공시일	2016-11-16
기준일	2016-11-15

포커스농산물모(채권-파생평)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	11	0	11	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2016-11-16
기준일	2016-11-15

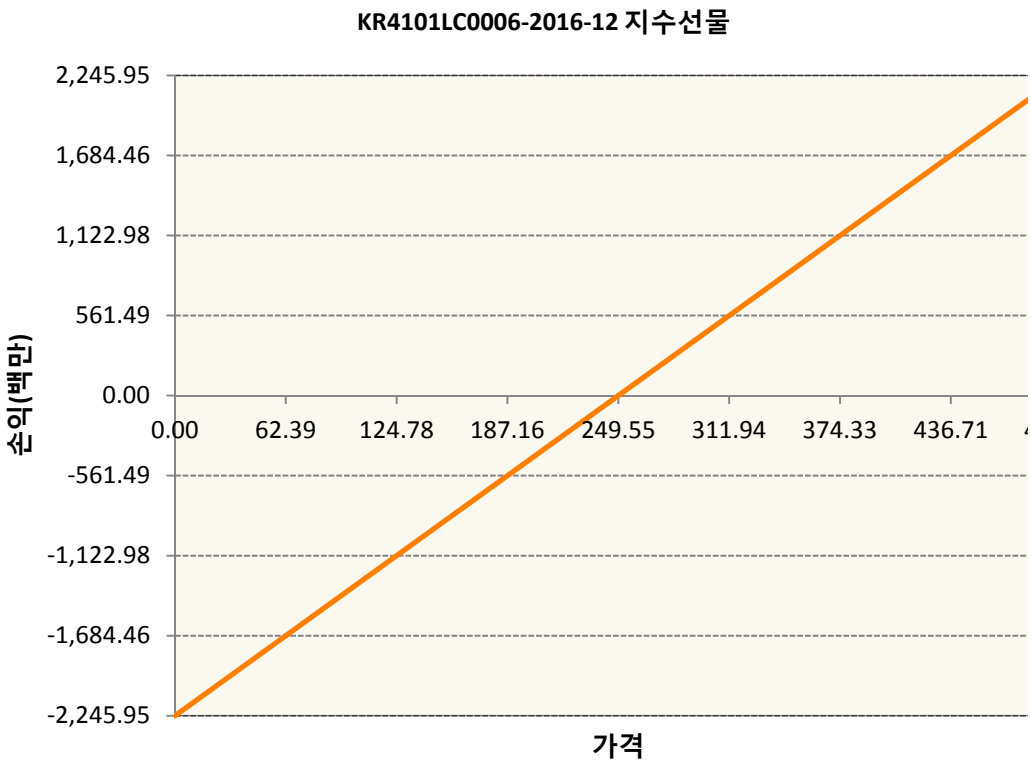
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,246	0	2,246	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							179
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-179	-179	-179	-179	-179	-179	-179
-5.33%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120
-2.67%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	60	60	60	60	60	60	60
5.33%	120	120	120	120	120	120	120
8.00%	179	179	179	179	179	179	179

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

140

공시일	2016-11-16
기준일	2016-11-15

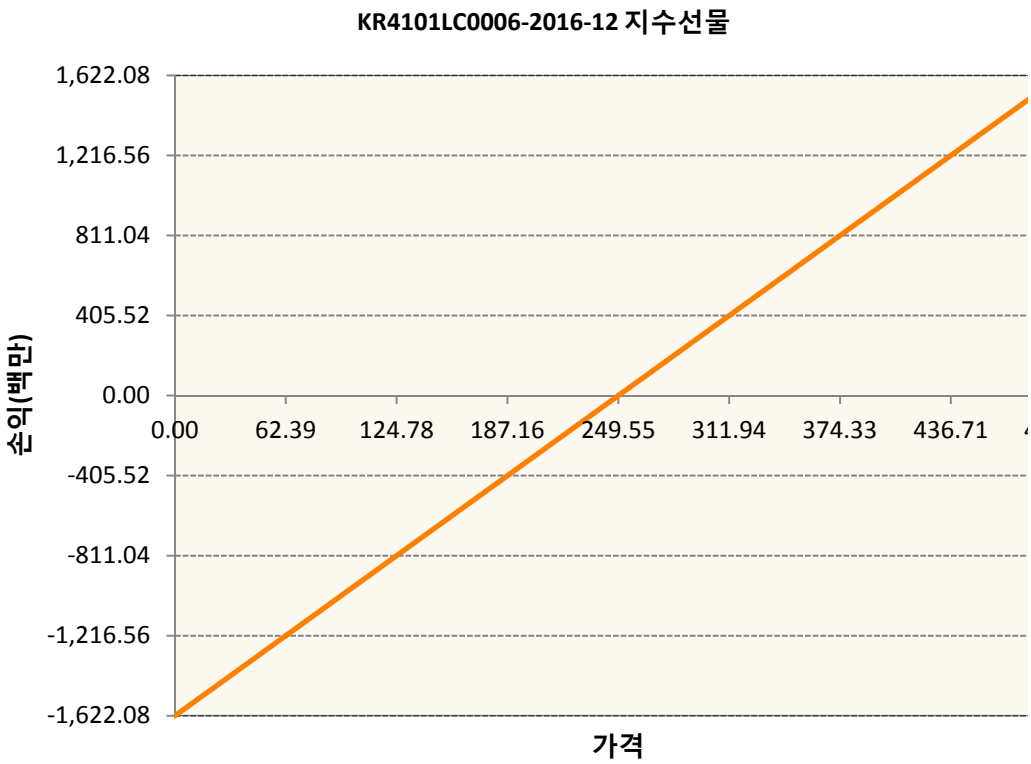
스마트레버리지목표전환형1호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,622	0	1,622	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							130
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
-5.33%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	43	43	43	43	43	43	43
5.33%	86	86	86	86	86	86	86
8.00%	130	130	130	130	130	130	130

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

101

공시일	2016-11-16
기준일	2016-11-15

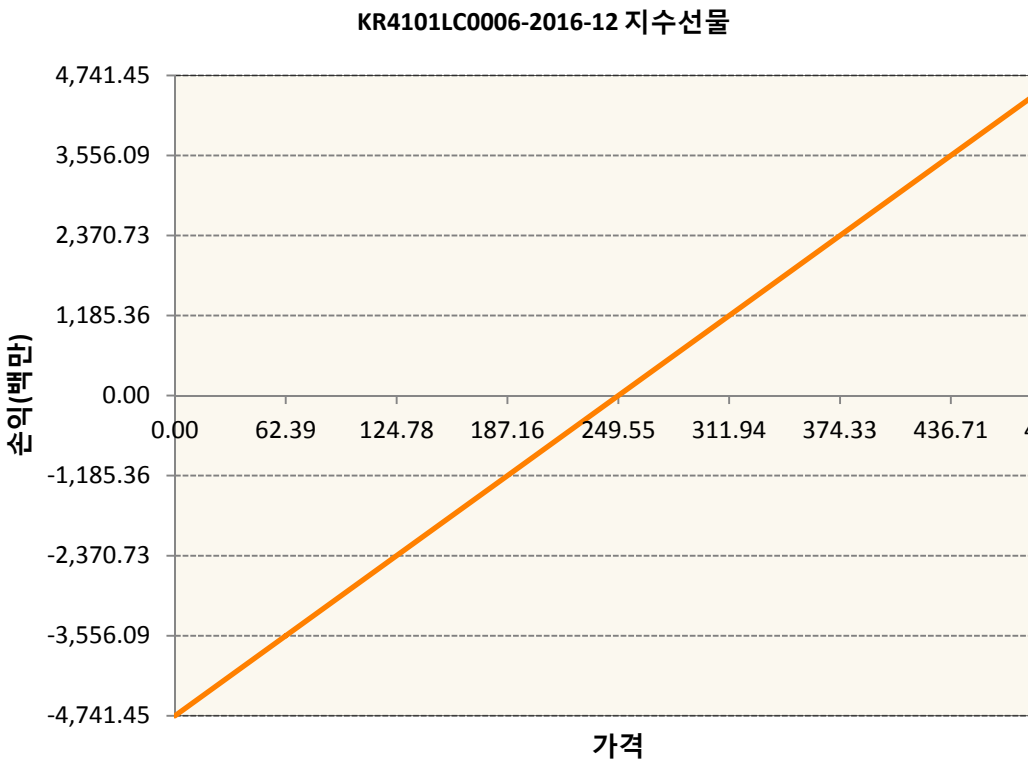
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,741	0	4,741	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							379
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-379	-379	-379	-379	-379	-379	-379
-5.33%	-253	-253	-253	-253	-253	-253	-253
-2.67%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	126	126	126	126	126	126	126
5.33%	253	253	253	253	253	253	253
8.00%	379	379	379	379	379	379	379

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

295

공시일	2016-11-16
기준일	2016-11-15

SMART합성-MSCI선진국증권상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	11,105	0	11,105	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S160822	872

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

708

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-11-16
기준일	2016-11-15

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	5,098	0	5,098	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S160908	407

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

772

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-11-16
기준일	2016-11-15

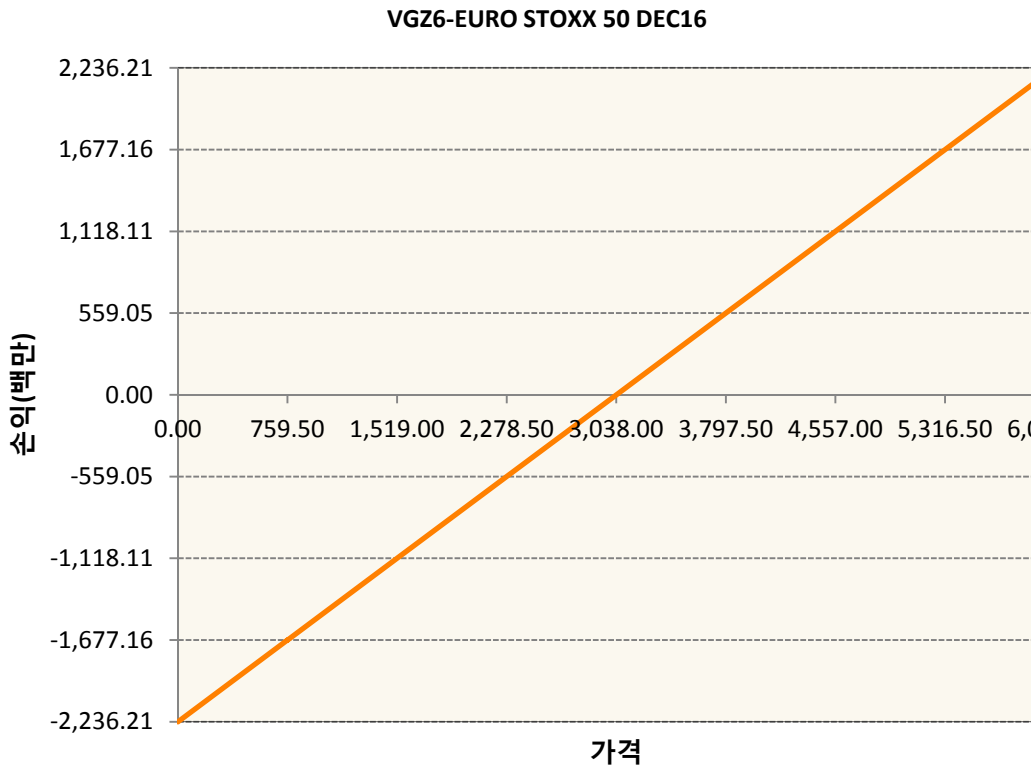
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,236	0	2,236	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	179

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

215

공시일	2016-11-16
기준일	2016-11-15

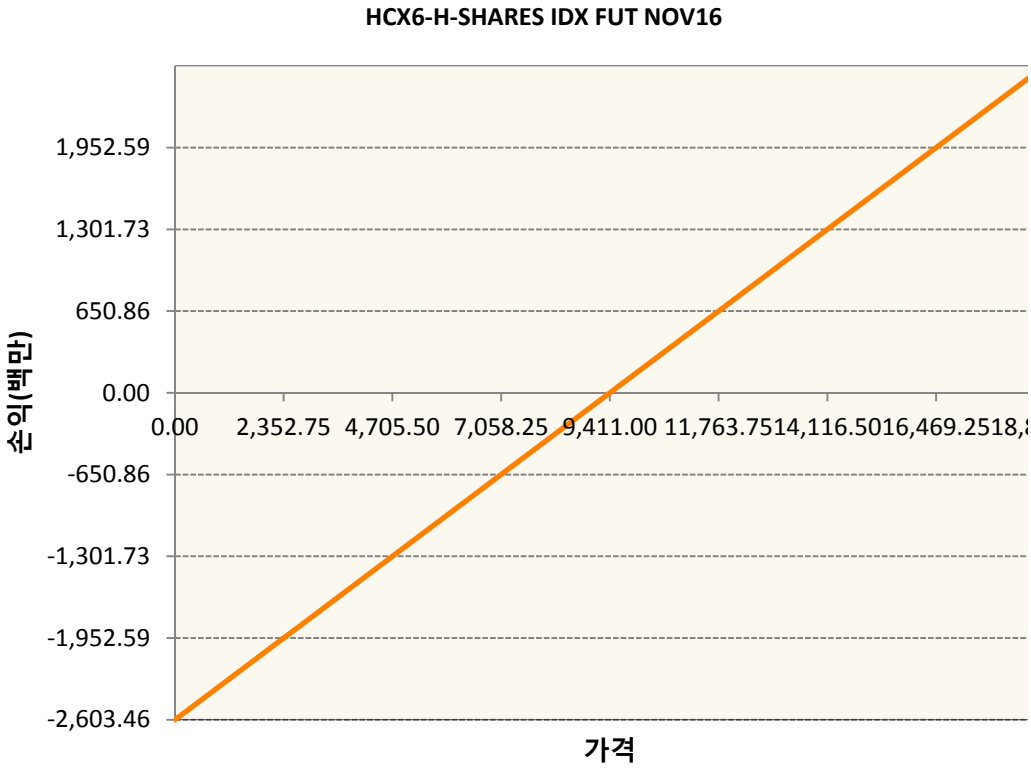
차이나인덱스모(주식-파생형)

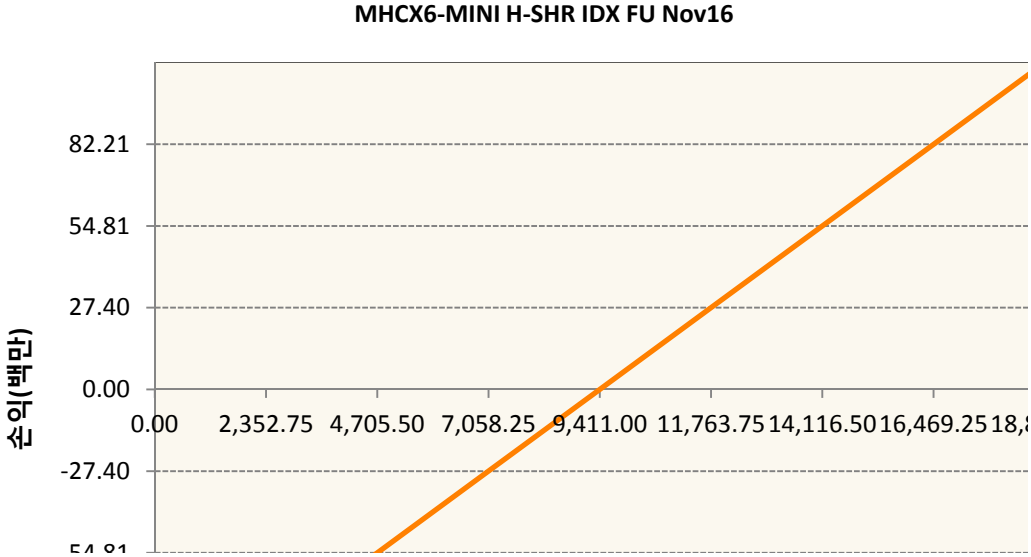
1. 계약금액

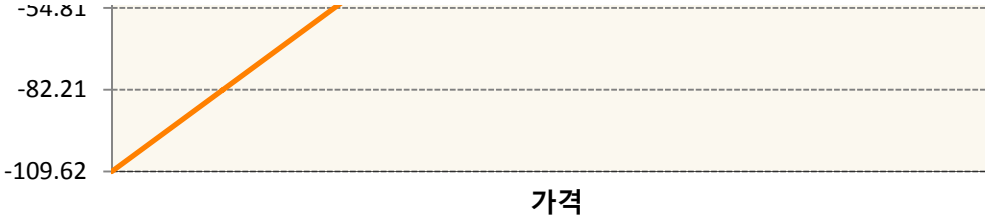
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,713	0	2,713	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCX6	H-SHARES IDX FUT NOV16	208
MHCX6	MINI H-SHR IDX FU Nov16	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

291

공시일	2016-11-16
기준일	2016-11-15

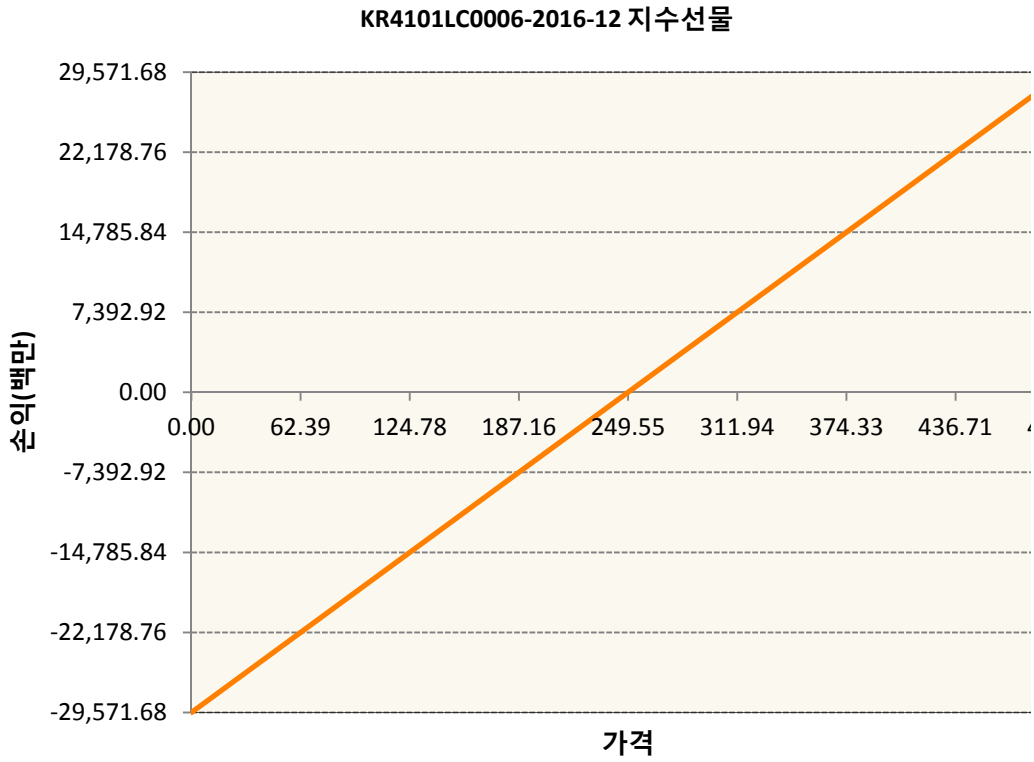
커버드콜(주식혼합-파생형)

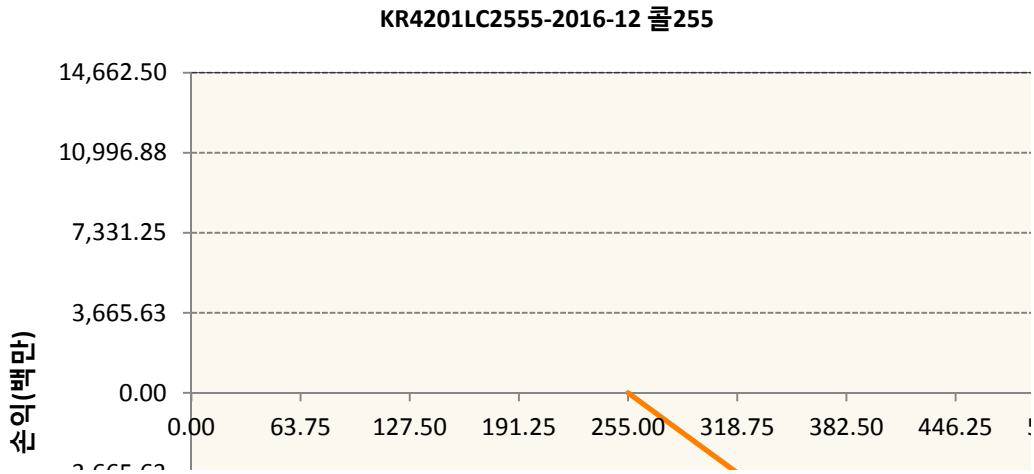
1. 계약금액

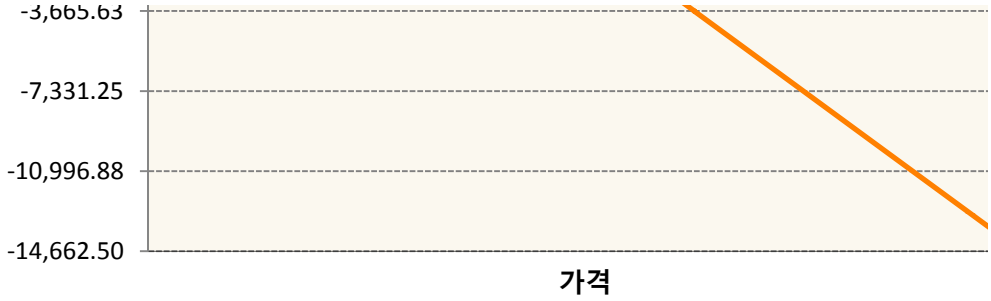
(단위:백만원)

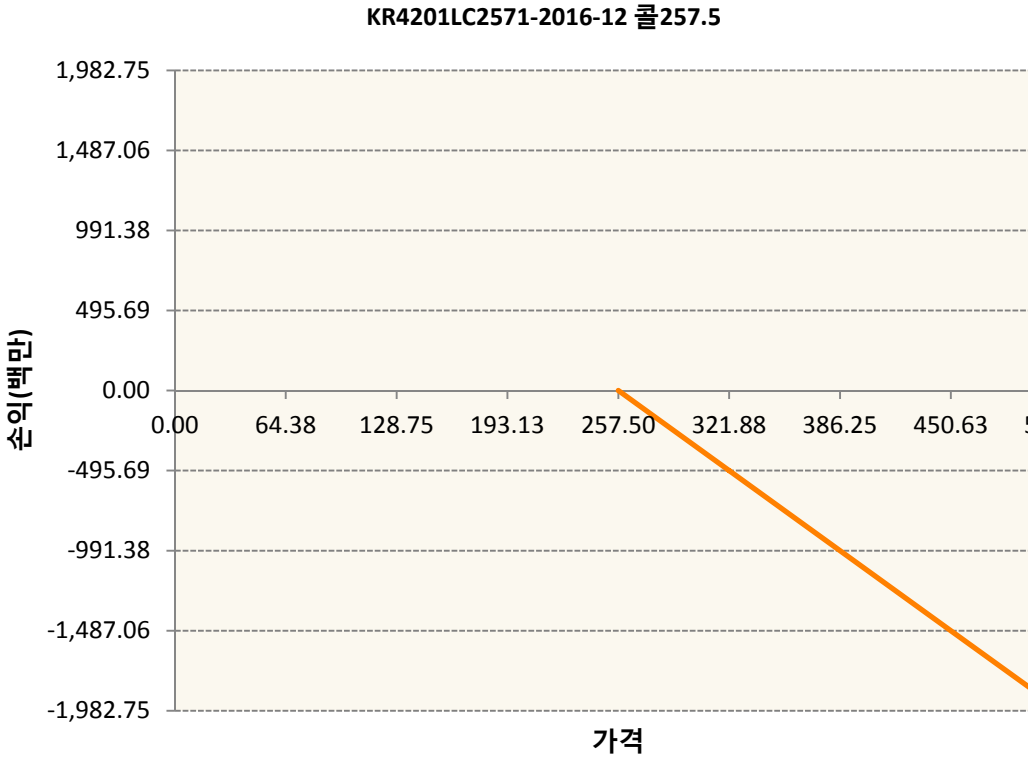
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	385	-385	장내
누계	유가증권	선물	29,572	0	29,572	장내
누계	유가증권	옵션	0	16,645	-16,645	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							2,362
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,362	-2,362	-2,362	-2,362	-2,362	-2,362	-2,362
-5.33%	-1,575	-1,575	-1,575	-1,575	-1,575	-1,575	-1,575
-2.67%	-787	-787	-787	-787	-787	-787	-787
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	787	787	787	787	787	787	787
5.33%	1,575	1,575	1,575	1,575	1,575	1,575	1,575
8.00%	2,362	2,362	2,362	2,362	2,362	2,362	2,362
KR4201LC25 2016-12 콜255							3,810
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	556	556	554	551	546	539	528
-5.33%	552	545	535	520	500	474	444
-2.67%	503	471	432	386	334	277	216
0%	248	169	86	0	-88	-178	-269
2.67%	-489	-591	-693	-795	-897	-999	-1,102
5.33%	-1,816	-1,888	-1,964	-2,044	-2,128	-2,214	-2,302
8.00%	-3,539	-3,567	-3,603	-3,646	-3,695	-3,750	-3,810
KR4201LC25 2016-12 콜257.5							455

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	51	51	51	50	50	49	49
-5.33%	51	50	49	48	46	44	41
-2.67%	47	45	41	37	32	26	19
0%	27	19	10	0	-10	-21	-32
2.67%	-44	-57	-71	-84	-98	-112	-125
5.33%	-193	-205	-217	-229	-242	-255	-268
8.00%	-407	-413	-420	-428	-437	-446	-455

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

5,858

공시일	2016-11-16
기준일	2016-11-15

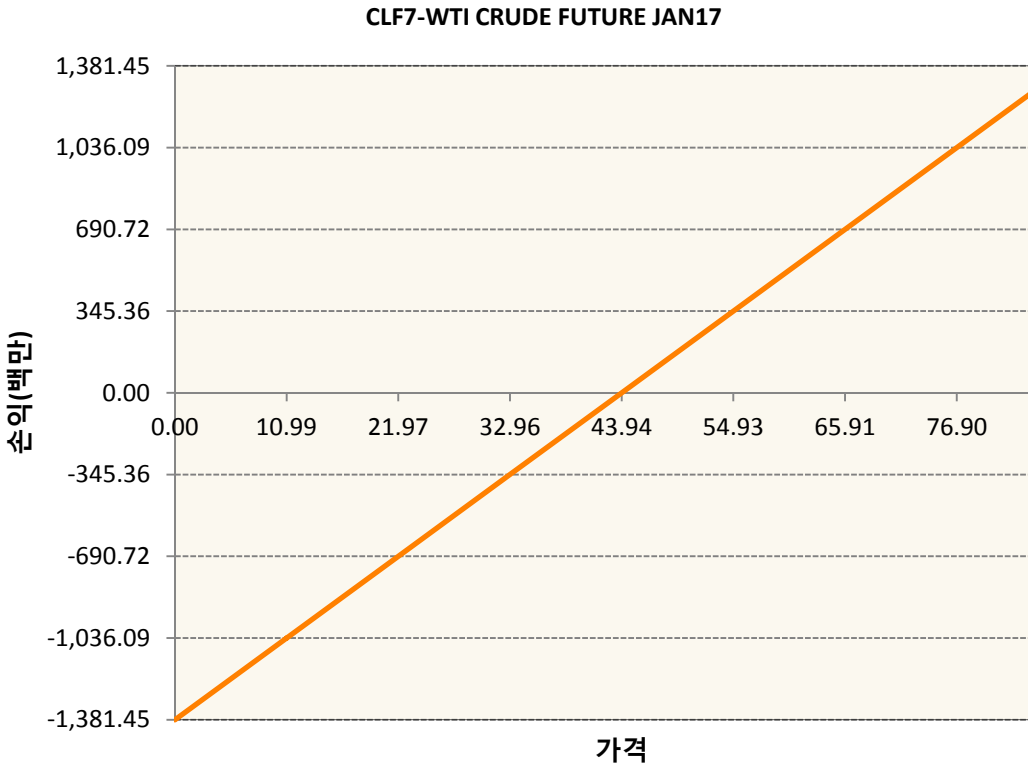
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

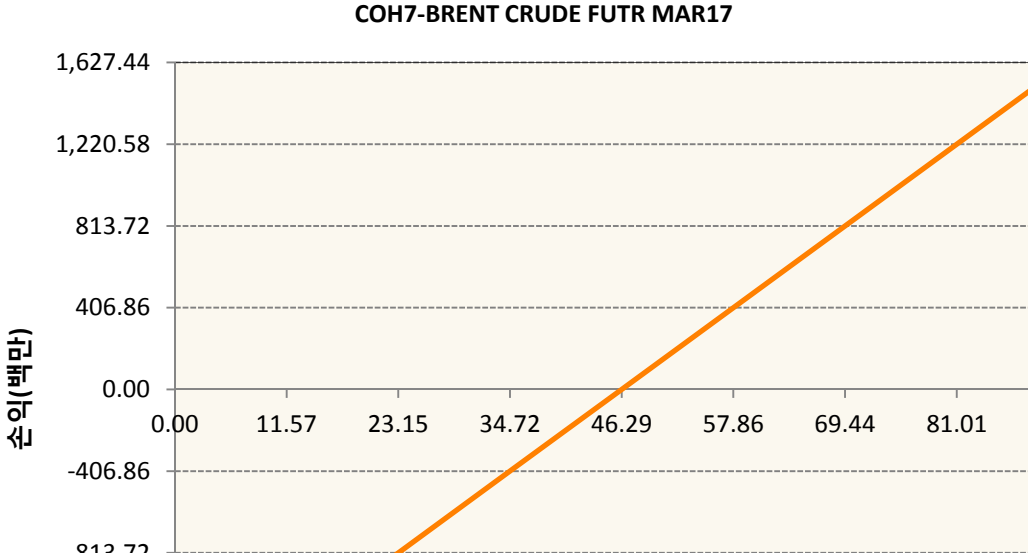
1. 계약금액

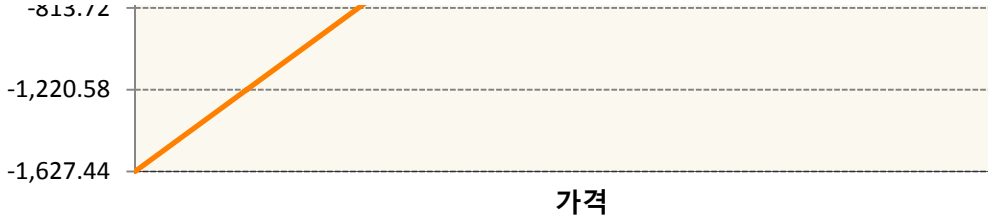
(단위:백만원)

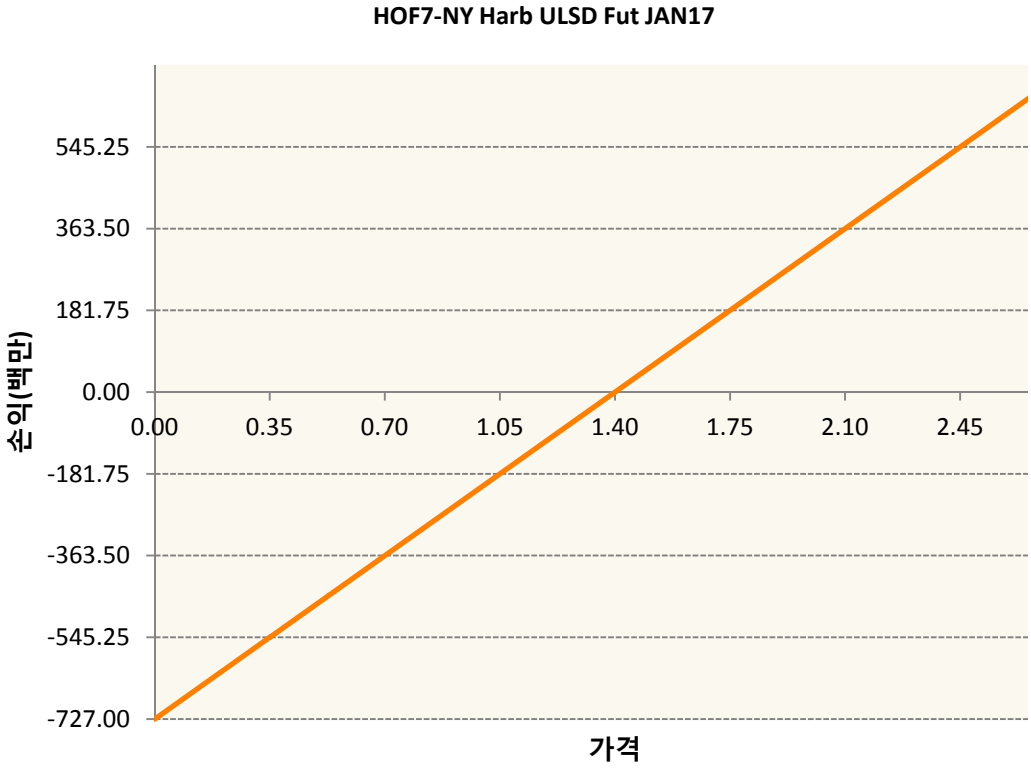
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,854	0	5,854	

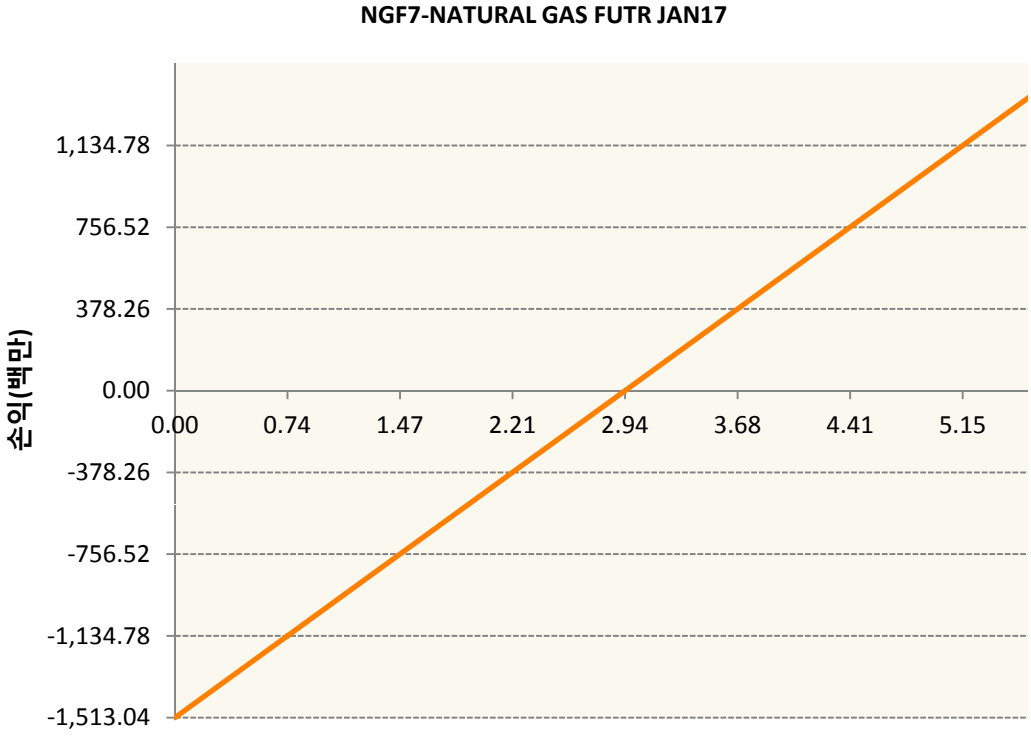
2. 만기시점의 손익구조



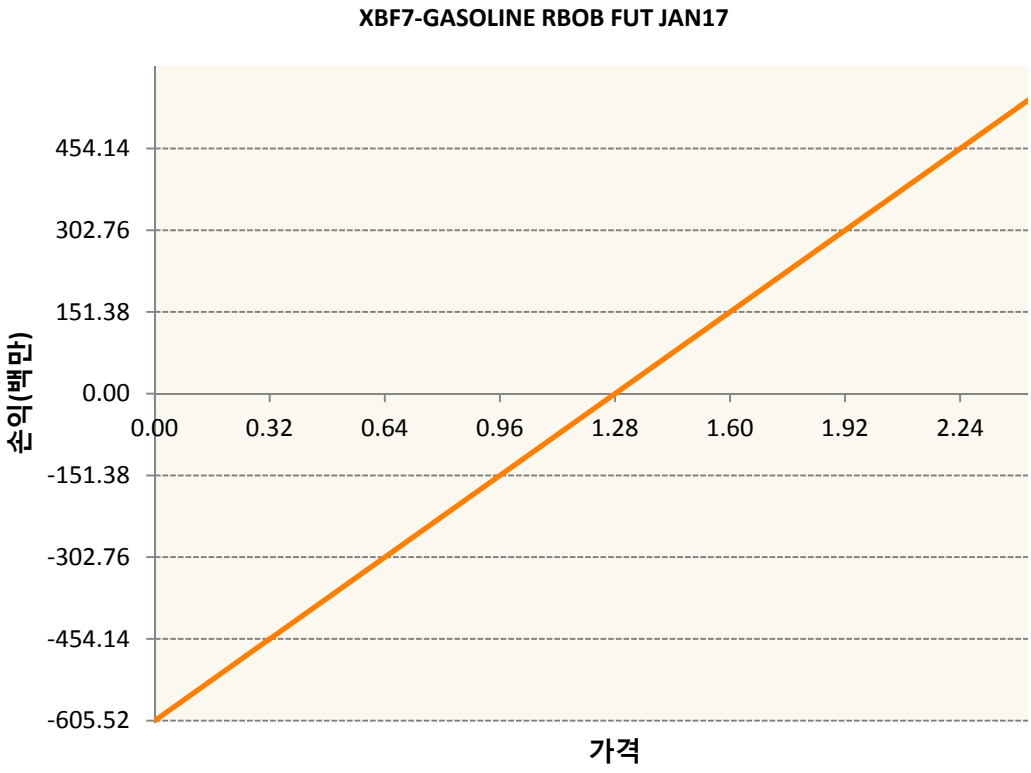



-1,220.58
-1,627.44
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
545.25
363.50
181.75
0.00
-181.75
-363.50
-545.25
-727.00
0.00
0.35
0.70
1.05
1.40
1.75
2.10
2.45
순익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,134.78
756.52
378.26
0.00
-378.26
-756.52
-1,134.78
-1,513.04
0.00
0.74
1.47
2.21
2.94
3.68
4.41
5.15
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF7	WTI CRUDE FUTURE JAN17	111
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	130
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	58
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	121
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	48

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,046

공시일	2016-11-16
기준일	2016-11-15

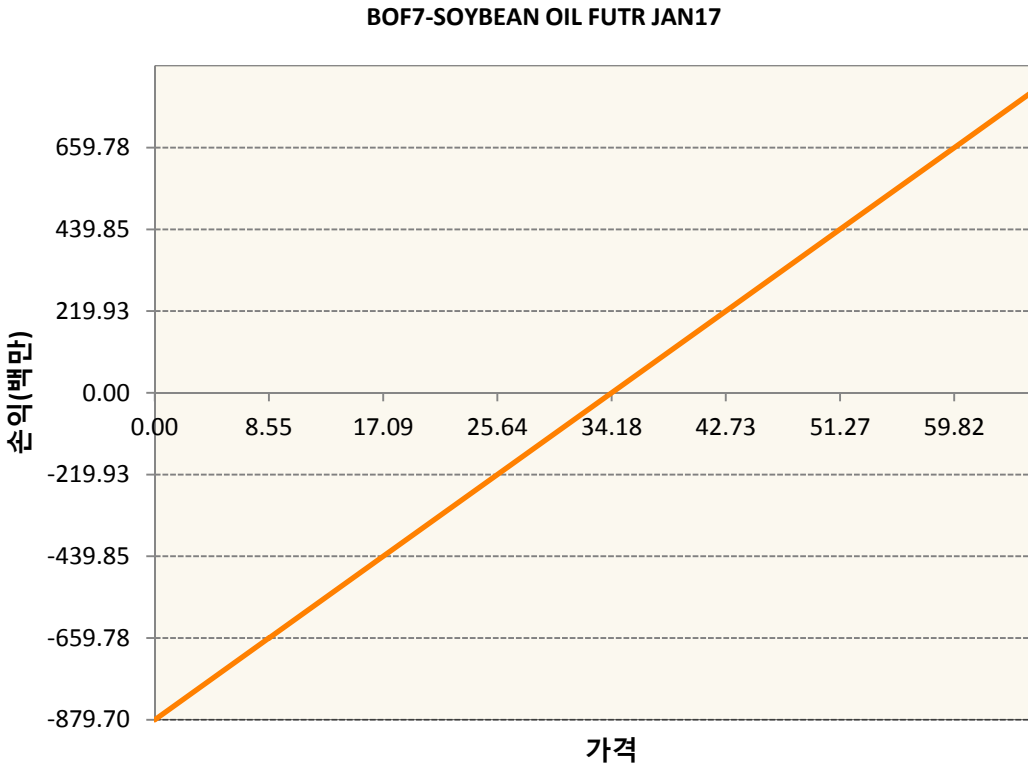
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

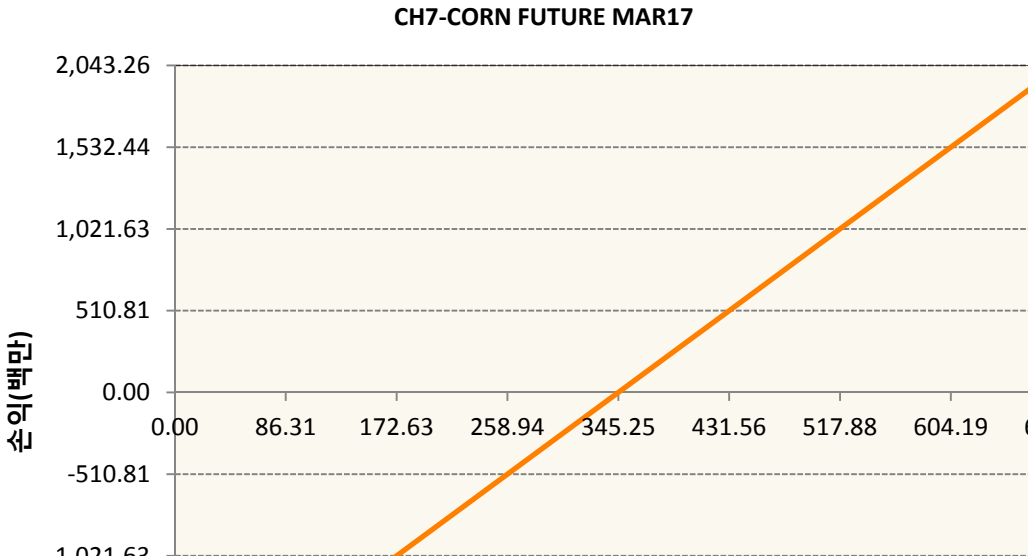
1. 계약금액

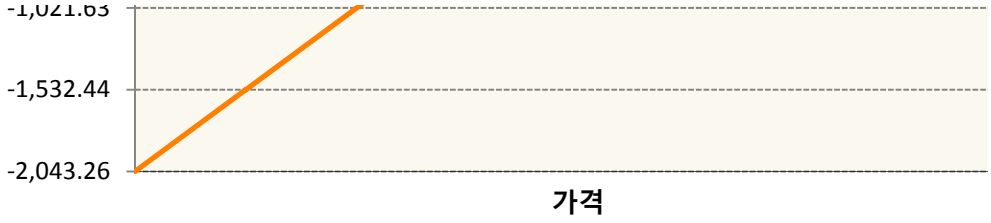
(단위:백만원)

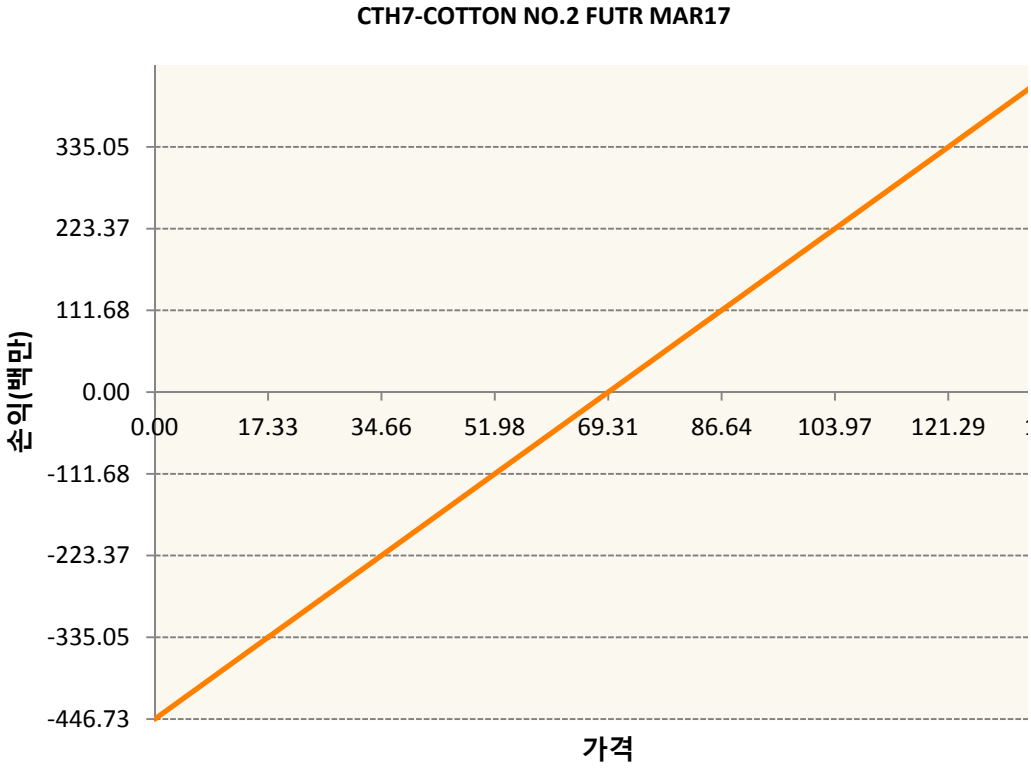
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,603	0	9,603	

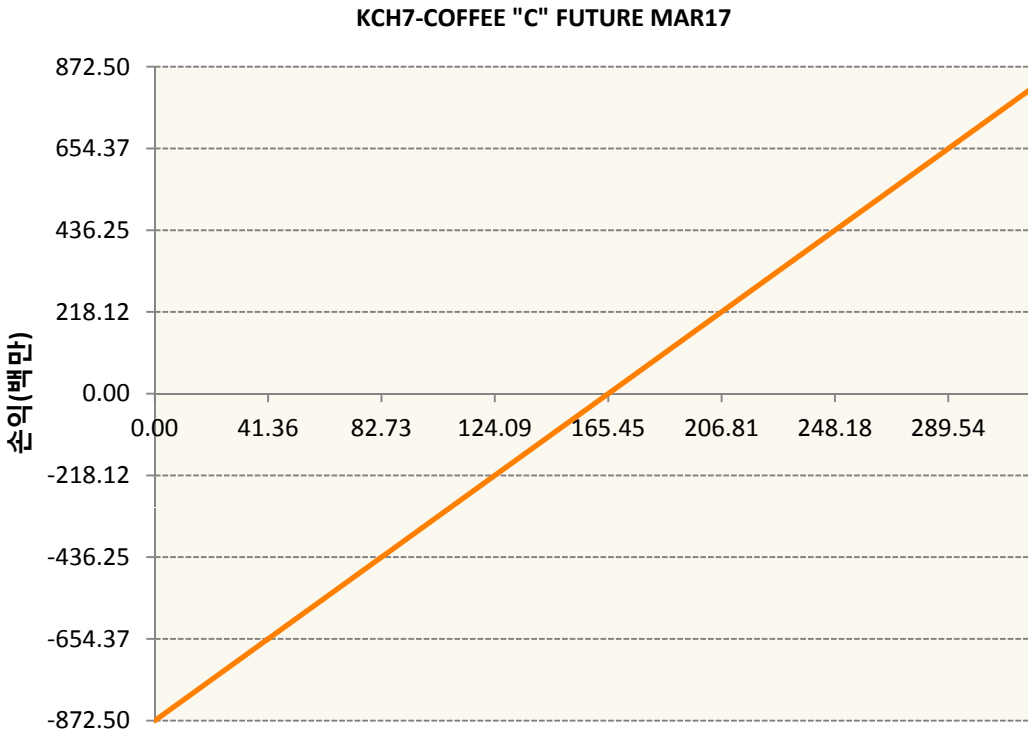
2. 만기시점의 손익구조





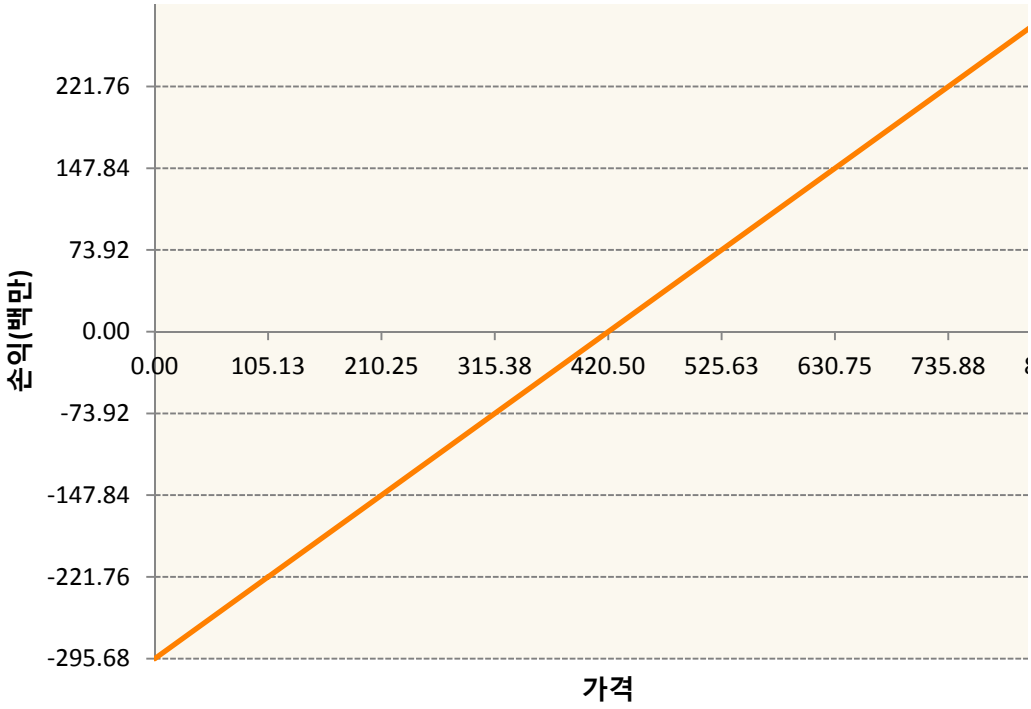

-1,532.44
-2,043.26
가격


CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
335.05
223.37
111.68
0.00
-111.68
-223.37
-335.05
-446.73
0.00
17.33
34.66
51.98
69.31
86.64
103.97
121.29
순익(백만)
가격

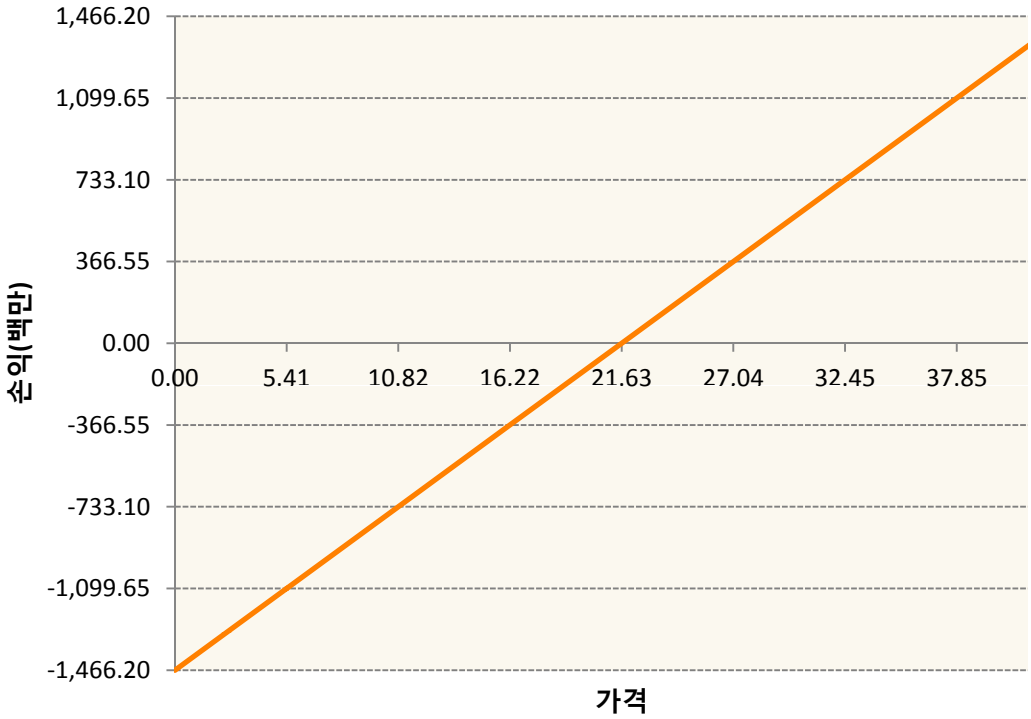

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
872.50
654.37
436.25
218.12
0.00
-218.12
-436.25
-654.37
-872.50
0.00
41.36
82.73
124.09
165.45
206.81
248.18
289.54
순익(백만)

가격

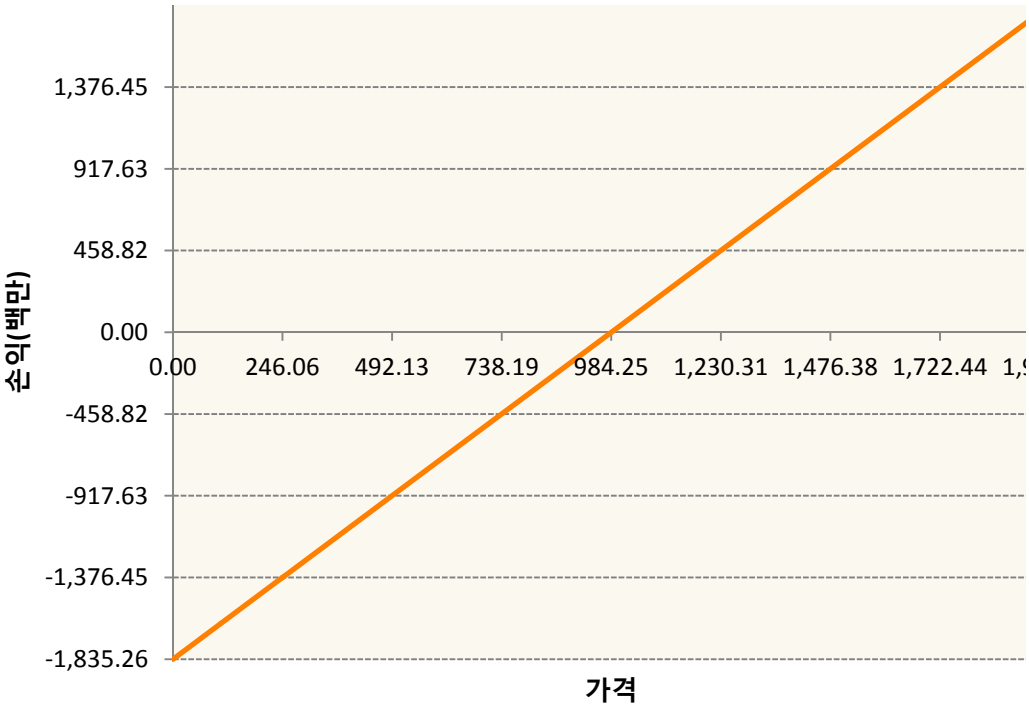
KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17



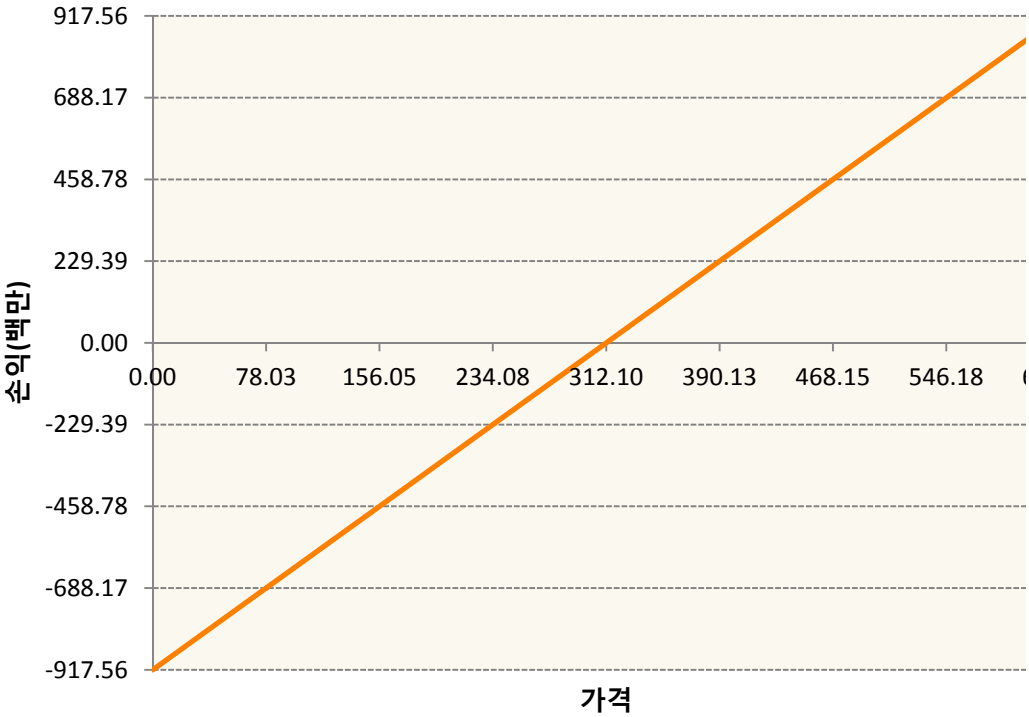
SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17



SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17

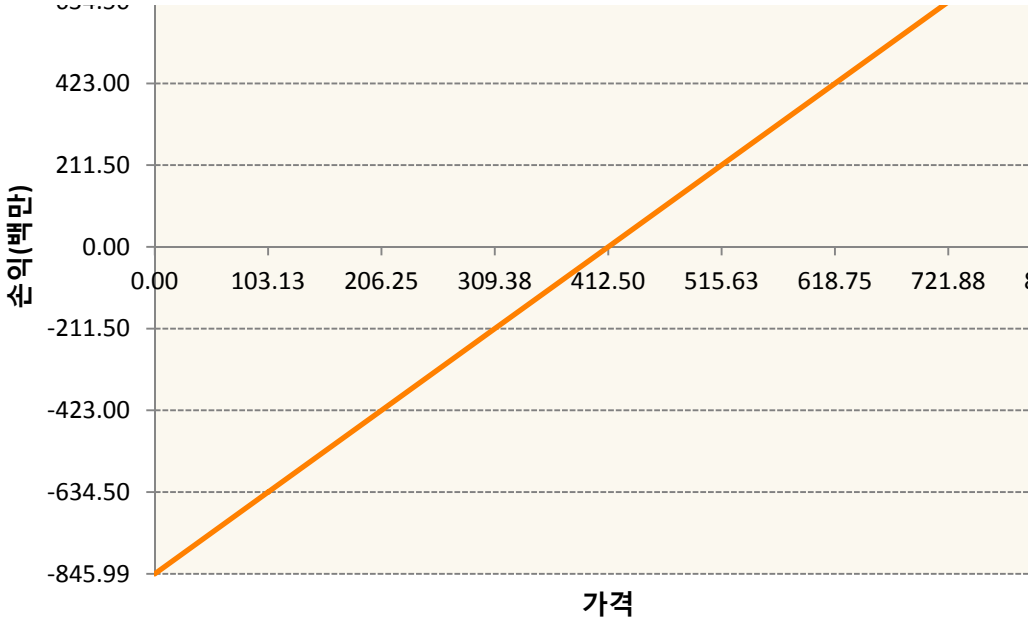


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17



WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF7	SOYBEAN OIL FUTR JAN17	70
CH7	CORN FUTURE MAR17	163
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	36
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	70
KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	24
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	117
SF7	SOYBEAN FUTURE JAN17	147
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	73
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	68

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

962