공시일	2015-07-15
기준일	2015-07-14

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	10	0	10	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	2015-07-15
기준일	2015-07-14

차곡차곡플러스모(주식혼합-파생)

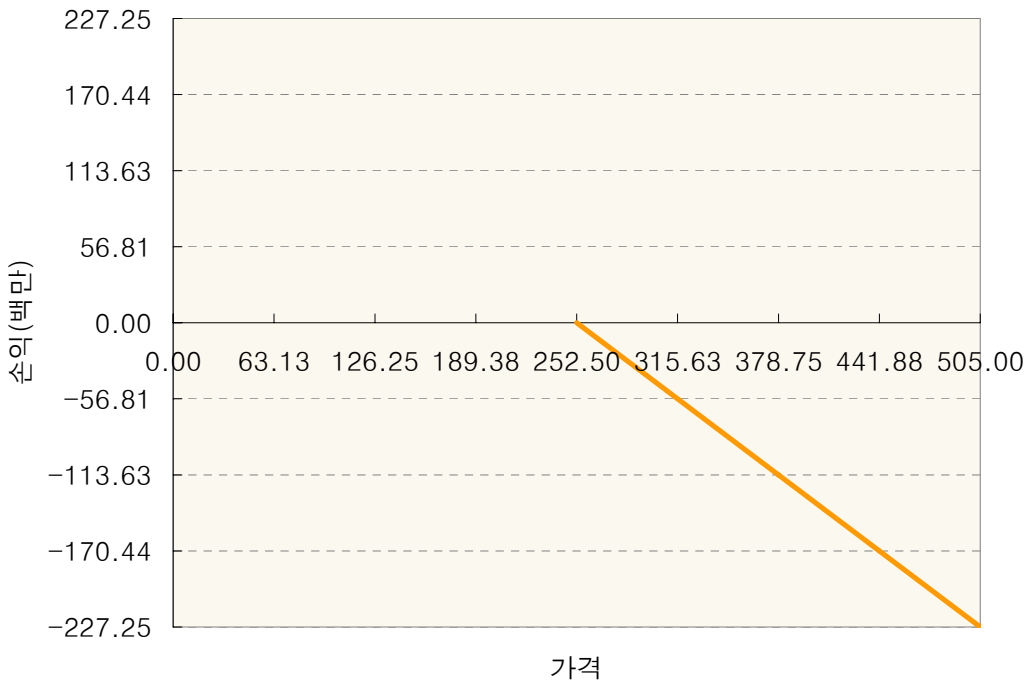
1. 계약금액

(단위:백만원)

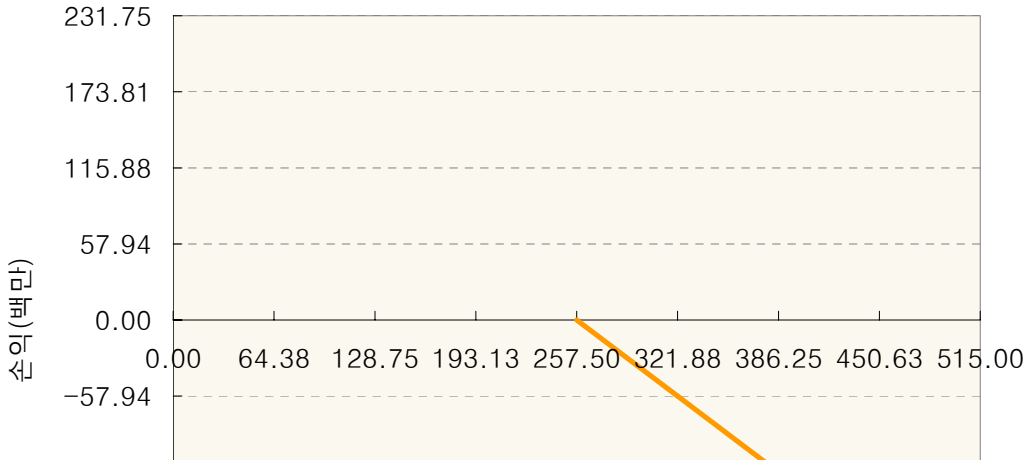
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	459	-459	장내

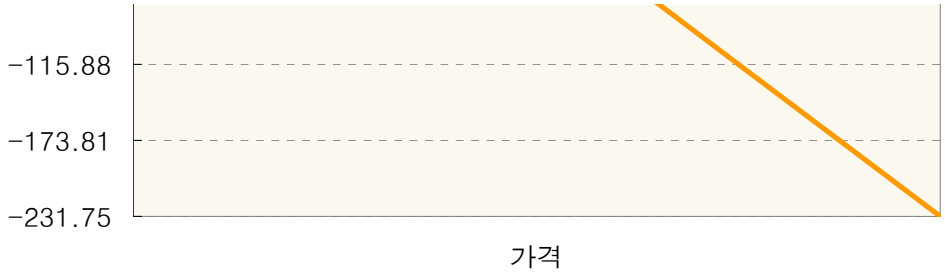
2. 만기시점의 손익구조

KR4201K82528-2015-08 콜252.5



KR4201K82577-2015-08 콜257.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201K825 2015-08 콜252.5 | 65

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11	11	11	10	10	10	10
-5.33%	10	10	10	10	10	9	9
-2.67%	9	9	8	7	6	6	5
0%	4	3	1	0	-1	-3	-4
2.67%	-10	-12	-13	-15	-16	-17	-19
5.33%	-34	-34	-35	-36	-37	-38	-40
8.00%	-62	-62	-62	-63	-63	-64	-65

KR4201K825 2015-08 콜257.5 | 52

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	5	5	5	5	5	5
-5.33%	5	5	5	5	4	4	4
-2.67%	5	4	4	4	3	3	2
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-5	-6	-8	-9	-11	-12	-14
5.33%	-21	-23	-24	-25	-27	-28	-30
8.00%	-46	-47	-48	-48	-49	-50	-52

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

(단위:백만원)

109

공시일	2015-07-15
기준일	2015-07-14

스마트인덱스모

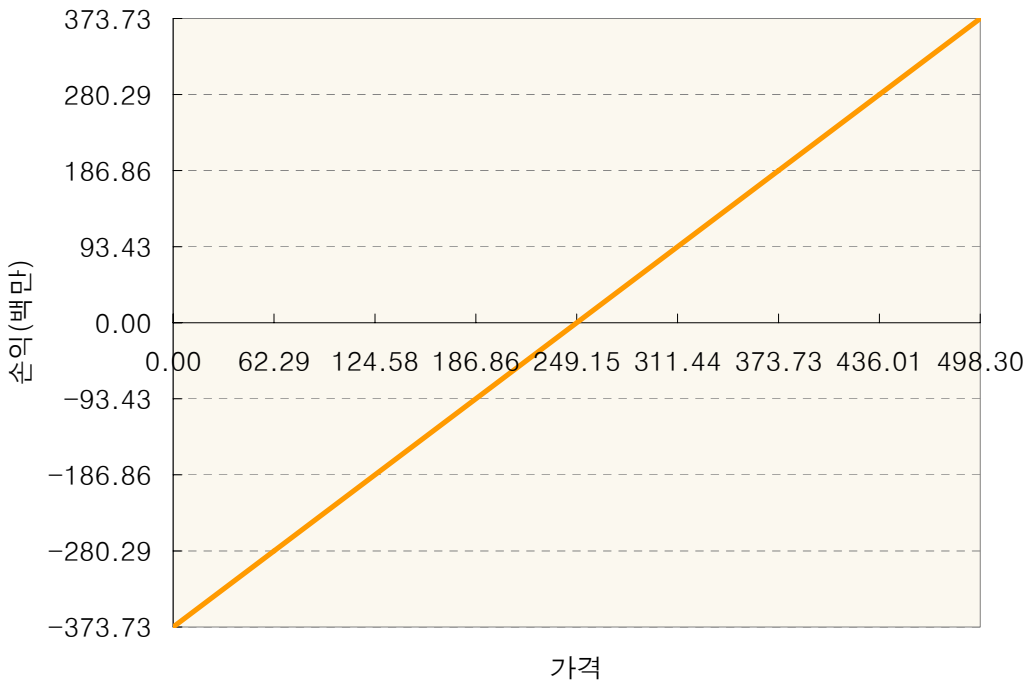
1. 계약금액

(단위:백만원)

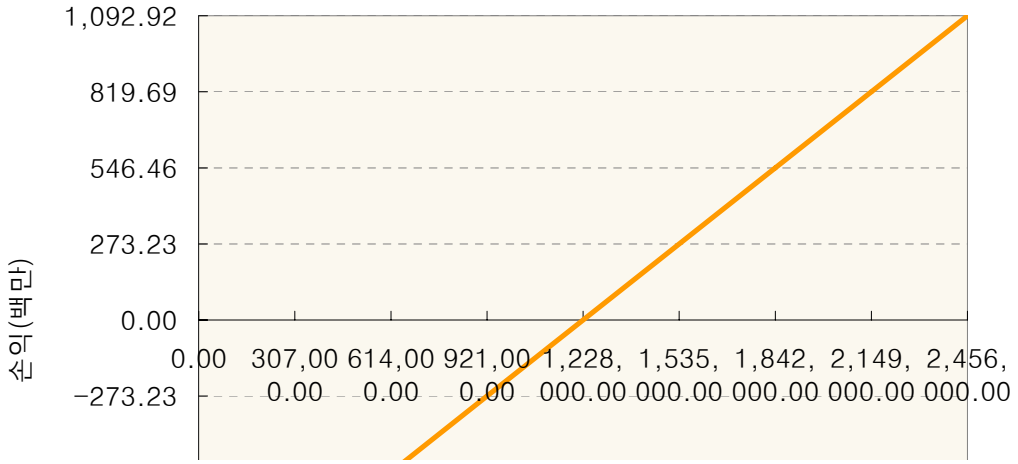
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	25	0	25	장내
누계	유가증권	선물	1,467	0	1,467	장내

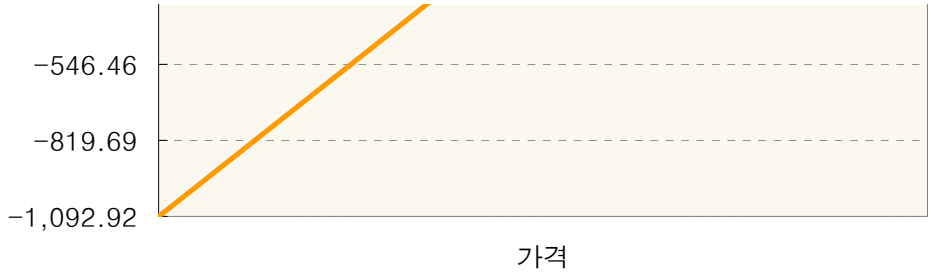
2. 만기시점의 손익구조

KR4101K90002-2015-09 지수선물



KR4111K90001-2015-09 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101K900 2015-09 지수선물 30

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
-5.33%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	10	10	10	10	10	10	10
5.33%	20	20	20	20	20	20	20
8.00%	30	30	30	30	30	30	30

KR4111K900 2015-09 삼성전자개별선물 87

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-5.33%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	29	29	29	29	29	29	29
5.33%	58	58	58	58	58	58	58
8.00%	87	87	87	87	87	87	87

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

(단위:백만원)

97

공시일	2015-07-15
기준일	2015-07-14

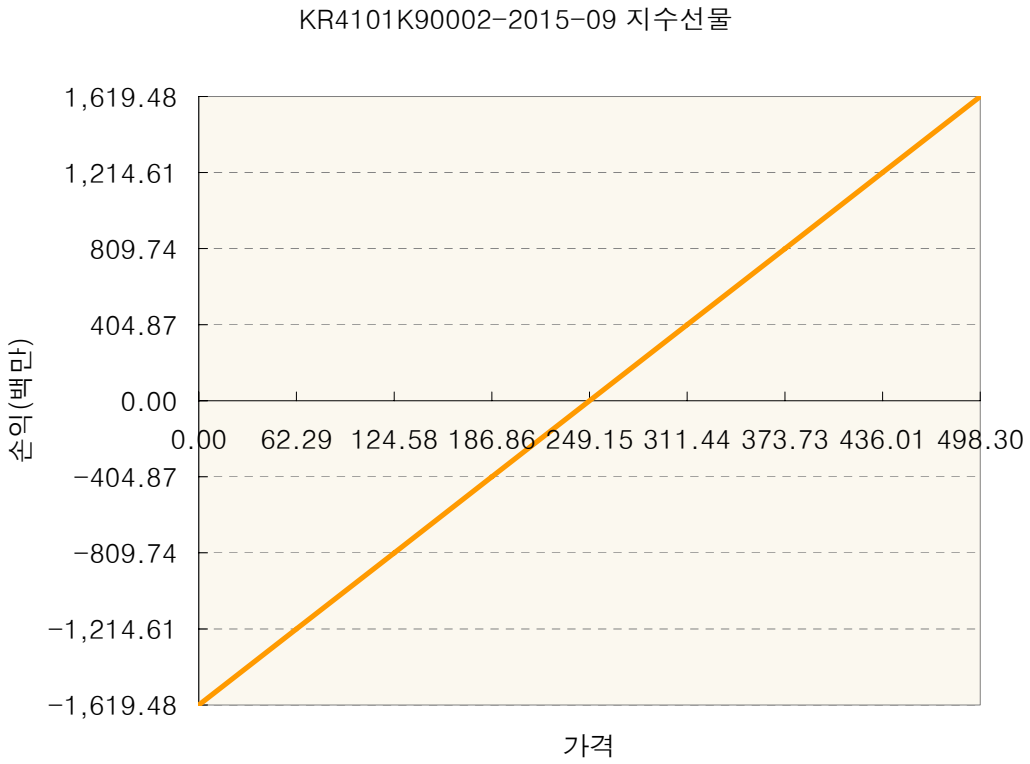
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,619	0	1,619	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101K900 2015-09 지수선물							129
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-129	-129	-129	-129	-129	-129	-129
-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%	129	129	129	129	129	129	129

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

85

공시일	2015-07-15
기준일	2015-07-14

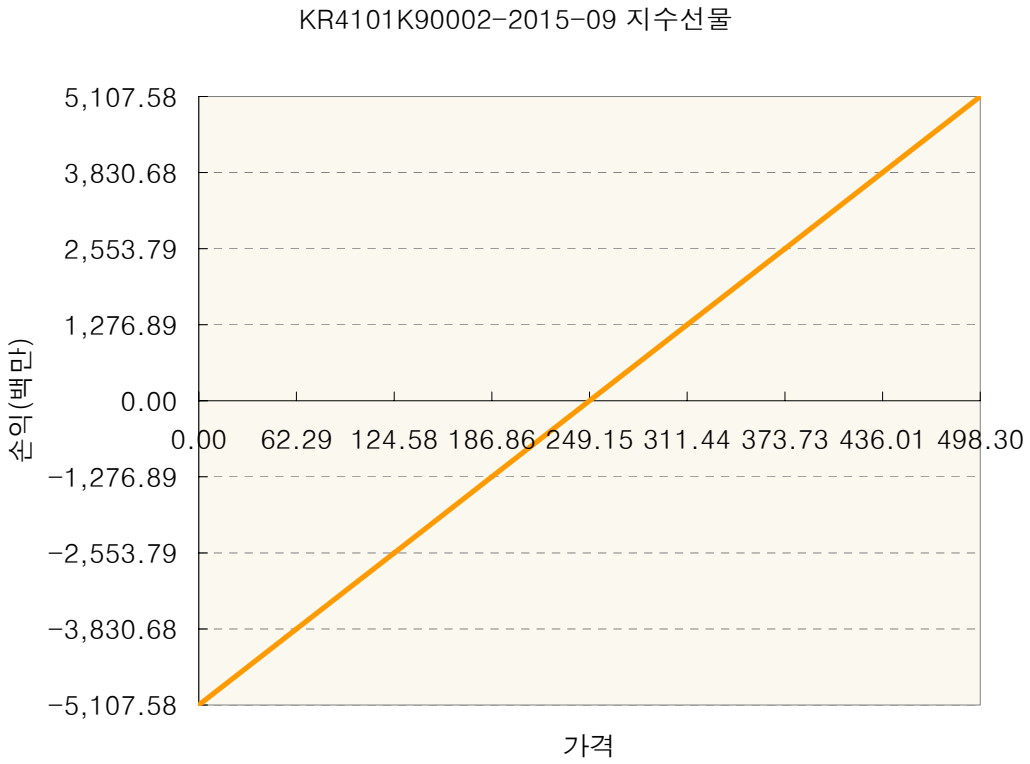
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	5,108	0	5,108	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101K900 2015-09 지수선물							408
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-408	-408	-408	-408	-408	-408	-408
-5.33%	-272	-272	-272	-272	-272	-272	-272
-2.67%	-136	-136	-136	-136	-136	-136	-136
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	136	136	136	136	136	136	136
5.33%	272	272	272	272	272	272	272
8.00%	408	408	408	408	408	408	408

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

268

공시일	2015-07-15
기준일	2015-07-14

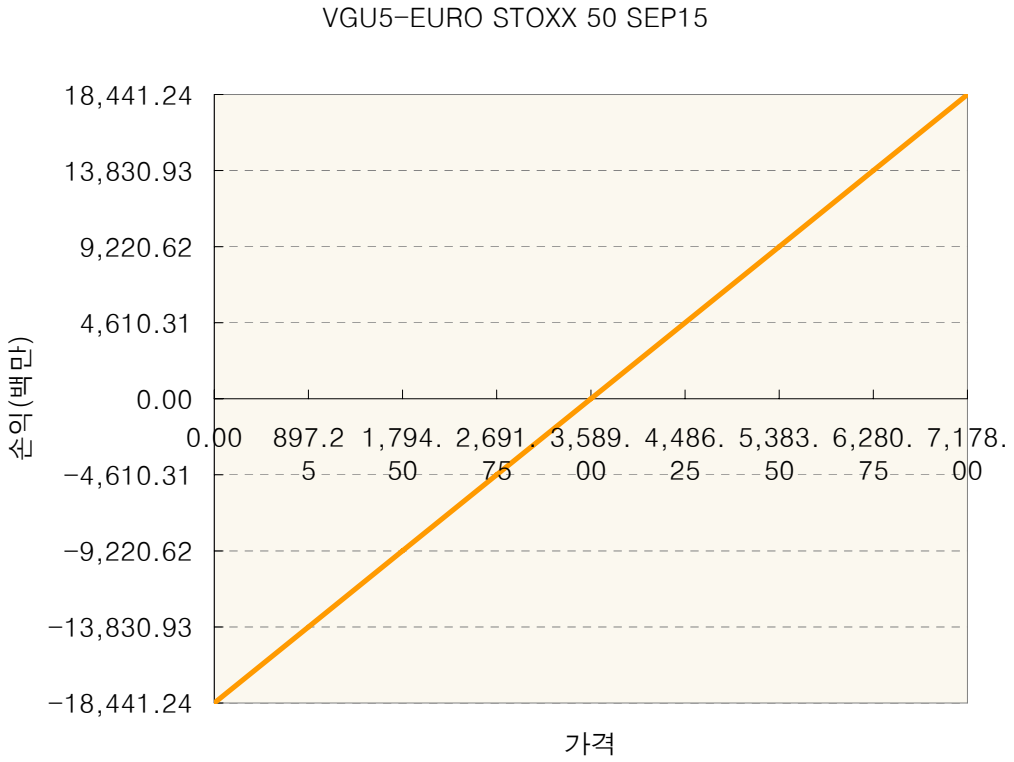
유로인덱스1호(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	18,441	0	18,441	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU5	EURO STOXX 50 SEP15	1,475

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

(단위:백만원)

1,390

공시일	2015-07-15
기준일	2015-07-14

아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

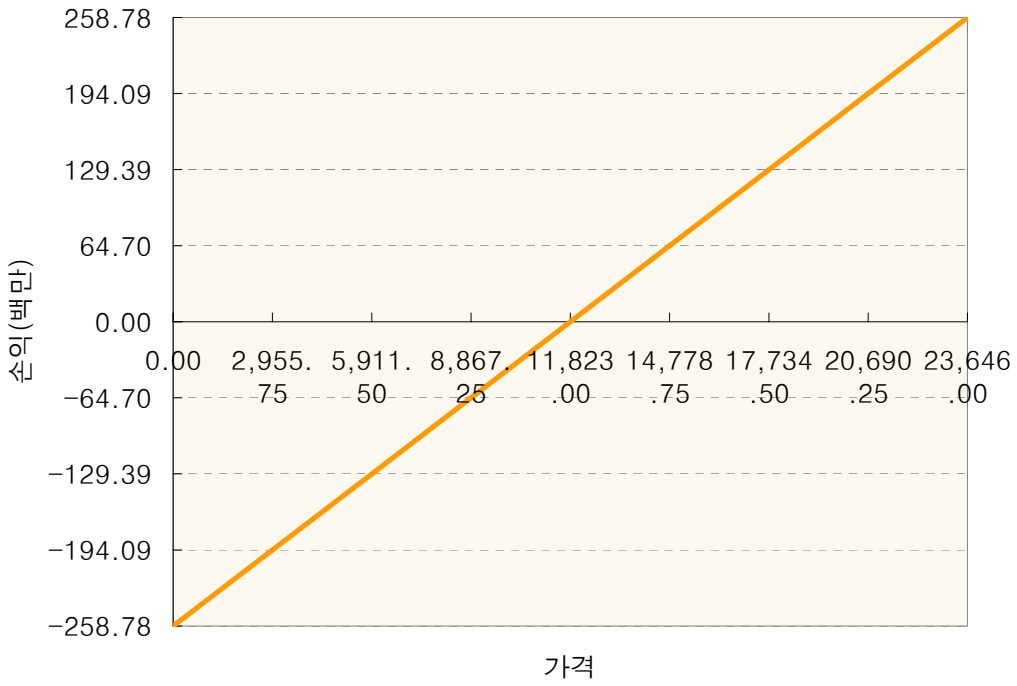
1. 계약금액

(단위:백만원)

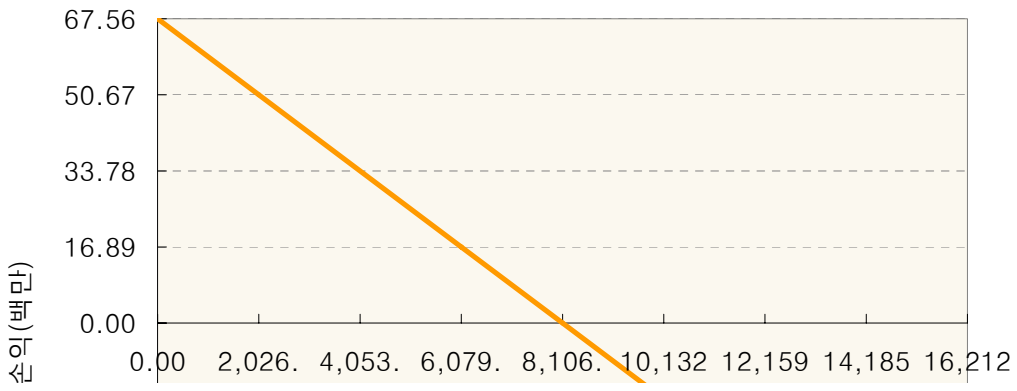
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	14	159	-145	
누계	유가증권	선물	259	0	259	장내

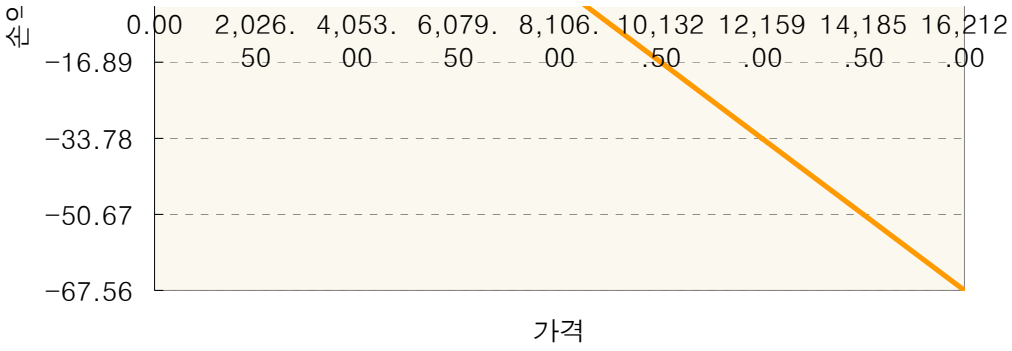
2. 만기시점의 손익구조

HCN5-H-SHARES IDX FUT JUL15

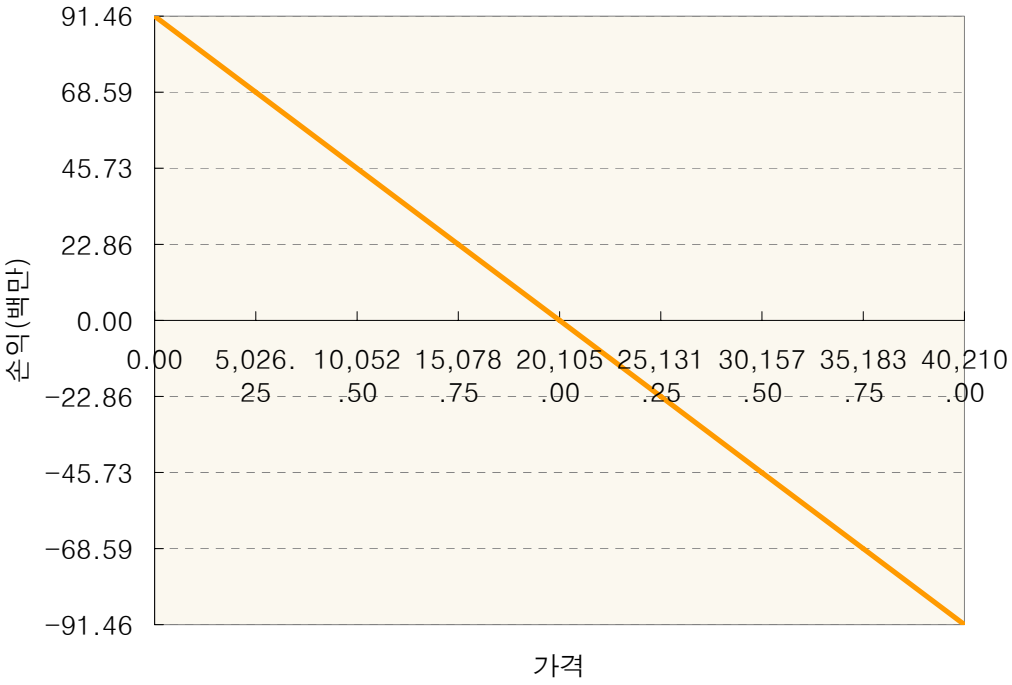


MJYU5-E-MICRO JPY/US Sep15

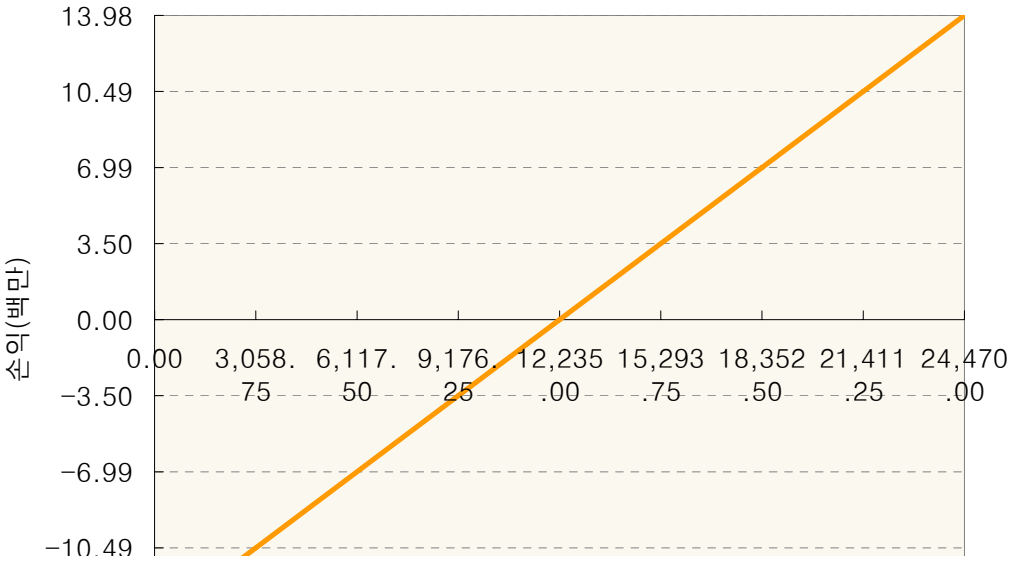


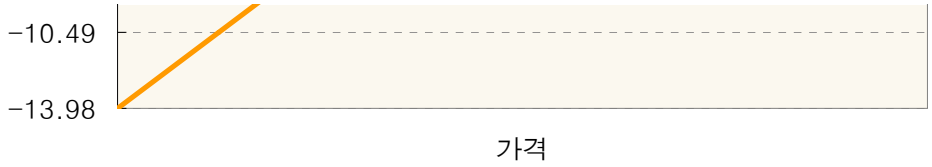


NIU5-NIKKEI 225 (SGX) Sep15



XUN5-SGX FTSE CHINA A50 FUTURE CONTRACT JUL15





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN5	H-SHARES IDX FUT JUL15	21
MJYU5	E-MICRO JPY/US Sep15	5
NIU5	NIKKEI 225 (SGX) Sep15	7
XUN5	SGX FTSE CHINA A50 FUTURE CONTRACT JUL15	1

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

(단위:백만원)

34

공시일	2015-07-15
기준일	2015-07-14

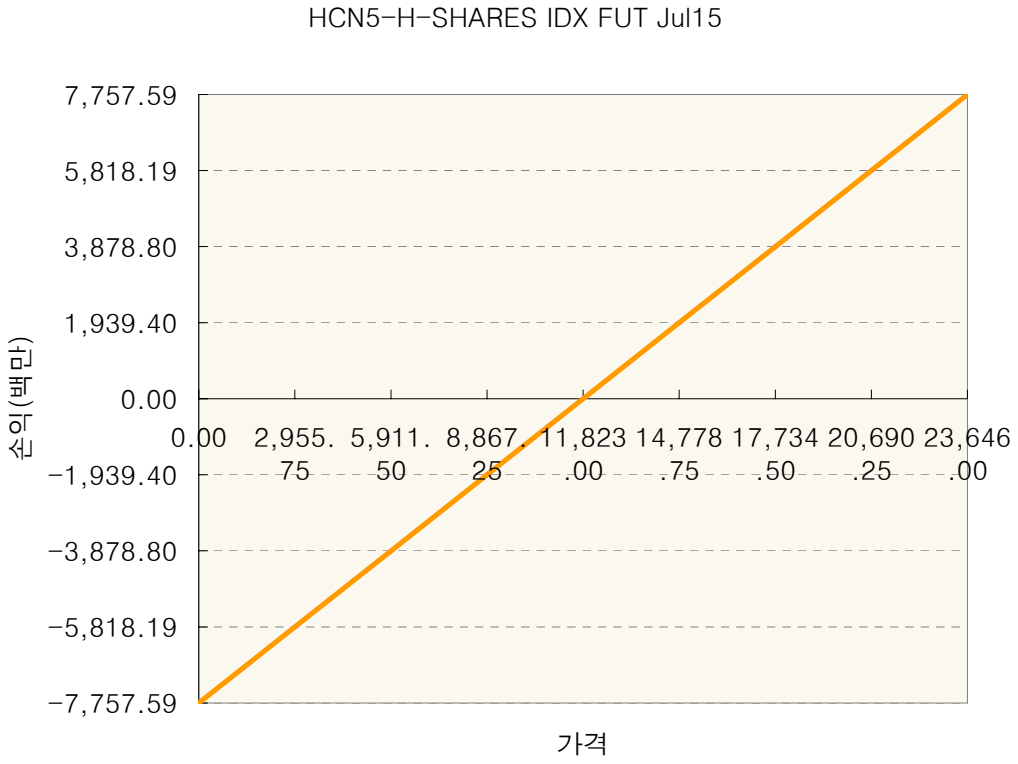
차이나인덱스(주식-파생형)(종)

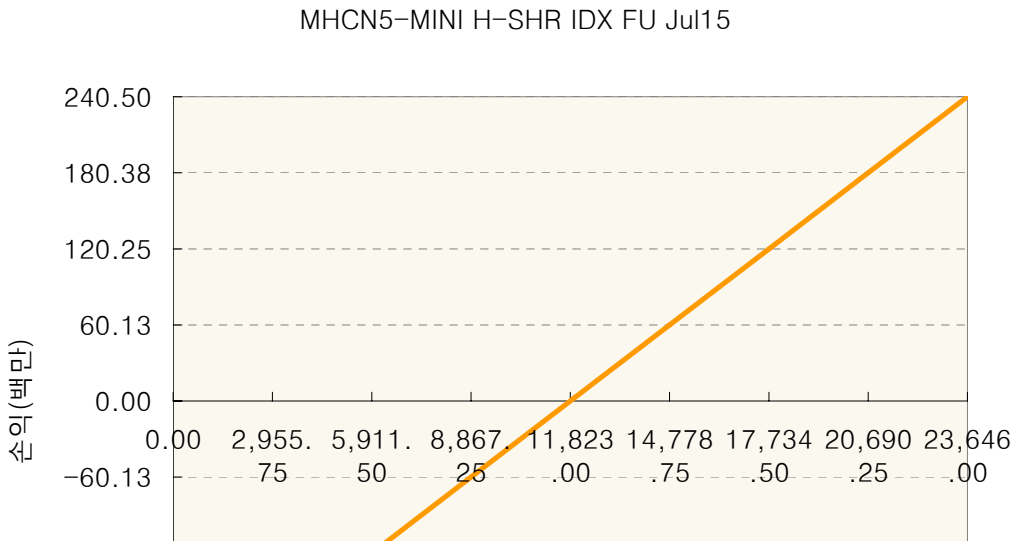
1. 계약금액

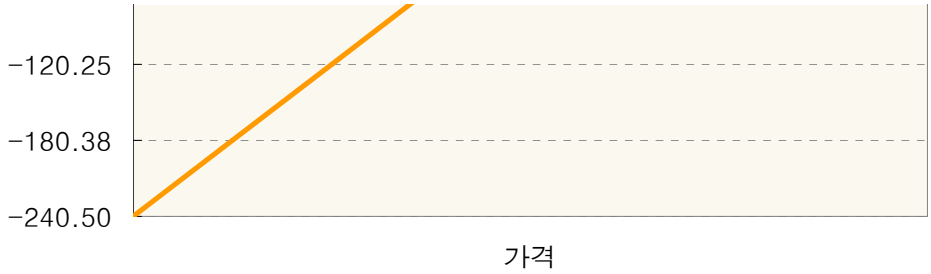
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,998	0	7,998	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN5	H-SHARES IDX FUT Jul15	621
MHCN5	MINI H-SHR IDX FU Jul15	19

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

(단위:백만원)

738

공시일	2015-07-15
기준일	2015-07-14

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	32,585	0	32,585	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO00(신한MXWO 미래S 0521	2,549

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,589

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2015-07-15
기준일	2015-07-14

중국본토인덱스RQFII모(주식-파

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	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSG20150‹CSI 300 Net Return Index	39

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

75

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2015-07-15
기준일	2015-07-14

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	9,723	0	9,723	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500 미래S0630	560
SWCSI50000 신한CSI500 미래S0709	169

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,439

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2015-07-15
기준일	2015-07-14

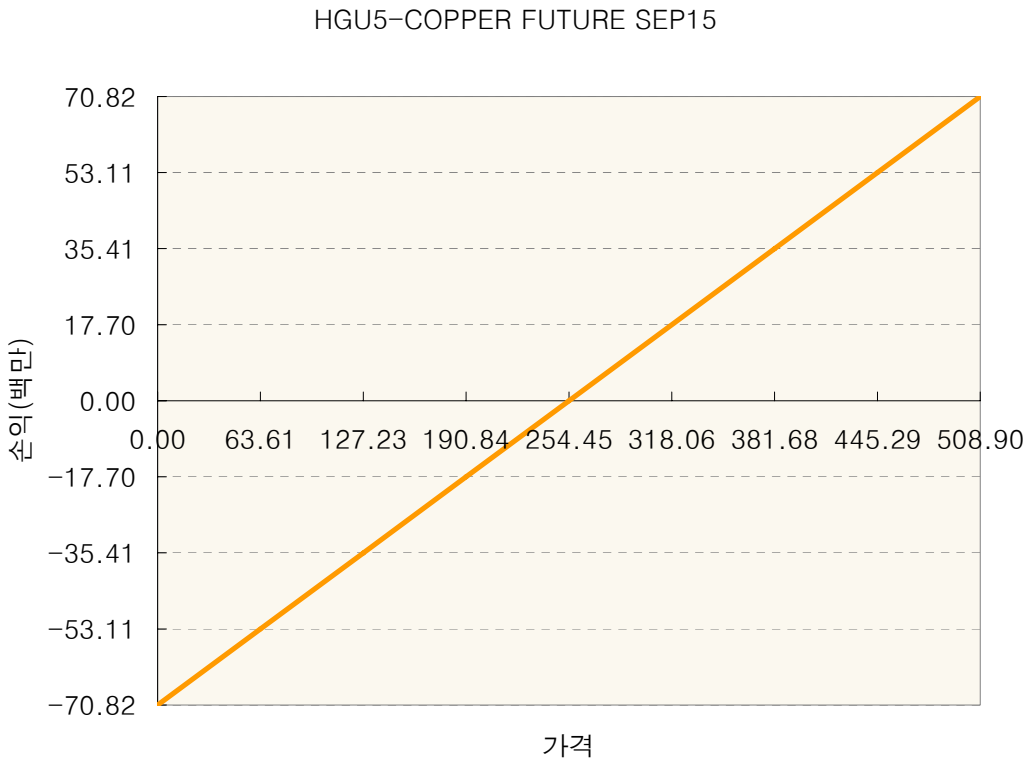
메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

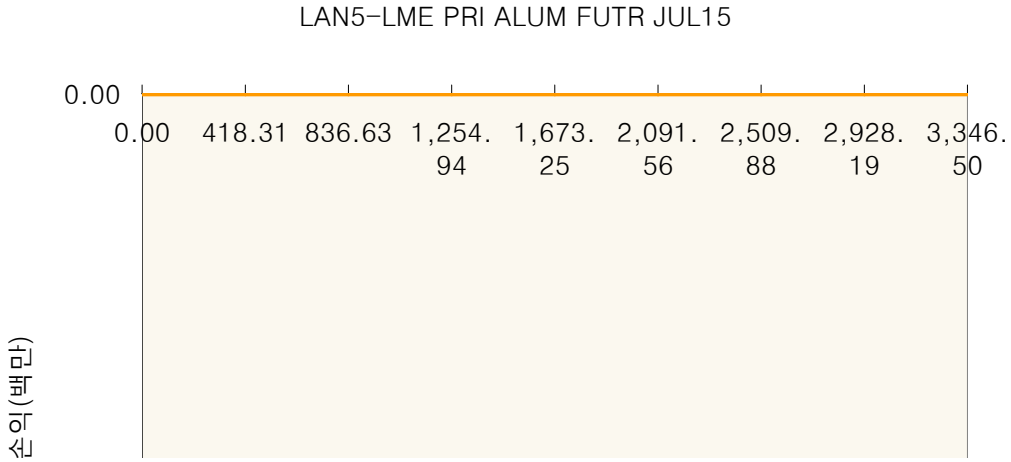
1. 계약금액

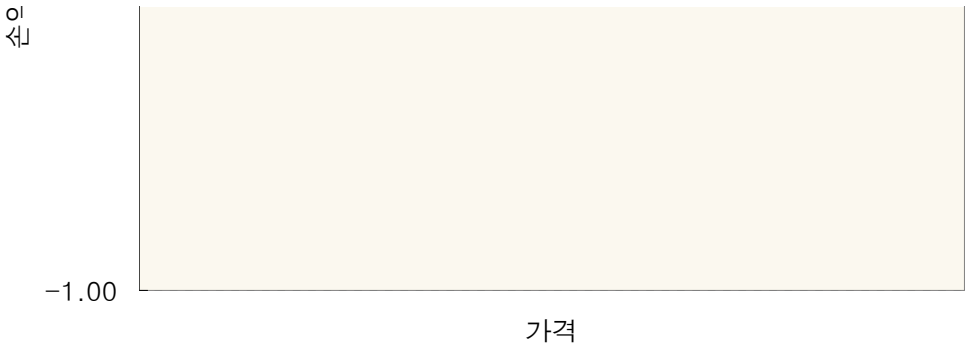
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	17	0	17	
누계	유가증권	선물	525	159	365	

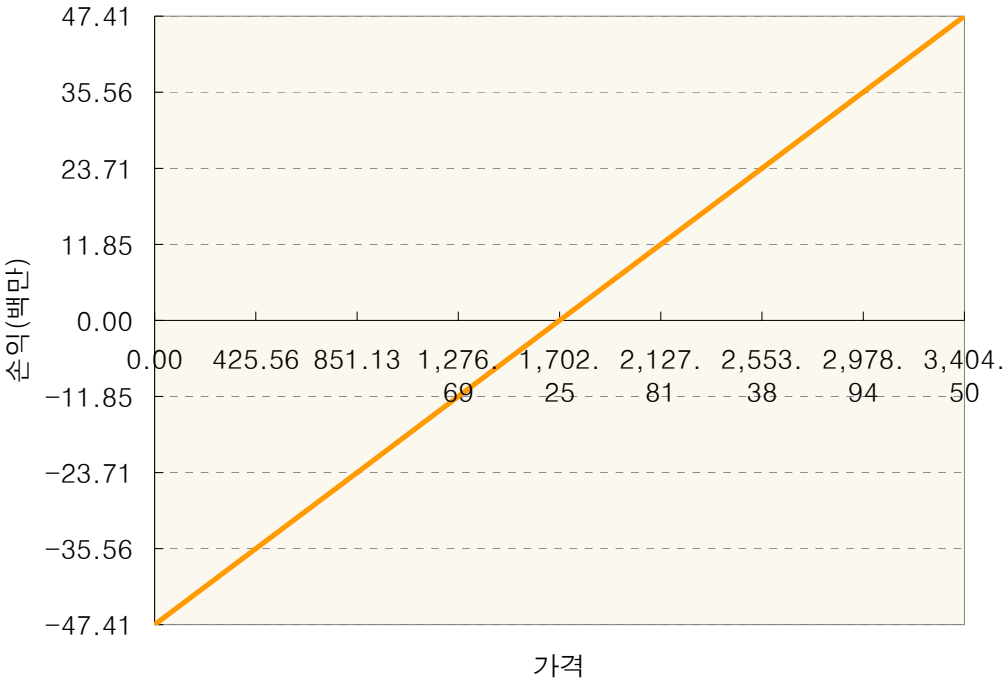
2. 만기시점의 손익구조



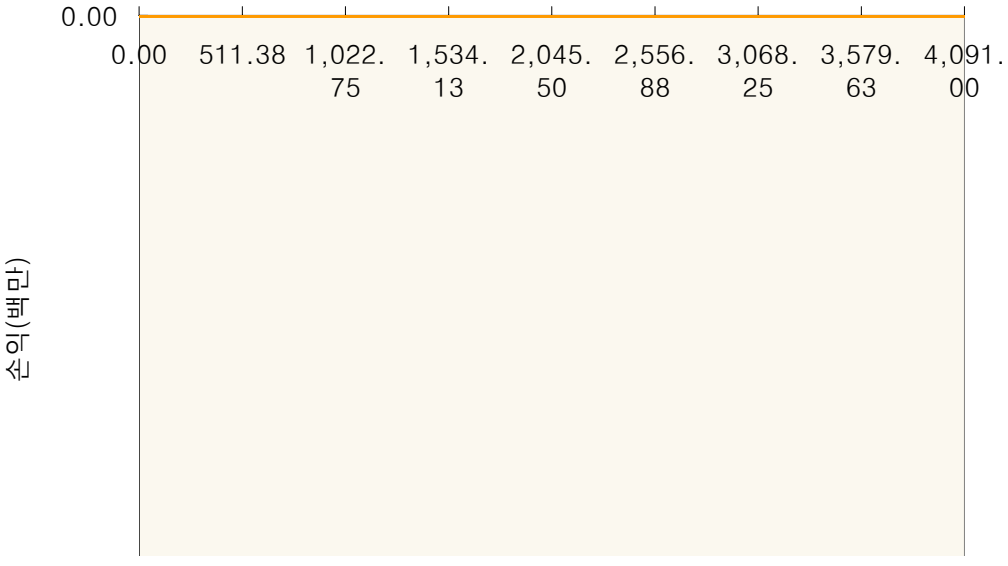


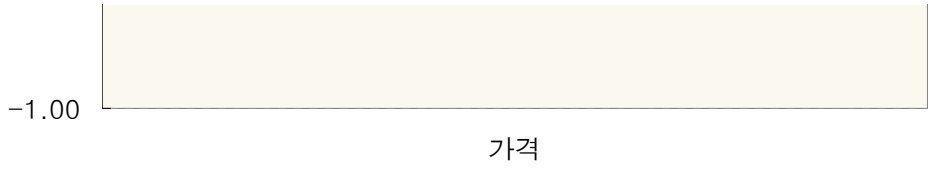


LAU5-LME PRI ALUM FUTR SEP15

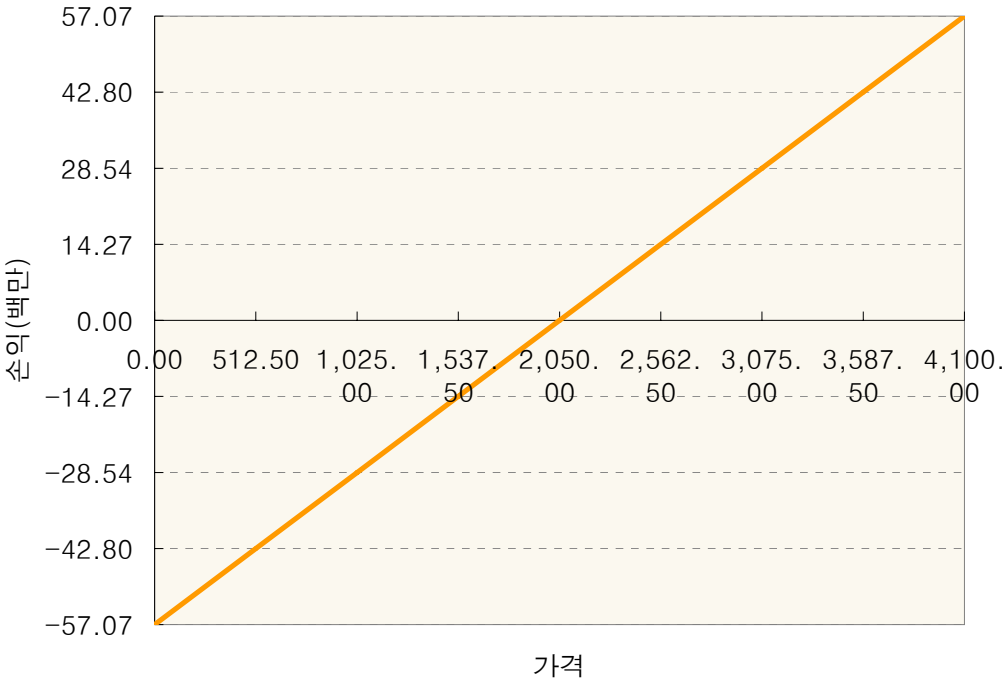


LXN5-LME ZINC FUTURE JUL15

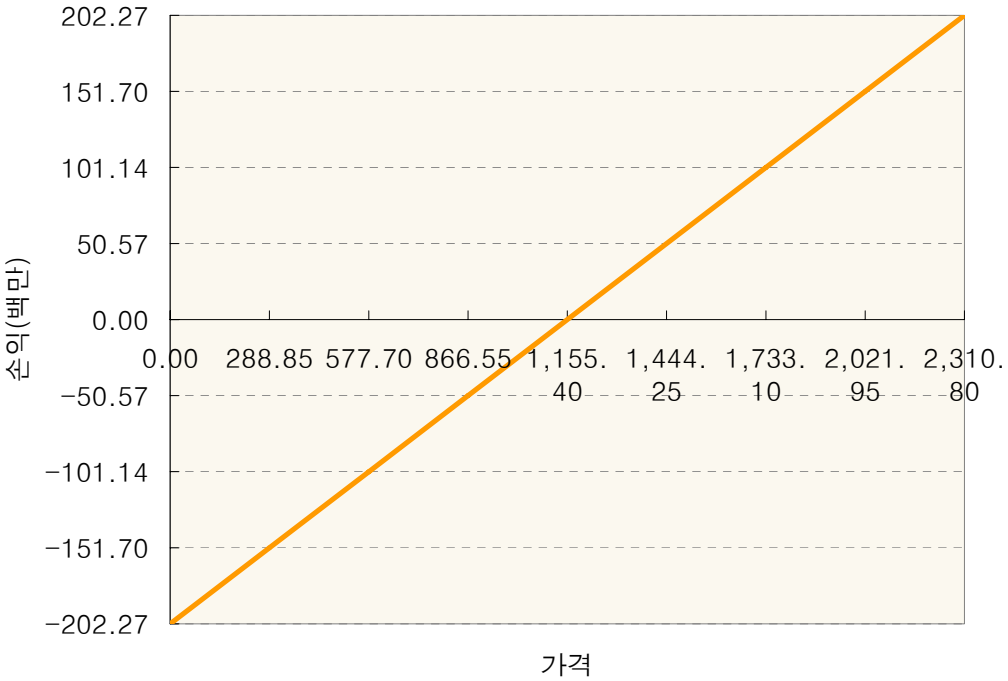


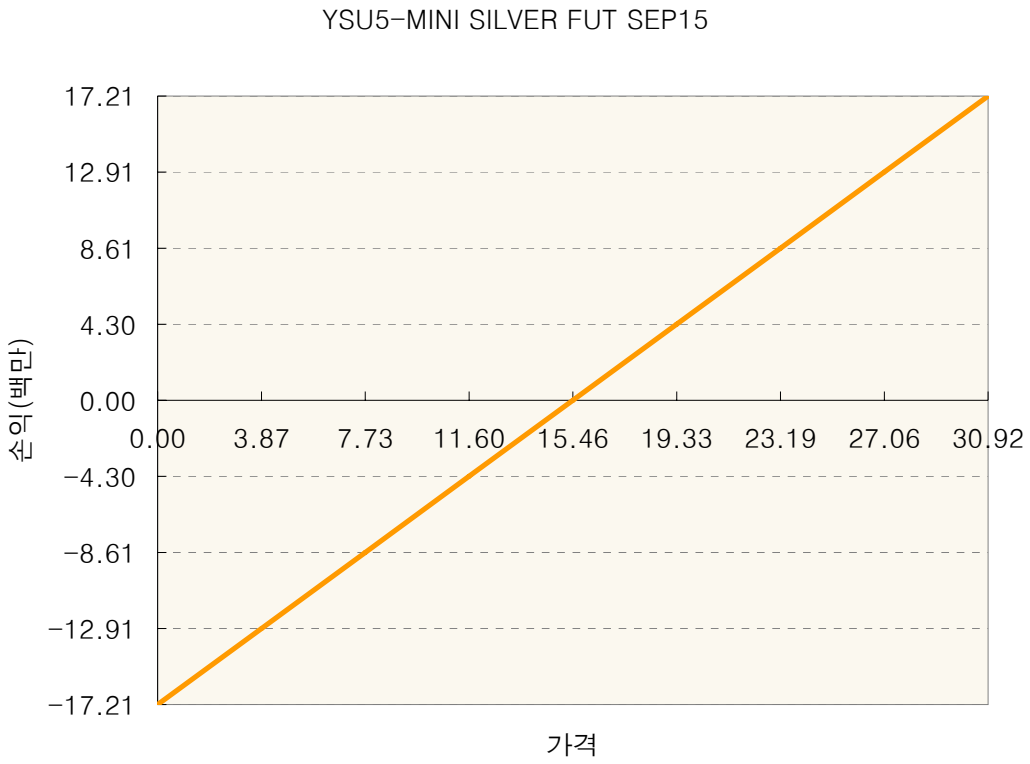


LXU5-LME ZINC FUTURE SEP15



XGQ5-MINI GOLD FUTURE Aug15





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGU5	COPPER FUTURE SEP15	6
LAN5	LME PRI ALUM FUTR JUL15	1
LAU5	LME PRI ALUM FUTR SEP15	4
LXN5	LME ZINC FUTURE JUL15	0.4
LXU5	LME ZINC FUTURE SEP15	5
XGQ5	MINI GOLD FUTURE Aug15	16
YSU5	MINI SILVER FUT SEP15	1

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

(단위:백만원)

27

공시일	2015-07-15
기준일	2015-07-14

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

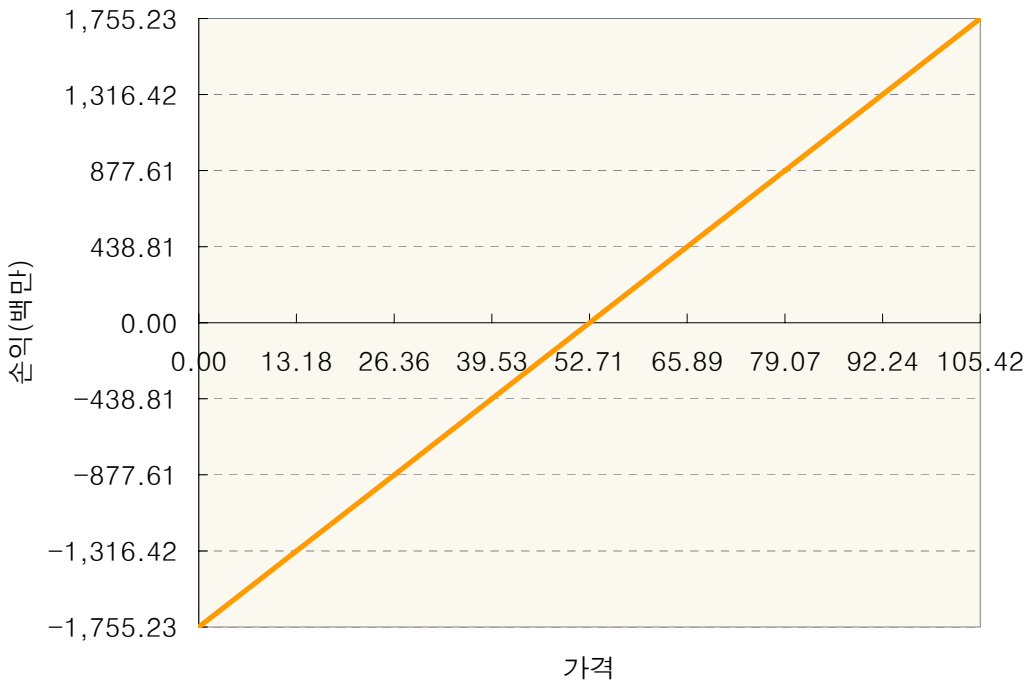
1. 계약금액

(단위:백만원)

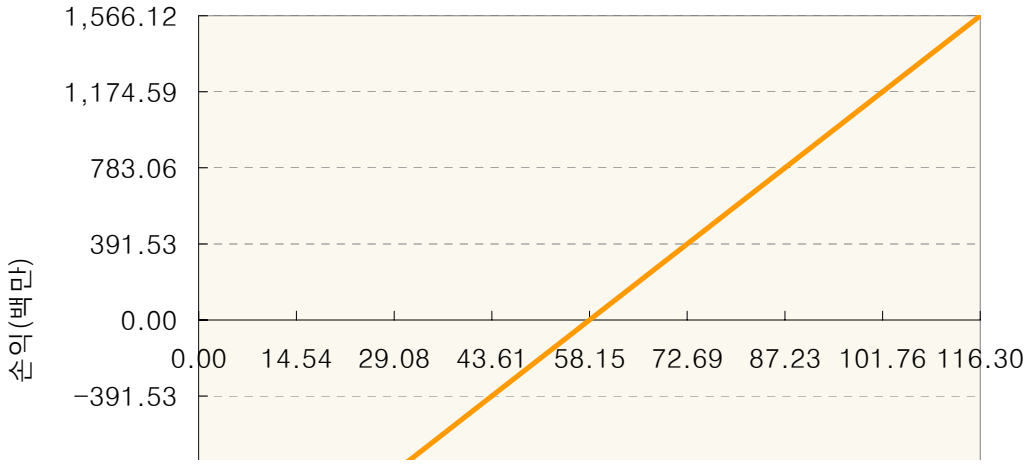
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,024	0	7,024	

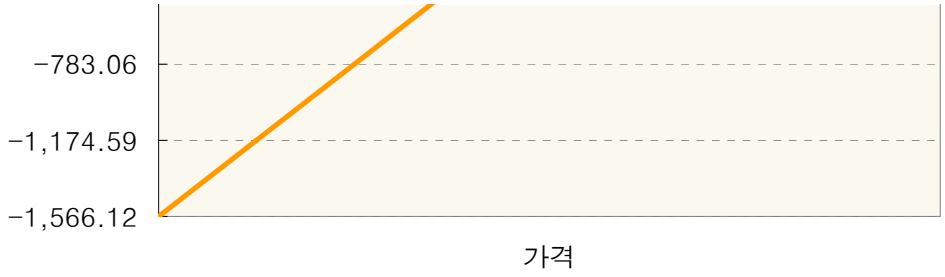
2. 만기시점의 손익구조

CLU5-WTI CRUDE FUTURE SEP15

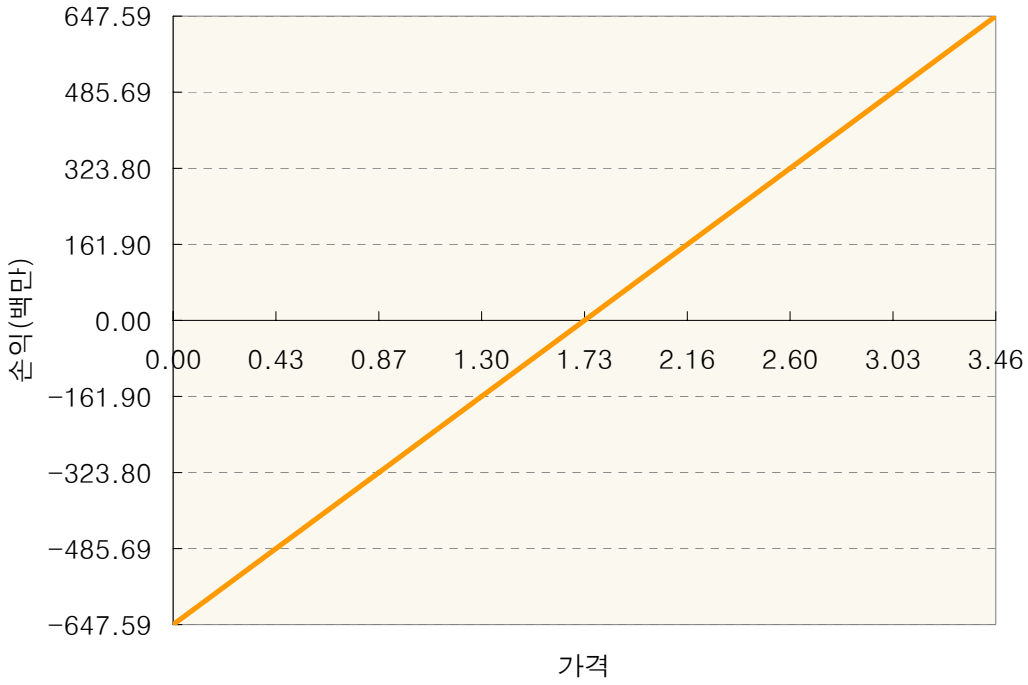


COU5-BRENT CRUDE FUTR Sep15

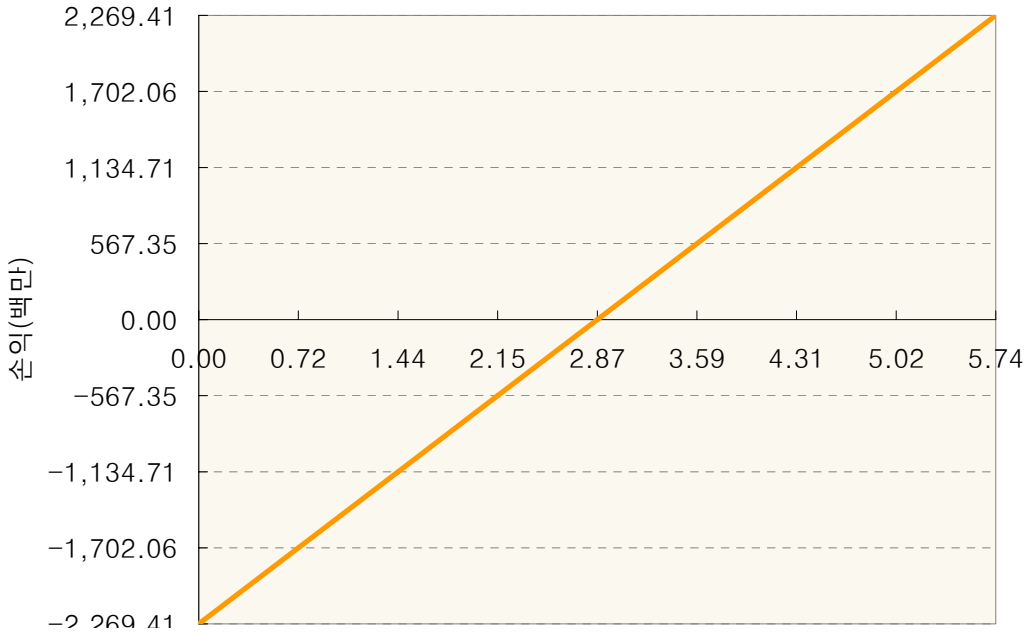


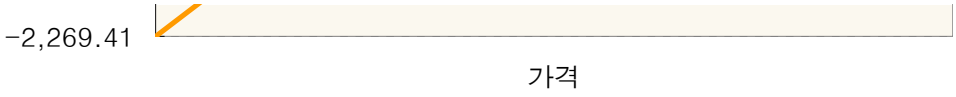


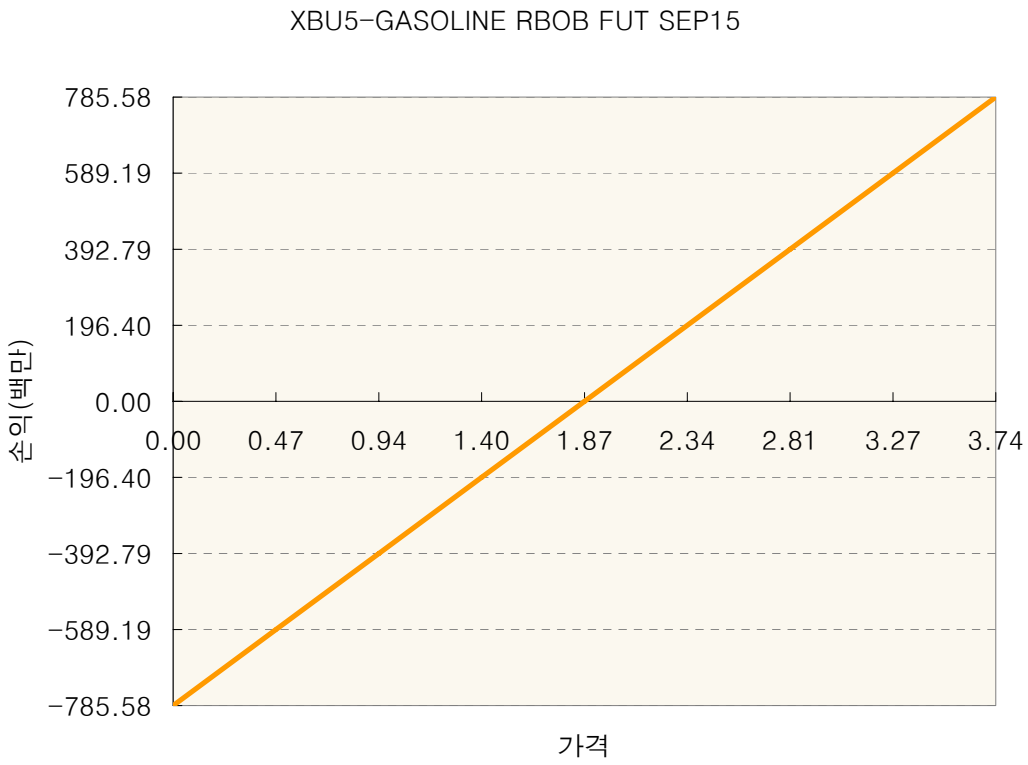
HOU5-NY Harb ULSD Fut SEP15



NGU5-NATURAL GAS FUTR SEP15







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLU5	WTI CRUDE FUTURE SEP15	140
COU5	BRENT CRUDE FUTR Sep15	125
HOU5	NY Harb ULSD Fut SEP15	52
NGU5	NATURAL GAS FUTR SEP15	182
XBU5	GASOLINE RBOB FUT SEP15	63

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,299

공시일	2015-07-15
기준일	2015-07-14

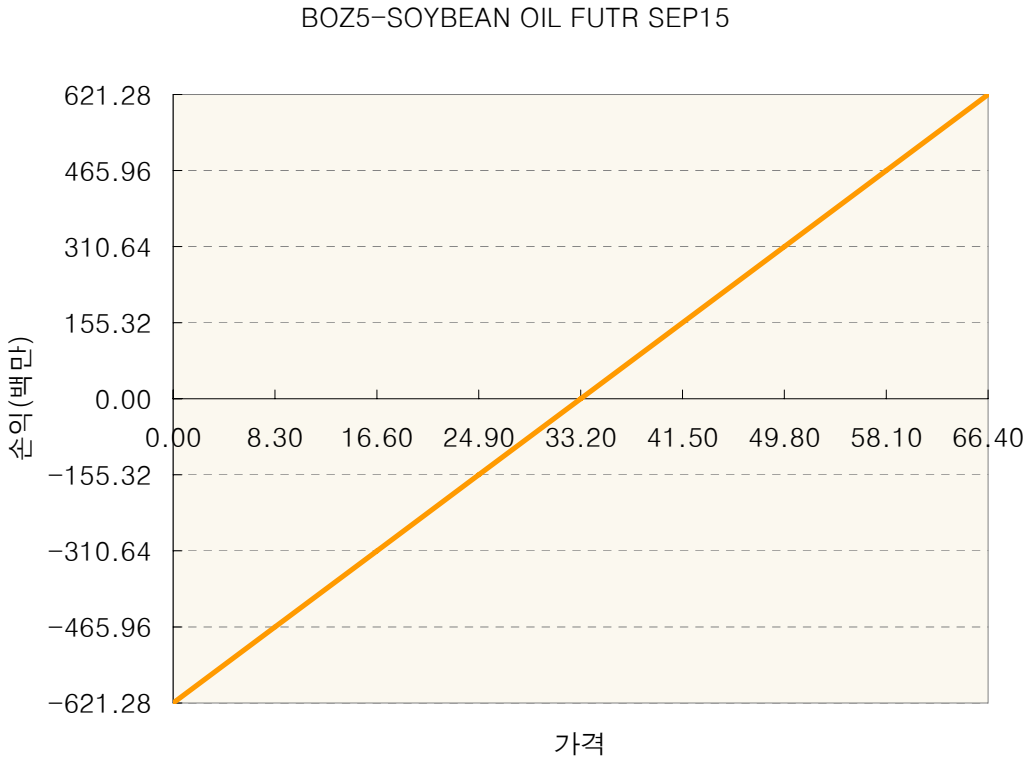
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

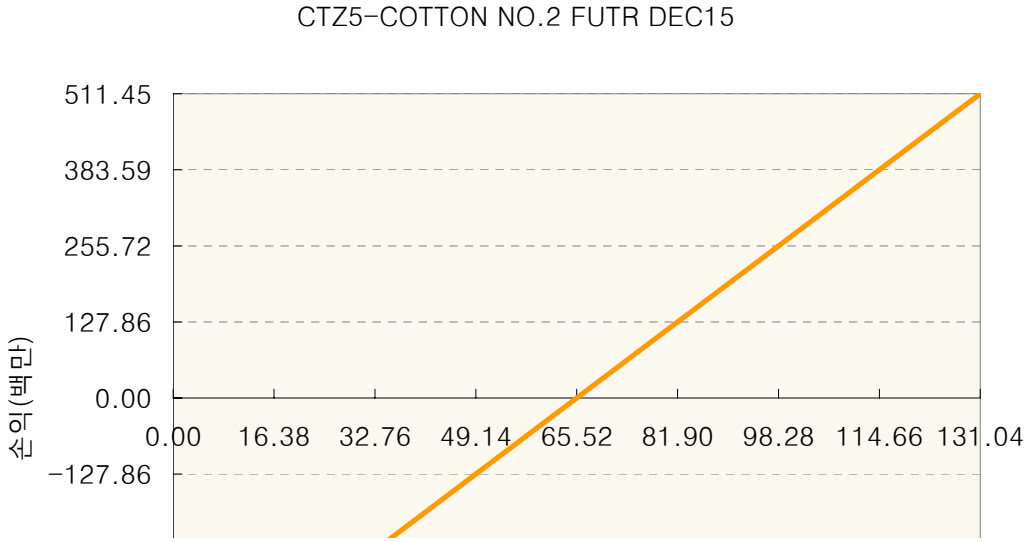
1. 계약금액

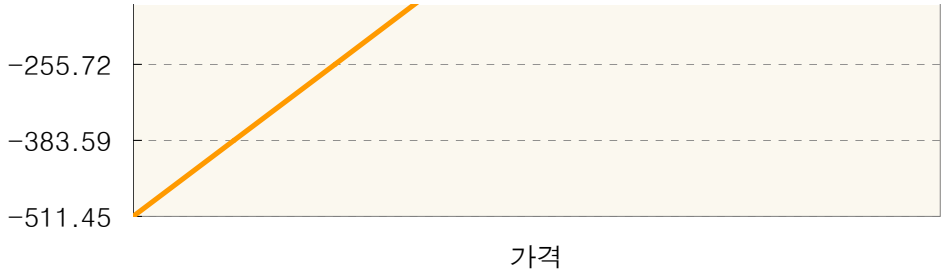
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,705	0	7,705	

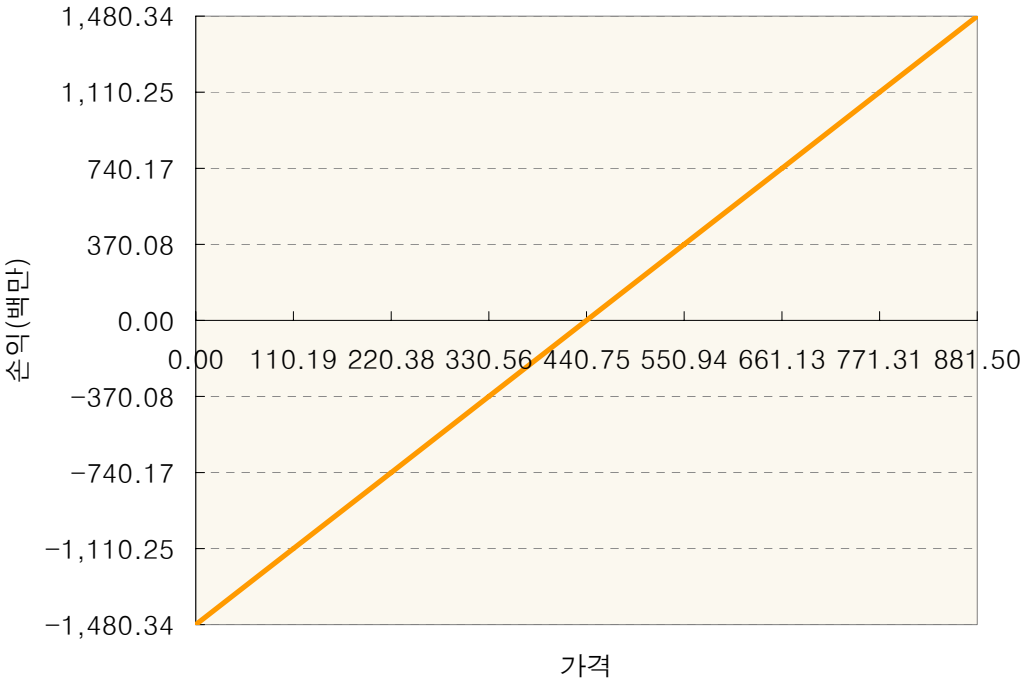
2. 만기시점의 손익구조



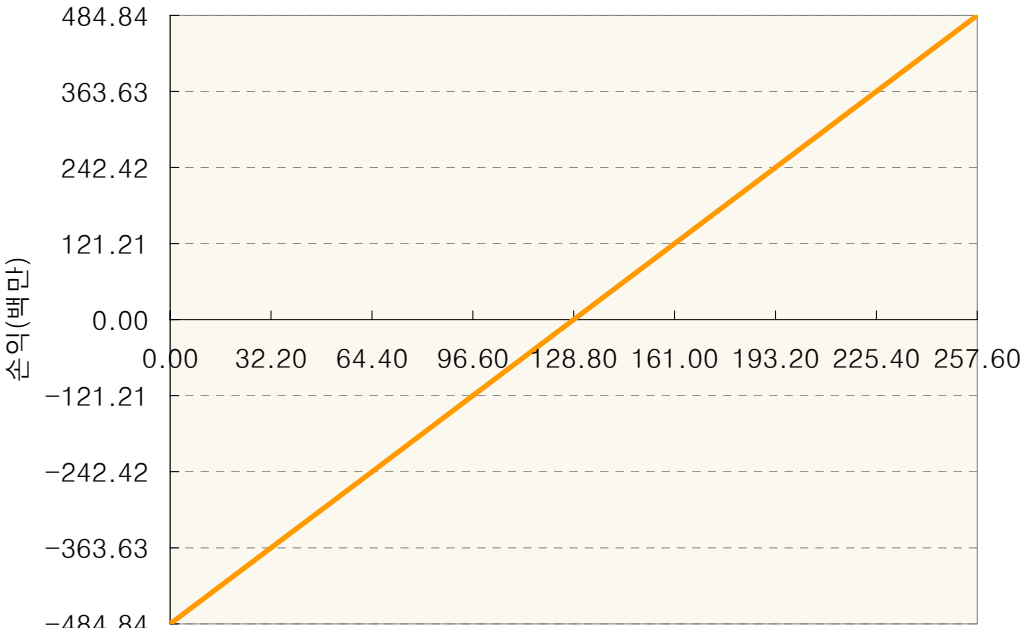


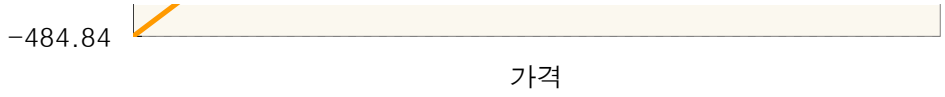


CU5-CORN FUTURE SEP15

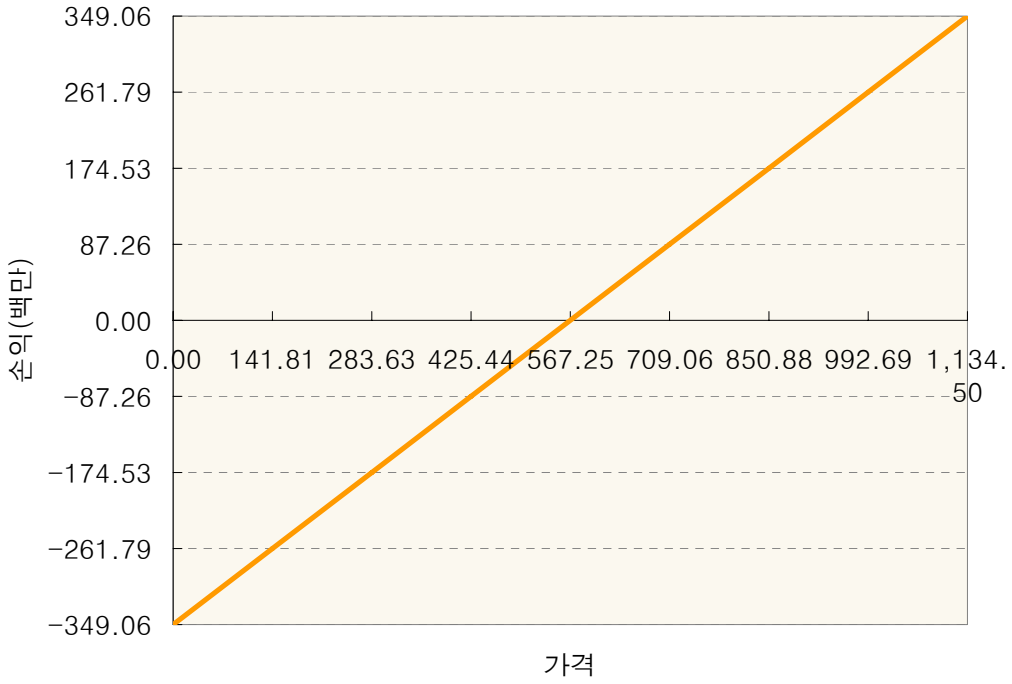


KCU5-COFFEE "C" FUTURE SEP15

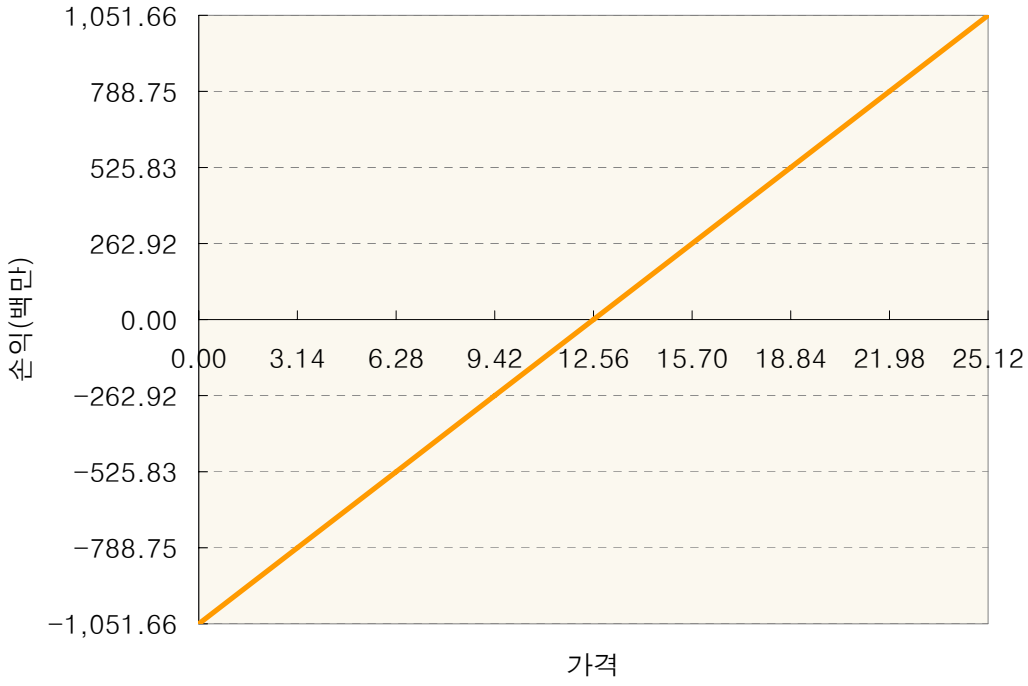




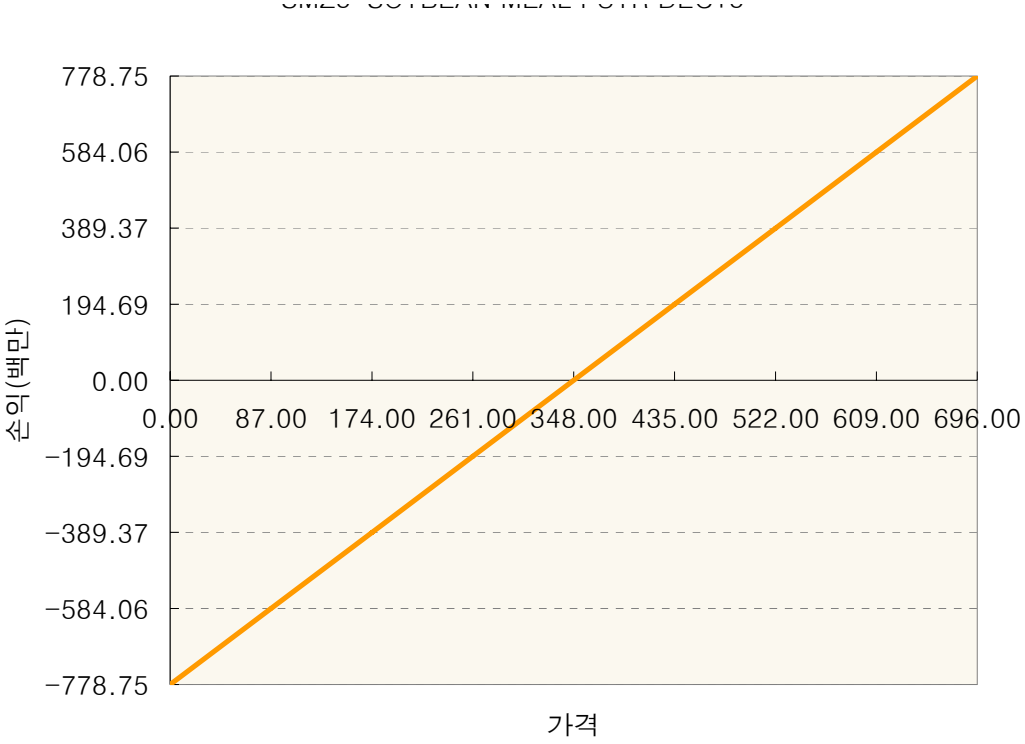
KWU5-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) SEP15



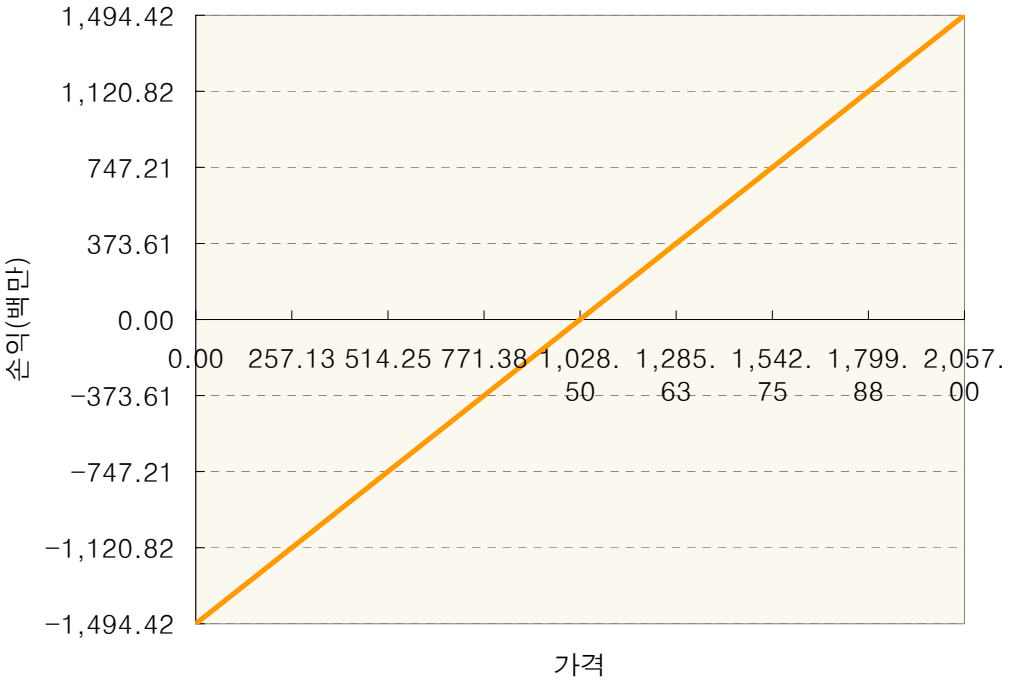
SBV5-Sugar #11 (WORLD) OCT15



SMZ5-SOYBEAN MEAL FUTR DEC15

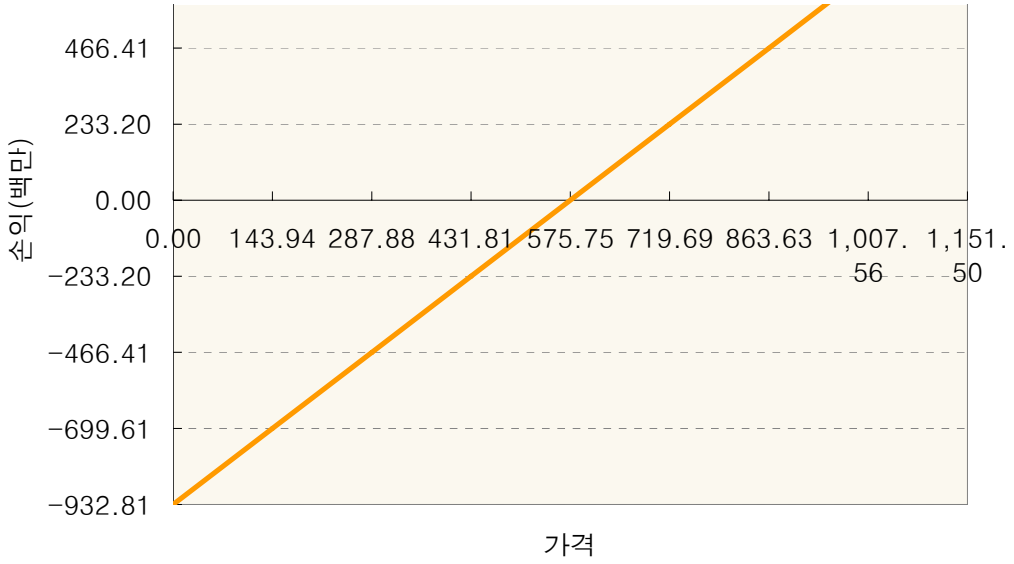


SX5-SOYBEAN FUTURE NOV15



WU5-WHEAT FUTURE(CBT) SEP15





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ5	SOYBEAN OIL FUTR SEP15	50
CTZ5	COTTON NO.2 FUTR DEC15	41
CU5	CORN FUTURE SEP15	118
KCU5	COFFEE "C" FUTURE SEP15	39
KWU5	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) SEP15	28
SBV5	Sugar #11 (WORLD) OCT15	84
SMZ5	SOYBEAN MEAL FUTR DEC15	62
SX5	SOYBEAN FUTURE NOV15	120
WU5	WHEAT FUTURE(CBT) SEP15	75

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

(단위:백만원)

906