공시일	2015-12-31
기준일	2015-12-30

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	2015-12-31
기준일	2015-12-30

스마트인덱스모

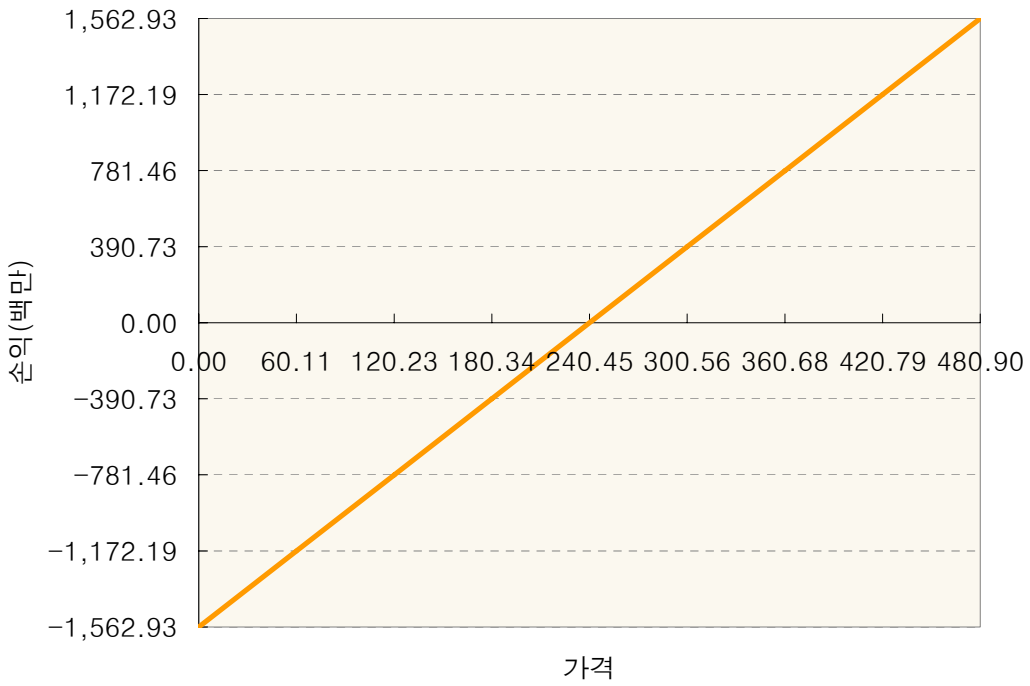
1. 계약금액

(단위:백만원)

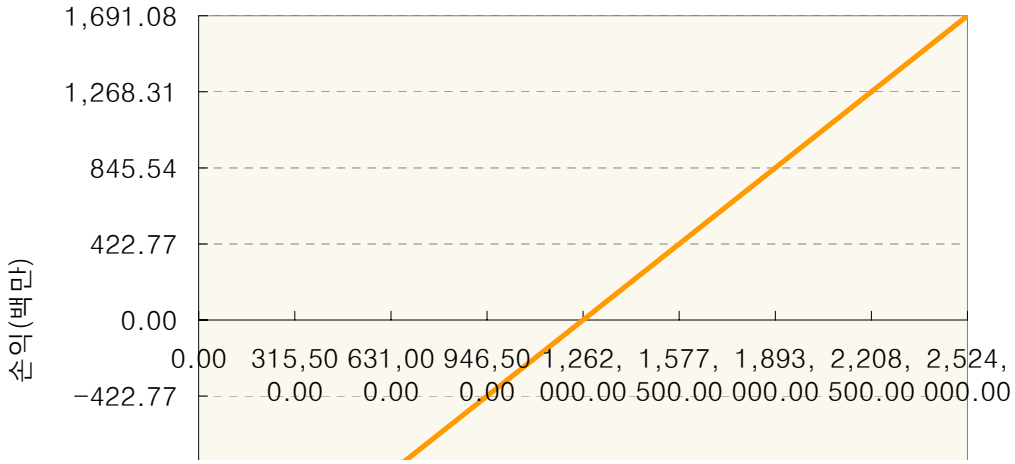
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,254	0	3,254	장내

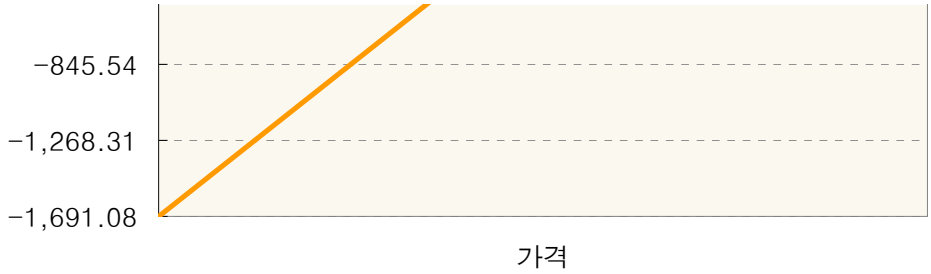
2. 만기시점의 손익구조

KR4101L30006-2016-03 코스피200지수선물



KR4111L30005-2016-03 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L3002016-03 코스피200지수선물							125
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	42	42	42	42	42	42	42
5.33%	83	83	83	83	83	83	83
8.00%	125	125	125	125	125	125	125
KR4111L3002016-03 삼성전자개별선물							135
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-135	-135	-135	-135	-135	-135	-135
-5.33%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90
-2.67%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	45	45	45	45	45	45	45
5.33%	90	90	90	90	90	90	90
8.00%	135	135	135	135	135	135	135

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

(단위:백만원)

211

공시일	2015-12-31
기준일	2015-12-30

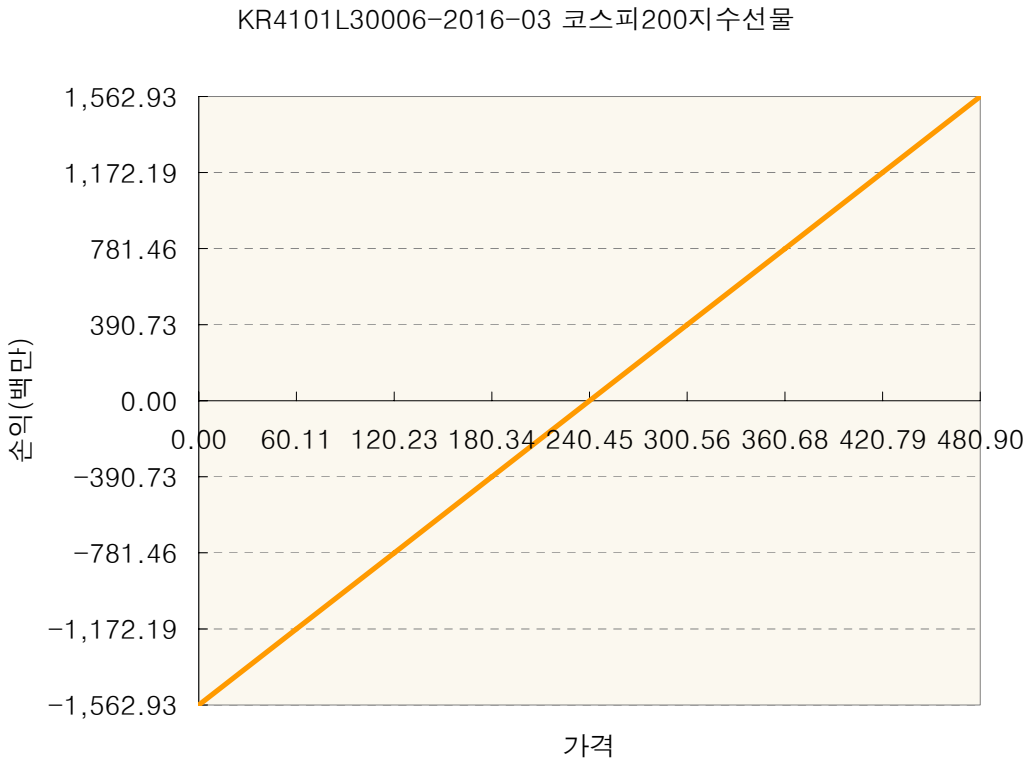
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,563	0	1,563	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물							125
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	42	42	42	42	42	42	42
5.33%	83	83	83	83	83	83	83
8.00%	125	125	125	125	125	125	125

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

94

공시일	2015-12-31
기준일	2015-12-30

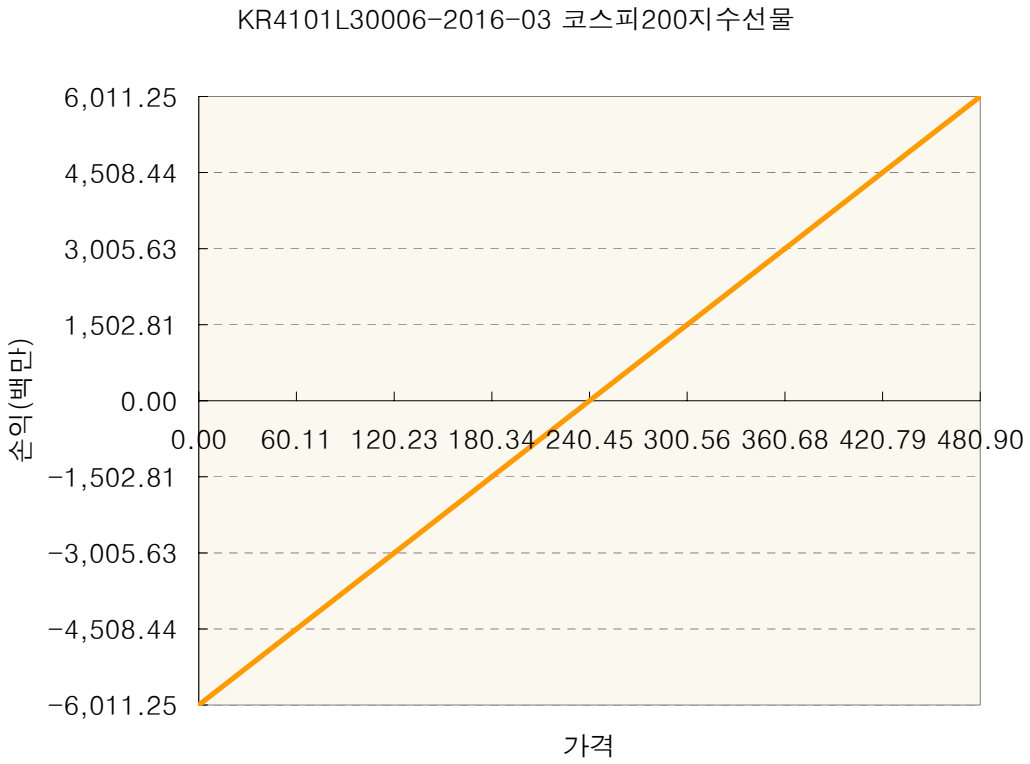
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	120	0	120	장내
누계	유가증권	선물	6,011	0	6,011	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물							481
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-481	-481	-481	-481	-481	-481	-481
-5.33%	-321	-321	-321	-321	-321	-321	-321
-2.67%	-160	-160	-160	-160	-160	-160	-160
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	160	160	160	160	160	160	160
5.33%	321	321	321	321	321	321	321
8.00%	481	481	481	481	481	481	481

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	360

공시일	2015-12-31
기준일	2015-12-30

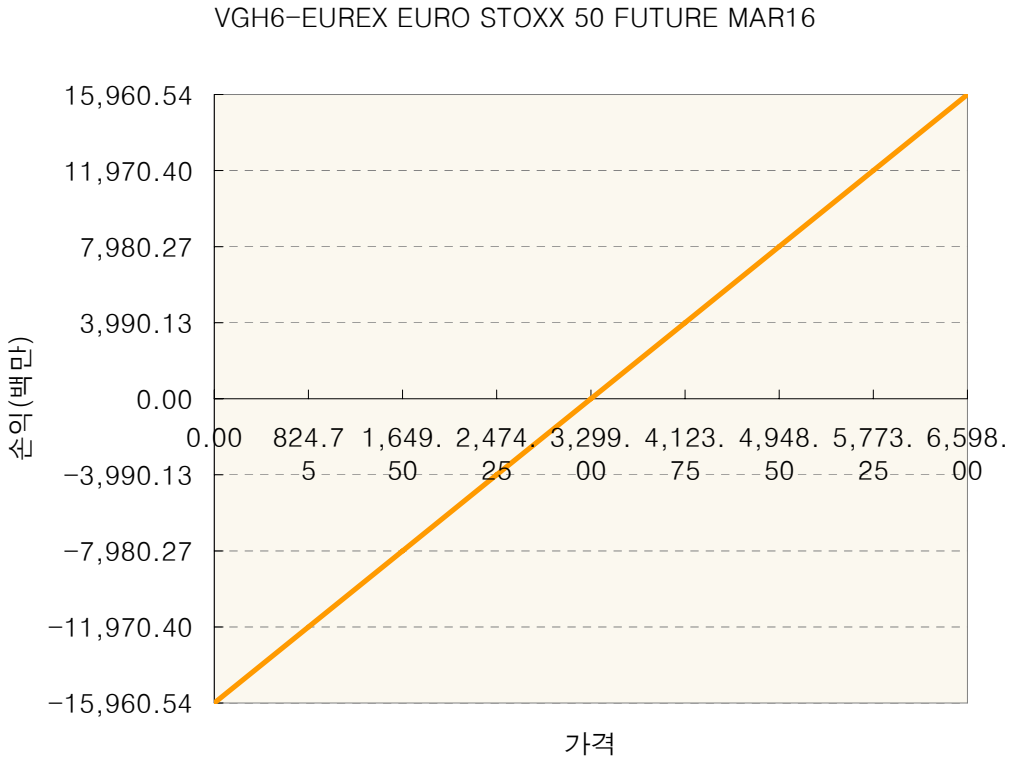
유로인덱스1호(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	15,961	0	15,961	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH6	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR16	1,277

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

(단위:백만원)

1,419

공시일	2015-12-31
기준일	2015-12-30

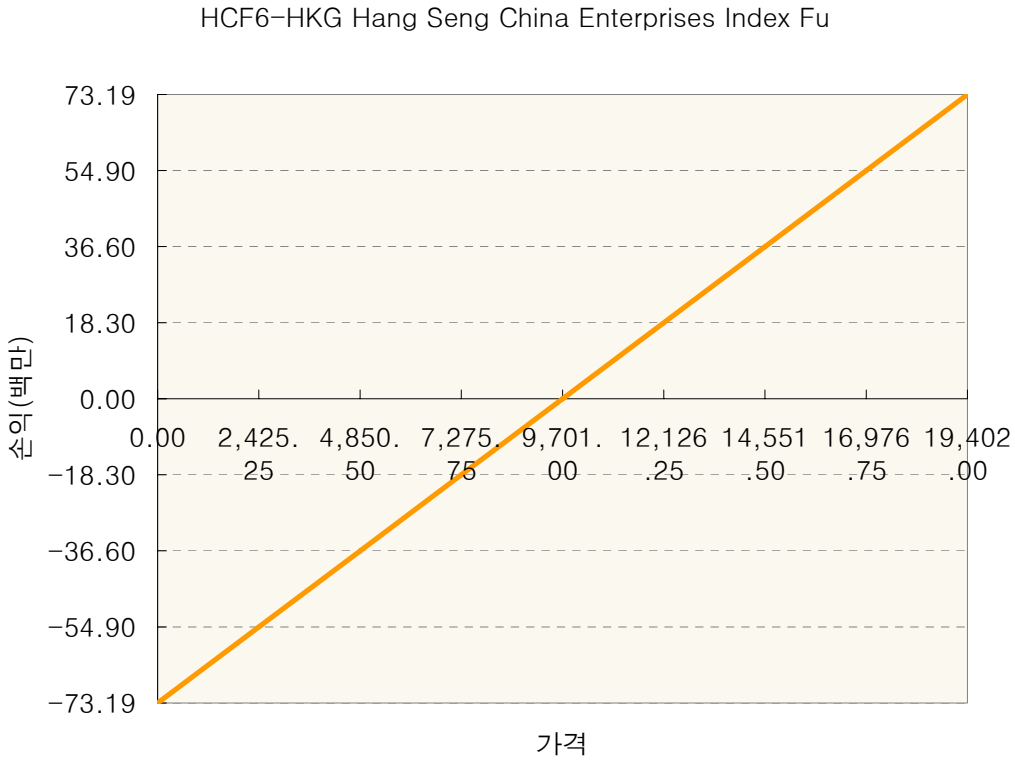
아시아콩숏모(주식혼합-파생형)

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	73	0	73	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF6	HKG Hang Seng China Enterprises Index Fu	6

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

(단위:백만원)

8

공시일	2015-12-31
기준일	2015-12-30

차이나인덱스(주식-파생형)(종)

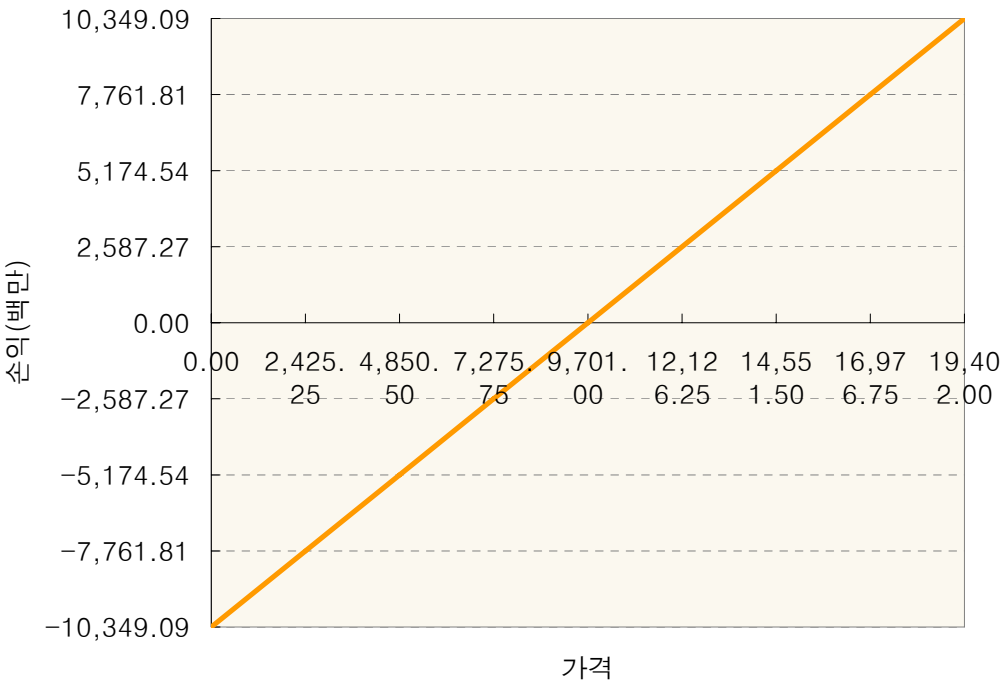
1. 계약금액

(단위:백만원)

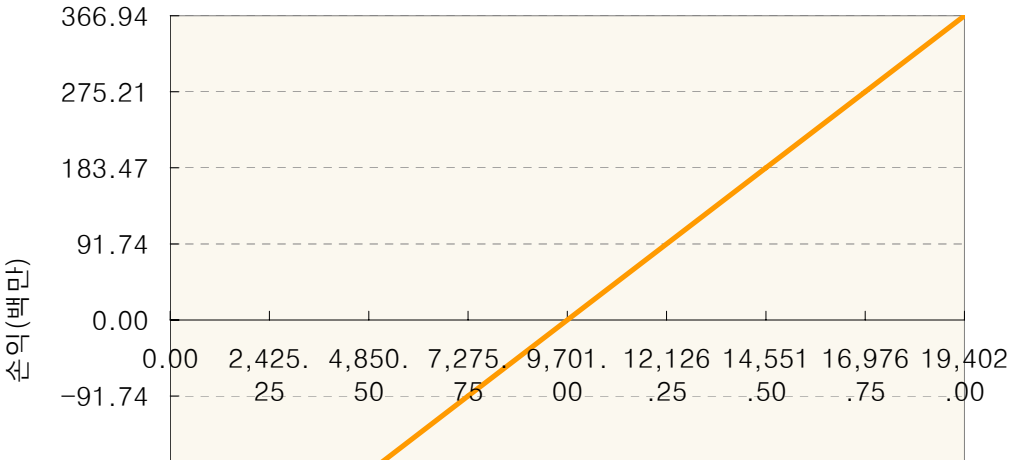
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,716	0	10,716	장내

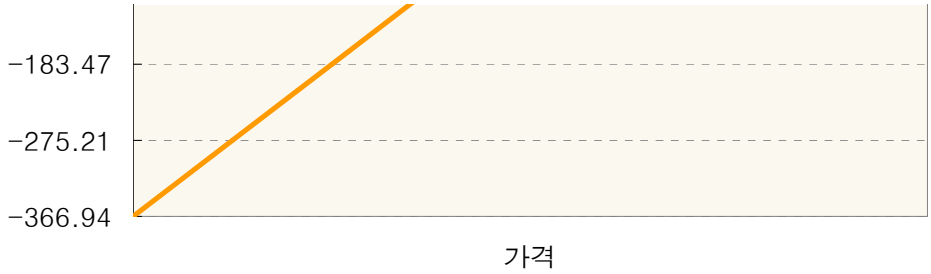
2. 만기시점의 손익구조

HCF6-HKG Hang Seng China Enterprises Index FU



MHCF6-HKG MINI HANG SENG CHINA H-SHR IDX FUT J





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF6	HKG Hang Seng China Enterprises Index FU	828
MHCF6	HKG MINI HANG SENG CHINA H-SHR IDX FUT J	29

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

(단위:백만원)

1,122

공시일	2015-12-31
기준일	2015-12-30

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	10,856	0	10,856	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO00(신한MXWO 미래S1120	862

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

647

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2015-12-31
기준일	2015-12-30

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	16

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

36

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2015-12-31
기준일	2015-12-30

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	8,353	0	8,353	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S12081	513
SWCSI50000 신한CSI500미래S12082	158

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,775

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2015-12-31
기준일	2015-12-30

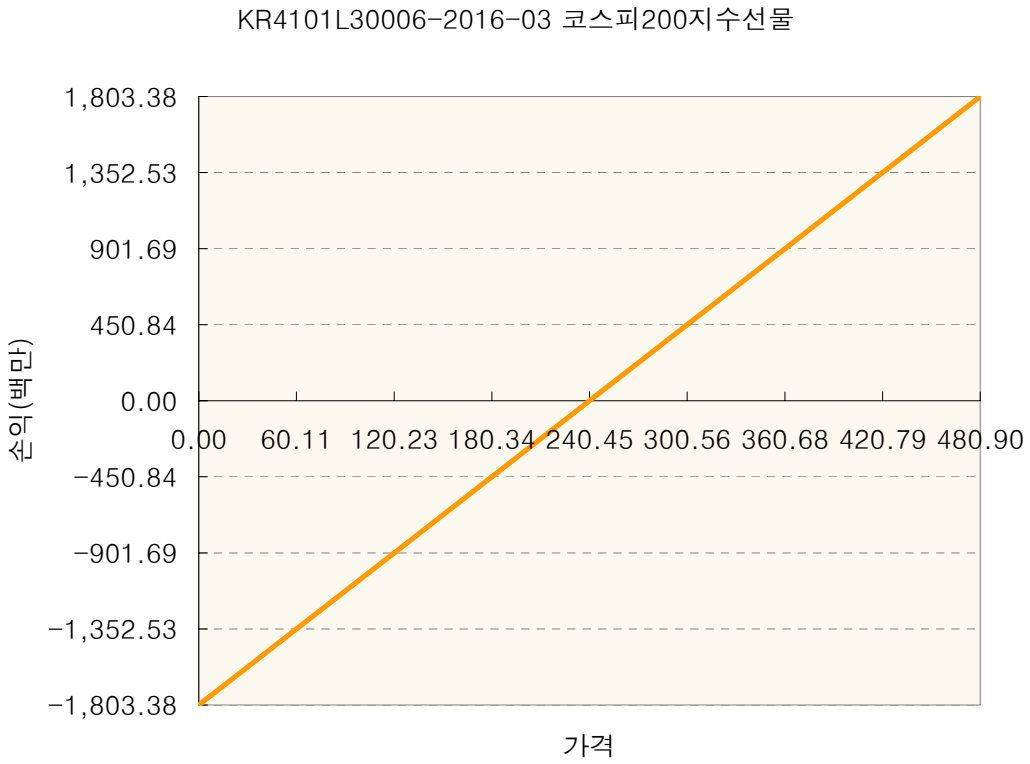
KOSPI200 레버리지 목표전환형 3

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	1,803	0	1,803	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물 144

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-144	-144	-144	-144	-144	-144	-144
-5.33%	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96
-2.67%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	48	48	48	48	48	48	48
5.33%	96	96	96	96	96	96	96
8.00%	144	144	144	144	144	144	144

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	108

공시일	2015-12-31
기준일	2015-12-30

NE-1호(ELS-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	1,952	0	1,952	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR65233AS5 ELS대우증권(ELS)15120	59
KR65433325 ELS신영증권플랜업(ELS)5447	52
KR65533AF5 ELSNH투자증권(ELS)11930	51
KR65733E15 ELS한국투자증권(ELS)5269	51

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

(단위:백만원)

106

공시일	2015-12-31
기준일	2015-12-30

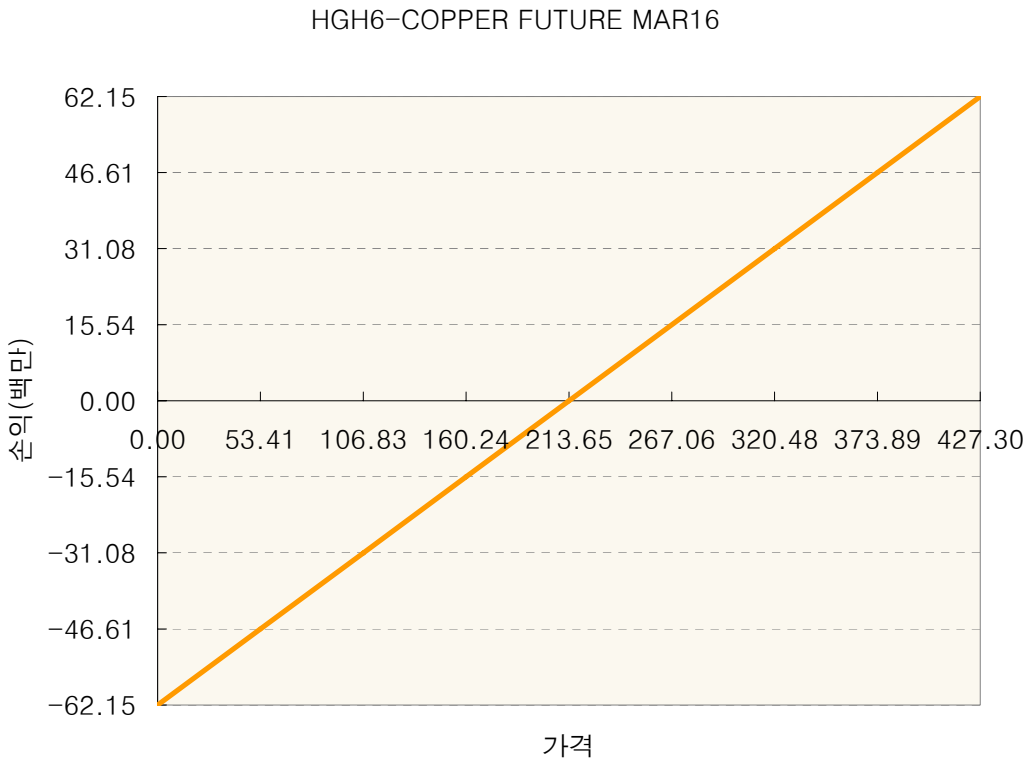
메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

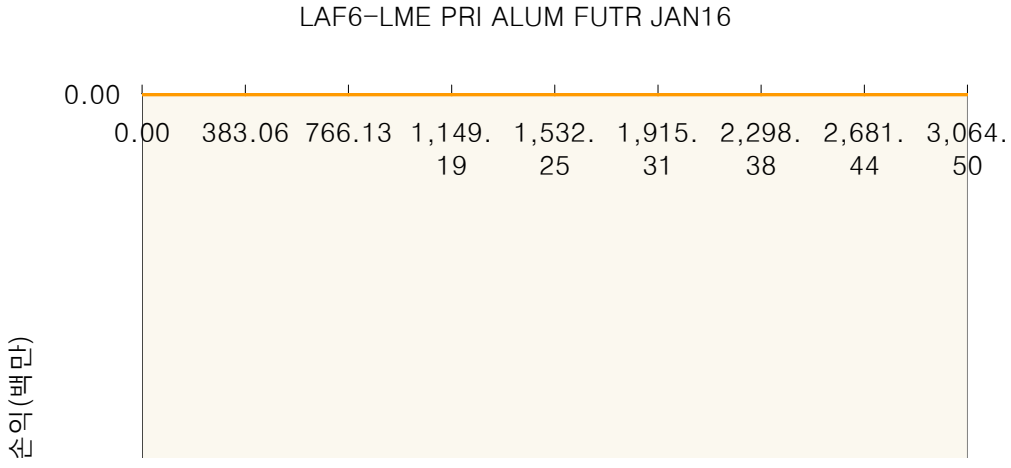
1. 계약금액

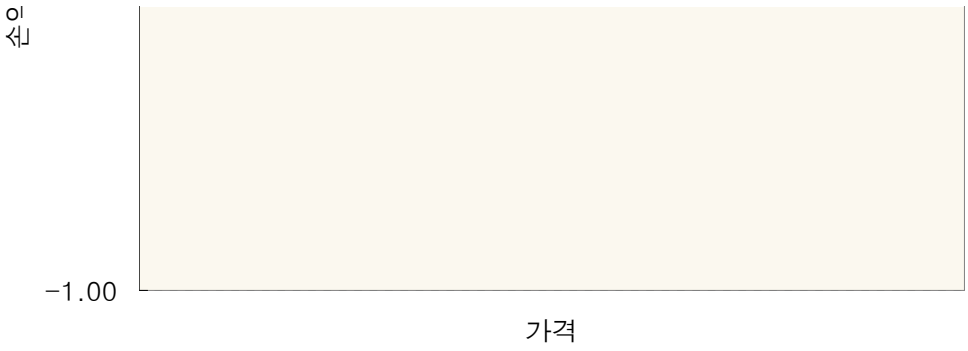
(단위:백만원)

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	16	0	16	
누계	유가증권	선물	493	182	311	

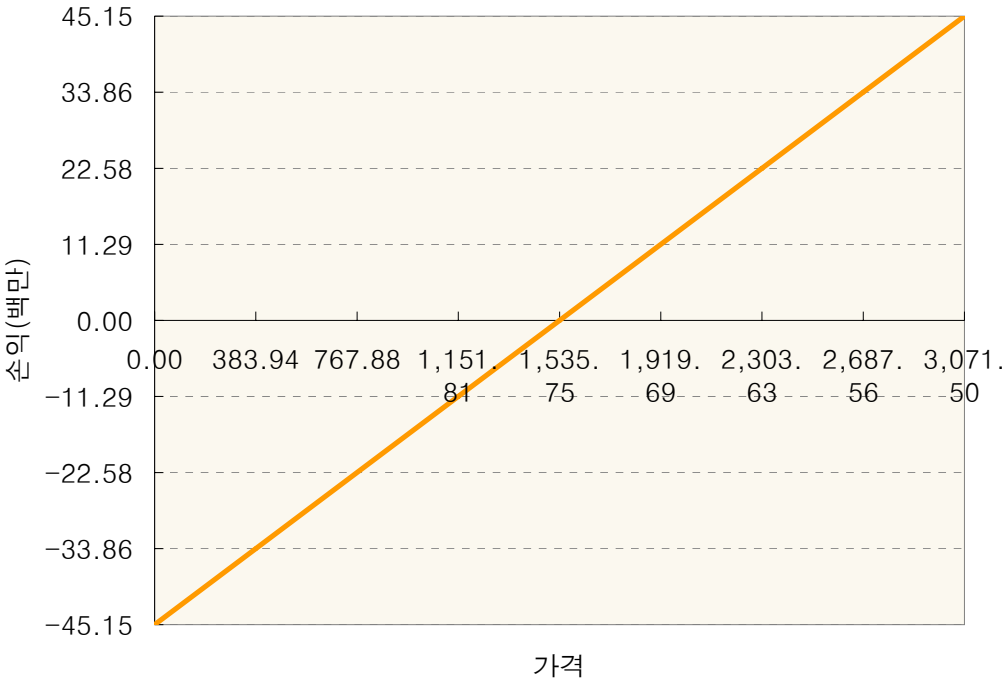
2. 만기시점의 손익구조



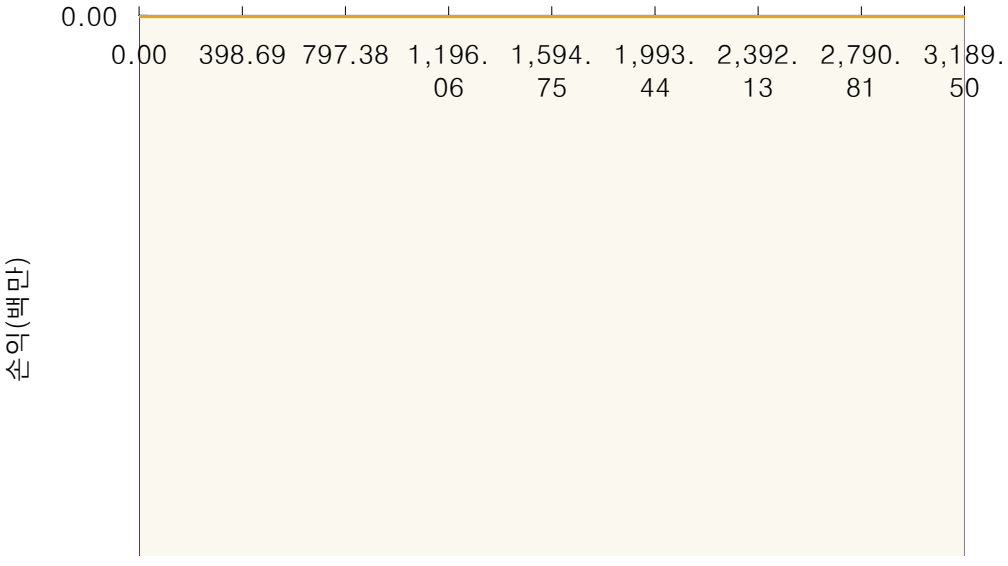


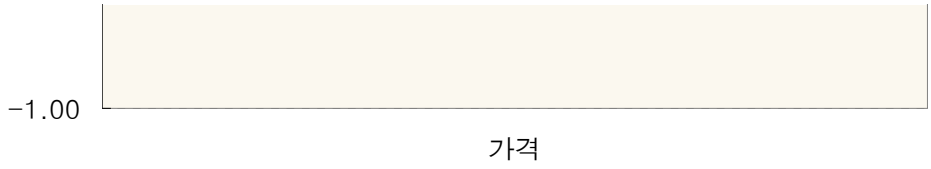


LAH6-LME PRI ALUM FUTR MAR16



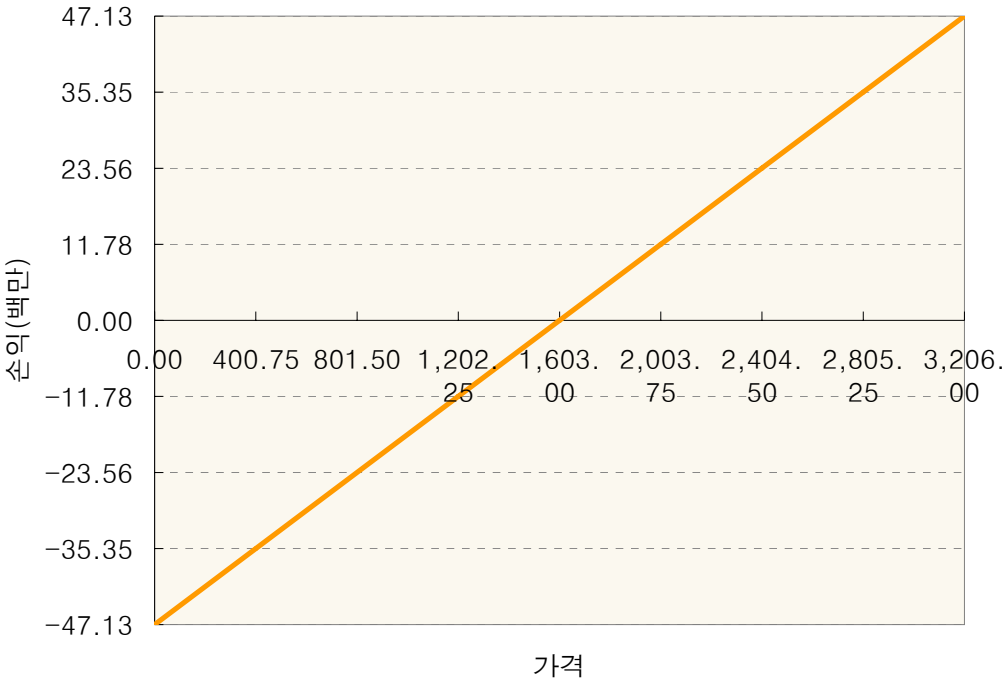
LXF6-LME ZINC FUTURE JAN16





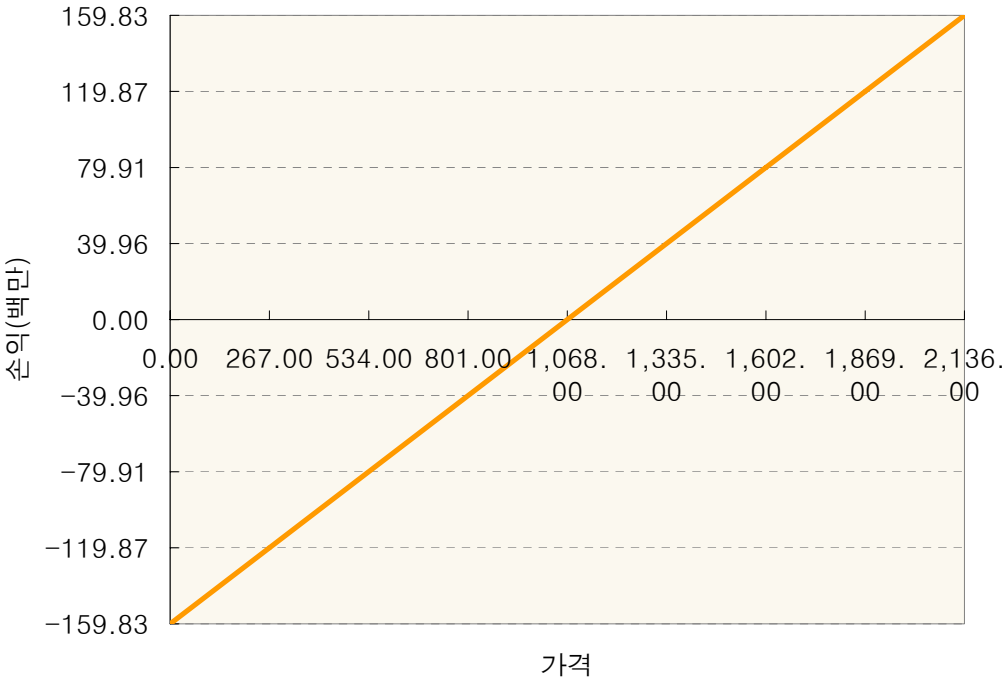
가격

LXH6-LME ZINC FUTURE MAR16

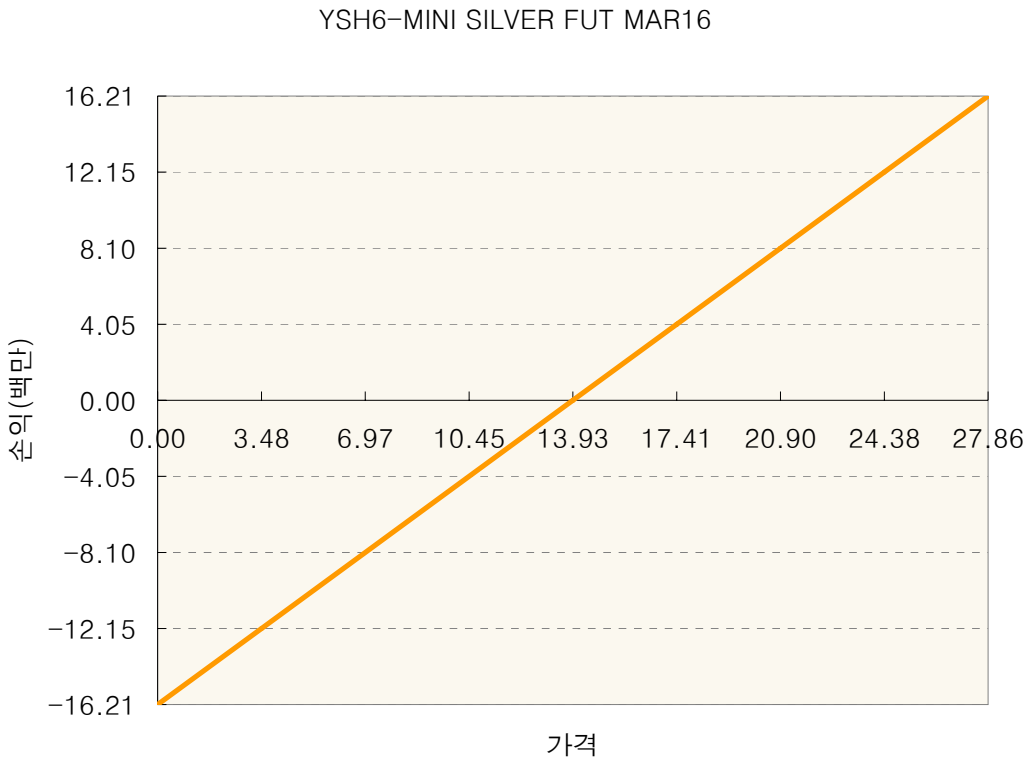


가격

XGG6-MINI GOLD FUTURE FEB16



가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGH6	COPPER FUTURE MAR16	5
LAF6	LME PRI ALUM FUTR JAN16	0.1
LAH6	LME PRI ALUM FUTR MAR16	4
LXF6	LME ZINC FUTURE JAN16	0.4
LXH6	LME ZINC FUTURE MAR16	4
XGG6	MINI GOLD FUTURE FEB16	13
YSH6	MINI SILVER FUT MAR16	1

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

(단위:백만원)

25

공시일	2015-12-31
기준일	2015-12-30

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

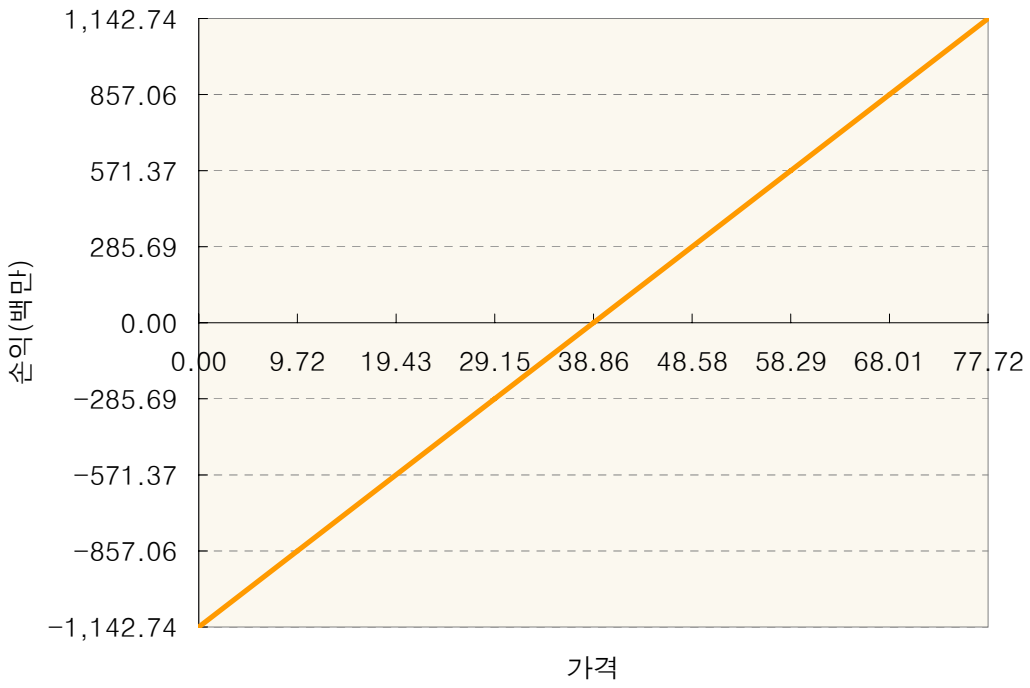
1. 계약금액

(단위:백만원)

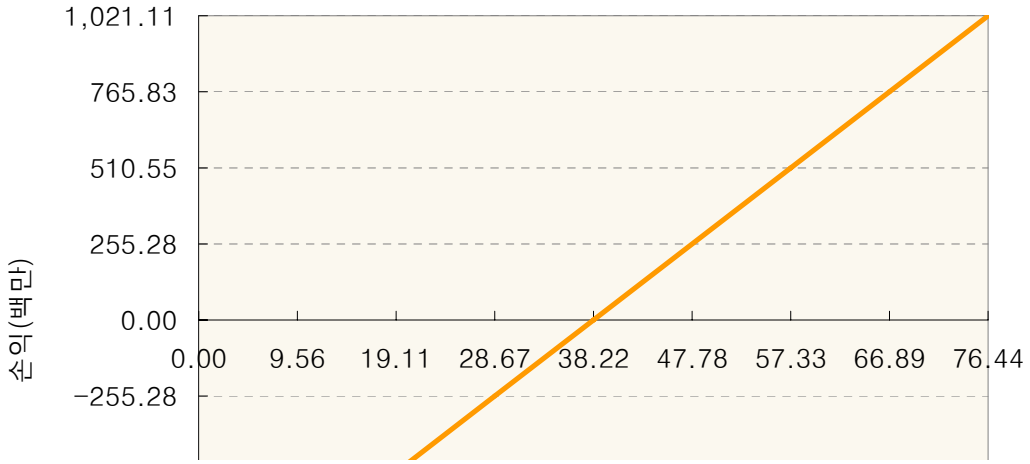
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,702	0	4,702	

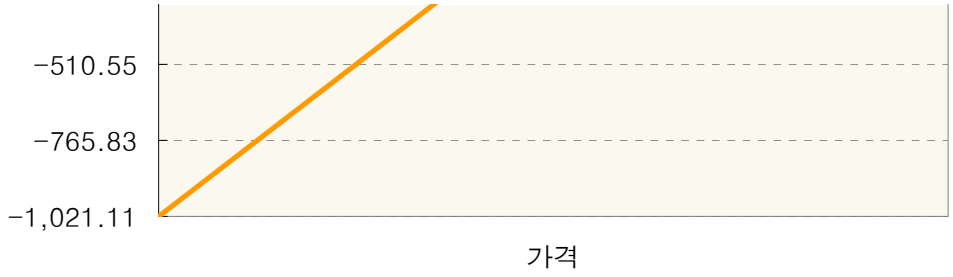
2. 만기시점의 손익구조

CLH6-WTI CRUDE FUTURE MAR16

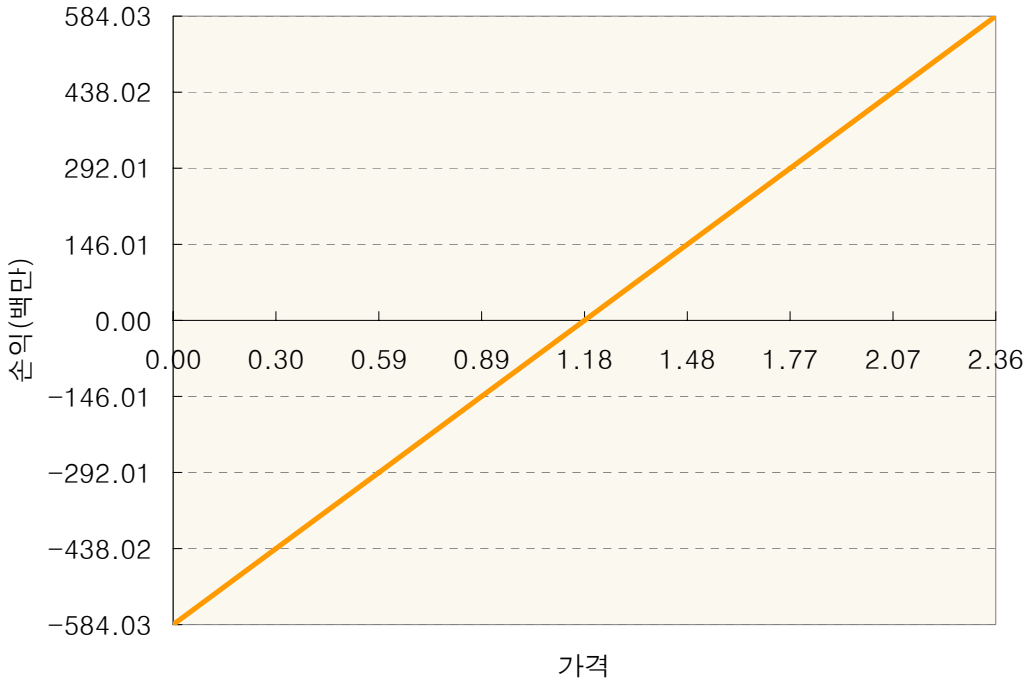


COH6-BRENT CRUDE FUTR MAR16

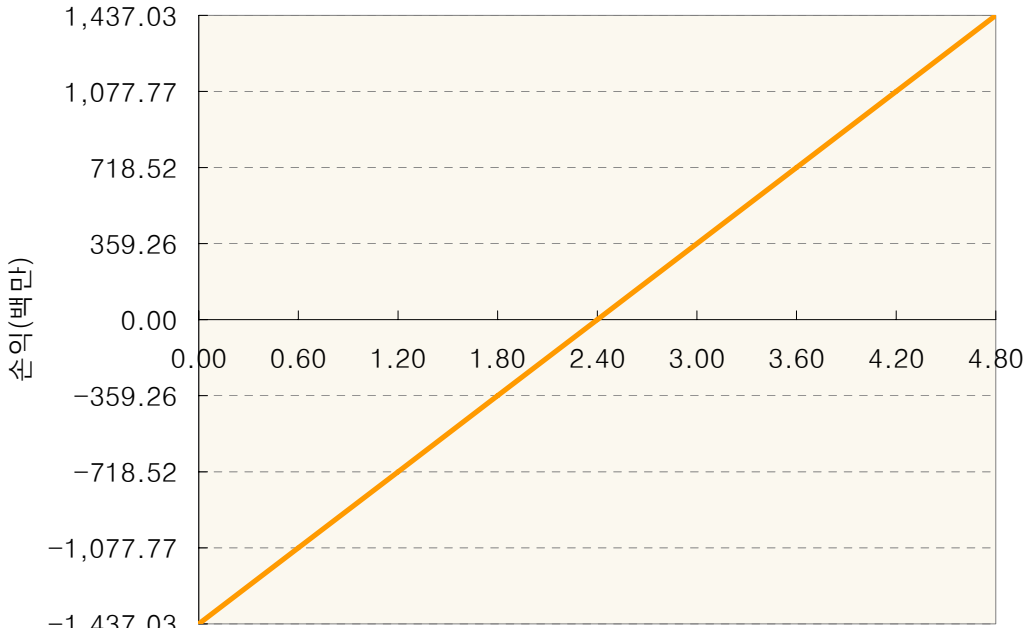


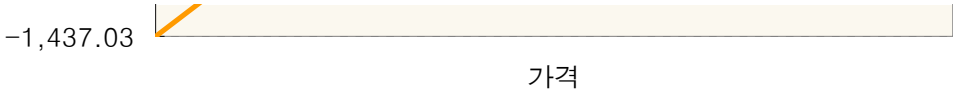


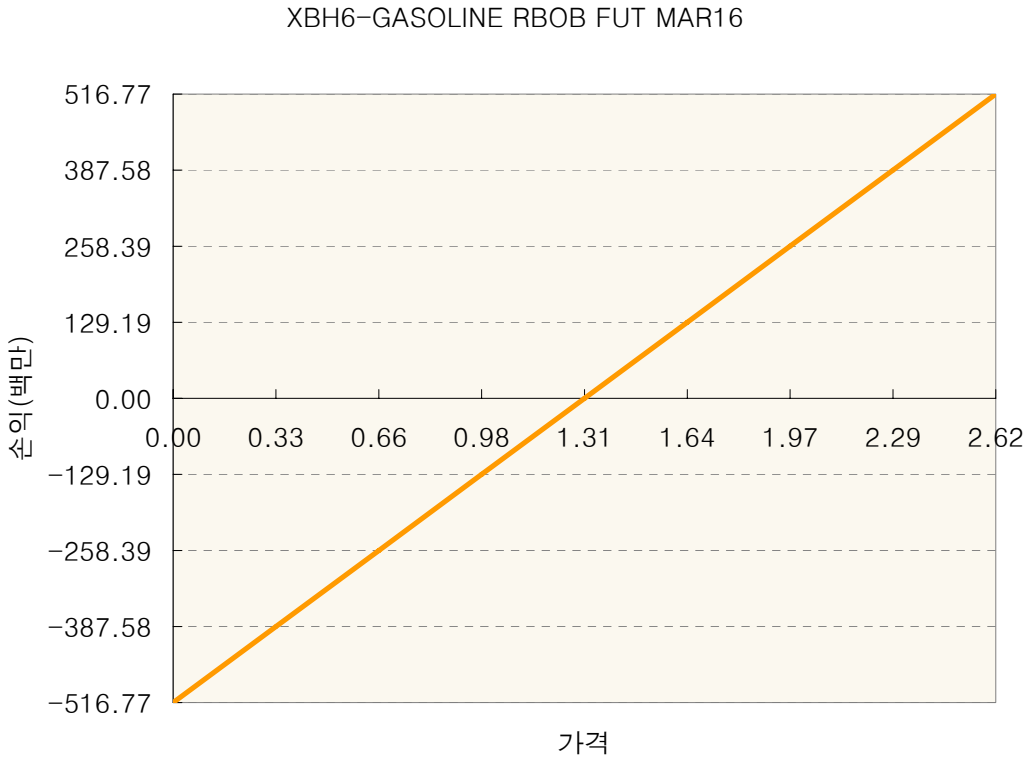
HOH6-NY Harb ULSD Fut MAR16



NGH6-NATURAL GAS FUTR MAR16







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLH6	WTI CRUDE FUTURE MAR16	91
COH6	BRENT CRUDE FUTR MAR16	82
HOH6	NY Harb ULSD Fut MAR16	47
NGH6	NATURAL GAS FUTR MAR16	115
XBH6	GASOLINE RBOB FUT MAR16	41

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

(단위:백만원)

975

공시일	2015-12-31
기준일	2015-12-30

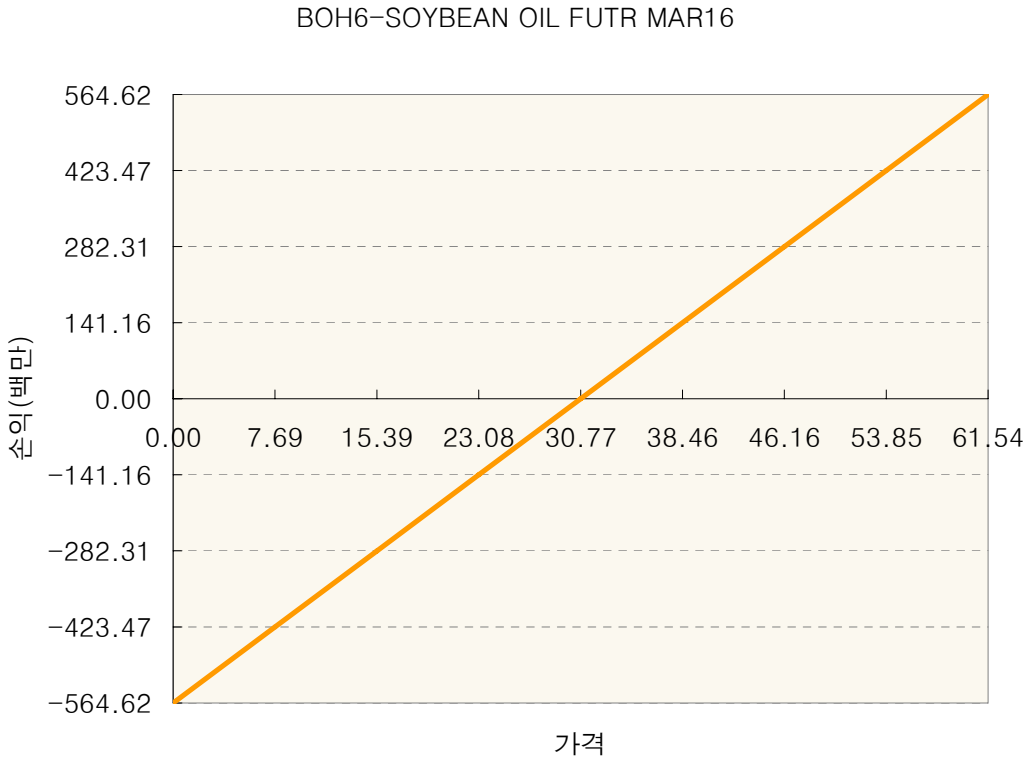
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

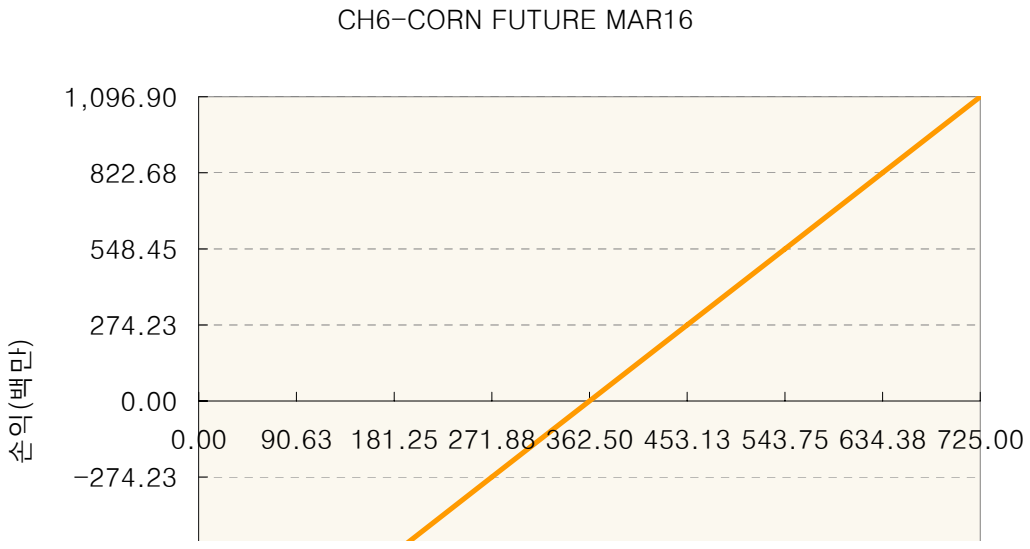
1. 계약금액

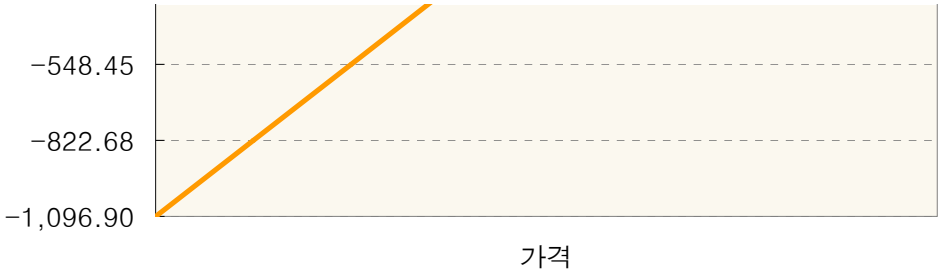
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,552	0	6,552	

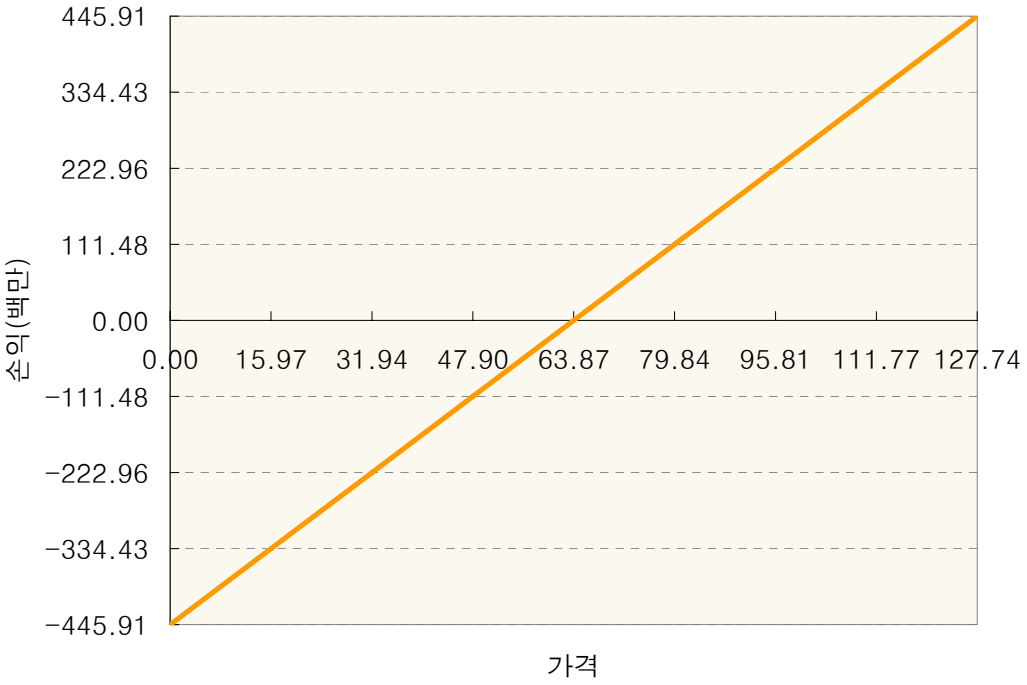
2. 만기시점의 손익구조



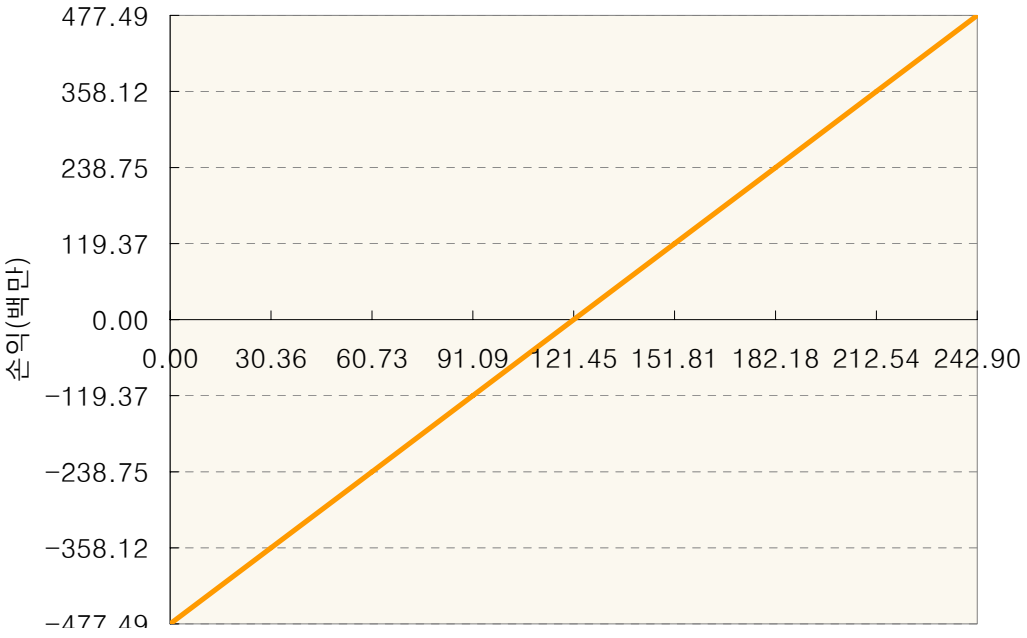


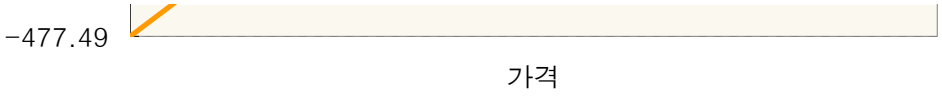


CTH6-COTTON NO.2 FUTR MAR16

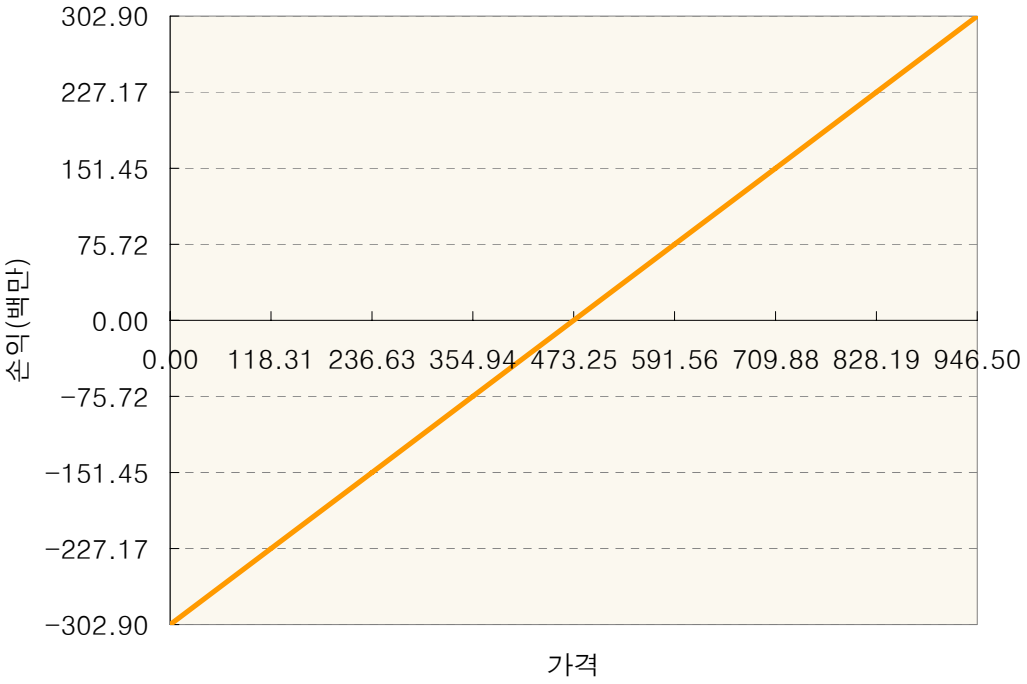


KCH6-COFFEE "C" FUTURE MAR16

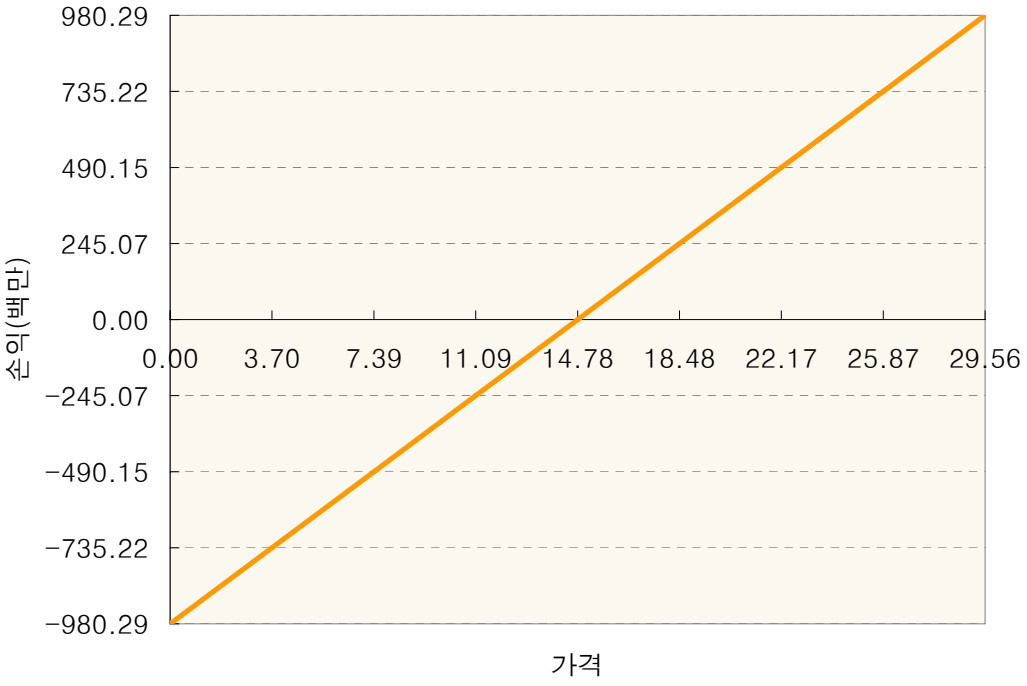




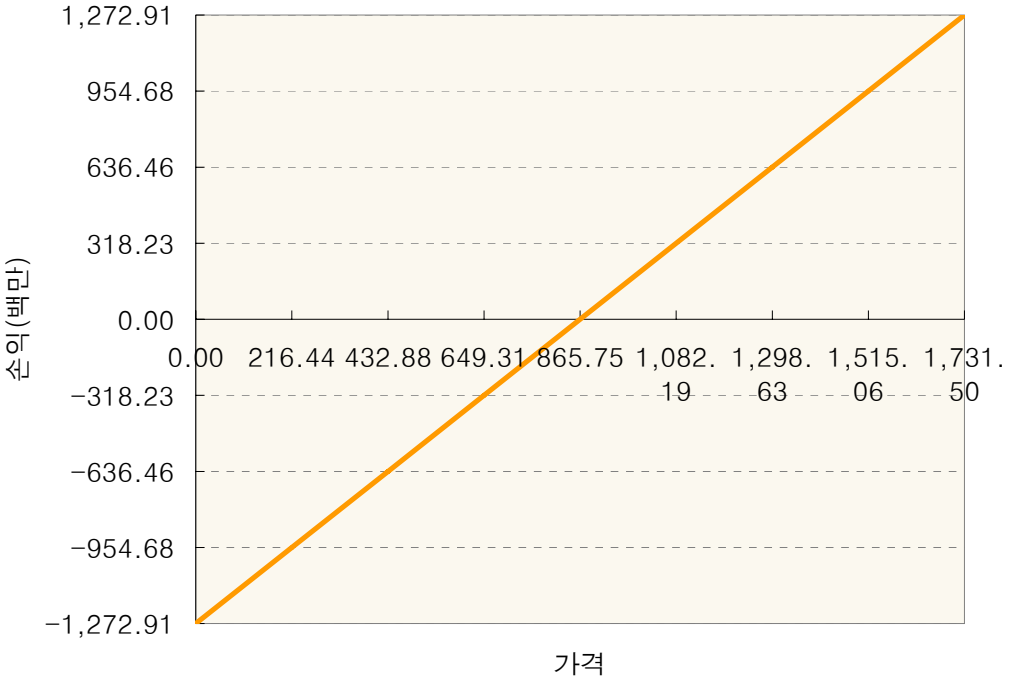
KWH6-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAR16



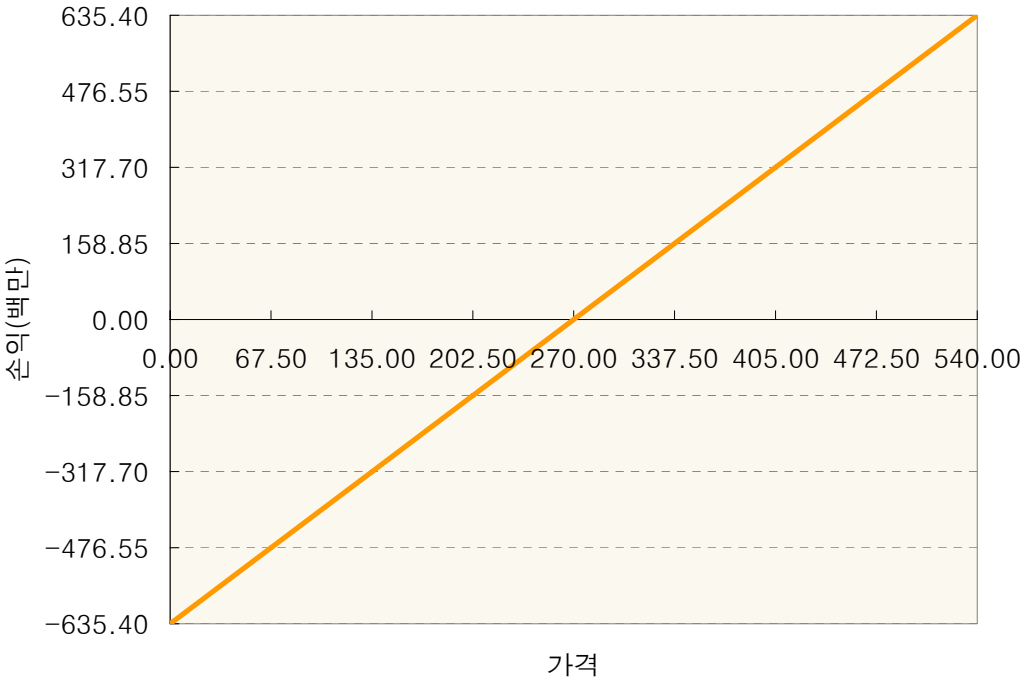
SBH6-Sugar #11 (WORLD) MAR16



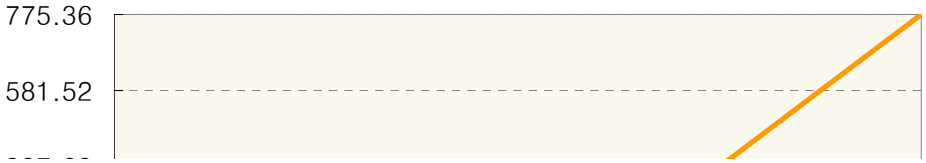
SH6-SOYBEAN FUTURE MAR16

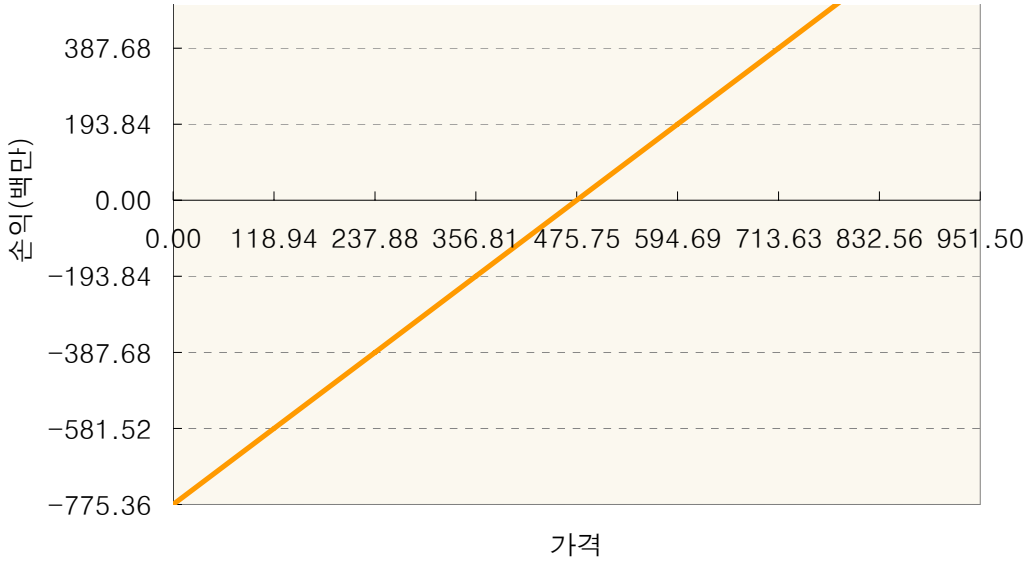


SMH6-SOYBEAN MEAL FUTR MAR16



WH6-WHEAT FUTURE(CBT) MAR16





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH6	SOYBEAN OIL FUTR MAR16	45
CH6	CORN FUTURE MAR16	88
CTH6	COTTON NO.2 FUTR MAR16	36
KCH6	COFFEE "C" FUTURE MAR16	38
KWH6	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAR16	24
SBH6	Sugar #11 (WORLD) MAR16	78
SH6	SOYBEAN FUTURE MAR16	102
SMH6	SOYBEAN MEAL FUTR MAR16	51
WH6	WHEAT FUTURE(CBT) MAR16	62

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

(단위:백만원)

738