공시일	2016-01-26
기준일	2016-01-25

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	2016-01-26
기준일	2016-01-25

스마트인덱스모

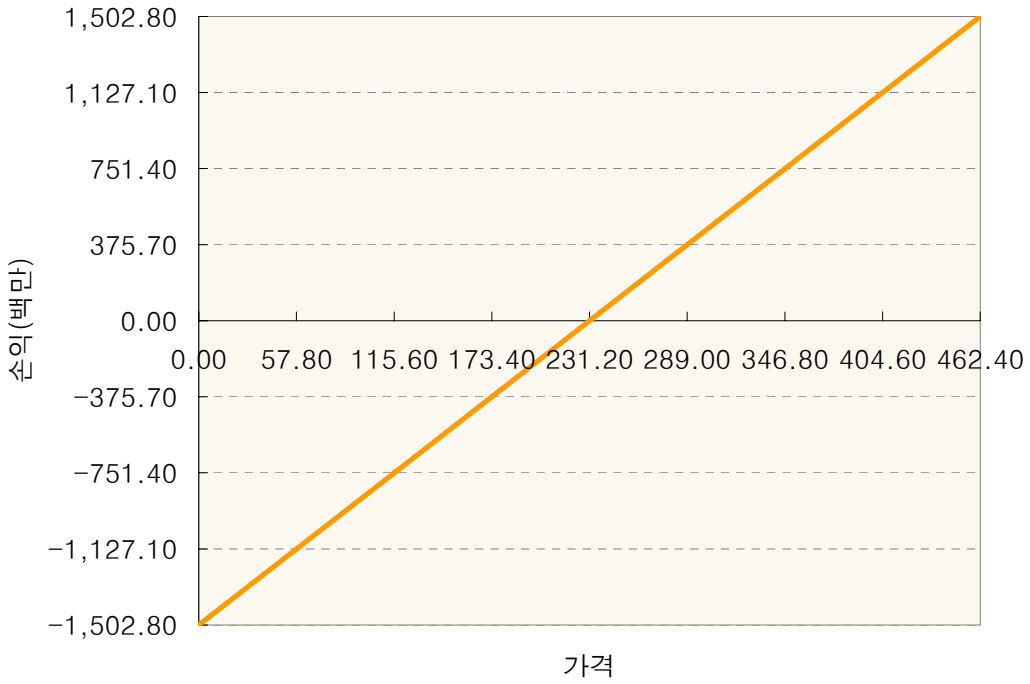
1. 계약금액

(단위:백만원)

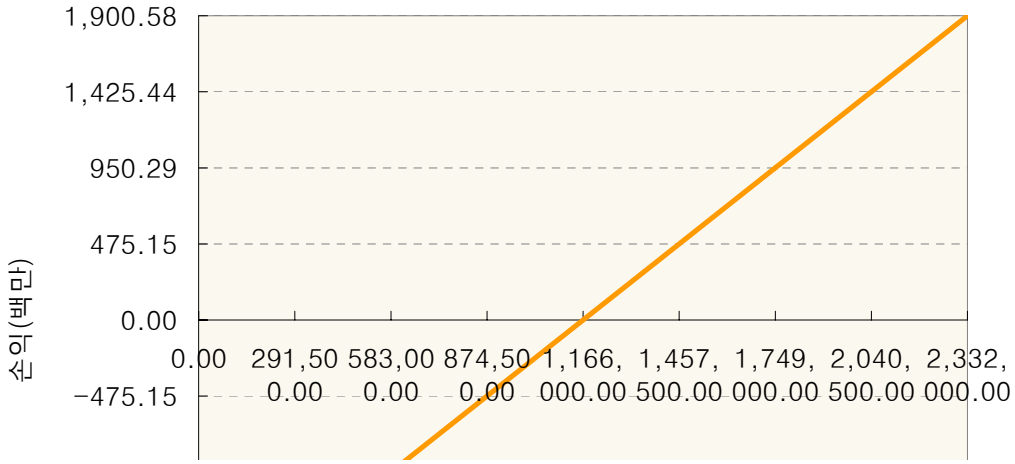
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	58	0	58	장내
누계	유가증권	선물	3,403	0	3,403	장내

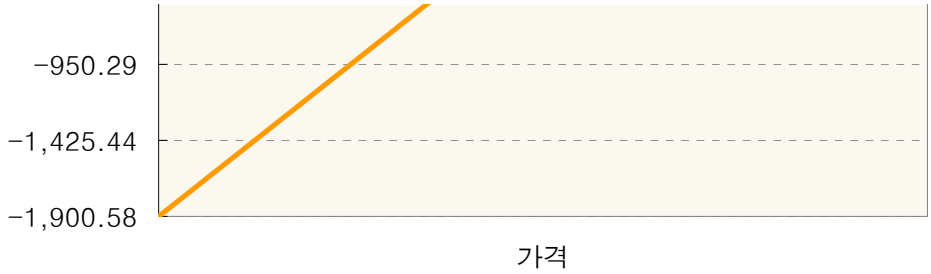
2. 만기시점의 손익구조

KR4101L30006-2016-03 코스피200지수선물



KR4111L30005-2016-03 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L3002016-03 코스피200지수선물							120
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120
-5.33%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
-2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	40	40	40	40	40	40	40
5.33%	80	80	80	80	80	80	80
8.00%	120	120	120	120	120	120	120
KR4111L3002016-03 삼성전자개별선물							152
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-152	-152	-152	-152	-152	-152	-152
-5.33%	-101	-101	-101	-101	-101	-101	-101
-2.67%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	51	51	51	51	51	51	51
5.33%	101	101	101	101	101	101	101
8.00%	152	152	152	152	152	152	152

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

(단위:백만원)

237

공시일	2016-01-26
기준일	2016-01-25

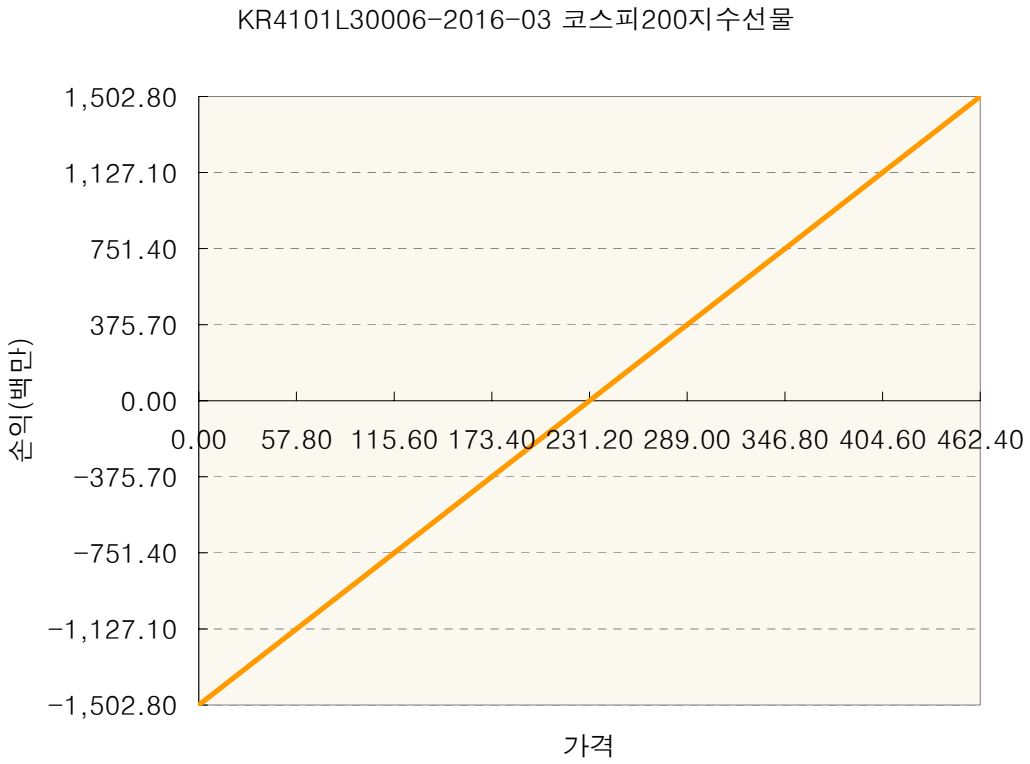
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,503	0	1,503	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물							120
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120
-5.33%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
-2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	40	40	40	40	40	40	40
5.33%	80	80	80	80	80	80	80
8.00%	120	120	120	120	120	120	120

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

93

공시일	2016-01-26
기준일	2016-01-25

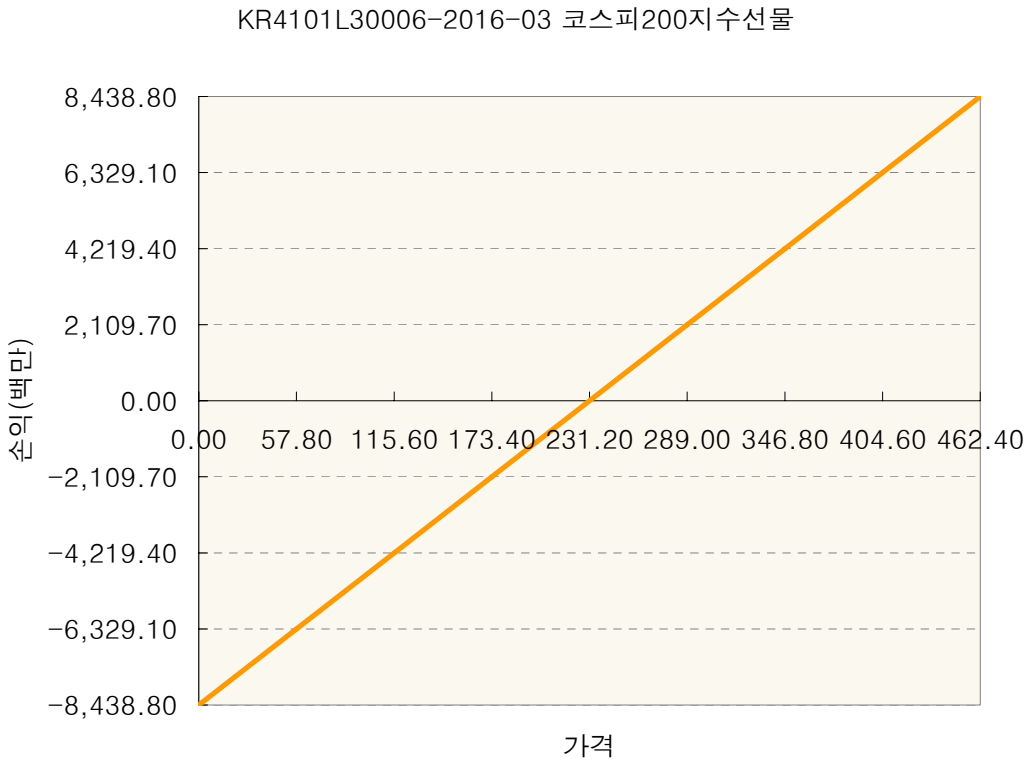
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	8,439	0	8,439	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물							672
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-672	-672	-672	-672	-672	-672	-672
-5.33%	-448	-448	-448	-448	-448	-448	-448
-2.67%	-224	-224	-224	-224	-224	-224	-224
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	224	224	224	224	224	224	224
5.33%	448	448	448	448	448	448	448
8.00%	672	672	672	672	672	672	672

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

524

공시일	2016-01-26
기준일	2016-01-25

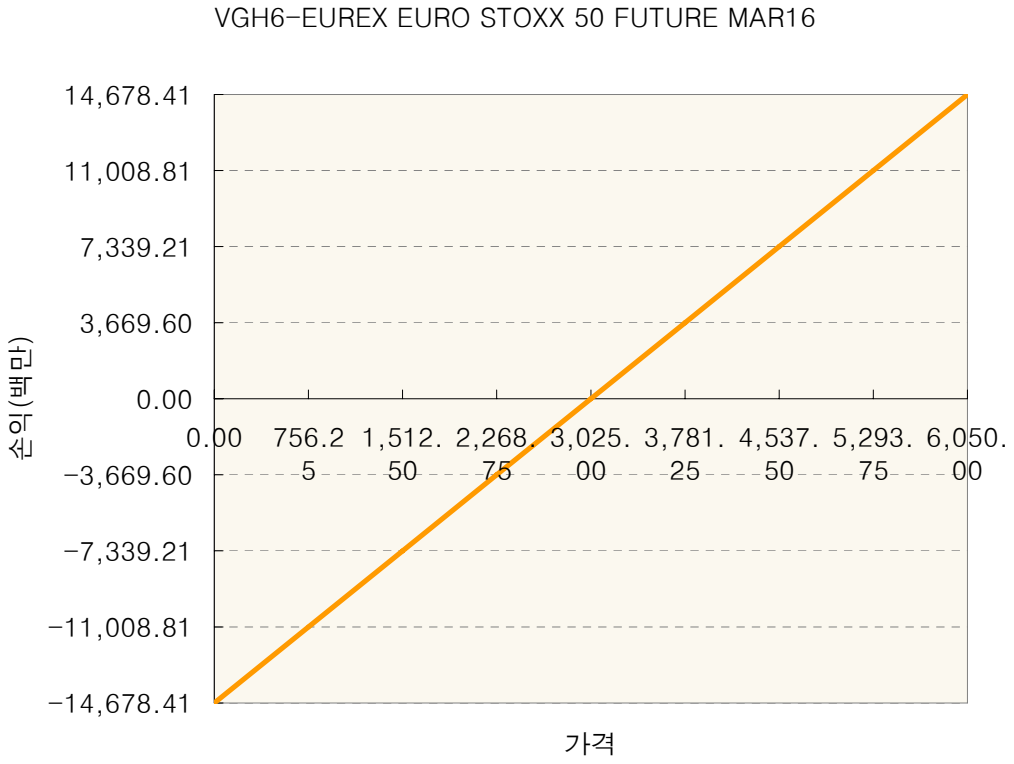
유로인덱스1호(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	14,678	0	14,678	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH6	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR16	1,174

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

(단위:백만원)

1,349

공시일	2016-01-26
기준일	2016-01-25

차이나인덱스(주식-파생형)(종)

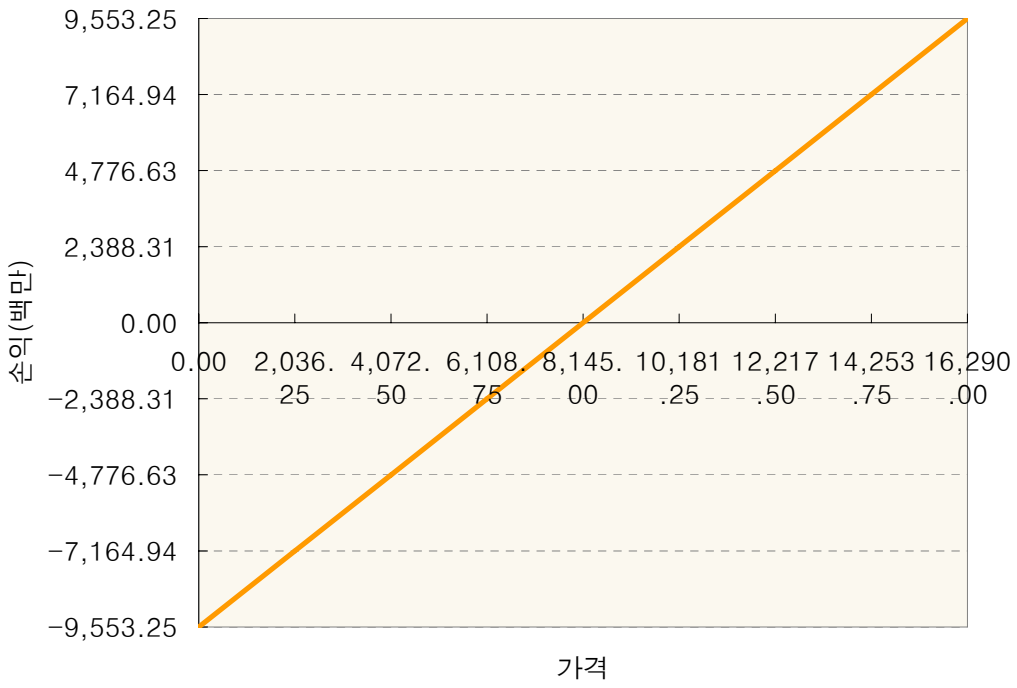
1. 계약금액

(단위:백만원)

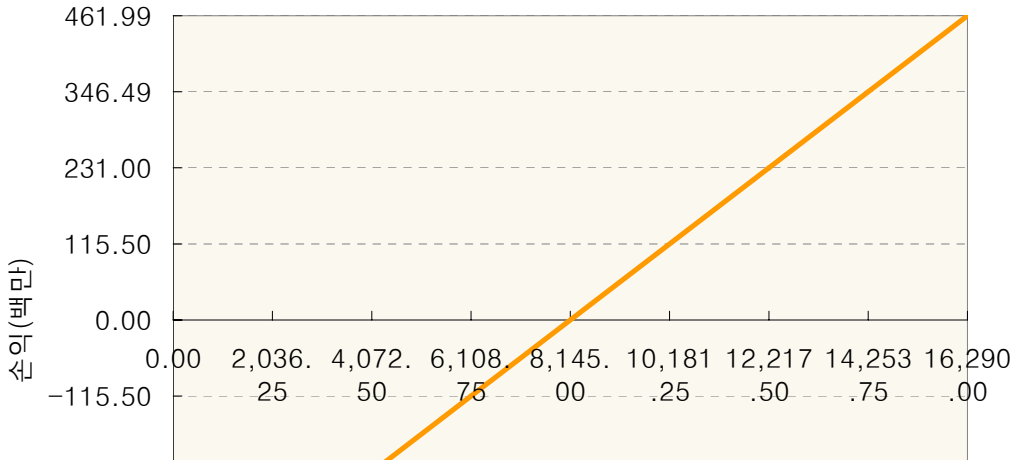
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2	0	2	장내
누계	유가증권	선물	10,015	0	10,015	장내

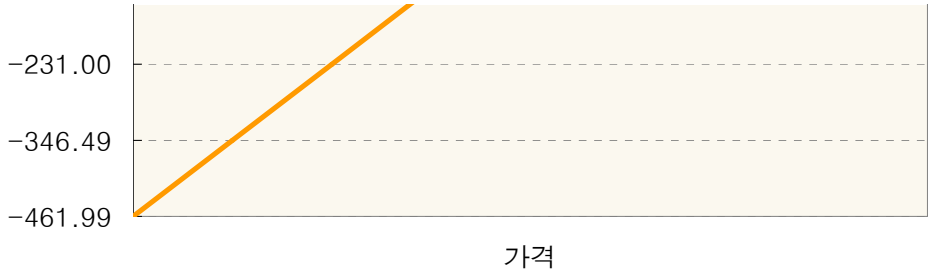
2. 만기시점의 손익구조

HCG6-HKG Hang Seng China Enterprises Index FU



MHCG6-HKG MINI HANG SENG CHINA H-SHR IDX FUT F





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCG6	HKG Hang Seng China Enterprises Index FU	764
MHCG6	HKG MINI HANG SENG CHINA H-SHR IDX FUT F	37

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

(단위:백만원)

1,086

공시일	2016-01-26
기준일	2016-01-25

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	785

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

613

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-01-26
기준일	2016-01-25

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	73

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

170

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-01-26
기준일	2016-01-25

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	8,333	0	8,333	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S12081	392
SWCSI50000 신한CSI500미래S12082	121

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,437

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-01-26
기준일	2016-01-25

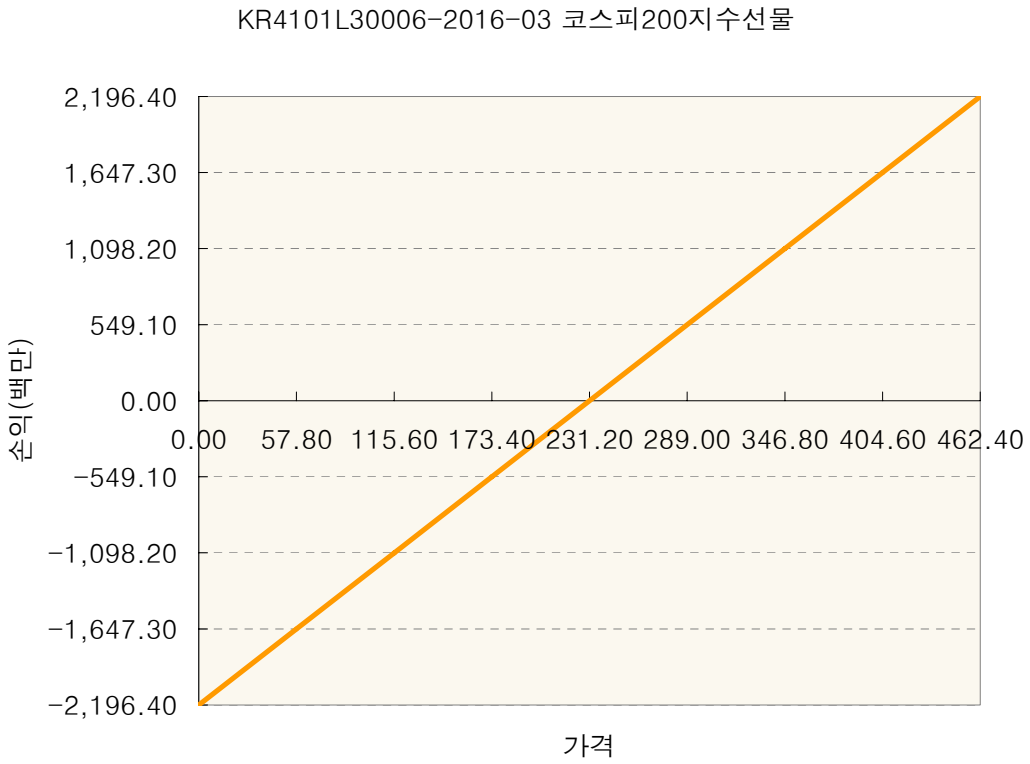
KOSPI200 레버리지 목표전환형 3

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	2,196	0	2,196	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물							175
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-175	-175	-175	-175	-175	-175	-175
-5.33%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117
-2.67%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	58	58	58	58	58	58	58
5.33%	117	117	117	117	117	117	117
8.00%	175	175	175	175	175	175	175

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

136

공시일	2016-01-26
기준일	2016-01-25

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	69
KR65433325 ELS신영증권플랜업(ELS)5447	60
KR65533AF5 ELSNH투자증권(ELS)11930	60
KR65733E15 ELS한국투자증권(ELS)5269	60

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

(단위:백만원)

139

공시일	2016-01-26
기준일	2016-01-25

미래설계SE-7호(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	8,104	0	8,104	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR65233BD5 ELS대우증권(ELS)15129	236
KR65533B85 ELSNH투자증권(ELS)11957	248
KR65733FJ5 ELS한국투자증권(ELS)5298	236
KR65933C95 ELS미래에셋증권(ELS)8483	236

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

(단위:백만원)

543

공시일	2016-01-26
기준일	2016-01-25

SE-8호(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	7,143	0	7,143	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR65233BE5 ELS대우증권(ELS)15130	202
KR65433515 ELS신영증권플랜업(ELS)5454	203
KR65533B75 ELSNH투자증권(ELS)11956	243
KR65733FH5 ELS한국투자증권(ELS)5297	203

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

(단위:백만원)

501

공시일	2016-01-26
기준일	2016-01-25

지수연계미래설계SE-8호(ELS-파

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	6,139	0	6,139	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR65233746 ELS대우증권(ELS)15148	162
KR65533446 ELSNH투자증권(ELS)11973	162
KR65733686 ELS한국투자증권(ELS)5319	177
KR65933566 ELS미래에셋증권(ELS)8513	162

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

(단위:백만원)

367

공시일	2016-01-26
기준일	2016-01-25

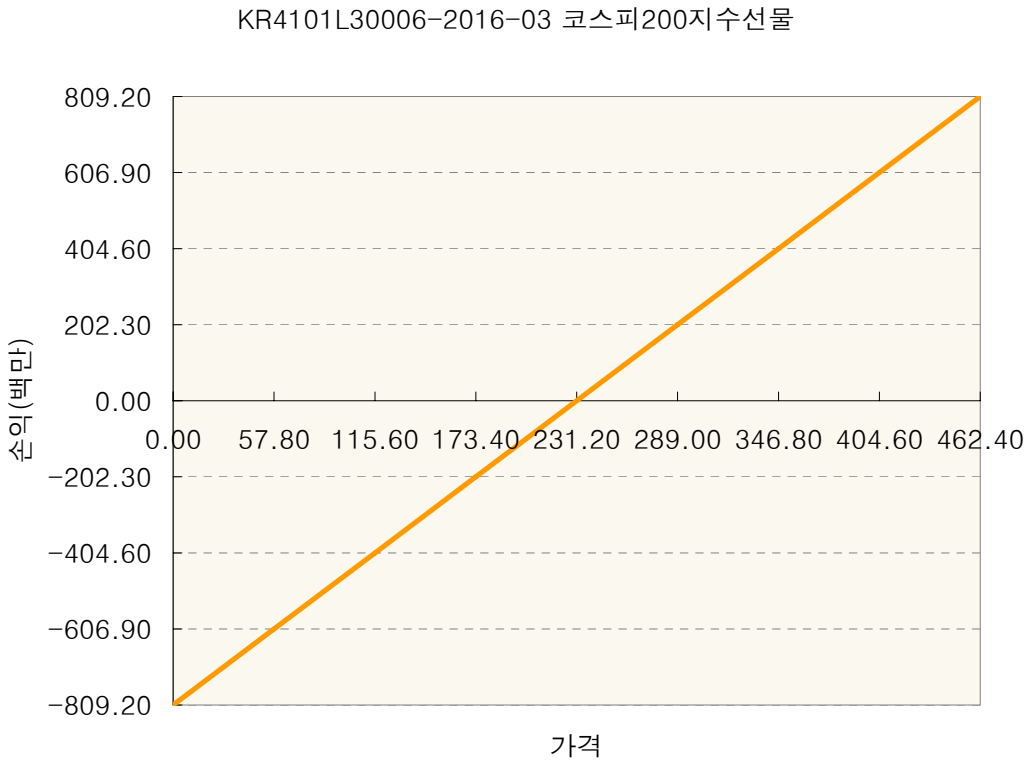
ETF스마트레버리지목표전환형5호

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	809	0	809	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물 64

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64
-5.33%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
-2.67%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	21	21	21	21	21	21	21
5.33%	43	43	43	43	43	43	43
8.00%	64	64	64	64	64	64	64

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	50

공시일	2016-01-26
기준일	2016-01-25

지수연계미래설계SE-9호(ELS-파

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	5,432	0	5,432	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR65233AK6 ELS대우증권(ELS)15162	150
KR65433286 ELS신영증권플랜업(ELS)5472	139
KR65533846 ELSNH투자증권(ELS)11987	138
KR65733AL6 ELS한국투자증권(ELS)5343	139

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

(단위:백만원)

290

공시일	2016-01-26
기준일	2016-01-25

메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

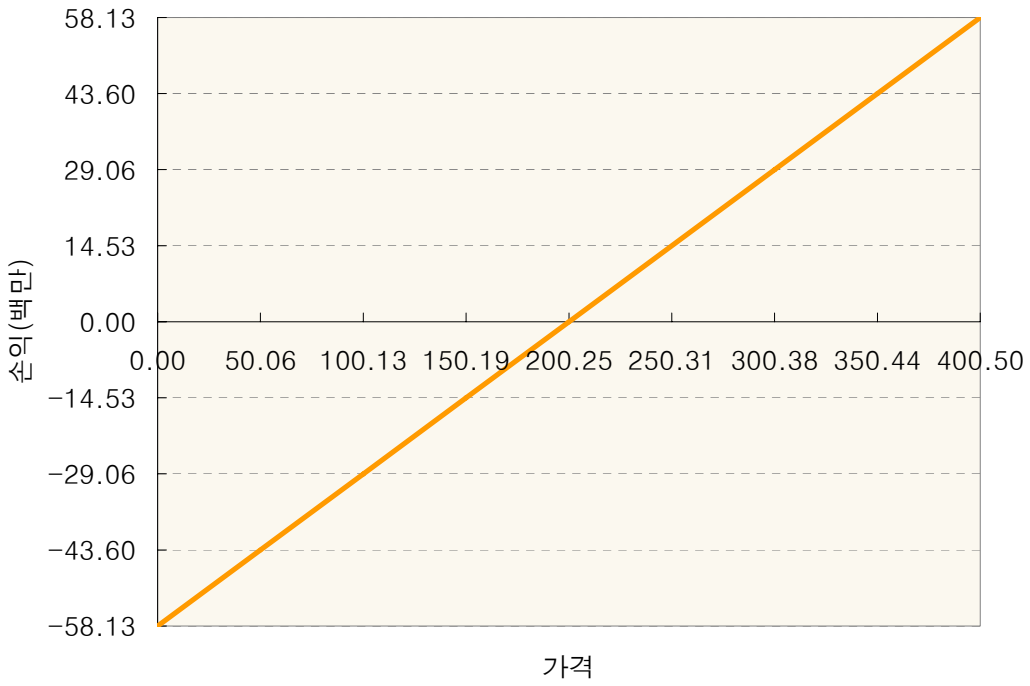
1. 계약금액

(단위:백만원)

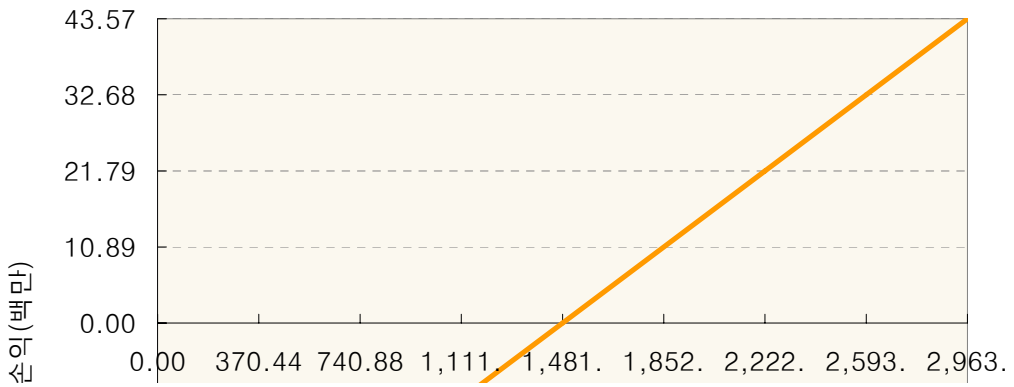
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	50	0	50	
누계	유가증권	선물	274	0	274	

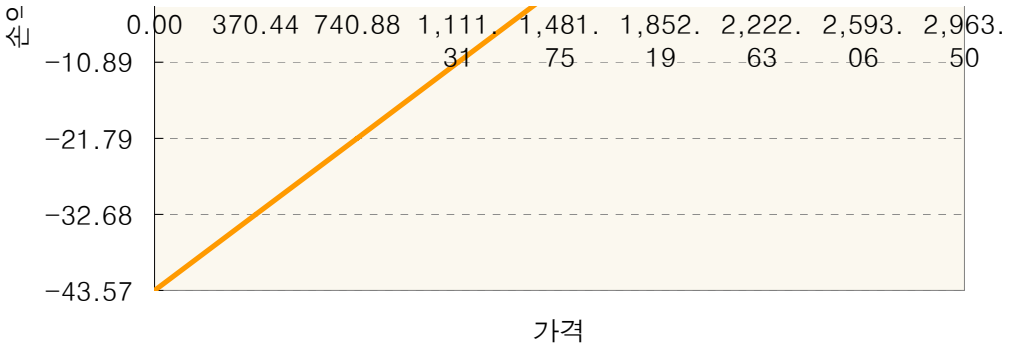
2. 만기시점의 손익구조

HGH6-COPPER FUTURE MAR16

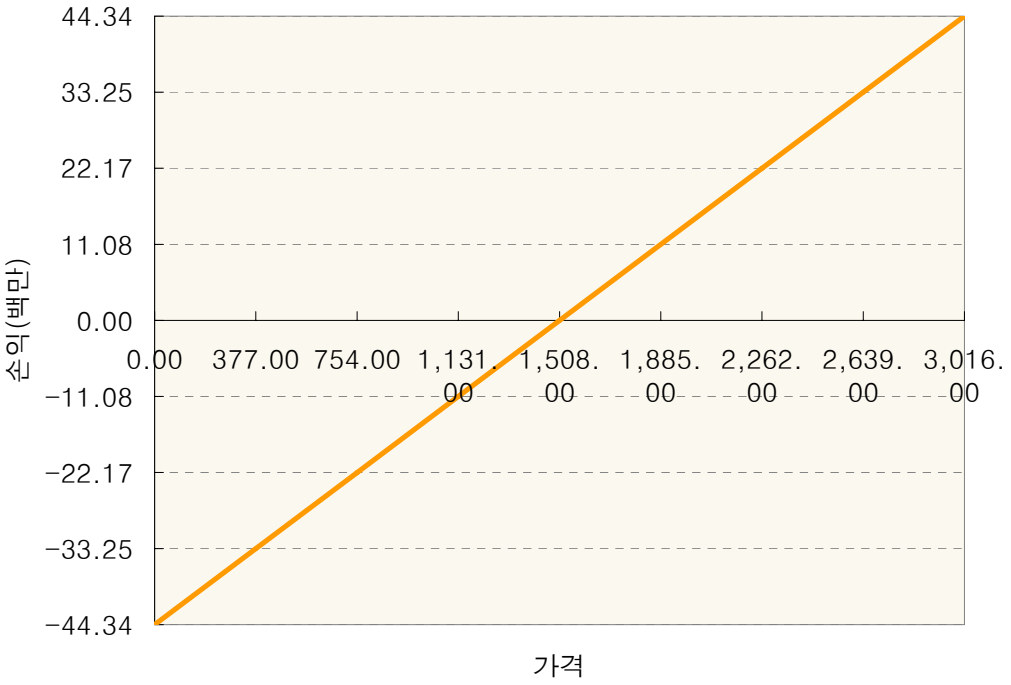


LAH6-LME PRI ALUM FUTR MAR16

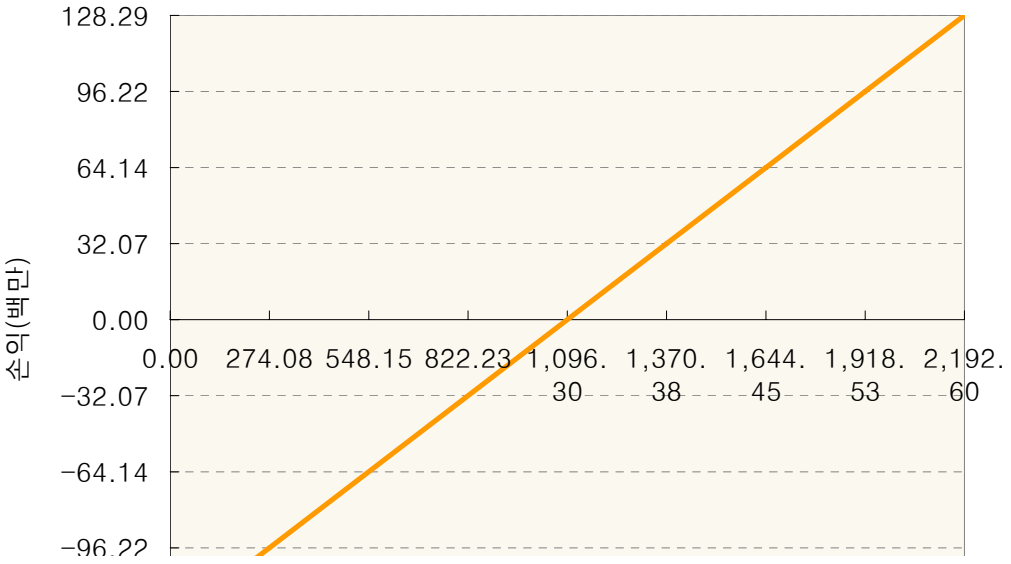


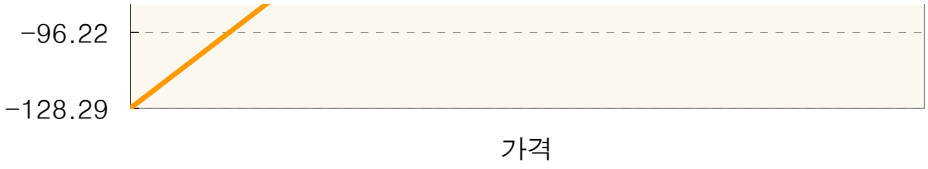


LXH6-LME ZINC FUTURE MAR16

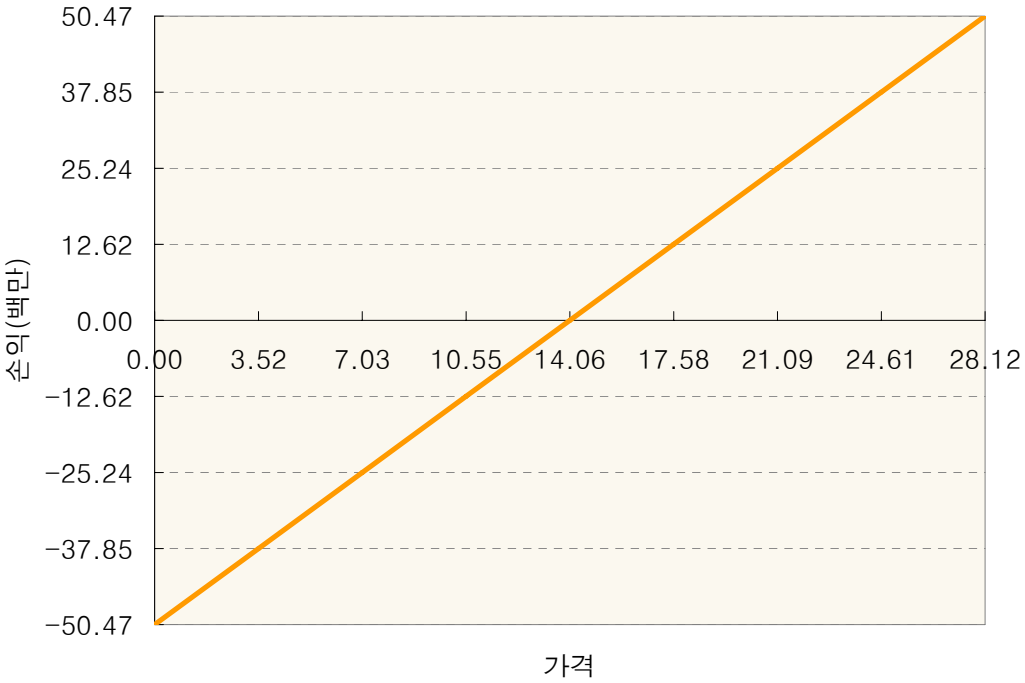


XGJ6-MINI GOLD FUTURE APR16





YSH6-MINI SILVER FUT MAR16



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGH6	COPPER FUTURE MAR16	5
LAH6	LME PRI ALUM FUTR MAR16	3
LXH6	LME ZINC FUTURE MAR16	4
XGJ6	MINI GOLD FUTURE APR16	10
YSH6	MINI SILVER FUT MAR16	4

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

(단위:백만원)

26

공시일	2016-01-26
기준일	2016-01-25

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

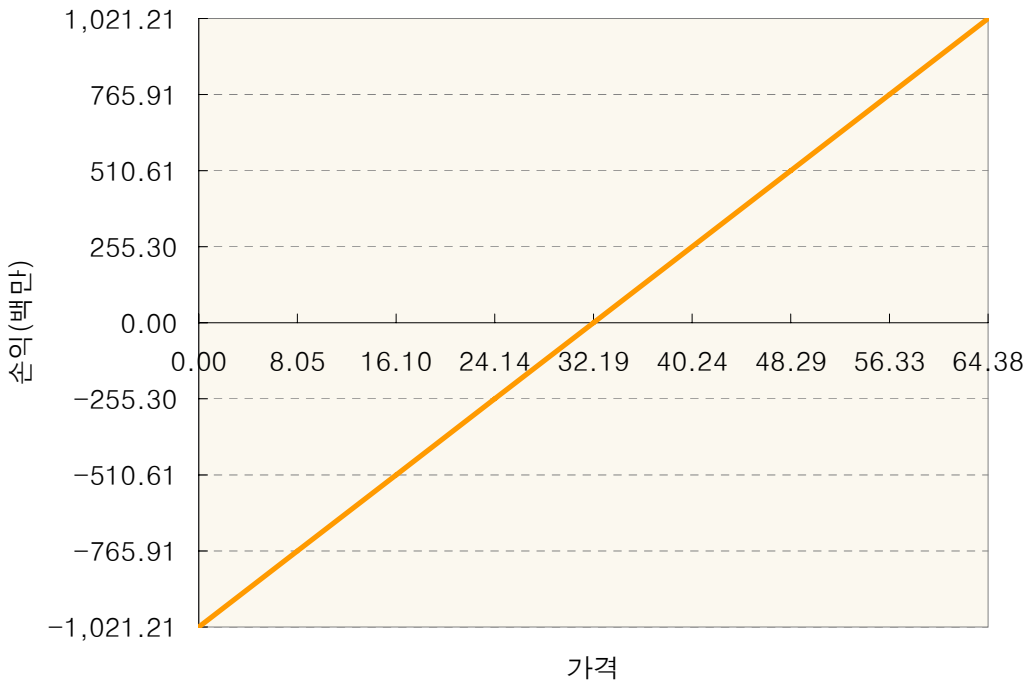
1. 계약금액

(단위:백만원)

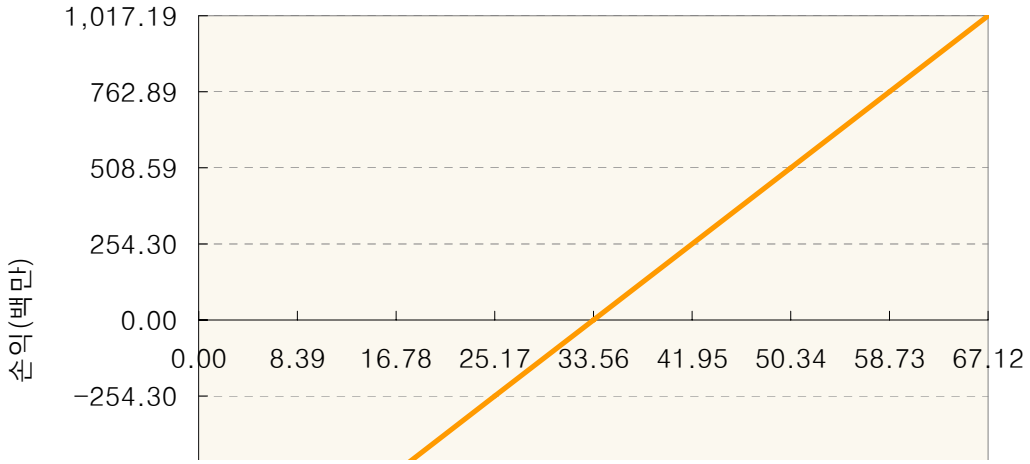
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,186	0	4,186	

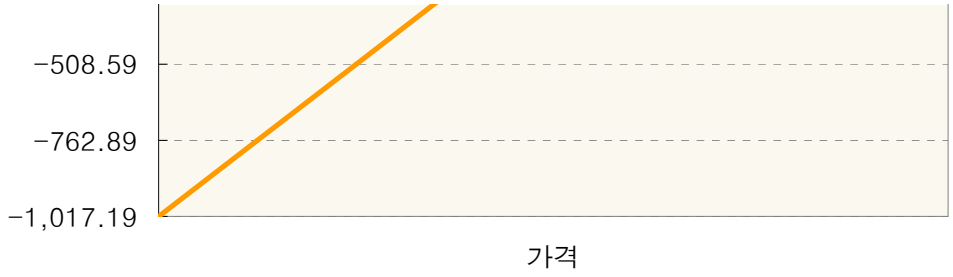
2. 만기시점의 손익구조

CLH6-WTI CRUDE FUTURE MAR16

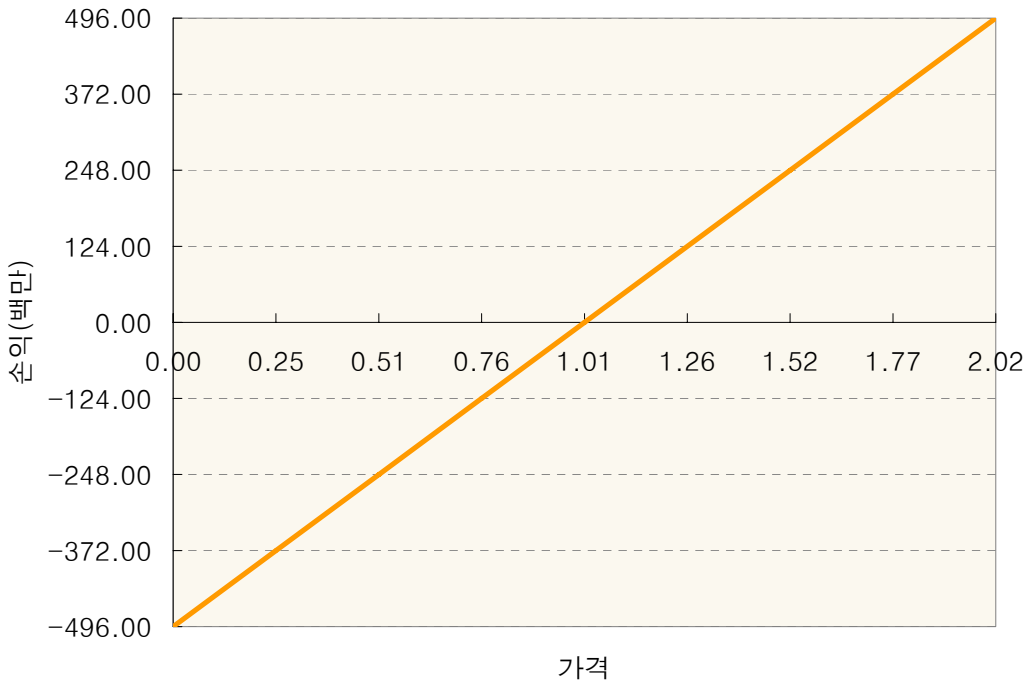


COK6-BRENT CRUDE FUTR MAY16

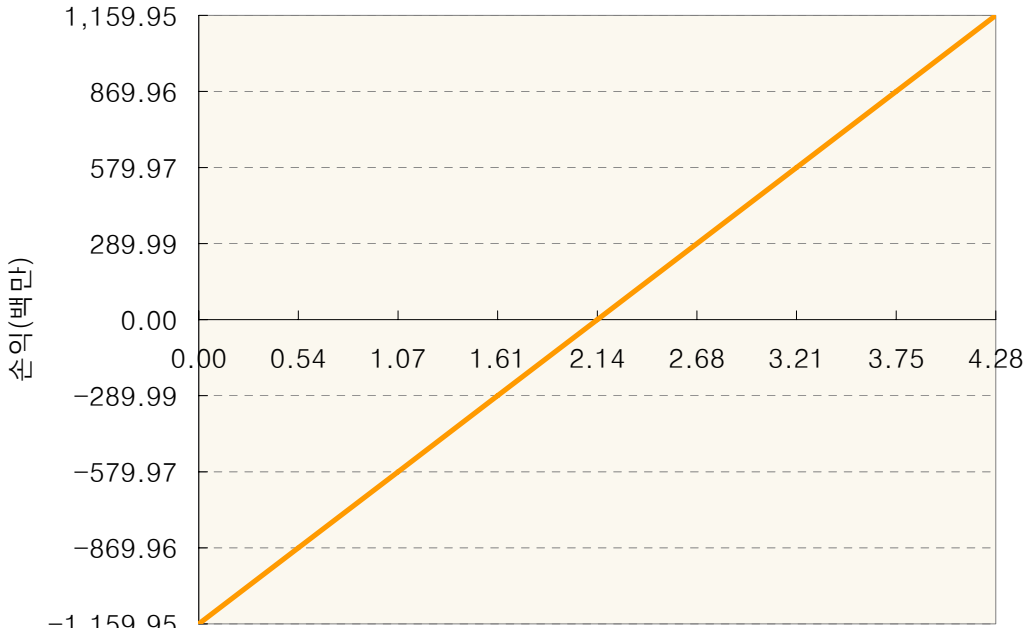


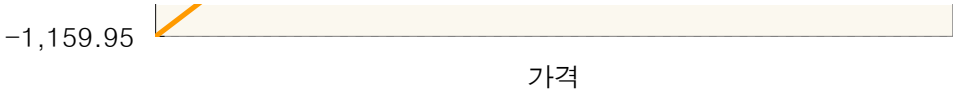


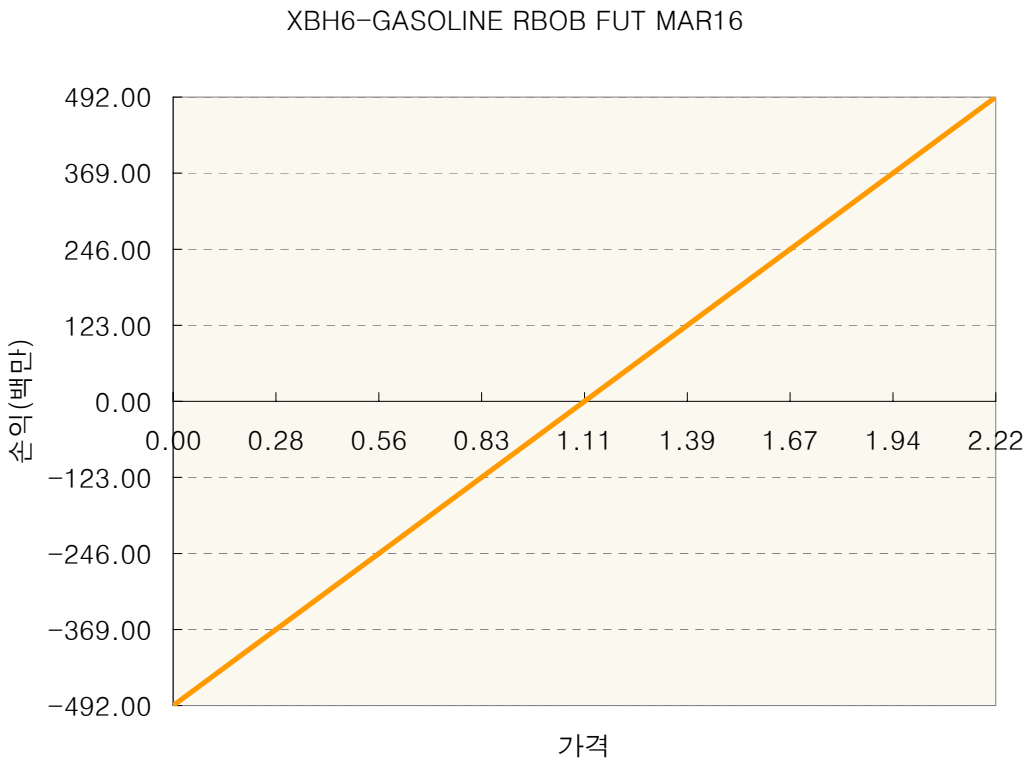
HOH6-NY Harb ULSD Fut MAR16



NGH6-NATURAL GAS FUTR MAR16







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLH6	WTI CRUDE FUTURE MAR16	82
COK6	BRENT CRUDE FUTR MAY16	81
HOH6	NY Harb ULSD Fut MAR16	40
NGH6	NATURAL GAS FUTR MAR16	93
XBH6	GASOLINE RBOB FUT MAR16	39

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

(단위:백만원)

879

공시일	2016-01-26
기준일	2016-01-25

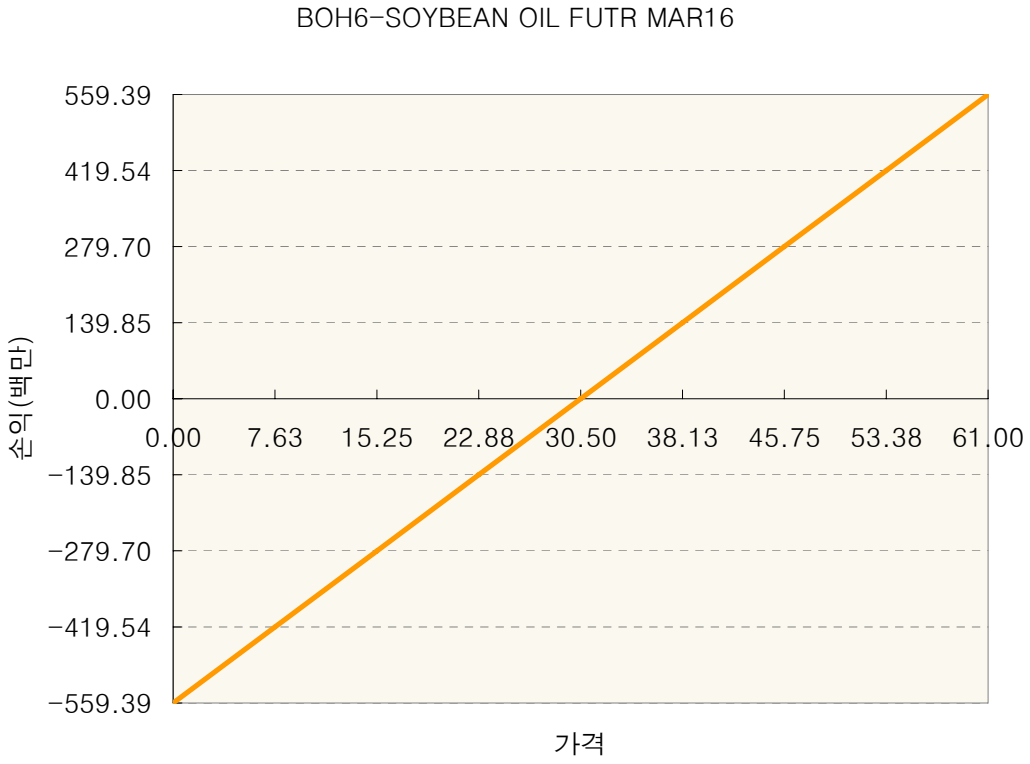
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

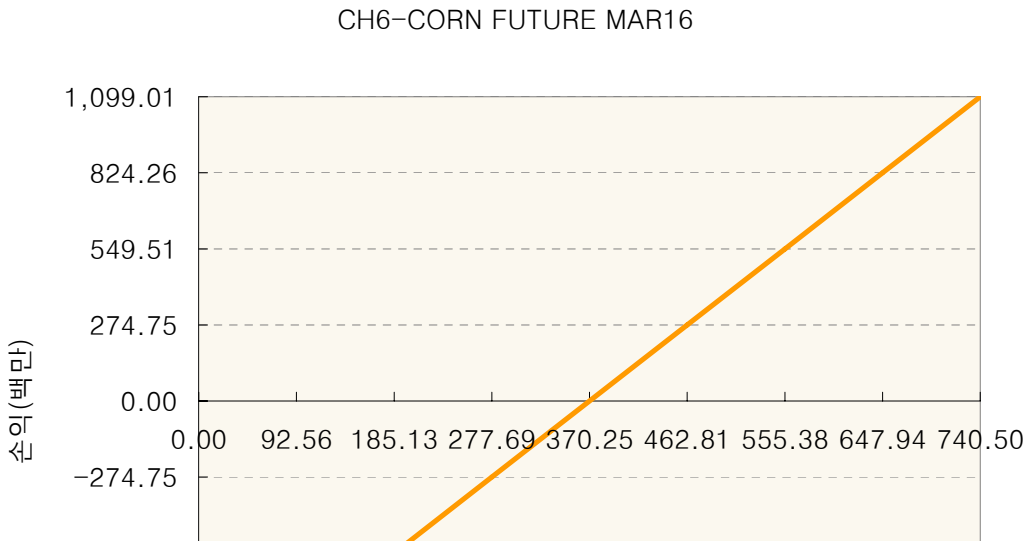
1. 계약금액

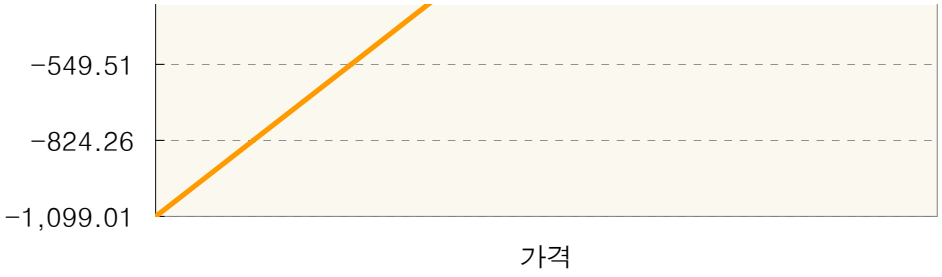
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,297	0	6,297	

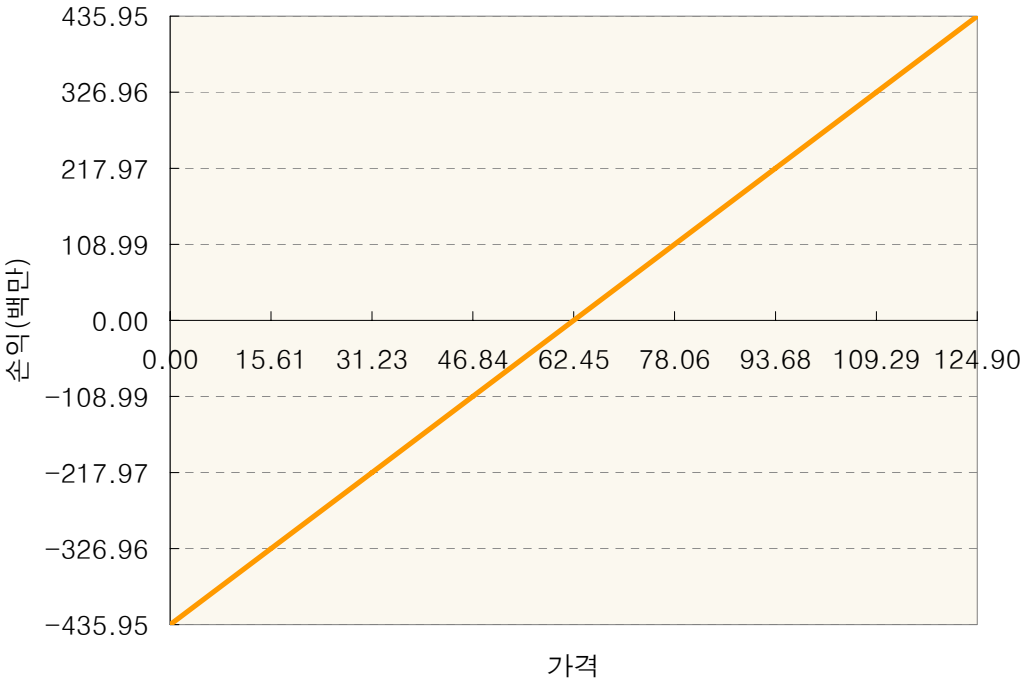
2. 만기시점의 손익구조



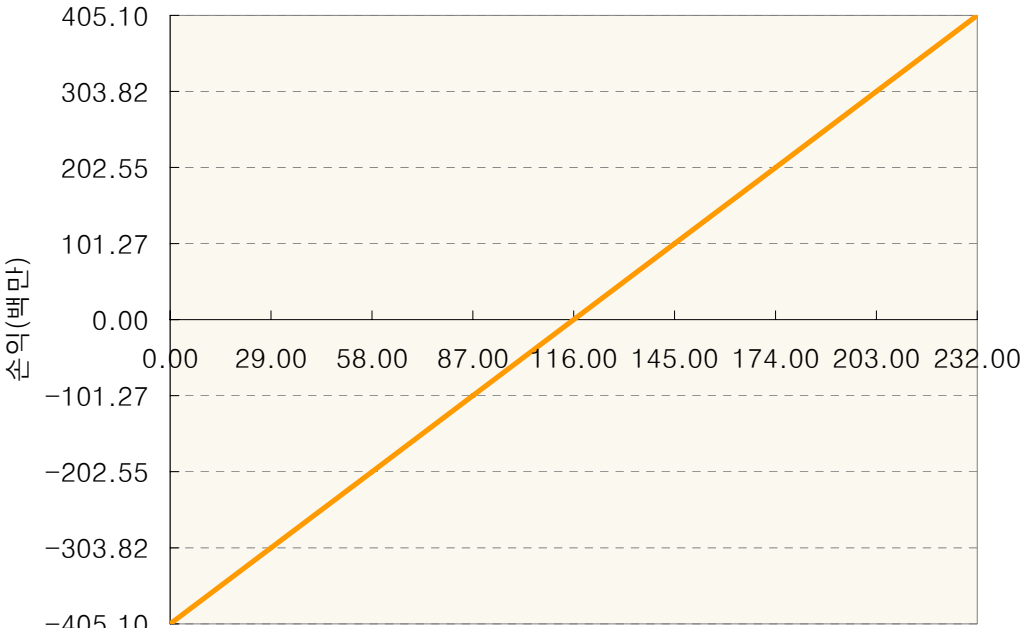


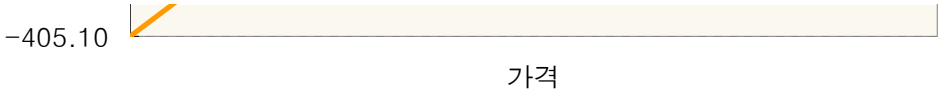


CTH6-COTTON NO.2 FUTR MAR16

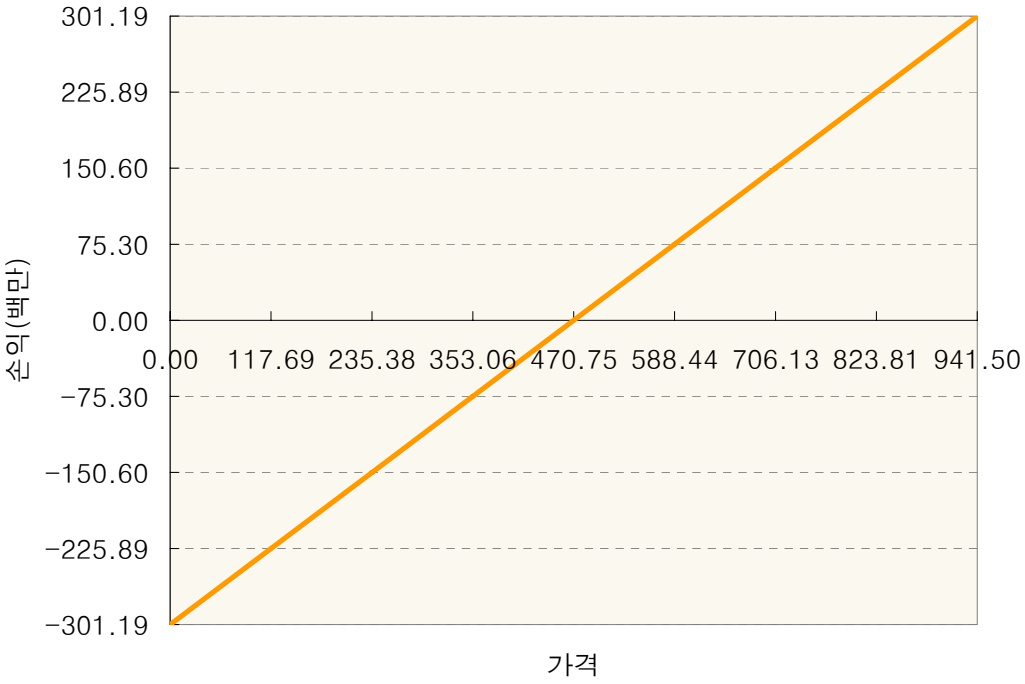


KCH6-COFFEE "C" FUTURE MAR16

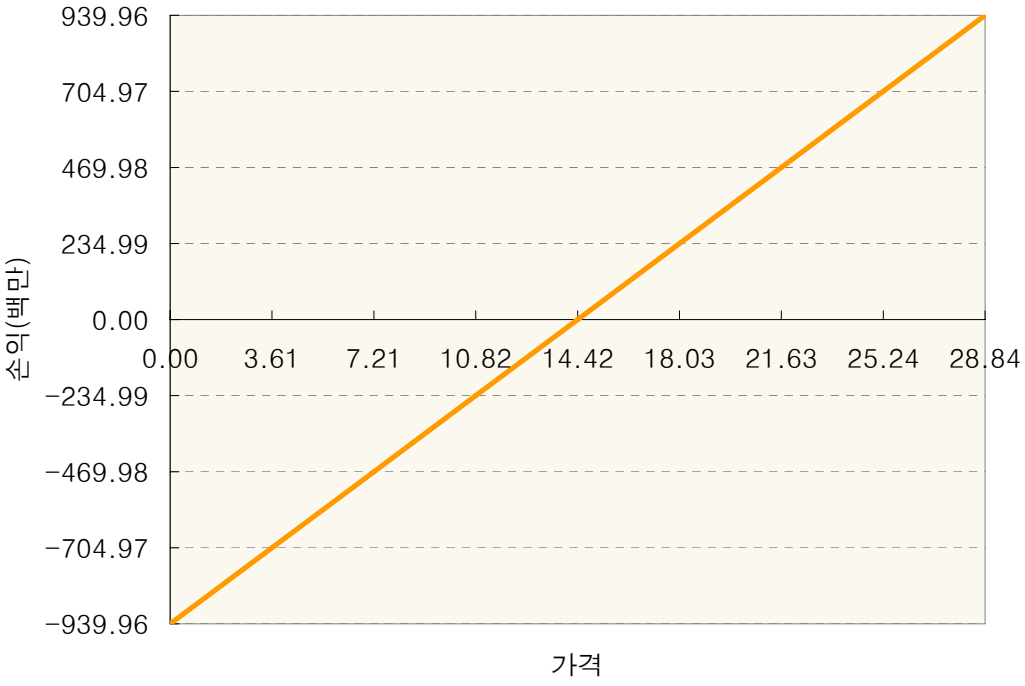




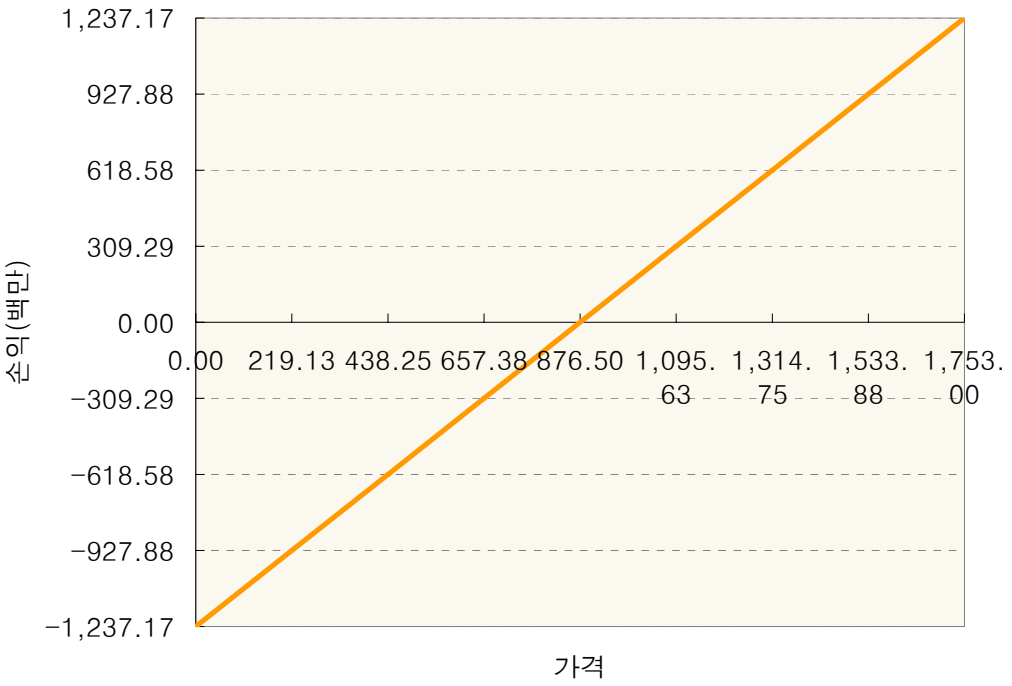
KWH6-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAR16



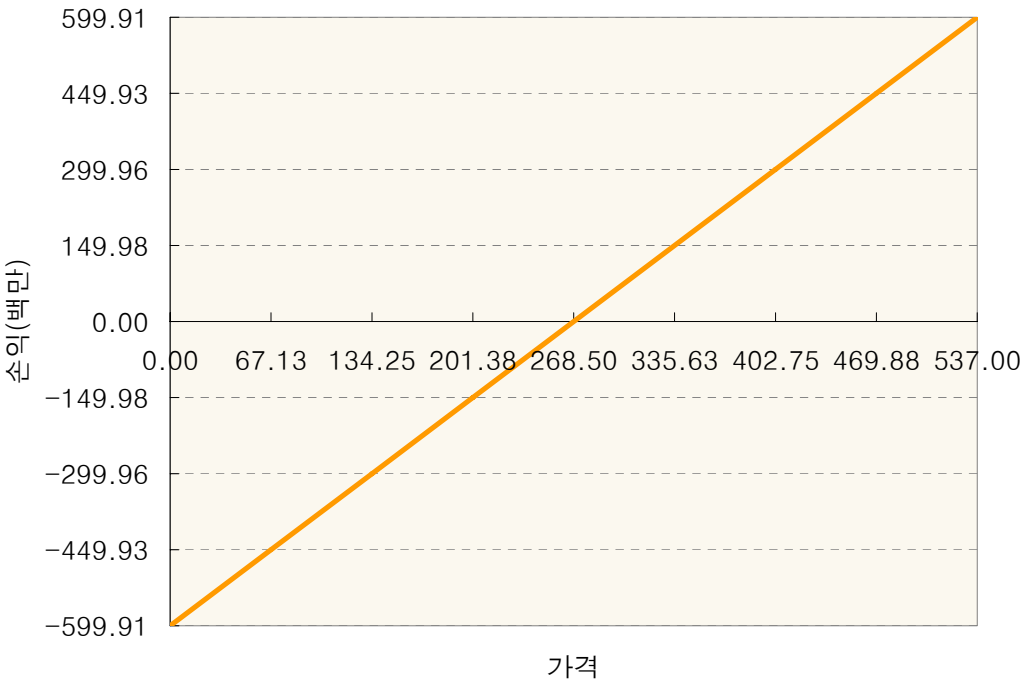
SBH6-Sugar #11 (WORLD) MAR16



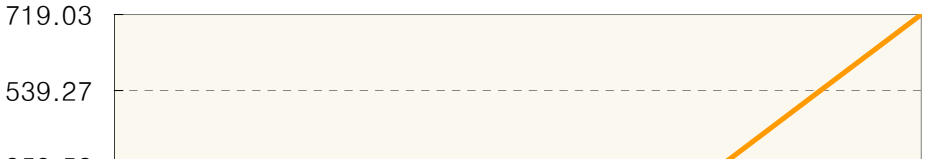
SH6-SOYBEAN FUTURE MAR16

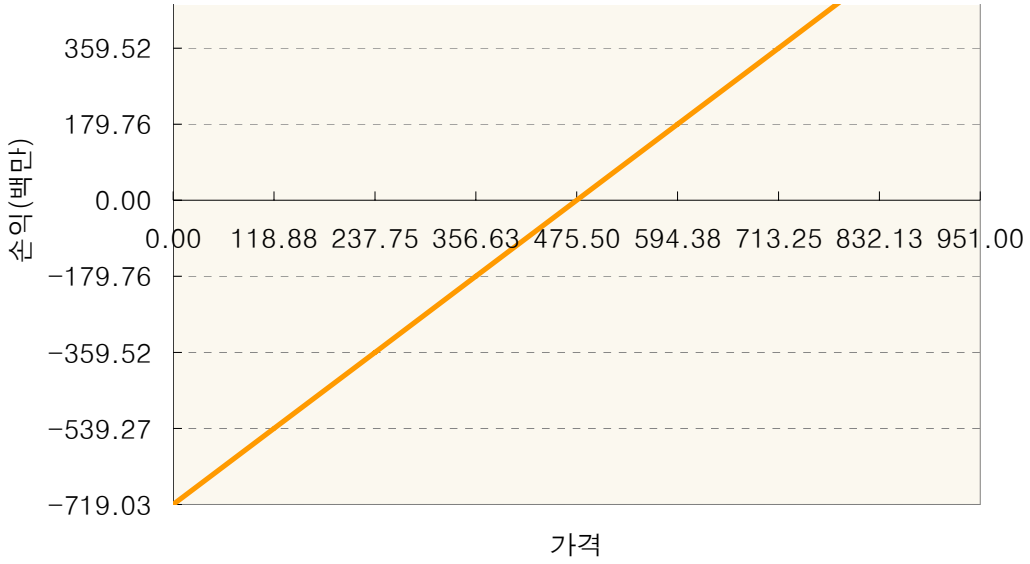


SMH6-SOYBEAN MEAL FUTR MAR16



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	35
KCH6	COFFEE "C" FUTURE MAR16	32
KWH6	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAR16	24
SBH6	Sugar #11 (WORLD) MAR16	75
SH6	SOYBEAN FUTURE MAR16	99
SMH6	SOYBEAN MEAL FUTR MAR16	48
WH6	WHEAT FUTURE(CBT) MAR16	58

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	701