공시일	2016-02-05
기준일	2016-02-04

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	2016-02-05
기준일	2016-02-04

스마트인덱스모

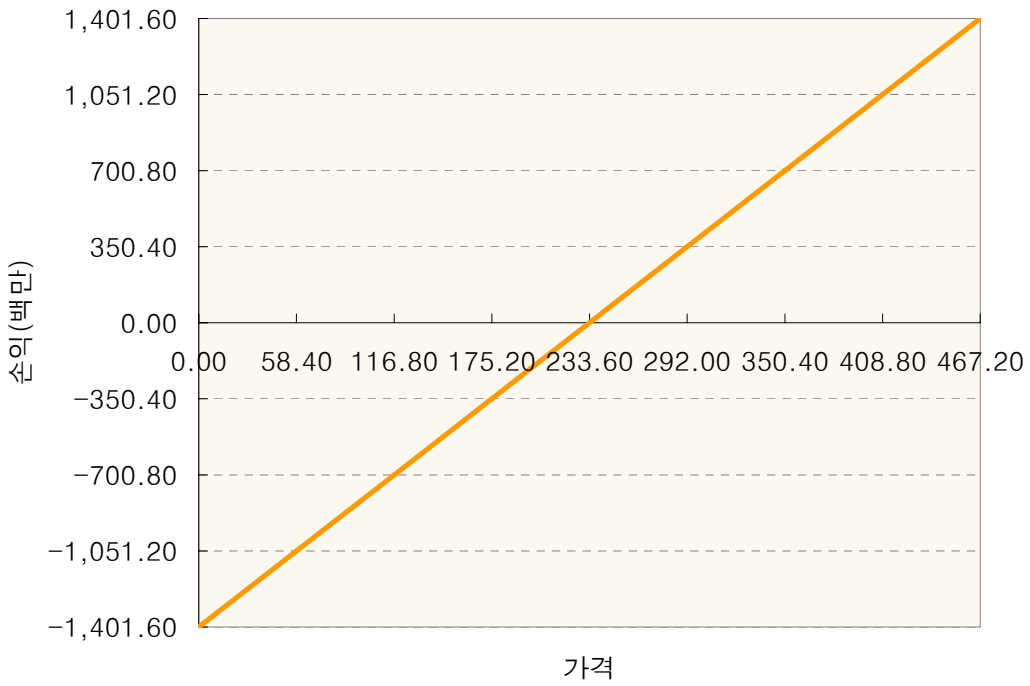
1. 계약금액

(단위:백만원)

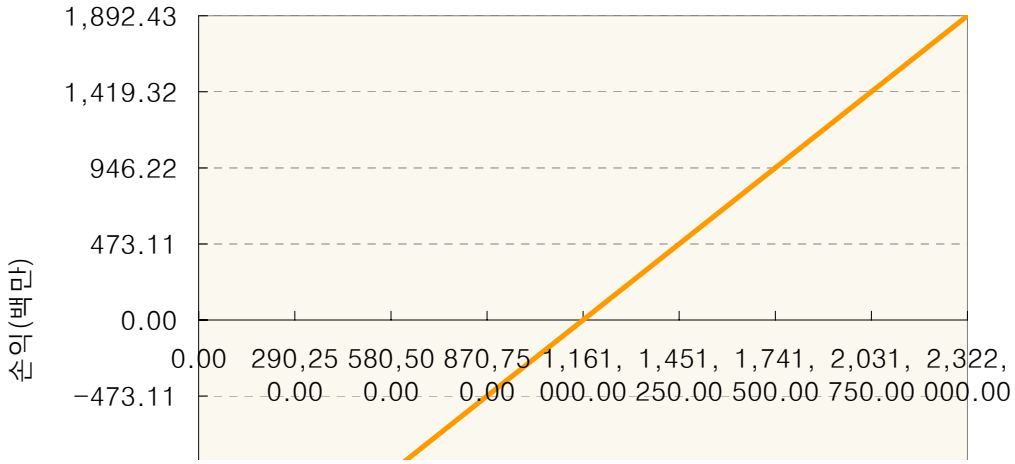
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,294	0	3,294	장내

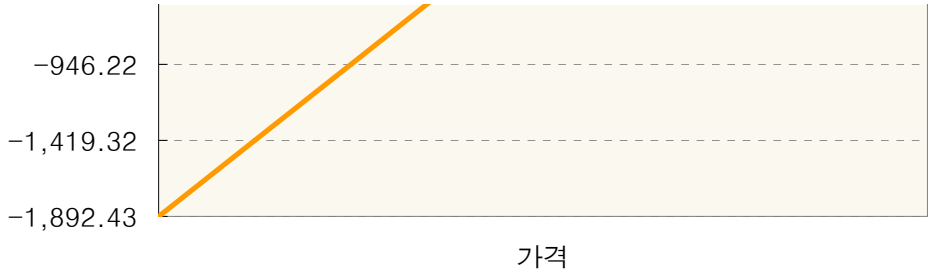
2. 만기시점의 손익구조

KR4101L30006-2016-03 코스피200지수선물



KR4111L30005-2016-03 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L300	2016-03 코스피200지수선물						112
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-112	-112	-112	-112	-112	-112	-112
-5.33%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-2.67%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	37	37	37	37	37	37	37
5.33%	75	75	75	75	75	75	75
8.00%	112	112	112	112	112	112	112
KR4111L300	2016-03 삼성전자개별선물						151
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-151	-151	-151	-151	-151	-151	-151
-5.33%	-100	-100	-100	-100	-100	-100	-100
-2.67%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	50	50	50	50	50	50	50
5.33%	100	100	100	100	100	100	100
8.00%	151	151	151	151	151	151	151

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

(단위:백만원)

234

공시일	2016-02-05
기준일	2016-02-04

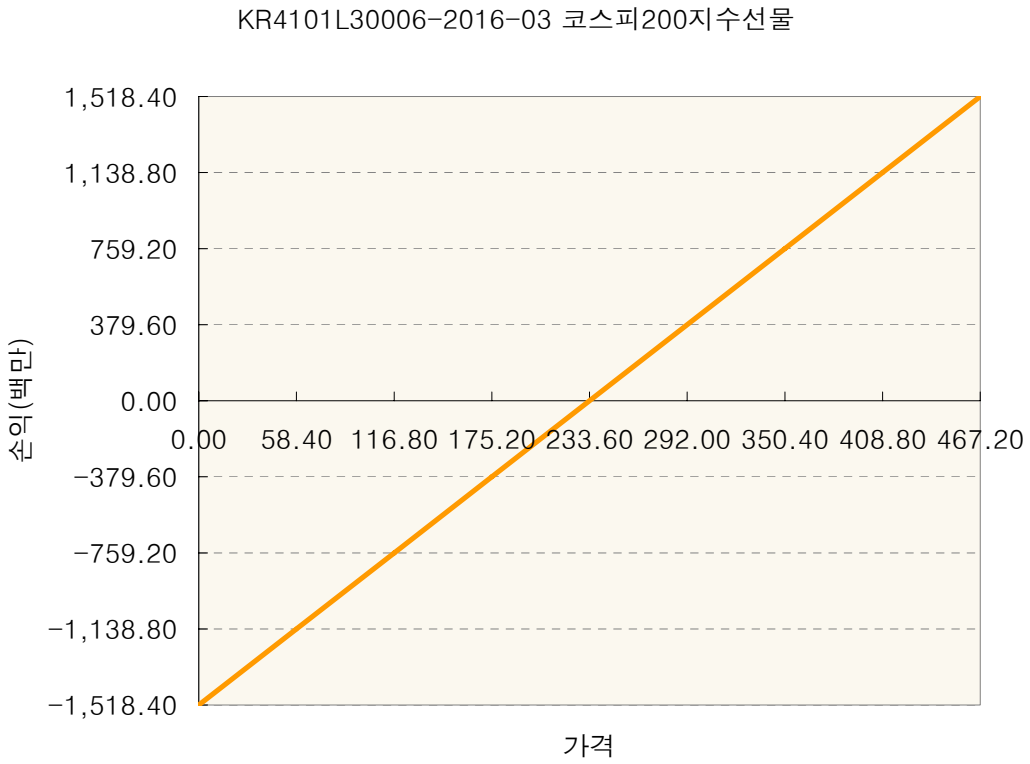
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,518	0	1,518	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물							121
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-121	-121	-121	-121	-121	-121	-121
-5.33%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
-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%	81	81	81	81	81	81	81
8.00%	121	121	121	121	121	121	121

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

97

공시일	2016-02-05
기준일	2016-02-04

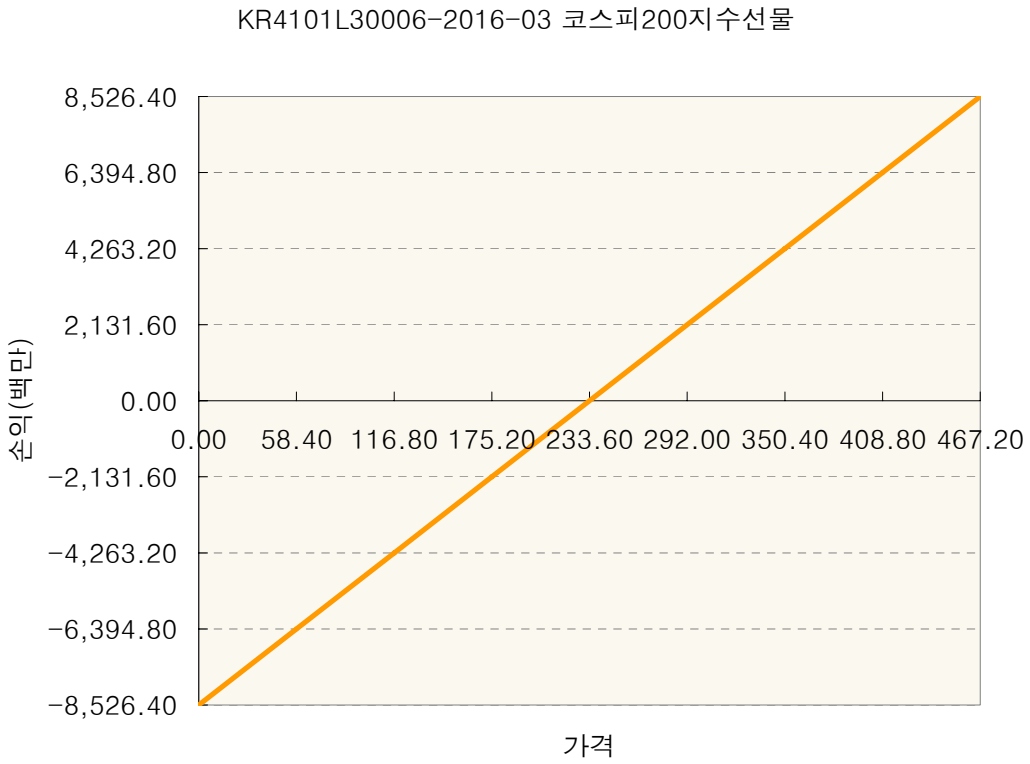
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	8,526	0	8,526	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물							680
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-680	-680	-680	-680	-680	-680	-680
-5.33%	-453	-453	-453	-453	-453	-453	-453
-2.67%	-227	-227	-227	-227	-227	-227	-227
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	227	227	227	227	227	227	227
5.33%	453	453	453	453	453	453	453
8.00%	680	680	680	680	680	680	680

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	542

공시일	2016-02-05
기준일	2016-02-04

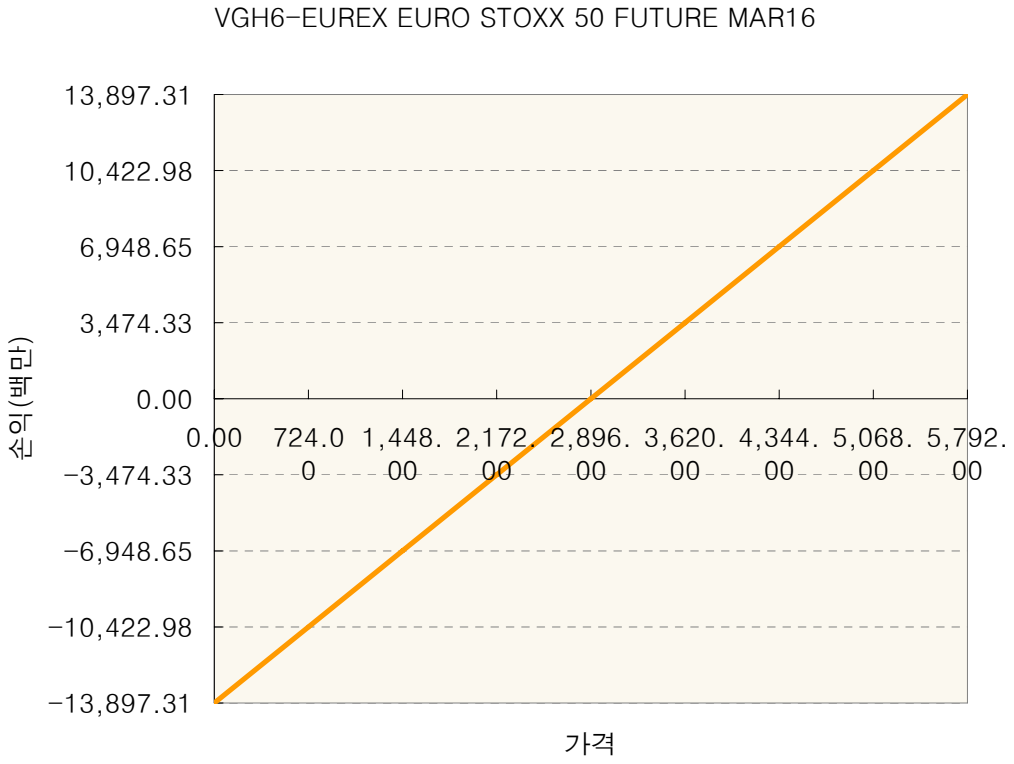
유로인덱스1호(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	13,897	0	13,897	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH6	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR16	1,112

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

(단위:백만원)

1,289

공시일	2016-02-05
기준일	2016-02-04

아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

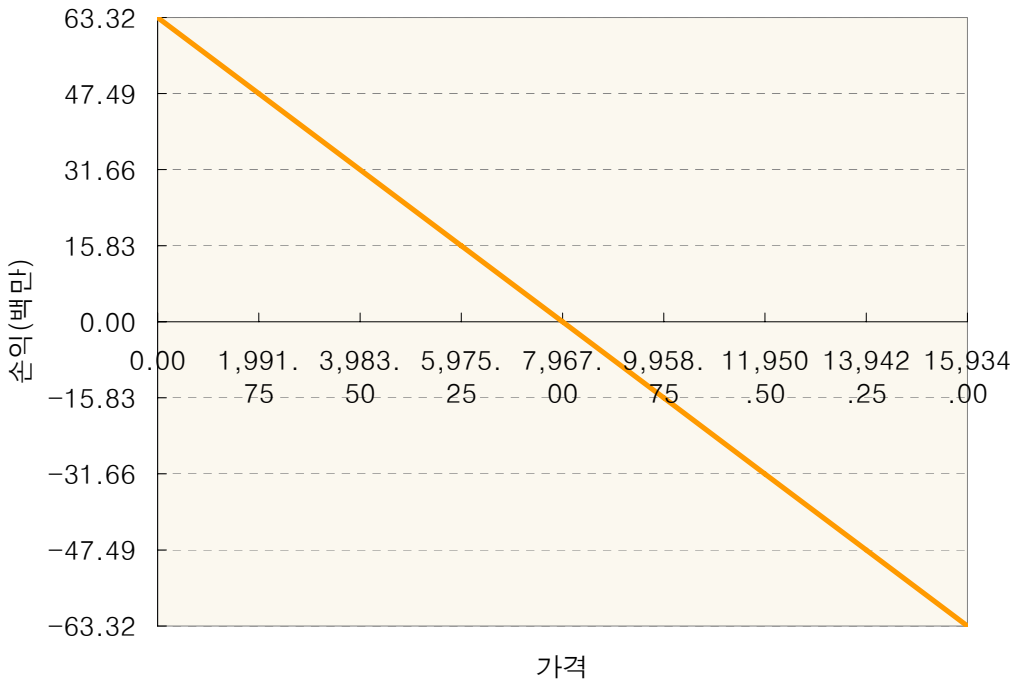
1. 계약금액

(단위:백만원)

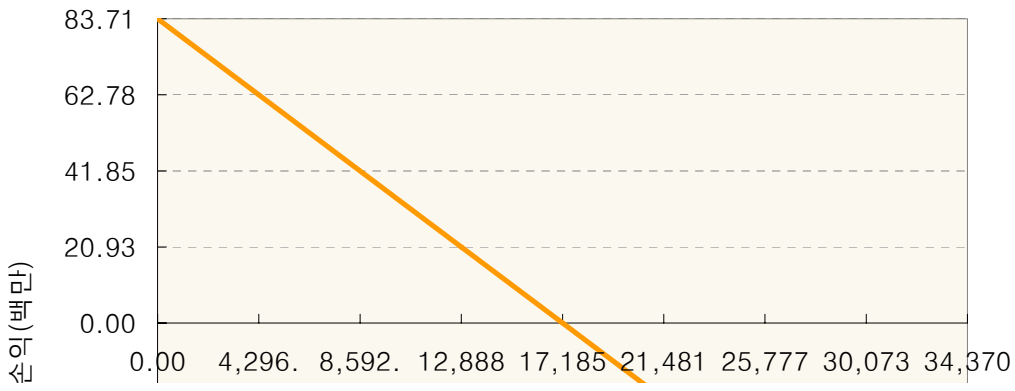
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	94	-94	
누계	유가증권	선물	0	63	-63	장내

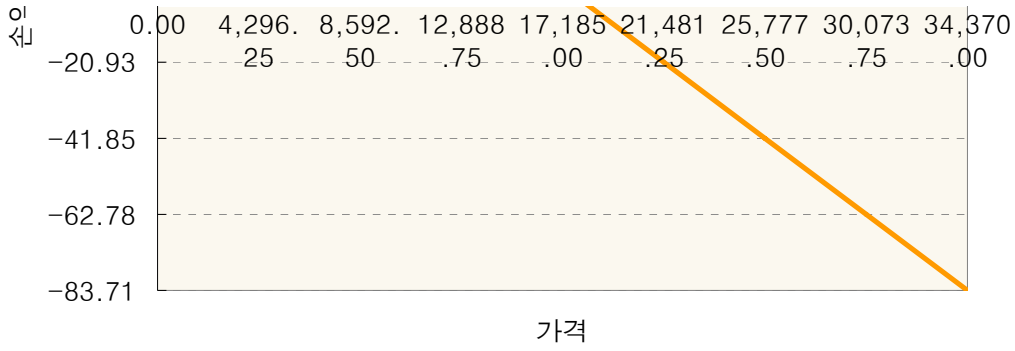
2. 만기시점의 손익구조

HCG6-HKG Hang Seng China Enterprises Index Fu

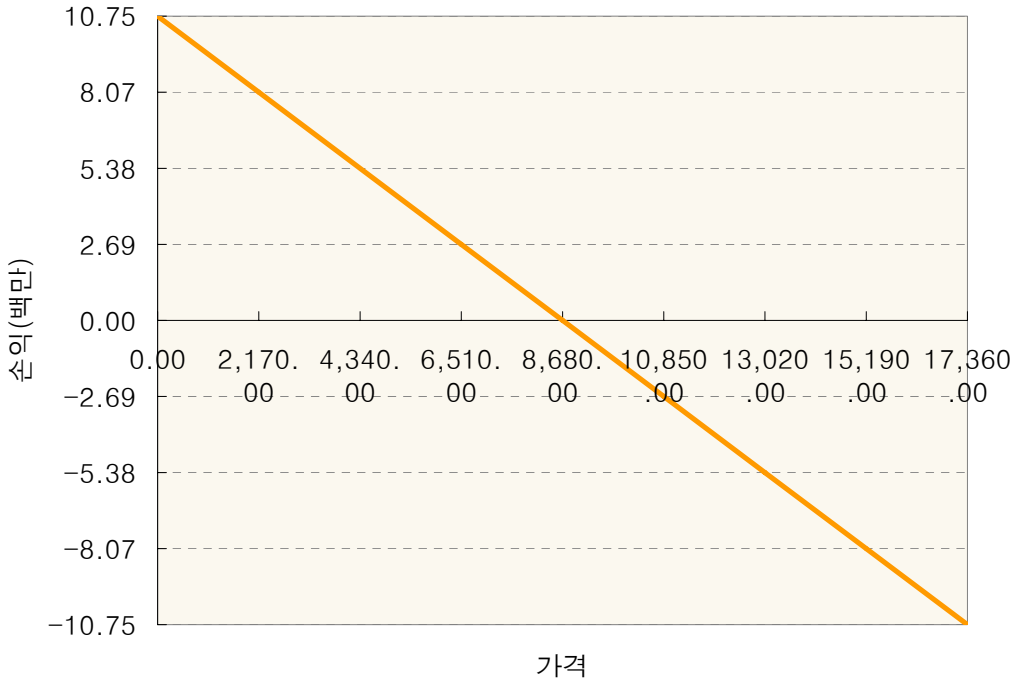


NIH6-SGX NIKKEI 225 STOCK INDEX FUTURE (SGX)





XUG6-SGX FTSE CHINA A50 FUTURE CONTRACT FEB16



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCG6	HKG Hang Seng China Enterprises Index Fu	5
NIH6	SGX NIKKEI 225 STOCK INDEX FUTURE (SGX)	7
XUG6	SGX FTSE CHINA A50 FUTURE CONTRACT FEB16	1

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

(단위:백만원)

16

공시일	2016-02-05
기준일	2016-02-04

차이나인덱스(주식-파생형)(종)

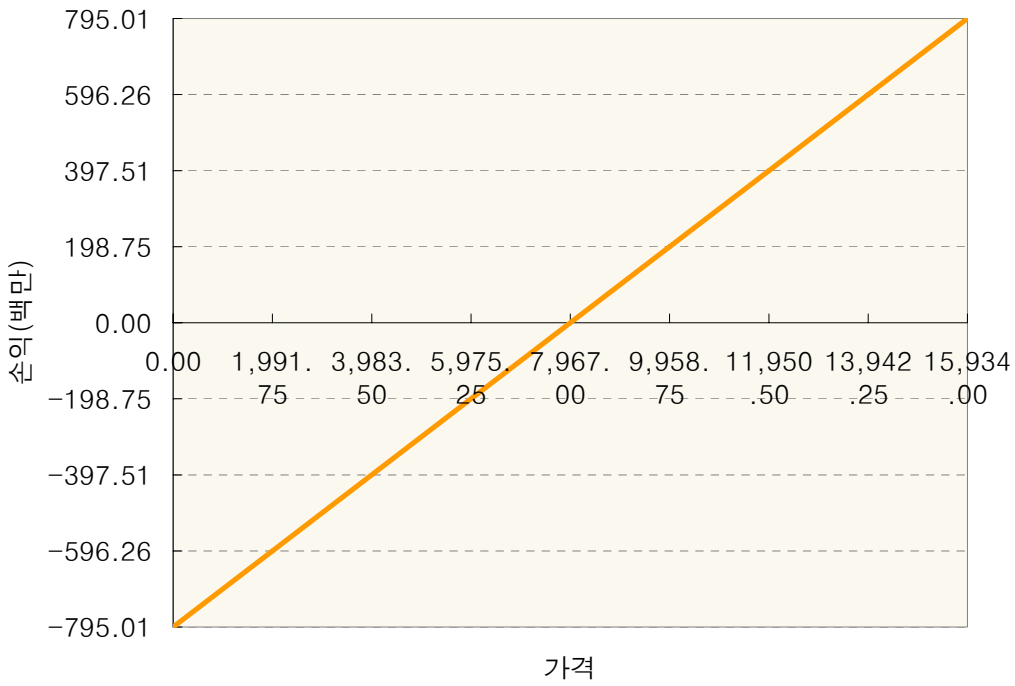
1. 계약금액

(단위:백만원)

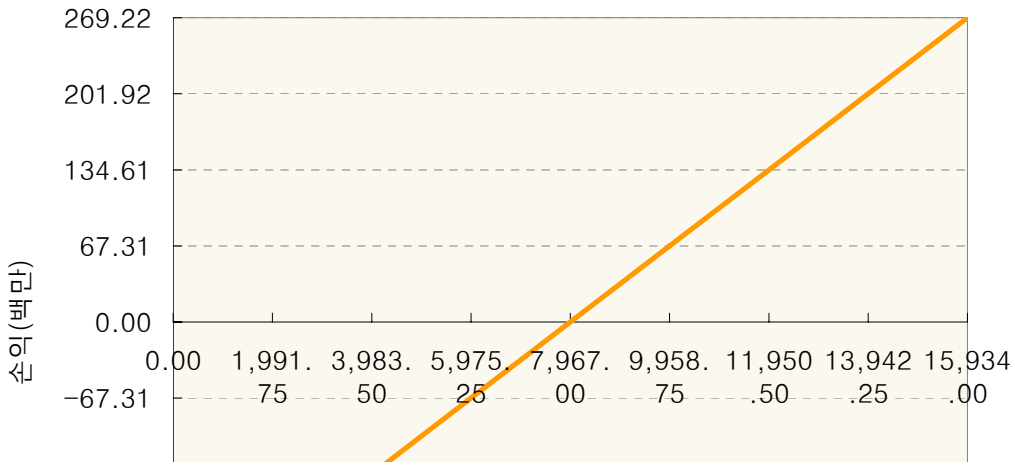
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	1	-1	장내
누계	유가증권	선물	1,064	0	1,064	장내

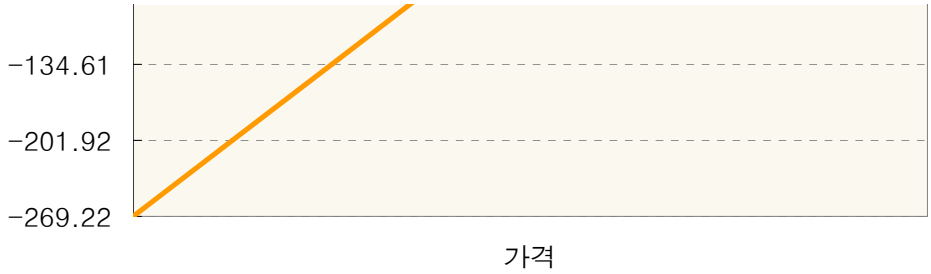
2. 만기시점의 손익구조

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	64
MHCG6	HKG MINI HANG SENG CHINA H-SHR IDX FUT F	22

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

(단위:백만원)

117

공시일	2016-02-05
기준일	2016-02-04

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	787

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

622

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-02-05
기준일	2016-02-04

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)

38

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-02-05
기준일	2016-02-04

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	370
SWCSI50000 신한CSI500미래S12082	114

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,384

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-02-05
기준일	2016-02-04

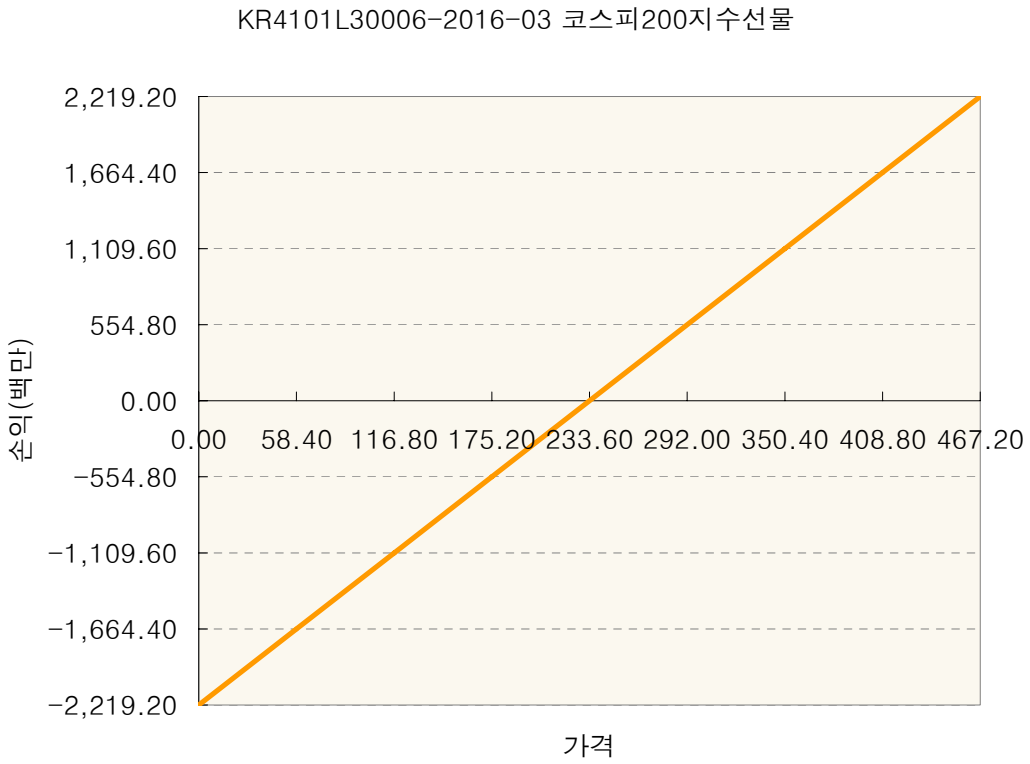
KOSPI200 레버리지 목표전환형 3

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	2,219	0	2,219	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물							177
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-177	-177	-177	-177	-177	-177	-177
-5.33%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118
-2.67%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	59	59	59	59	59	59	59
5.33%	118	118	118	118	118	118	118
8.00%	177	177	177	177	177	177	177

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

141

공시일	2016-02-05
기준일	2016-02-04

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	70
KR65433325 ELS신영증권플랜업(ELS)5447	61
KR65533AF5 ELSNH투자증권(ELS)11930	60
KR65733E15 ELS한국투자증권(ELS)5269	60

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

(단위:백만원)

160

공시일	2016-02-05
기준일	2016-02-04

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	242
KR65533B85 ELSNH투자증권(ELS)11957	255
KR65733FJ5 ELS한국투자증권(ELS)5298	242
KR65933C95 ELS미래에셋증권(ELS)8483	242

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

(단위:백만원)

622

공시일	2016-02-05
기준일	2016-02-04

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	203
KR65433515 ELS신영증권플랜업(ELS)5454	203
KR65533B75 ELSNH투자증권(ELS)11956	244
KR65733FH5 ELS한국투자증권(ELS)5297	203

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

(단위:백만원)

526

공시일	2016-02-05
기준일	2016-02-04

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	168
KR65533446 ELSNH투자증권(ELS)11973	168
KR65733686 ELS한국투자증권(ELS)5319	184
KR65933566 ELS미래에셋증권(ELS)8513	169

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

(단위:백만원)

382

공시일	2016-02-05
기준일	2016-02-04

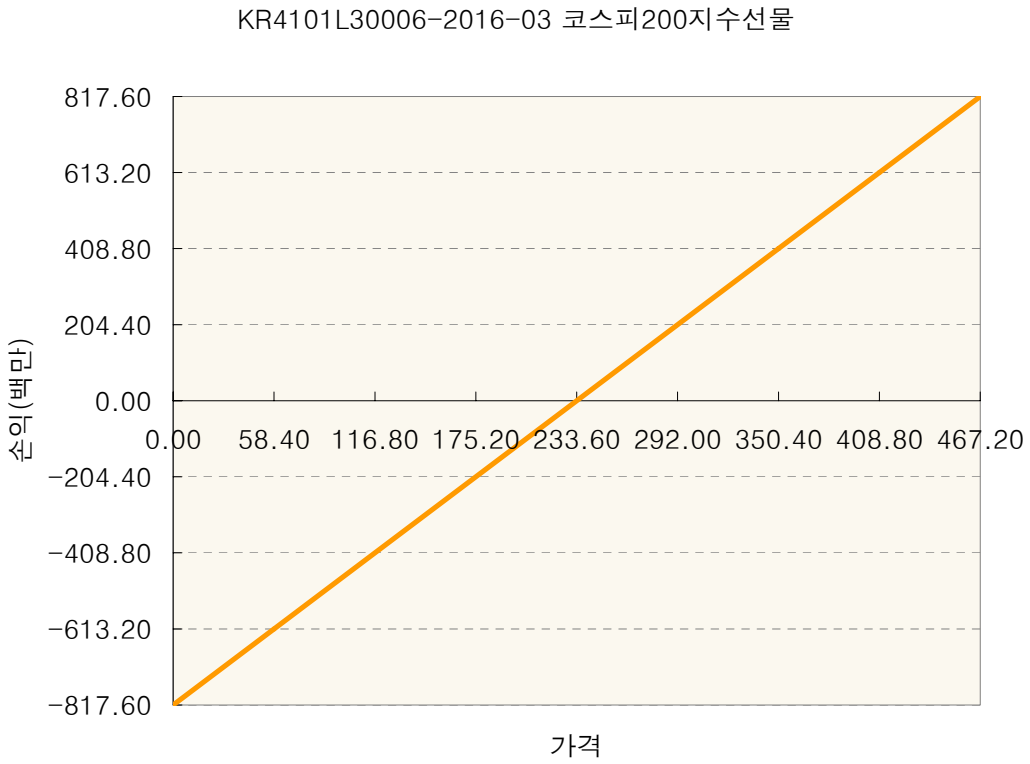
ETF스마트레버리지목표전환형5호

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	818	0	818	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물							65
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
-5.33%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
-2.67%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	22	22	22	22	22	22	22
5.33%	43	43	43	43	43	43	43
8.00%	65	65	65	65	65	65	65

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

52

공시일	2016-02-05
기준일	2016-02-04

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	158
KR65433286 ELS신영증권플랜업(ELS)5472	146
KR65533846 ELSNH투자증권(ELS)11987	146
KR65733AL6 ELS한국투자증권(ELS)5343	146

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

(단위:백만원)

353

공시일	2016-02-05
기준일	2016-02-04

지수연계미래설계SE-10호(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	3,825	0	3,825	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR65133A46 ELS대신증권(ELS) 6376	117
KR65233BD6 ELS대우증권(ELS) 15170	101
KR65533AP6 ELSNH투자증권(ELS) 12036	101
KR65733C46 ELS한국투자증권(ELS) 5359	101

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

(단위:백만원)

230

공시일	2016-02-05
기준일	2016-02-04

지수연계미래설계SE-11호(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	5,962	0	5,962	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR65133226 ELS대신증권(ELS)6386	171
KR65233336 ELS대우증권(ELS)15180	159
KR65533236 ELSNH투자증권(ELS)12056	183
KR65733536 ELS한국투자증권(ELS)5388	165

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

(단위:백만원)

386

공시일	2016-02-05
기준일	2016-02-04

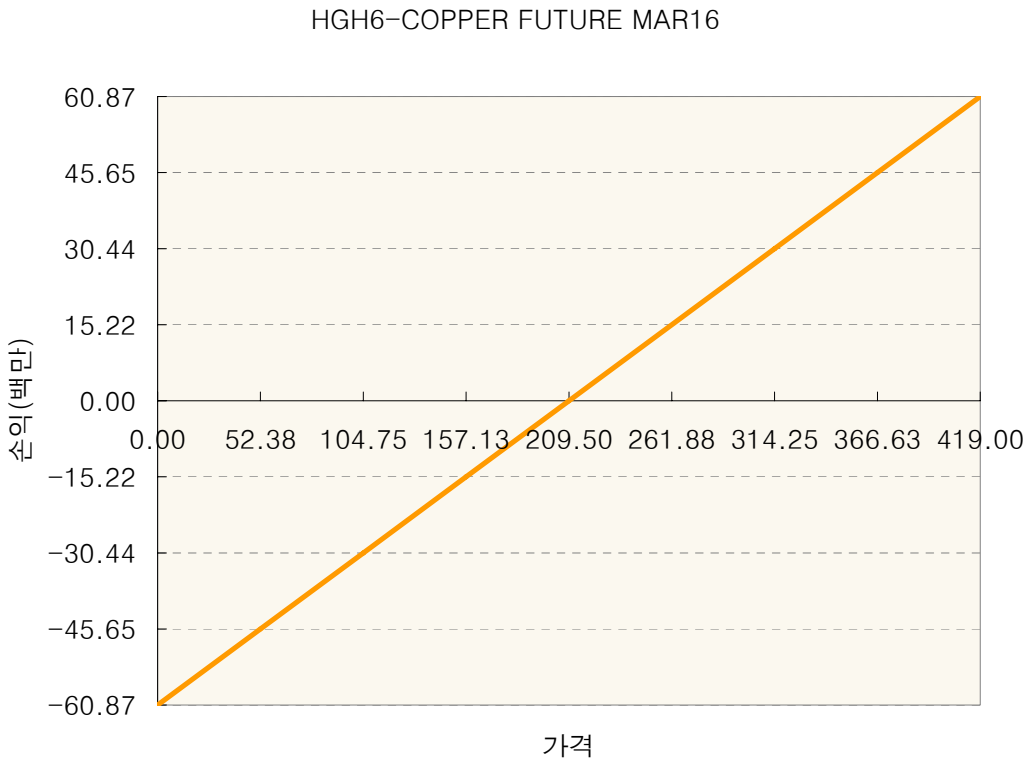
메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

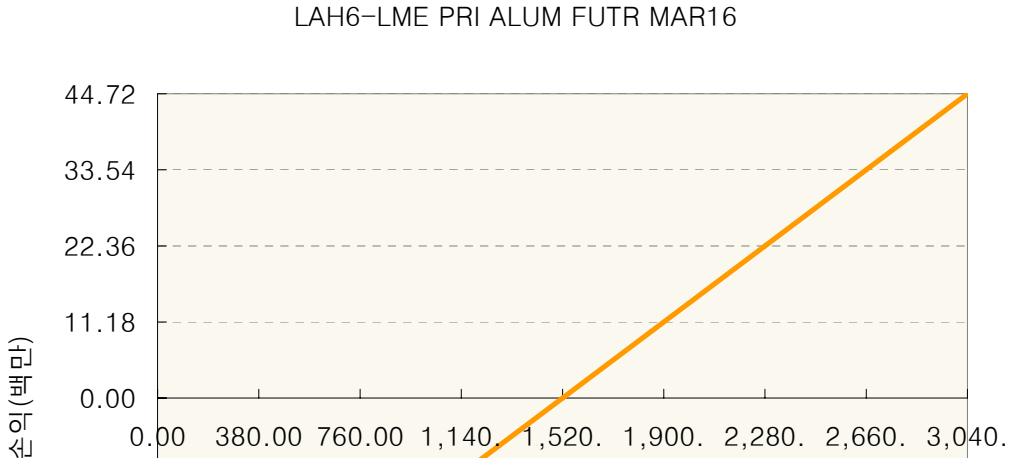
1. 계약금액

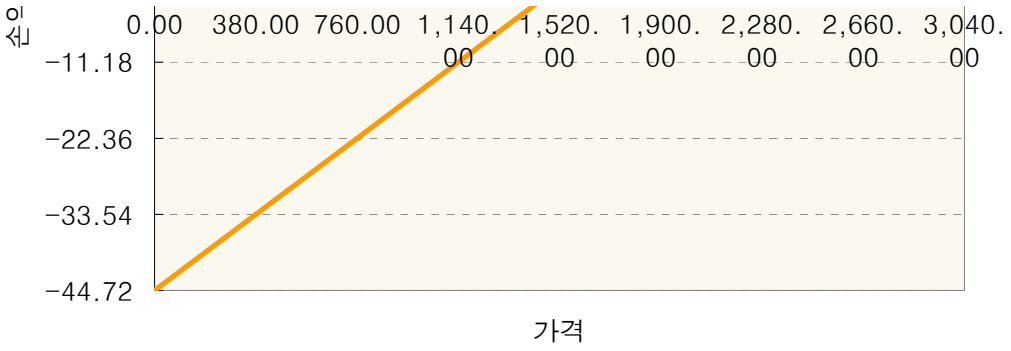
(단위:백만원)

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	53	0	53	
누계	유가증권	선물	289	0	289	

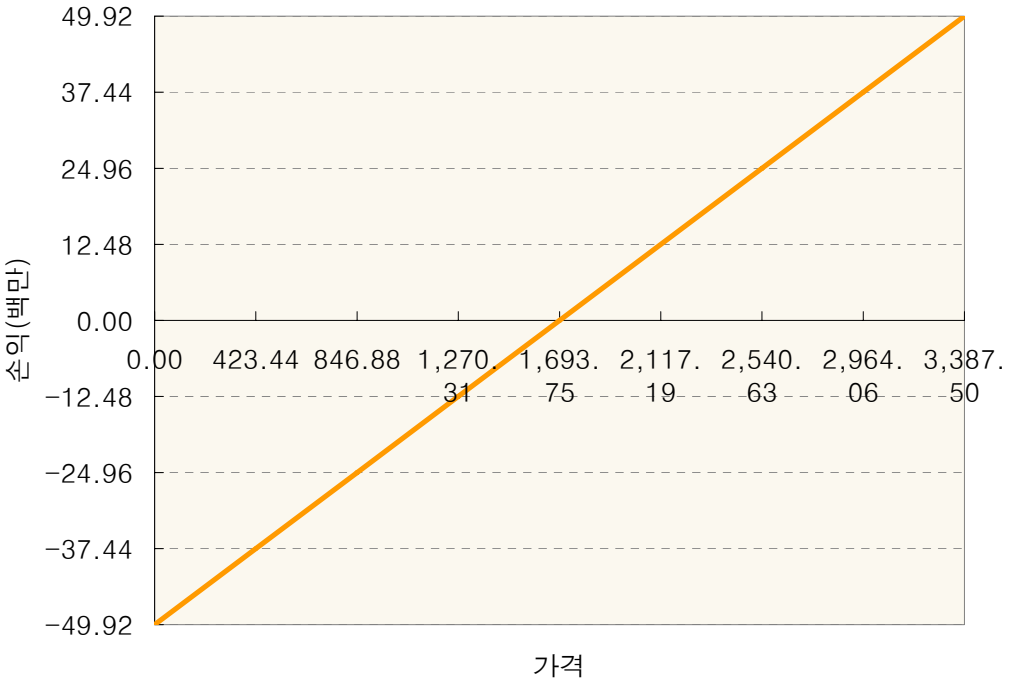
2. 만기시점의 손익구조



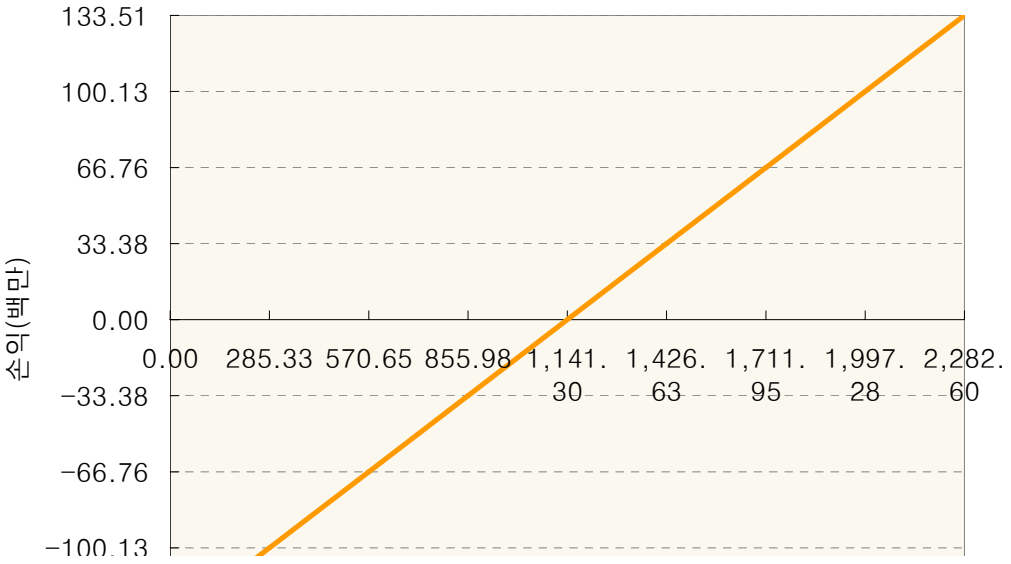


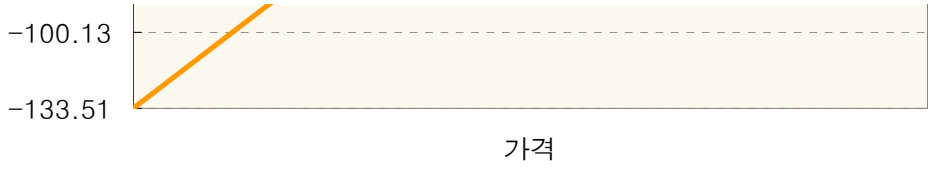


LXH6-LME ZINC FUTURE MAR16

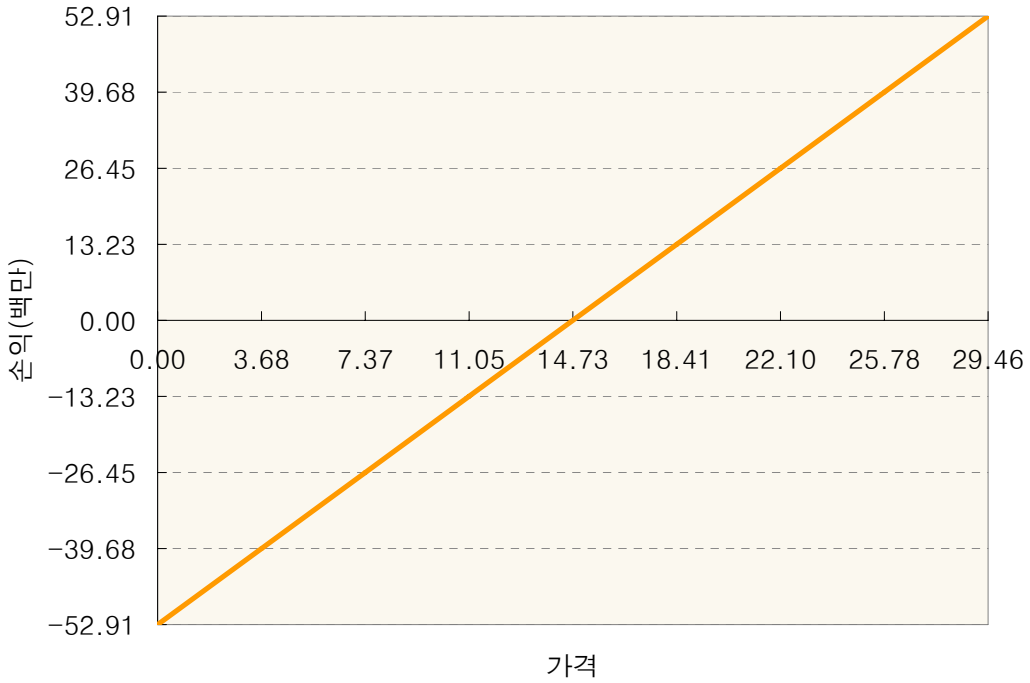


XGJ6-MINI GOLD FUTURE APR16





YSH6-MINI SILVER FUT MAR16



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGH6	COPPER FUTURE MAR16	5
LAH6	LME PRI ALUM FUTR MAR16	4
LXH6	LME ZINC FUTURE MAR16	4
XGJ6	MINI GOLD FUTURE APR16	11
YSH6	MINI SILVER FUT MAR16	4

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

(단위:백만원)

27

공시일	2016-02-05
기준일	2016-02-04

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

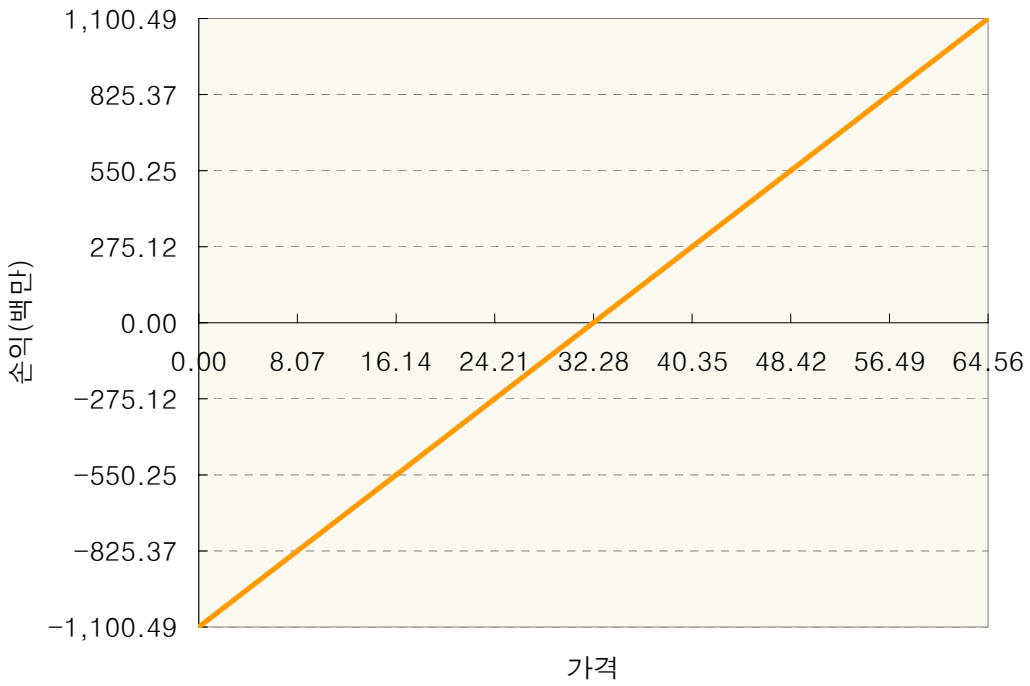
1. 계약금액

(단위:백만원)

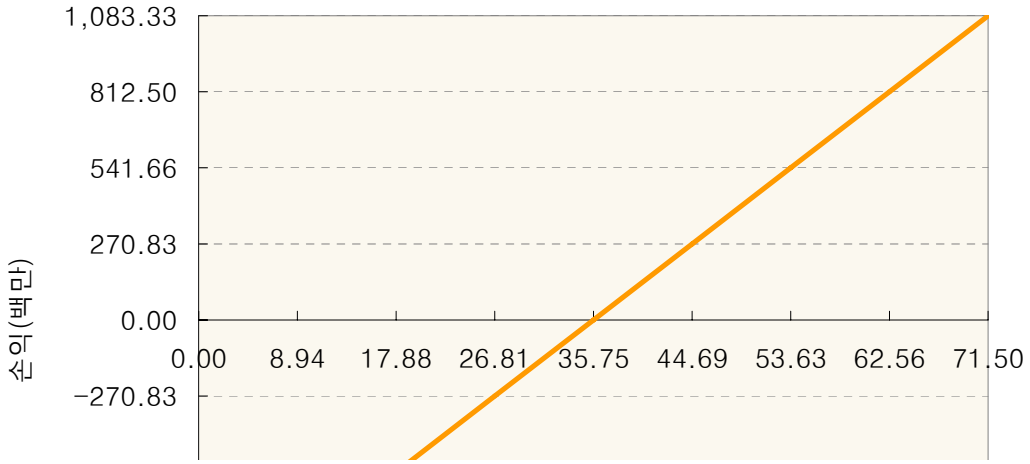
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,317	0	4,317	

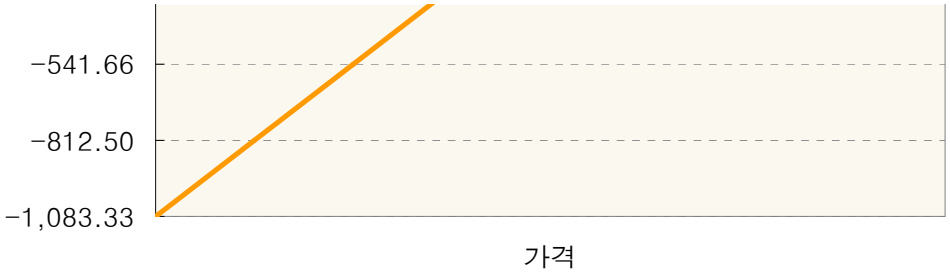
2. 만기시점의 손익구조

CLH6-WTI CRUDE FUTURE MAR16

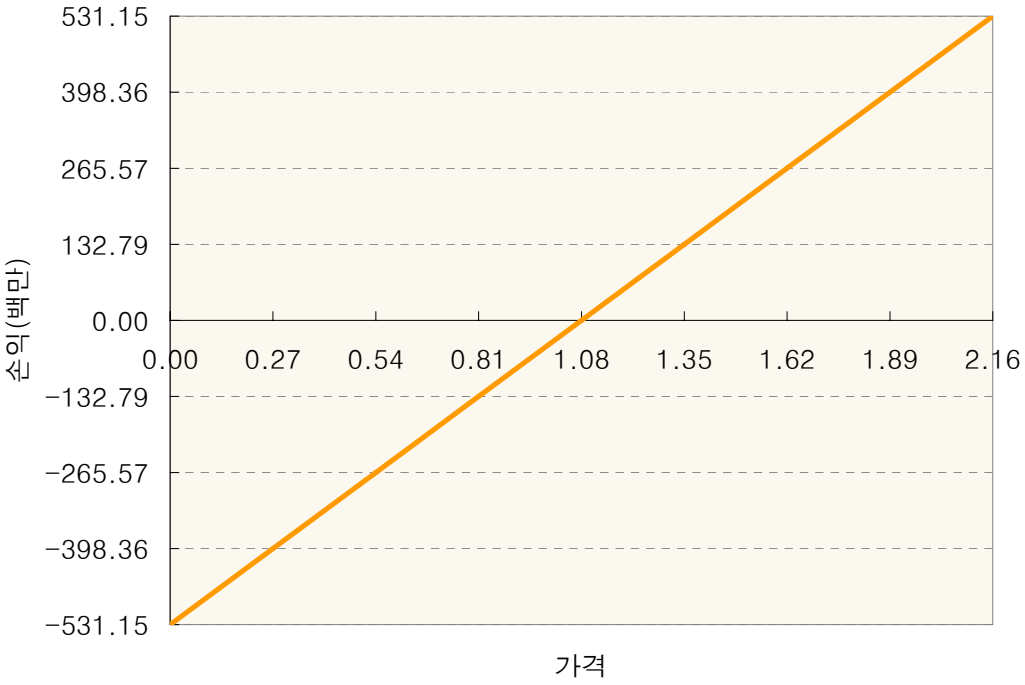


COK6-BRENT CRUDE FUTR MAY16

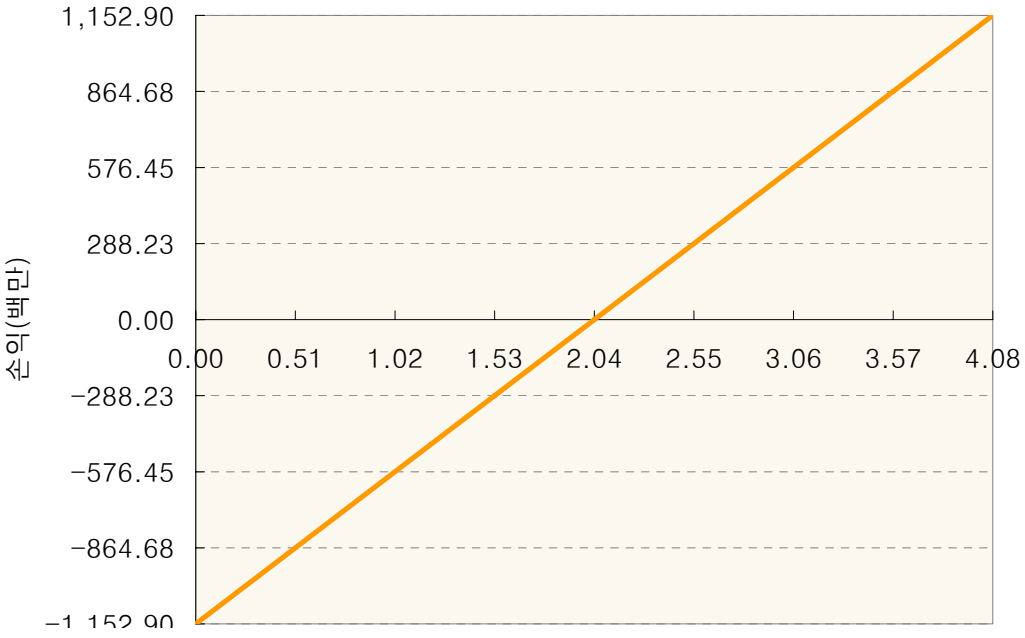


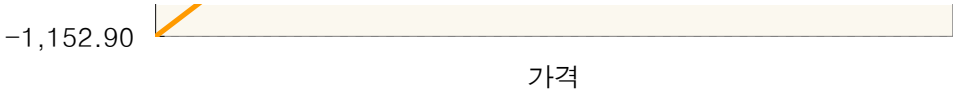


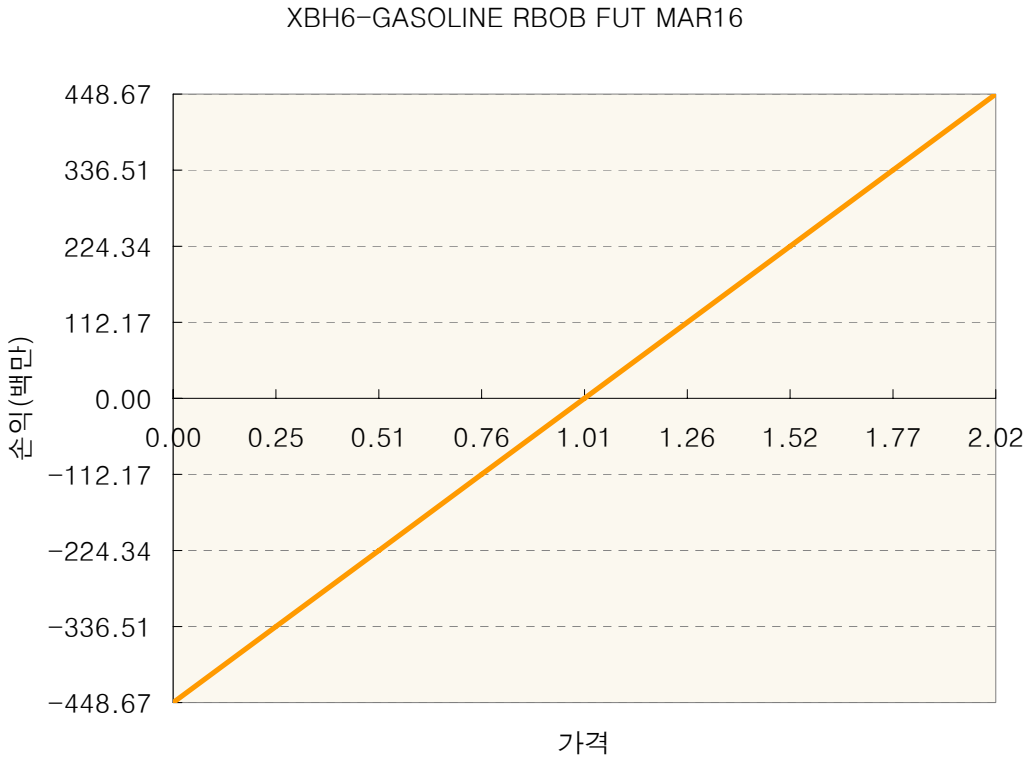
HOH6-NY Harb ULSD Fut MAR16



NGH6-NATURAL GAS FUTR MAR16







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLH6	WTI CRUDE FUTURE MAR16	88
COK6	BRENT CRUDE FUTR MAY16	87
HOH6	NY Harb ULSD Fut MAR16	42
NGH6	NATURAL GAS FUTR MAR16	92
XBH6	GASOLINE RBOB FUT MAR16	36

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

(단위:백만원)

917

공시일	2016-02-05
기준일	2016-02-04

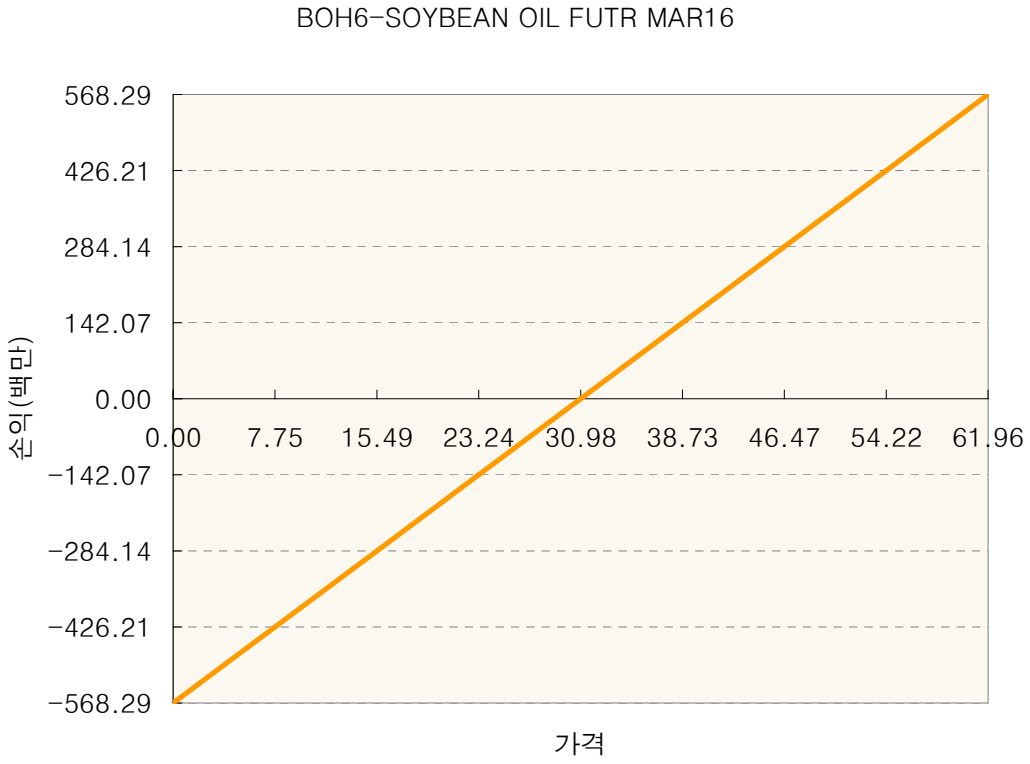
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

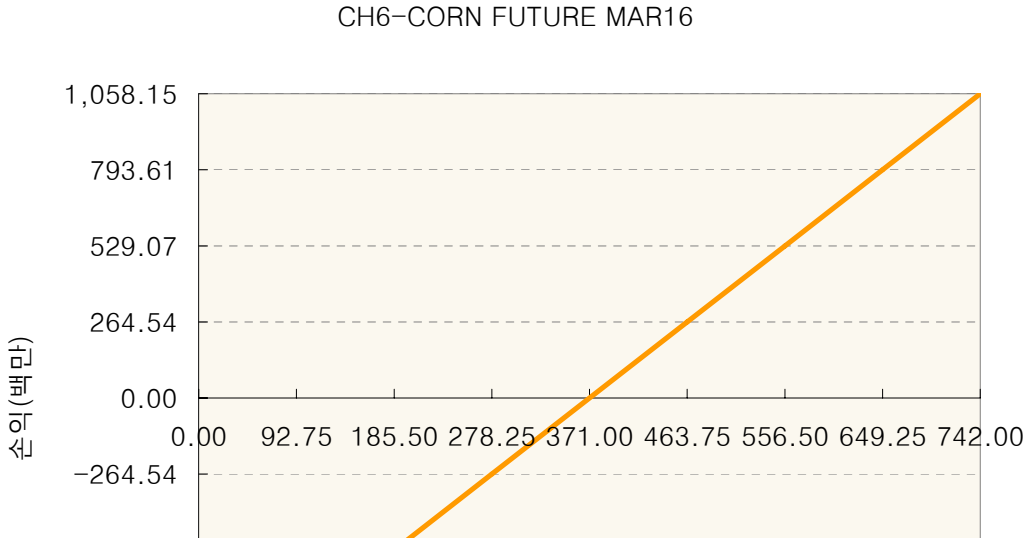
1. 계약금액

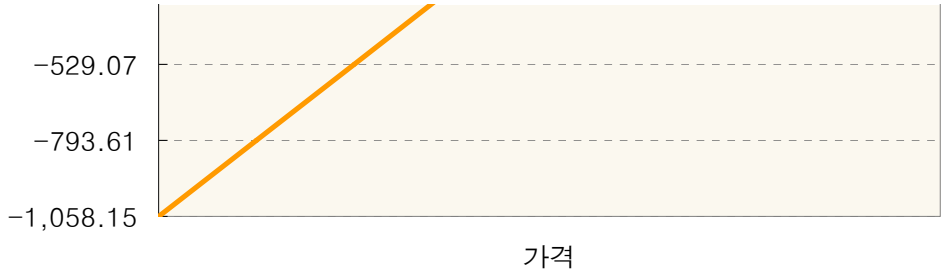
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,185	0	6,185	

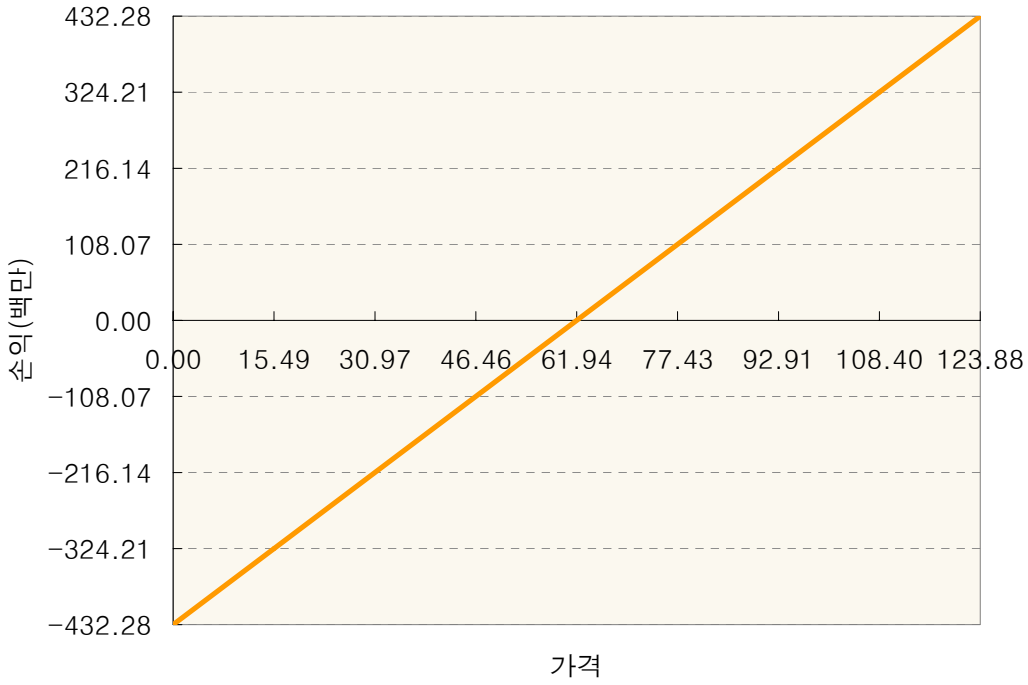
2. 만기시점의 손익구조



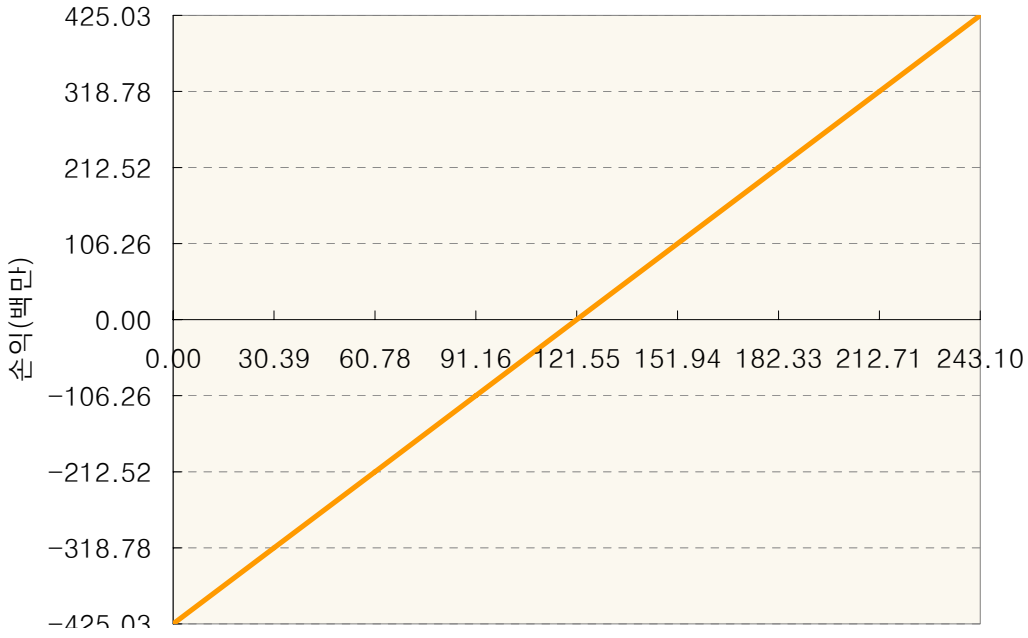


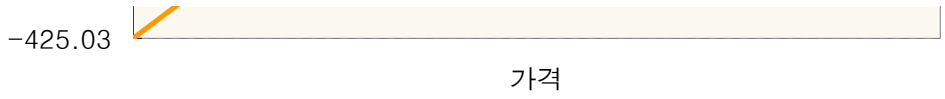


CTH6-COTTON NO.2 FUTR MAR16

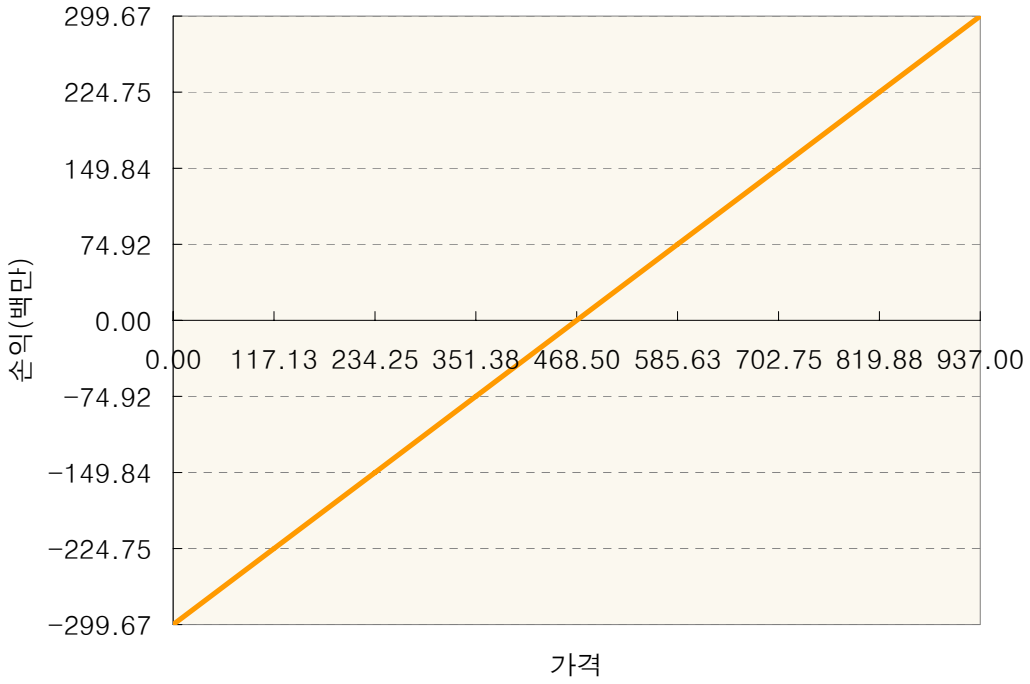


KCH6-COFFEE "C" FUTURE MAR16

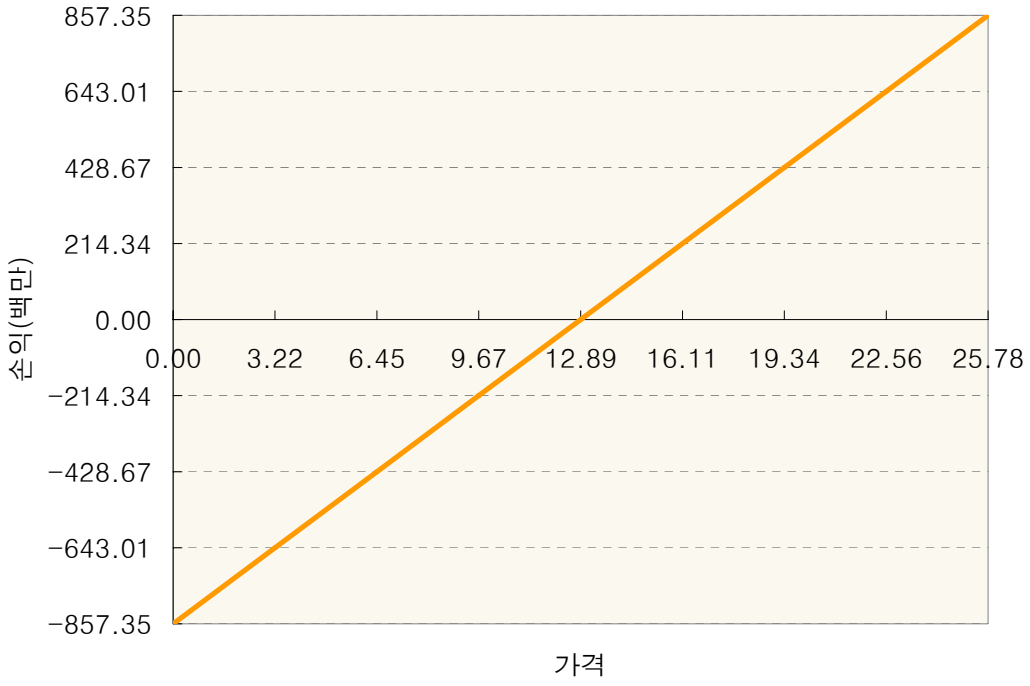




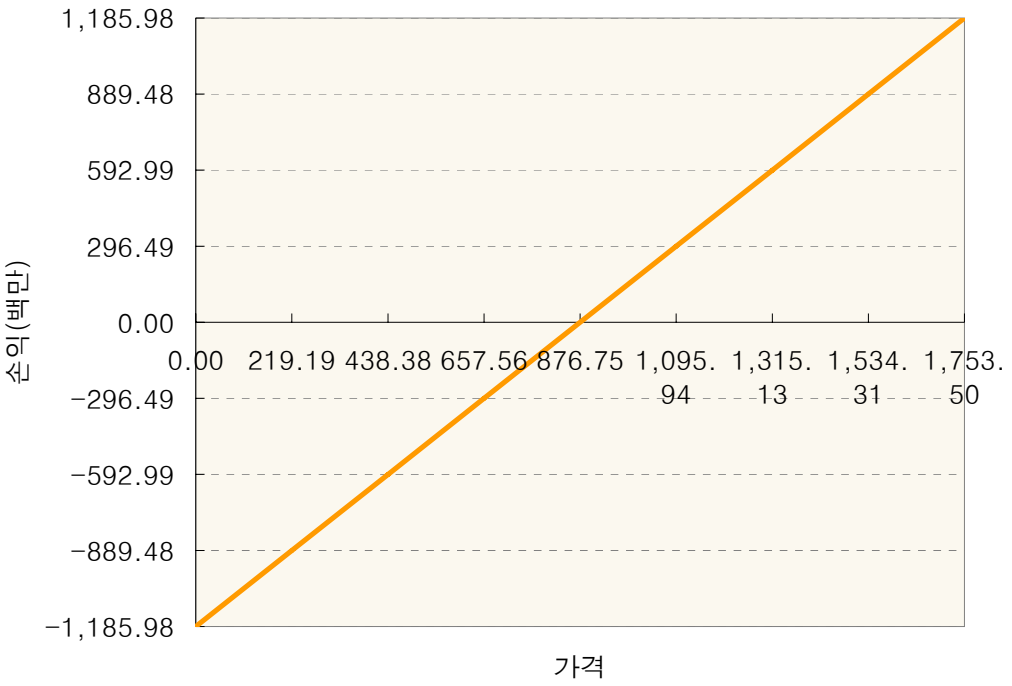
KWH6-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAR16



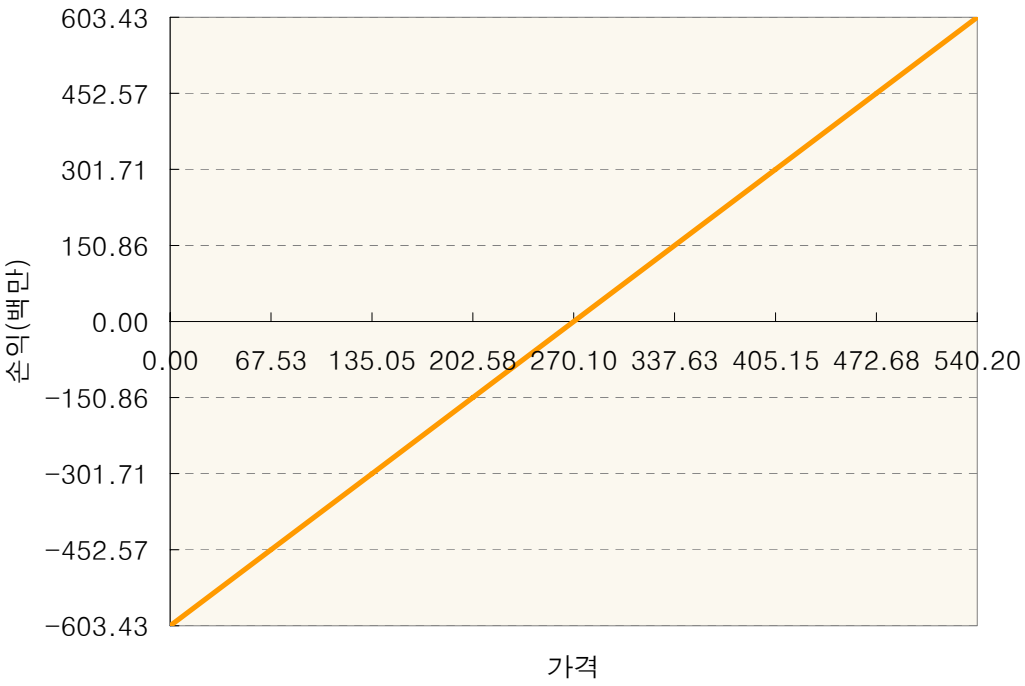
SBH6-Sugar #11 (WORLD) MAR16



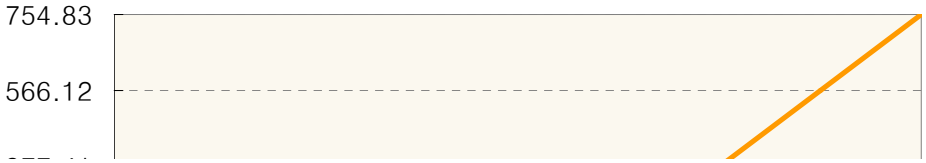
SH6-SOYBEAN FUTURE MAR16

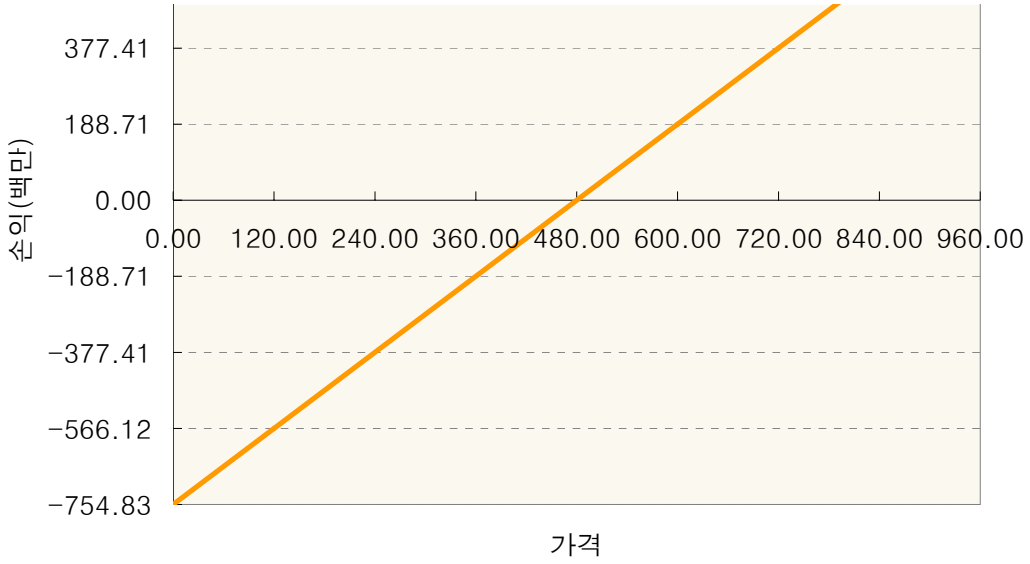


SMH6-SOYBEAN MEAL FUTR MAR16



WH6-WHEAT FUTURE(CBT) MAR16





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH6	SOYBEAN OIL FUTR MAR16	45
CH6	CORN FUTURE MAR16	85
CTH6	COTTON NO.2 FUTR MAR16	35
KCH6	COFFEE "C" FUTURE MAR16	34
KWH6	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAR16	24
SBH6	Sugar #11 (WORLD) MAR16	69
SH6	SOYBEAN FUTURE MAR16	95
SMH6	SOYBEAN MEAL FUTR MAR16	48
WH6	WHEAT FUTURE(CBT) MAR16	60

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

(단위:백만원)

682