공시일	2016-02-15
기준일	2016-02-12

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	2016-02-15
기준일	2016-02-12

스마트인덱스모

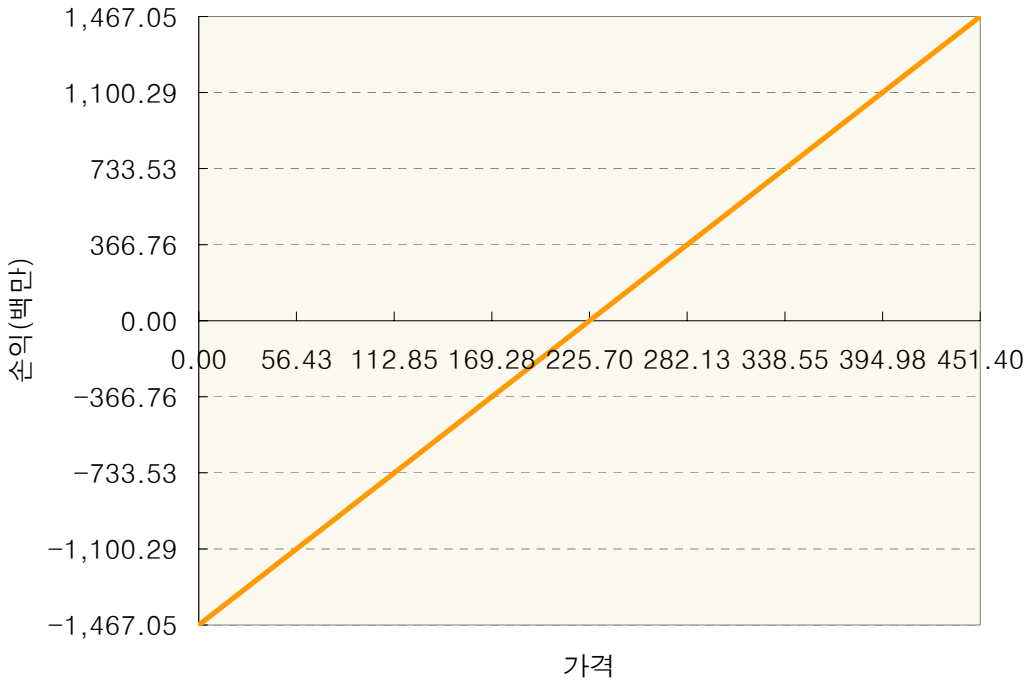
1. 계약금액

(단위:백만원)

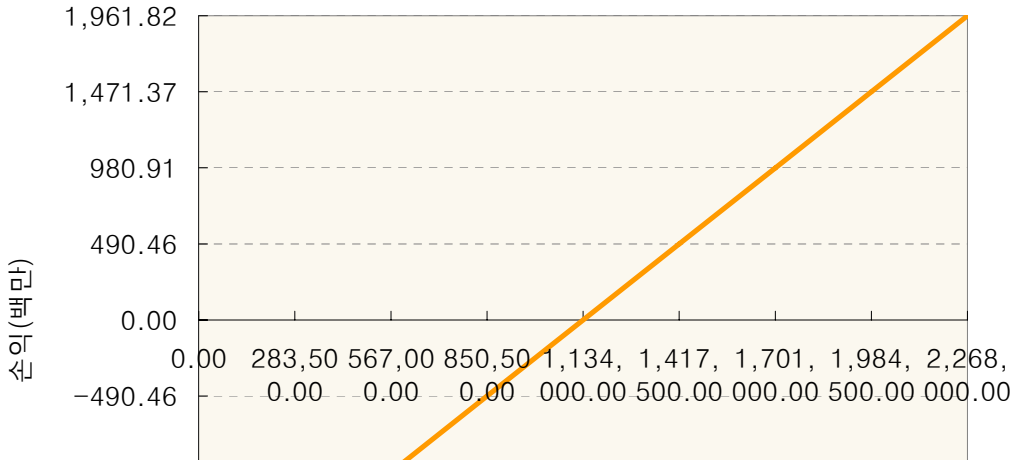
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	113	0	113	장내
누계	유가증권	선물	3,429	0	3,429	장내

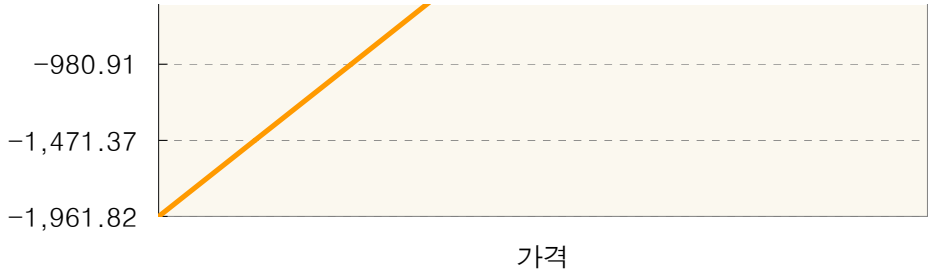
2. 만기시점의 손익구조

KR4101L30006-2016-03 코스피200지수선물



KR4111L30005-2016-03 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물							117
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117
-5.33%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	39	39	39	39	39	39	39
5.33%	78	78	78	78	78	78	78
8.00%	117	117	117	117	117	117	117
KR4111L300 2016-03 삼성전자개별선물							156
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
-5.33%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104
-2.67%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	52	52	52	52	52	52	52
5.33%	104	104	104	104	104	104	104
8.00%	156	156	156	156	156	156	156

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

(단위:백만원)

249

공시일	2016-02-15
기준일	2016-02-12

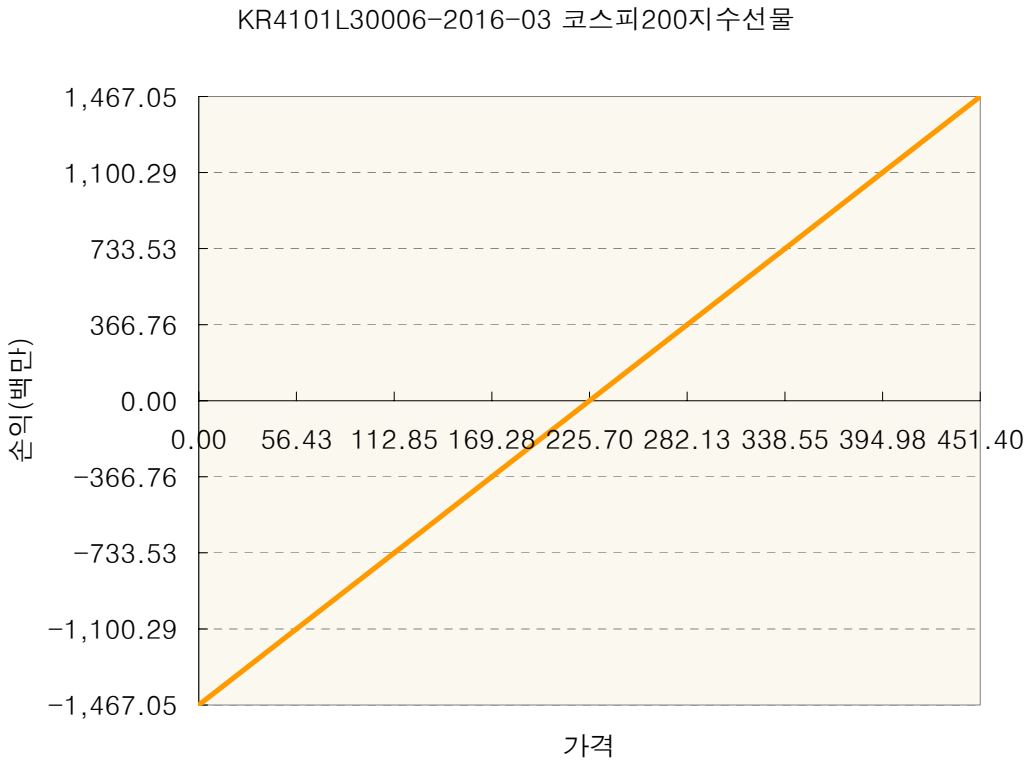
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,467	0	1,467	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물							117
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117
-5.33%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	39	39	39	39	39	39	39
5.33%	78	78	78	78	78	78	78
8.00%	117	117	117	117	117	117	117

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

95

공시일	2016-02-15
기준일	2016-02-12

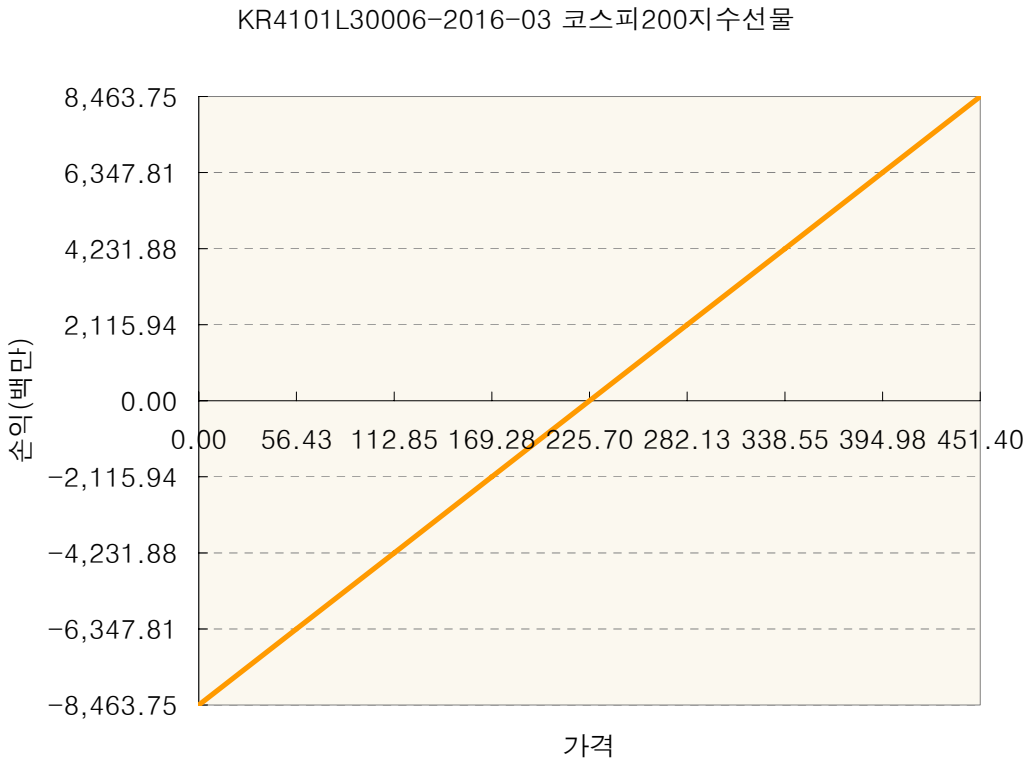
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	226	0	226	장내
누계	유가증권	선물	8,464	0	8,464	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물							675
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-675	-675	-675	-675	-675	-675	-675
-5.33%	-450	-450	-450	-450	-450	-450	-450
-2.67%	-225	-225	-225	-225	-225	-225	-225
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	225	225	225	225	225	225	225
5.33%	450	450	450	450	450	450	450
8.00%	675	675	675	675	675	675	675

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

549

공시일	2016-02-15
기준일	2016-02-12

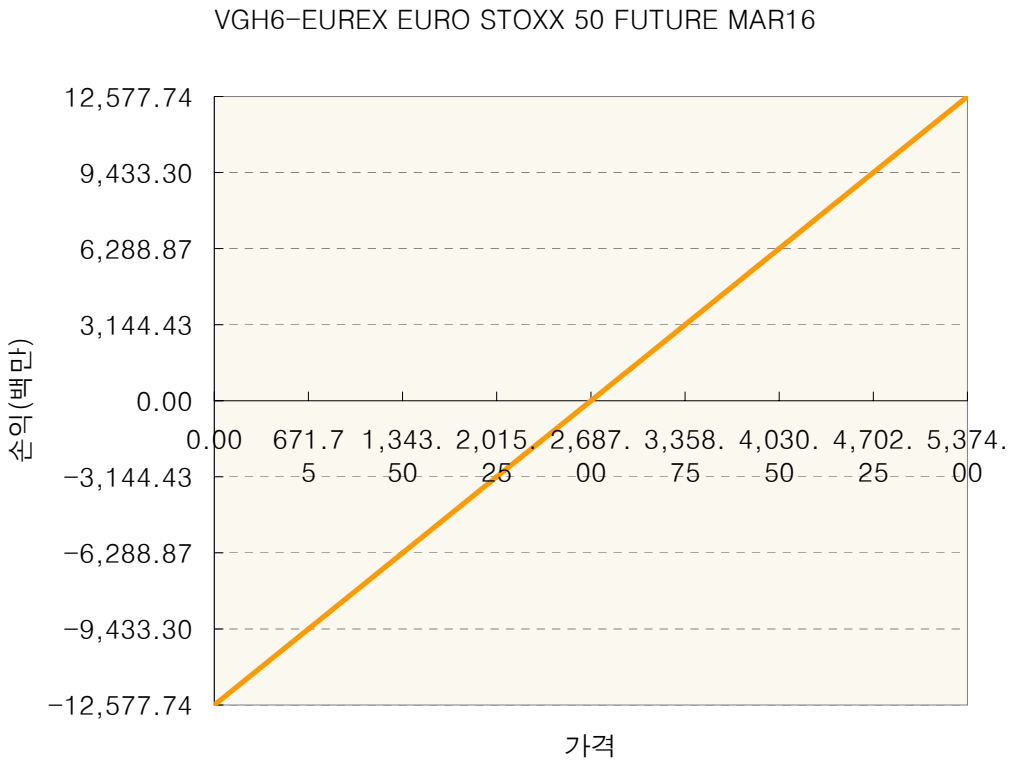
유로인덱스1호(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	12,578	0	12,578	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH6	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR16	1,006

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

(단위:백만원)

1,188

공시일	2016-02-15
기준일	2016-02-12

아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

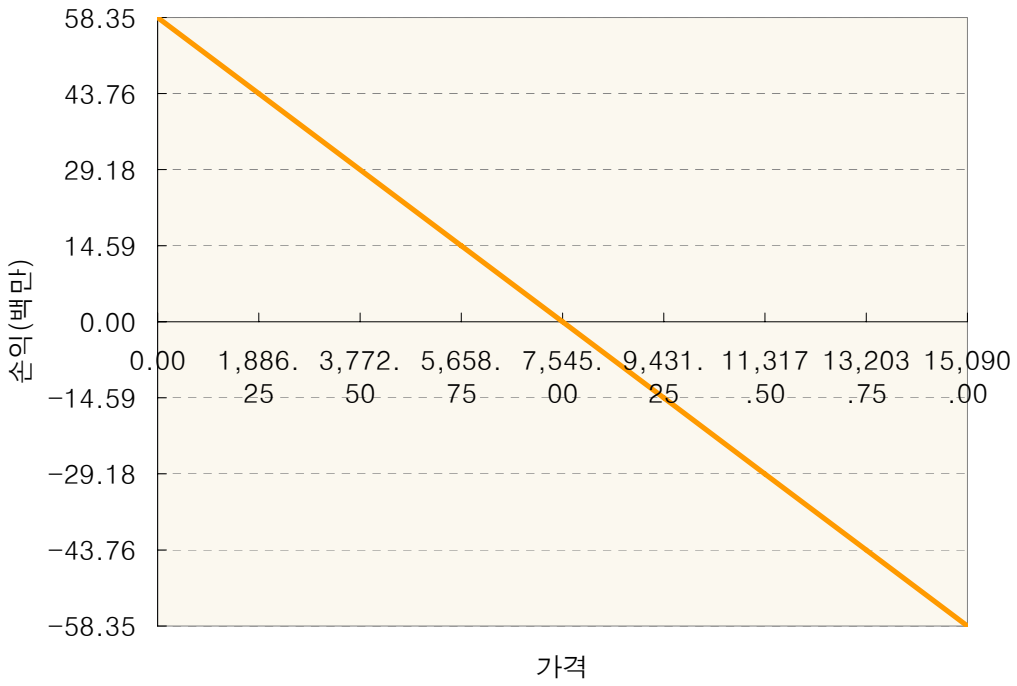
1. 계약금액

(단위:백만원)

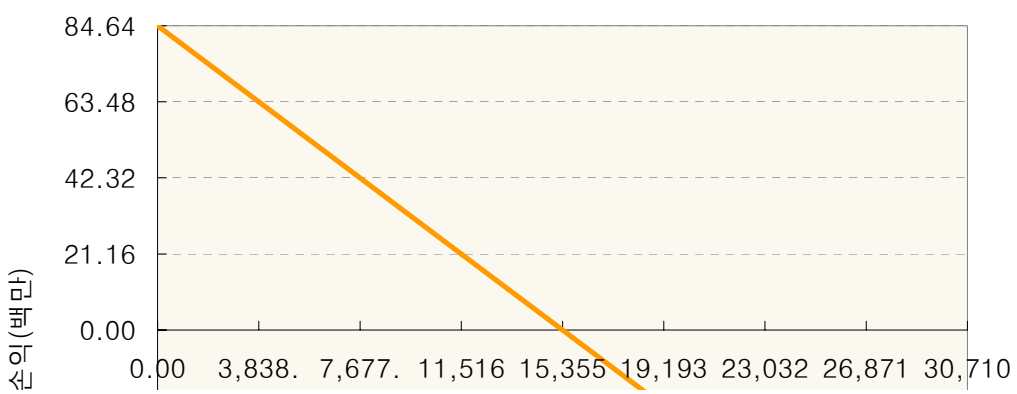
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	120	-120	
누계	유가증권	선물	0	58	-58	장내

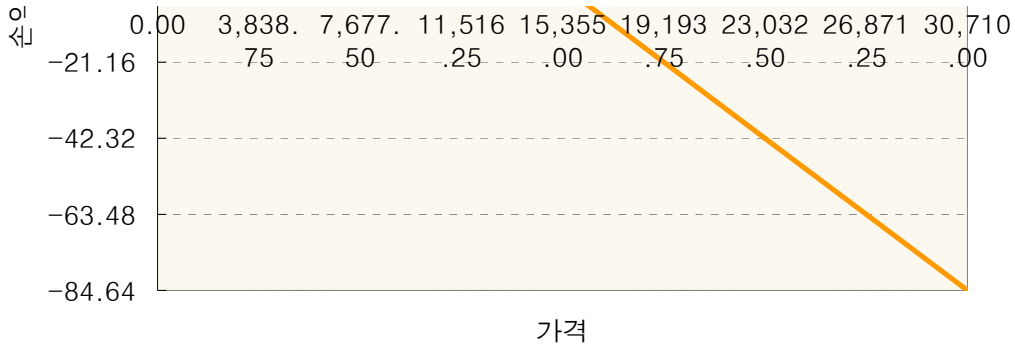
2. 만기시점의 손익구조

HCG6-HKG Hang Seng China Enterprises Index Fu

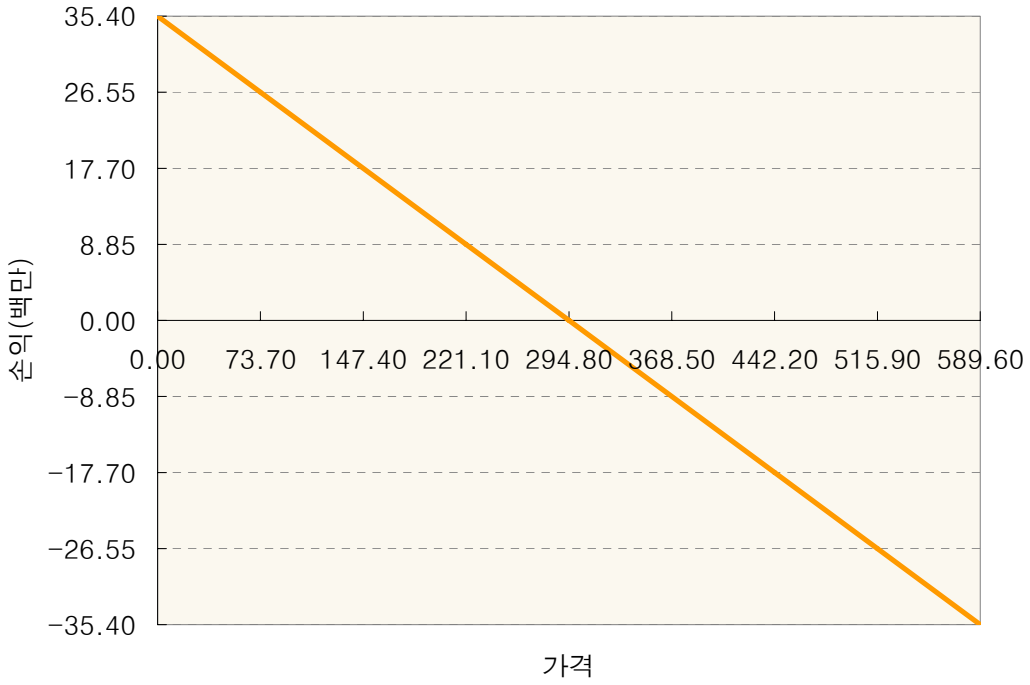


NIH6-SGX NIKKEI 225 STOCK INDEX FUTURE (SGX)





TWG6-SGX MSCI TAIWAN INDEX FUTURE 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
TWG6	SGX MSCI TAIWAN INDEX FUTURE FEB16	3

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

(단위:백만원)

17

공시일	2016-02-15
기준일	2016-02-12

차이나인덱스(주식-파생형)(종)

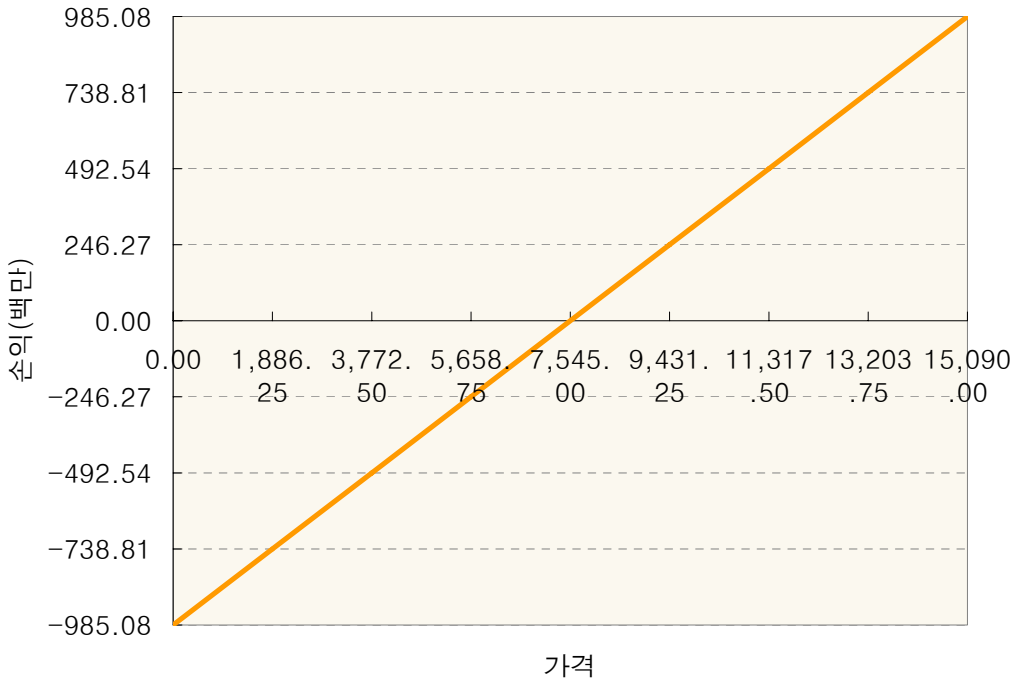
1. 계약금액

(단위:백만원)

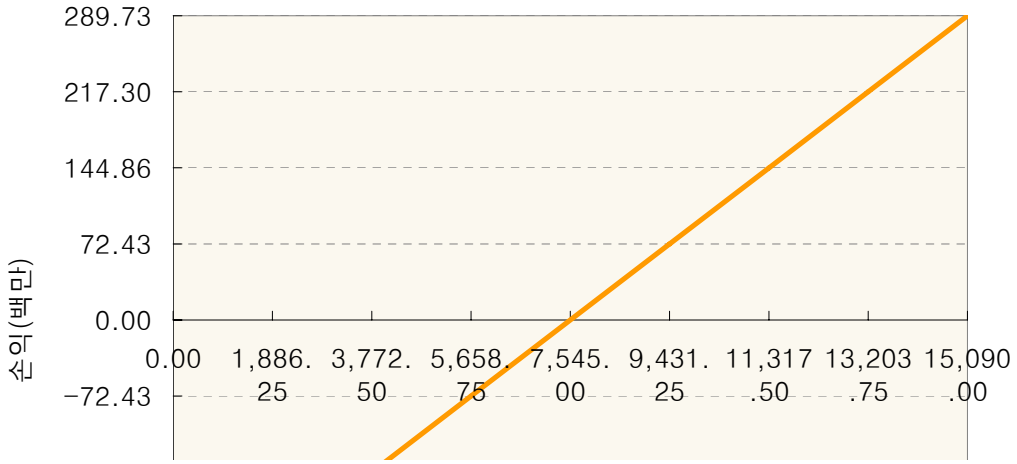
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,275	0	1,275	장내

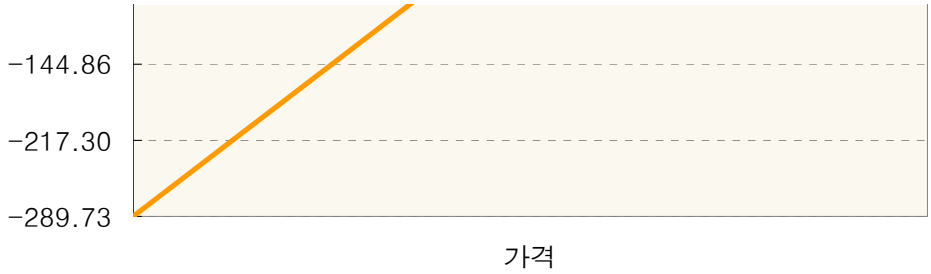
2. 만기시점의 손익구조

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	79
MHCG6	HKG MINI HANG SENG CHINA H-SHR IDX FUT F	23

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

(단위:백만원)

143

공시일	2016-02-15
기준일	2016-02-12

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	749

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

616

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-02-15
기준일	2016-02-12

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	17

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

40

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-02-15
기준일	2016-02-12

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	366
SWCSI50000 신한CSI500미래S12082	113

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,370

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-02-15
기준일	2016-02-12

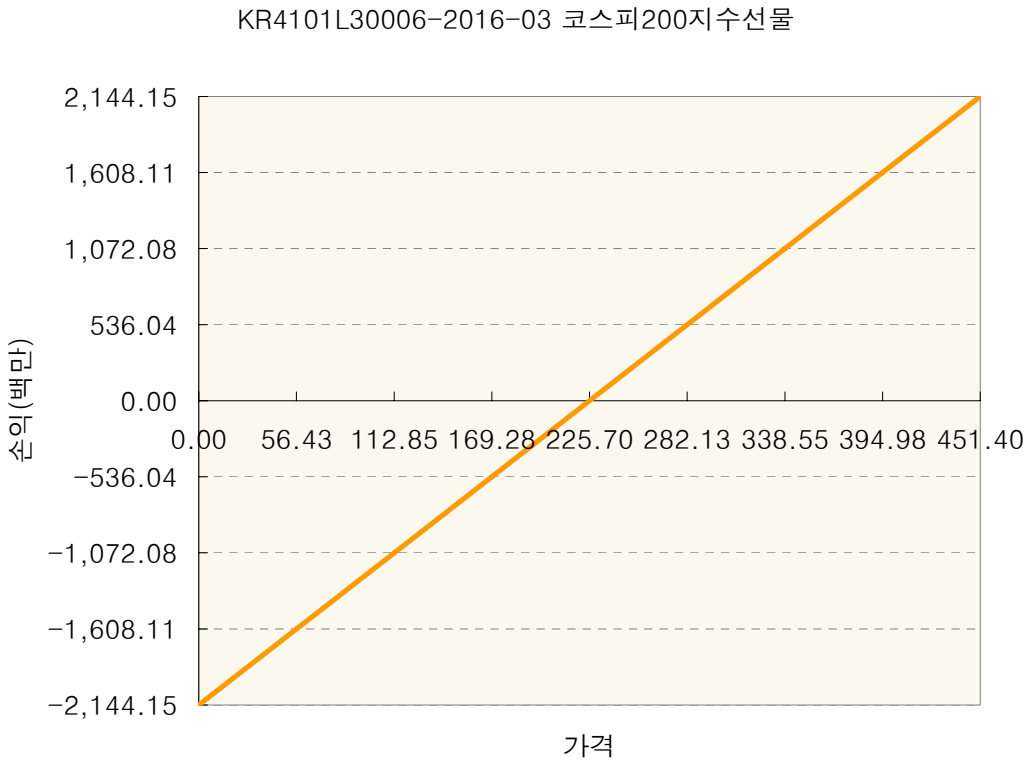
KOSPI200 레버리지 목표전환형 3

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	2,144	0	2,144	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물							171
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-171	-171	-171	-171	-171	-171	-171
-5.33%	-114	-114	-114	-114	-114	-114	-114
-2.67%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	57	57	57	57	57	57	57
5.33%	114	114	114	114	114	114	114
8.00%	171	171	171	171	171	171	171

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

139

공시일	2016-02-15
기준일	2016-02-12

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	73
KR65433325 ELS신영증권플랜업(ELS)5447	63
KR65533AF5 ELSNH투자증권(ELS)11930	63
KR65733E15 ELS한국투자증권(ELS)5269	63

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

(단위:백만원)

161

공시일	2016-02-15
기준일	2016-02-12

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	241
KR65533B85 ELSNH투자증권(ELS)11957	254
KR65733FJ5 ELS한국투자증권(ELS)5298	242
KR65933C95 ELS미래에셋증권(ELS)8483	242

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

(단위:백만원)

699

공시일	2016-02-15
기준일	2016-02-12

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	209
KR65433515 ELS신영증권플랜업(ELS)5454	209
KR65533B75 ELSNH투자증권(ELS)11956	251
KR65733FH5 ELS한국투자증권(ELS)5297	209

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

(단위:백만원)

545

공시일	2016-02-15
기준일	2016-02-12

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	178
KR65533446 ELSNH투자증권(ELS)11973	178
KR65733686 ELS한국투자증권(ELS)5319	195
KR65933566 ELS미래에셋증권(ELS)8513	178

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

(단위:백만원)

467

공시일	2016-02-15
기준일	2016-02-12

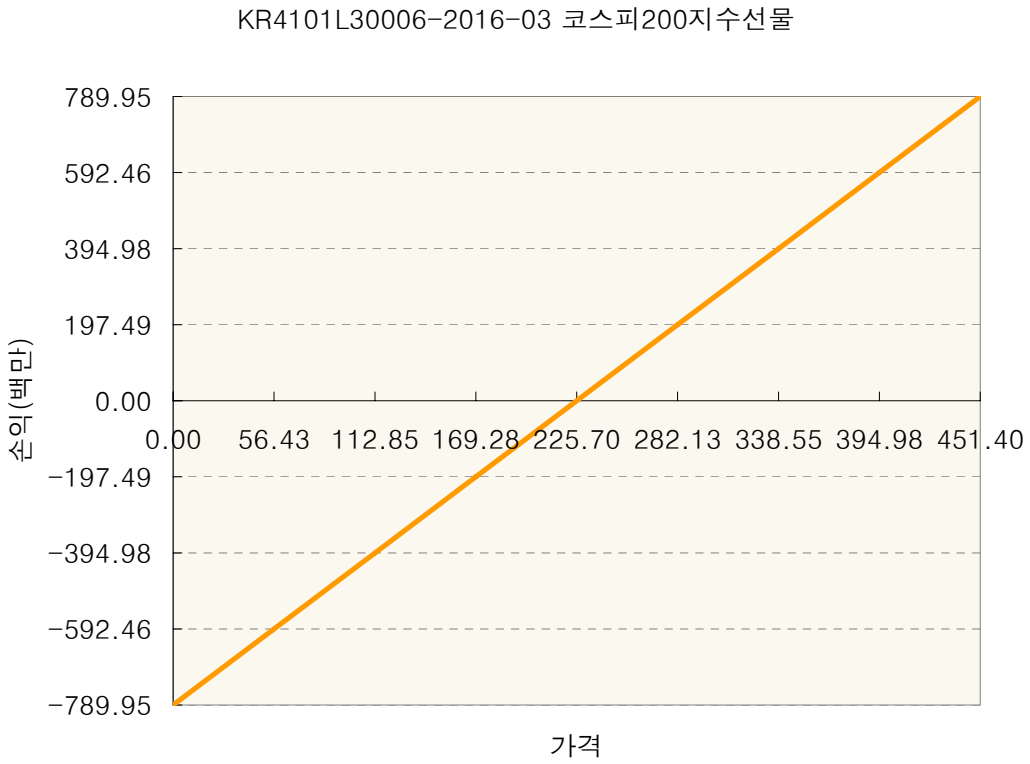
ETF스마트레버리지목표전환형5호

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	790	0	790	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물							63
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
-5.33%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
-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%	42	42	42	42	42	42	42
8.00%	63	63	63	63	63	63	63

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

51

공시일	2016-02-15
기준일	2016-02-12

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	168
KR65433286 ELS신영증권플랜업(ELS)5472	156
KR65533846 ELSNH투자증권(ELS)11987	155
KR65733AL6 ELS한국투자증권(ELS)5343	156

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

(단위:백만원)

380

공시일	2016-02-15
기준일	2016-02-12

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	125
KR65233BD6 ELS대우증권(ELS) 15170	107
KR65533AP6 ELSNH투자증권(ELS) 12036	107
KR65733C46 ELS한국투자증권(ELS) 5359	108

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

(단위:백만원)

264

공시일	2016-02-15
기준일	2016-02-12

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	179
KR65233336 ELS대우증권(ELS)15180	167
KR65533236 ELSNH투자증권(ELS)12056	193
KR65733536 ELS한국투자증권(ELS)5388	173

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

(단위:백만원)

428

공시일	2016-02-15
기준일	2016-02-12

지수연계미래설계SE-12호(ELS-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	8,601	0	8,601	장외
누계	유가증권	ELS	8,601	0	8,601	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR65133626 ELS대신증권(ELS) 6401	225
KR65233676 ELS대우증권(ELS) 15190	224
KR65533526 ELSNH투자증권(ELS) 12077	224
KR65733986 ELS한국투자증권(ELS) 5399	246

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

(단위:백만원)

479

공시일	2016-02-15
기준일	2016-02-12

메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

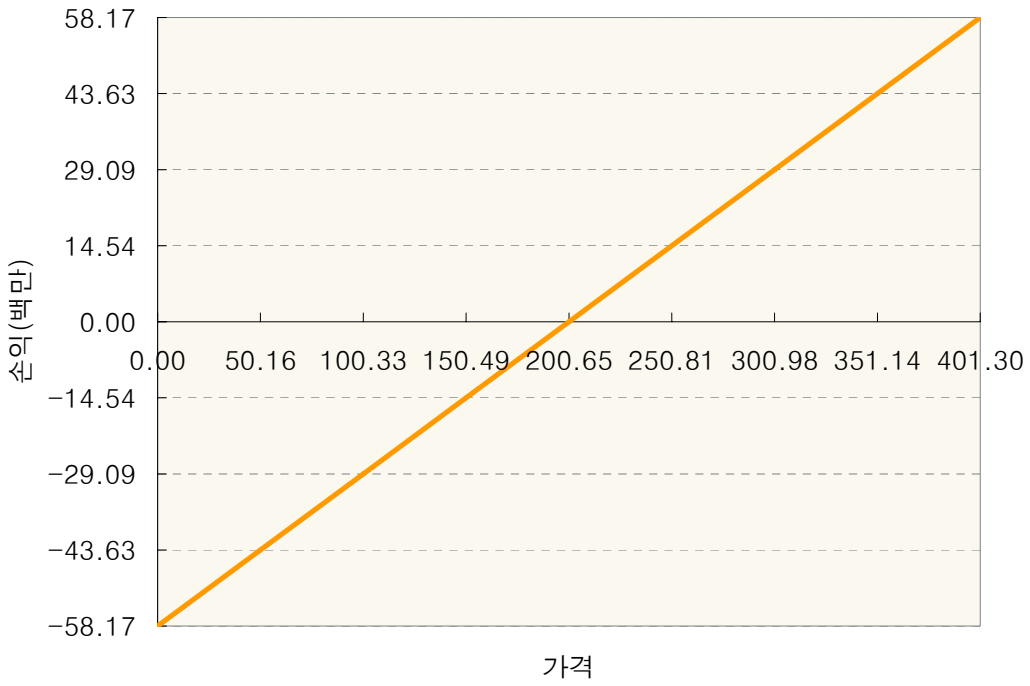
1. 계약금액

(단위:백만원)

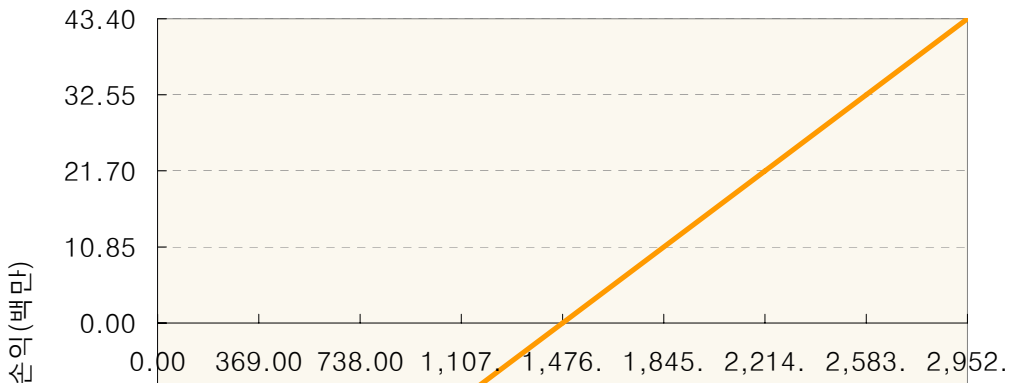
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	57	0	57	
누계	유가증권	선물	298	0	298	

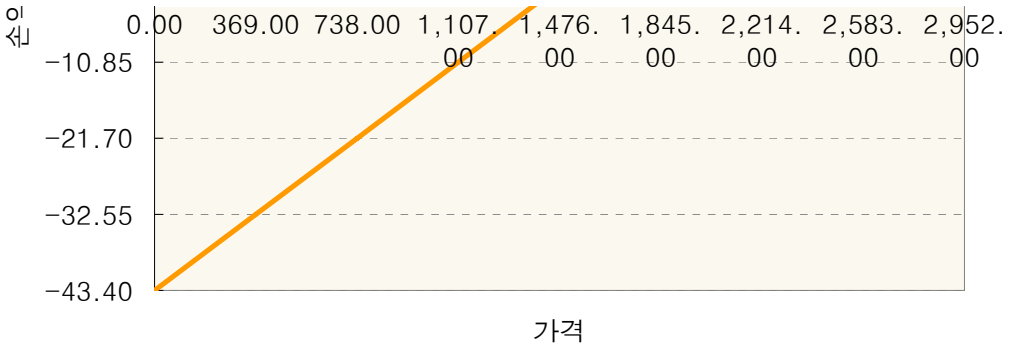
2. 만기시점의 손익구조

HGH6-COPPER FUTURE MAR16

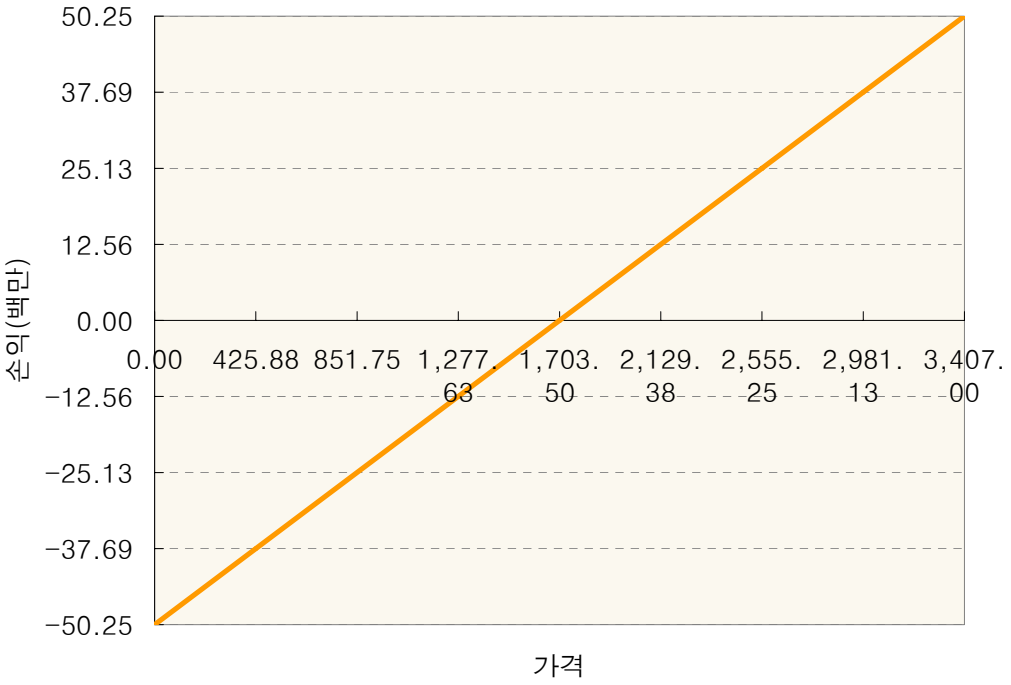


LAH6-LME PRI ALUM FUTR MAR16

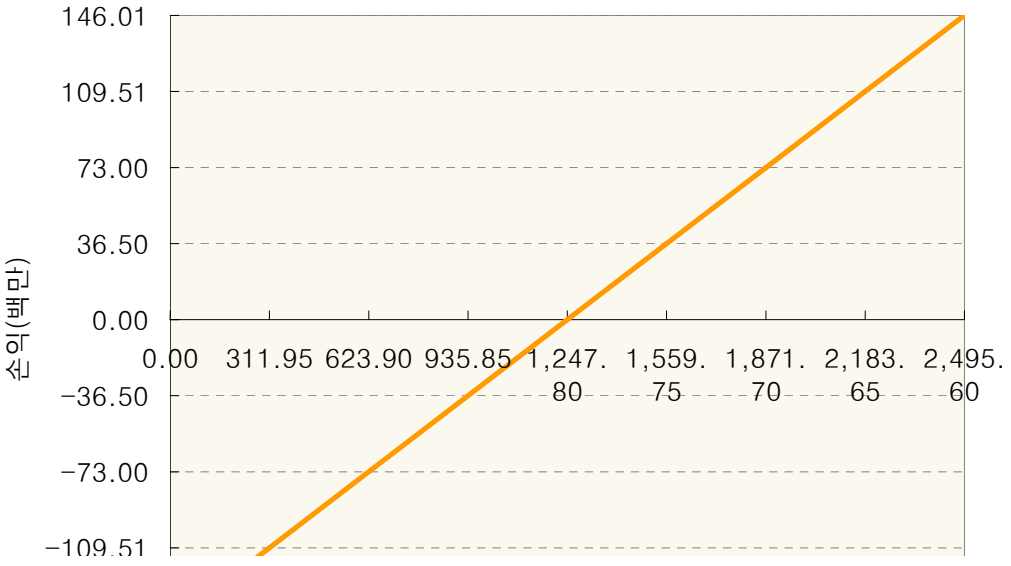


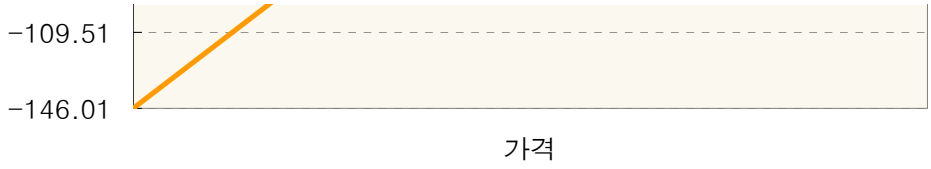


LXH6-LME ZINC FUTURE MAR16

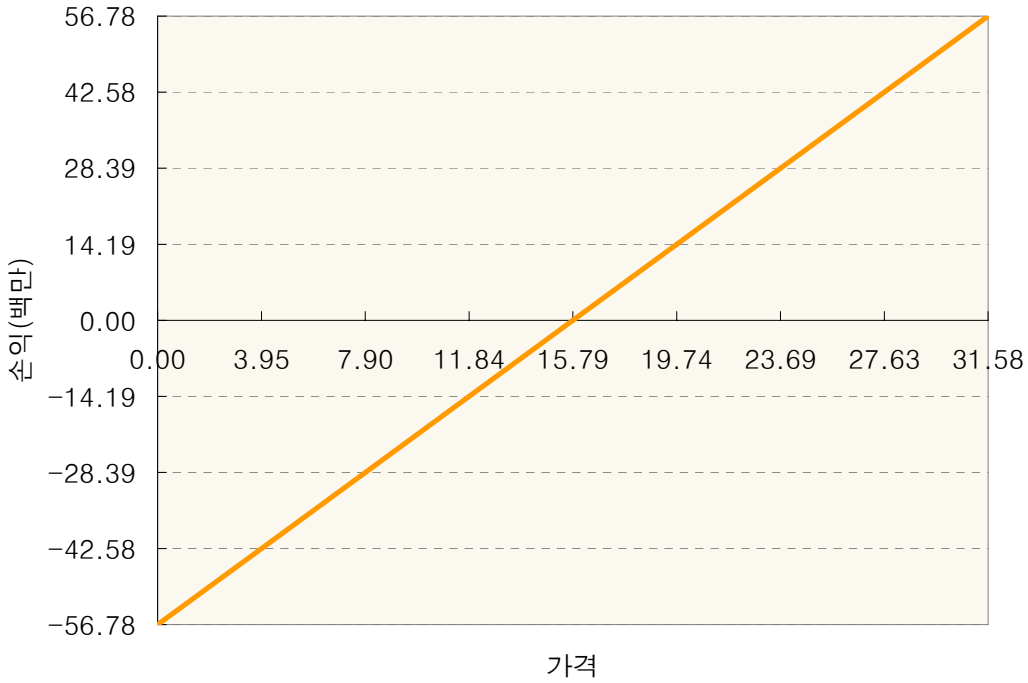


XGJ6-MINI GOLD FUTURE APR16





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	12
YSH6	MINI SILVER FUT MAR16	5

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

(단위:백만원)

29

공시일	2016-02-15
기준일	2016-02-12

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

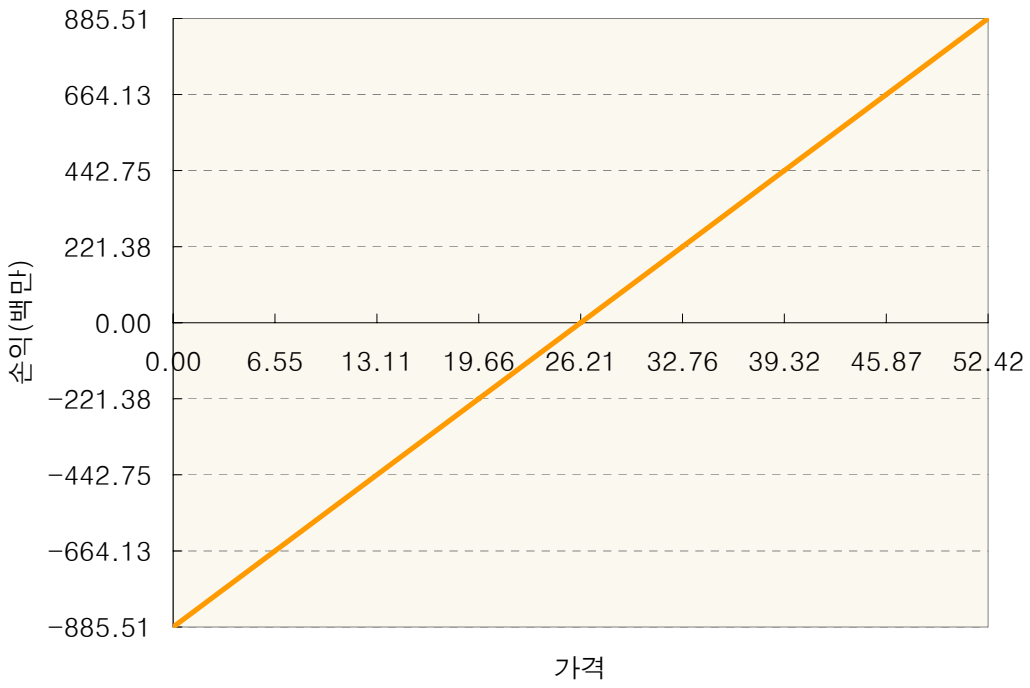
1. 계약금액

(단위:백만원)

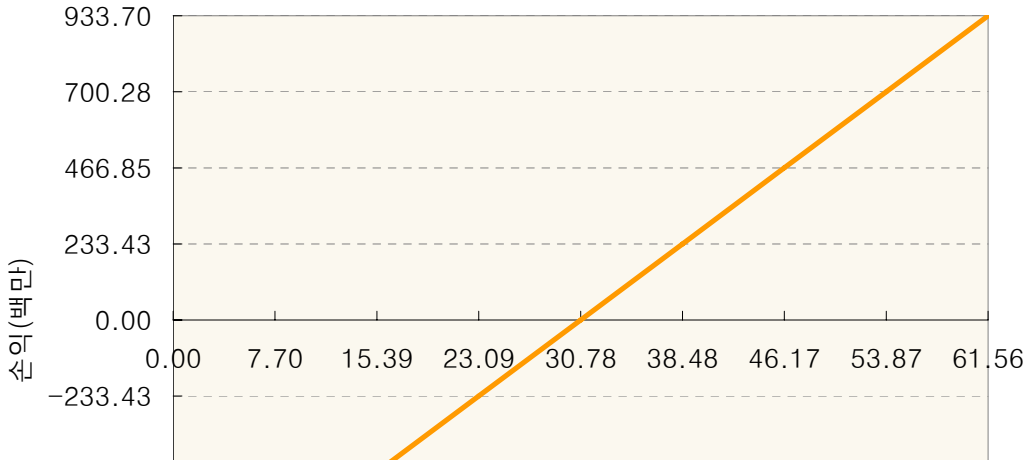
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,842	0	3,842	

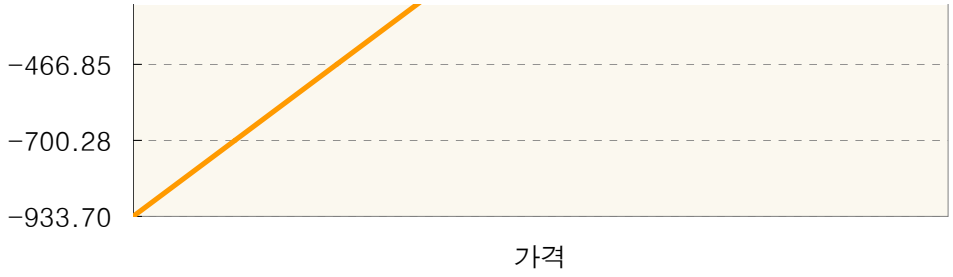
2. 만기시점의 손익구조

CLH6-WTI CRUDE FUTURE MAR16

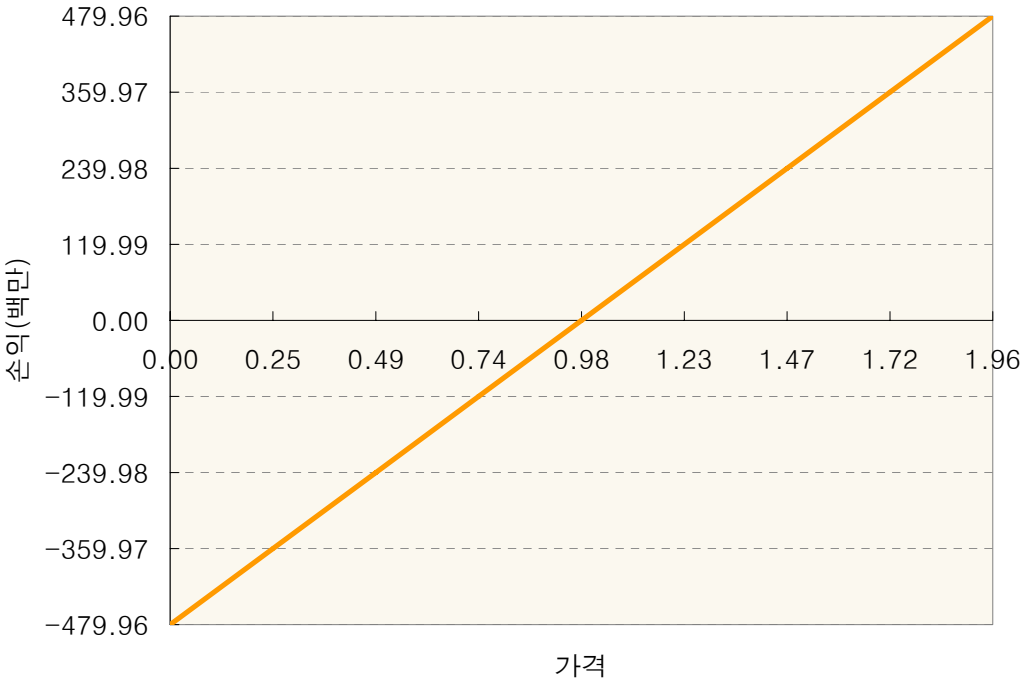


COK6-BRENT CRUDE FUTR MAY16

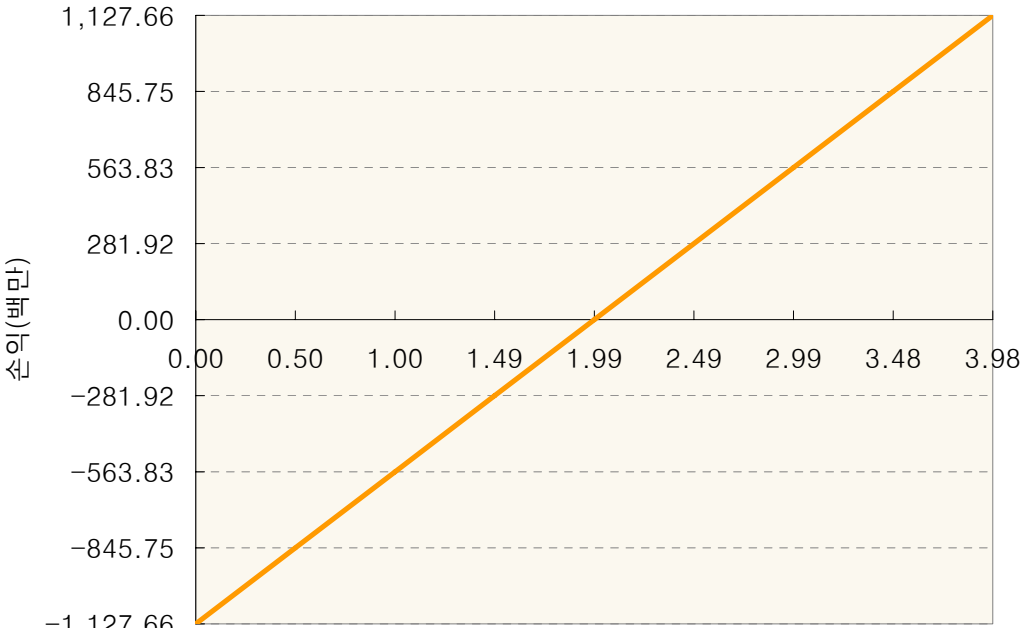


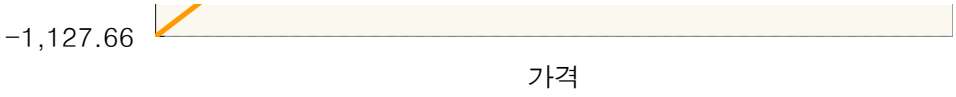


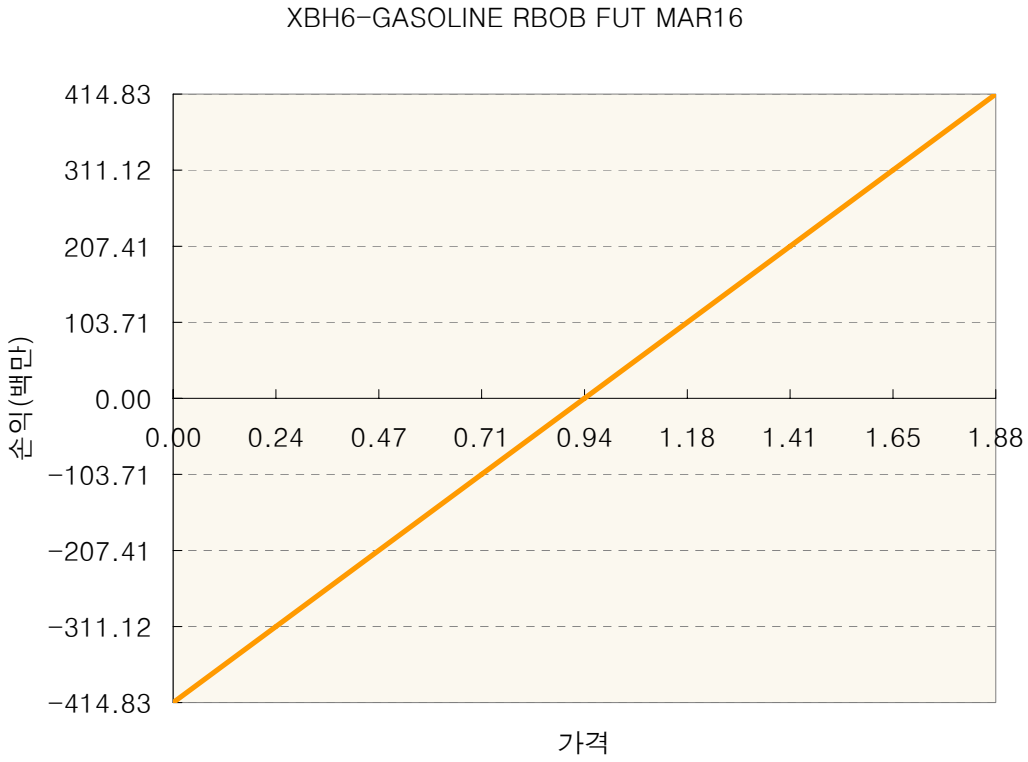
HOH6-NY Harb ULSD Fut MAR16



NGH6-NATURAL GAS FUTR MAR16







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLH6	WTI CRUDE FUTURE MAR16	71
COK6	BRENT CRUDE FUTR MAY16	75
HOH6	NY Harb ULSD Fut MAR16	38
NGH6	NATURAL GAS FUTR MAR16	90
XBH6	GASOLINE RBOB FUT MAR16	33

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

(단위:백만원)

826

공시일	2016-02-15
기준일	2016-02-12

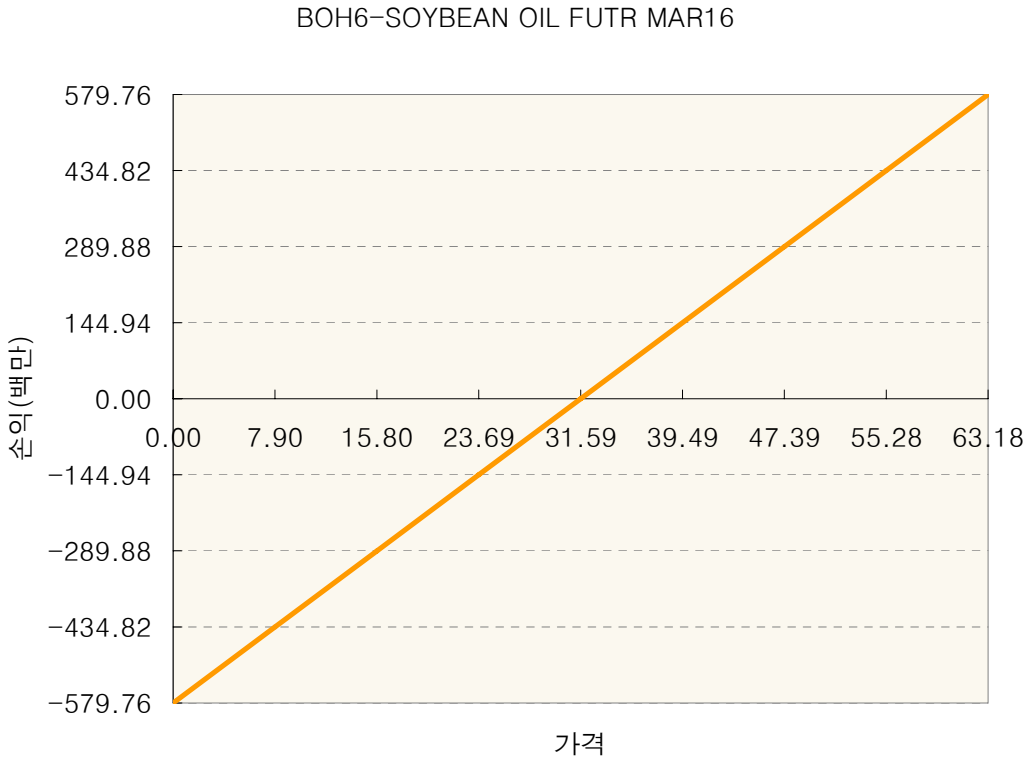
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

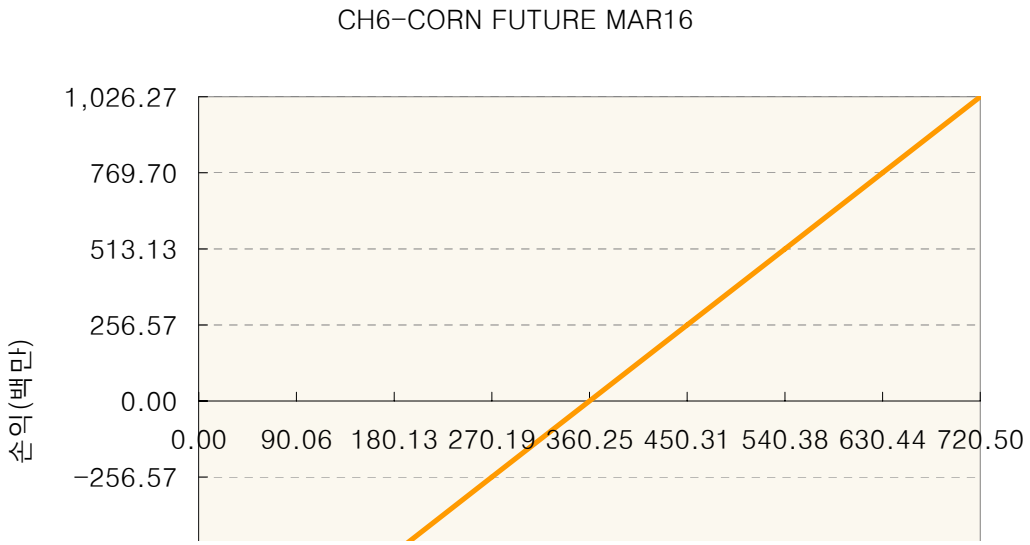
1. 계약금액

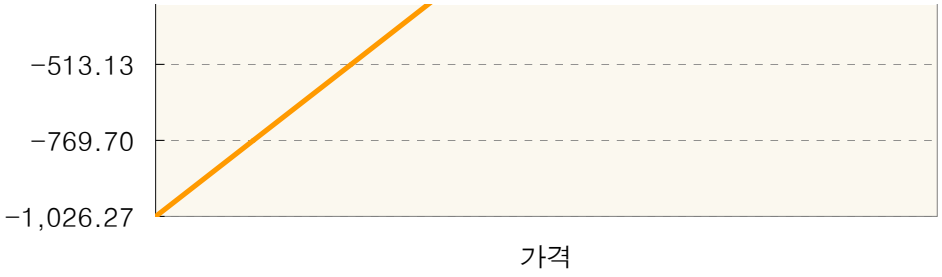
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,049	0	6,049	

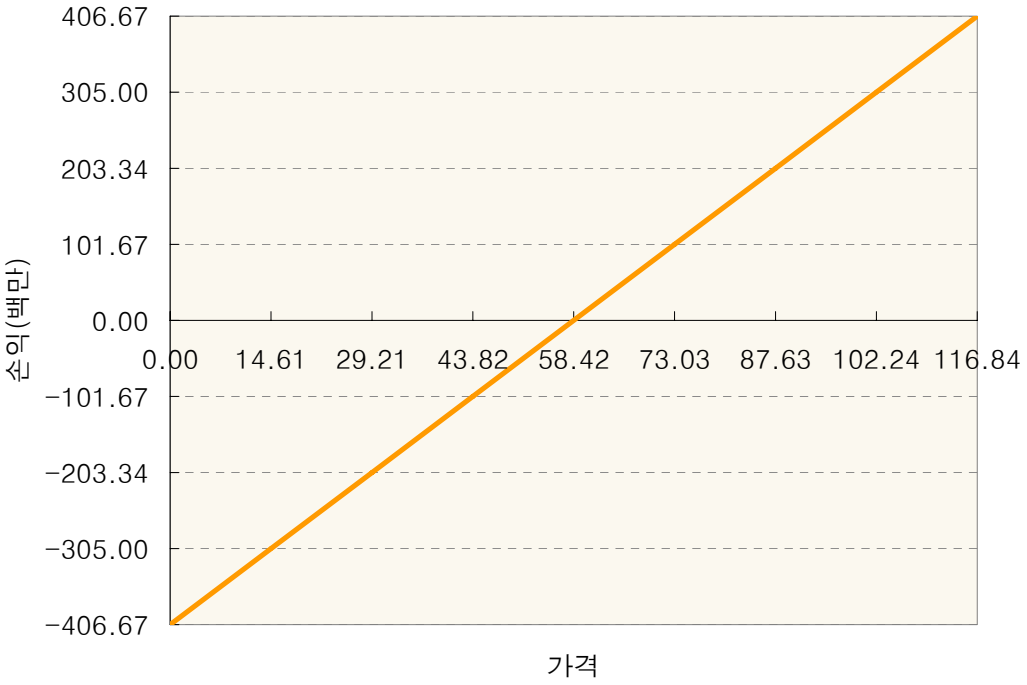
2. 만기시점의 손익구조



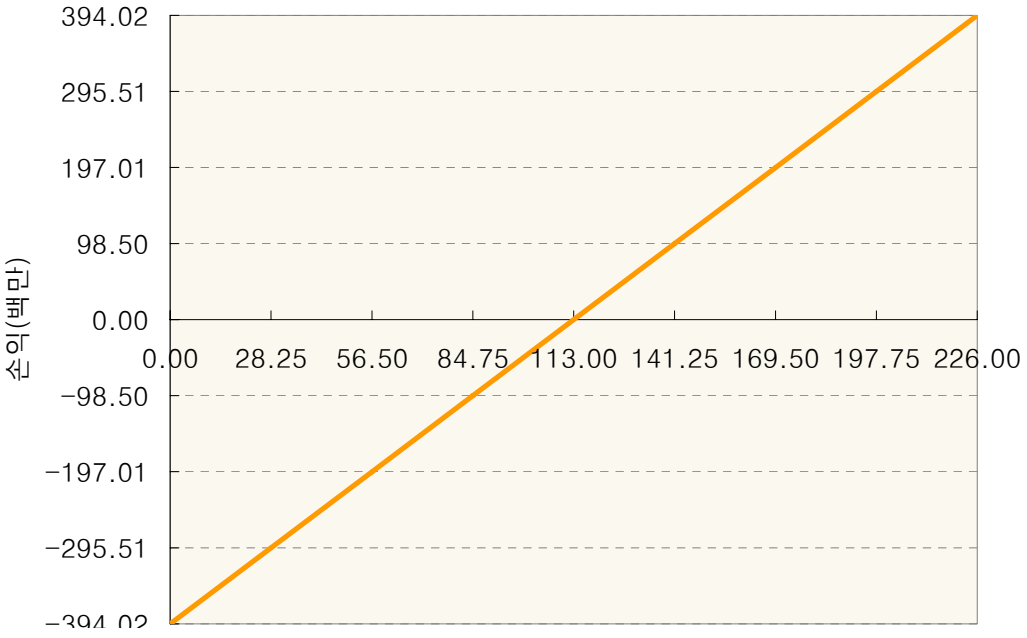


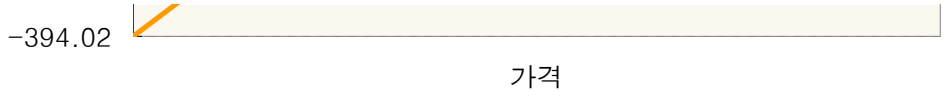


CTH6-COTTON NO.2 FUTR MAR16

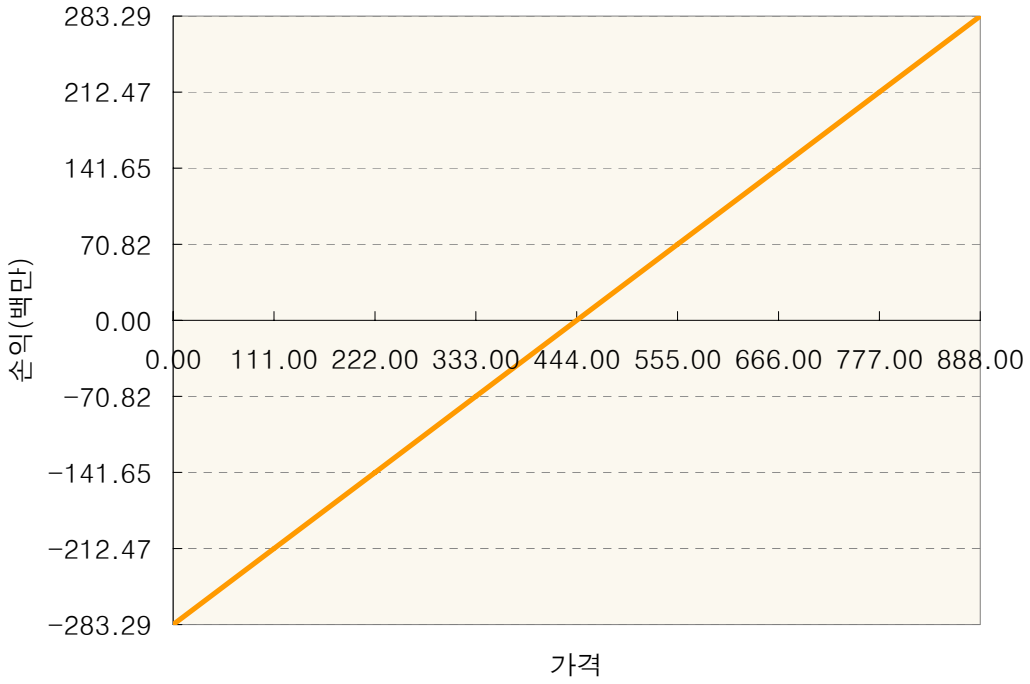


KCH6-COFFEE "C" FUTURE MAR16

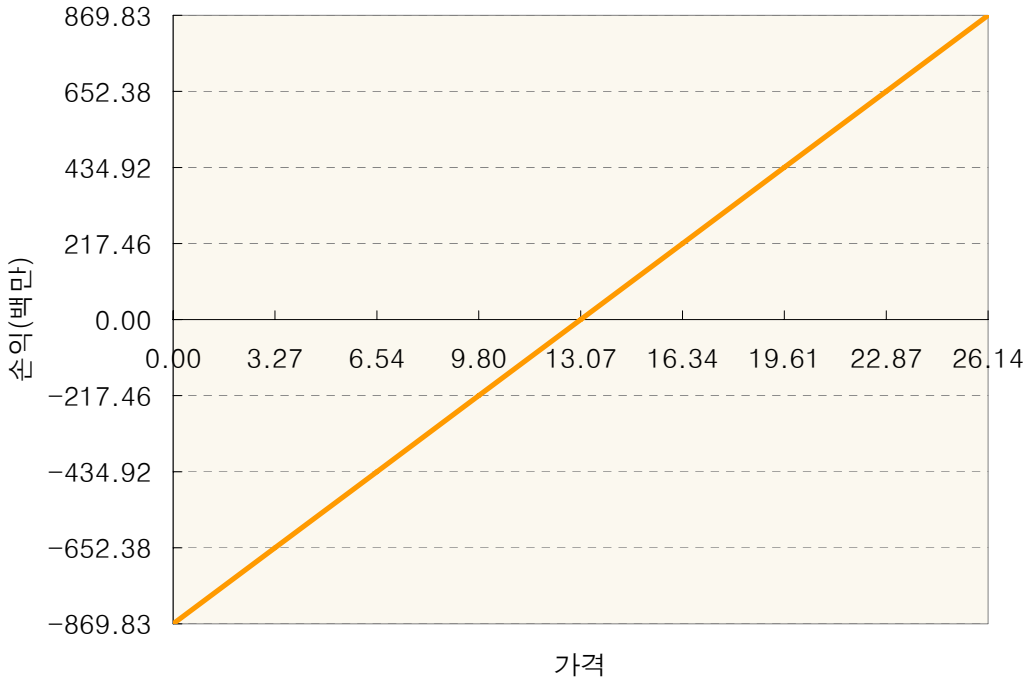




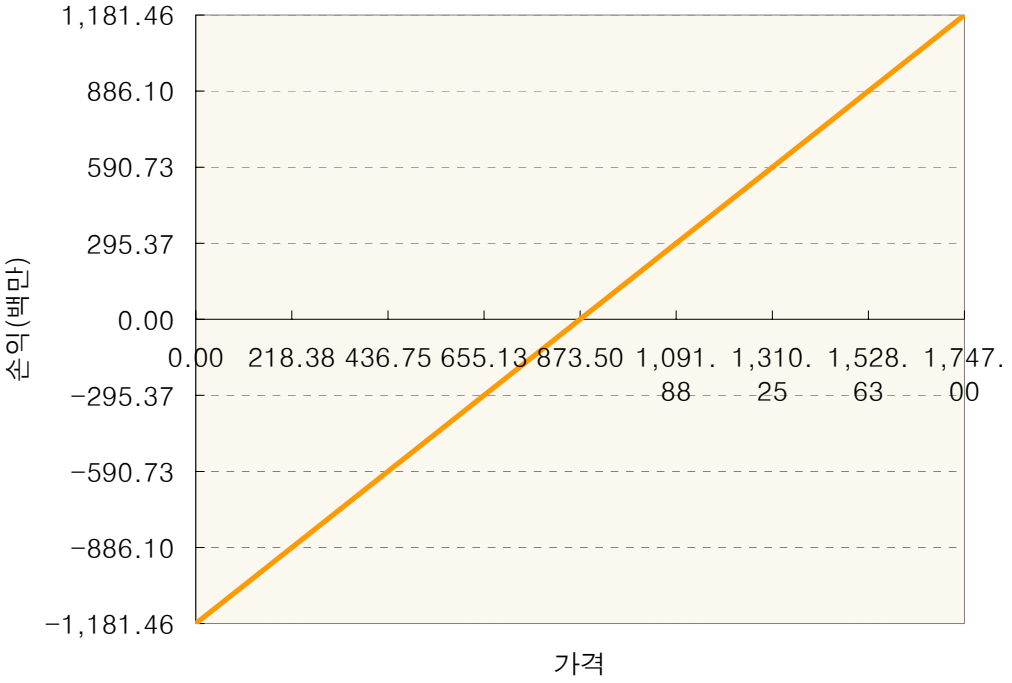
KWH6-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAR16



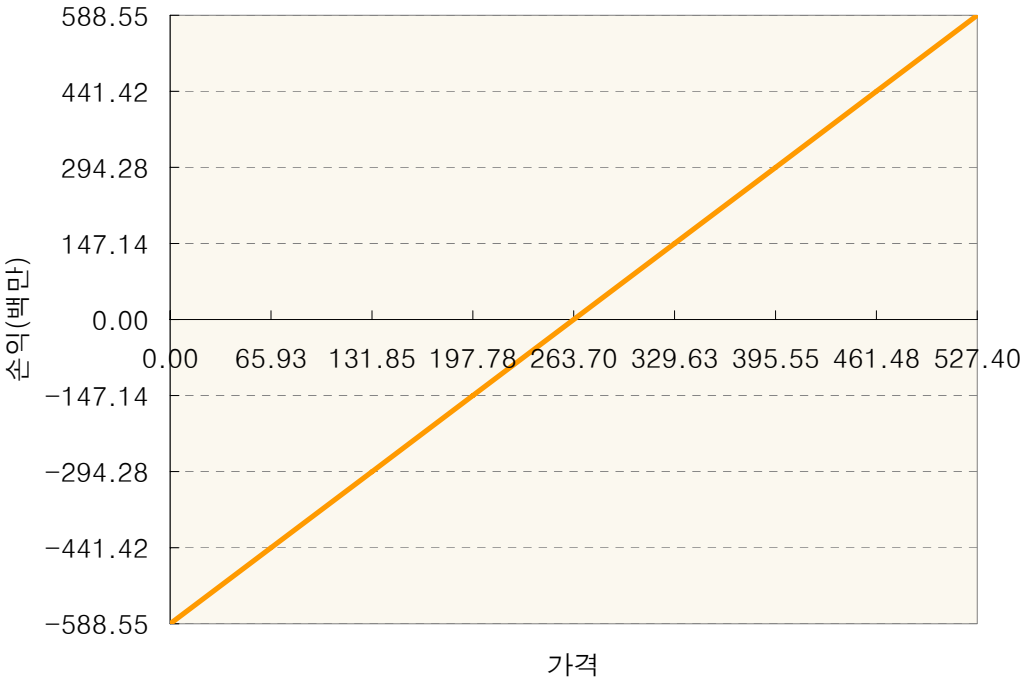
SBH6-Sugar #11 (WORLD) MAR16



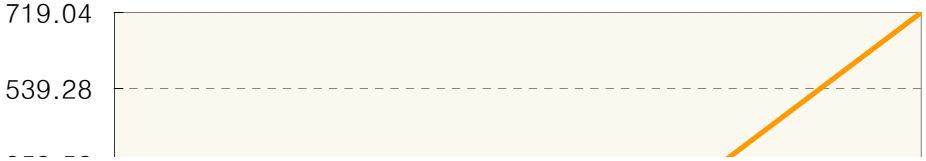
SH6-SOYBEAN FUTURE MAR16

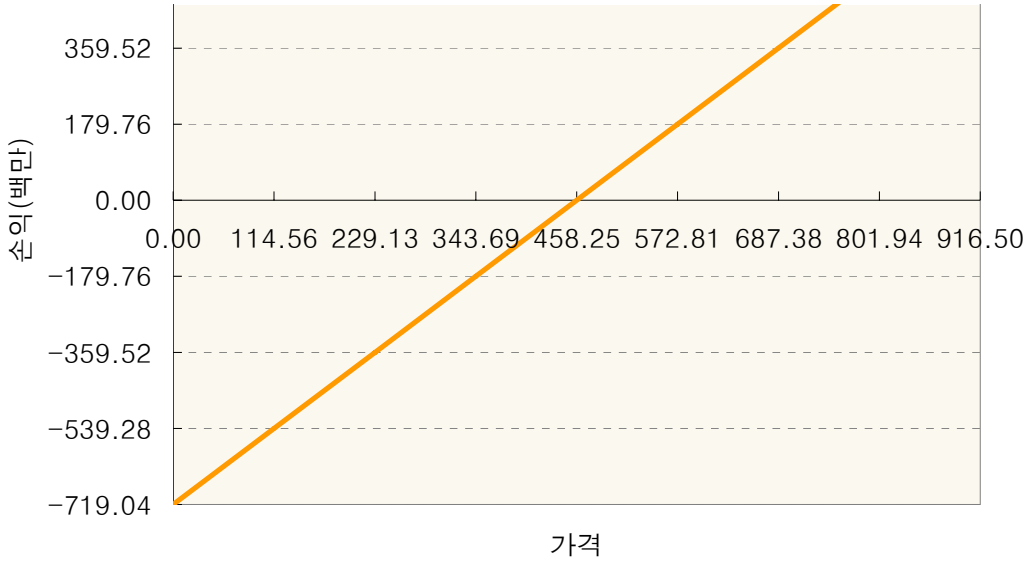


SMH6-SOYBEAN MEAL FUTR MAR16



WH6-WHEAT FUTURE(CBT) MAR16





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH6	SOYBEAN OIL FUTR MAR16	46
CH6	CORN FUTURE MAR16	82
CTH6	COTTON NO.2 FUTR MAR16	33
KCH6	COFFEE "C" FUTURE MAR16	32
KWH6	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAR16	23
SBH6	Sugar #11 (WORLD) MAR16	70
SH6	SOYBEAN FUTURE MAR16	95
SMH6	SOYBEAN MEAL FUTR MAR16	47
WH6	WHEAT FUTURE(CBT) MAR16	58

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

(단위:백만원)

668