공시일	2016-04-25
기준일	2016-04-22

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	2016-04-25
기준일	2016-04-22

스마트인덱스모

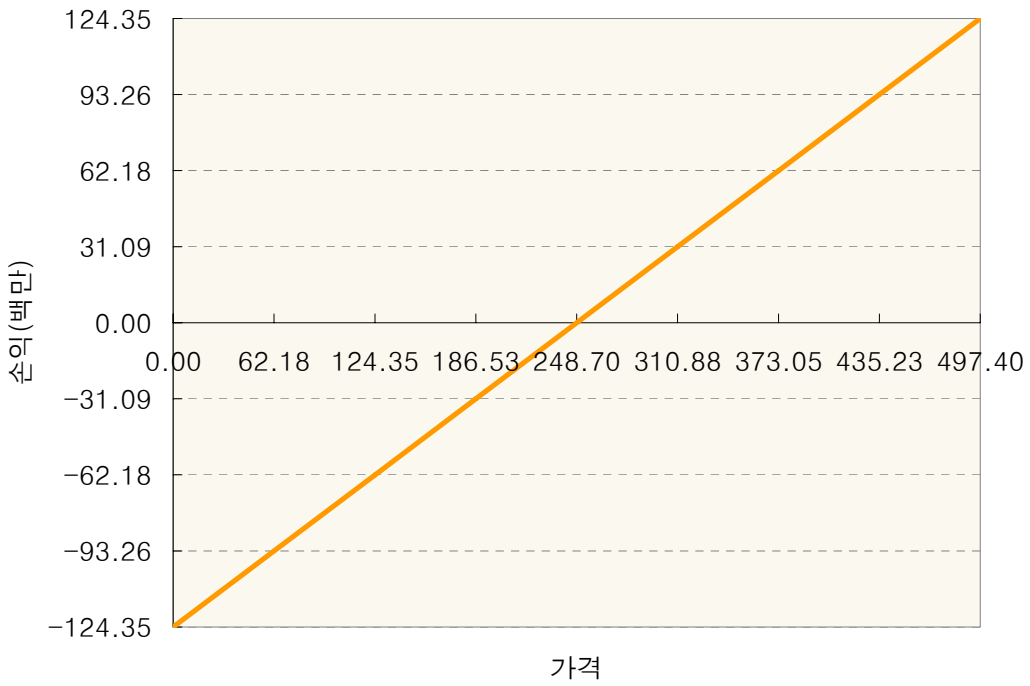
1. 계약금액

(단위:백만원)

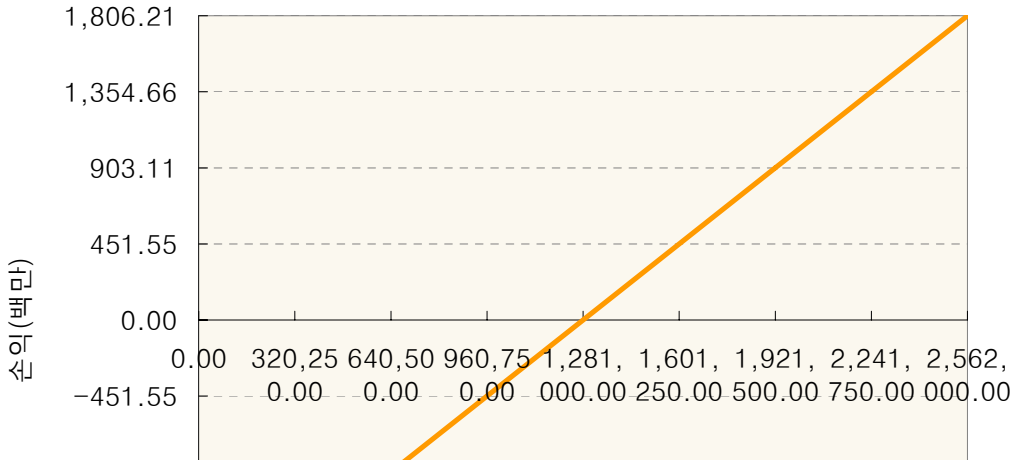
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	77	-77	장내
누계	유가증권	선물	1,931	0	1,931	장내

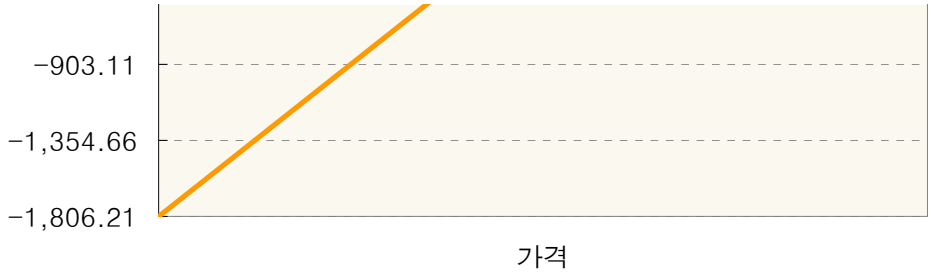
2. 만기시점의 손익구조

KR4101L60003-2016-06 지수선물



KR4111L50003-2016-05 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L600 2016-06 지수선물							10
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	3	3	3	3	3	3	3
5.33%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	10	10	10	10	10	10	10
KR4111L500 2016-05 삼성전자개별선물							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)

146

공시일	2016-04-25
기준일	2016-04-22

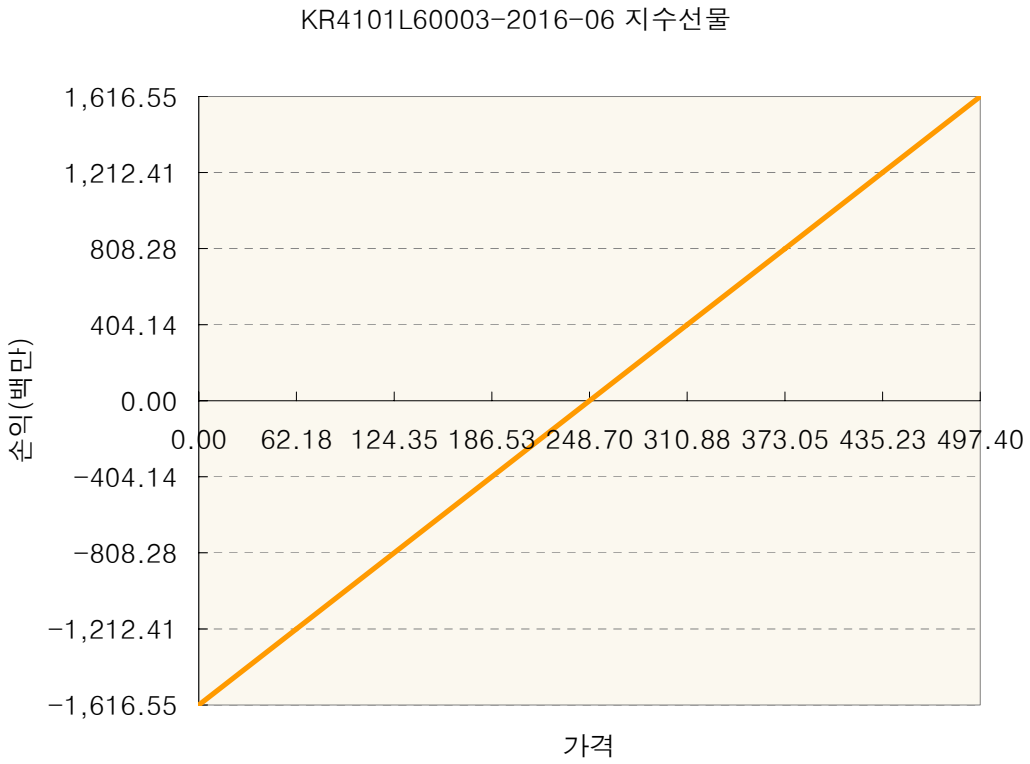
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,617	0	1,617	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L600 2016-06 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)
	106

공시일	2016-04-25
기준일	2016-04-22

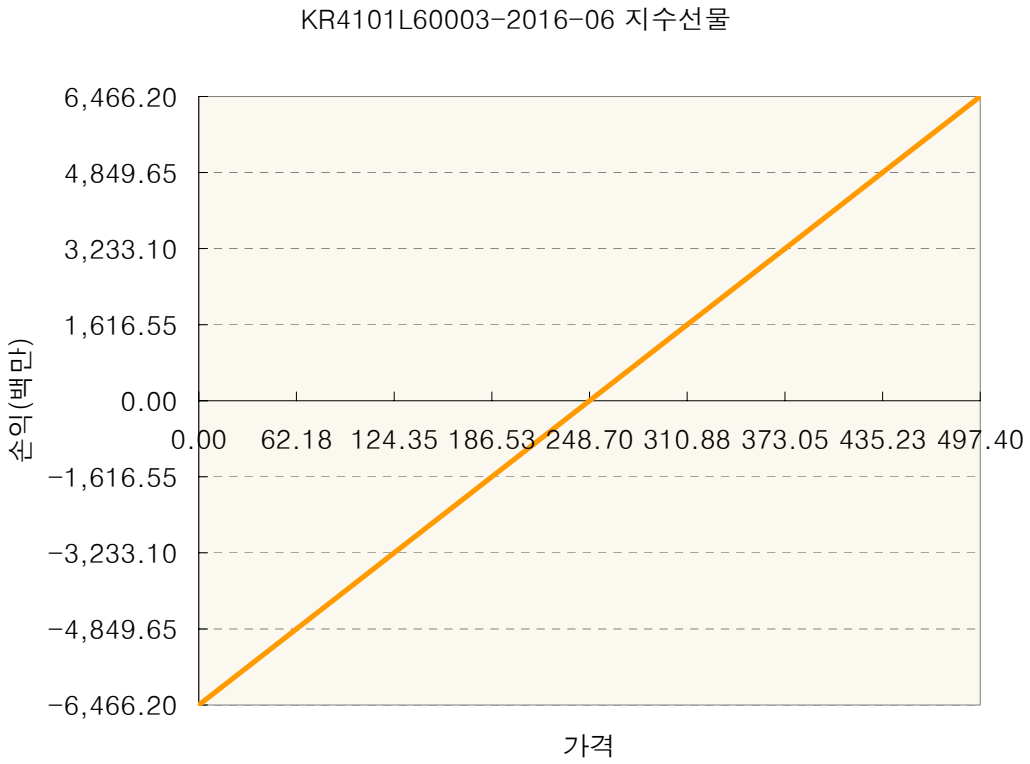
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	124	-124	장내
누계	유가증권	선물	6,466	0	6,466	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L600 2016-06 지수선물 517

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-517	-517	-517	-517	-517	-517	-517
-5.33%	-344	-344	-344	-344	-344	-344	-344
-2.67%	-172	-172	-172	-172	-172	-172	-172
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	172	172	172	172	172	172	172
5.33%	344	344	344	344	344	344	344
8.00%	517	517	517	517	517	517	517

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

424

공시일	2016-04-25
기준일	2016-04-22

아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

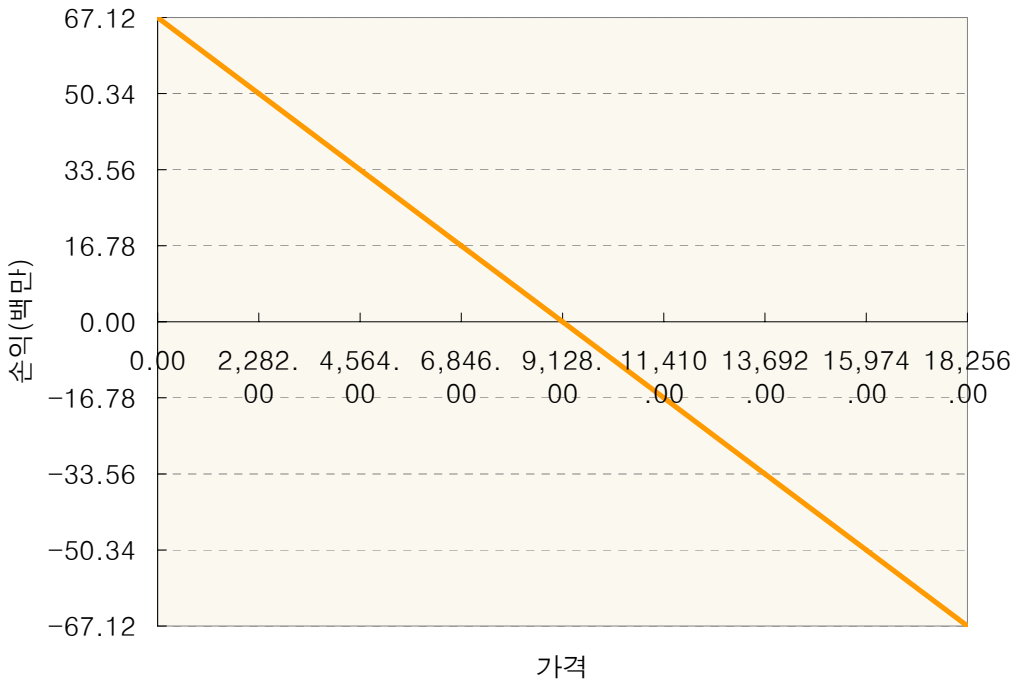
1. 계약금액

(단위:백만원)

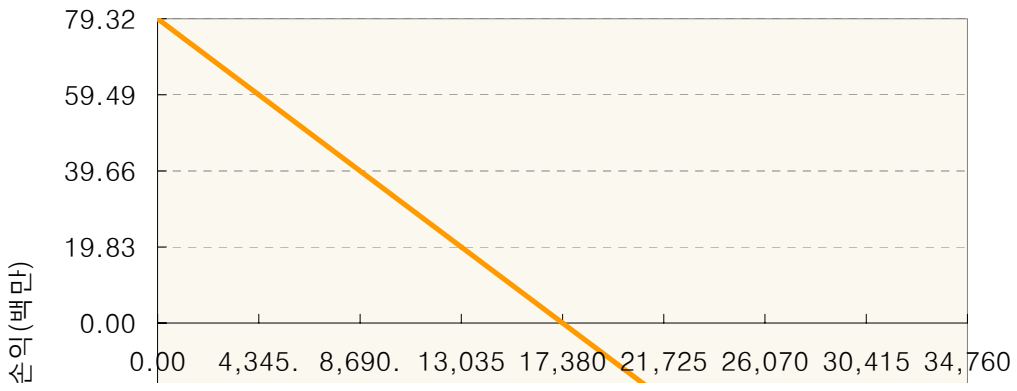
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	139	-139	
누계	유가증권	선물	0	67	-67	장내

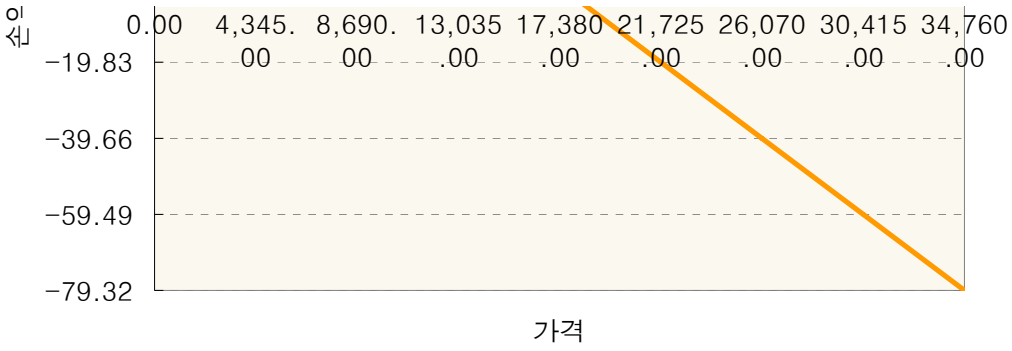
2. 만기시점의 손익구조

HCJ6-H-SHARES IDX FUT Apr16

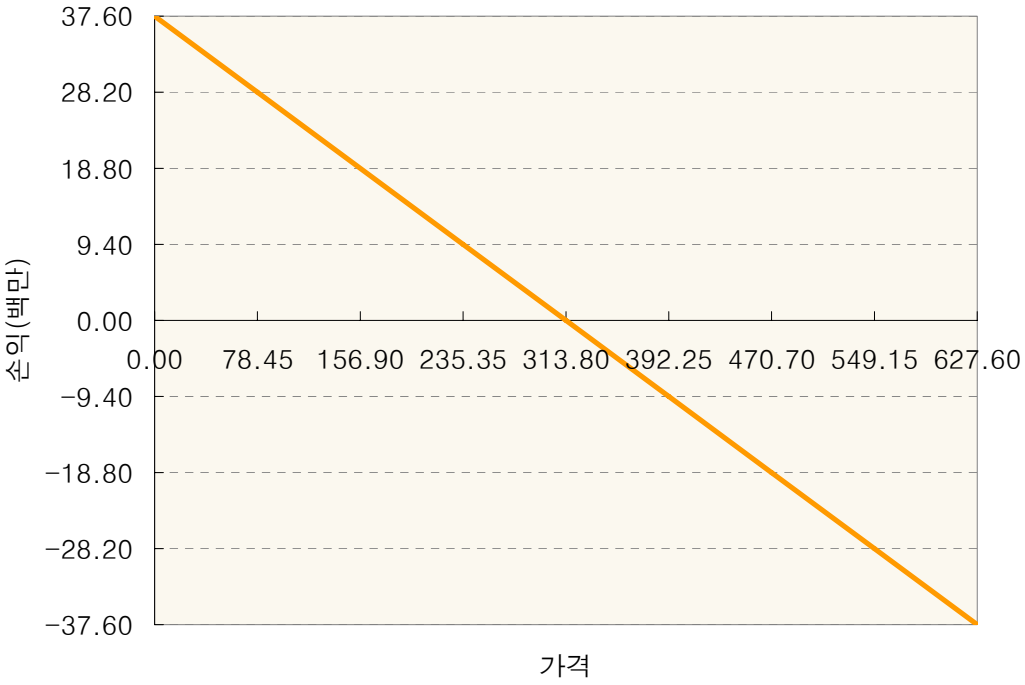


NIM6-NIKKEI 225 (SGX) JUN16

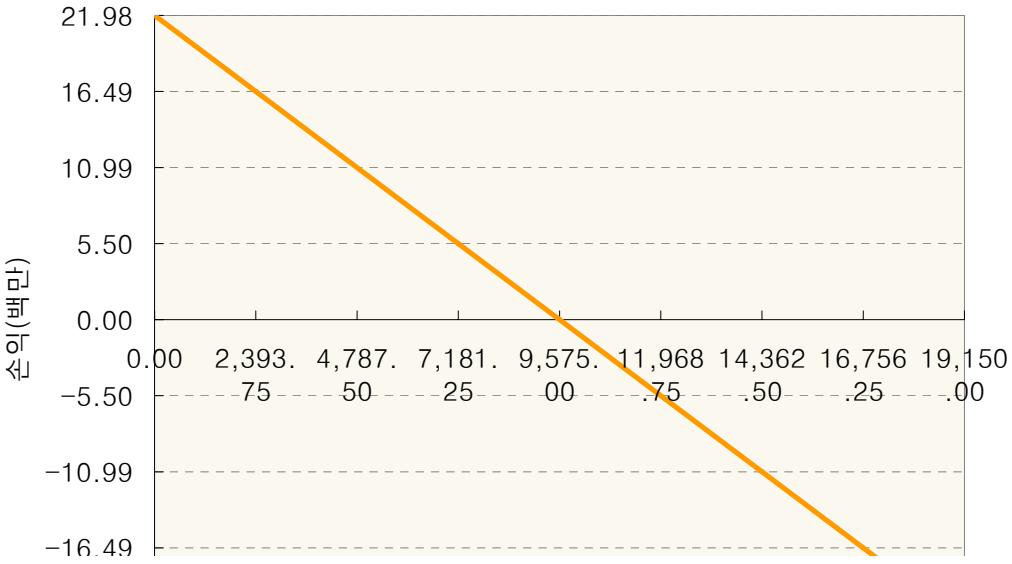


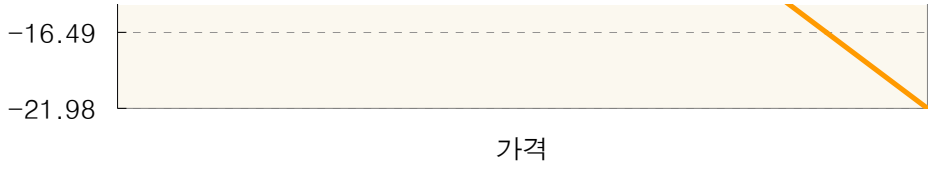


TWJ6-MSCI TAIWAN INDEX Apr16



XUJ6-FTSE CHINA A50 Apr16





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ6	H-SHARES IDX FUT Apr16	5
NIM6	NIKKEI 225 (SGX) JUN16	6
TWJ6	MSCI TAIWAN INDEX Apr16	3
XUJ6	FTSE CHINA A50 Apr16	2

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

(단위:백만원)

22

공시일	2016-04-25
기준일	2016-04-22

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	9,797	0	9,797	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO00(신한MXWO 미래S160222	860

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

737

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-04-25
기준일	2016-04-22

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	6,120	0	6,120	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S160308	391
SWCSI50000 신한CSI500미래S160308-1	122

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,528

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-04-25
기준일	2016-04-22

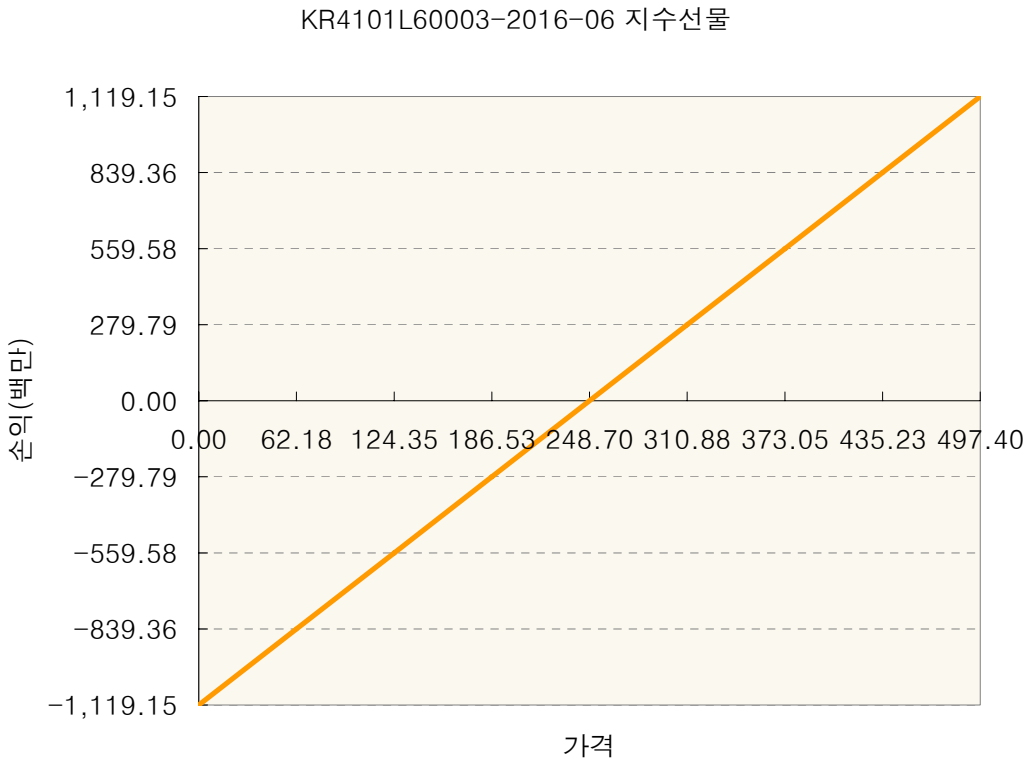
KOSPI200 레버리지 목표전환형 3

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	124	-124	장내
누계	유가증권	선물	1,119	0	1,119	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L600 2016-06 지수선물 89

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-5.33%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	30	30	30	30	30	30	30
5.33%	60	60	60	60	60	60	60
8.00%	89	89	89	89	89	89	89

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

73

공시일	2016-04-25
기준일	2016-04-22

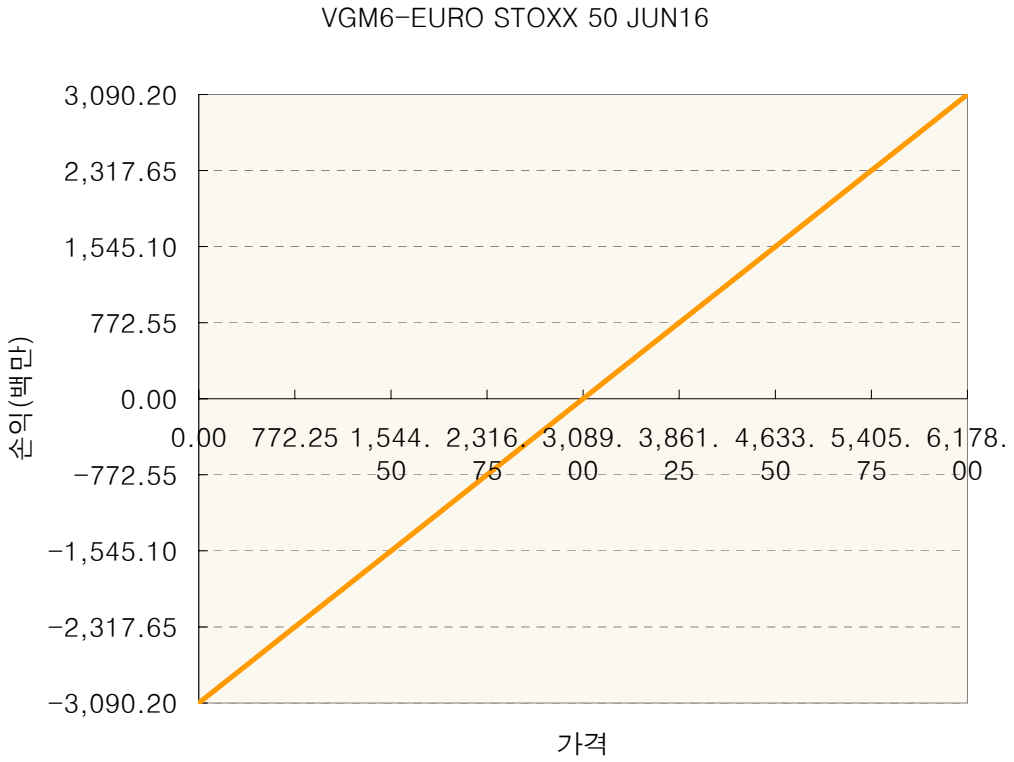
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,090	0	3,090	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM6	EURO STOXX 50 JUN16	247

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

(단위:백만원)

295

공시일	2016-04-25
기준일	2016-04-22

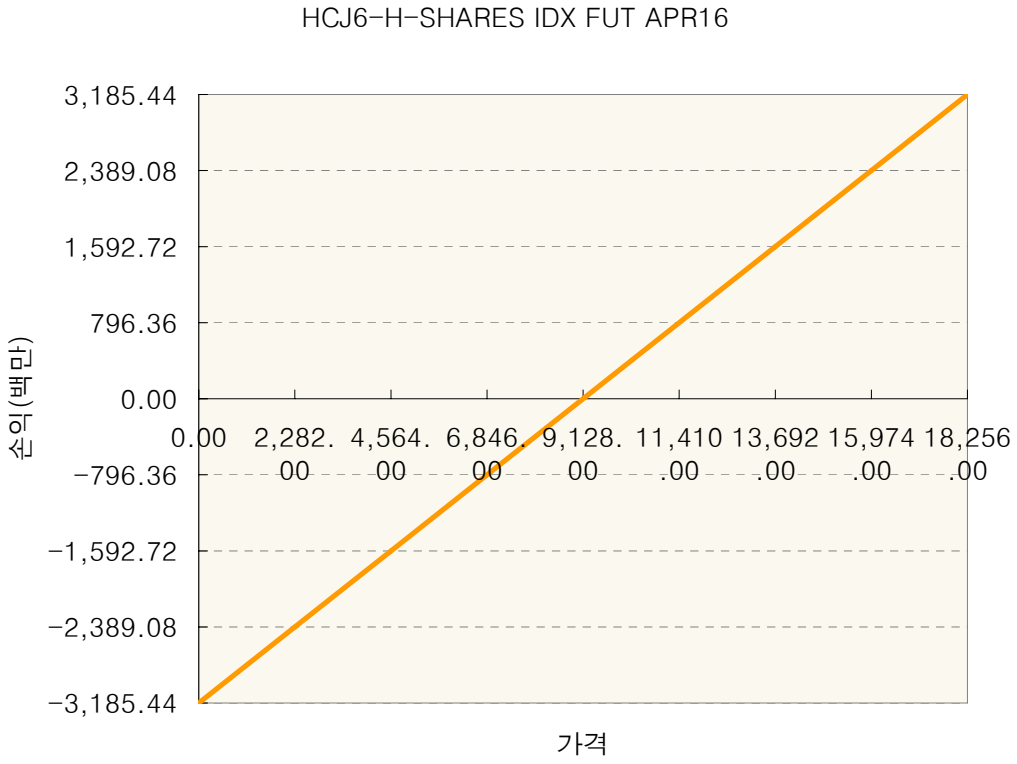
차이나인덱스모(주식-파생형)

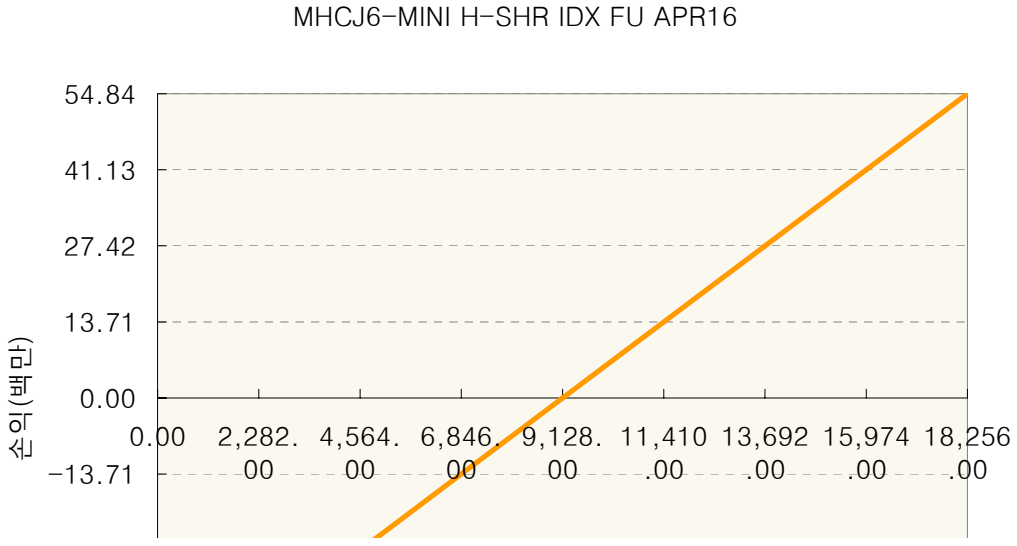
1. 계약금액

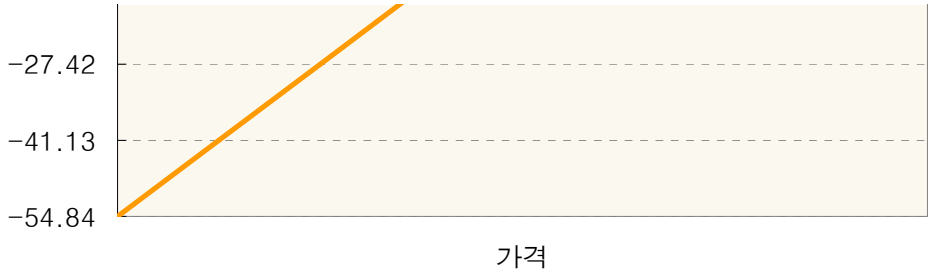
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,240	0	3,240	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ6	H-SHARES IDX FUT APR16	255
MHCJ6	MINI H-SHR IDX FU APR16	4

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

(단위:백만원)

374

공시일	2016-04-25
기준일	2016-04-22

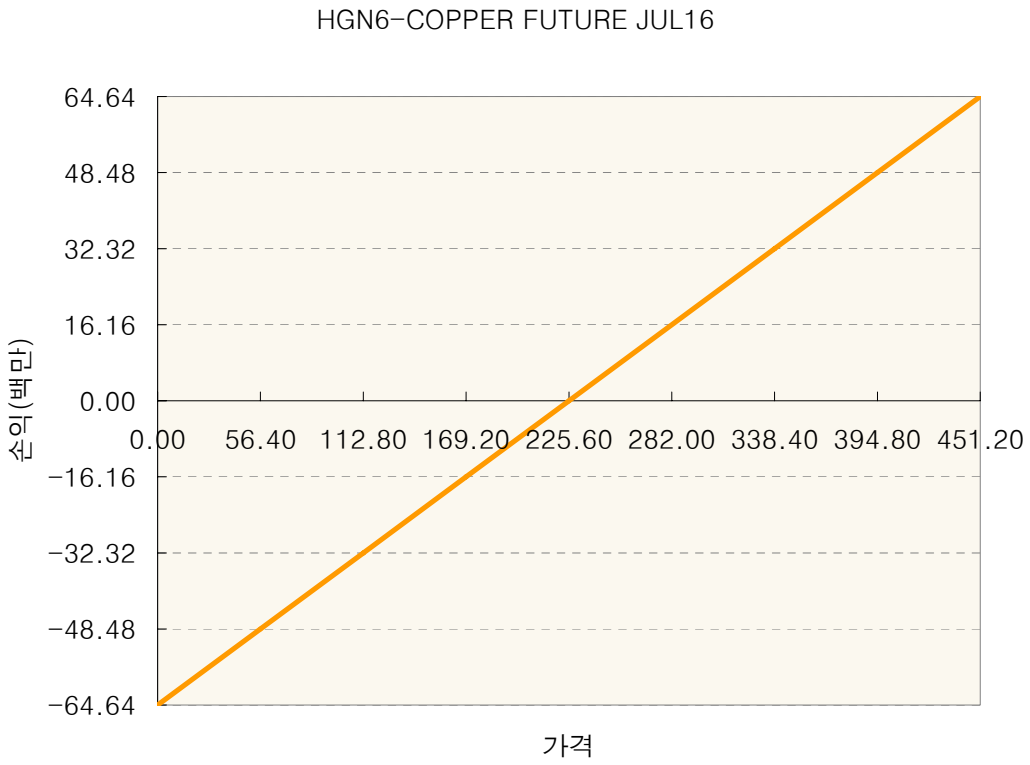
메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

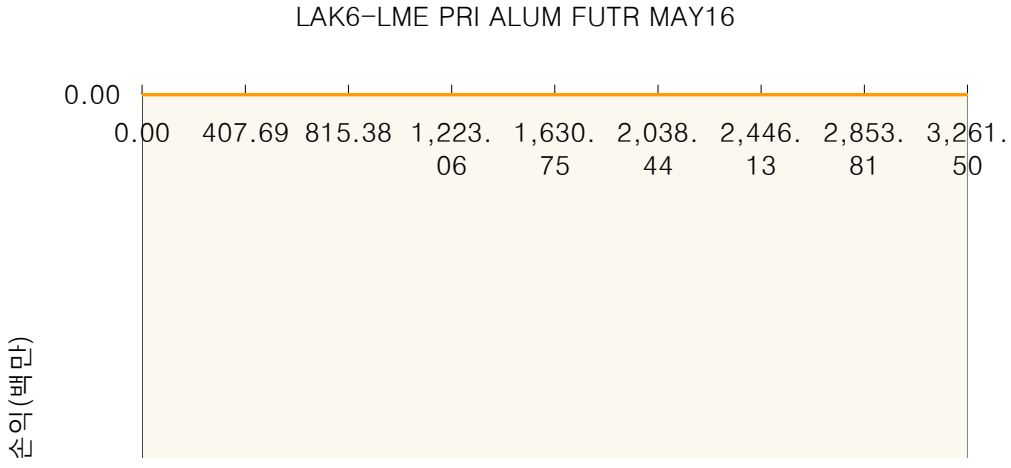
1. 계약금액

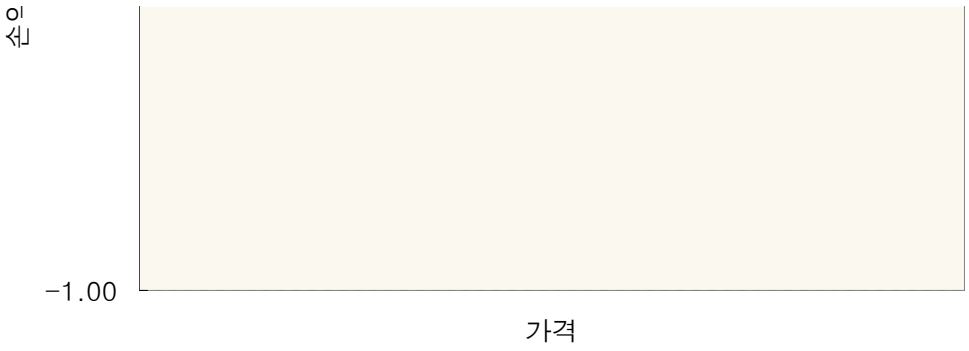
(단위:백만원)

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	59	0	59	
누계	유가증권	선물	416	95	321	

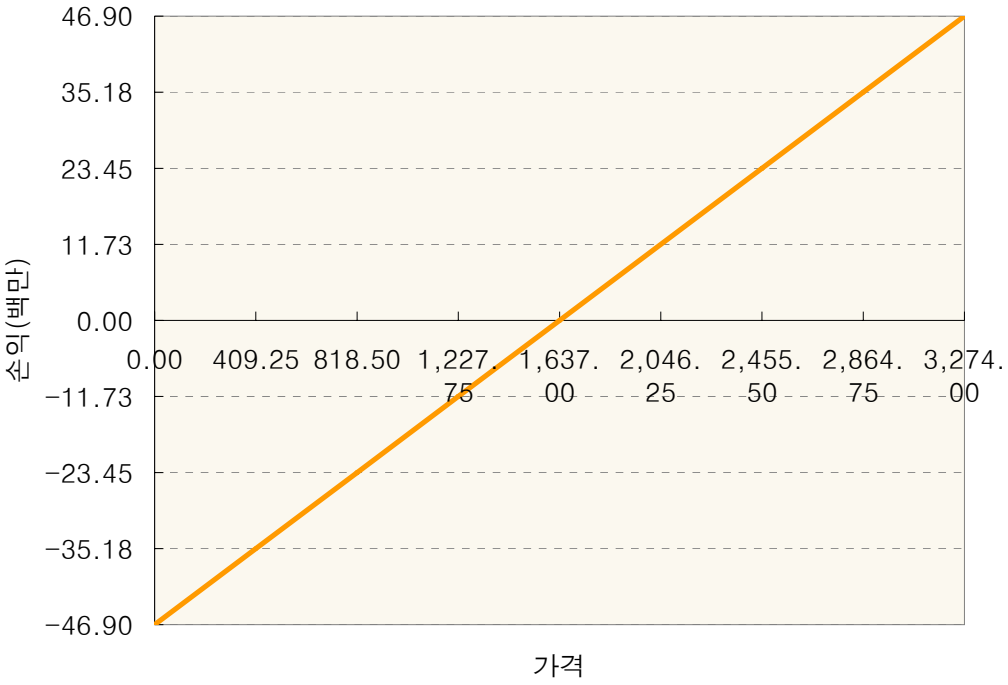
2. 만기시점의 손익구조



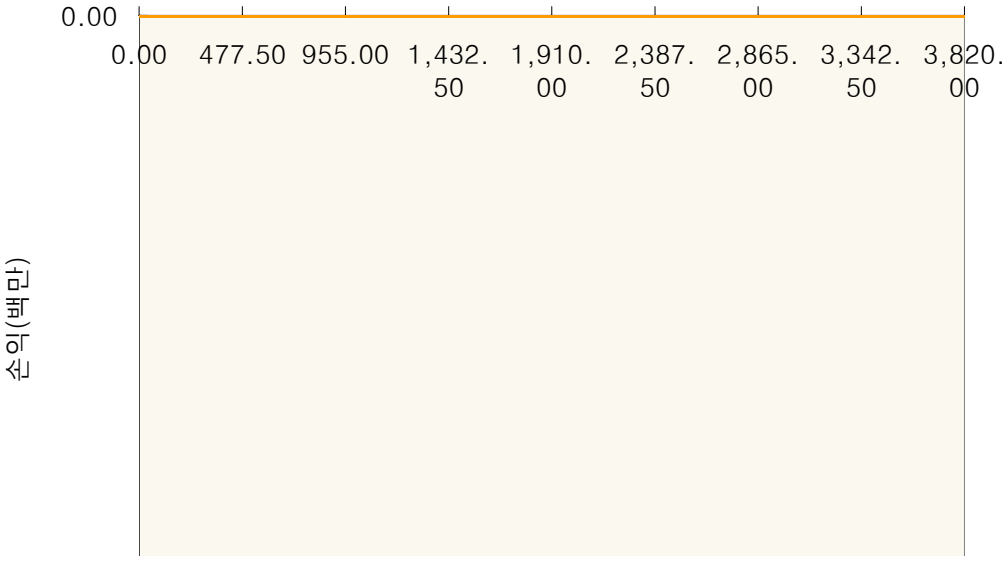


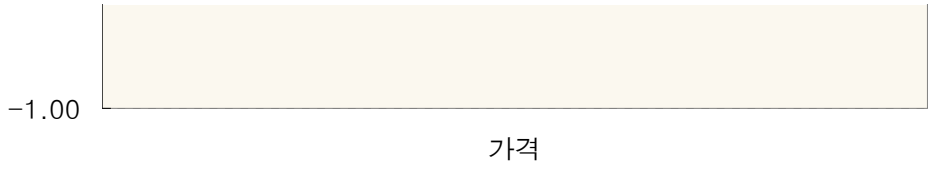


LAN6-LME PRI ALUM FUTR JUL16



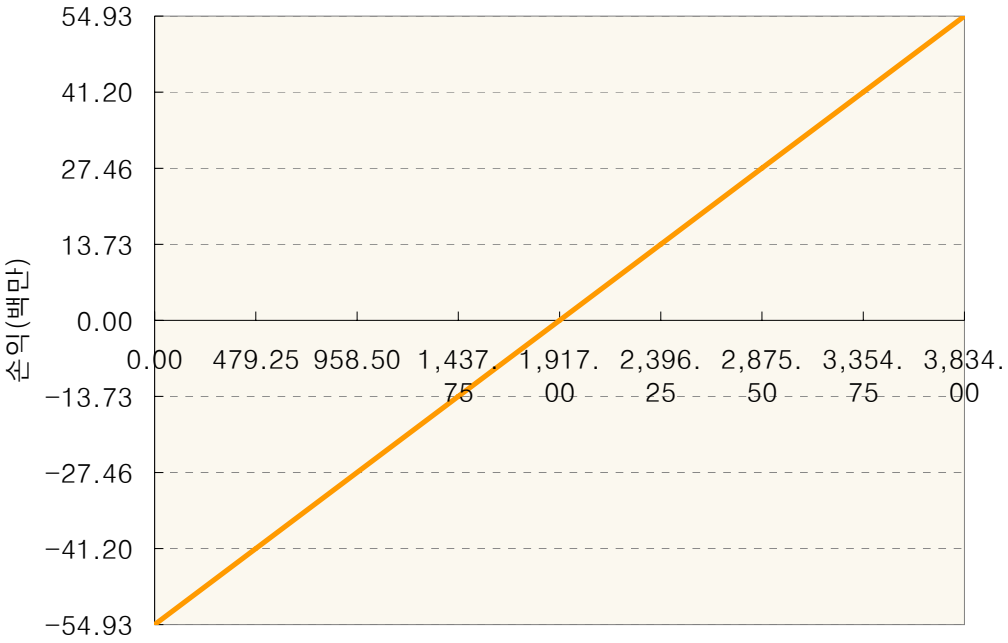
LXK6-LME ZINC FUTURE MAY16





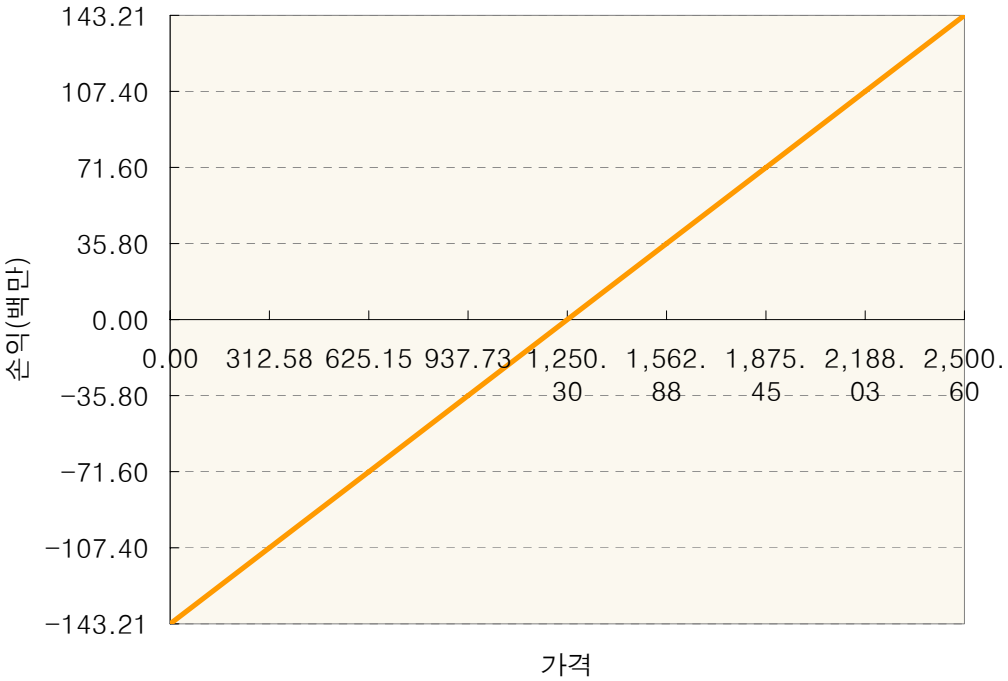
가격

LXN6-LME ZINC FUTURE JUL16

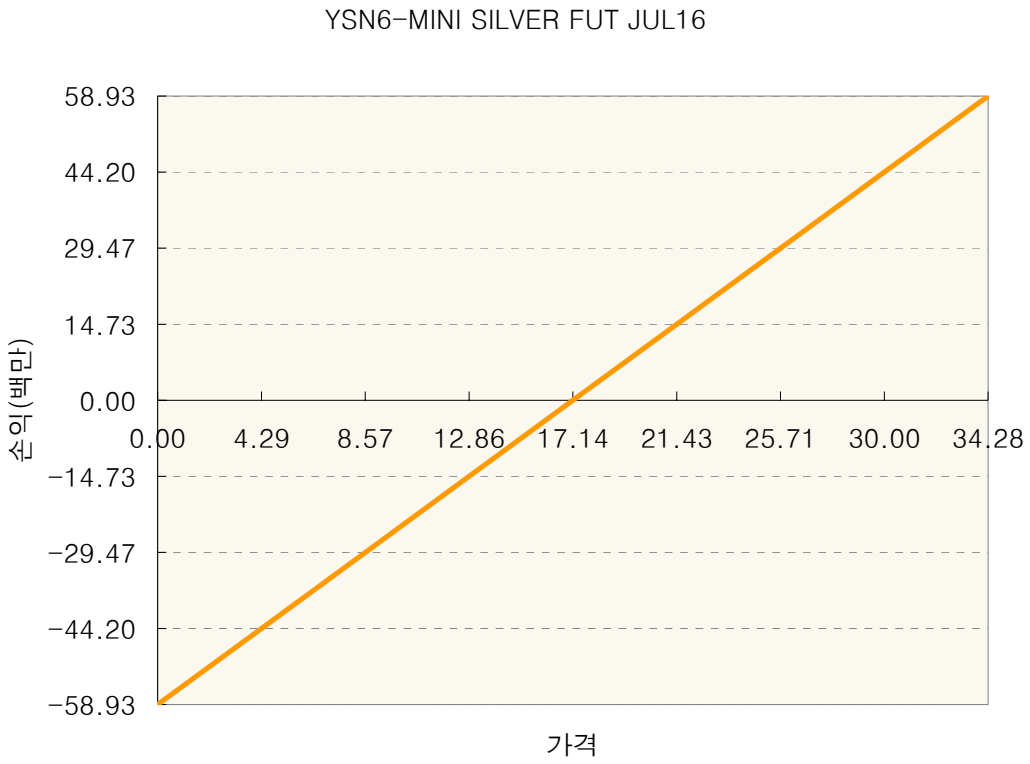


가격

XGM6-MINI GOLD FUTURE JUN16



가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGN6	COPPER FUTURE JUL16	5
LAK6	LME PRI ALUM FUTR MAY16	1
LAN6	LME PRI ALUM FUTR JUL16	4
LXK6	LME ZINC FUTURE MAY16	0.4
LXN6	LME ZINC FUTURE JUL16	4
XGM6	MINI GOLD FUTURE JUN16	11
YSN6	MINI SILVER FUT JUL16	5

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

(단위:백만원)

32

공시일	2016-04-25
기준일	2016-04-22

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

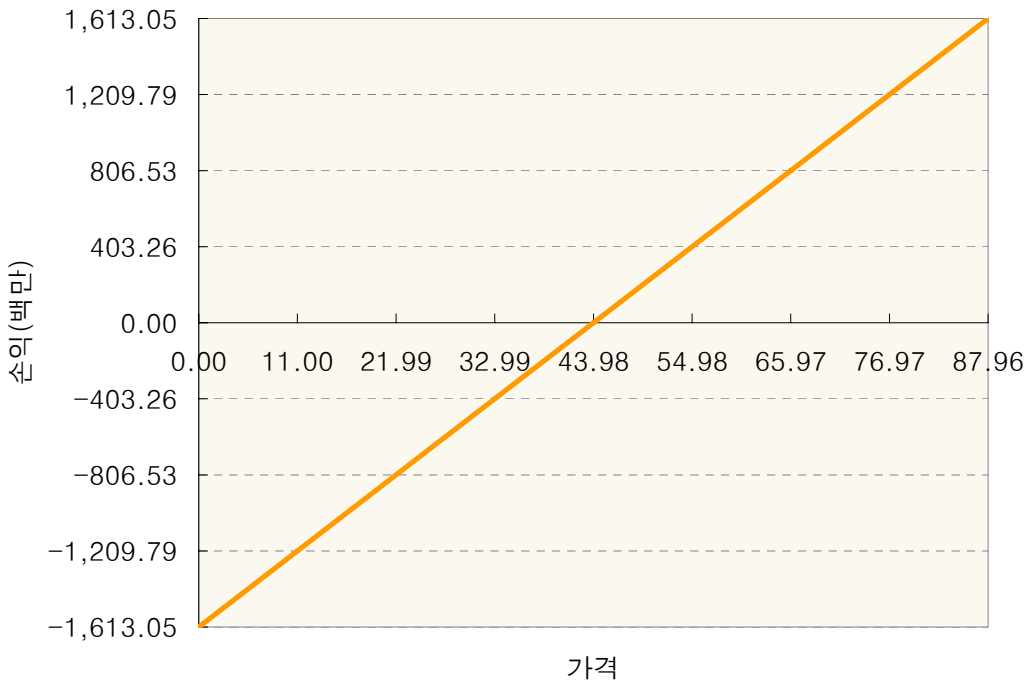
1. 계약금액

(단위:백만원)

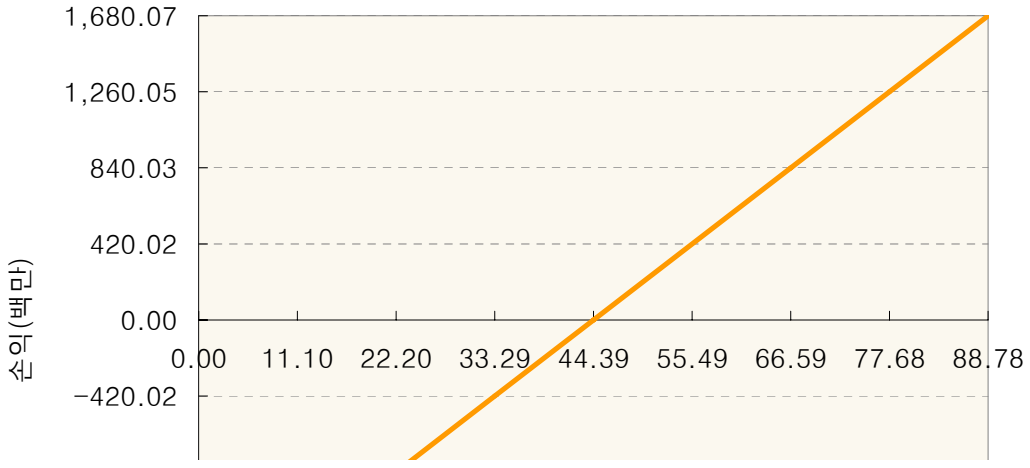
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,158	0	6,158	

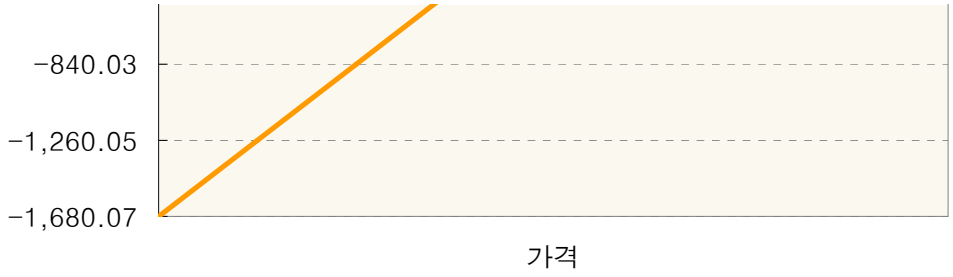
2. 만기시점의 손익구조

CLN6-WTI CRUDE FUTURE JUL16

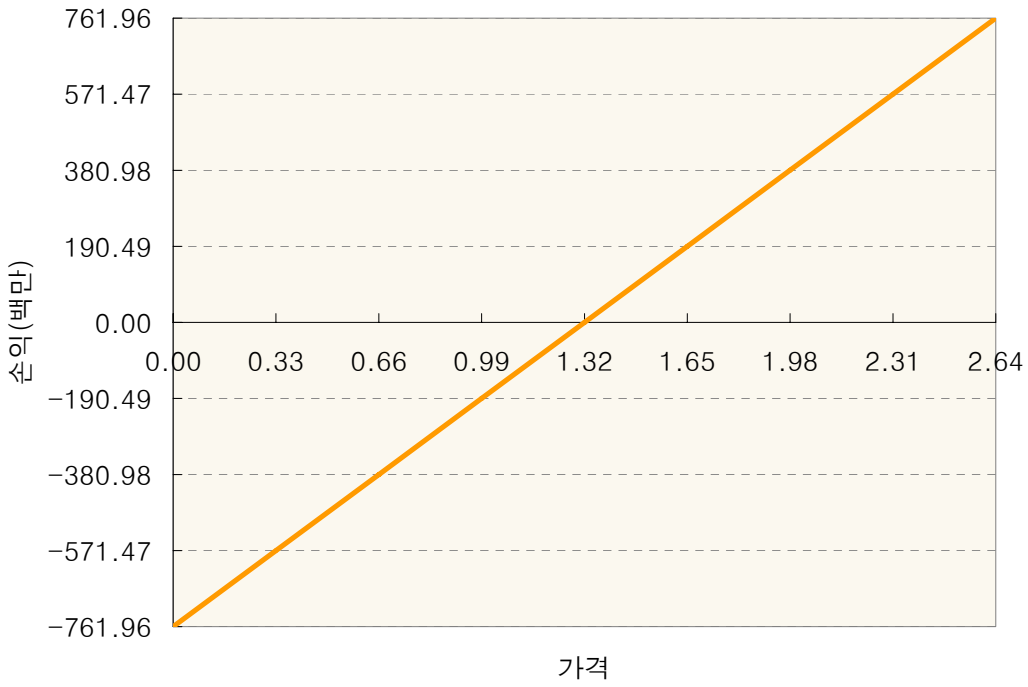


CON6-BRENT CRUDE FUTR JUL16

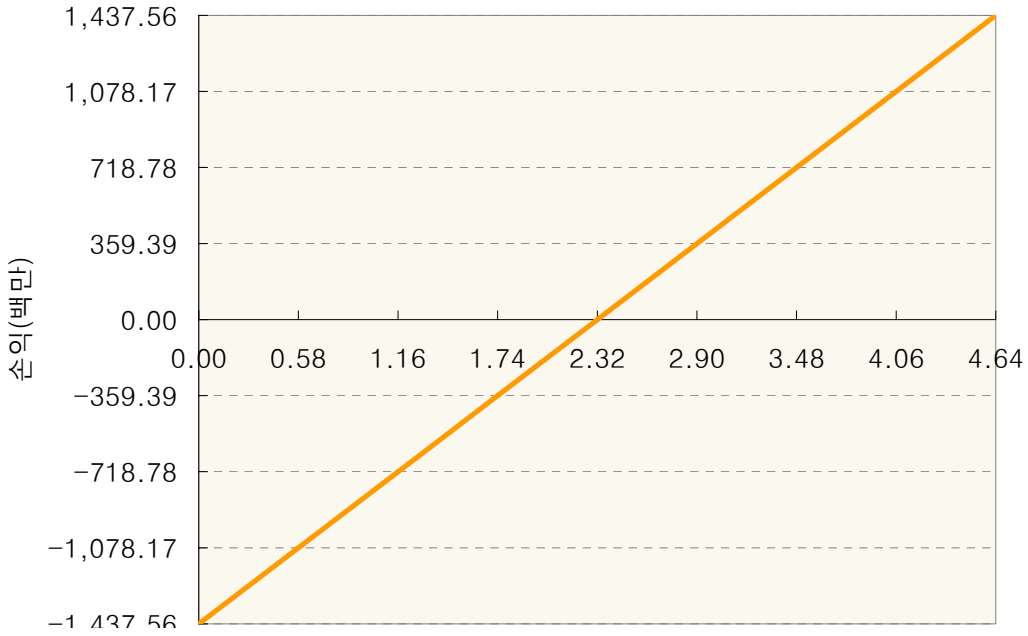


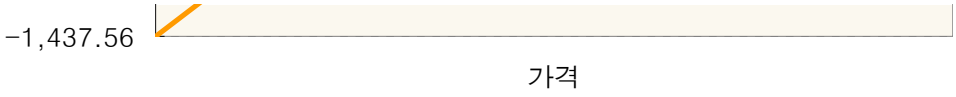


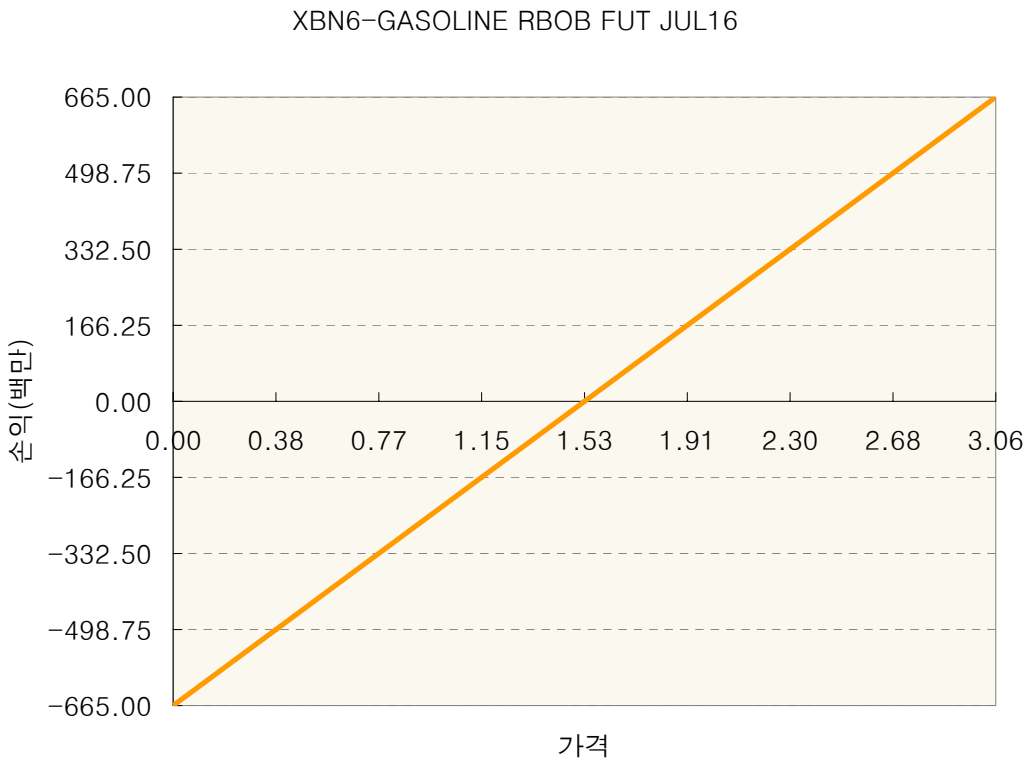
HON6-NY Harb ULSD Fut JUL16



NGN6-NATURAL GAS FUTR JUL16







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN6	WTI CRUDE FUTURE JUL16	129
CON6	BRENT CRUDE FUTR JUL16	134
HON6	NY Harb ULSD Fut JUL16	61
NGN6	NATURAL GAS FUTR JUL16	115
XBN6	GASOLINE RBOB FUT JUL16	53

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

(단위:백만원)

1,348

공시일	2016-04-25
기준일	2016-04-22

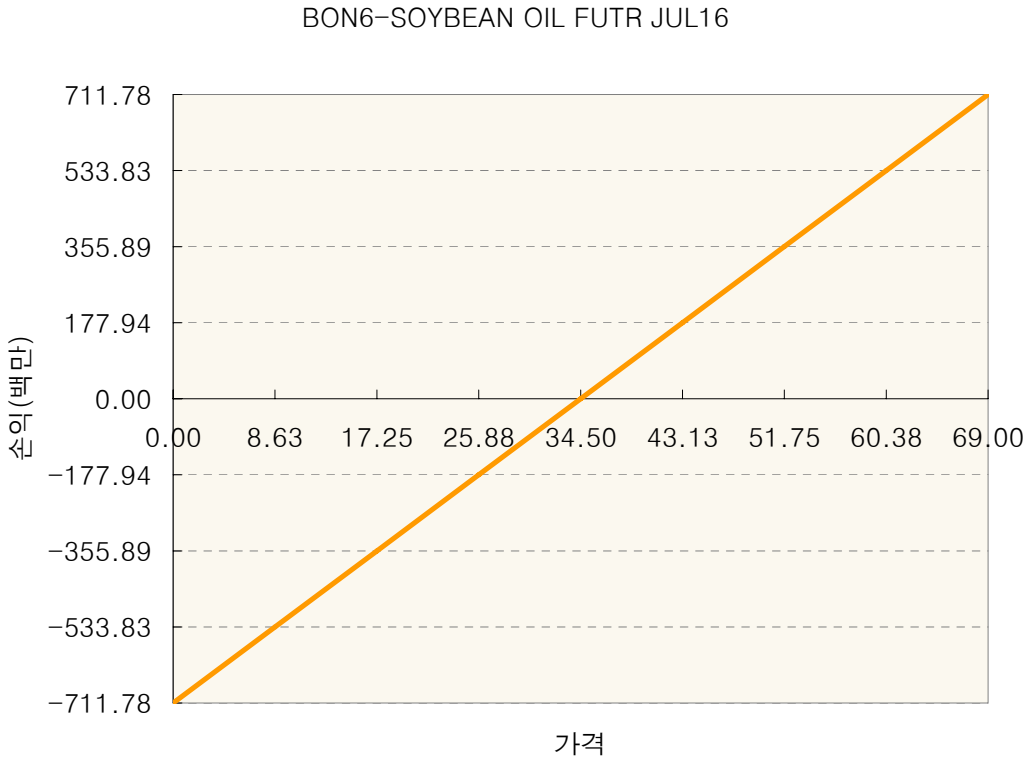
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

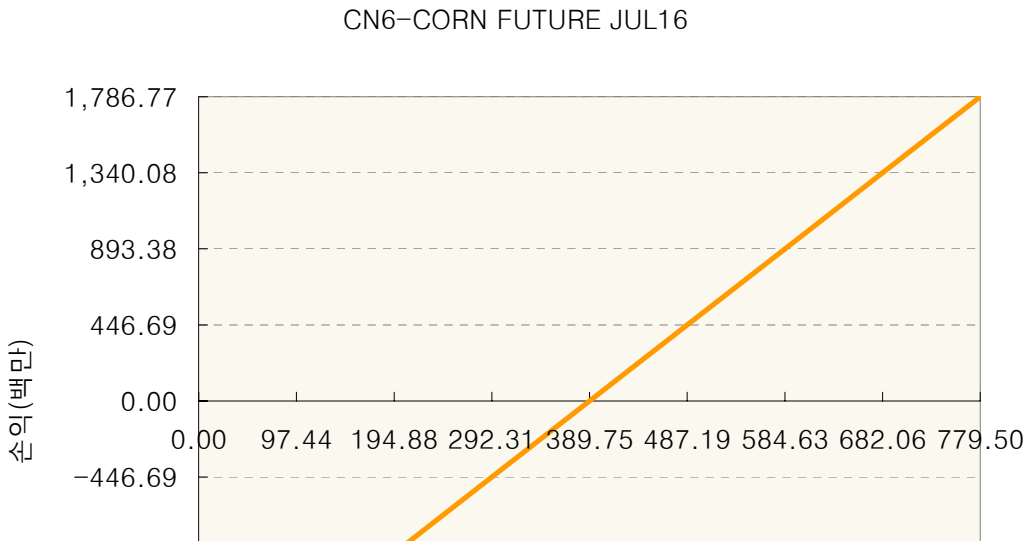
1. 계약금액

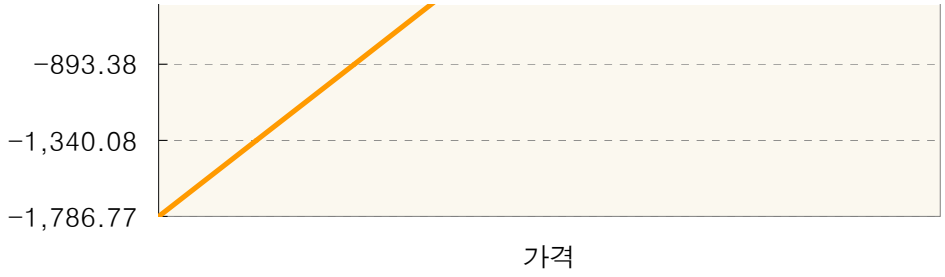
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,420	0	7,420	

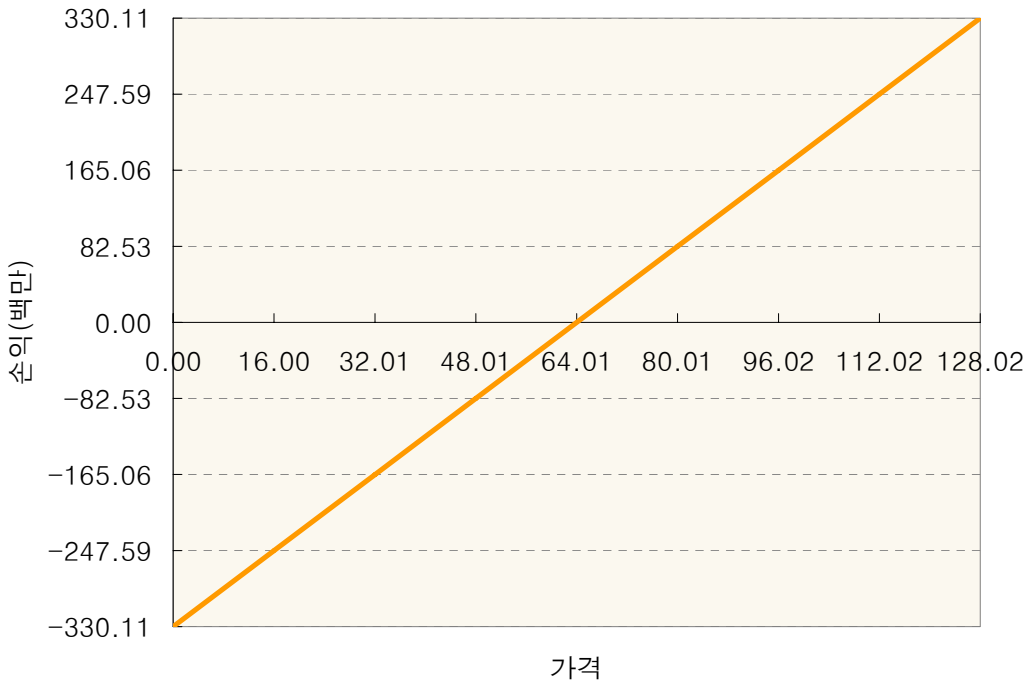
2. 만기시점의 손익구조



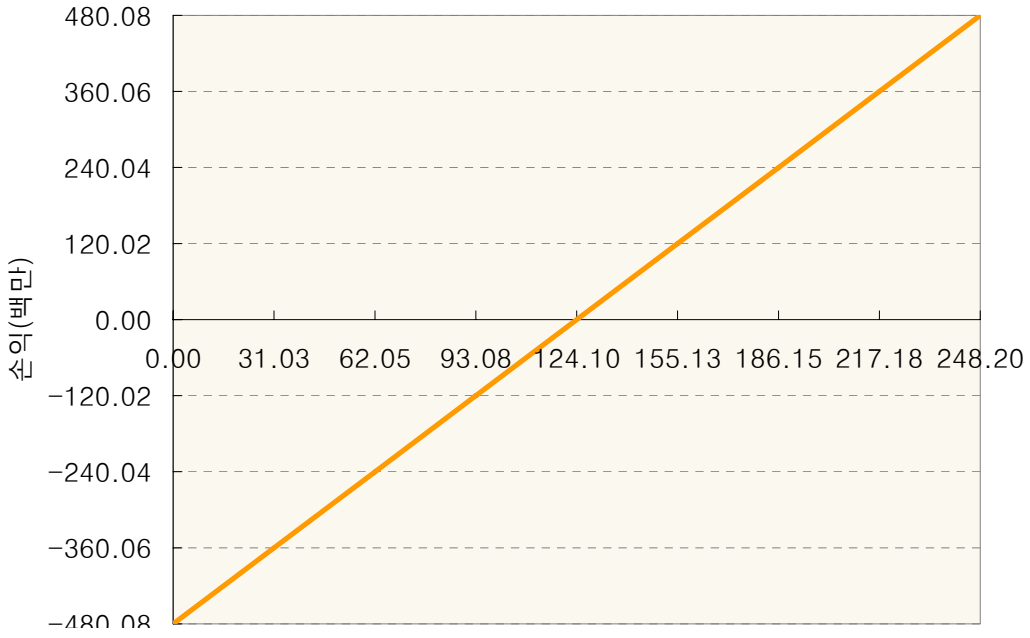


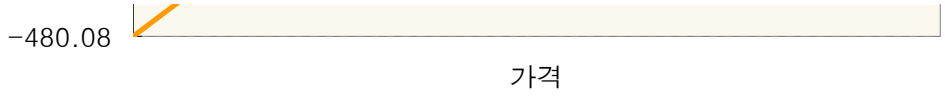


CTN6-COTTON NO.2 FUTR JUL16

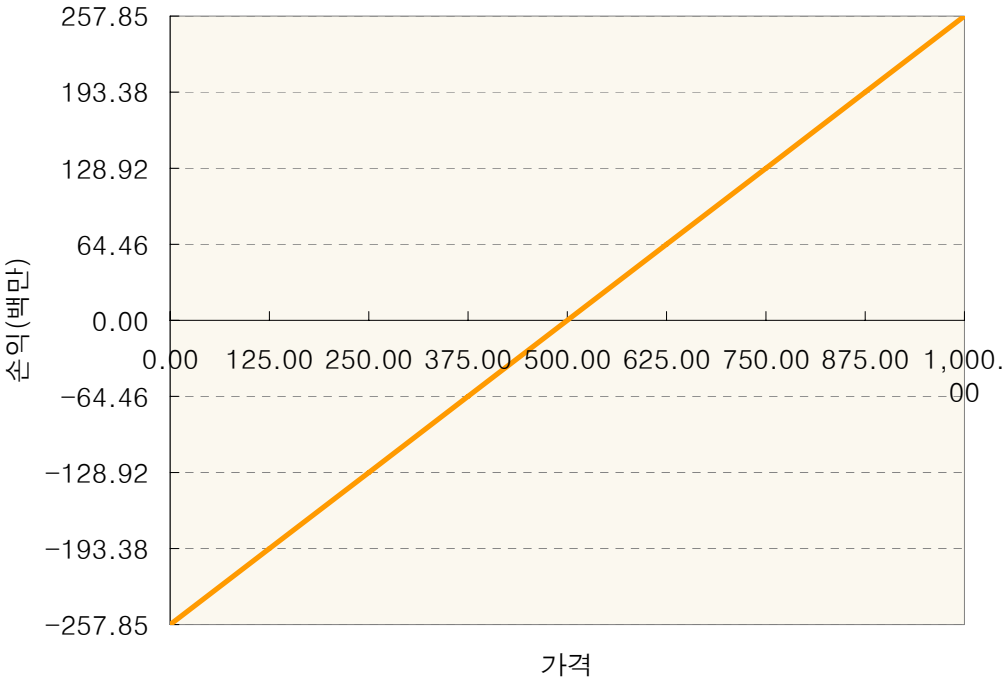


KCN6-COFFEE 'C' FUTURE JUL16

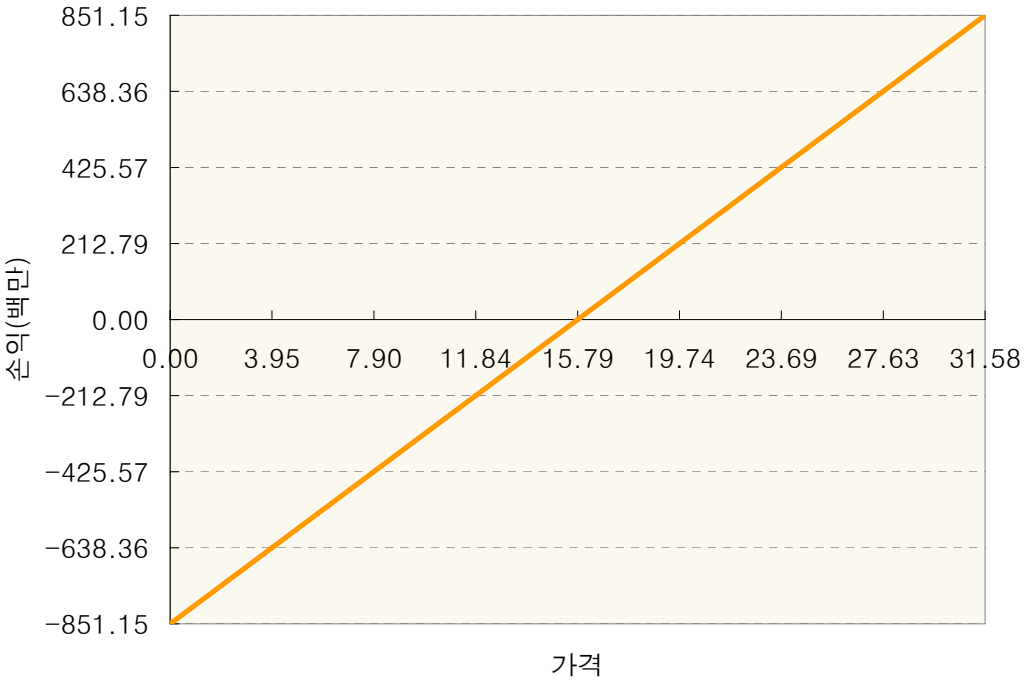




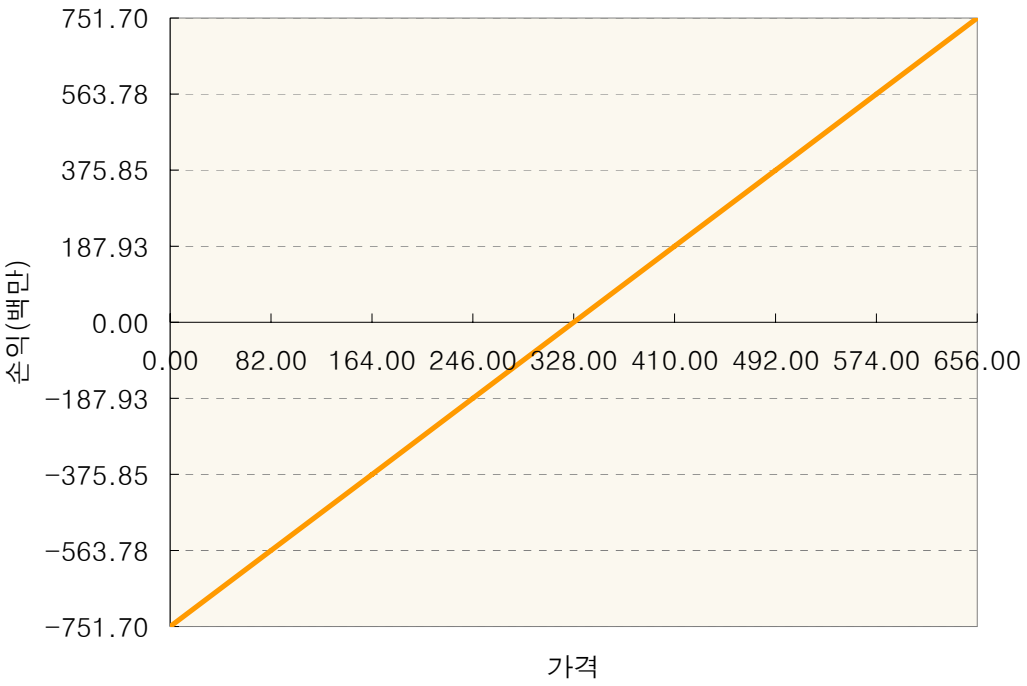
KWN6-KC HRW WHEAT FUT JUL16



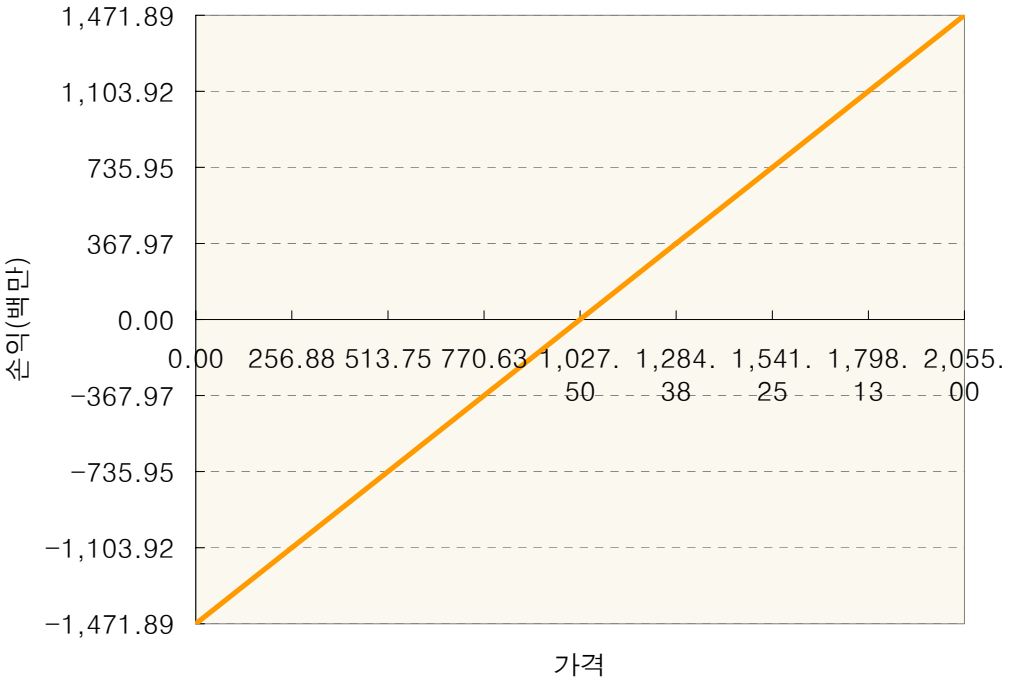
SBN6-SUGAR #11 (WORLD) JUL16



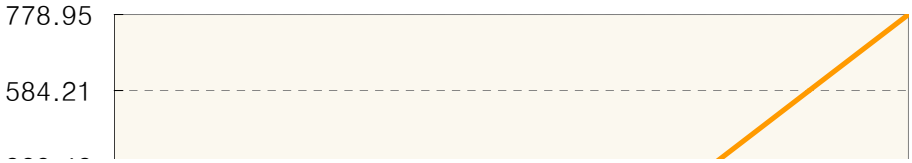
SMN6-SOYBEAN MEAL FUTR JUL16

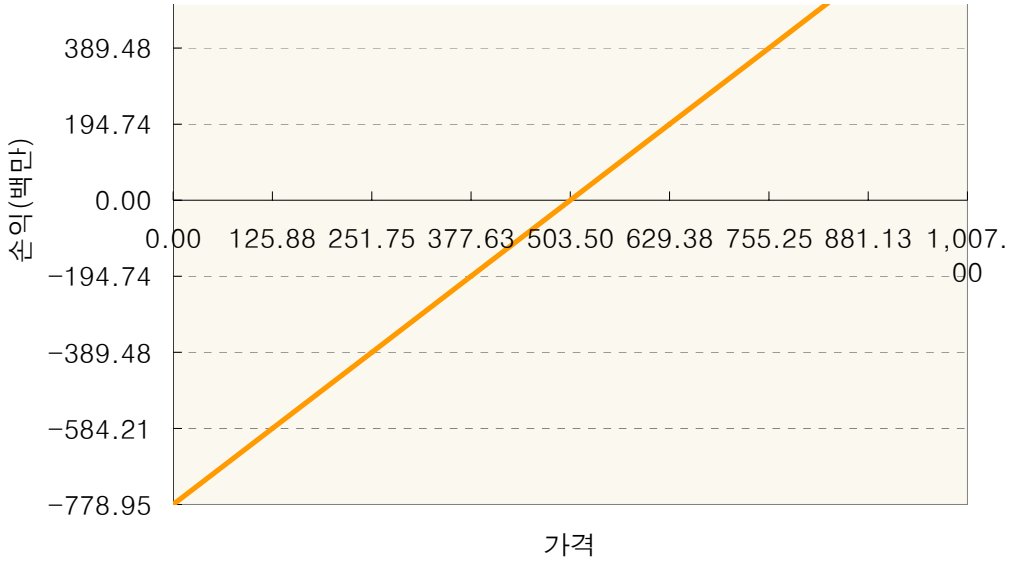


SN6-SOYBEAN FUTURE JUL16



WN6-WHEAT FUTURE(CBT) JUL16





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BON6	SOYBEAN OIL FUTR JUL16	57
CN6	CORN FUTURE JUL16	143
CTN6	COTTON NO.2 FUTR JUL16	26
KCN6	COFFEE 'C' FUTURE JUL16	38
KWN6	KC HRW WHEAT FUT JUL16	21
SBN6	SUGAR #11 (WORLD) JUL16	68
SMN6	SOYBEAN MEAL FUTR JUL16	60
SN6	SOYBEAN FUTURE JUL16	118
WN6	WHEAT FUTURE(CBT) JUL16	62

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	803