| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-05-09 |
| 기준일 | 2016-05-04 |

# 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 | 2016-05-09 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-05-04 |

# 스마트인덱스모

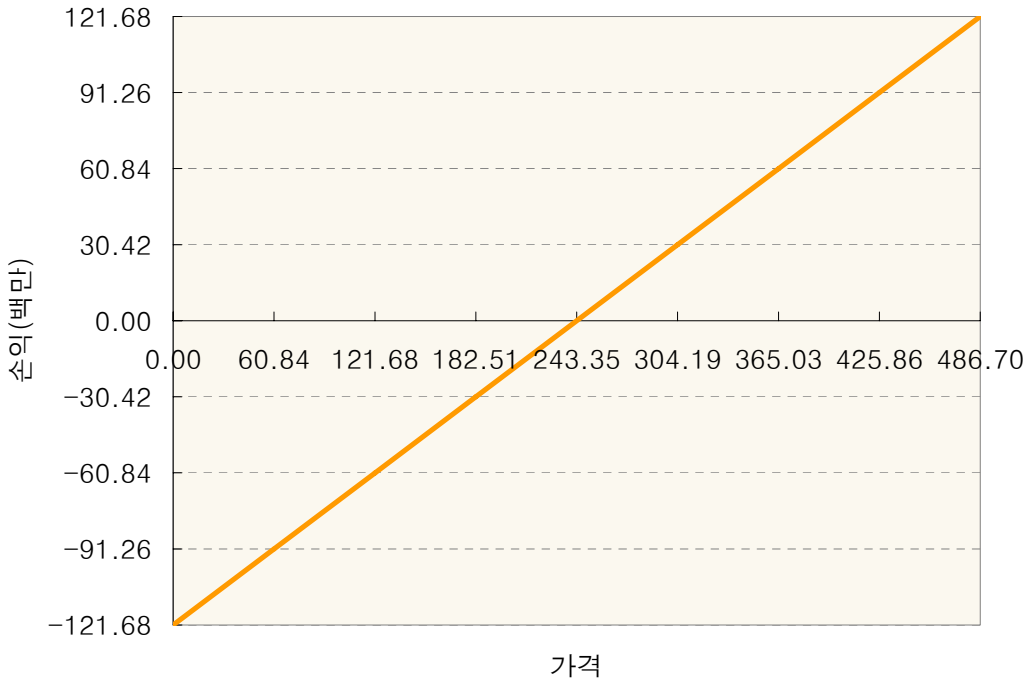
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

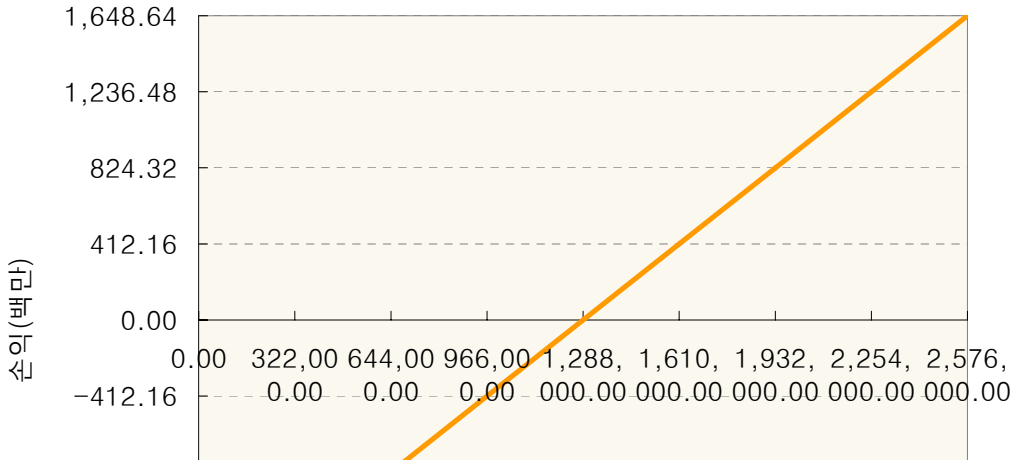
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,770 | 0 | 1,770 | 장내 |

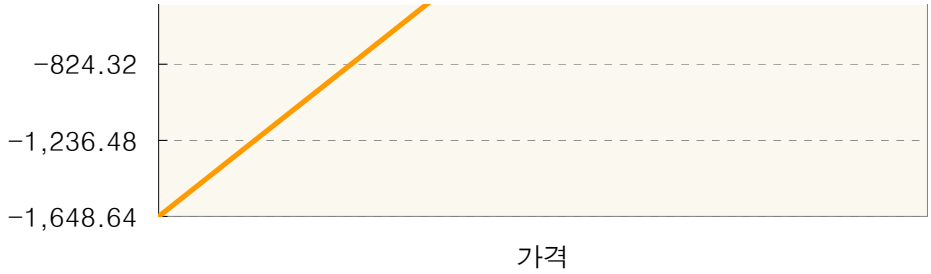
## 2. 만기시점의 손익구조

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% | -6 | -6 | -6 | -6 | -6 | -6 | -6 |
| -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% | 6 | 6 | 6 | 6 | 6 | 6 | 6 |
| 8.00% | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 |
| KR4111L500 | 2016-05 삼성전자개별선물 | | | | | | 132 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -132 | -132 | -132 | -132 | -132 | -132 | -132 |
| -5.33% | -88 | -88 | -88 | -88 | -88 | -88 | -88 |
| -2.67% | -44 | -44 | -44 | -44 | -44 | -44 | -44 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 44 | 44 | 44 | 44 | 44 | 44 | 44 |
| 5.33% | 88 | 88 | 88 | 88 | 88 | 88 | 88 |
| 8.00% | 132 | 132 | 132 | 132 | 132 | 132 | 132 |

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

(단위:백만원)

| 134 |
|---|

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-05-09 |
| 기준일 | 2016-05-04 |

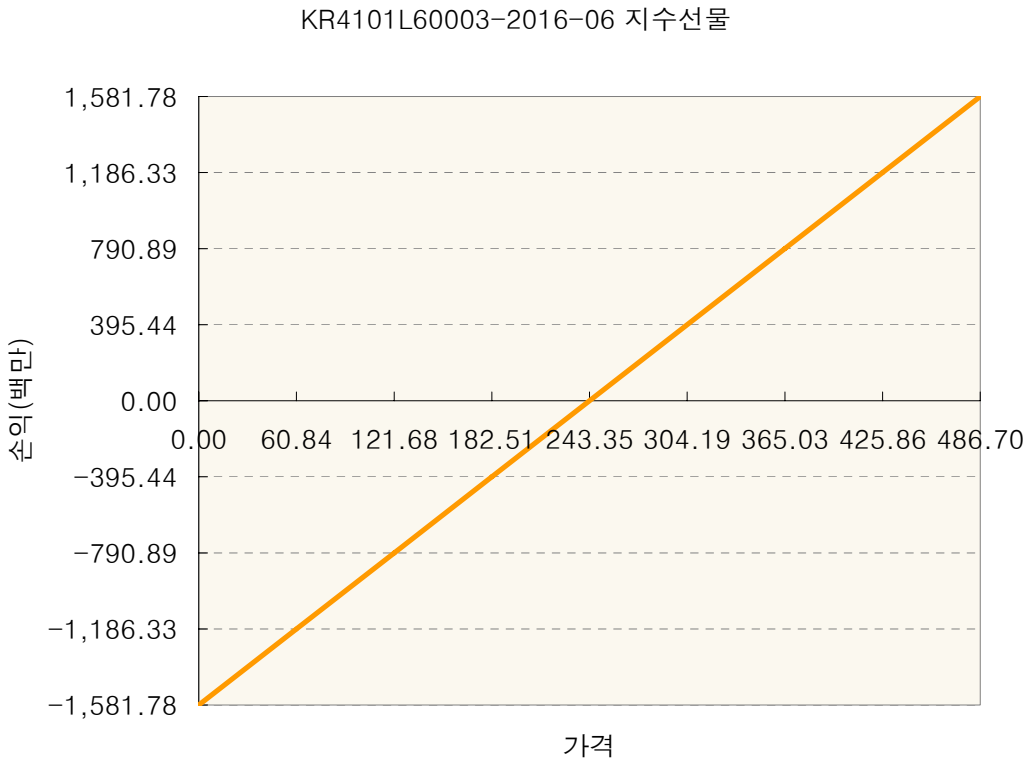
# 스마트레버리지목표전환형1호

## 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 | 1,582 | 0 | 1,582 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L600 2016-06 지수선물 127

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -127 | -127 | -127 | -127 | -127 | -127 | -127 |
| -5.33% | -84 | -84 | -84 | -84 | -84 | -84 | -84 |
| -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% | 84 | 84 | 84 | 84 | 84 | 84 | 84 |
| 8.00% | 127 | 127 | 127 | 127 | 127 | 127 | 127 |

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

| 103 |
|---|

| 공시일 | 2016-05-09 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-05-04 |

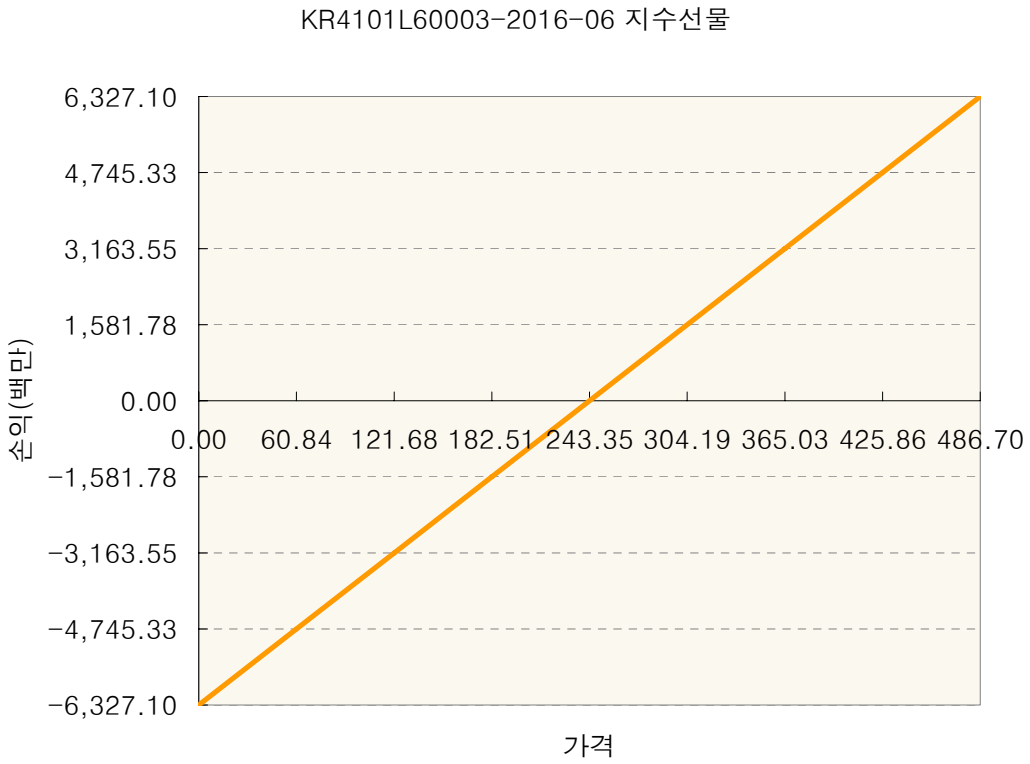
# 1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

## 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 | 6,327 | 0 | 6,327 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L600 2016-06 지수선물 506

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -506 | -506 | -506 | -506 | -506 | -506 | -506 |
| -5.33% | -337 | -337 | -337 | -337 | -337 | -337 | -337 |
| -2.67% | -169 | -169 | -169 | -169 | -169 | -169 | -169 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 169 | 169 | 169 | 169 | 169 | 169 | 169 |
| 5.33% | 337 | 337 | 337 | 337 | 337 | 337 | 337 |
| 8.00% | 506 | 506 | 506 | 506 | 506 | 506 | 506 |

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

| 414 |
|---|

| 공시일 | 2016-05-09 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-05-04 |

# 아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

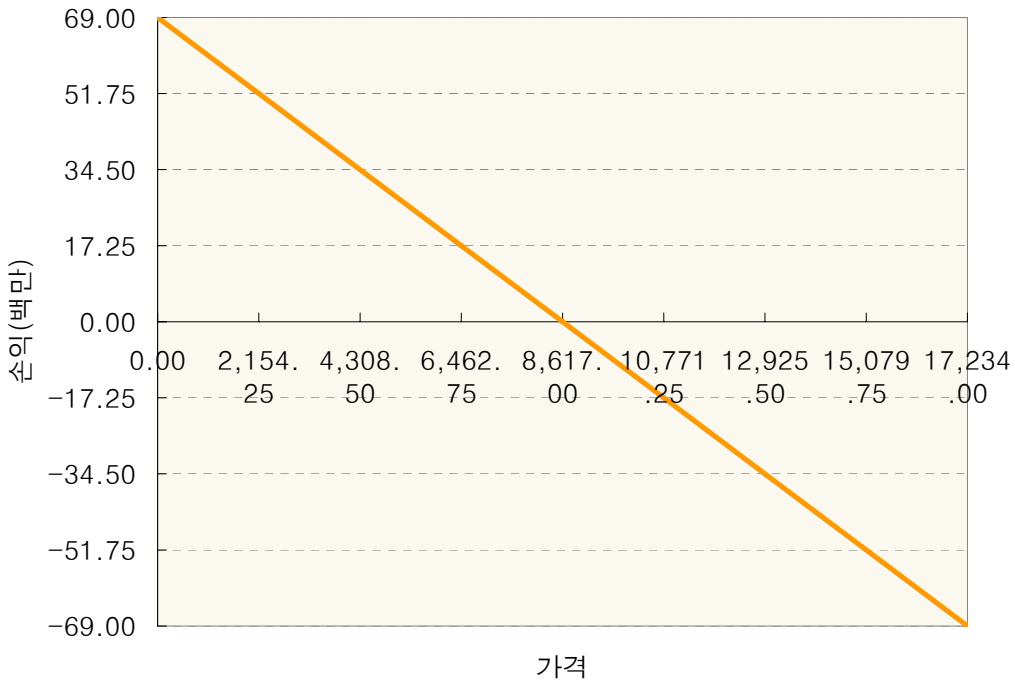
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

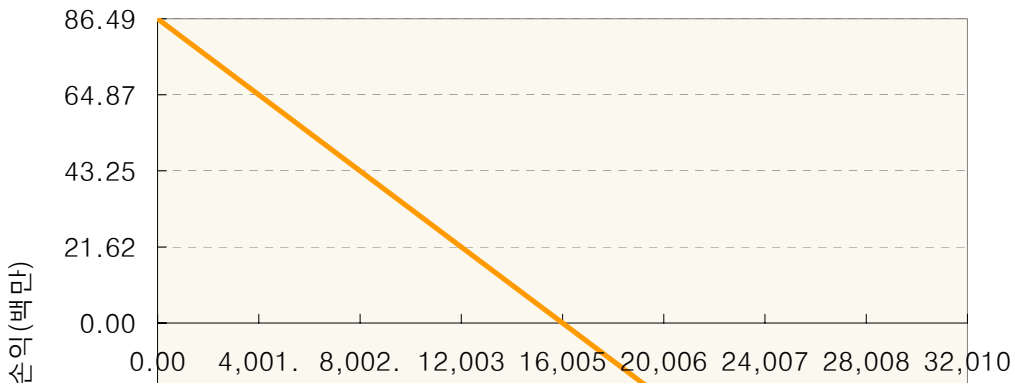
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 146 | -146 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 69 | -69 | 장내 |

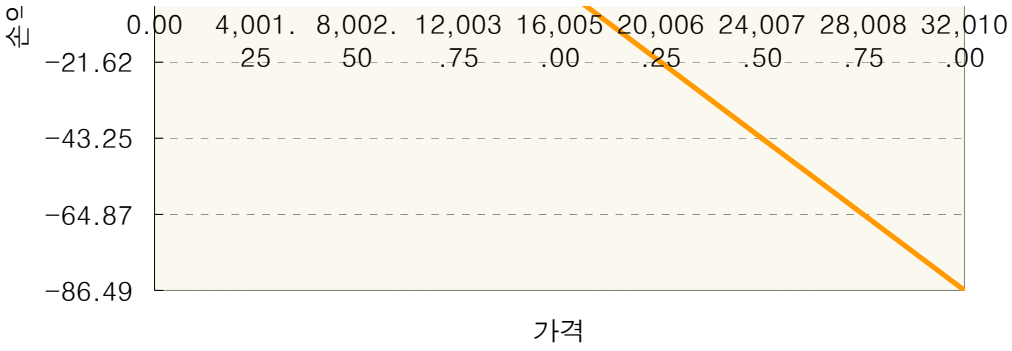
## 2. 만기시점의 손익구조

HCK6-H-SHARES IDX FUT MAY16

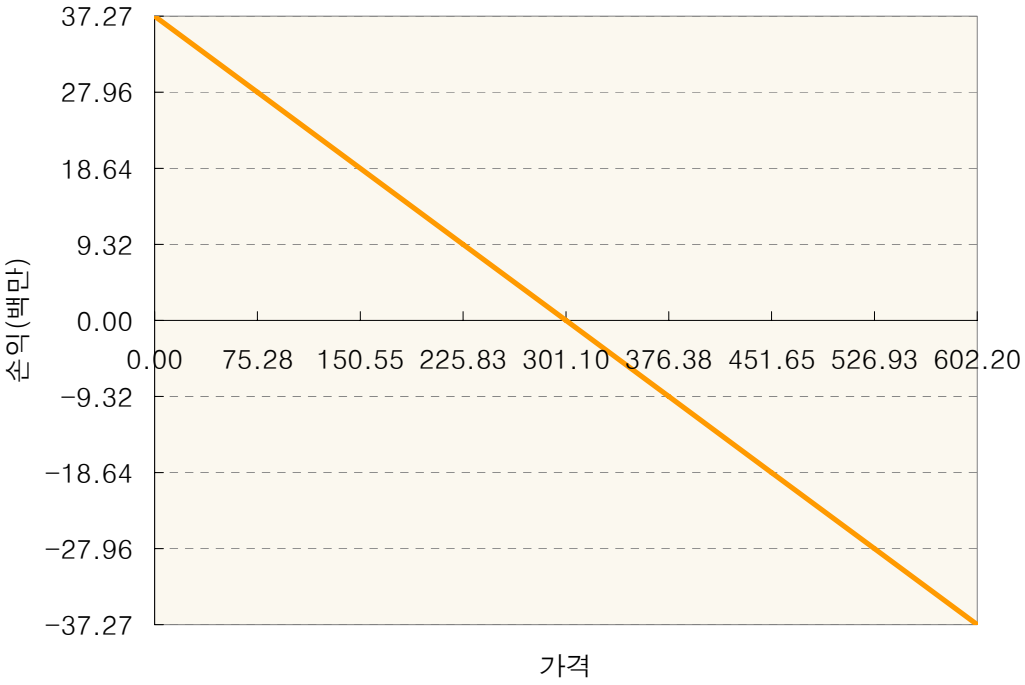



NIM6-NIKKEI 225 (SGX) JUN16

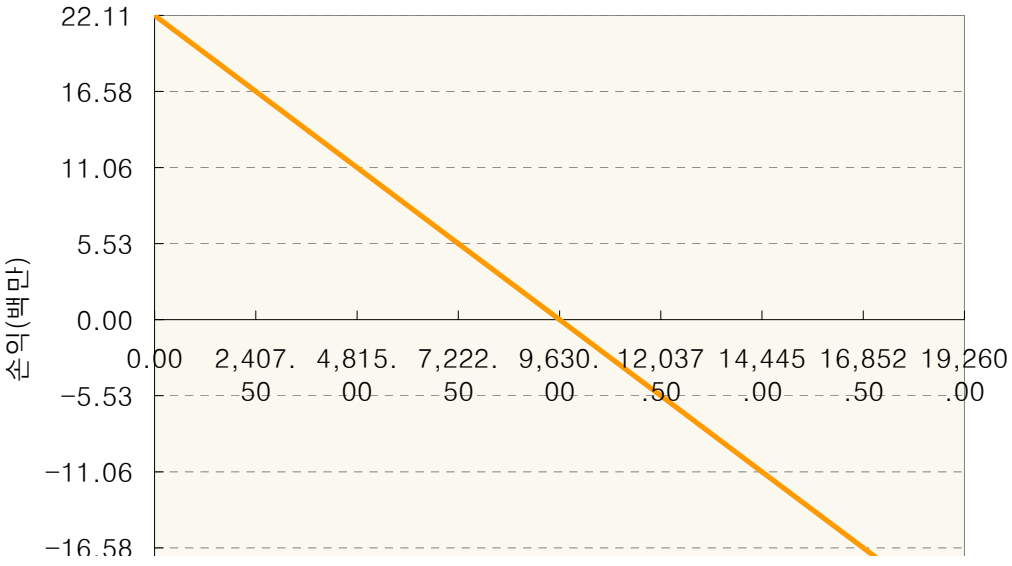


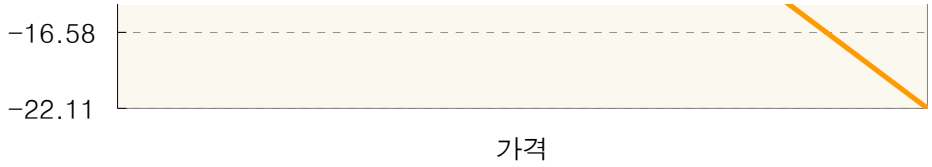



TWK6-MSCI TAIWAN INDEX MAY16




XUK6-FTSE CHINA A50 MAY16






### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| HCK6 | H-SHARES IDX FUT MAY16 | 6 |
| NIM6 | NIKKEI 225 (SGX) JUN16 | 7 |
| TWK6 | MSCI TAIWAN INDEX MAY16 | 3 |
| XUK6 | FTSE CHINA A50 MAY16 | 2 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 23 |

| 공시일 | 2016-05-09 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-05-04 |

# 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 | 9,797 | 0 | 9,797 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| SWMXWO00(신한MXWO 미래S160222 | 846 |
|---|---|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| 725 |
|---|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-05-09 |
| 기준일 | 2016-05-04 |

# 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 | 4,617 | 0 | 4,617 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| SWCSI50000 신한CSI500미래S160308 | 272 |
| SWCSI50000 신한CSI500미래S160308-1 | 125 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 1,178 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-05-09 |
| 기준일 | 2016-05-04 |

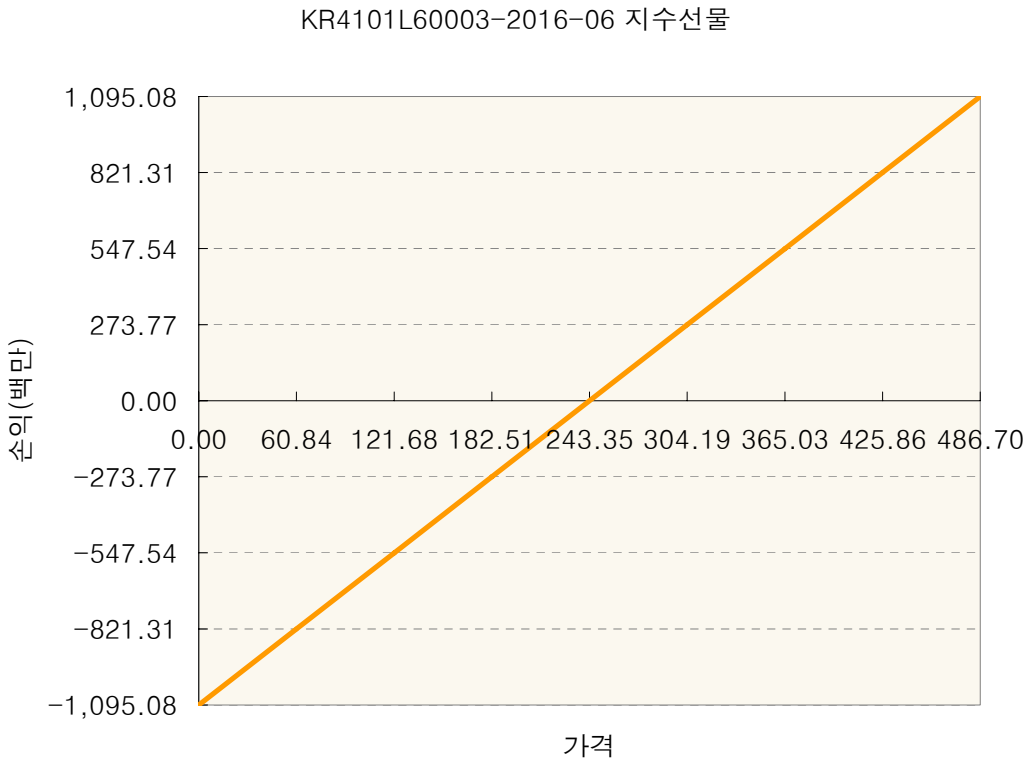
# KOSPI200 레버리지 목표전환형 3

## 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 | 1,095 | 0 | 1,095 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L600 2016-06 지수선물 88

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -88 | -88 | -88 | -88 | -88 | -88 | -88 |
| -5.33% | -58 | -58 | -58 | -58 | -58 | -58 | -58 |
| -2.67% | -29 | -29 | -29 | -29 | -29 | -29 | -29 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 29 | 29 | 29 | 29 | 29 | 29 | 29 |
| 5.33% | 58 | 58 | 58 | 58 | 58 | 58 | 58 |
| 8.00% | 88 | 88 | 88 | 88 | 88 | 88 | 88 |

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

| 72 |
|---|

| 공시일 | 2016-05-09 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-05-04 |

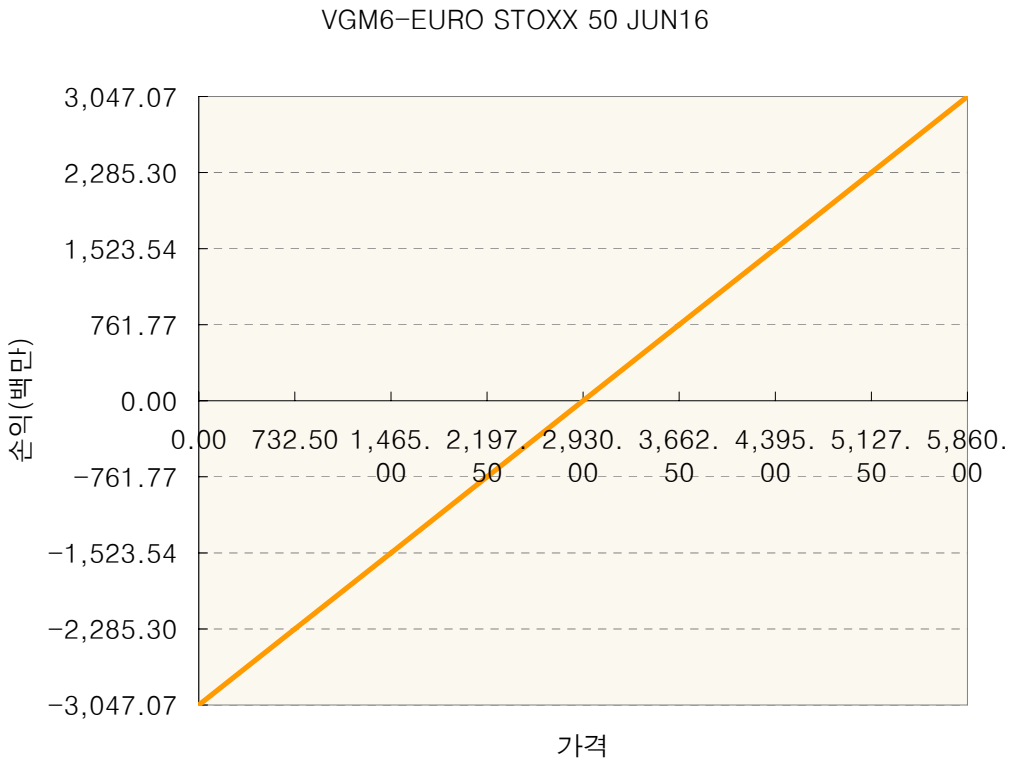
# 유로인덱스모(주식-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,047 | 0 | 3,047 | |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| VGM6 | EURO STOXX 50 JUN16 | 244 |

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

(단위:백만원)

293

| 공시일 | 2016-05-09 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-05-04 |

# 차이나인덱스모(주식-파생형)

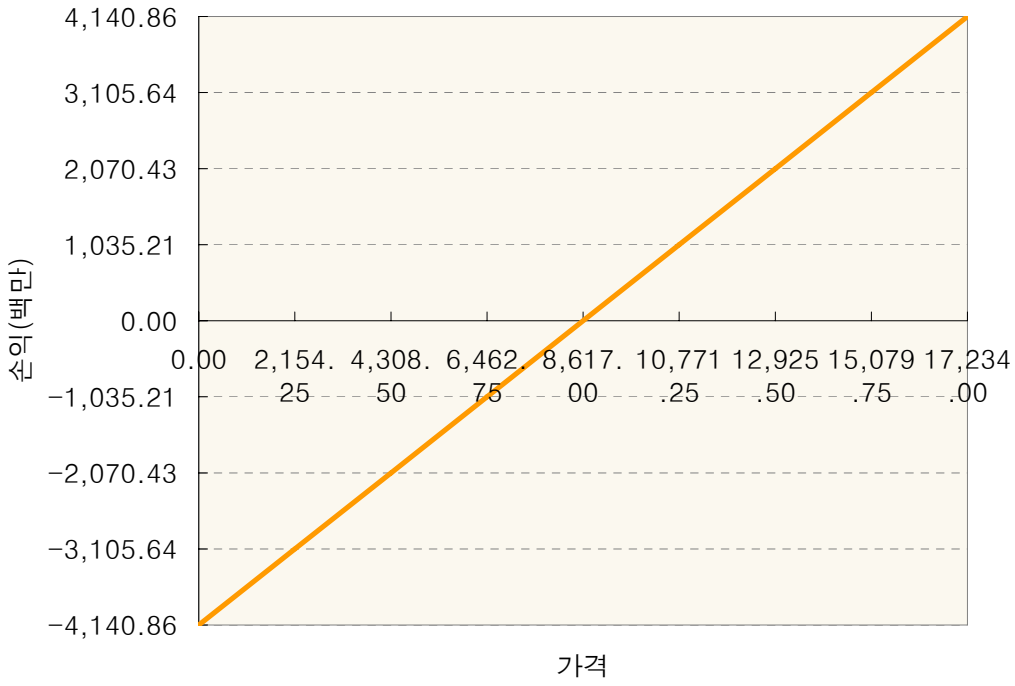
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

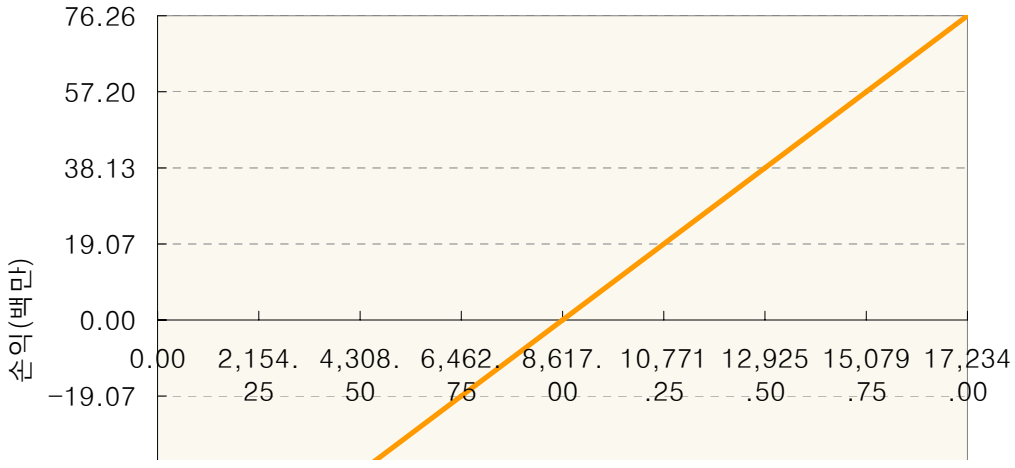
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 4,217 | 0 | 4,217 | 장내 |

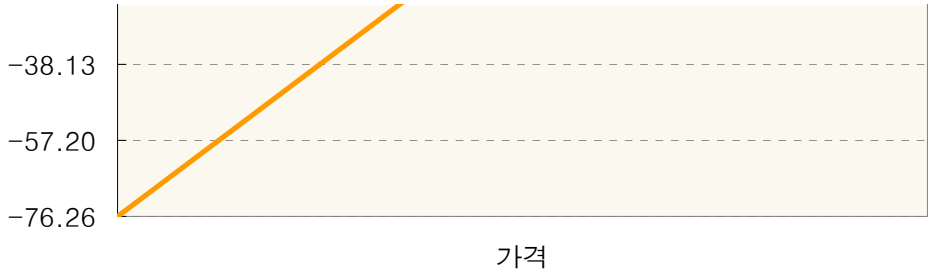
## 2. 만기시점의 손익구조

HCK6-H-SHARES IDX FUT MAY16




MHCK6-MINI H-SHR IDX MAY16






### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| HCK6 | H-SHARES IDX FUT MAY16 | 331 |
| MHCK6 | MINI H-SHR IDX MAY16 | 6 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 489 |

| 공시일 | 2016-05-09 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-05-04 |

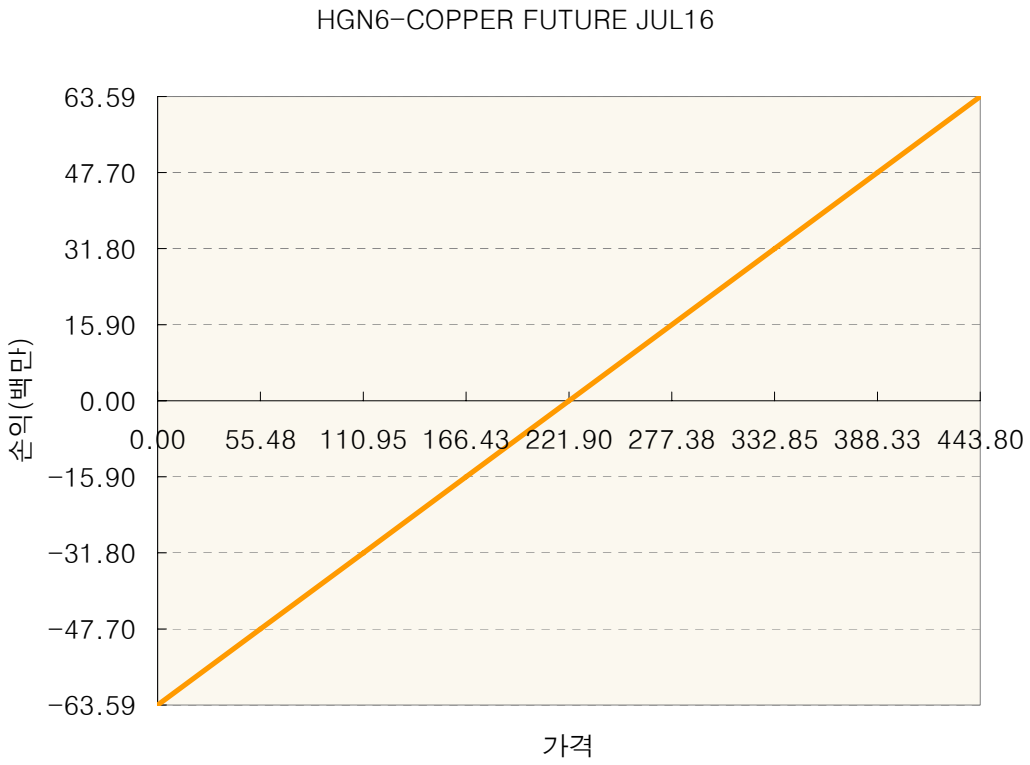
# 메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

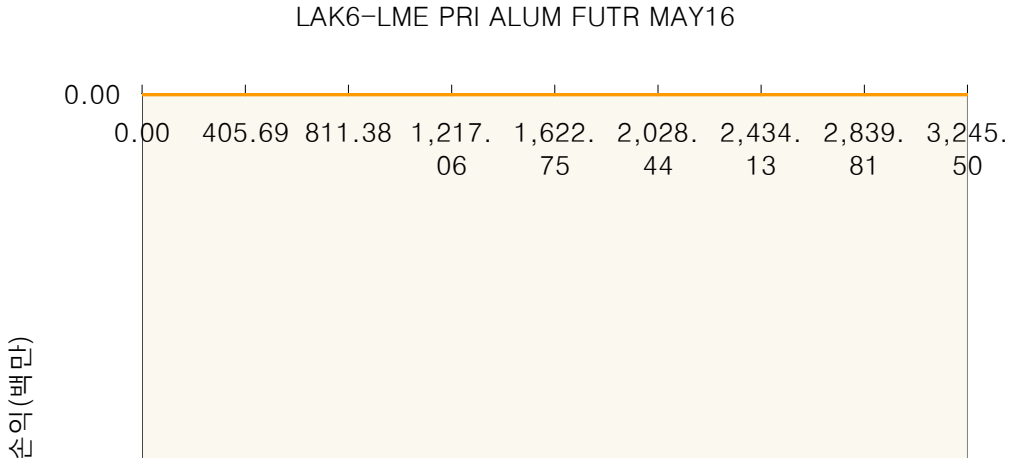
## 1. 계약금액

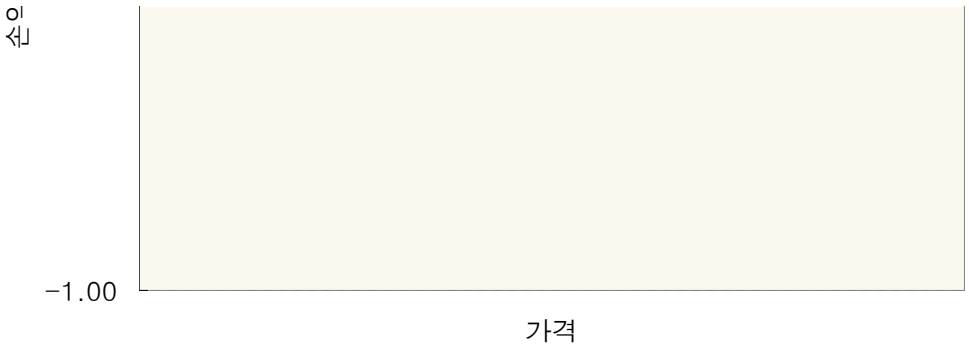
(단위:백만원)

| 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 | 60 | 0 | 60 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 418 | 96 | 322 | |

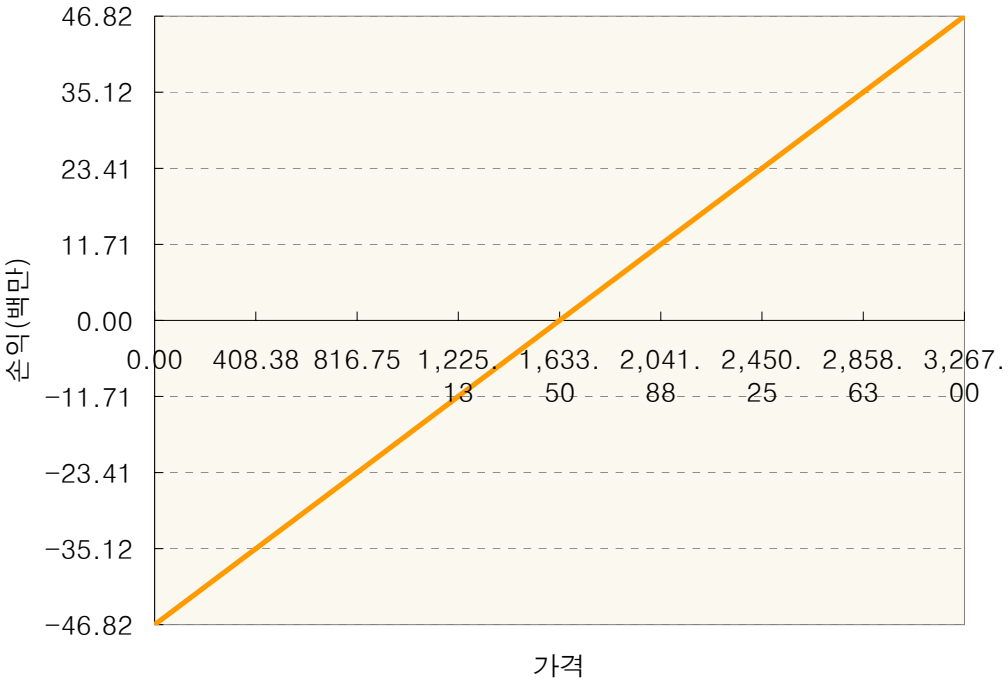
## 2. 만기시점의 손익구조



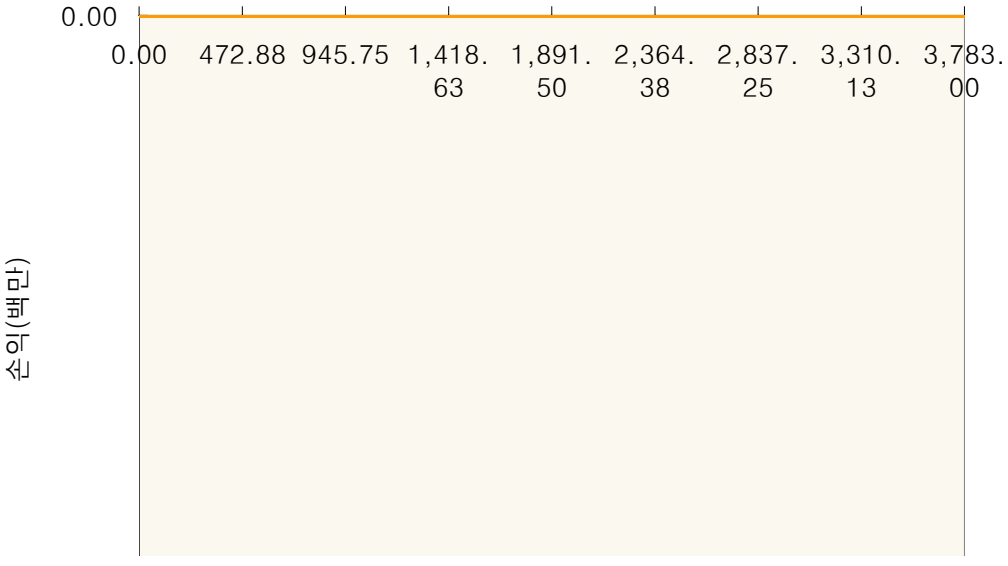



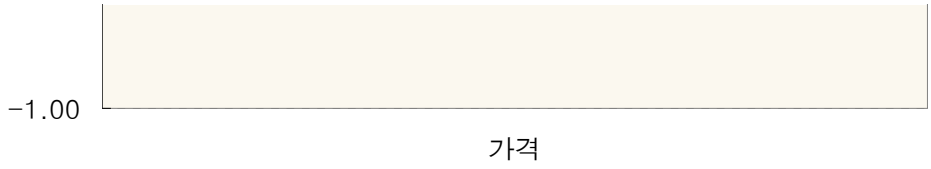



LAN6-LME PRI ALUM FUTR JUL16



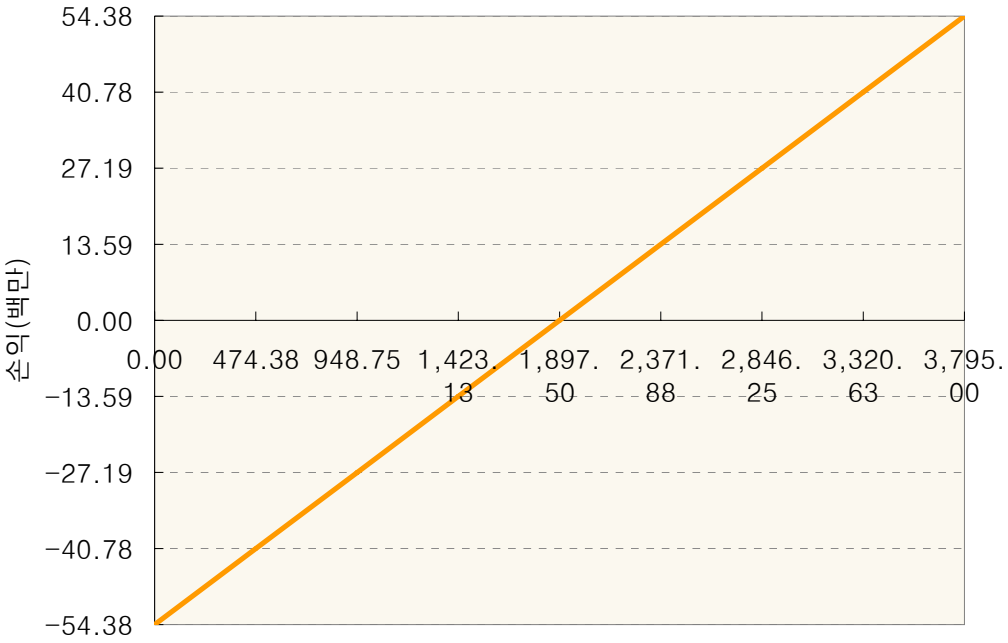

LXK6-LME ZINC FUTURE MAY16





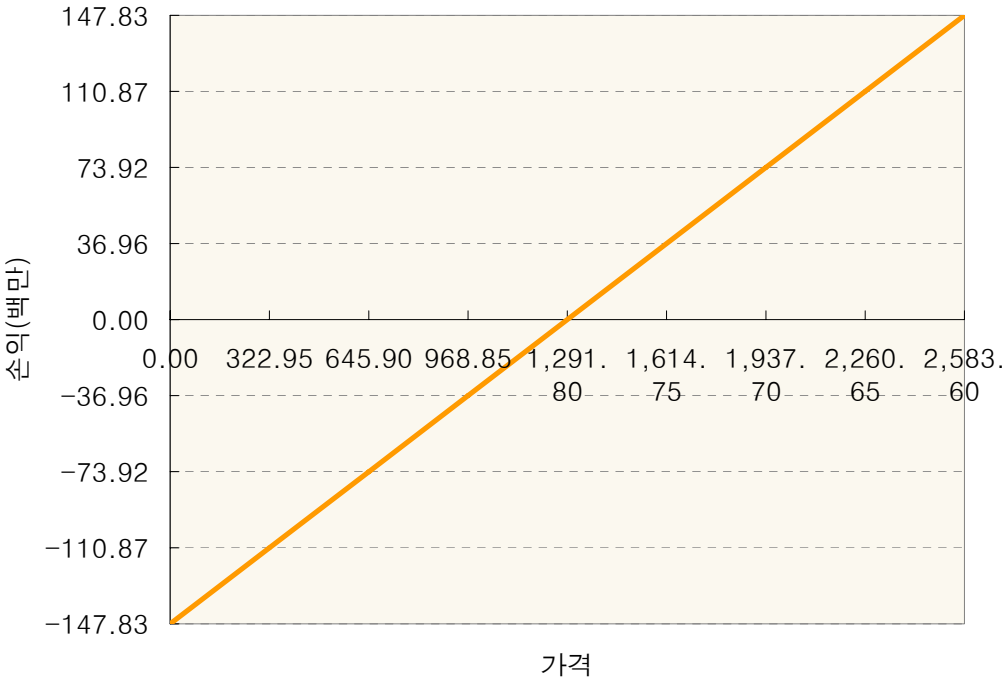

가격

LXN6-LME ZINC FUTURE JUL16

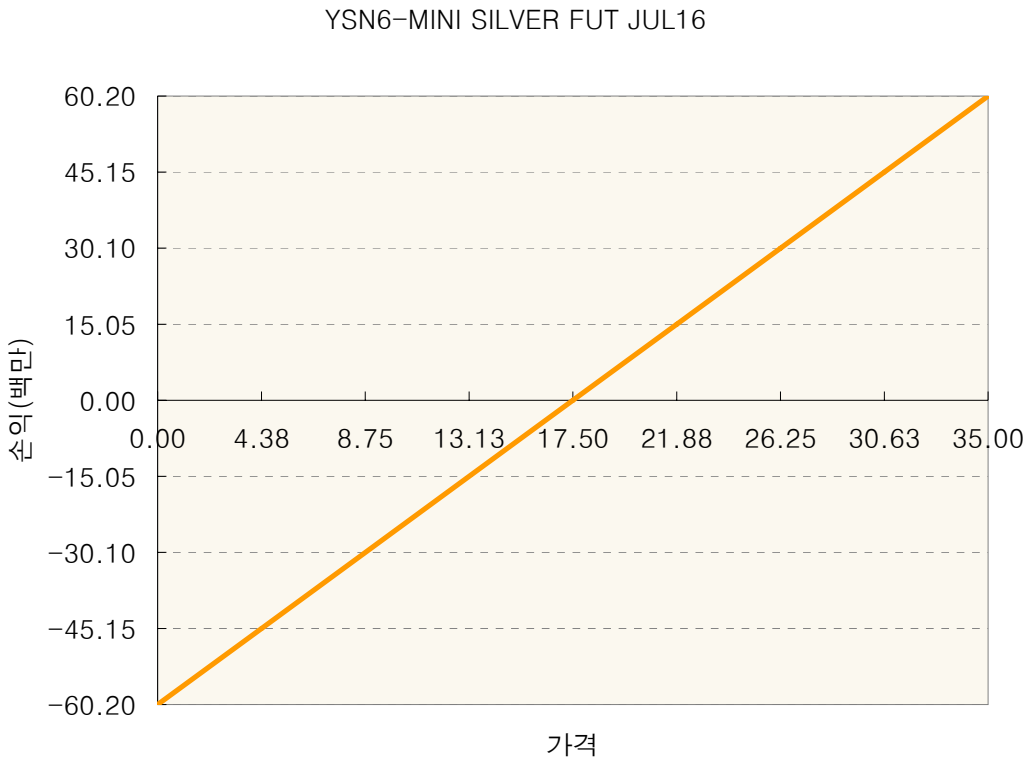



가격

XGM6-MINI GOLD FUTURE JUN16




가격




### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| HGN6 | COPPER FUTURE JUL16 | 5 |
| LAK6 | LME PRI ALUM FUTR MAY16 | 0.5 |
| LAN6 | LME PRI ALUM FUTR JUL16 | 4 |
| LXK6 | LME ZINC FUTURE MAY16 | 0.3 |
| LXN6 | LME ZINC FUTURE JUL16 | 4 |
| XGM6 | MINI GOLD FUTURE JUN16 | 12 |
| YSN6 | MINI SILVER FUT JUL16 | 5 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 32 |

| 공시일 | 2016-05-09 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-05-04 |

# 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

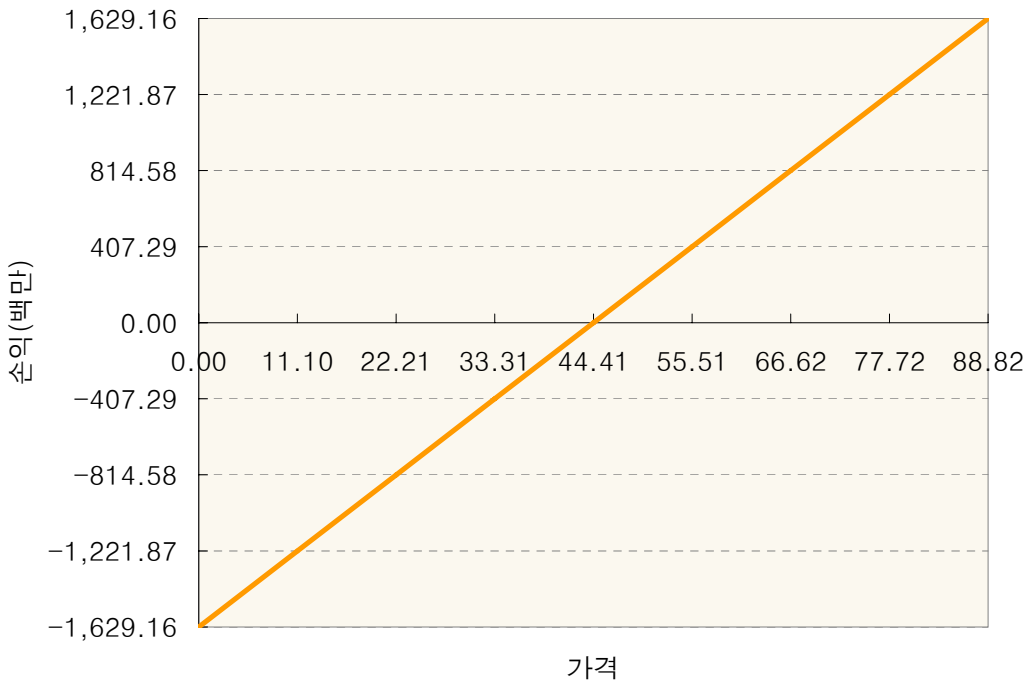
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

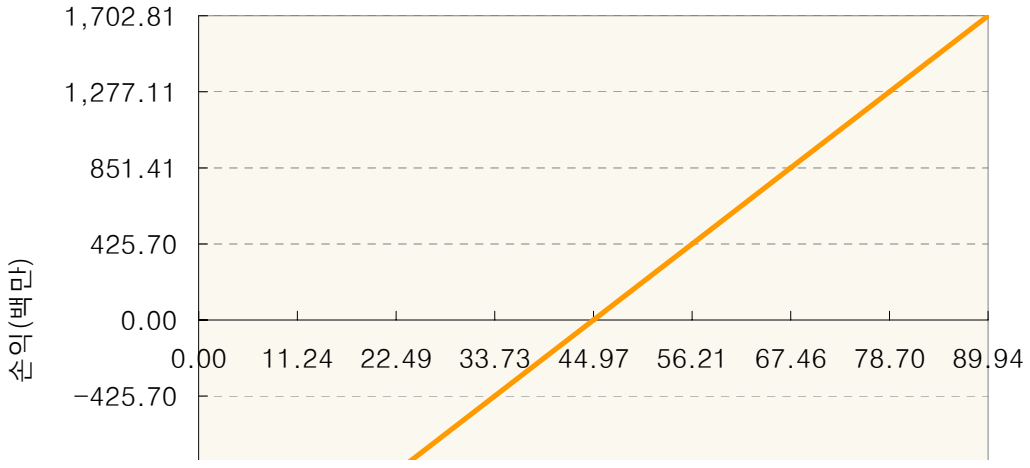
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 6,024 | 0 | 6,024 | |

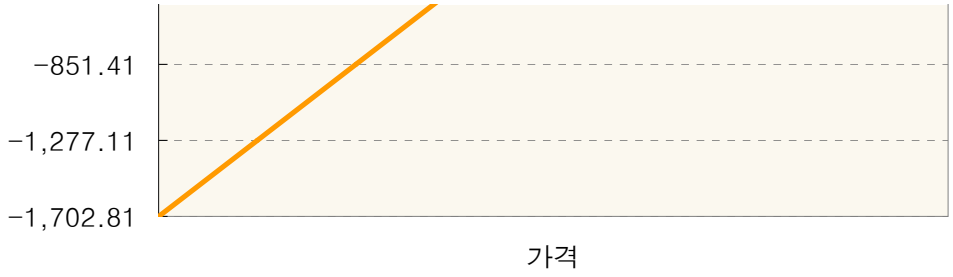
## 2. 만기시점의 손익구조

CLN6-WTI CRUDE FUTURE JUL16

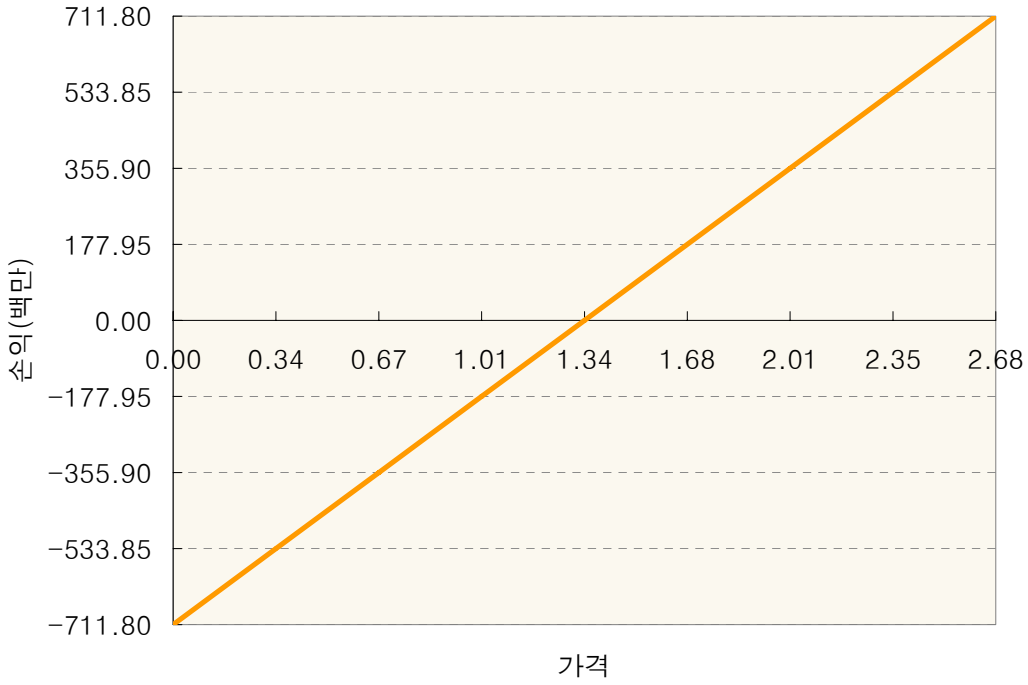



CON6-BRENT CRUDE FUTR JUL16

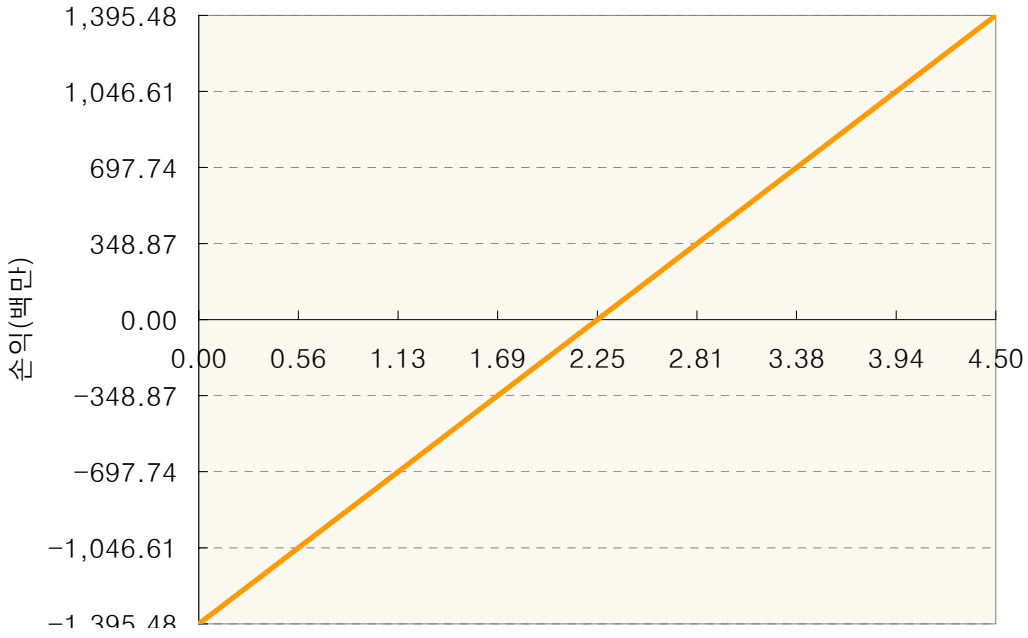


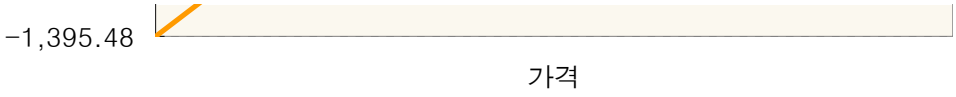


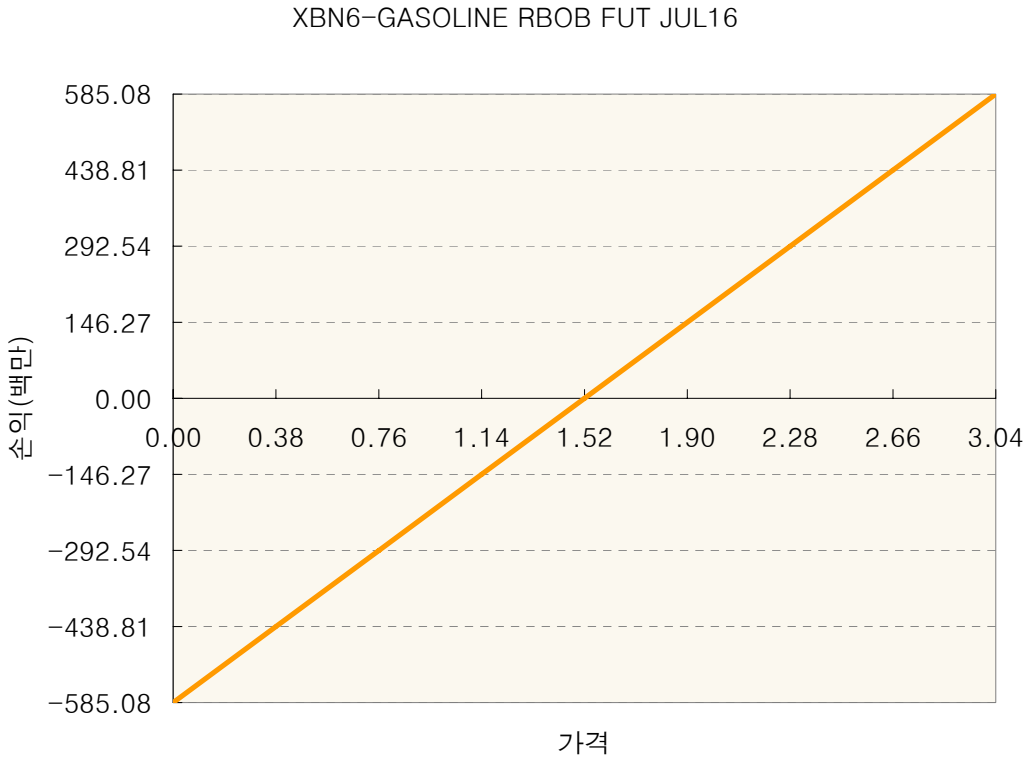

HON6-NY Harb ULSD Fut JUL16




NGN6-NATURAL GAS FUTR JUL16






**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| CLN6 | WTI CRUDE FUTURE JUL16 | 130 |
| CON6 | BRENT CRUDE FUTR JUL16 | 136 |
| HON6 | NY Harb ULSD Fut JUL16 | 57 |
| NGN6 | NATURAL GAS FUTR JUL16 | 112 |
| XBN6 | GASOLINE RBOB FUT JUL16 | 47 |

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

| |
|---|
| 1,331 |

| 공시일 | 2016-05-09 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-05-04 |

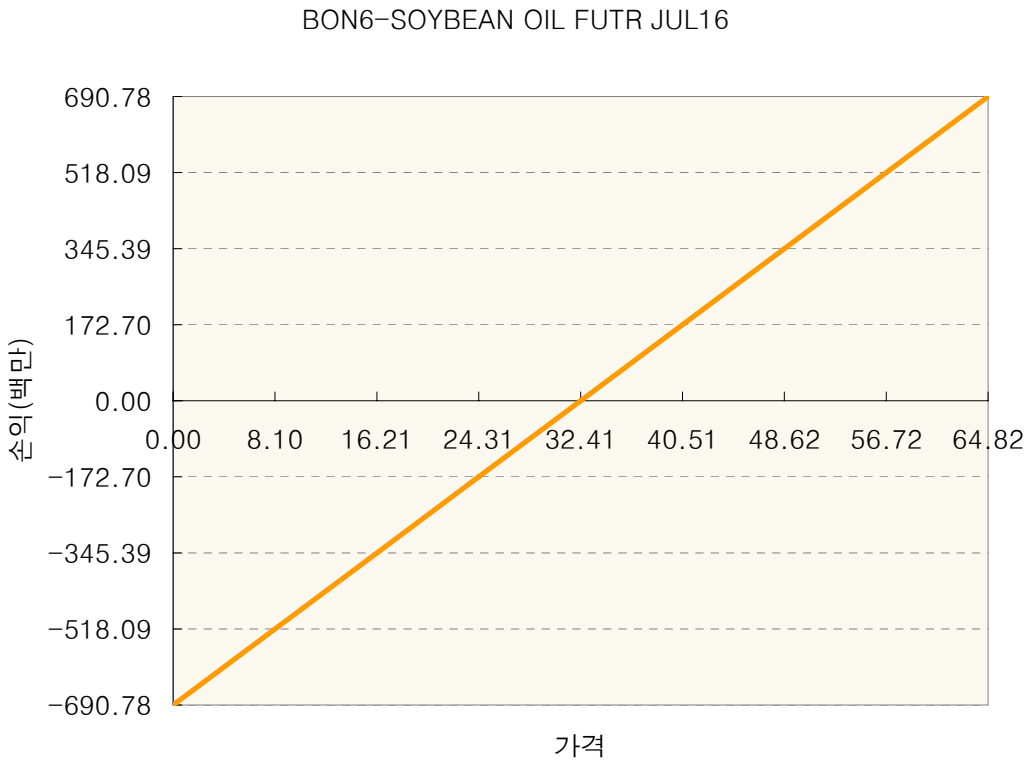
# 애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

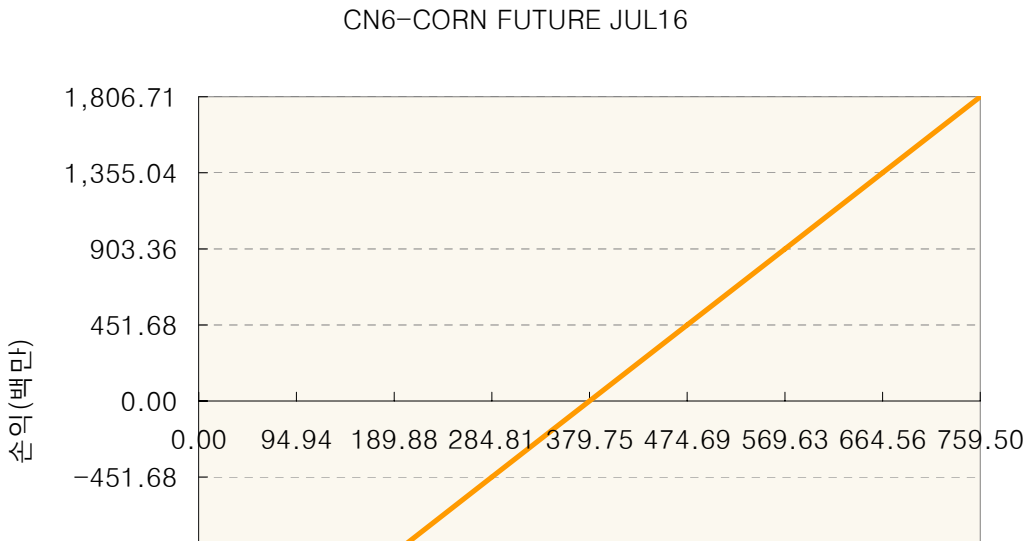
## 1. 계약금액

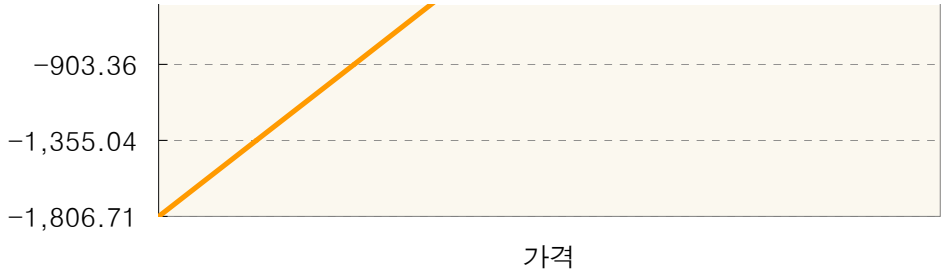
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 7,486 | 0 | 7,486 | |

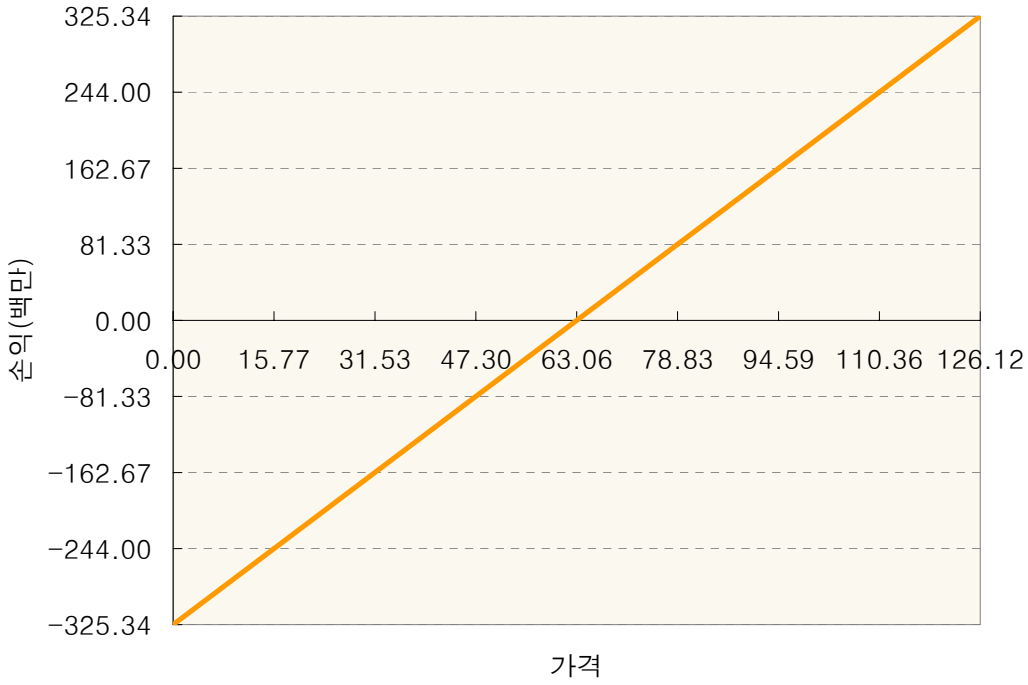
## 2. 만기시점의 손익구조



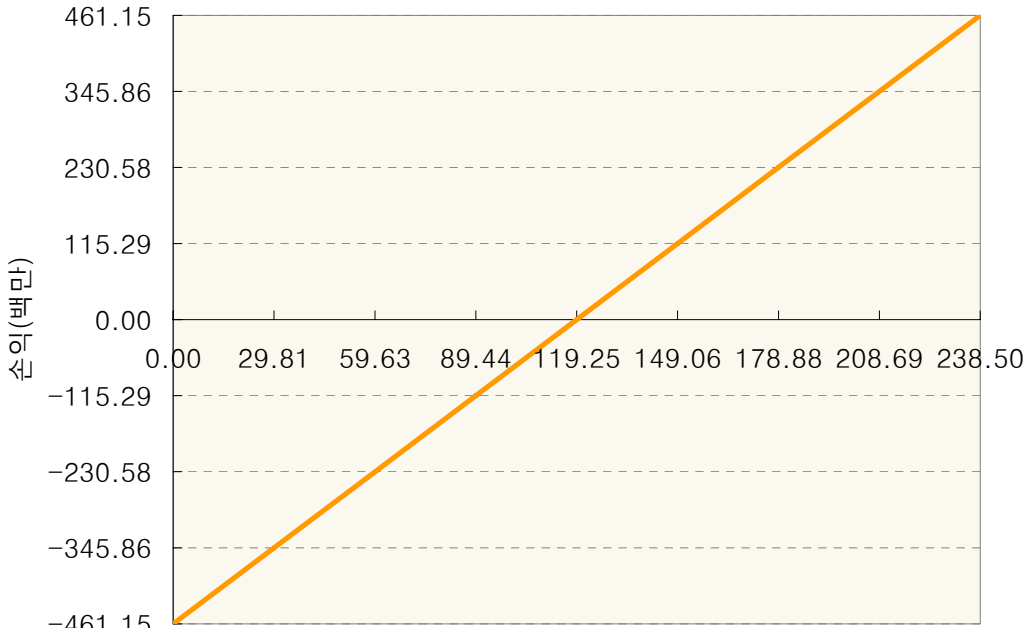



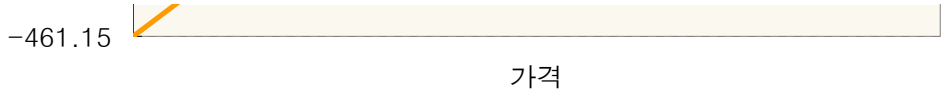



CTN6-COTTON NO.2 FUTR JUL16

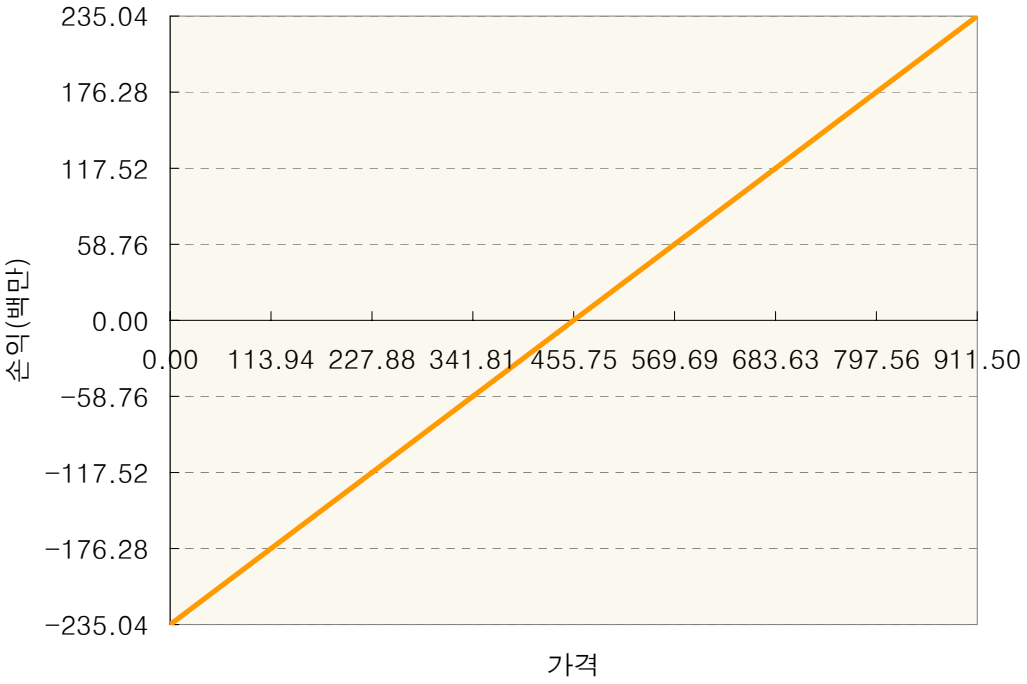



KCN6-COFFEE 'C' FUTURE JUL16

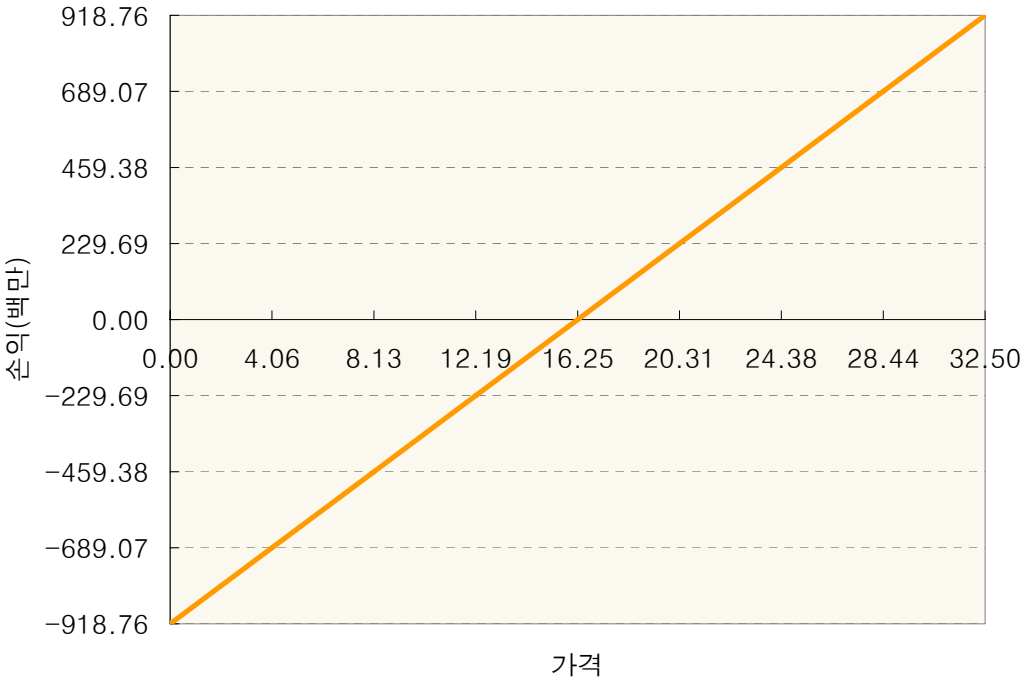




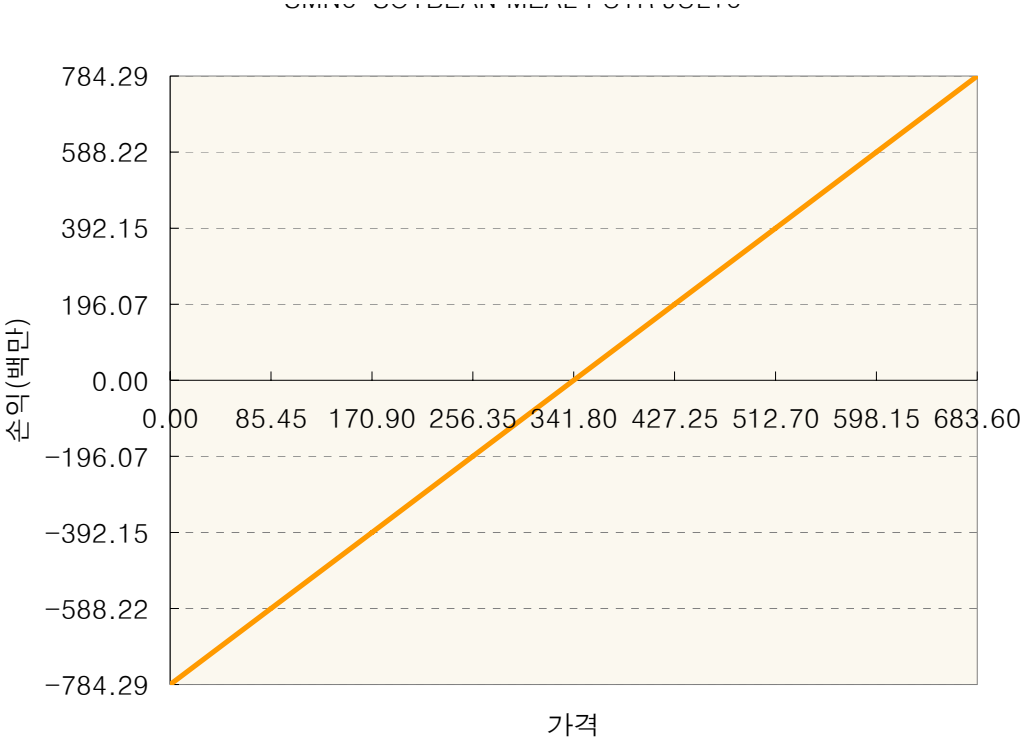

KWN6-KC HRW WHEAT FUT JUL16



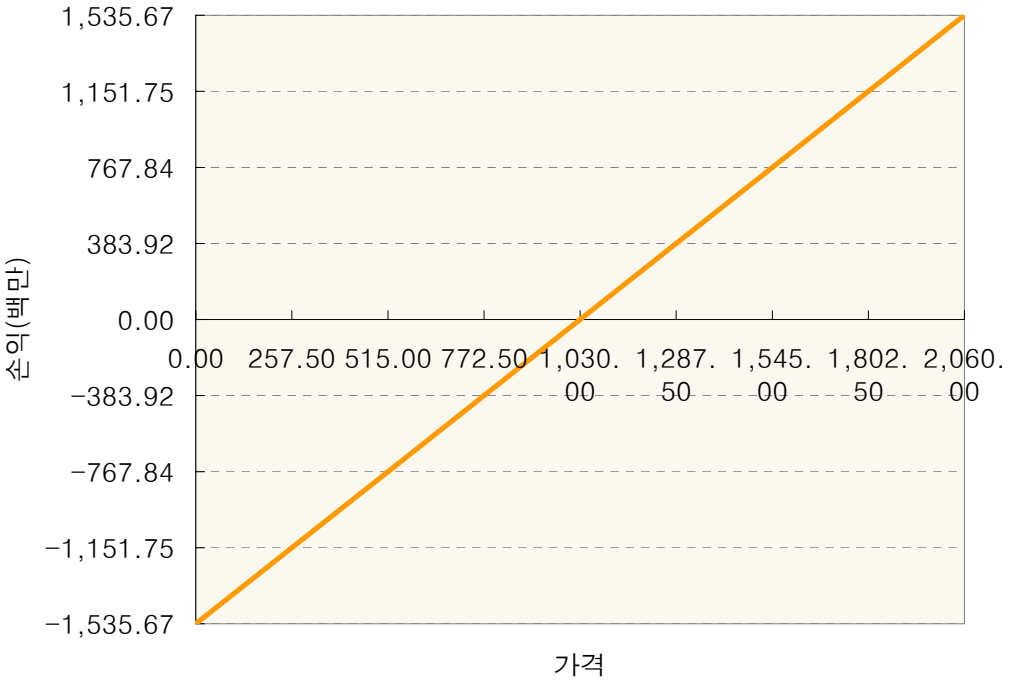

SBN6-SUGAR #11 (WORLD) JUL16



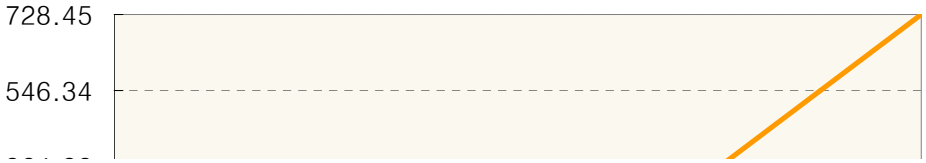

SMN6-SOYBEAN MEAL FUTR JUL16

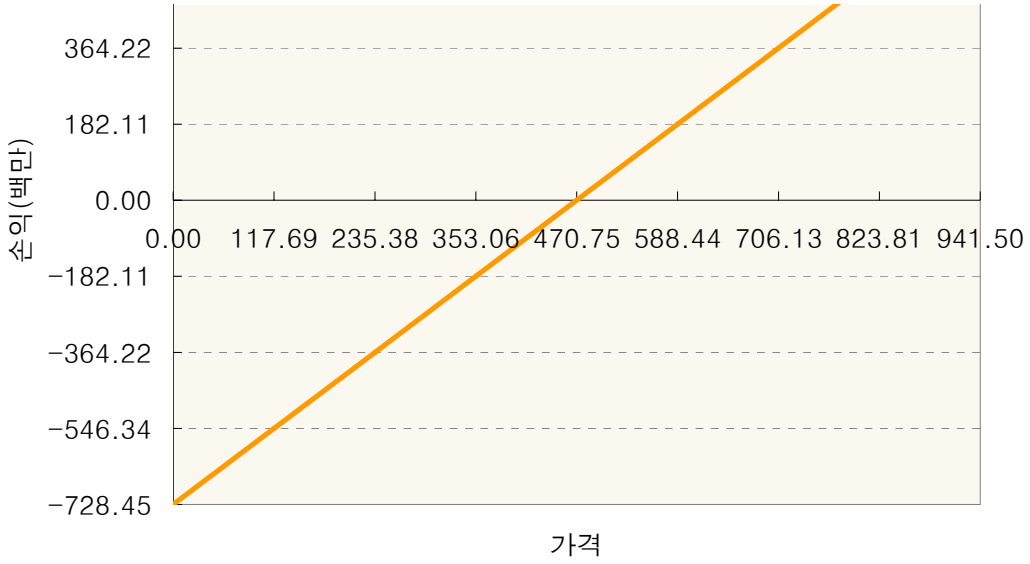



SN6-SOYBEAN FUTURE JUL16




WN6-WHEAT FUTURE(CBT) JUL16






### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| BON6 | SOYBEAN OIL FUTR JUL16 | 55 |
| CN6 | CORN FUTURE JUL16 | 145 |
| CTN6 | COTTON NO.2 FUTR JUL16 | 26 |
| KCN6 | COFFEE 'C' FUTURE JUL16 | 37 |
| KWN6 | KC HRW WHEAT FUT JUL16 | 19 |
| SBN6 | SUGAR #11 (WORLD) JUL16 | 74 |
| SMN6 | SOYBEAN MEAL FUTR JUL16 | 63 |
| SN6 | SOYBEAN FUTURE JUL16 | 123 |
| WN6 | WHEAT FUTURE(CBT) JUL16 | 58 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **819** |