공시일	2016-05-12
기준일	2016-05-11

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	2016-05-12
기준일	2016-05-11

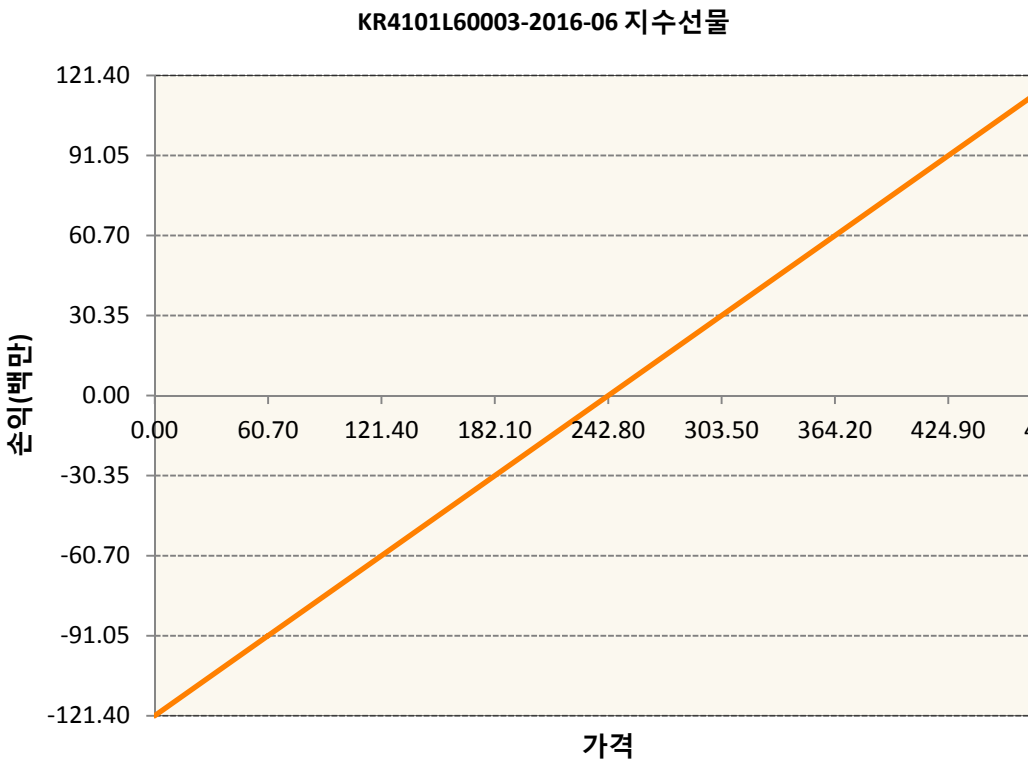
스마트인덱스모

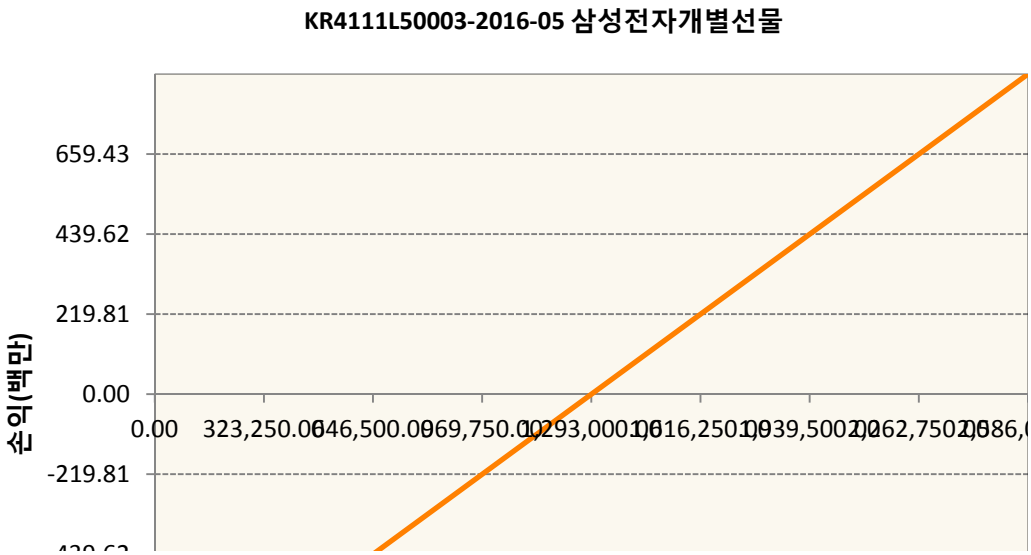
1. 계약금액

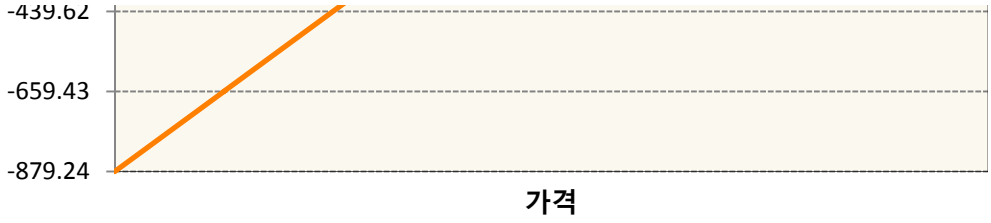
(단위:백만원)

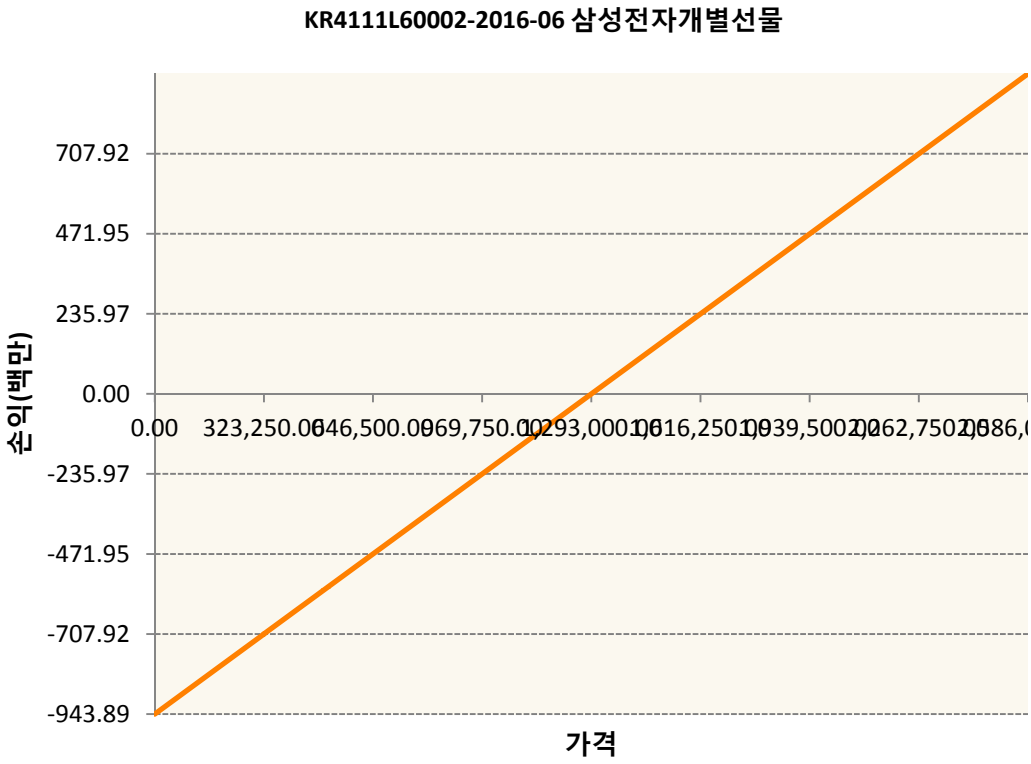
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	944	891	53	장내
누계	유가증권	선물	1,945	0	1,945	장내

2. 만기시점의 손익구조









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							70
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70

-5.33%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
-2.67%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	23	23	23	23	23	23	23
5.33%	47	47	47	47	47	47	47
8.00%	70	70	70	70	70	70	70
KR4111L600	2016-06 삼성전자개별선물						75
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-5.33%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	25	25	25	25	25	25	25
5.33%	50	50	50	50	50	50	50
8.00%	75	75	75	75	75	75	75

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

144

공시일	2016-05-12
기준일	2016-05-11

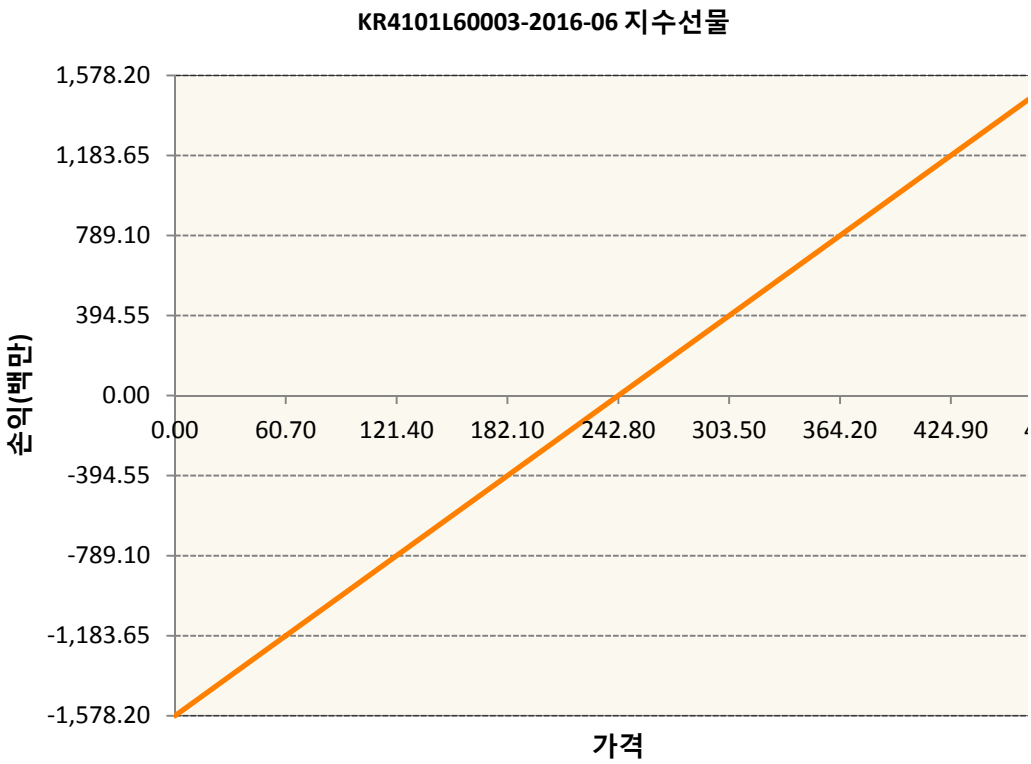
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,578	0	1,578	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L600 2016-06 지수선물							126
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
-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%	126	126	126	126	126	126	126

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

103

공시일	2016-05-12
기준일	2016-05-11

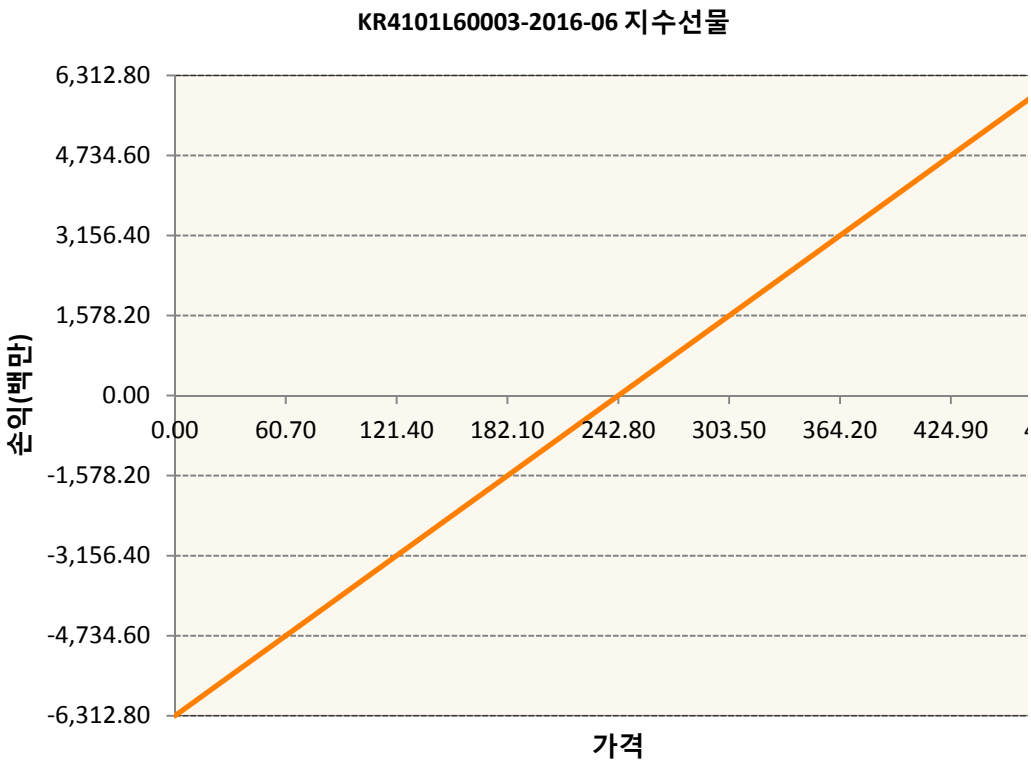
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	6,313	0	6,313	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)

412

공시일	2016-05-12
기준일	2016-05-11

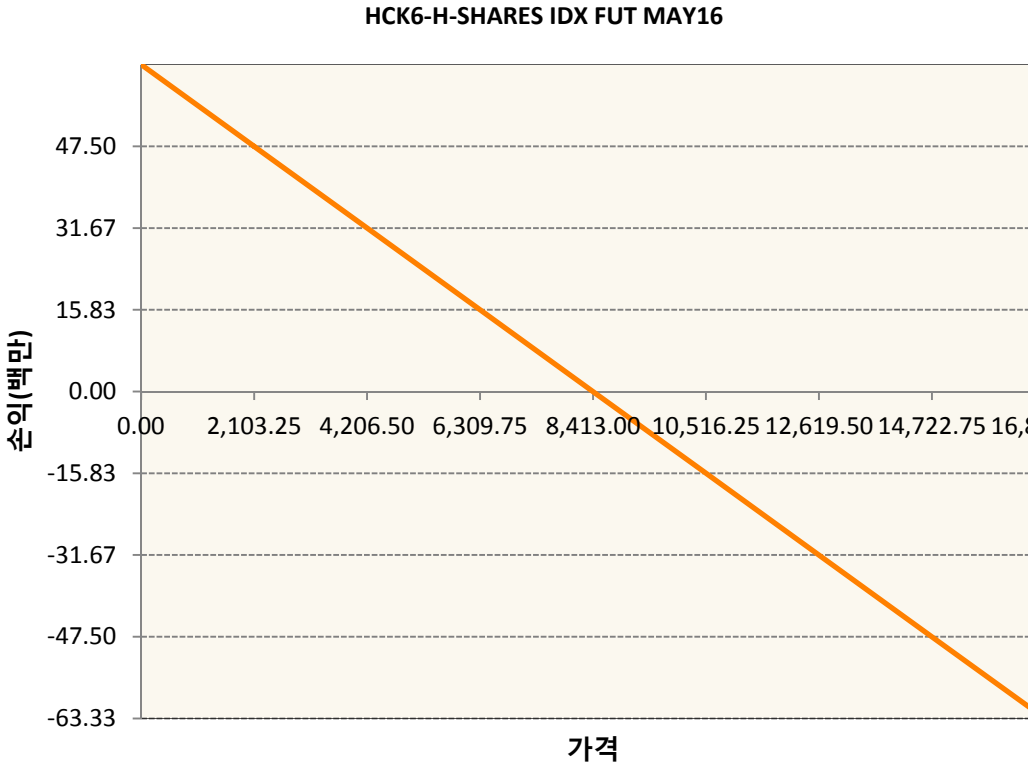
아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

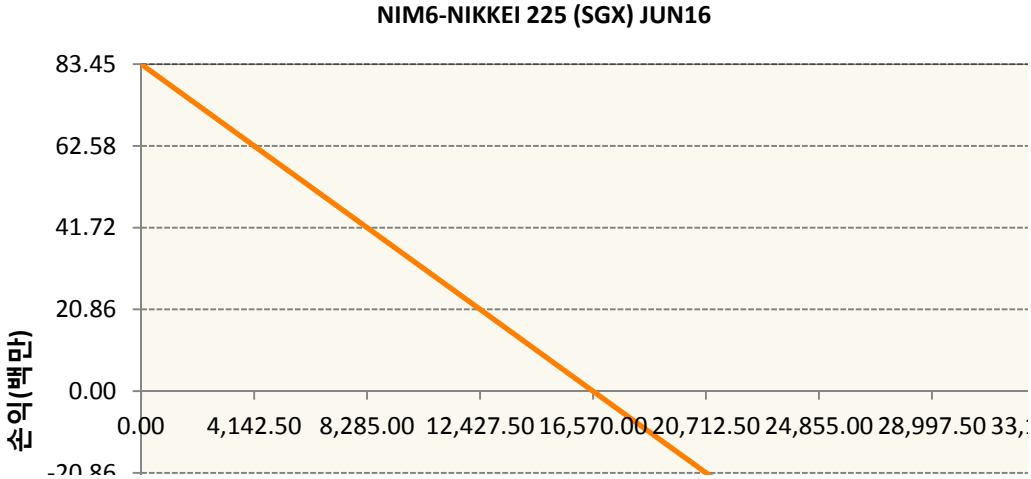
1. 계약금액

(단위:백만원)

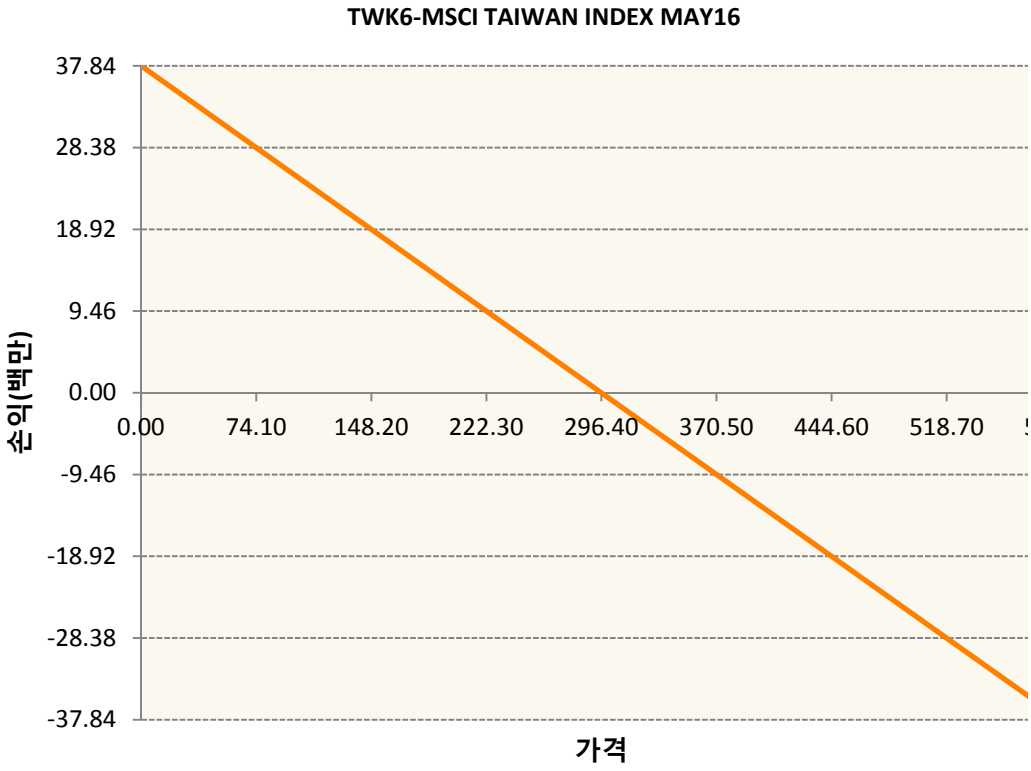
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	144	-144	
누계	유가증권	선물	0	63	-63	장내

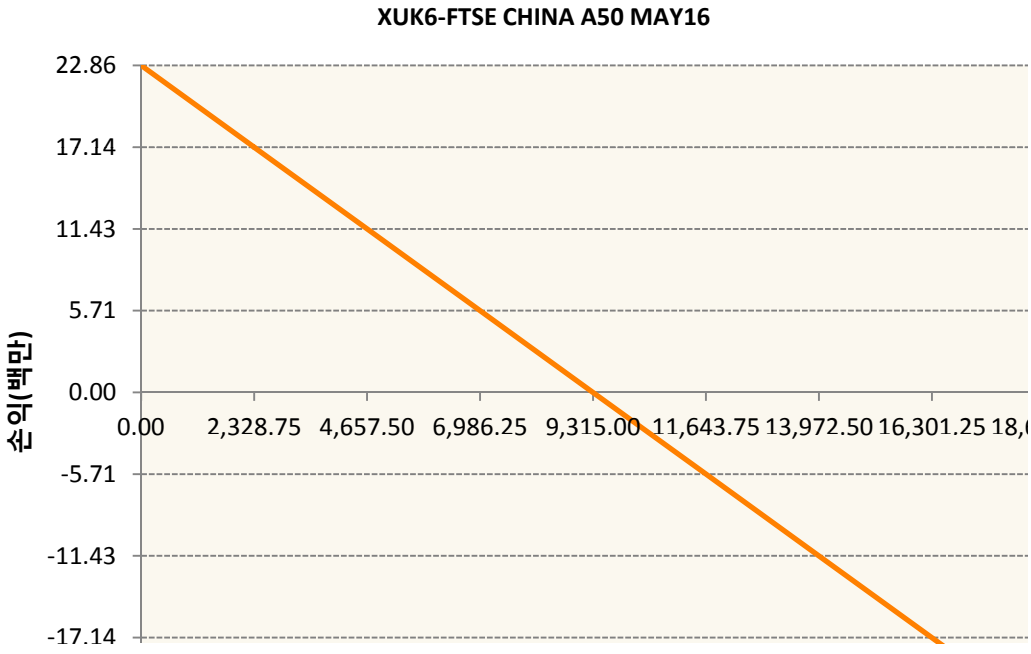
2. 만기시점의 손익구조

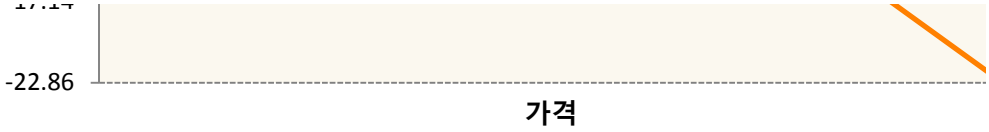





-41.72
-62.58
-83.45
가격


TWK6-MSCI TAIWAN INDEX MAY16
37.84
28.38
18.92
9.46
0.00
-9.46
-18.92
-28.38
-37.84
순익(백만)
0.00
74.10
148.20
222.30
296.40
370.50
444.60
518.70
가격


XUK6-FTSE CHINA A50 MAY16
22.86
17.14
11.43
5.71
0.00
-5.71
-11.43
-17.14
순익(백만)
0.00
2,328.75
4,657.50
6,986.25
9,315.00
11,643.75
13,972.50
16,301.25



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCK6	H-SHARES IDX FUT MAY16	5
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)

22

공시일	2016-05-12
기준일	2016-05-11

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)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S160222	849

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

729

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-05-12
기준일	2016-05-11

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	252
SWCSI50000 신한CSI500미래S160308-1	116

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,097

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-05-12
기준일	2016-05-11

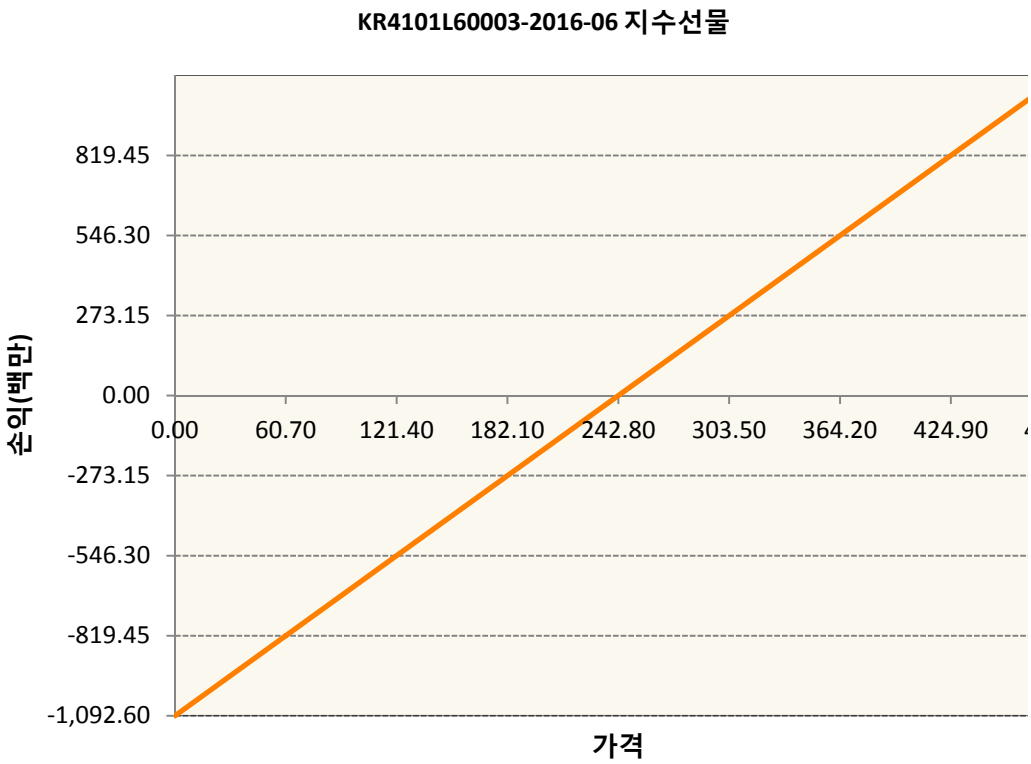
KOSPI200 레버리지 목표전환형 3

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	1,093	0	1,093	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)

71

공시일	2016-05-12
기준일	2016-05-11

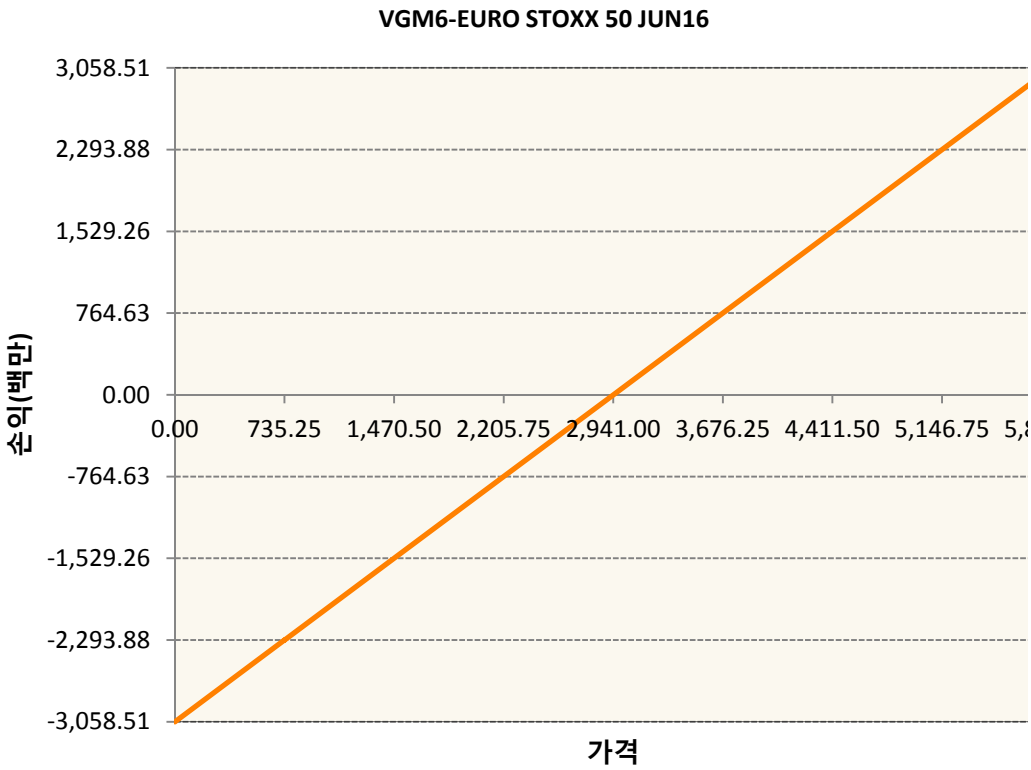
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,059	0	3,059	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM6	EURO STOXX 50 JUN16	245

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

(단위:백만원)

292

공시일	2016-05-12
기준일	2016-05-11

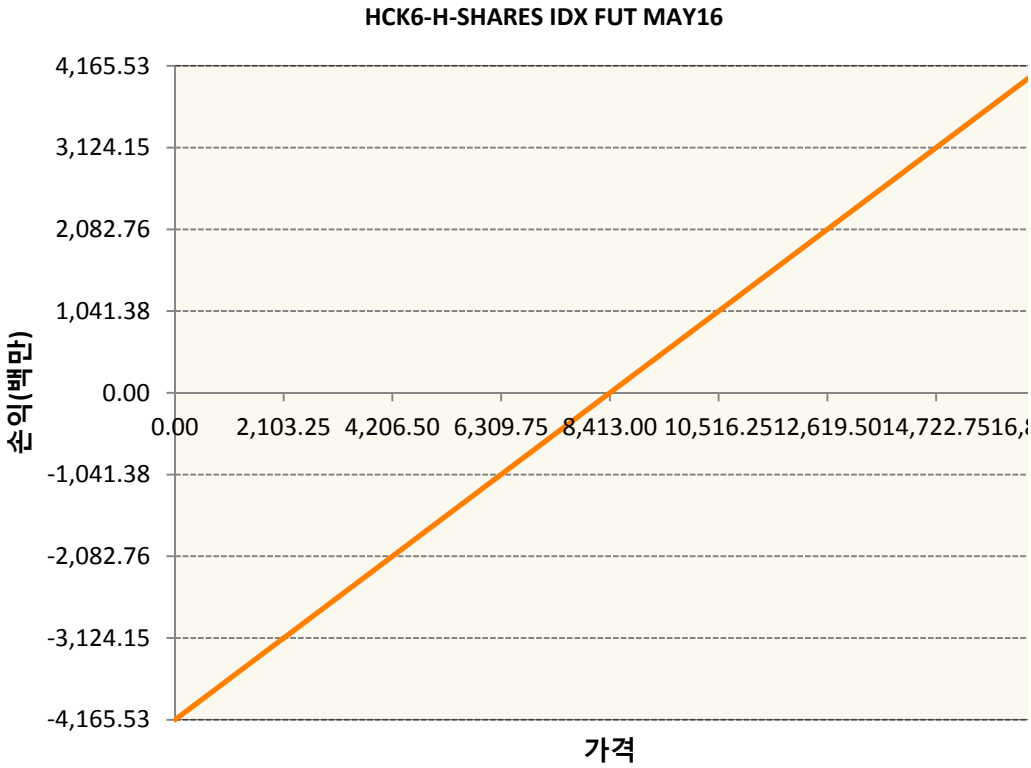
차이나인덱스모(주식-파생형)

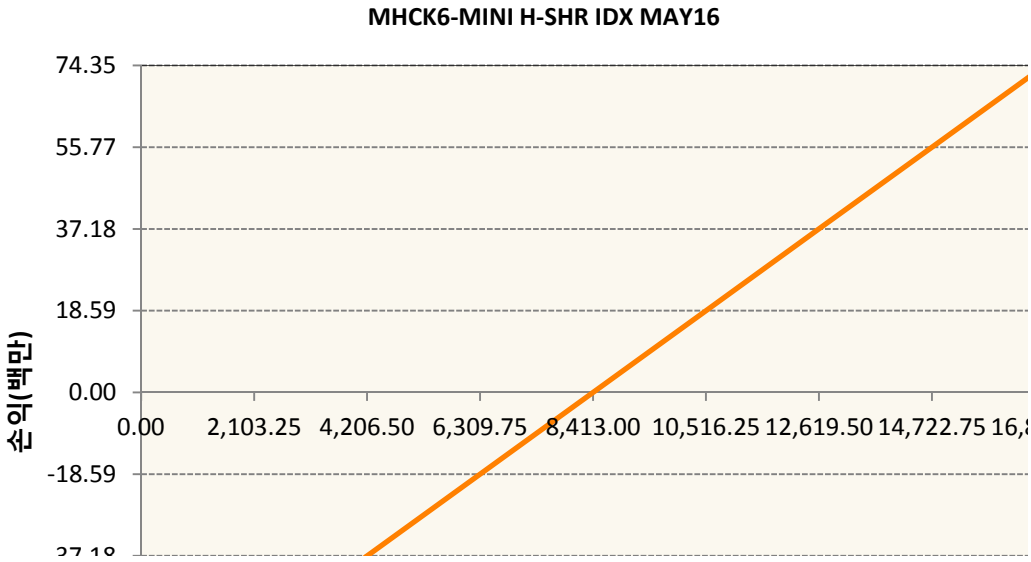
1. 계약금액

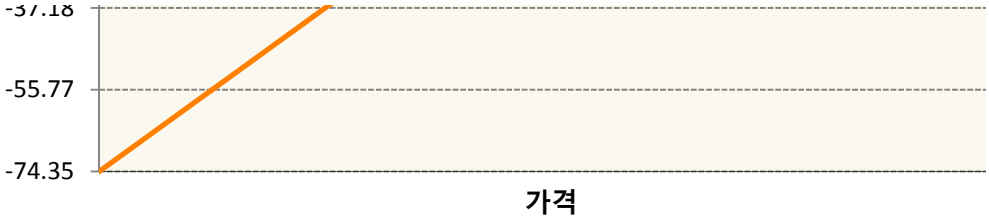
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,240	0	4,240	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCK6	H-SHARES IDX FUT MAY16	333
MHCK6	MINI H-SHR IDX MAY16	6

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

492

공시일	2016-05-12
기준일	2016-05-11

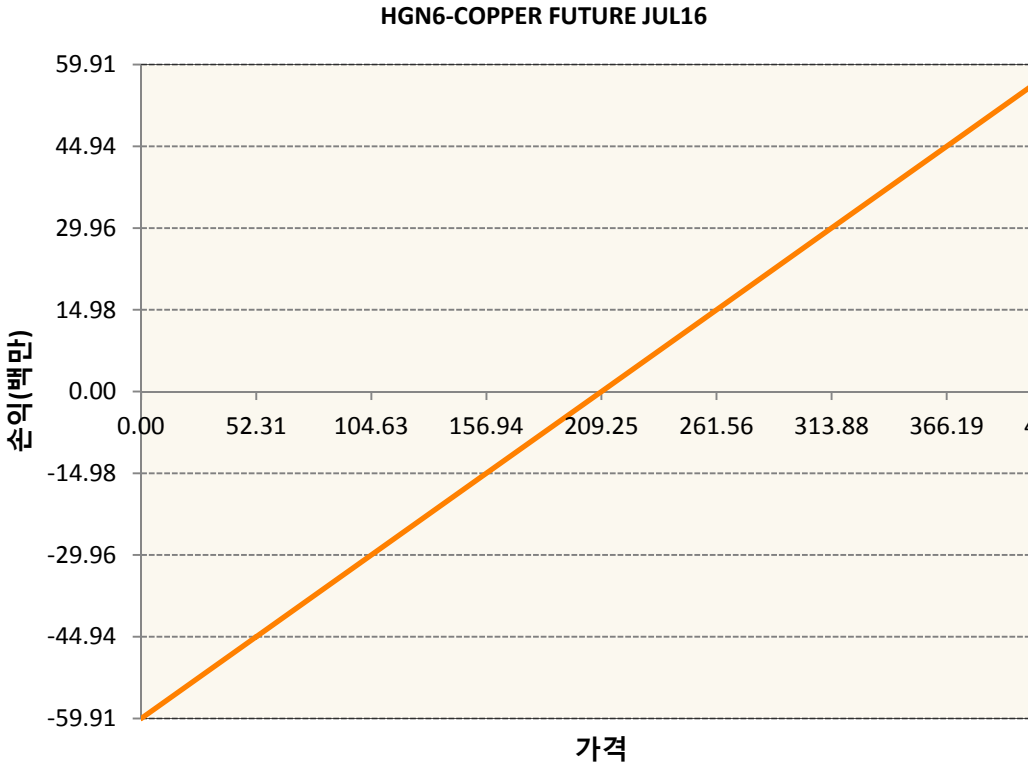
메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

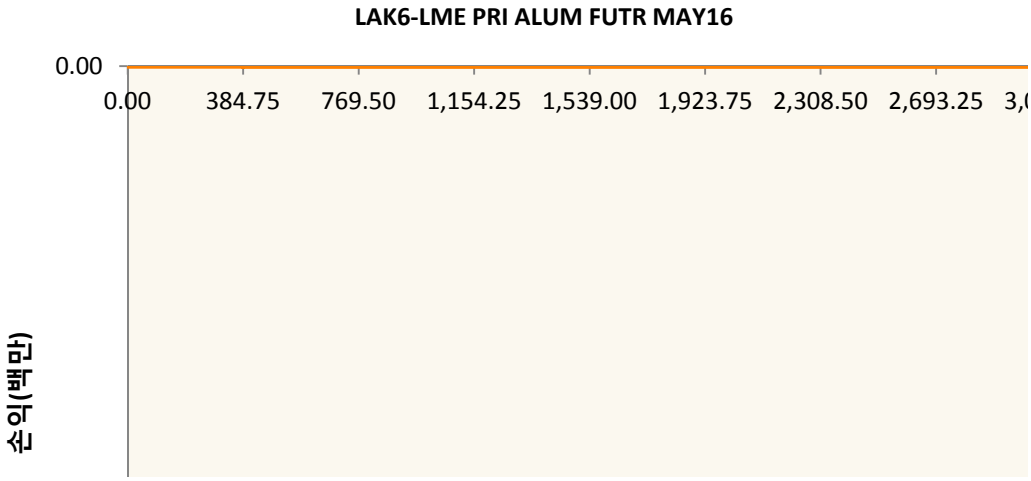
1. 계약금액

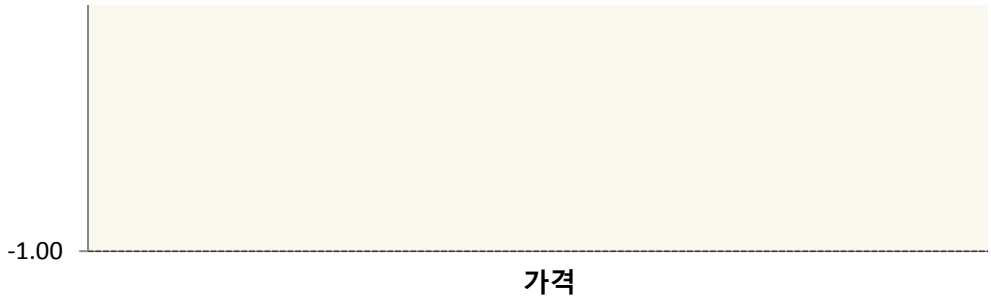
(단위:백만원)

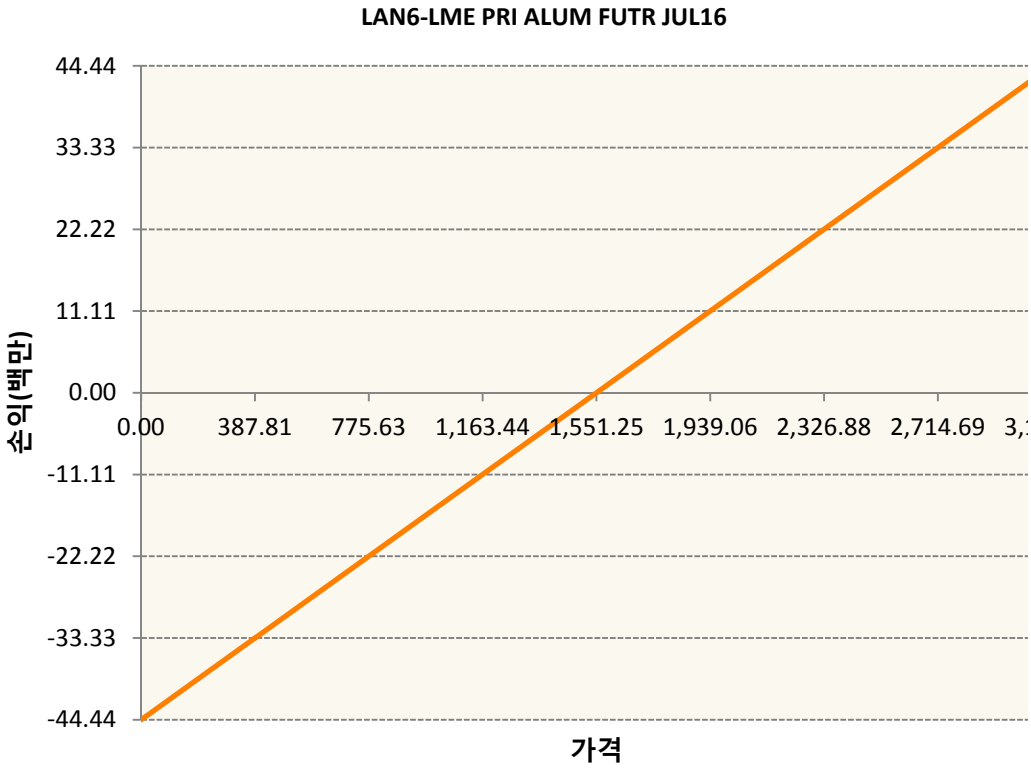
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	59	0	59	
누계	유가증권	선물	404	100	304	

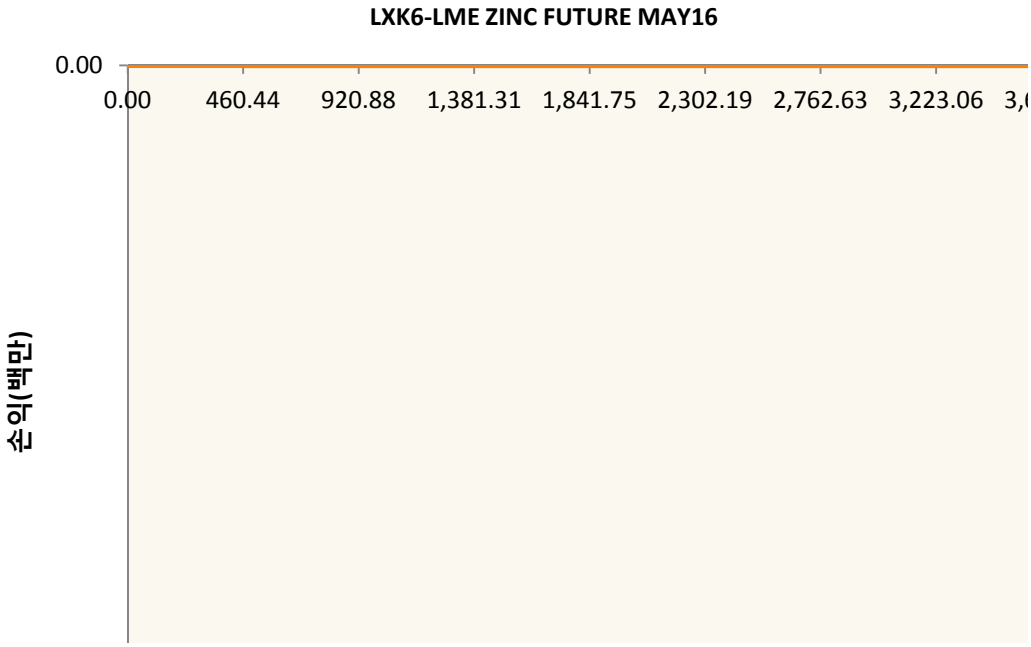
2. 만기시점의 손익구조

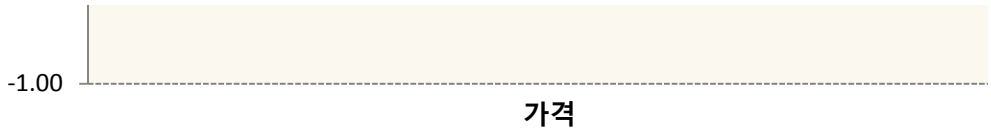


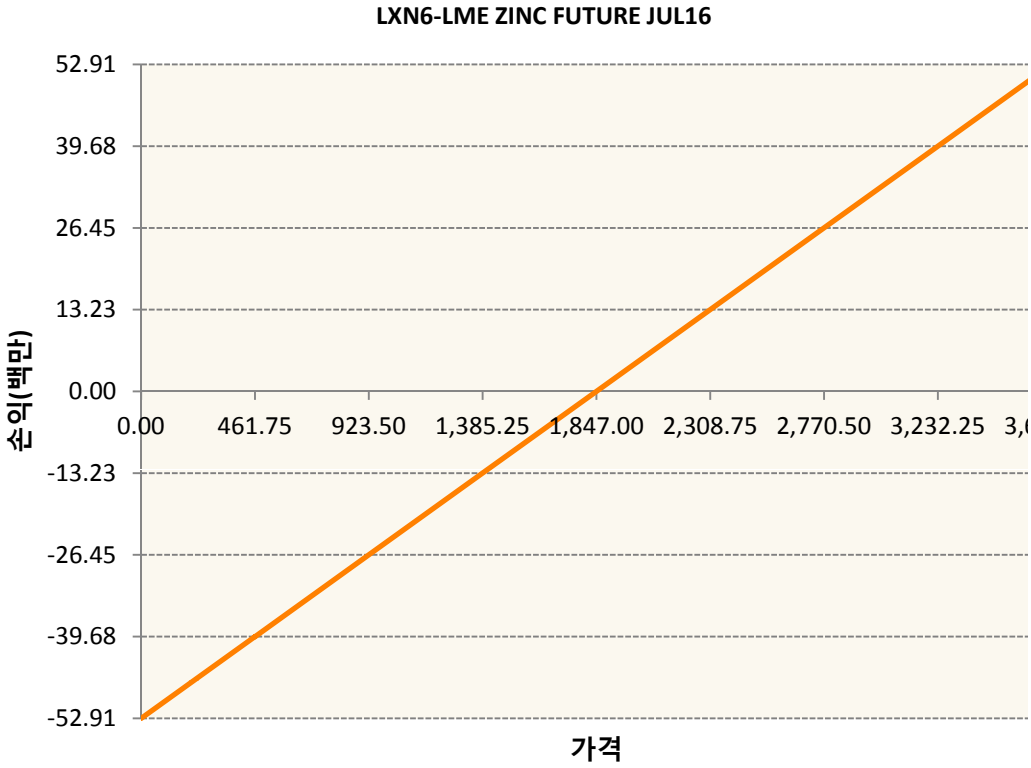


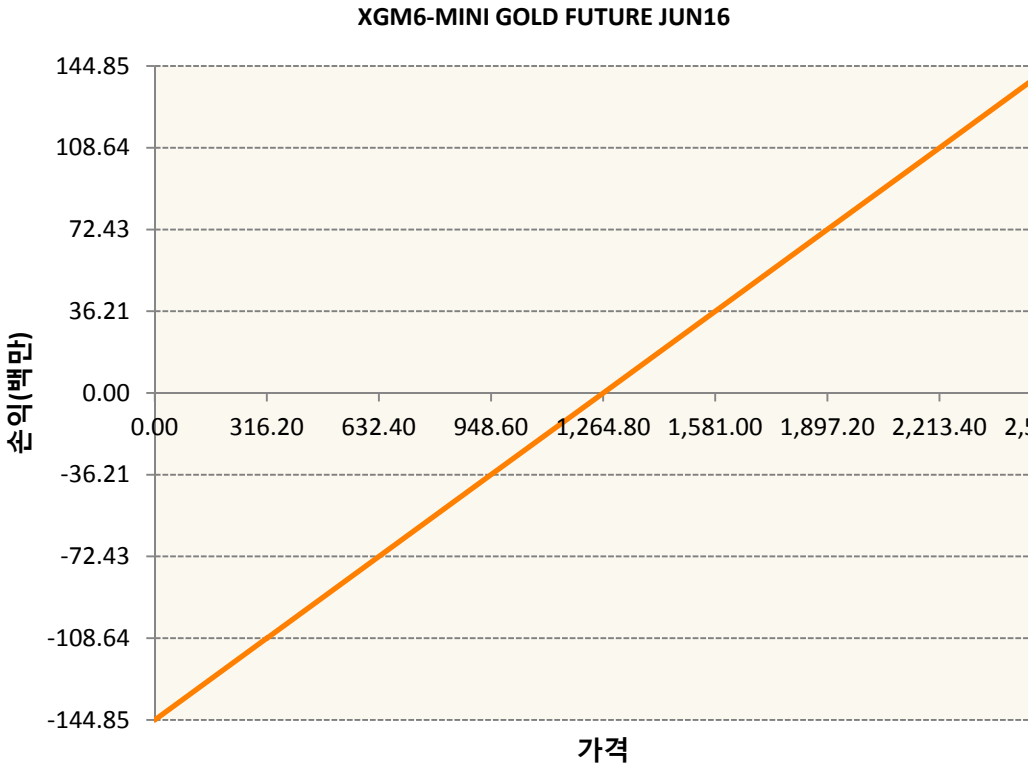

-1.00
가격

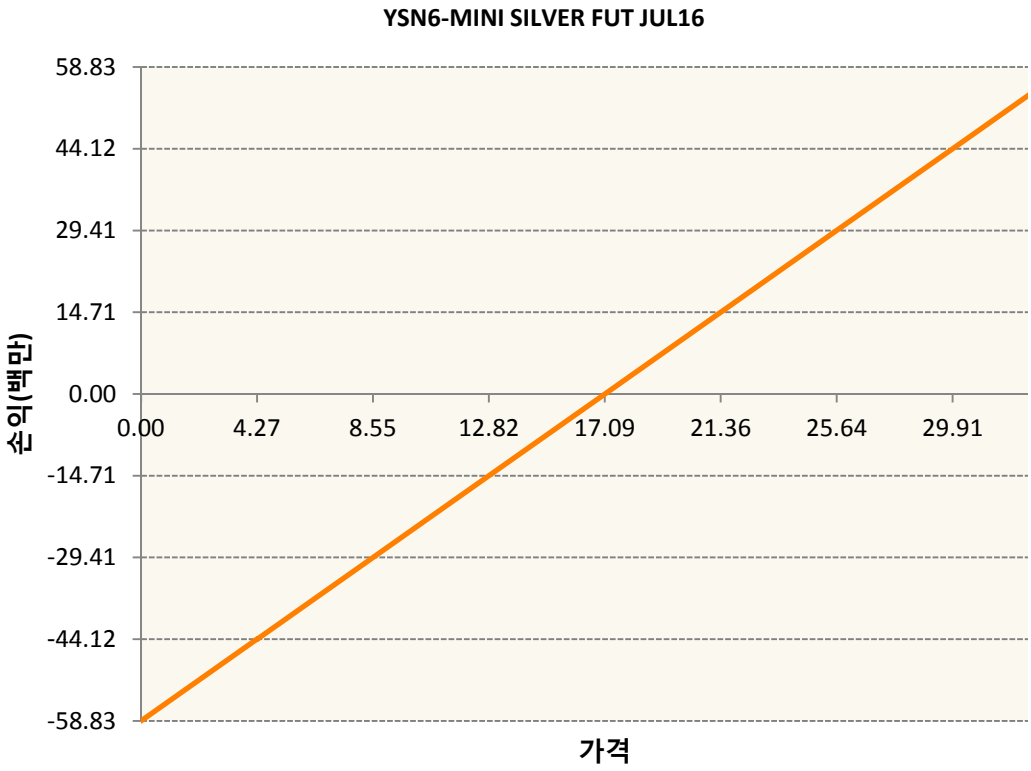

LAN6-LME PRI ALUM FUTR JUL16
44.44
33.33
22.22
11.11
0.00
-11.11
-22.22
-33.33
-44.44
0.00
387.81
775.63
1,163.44
1,551.25
1,939.06
2,326.88
2,714.69
순익(백만)
가격


LXK6-LME ZINC FUTURE MAY16
0.00
0.00
460.44
920.88
1,381.31
1,841.75
2,302.19
2,762.63
3,223.06
순익(백만)


-1.00
가격


LXN6-LME ZINC FUTURE JUL16
52.91
39.68
26.45
13.23
0.00
-13.23
-26.45
-39.68
-52.91
0.00
461.75
923.50
1,385.25
1,847.00
2,308.75
2,770.50
3,232.25
순익(백만)
가격


XGM6-MINI GOLD FUTURE JUN16
144.85
108.64
72.43
36.21
0.00
-36.21
-72.43
-108.64
-144.85
0.00
316.20
632.40
948.60
1,264.80
1,581.00
1,897.20
2,213.40
순익(백만)
가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HGN6	COPPER FUTURE JUL16	5
LAK6	LME PRI ALUM FUTR MAY16	0.1
LAN6	LME PRI ALUM FUTR JUL16	4
LXK6	LME ZINC FUTURE MAY16	0.1
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)

30

공시일	2016-05-12
기준일	2016-05-11

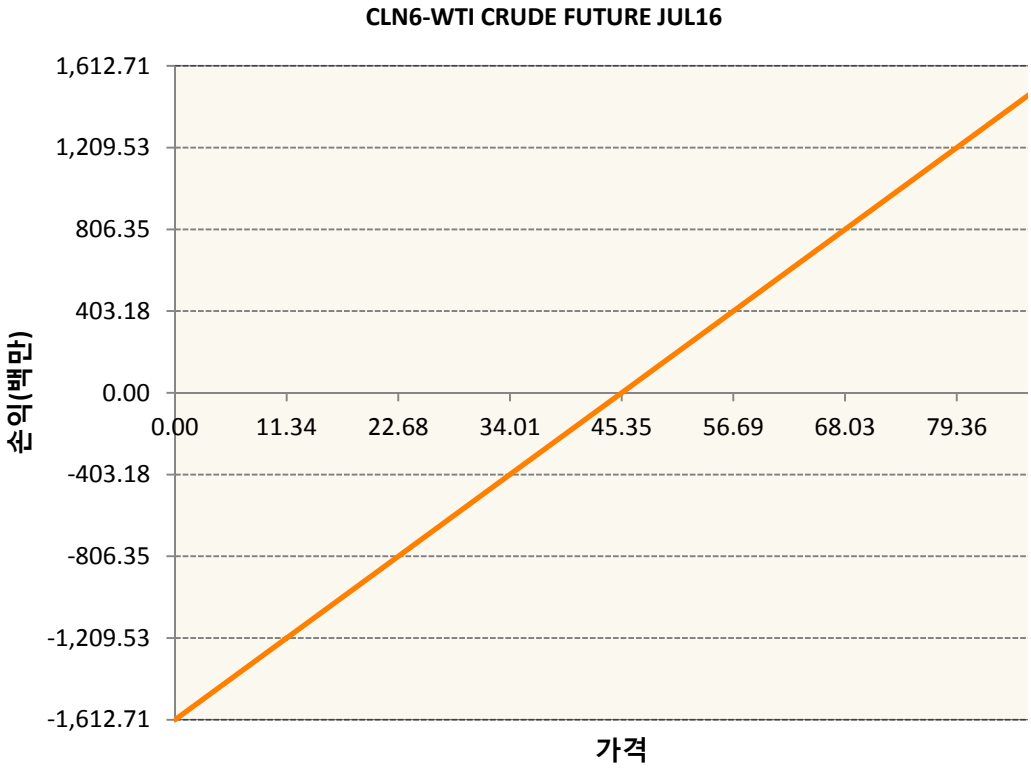
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

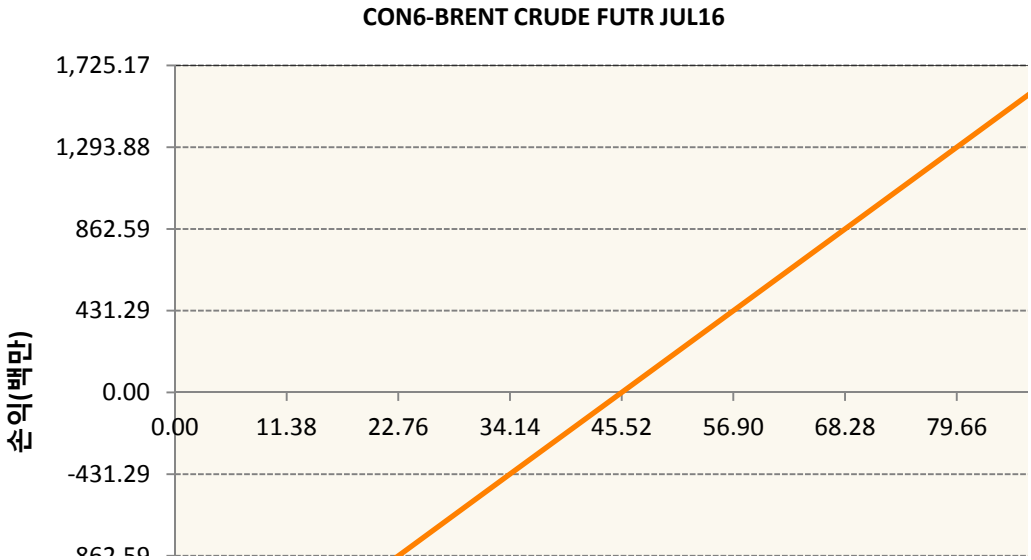
1. 계약금액

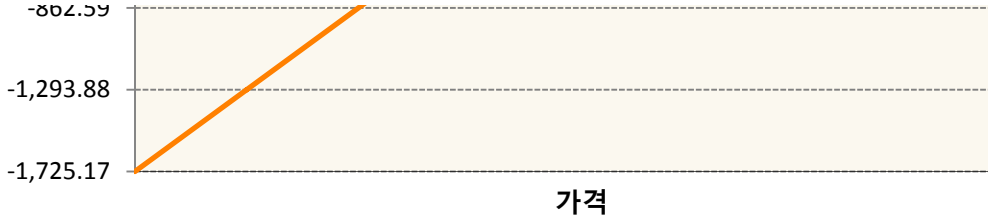
(단위:백만원)

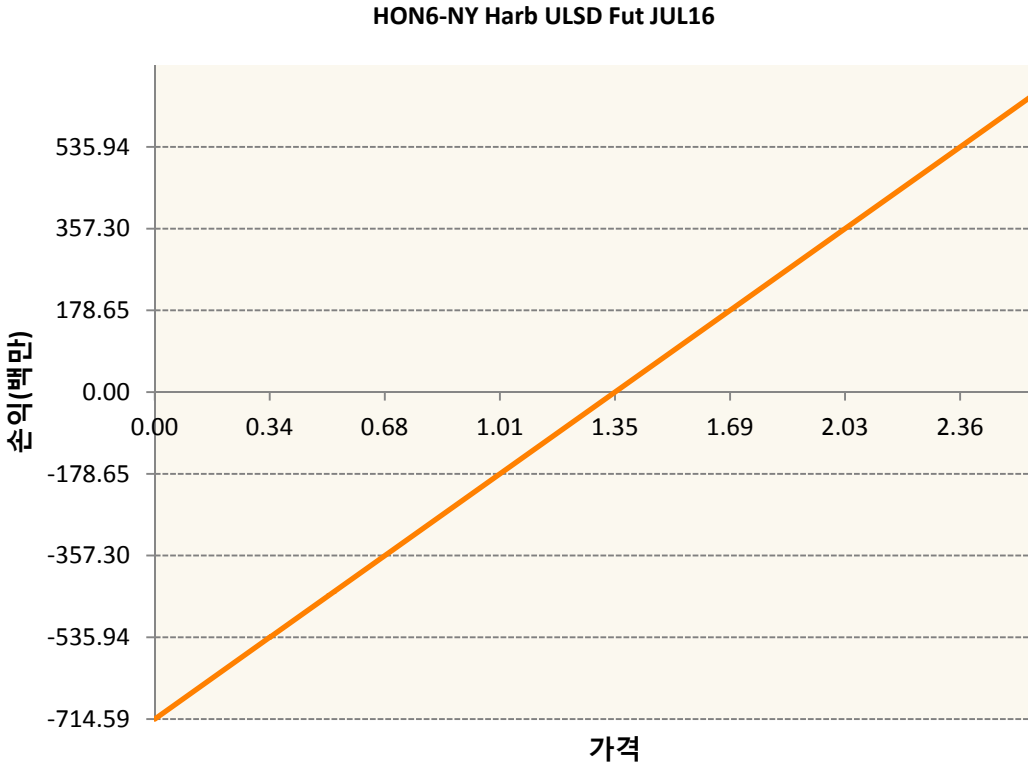
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,044	0	6,044	

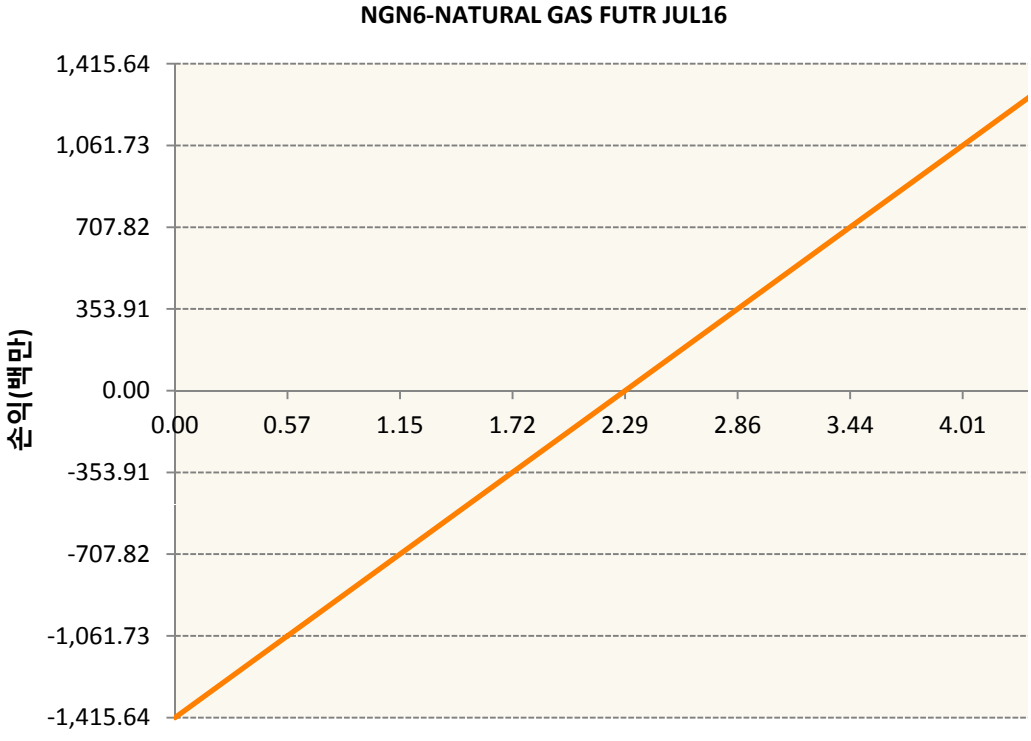
2. 만기시점의 손익구조



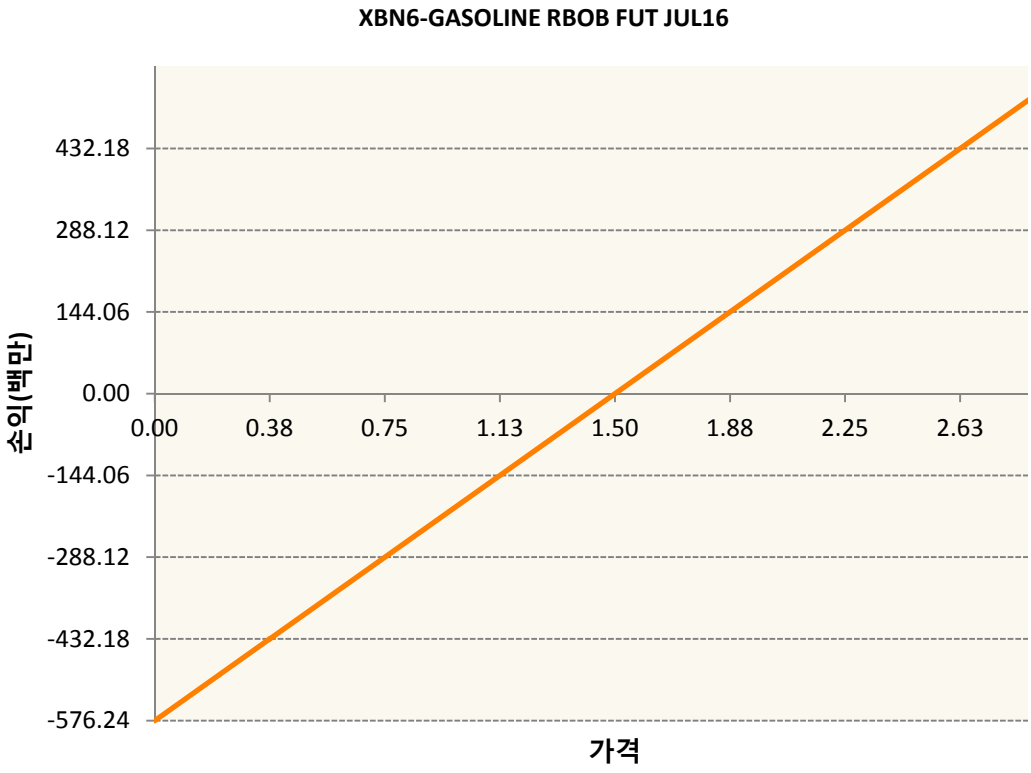



-1,293.88
-1,725.17
가격


HON6-NY Harb ULSD Fut JUL16
535.94
357.30
178.65
0.00
-178.65
-357.30
-535.94
-714.59
0.00
0.34
0.68
1.01
1.35
1.69
2.03
2.36
순익(백만)
가격


NGN6-NATURAL GAS FUTR JUL16
1,415.64
1,061.73
707.82
353.91
0.00
-353.91
-707.82
-1,061.73
-1,415.64
0.00
0.57
1.15
1.72
2.29
2.86
3.44
4.01
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLN6	WTI CRUDE FUTURE JUL16	129
CON6	BRENT CRUDE FUTR JUL16	138
HON6	NY Harb ULSD Fut JUL16	57
NGN6	NATURAL GAS FUTR JUL16	113
XBN6	GASOLINE RBOB FUT JUL16	46

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,335

공시일	2016-05-12
기준일	2016-05-11

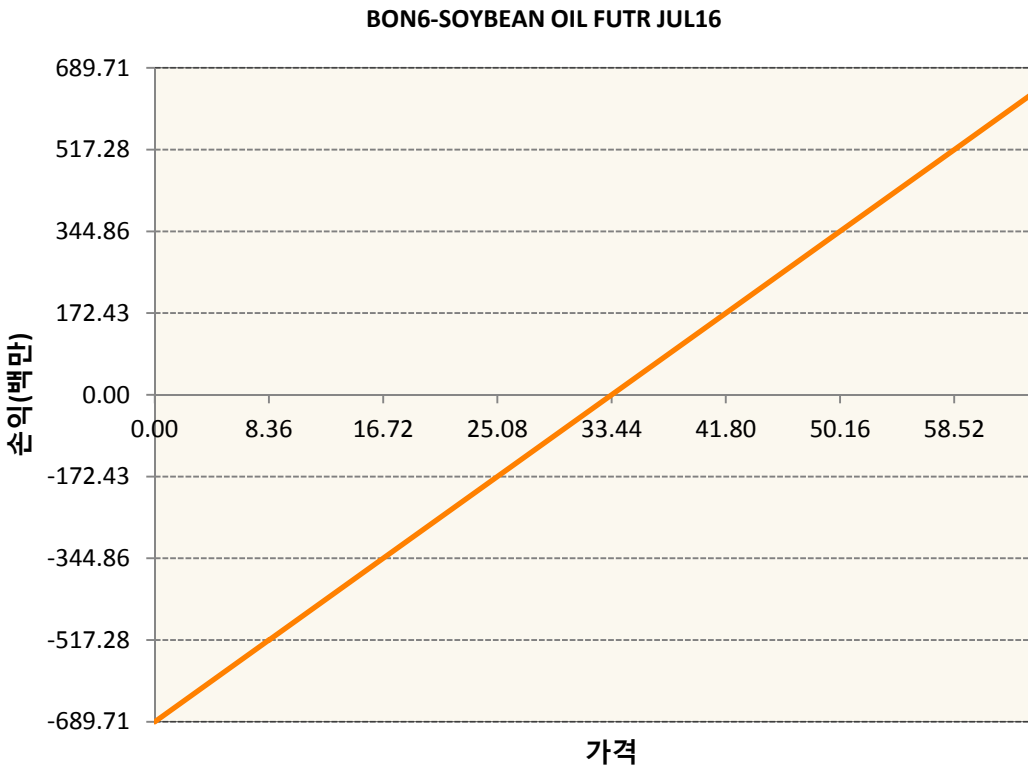
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

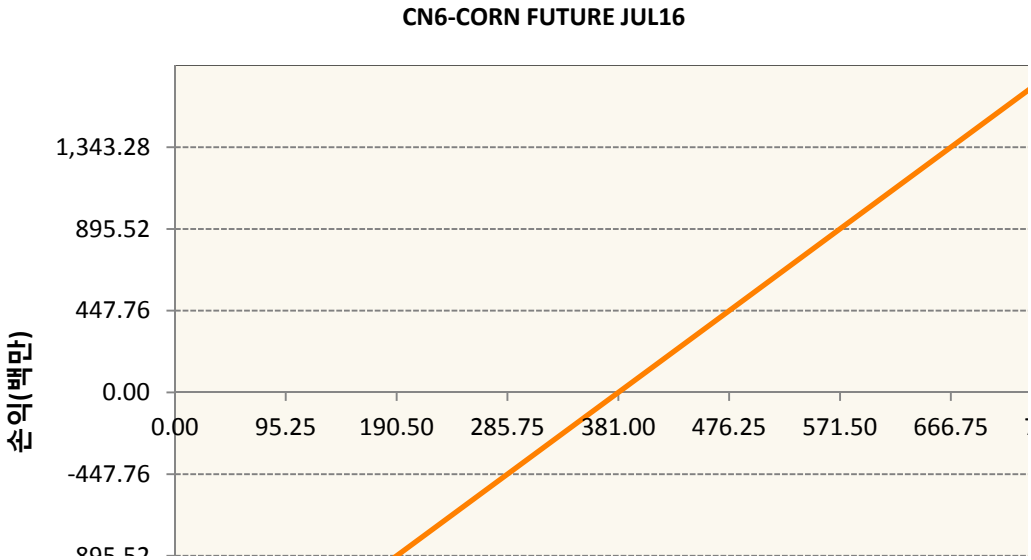
1. 계약금액

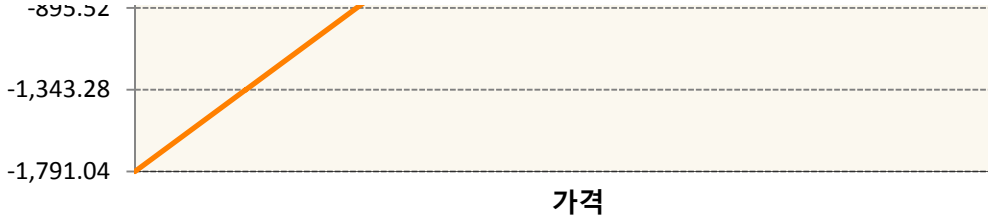
(단위:백만원)

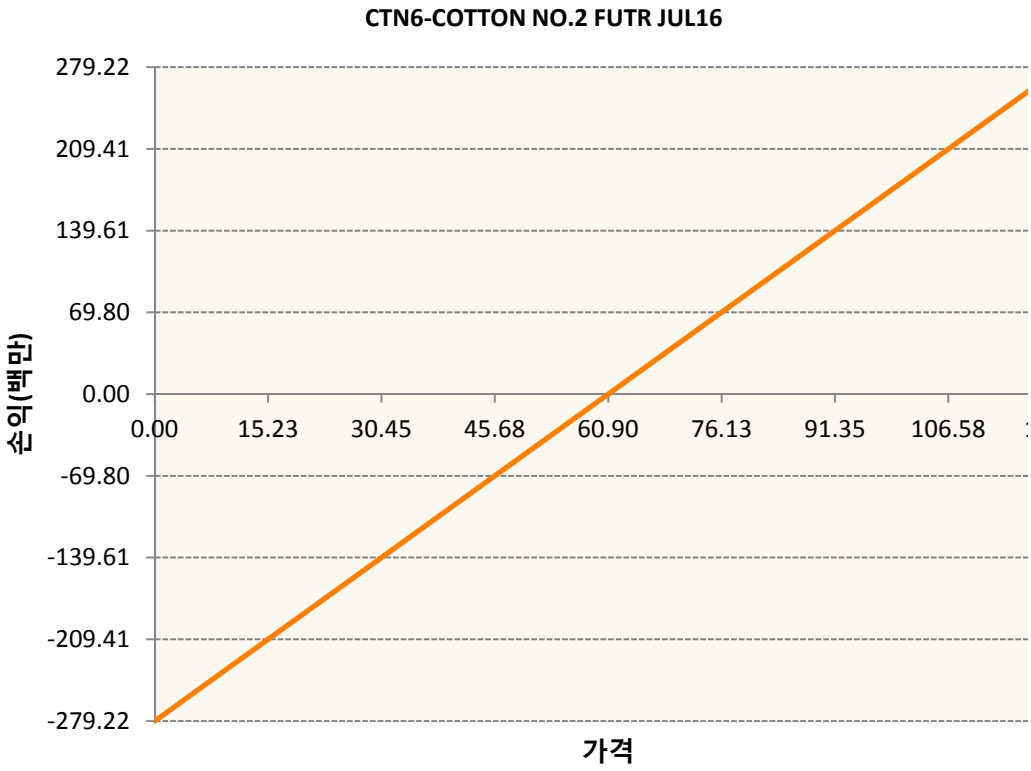
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,467	0	7,467	

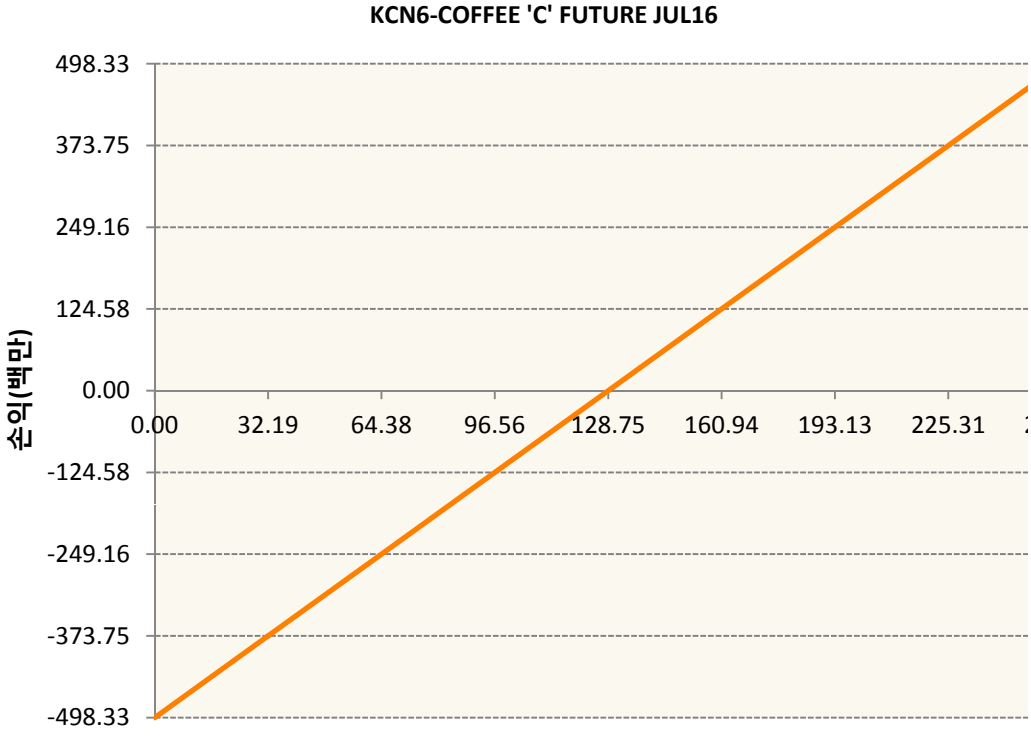
2. 만기시점의 손익구조



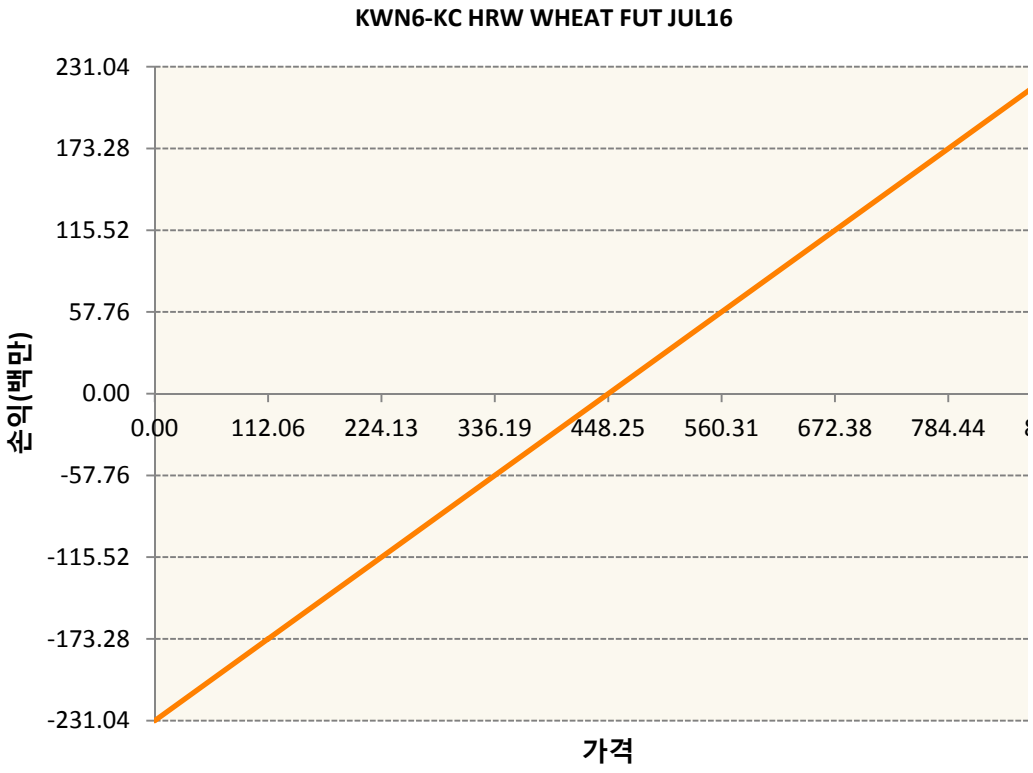


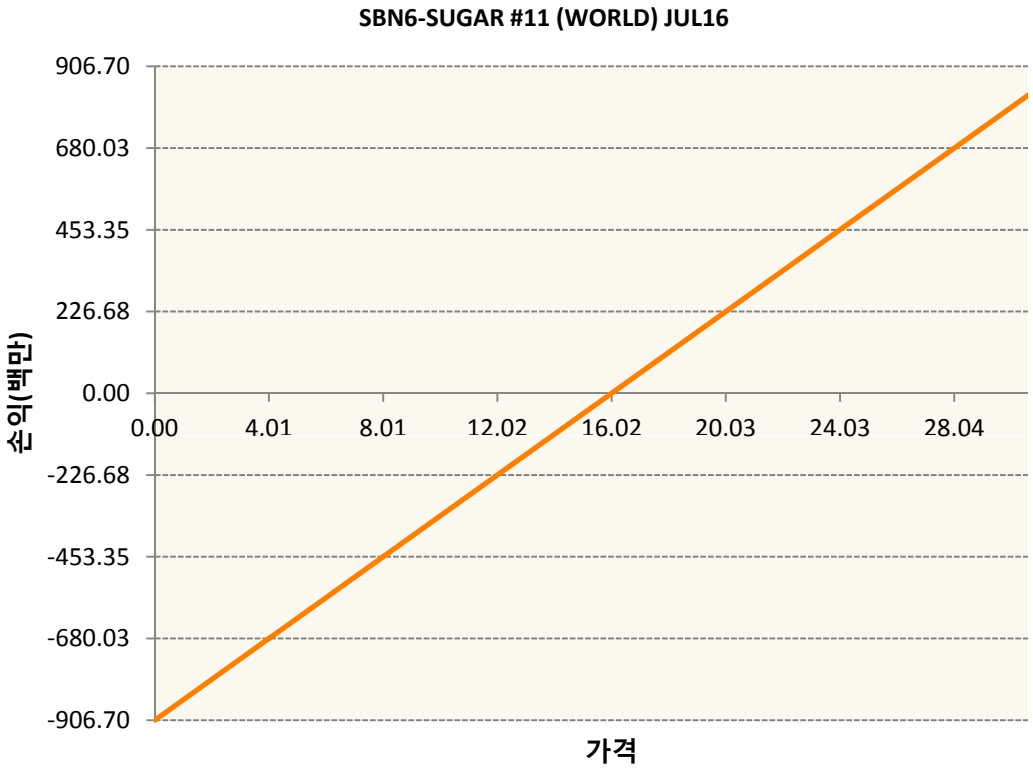

-1,343.28
-1,791.04
가격

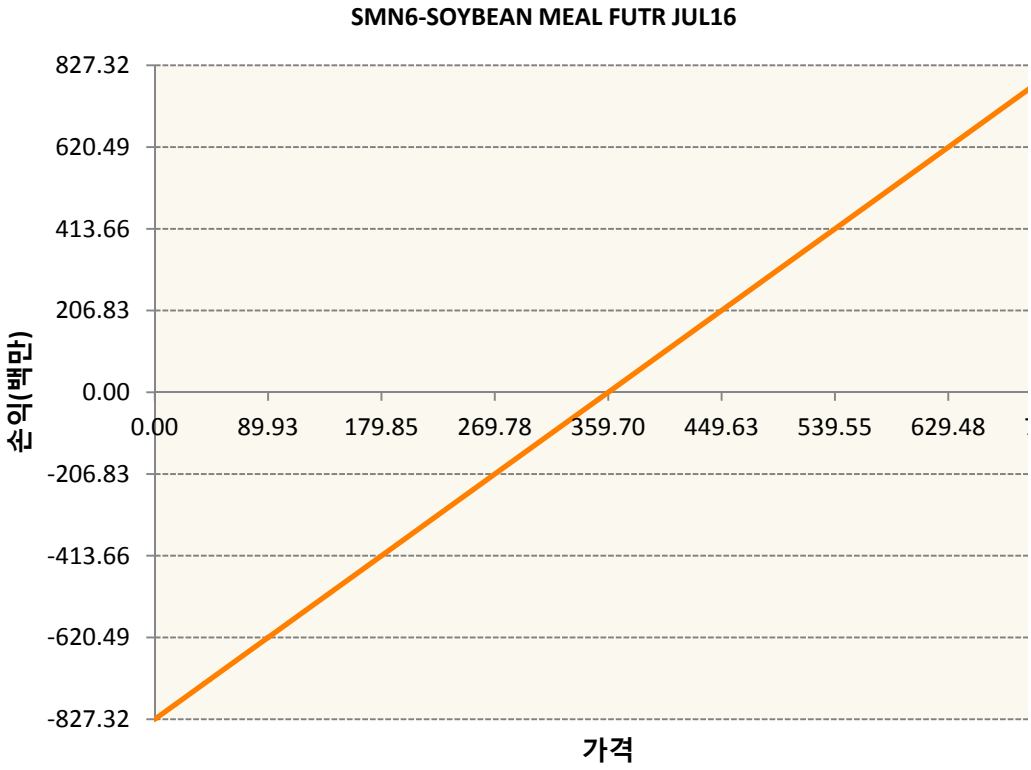

CTN6-COTTON NO.2 FUTR JUL16
279.22
209.41
139.61
69.80
0.00
-69.80
-139.61
-209.41
-279.22
0.00
15.23
30.45
45.68
60.90
76.13
91.35
106.58
순익(백만)
가격

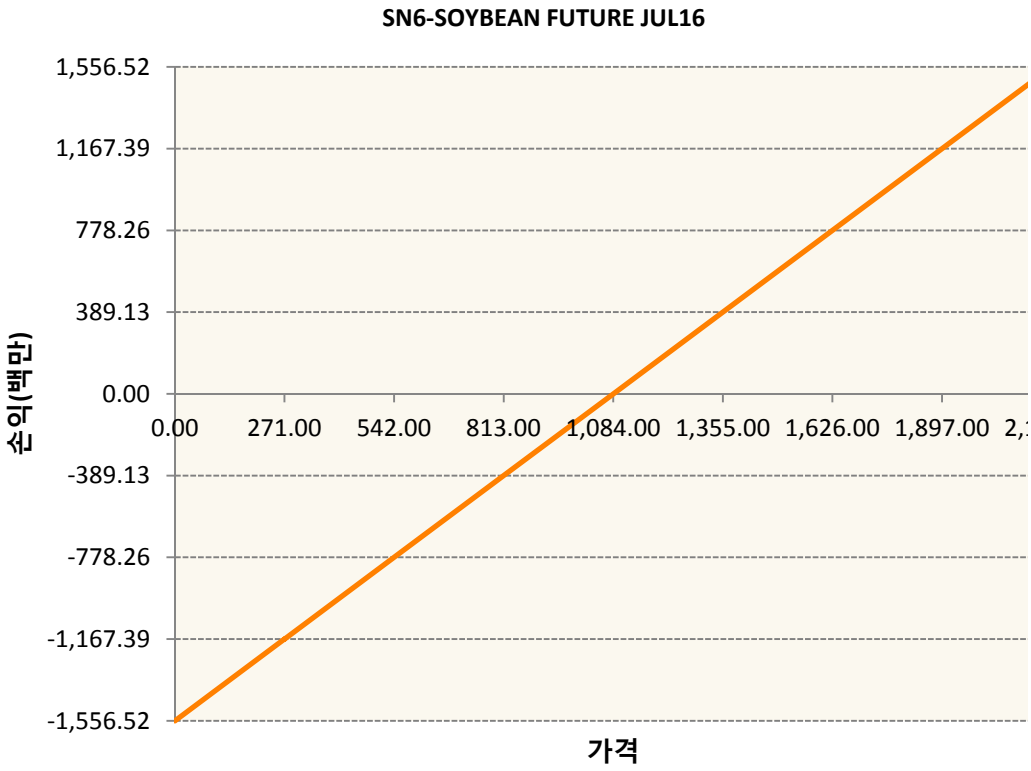

KCN6-COFFEE 'C' FUTURE JUL16
498.33
373.75
249.16
124.58
0.00
-124.58
-249.16
-373.75
-498.33
0.00
32.19
64.38
96.56
128.75
160.94
193.13
225.31
순익(백만)

가격

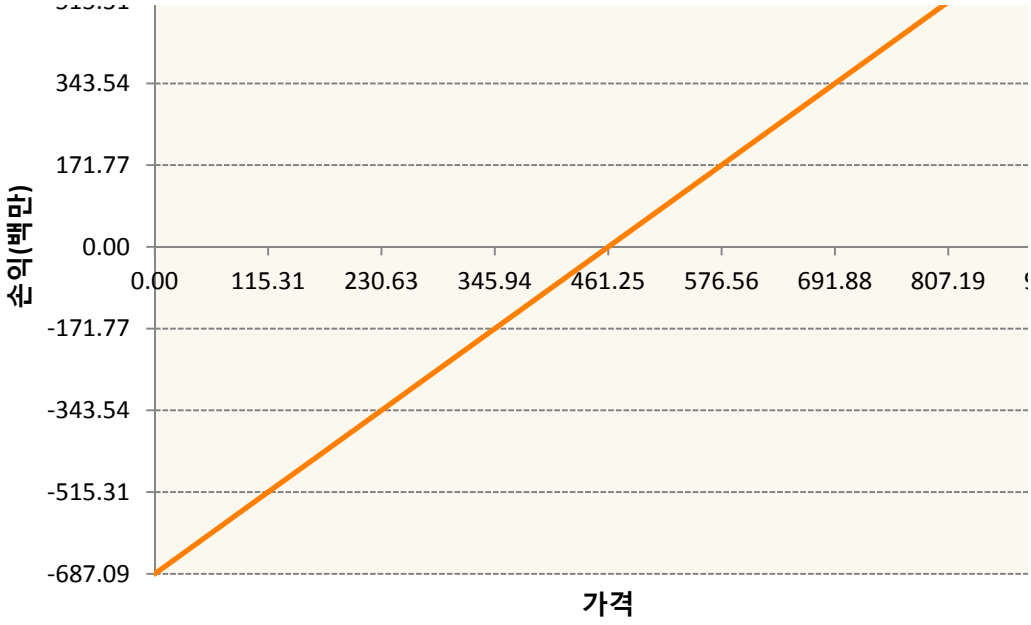

KWN6-KC HRW WHEAT FUT JUL16
231.04
173.28
115.52
57.76
0.00
-57.76
-115.52
-173.28
-231.04
0.00
112.06
224.13
336.19
448.25
560.31
672.38
784.44
손익(백만)
가격


SBN6-SUGAR #11 (WORLD) JUL16
906.70
680.03
453.35
226.68
0.00
-226.68
-453.35
-680.03
-906.70
0.00
4.01
8.01
12.02
16.02
20.03
24.03
28.04
손익(백만)
가격


SMN6-SOYBEAN MEAL FUTR JUL16
827.32
620.49
413.66
206.83
0.00
-206.83
-413.66
-620.49
-827.32
0.00
89.93
179.85
269.78
359.70
449.63
539.55
629.48
손익(백만)
가격


SN6-SOYBEAN FUTURE JUL16
1,556.52
1,167.39
778.26
389.13
0.00
-389.13
-778.26
-1,167.39
-1,556.52
0.00
271.00
542.00
813.00
1,084.00
1,355.00
1,626.00
1,897.00
손익(백만)
가격


WN6-WHEAT FUTURE(CBT) JUL16
687.09
515.31



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON6	SOYBEAN OIL FUTR JUL16	55
CN6	CORN FUTURE JUL16	143
CTN6	COTTON NO.2 FUTR JUL16	22
KCN6	COFFEE 'C' FUTURE JUL16	40
KWN6	KC HRW WHEAT FUT JUL16	18
SBN6	SUGAR #11 (WORLD) JUL16	73
SMN6	SOYBEAN MEAL FUTR JUL16	66
SN6	SOYBEAN FUTURE JUL16	125
WN6	WHEAT FUTURE(CBT) JUL16	55

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

821