| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-05-20 |
| 기준일 | 2016-05-19 |

# 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 | 2016-05-20 |
| 기준일 | 2016-05-19 |

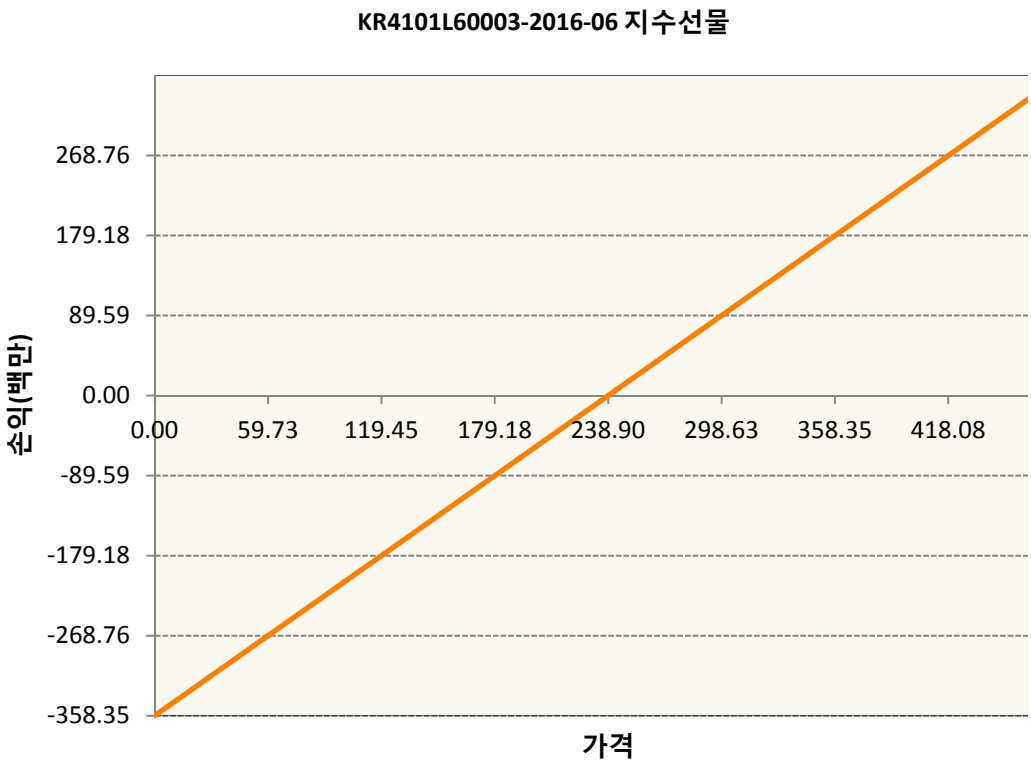
# 스마트인덱스모

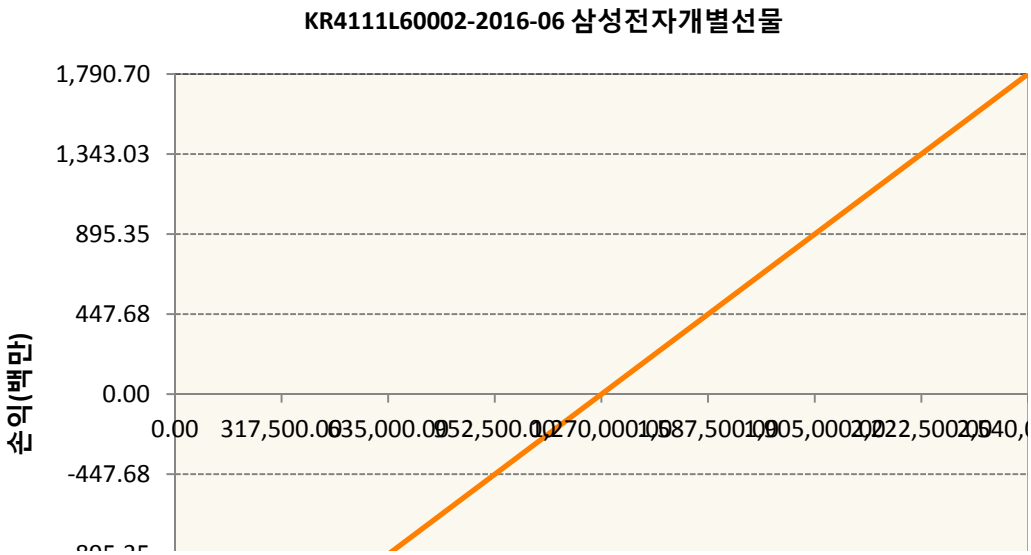
## 1. 계약금액

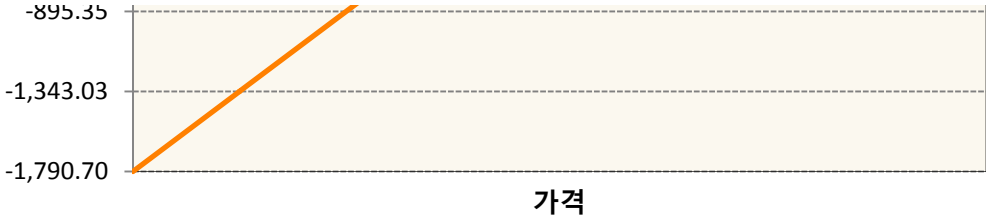
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,149 | 0 | 2,149 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조






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

| KR4101L600 | 2016-06 지수선물 | | | | | | 29 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -29 | -29 | -29 | -29 | -29 | -29 | -29 |
| -5.33% | -19 | -19 | -19 | -19 | -19 | -19 | -19 |
| -2.67% | -10 | -10 | -10 | -10 | -10 | -10 | -10 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 |
| 5.33% | 19 | 19 | 19 | 19 | 19 | 19 | 19 |
| 8.00% | 29 | 29 | 29 | 29 | 29 | 29 | 29 |
| KR4111L600 | 2016-06 삼성전자개별선물 | | | | | | 143 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -143 | -143 | -143 | -143 | -143 | -143 | -143 |
| -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% | 143 | 143 | 143 | 143 | 143 | 143 | 143 |

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

| **158** |
|---|

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-05-20 |
| 기준일 | 2016-05-19 |

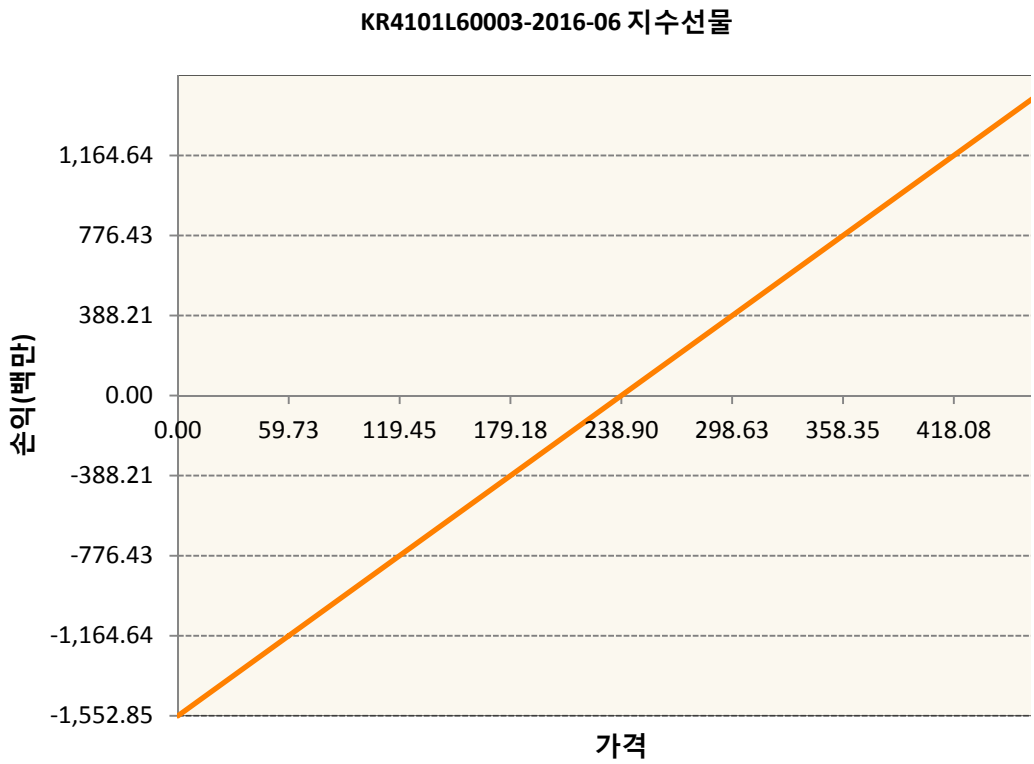
# 스마트레버리지목표전환형1호

## 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 | 1,553 | 0 | 1,553 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101L600 2016-06 지수선물 | | | | | | | 124 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -124 | -124 | -124 | -124 | -124 | -124 | -124 |
| -5.33% | -83 | -83 | -83 | -83 | -83 | -83 | -83 |
| -2.67% | -41 | -41 | -41 | -41 | -41 | -41 | -41 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 41 | 41 | 41 | 41 | 41 | 41 | 41 |
| 5.33% | 83 | 83 | 83 | 83 | 83 | 83 | 83 |
| 8.00% | 124 | 124 | 124 | 124 | 124 | 124 | 124 |

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

| |
|---|
| **101** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-05-20 |
| 기준일 | 2016-05-19 |

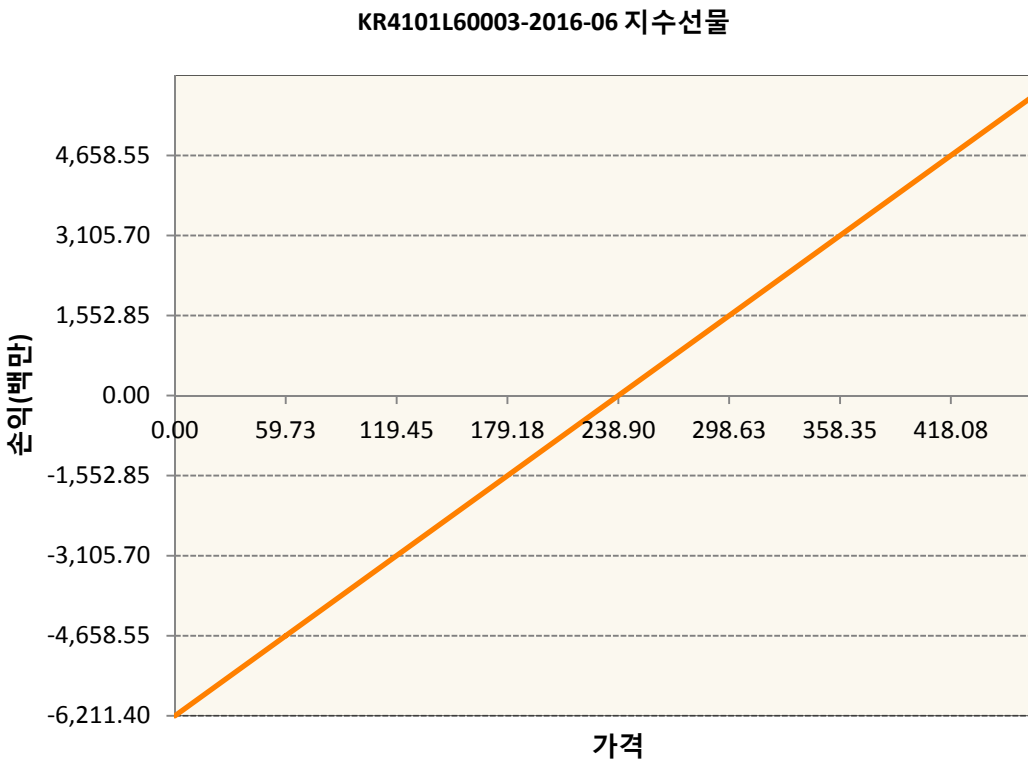
# 1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

## 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 | 6,211 | 0 | 6,211 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101L600 2016-06 지수선물 | | | | | | | 497 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -497 | -497 | -497 | -497 | -497 | -497 | -497 |
| -5.33% | -331 | -331 | -331 | -331 | -331 | -331 | -331 |
| -2.67% | -166 | -166 | -166 | -166 | -166 | -166 | -166 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 166 | 166 | 166 | 166 | 166 | 166 | 166 |
| 5.33% | 331 | 331 | 331 | 331 | 331 | 331 | 331 |
| 8.00% | 497 | 497 | 497 | 497 | 497 | 497 | 497 |

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

| |
|---|
| **404** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-05-20 |
| 기준일 | 2016-05-19 |

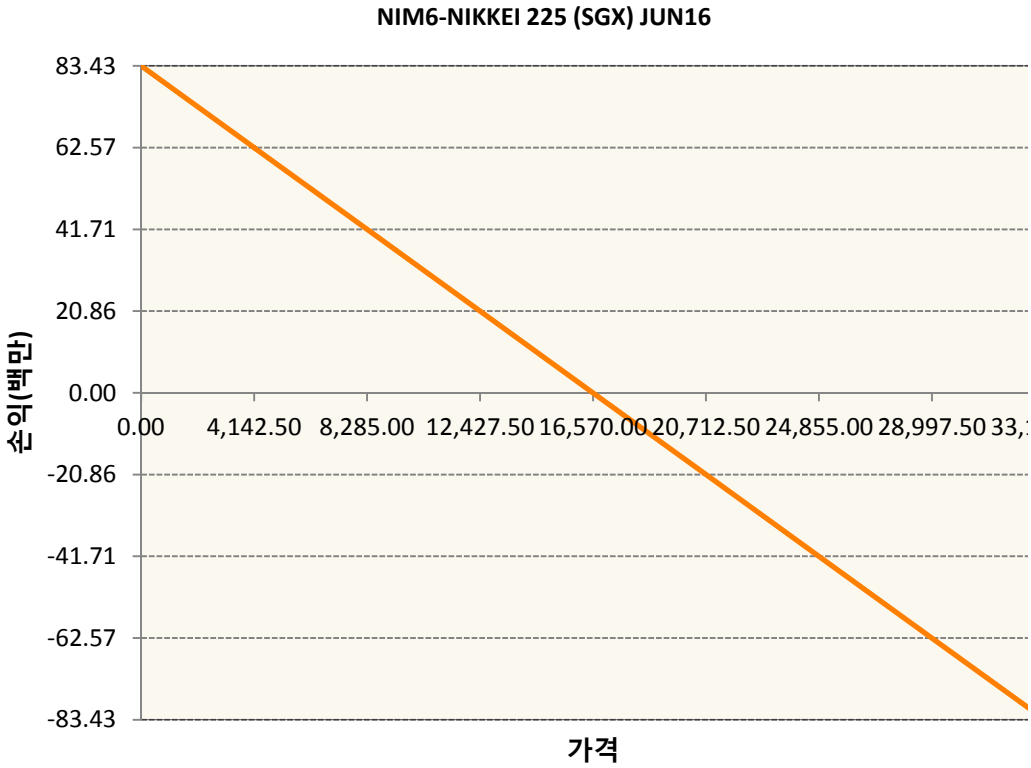
# 아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

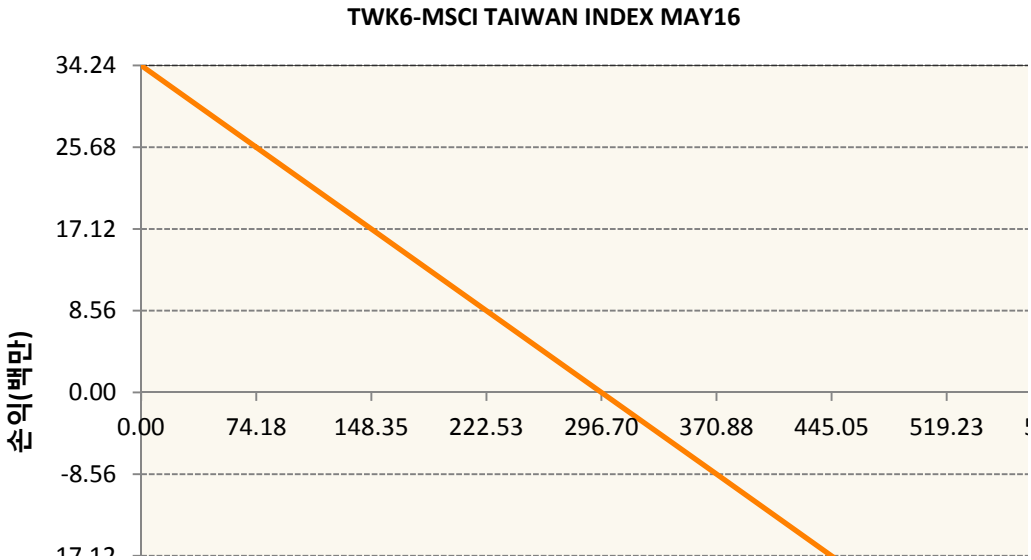
## 1. 계약금액

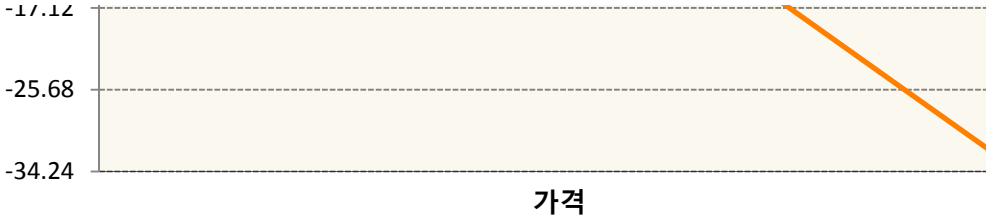
(단위:백만원)

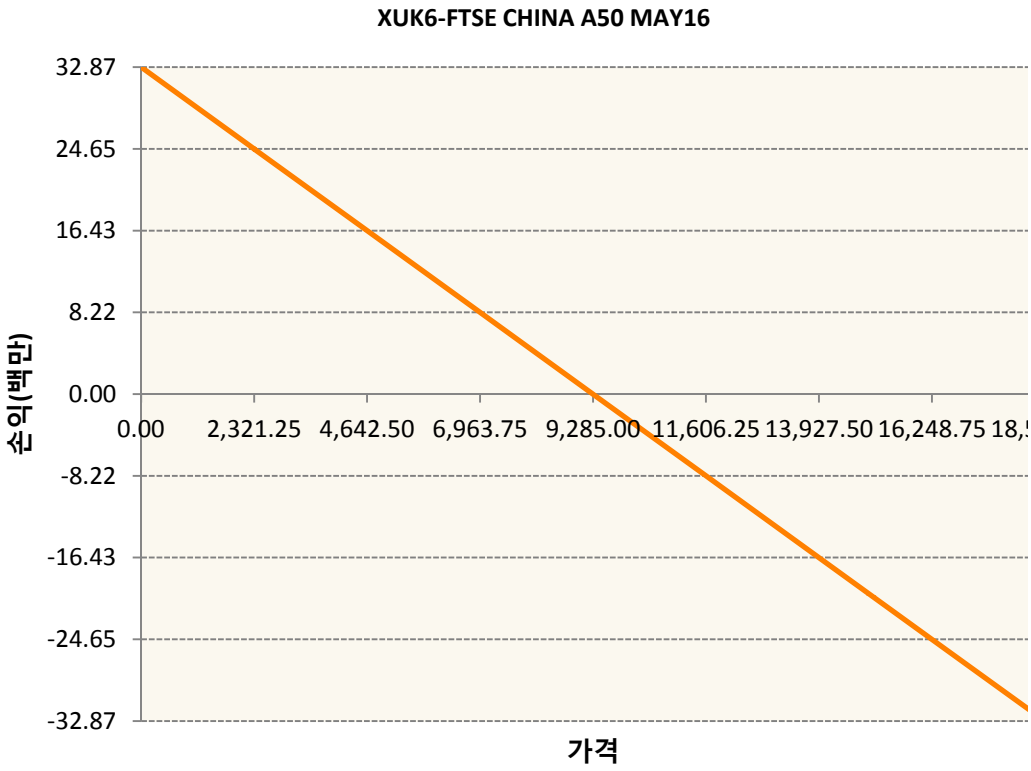
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 151 | -151 | |

## 2. 만기시점의 손익구조






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

| | | |
|---|---|---|
| NIM6 | NIKKEI 225 (SGX) JUN16 | 7 |
| TWK6 | MSCI TAIWAN INDEX MAY16 | 3 |
| XUK6 | FTSE CHINA A50 MAY16 | 3 |

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

| |
|---|
| **16** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-05-20 |
| 기준일 | 2016-05-19 |

# 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 | 841 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **720** |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-05-20 |
| 기준일 | 2016-05-19 |

# 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 | 249 |
| SWCSI50000 신한CSI500미래S160308-1 | 114 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **1,075** |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-05-20 |
| 기준일 | 2016-05-19 |

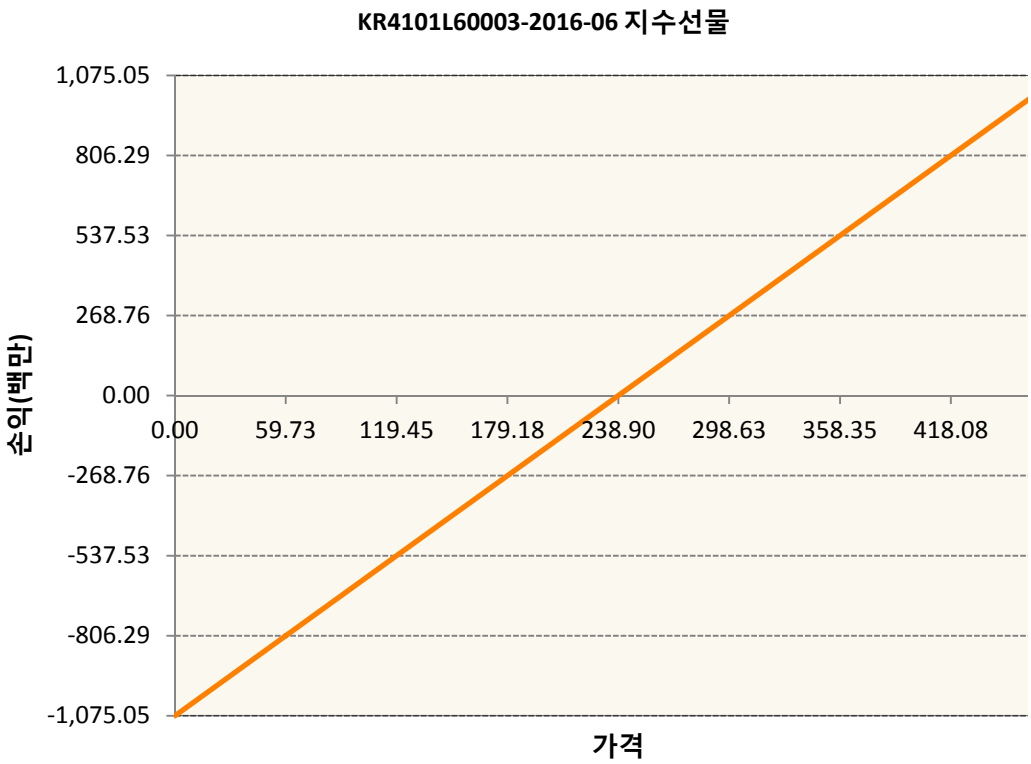
# KOSPI200 레버리지 목표전환형 3

## 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 | 1,075 | 0 | 1,075 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L600 2016-06 지수선물 86

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -86 | -86 | -86 | -86 | -86 | -86 | -86 |
| -5.33% | -57 | -57 | -57 | -57 | -57 | -57 | -57 |
| -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% | 57 | 57 | 57 | 57 | 57 | 57 | 57 |
| 8.00% | 86 | 86 | 86 | 86 | 86 | 86 | 86 |

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

| 70 |
|---|

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-05-20 |
| 기준일 | 2016-05-19 |

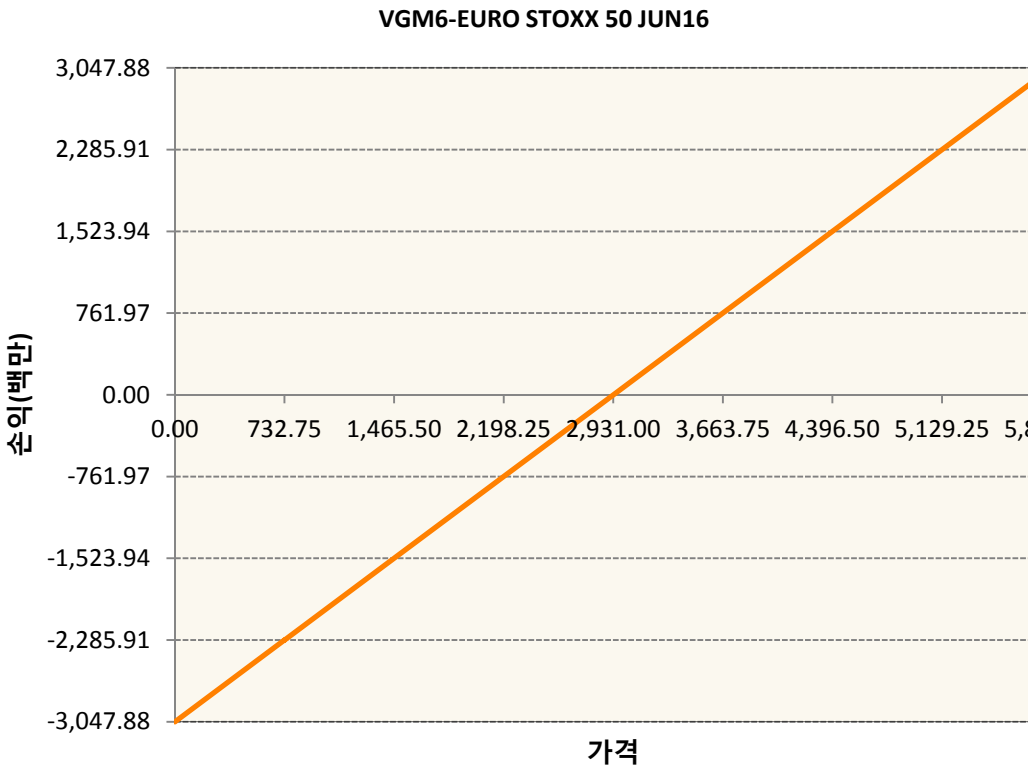
# 유로인덱스모(주식-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,048 | 0 | 3,048 | |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

**286**

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-05-20 |
| 기준일 | 2016-05-19 |

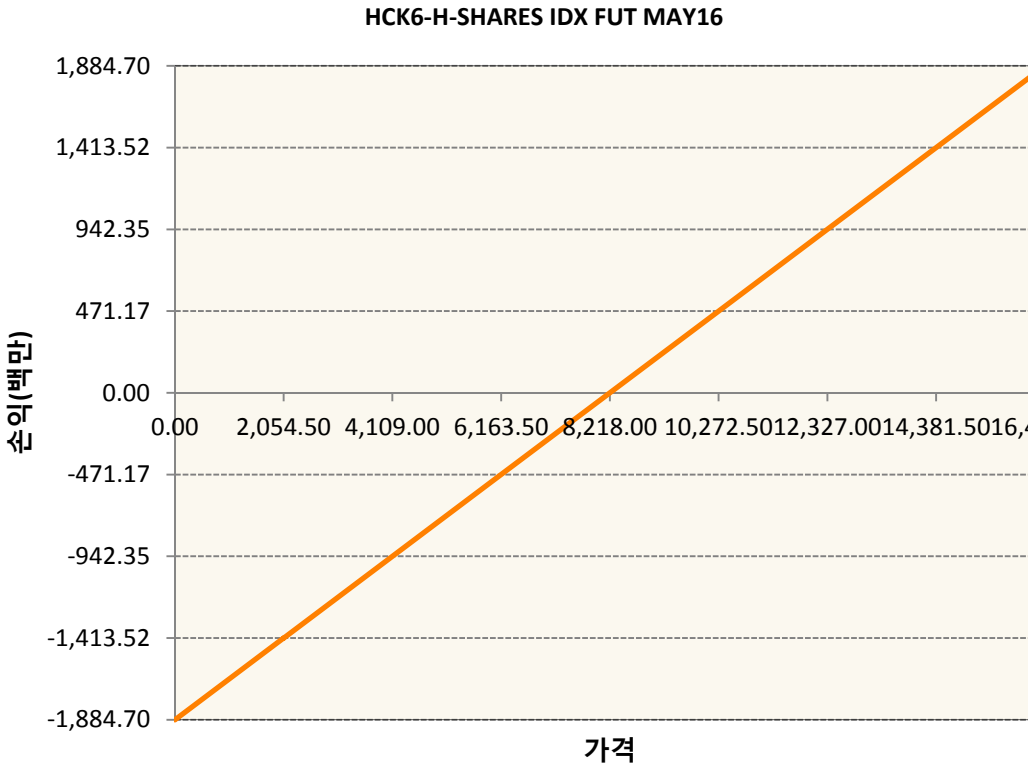
# 차이나인덱스모(주식-파생형)

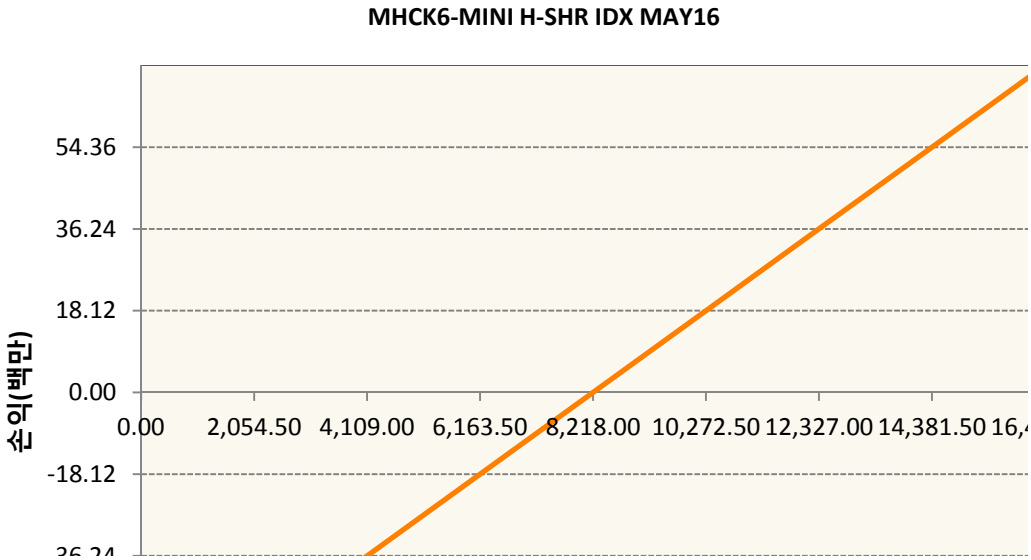
## 1. 계약금액

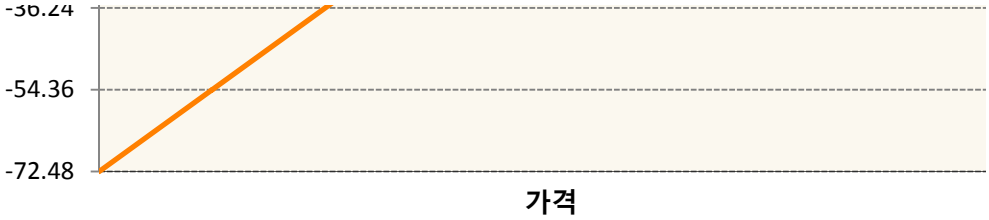
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,957 | 0 | 1,957 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조






| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---|---|
| HCK6 | H-SHARES IDX FUT MAY16 | 151 |
| MHCK6 | MINI H-SHR IDX MAY16 | 6 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|---|---|
| | **226** |

| 공시일 | 2016-05-20 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-05-19 |

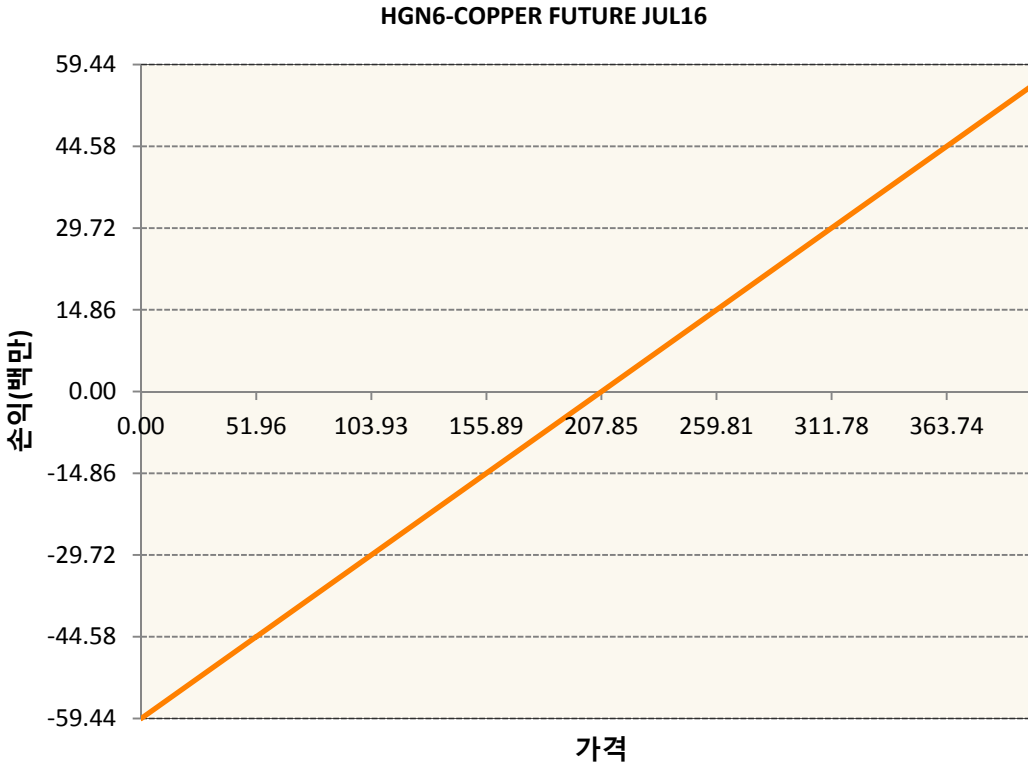
# 메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

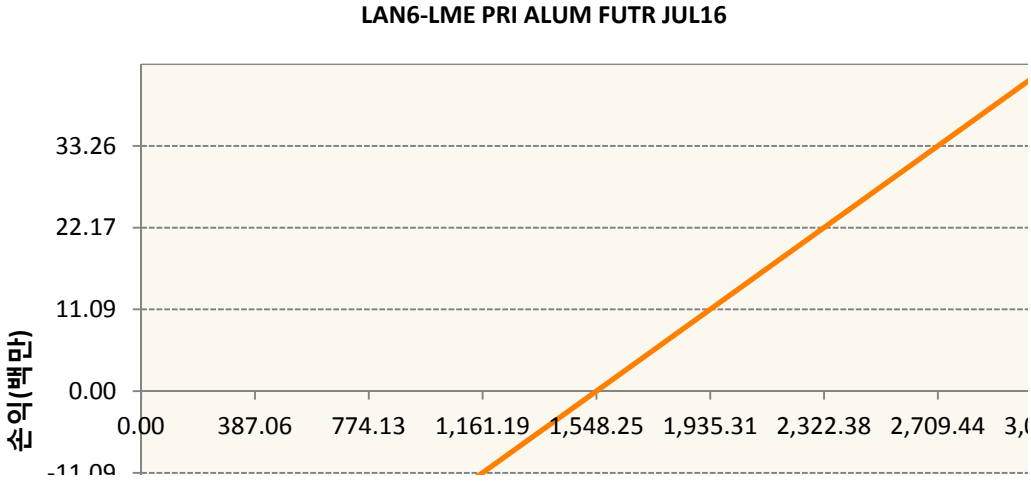
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

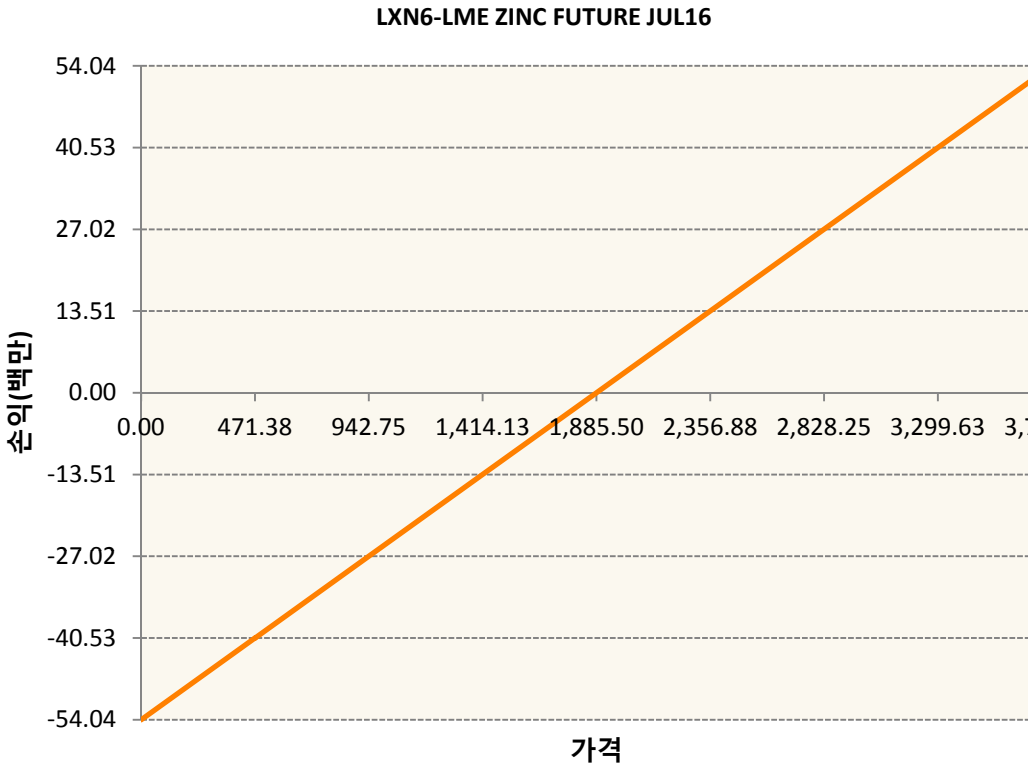
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 선물 | 유가증권 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 선물 | 유가증권 | 59 | 0 | 59 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 302 | 0 | 302 | |

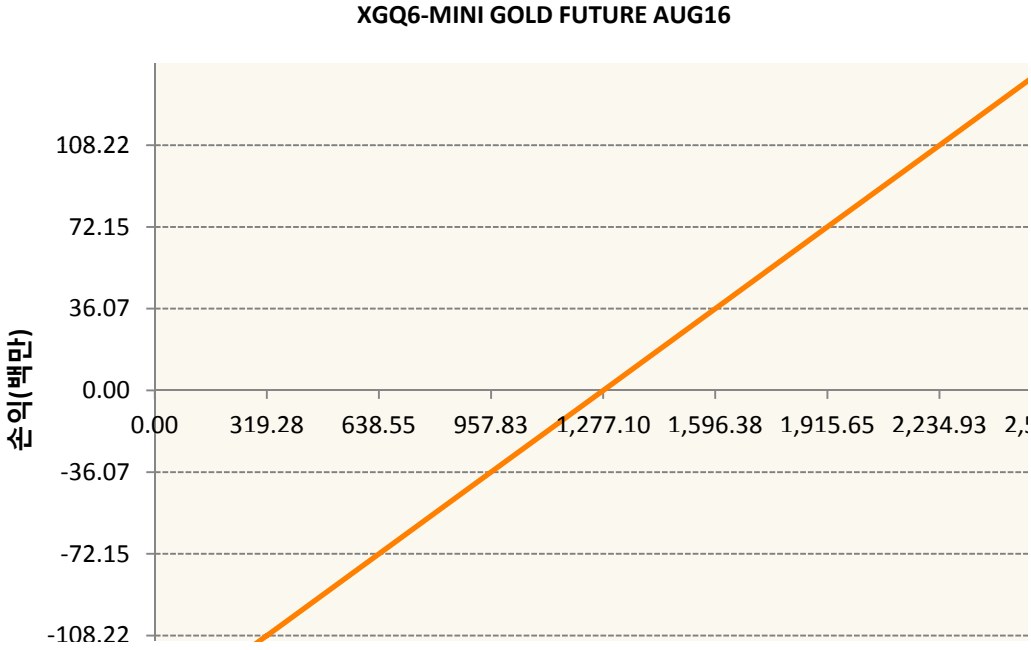
## 2. 만기시점의 손익구조

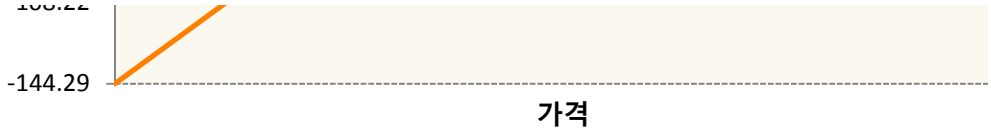


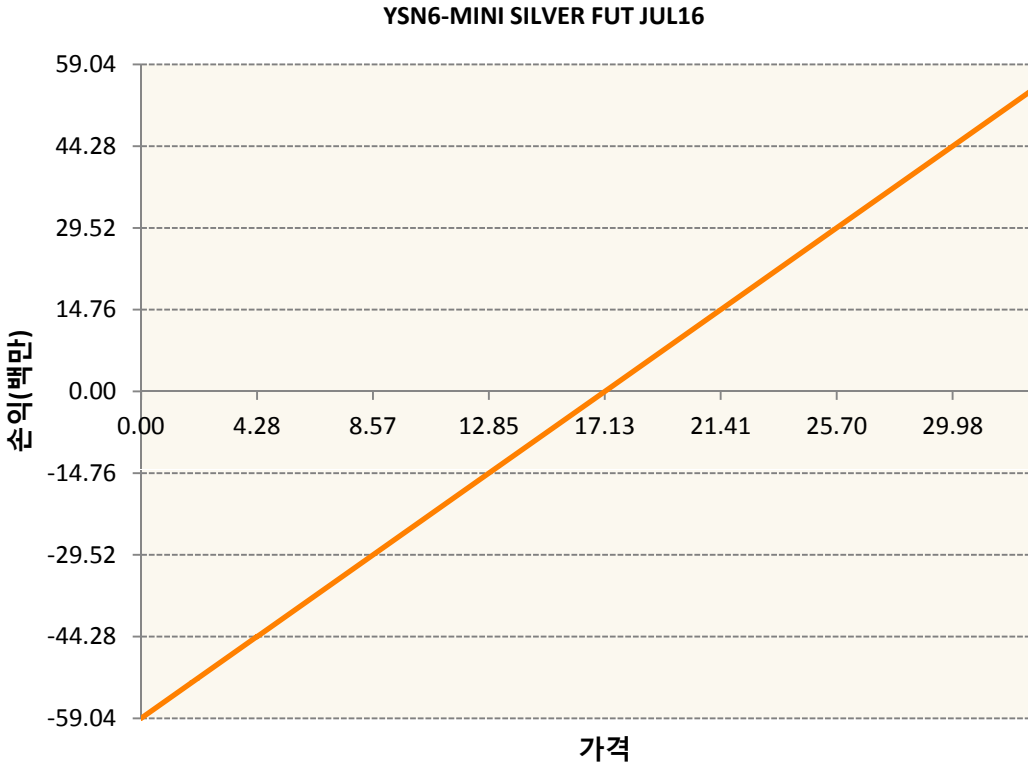




-22.17
-33.26
-44.34
가격


LXN6-LME ZINC FUTURE JUL16
54.04
40.53
27.02
13.51
0.00
-13.51
-27.02
-40.53
-54.04
순익(백만)
0.00
471.38
942.75
1,414.13
1,885.50
2,356.88
2,828.25
3,299.63
가격


XGQ6-MINI GOLD FUTURE AUG16
108.22
72.15
36.07
0.00
-36.07
-72.15
-108.22
순익(백만)
0.00
319.28
638.55
957.83
1,277.10
1,596.38
1,915.65
2,234.93




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

| | | |
|---|---|---|
| HGN6 | COPPER FUTURE JUL16 | 5 |
| LAN6 | LME PRI ALUM FUTR JUL16 | 4 |
| LXN6 | LME ZINC FUTURE JUL16 | 4 |
| XGQ6 | MINI GOLD FUTURE AUG16 | 12 |
| YSN6 | MINI SILVER FUT JUL16 | 5 |

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

| |
|---|
| **30** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-05-20 |
| 기준일 | 2016-05-19 |

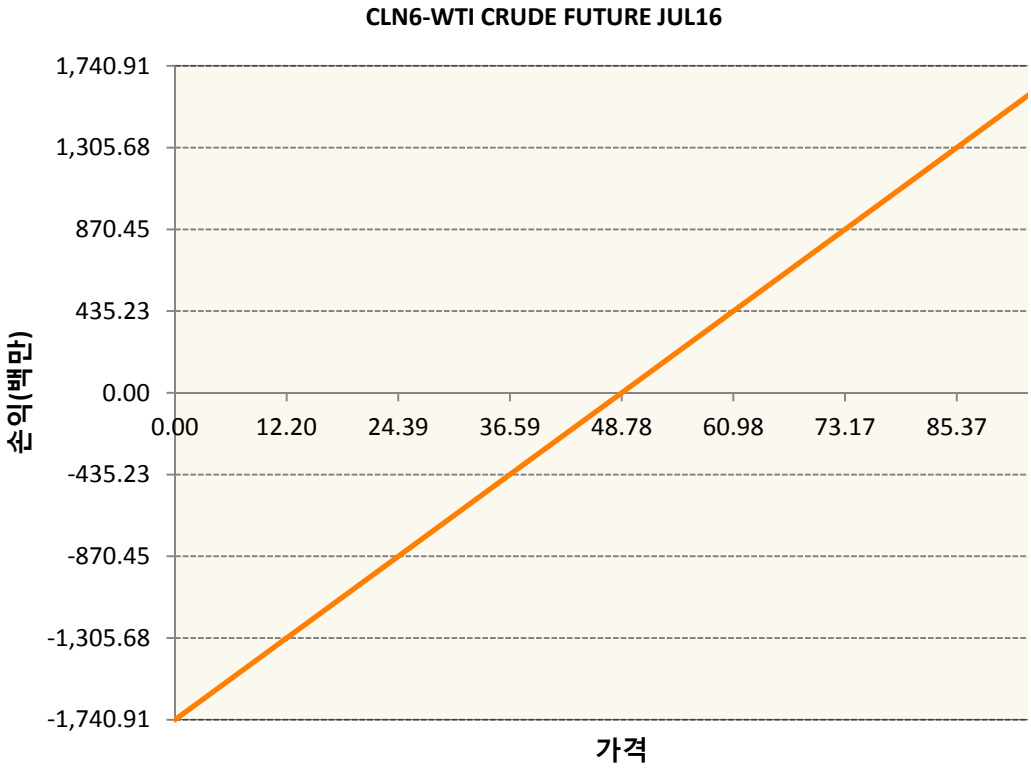
# 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

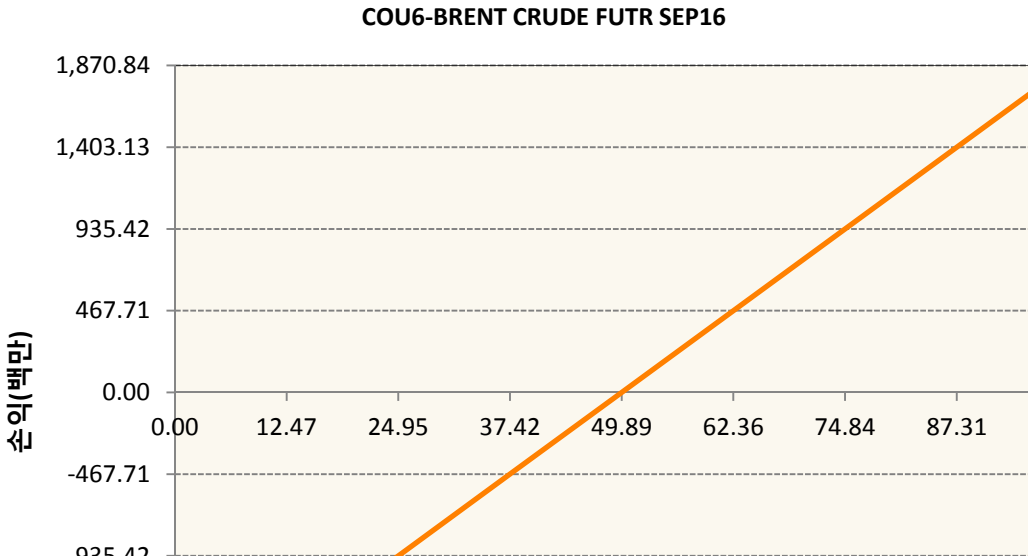
## 1. 계약금액

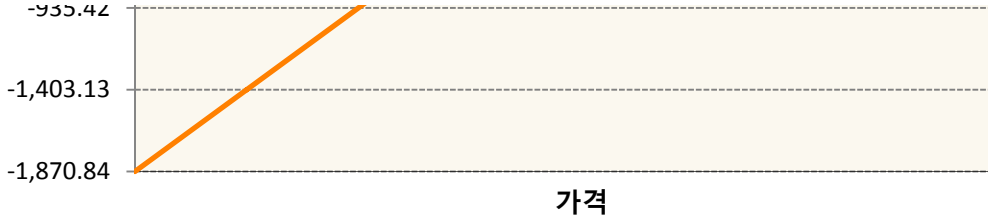
(단위:백만원)

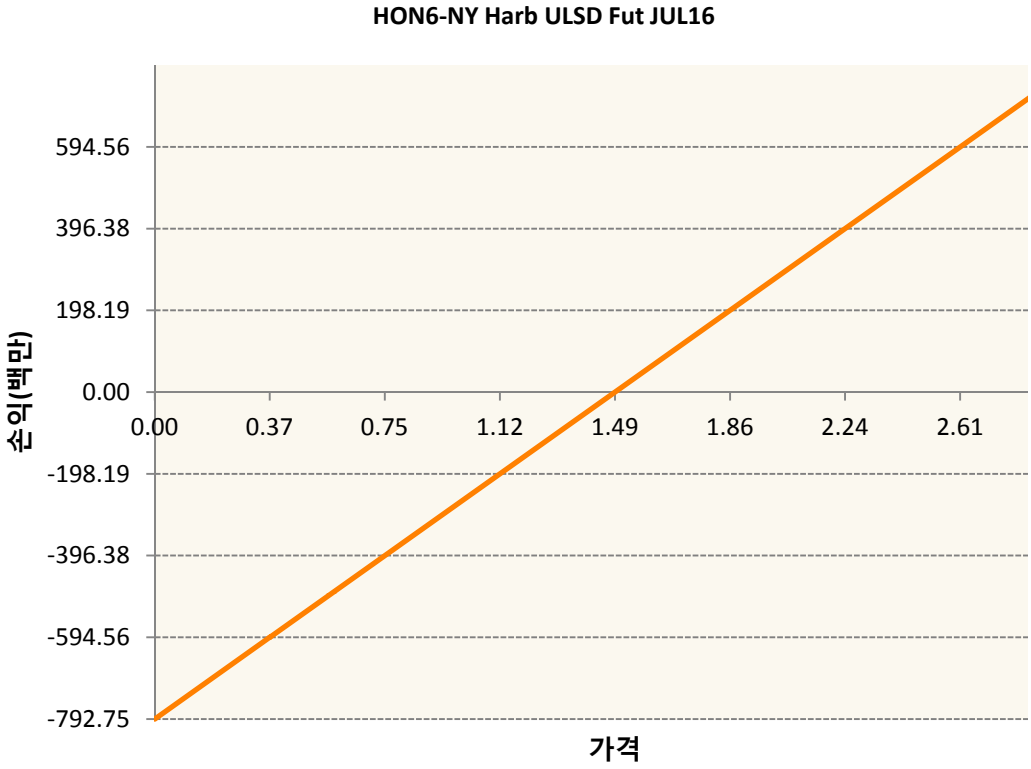
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 6,361 | 0 | 6,361 | |

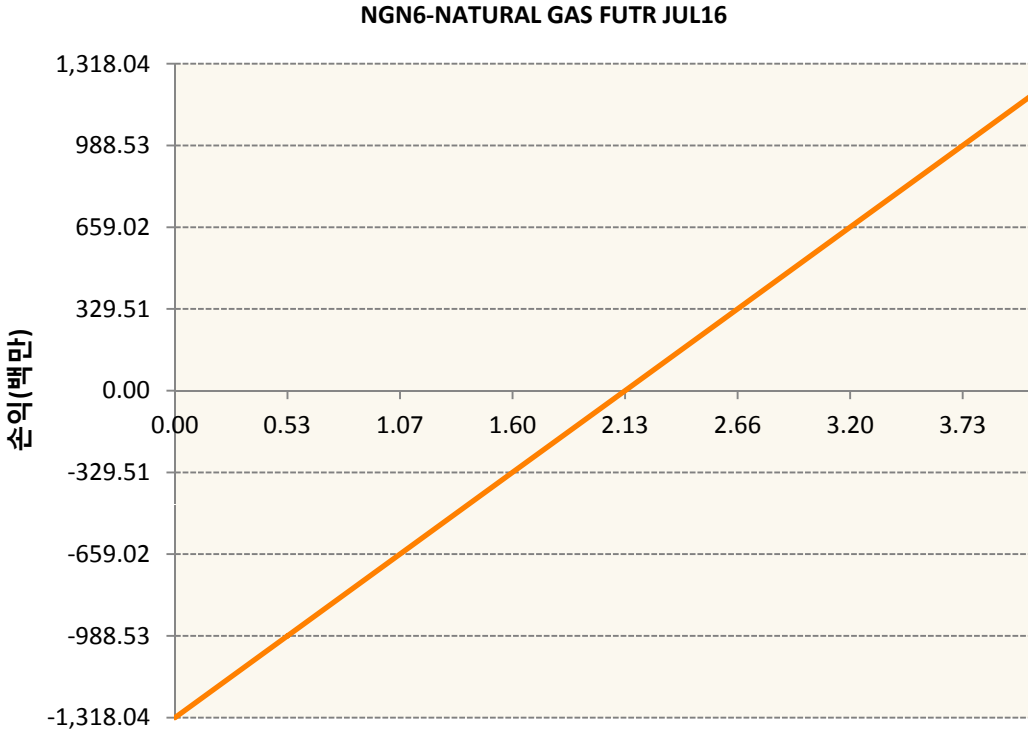
## 2. 만기시점의 손익구조



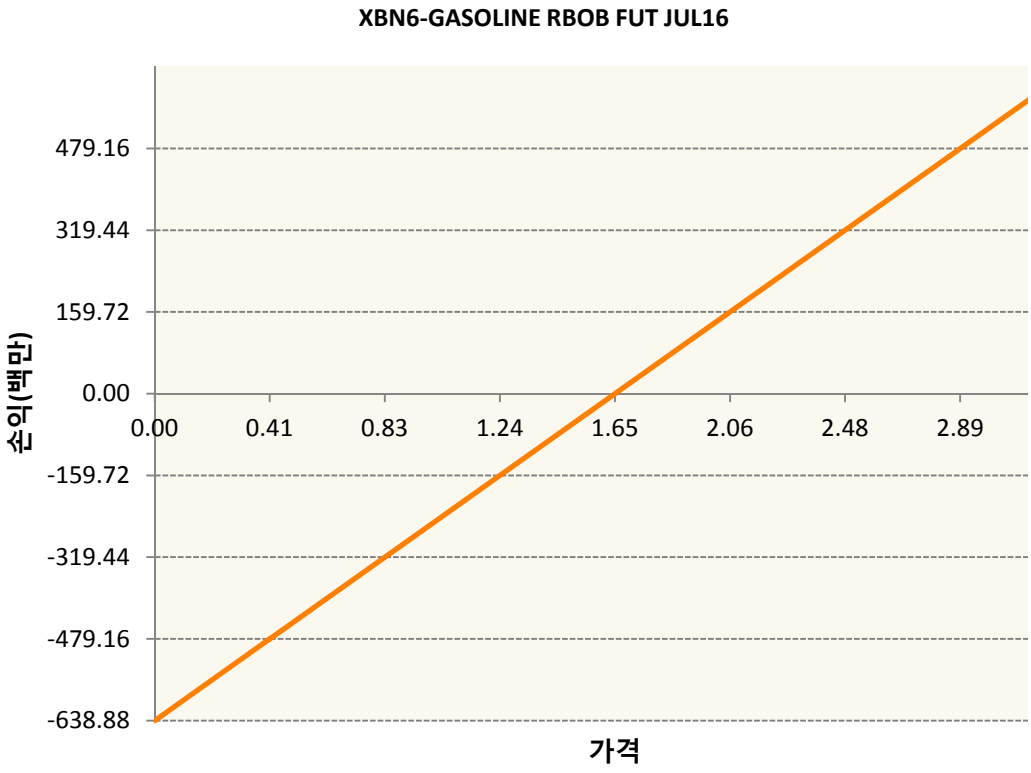




-1,403.13
-1,870.84
가격


HON6-NY Harb ULSD Fut JUL16
594.56
396.38
198.19
0.00
-198.19
-396.38
-594.56
-792.75
0.00
0.37
0.75
1.12
1.49
1.86
2.24
2.61
순익(백만)
가격


NGN6-NATURAL GAS FUTR JUL16
1,318.04
988.53
659.02
329.51
0.00
-329.51
-659.02
-988.53
-1,318.04
0.00
0.53
1.07
1.60
2.13
2.66
3.20
3.73
순익(백만)

가격




| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---|---|
| CLN6 | WTI CRUDE FUTURE JUL16 | 139 |
| COU6 | BRENT CRUDE FUTR SEP16 | 150 |
| HON6 | NY Harb ULSD Fut JUL16 | 63 |
| NGN6 | NATURAL GAS FUTR JUL16 | 105 |
| XBN6 | GASOLINE RBOB FUT JUL16 | 51 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|---|---|
| | **1,409** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-05-20 |
| 기준일 | 2016-05-19 |

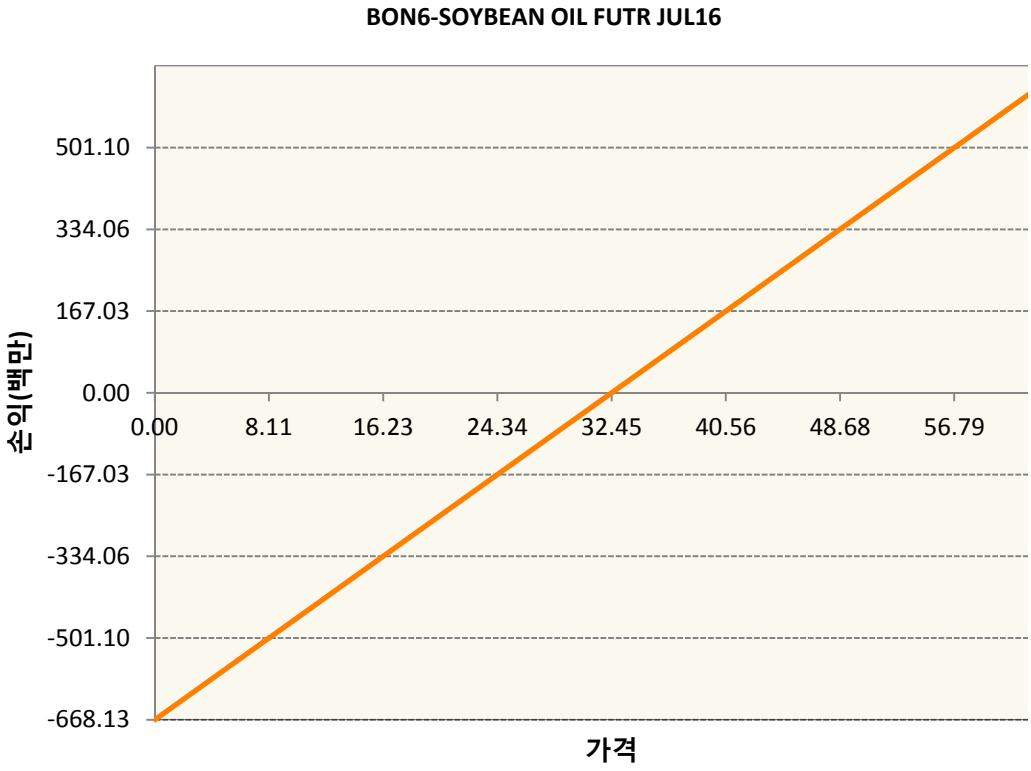
# 애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

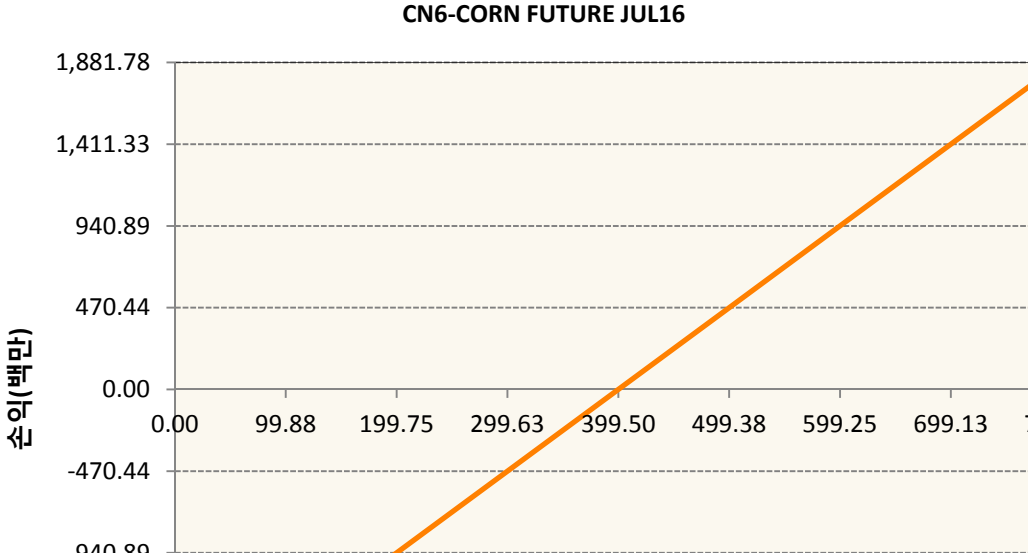
## 1. 계약금액

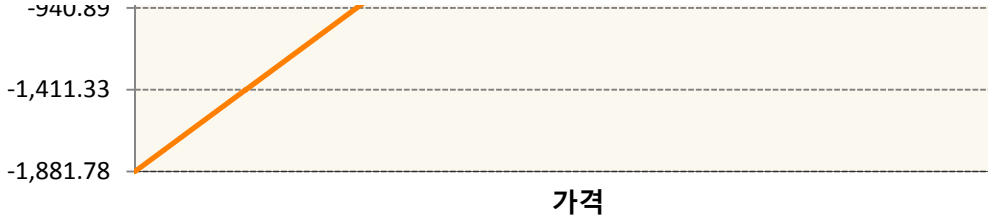
(단위:백만원)

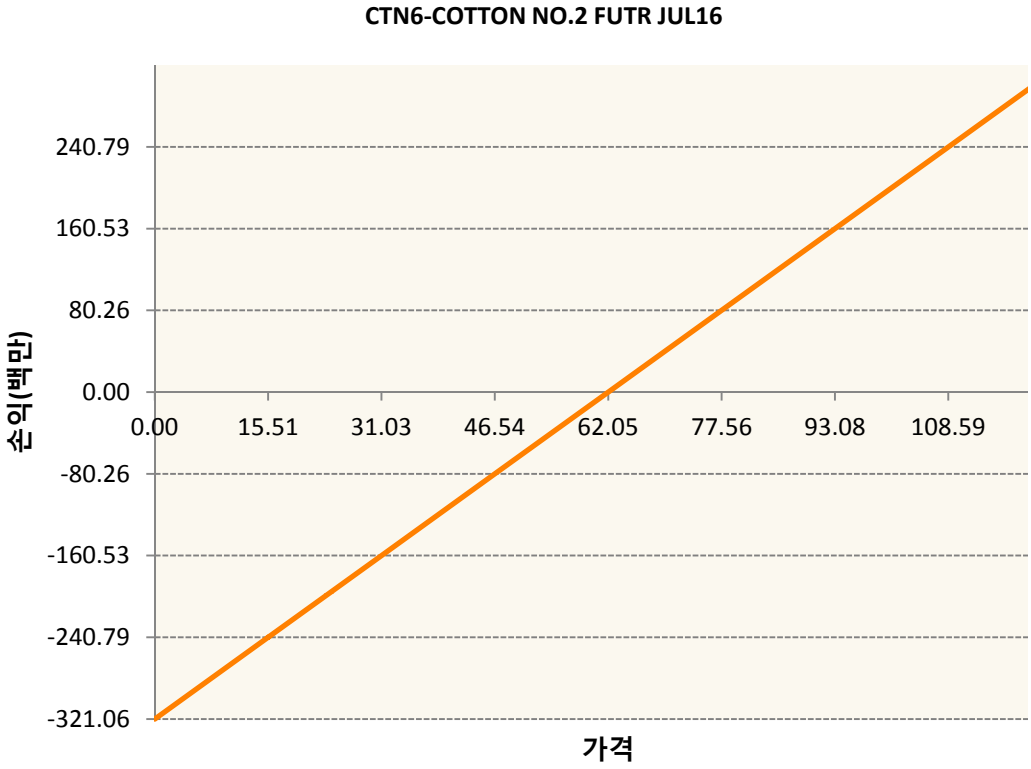
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 7,804 | 0 | 7,804 | |

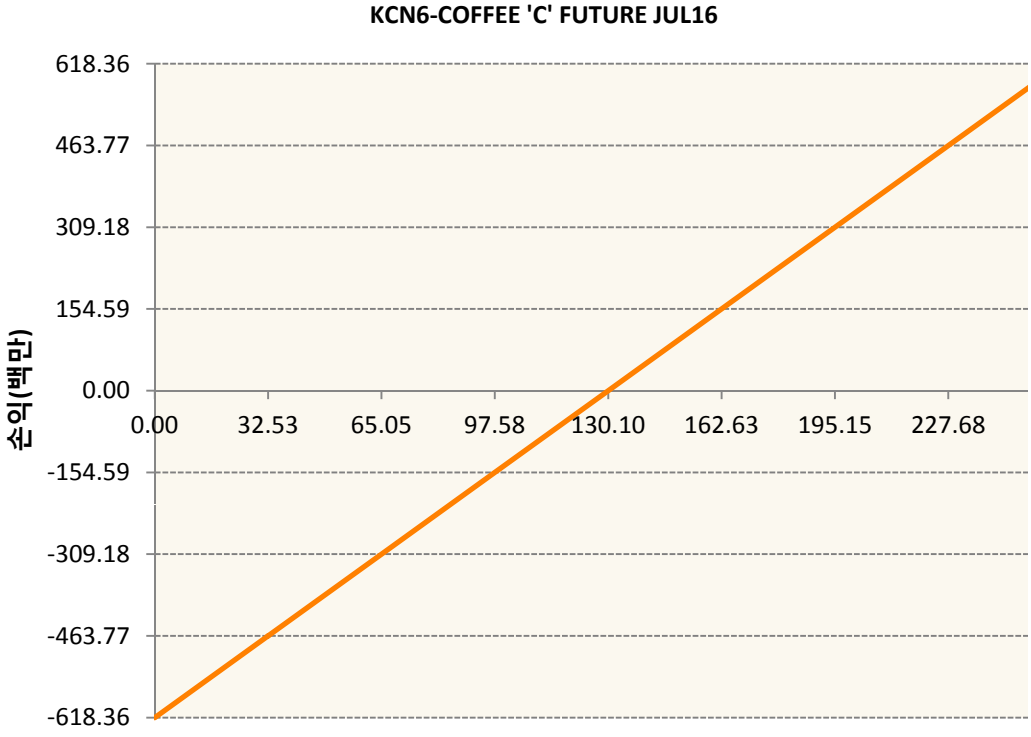
## 2. 만기시점의 손익구조



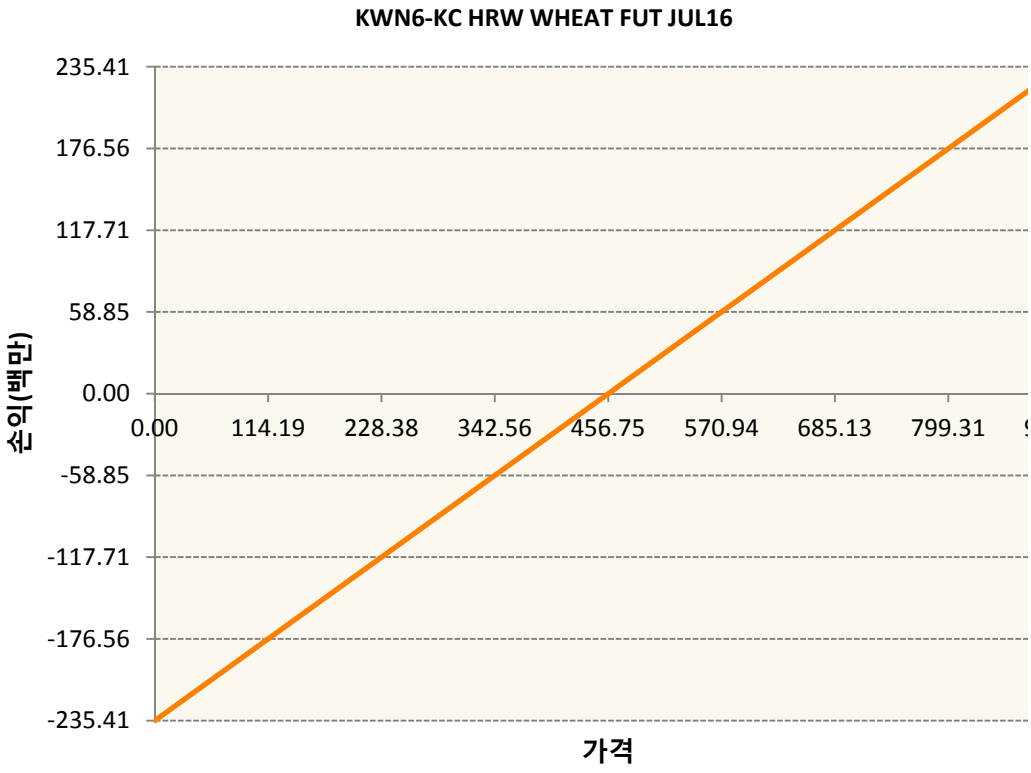



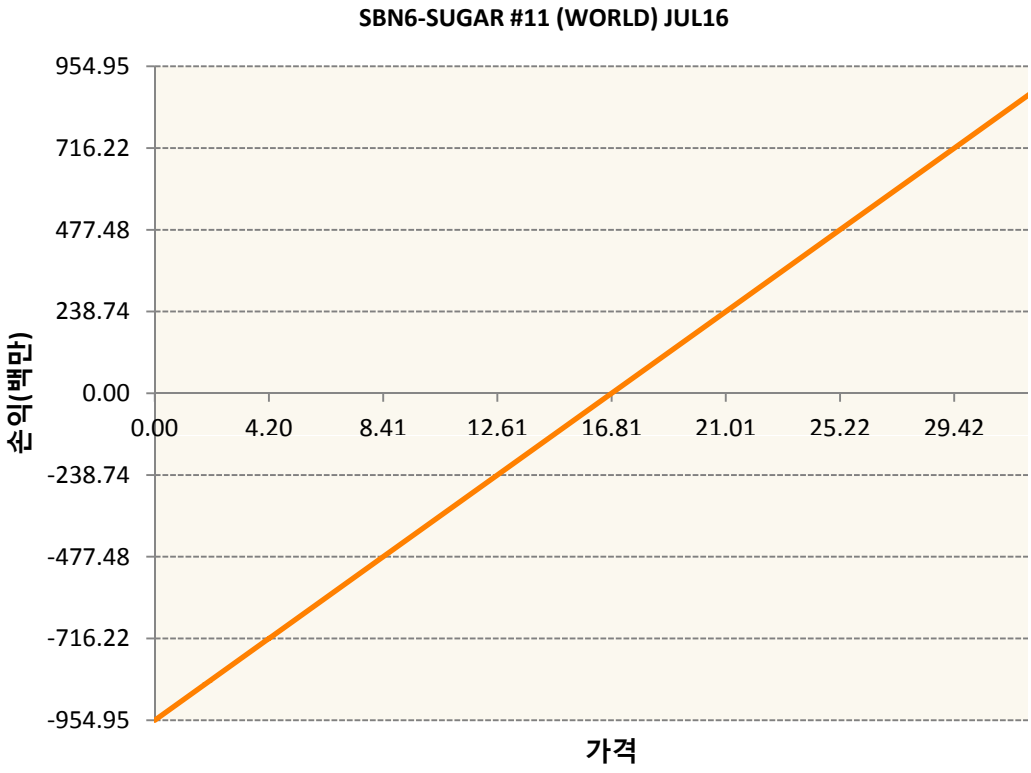

-940.89
-1,411.33
-1,881.78
가격

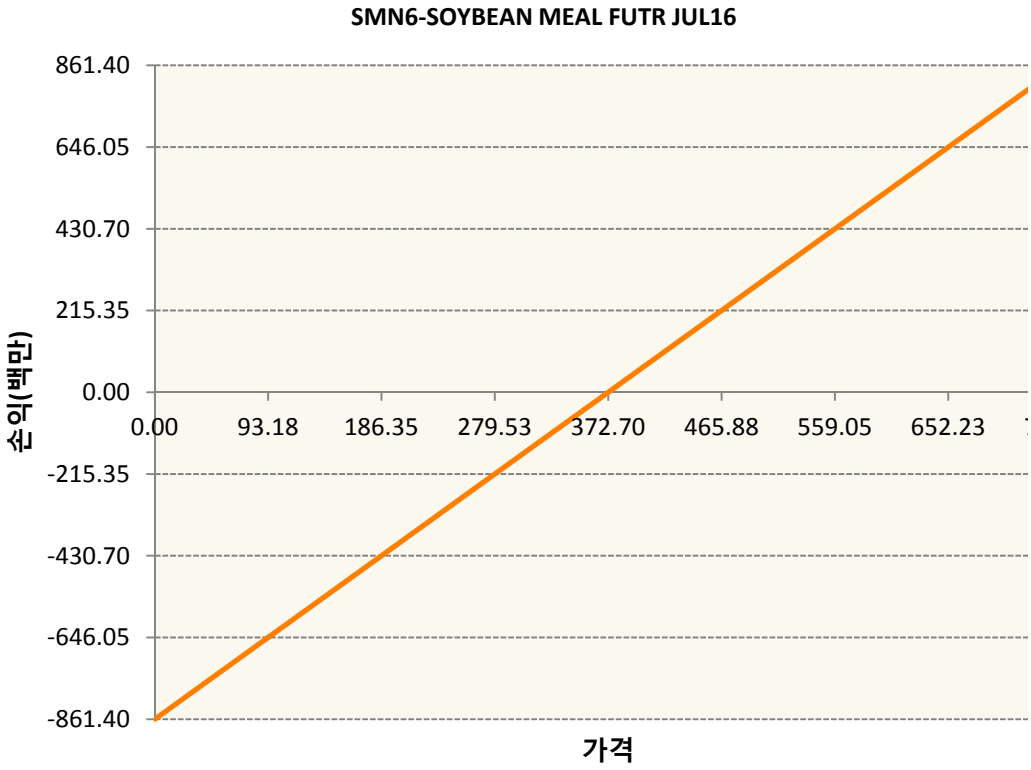

CTN6-COTTON NO.2 FUTR JUL16
240.79
160.53
80.26
0.00
-80.26
-160.53
-240.79
-321.06
0.00
15.51
31.03
46.54
62.05
77.56
93.08
108.59
순익(백만)
가격

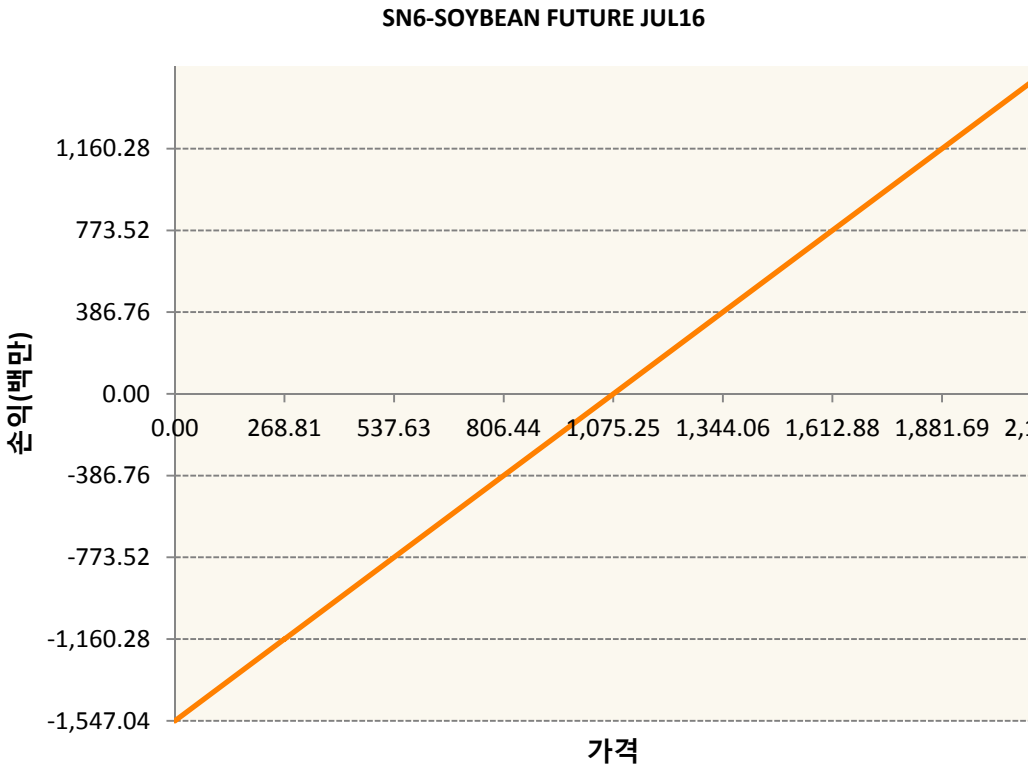

KCN6-COFFEE 'C' FUTURE JUL16
618.36
463.77
309.18
154.59
0.00
-154.59
-309.18
-463.77
-618.36
0.00
32.53
65.05
97.58
130.10
162.63
195.15
227.68
순익(백만)

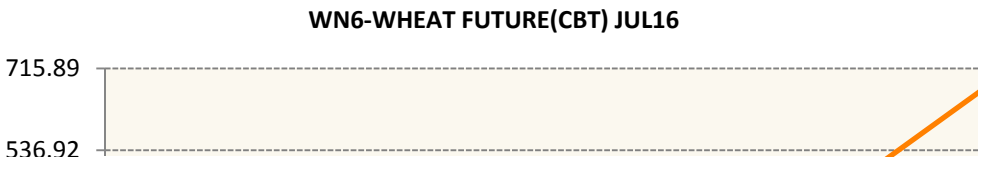
가격

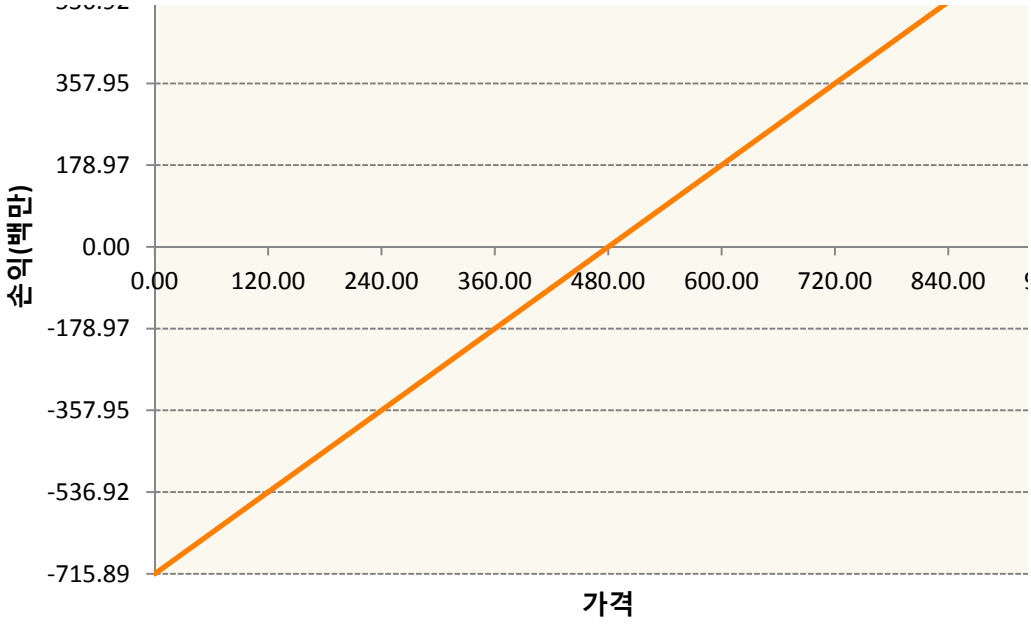

KWN6-KC HRW WHEAT FUT JUL16
235.41
176.56
117.71
58.85
0.00
-58.85
-117.71
-176.56
-235.41
0.00
114.19
228.38
342.56
456.75
570.94
685.13
799.31
손익(백만)
가격


SBN6-SUGAR #11 (WORLD) JUL16
954.95
716.22
477.48
238.74
0.00
-238.74
-477.48
-716.22
-954.95
0.00
4.20
8.41
12.61
16.81
21.01
25.22
29.42
손익(백만)
가격


SMN6-SOYBEAN MEAL FUTR JUL16
861.40
646.05
430.70
215.35
0.00
-215.35
-430.70
-646.05
-861.40
0.00
93.18
186.35
279.53
372.70
465.88
559.05
652.23
손익(백만)
가격


SN6-SOYBEAN FUTURE JUL16
1,160.28
773.52
386.76
0.00
-386.76
-773.52
-1,160.28
-1,547.04
0.00
268.81
537.63
806.44
1,075.25
1,344.06
1,612.88
1,881.69
손익(백만)
가격


WN6-WHEAT FUTURE(CBT) JUL16
715.89
536.92




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

| | | |
|---|---|---|
| BON6 | SOYBEAN OIL FUTR JUL16 | 53 |
| CN6 | CORN FUTURE JUL16 | 151 |
| CTN6 | COTTON NO.2 FUTR JUL16 | 26 |
| KCN6 | COFFEE 'C' FUTURE JUL16 | 49 |
| KWN6 | KC HRW WHEAT FUT JUL16 | 19 |
| SBN6 | SUGAR #11 (WORLD) JUL16 | 76 |
| SMN6 | SOYBEAN MEAL FUTR JUL16 | 69 |
| SN6 | SOYBEAN FUTURE JUL16 | 124 |
| WN6 | WHEAT FUTURE(CBT) JUL16 | 57 |

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

| |
|---|
| **863** |