공시일	2016-05-30
기준일	2016-05-27

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	2016-05-30
기준일	2016-05-27

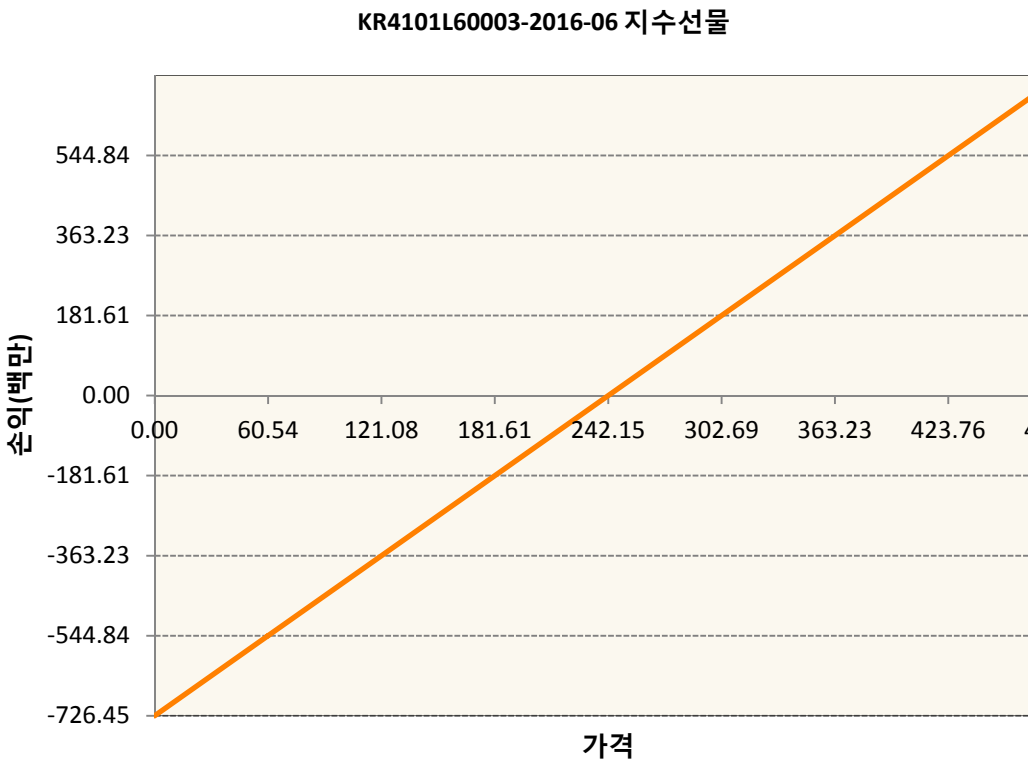
스마트인덱스모

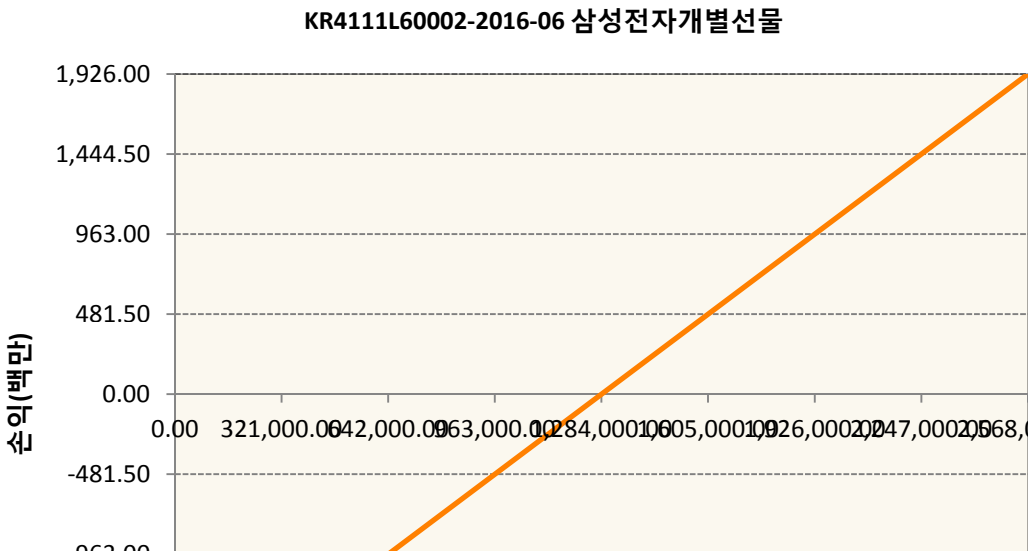
1. 계약금액

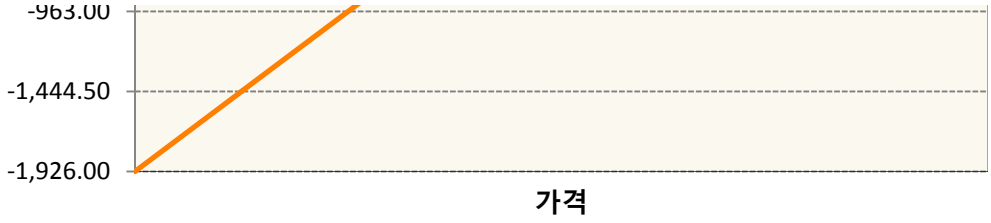
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,652	0	2,652	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101L600	2016-06 지수선물						58
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	19	19	19	19	19	19	19
5.33%	39	39	39	39	39	39	39
8.00%	58	58	58	58	58	58	58

KR4111L600	2016-06 삼성전자개별선물						154
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-154	-154	-154	-154	-154	-154	-154
-5.33%	-103	-103	-103	-103	-103	-103	-103
-2.67%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	51	51	51	51	51	51	51
5.33%	103	103	103	103	103	103	103
8.00%	154	154	154	154	154	154	154

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

201

공시일	2016-05-30
기준일	2016-05-27

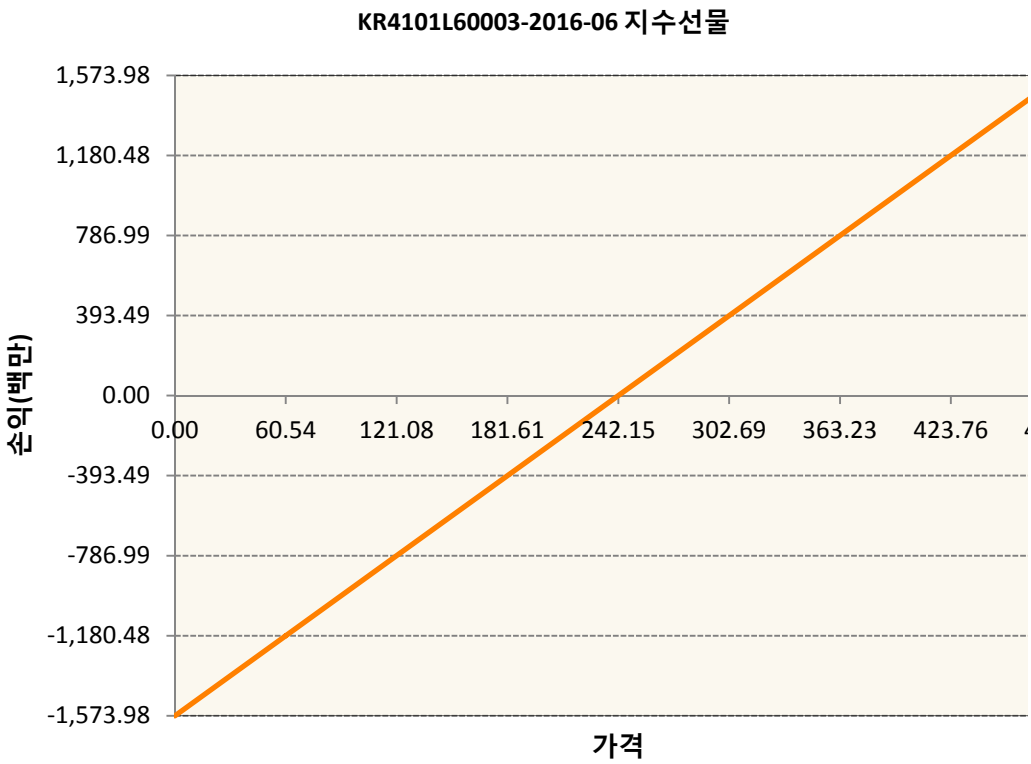
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,574	0	1,574	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)

102

공시일	2016-05-30
기준일	2016-05-27

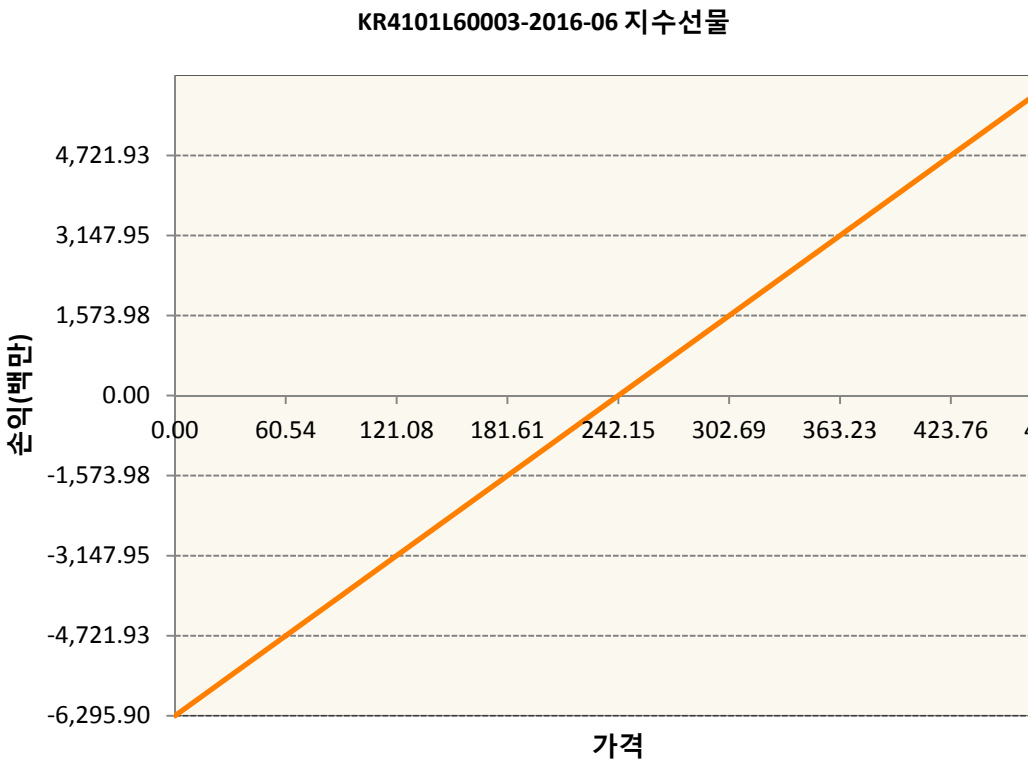
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	6,296	0	6,296	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L600 2016-06 지수선물							503
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-503	-503	-503	-503	-503	-503	-503
-5.33%	-335	-335	-335	-335	-335	-335	-335
-2.67%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	168	168	168	168	168	168	168
5.33%	335	335	335	335	335	335	335
8.00%	503	503	503	503	503	503	503

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

408

공시일	2016-05-30
기준일	2016-05-27

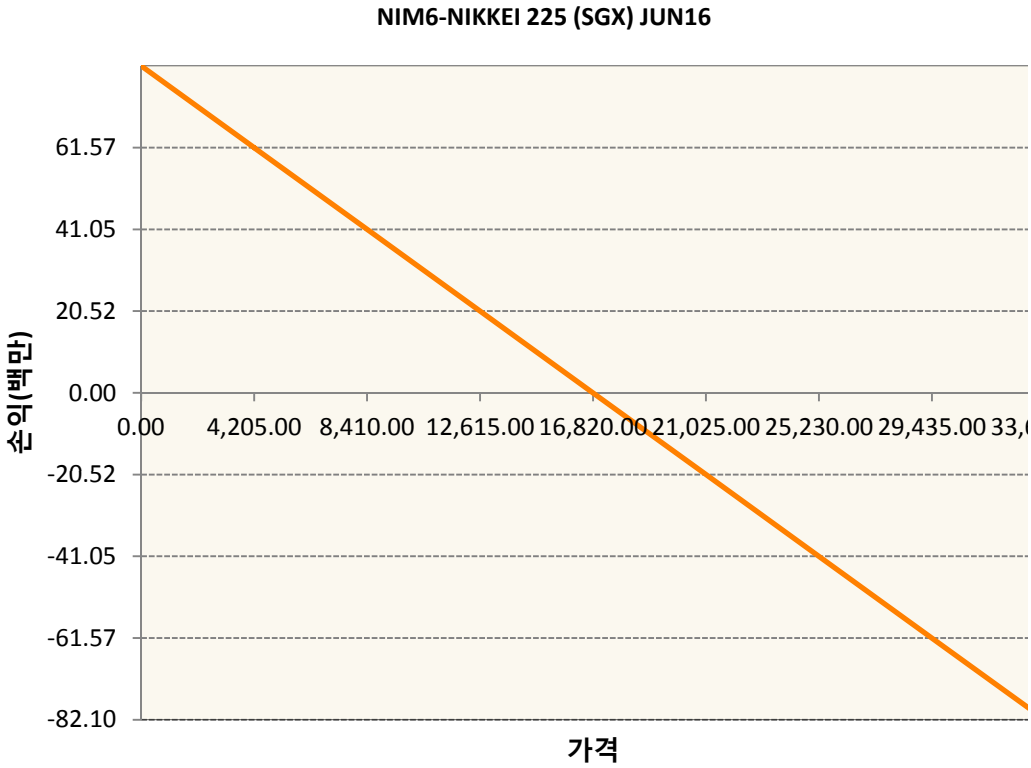
아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

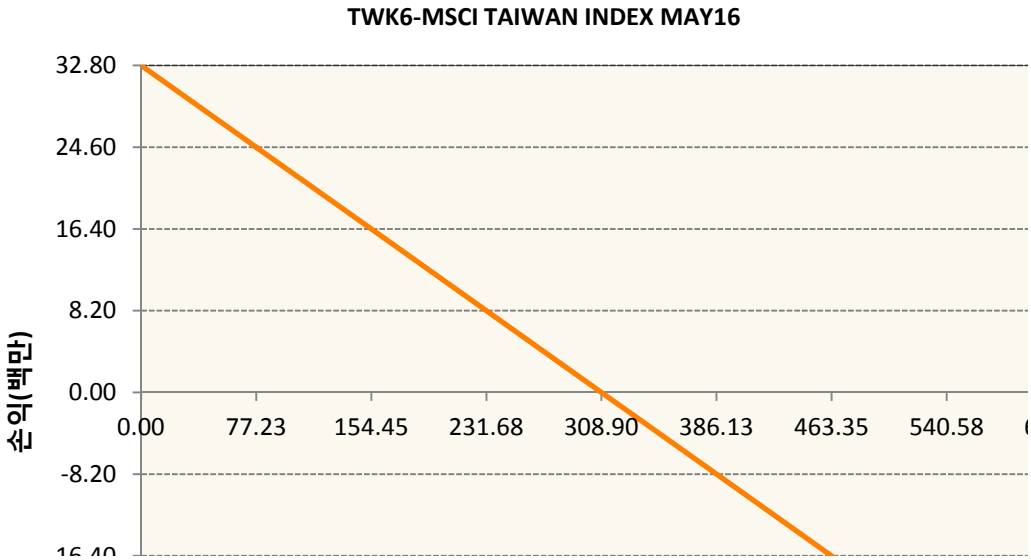
1. 계약금액

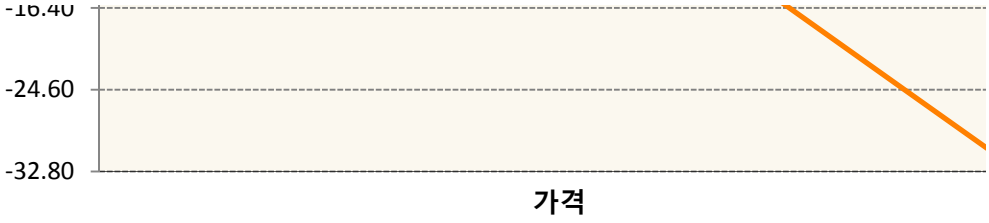
(단위:백만원)

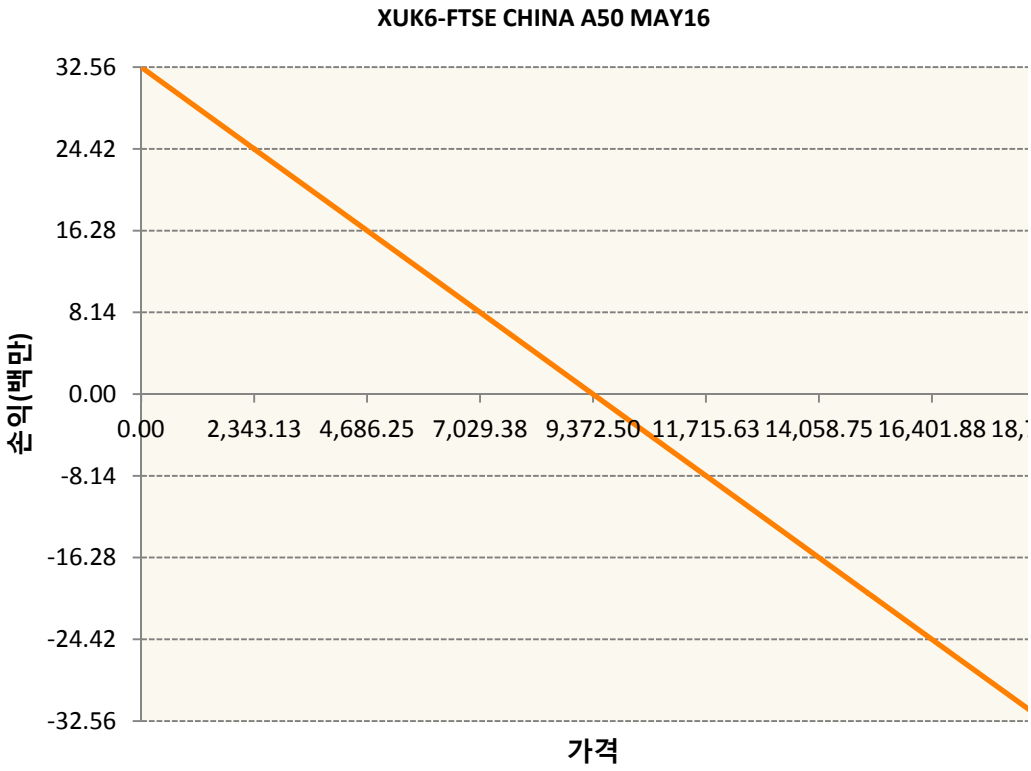
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	0	147	-147	

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	2016-05-30
기준일	2016-05-27

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	10,424	0	10,424	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S160520	857

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

736

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-05-30
기준일	2016-05-27

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	251
SWCSI50000 신한CSI500미래S160308-1	115

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,072

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-05-30
기준일	2016-05-27

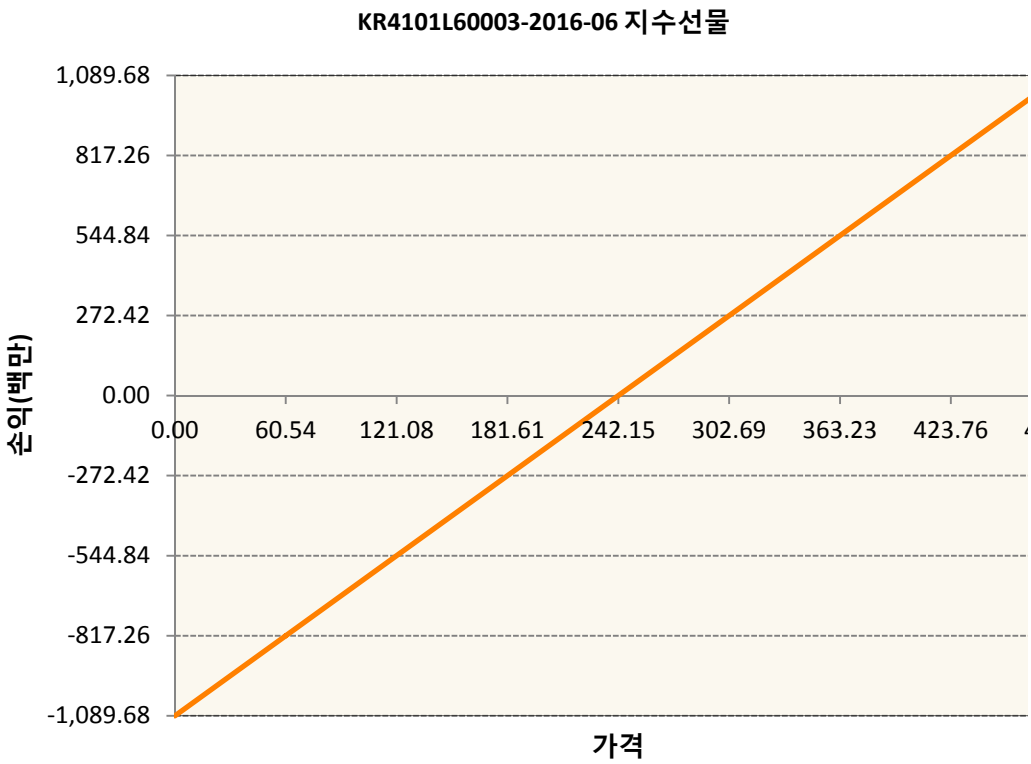
KOSPI200 레버리지 목표전환형 3

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	1,090	0	1,090	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L600	2016-06 지수선물						87
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-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%	87	87	87	87	87	87	87

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

71

공시일	2016-05-30
기준일	2016-05-27

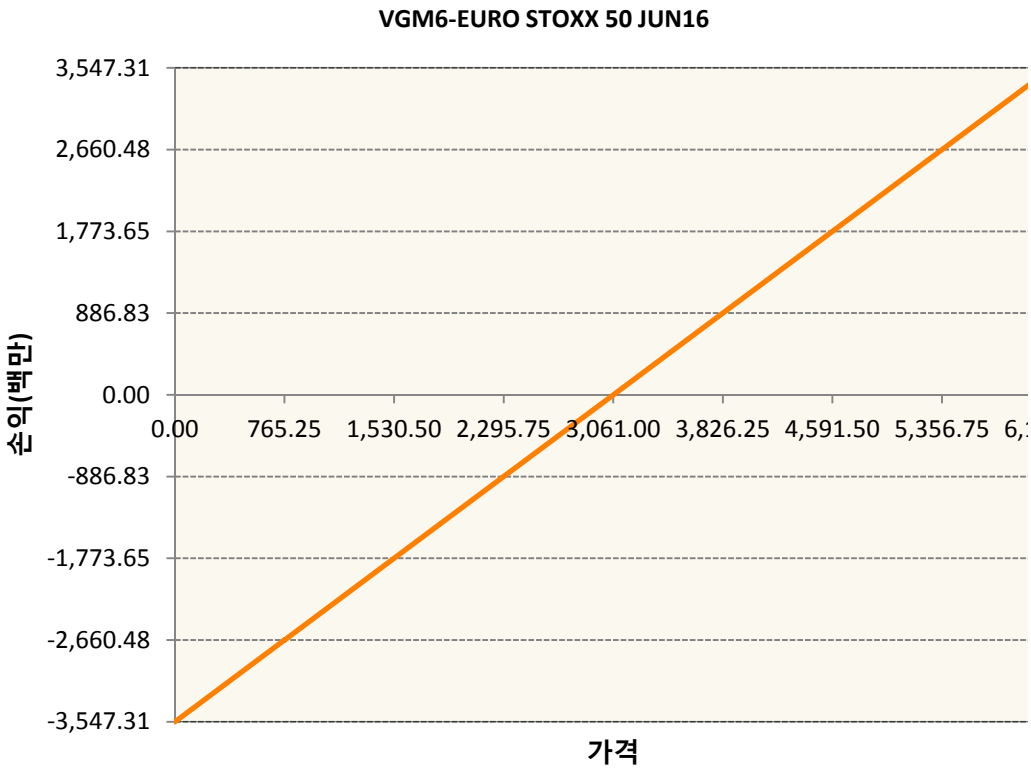
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,547	0	3,547	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM6	EURO STOXX 50 JUN16	284

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

(단위:백만원)

334

공시일	2016-05-30
기준일	2016-05-27

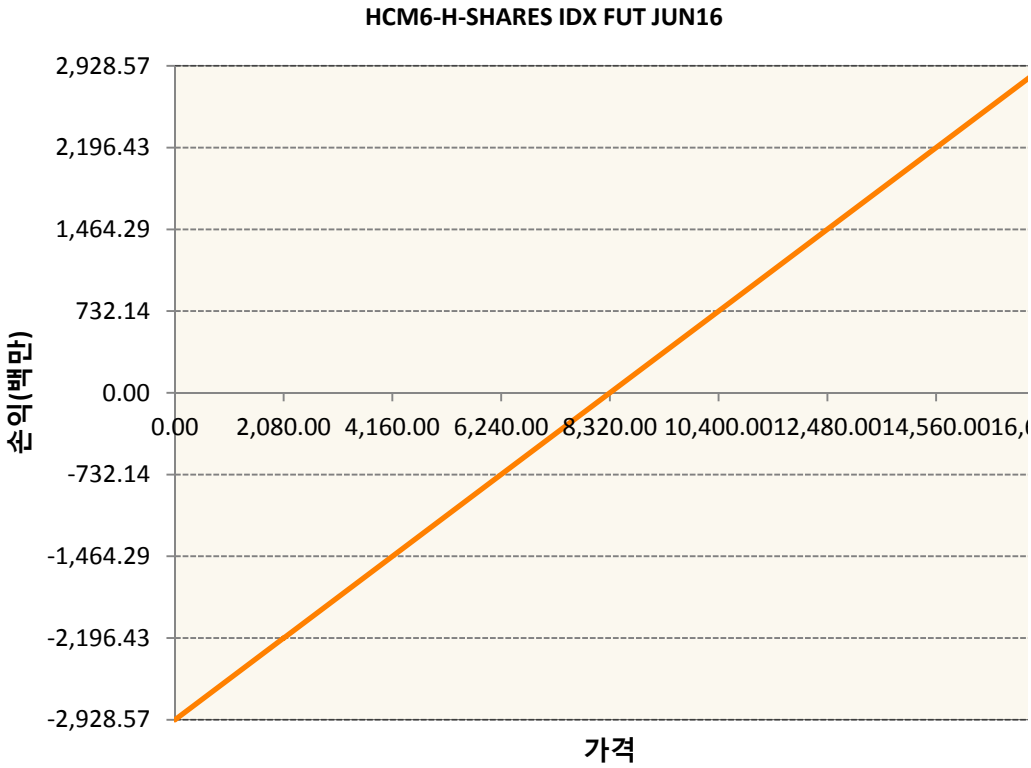
차이나인덱스모(주식-파생형)

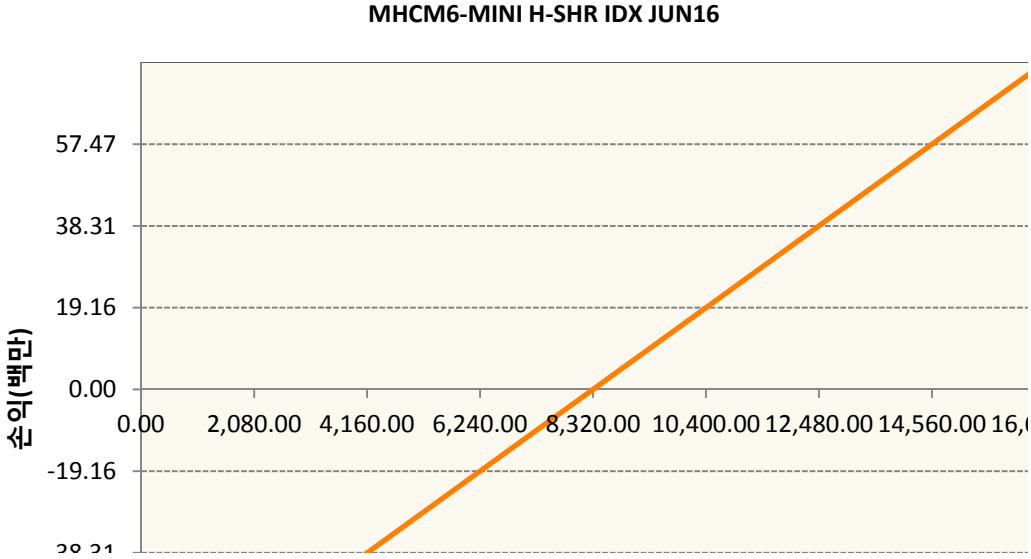
1. 계약금액

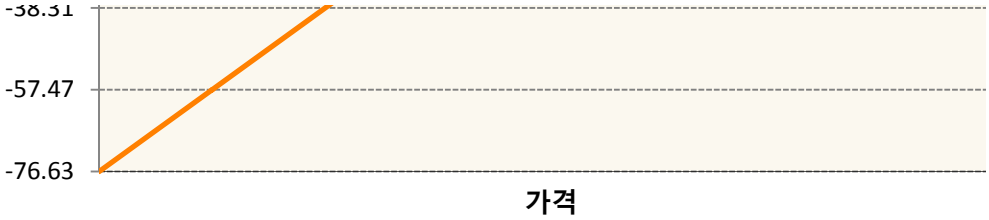
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,005	0	3,005	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCM6	H-SHARES IDX FUT JUN16	234
MHCM6	MINI H-SHR IDX JUN16	6

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	342

공시일	2016-05-30
기준일	2016-05-27

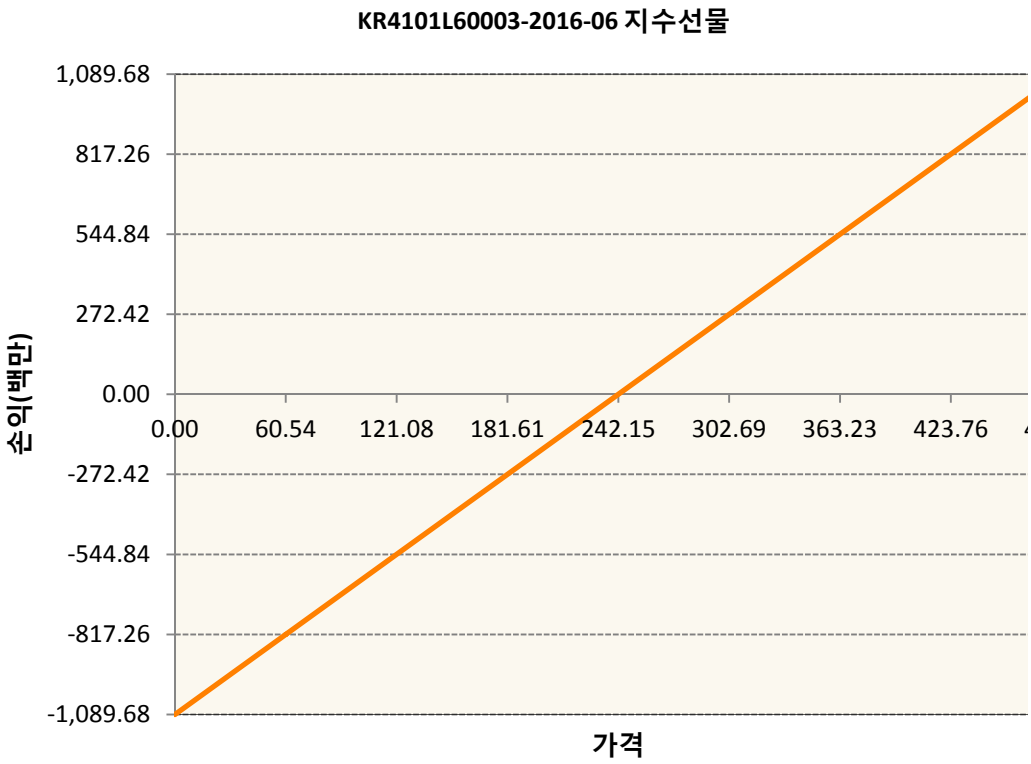
커버드콜(주식혼합-파생형)

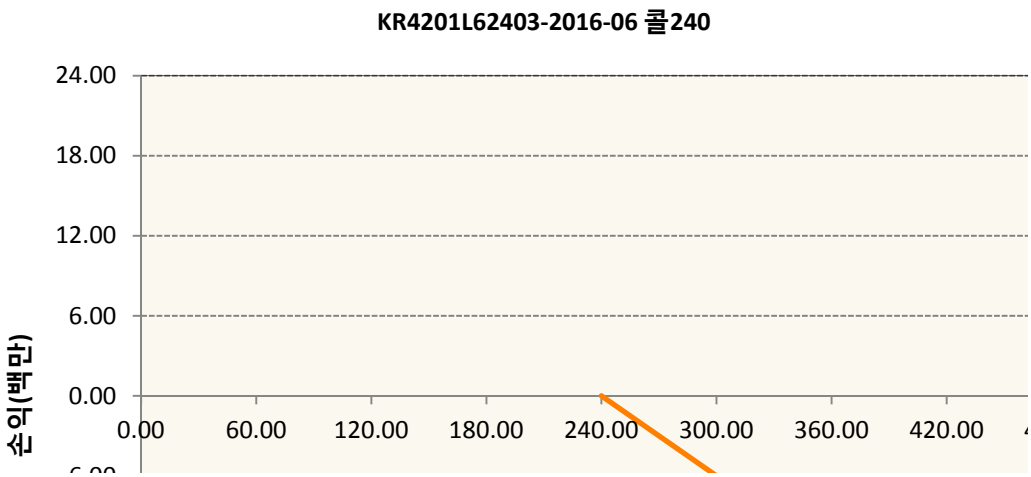
1. 계약금액

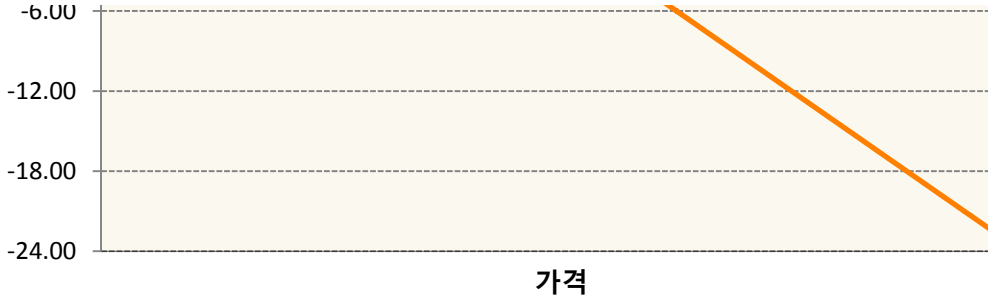
(단위:백만원)

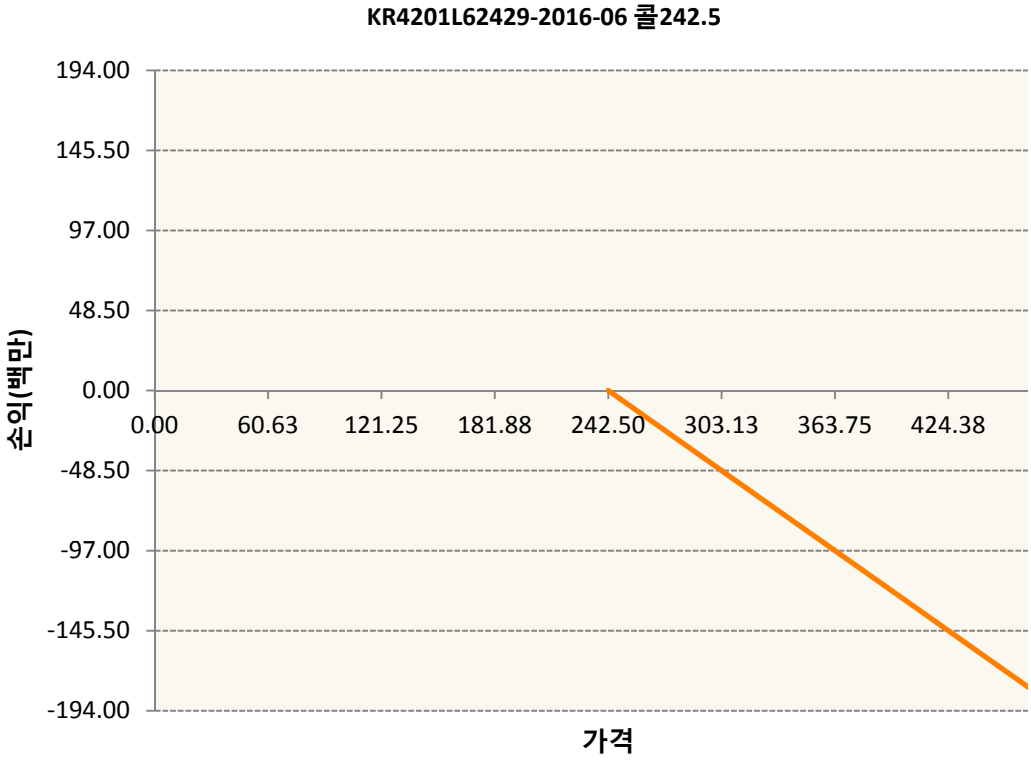
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	241	0	241	장내
신규	유가증권	옵션	0	49	-49	장내
누계	유가증권	선물	1,090	0	1,090	장내
누계	유가증권	옵션	0	218	-218	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101L600 2016-06 지수선물							87
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-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%	87	87	87	87	87	87	87
KR4201L624 2016-06 콜240							9
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2	2	2	2	2	2	2
-5.33%	2	2	2	2	2	2	1
-2.67%	1	1	1	1	1	1	1
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%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
KR4201L624 2016-06 콜242.5							68

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7	7	7	7	7	7	7
-5.33%	7	7	7	7	7	7	7
-2.67%	7	7	6	6	6	6	5
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	-17	-17	-17	-18	-18	-18	-19
5.33%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
8.00%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68

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

168

공시일	2016-05-30
기준일	2016-05-27

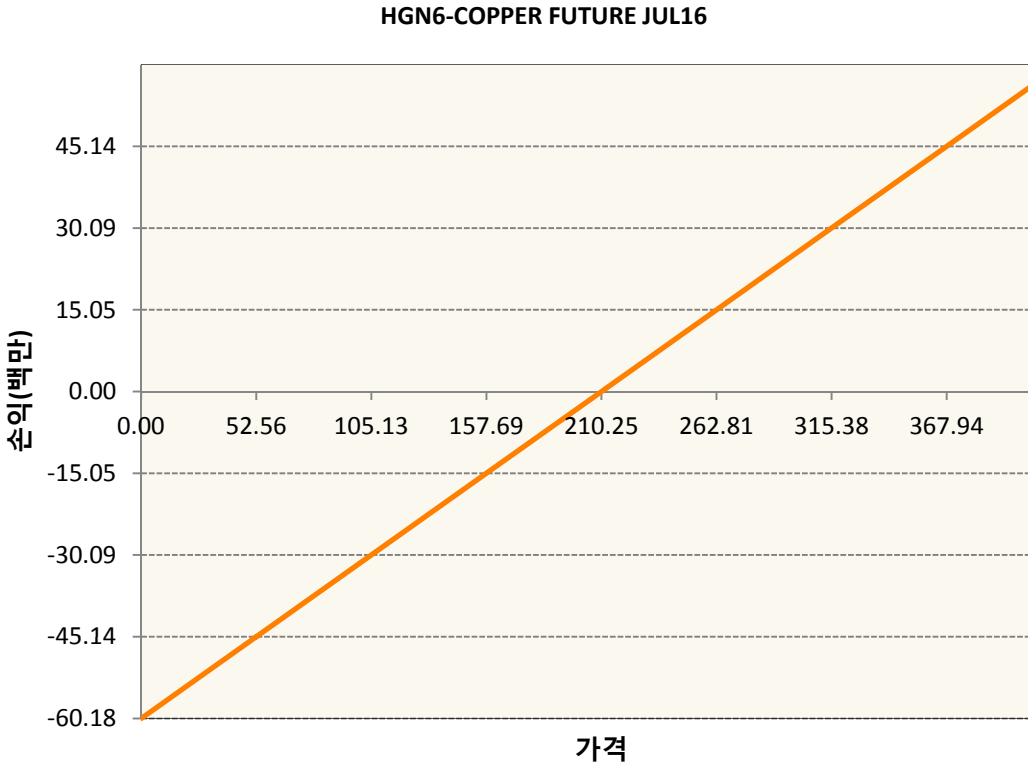
메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

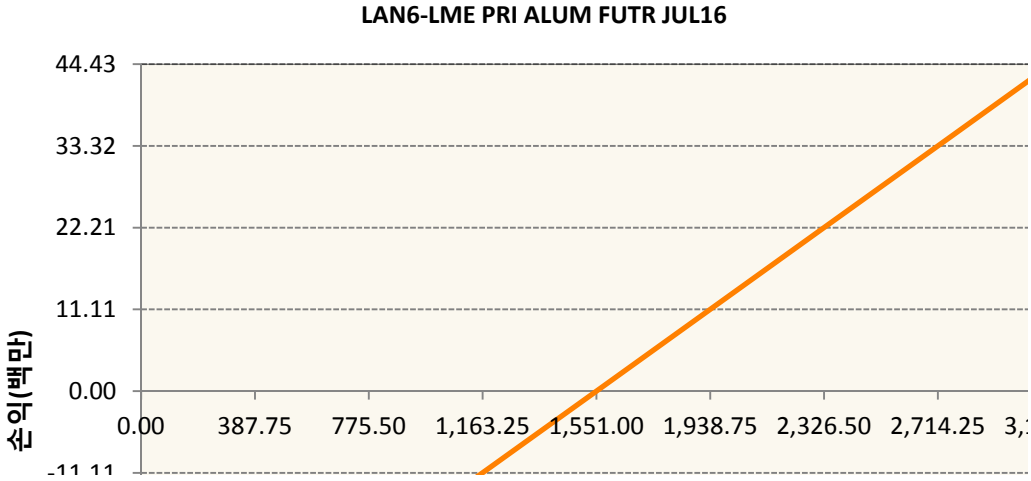
1. 계약금액

(단위:백만원)

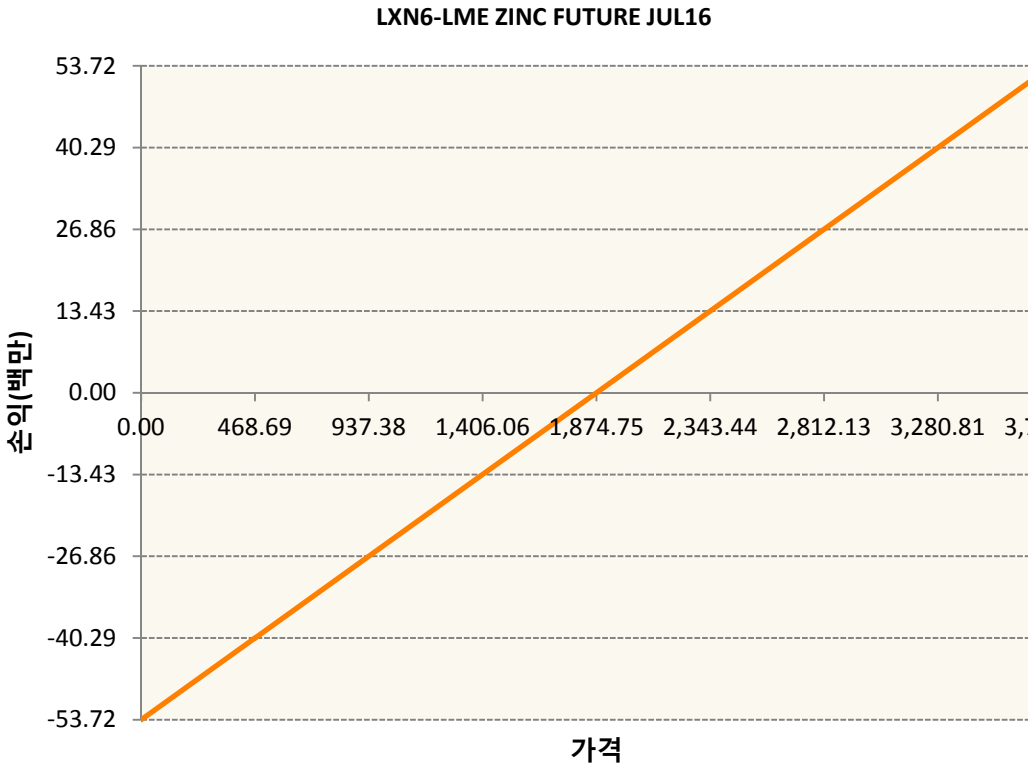
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	56	0	56	
누계	유가증권	선물	296	0	296	

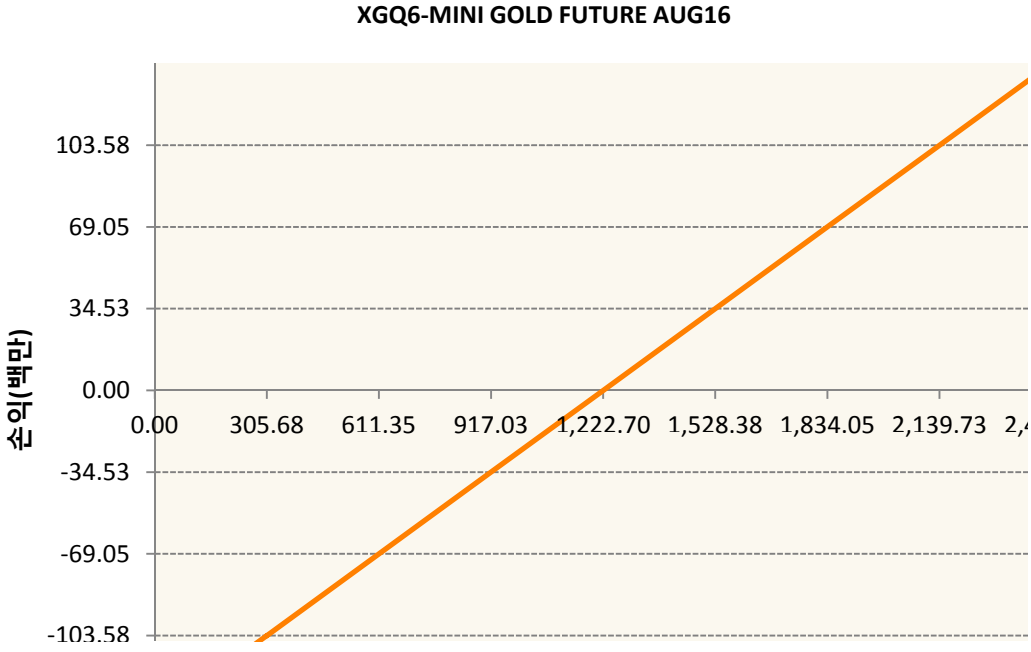
2. 만기시점의 손익구조

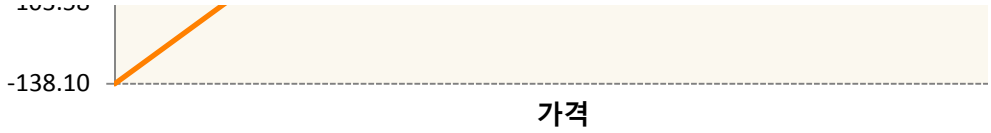


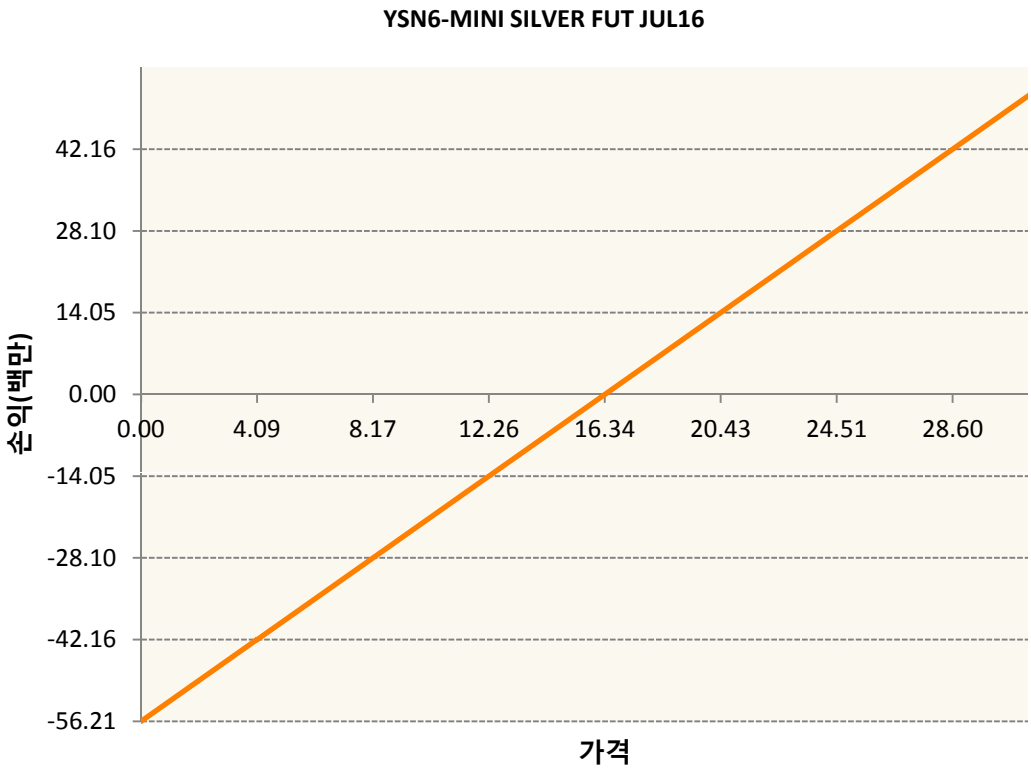



-22.21
-33.32
-44.43
가격


LXN6-LME ZINC FUTURE JUL16
53.72
40.29
26.86
13.43
0.00
-13.43
-26.86
-40.29
-53.72
0.00
468.69
937.38
1,406.06
1,874.75
2,343.44
2,812.13
3,280.81
순익(백만)
가격


XGQ6-MINI GOLD FUTURE AUG16
103.58
69.05
34.53
0.00
-34.53
-69.05
-103.58
0.00
305.68
611.35
917.03
1,222.70
1,528.38
1,834.05
2,139.73
순익(백만)





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	11
YSN6	MINI SILVER FUT JUL16	4

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

29

공시일	2016-05-30
기준일	2016-05-27

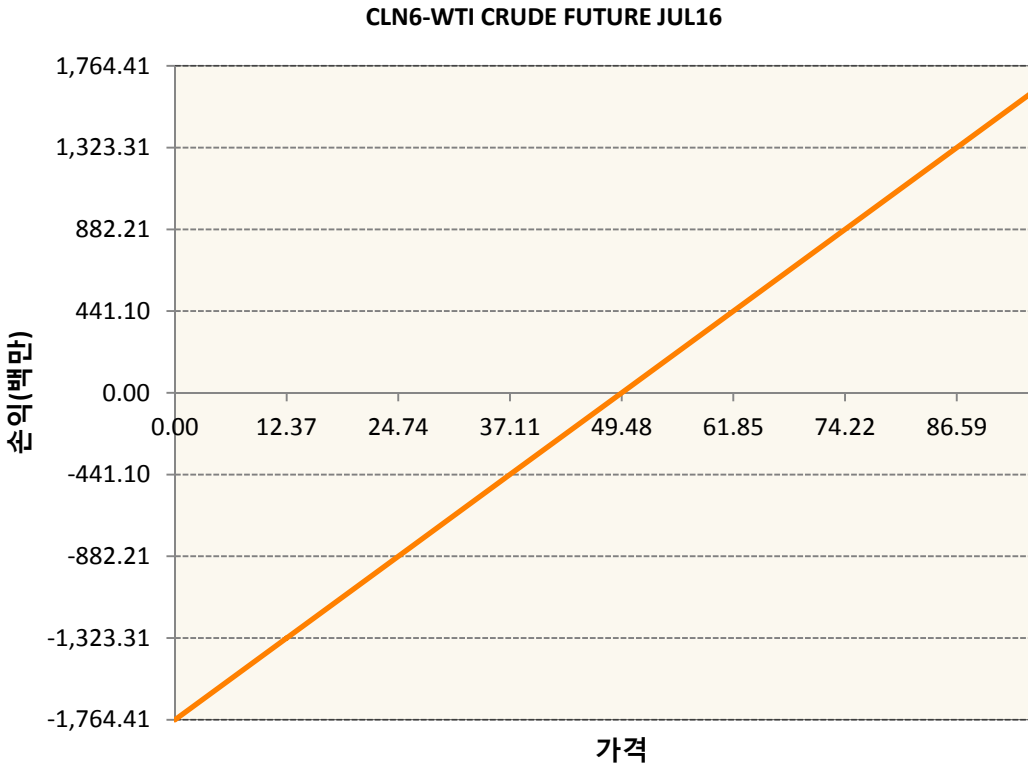
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

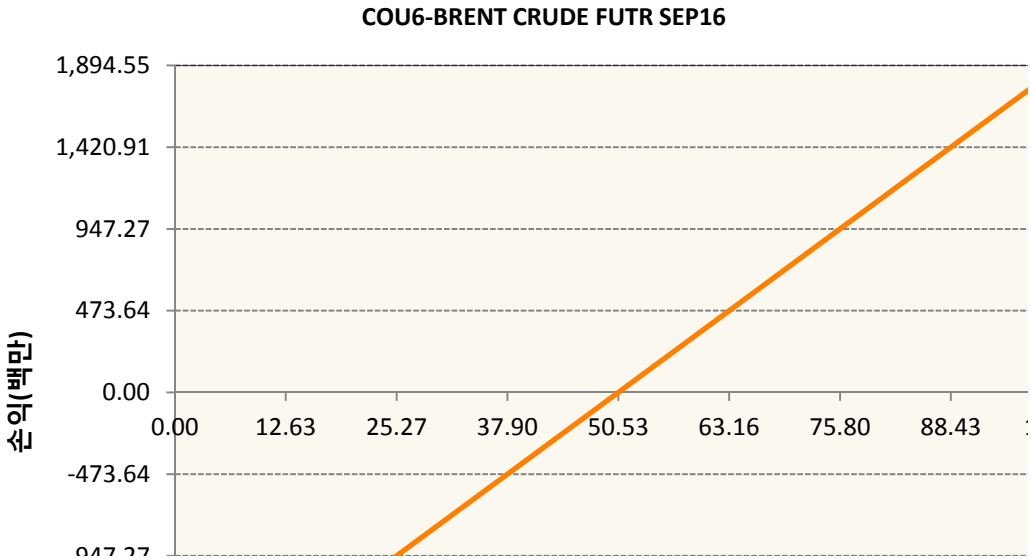
1. 계약금액

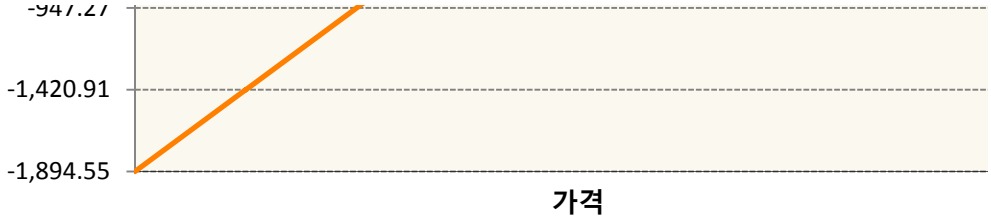
(단위:백만원)

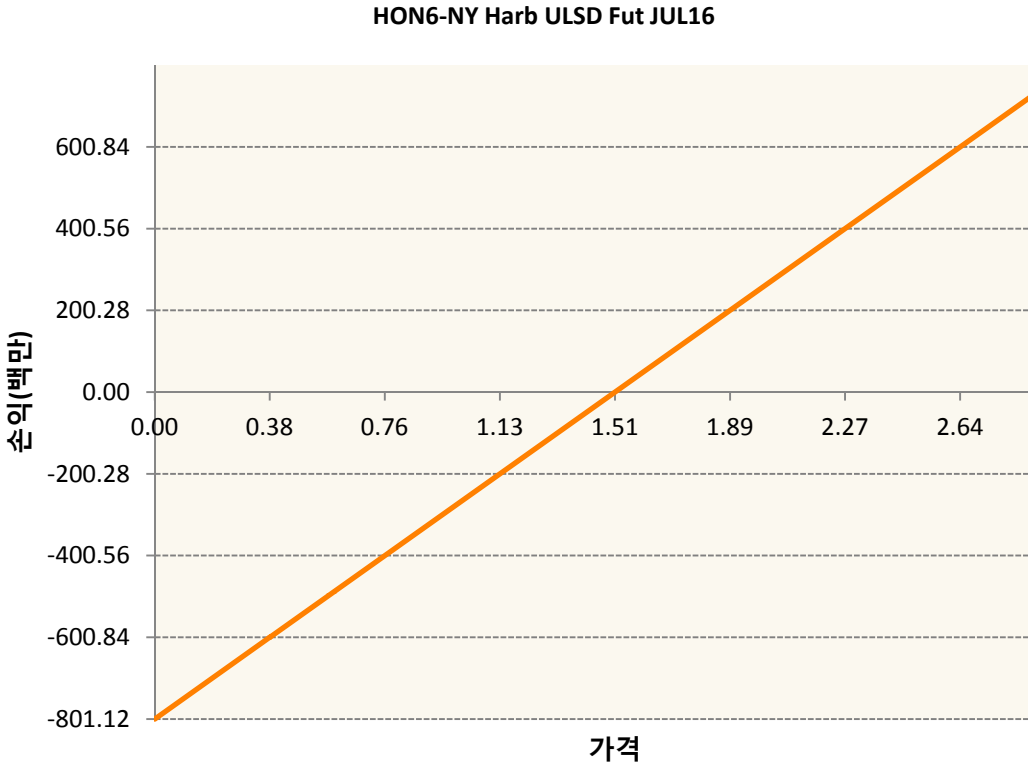
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,419	0	6,419	

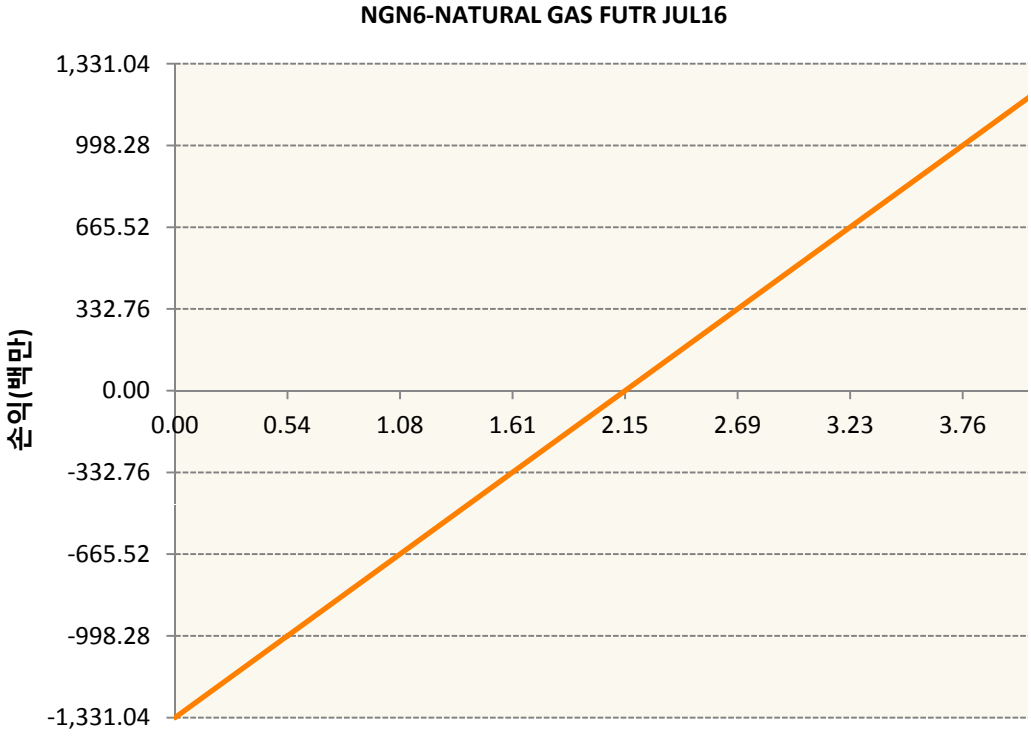
2. 만기시점의 손익구조



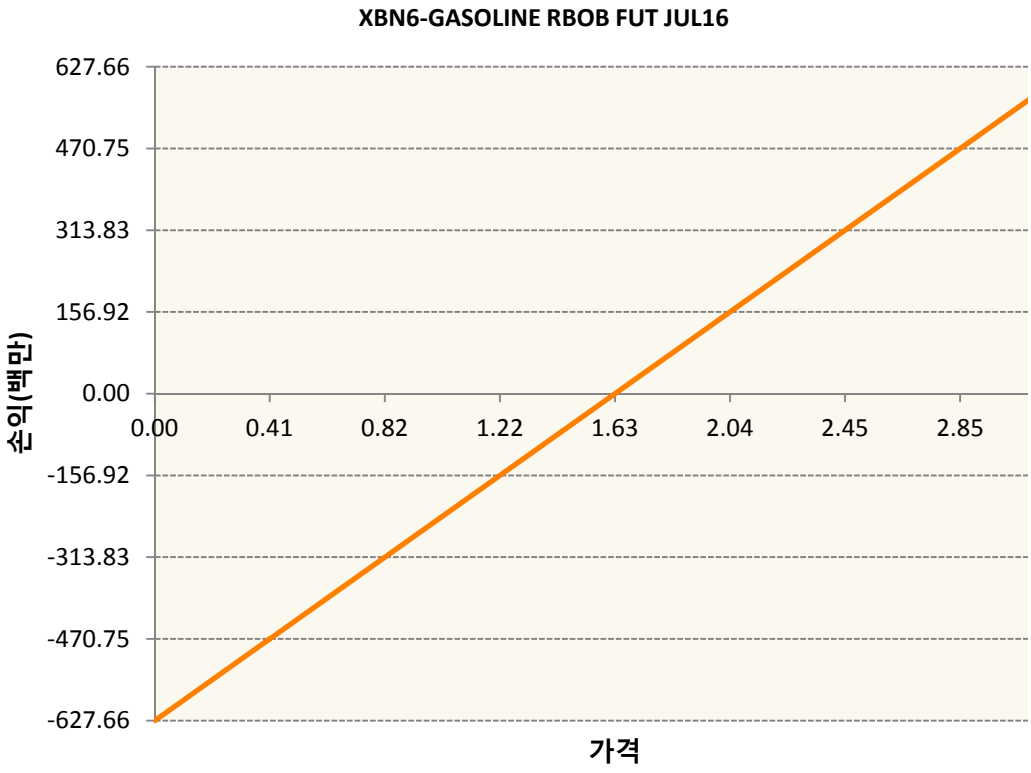



-1,420.91
-1,894.55
가격


HON6-NY Harb ULSD Fut JUL16
600.84
400.56
200.28
0.00
-200.28
-400.56
-600.84
-801.12
0.00
0.38
0.76
1.13
1.51
1.89
2.27
2.64
순익(백만)
가격


NGN6-NATURAL GAS FUTR JUL16
1,331.04
998.28
665.52
332.76
0.00
-332.76
-665.52
-998.28
-1,331.04
0.00
0.54
1.08
1.61
2.15
2.69
3.23
3.76
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLN6	WTI CRUDE FUTURE JUL16	141
COU6	BRENT CRUDE FUTR SEP16	152
HON6	NY Harb ULSD Fut JUL16	64
NGN6	NATURAL GAS FUTR JUL16	106
XBN6	GASOLINE RBOB FUT JUL16	50

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,416

공시일	2016-05-30
기준일	2016-05-27

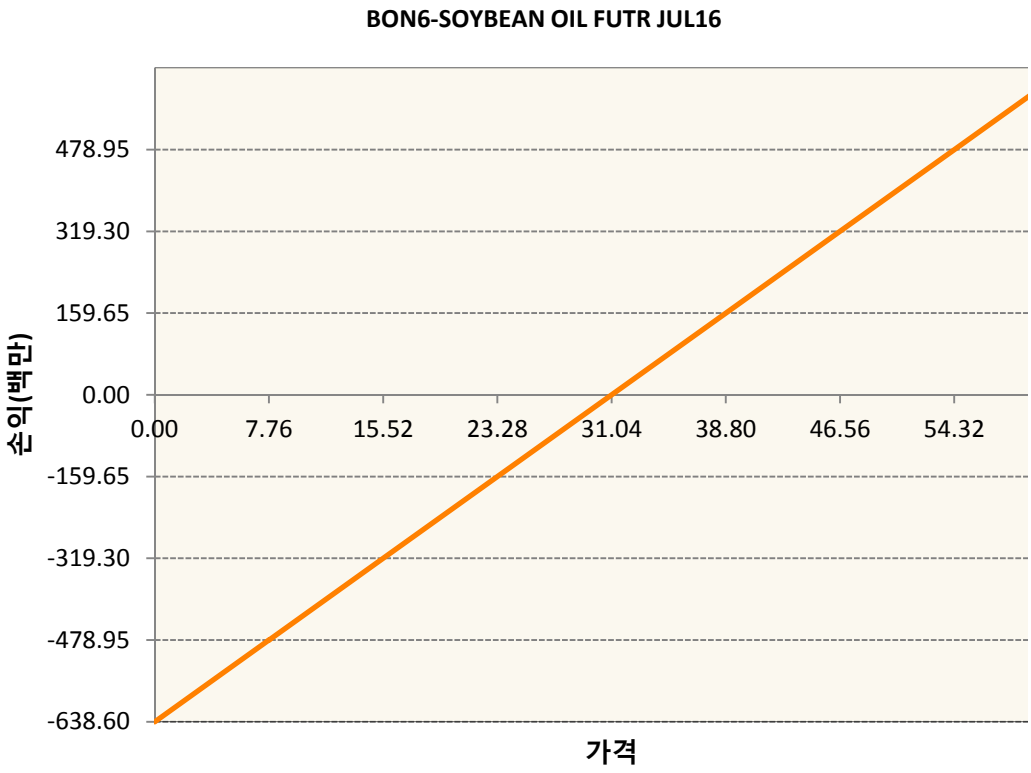
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

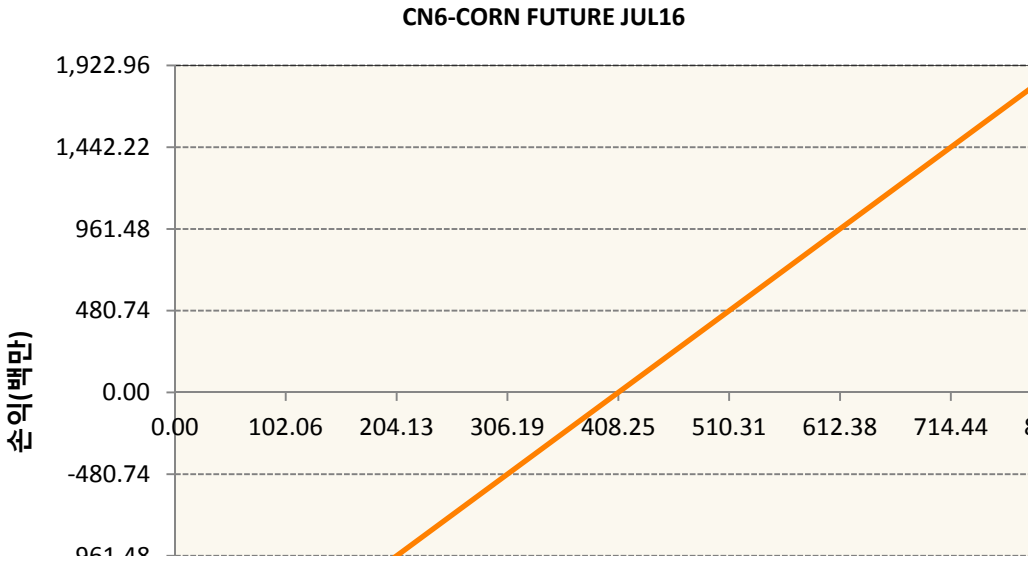
1. 계약금액

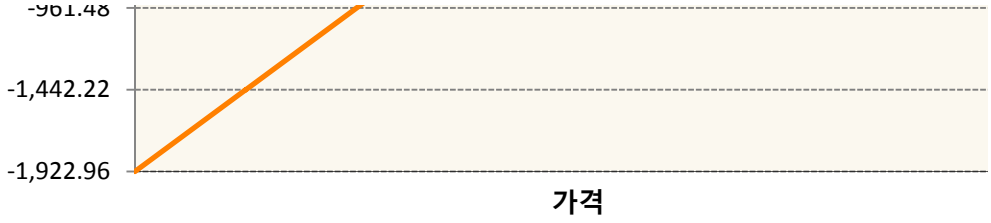
(단위:백만원)

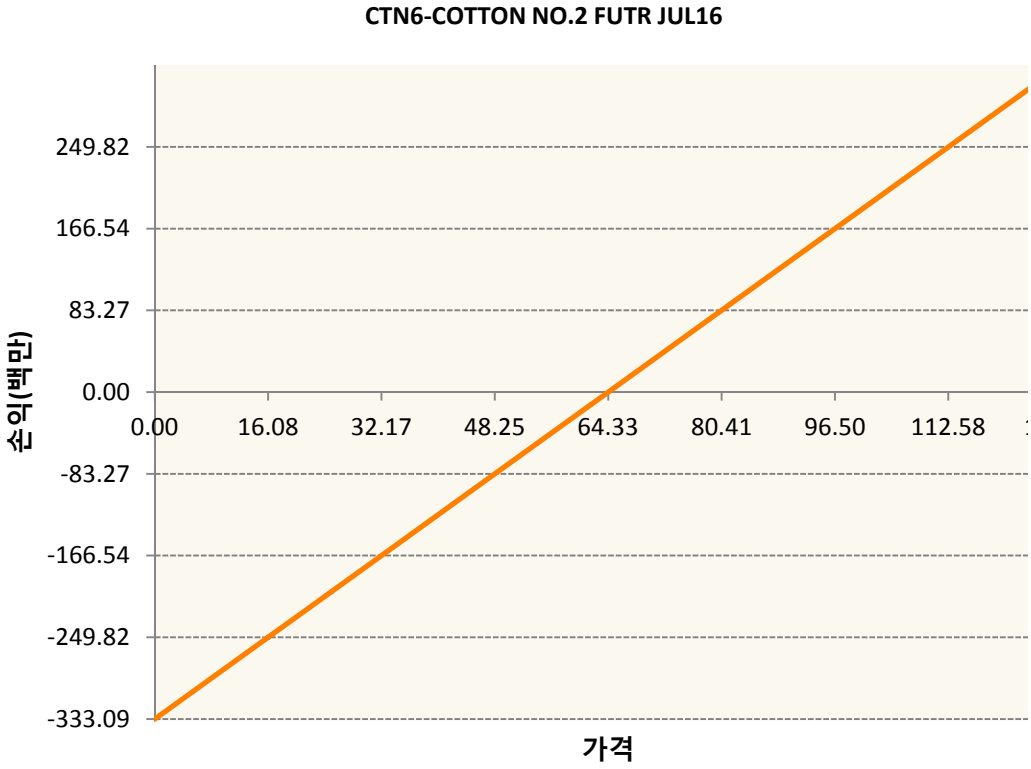
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,914	0	7,914	

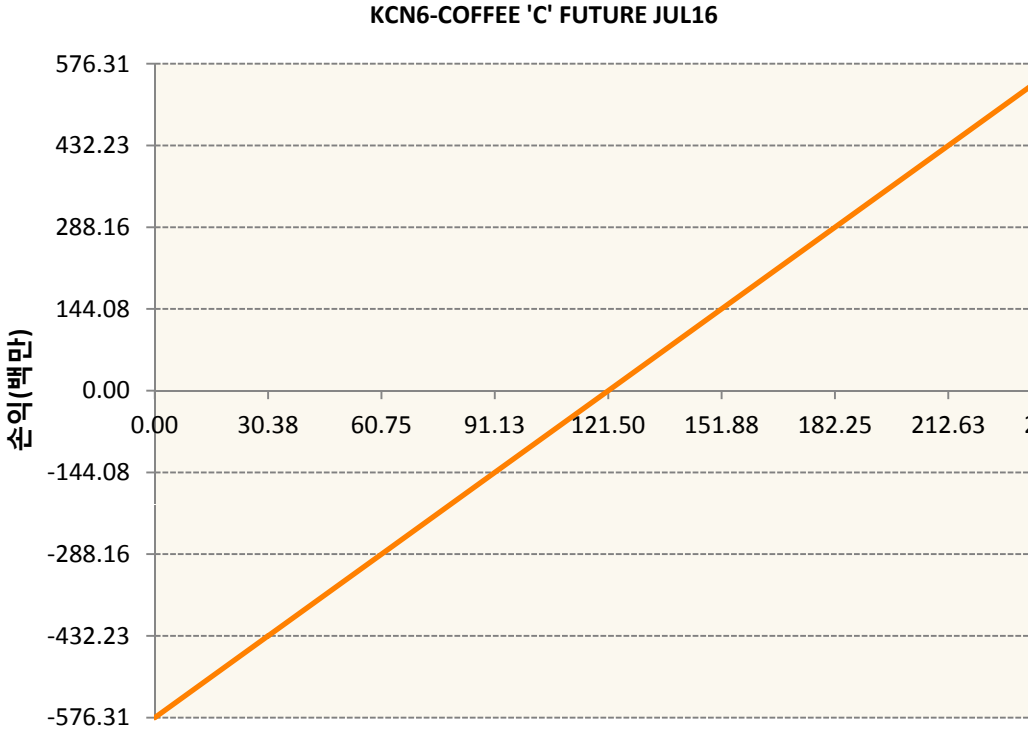
2. 만기시점의 손익구조





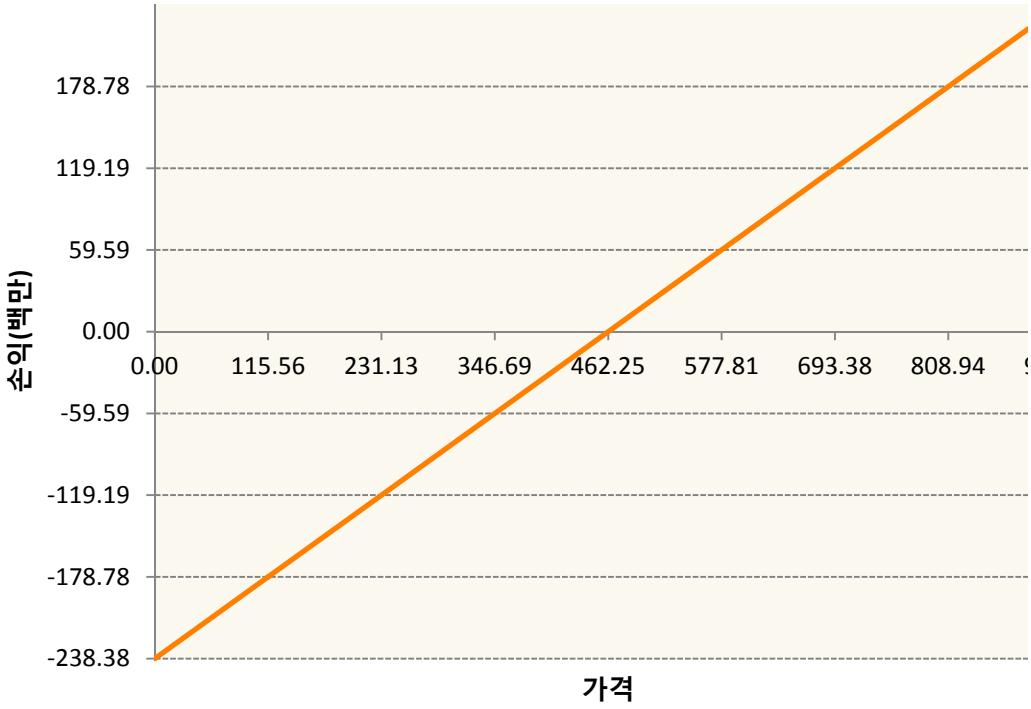

-961.48
-1,442.22
-1,922.96
가격


CTN6-COTTON NO.2 FUTR JUL16
249.82
166.54
83.27
0.00
-83.27
-166.54
-249.82
-333.09
0.00
16.08
32.17
48.25
64.33
80.41
96.50
112.58
순익(백만)
가격

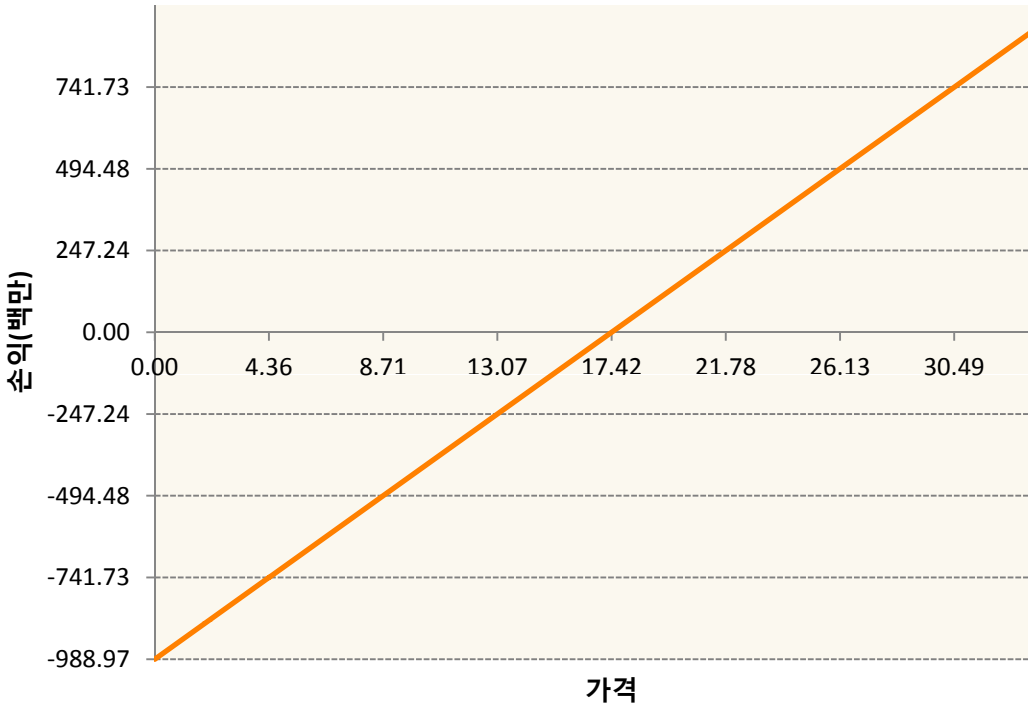

KCN6-COFFEE 'C' FUTURE JUL16
576.31
432.23
288.16
144.08
0.00
-144.08
-288.16
-432.23
-576.31
0.00
30.38
60.75
91.13
121.50
151.88
182.25
212.63
순익(백만)

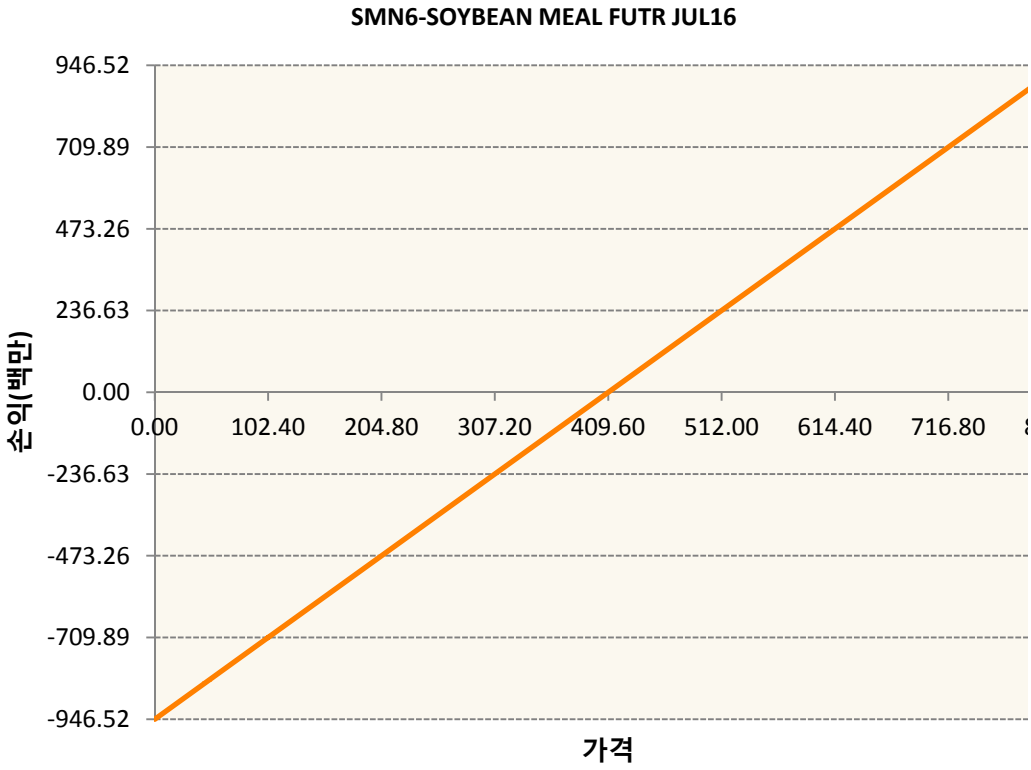
가격

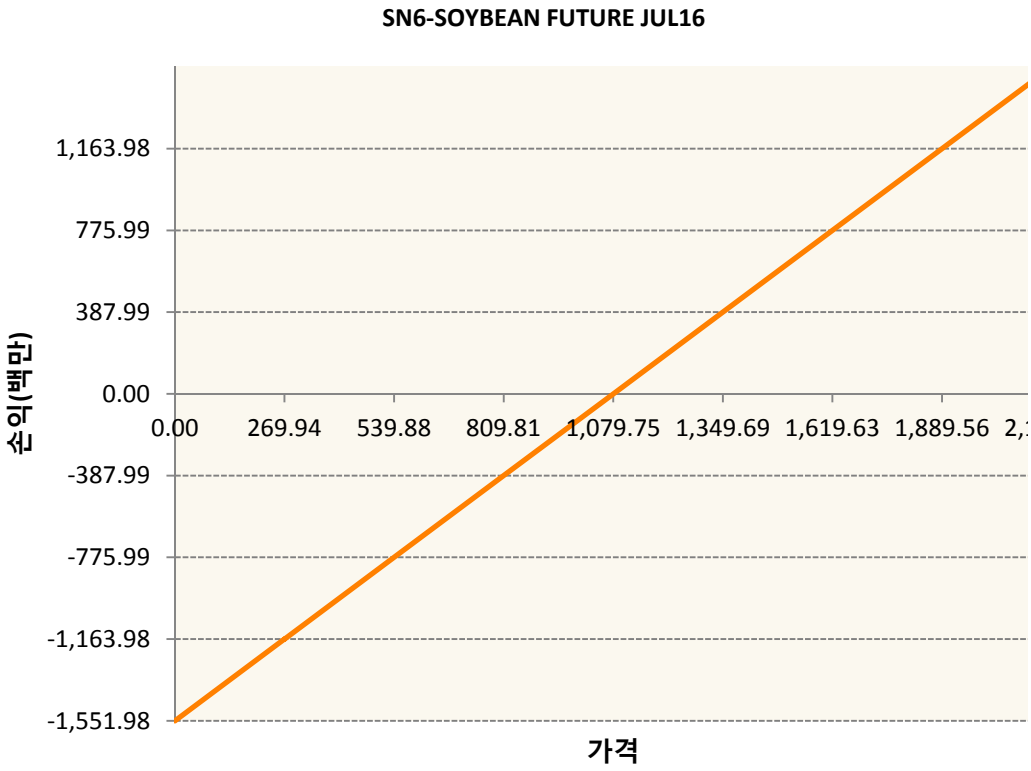
KWN6-KC HRW WHEAT FUT JUL16



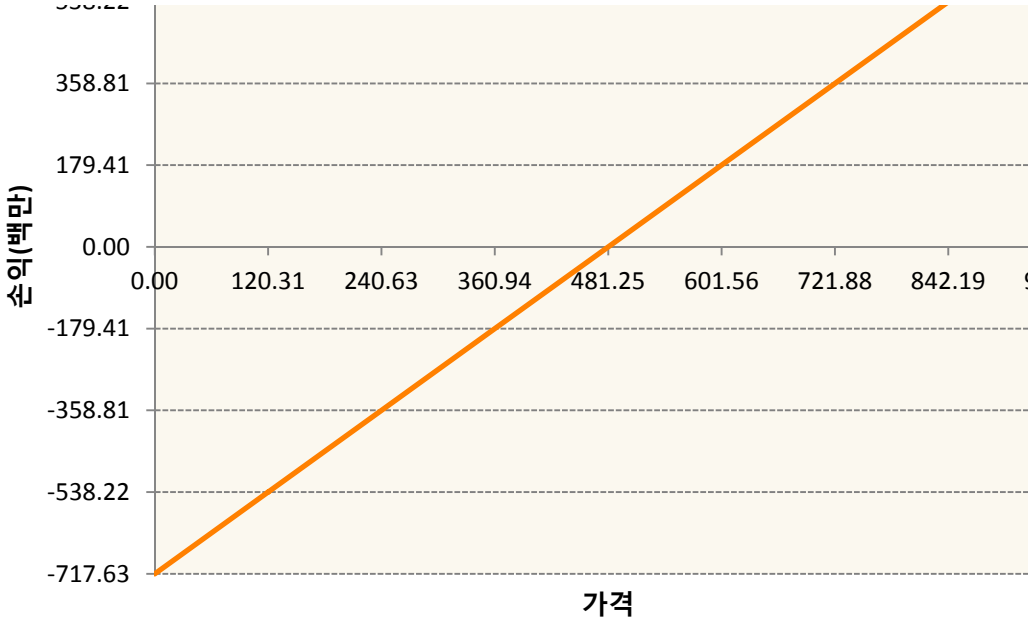
SBN6-SUGAR #11 (WORLD) JUL16




SMN6-SOYBEAN MEAL FUTR JUL16
946.52
709.89
473.26
236.63
0.00
-236.63
-473.26
-709.89
-946.52
0.00
102.40
204.80
307.20
409.60
512.00
614.40
716.80
손익(백만)
가격


SN6-SOYBEAN FUTURE JUL16
1,163.98
775.99
387.99
0.00
-387.99
-775.99
-1,163.98
-1,551.98
0.00
269.94
539.88
809.81
1,079.75
1,349.69
1,619.63
1,889.56
손익(백만)
가격


WN6-WHEAT FUTURE(CBT) JUL16
538.22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON6	SOYBEAN OIL FUTR JUL16	51
CN6	CORN FUTURE JUL16	154
CTN6	COTTON NO.2 FUTR JUL16	27
KCN6	COFFEE 'C' FUTURE JUL16	46
KWN6	KC HRW WHEAT FUT JUL16	19
SBN6	SUGAR #11 (WORLD) JUL16	79
SMN6	SOYBEAN MEAL FUTR JUL16	76
SN6	SOYBEAN FUTURE JUL16	124
WN6	WHEAT FUTURE(CBT) JUL16	57

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

876