| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-06-02 |
| 기준일 | 2016-06-01 |

# 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 | 2016-06-02 |
| 기준일 | 2016-06-01 |

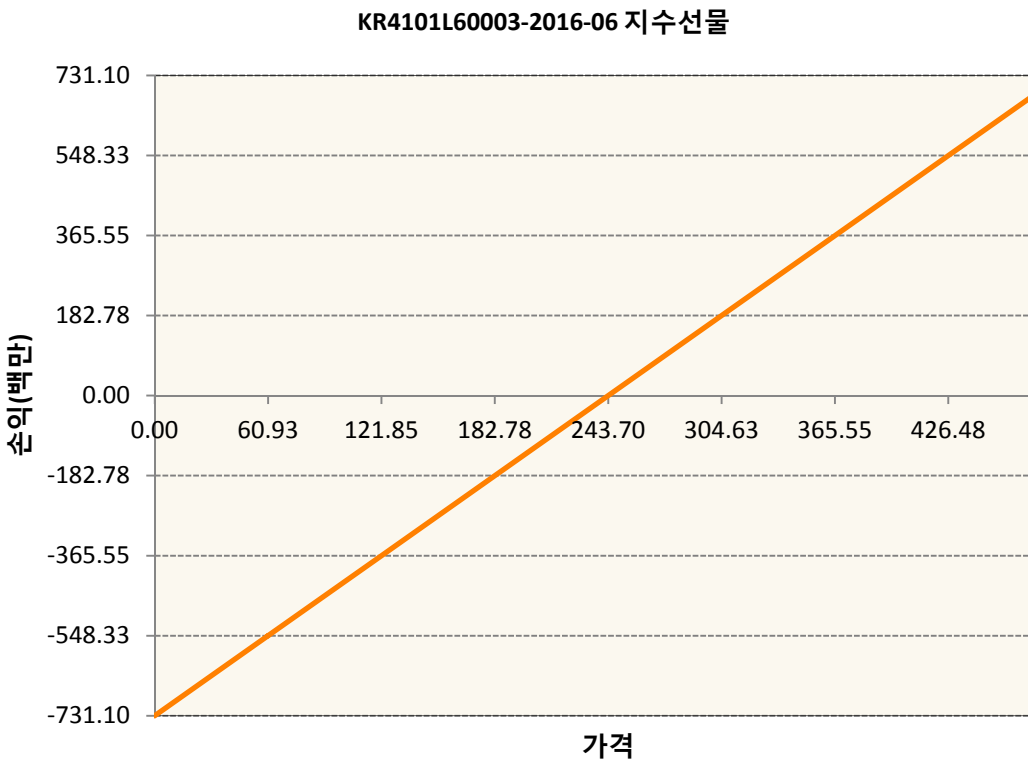
# 스마트인덱스모

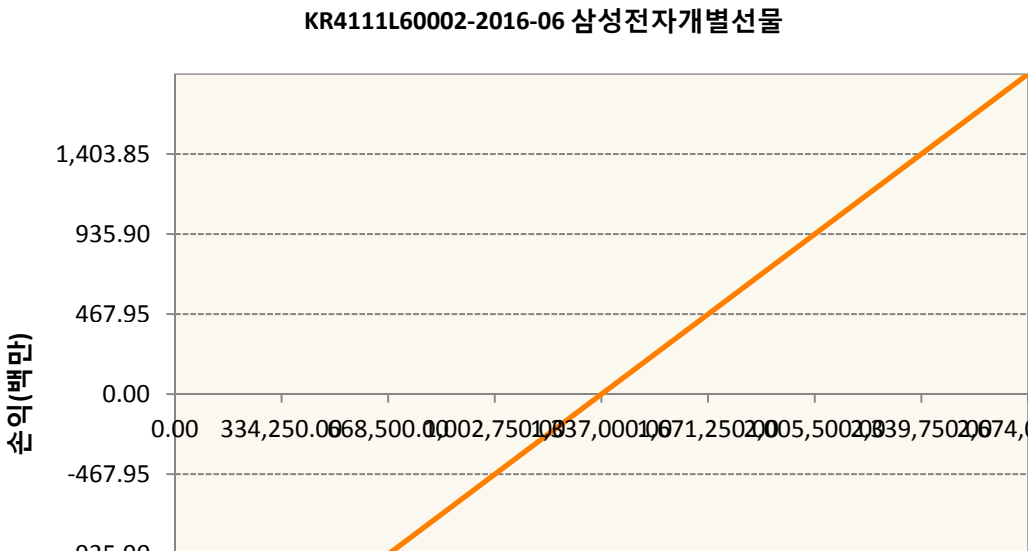
## 1. 계약금액

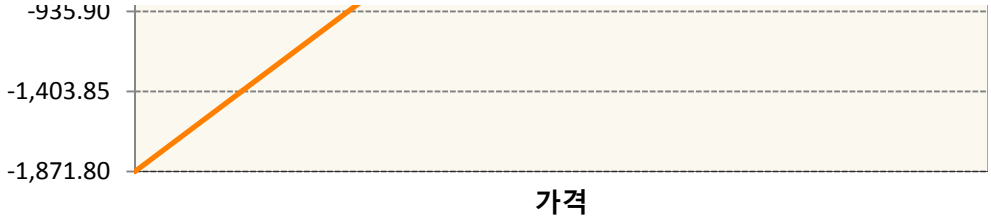
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,603 | 0 | 2,603 | 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 | | | | | | 149 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -149 | -149 | -149 | -149 | -149 | -149 | -149 |
| -5.33% | -100 | -100 | -100 | -100 | -100 | -100 | -100 |
| -2.67% | -50 | -50 | -50 | -50 | -50 | -50 | -50 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 50 | 50 | 50 | 50 | 50 | 50 | 50 |
| 5.33% | 100 | 100 | 100 | 100 | 100 | 100 | 100 |
| 8.00% | 149 | 149 | 149 | 149 | 149 | 149 | 149 |

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

| **196** |
|---|

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-06-02 |
| 기준일 | 2016-06-01 |

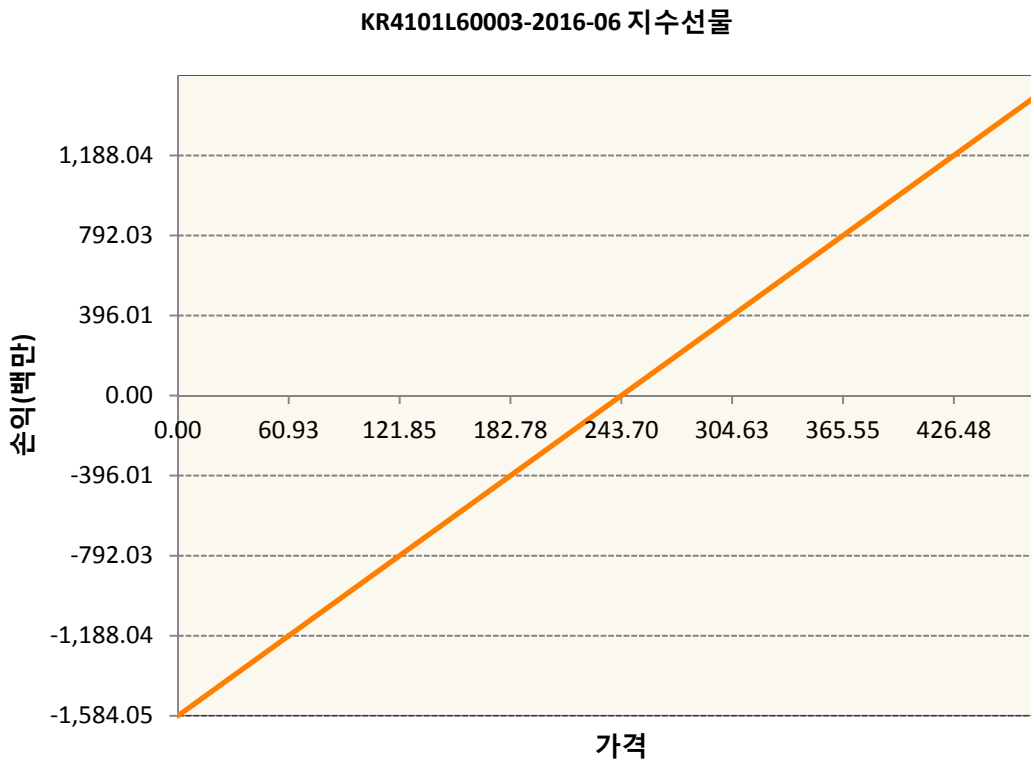
# 스마트레버리지목표전환형1호

## 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 | 1,584 | 0 | 1,584 | 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)

| |
|---|
| **102** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-06-02 |
| 기준일 | 2016-06-01 |

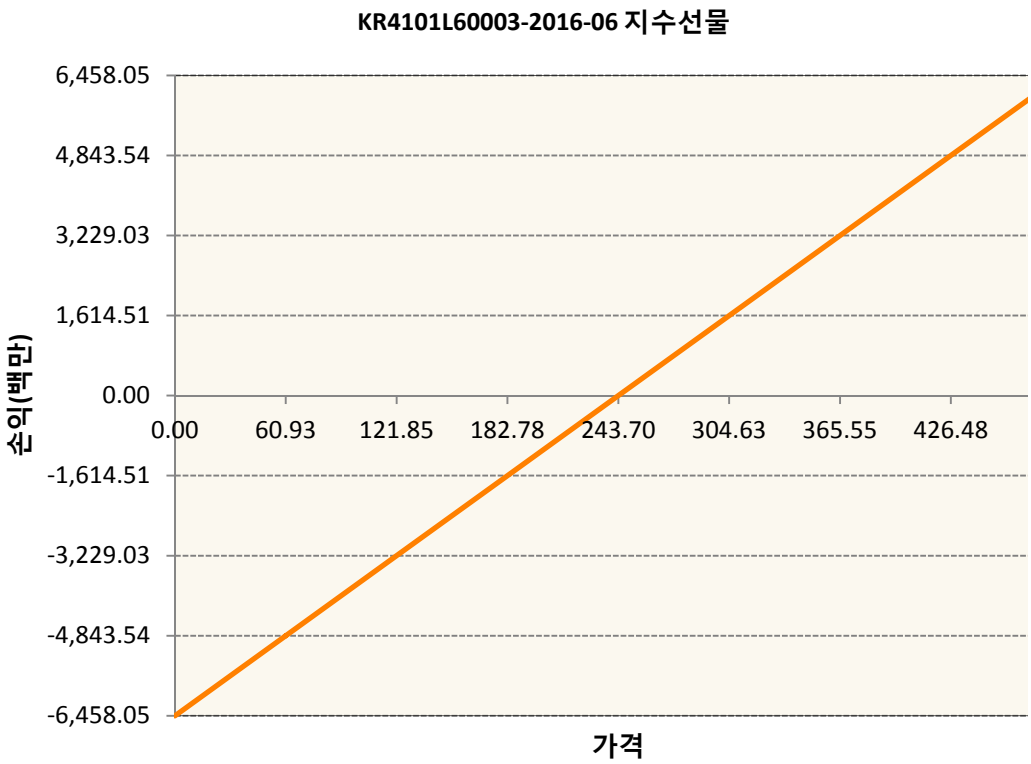
# 1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

## 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 | 6,458 | 0 | 6,458 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101L600 | 2016-06 지수선물 | | | | | | 516 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -516 | -516 | -516 | -516 | -516 | -516 | -516 |
| -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% | 516 | 516 | 516 | 516 | 516 | 516 | 516 |

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

| 416 |
|---|

| 공시일 | 2016-06-02 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-06-01 |

# 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 | 859 |
|---|---|

* 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 | 2016-06-02 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-06-01 |

# 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 | 260 |
| SWCSI50000 신한CSI500미래S160308-1 | 120 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **1,108** |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-06-02 |
| 기준일 | 2016-06-01 |

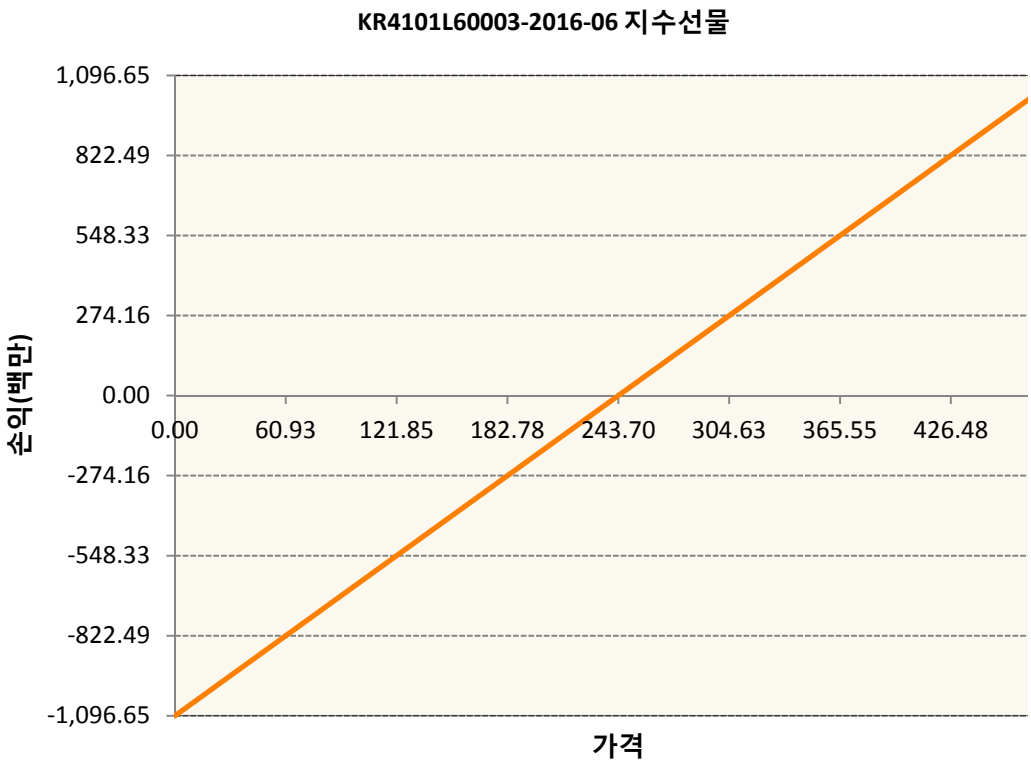
# KOSPI200 레버리지 목표전환형 3

## 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 | 1,097 | 0 | 1,097 | 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 | 2016-06-02 |
| 기준일 | 2016-06-01 |

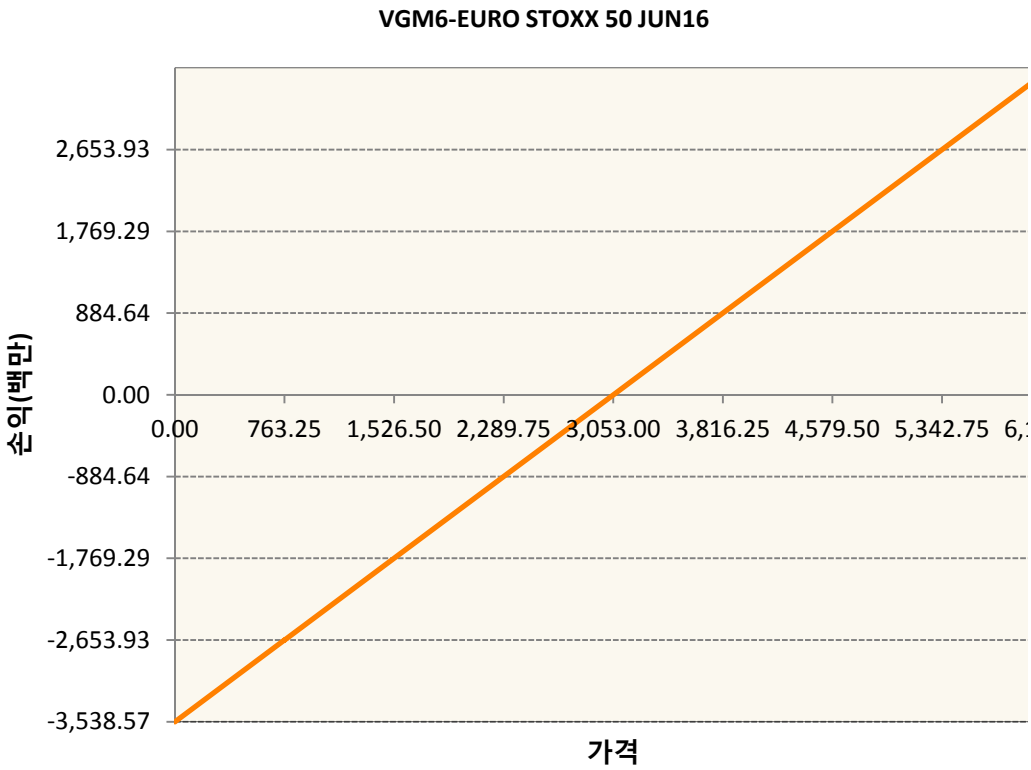
# 유로인덱스모(주식-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,539 | 0 | 3,539 | |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| VGM6 | EURO STOXX 50 JUN16 | 283 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **330** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-06-02 |
| 기준일 | 2016-06-01 |

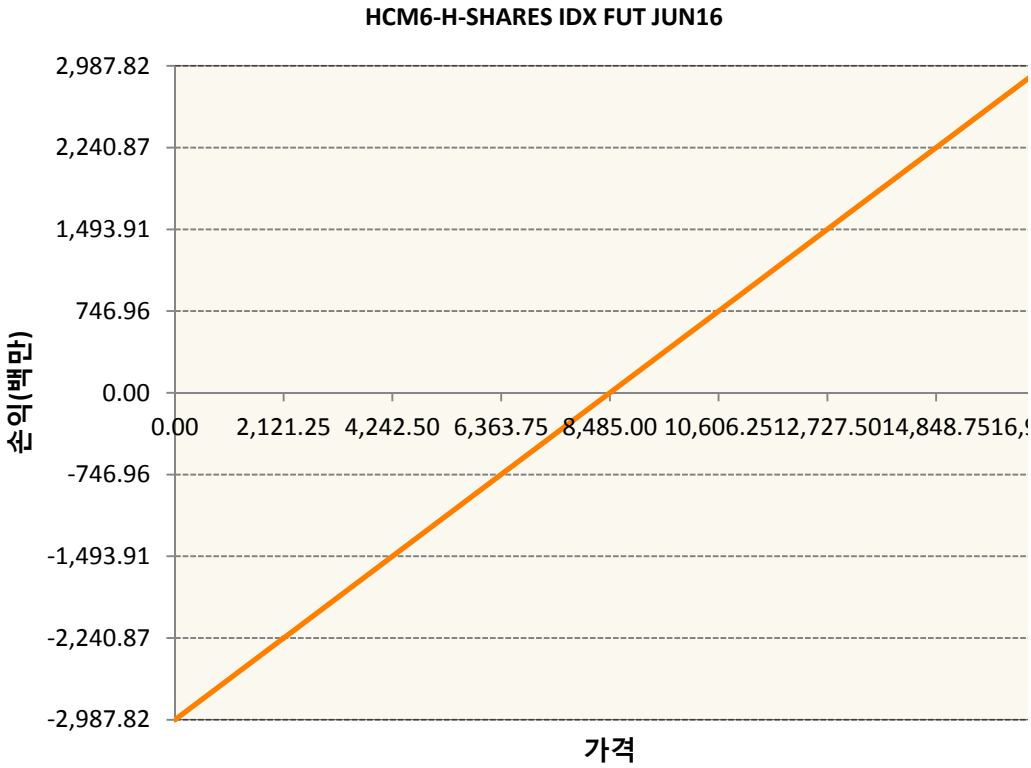
# 차이나인덱스모(주식-파생형)

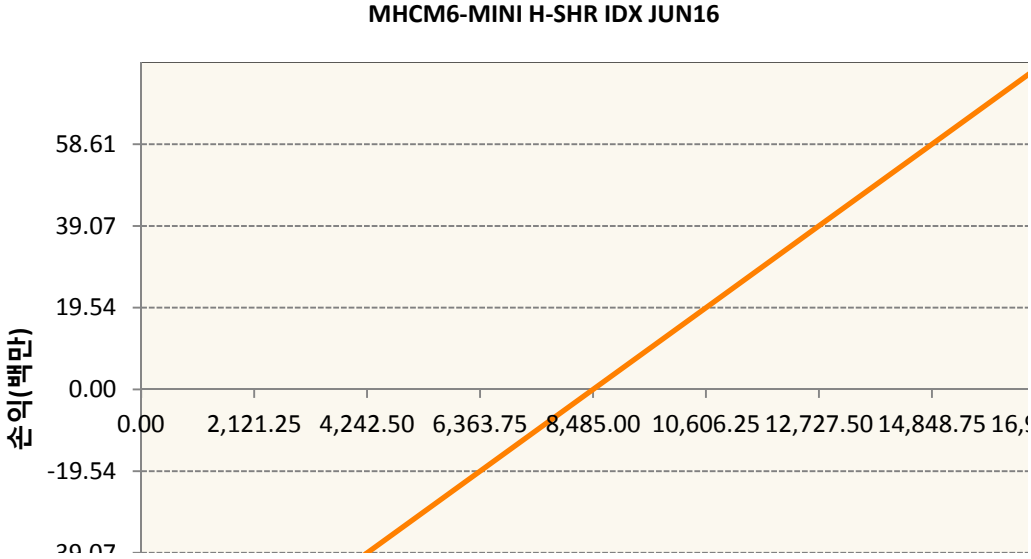
## 1. 계약금액

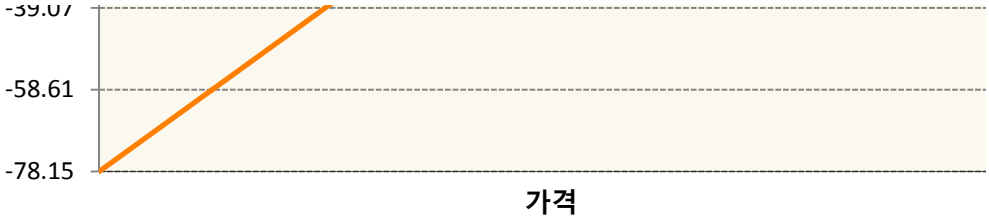
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,066 | 0 | 3,066 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조






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

| | | |
|---|---|---|
| HCM6 | H-SHARES IDX FUT JUN16 | 239 |
| MHCM6 | MINI H-SHR IDX JUN16 | 6 |

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

| |
|---|
| **348** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-06-02 |
| 기준일 | 2016-06-01 |

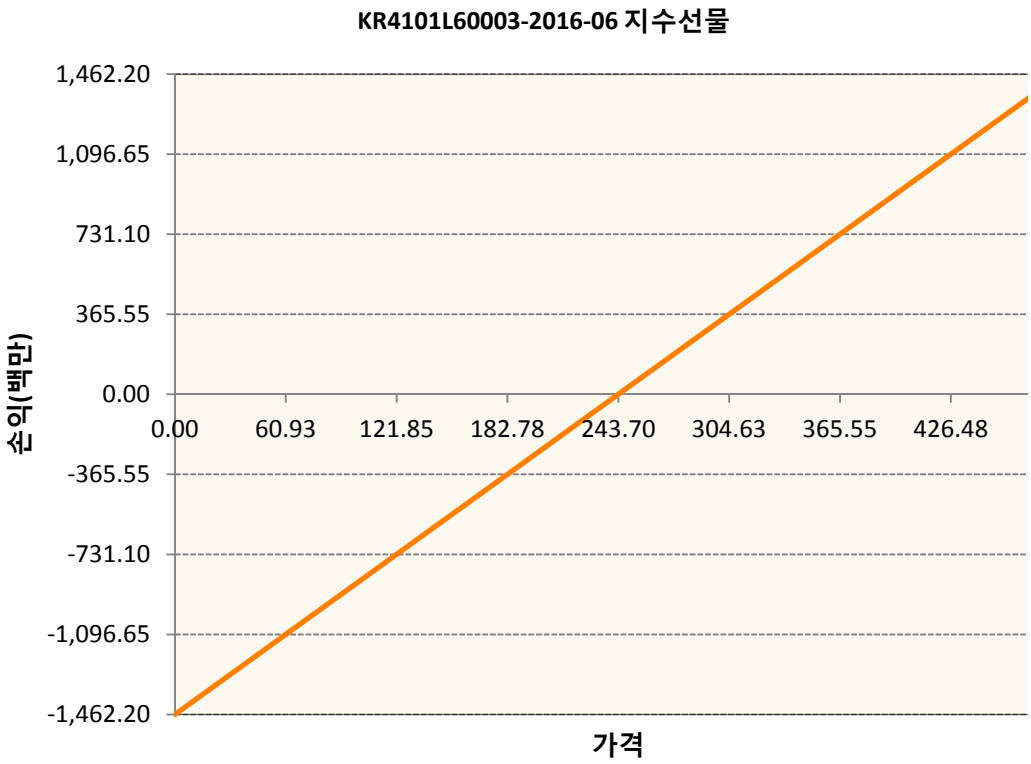
# 커버드콜(주식혼합-파생형)

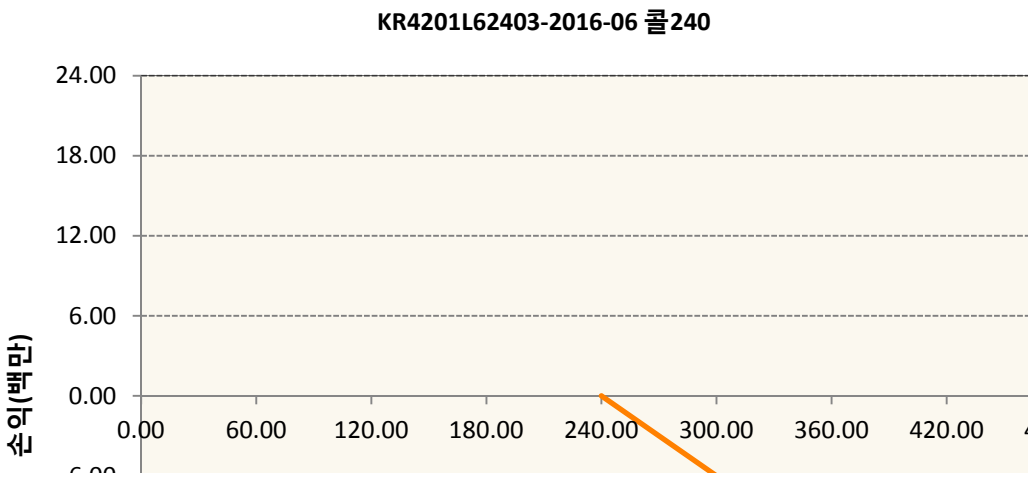
## 1. 계약금액

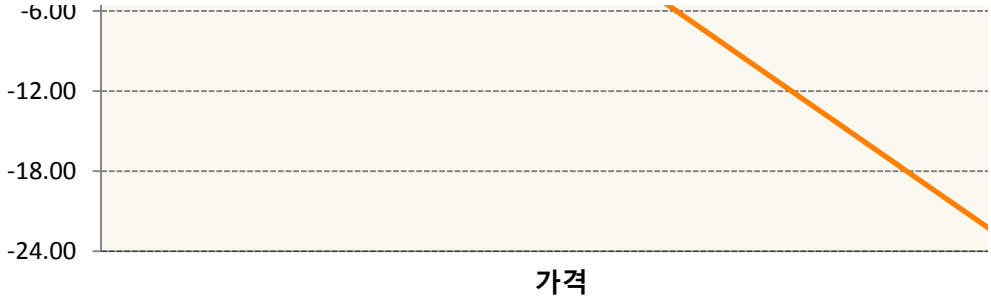
(단위:백만원)

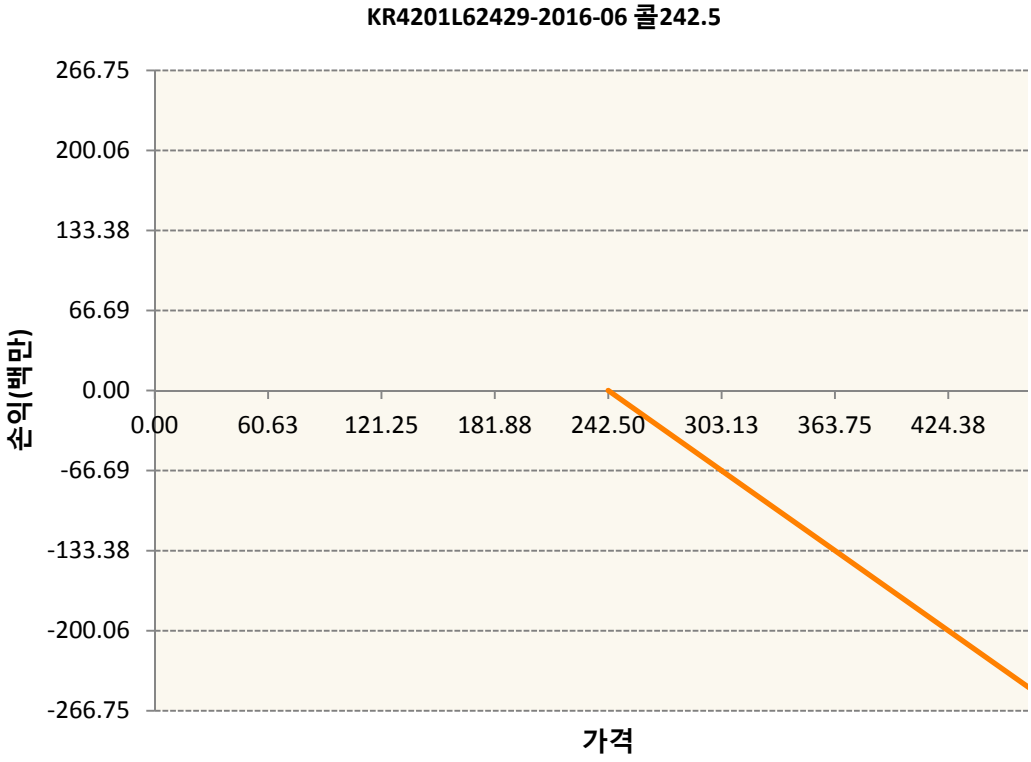
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,462 | 0 | 1,462 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 291 | -291 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조






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

| KR4101L600 | 2016-06 지수선물 | | | | | | 117 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -117 | -117 | -117 | -117 | -117 | -117 | -117 |
| -5.33% | -78 | -78 | -78 | -78 | -78 | -78 | -78 |
| -2.67% | -39 | -39 | -39 | -39 | -39 | -39 | -39 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 39 | 39 | 39 | 39 | 39 | 39 | 39 |
| 5.33% | 78 | 78 | 78 | 78 | 78 | 78 | 78 |
| 8.00% | 117 | 117 | 117 | 117 | 117 | 117 | 117 |
| KR4201L624 | 2016-06 콜240 | | | | | | 10 |
| | 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 | 2 |
| -2.67% | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 |
| 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 |
| KR4201L624 2016-06 콜242.5 | | | | | | | 101 |

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 12 | 12 | 12 | 12 | 12 | 12 | 12 |
| -5.33% | 12 | 12 | 12 | 12 | 12 | 12 | 12 |
| -2.67% | 12 | 12 | 12 | 11 | 11 | 11 | 10 |
| 0% | 2 | 1 | 1 | 0 | -1 | -1 | -2 |
| 2.67% | -29 | -29 | -29 | -30 | -30 | -30 | -30 |
| 5.33% | -65 | -65 | -65 | -65 | -65 | -65 | -65 |
| 8.00% | -101 | -101 | -101 | -101 | -101 | -101 | -101 |

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

| |
|---|
| **246** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-06-02 |
| 기준일 | 2016-06-01 |

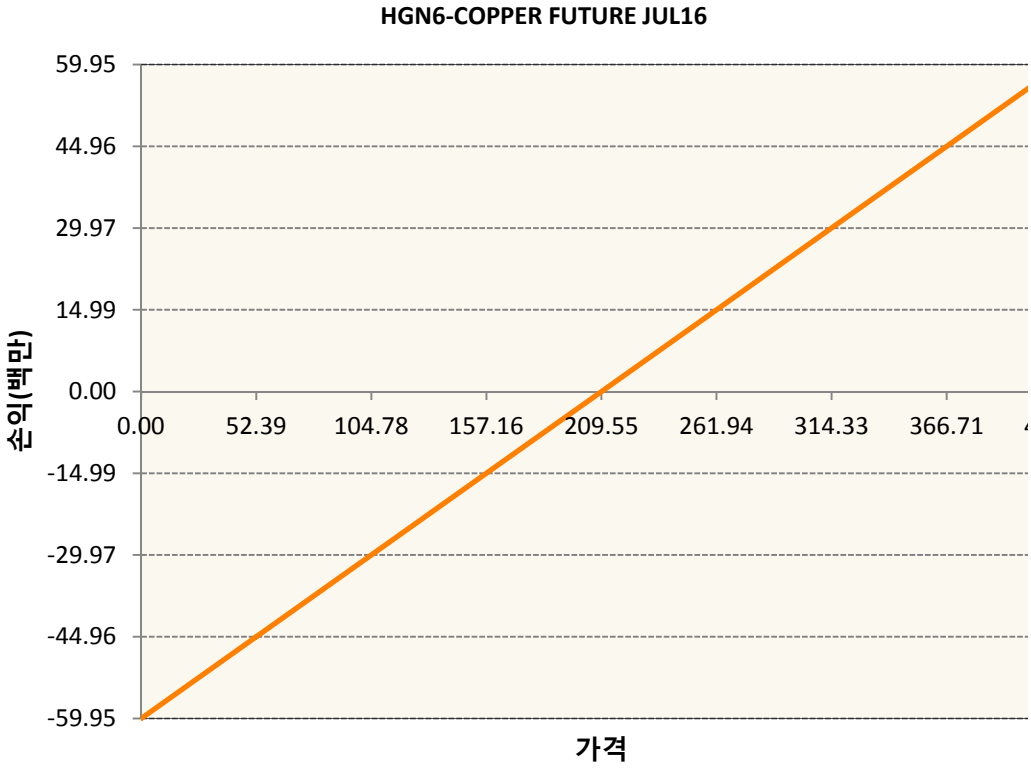
# 메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

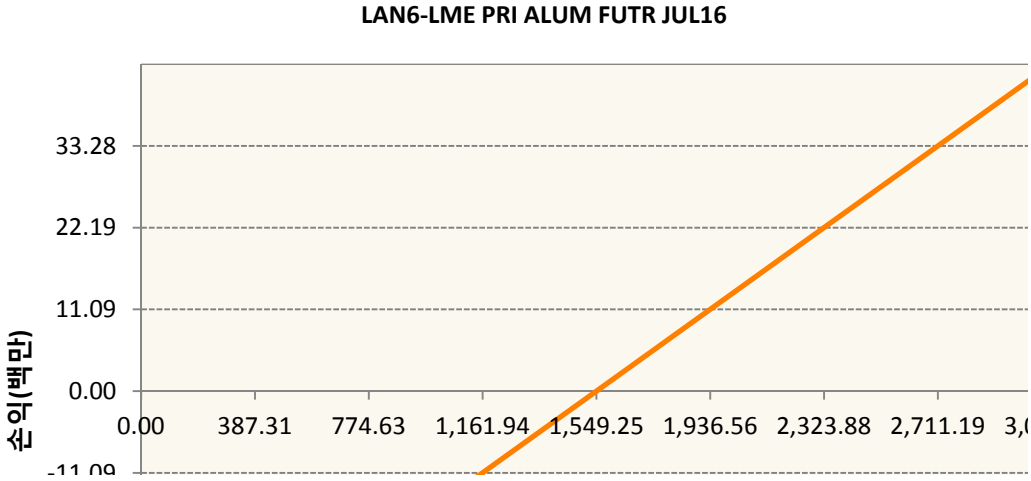
## 1. 계약금액

(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 | 55 | 0 | 55 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 297 | 0 | 297 | |

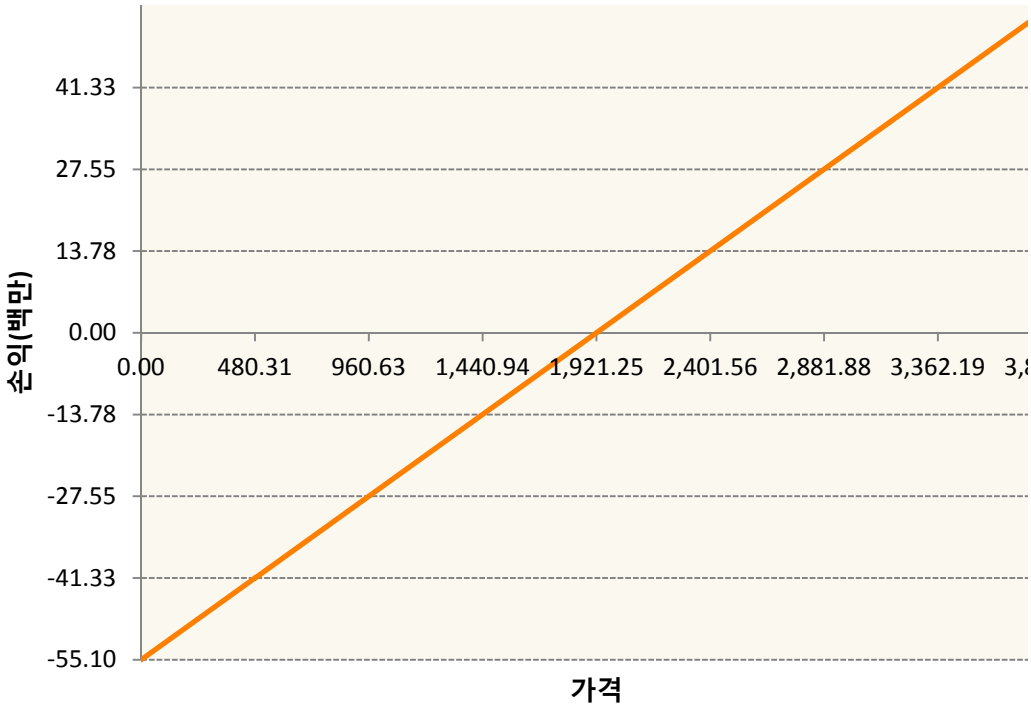
## 2. 만기시점의 손익구조



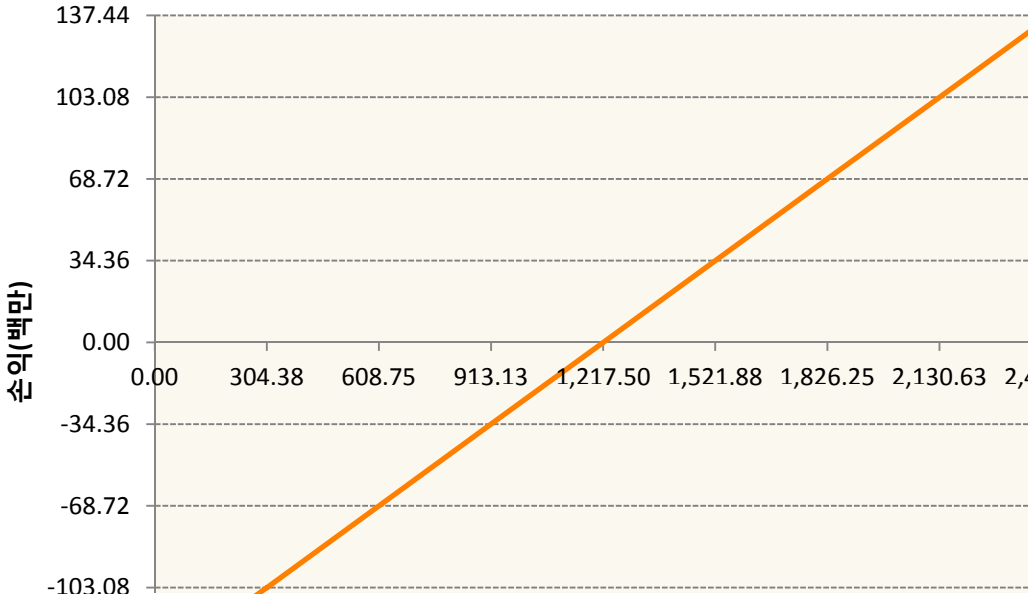



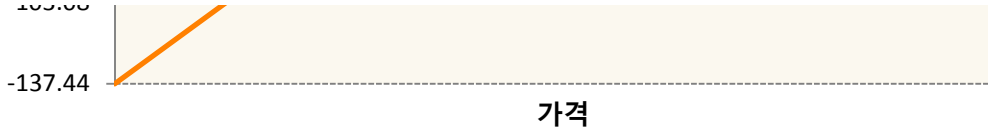


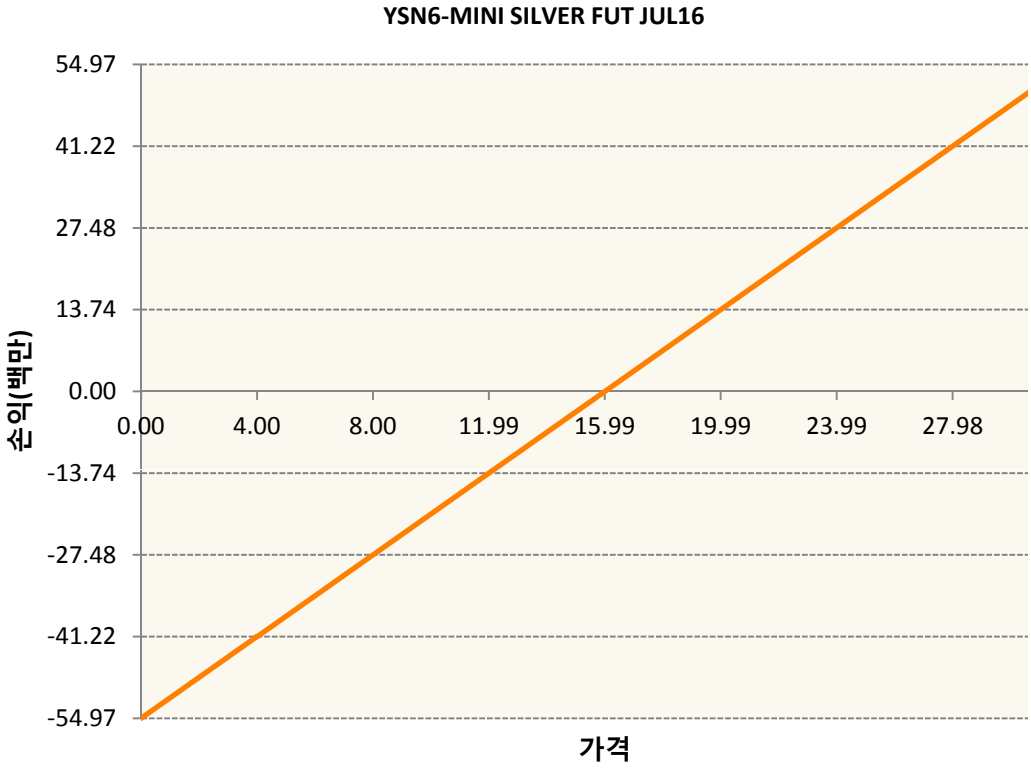

LXN6-LME ZINC FUTURE JUL16




XGQ6-MINI GOLD FUTURE AUG16






| 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 | 2016-06-02 |
| 기준일 | 2016-06-01 |

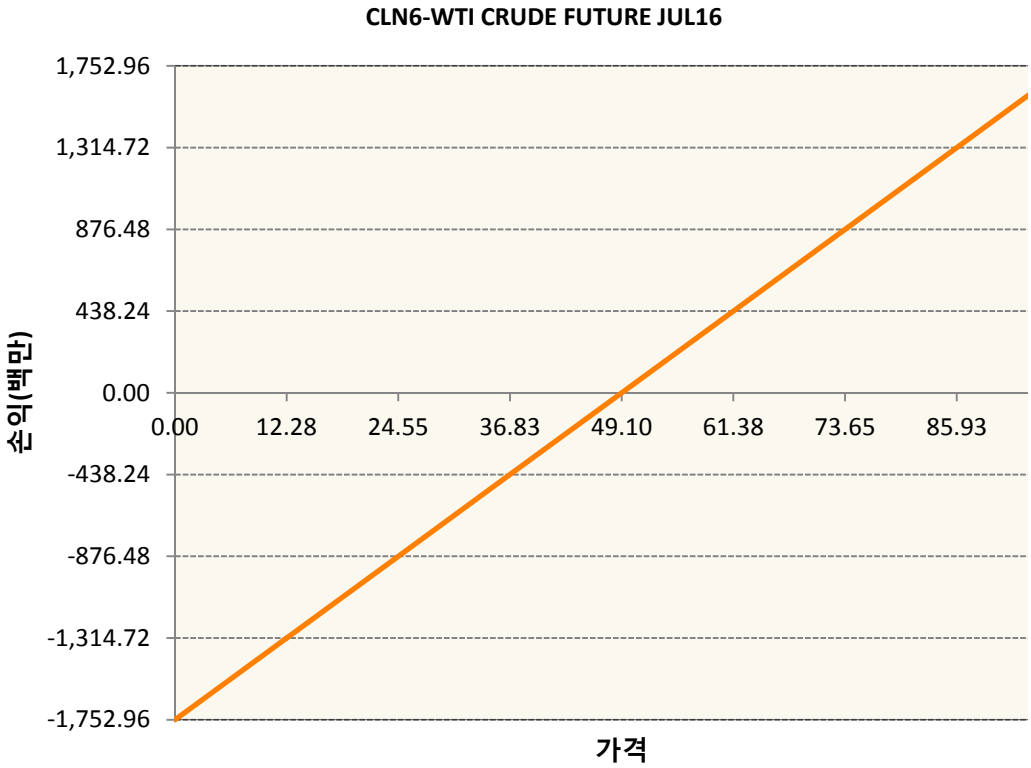
# 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

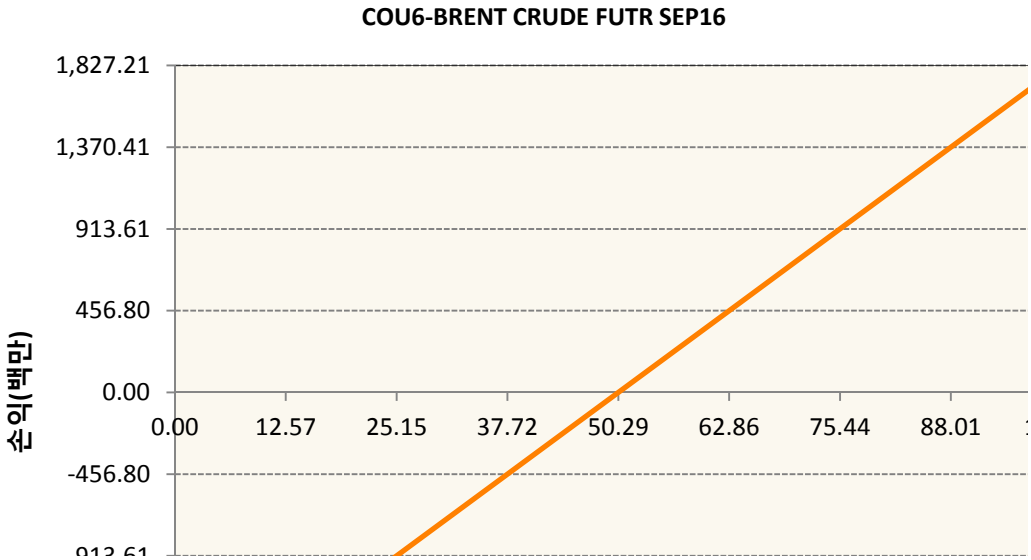
## 1. 계약금액

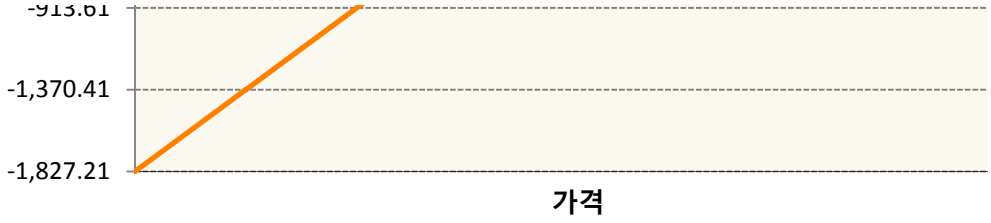
(단위:백만원)

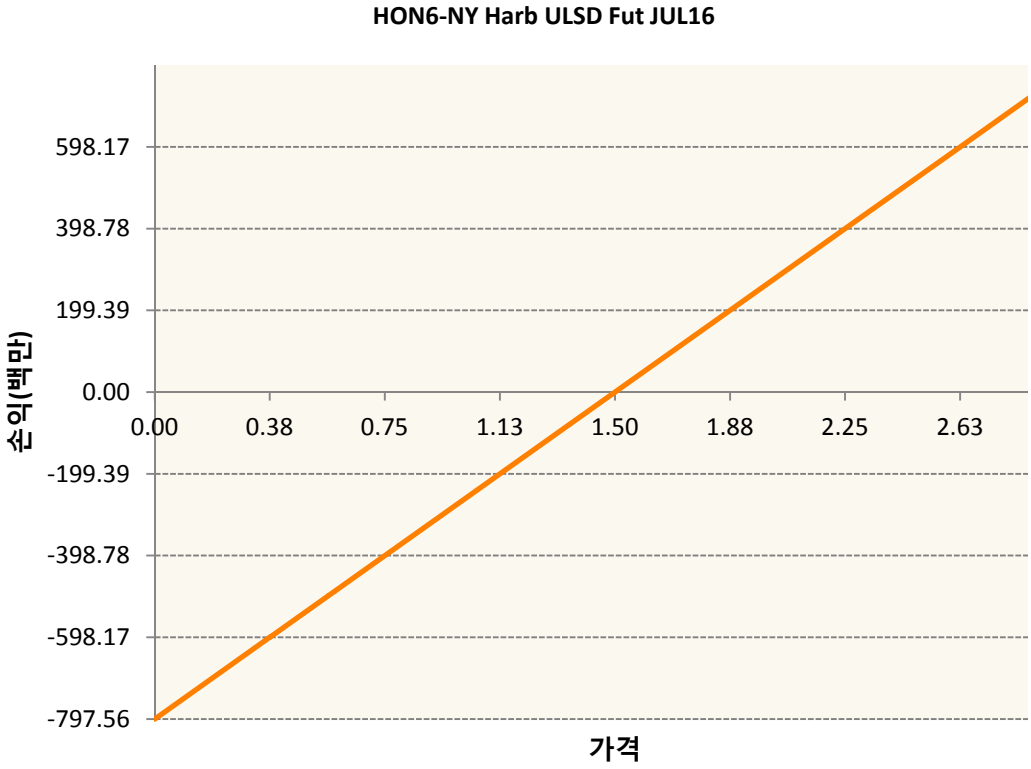
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 6,420 | 0 | 6,420 | |

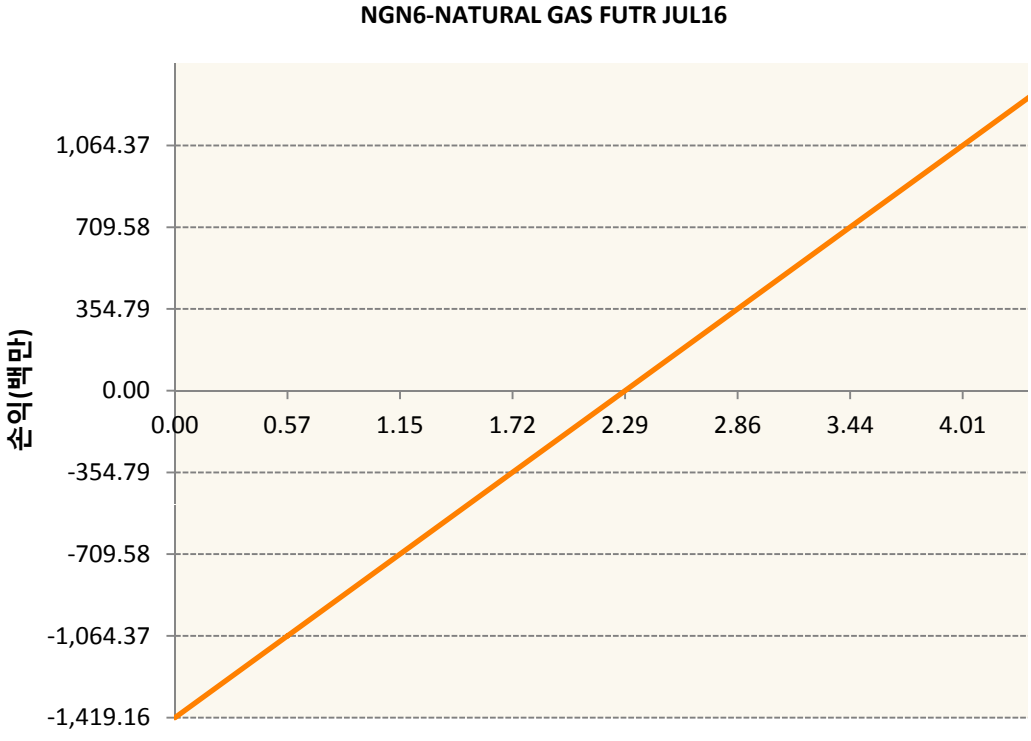
## 2. 만기시점의 손익구조



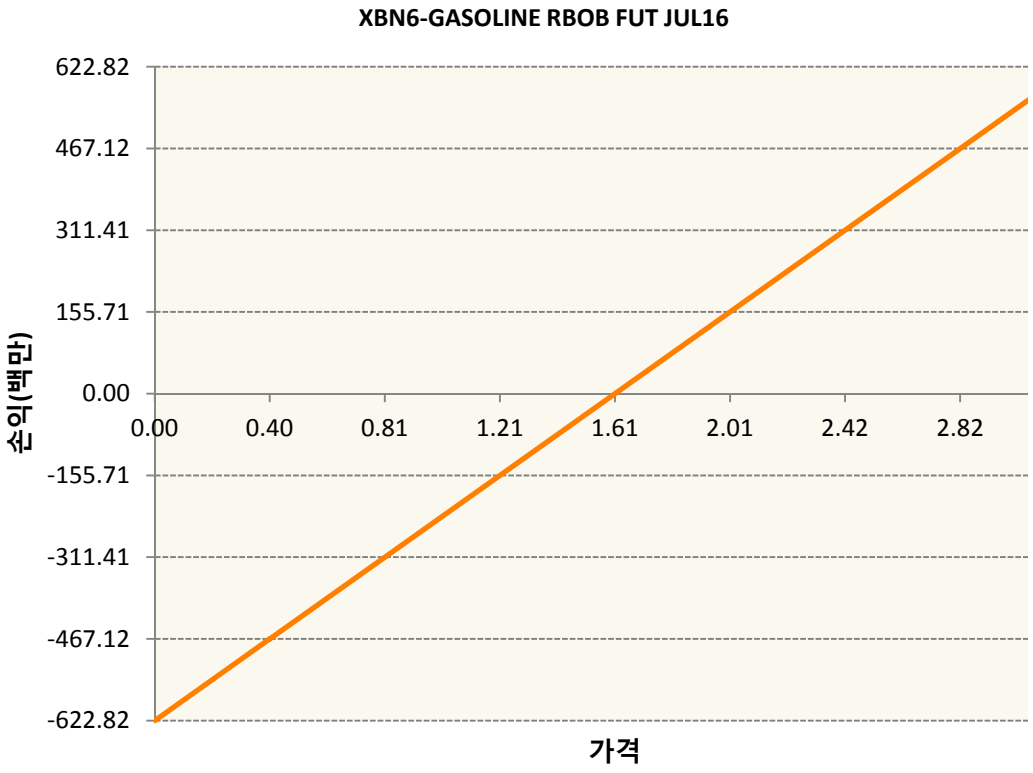




-913.61
-1,370.41
-1,827.21
가격


HON6-NY Harb ULSD Fut JUL16
598.17
398.78
199.39
0.00
-199.39
-398.78
-598.17
-797.56
0.00
0.38
0.75
1.13
1.50
1.88
2.25
2.63
순익(백만)
가격


NGN6-NATURAL GAS FUTR JUL16
1,064.37
709.58
354.79
0.00
-354.79
-709.58
-1,064.37
-1,419.16
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 | 140 |
| COU6 | BRENT CRUDE FUTR SEP16 | 146 |
| HON6 | NY Harb ULSD Fut JUL16 | 64 |
| NGN6 | NATURAL GAS FUTR JUL16 | 114 |
| XBN6 | GASOLINE RBOB FUT JUL16 | 50 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|---|---|
| | **1,418** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-06-02 |
| 기준일 | 2016-06-01 |

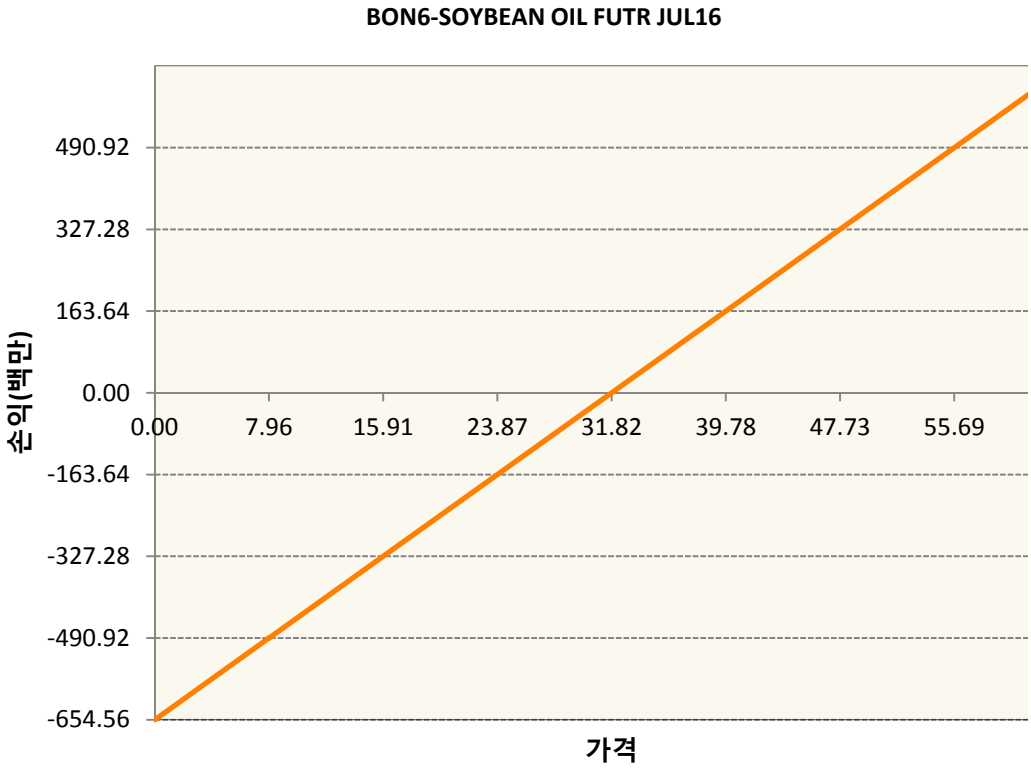
# 애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

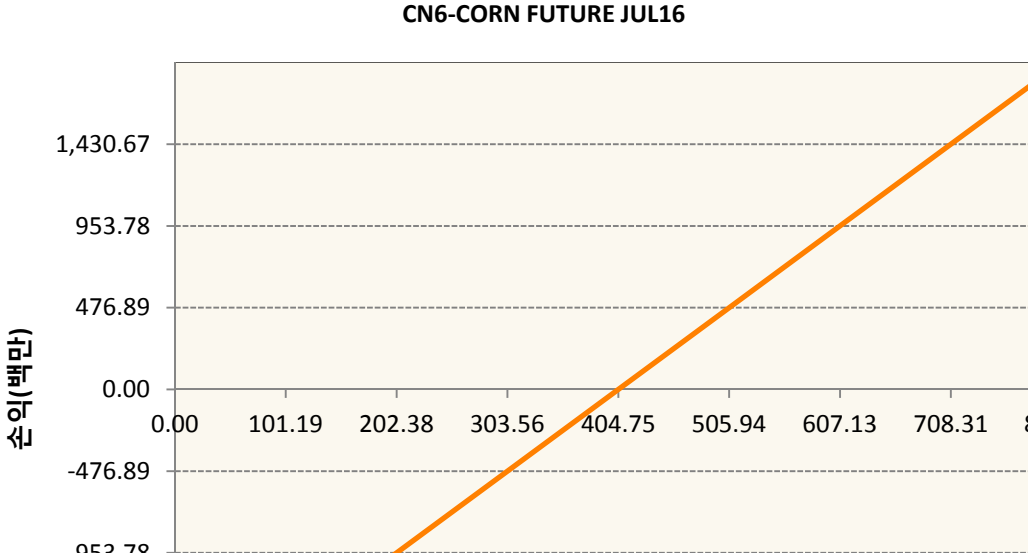
## 1. 계약금액

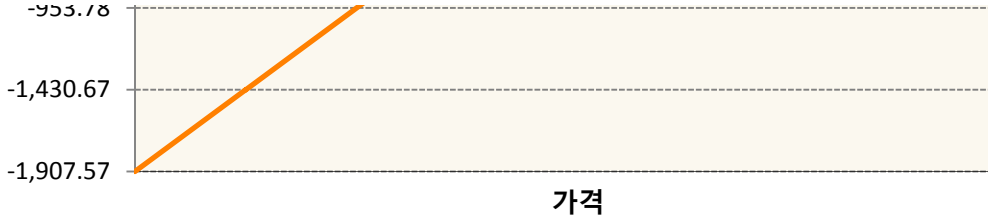
(단위:백만원)

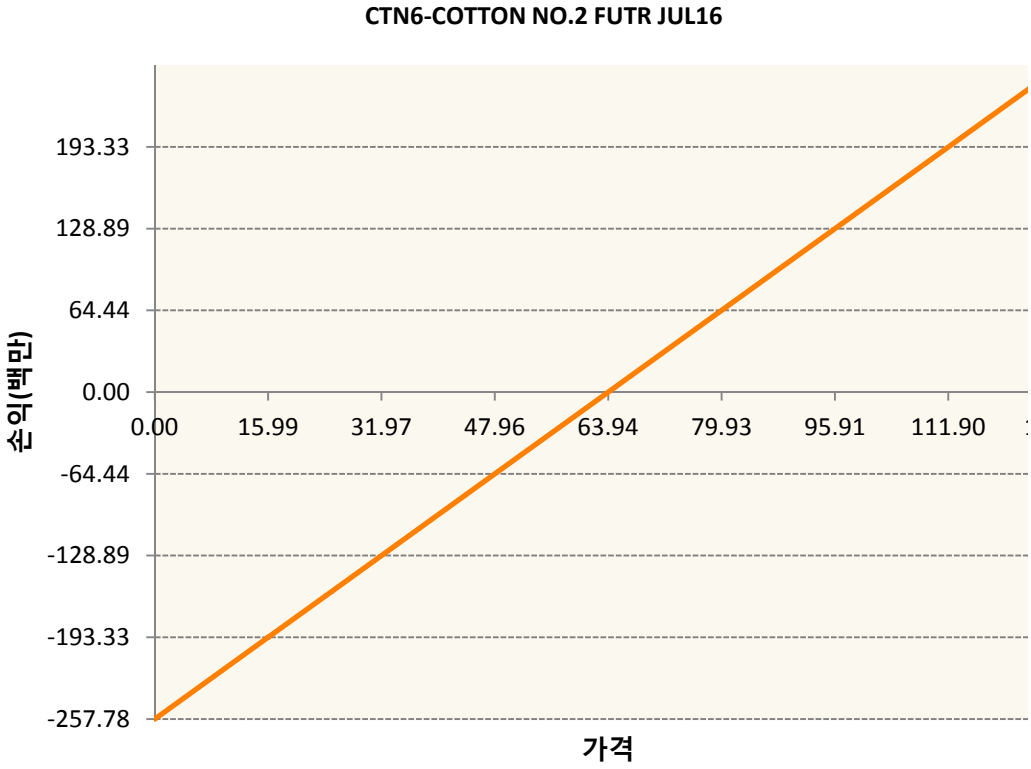
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 7,680 | 0 | 7,680 | |

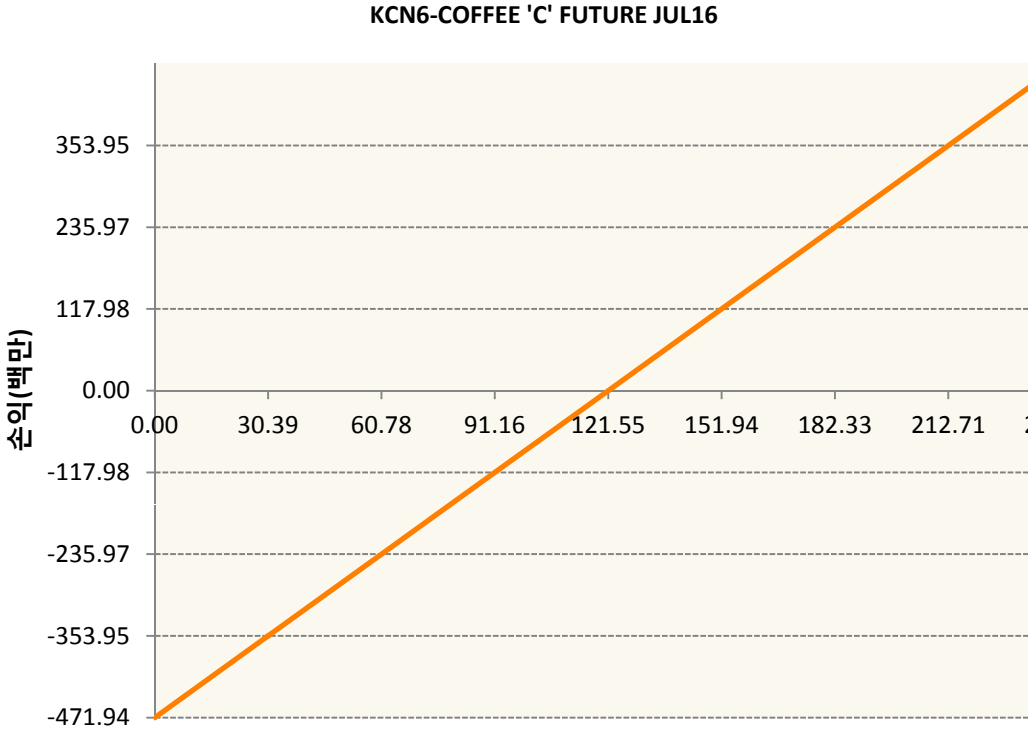
## 2. 만기시점의 손익구조



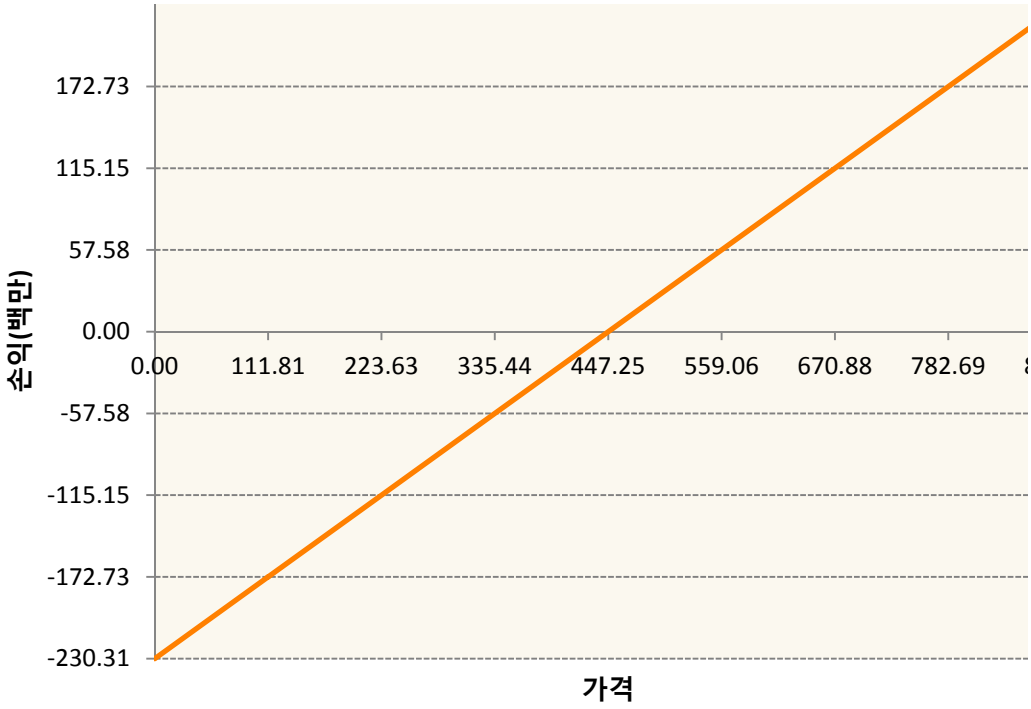

-1,430.67
-1,907.57
가격


CTN6-COTTON NO.2 FUTR JUL16
193.33
128.89
64.44
0.00
-64.44
-128.89
-193.33
-257.78
0.00
15.99
31.97
47.96
63.94
79.93
95.91
111.90
순익(백만)
가격

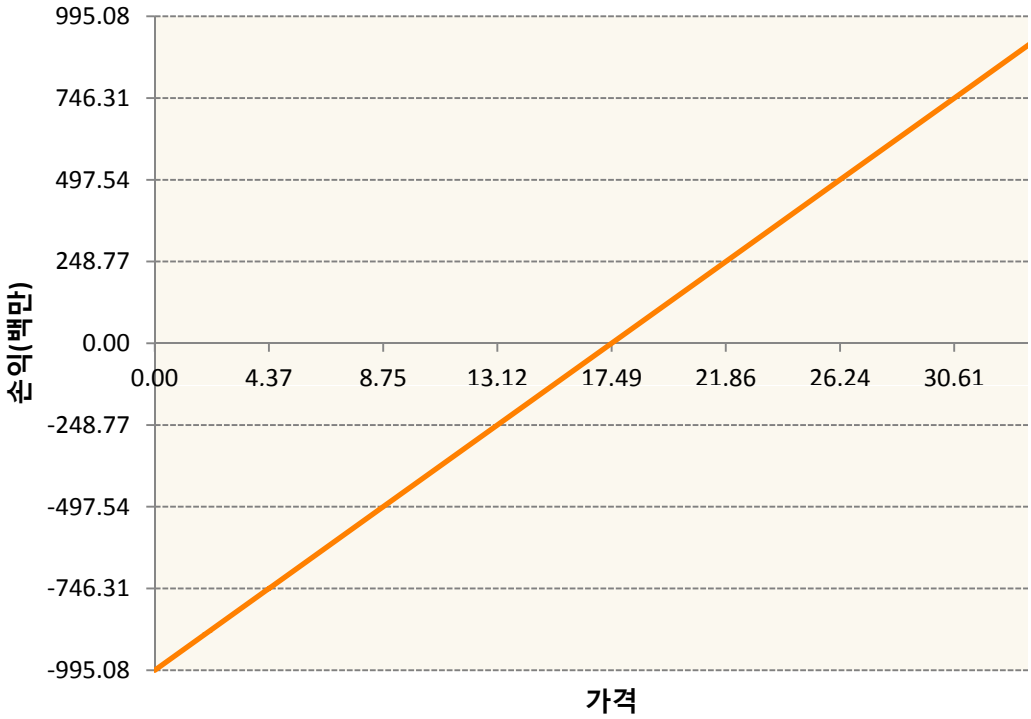

KCN6-COFFEE 'C' FUTURE JUL16
353.95
235.97
117.98
0.00
-117.98
-235.97
-353.95
-471.94
0.00
30.39
60.78
91.16
121.55
151.94
182.33
212.71
순익(백만)

가격

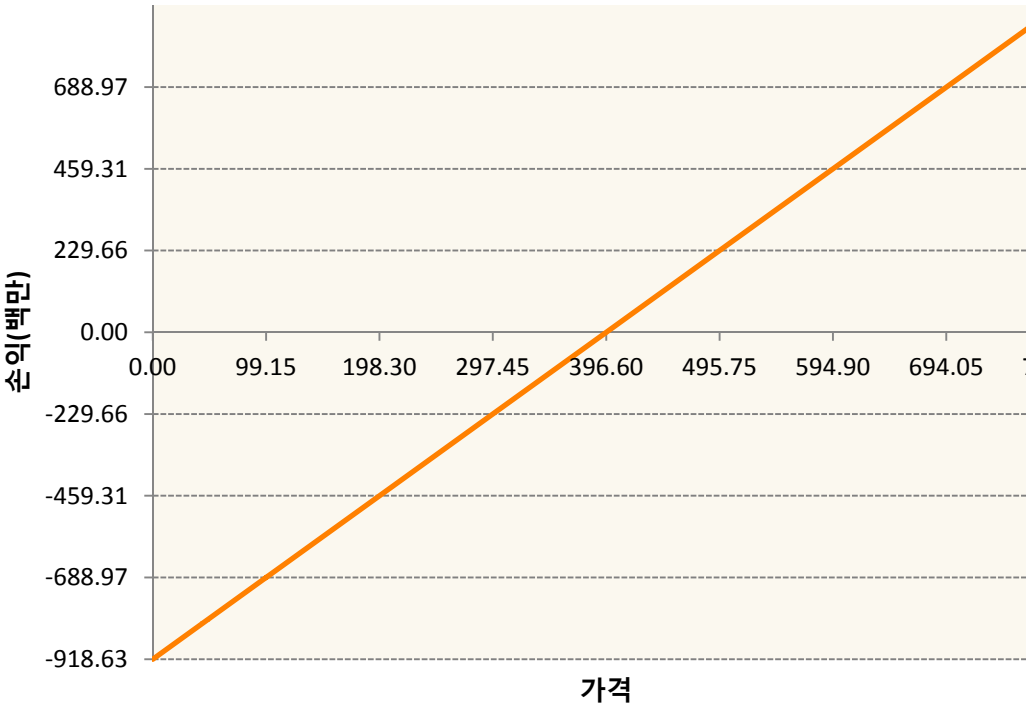
KWN6-KC HRW WHEAT FUT JUL16



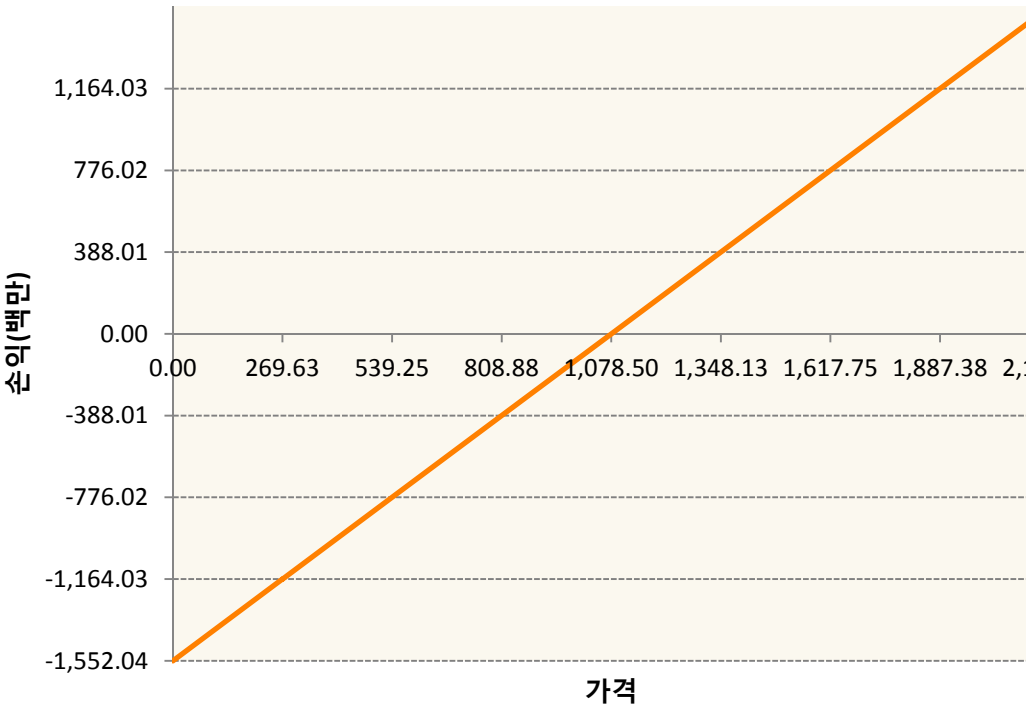

SBN6-SUGAR #11 (WORLD) JUL16



SMN6-SOYBEAN MEAL FUTR JUL16

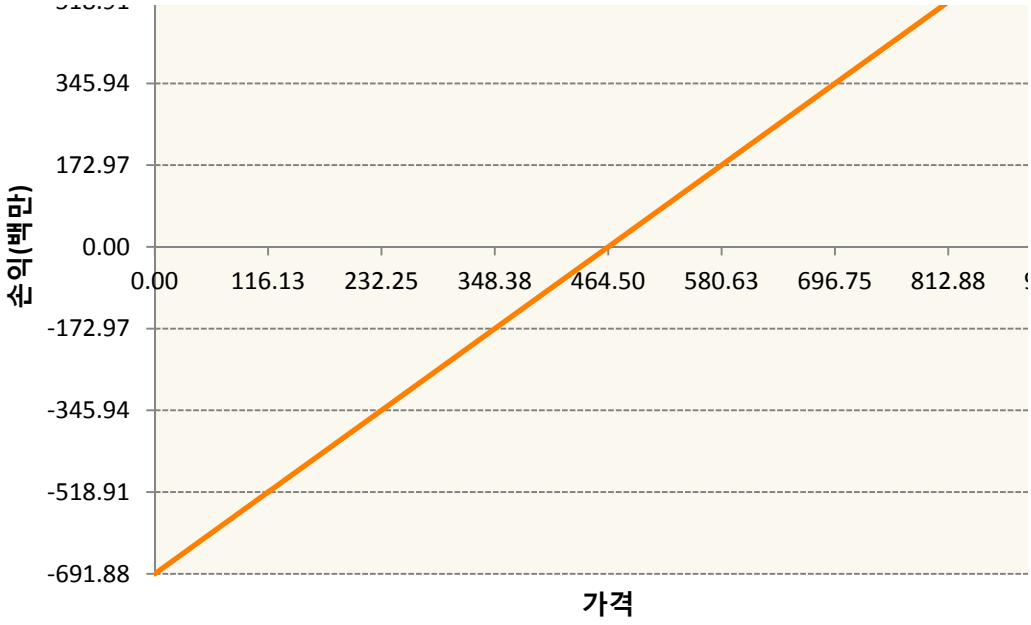



SN6-SOYBEAN FUTURE JUL16




WN6-WHEAT FUTURE(CBT) JUL16






| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---|---|
| BON6 | SOYBEAN OIL FUTR JUL16 | 52 |
| CN6 | CORN FUTURE JUL16 | 153 |
| CTN6 | COTTON NO.2 FUTR JUL16 | 21 |
| KCN6 | COFFEE 'C' FUTURE JUL16 | 38 |
| KWN6 | KC HRW WHEAT FUT JUL16 | 18 |
| SBN6 | SUGAR #11 (WORLD) JUL16 | 80 |
| SMN6 | SOYBEAN MEAL FUTR JUL16 | 73 |
| SN6 | SOYBEAN FUTURE JUL16 | 124 |
| WN6 | WHEAT FUTURE(CBT) JUL16 | 55 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|---|---|
| | **850** |