공시일	2016-06-10
기준일	2016-06-09

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	2016-06-10
기준일	2016-06-09

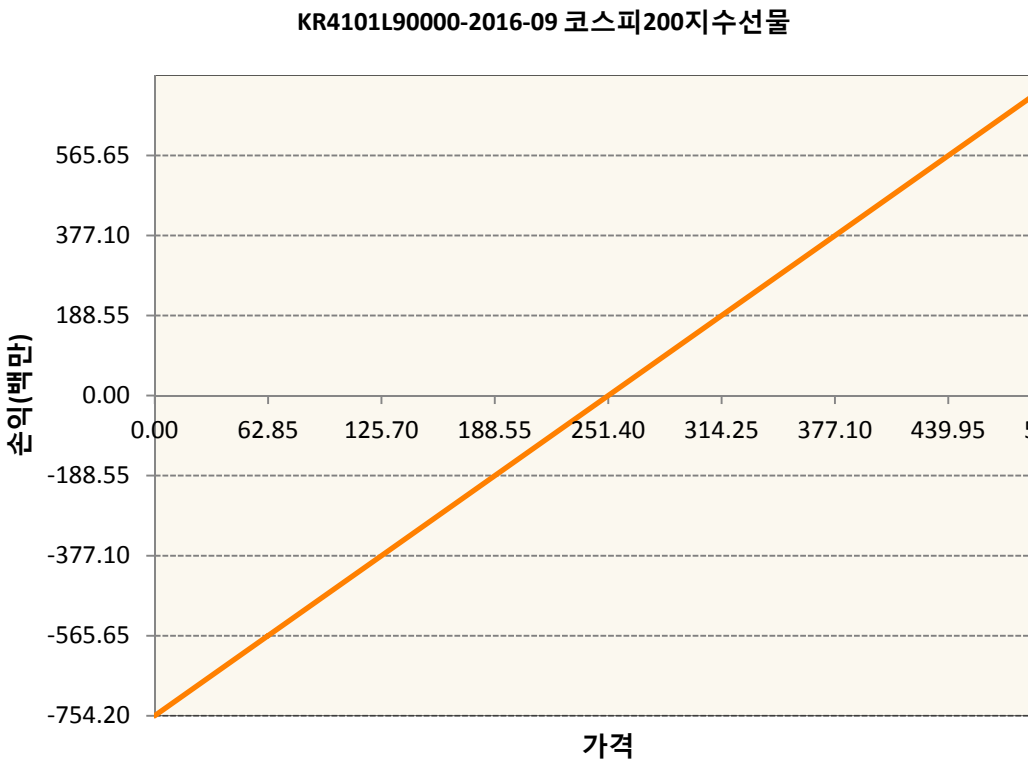
스마트인덱스모

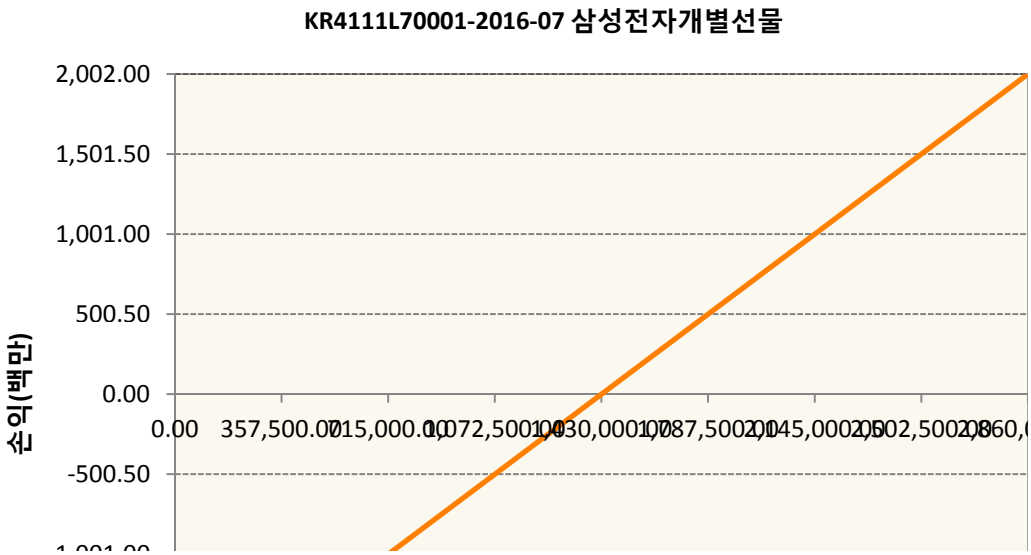
1. 계약금액

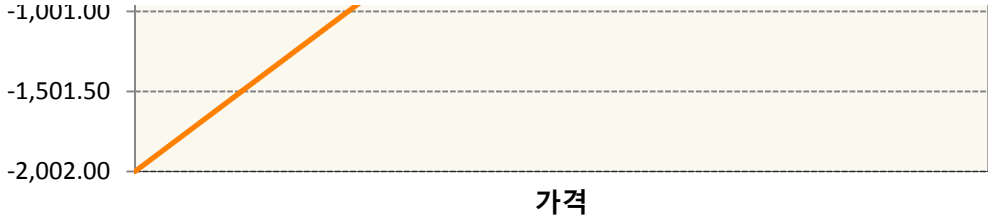
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,514	0	1,514	장내
누계	유가증권	선물	2,756	0	2,756	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						60
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
-5.33%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
-2.67%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	20	20	20	20	20	20	20
5.33%	40	40	40	40	40	40	40
8.00%	60	60	60	60	60	60	60

KR4111L700	2016-07 삼성전자개별선물						160
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-160	-160	-160	-160	-160	-160	-160
-5.33%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107
-2.67%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	53	53	53	53	53	53	53
5.33%	107	107	107	107	107	107	107
8.00%	160	160	160	160	160	160	160

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

217

공시일	2016-06-10
기준일	2016-06-09

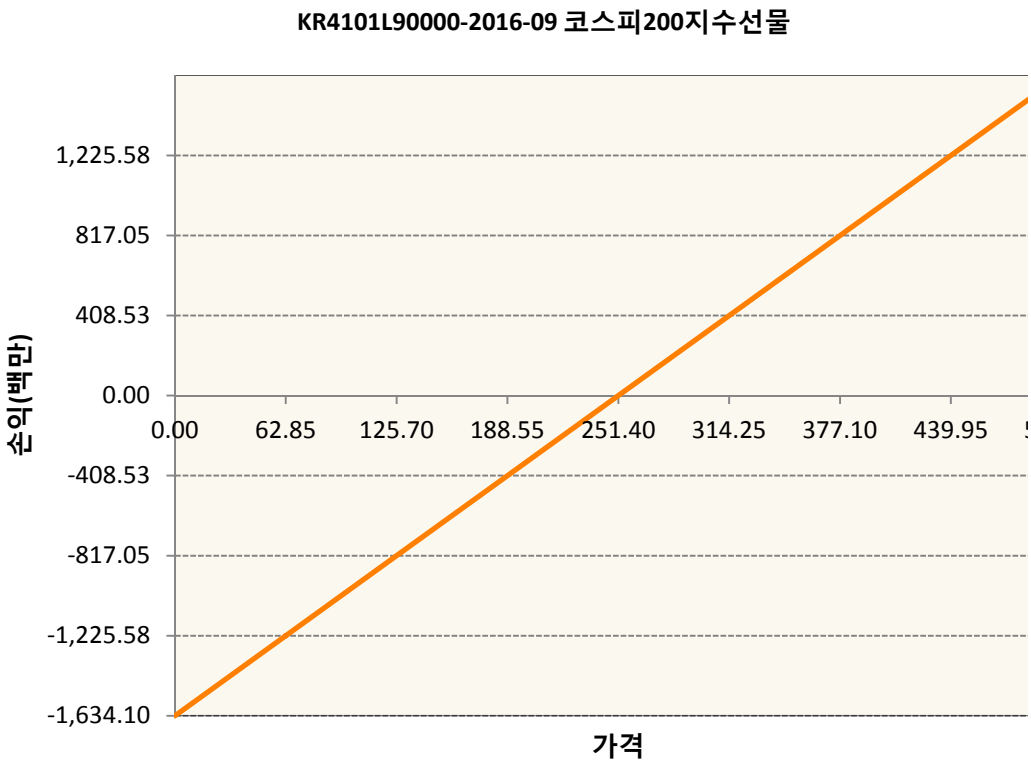
스마트레버리지목표전환형1호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	880	0	880	장내
누계	유가증권	선물	1,634	0	1,634	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900 2016-09 코스피200지수선물							130
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
-5.33%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	43	43	43	43	43	43	43
5.33%	87	87	87	87	87	87	87
8.00%	130	130	130	130	130	130	130

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

105

공시일	2016-06-10
기준일	2016-06-09

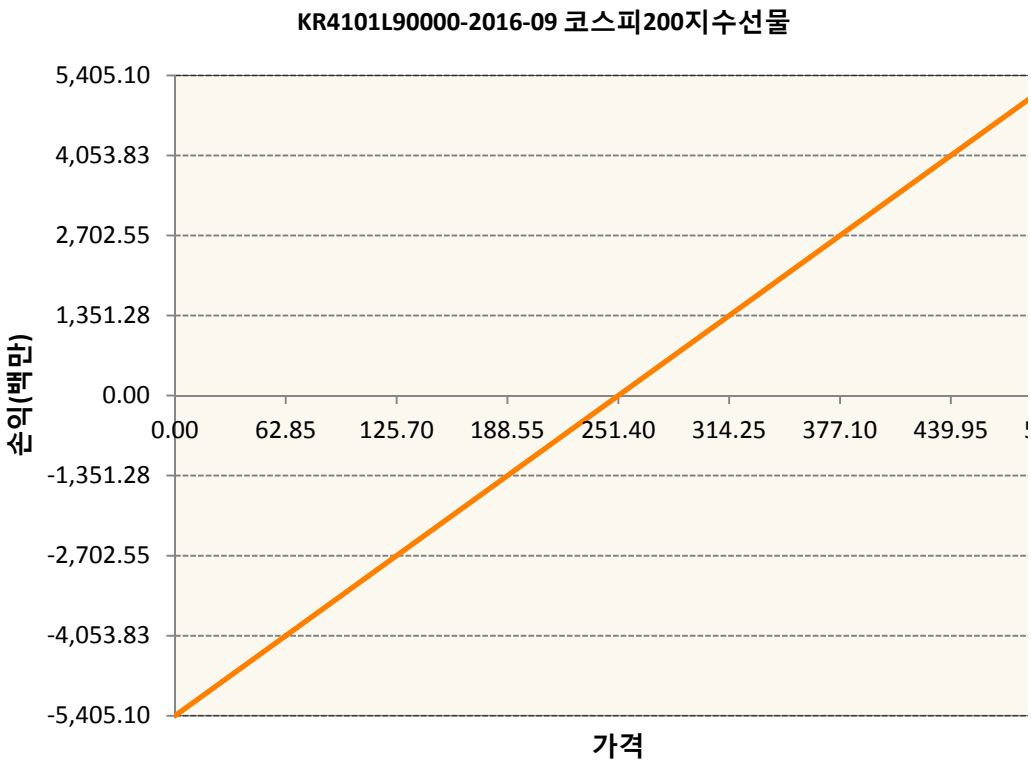
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,388	0	2,388	장내
누계	유가증권	선물	5,405	0	5,405	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						430
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-430	-430	-430	-430	-430	-430	-430
-5.33%	-287	-287	-287	-287	-287	-287	-287
-2.67%	-143	-143	-143	-143	-143	-143	-143
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	143	143	143	143	143	143	143
5.33%	287	287	287	287	287	287	287
8.00%	430	430	430	430	430	430	430

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

347

공시일	2016-06-10
기준일	2016-06-09

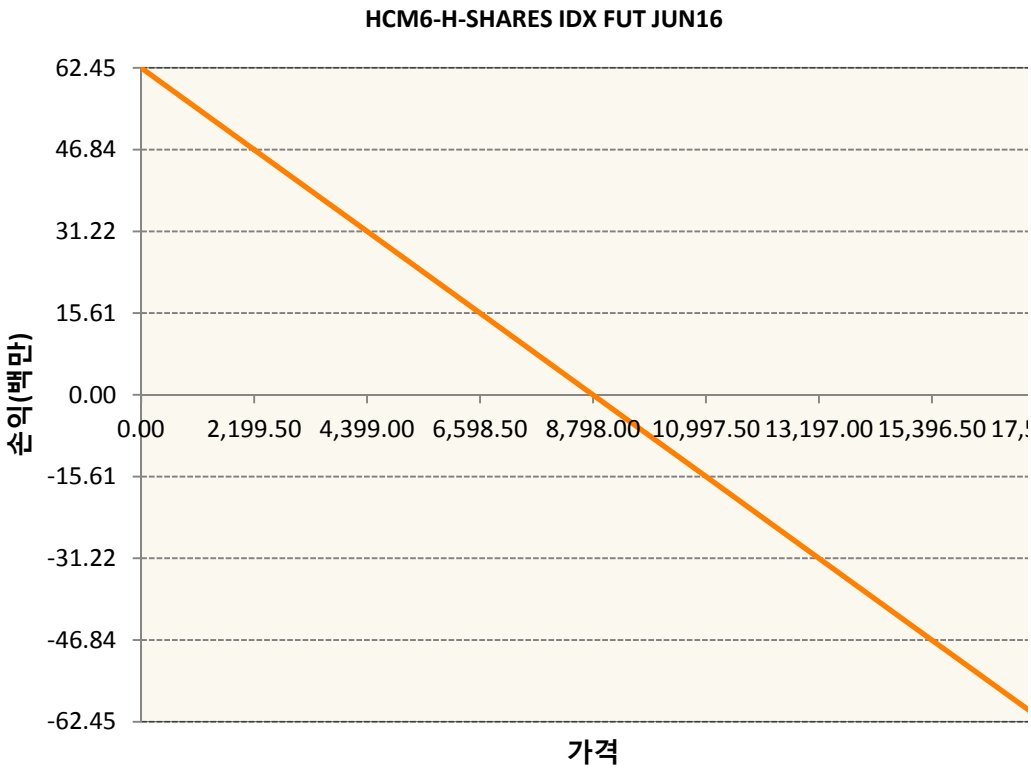
아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

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	0	62	-62	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM6	H-SHARES IDX FUT JUN16	5

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

(단위:백만원)

7

공시일	2016-06-10
기준일	2016-06-09

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	871

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

746

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-06-10
기준일	2016-06-09

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	4,811	0	4,811	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S160608	384

* 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	2016-06-10
기준일	2016-06-09

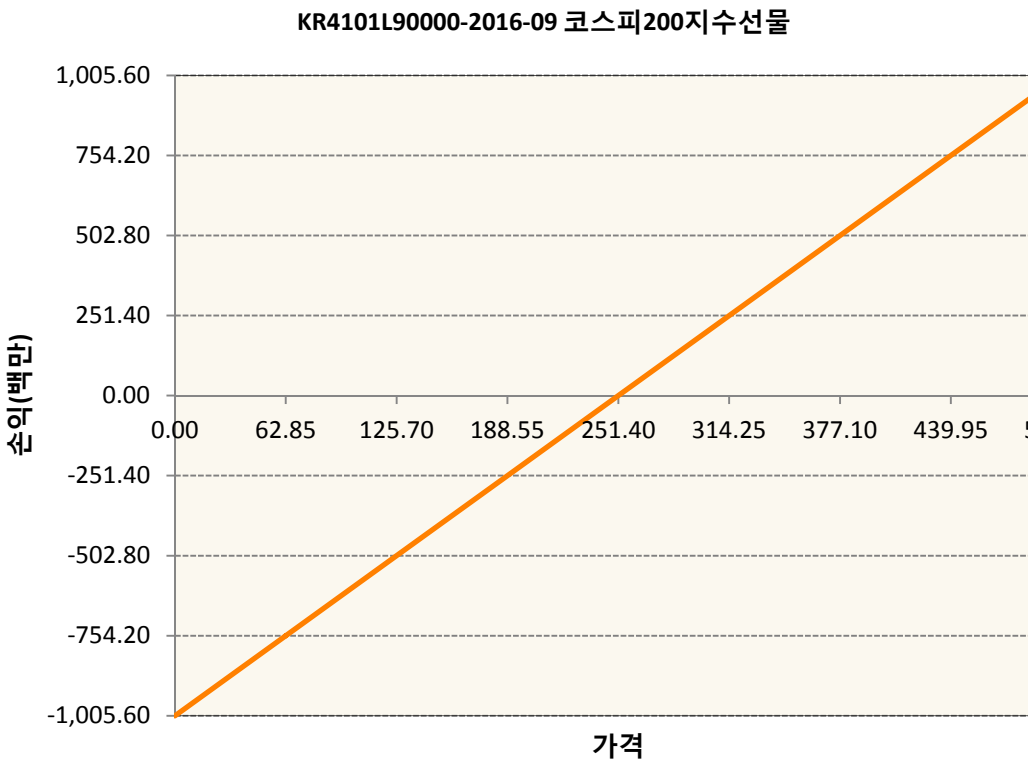
KOSPI200 레버리지 목표전환형 3

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	502	0	502	장내
누계	유가증권	선물	1,006	0	1,006	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						80
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
-5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	27	27	27	27	27	27	27
5.33%	53	53	53	53	53	53	53
8.00%	80	80	80	80	80	80	80

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

65

공시일	2016-06-10
기준일	2016-06-09

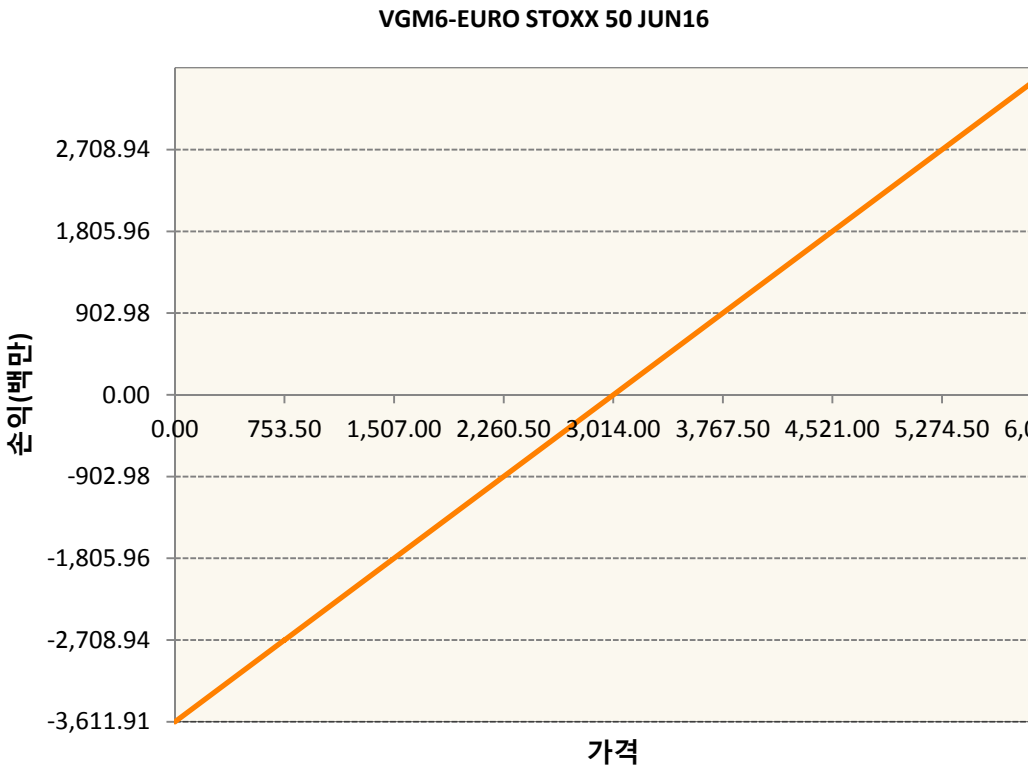
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,612	0	3,612	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM6	EURO STOXX 50 JUN16	289

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

(단위:백만원)

332

공시일	2016-06-10
기준일	2016-06-09

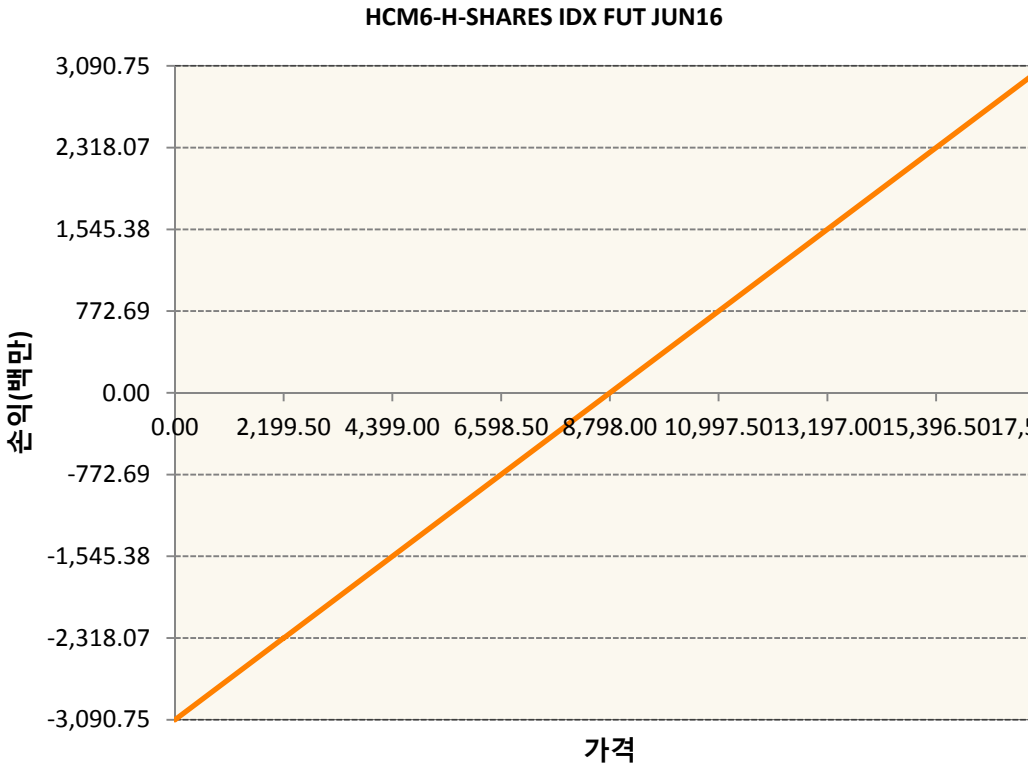
차이나인덱스모(주식-파생형)

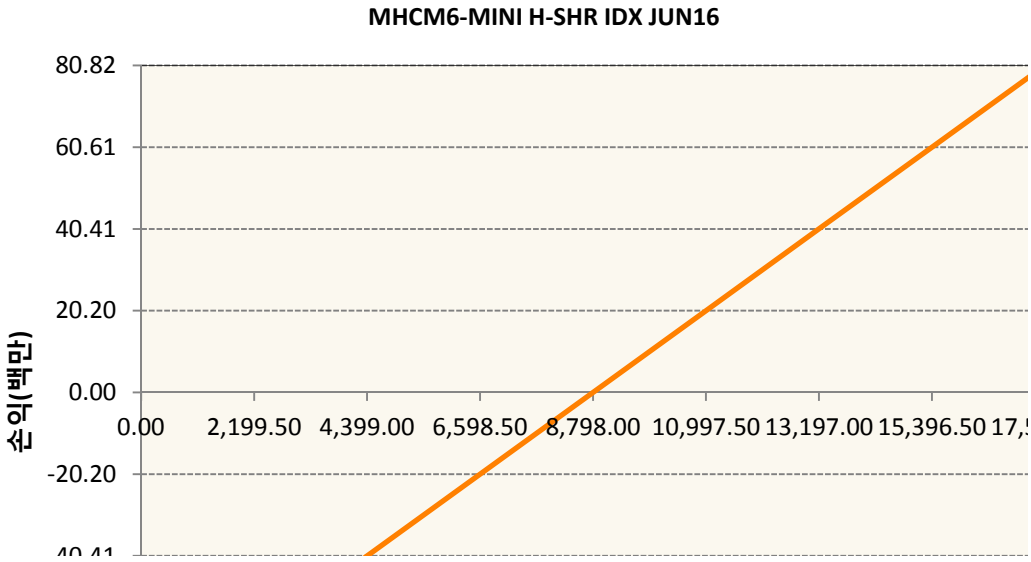
1. 계약금액

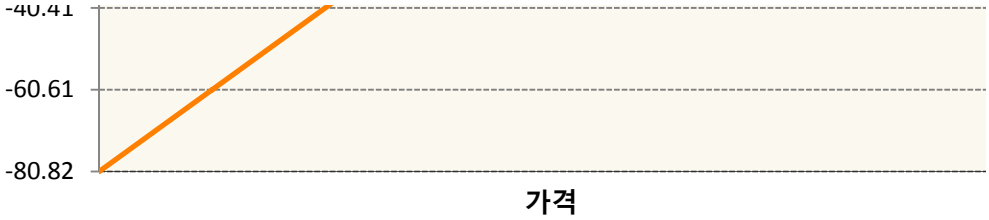
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,172	0	3,172	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCM6	H-SHARES IDX FUT JUN16	247
MHCM6	MINI H-SHR IDX JUN16	6

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	360

공시일	2016-06-10
기준일	2016-06-09

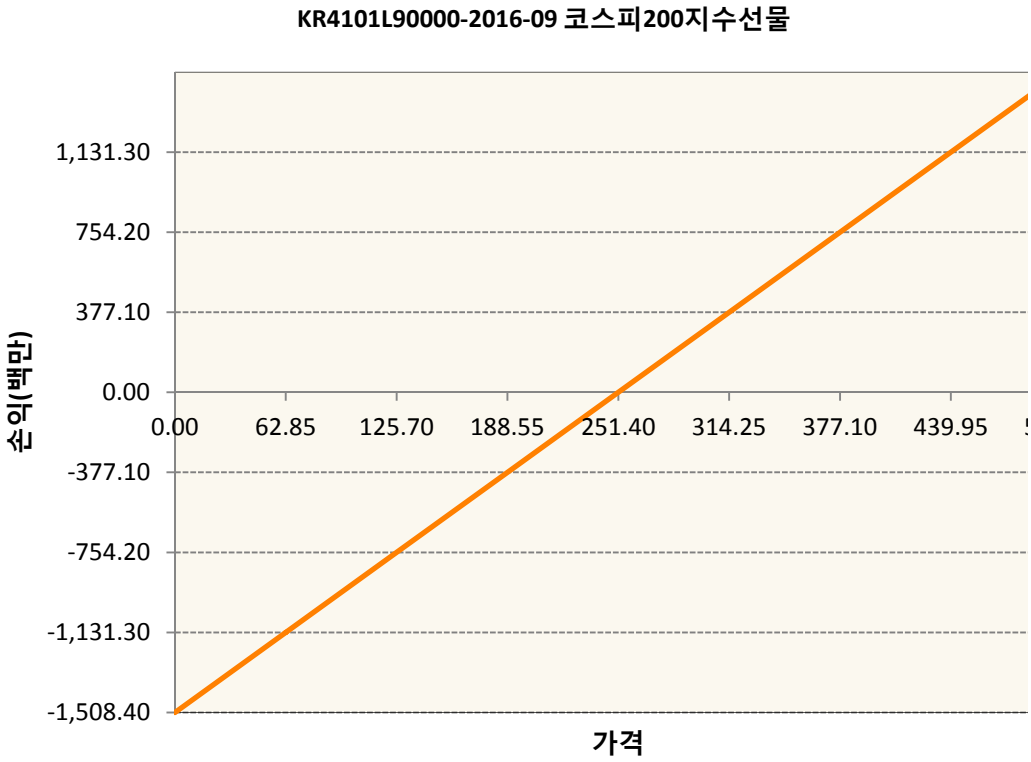
커버드콜(주식혼합-파생형)

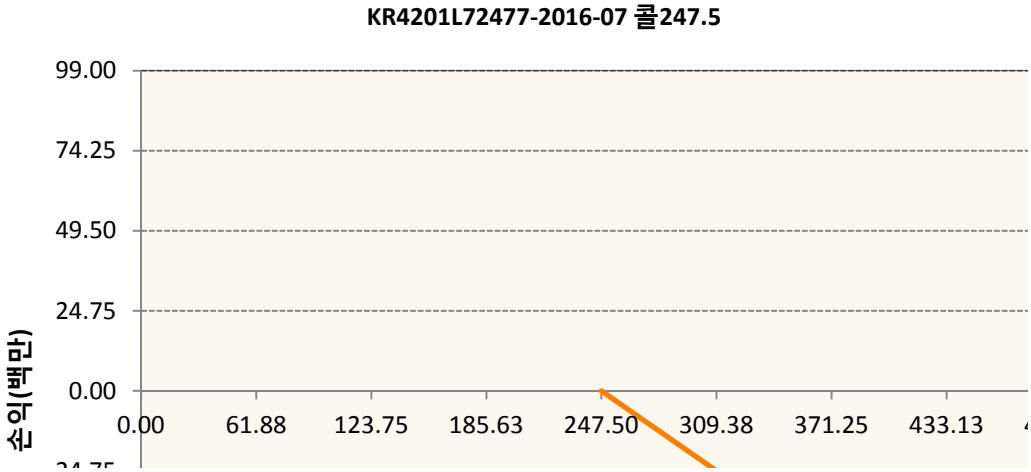
1. 계약금액

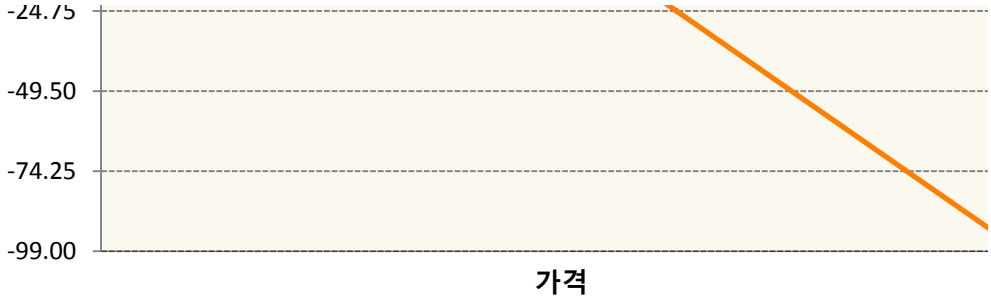
(단위:백만원)

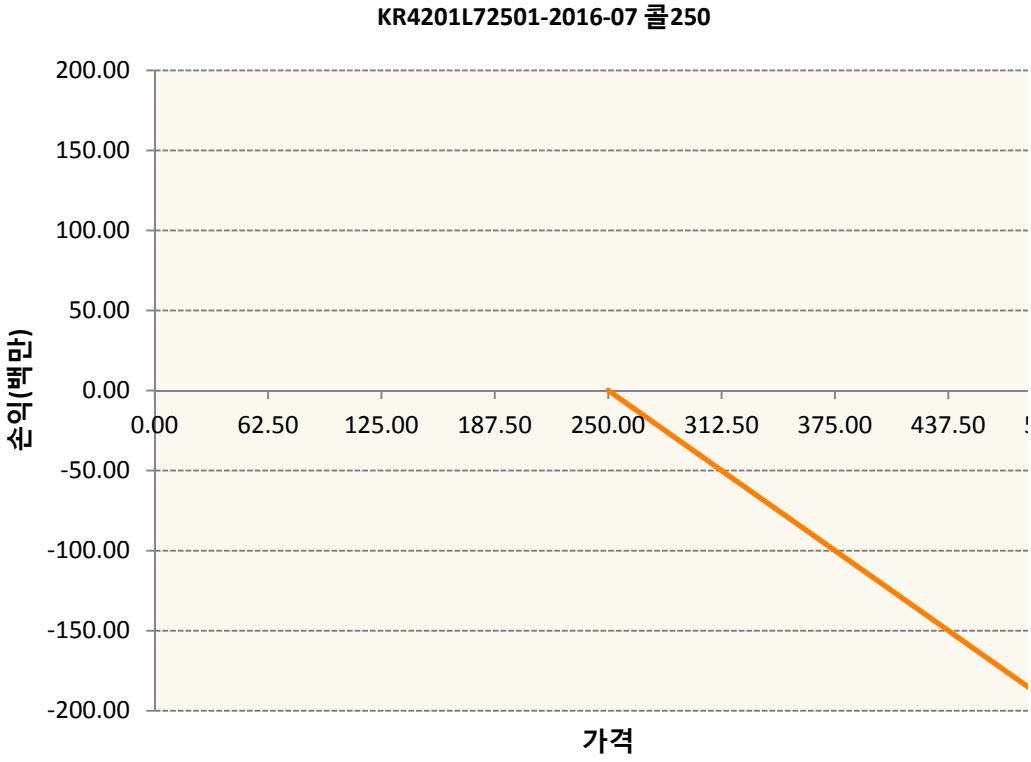
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	879	0	879	장내
신규	유가증권	옵션	0	304	-304	장내
누계	유가증권	선물	1,508	0	1,508	장내
누계	유가증권	옵션	0	299	-299	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101L900 2016-09 코스피200지수선물							120
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120
-5.33%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
-2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	40	40	40	40	40	40	40
5.33%	80	80	80	80	80	80	80
8.00%	120	120	120	120	120	120	120
KR4201L724 2016-07 콜247.5							35
	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%	10	10	9	9	9	9	8
-2.67%	8	7	7	6	6	5	5
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	-9	-9	-9	-10	-10	-11	-11
5.33%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-23
8.00%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
KR4201L725	2016-07 콜250						66
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15	15	15	15	15	15	14
-5.33%	15	14	14	14	13	13	12
-2.67%	12	12	11	10	9	8	7
0%	4	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	-15	-15	-16	-17	-18	-19	-20
5.33%	-39	-39	-40	-40	-41	-41	-42
8.00%	-65	-65	-65	-66	-66	-66	-66

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

210

공시일	2016-06-10
기준일	2016-06-09

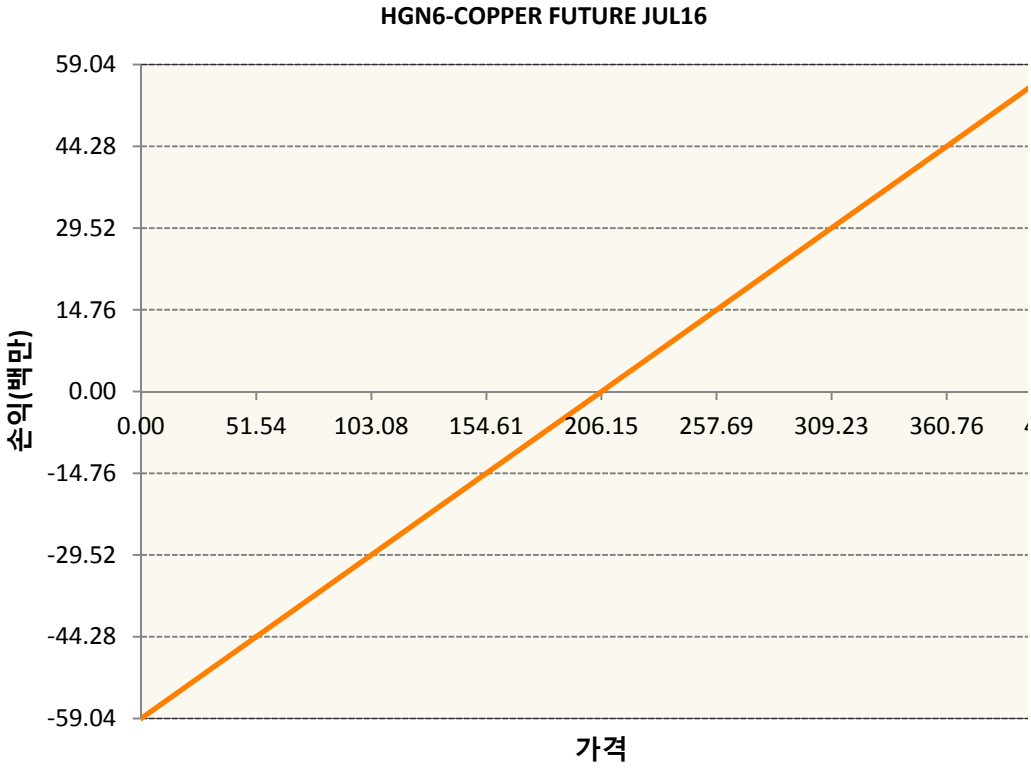
메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

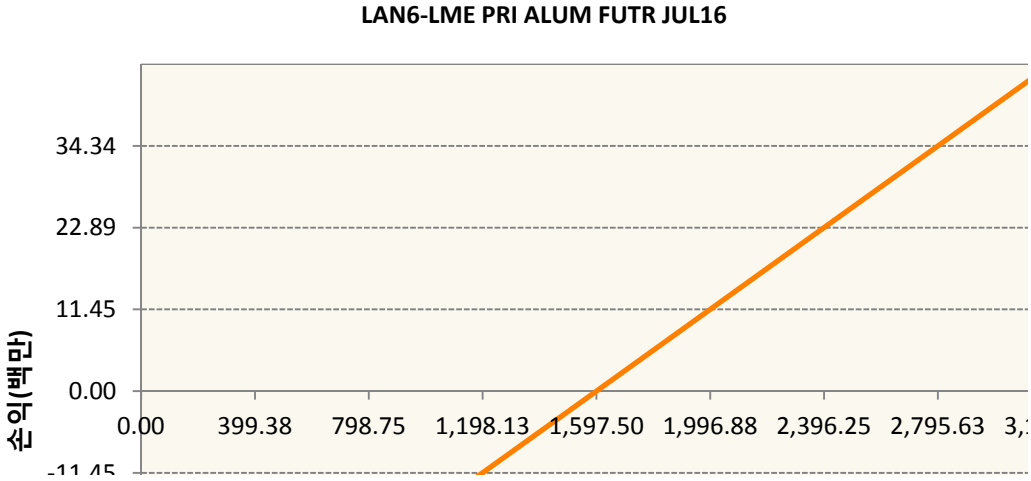
1. 계약금액

(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	58	0	58	
누계	유가증권	선물	307	0	307	

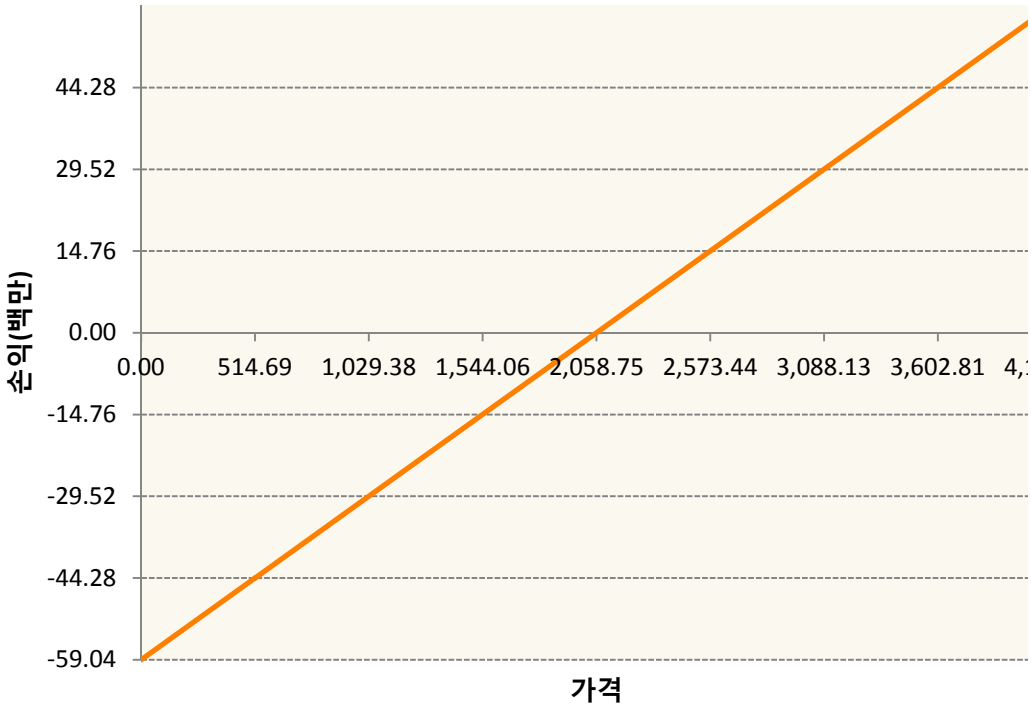
2. 만기시점의 손익구조



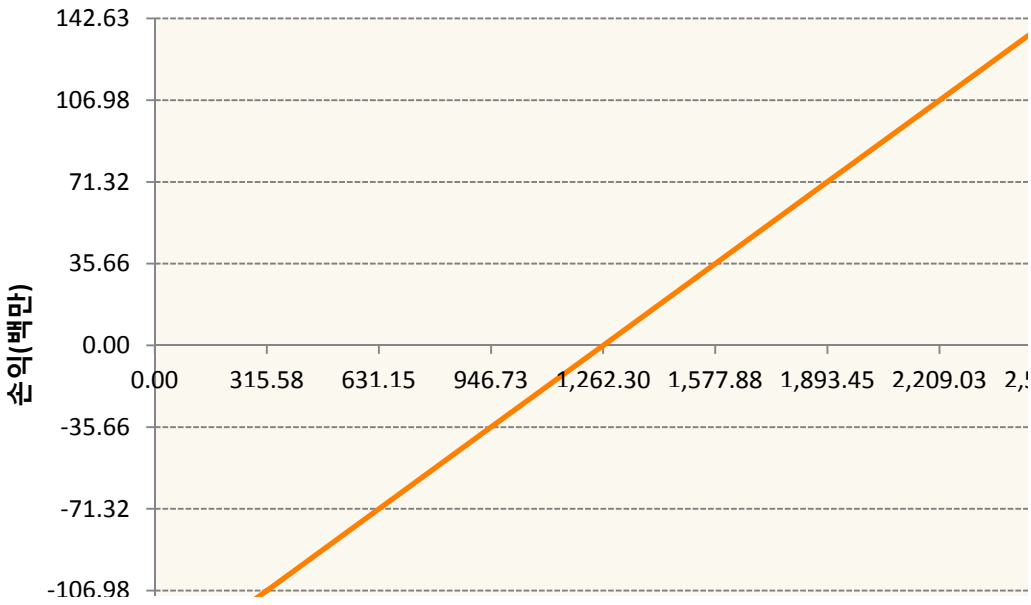


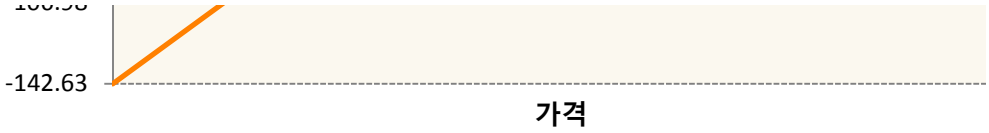


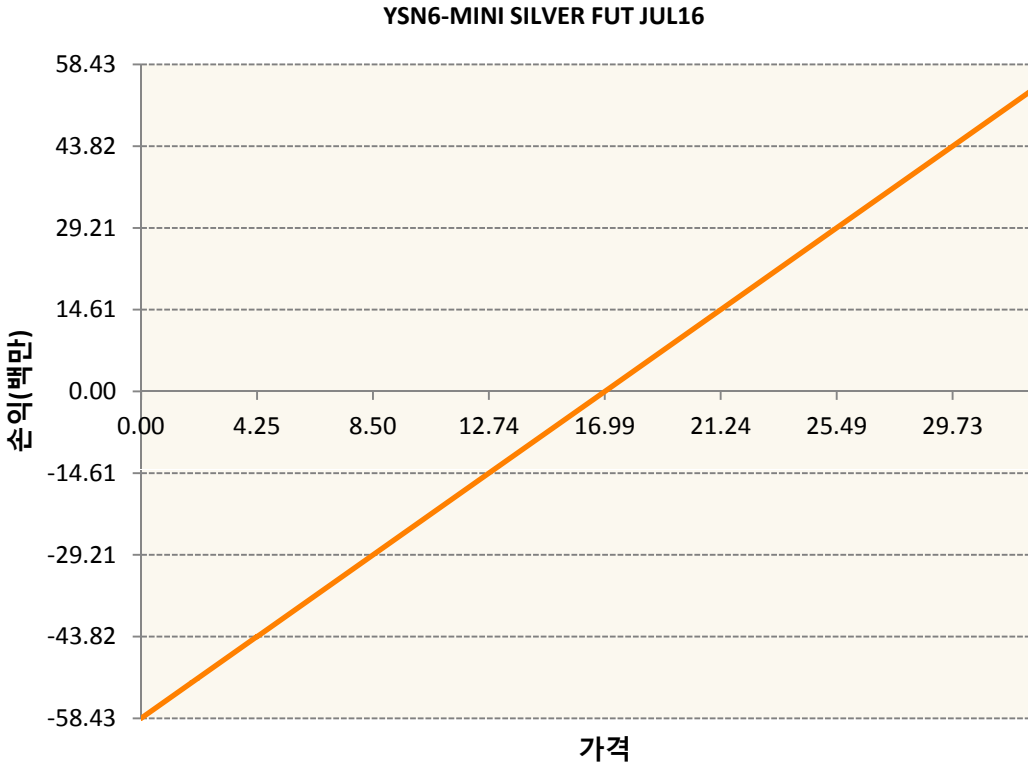
LXN6-LME ZINC FUTURE JUL16



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	5
XGQ6	MINI GOLD FUTURE AUG16	11
YSN6	MINI SILVER FUT JUL16	5

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

30

공시일	2016-06-10
기준일	2016-06-09

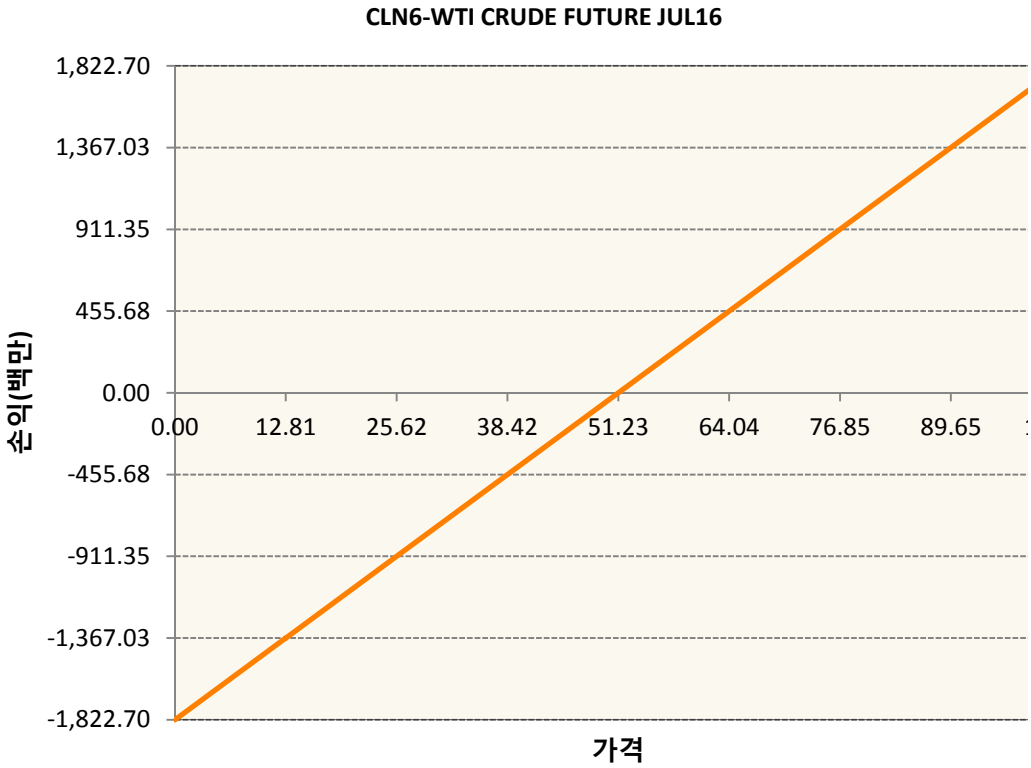
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

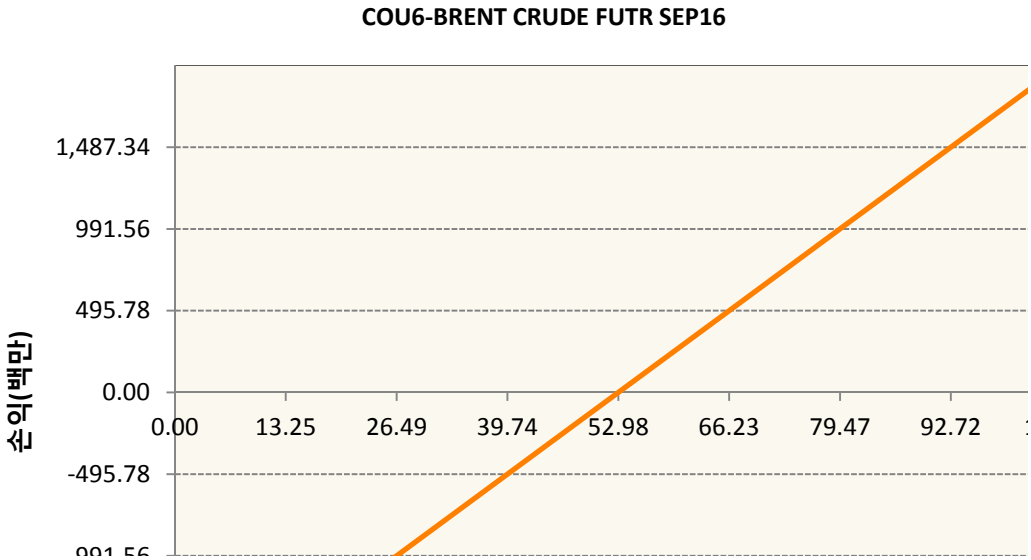
1. 계약금액

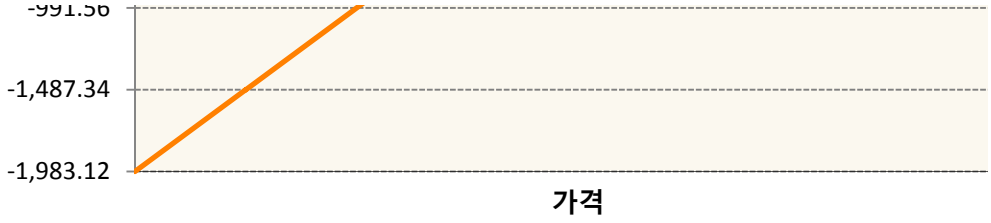
(단위:백만원)

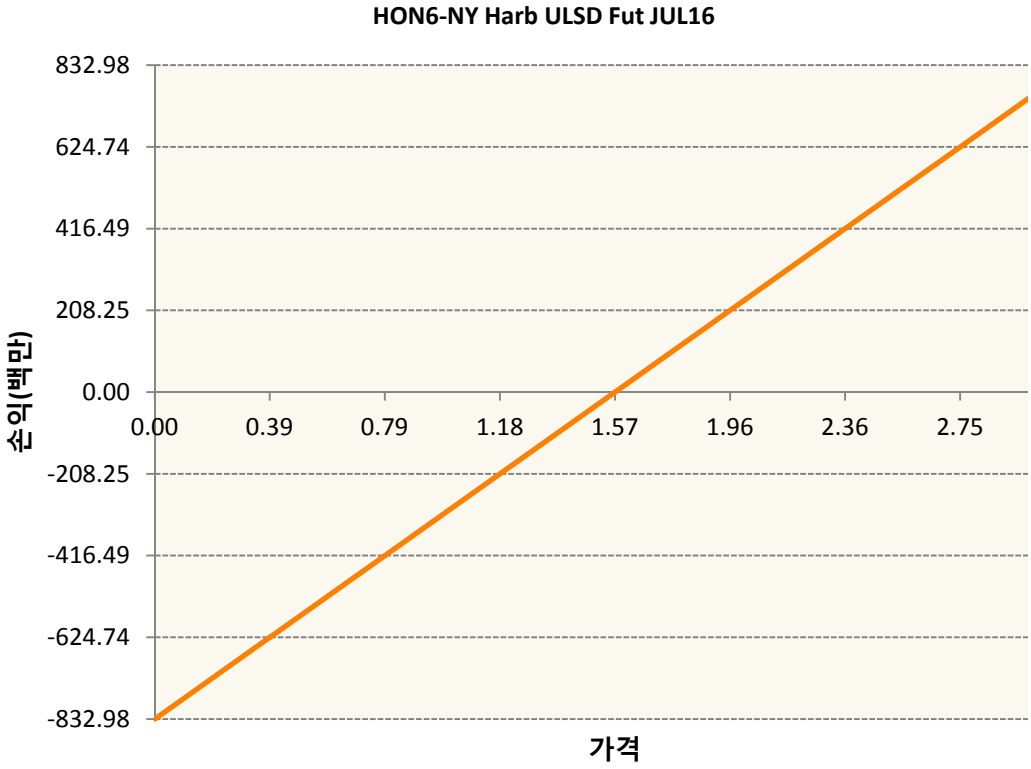
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,792	0	6,792	

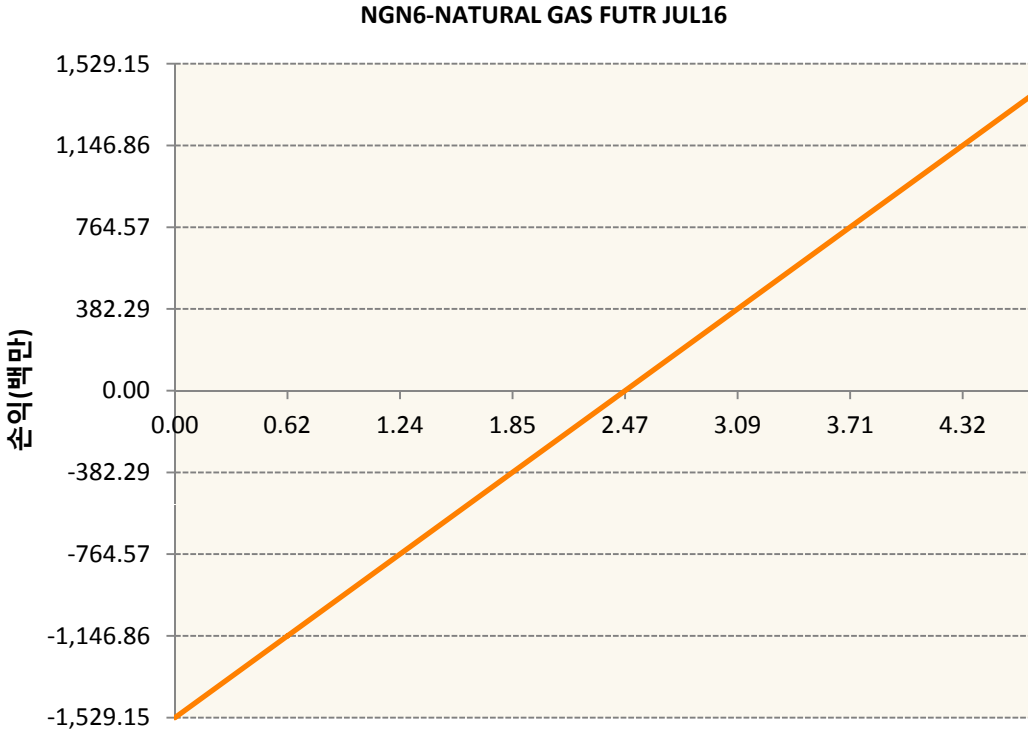
2. 만기시점의 손익구조



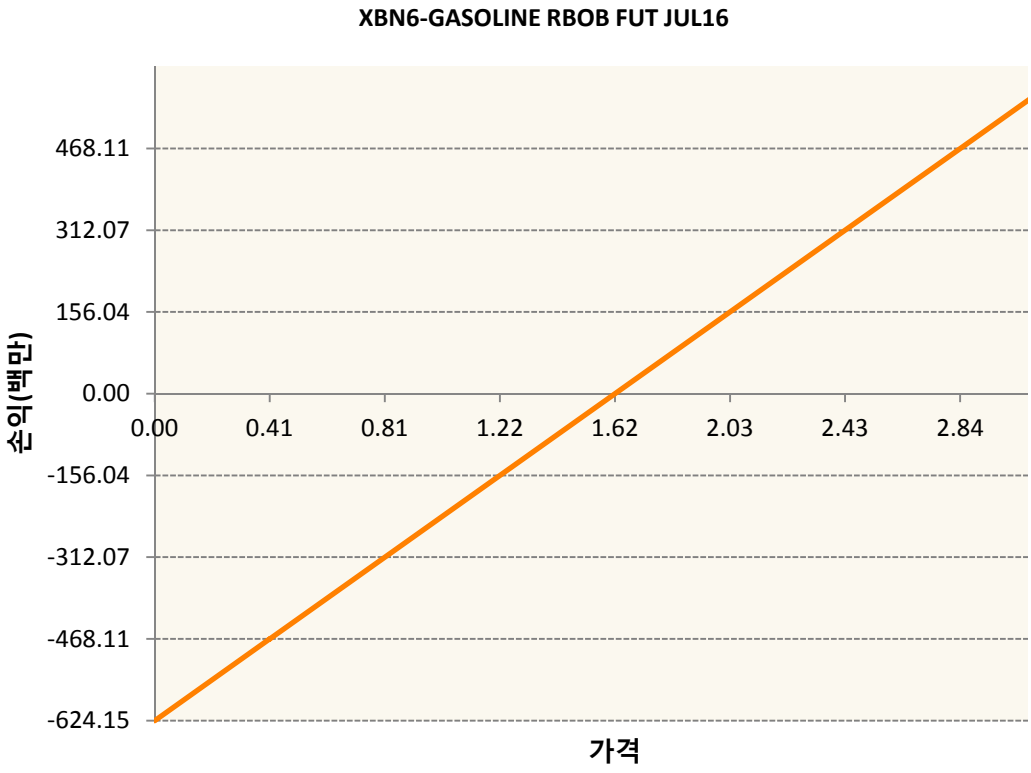



-991.56
-1,487.34
-1,983.12
가격


HON6-NY Harb ULSD Fut JUL16
832.98
624.74
416.49
208.25
0.00
-208.25
-416.49
-624.74
-832.98
0.00
0.39
0.79
1.18
1.57
1.96
2.36
2.75
손익(백만)
가격


NGN6-NATURAL GAS FUTR JUL16
1,529.15
1,146.86
764.57
382.29
0.00
-382.29
-764.57
-1,146.86
-1,529.15
0.00
0.62
1.24
1.85
2.47
3.09
3.71
4.32
손익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLN6	WTI CRUDE FUTURE JUL16	146
COU6	BRENT CRUDE FUTR SEP16	159
HON6	NY Harb ULSD Fut JUL16	67
NGN6	NATURAL GAS FUTR JUL16	122
XBN6	GASOLINE RBOB FUT JUL16	50

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,501

공시일	2016-06-10
기준일	2016-06-09

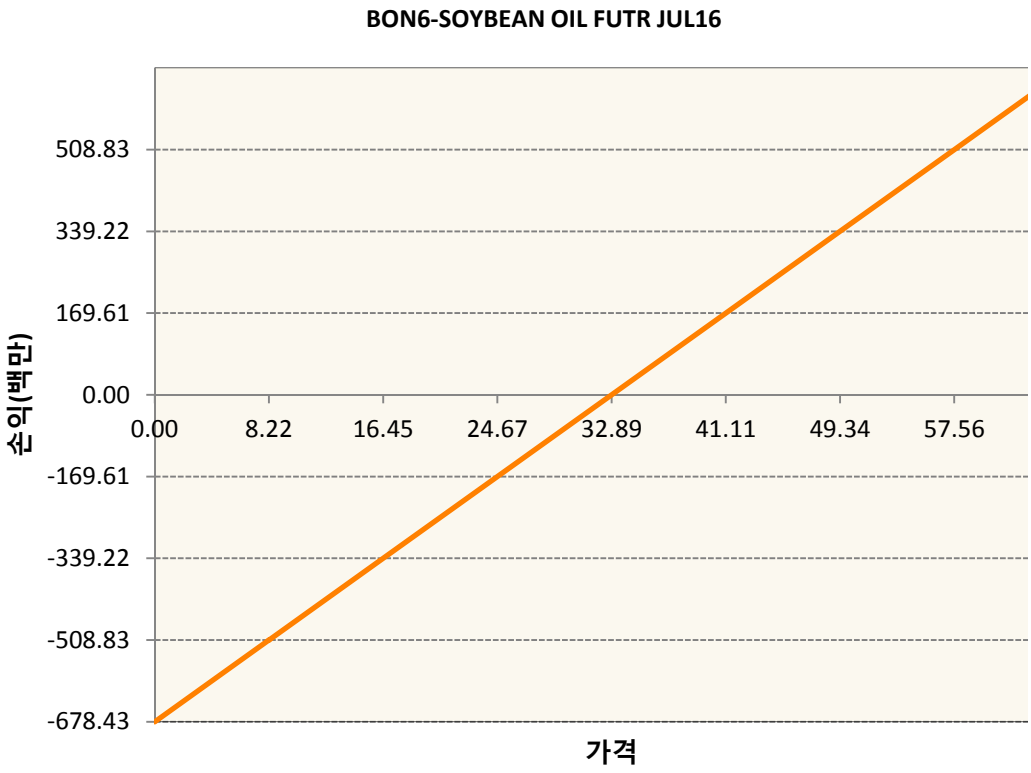
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

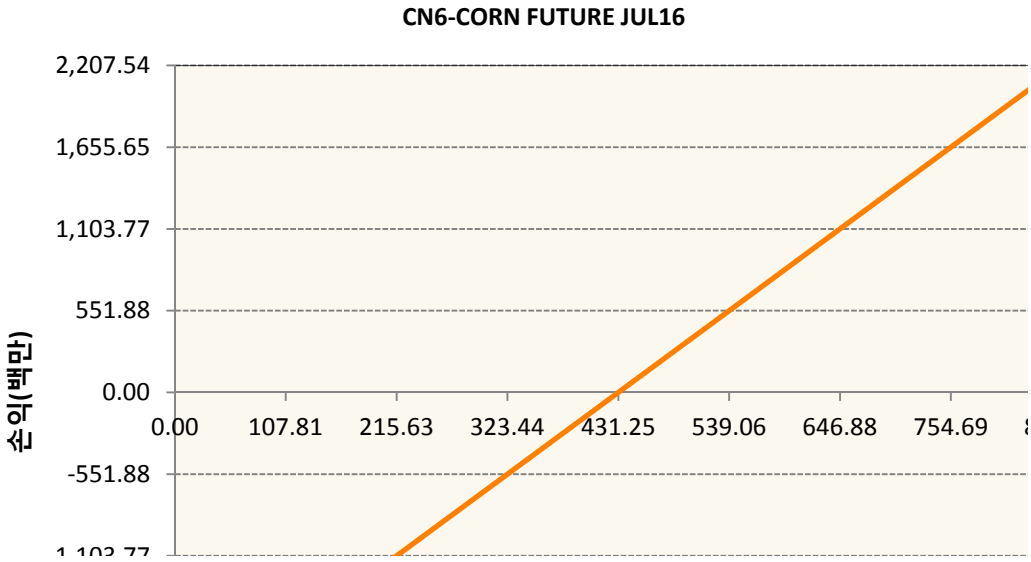
1. 계약금액

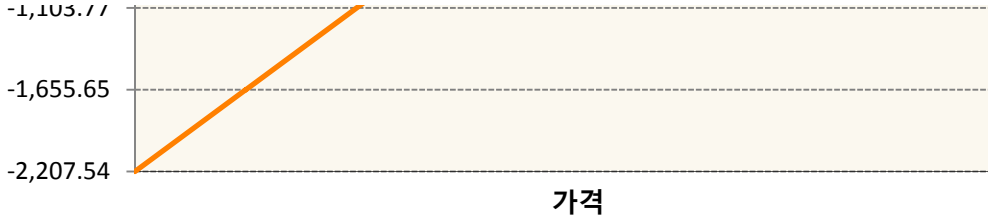
(단위:백만원)

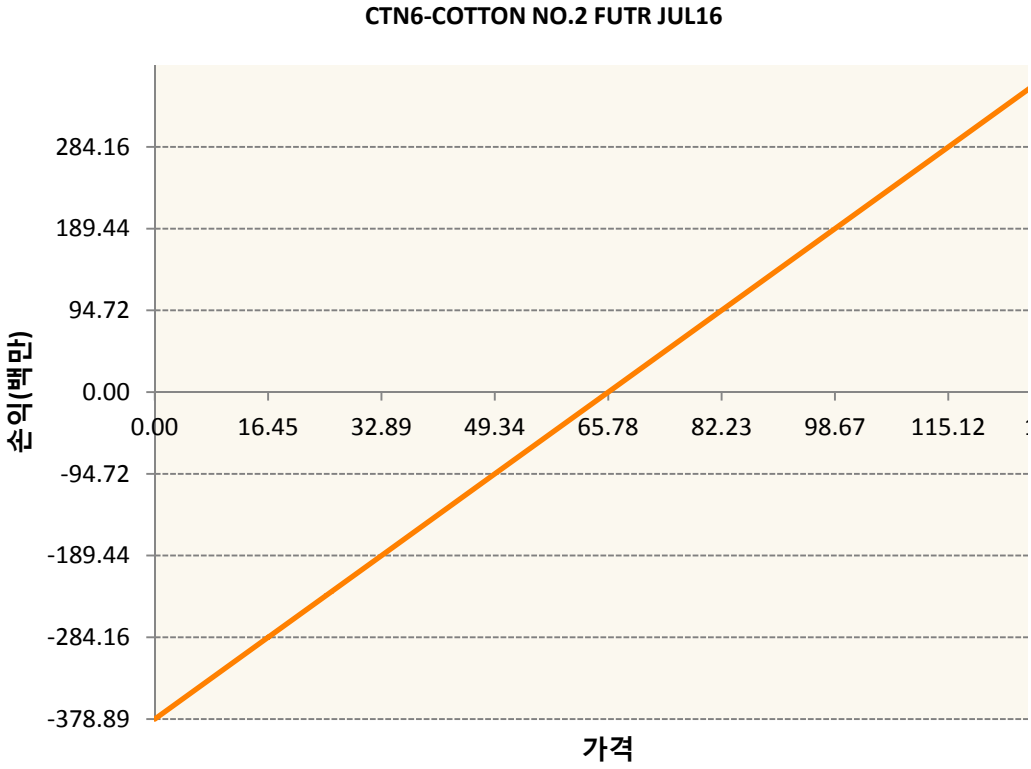
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,657	0	8,657	

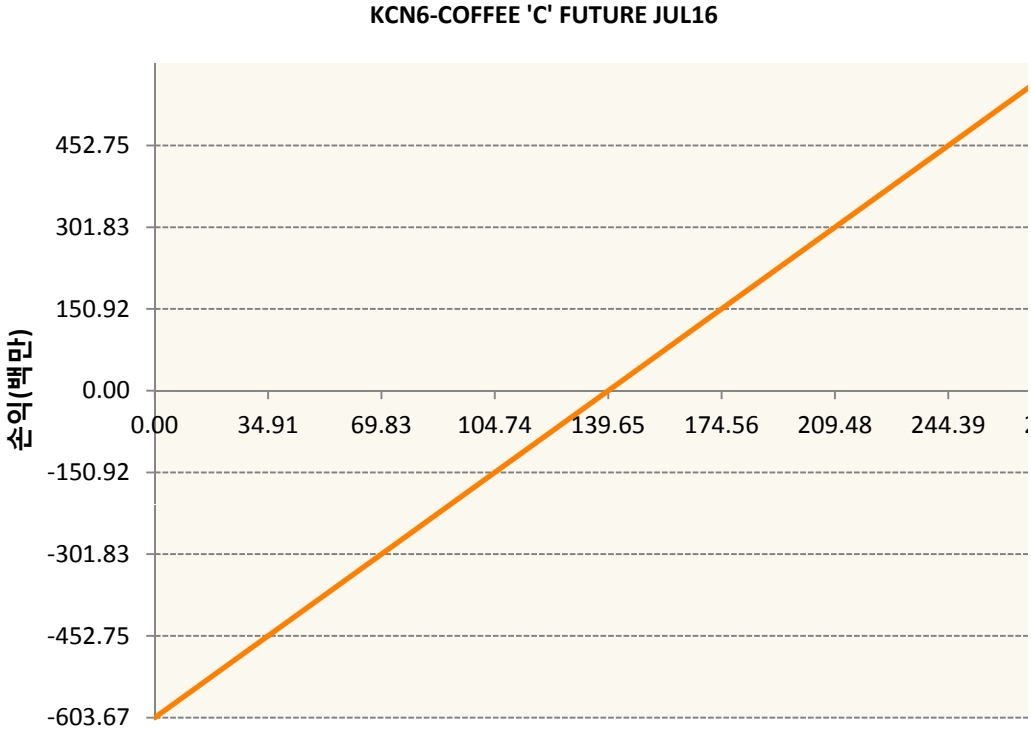
2. 만기시점의 손익구조





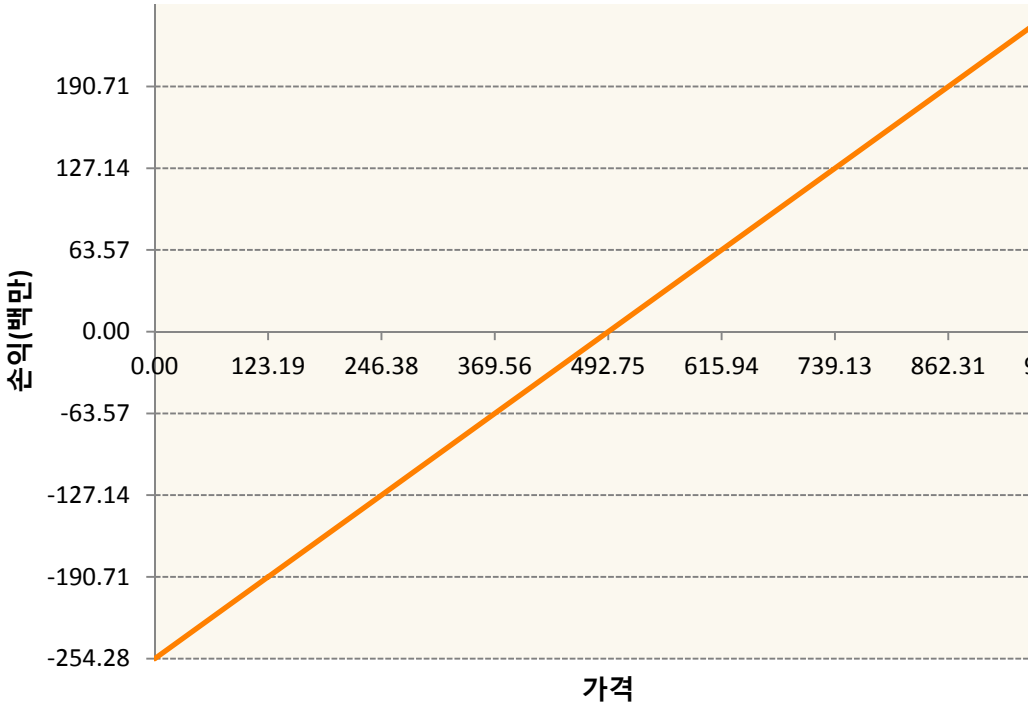

-1,655.65
-2,207.54
가격


CTN6-COTTON NO.2 FUTR JUL16
284.16
189.44
94.72
0.00
-94.72
-189.44
-284.16
-378.89
0.00
16.45
32.89
49.34
65.78
82.23
98.67
115.12
순익(백만)
가격

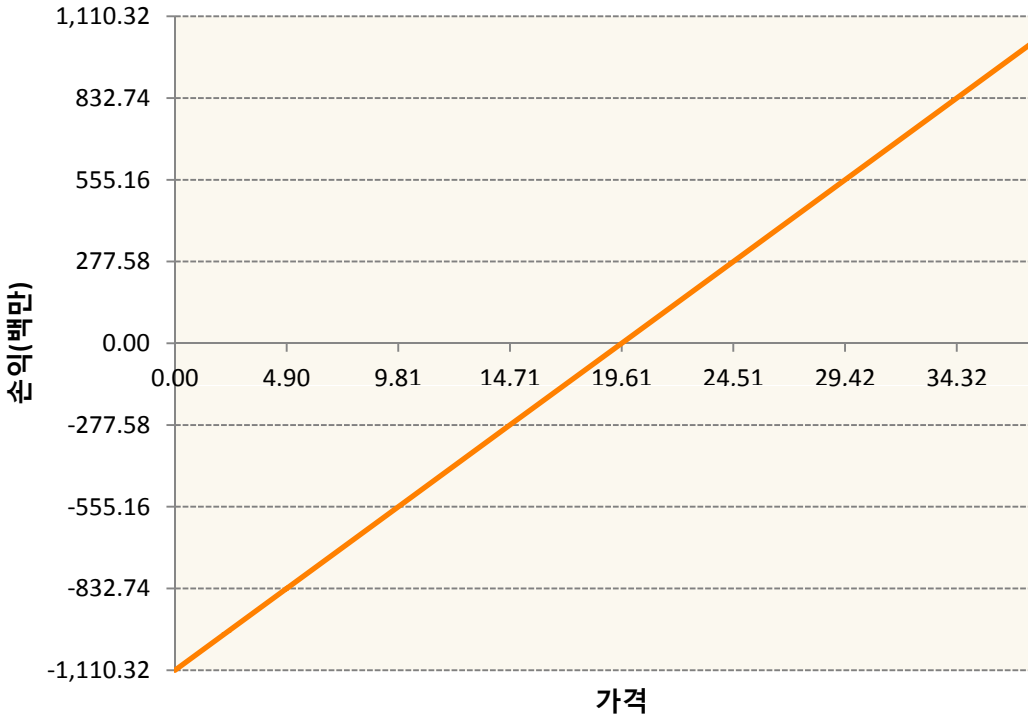

KCN6-COFFEE 'C' FUTURE JUL16
452.75
301.83
150.92
0.00
-150.92
-301.83
-452.75
-603.67
0.00
34.91
69.83
104.74
139.65
174.56
209.48
244.39
순익(백만)

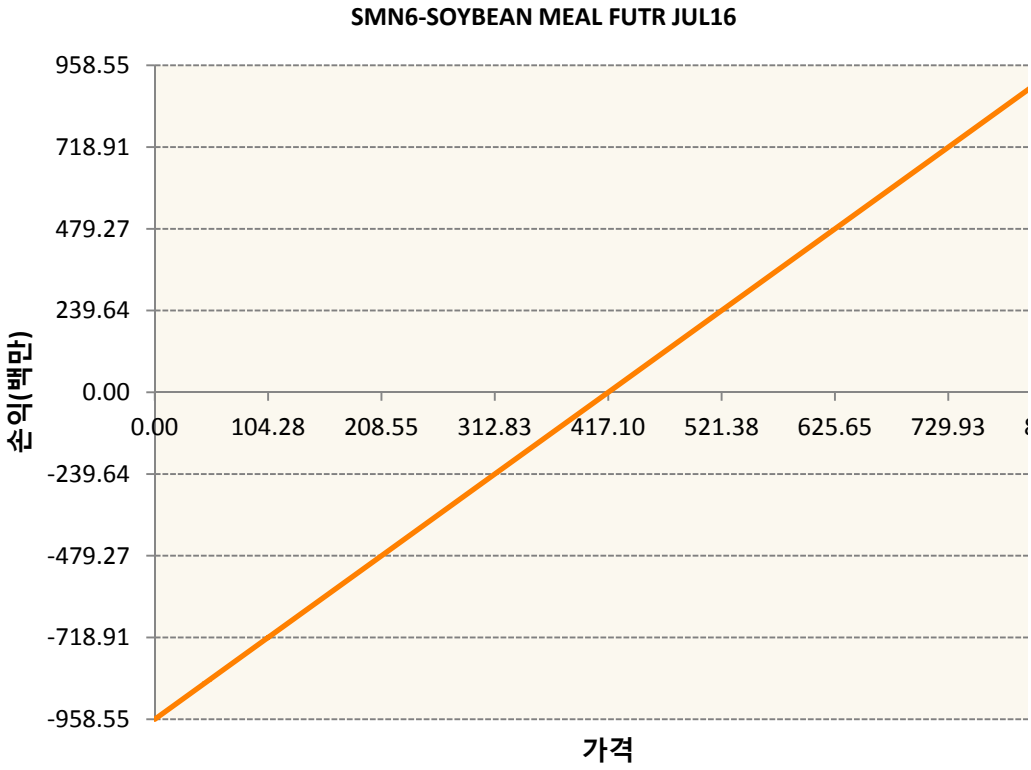
가격

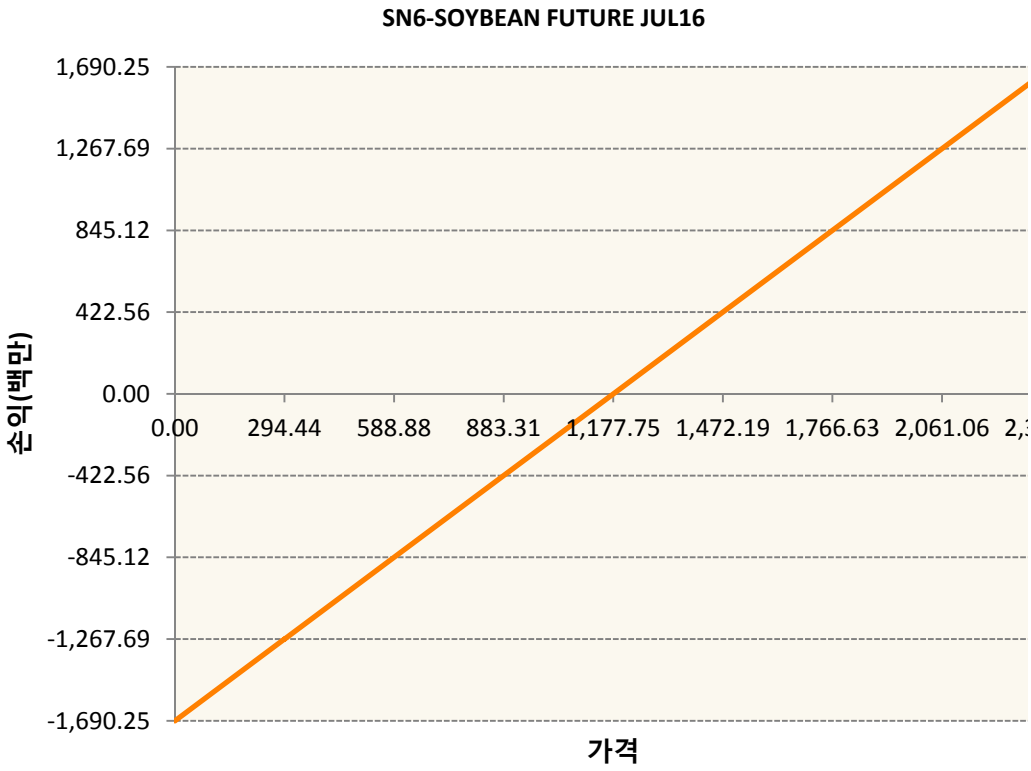
KWN6-KC HRW WHEAT FUT JUL16



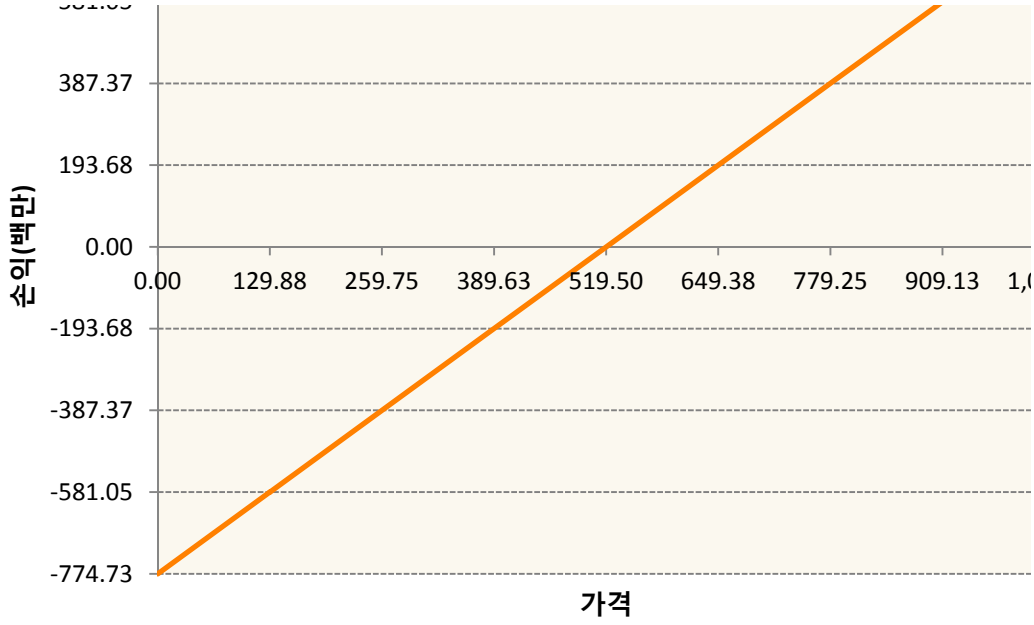
SBN6-SUGAR #11 (WORLD) JUL16




SMN6-SOYBEAN MEAL FUTR JUL16
958.55
718.91
479.27
239.64
0.00
-239.64
-479.27
-718.91
-958.55
0.00
104.28
208.55
312.83
417.10
521.38
625.65
729.93
손익(백만)
가격


SN6-SOYBEAN FUTURE JUL16
1,690.25
1,267.69
845.12
422.56
0.00
-422.56
-845.12
-1,267.69
-1,690.25
0.00
294.44
588.88
883.31
1,177.75
1,472.19
1,766.63
2,061.06
손익(백만)
가격


WN6-WHEAT FUTURE(CBT) JUL16
581.05



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON6	SOYBEAN OIL FUTR JUL16	54
CN6	CORN FUTURE JUL16	177
CTN6	COTTON NO.2 FUTR JUL16	30
KCN6	COFFEE 'C' FUTURE JUL16	48
KWN6	KC HRW WHEAT FUT JUL16	20
SBN6	SUGAR #11 (WORLD) JUL16	89
SMN6	SOYBEAN MEAL FUTR JUL16	77
SN6	SOYBEAN FUTURE JUL16	135
WN6	WHEAT FUTURE(CBT) JUL16	62

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

968