공시일	2016-07-01
기준일	2016-06-30

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	11	0	11	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	2016-07-01
기준일	2016-06-30

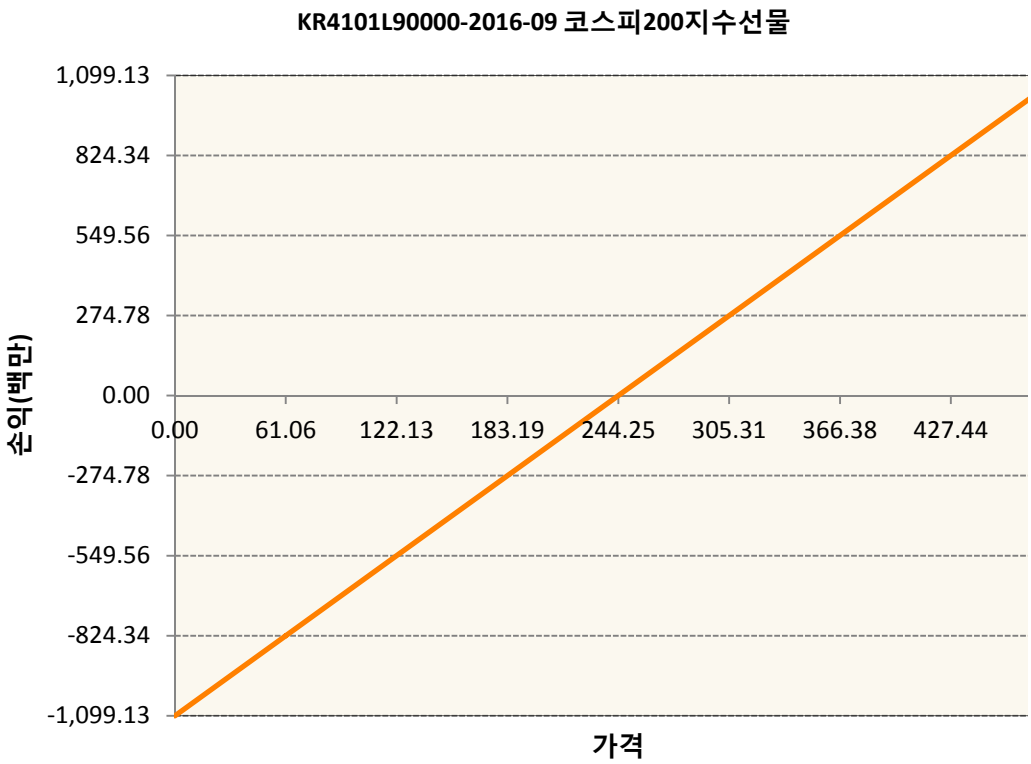
스마트인덱스모

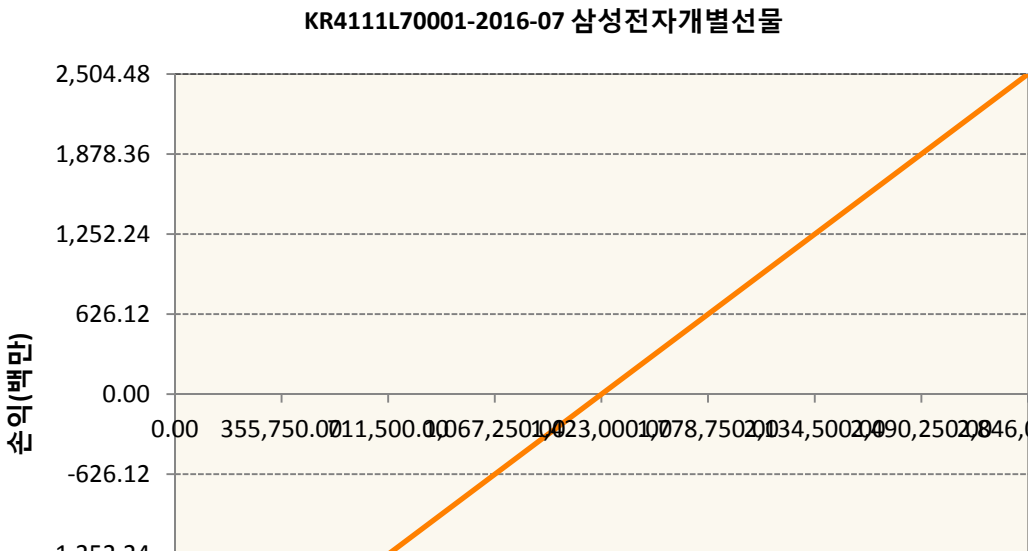
1. 계약금액

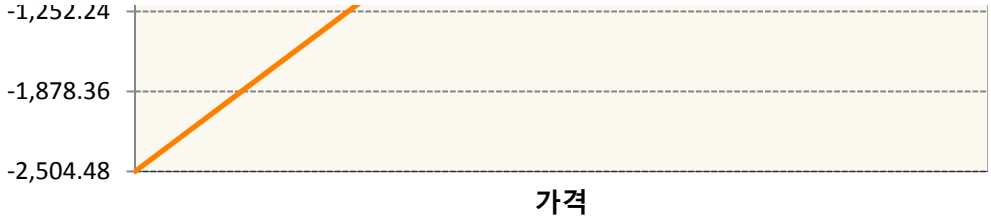
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,604	0	3,604	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						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%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
-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%	59	59	59	59	59	59	59
8.00%	88	88	88	88	88	88	88

KR4111L700	2016-07 삼성전자개별선물						201
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-201
-5.33%	-134	-134	-134	-134	-134	-134	-134
-2.67%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	67	67	67	67	67	67	67
5.33%	134	134	134	134	134	134	134
8.00%	201	201	201	201	201	201	201

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

269

공시일	2016-07-01
기준일	2016-06-30

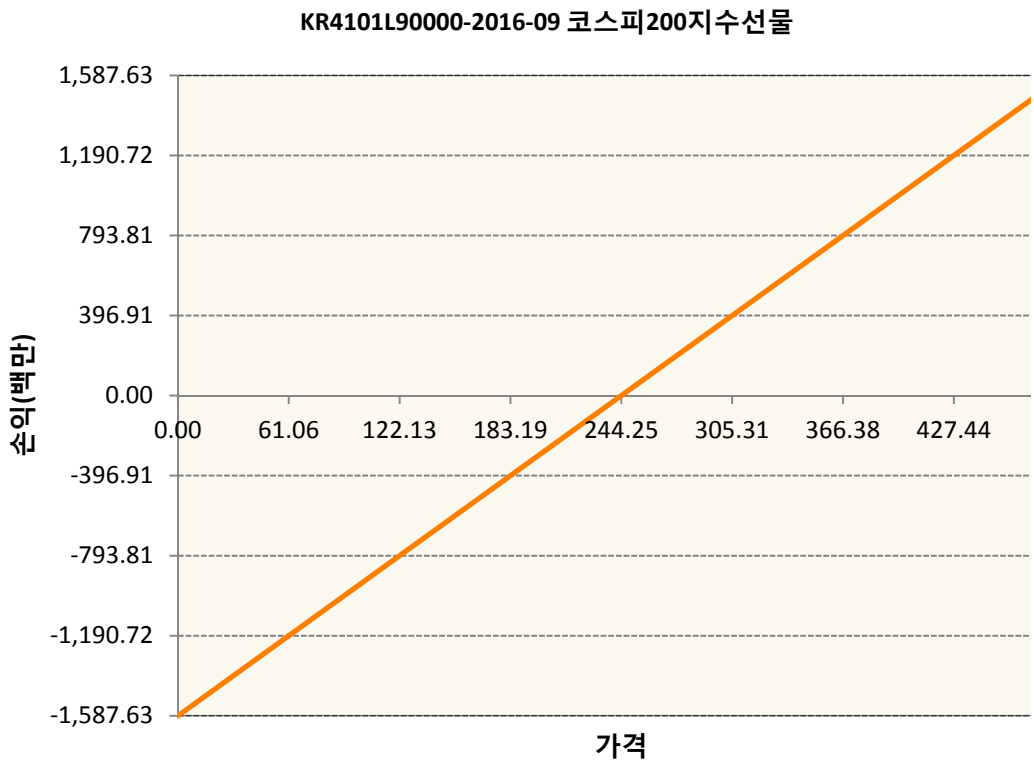
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,588	0	1,588	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						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%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
-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%	85	85	85	85	85	85	85
8.00%	127	127	127	127	127	127	127

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

106

공시일	2016-07-01
기준일	2016-06-30

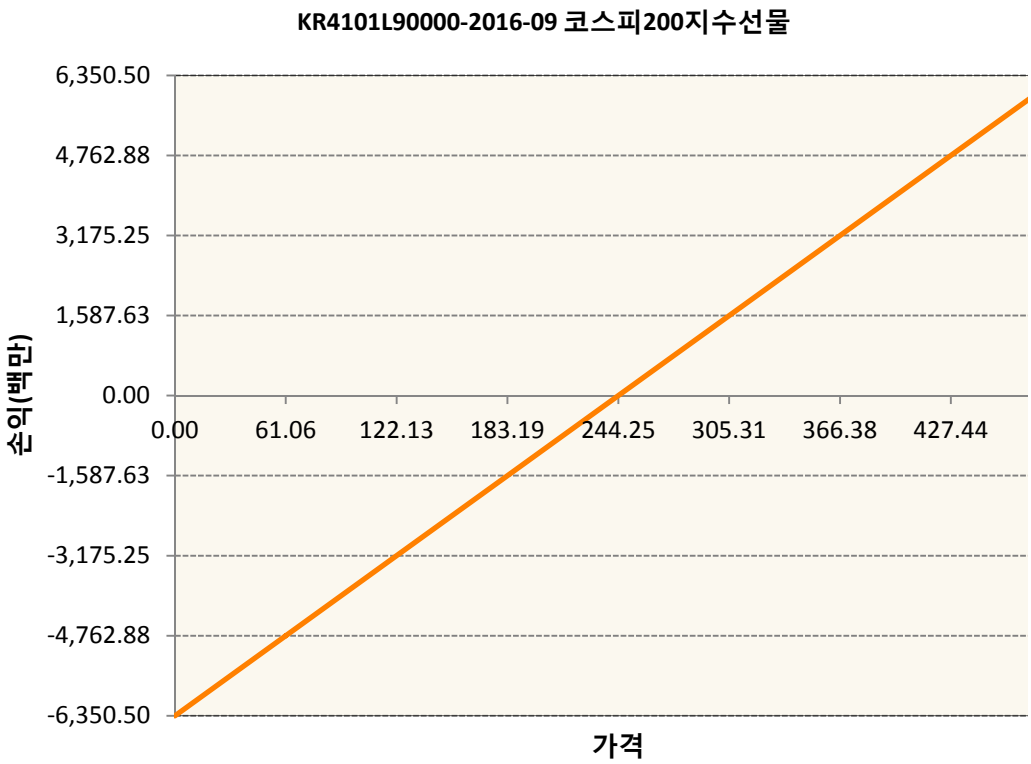
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	6,351	0	6,351	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						508
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-508	-508	-508	-508	-508	-508	-508
-5.33%	-339	-339	-339	-339	-339	-339	-339
-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%	339	339	339	339	339	339	339
8.00%	508	508	508	508	508	508	508

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

423

공시일	2016-07-01
기준일	2016-06-30

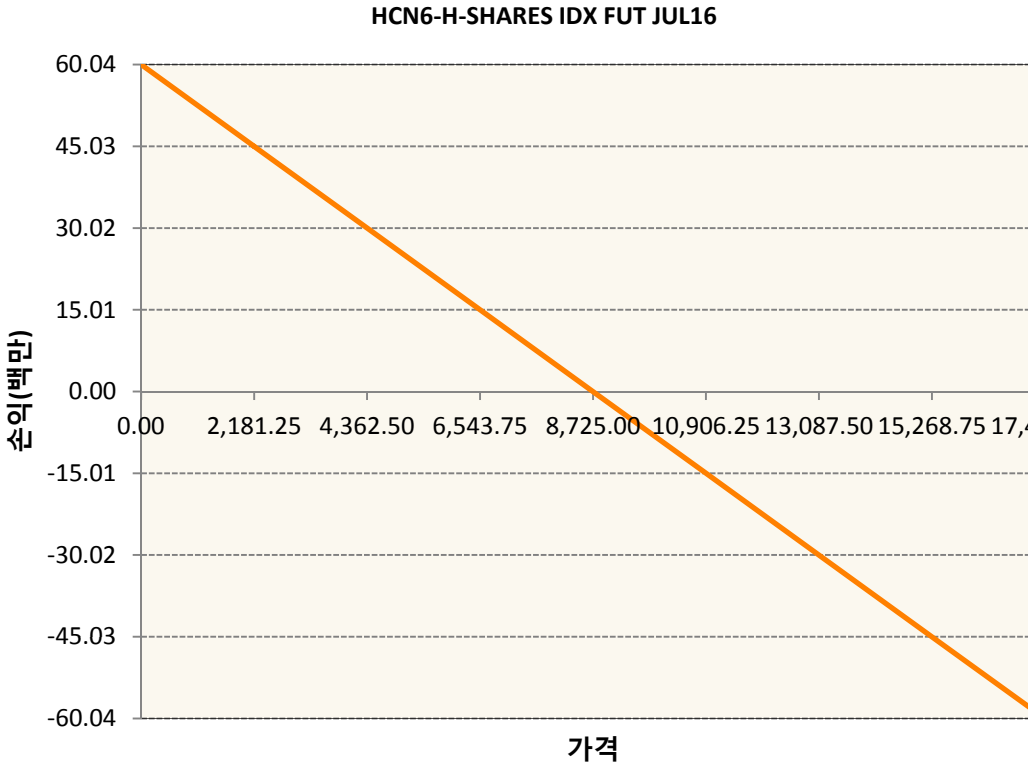
아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

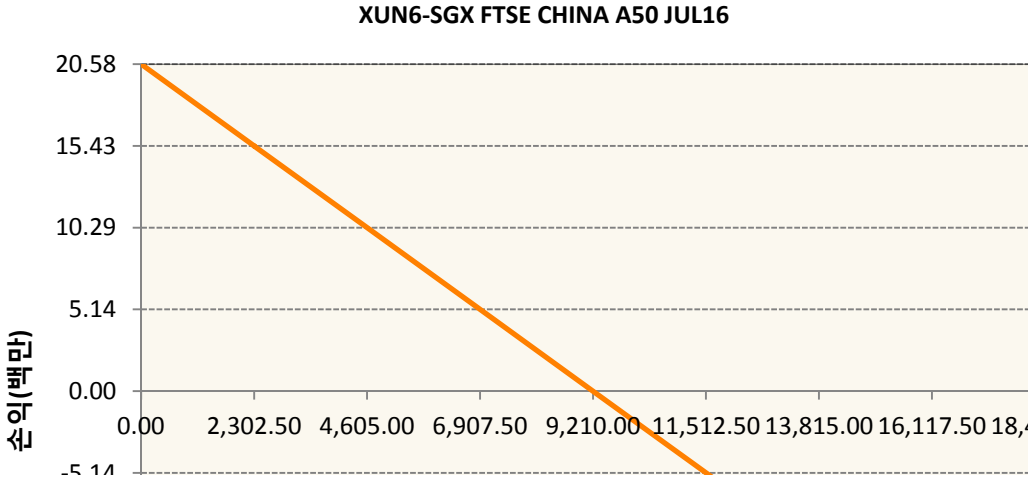
1. 계약금액

(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	21	-21	
누계	유가증권	선물	0	60	-60	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCN6	H-SHARES IDX FUT JUL16	5
XUN6	SGX FTSE CHINA A50 JUL16	2

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

공시일	2016-07-01
기준일	2016-06-30

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	839

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

786

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-07-01
기준일	2016-06-30

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	386

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,082

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-07-01
기준일	2016-06-30

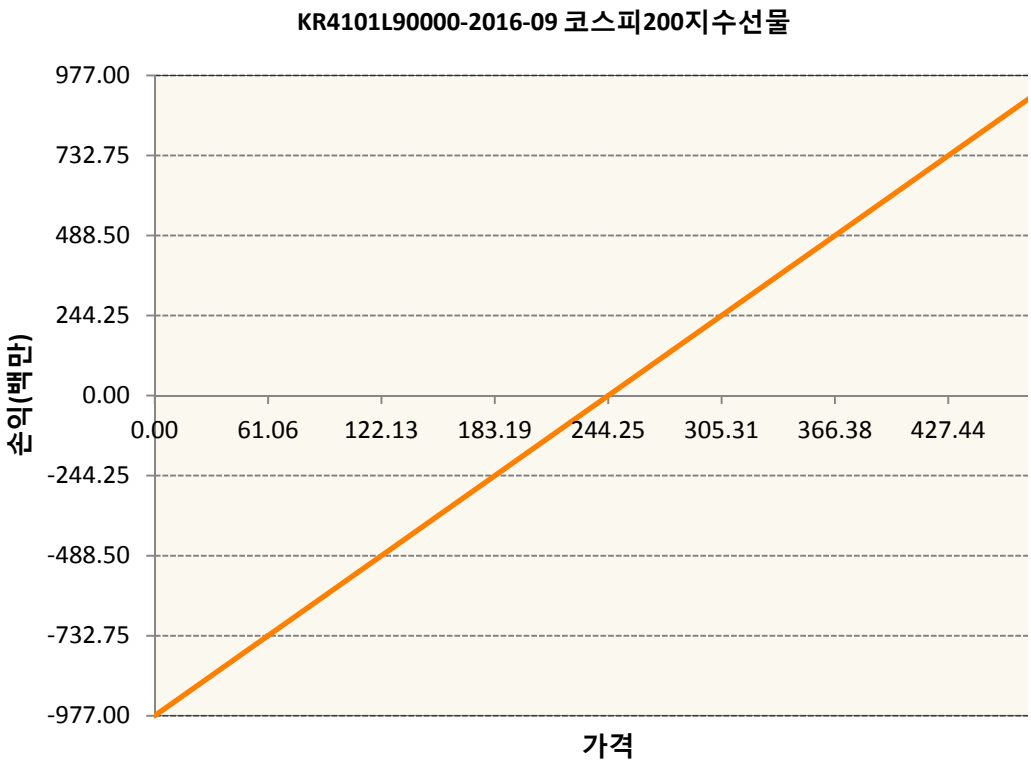
KOSPI200 레버리지 목표전환형 3

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	977	0	977	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						78
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
-5.33%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
-2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	26	26	26	26	26	26	26
5.33%	52	52	52	52	52	52	52
8.00%	78	78	78	78	78	78	78

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

65

공시일	2016-07-01
기준일	2016-06-30

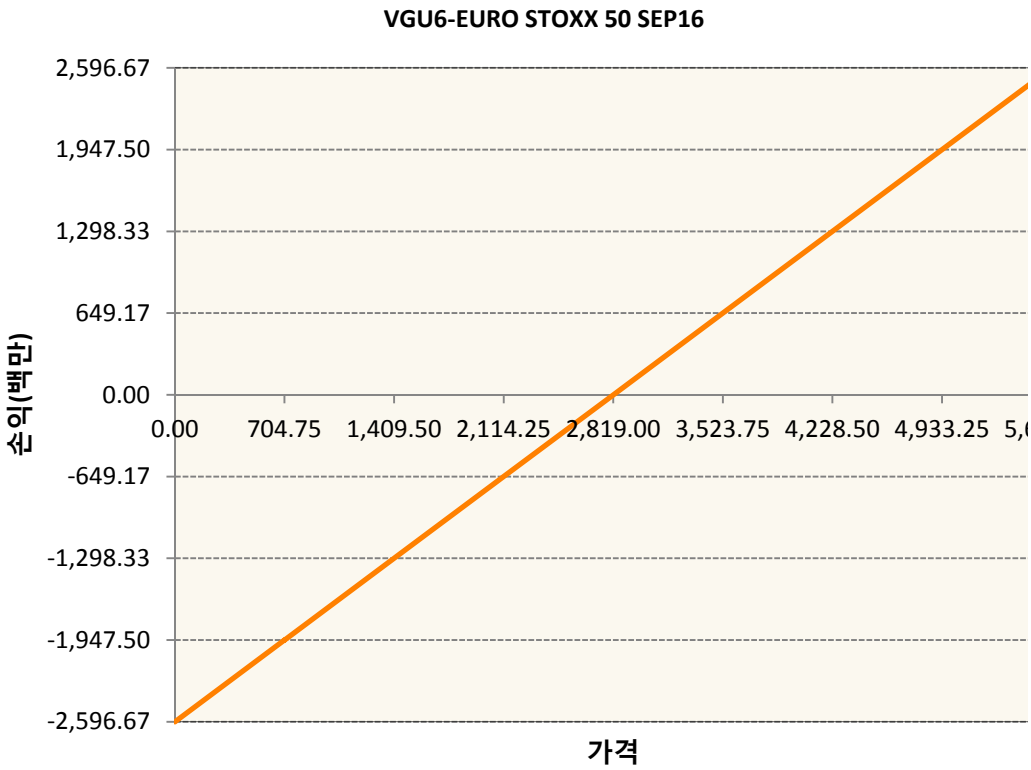
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,597	0	2,597	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 SEP16	208

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

(단위:백만원)

255

공시일	2016-07-01
기준일	2016-06-30

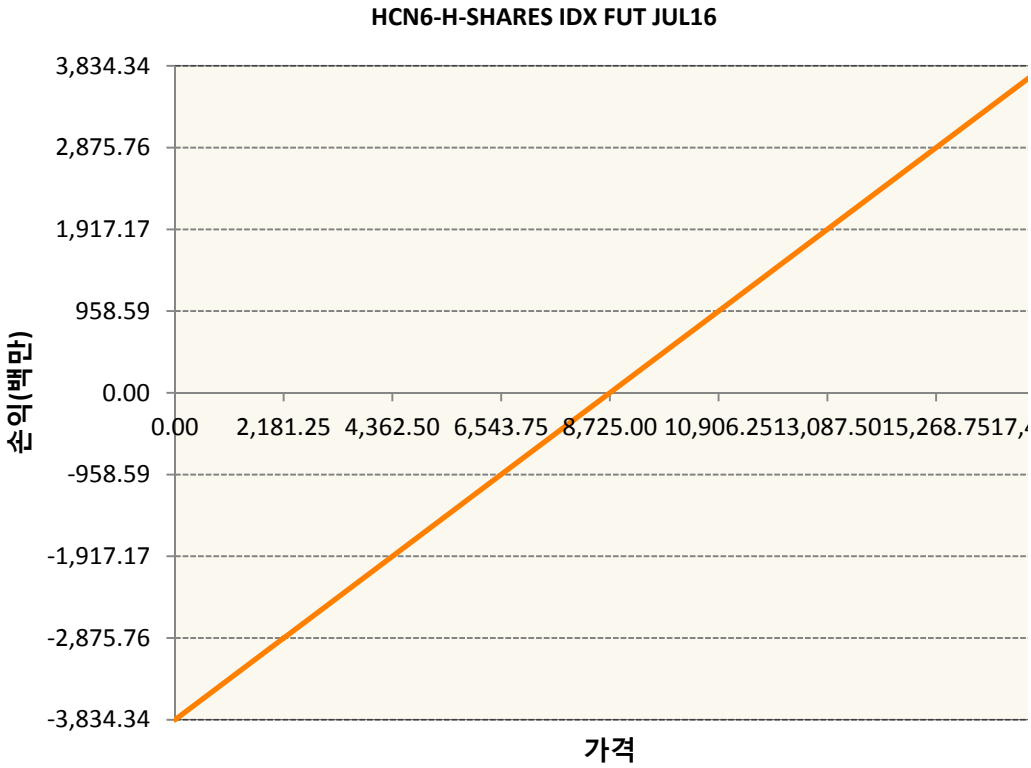
차이나인덱스모(주식-파생형)

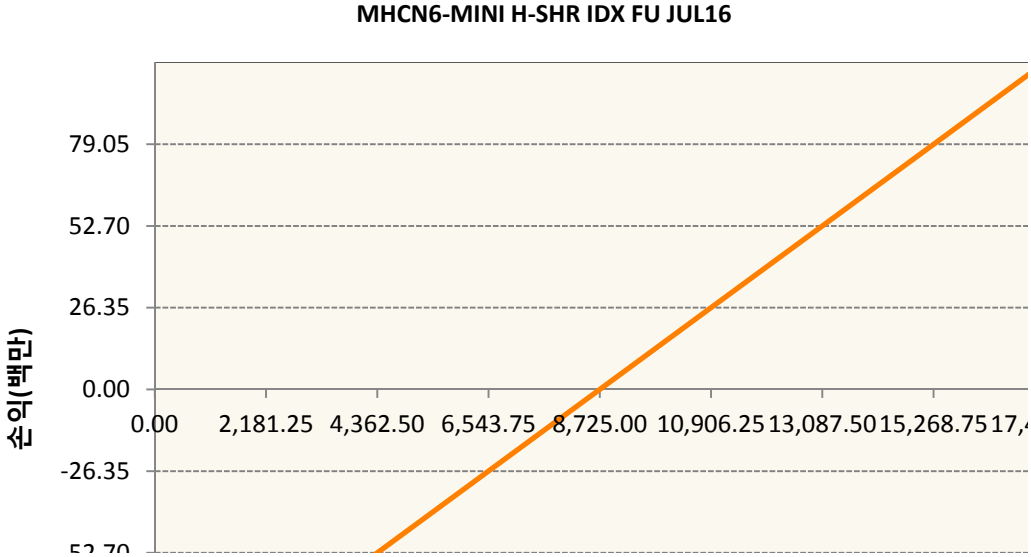
1. 계약금액

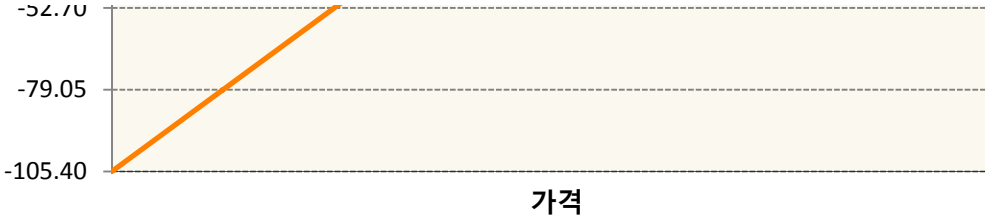
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,940	0	3,940	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCN6	H-SHARES IDX FUT JUL16	307
MHCN6	MINI H-SHR IDX FU JUL16	8

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

446

공시일	2016-07-01
기준일	2016-06-30

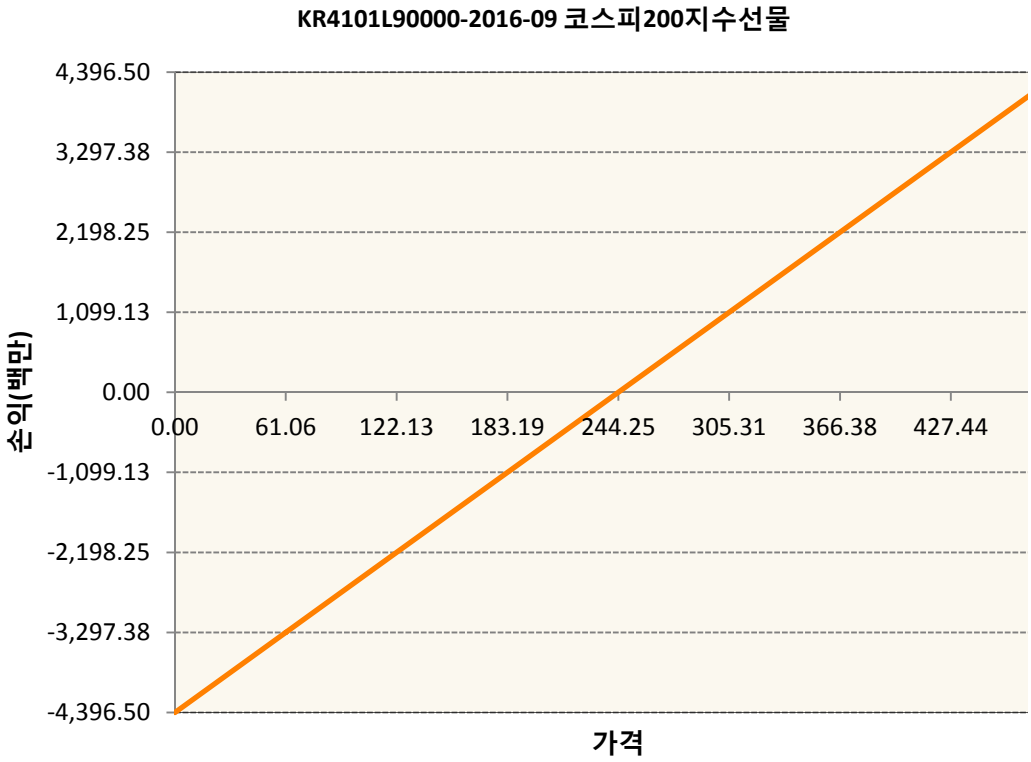
커버드콜(주식혼합-파생형)

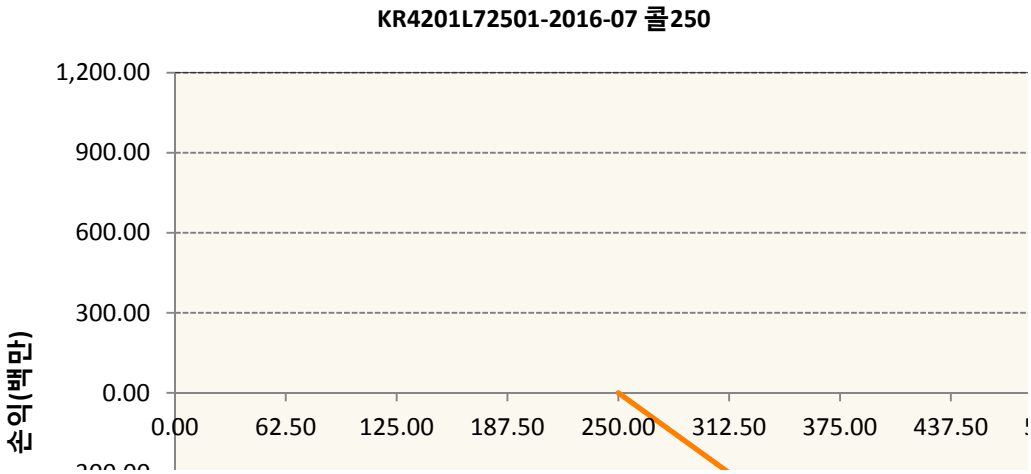
1. 계약금액

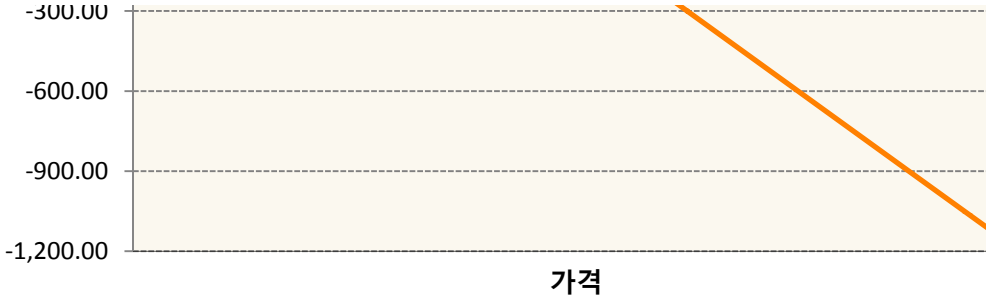
(단위:백만원)

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	4,397	0	4,397	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,200	-1,200	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						352
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-352	-352	-352	-352	-352	-352	-352
-5.33%	-234	-234	-234	-234	-234	-234	-234
-2.67%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	117	117	117	117	117	117	117
5.33%	234	234	234	234	234	234	234
8.00%	352	352	352	352	352	352	352
KR4201L725	2016-07 콜250						315
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19	19	19	19	19	19	18
-5.33%	19	19	19	18	18	18	18
-2.67%	18	18	17	16	15	13	12
0%	10	7	4	0	-4	-8	-13
2.67%	-40	-45	-51	-57	-62	-68	-74
5.33%	-158	-160	-163	-167	-170	-174	-178
8.00%	-309	-309	-310	-310	-312	-313	-315

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

586

공시일	2016-07-01
기준일	2016-06-30

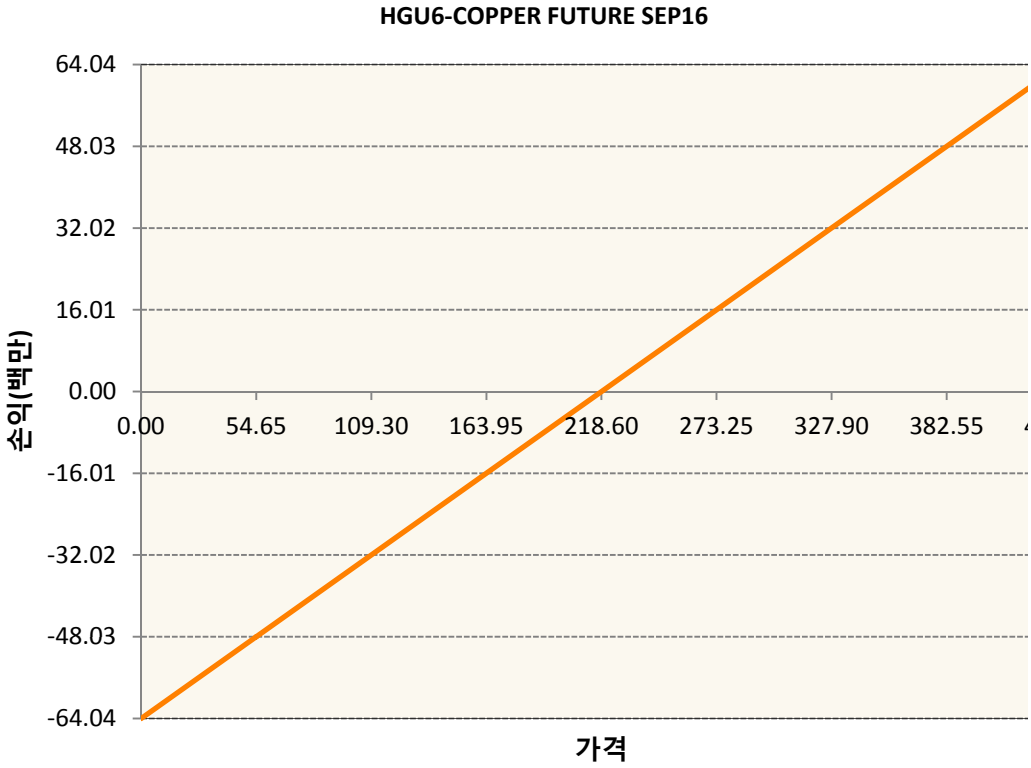
메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

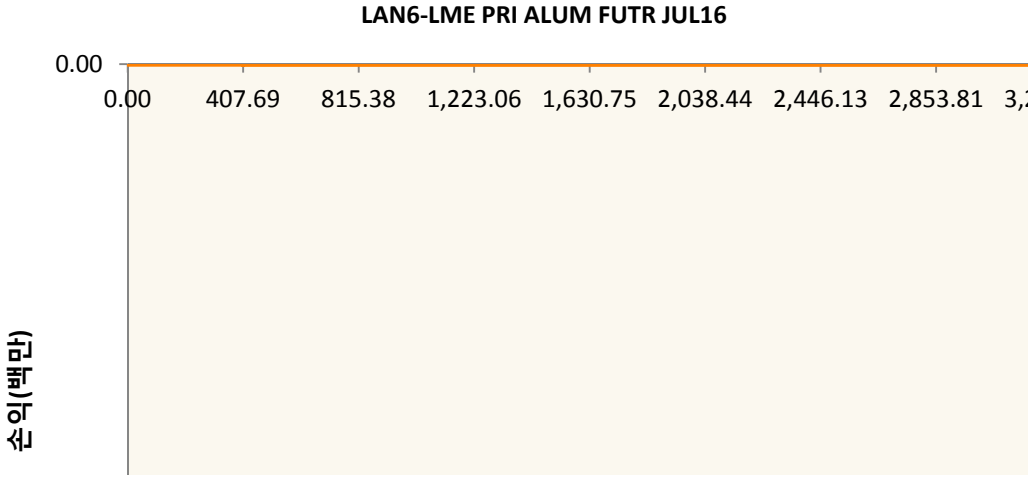
1. 계약금액

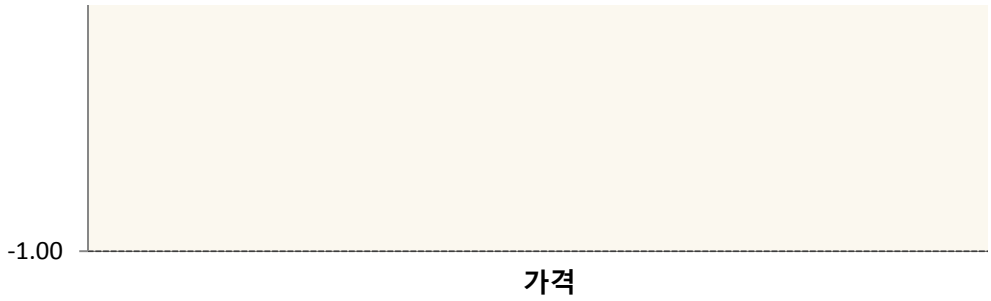
(단위:백만원)

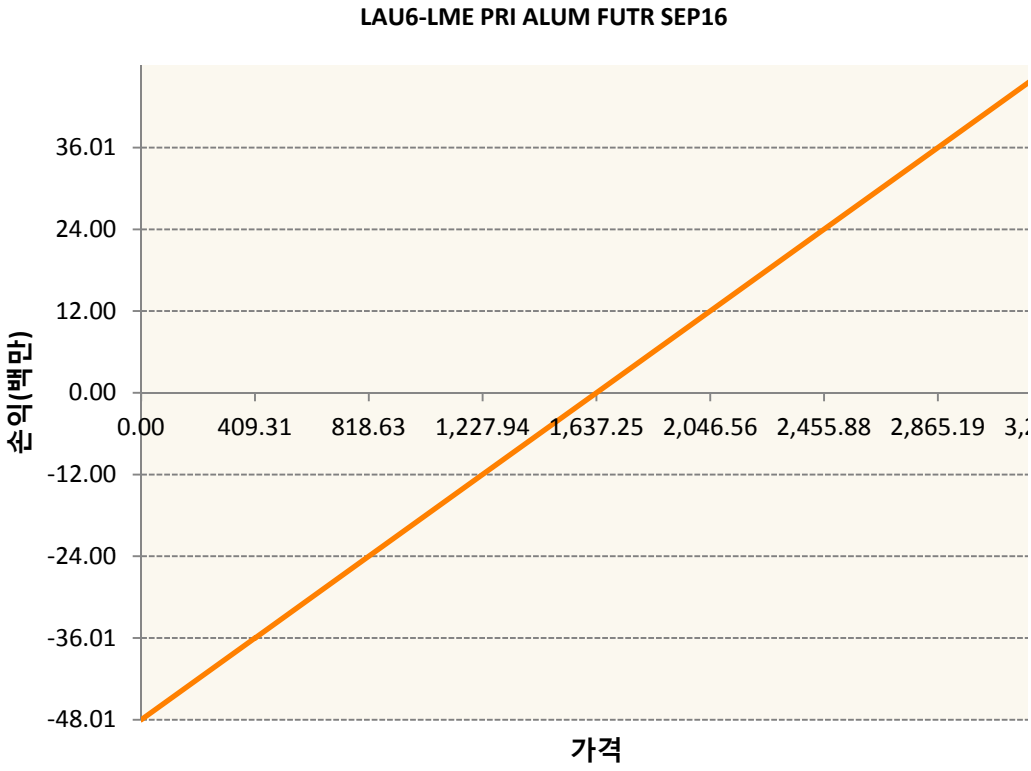
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	65	0	65	
누계	유가증권	선물	430	104	326	

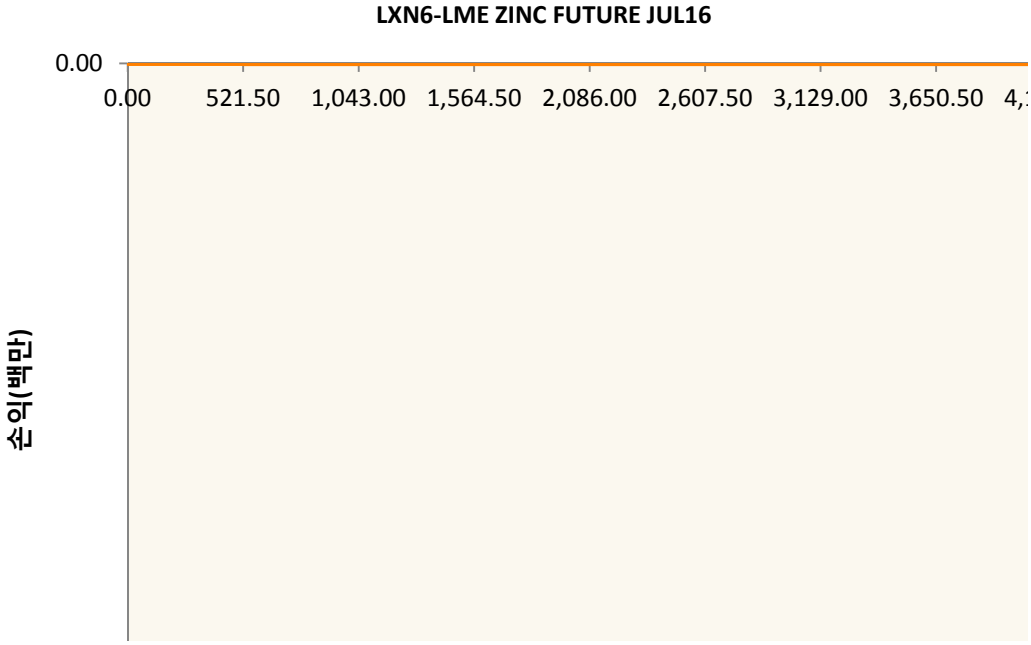
2. 만기시점의 손익구조

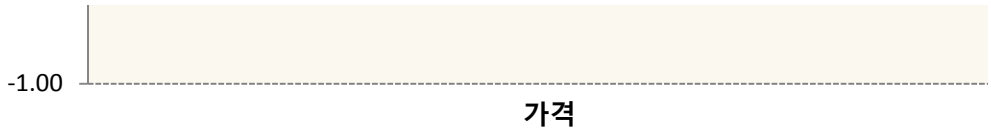


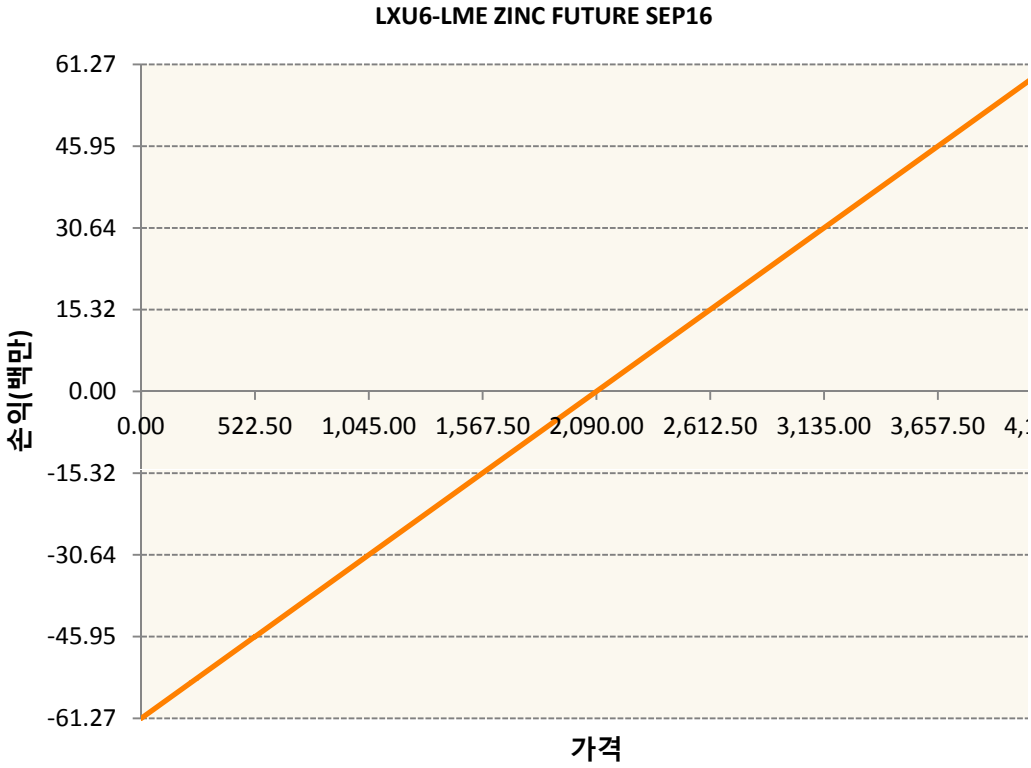


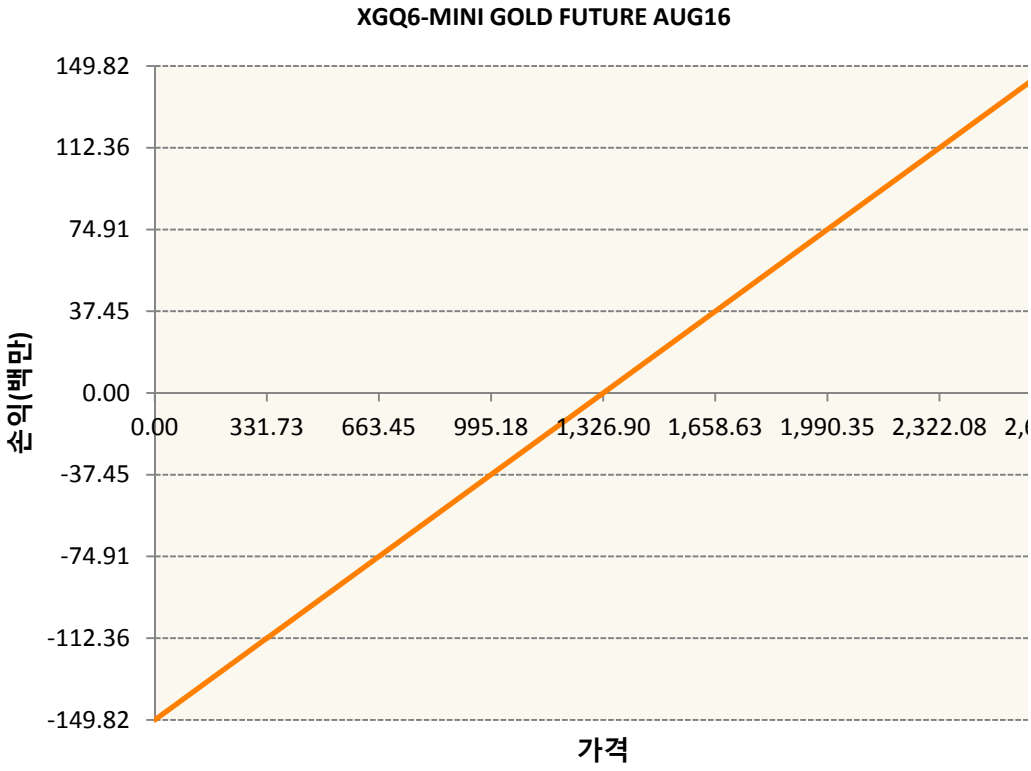

-1.00
가격

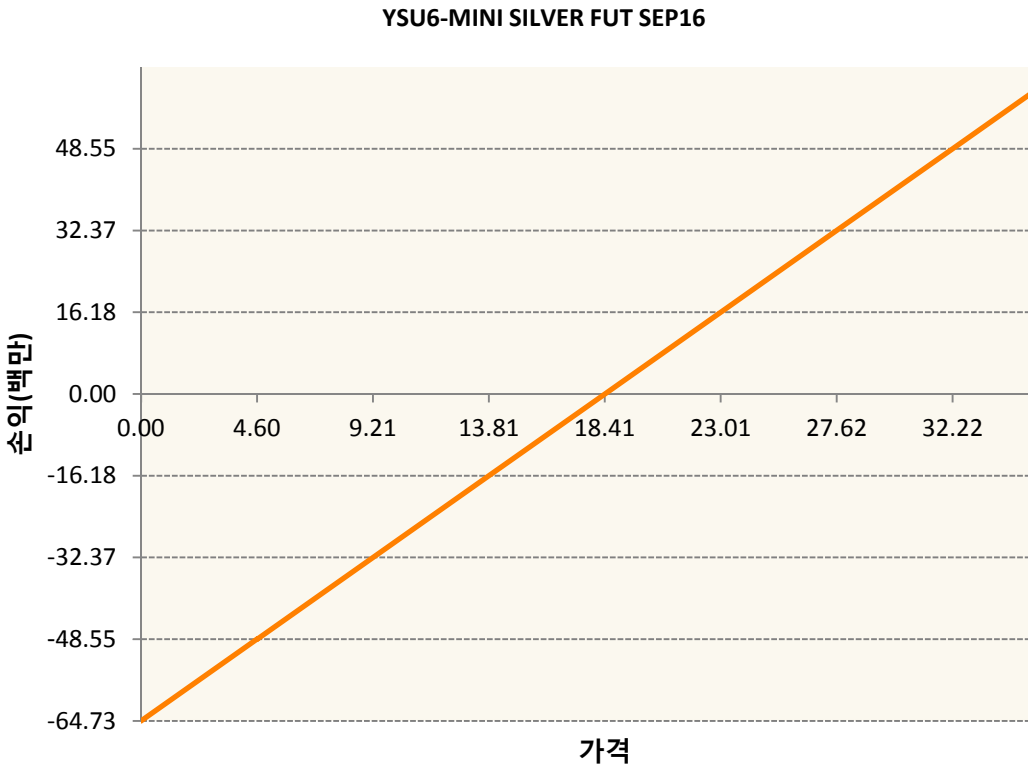

LAU6-LME PRI ALUM FUTR SEP16
36.01
24.00
12.00
0.00
-12.00
-24.00
-36.01
-48.01
순익(백만)
0.00
409.31
818.63
1,227.94
1,637.25
2,046.56
2,455.88
2,865.19
가격


LXN6-LME ZINC FUTURE JUL16
0.00
0.00
521.50
1,043.00
1,564.50
2,086.00
2,607.50
3,129.00
3,650.50
순익(백만)


-1.00
가격


LXU6-LME ZINC FUTURE SEP16
61.27
45.95
30.64
15.32
0.00
-15.32
-30.64
-45.95
-61.27
0.00
522.50
1,045.00
1,567.50
2,090.00
2,612.50
3,135.00
3,657.50
순익(백만)
가격


XGQ6-MINI GOLD FUTURE AUG16
149.82
112.36
74.91
37.45
0.00
-37.45
-74.91
-112.36
-149.82
0.00
331.73
663.45
995.18
1,326.90
1,658.63
1,990.35
2,322.08
순익(백만)
가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HGU6	COPPER FUTURE SEP16	5
LAN6	LME PRI ALUM FUTR JUL16	0.1
LAU6	LME PRI ALUM FUTR SEP16	4
LXN6	LME ZINC FUTURE JUL16	0.2
LXU6	LME ZINC FUTURE SEP16	5
XGQ6	MINI GOLD FUTURE AUG16	12
YSU6	MINI SILVER FUT SEP16	5

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	32

공시일	2016-07-01
기준일	2016-06-30

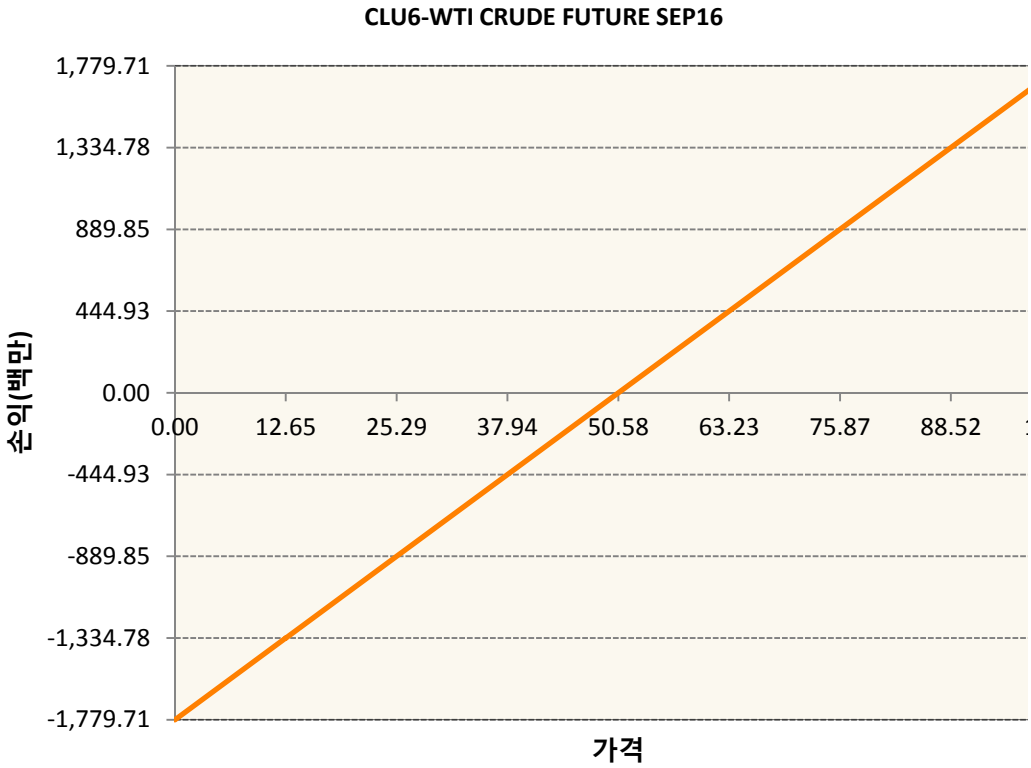
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

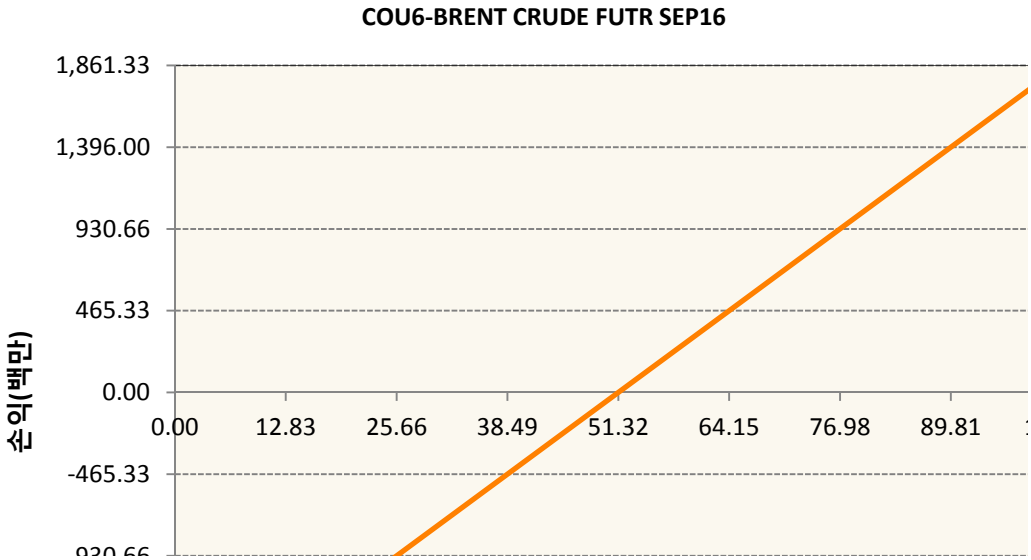
1. 계약금액

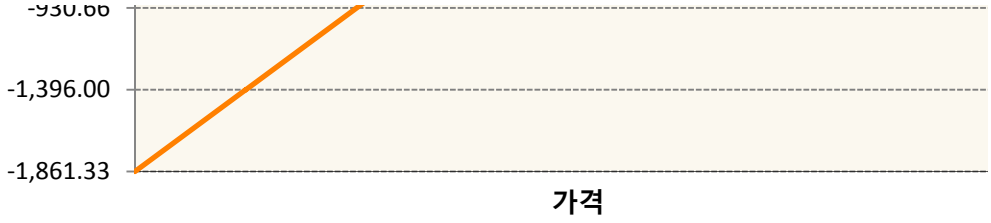
(단위:백만원)

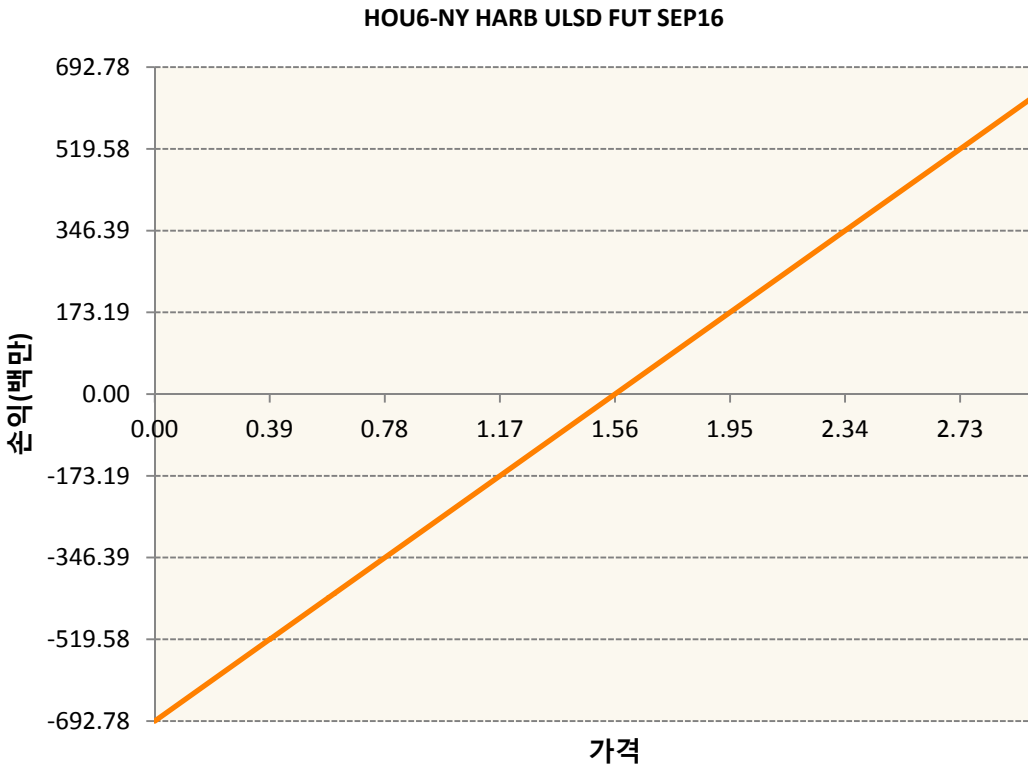
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,608	0	6,608	

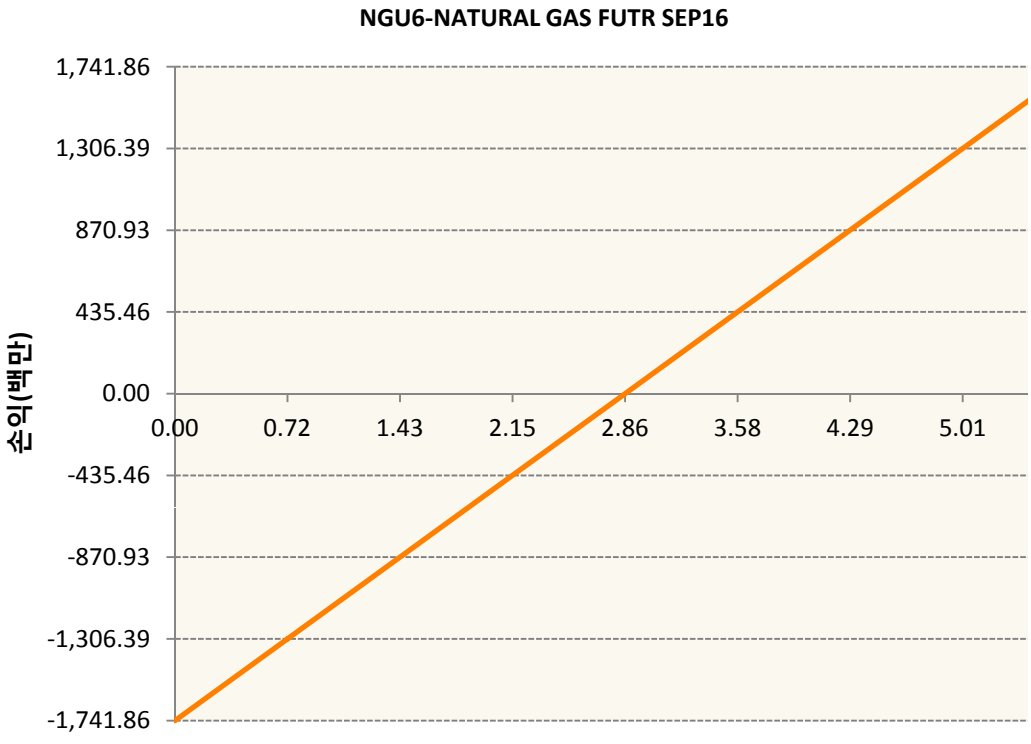
2. 만기시점의 손익구조



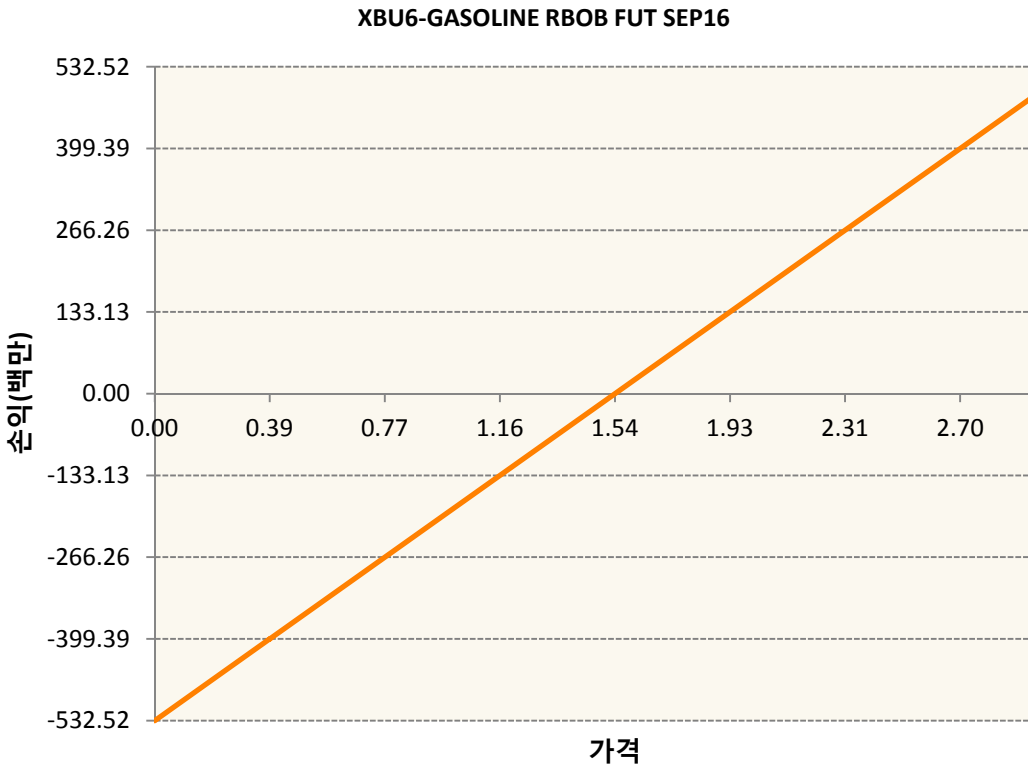



-1,396.00
-1,861.33
가격


HOU6-NY HARB ULSD FUT SEP16
692.78
519.58
346.39
173.19
0.00
-173.19
-346.39
-519.58
-692.78
0.00
0.39
0.78
1.17
1.56
1.95
2.34
2.73
순익(백만)
가격


NGU6-NATURAL GAS FUTR SEP16
1,741.86
1,306.39
870.93
435.46
0.00
-435.46
-870.93
-1,306.39
-1,741.86
0.00
0.72
1.43
2.15
2.86
3.58
4.29
5.01
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLU6	WTI CRUDE FUTURE SEP16	142
COU6	BRENT CRUDE FUTR SEP16	149
HOU6	NY HARB ULSD FUT SEP16	55
NGU6	NATURAL GAS FUTR SEP16	139
XBU6	GASOLINE RBOB FUT SEP16	43

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,481

공시일	2016-07-01
기준일	2016-06-30

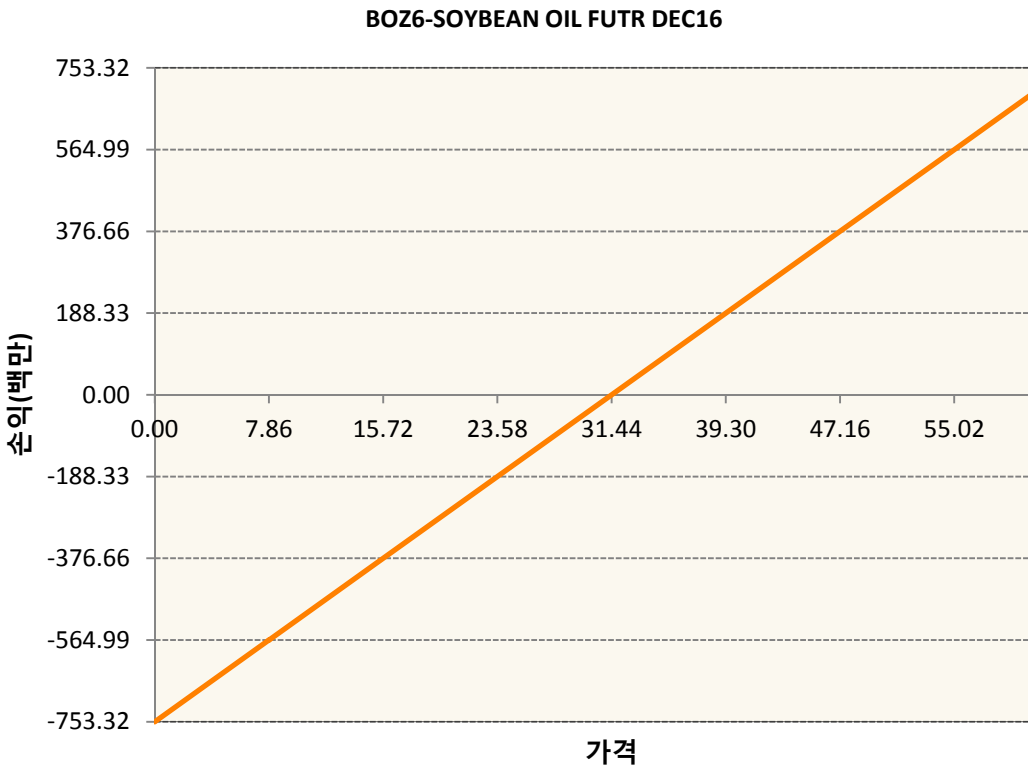
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

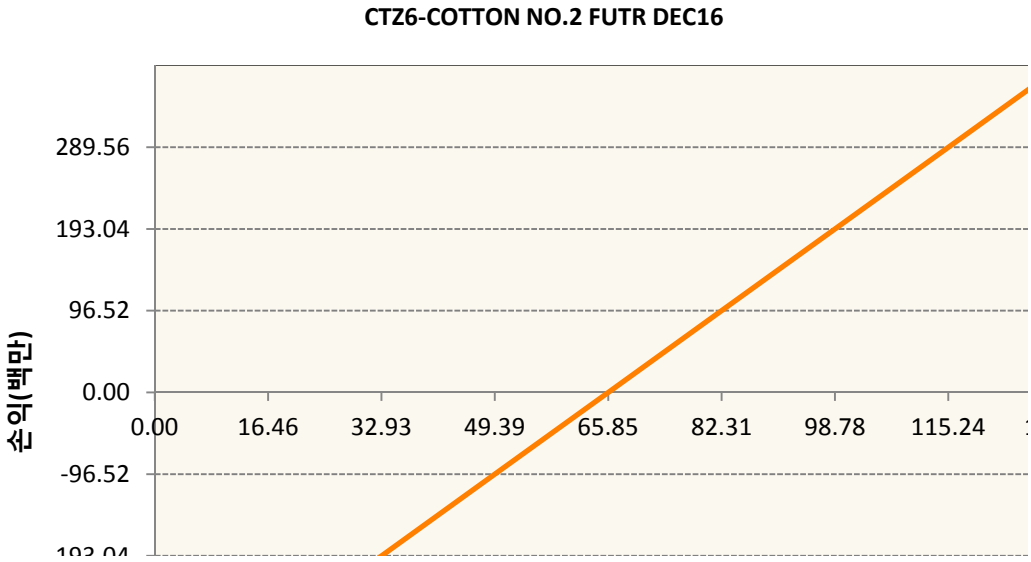
1. 계약금액

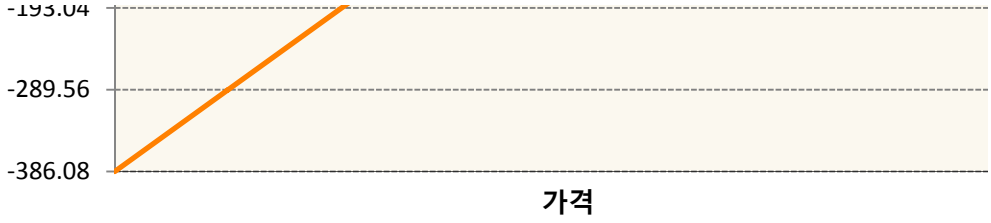
(단위:백만원)

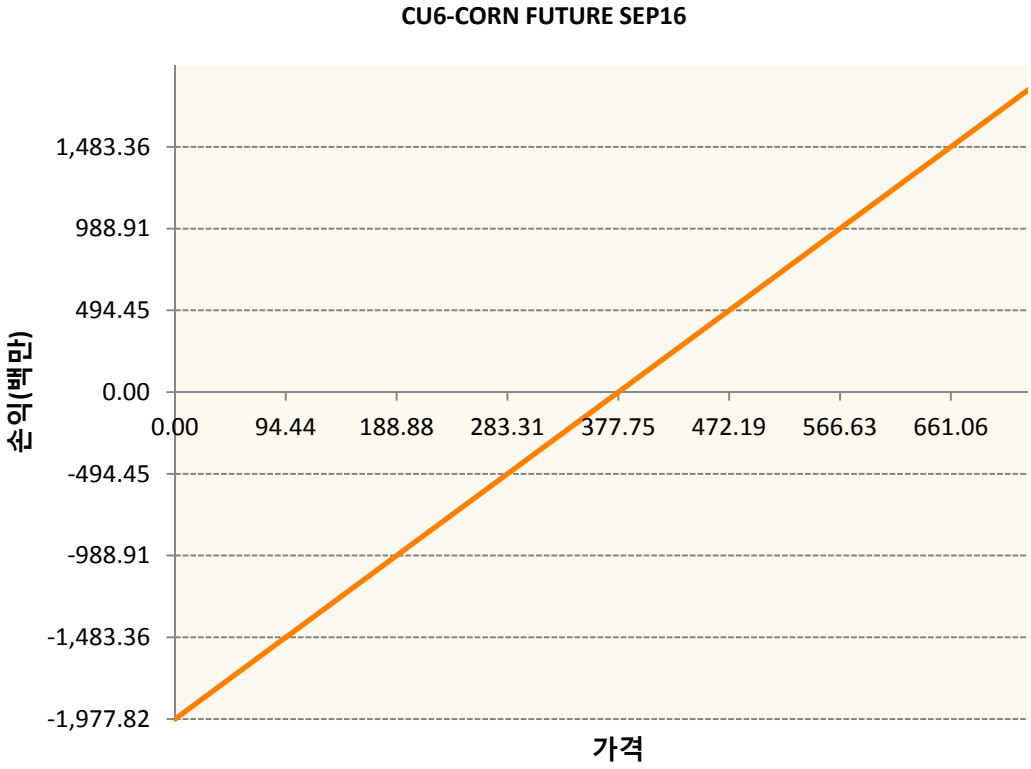
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,955	0	8,955	

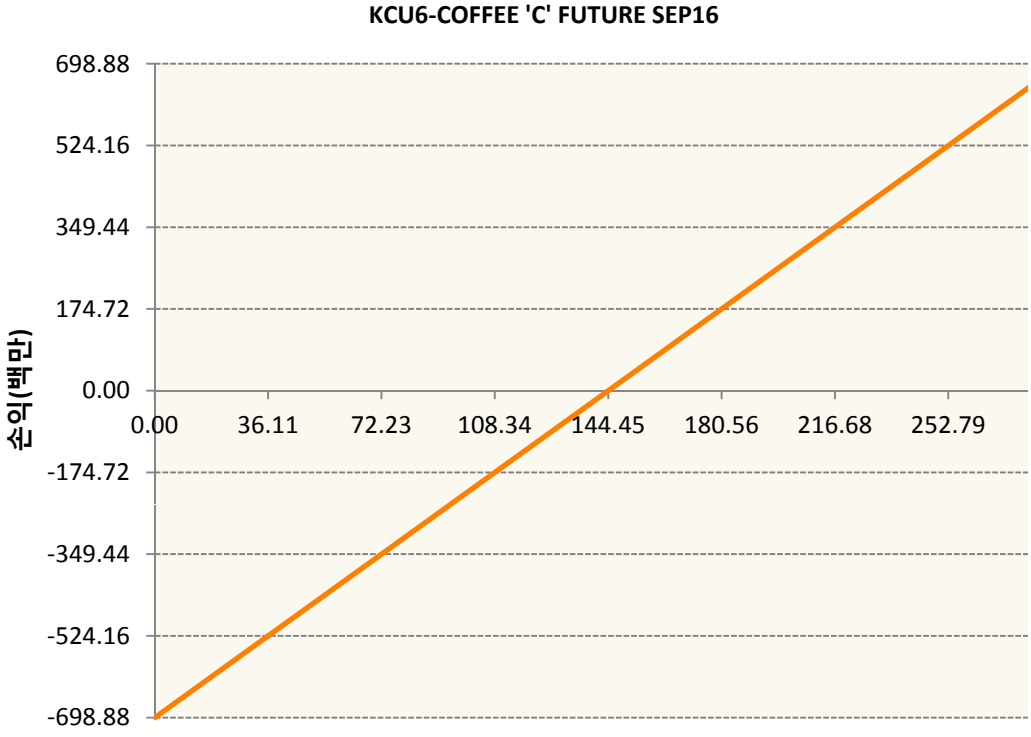
2. 만기시점의 손익구조



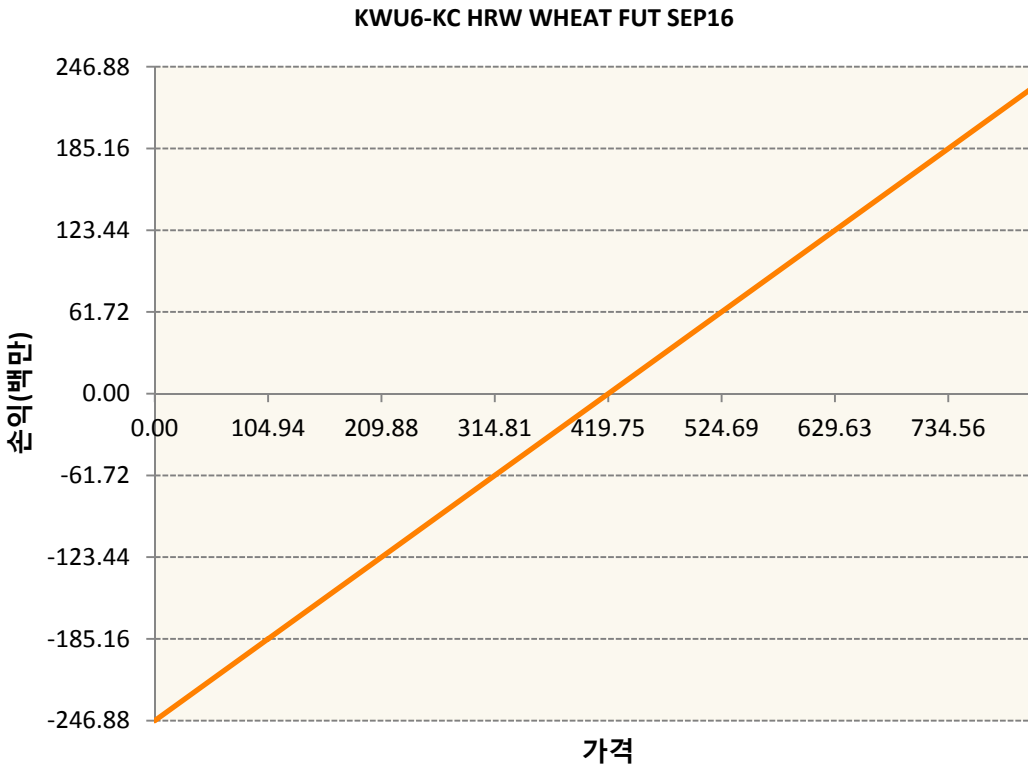


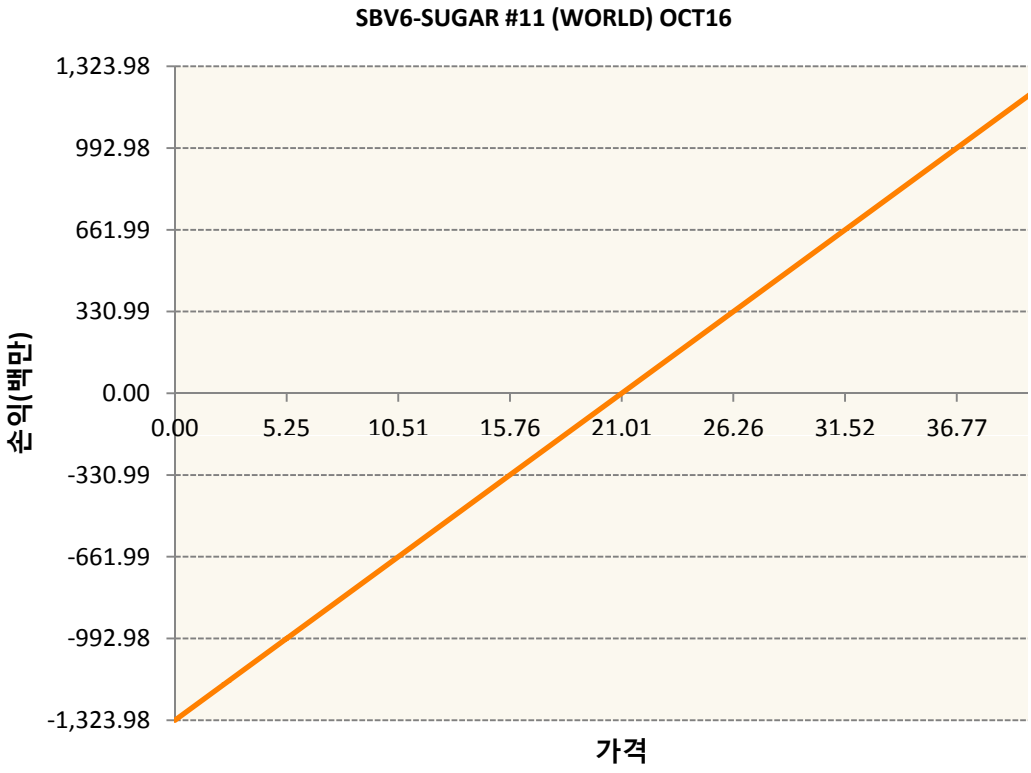

-193.04
-289.56
-386.08
가격

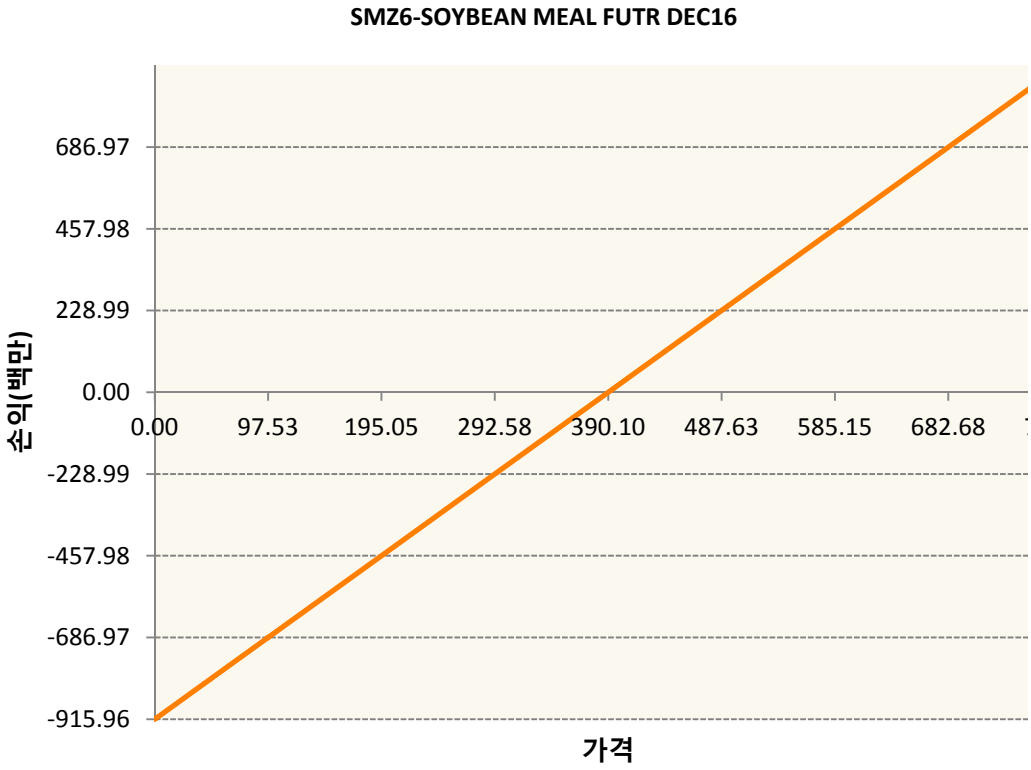

CU6-CORN FUTURE SEP16
1,483.36
988.91
494.45
0.00
-494.45
-988.91
-1,483.36
-1,977.82
0.00
94.44
188.88
283.31
377.75
472.19
566.63
661.06
순익(백만)
가격

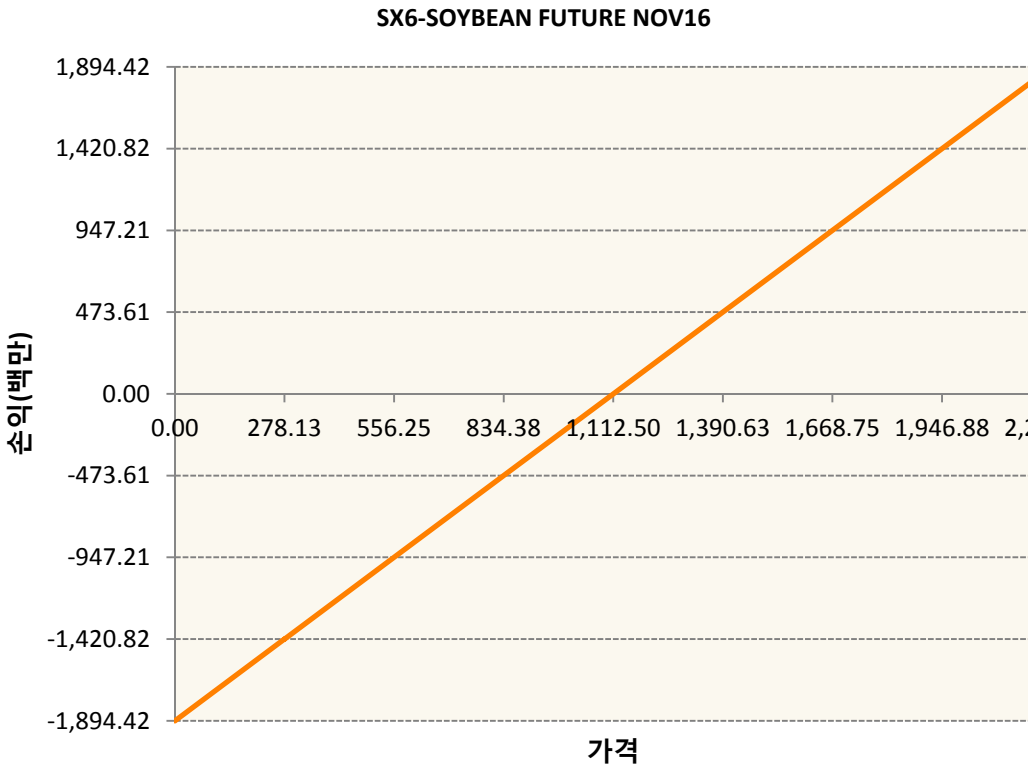

KCU6-COFFEE 'C' FUTURE SEP16
698.88
524.16
349.44
174.72
0.00
-174.72
-349.44
-524.16
-698.88
0.00
36.11
72.23
108.34
144.45
180.56
216.68
252.79
순익(백만)

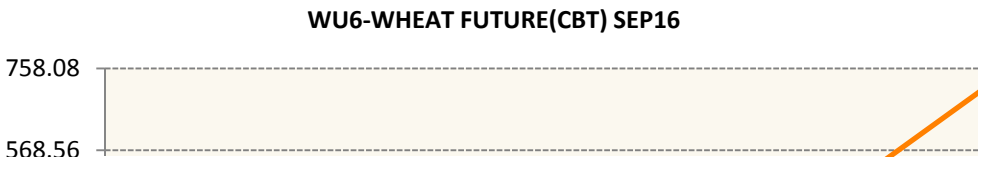
가격

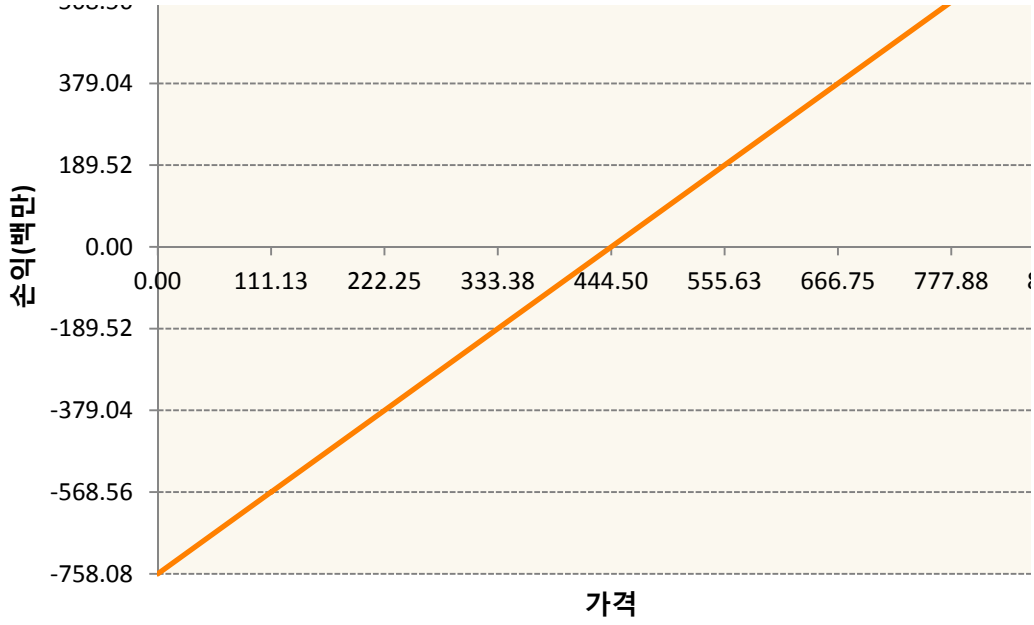

KWU6-KC HRW WHEAT FUT SEP16
246.88
185.16
123.44
61.72
0.00
-61.72
-123.44
-185.16
-246.88
0.00
104.94
209.88
314.81
419.75
524.69
629.63
734.56
손익(백만)
가격


SBV6-SUGAR #11 (WORLD) OCT16
1,323.98
992.98
661.99
330.99
0.00
-330.99
-661.99
-992.98
-1,323.98
0.00
5.25
10.51
15.76
21.01
26.26
31.52
36.77
손익(백만)
가격


SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16
686.97
457.98
228.99
0.00
-228.99
-457.98
-686.97
-915.96
손익(백만)
0.00
97.53
195.05
292.58
390.10
487.63
585.15
682.68
가격


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16
1,894.42
1,420.82
947.21
473.61
0.00
-473.61
-947.21
-1,420.82
-1,894.42
손익(백만)
0.00
278.13
556.25
834.38
1,112.50
1,390.63
1,668.75
1,946.88
가격


WU6-WHEAT FUTURE(CBT) SEP16
758.08
568.56



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ6	SOYBEAN OIL FUTR DEC16	60
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	31
CU6	CORN FUTURE SEP16	158
KCU6	COFFEE 'C' FUTURE SEP16	56
KWU6	KC HRW WHEAT FUT SEP16	20
SBV6	SUGAR #11 (WORLD) OCT16	106
SMZ6	SOYBEAN MEAL FUTR DEC16	73
SX6	SOYBEAN FUTURE NOV16	152
WU6	WHEAT FUTURE(CBT) SEP16	0

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

1,014