공시일	2016-07-06
기준일	2016-07-05

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	2016-07-06
기준일	2016-07-05

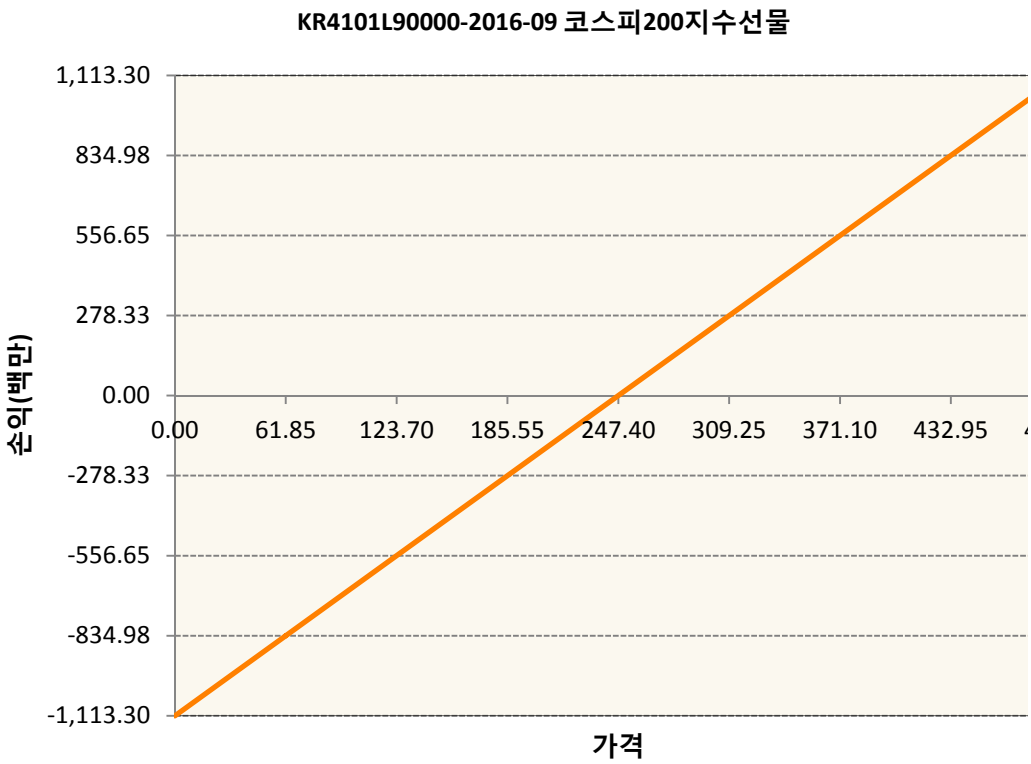
스마트인덱스모

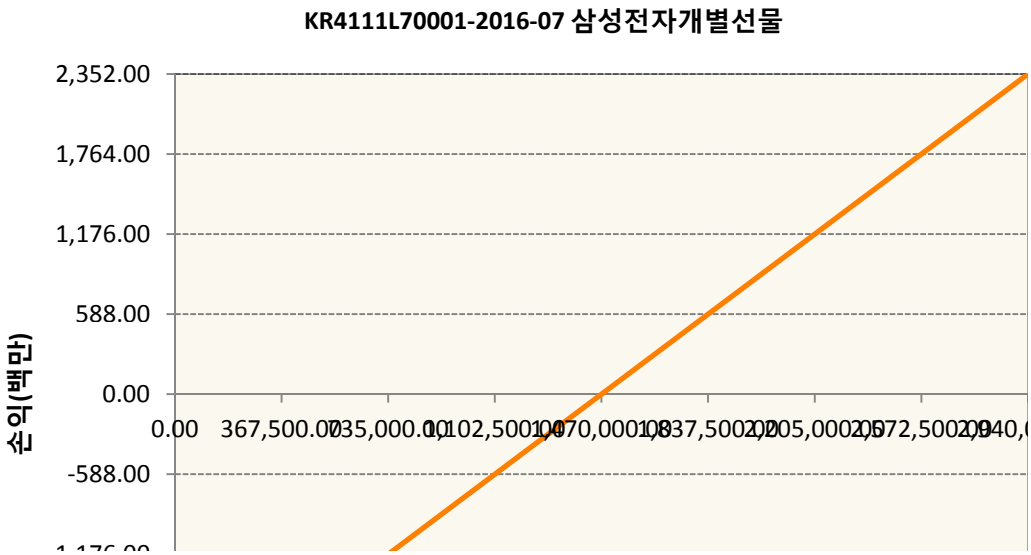
1. 계약금액

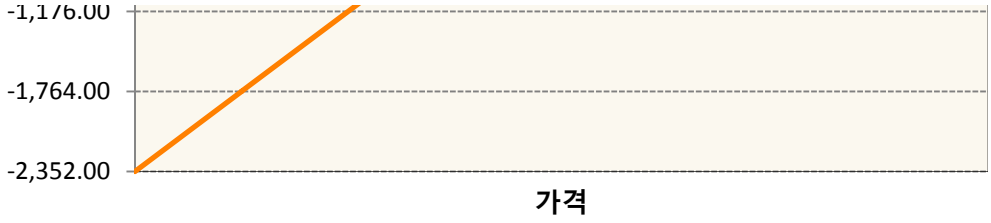
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	44	-44	장내
누계	유가증권	선물	3,465	0	3,465	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						89
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-5.33%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	30	30	30	30	30	30	30
5.33%	59	59	59	59	59	59	59
8.00%	89	89	89	89	89	89	89

KR4111L700	2016-07 삼성전자개별선물						188
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-188	-188	-188	-188	-188	-188	-188
-5.33%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125
-2.67%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	63	63	63	63	63	63	63
5.33%	125	125	125	125	125	125	125
8.00%	188	188	188	188	188	188	188

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

258

공시일	2016-07-06
기준일	2016-07-05

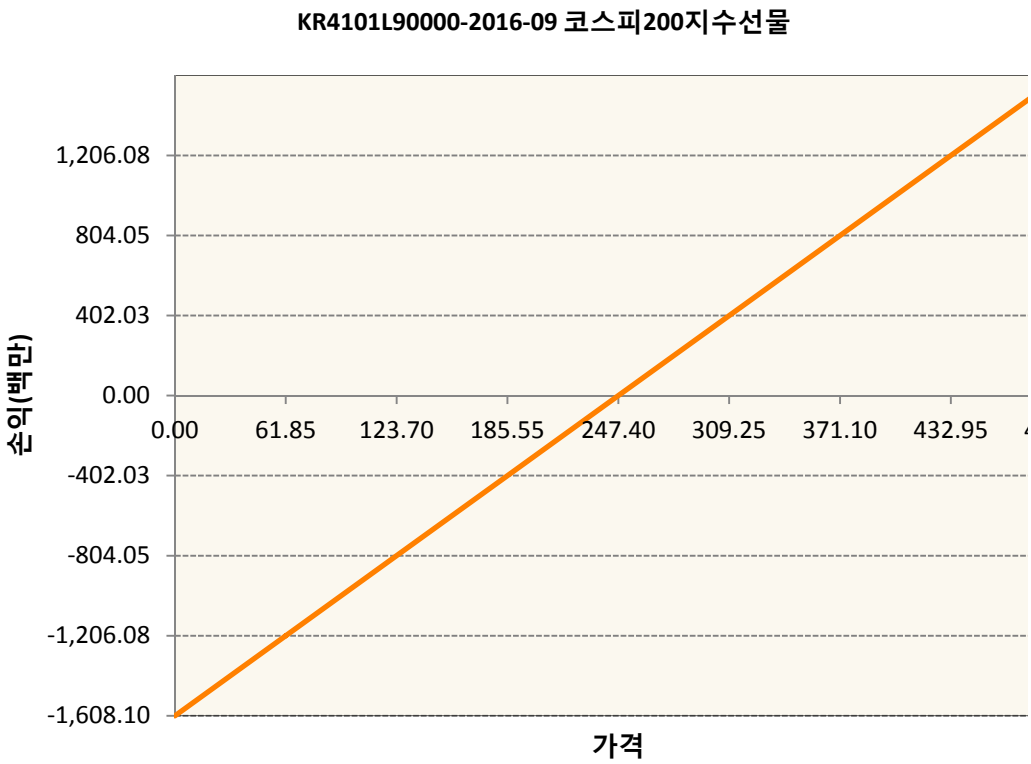
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,608	0	1,608	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						128
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
-5.33%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
-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%	86	86	86	86	86	86	86
8.00%	128	128	128	128	128	128	128

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

107

공시일	2016-07-06
기준일	2016-07-05

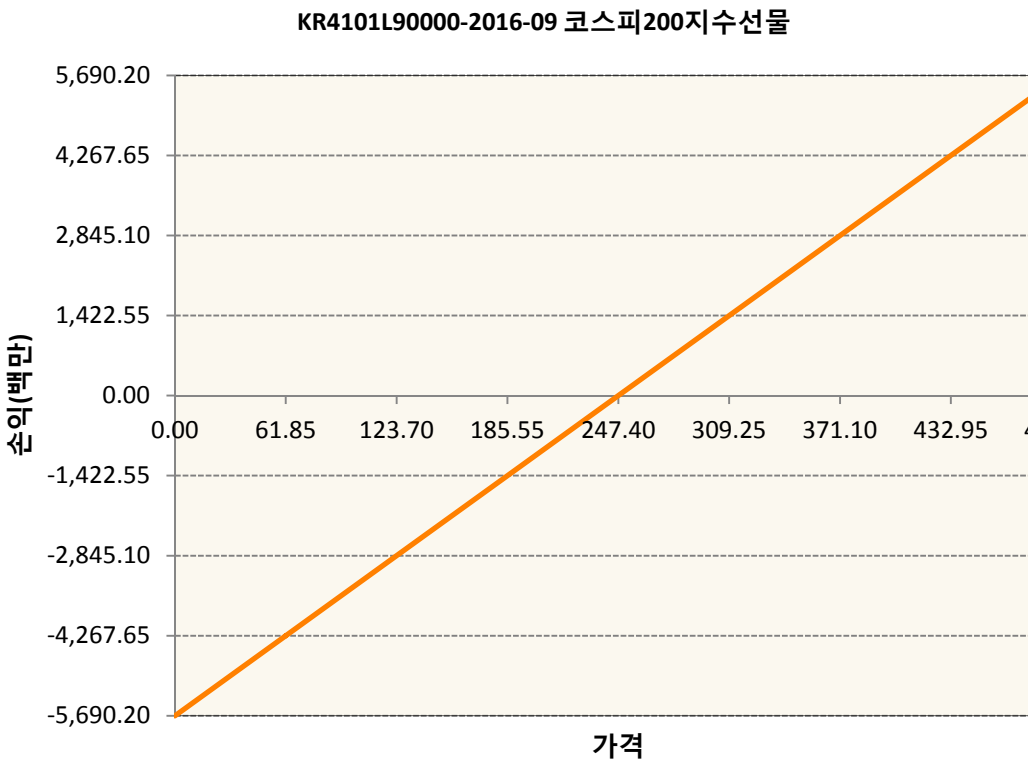
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	5,690	0	5,690	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						454
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-454	-454	-454	-454	-454	-454	-454
-5.33%	-303	-303	-303	-303	-303	-303	-303
-2.67%	-151	-151	-151	-151	-151	-151	-151
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	151	151	151	151	151	151	151
5.33%	303	303	303	303	303	303	303
8.00%	454	454	454	454	454	454	454

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

377

공시일	2016-07-06
기준일	2016-07-05

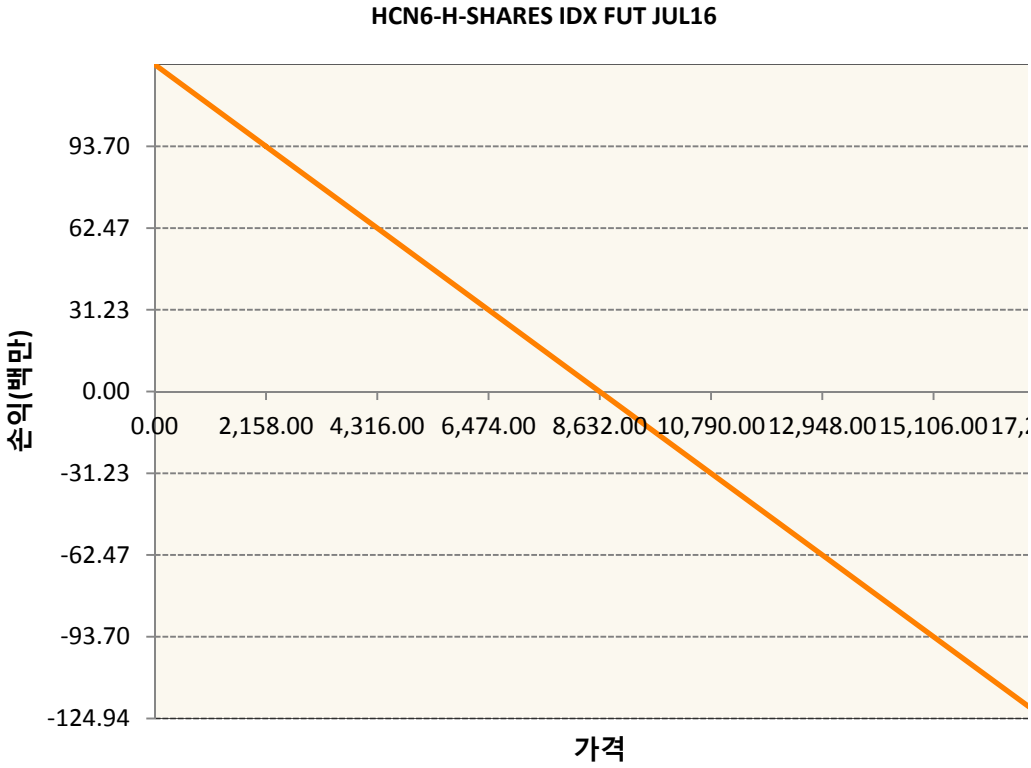
아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

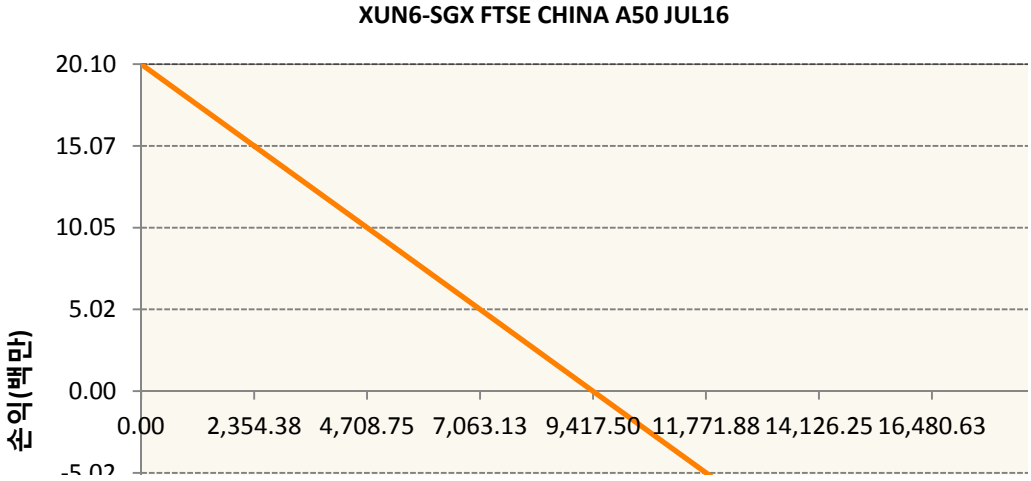
1. 계약금액

(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	20	-20	
누계	유가증권	선물	0	125	-125	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCN6	H-SHARES IDX FUT JUL16	10
XUN6	SGX FTSE CHINA A50 JUL16	2

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	17

공시일	2016-07-06
기준일	2016-07-05

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	853

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

793

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-07-06
기준일	2016-07-05

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	394

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,084

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-07-06
기준일	2016-07-05

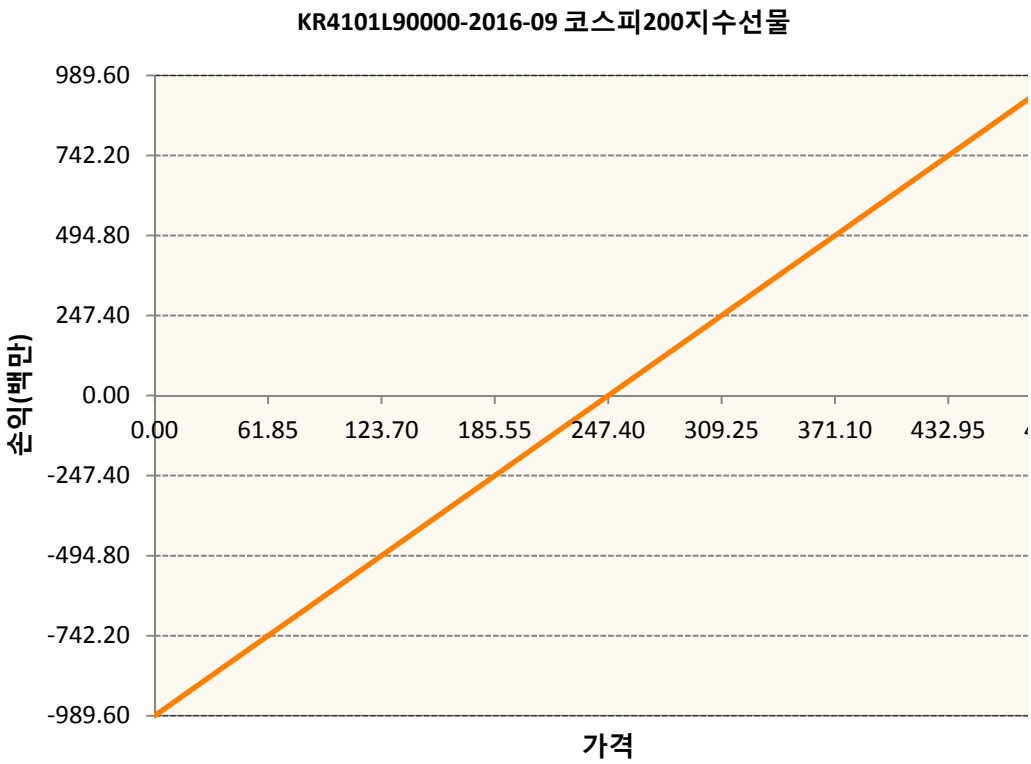
KOSPI200 레버리지 목표전환형 3

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	990	0	990	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						79
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-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%	53	53	53	53	53	53	53
8.00%	79	79	79	79	79	79	79

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

66

공시일	2016-07-06
기준일	2016-07-05

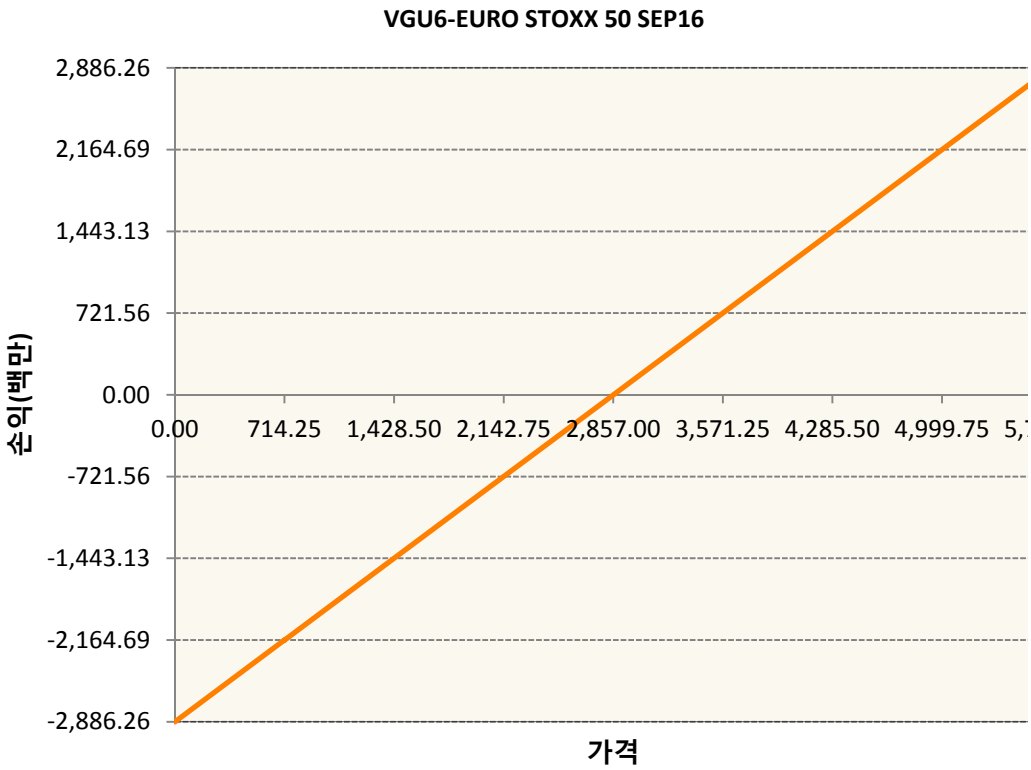
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,886	0	2,886	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 SEP16	231

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

(단위:백만원)

284

공시일	2016-07-06
기준일	2016-07-05

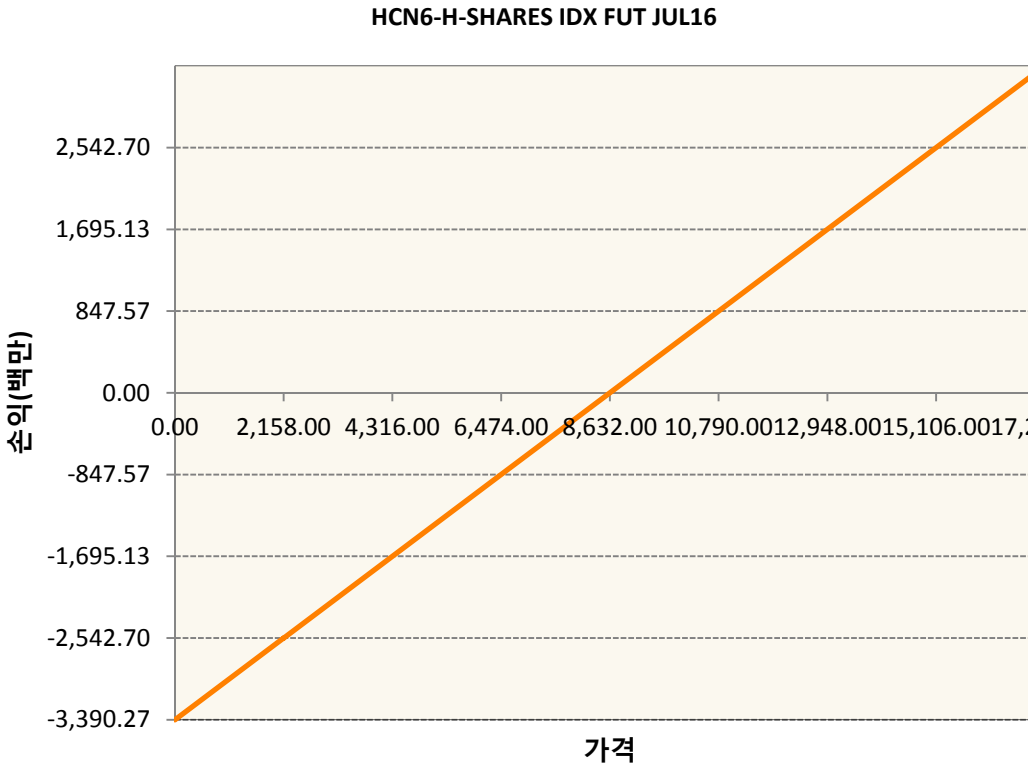
차이나인덱스모(주식-파생형)

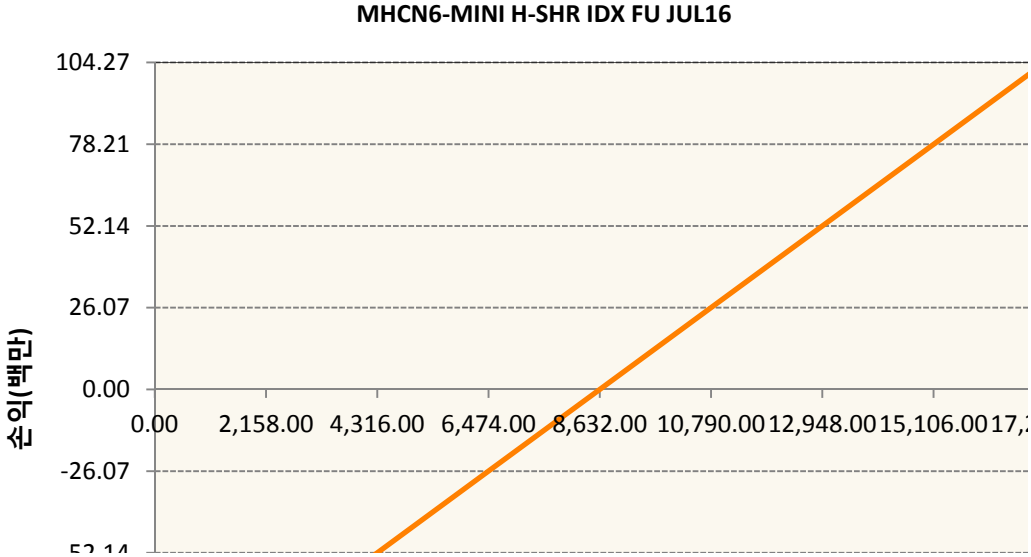
1. 계약금액

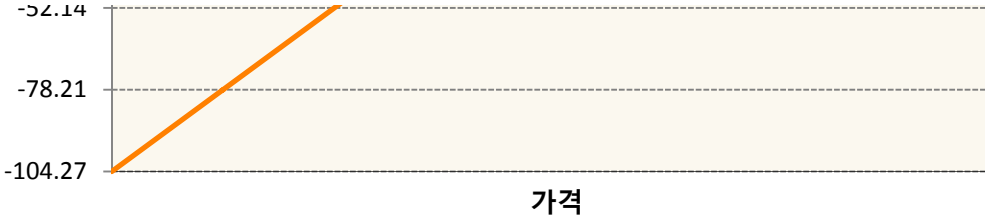
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,495	0	3,495	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCN6	H-SHARES IDX FUT JUL16	271
MHCN6	MINI H-SHR IDX FU JUL16	8

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	397

공시일	2016-07-06
기준일	2016-07-05

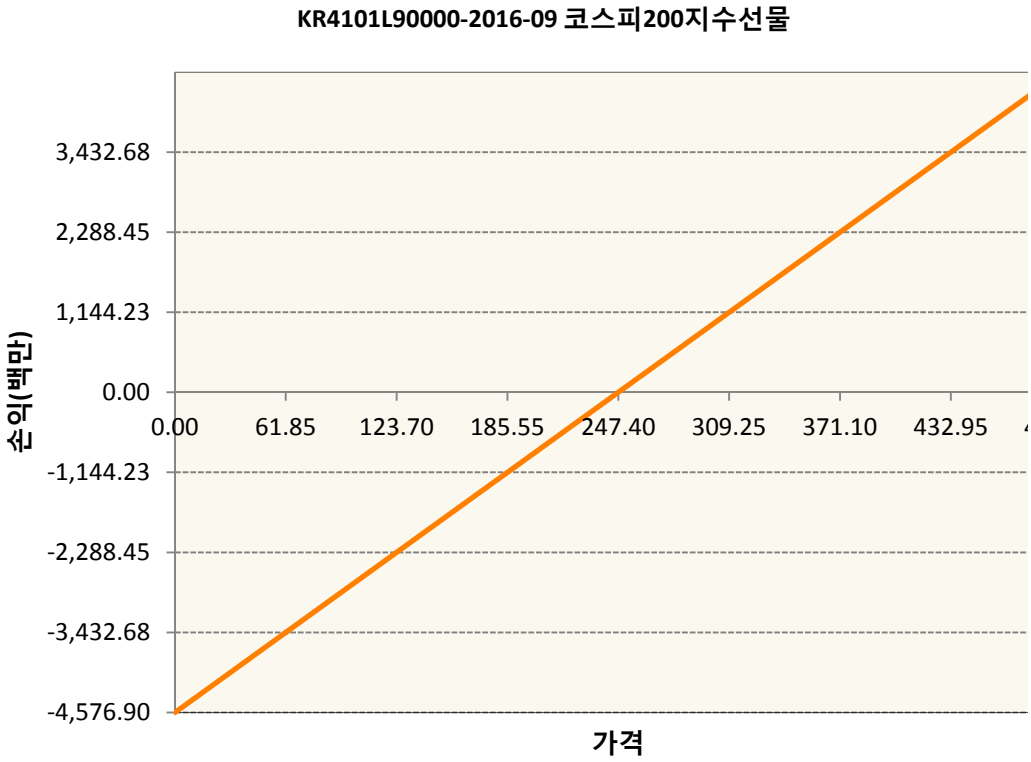
커버드콜(주식혼합-파생형)

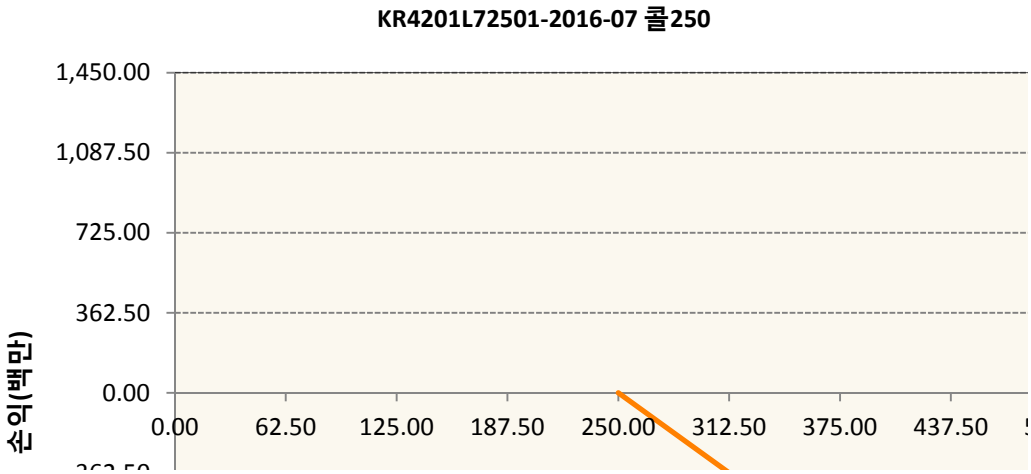
1. 계약금액

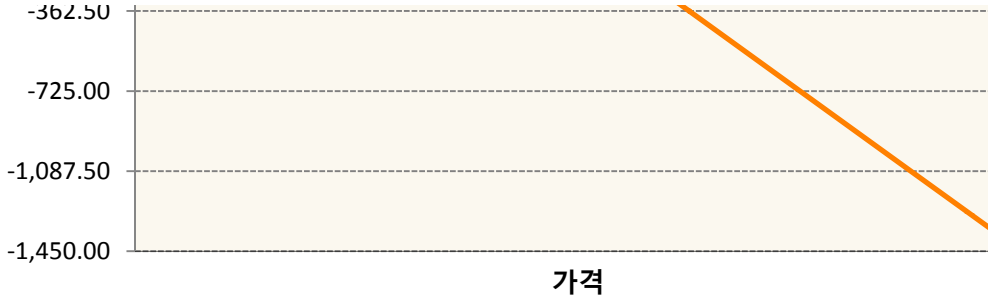
(단위:백만원)

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	4,577	0	4,577	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,450	-1,450	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						365
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-365	-365	-365	-365	-365	-365	-365
-5.33%	-244	-244	-244	-244	-244	-244	-244
-2.67%	-122	-122	-122	-122	-122	-122	-122
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	122	122	122	122	122	122	122
5.33%	244	244	244	244	244	244	244
8.00%	365	365	365	365	365	365	365
KR4201L725	2016-07 콜250						460
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	23	23	23	23	23	23	23
-5.33%	23	23	23	23	23	23	23
-2.67%	23	23	22	22	21	20	19
0%	11	7	4	0	-4	-8	-12
2.67%	-88	-91	-95	-99	-102	-106	-111
5.33%	-269	-269	-269	-270	-271	-272	-273
8.00%	-460	-460	-460	-460	-460	-460	-460

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

828

공시일	2016-07-06
기준일	2016-07-05

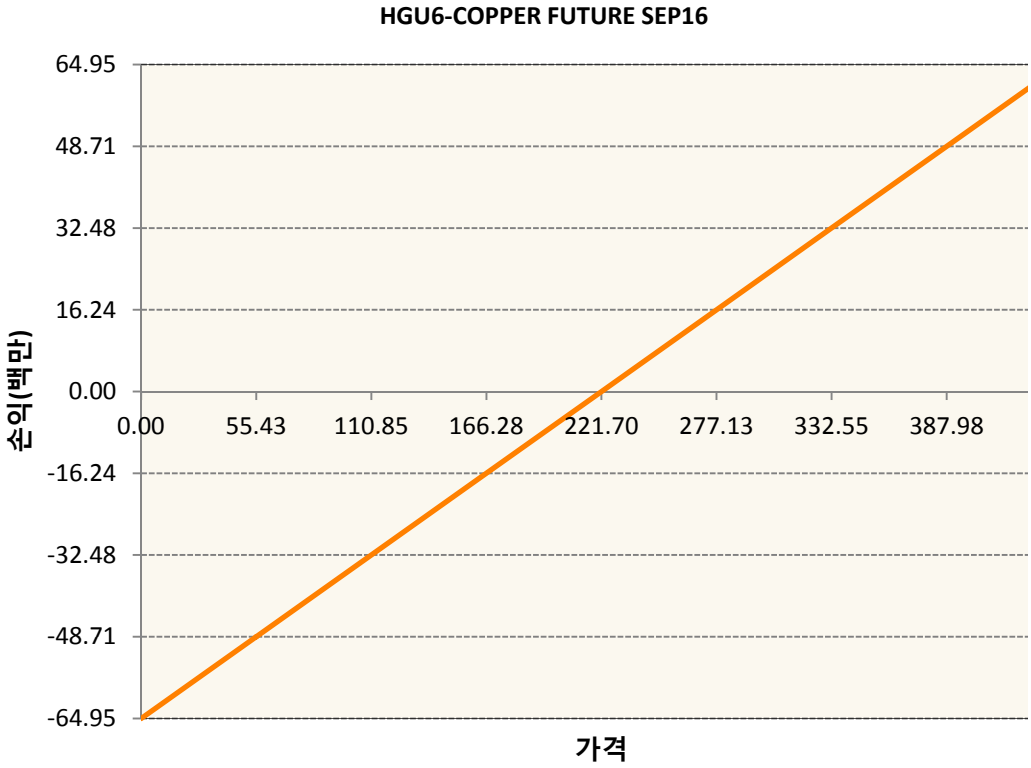
메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

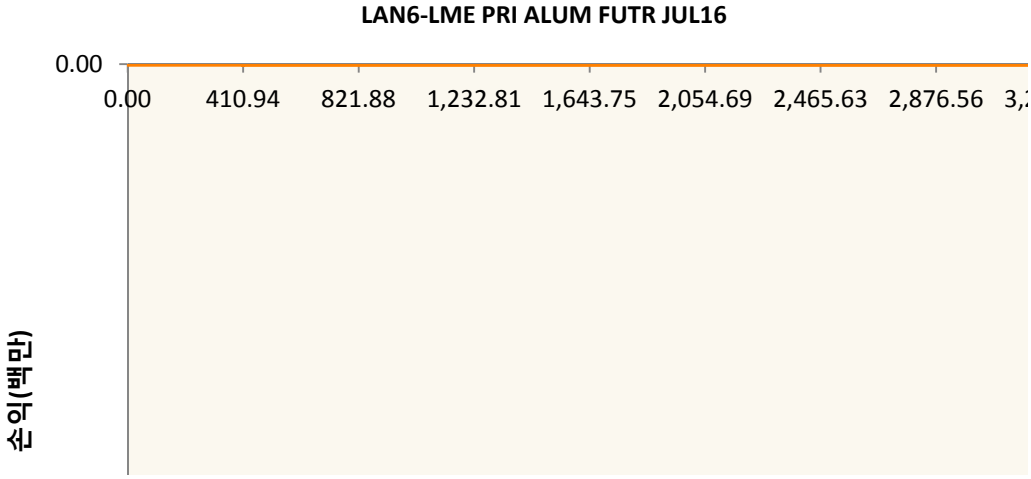
1. 계약금액

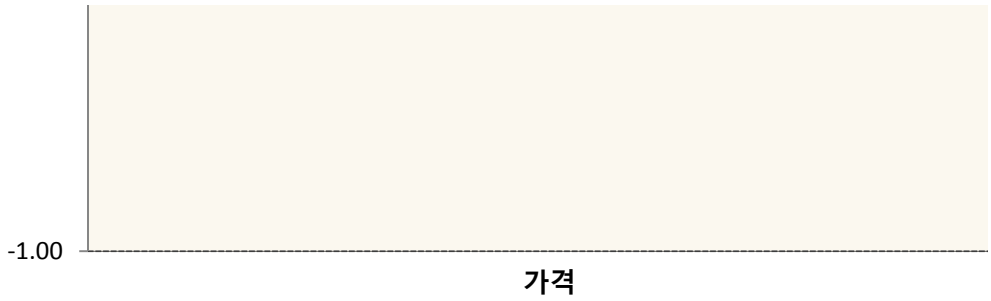
(단위:백만원)

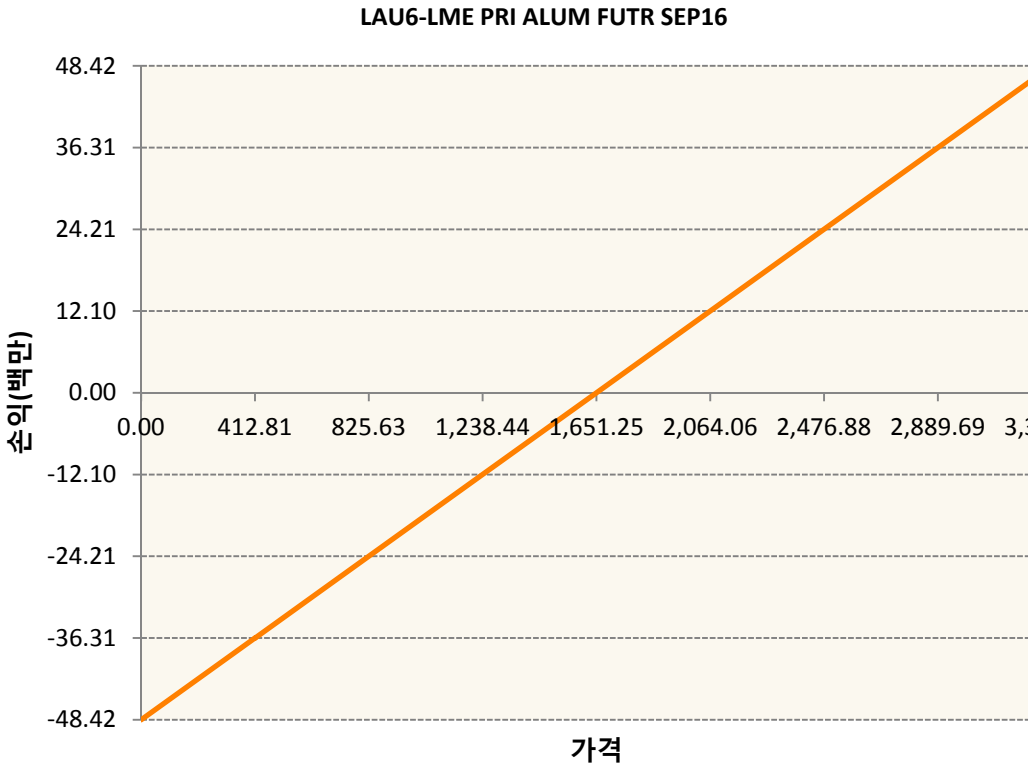
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	69	0	69	
누계	유가증권	선물	434	102	332	

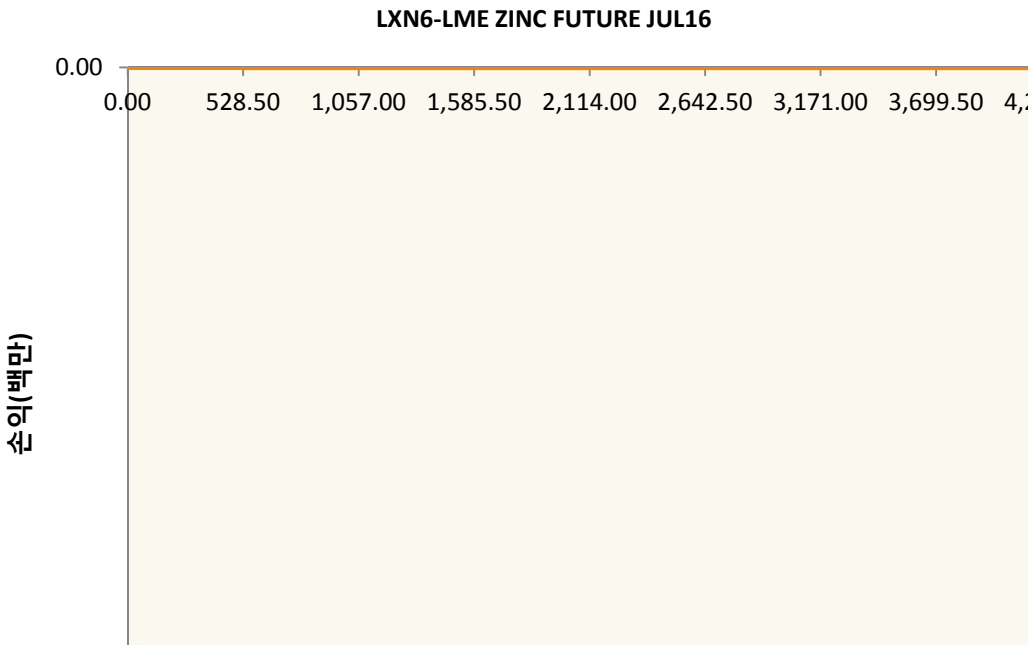
2. 만기시점의 손익구조

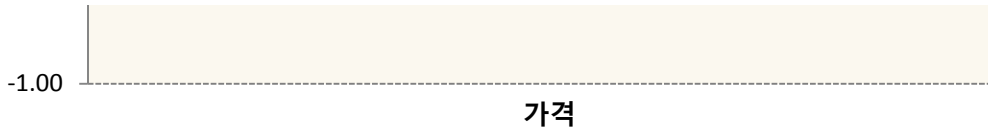


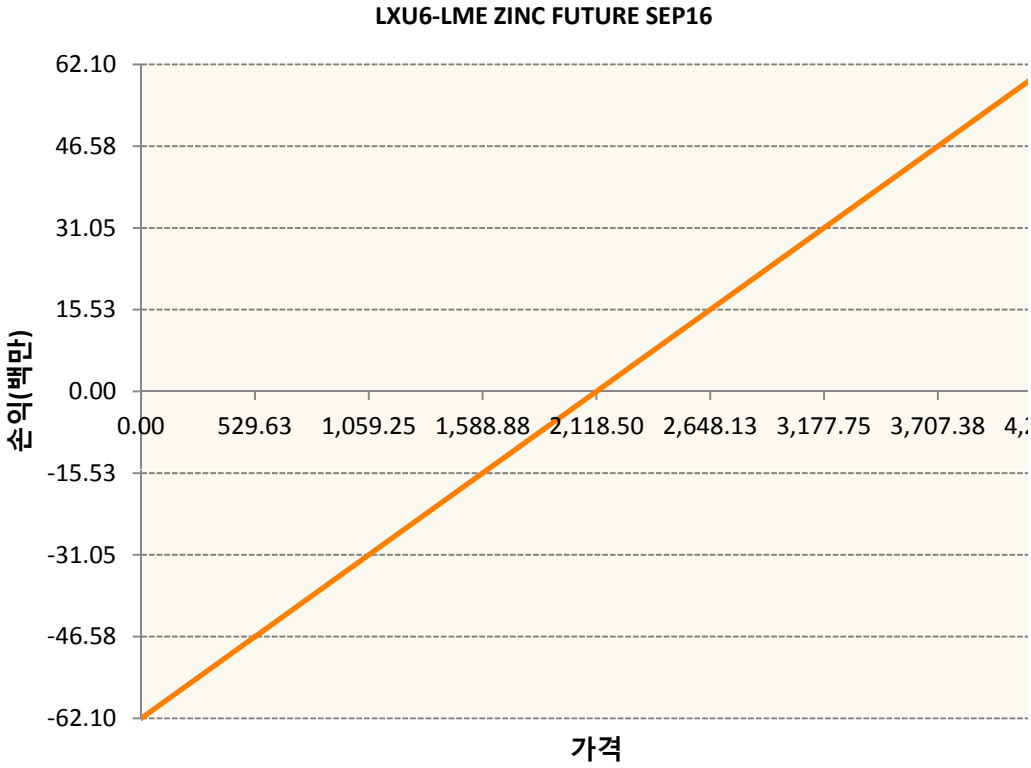


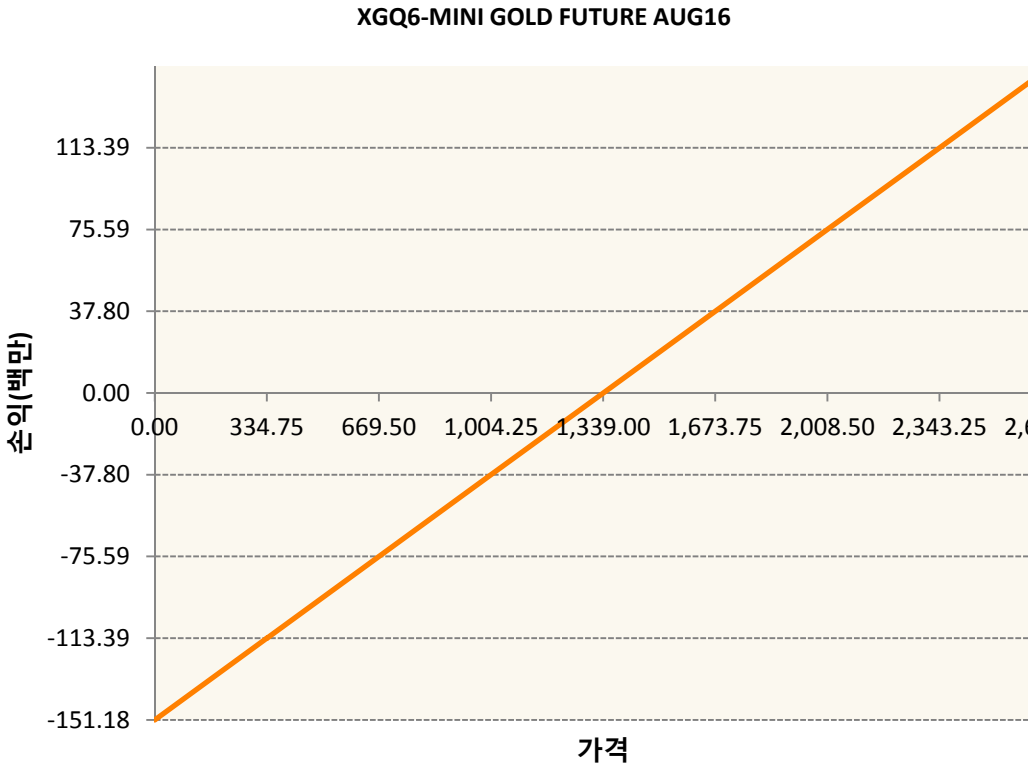

-1.00
가격

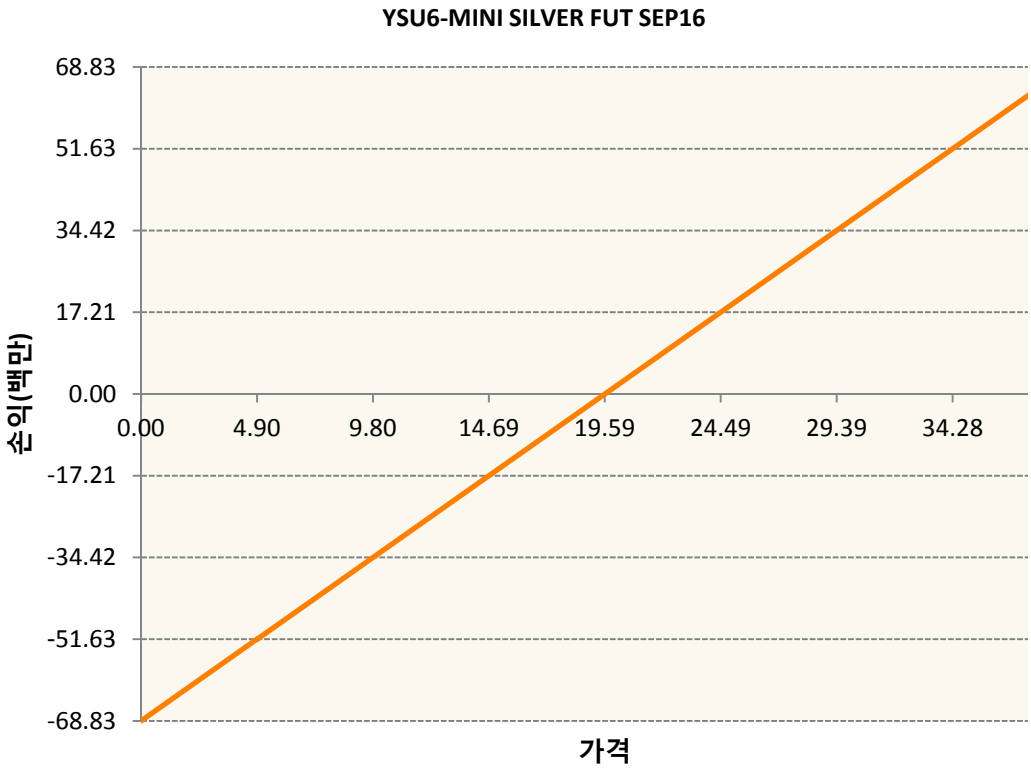

LAU6-LME PRI ALUM FUTR SEP16
48.42
36.31
24.21
12.10
0.00
-12.10
-24.21
-36.31
-48.42
0.00
412.81
825.63
1,238.44
1,651.25
2,064.06
2,476.88
2,889.69
순익(백만)
가격


LXN6-LME ZINC FUTURE JUL16
0.00
0.00
528.50
1,057.00
1,585.50
2,114.00
2,642.50
3,171.00
3,699.50
순익(백만)


-1.00
가격


LXU6-LME ZINC FUTURE SEP16
62.10
46.58
31.05
15.53
0.00
-15.53
-31.05
-46.58
-62.10
0.00
529.63
1,059.25
1,588.88
2,118.50
2,648.13
3,177.75
3,707.38
순익(백만)
가격


XGQ6-MINI GOLD FUTURE AUG16
113.39
75.59
37.80
0.00
-37.80
-75.59
-113.39
-151.18
0.00
334.75
669.50
1,004.25
1,339.00
1,673.75
2,008.50
2,343.25
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	0.3
LXU6	LME ZINC FUTURE SEP16	5
XGQ6	MINI GOLD FUTURE AUG16	12
YSU6	MINI SILVER FUT SEP16	6

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	33

공시일	2016-07-06
기준일	2016-07-05

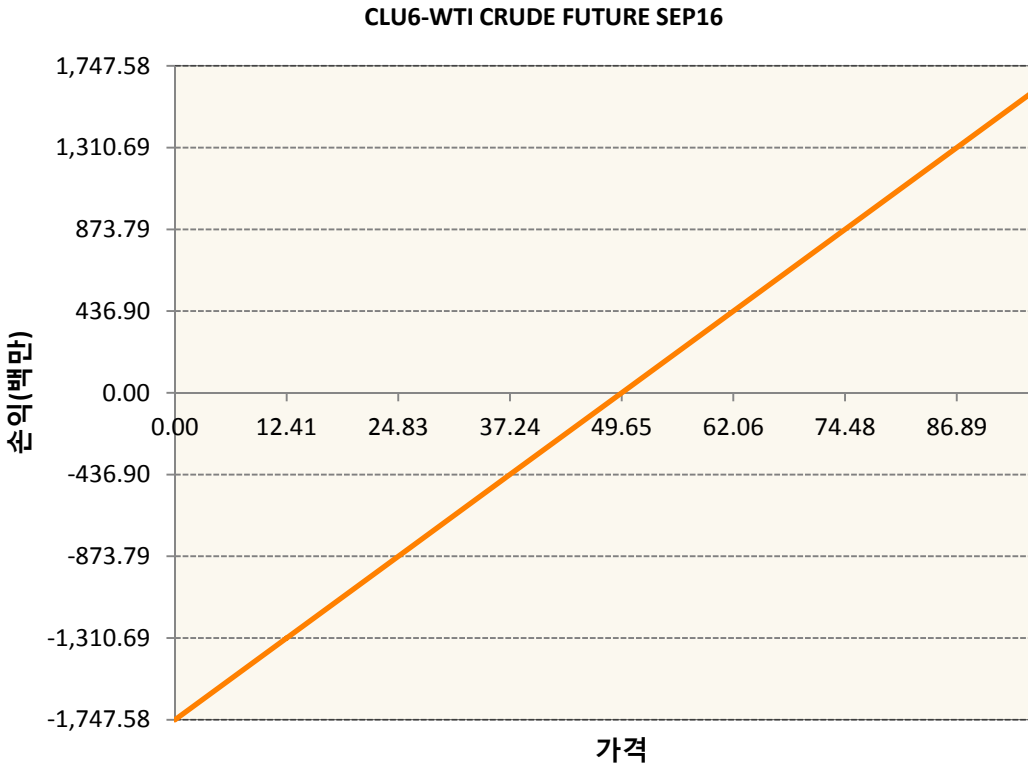
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

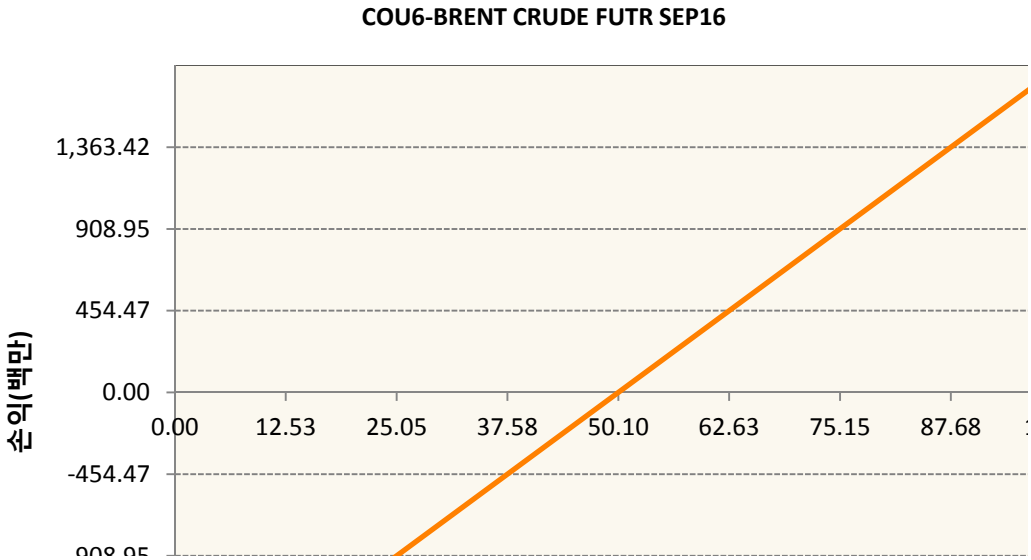
1. 계약금액

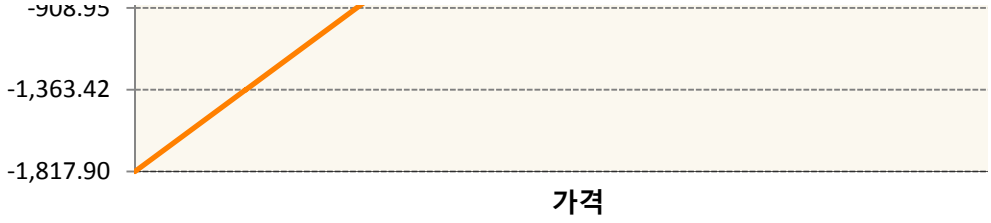
(단위:백만원)

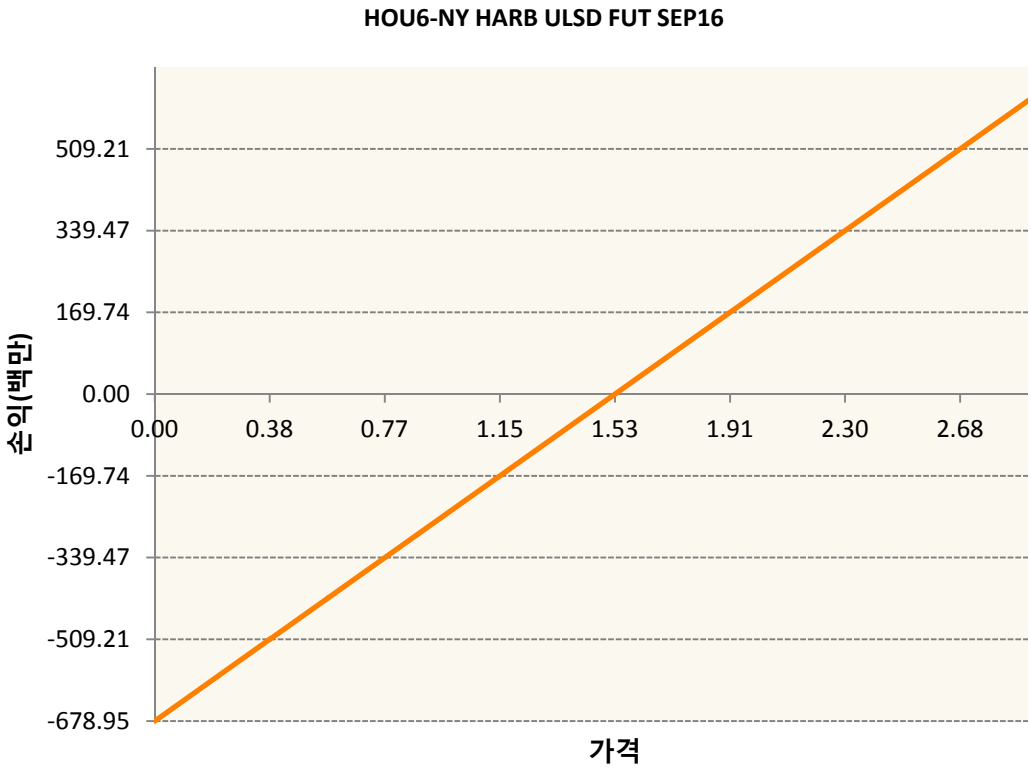
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,585	0	6,585	

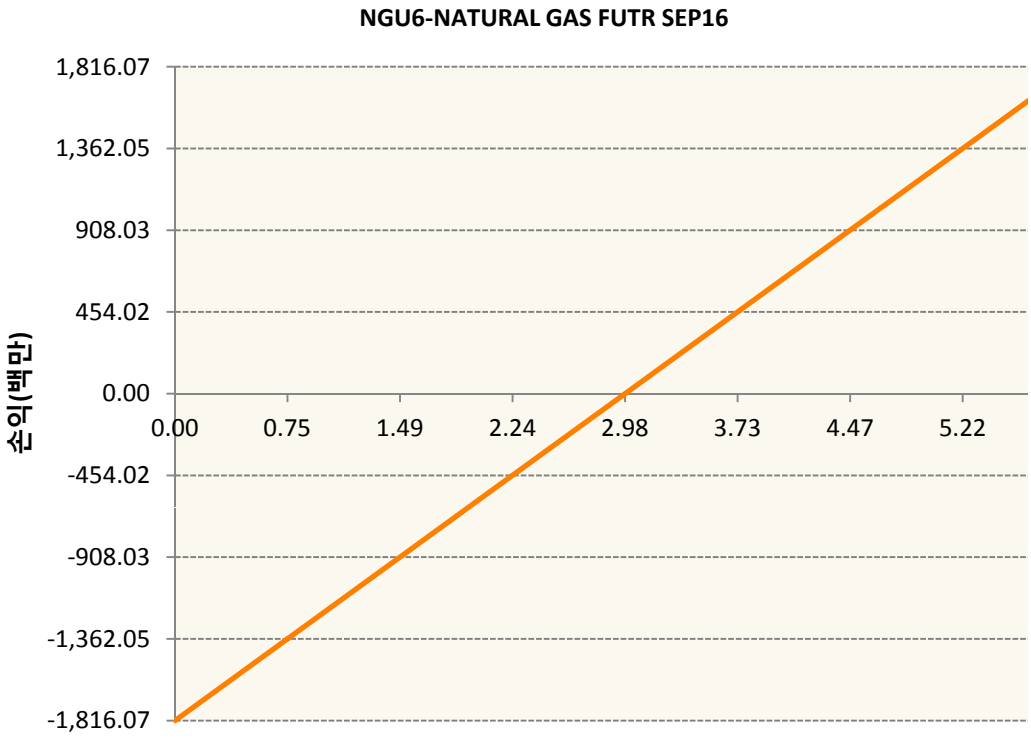
2. 만기시점의 손익구조



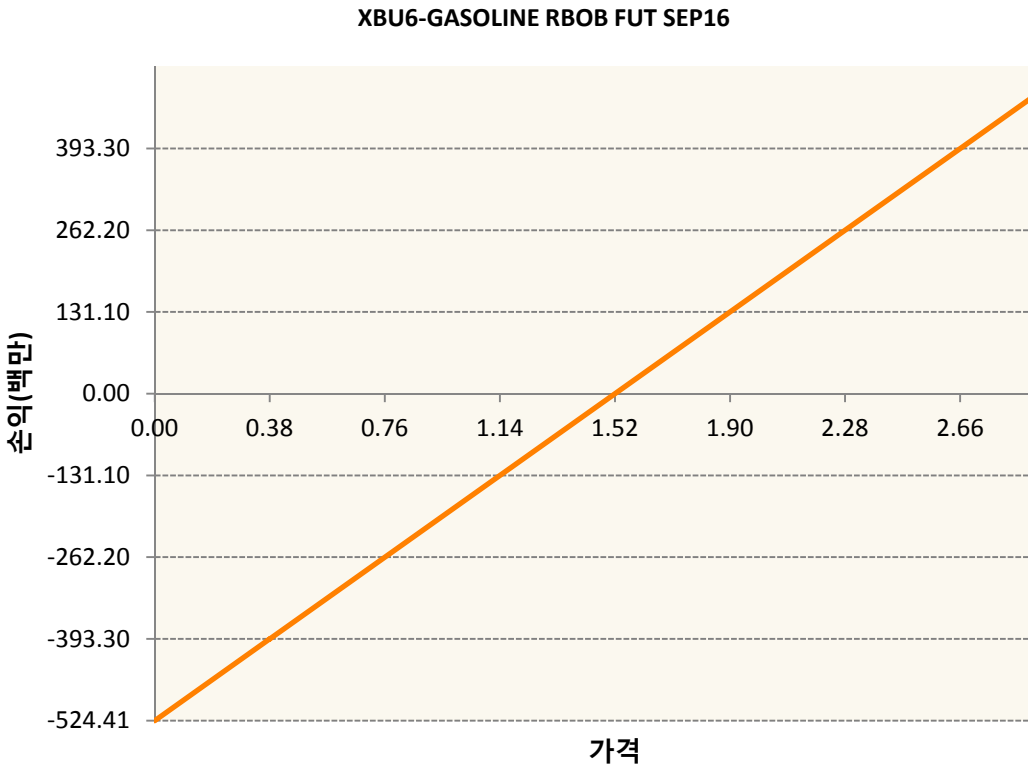



-1,363.42
-1,817.90
가격


HOU6-NY HARB ULSD FUT SEP16
509.21
339.47
169.74
0.00
-169.74
-339.47
-509.21
-678.95
0.00
0.38
0.77
1.15
1.53
1.91
2.30
2.68
순익(백만)
가격


NGU6-NATURAL GAS FUTR SEP16
1,816.07
1,362.05
908.03
454.02
0.00
-454.02
-908.03
-1,362.05
-1,816.07
0.00
0.75
1.49
2.24
2.98
3.73
4.47
5.22
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLU6	WTI CRUDE FUTURE SEP16	140
COU6	BRENT CRUDE FUTR SEP16	145
HOU6	NY HARB ULSD FUT SEP16	54
NGU6	NATURAL GAS FUTR SEP16	145
XBU6	GASOLINE RBOB FUT SEP16	42

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,473

공시일	2016-07-06
기준일	2016-07-05

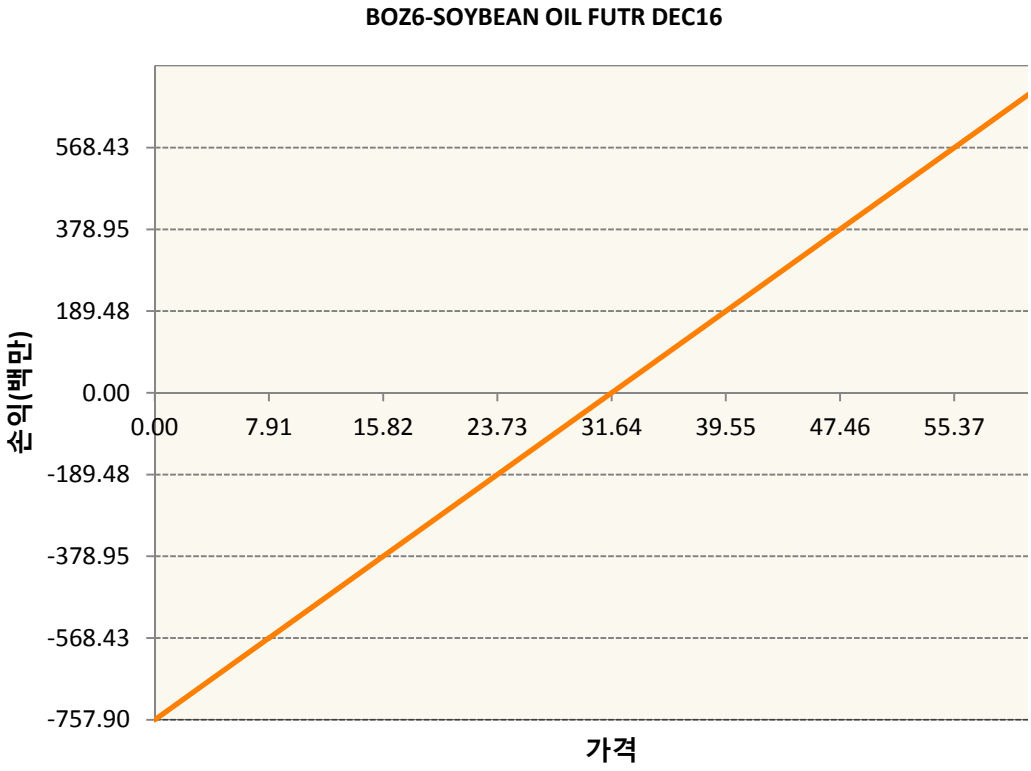
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

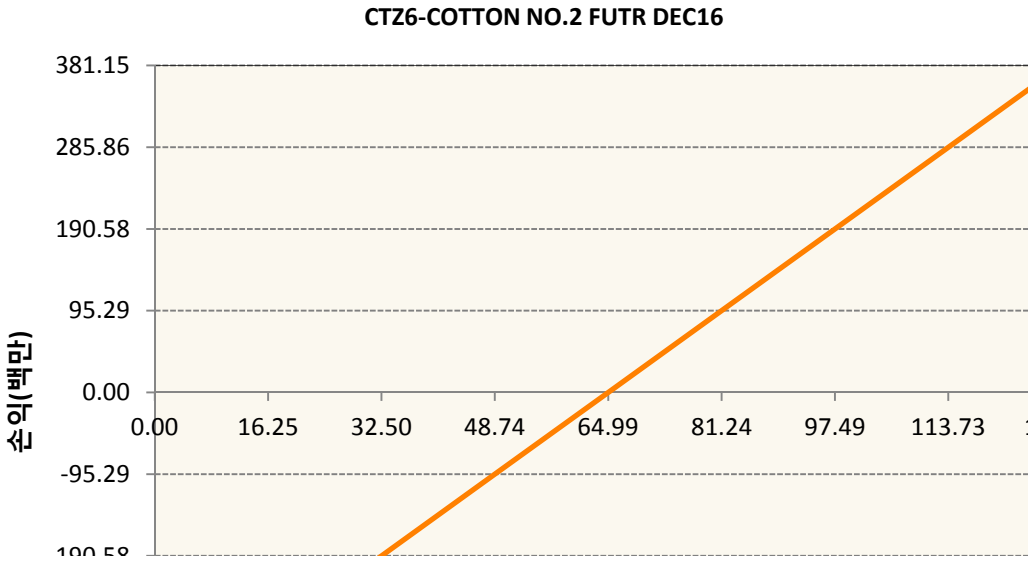
1. 계약금액

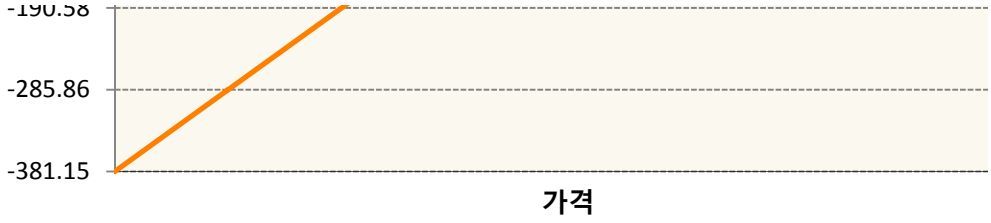
(단위:백만원)

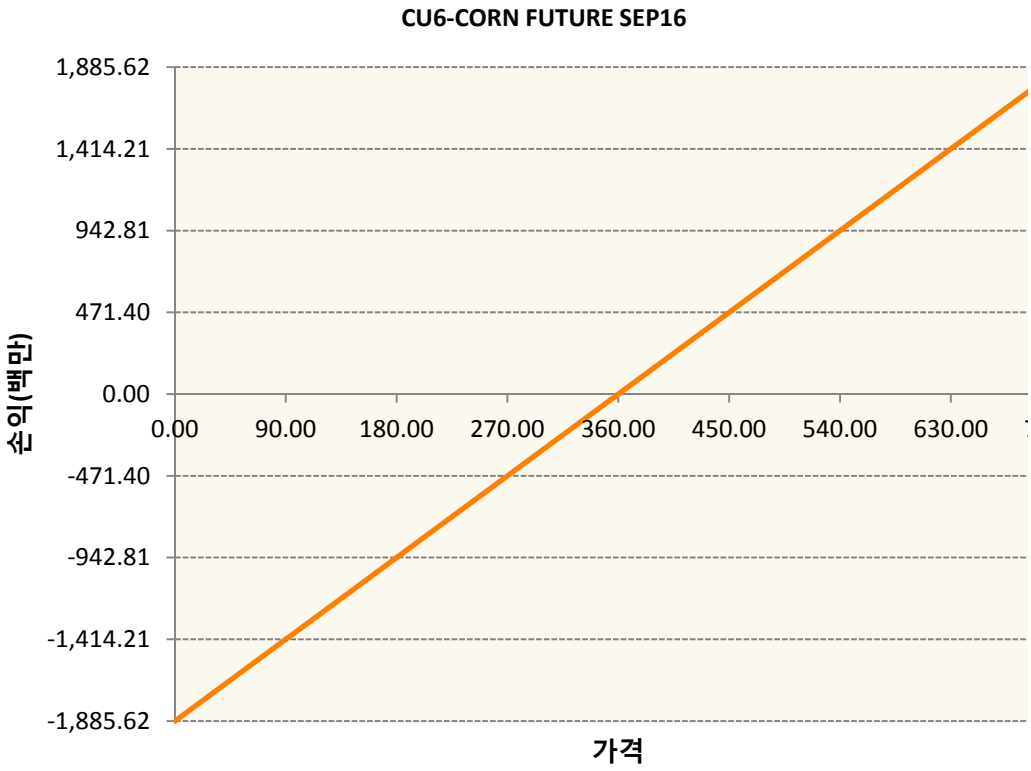
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,889	0	8,889	

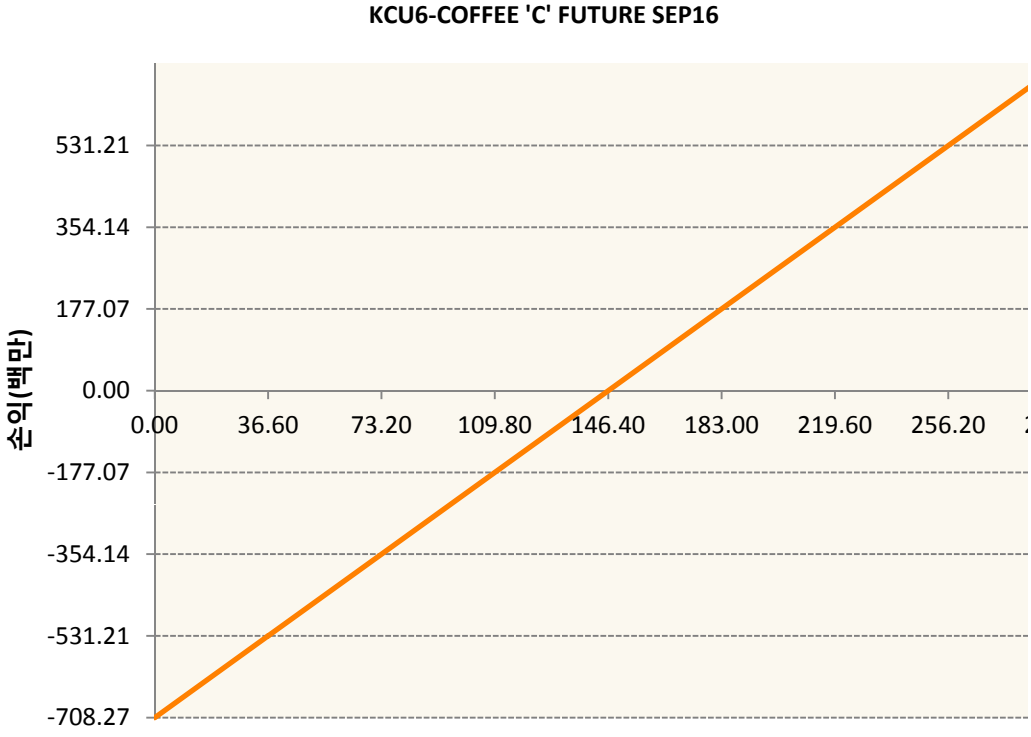
2. 만기시점의 손익구조





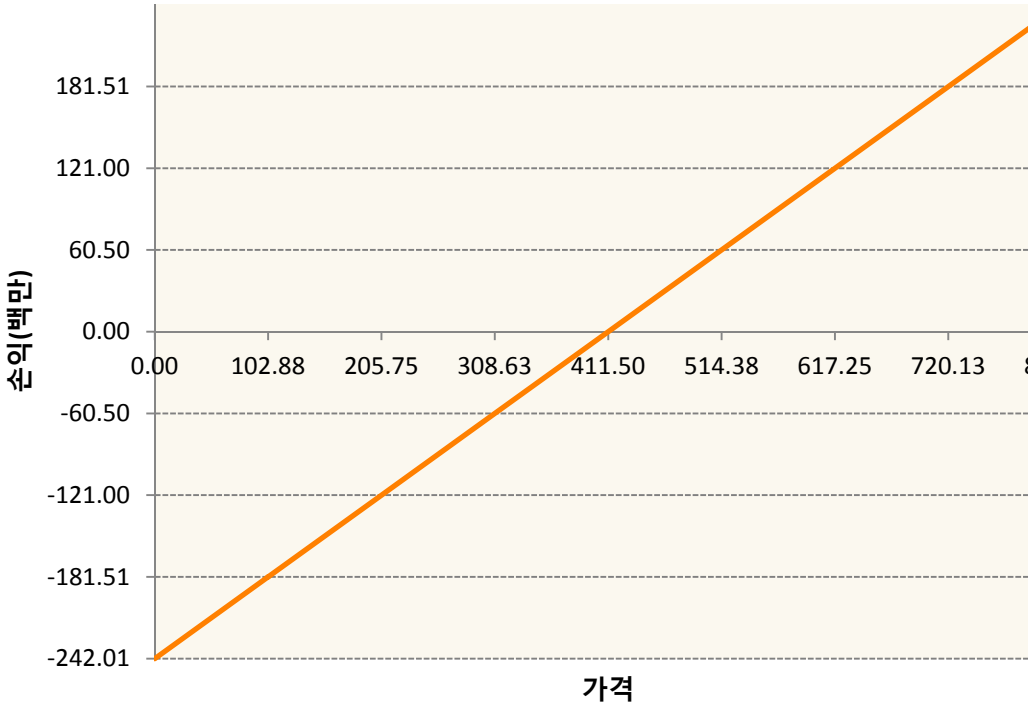

-190.58
-285.86
-381.15
가격


CU6-CORN FUTURE SEP16
1,885.62
1,414.21
942.81
471.40
0.00
-471.40
-942.81
-1,414.21
-1,885.62
0.00
90.00
180.00
270.00
360.00
450.00
540.00
630.00
순익(백만)
가격

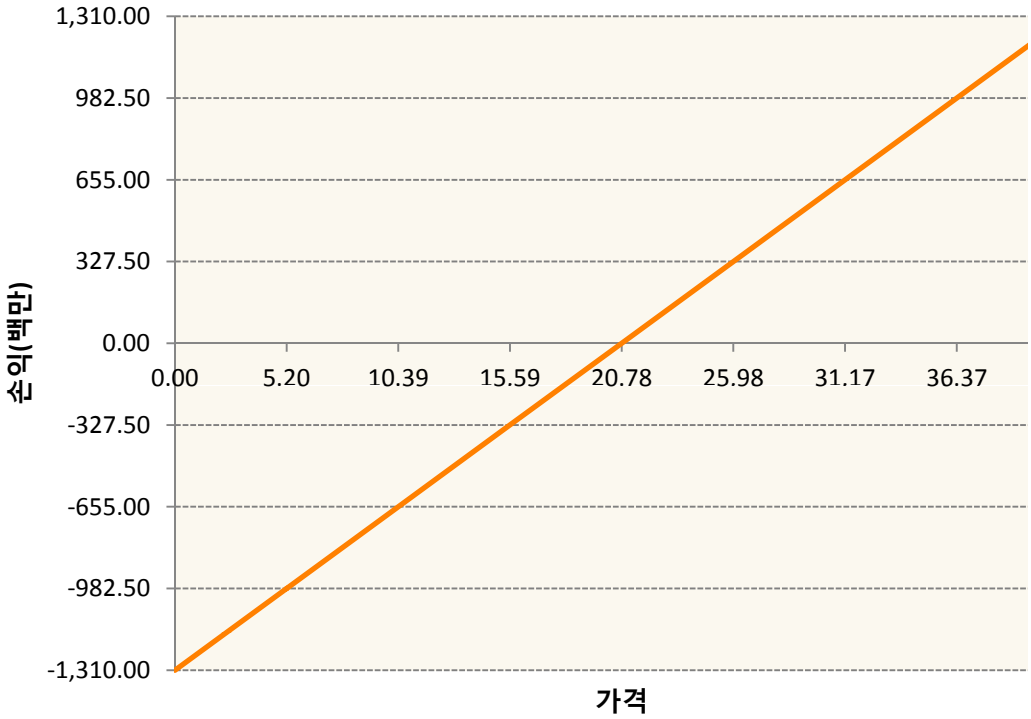

KCU6-COFFEE 'C' FUTURE SEP16
531.21
354.14
177.07
0.00
-177.07
-354.14
-531.21
-708.27
0.00
36.60
73.20
109.80
146.40
183.00
219.60
256.20
순익(백만)

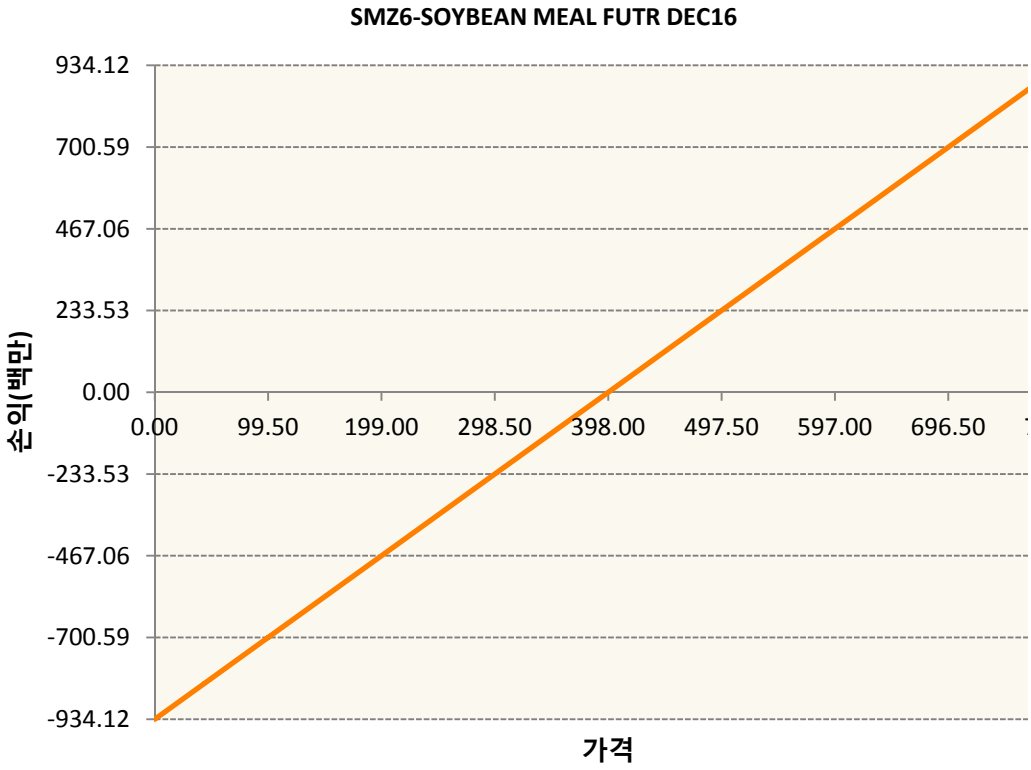
가격

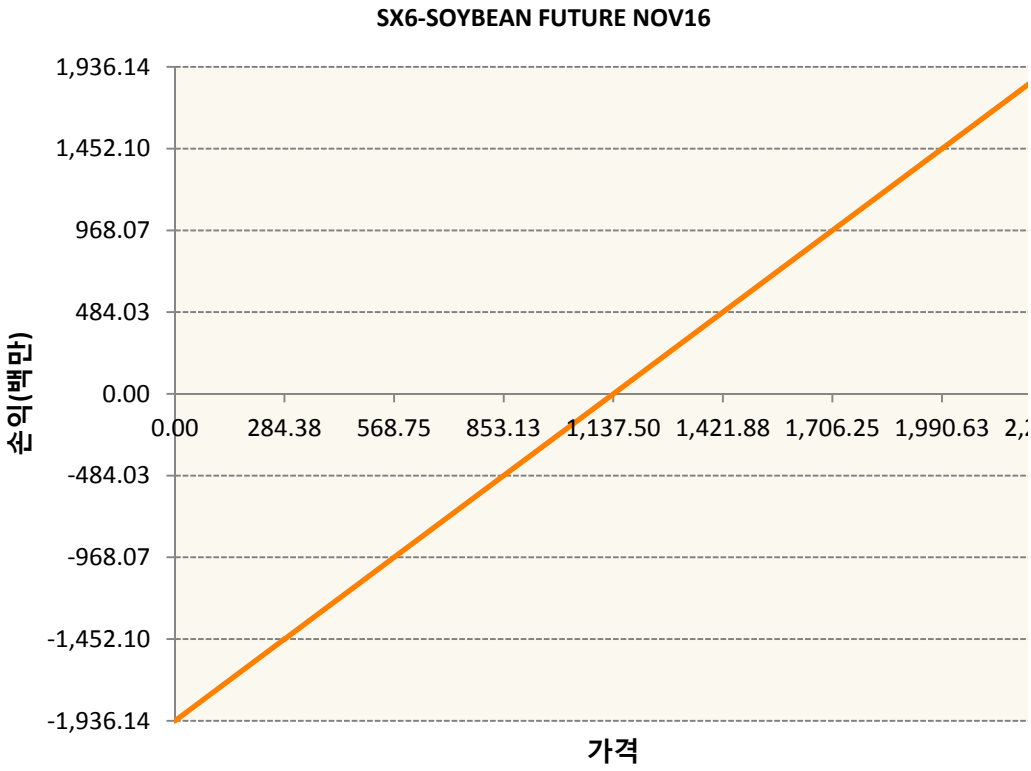
KWU6-KC HRW WHEAT FUT SEP16

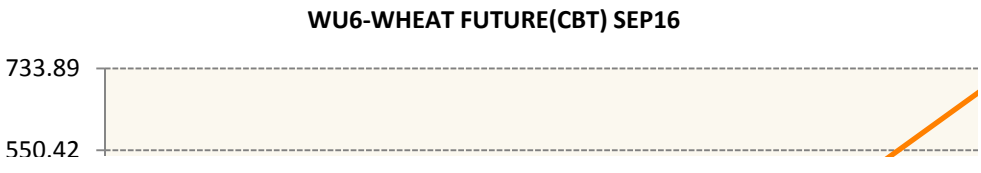


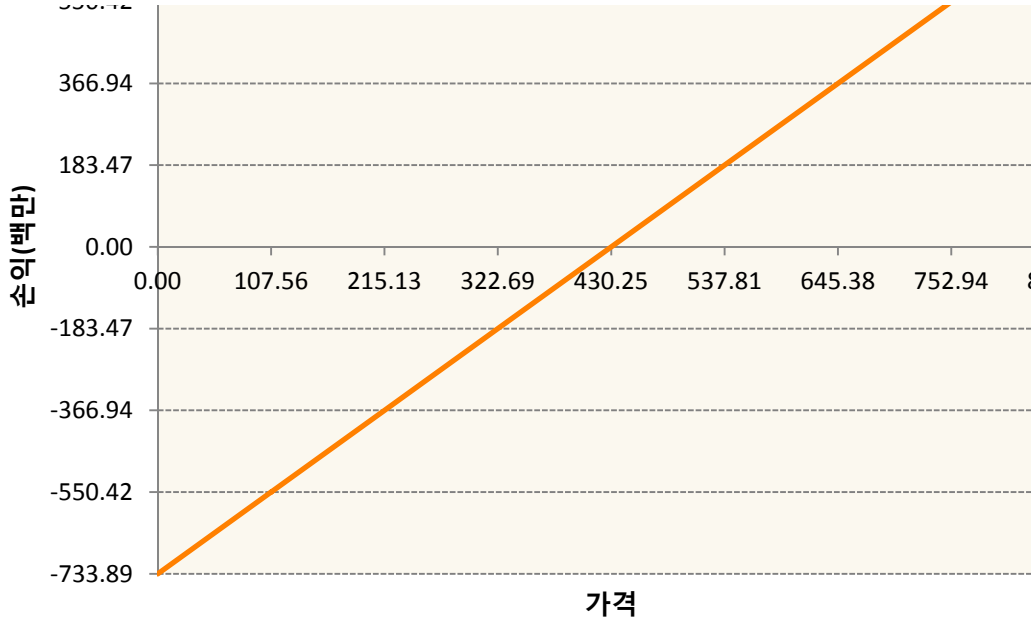
SBV6-SUGAR #11 (WORLD) OCT16




SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16
934.12
700.59
467.06
233.53
0.00
-233.53
-467.06
-700.59
-934.12
0.00
99.50
199.00
298.50
398.00
497.50
597.00
696.50
손익(백만)
가격


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16
1,936.14
1,452.10
968.07
484.03
0.00
-484.03
-968.07
-1,452.10
-1,936.14
0.00
284.38
568.75
853.13
1,137.50
1,421.88
1,706.25
1,990.63
손익(백만)
가격


WU6-WHEAT FUTURE(CBT) SEP16
733.89
550.42



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ6	SOYBEAN OIL FUTR DEC16	61
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	30
CU6	CORN FUTURE SEP16	151
KCU6	COFFEE 'C' FUTURE SEP16	57
KWU6	KC HRW WHEAT FUT SEP16	19
SBV6	SUGAR #11 (WORLD) OCT16	105
SMZ6	SOYBEAN MEAL FUTR DEC16	75
SX6	SOYBEAN FUTURE NOV16	155
WU6	WHEAT FUTURE(CBT) SEP16	0

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

996