공시일	2016-07-12
기준일	2016-07-11

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	2016-07-12
기준일	2016-07-11

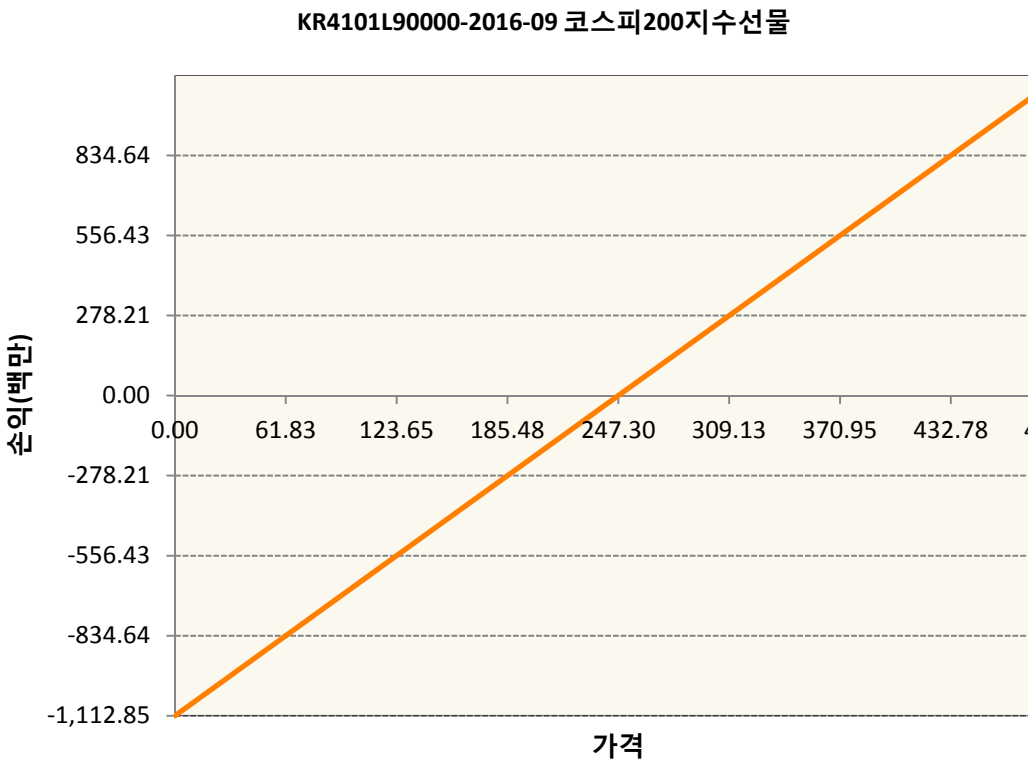
스마트인덱스모

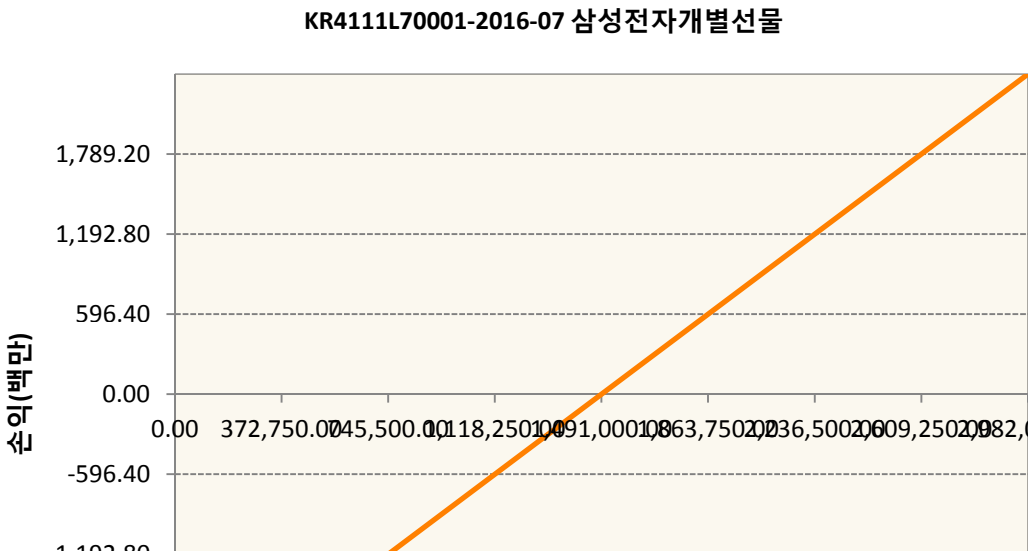
1. 계약금액

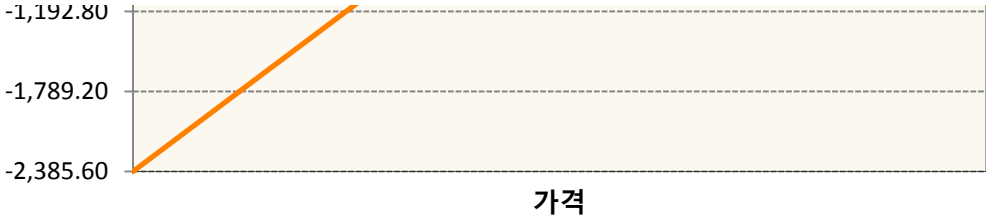
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,498	0	3,498	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						191
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-191	-191	-191	-191	-191	-191	-191
-5.33%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127
-2.67%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	64	64	64	64	64	64	64
5.33%	127	127	127	127	127	127	127
8.00%	191	191	191	191	191	191	191

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

265

공시일	2016-07-12
기준일	2016-07-11

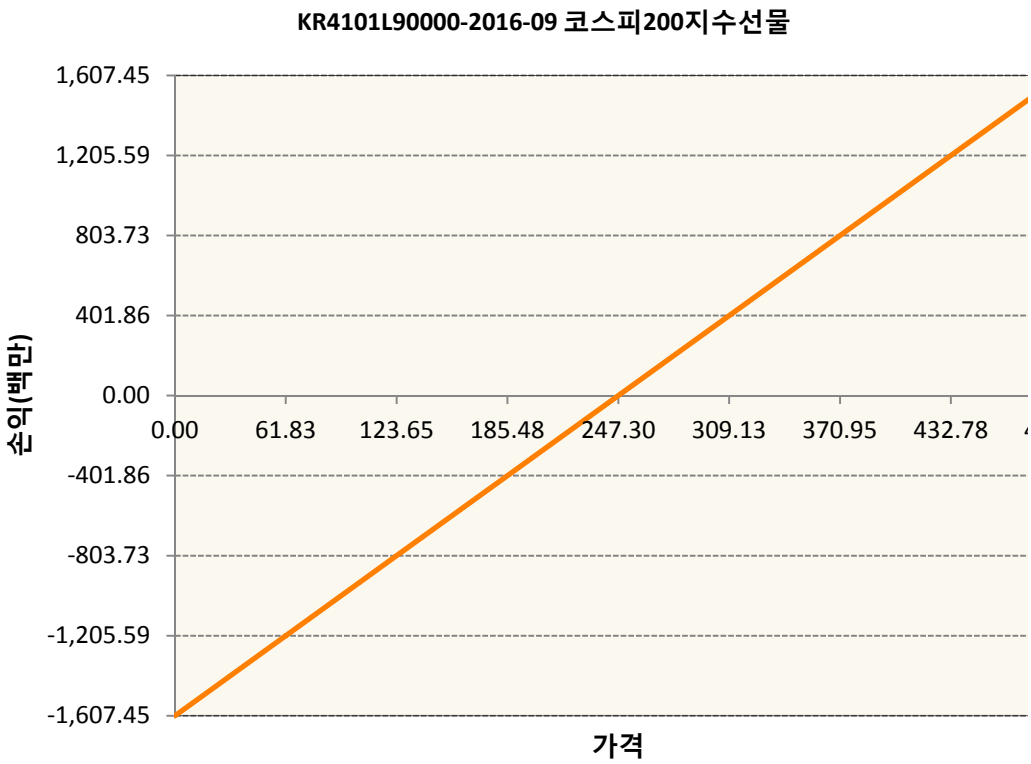
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,607	0	1,607	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	2016-07-12
기준일	2016-07-11

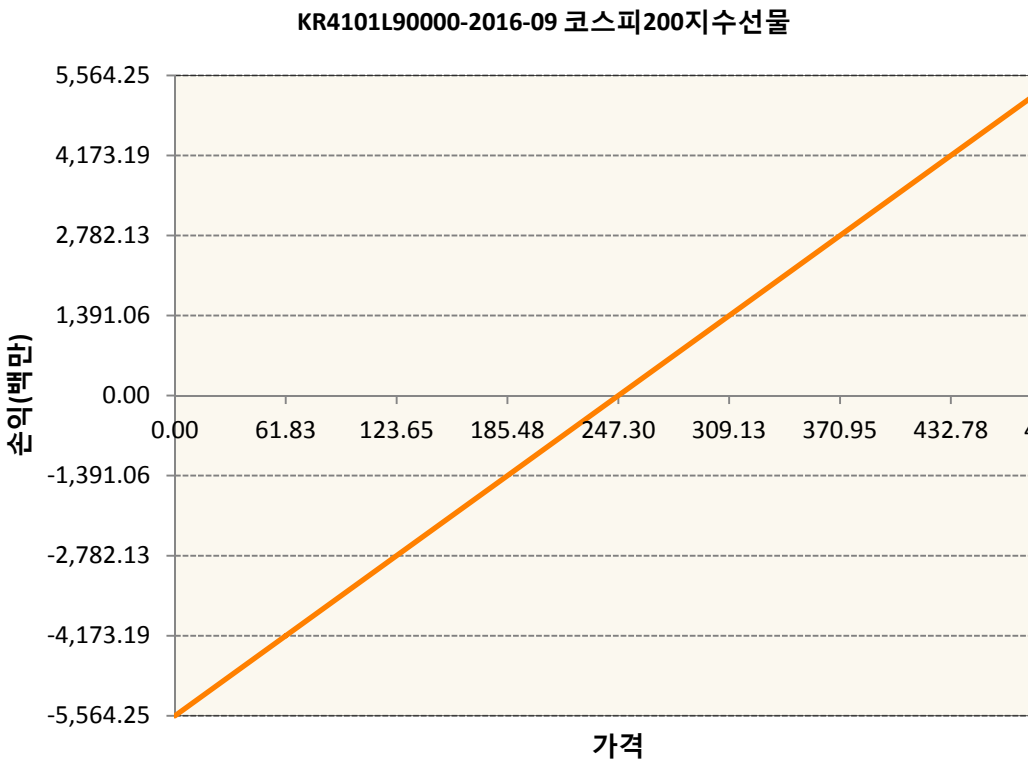
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	371	-371	장내
누계	유가증권	선물	5,564	0	5,564	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						445
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-445	-445	-445	-445	-445	-445	-445
-5.33%	-296	-296	-296	-296	-296	-296	-296
-2.67%	-148	-148	-148	-148	-148	-148	-148
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	148	148	148	148	148	148	148
5.33%	296	296	296	296	296	296	296
8.00%	445	445	445	445	445	445	445

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

370

공시일	2016-07-12
기준일	2016-07-11

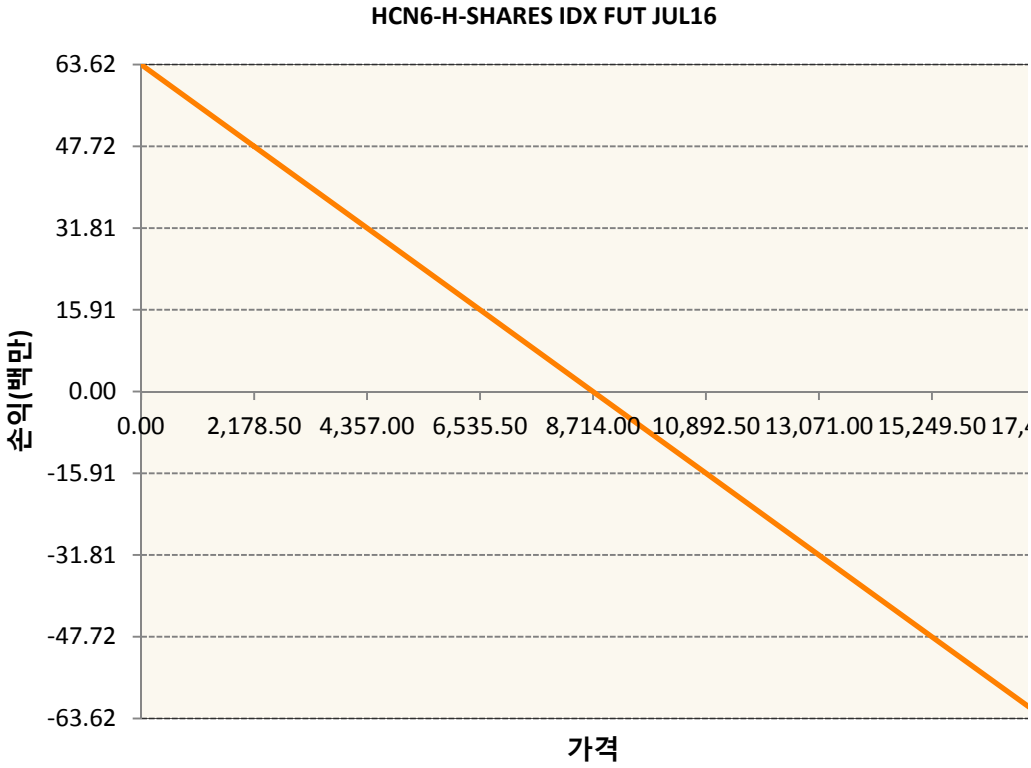
아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

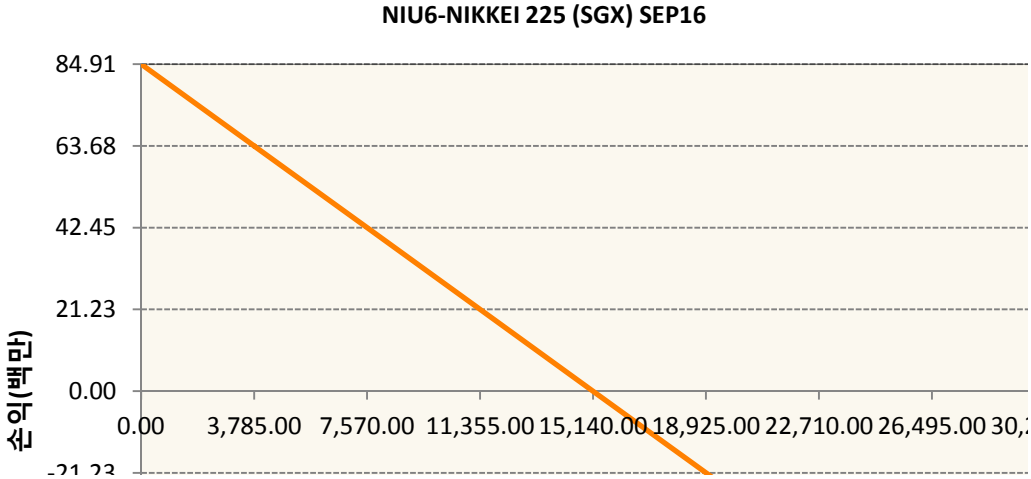
1. 계약금액

(단위:백만원)

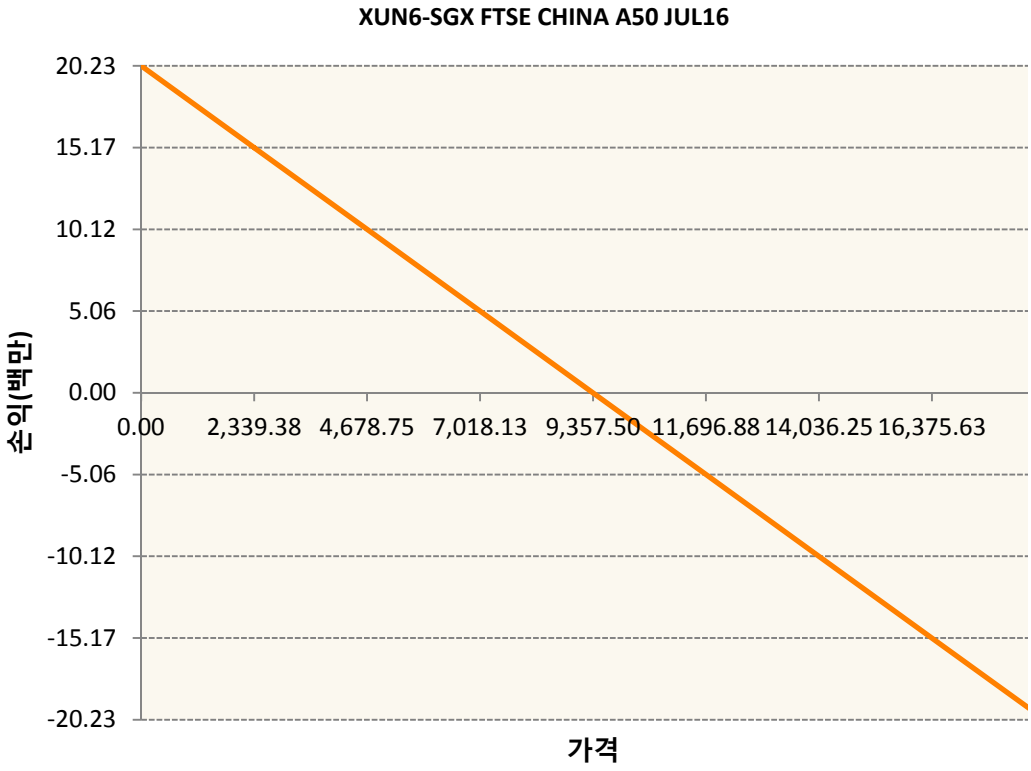
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	105	-105	
누계	유가증권	선물	0	64	-64	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCN6	H-SHARES IDX FUT JUL16	5
NIU6	NIKKEI 225 (SGX) SEP16	7
XUN6	SGX FTSE CHINA A50 JUL16	2

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

19

공시일	2016-07-12
기준일	2016-07-11

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	854

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

796

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-07-12
기준일	2016-07-11

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	396

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,049

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-07-12
기준일	2016-07-11

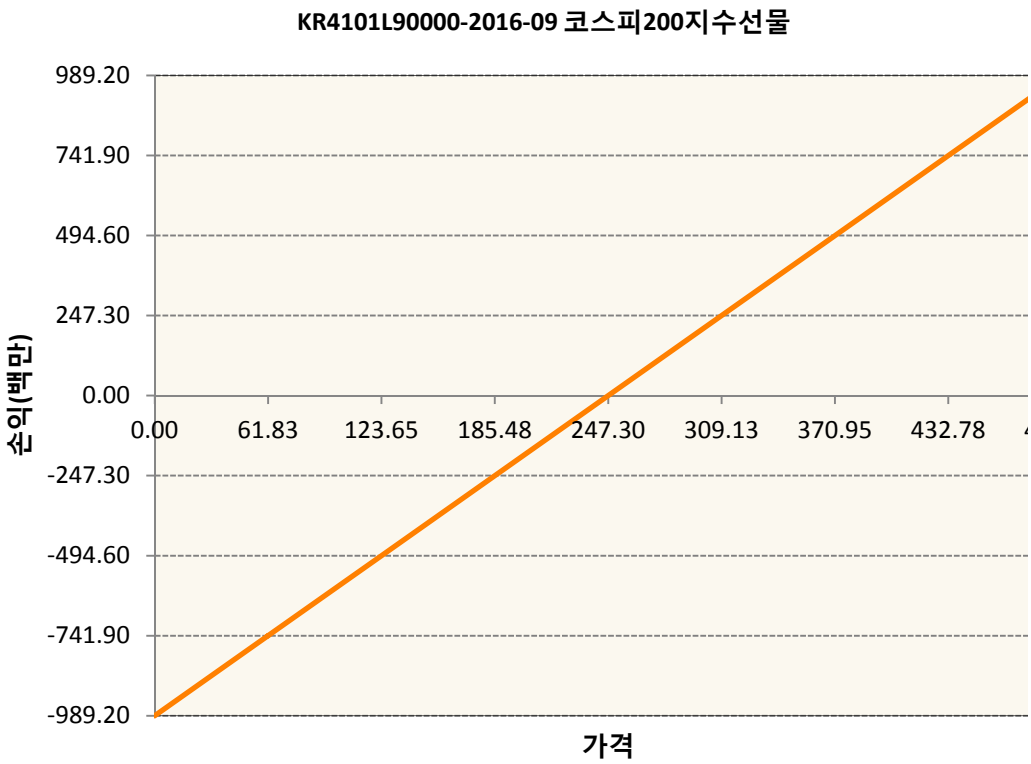
KOSPI200 레버리지 목표전환형 3

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	989	0	989	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	2016-07-12
기준일	2016-07-11

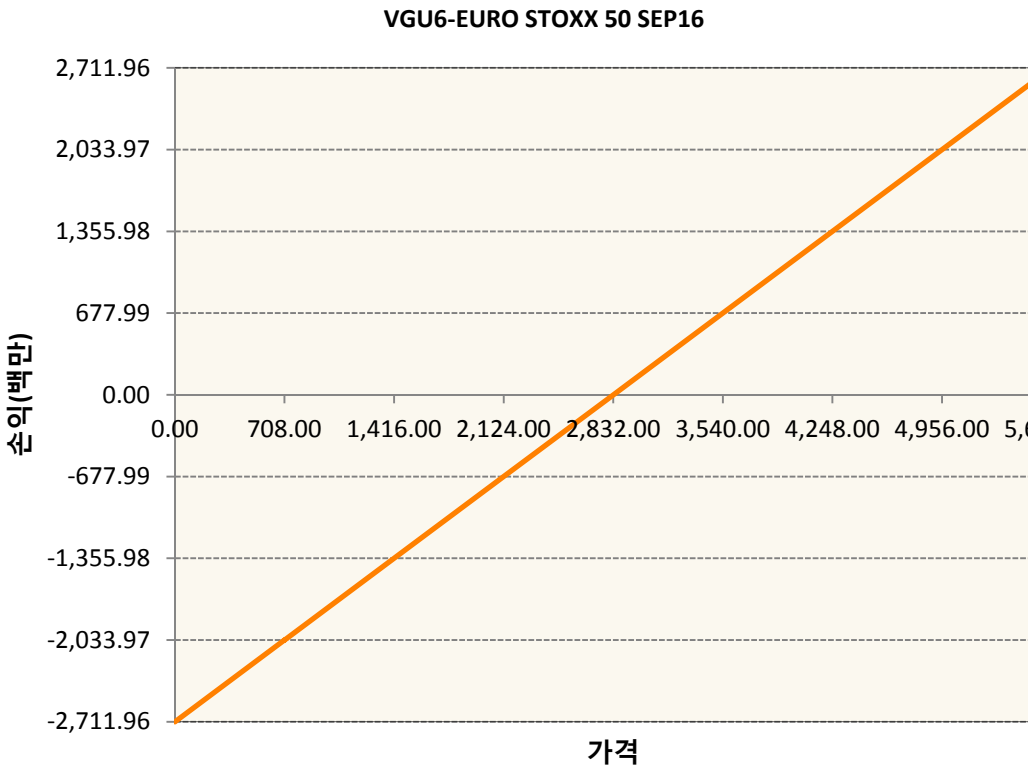
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,712	0	2,712	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 SEP16	217

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

(단위:백만원)

268

공시일	2016-07-12
기준일	2016-07-11

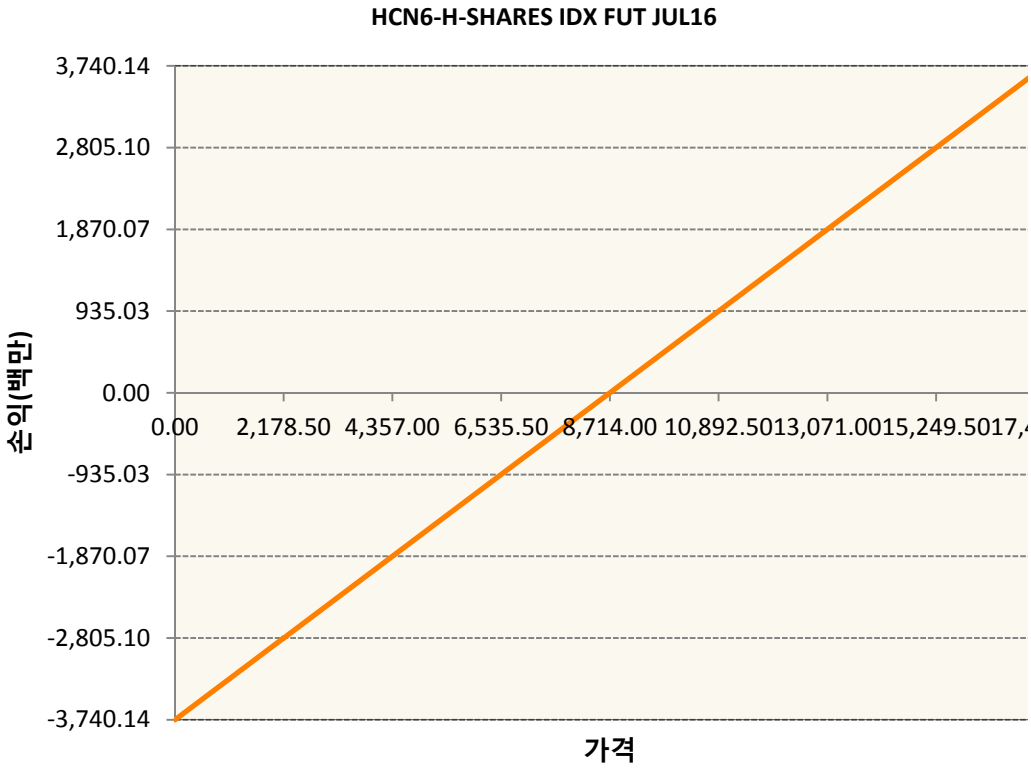
차이나인덱스모(주식-파생형)

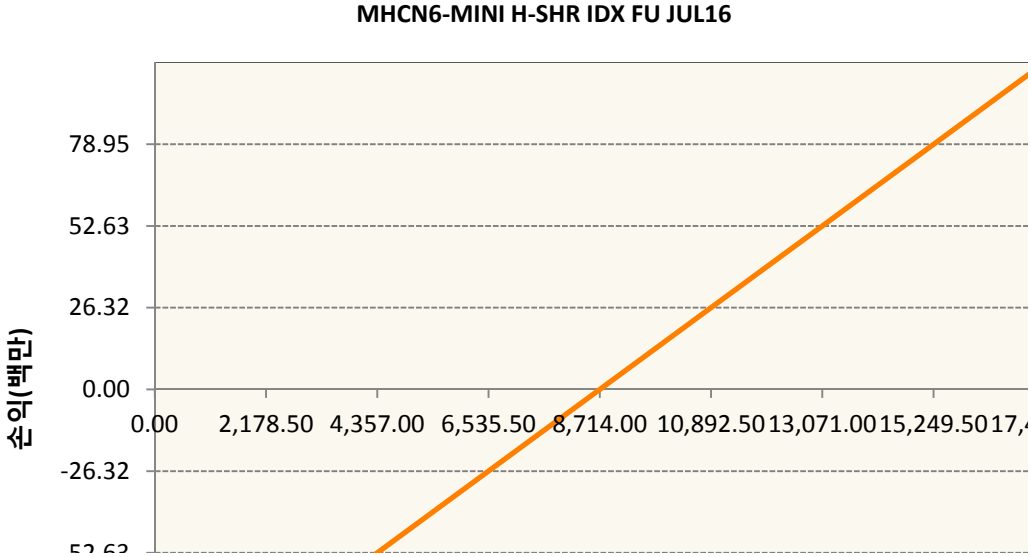
1. 계약금액

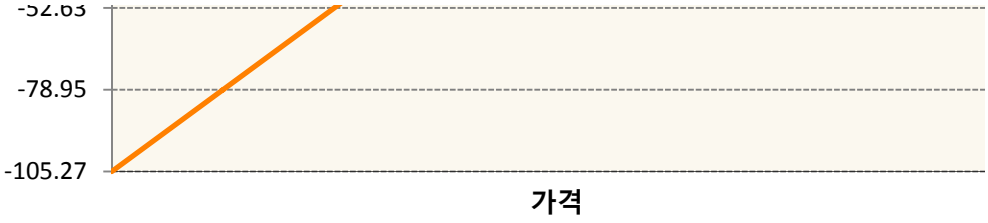
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,845	0	3,845	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCN6	H-SHARES IDX FUT JUL16	299
MHCN6	MINI H-SHR IDX FU JUL16	8

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	431

공시일	2016-07-12
기준일	2016-07-11

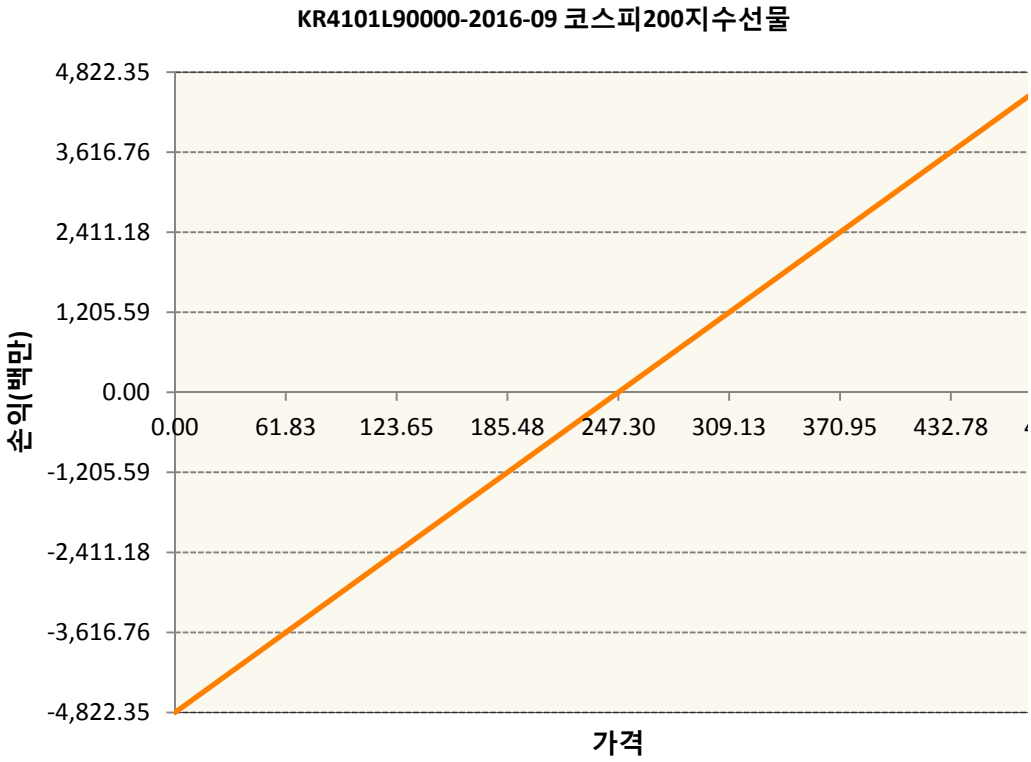
커버드콜(주식혼합-파생형)

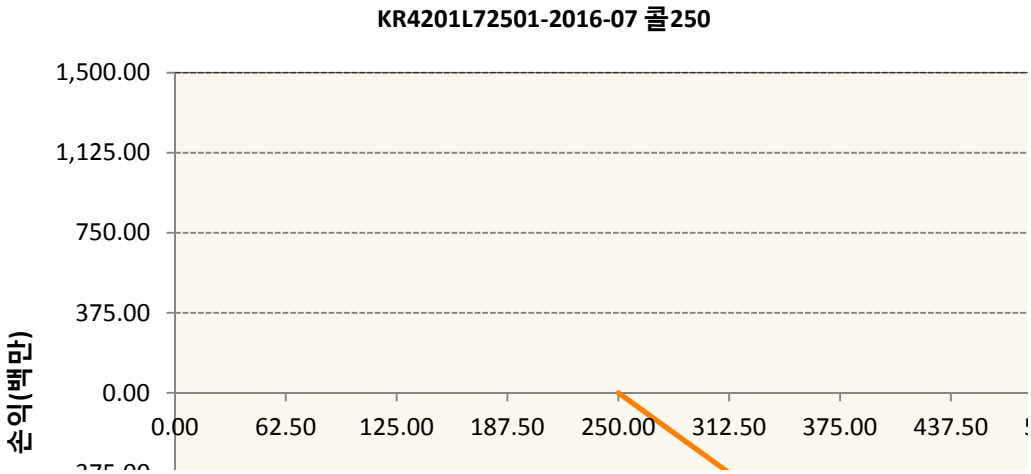
1. 계약금액

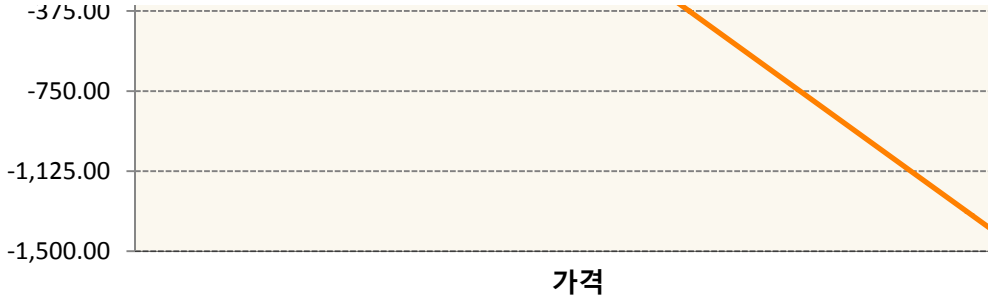
(단위:백만원)

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	4,822	0	4,822	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,500	-1,500	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						385
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-385	-385	-385	-385	-385	-385	-385
-5.33%	-257	-257	-257	-257	-257	-257	-257
-2.67%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	128	128	128	128	128	128	128
5.33%	257	257	257	257	257	257	257
8.00%	385	385	385	385	385	385	385
KR4201L725	2016-07 콜250						493
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9	9	9	9	9	9	9
-5.33%	9	9	9	9	9	9	9
-2.67%	9	9	9	9	9	9	9
0%	5	4	2	0	-2	-4	-7
2.67%	-100	-102	-103	-105	-107	-109	-111
5.33%	-295	-295	-295	-295	-295	-296	-296
8.00%	-493	-493	-493	-493	-493	-493	-493

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

920

공시일	2016-07-12
기준일	2016-07-11

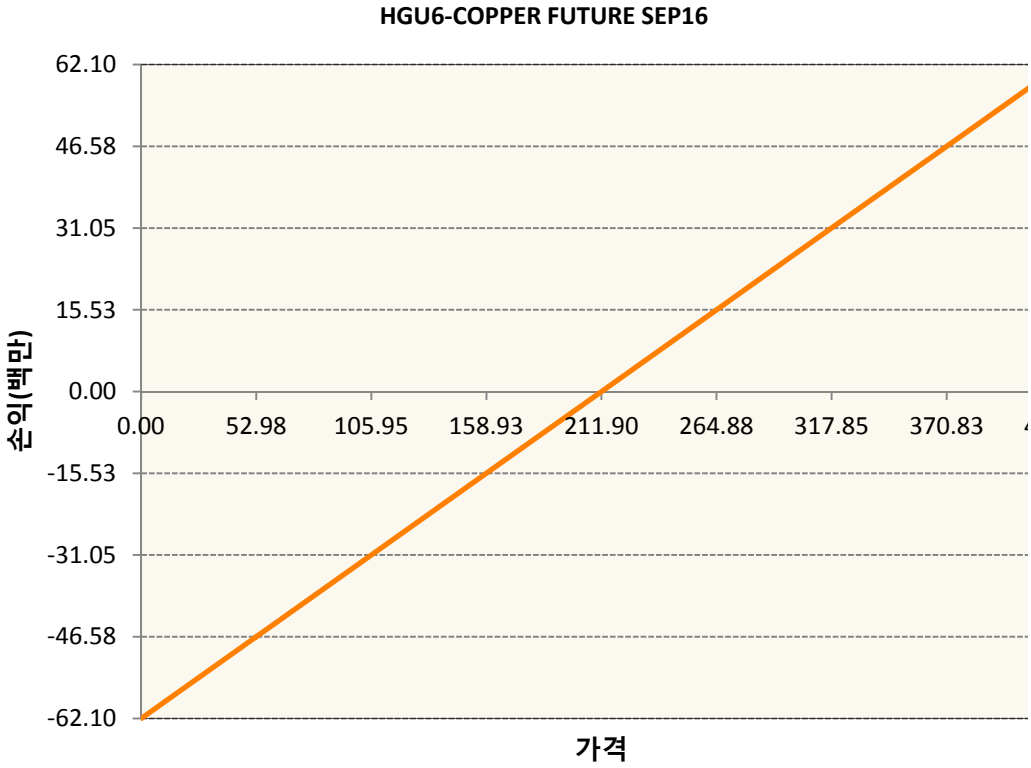
메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

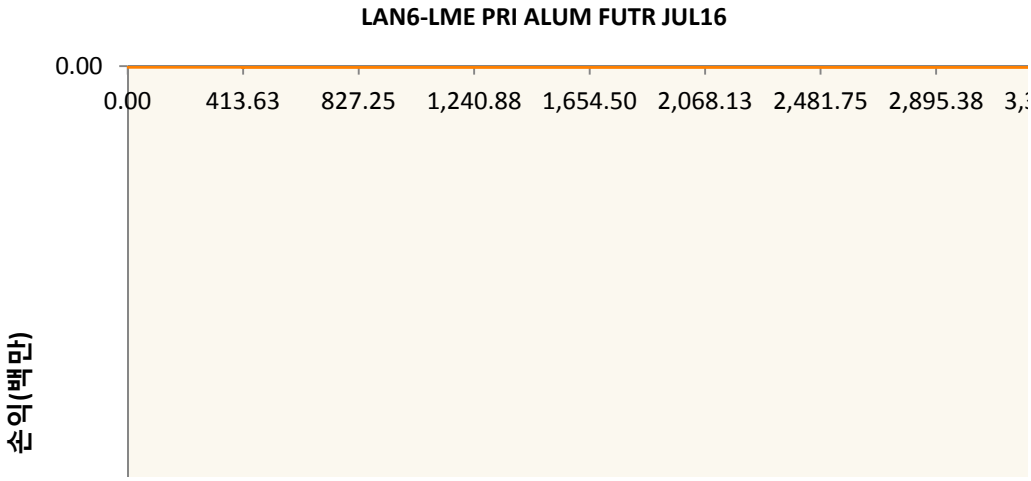
1. 계약금액

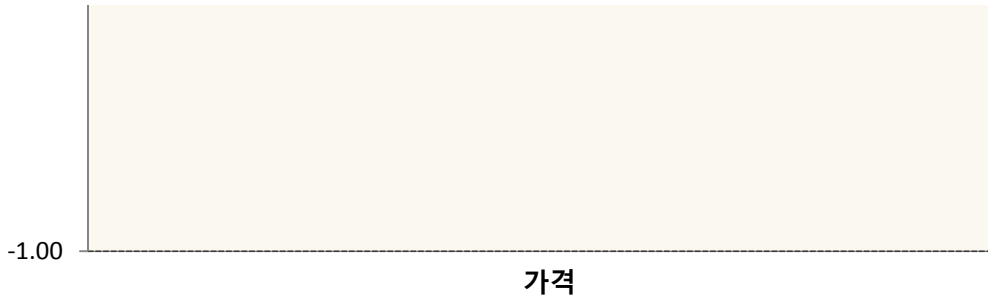
(단위:백만원)

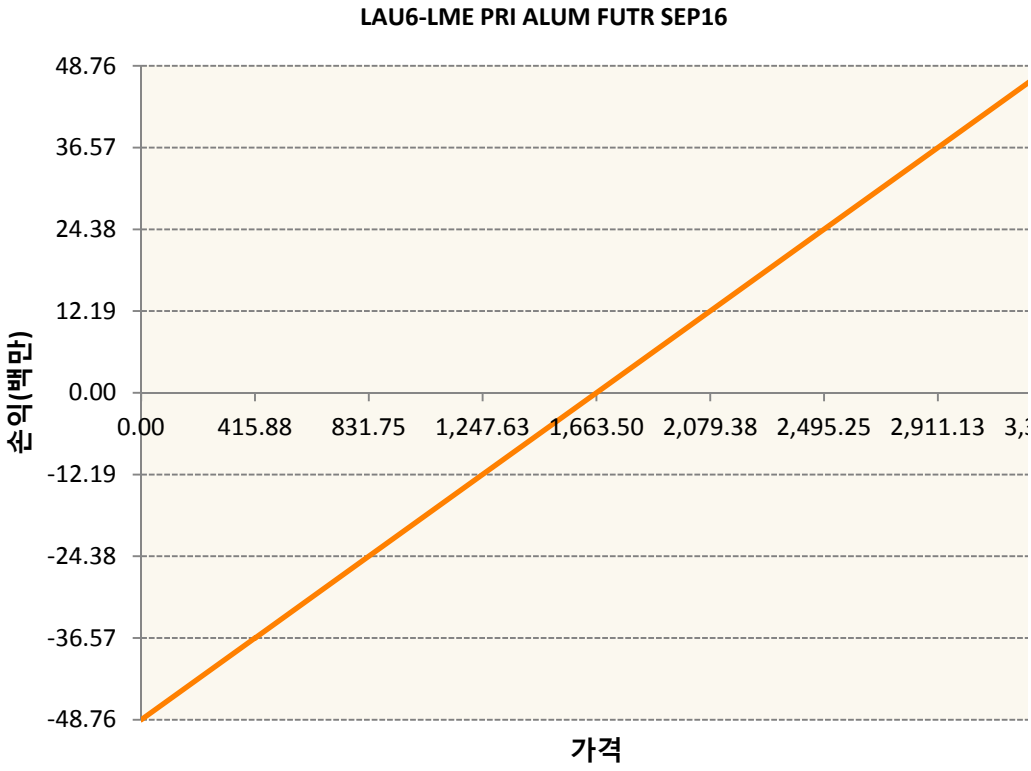
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	71	0	71	
누계	유가증권	선물	436	101	334	

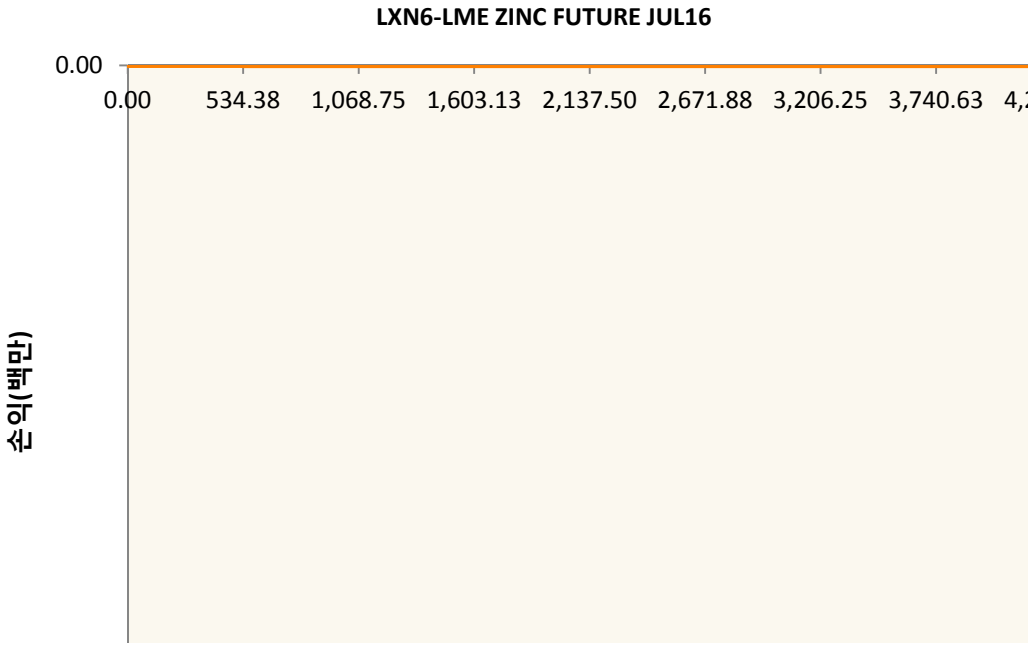
2. 만기시점의 손익구조

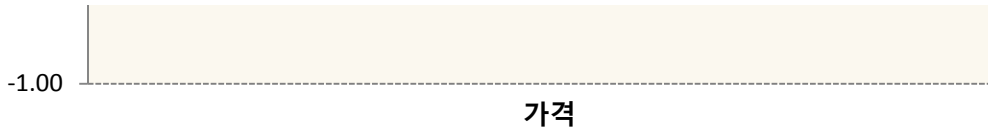


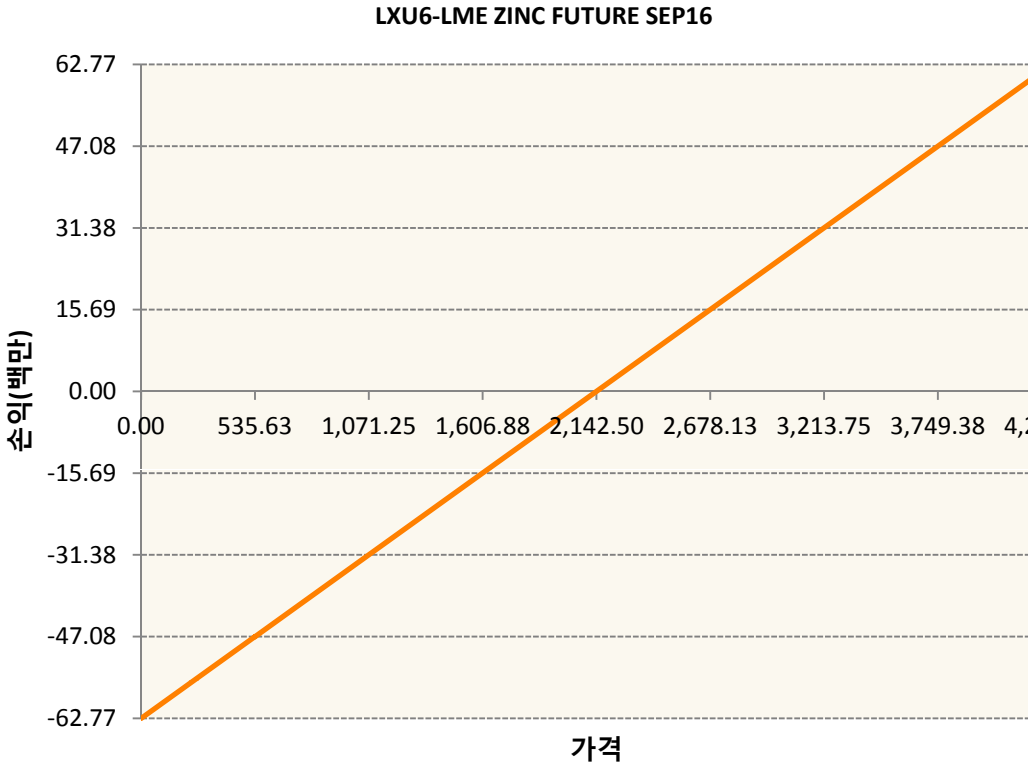


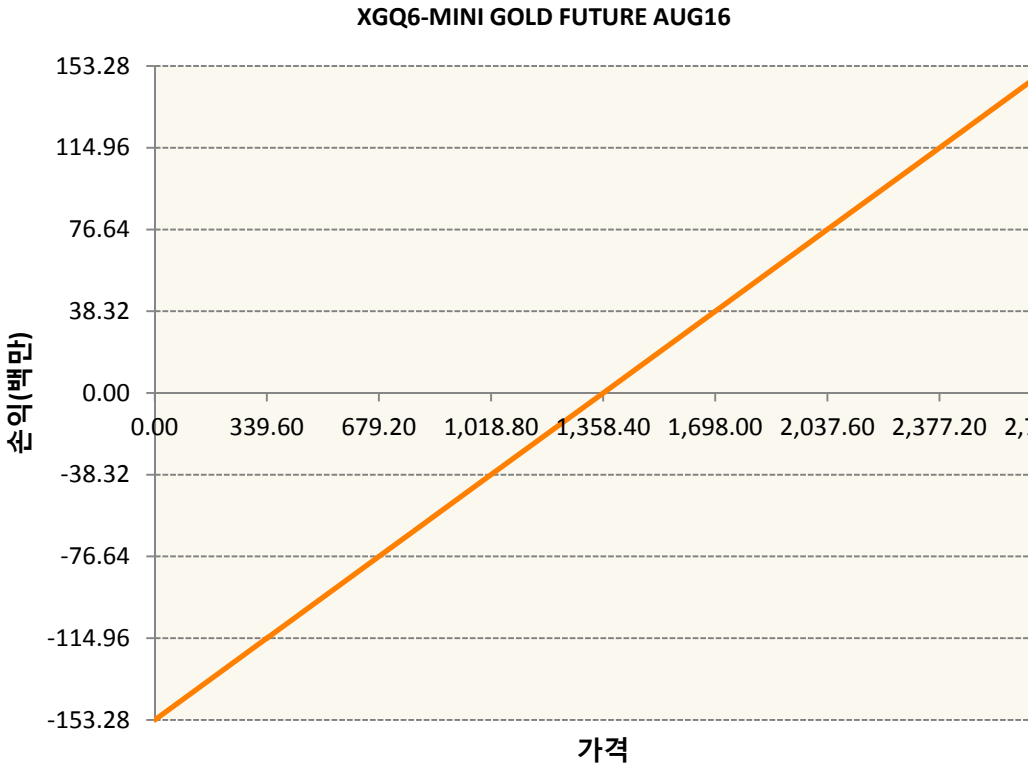

-1.00
가격

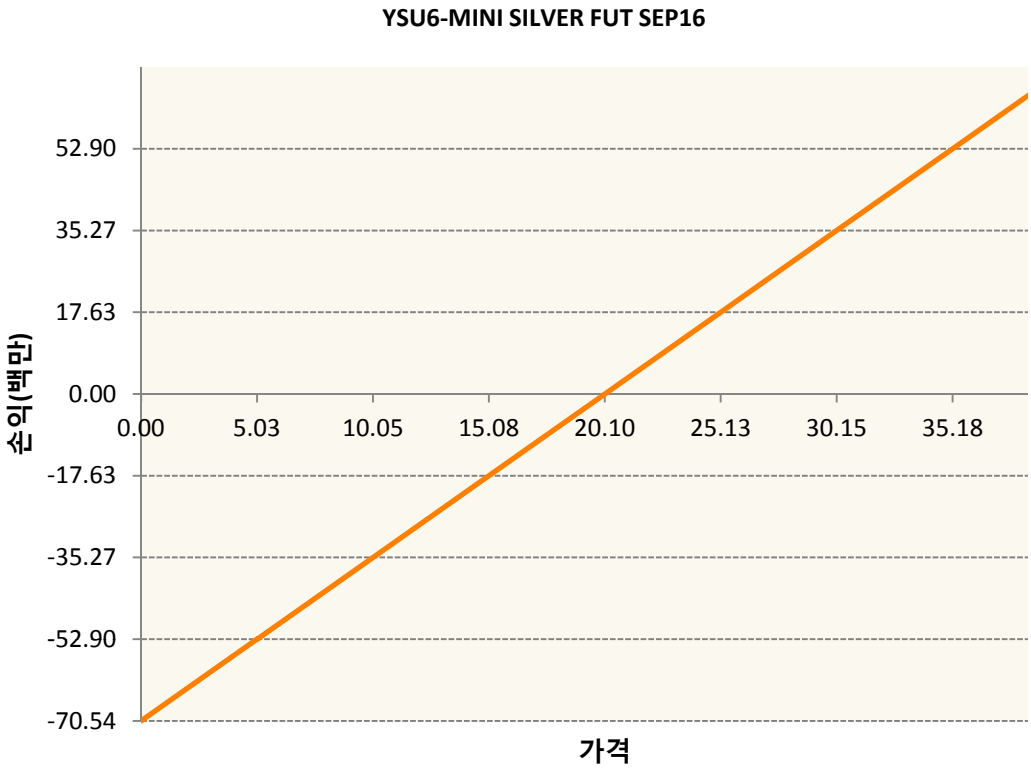

LAU6-LME PRI ALUM FUTR SEP16
48.76
36.57
24.38
12.19
0.00
-12.19
-24.38
-36.57
-48.76
0.00
415.88
831.75
1,247.63
1,663.50
2,079.38
2,495.25
2,911.13
순익(백만)
가격


LXN6-LME ZINC FUTURE JUL16
0.00
0.00
534.38
1,068.75
1,603.13
2,137.50
2,671.88
3,206.25
3,740.63
순익(백만)


-1.00
가격


LXU6-LME ZINC FUTURE SEP16
62.77
47.08
31.38
15.69
0.00
-15.69
-31.38
-47.08
-62.77
0.00
535.63
1,071.25
1,606.88
2,142.50
2,678.13
3,213.75
3,749.38
순익(백만)
가격


XGQ6-MINI GOLD FUTURE AUG16
153.28
114.96
76.64
38.32
0.00
-38.32
-76.64
-114.96
-153.28
0.00
339.60
679.20
1,018.80
1,358.40
1,698.00
2,037.60
2,377.20
순익(백만)
가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HGU6	COPPER FUTURE SEP16	5
LAN6	LME PRI ALUM FUTR JUL16	0.2
LAU6	LME PRI ALUM FUTR SEP16	4
LXN6	LME ZINC FUTURE JUL16	0.4
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	2016-07-12
기준일	2016-07-11

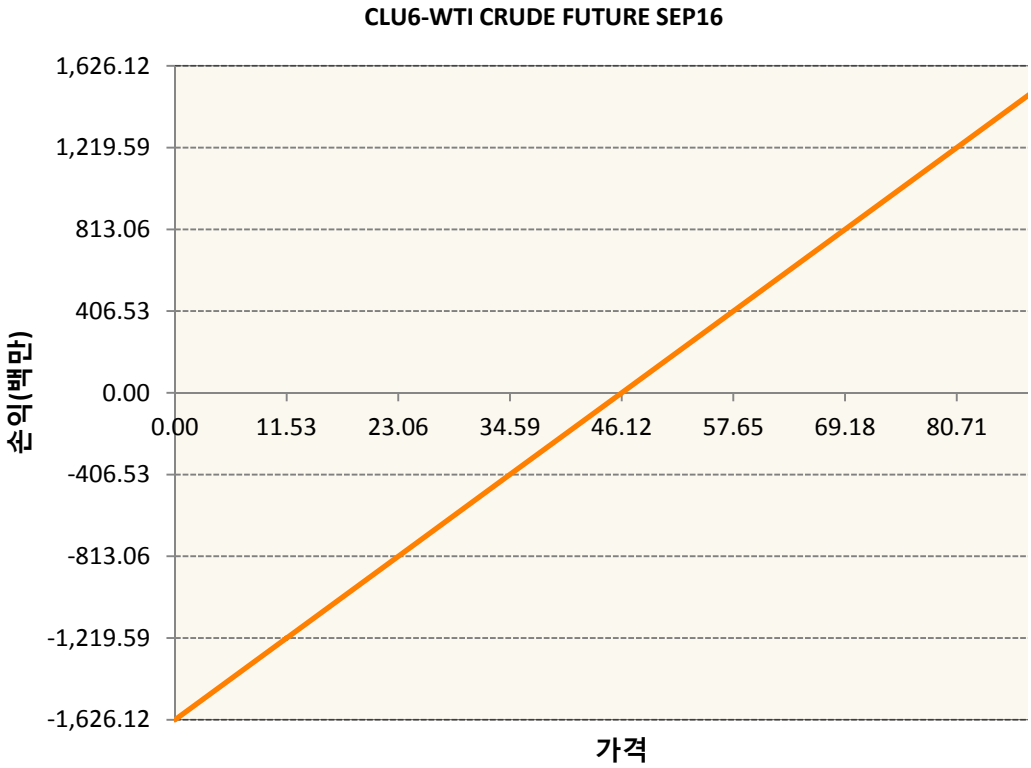
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

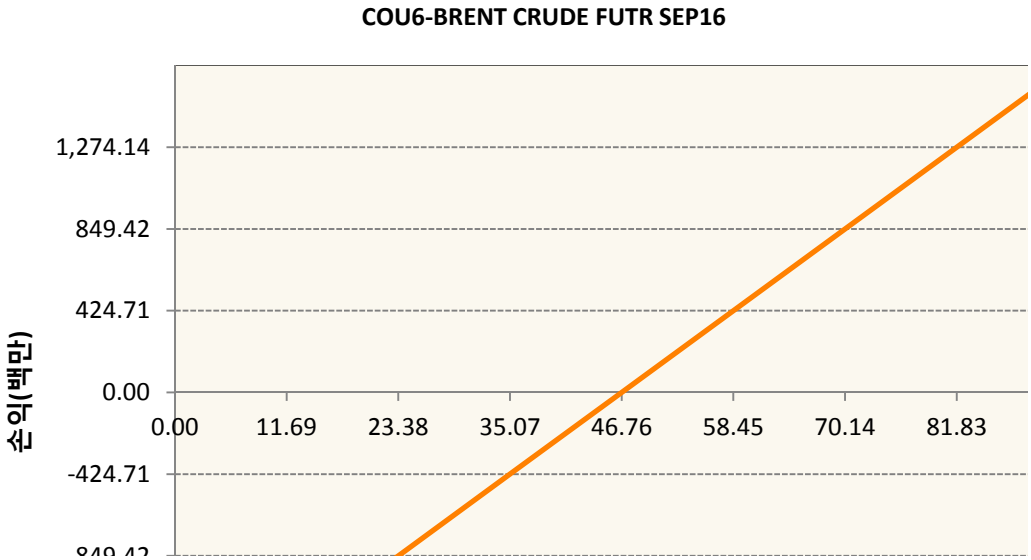
1. 계약금액

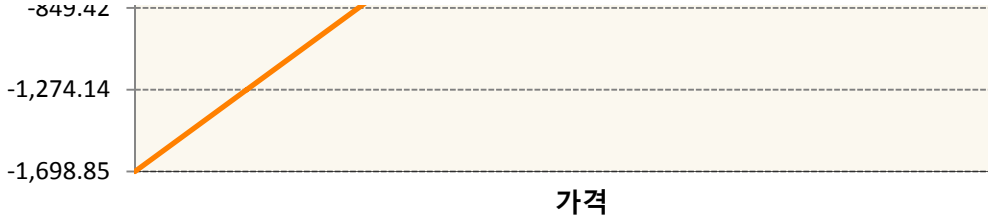
(단위:백만원)

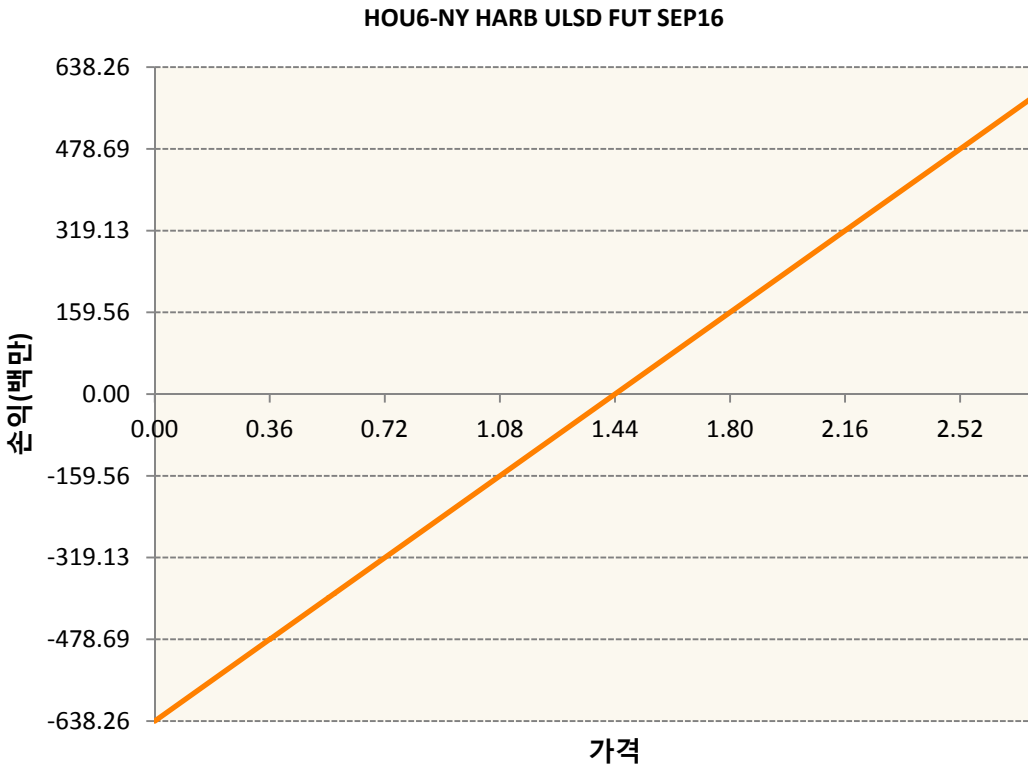
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,142	0	6,142	

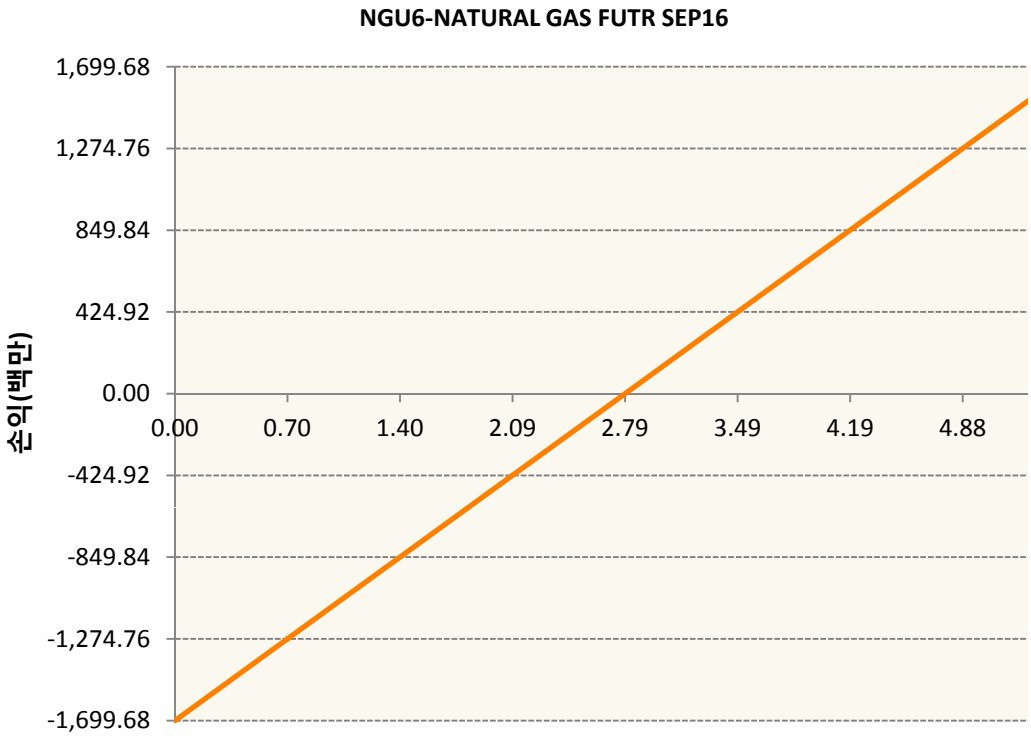
2. 만기시점의 손익구조



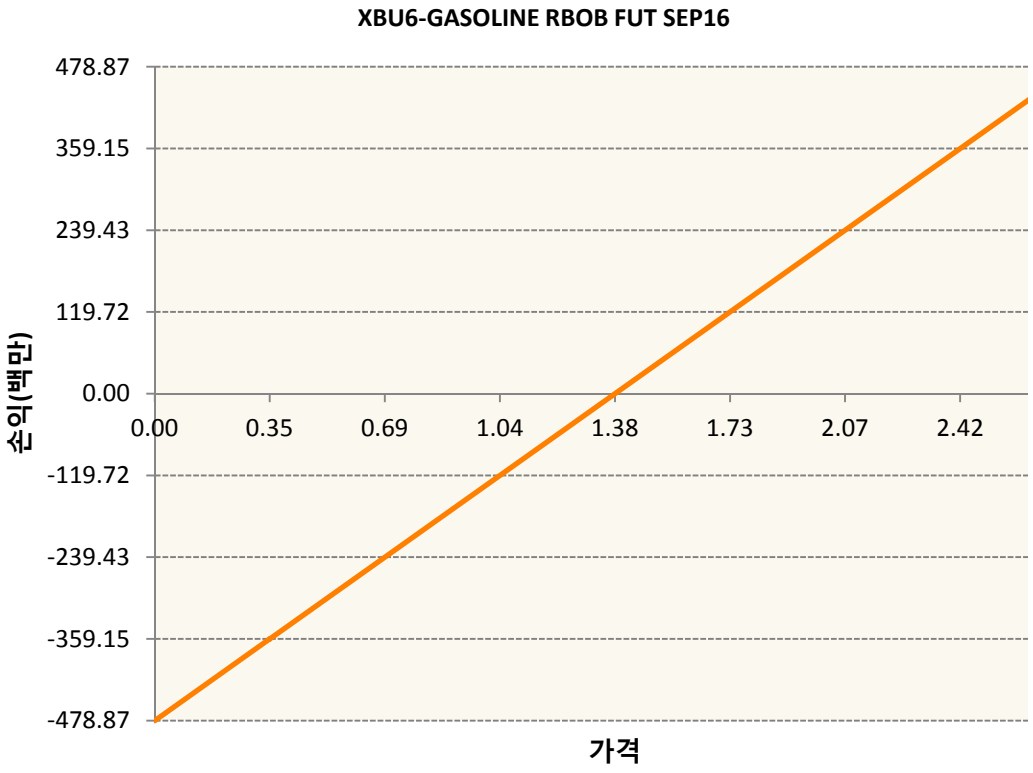



-1,274.14
-1,698.85
가격


HOU6-NY HARB ULSD FUT SEP16
638.26
478.69
319.13
159.56
0.00
-159.56
-319.13
-478.69
-638.26
0.00
0.36
0.72
1.08
1.44
1.80
2.16
2.52
순익(백만)
가격


NGU6-NATURAL GAS FUTR SEP16
1,699.68
1,274.76
849.84
424.92
0.00
-424.92
-849.84
-1,274.76
-1,699.68
0.00
0.70
1.40
2.09
2.79
3.49
4.19
4.88
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLU6	WTI CRUDE FUTURE SEP16	130
COU6	BRENT CRUDE FUTR SEP16	136
HOU6	NY HARB ULSD FUT SEP16	51
NGU6	NATURAL GAS FUTR SEP16	136
XBU6	GASOLINE RBOB FUT SEP16	38

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,375

공시일	2016-07-12
기준일	2016-07-11

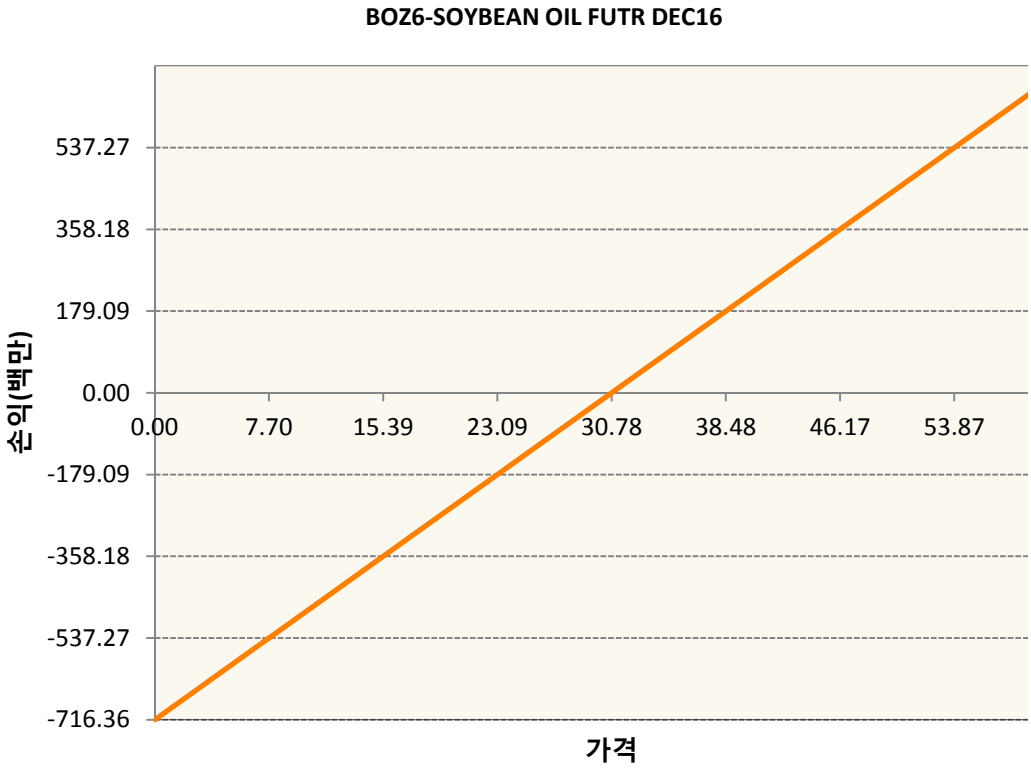
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

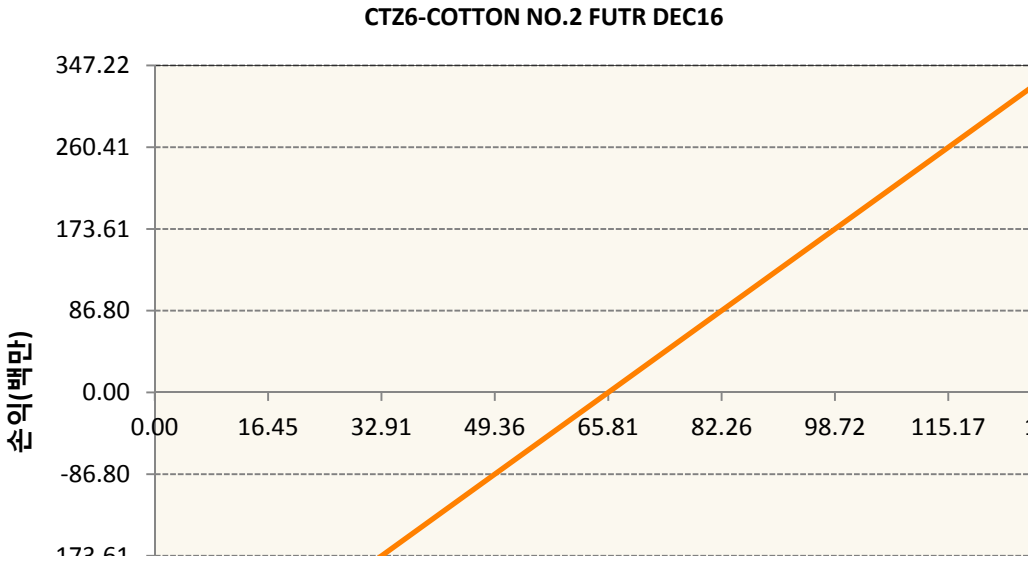
1. 계약금액

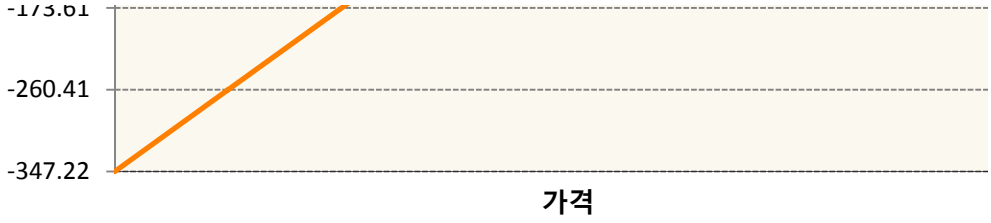
(단위:백만원)

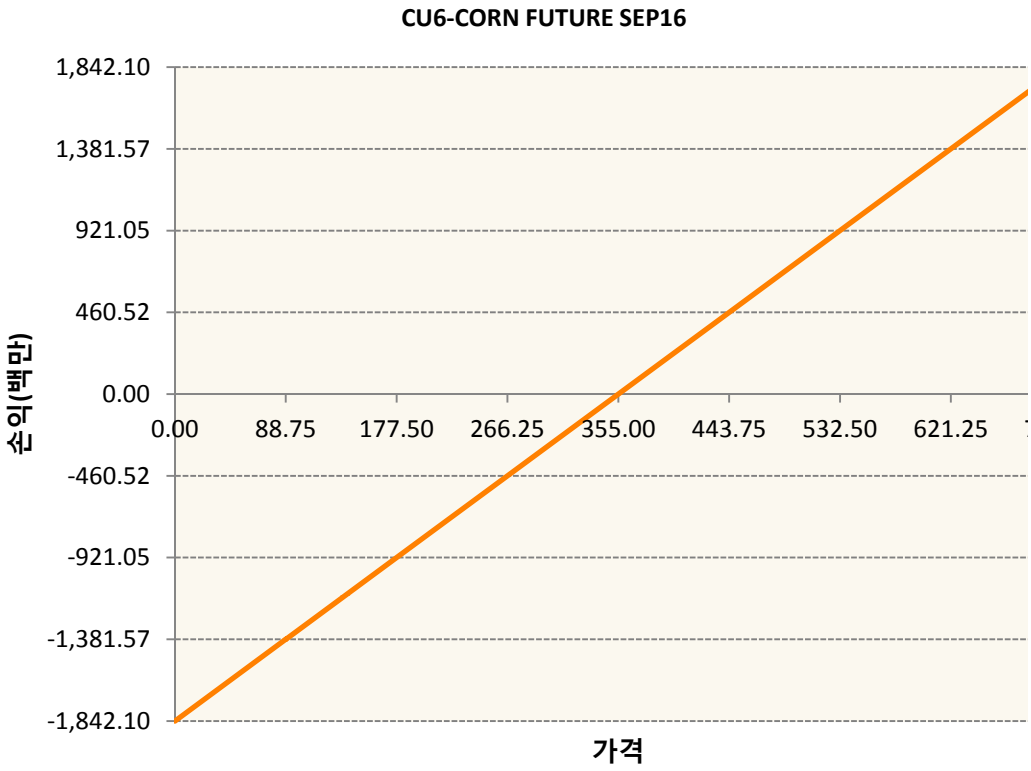
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,301	0	8,301	

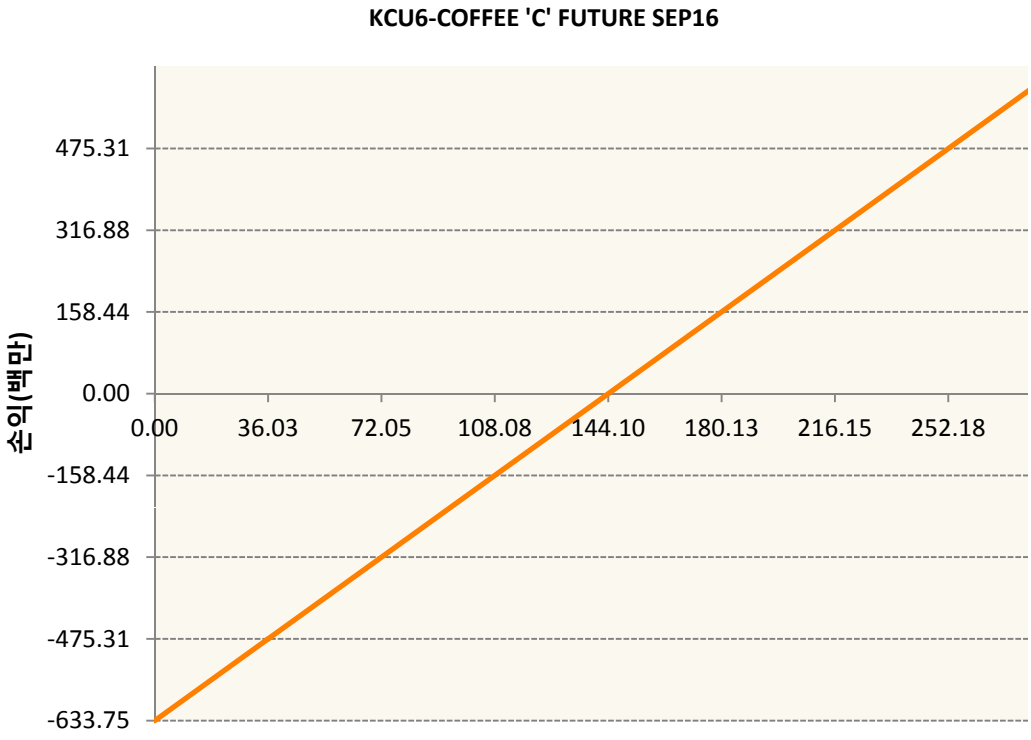
2. 만기시점의 손익구조



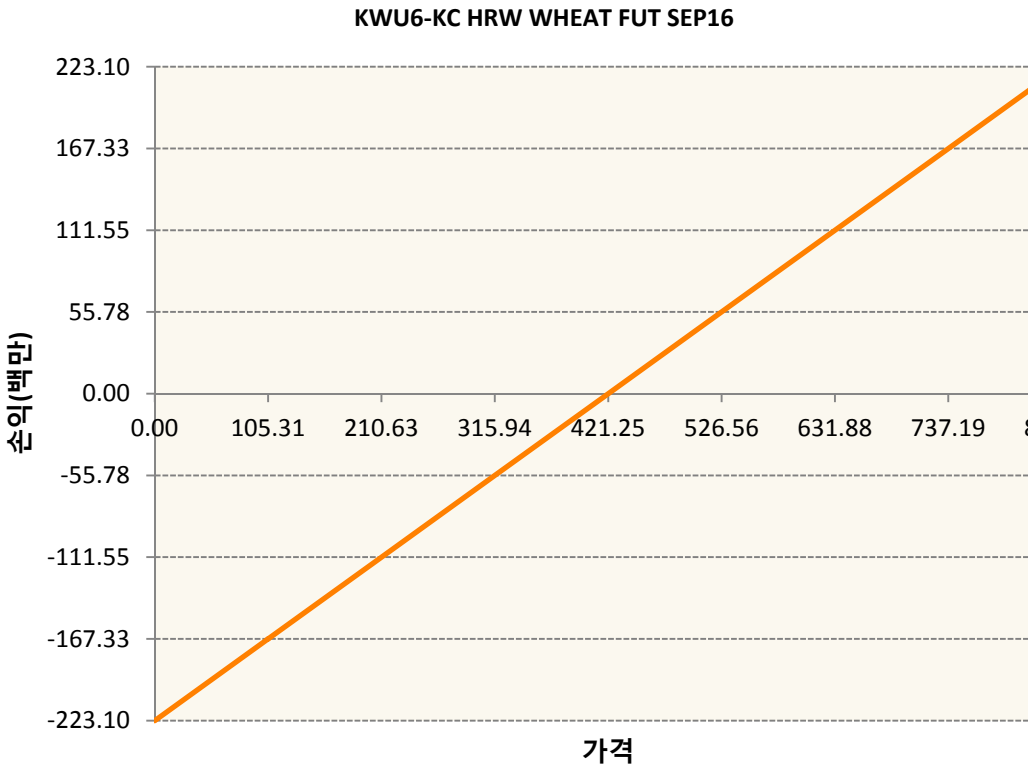


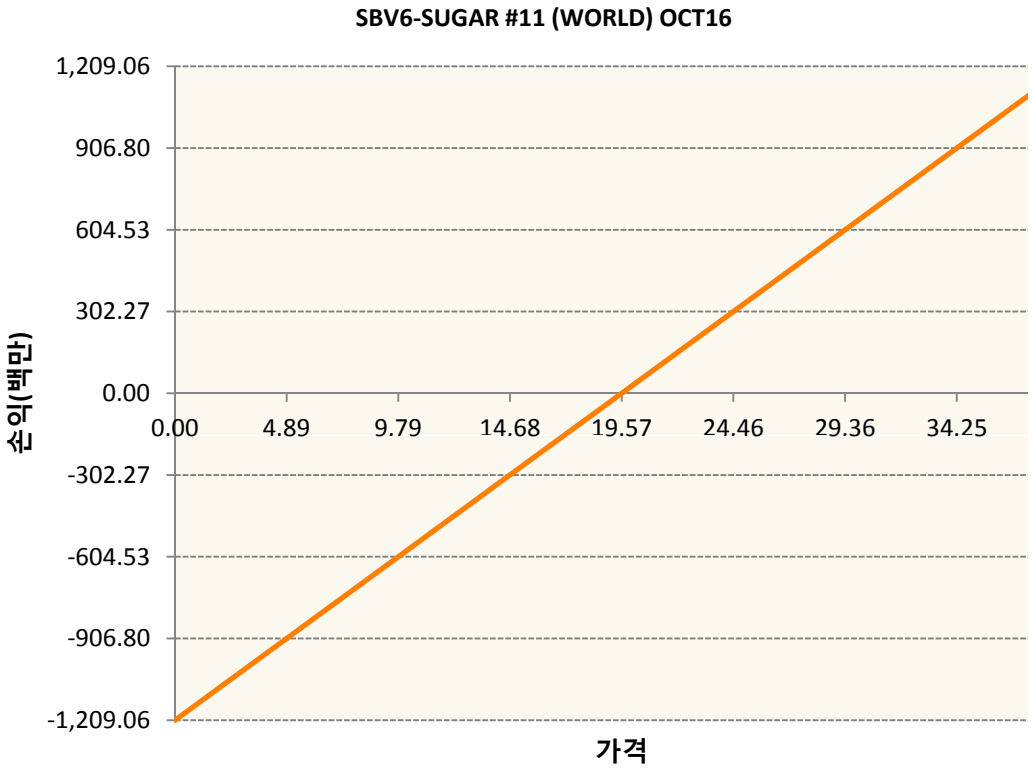

-260.41
-347.22
가격

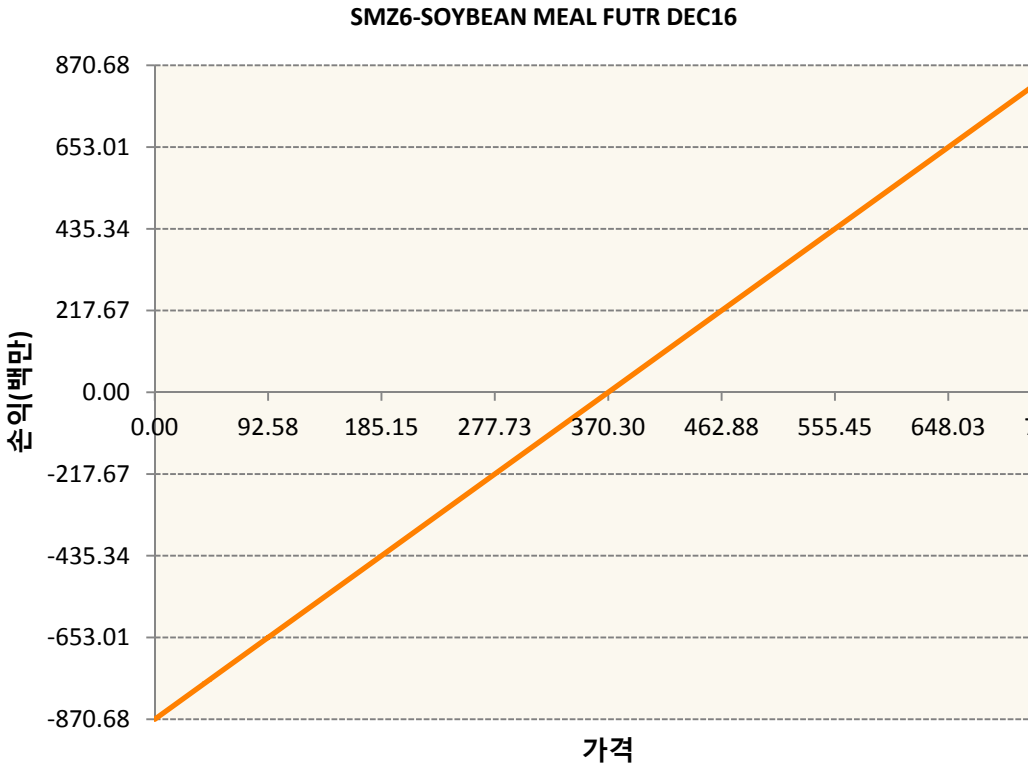

CU6-CORN FUTURE SEP16
1,842.10
1,381.57
921.05
460.52
0.00
-460.52
-921.05
-1,381.57
-1,842.10
0.00
88.75
177.50
266.25
355.00
443.75
532.50
621.25
순익(백만)
가격

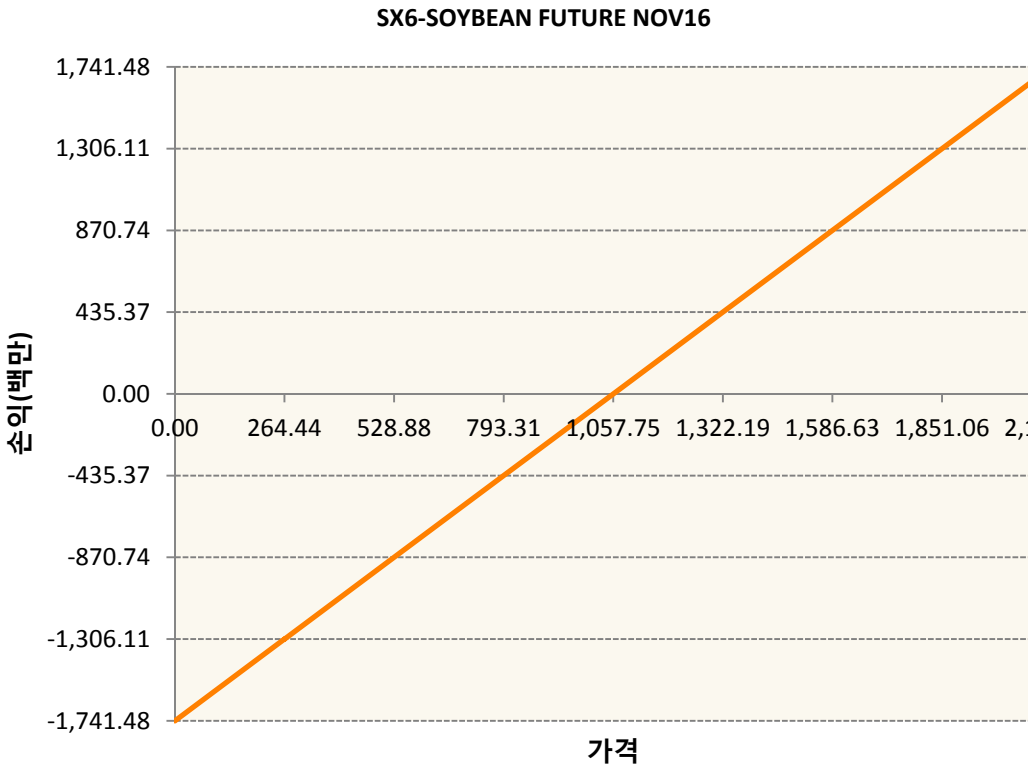

KCU6-COFFEE 'C' FUTURE SEP16
475.31
316.88
158.44
0.00
-158.44
-316.88
-475.31
-633.75
0.00
36.03
72.05
108.08
144.10
180.13
216.15
252.18
순익(백만)

가격

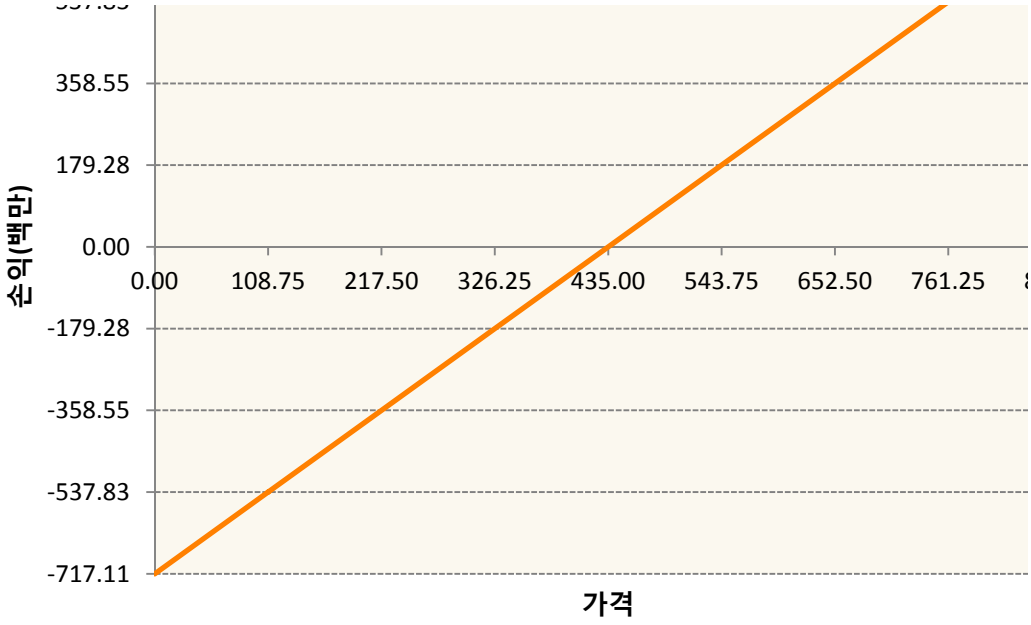

KWU6-KC HRW WHEAT FUT SEP16
223.10
167.33
111.55
55.78
0.00
-55.78
-111.55
-167.33
-223.10
0.00
105.31
210.63
315.94
421.25
526.56
631.88
737.19
손익(백만)
가격


SBV6-SUGAR #11 (WORLD) OCT16
1,209.06
906.80
604.53
302.27
0.00
-302.27
-604.53
-906.80
-1,209.06
0.00
4.89
9.79
14.68
19.57
24.46
29.36
34.25
손익(백만)
가격


SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16
870.68
653.01
435.34
217.67
0.00
-217.67
-435.34
-653.01
-870.68
0.00
92.58
185.15
277.73
370.30
462.88
555.45
648.03
손익(백만)
가격


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16
1,741.48
1,306.11
870.74
435.37
0.00
-435.37
-870.74
-1,306.11
-1,741.48
0.00
264.44
528.88
793.31
1,057.75
1,322.19
1,586.63
1,851.06
손익(백만)
가격


WU6-WHEAT FUTURE(CBT) SEP16
717.11
537.83



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ6	SOYBEAN OIL FUTR DEC16	57
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	28
CU6	CORN FUTURE SEP16	147
KCU6	COFFEE 'C' FUTURE SEP16	51
KWU6	KC HRW WHEAT FUT SEP16	18
SBV6	SUGAR #11 (WORLD) OCT16	97
SMZ6	SOYBEAN MEAL FUTR DEC16	70
SX6	SOYBEAN FUTURE NOV16	139
WU6	WHEAT FUTURE(CBT) SEP16	0

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

937