공시일	2016-07-29
기준일	2016-07-28

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	2016-07-29
기준일	2016-07-28

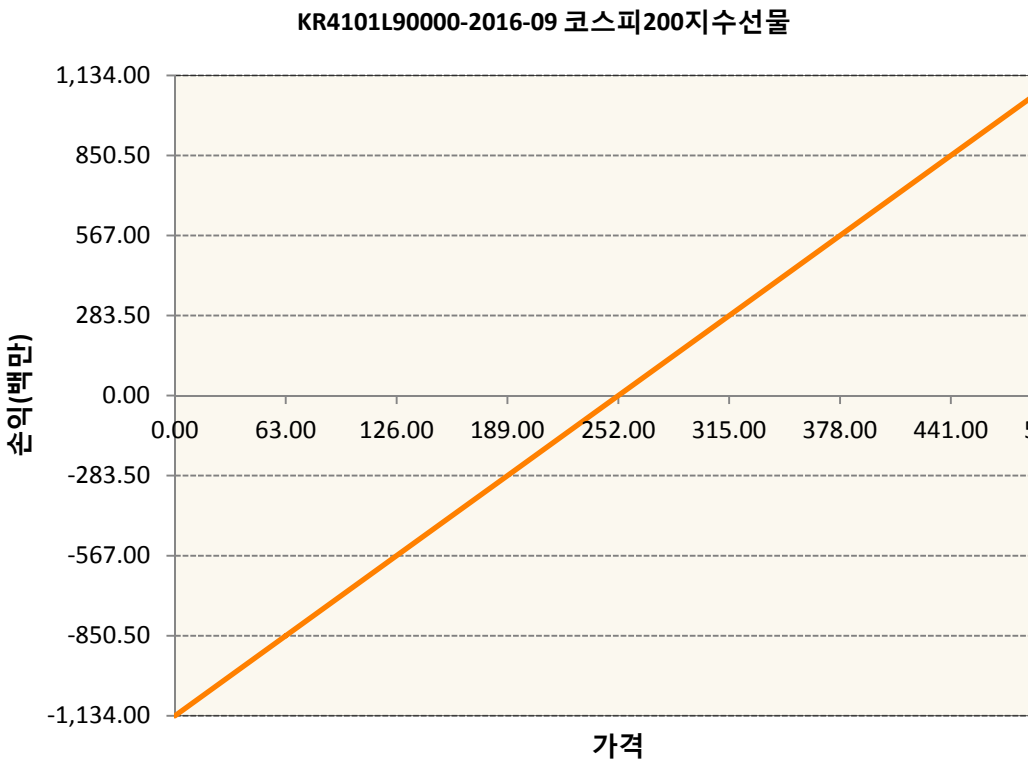
스마트인덱스모

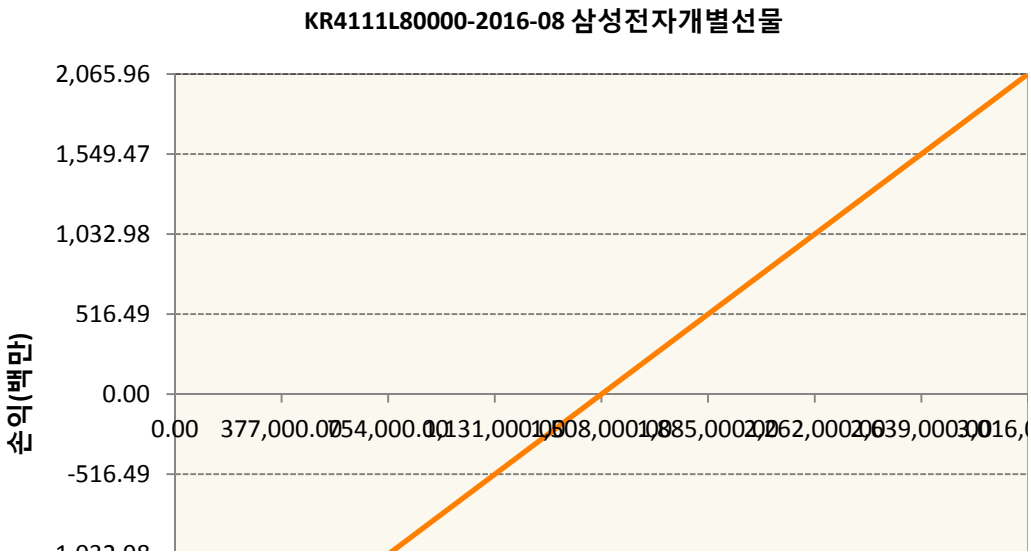
1. 계약금액

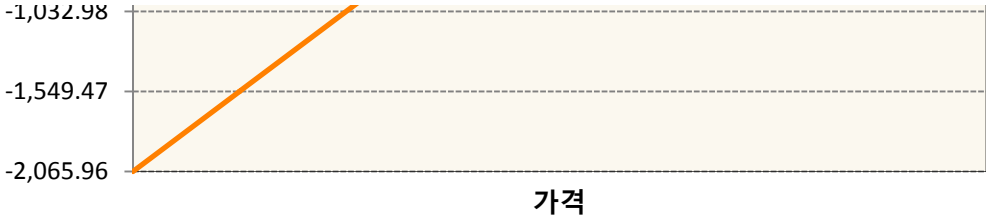
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	75	-75	장내
누계	유가증권	선물	3,200	0	3,200	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						91
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
-5.33%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
-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%	60	60	60	60	60	60	60
8.00%	91	91	91	91	91	91	91

KR4111L800	2016-08 삼성전자개별선물						165
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-165	-165	-165	-165	-165	-165	-165
-5.33%	-110	-110	-110	-110	-110	-110	-110
-2.67%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	55	55	55	55	55	55	55
5.33%	110	110	110	110	110	110	110
8.00%	165	165	165	165	165	165	165

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

243

공시일	2016-07-29
기준일	2016-07-28

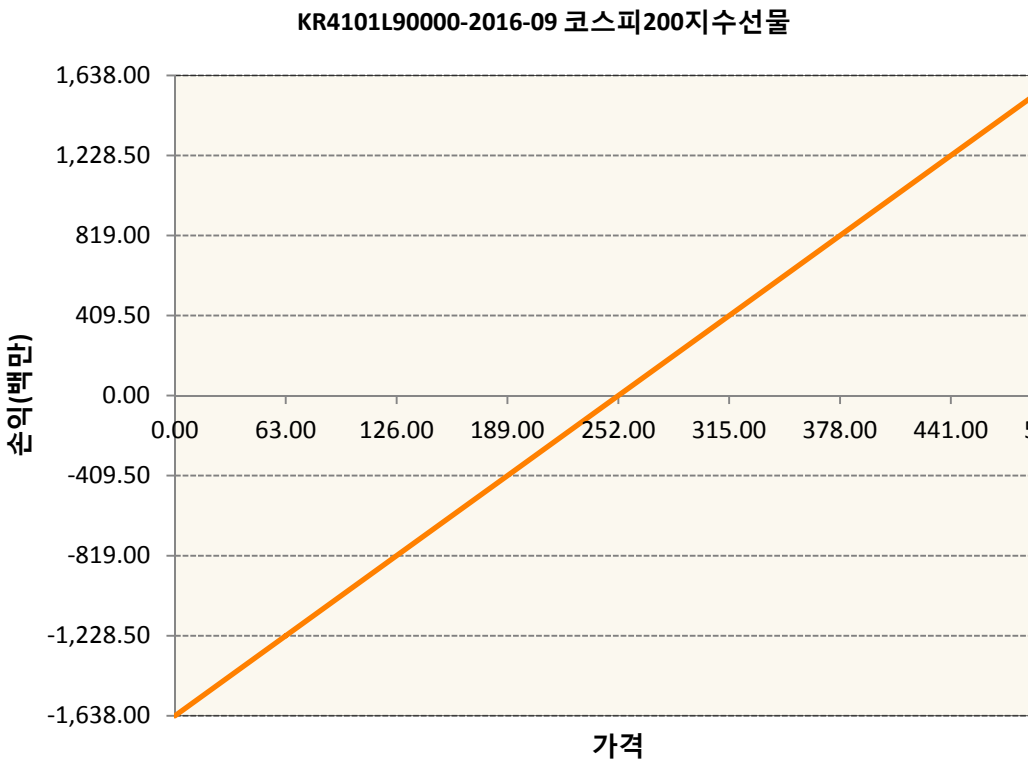
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,638	0	1,638	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						131
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-5.33%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	44	44	44	44	44	44	44
5.33%	87	87	87	87	87	87	87
8.00%	131	131	131	131	131	131	131

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

108

공시일	2016-07-29
기준일	2016-07-28

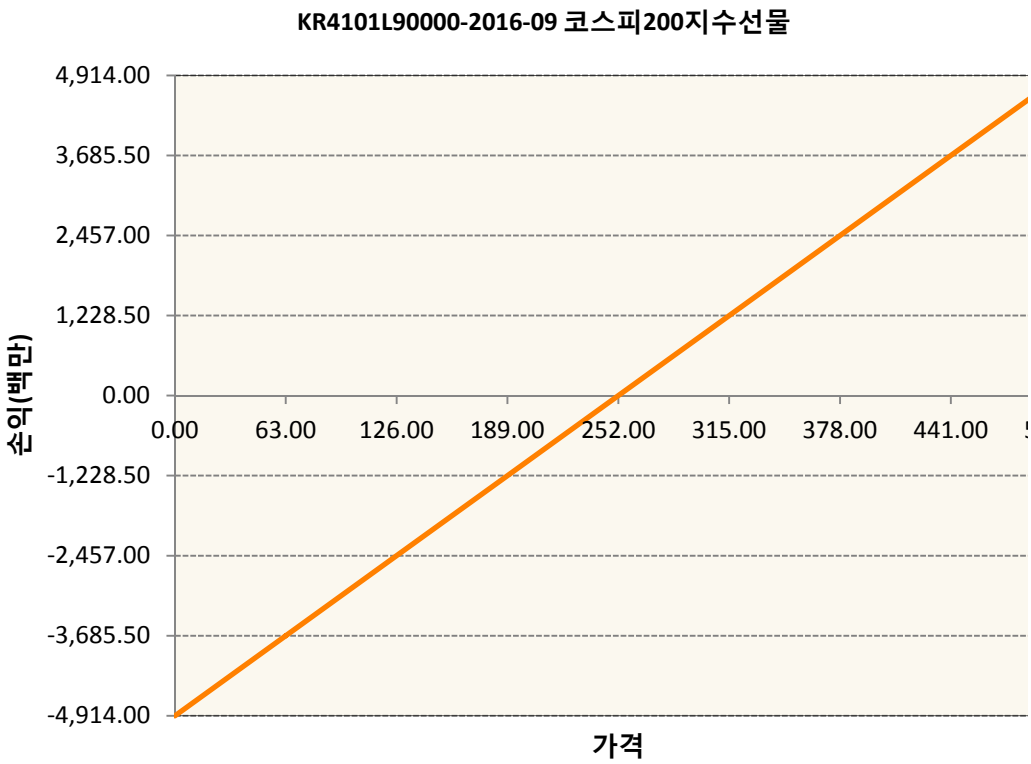
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	4,914	0	4,914	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						393
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-393	-393	-393	-393	-393	-393	-393
-5.33%	-262	-262	-262	-262	-262	-262	-262
-2.67%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	131	131	131	131	131	131	131
5.33%	262	262	262	262	262	262	262
8.00%	393	393	393	393	393	393	393

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

323

공시일	2016-07-29
기준일	2016-07-28

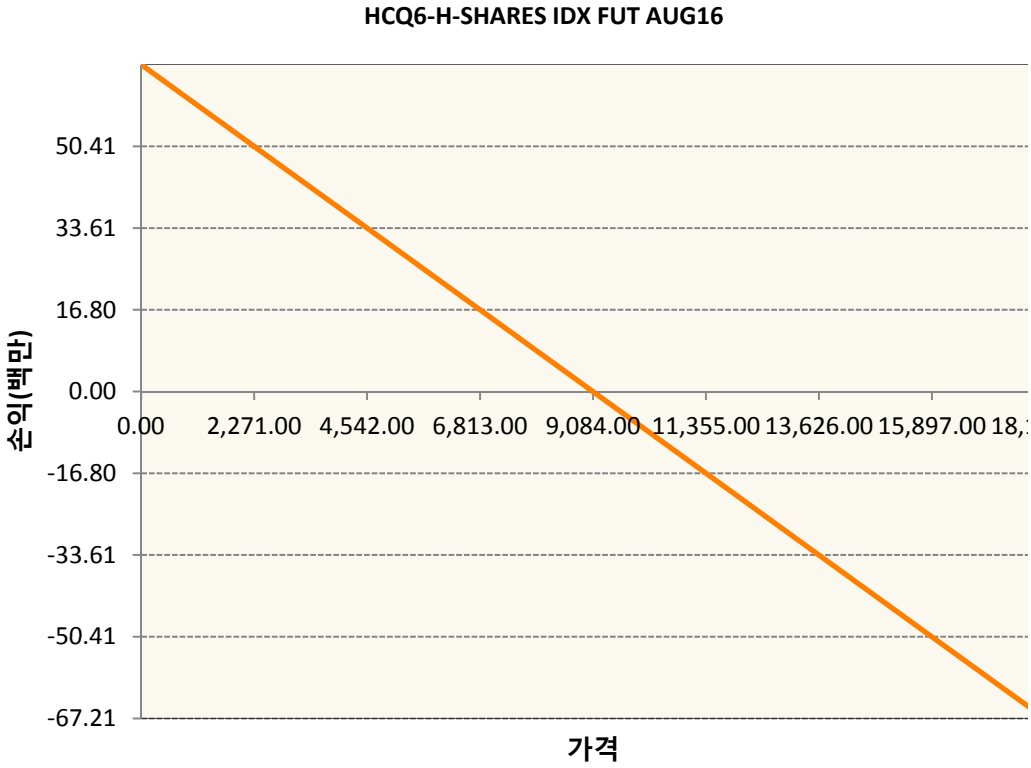
아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

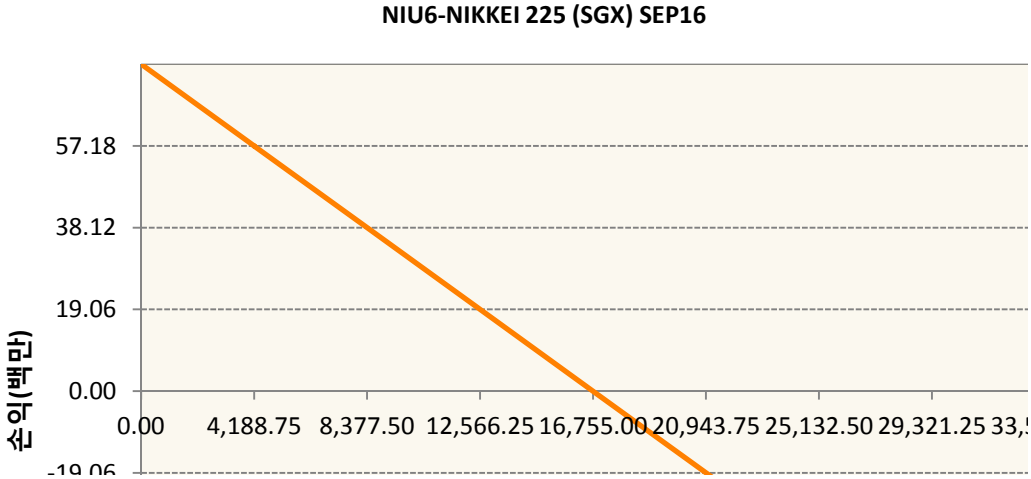
1. 계약금액

(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	76	-76	
누계	유가증권	선물	0	67	-67	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCQ6	H-SHARES IDX FUT AUG16	5
NIU6	NIKKEI 225 (SGX) SEP16	6

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

15

공시일	2016-07-29
기준일	2016-07-28

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	875

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

808

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-07-29
기준일	2016-07-28

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	393

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,002

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-07-29
기준일	2016-07-28

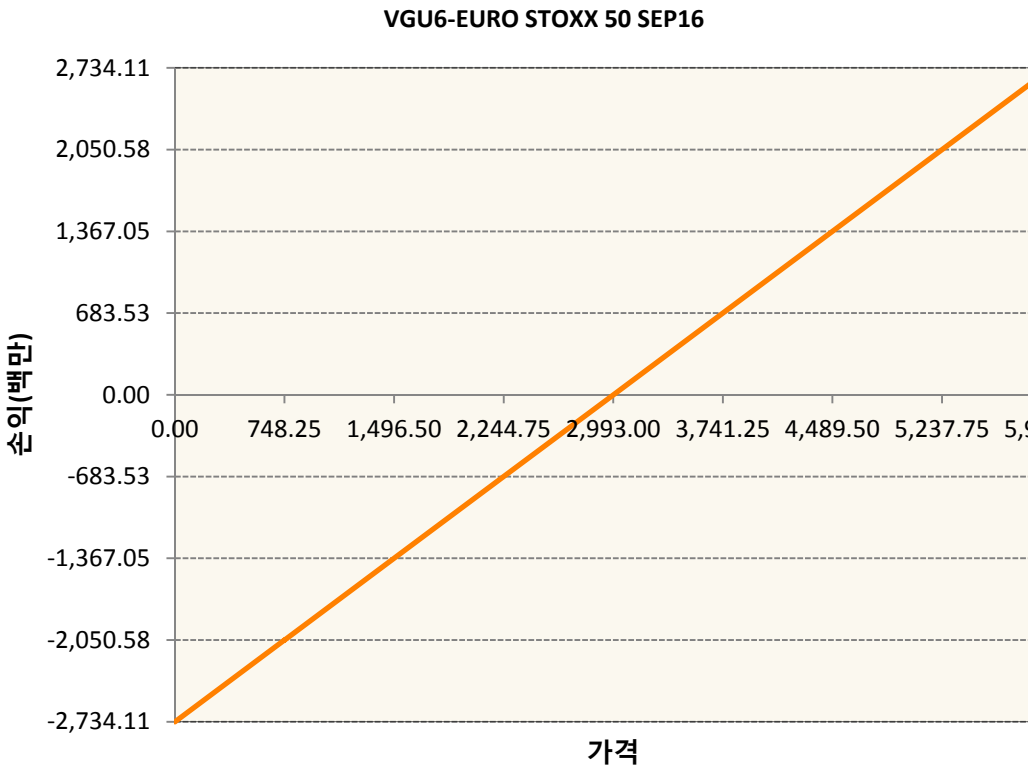
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,734	0	2,734	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 SEP16	219

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

(단위:백만원)

271

공시일	2016-07-29
기준일	2016-07-28

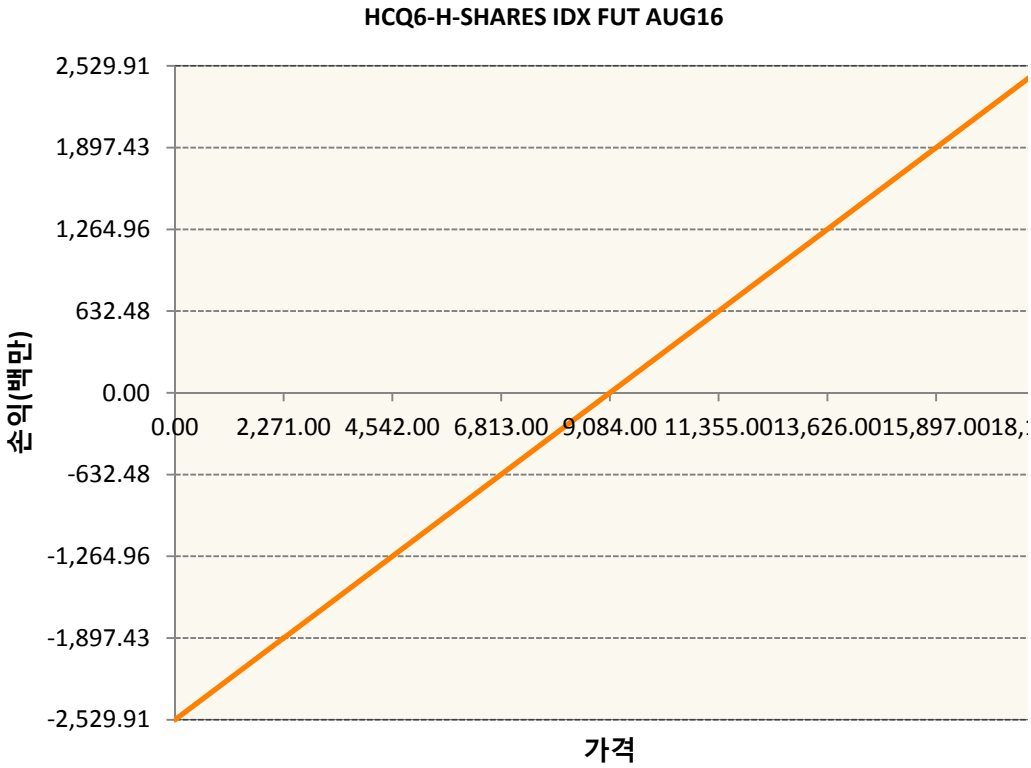
차이나인덱스모(주식-파생형)

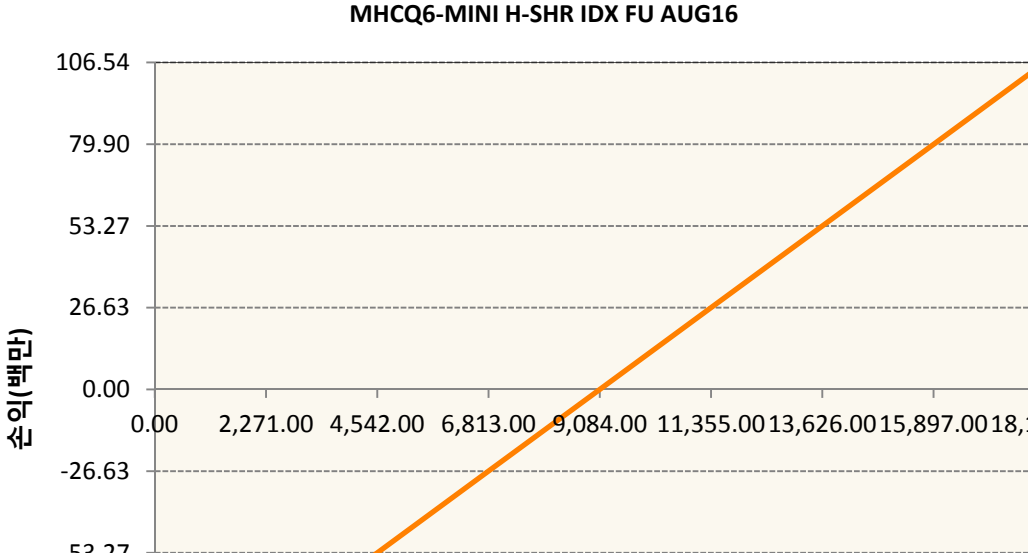
1. 계약금액

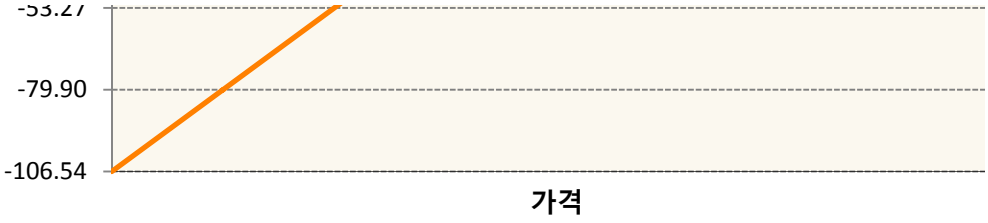
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,636	0	2,636	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ6	H-SHARES IDX FUT AUG16	202
MHCQ6	MINI H-SHR IDX FU AUG16	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	295

공시일	2016-07-29
기준일	2016-07-28

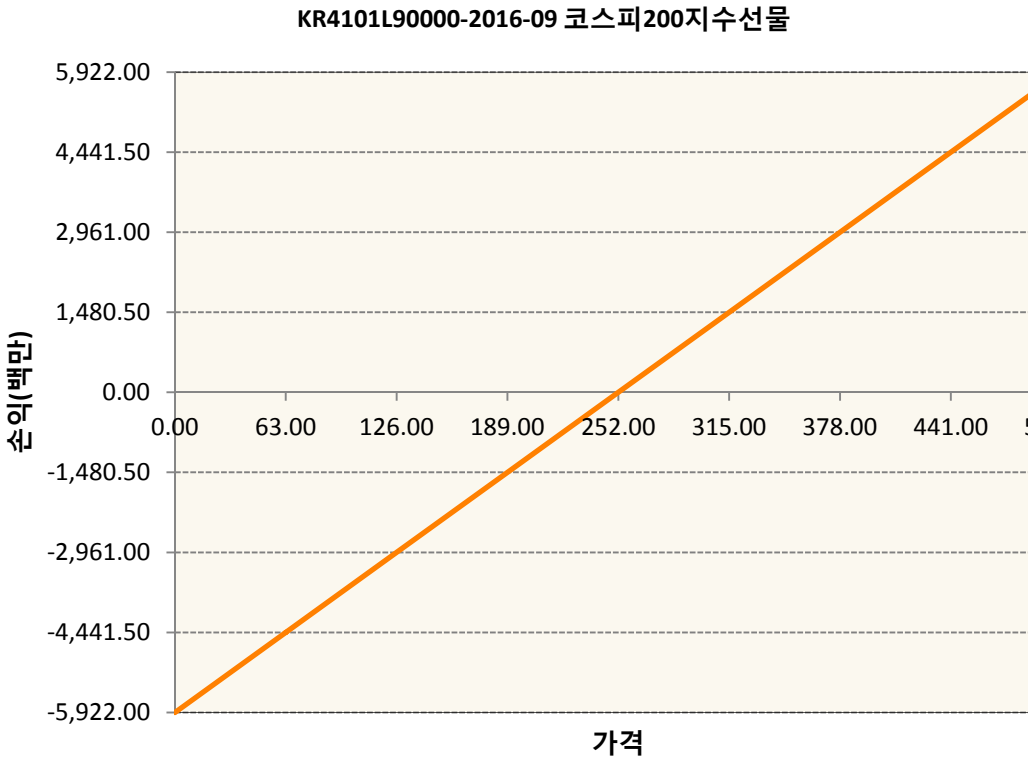
커버드콜(주식혼합-파생형)

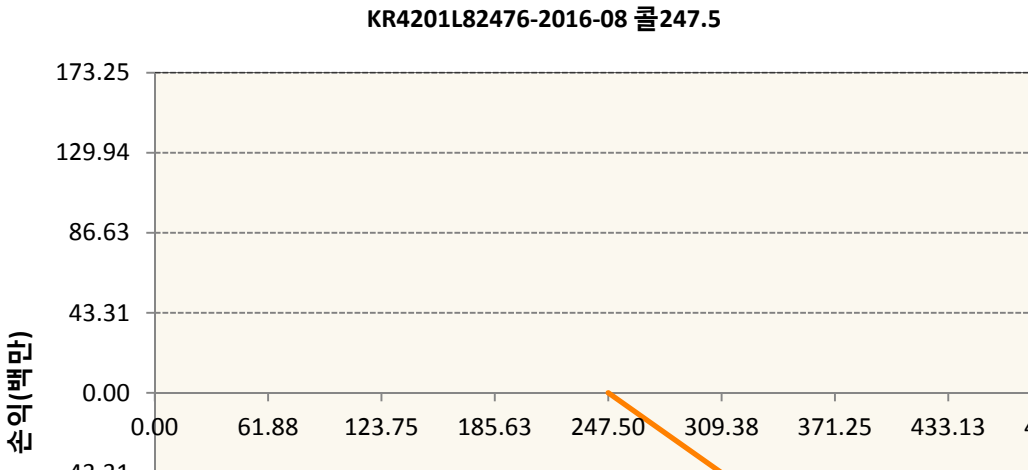
1. 계약금액

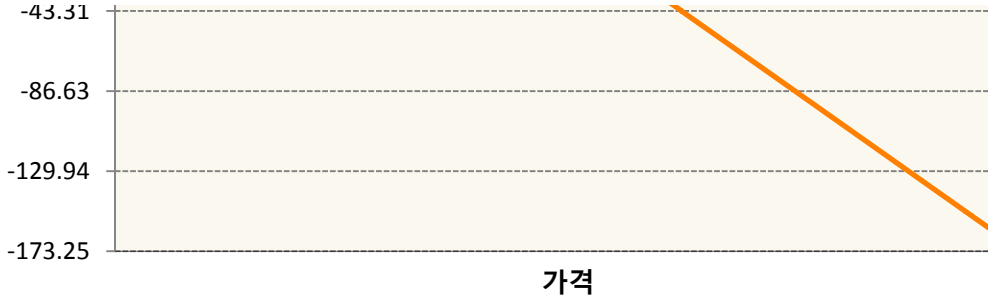
(단위:백만원)

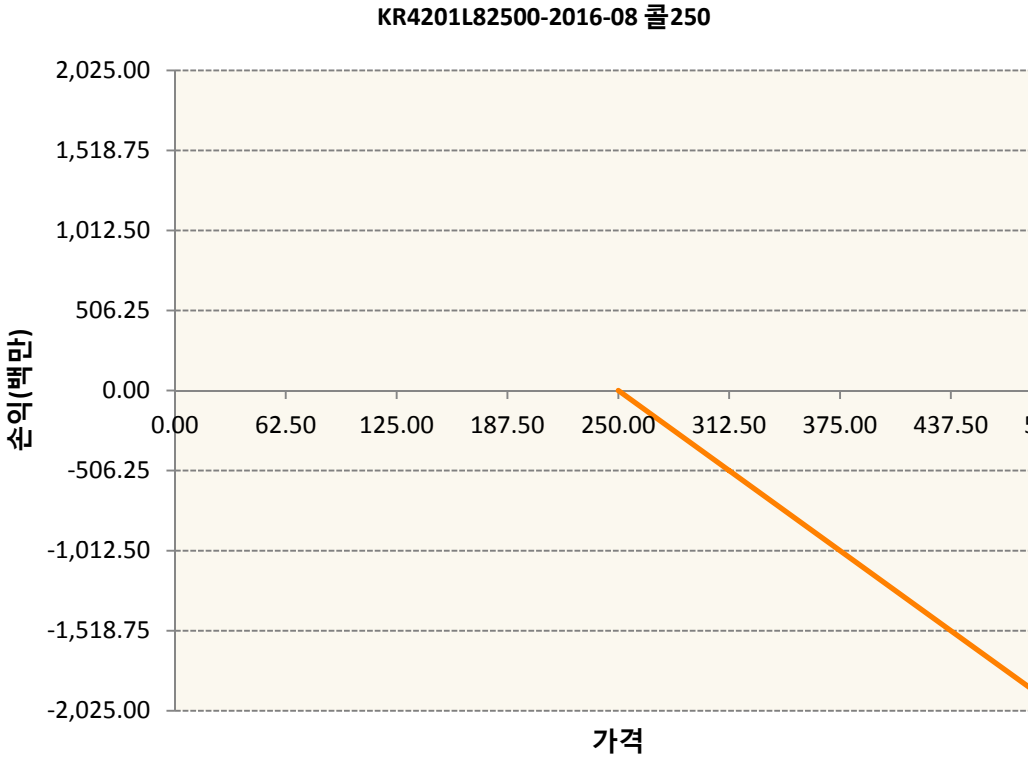
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	126	0	126	장내
신규	유가증권	옵션	0	25	-25	장내
누계	유가증권	선물	5,922	0	5,922	장내
누계	유가증권	옵션	0	2,198	-2,198	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101L900 2016-09 코스피200지수선물							473
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-473	-473	-473	-473	-473	-473	-473
-5.33%	-316	-316	-316	-316	-316	-316	-316
-2.67%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	158	158	158	158	158	158	158
5.33%	316	316	316	316	316	316	316
8.00%	473	473	473	473	473	473	473
KR4201L824 2016-08 콜247.5							68
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	18	18	18	18	18	18	18
-5.33%	18	18	18	18	17	17	17
-2.67%	15	15	14	13	13	12	11
0%	1	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
5.33%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
8.00%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68
KR4201L825	2016-08 콜250						751

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	139	139	139	139	139	139	138
-5.33%	139	138	138	137	135	134	132
-2.67%	126	122	117	111	105	99	93
0%	23	15	8	0	-8	-16	-24
2.67%	-209	-211	-213	-216	-219	-223	-227
5.33%	-479	-479	-479	-479	-480	-480	-481
8.00%	-750	-750	-750	-750	-750	-750	-751

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

1,423

공시일	2016-07-29
기준일	2016-07-28

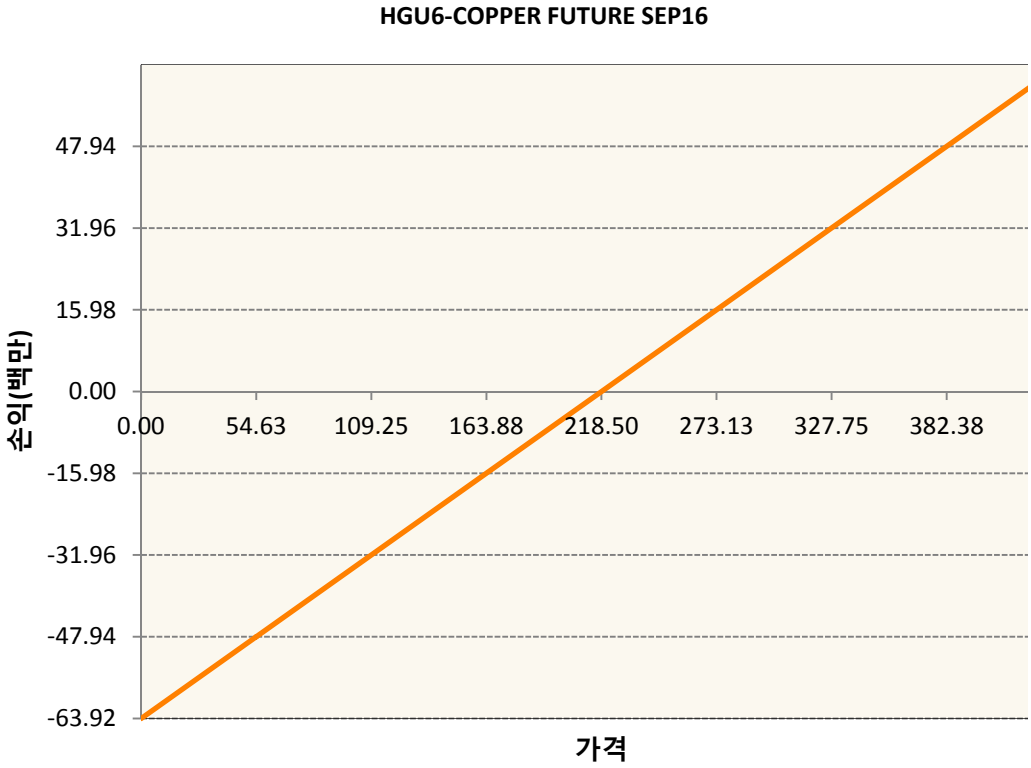
메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

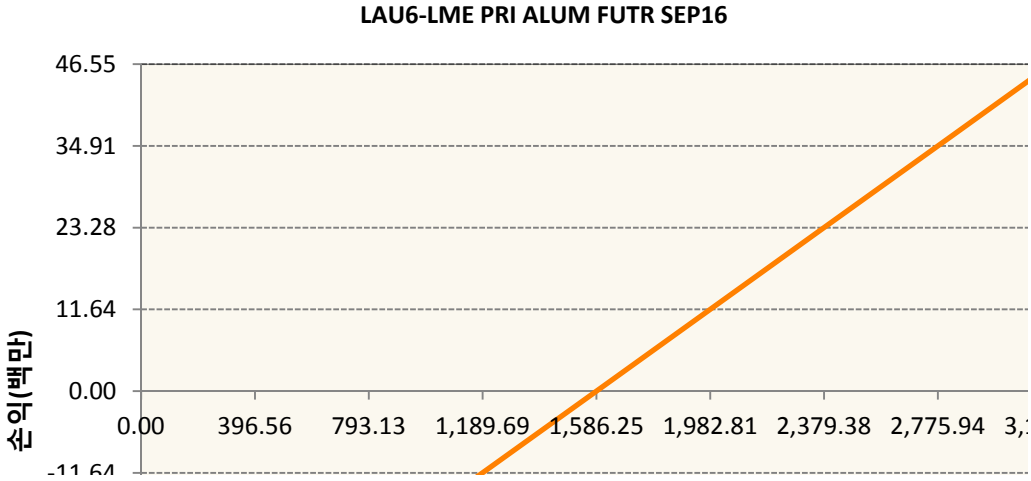
1. 계약금액

(단위:백만원)

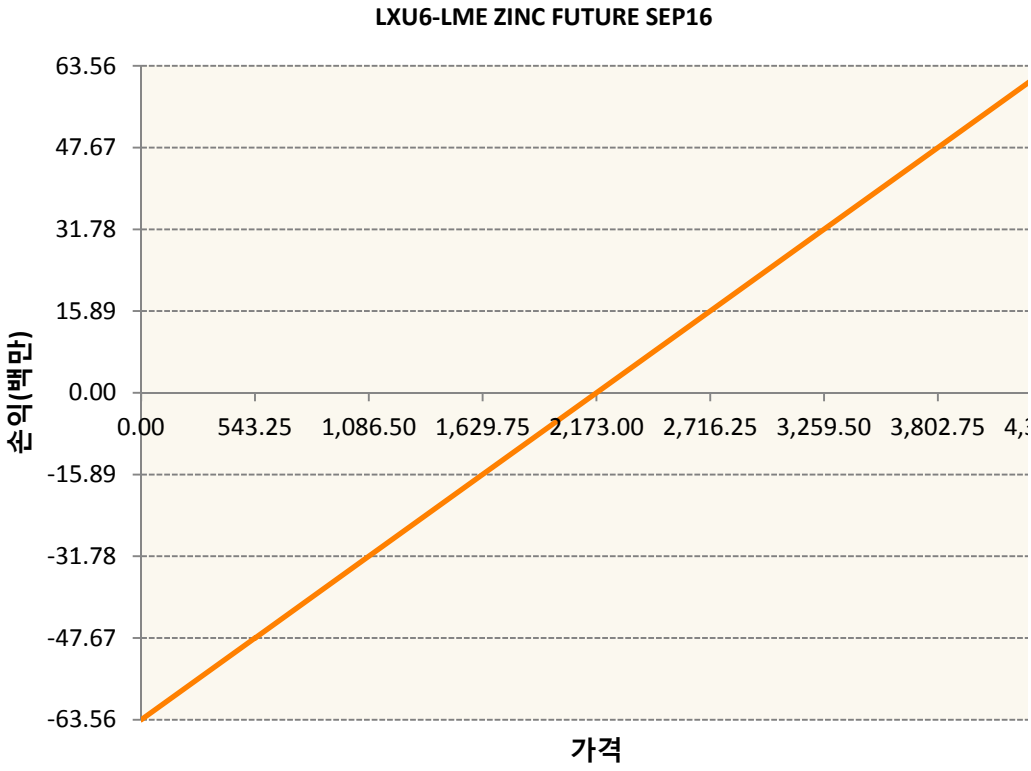
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	47	0	47	
누계	유가증권	선물	320	0	320	

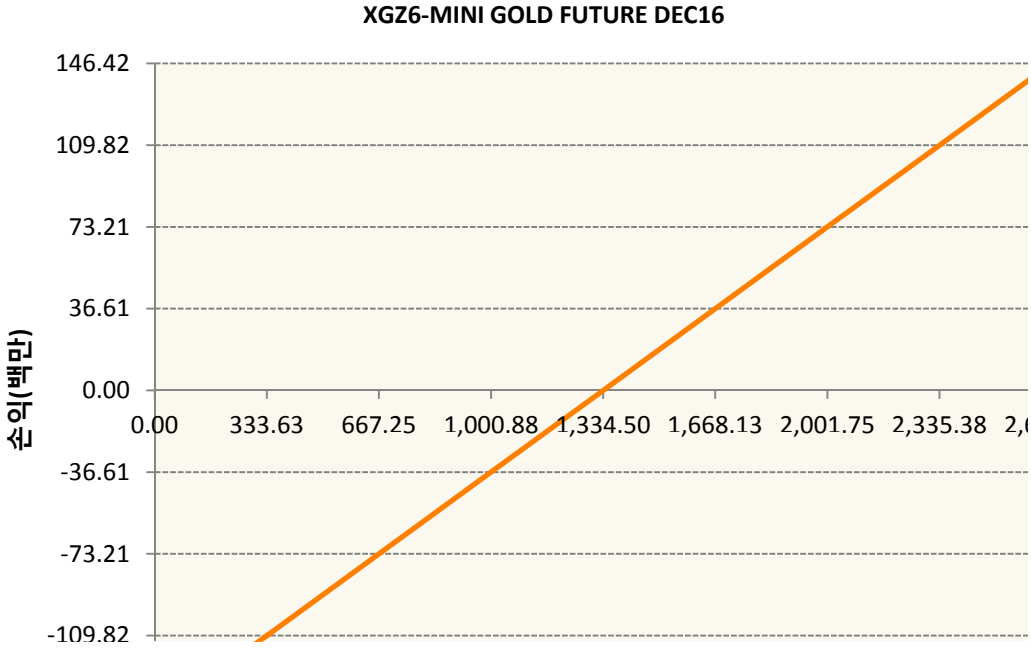
2. 만기시점의 손익구조

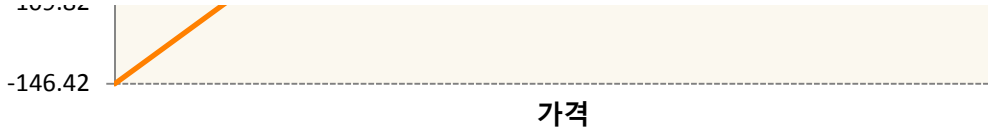


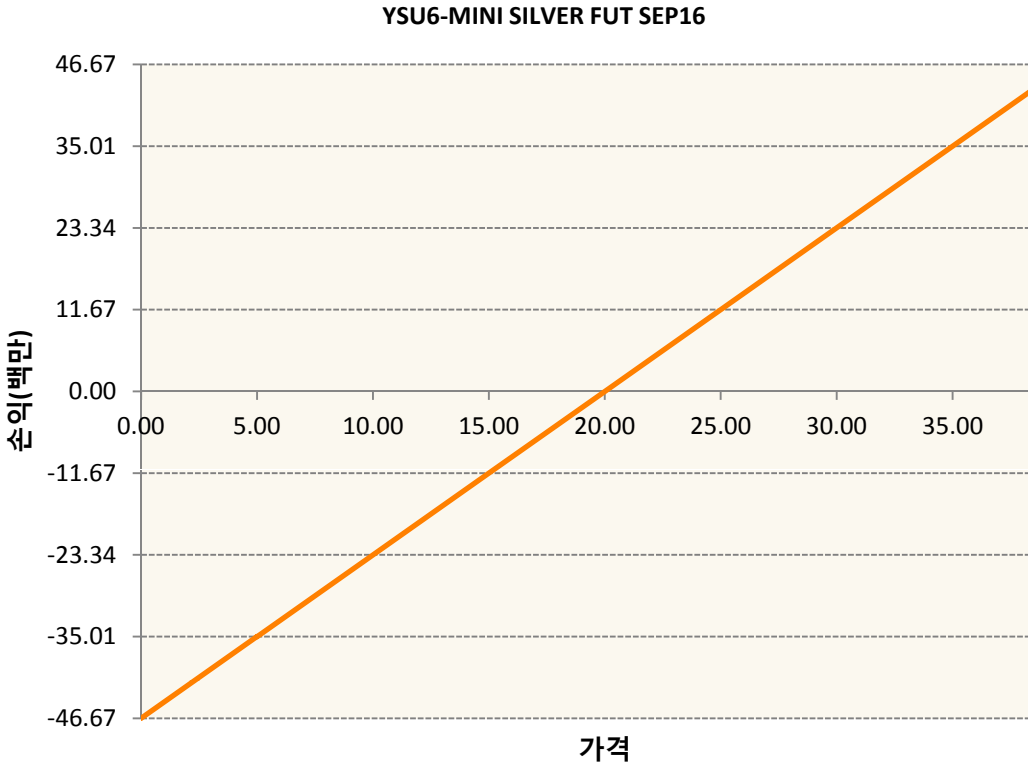



-23.28
-34.91
-46.55
가격


LXU6-LME ZINC FUTURE SEP16
63.56
47.67
31.78
15.89
0.00
0.00
543.25
1,086.50
1,629.75
2,173.00
2,716.25
3,259.50
3,802.75
-15.89
-31.78
-47.67
-63.56
순익(백만)
가격


XGZ6-MINI GOLD FUTURE DEC16
146.42
109.82
73.21
36.61
0.00
0.00
333.63
667.25
1,000.88
1,334.50
1,668.13
2,001.75
2,335.38
-36.61
-73.21
-109.82
순익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HGU6	COPPER FUTURE SEP16	5
LAU6	LME PRI ALUM FUTR SEP16	4
LXU6	LME ZINC FUTURE SEP16	5
XGZ6	MINI GOLD FUTURE DEC16	12
YSU6	MINI SILVER FUT SEP16	4

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

29

공시일	2016-07-29
기준일	2016-07-28

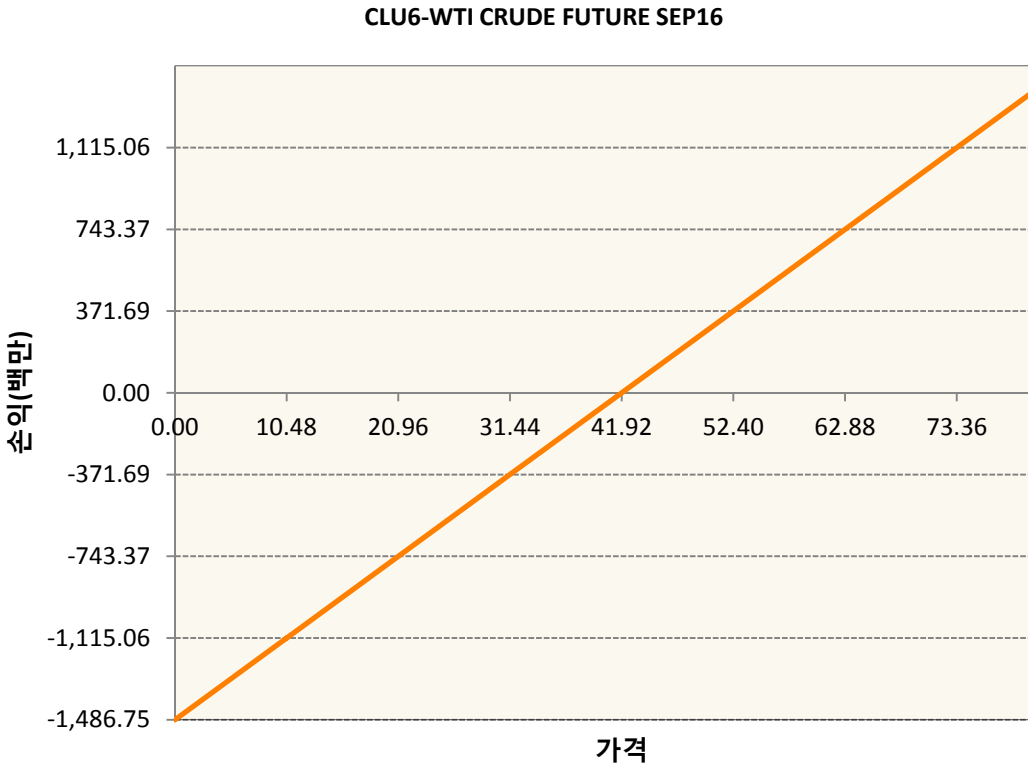
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

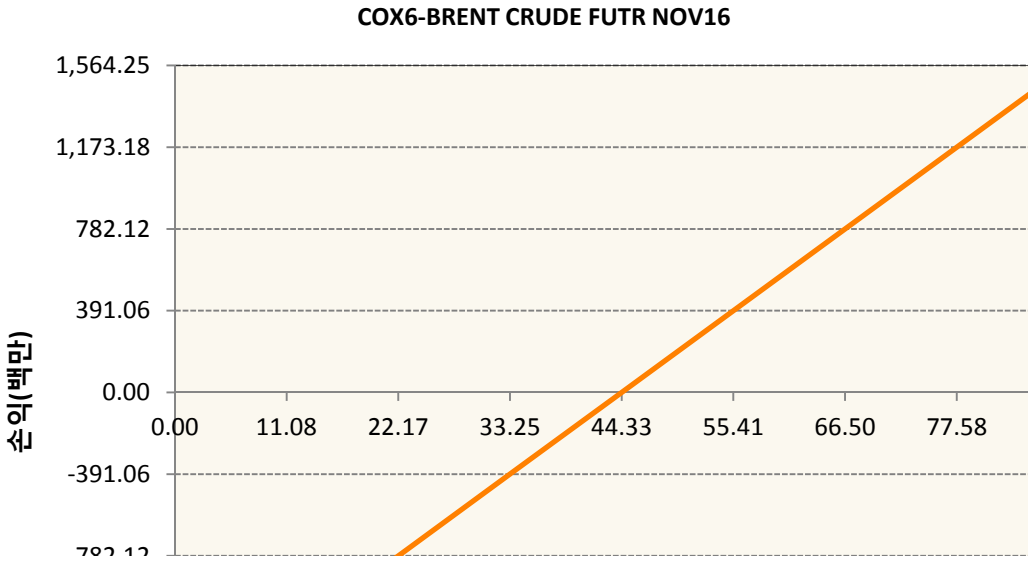
1. 계약금액

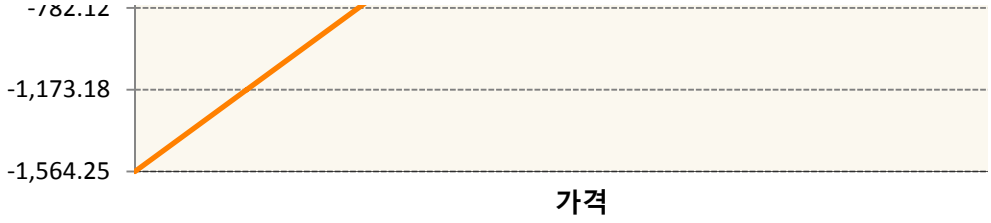
(단위:백만원)

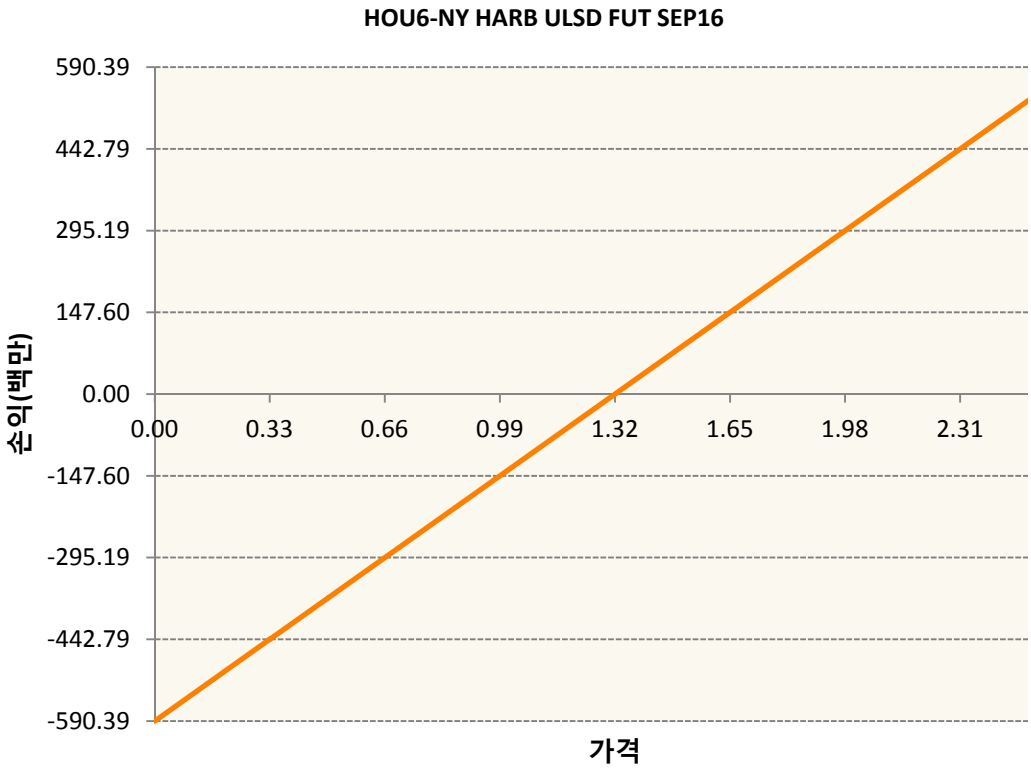
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,848	0	5,848	

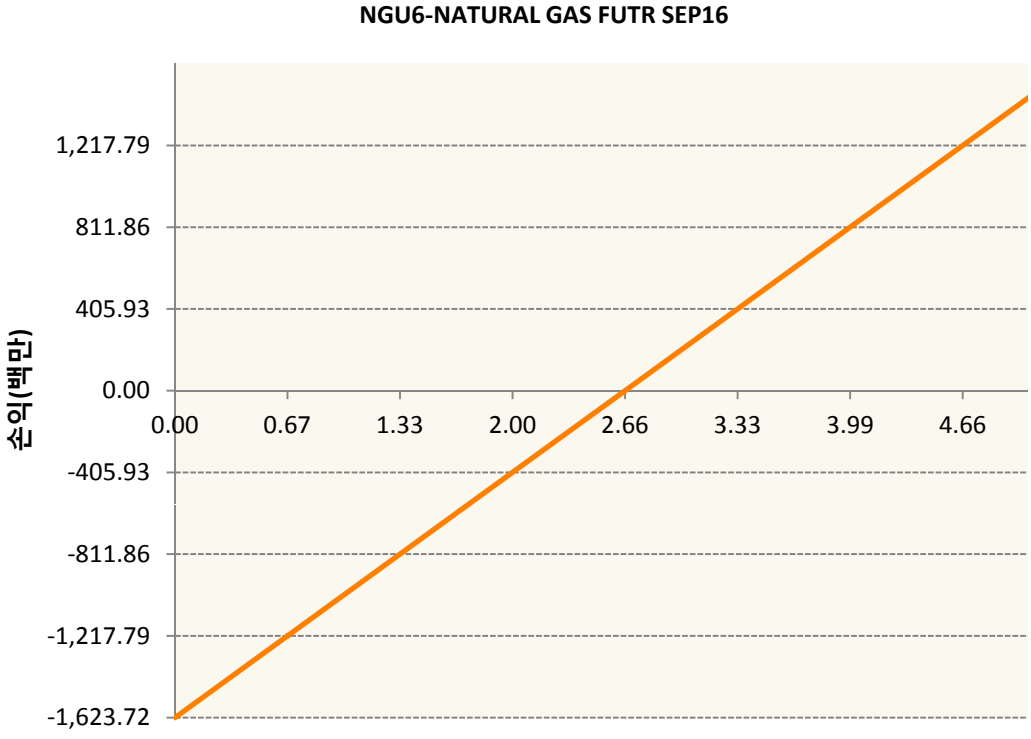
2. 만기시점의 손익구조



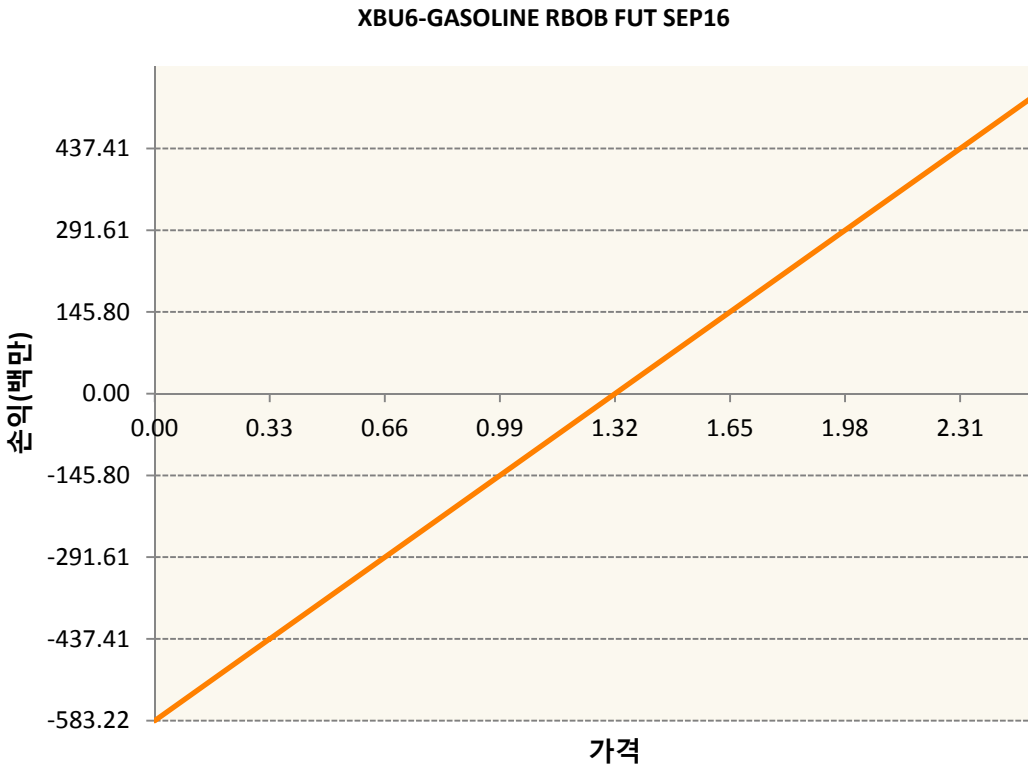



-1,173.18
-1,564.25
가격


HOU6-NY HARB ULSD FUT SEP16
590.39
442.79
295.19
147.60
0.00
-147.60
-295.19
-442.79
-590.39
0.00
0.33
0.66
0.99
1.32
1.65
1.98
2.31
순익(백만)
가격


NGU6-NATURAL GAS FUTR SEP16
1,217.79
811.86
405.93
0.00
-405.93
-811.86
-1,217.79
-1,623.72
0.00
0.67
1.33
2.00
2.66
3.33
3.99
4.66
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLU6	WTI CRUDE FUTURE SEP16	119
COX6	BRENT CRUDE FUTR NOV16	125
HOU6	NY HARB ULSD FUT SEP16	47
NGU6	NATURAL GAS FUTR SEP16	130
XBU6	GASOLINE RBOB FUT SEP16	47

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,065

공시일	2016-07-29
기준일	2016-07-28

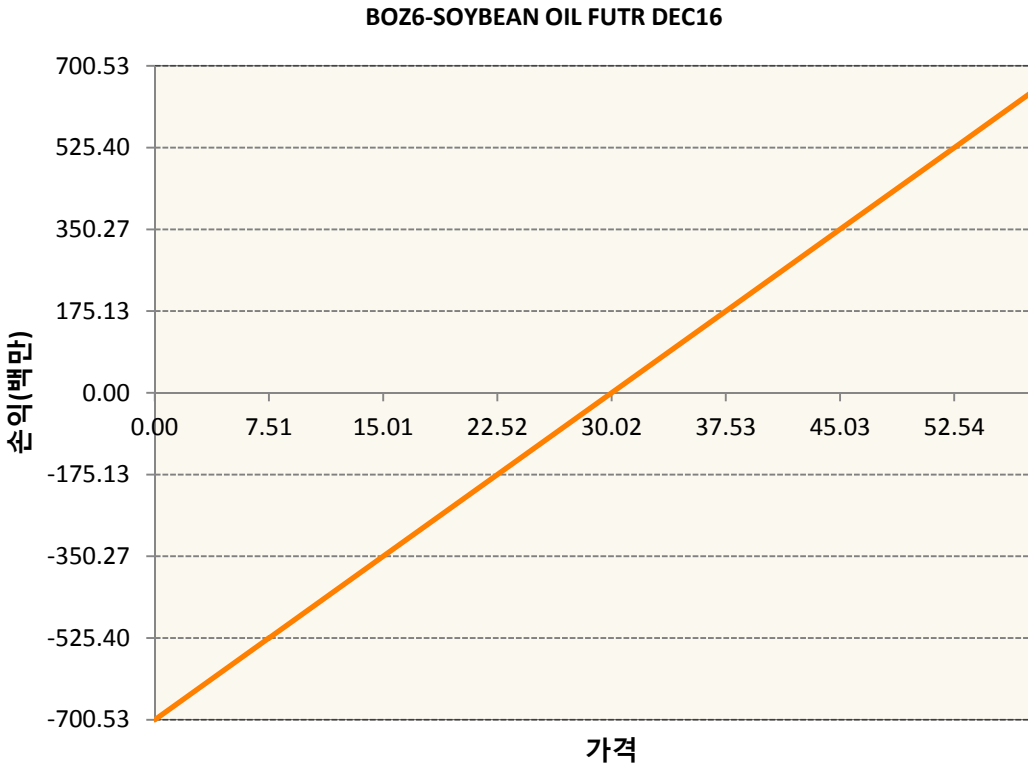
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

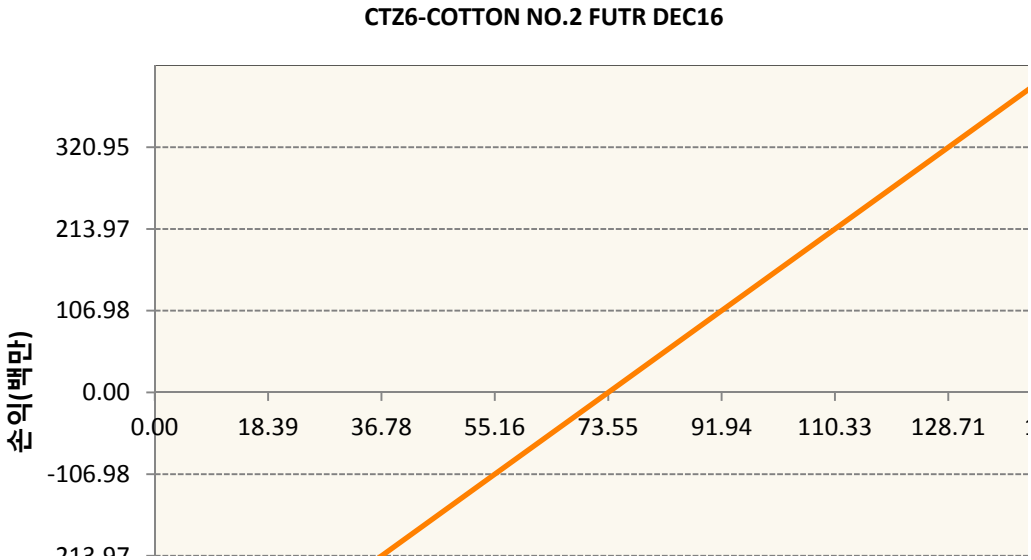
1. 계약금액

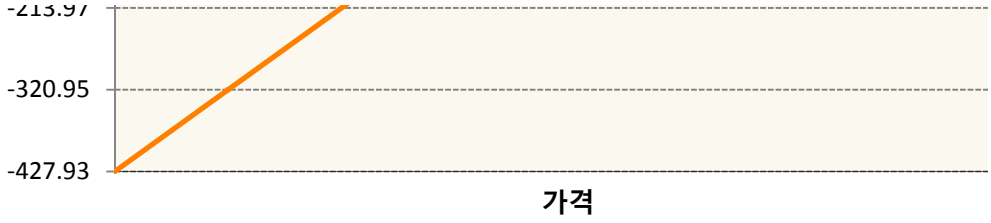
(단위:백만원)

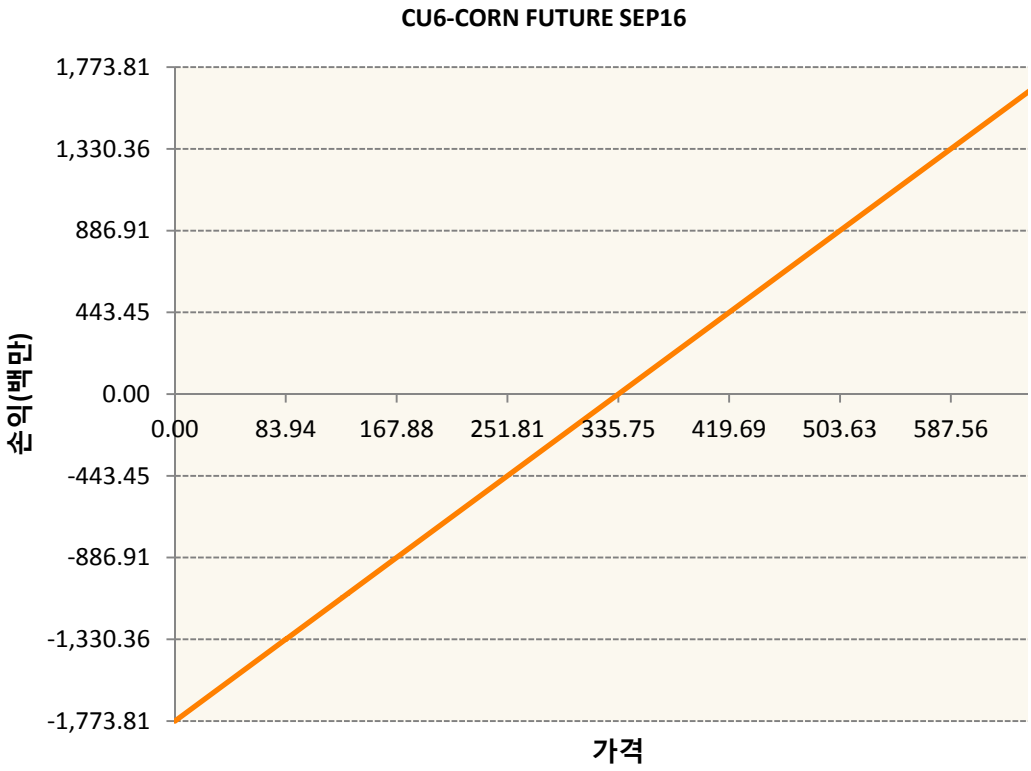
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,114	0	8,114	

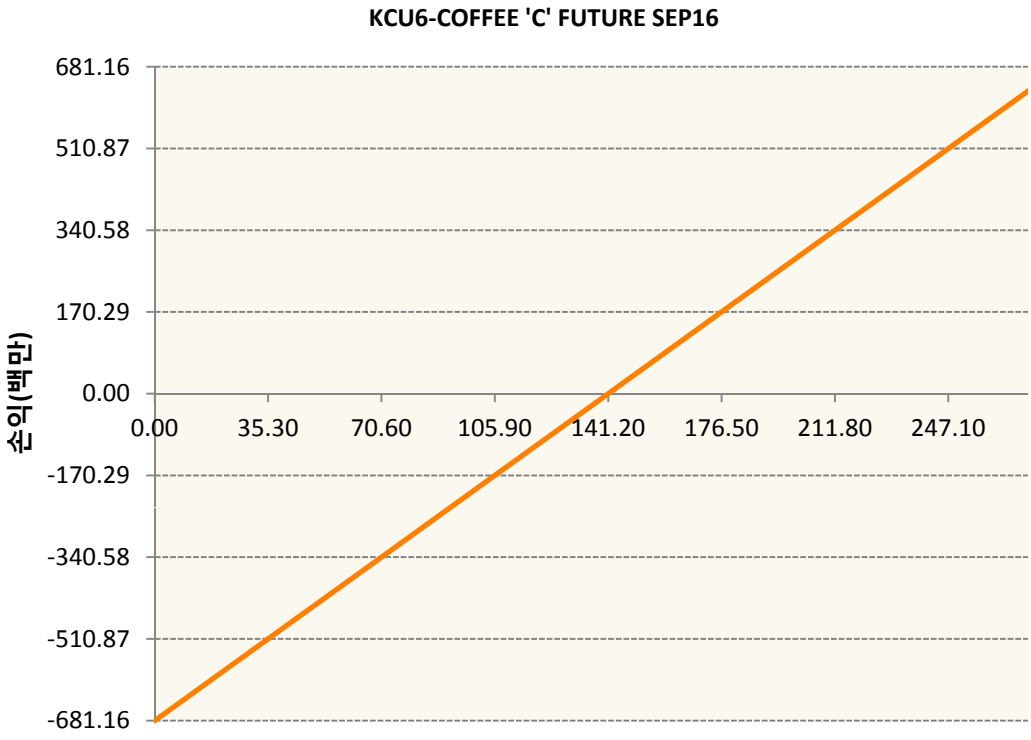
2. 만기시점의 손익구조



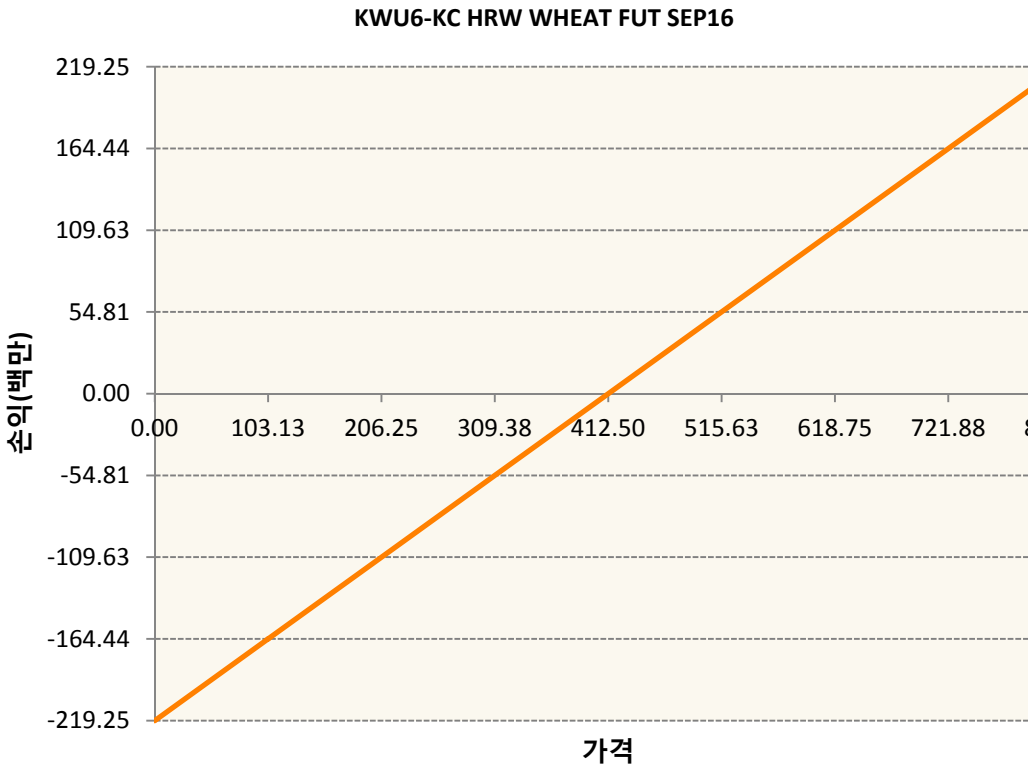


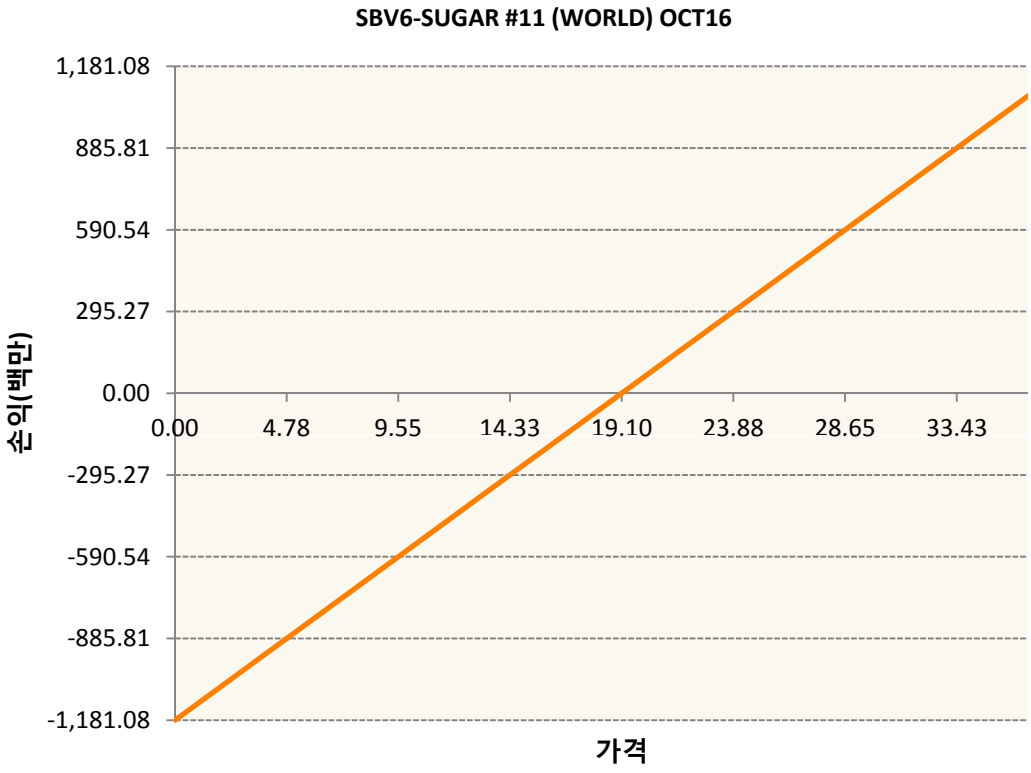

-213.97
-320.95
-427.93
가격

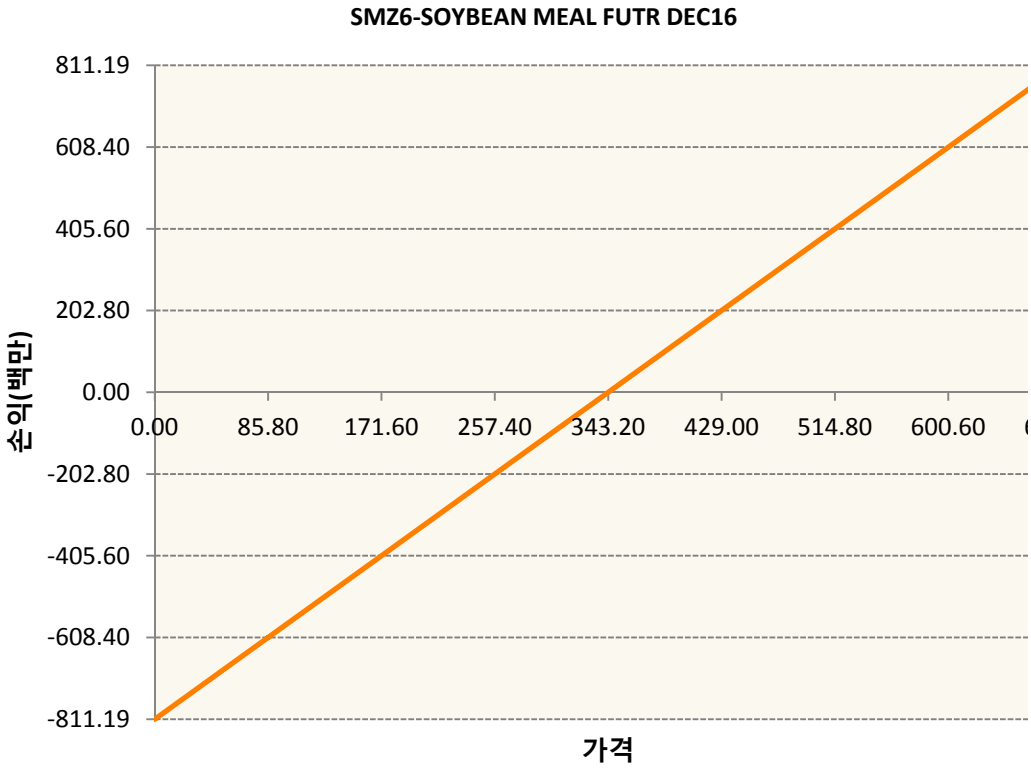

CU6-CORN FUTURE SEP16
1,773.81
1,330.36
886.91
443.45
0.00
-443.45
-886.91
-1,330.36
-1,773.81
0.00
83.94
167.88
251.81
335.75
419.69
503.63
587.56
순익(백만)
가격

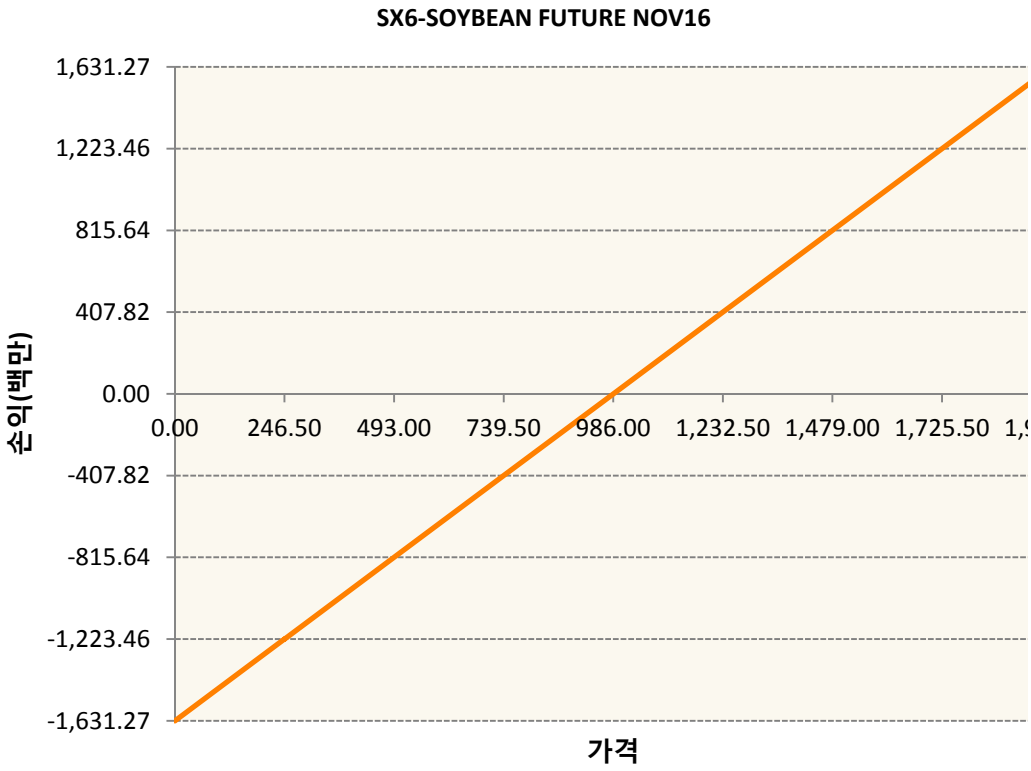

KCU6-COFFEE 'C' FUTURE SEP16
681.16
510.87
340.58
170.29
0.00
-170.29
-340.58
-510.87
-681.16
0.00
35.30
70.60
105.90
141.20
176.50
211.80
247.10
순익(백만)

가격

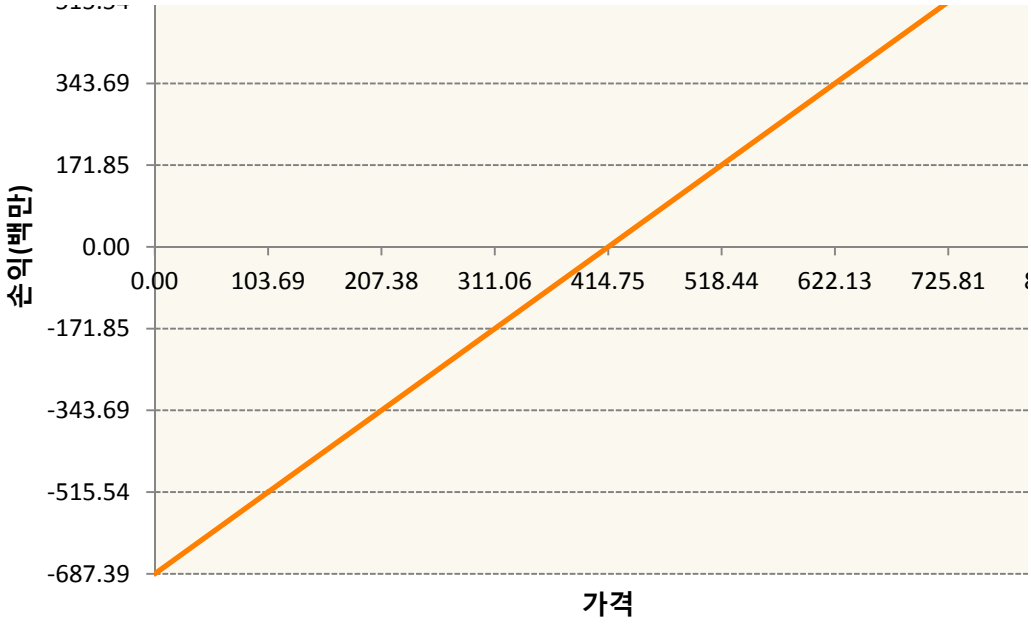

KWU6-KC HRW WHEAT FUT SEP16
219.25
164.44
109.63
54.81
0.00
-54.81
-109.63
-164.44
-219.25
0.00
103.13
206.25
309.38
412.50
515.63
618.75
721.88
손익(백만)
가격


SBV6-SUGAR #11 (WORLD) OCT16
1,181.08
885.81
590.54
295.27
0.00
-295.27
-590.54
-885.81
-1,181.08
0.00
4.78
9.55
14.33
19.10
23.88
28.65
33.43
손익(백만)
가격


SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16
811.19
608.40
405.60
202.80
0.00
-202.80
-405.60
-608.40
-811.19
0.00
85.80
171.60
257.40
343.20
429.00
514.80
600.60
손익(백만)
가격


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16
1,631.27
1,223.46
815.64
407.82
0.00
-407.82
-815.64
-1,223.46
-1,631.27
0.00
246.50
493.00
739.50
986.00
1,232.50
1,479.00
1,725.50
손익(백만)
가격


WU6-WHEAT FUTURE(CBT) SEP16
515.54



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ6	SOYBEAN OIL FUTR DEC16	56
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	34
CU6	CORN FUTURE SEP16	142
KCU6	COFFEE 'C' FUTURE SEP16	54
KWU6	KC HRW WHEAT FUT SEP16	18
SBV6	SUGAR #11 (WORLD) OCT16	94
SMZ6	SOYBEAN MEAL FUTR DEC16	65
SX6	SOYBEAN FUTURE NOV16	131
WU6	WHEAT FUTURE(CBT) SEP16	55

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

847