공시일	2016-08-05
기준일	2016-08-04

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	2016-08-05
기준일	2016-08-04

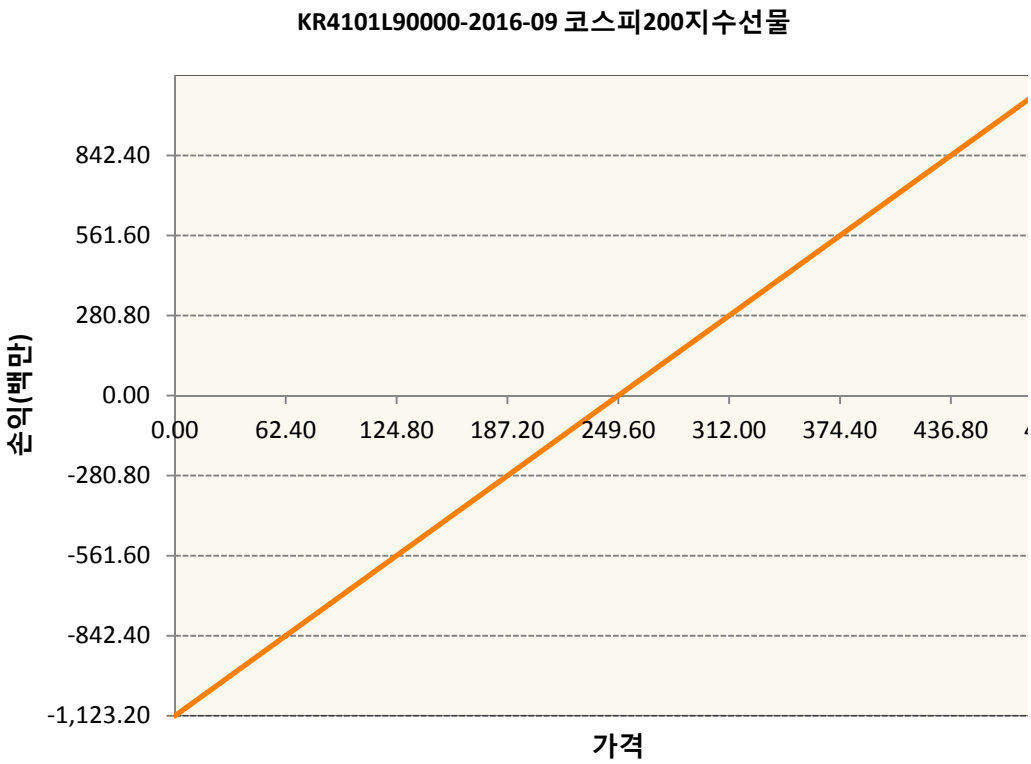
스마트인덱스모

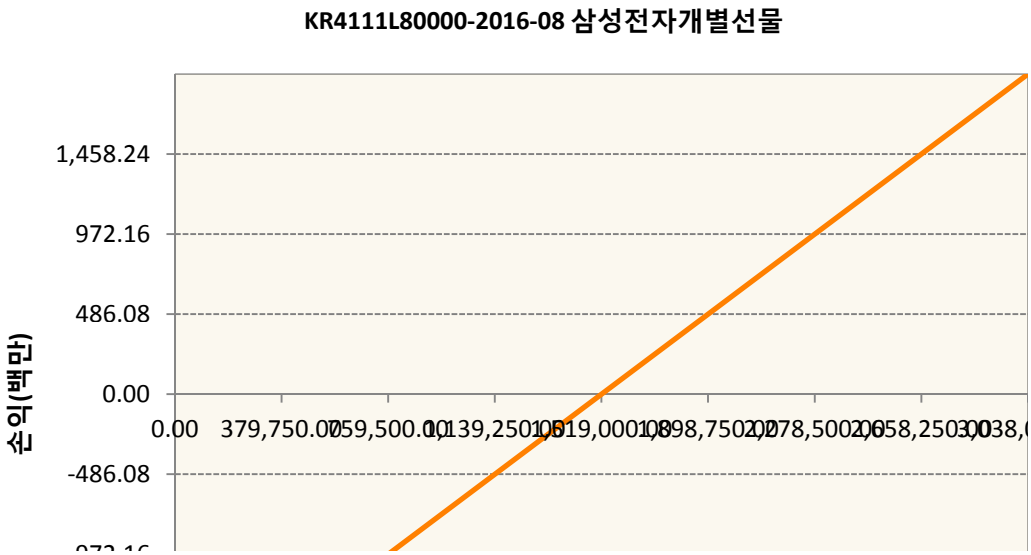
1. 계약금액

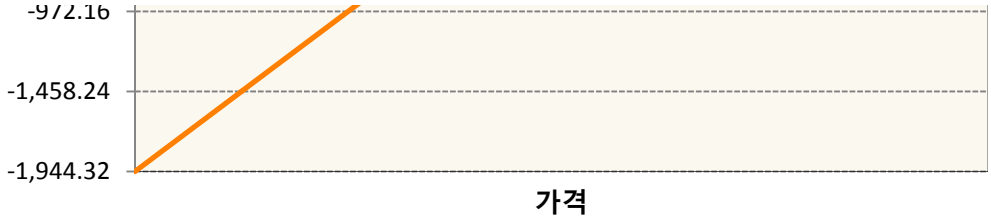
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,068	0	3,068	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						90
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90
-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%	90	90	90	90	90	90	90

KR4111L800	2016-08 삼성전자개별선물						155
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-155	-155	-155	-155	-155	-155	-155
-5.33%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104
-2.67%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	52	52	52	52	52	52	52
5.33%	104	104	104	104	104	104	104
8.00%	155	155	155	155	155	155	155

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

235

공시일	2016-08-05
기준일	2016-08-04

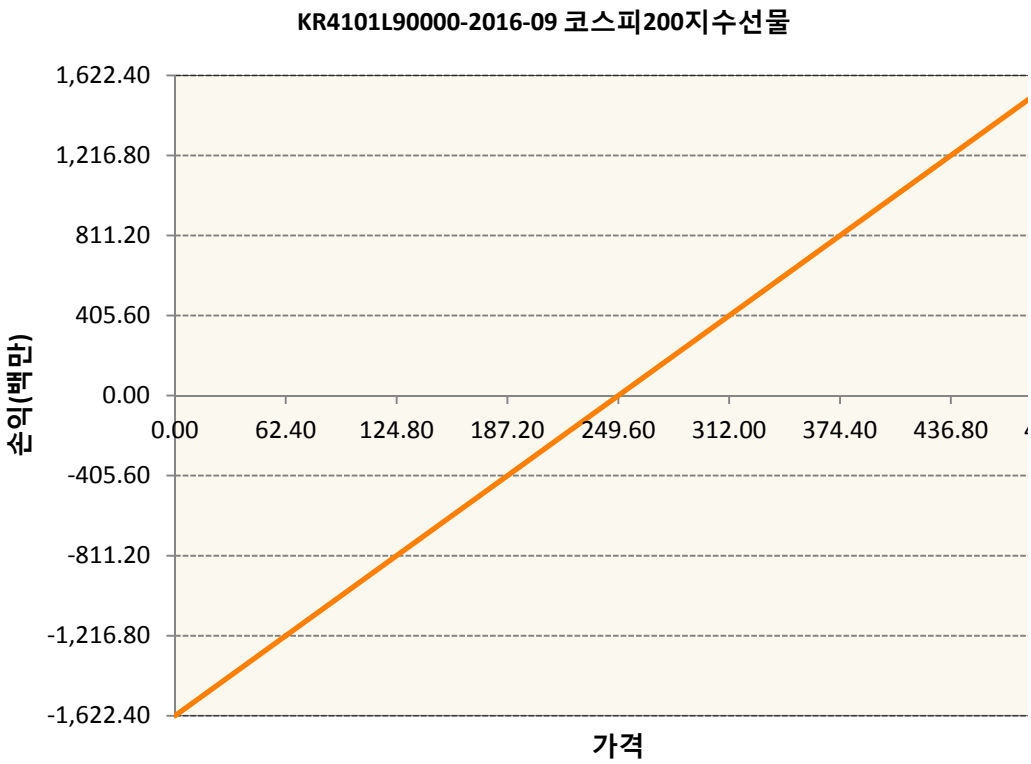
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,622	0	1,622	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%	-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%	130	130	130	130	130	130	130

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

107

공시일	2016-08-05
기준일	2016-08-04

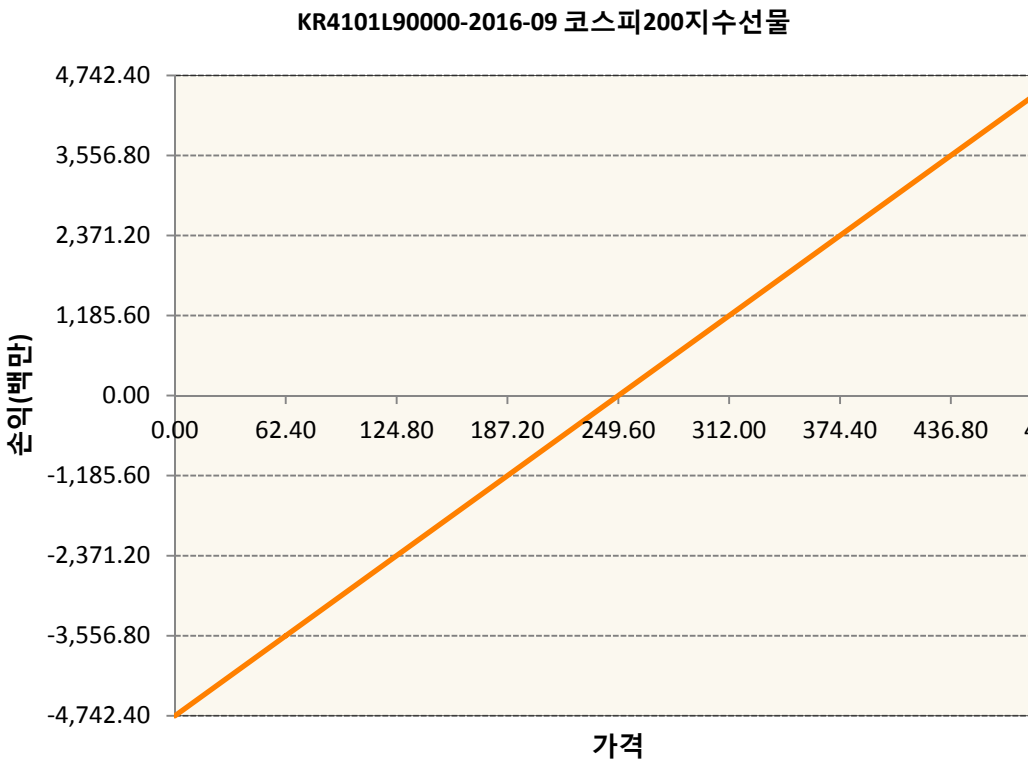
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	4,742	0	4,742	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						379
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-379	-379	-379	-379	-379	-379	-379
-5.33%	-253	-253	-253	-253	-253	-253	-253
-2.67%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	126	126	126	126	126	126	126
5.33%	253	253	253	253	253	253	253
8.00%	379	379	379	379	379	379	379

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

313

공시일	2016-08-05
기준일	2016-08-04

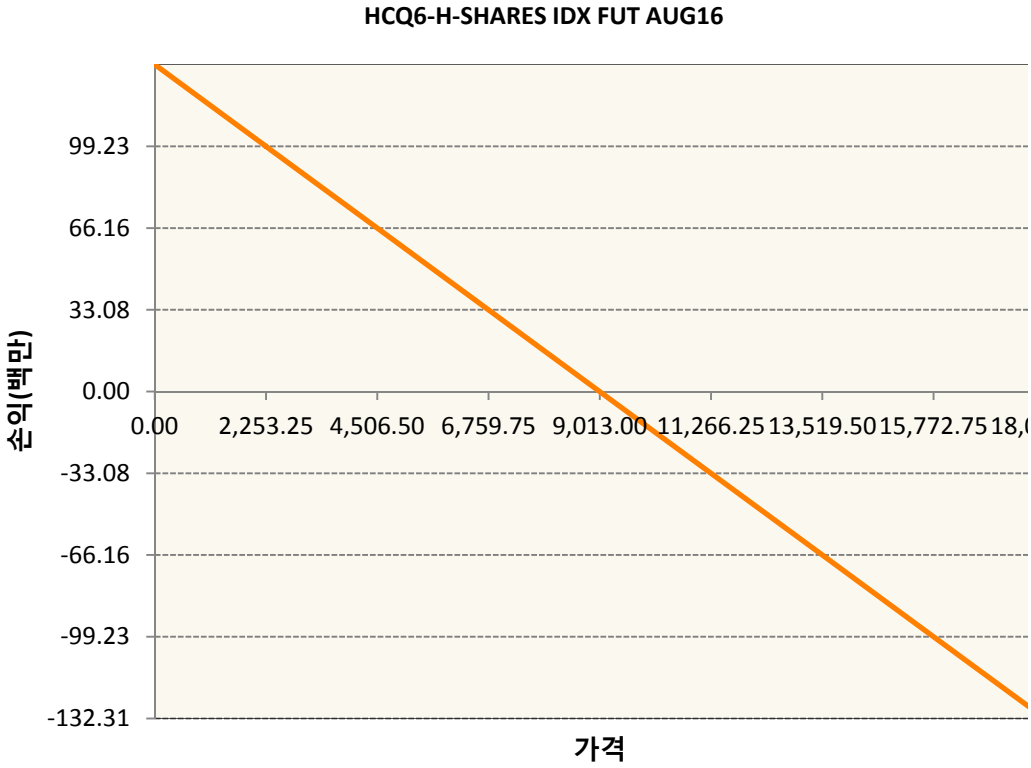
아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

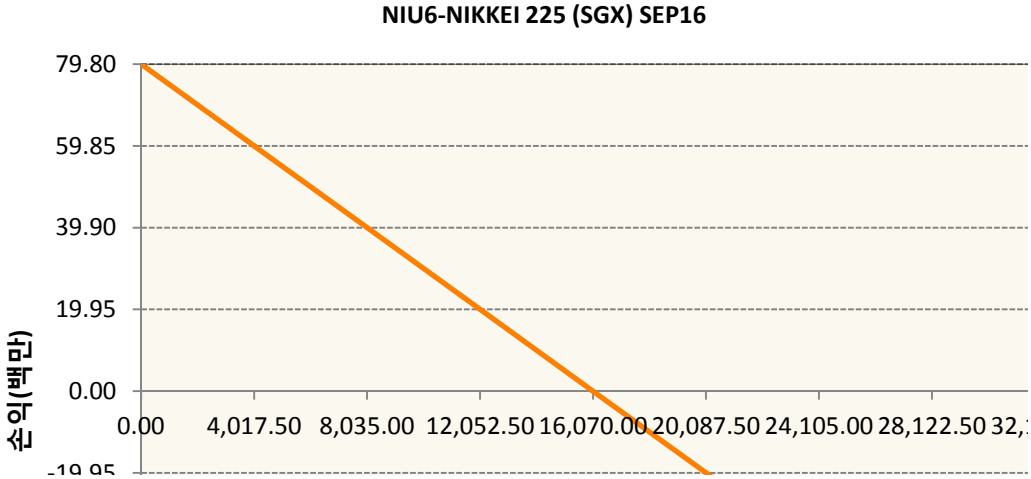
1. 계약금액

(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	80	-80	
누계	유가증권	선물	0	132	-132	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCQ6	H-SHARES IDX FUT AUG16	11
NIU6	NIKKEI 225 (SGX) SEP16	6

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

23

공시일	2016-08-05
기준일	2016-08-04

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	873

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

806

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-08-05
기준일	2016-08-04

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)

980

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-08-05
기준일	2016-08-04

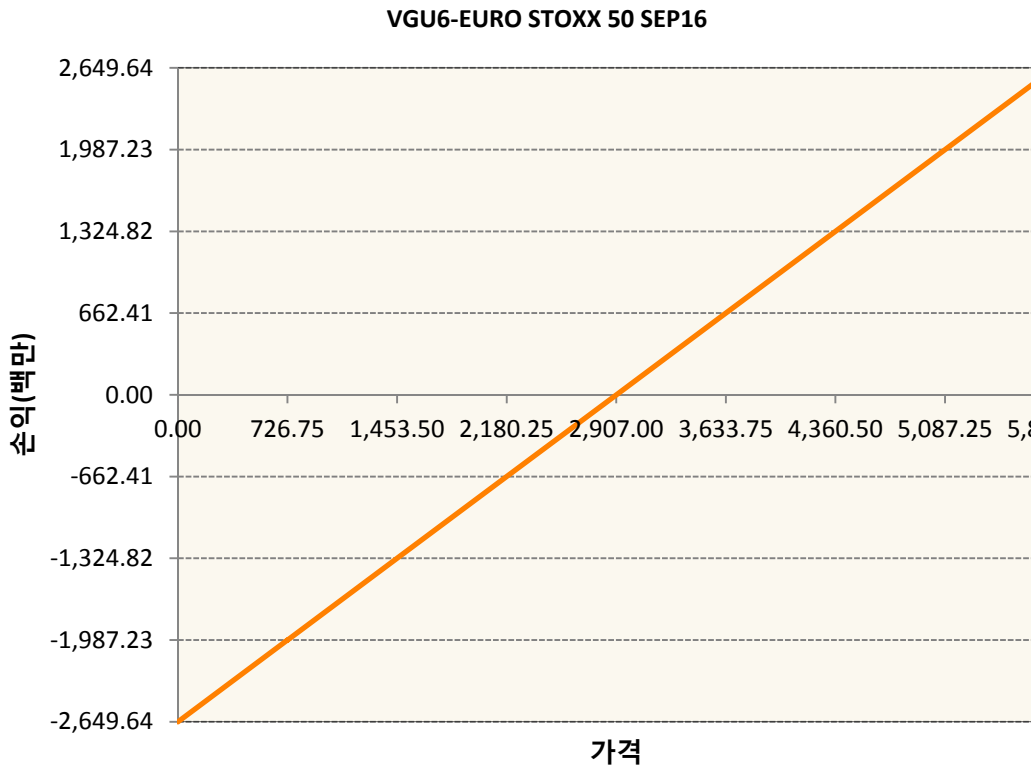
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,650	0	2,650	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 SEP16	212

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

(단위:백만원)

263

공시일	2016-08-05
기준일	2016-08-04

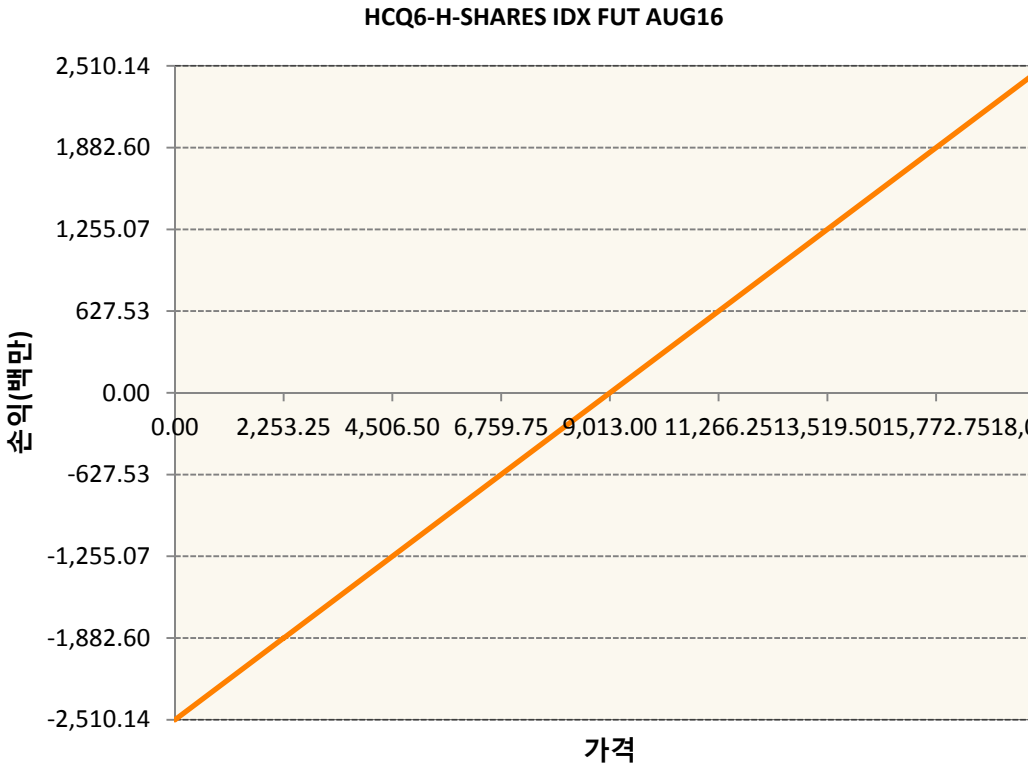
차이나인덱스모(주식-파생형)

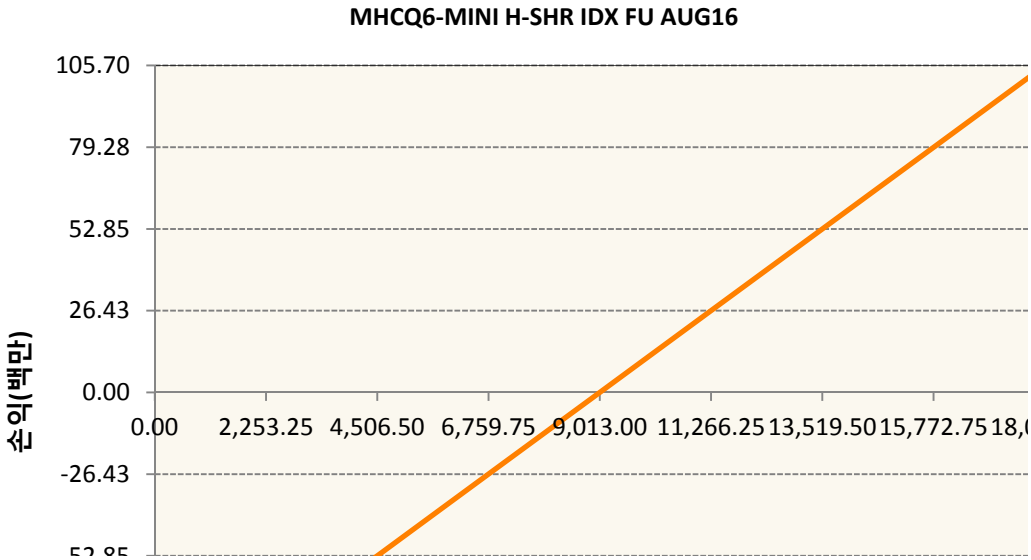
1. 계약금액

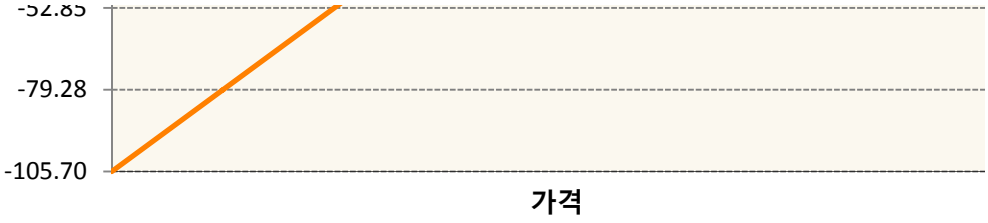
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,616	0	2,616	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ6	H-SHARES IDX FUT AUG16	201
MHCQ6	MINI H-SHR IDX FU AUG16	8

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	294

공시일	2016-08-05
기준일	2016-08-04

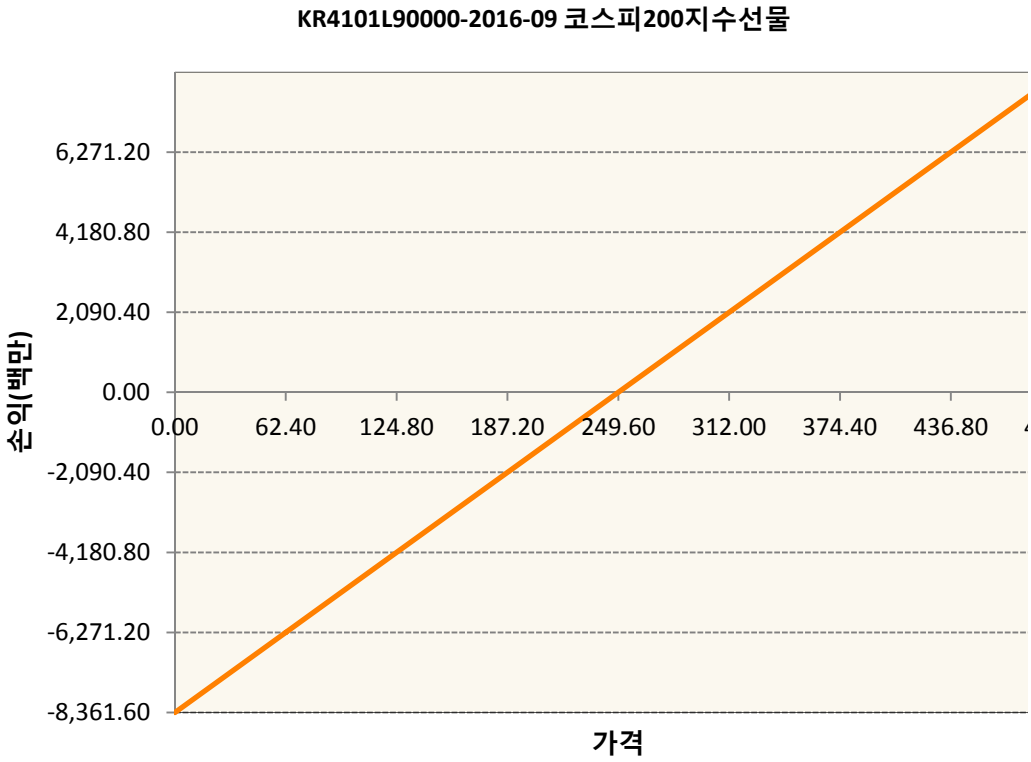
커버드콜(주식혼합-파생형)

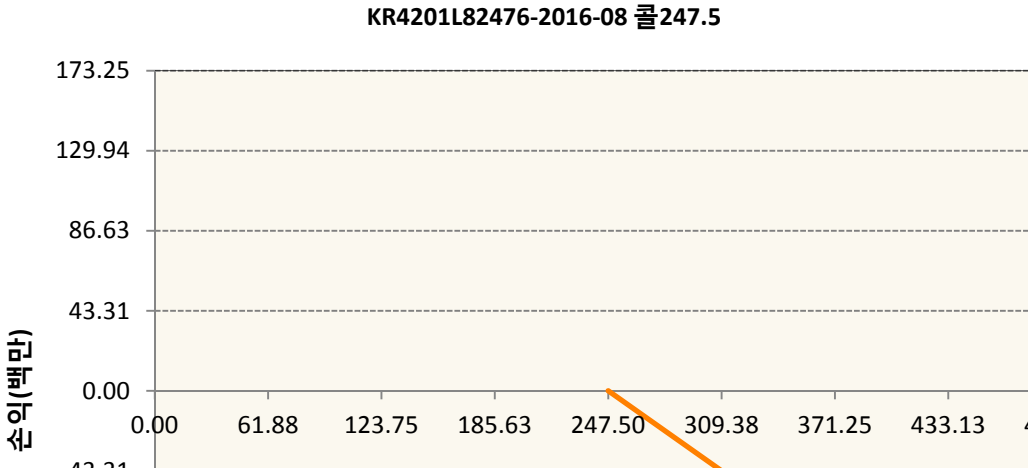
1. 계약금액

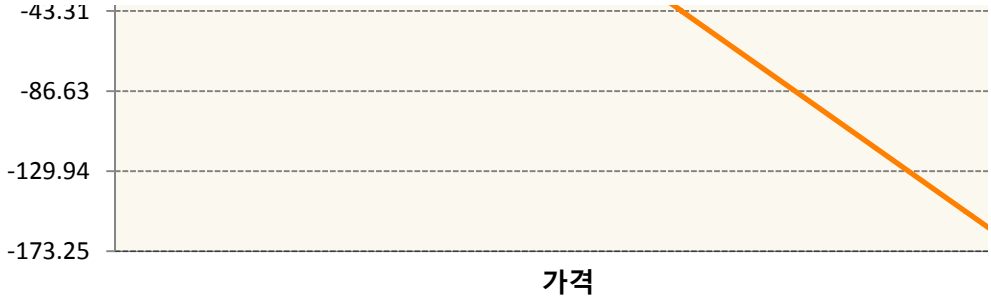
(단위:백만원)

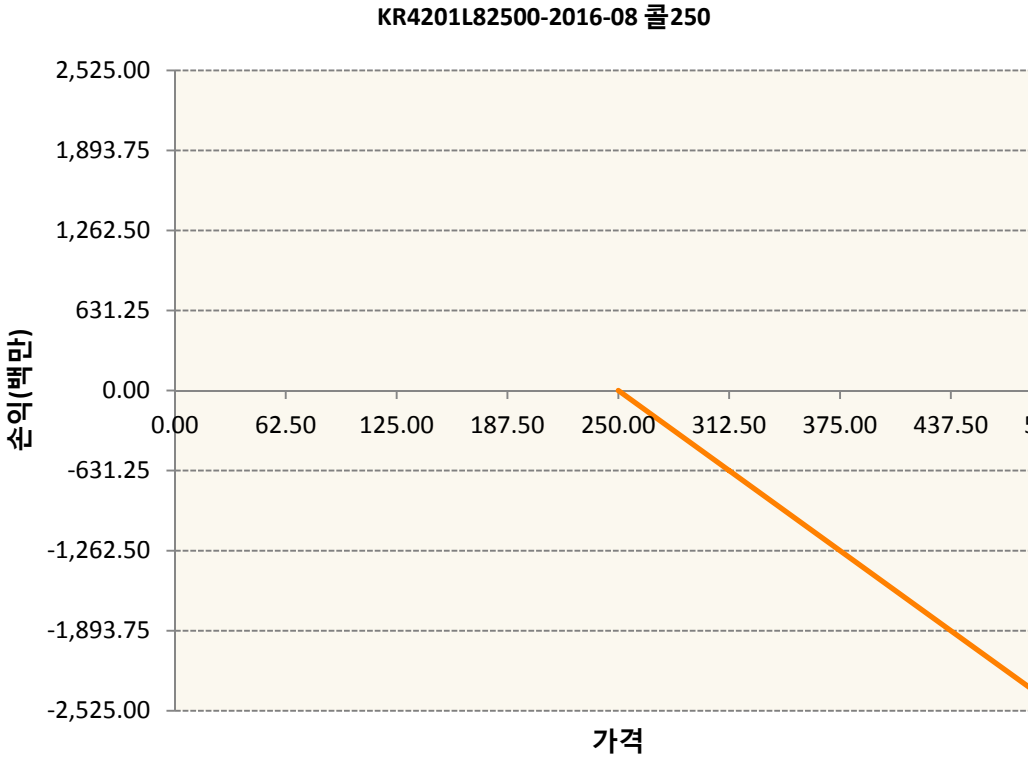
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	499	0	499	장내
신규	유가증권	옵션	0	101	-101	장내
누계	유가증권	선물	8,362	0	8,362	장내
누계	유가증권	옵션	0	2,698	-2,698	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101L900 2016-09 코스피200지수선물							668
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-668	-668	-668	-668	-668	-668	-668
-5.33%	-445	-445	-445	-445	-445	-445	-445
-2.67%	-223	-223	-223	-223	-223	-223	-223
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	223	223	223	223	223	223	223
5.33%	445	445	445	445	445	445	445
8.00%	668	668	668	668	668	668	668
KR4201L824 2016-08 콜247.5							66
	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	8	8	8
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
5.33%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
8.00%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
KR4201L825	2016-08 콜250						899

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	69	69	69	69	69	69	69
-5.33%	69	69	69	69	69	69	68
-2.67%	68	68	67	65	63	61	59
0%	21	14	7	0	-7	-14	-21
2.67%	-230	-232	-234	-237	-240	-244	-247
5.33%	-563	-563	-563	-563	-563	-564	-564
8.00%	-899	-899	-899	-899	-899	-899	-899

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

1,843

공시일	2016-08-05
기준일	2016-08-04

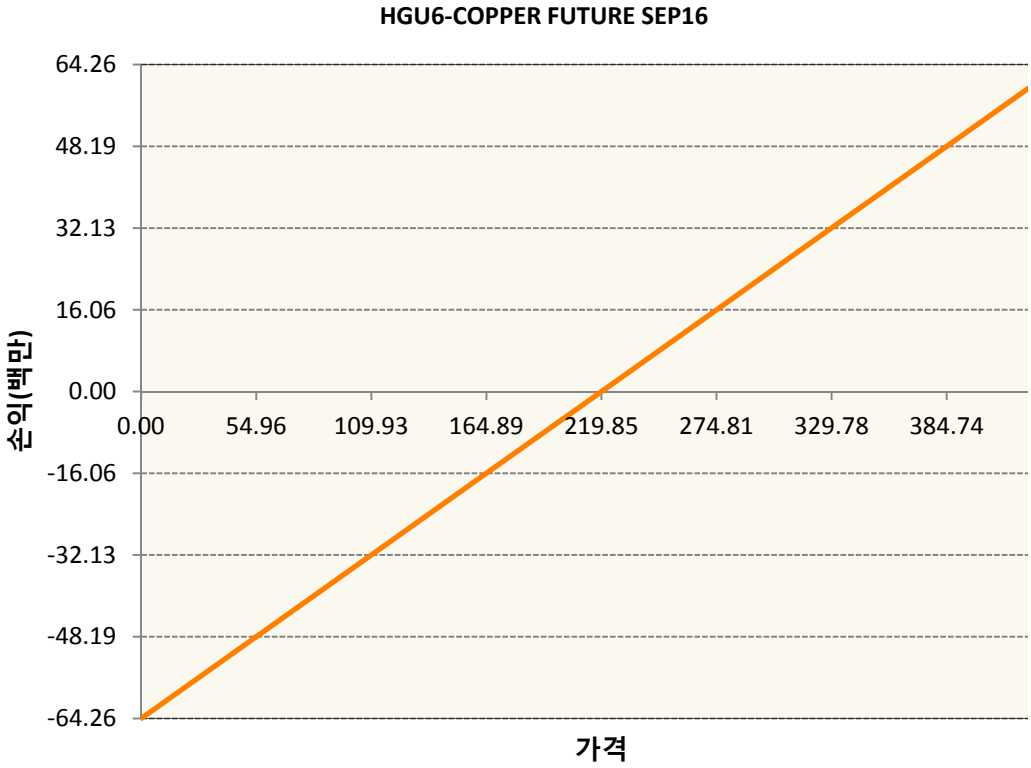
메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

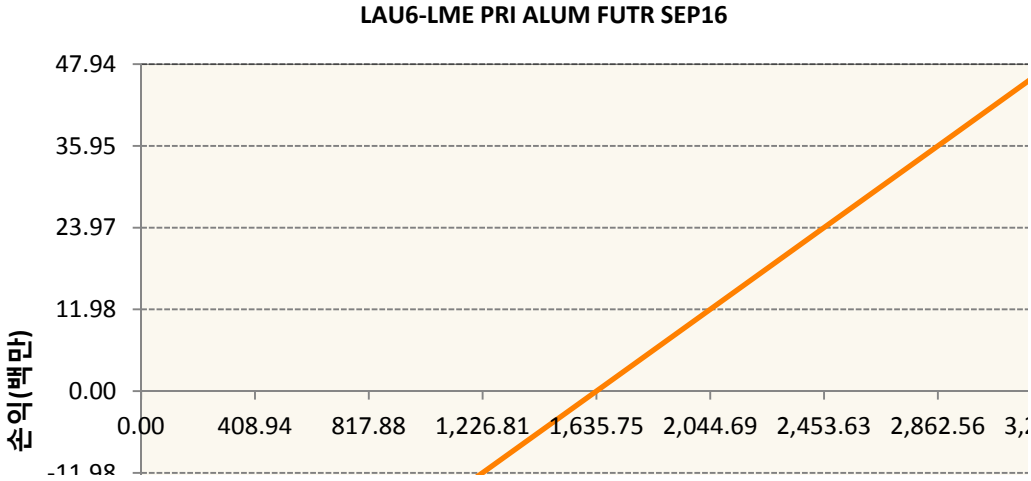
1. 계약금액

(단위:백만원)

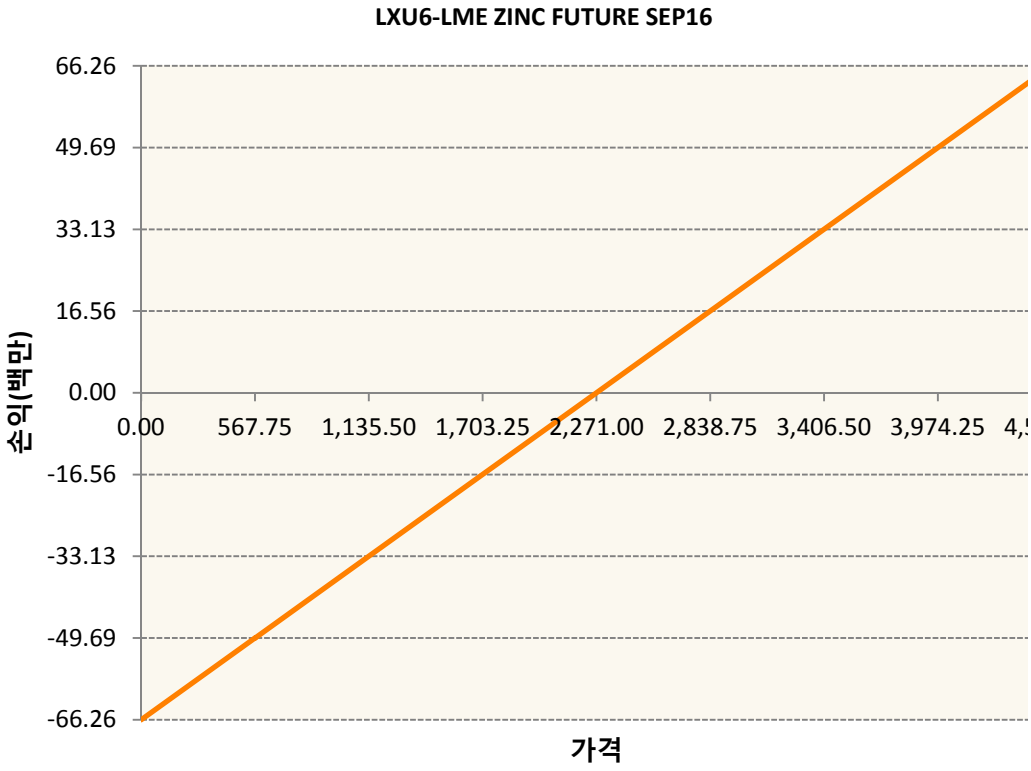
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	48	0	48	
누계	유가증권	선물	328	0	328	

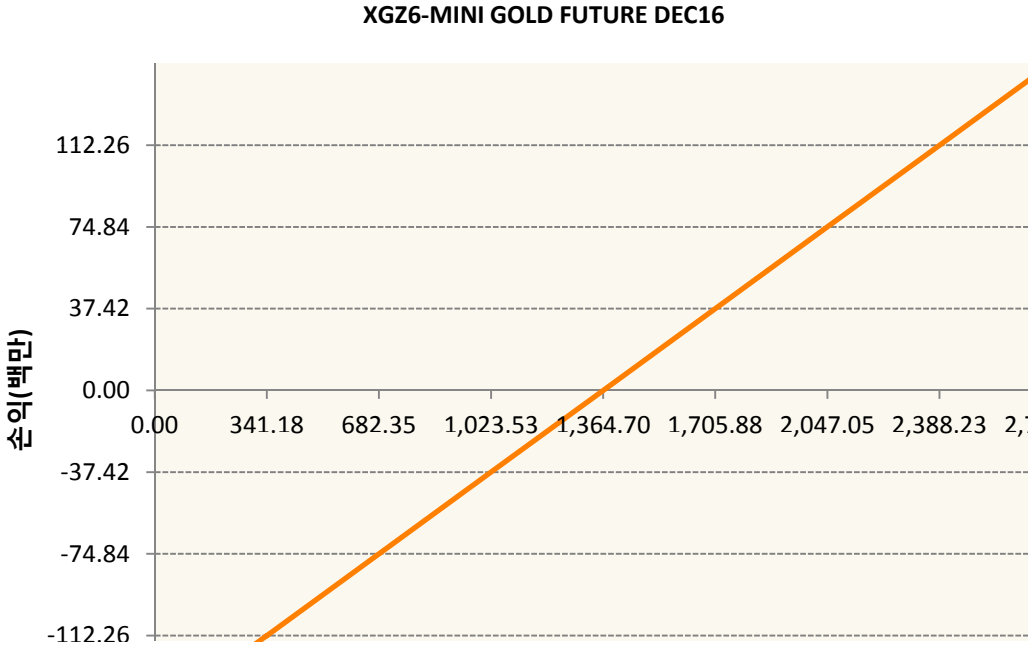
2. 만기시점의 손익구조

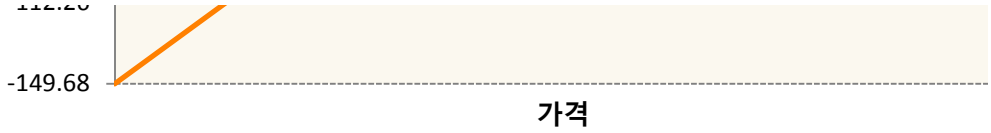


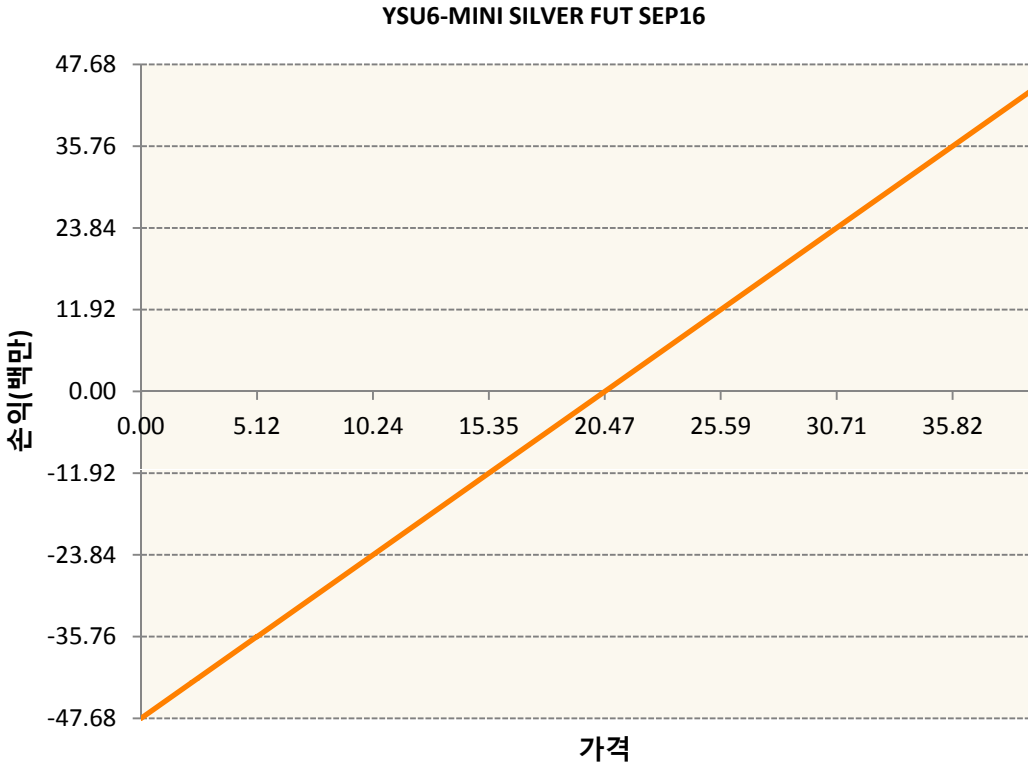



-23.97
-35.95
-47.94
가격


LXU6-LME ZINC FUTURE SEP16
66.26
49.69
33.13
16.56
0.00
-16.56
-33.13
-49.69
-66.26
순익(백만)
0.00
567.75
1,135.50
1,703.25
2,271.00
2,838.75
3,406.50
3,974.25
가격


XGZ6-MINI GOLD FUTURE DEC16
112.26
74.84
37.42
0.00
-37.42
-74.84
-112.26
순익(백만)
0.00
341.18
682.35
1,023.53
1,364.70
1,705.88
2,047.05
2,388.23





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)

30

공시일	2016-08-05
기준일	2016-08-04

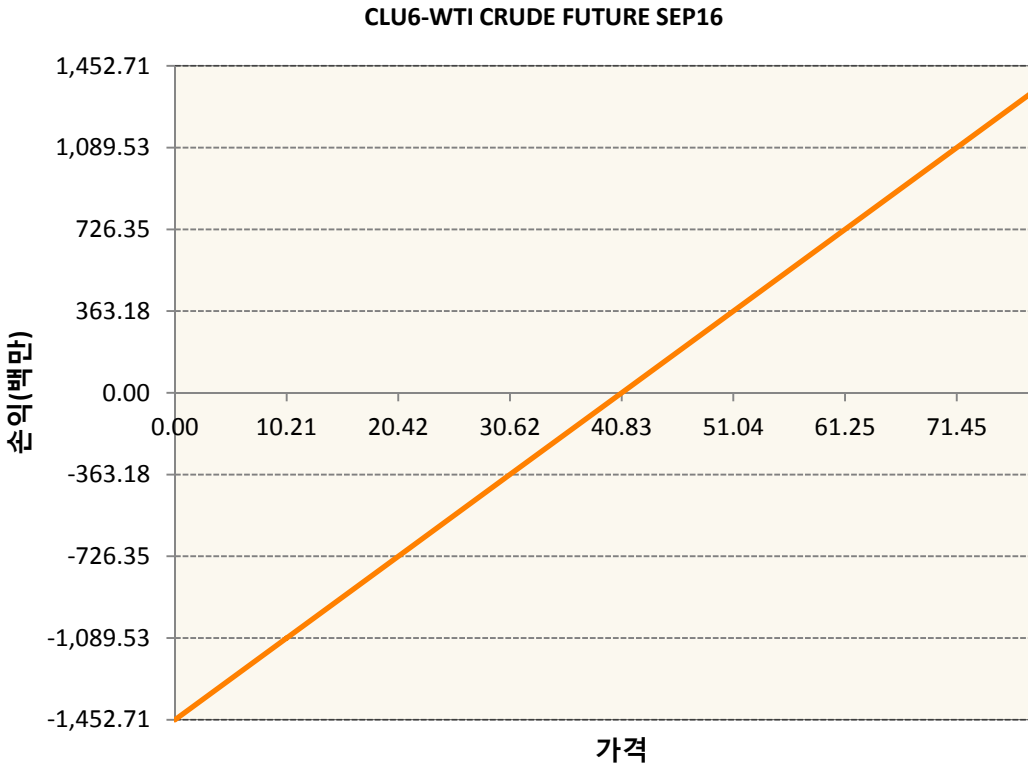
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

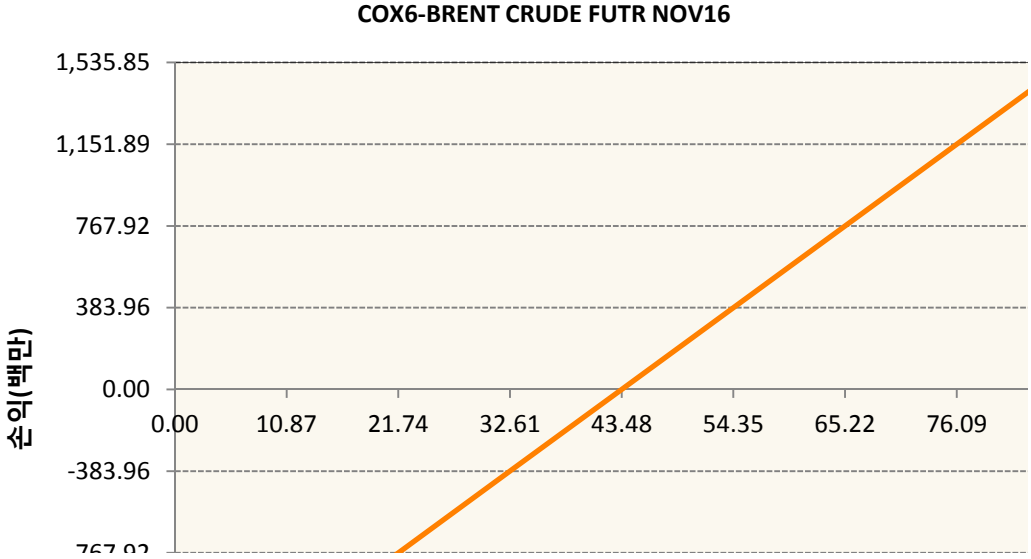
1. 계약금액

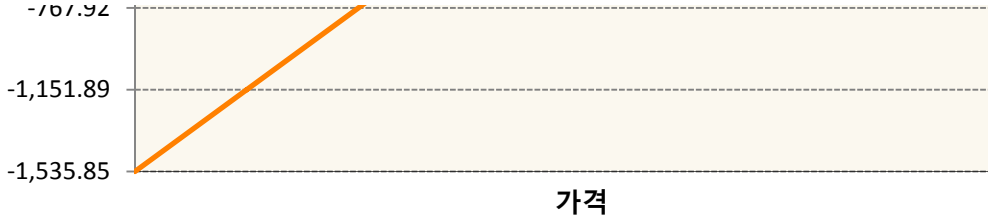
(단위:백만원)

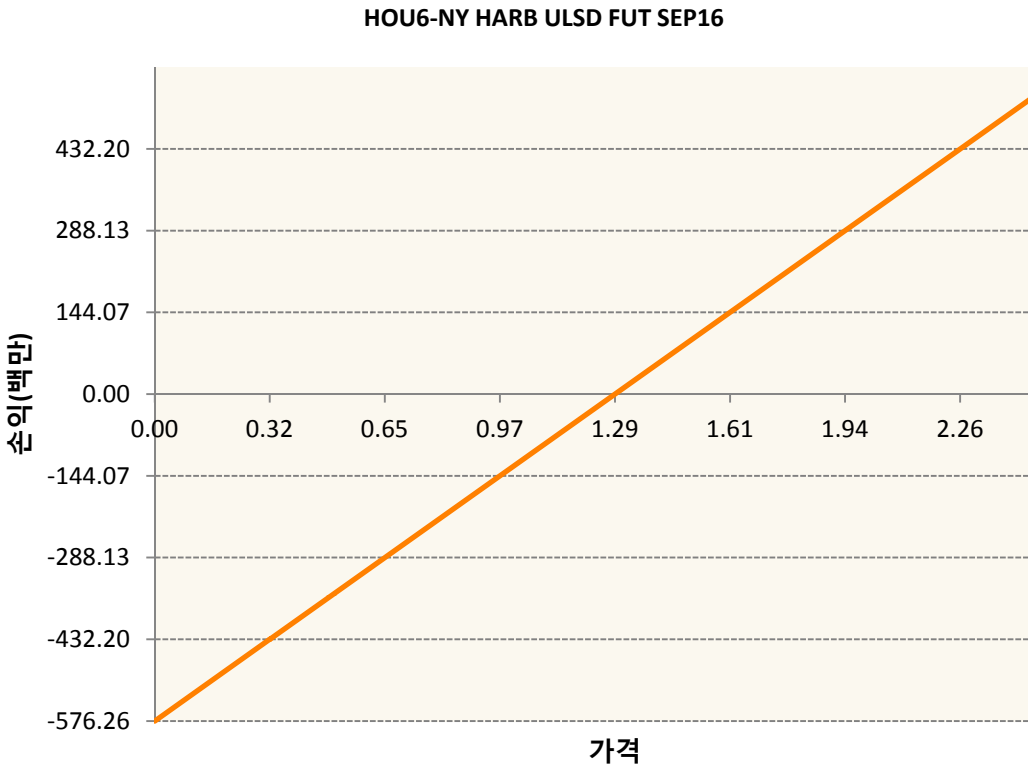
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,890	0	5,890	

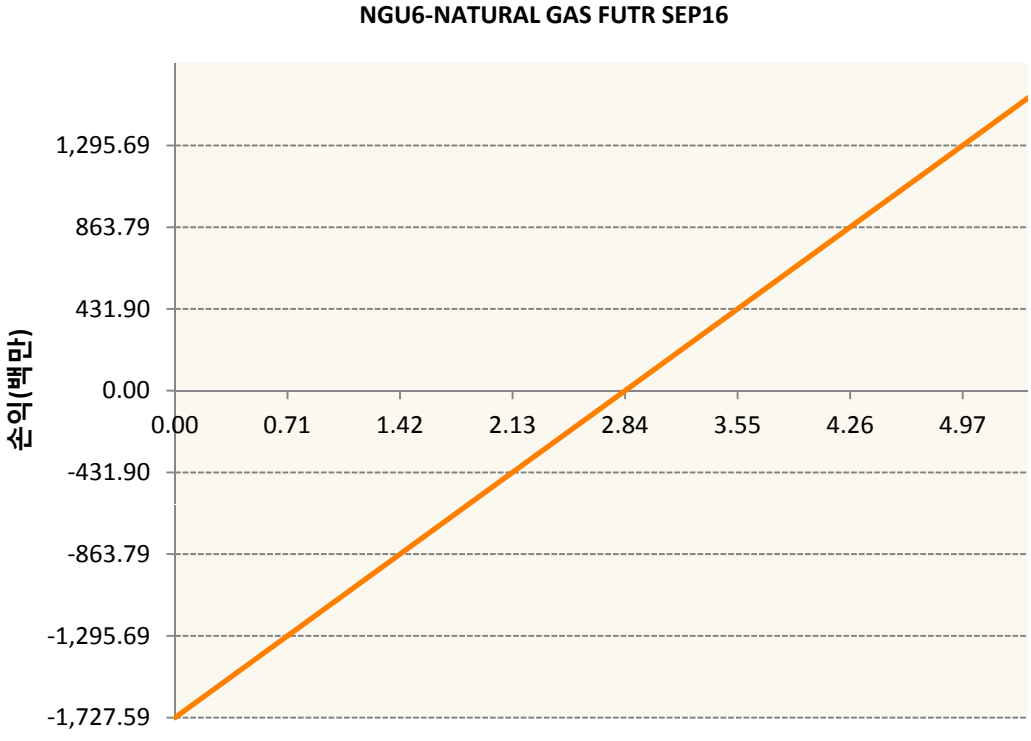
2. 만기시점의 손익구조



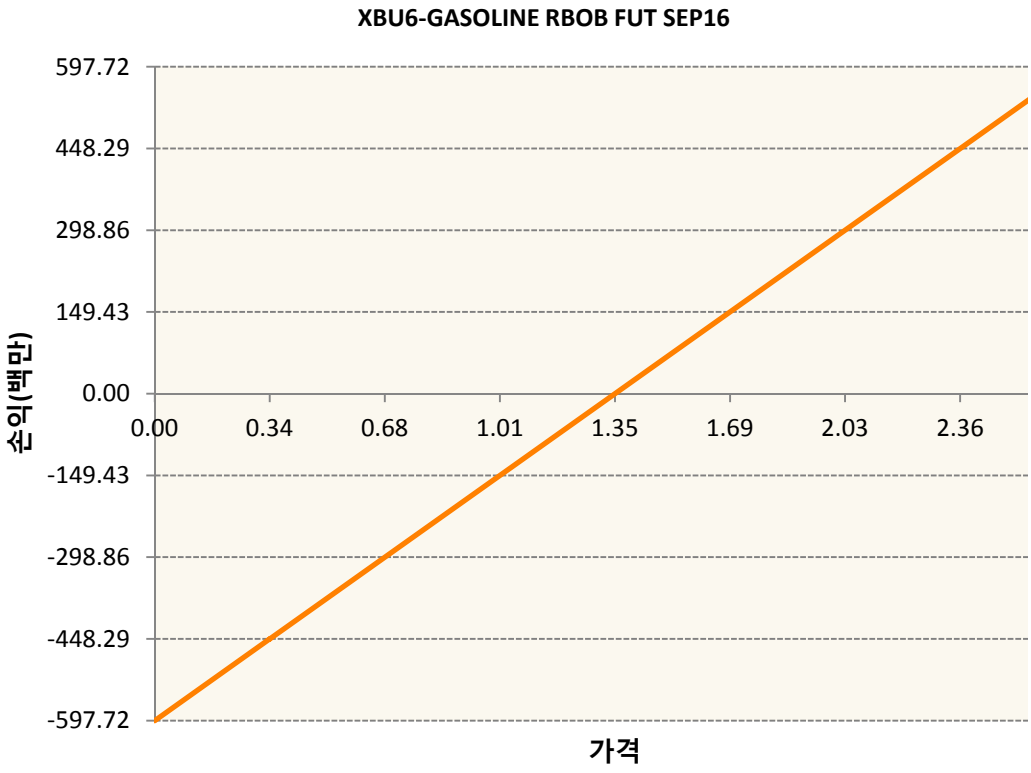



-1,151.89
-1,535.85
가격


HOU6-NY HARB ULSD FUT SEP16
432.20
288.13
144.07
0.00
-144.07
-288.13
-432.20
-576.26
0.00
0.32
0.65
0.97
1.29
1.61
1.94
2.26
순익(백만)
가격


NGU6-NATURAL GAS FUTR SEP16
1,295.69
863.79
431.90
0.00
-431.90
-863.79
-1,295.69
-1,727.59
0.00
0.71
1.42
2.13
2.84
3.55
4.26
4.97
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLU6	WTI CRUDE FUTURE SEP16	116
COX6	BRENT CRUDE FUTR NOV16	123
HOU6	NY HARB ULSD FUT SEP16	46
NGU6	NATURAL GAS FUTR SEP16	138
XBU6	GASOLINE RBOB FUT SEP16	48

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,062

공시일	2016-08-05
기준일	2016-08-04

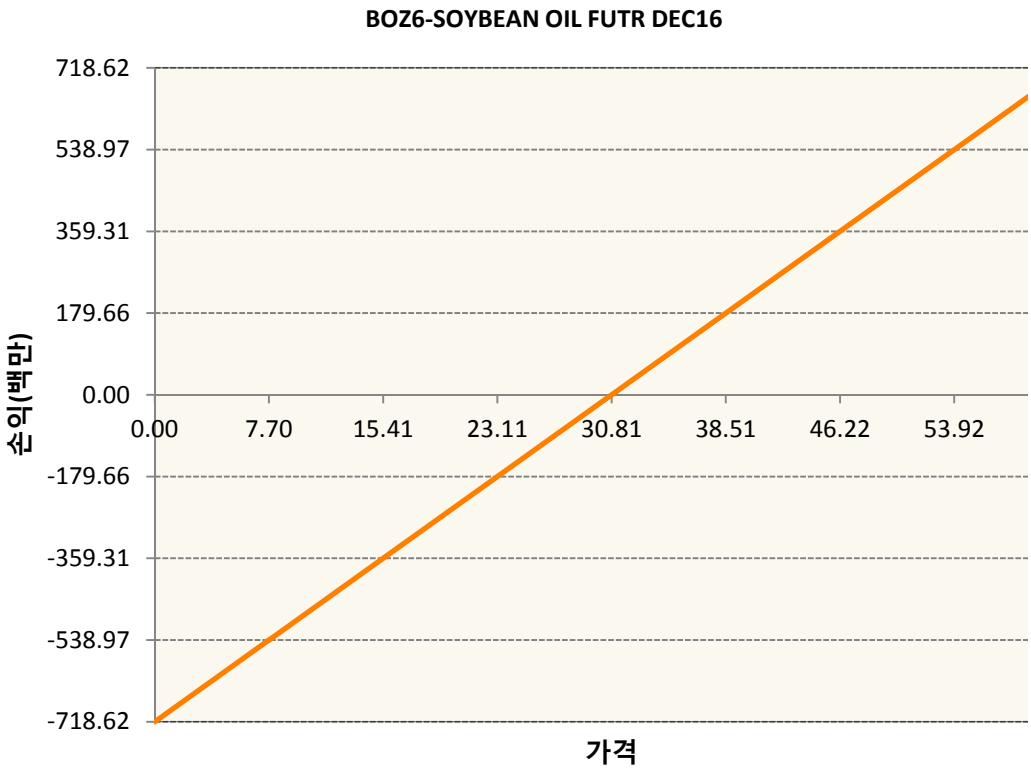
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

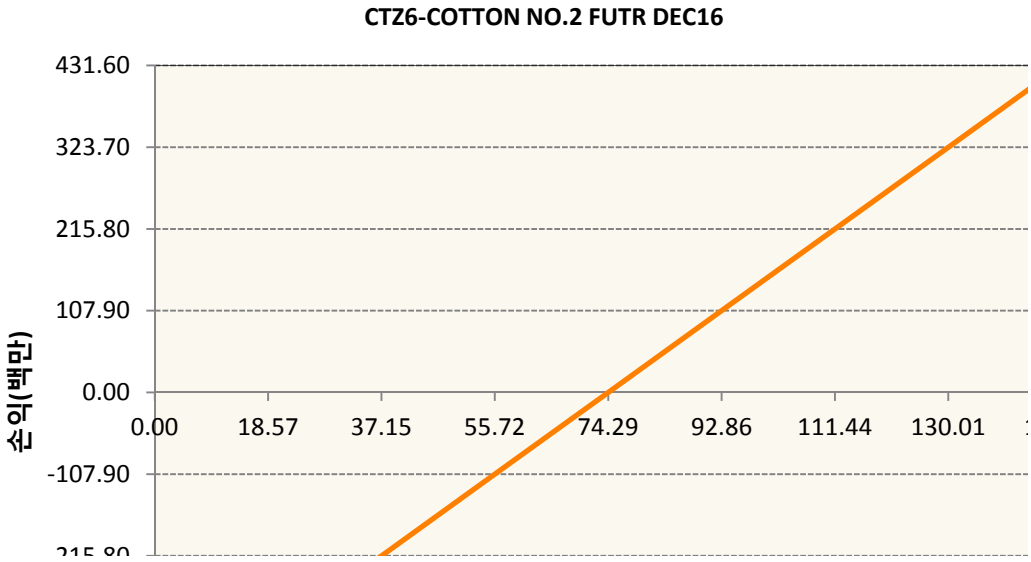
1. 계약금액

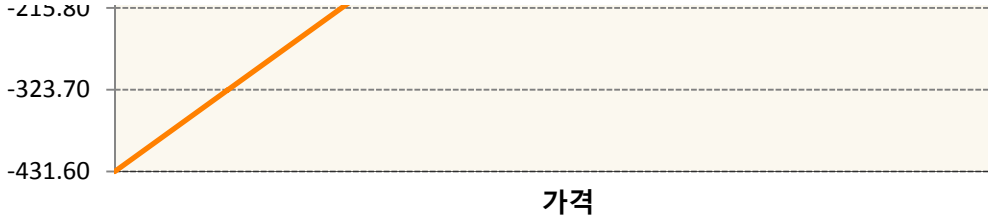
(단위:백만원)

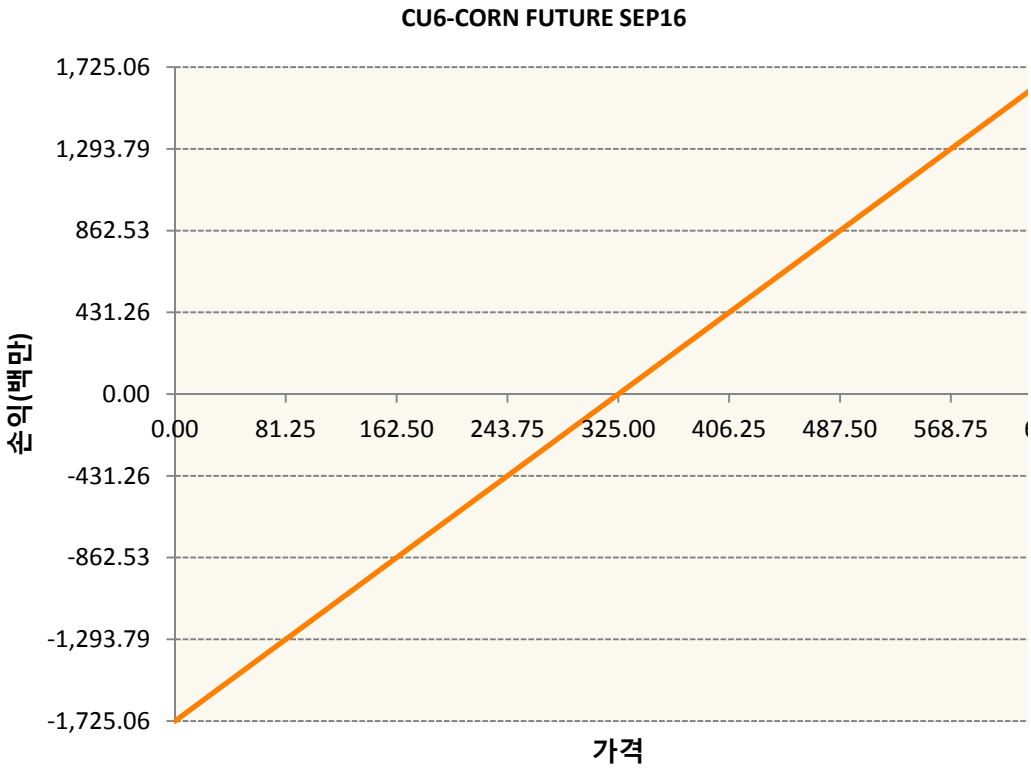
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,993	0	7,993	

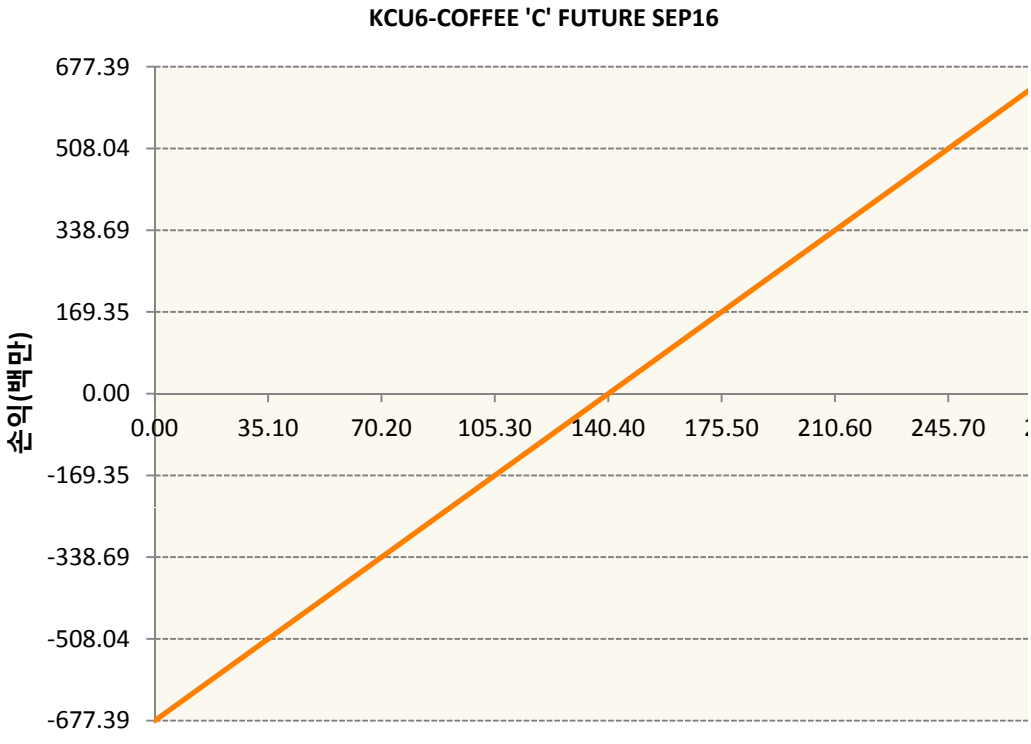
2. 만기시점의 손익구조



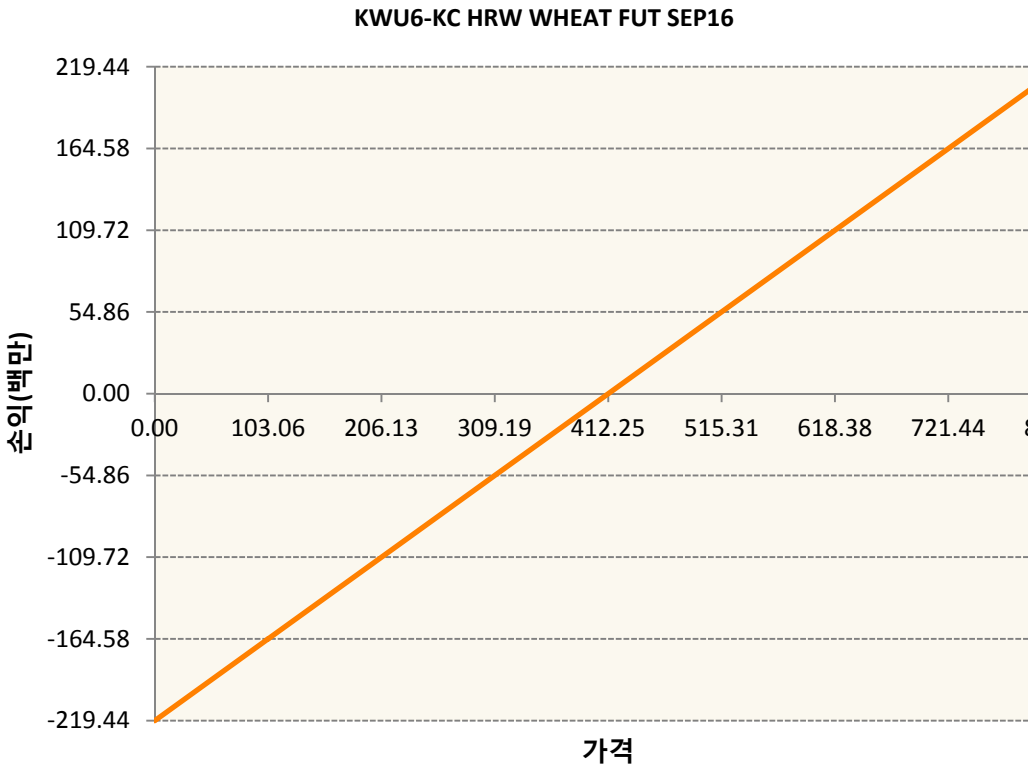


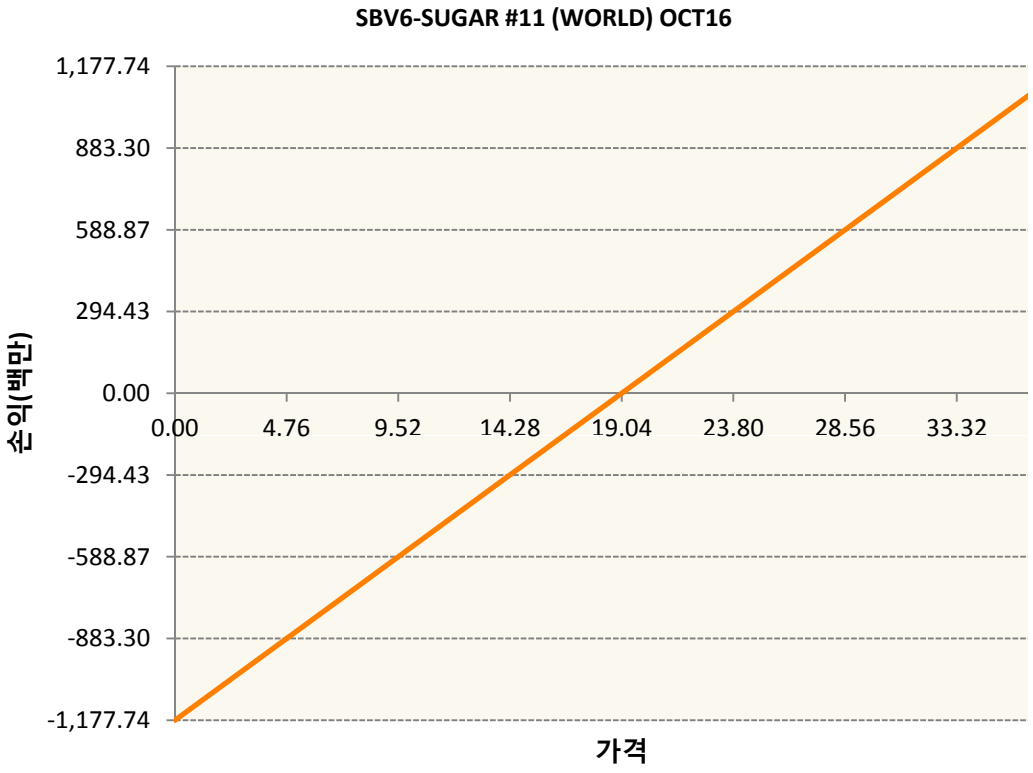

-323.70
-431.60
가격

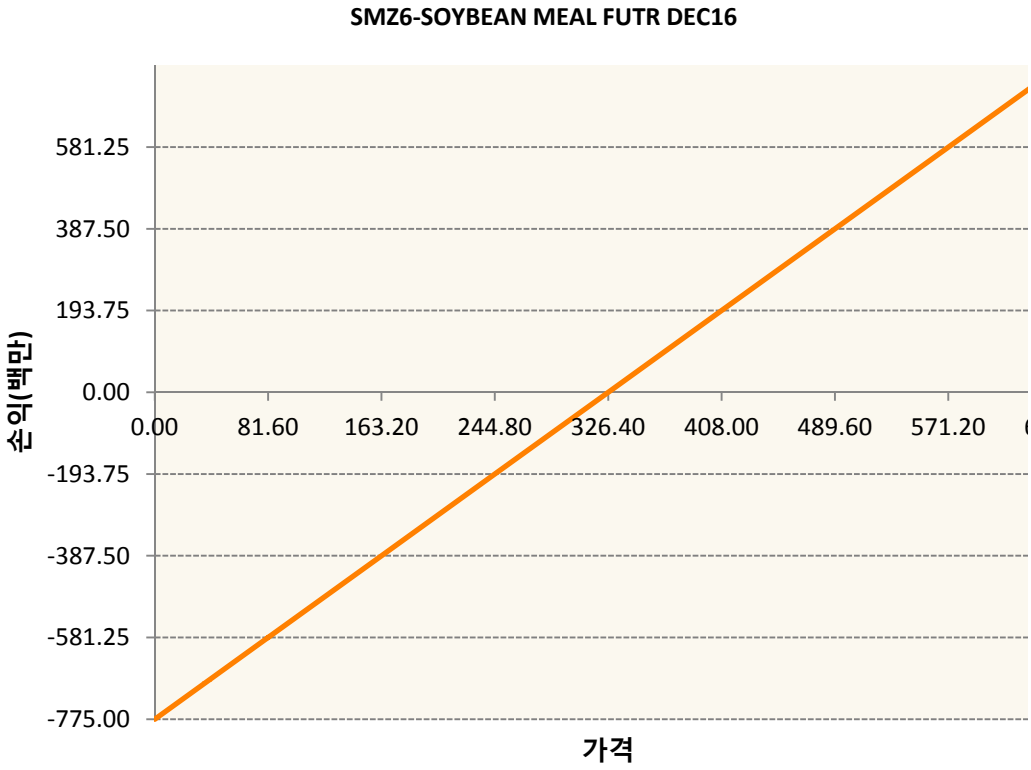

CU6-CORN FUTURE SEP16
1,725.06
1,293.79
862.53
431.26
0.00
-431.26
-862.53
-1,293.79
-1,725.06
0.00
81.25
162.50
243.75
325.00
406.25
487.50
568.75
순익(백만)
가격

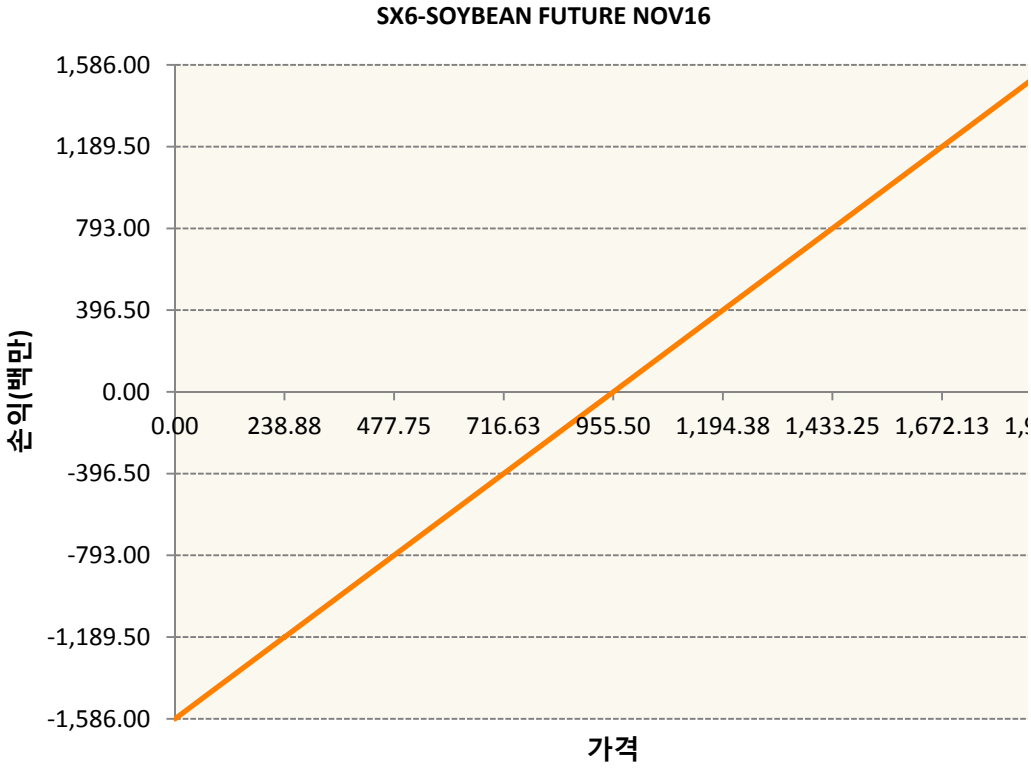

KCU6-COFFEE 'C' FUTURE SEP16
677.39
508.04
338.69
169.35
0.00
-169.35
-338.69
-508.04
-677.39
0.00
35.10
70.20
105.30
140.40
175.50
210.60
245.70
순익(백만)

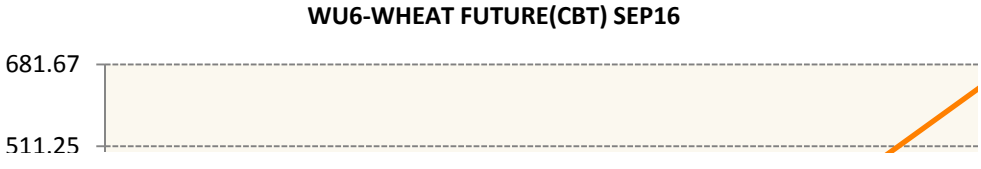
가격

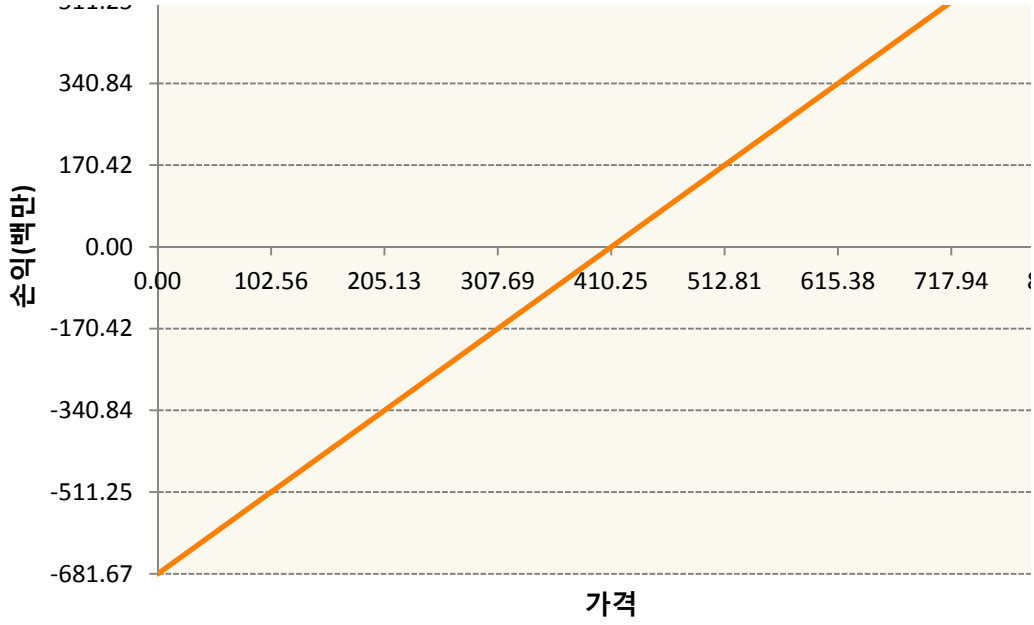

KWU6-KC HRW WHEAT FUT SEP16
219.44
164.58
109.72
54.86
0.00
-54.86
-109.72
-164.58
-219.44
0.00
103.06
206.13
309.19
412.25
515.31
618.38
721.44
손익(백만)
가격


SBV6-SUGAR #11 (WORLD) OCT16
1,177.74
883.30
588.87
294.43
0.00
-294.43
-588.87
-883.30
-1,177.74
0.00
4.76
9.52
14.28
19.04
23.80
28.56
33.32
손익(백만)
가격


SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16
581.25
387.50
193.75
0.00
-193.75
-387.50
-581.25
-775.00
0.00
81.60
163.20
244.80
326.40
408.00
489.60
571.20
손익(백만)
가격


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16
1,586.00
1,189.50
793.00
396.50
0.00
-396.50
-793.00
-1,189.50
-1,586.00
0.00
238.88
477.75
716.63
955.50
1,194.38
1,433.25
1,672.13
손익(백만)
가격


WU6-WHEAT FUTURE(CBT) SEP16
681.67
511.25



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ6	SOYBEAN OIL FUTR DEC16	57
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	35
CU6	CORN FUTURE SEP16	138
KCU6	COFFEE 'C' FUTURE SEP16	54
KWU6	KC HRW WHEAT FUT SEP16	18
SBV6	SUGAR #11 (WORLD) OCT16	94
SMZ6	SOYBEAN MEAL FUTR DEC16	62
SX6	SOYBEAN FUTURE NOV16	127
WU6	WHEAT FUTURE(CBT) SEP16	55

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	834