공시일	2016-08-09
기준일	2016-08-08

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	2016-08-09
기준일	2016-08-08

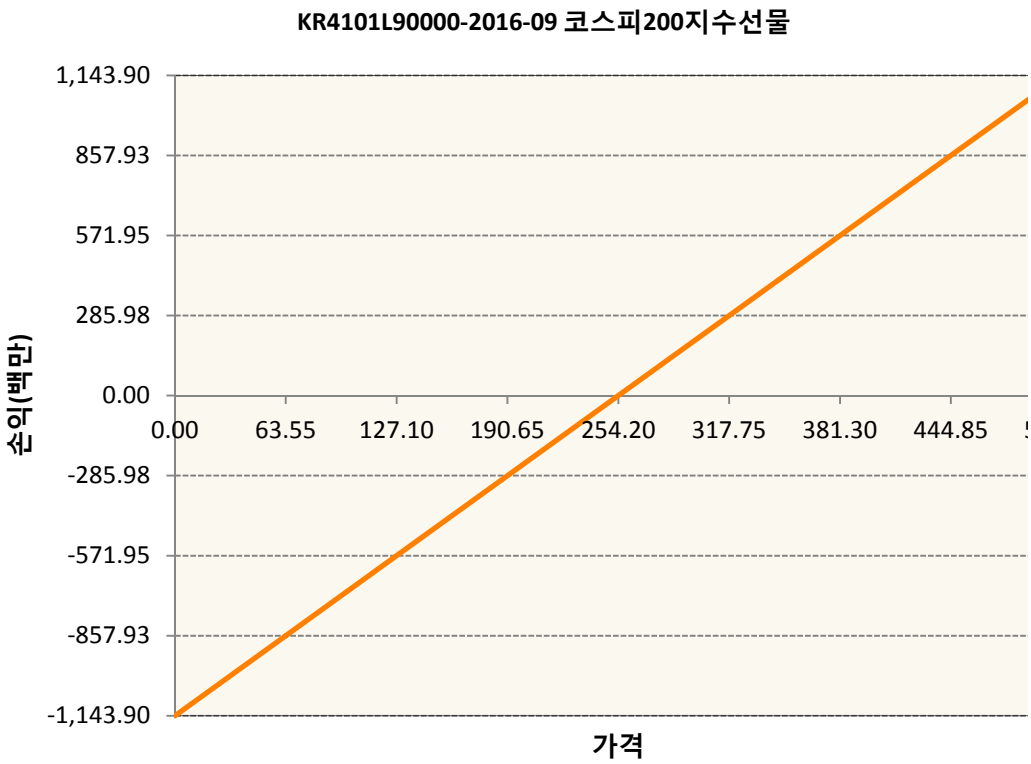
스마트인덱스모

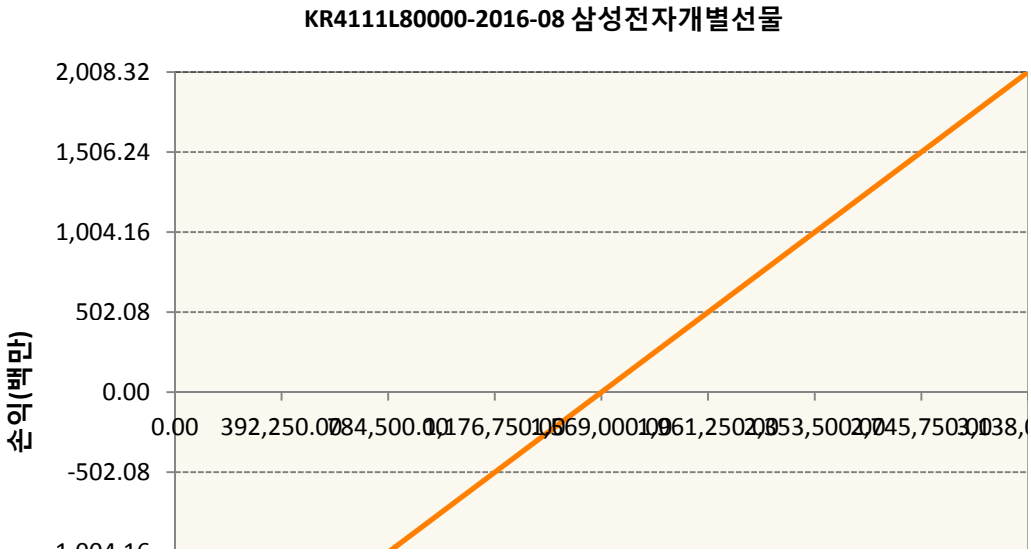
1. 계약금액

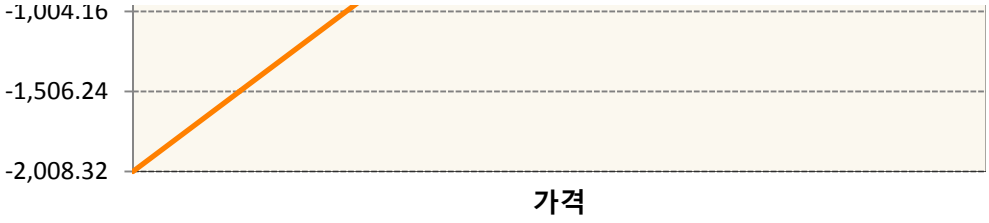
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,152	0	3,152	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%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61
-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%	61	61	61	61	61	61	61
8.00%	91	91	91	91	91	91	91

KR4111L800	2016-08 삼성전자개별선물						161
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-161	-161	-161	-161	-161	-161	-161
-5.33%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107
-2.67%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	54	54	54	54	54	54	54
5.33%	107	107	107	107	107	107	107
8.00%	161	161	161	161	161	161	161

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

241

공시일	2016-08-09
기준일	2016-08-08

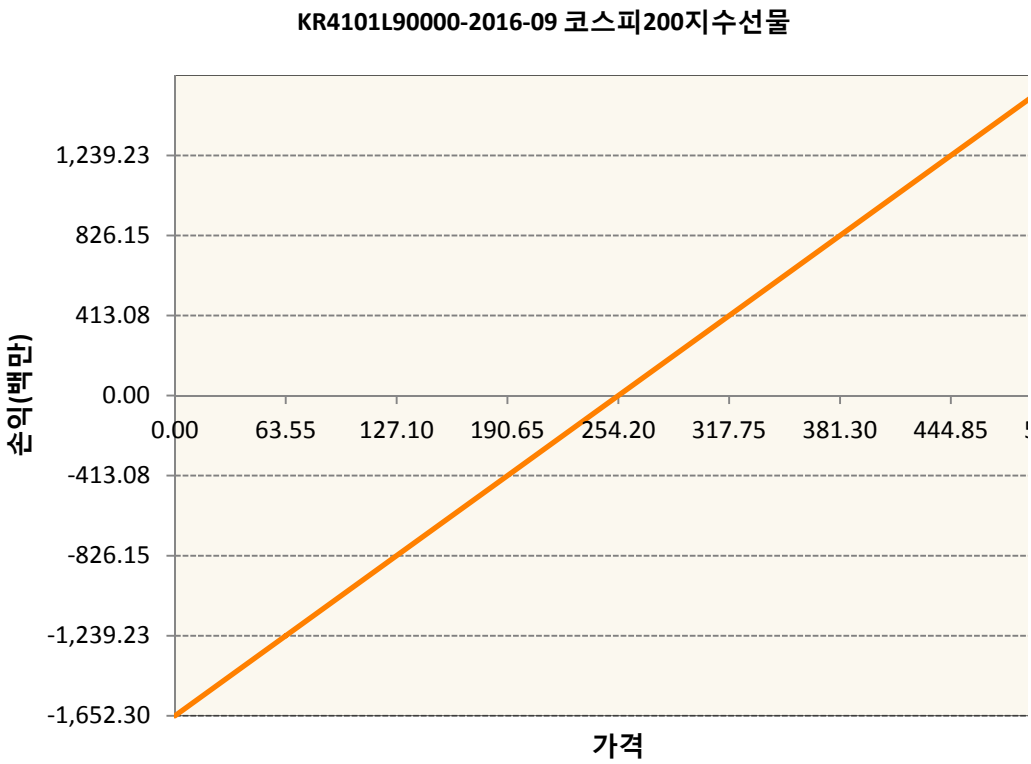
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,652	0	1,652	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900 2016-09 코스피200지수선물							132
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-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%	88	88	88	88	88	88	88
8.00%	132	132	132	132	132	132	132

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

109

공시일	2016-08-09
기준일	2016-08-08

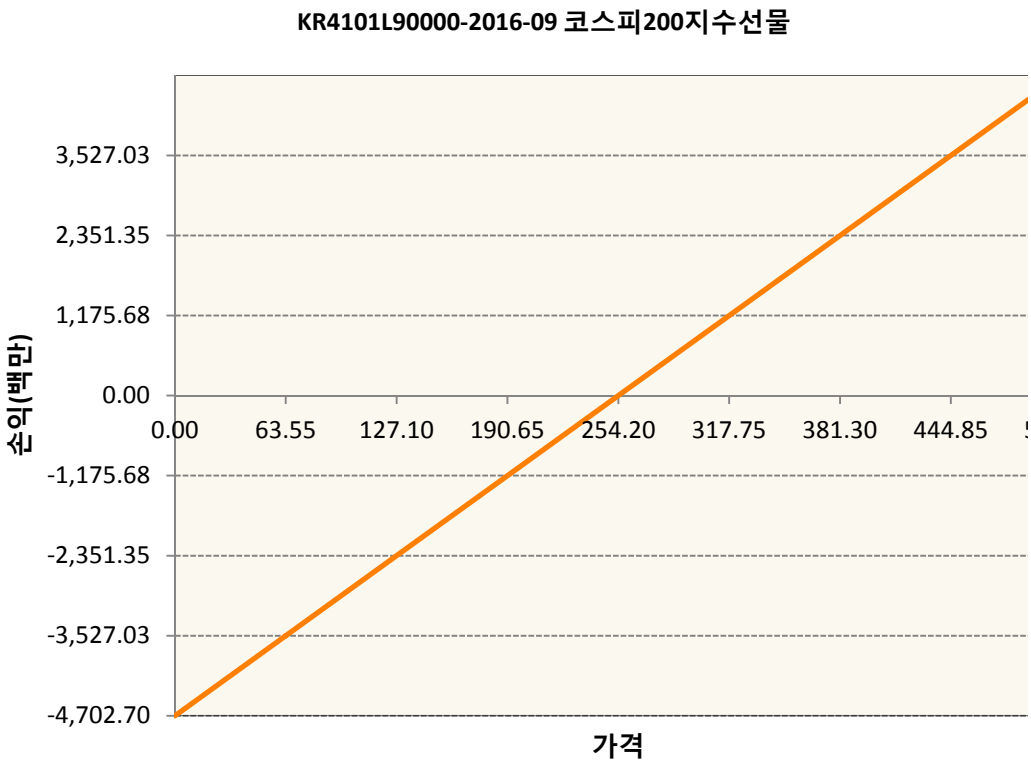
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	127	-127	장내
누계	유가증권	선물	4,703	0	4,703	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						376
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-376	-376	-376	-376	-376	-376	-376
-5.33%	-251	-251	-251	-251	-251	-251	-251
-2.67%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	125	125	125	125	125	125	125
5.33%	251	251	251	251	251	251	251
8.00%	376	376	376	376	376	376	376

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

310

공시일	2016-08-09
기준일	2016-08-08

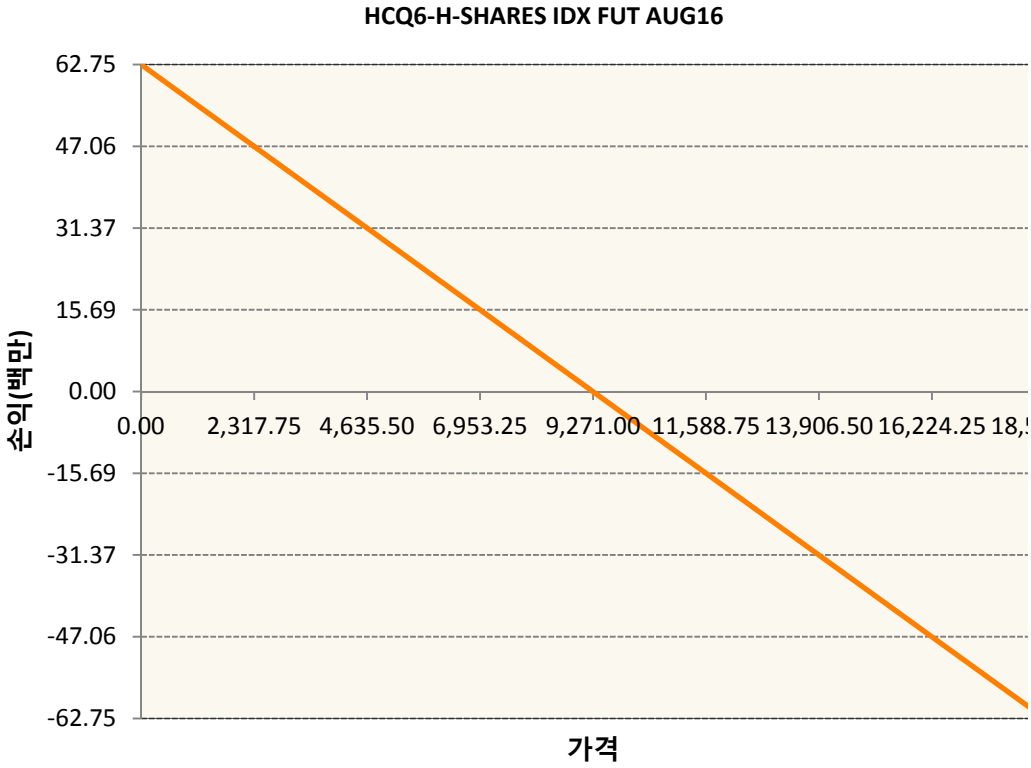
아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

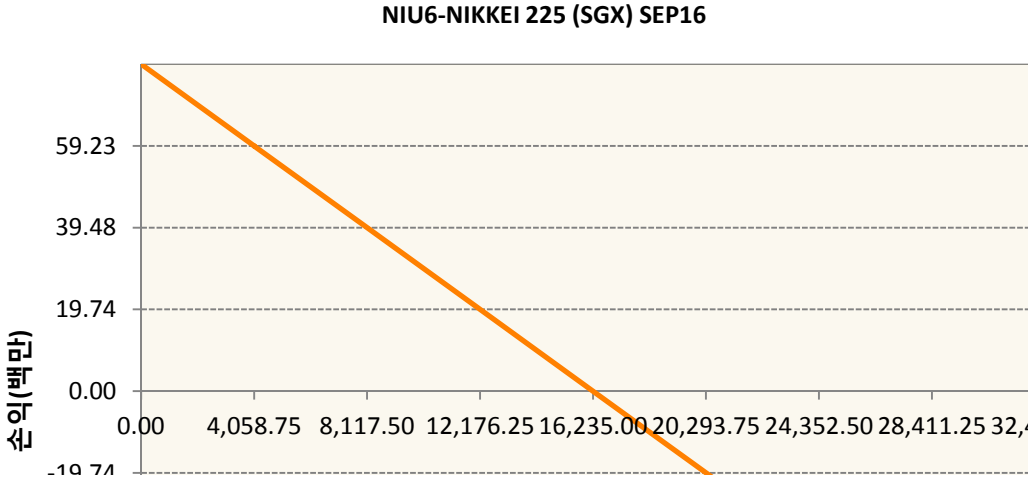
1. 계약금액

(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	79	-79	
누계	유가증권	선물	0	63	-63	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	2016-08-09
기준일	2016-08-08

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	880

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

812

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-08-09
기준일	2016-08-08

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	397

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

977

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-08-09
기준일	2016-08-08

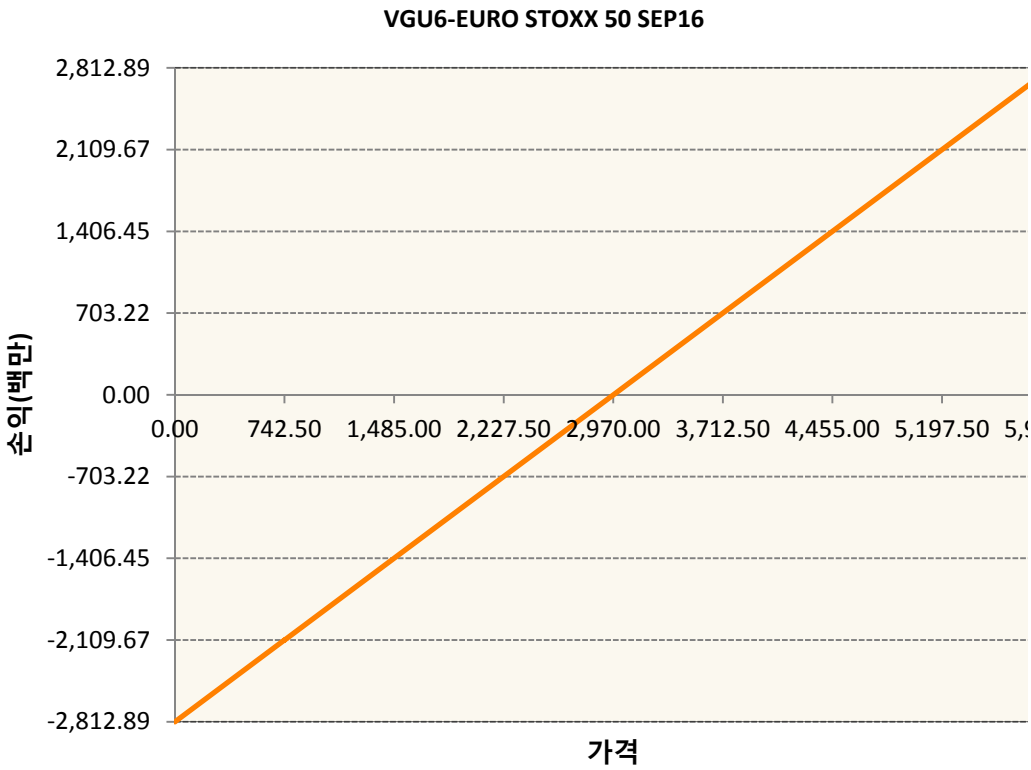
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,813	0	2,813	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 SEP16	225

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

(단위:백만원)

278

공시일	2016-08-09
기준일	2016-08-08

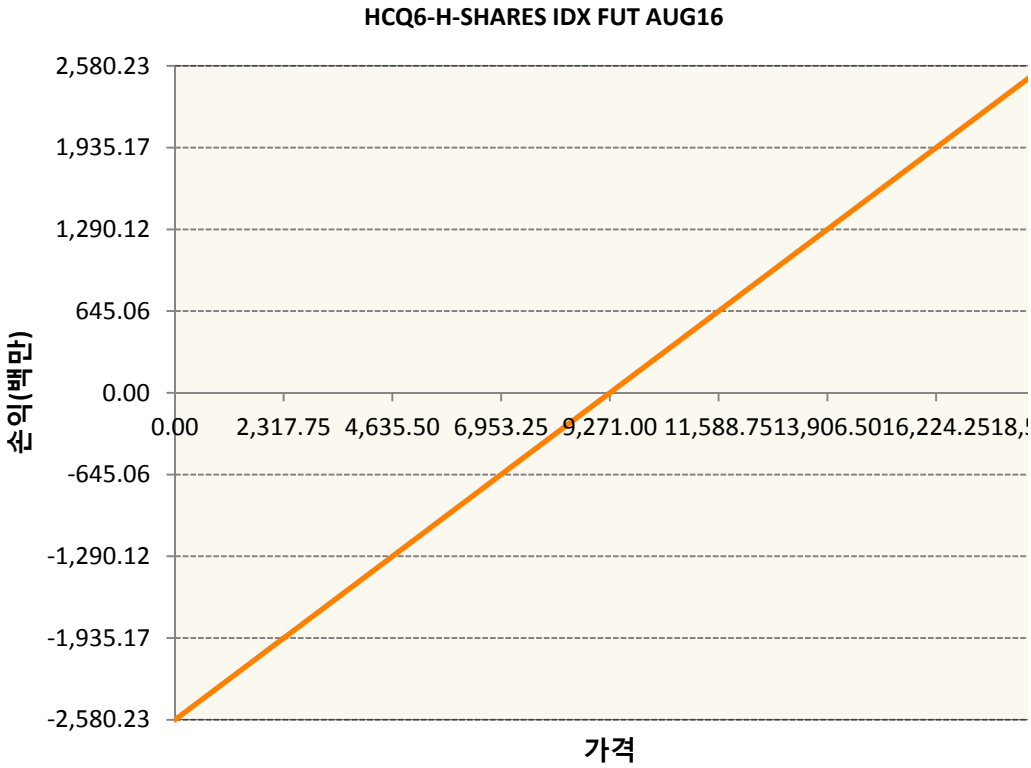
차이나인덱스모(주식-파생형)

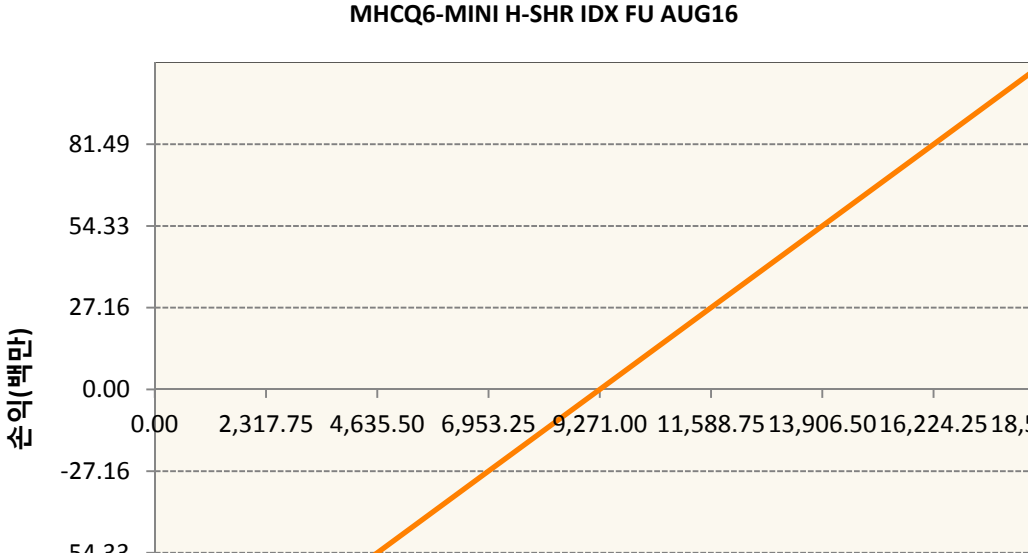
1. 계약금액

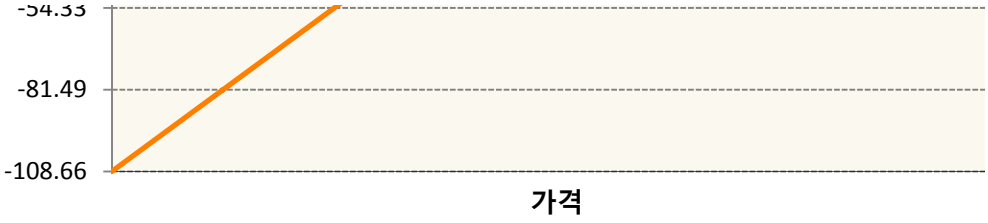
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,689	0	2,689	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ6	H-SHARES IDX FUT AUG16	206
MHCQ6	MINI H-SHR IDX FU AUG16	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	302

공시일	2016-08-09
기준일	2016-08-08

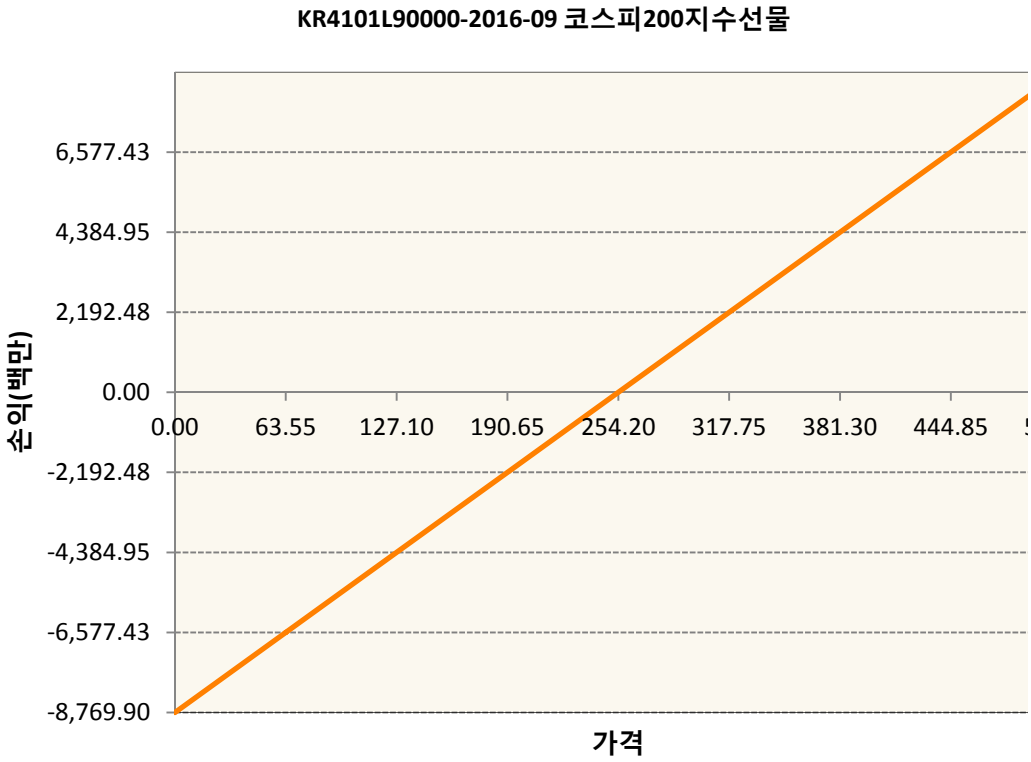
커버드콜(주식혼합-파생형)

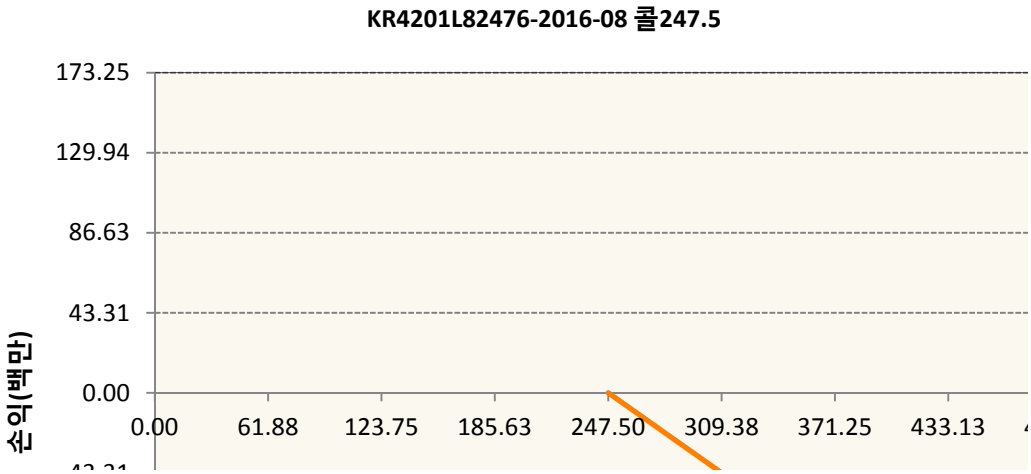
1. 계약금액

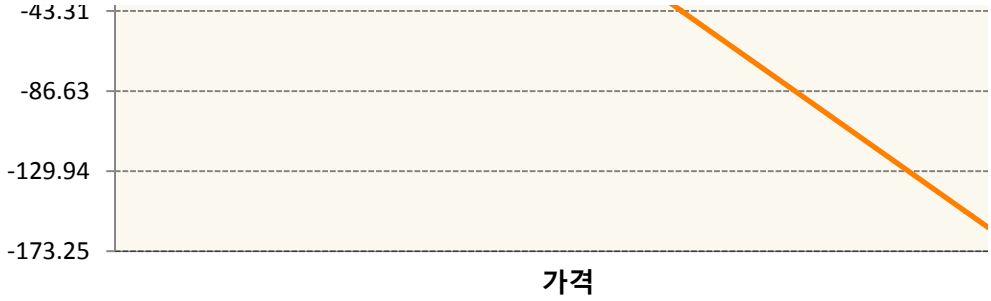
(단위:백만원)

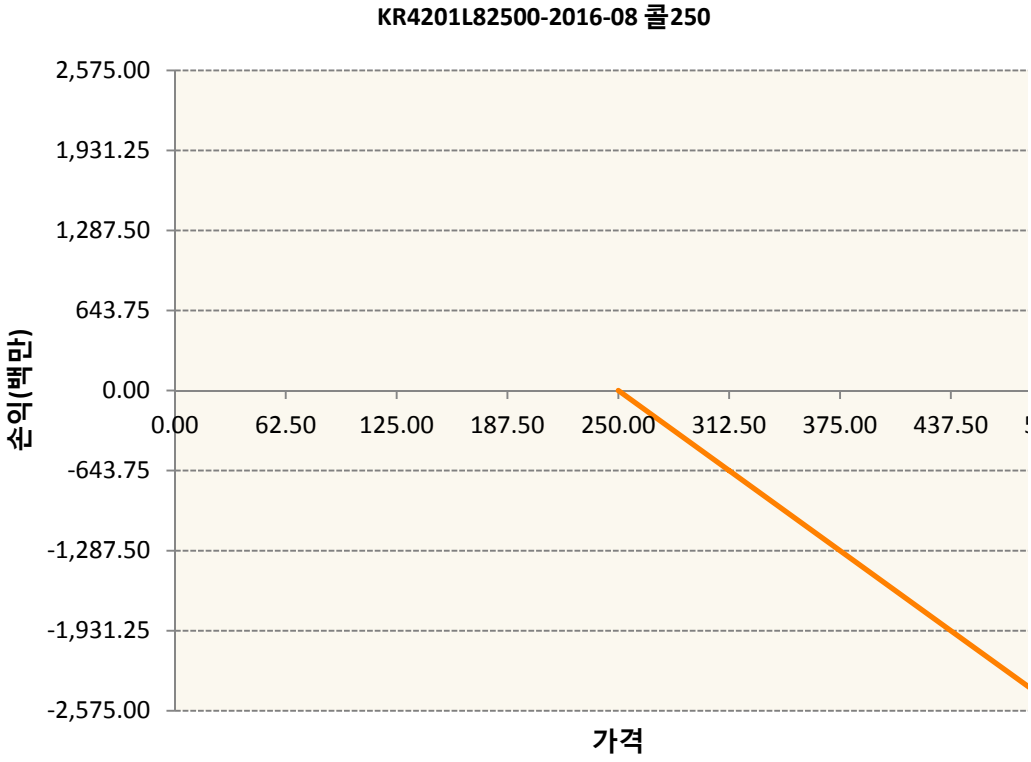
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	254	0	254	장내
신규	유가증권	옵션	0	51	-51	장내
누계	유가증권	선물	8,770	0	8,770	장내
누계	유가증권	옵션	0	2,748	-2,748	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101L900 2016-09 코스피200지수선물							701
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-701	-701	-701	-701	-701	-701	-701
-5.33%	-468	-468	-468	-468	-468	-468	-468
-2.67%	-234	-234	-234	-234	-234	-234	-234
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	234	234	234	234	234	234	234
5.33%	468	468	468	468	468	468	468
8.00%	701	701	701	701	701	701	701
KR4201L824 2016-08 콜247.5							71
	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%	21	20	20	20	20	19	19
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
5.33%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
8.00%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71
KR4201L825	2016-08 콜250						1,043

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	215	215	215	215	215	215	215
-5.33%	215	215	215	215	215	215	215
-2.67%	211	209	207	204	201	198	195
0%	3	2	1	0	-1	-3	-5
2.67%	-345	-345	-345	-345	-345	-345	-345
5.33%	-694	-694	-694	-694	-694	-694	-694
8.00%	-1,043	-1,043	-1,043	-1,043	-1,043	-1,043	-1,043

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

2,099

공시일	2016-08-09
기준일	2016-08-08

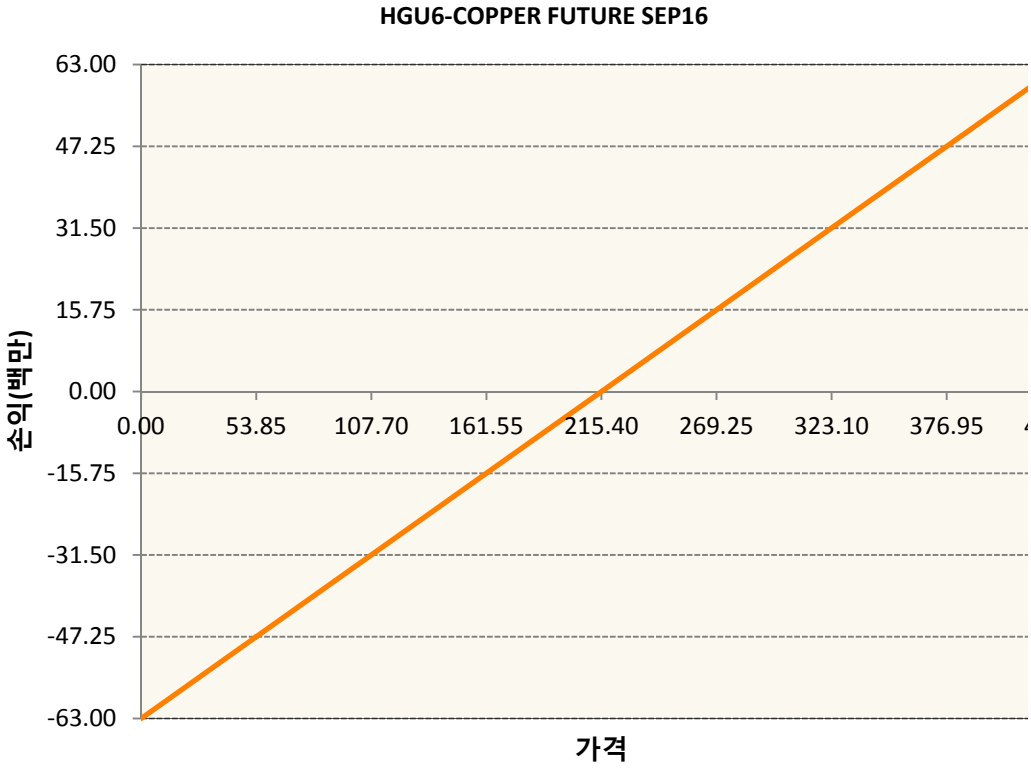
메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

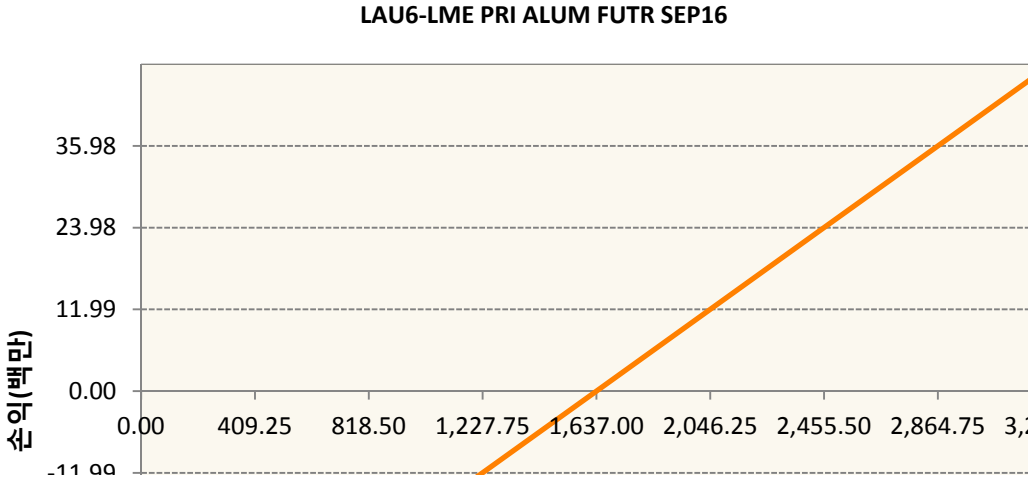
1. 계약금액

(단위:백만원)

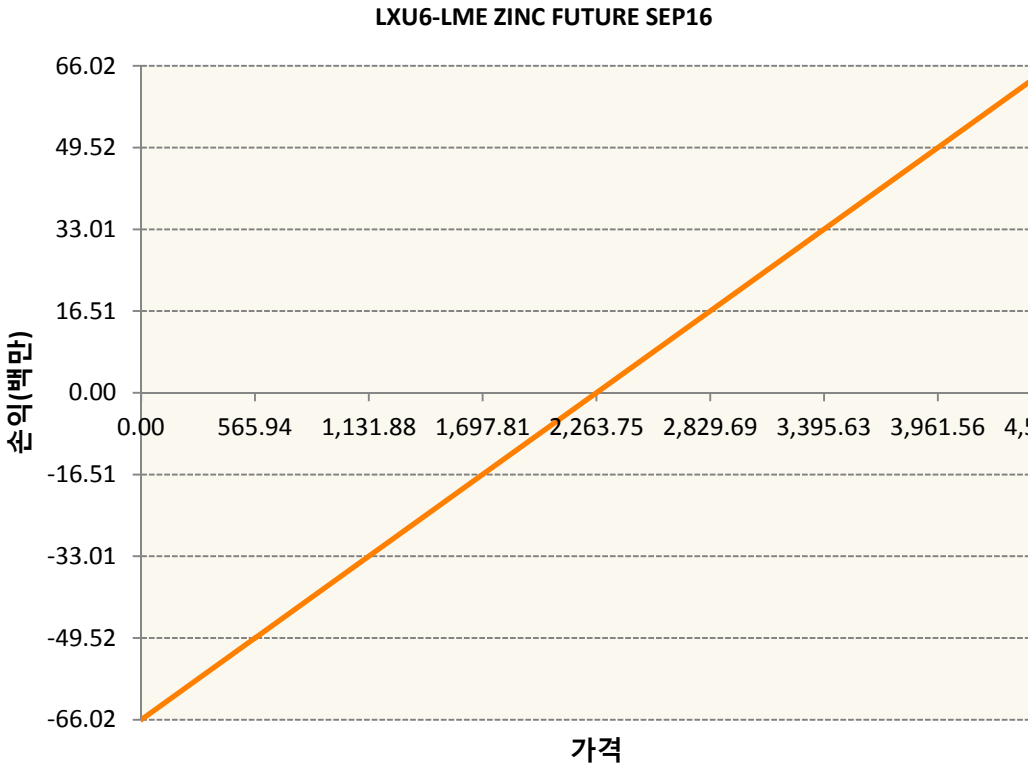
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	46	0	46	
누계	유가증권	선물	324	0	324	

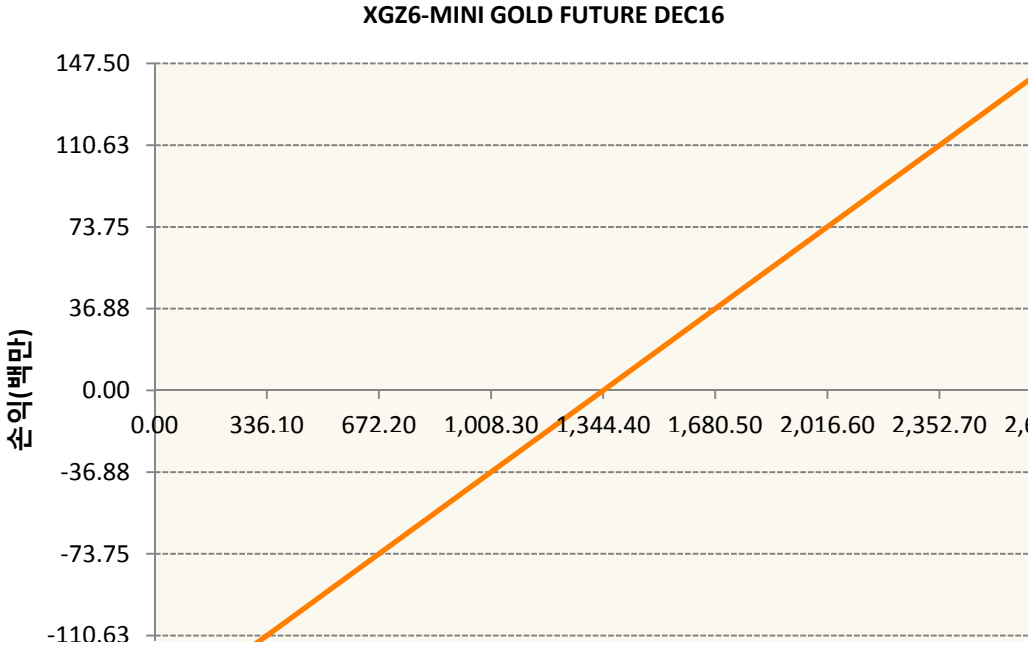
2. 만기시점의 손익구조

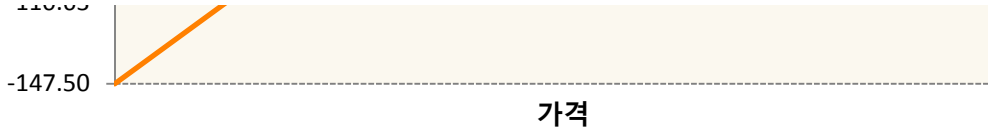


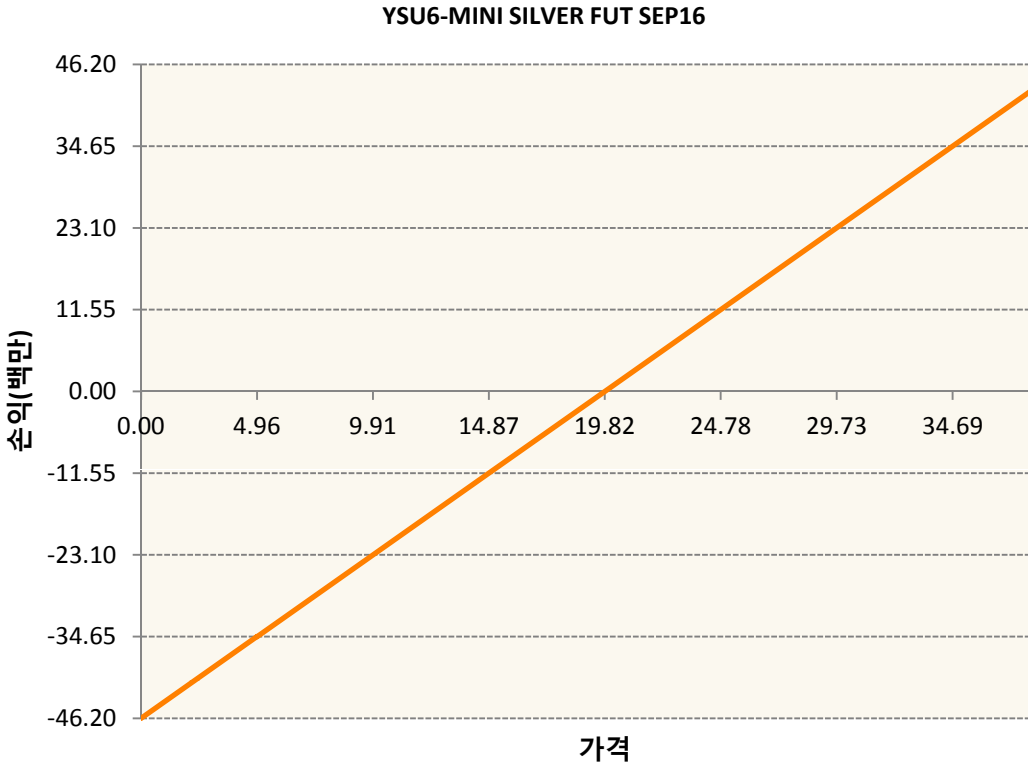



-23.98
-35.98
-47.97
가격


LXU6-LME ZINC FUTURE SEP16
66.02
49.52
33.01
16.51
0.00
-16.51
-33.01
-49.52
-66.02
순익(백만)
0.00
565.94
1,131.88
1,697.81
2,263.75
2,829.69
3,395.63
3,961.56
가격


XGZ6-MINI GOLD FUTURE DEC16
147.50
110.63
73.75
36.88
0.00
-36.88
-73.75
-110.63
순익(백만)
0.00
336.10
672.20
1,008.30
1,344.40
1,680.50
2,016.60
2,352.70





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	2016-08-09
기준일	2016-08-08

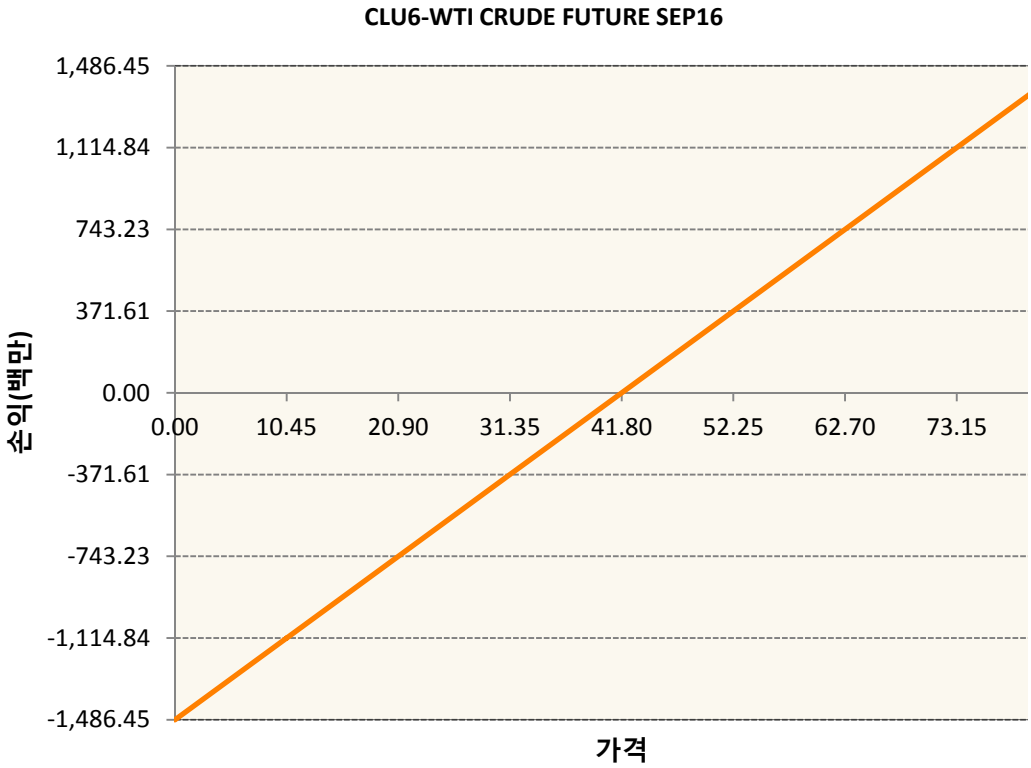
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

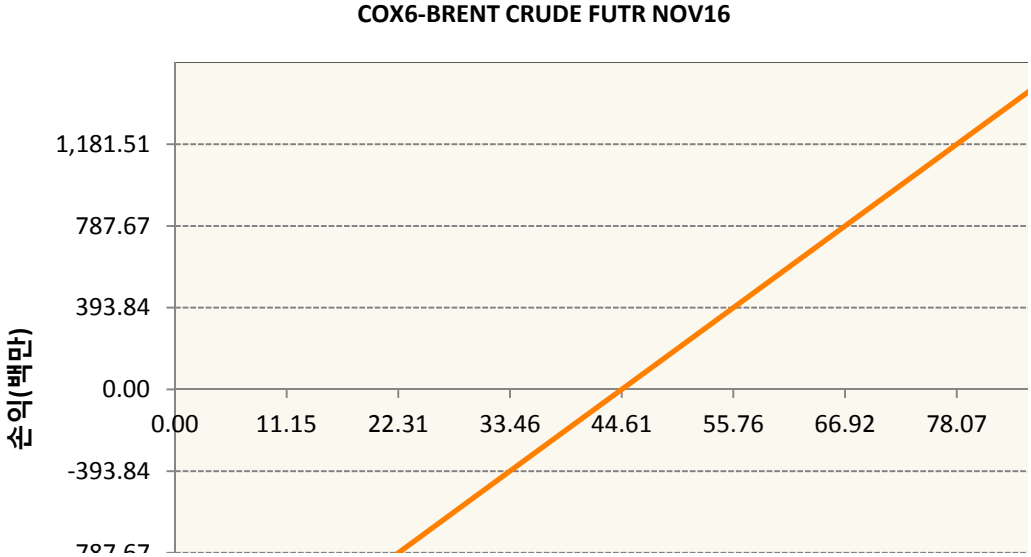
1. 계약금액

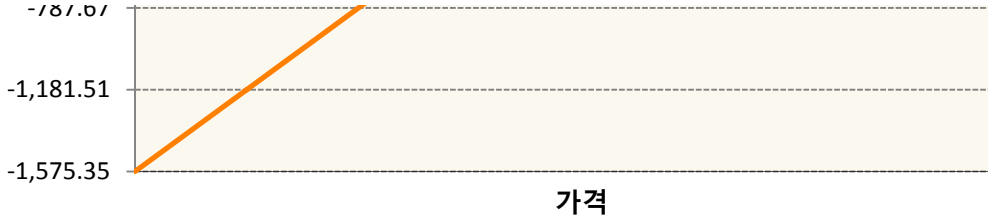
(단위:백만원)

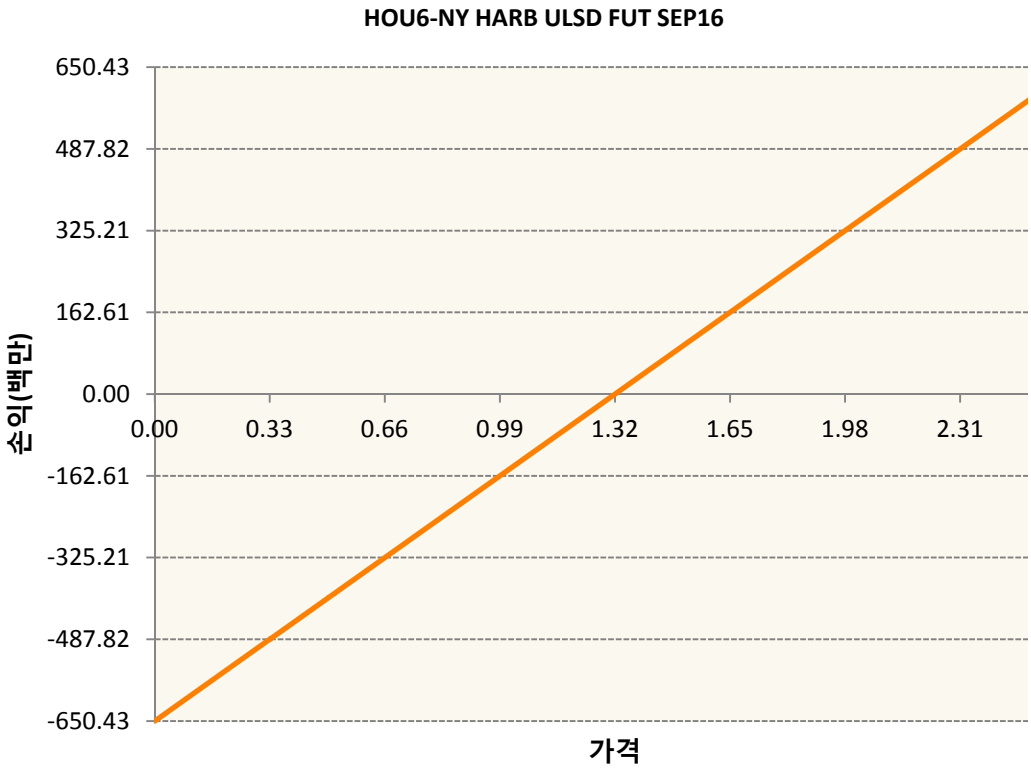
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,010	0	6,010	

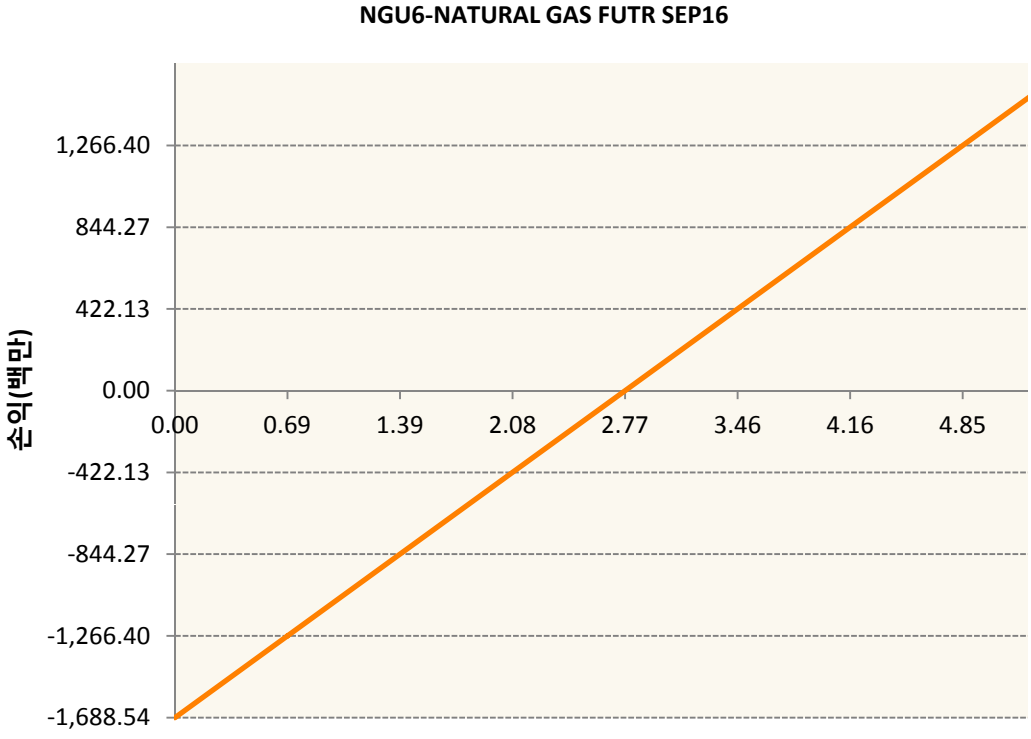
2. 만기시점의 손익구조



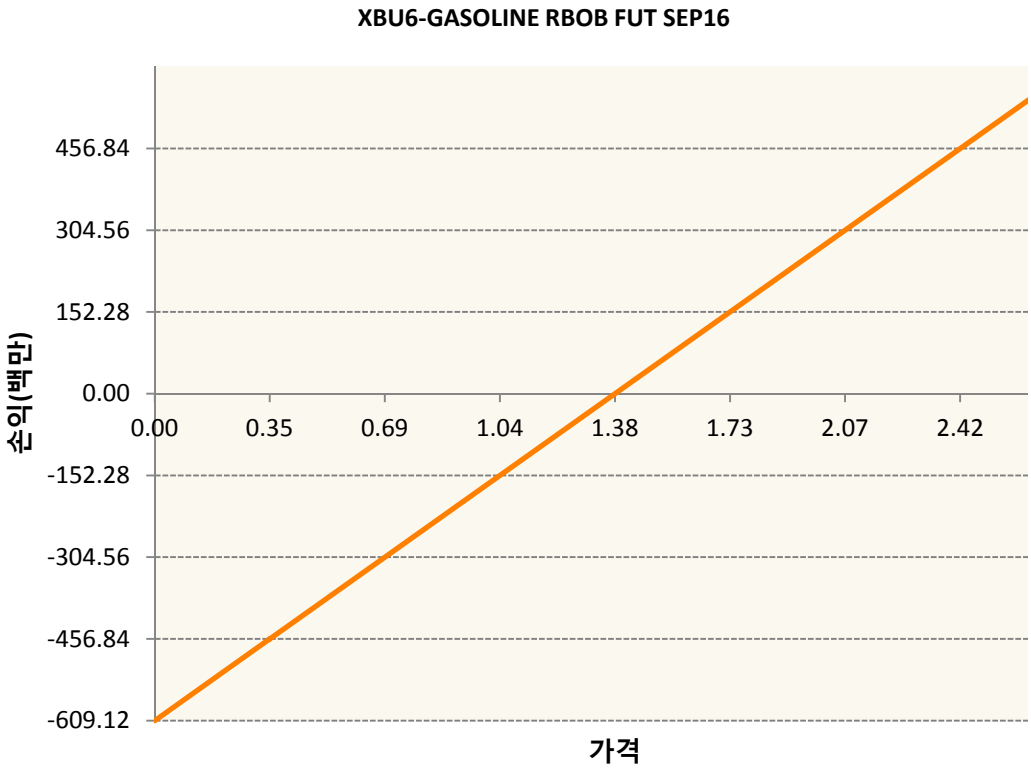



-1,181.51
-1,575.35
가격


HOU6-NY HARB ULSD FUT SEP16
650.43
487.82
325.21
162.61
0.00
-162.61
-325.21
-487.82
-650.43
0.00
0.33
0.66
0.99
1.32
1.65
1.98
2.31
순익(백만)
가격


NGU6-NATURAL GAS FUTR SEP16
1,266.40
844.27
422.13
0.00
-422.13
-844.27
-1,266.40
-1,688.54
0.00
0.69
1.39
2.08
2.77
3.46
4.16
4.85
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLU6	WTI CRUDE FUTURE SEP16	119
COX6	BRENT CRUDE FUTR NOV16	126
HOU6	NY HARB ULSD FUT SEP16	52
NGU6	NATURAL GAS FUTR SEP16	135
XBU6	GASOLINE RBOB FUT SEP16	49

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,082

공시일	2016-08-09
기준일	2016-08-08

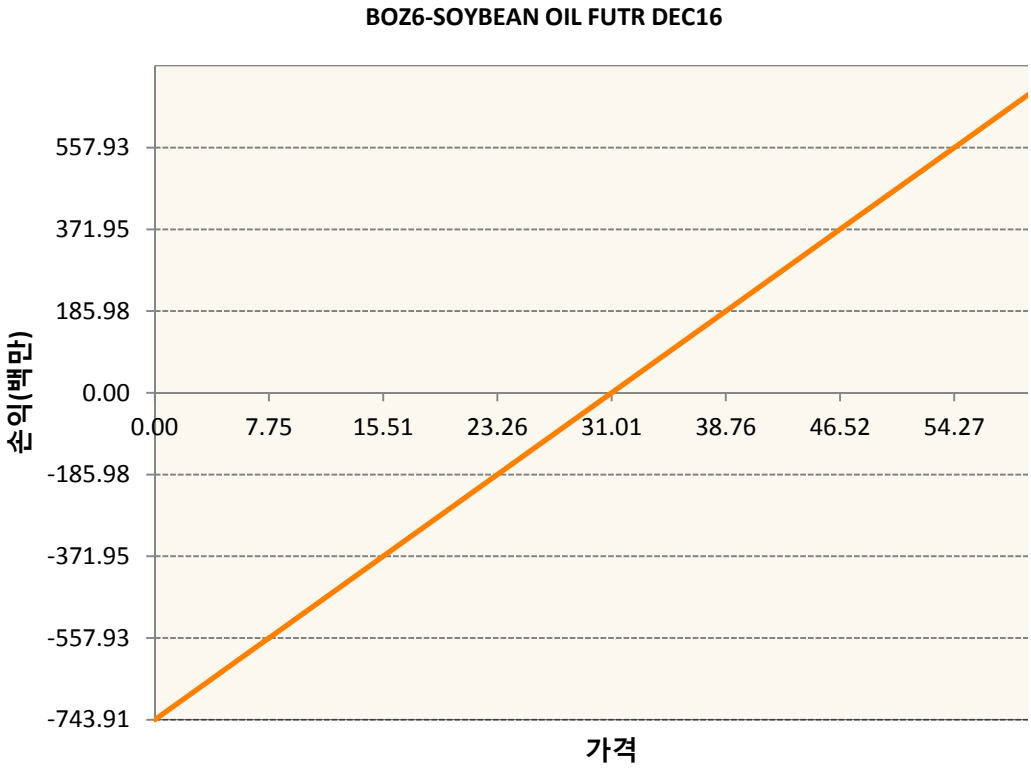
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

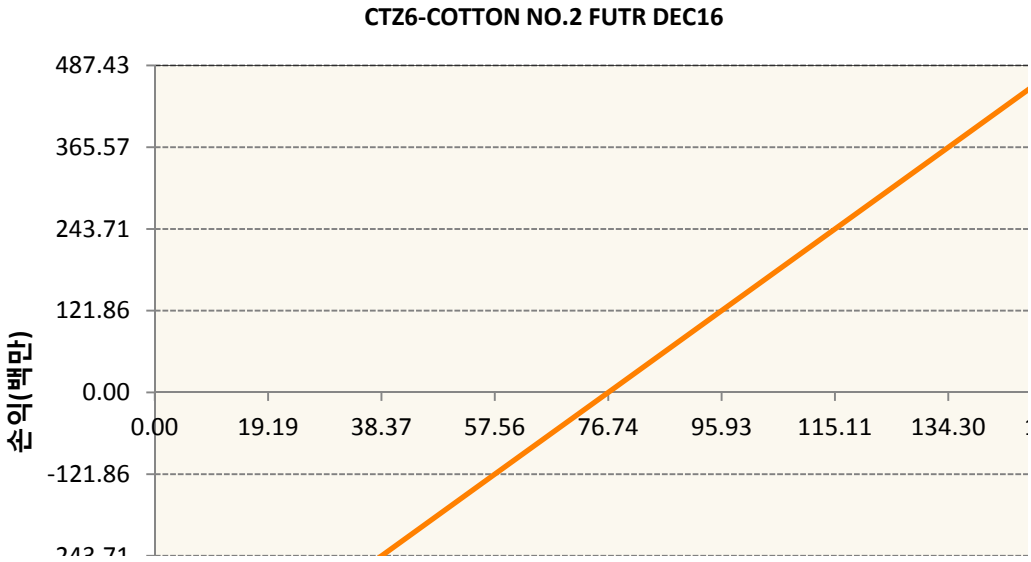
1. 계약금액

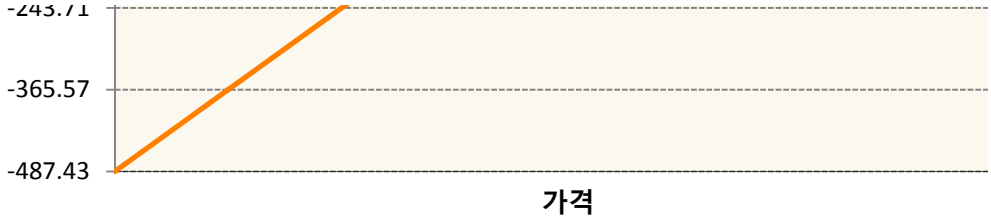
(단위:백만원)

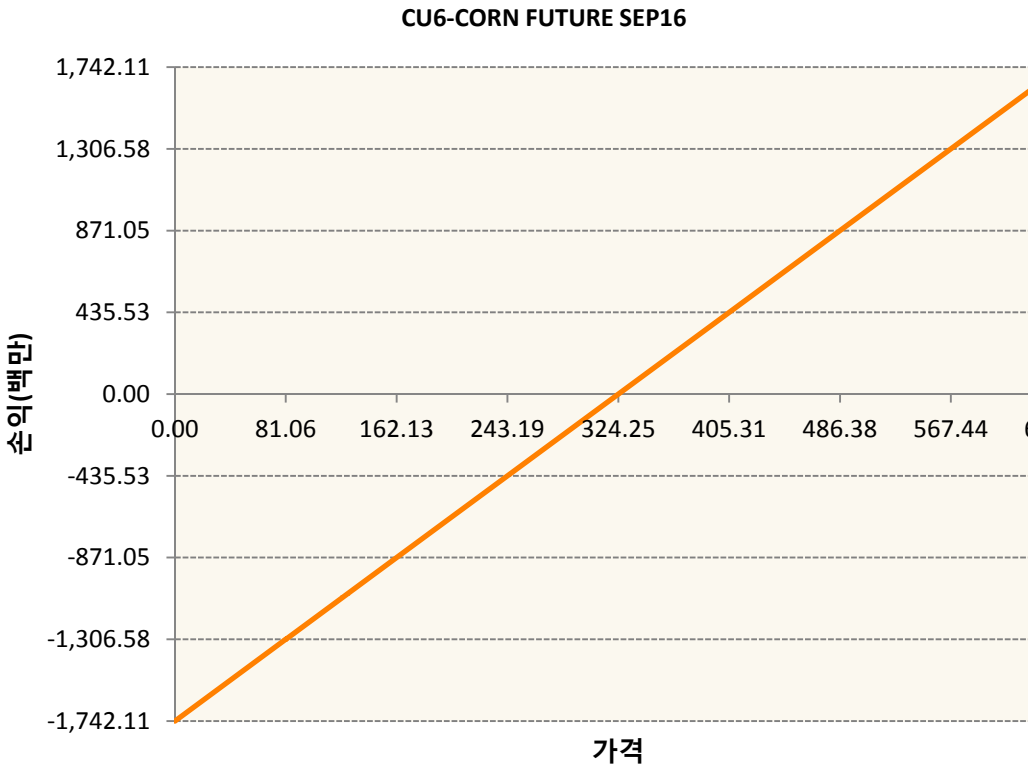
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,343	0	8,343	

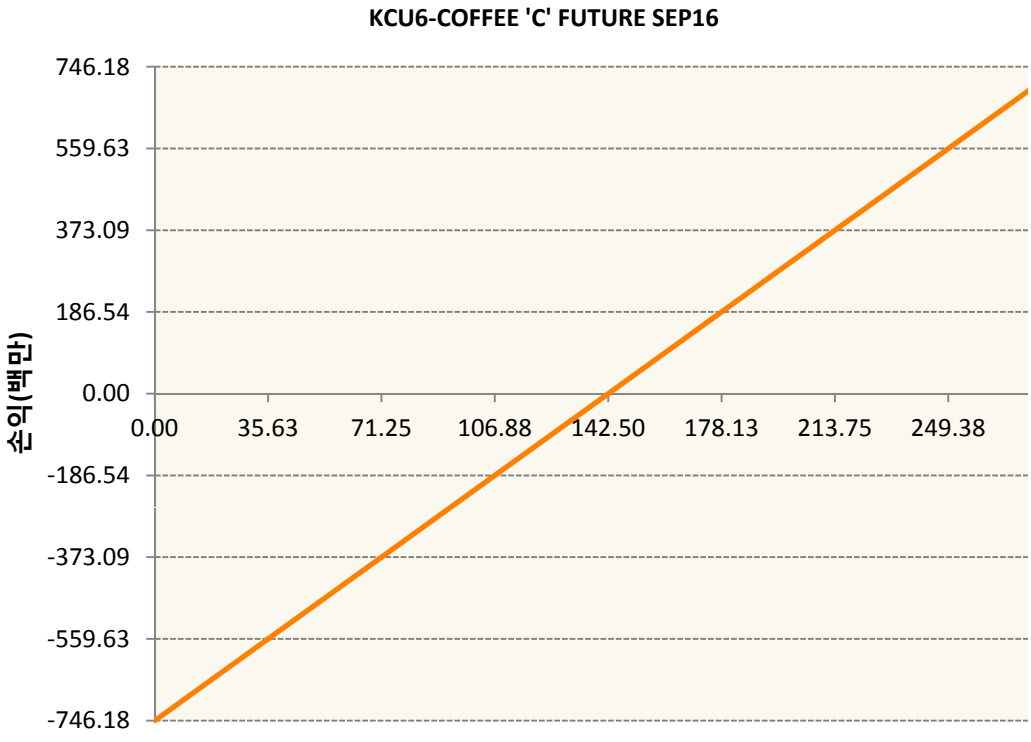
2. 만기시점의 손익구조



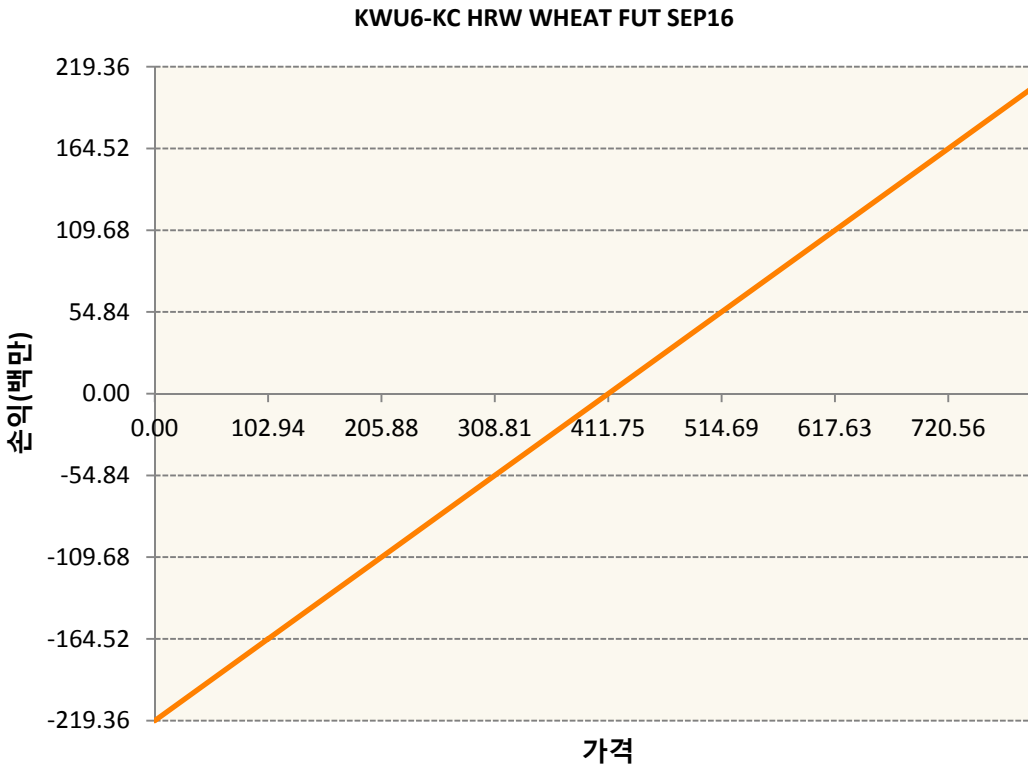


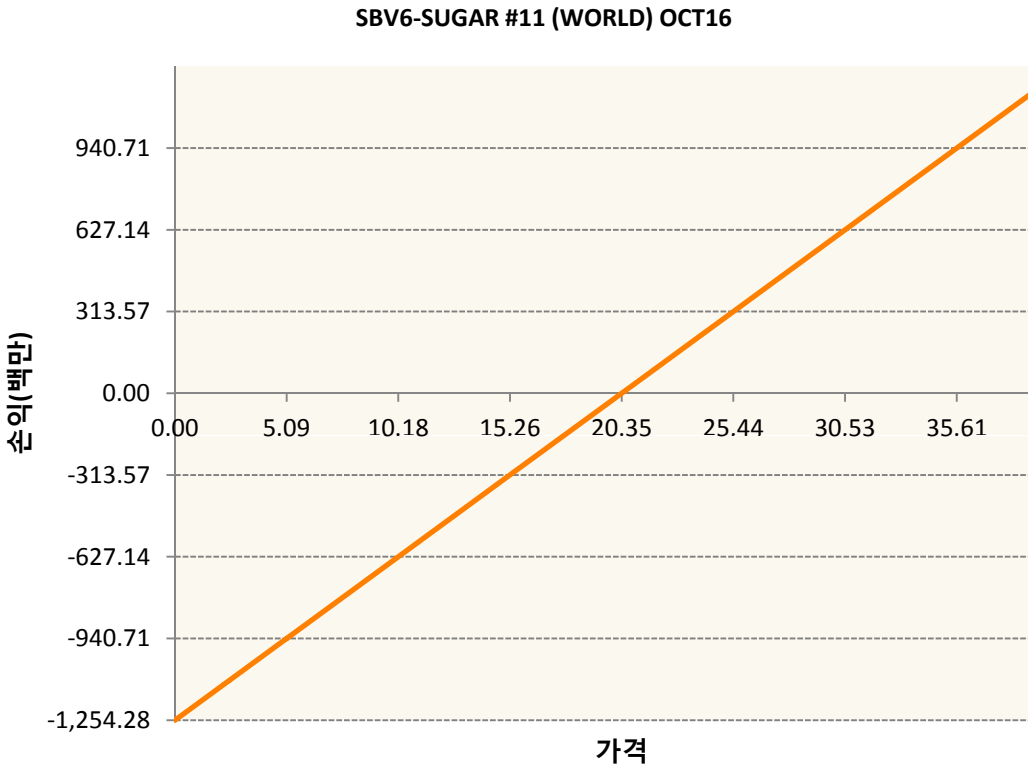

-365.57
-487.43
가격


CU6-CORN FUTURE SEP16
1,742.11
1,306.58
871.05
435.53
0.00
-435.53
-871.05
-1,306.58
-1,742.11
0.00
81.06
162.13
243.19
324.25
405.31
486.38
567.44
순익(백만)
가격

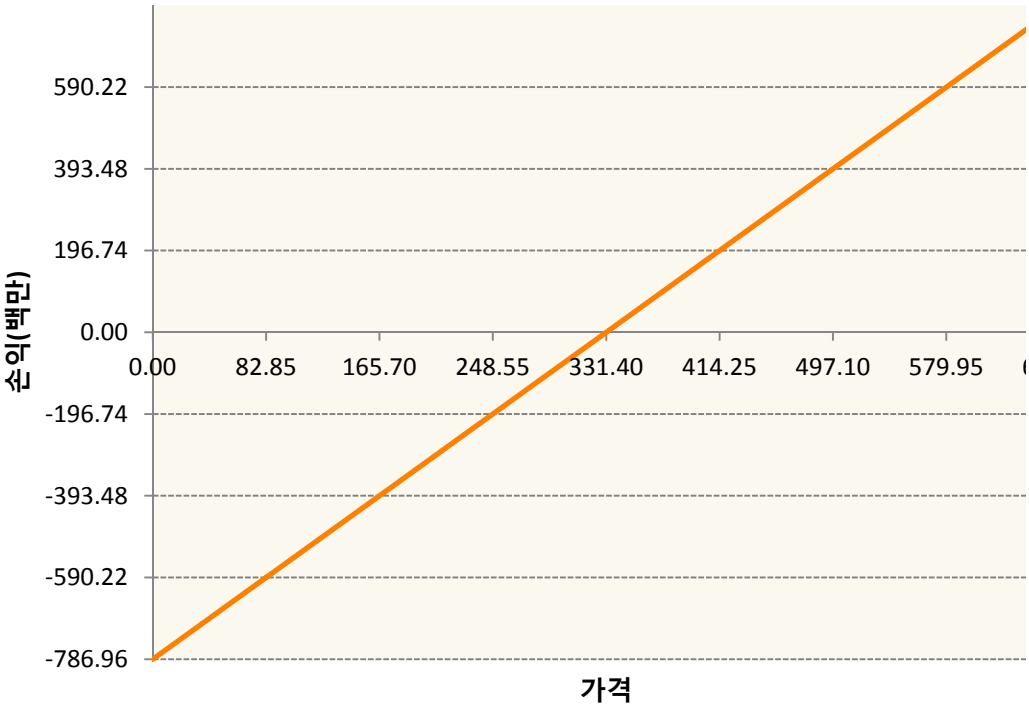

KCU6-COFFEE 'C' FUTURE SEP16
746.18
559.63
373.09
186.54
0.00
-186.54
-373.09
-559.63
-746.18
0.00
35.63
71.25
106.88
142.50
178.13
213.75
249.38
순익(백만)

가격

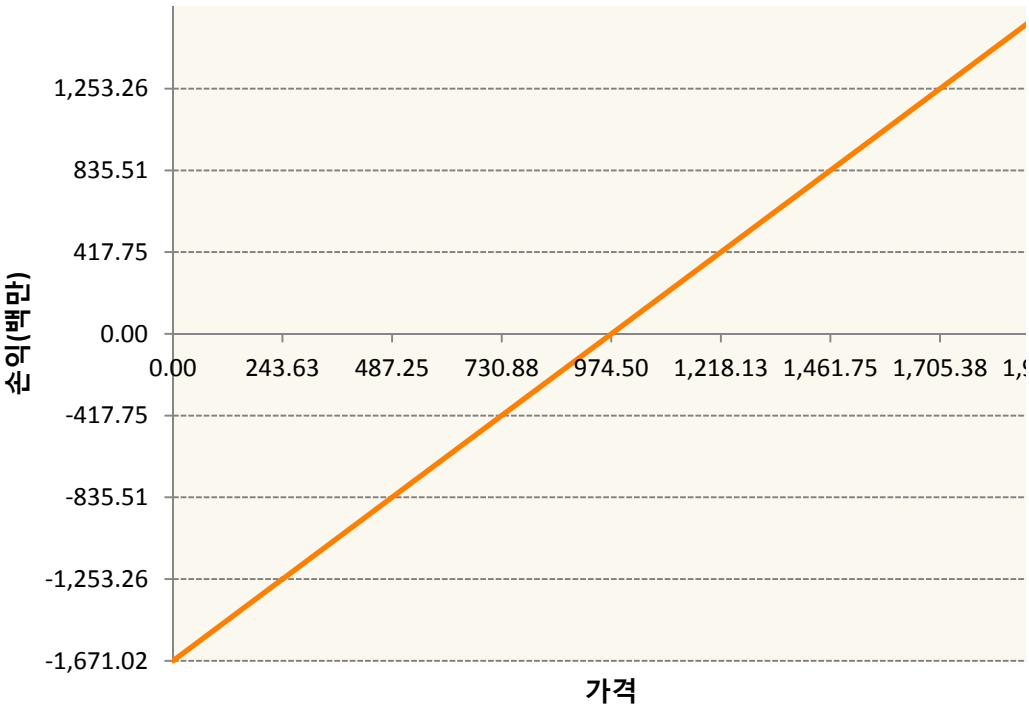

KWU6-KC HRW WHEAT FUT SEP16
219.36
164.52
109.68
54.84
0.00
-54.84
-109.68
-164.52
-219.36
0.00
102.94
205.88
308.81
411.75
514.69
617.63
720.56
손익(백만)
가격


SBV6-SUGAR #11 (WORLD) OCT16
940.71
627.14
313.57
0.00
-313.57
-627.14
-940.71
-1,254.28
0.00
5.09
10.18
15.26
20.35
25.44
30.53
35.61
손익(백만)
가격

SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16

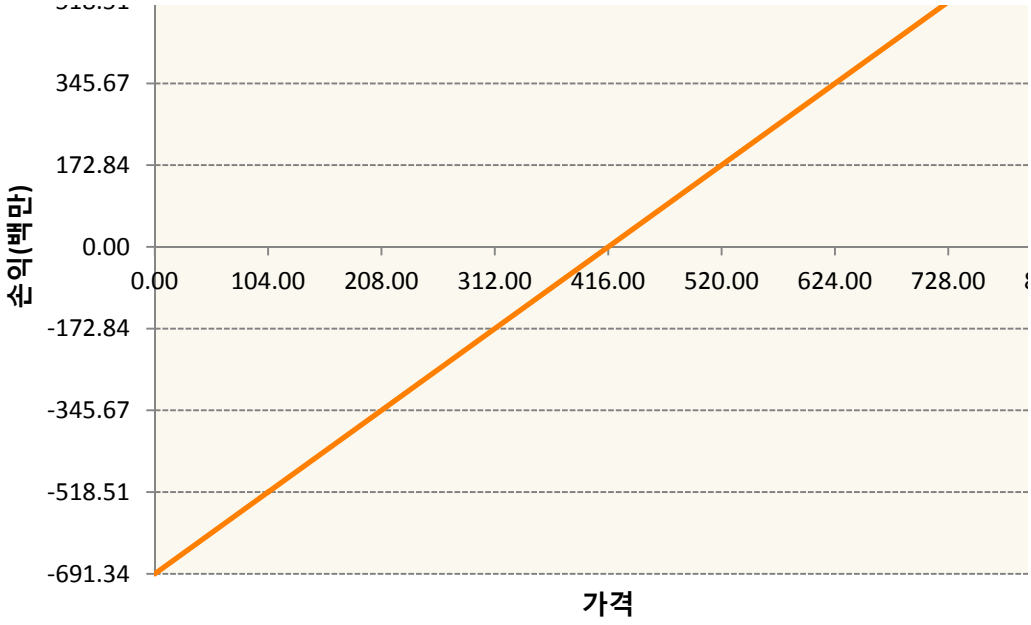


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16



WU6-WHEAT FUTURE(CBT) SEP16





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ6	SOYBEAN OIL FUTR DEC16	60
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	39
CU6	CORN FUTURE SEP16	139
KCU6	COFFEE 'C' FUTURE SEP16	60
KWU6	KC HRW WHEAT FUT SEP16	18
SBV6	SUGAR #11 (WORLD) OCT16	100
SMZ6	SOYBEAN MEAL FUTR DEC16	63
SX6	SOYBEAN FUTURE NOV16	134
WU6	WHEAT FUTURE(CBT) SEP16	55

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	873