공시일	2016-08-12
기준일	2016-08-11

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	2016-08-12
기준일	2016-08-11

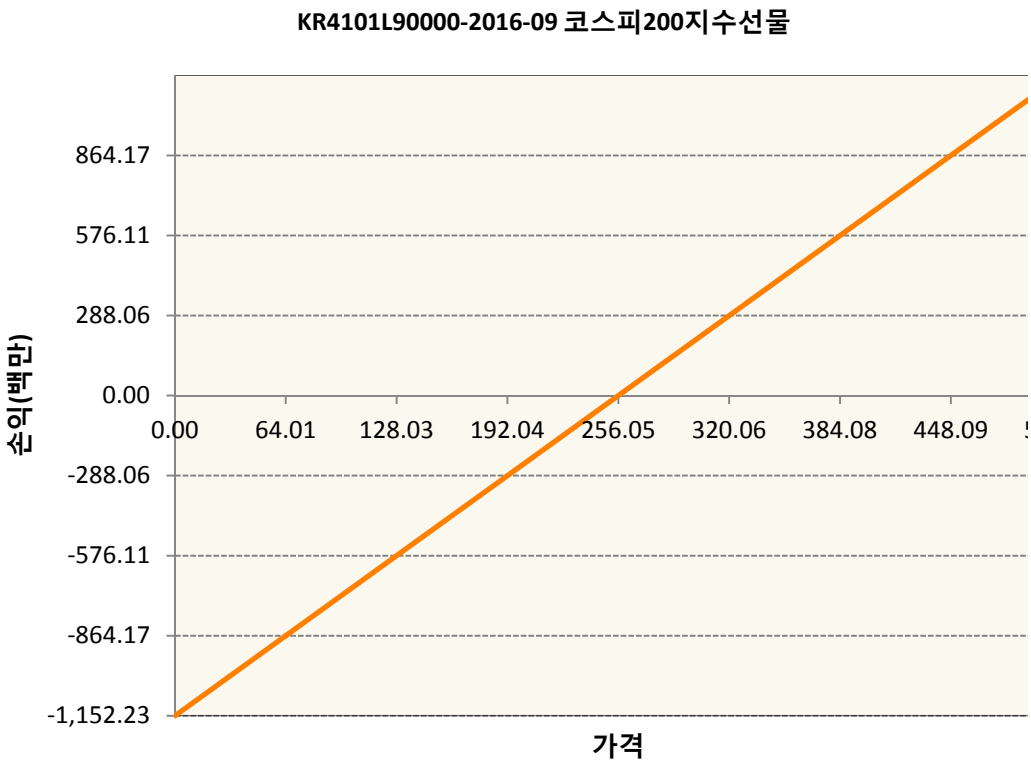
스마트인덱스모

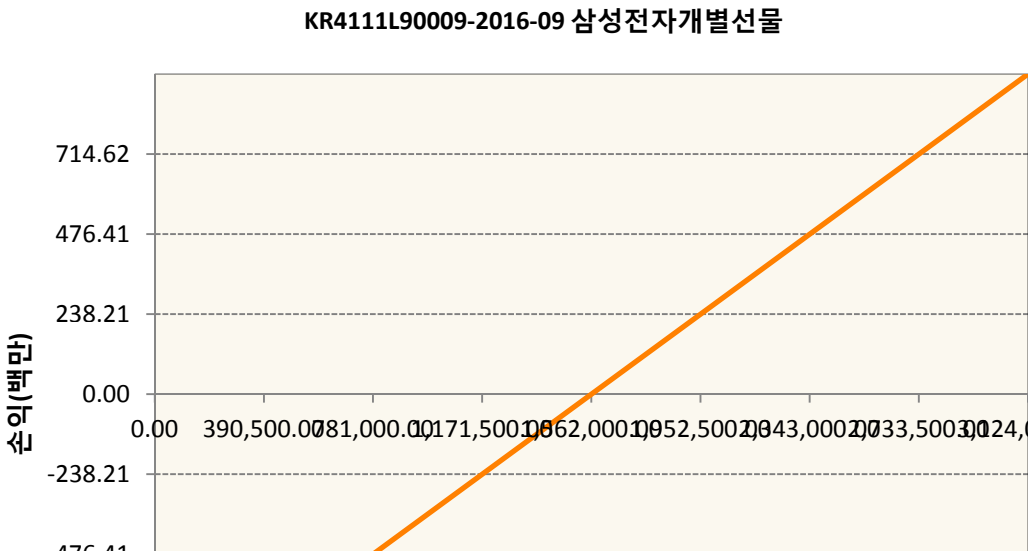
1. 계약금액

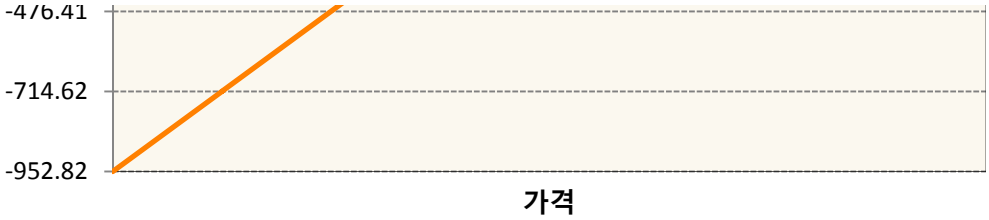
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	942	0	942	장내
누계	유가증권	선물	2,105	0	2,105	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						92
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
-5.33%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61
-2.67%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	31	31	31	31	31	31	31
5.33%	61	61	61	61	61	61	61
8.00%	92	92	92	92	92	92	92
KR4111L900	2016-09 삼성전자개별선물						76
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
-5.33%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	25	25	25	25	25	25	25
5.33%	51	51	51	51	51	51	51
8.00%	76	76	76	76	76	76	76

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

155

공시일	2016-08-12
기준일	2016-08-11

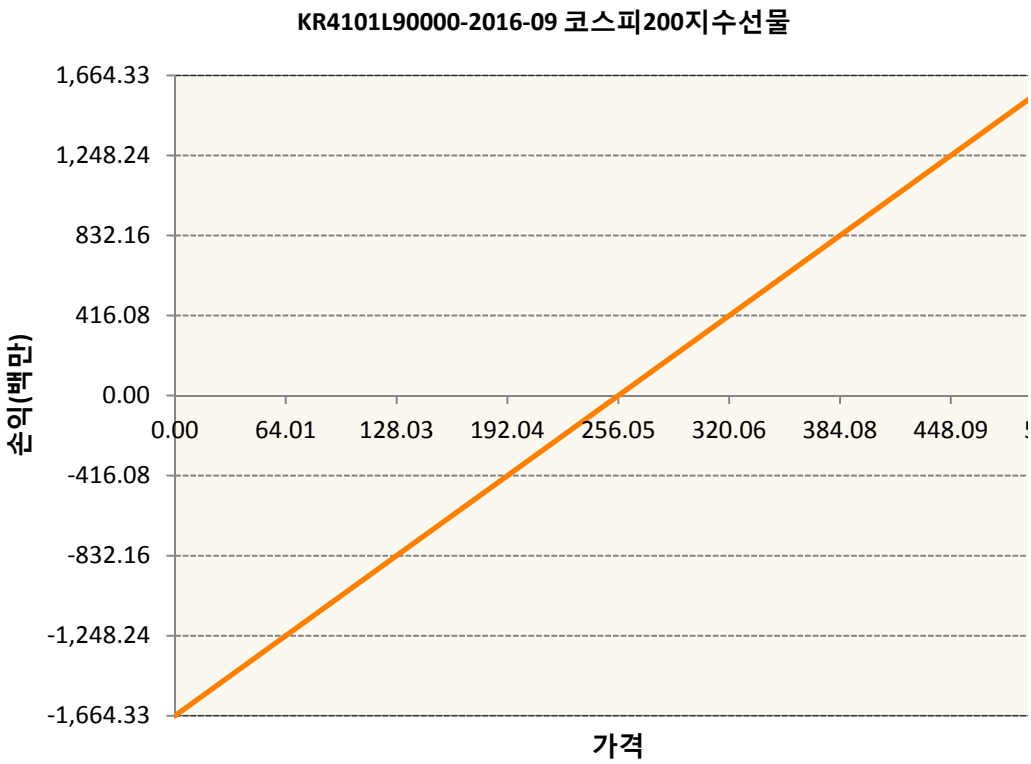
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,664	0	1,664	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						133
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133
-5.33%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-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%	89	89	89	89	89	89	89
8.00%	133	133	133	133	133	133	133

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

110

공시일	2016-08-12
기준일	2016-08-11

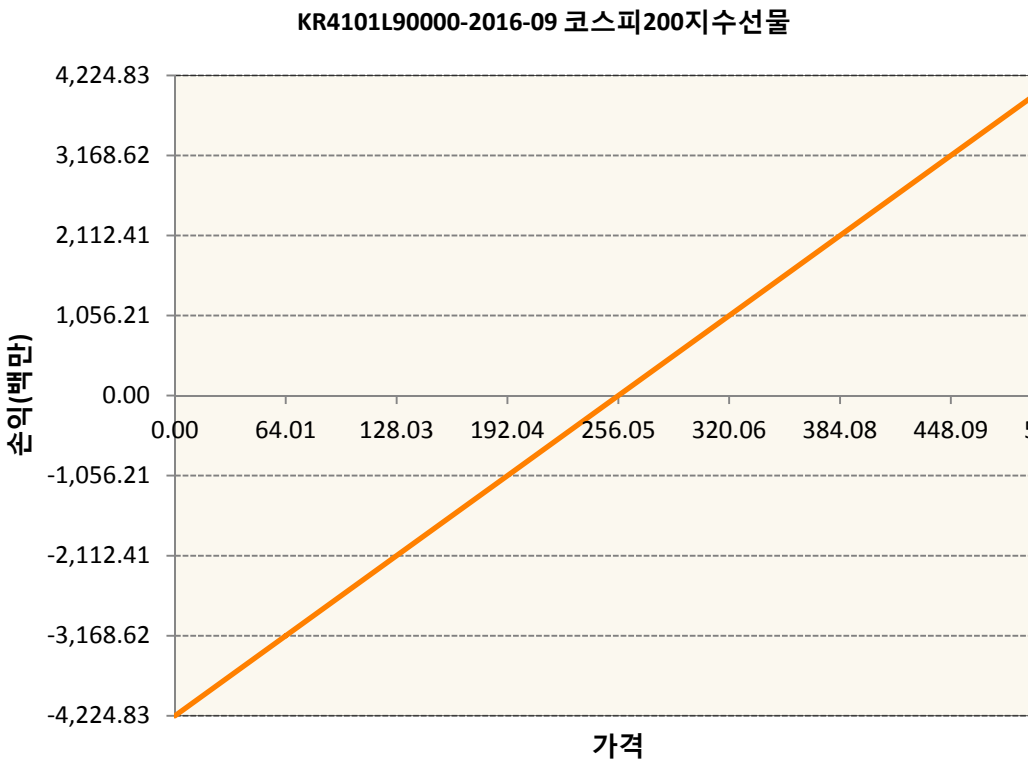
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	128	-128	장내
누계	유가증권	선물	4,225	0	4,225	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						338
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-338	-338	-338	-338	-338	-338	-338
-5.33%	-225	-225	-225	-225	-225	-225	-225
-2.67%	-113	-113	-113	-113	-113	-113	-113
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	113	113	113	113	113	113	113
5.33%	225	225	225	225	225	225	225
8.00%	338	338	338	338	338	338	338

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

278

공시일	2016-08-12
기준일	2016-08-11

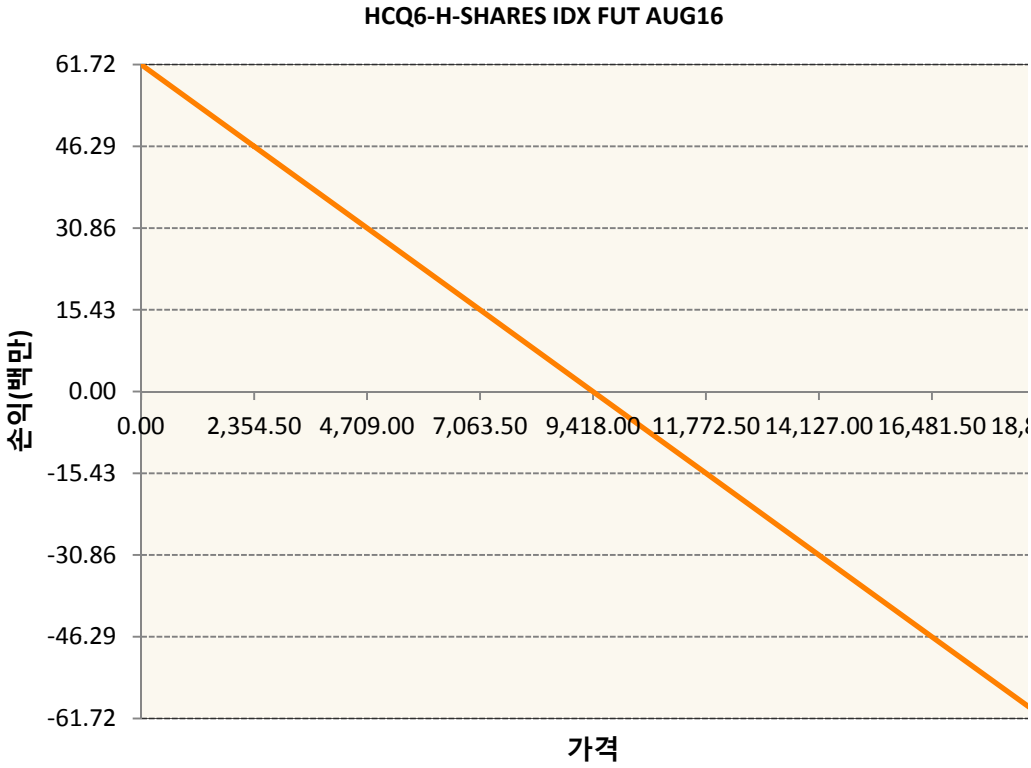
아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

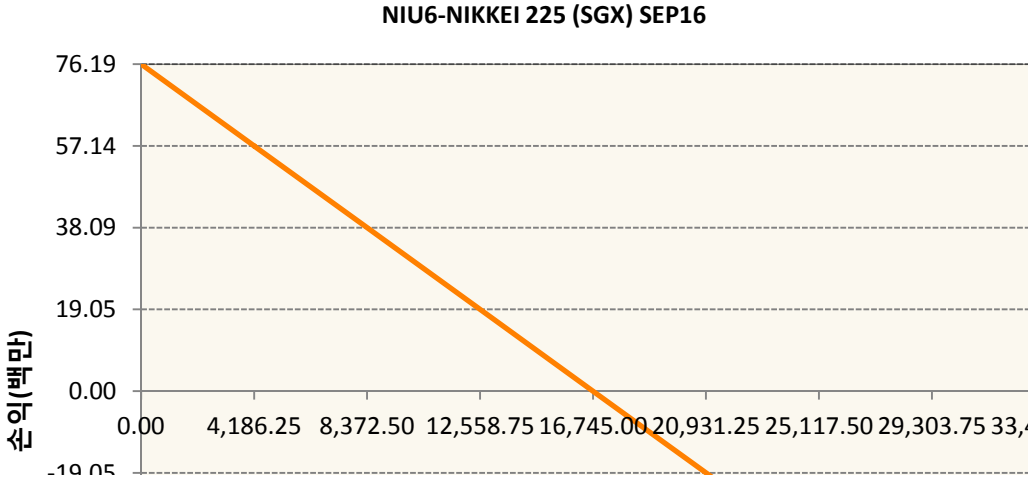
1. 계약금액

(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	76	-76	
누계	유가증권	선물	0	62	-62	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	2016-08-12
기준일	2016-08-11

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	885

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

816

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-08-12
기준일	2016-08-11

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	393

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

965

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-08-12
기준일	2016-08-11

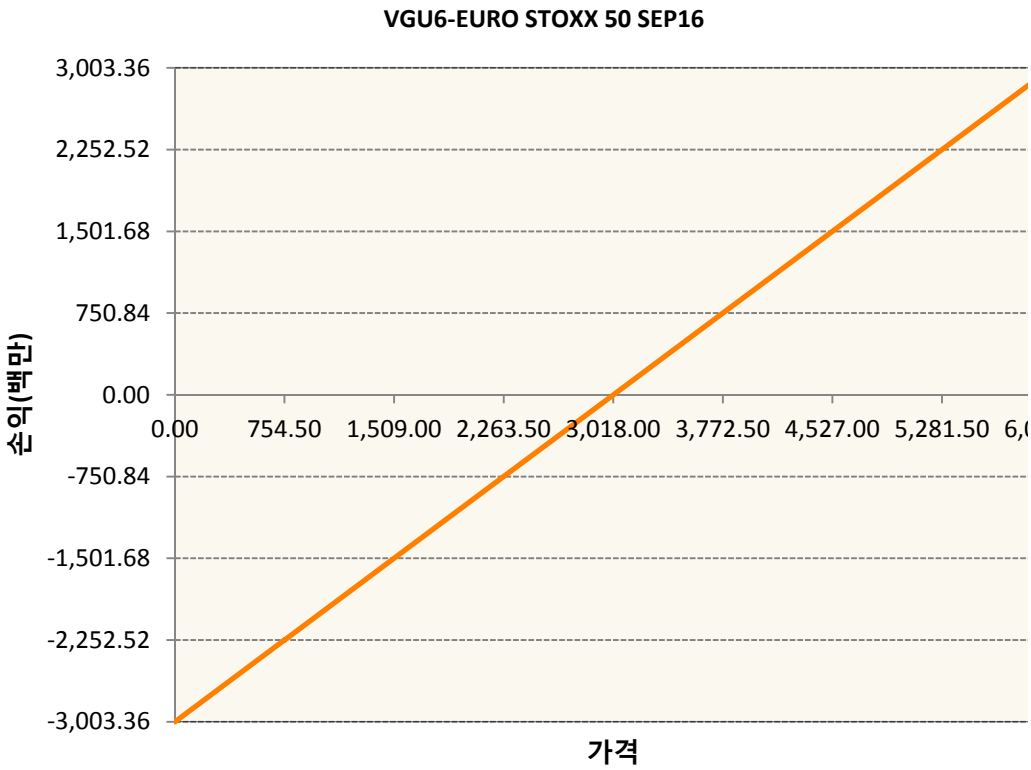
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,003	0	3,003	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 SEP16	240

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

(단위:백만원)

297

공시일	2016-08-12
기준일	2016-08-11

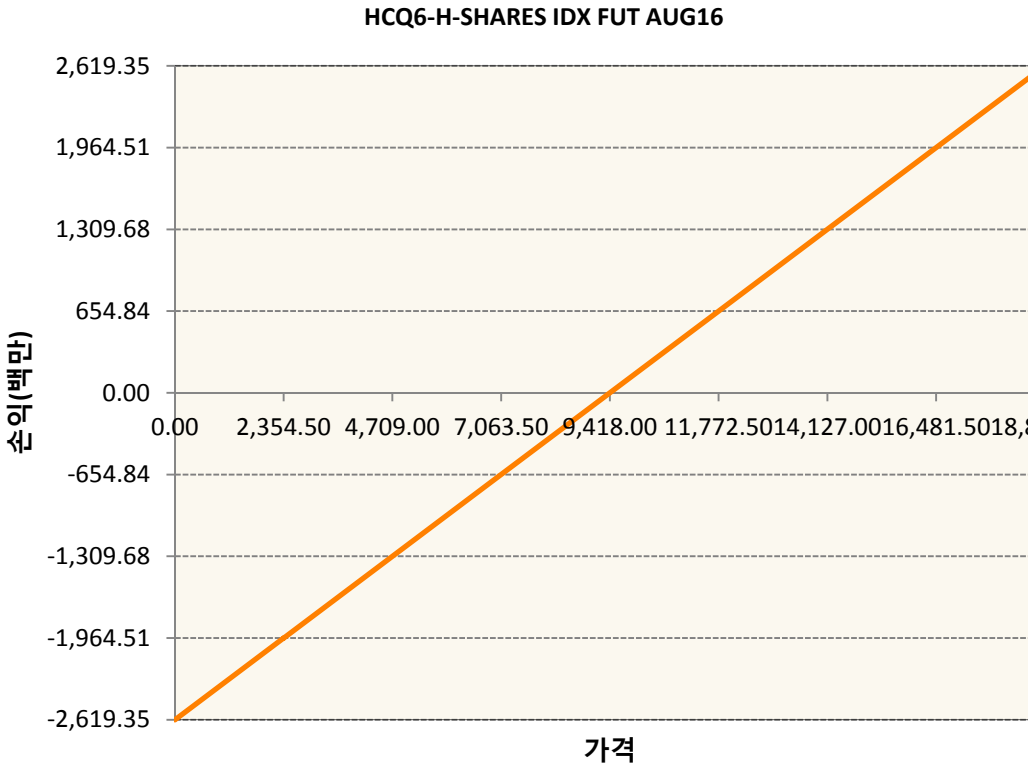
차이나인덱스모(주식-파생형)

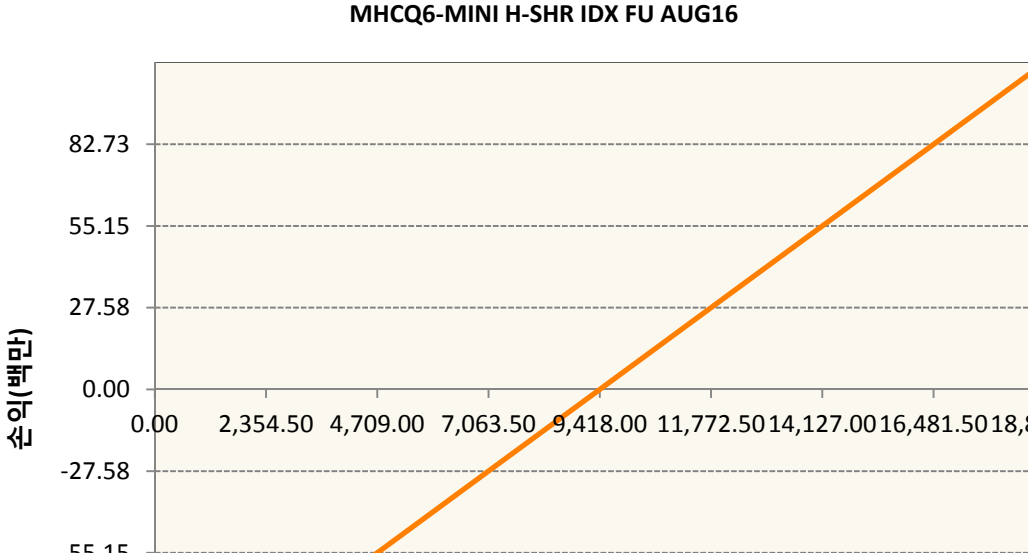
1. 계약금액

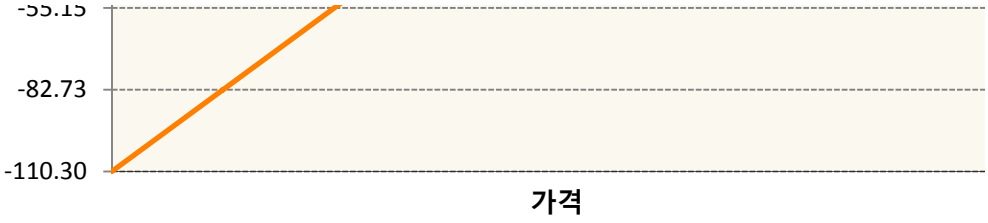
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,730	0	2,730	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ6	H-SHARES IDX FUT AUG16	210
MHCQ6	MINI H-SHR IDX FU AUG16	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	307

공시일	2016-08-12
기준일	2016-08-11

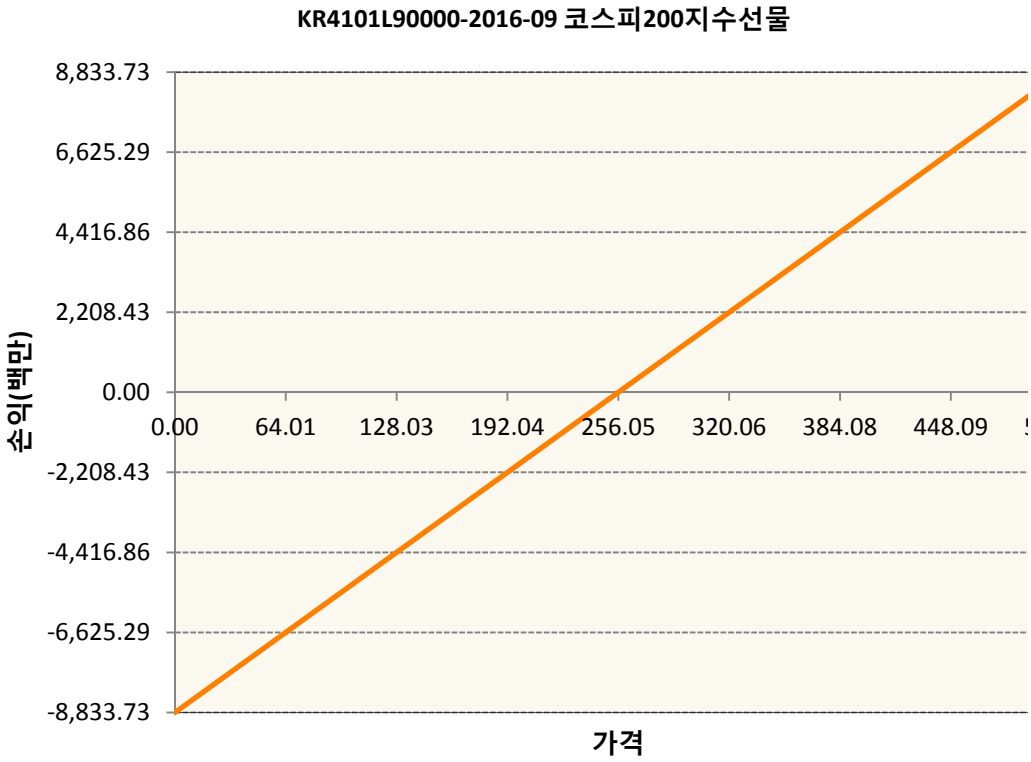
커버드콜(주식혼합-파생형)

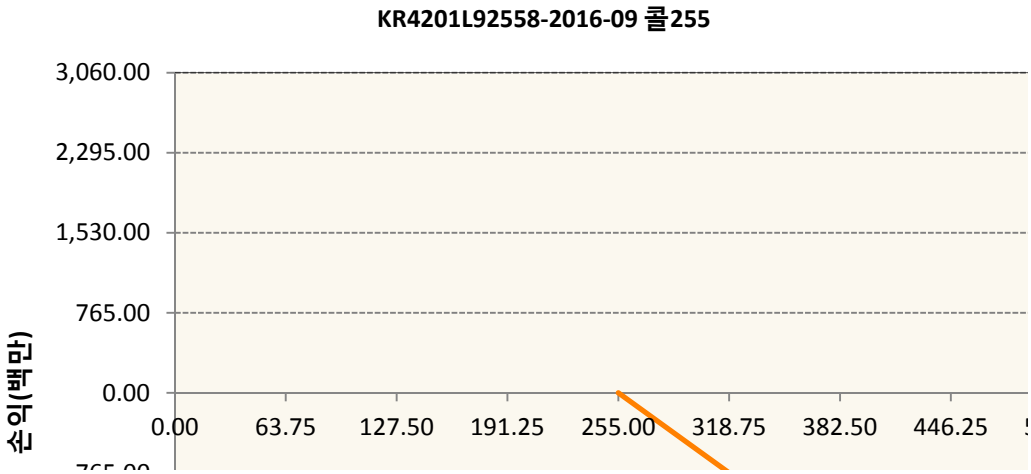
1. 계약금액

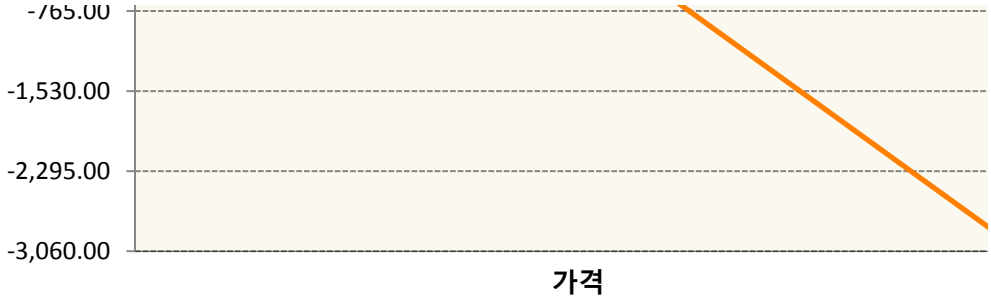
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	3,098	-3,098	장내
누계	유가증권	선물	8,834	0	8,834	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,060	-3,060	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900 2016-09 코스피200지수선물							707
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-707	-707	-707	-707	-707	-707	-707
-5.33%	-471	-471	-471	-471	-471	-471	-471
-2.67%	-236	-236	-236	-236	-236	-236	-236
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	236	236	236	236	236	236	236
5.33%	471	471	471	471	471	471	471
8.00%	707	707	707	707	707	707	707
KR4201L925 2016-09 콜255							1,076
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	223	222	222	222	221	220	218
-5.33%	221	219	216	213	209	203	197
-2.67%	193	183	172	161	149	136	123
0%	46	31	15	0	-15	-31	-47
2.67%	-268	-275	-284	-293	-303	-314	-325
5.33%	-663	-664	-666	-669	-672	-676	-682
8.00%	-1,072	-1,072	-1,072	-1,073	-1,073	-1,074	-1,076

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

(단위:백만원)

1,847

공시일	2016-08-12
기준일	2016-08-11

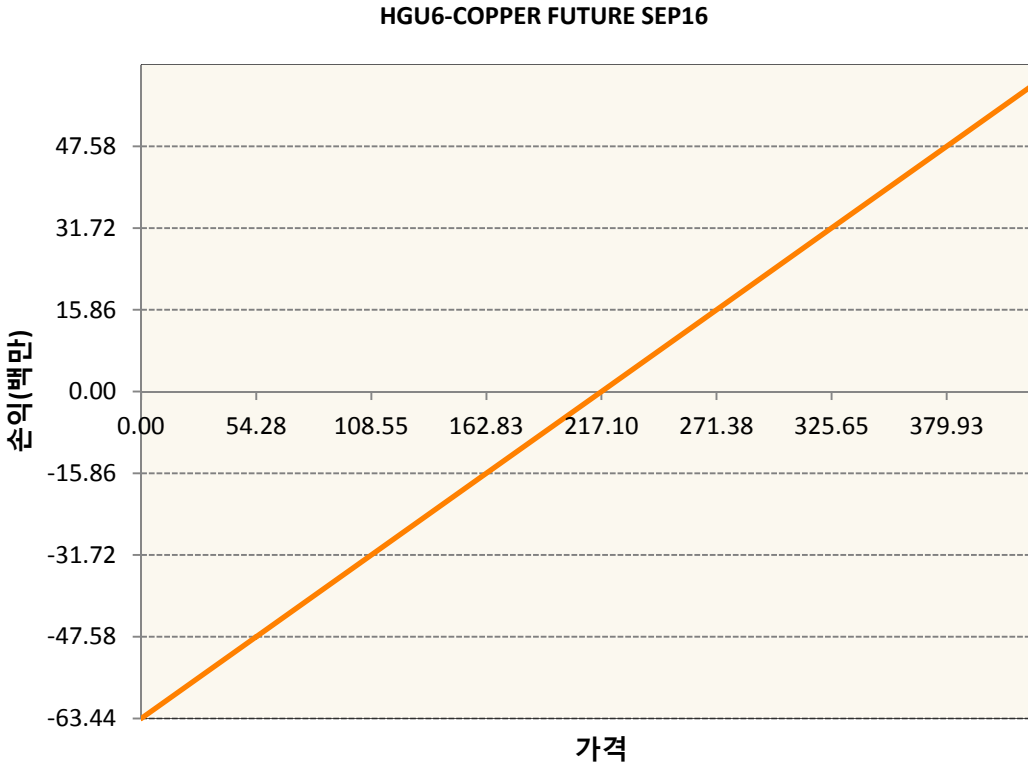
메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

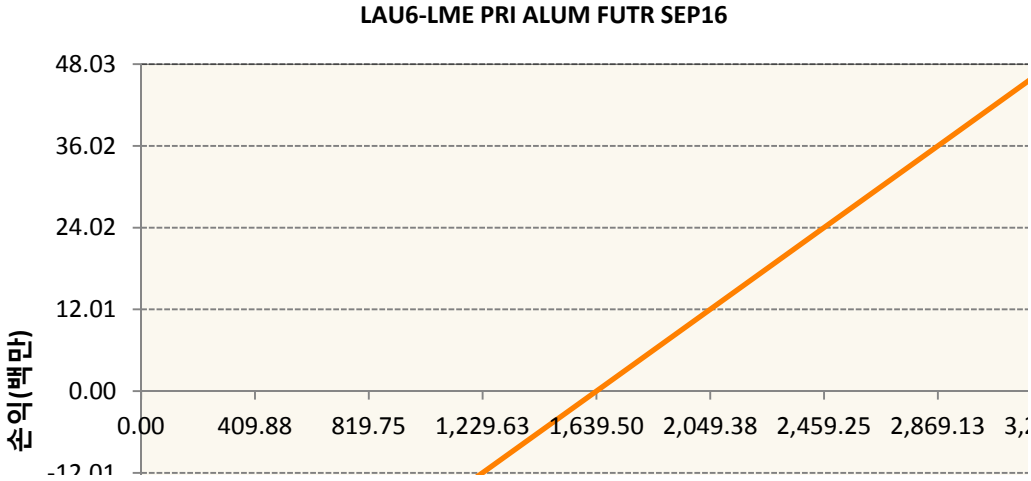
1. 계약금액

(단위:백만원)

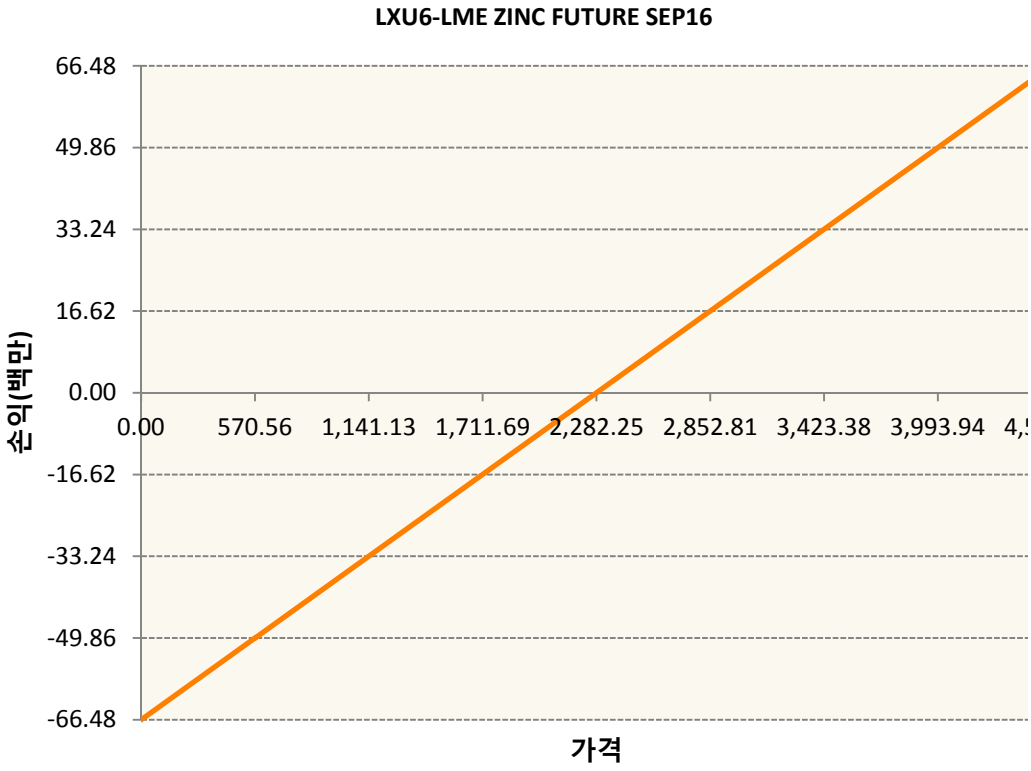
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	47	0	47	
누계	유가증권	선물	326	0	326	

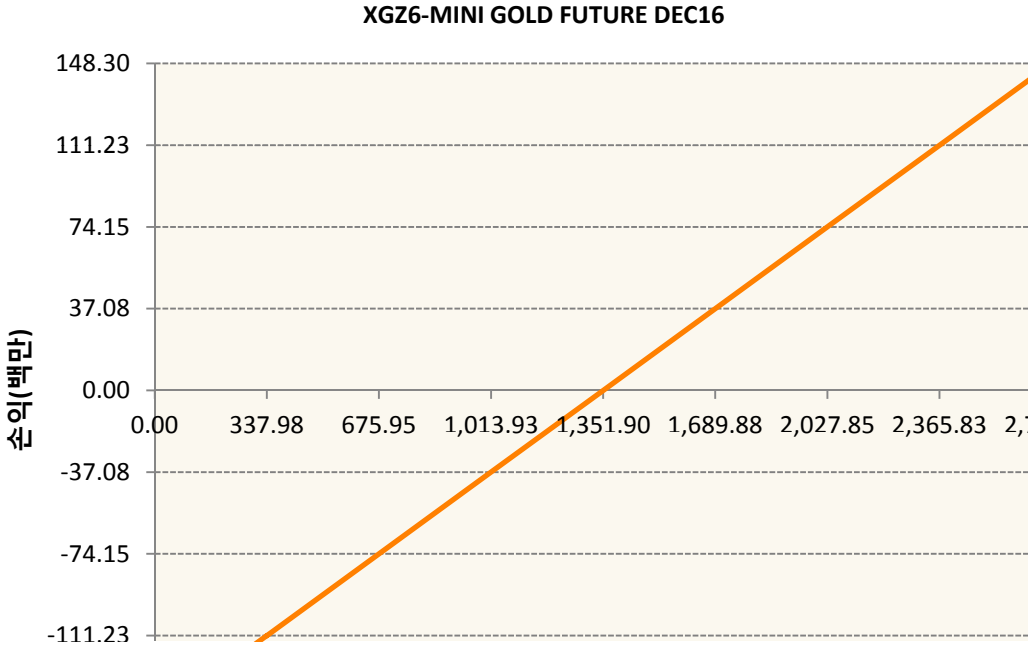
2. 만기시점의 손익구조

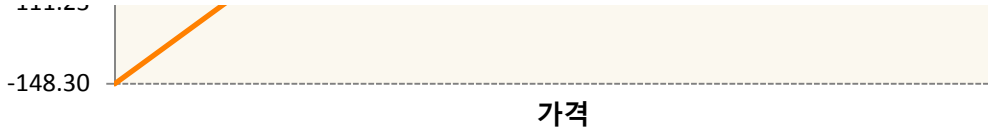


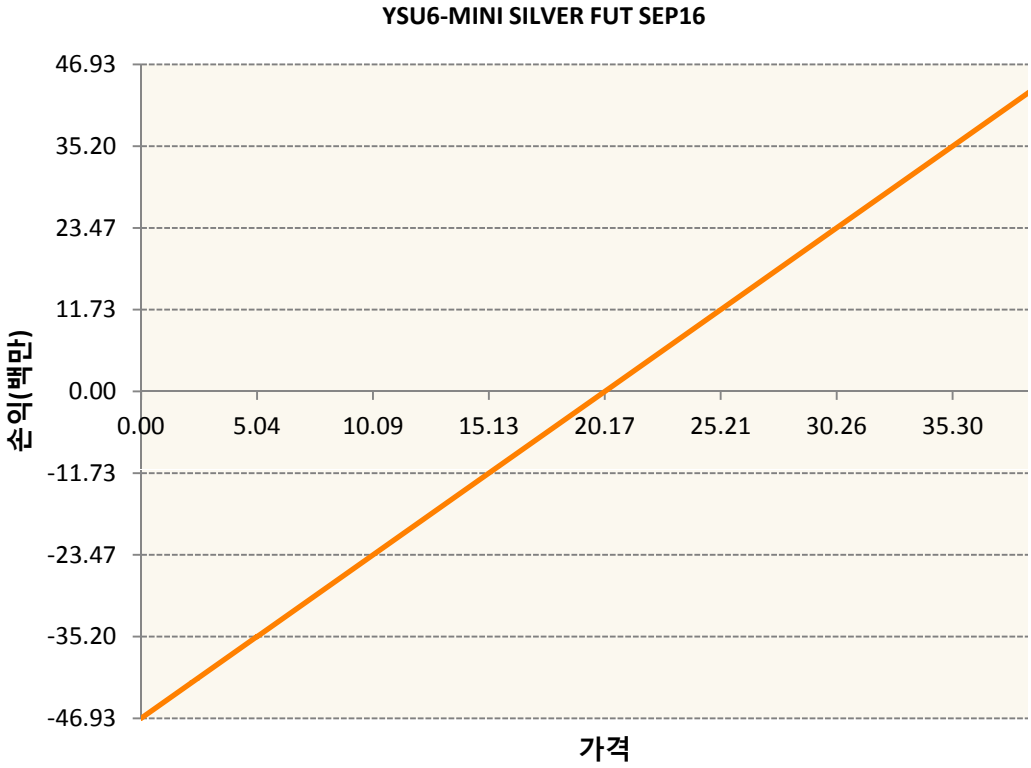



-24.02
-36.02
-48.03
가격


LXU6-LME ZINC FUTURE SEP16
66.48
49.86
33.24
16.62
0.00
-16.62
-33.24
-49.86
-66.48
0.00
570.56
1,141.13
1,711.69
2,282.25
2,852.81
3,423.38
3,993.94
순익(백만)
가격


XGZ6-MINI GOLD FUTURE DEC16
148.30
111.23
74.15
37.08
0.00
-37.08
-74.15
-111.23
0.00
337.98
675.95
1,013.93
1,351.90
1,689.88
2,027.85
2,365.83
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)
	30

공시일	2016-08-12
기준일	2016-08-11

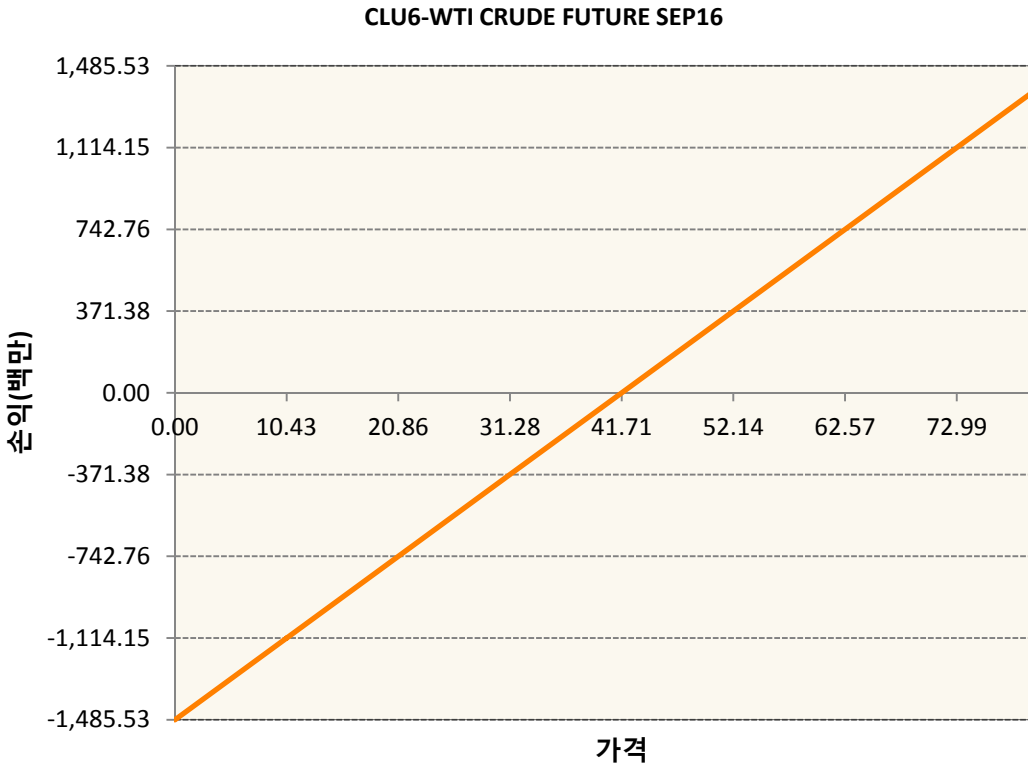
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

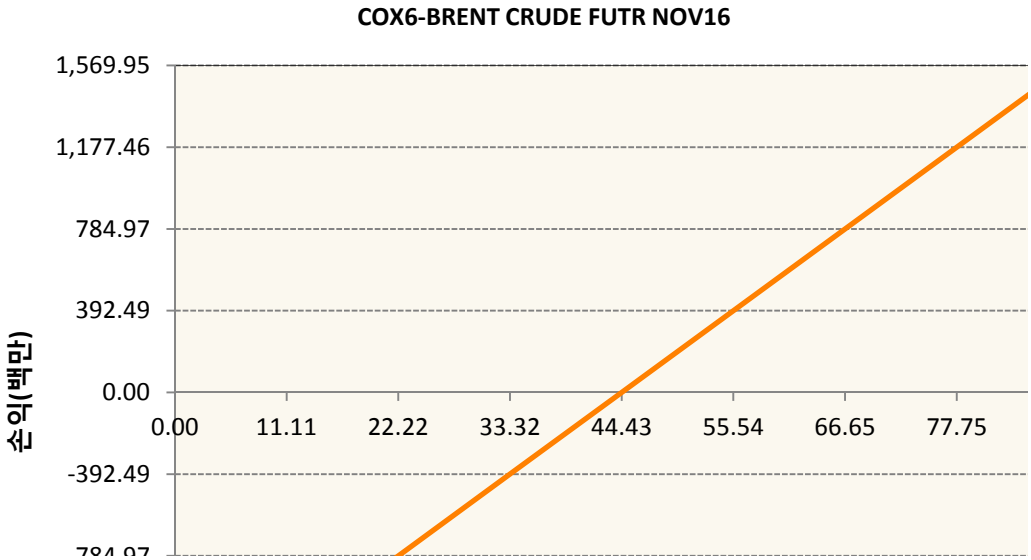
1. 계약금액

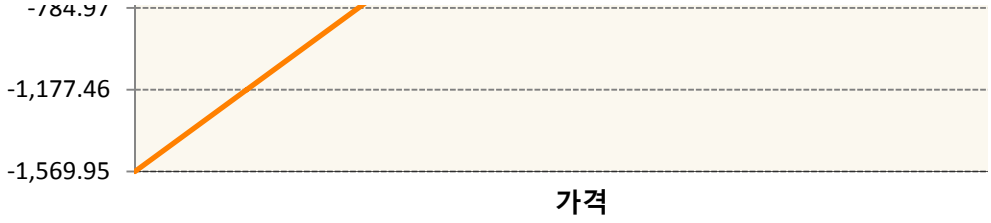
(단위:백만원)

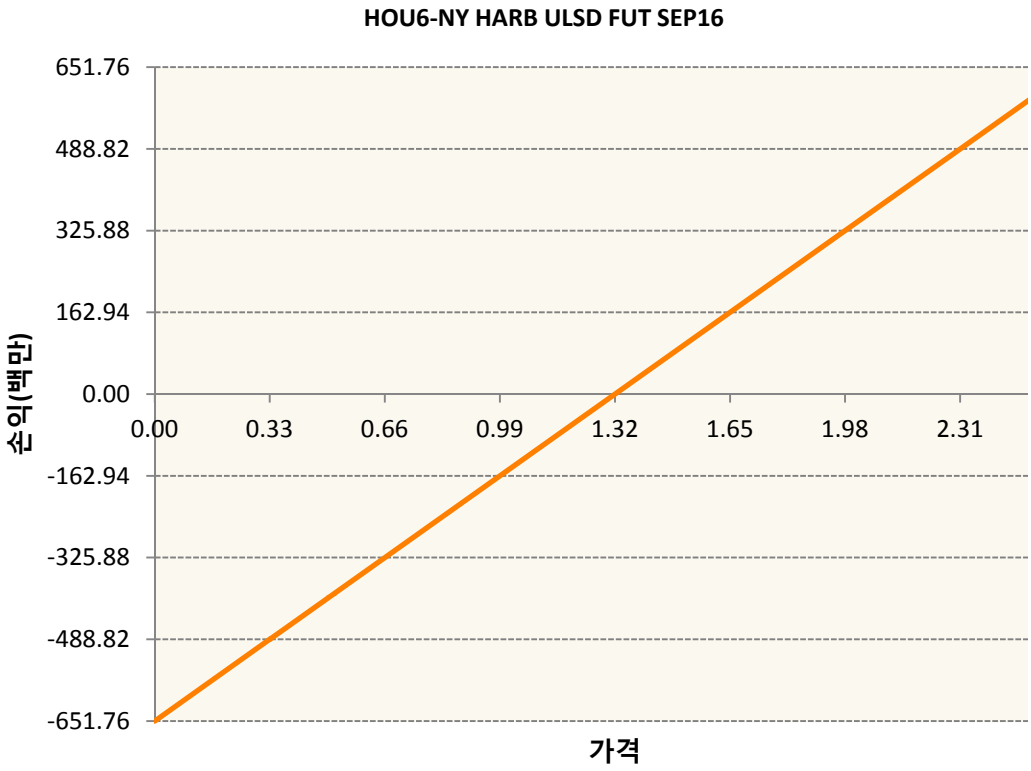
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,853	0	5,853	

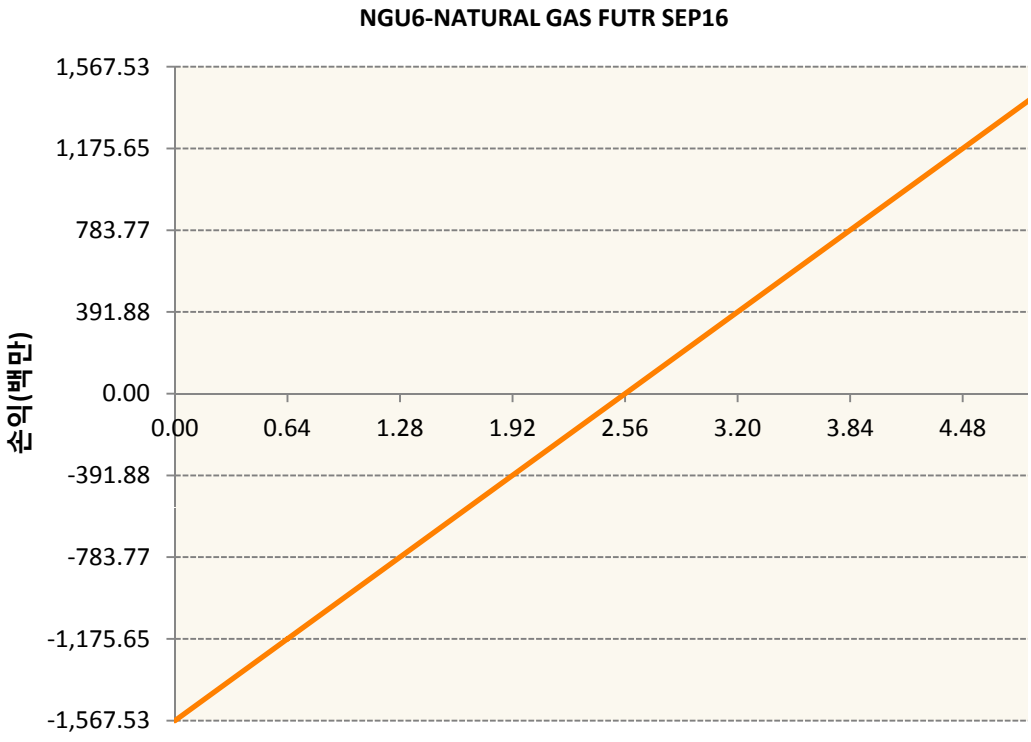
2. 만기시점의 손익구조



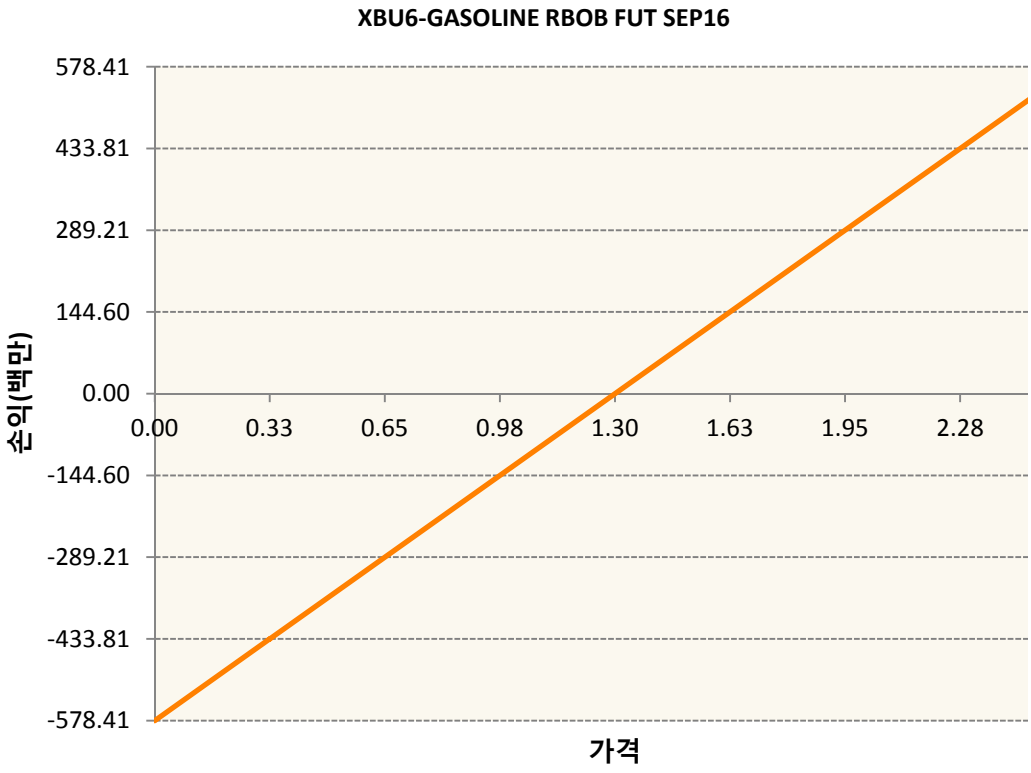



-1,177.46
-1,569.95
가격


HOU6-NY HARB ULSD FUT SEP16
651.76
488.82
325.88
162.94
0.00
-162.94
-325.88
-488.82
-651.76
0.00
0.33
0.66
0.99
1.32
1.65
1.98
2.31
손익(백만)
가격


NGU6-NATURAL GAS FUTR SEP16
1,567.53
1,175.65
783.77
391.88
0.00
-391.88
-783.77
-1,175.65
-1,567.53
0.00
0.64
1.28
1.92
2.56
3.20
3.84
4.48
손익(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	125
XBU6	GASOLINE RBOB FUT SEP16	46

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,052

공시일	2016-08-12
기준일	2016-08-11

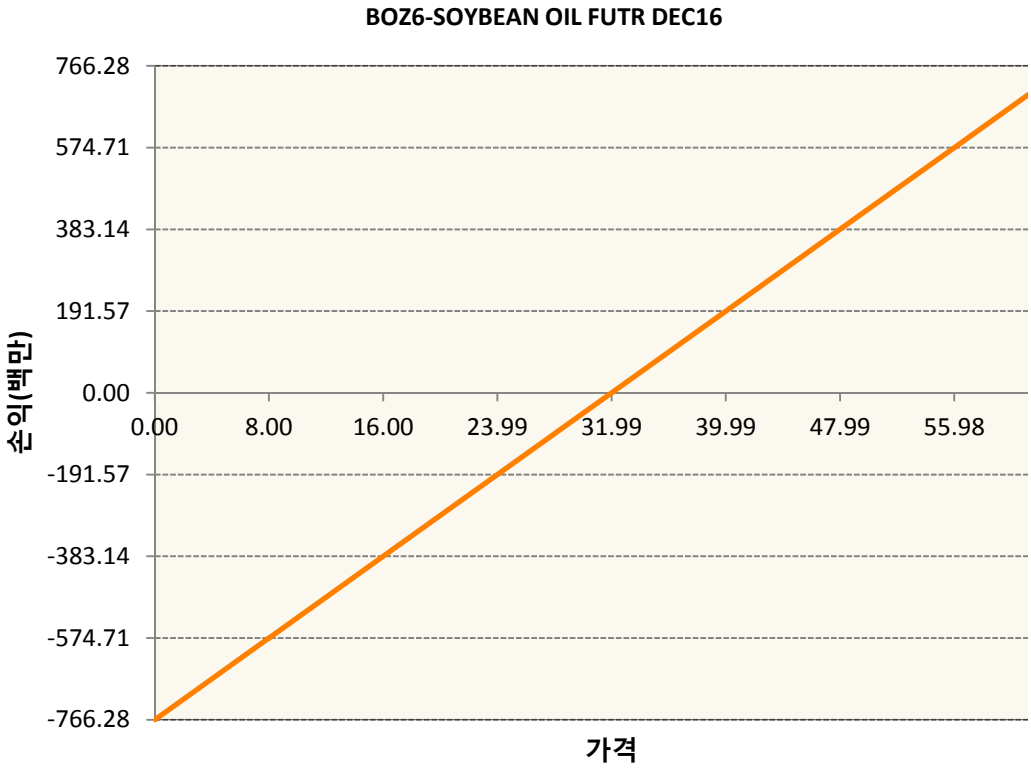
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

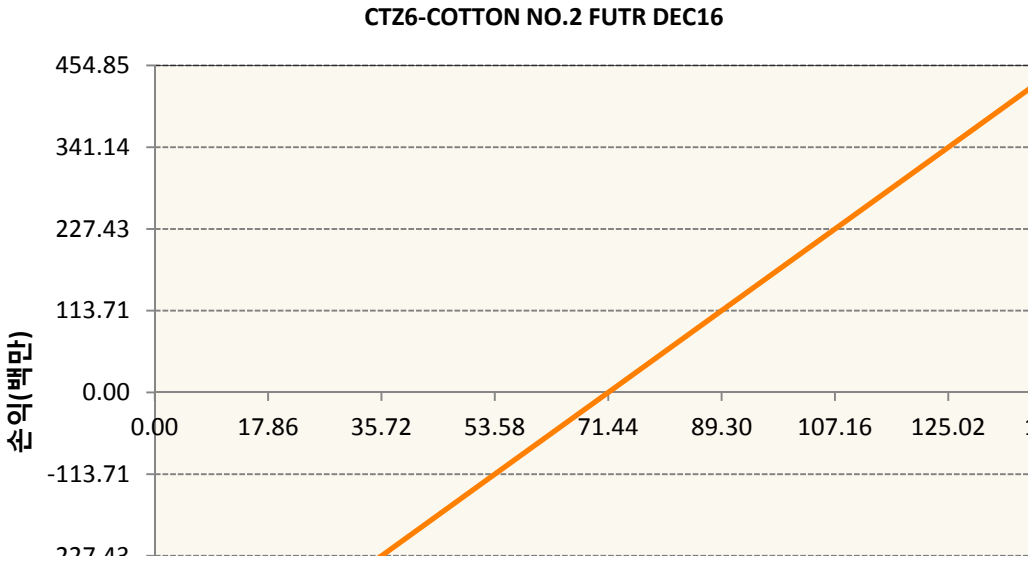
1. 계약금액

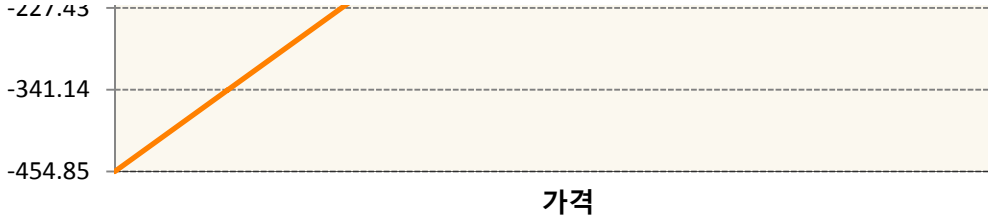
(단위:백만원)

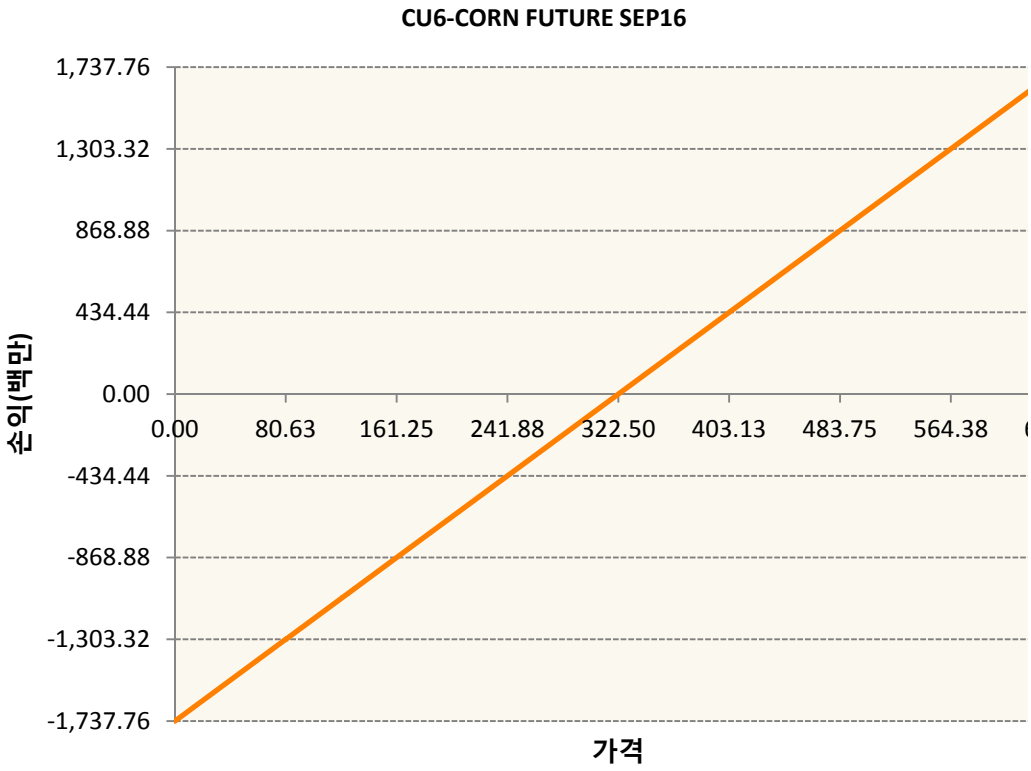
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,290	0	8,290	

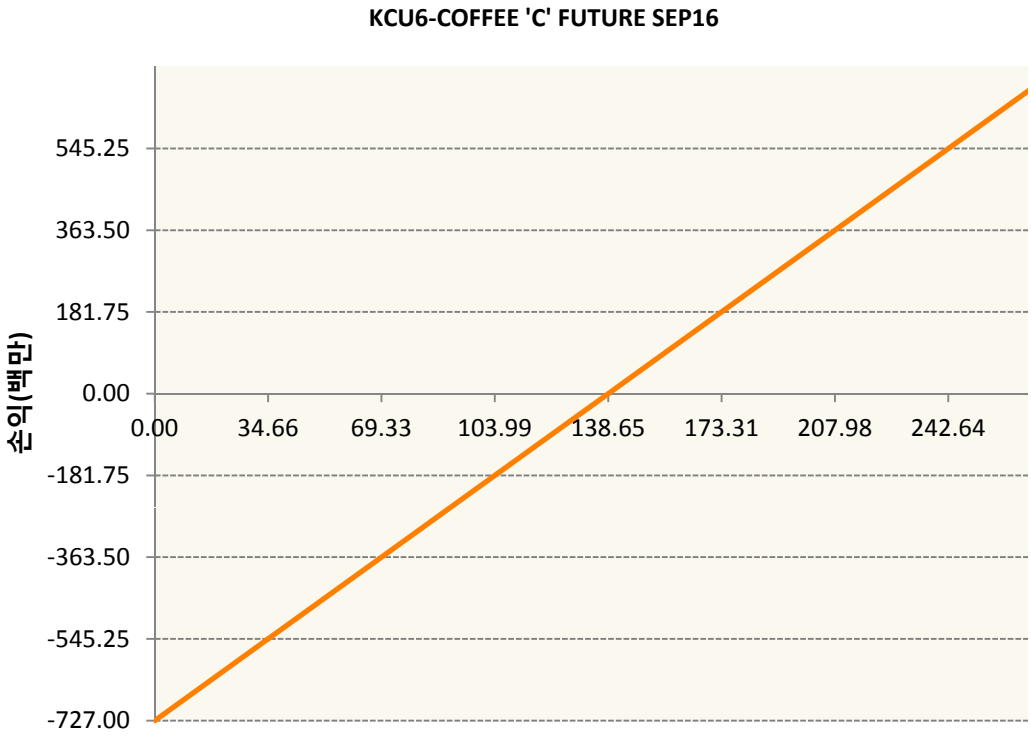
2. 만기시점의 손익구조



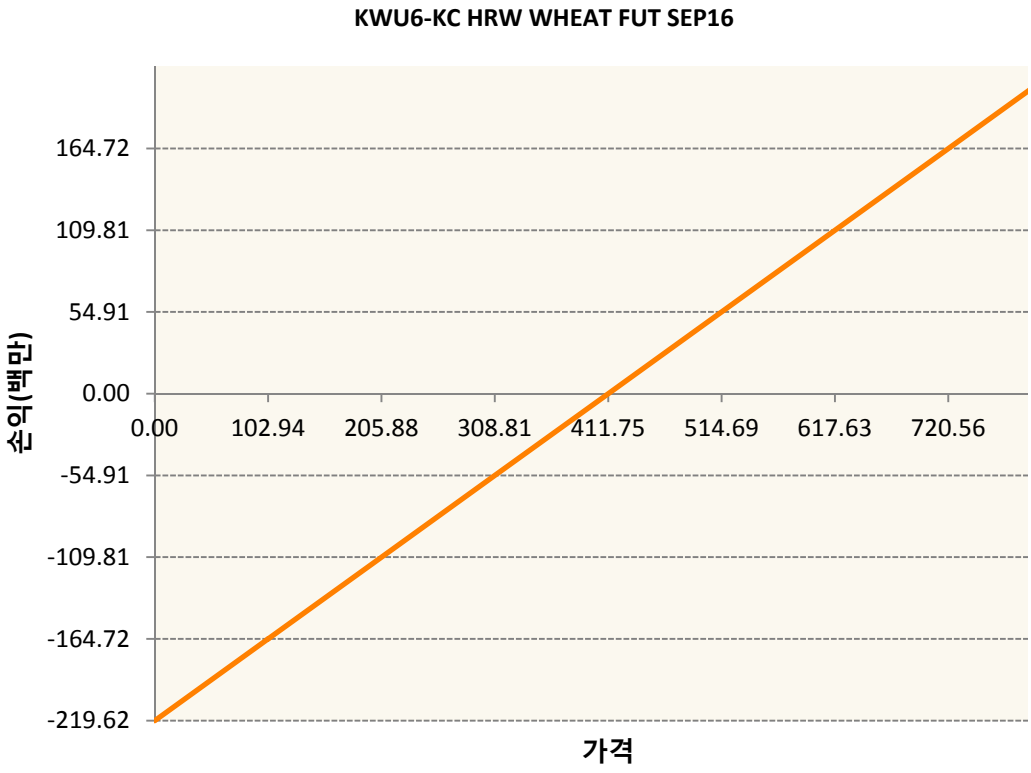


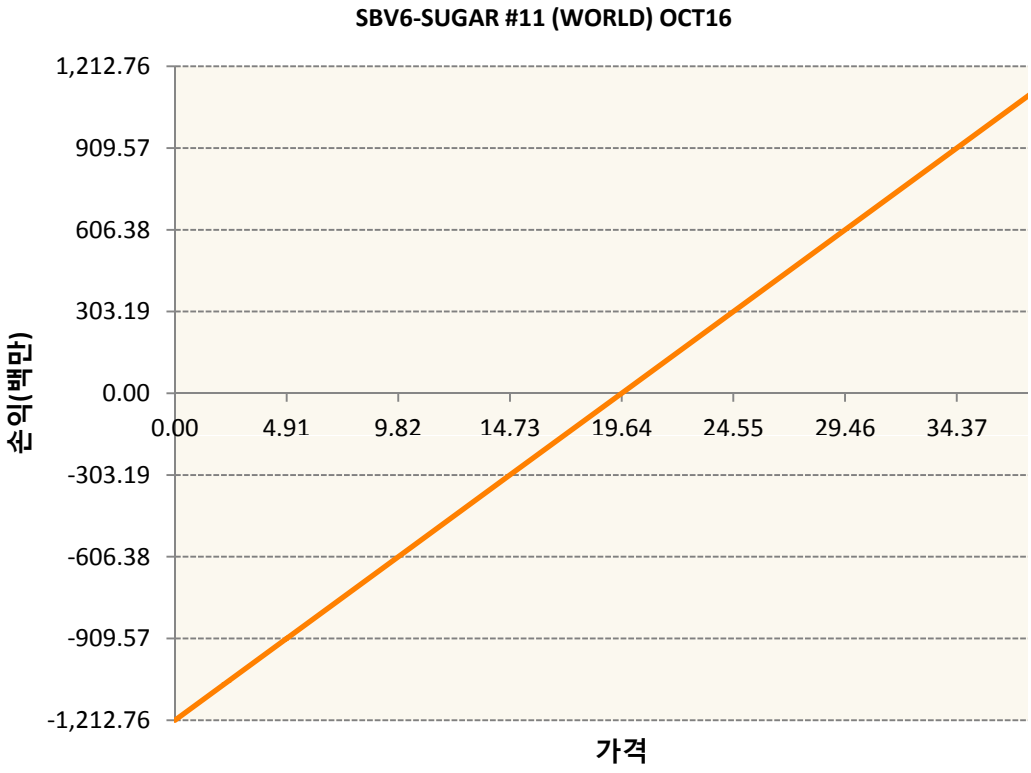

-341.14
-454.85
가격


CU6-CORN FUTURE SEP16
1,737.76
1,303.32
868.88
434.44
0.00
-434.44
-868.88
-1,303.32
-1,737.76
0.00
80.63
161.25
241.88
322.50
403.13
483.75
564.38
순익(백만)
가격

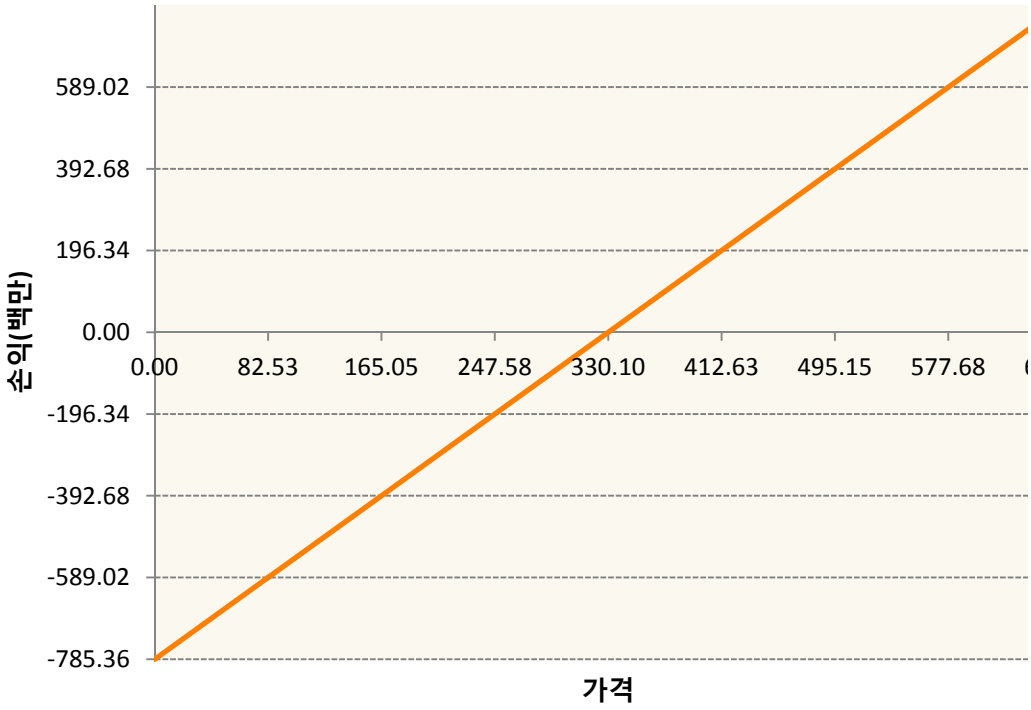

KCU6-COFFEE 'C' FUTURE SEP16
545.25
363.50
181.75
0.00
-181.75
-363.50
-545.25
-727.00
0.00
34.66
69.33
103.99
138.65
173.31
207.98
242.64
순익(백만)

가격

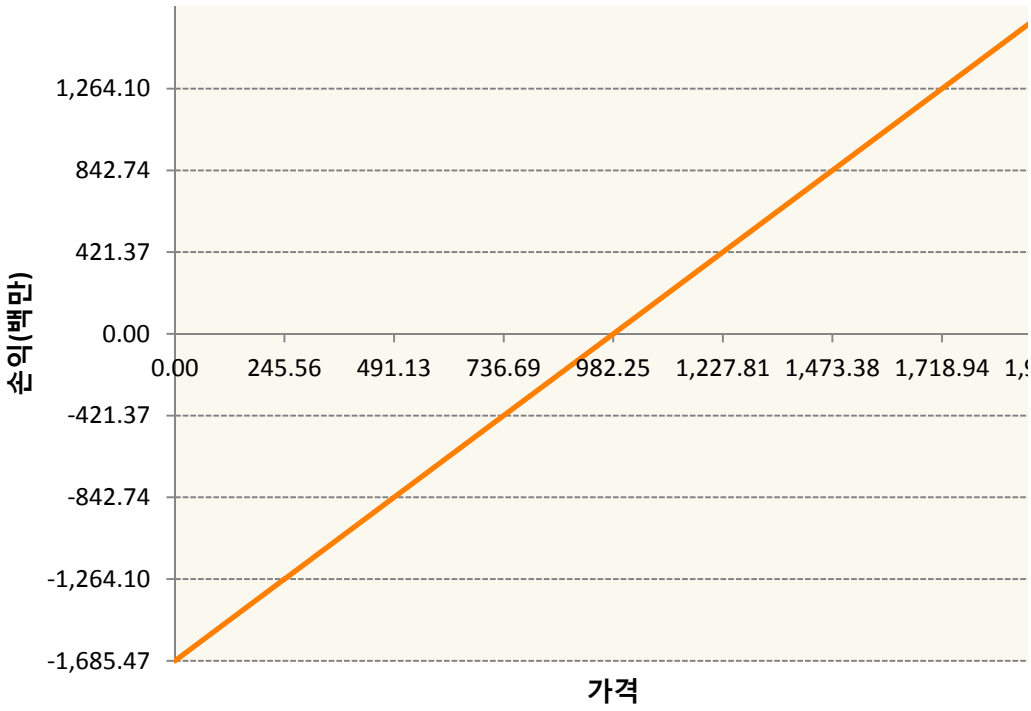

KWU6-KC HRW WHEAT FUT SEP16
164.72
109.81
54.91
0.00
-54.91
-109.81
-164.72
-219.62
0.00
102.94
205.88
308.81
411.75
514.69
617.63
720.56
손익(백만)
가격


SBV6-SUGAR #11 (WORLD) OCT16
1,212.76
909.57
606.38
303.19
0.00
-303.19
-606.38
-909.57
-1,212.76
0.00
4.91
9.82
14.73
19.64
24.55
29.46
34.37
손익(백만)
가격

SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16

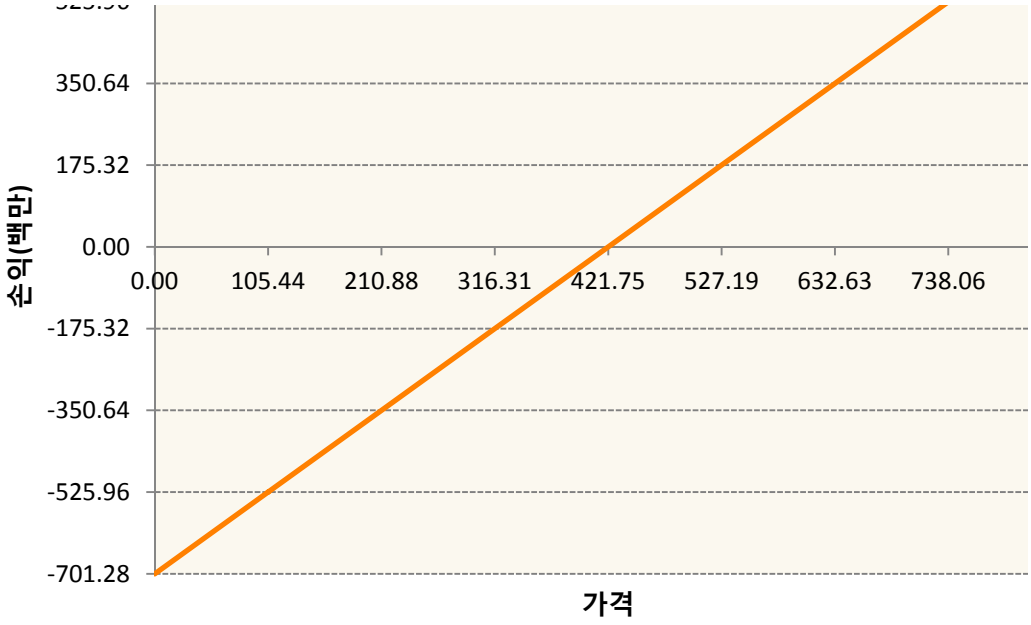


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16



WU6-WHEAT FUTURE(CBT) SEP16





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ6	SOYBEAN OIL FUTR DEC16	61
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	36
CU6	CORN FUTURE SEP16	139
KCU6	COFFEE 'C' FUTURE SEP16	58
KWU6	KC HRW WHEAT FUT SEP16	18
SBV6	SUGAR #11 (WORLD) OCT16	97
SMZ6	SOYBEAN MEAL FUTR DEC16	63
SX6	SOYBEAN FUTURE NOV16	135
WU6	WHEAT FUTURE(CBT) SEP16	56

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

866