공시일	2016-08-16
기준일	2016-08-12

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	2016-08-16
기준일	2016-08-12

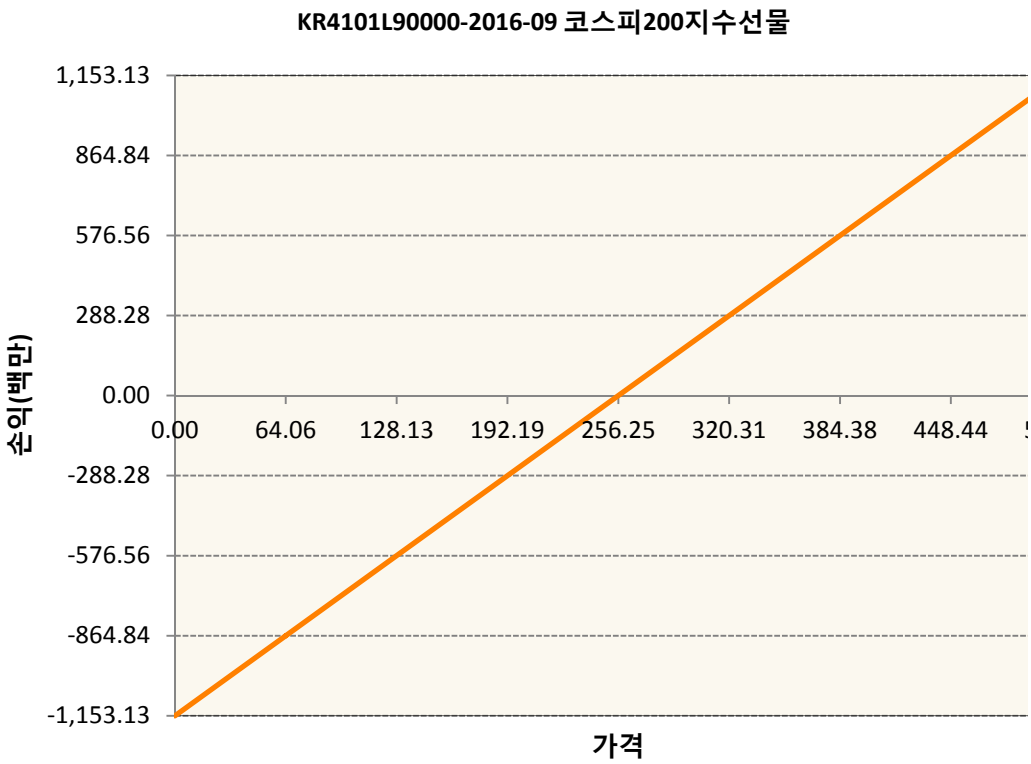
스마트인덱스모

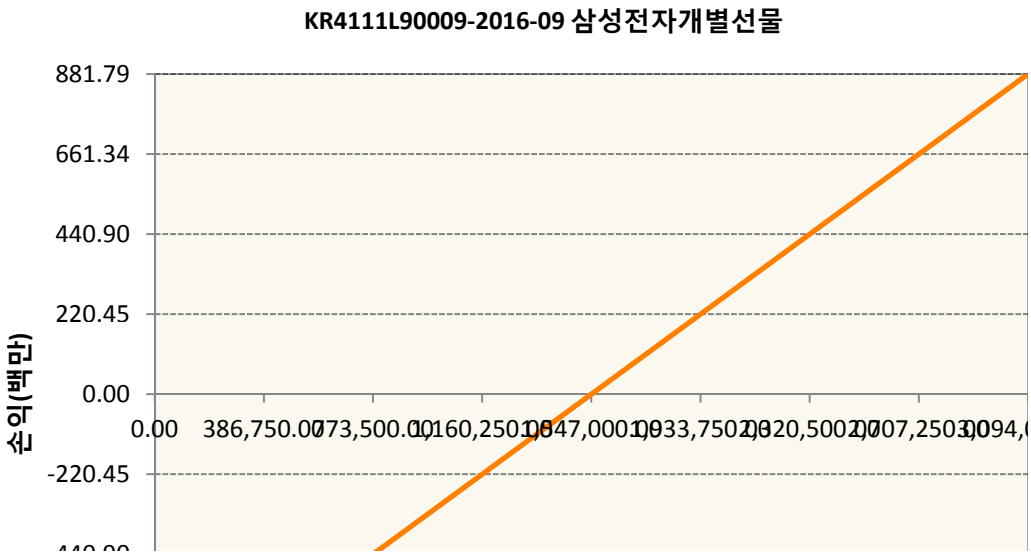
1. 계약금액

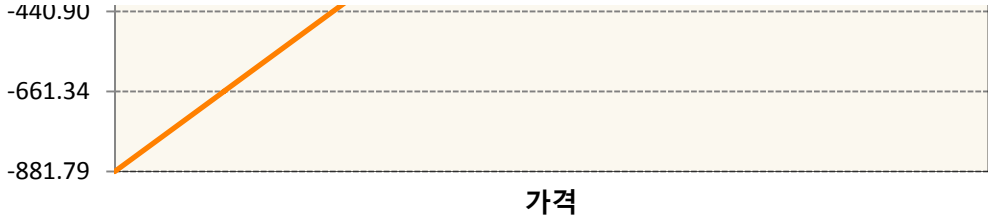
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	62	-62	장내
누계	유가증권	선물	2,035	0	2,035	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						70
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70
-5.33%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
-2.67%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	23	23	23	23	23	23	23
5.33%	47	47	47	47	47	47	47
8.00%	70	70	70	70	70	70	70

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

(단위:백만원)

149

공시일	2016-08-16
기준일	2016-08-12

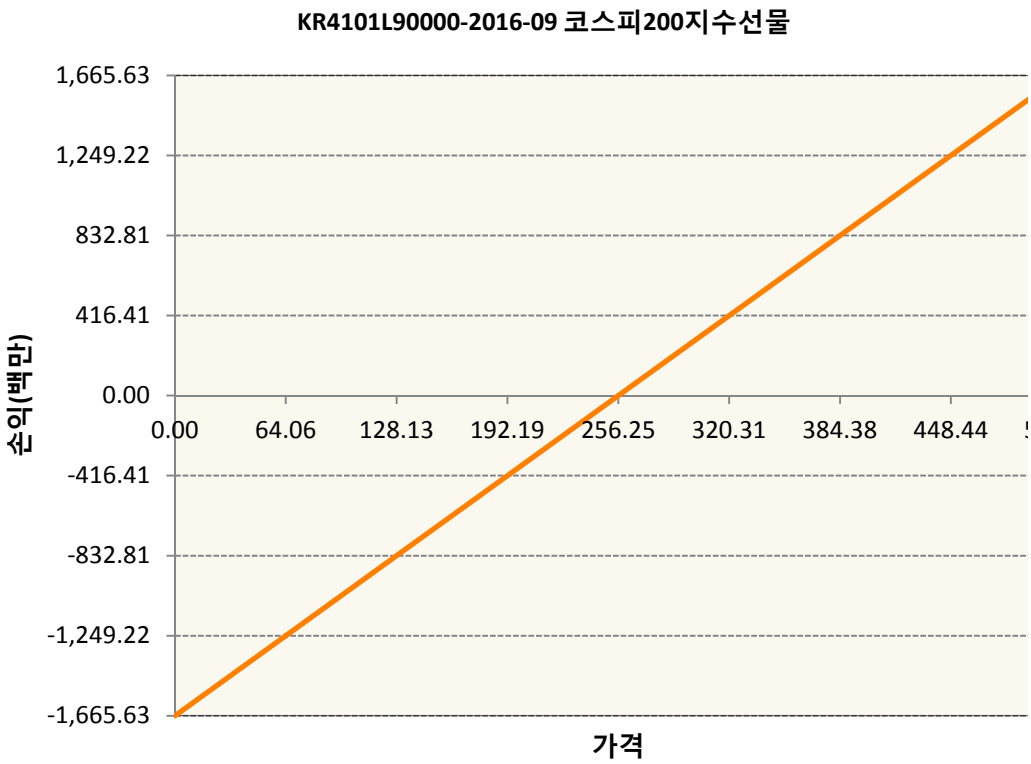
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,666	0	1,666	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	2016-08-16
기준일	2016-08-12

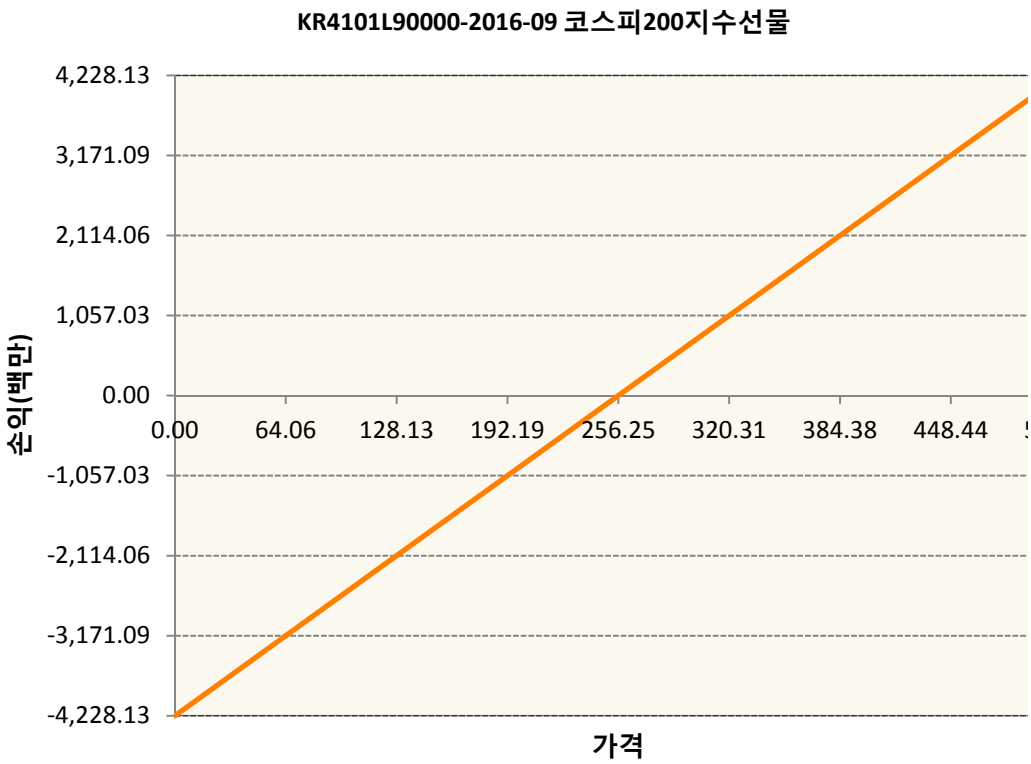
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	4,228	0	4,228	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	2016-08-16
기준일	2016-08-12

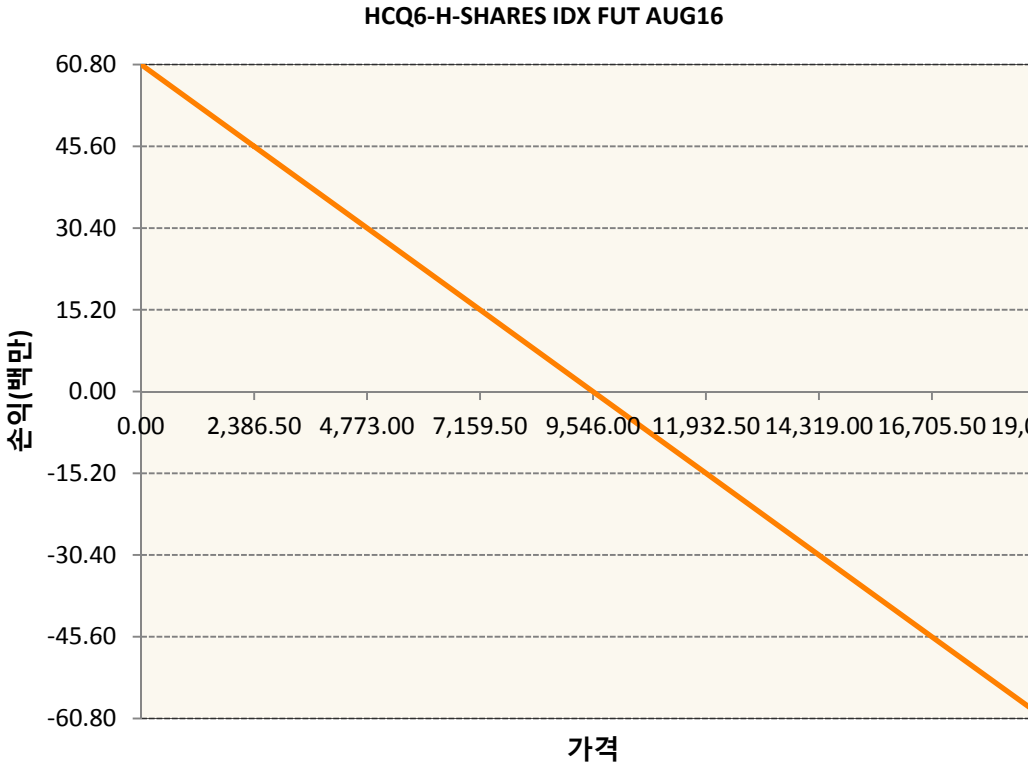
아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

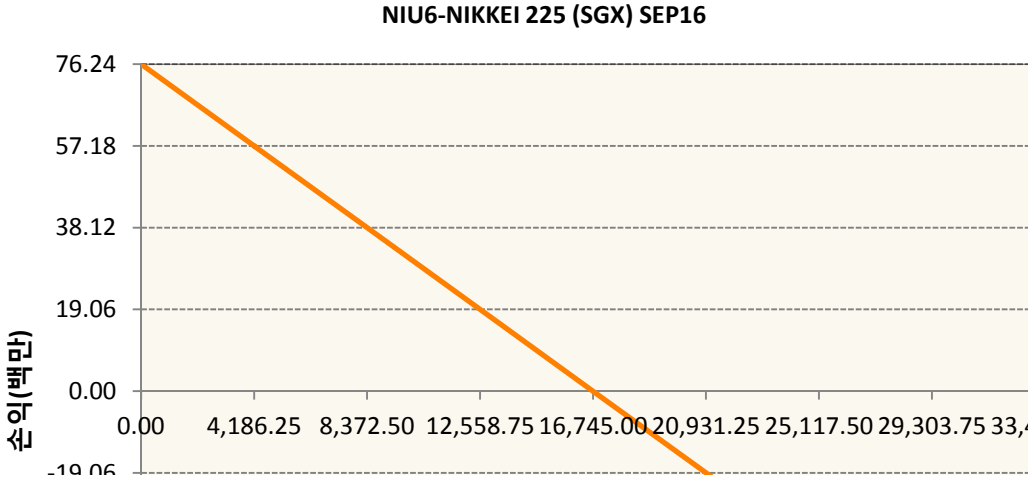
1. 계약금액

(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	61	-61	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	2016-08-16
기준일	2016-08-12

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	889

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

819

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-08-16
기준일	2016-08-12

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)

970

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-08-16
기준일	2016-08-12

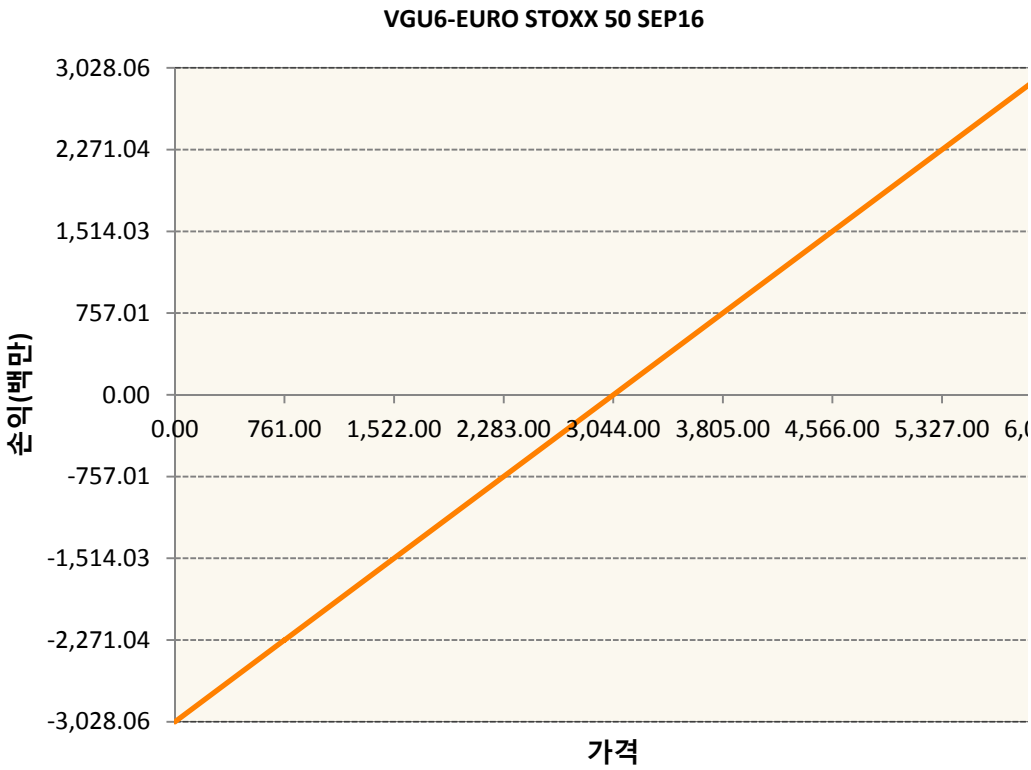
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,028	0	3,028	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 SEP16	242

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

(단위:백만원)

300

공시일	2016-08-16
기준일	2016-08-12

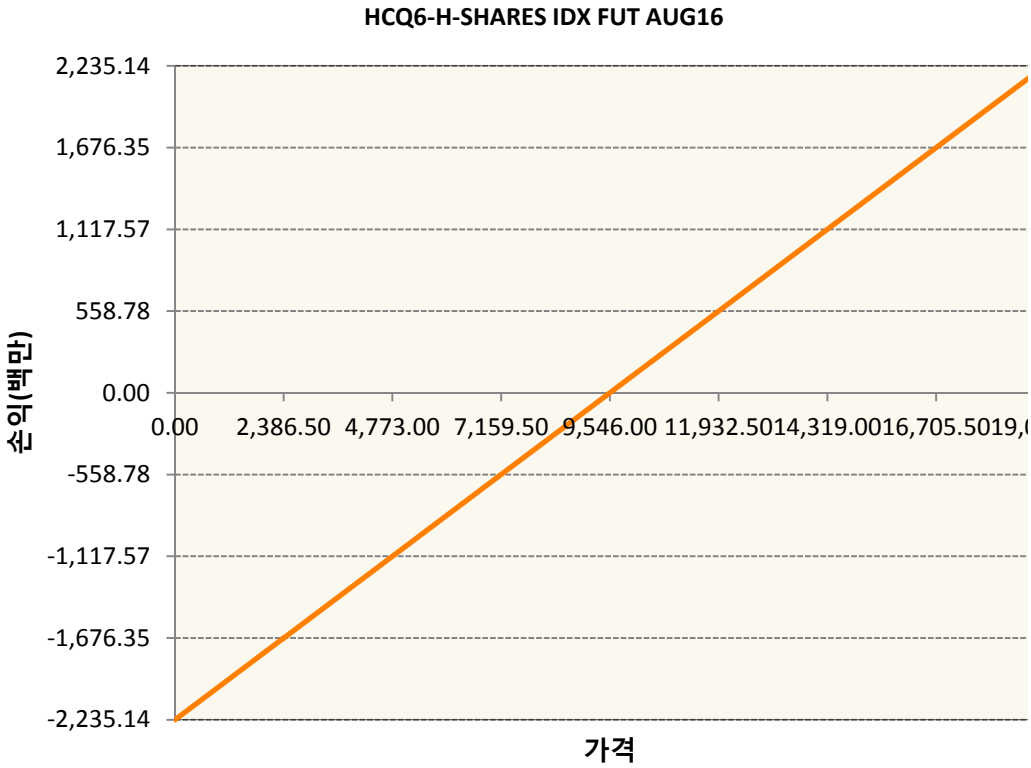
차이나인덱스모(주식-파생형)

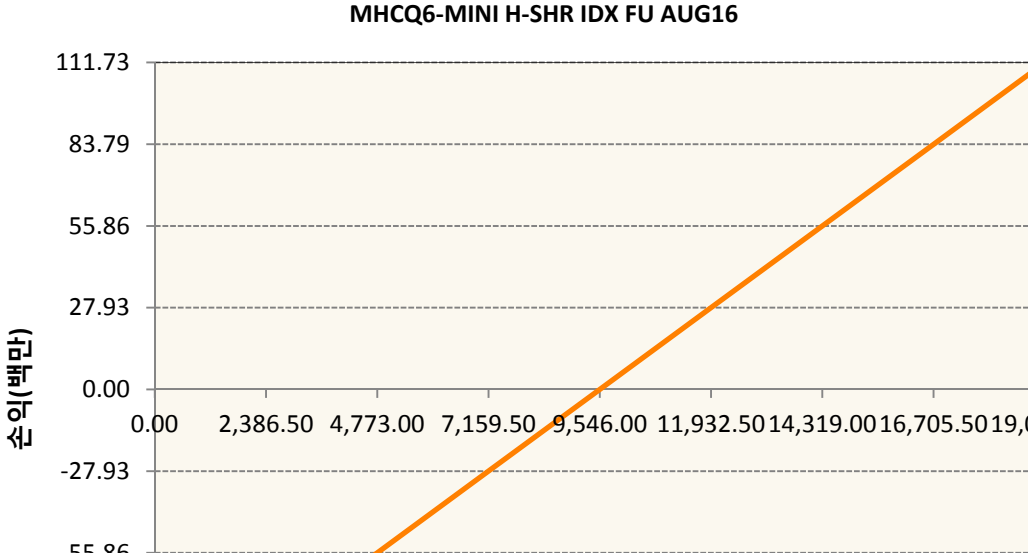
1. 계약금액

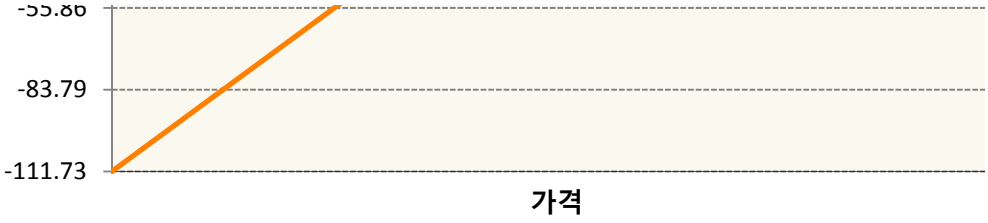
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,347	0	2,347	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ6	H-SHARES IDX FUT AUG16	179
MHCQ6	MINI H-SHR IDX FU AUG16	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	264

공시일	2016-08-16
기준일	2016-08-12

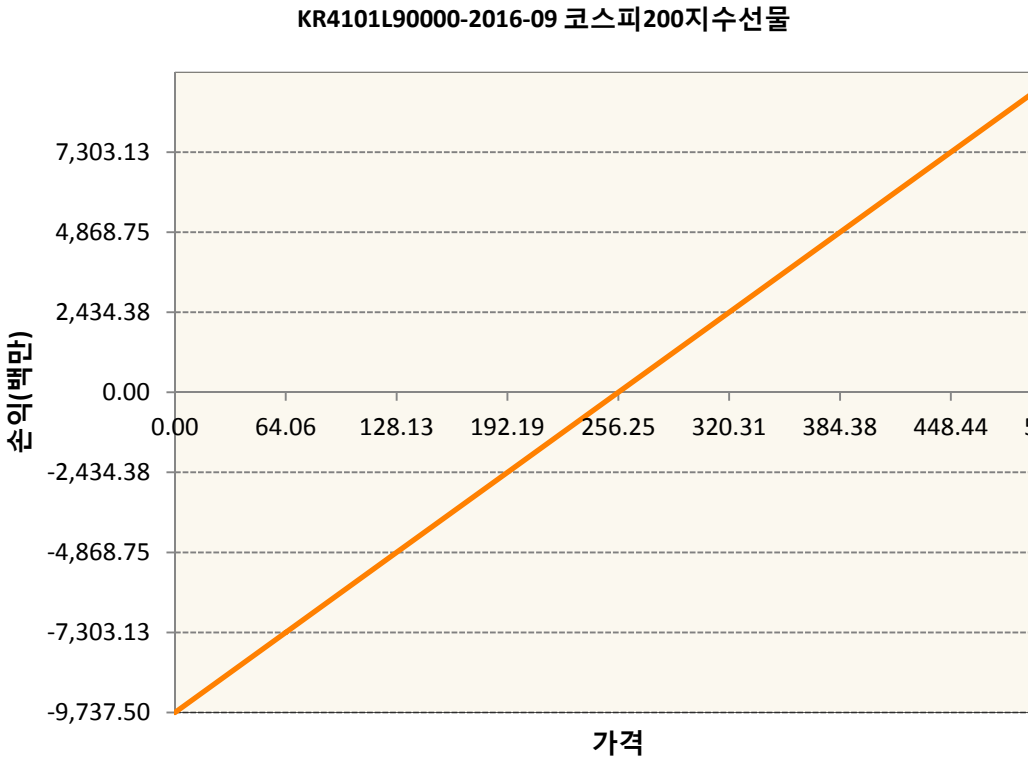
커버드콜(주식혼합-파생형)

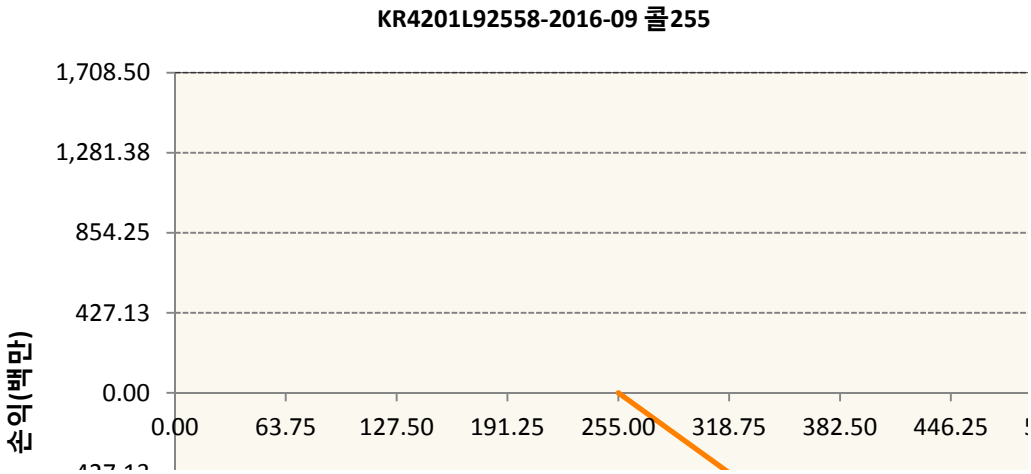
1. 계약금액

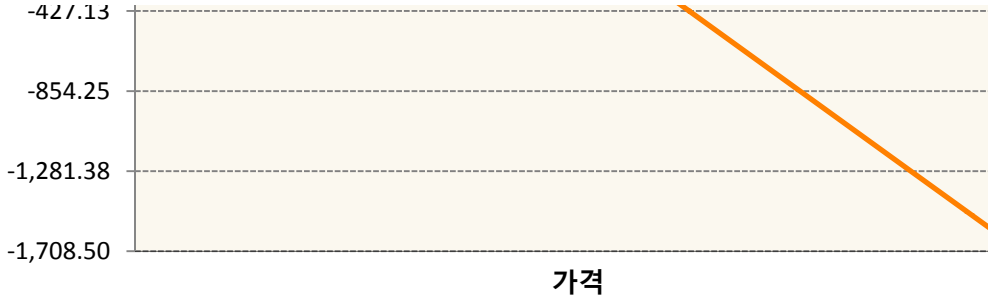
(단위:백만원)

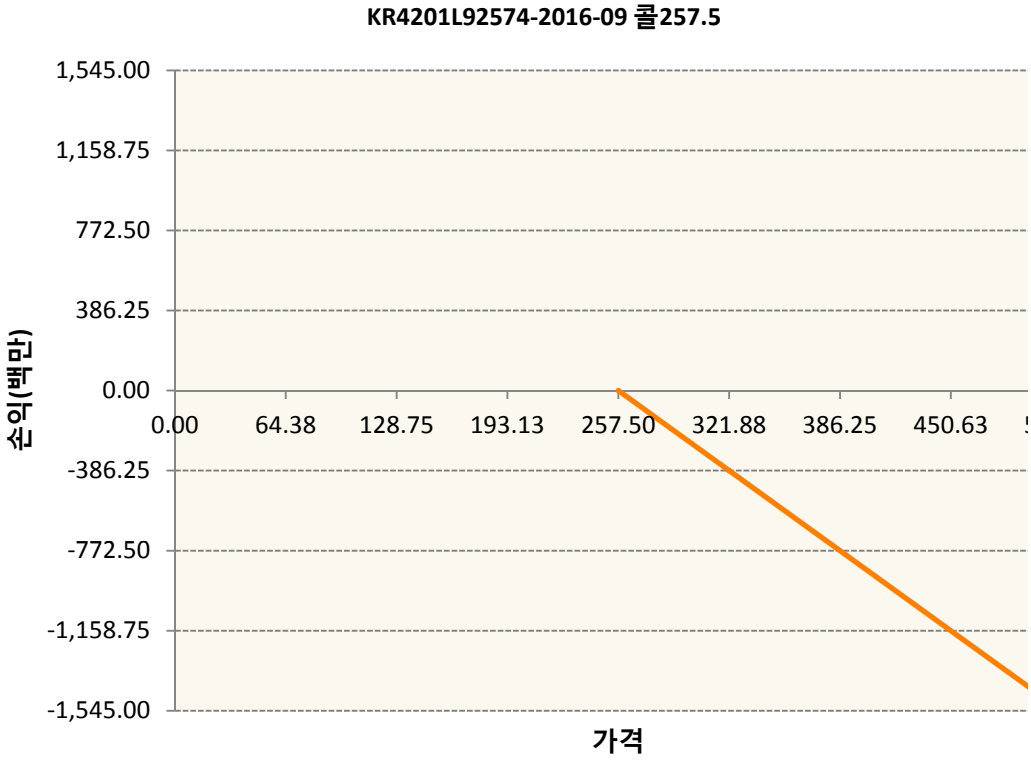
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	898	0	898	장내
신규	유가증권	옵션	1,332	1,559	-227	장내
누계	유가증권	선물	9,738	0	9,738	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,254	-3,254	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101L900 2016-09 코스피200지수선물							779
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-779	-779	-779	-779	-779	-779	-779
-5.33%	-519	-519	-519	-519	-519	-519	-519
-2.67%	-260	-260	-260	-260	-260	-260	-260
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	260	260	260	260	260	260	260
5.33%	519	519	519	519	519	519	519
8.00%	779	779	779	779	779	779	779
KR4201L925 2016-09 콜255							600
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	125	125	125	125	124	124	123
-5.33%	124	123	121	119	117	114	111
-2.67%	108	102	96	90	83	76	69
0%	26	17	9	0	-9	-17	-26
2.67%	-149	-153	-158	-163	-169	-175	-181
5.33%	-369	-370	-371	-373	-375	-377	-380
8.00%	-597	-598	-598	-598	-598	-599	-600
KR4201L925 2016-09 콜257.5							500

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	76	76	75	75	75	75	74
-5.33%	75	75	74	73	72	70	68
-2.67%	69	66	62	58	53	48	43
0%	23	16	8	0	-8	-16	-23
2.67%	-105	-111	-117	-123	-130	-136	-143
5.33%	-293	-295	-297	-299	-302	-305	-309
8.00%	-497	-497	-497	-497	-498	-499	-500

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

1,907

공시일	2016-08-16
기준일	2016-08-12

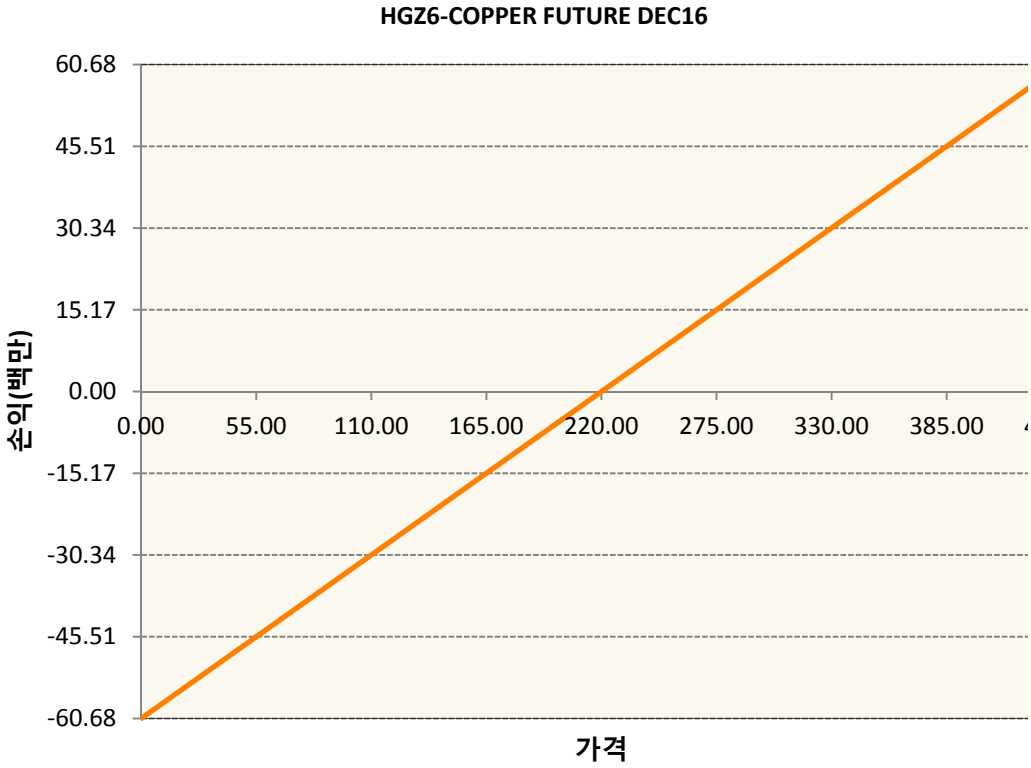
메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

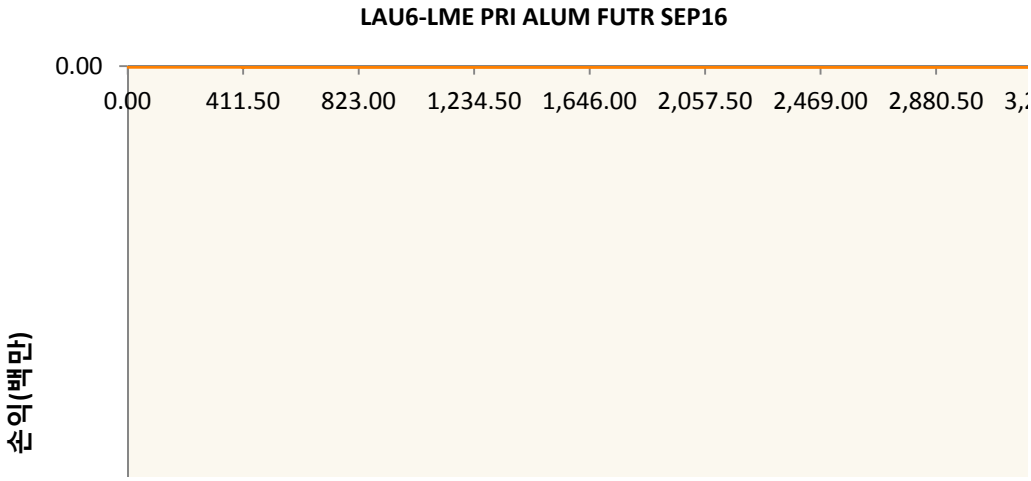
1. 계약금액

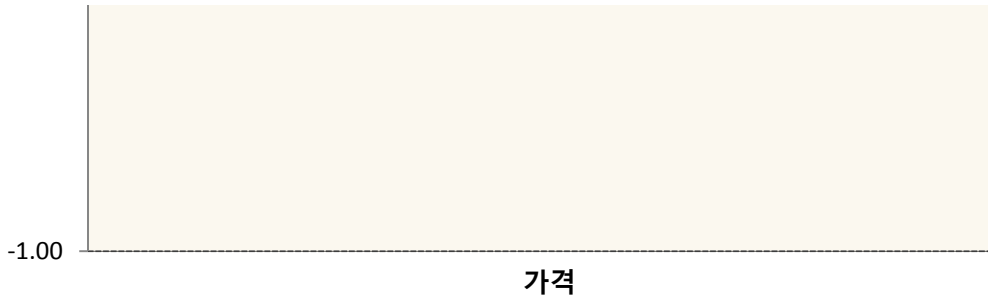
(단위:백만원)

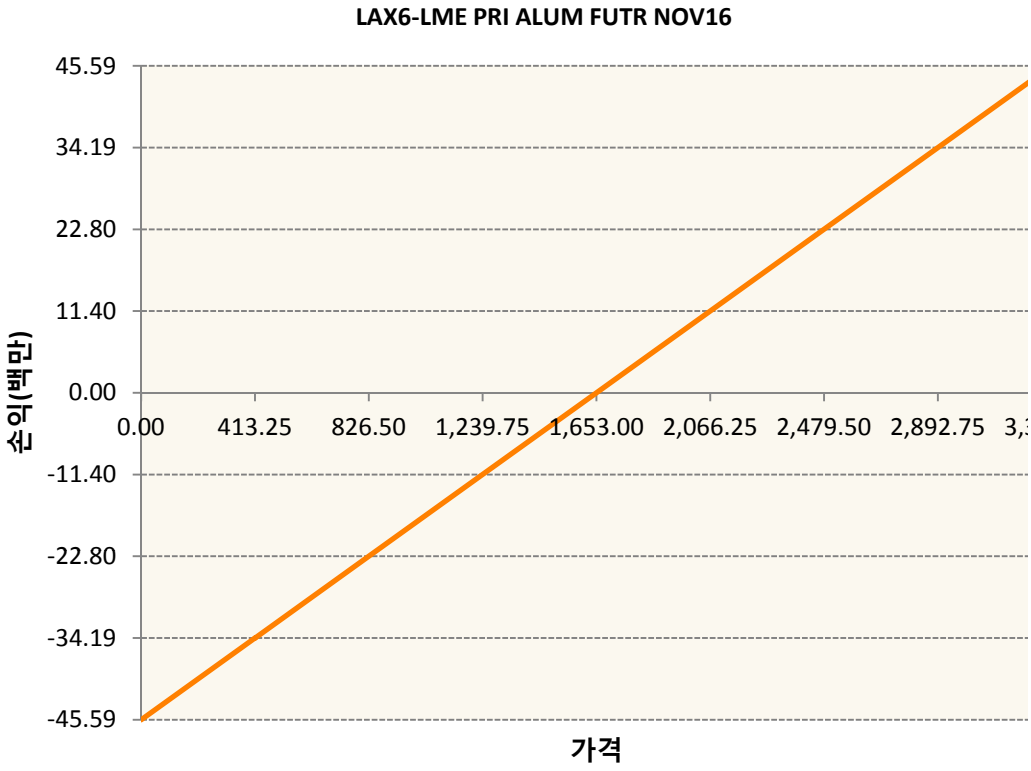
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	44	0	44	
누계	유가증권	선물	432	108	323	

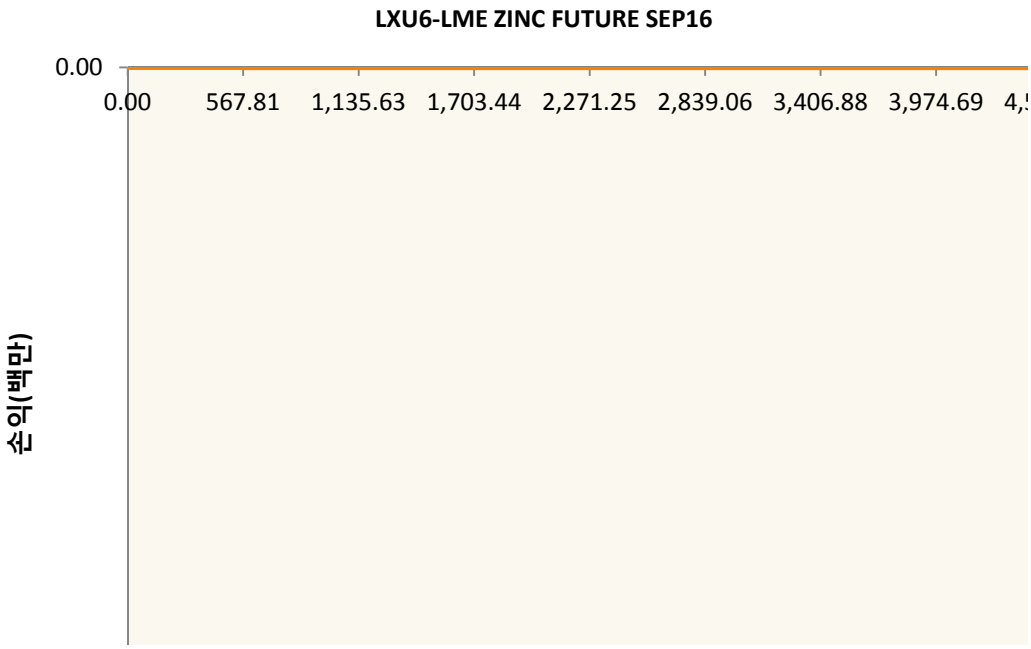
2. 만기시점의 손익구조

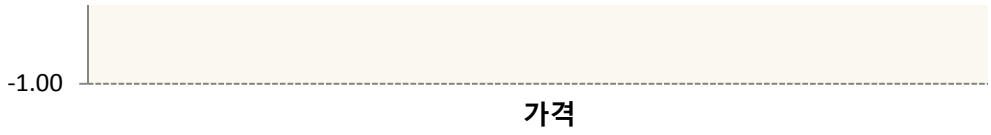


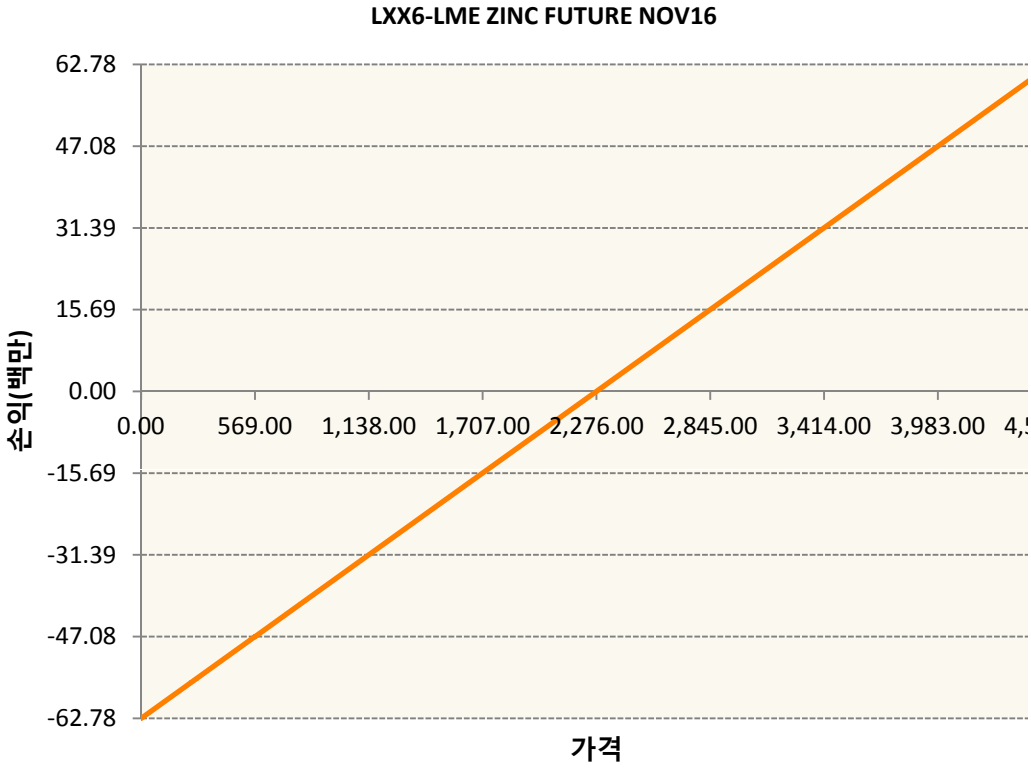


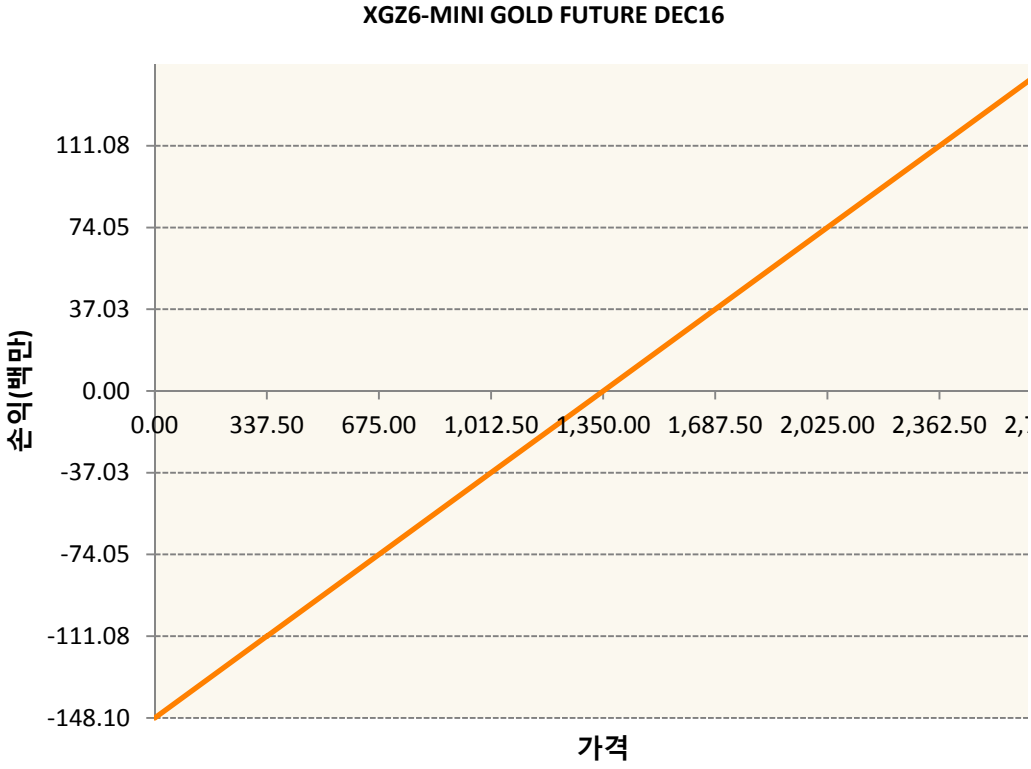

-1.00
가격

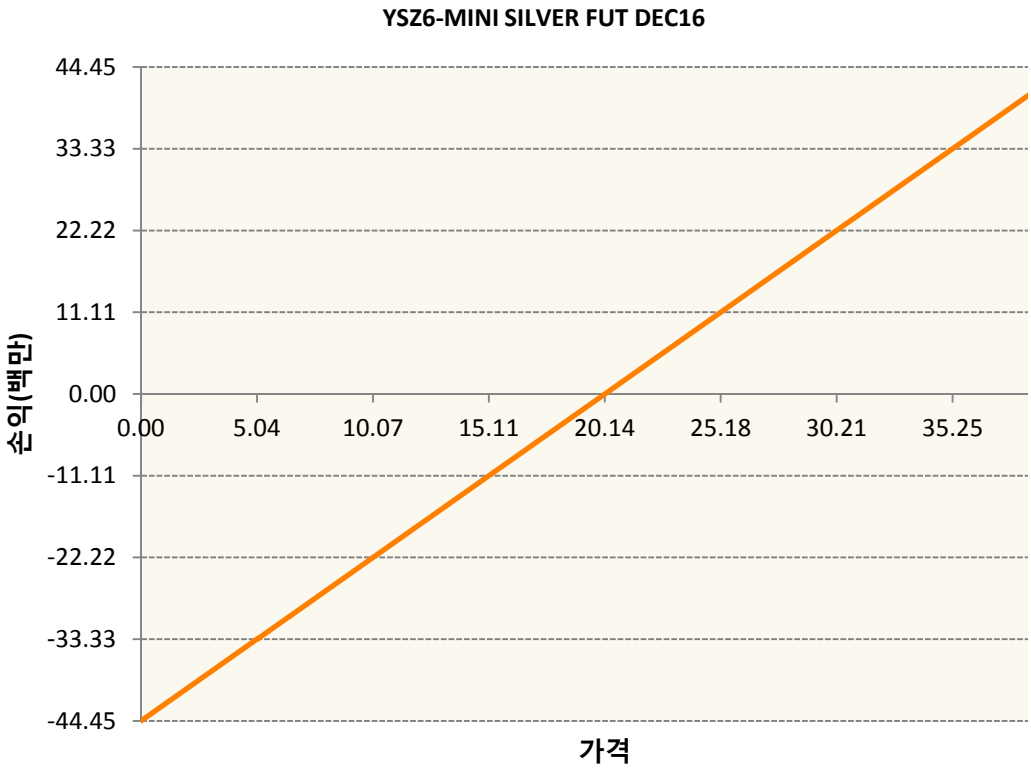

LAX6-LME PRI ALUM FUTR NOV16
45.59
34.19
22.80
11.40
0.00
-11.40
-22.80
-34.19
-45.59
0.00
413.25
826.50
1,239.75
1,653.00
2,066.25
2,479.50
2,892.75
순익(백만)
가격


LXU6-LME ZINC FUTURE SEP16
0.00
0.00
567.81
1,135.63
1,703.44
2,271.25
2,839.06
3,406.88
3,974.69
순익(백만)


-1.00
가격


LXX6-LME ZINC FUTURE NOV16
62.78
47.08
31.39
15.69
0.00
-15.69
-31.39
-47.08
-62.78
0.00
569.00
1,138.00
1,707.00
2,276.00
2,845.00
3,414.00
3,983.00
순익(백만)
가격


XGZ6-MINI GOLD FUTURE DEC16
111.08
74.05
37.03
0.00
-37.03
-74.05
-111.08
-148.10
0.00
337.50
675.00
1,012.50
1,350.00
1,687.50
2,025.00
2,362.50
순익(백만)
가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HGZ6	COPPER FUTURE DEC16	5
LAU6	LME PRI ALUM FUTR SEP16	0.3
LAX6	LME PRI ALUM FUTR NOV16	4
LXU6	LME ZINC FUTURE SEP16	0.2
LXX6	LME ZINC FUTURE NOV16	5
XGZ6	MINI GOLD FUTURE DEC16	12
YSZ6	MINI SILVER FUT DEC16	4

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	29

공시일	2016-08-16
기준일	2016-08-12

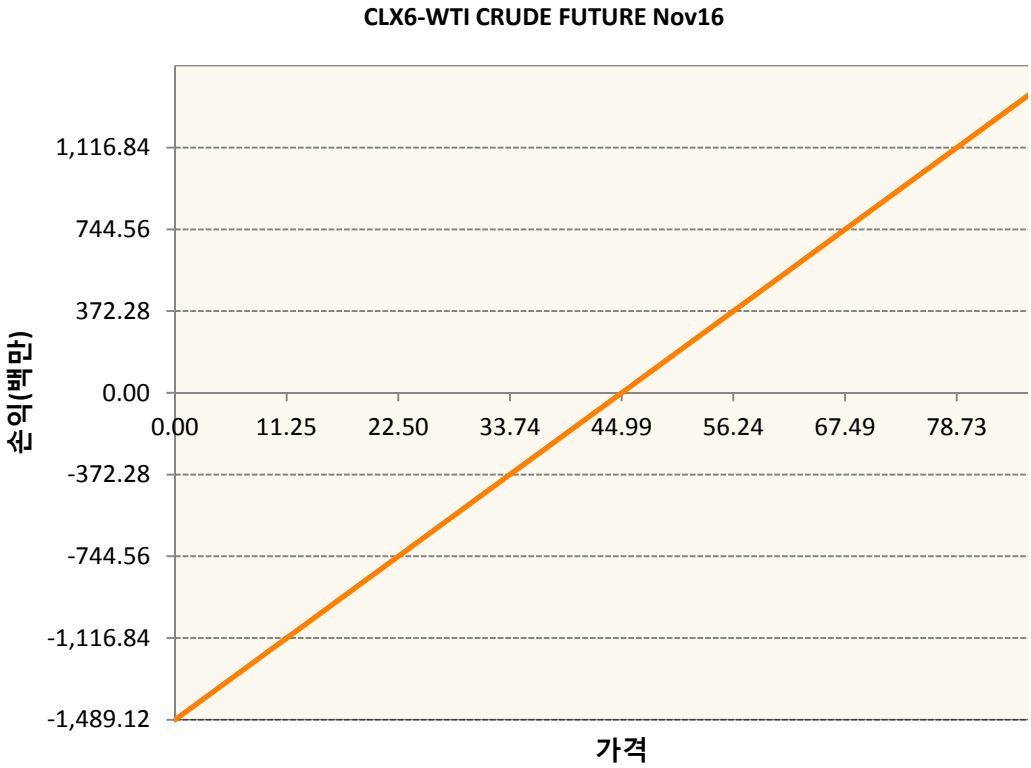
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

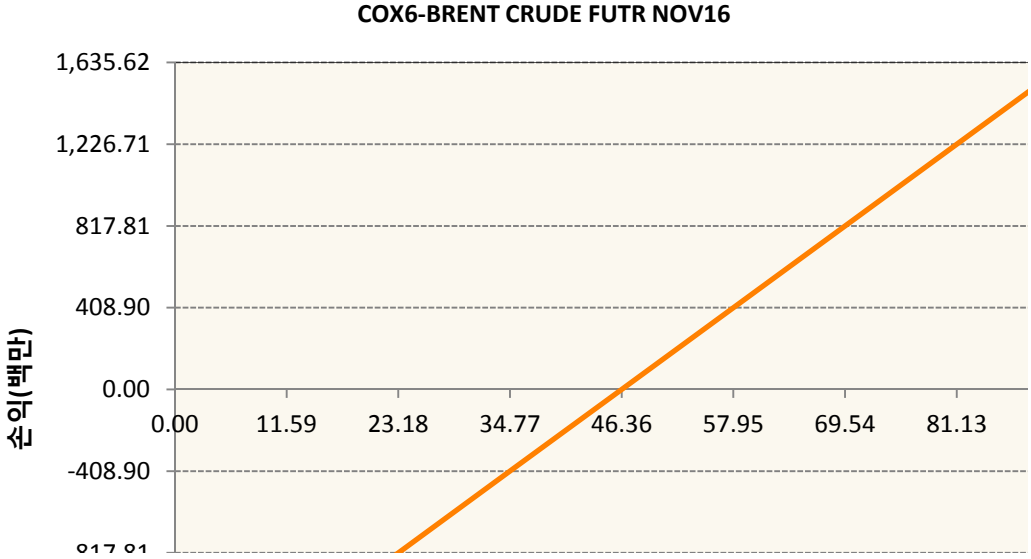
1. 계약금액

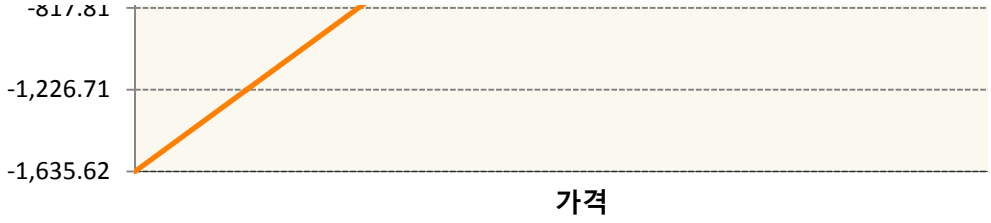
(단위:백만원)

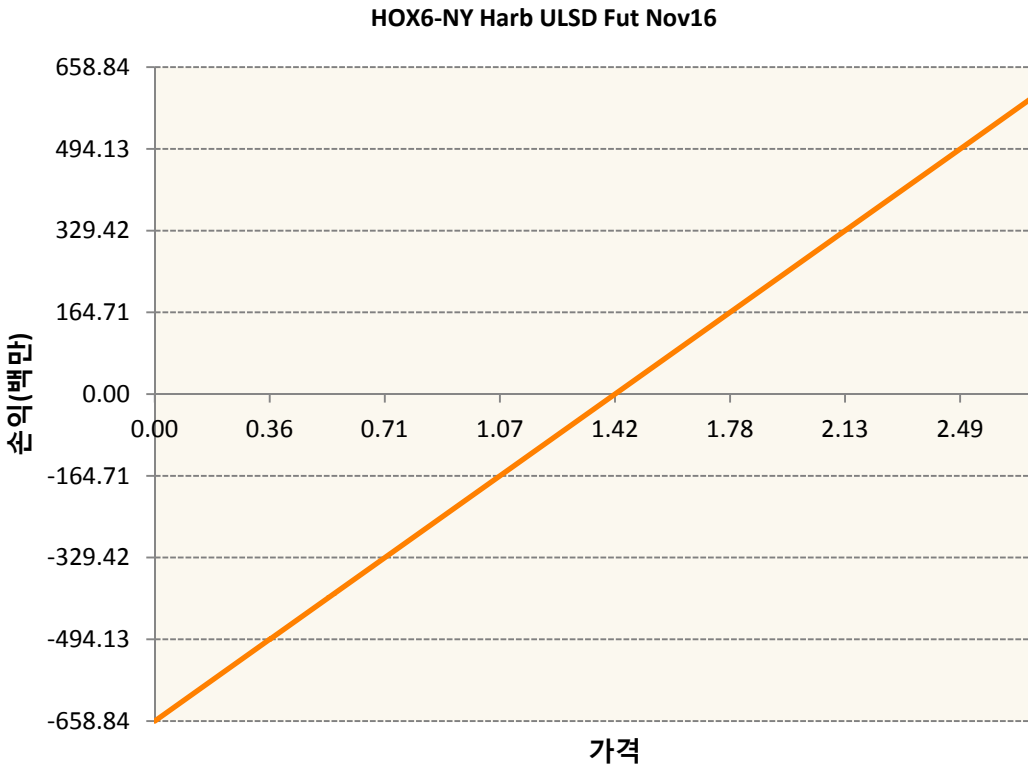
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,921	0	5,921	

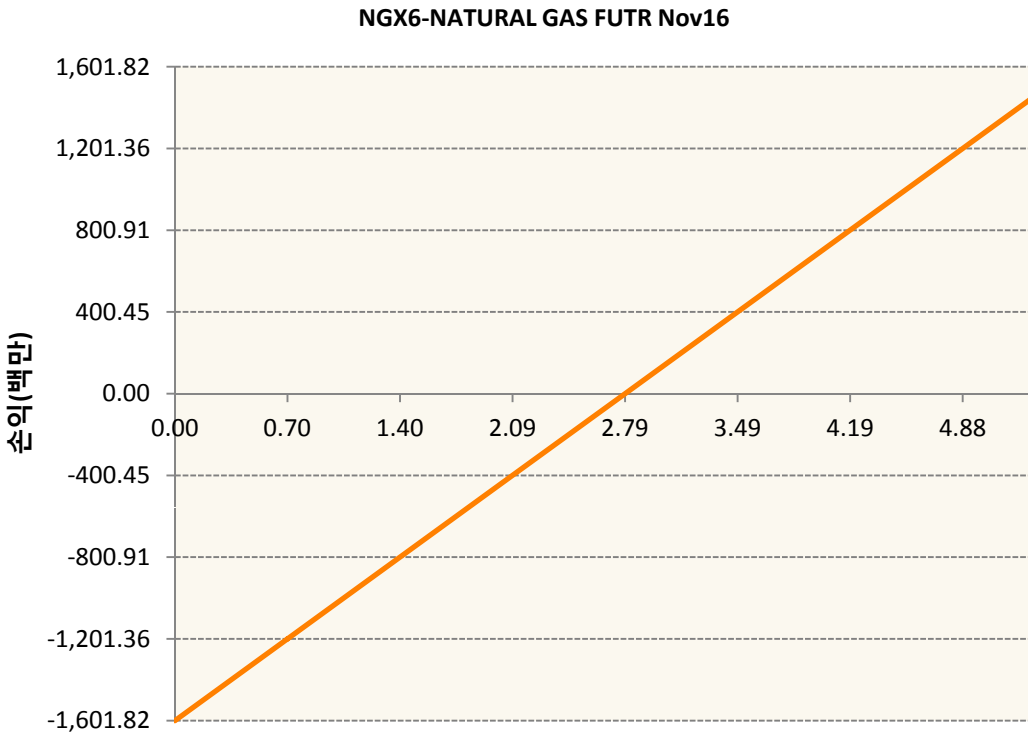
2. 만기시점의 손익구조



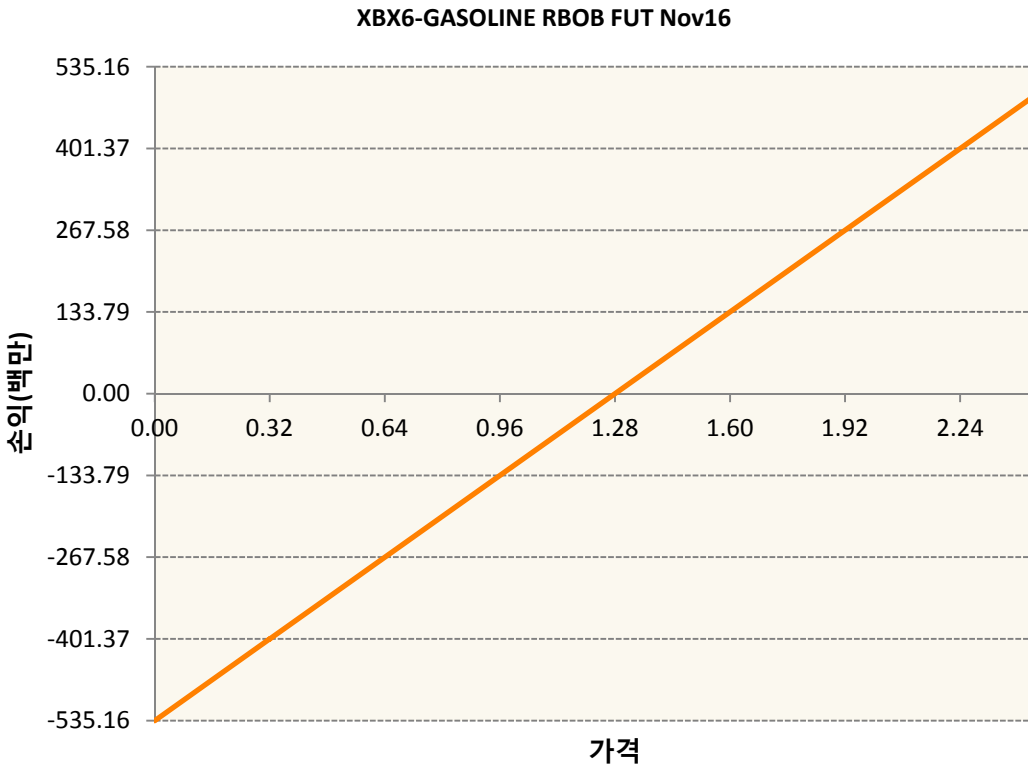



-1,226.71
-1,635.62
가격


HOX6-NY Harb ULSD Fut Nov16
658.84
494.13
329.42
164.71
0.00
-164.71
-329.42
-494.13
-658.84
0.00
0.36
0.71
1.07
1.42
1.78
2.13
2.49
순익(백만)
가격


NGX6-NATURAL GAS FUTR Nov16
1,601.82
1,201.36
800.91
400.45
0.00
-400.45
-800.91
-1,201.36
-1,601.82
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)
CLX6	WTI CRUDE FUTURE Nov16	119
COX6	BRENT CRUDE FUTR NOV16	131
HOX6	NY Harb ULSD Fut Nov16	53
NGX6	NATURAL GAS FUTR Nov16	128
XBX6	GASOLINE RBOB FUT Nov16	43

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,066

공시일	2016-08-16
기준일	2016-08-12

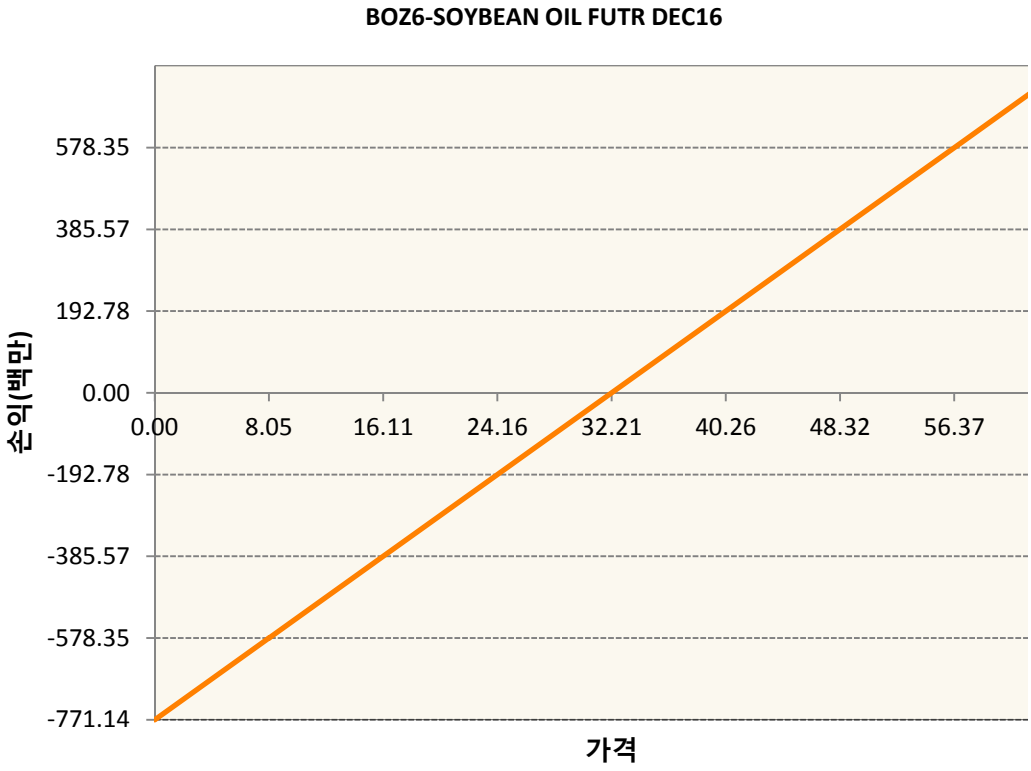
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

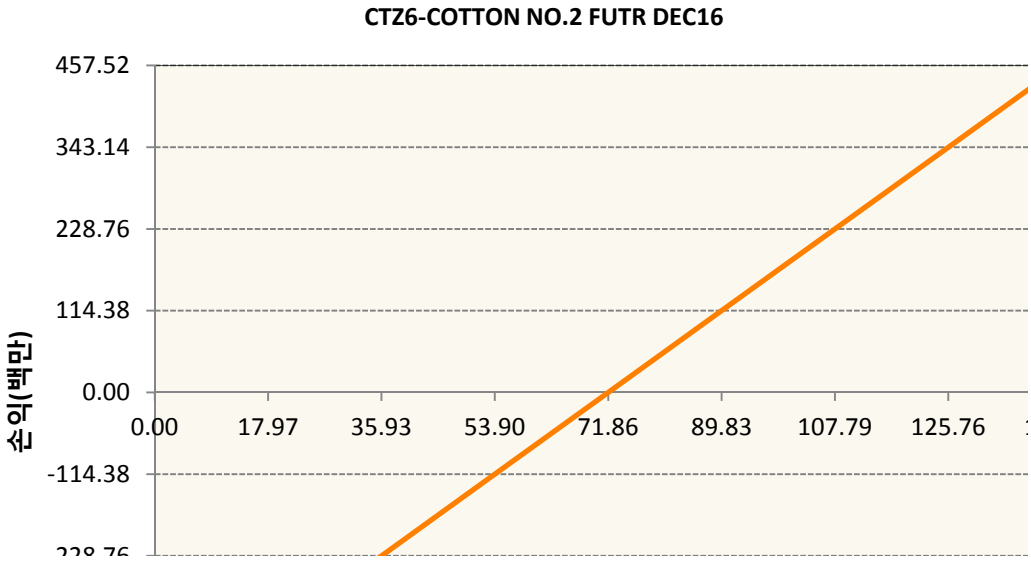
1. 계약금액

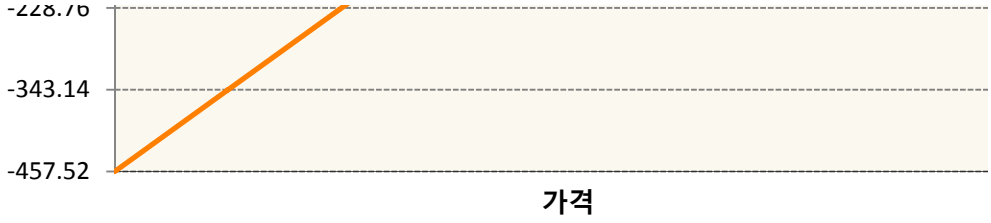
(단위:백만원)

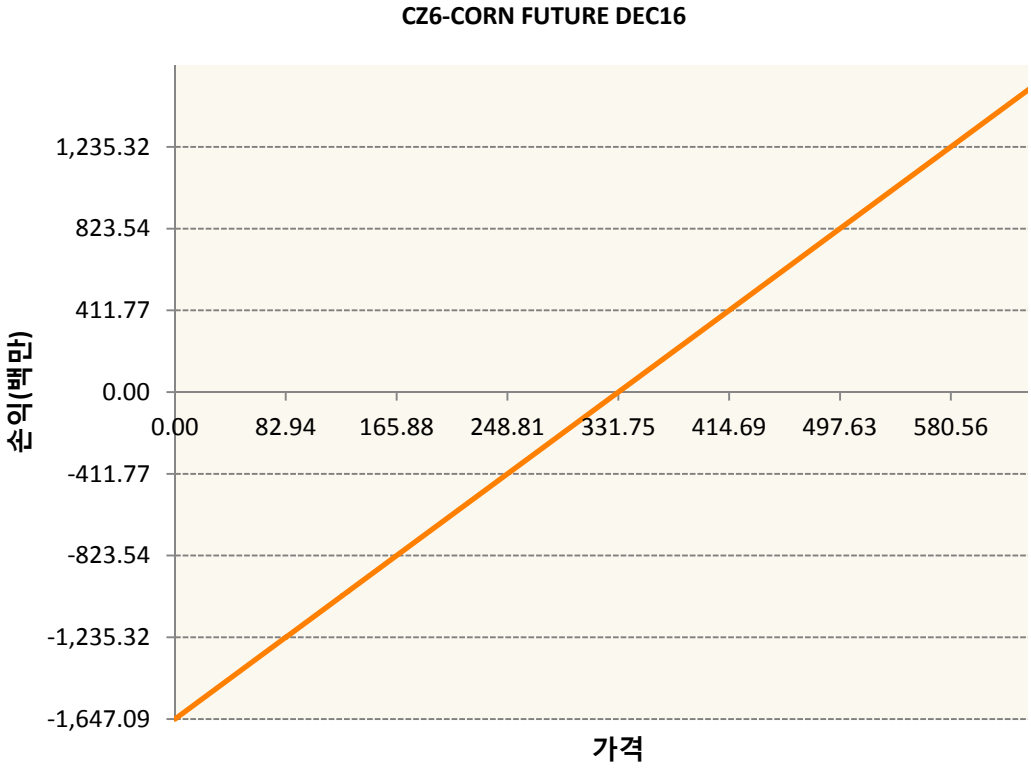
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,151	0	8,151	

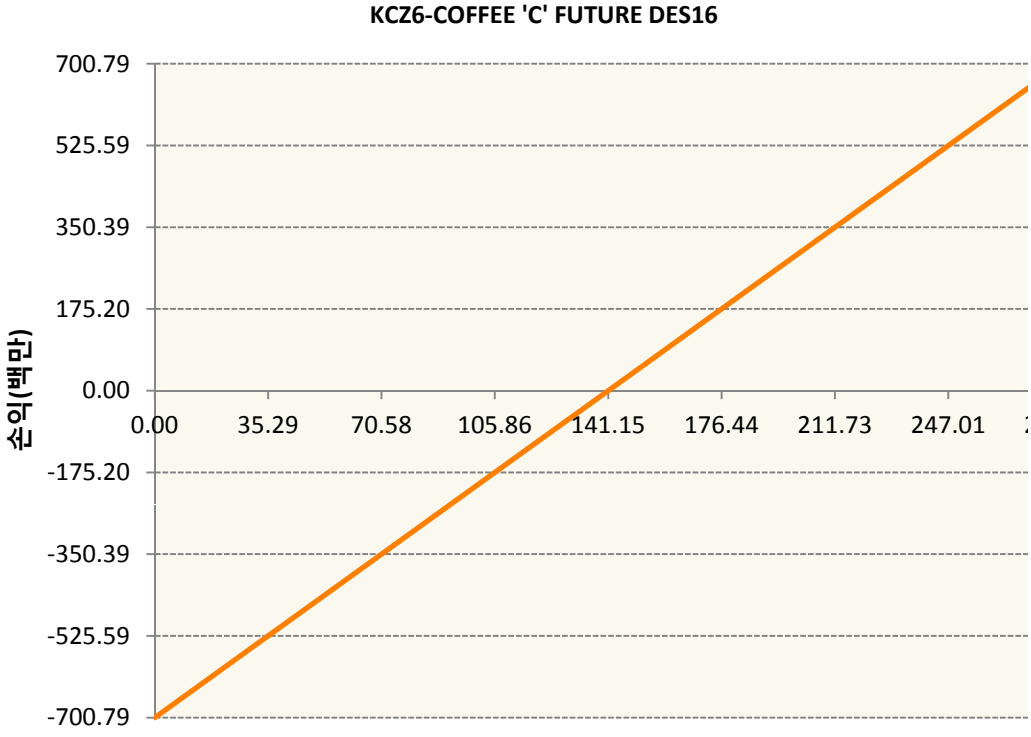
2. 만기시점의 손익구조



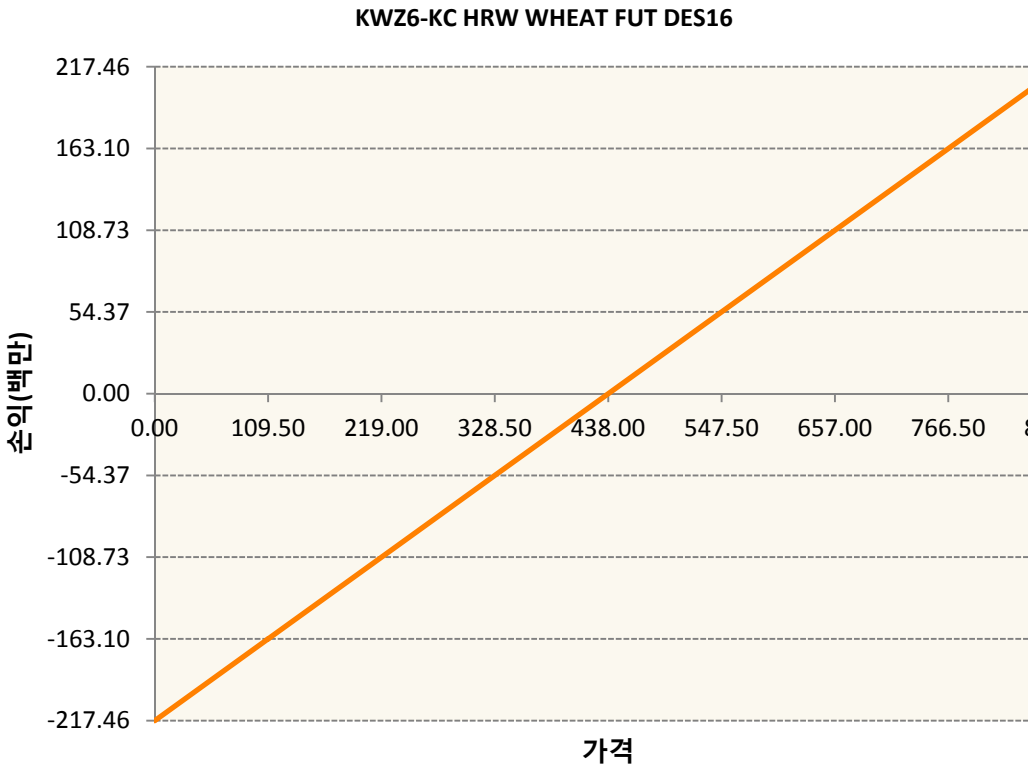


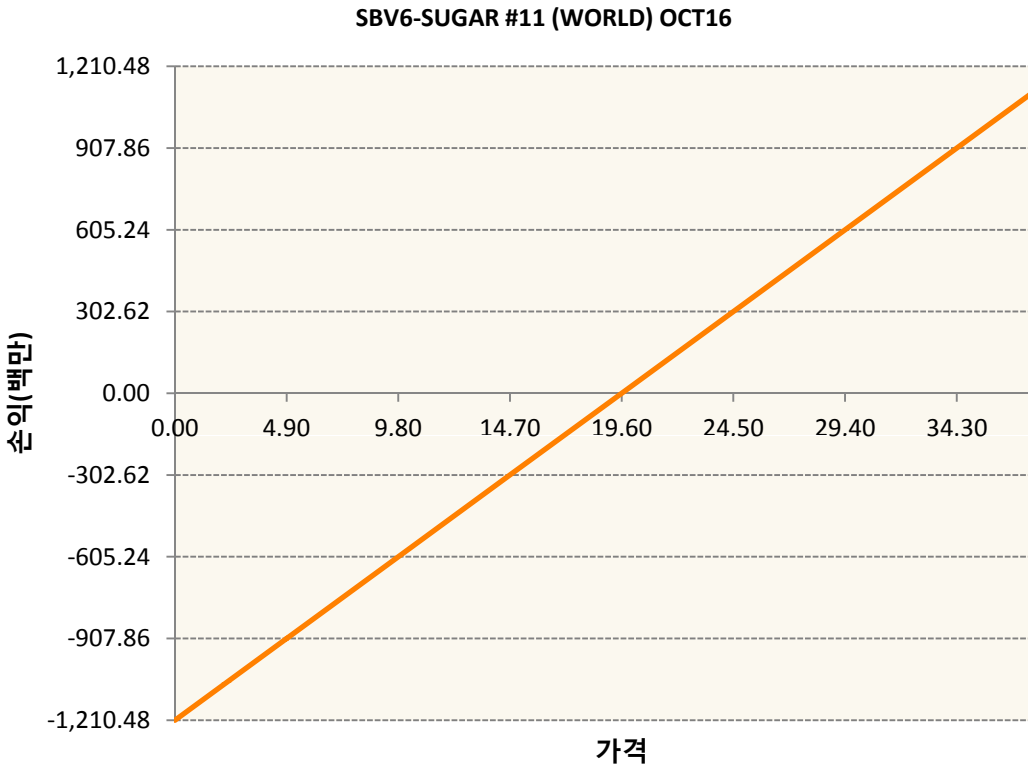

-228.76
-343.14
-457.52
가격

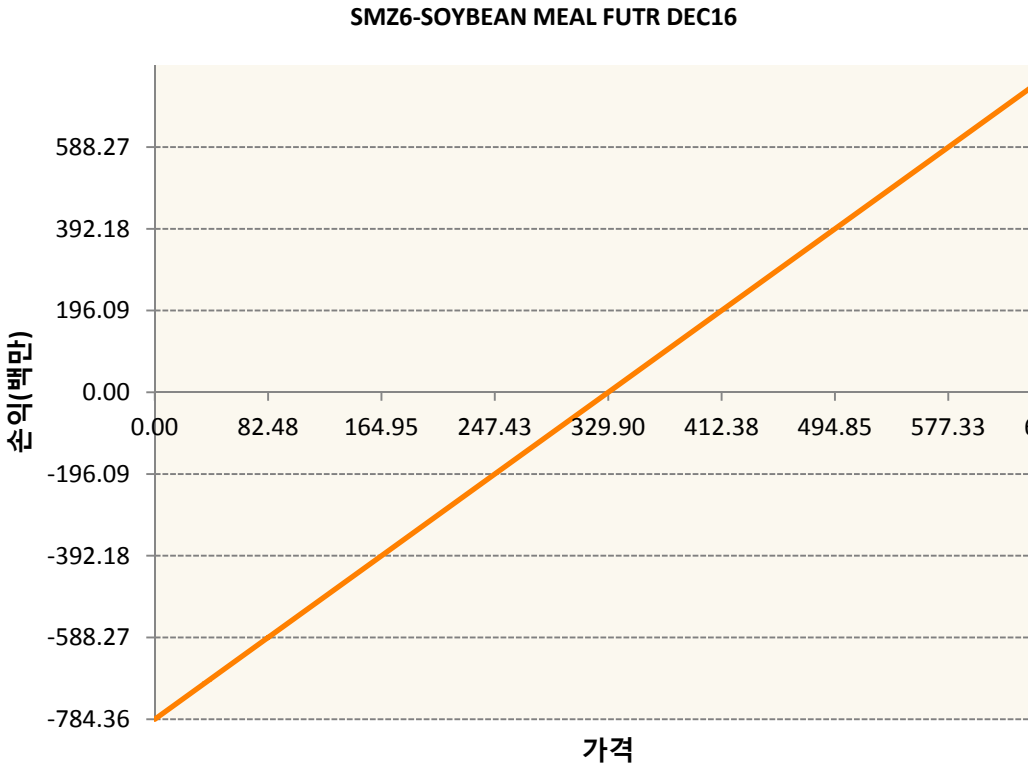

CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,235.32
823.54
411.77
0.00
-411.77
-823.54
-1,235.32
-1,647.09
0.00
82.94
165.88
248.81
331.75
414.69
497.63
580.56
순익(백만)
가격

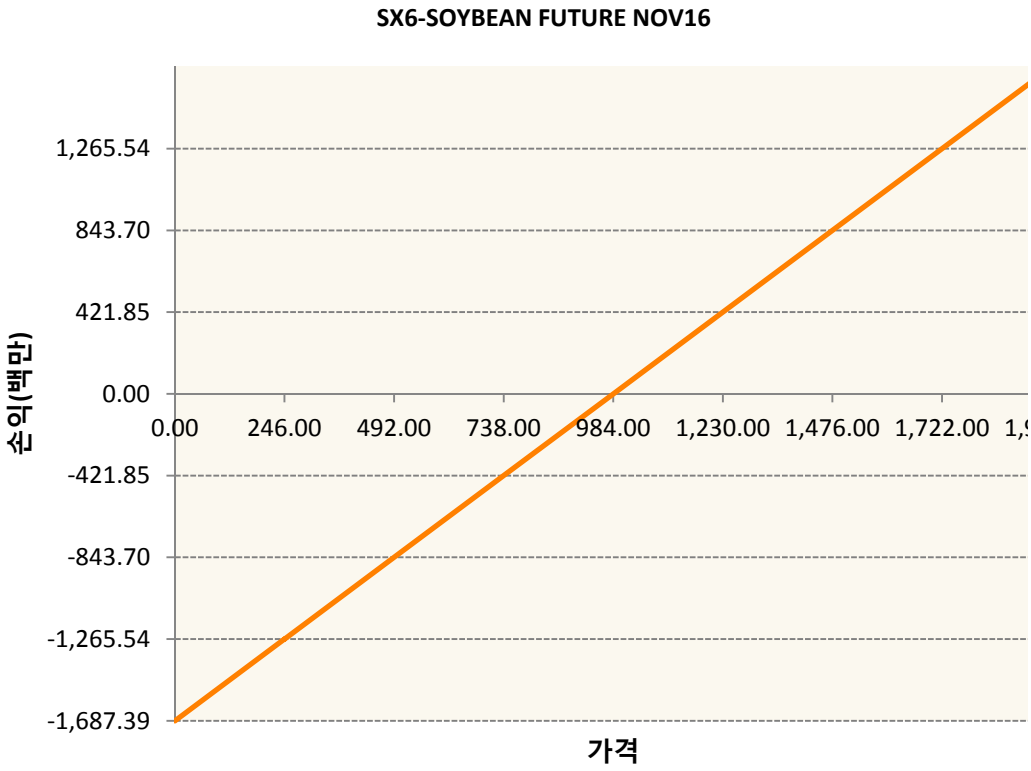

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
700.79
525.59
350.39
175.20
0.00
-175.20
-350.39
-525.59
-700.79
0.00
35.29
70.58
105.86
141.15
176.44
211.73
247.01
순익(백만)

가격

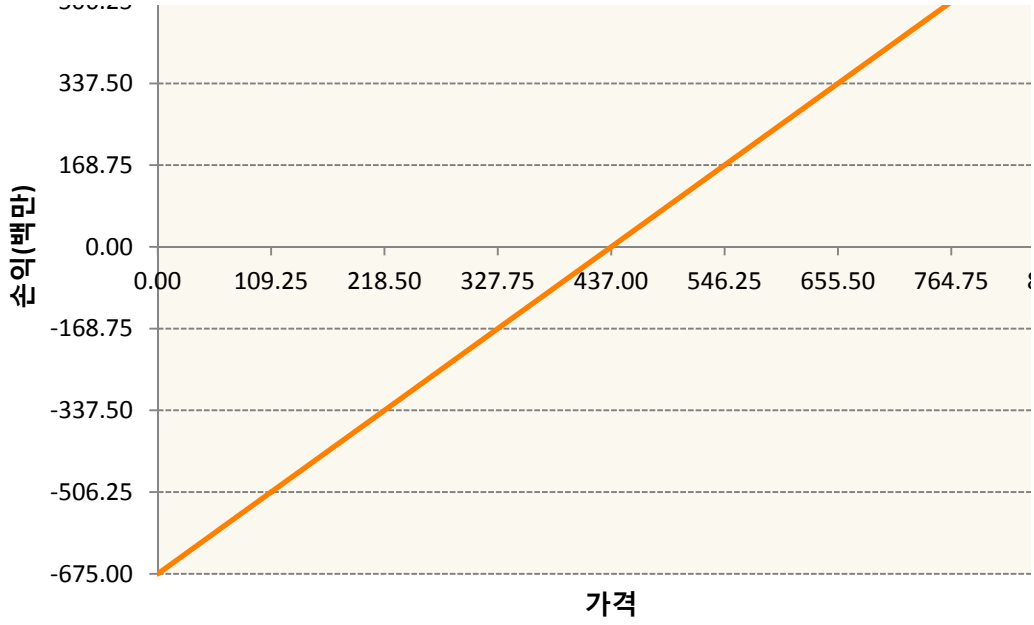

KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16
217.46
163.10
108.73
54.37
0.00
-54.37
-108.73
-163.10
-217.46
0.00
109.50
219.00
328.50
438.00
547.50
657.00
766.50
손익(백만)
가격


SBV6-SUGAR #11 (WORLD) OCT16
1,210.48
907.86
605.24
302.62
0.00
-302.62
-605.24
-907.86
-1,210.48
0.00
4.90
9.80
14.70
19.60
24.50
29.40
34.30
손익(백만)
가격


SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16
588.27
392.18
196.09
0.00
-196.09
-392.18
-588.27
-784.36
손익(백만)
0.00
82.48
164.95
247.43
329.90
412.38
494.85
577.33
가격


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16
1,265.54
843.70
421.85
0.00
-421.85
-843.70
-1,265.54
-1,687.39
손익(백만)
0.00
246.00
492.00
738.00
984.00
1,230.00
1,476.00
1,722.00
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
675.00
506.25



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ6	SOYBEAN OIL FUTR DEC16	62
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	37
CZ6	CORN FUTURE DEC16	132
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	56
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	17
SBV6	SUGAR #11 (WORLD) OCT16	97
SMZ6	SOYBEAN MEAL FUTR DEC16	63
SX6	SOYBEAN FUTURE NOV16	135
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	54

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	849