공시일	2016-08-17
기준일	2016-08-16

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	2016-08-17
기준일	2016-08-16

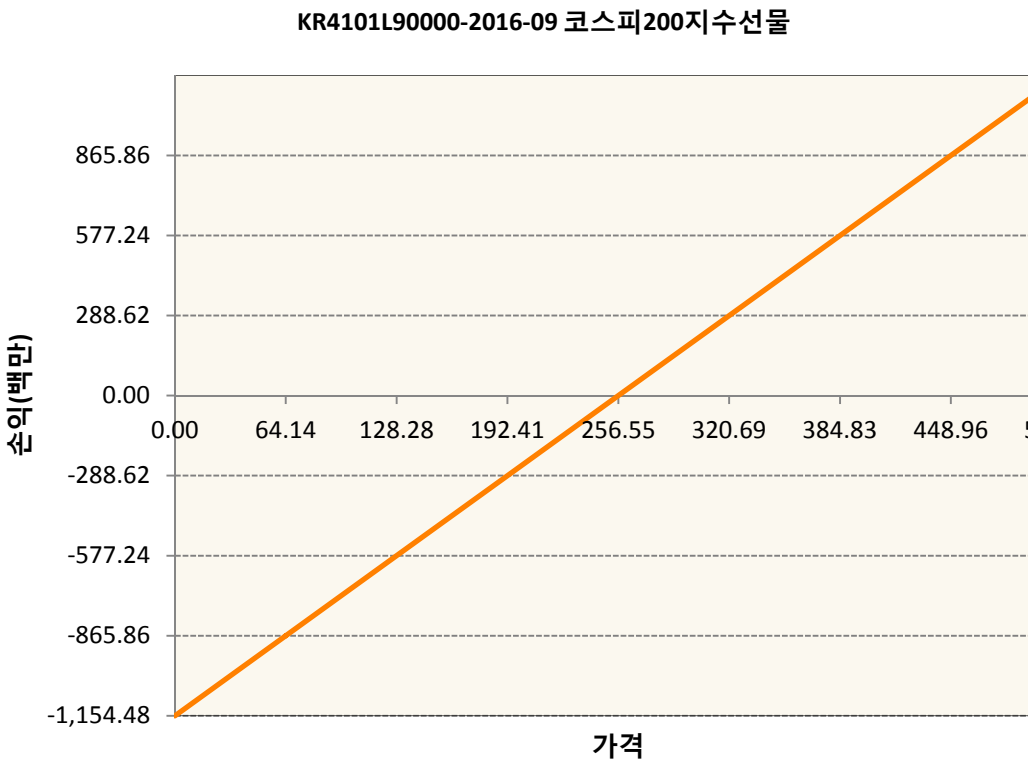
스마트인덱스모

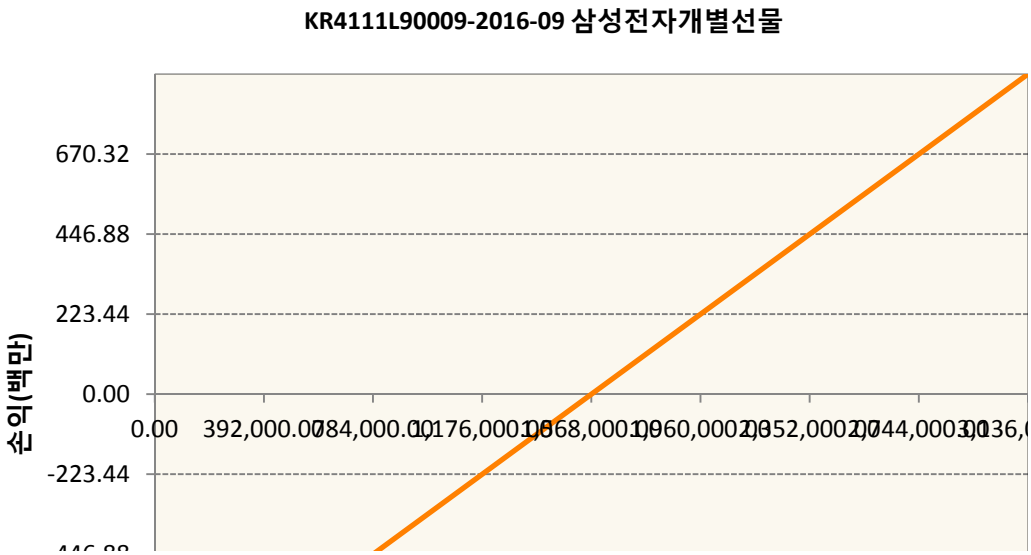
1. 계약금액

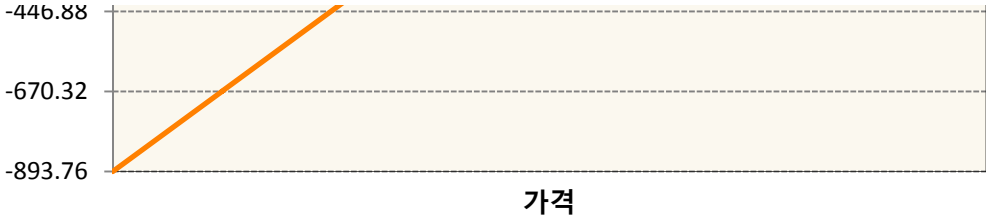
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,048	0	2,048	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						72
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72
-5.33%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
-2.67%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	24	24	24	24	24	24	24
5.33%	48	48	48	48	48	48	48
8.00%	72	72	72	72	72	72	72

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

150

공시일	2016-08-17
기준일	2016-08-16

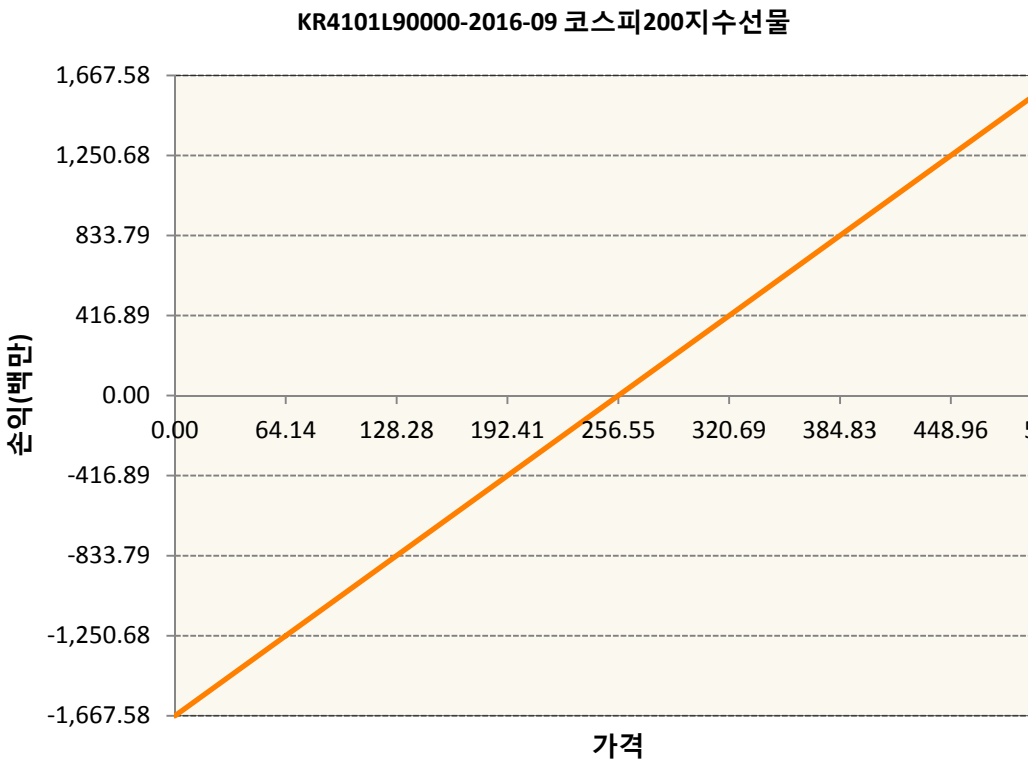
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,668	0	1,668	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	2016-08-17
기준일	2016-08-16

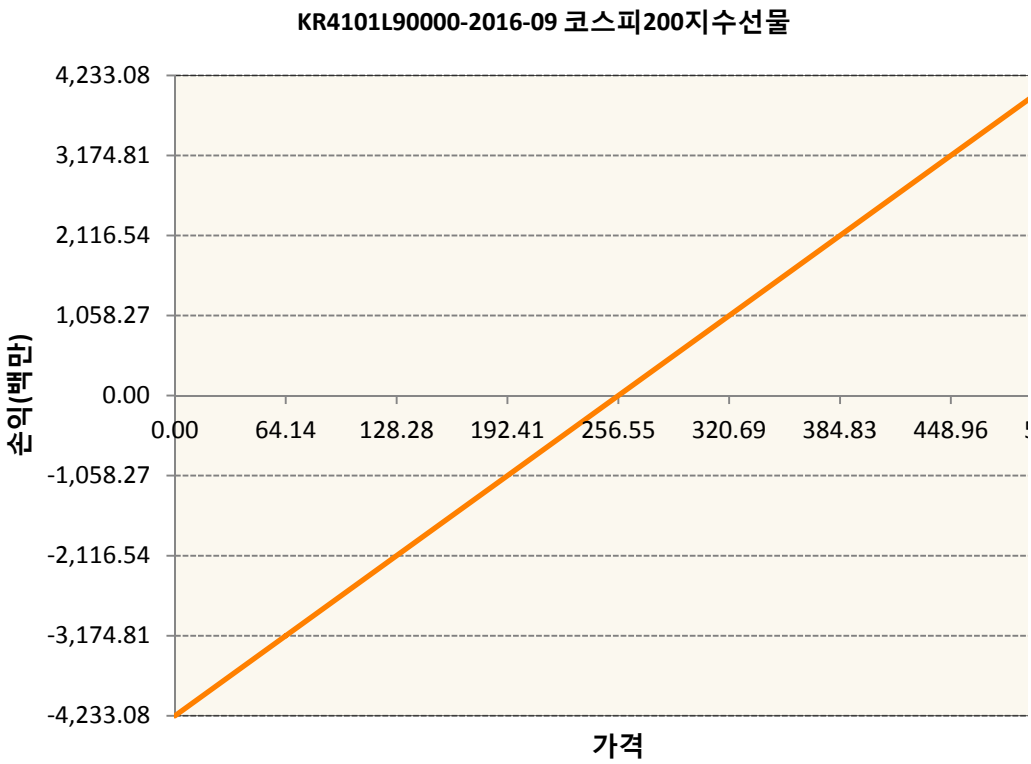
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	4,233	0	4,233	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	2016-08-17
기준일	2016-08-16

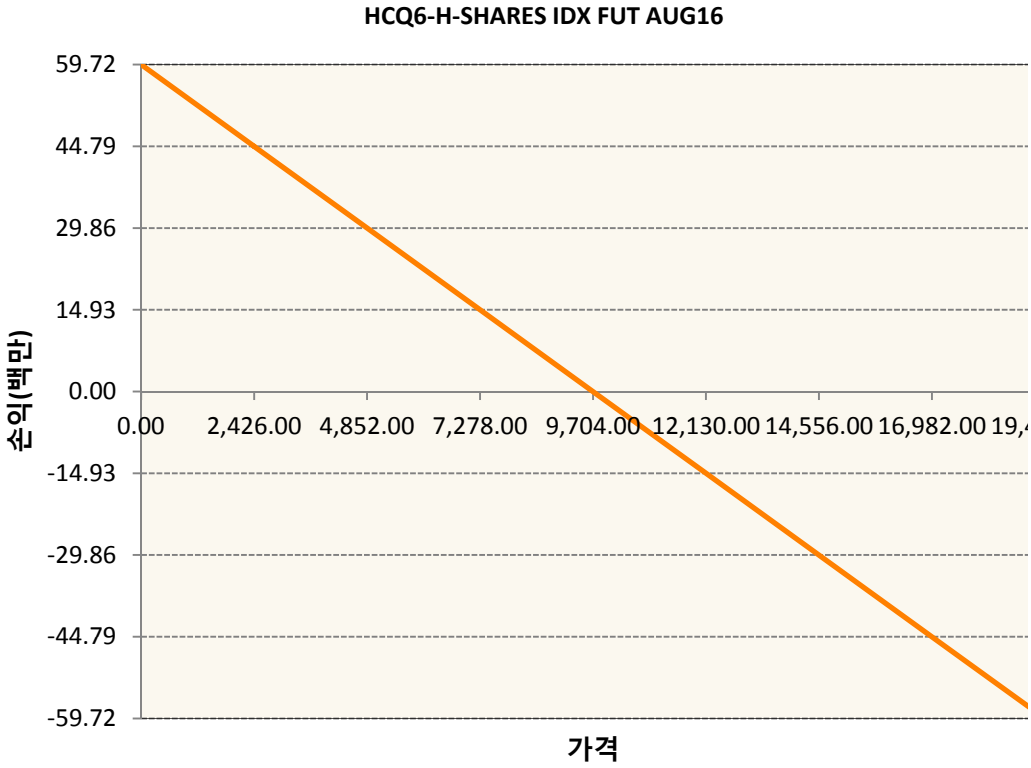
아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

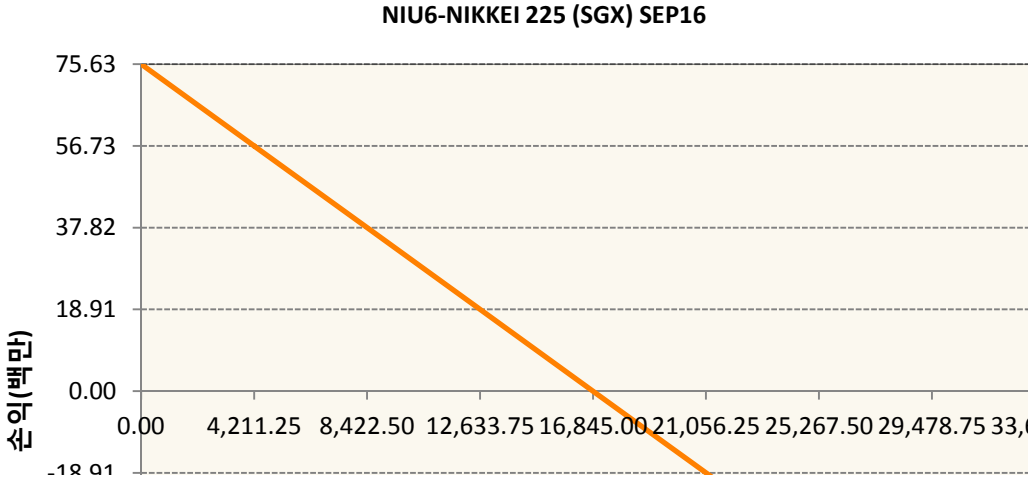
1. 계약금액

(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	60	-60	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)
	14

공시일	2016-08-17
기준일	2016-08-16

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	891

* 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	2016-08-17
기준일	2016-08-16

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	408

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

997

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-08-17
기준일	2016-08-16

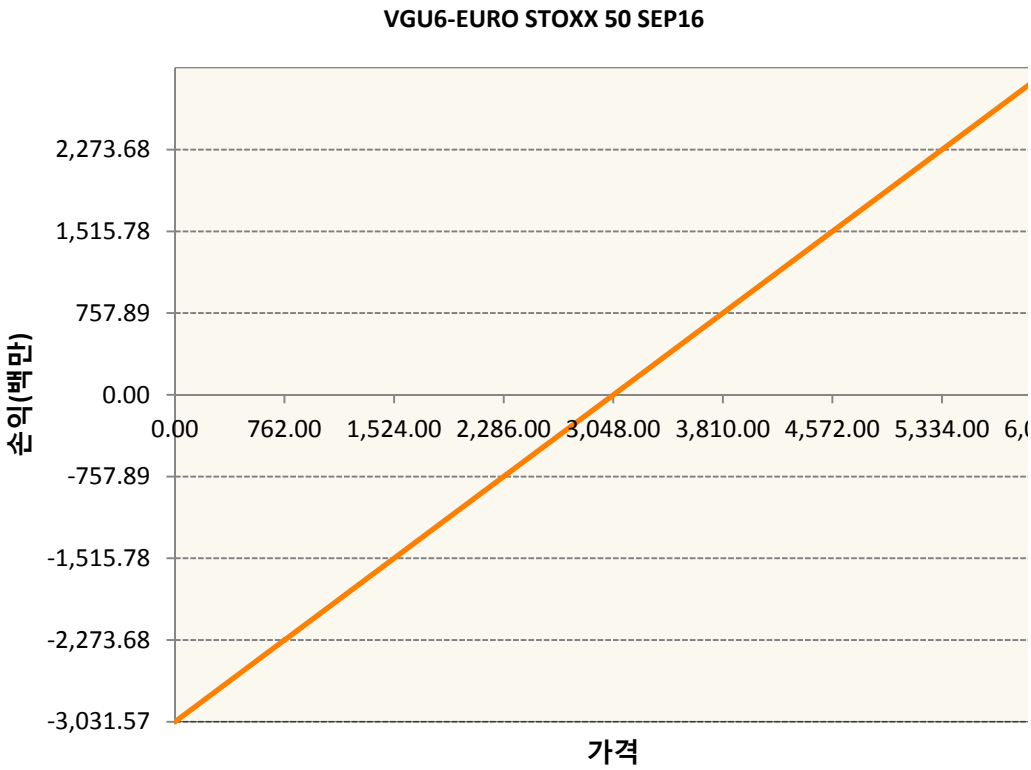
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,032	0	3,032	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 SEP16	243

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

(단위:백만원)

300

공시일	2016-08-17
기준일	2016-08-16

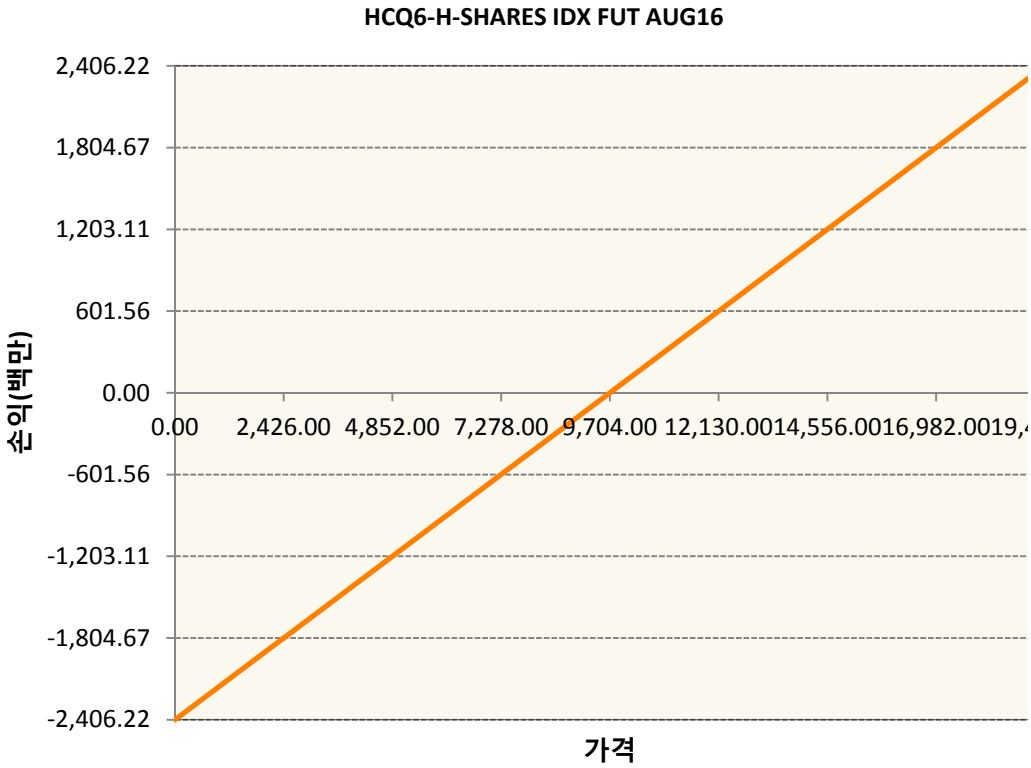
차이나인덱스모(주식-파생형)

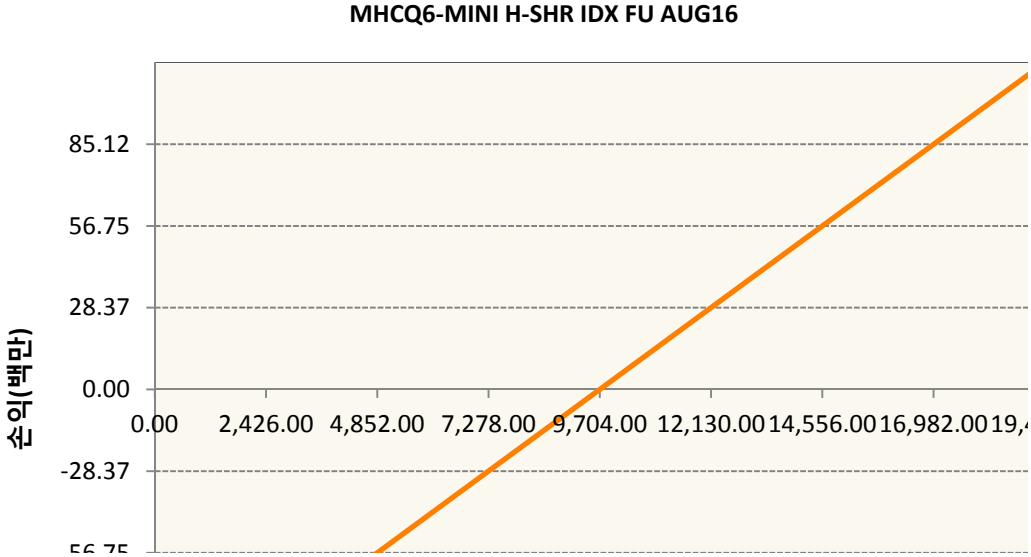
1. 계약금액

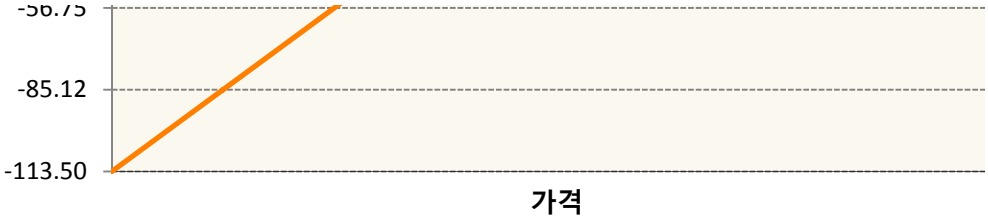
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,520	0	2,520	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ6	H-SHARES IDX FUT AUG16	192
MHCQ6	MINI H-SHR IDX FU AUG16	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	284

공시일	2016-08-17
기준일	2016-08-16

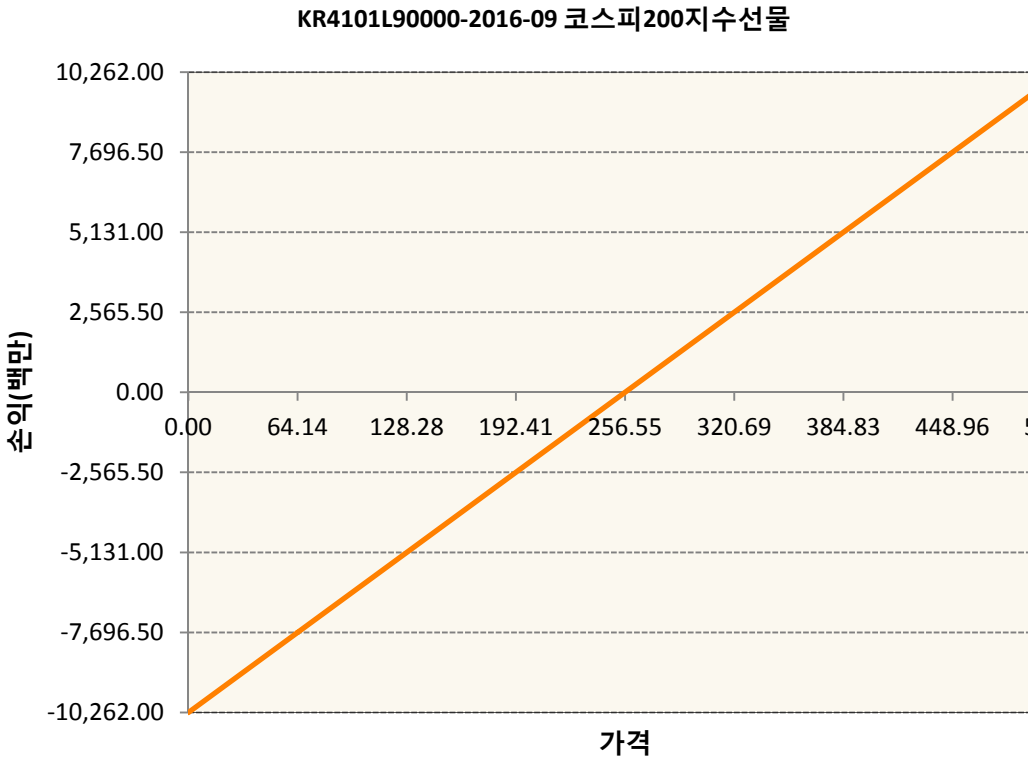
커버드콜(주식혼합-파생형)

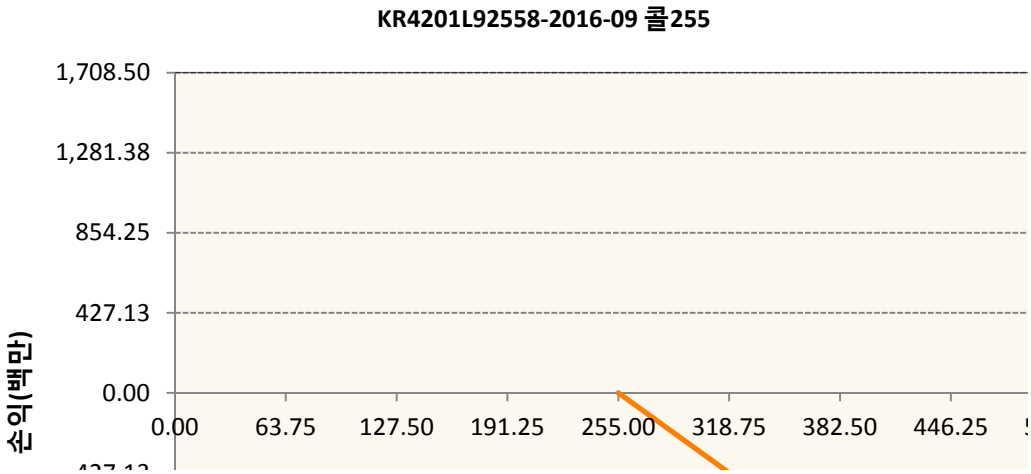
1. 계약금액

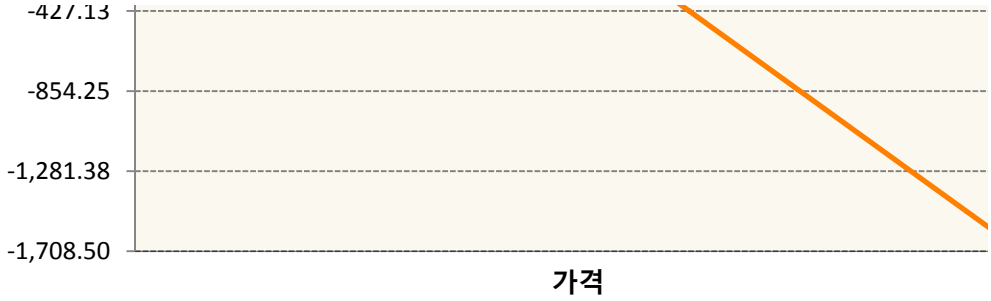
(단위:백만원)

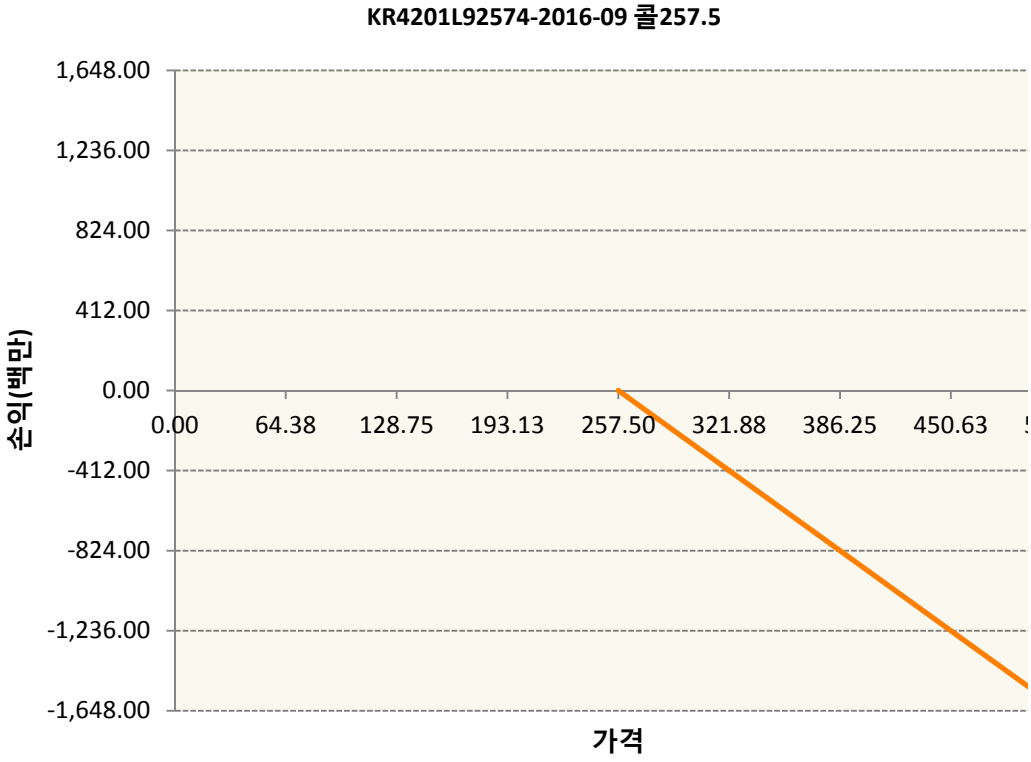
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	513	0	513	장내
신규	유가증권	옵션	0	104	-104	장내
누계	유가증권	선물	10,262	0	10,262	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,357	-3,357	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101L900 2016-09 코스피200지수선물							820
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-820	-820	-820	-820	-820	-820	-820
-5.33%	-546	-546	-546	-546	-546	-546	-546
-2.67%	-273	-273	-273	-273	-273	-273	-273
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	273	273	273	273	273	273	273
5.33%	546	546	546	546	546	546	546
8.00%	820	820	820	820	820	820	820
KR4201L925 2016-09 콜255							604
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	120	120	120	120	120	119	119
-5.33%	120	119	118	116	114	111	108
-2.67%	105	100	95	89	82	76	69
0%	25	17	8	0	-8	-17	-25
2.67%	-152	-156	-160	-165	-170	-176	-182
5.33%	-374	-374	-375	-376	-378	-380	-382
8.00%	-602	-602	-602	-602	-602	-603	-604
KR4201L925 2016-09 콜257.5							537

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	76	76	76	76	76	76	75
-5.33%	76	76	75	74	73	72	70
-2.67%	70	67	64	60	55	50	45
0%	24	16	8	0	-8	-16	-24
2.67%	-114	-120	-126	-132	-139	-145	-152
5.33%	-317	-318	-320	-322	-324	-328	-331
8.00%	-534	-534	-534	-535	-535	-536	-537

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

2,001

공시일	2016-08-17
기준일	2016-08-16

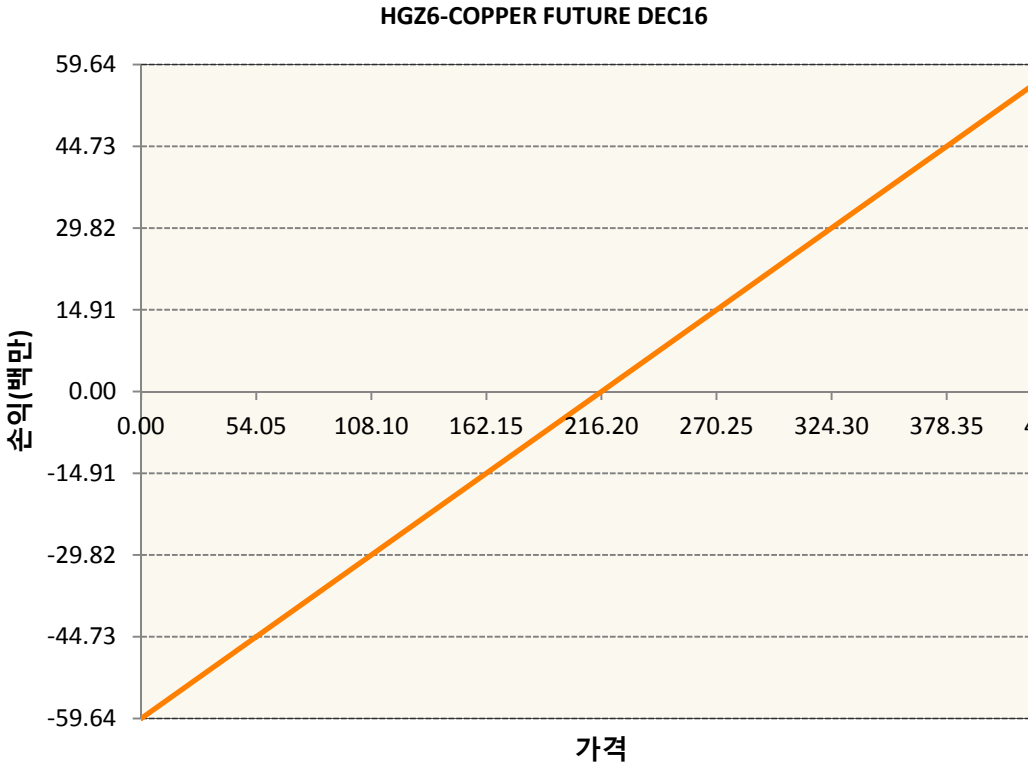
메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

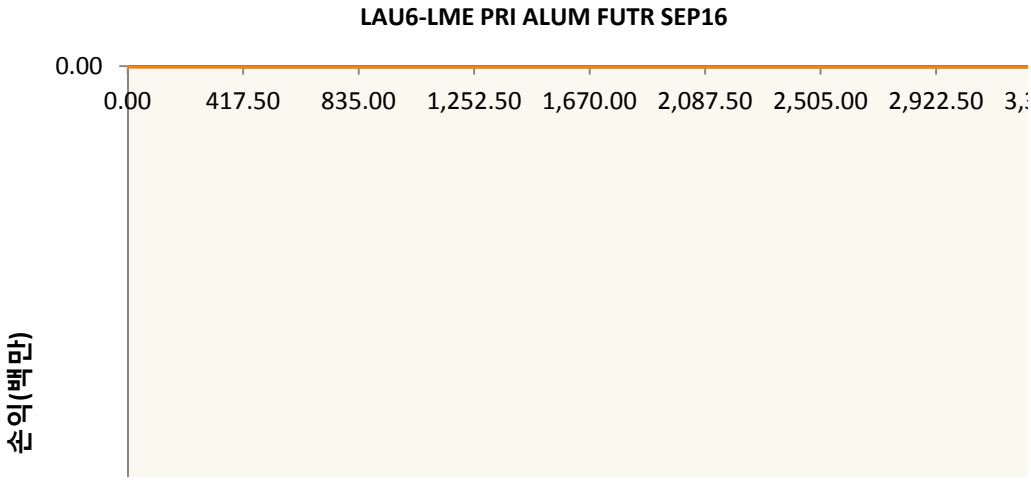
1. 계약금액

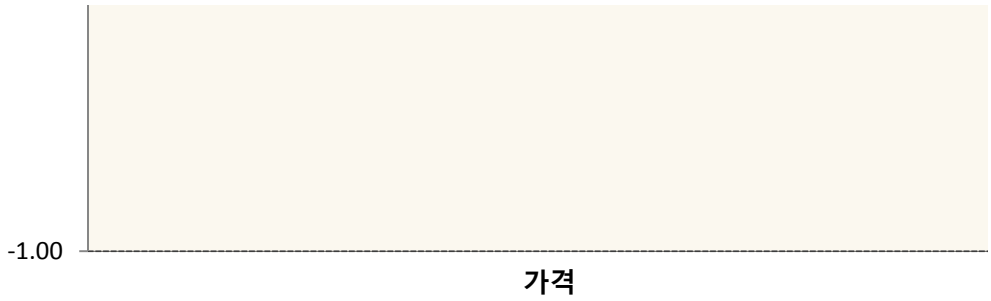
(단위:백만원)

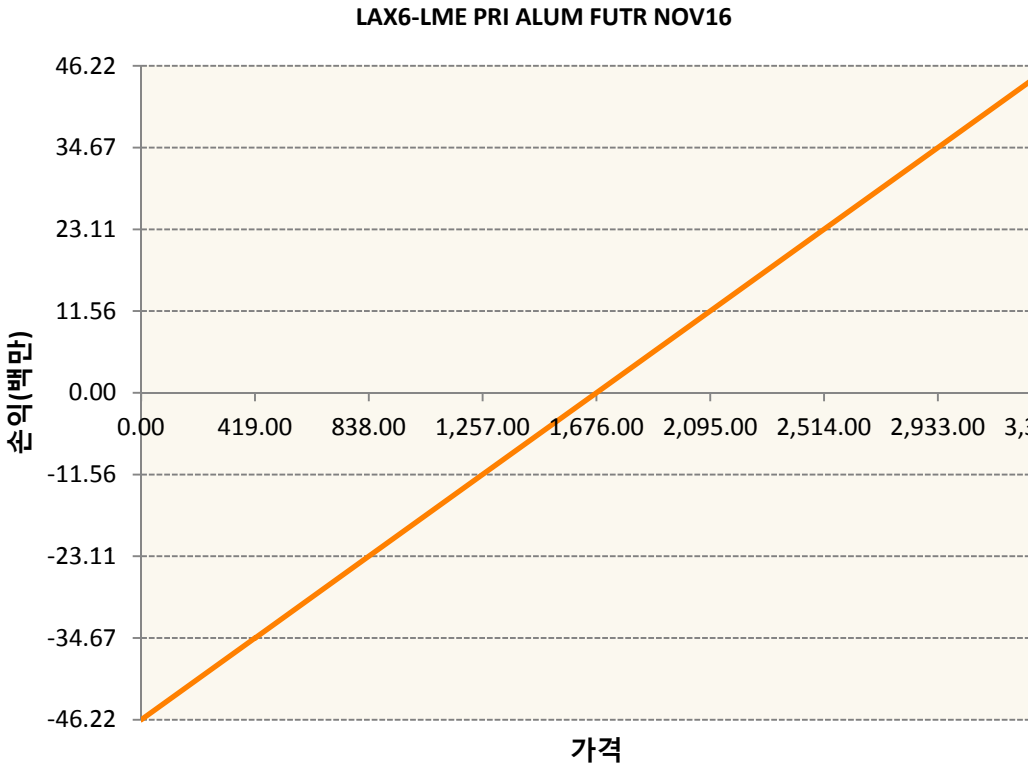
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	44	0	44	
누계	유가증권	선물	431	108	323	

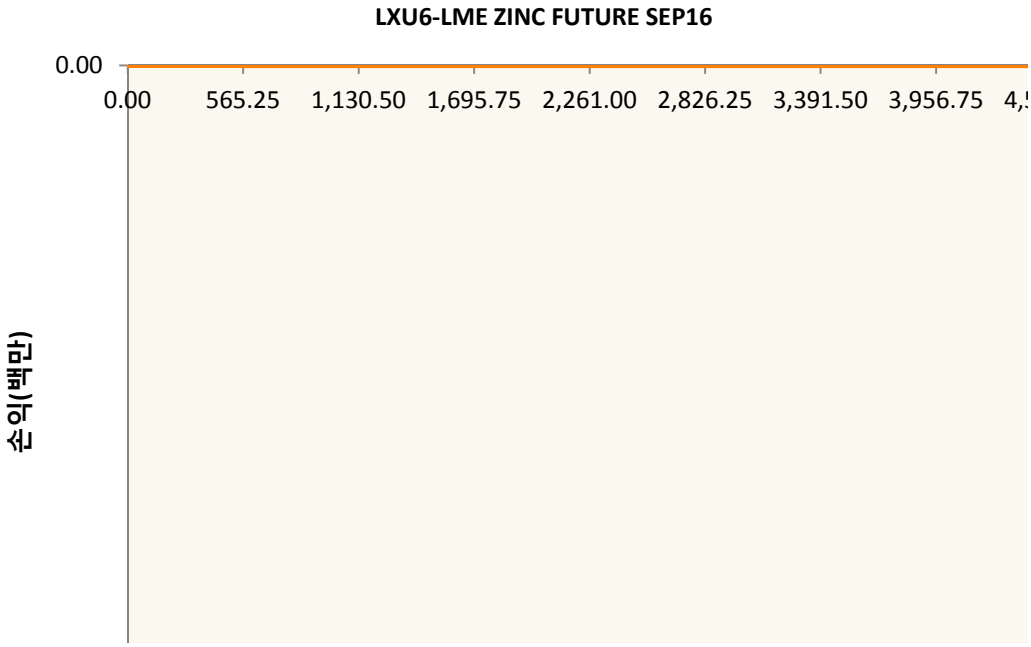
2. 만기시점의 손익구조

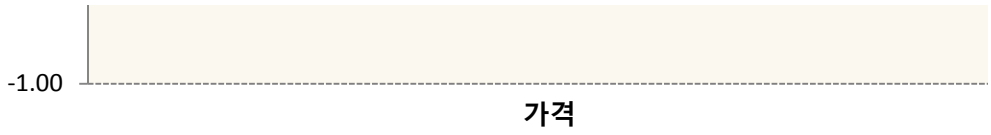


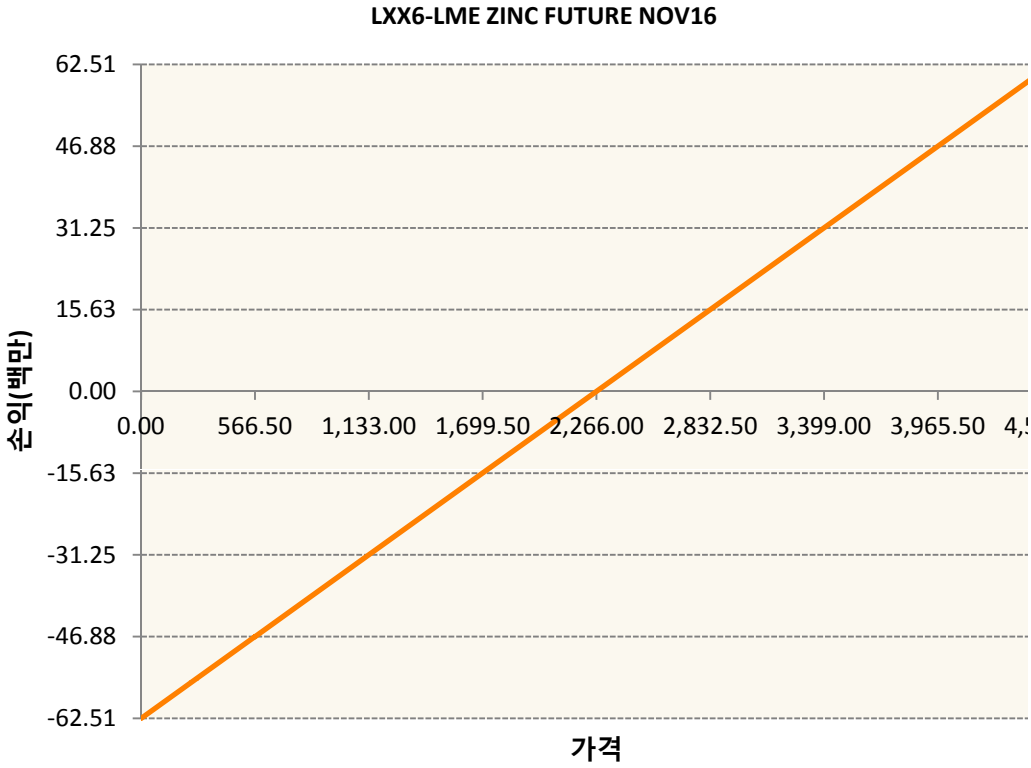


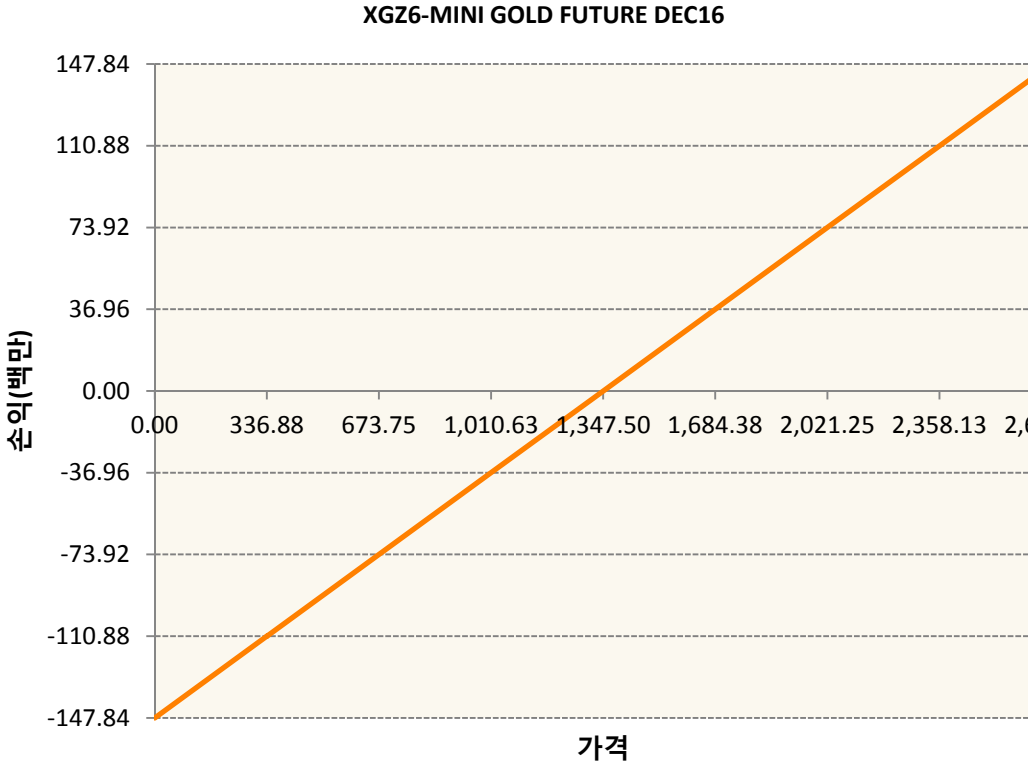

-1.00
가격

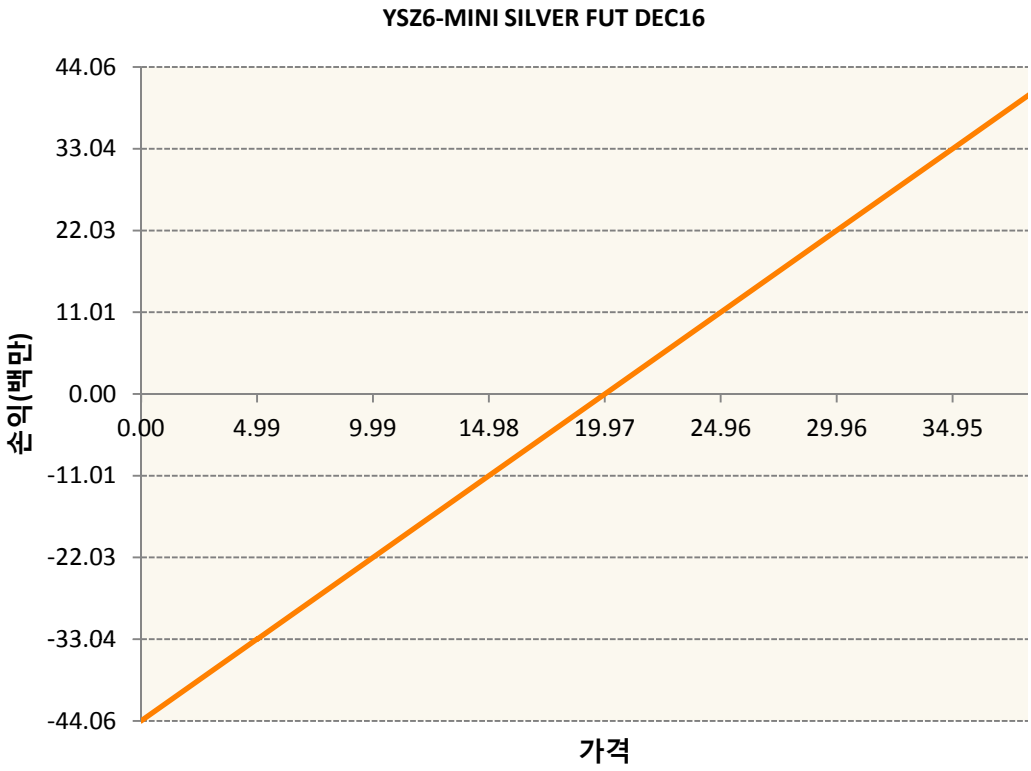

LAX6-LME PRI ALUM FUTR NOV16
46.22
34.67
23.11
11.56
0.00
-11.56
-23.11
-34.67
-46.22
0.00
419.00
838.00
1,257.00
1,676.00
2,095.00
2,514.00
2,933.00
순익(백만)
가격


LXU6-LME ZINC FUTURE SEP16
0.00
0.00
565.25
1,130.50
1,695.75
2,261.00
2,826.25
3,391.50
3,956.75
순익(백만)


-1.00
가격


LXX6-LME ZINC FUTURE NOV16
62.51
46.88
31.25
15.63
0.00
-15.63
-31.25
-46.88
-62.51
0.00
566.50
1,133.00
1,699.50
2,266.00
2,832.50
3,399.00
3,965.50
순익(백만)
가격


XGZ6-MINI GOLD FUTURE DEC16
147.84
110.88
73.92
36.96
0.00
-36.96
-73.92
-110.88
-147.84
0.00
336.88
673.75
1,010.63
1,347.50
1,684.38
2,021.25
2,358.13
순익(백만)
가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HGZ6	COPPER FUTURE DEC16	5
LAU6	LME PRI ALUM FUTR SEP16	0.4
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	2016-08-17
기준일	2016-08-16

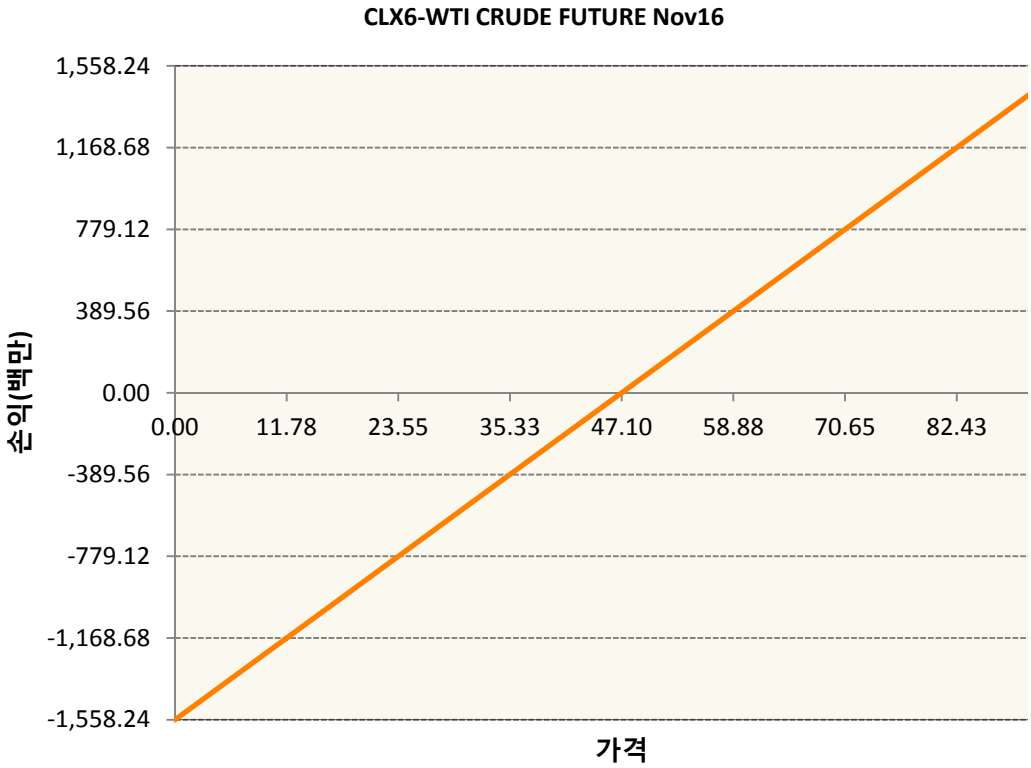
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

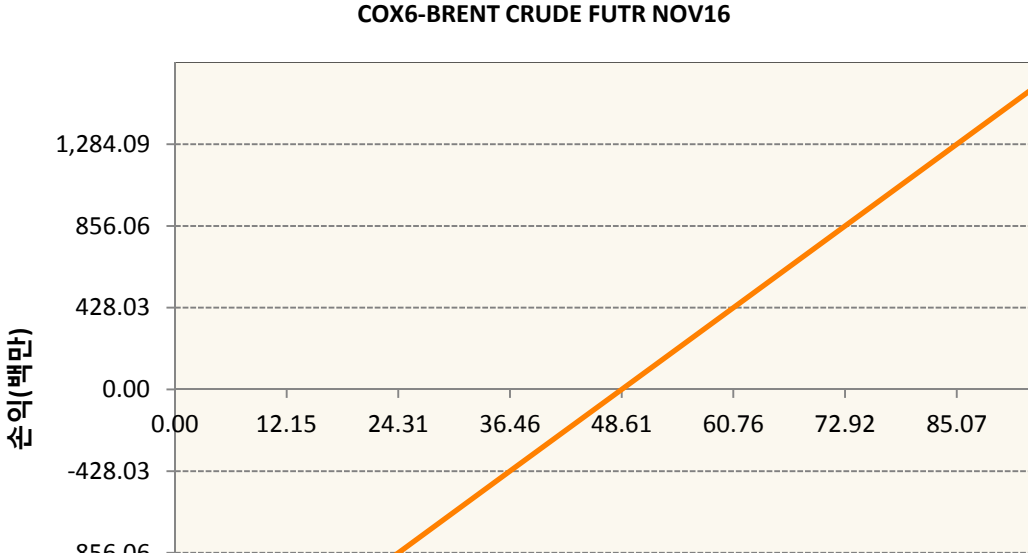
1. 계약금액

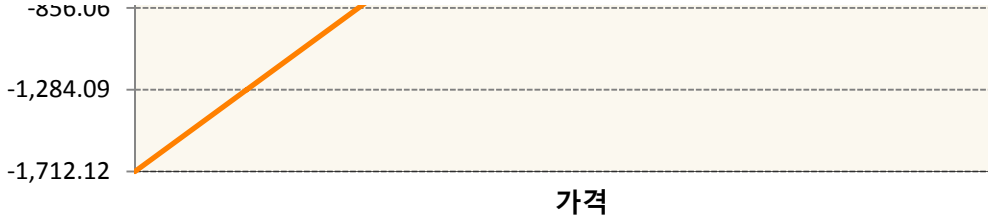
(단위:백만원)

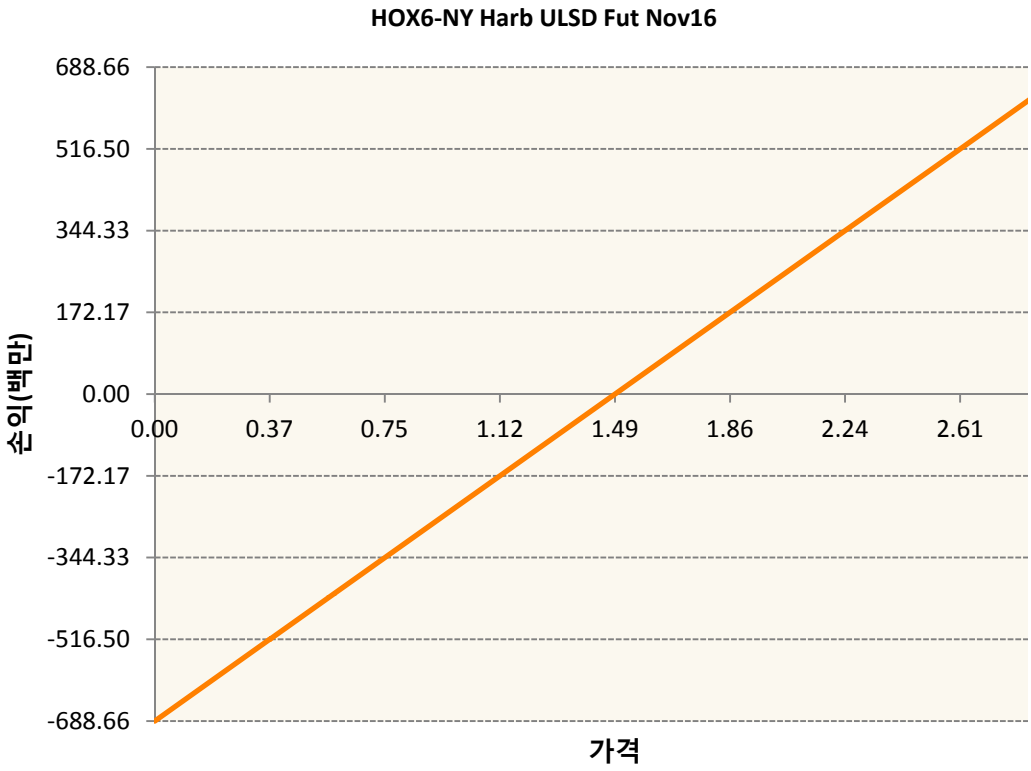
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,127	0	6,127	

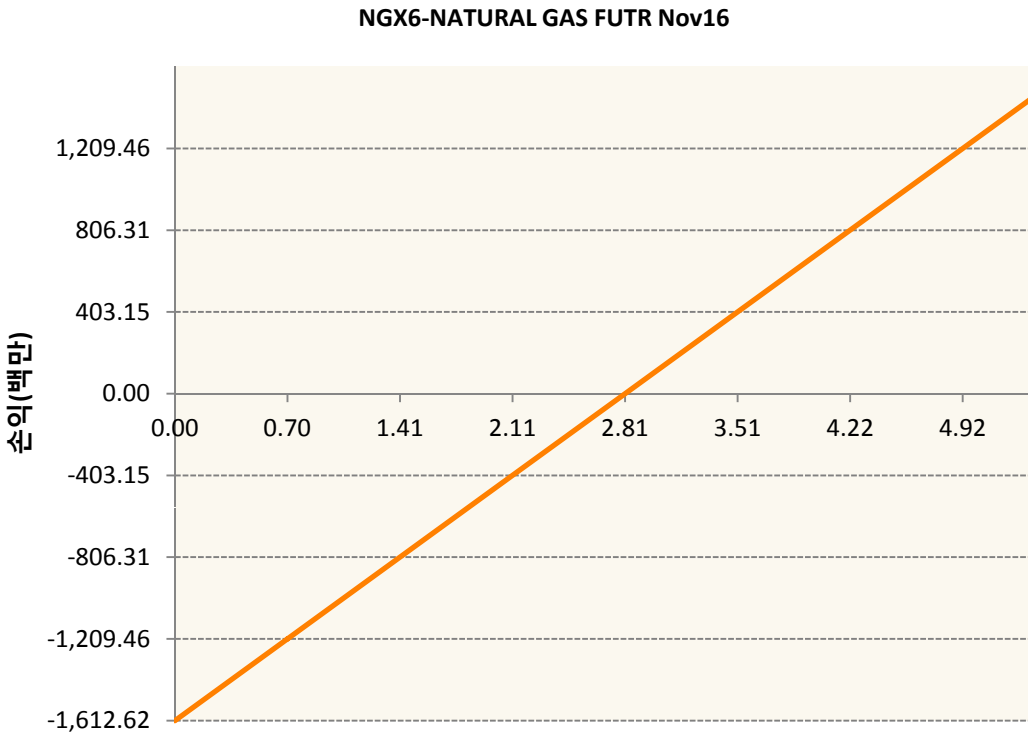
2. 만기시점의 손익구조



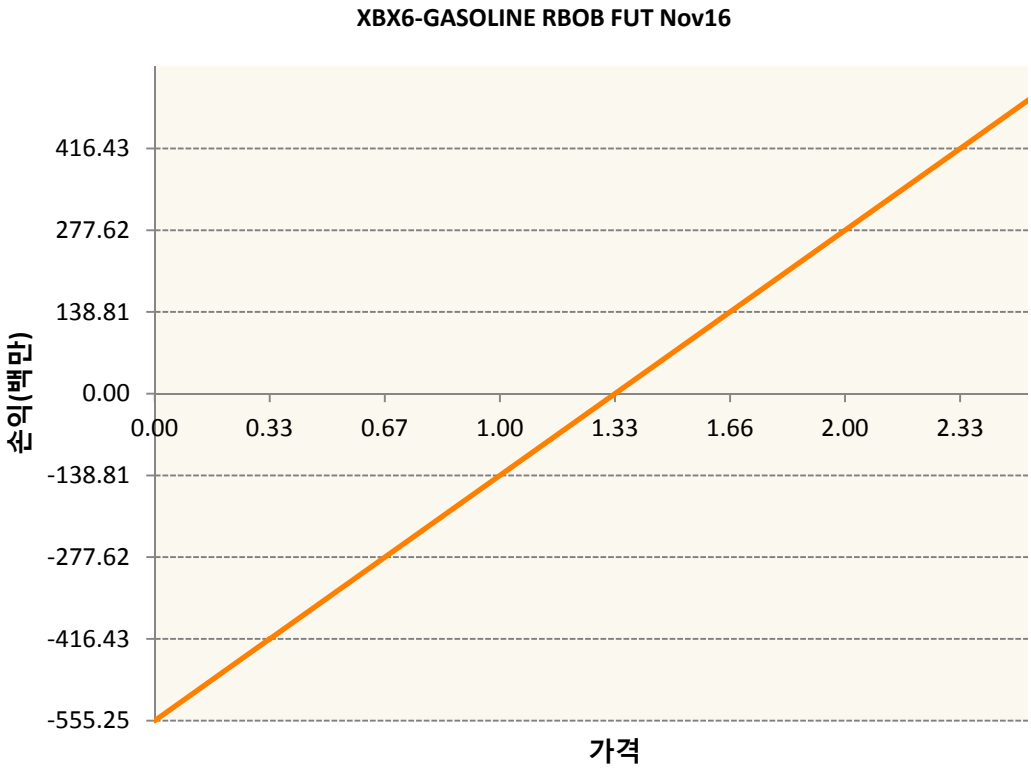



-1,284.09
-1,712.12
가격


HOX6-NY Harb ULSD Fut Nov16
688.66
516.50
344.33
172.17
0.00
-172.17
-344.33
-516.50
-688.66
0.00
0.37
0.75
1.12
1.49
1.86
2.24
2.61
손익(백만)
가격


NGX6-NATURAL GAS FUTR Nov16
1,209.46
806.31
403.15
0.00
-403.15
-806.31
-1,209.46
-1,612.62
0.00
0.70
1.41
2.11
2.81
3.51
4.22
4.92
손익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX6	WTI CRUDE FUTURE Nov16	125
COX6	BRENT CRUDE FUTR NOV16	137
HOX6	NY Harb ULSD Fut Nov16	55
NGX6	NATURAL GAS FUTR Nov16	129
XBX6	GASOLINE RBOB FUT Nov16	44

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,102

공시일	2016-08-17
기준일	2016-08-16

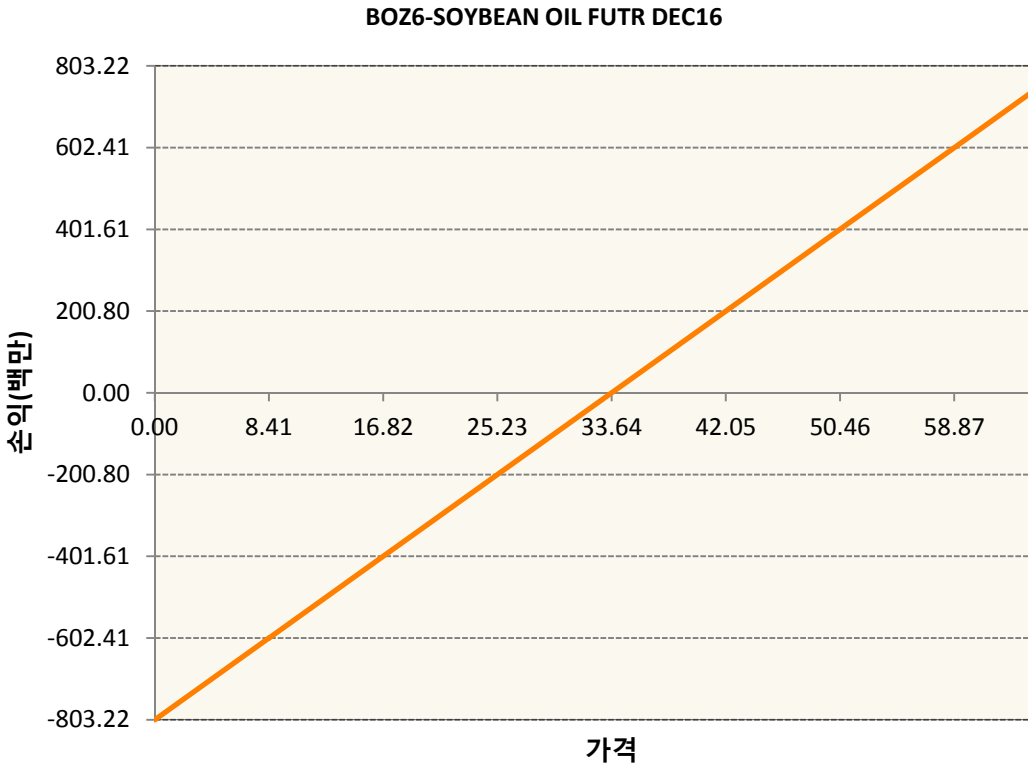
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

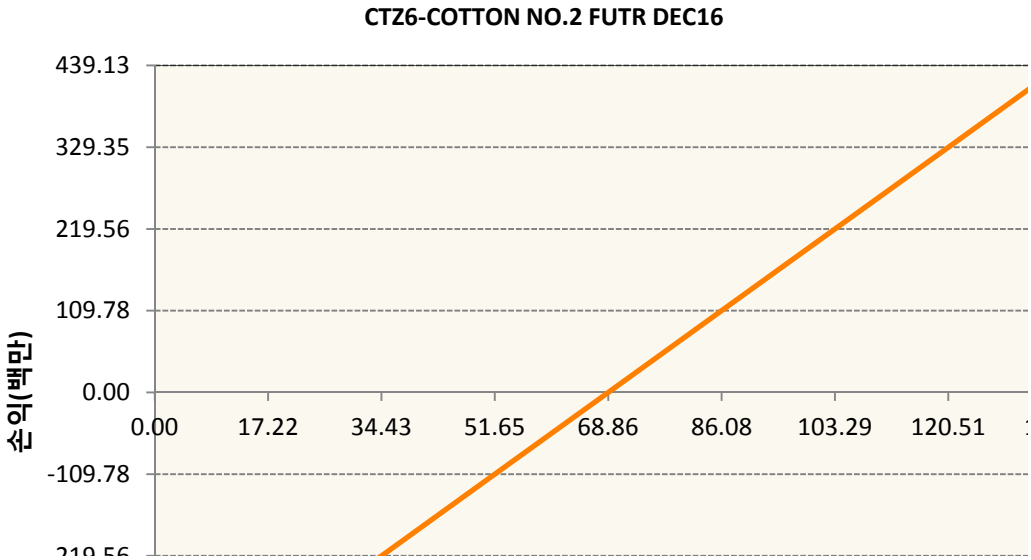
1. 계약금액

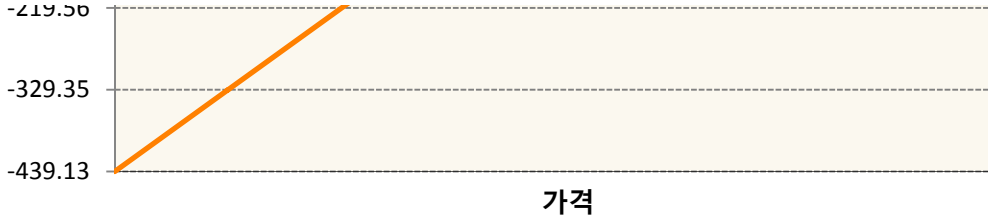
(단위:백만원)

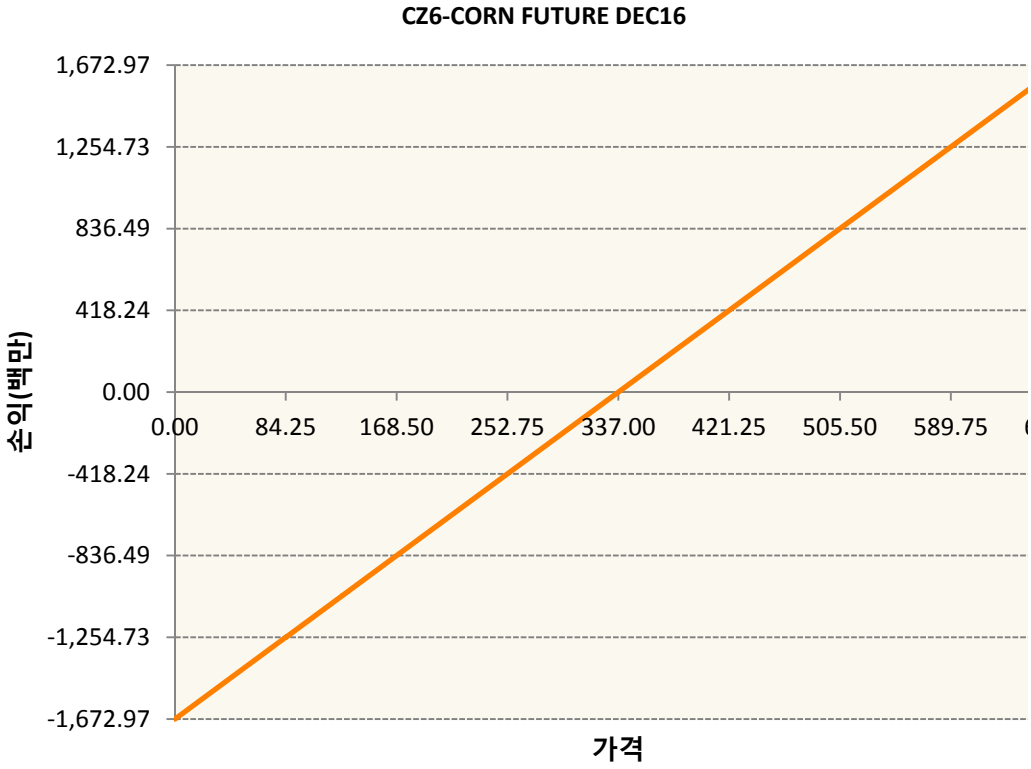
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,266	0	8,266	

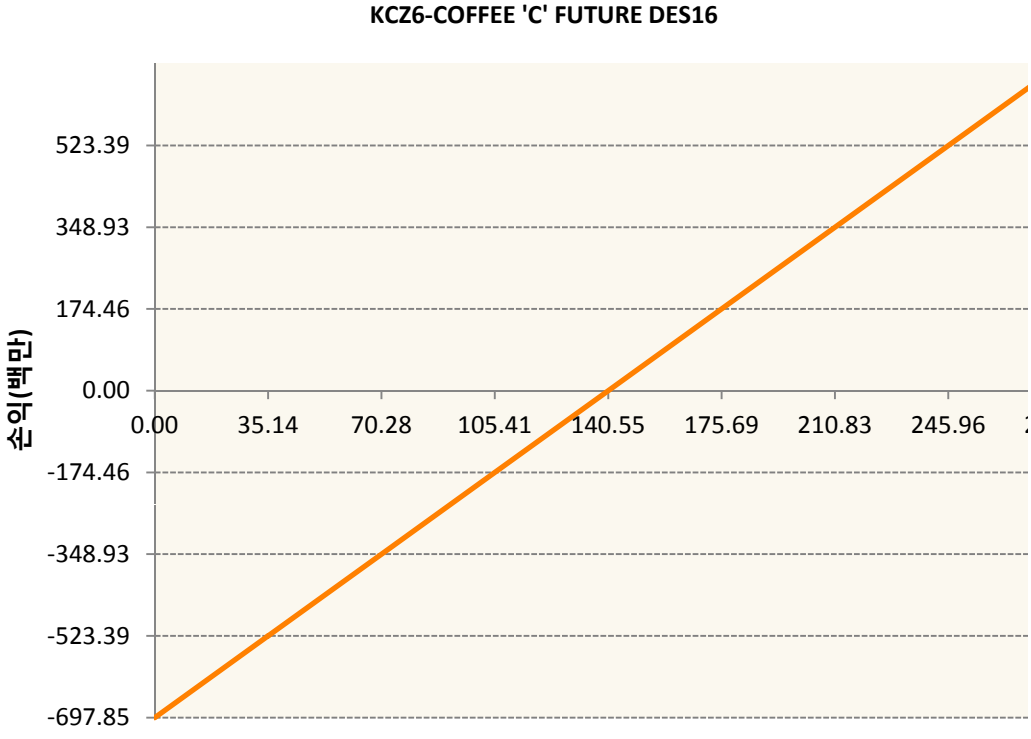
2. 만기시점의 손익구조



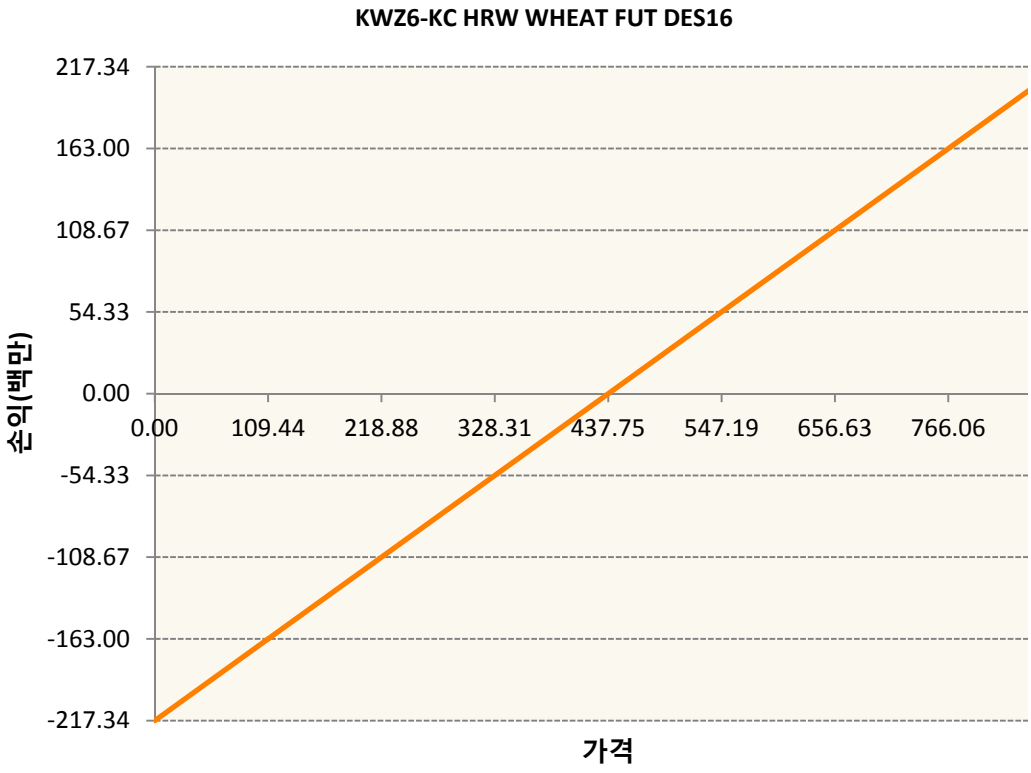


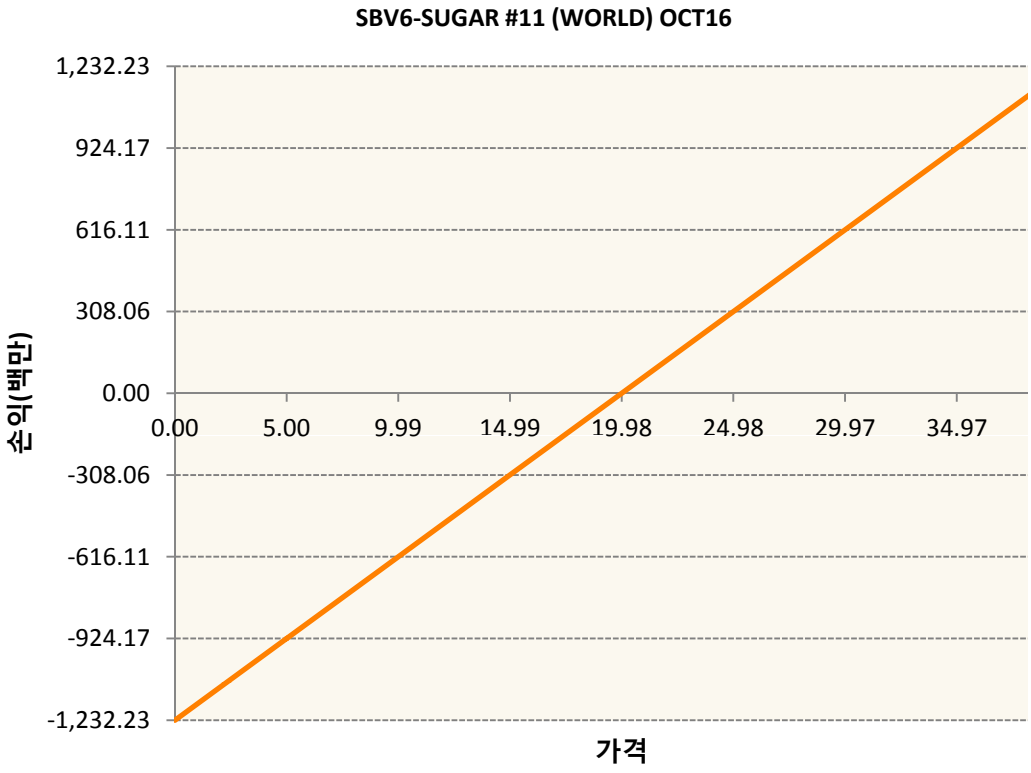

-219.56
-329.35
-439.13
가격

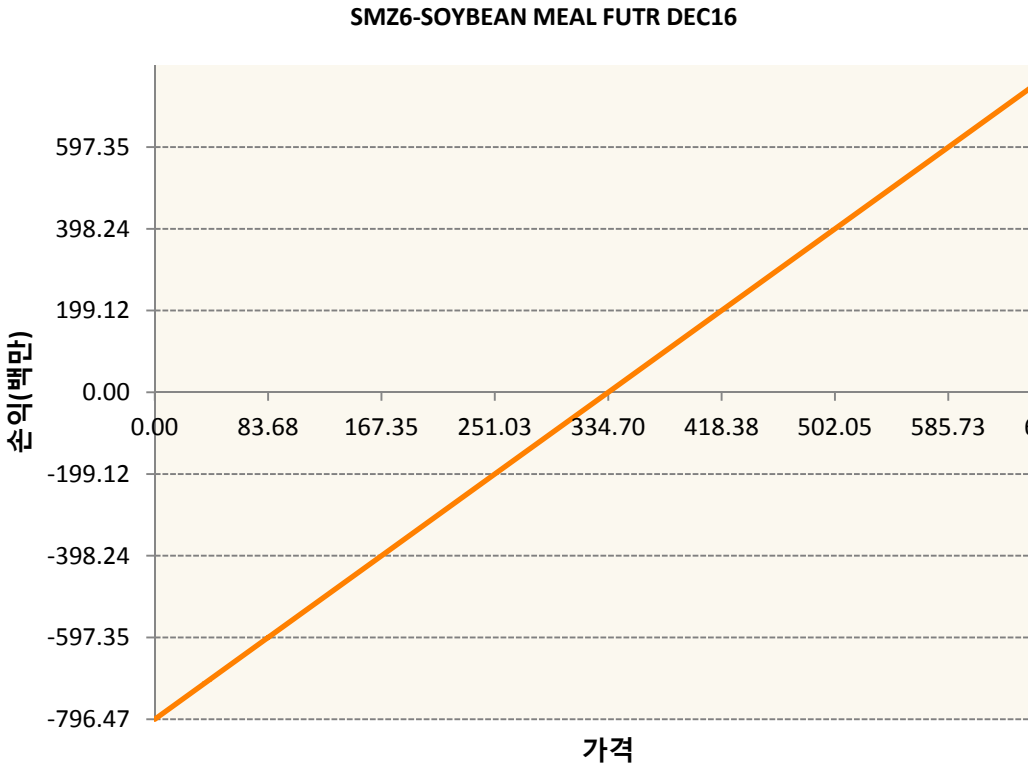

CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,672.97
1,254.73
836.49
418.24
0.00
-418.24
-836.49
-1,254.73
-1,672.97
0.00
84.25
168.50
252.75
337.00
421.25
505.50
589.75
순익(백만)
가격

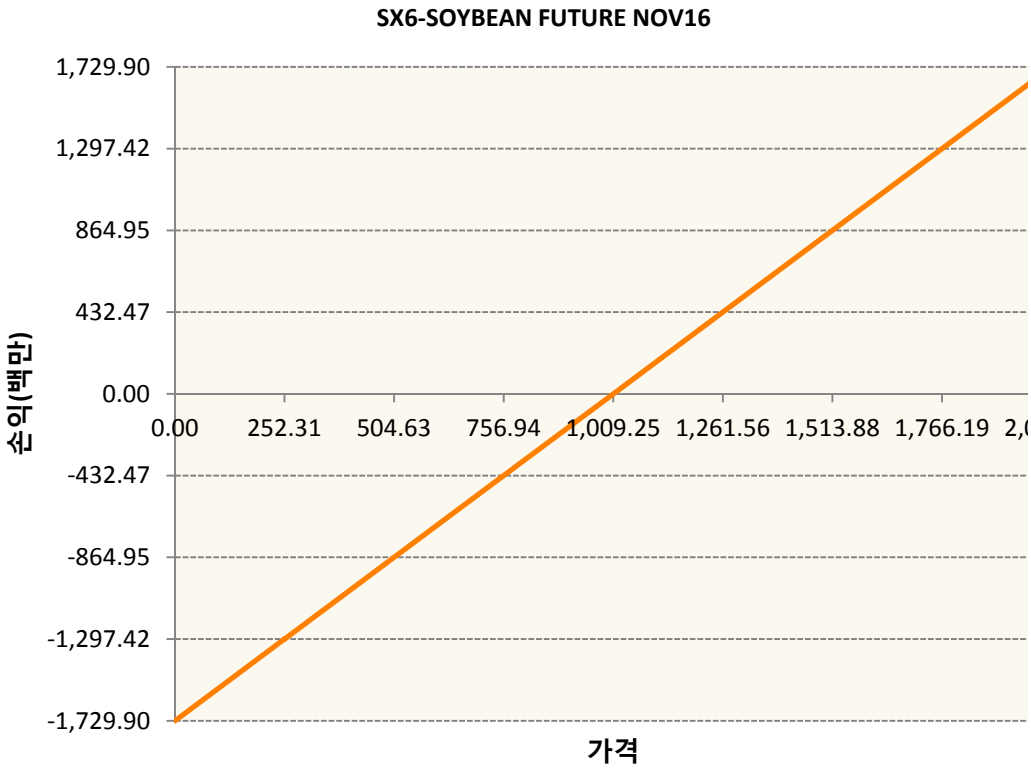

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
523.39
348.93
174.46
0.00
-174.46
-348.93
-523.39
-697.85
0.00
35.14
70.28
105.41
140.55
175.69
210.83
245.96
순익(백만)

가격

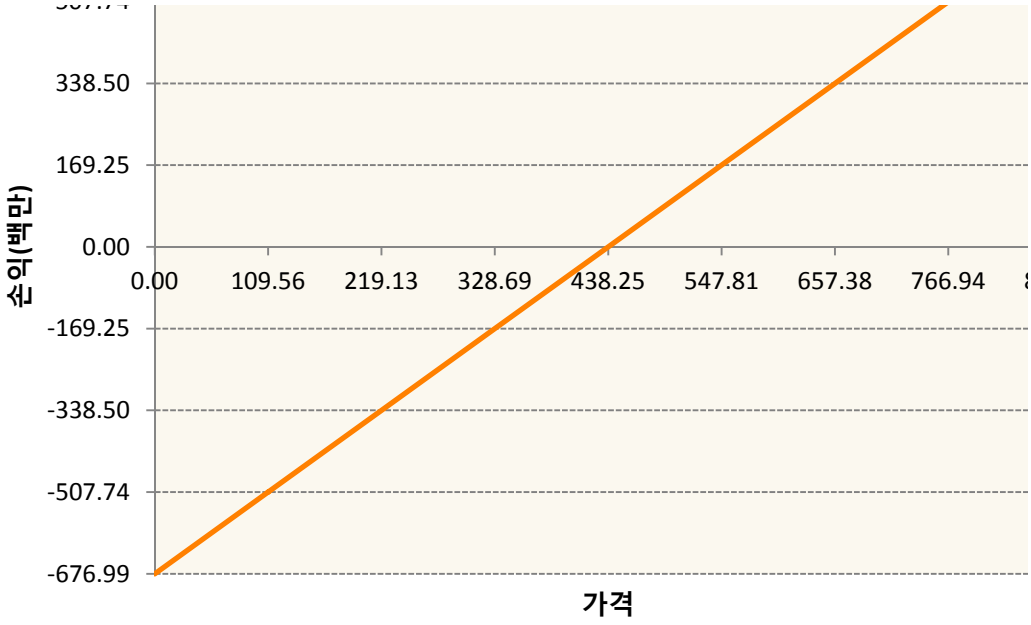

KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16
217.34
163.00
108.67
54.33
0.00
-54.33
-108.67
-163.00
-217.34
0.00
109.44
218.88
328.31
437.75
547.19
656.63
766.06
손익(백만)
가격


SBV6-SUGAR #11 (WORLD) OCT16
1,232.23
924.17
616.11
308.06
0.00
-308.06
-616.11
-924.17
-1,232.23
0.00
5.00
9.99
14.99
19.98
24.98
29.97
34.97
손익(백만)
가격


SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16
597.35
398.24
199.12
0.00
-199.12
-398.24
-597.35
-796.47
0.00
83.68
167.35
251.03
334.70
418.38
502.05
585.73
손익(백만)
가격


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16
1,729.90
1,297.42
864.95
432.47
0.00
-432.47
-864.95
-1,297.42
-1,729.90
0.00
252.31
504.63
756.94
1,009.25
1,261.56
1,513.88
1,766.19
손익(백만)
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
676.99
507.74



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ6	SOYBEAN OIL FUTR DEC16	64
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	35
CZ6	CORN FUTURE DEC16	134
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	56
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	17
SBV6	SUGAR #11 (WORLD) OCT16	99
SMZ6	SOYBEAN MEAL FUTR DEC16	64
SX6	SOYBEAN FUTURE NOV16	138
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	54

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

859