공시일	2016-08-19
기준일	2016-08-18

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	2016-08-19
기준일	2016-08-18

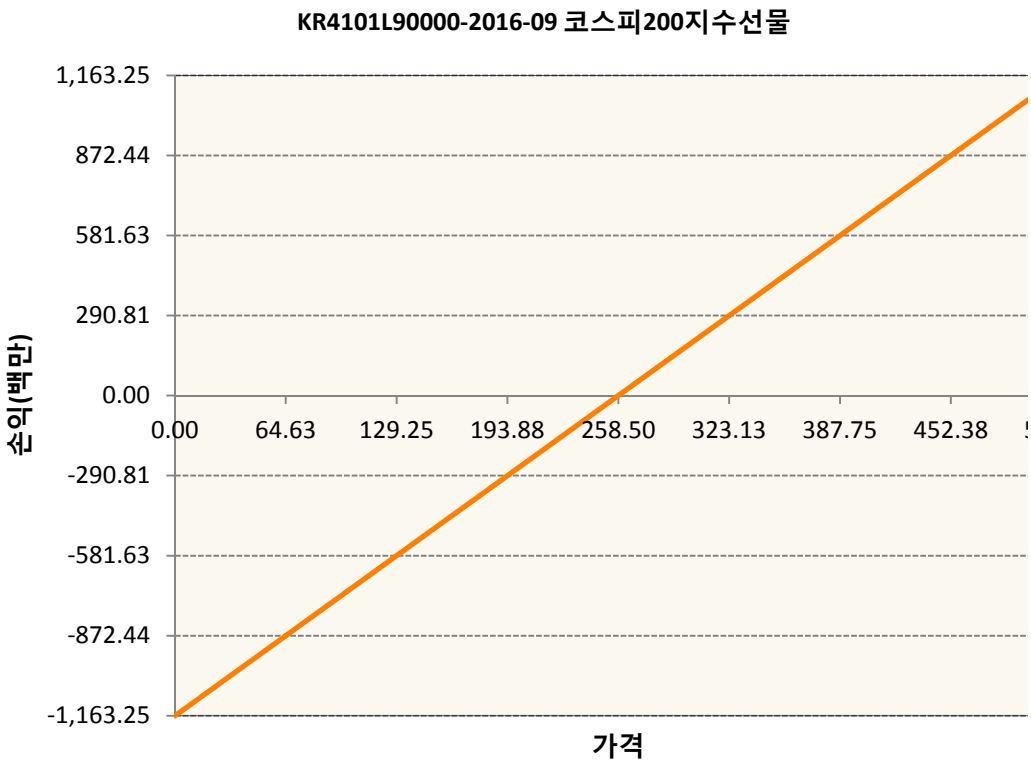
스마트인덱스모

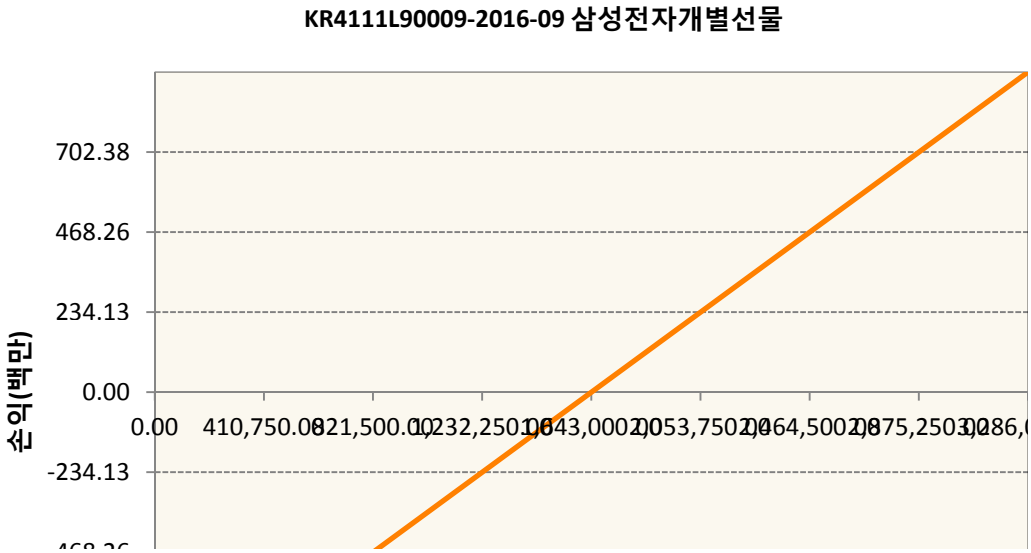
1. 계약금액

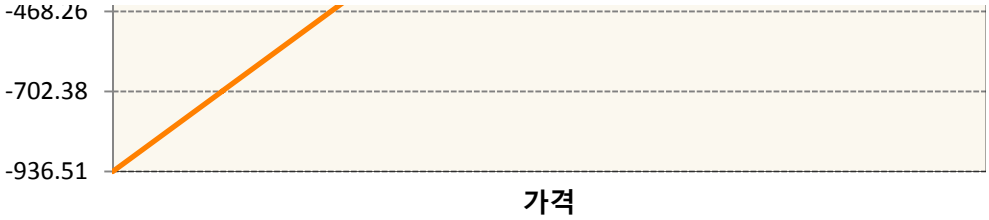
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,100	0	2,100	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						93
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
-5.33%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
-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%	62	62	62	62	62	62	62
8.00%	93	93	93	93	93	93	93
KR4111L900	2016-09 삼성전자개별선물						75
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-5.33%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
-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%	50	50	50	50	50	50	50
8.00%	75	75	75	75	75	75	75

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

156

공시일	2016-08-19
기준일	2016-08-18

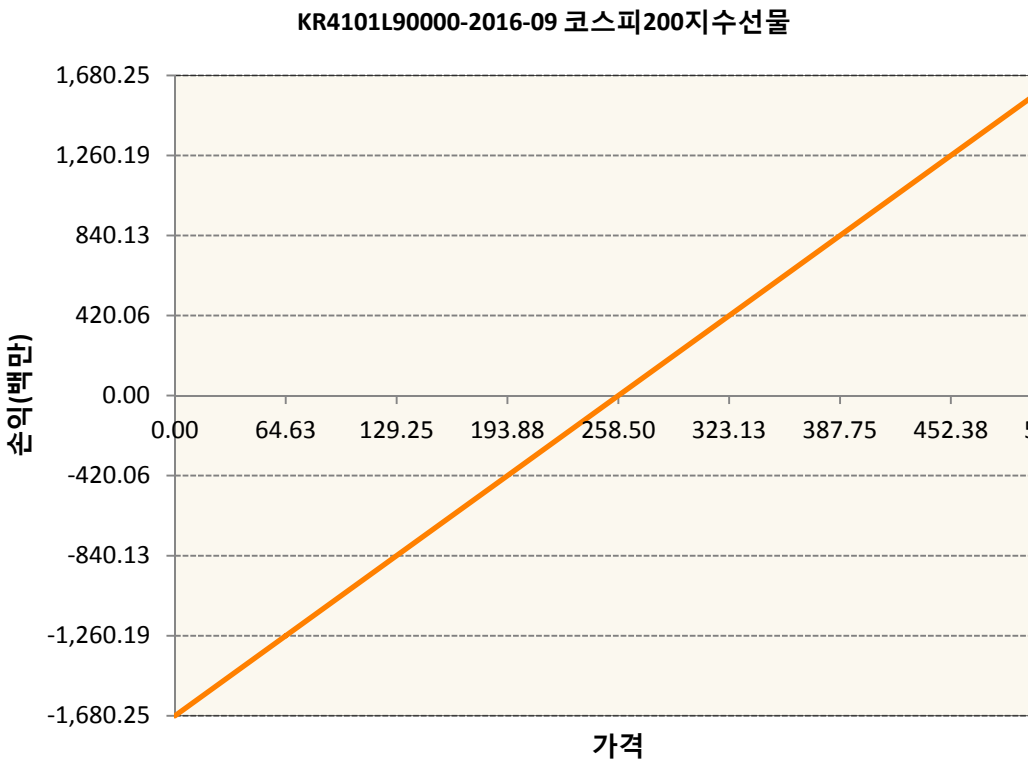
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,680	0	1,680	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						134
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-134	-134	-134	-134	-134	-134	-134
-5.33%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-2.67%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	45	45	45	45	45	45	45
5.33%	89	89	89	89	89	89	89
8.00%	134	134	134	134	134	134	134

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

111

공시일	2016-08-19
기준일	2016-08-18

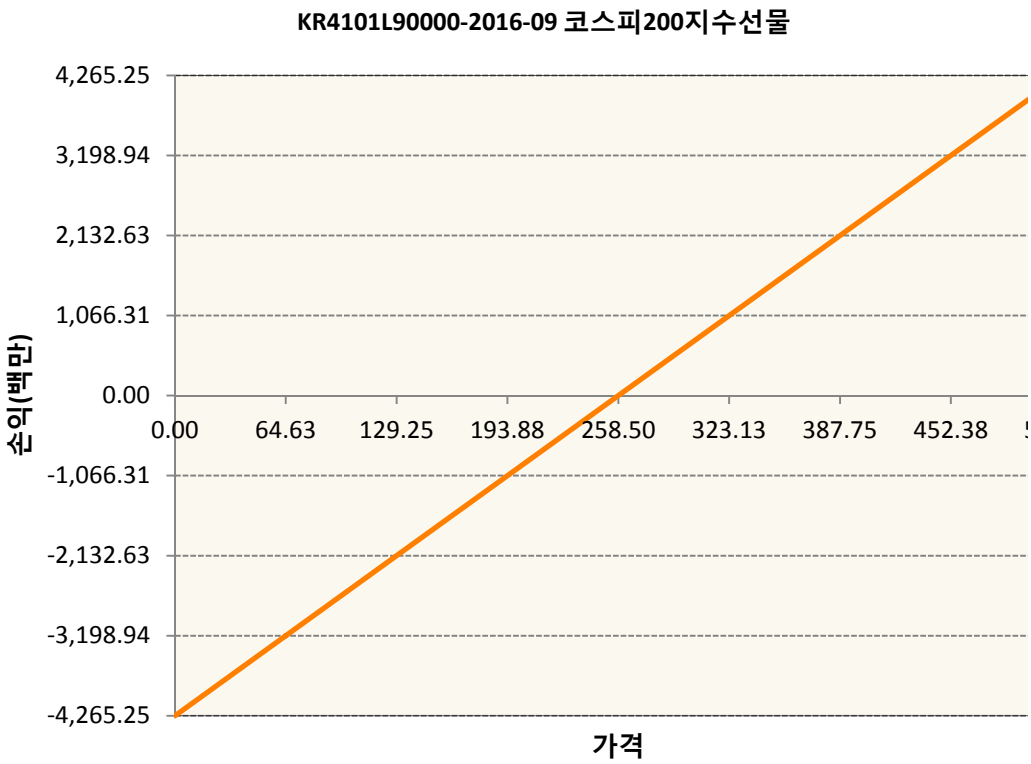
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	4,265	0	4,265	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						341
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-341	-341	-341	-341	-341	-341	-341
-5.33%	-227	-227	-227	-227	-227	-227	-227
-2.67%	-114	-114	-114	-114	-114	-114	-114
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	114	114	114	114	114	114	114
5.33%	227	227	227	227	227	227	227
8.00%	341	341	341	341	341	341	341

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

281

공시일	2016-08-19
기준일	2016-08-18

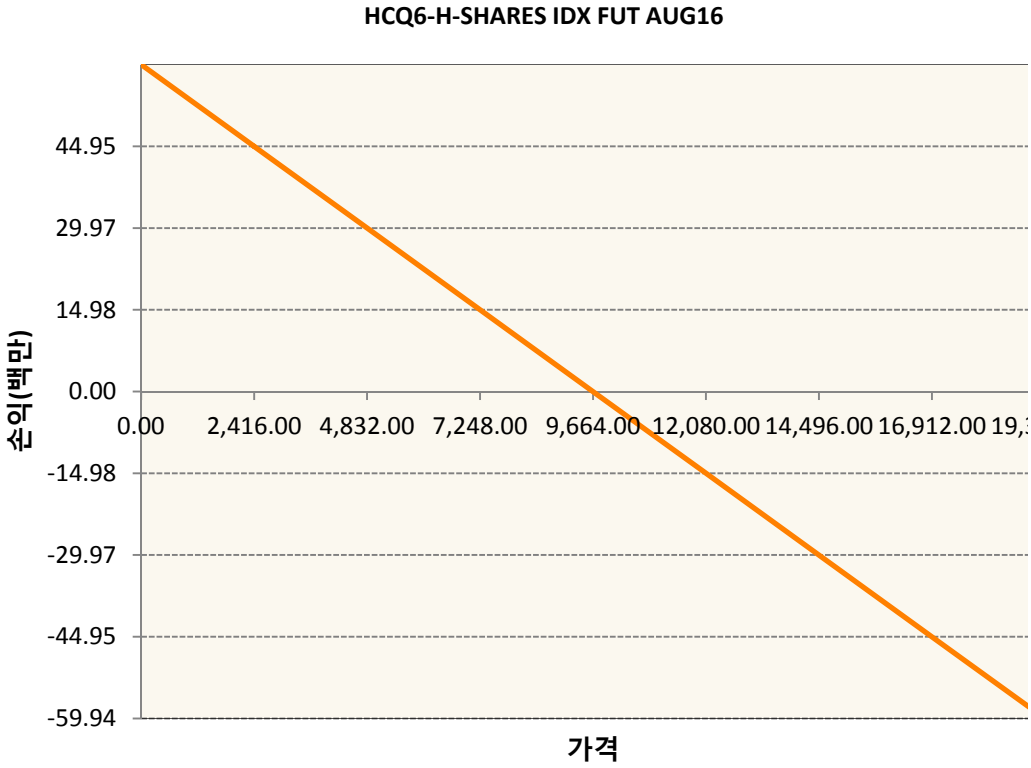
아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

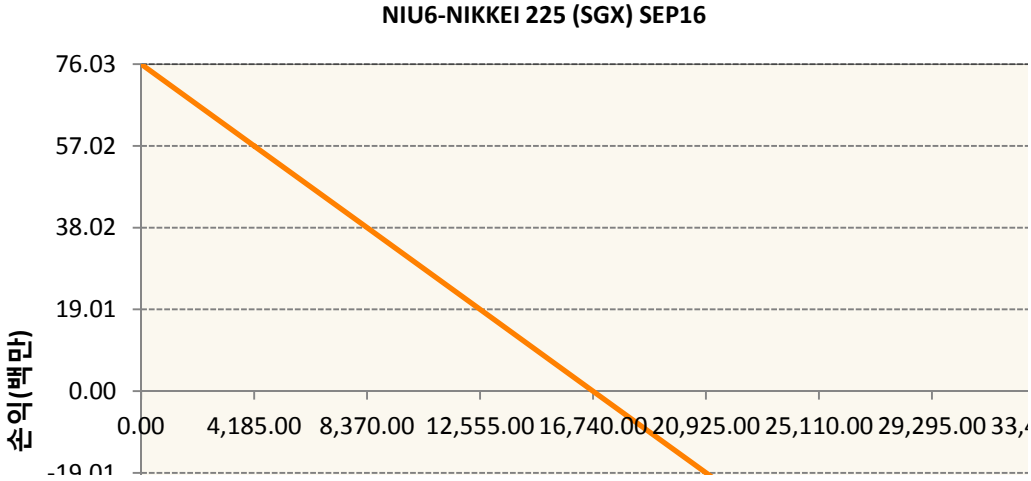
1. 계약금액

(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	2016-08-19
기준일	2016-08-18

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	888

* 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	2016-08-19
기준일	2016-08-18

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	410

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

999

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-08-19
기준일	2016-08-18

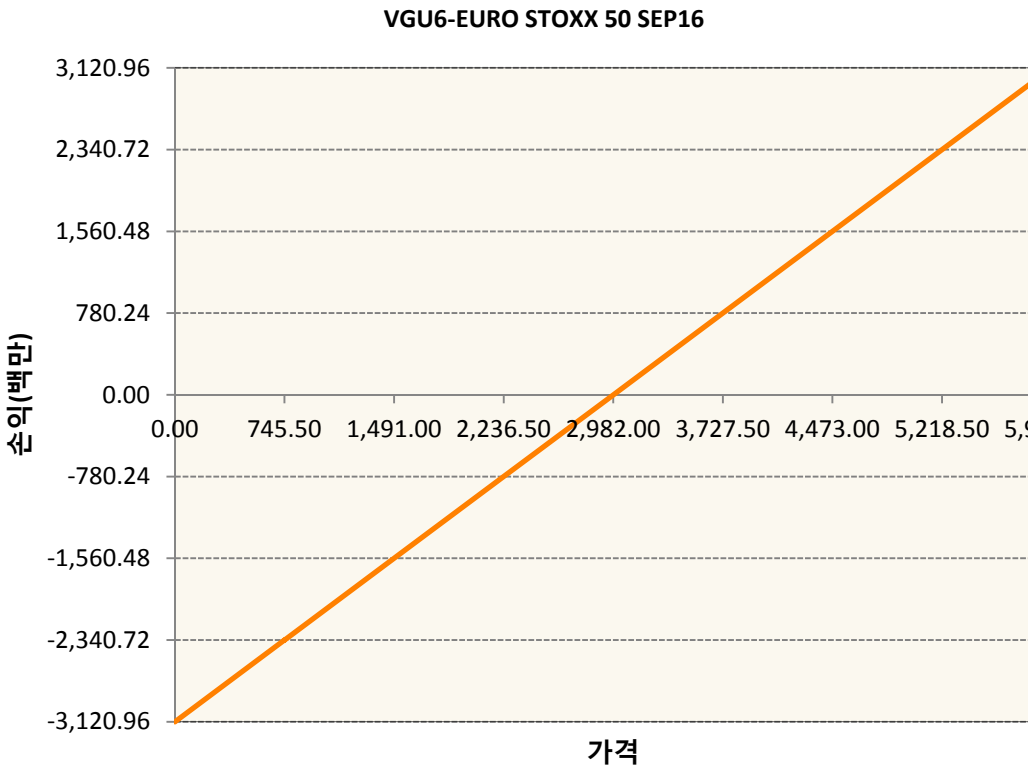
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,121	0	3,121	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 SEP16	250

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

(단위:백만원)

308

공시일	2016-08-19
기준일	2016-08-18

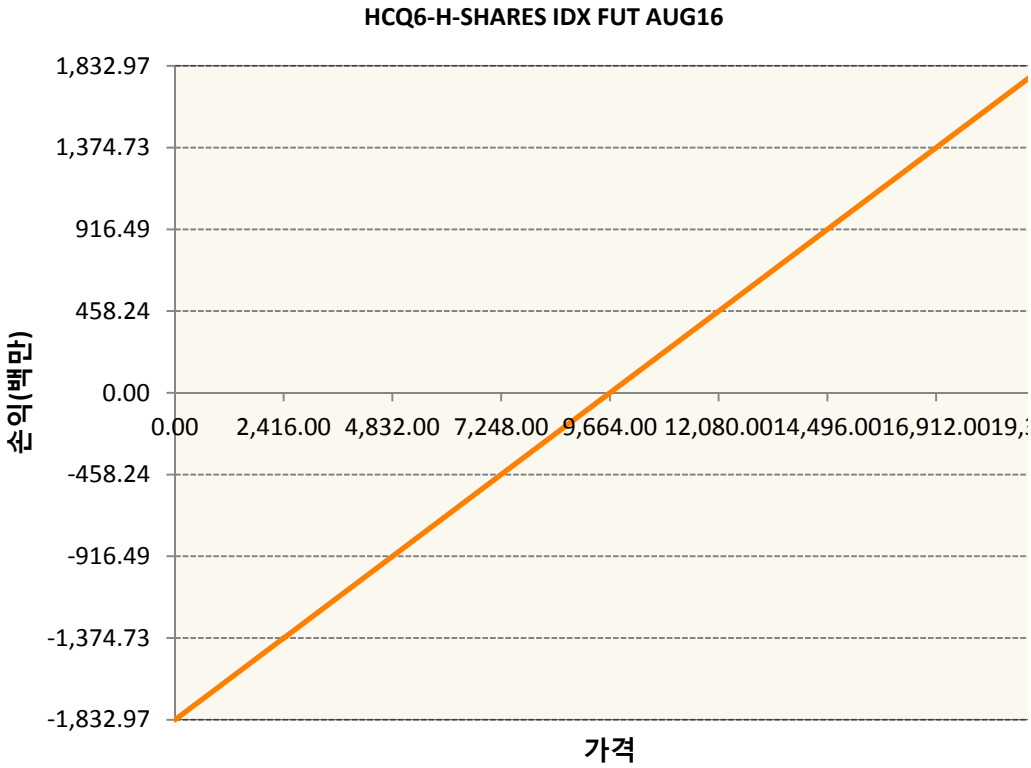
차이나인덱스모(주식-파생형)

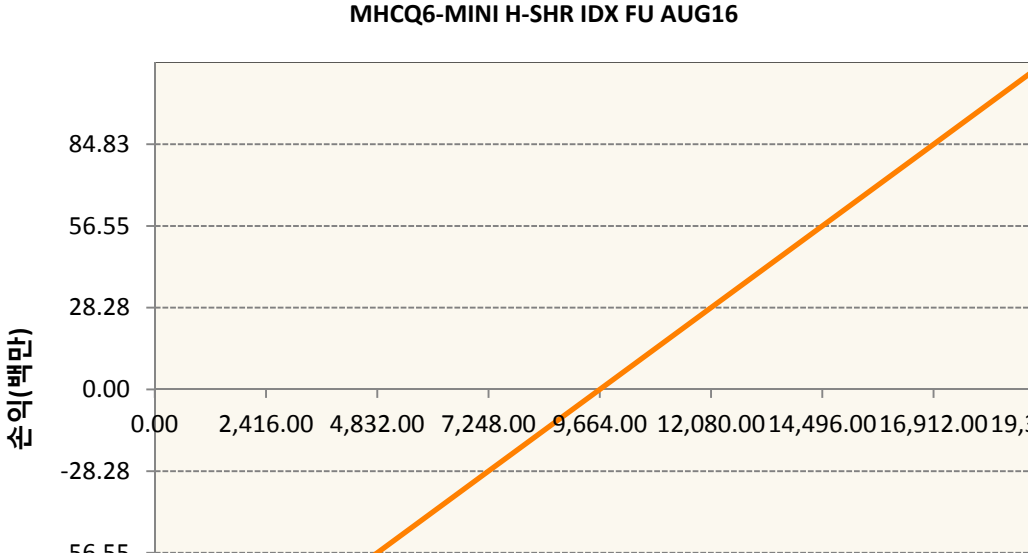
1. 계약금액

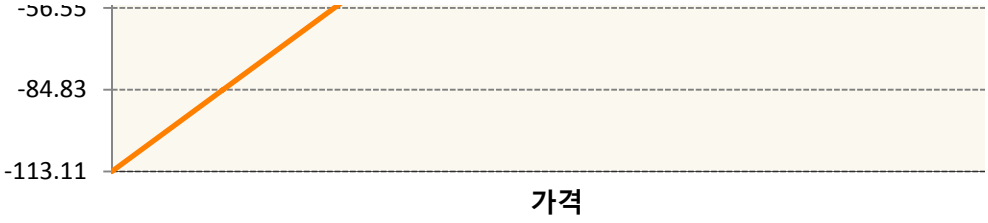
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,946	0	1,946	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ6	H-SHARES IDX FUT AUG16	147
MHCQ6	MINI H-SHR IDX FU AUG16	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	219

공시일	2016-08-19
기준일	2016-08-18

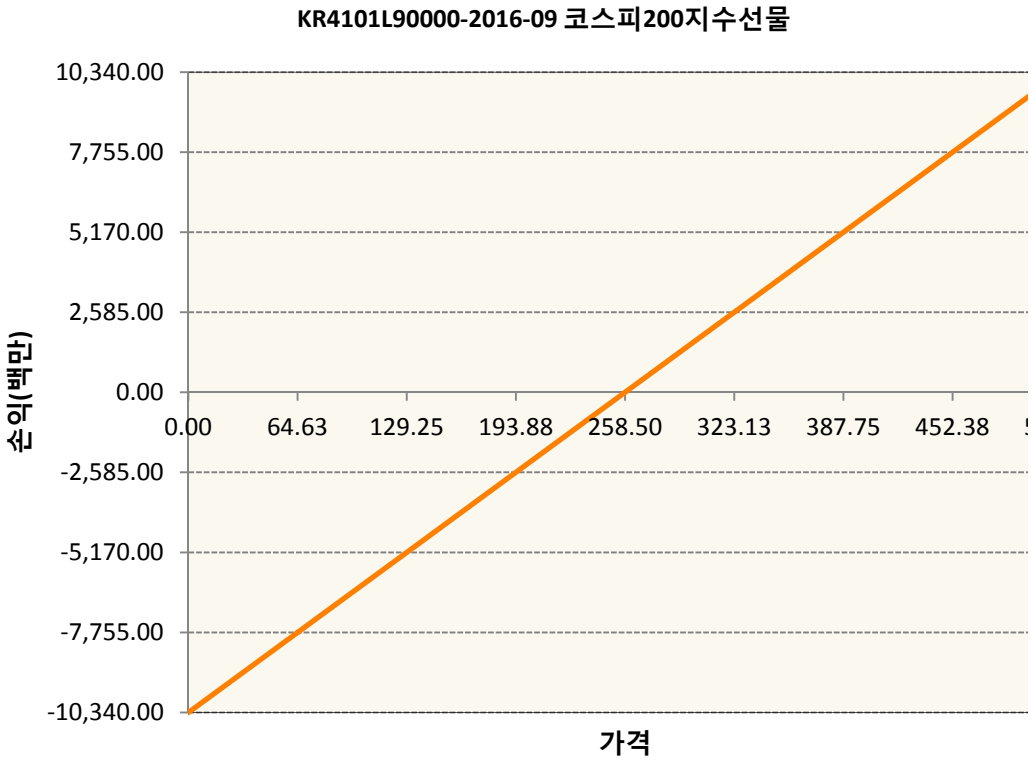
커버드콜(주식혼합-파생형)

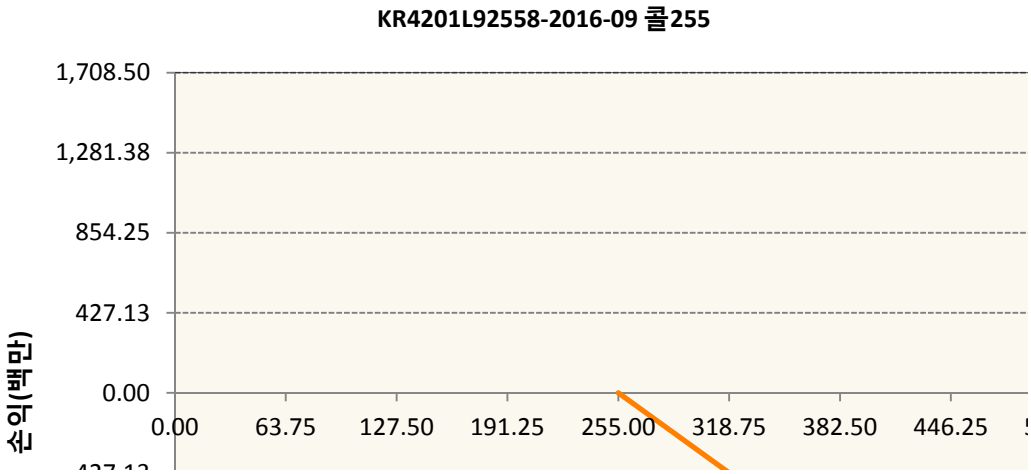
1. 계약금액

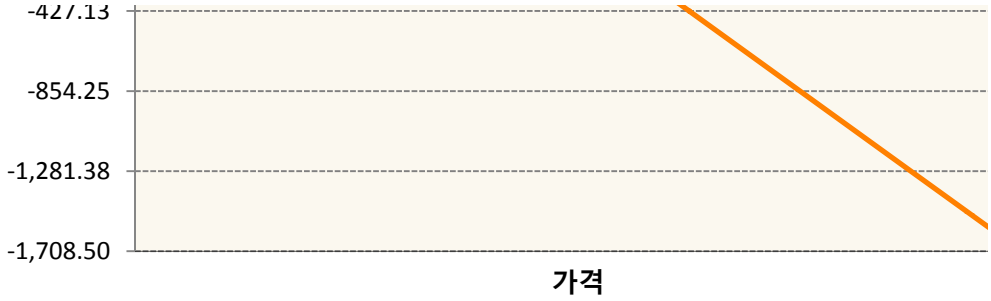
(단위:백만원)

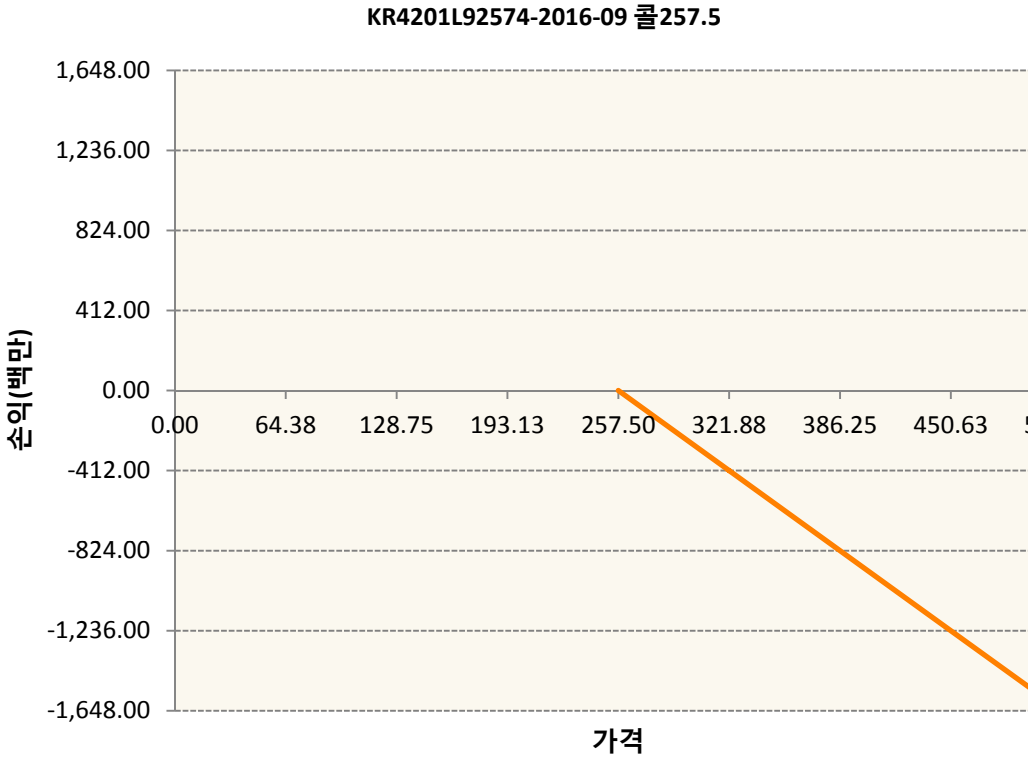
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,340	0	10,340	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,357	-3,357	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101L900 2016-09 코스피200지수선물							826
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-826	-826	-826	-826	-826	-826	-826
-5.33%	-551	-551	-551	-551	-551	-551	-551
-2.67%	-275	-275	-275	-275	-275	-275	-275
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	275	275	275	275	275	275	275
5.33%	551	551	551	551	551	551	551
8.00%	826	826	826	826	826	826	826
KR4201L925 2016-09 콜255							641
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	153	153	153	153	153	152	151
-5.33%	152	151	150	148	145	142	139
-2.67%	130	124	118	111	105	98	91
0%	21	14	7	0	-7	-14	-22
2.67%	-182	-183	-185	-188	-191	-195	-199
5.33%	-410	-410	-410	-411	-411	-412	-413
8.00%	-640	-640	-640	-640	-640	-640	-641
KR4201L925 2016-09 콜257.5							580

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	99	99	99	99	99	98	98
-5.33%	99	98	98	97	95	94	92
-2.67%	90	86	82	77	72	67	61
0%	22	15	7	0	-7	-15	-22
2.67%	-145	-149	-152	-156	-161	-166	-171
5.33%	-359	-360	-360	-361	-362	-364	-366
8.00%	-579	-579	-579	-579	-579	-580	-580

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

2,166

공시일	2016-08-19
기준일	2016-08-18

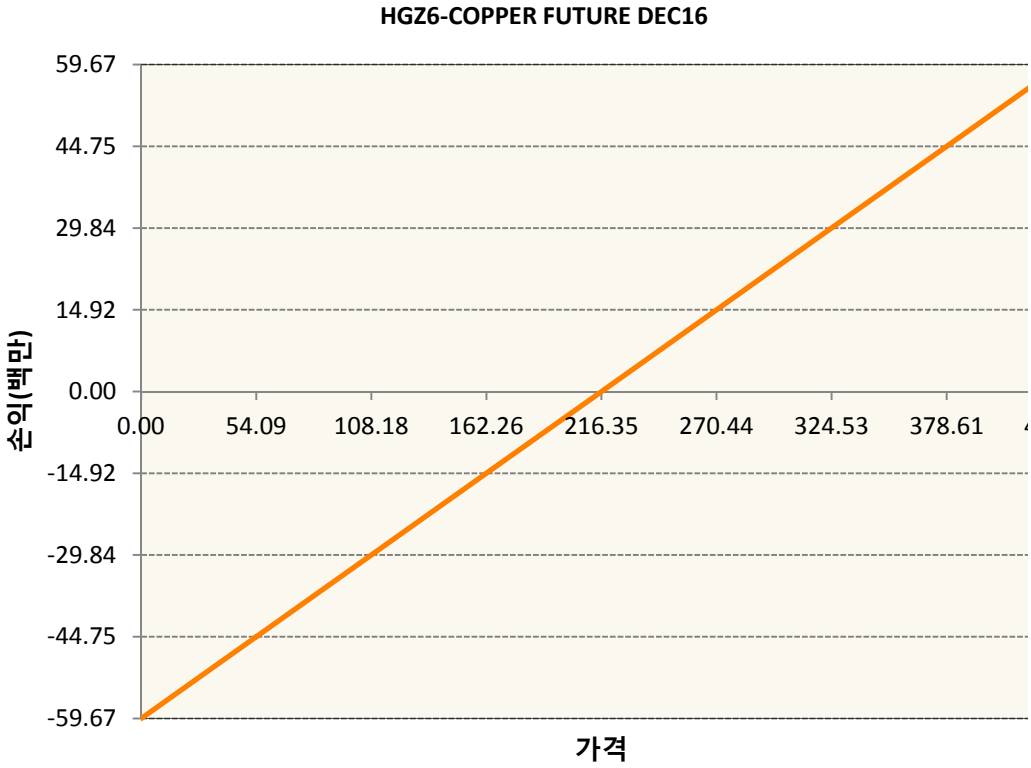
메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

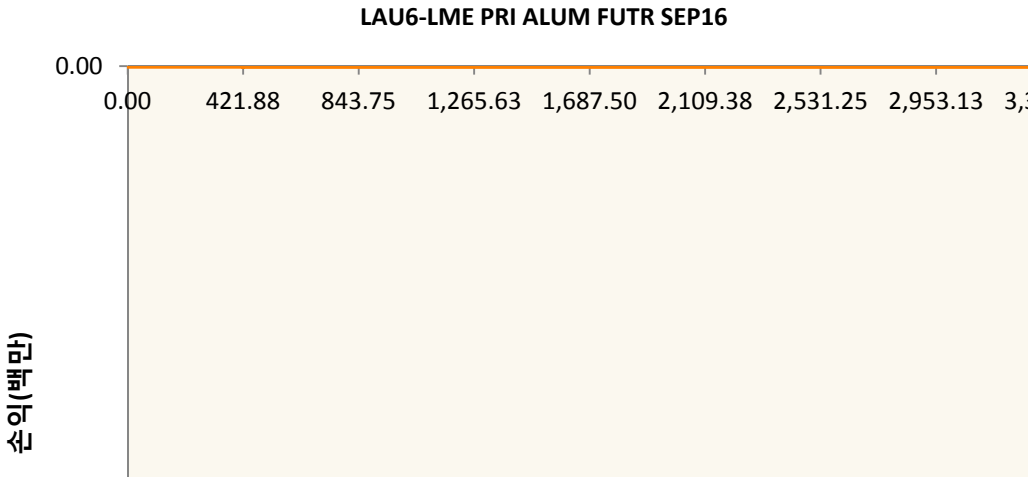
1. 계약금액

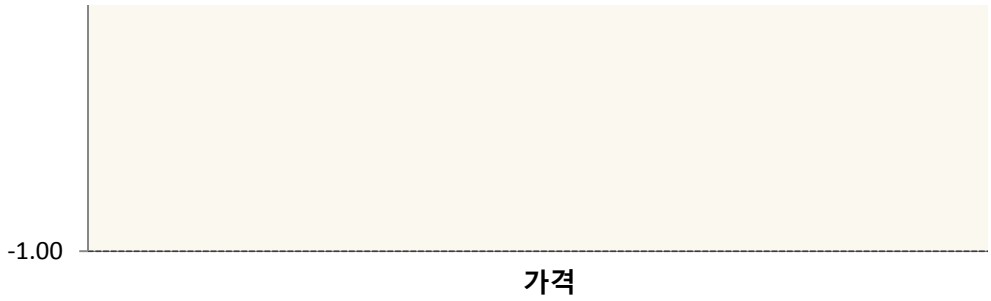
(단위:백만원)

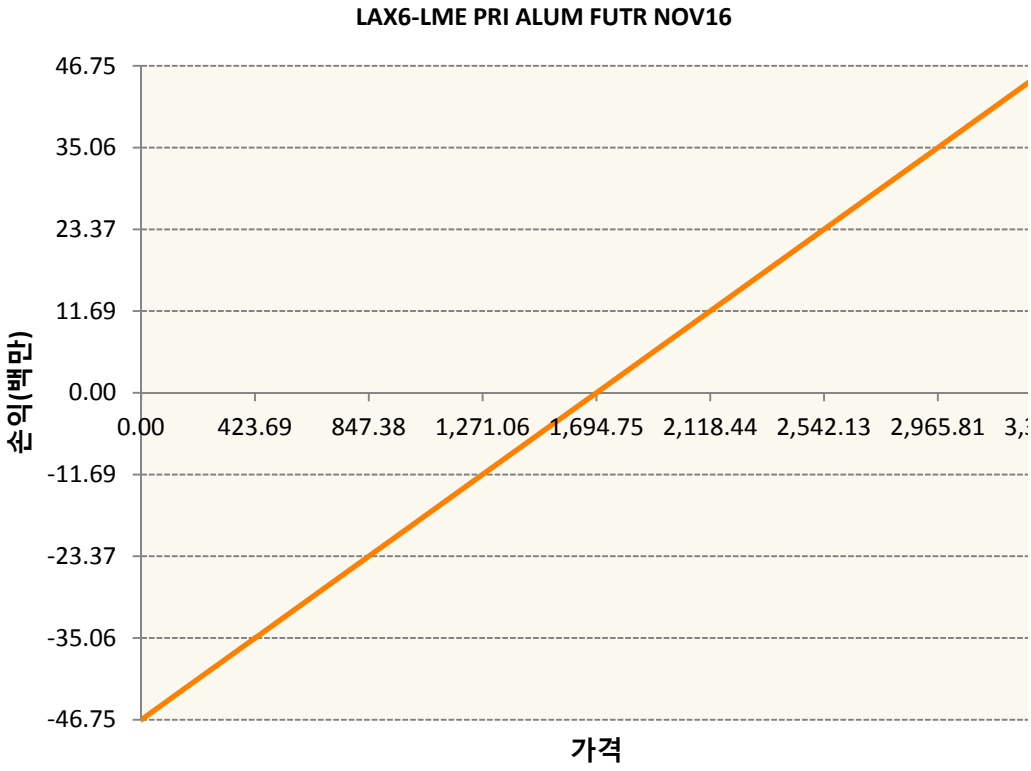
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	44	0	44	
누계	유가증권	선물	433	107	326	

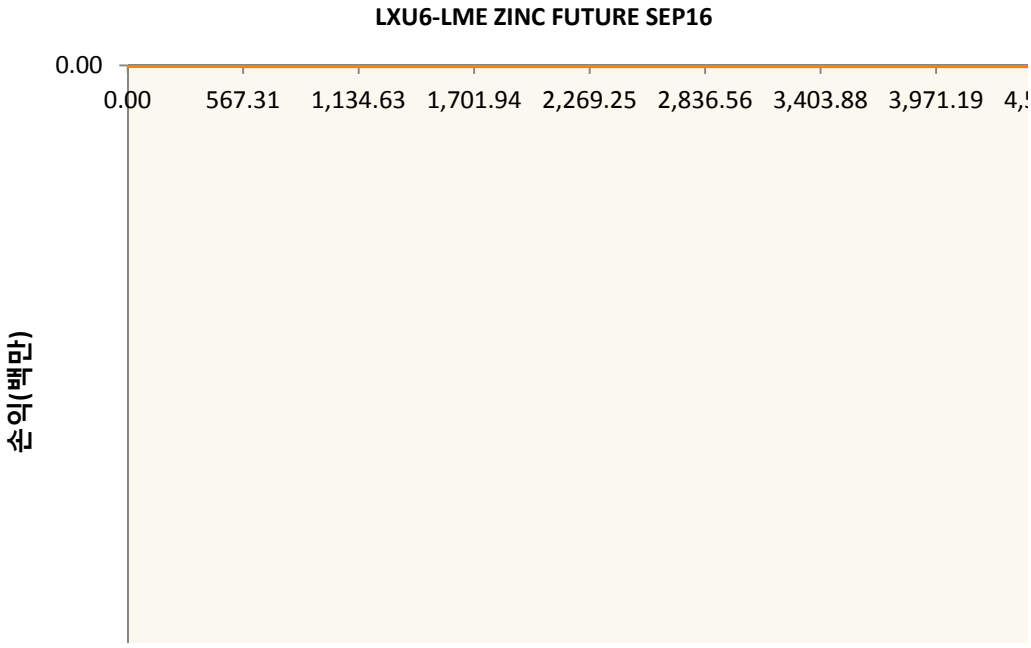
2. 만기시점의 손익구조

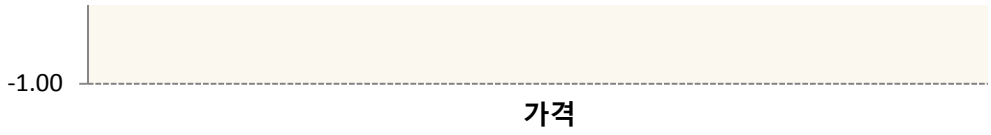


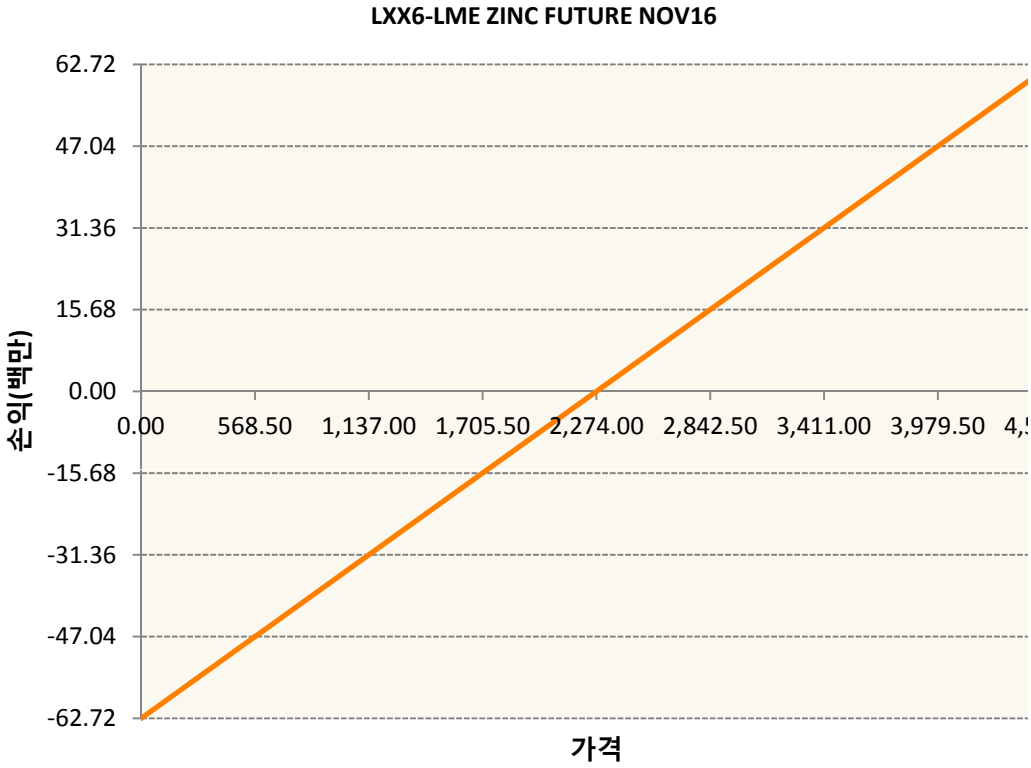


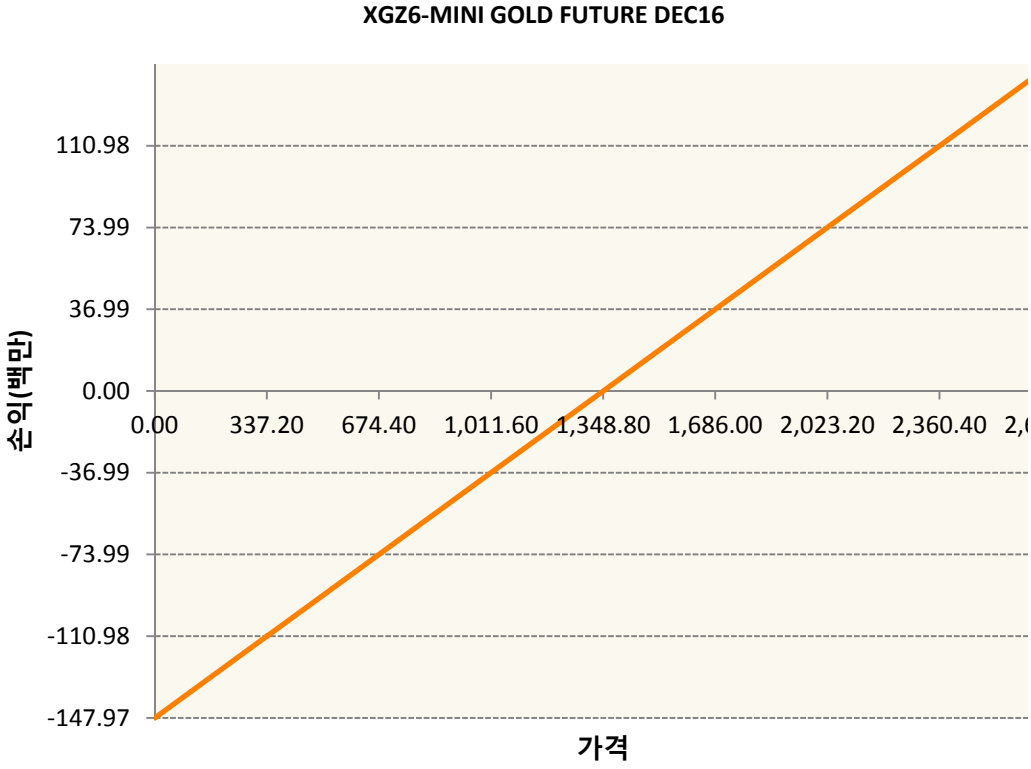

-1.00
가격

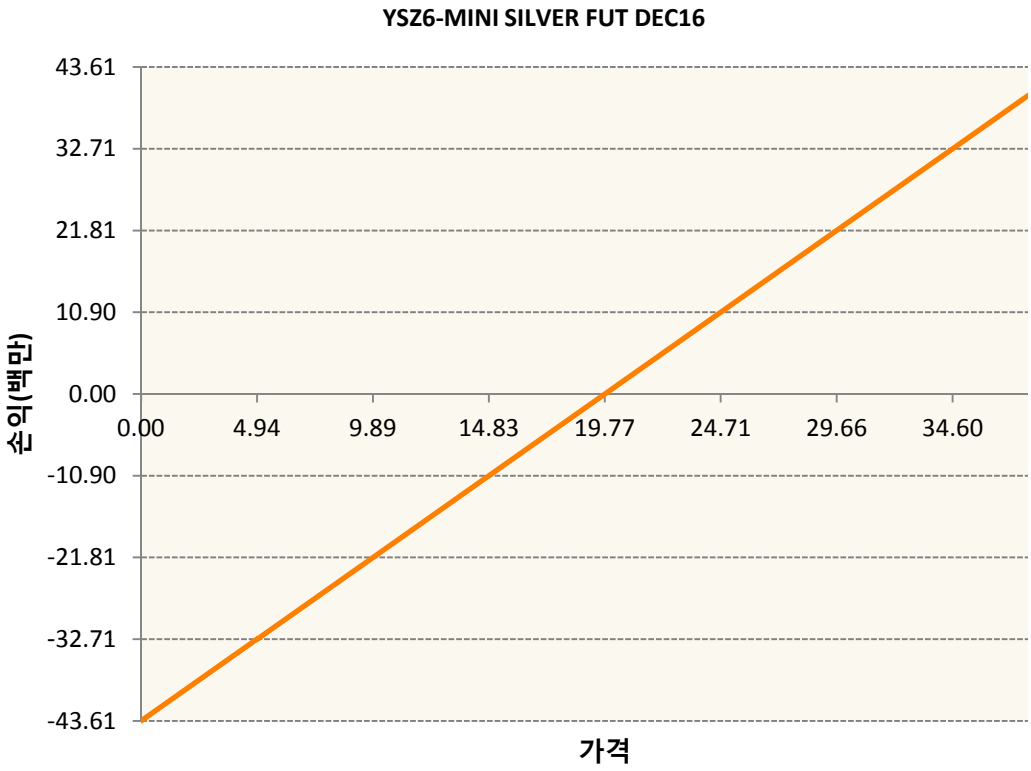

LAX6-LME PRI ALUM FUTR NOV16
46.75
35.06
23.37
11.69
0.00
-11.69
-23.37
-35.06
-46.75
0.00
423.69
847.38
1,271.06
1,694.75
2,118.44
2,542.13
2,965.81
순익(백만)
가격


LXU6-LME ZINC FUTURE SEP16
0.00
0.00
567.31
1,134.63
1,701.94
2,269.25
2,836.56
3,403.88
3,971.19
순익(백만)


-1.00
가격


LXX6-LME ZINC FUTURE NOV16
62.72
47.04
31.36
15.68
0.00
-15.68
-31.36
-47.04
-62.72
0.00
568.50
1,137.00
1,705.50
2,274.00
2,842.50
3,411.00
3,979.50
순익(백만)
가격


XGZ6-MINI GOLD FUTURE DEC16
110.98
73.99
36.99
0.00
-36.99
-73.99
-110.98
-147.97
0.00
337.20
674.40
1,011.60
1,348.80
1,686.00
2,023.20
2,360.40
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	3

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

공시일	2016-08-19
기준일	2016-08-18

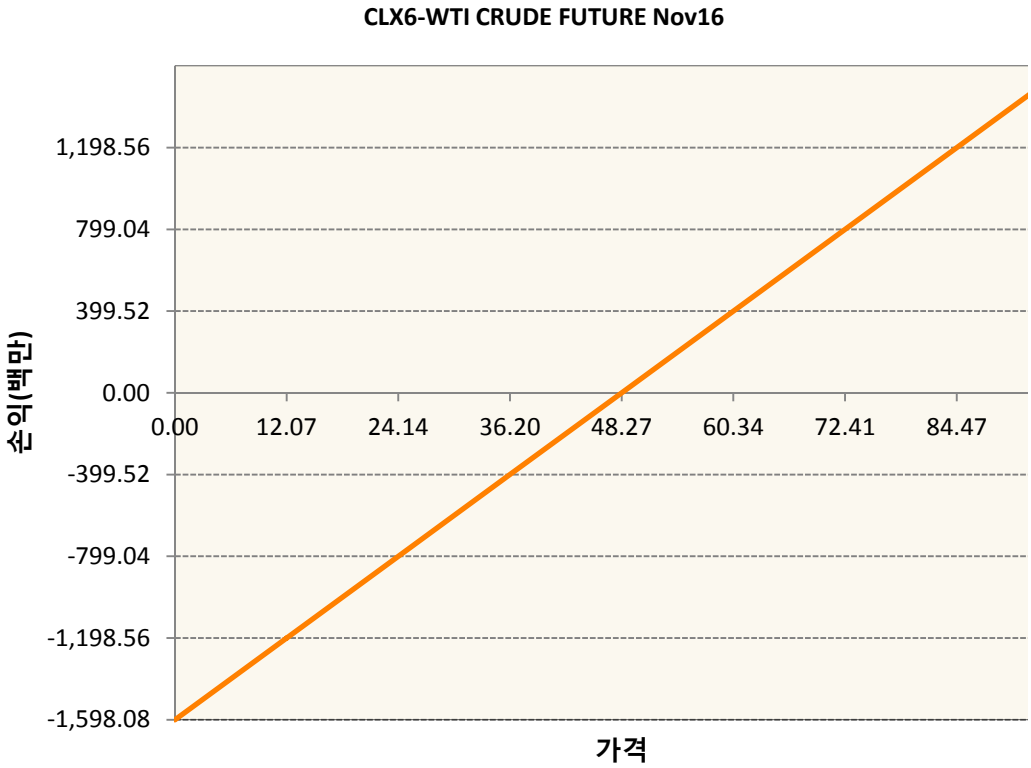
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

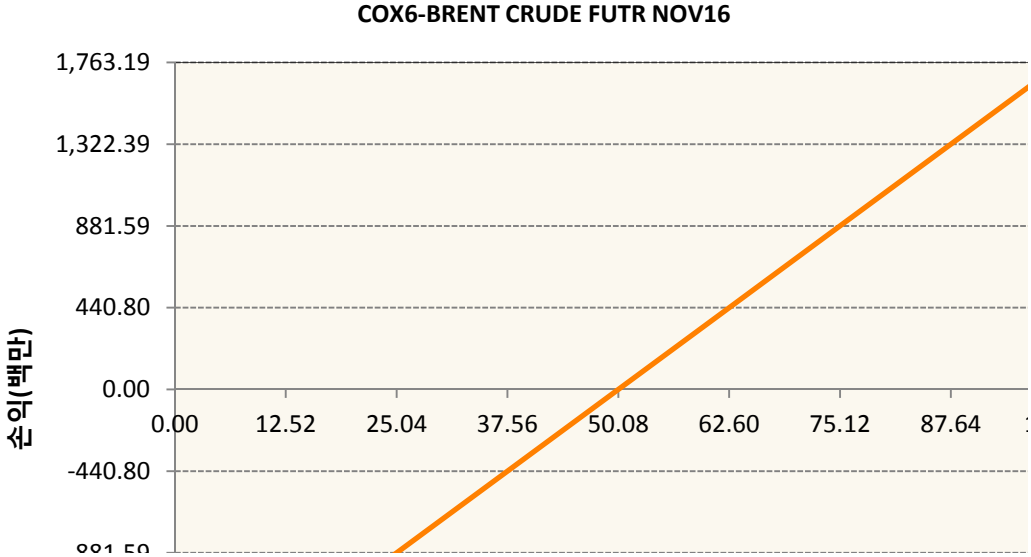
1. 계약금액

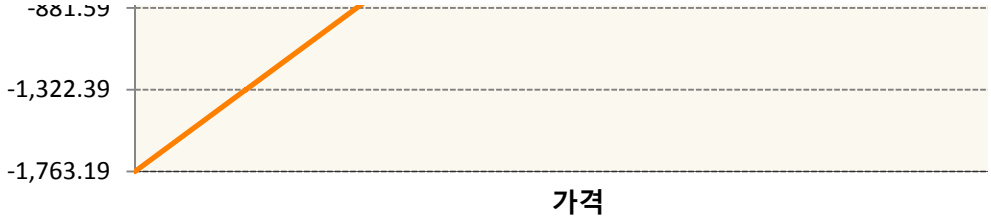
(단위:백만원)

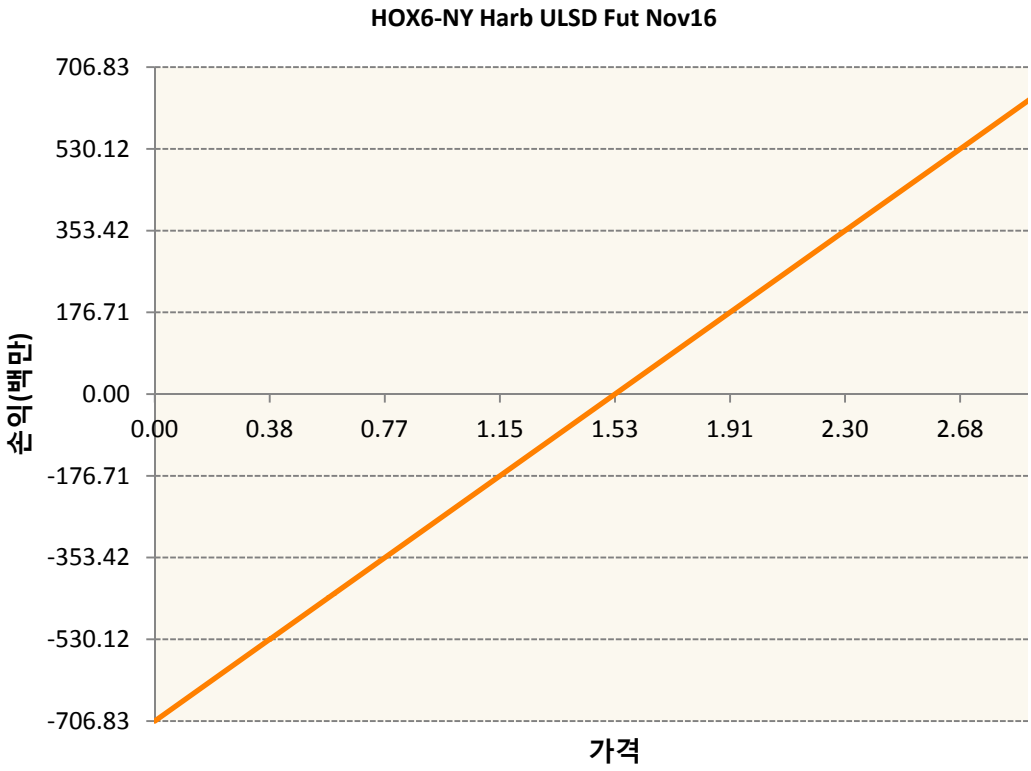
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,270	0	6,270	

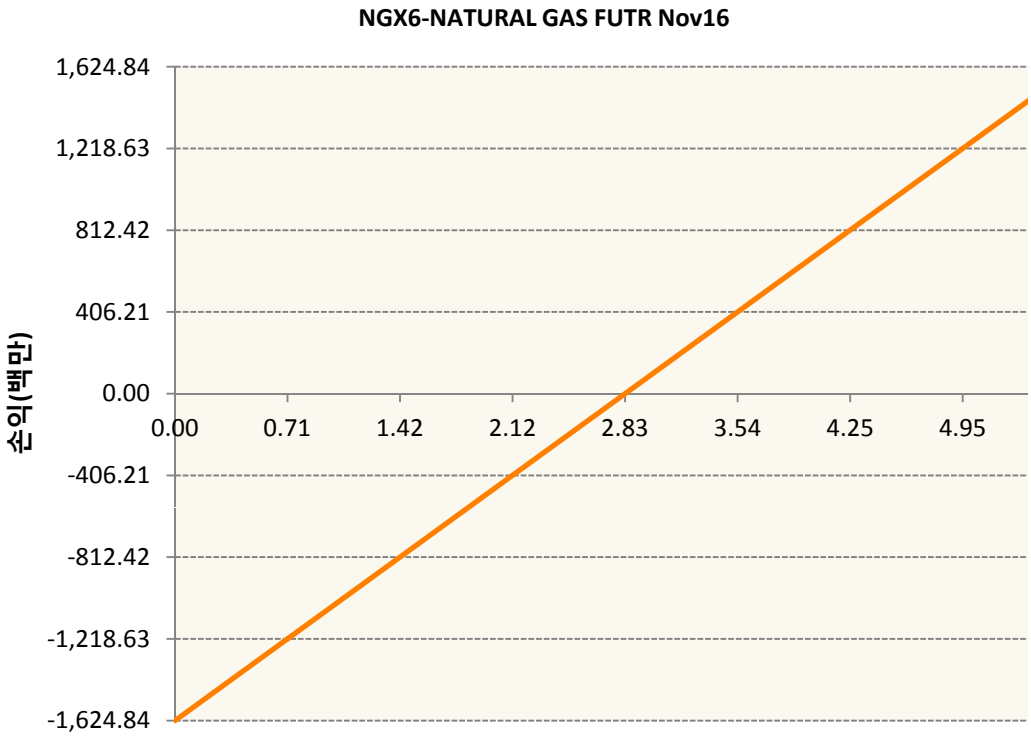
2. 만기시점의 손익구조



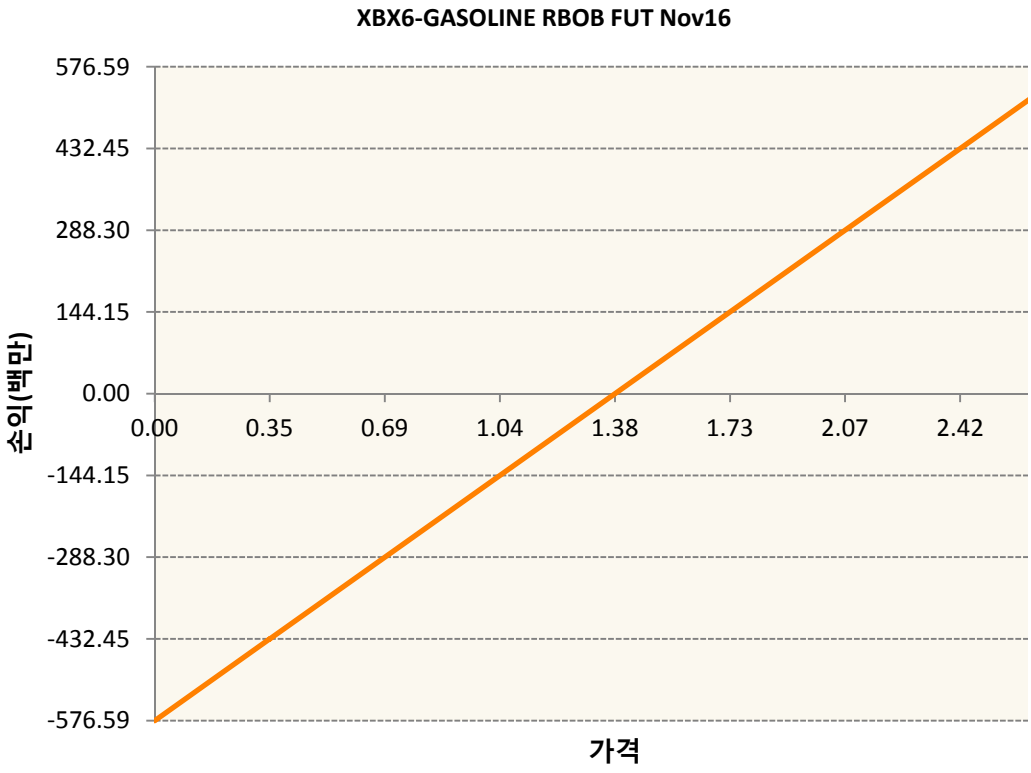



-1,322.39
-1,763.19
가격


HOX6-NY Harb ULSD Fut Nov16
706.83
530.12
353.42
176.71
0.00
-176.71
-353.42
-530.12
-706.83
0.00
0.38
0.77
1.15
1.53
1.91
2.30
2.68
손익(백만)
가격


NGX6-NATURAL GAS FUTR Nov16
1,624.84
1,218.63
812.42
406.21
0.00
-406.21
-812.42
-1,218.63
-1,624.84
0.00
0.71
1.42
2.12
2.83
3.54
4.25
4.95
손익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX6	WTI CRUDE FUTURE Nov16	128
COX6	BRENT CRUDE FUTR NOV16	141
HOX6	NY Harb ULSD Fut Nov16	57
NGX6	NATURAL GAS FUTR Nov16	130
XBX6	GASOLINE RBOB FUT Nov16	46

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,124

공시일	2016-08-19
기준일	2016-08-18

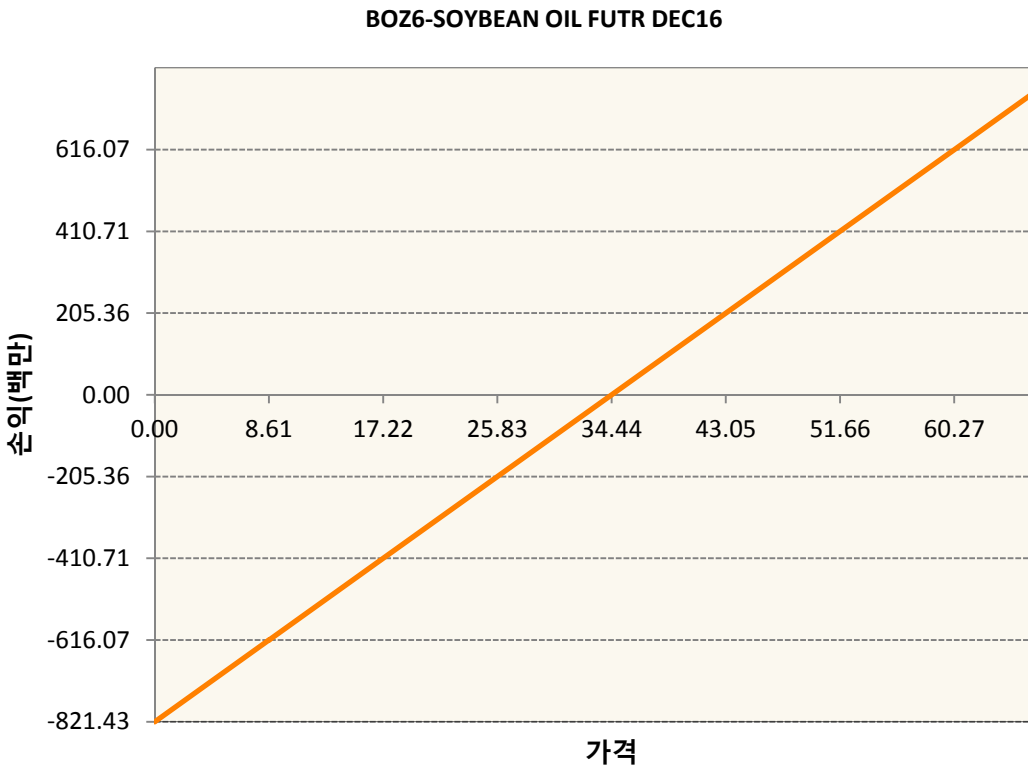
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

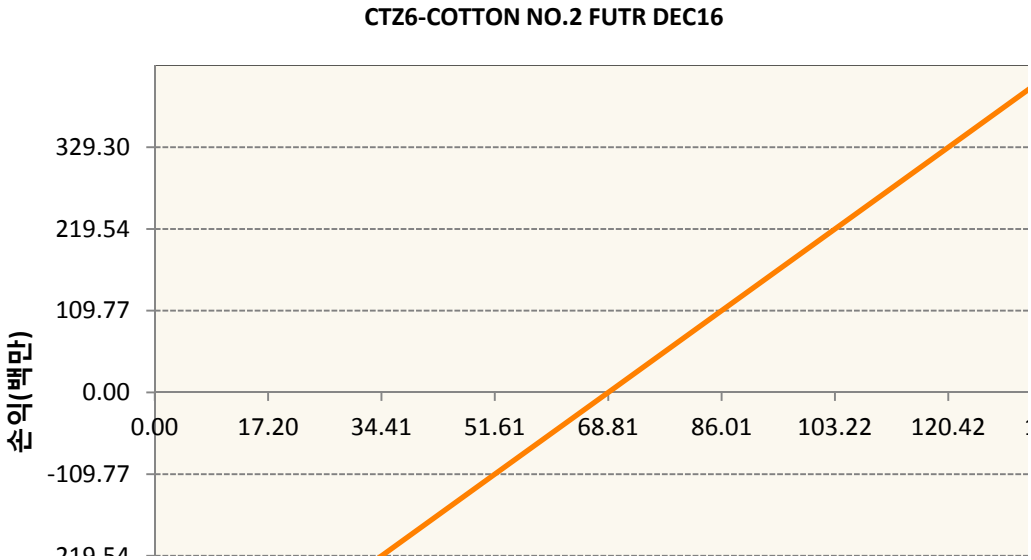
1. 계약금액

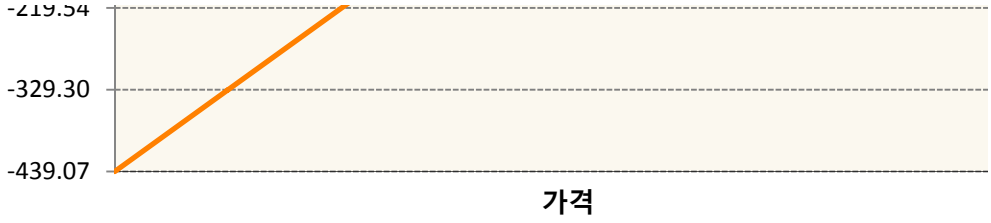
(단위:백만원)

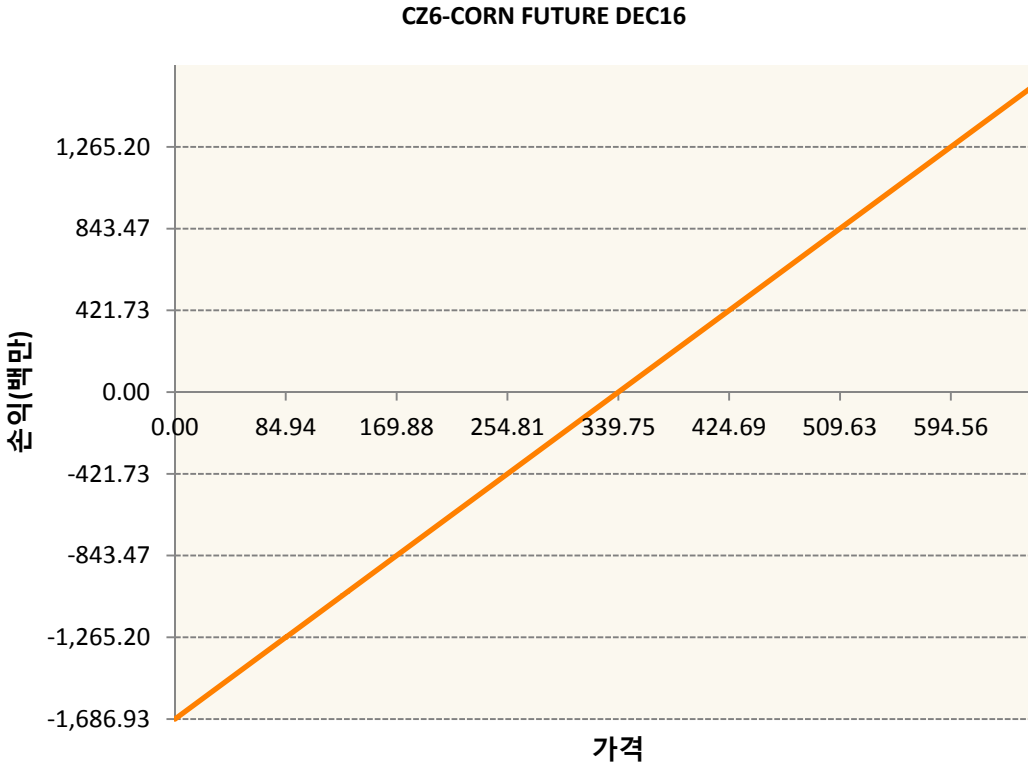
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,282	0	8,282	

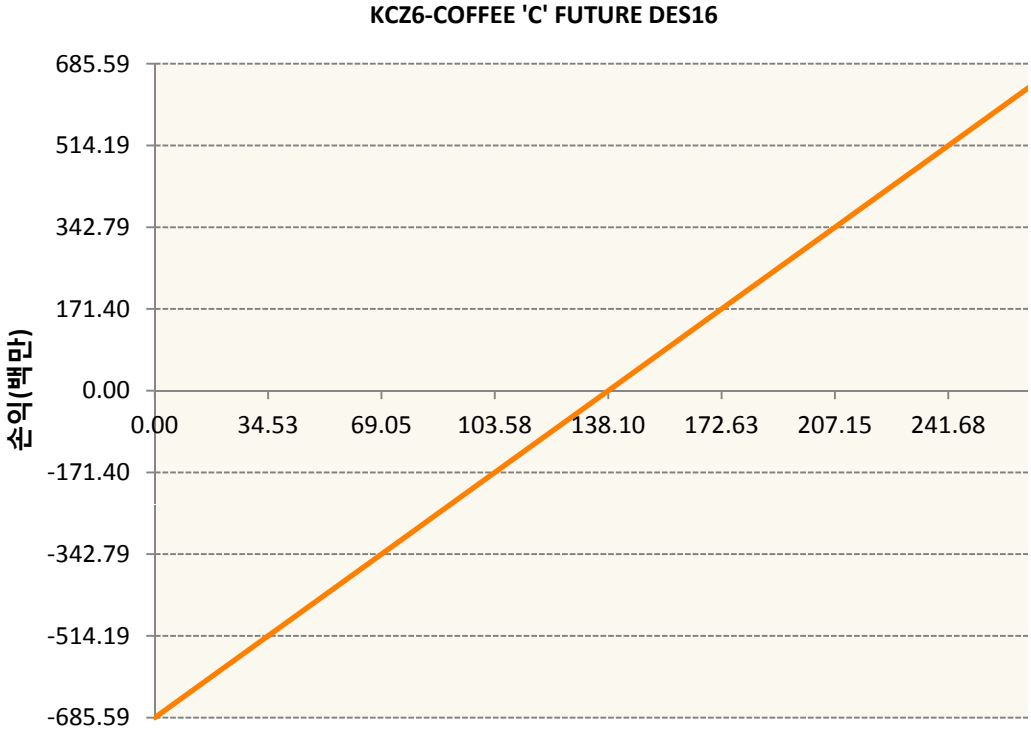
2. 만기시점의 손익구조





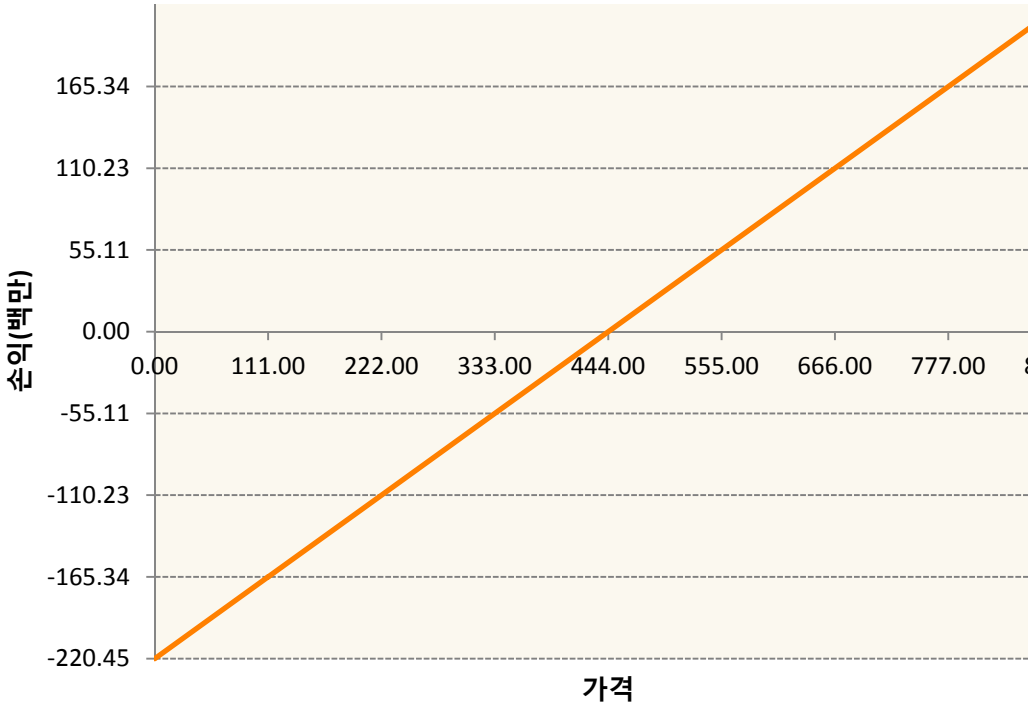

-219.54
-329.30
-439.07
가격


CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,265.20
843.47
421.73
0.00
-421.73
-843.47
-1,265.20
-1,686.93
0.00
84.94
169.88
254.81
339.75
424.69
509.63
594.56
순익(백만)
가격

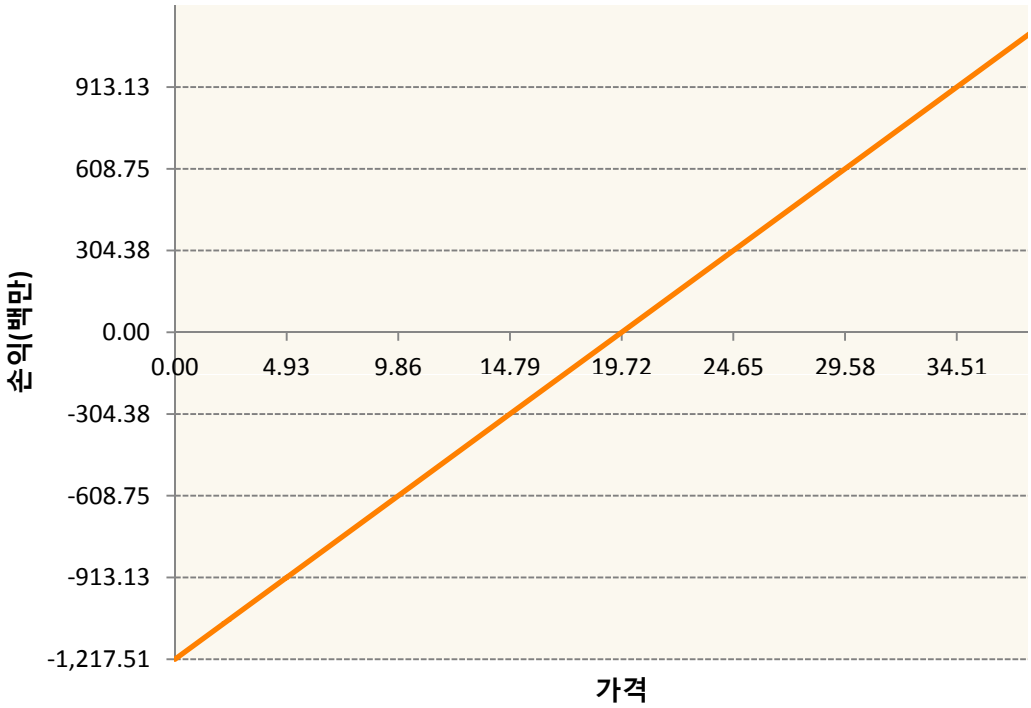

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
685.59
514.19
342.79
171.40
0.00
-171.40
-342.79
-514.19
-685.59
0.00
34.53
69.05
103.58
138.10
172.63
207.15
241.68
순익(백만)

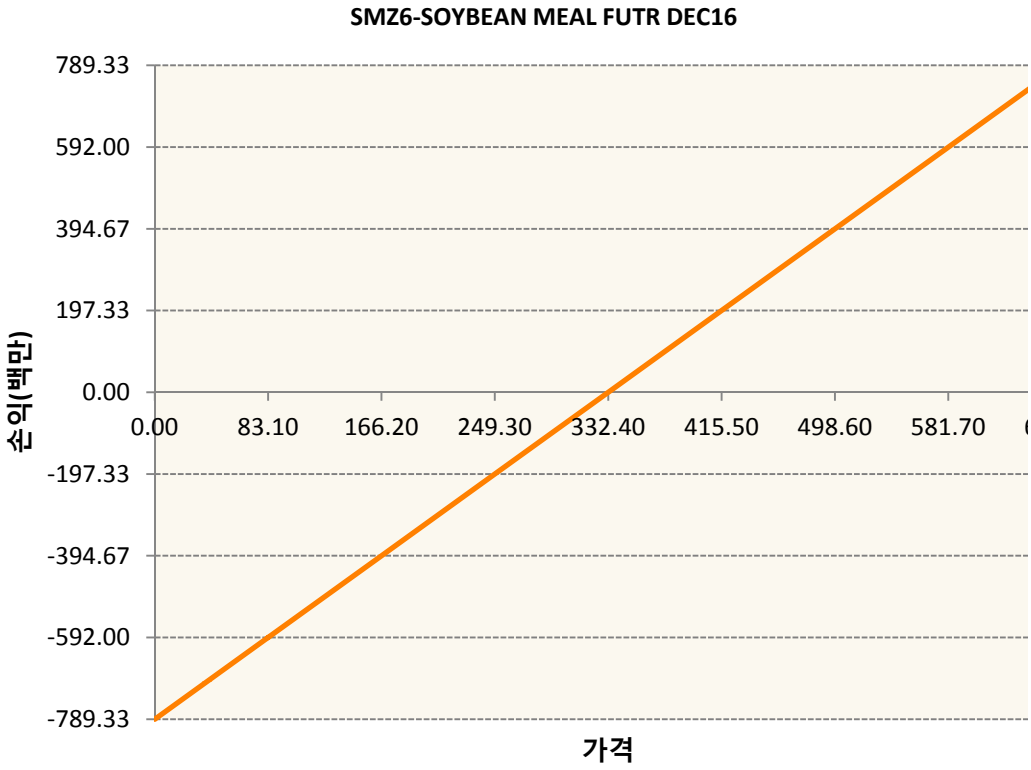
가격

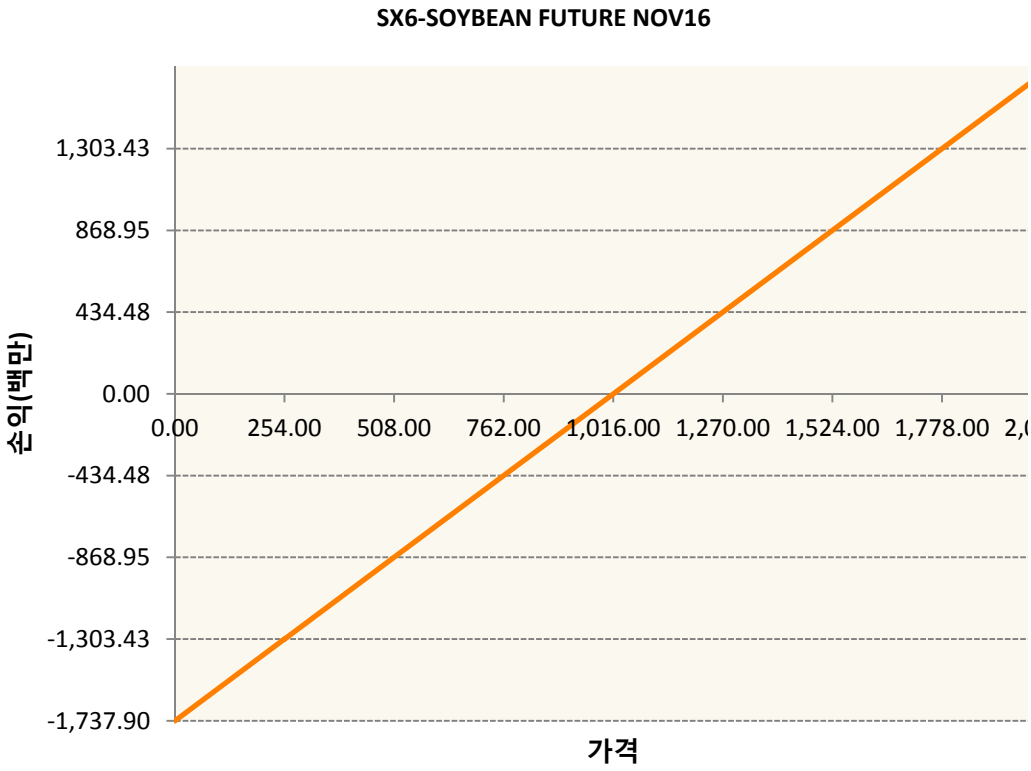
KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16



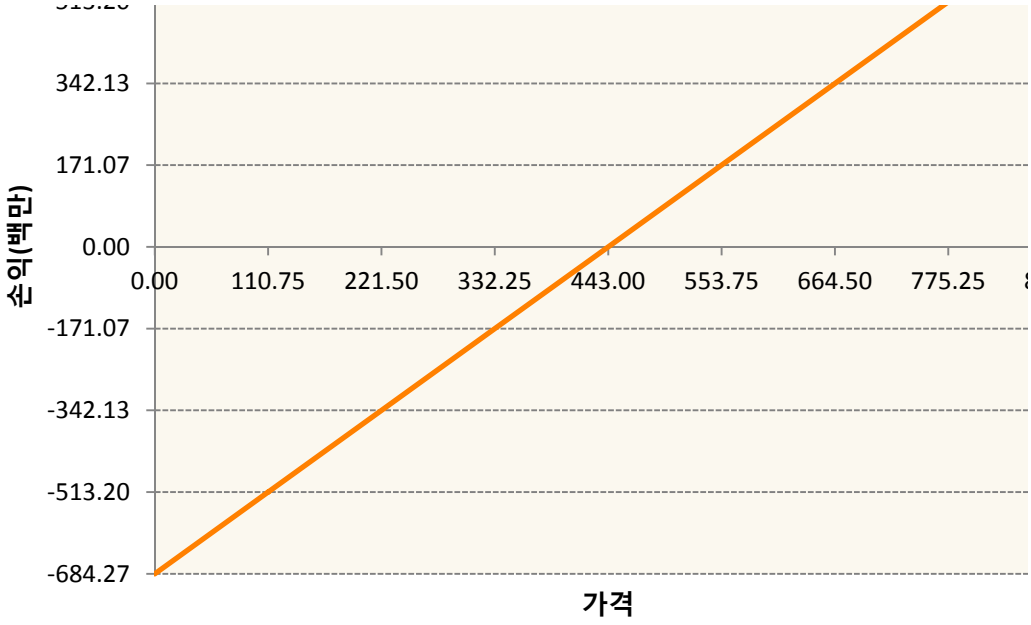
SBV6-SUGAR #11 (WORLD) OCT16




SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16
789.33
592.00
394.67
197.33
0.00
-197.33
-394.67
-592.00
-789.33
0.00
83.10
166.20
249.30
332.40
415.50
498.60
581.70
손익(백만)
가격


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16
1,303.43
868.95
434.48
0.00
-434.48
-868.95
-1,303.43
-1,737.90
0.00
254.00
508.00
762.00
1,016.00
1,270.00
1,524.00
1,778.00
손익(백만)
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
513.20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ6	SOYBEAN OIL FUTR DEC16	66
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	35
CZ6	CORN FUTURE DEC16	135
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	55
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	18
SBV6	SUGAR #11 (WORLD) OCT16	97
SMZ6	SOYBEAN MEAL FUTR DEC16	63
SX6	SOYBEAN FUTURE NOV16	139
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	55

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

848