공시일	2016-08-23
기준일	2016-08-22

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	2016-08-23
기준일	2016-08-22

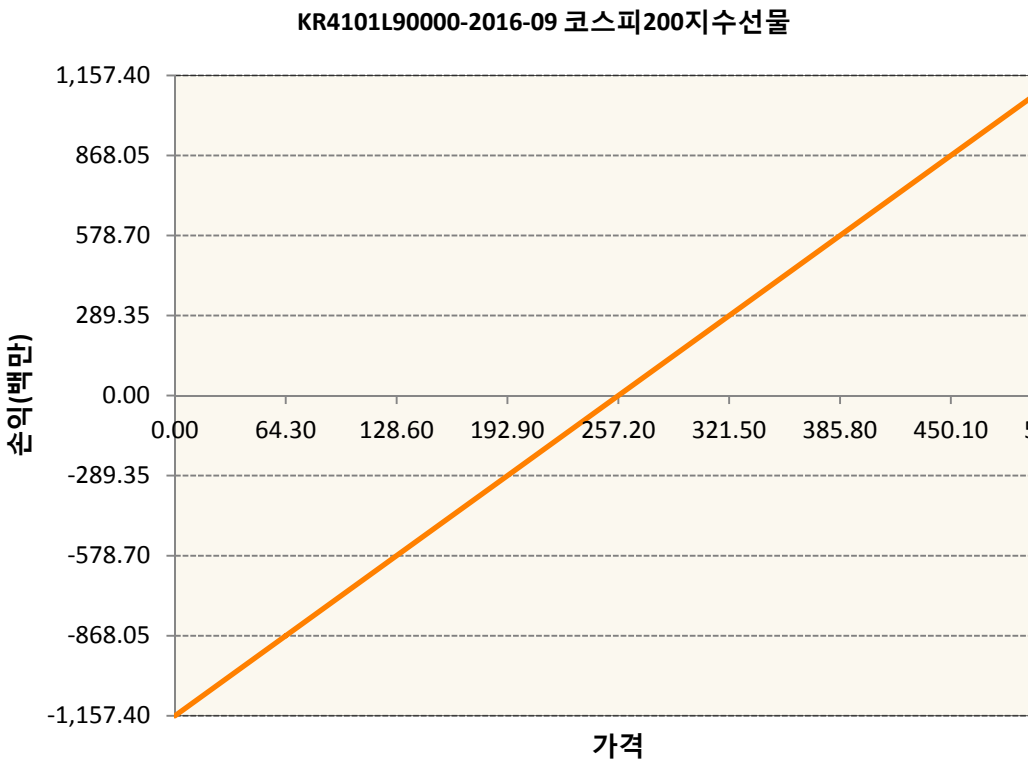
스마트인덱스모

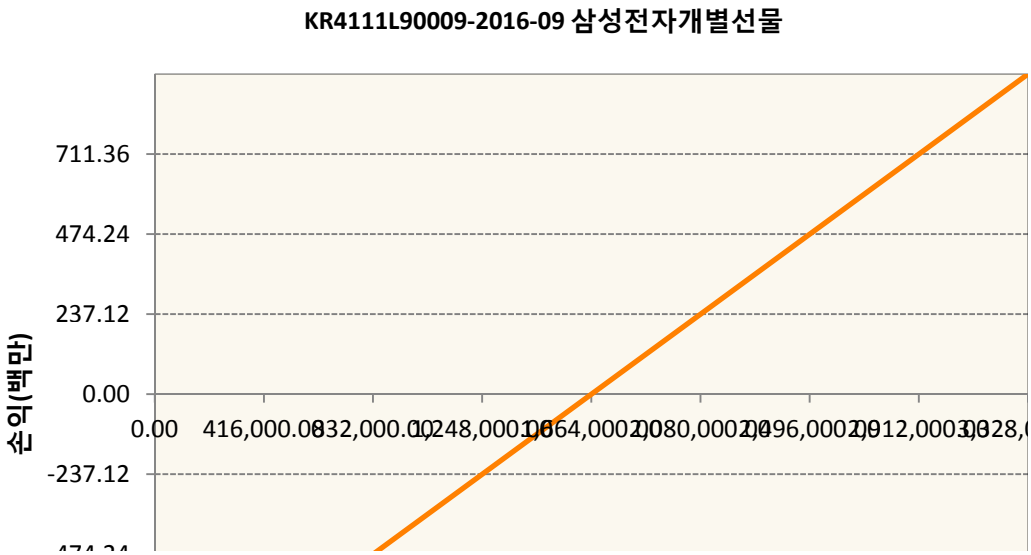
1. 계약금액

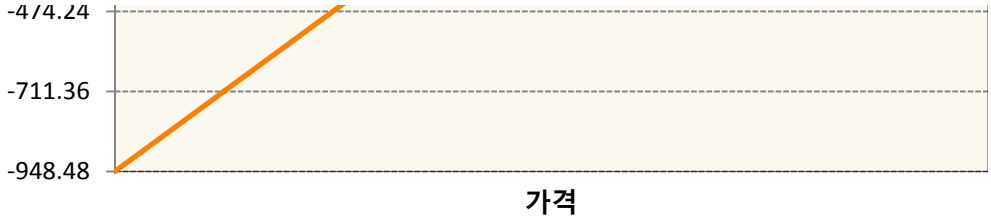
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,106	0	2,106	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						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)

156

공시일	2016-08-23
기준일	2016-08-22

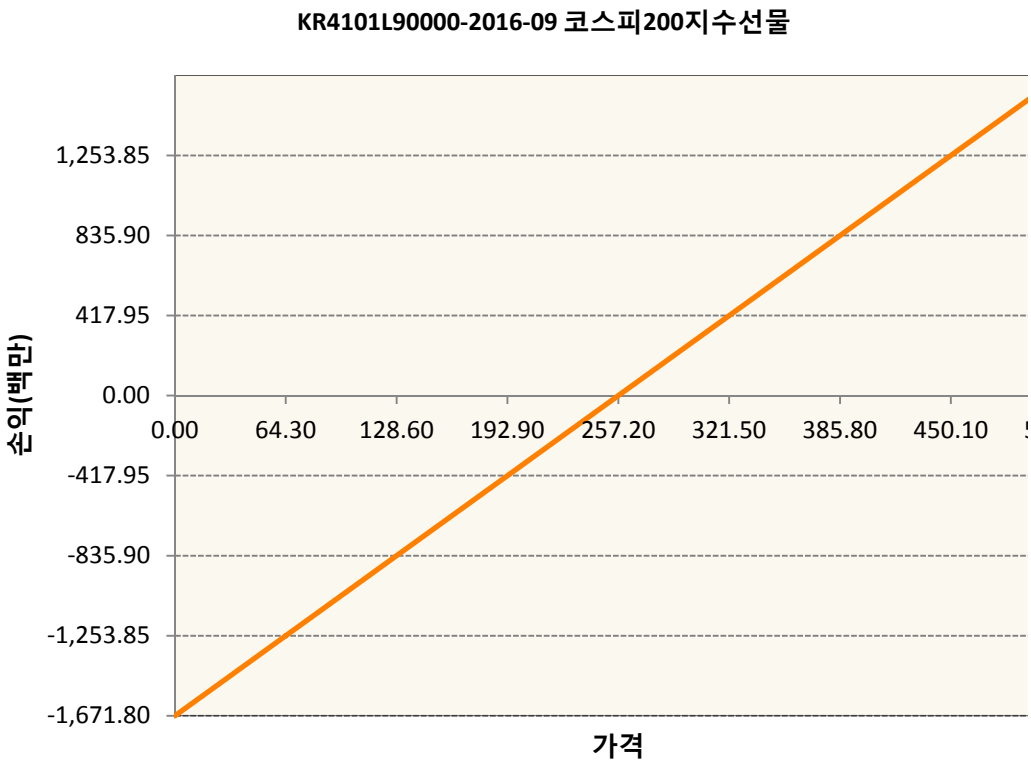
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,672	0	1,672	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)

110

공시일	2016-08-23
기준일	2016-08-22

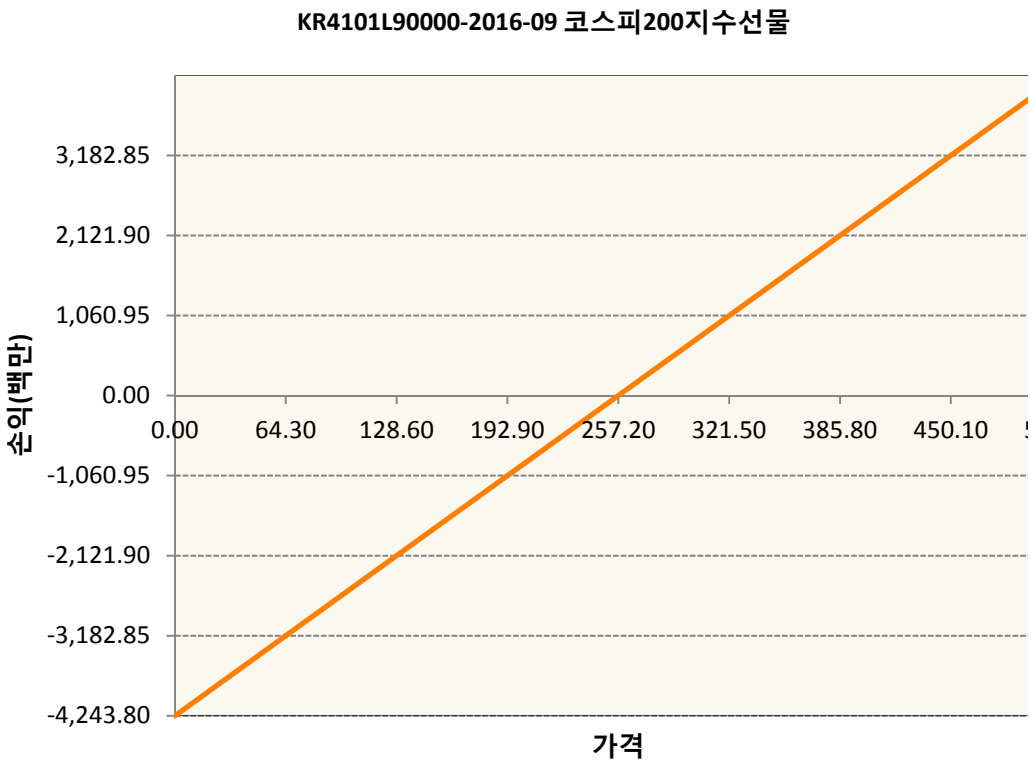
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	4,244	0	4,244	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						340
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-340	-340	-340	-340	-340	-340	-340
-5.33%	-226	-226	-226	-226	-226	-226	-226
-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%	226	226	226	226	226	226	226
8.00%	340	340	340	340	340	340	340

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

279

공시일	2016-08-23
기준일	2016-08-22

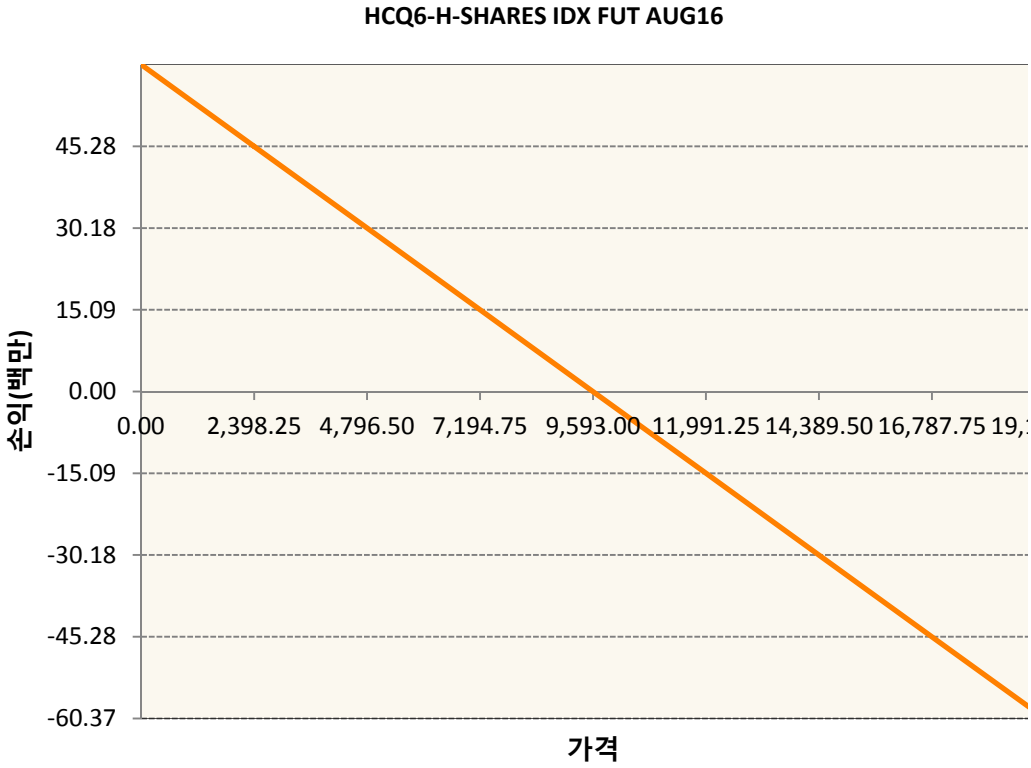
아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

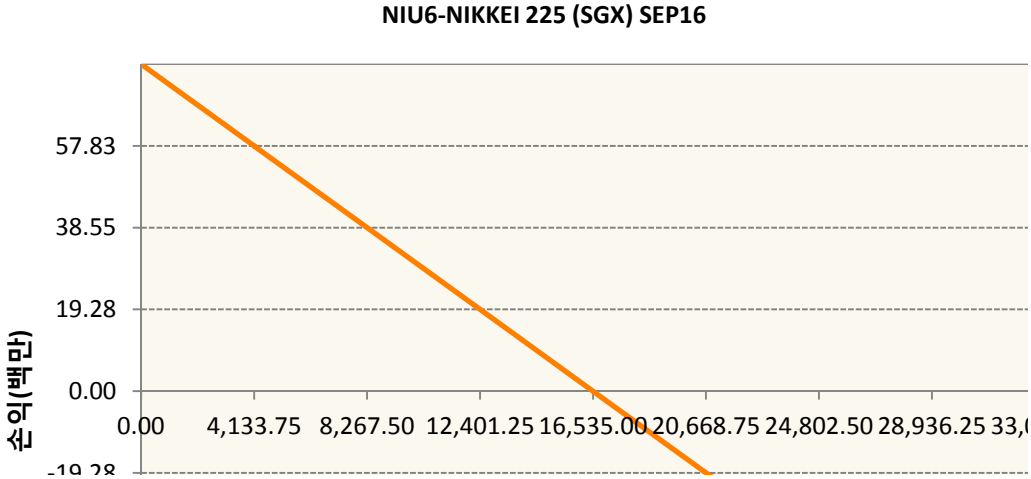
1. 계약금액

(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	77	-77	
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)

15

공시일	2016-08-23
기준일	2016-08-22

SMART합성-MSCI선진국증권상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	11,105	0	11,105	장외
누계	지수	스왑	11,105	0	11,105	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S160822	888

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

817

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-08-23
기준일	2016-08-22

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	405

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

966

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-08-23
기준일	2016-08-22

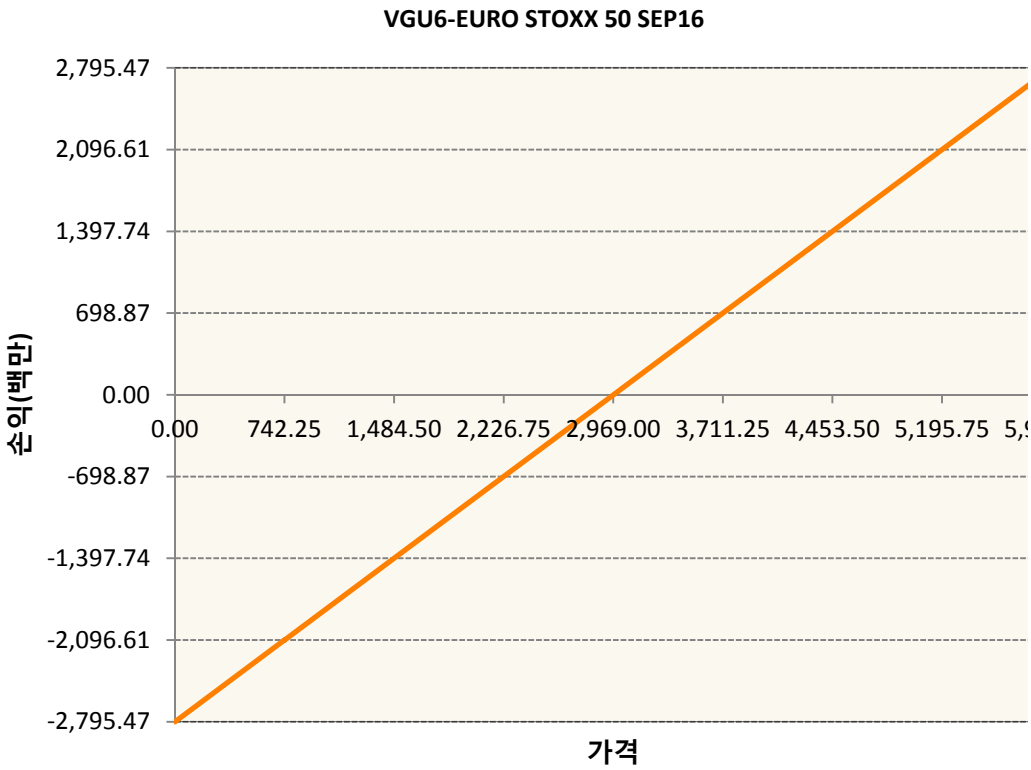
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,795	0	2,795	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 SEP16	224

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

(단위:백만원)

276

공시일	2016-08-23
기준일	2016-08-22

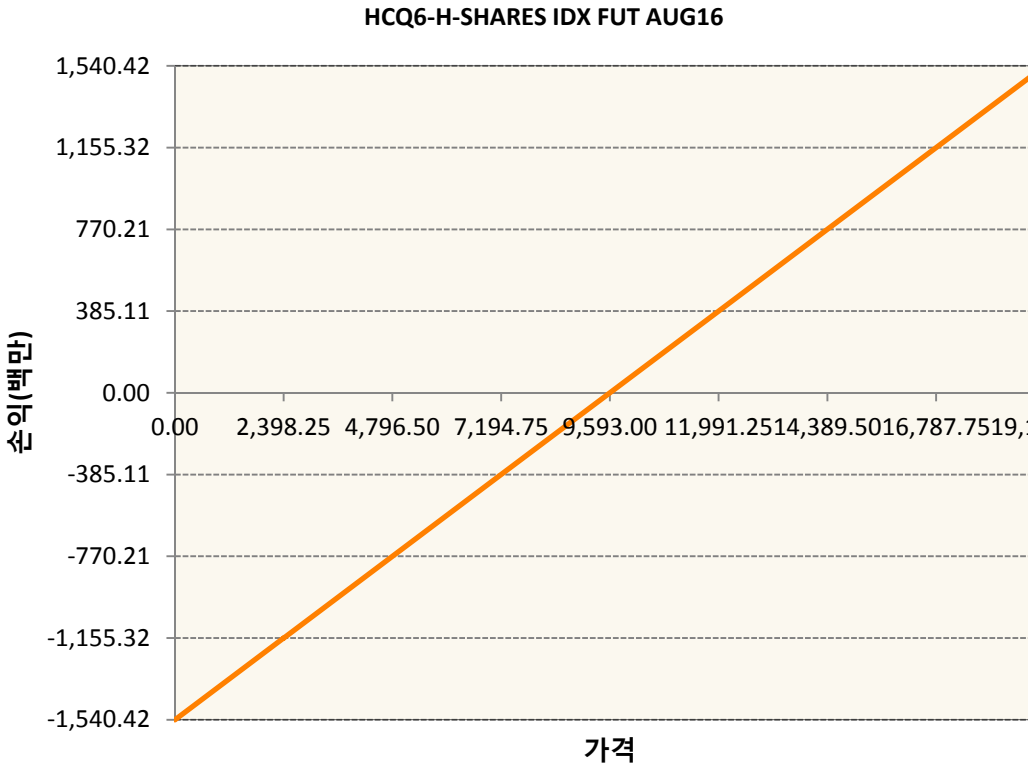
차이나인덱스모(주식-파생형)

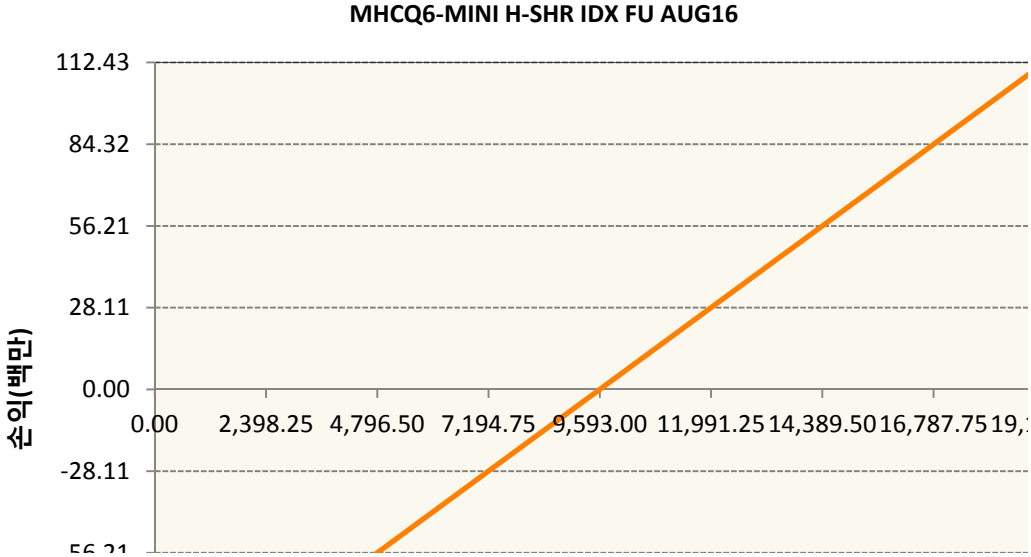
1. 계약금액

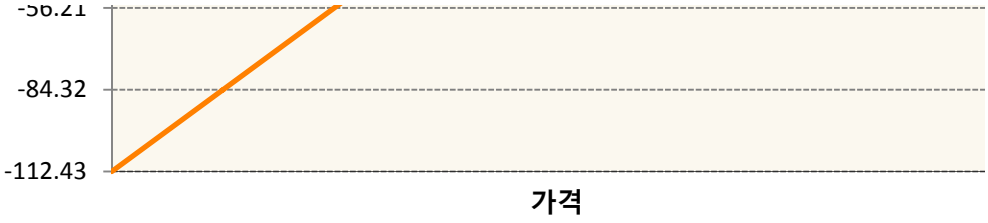
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,653	0	1,653	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ6	H-SHARES IDX FUT AUG16	123
MHCQ6	MINI H-SHR IDX FU AUG16	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	186

공시일	2016-08-23
기준일	2016-08-22

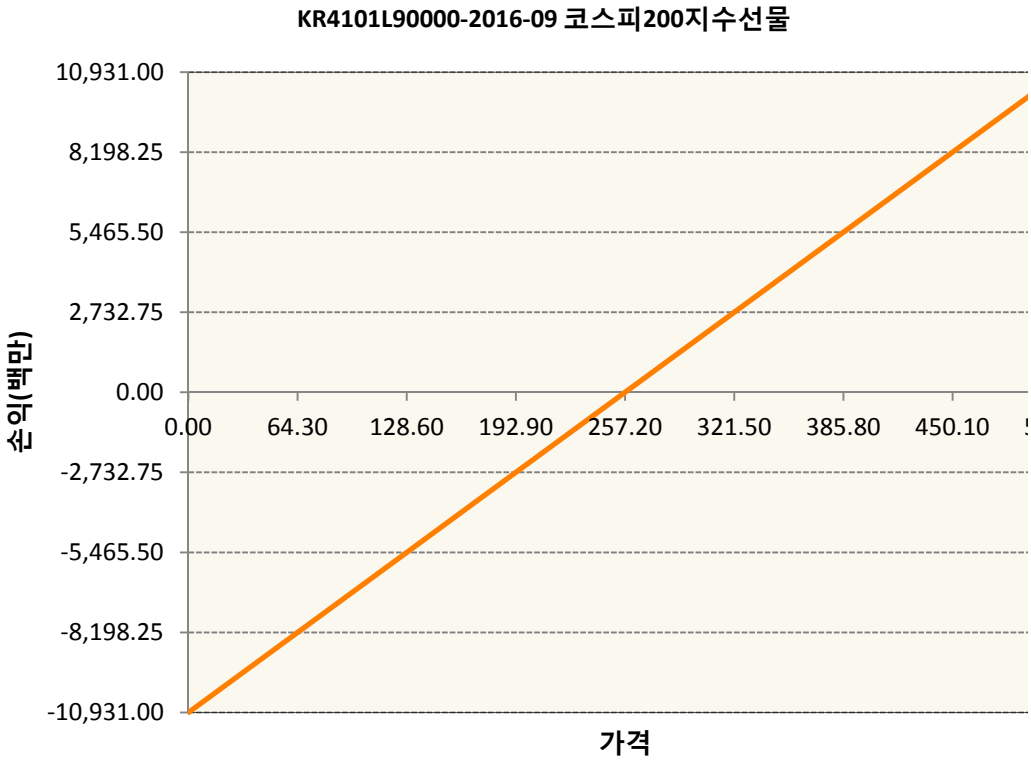
커버드콜(주식혼합-파생형)

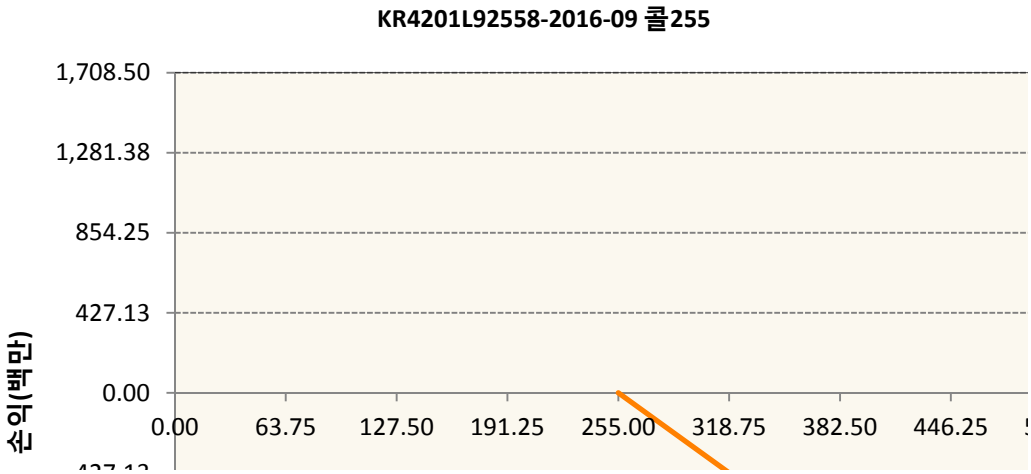
1. 계약금액

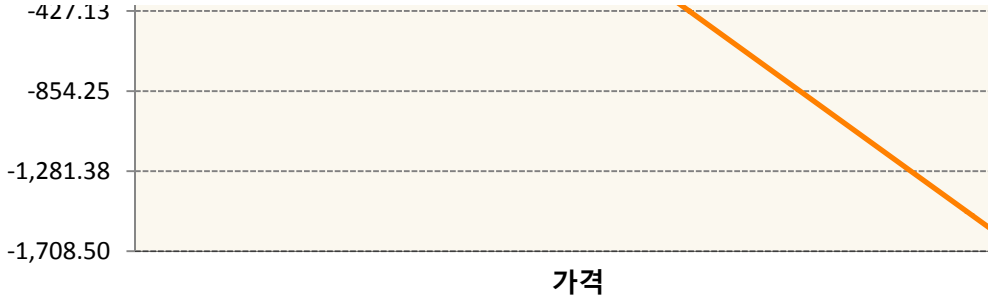
(단위:백만원)

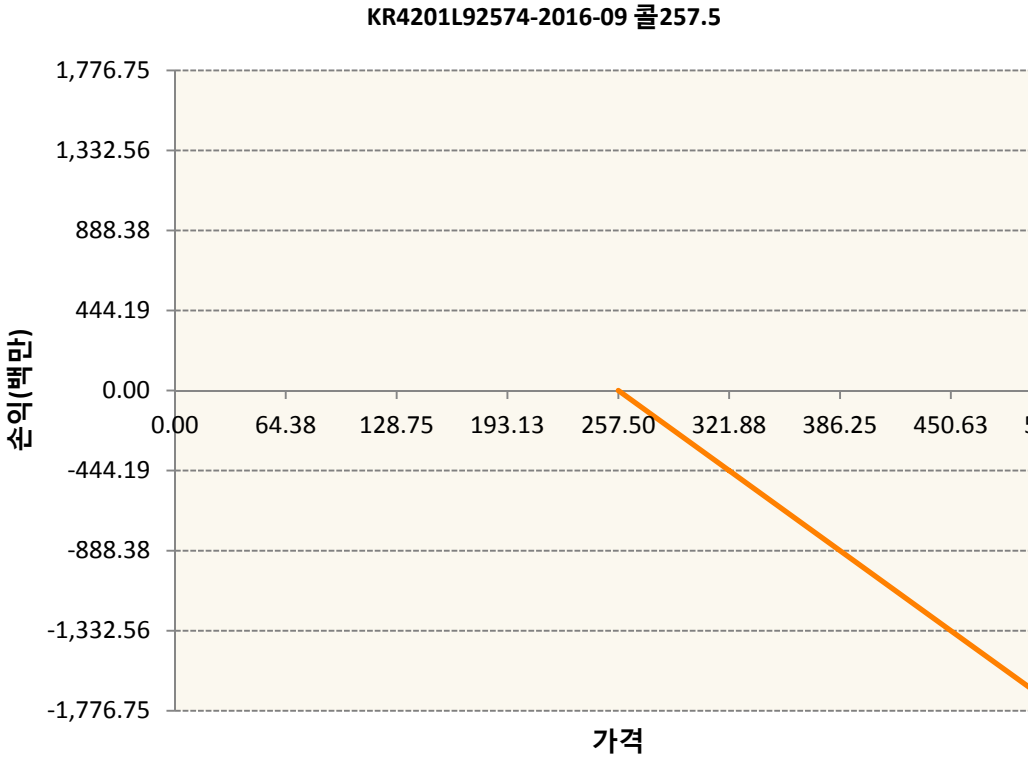
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,931	0	10,931	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,485	-3,485	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101L900 2016-09 코스피200지수선물							875
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-875	-875	-875	-875	-875	-875	-875
-5.33%	-583	-583	-583	-583	-583	-583	-583
-2.67%	-292	-292	-292	-292	-292	-292	-292
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	292	292	292	292	292	292	292
5.33%	583	583	583	583	583	583	583
8.00%	875	875	875	875	875	875	875
KR4201L925 2016-09 콜255							632
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	132	132	132	131	131	131	131
-5.33%	131	130	130	128	126	124	122
-2.67%	116	111	106	100	94	88	82
0%	21	14	7	0	-7	-14	-21
2.67%	-175	-177	-179	-182	-185	-189	-193
5.33%	-402	-402	-403	-403	-404	-405	-406
8.00%	-632	-632	-632	-632	-632	-632	-632
KR4201L925 2016-09 콜257.5							613

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	88	88	88	88	88	88	87
-5.33%	88	88	87	87	86	84	83
-2.67%	82	79	75	71	67	62	57
0%	23	15	8	0	-8	-15	-23
2.67%	-147	-151	-155	-160	-165	-171	-176
5.33%	-376	-376	-377	-378	-379	-381	-383
8.00%	-612	-612	-612	-612	-613	-613	-613

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

2,241

공시일	2016-08-23
기준일	2016-08-22

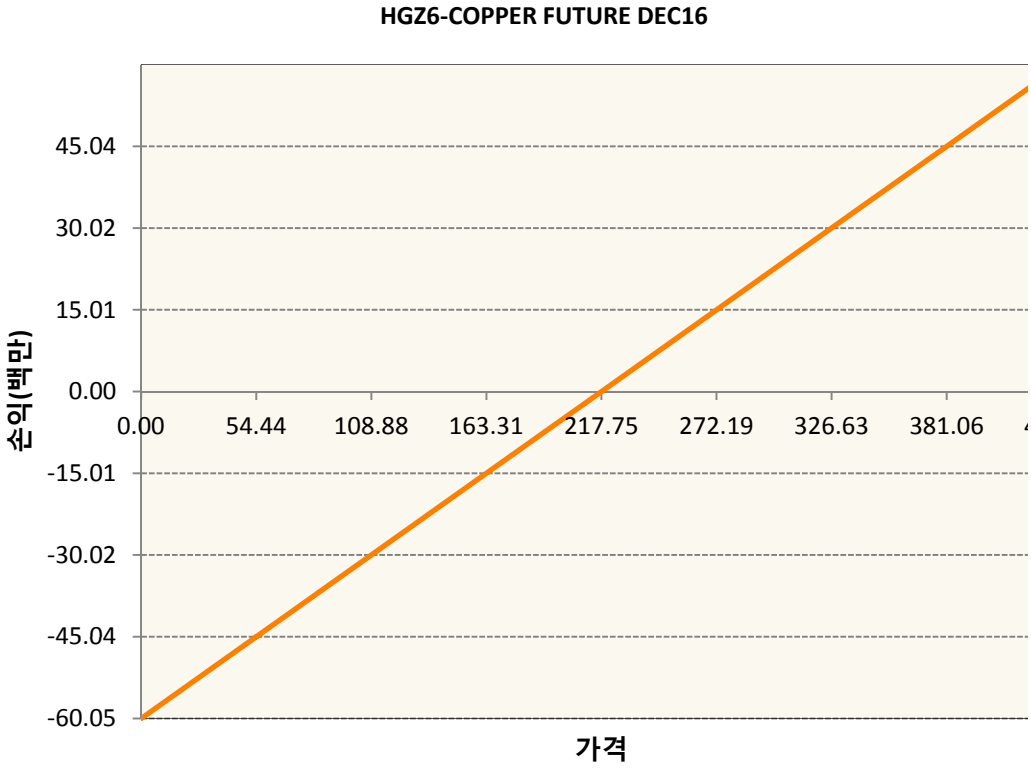
메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

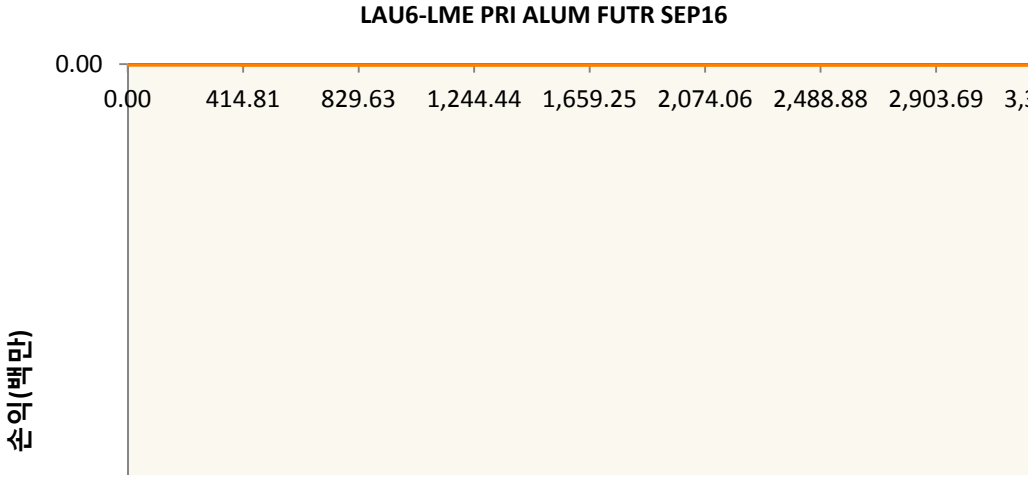
1. 계약금액

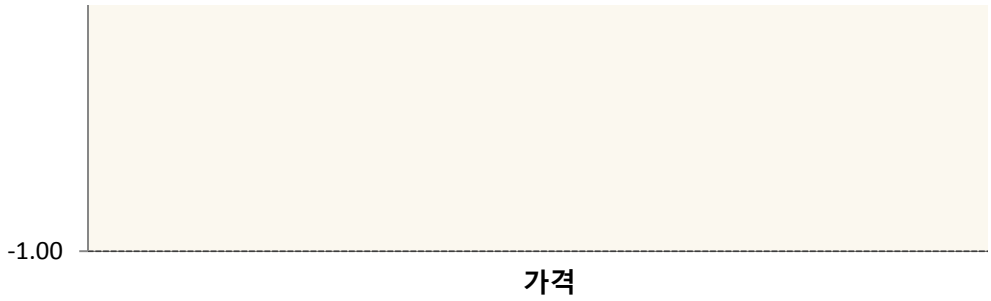
(단위:백만원)

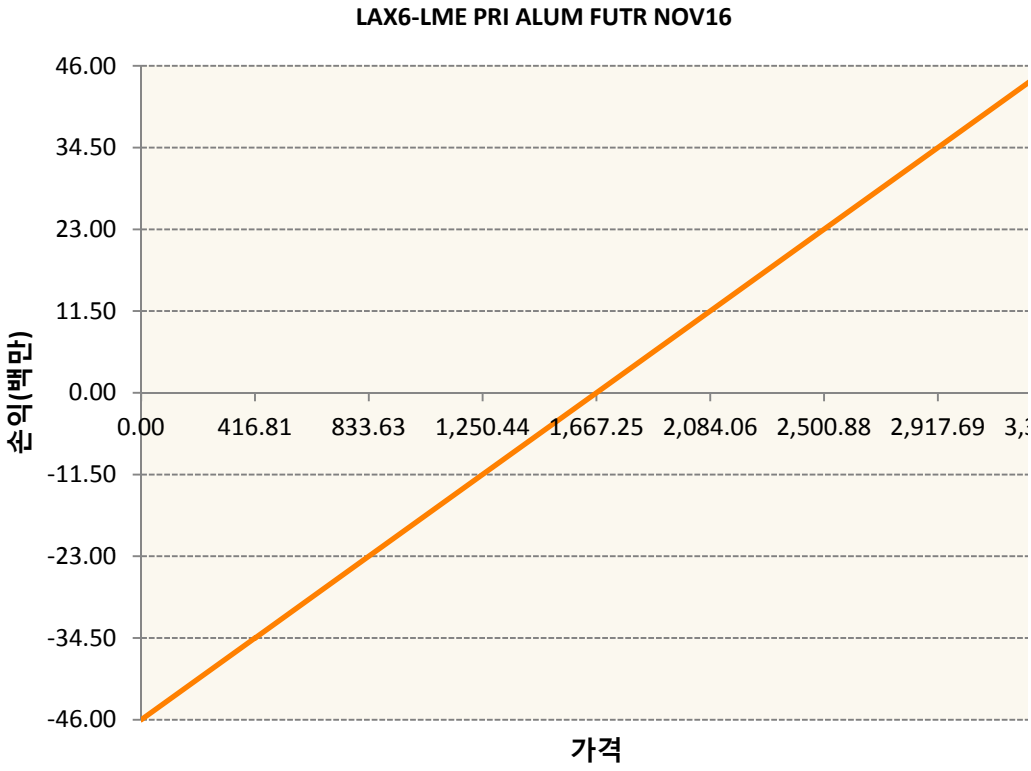
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	43	0	43	
누계	유가증권	선물	432	108	325	

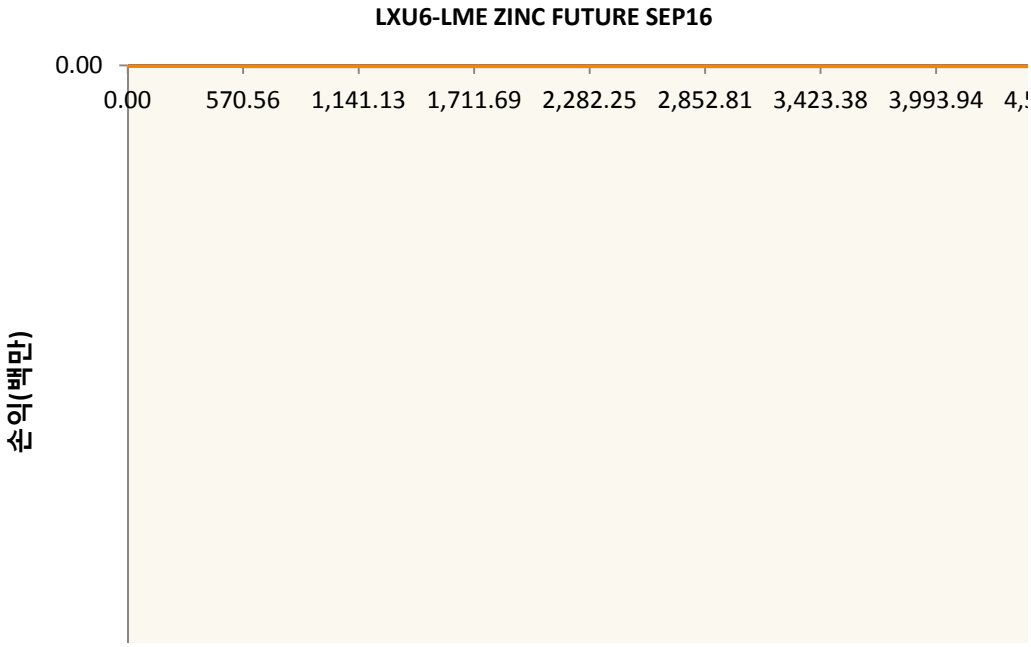
2. 만기시점의 손익구조

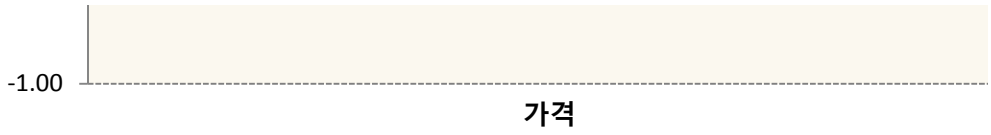


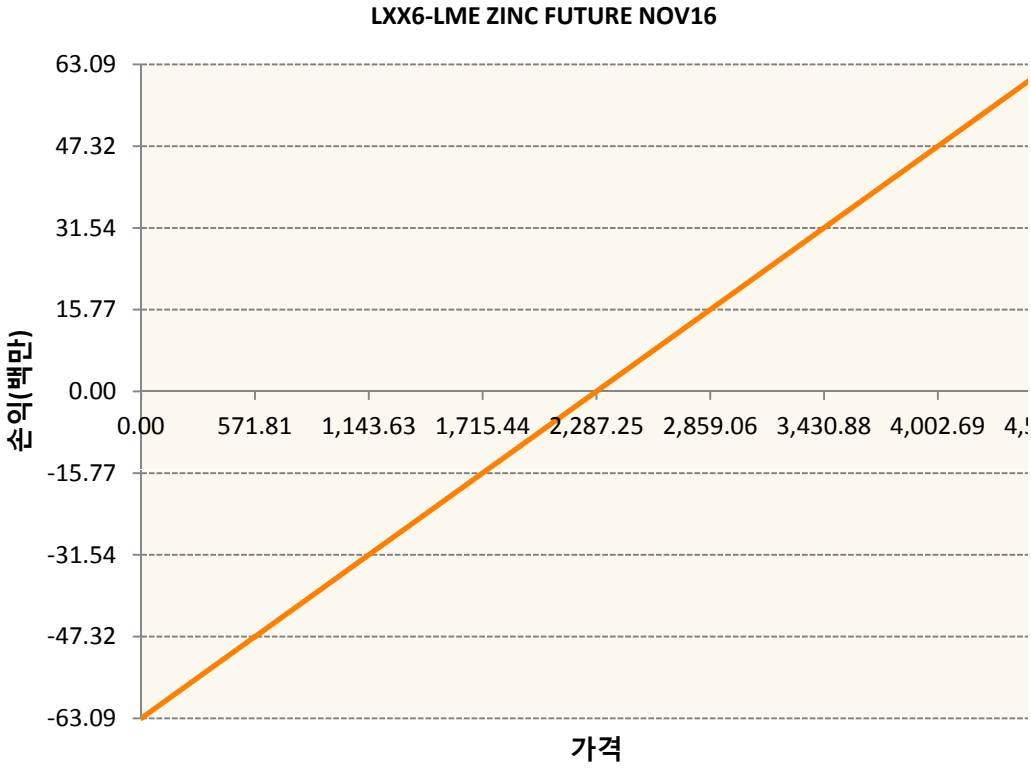


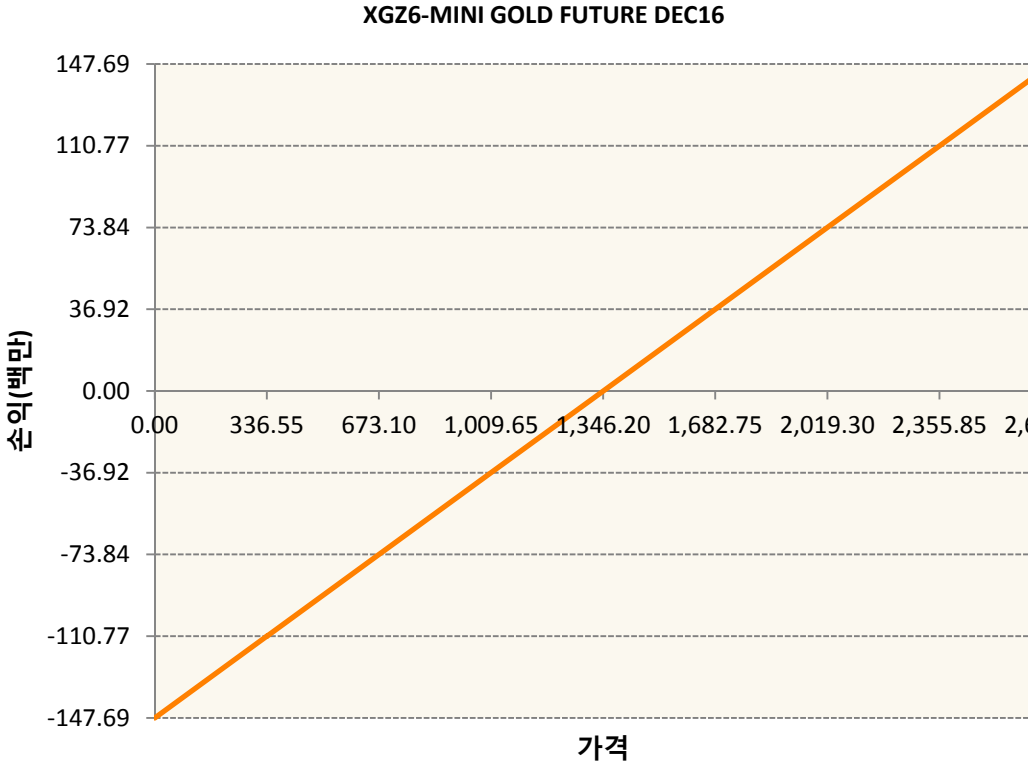

-1.00
가격

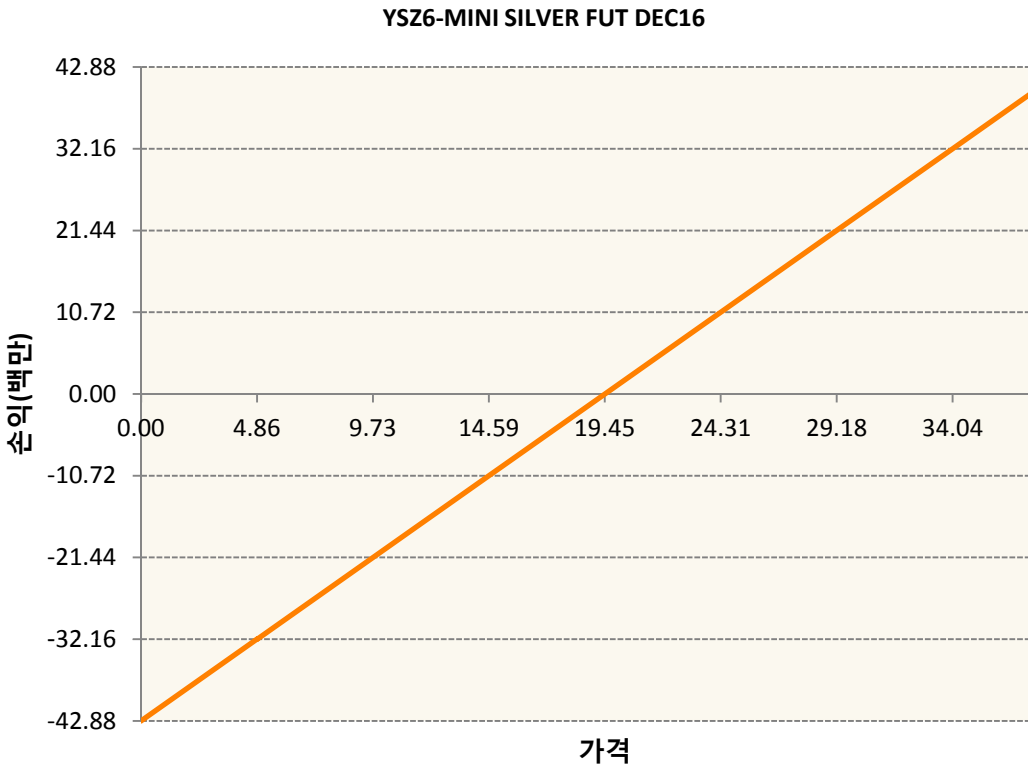

LAX6-LME PRI ALUM FUTR NOV16
46.00
34.50
23.00
11.50
0.00
-11.50
-23.00
-34.50
-46.00
0.00
416.81
833.63
1,250.44
1,667.25
2,084.06
2,500.88
2,917.69
순익(백만)
가격


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


-1.00
가격


LXX6-LME ZINC FUTURE NOV16
63.09
47.32
31.54
15.77
0.00
-15.77
-31.54
-47.32
-63.09
0.00
571.81
1,143.63
1,715.44
2,287.25
2,859.06
3,430.88
4,002.69
순익(백만)
가격


XGZ6-MINI GOLD FUTURE DEC16
147.69
110.77
73.84
36.92
0.00
-36.92
-73.84
-110.77
-147.69
0.00
336.55
673.10
1,009.65
1,346.20
1,682.75
2,019.30
2,355.85
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	0.3
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	2016-08-23
기준일	2016-08-22

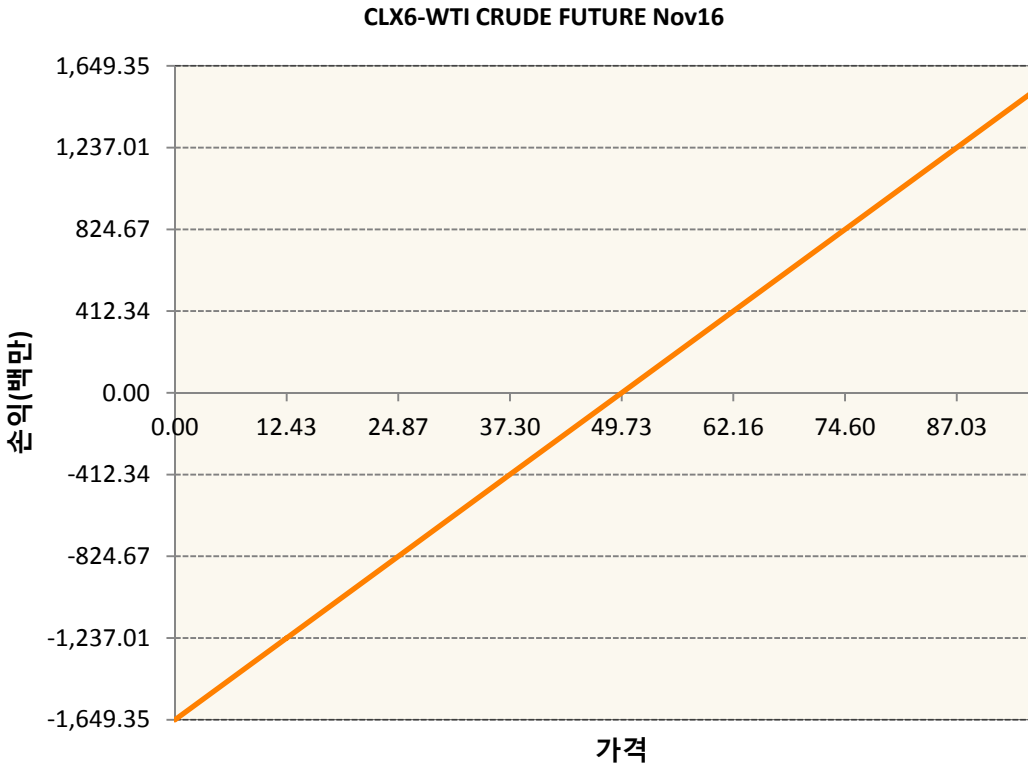
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

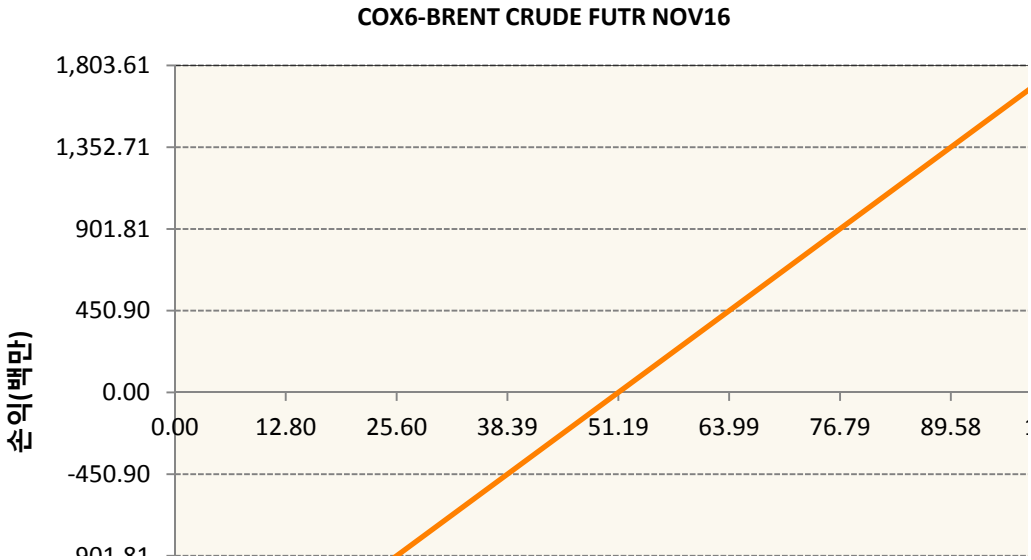
1. 계약금액

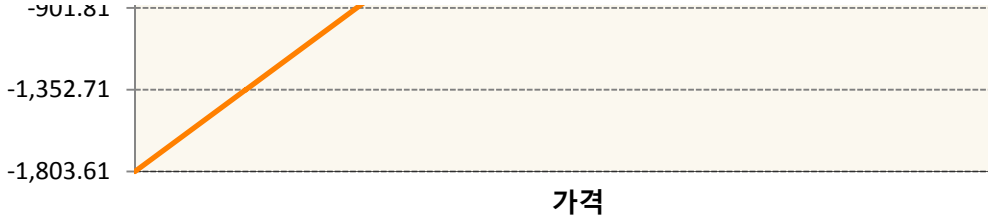
(단위:백만원)

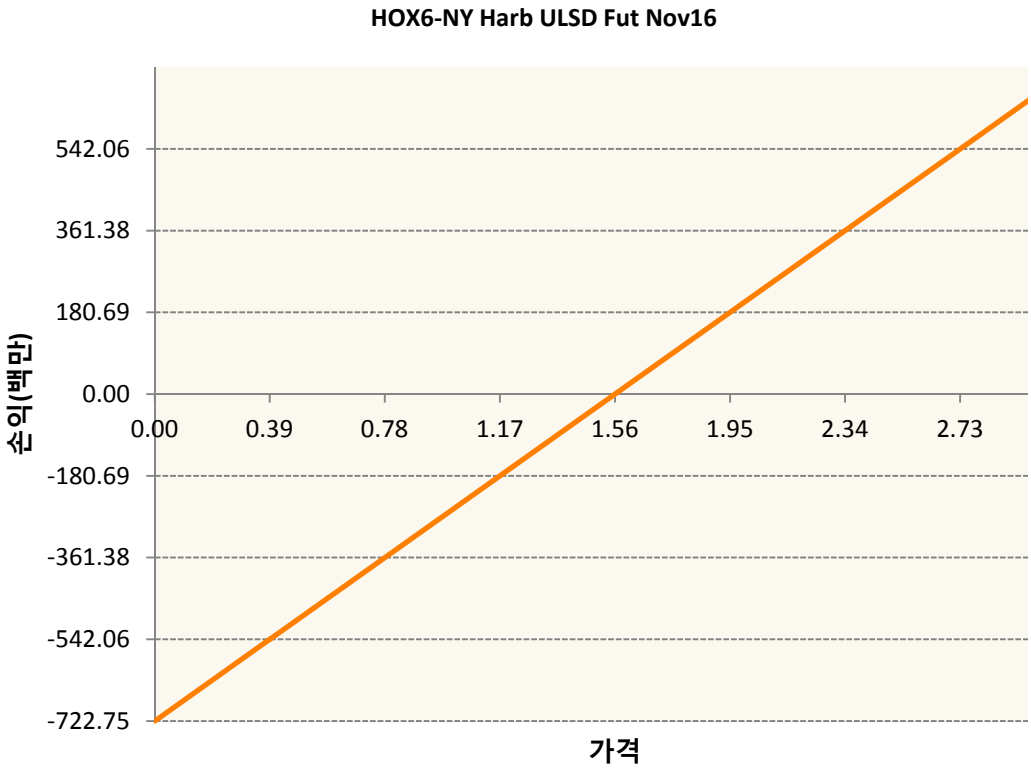
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,367	0	6,367	

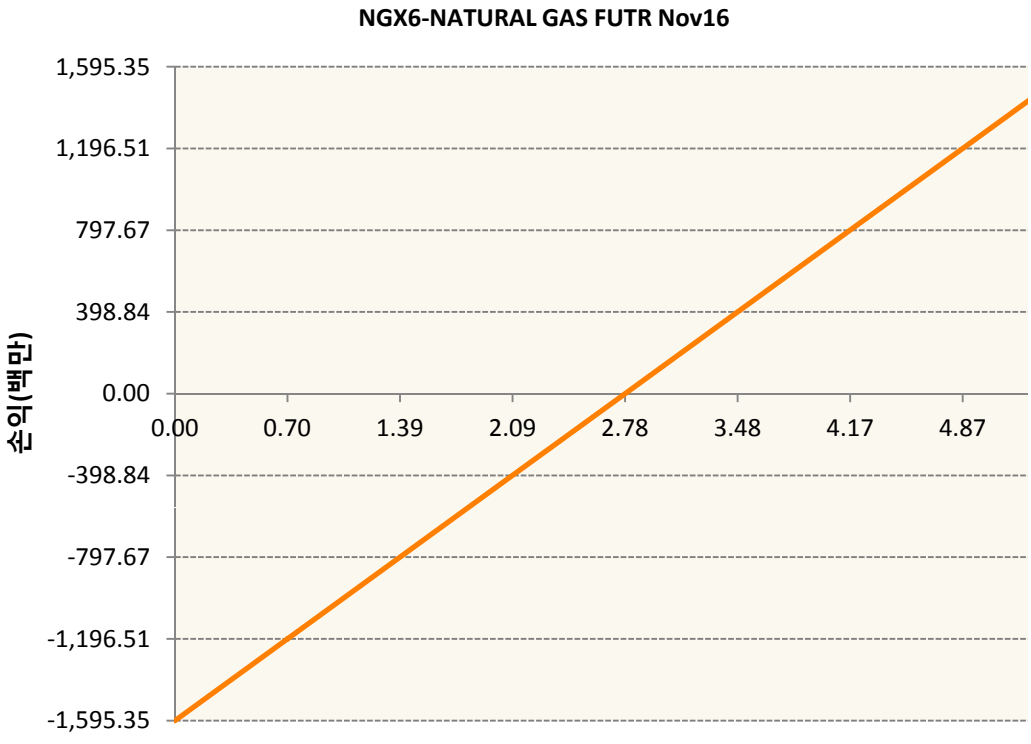
2. 만기시점의 손익구조



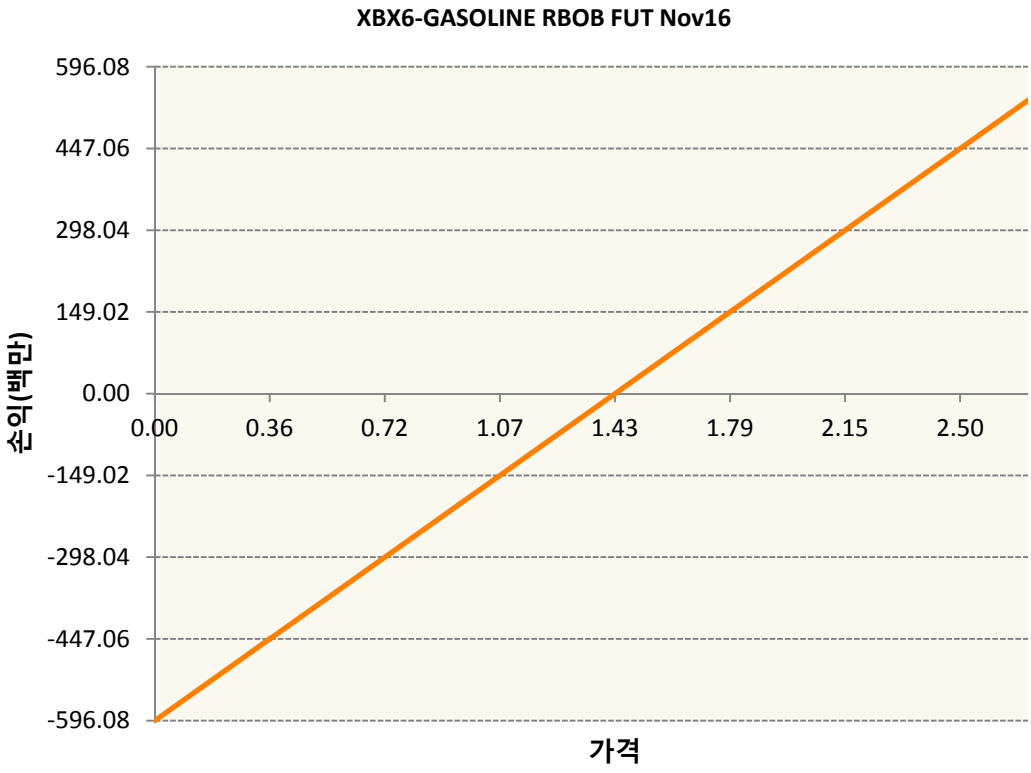



-1,352.71
-1,803.61
가격


HOX6-NY Harb ULSD Fut Nov16
542.06
361.38
180.69
0.00
-180.69
-361.38
-542.06
-722.75
0.00
0.39
0.78
1.17
1.56
1.95
2.34
2.73
순익(백만)
가격


NGX6-NATURAL GAS FUTR Nov16
1,595.35
1,196.51
797.67
398.84
0.00
-398.84
-797.67
-1,196.51
-1,595.35
0.00
0.70
1.39
2.09
2.78
3.48
4.17
4.87
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX6	WTI CRUDE FUTURE Nov16	132
COX6	BRENT CRUDE FUTR NOV16	144
HOX6	NY Harb ULSD Fut Nov16	58
NGX6	NATURAL GAS FUTR Nov16	128
XBX6	GASOLINE RBOB FUT Nov16	48

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,141

공시일	2016-08-23
기준일	2016-08-22

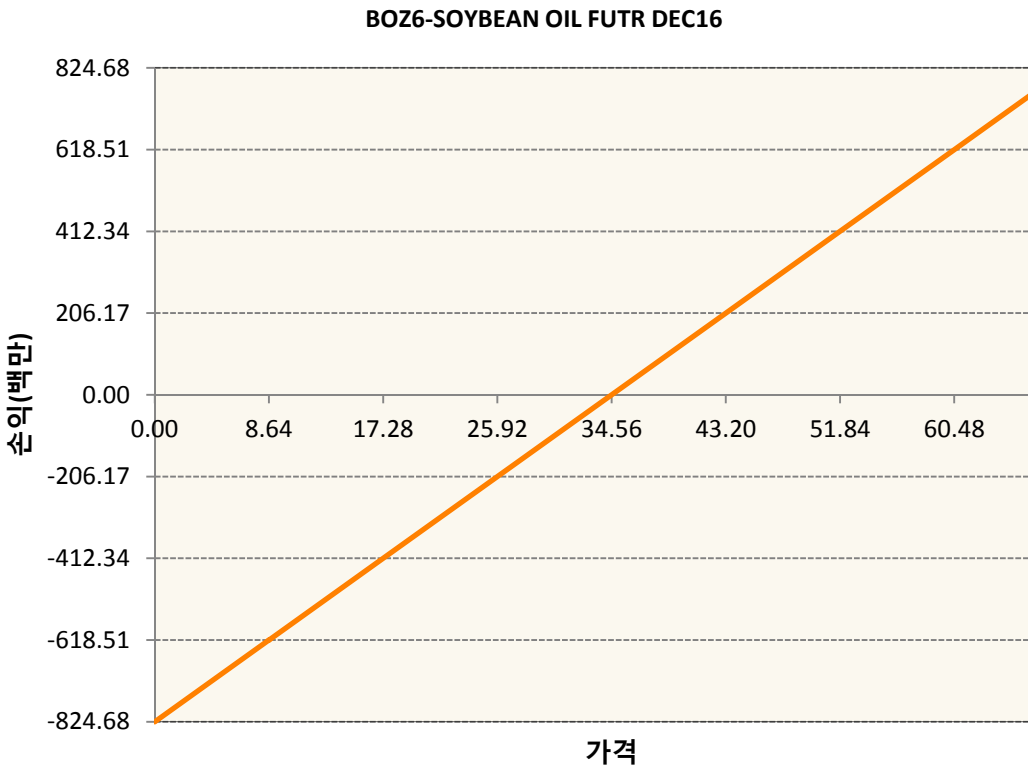
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

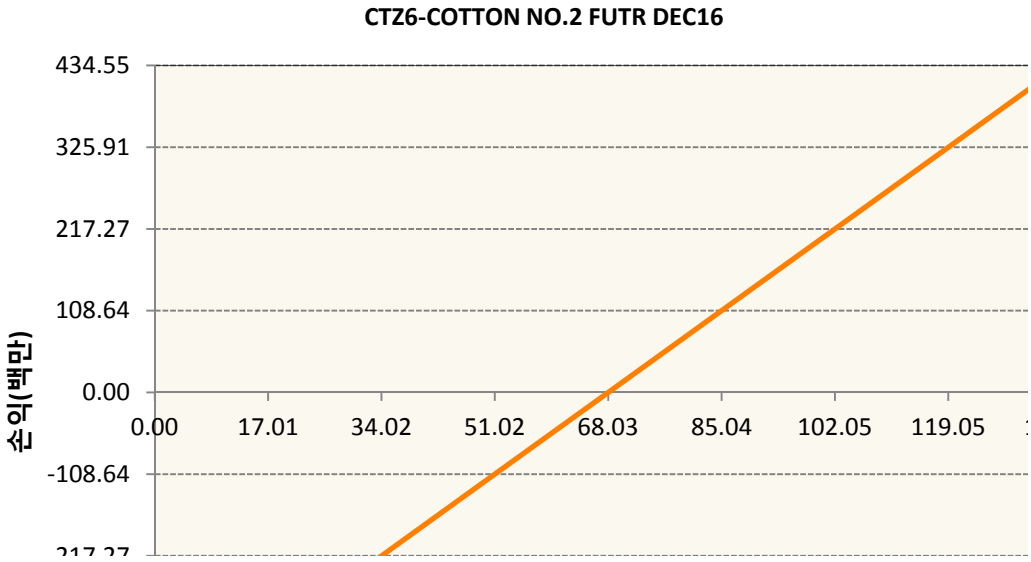
1. 계약금액

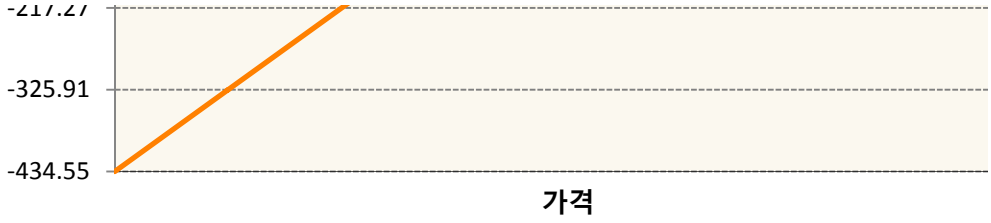
(단위:백만원)

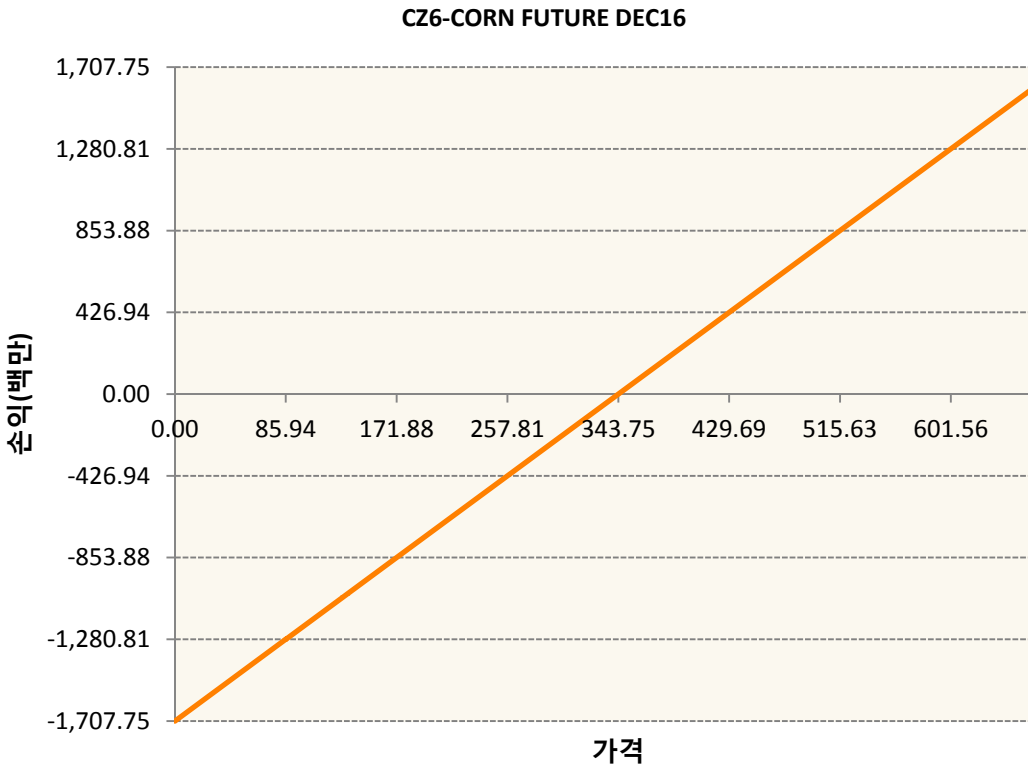
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,285	0	8,285	

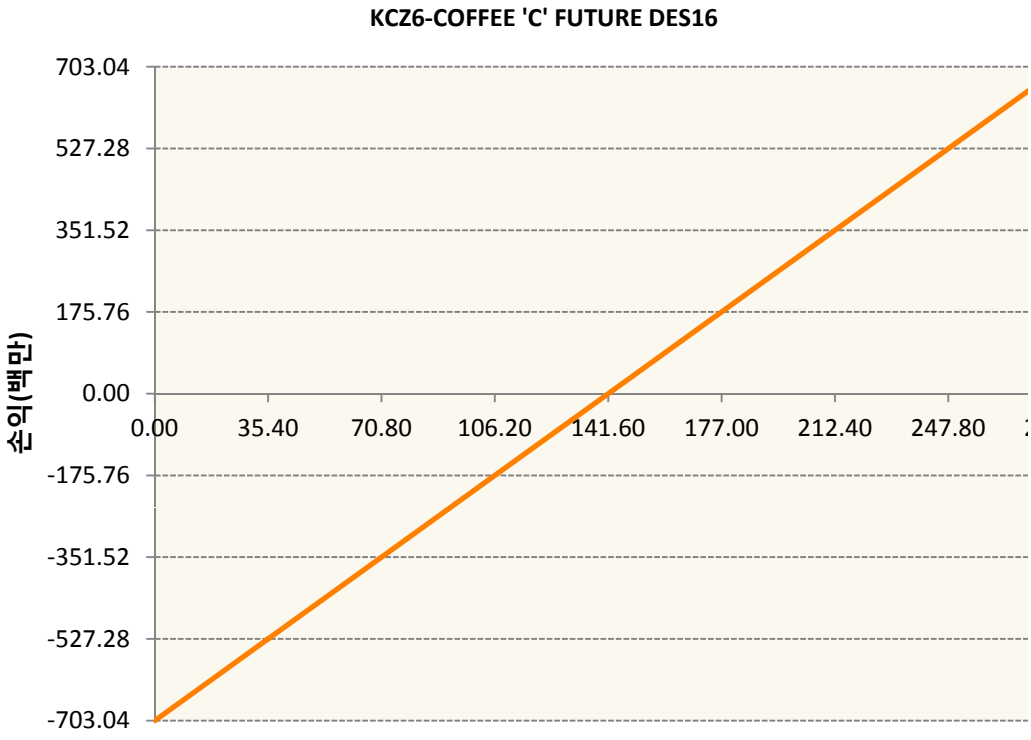
2. 만기시점의 손익구조



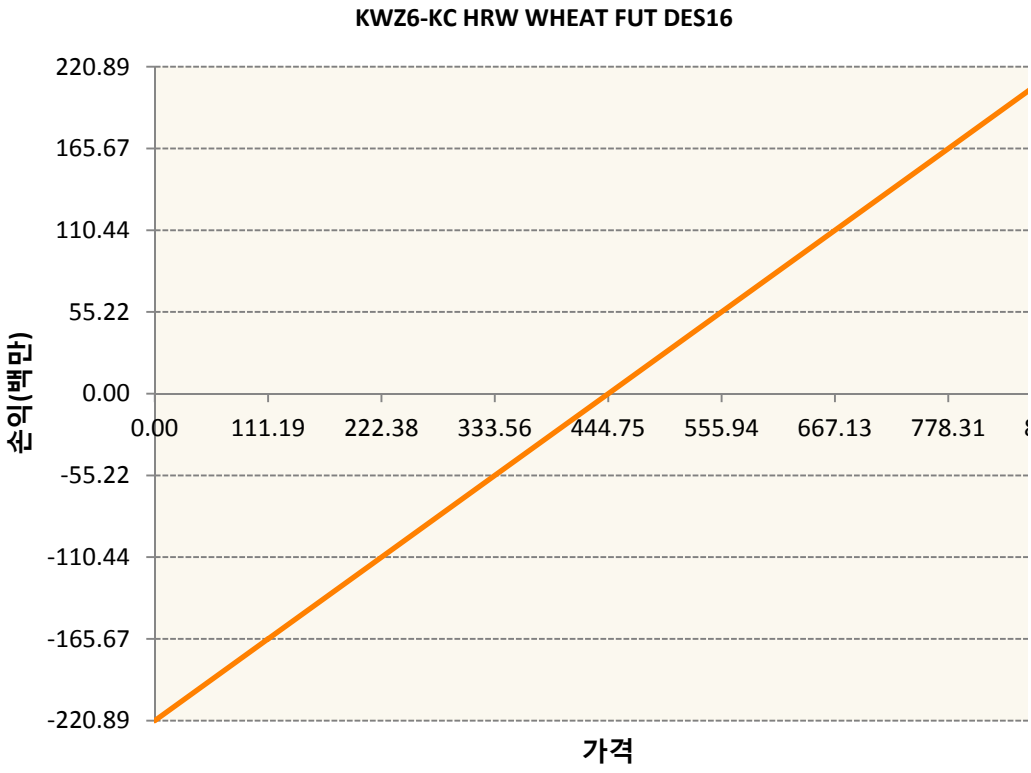


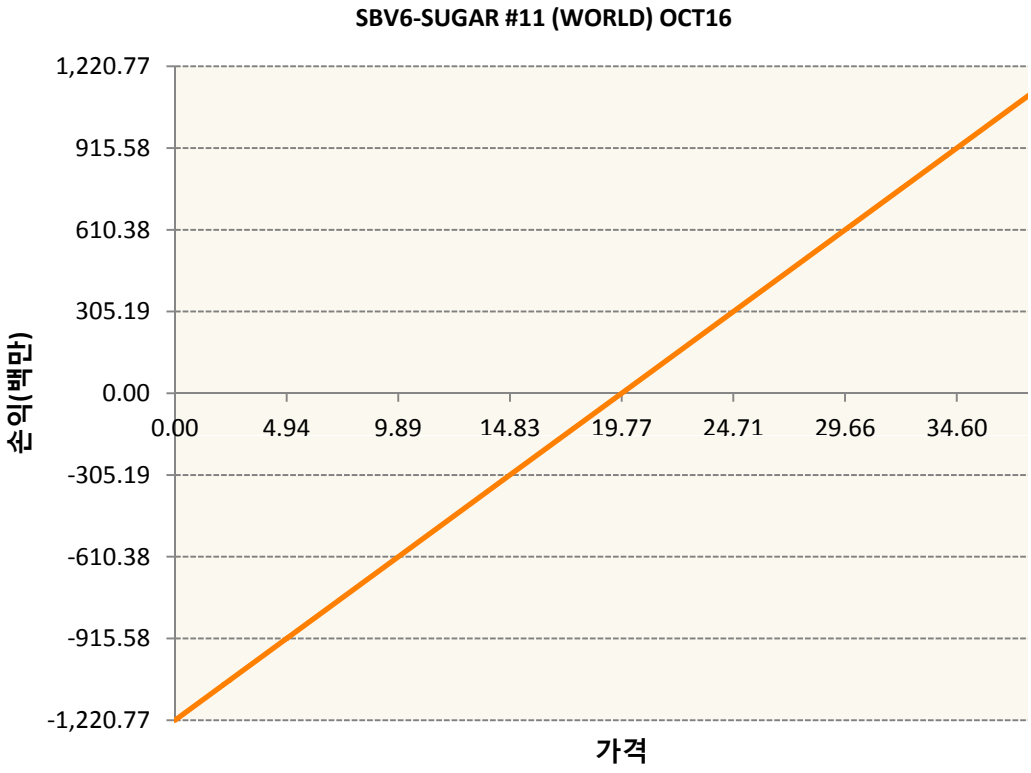

-325.91
-434.55
가격

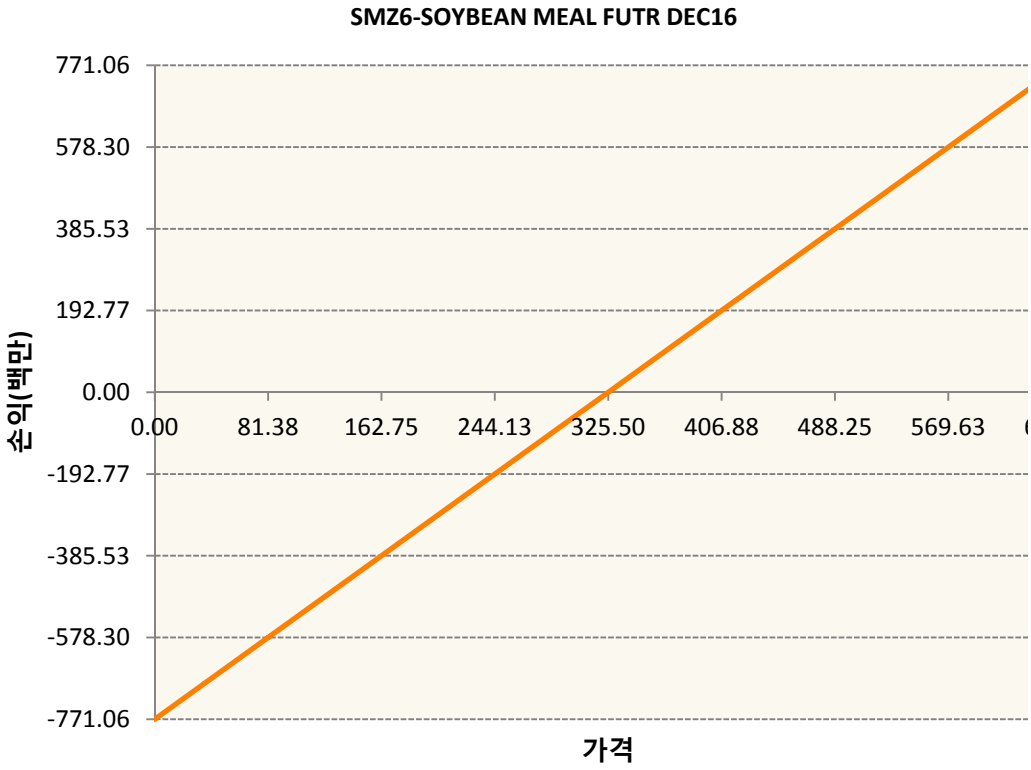

CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,707.75
1,280.81
853.88
426.94
0.00
-426.94
-853.88
-1,280.81
-1,707.75
0.00
85.94
171.88
257.81
343.75
429.69
515.63
601.56
순익(백만)
가격

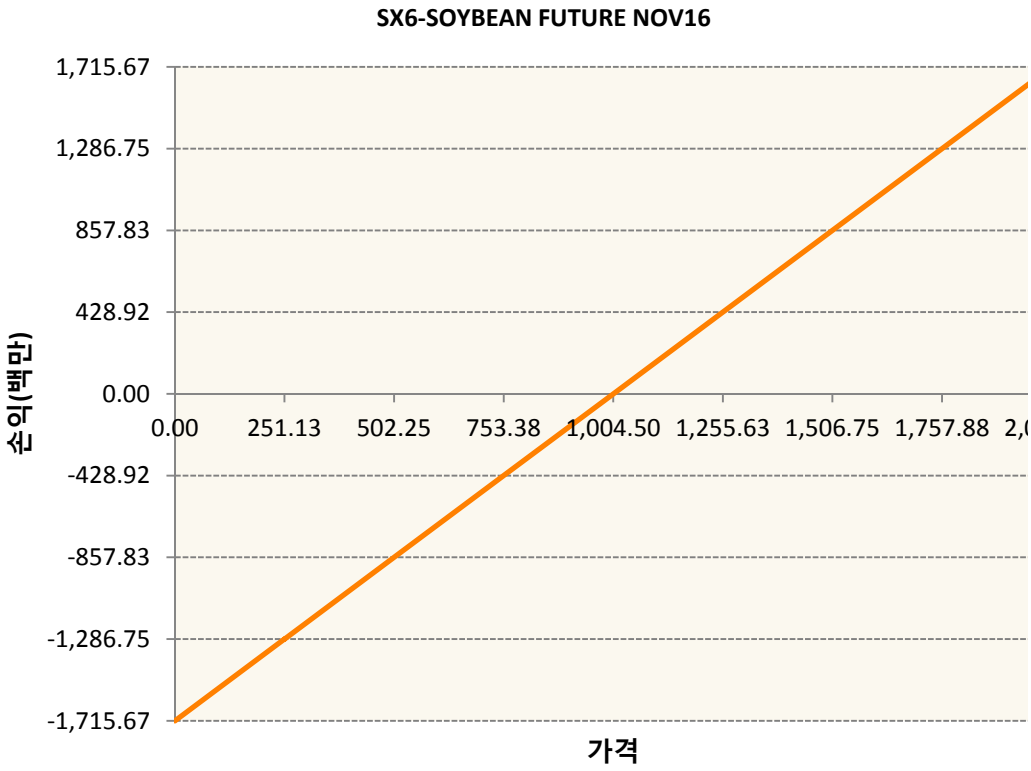

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
703.04
527.28
351.52
175.76
0.00
-175.76
-351.52
-527.28
-703.04
0.00
35.40
70.80
106.20
141.60
177.00
212.40
247.80
순익(백만)

가격

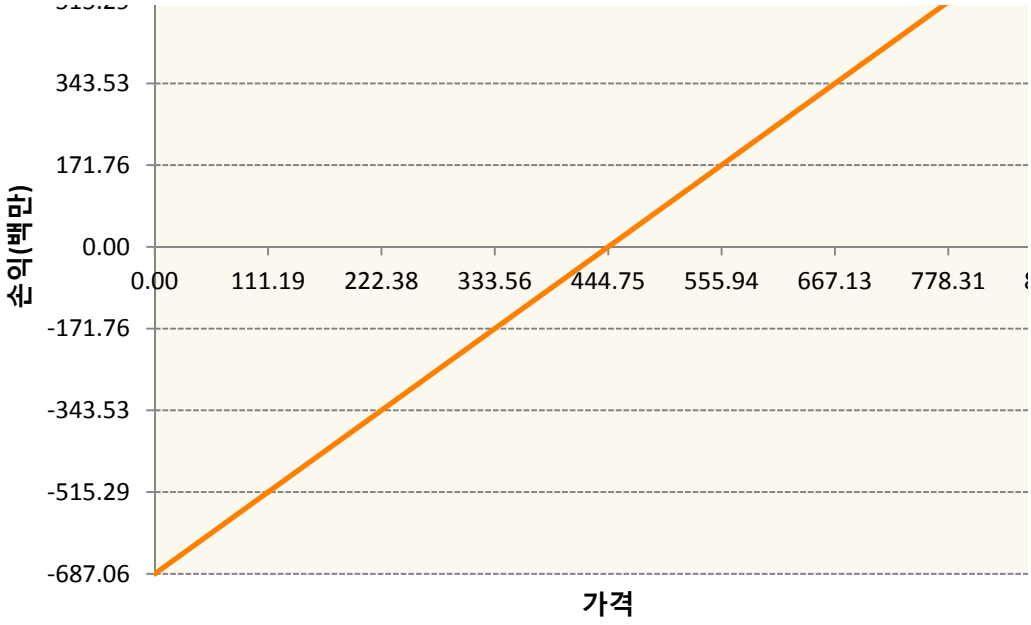

KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16
220.89
165.67
110.44
55.22
0.00
-55.22
-110.44
-165.67
-220.89
0.00
111.19
222.38
333.56
444.75
555.94
667.13
778.31
손익(백만)
가격


SBV6-SUGAR #11 (WORLD) OCT16
1,220.77
915.58
610.38
305.19
0.00
-305.19
-610.38
-915.58
-1,220.77
0.00
4.94
9.89
14.83
19.77
24.71
29.66
34.60
손익(백만)
가격


SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16
771.06
578.30
385.53
192.77
0.00
-192.77
-385.53
-578.30
-771.06
0.00
81.38
162.75
244.13
325.50
406.88
488.25
569.63
손익(백만)
가격


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16
1,715.67
1,286.75
857.83
428.92
0.00
-428.92
-857.83
-1,286.75
-1,715.67
0.00
251.13
502.25
753.38
1,004.50
1,255.63
1,506.75
1,757.88
손익(백만)
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
515.29



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ6	SOYBEAN OIL FUTR DEC16	66
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	35
CZ6	CORN FUTURE DEC16	137
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	56
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	18
SBV6	SUGAR #11 (WORLD) OCT16	98
SMZ6	SOYBEAN MEAL FUTR DEC16	62
SX6	SOYBEAN FUTURE NOV16	137
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	55

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

824