공시일	2016-08-24
기준일	2016-08-23

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	2016-08-24
기준일	2016-08-23

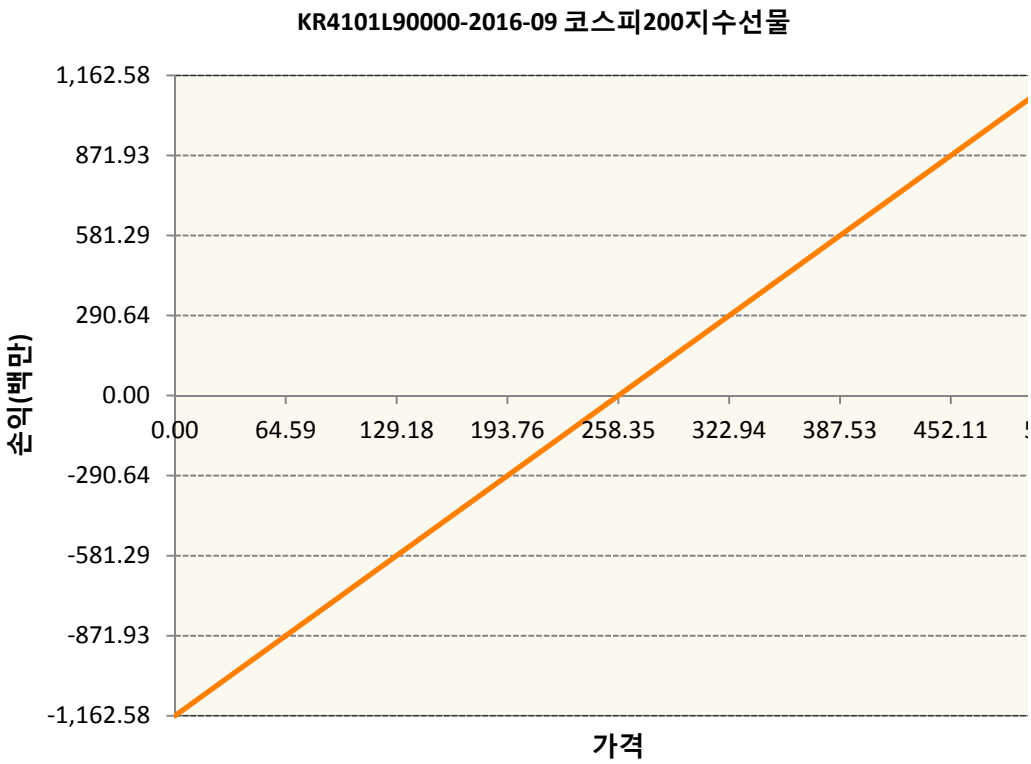
스마트인덱스모

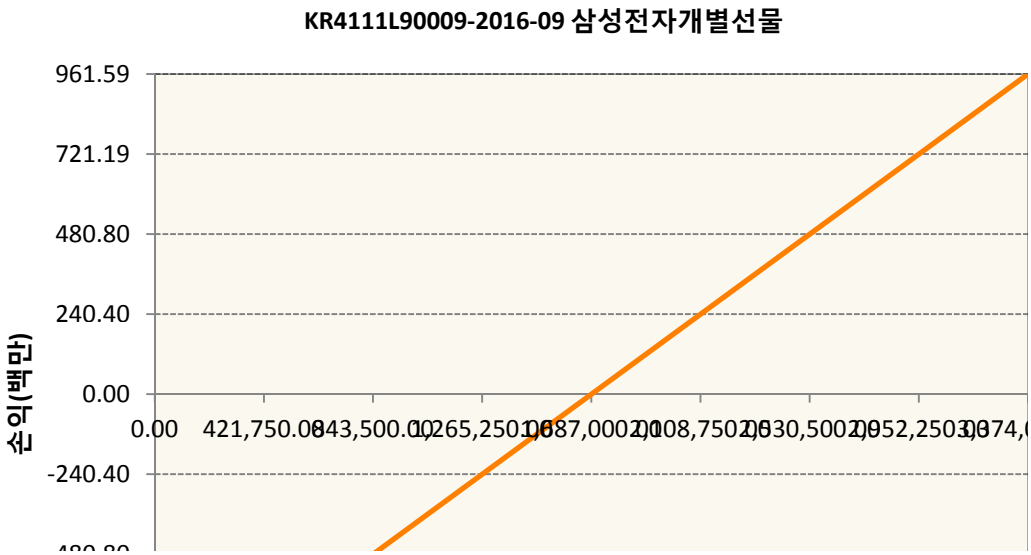
1. 계약금액

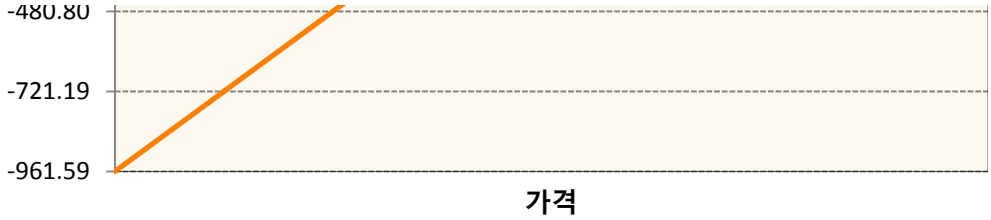
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,124	0	2,124	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						77
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
-5.33%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
-2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	26	26	26	26	26	26	26
5.33%	51	51	51	51	51	51	51
8.00%	77	77	77	77	77	77	77

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

157

공시일	2016-08-24
기준일	2016-08-23

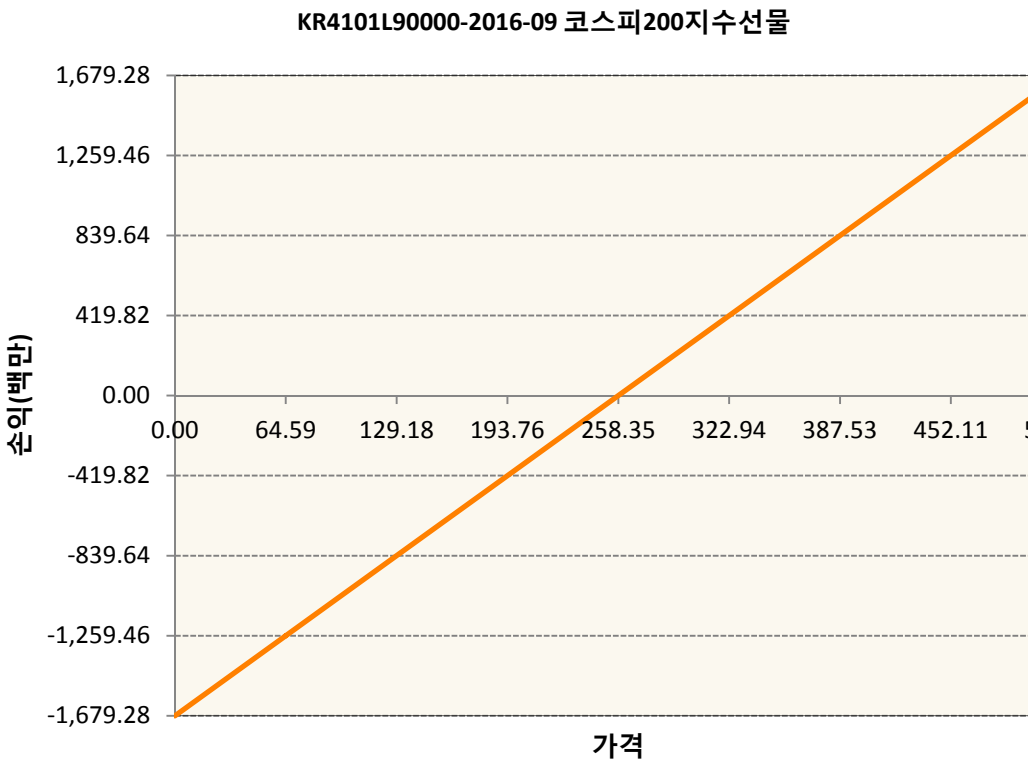
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,679	0	1,679	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%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90
-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%	90	90	90	90	90	90	90
8.00%	134	134	134	134	134	134	134

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

111

공시일	2016-08-24
기준일	2016-08-23

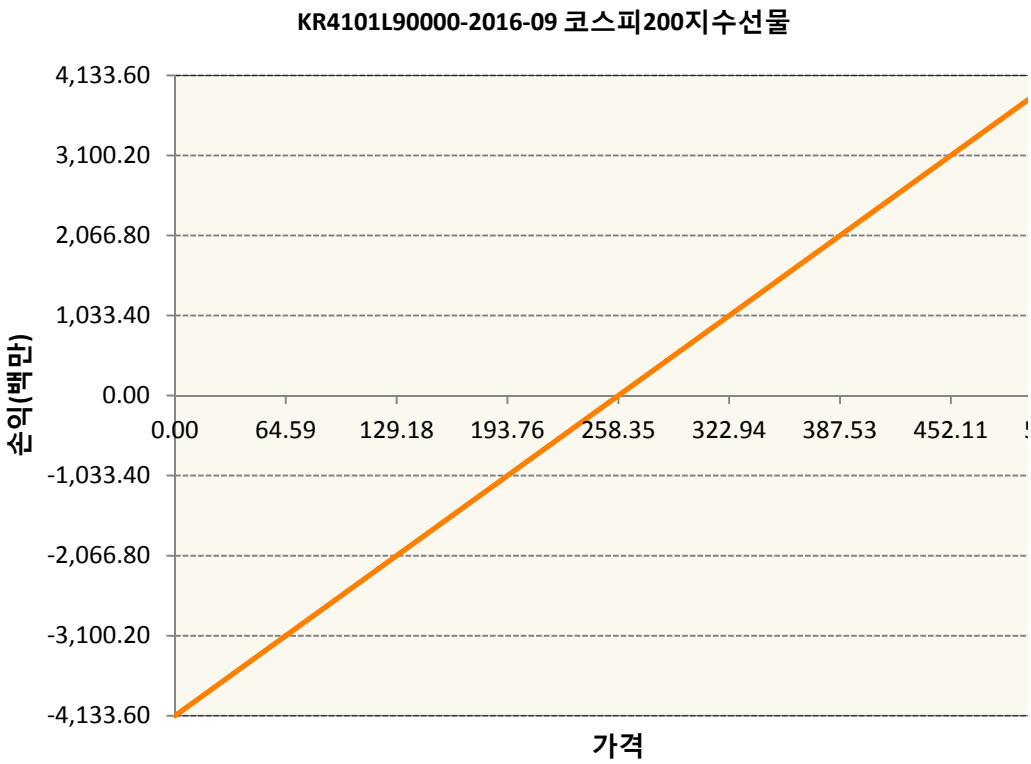
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	129	-129	장내
누계	유가증권	선물	4,134	0	4,134	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						331
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-331	-331	-331	-331	-331	-331	-331
-5.33%	-221	-221	-221	-221	-221	-221	-221
-2.67%	-110	-110	-110	-110	-110	-110	-110
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	110	110	110	110	110	110	110
5.33%	221	221	221	221	221	221	221
8.00%	331	331	331	331	331	331	331

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

272

공시일	2016-08-24
기준일	2016-08-23

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	11,105	0	11,105	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S160822	889

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

815

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-08-24
기준일	2016-08-23

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)

965

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-08-24
기준일	2016-08-23

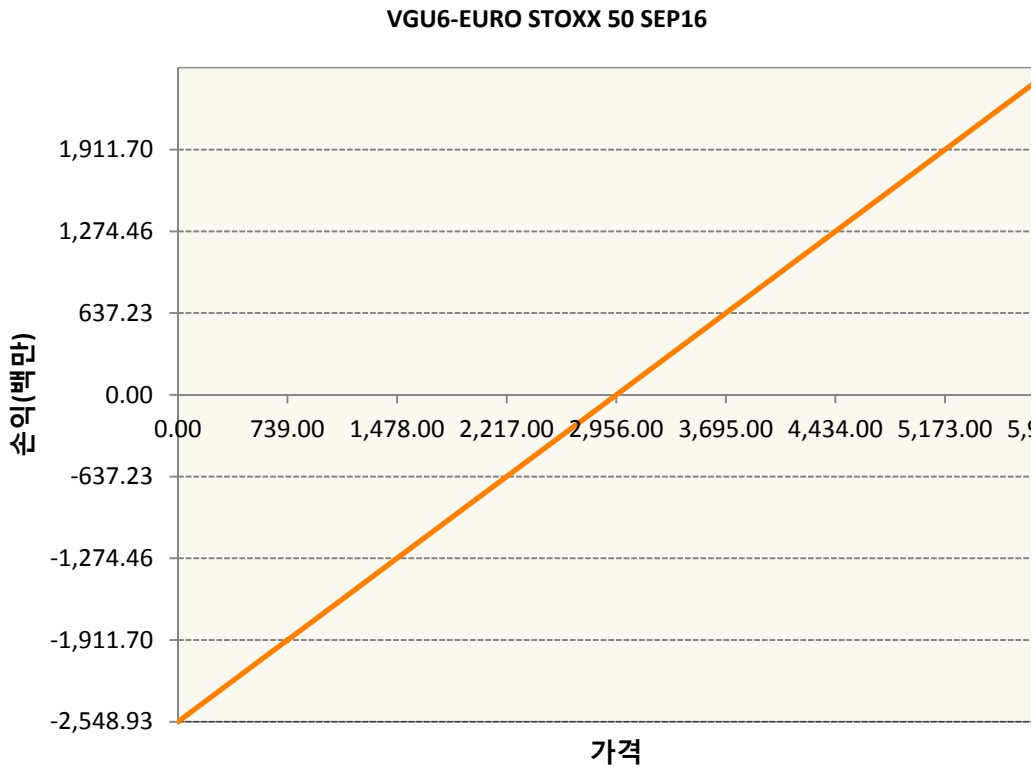
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,549	0	2,549	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 SEP16	204

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

(단위:백만원)

252

공시일	2016-08-24
기준일	2016-08-23

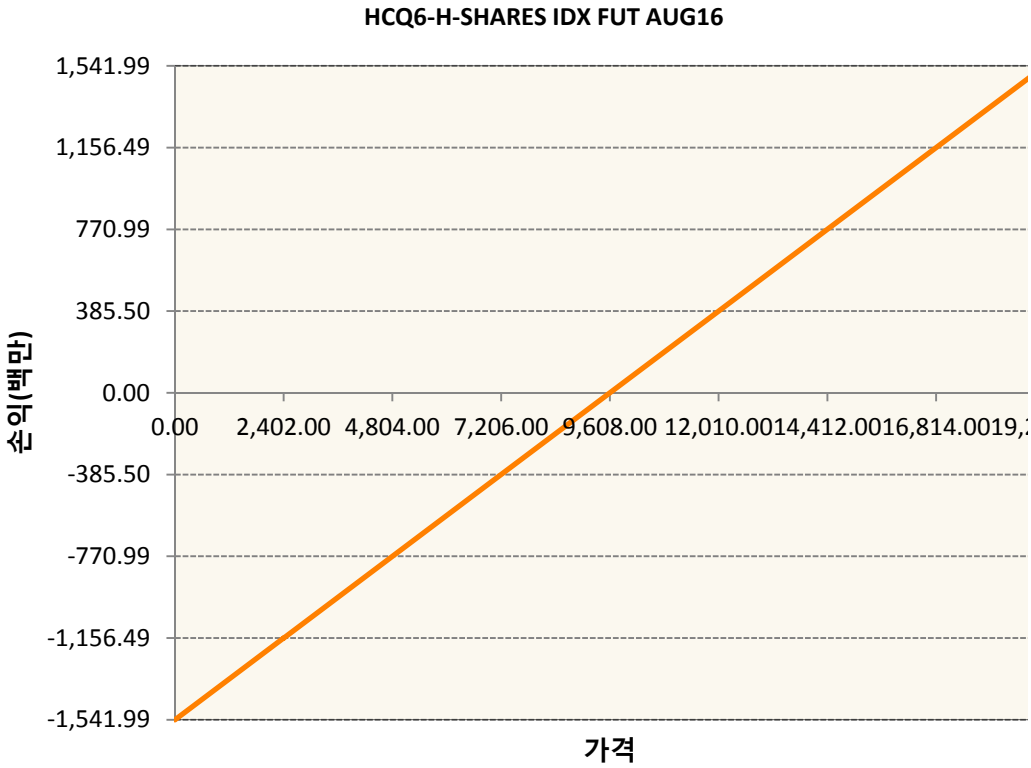
차이나인덱스모(주식-파생형)

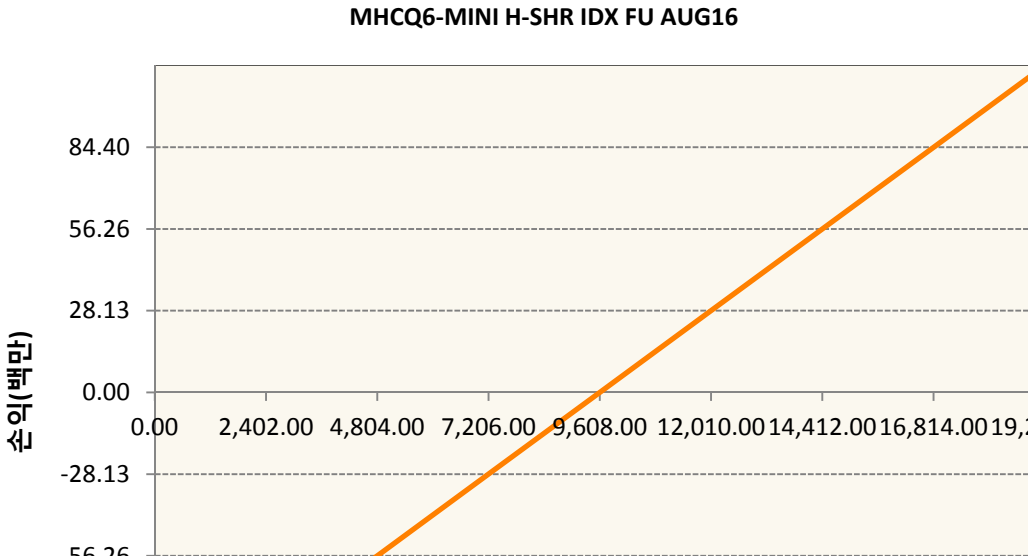
1. 계약금액

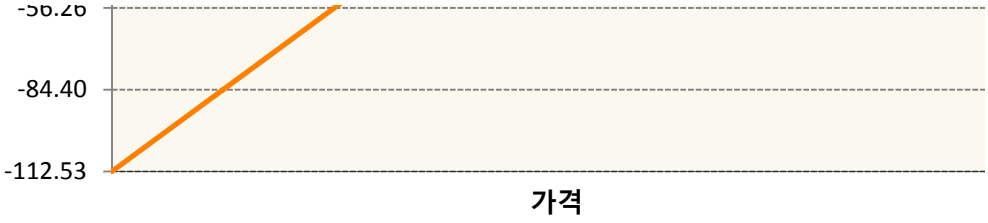
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,655	0	1,655	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	2016-08-24
기준일	2016-08-23

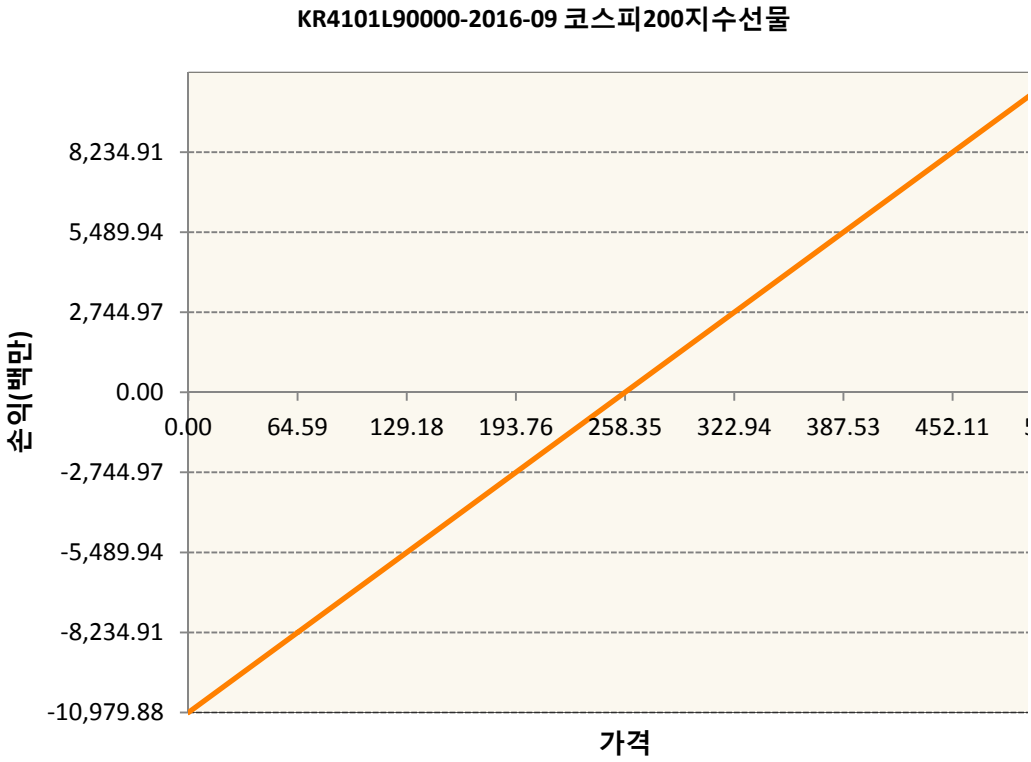
커버드콜(주식혼합-파생형)

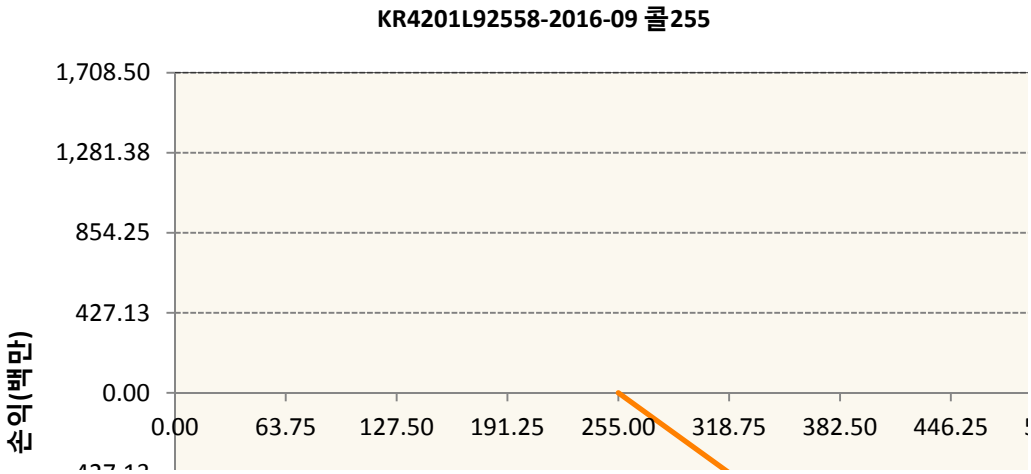
1. 계약금액

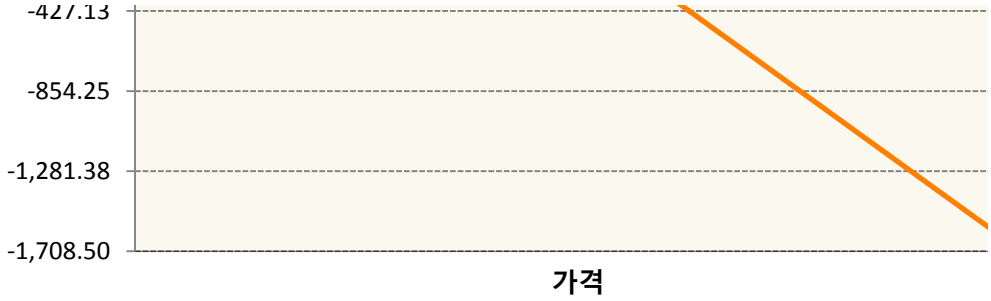
(단위:백만원)

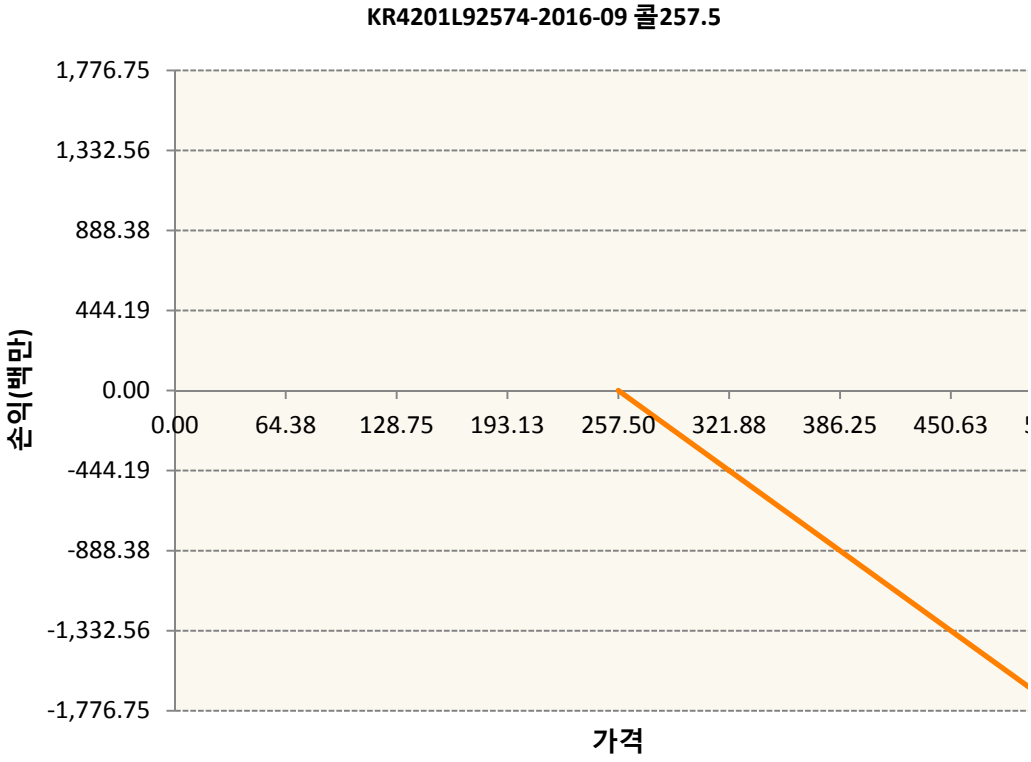
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,980	0	10,980	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,485	-3,485	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101L900 2016-09 코스피200지수선물							879
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-879	-879	-879	-879	-879	-879	-879
-5.33%	-586	-586	-586	-586	-586	-586	-586
-2.67%	-293	-293	-293	-293	-293	-293	-293
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	293	293	293	293	293	293	293
5.33%	586	586	586	586	586	586	586
8.00%	879	879	879	879	879	879	879
KR4201L925 2016-09 콜255							653
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	152	152	152	152	152	152	151
-5.33%	152	151	150	149	147	145	142
-2.67%	132	127	121	115	109	103	97
0%	17	12	6	0	-6	-12	-19
2.67%	-192	-193	-195	-196	-198	-201	-204
5.33%	-422	-422	-422	-423	-423	-423	-424
8.00%	-653	-653	-653	-653	-653	-653	-653
KR4201L925 2016-09 콜257.5							641

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	103	103	103	103	103	103	102
-5.33%	103	102	102	101	101	99	98
-2.67%	95	92	88	84	79	74	69
0%	21	14	7	0	-7	-14	-22
2.67%	-169	-171	-174	-177	-181	-185	-189
5.33%	-403	-403	-403	-404	-404	-405	-407
8.00%	-640	-640	-640	-640	-640	-640	-641

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

2,345

공시일	2016-08-24
기준일	2016-08-23

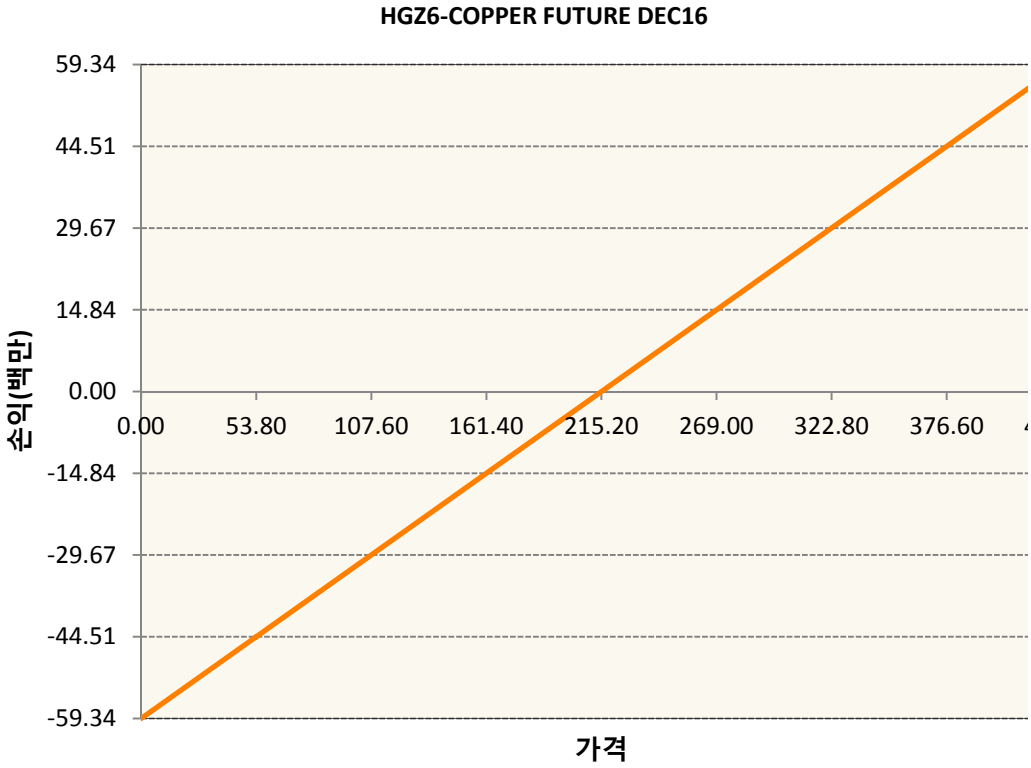
메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

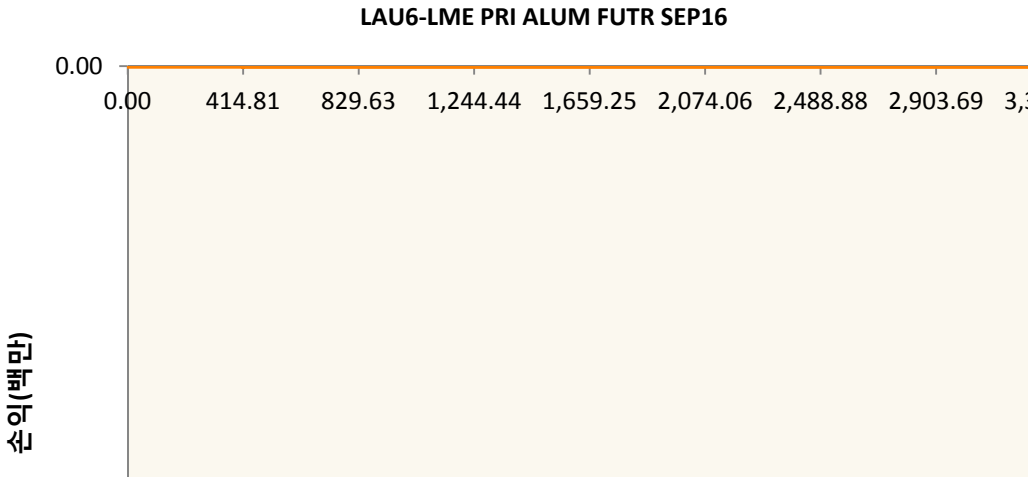
1. 계약금액

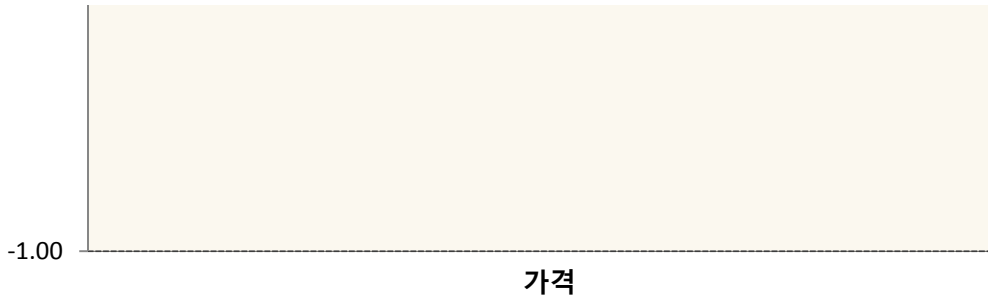
(단위:백만원)

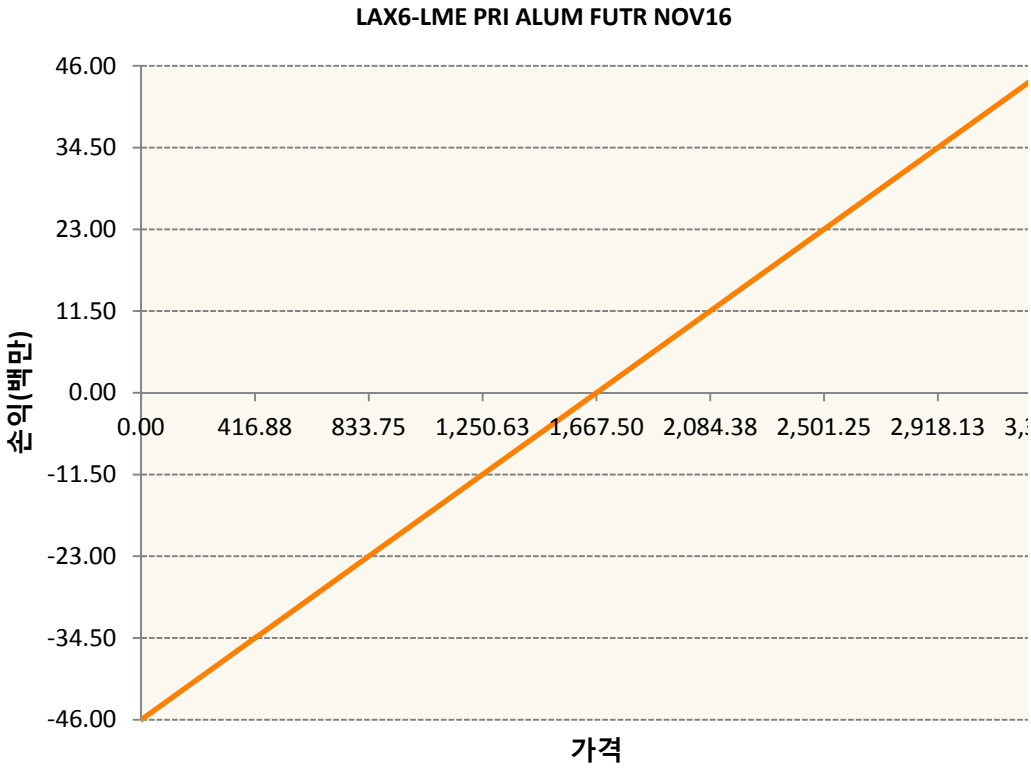
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	42	0	42	
누계	유가증권	선물	431	108	323	

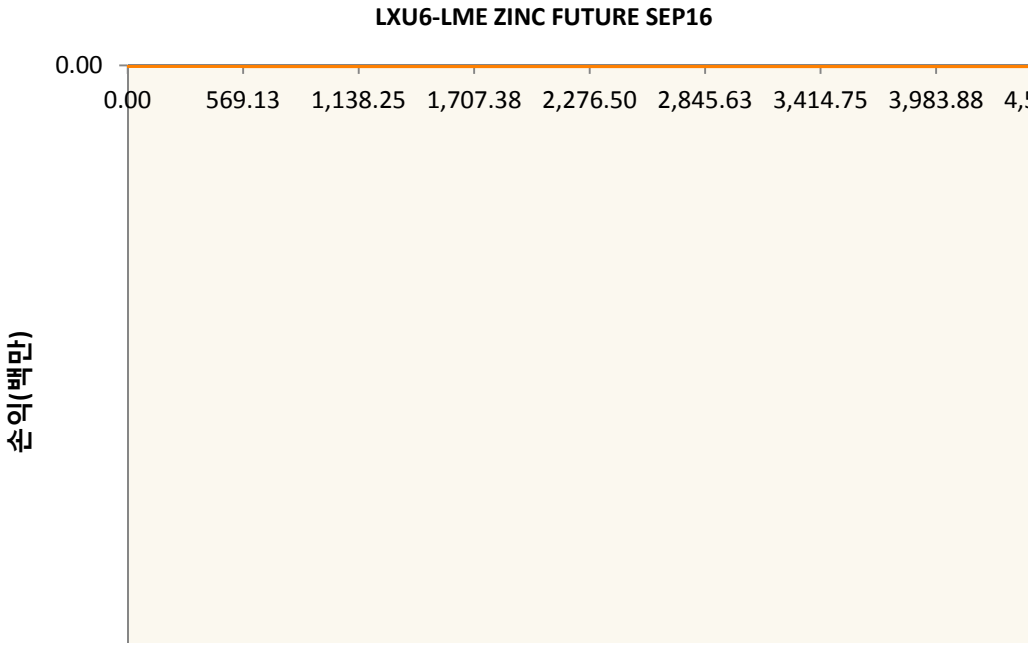
2. 만기시점의 손익구조

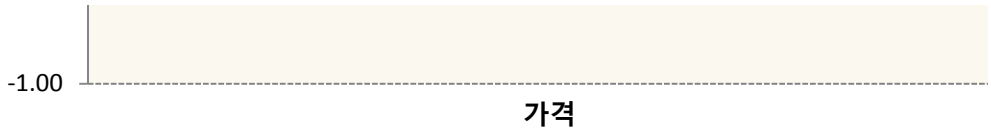


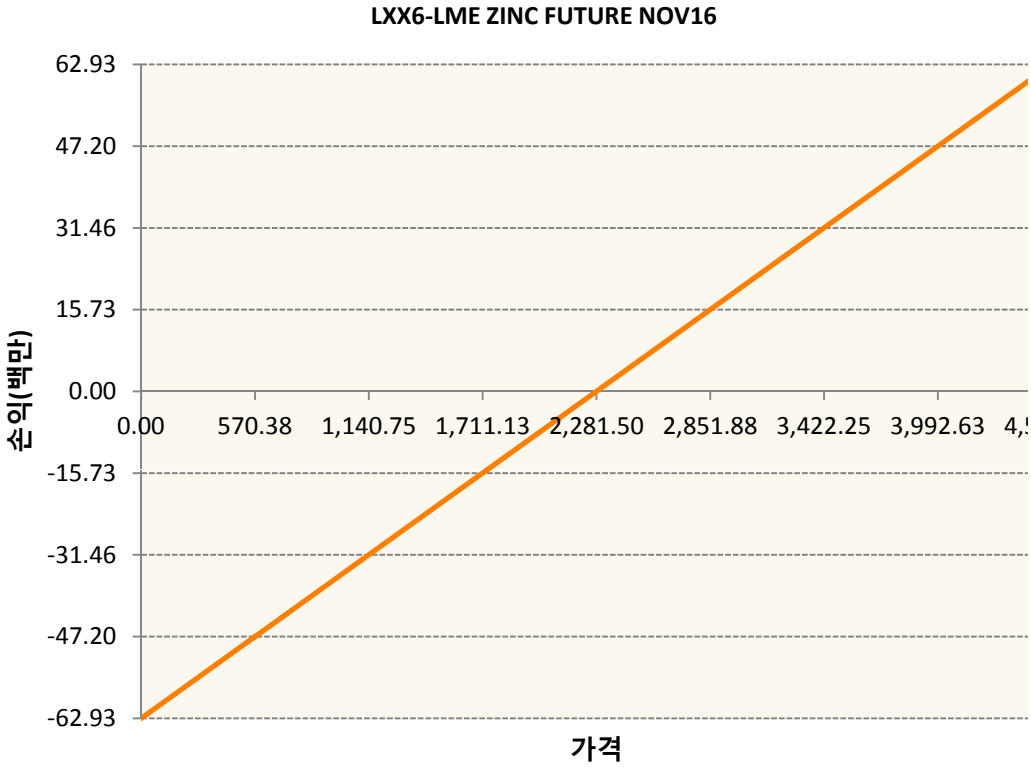


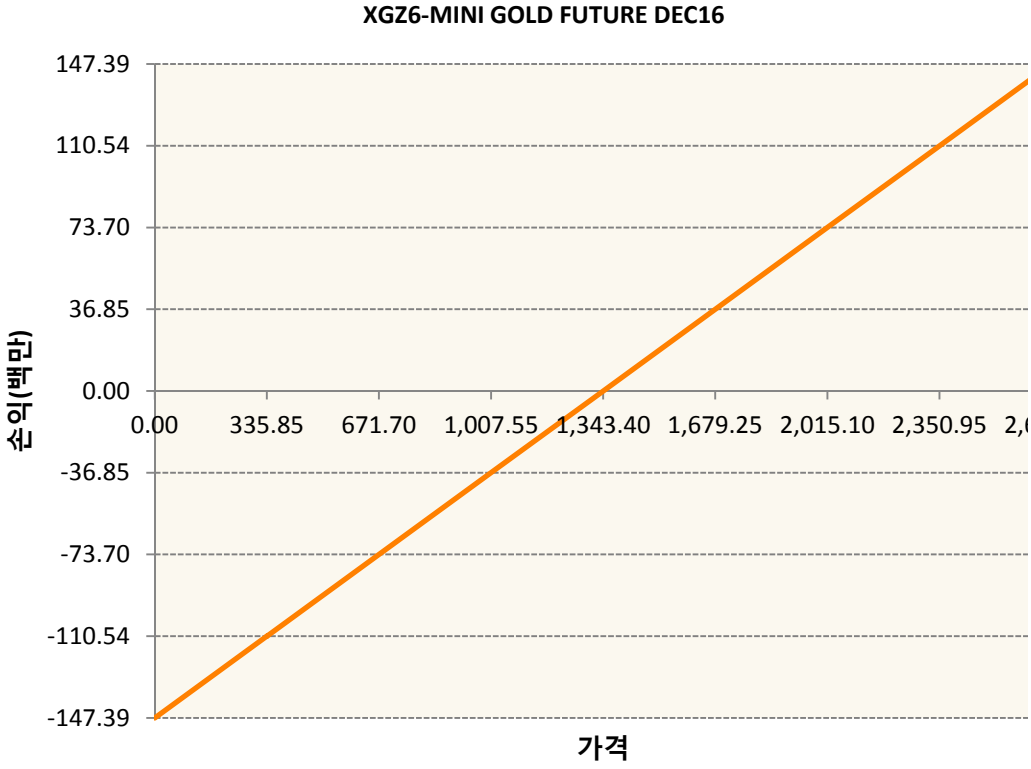

-1.00
가격

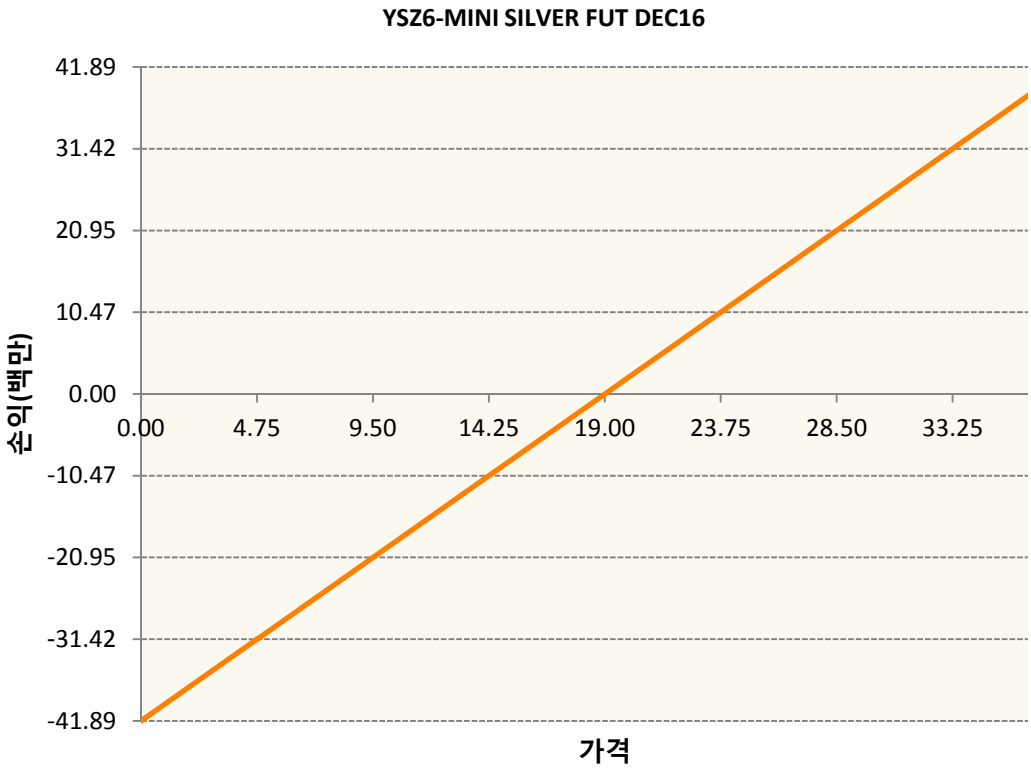

LAX6-LME PRI ALUM FUTR NOV16
46.00
34.50
23.00
11.50
0.00
-11.50
-23.00
-34.50
-46.00
0.00
416.88
833.75
1,250.63
1,667.50
2,084.38
2,501.25
2,918.13
순익(백만)
가격


LXU6-LME ZINC FUTURE SEP16
0.00
0.00
569.13
1,138.25
1,707.38
2,276.50
2,845.63
3,414.75
3,983.88
순익(백만)


-1.00
가격


LXX6-LME ZINC FUTURE NOV16
62.93
47.20
31.46
15.73
0.00
-15.73
-31.46
-47.20
-62.93
0.00
570.38
1,140.75
1,711.13
2,281.50
2,851.88
3,422.25
3,992.63
순익(백만)
가격


XGZ6-MINI GOLD FUTURE DEC16
147.39
110.54
73.70
36.85
0.00
-36.85
-73.70
-110.54
-147.39
0.00
335.85
671.70
1,007.55
1,343.40
1,679.25
2,015.10
2,350.95
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	2016-08-24
기준일	2016-08-23

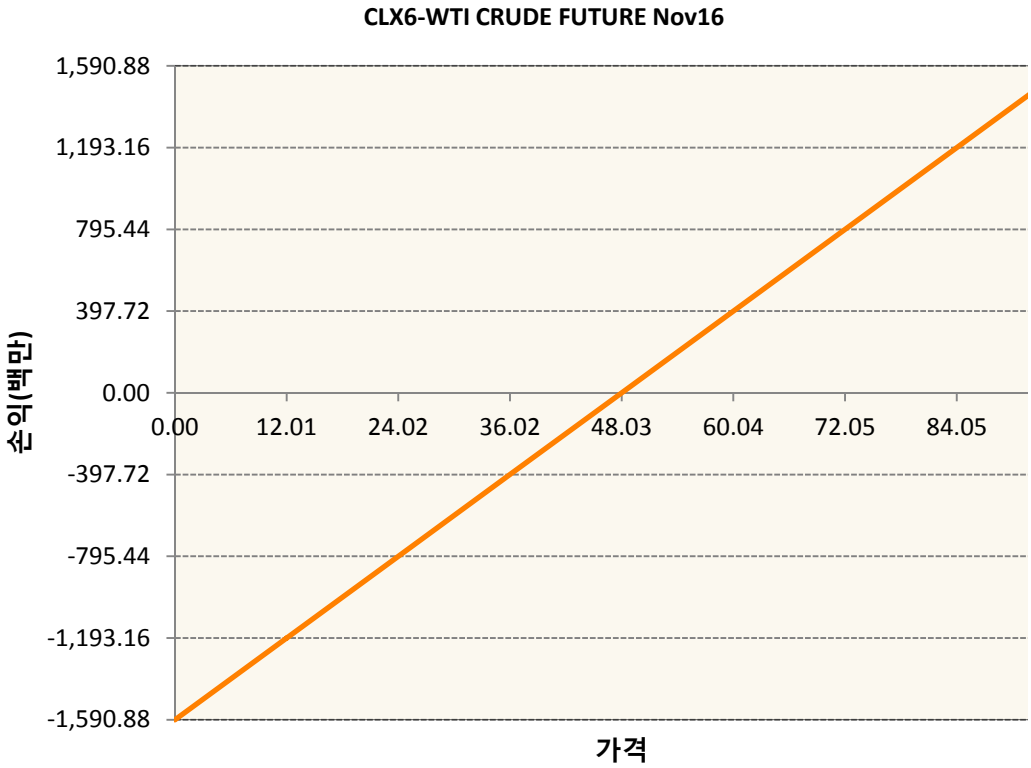
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

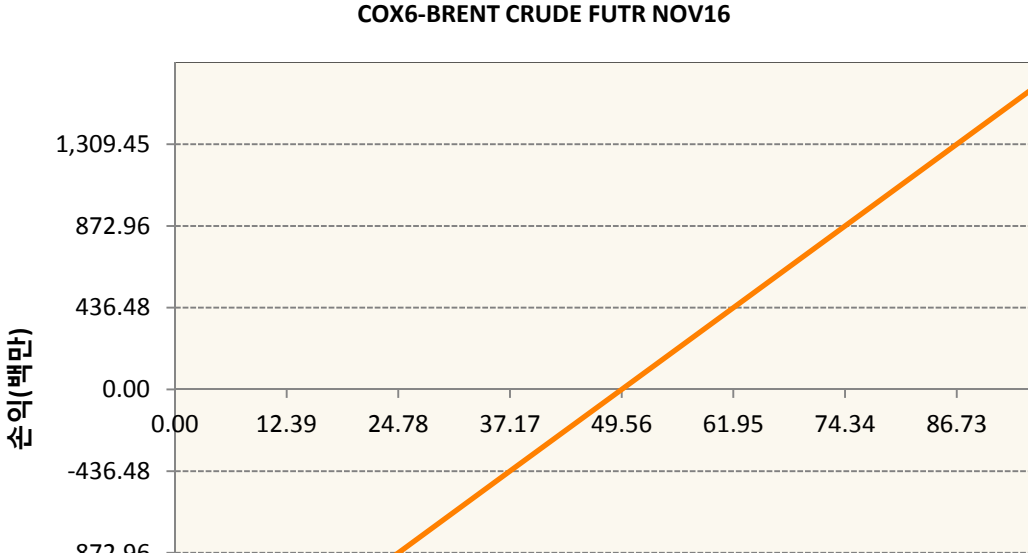
1. 계약금액

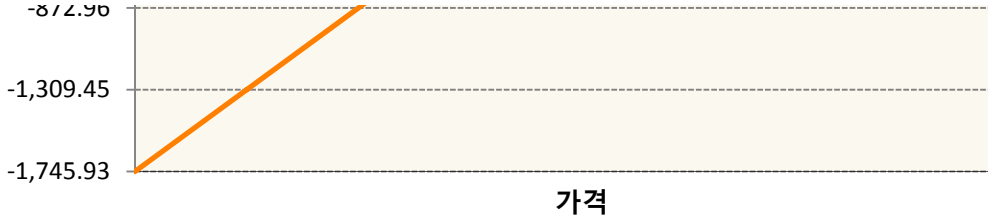
(단위:백만원)

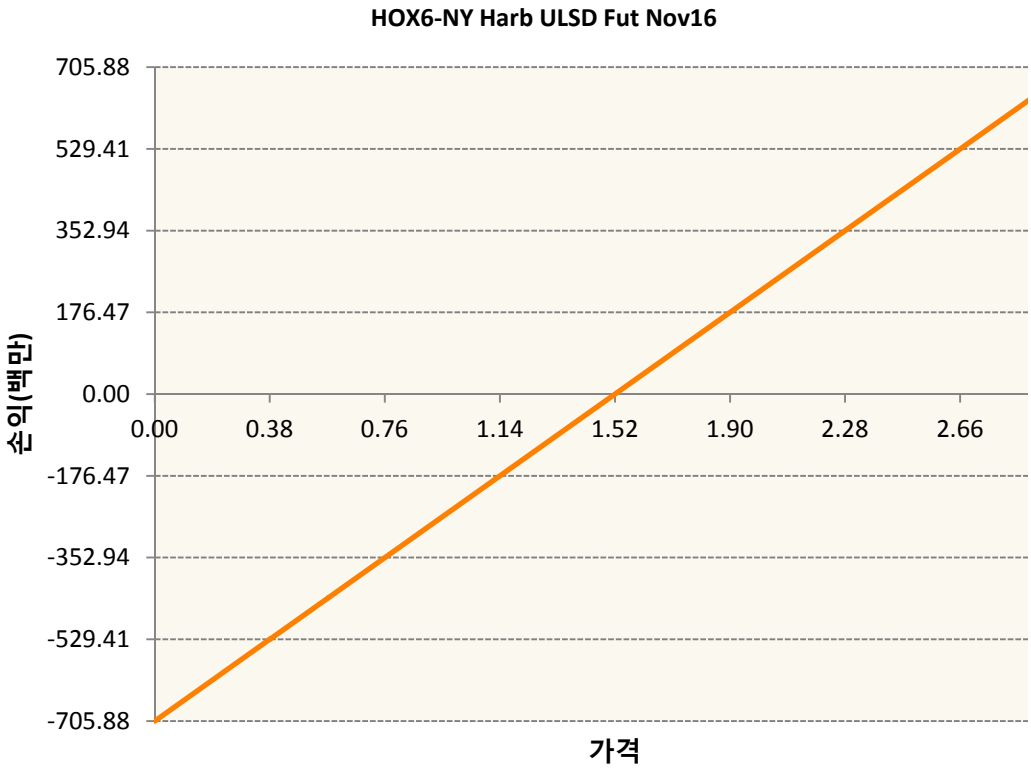
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,252	0	6,252	

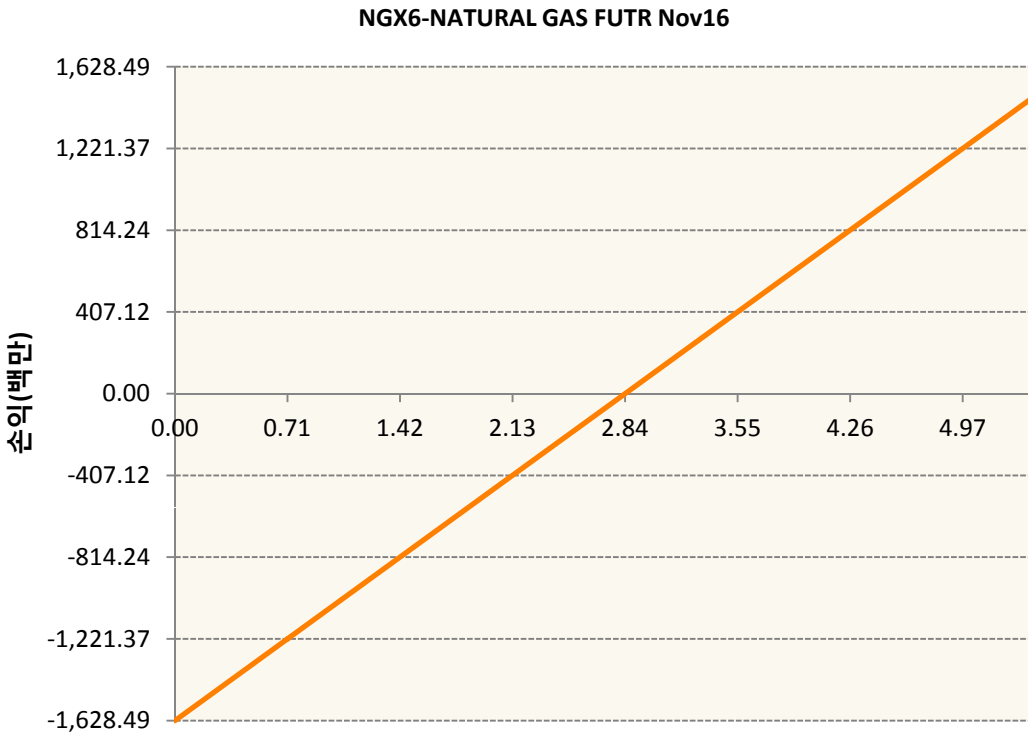
2. 만기시점의 손익구조



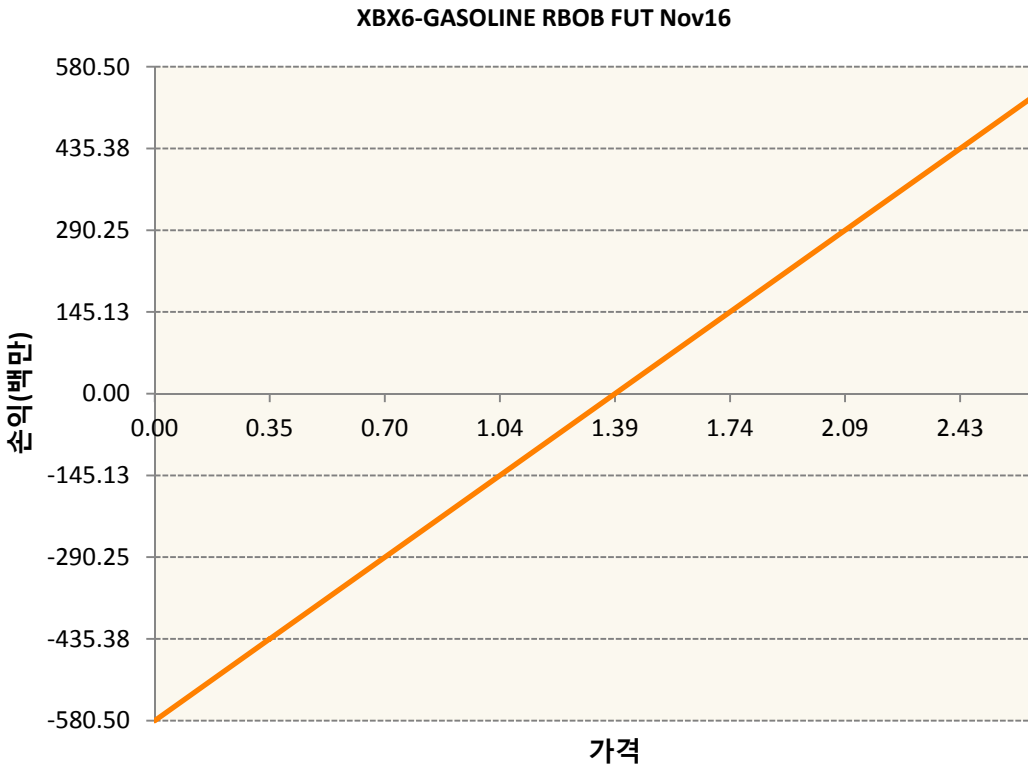



-1,309.45
-1,745.93
가격


HOX6-NY Harb ULSD Fut Nov16
705.88
529.41
352.94
176.47
0.00
-176.47
-352.94
-529.41
-705.88
0.00
0.38
0.76
1.14
1.52
1.90
2.28
2.66
순익(백만)
가격


NGX6-NATURAL GAS FUTR Nov16
1,628.49
1,221.37
814.24
407.12
0.00
-407.12
-814.24
-1,221.37
-1,628.49
0.00
0.71
1.42
2.13
2.84
3.55
4.26
4.97
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX6	WTI CRUDE FUTURE Nov16	127
COX6	BRENT CRUDE FUTR NOV16	140
HOX6	NY Harb ULSD Fut Nov16	56
NGX6	NATURAL GAS FUTR Nov16	130
XBX6	GASOLINE RBOB FUT Nov16	46

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,120

공시일	2016-08-24
기준일	2016-08-23

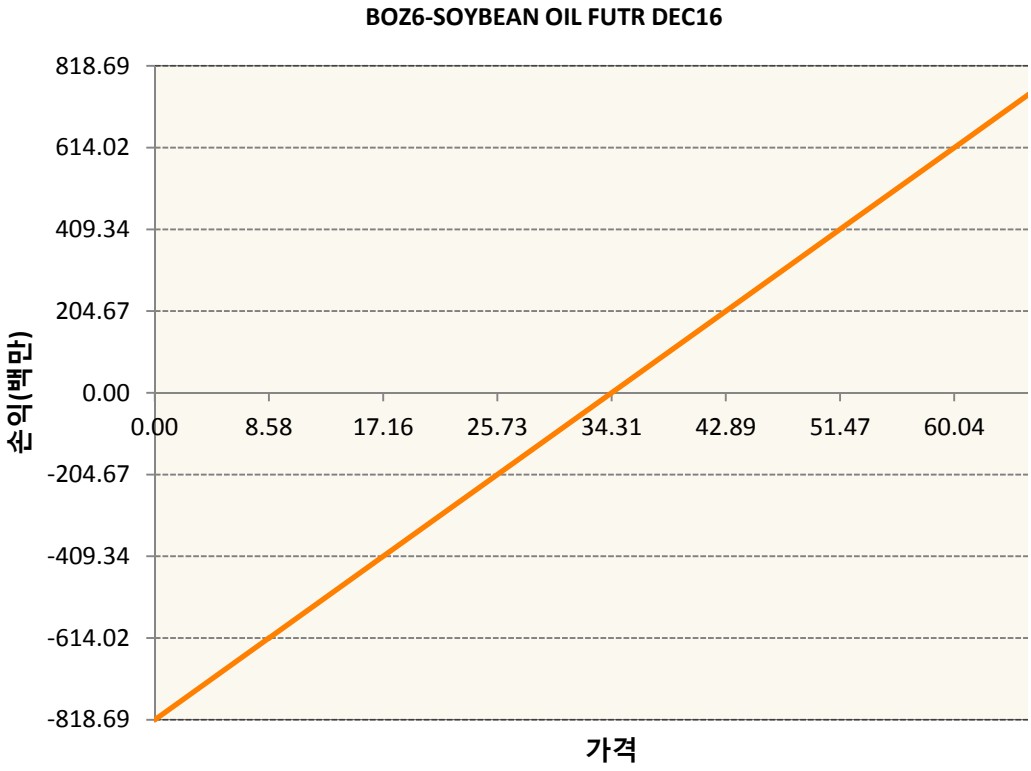
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

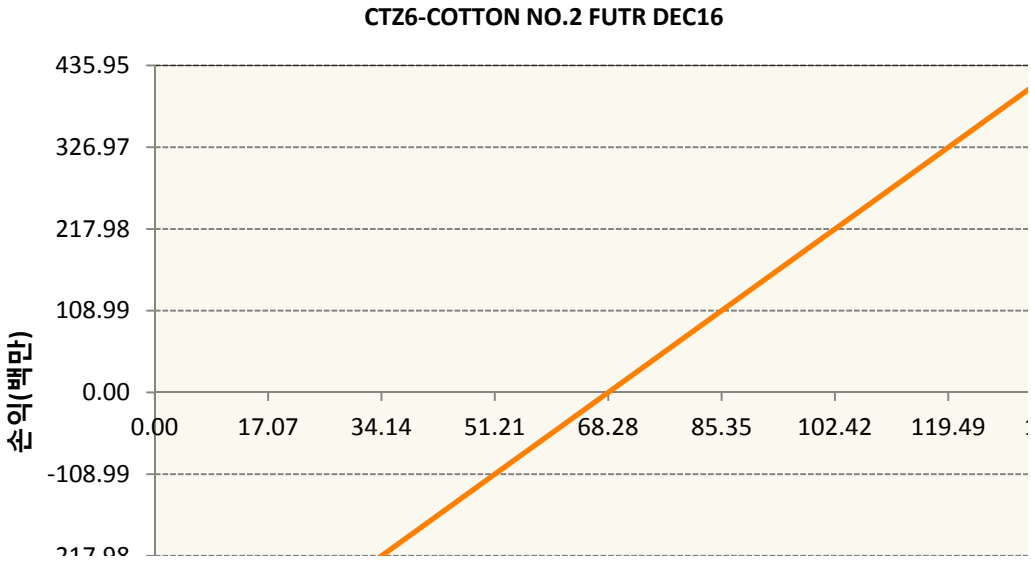
1. 계약금액

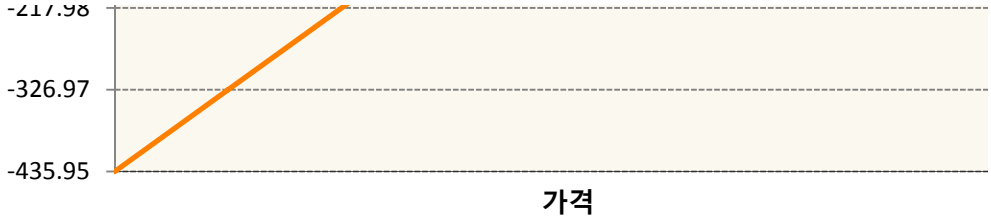
(단위:백만원)

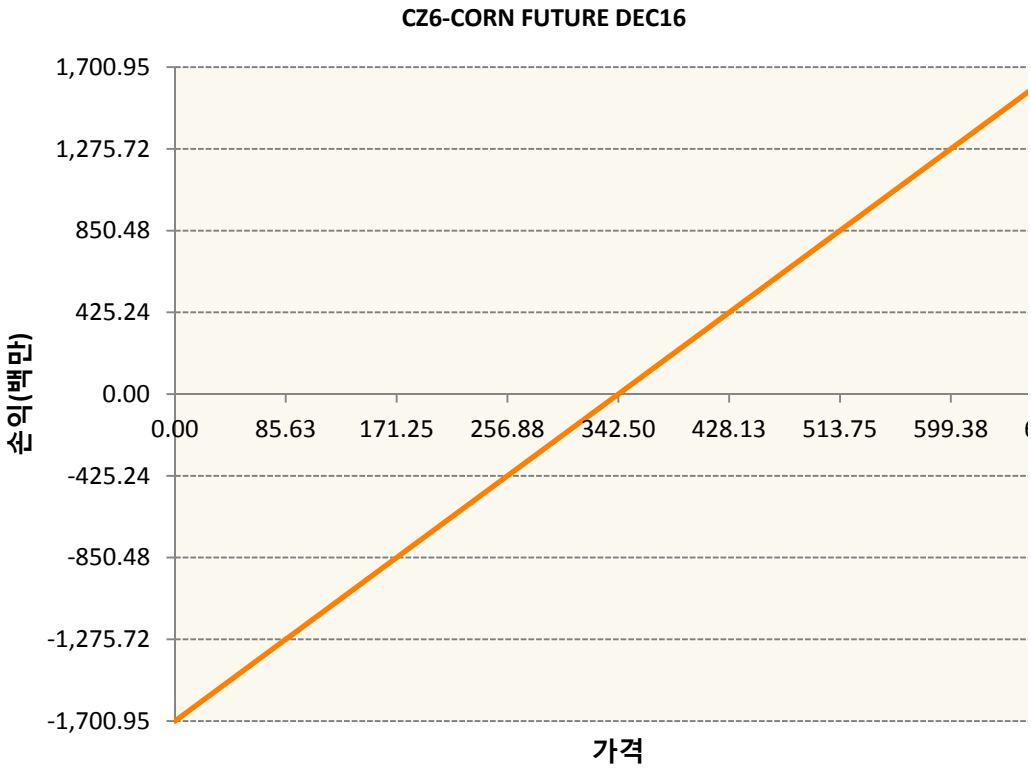
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,353	0	8,353	

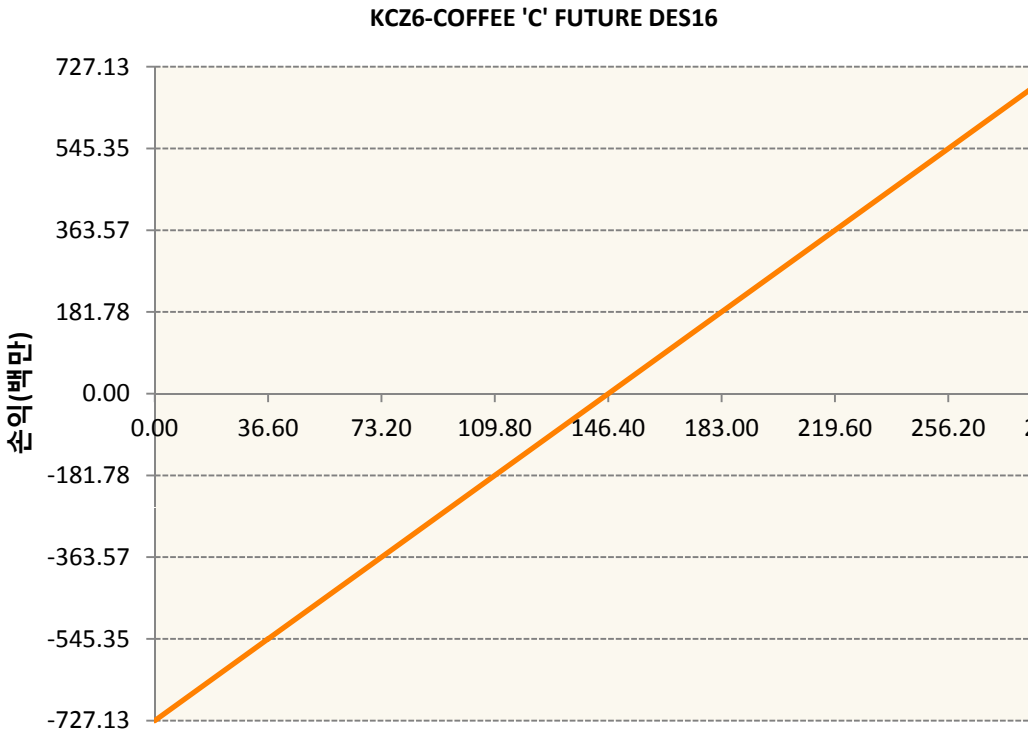
2. 만기시점의 손익구조



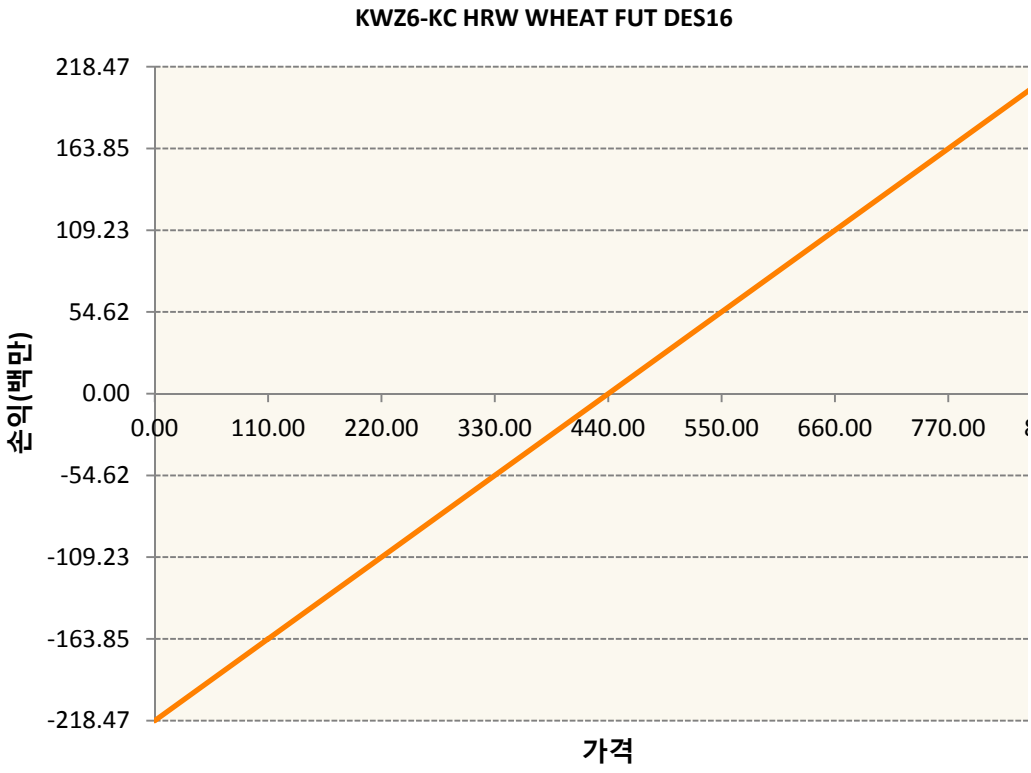


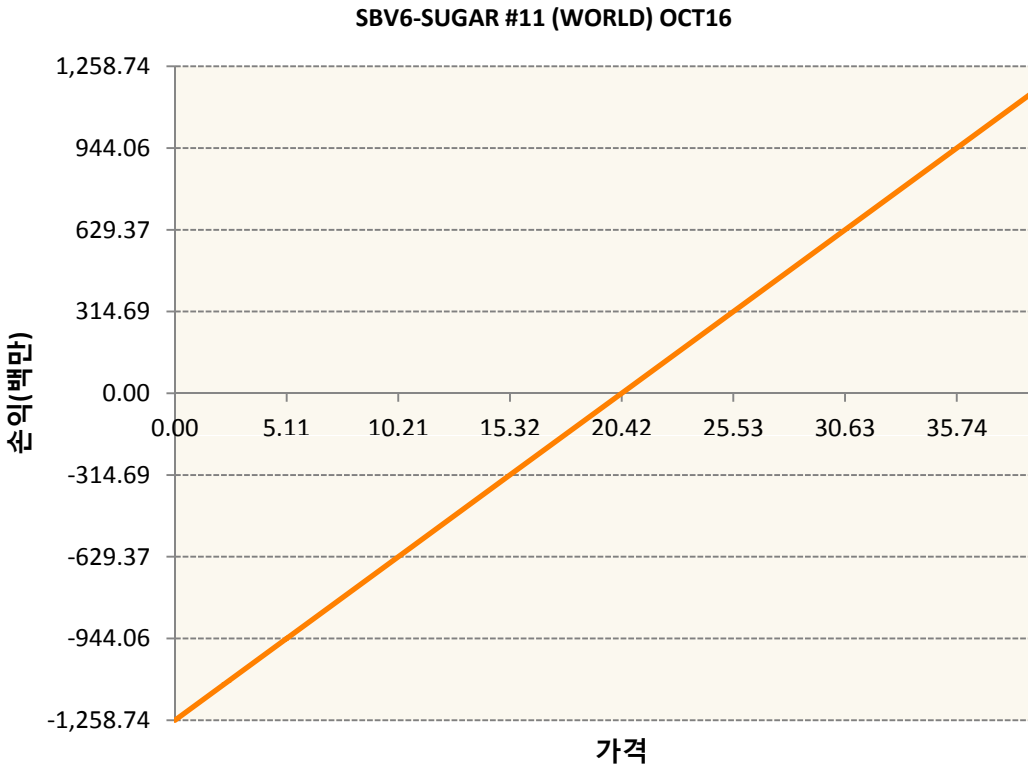

-326.97
-435.95
가격

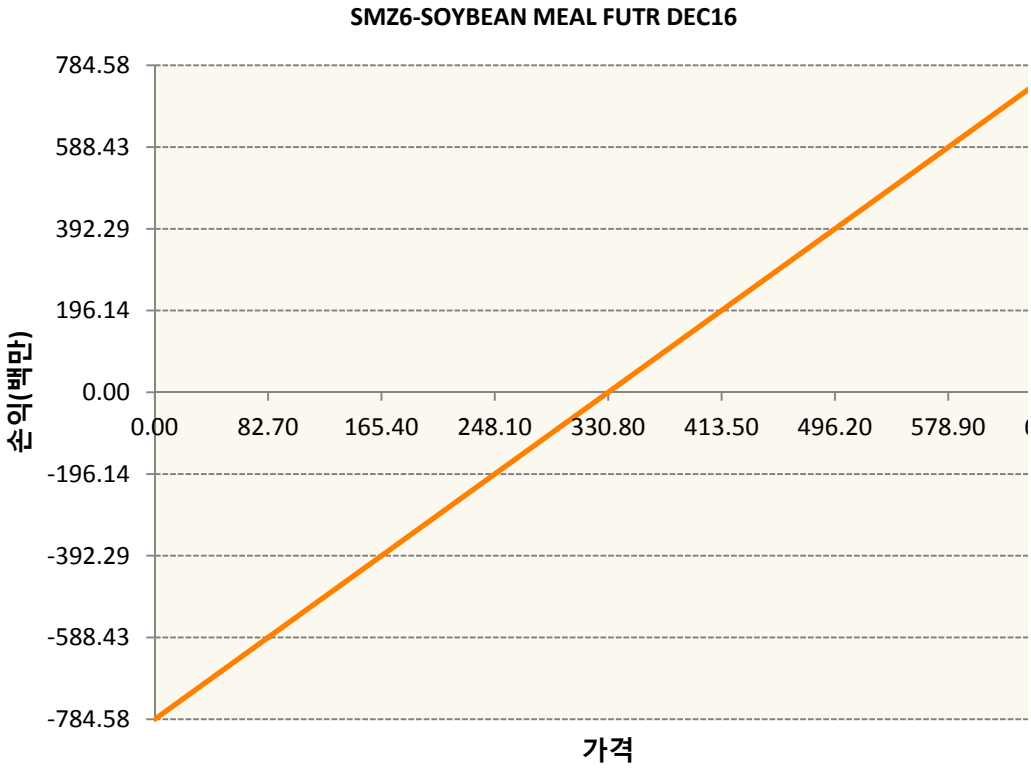

CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,700.95
1,275.72
850.48
425.24
0.00
-425.24
-850.48
-1,275.72
-1,700.95
0.00
85.63
171.25
256.88
342.50
428.13
513.75
599.38
순익(백만)
가격

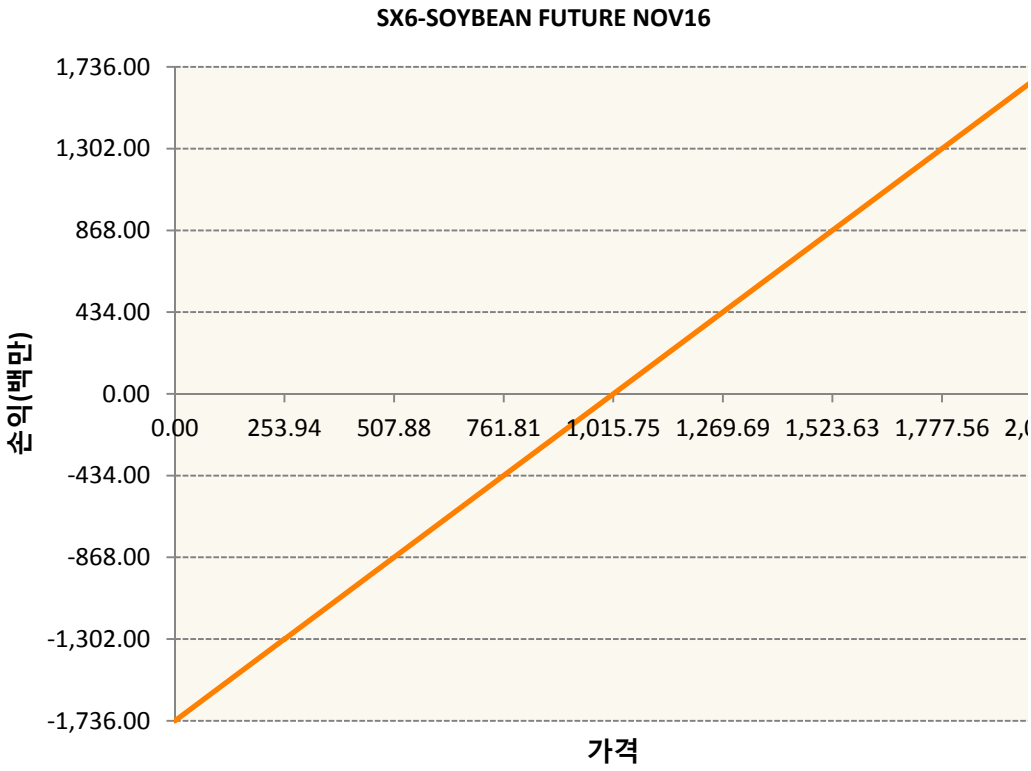

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
727.13
545.35
363.57
181.78
0.00
-181.78
-363.57
-545.35
-727.13
0.00
36.60
73.20
109.80
146.40
183.00
219.60
256.20
순익(백만)

가격

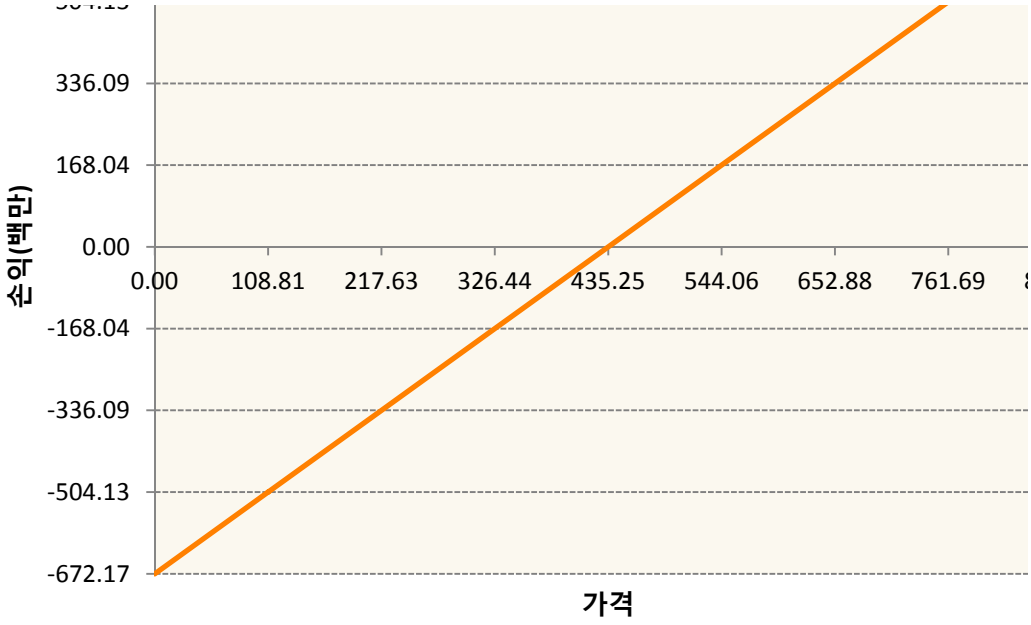

KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16
218.47
163.85
109.23
54.62
0.00
-54.62
-109.23
-163.85
-218.47
0.00
110.00
220.00
330.00
440.00
550.00
660.00
770.00
손익(백만)
가격


SBV6-SUGAR #11 (WORLD) OCT16
1,258.74
944.06
629.37
314.69
0.00
-314.69
-629.37
-944.06
-1,258.74
0.00
5.11
10.21
15.32
20.42
25.53
30.63
35.74
손익(백만)
가격


SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16
784.58
588.43
392.29
196.14
0.00
-196.14
-392.29
-588.43
-784.58
0.00
82.70
165.40
248.10
330.80
413.50
496.20
578.90
손익(백만)
가격


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16
1,736.00
1,302.00
868.00
434.00
0.00
-434.00
-868.00
-1,302.00
-1,736.00
0.00
253.94
507.88
761.81
1,015.75
1,269.69
1,523.63
1,777.56
손익(백만)
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
672.17
504.13



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ6	SOYBEAN OIL FUTR DEC16	65
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	35
CZ6	CORN FUTURE DEC16	136
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	58
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	17
SBV6	SUGAR #11 (WORLD) OCT16	101
SMZ6	SOYBEAN MEAL FUTR DEC16	63
SX6	SOYBEAN FUTURE NOV16	139
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	54

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

832