공시일	2016-08-26
기준일	2016-08-25

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	2016-08-26
기준일	2016-08-25

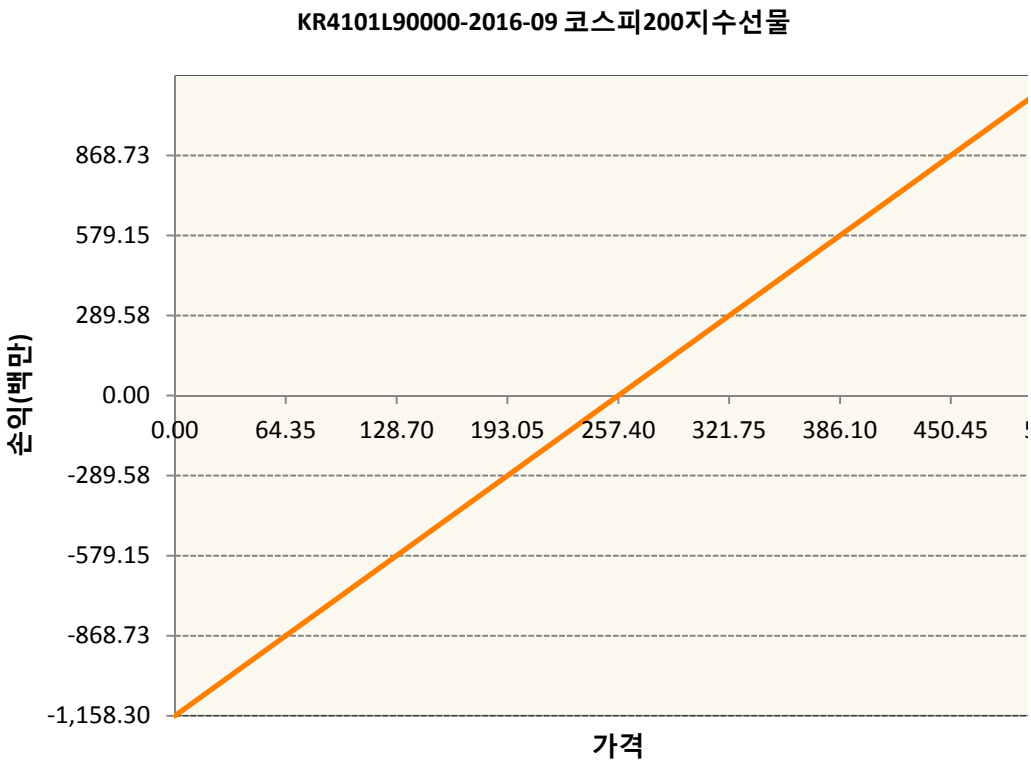
스마트인덱스모

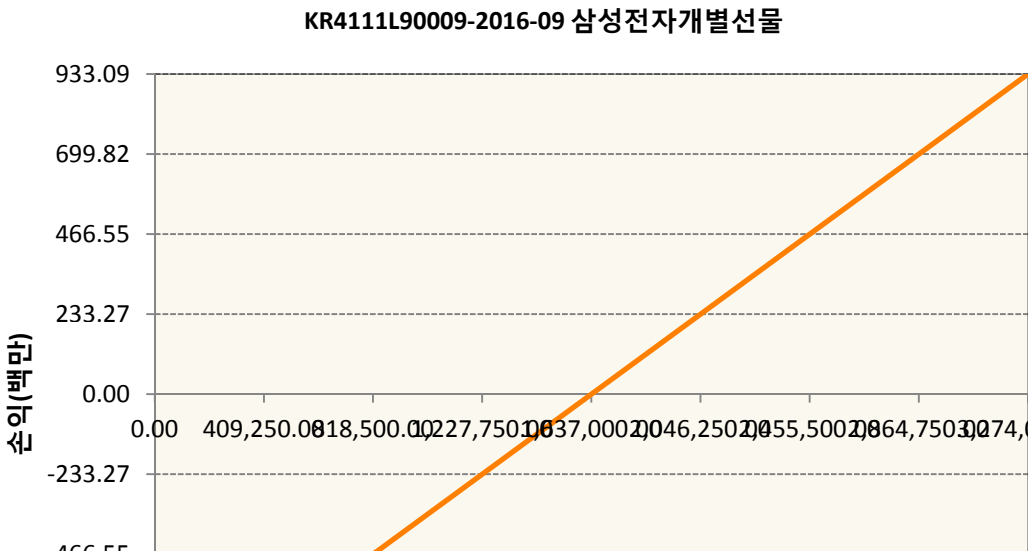
1. 계약금액

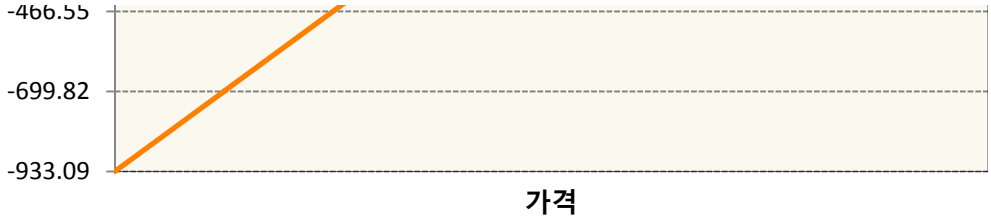
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,091	0	2,091	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)

152

공시일	2016-08-26
기준일	2016-08-25

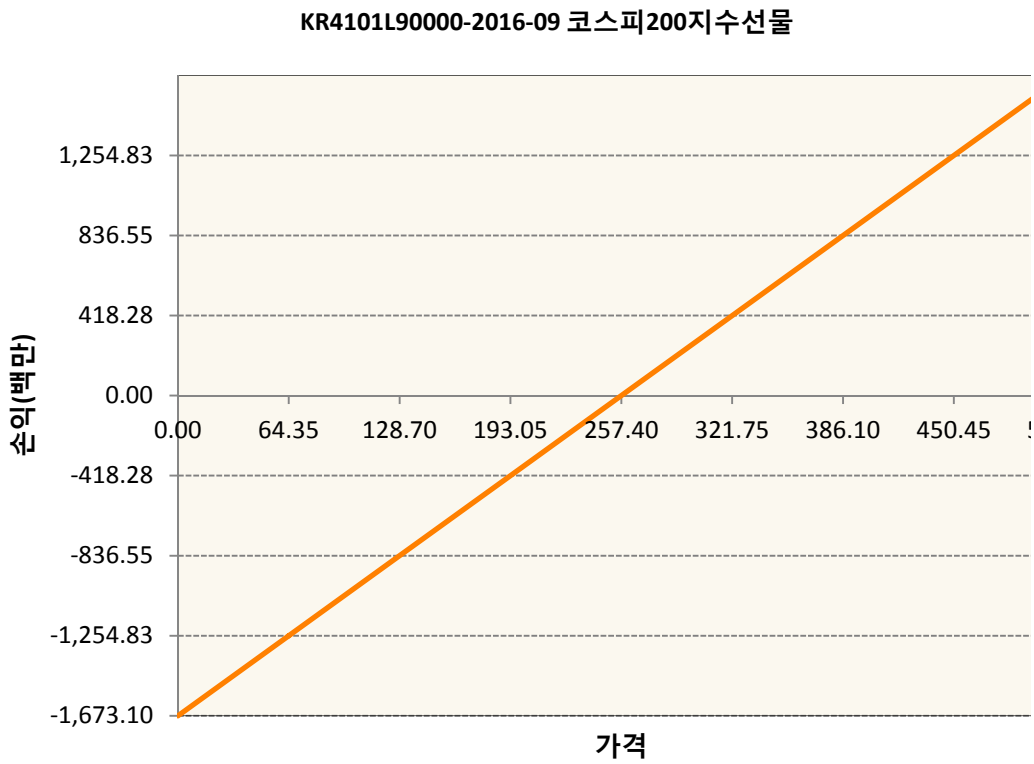
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,673	0	1,673	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)

109

공시일	2016-08-26
기준일	2016-08-25

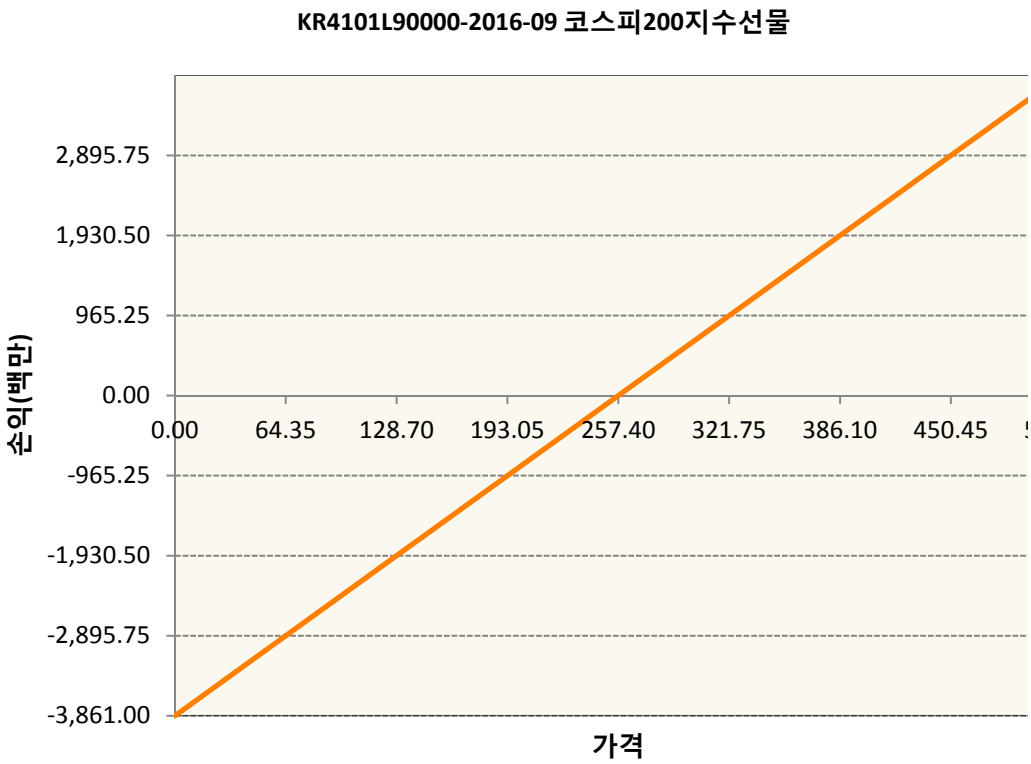
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	3,861	0	3,861	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						309
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-309	-309	-309	-309	-309	-309	-309
-5.33%	-206	-206	-206	-206	-206	-206	-206
-2.67%	-103	-103	-103	-103	-103	-103	-103
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	103	103	103	103	103	103	103
5.33%	206	206	206	206	206	206	206
8.00%	309	309	309	309	309	309	309

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

251

공시일	2016-08-26
기준일	2016-08-25

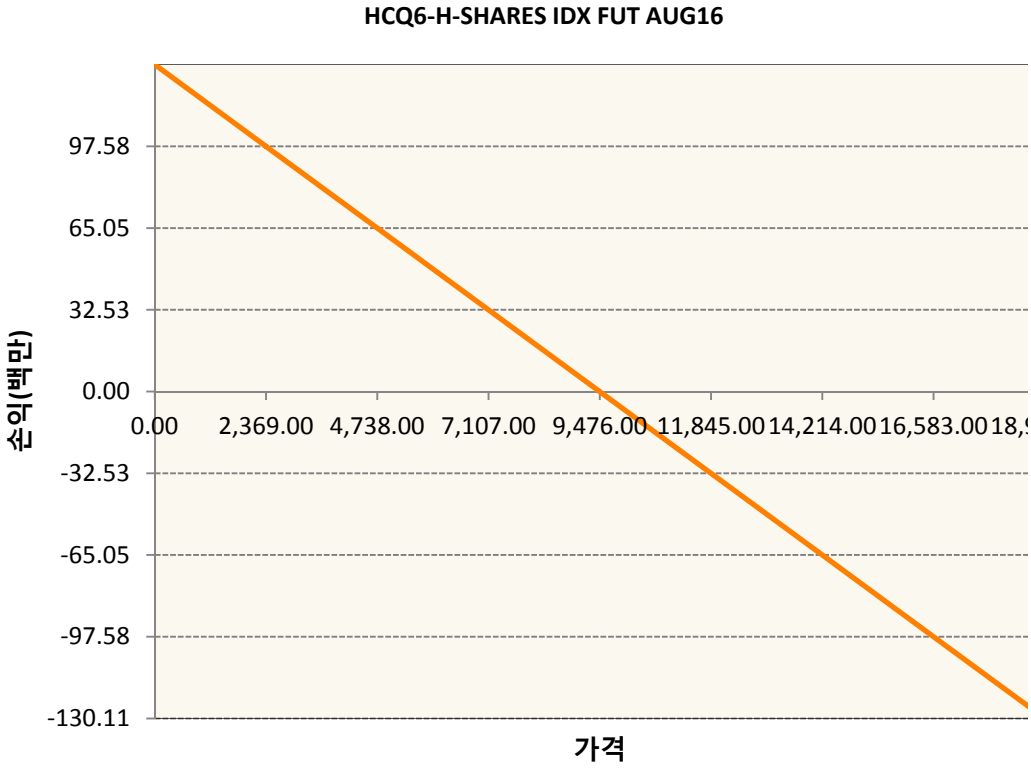
아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

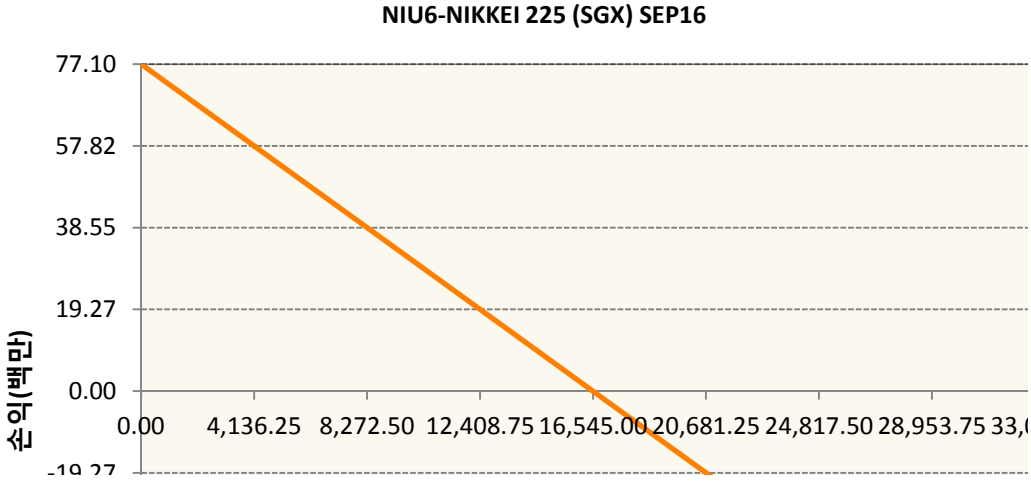
1. 계약금액

(단위:백만원)

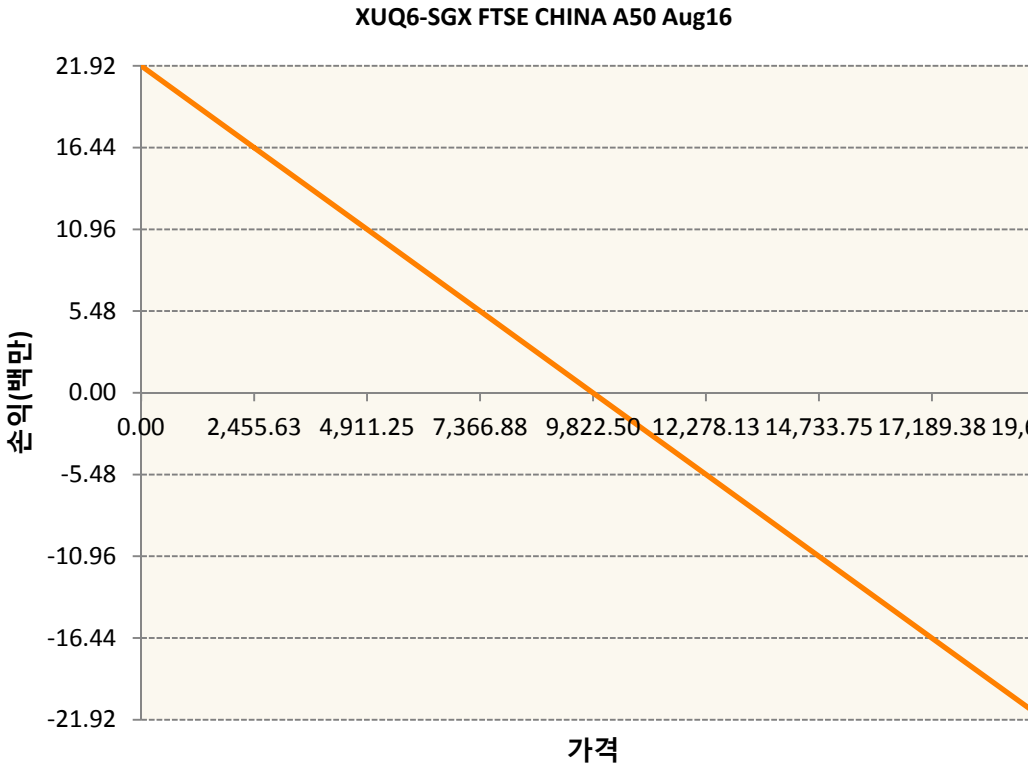
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	99	-99	
누계	유가증권	선물	0	130	-130	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCQ6	H-SHARES IDX FUT AUG16	10
NIU6	NIKKEI 225 (SGX) SEP16	6
XUQ6	SGX FTSE CHINA A50 Aug16	2

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

26

공시일	2016-08-26
기준일	2016-08-25

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	888

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

797

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-08-26
기준일	2016-08-25

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	402

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

947

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-08-26
기준일	2016-08-25

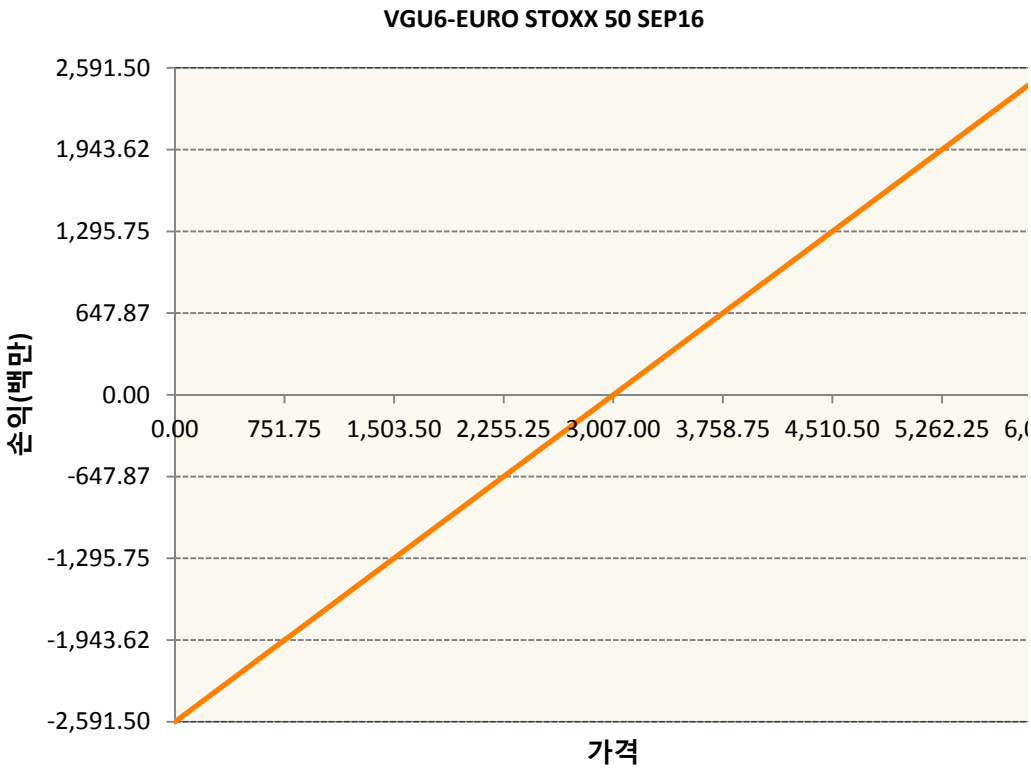
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,591	0	2,591	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 SEP16	207

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

(단위:백만원)

256

공시일	2016-08-26
기준일	2016-08-25

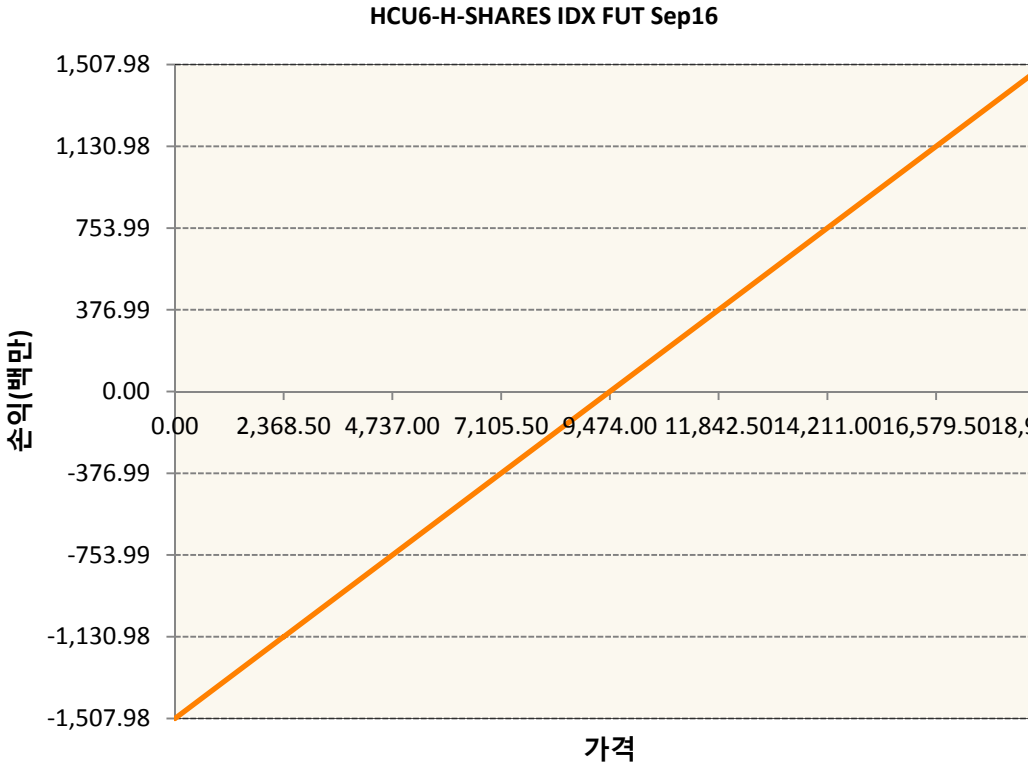
차이나인덱스모(주식-파생형)

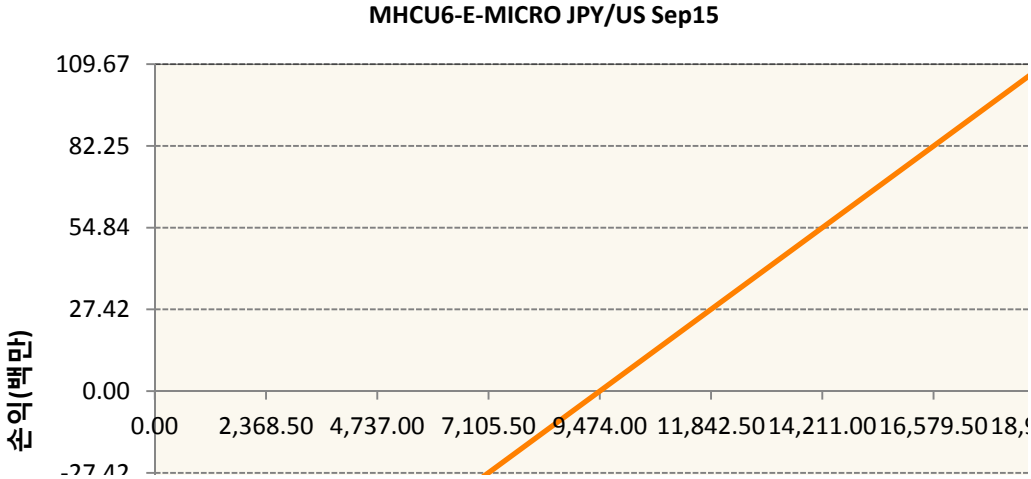
1. 계약금액

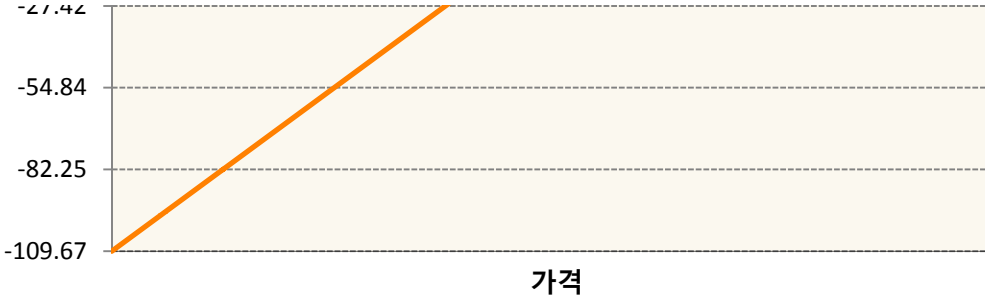
(단위:백만원)

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	110	0	110	
누계	유가증권	선물	1,508	0	1,508	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCU6	H-SHARES IDX FUT Sep16	121
MHCU6	E-MICRO JPY/US Sep15	9

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

174

공시일	2016-08-26
기준일	2016-08-25

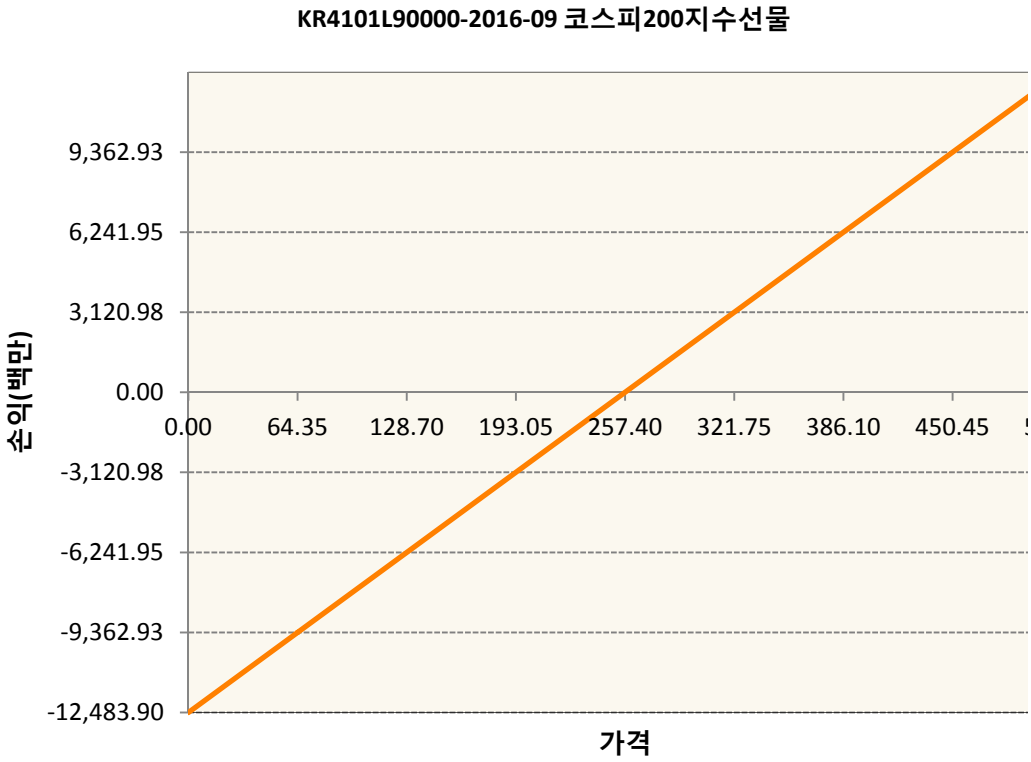
커버드콜(주식혼합-파생형)

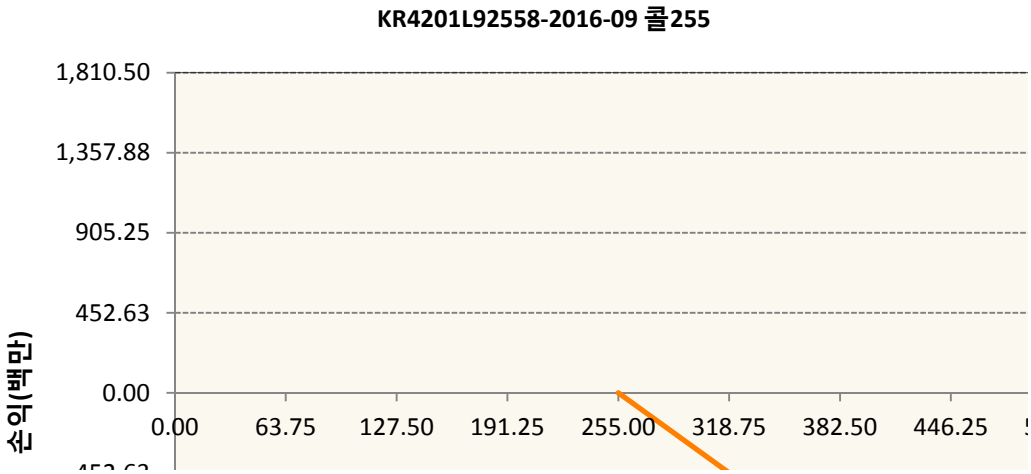
1. 계약금액

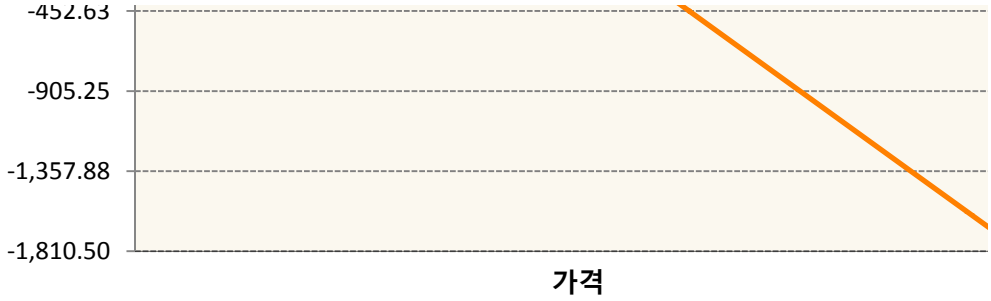
(단위:백만원)

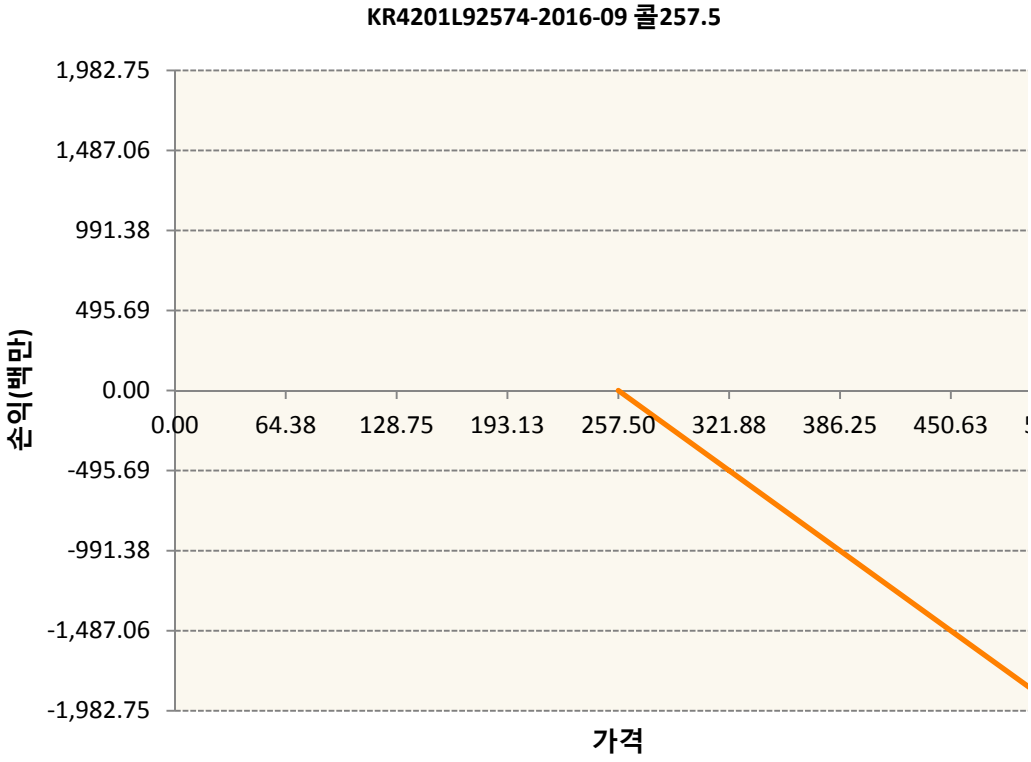
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	515	0	515	장내
신규	유가증권	옵션	0	103	-103	장내
누계	유가증권	선물	12,484	0	12,484	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,793	-3,793	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101L900 2016-09 코스피200지수선물							998
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-998	-998	-998	-998	-998	-998	-998
-5.33%	-665	-665	-665	-665	-665	-665	-665
-2.67%	-333	-333	-333	-333	-333	-333	-333
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	333	333	333	333	333	333	333
5.33%	665	665	665	665	665	665	665
8.00%	998	998	998	998	998	998	998
KR4201L925 2016-09 콜255							679
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	130	130	130	130	130	130	130
-5.33%	130	130	129	128	127	126	124
-2.67%	118	114	109	104	99	93	88
0%	19	13	7	0	-7	-13	-20
2.67%	-194	-195	-196	-199	-201	-204	-207
5.33%	-436	-436	-436	-436	-436	-437	-437
8.00%	-679	-679	-679	-679	-679	-679	-679
KR4201L925 2016-09 콜257.5							694

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	87	87	87	87	87	87	87
-5.33%	87	87	87	87	86	85	84
-2.67%	83	81	78	75	71	66	62
0%	23	15	8	0	-8	-15	-23
2.67%	-172	-175	-179	-183	-187	-192	-198
5.33%	-430	-430	-431	-431	-432	-433	-435
8.00%	-694	-694	-694	-694	-694	-694	-694

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

2,539

공시일	2016-08-26
기준일	2016-08-25

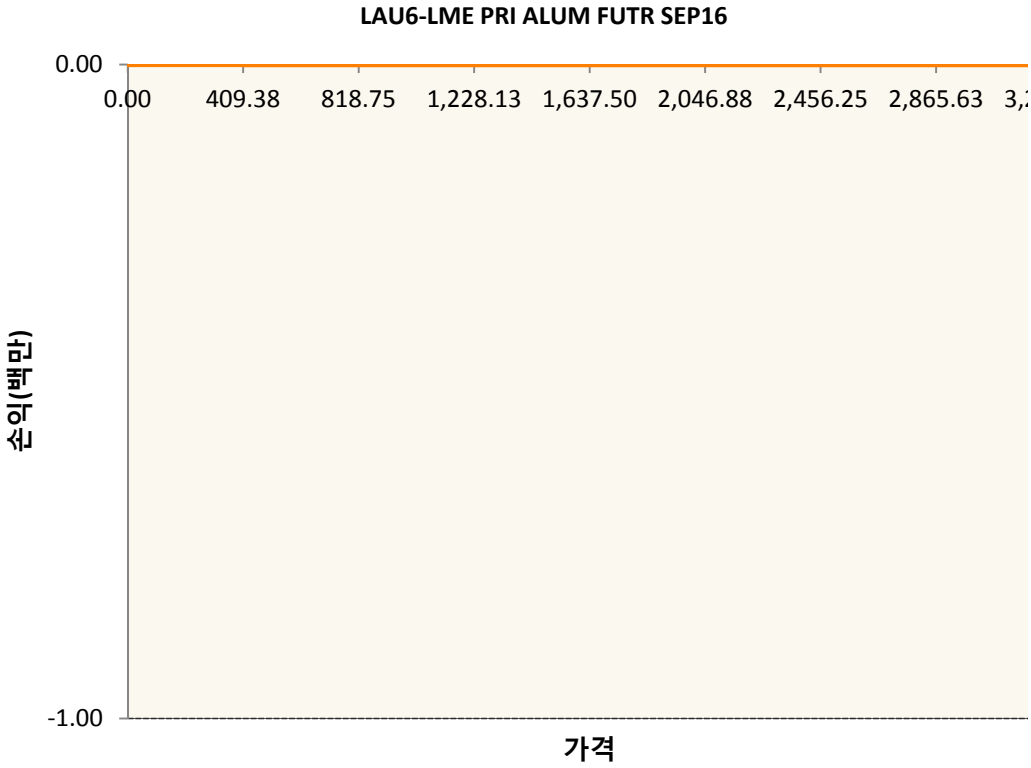
메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

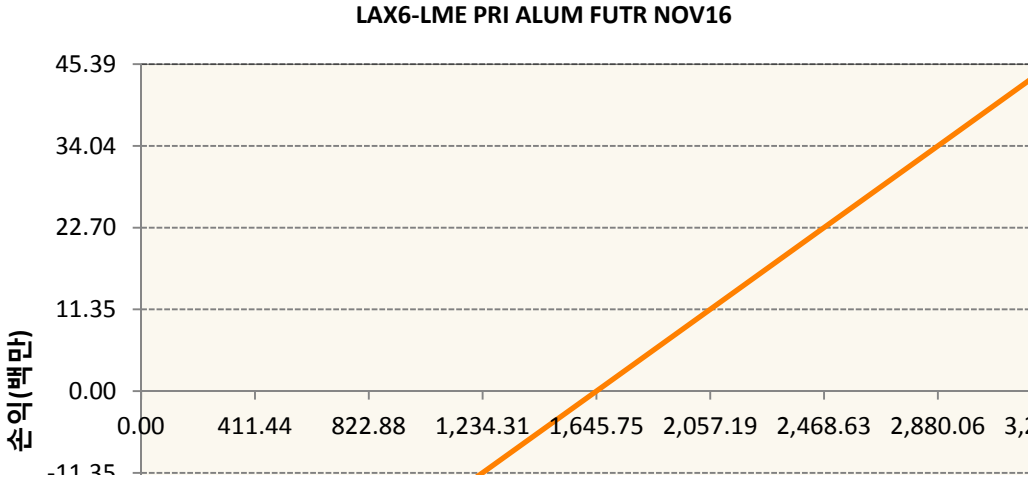
1. 계약금액

(단위:백만원)

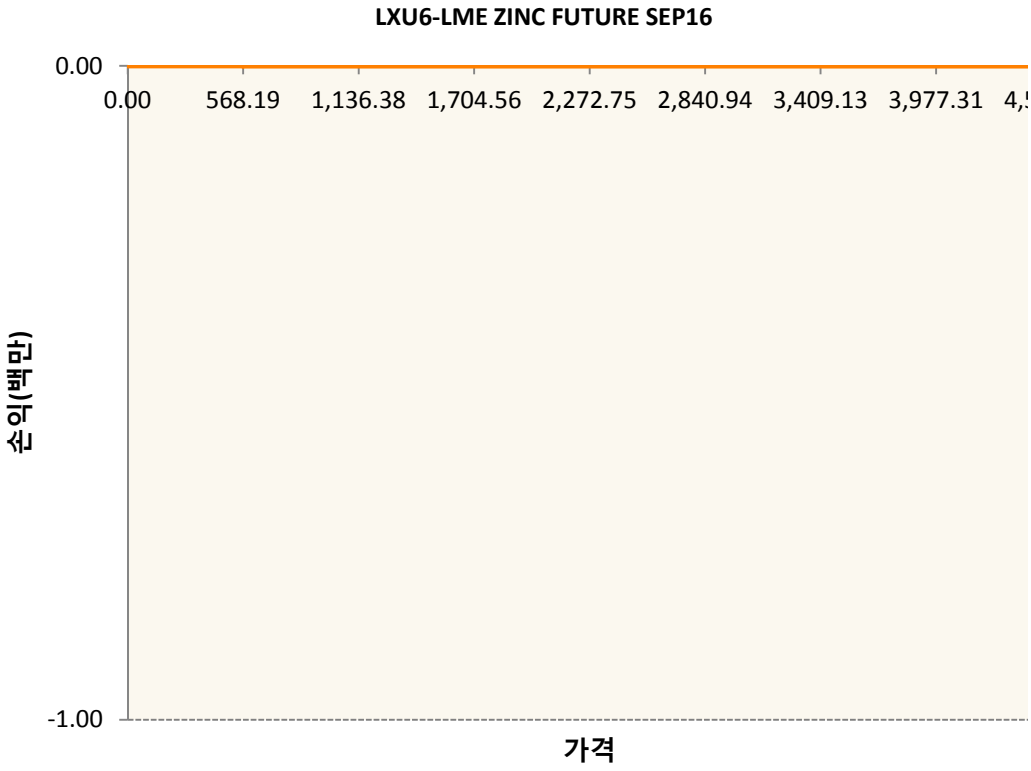
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	41	0	41	
누계	유가증권	선물	320	174	146	

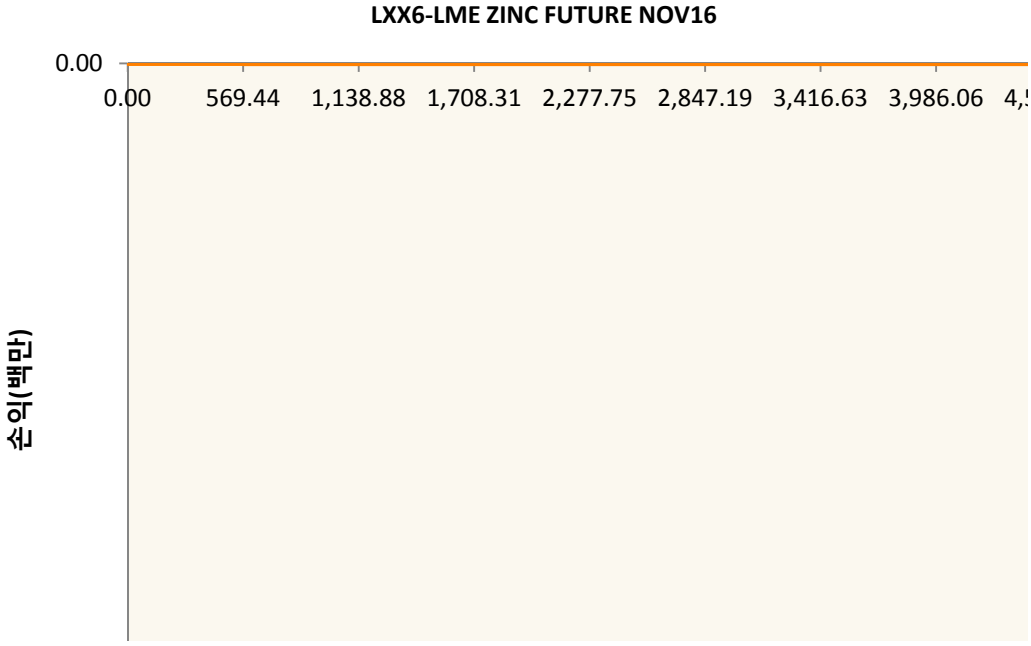
2. 만기시점의 손익구조

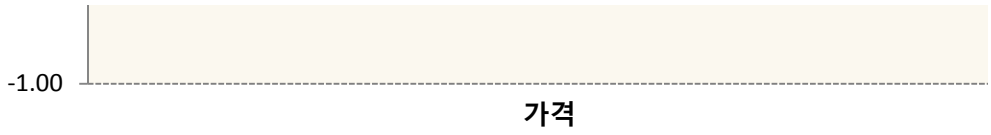


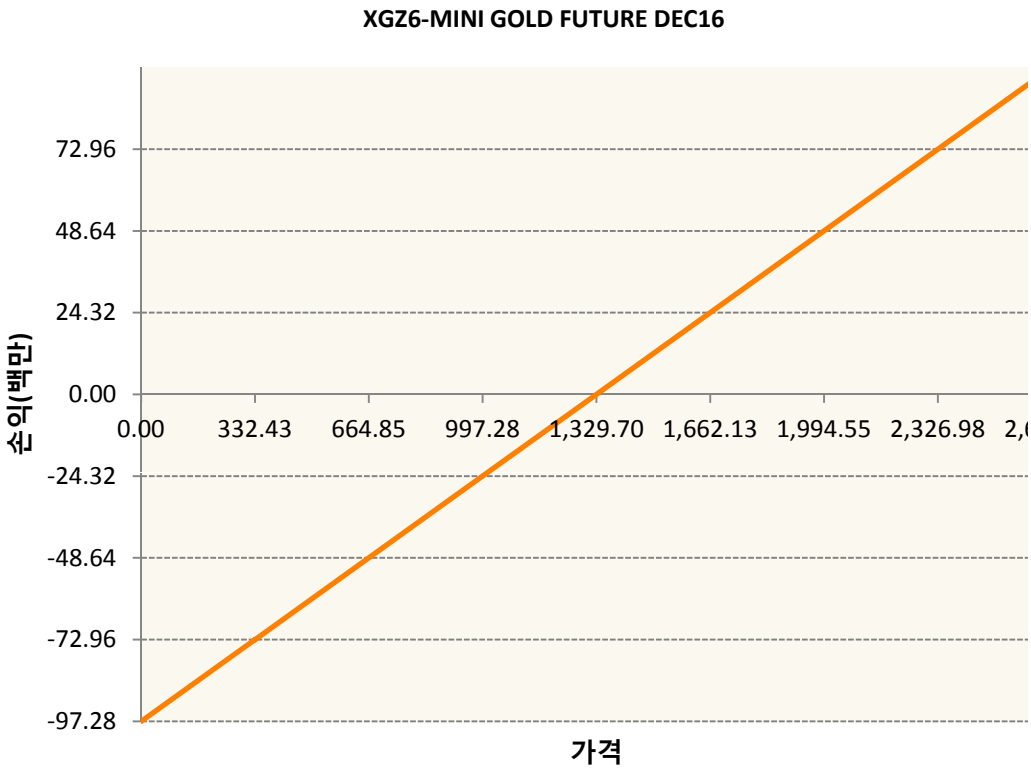


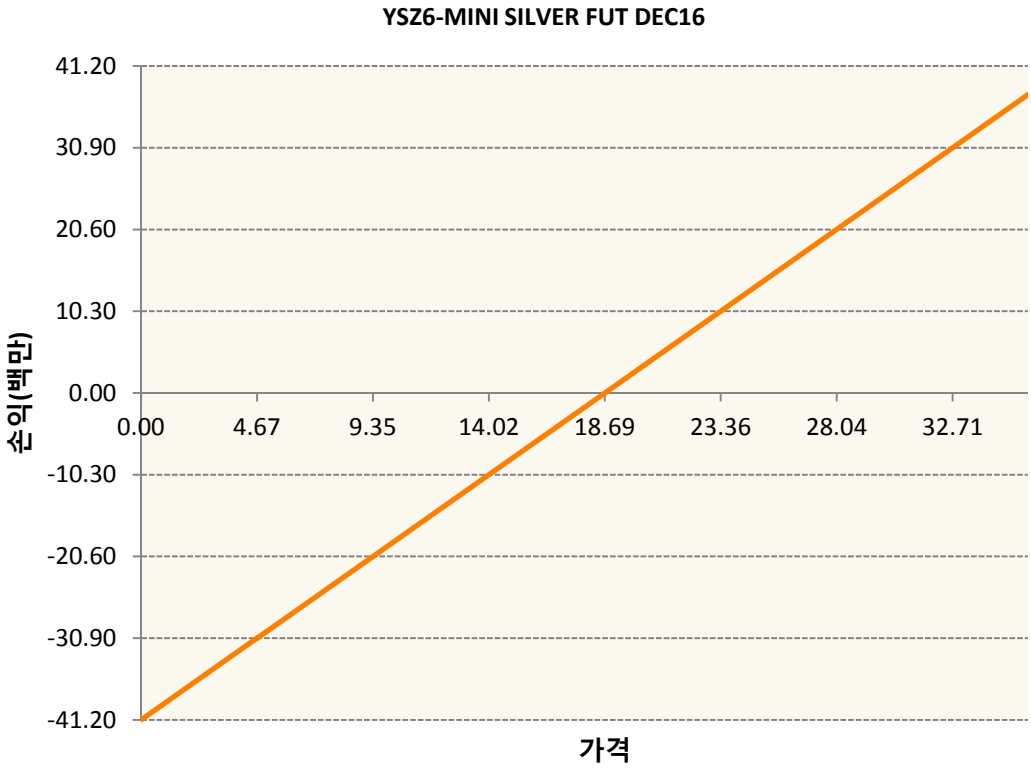

-22.70
-34.04
-45.39
가격


LXU6-LME ZINC FUTURE SEP16
0.00
0.00
568.19
1,136.38
1,704.56
2,272.75
2,840.94
3,409.13
3,977.31
-1.00
순익(백만)
가격


LXX6-LME ZINC FUTURE NOV16
0.00
0.00
569.44
1,138.88
1,708.31
2,277.75
2,847.19
3,416.63
3,986.06
순익(백만)


-1.00
가격


XGZ6-MINI GOLD FUTURE DEC16
72.96
48.64
24.32
0.00
-24.32
-48.64
-72.96
-97.28
순익(백만)
0.00
332.43
664.85
997.28
1,329.70
1,662.13
1,994.55
2,326.98
가격


YSZ6-MINI SILVER FUT DEC16
41.20
30.90
20.60
10.30
0.00
-10.30
-20.60
-30.90
-41.20
순익(백만)
0.00
4.67
9.35
14.02
18.69
23.36
28.04
32.71
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

LAU6	LME PRI ALUM FUTR SEP16	0.2
LAX6	LME PRI ALUM FUTR NOV16	4
LXU6	LME ZINC FUTURE SEP16	0.3
LXX6	LME ZINC FUTURE NOV16	0.2
XGZ6	MINI GOLD FUTURE DEC16	8
YSZ6	MINI SILVER FUT DEC16	3

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

14

공시일	2016-08-26
기준일	2016-08-25

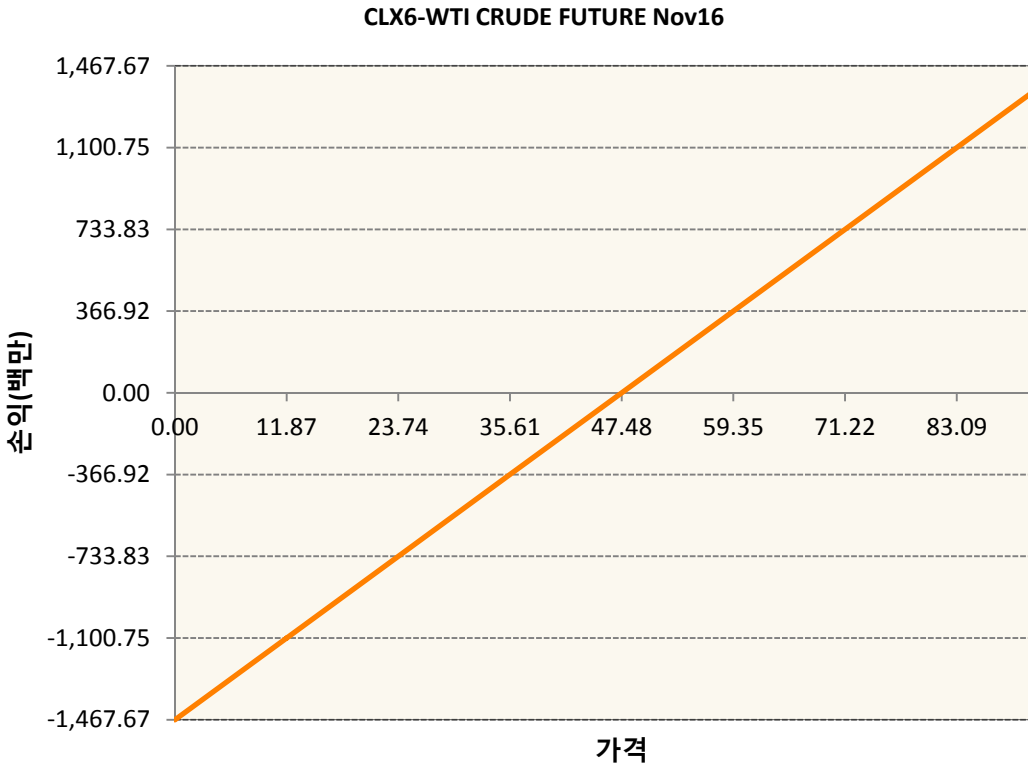
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

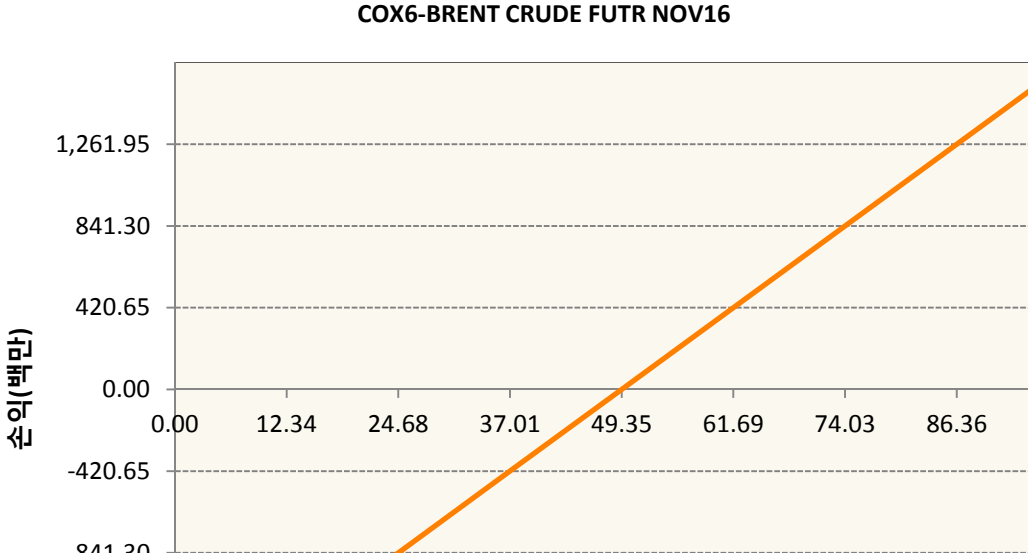
1. 계약금액

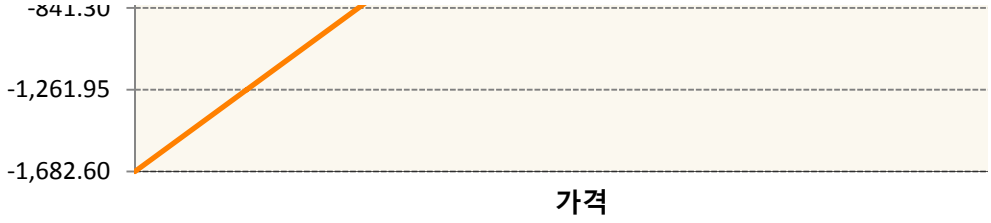
(단위:백만원)

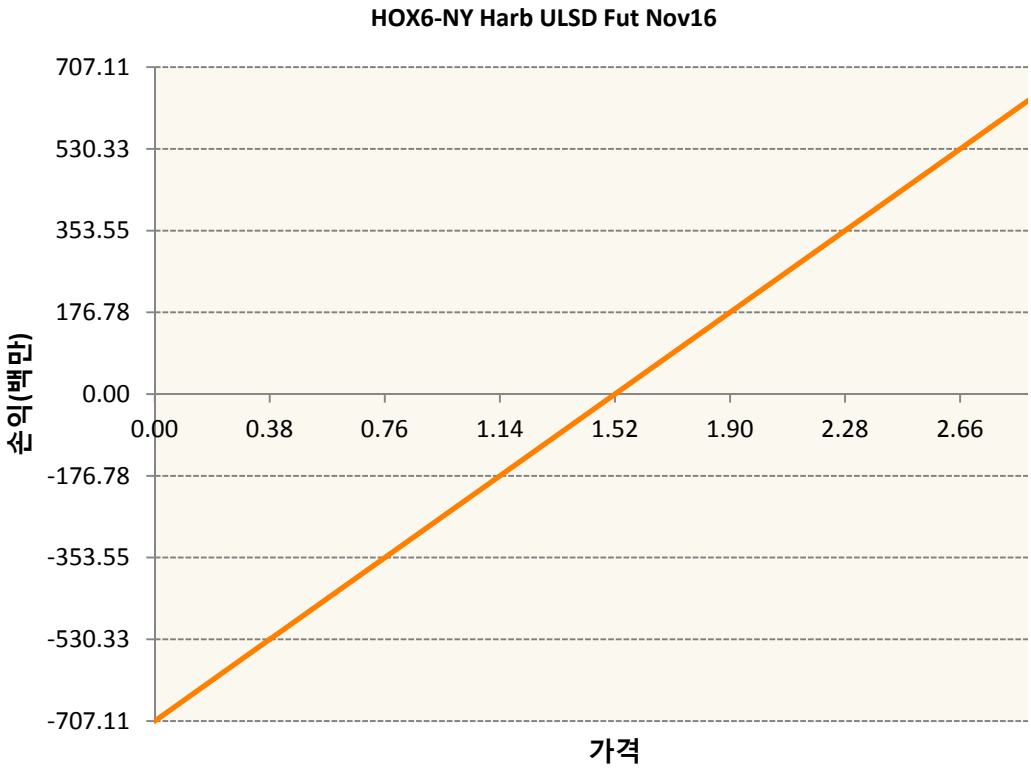
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,142	0	6,142	

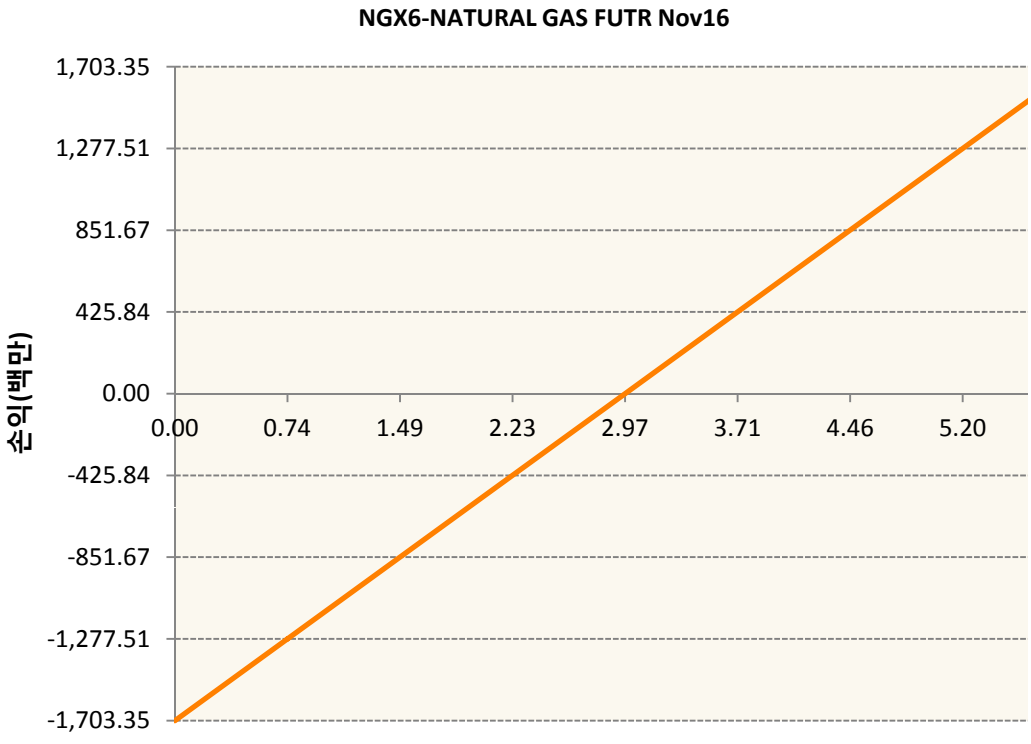
2. 만기시점의 손익구조



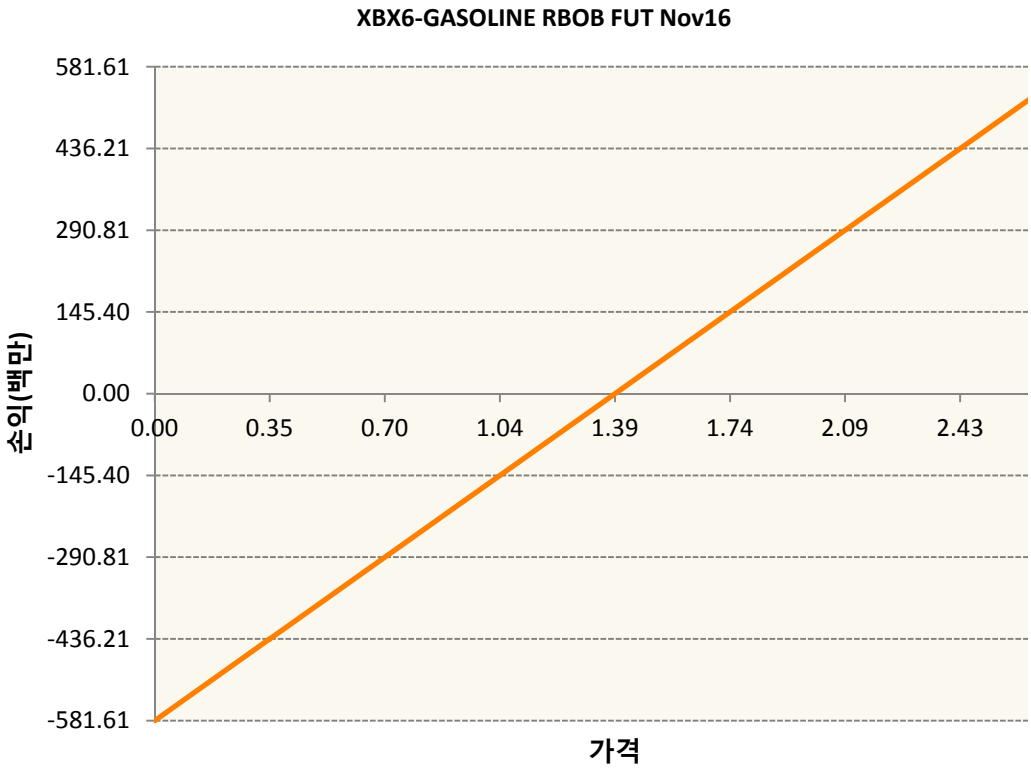



-841.30
-1,261.95
-1,682.60
가격


HOX6-NY Harb ULSD Fut Nov16
707.11
530.33
353.55
176.78
0.00
-176.78
-353.55
-530.33
-707.11
0.00
0.38
0.76
1.14
1.52
1.90
2.28
2.66
손익(백만)
가격


NGX6-NATURAL GAS FUTR Nov16
1,703.35
1,277.51
851.67
425.84
0.00
-425.84
-851.67
-1,277.51
-1,703.35
0.00
0.74
1.49
2.23
2.97
3.71
4.46
5.20
손익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX6	WTI CRUDE FUTURE Nov16	117
COX6	BRENT CRUDE FUTR NOV16	135
HOX6	NY Harb ULSD Fut Nov16	57
NGX6	NATURAL GAS FUTR Nov16	136
XBX6	GASOLINE RBOB FUT Nov16	47

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,098

공시일	2016-08-26
기준일	2016-08-25

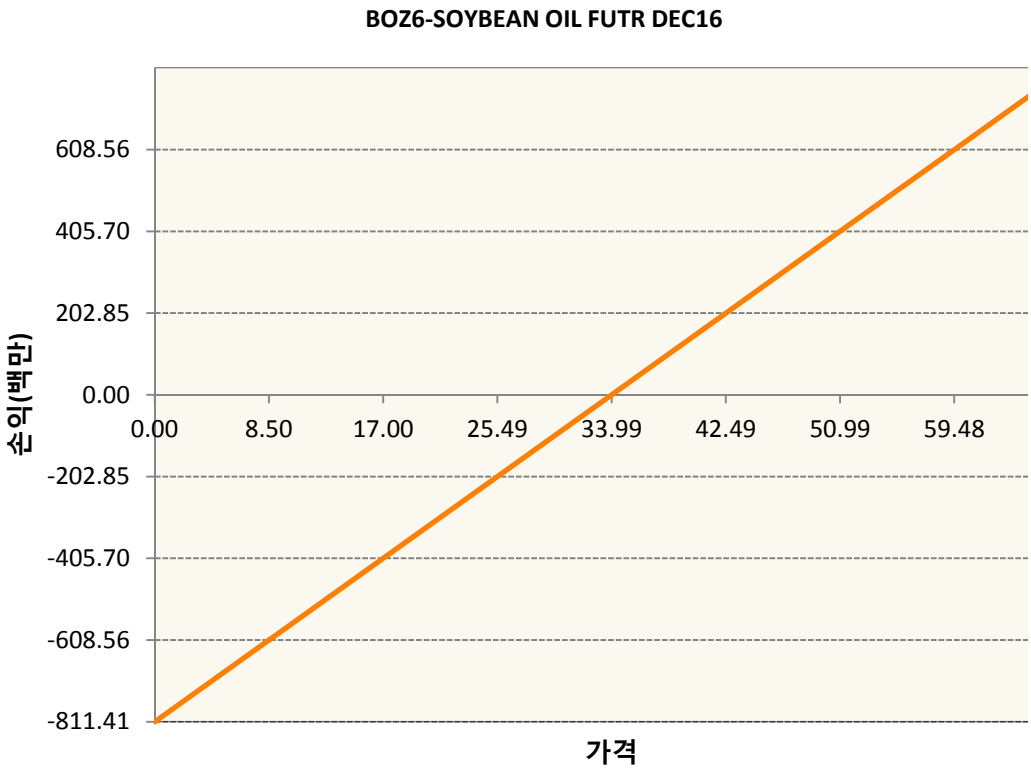
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

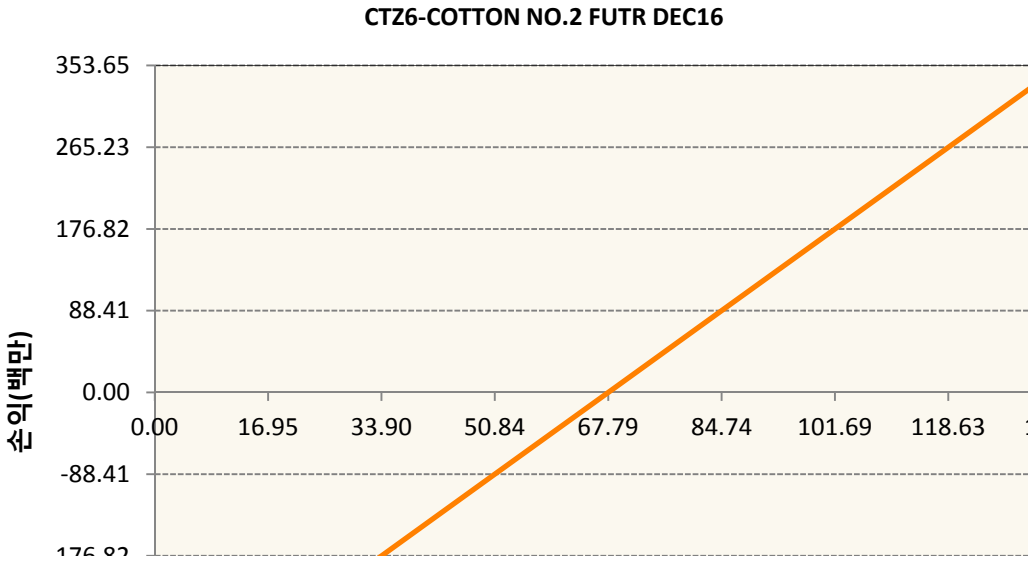
1. 계약금액

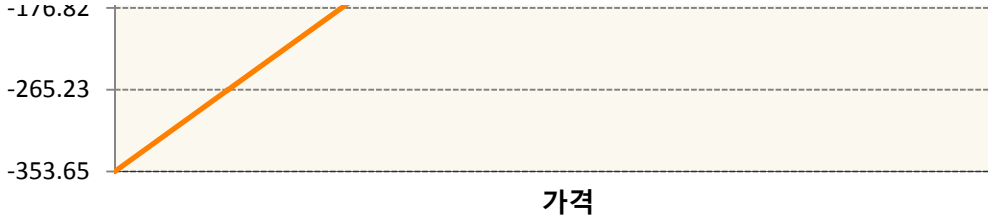
(단위:백만원)

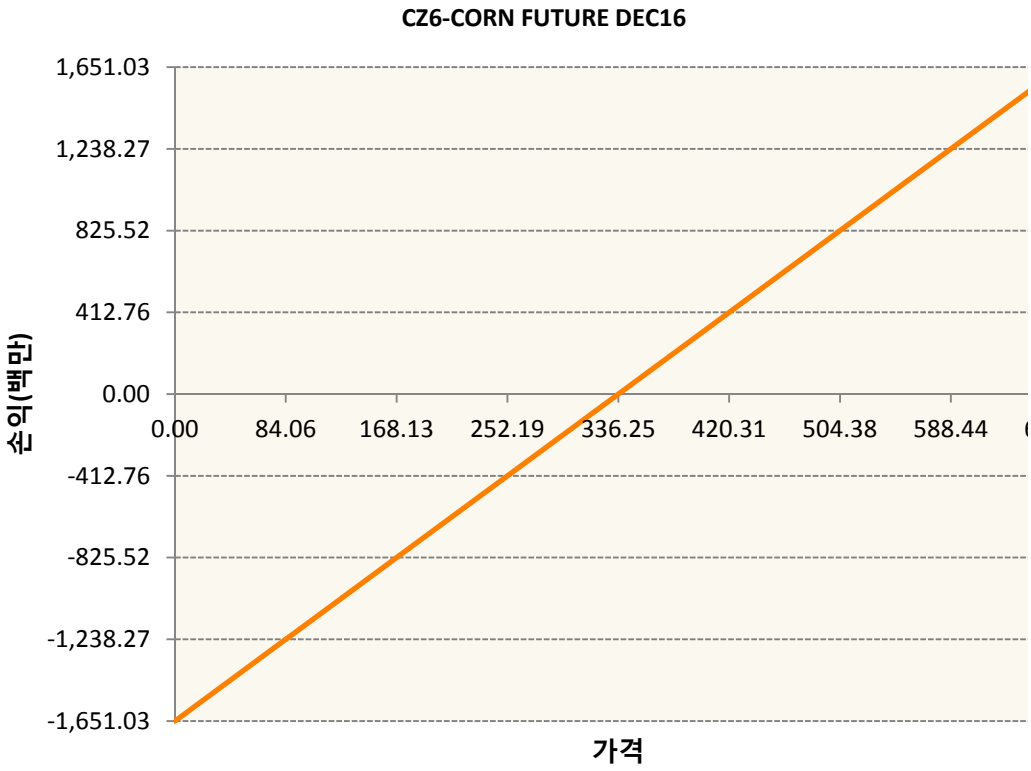
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,083	0	8,083	

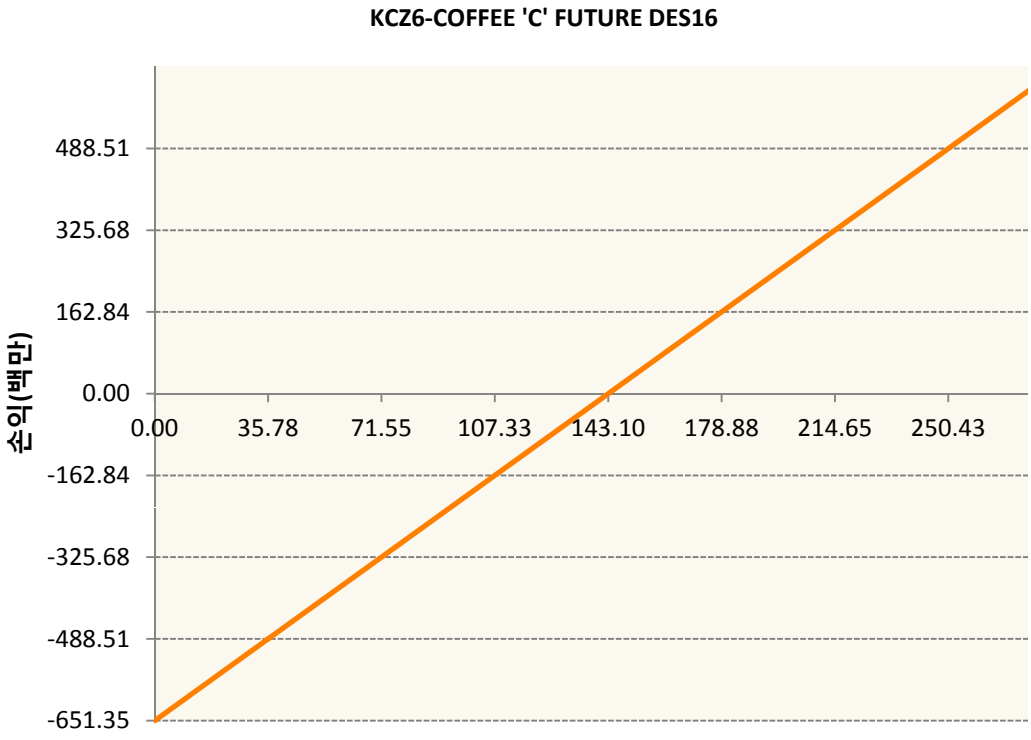
2. 만기시점의 손익구조



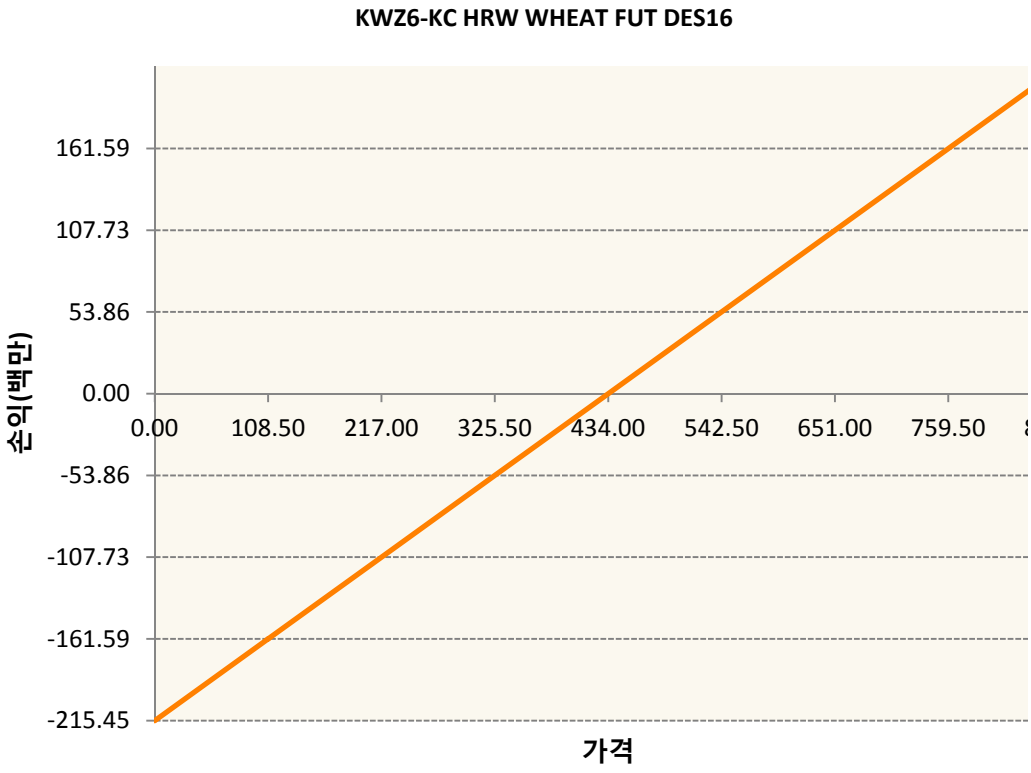


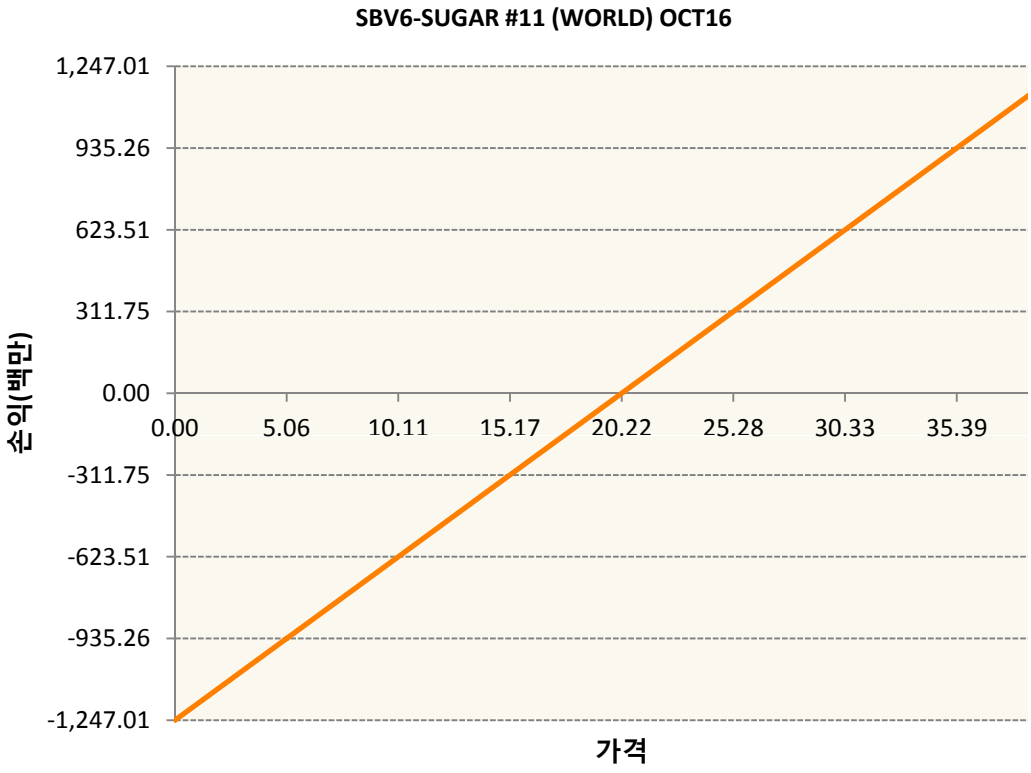

-265.23
-353.65
가격

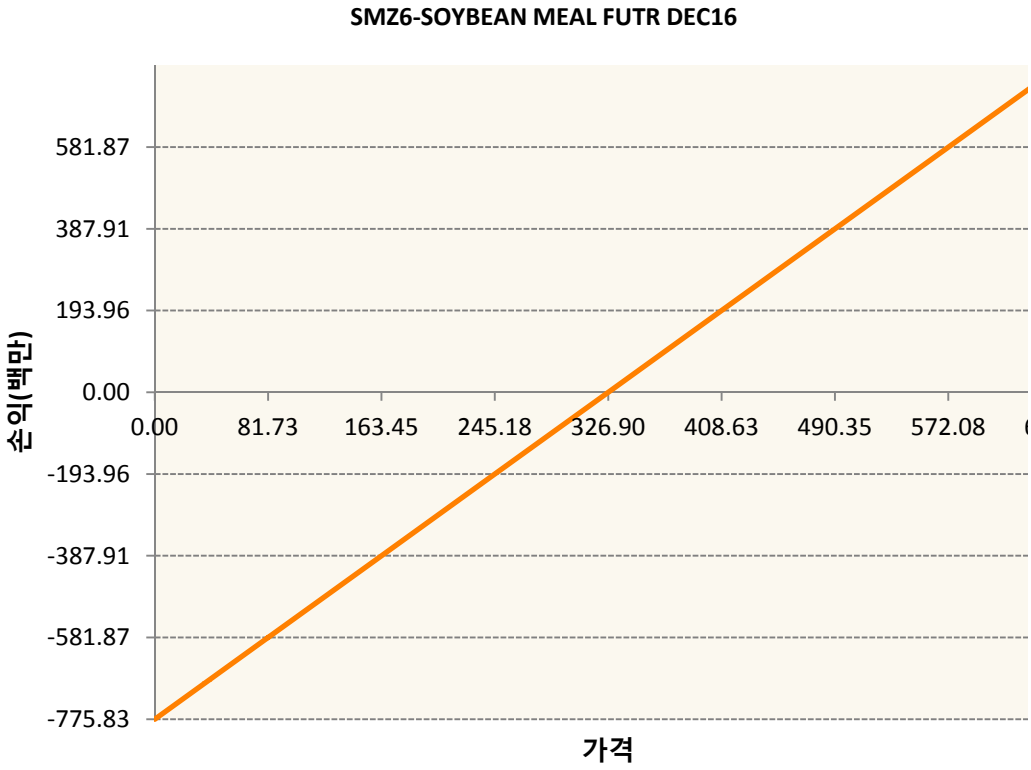

CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,651.03
1,238.27
825.52
412.76
0.00
-412.76
-825.52
-1,238.27
-1,651.03
0.00
84.06
168.13
252.19
336.25
420.31
504.38
588.44
순익(백만)
가격

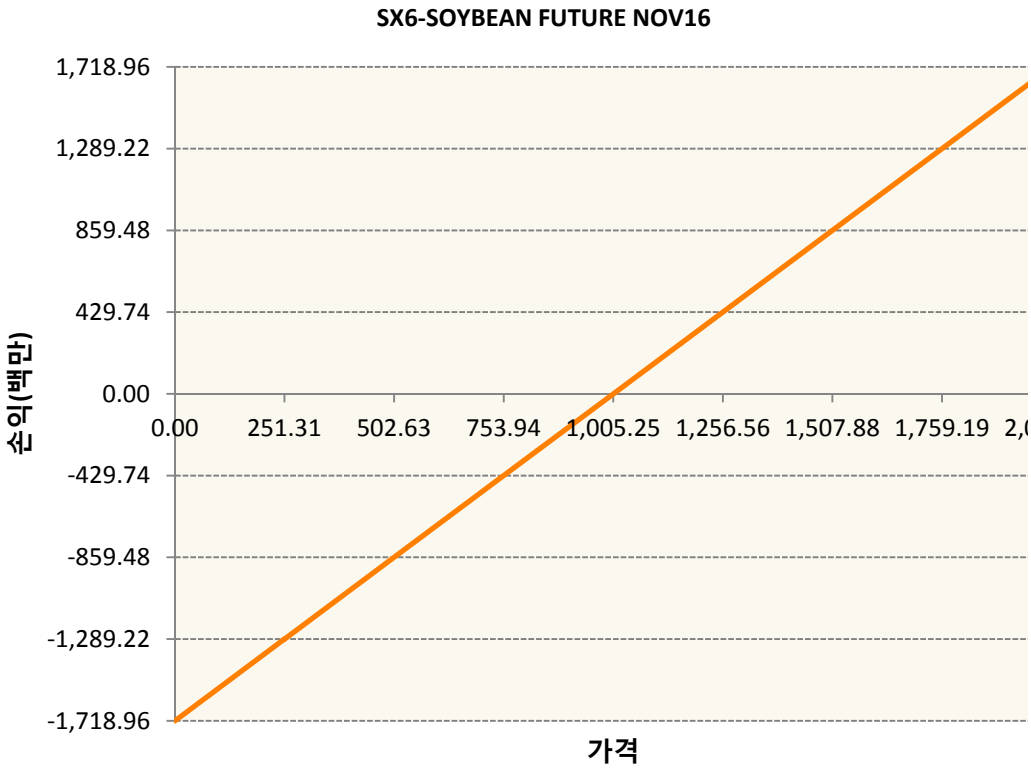

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
488.51
325.68
162.84
0.00
-162.84
-325.68
-488.51
-651.35
0.00
35.78
71.55
107.33
143.10
178.88
214.65
250.43
순익(백만)

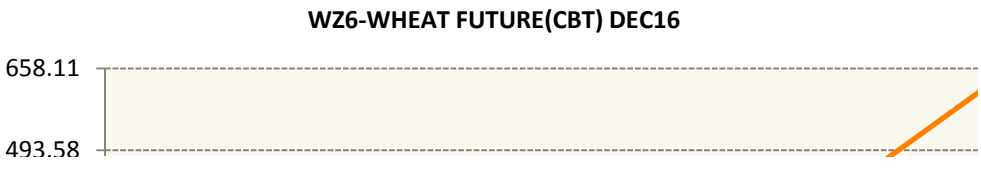
가격

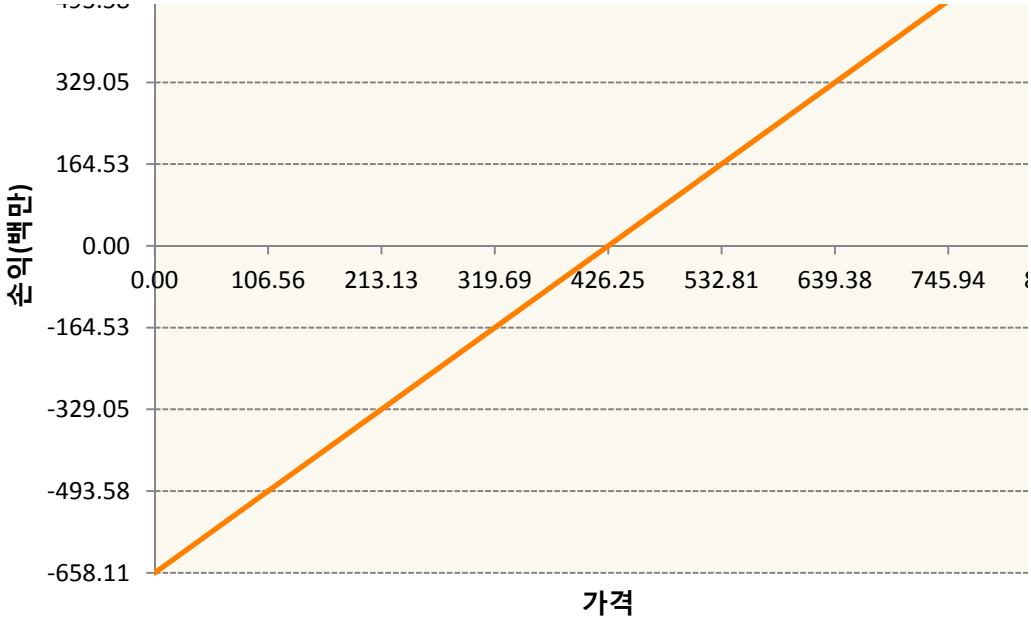

KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16
161.59
107.73
53.86
0.00
-53.86
-107.73
-161.59
-215.45
0.00
108.50
217.00
325.50
434.00
542.50
651.00
759.50
손익(백만)
가격


SBV6-SUGAR #11 (WORLD) OCT16
1,247.01
935.26
623.51
311.75
0.00
-311.75
-623.51
-935.26
-1,247.01
0.00
5.06
10.11
15.17
20.22
25.28
30.33
35.39
손익(백만)
가격


SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16
581.87
387.91
193.96
0.00
-193.96
-387.91
-581.87
-775.83
손익(백만)
0.00
81.73
163.45
245.18
326.90
408.63
490.35
572.08
가격


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16
1,718.96
1,289.22
859.48
429.74
0.00
-429.74
-859.48
-1,289.22
-1,718.96
손익(백만)
0.00
251.31
502.63
753.94
1,005.25
1,256.56
1,507.88
1,759.19
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
658.11
493.58



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ6	SOYBEAN OIL FUTR DEC16	65
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	28
CZ6	CORN FUTURE DEC16	132
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	52
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	17
SBV6	SUGAR #11 (WORLD) OCT16	100
SMZ6	SOYBEAN MEAL FUTR DEC16	62
SX6	SOYBEAN FUTURE NOV16	138
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	53

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	805