공시일	2016-08-29
기준일	2016-08-26

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	2016-08-29
기준일	2016-08-26

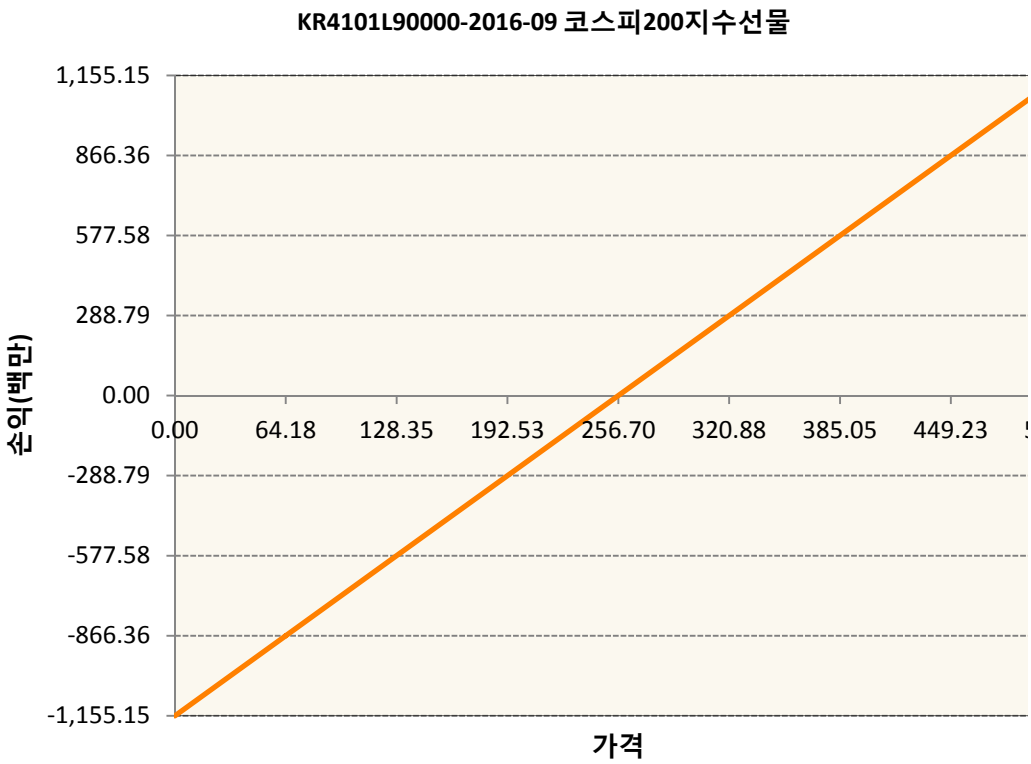
스마트인덱스모

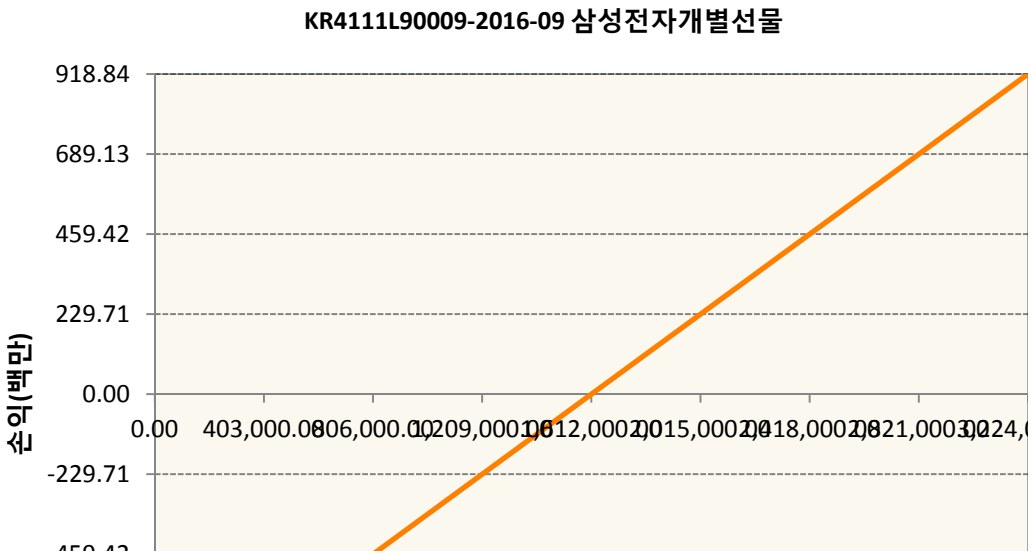
1. 계약금액

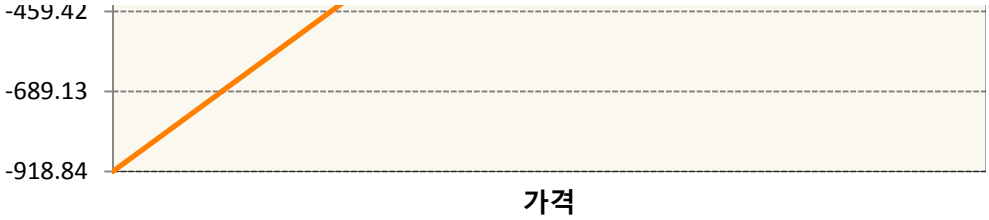
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,074	0	2,074	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						74
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
-5.33%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-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%	49	49	49	49	49	49	49
8.00%	74	74	74	74	74	74	74

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

(단위:백만원)

148

공시일	2016-08-29
기준일	2016-08-26

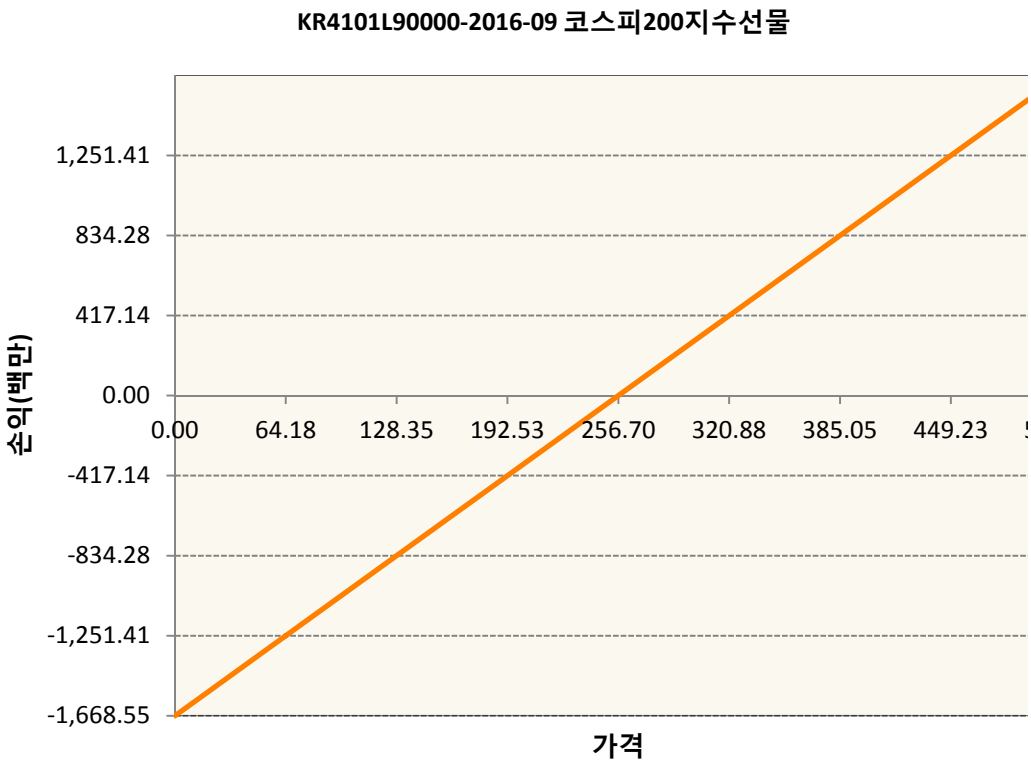
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,669	0	1,669	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)

106

공시일	2016-08-29
기준일	2016-08-26

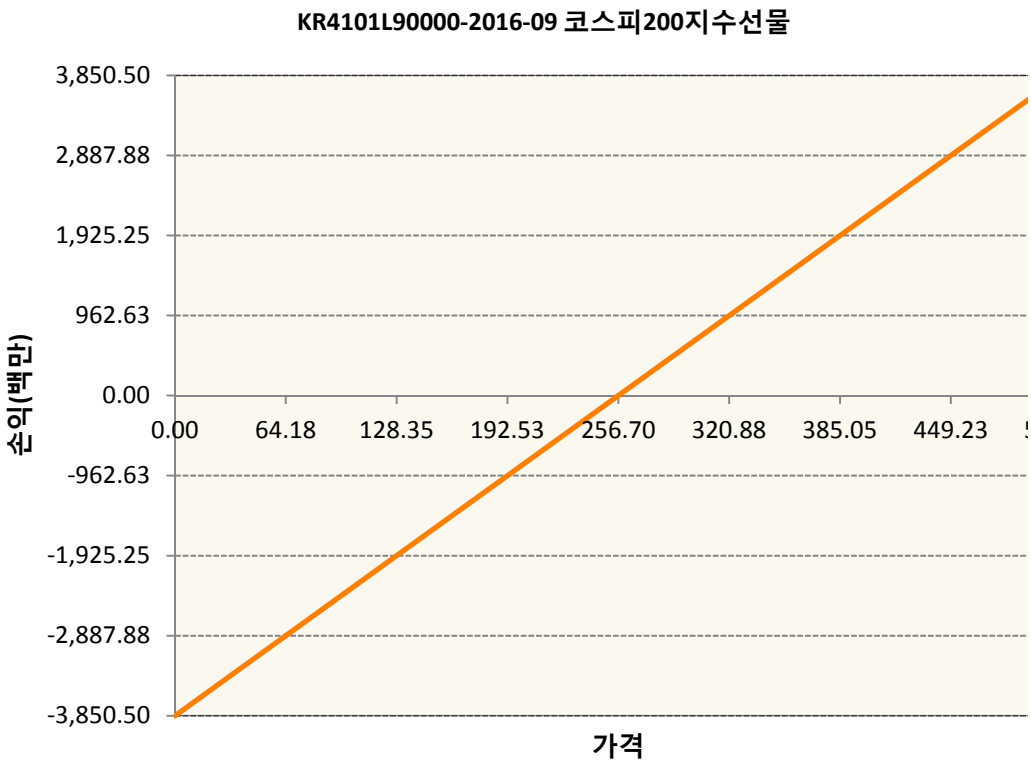
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	3,851	0	3,851	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						307
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-307	-307	-307	-307	-307	-307	-307
-5.33%	-205	-205	-205	-205	-205	-205	-205
-2.67%	-102	-102	-102	-102	-102	-102	-102
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	102	102	102	102	102	102	102
5.33%	205	205	205	205	205	205	205
8.00%	307	307	307	307	307	307	307

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

246

공시일	2016-08-29
기준일	2016-08-26

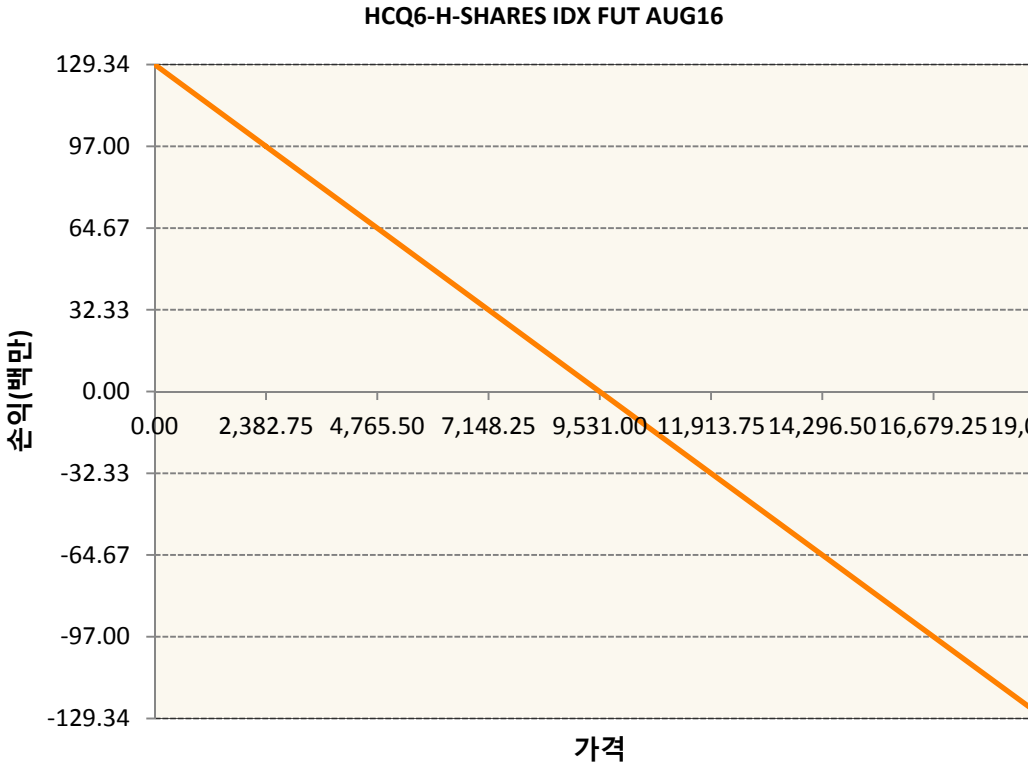
아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

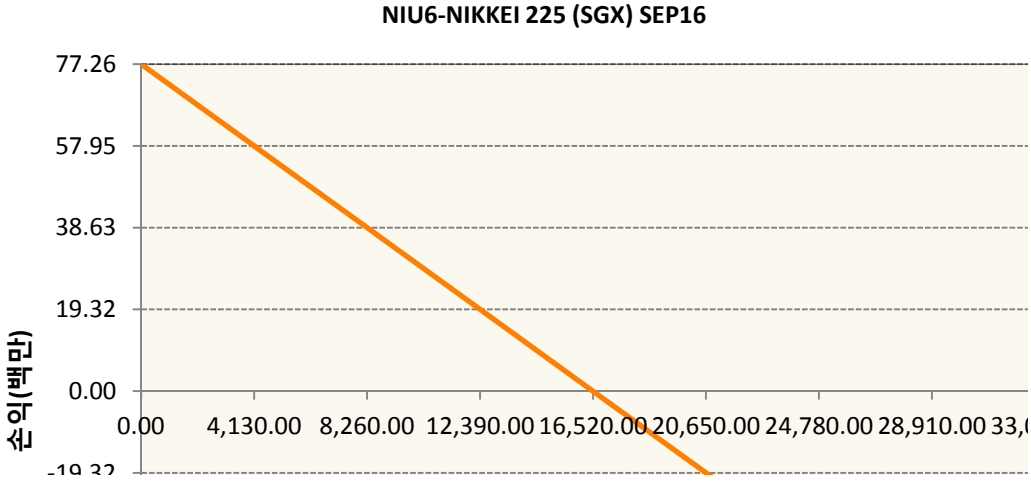
1. 계약금액

(단위:백만원)

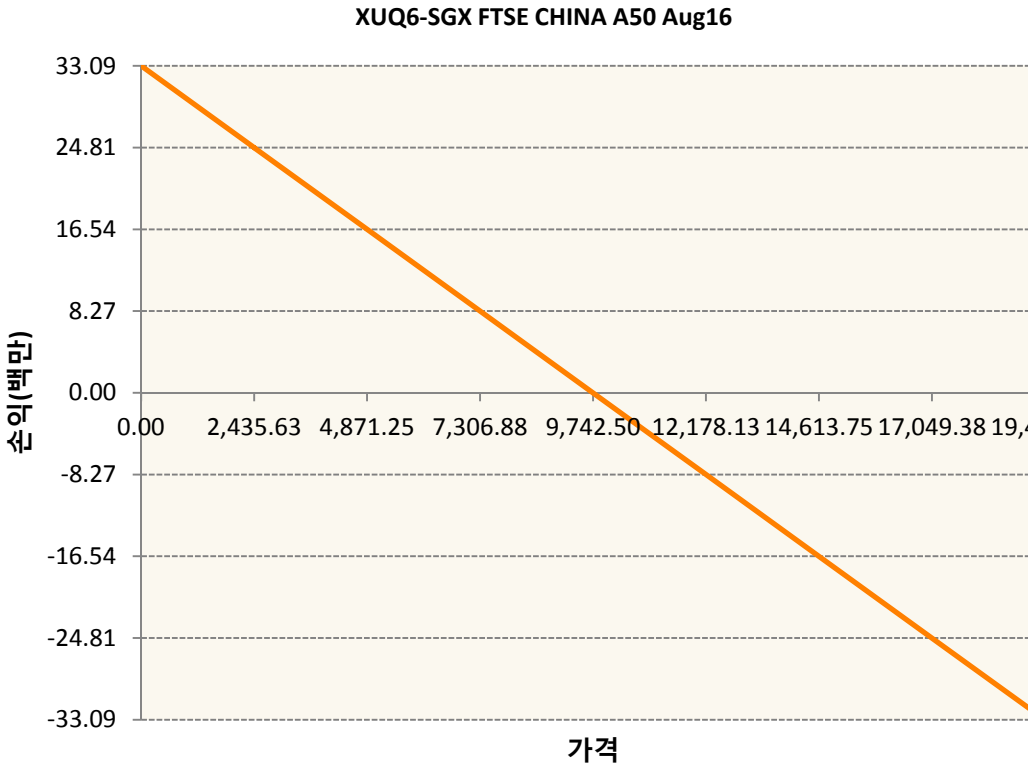
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	110	-110	
누계	유가증권	선물	0	129	-129	장내

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	3

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	28

공시일	2016-08-29
기준일	2016-08-26

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	886

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

771

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-08-29
기준일	2016-08-26

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	403

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

929

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-08-29
기준일	2016-08-26

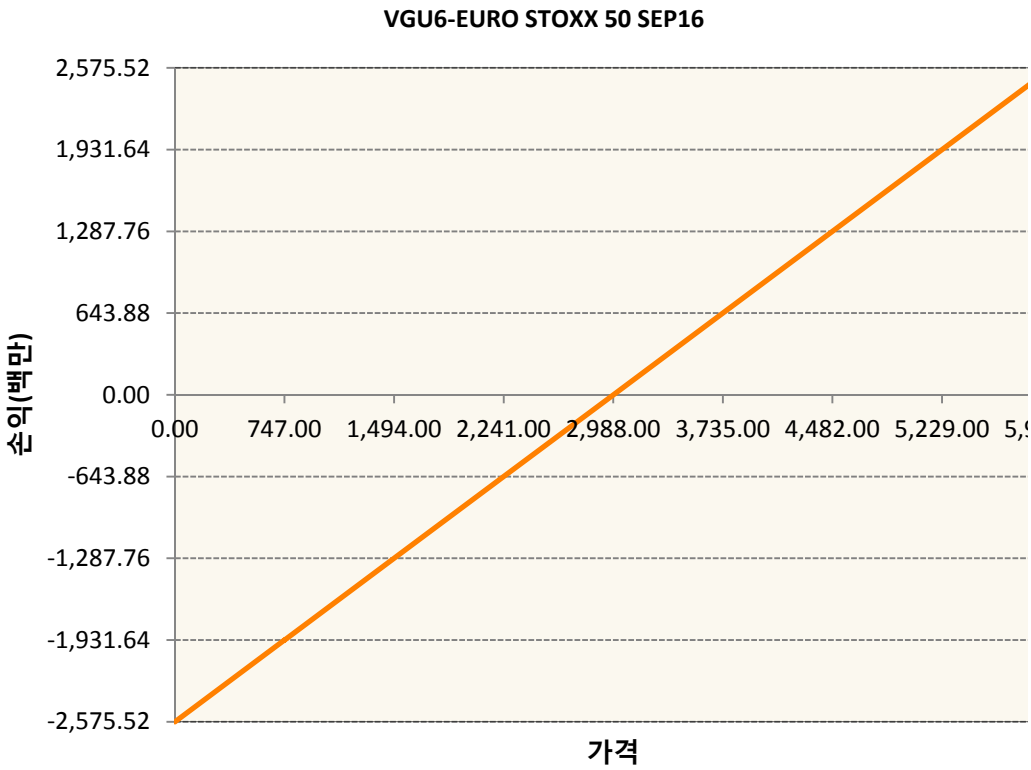
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,576	0	2,576	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 SEP16	206

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

(단위:백만원)

254

공시일	2016-08-29
기준일	2016-08-26

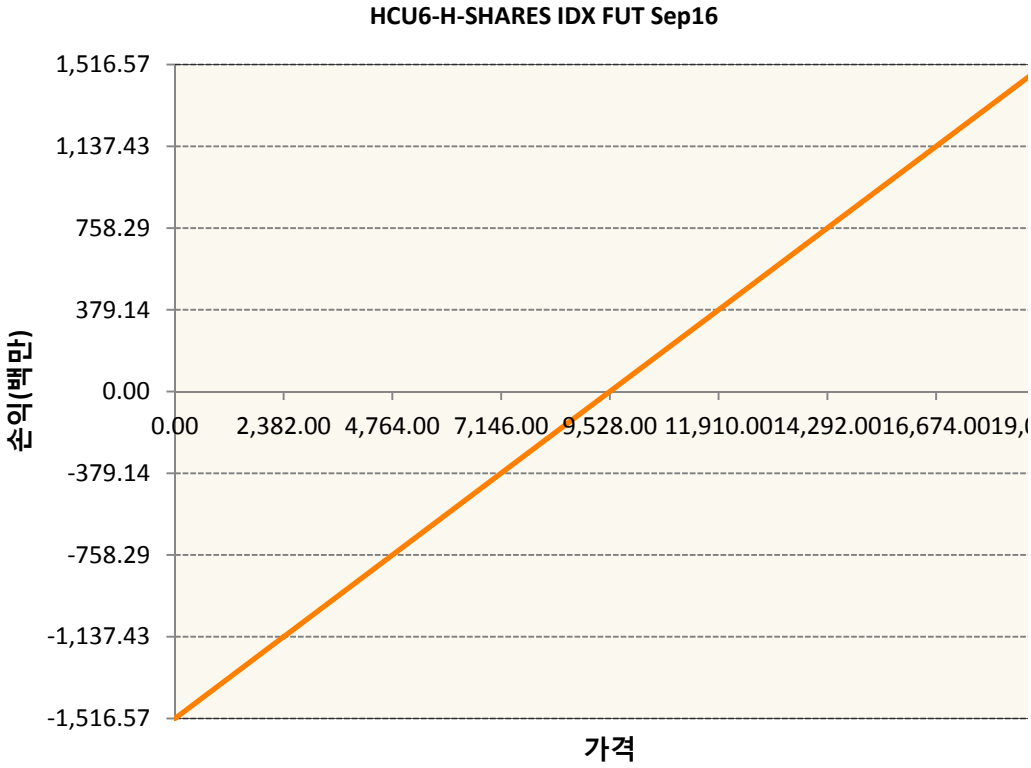
차이나인덱스모(주식-파생형)

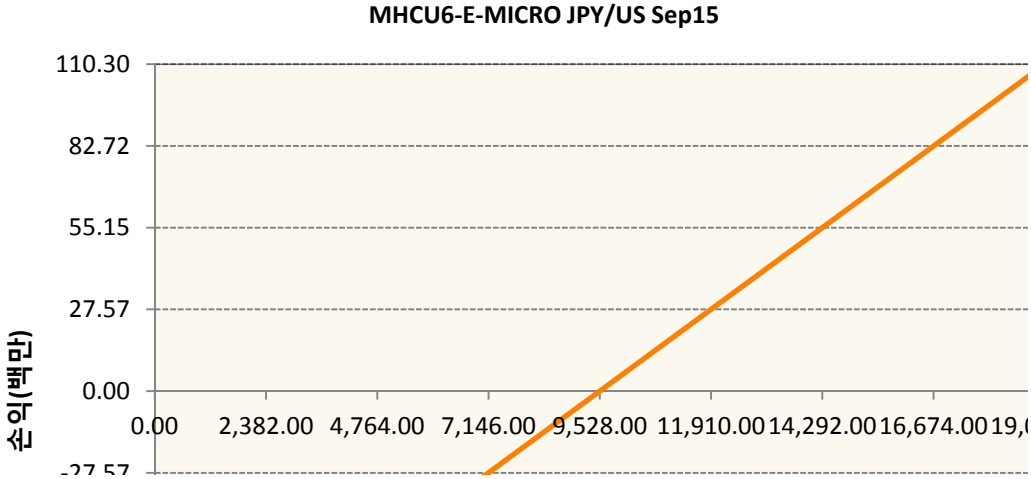
1. 계약금액

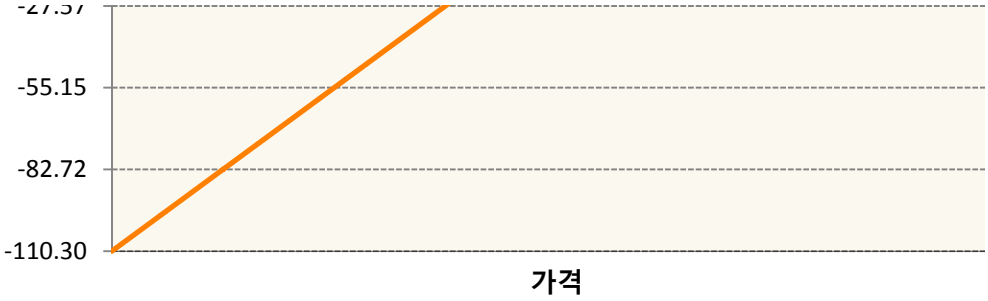
(단위:백만원)

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	1,517	0	1,517	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)
	175

공시일	2016-08-29
기준일	2016-08-26

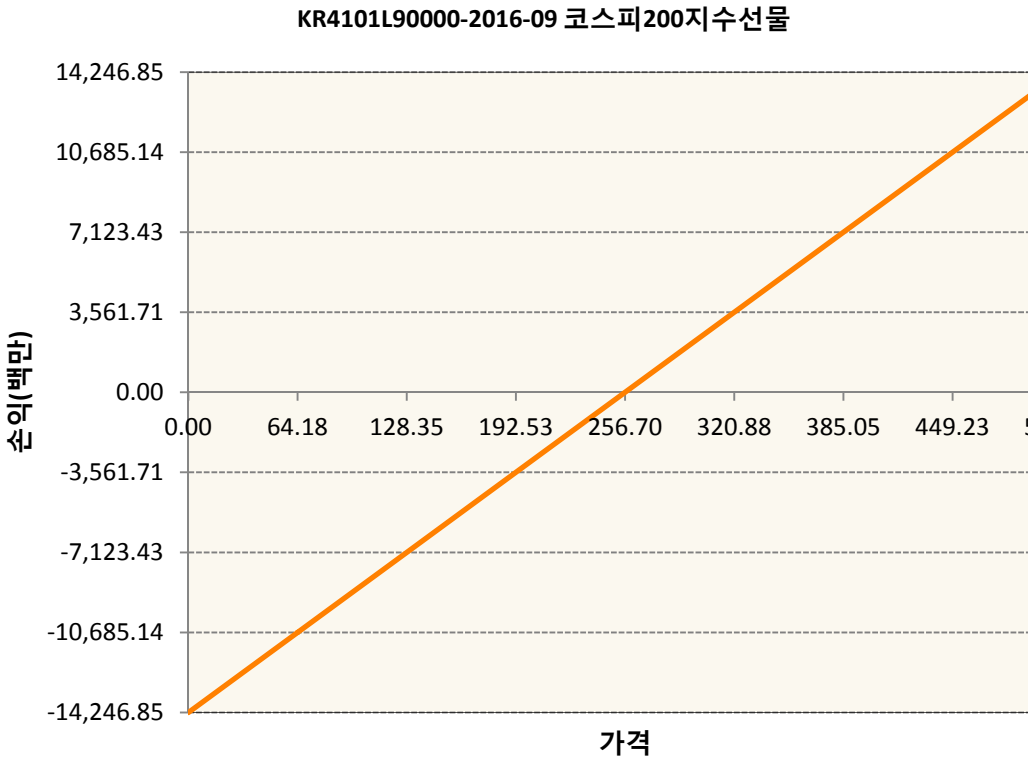
커버드콜(주식혼합-파생형)

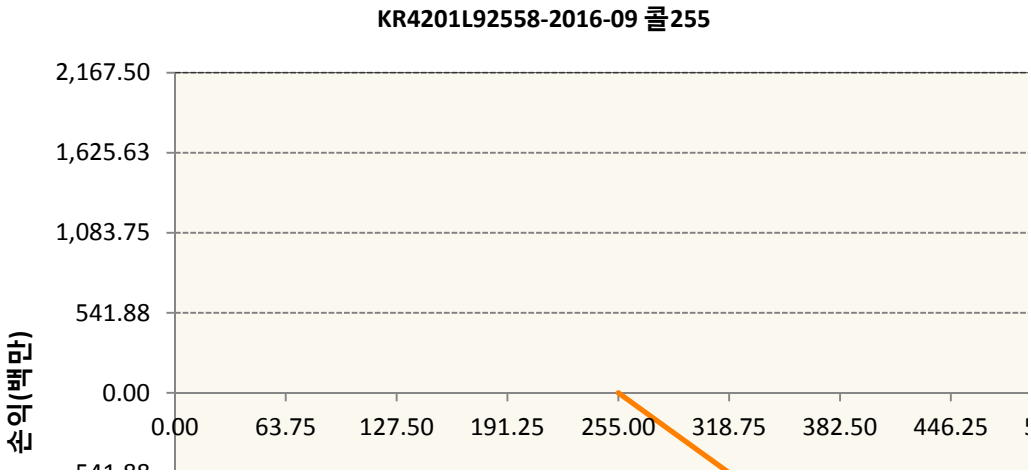
1. 계약금액

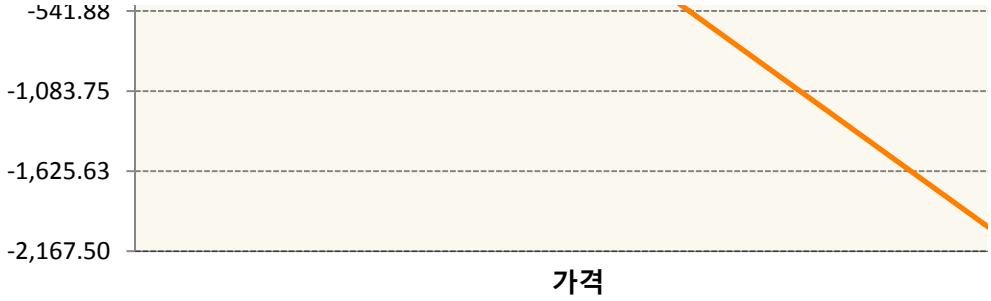
(단위:백만원)

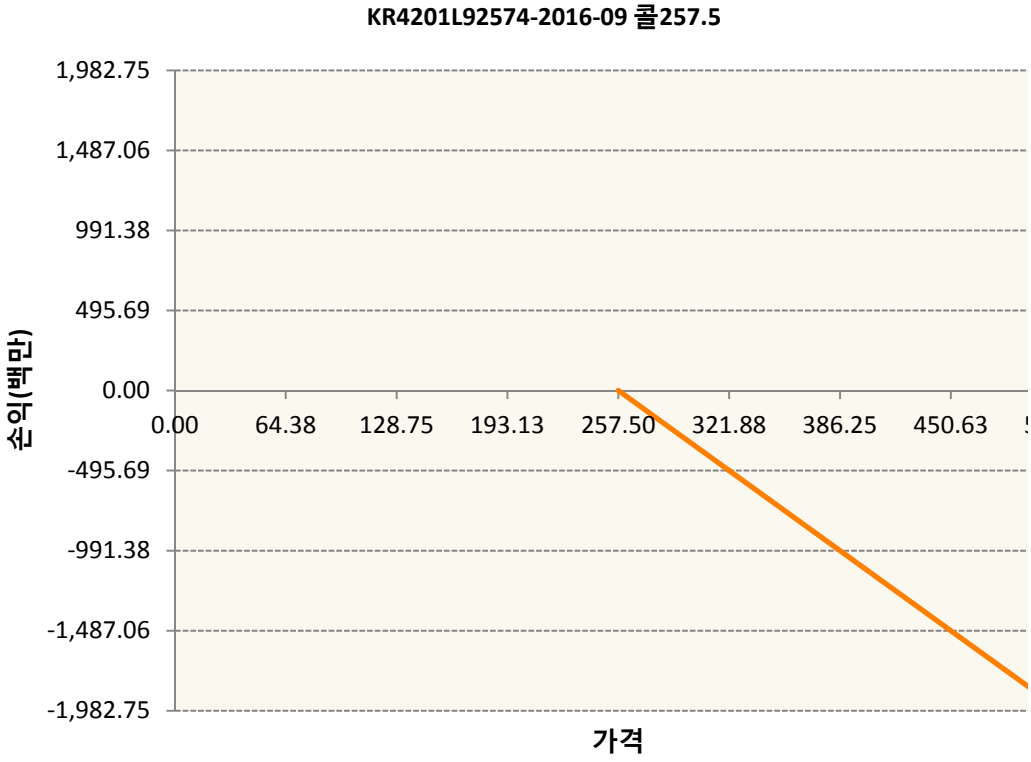
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,796	0	1,796	장내
신규	유가증권	옵션	0	361	-361	장내
누계	유가증권	선물	14,247	0	14,247	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,150	-4,150	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101L900 2016-09 코스피200지수선물							1,138
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,138	-1,138	-1,138	-1,138	-1,138	-1,138	-1,138
-5.33%	-758	-758	-758	-758	-758	-758	-758
-2.67%	-379	-379	-379	-379	-379	-379	-379
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	379	379	379	379	379	379	379
5.33%	758	758	758	758	758	758	758
8.00%	1,138	1,138	1,138	1,138	1,138	1,138	1,138
KR4201L925 2016-09 콜255							797
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	125	125	125	125	124	124	124
-5.33%	124	124	124	124	123	122	120
-2.67%	117	113	109	104	99	94	88
0%	24	16	8	0	-8	-16	-24
2.67%	-219	-221	-223	-226	-229	-233	-237
5.33%	-507	-507	-507	-507	-508	-508	-509
8.00%	-797	-797	-797	-797	-797	-797	-797
KR4201L925 2016-09 콜257.5							674

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	65	65	65	65	65	65	65
-5.33%	65	65	65	65	65	65	64
-2.67%	64	62	60	58	55	52	48
0%	21	14	7	0	-7	-14	-22
2.67%	-156	-159	-163	-168	-173	-178	-183
5.33%	-410	-411	-411	-412	-413	-414	-416
8.00%	-673	-673	-673	-673	-673	-673	-674

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

2,758

공시일	2016-08-29
기준일	2016-08-26

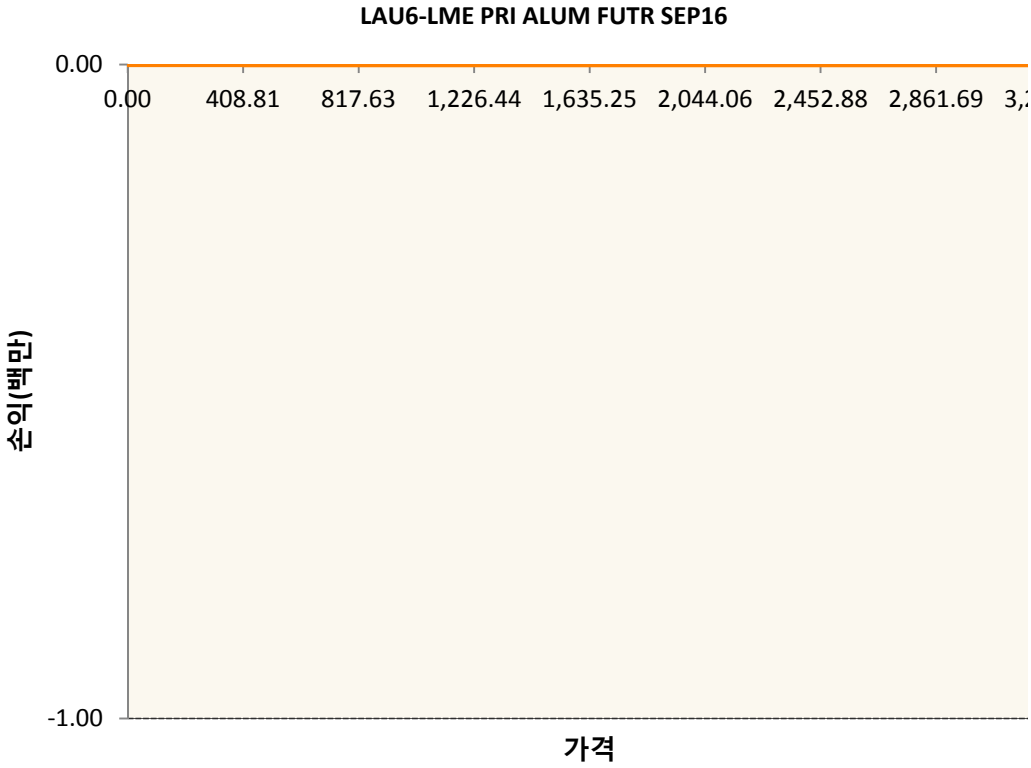
메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

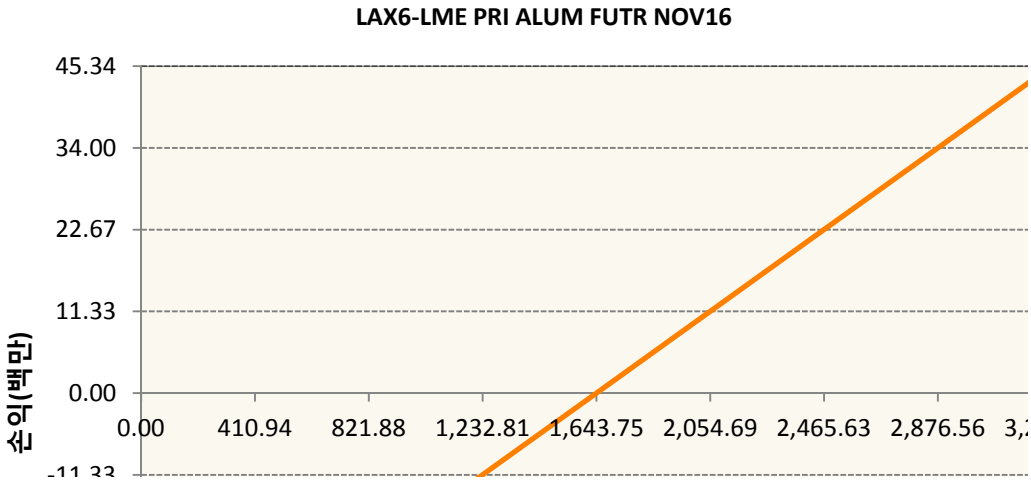
1. 계약금액

(단위:백만원)

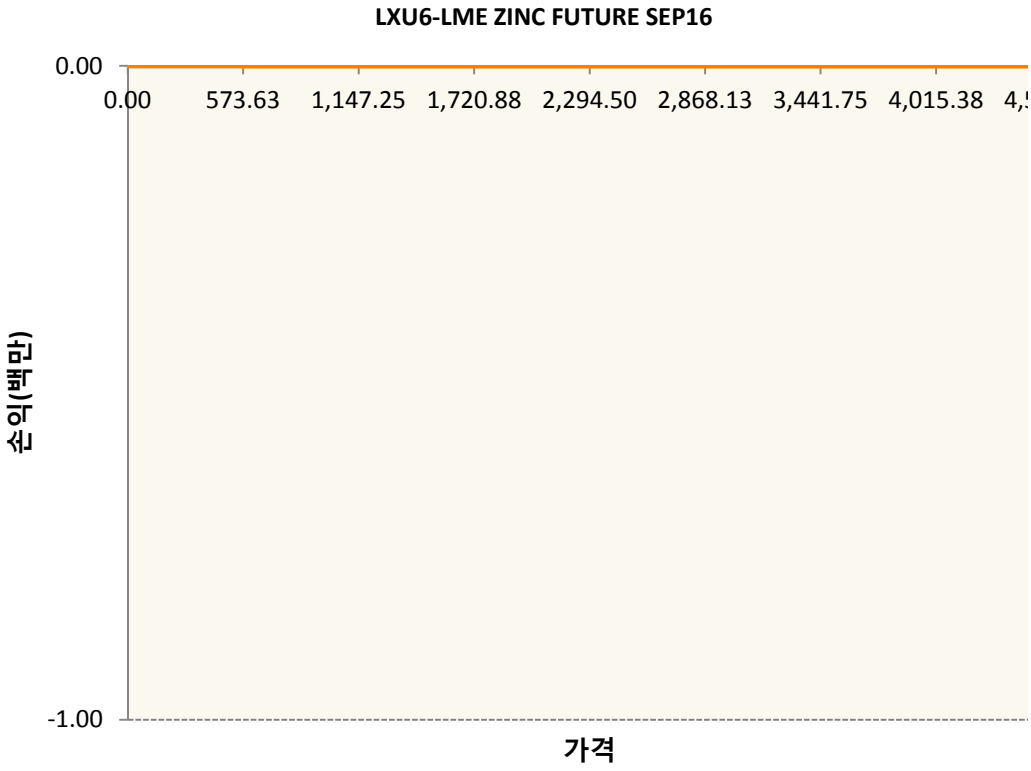
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	41	0	41	
누계	유가증권	선물	321	173	148	

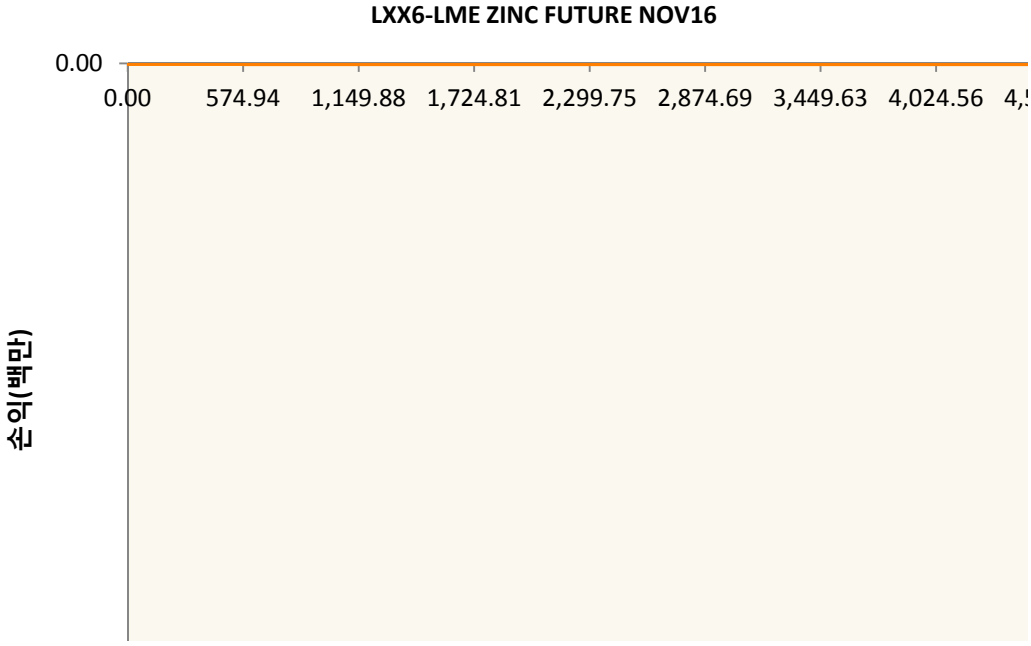
2. 만기시점의 손익구조

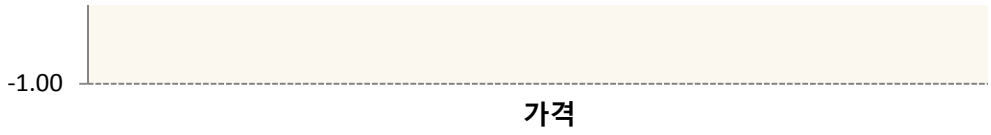


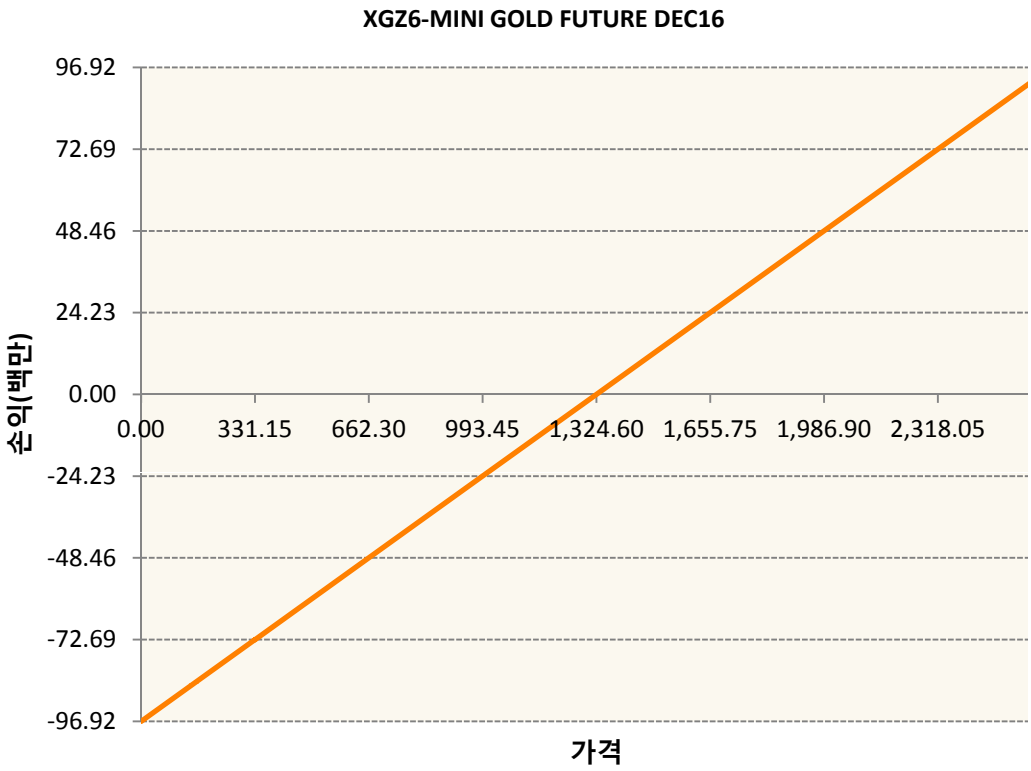


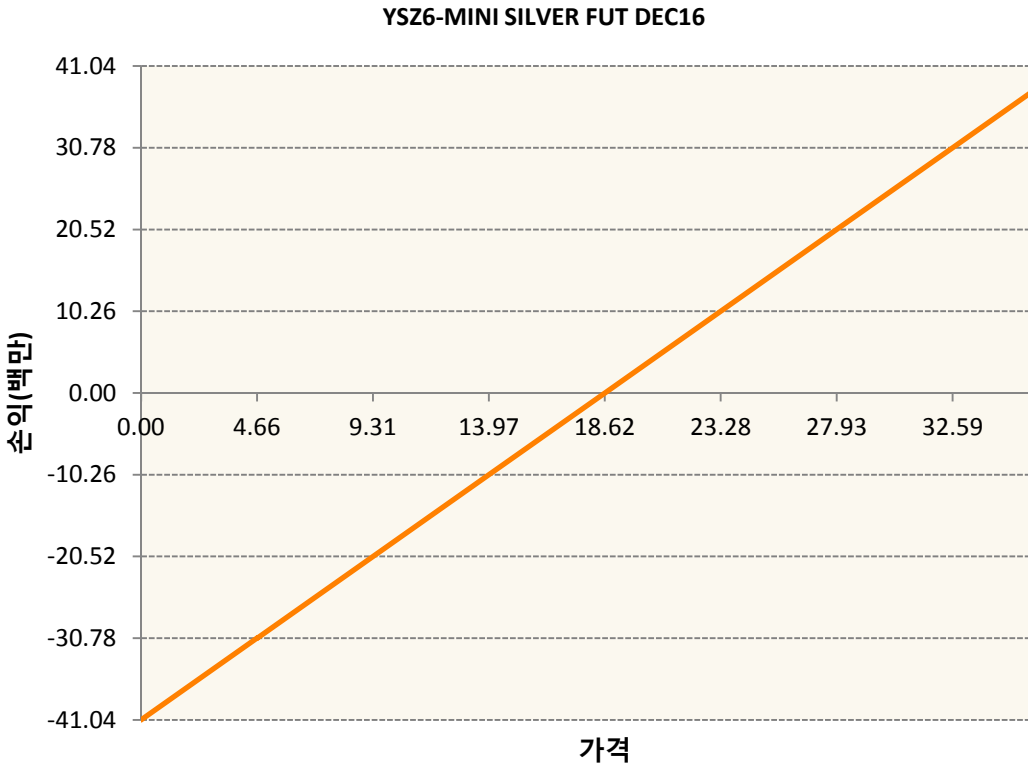

-22.67
-34.00
-45.34
가격


LXU6-LME ZINC FUTURE SEP16
0.00
0.00
573.63
1,147.25
1,720.88
2,294.50
2,868.13
3,441.75
4,015.38
-1.00
순익(백만)
가격


LXX6-LME ZINC FUTURE NOV16
0.00
0.00
574.94
1,149.88
1,724.81
2,299.75
2,874.69
3,449.63
4,024.56
순익(백만)


-1.00
가격


XGZ6-MINI GOLD FUTURE DEC16
96.92
72.69
48.46
24.23
0.00
-24.23
-48.46
-72.69
-96.92
순익(백만)
0.00
331.15
662.30
993.45
1,324.60
1,655.75
1,986.90
2,318.05
가격


YSZ6-MINI SILVER FUT DEC16
41.04
30.78
20.52
10.26
0.00
-10.26
-20.52
-30.78
-41.04
순익(백만)
0.00
4.66
9.31
13.97
18.62
23.28
27.93
32.59
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	0.4
LXX6	LME ZINC FUTURE NOV16	0.1
XGZ6	MINI GOLD FUTURE DEC16	8
YSZ6	MINI SILVER FUT DEC16	3

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

14

공시일	2016-08-29
기준일	2016-08-26

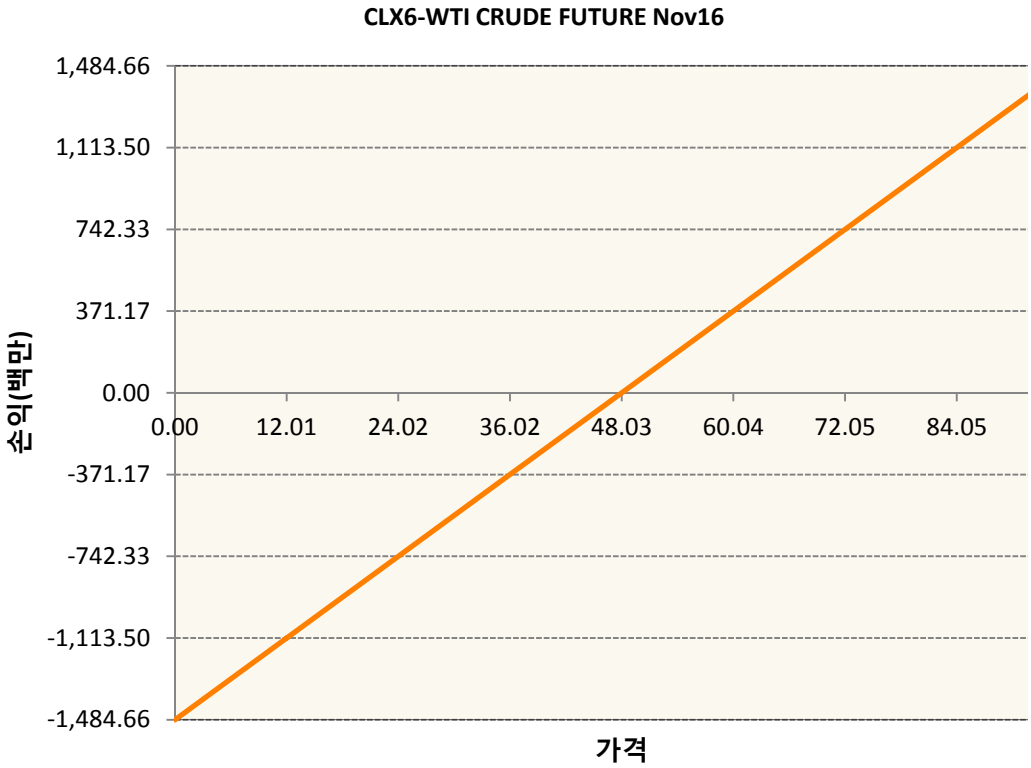
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

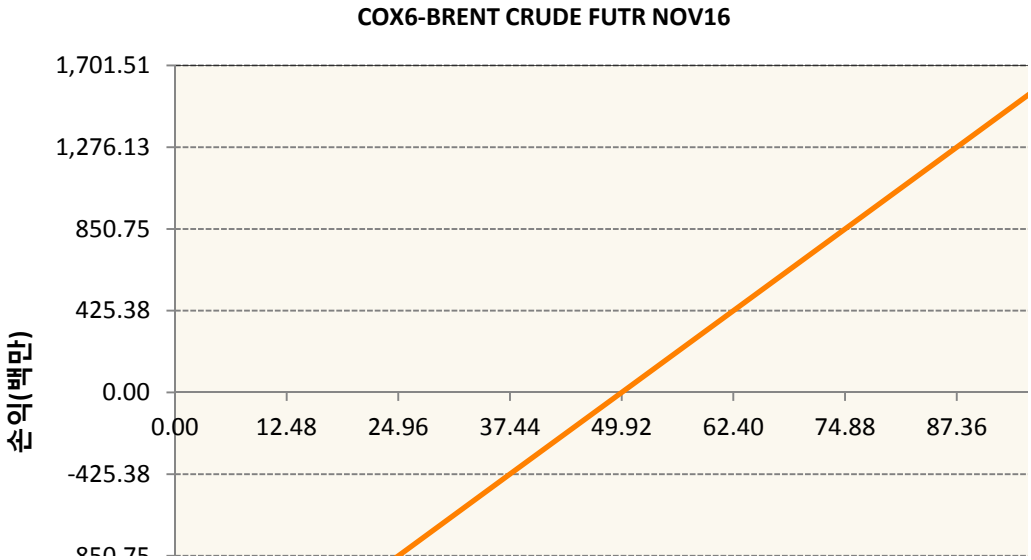
1. 계약금액

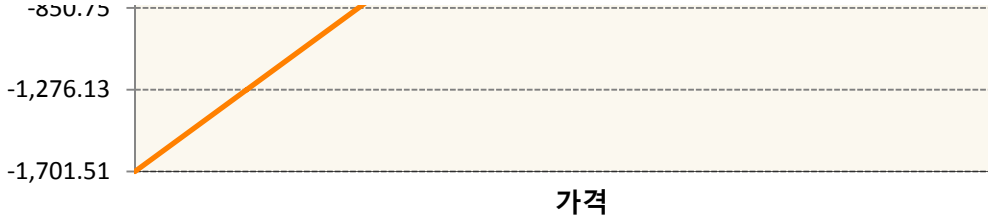
(단위:백만원)

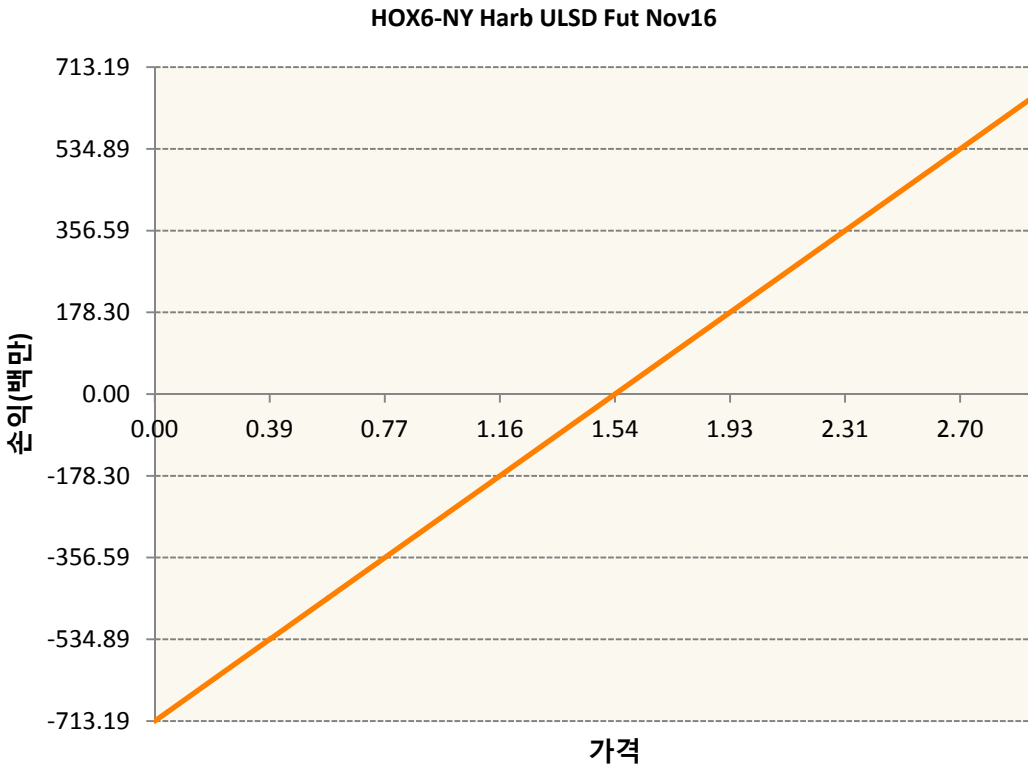
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,213	0	6,213	

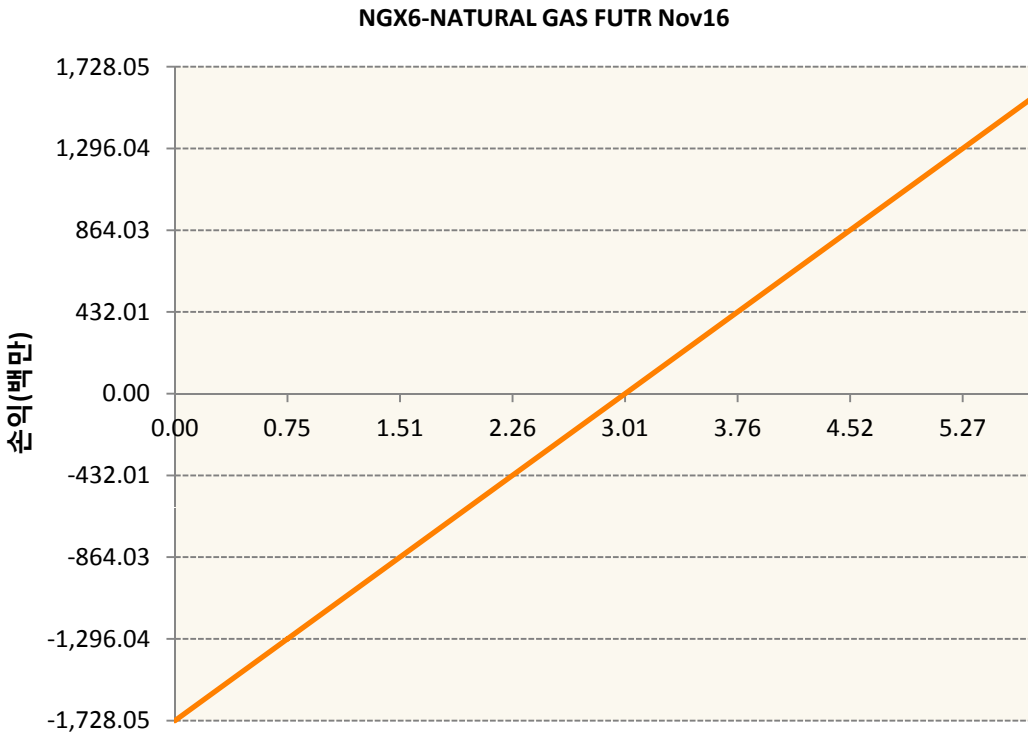
2. 만기시점의 손익구조



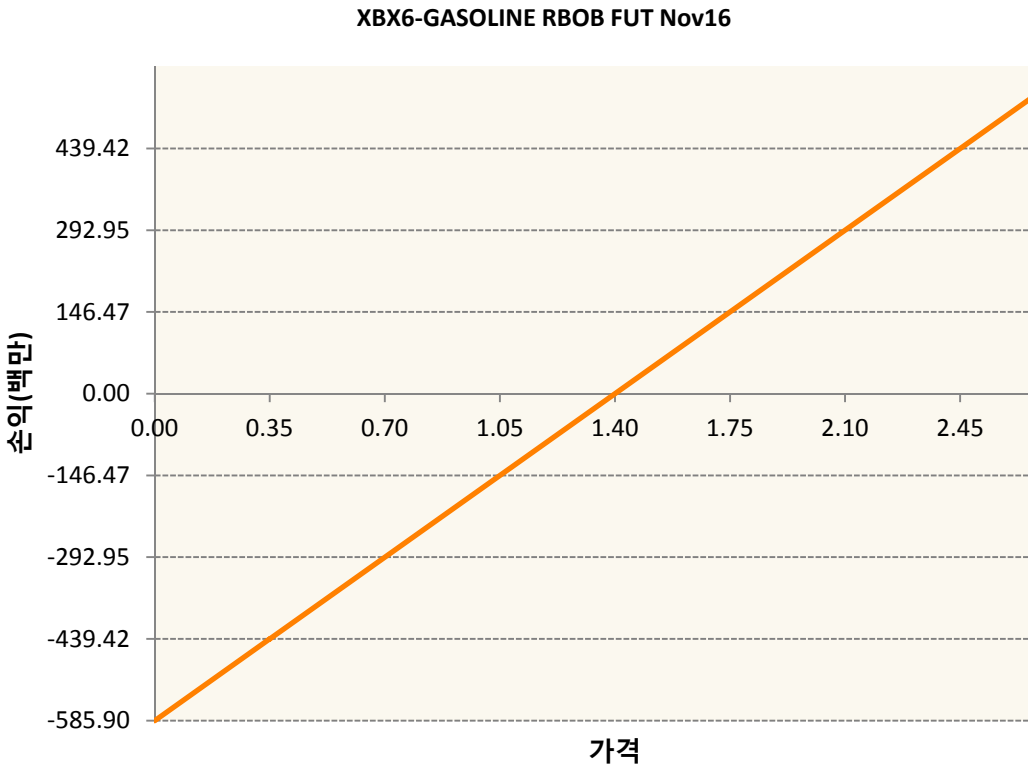



-1,276.13
-1,701.51
가격


HOX6-NY Harb ULSD Fut Nov16
713.19
534.89
356.59
178.30
0.00
-178.30
-356.59
-534.89
-713.19
0.00
0.39
0.77
1.16
1.54
1.93
2.31
2.70
손익(백만)
가격


NGX6-NATURAL GAS FUTR Nov16
1,728.05
1,296.04
864.03
432.01
0.00
-432.01
-864.03
-1,296.04
-1,728.05
0.00
0.75
1.51
2.26
3.01
3.76
4.52
5.27
손익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX6	WTI CRUDE FUTURE Nov16	119
COX6	BRENT CRUDE FUTR NOV16	136
HOX6	NY Harb ULSD Fut Nov16	57
NGX6	NATURAL GAS FUTR Nov16	138
XBX6	GASOLINE RBOB FUT Nov16	47

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,110

공시일	2016-08-29
기준일	2016-08-26

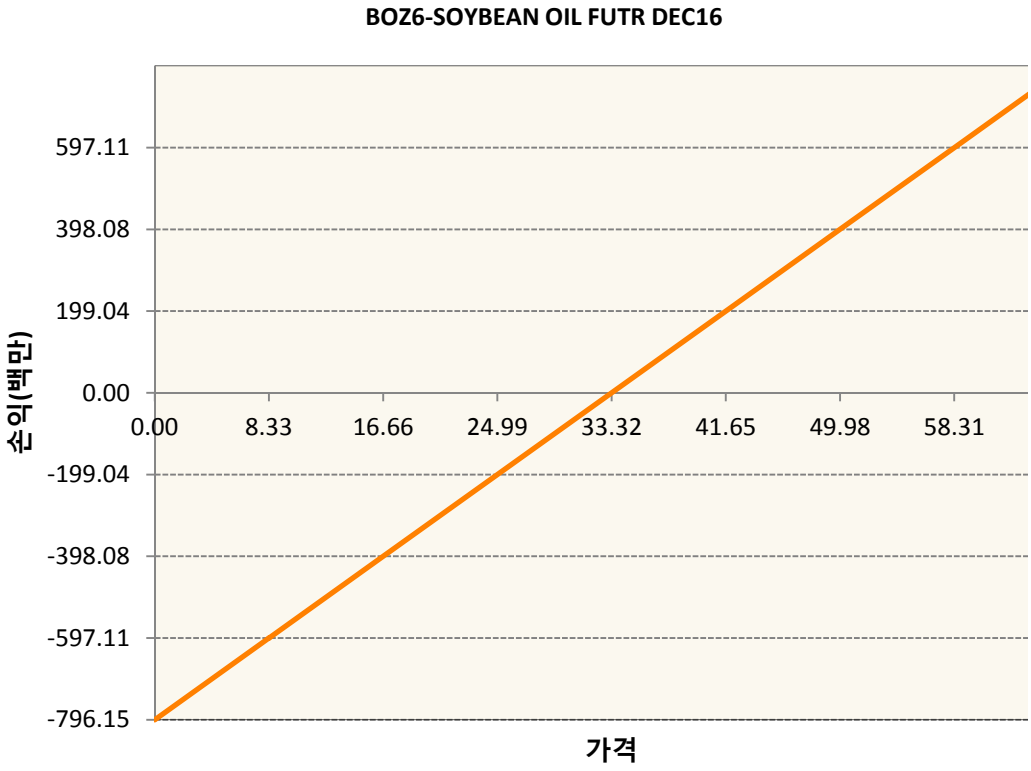
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

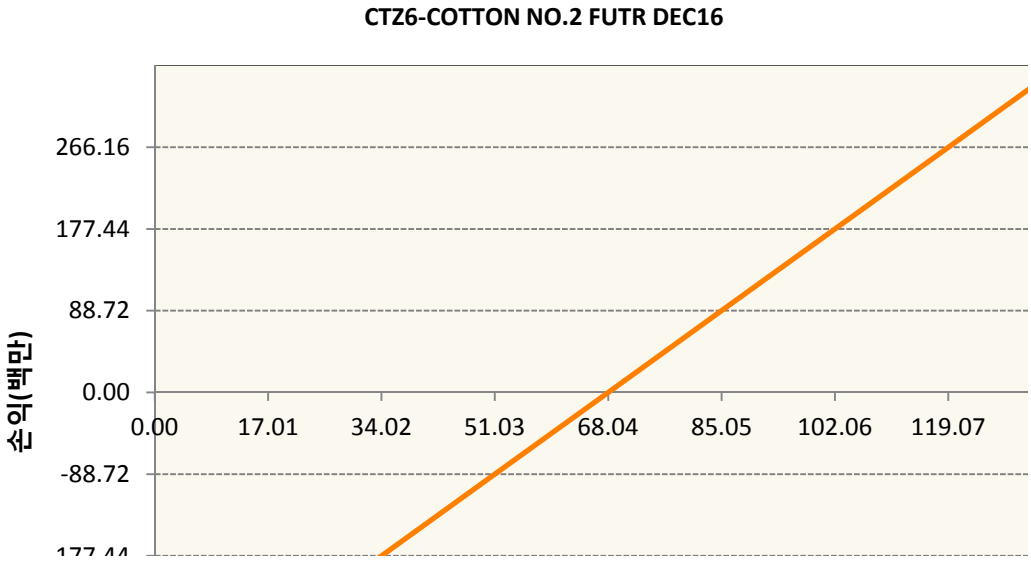
1. 계약금액

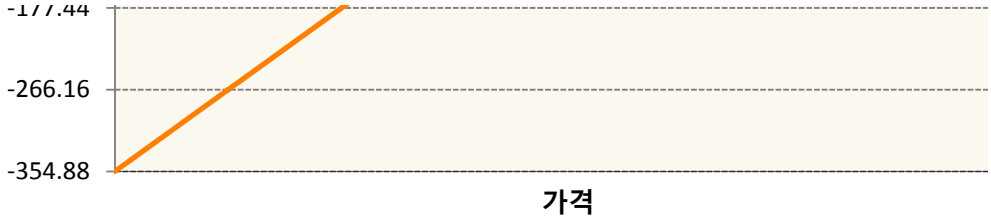
(단위:백만원)

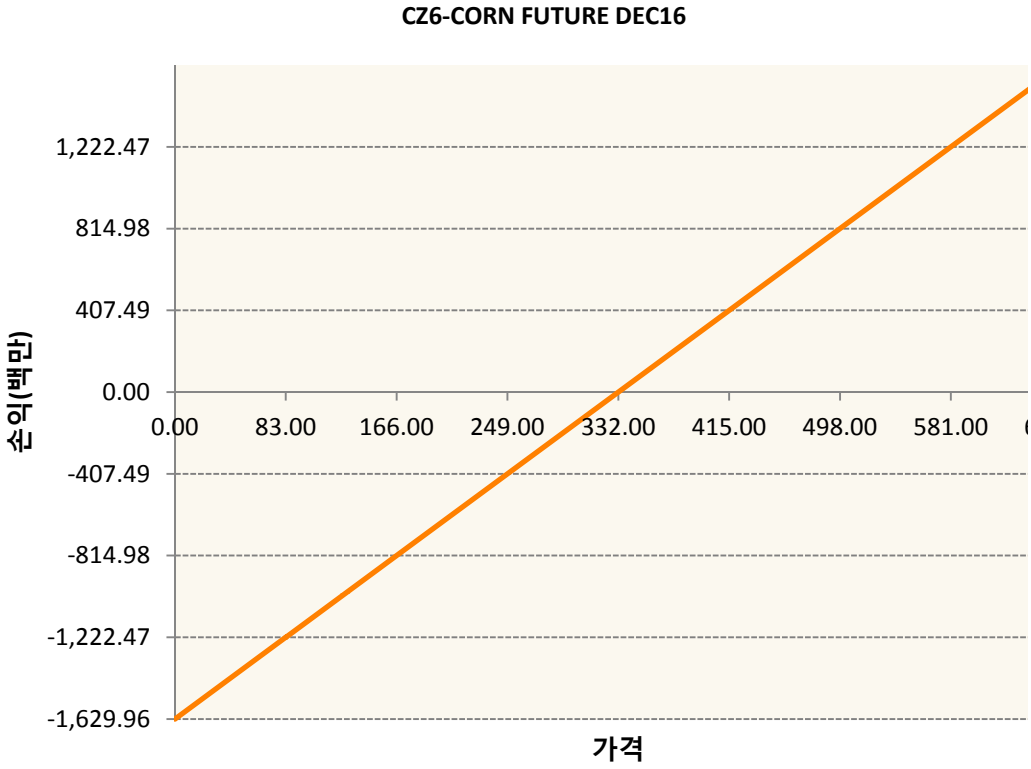
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,003	0	8,003	

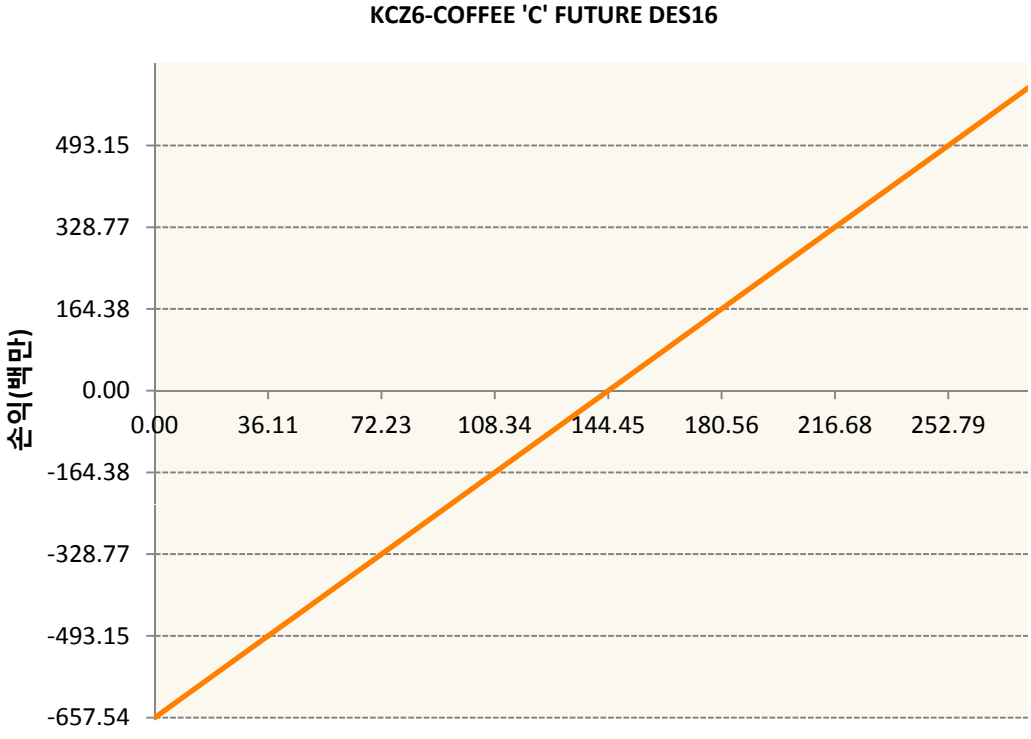
2. 만기시점의 손익구조





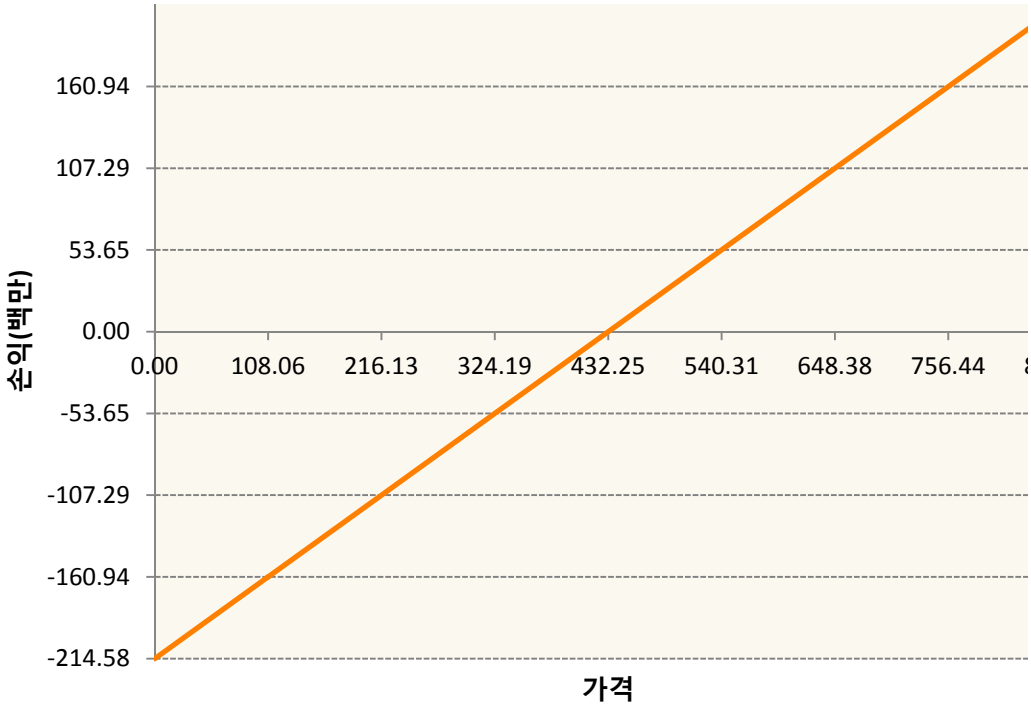

-266.16
-354.88
가격


CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,222.47
814.98
407.49
0.00
-407.49
-814.98
-1,222.47
-1,629.96
0.00
83.00
166.00
249.00
332.00
415.00
498.00
581.00
순익(백만)
가격

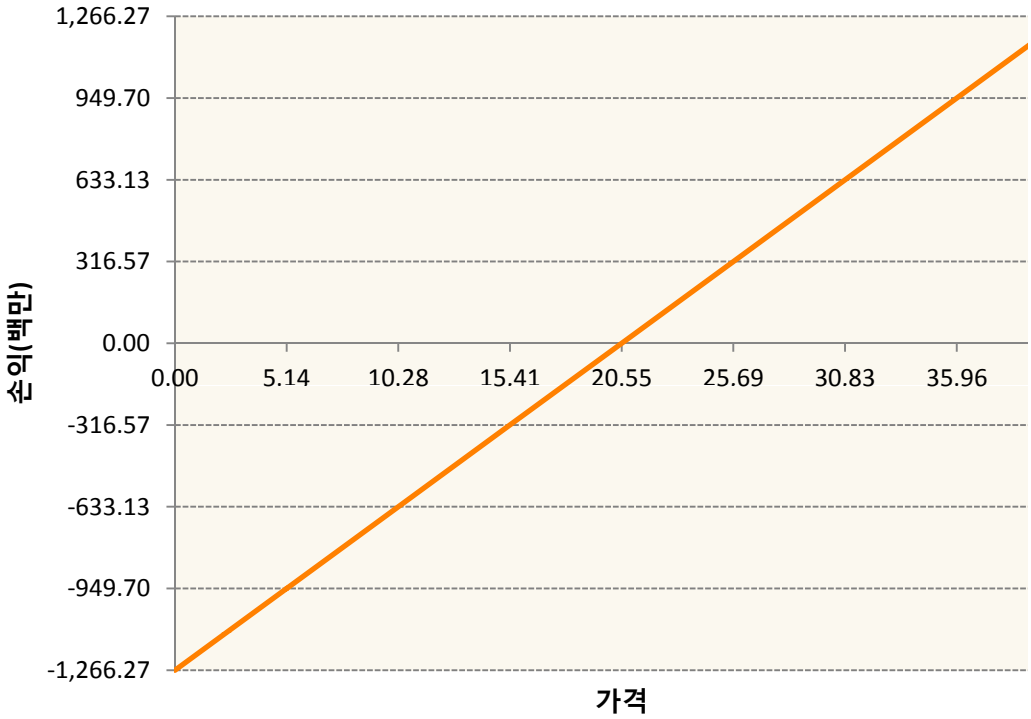

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
493.15
328.77
164.38
0.00
-164.38
-328.77
-493.15
-657.54
0.00
36.11
72.23
108.34
144.45
180.56
216.68
252.79
순익(백만)

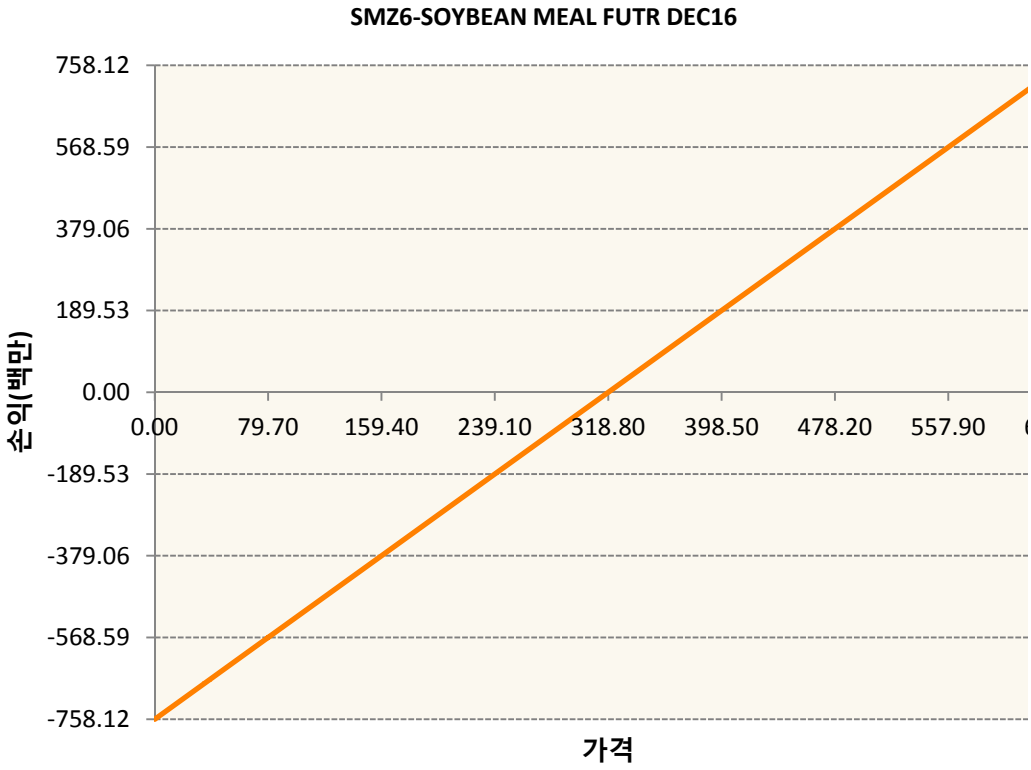
가격

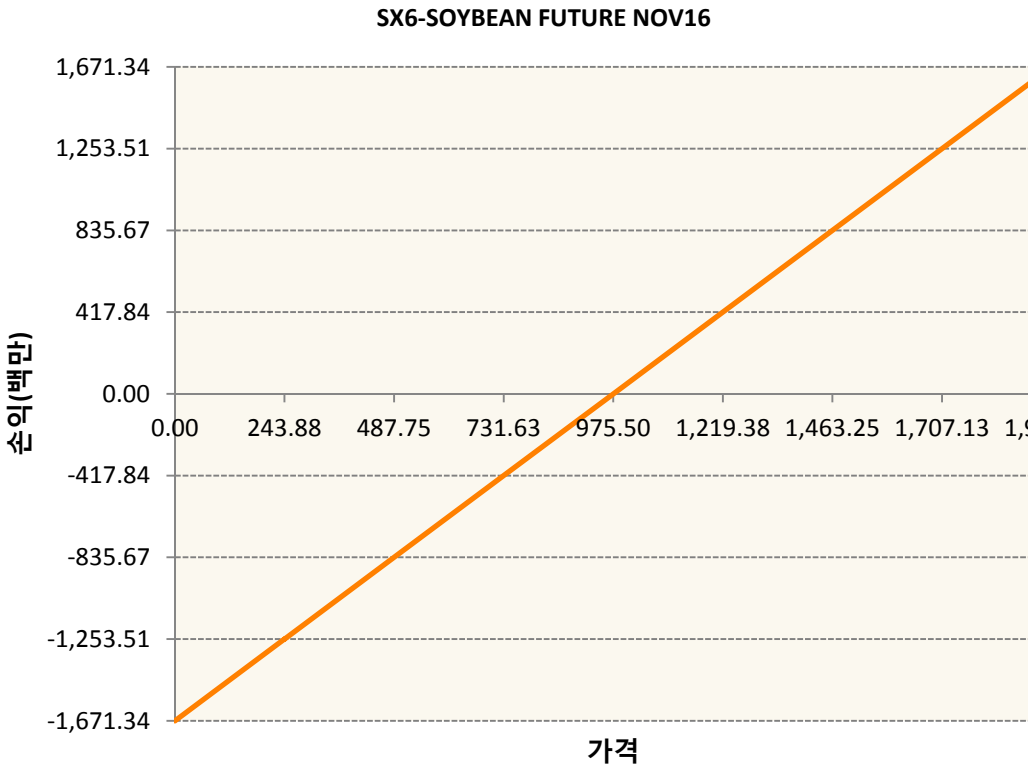
KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16



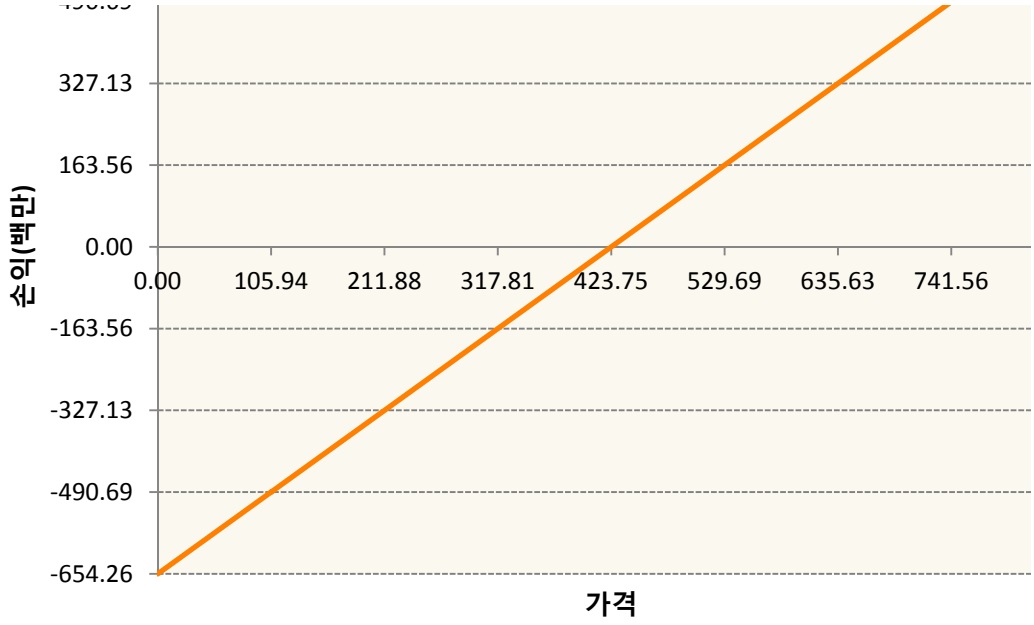
SBV6-SUGAR #11 (WORLD) OCT16




SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16
758.12
568.59
379.06
189.53
0.00
-189.53
-379.06
-568.59
-758.12
0.00
79.70
159.40
239.10
318.80
398.50
478.20
557.90
손익(백만)
가격


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16
1,671.34
1,253.51
835.67
417.84
0.00
-417.84
-835.67
-1,253.51
-1,671.34
0.00
243.88
487.75
731.63
975.50
1,219.38
1,463.25
1,707.13
손익(백만)
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
654.26
490.69



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ6	SOYBEAN OIL FUTR DEC16	64
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	28
CZ6	CORN FUTURE DEC16	130
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	53
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	17
SBV6	SUGAR #11 (WORLD) OCT16	101
SMZ6	SOYBEAN MEAL FUTR DEC16	61
SX6	SOYBEAN FUTURE NOV16	134
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	52

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

800