| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-09-01 |
| 기준일 | 2016-08-31 |

# 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 | 2016-09-01 |
| 기준일 | 2016-08-31 |

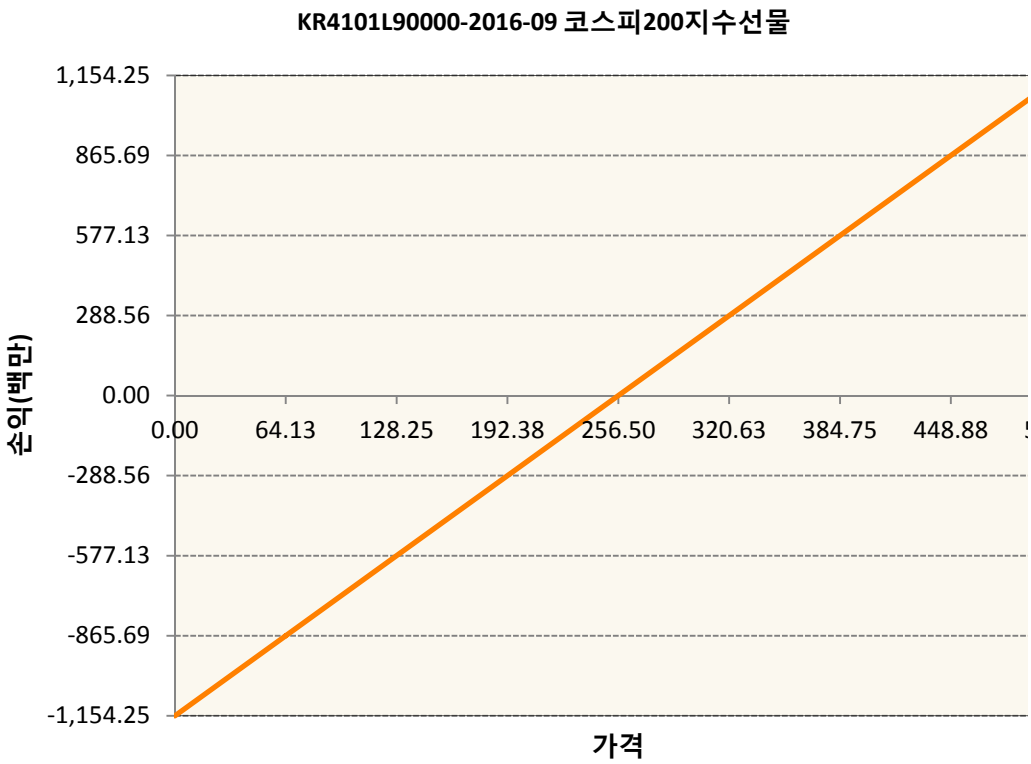
# 스마트인덱스모

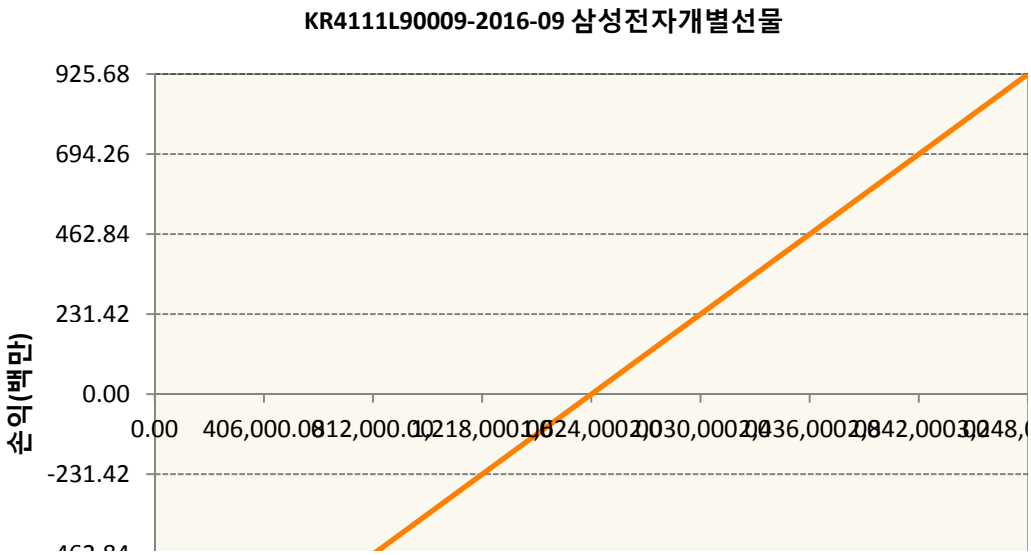
## 1. 계약금액

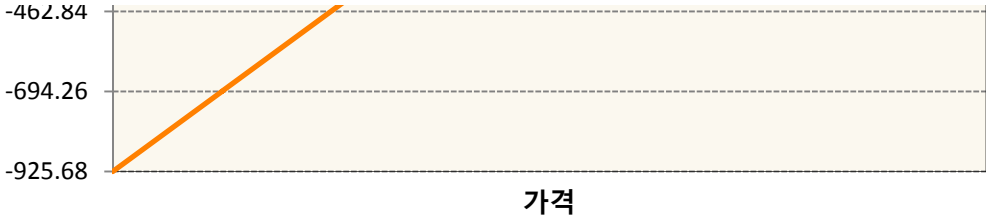
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,080 | 0 | 2,080 | 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% | -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% | 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)

| **147** |
|---|

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-09-01 |
| 기준일 | 2016-08-31 |

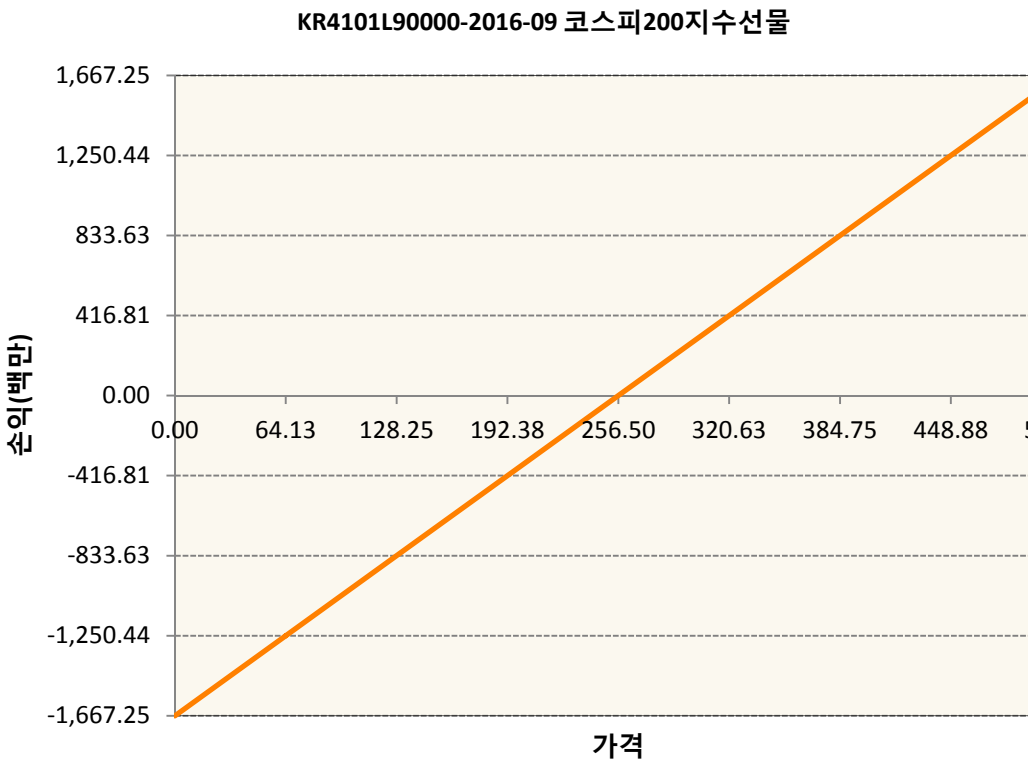
# 스마트레버리지목표전환형1호

## 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 | 1,667 | 0 | 1,667 | 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)

| 105 |
|---|

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-09-01 |
| 기준일 | 2016-08-31 |

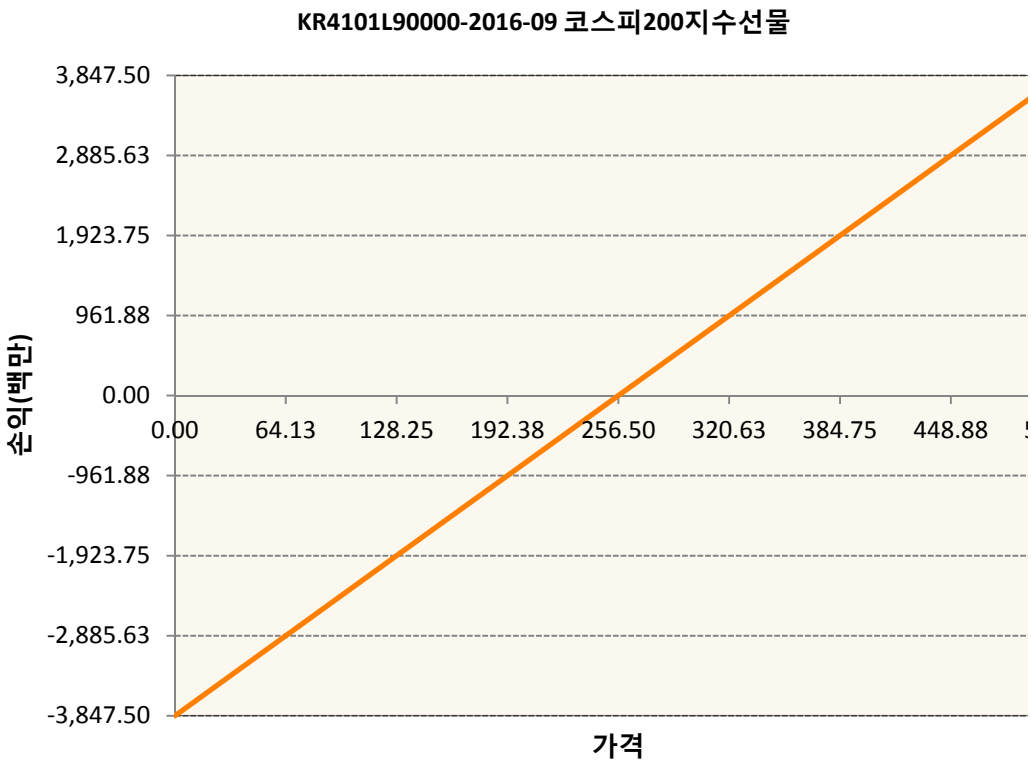
# 1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

## 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 | 3,848 | 0 | 3,848 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101L900 | 2016-09 코스피200지수선물 | | | | | | 308 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -308 | -308 | -308 | -308 | -308 | -308 | -308 |
| -5.33% | -205 | -205 | -205 | -205 | -205 | -205 | -205 |
| -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% | 205 | 205 | 205 | 205 | 205 | 205 | 205 |
| 8.00% | 308 | 308 | 308 | 308 | 308 | 308 | 308 |

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

| |
|---|
| **243** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-09-01 |
| 기준일 | 2016-08-31 |

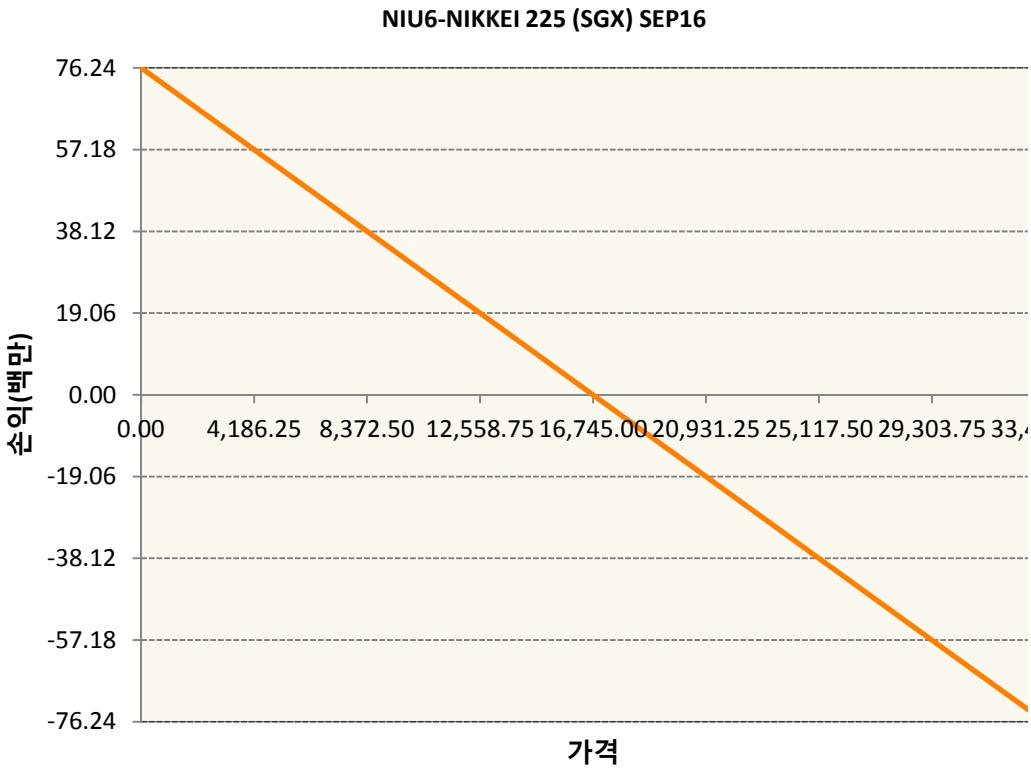
# 아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 76 | -76 | |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| NIU6 | NIKKEI 225 (SGX) SEP16 | 6 |

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

(단위:백만원)

**8**

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-09-01 |
| 기준일 | 2016-08-31 |

# 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 | 885 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **755** |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-09-01 |
| 기준일 | 2016-08-31 |

# 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 | 404 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **903** |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| 공시일 | 2016-09-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-08-31 |

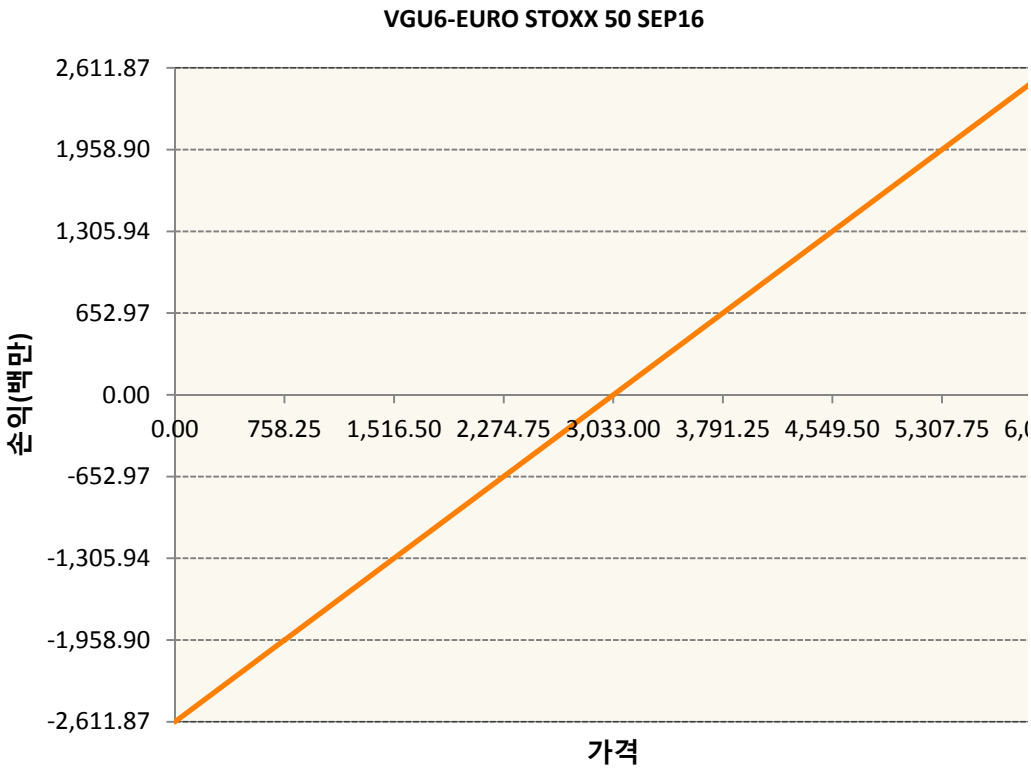
# 유로인덱스모(주식-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,612 | 0 | 2,612 | |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| VGU6 | EURO STOXX 50 SEP16 | 209 |
|---|---|---|

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

(단위:백만원)

**258**

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-09-01 |
| 기준일 | 2016-08-31 |

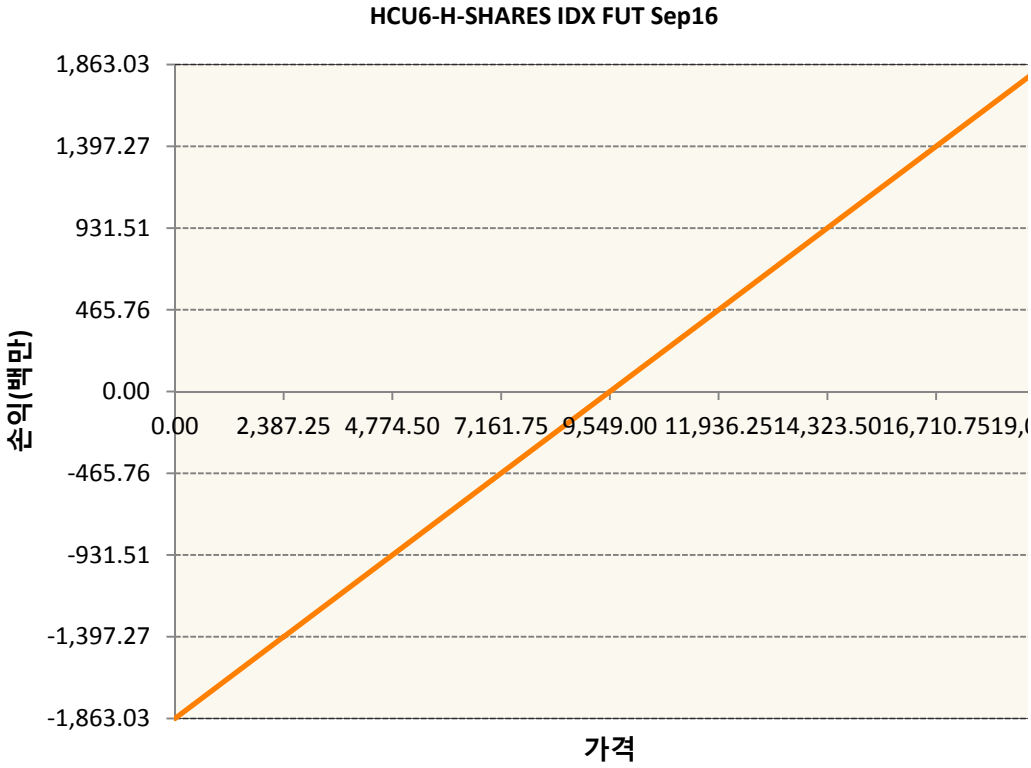
# 차이나인덱스모(주식-파생형)

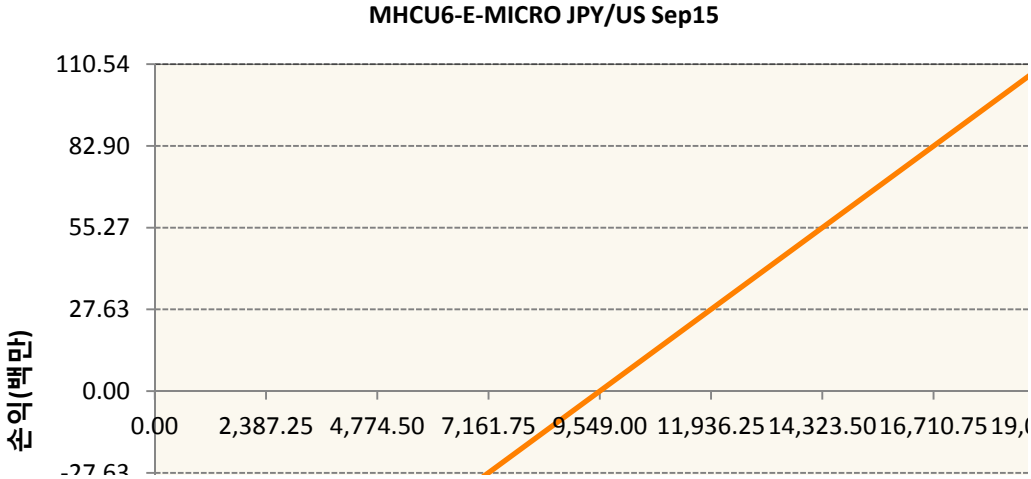
## 1. 계약금액

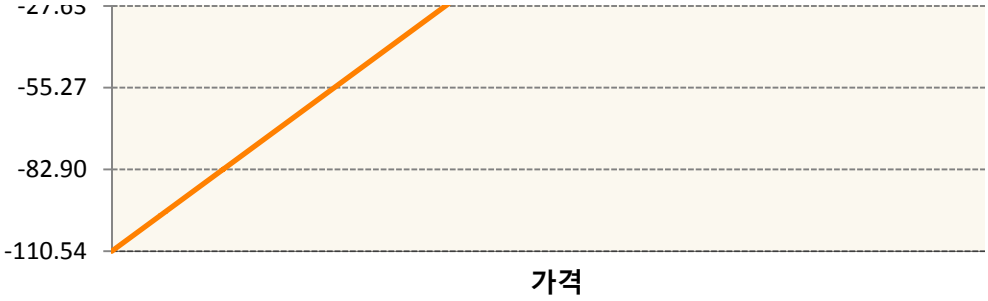
(단위:백만원)

| 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 | 111 | 0 | 111 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,863 | 0 | 1,863 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조






| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---|---|
| HCU6 | H-SHARES IDX FUT Sep16 | 149 |
| MHCU6 | E-MICRO JPY/US Sep15 | 9 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|---|---|
| | **214** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-09-01 |
| 기준일 | 2016-08-31 |

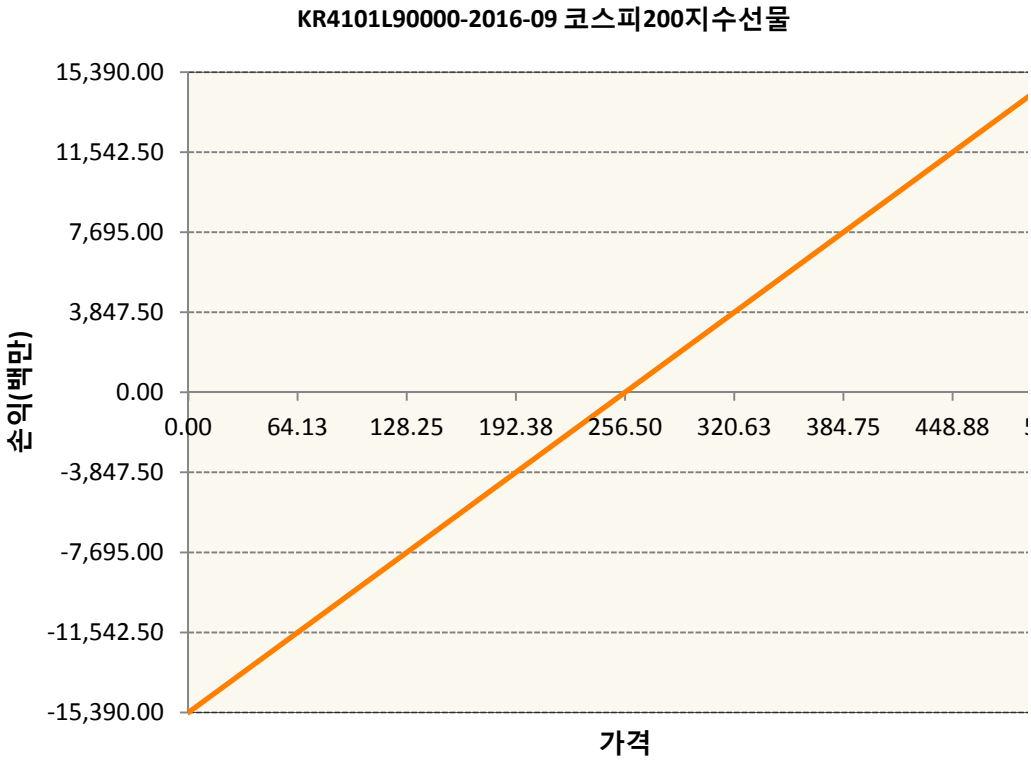
# 커버드콜(주식혼합-파생형)

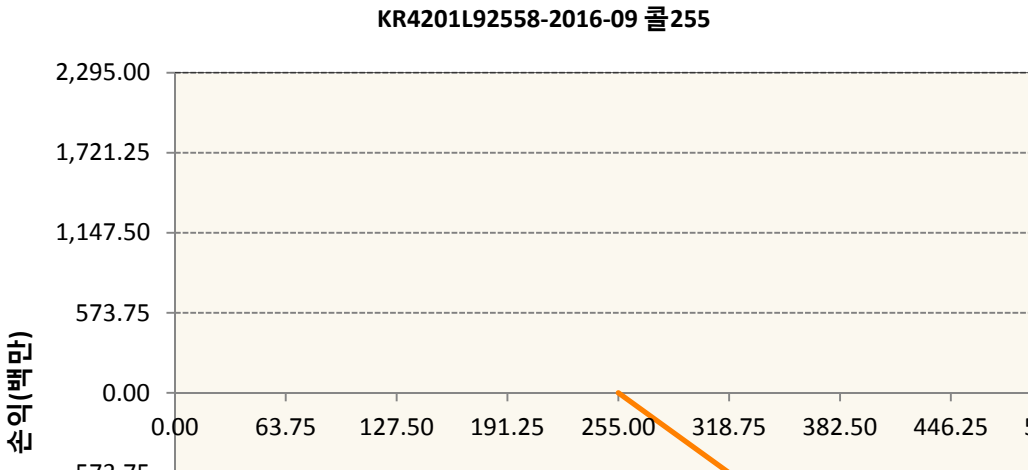
## 1. 계약금액

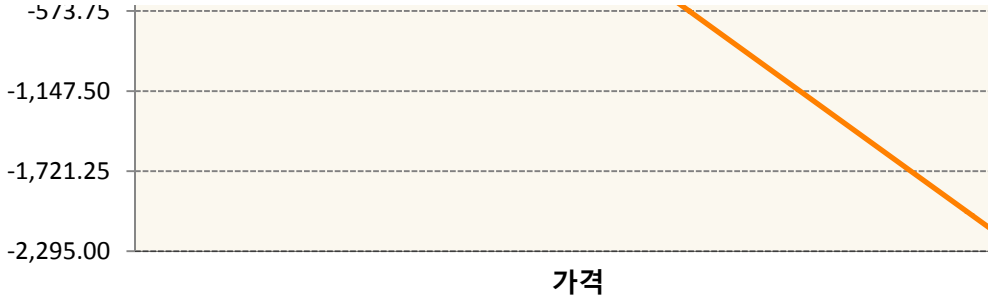
(단위:백만원)

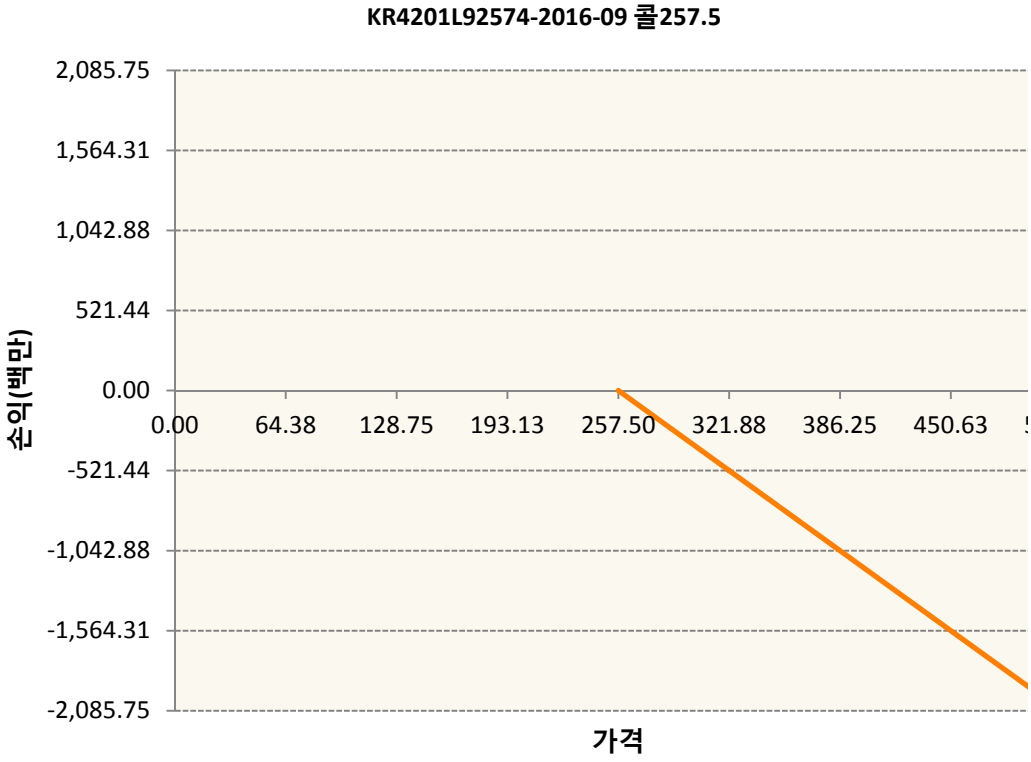
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 642 | 0 | 642 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 129 | -129 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 15,390 | 0 | 15,390 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 4,381 | -4,381 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조






**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| KR4101L900 2016-09 코스피200지수선물 | | | | | | | 1,233 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,233 | -1,233 | -1,233 | -1,233 | -1,233 | -1,233 | -1,233 |
| -5.33% | -822 | -822 | -822 | -822 | -822 | -822 | -822 |
| -2.67% | -411 | -411 | -411 | -411 | -411 | -411 | -411 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 411 | 411 | 411 | 411 | 411 | 411 | 411 |
| 5.33% | 822 | 822 | 822 | 822 | 822 | 822 | 822 |
| 8.00% | 1,233 | 1,233 | 1,233 | 1,233 | 1,233 | 1,233 | 1,233 |
| KR4201L925 2016-09 콜255 | | | | | | | 882 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |

| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| -8.00% | 125 | 125 | 125 | 125 | 125 | 125 | 125 |
| -5.33% | 125 | 125 | 125 | 125 | 125 | 125 | 124 |
| -2.67% | 122 | 120 | 117 | 114 | 111 | 108 | 104 |
| 0% | 17 | 11 | 6 | 0 | -6 | -12 | -18 |
| 2.67% | -266 | -267 | -267 | -268 | -269 | -270 | -272 |
| 5.33% | -574 | -574 | -574 | -574 | -574 | -574 | -574 |
| 8.00% | -882 | -882 | -882 | -882 | -882 | -882 | -882 |
| KR4201L925 2016-09 콜257.5 | | | | | | | 749 |

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 57 | 57 | 57 | 57 | 57 | 57 | 57 |
| -5.33% | 57 | 57 | 57 | 57 | 57 | 57 | 57 |
| -2.67% | 57 | 56 | 55 | 54 | 53 | 51 | 49 |
| 0% | 17 | 11 | 6 | 0 | -6 | -11 | -17 |
| 2.67% | -196 | -197 | -198 | -200 | -203 | -205 | -208 |
| 5.33% | -472 | -472 | -472 | -472 | -472 | -472 | -472 |
| 8.00% | -749 | -749 | -749 | -749 | -749 | -749 | -749 |

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

| |
|---|
| **3,219** |

| 공시일 | 2016-09-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-08-31 |

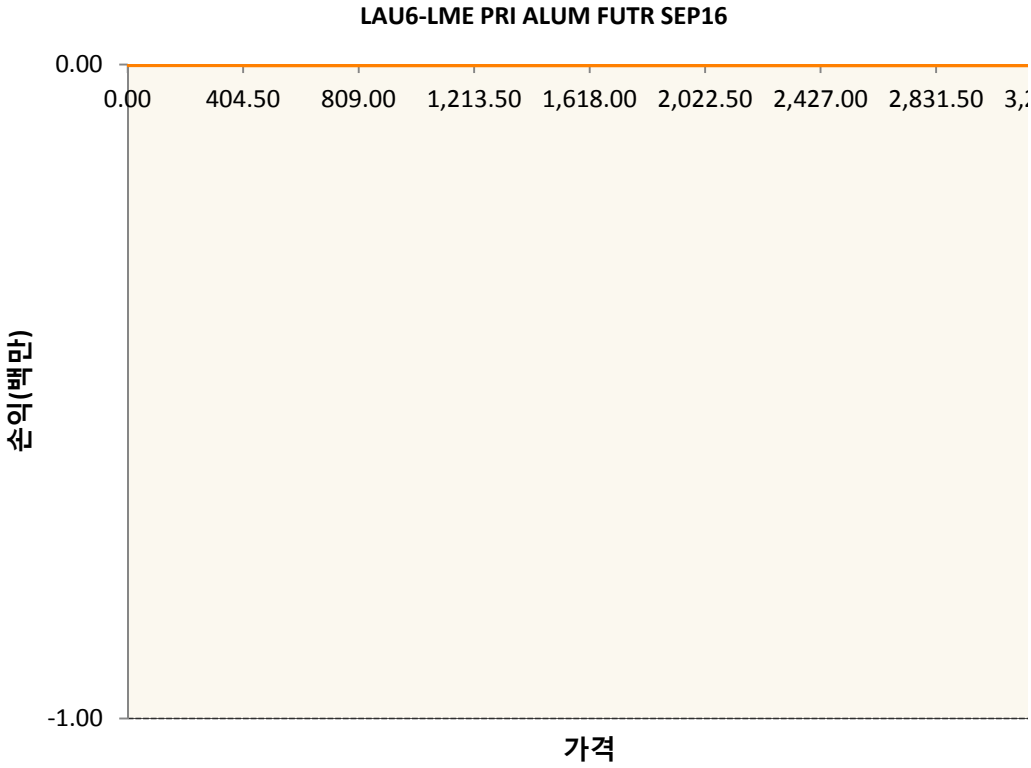
# 메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

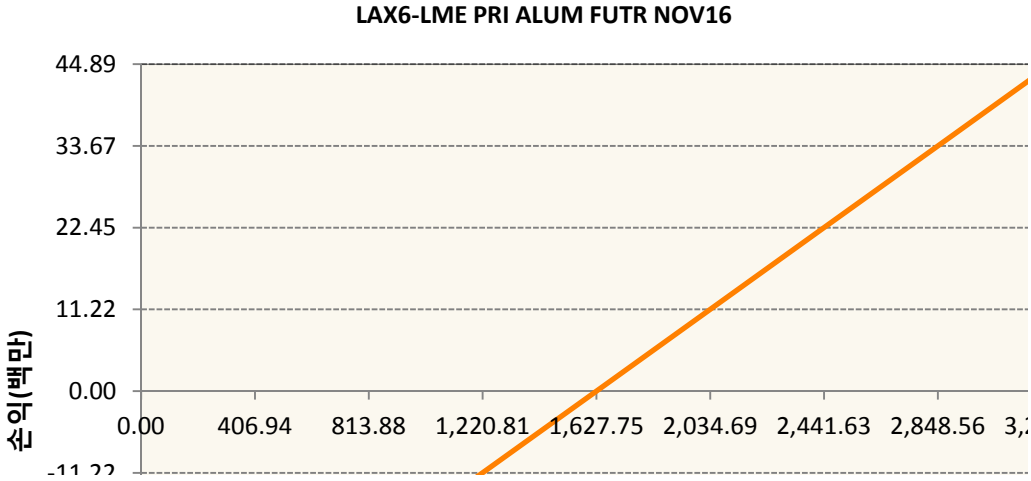
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

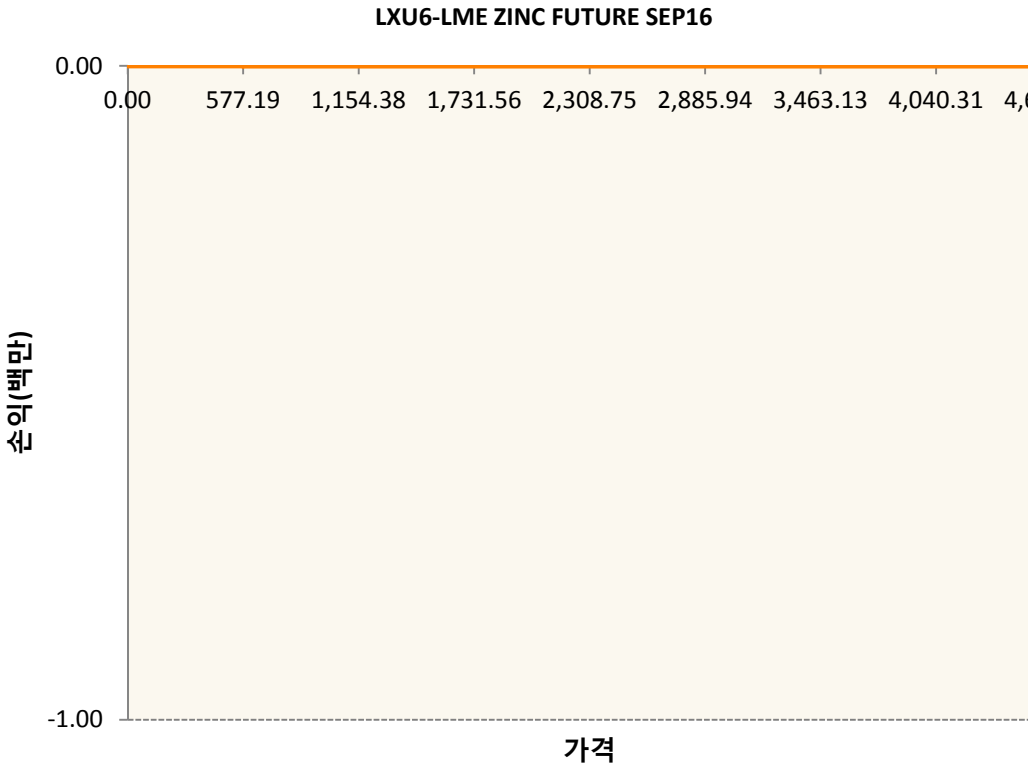
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 선물 | 유가증권 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 선물 | 유가증권 | 41 | 0 | 41 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 320 | 172 | 148 | |

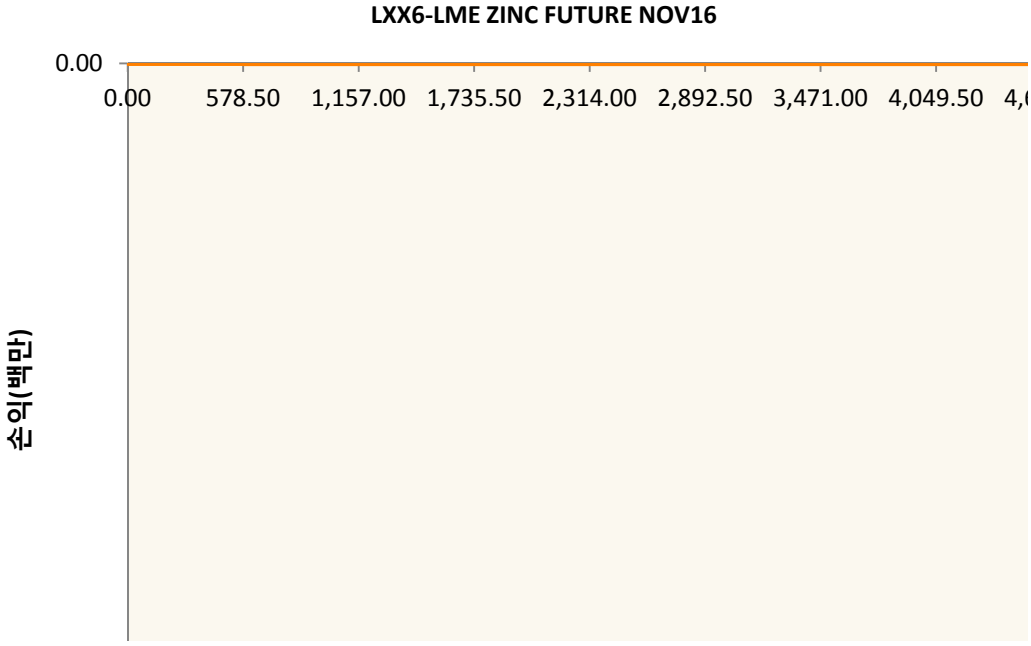
## 2. 만기시점의 손익구조

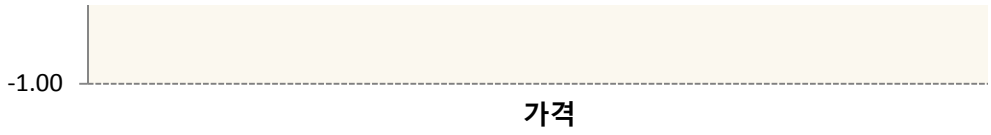


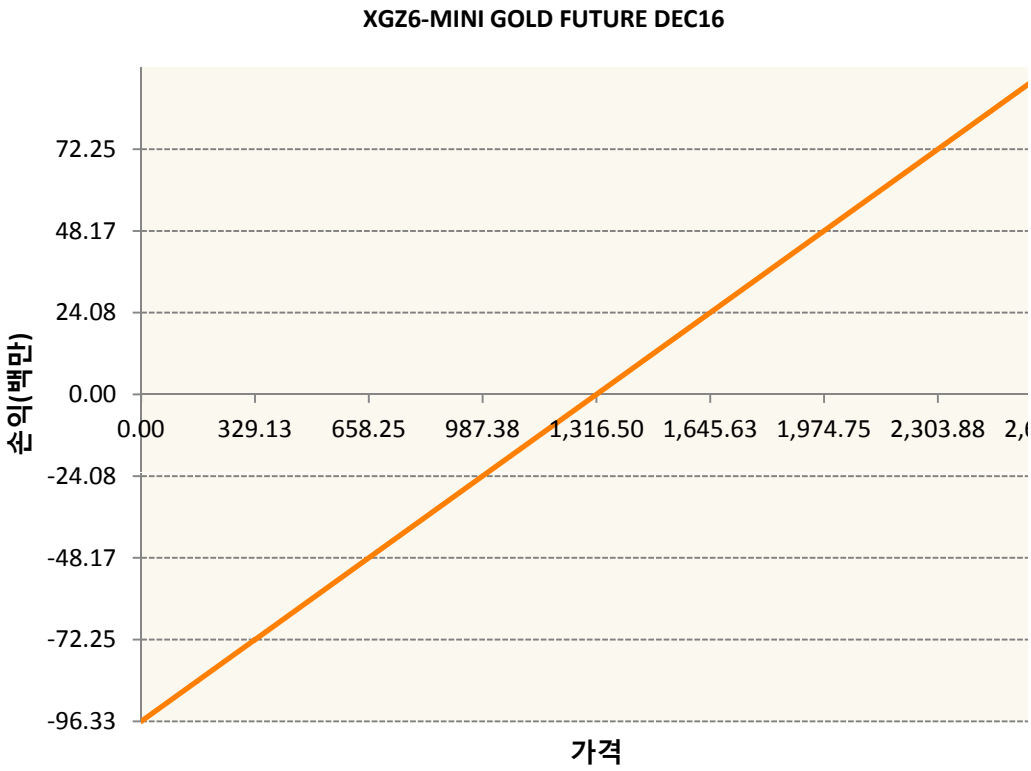



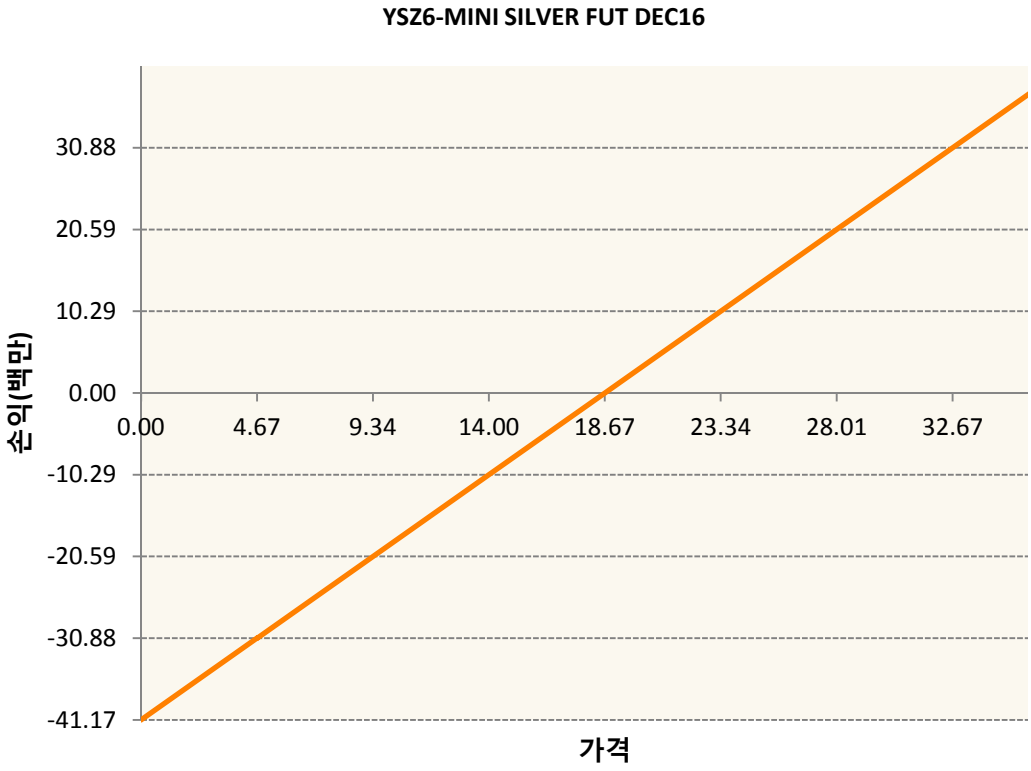

-11.22
-22.45
-33.67
-44.89
가격


LXU6-LME ZINC FUTURE SEP16
0.00
0.00
577.19
1,154.38
1,731.56
2,308.75
2,885.94
3,463.13
4,040.31
-1.00
순익(백만)
가격


LXX6-LME ZINC FUTURE NOV16
0.00
0.00
578.50
1,157.00
1,735.50
2,314.00
2,892.50
3,471.00
4,049.50
순익(백만)


-1.00
가격


XGZ6-MINI GOLD FUTURE DEC16
72.25
48.17
24.08
0.00
-24.08
-48.17
-72.25
-96.33
순익(백만)
0.00
329.13
658.25
987.38
1,316.50
1,645.63
1,974.75
2,303.88
가격


YSZ6-MINI SILVER FUT DEC16
30.88
20.59
10.29
0.00
-10.29
-20.59
-30.88
-41.17
순익(백만)
0.00
4.67
9.34
14.00
18.67
23.34
28.01
32.67
가격

**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| LAU6 | LME PRI ALUM FUTR SEP16 | 0.1 |
| LAX6 | LME PRI ALUM FUTR NOV16 | 4 |
| LXU6 | LME ZINC FUTURE SEP16 | 0.4 |
| LXX6 | LME ZINC FUTURE NOV16 | 0 |
| XGZ6 | MINI GOLD FUTURE DEC16 | 8 |
| YSZ6 | MINI SILVER FUT DEC16 | 3 |

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

| |
|---|
| **14** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-09-01 |
| 기준일 | 2016-08-31 |

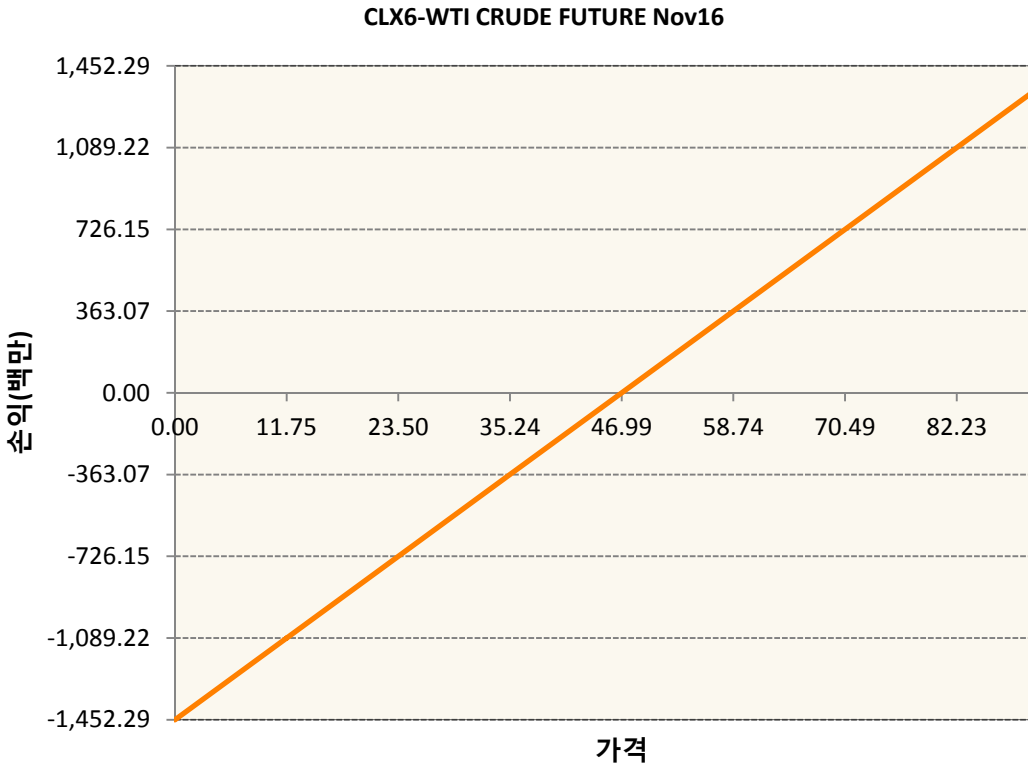
# 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

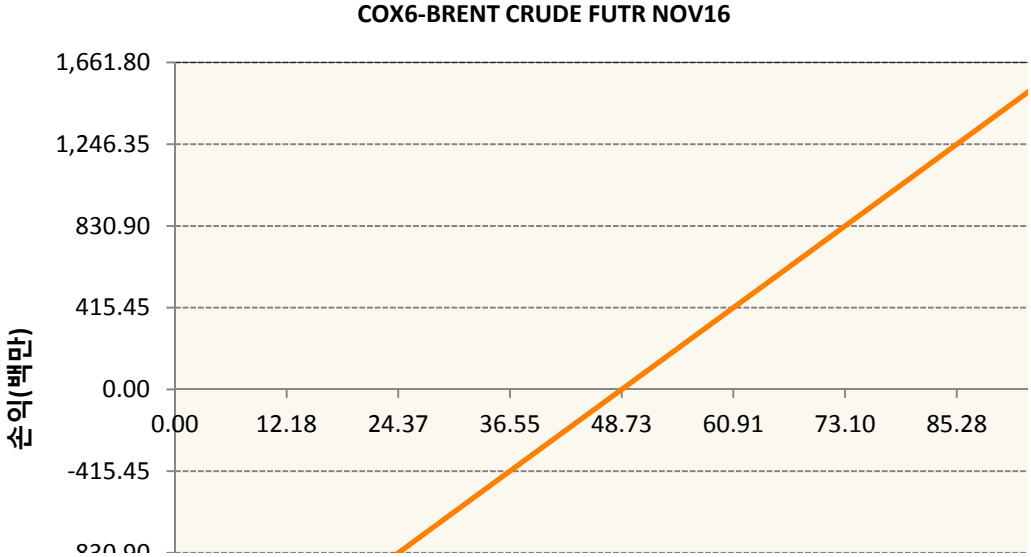
## 1. 계약금액

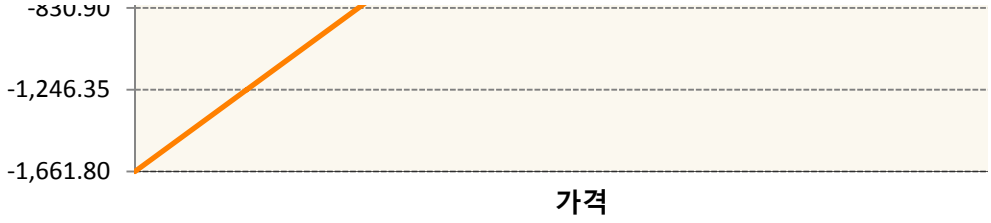
(단위:백만원)

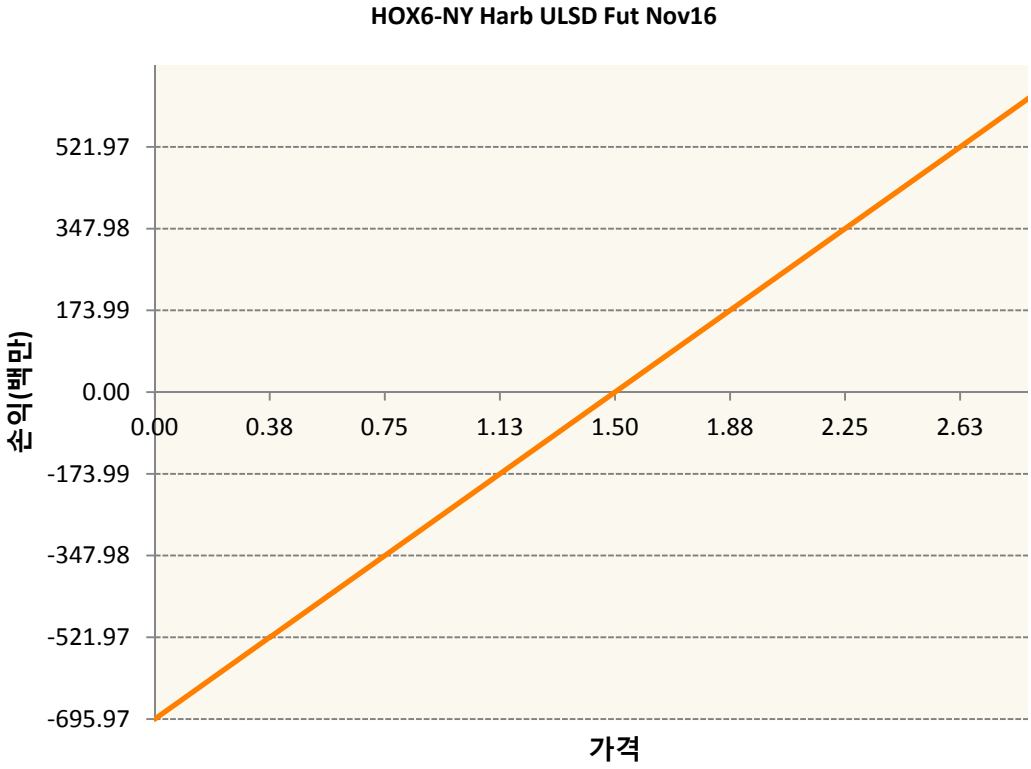
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 6,072 | 0 | 6,072 | |

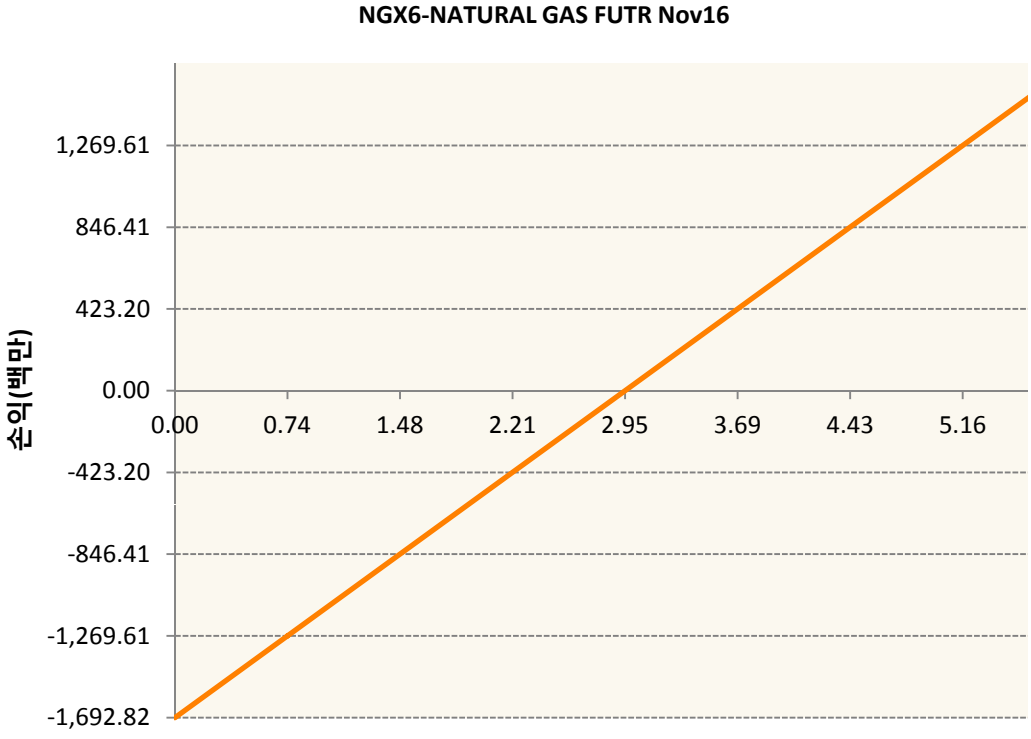
## 2. 만기시점의 손익구조



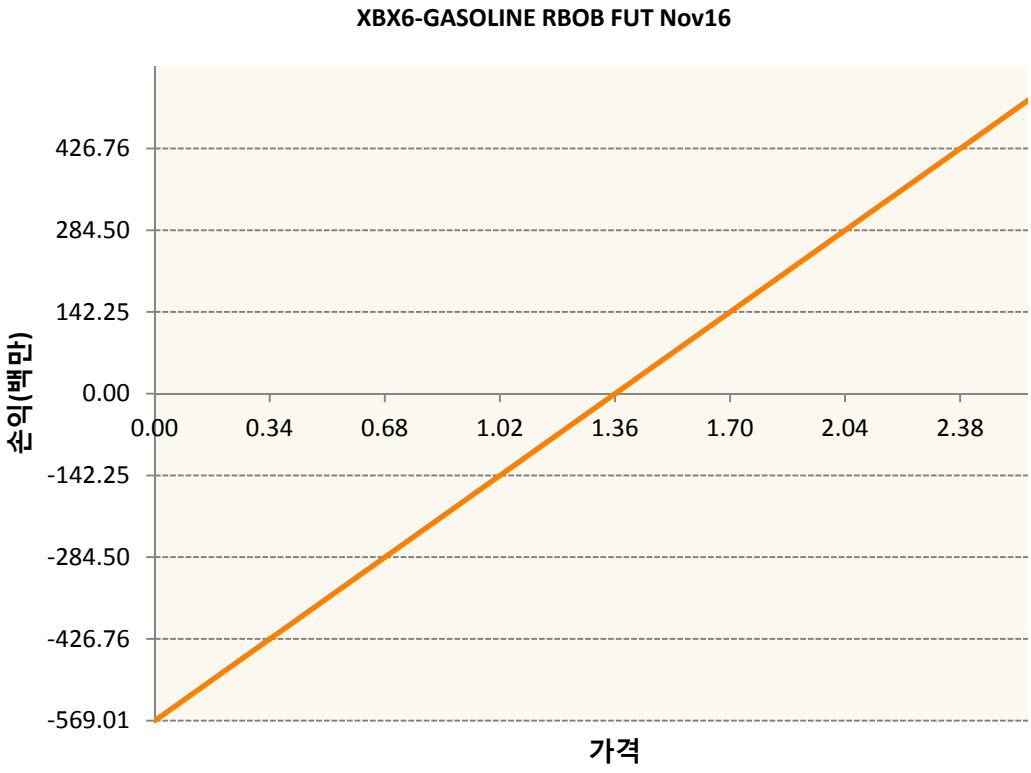




-1,246.35
-1,661.80
가격


HOX6-NY Harb ULSD Fut Nov16
521.97
347.98
173.99
0.00
-173.99
-347.98
-521.97
-695.97
0.00
0.38
0.75
1.13
1.50
1.88
2.25
2.63
순익(백만)
가격


NGX6-NATURAL GAS FUTR Nov16
1,269.61
846.41
423.20
0.00
-423.20
-846.41
-1,269.61
-1,692.82
0.00
0.74
1.48
2.21
2.95
3.69
4.43
5.16
순익(백만)

가격




| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---|---|
| CLX6 | WTI CRUDE FUTURE Nov16 | 116 |
| COX6 | BRENT CRUDE FUTR NOV16 | 133 |
| HOX6 | NY Harb ULSD Fut Nov16 | 56 |
| NGX6 | NATURAL GAS FUTR Nov16 | 135 |
| XBX6 | GASOLINE RBOB FUT Nov16 | 46 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|---|---|
| | **1,079** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-09-01 |
| 기준일 | 2016-08-31 |

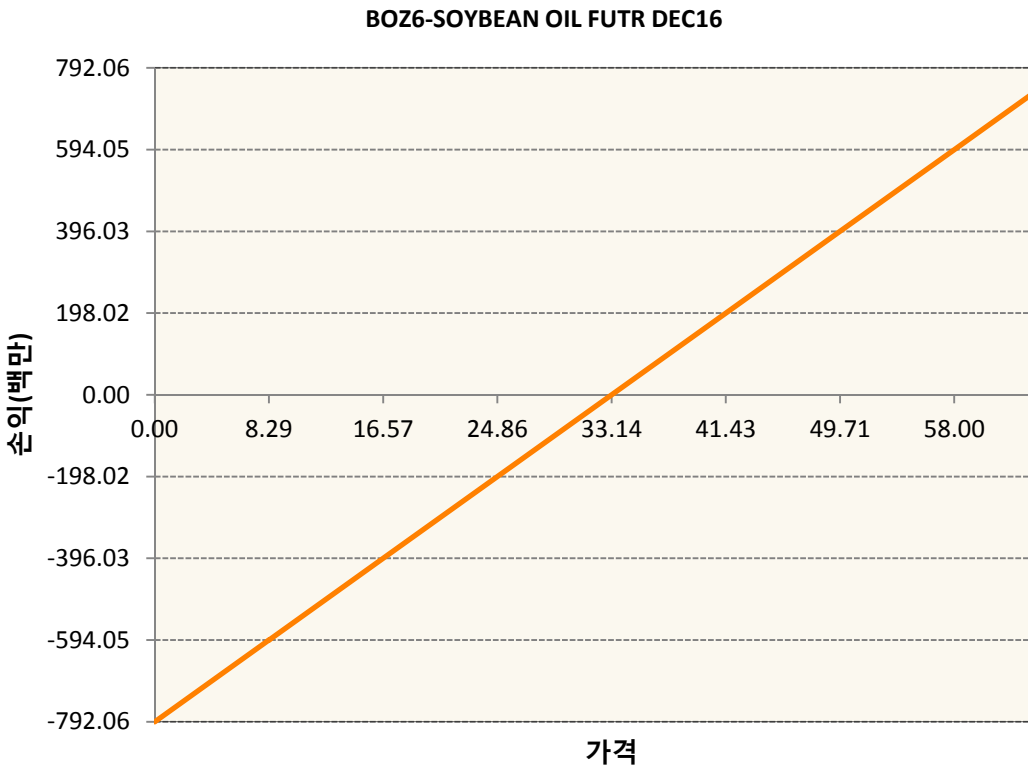
# 애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

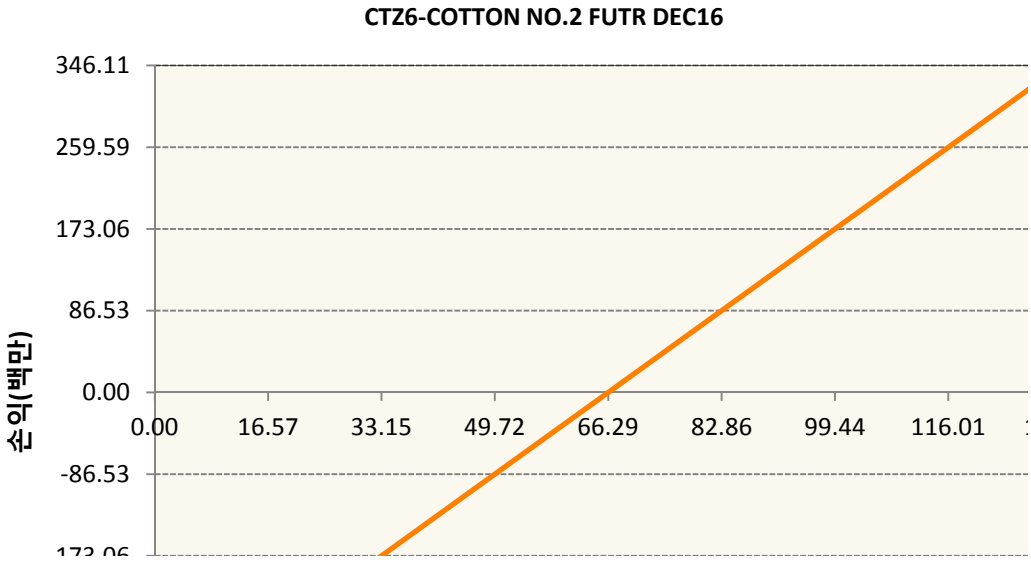
## 1. 계약금액

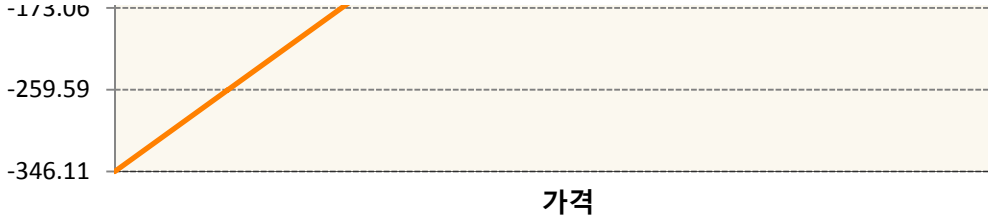
(단위:백만원)

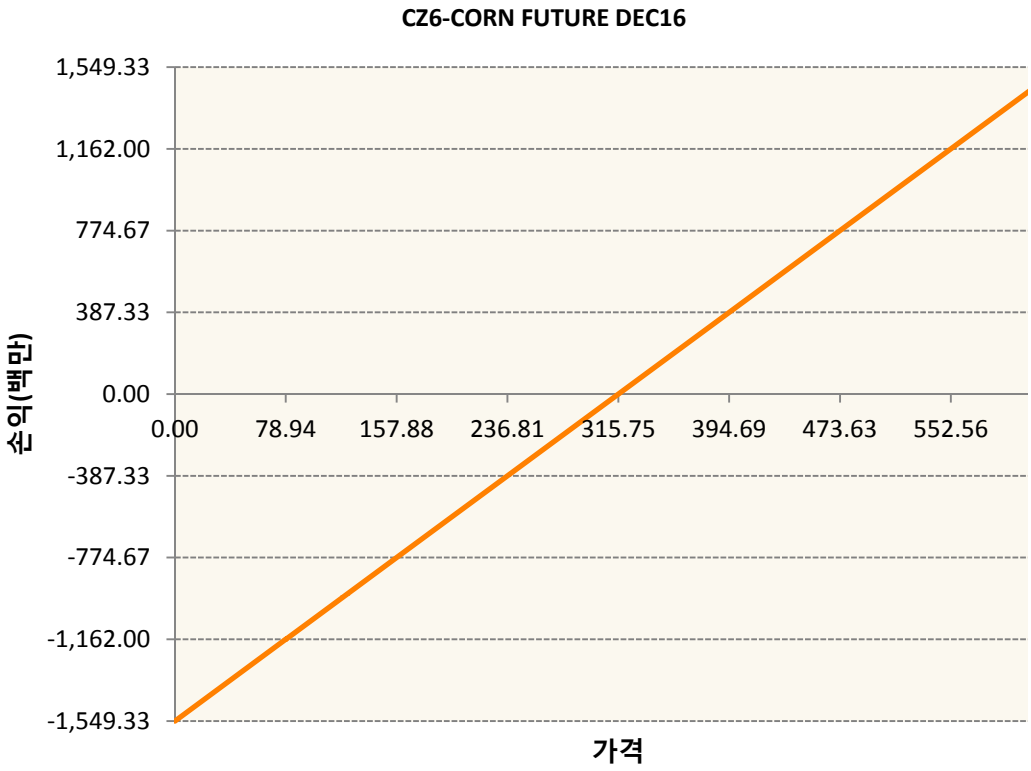
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 7,785 | 0 | 7,785 | |

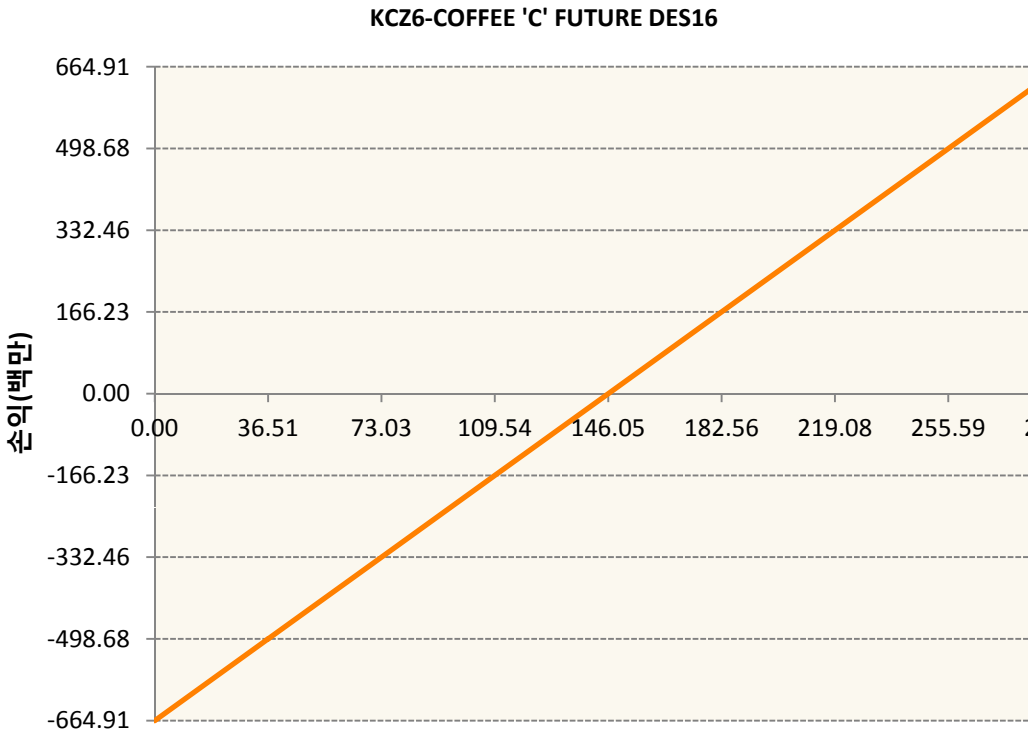
## 2. 만기시점의 손익구조



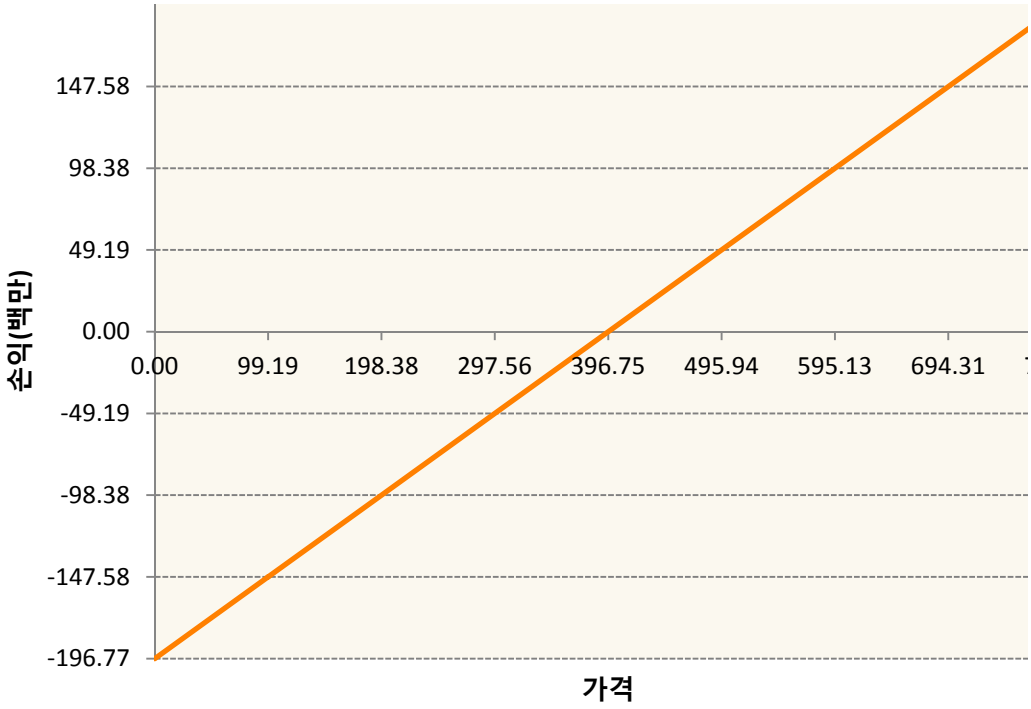

-259.59
-346.11
가격


CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,549.33
1,162.00
774.67
387.33
0.00
-387.33
-774.67
-1,162.00
-1,549.33
0.00
78.94
157.88
236.81
315.75
394.69
473.63
552.56
손익(백만)
가격

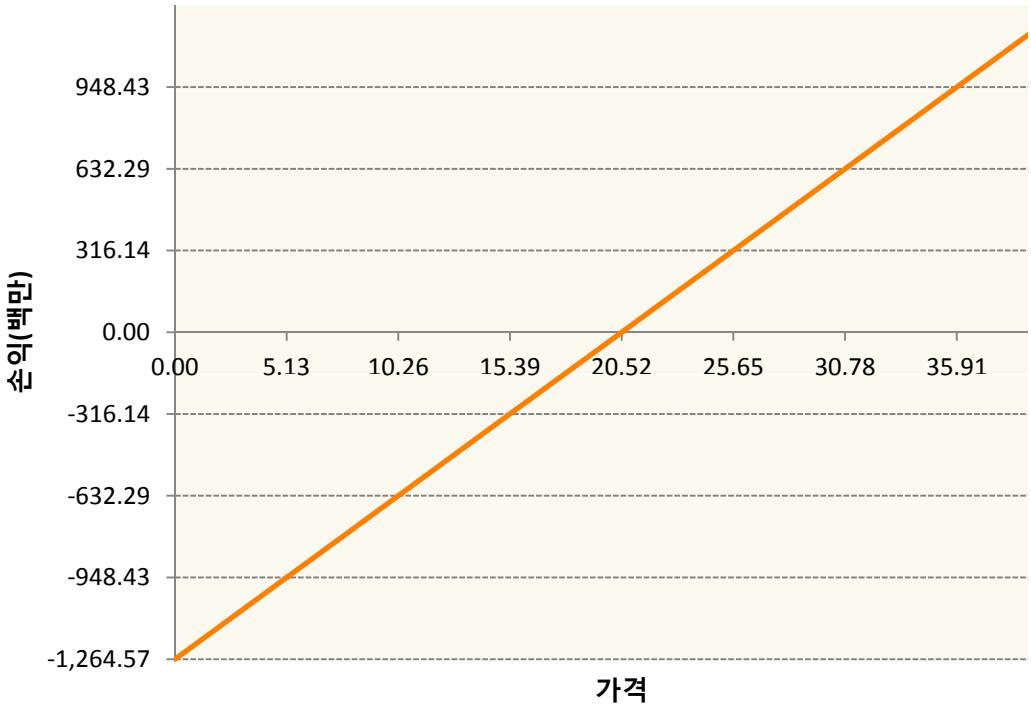

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
664.91
498.68
332.46
166.23
0.00
-166.23
-332.46
-498.68
-664.91
0.00
36.51
73.03
109.54
146.05
182.56
219.08
255.59
손익(백만)

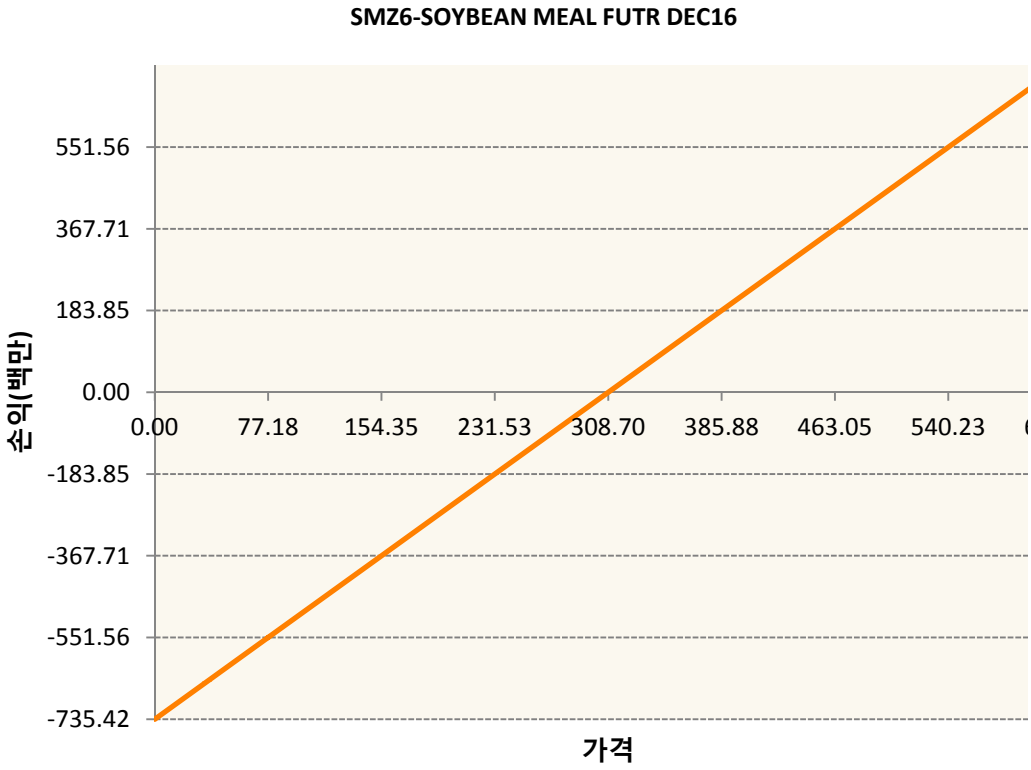
가격

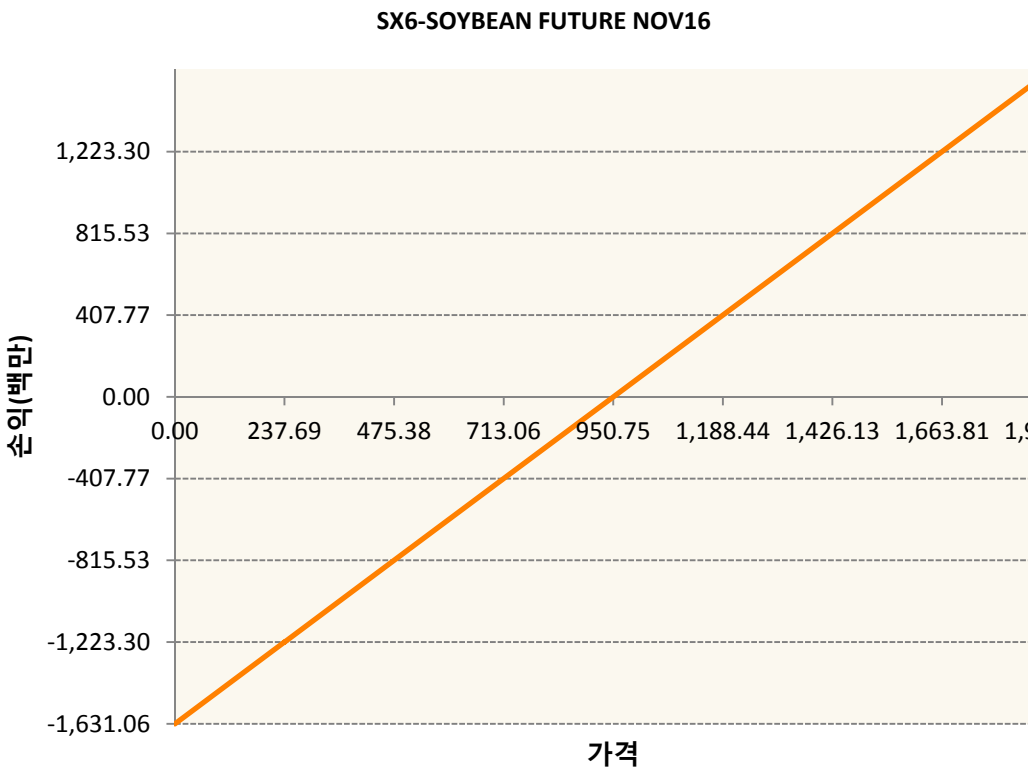
KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16



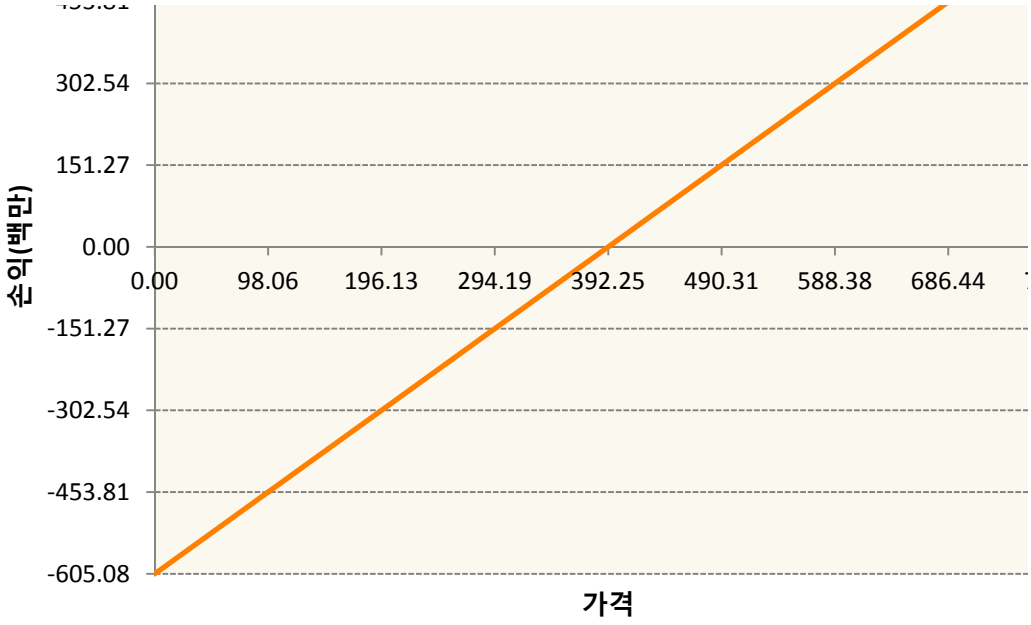

SBV6-SUGAR #11 (WORLD) OCT16




SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16
551.56
367.71
183.85
0.00
-183.85
-367.71
-551.56
-735.42
손익(백만)
0.00
77.18
154.35
231.53
308.70
385.88
463.05
540.23
가격


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16
1,223.30
815.53
407.77
0.00
-407.77
-815.53
-1,223.30
-1,631.06
손익(백만)
0.00
237.69
475.38
713.06
950.75
1,188.44
1,426.13
1,663.81
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
605.08
453.81




**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| BOZ6 | SOYBEAN OIL FUTR DEC16 | 63 |
| CTZ6 | COTTON NO.2 FUTR DEC16 | 28 |
| CZ6 | CORN FUTURE DEC16 | 124 |
| KCZ6 | COFFEE 'C' FUTURE DES16 | 53 |
| KWZ6 | KC HRW WHEAT FUT DES16 | 16 |
| SBV6 | SUGAR #11 (WORLD) OCT16 | 101 |
| SMZ6 | SOYBEAN MEAL FUTR DEC16 | 59 |
| SX6 | SOYBEAN FUTURE NOV16 | 130 |
| WZ6 | WHEAT FUTURE(CBT) DEC16 | 48 |

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

| |
|---|
| **777** |