| | |
|---|---|
| 공시일 | 2014-09-19 |
| 기준일 | 2014-09-18 |

# 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 | 16 | 0 | 16 | 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 | 2014-09-19 |
| 기준일 | 2014-09-18 |

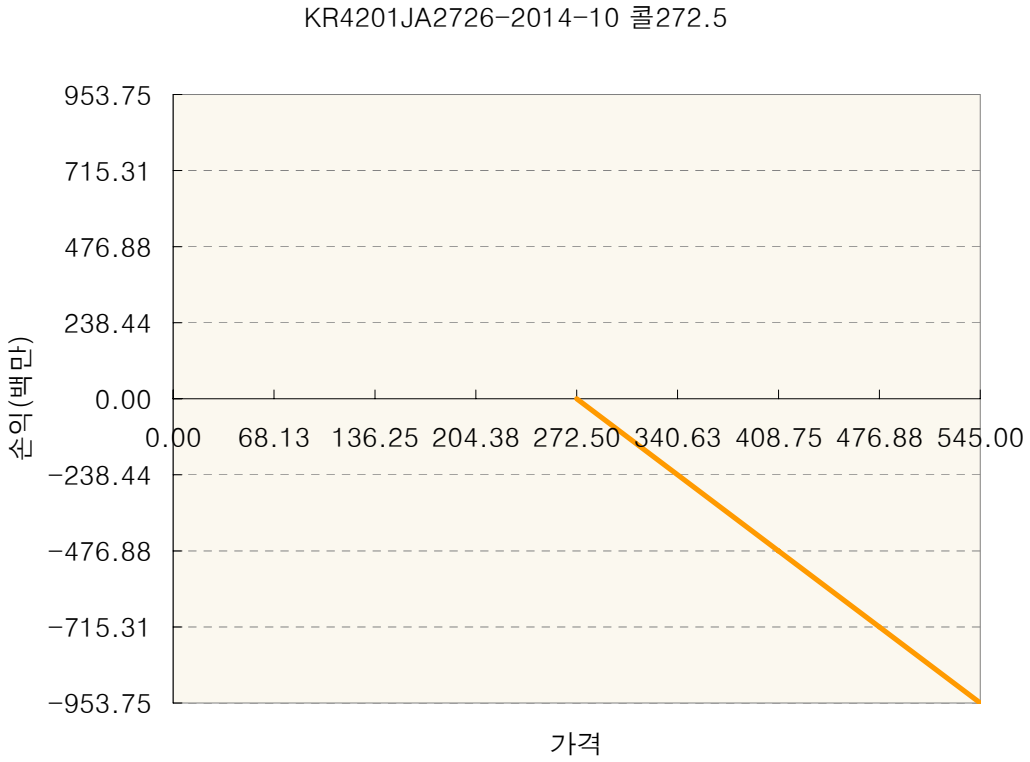
# 차곡차곡플러스모(주식혼합-파생)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 954 | -954 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201JA27 2014-10 콜272.5 : 189

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 5 | 5 | 5 | 5 | 5 | 5 | 5 |
| -5.33% | 5 | 5 | 5 | 5 | 5 | 5 | 5 |
| -2.67% | 5 | 5 | 5 | 5 | 4 | 4 | 3 |
| 0% | 4 | 3 | 2 | 0 | -2 | -4 | -6 |
| 2.67% | -11 | -15 | -19 | -23 | -27 | -31 | -35 |
| 5.33% | -72 | -76 | -80 | -84 | -88 | -92 | -96 |
| 8.00% | -177 | -179 | -180 | -182 | -184 | -186 | -189 |

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

| 128 |
|---|

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2014-09-19 |
| 기준일 | 2014-09-18 |

# 스마트코스피200인덱스모

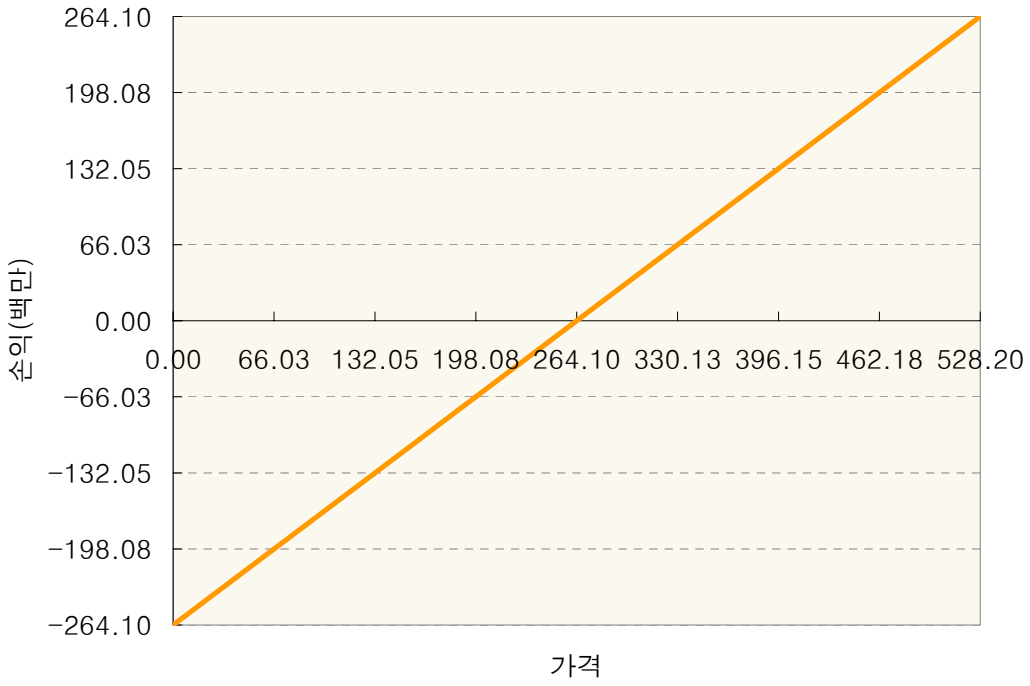
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

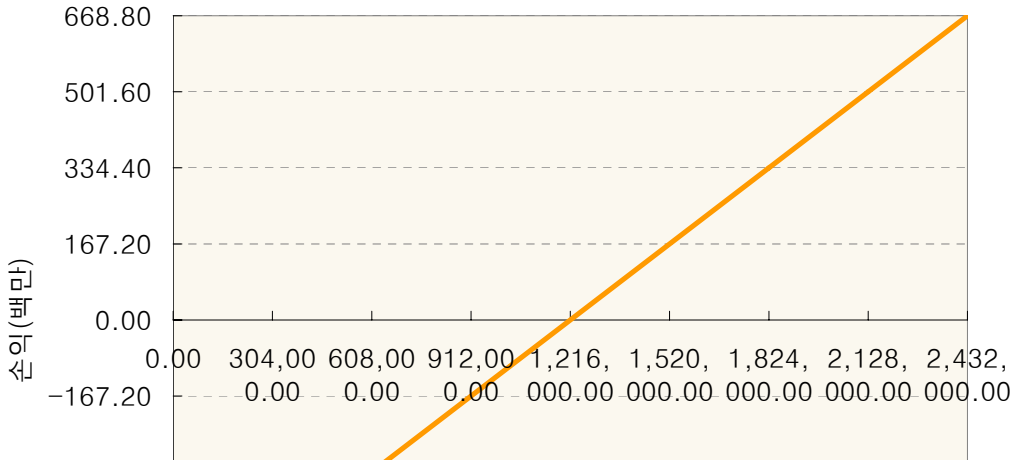
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 933 | 0 | 933 | 장내 |

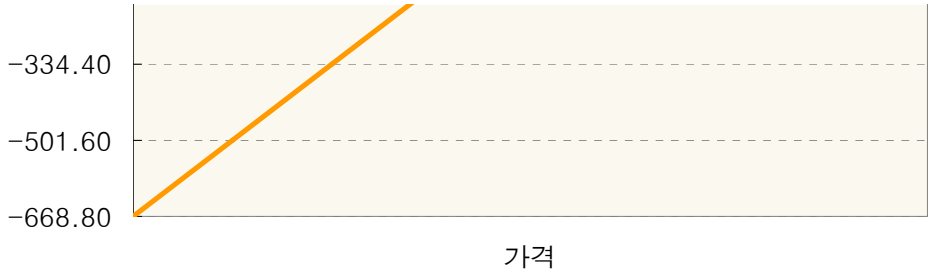
## 2. 만기시점의 손익구조

KR4101JC0000-2014-12 지수선물




KR4111JC0008-2014-12 삼성전자개별선물






### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101JC00 2014-12 지수선물 | | | | | | | 21 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -21 | -21 | -21 | -21 | -21 | -21 | -21 |
| -5.33% | -14 | -14 | -14 | -14 | -14 | -14 | -14 |
| -2.67% | -7 | -7 | -7 | -7 | -7 | -7 | -7 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 7 | 7 | 7 | 7 | 7 | 7 | 7 |
| 5.33% | 14 | 14 | 14 | 14 | 14 | 14 | 14 |
| 8.00% | 21 | 21 | 21 | 21 | 21 | 21 | 21 |
| KR4111JC00 2014-12 삼성전자개별선물 | | | | | | | 53 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -53 | -53 | -53 | -53 | -53 | -53 | -53 |
| -5.33% | -35 | -35 | -35 | -35 | -35 | -35 | -35 |
| -2.67% | -18 | -18 | -18 | -18 | -18 | -18 | -18 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 18 | 18 | 18 | 18 | 18 | 18 | 18 |
| 5.33% | 35 | 35 | 35 | 35 | 35 | 35 | 35 |
| 8.00% | 53 | 53 | 53 | 53 | 53 | 53 | 53 |

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

(단위:백만원)

| 61 |
|---|

| 공시일 | 2014-09-19 |
|---|---|
| 기준일 | 2014-09-18 |

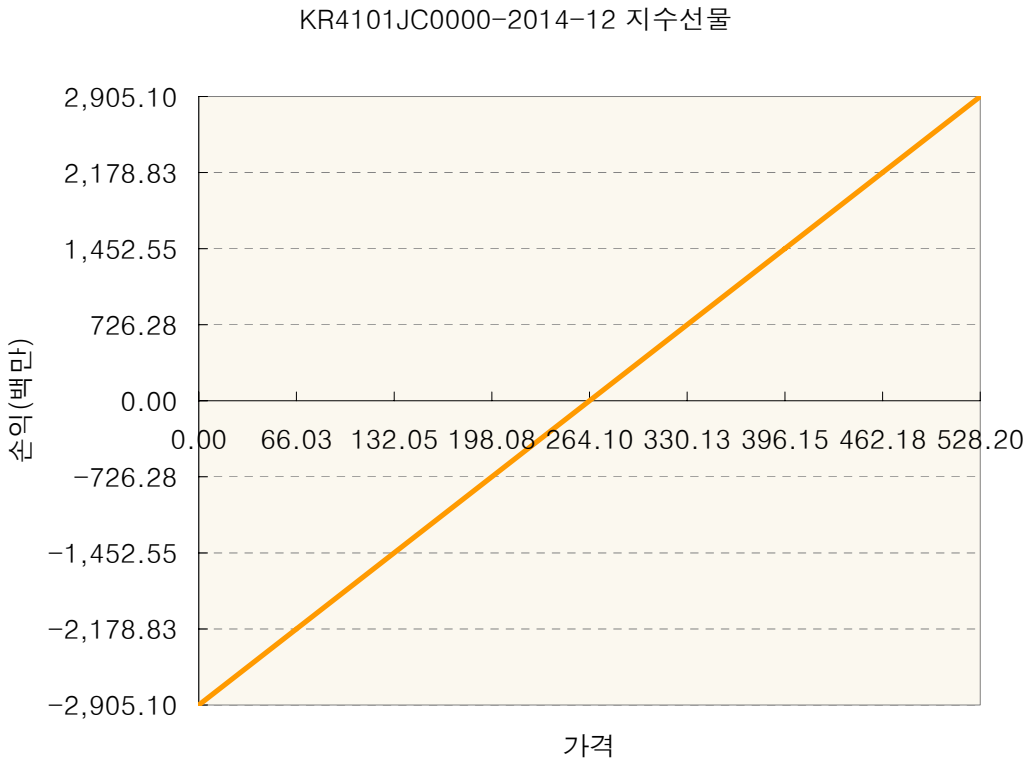
# 스마트레버리지목표전환형1호

## 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 | 2,905 | 0 | 2,905 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101JC00 2014-12 지수선물 | | | | | | | 230 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -230 | -230 | -230 | -230 | -230 | -230 | -230 |
| -5.33% | -154 | -154 | -154 | -154 | -154 | -154 | -154 |
| -2.67% | -77 | -77 | -77 | -77 | -77 | -77 | -77 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 77 | 77 | 77 | 77 | 77 | 77 | 77 |
| 5.33% | 154 | 154 | 154 | 154 | 154 | 154 | 154 |
| 8.00% | 230 | 230 | 230 | 230 | 230 | 230 | 230 |

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

| 149 |
|---|

| 공시일 | 2014-09-19 |
|---|---|
| 기준일 | 2014-09-18 |

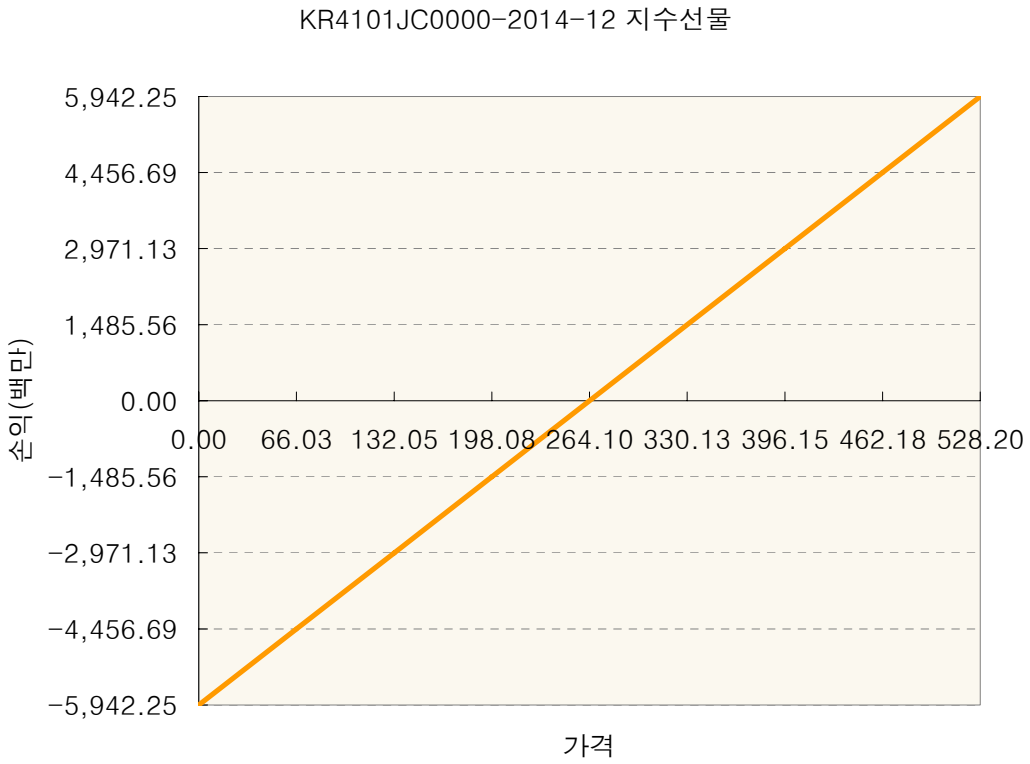
# 1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 132 | 0 | 132 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 5,942 | 0 | 5,942 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101JC00 2014-12 지수선물 | | | | | | | 471 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -471 | -471 | -471 | -471 | -471 | -471 | -471 |
| -5.33% | -314 | -314 | -314 | -314 | -314 | -314 | -314 |
| -2.67% | -157 | -157 | -157 | -157 | -157 | -157 | -157 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 157 | 157 | 157 | 157 | 157 | 157 | 157 |
| 5.33% | 314 | 314 | 314 | 314 | 314 | 314 | 314 |
| 8.00% | 471 | 471 | 471 | 471 | 471 | 471 | 471 |

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

| 306 |
|---|

| 공시일 | 2014-09-19 |
|---|---|
| 기준일 | 2014-09-18 |

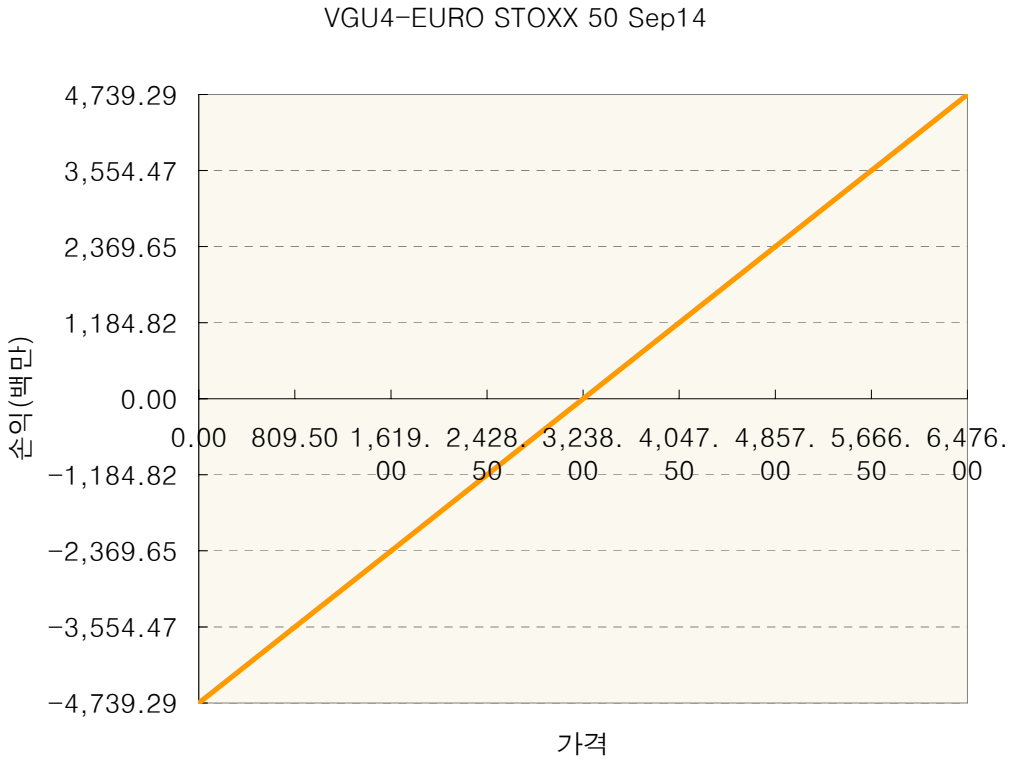
# 유로인덱스1호(주식-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 4,739 | 0 | 4,739 | |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| VGU4 | EURO STOXX 50 Sep14 | 379 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 280 |

| 공시일 | 2014-09-19 |
|---|---|
| 기준일 | 2014-09-18 |

# 아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

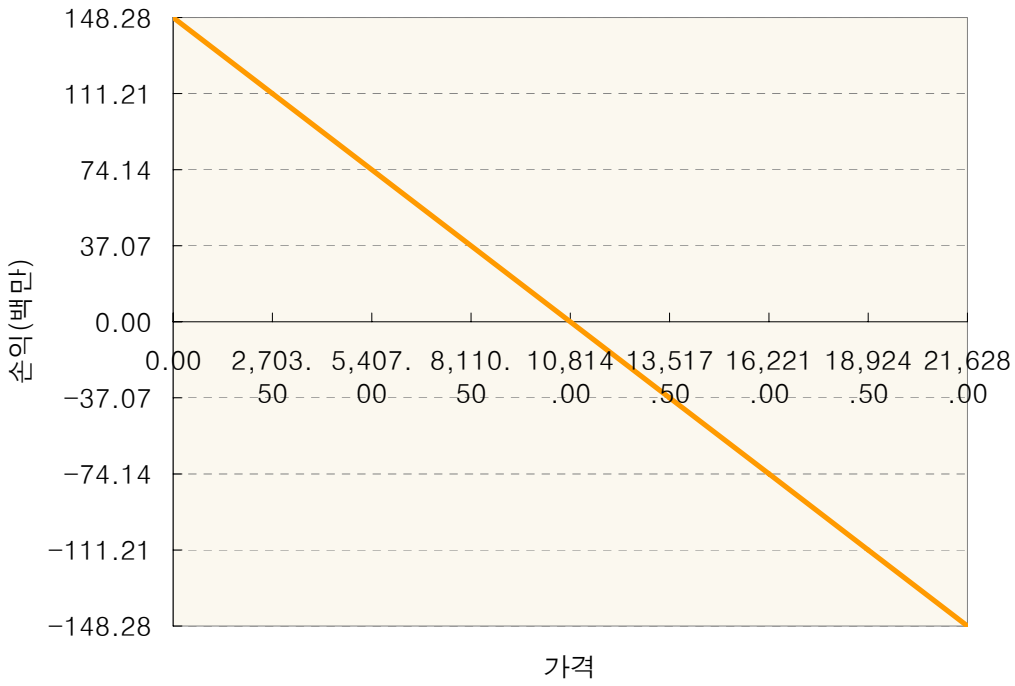
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

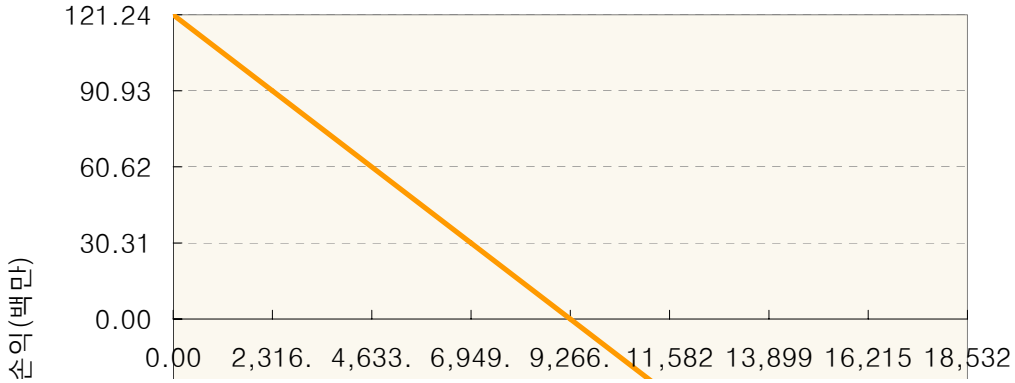
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 190 | -190 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 148 | -148 | 장내 |

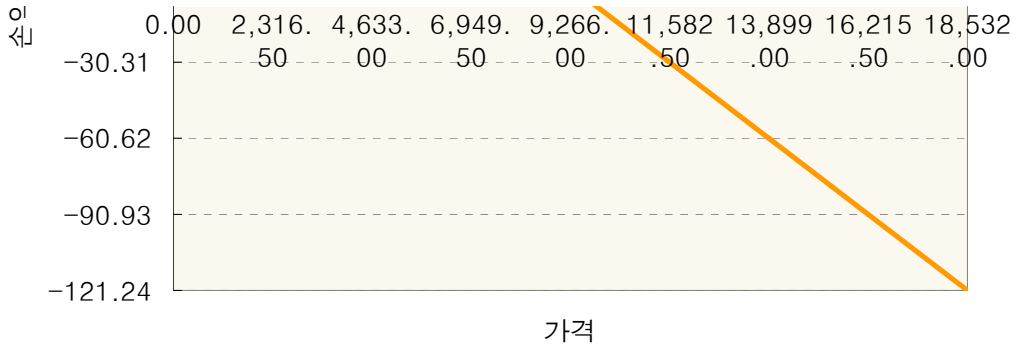
## 2. 만기시점의 손익구조

HCU4-H-SHARES IDX FUT Sep14

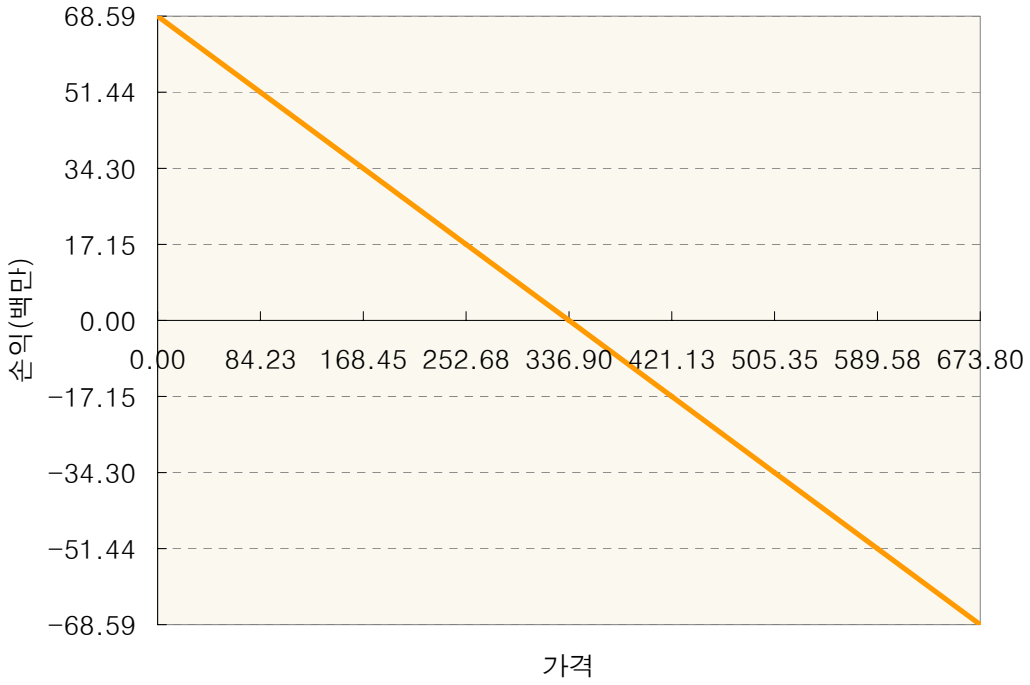



JYZ4-JPN YEN CURR FUT Dec14






TWU4-MSCI TAIWAN INDEX Sep14




### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| HCU4 | H-SHARES IDX FUT Sep14 | 12 |
| JYZ4 | JPN YEN CURR FUT Dec14 | 10 |
| TWU4 | MSCI TAIWAN INDEX Sep14 | 5 |

* 일부종목에 대해 산출이 불가능하여 제외함

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 19 |

* 일부종목에 대해 산출이 불가능하여 제외함

| 공시일 | 2014-09-19 |
|---|---|
| 기준일 | 2014-09-18 |

# 메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

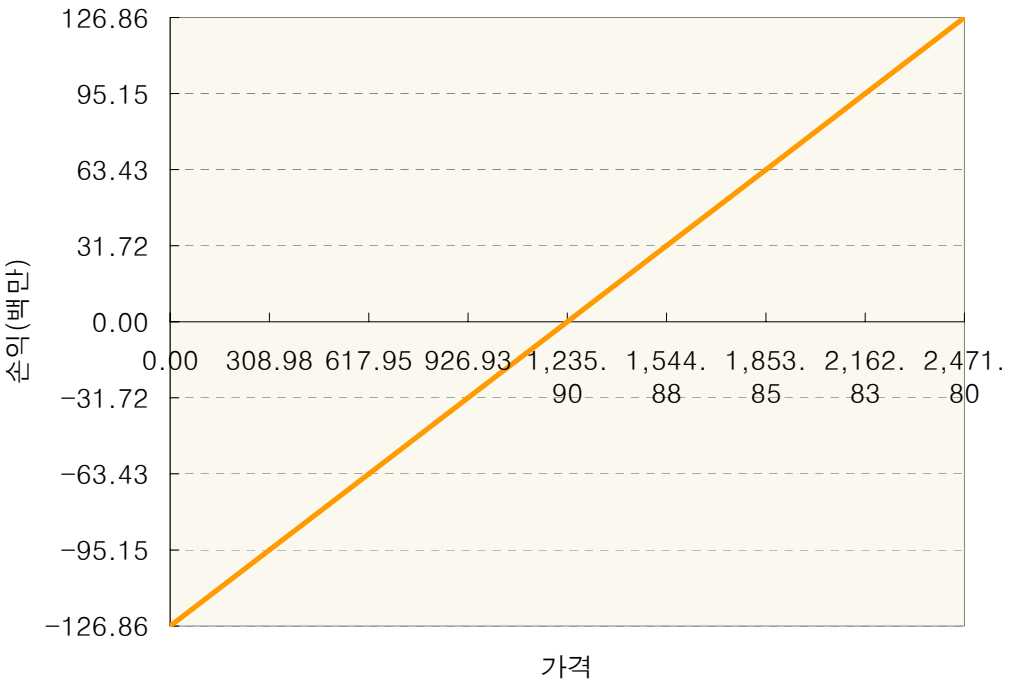
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

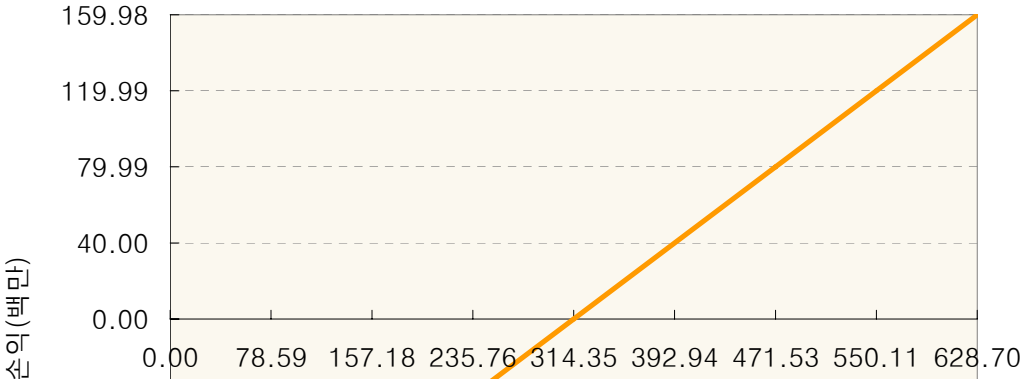
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 선물 | 유가증권 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 선물 | 유가증권 | 38 | 0 | 38 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 556 | 0 | 556 | |

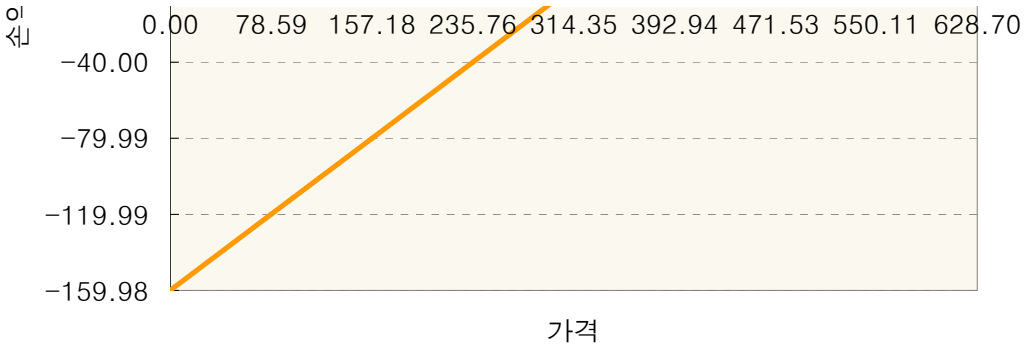
## 2. 만기시점의 손익구조

GCZ4-GOLD 100 OZ FUTR Dec14

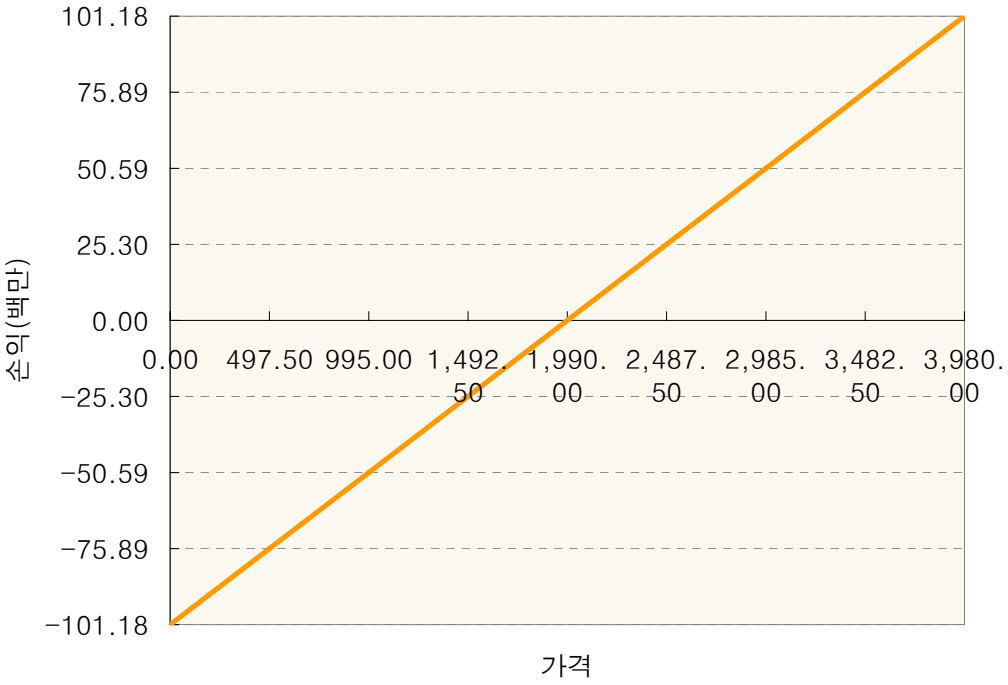



HGZ4-COPPER FUTURE Dec14

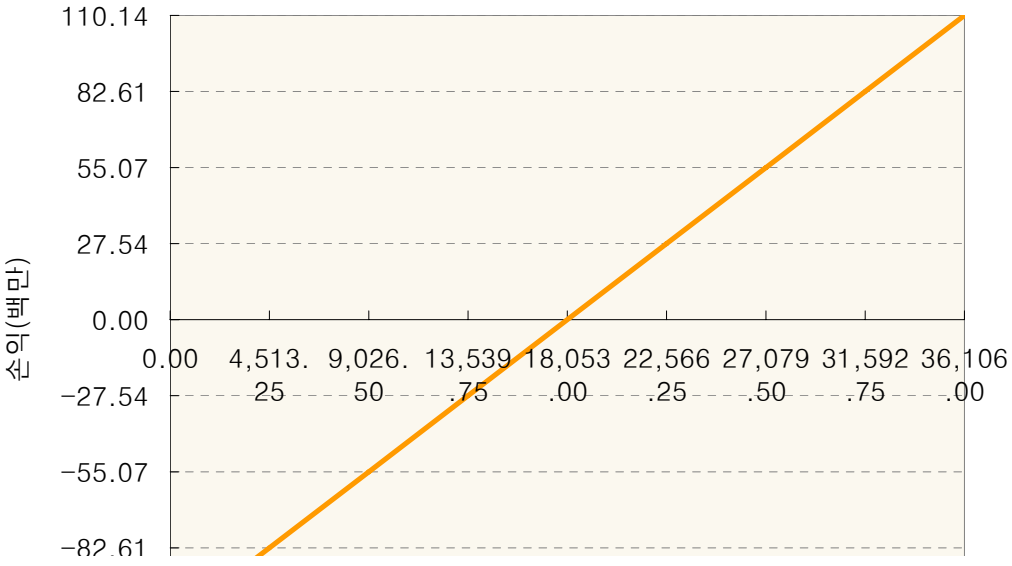


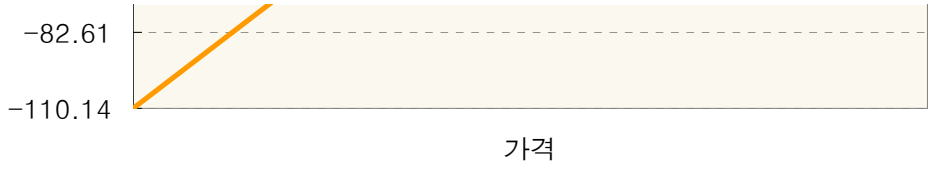



LAX4-LME PRI ALUM FUTR Nov14



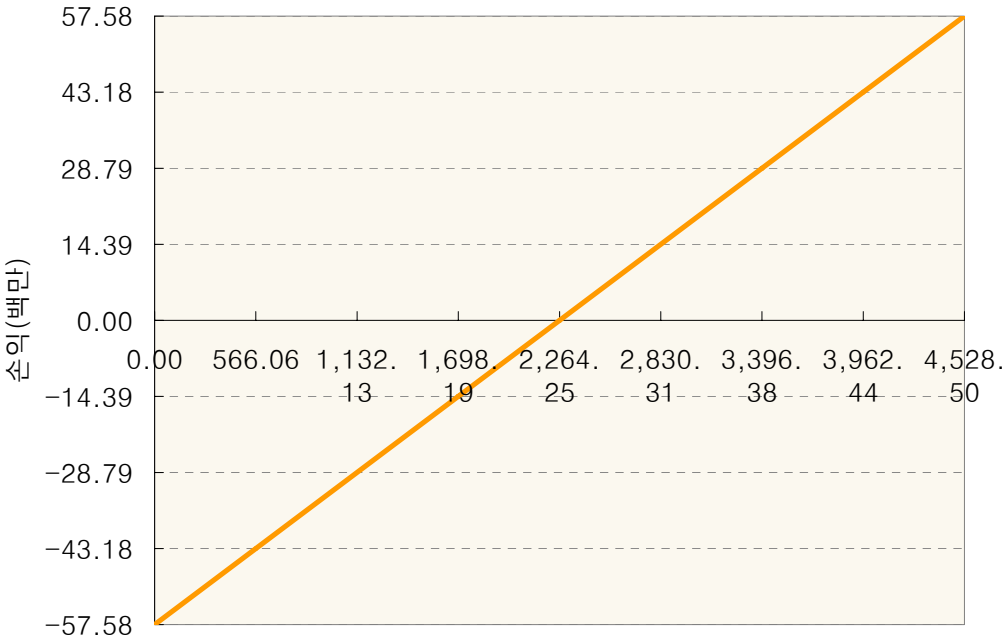

LNX4-LME NICKEL FUTURE Nov14





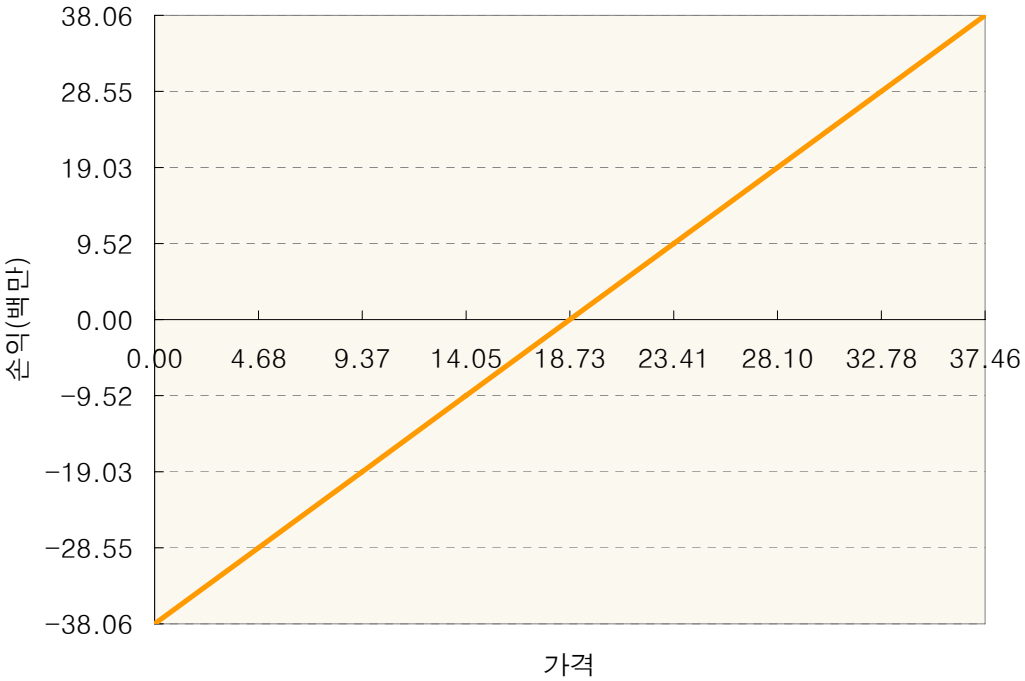

가격

LXX4-LME ZINC FUTURE Nov14




가격

YSZ4-MINI SILVER FUT Dec14




가격

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| GCZ4 | GOLD 100 OZ FUTR Dec14 | 10 |
| HGZ4 | COPPER FUTURE Dec14 | 13 |
| LAX4 | LME PRI ALUM FUTR Nov14 | 8 |
| LNX4 | LME NICKEL FUTURE Nov14 | 9 |
| LXX4 | LME ZINC FUTURE Nov14 | 5 |
| YSZ4 | MINI SILVER FUT Dec14 | 3 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 46 |

| 공시일 | 2014-09-19 |
|---|---|
| 기준일 | 2014-09-18 |

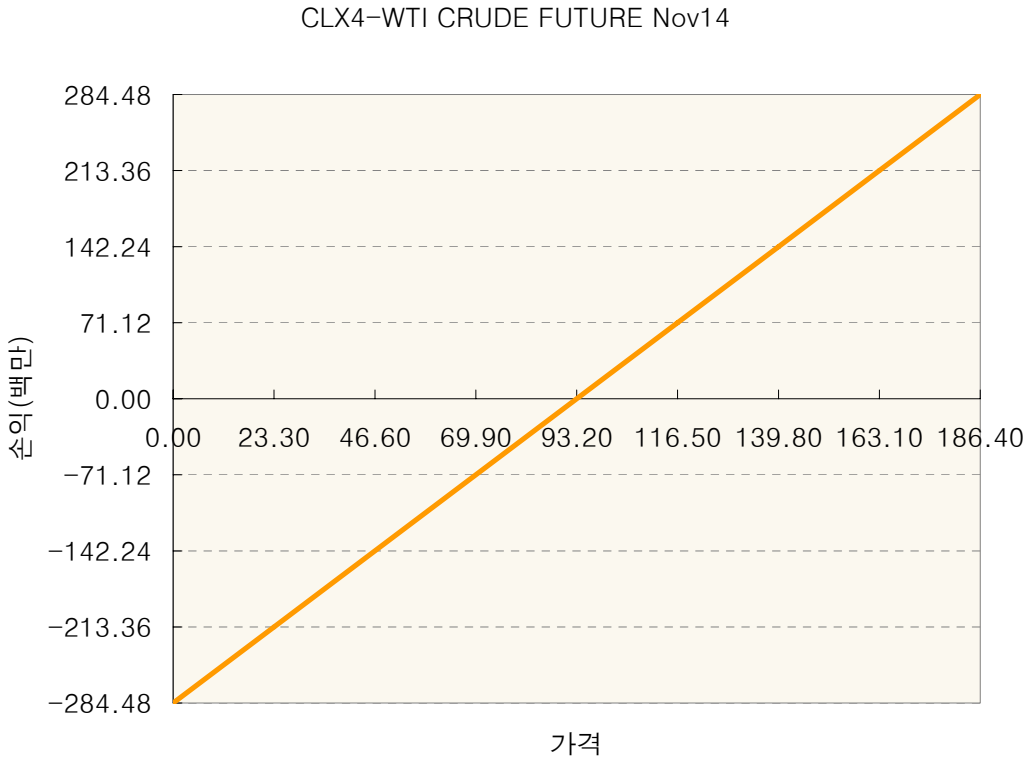
# 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

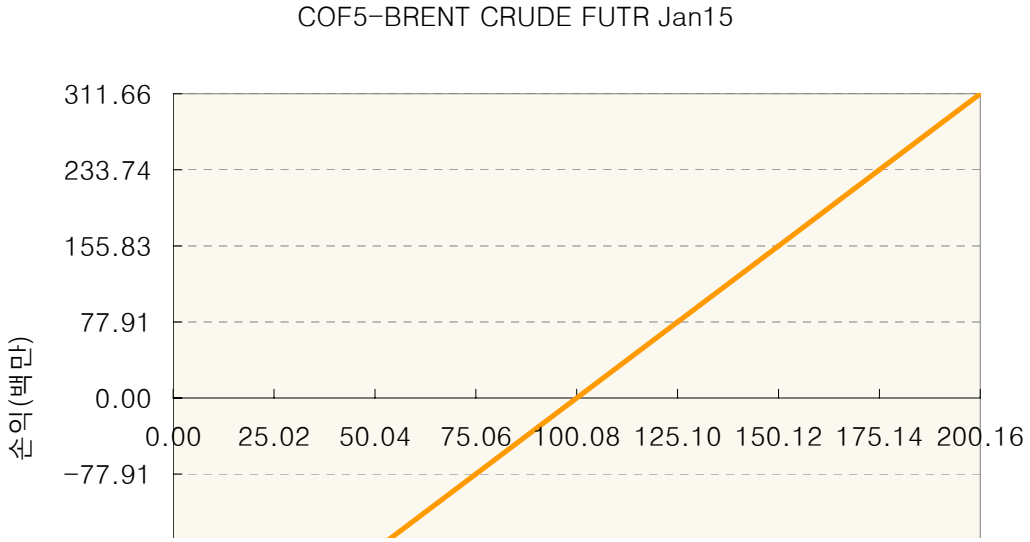
## 1. 계약금액

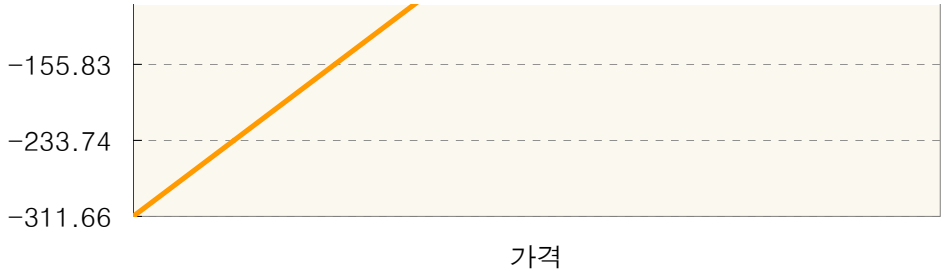
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,503 | 0 | 1,503 | |

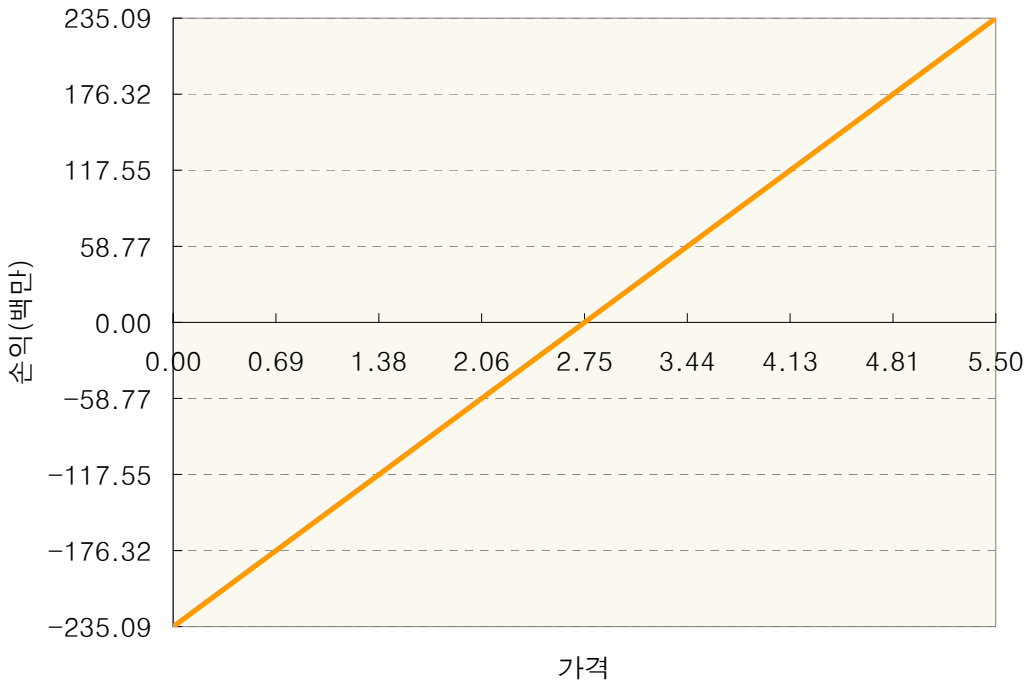
## 2. 만기시점의 손익구조



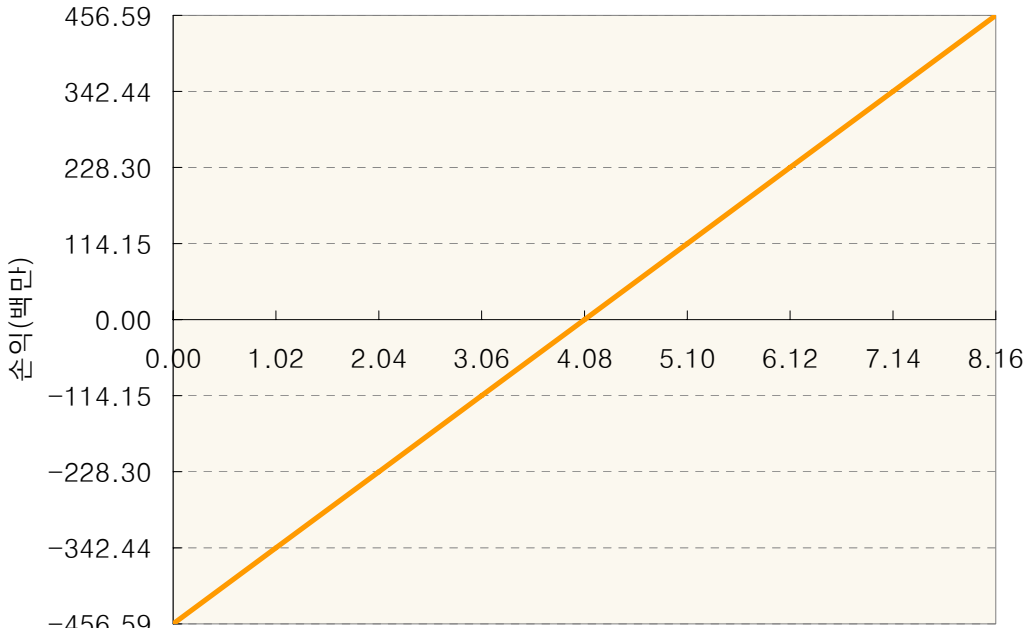



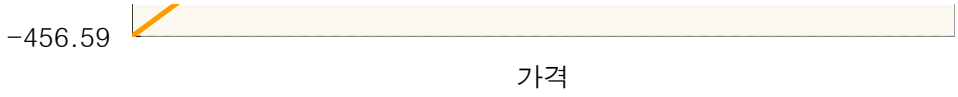


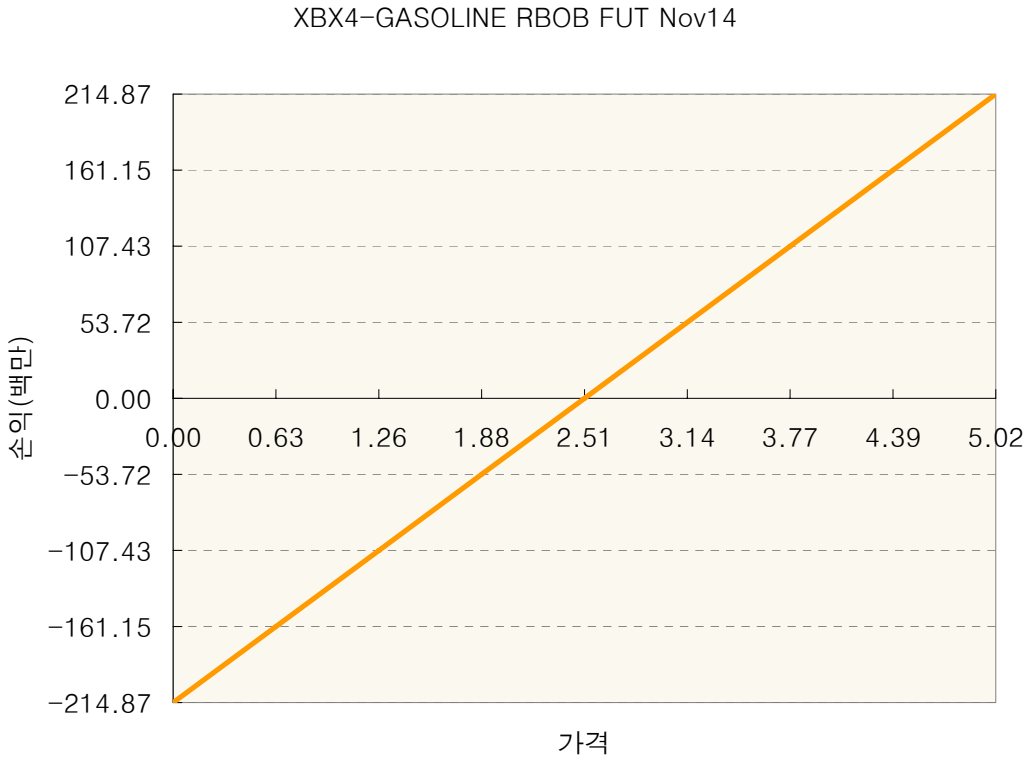

HOX4-NY Harb ULSD Fut Nov14




NGX4-NATURAL GAS FUTR Nov14






### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| CLX4 | WTI CRUDE FUTURE Nov14 | 23 |
| COF5 | BRENT CRUDE FUTR Jan15 | 25 |
| HOX4 | NY Harb ULSD Fut Nov14 | 19 |
| NGX4 | NATURAL GAS FUTR Nov14 | 37 |
| XBX4 | GASOLINE RBOB FUT Nov14 | 17 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 172 |

| 공시일 | 2014-09-19 |
|---|---|
| 기준일 | 2014-09-18 |

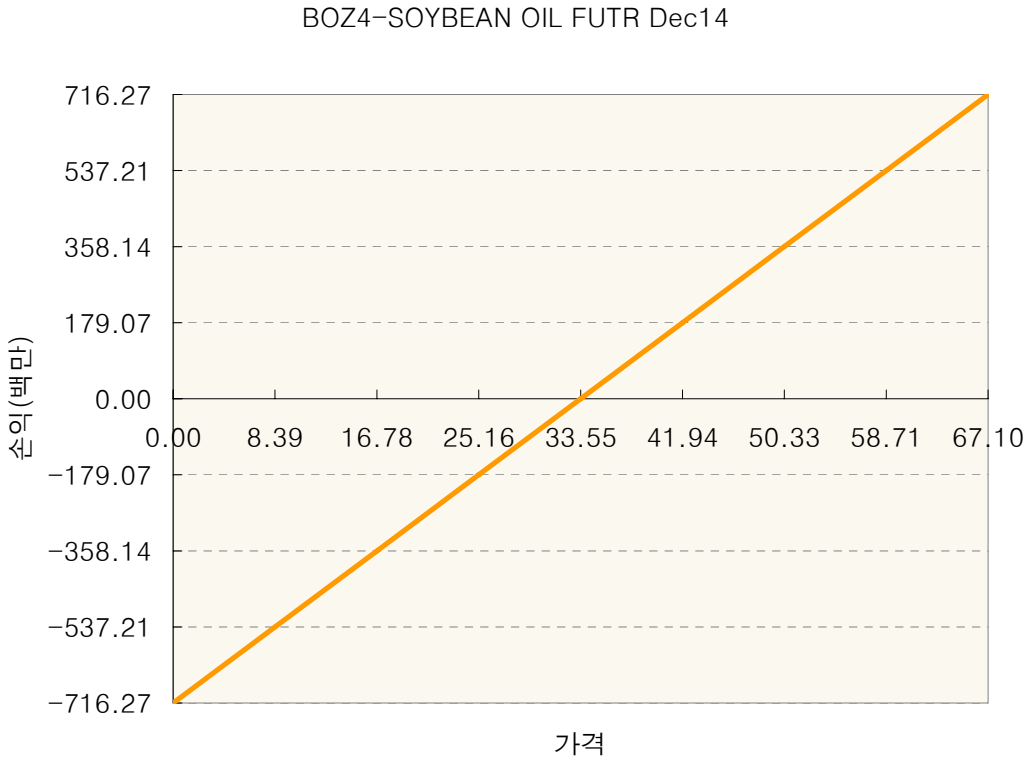
# 애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

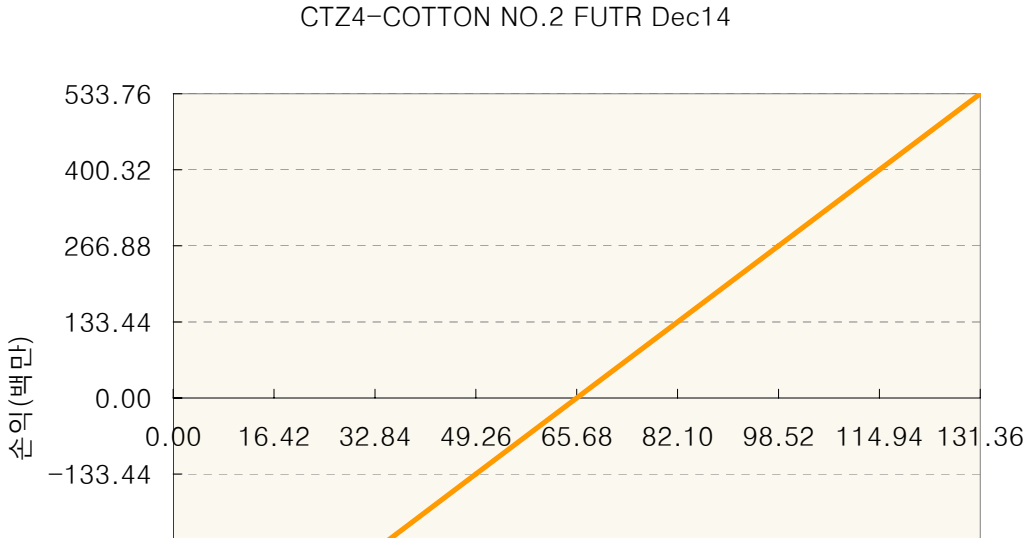
## 1. 계약금액

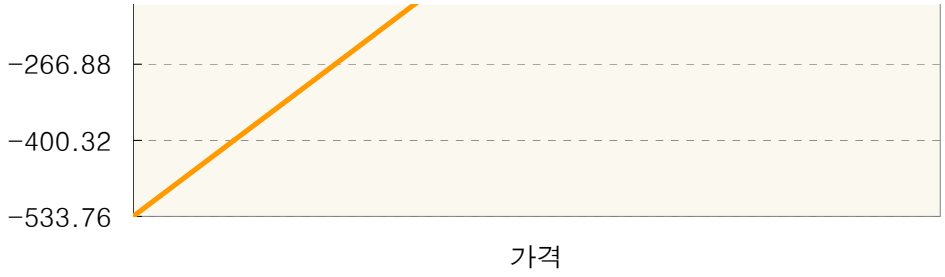
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 7,839 | 0 | 7,839 | |

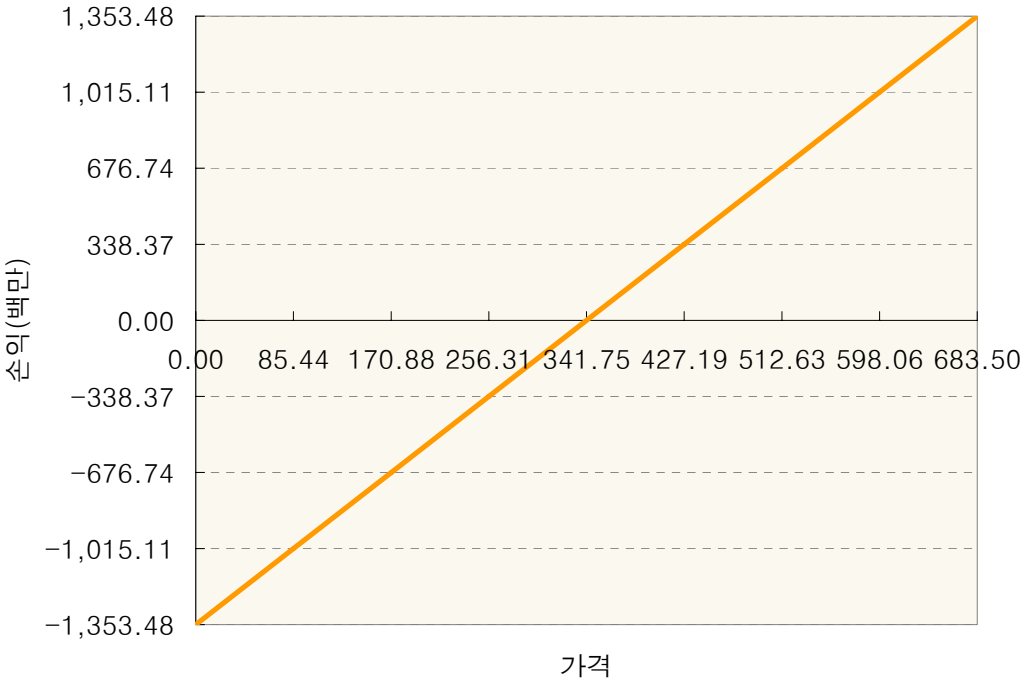
## 2. 만기시점의 손익구조



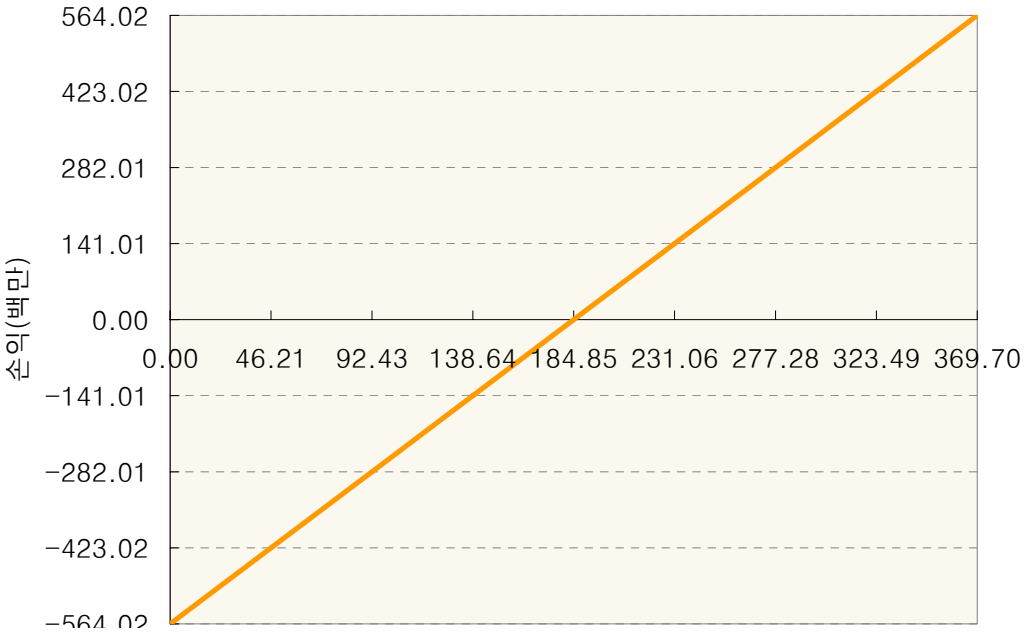



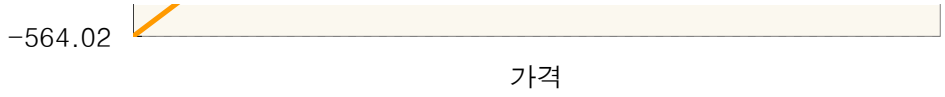



CZ4-CORN FUTURE Dec14

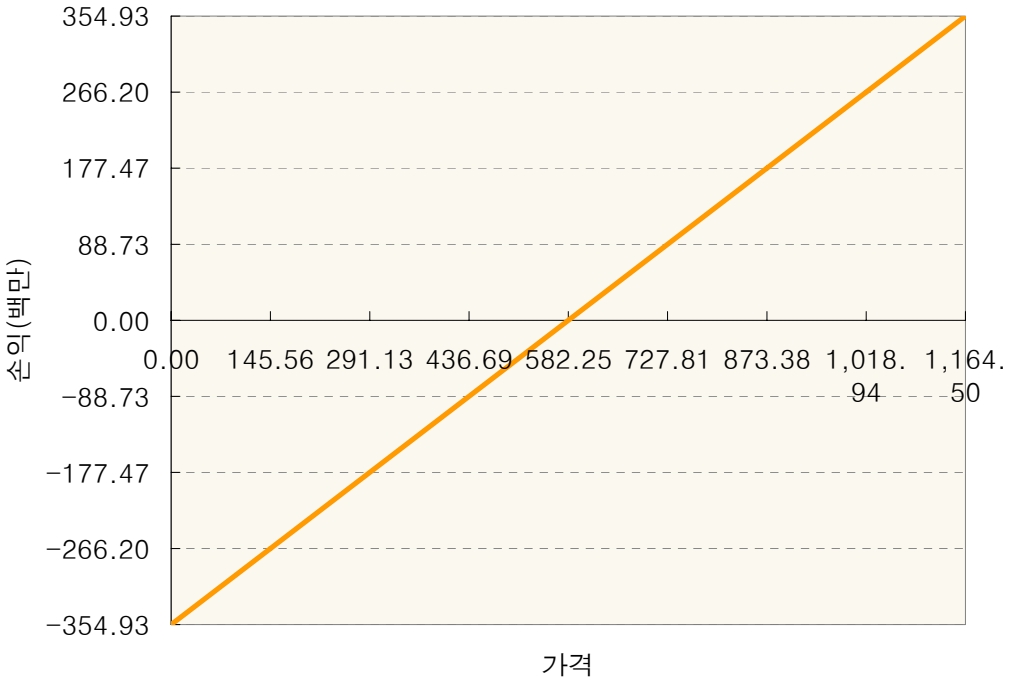



KCZ4-COFFEE "C" FUTURE Dec14

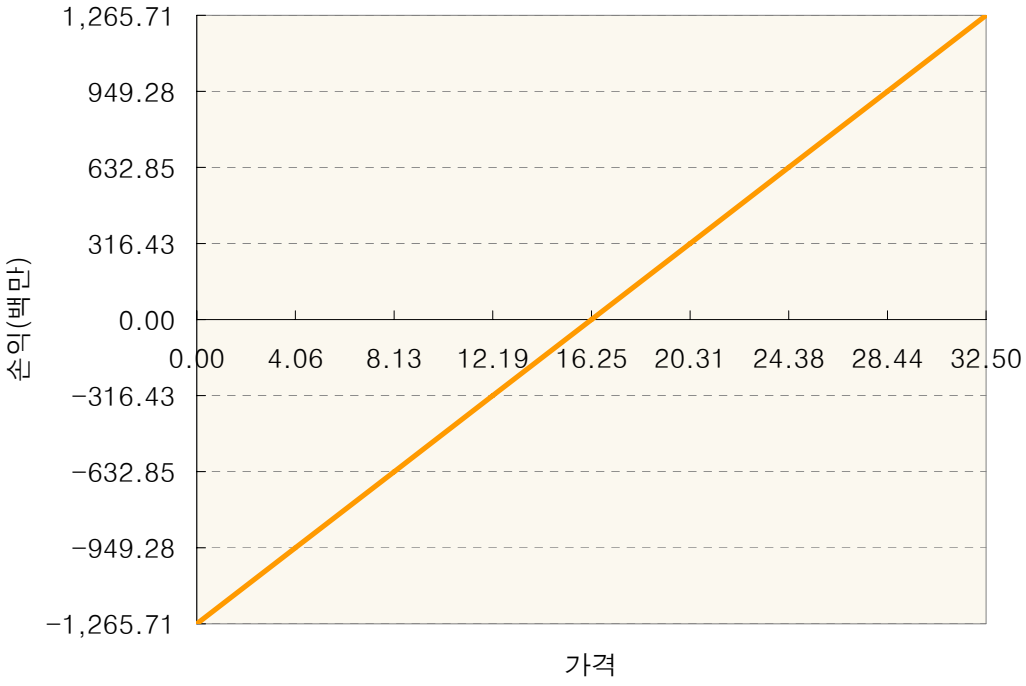




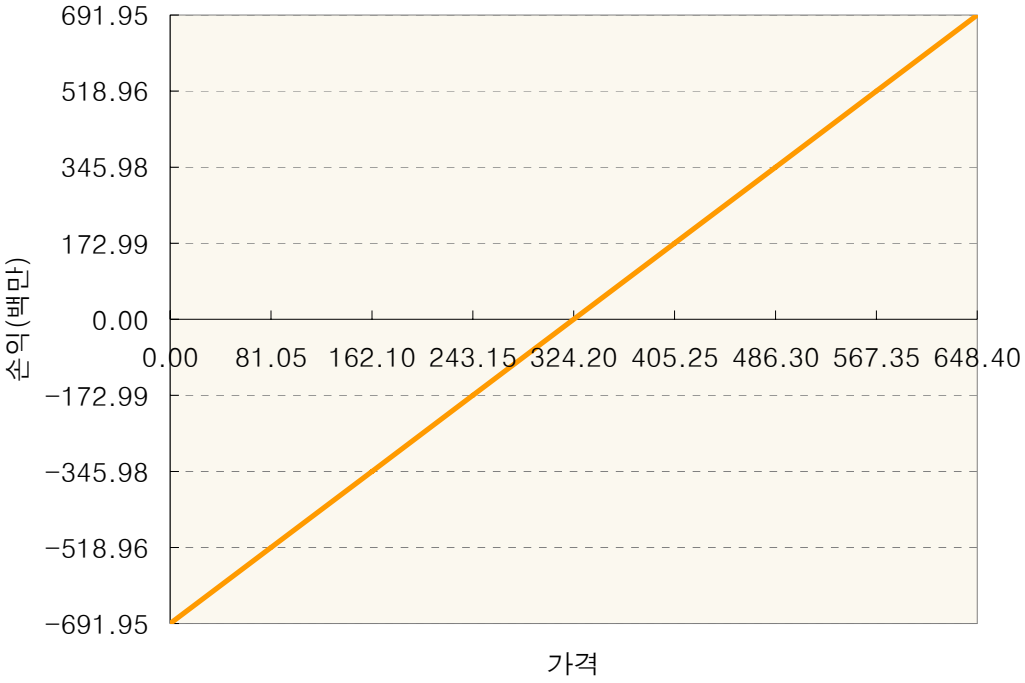

KWZ4-WHEAT FUTURE(KCB) Dec14



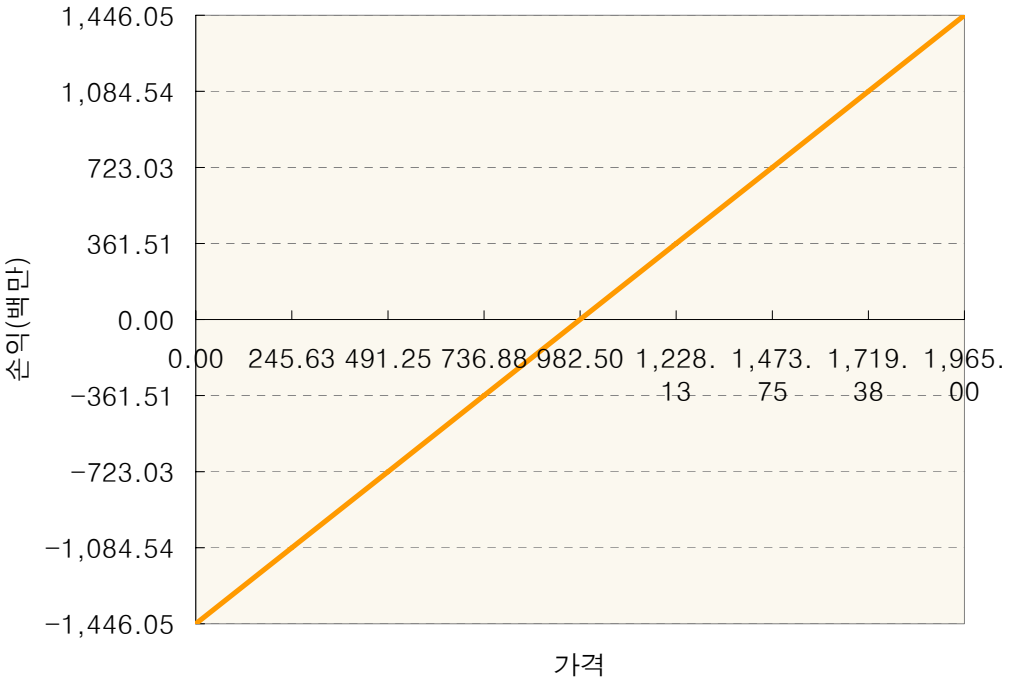

SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar15



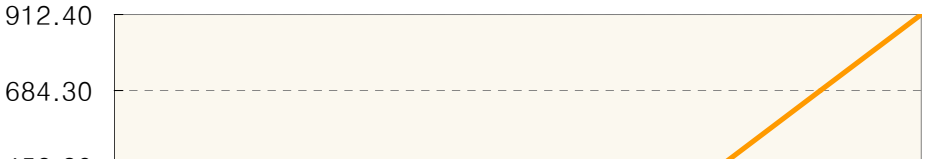

SMZ4-SOYBEAN MEAL FUTR Dec14

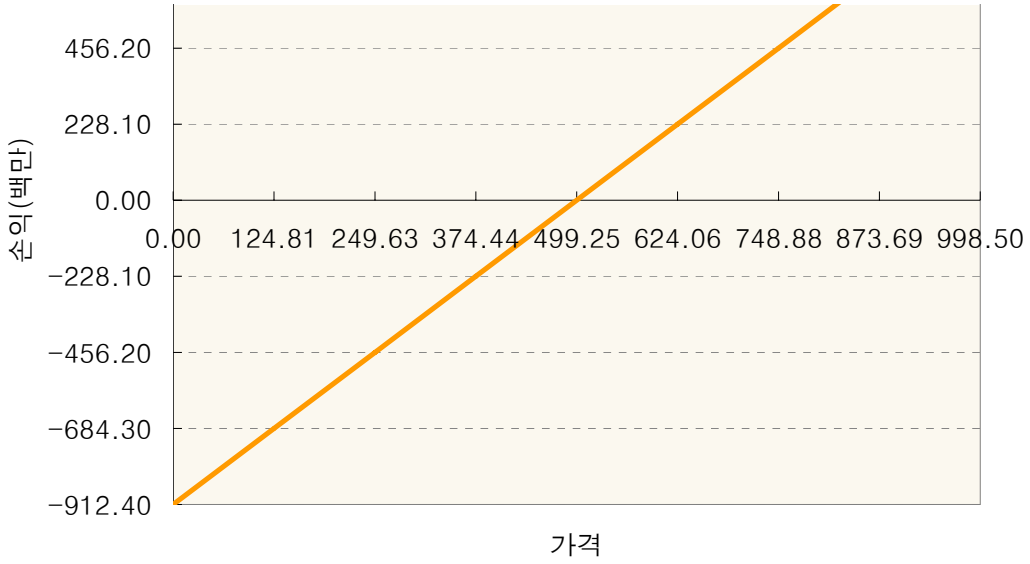



SX4-SOYBEAN FUTURE Nov14




WZ4-WHEAT FUTURE(CBT) Dec14






### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| BOZ4 | SOYBEAN OIL FUTR Dec14 | 57 |
| CTZ4 | COTTON NO.2 FUTR Dec14 | 43 |
| CZ4 | CORN FUTURE Dec14 | 108 |
| KCZ4 | COFFEE "C" FUTURE Dec14 | 45 |
| KWZ4 | WHEAT FUTURE(KCB) Dec14 | 28 |
| SBH5 | Sugar #11 (WORLD) Mar15 | 101 |
| SMZ4 | SOYBEAN MEAL FUTR Dec14 | 55 |
| SX4 | SOYBEAN FUTURE Nov14 | 116 |
| WZ4 | WHEAT FUTURE(CBT) Dec14 | 73 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **948** |