공시일	2014-12-31
기준일	2014-12-30

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	12	0	12	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	2014-12-31
기준일	2014-12-30

차곡차곡플러스모(주식혼합-파생)

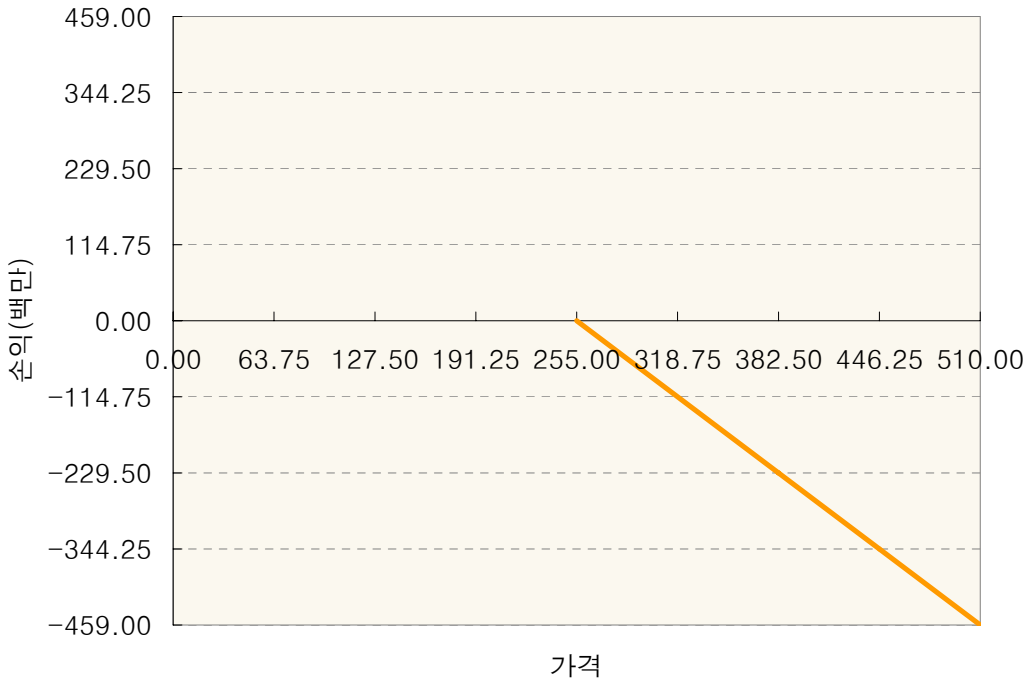
1. 계약금액

(단위:백만원)

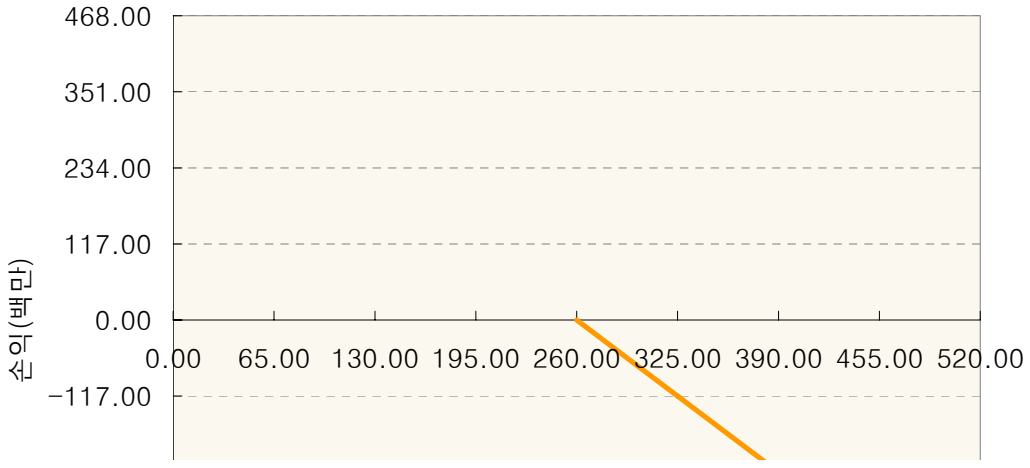
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	927	-927	장내

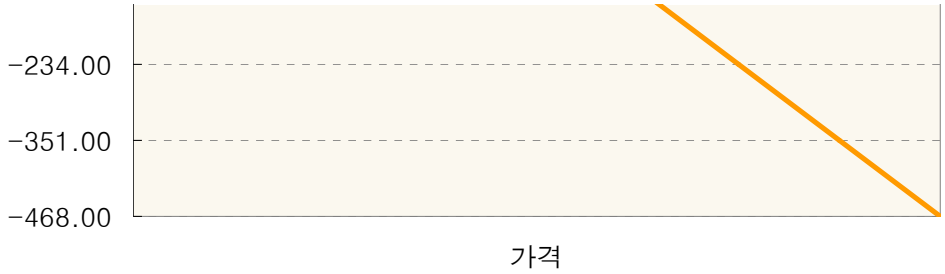
2. 만기시점의 손익구조

KR4201K12558-2015-01 콜255



KR4201K12608-2015-01 콜260





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201K125 2015-01 콜255							80
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	-2	-3	-3	-4	-5	-7	-8
5.33%	-25	-26	-28	-29	-30	-32	-33
8.00%	-78	-78	-78	-78	-79	-79	-80
KR4201K126 2015-01 콜260							43
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	-1	-1	-1	-2
5.33%	-4	-6	-7	-8	-9	-11	-12
8.00%	-36	-37	-38	-39	-40	-42	-43

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

(단위:백만원)

33

공시일	2014-12-31
기준일	2014-12-30

스마트인덱스모

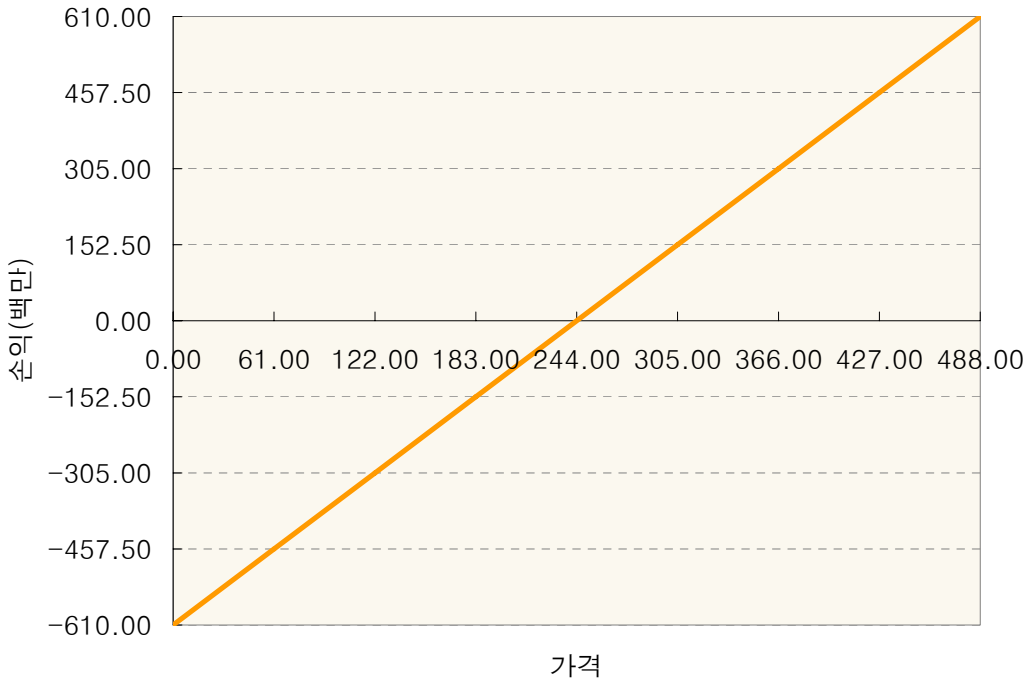
1. 계약금액

(단위:백만원)

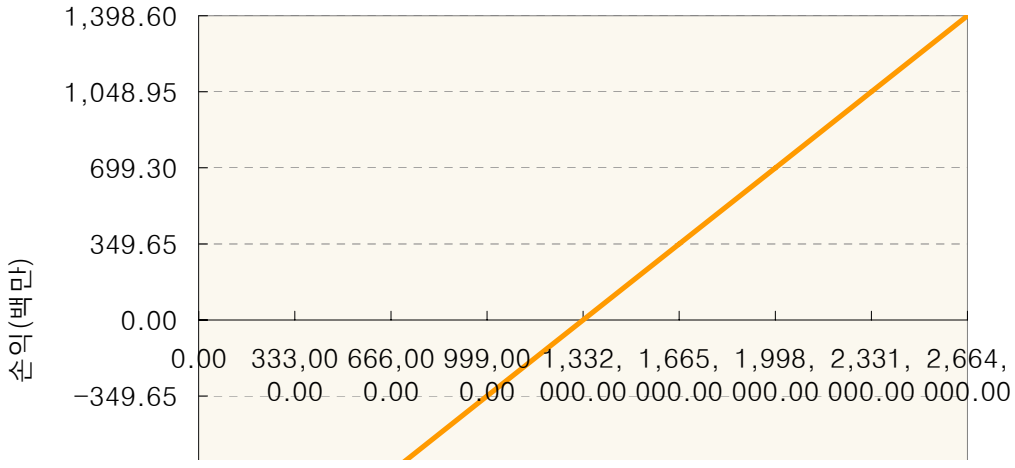
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	367	0	367	장내
누계	유가증권	선물	2,009	0	2,009	장내

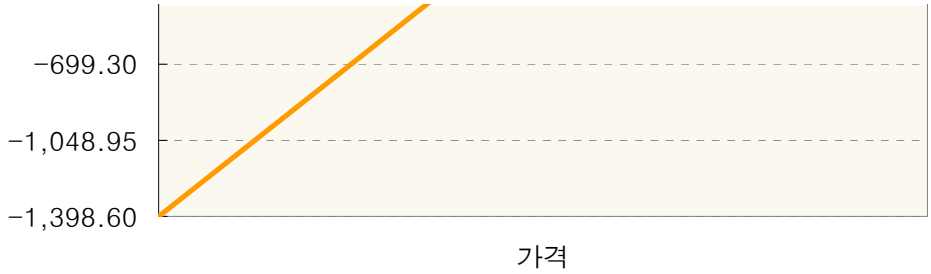
2. 만기시점의 손익구조

KR4101K30008-2015-03 지수선물



KR4111K30007-2015-03 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101K300 2015-03 지수선물							49
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	16	16	16	16	16	16	16
5.33%	33	33	33	33	33	33	33
8.00%	49	49	49	49	49	49	49
KR4111K300 2015-03 삼성전자개별선물							111
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111
-5.33%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
-2.67%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	37	37	37	37	37	37	37
5.33%	74	74	74	74	74	74	74
8.00%	111	111	111	111	111	111	111

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

(단위:백만원)

143

공시일	2014-12-31
기준일	2014-12-30

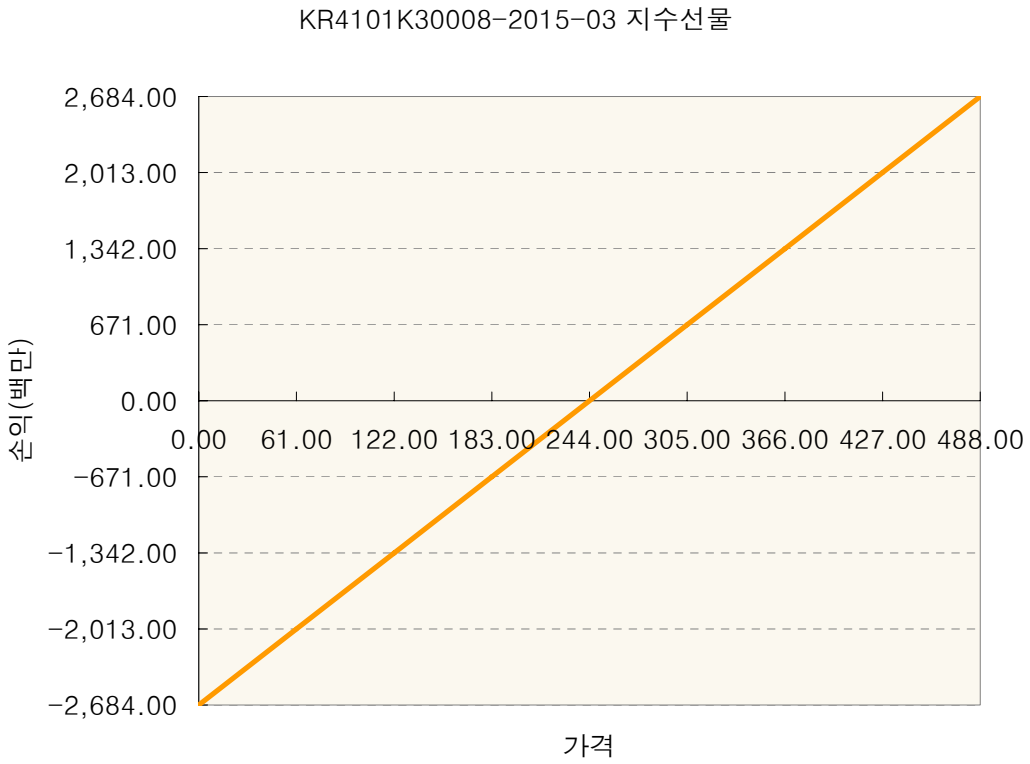
스마트레버리지목표전환형1호

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	2,684	0	2,684	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101K300 2015-03 지수선물							215
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-215	-215	-215	-215	-215	-215	-215
-5.33%	-143	-143	-143	-143	-143	-143	-143
-2.67%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	72	72	72	72	72	72	72
5.33%	143	143	143	143	143	143	143
8.00%	215	215	215	215	215	215	215

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	140

공시일	2014-12-31
기준일	2014-12-30

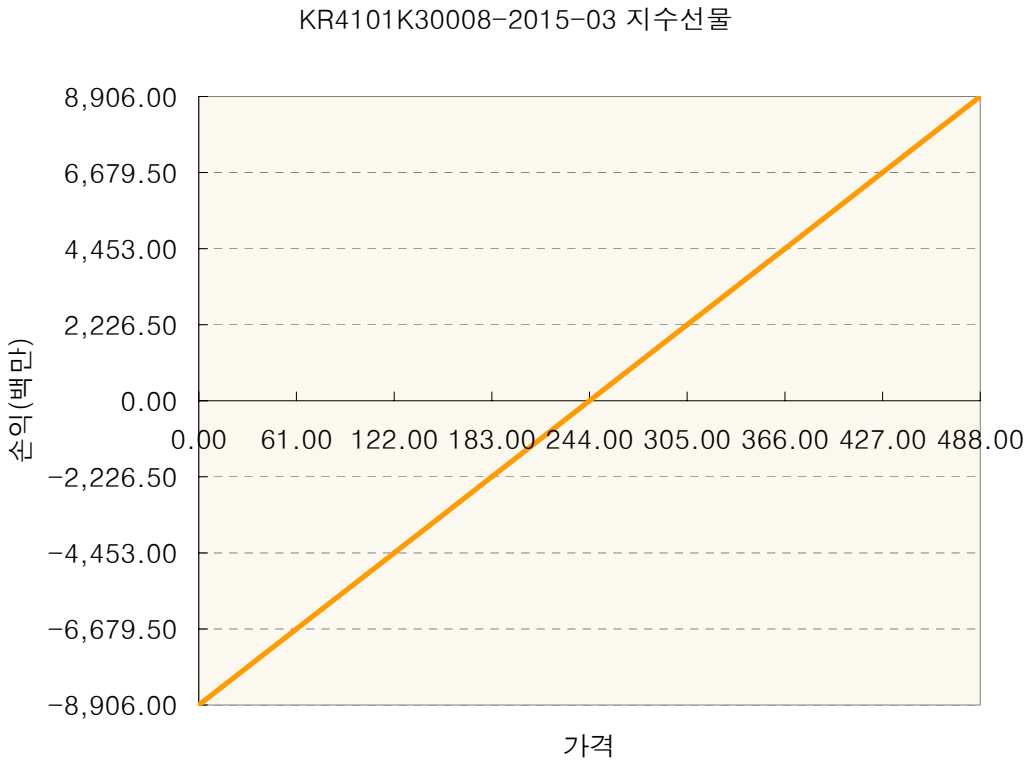
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	122	0	122	장내
누계	유가증권	선물	8,906	0	8,906	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101K300 2015-03 지수선물							713
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-713	-713	-713	-713	-713	-713	-713
-5.33%	-475	-475	-475	-475	-475	-475	-475
-2.67%	-238	-238	-238	-238	-238	-238	-238
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	238	238	238	238	238	238	238
5.33%	475	475	475	475	475	475	475
8.00%	713	713	713	713	713	713	713

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	465

공시일	2014-12-31
기준일	2014-12-30

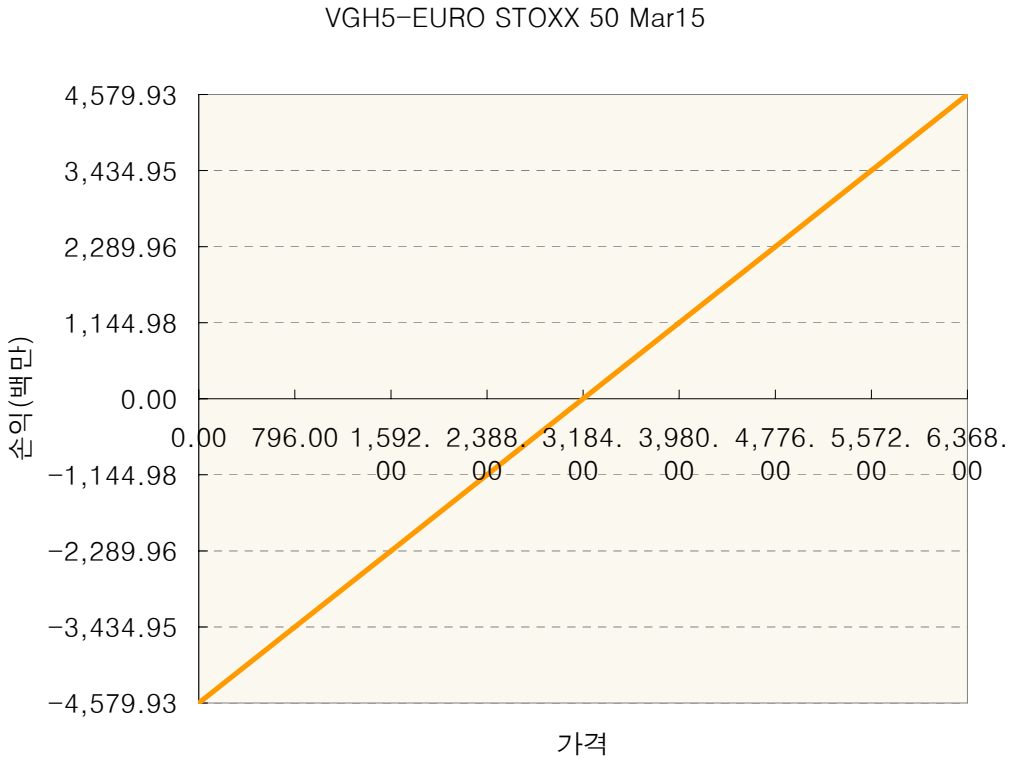
유로인덱스1호(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,580	0	4,580	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH5	EURO STOXX 50 Mar15	366

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

(단위:백만원)

291

공시일	2014-12-31
기준일	2014-12-30

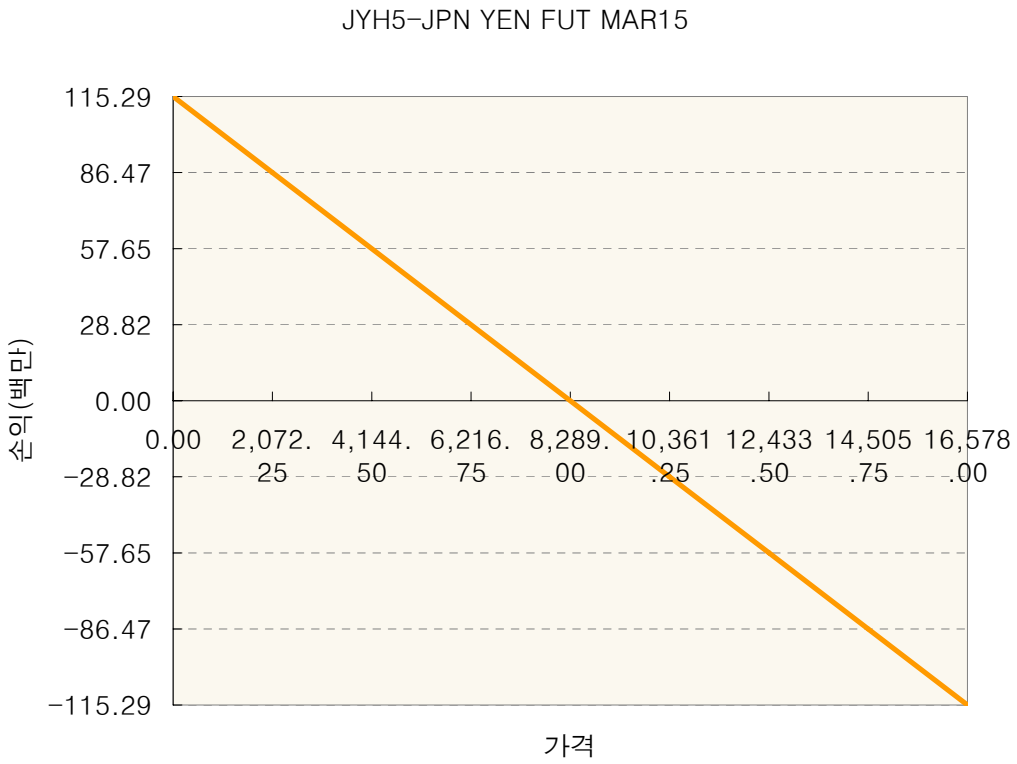
아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

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	115	-115	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JYH5	JPN YEN FUT MAR15	9

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

(단위:백만원)

4

공시일	2014-12-31
기준일	2014-12-30

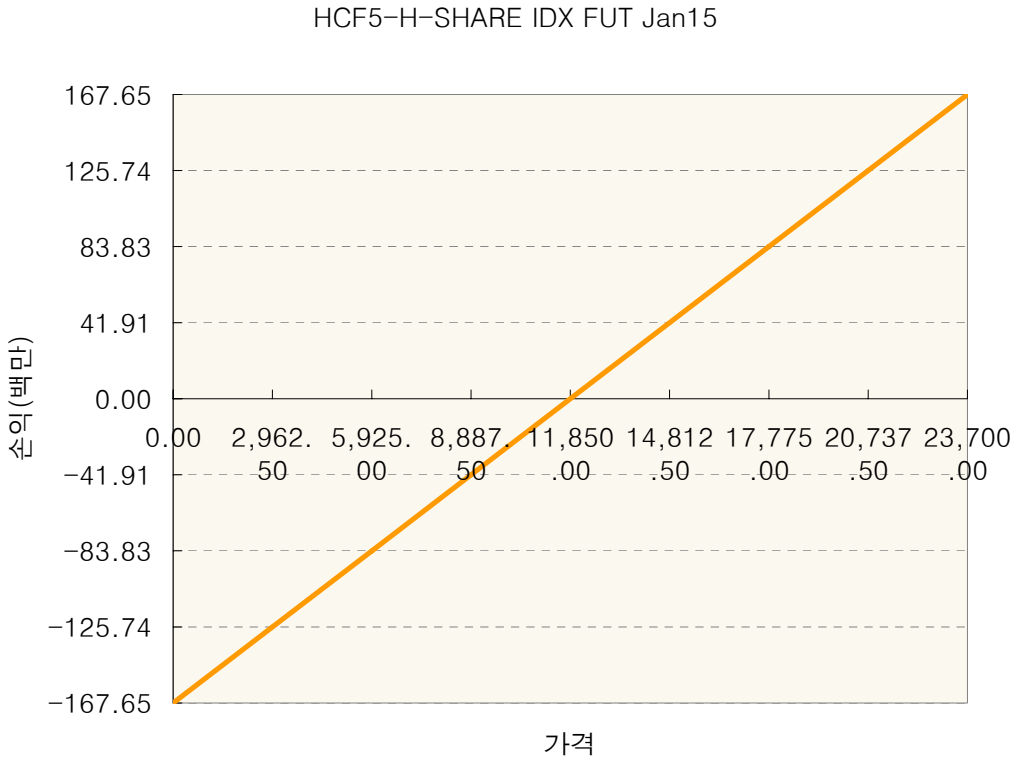
차이나인덱스(주식-파생형)(종)

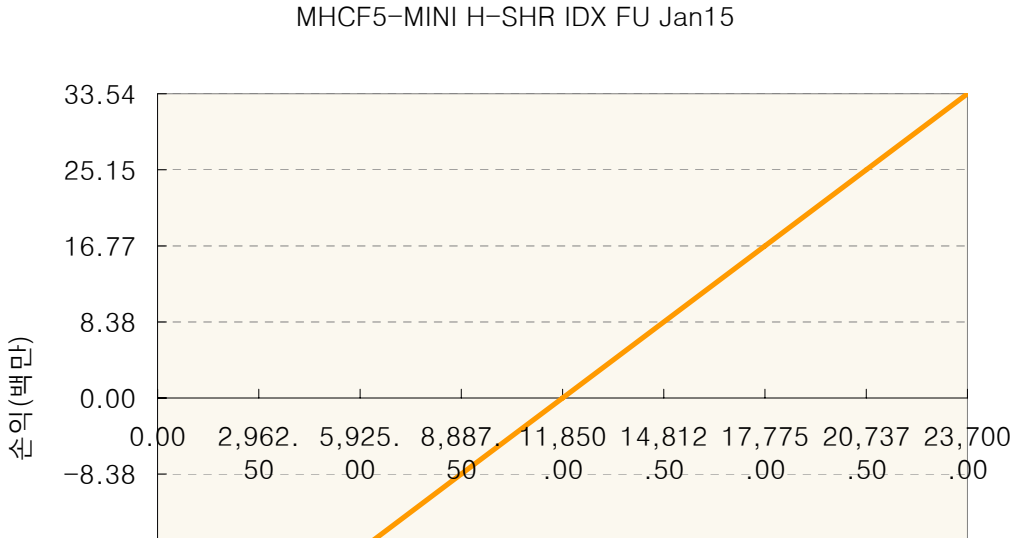
1. 계약금액

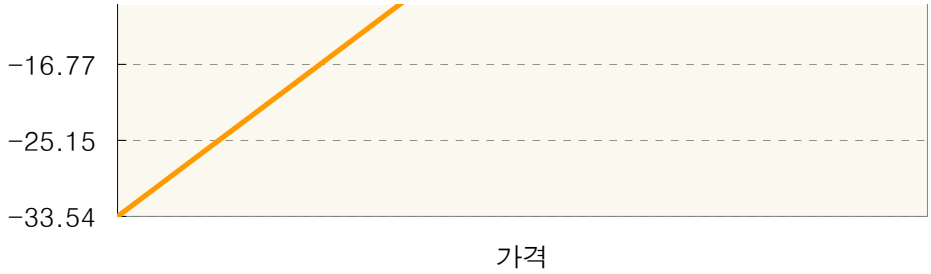
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	201	0	201	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF5	H-SHARE IDX FUT Jan15	13
MHCF5	MINI H-SHR IDX FU Jan15	3

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

(단위:백만원)

15

공시일	2014-12-31
기준일	2014-12-30

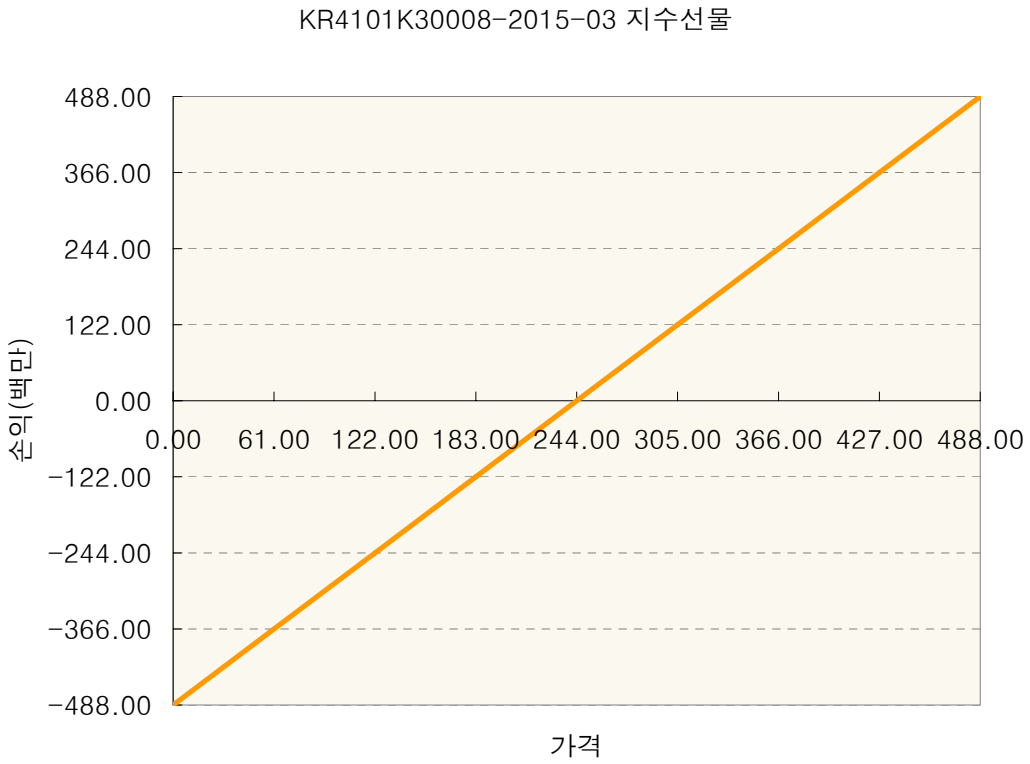
ETF스마트레버리지목표전환형제4

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	488	0	488	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101K300 2015-03 지수선물							39
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-5.33%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
-2.67%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	13	13	13	13	13	13	13
5.33%	26	26	26	26	26	26	26
8.00%	39	39	39	39	39	39	39

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

25

공시일	2014-12-31
기준일	2014-12-30

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	30,845	0	30,845	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO00(MSCI Daily TR Net World USD	2,483

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,355

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2014-12-31
기준일	2014-12-30

메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

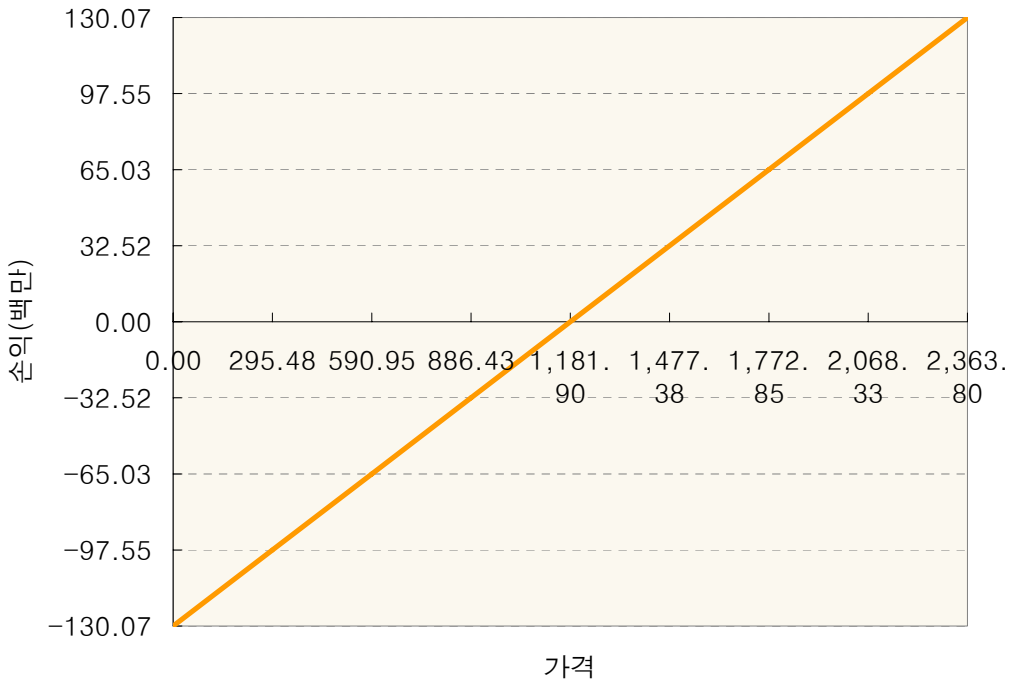
1. 계약금액

(단위:백만원)

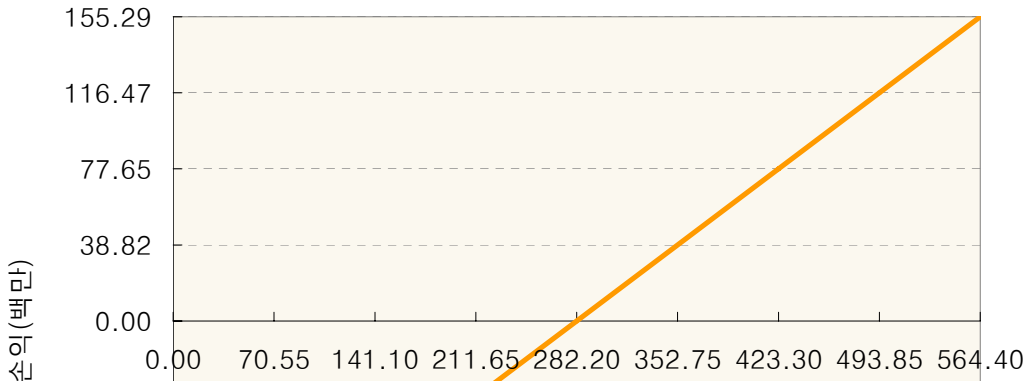
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	17	0	17	
누계	유가증권	선물	643	171	471	

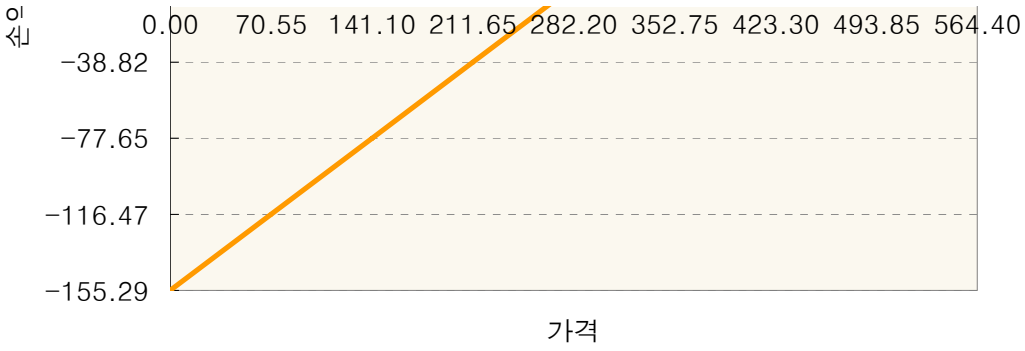
2. 만기시점의 손익구조

GCG5-GOLD 100 OZ FUTR Feb15

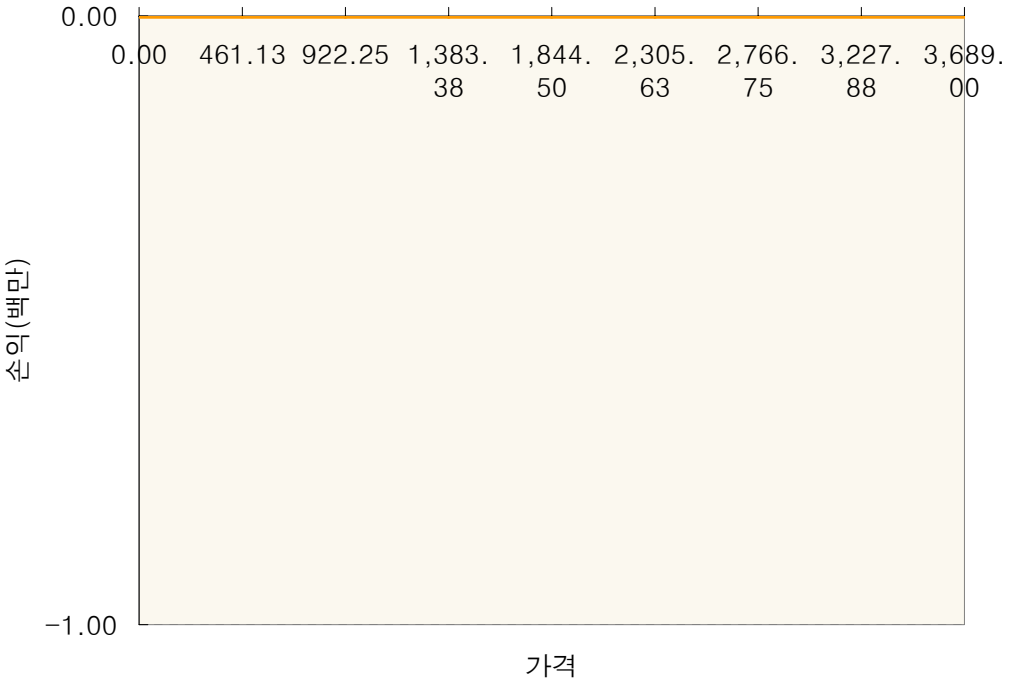


HGH5-COPPER FUTURE Mar15

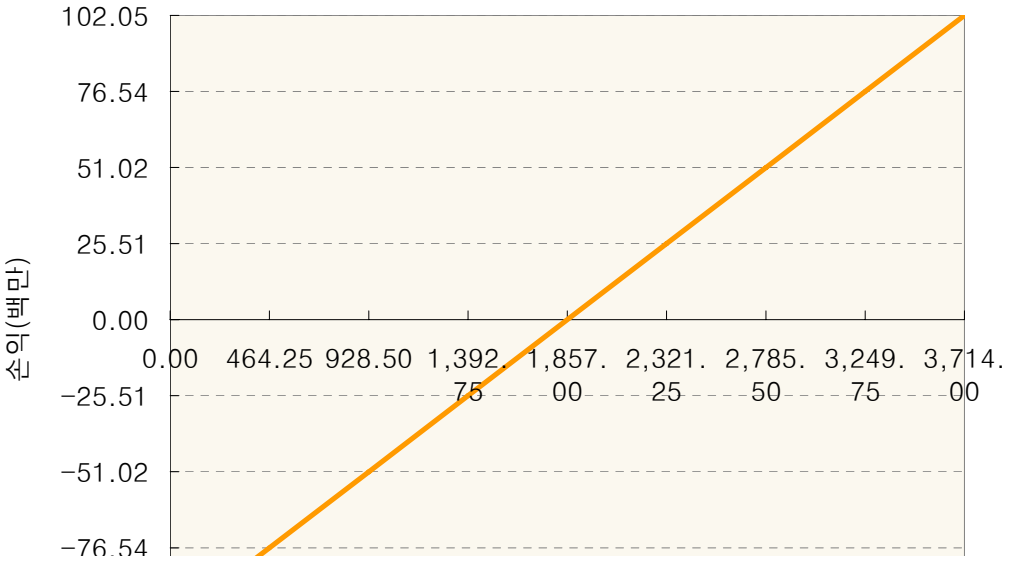


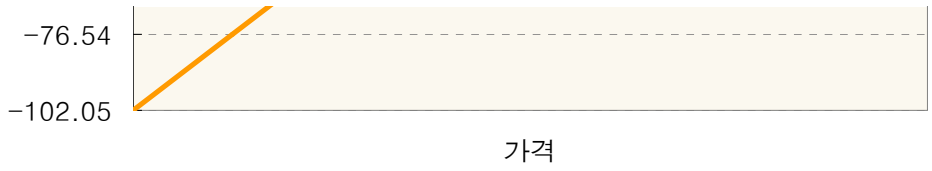


LAF5-LME PRI ALUM FUTR JAN 15

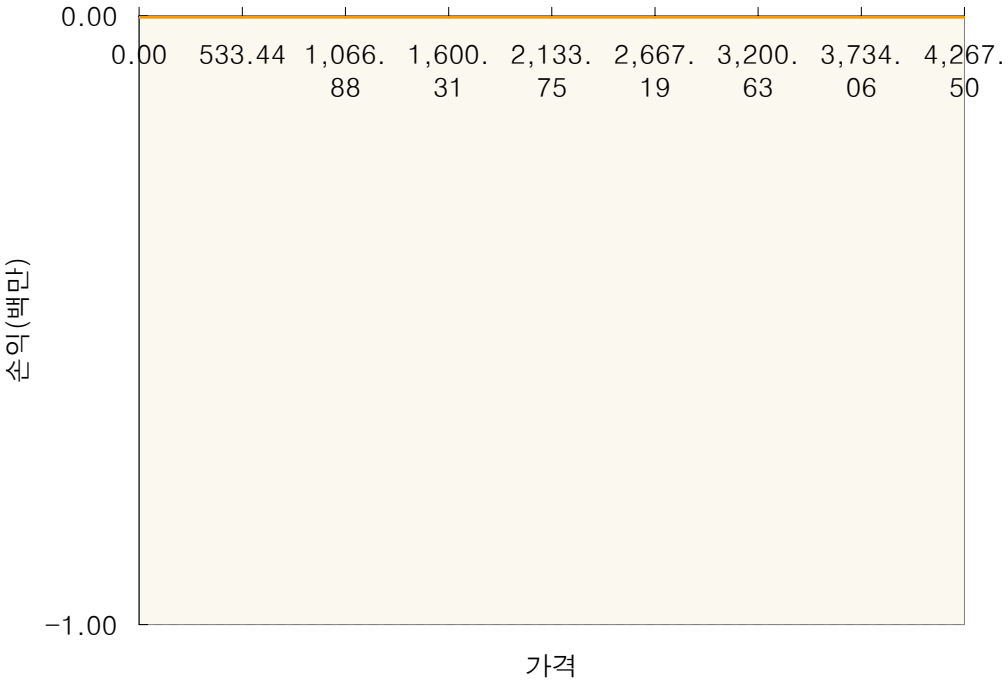


LAH5-LME PRI ALUM FUTR MAR 15

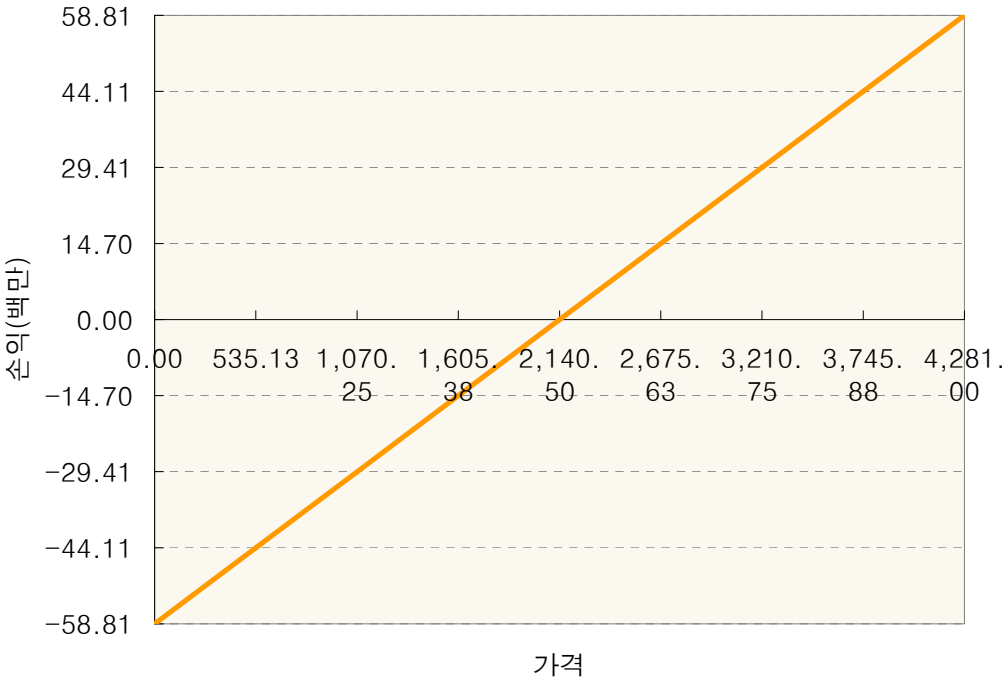




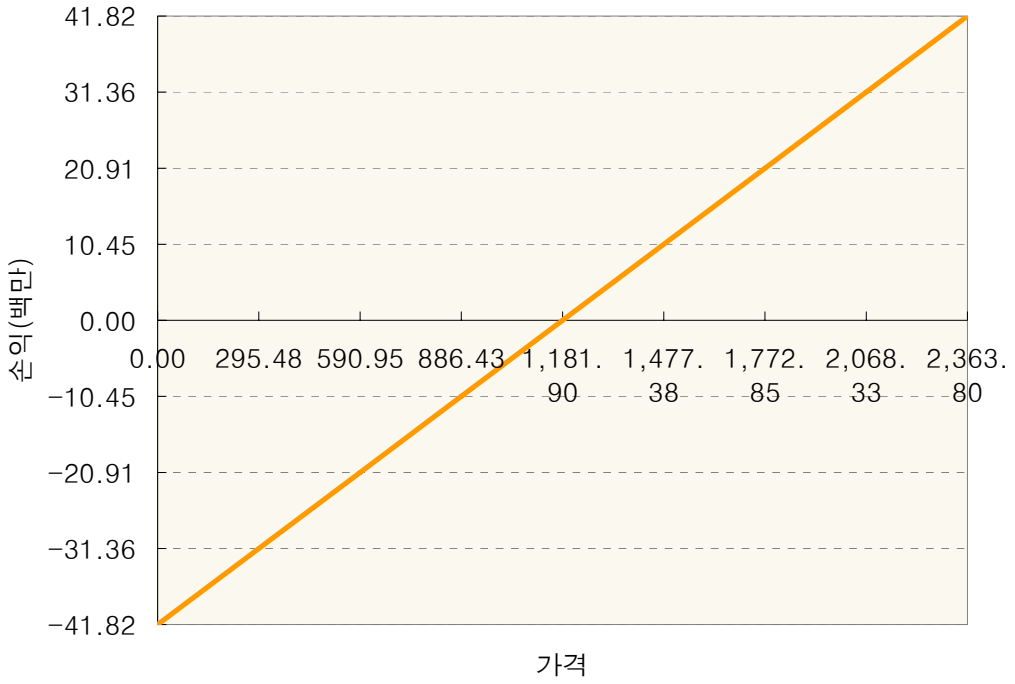
LXF5-LME ZINC FUTURE JAN15



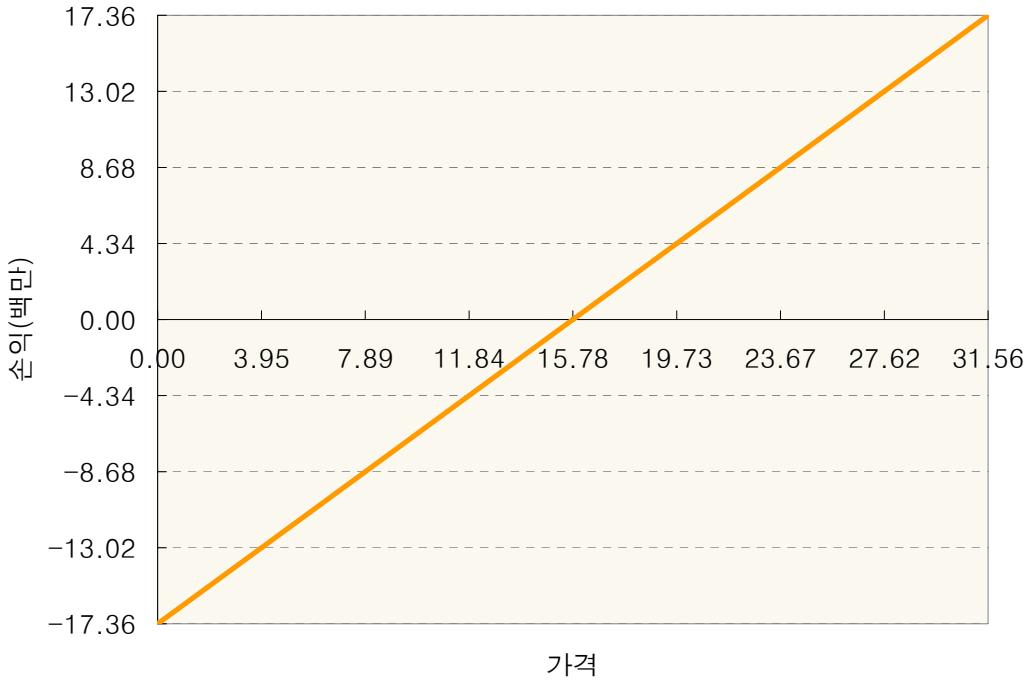
LXH5-LME ZINC FUTURE MAR15



XGG5-MINI GOLD FUTURE Feb15



YSH5-MINI SILVER FUT Mar15



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

GCG5	GOLD 100 OZ FUTR Feb15	10
HGH5	COPPER FUTURE Mar15	12

LAF5	LME PRI ALUM FUTR JAN 15	1
LAH5	LME PRI ALUM FUTR MAR 15	8
LXF5	LME ZINC FUTURE JAN15	0.3
LXH5	LME ZINC FUTURE MAR15	5
XGG5	MINI GOLD FUTURE Feb15	3
YSH5	MINI SILVER FUT Mar15	1

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

36

공시일	2014-12-31
기준일	2014-12-30

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

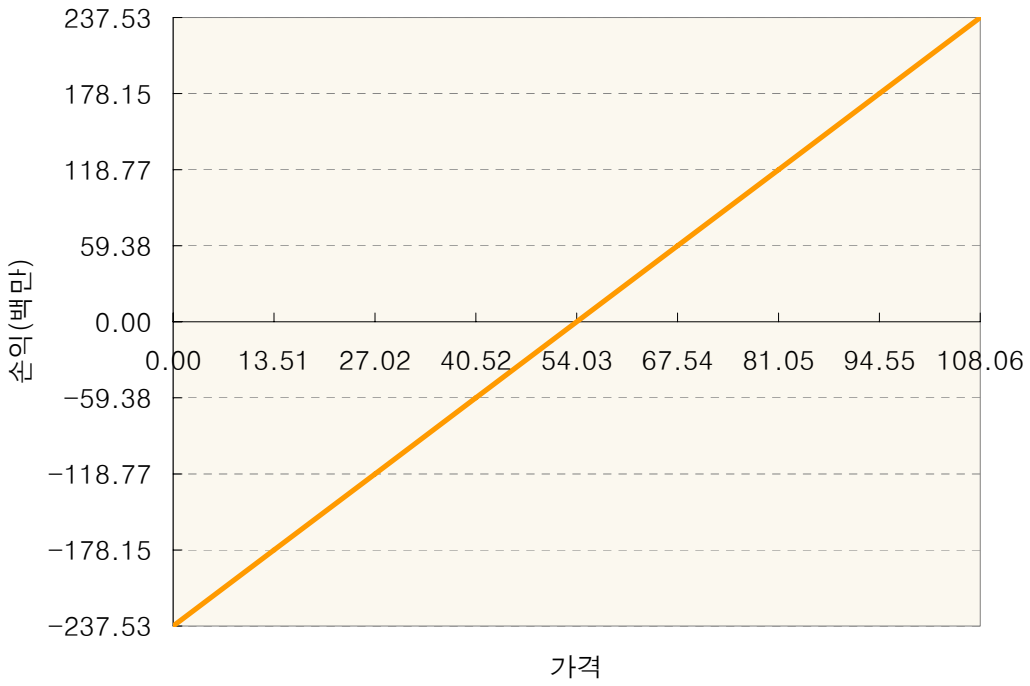
1. 계약금액

(단위:백만원)

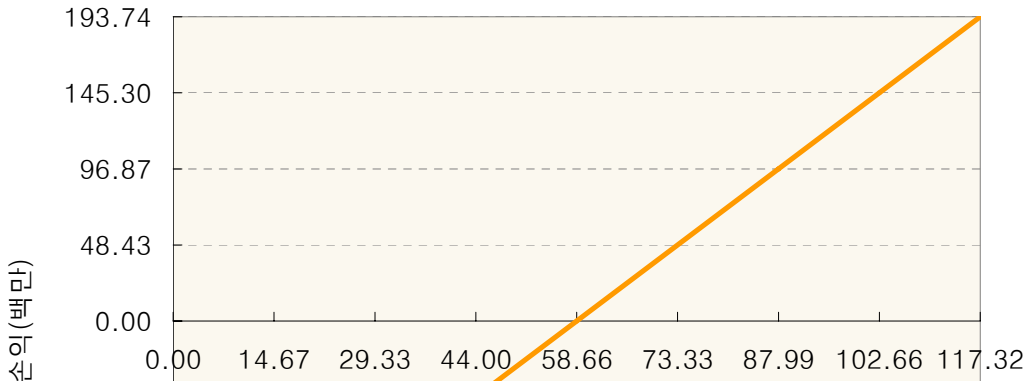
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	238	0	238	
누계	유가증권	선물	731	0	731	

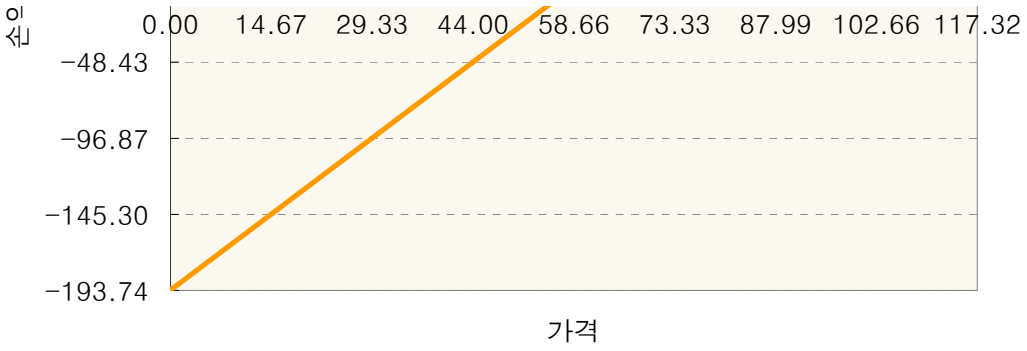
2. 만기시점의 손익구조

CLH5-WTI CRUDE FUTURE Mar15

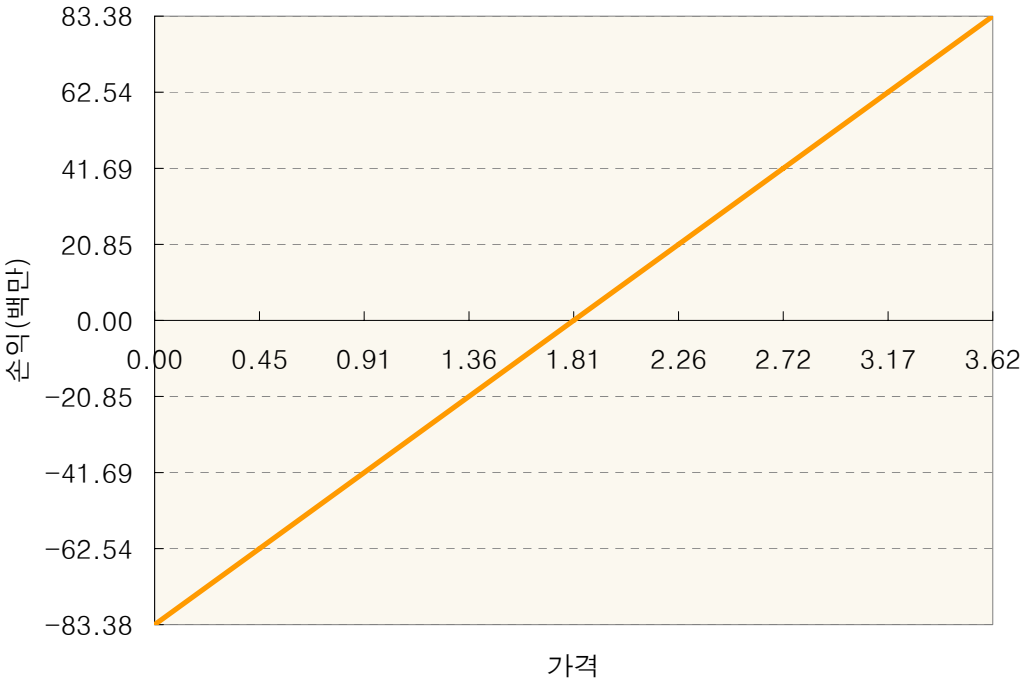


COH5-BRENT CRUDE FUTR Mar15

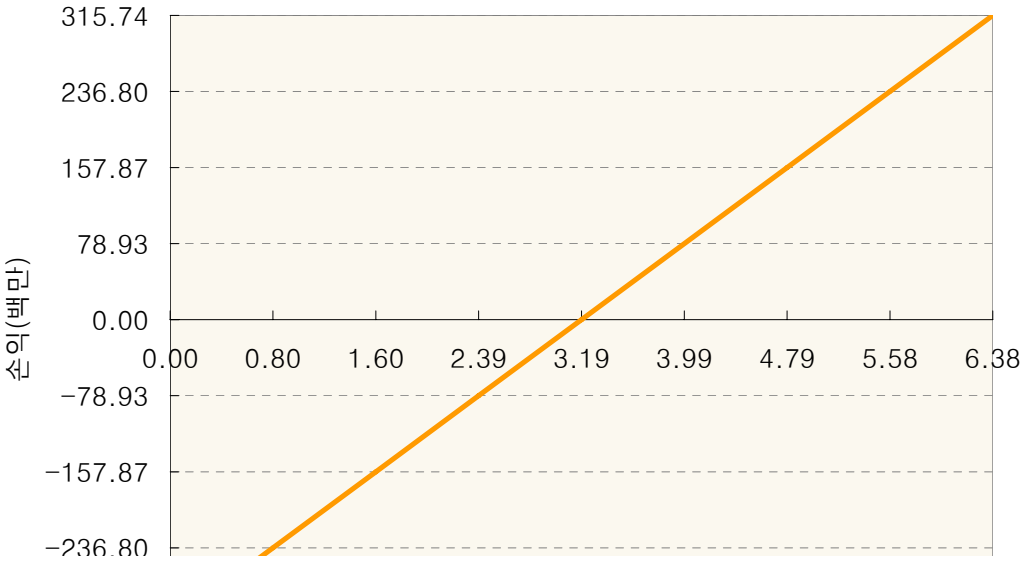


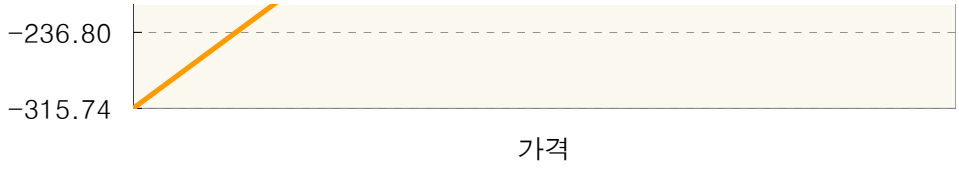


HOH5-NY Harb ULSD Fut Mar15

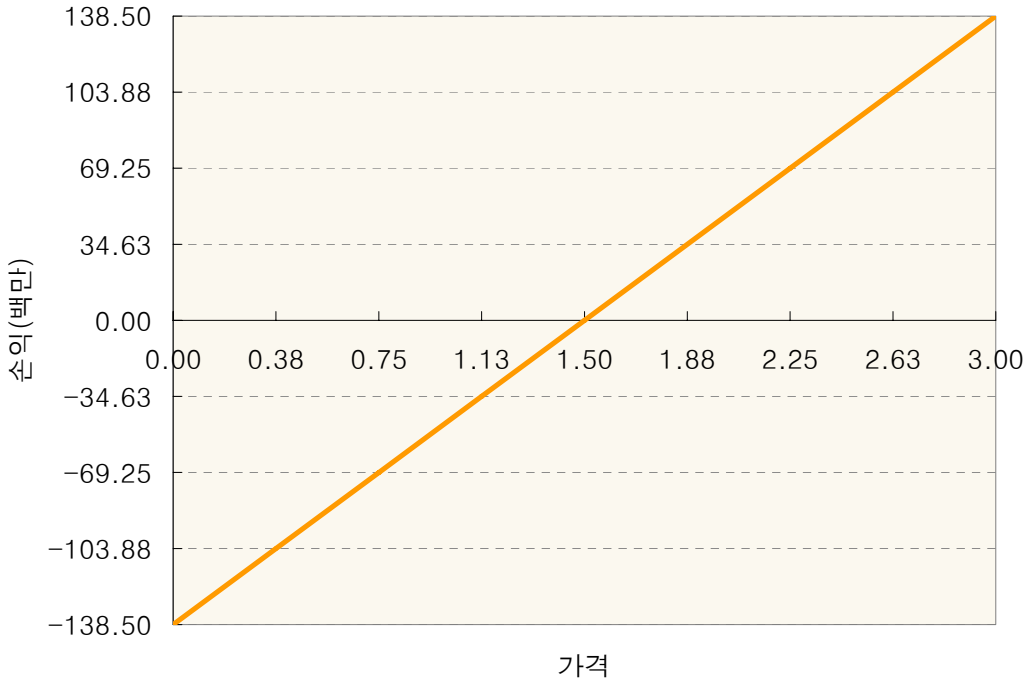


NGH5-NATURAL GAS FUTR Mar15





XBH5-GASOLINE RBOB FUT Mar15



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLH5	WTI CRUDE FUTURE Mar15	19
COH5	BRENT CRUDE FUTR Mar15	15
HOH5	NY Harb ULSD Fut Mar15	7
NGH5	NATURAL GAS FUTR Mar15	25
XBH5	GASOLINE RBOB FUT Mar15	11

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

(단위:백만원)

137

공시일	2014-12-31
기준일	2014-12-30

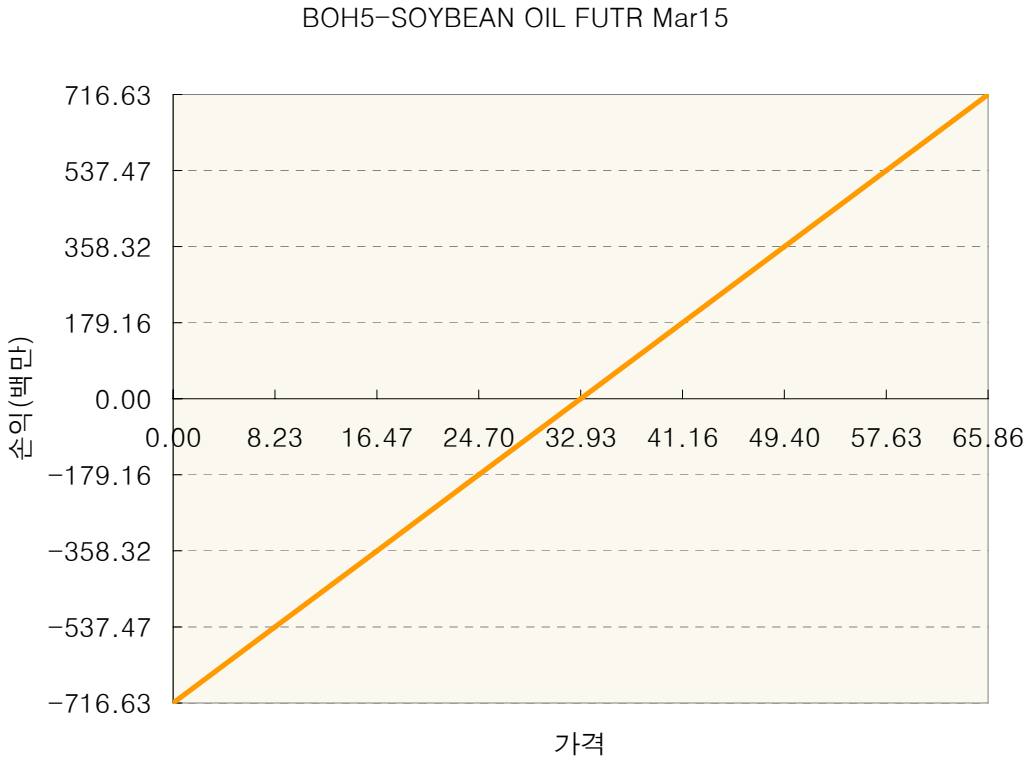
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

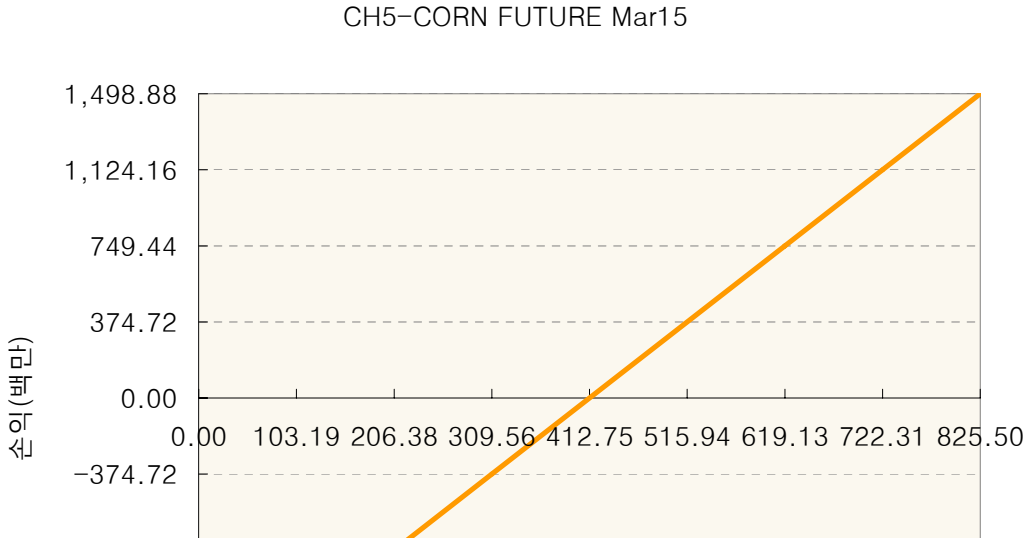
1. 계약금액

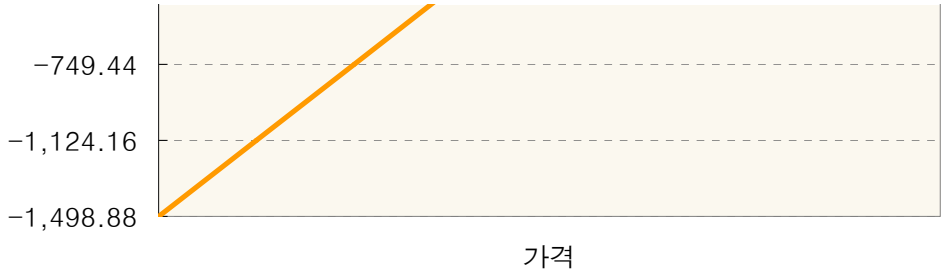
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,174	0	8,174	

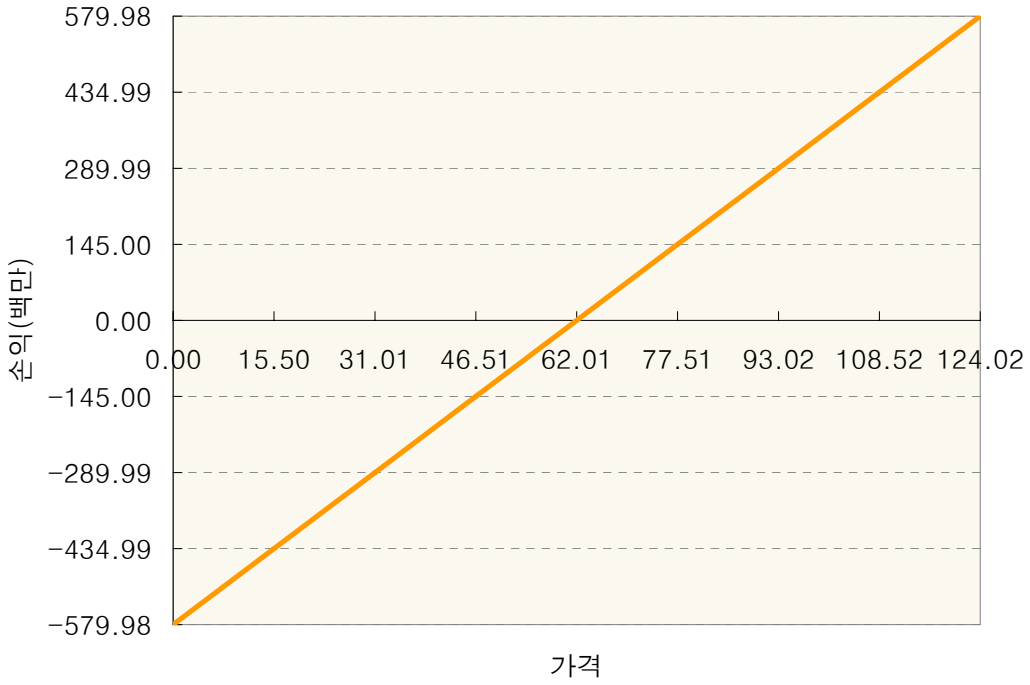
2. 만기시점의 손익구조



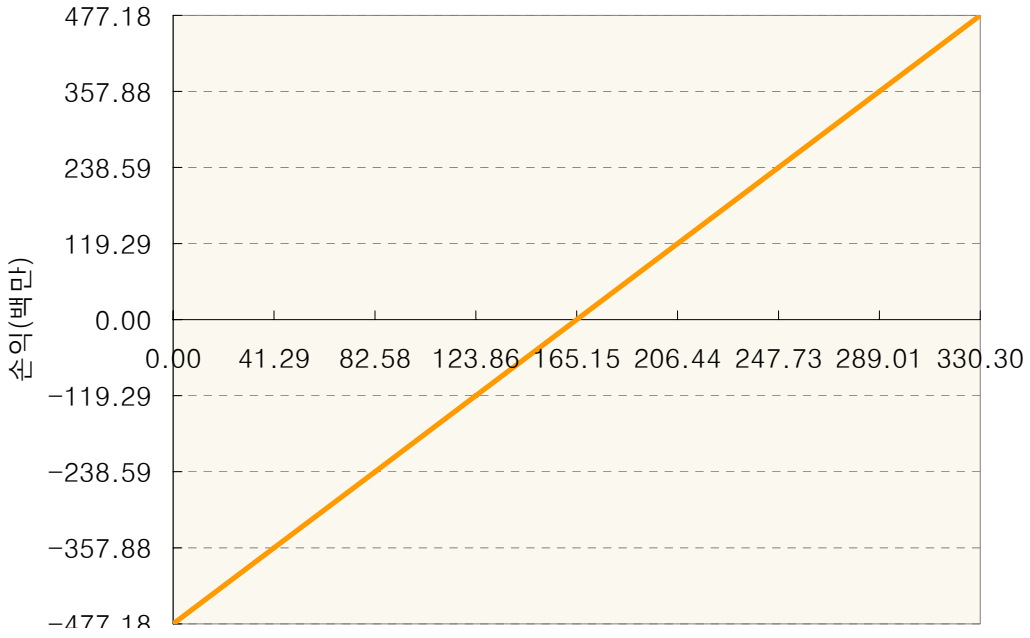


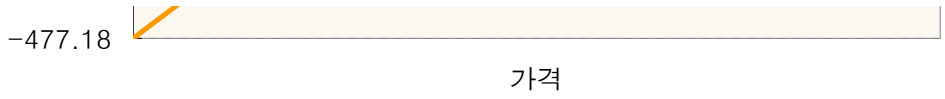


CTH5-COTTON NO.2 FUTR Mar15

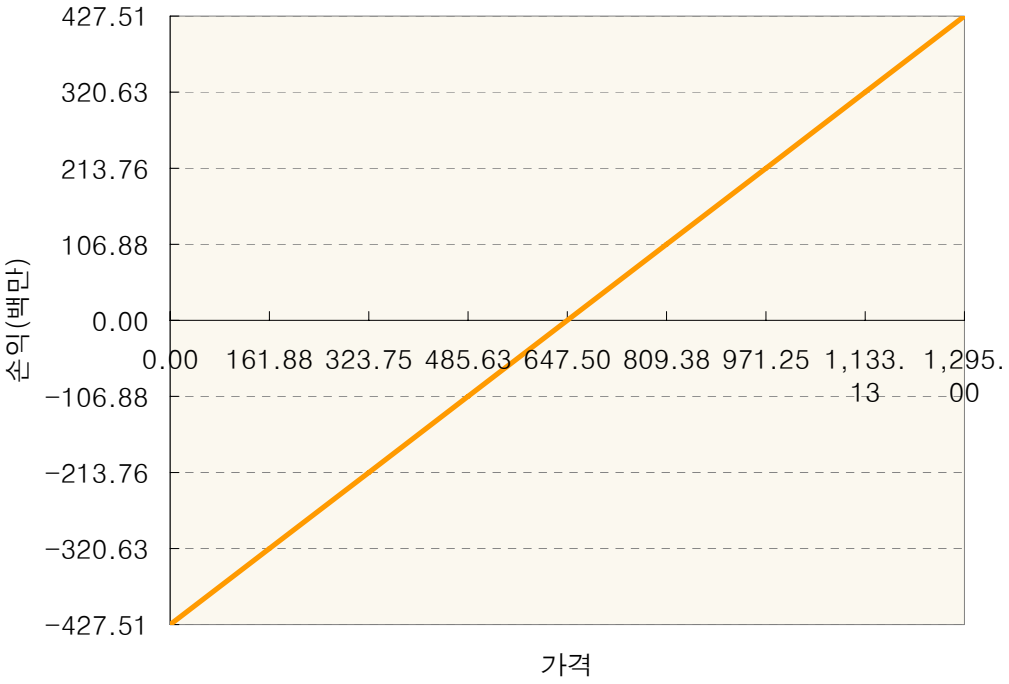


KCH5-COFFEE "C" FUTURE Mar15

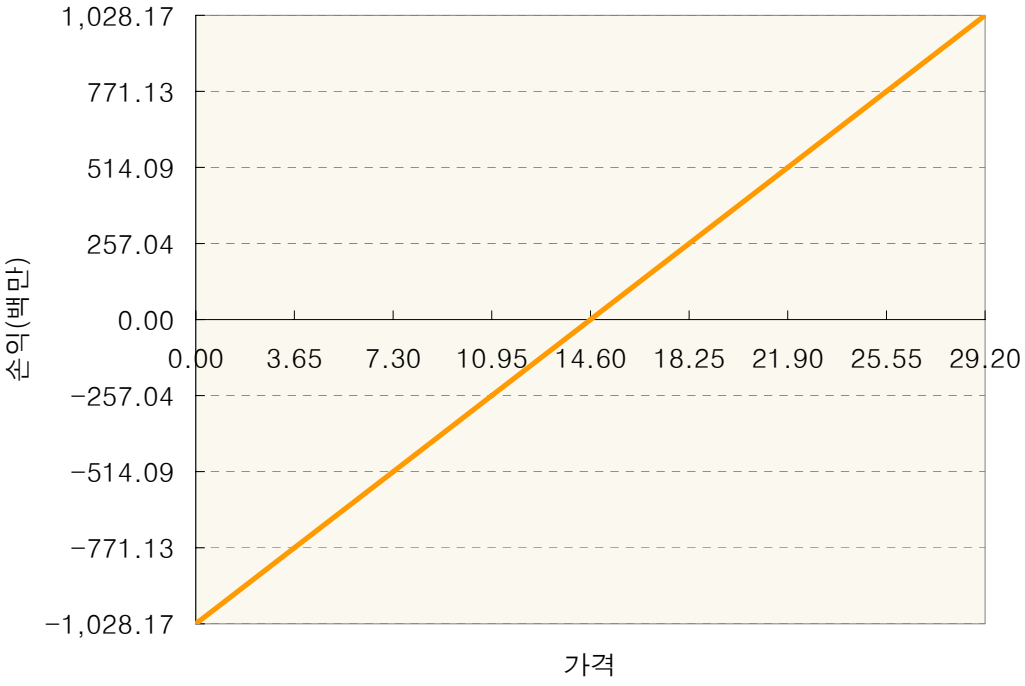




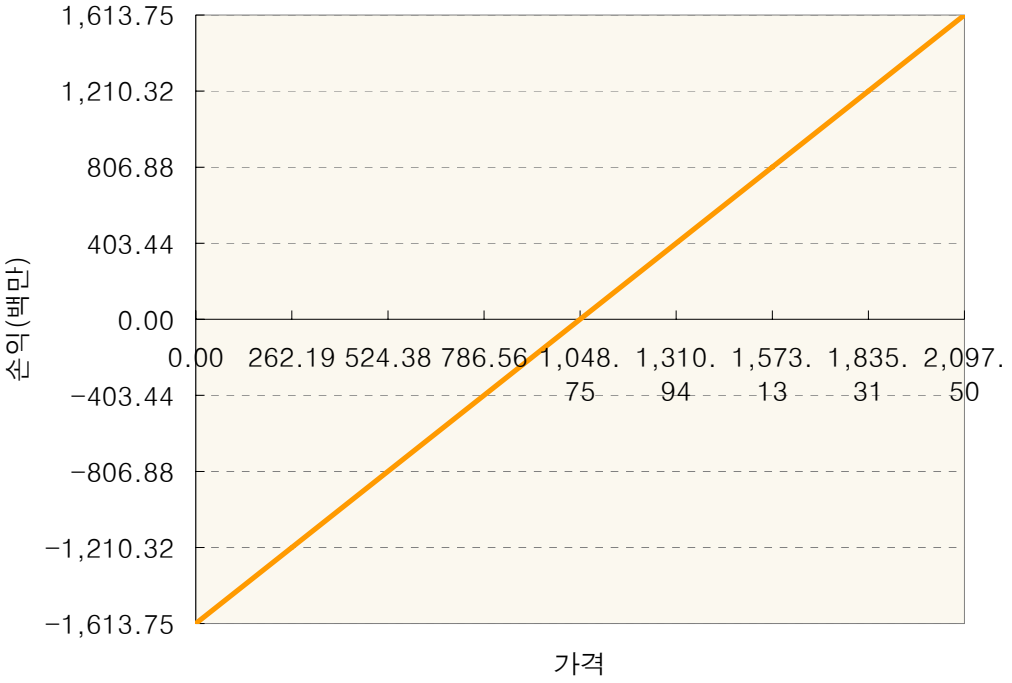
KWH5-WHEAT FUTURE(KCB) Mar15



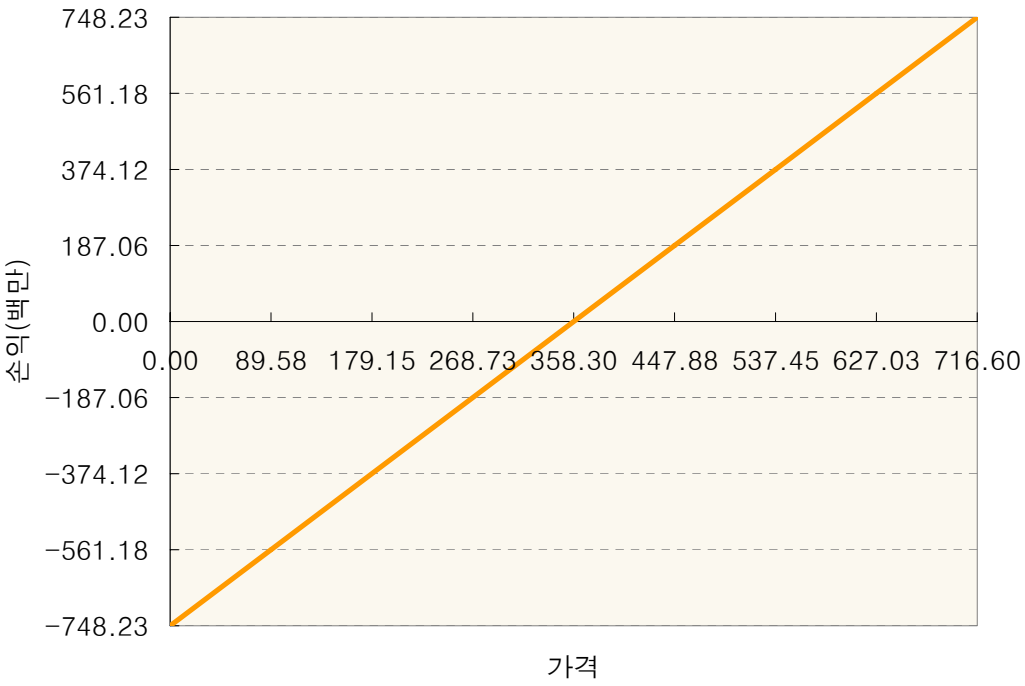
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar15



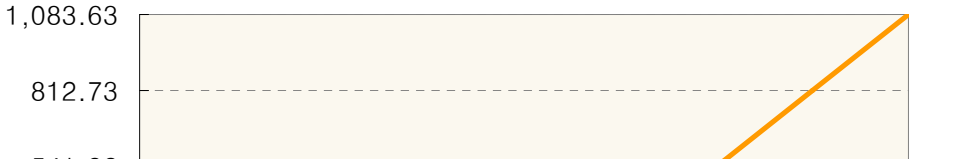
SH5-SOYBEAN FUTURE Mar15

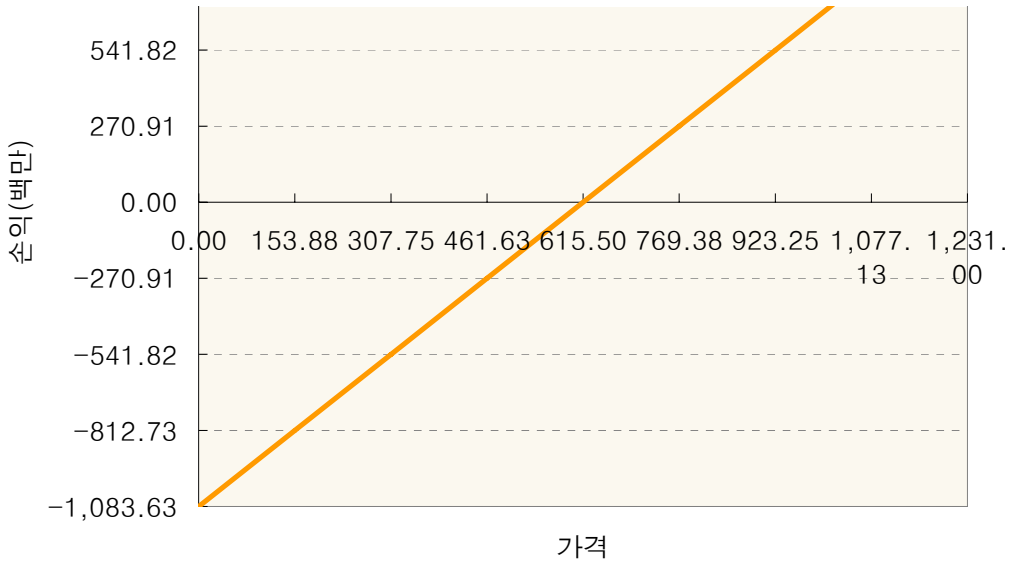


SMH5-SOYBEAN MEAL FUTR Mar15



WH5-WHEAT FUTURE(CBT) Mar15





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH5	SOYBEAN OIL FUTR Mar15	57
CH5	CORN FUTURE Mar15	120
CTH5	COTTON NO.2 FUTR Mar15	46
KCH5	COFFEE "C" FUTURE Mar15	38
KWH5	WHEAT FUTURE(KCB) Mar15	34
SBH5	Sugar #11 (WORLD) Mar15	82
SH5	SOYBEAN FUTURE Mar15	129
SMH5	SOYBEAN MEAL FUTR Mar15	60
WH5	WHEAT FUTURE(CBT) Mar15	87

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

(단위:백만원)

996