| | |
|---|---|
| 공시일 | 2015-01-06 |
| 기준일 | 2015-01-05 |

# 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 | 2015-01-06 |
| 기준일 | 2015-01-05 |

# 차곡차곡플러스모(주식혼합-파생)

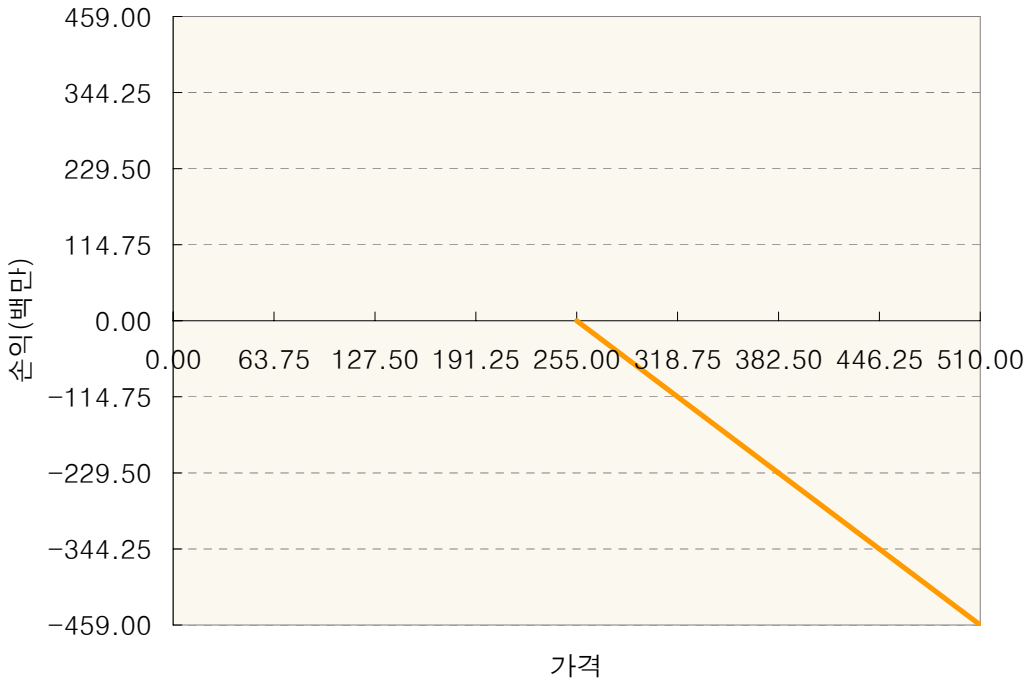
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

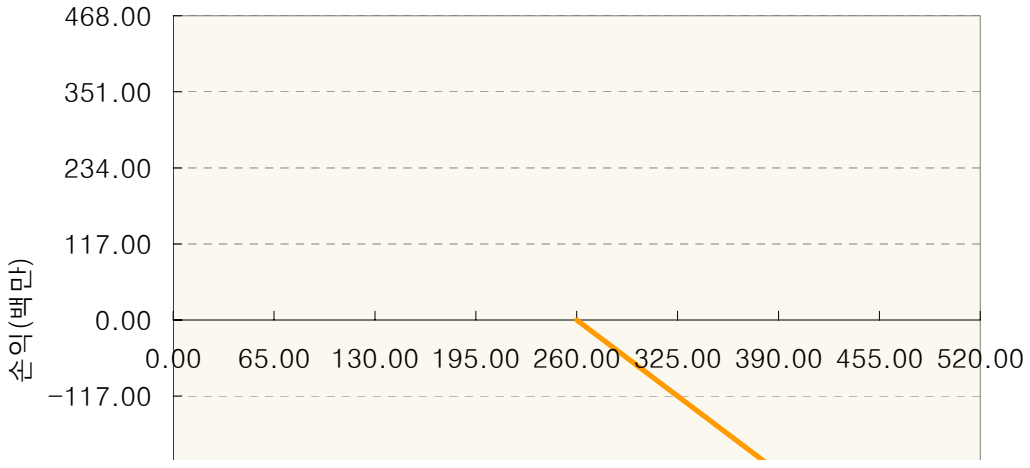
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 927 | -927 | 장내 |

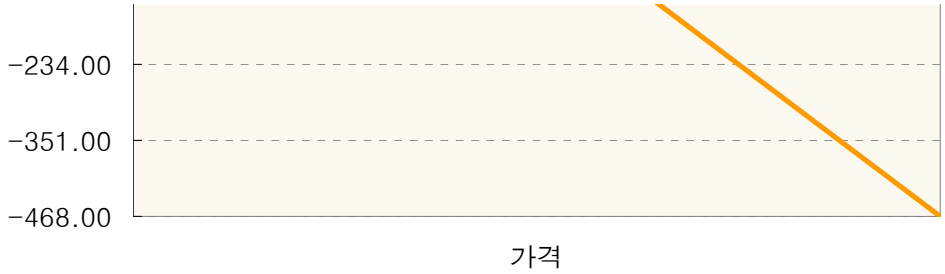
## 2. 만기시점의 손익구조

KR4201K12558-2015-01 콜255




KR4201K12608-2015-01 콜260






### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201K125 2015-01 콜255 | 79

| | 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% | -22 | -22 | -23 | -24 | -24 | -25 | -25 |
| 8.00% | -79 | -79 | -79 | -79 | -79 | -79 | -79 |

KR4201K126 2015-01 콜260 | 37

| | 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 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 5.33% | -1 | -1 | -2 | -2 | -3 | -3 | -4 |
| 8.00% | -35 | -35 | -35 | -35 | -36 | -36 | -37 |

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

(단위:백만원)

| 6 |
|---|

| 공시일 | 2015-01-06 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-01-05 |

# 스마트인덱스모

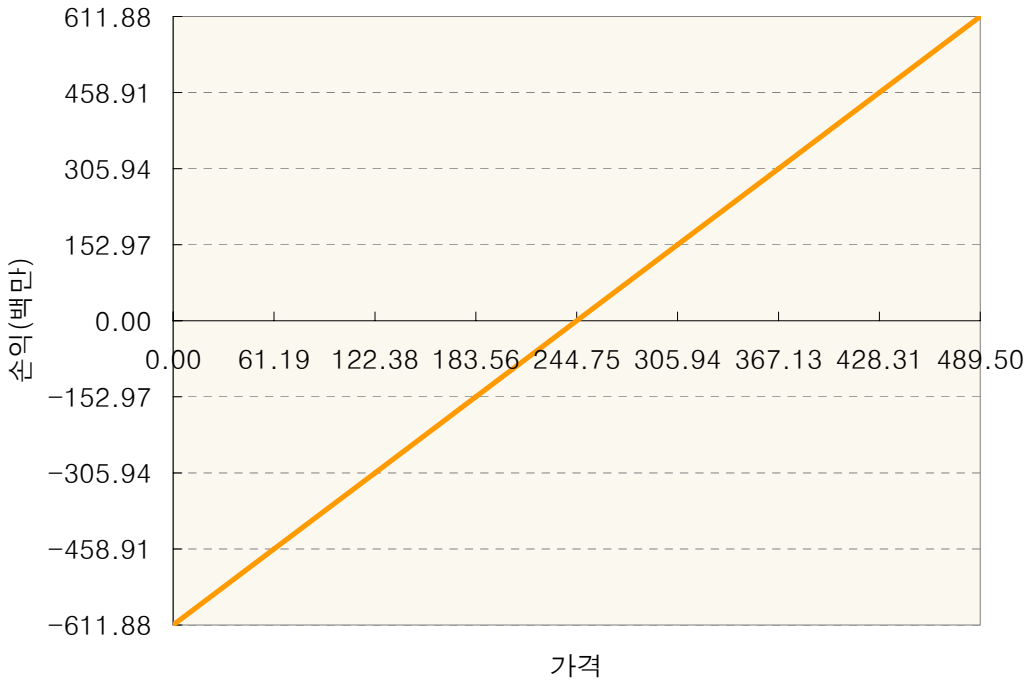
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

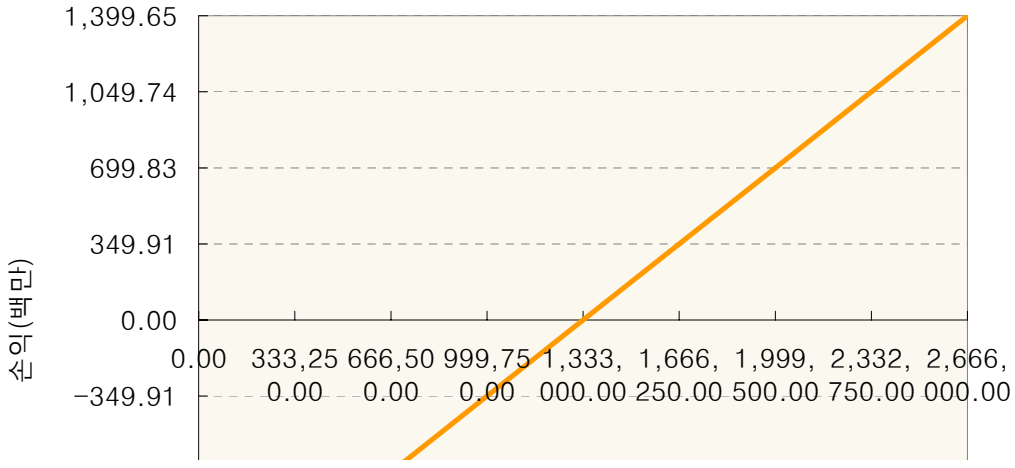
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,012 | 0 | 2,012 | 장내 |

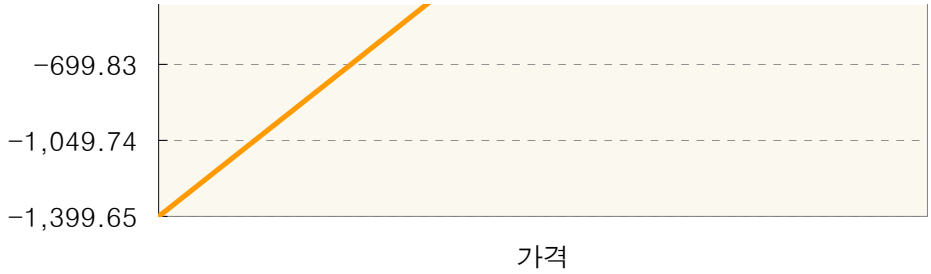
## 2. 만기시점의 손익구조

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 | | | | | | | 112 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -112 | -112 | -112 | -112 | -112 | -112 | -112 |
| -5.33% | -75 | -75 | -75 | -75 | -75 | -75 | -75 |
| -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% | 75 | 75 | 75 | 75 | 75 | 75 | 75 |
| 8.00% | 112 | 112 | 112 | 112 | 112 | 112 | 112 |

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

(단위:백만원)

| 144 |
|---|

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2015-01-06 |
| 기준일 | 2015-01-05 |

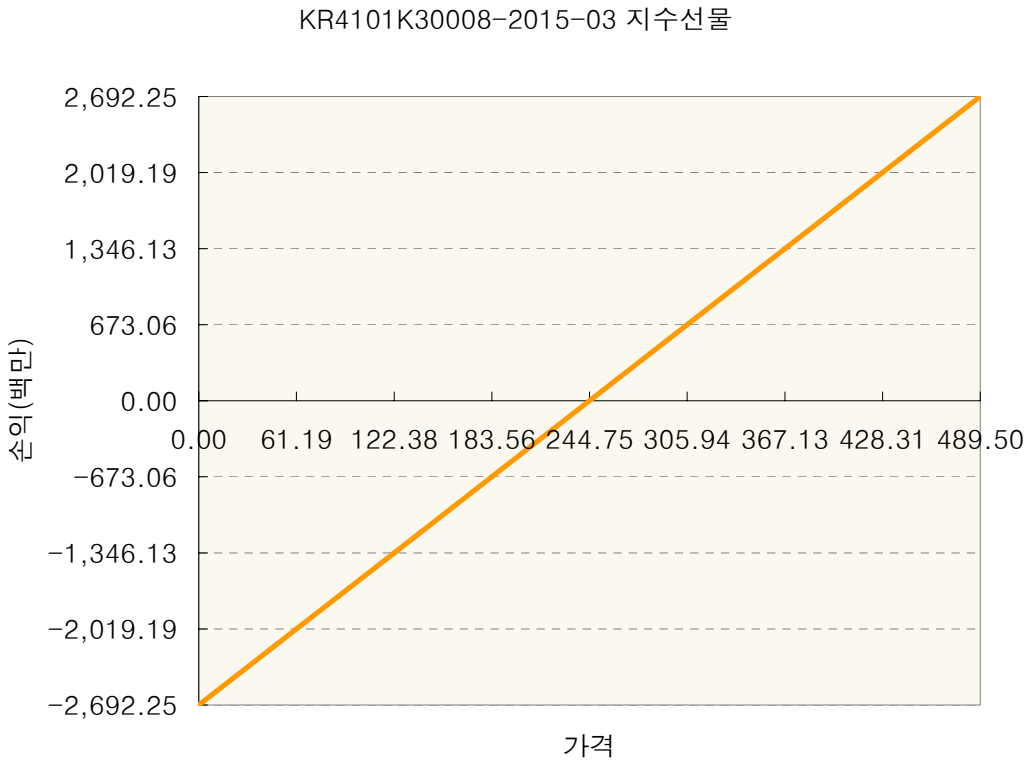
# 스마트레버리지목표전환형1호

## 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 | 2,692 | 0 | 2,692 | 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 | 2015-01-06 |
| 기준일 | 2015-01-05 |

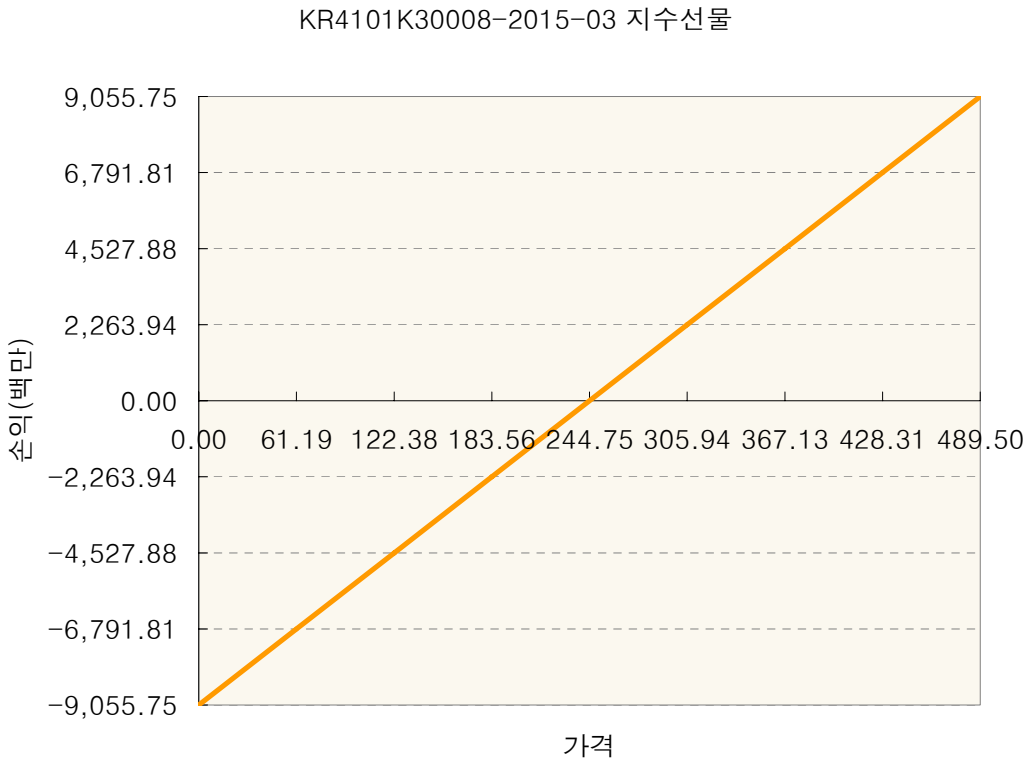
# 1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

## 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 | 9,056 | 0 | 9,056 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101K300 2015-03 지수선물 723

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -723 | -723 | -723 | -723 | -723 | -723 | -723 |
| -5.33% | -482 | -482 | -482 | -482 | -482 | -482 | -482 |
| -2.67% | -241 | -241 | -241 | -241 | -241 | -241 | -241 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 241 | 241 | 241 | 241 | 241 | 241 | 241 |
| 5.33% | 482 | 482 | 482 | 482 | 482 | 482 | 482 |
| 8.00% | 723 | 723 | 723 | 723 | 723 | 723 | 723 |

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

| 472 |
|---|

| 공시일 | 2015-01-06 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-01-05 |

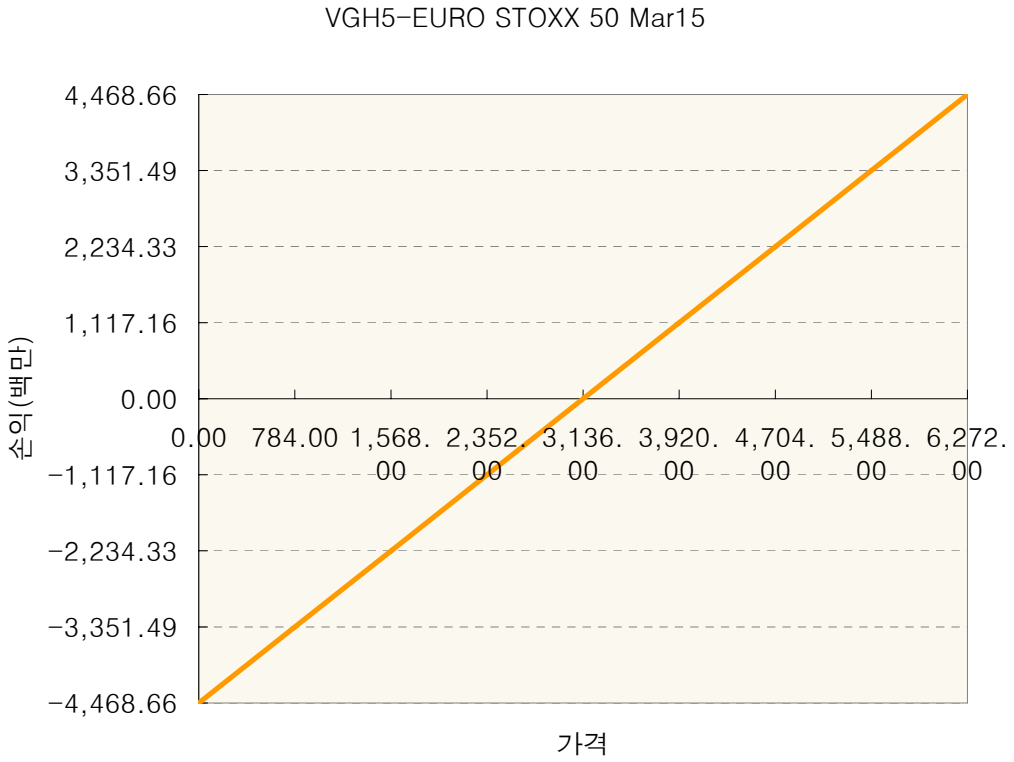
# 유로인덱스1호(주식-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 4,469 | 0 | 4,469 | |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| VGH5 | EURO STOXX 50 Mar15 | 357 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 284 |

| 공시일 | 2015-01-06 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-01-05 |

# 아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

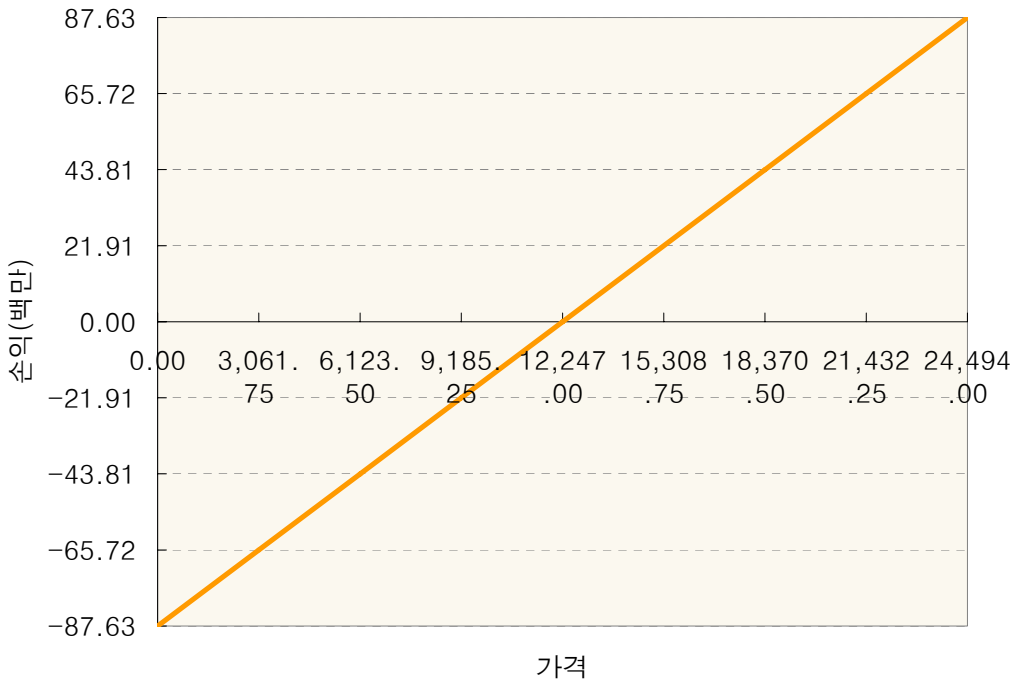
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

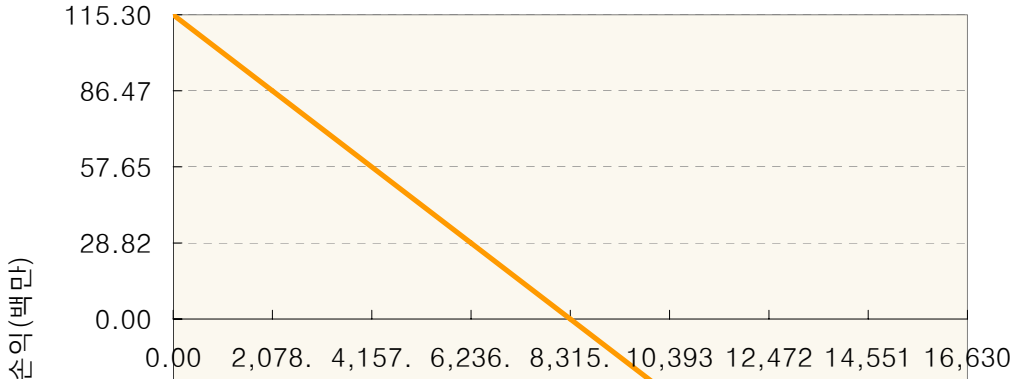
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 115 | -115 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 88 | 0 | 88 | 장내 |

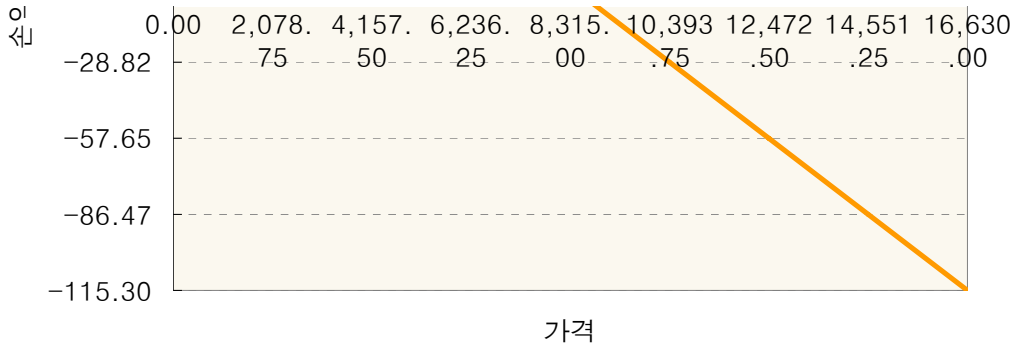
## 2. 만기시점의 손익구조

HCF5-H-SHARES IDX FUT Jan15




JYH5-JPN YEN FUT MAR15






### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| HCF5 | H-SHARES IDX FUT Jan15 | 7 |
| JYH5 | JPN YEN FUT MAR15 | 9 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 11 |

| 공시일 | 2015-01-06 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-01-05 |

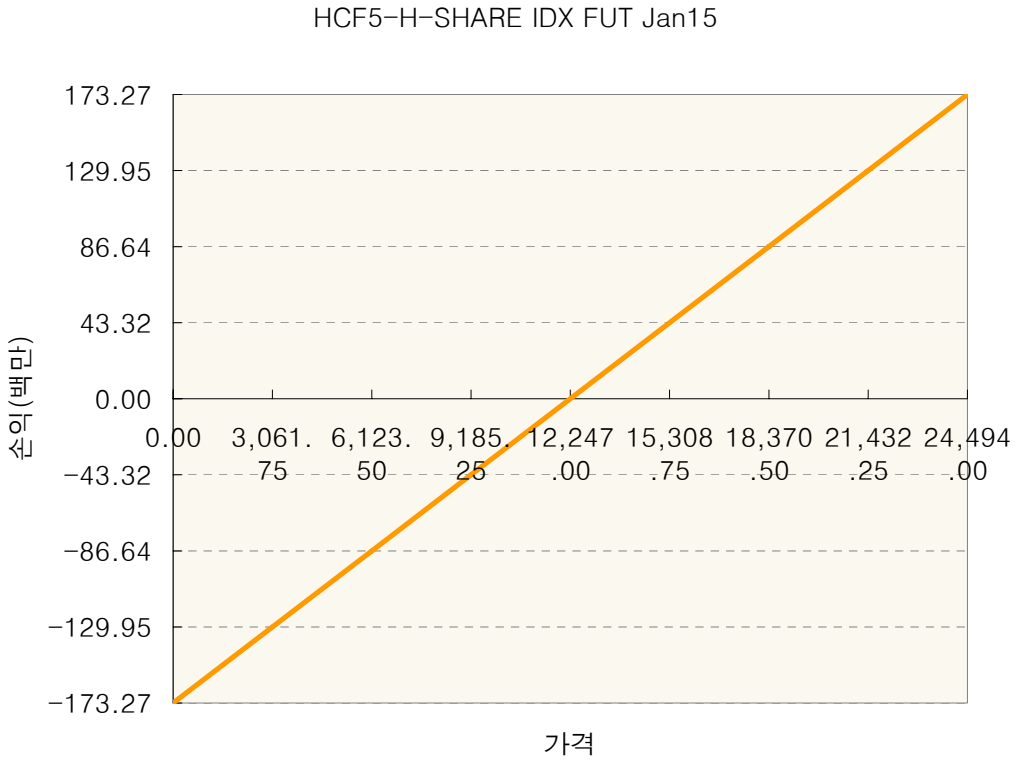
# 차이나인덱스(주식-파생형)(종)

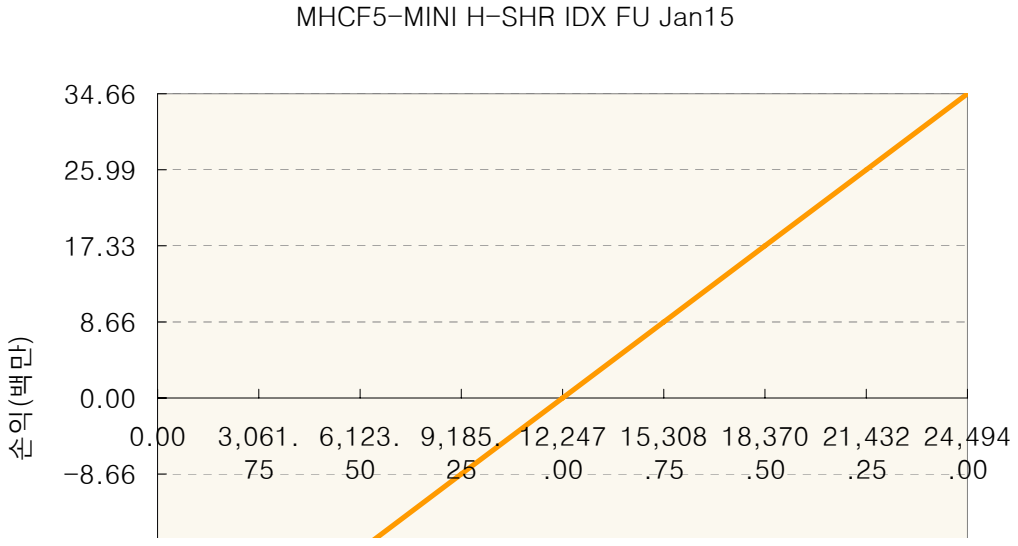
## 1. 계약금액

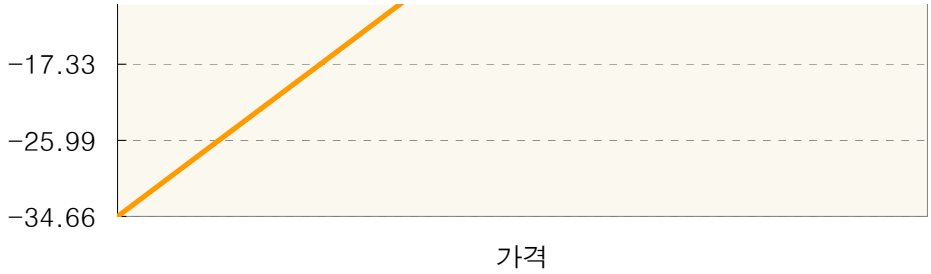
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 208 | 0 | 208 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조






### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| HCF5 | H-SHARE IDX FUT Jan15 | 14 |
| MHCF5 | MINI H-SHR IDX FU Jan15 | 3 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 16 |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2015-01-06 |
| 기준일 | 2015-01-05 |

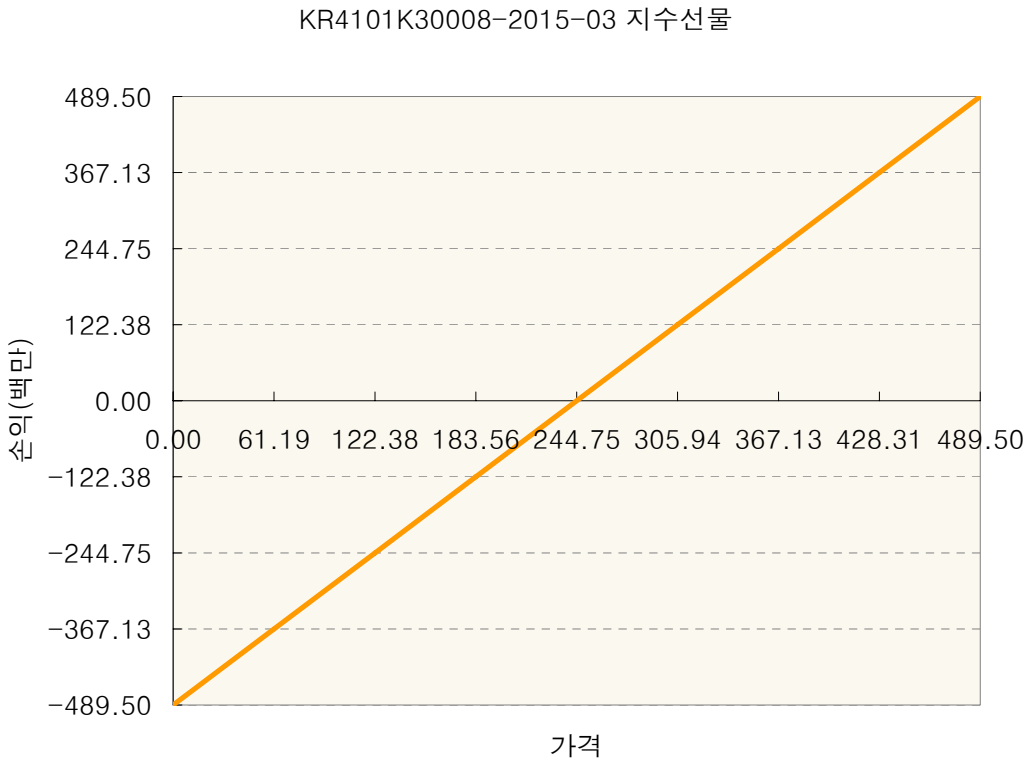
# ETF스마트레버리지목표전환형제4

## 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 | 490 | 0 | 490 | 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)

| 26 |
|---|

| 공시일 | 2015-01-06 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-01-05 |

# 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 | 2,445 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 1,338 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| 공시일 | 2015-01-06 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-01-05 |

# 메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

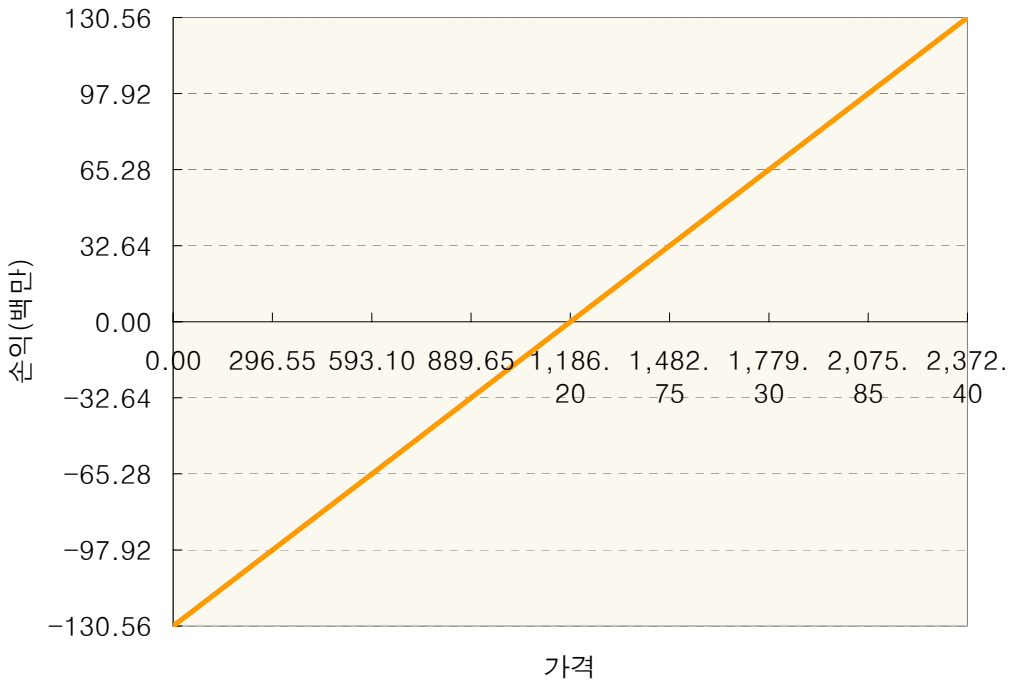
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

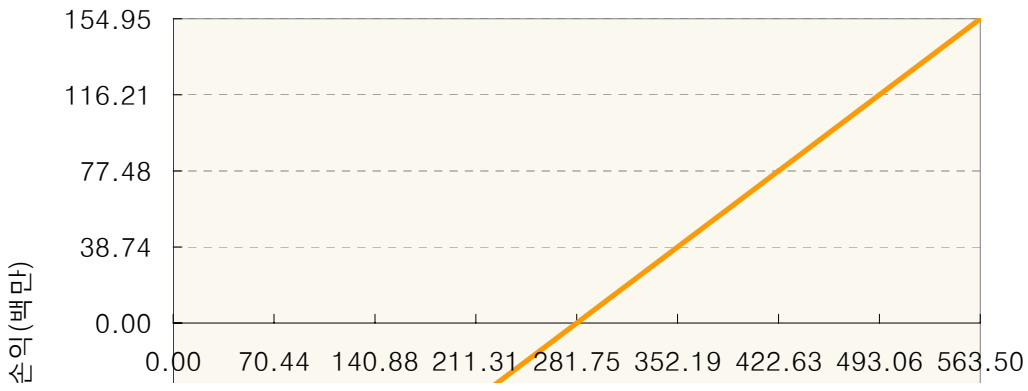
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 선물 | 유가증권 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 선물 | 유가증권 | 17 | 0 | 17 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 643 | 171 | 471 | |

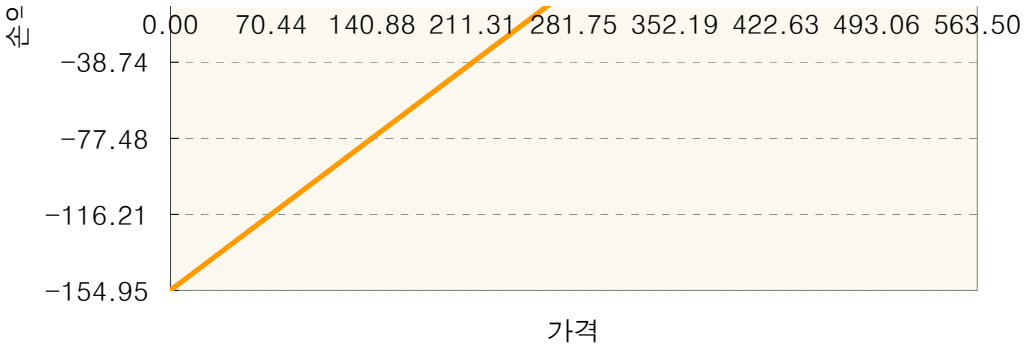
## 2. 만기시점의 손익구조

GCG5-GOLD 100 OZ FUTR Feb15

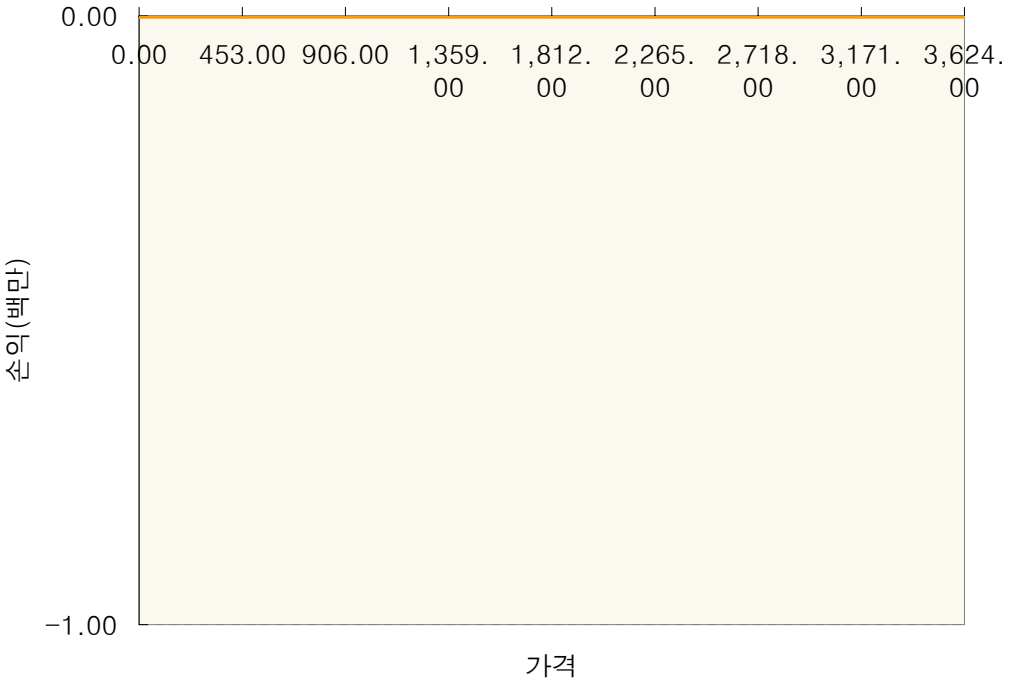



HGH5-COPPER FUTURE Mar15

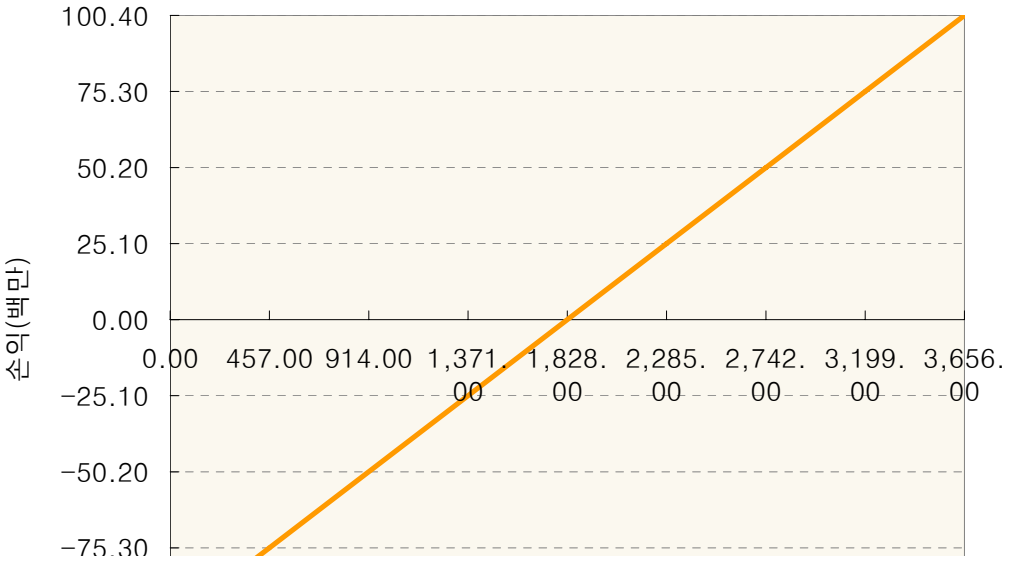


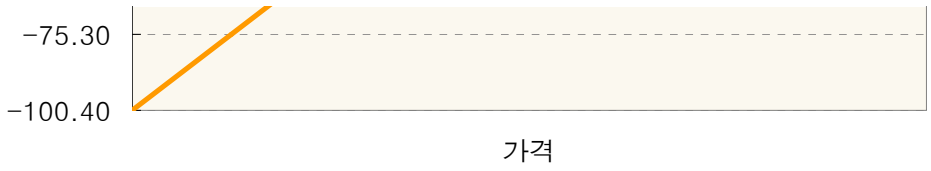



LAF5-LME PRI ALUM FUTR JAN 15

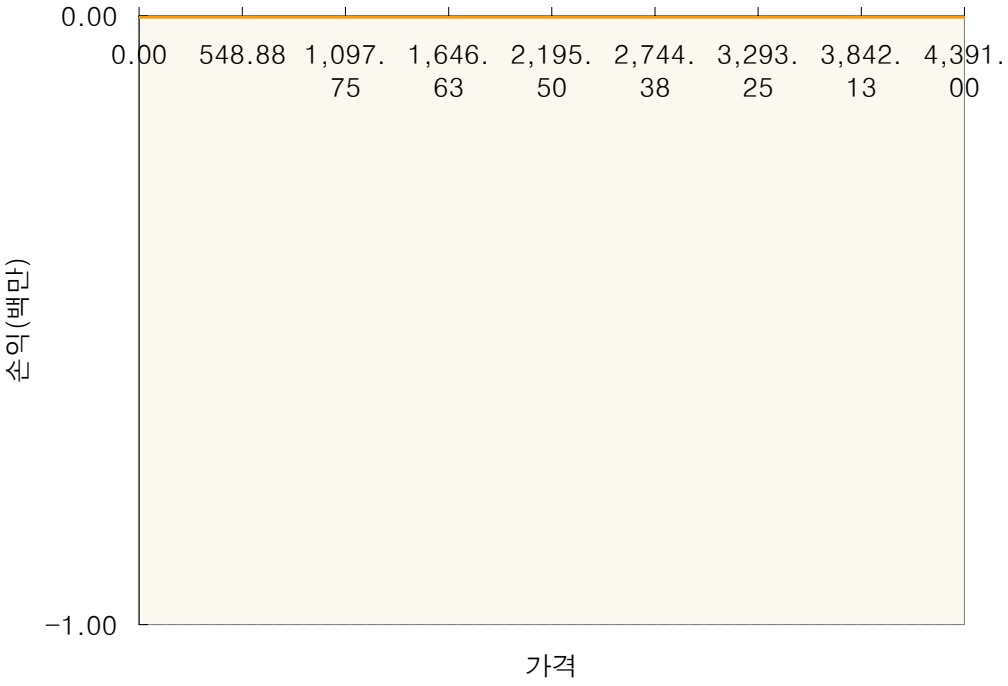



LAH5-LME PRI ALUM FUTR MAR 15

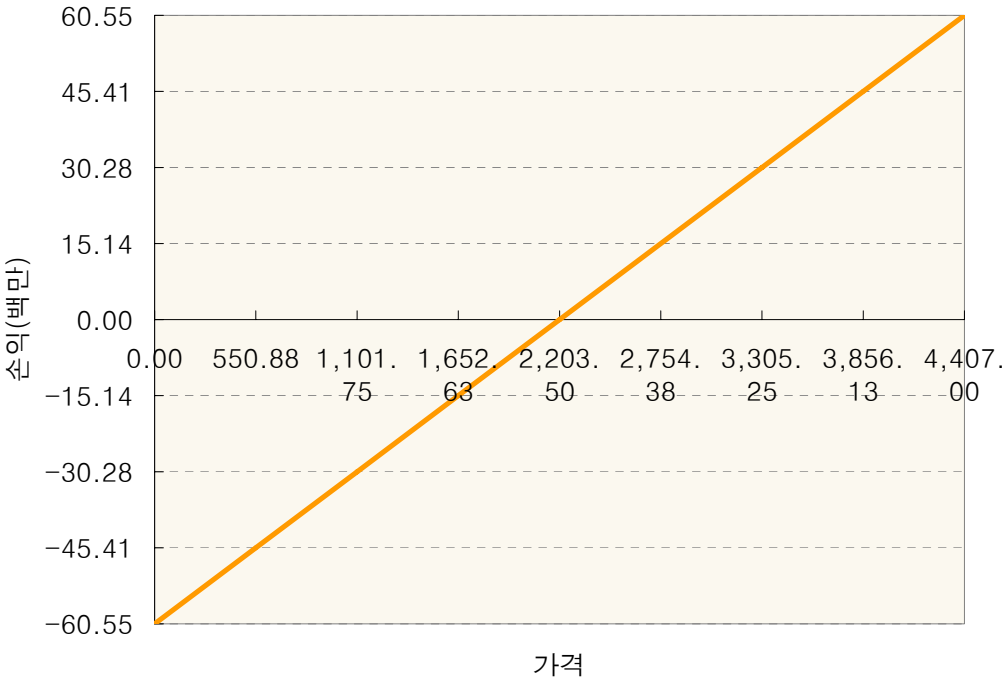




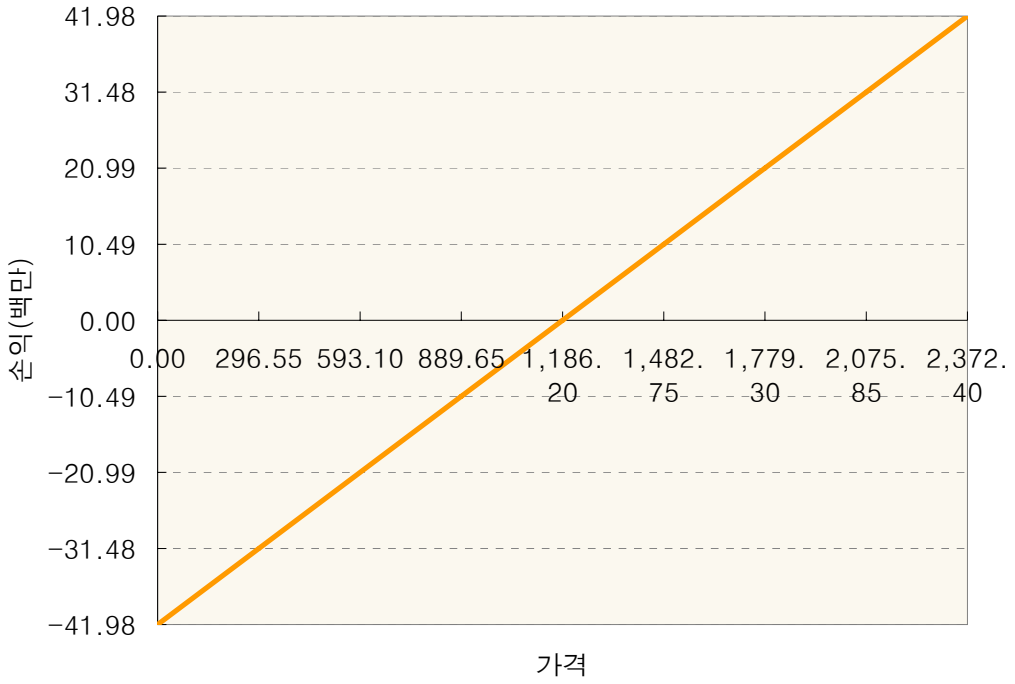

LXF5-LME ZINC FUTURE JAN15



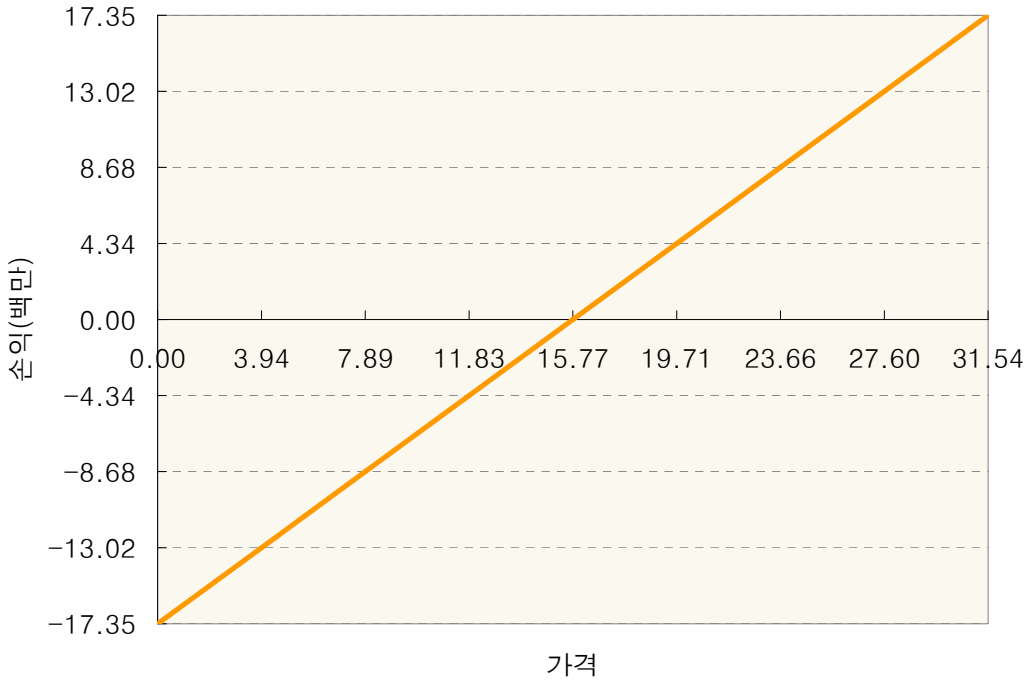

LXH5-LME ZINC FUTURE MAR15



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 | 0.1 |
| 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 | 2015-01-06 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-01-05 |

# 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

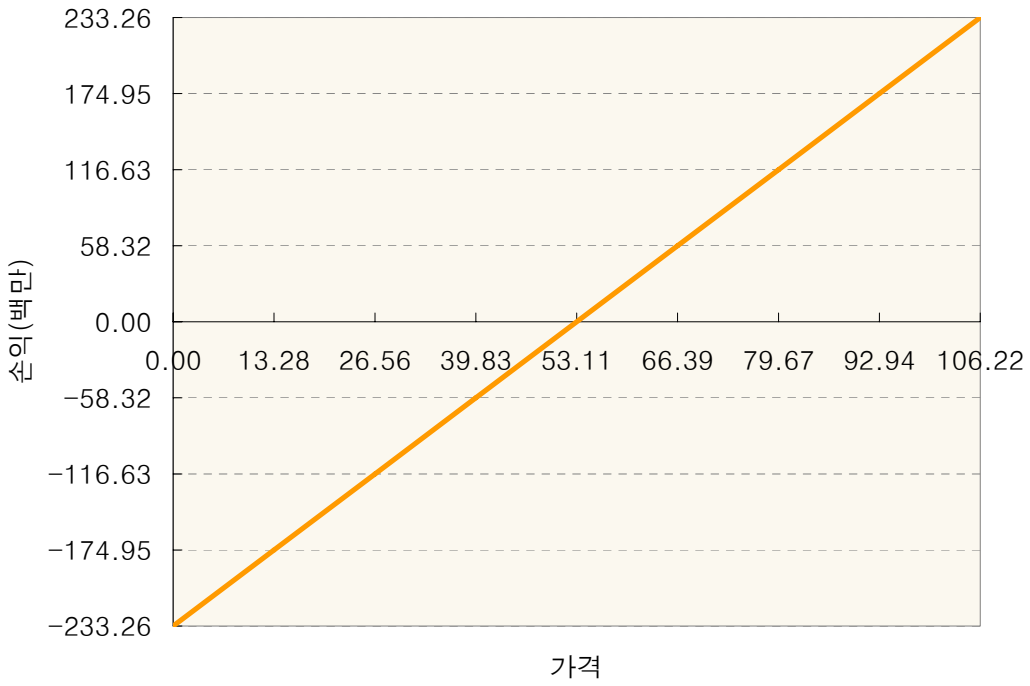
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

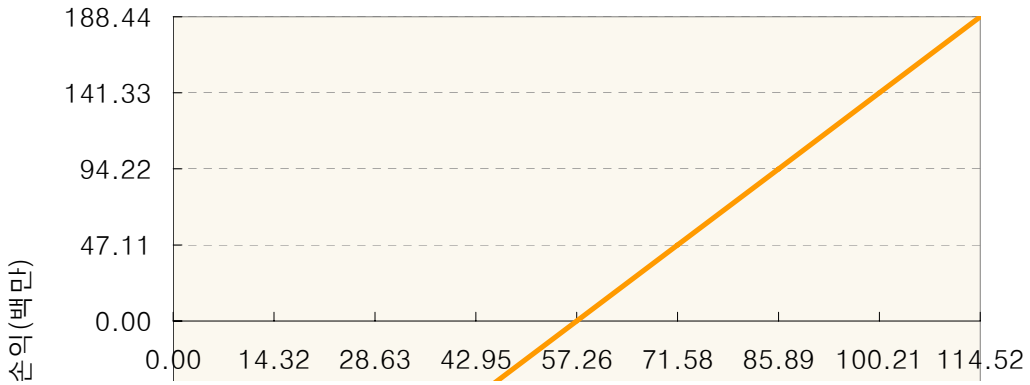
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 선물 | 유가증권 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 선물 | 유가증권 | 233 | 0 | 233 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 702 | 0 | 702 | |

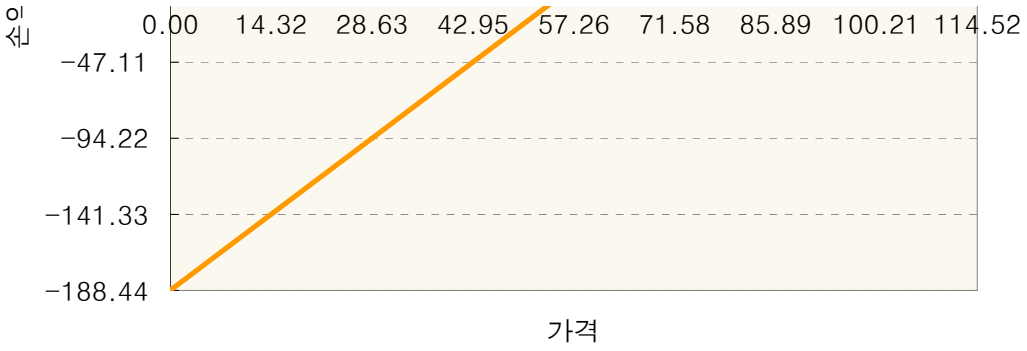
## 2. 만기시점의 손익구조

CLH5-WTI CRUDE FUTURE Mar15

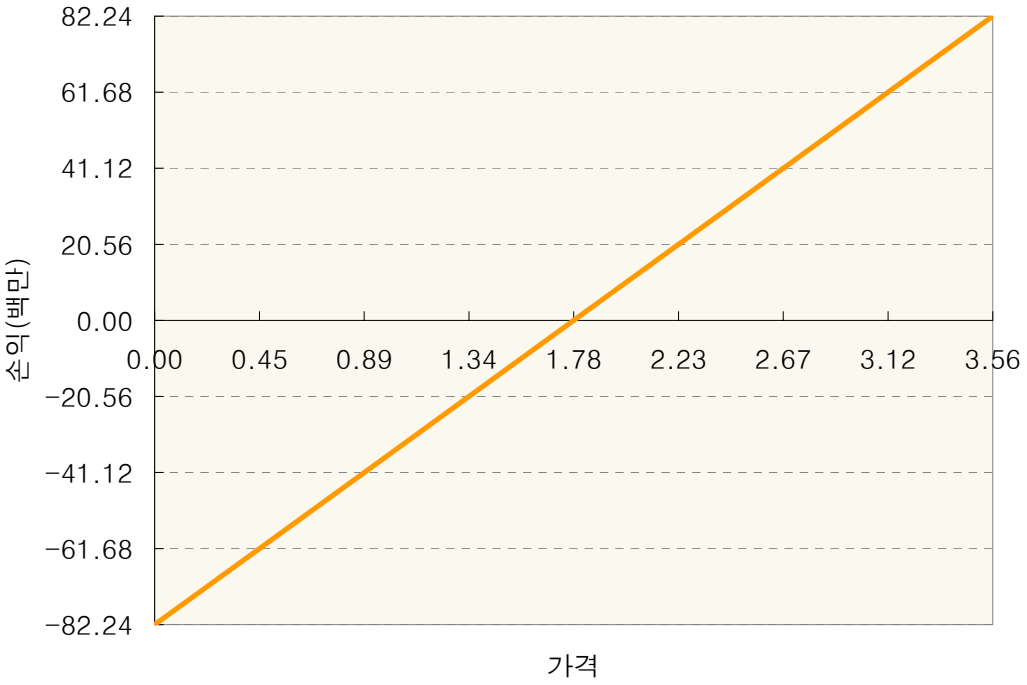



COH5-BRENT CRUDE FUTR Mar15

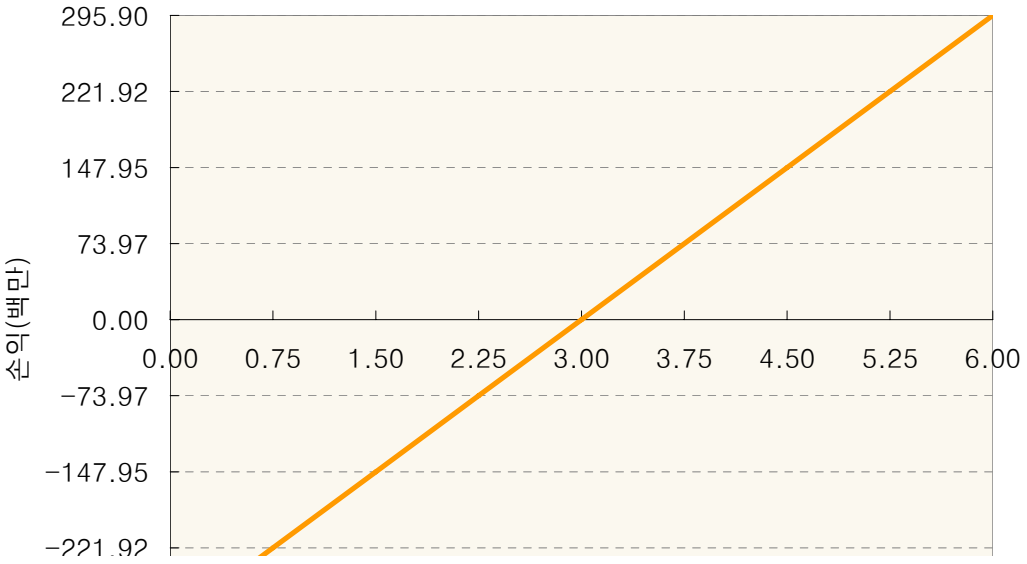


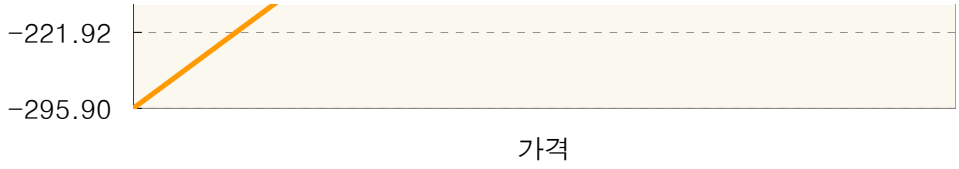



HOH5-NY Harb ULSD Fut Mar15

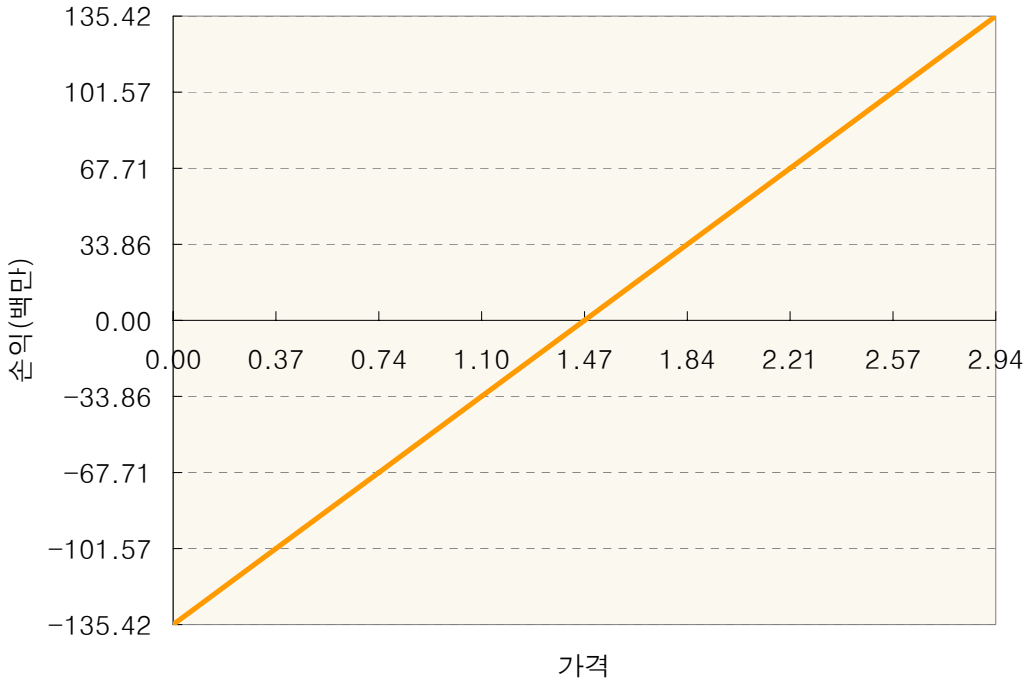



NGH5-NATURAL GAS FUTR Mar15






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 | 24 |
| XBH5 | GASOLINE RBOB FUT Mar15 | 11 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 132 |

| 공시일 | 2015-01-06 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-01-05 |

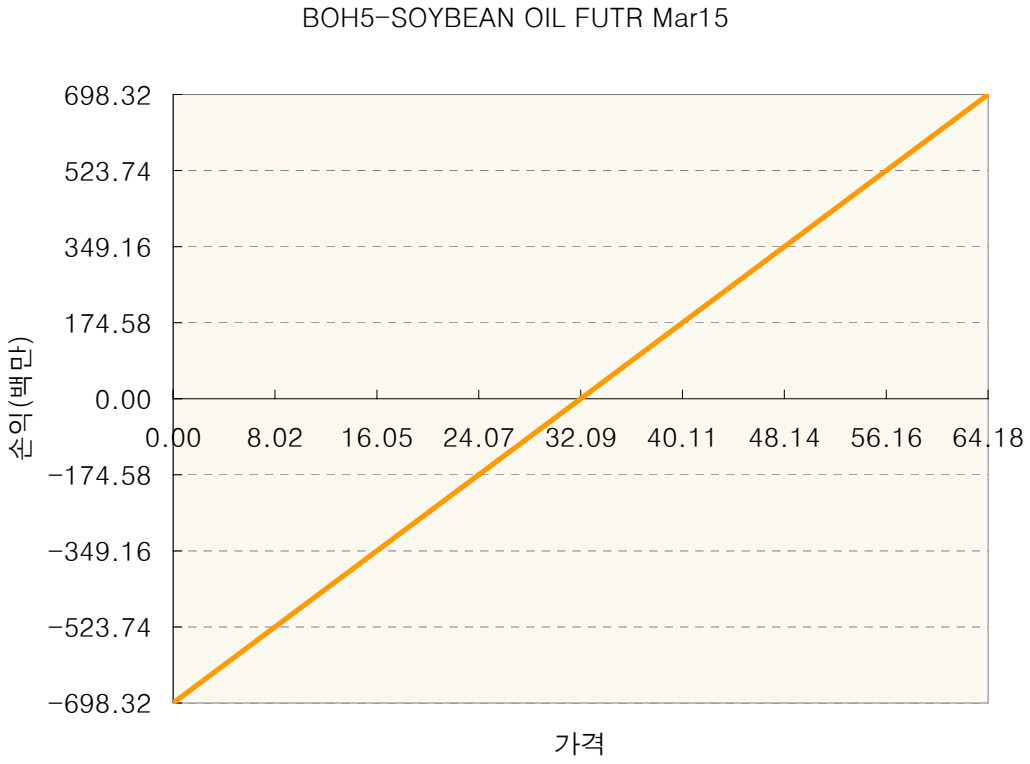
# 애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

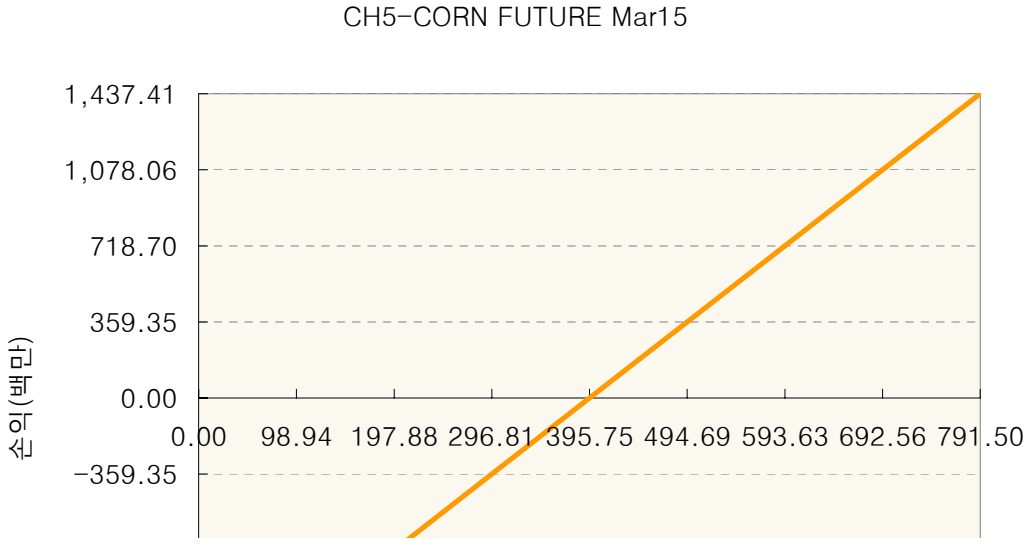
## 1. 계약금액

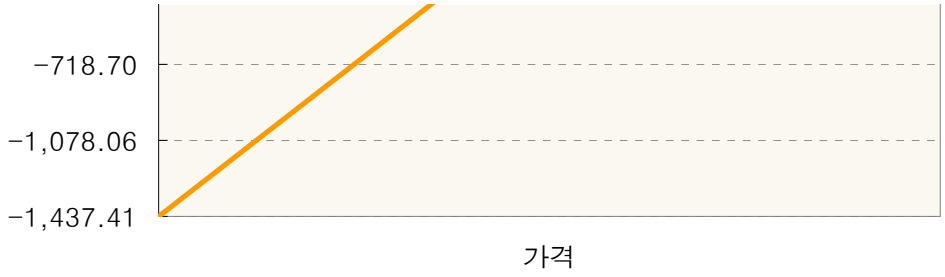
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 7,843 | 0 | 7,843 | |

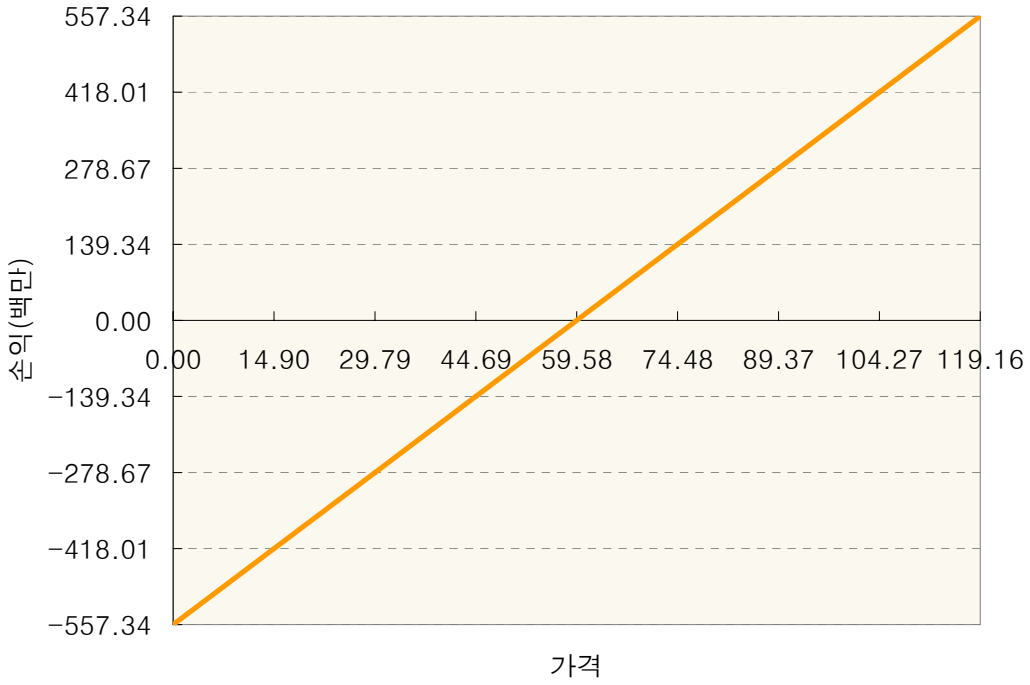
## 2. 만기시점의 손익구조



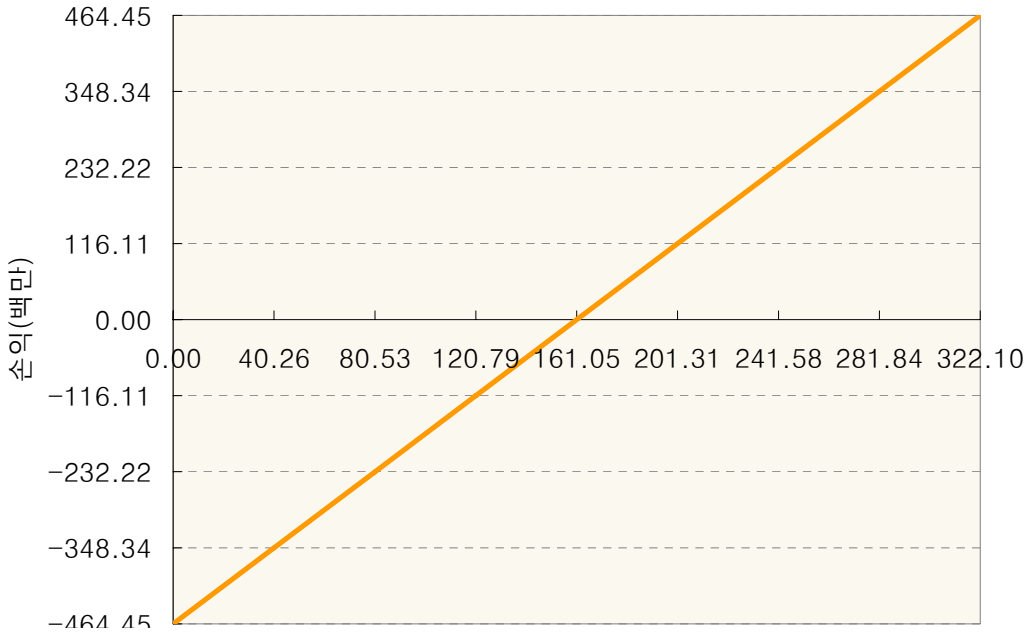



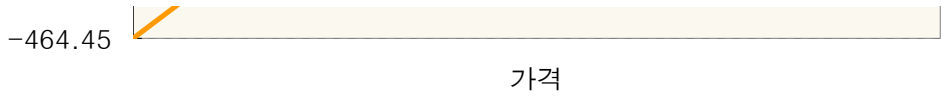



CTH5-COTTON NO.2 FUTR Mar15

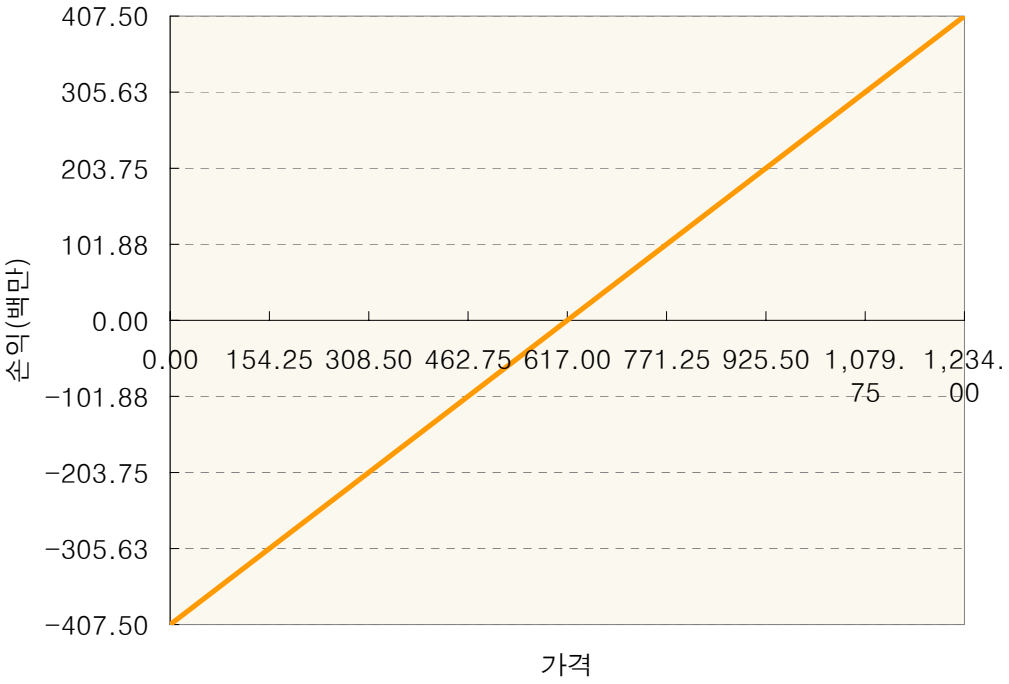



KCH5-COFFEE "C" FUTURE Mar15

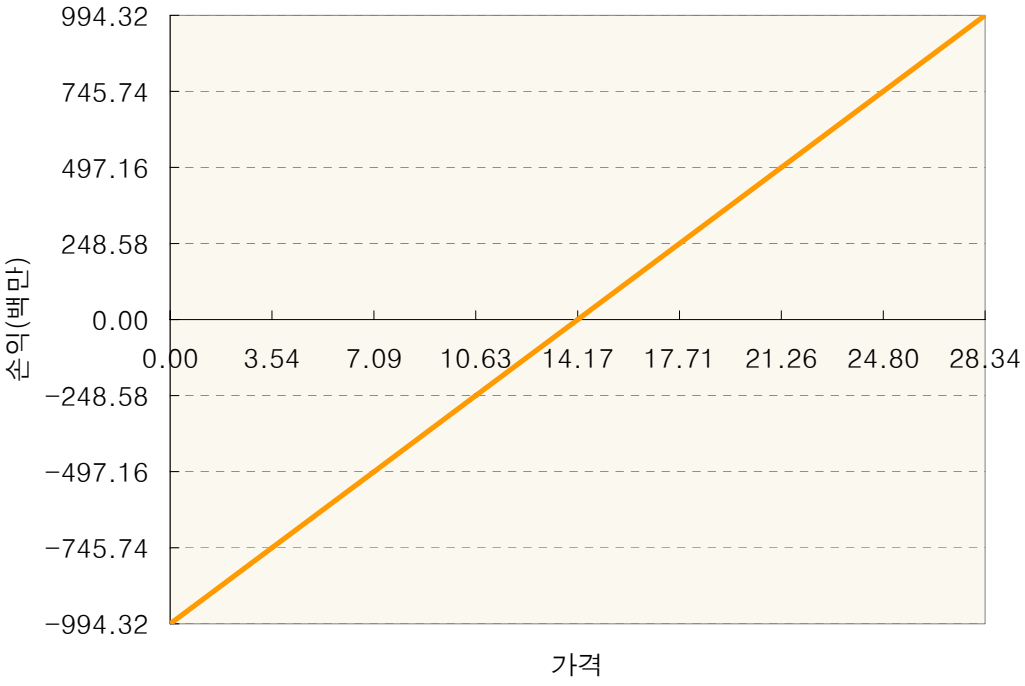




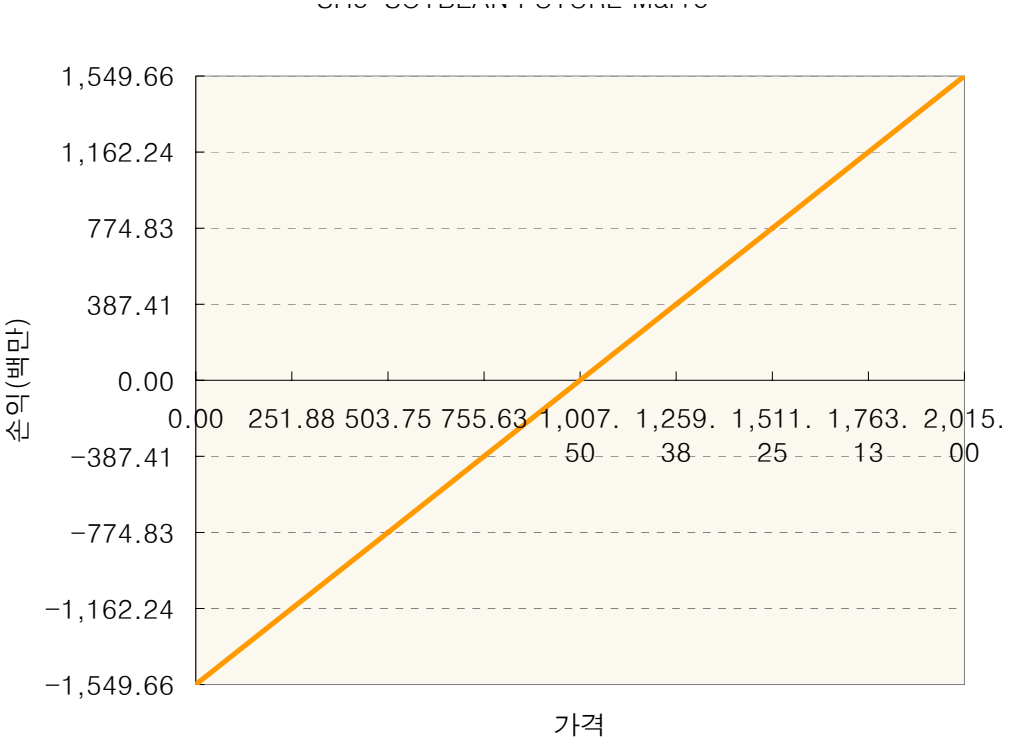

KWH5-WHEAT FUTURE(KCB) Mar15



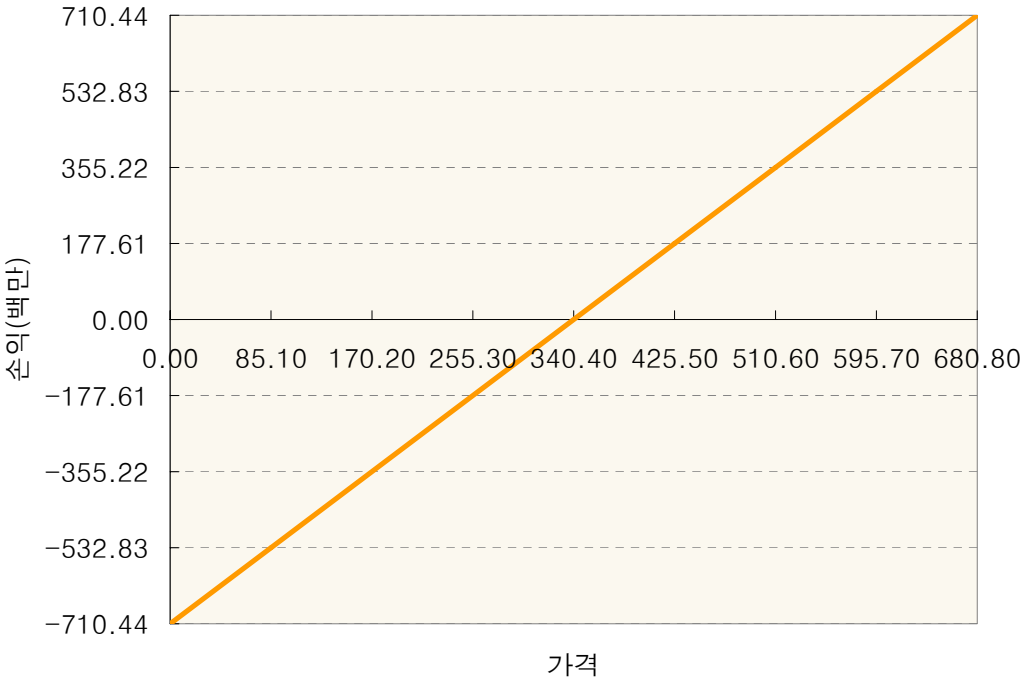

SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar15




SH5-SOYBEAN FUTURE Mar15

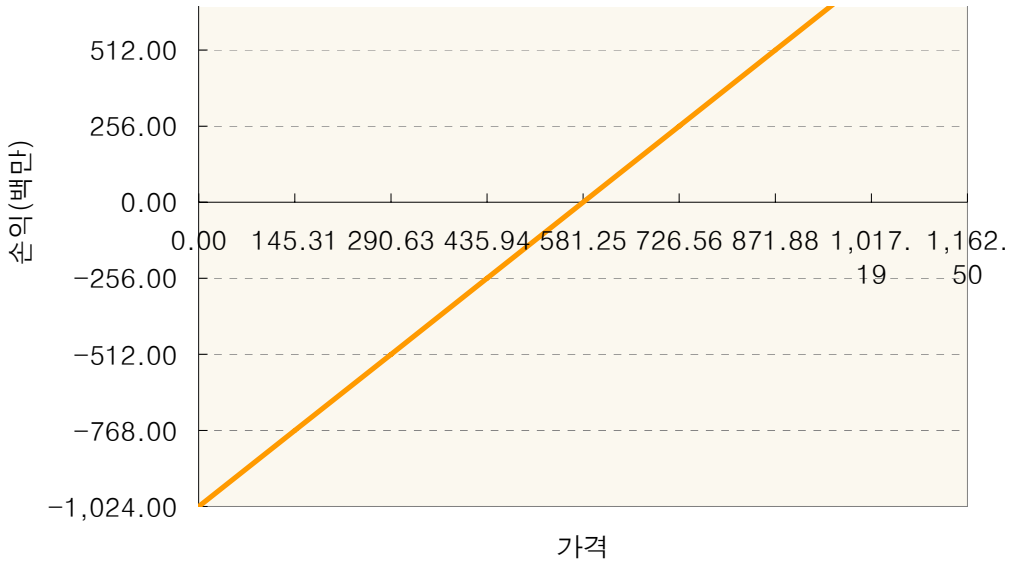



SMH5-SOYBEAN MEAL FUTR Mar15




WH5-WHEAT FUTURE(CBT) Mar15






### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| BOH5 | SOYBEAN OIL FUTR Mar15 | 56 |
| CH5 | CORN FUTURE Mar15 | 115 |
| CTH5 | COTTON NO.2 FUTR Mar15 | 45 |
| KCH5 | COFFEE "C" FUTURE Mar15 | 37 |
| KWH5 | WHEAT FUTURE(KCB) Mar15 | 33 |
| SBH5 | Sugar #11 (WORLD) Mar15 | 80 |
| SH5 | SOYBEAN FUTURE Mar15 | 124 |
| SMH5 | SOYBEAN MEAL FUTR Mar15 | 57 |
| WH5 | WHEAT FUTURE(CBT) Mar15 | 82 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 958 |