공시일	2015-01-09
기준일	2015-01-08

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	2015-01-09
기준일	2015-01-08

차곡차곡플러스모(주식혼합-파생)

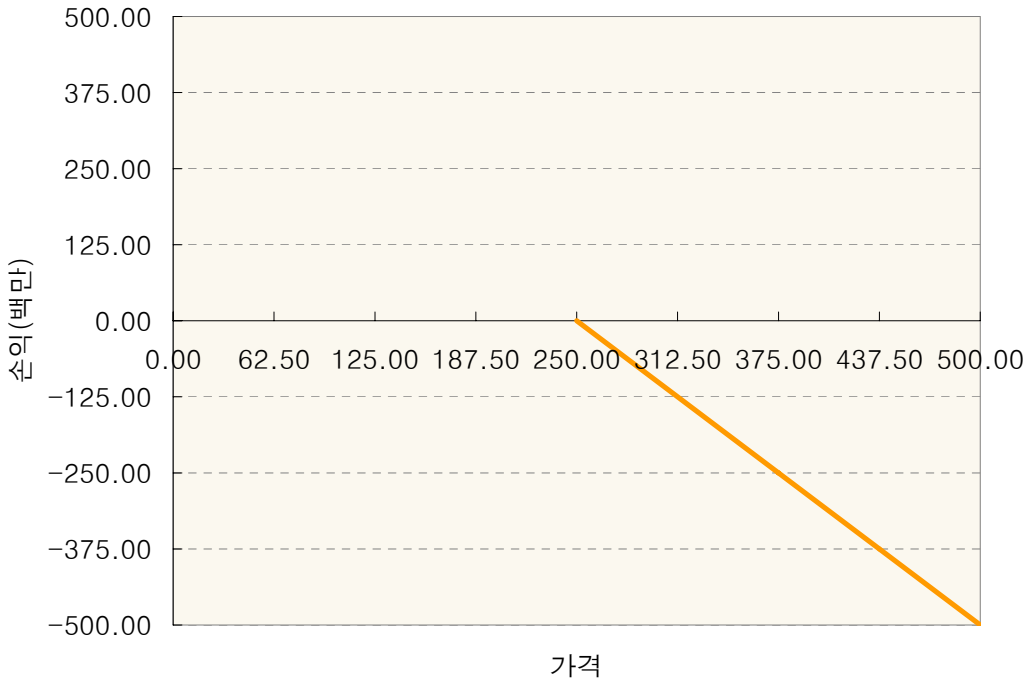
1. 계약금액

(단위:백만원)

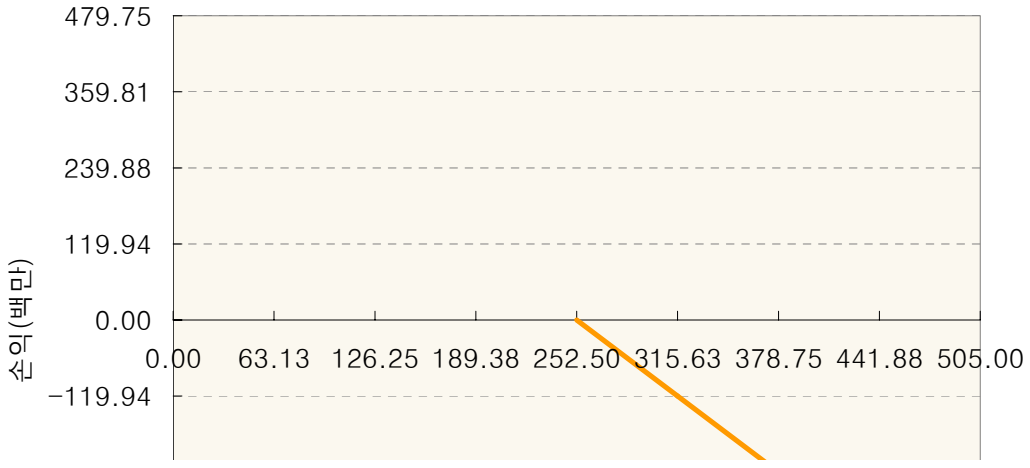
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	323	807	-484	장내
누계	유가증권	옵션	0	980	-980	장내

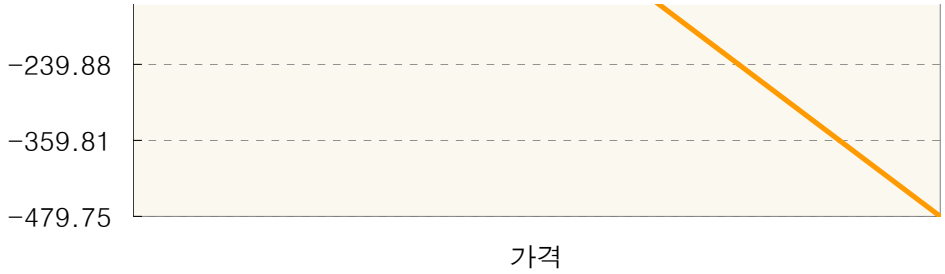
2. 만기시점의 손익구조

KR4201K22508-2015-02 콜250



KR4201K22524-2015-02 콜252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201K225 2015-02 콜250							129
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	18	18	18	18	18	17	17
-5.33%	18	18	17	17	16	15	14
-2.67%	16	15	14	13	11	9	7
0%	8	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	-16	-20	-23	-27	-30	-33	-37
5.33%	-61	-64	-66	-69	-72	-75	-78
8.00%	-120	-121	-122	-123	-125	-127	-129
KR4201K225 2015-02 콜252.5							109
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11	11	11	11	11	11	11
-5.33%	11	11	11	11	10	10	9
-2.67%	11	10	9	8	7	6	4
0%	6	4	2	0	-2	-5	-7
2.67%	-10	-13	-17	-20	-23	-26	-29
5.33%	-46	-48	-51	-54	-57	-60	-64
8.00%	-97	-99	-100	-102	-104	-106	-109

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

(단위:백만원)

216

공시일	2015-01-09
기준일	2015-01-08

스마트인덱스모

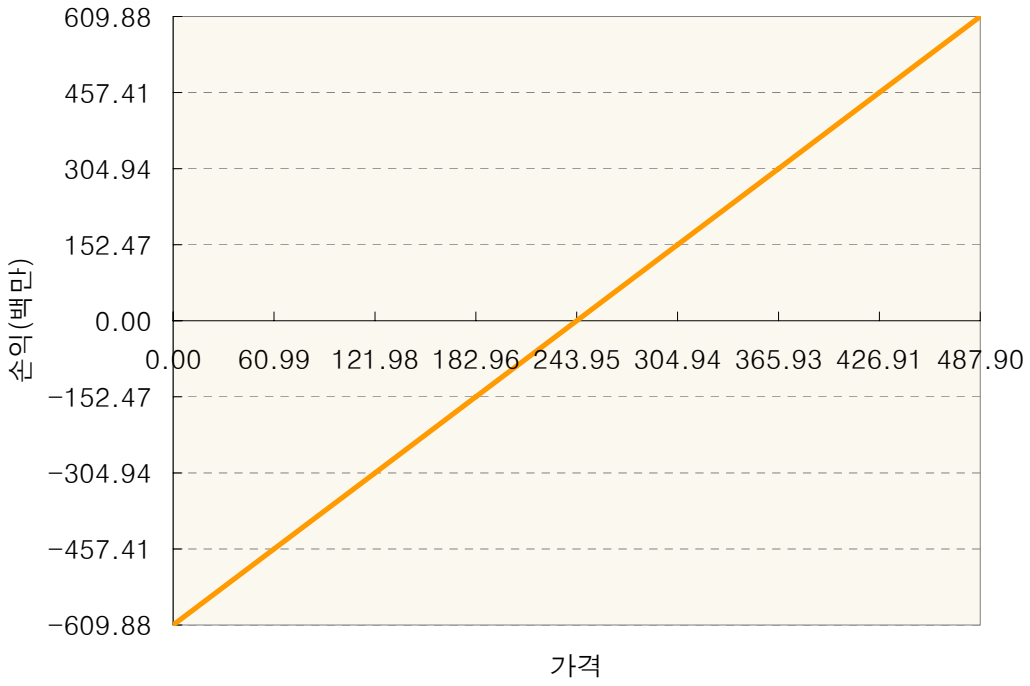
1. 계약금액

(단위:백만원)

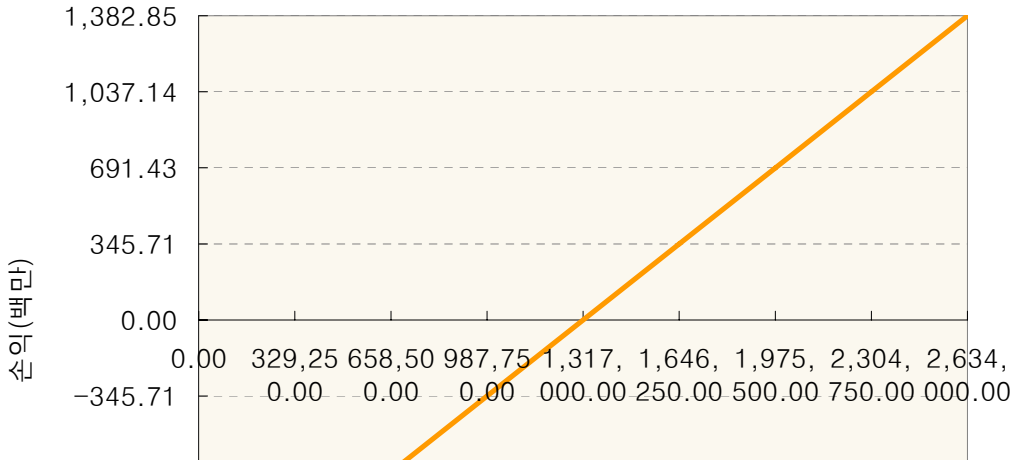
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,993	0	1,993	장내

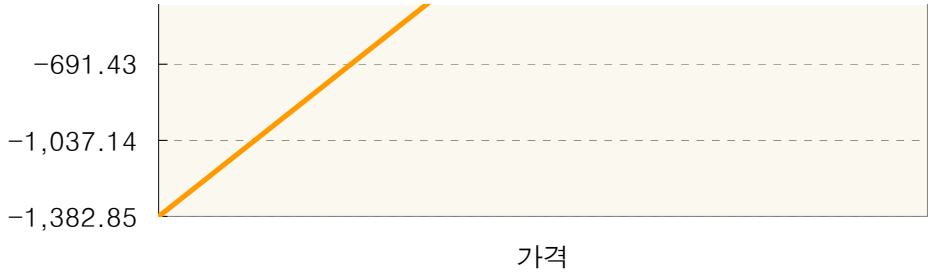
2. 만기시점의 손익구조

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							110
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-110	-110	-110	-110	-110	-110	-110
-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%	110	110	110	110	110	110	110

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

(단위:백만원)

141

공시일	2015-01-09
기준일	2015-01-08

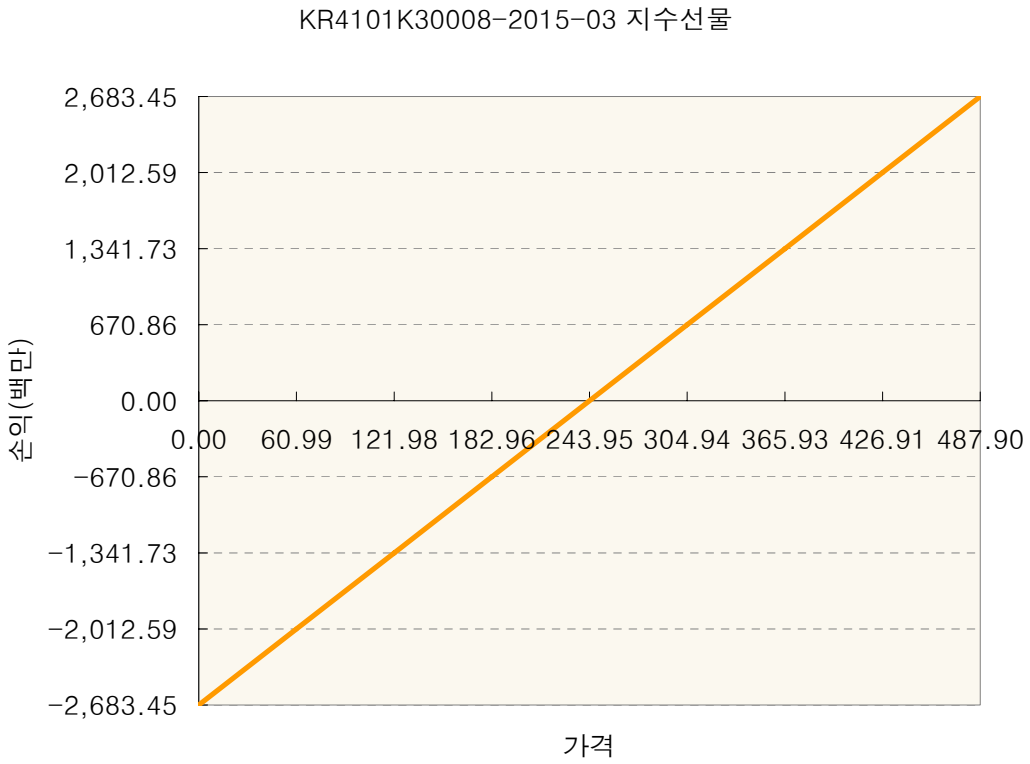
스마트레버리지목표전환형1호

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	2,683	0	2,683	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)

139

공시일	2015-01-09
기준일	2015-01-08

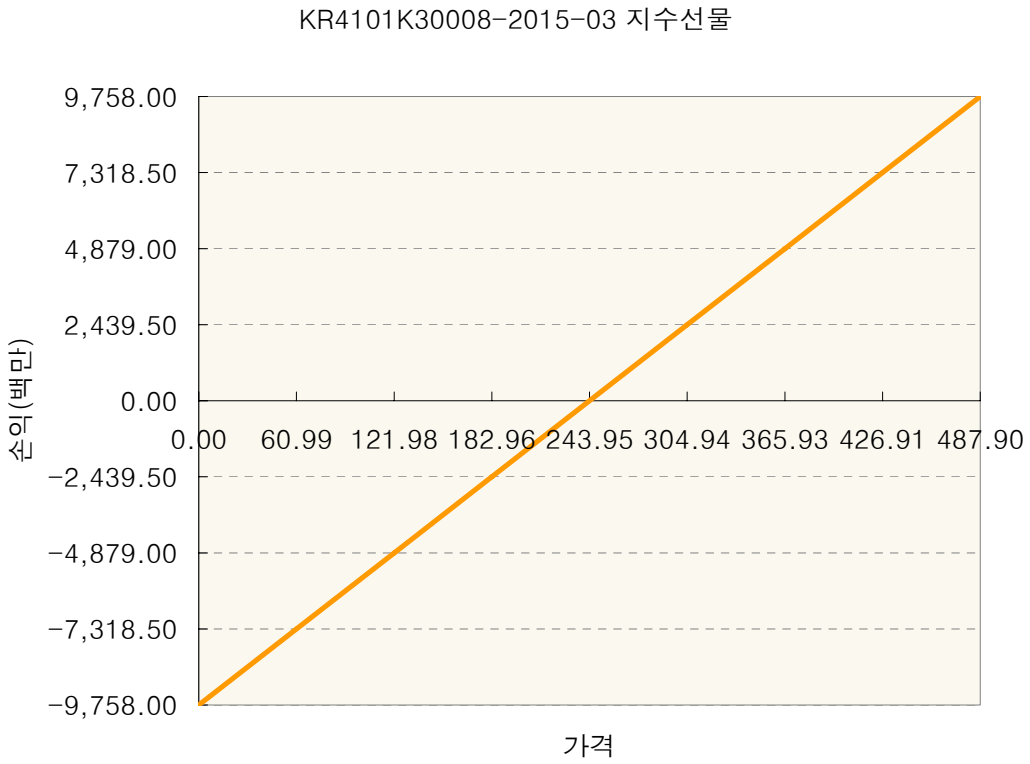
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	9,758	0	9,758	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101K300 2015-03 지수선물							781
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-781	-781	-781	-781	-781	-781	-781
-5.33%	-520	-520	-520	-520	-520	-520	-520
-2.67%	-260	-260	-260	-260	-260	-260	-260
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	260	260	260	260	260	260	260
5.33%	520	520	520	520	520	520	520
8.00%	781	781	781	781	781	781	781

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

507

공시일	2015-01-09
기준일	2015-01-08

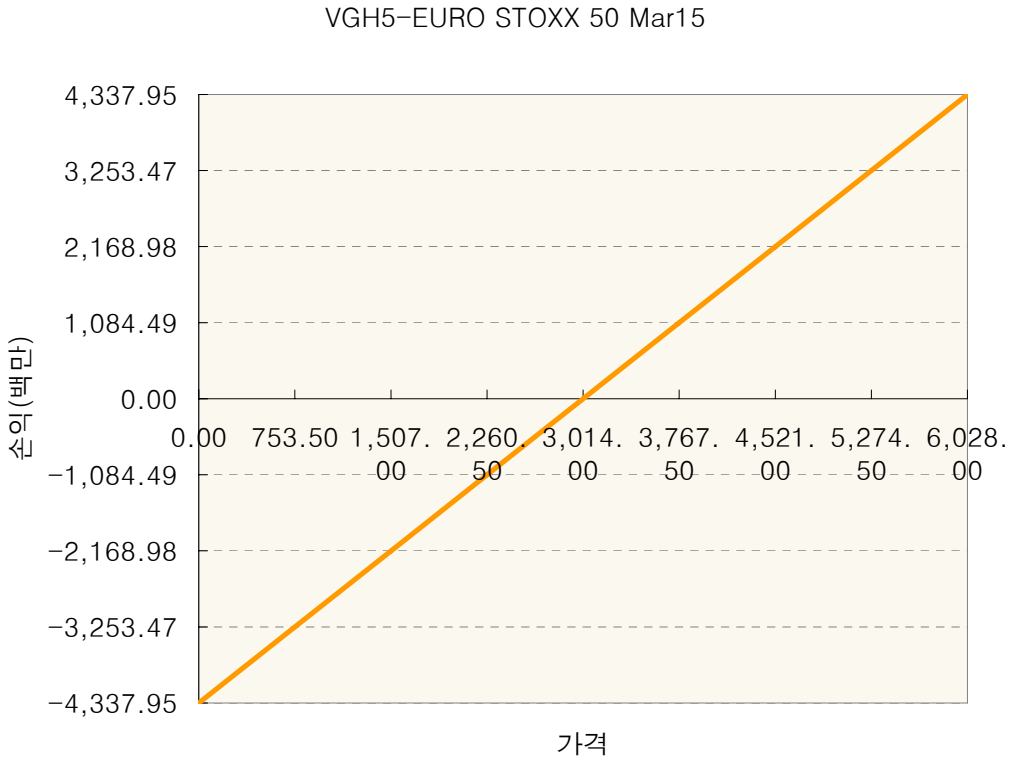
유로인덱스1호(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,338	0	4,338	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH5	EURO STOXX 50 Mar15	347

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

(단위:백만원)

282

공시일	2015-01-09
기준일	2015-01-08

아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

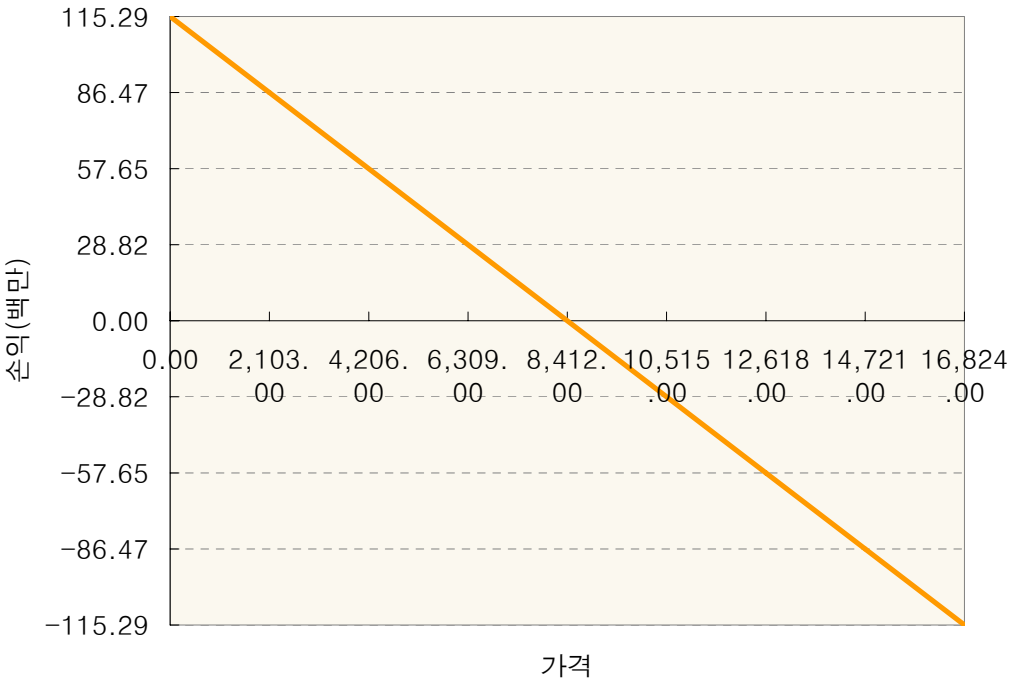
1. 계약금액

(단위:백만원)

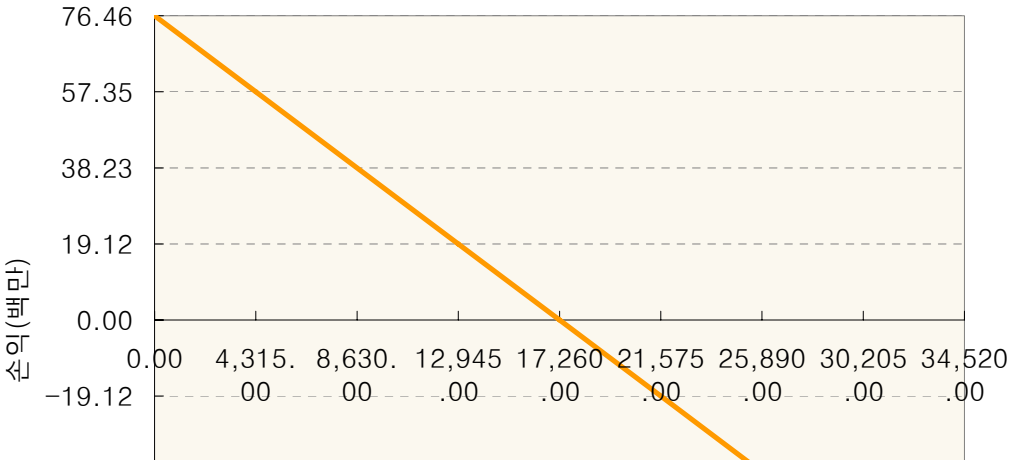
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	0	228	-228	

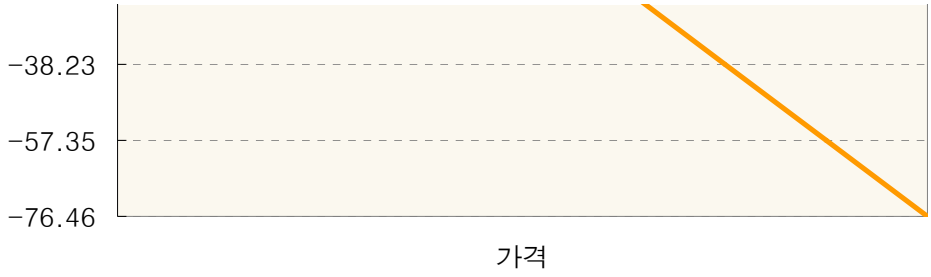
2. 만기시점의 손익구조

JYH5-JPN YEN FUT MAR15

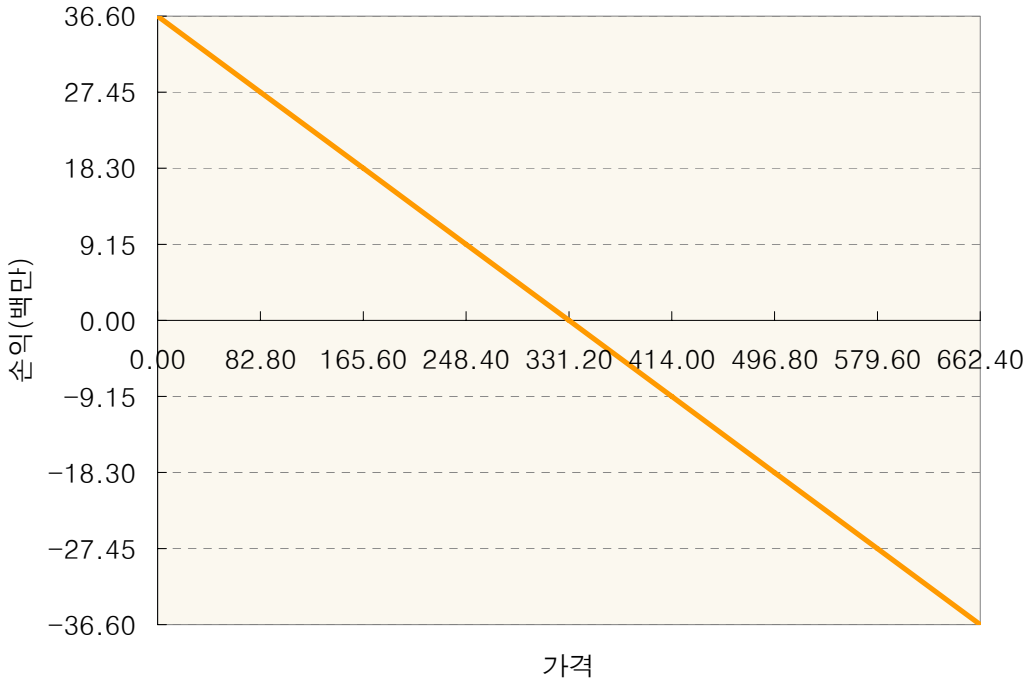


NIH5-NIKKEI 225 (SGX) Mar15





TWF5-MSCI TAIWAN INDEX Jan15



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

JYH5	JPN YEN FUT MAR15	9
NIH5	NIKKEI 225 (SGX) Mar15	6
TWF5	MSCI TAIWAN INDEX Jan15	3

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

11

공시일	2015-01-09
기준일	2015-01-08

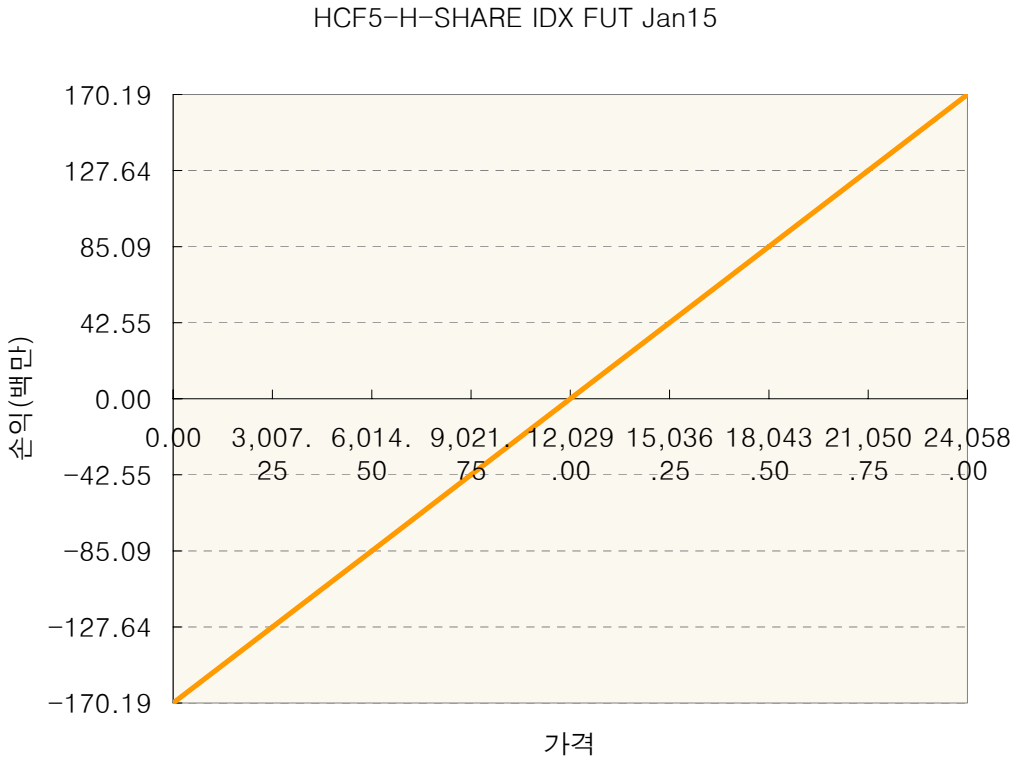
차이나인덱스(주식-파생형)(종)

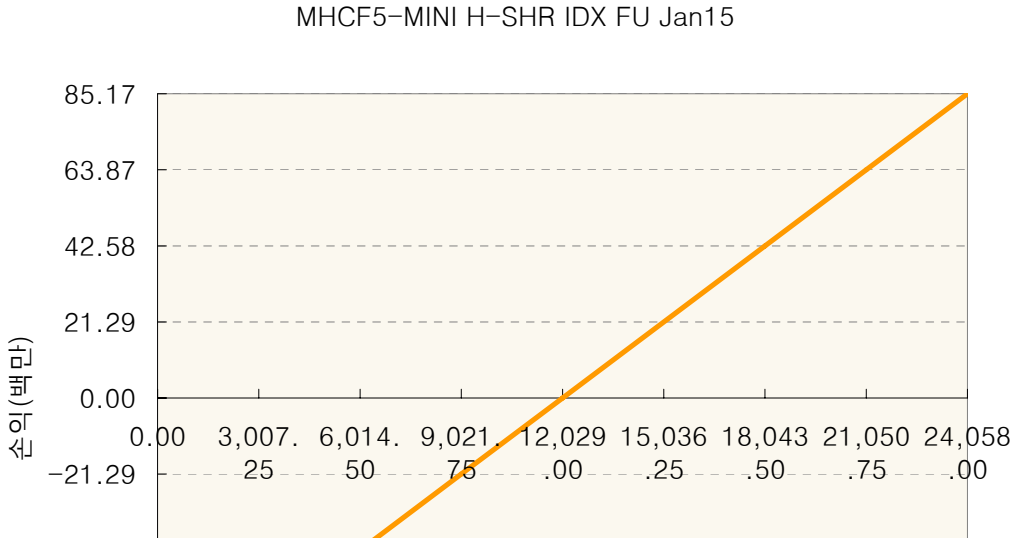
1. 계약금액

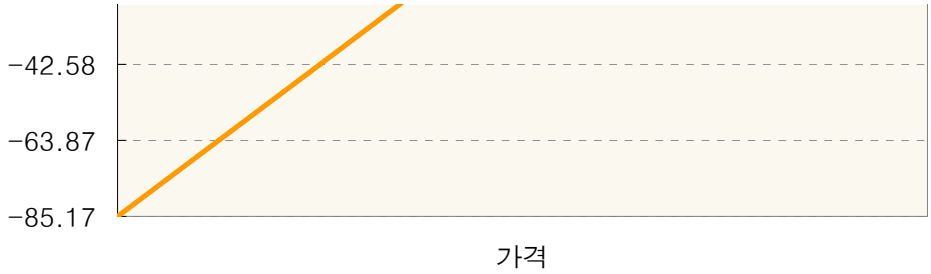
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	255	0	255	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF5	H-SHARE IDX FUT Jan15	14
MHCF5	MINI H-SHR IDX FU Jan15	7

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

(단위:백만원)

19

공시일	2015-01-09
기준일	2015-01-08

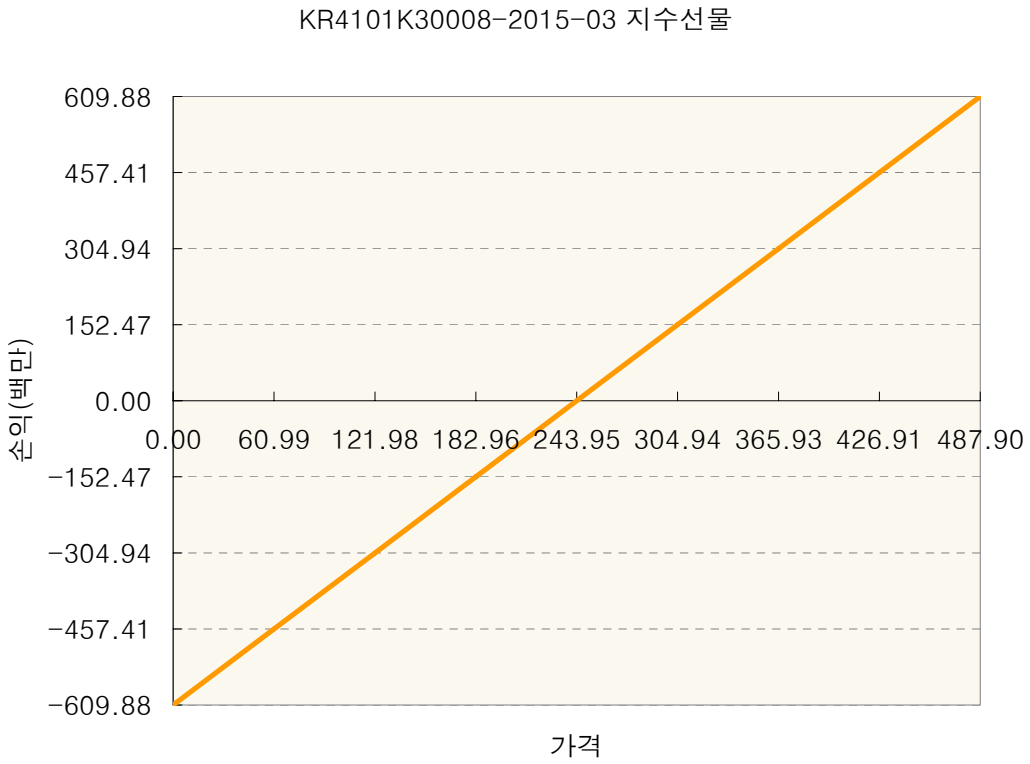
ETF스마트레버리지목표전환형제4

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	610	0	610	장내

2. 만기시점의 손익구조



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

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

32

공시일	2015-01-09
기준일	2015-01-08

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	2,386

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,337

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2015-01-09
기준일	2015-01-08

메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

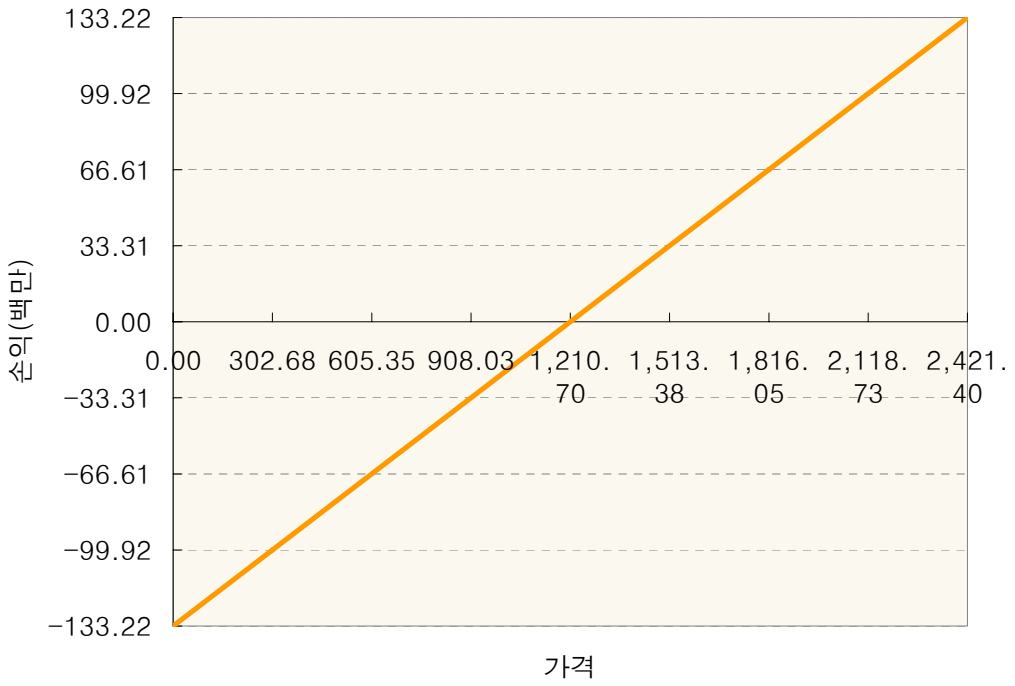
1. 계약금액

(단위:백만원)

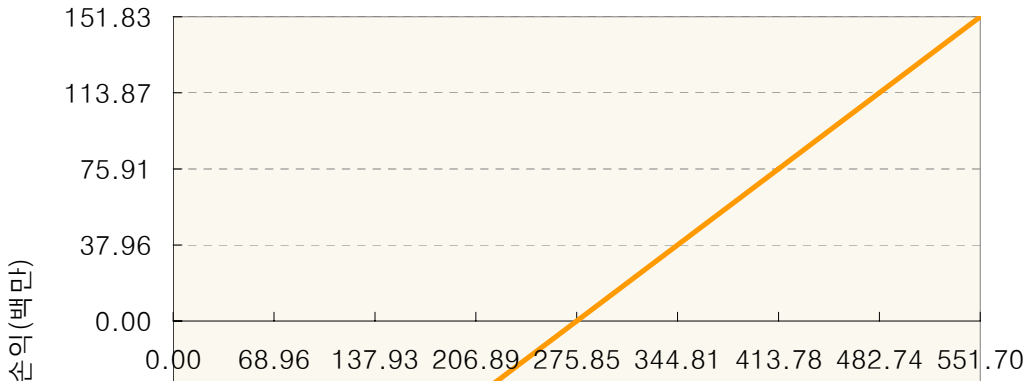
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	18	0	18	
누계	유가증권	선물	635	176	459	

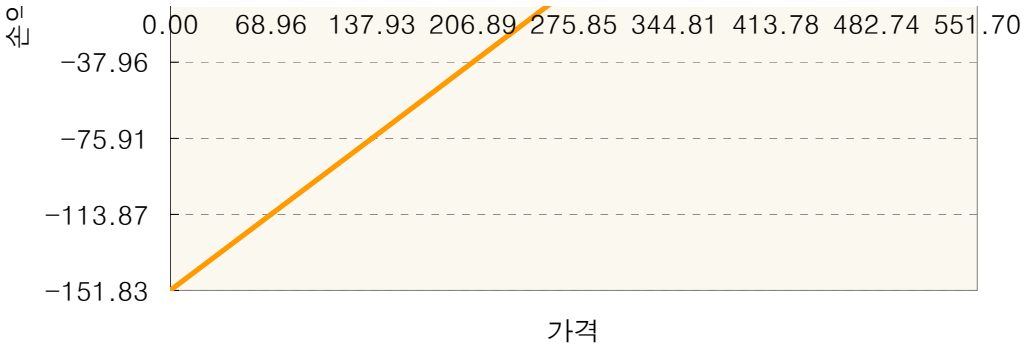
2. 만기시점의 손익구조

GCG5-GOLD 100 OZ FUTR Feb15

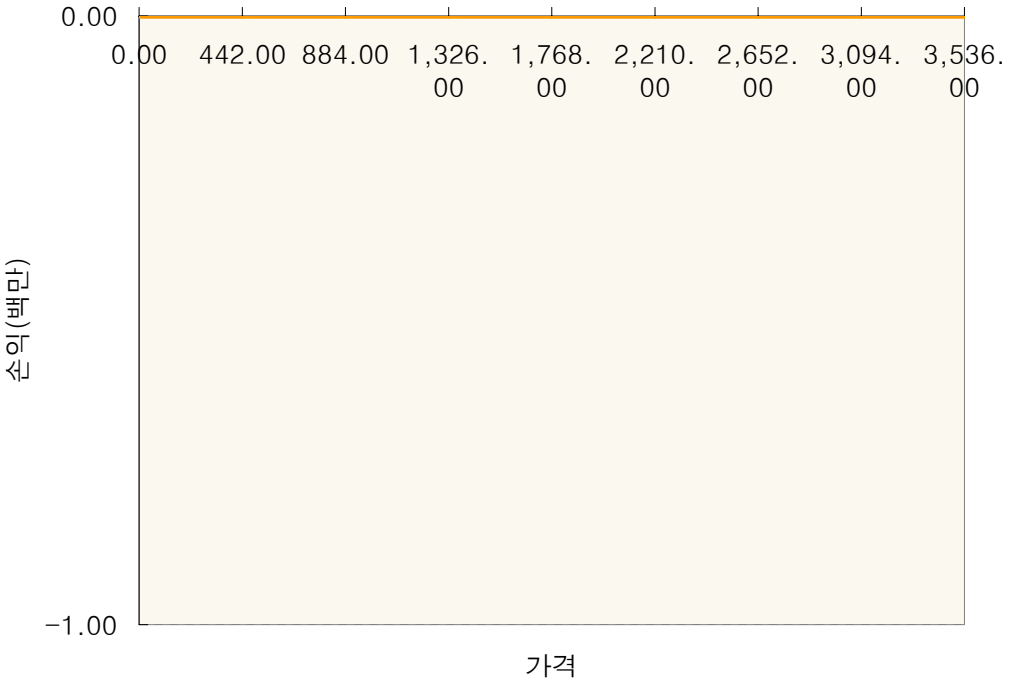


HGH5-COPPER FUTURE Mar15

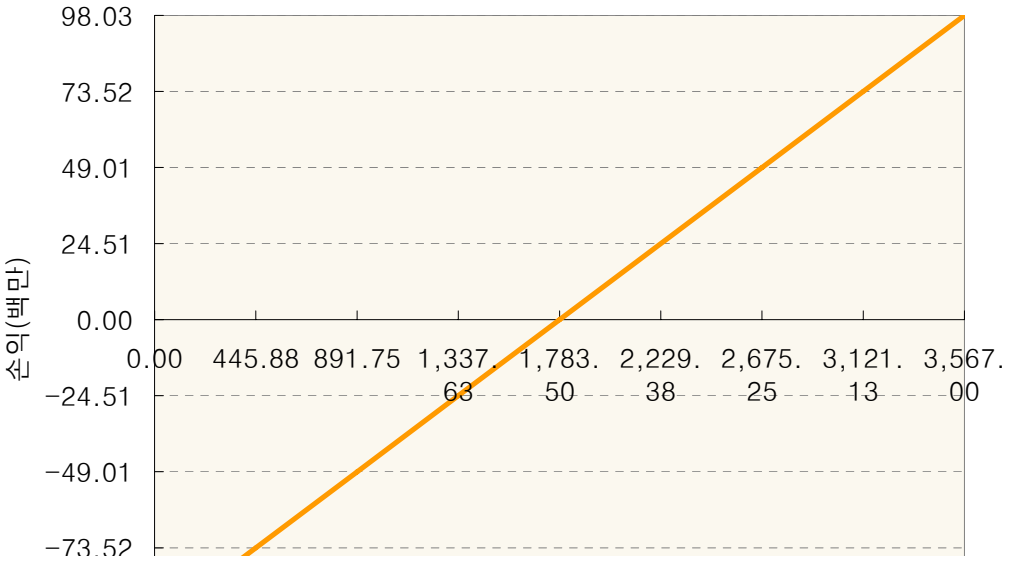


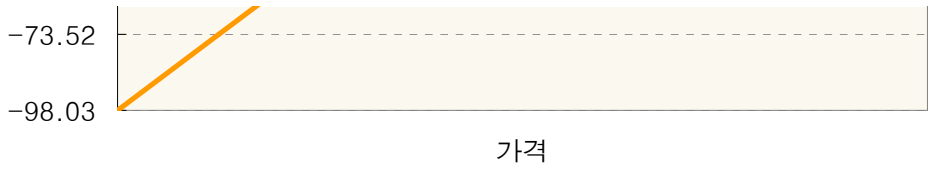


LAF5-LME PRI ALUM FUTR JAN 15

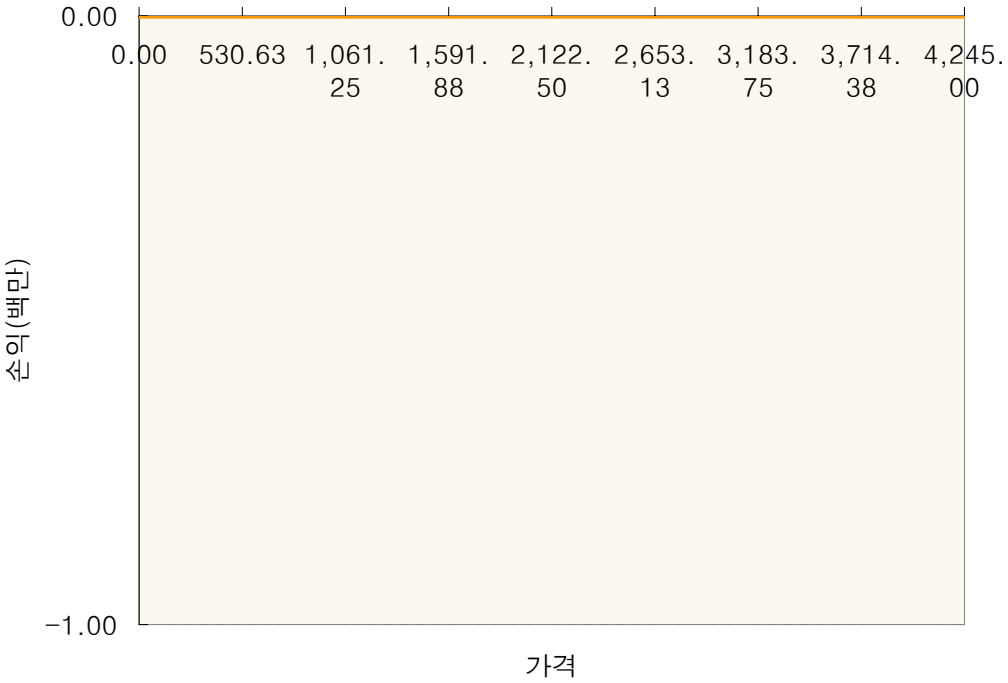


LAH5-LME PRI ALUM FUTR MAR 15

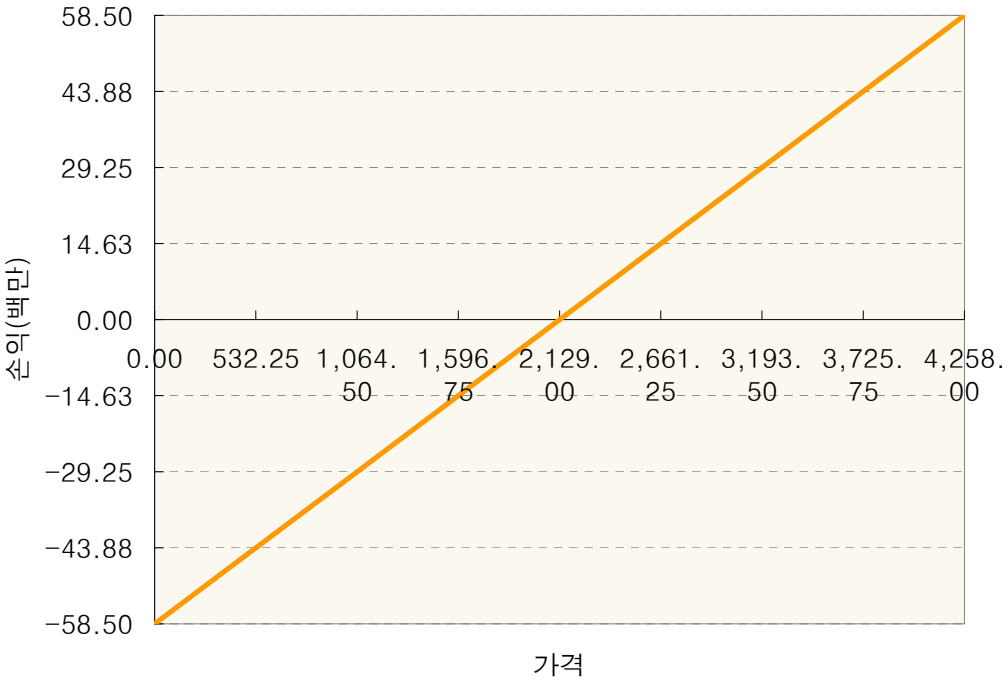




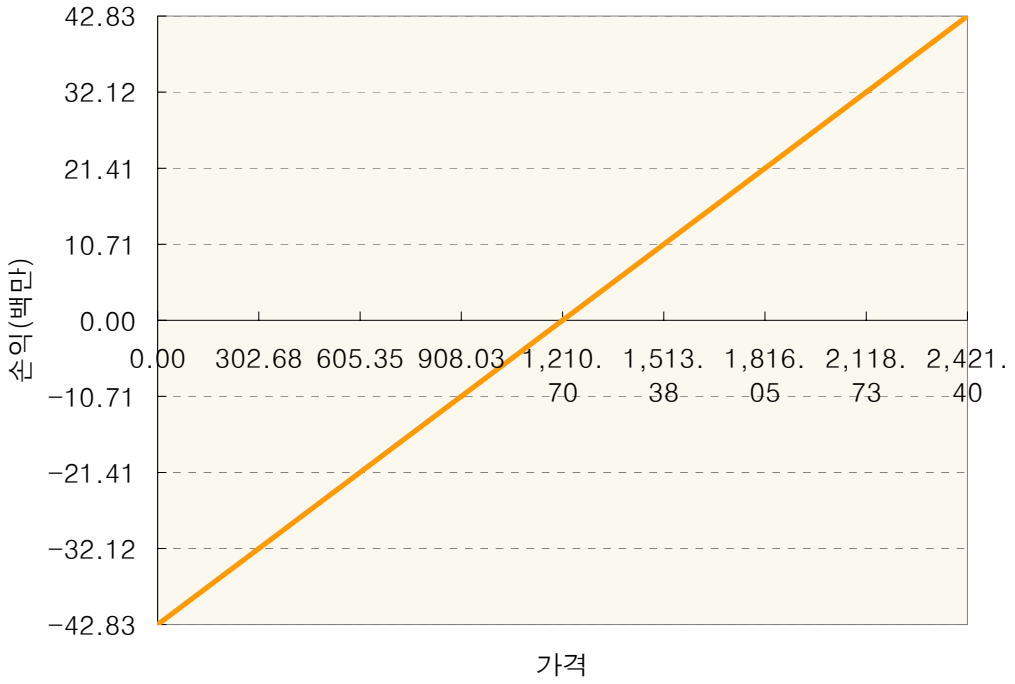
LXF5-LME ZINC FUTURE JAN15



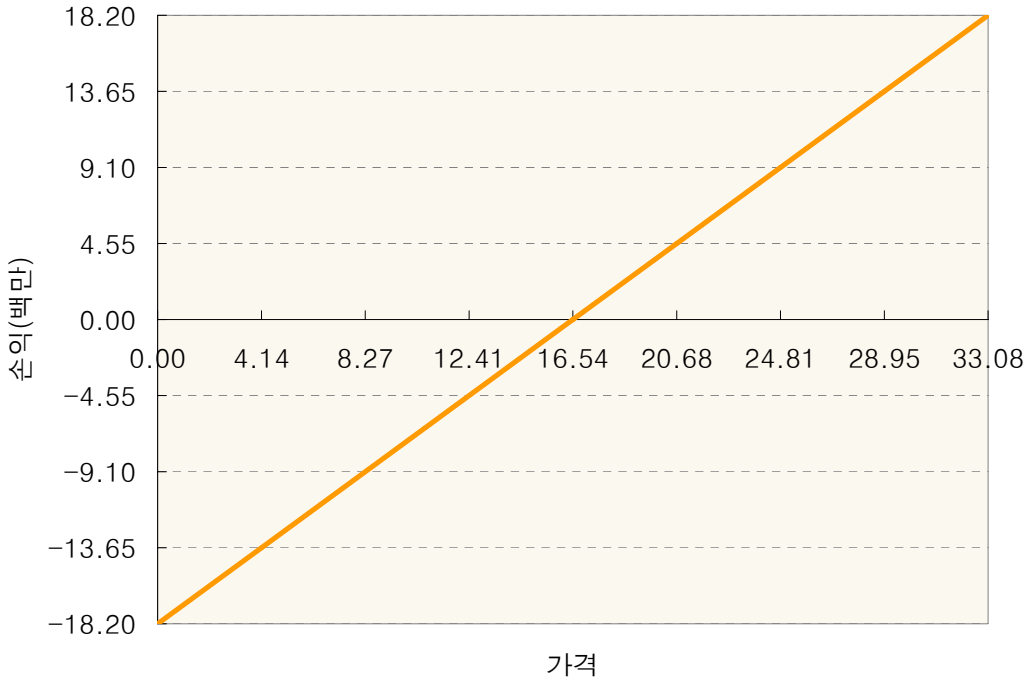
LXH5-LME ZINC FUTURE MAR15



XGG5-MINI GOLD FUTURE Feb15



YSH5-MINI SILVER FUT Mar15



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

GCG5	GOLD 100 OZ FUTR Feb15	11
HGH5	COPPER FUTURE Mar15	12

LAF5	LME PRI ALUM FUTR JAN 15	2
LAH5	LME PRI ALUM FUTR MAR 15	8
LXF5	LME ZINC FUTURE JAN15	0.4
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	2015-01-09
기준일	2015-01-08

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

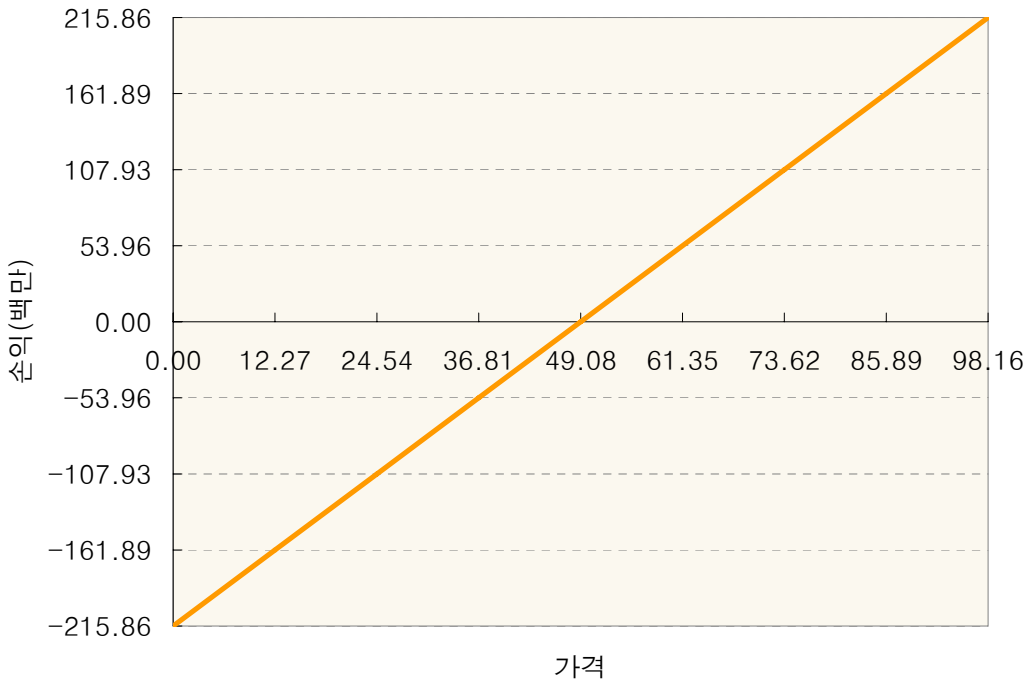
1. 계약금액

(단위:백만원)

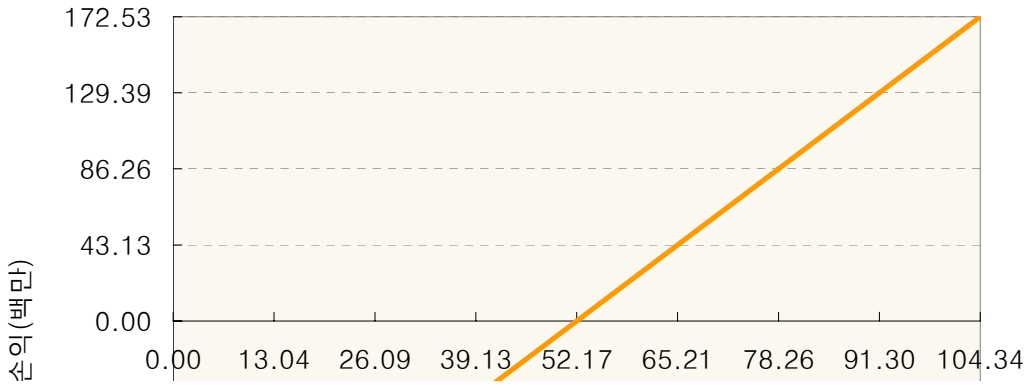
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	216	0	216	
누계	유가증권	선물	661	0	661	

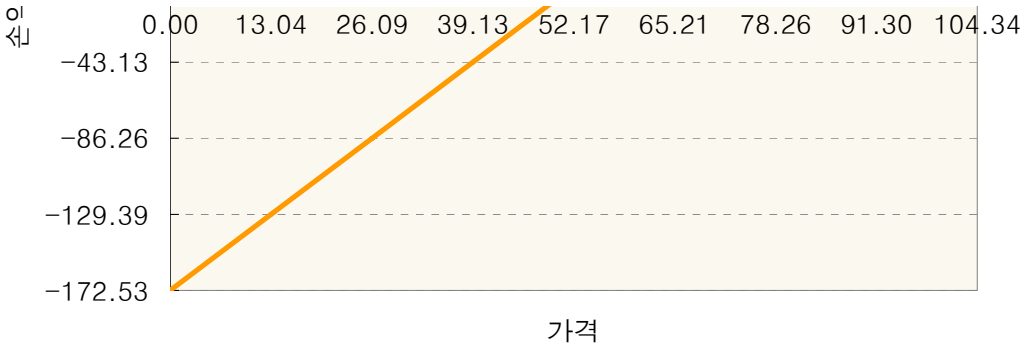
2. 만기시점의 손익구조

CLH5-WTI CRUDE FUTURE Mar15

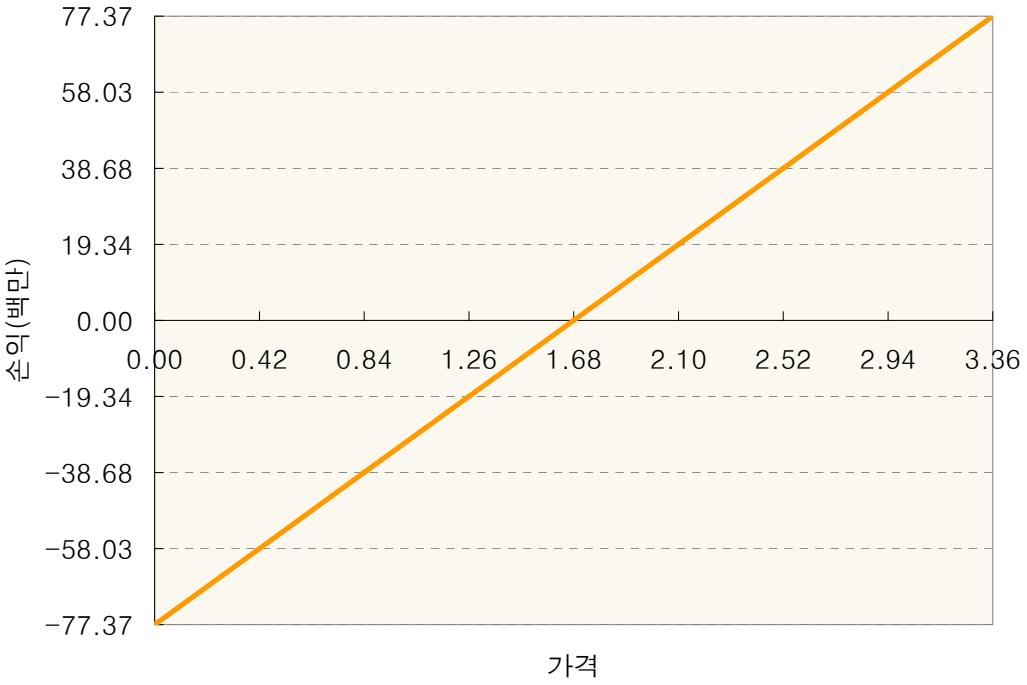


COH5-BRENT CRUDE FUTR Mar15

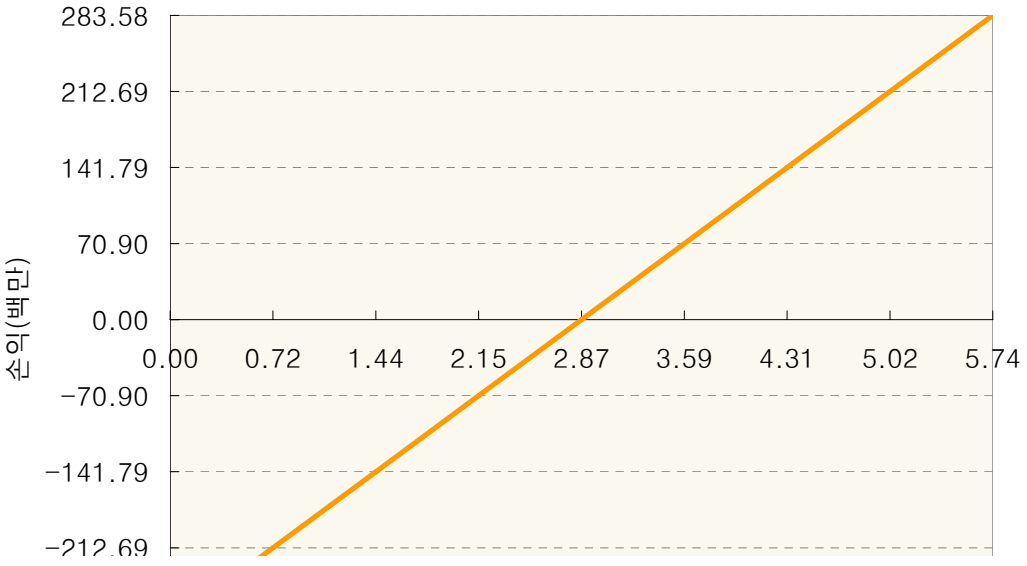


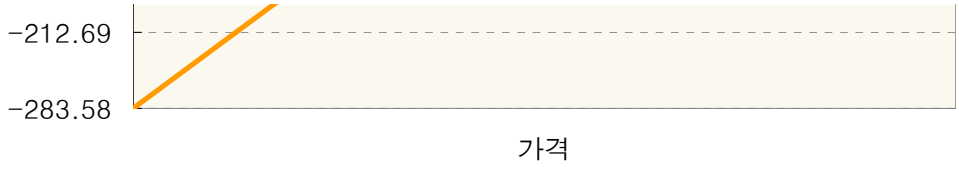


HOH5-NY Harb ULSD Fut Mar15

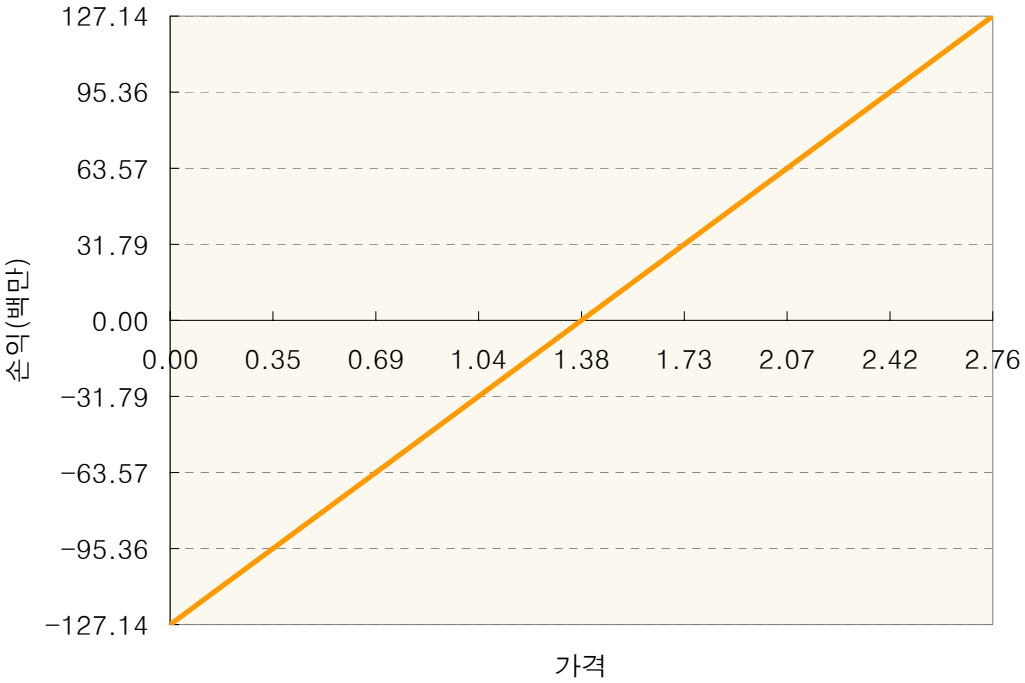


NGH5-NATURAL GAS FUTR Mar15





XBH5-GASOLINE RBOB FUT Mar15



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLH5	WTI CRUDE FUTURE Mar15	17
COH5	BRENT CRUDE FUTR Mar15	14
HOH5	NY Harb ULSD Fut Mar15	6
NGH5	NATURAL GAS FUTR Mar15	23
XBH5	GASOLINE RBOB FUT Mar15	10

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

(단위:백만원)

126

공시일	2015-01-09
기준일	2015-01-08

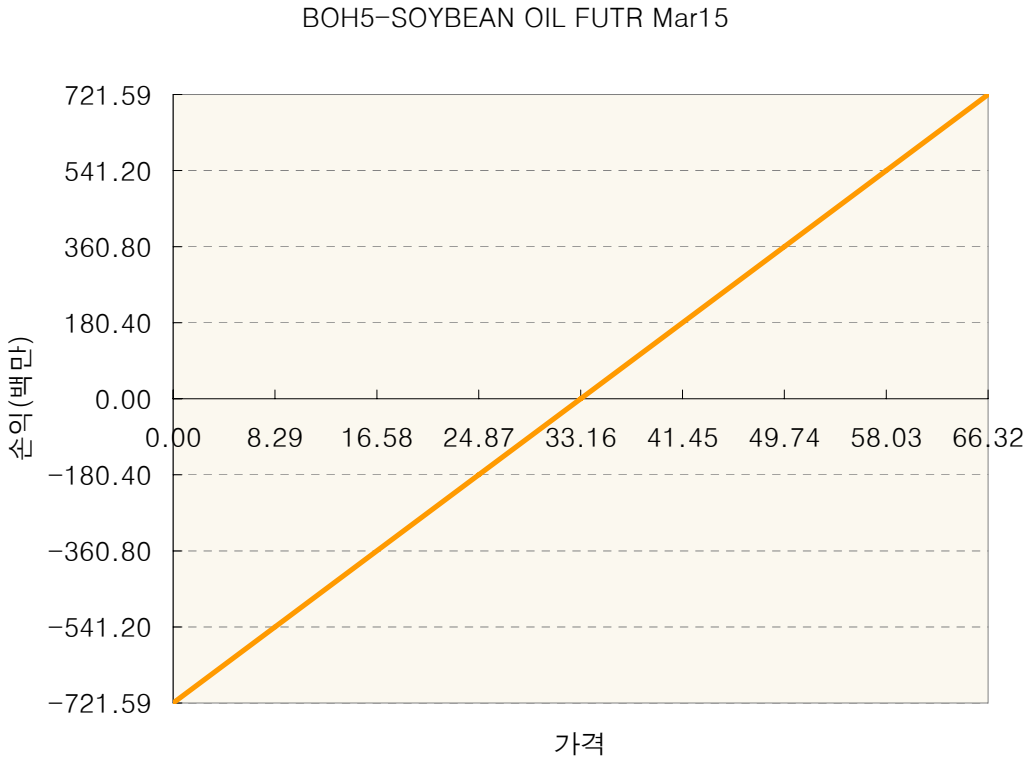
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

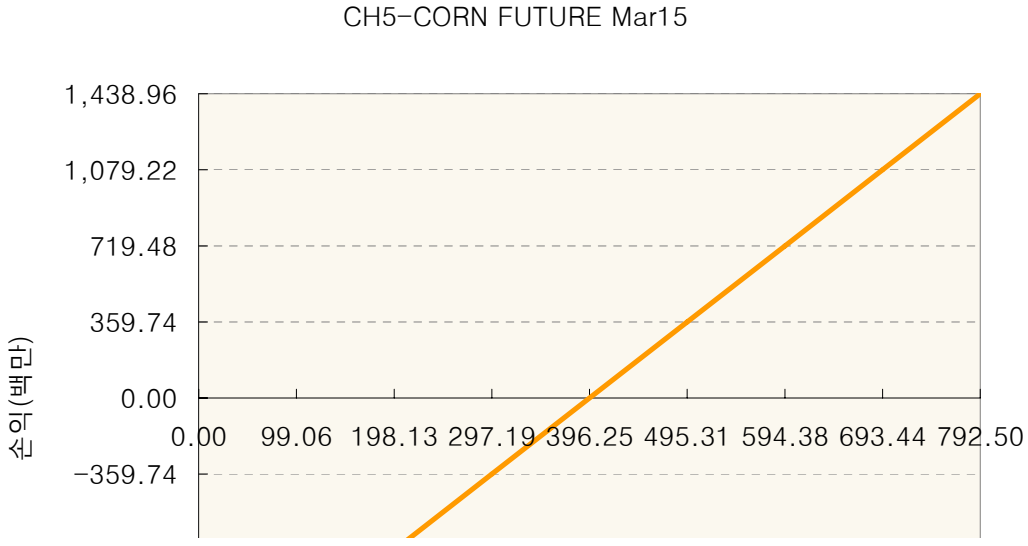
1. 계약금액

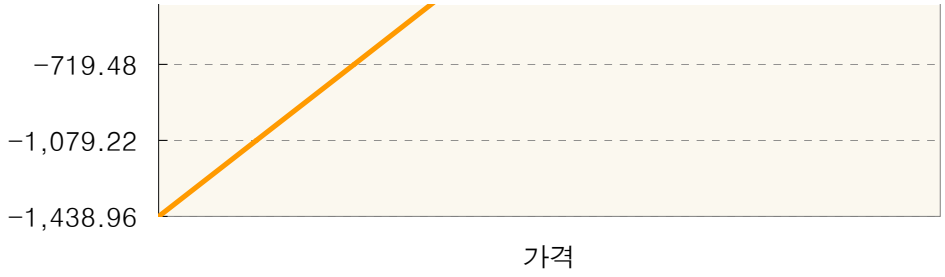
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,068	0	8,068	

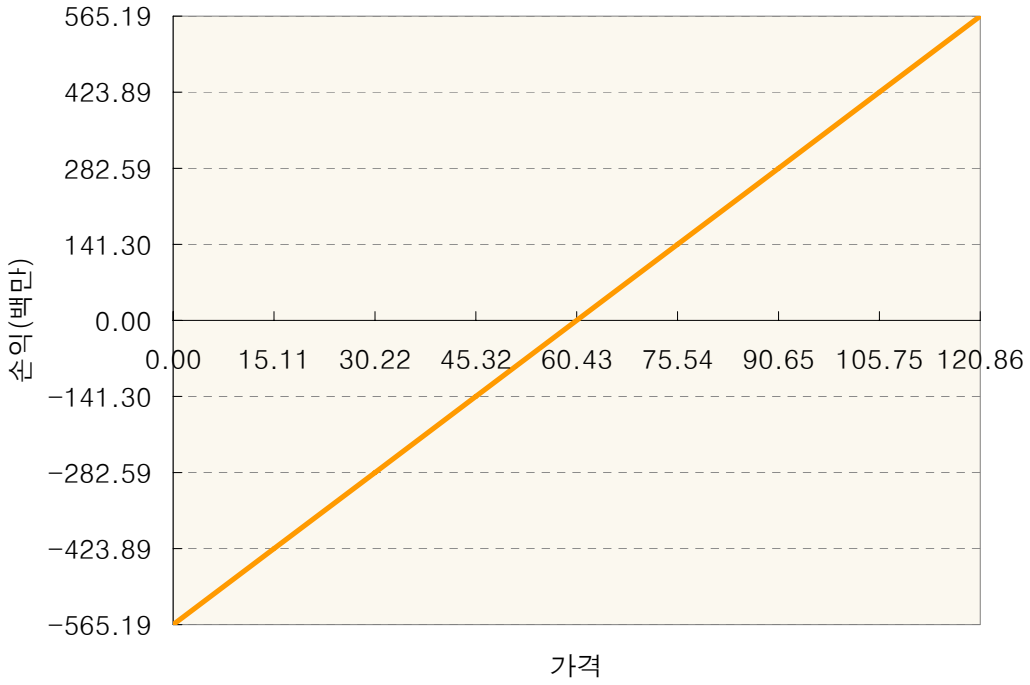
2. 만기시점의 손익구조



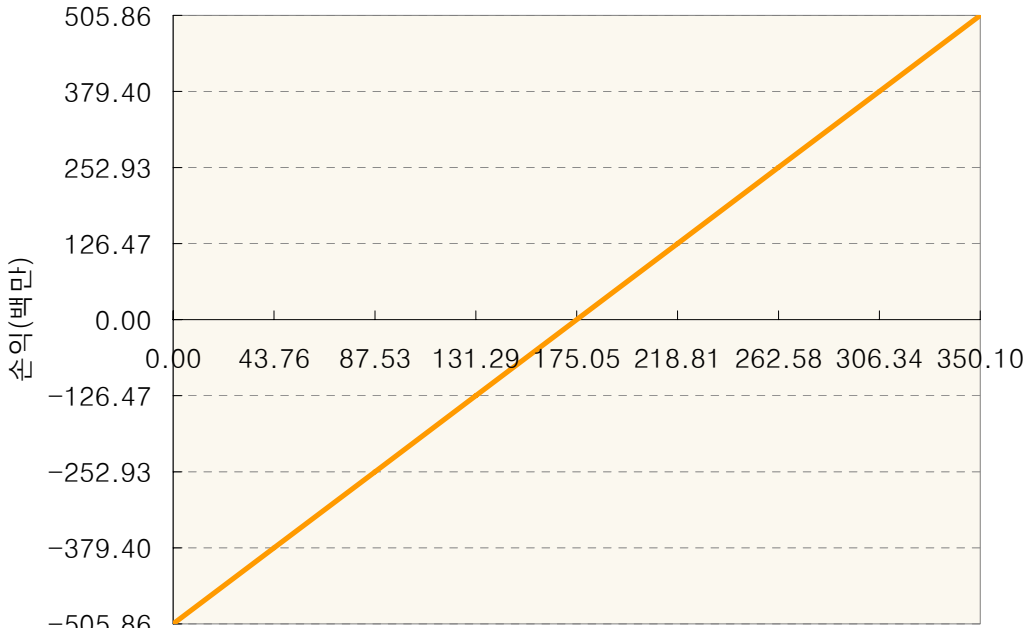


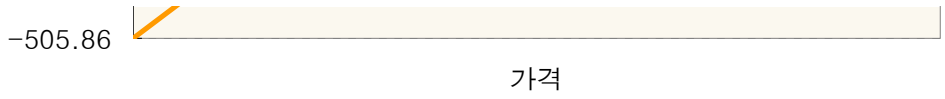


CTH5-COTTON NO.2 FUTR Mar15

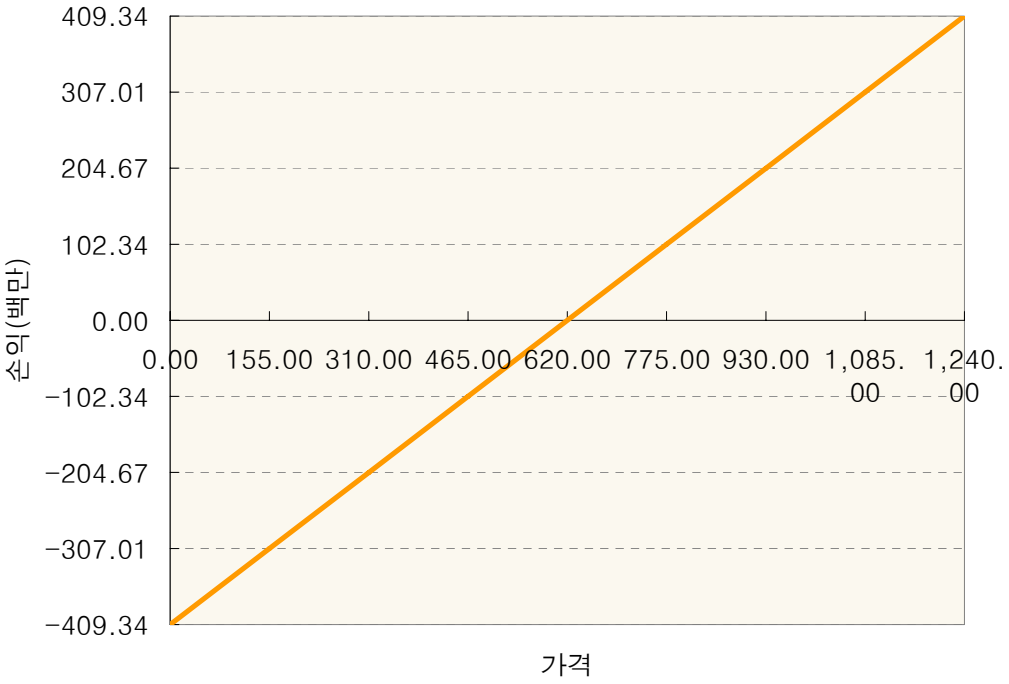


KCH5-COFFEE "C" FUTURE Mar15

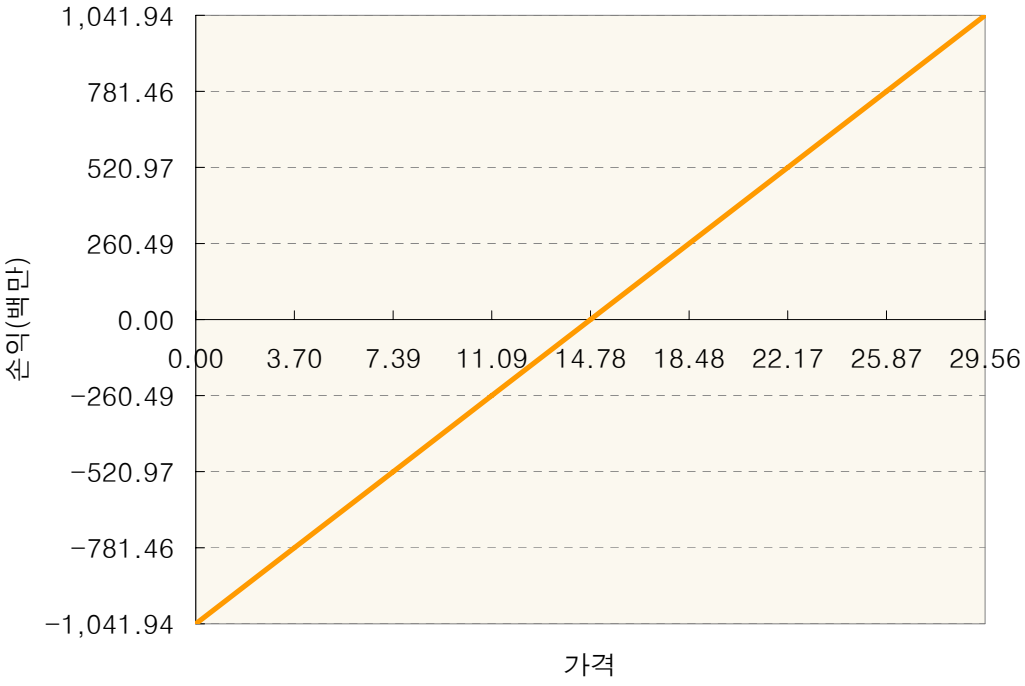




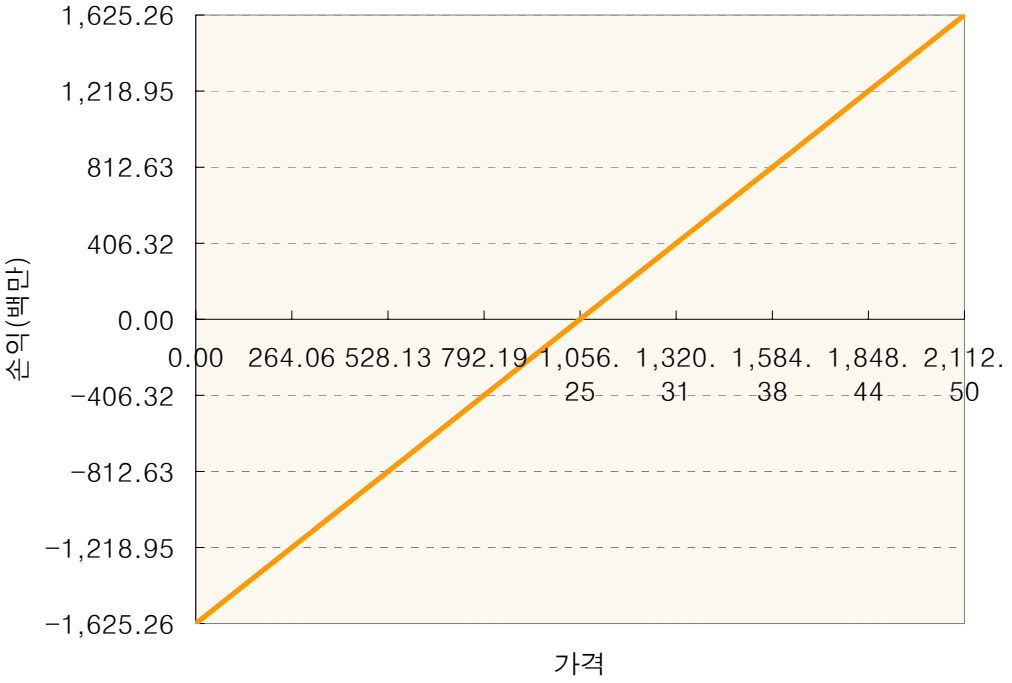
KWH5-WHEAT FUTURE(KCB) Mar15



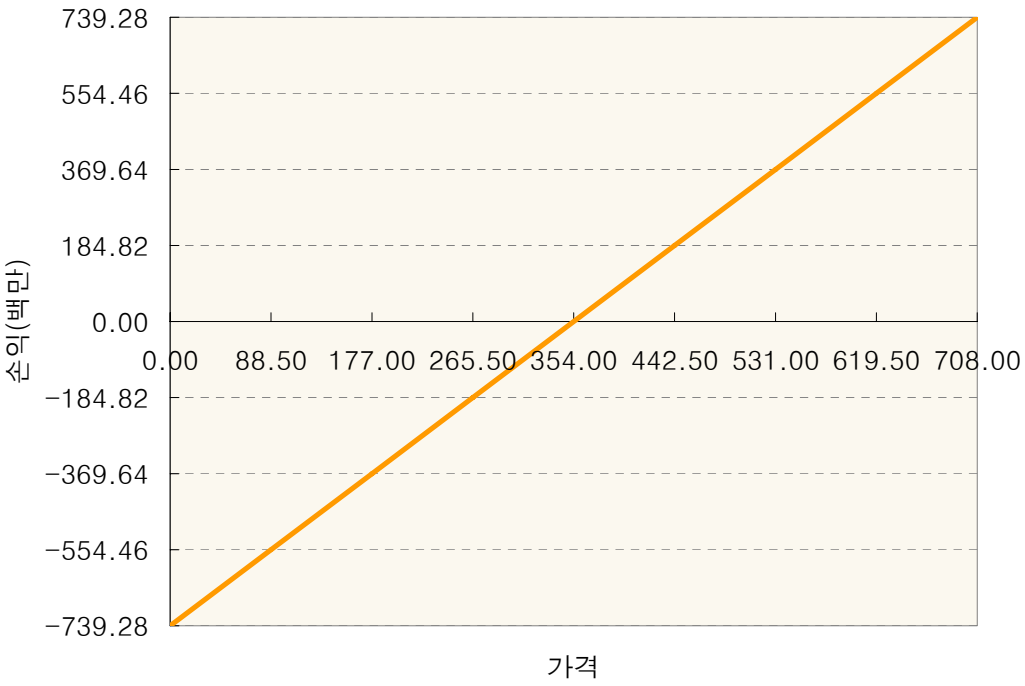
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar15



SH5-SOYBEAN FUTURE Mar15

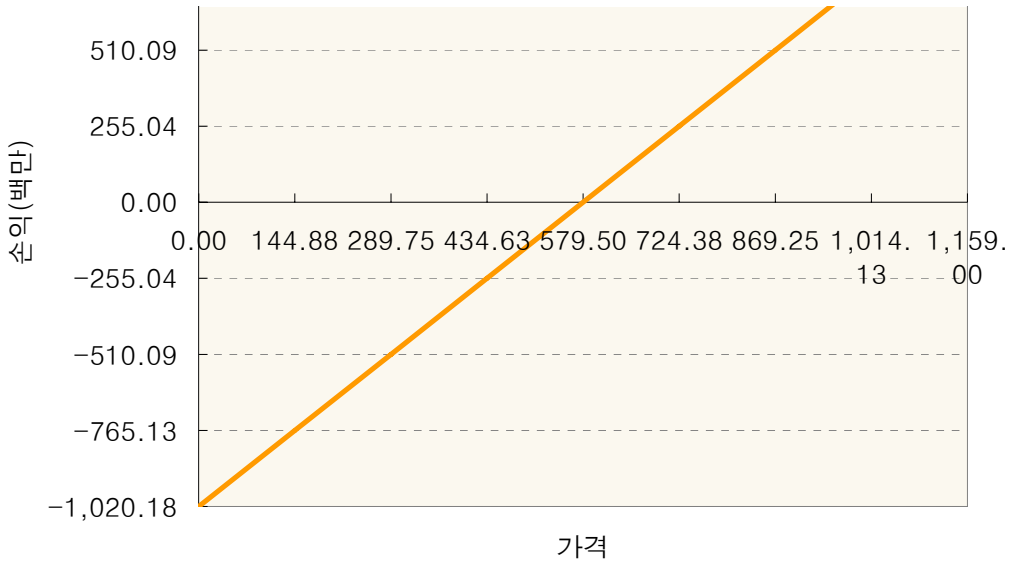


SMH5-SOYBEAN MEAL FUTR Mar15



WH5-WHEAT FUTURE(CBT) Mar15





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH5	SOYBEAN OIL FUTR Mar15	58
CH5	CORN FUTURE Mar15	115
CTH5	COTTON NO.2 FUTR Mar15	45
KCH5	COFFEE "C" FUTURE Mar15	40
KWH5	WHEAT FUTURE(KCB) Mar15	33
SBH5	Sugar #11 (WORLD) Mar15	83
SH5	SOYBEAN FUTURE Mar15	130
SMH5	SOYBEAN MEAL FUTR Mar15	59
WH5	WHEAT FUTURE(CBT) Mar15	82

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

(단위:백만원)

993