공시일	2015-01-14
기준일	2015-01-13

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	2015-01-14
기준일	2015-01-13

차곡차곡플러스모(주식혼합-파생)

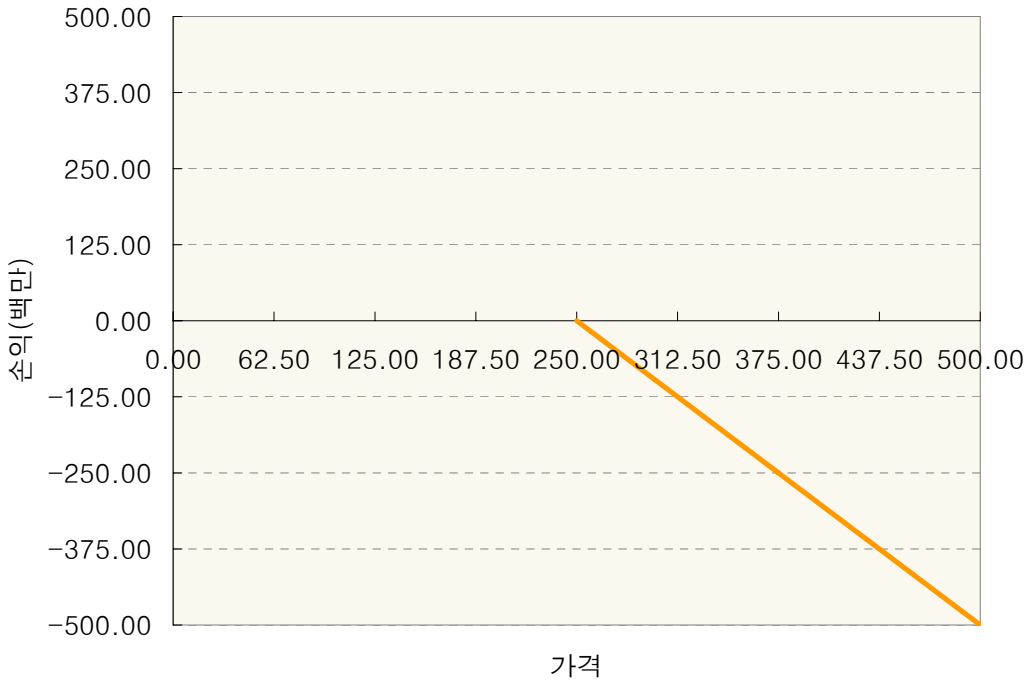
1. 계약금액

(단위:백만원)

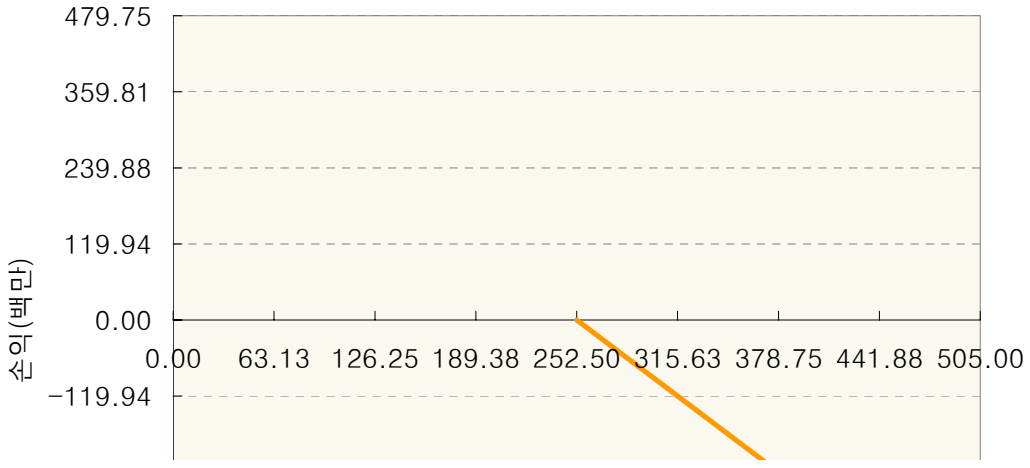
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	980	-980	장내

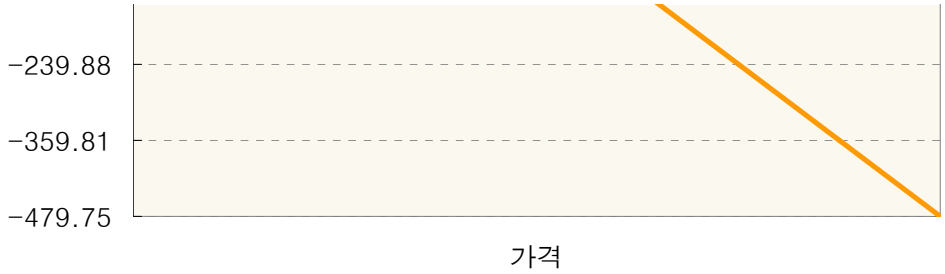
2. 만기시점의 손익구조

KR4201K22508-2015-02 콜250



KR4201K22524-2015-02 콜252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201K225 2015-02 콜250							145
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	22	22	22	22	21	21	21
-5.33%	22	21	21	21	20	19	18
-2.67%	20	19	17	16	14	12	10
0%	8	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	-24	-27	-30	-33	-36	-38	-41
5.33%	-77	-78	-80	-82	-84	-86	-88
8.00%	-140	-140	-141	-142	-142	-143	-145
KR4201K225 2015-02 콜252.5							123
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	14	14	14	14	14	13	13
-5.33%	14	13	13	13	13	12	12
-2.67%	13	12	11	10	9	8	6
0%	7	5	2	0	-2	-5	-7
2.67%	-16	-19	-22	-24	-27	-30	-33
5.33%	-59	-61	-63	-66	-68	-70	-73
8.00%	-117	-117	-118	-119	-120	-122	-123

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

(단위:백만원)

265

공시일	2015-01-14
기준일	2015-01-13

스마트인덱스모

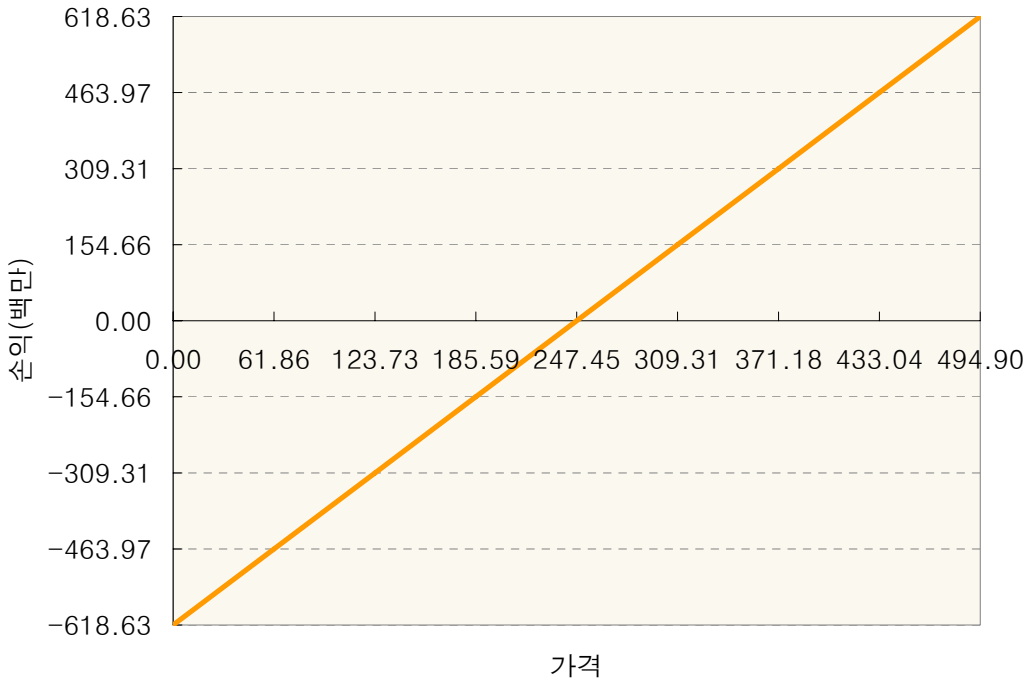
1. 계약금액

(단위:백만원)

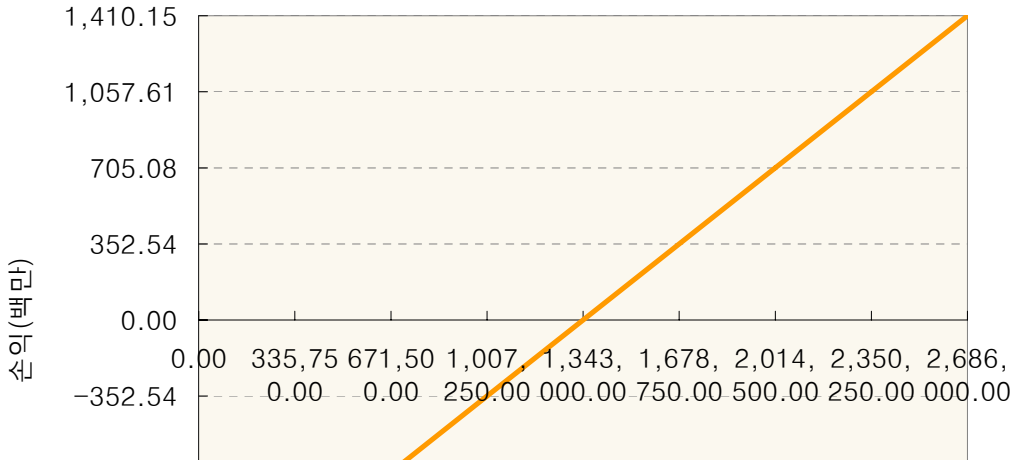
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,029	0	2,029	장내

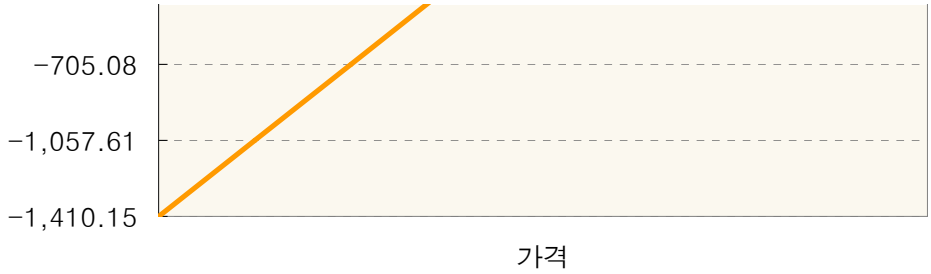
2. 만기시점의 손익구조

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)

142

공시일	2015-01-14
기준일	2015-01-13

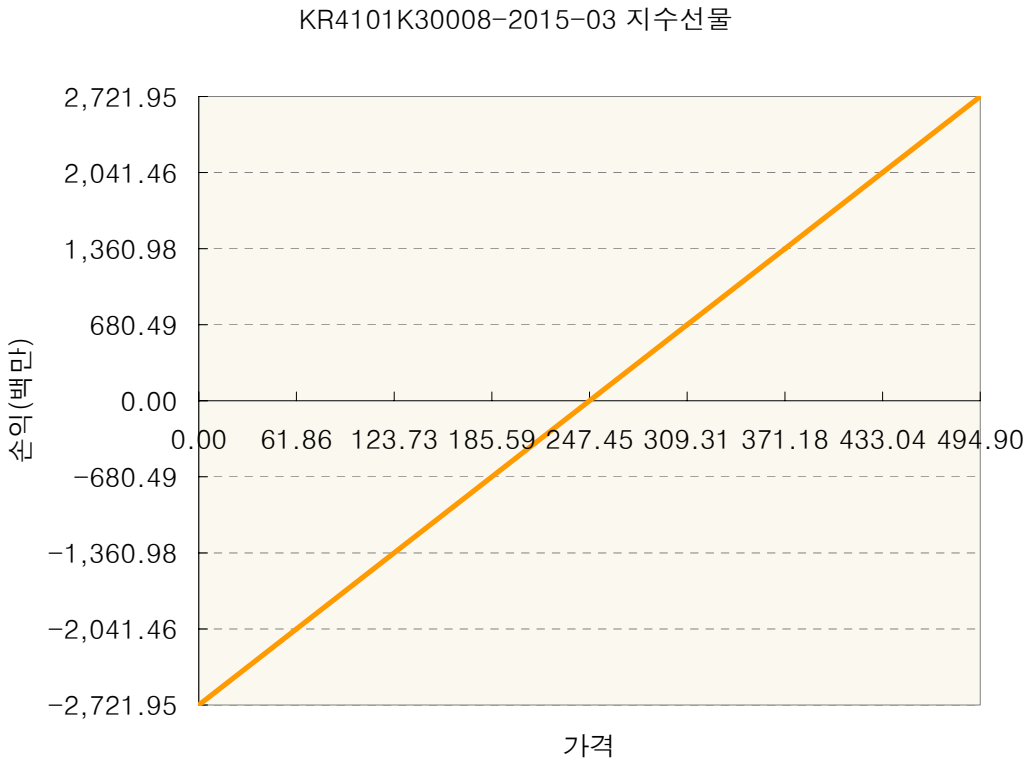
스마트레버리지목표전환형1호

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	2,722	0	2,722	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101K300 2015-03 지수선물 217

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-217	-217	-217	-217	-217	-217	-217
-5.33%	-144	-144	-144	-144	-144	-144	-144
-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%	144	144	144	144	144	144	144
8.00%	217	217	217	217	217	217	217

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

공시일	2015-01-14
기준일	2015-01-13

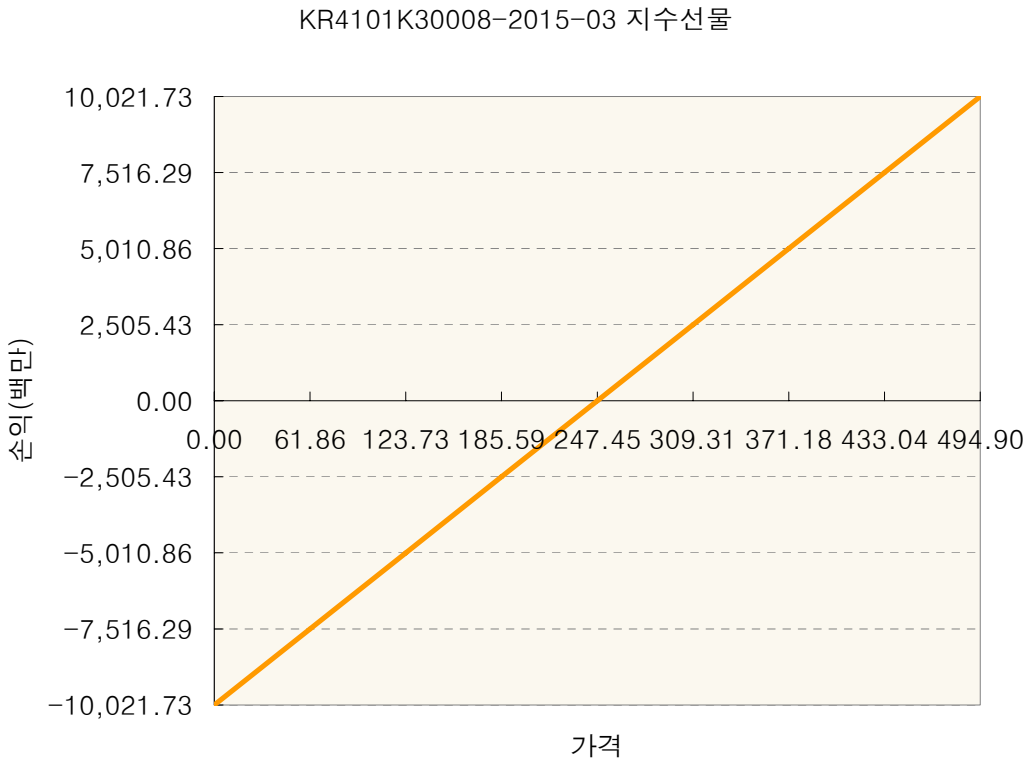
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	10,022	0	10,022	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101K300 2015-03 지수선물 798

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-798	-798	-798	-798	-798	-798	-798
-5.33%	-532	-532	-532	-532	-532	-532	-532
-2.67%	-266	-266	-266	-266	-266	-266	-266
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	266	266	266	266	266	266	266
5.33%	532	532	532	532	532	532	532
8.00%	798	798	798	798	798	798	798

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

517

공시일	2015-01-14
기준일	2015-01-13

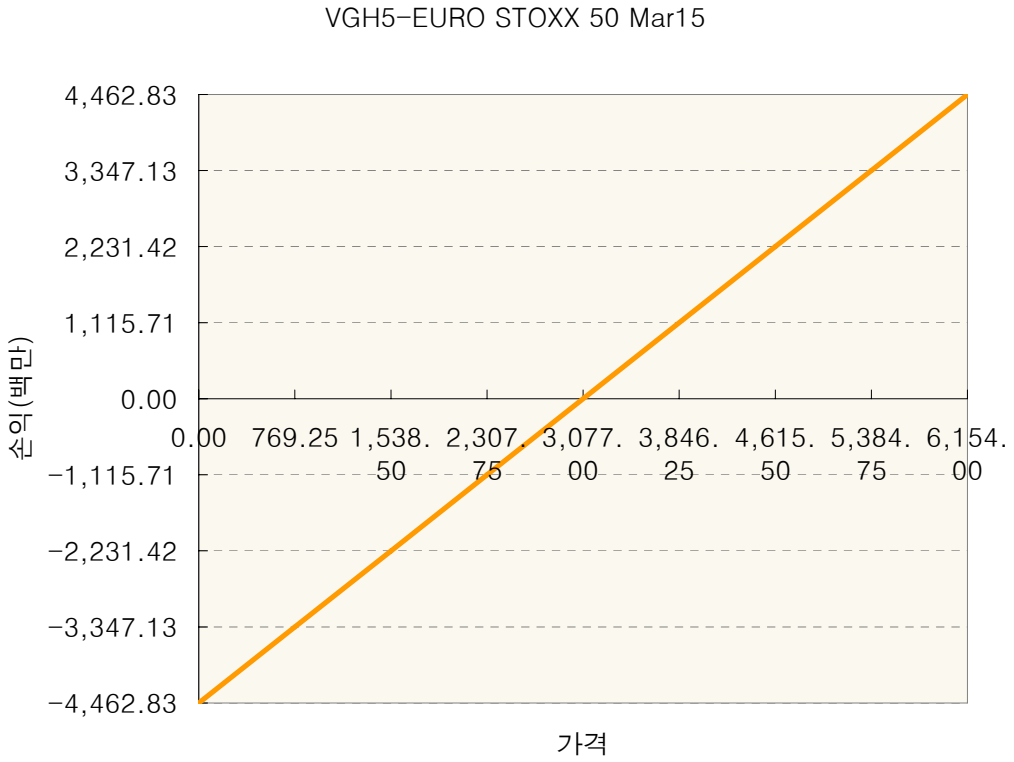
유로인덱스1호(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,463	0	4,463	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH5	EURO STOXX 50 Mar15	357

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

(단위:백만원)

300

공시일	2015-01-14
기준일	2015-01-13

아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

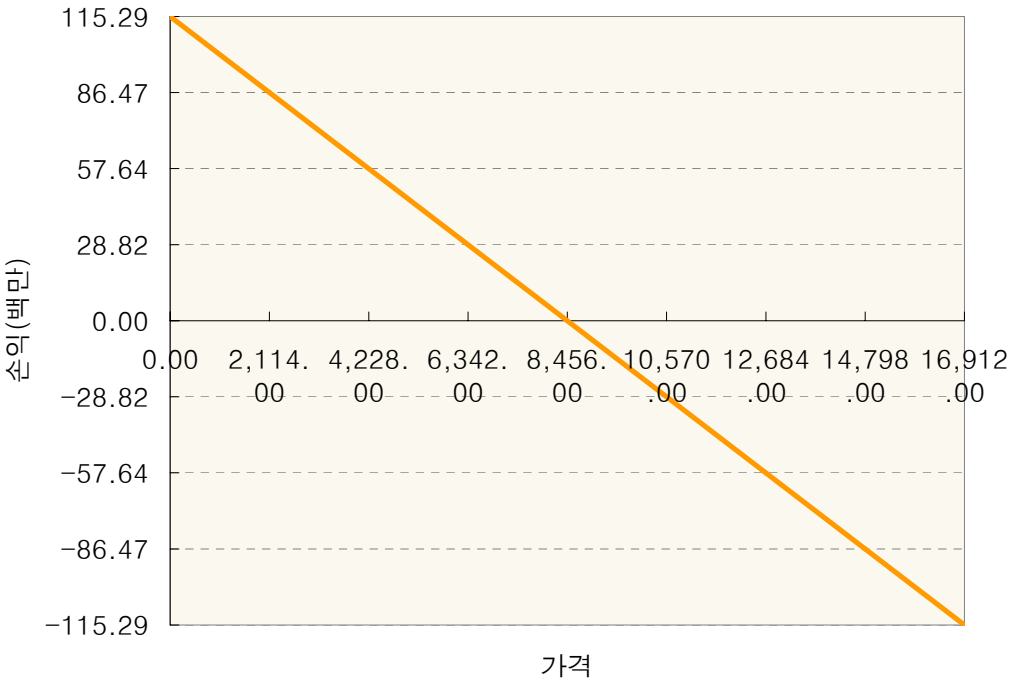
1. 계약금액

(단위:백만원)

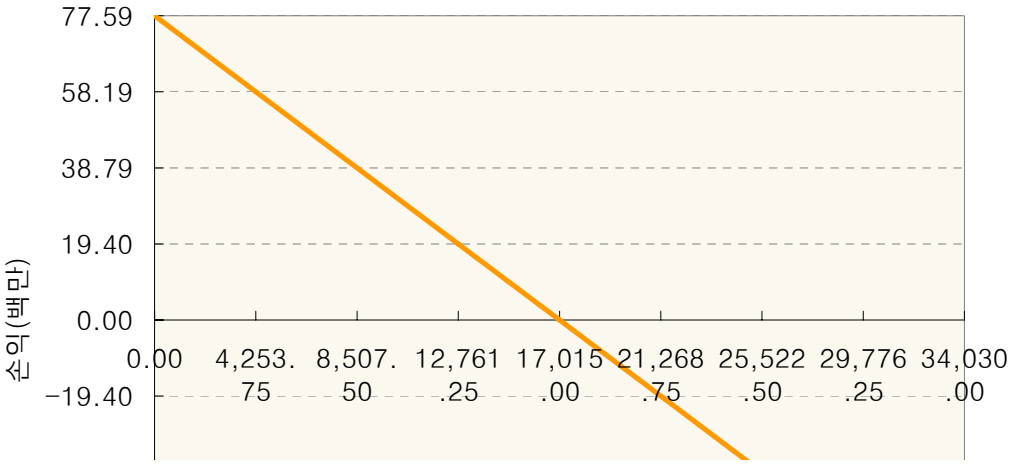
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	0	229	-229	

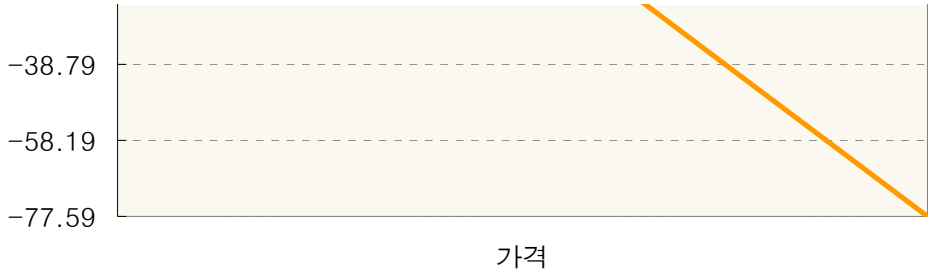
2. 만기시점의 손익구조

JYH5-JPN YEN FUT MAR15

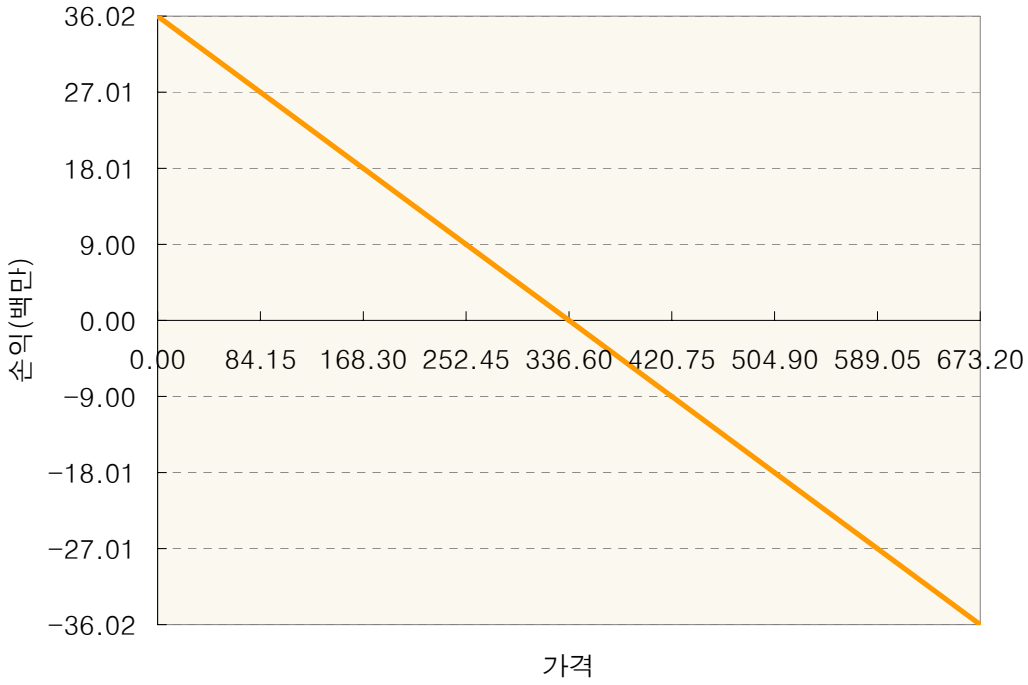


NIH5-NIKKEI 225 (SGX) Mar15





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	2015-01-14
기준일	2015-01-13

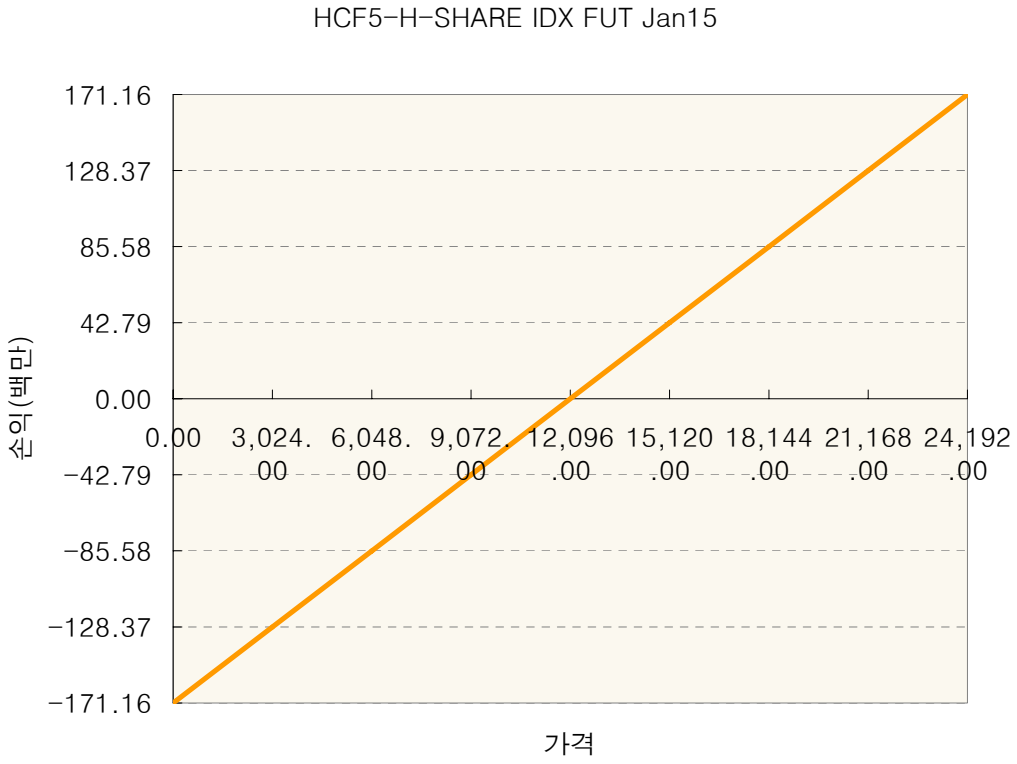
차이나인덱스(주식-파생형)(종)

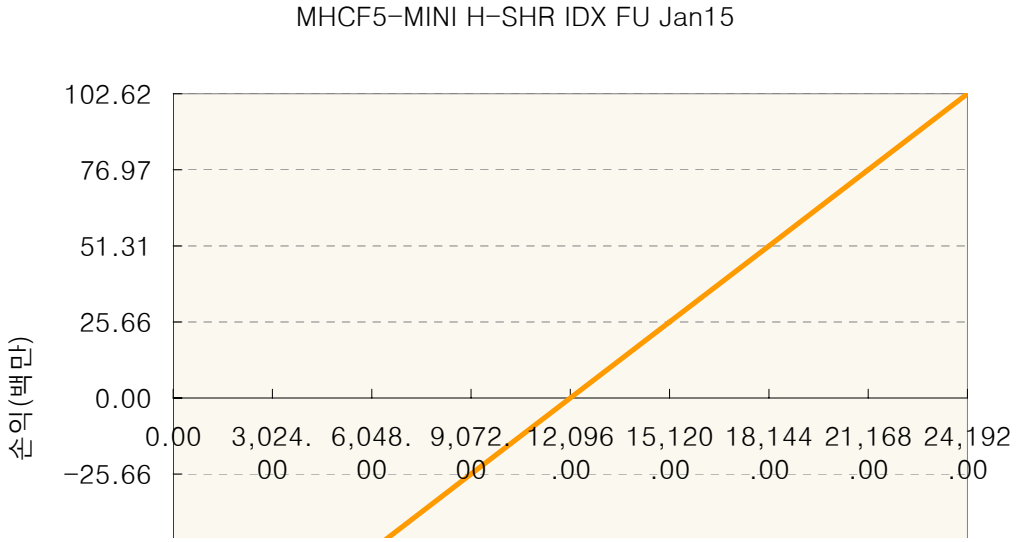
1. 계약금액

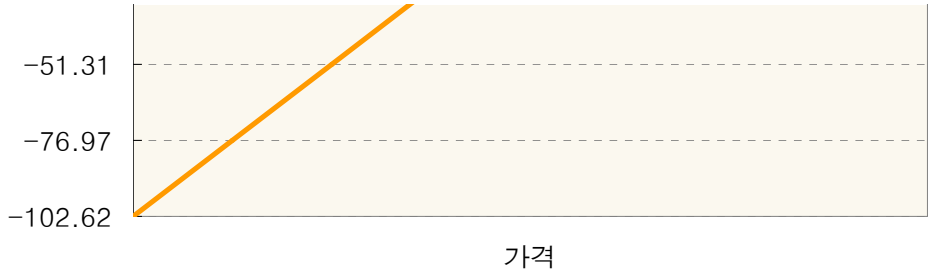
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	274	0	274	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF5	H-SHARE IDX FUT Jan15	14
MHCF5	MINI H-SHR IDX FU Jan15	8

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

(단위:백만원)

21

공시일	2015-01-14
기준일	2015-01-13

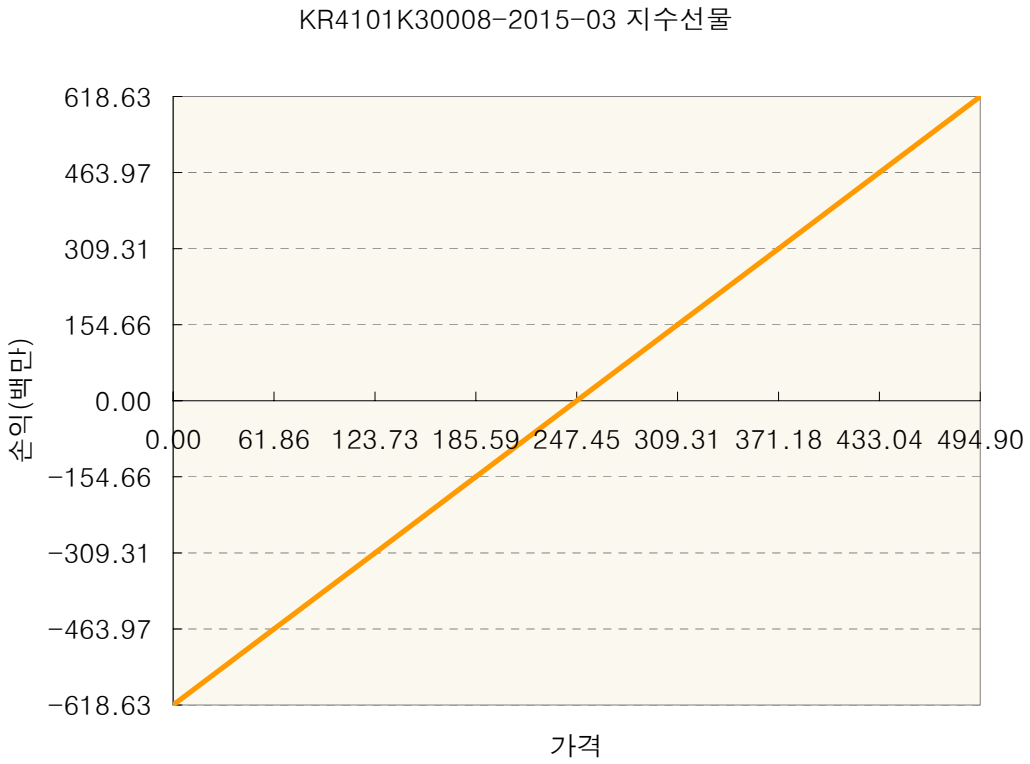
ETF스마트레버리지목표전환형제4

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	619	0	619	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	2015-01-14
기준일	2015-01-13

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	2,408

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,377

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2015-01-14
기준일	2015-01-13

메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

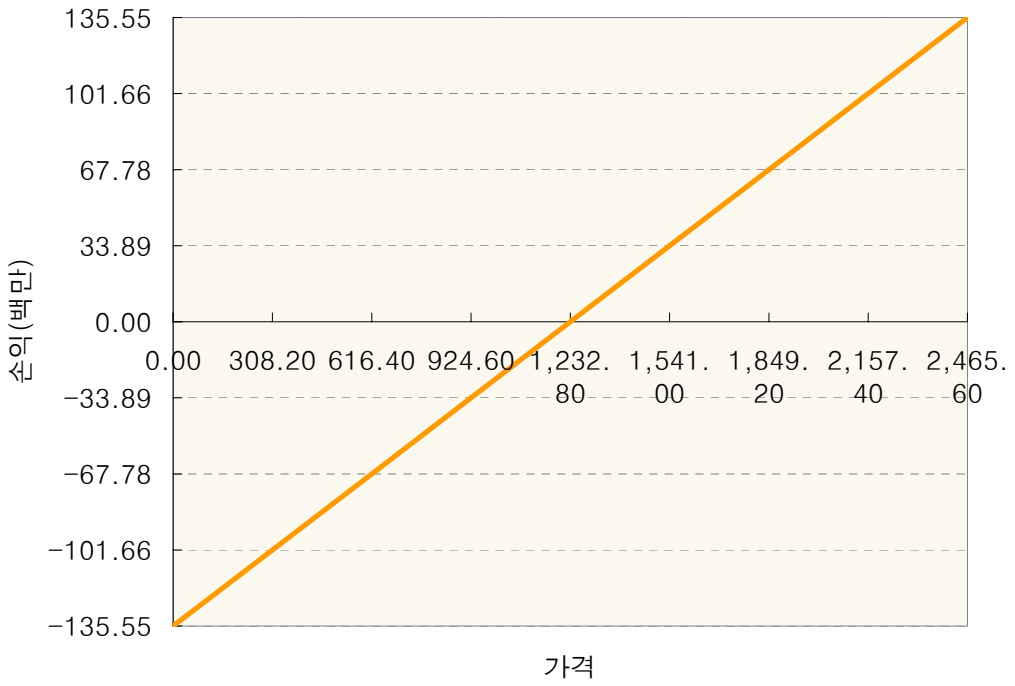
1. 계약금액

(단위:백만원)

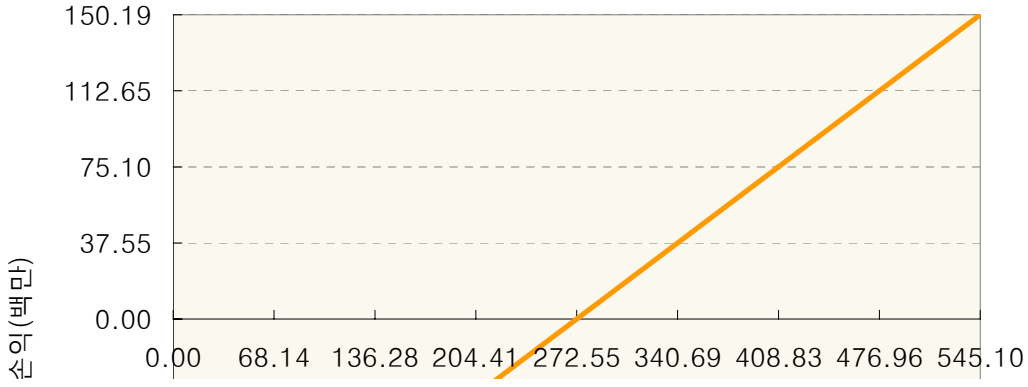
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	18	0	18	
누계	유가증권	선물	639	174	465	

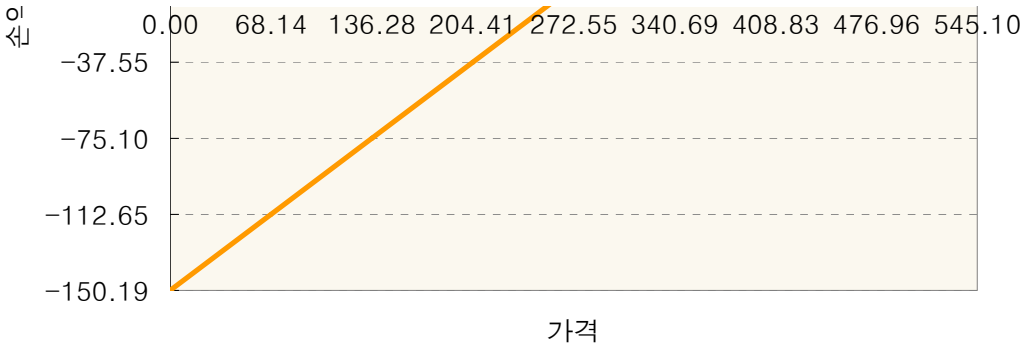
2. 만기시점의 손익구조

GCG5-GOLD 100 OZ FUTR Feb15

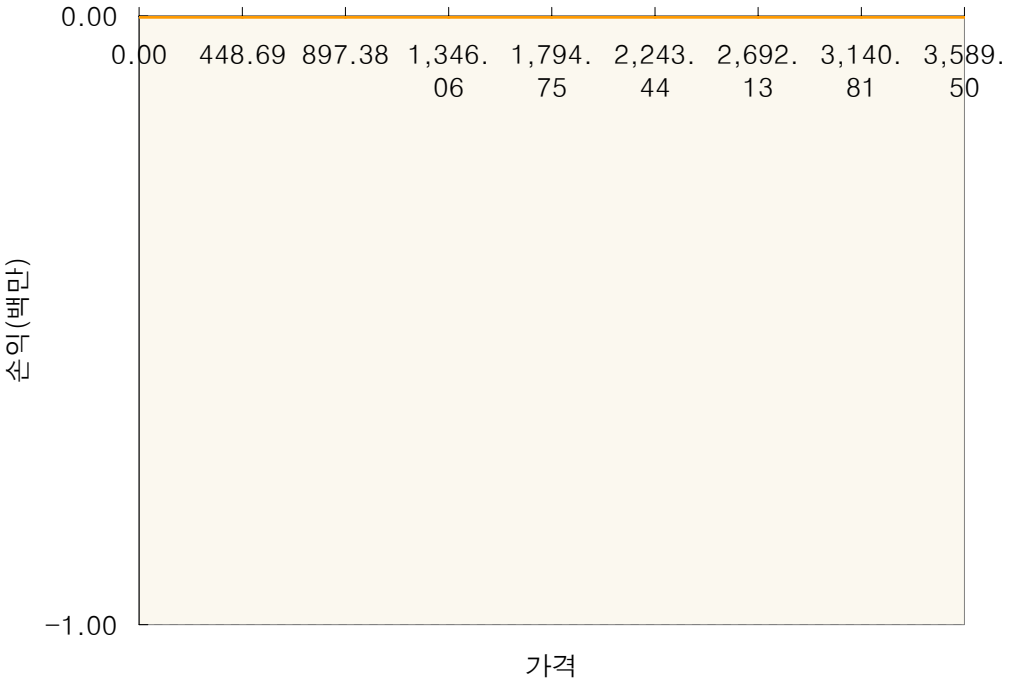


HGH5-COPPER FUTURE Mar15

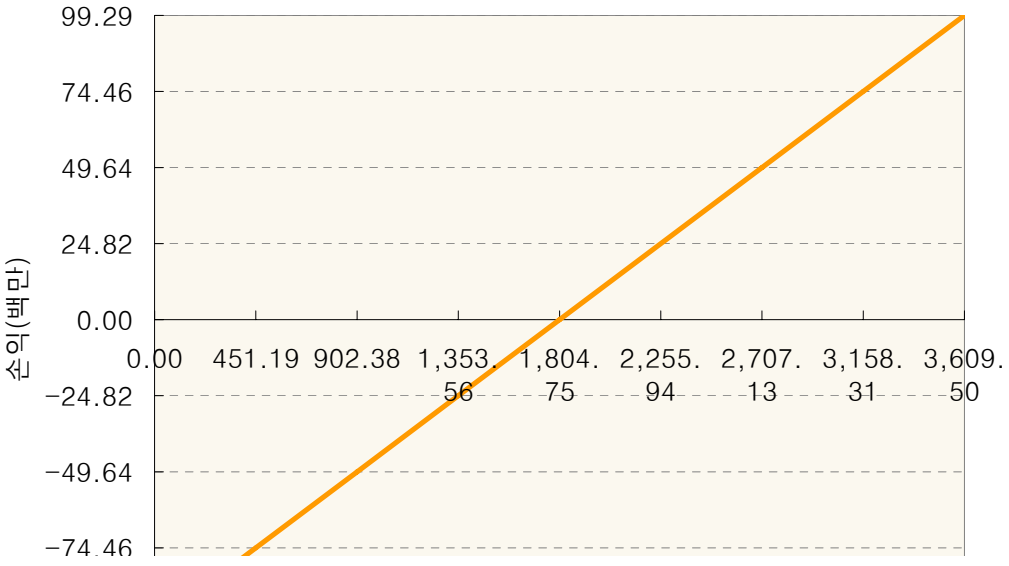


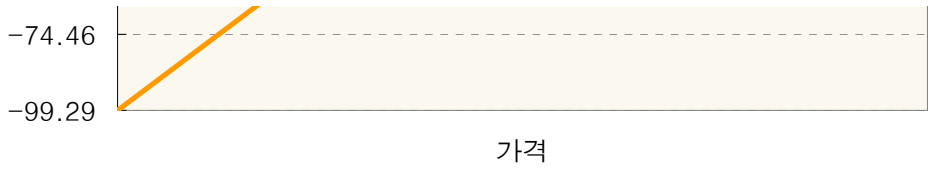


LAF5-LME PRI ALUM FUTR JAN 15

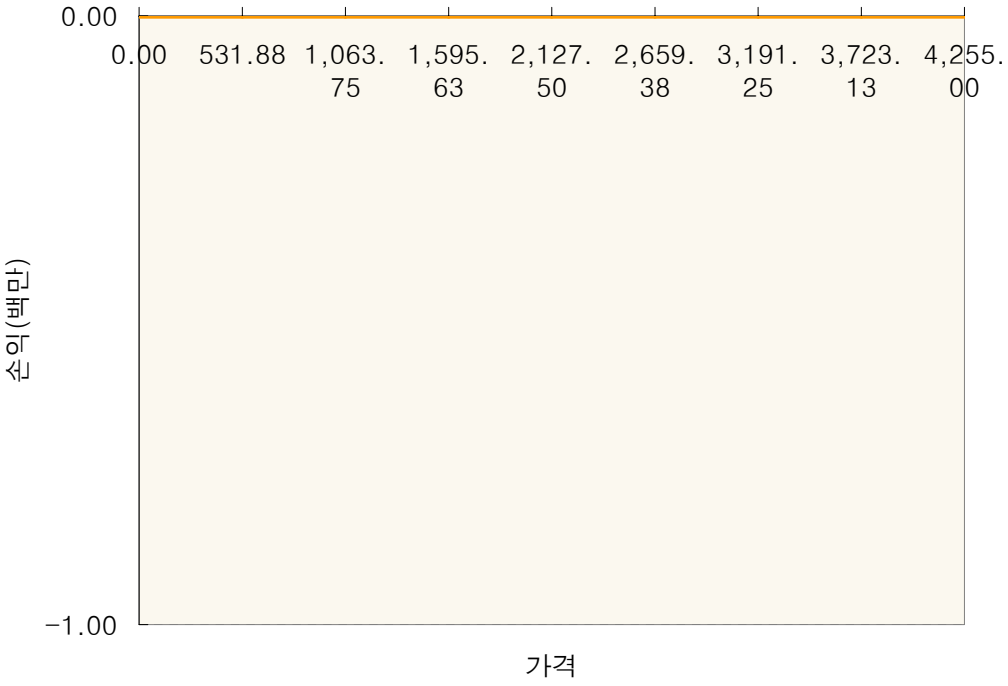


LAH5-LME PRI ALUM FUTR MAR 15

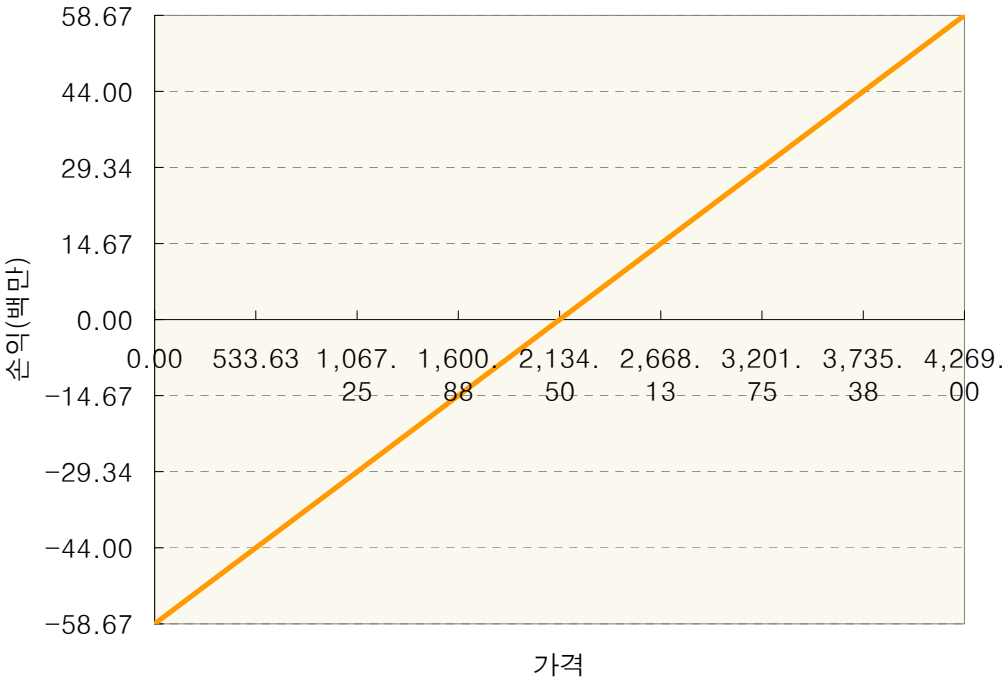




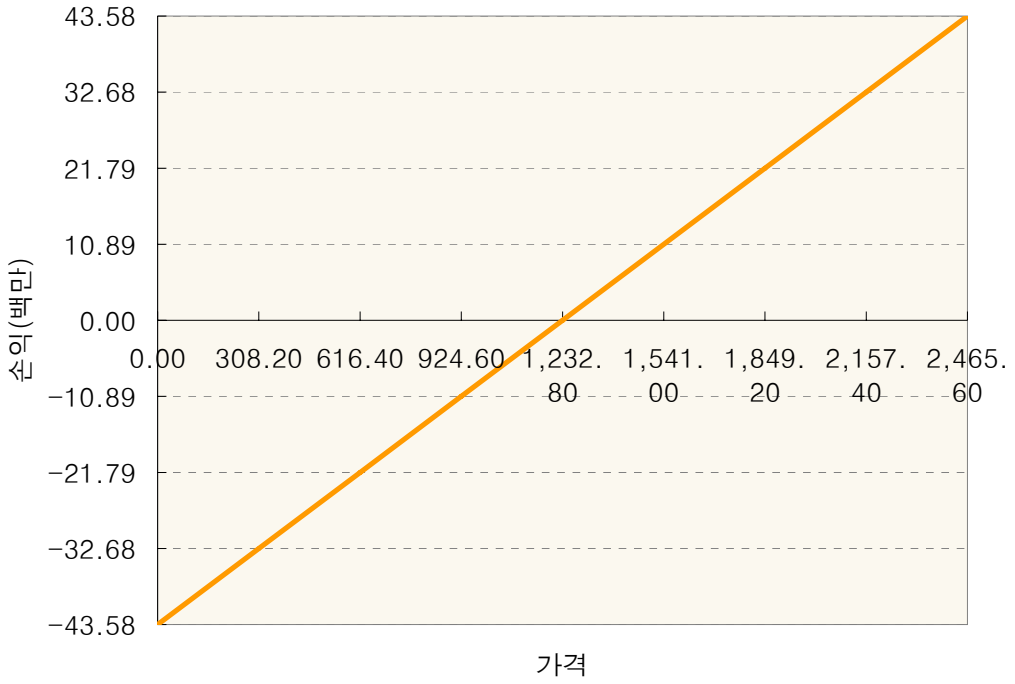
LXF5-LME ZINC FUTURE JAN15



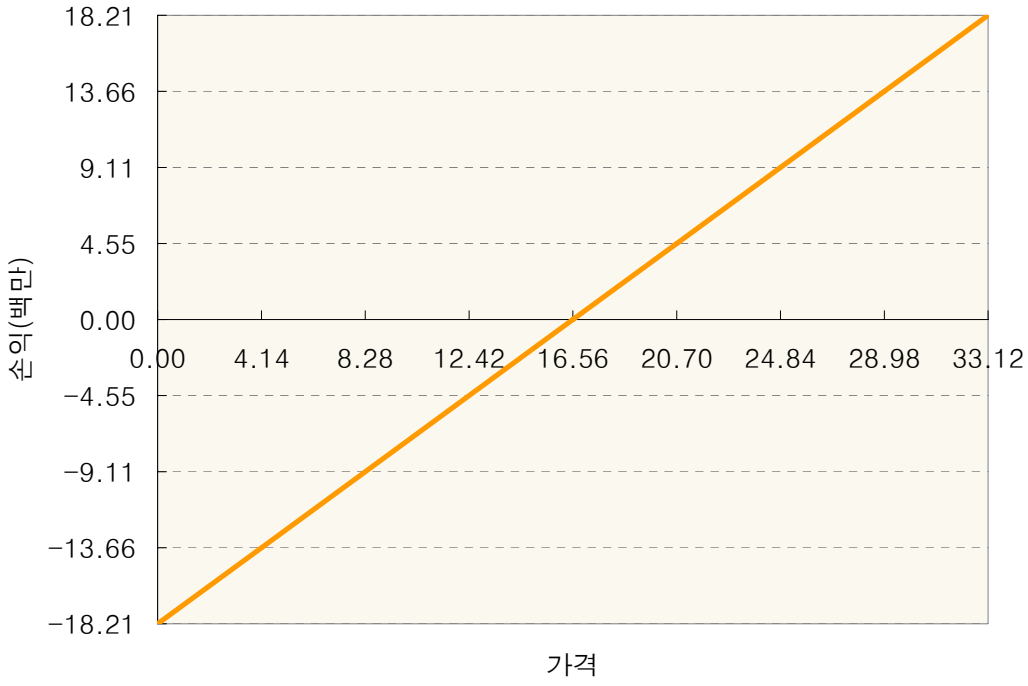
LXH5-LME ZINC FUTURE MAR15



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	1
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	2015-01-14
기준일	2015-01-13

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

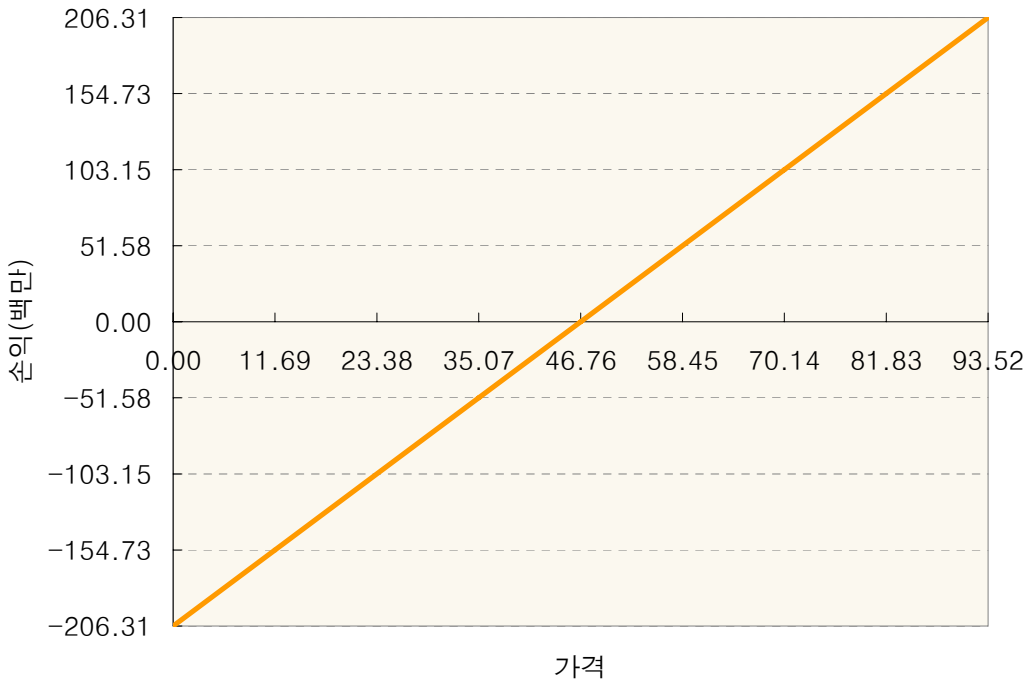
1. 계약금액

(단위:백만원)

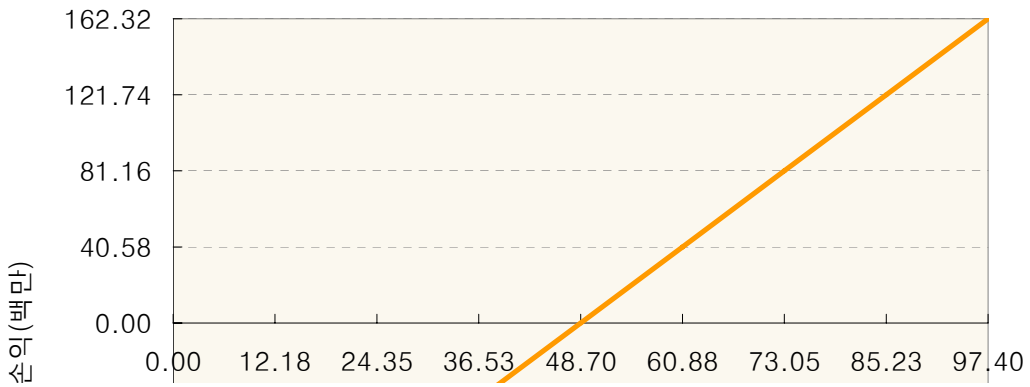
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	206	0	206	
누계	유가증권	선물	636	0	636	

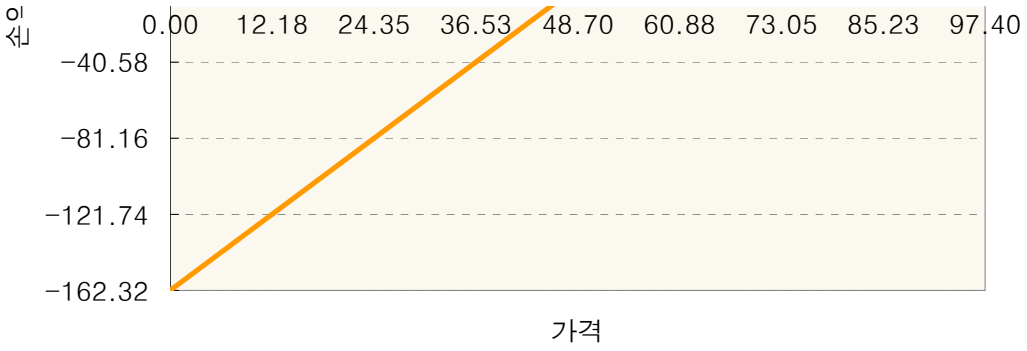
2. 만기시점의 손익구조

CLH5-WTI CRUDE FUTURE Mar15

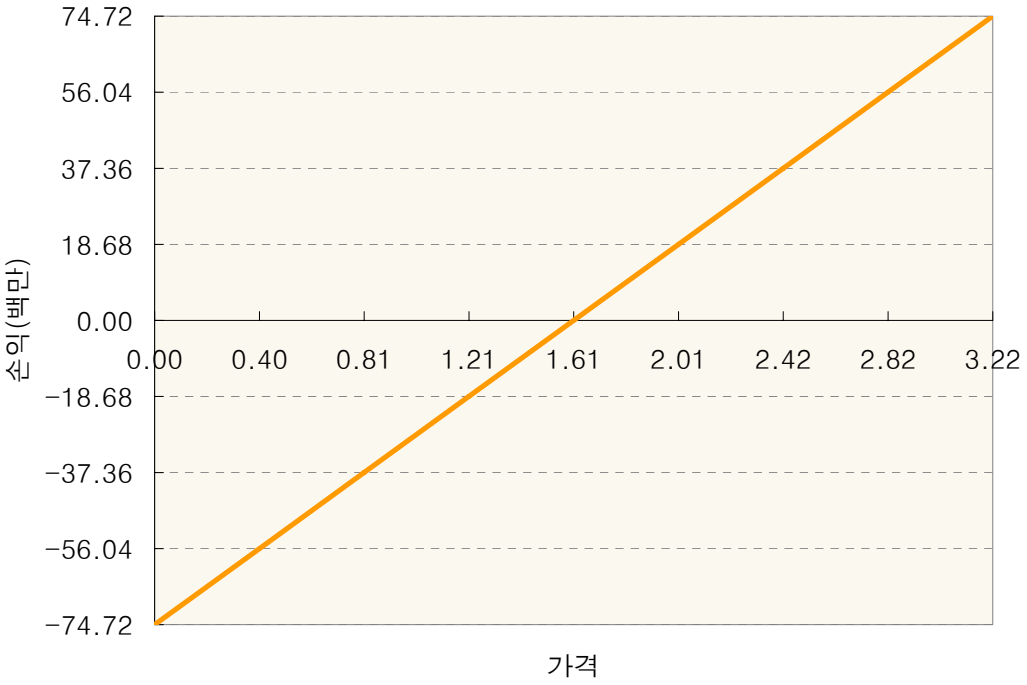


COH5-BRENT CRUDE FUTR Mar15

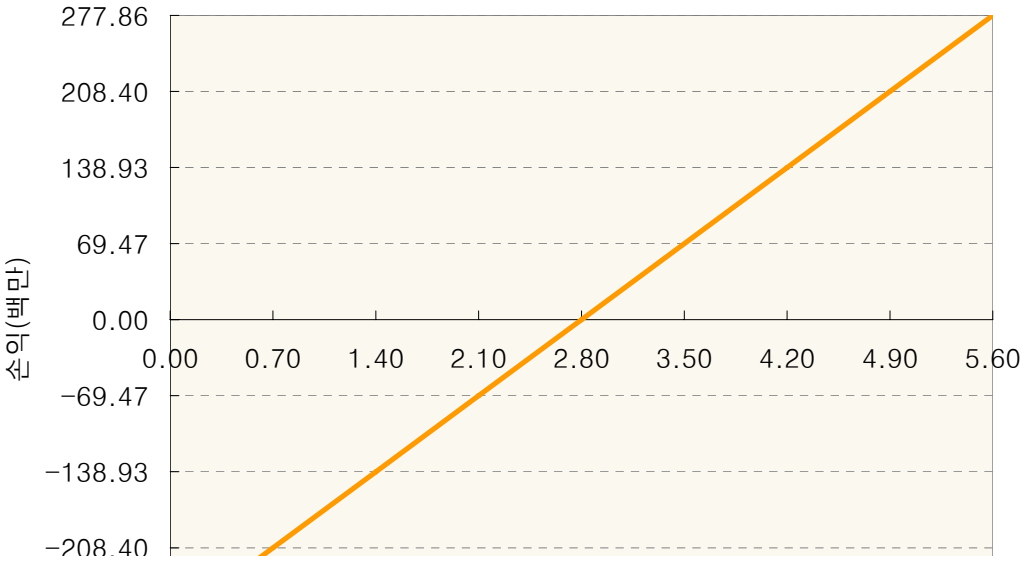


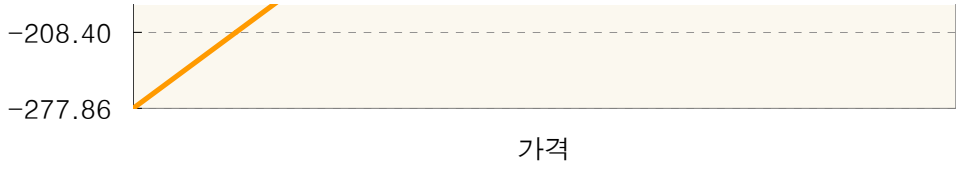


HOH5-NY Harb ULSD Fut Mar15

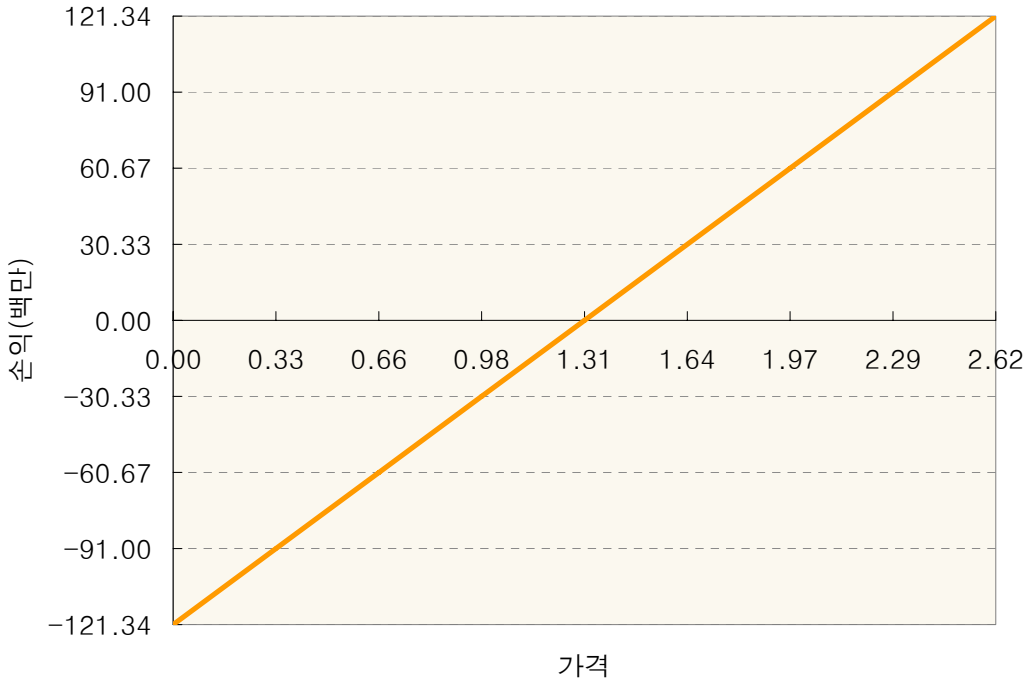


NGH5-NATURAL GAS FUTR Mar15





XBH5-GASOLINE RBOB FUT Mar15



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLH5	WTI CRUDE FUTURE Mar15	17
COH5	BRENT CRUDE FUTR Mar15	13
HOH5	NY Harb ULSD Fut Mar15	6
NGH5	NATURAL GAS FUTR Mar15	22
XBH5	GASOLINE RBOB FUT Mar15	10

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

(단위:백만원)

123

공시일	2015-01-14
기준일	2015-01-13

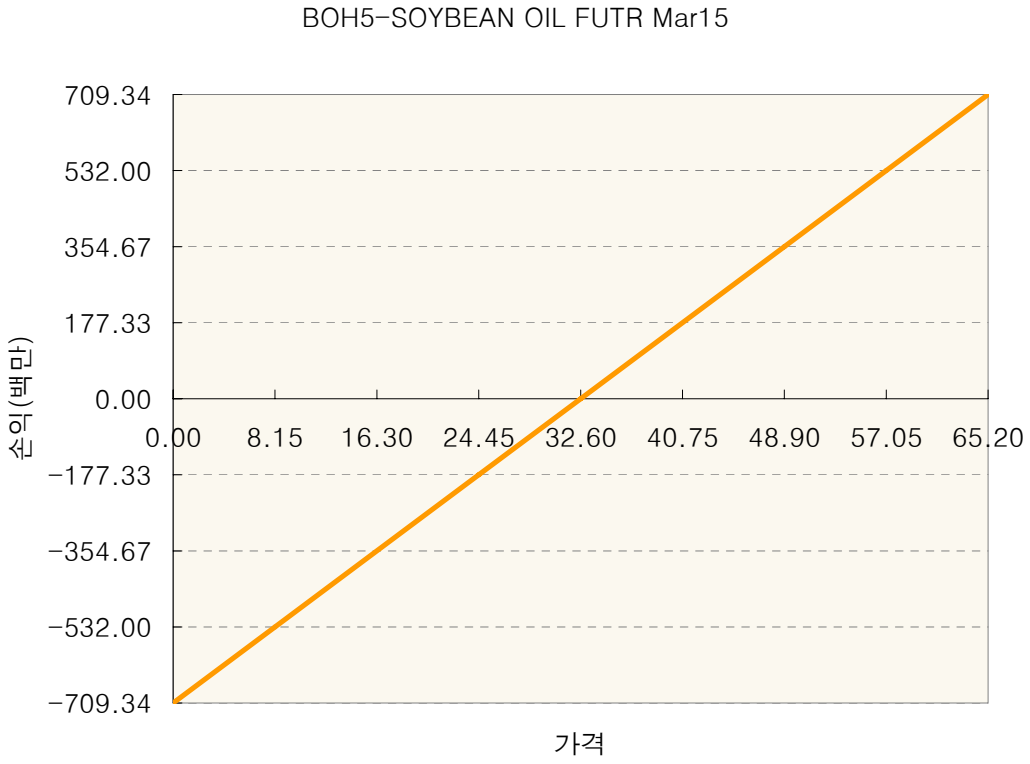
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

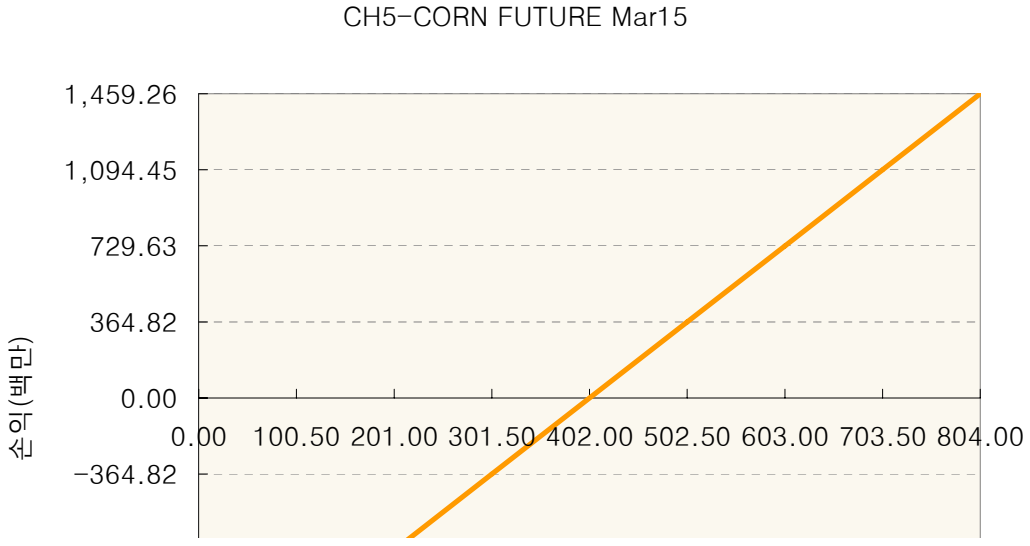
1. 계약금액

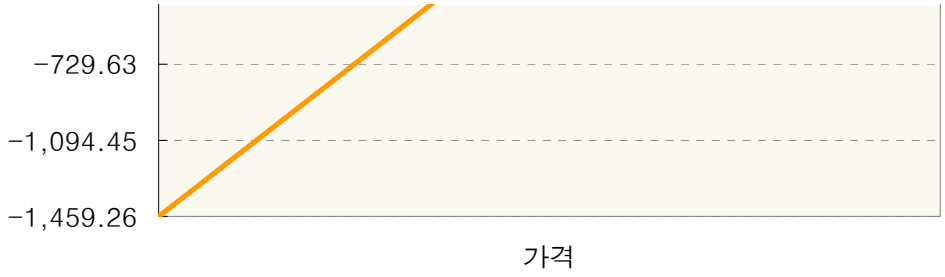
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,925	0	7,925	

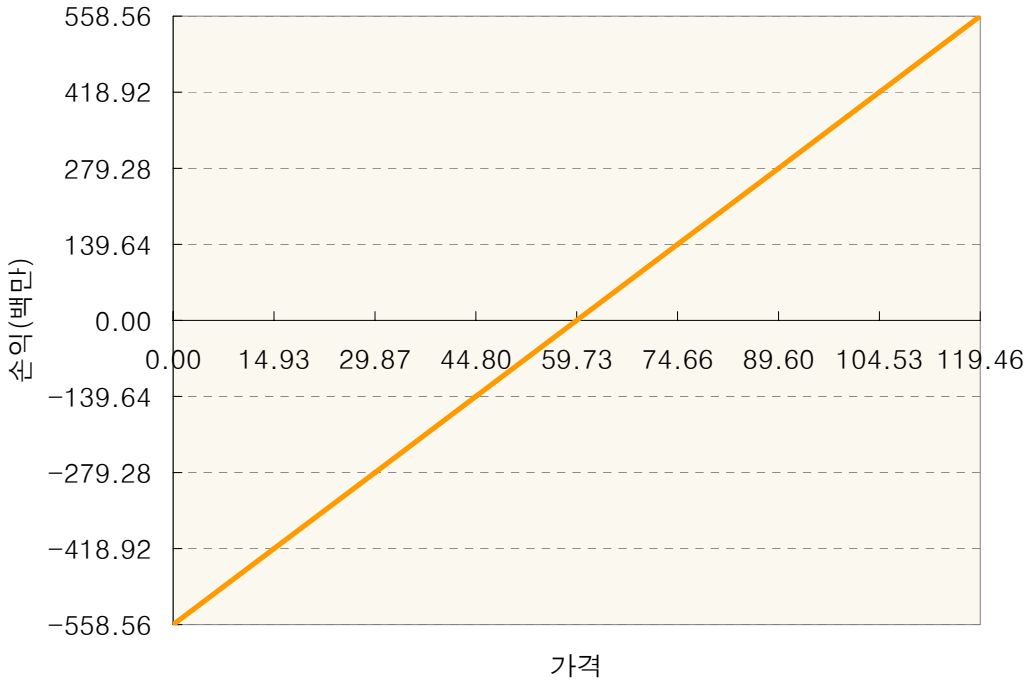
2. 만기시점의 손익구조



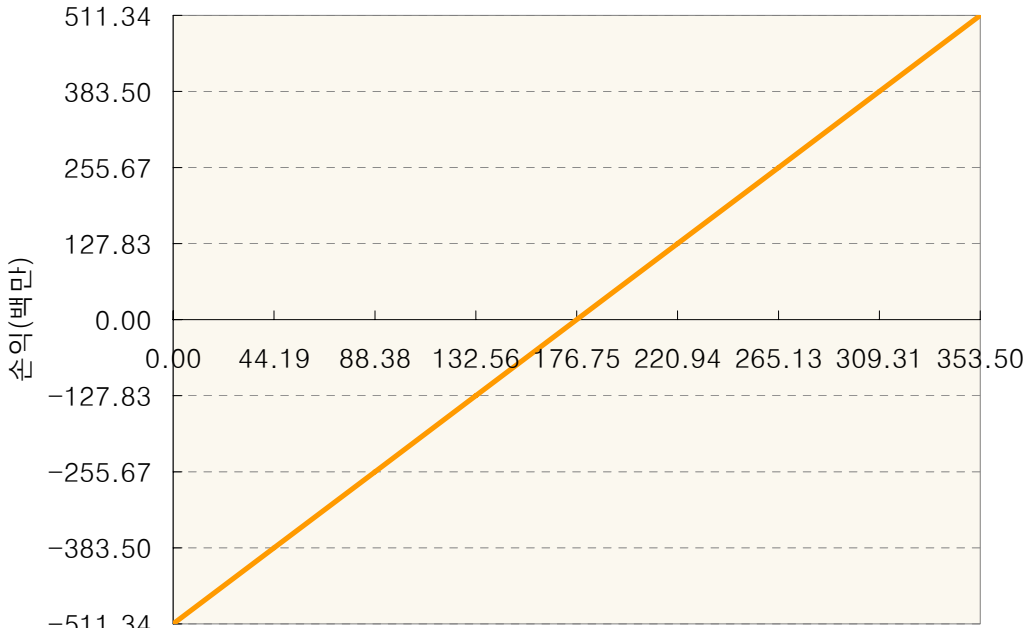


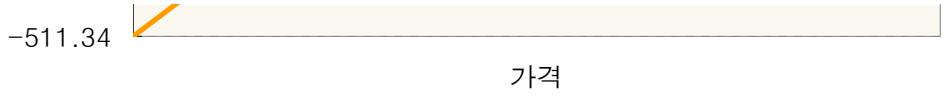


CTH5-COTTON NO.2 FUTR Mar15

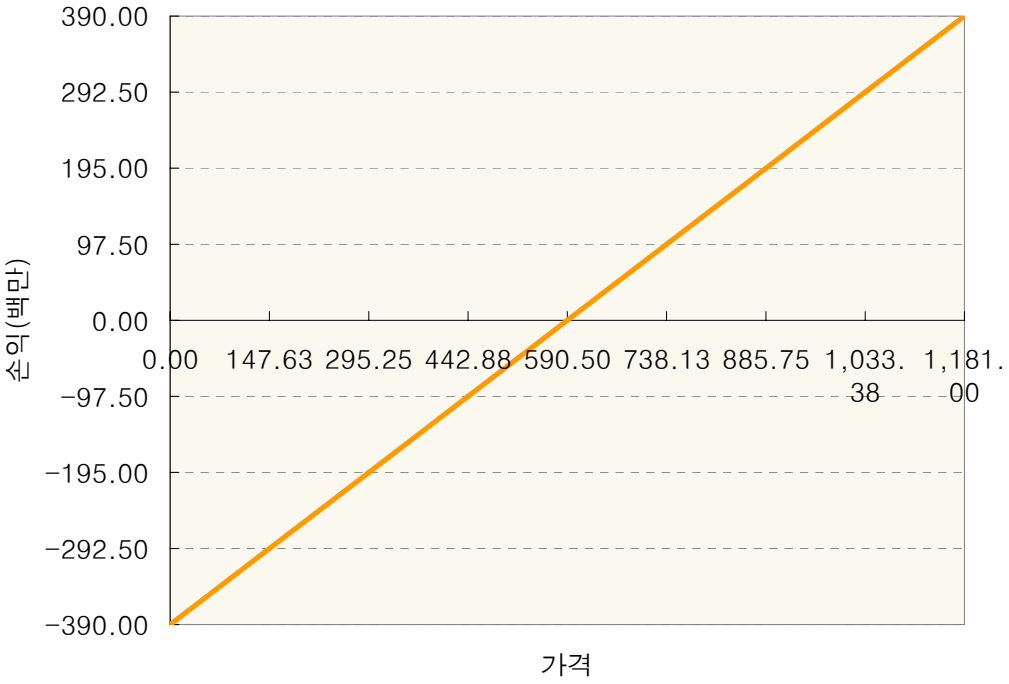


KCH5-COFFEE "C" FUTURE Mar15

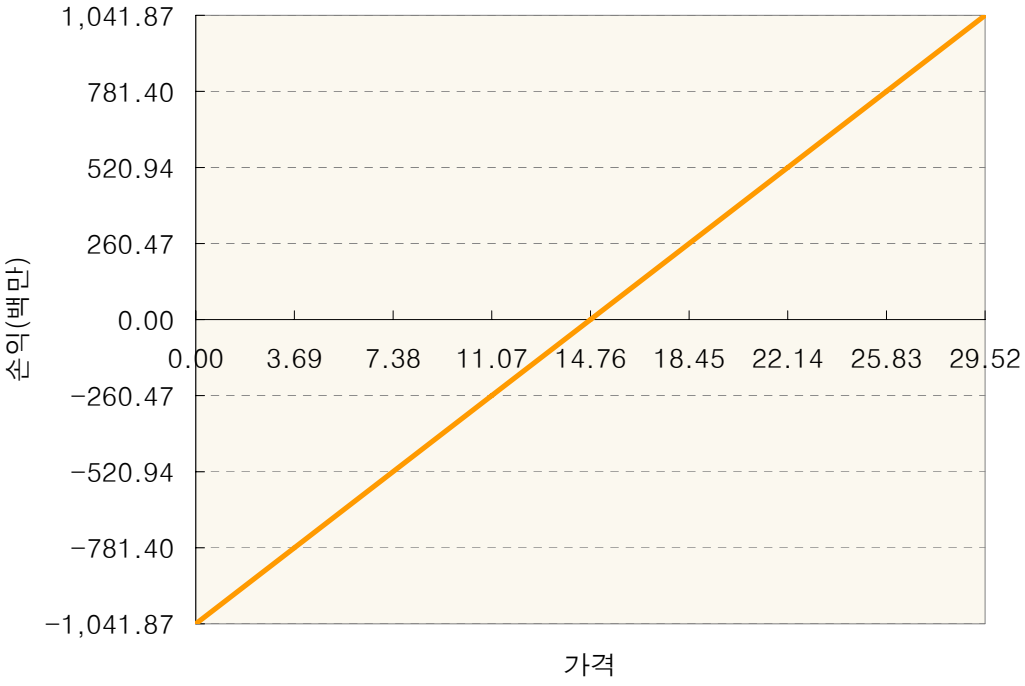




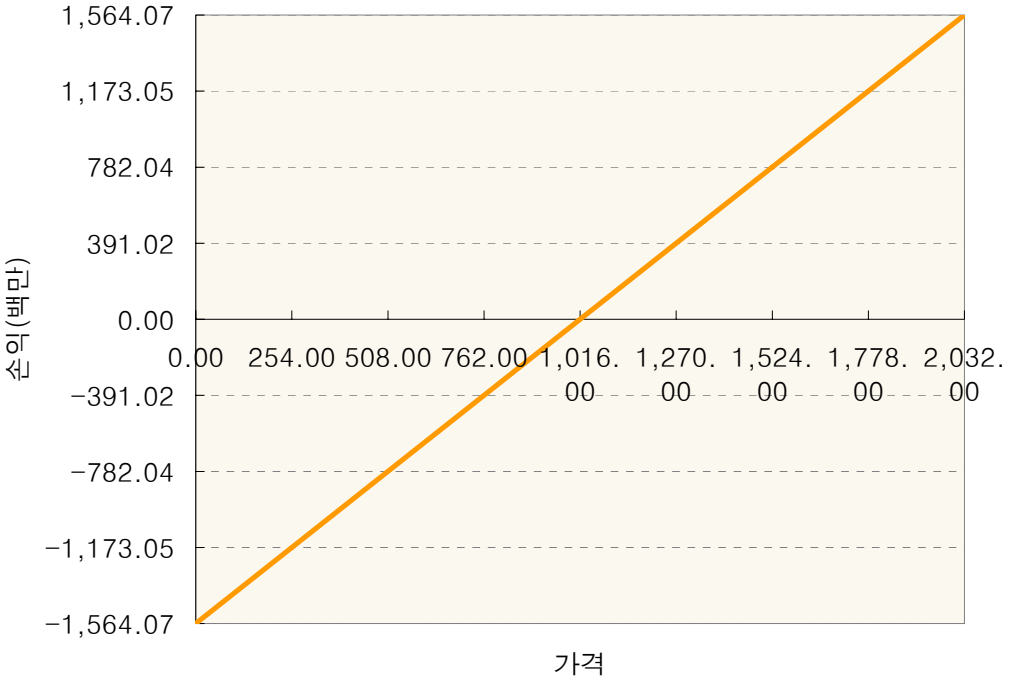
KWH5-WHEAT FUTURE(KCB) Mar15



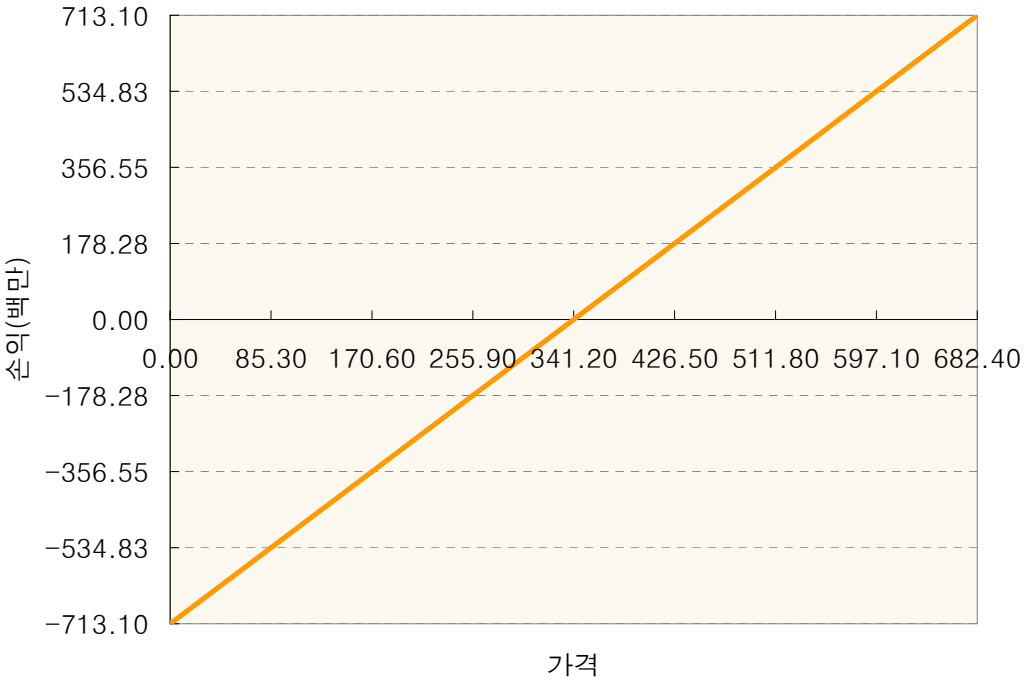
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar15



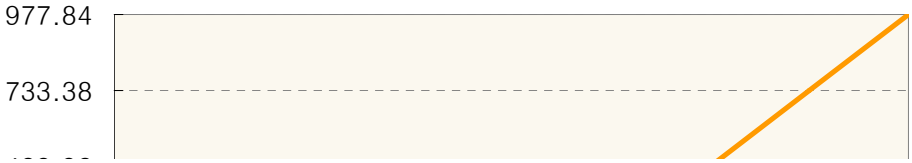
SH5-SOYBEAN FUTURE Mar15

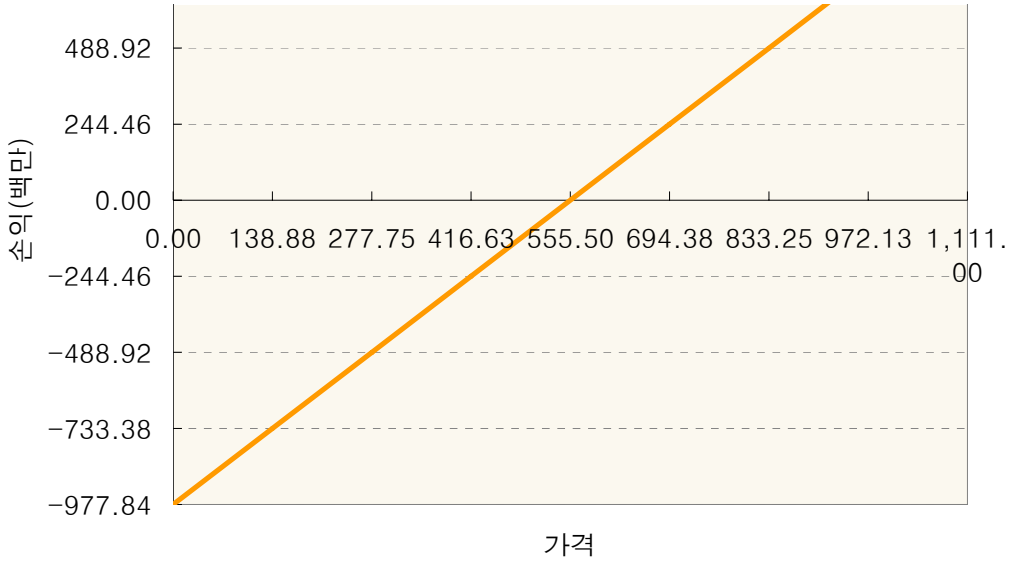


SMH5-SOYBEAN MEAL FUTR Mar15



WH5-WHEAT FUTURE(CBT) Mar15





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH5	SOYBEAN OIL FUTR Mar15	57
CH5	CORN FUTURE Mar15	117
CTH5	COTTON NO.2 FUTR Mar15	45
KCH5	COFFEE "C" FUTURE Mar15	41
KWH5	WHEAT FUTURE(KCB) Mar15	31
SBH5	Sugar #11 (WORLD) Mar15	83
SH5	SOYBEAN FUTURE Mar15	125
SMH5	SOYBEAN MEAL FUTR Mar15	57
WH5	WHEAT FUTURE(CBT) Mar15	78

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

(단위:백만원)

977