공시일	2015-01-22
기준일	2015-01-21

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	11	0	11	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	2015-01-22
기준일	2015-01-21

차곡차곡플러스모(주식혼합-파생)

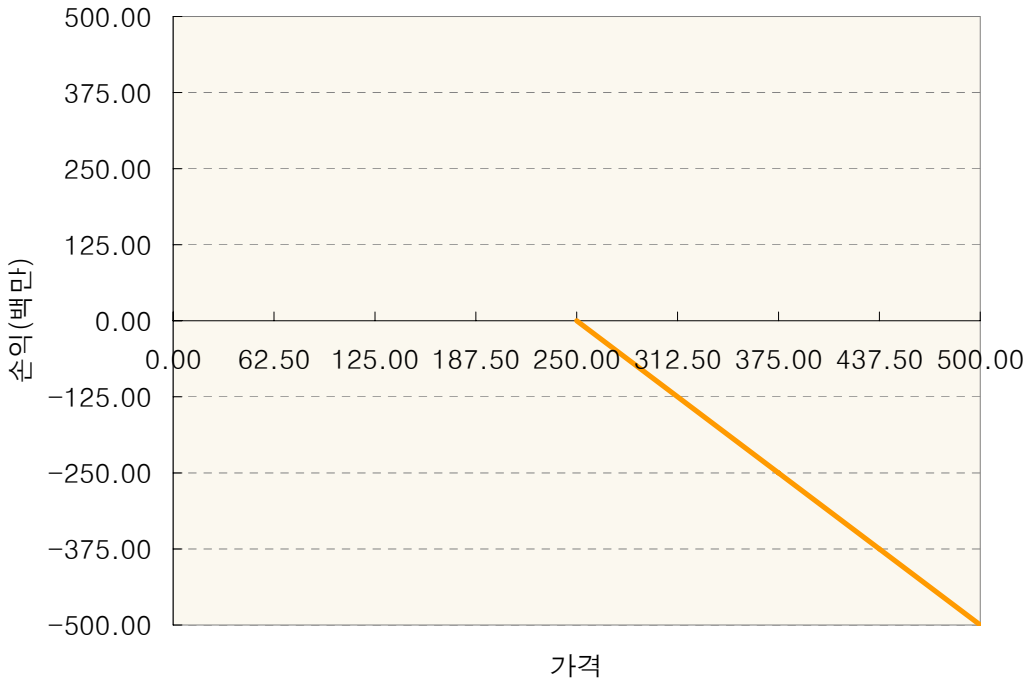
1. 계약금액

(단위:백만원)

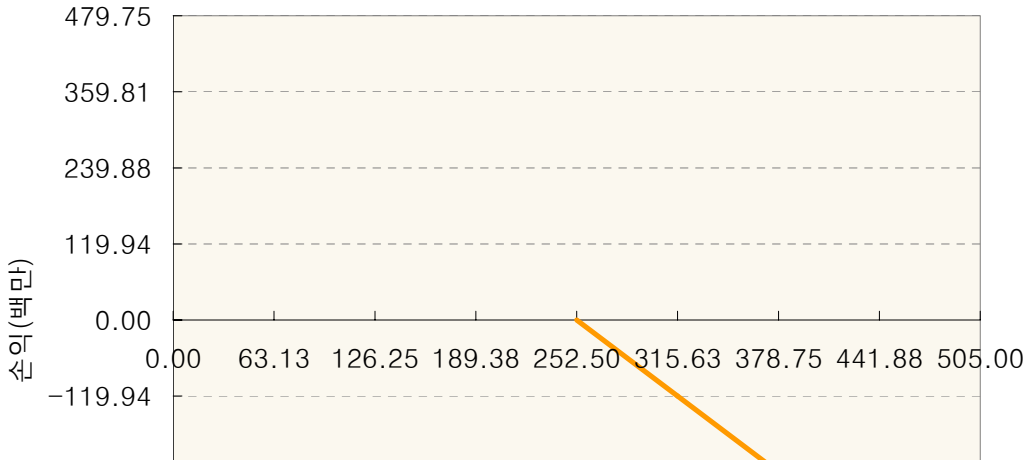
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	980	-980	장내

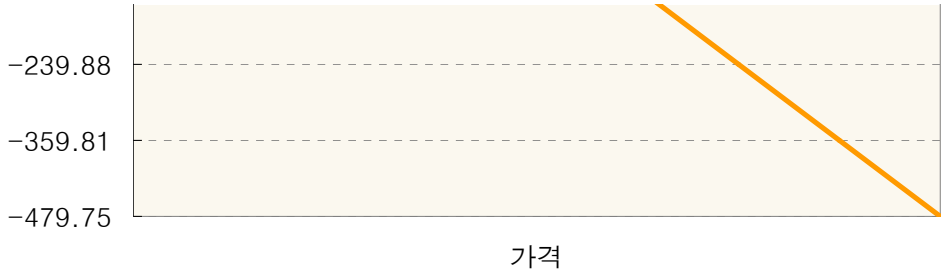
2. 만기시점의 손익구조

KR4201K22508-2015-02 콜250



KR4201K22524-2015-02 콜252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201K225 2015-02 콜250							161
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	27	27	27	27	27	27	26
-5.33%	27	27	26	26	25	24	24
-2.67%	24	23	21	20	18	16	14
0%	8	5	3	0	-3	-5	-8
2.67%	-33	-35	-37	-40	-42	-44	-47
5.33%	-93	-94	-95	-96	-97	-98	-100
8.00%	-159	-159	-159	-159	-160	-160	-161
KR4201K225 2015-02 콜252.5							139
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17	17	17	17	17	17	16
-5.33%	17	17	16	16	16	15	15
-2.67%	16	15	14	13	12	10	9
0%	7	5	2	0	-2	-5	-7
2.67%	-23	-25	-28	-30	-33	-36	-38
5.33%	-75	-76	-77	-79	-80	-82	-84
8.00%	-136	-136	-137	-137	-138	-138	-139

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

(단위:백만원)

322

공시일	2015-01-22
기준일	2015-01-21

스마트인덱스모

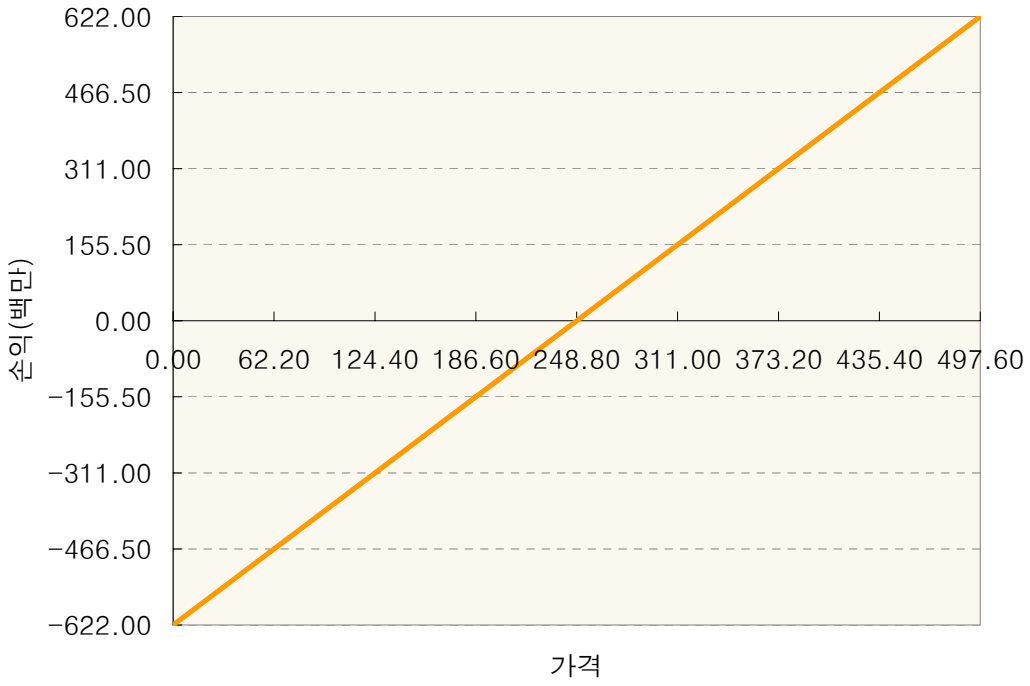
1. 계약금액

(단위:백만원)

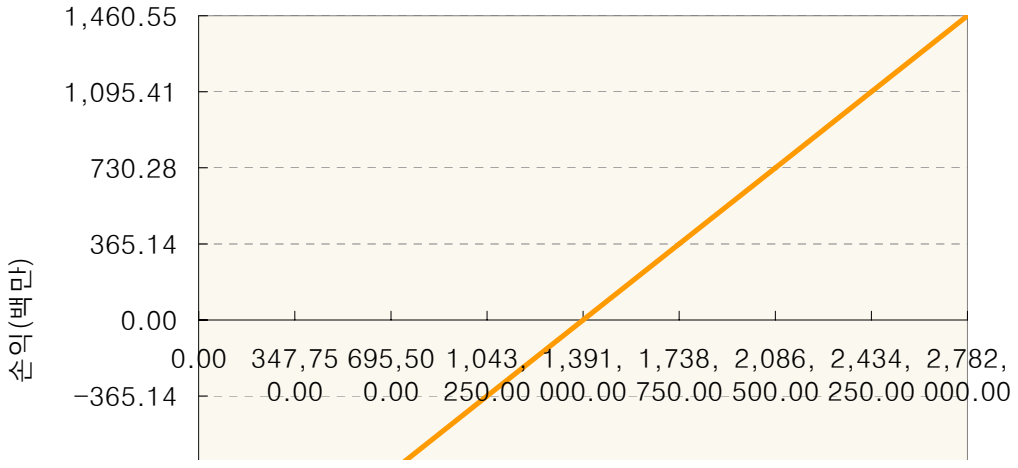
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,083	0	2,083	장내

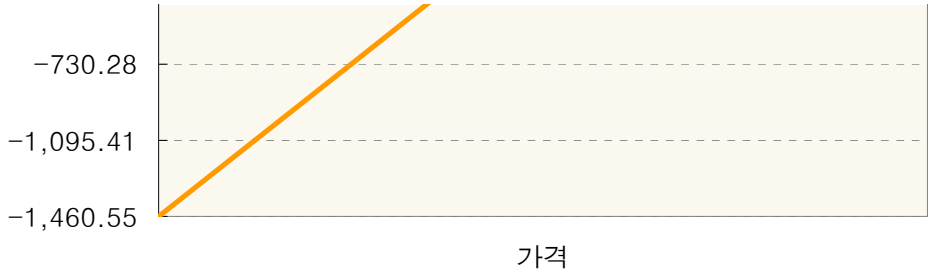
2. 만기시점의 손익구조

KR4101K30008-2015-03 지수선물



KR4111K30007-2015-03 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101K300 2015-03 지수선물							50
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	17	17	17	17	17	17	17
5.33%	33	33	33	33	33	33	33
8.00%	50	50	50	50	50	50	50
KR4111K300 2015-03 삼성전자개별선물							117
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117
-5.33%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	39	39	39	39	39	39	39
5.33%	78	78	78	78	78	78	78
8.00%	117	117	117	117	117	117	117

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

(단위:백만원)

151

공시일	2015-01-22
기준일	2015-01-21

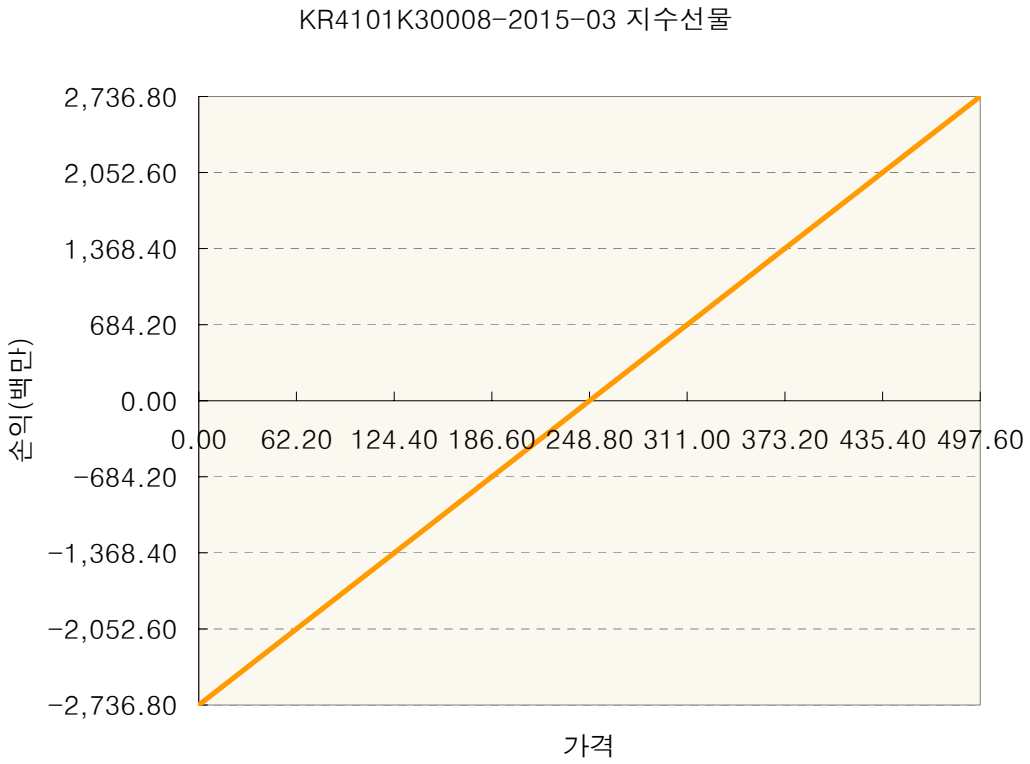
스마트레버리지목표전환형1호

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	2,737	0	2,737	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101K300 2015-03 지수선물							219
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-219	-219	-219	-219	-219	-219	-219
-5.33%	-146	-146	-146	-146	-146	-146	-146
-2.67%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	73	73	73	73	73	73	73
5.33%	146	146	146	146	146	146	146
8.00%	219	219	219	219	219	219	219

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

143

공시일	2015-01-22
기준일	2015-01-21

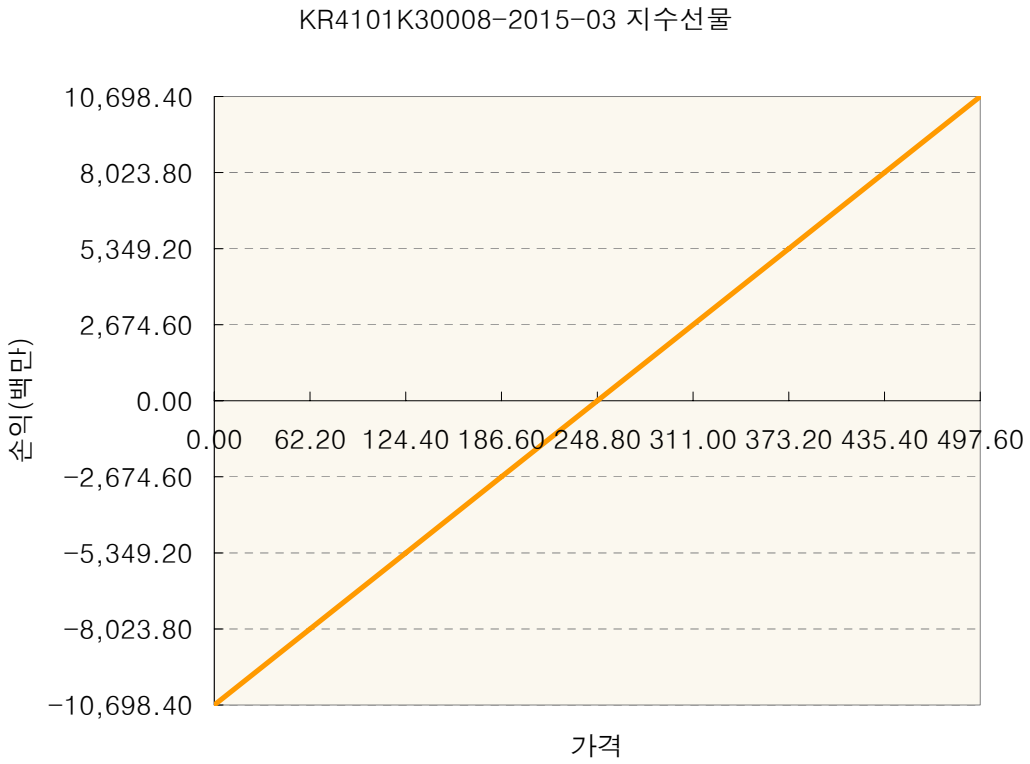
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	10,698	0	10,698	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101K300 2015-03 지수선물 855

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-855	-855	-855	-855	-855	-855	-855
-5.33%	-570	-570	-570	-570	-570	-570	-570
-2.67%	-285	-285	-285	-285	-285	-285	-285
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	285	285	285	285	285	285	285
5.33%	570	570	570	570	570	570	570
8.00%	855	855	855	855	855	855	855

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

561

공시일	2015-01-22
기준일	2015-01-21

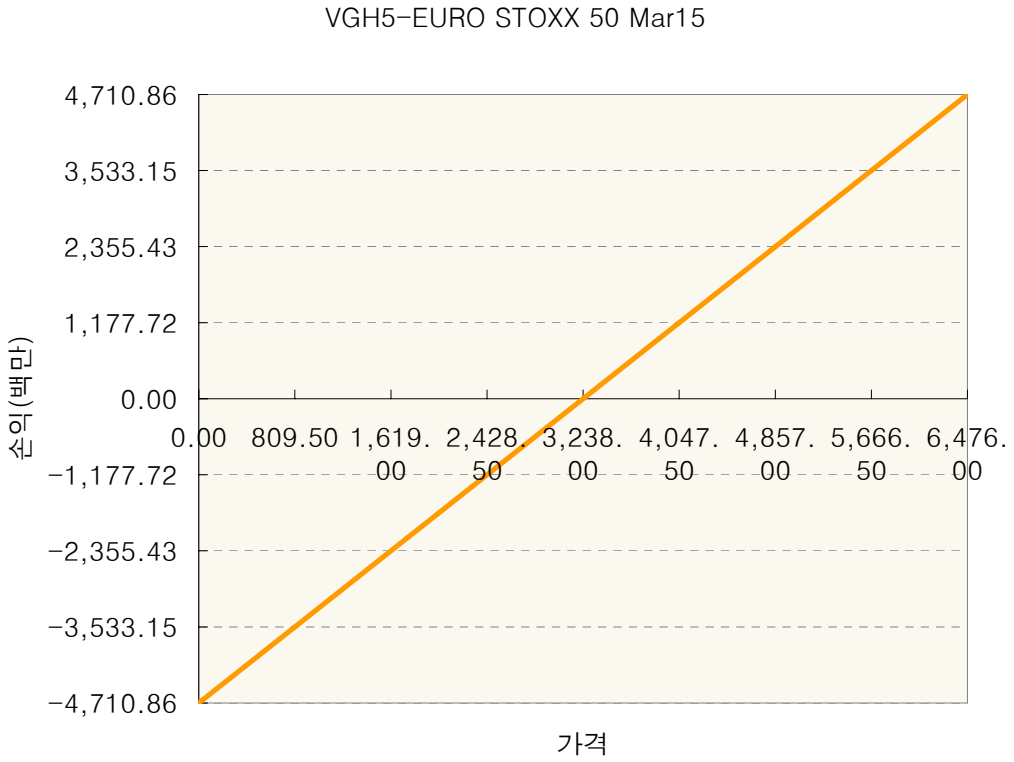
유로인덱스1호(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,711	0	4,711	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH5	EURO STOXX 50 Mar15	377

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

(단위:백만원)

315

공시일	2015-01-22
기준일	2015-01-21

아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

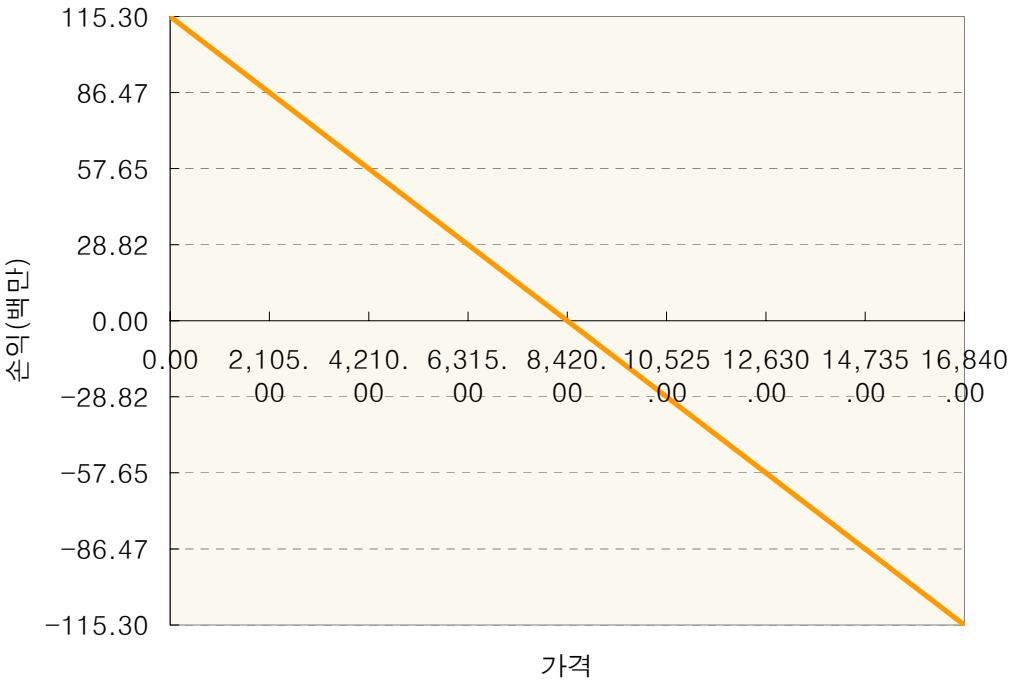
1. 계약금액

(단위:백만원)

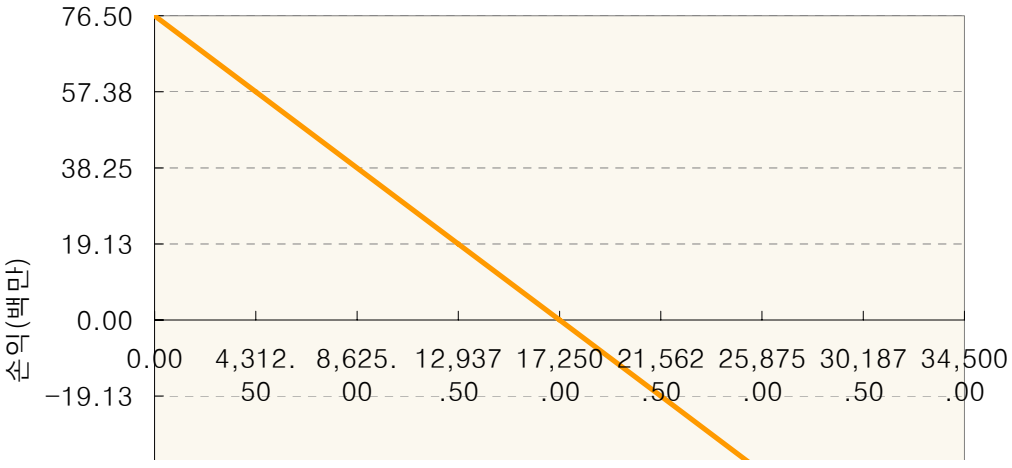
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	0	227	-227	

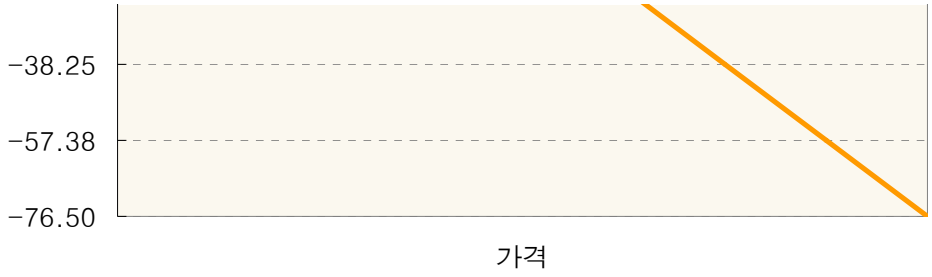
2. 만기시점의 손익구조

JYH5-JPN YEN FUT MAR15

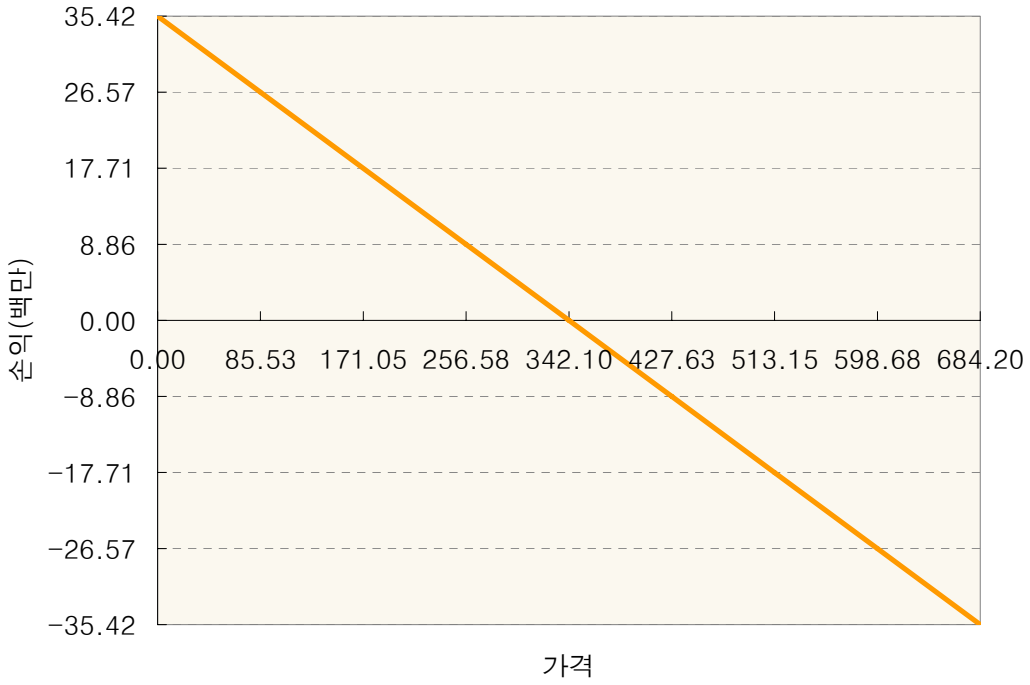


NIH5-NIKKEI 225 (SGX) Mar15





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	2015-01-22
기준일	2015-01-21

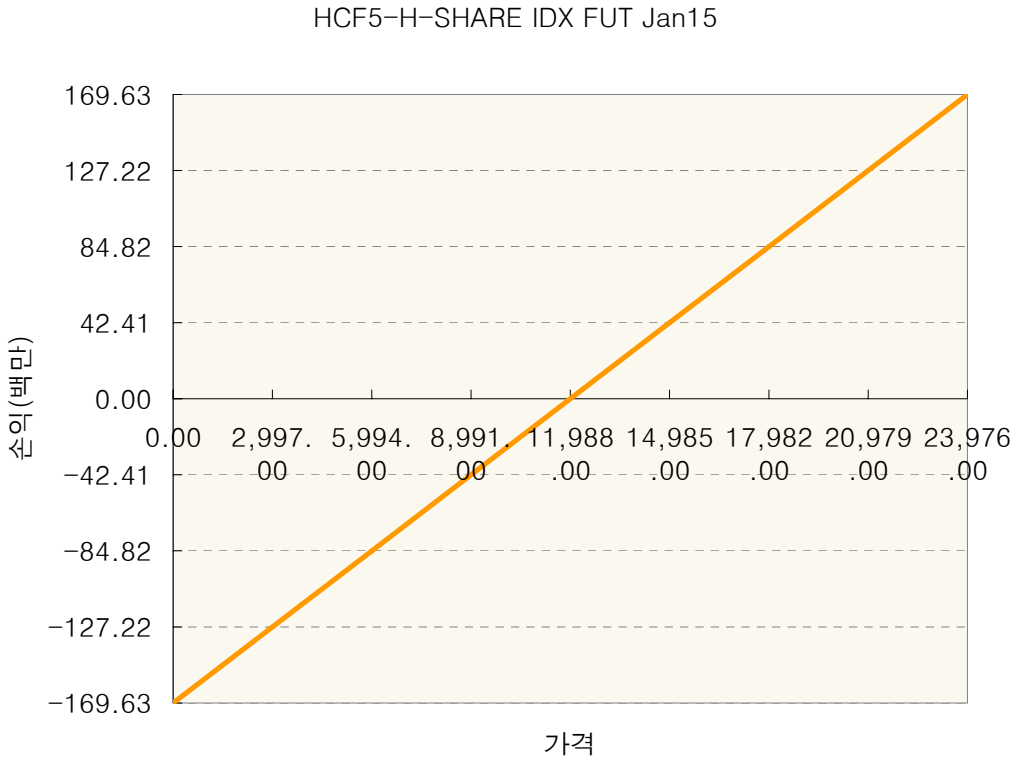
차이나인덱스(주식-파생형)(종)

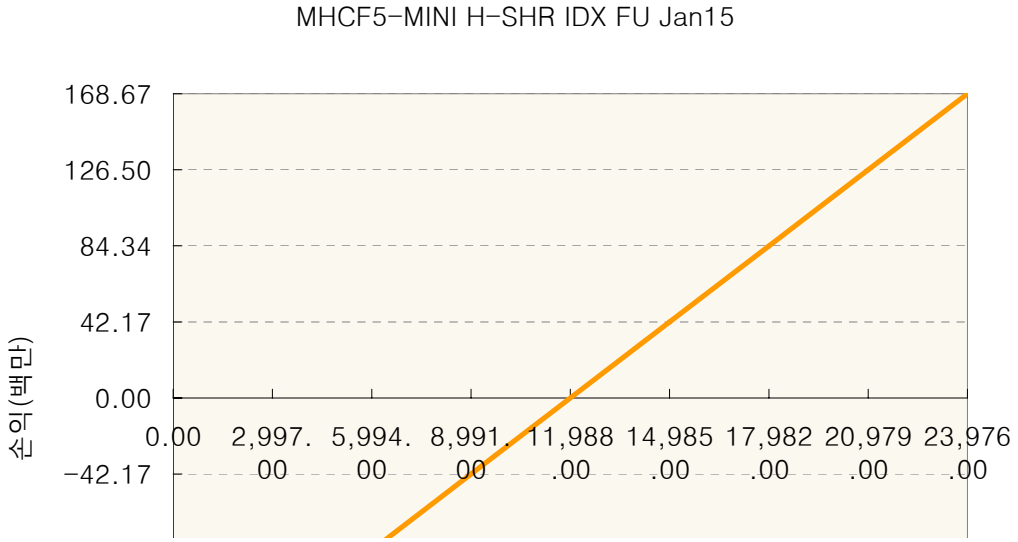
1. 계약금액

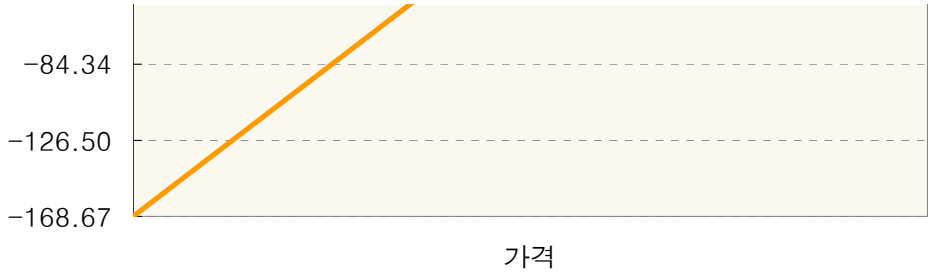
(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF5	H-SHARE IDX FUT Jan15	14
MHCF5	MINI H-SHR IDX FU Jan15	13

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

(단위:백만원)

27

공시일	2015-01-22
기준일	2015-01-21

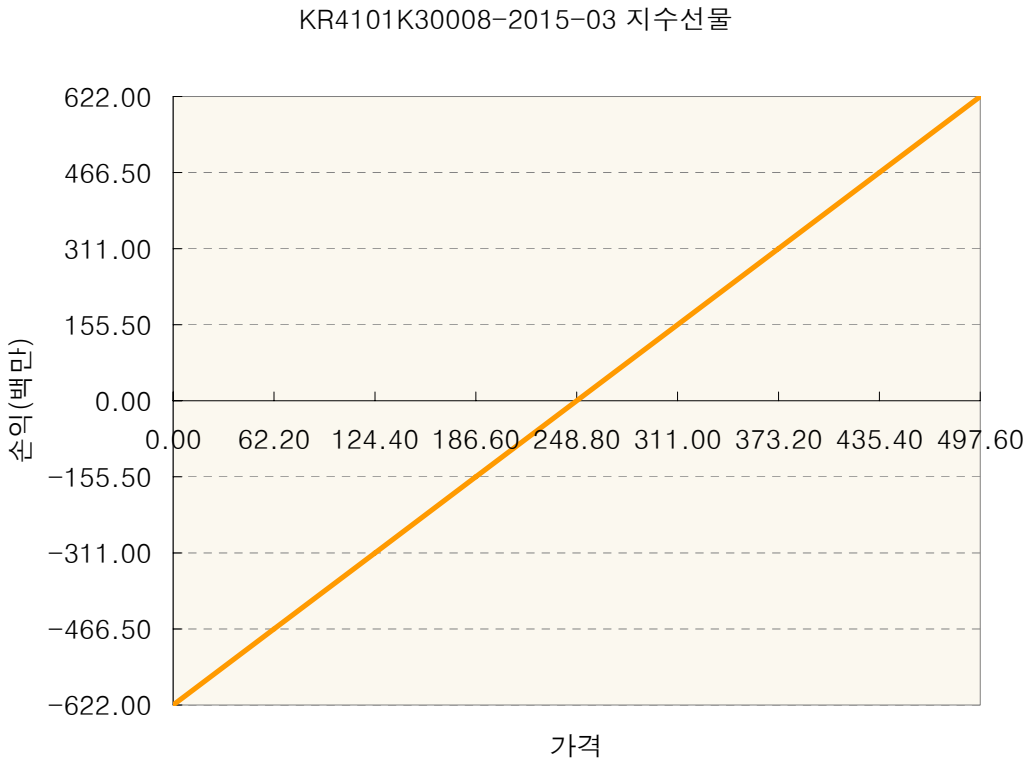
ETF스마트레버리지목표전환형제4

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	622	0	622	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101K300 2015-03 지수선물 50

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	17	17	17	17	17	17	17
5.33%	33	33	33	33	33	33	33
8.00%	50	50	50	50	50	50	50

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

33

공시일	2015-01-22
기준일	2015-01-21

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	2,420

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,387

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2015-01-22
기준일	2015-01-21

메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

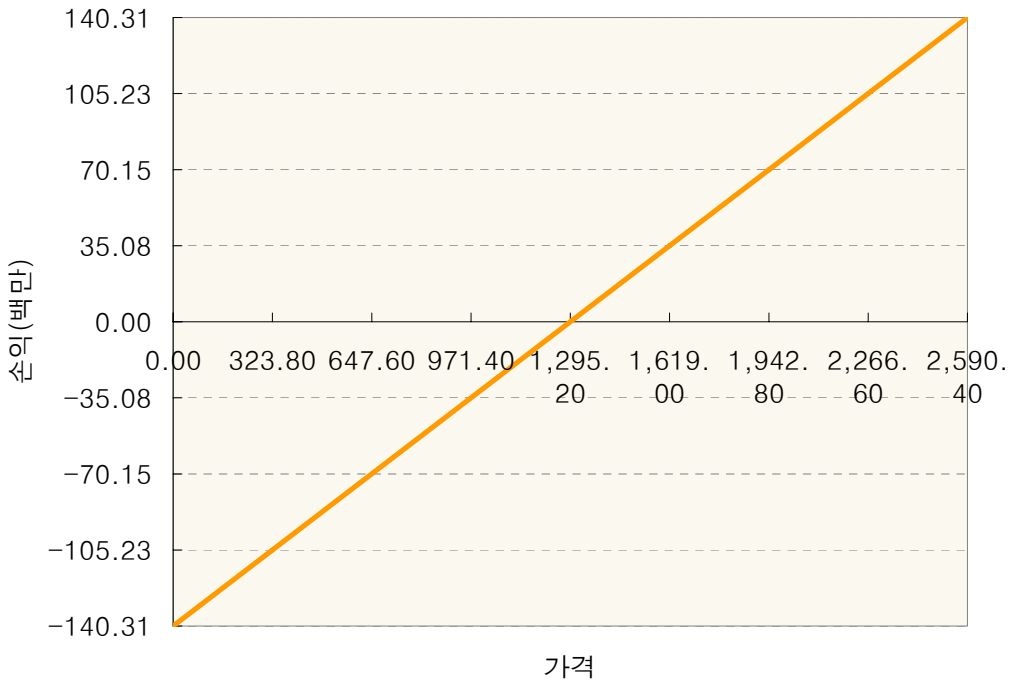
1. 계약금액

(단위:백만원)

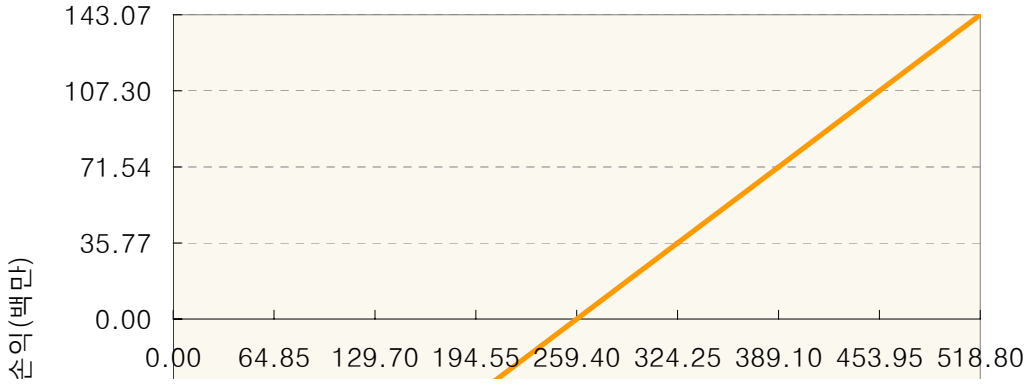
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	20	0	20	
누계	유가증권	선물	594	174	420	

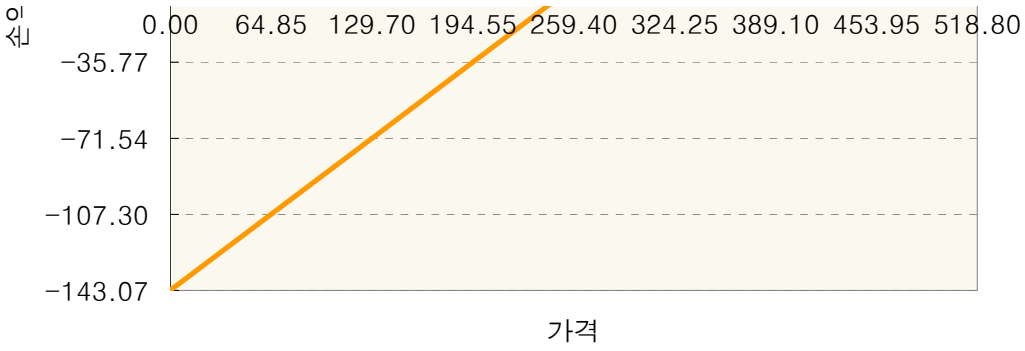
2. 만기시점의 손익구조

GCJ5-GOLD 100 OZ FUTR Apr15

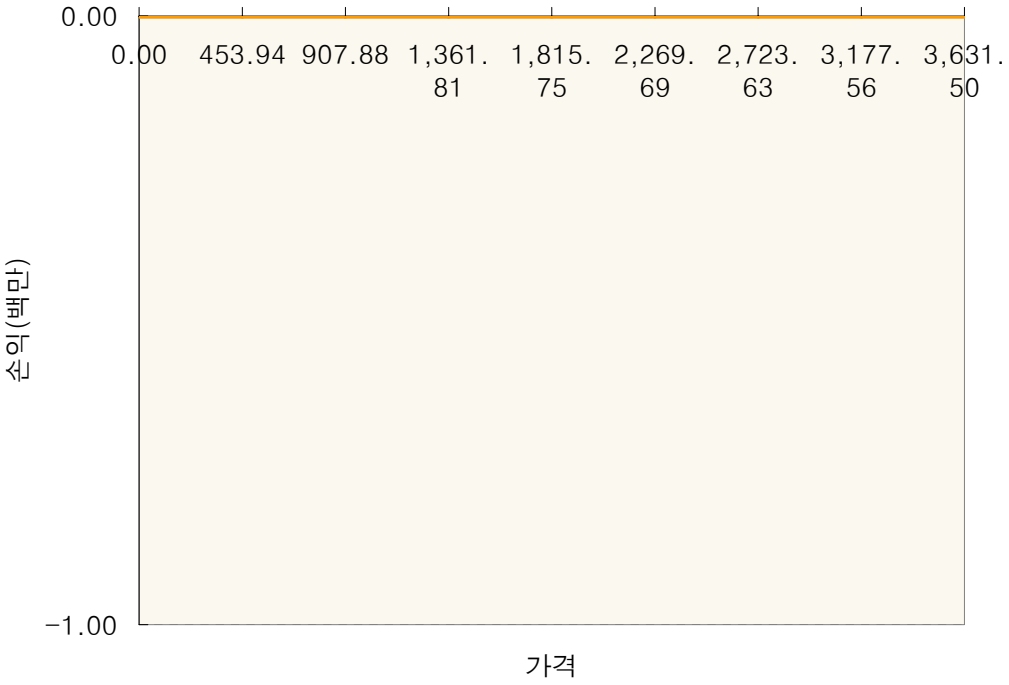


HGH5-COPPER FUTURE Mar15

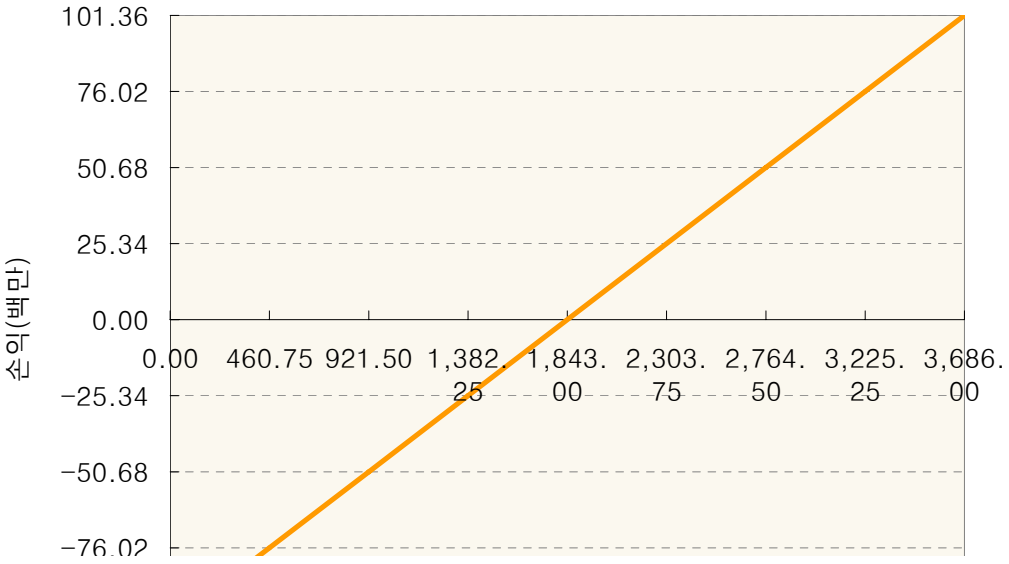


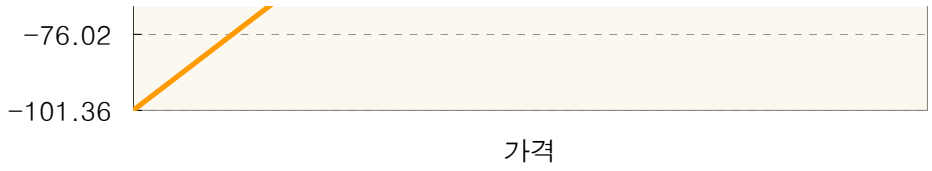


LAF5-LME PRI ALUM FUTR JAN 15

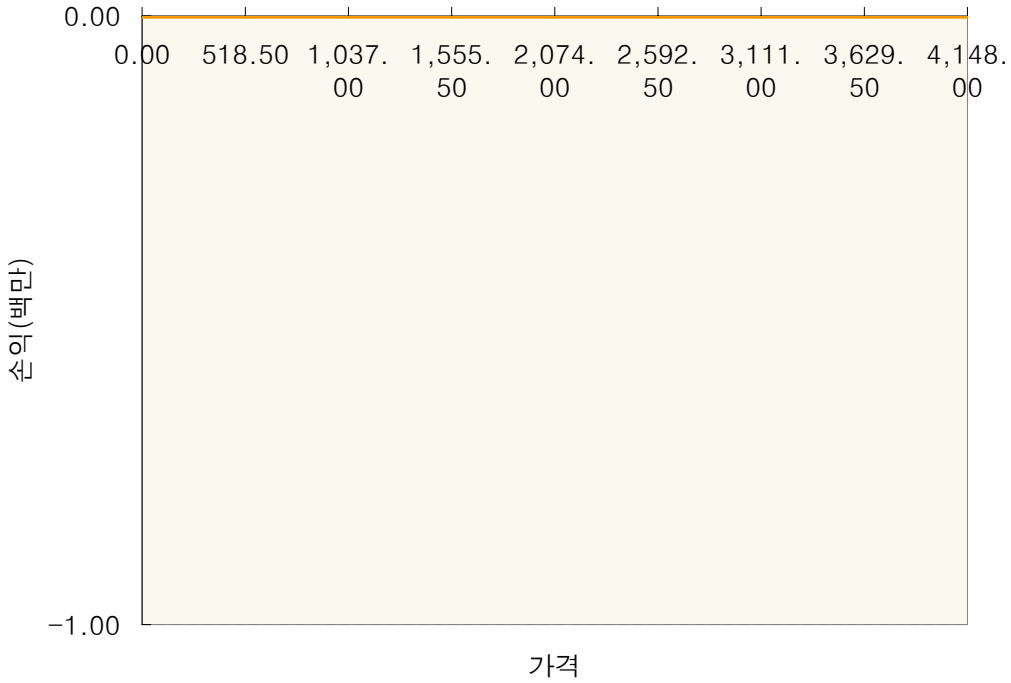


LAH5-LME PRI ALUM FUTR MAR 15

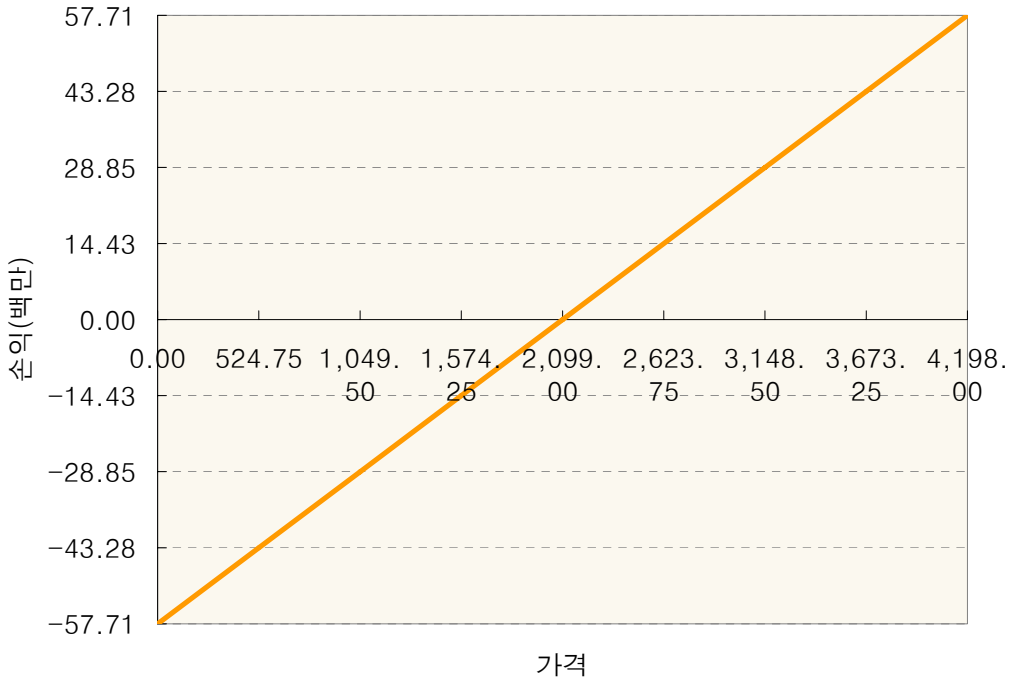


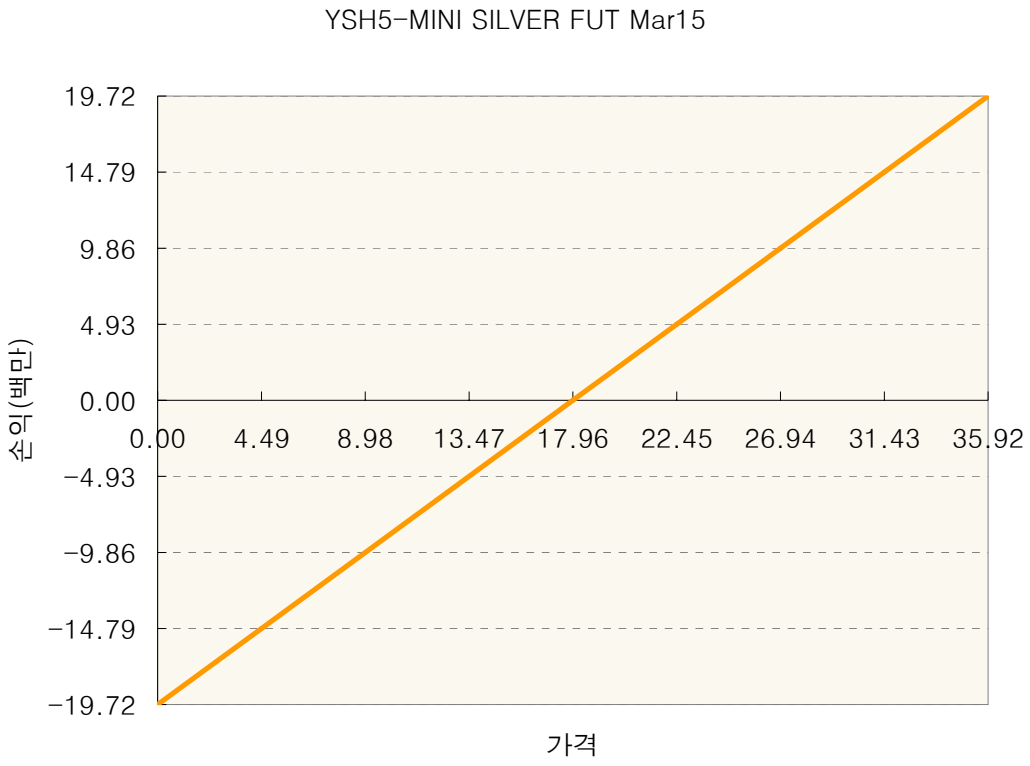


LXF5-LME ZINC FUTURE JAN15



LXH5-LME ZINC FUTURE MAR15





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

GCJ5	GOLD 100 OZ FUTR Apr15	11
HGH5	COPPER FUTURE Mar15	11
LAF5	LME PRI ALUM FUTR JAN 15	1
LAH5	LME PRI ALUM FUTR MAR 15	8
LXF5	LME ZINC FUTURE JAN15	1
LXH5	LME ZINC FUTURE MAR15	5
YSH5	MINI SILVER FUT Mar15	2

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

(단위:백만원)

34

공시일	2015-01-22
기준일	2015-01-21

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

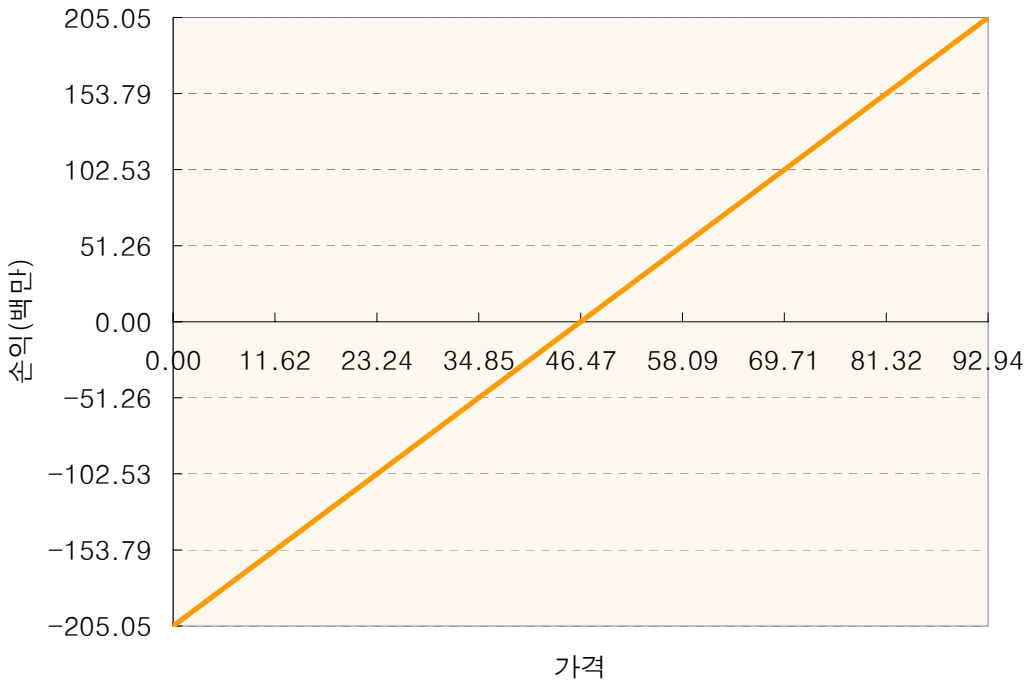
1. 계약금액

(단위:백만원)

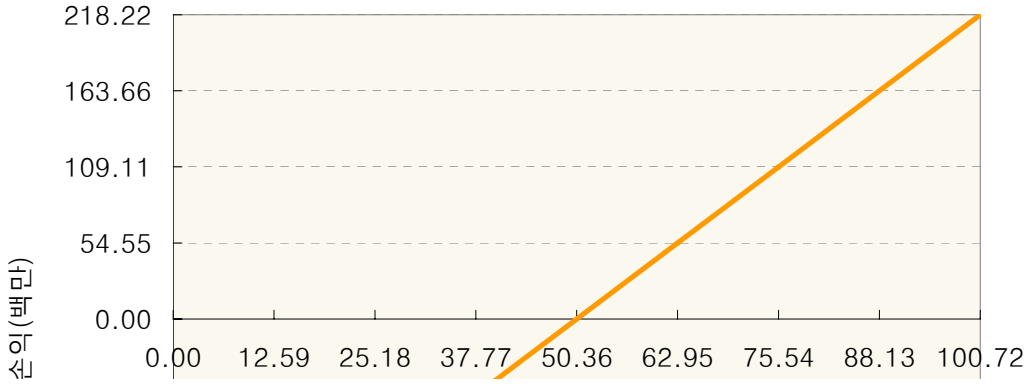
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	205	0	205	
누계	유가증권	선물	696	0	696	

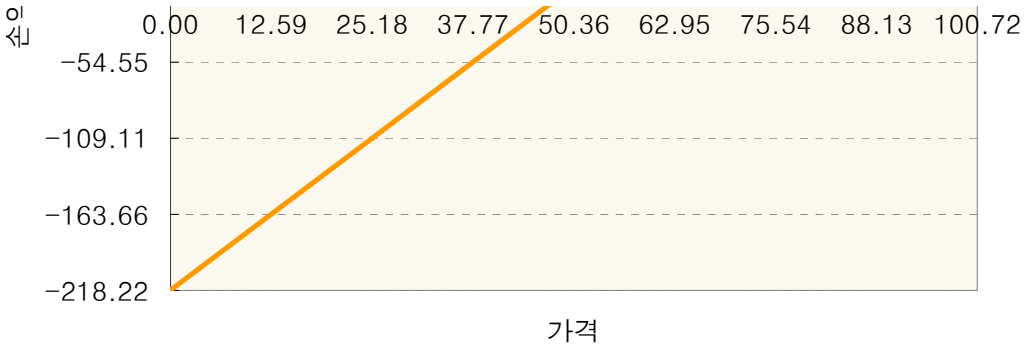
2. 만기시점의 손익구조

CLH5-WTI CRUDE FUTURE Mar15

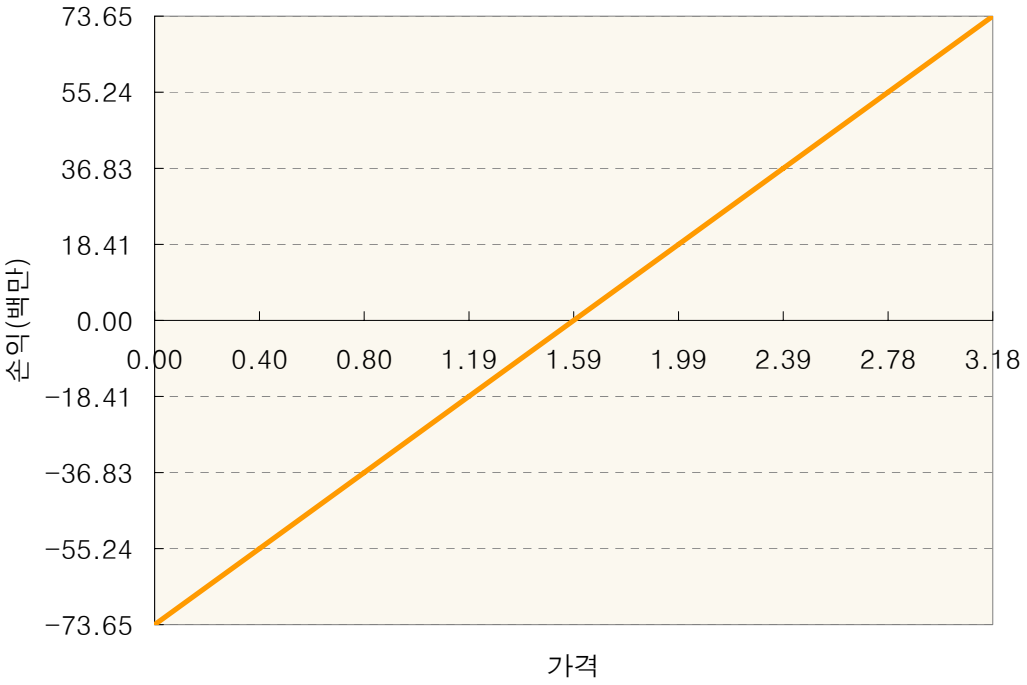


COK5-BRENT CRUDE FUTR May15

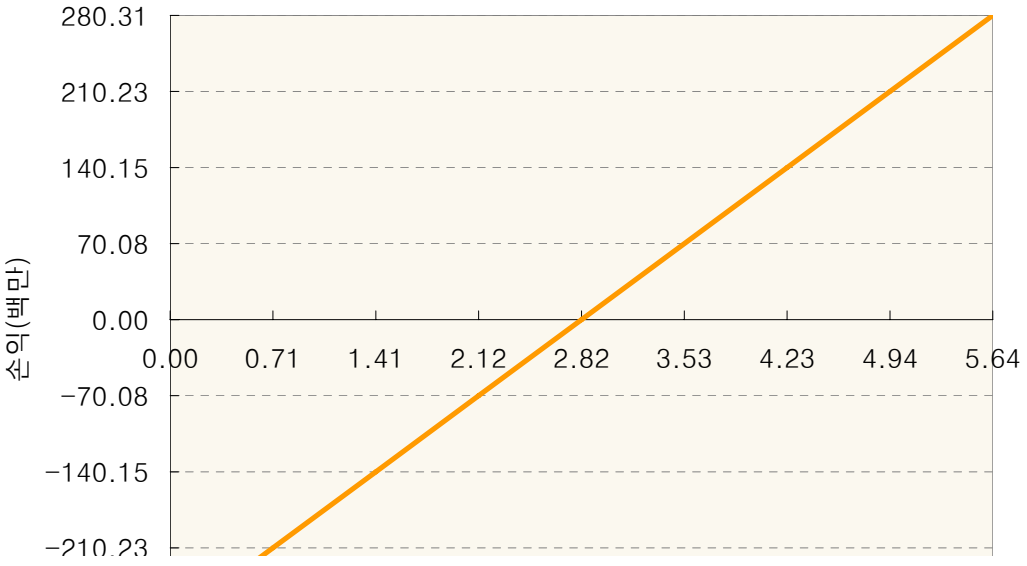


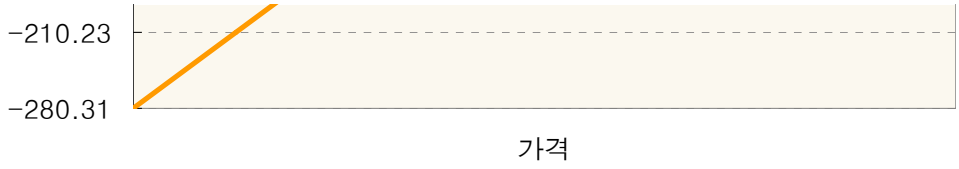


HOH5-NY Harb ULSD Fut Mar15

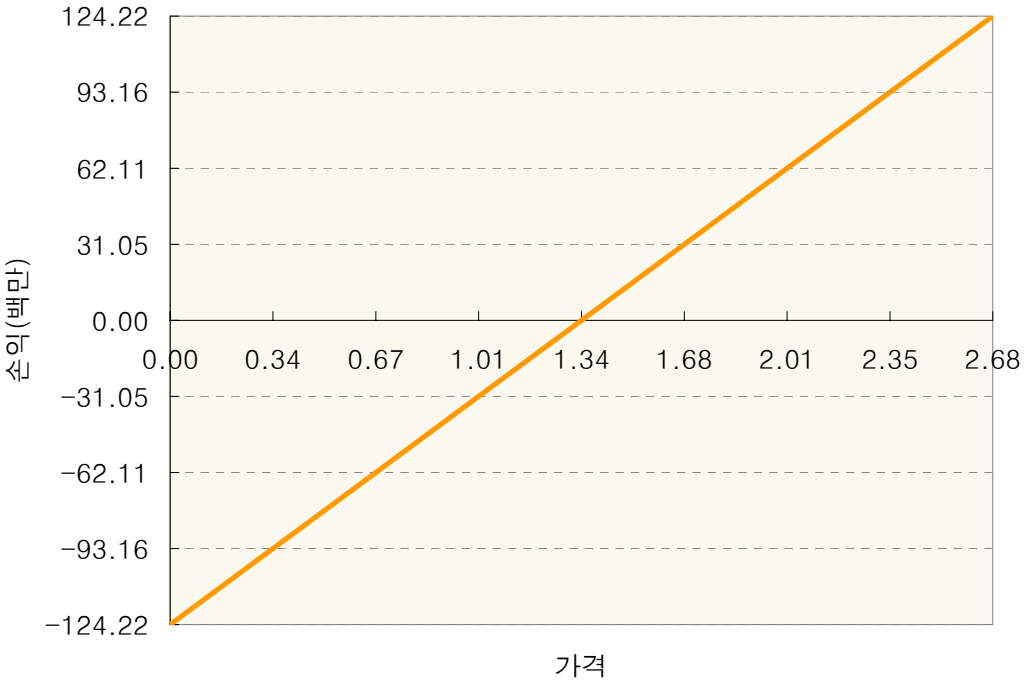


NGH5-NATURAL GAS FUTR Mar15





XBH5-GASOLINE RBOB FUT Mar15



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLH5	WTI CRUDE FUTURE Mar15	16
COK5	BRENT CRUDE FUTR May15	17
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)

135

공시일	2015-01-22
기준일	2015-01-21

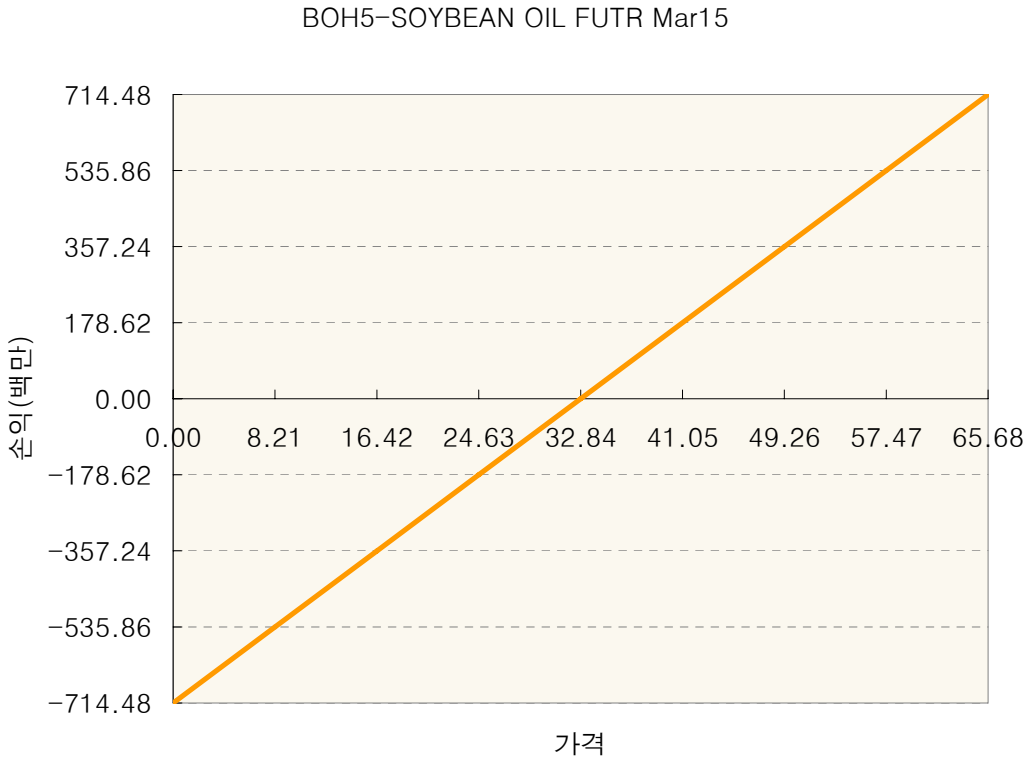
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

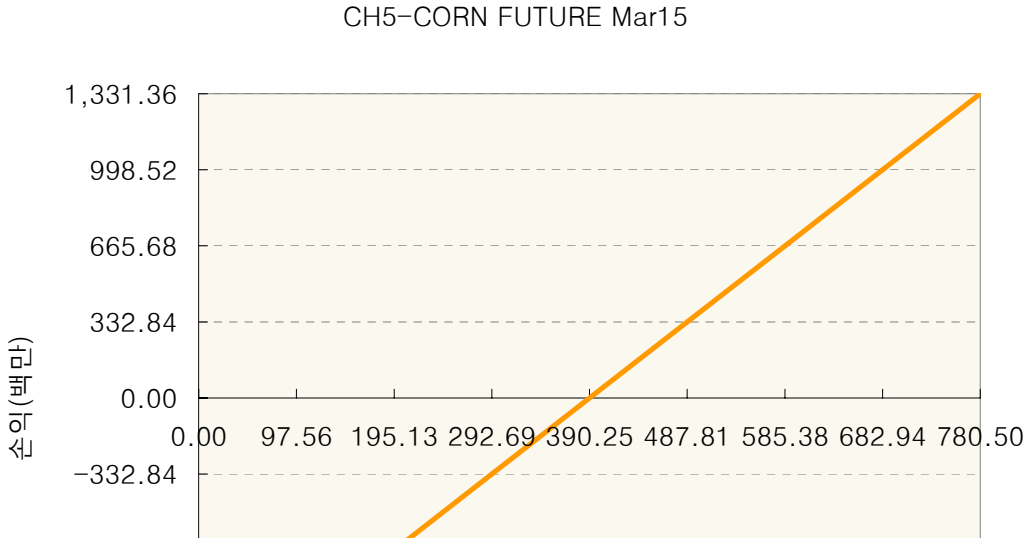
1. 계약금액

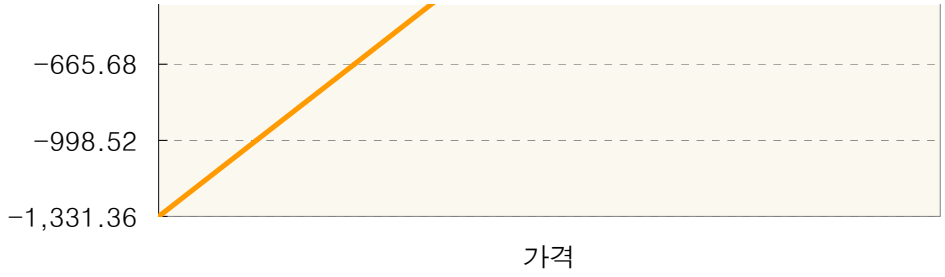
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,761	0	7,761	

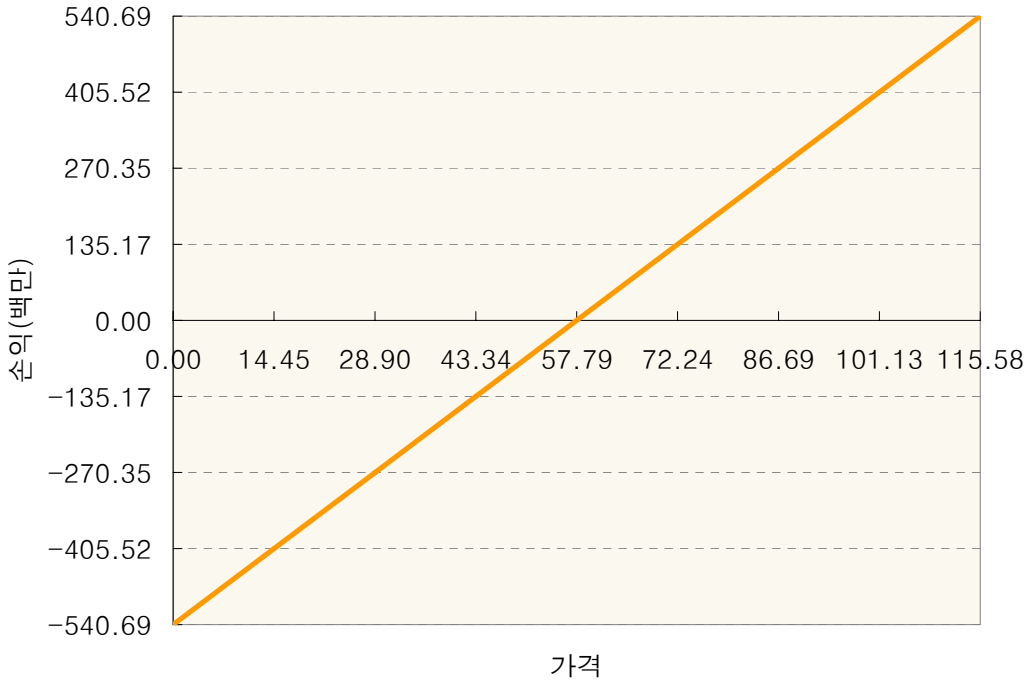
2. 만기시점의 손익구조



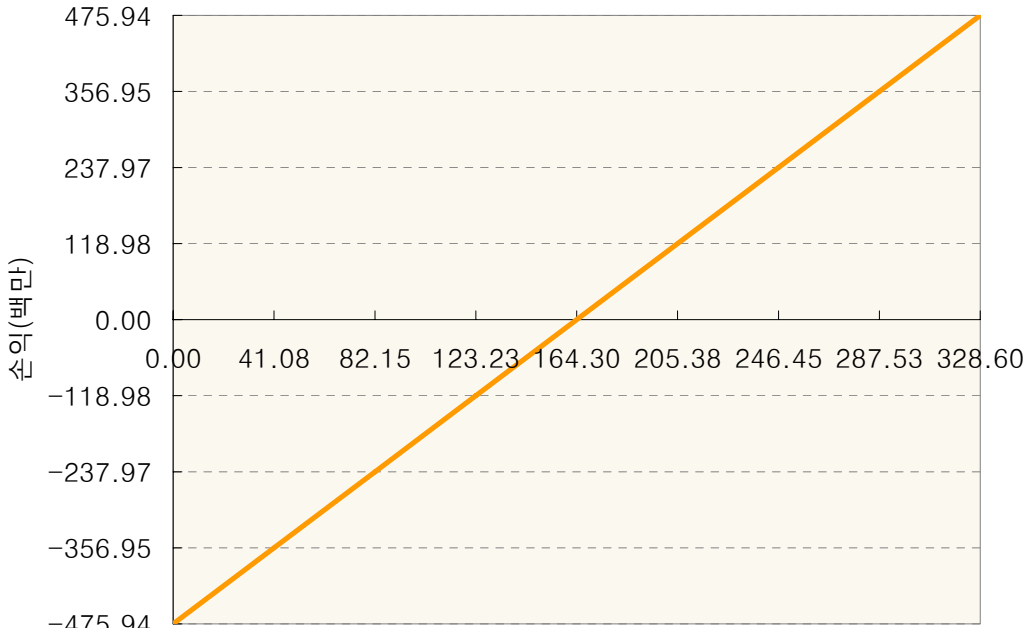


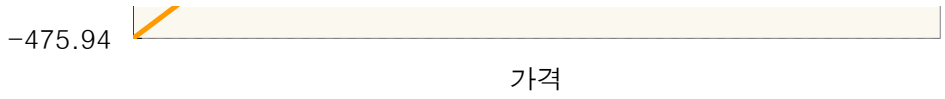


CTH5-COTTON NO.2 FUTR Mar15

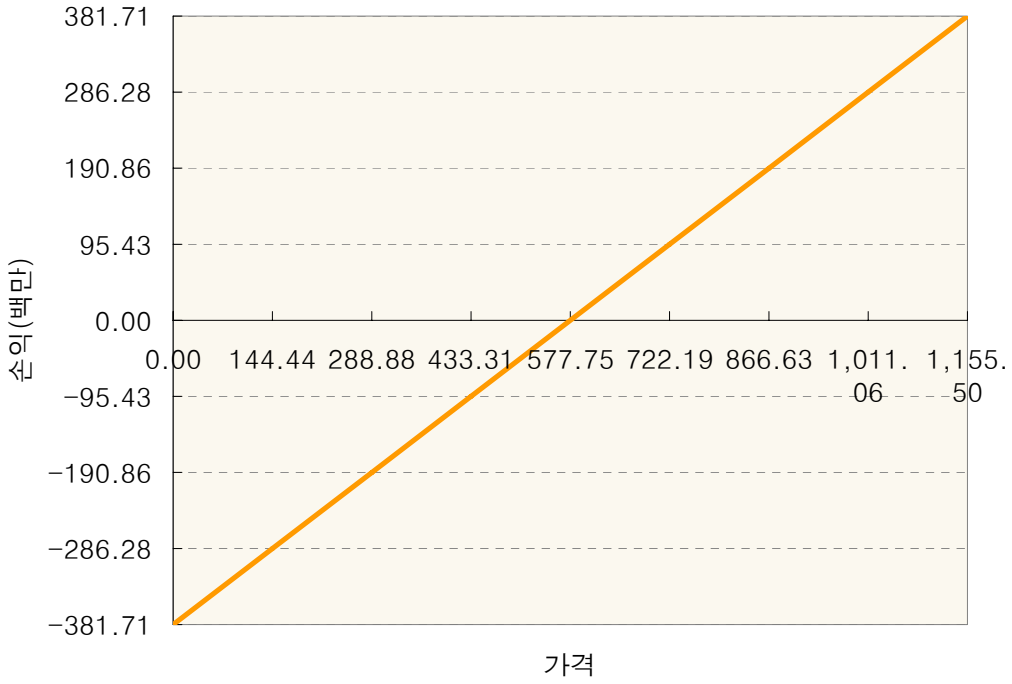


KCH5-COFFEE "C" FUTURE Mar15

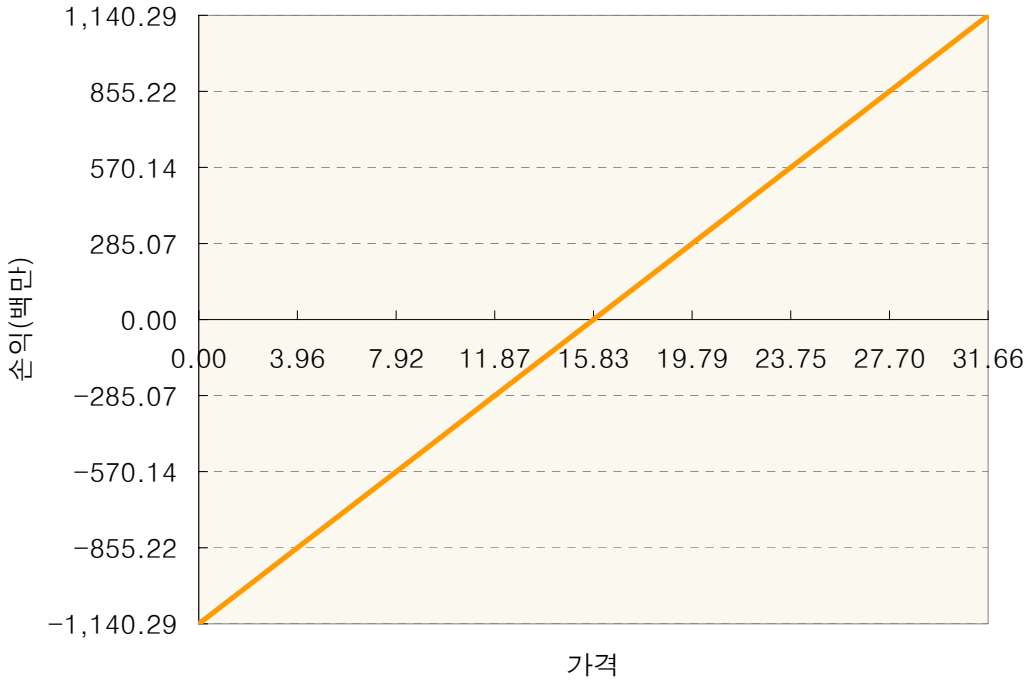




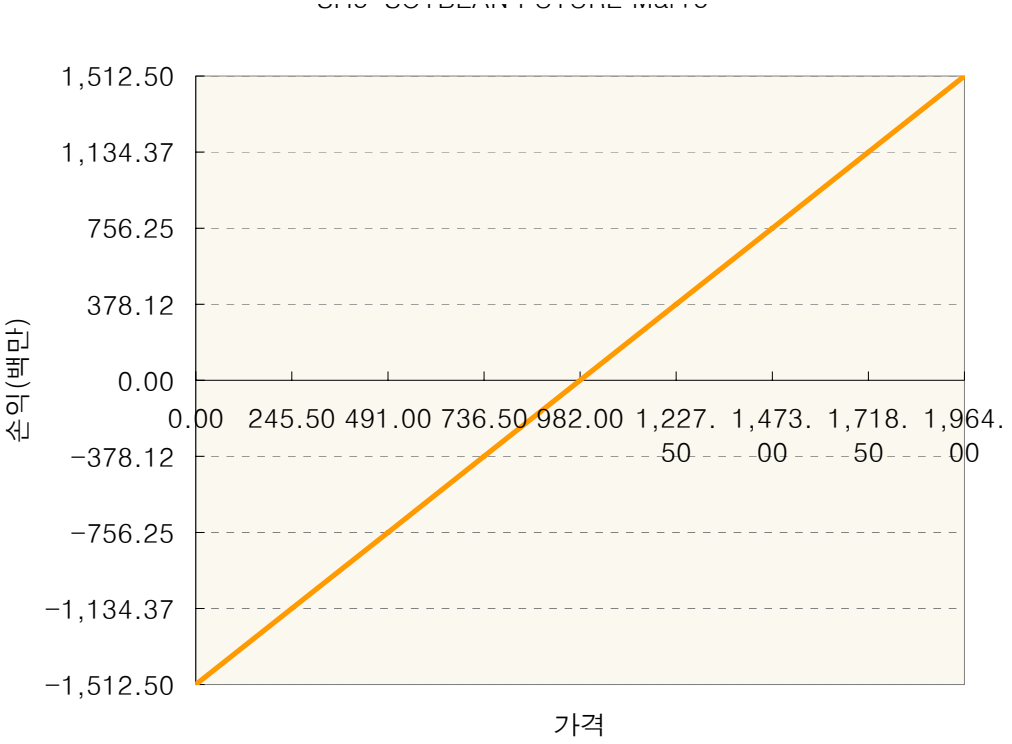
KWH5-WHEAT FUTURE(KCB) Mar15



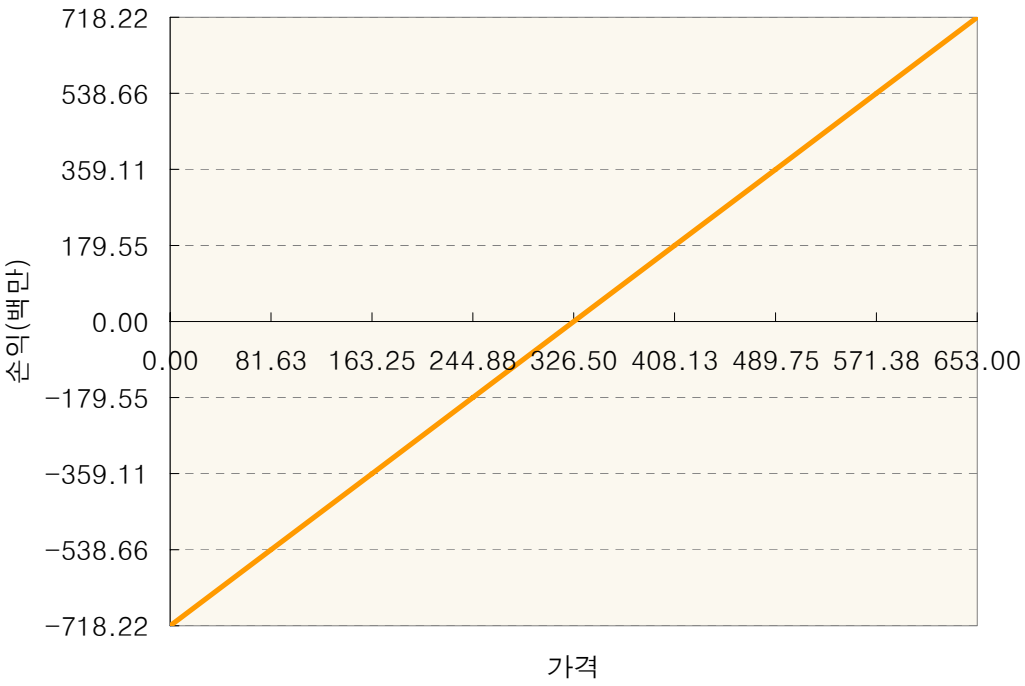
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar15



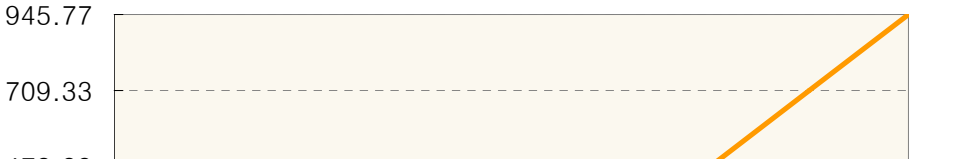
SH5-SOYBEAN FUTURE Mar15

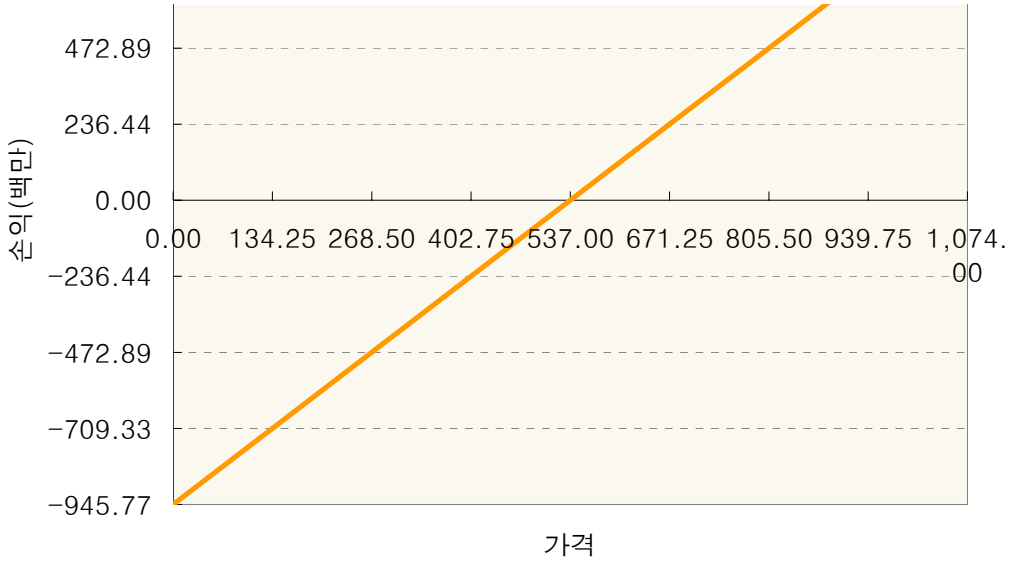


SMH5-SOYBEAN MEAL FUTR Mar15



WH5-WHEAT FUTURE(CBT) Mar15





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH5	SOYBEAN OIL FUTR Mar15	57
CH5	CORN FUTURE Mar15	107
CTH5	COTTON NO.2 FUTR Mar15	43
KCH5	COFFEE "C" FUTURE Mar15	38
KWH5	WHEAT FUTURE(KCB) Mar15	31
SBH5	Sugar #11 (WORLD) Mar15	91
SH5	SOYBEAN FUTURE Mar15	121
SMH5	SOYBEAN MEAL FUTR Mar15	57
WH5	WHEAT FUTURE(CBT) Mar15	76

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

(단위:백만원)

870