공시일	2015-01-29
기준일	2015-01-28

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	2015-01-29
기준일	2015-01-28

차곡차곡플러스모(주식혼합-파생)

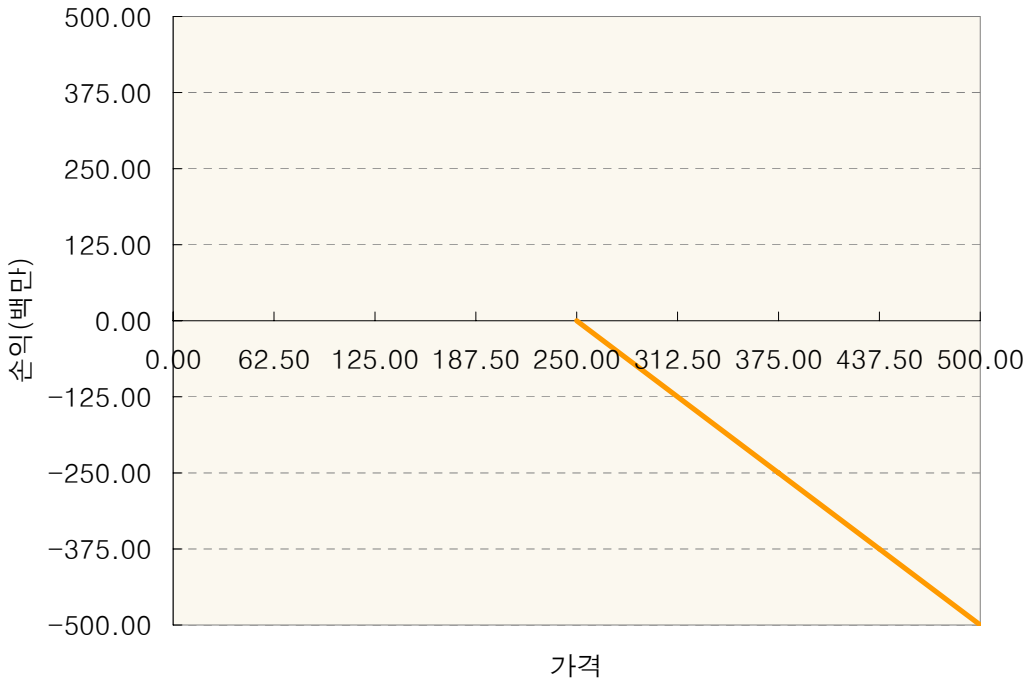
1. 계약금액

(단위:백만원)

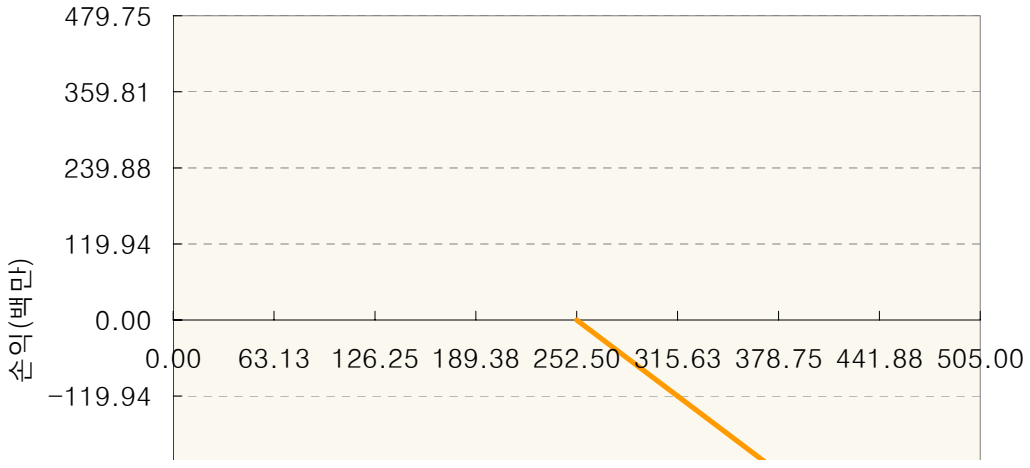
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	980	-980	장내

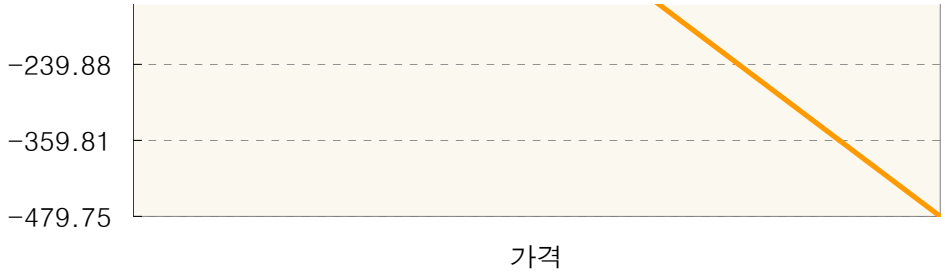
2. 만기시점의 손익구조

KR4201K22508-2015-02 콜250



KR4201K22524-2015-02 콜252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201K225 2015-02 콜250							185
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	40	40	40	40	39	39	39
-5.33%	39	39	39	38	38	37	36
-2.67%	35	33	31	30	28	26	24
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	-51	-52	-53	-53	-54	-55	-57
5.33%	-118	-118	-118	-118	-118	-119	-119
8.00%	-185	-185	-185	-185	-185	-185	-185
KR4201K225 2015-02 콜252.5							166
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	24	24	24	24	24	24	24
-5.33%	24	24	24	24	24	23	23
-2.67%	23	22	21	20	18	17	16
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	-40	-41	-42	-43	-45	-46	-48
5.33%	-101	-102	-102	-102	-102	-103	-104
8.00%	-165	-165	-165	-165	-165	-165	-166

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

(단위:백만원)

427

공시일	2015-01-29
기준일	2015-01-28

스마트인덱스모

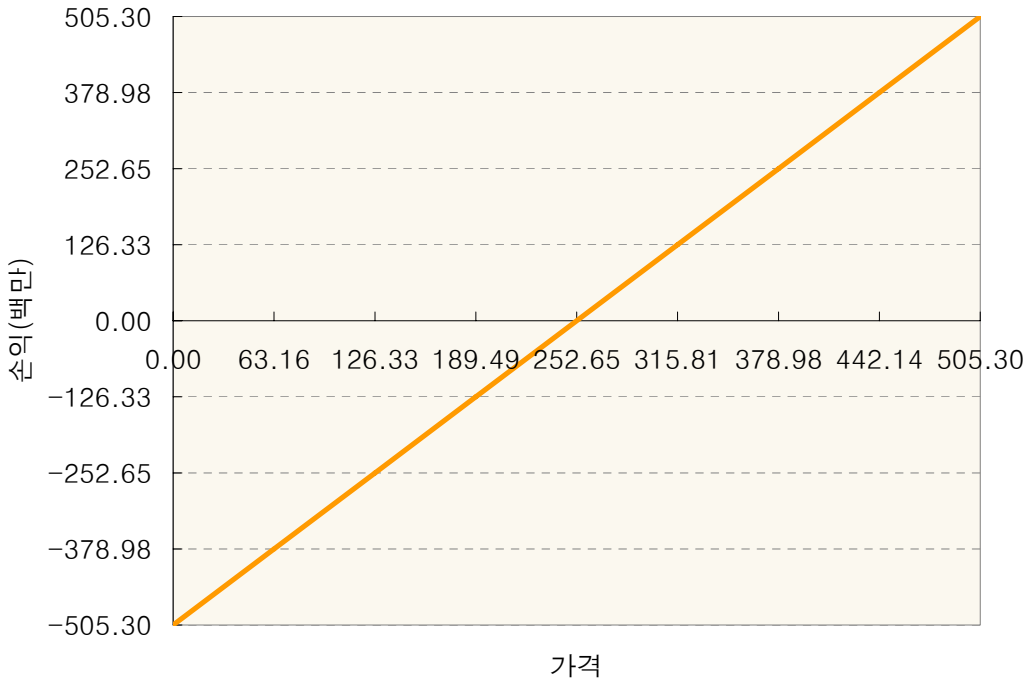
1. 계약금액

(단위:백만원)

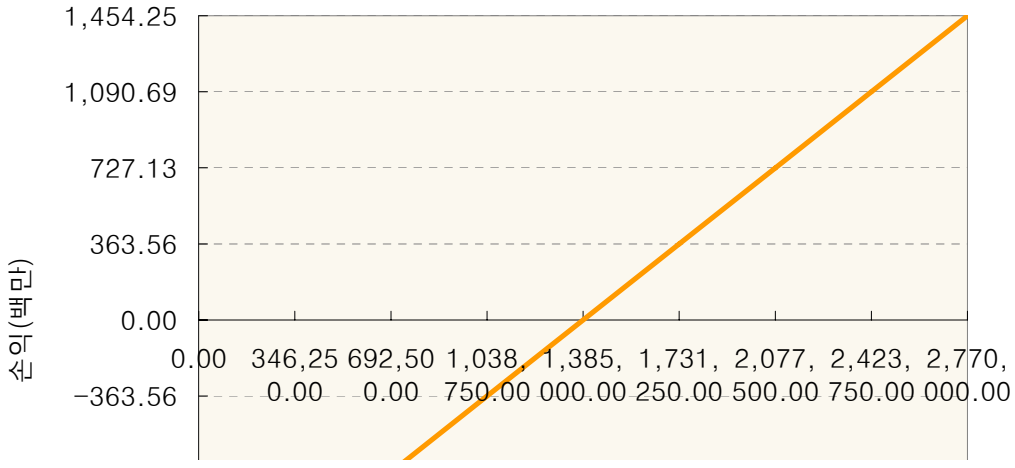
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	126	-126	장내
누계	유가증권	선물	1,960	0	1,960	장내

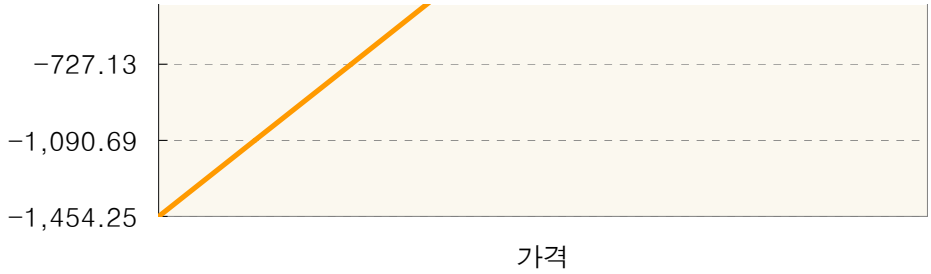
2. 만기시점의 손익구조

KR4101K30008-2015-03 지수선물



KR4111K30007-2015-03 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101K300 2015-03 지수선물							40
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
-5.33%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
-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%	27	27	27	27	27	27	27
8.00%	40	40	40	40	40	40	40
KR4111K300 2015-03 삼성전자개별선물							116
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116
-5.33%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
-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%	77	77	77	77	77	77	77
8.00%	116	116	116	116	116	116	116

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

(단위:백만원)

144

공시일	2015-01-29
기준일	2015-01-28

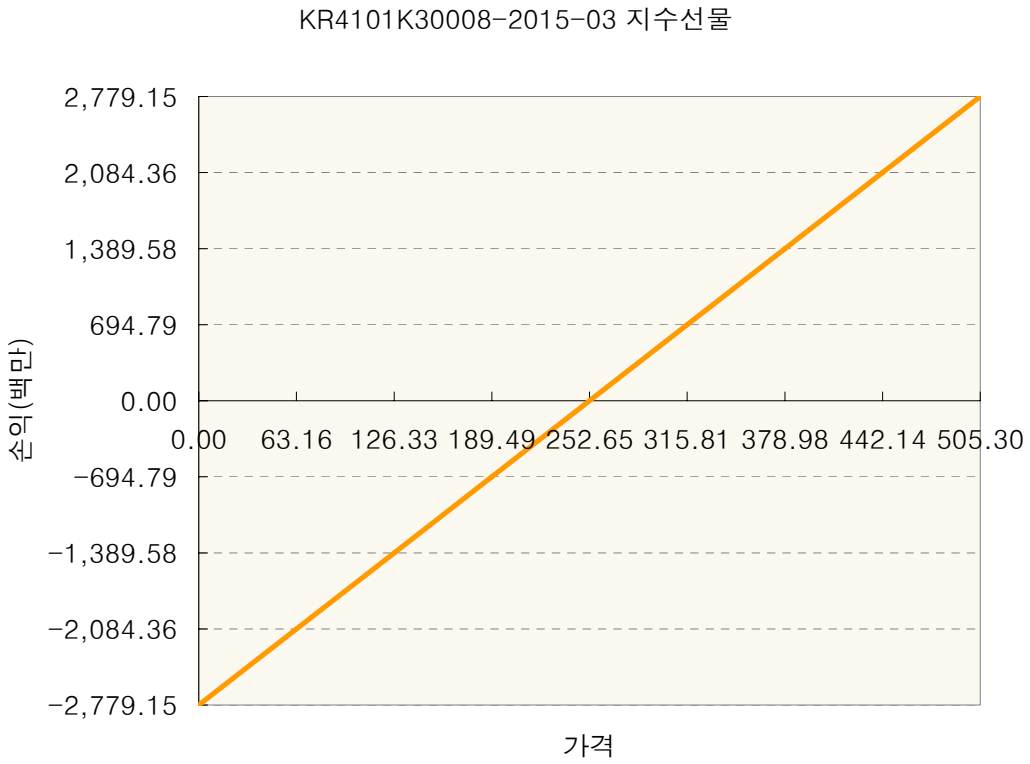
스마트레버리지목표전환형1호

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	2,779	0	2,779	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101K300 2015-03 지수선물 222

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-222	-222	-222	-222	-222	-222	-222
-5.33%	-148	-148	-148	-148	-148	-148	-148
-2.67%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	74	74	74	74	74	74	74
5.33%	148	148	148	148	148	148	148
8.00%	222	222	222	222	222	222	222

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

145

공시일	2015-01-29
기준일	2015-01-28

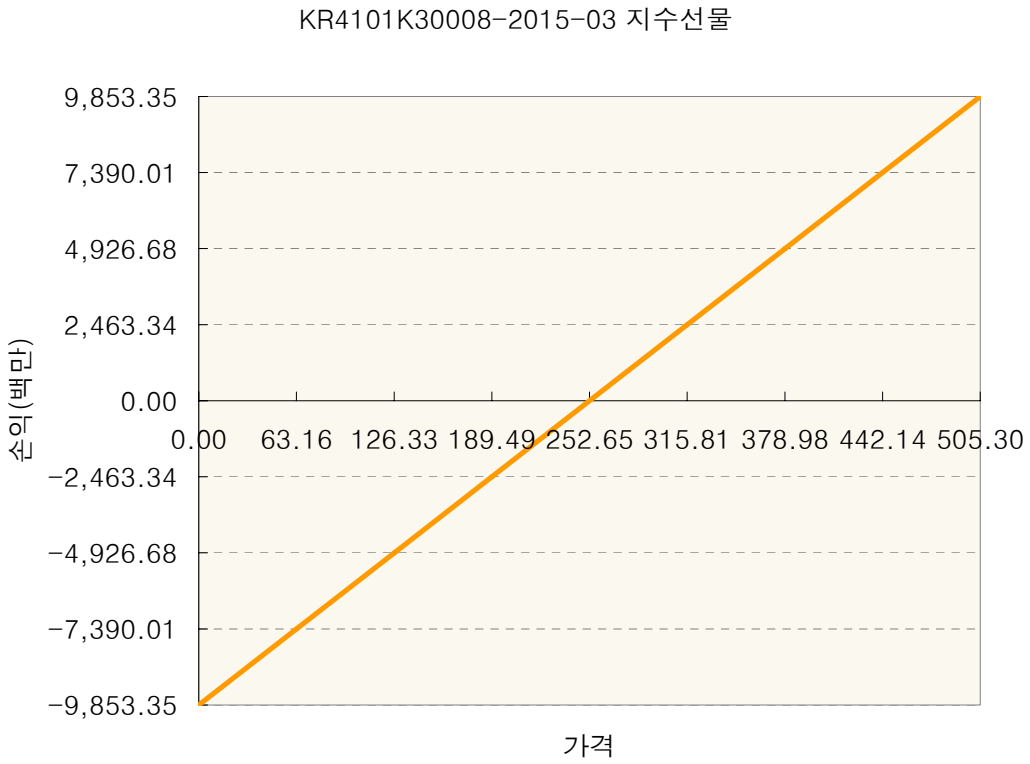
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	253	-253	장내
누계	유가증권	선물	9,853	0	9,853	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101K300 2015-03 지수선물 787

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-787	-787	-787	-787	-787	-787	-787
-5.33%	-525	-525	-525	-525	-525	-525	-525
-2.67%	-262	-262	-262	-262	-262	-262	-262
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	262	262	262	262	262	262	262
5.33%	525	525	525	525	525	525	525
8.00%	787	787	787	787	787	787	787

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

516

공시일	2015-01-29
기준일	2015-01-28

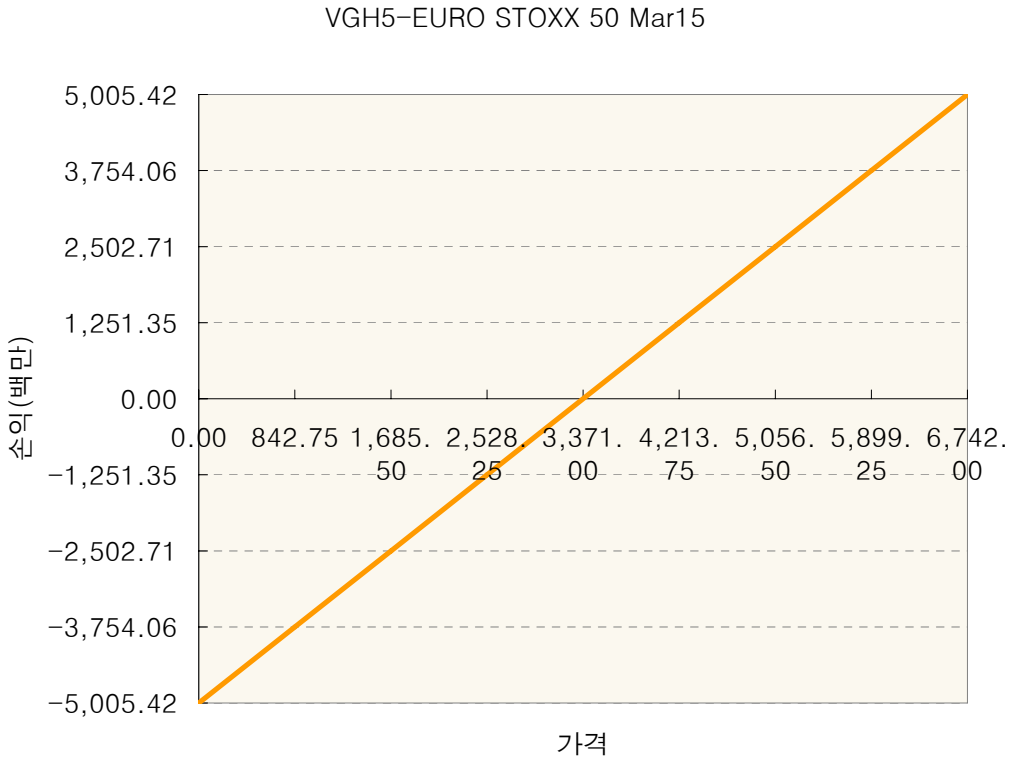
유로인덱스1호(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,005	0	5,005	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH5	EURO STOXX 50 Mar15	400

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

(단위:백만원)

340

공시일	2015-01-29
기준일	2015-01-28

아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

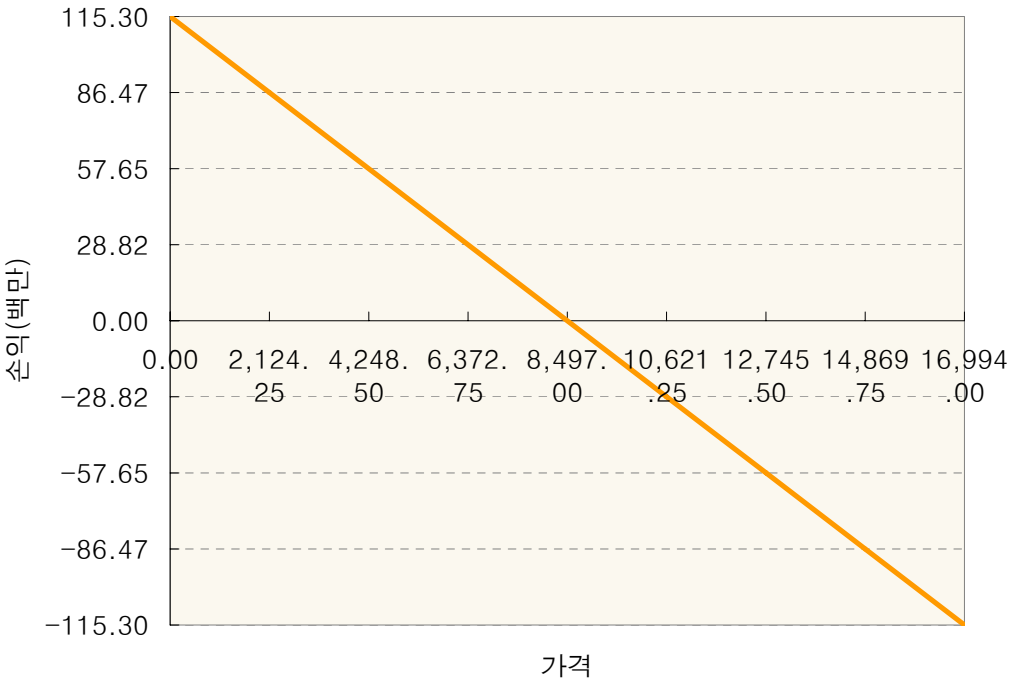
1. 계약금액

(단위:백만원)

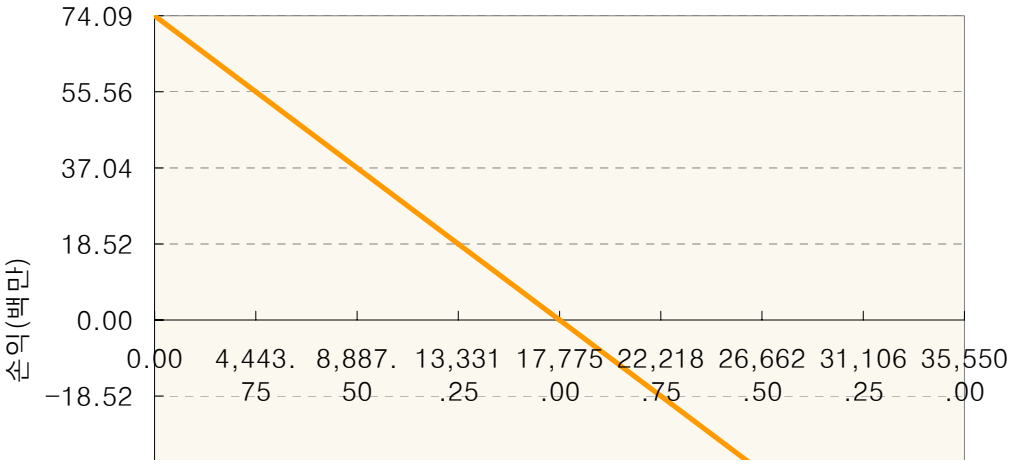
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	0	189	-189	

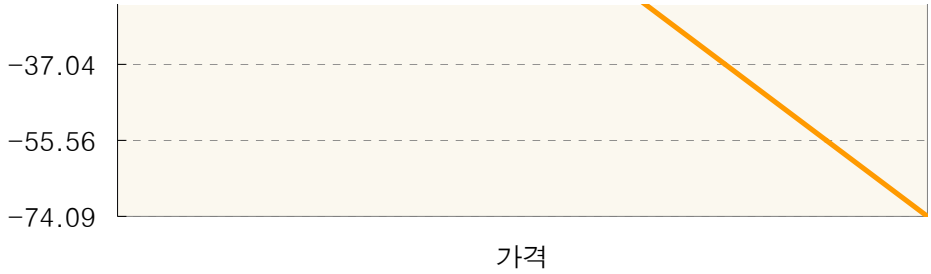
2. 만기시점의 손익구조

JYH5-JPN YEN FUT MAR15



NIH5-NIKKEI 225 (SGX) Mar15





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JYH5	JPN YEN FUT MAR15	9
NIH5	NIKKEI 225 (SGX) Mar15	6

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

(단위:백만원)

9

공시일	2015-01-29
기준일	2015-01-28

차이나인덱스(주식-파생형)(종)

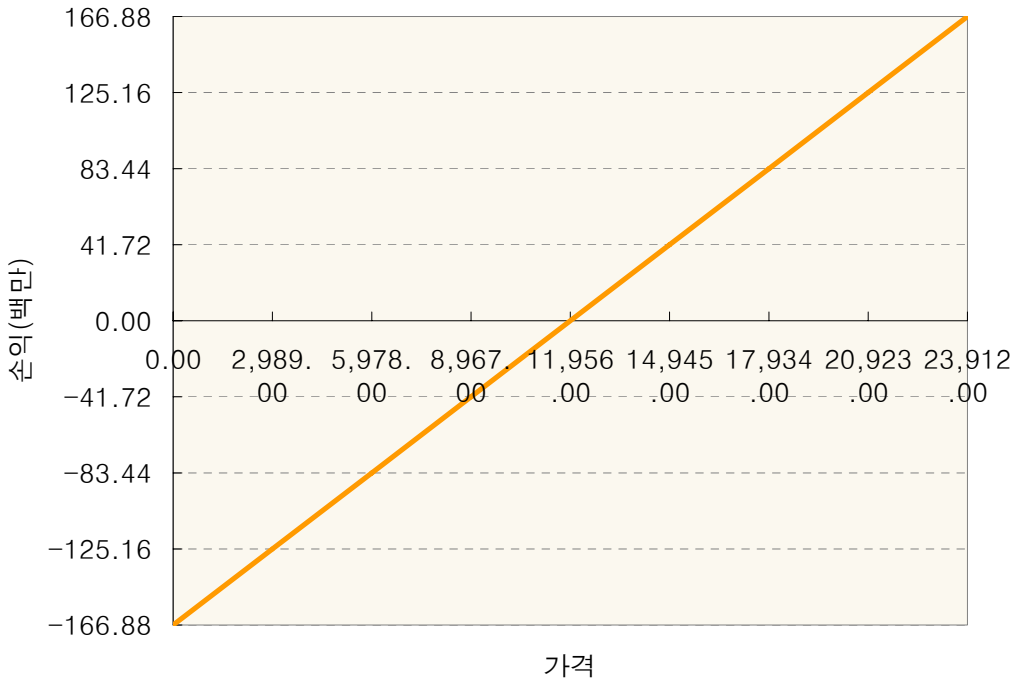
1. 계약금액

(단위:백만원)

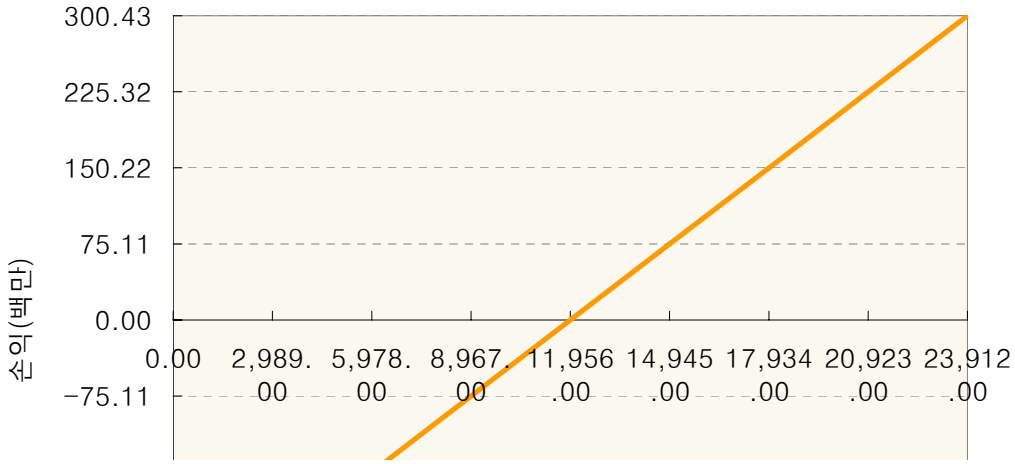
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	467	0	467	장내

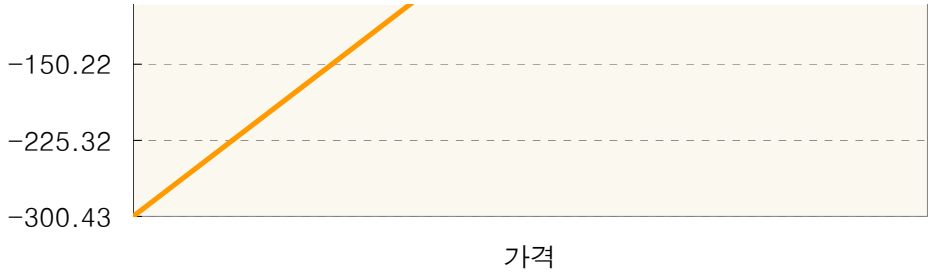
2. 만기시점의 손익구조

HCG5-H-SHARE IDX FUT Feb15



MHCG5-MINI H-SHR IDX FU Feb15





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCG5	H-SHARE IDX FUT Feb15	13
MHCG5	MINI H-SHR IDX FU Feb15	24

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

(단위:백만원)

36

공시일	2015-01-29
기준일	2015-01-28

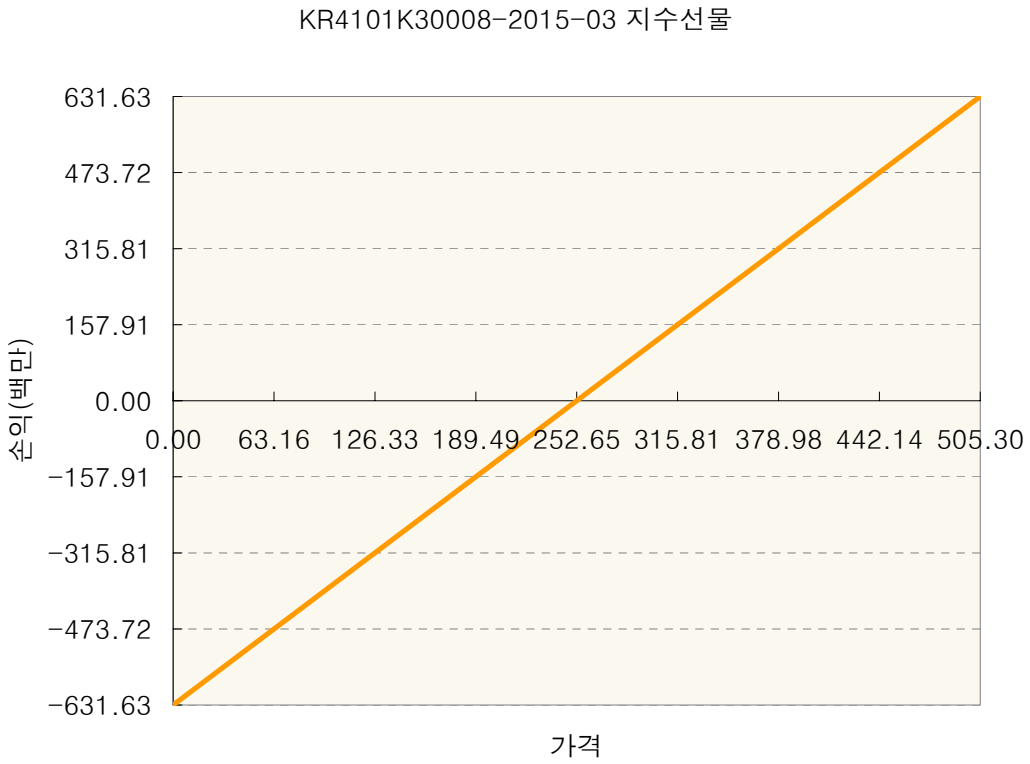
ETF스마트레버리지목표전환형제4

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	632	0	632	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%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
-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%	34	34	34	34	34	34	34
8.00%	50	50	50	50	50	50	50

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

33

공시일	2015-01-29
기준일	2015-01-28

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	2,450

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,413

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2015-01-29
기준일	2015-01-28

메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

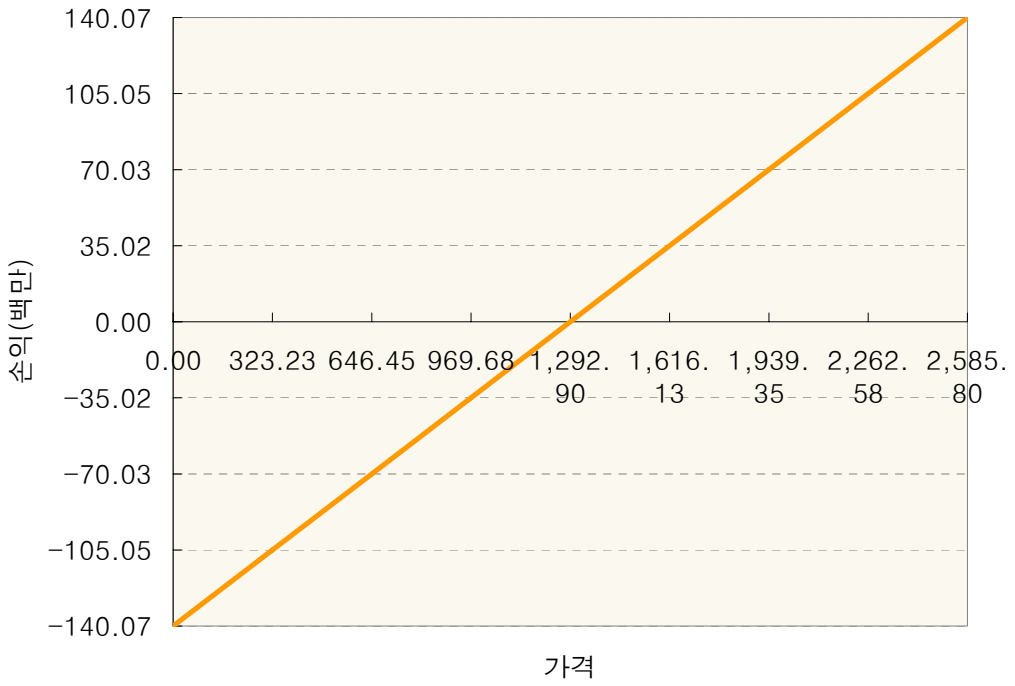
1. 계약금액

(단위:백만원)

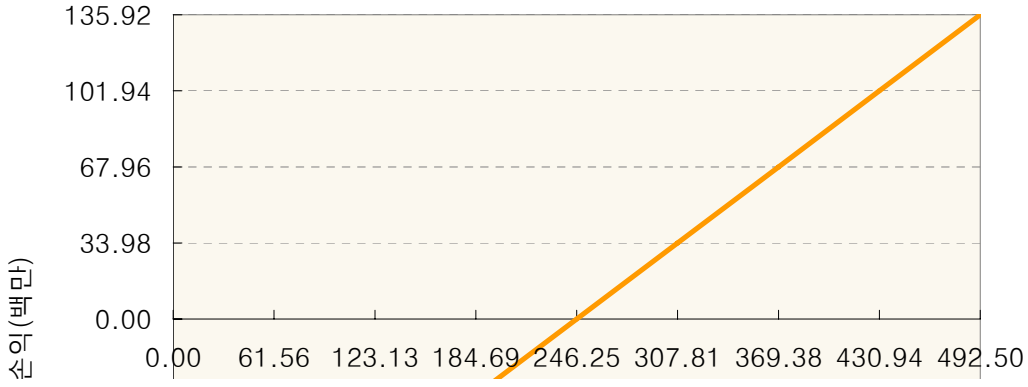
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	20	0	20	
누계	유가증권	선물	436	0	436	

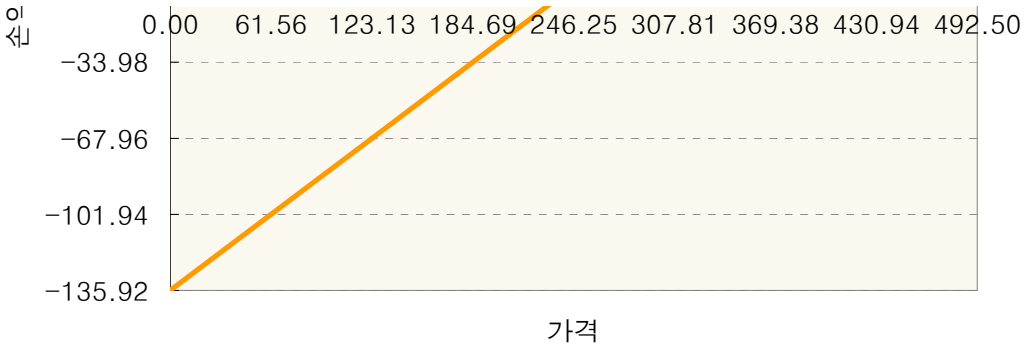
2. 만기시점의 손익구조

GCJ5-GOLD 100 OZ FUTR Apr15

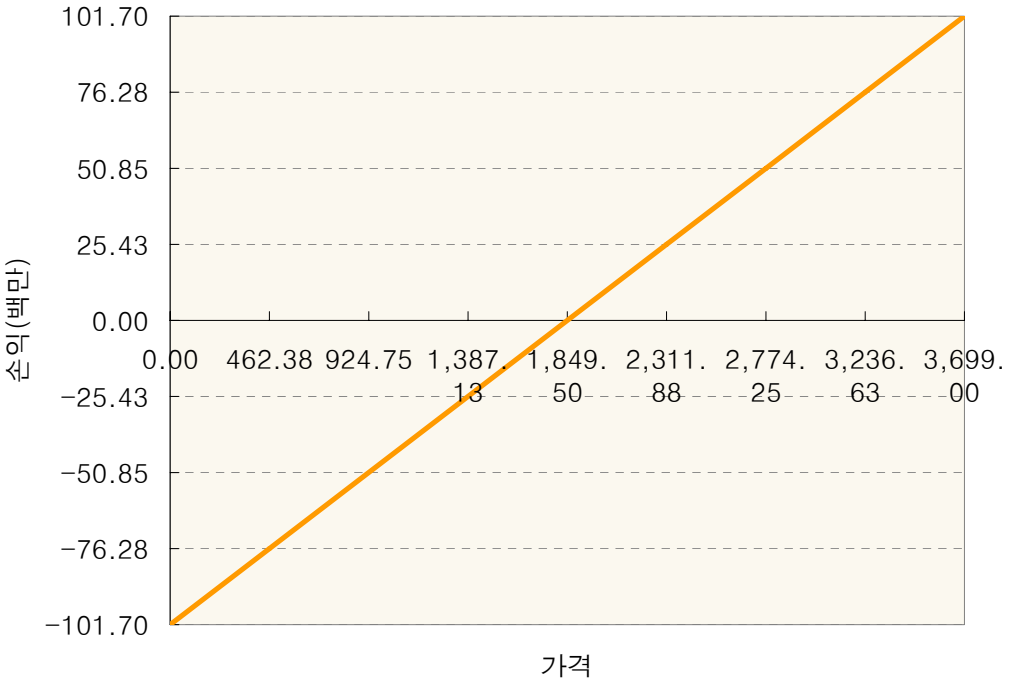


HGH5-COPPER FUTURE Mar15

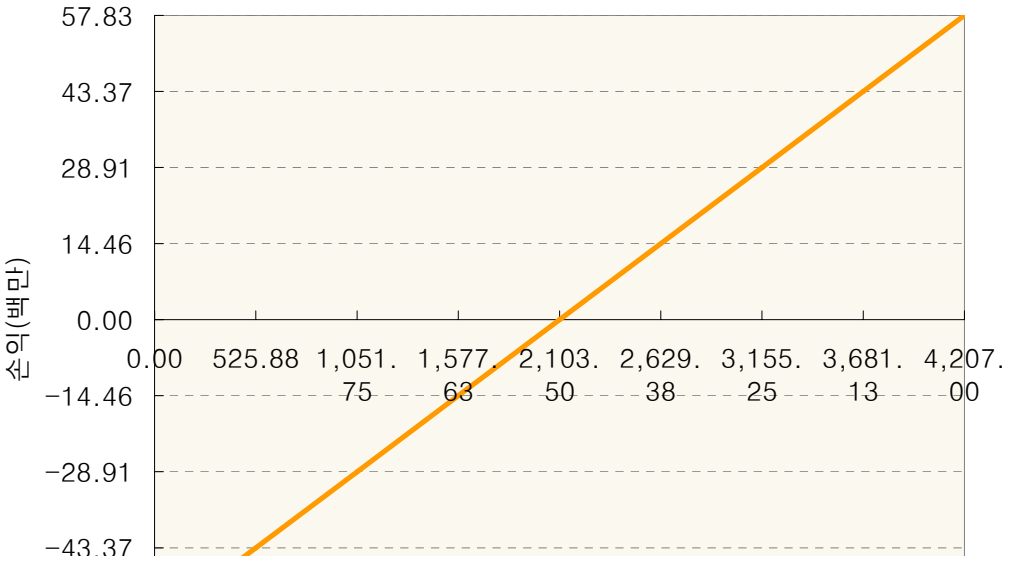


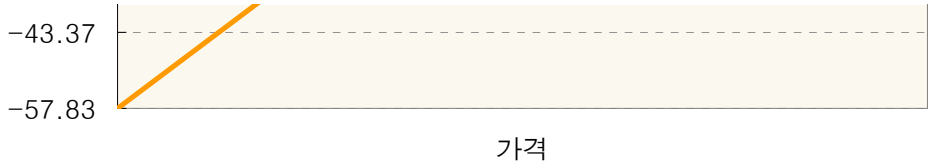


LAH5-LME PRI ALUM FUTR MAR 15

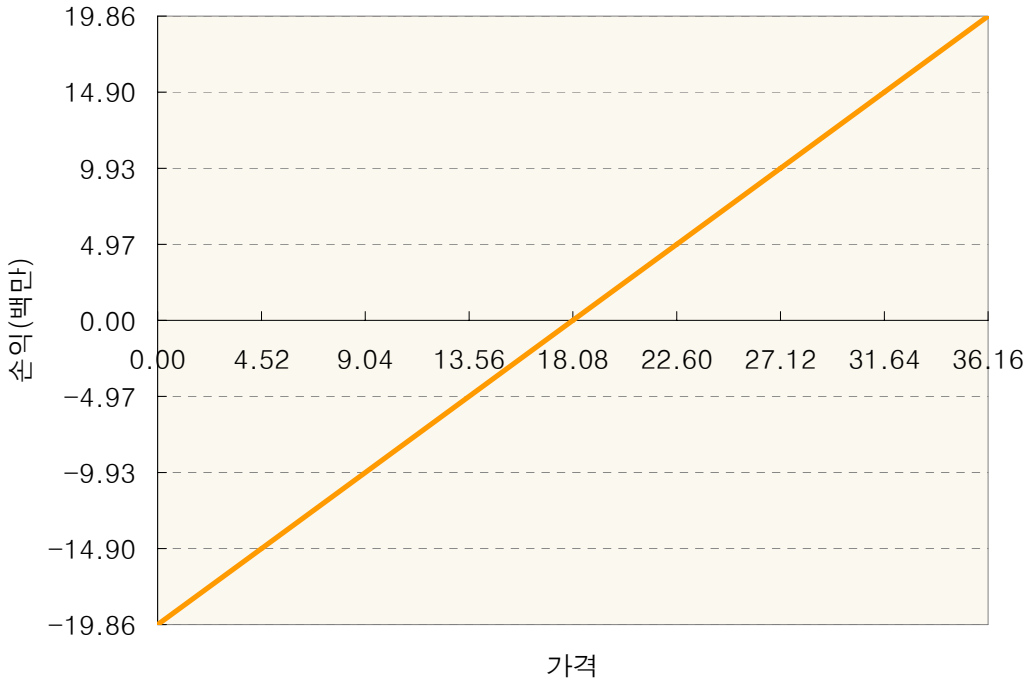


LXH5-LME ZINC FUTURE MAR15





YSH5-MINI SILVER FUT Mar15



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

33

공시일	2015-01-29
기준일	2015-01-28

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

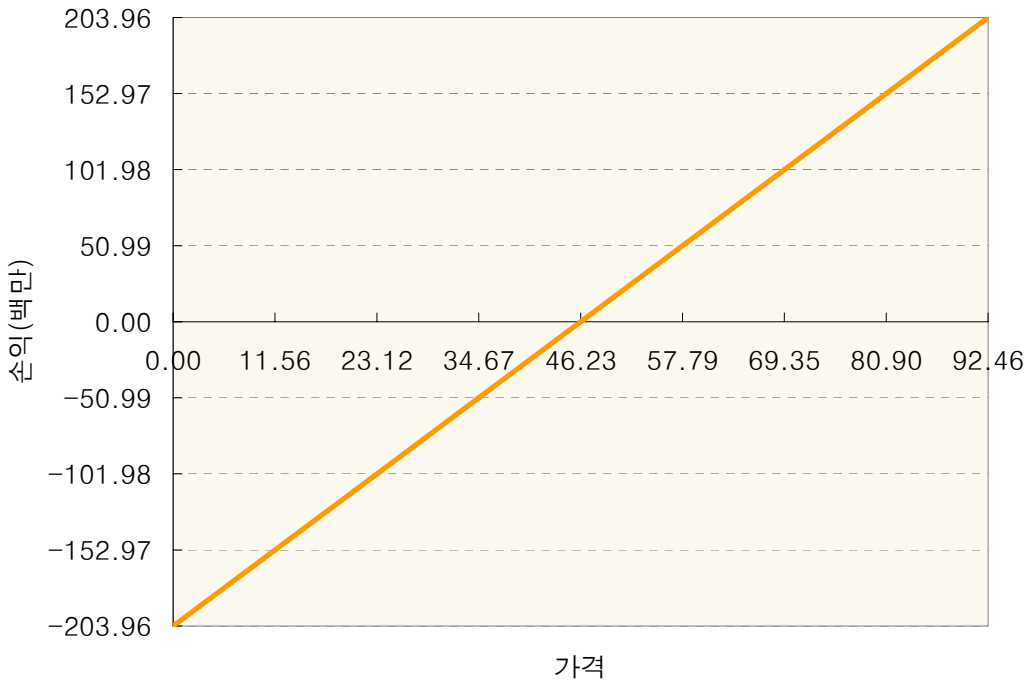
1. 계약금액

(단위:백만원)

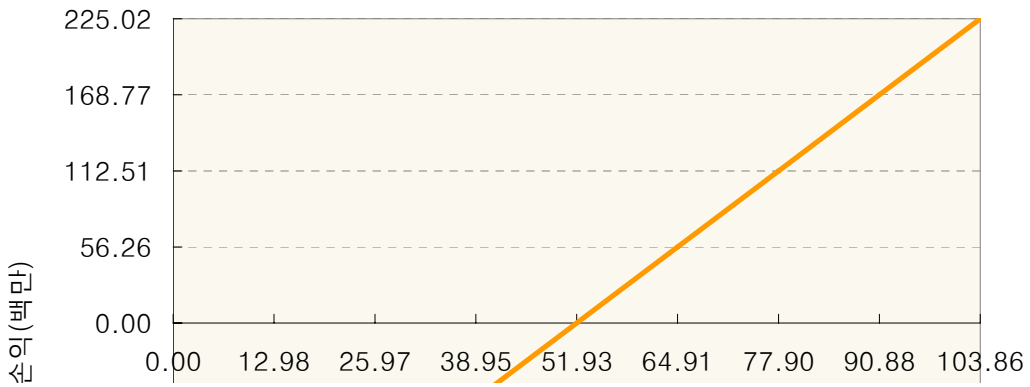
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	204	0	204	
누계	유가증권	선물	720	0	720	

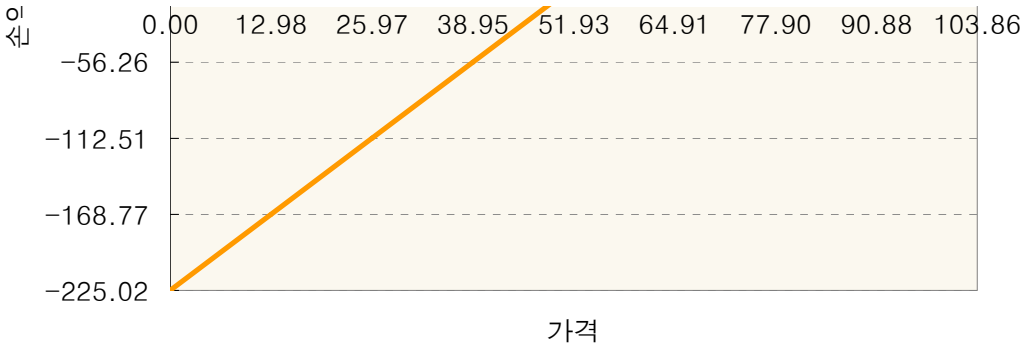
2. 만기시점의 손익구조

CLH5-WTI CRUDE FUTURE Mar15

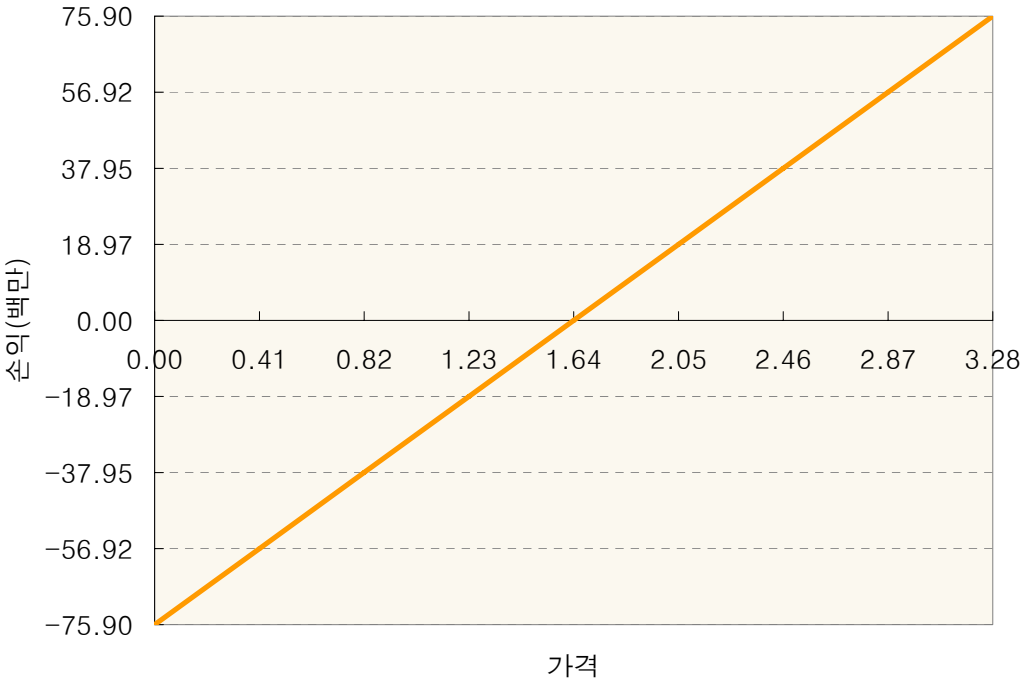


COK5-BRENT CRUDE FUTR May15

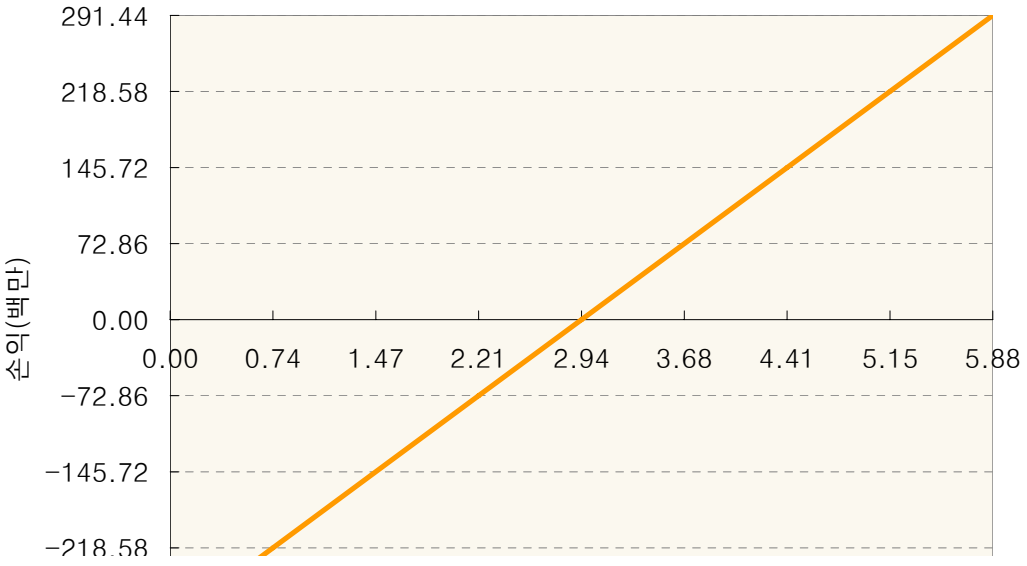


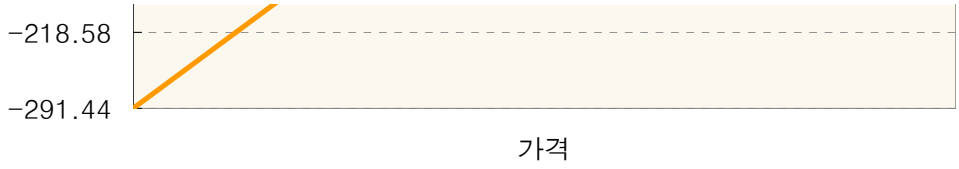


HOH5-NY Harb ULSD Fut Mar15

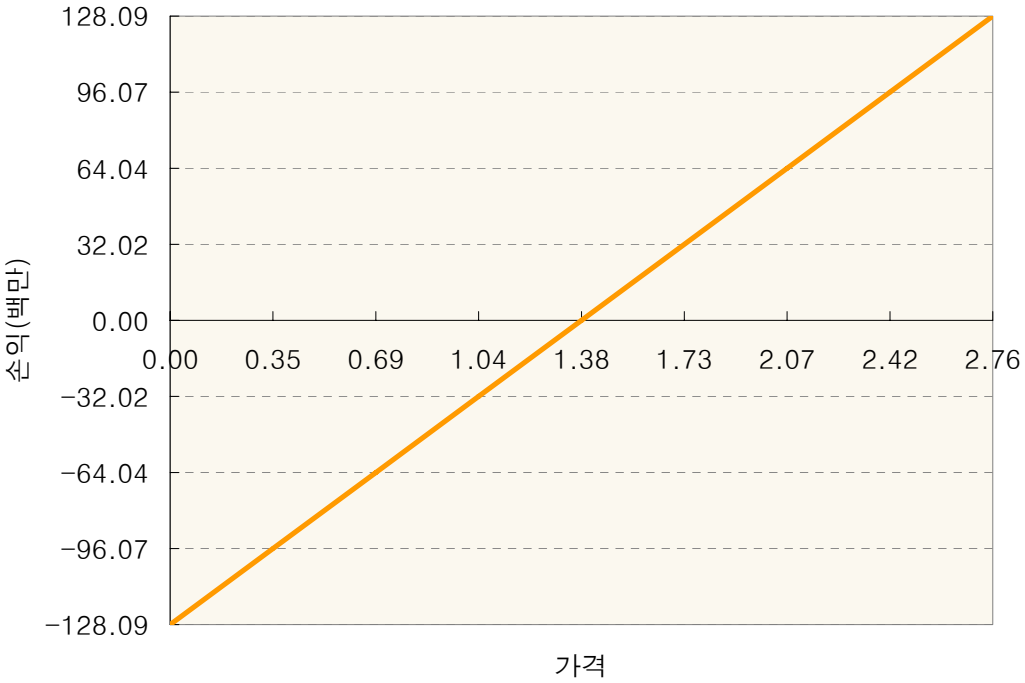


NGH5-NATURAL GAS FUTR Mar15





XBH5-GASOLINE RBOB FUT Mar15



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLH5	WTI CRUDE FUTURE Mar15	16
COK5	BRENT CRUDE FUTR May15	18
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)

141

공시일	2015-01-29
기준일	2015-01-28

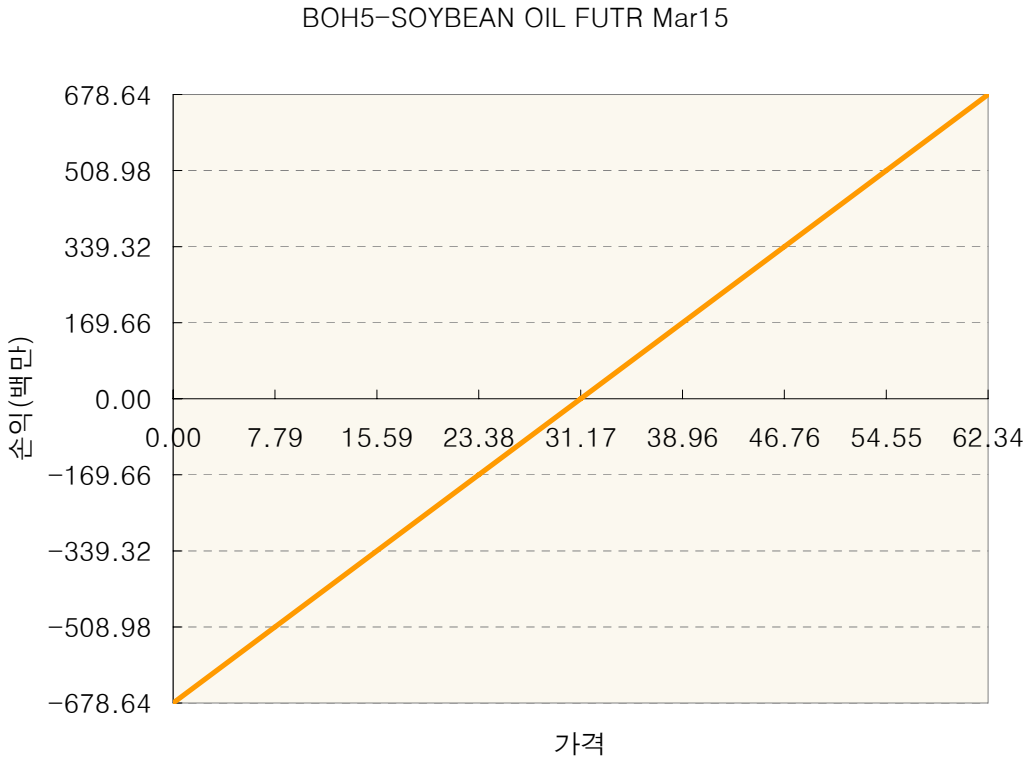
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

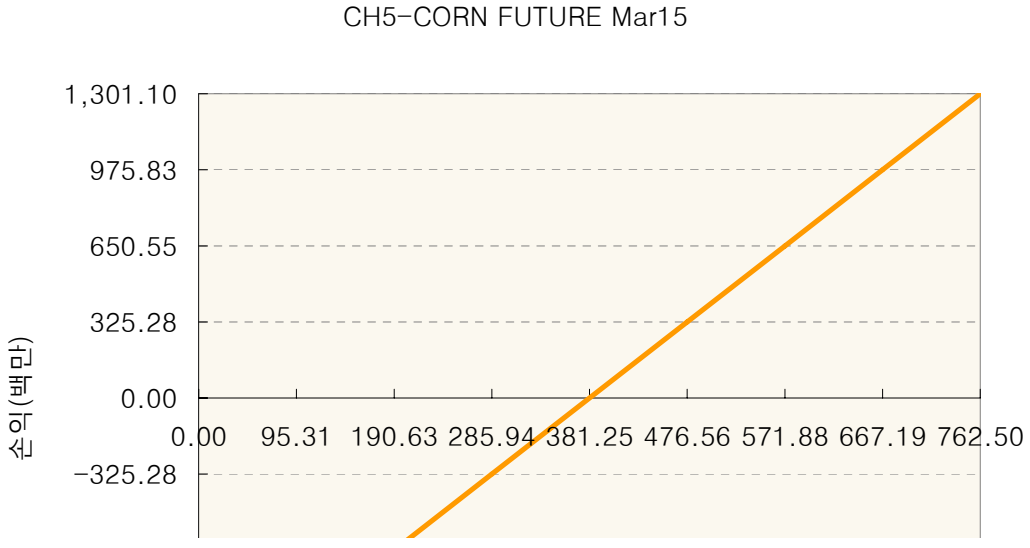
1. 계약금액

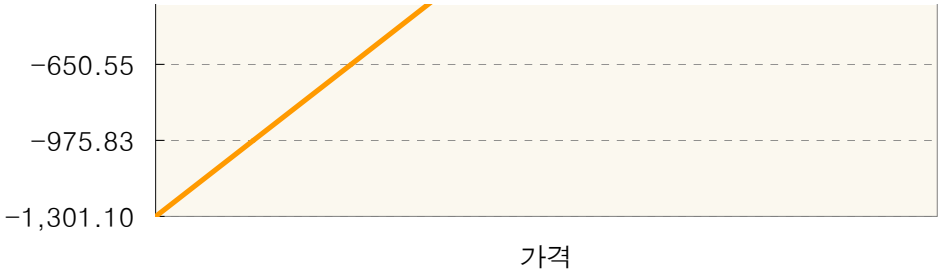
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,625	0	7,625	

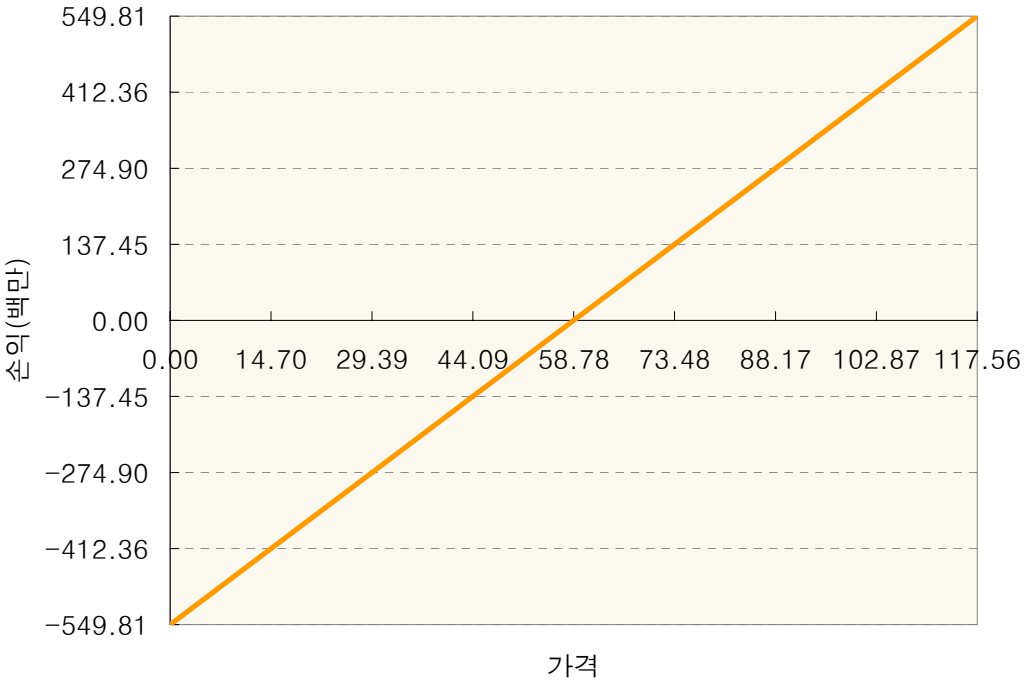
2. 만기시점의 손익구조



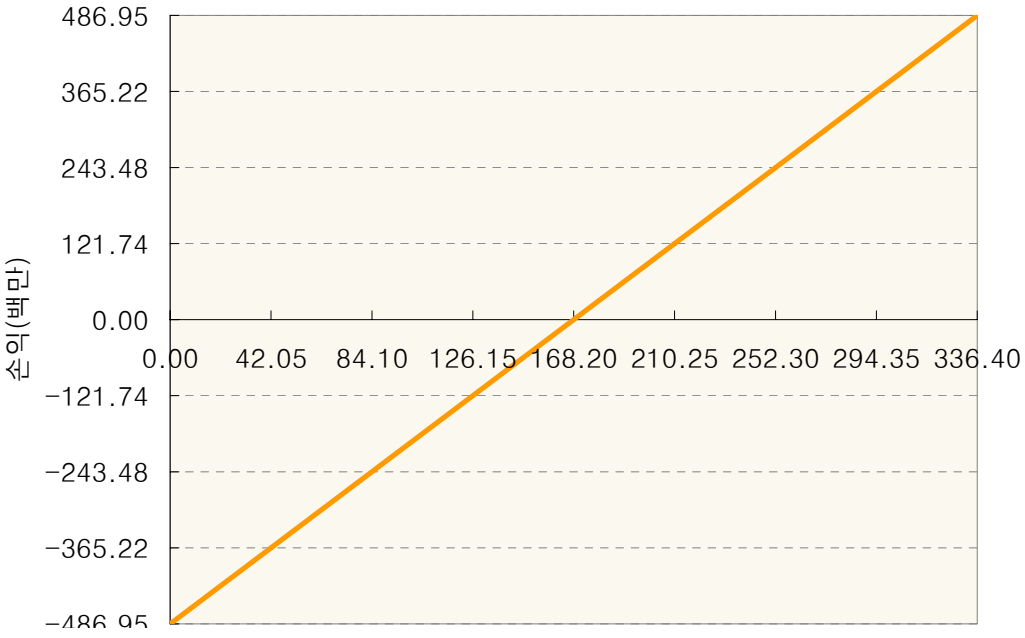


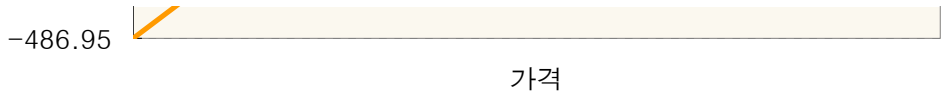


CTH5-COTTON NO.2 FUTR Mar15

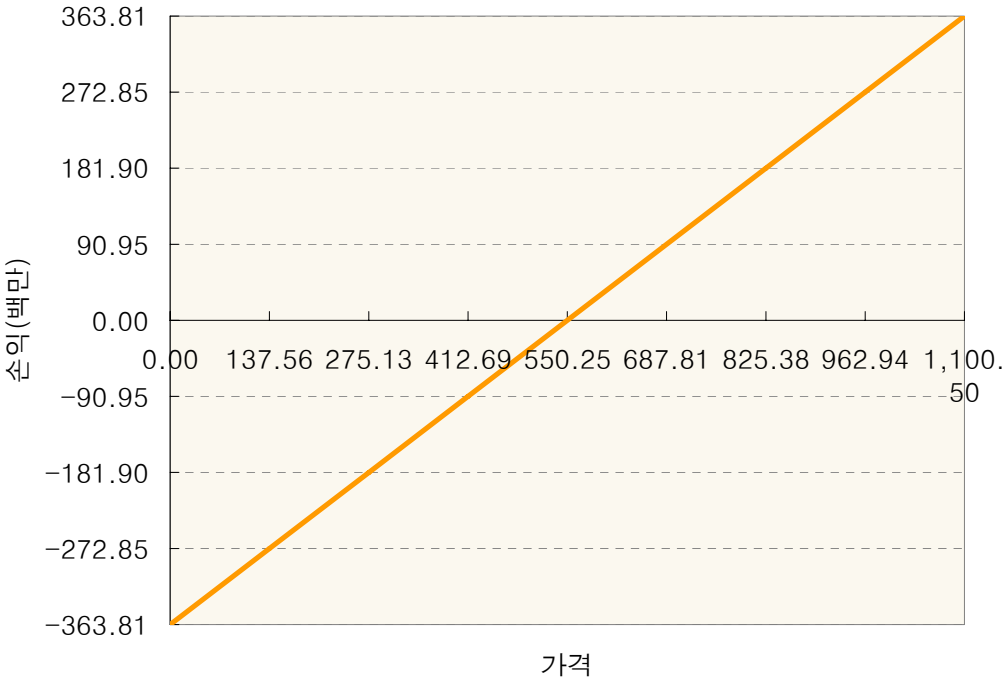


KCH5-COFFEE "C" FUTURE Mar15

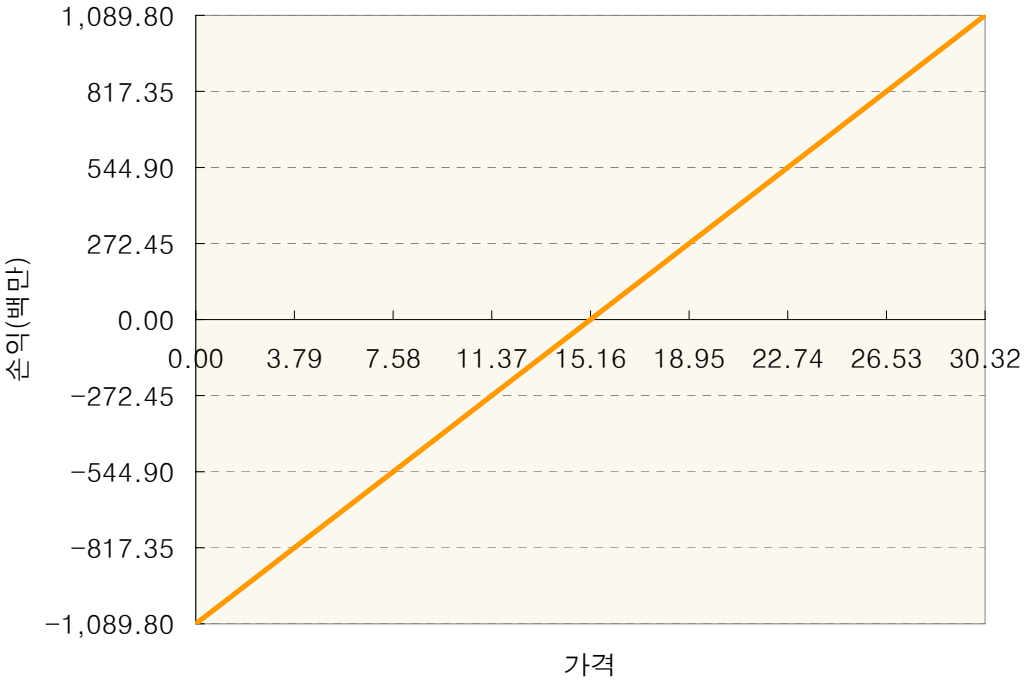




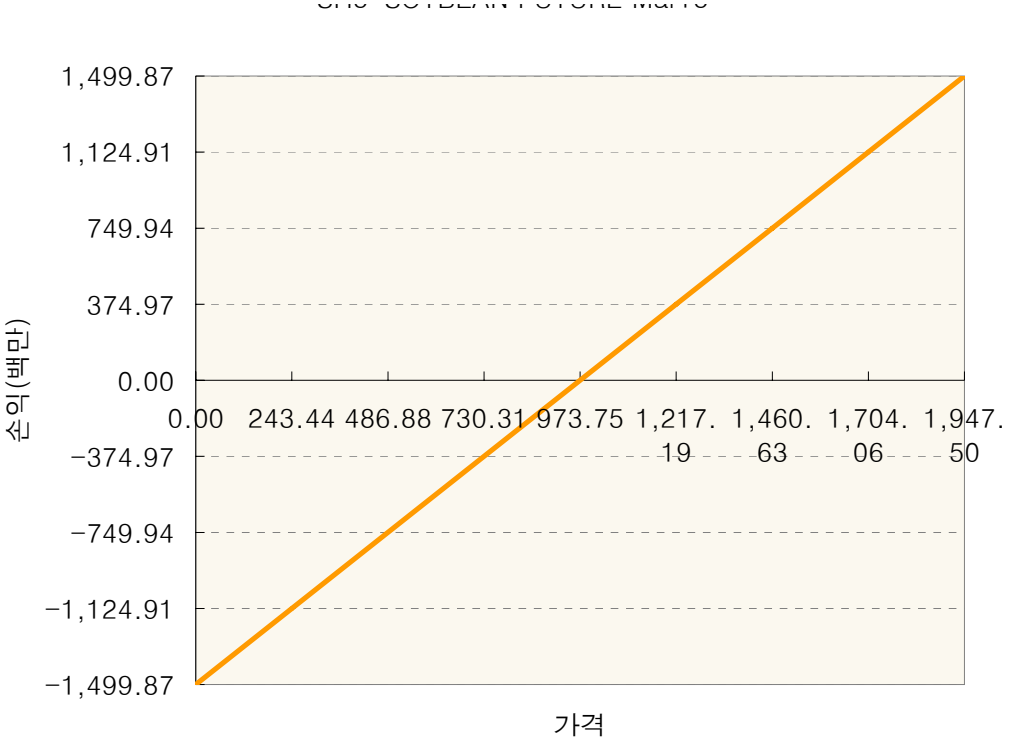
KWH5-WHEAT FUTURE(KCB) Mar15



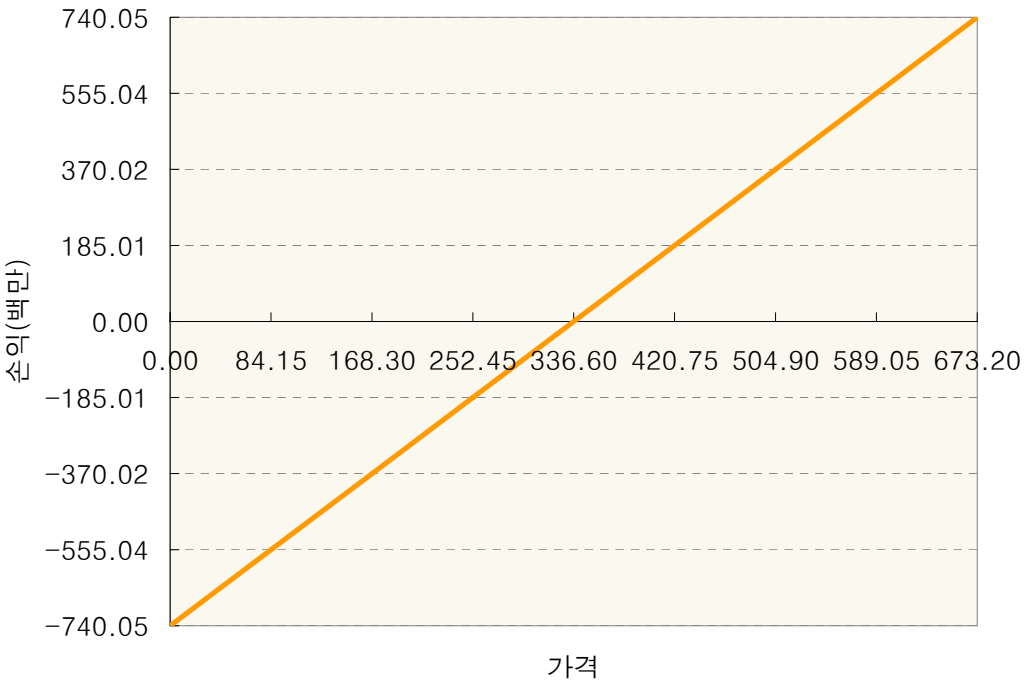
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar15



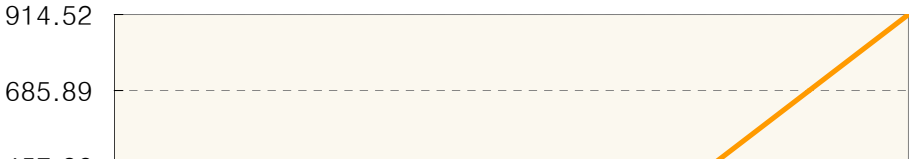
SH5-SOYBEAN FUTURE Mar15

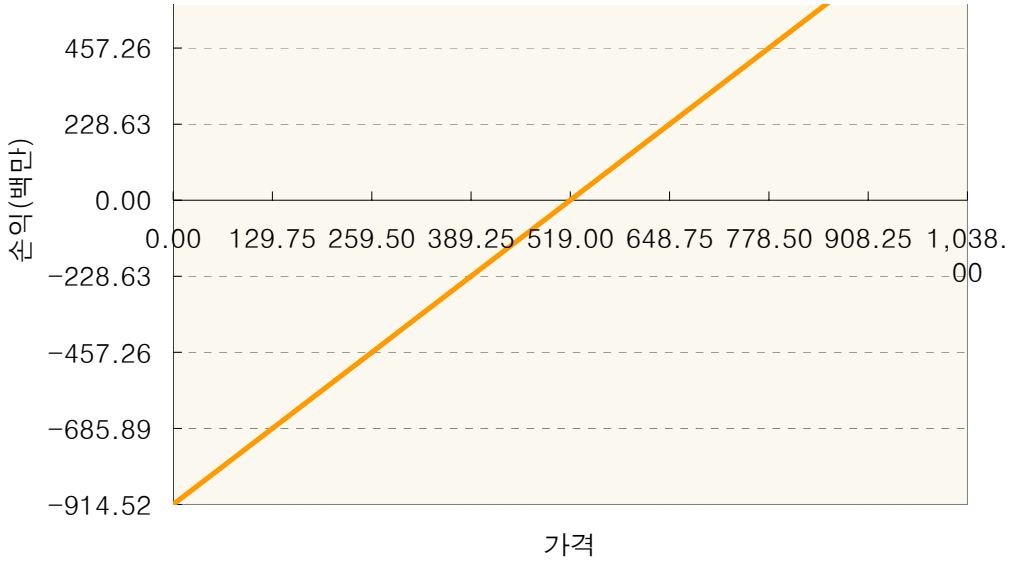


SMH5-SOYBEAN MEAL FUTR Mar15



WH5-WHEAT FUTURE(CBT) Mar15





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH5	SOYBEAN OIL FUTR Mar15	54
CH5	CORN FUTURE Mar15	104
CTH5	COTTON NO.2 FUTR Mar15	44
KCH5	COFFEE "C" FUTURE Mar15	39
KWH5	WHEAT FUTURE(KCB) Mar15	29
SBH5	Sugar #11 (WORLD) Mar15	87
SH5	SOYBEAN FUTURE Mar15	120
SMH5	SOYBEAN MEAL FUTR Mar15	59
WH5	WHEAT FUTURE(CBT) Mar15	73

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

(단위:백만원)

864