공시일	2015-02-04
기준일	2015-02-03

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	2015-02-04
기준일	2015-02-03

차곡차곡플러스모(주식혼합-파생)

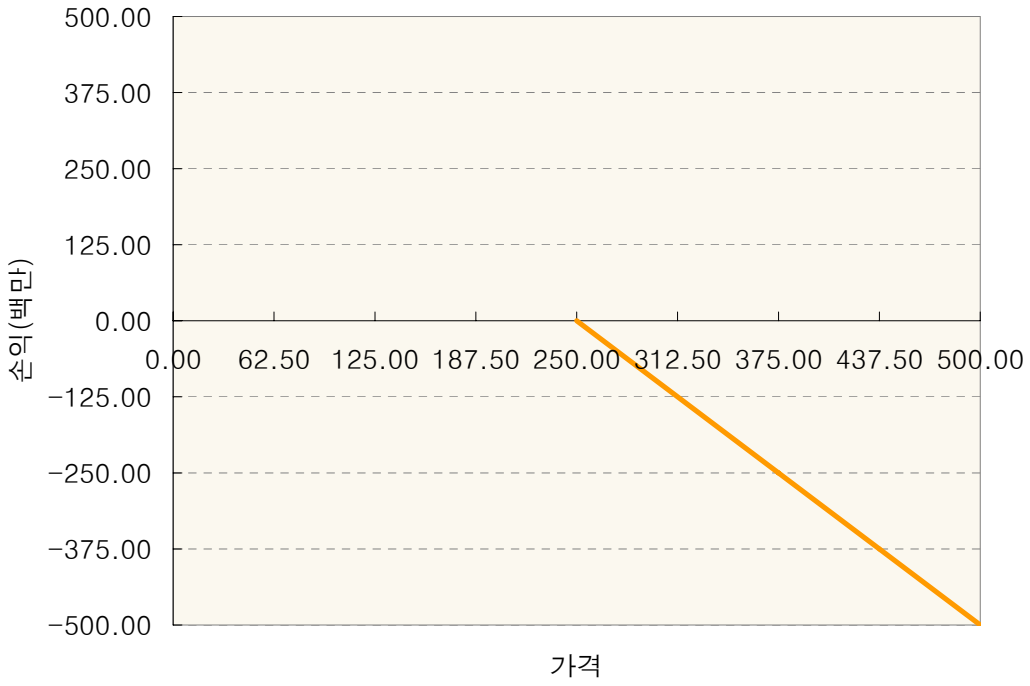
1. 계약금액

(단위:백만원)

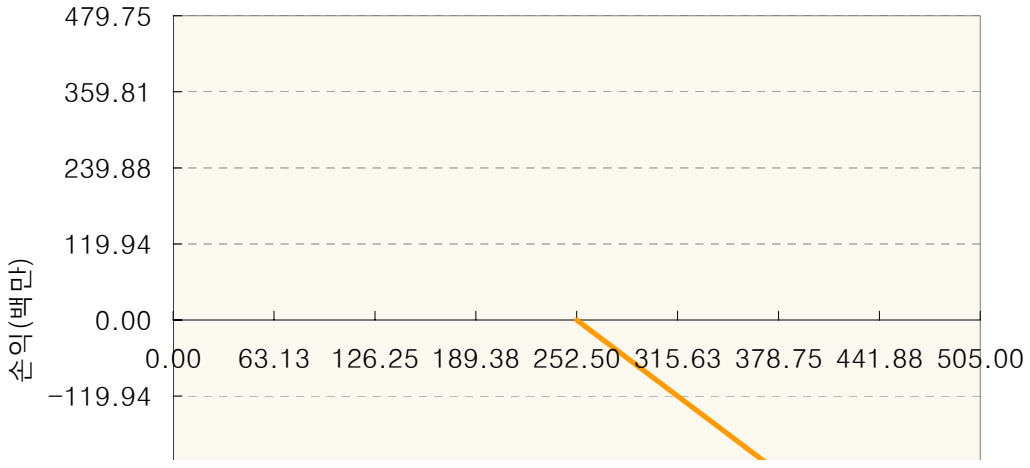
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	980	-980	장내

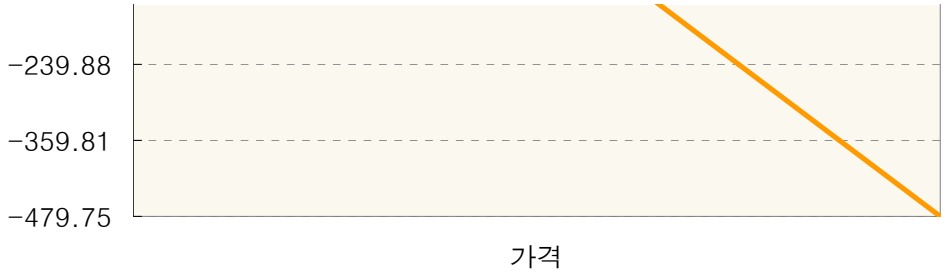
2. 만기시점의 손익구조

KR4201K22508-2015-02 콜250



KR4201K22524-2015-02 콜252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201K225 2015-02 콜250							183
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	22	22	22	22	22	22	22
-5.33%	22	22	22	22	22	22	21
-2.67%	21	21	20	19	19	18	17
0%	5	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	-50	-50	-50	-51	-52	-52	-53
5.33%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116
8.00%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
KR4201K225 2015-02 콜252.5							160
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10	10	10	10	10	10	10
-5.33%	10	10	10	10	10	10	10
-2.67%	10	10	10	10	9	9	8
0%	4	3	1	0	-1	-3	-4
2.67%	-35	-36	-37	-38	-39	-40	-41
5.33%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-98
8.00%	-160	-160	-160	-160	-160	-160	-160

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

(단위:백만원)

438

공시일	2015-02-04
기준일	2015-02-03

스마트인덱스모

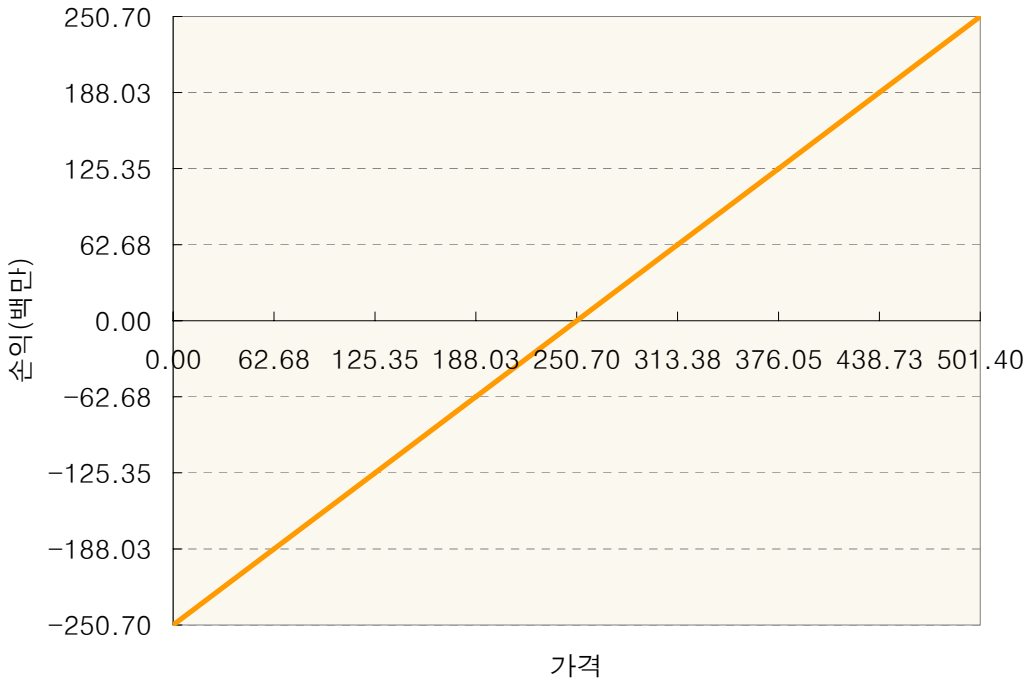
1. 계약금액

(단위:백만원)

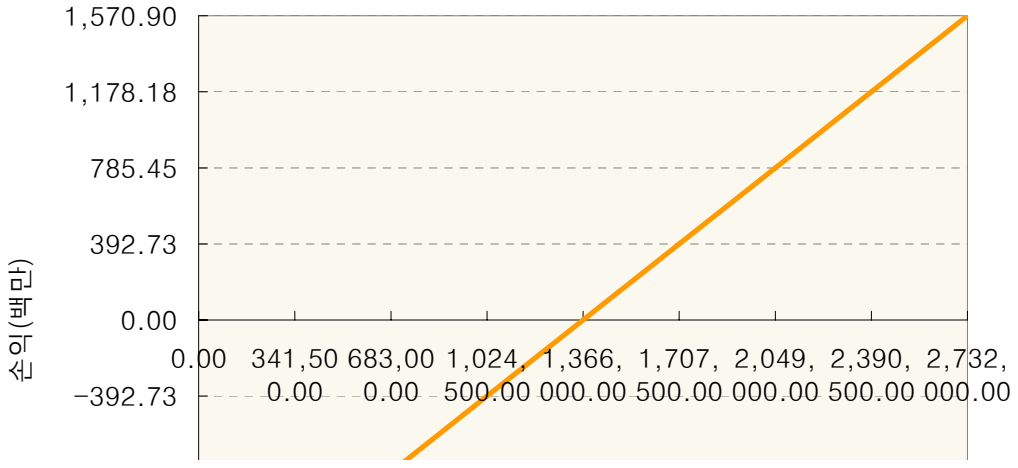
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	205	0	205	장내
누계	유가증권	선물	1,822	0	1,822	장내

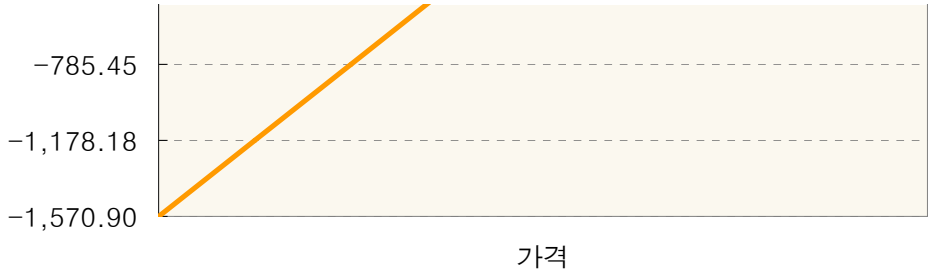
2. 만기시점의 손익구조

KR4101K30008-2015-03 지수선물



KR4111K30007-2015-03 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101K300 2015-03 지수선물							20
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
-5.33%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
-2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	7	7	7	7	7	7	7
5.33%	13	13	13	13	13	13	13
8.00%	20	20	20	20	20	20	20
KR4111K300 2015-03 삼성전자개별선물							126
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
-5.33%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	42	42	42	42	42	42	42
5.33%	84	84	84	84	84	84	84
8.00%	126	126	126	126	126	126	126

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

(단위:백만원)

138

공시일	2015-02-04
기준일	2015-02-03

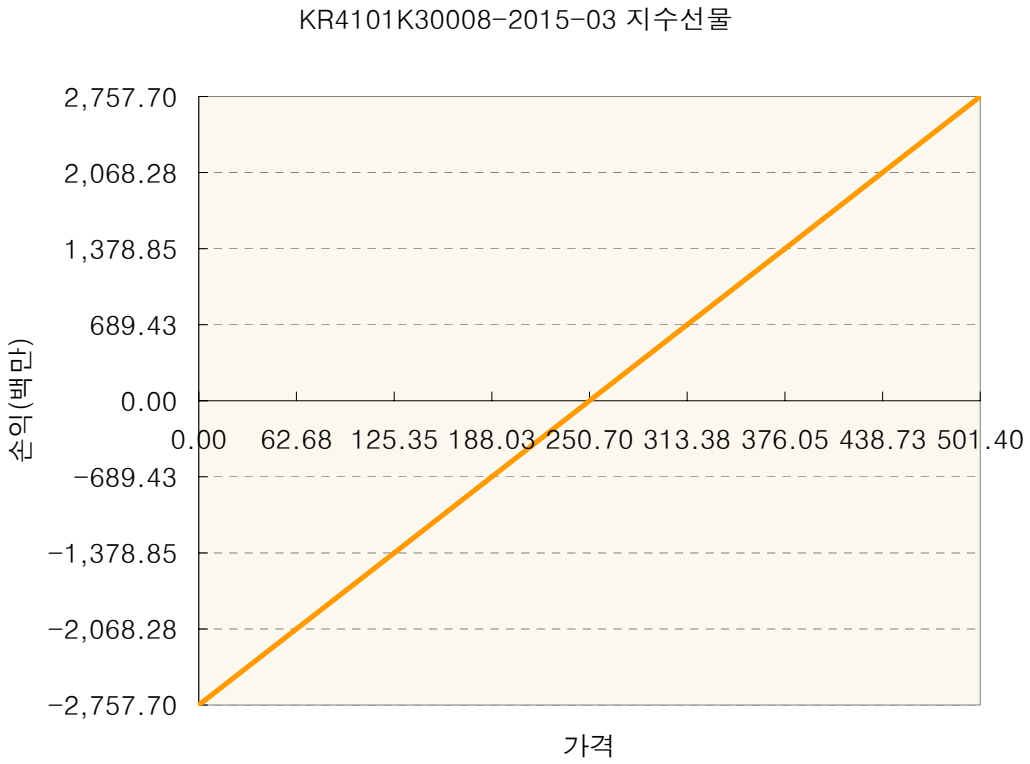
스마트레버리지목표전환형1호

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	2,758	0	2,758	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101K300 2015-03 지수선물 220

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-220	-220	-220	-220	-220	-220	-220
-5.33%	-147	-147	-147	-147	-147	-147	-147
-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%	147	147	147	147	147	147	147
8.00%	220	220	220	220	220	220	220

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

142

공시일	2015-02-04
기준일	2015-02-03

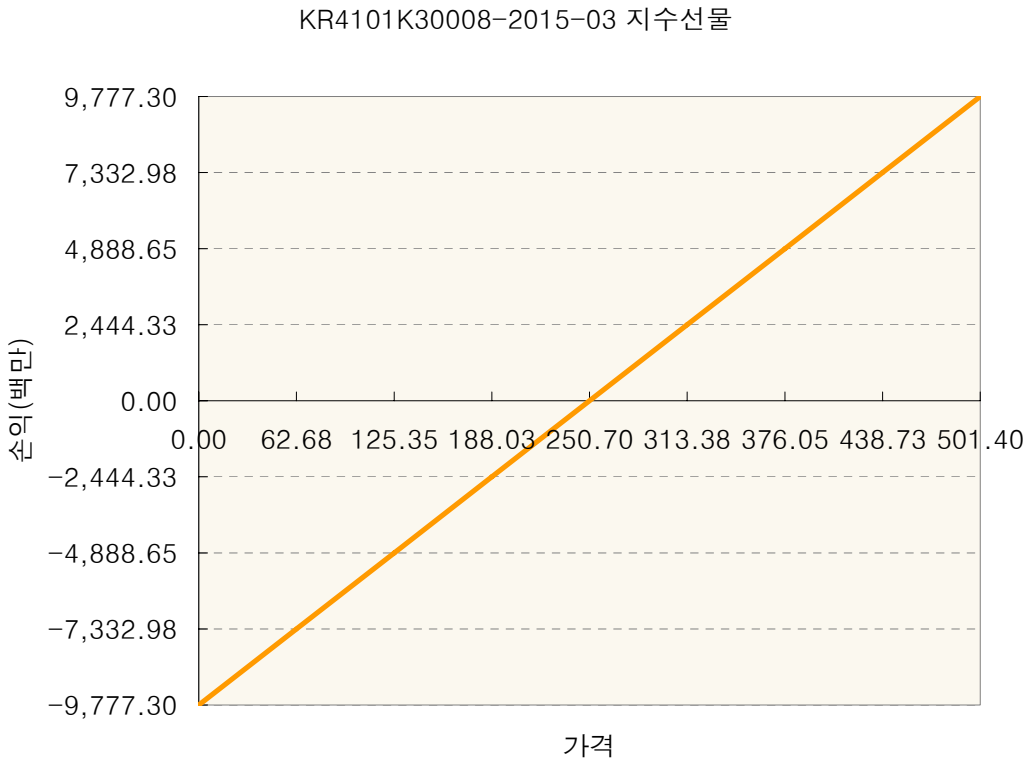
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	9,777	0	9,777	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%	-521	-521	-521	-521	-521	-521	-521
-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%	521	521	521	521	521	521	521
8.00%	781	781	781	781	781	781	781

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	504

공시일	2015-02-04
기준일	2015-02-03

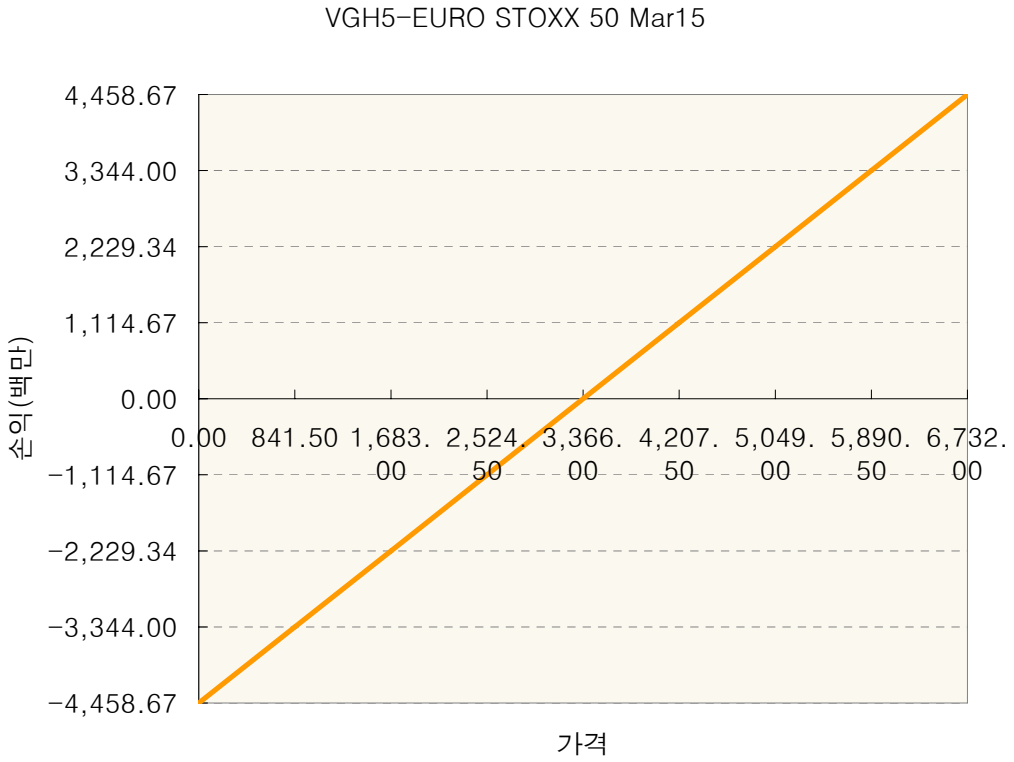
유로인덱스1호(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,459	0	4,459	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH5	EURO STOXX 50 Mar15	357

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

(단위:백만원)

302

공시일	2015-02-04
기준일	2015-02-03

차이나인덱스(주식-파생형)(종)

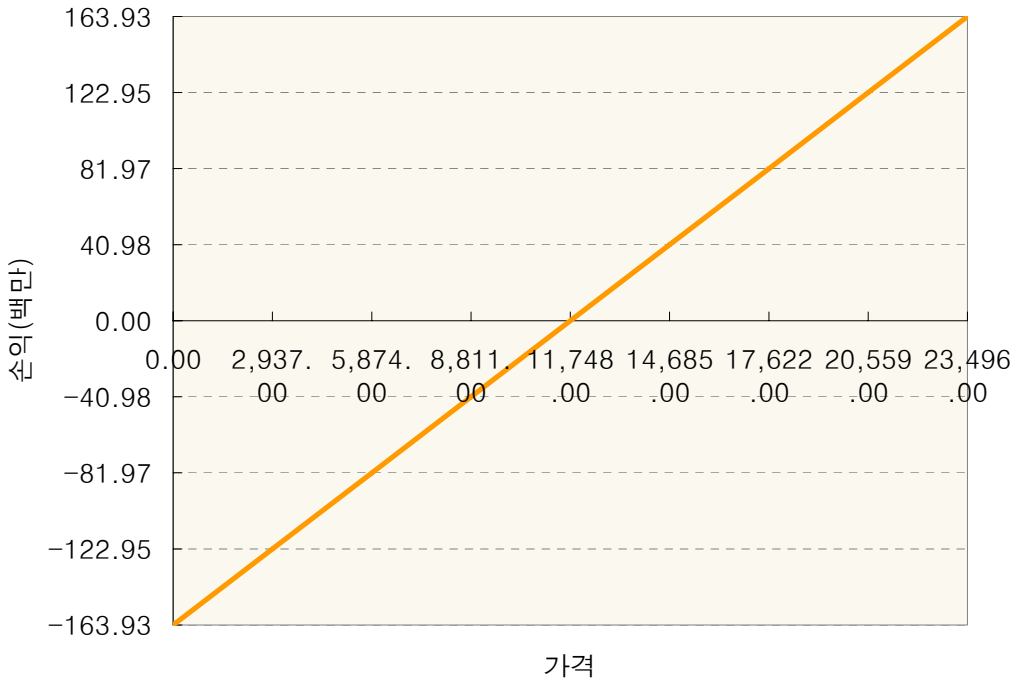
1. 계약금액

(단위:백만원)

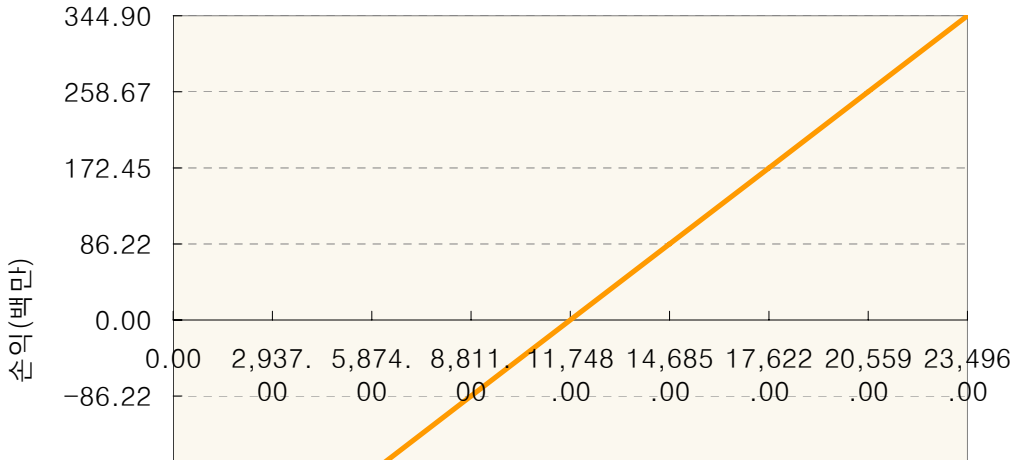
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	509	0	509	장내

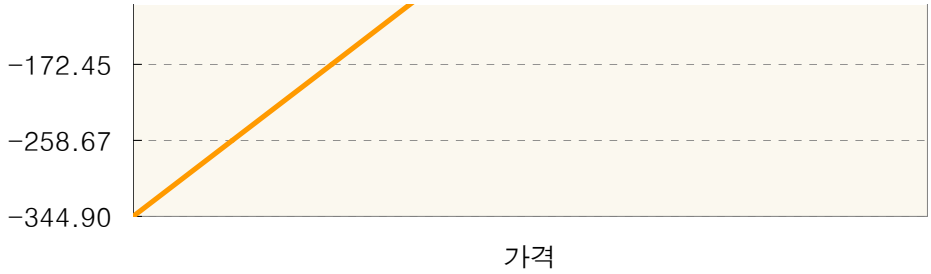
2. 만기시점의 손익구조

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	28

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

(단위:백만원)

39

공시일	2015-02-04
기준일	2015-02-03

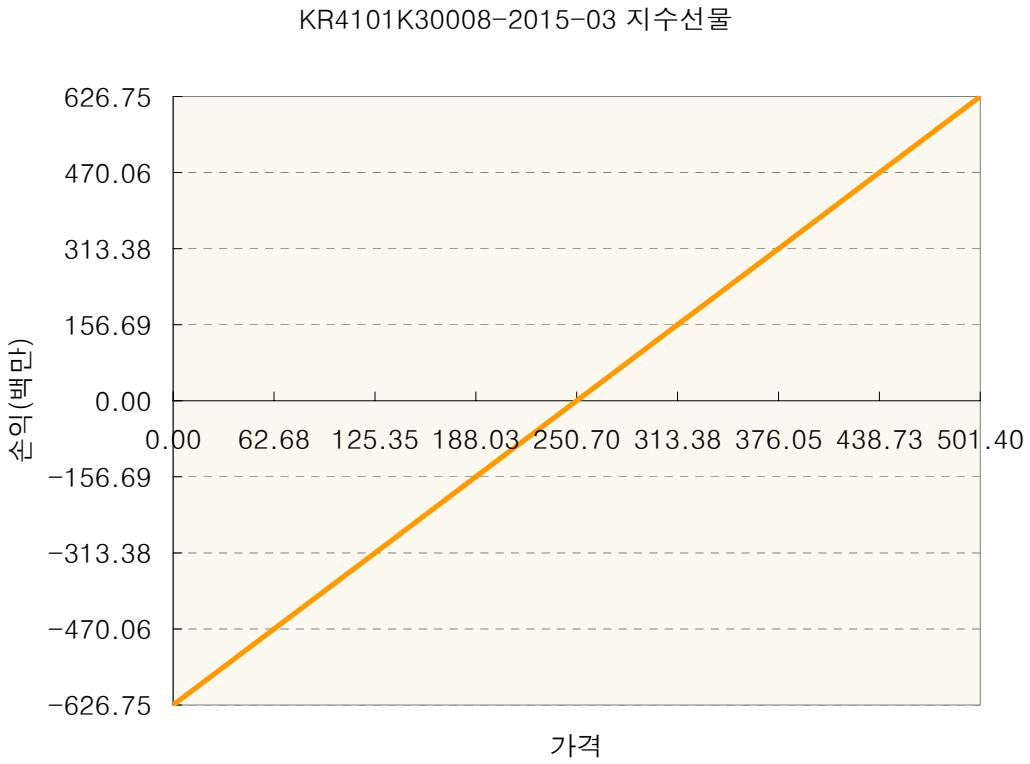
ETF스마트레버리지목표전환형제4

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	627	0	627	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)

32

공시일	2015-02-04
기준일	2015-02-03

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	2,434

* 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	2015-02-04
기준일	2015-02-03

메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

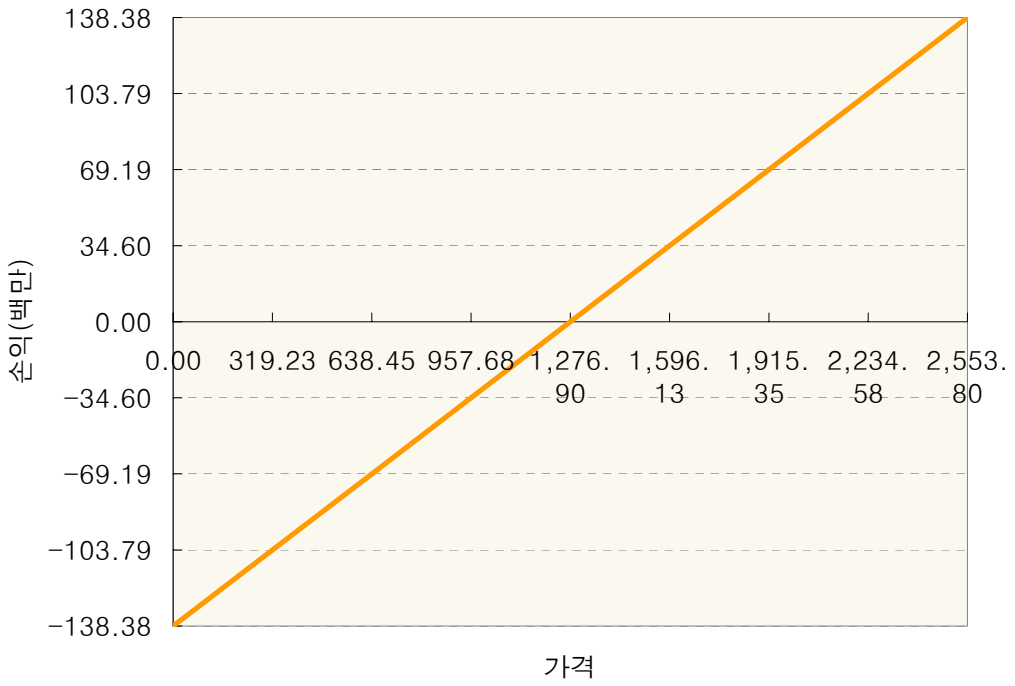
1. 계약금액

(단위:백만원)

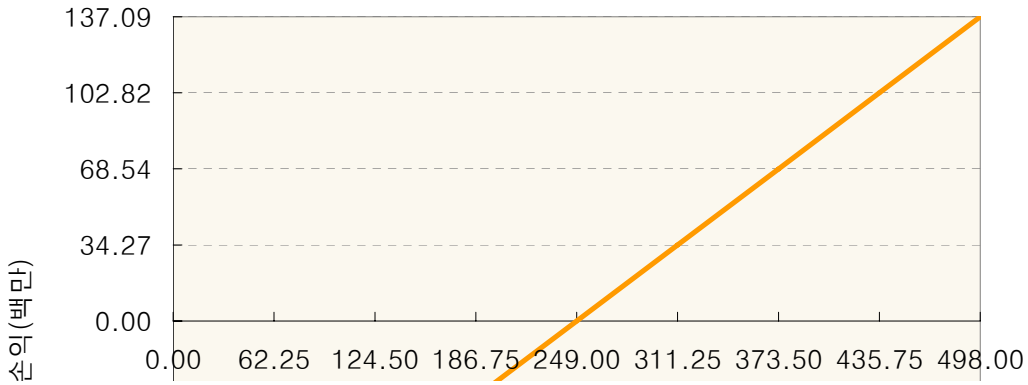
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	19	0	19	
누계	유가증권	선물	436	0	436	

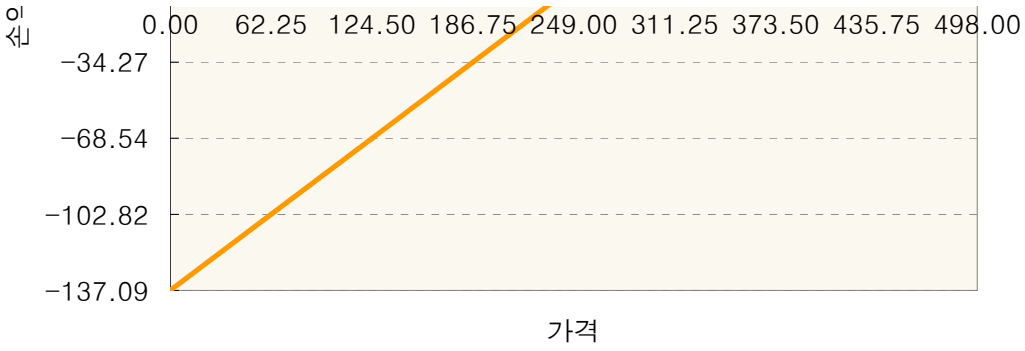
2. 만기시점의 손익구조

GCJ5-GOLD 100 OZ FUTR Apr15

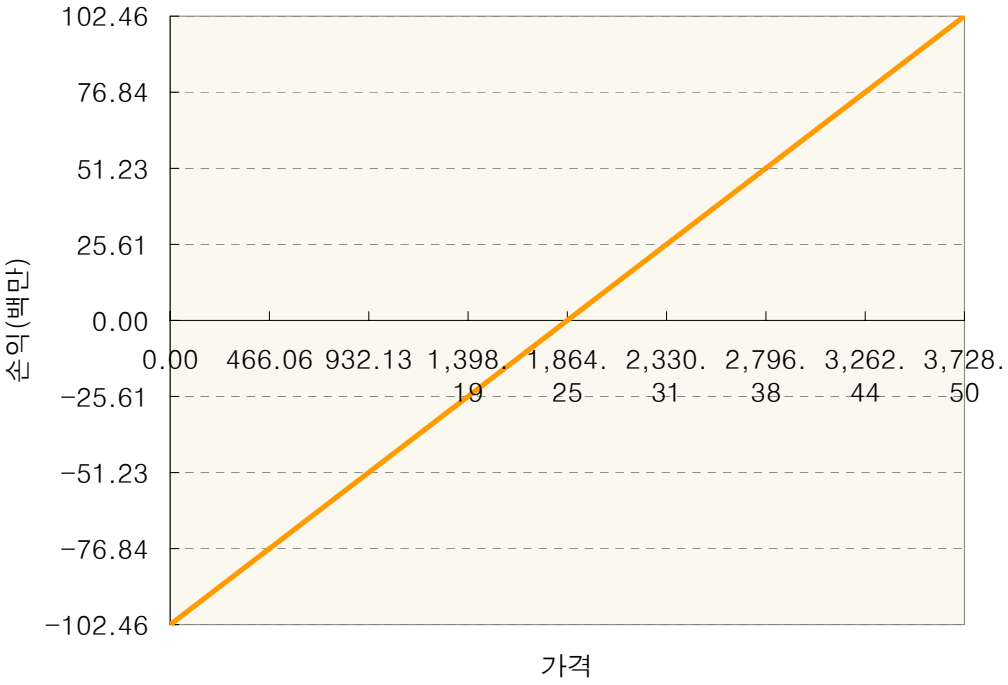


HGH5-COPPER FUTURE Mar15

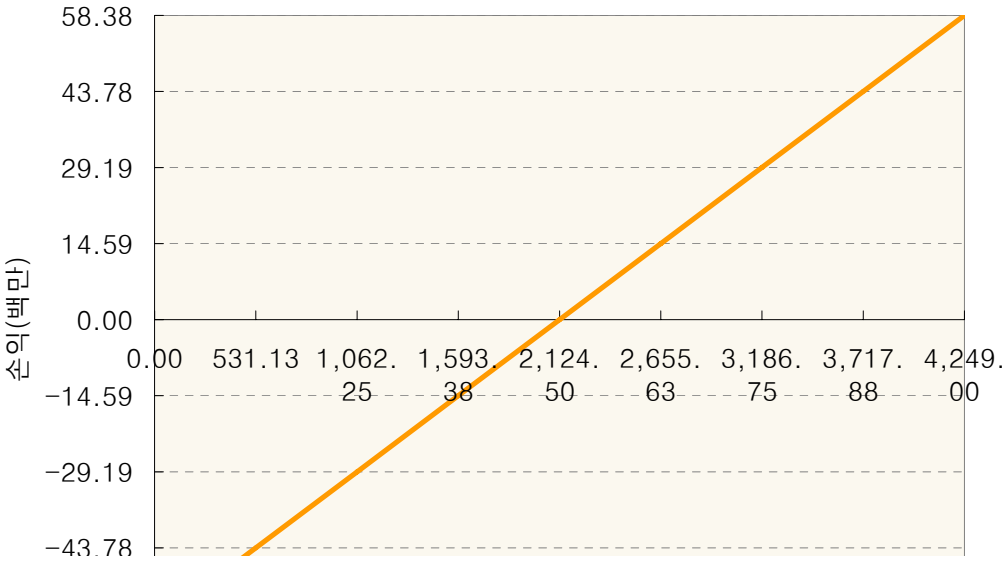


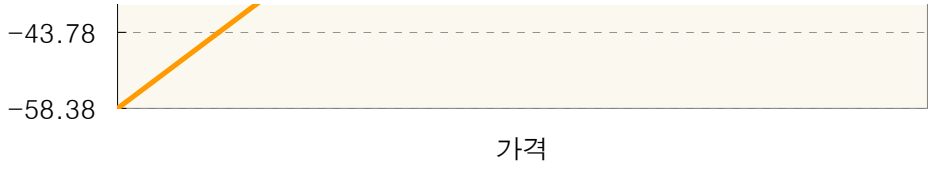


LAH5-LME PRI ALUM FUTR MAR 15

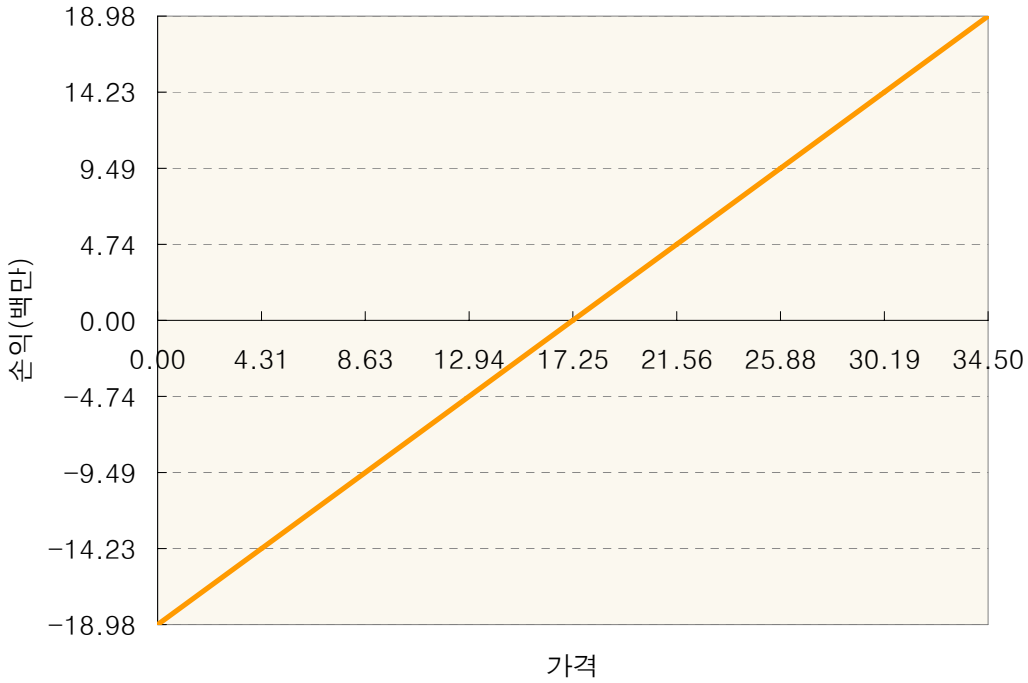


LXH5-LME ZINC FUTURE MAR15





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	2015-02-04
기준일	2015-02-03

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

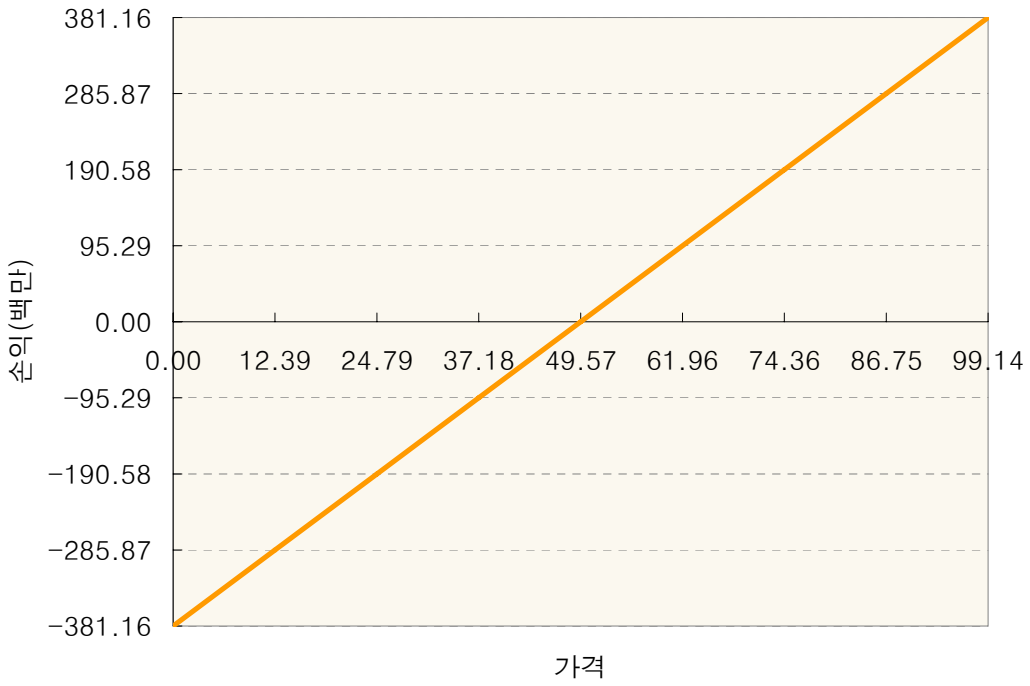
1. 계약금액

(단위:백만원)

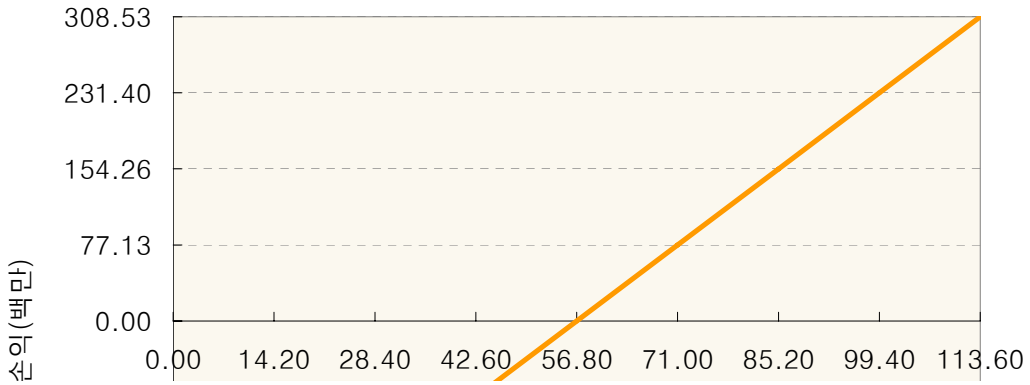
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	381	0	381	
누계	유가증권	선물	1,038	0	1,038	

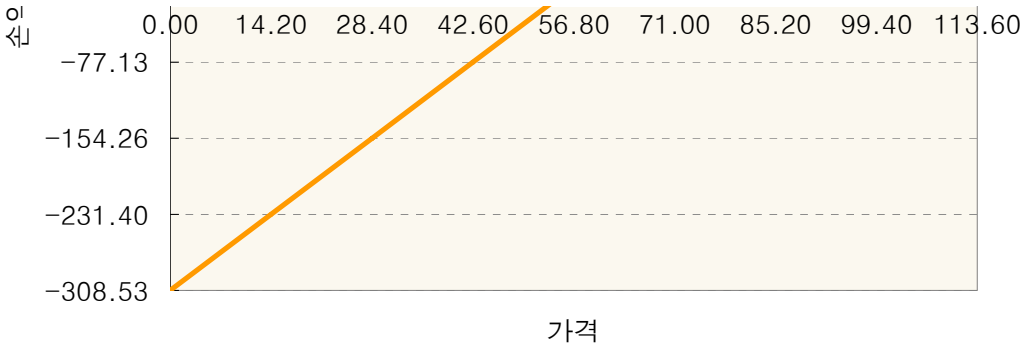
2. 만기시점의 손익구조

CLH5-WTI CRUDE FUTURE Mar15

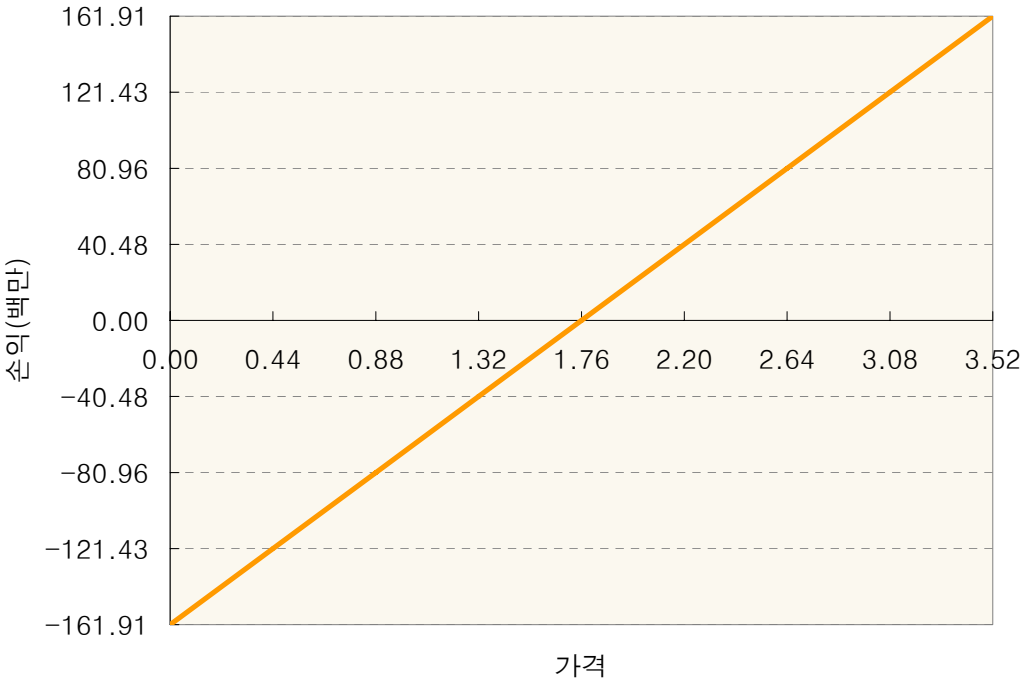


COK5-BRENT CRUDE FUTR May15

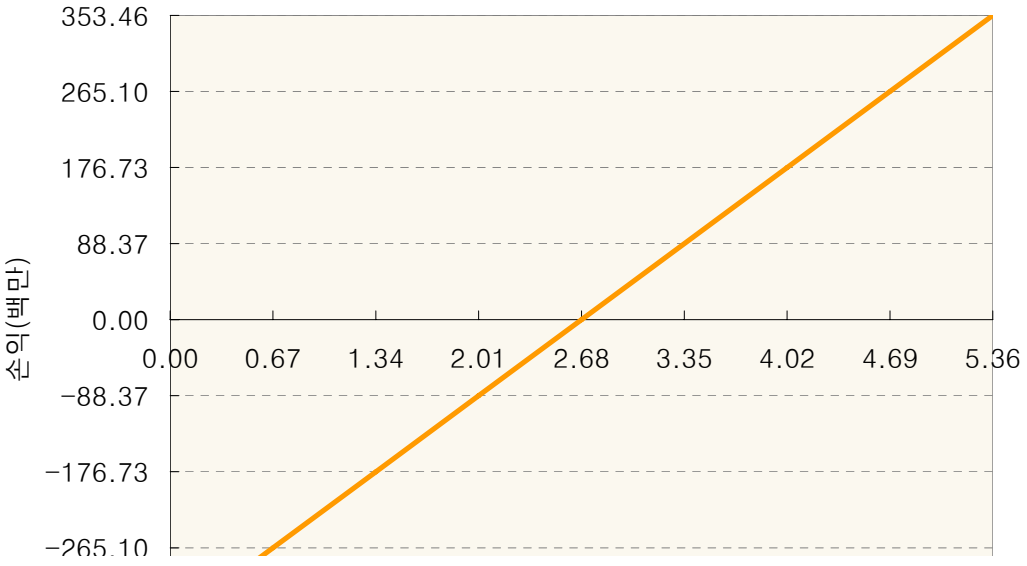


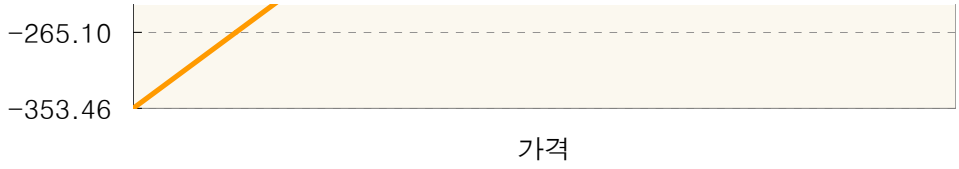


HOH5-NY Harb ULSD Fut Mar15

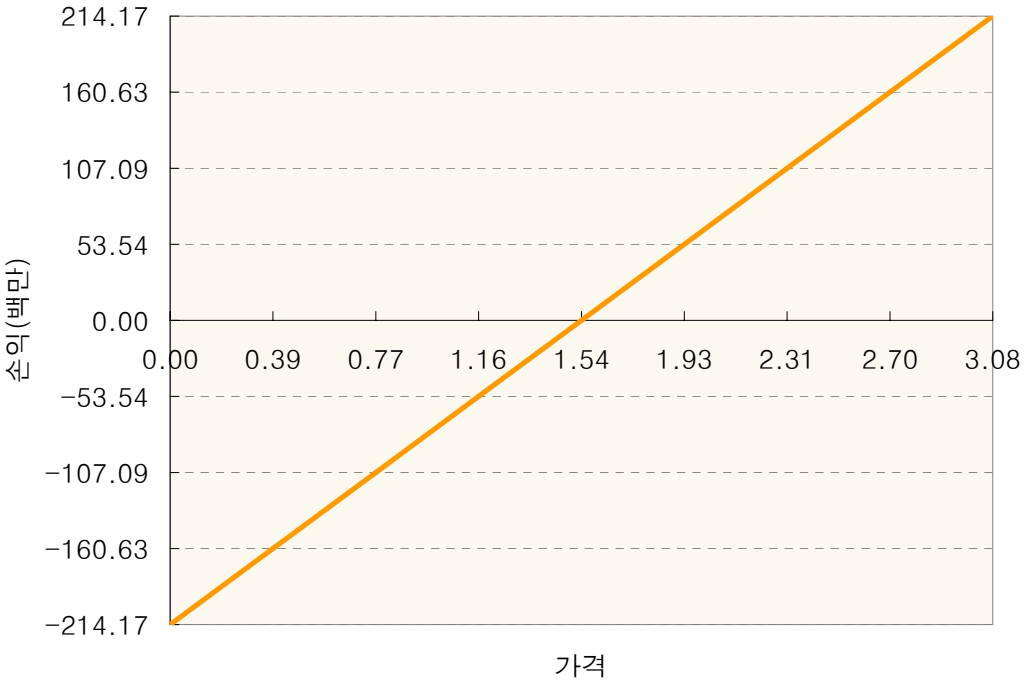


NGH5-NATURAL GAS FUTR Mar15





XBH5-GASOLINE RBOB FUT Mar15



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLH5	WTI CRUDE FUTURE Mar15	30
COK5	BRENT CRUDE FUTR May15	25
HOH5	NY Harb ULSD Fut Mar15	13
NGH5	NATURAL GAS FUTR Mar15	28
XBH5	GASOLINE RBOB FUT Mar15	17

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

(단위:백만원)

209

공시일	2015-02-04
기준일	2015-02-03

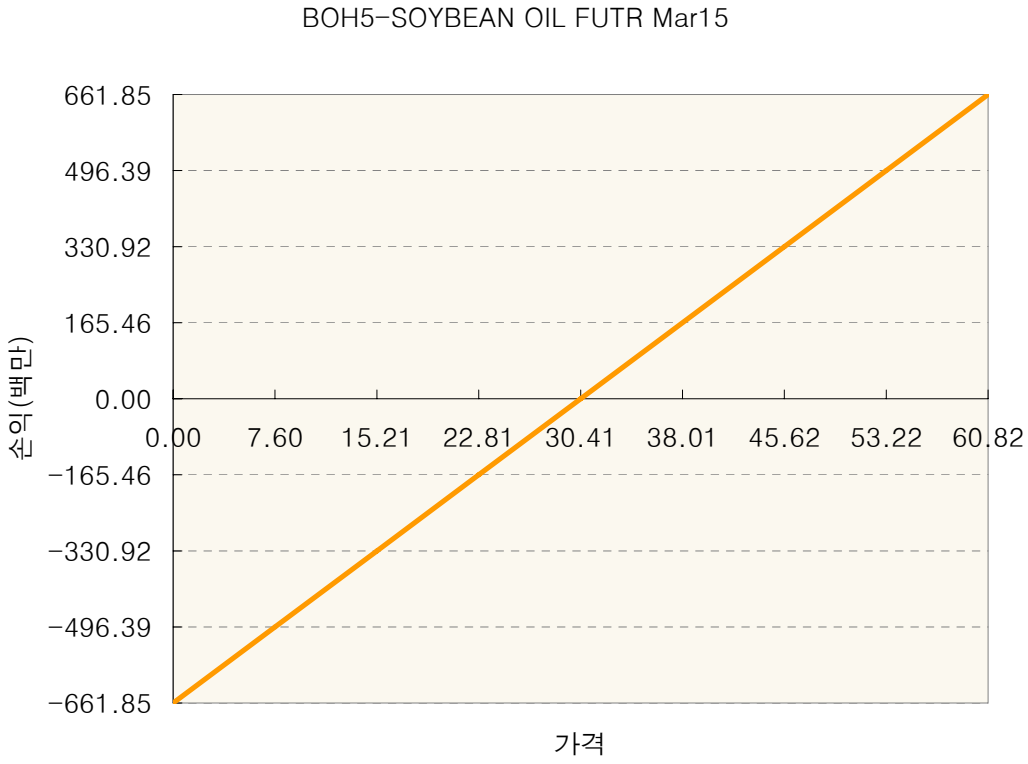
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

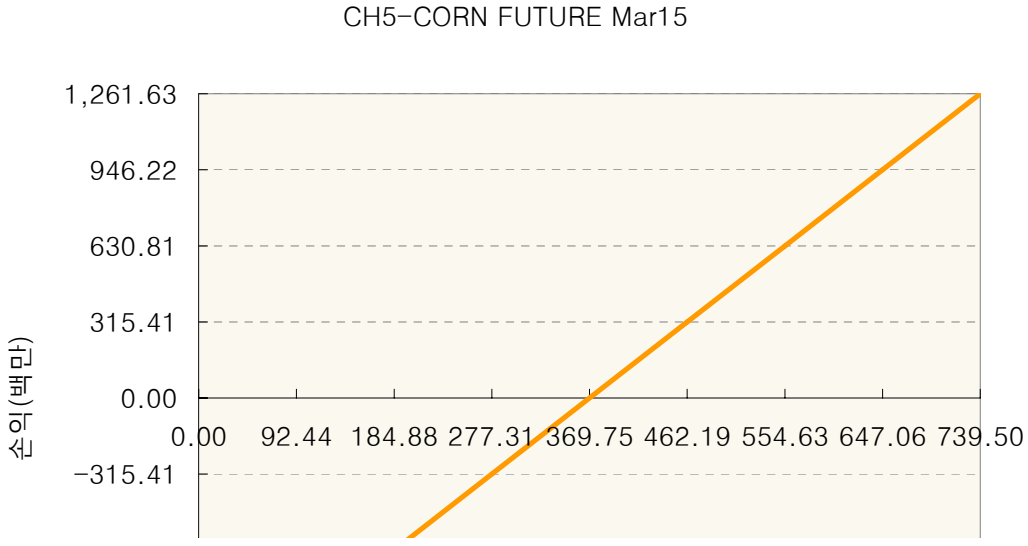
1. 계약금액

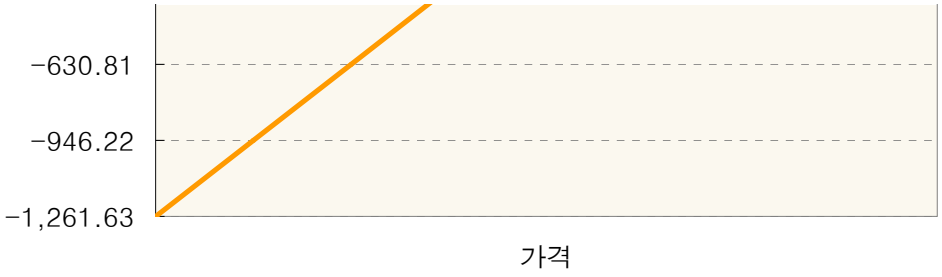
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,388	0	7,388	

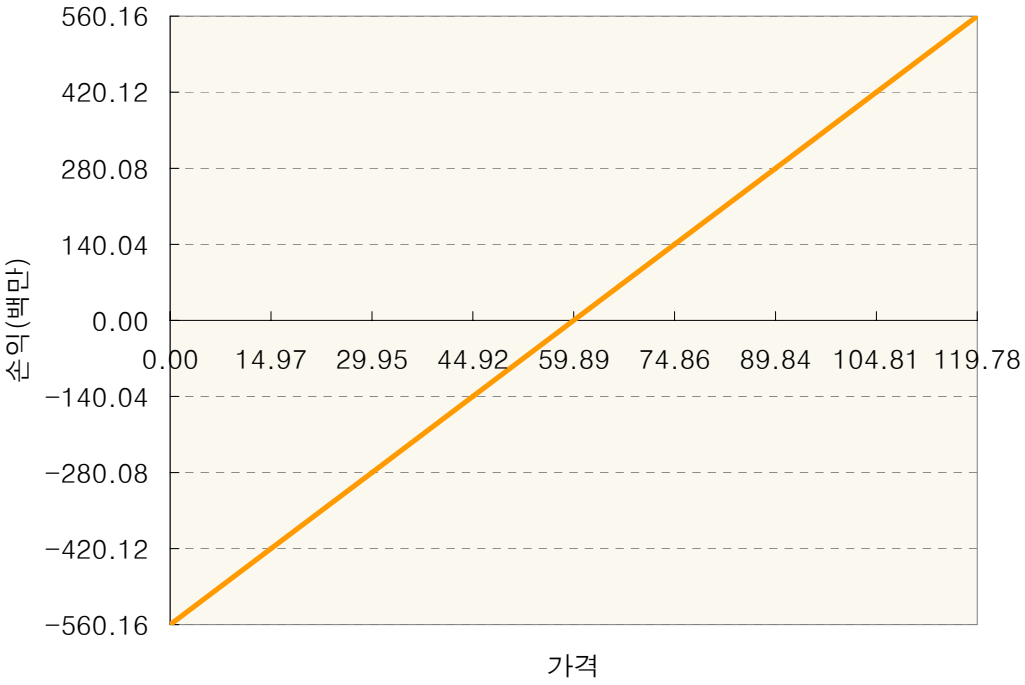
2. 만기시점의 손익구조



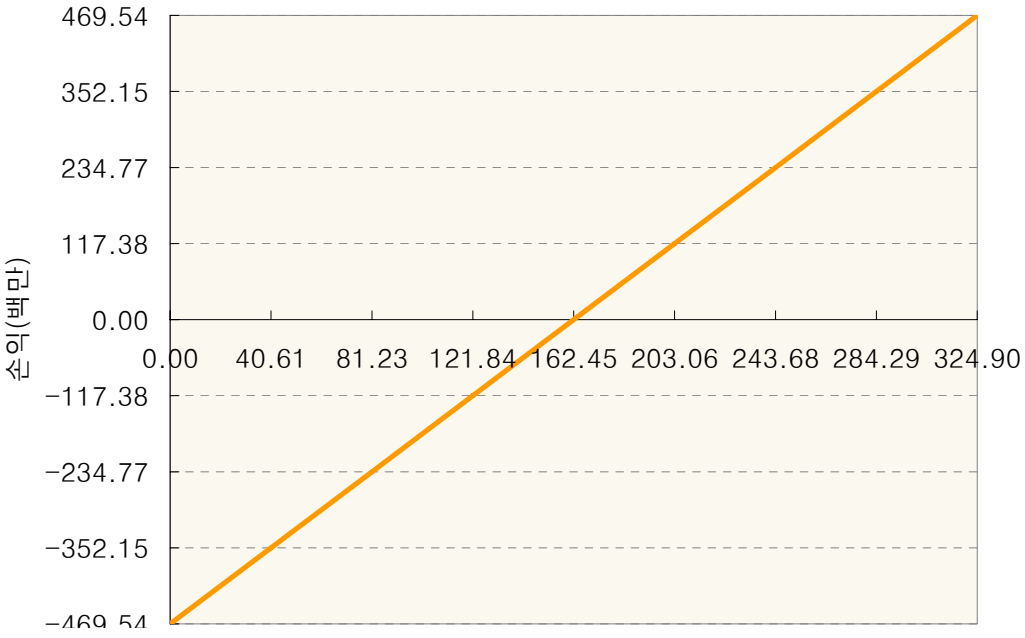


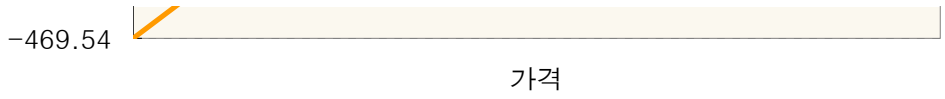


CTH5-COTTON NO.2 FUTR Mar15

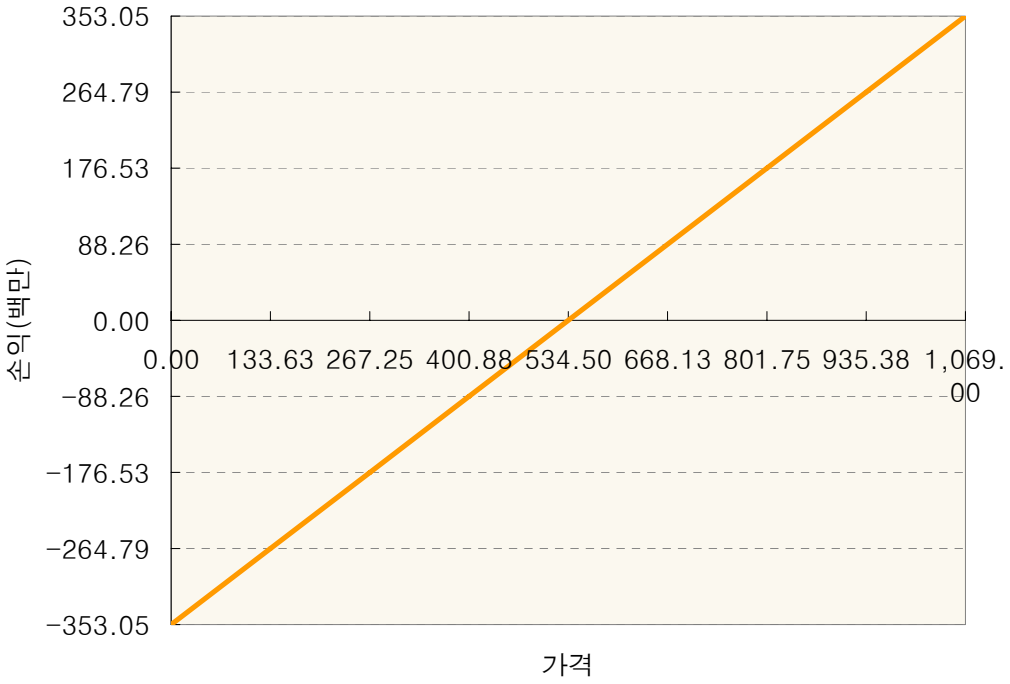


KCH5-COFFEE "C" FUTURE Mar15

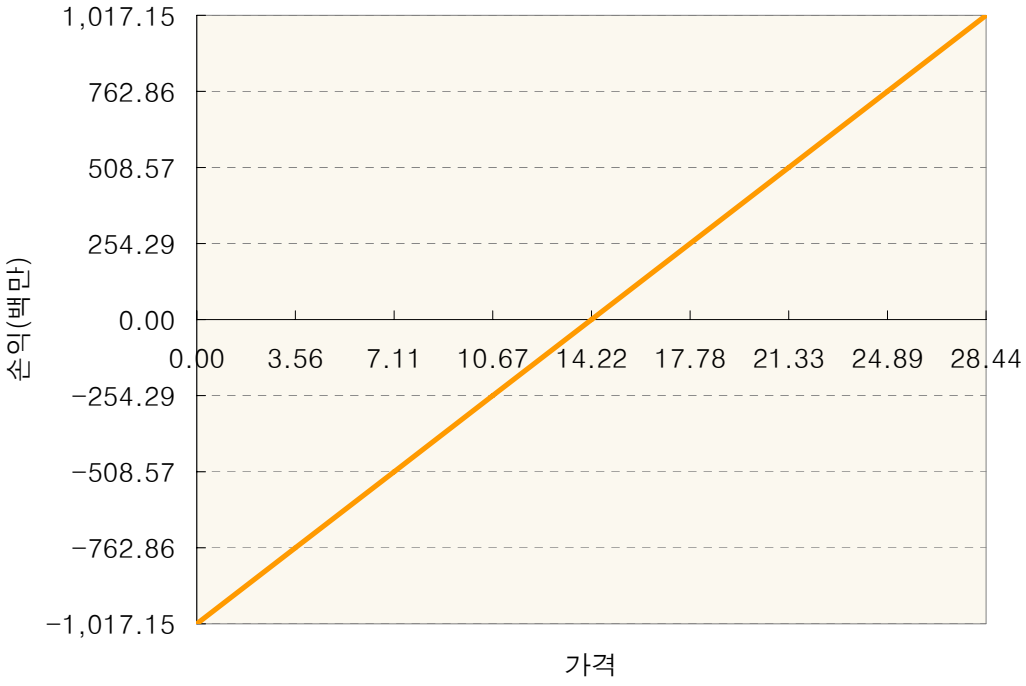




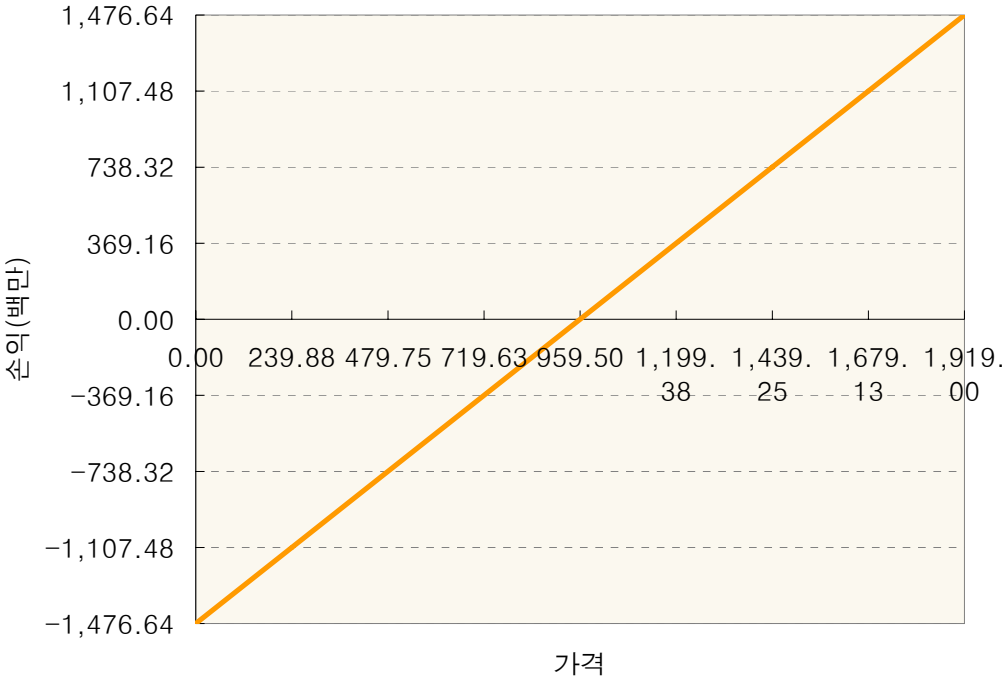
KWH5-WHEAT FUTURE(KCB) Mar15



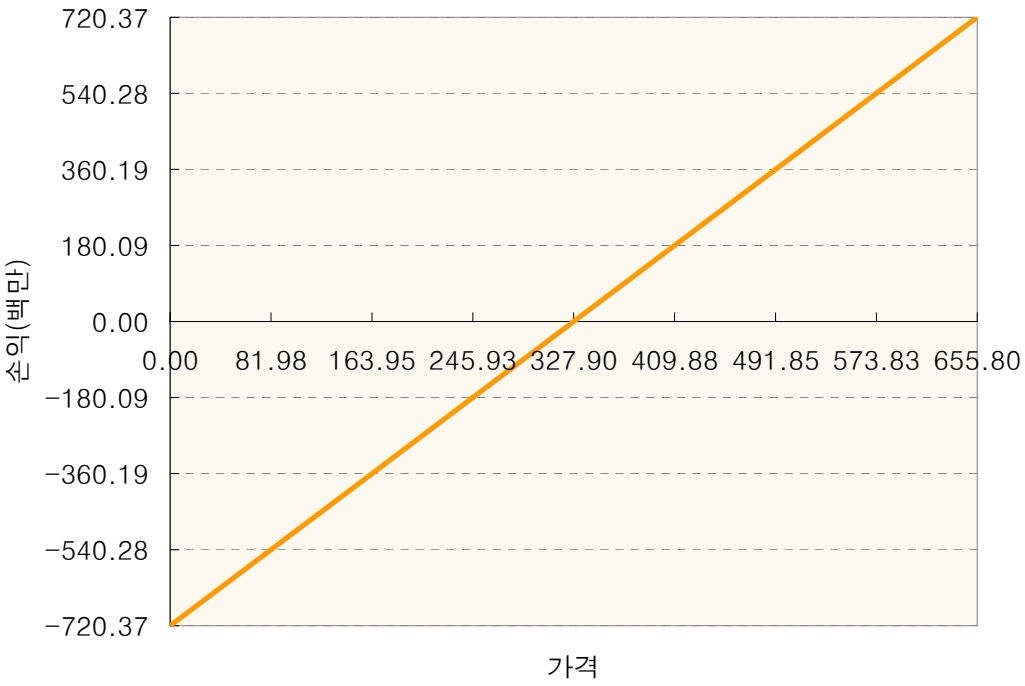
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar15



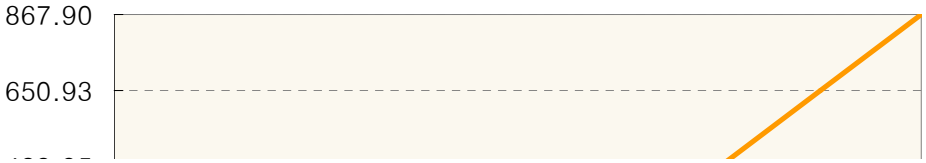
SH5-SOYBEAN FUTURE Mar15

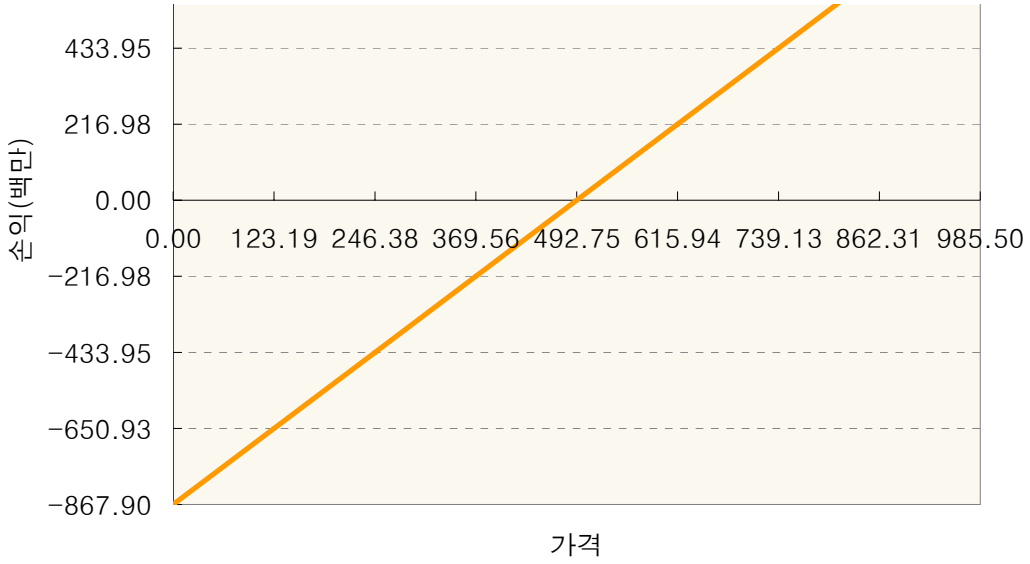


SMH5-SOYBEAN MEAL FUTR Mar15



WH5-WHEAT FUTURE(CBT) Mar15





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH5	SOYBEAN OIL FUTR Mar15	53
CH5	CORN FUTURE Mar15	101
CTH5	COTTON NO.2 FUTR Mar15	45
KCH5	COFFEE "C" FUTURE Mar15	38
KWH5	WHEAT FUTURE(KCB) Mar15	28
SBH5	Sugar #11 (WORLD) Mar15	81
SH5	SOYBEAN FUTURE Mar15	118
SMH5	SOYBEAN MEAL FUTR Mar15	58
WH5	WHEAT FUTURE(CBT) Mar15	69

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

(단위:백만원)

838