공시일	2015-02-23
기준일	2015-02-17

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	2015-02-23
기준일	2015-02-17

차곡차곡플러스모(주식혼합-파생)

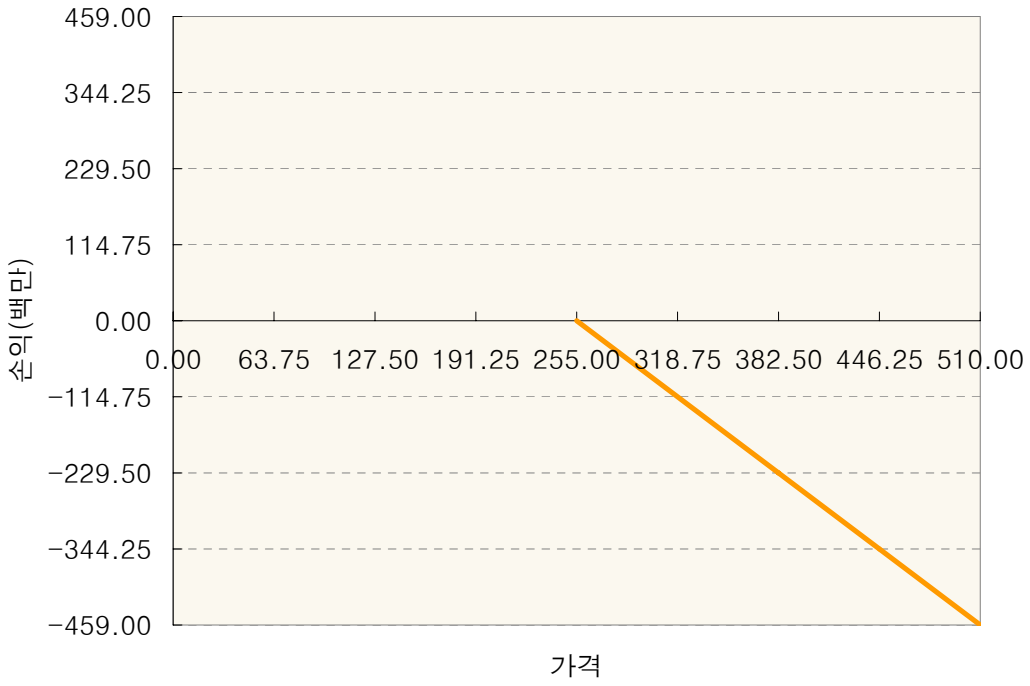
1. 계약금액

(단위:백만원)

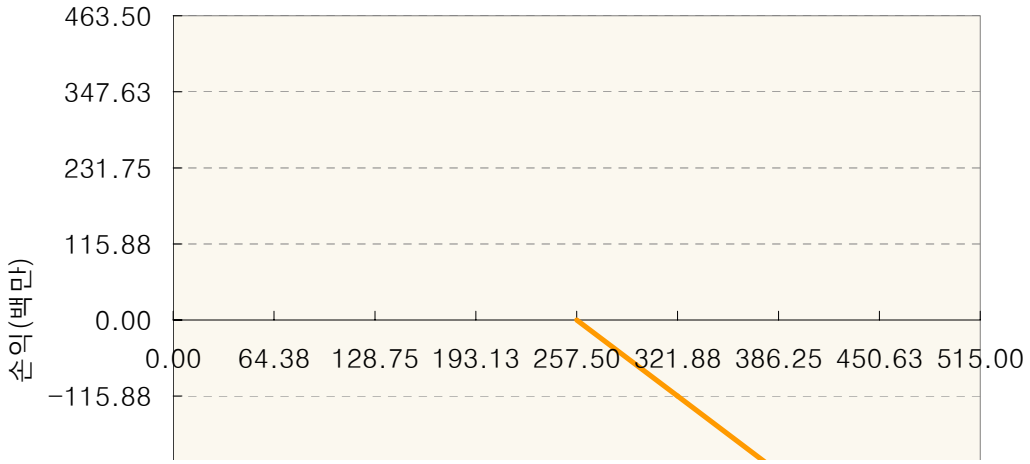
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	923	-923	장내

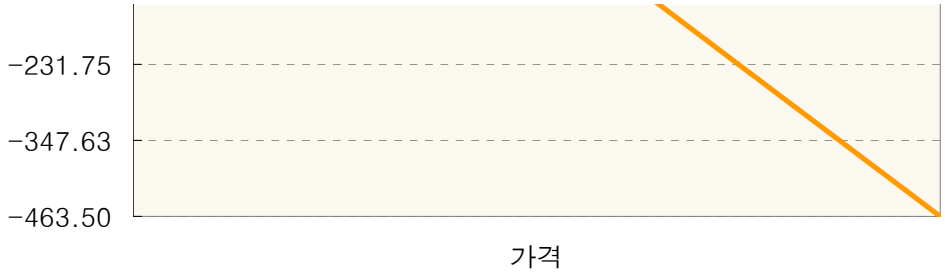
2. 만기시점의 손익구조

KR4201K32556-2015-03 콜255



KR4201K32572-2015-03 콜257.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201K325 2015-03 콜255 | 131

	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	9
-2.67%	10	9	9	9	8	7	6
0%	5	3	2	0	-2	-4	-5
2.67%	-21	-23	-25	-27	-29	-31	-33
5.33%	-71	-71	-72	-73	-74	-75	-77
8.00%	-130	-130	-130	-130	-130	-131	-131

KR4201K325 2015-03 콜257.5 | 115

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	5	5	5	5	5	5
-5.33%	5	5	5	5	5	5	5
-2.67%	5	5	5	5	4	4	3
0%	3	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	-12	-15	-17	-19	-21	-23	-25
5.33%	-55	-56	-57	-59	-60	-62	-63
8.00%	-112	-112	-112	-113	-113	-114	-115

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

(단위:백만원)

234

공시일	2015-02-23
기준일	2015-02-17

스마트인덱스모

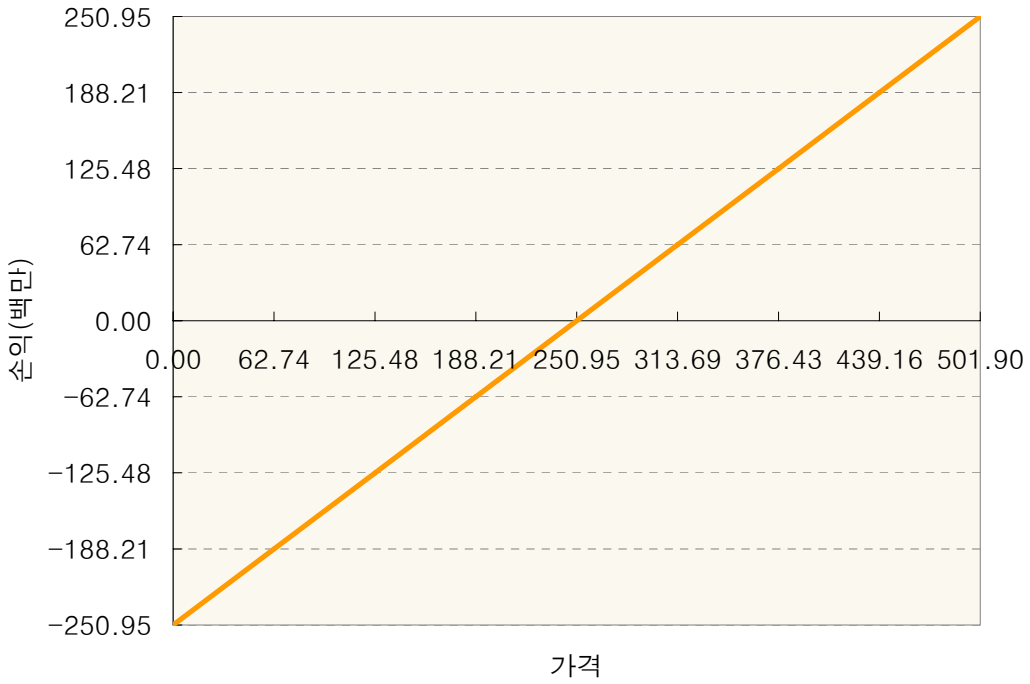
1. 계약금액

(단위:백만원)

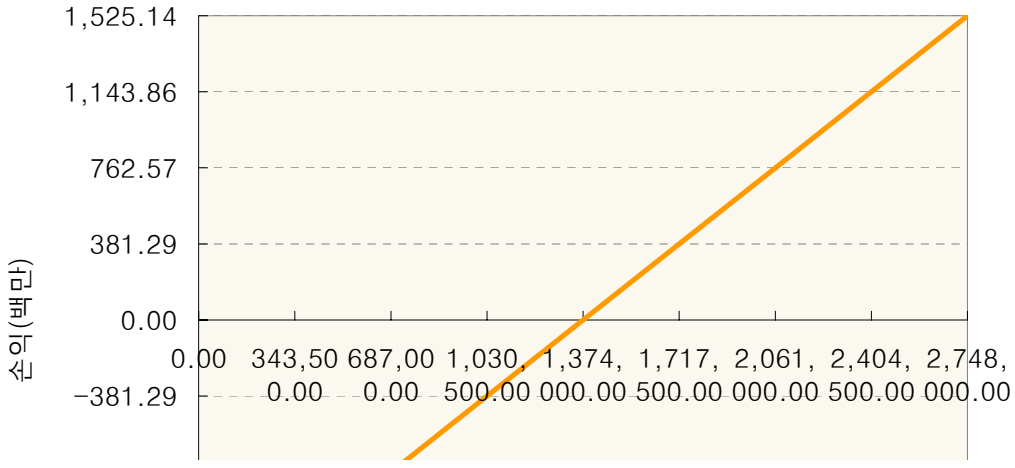
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,776	0	1,776	장내

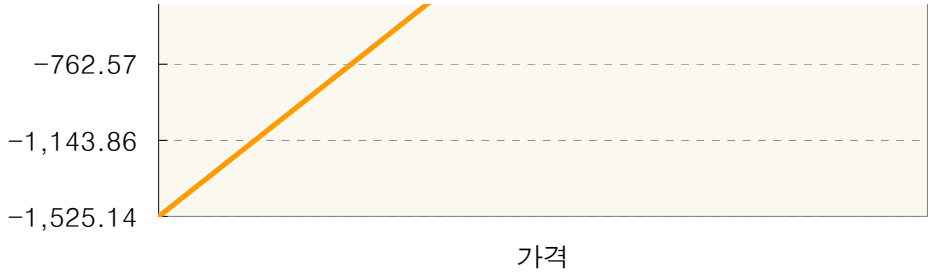
2. 만기시점의 손익구조

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							122
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-122	-122	-122	-122	-122	-122	-122
-5.33%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	41	41	41	41	41	41	41
5.33%	82	82	82	82	82	82	82
8.00%	122	122	122	122	122	122	122

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

(단위:백만원)

131

공시일	2015-02-23
기준일	2015-02-17

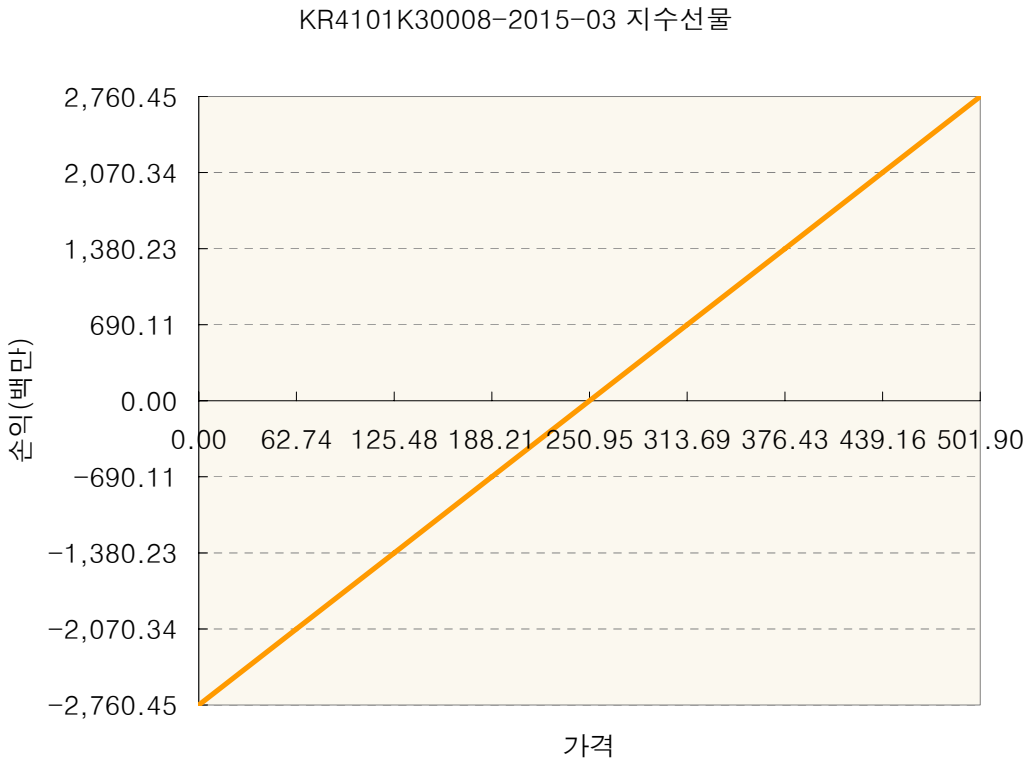
스마트레버리지목표전환형1호

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	2,760	0	2,760	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)

138

공시일	2015-02-23
기준일	2015-02-17

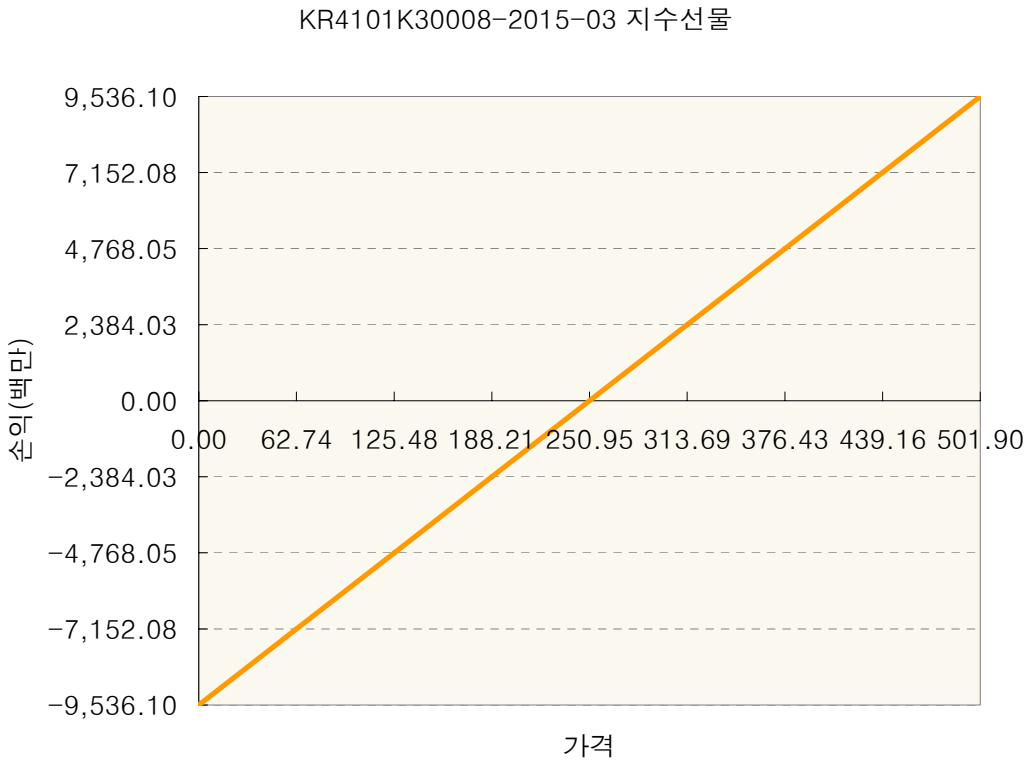
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	125	-125	장내
누계	유가증권	선물	9,536	0	9,536	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101K300 2015-03 지수선물							761
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-761	-761	-761	-761	-761	-761	-761
-5.33%	-507	-507	-507	-507	-507	-507	-507
-2.67%	-254	-254	-254	-254	-254	-254	-254
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	254	254	254	254	254	254	254
5.33%	507	507	507	507	507	507	507
8.00%	761	761	761	761	761	761	761

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

478

공시일	2015-02-23
기준일	2015-02-17

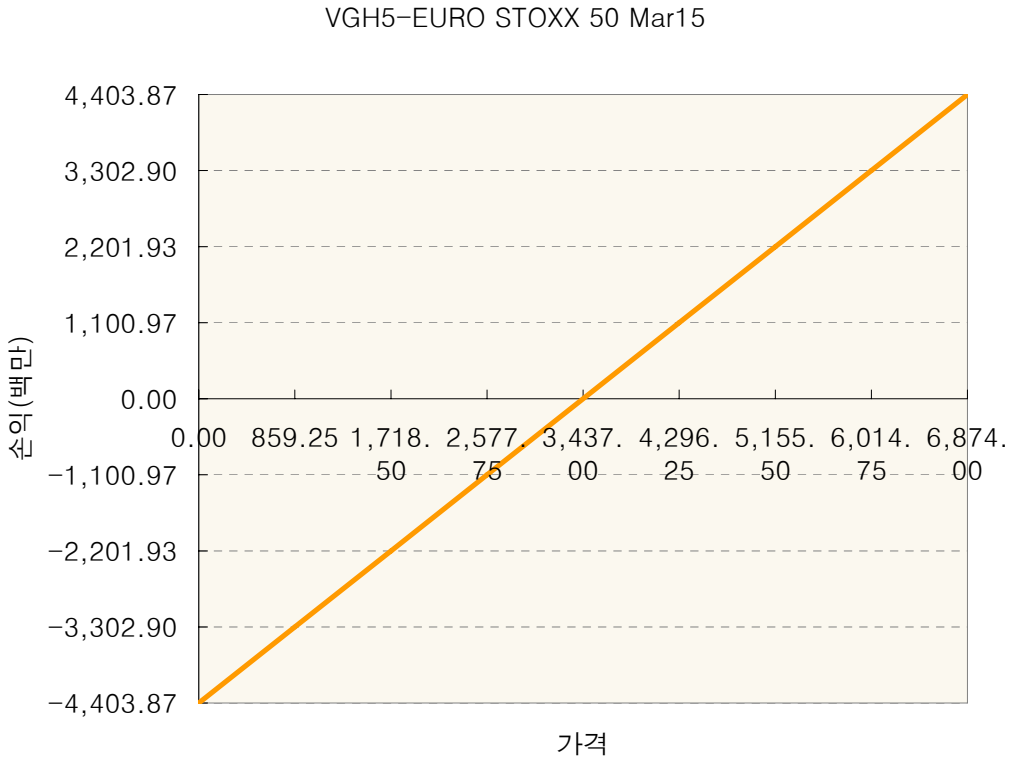
유로인덱스1호(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,404	0	4,404	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH5	EURO STOXX 50 Mar15	352

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

(단위:백만원)

299

공시일	2015-02-23
기준일	2015-02-17

아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

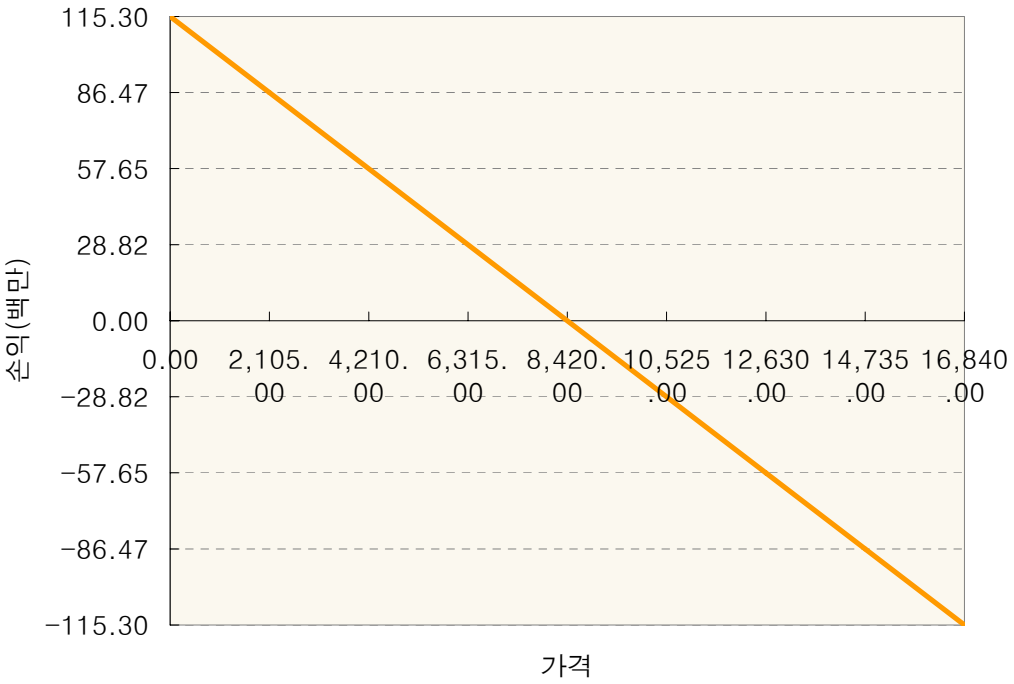
1. 계약금액

(단위:백만원)

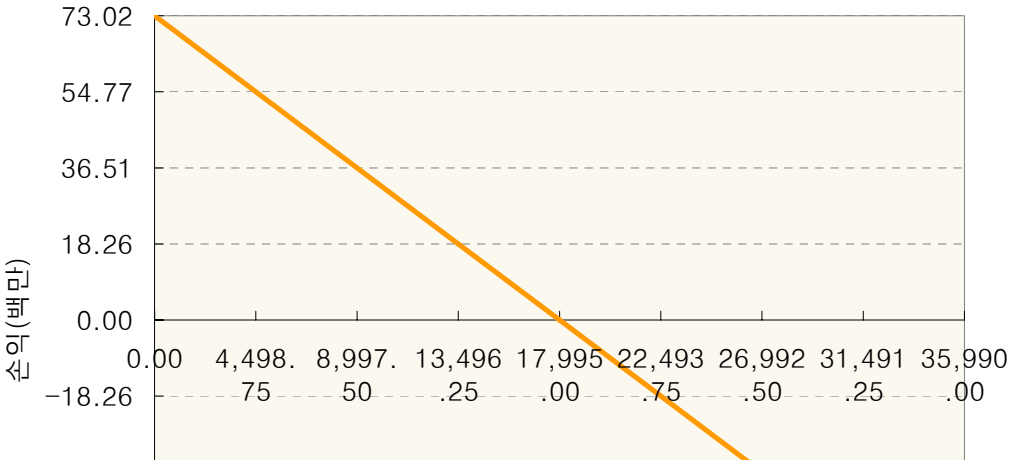
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	0	188	-188	

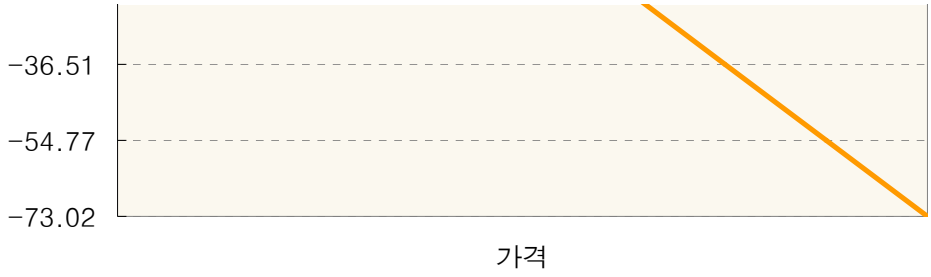
2. 만기시점의 손익구조

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	2015-02-23
기준일	2015-02-17

차이나인덱스(주식-파생형)(종)

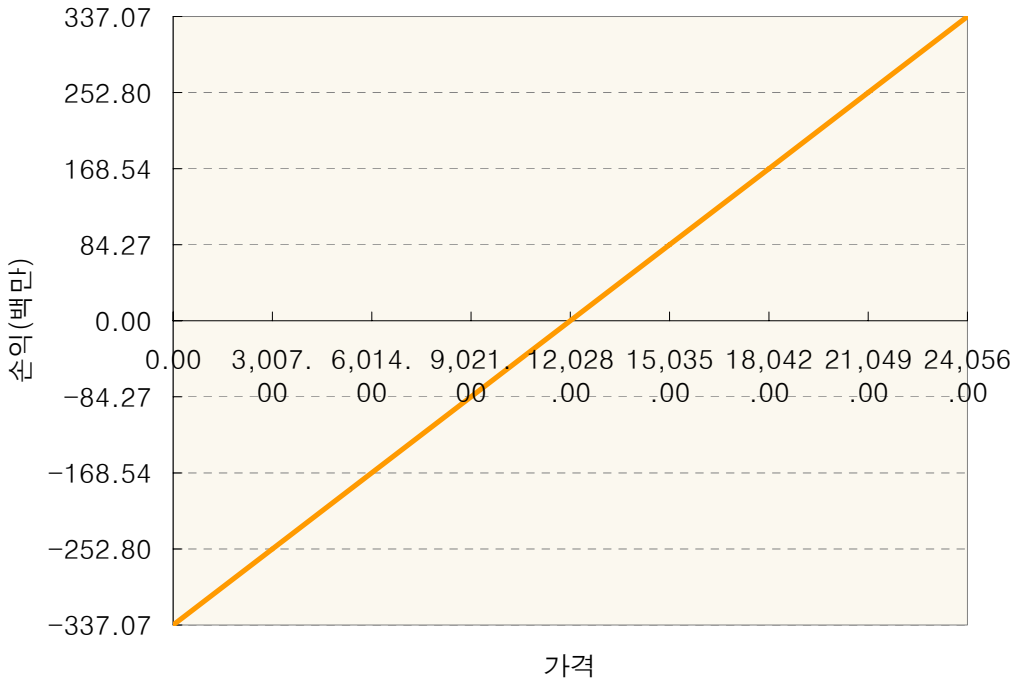
1. 계약금액

(단위:백만원)

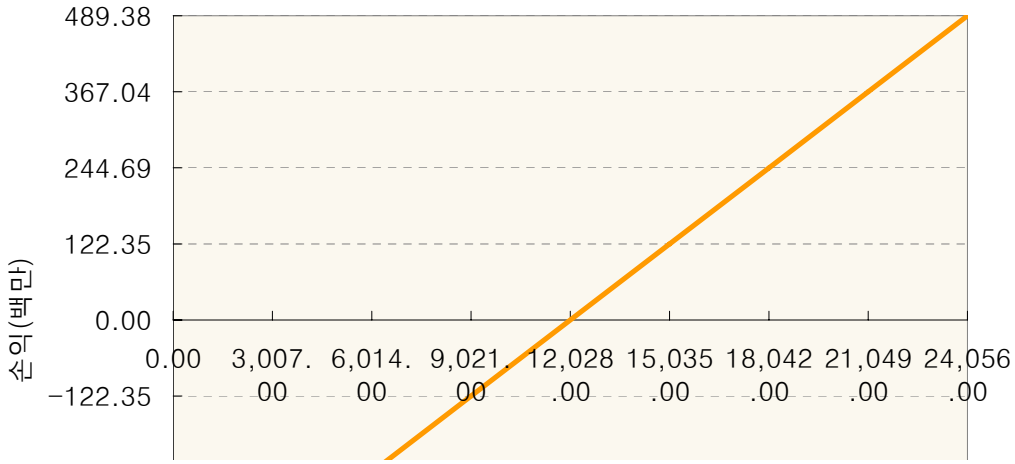
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	826	0	826	장내

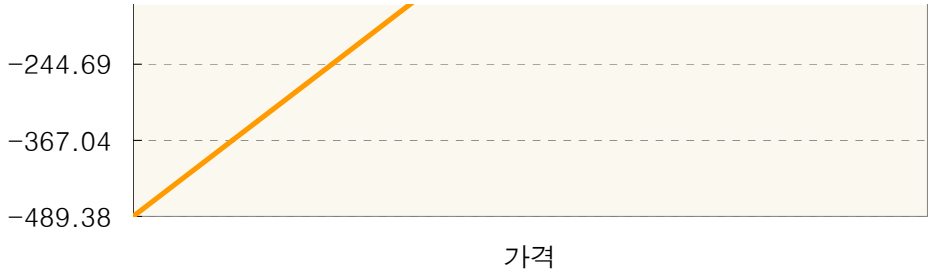
2. 만기시점의 손익구조

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	27
MHCG5	MINI H-SHR IDX FU Feb15	39

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

(단위:백만원)

63

공시일	2015-02-23
기준일	2015-02-17

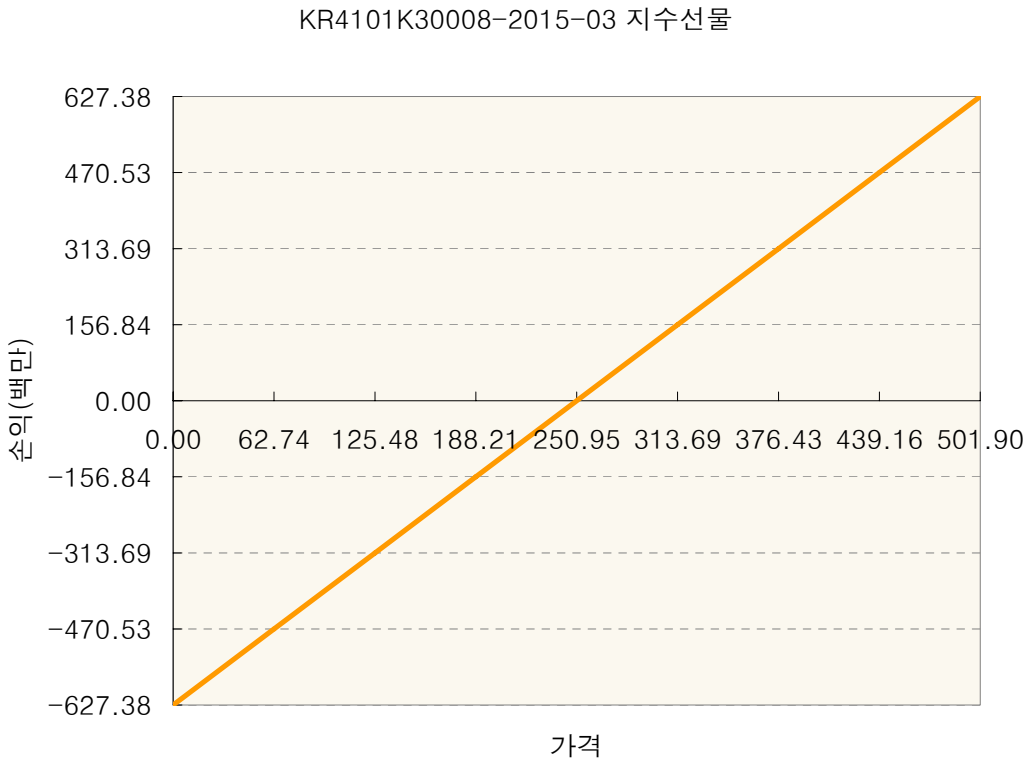
ETF스마트레버리지목표전환형제4

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)

31

공시일	2015-02-23
기준일	2015-02-17

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	2,521

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,404

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2015-02-23
기준일	2015-02-17

메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

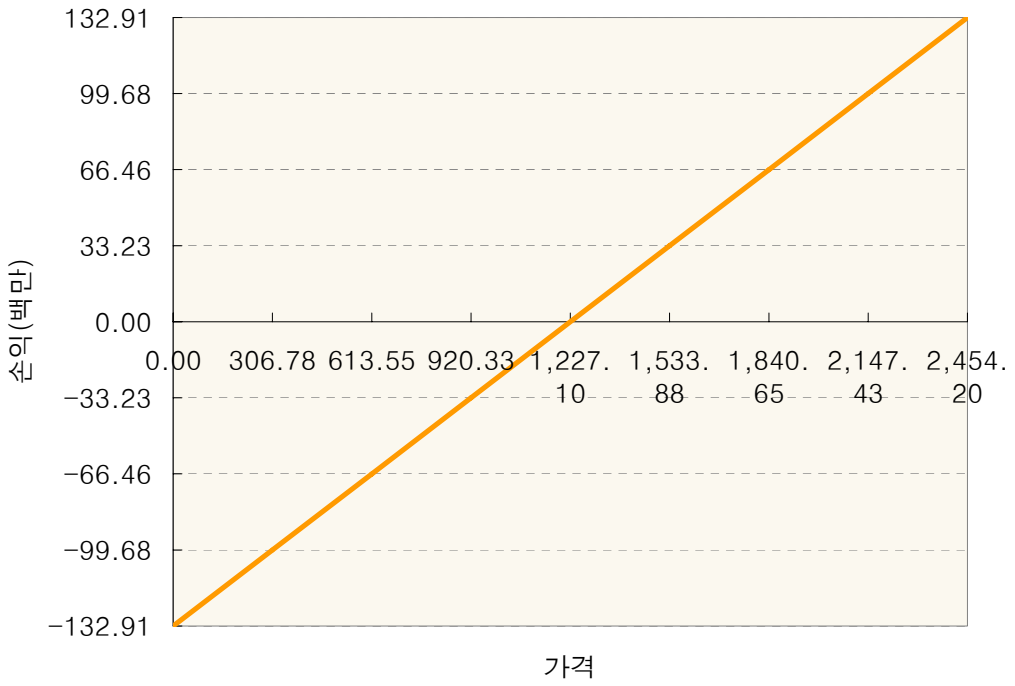
1. 계약금액

(단위:백만원)

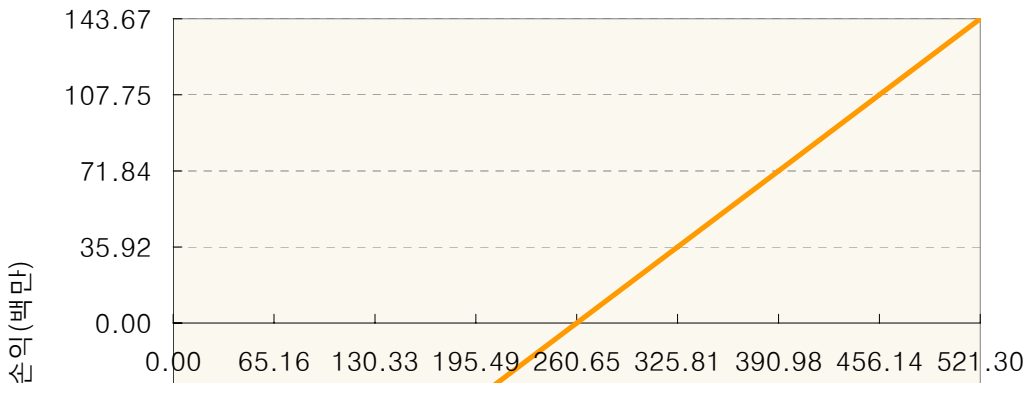
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	19	0	19	
누계	유가증권	선물	595	162	433	

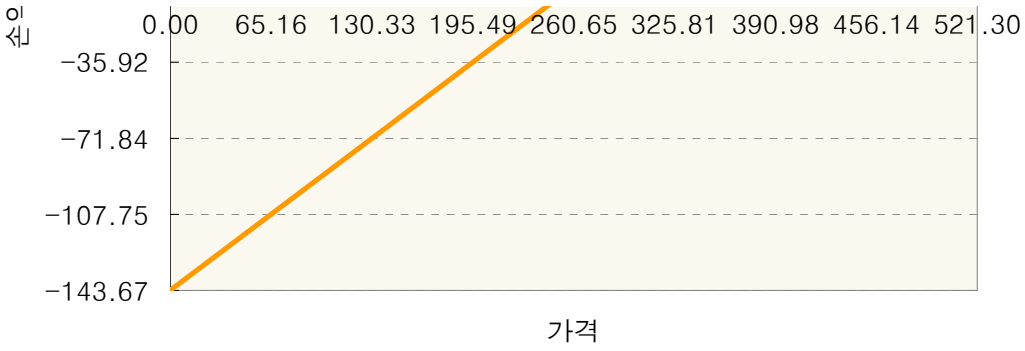
2. 만기시점의 손익구조

GCJ5-GOLD 100 OZ FUTR Apr15

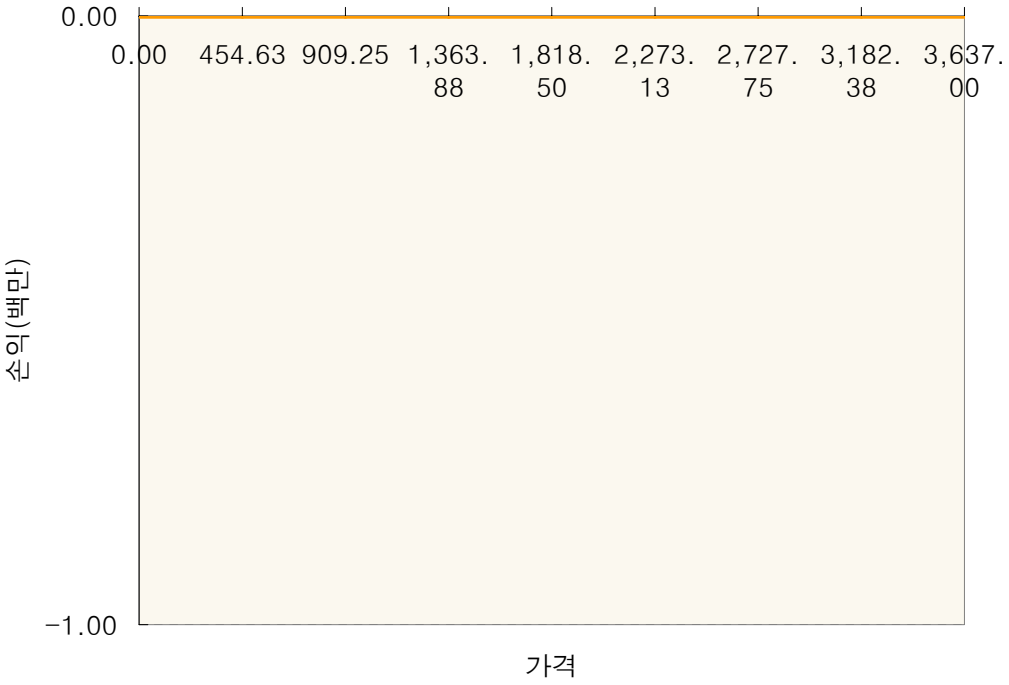


HGK5-COPPER FUTURE May15

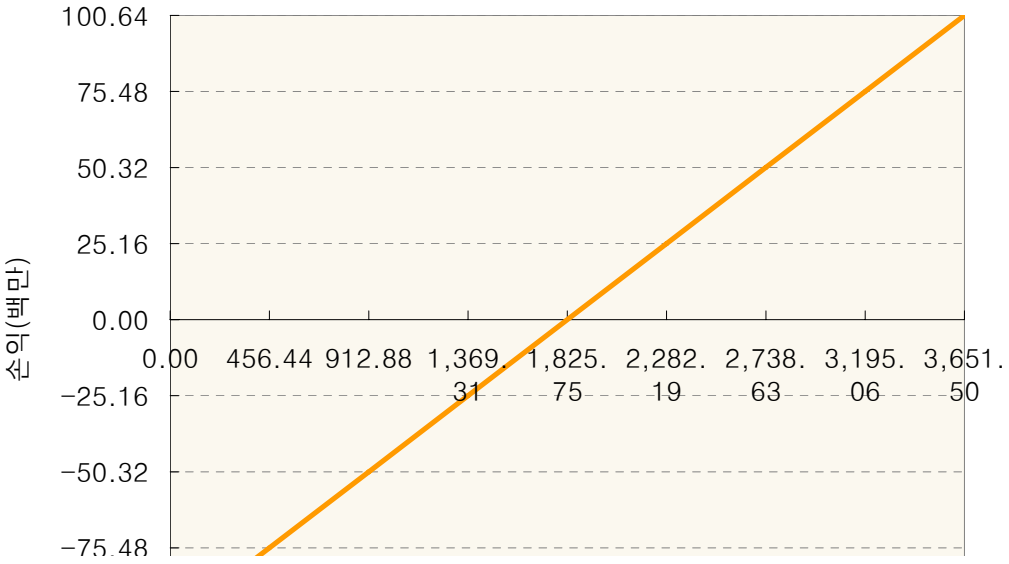


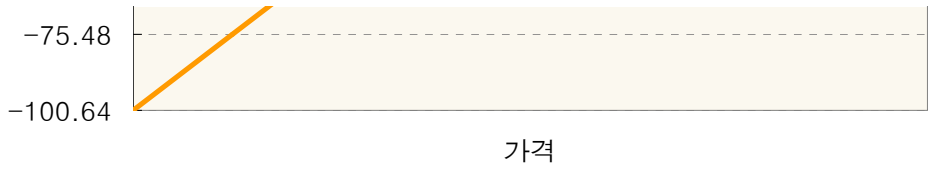


LAH5-LME PRI ALUM FUTR MAR 15

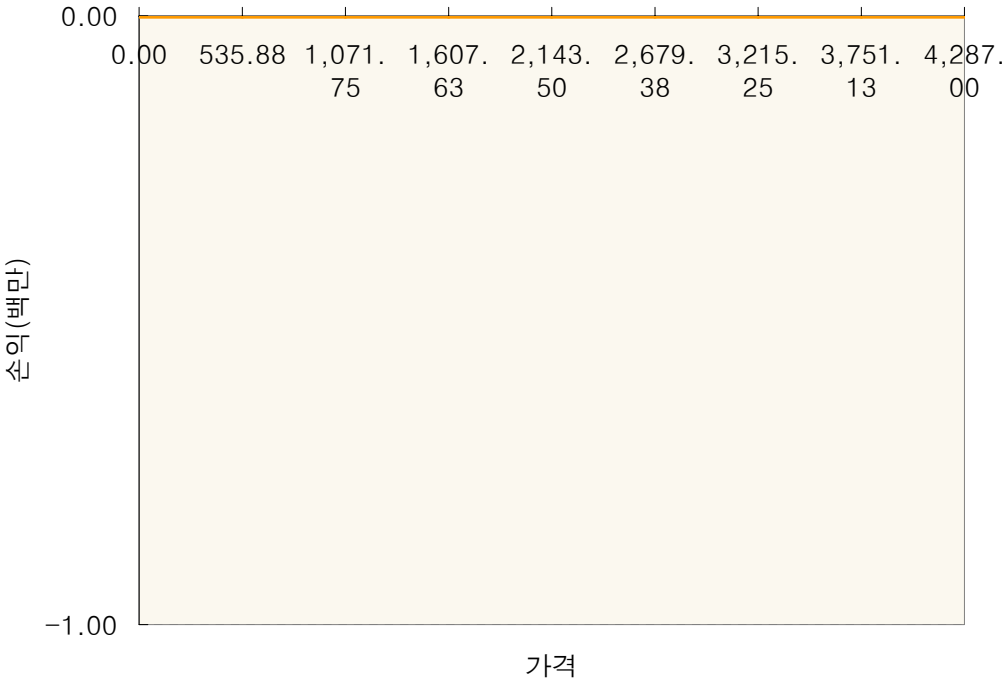


LAK5-LME PRI ALUM FUTR MAY15

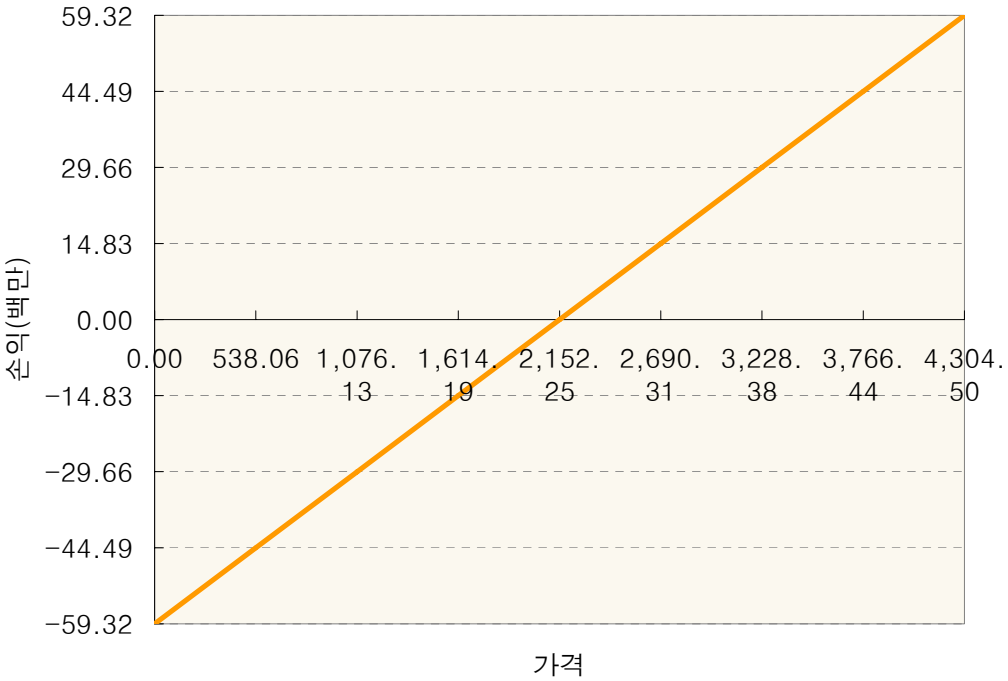


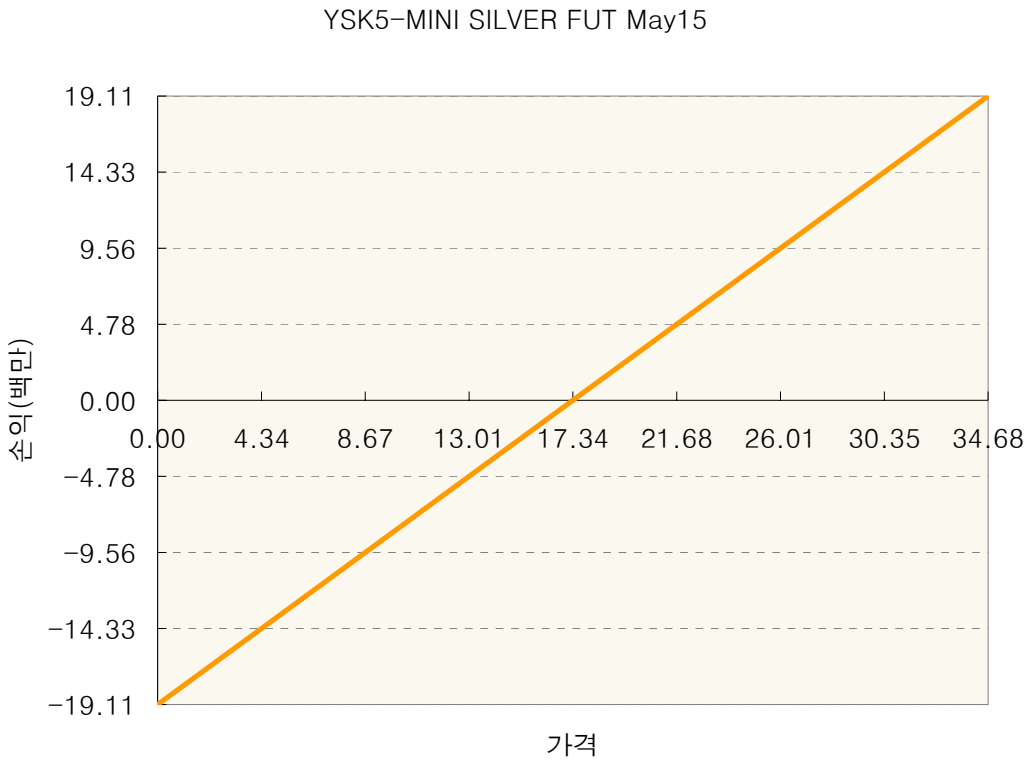


LXH5-LME ZINC FUTURE MAR15



LXK5-LME ZINC FUTURE MAY15





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

GCJ5	GOLD 100 OZ FUTR Apr15	11
HGK5	COPPER FUTURE May15	11
LAH5	LME PRI ALUM FUTR MAR 15	0.2
LAK5	LME PRI ALUM FUTR MAY15	8
LXH5	LME ZINC FUTURE MAR15	0.1
LXK5	LME ZINC FUTURE MAY15	5
YSK5	MINI SILVER FUT May15	2

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

(단위:백만원)

33

공시일	2015-02-23
기준일	2015-02-17

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

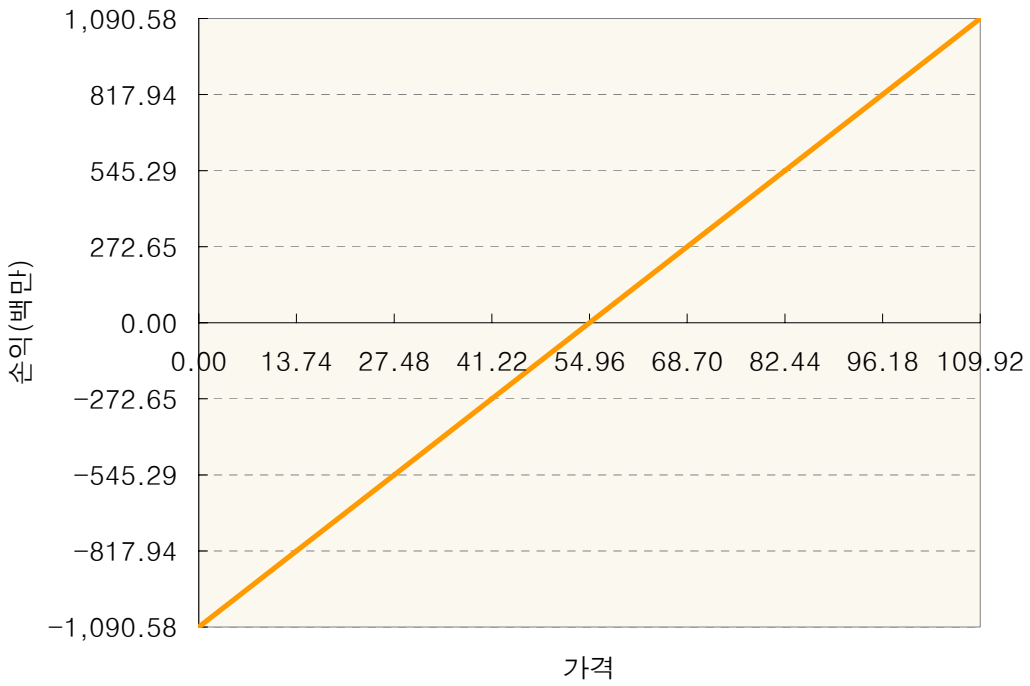
1. 계약금액

(단위:백만원)

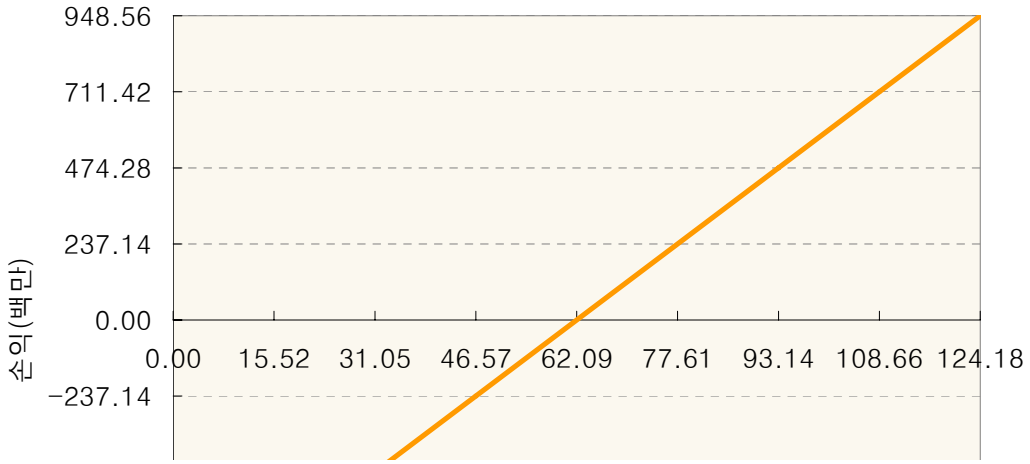
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,310	0	4,310	

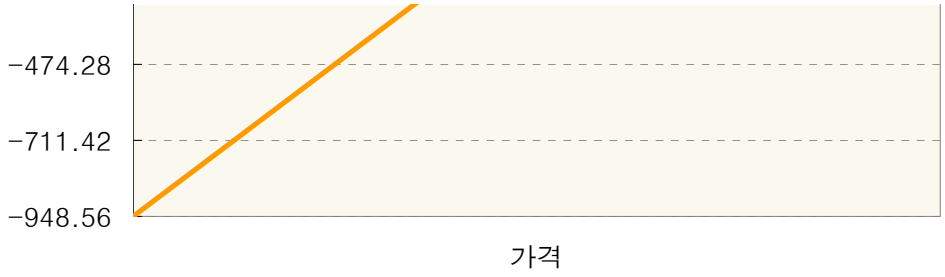
2. 만기시점의 손익구조

CLK5-WTI CRUDE FUTURE May15

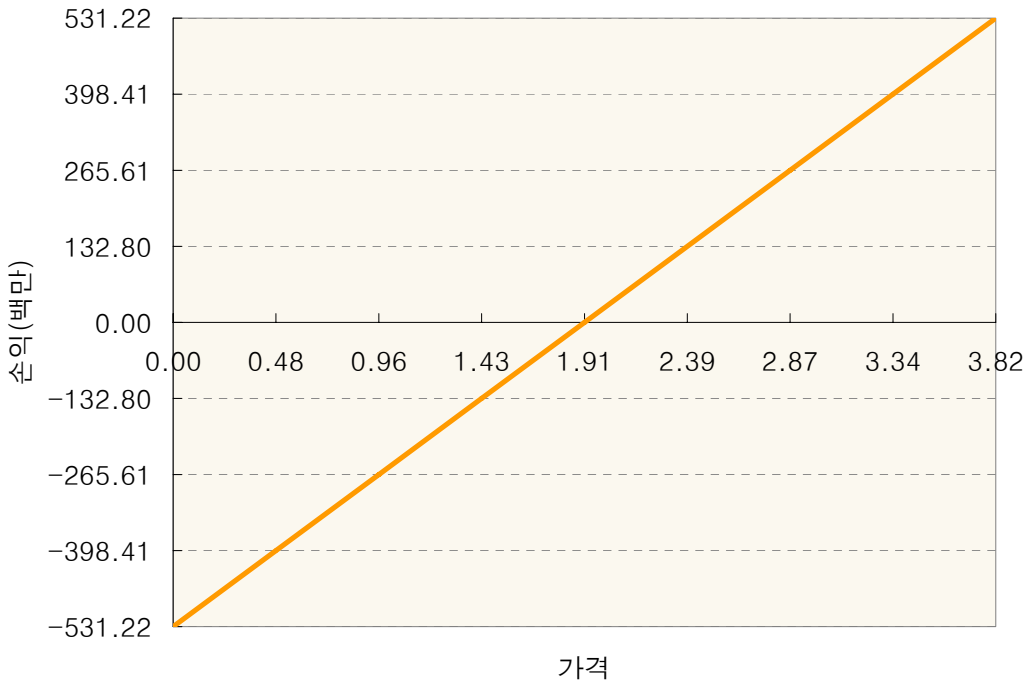


COK5-BRENT CRUDE FUTR May15

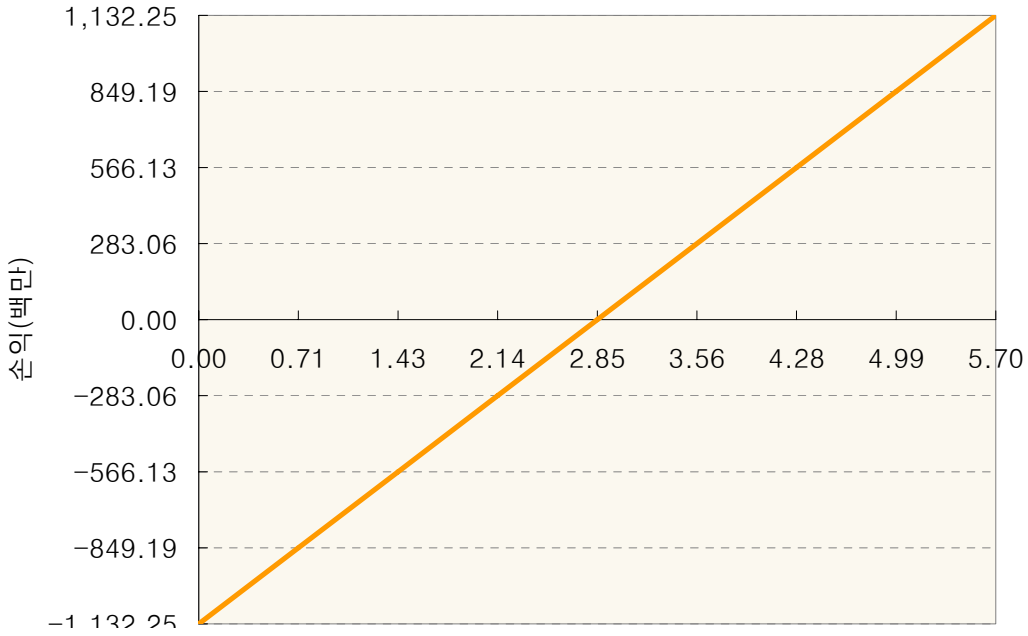


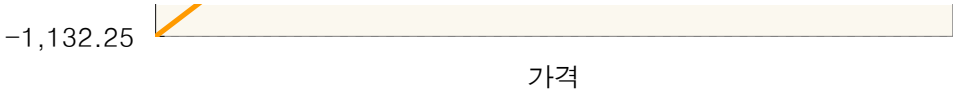


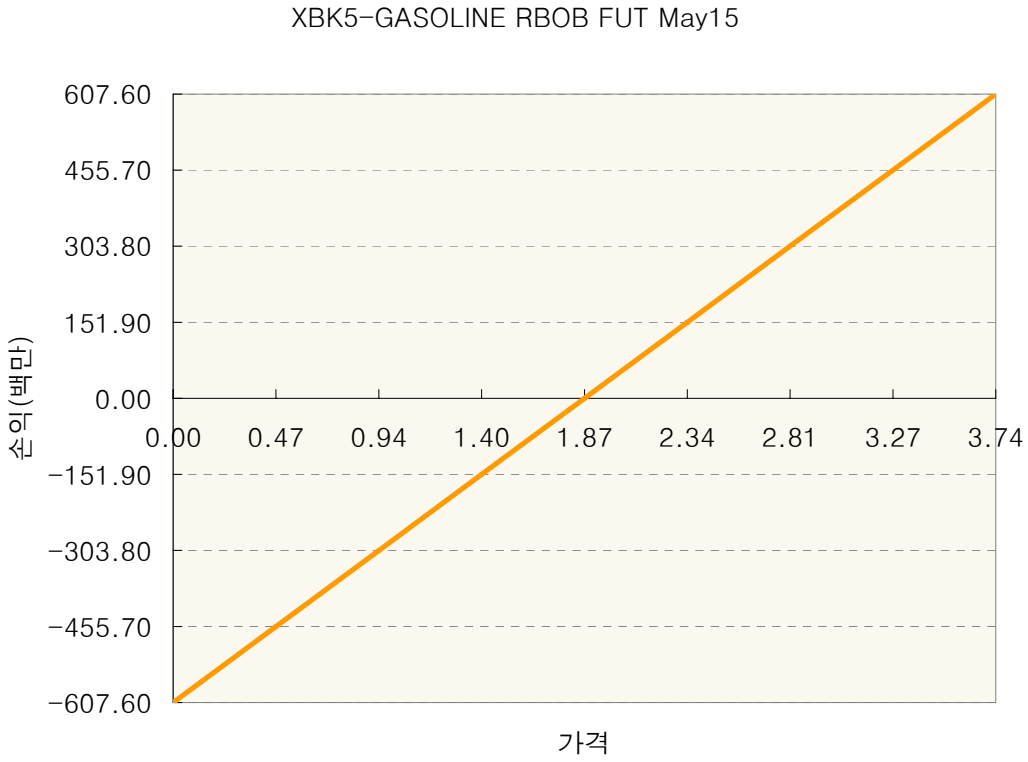
HOK5-NY Harb ULSD Fut May15



NGK5-NATURAL GAS FUTR May15







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK5	WTI CRUDE FUTURE May15	87
COK5	BRENT CRUDE FUTR May15	76
HOK5	NY Harb ULSD Fut May15	42
NGK5	NATURAL GAS FUTR May15	91
XBK5	GASOLINE RBOB FUT May15	49

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

(단위:백만원)

657

공시일	2015-02-23
기준일	2015-02-17

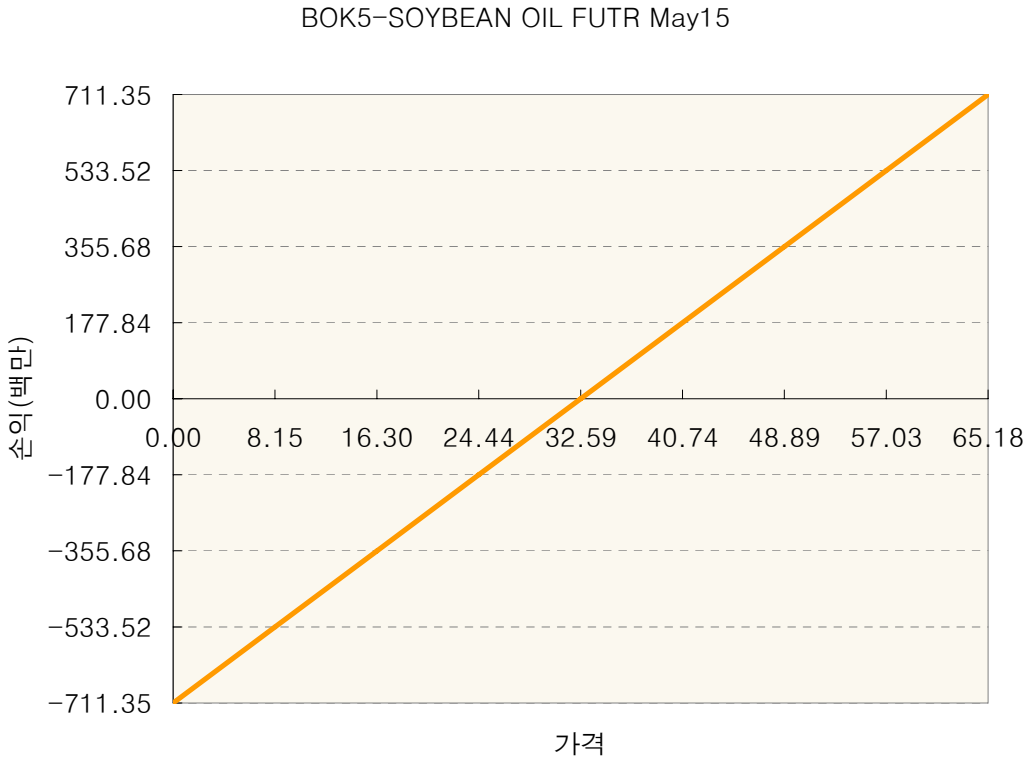
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

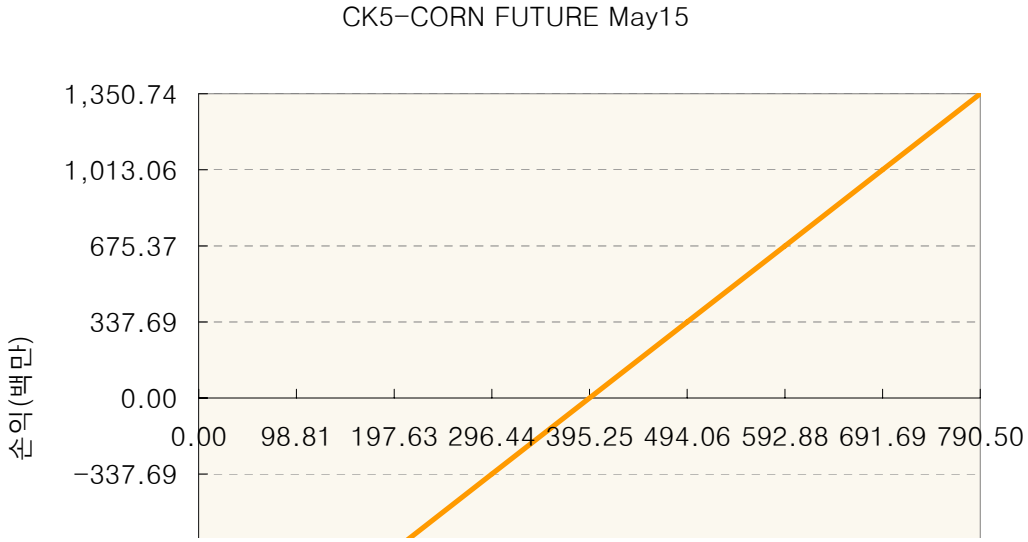
1. 계약금액

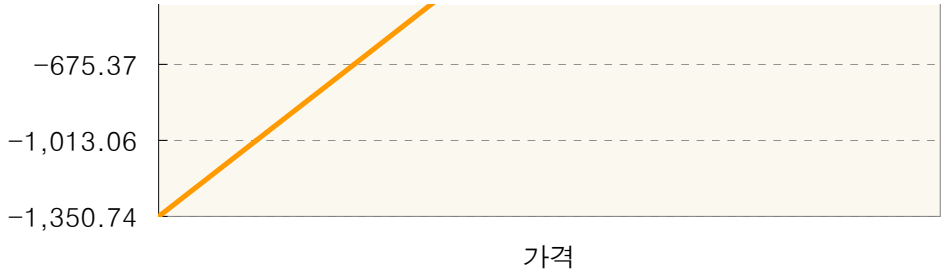
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,770	0	7,770	

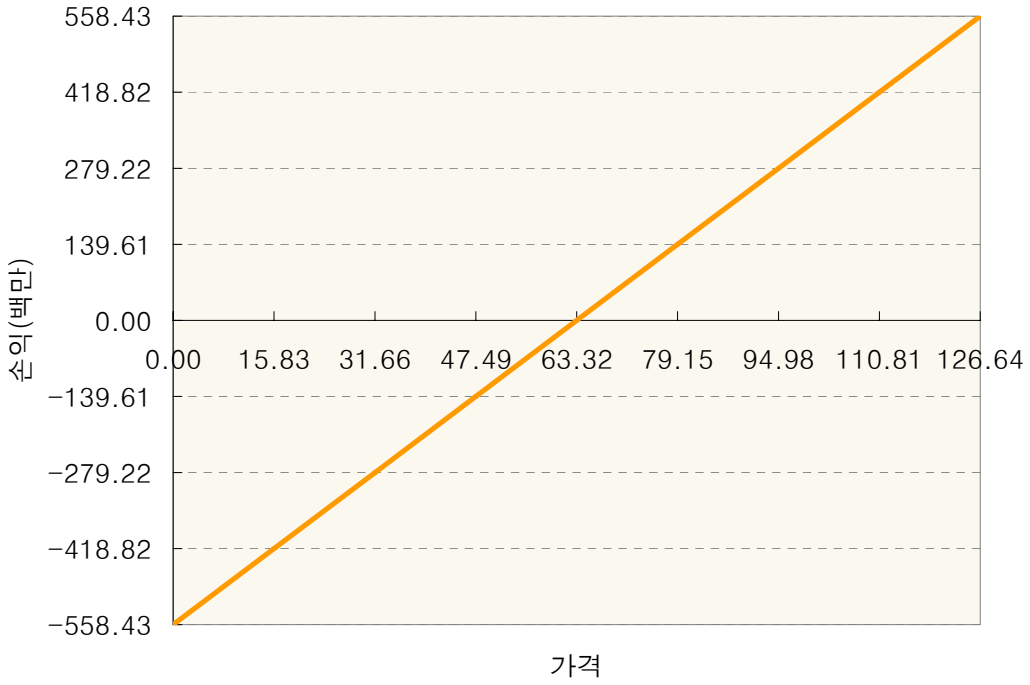
2. 만기시점의 손익구조



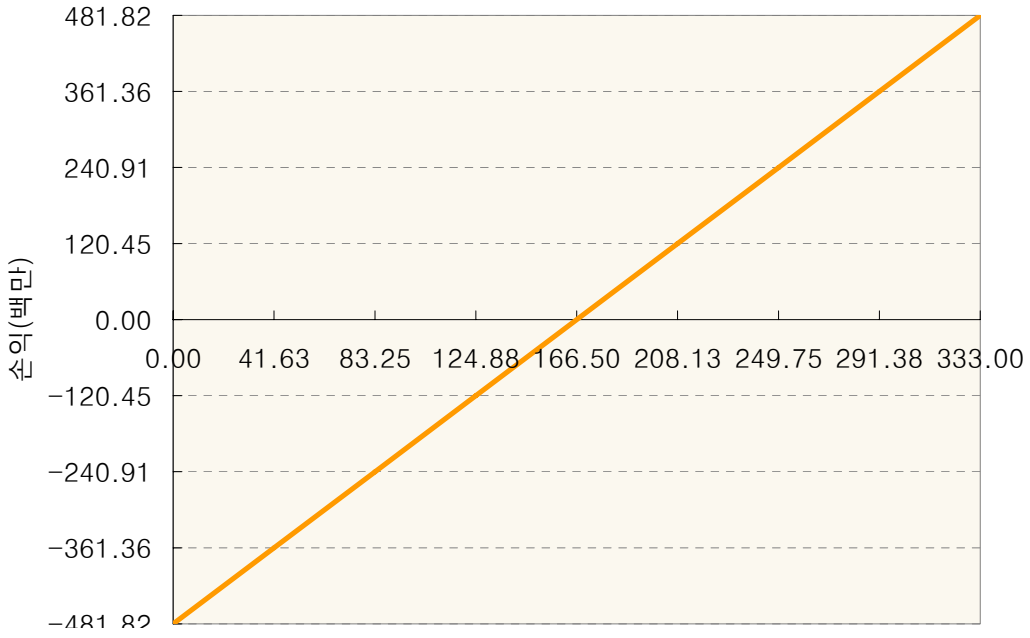


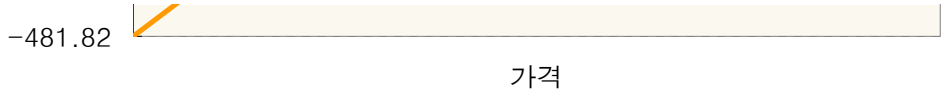


CTK5-COTTON NO.2 FUTR May15

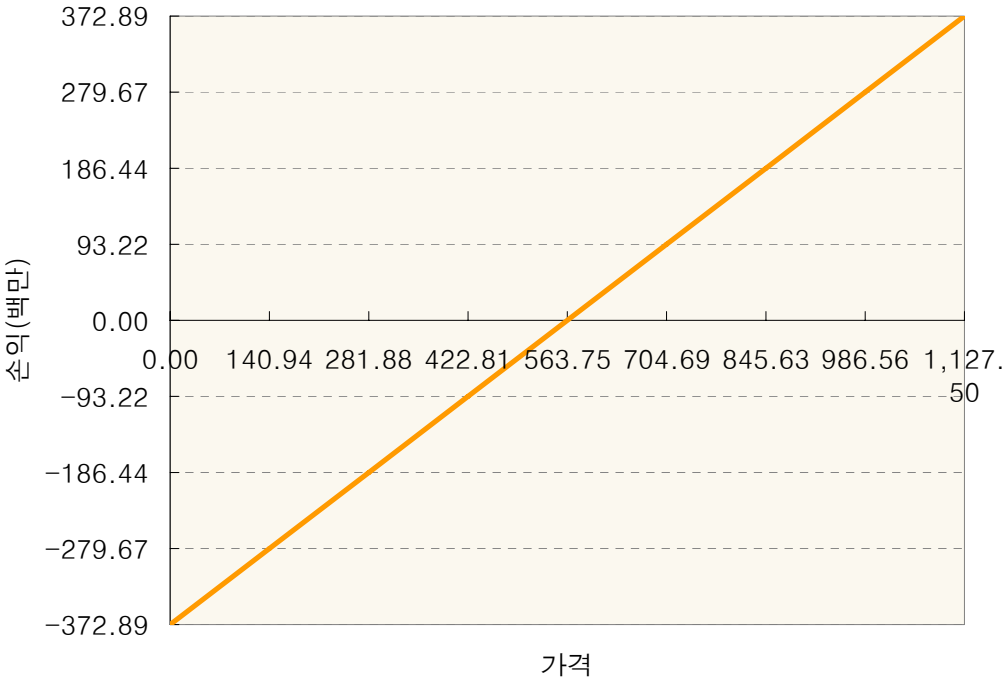


KCK5-COFFEE "C" FUTURE May15

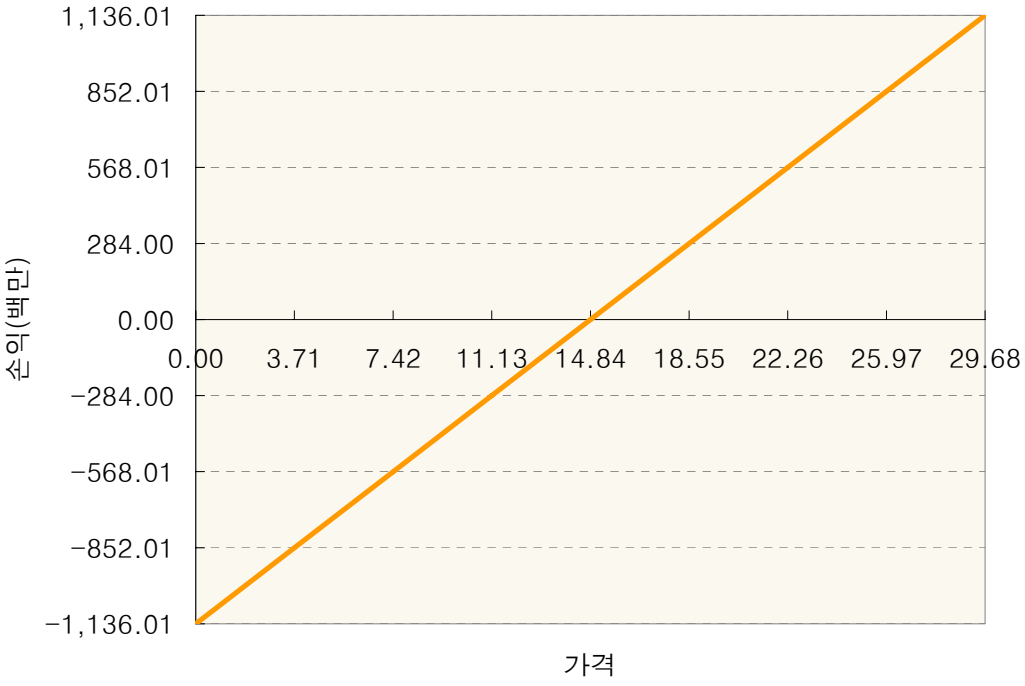




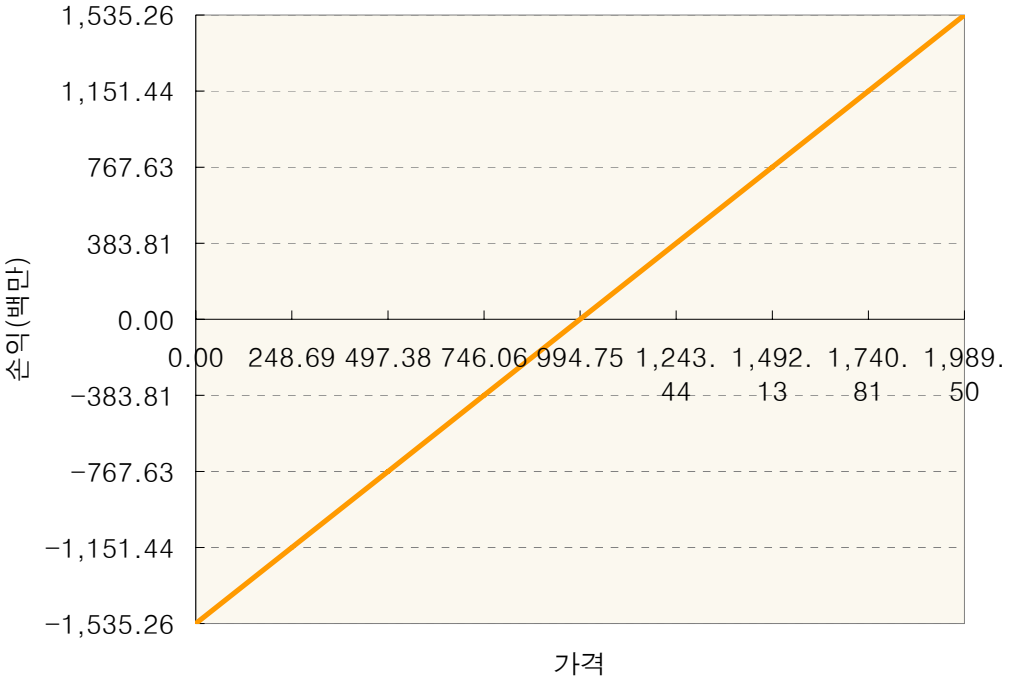
KWK5-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) May15



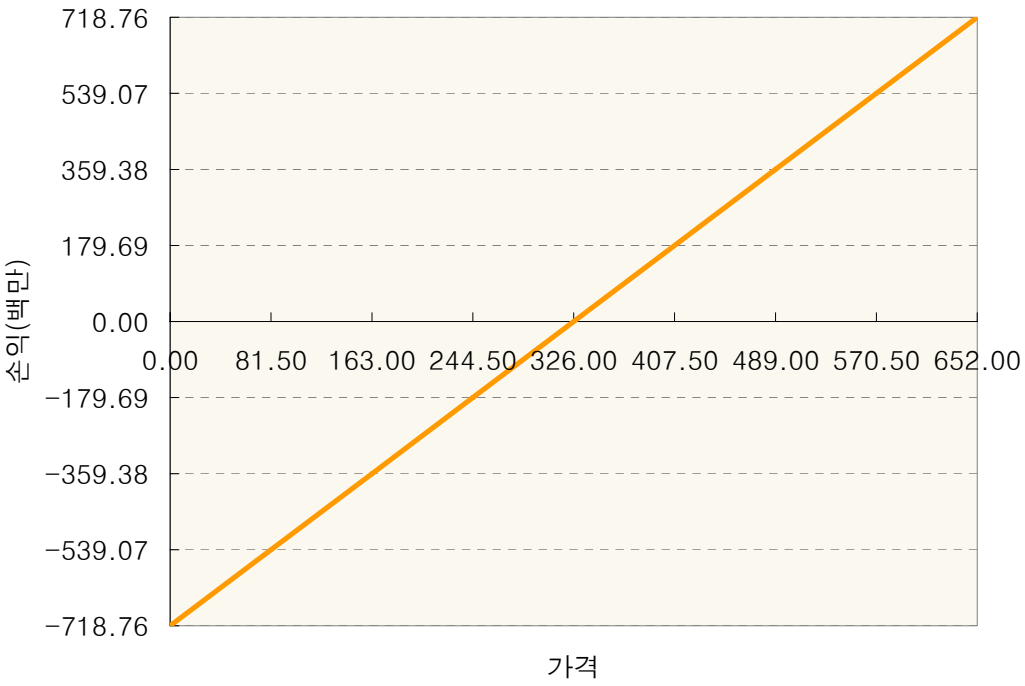
SBK5-Sugar #11 (WORLD) May15



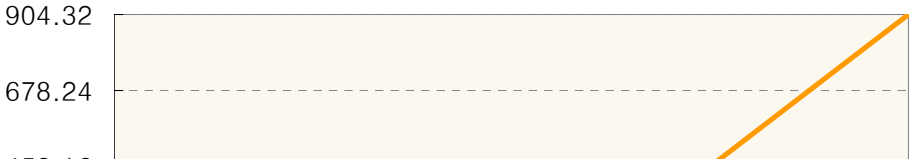
SK5-SOYBEAN FUTURE May15

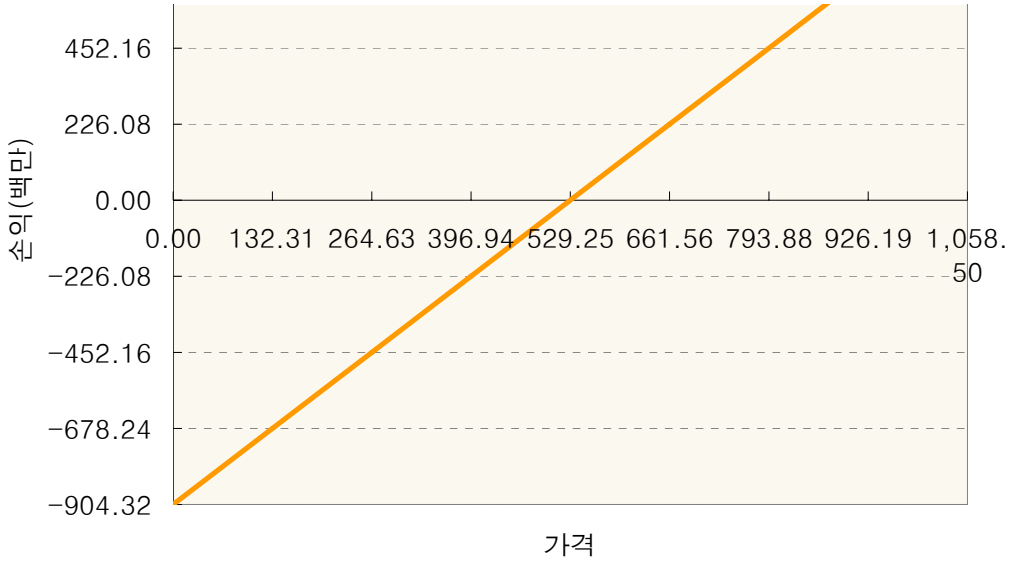


SMK5-SOYBEAN MEAL FUTR May15



WK5-WHEAT FUTURE(CBT) May15





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK5	SOYBEAN OIL FUTR May15	57
CK5	CORN FUTURE May15	108
CTK5	COTTON NO.2 FUTR May15	45
KCK5	COFFEE "C" FUTURE May15	39
KWK5	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) May15	30
SBK5	Sugar #11 (WORLD) May15	91
SK5	SOYBEAN FUTURE May15	123
SMK5	SOYBEAN MEAL FUTR May15	58
WK5	WHEAT FUTURE(CBT) May15	72

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

(단위:백만원)

889