| | |
|---|---|
| 공시일 | 2015-09-22 |
| 기준일 | 2015-09-21 |

# 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 | 2015-09-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-09-21 |

# 차곡차곡플러스모(주식혼합-파생)

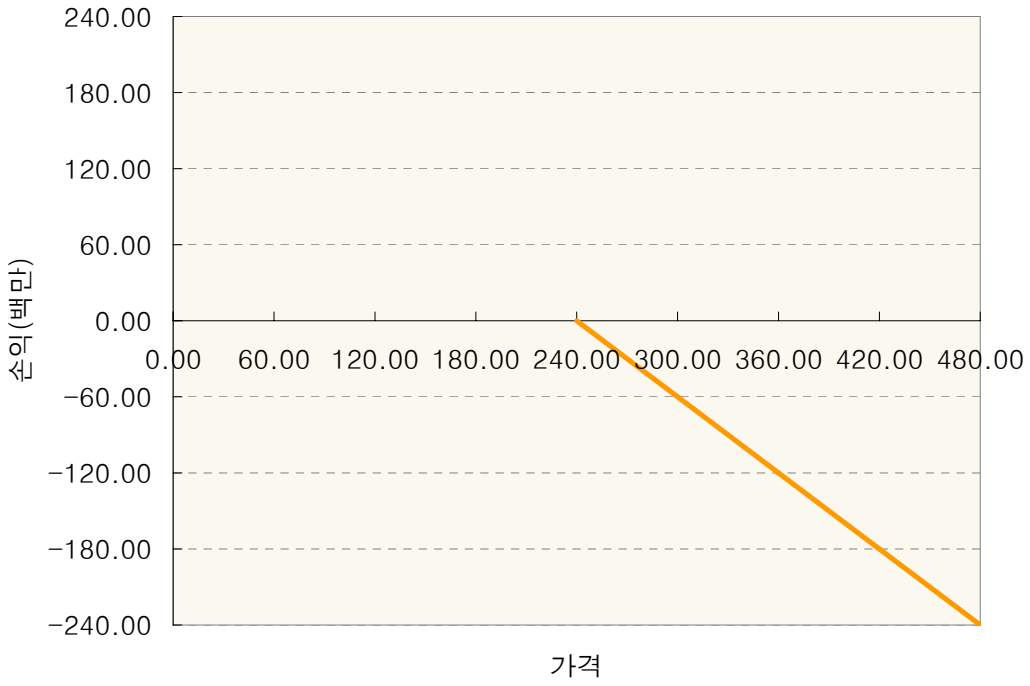
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

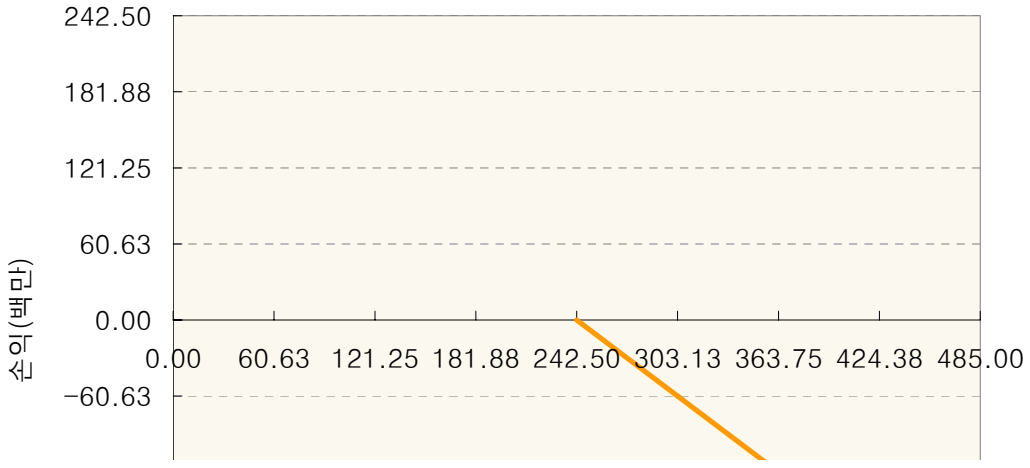
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 483 | -483 | 장내 |

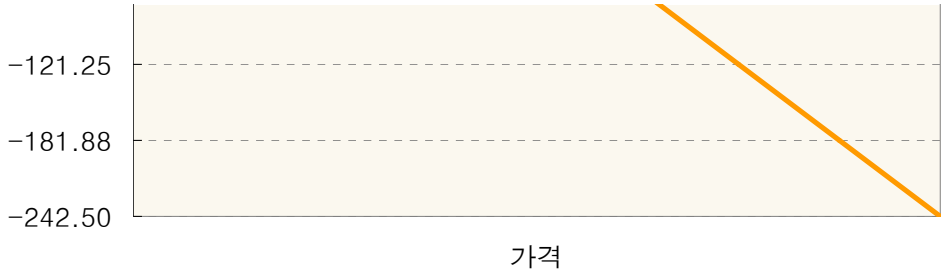
## 2. 만기시점의 손익구조

KR4201KA2400-2015-10 콜240




KR4201KA2426-2015-10 콜242.5






### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4201KA24 2015-10 콜240 | | | | | | | 69 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 14 | 13 | 13 | 13 | 13 | 13 | 13 |
| -5.33% | 13 | 13 | 13 | 12 | 12 | 11 | 10 |
| -2.67% | 12 | 11 | 10 | 9 | 8 | 6 | 5 |
| 0% | 5 | 3 | 2 | 0 | -2 | -3 | -5 |
| 2.67% | -11 | -13 | -14 | -16 | -18 | -19 | -21 |
| 5.33% | -36 | -37 | -38 | -39 | -40 | -41 | -43 |
| 8.00% | -65 | -66 | -66 | -67 | -67 | -68 | -69 |
| KR4201KA24 2015-10 콜242.5 | | | | | | | 62 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 |
| -5.33% | 9 | 9 | 9 | 9 | 8 | 8 | 7 |
| -2.67% | 8 | 8 | 7 | 6 | 6 | 5 | 3 |
| 0% | 4 | 3 | 1 | 0 | -1 | -3 | -5 |
| 2.67% | -8 | -10 | -11 | -13 | -15 | -16 | -18 |
| 5.33% | -29 | -31 | -32 | -33 | -35 | -36 | -38 |
| 8.00% | -57 | -58 | -59 | -59 | -60 | -61 | -62 |

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

(단위:백만원)

| 128 |
|---|

| 공시일 | 2015-09-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-09-21 |

# 스마트인덱스모

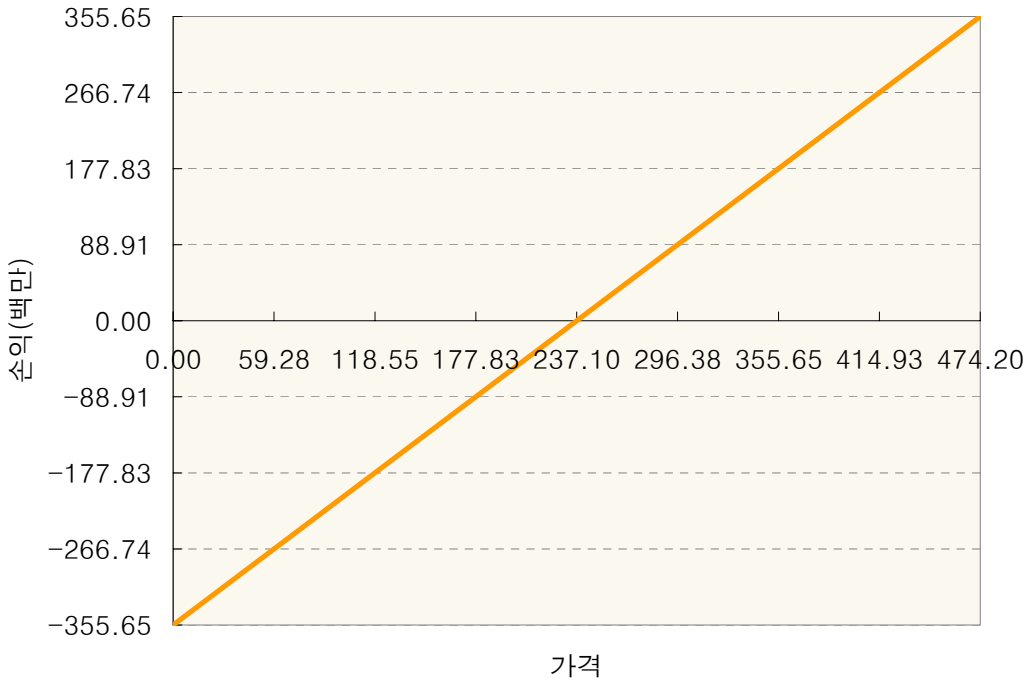
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

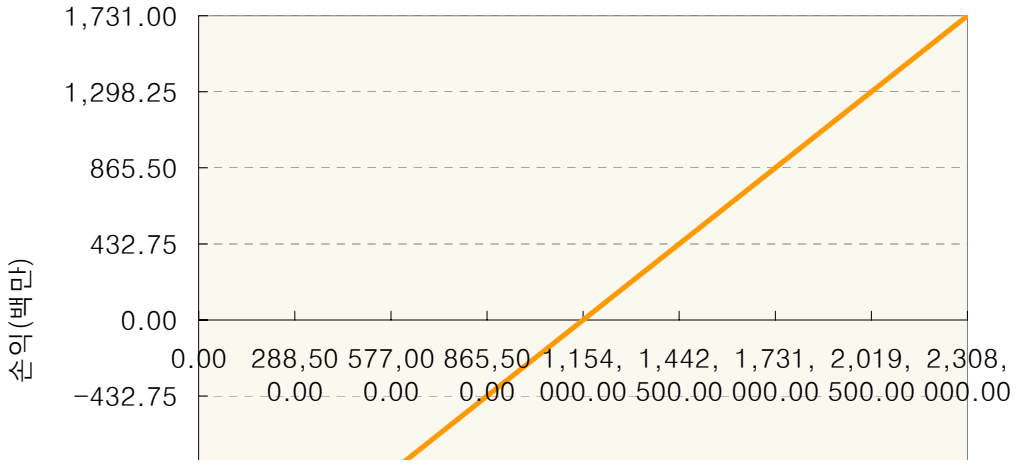
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,087 | 0 | 2,087 | 장내 |

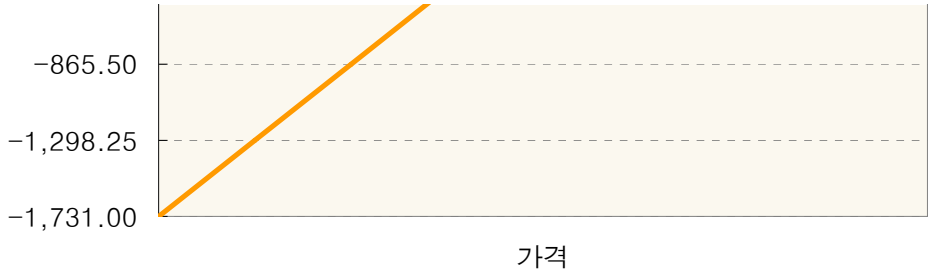
## 2. 만기시점의 손익구조

KR4101KC0007-2015-12 지수선물




KR4111KC0005-2015-12 삼성전자개별선물






### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101KC0C 2015-12 지수선물 | | | | | | | 28 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -28 | -28 | -28 | -28 | -28 | -28 | -28 |
| -5.33% | -19 | -19 | -19 | -19 | -19 | -19 | -19 |
| -2.67% | -9 | -9 | -9 | -9 | -9 | -9 | -9 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 |
| 5.33% | 19 | 19 | 19 | 19 | 19 | 19 | 19 |
| 8.00% | 28 | 28 | 28 | 28 | 28 | 28 | 28 |
| KR4111KC0C 2015-12 삼성전자개별선물 | | | | | | | 138 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -138 | -138 | -138 | -138 | -138 | -138 | -138 |
| -5.33% | -92 | -92 | -92 | -92 | -92 | -92 | -92 |
| -2.67% | -46 | -46 | -46 | -46 | -46 | -46 | -46 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 46 | 46 | 46 | 46 | 46 | 46 | 46 |
| 5.33% | 92 | 92 | 92 | 92 | 92 | 92 | 92 |
| 8.00% | 138 | 138 | 138 | 138 | 138 | 138 | 138 |

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

(단위:백만원)

| 134 |
|---|

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2015-09-22 |
| 기준일 | 2015-09-21 |

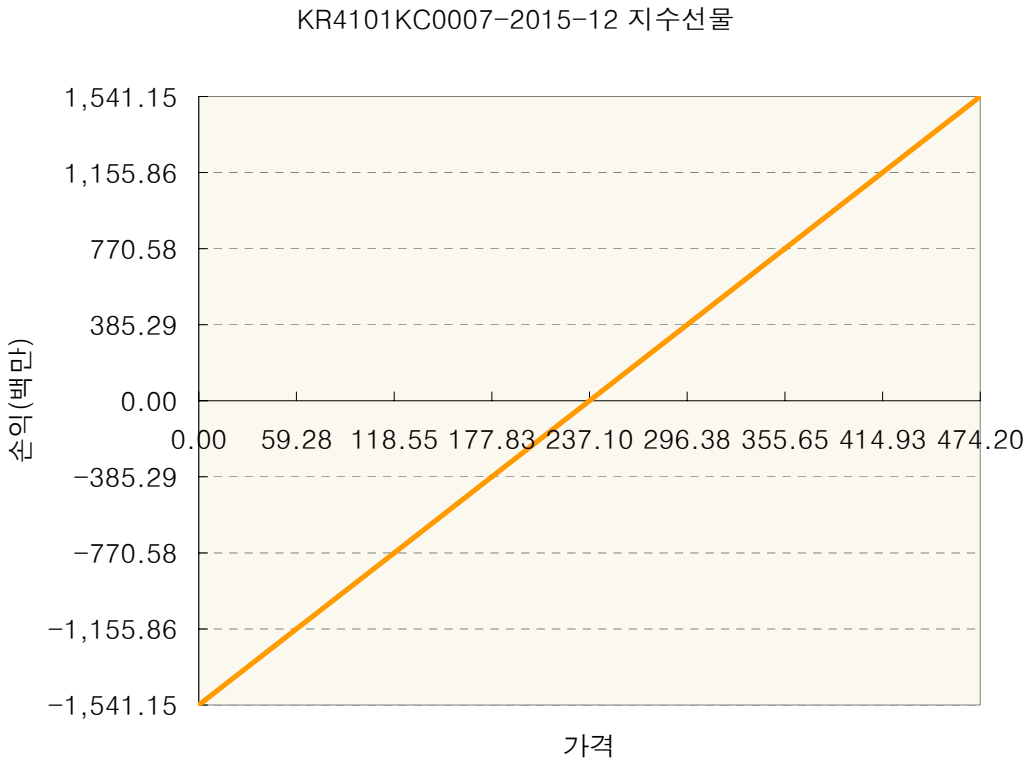
# 스마트레버리지목표전환형1호

## 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 | 1,541 | 0 | 1,541 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101KC0C 2015-12 지수선물 | | | | | | | 123 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -123 | -123 | -123 | -123 | -123 | -123 | -123 |
| -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% | 123 | 123 | 123 | 123 | 123 | 123 | 123 |

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

| 91 |
|---|

| 공시일 | 2015-09-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-09-21 |

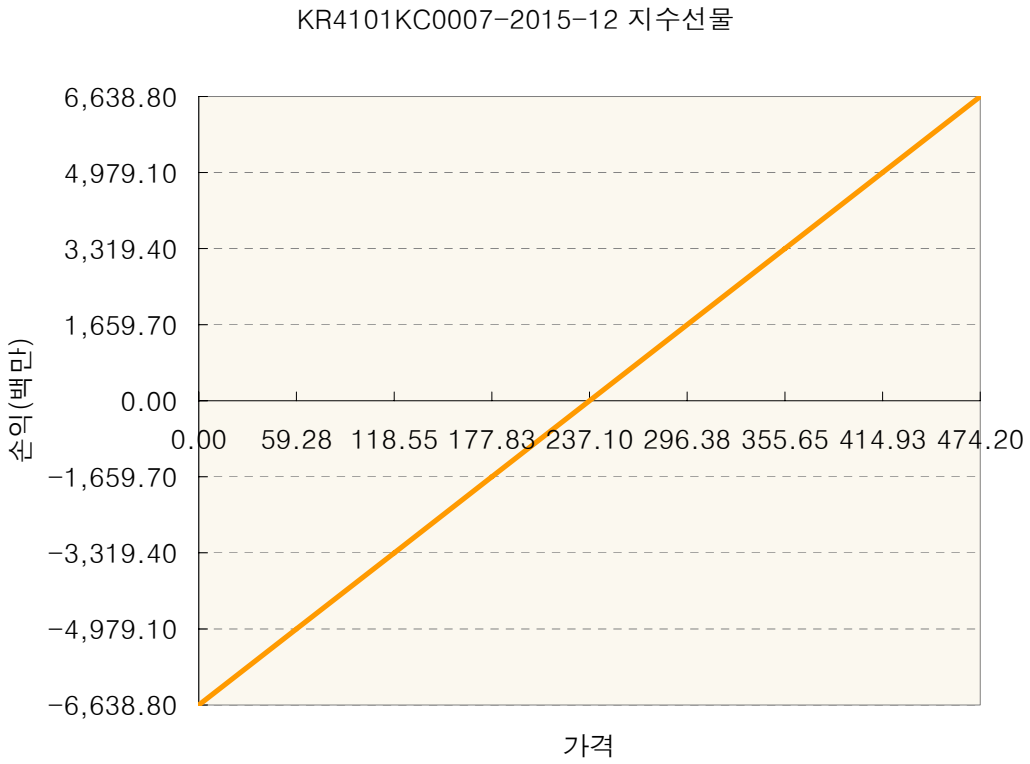
# 1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

## 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 | 6,639 | 0 | 6,639 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101KC0C 2015-12 지수선물 | | | | | | | 530 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -530 | -530 | -530 | -530 | -530 | -530 | -530 |
| -5.33% | -354 | -354 | -354 | -354 | -354 | -354 | -354 |
| -2.67% | -177 | -177 | -177 | -177 | -177 | -177 | -177 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 177 | 177 | 177 | 177 | 177 | 177 | 177 |
| 5.33% | 354 | 354 | 354 | 354 | 354 | 354 | 354 |
| 8.00% | 530 | 530 | 530 | 530 | 530 | 530 | 530 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
| --- | --- |
| | 390 |

| 공시일 | 2015-09-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-09-21 |

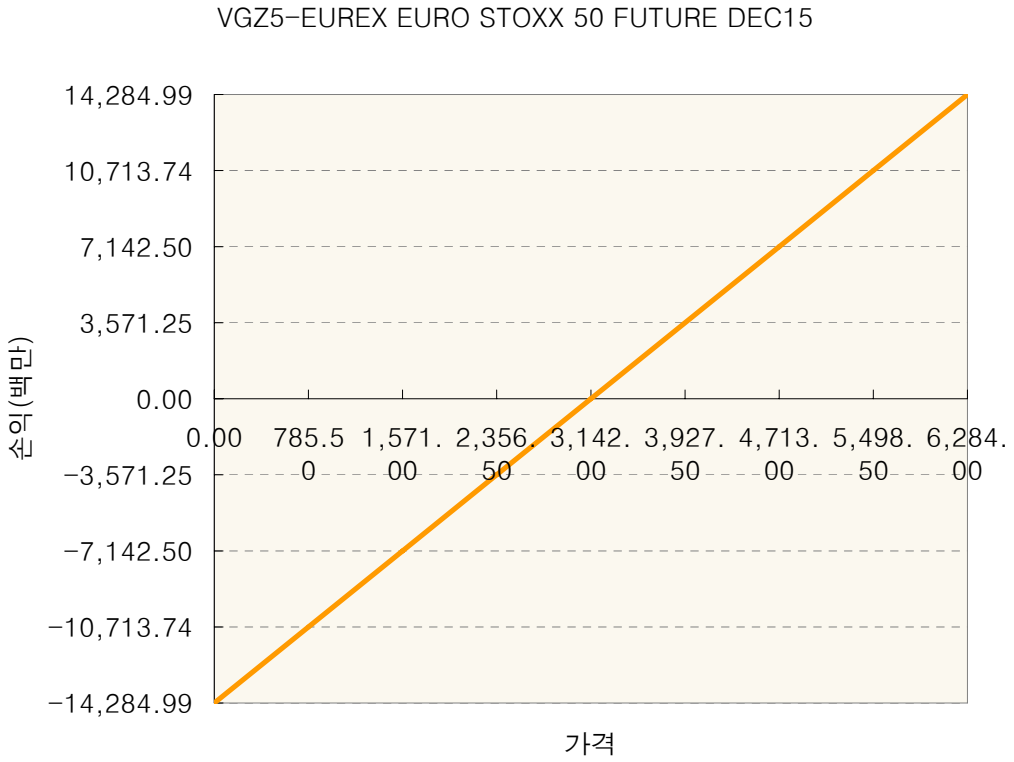
# 유로인덱스1호(주식-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 14,285 | 0 | 14,285 | |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| VGZ5 | EUREX EURO STOXX 50 FUTURE DEC15 | 1,143 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 1,179 |

| 공시일 | 2015-09-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-09-21 |

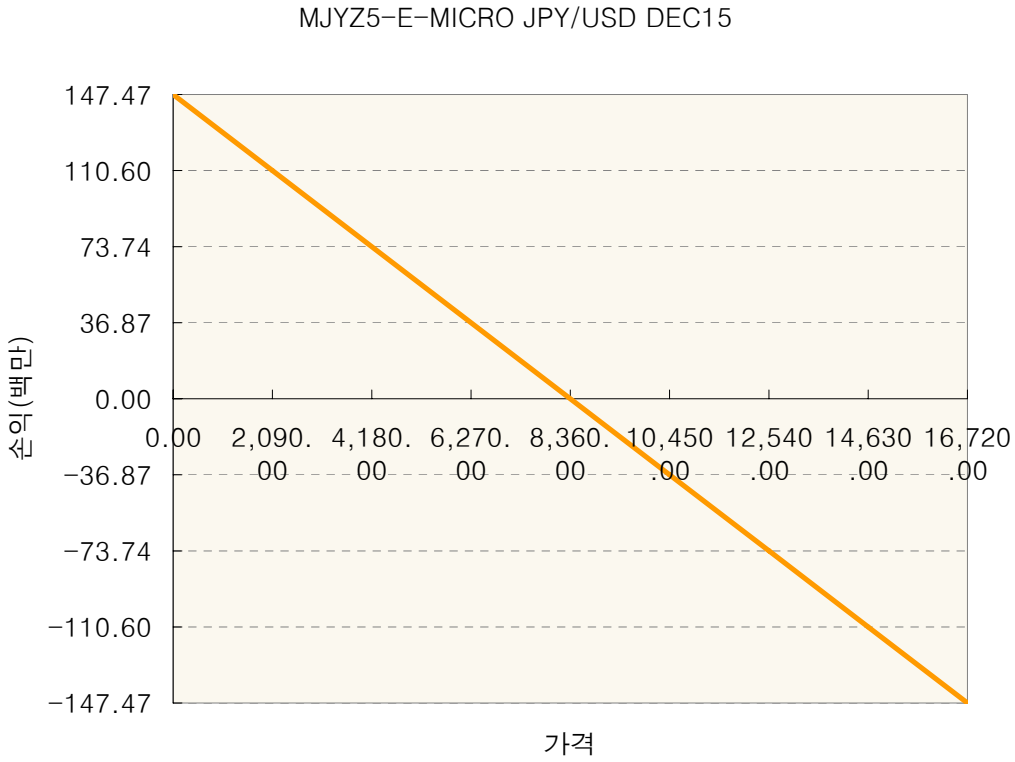
# 아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

## 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 | 147 | -147 | |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| MJYZ5 | E-MICRO JPY/USD DEC15 | 12 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 5 |

| 공시일 | 2015-09-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-09-21 |

# 차이나인덱스(주식-파생형)(종)

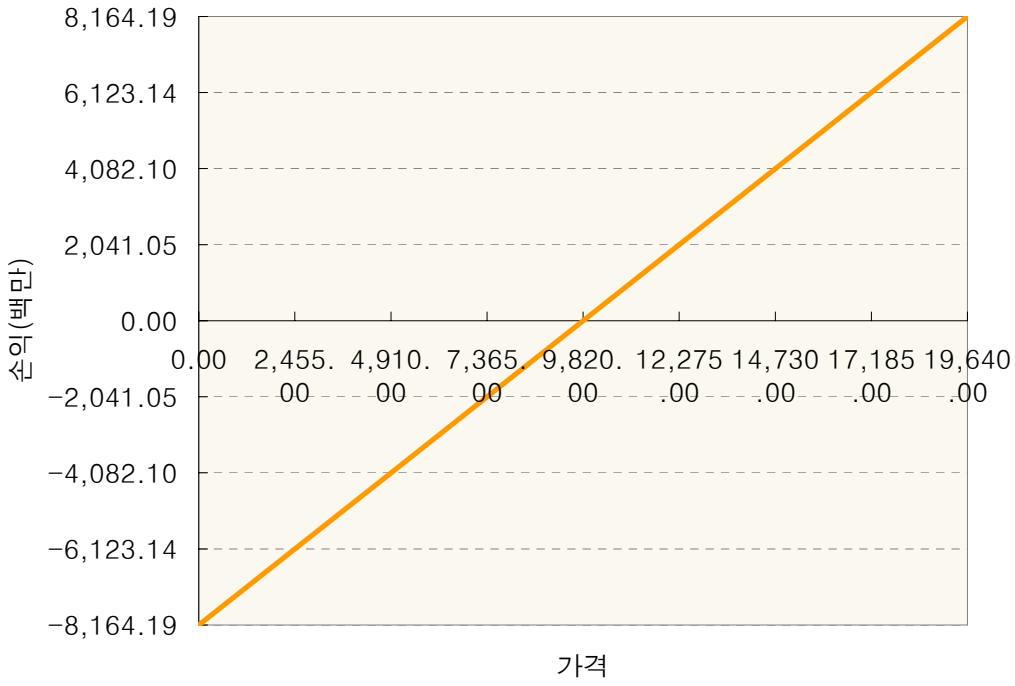
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

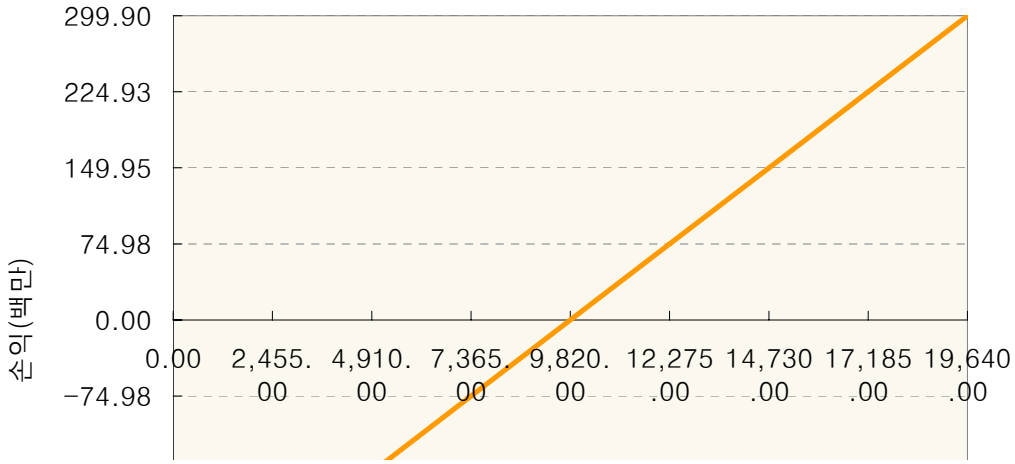
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 8,464 | 0 | 8,464 | 장내 |

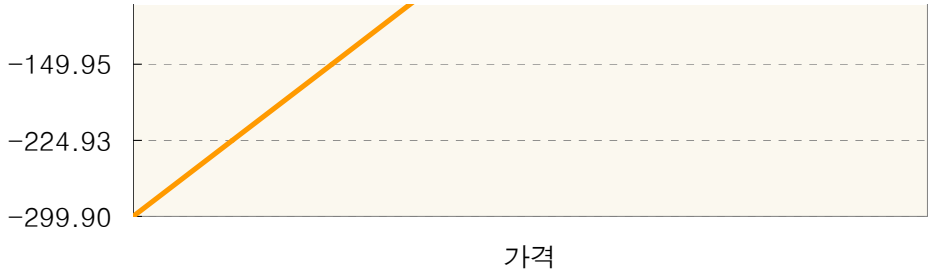
## 2. 만기시점의 손익구조

HCU5-H-SHARES IDX FUT Sep15




MHCU5-MINI H-SHR IDX Fu Sep15






### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| HCU5 | H-SHARES IDX FUT Sep15 | 653 |
| MHCU5 | MINI H-SHR IDX Fu Sep15 | 24 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 838 |

| 공시일 | 2015-09-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-09-21 |

# 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 | 31,207 | 0 | 31,207 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| SWMXWO00( 신한MXWO 미래S 0521 | 2,365 |
|---|---|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| 1,773 |
|---|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| 공시일 | 2015-09-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-09-21 |

# 중국본토인덱스RQFII모(주식-파

## 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 | 0 | 0 | 0 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| SWSG20150‹CSI 300 Net Return Index | 66 |
|---|---|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| 151 |
|---|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| 공시일 | 2015-09-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-09-21 |

# SMART중국본토중소형CSI500상장

## 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 | 7,065 | 0 | 7,065 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| SWCSI50000 신한CSI500미래S09091 | 423 |
| SWCSI50000 신한CSI500미래S09092 | 131 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 1,407 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| 공시일 | 2015-09-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-09-21 |

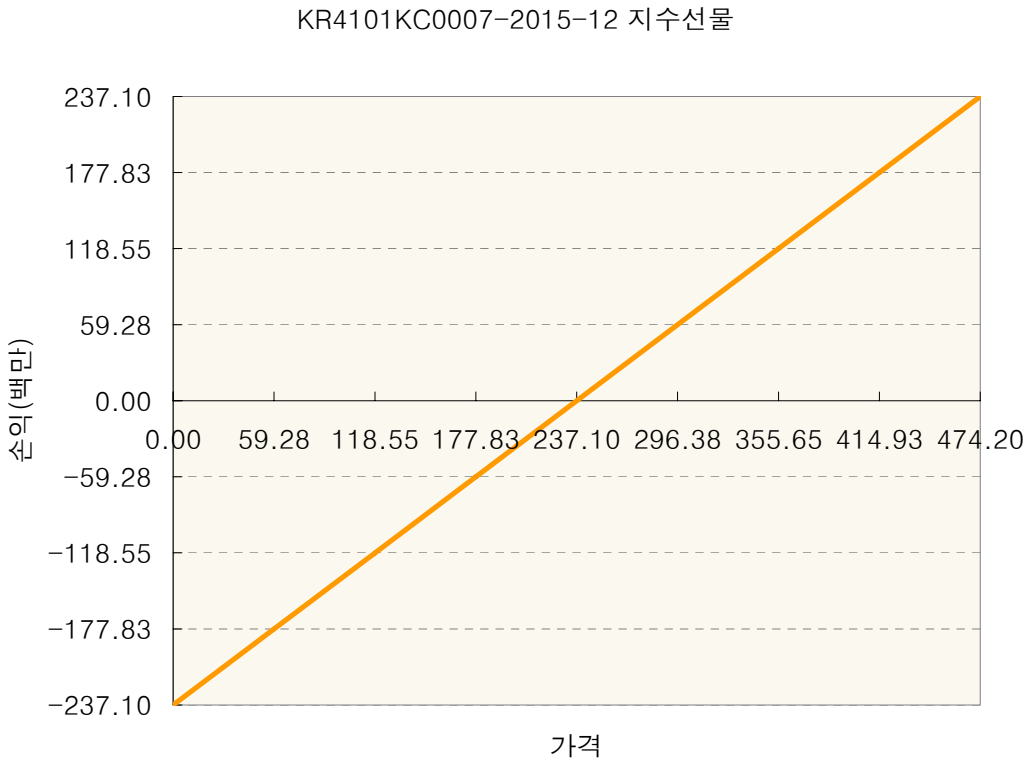
# KOSPI200스마트레버리지목표전환

## 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 | 237 | 0 | 237 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101KC0C 2015-12 지수선물 | | | | | | | 19 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -19 | -19 | -19 | -19 | -19 | -19 | -19 |
| -5.33% | -13 | -13 | -13 | -13 | -13 | -13 | -13 |
| -2.67% | -6 | -6 | -6 | -6 | -6 | -6 | -6 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 6 | 6 | 6 | 6 | 6 | 6 | 6 |
| 5.33% | 13 | 13 | 13 | 13 | 13 | 13 | 13 |
| 8.00% | 19 | 19 | 19 | 19 | 19 | 19 | 19 |

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

| 14 |
|---|

| 공시일 | 2015-09-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-09-21 |

# 메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

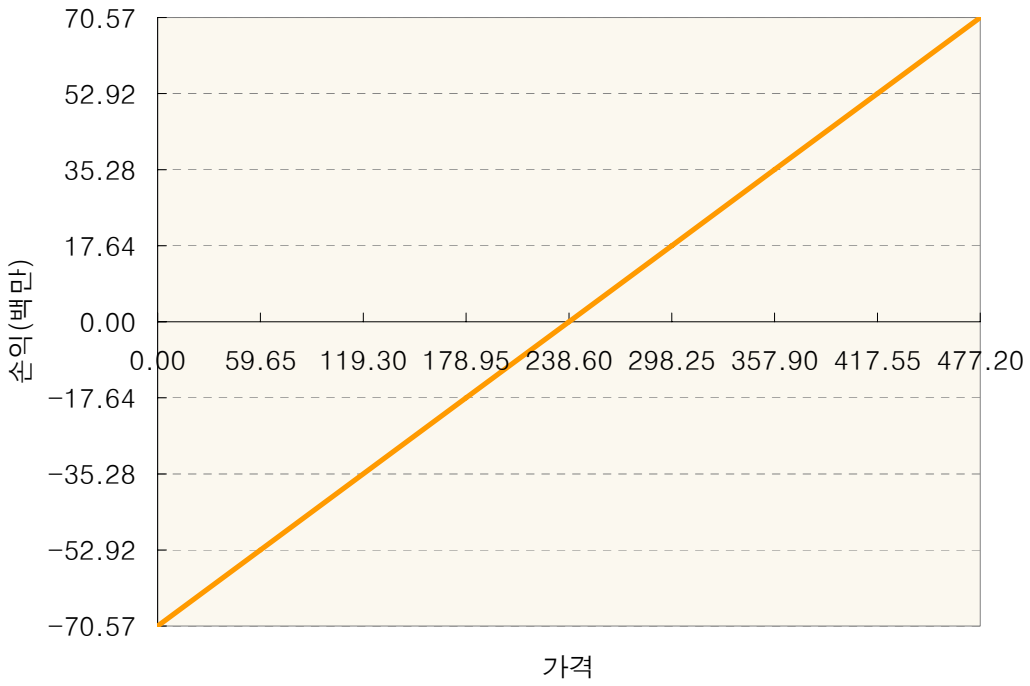
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

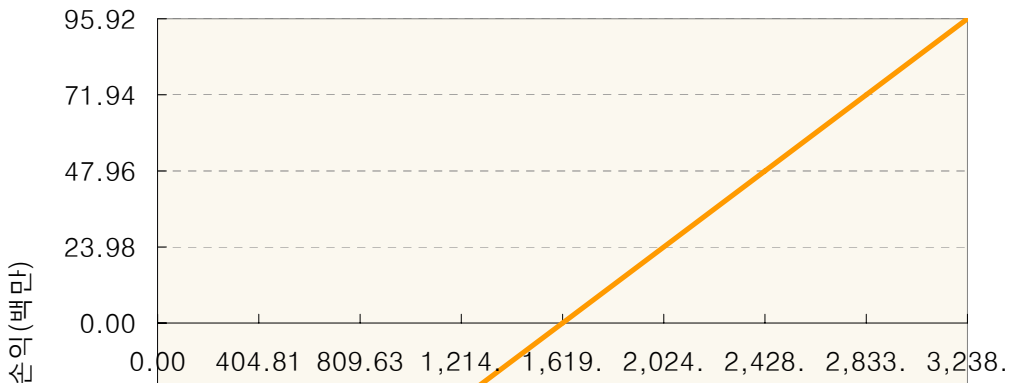
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 선물 | 유가증권 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 선물 | 유가증권 | 72 | 0 | 72 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 301 | 0 | 301 | |

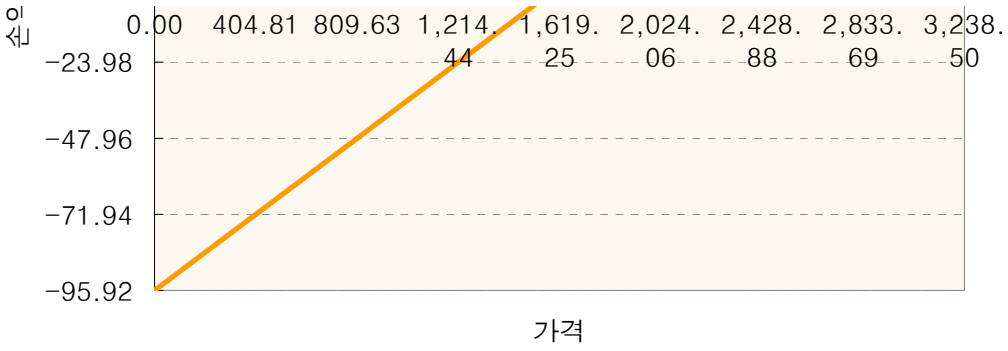
## 2. 만기시점의 손익구조

HGZ5-COPPER FUTURE DEC15

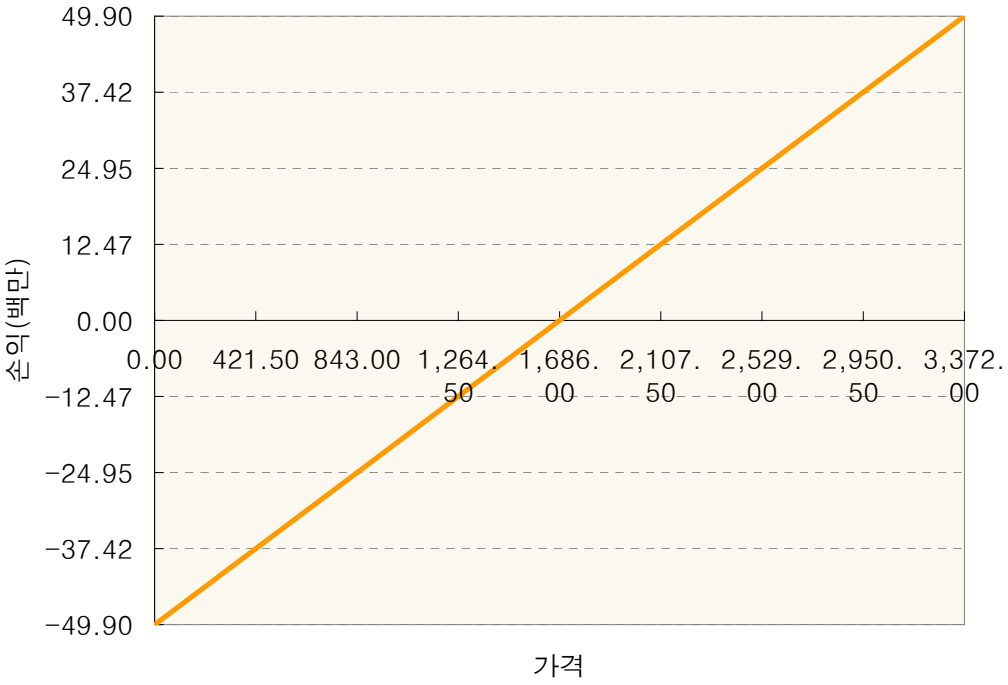



LAX5-LME PRI ALUM FUTR NOV15

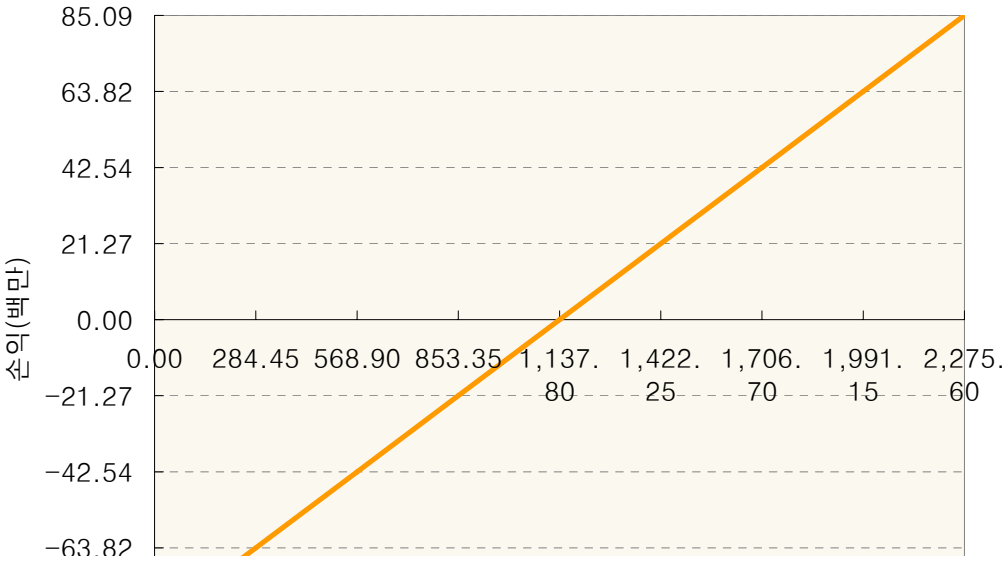


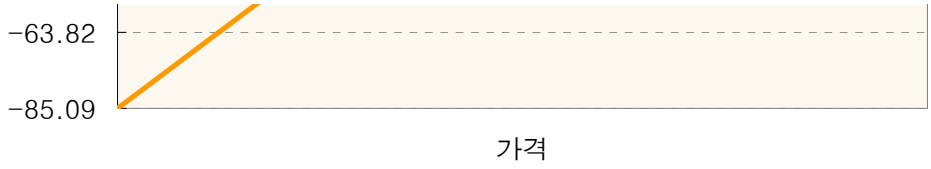



LXX5-LME ZINC FUTURE NOV15

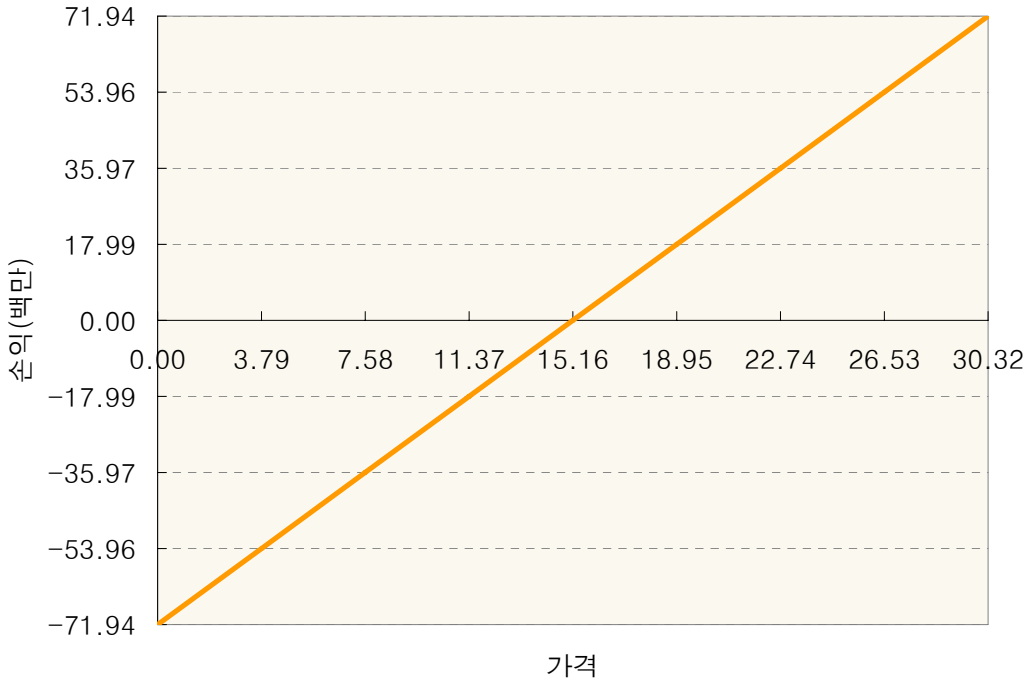



XGZ5-MINI GOLD FUTURE DEC15






YSZ5-MINI SILVER FUT DEC15




### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| HGZ5 | COPPER FUTURE DEC15 | 6 |
| LAX5 | LME PRI ALUM FUTR NOV15 | 8 |
| LXX5 | LME ZINC FUTURE NOV15 | 4 |
| XGZ5 | MINI GOLD FUTURE DEC15 | 7 |
| YSZ5 | MINI SILVER FUT DEC15 | 6 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 30 |

| 공시일 | 2015-09-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-09-21 |

# 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

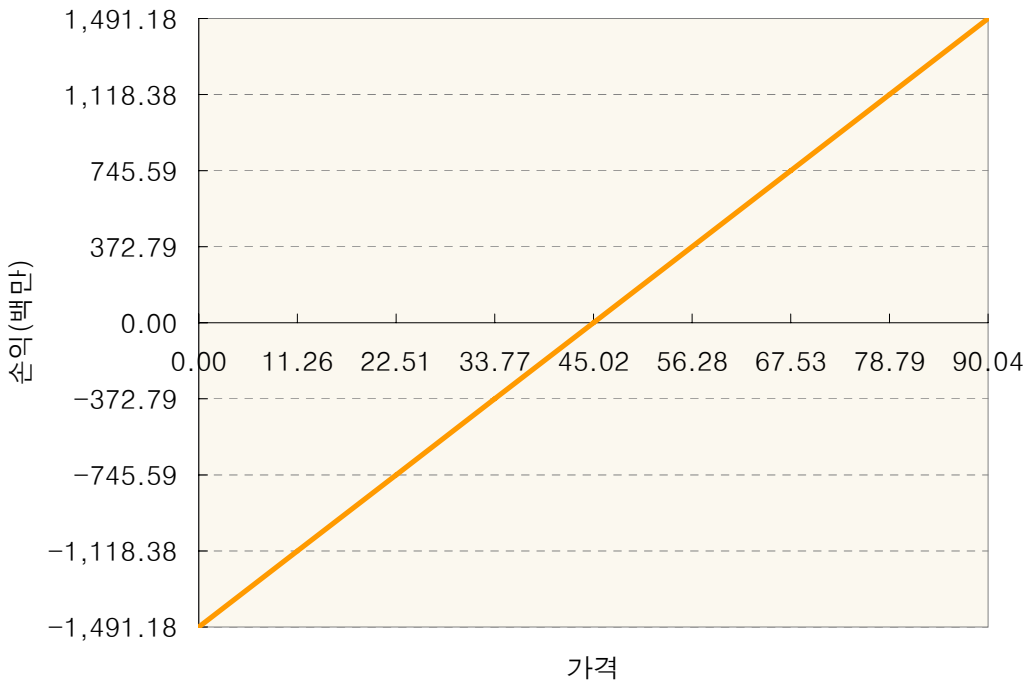
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

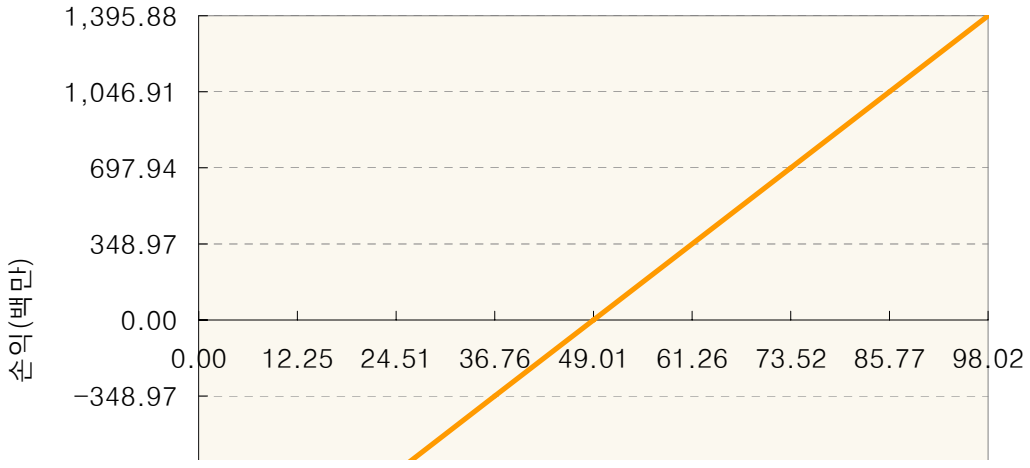
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 5,939 | 0 | 5,939 | |

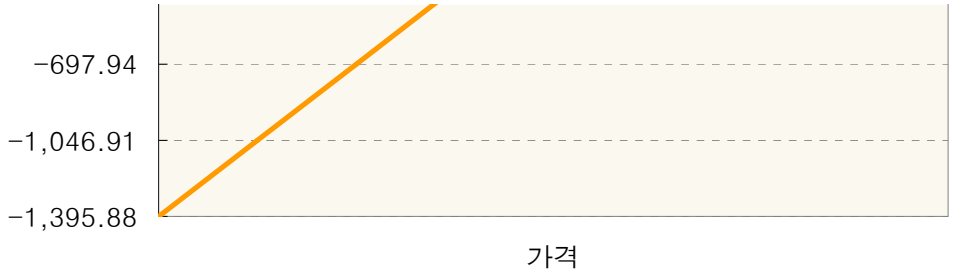
## 2. 만기시점의 손익구조

CLX5-WTI CRUDE FUTURE Nov15

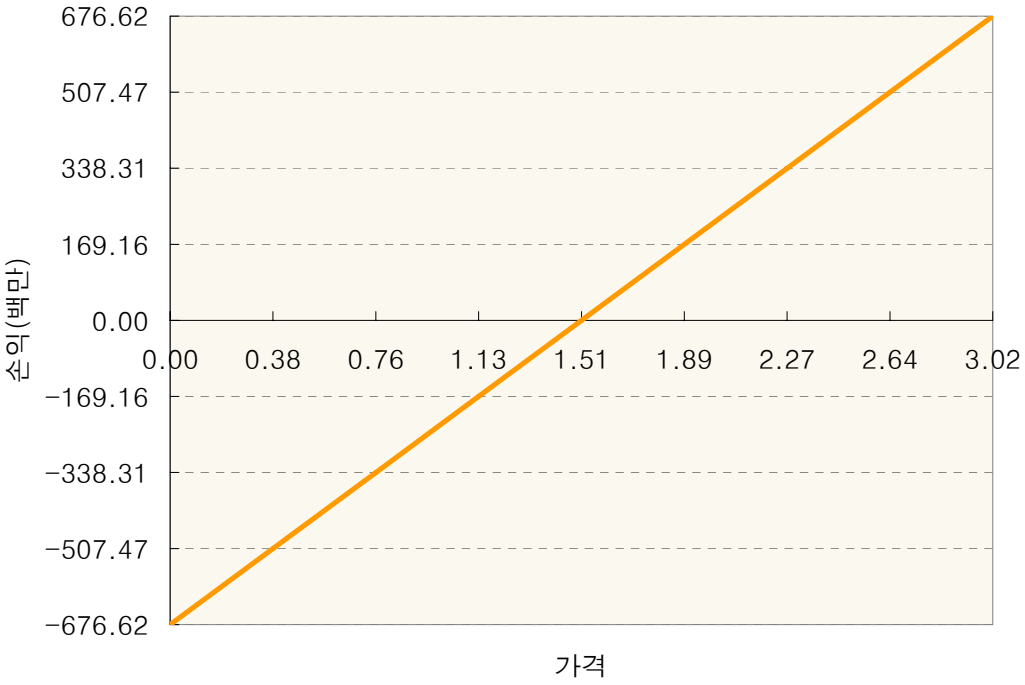



COF6-BRENT CRUDE FUTR JAN16

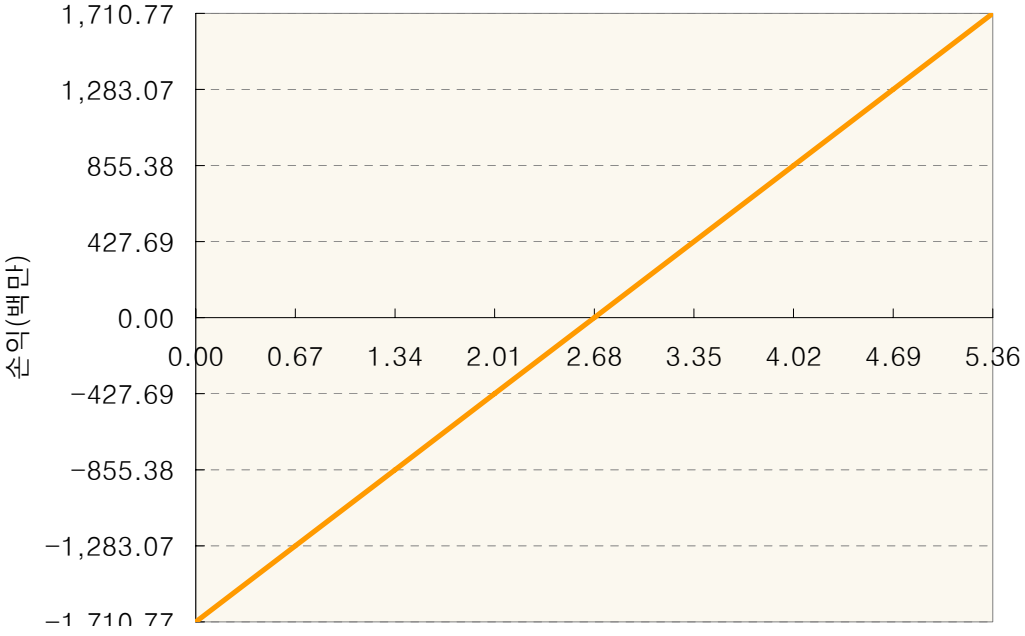


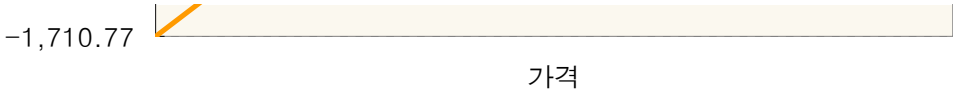


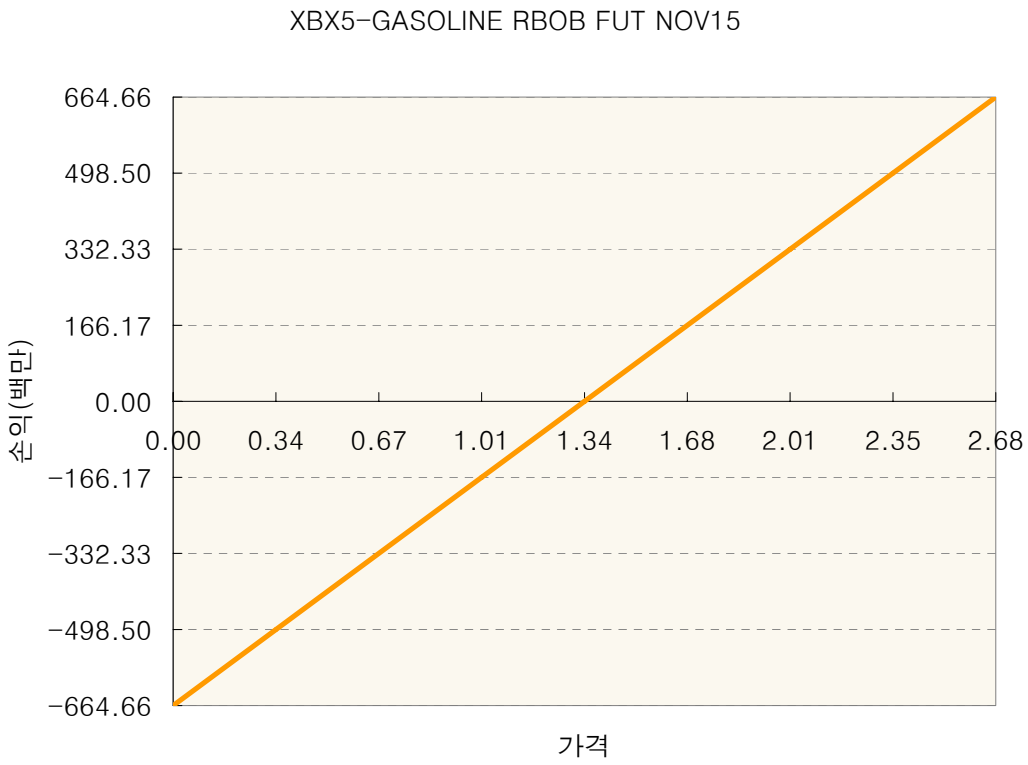

HOX5-NY Harb ULSD Fut Nov15




NGX5-NATURAL GAS FUTR NOV15






### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| CLX5 | WTI CRUDE FUTURE Nov15 | 119 |
| COF6 | BRENT CRUDE FUTR JAN16 | 112 |
| HOX5 | NY Harb ULSD Fut Nov15 | 54 |
| NGX5 | NATURAL GAS FUTR NOV15 | 137 |
| XBX5 | GASOLINE RBOB FUT NOV15 | 53 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 1,195 |

| 공시일 | 2015-09-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-09-21 |

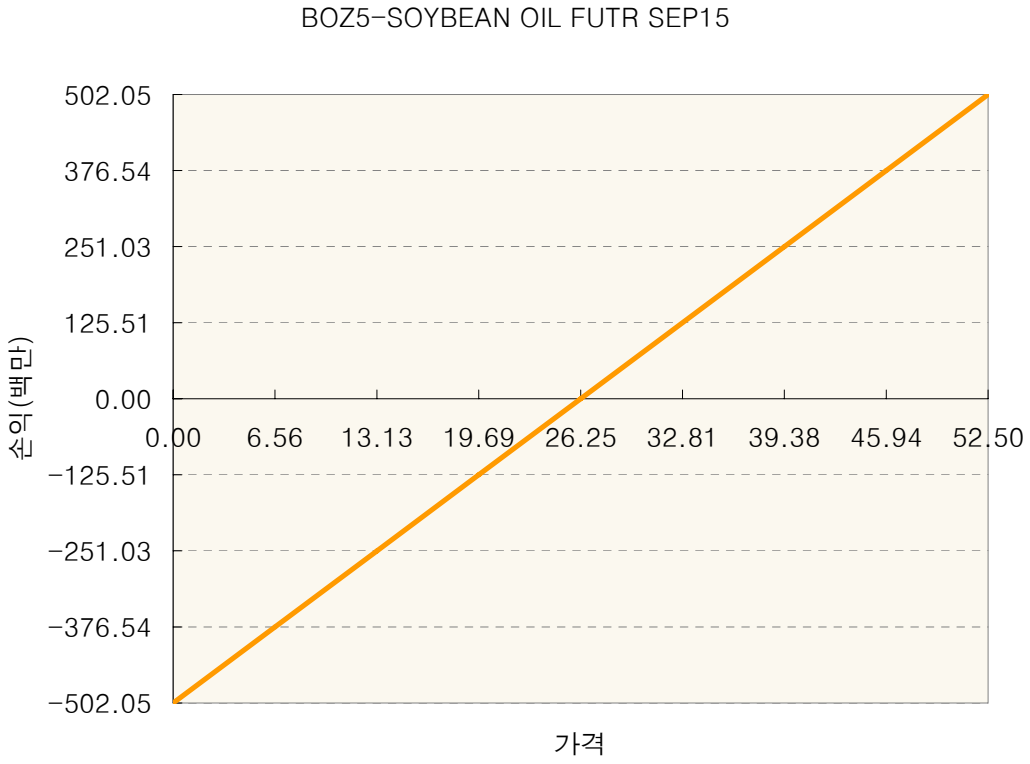
# 애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

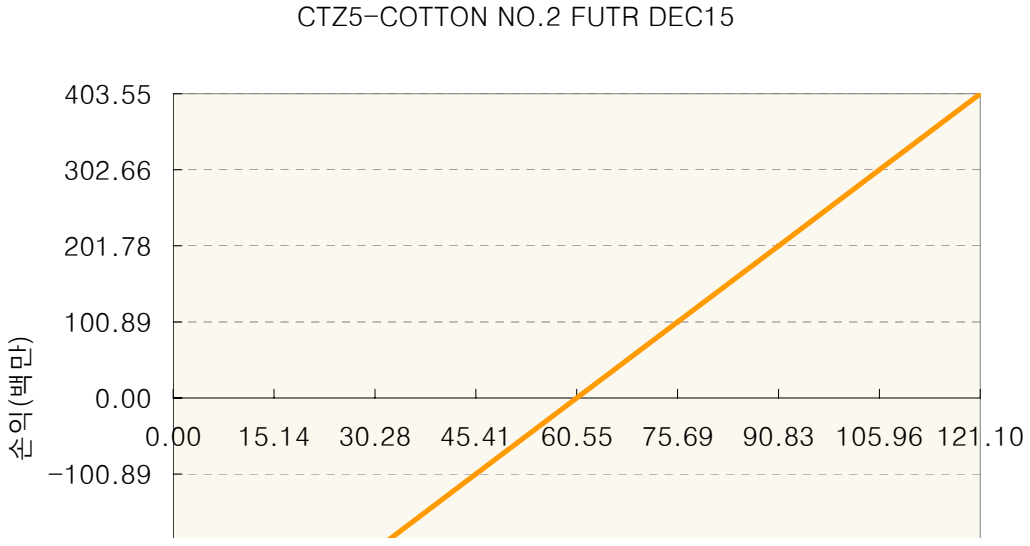
## 1. 계약금액

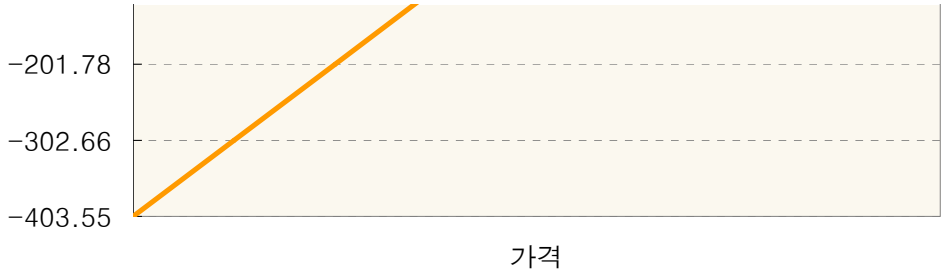
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 6,291 | 0 | 6,291 | |

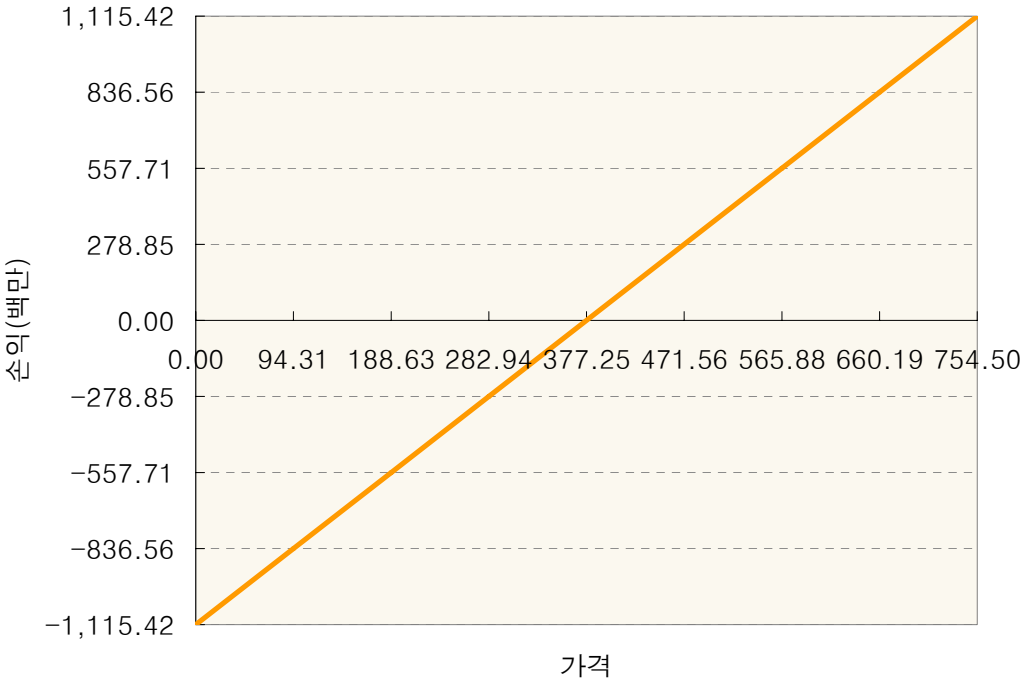
## 2. 만기시점의 손익구조



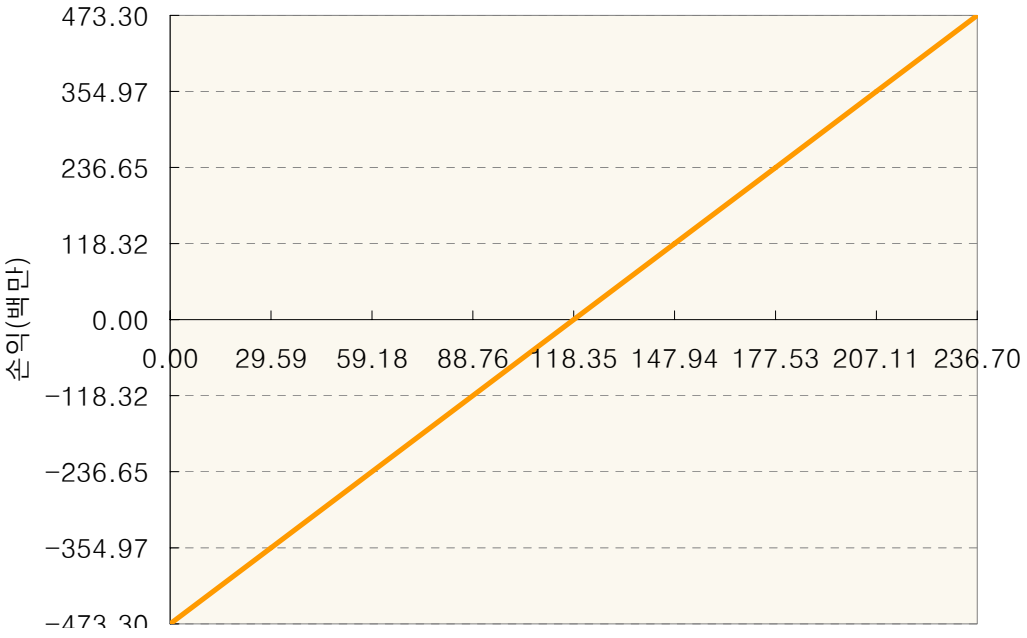



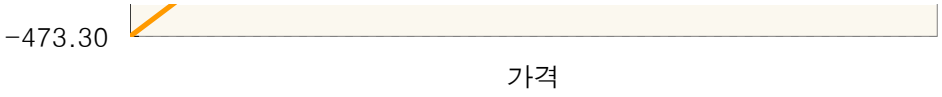



CZ5-CORN FUTURE DEC15

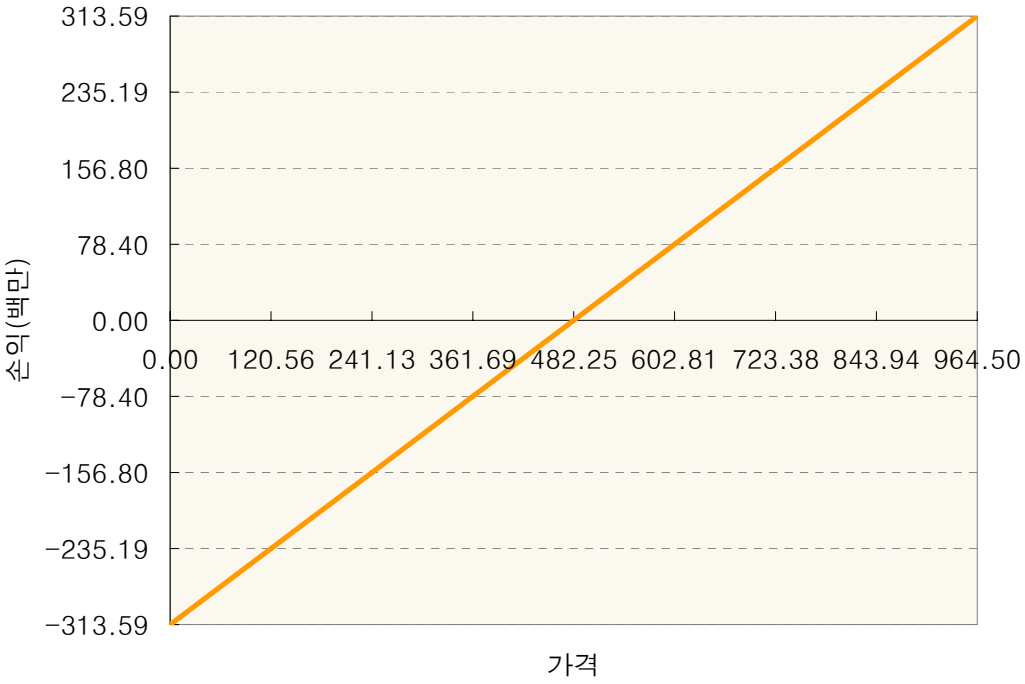



KCZ5-COFFEE "C" FUTURE DEC15

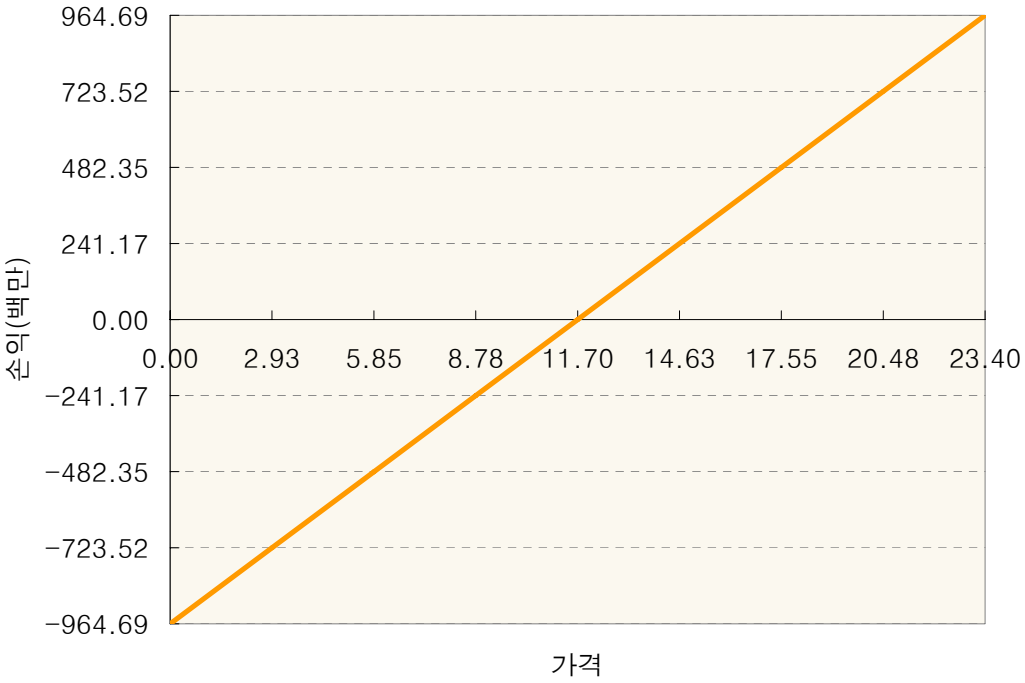




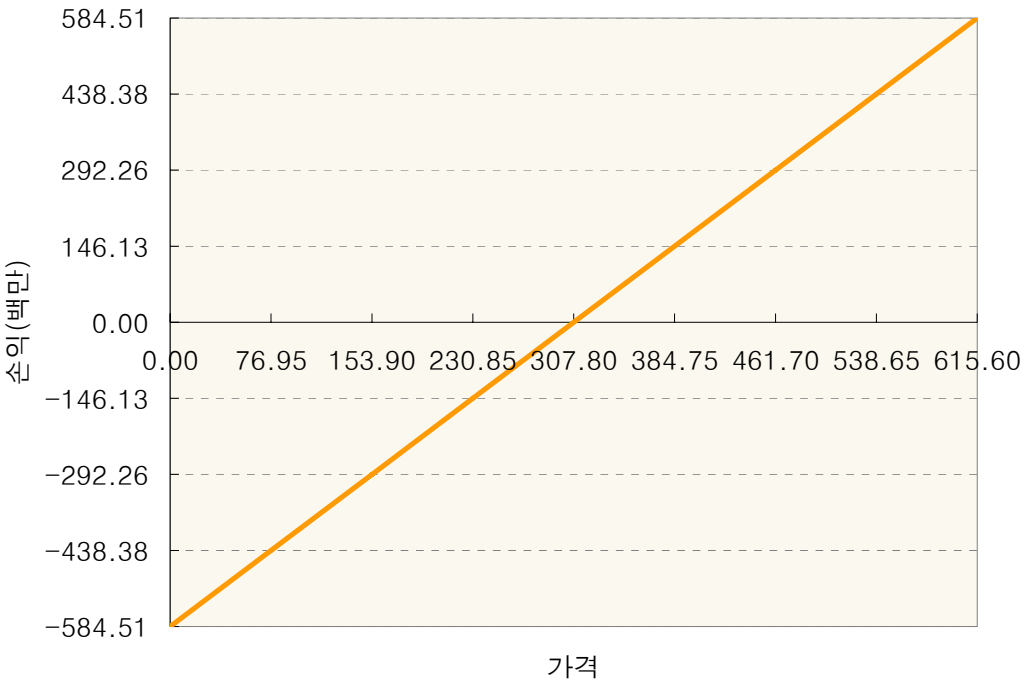

KWZ5-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) DEC15



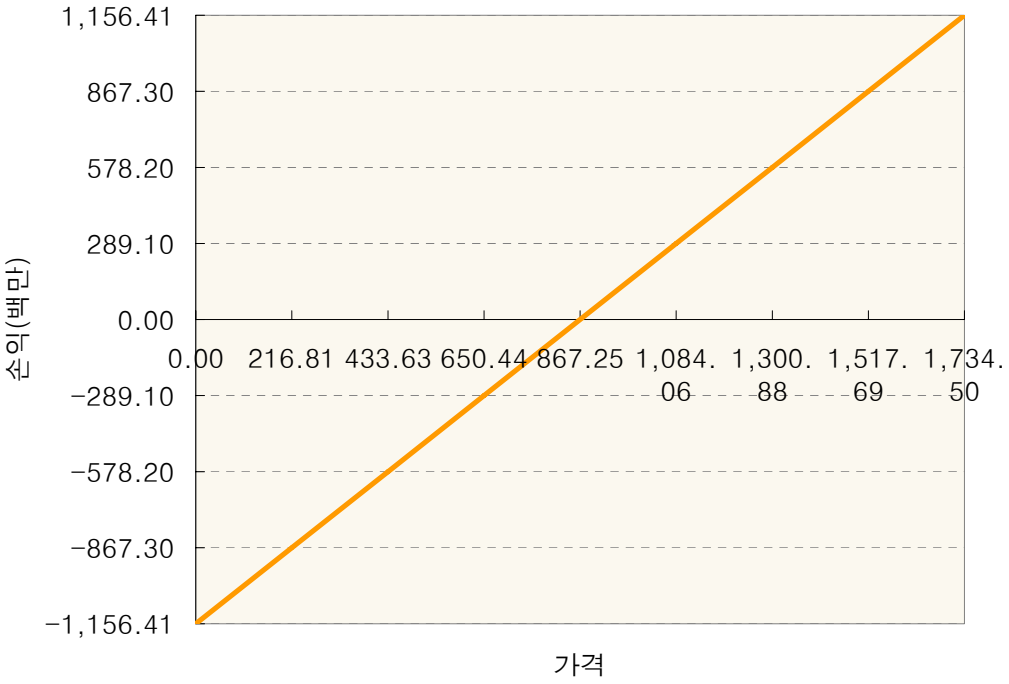

SBH6-Sugar #11 (WORLD) MAR16



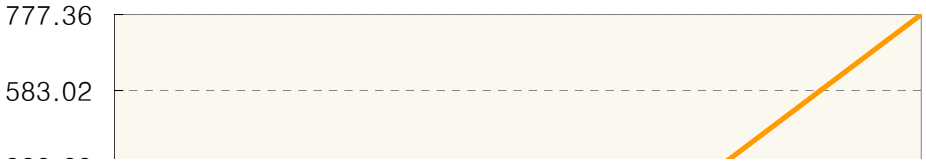

SMZ5-SOYBEAN MEAL FUTR DEC15

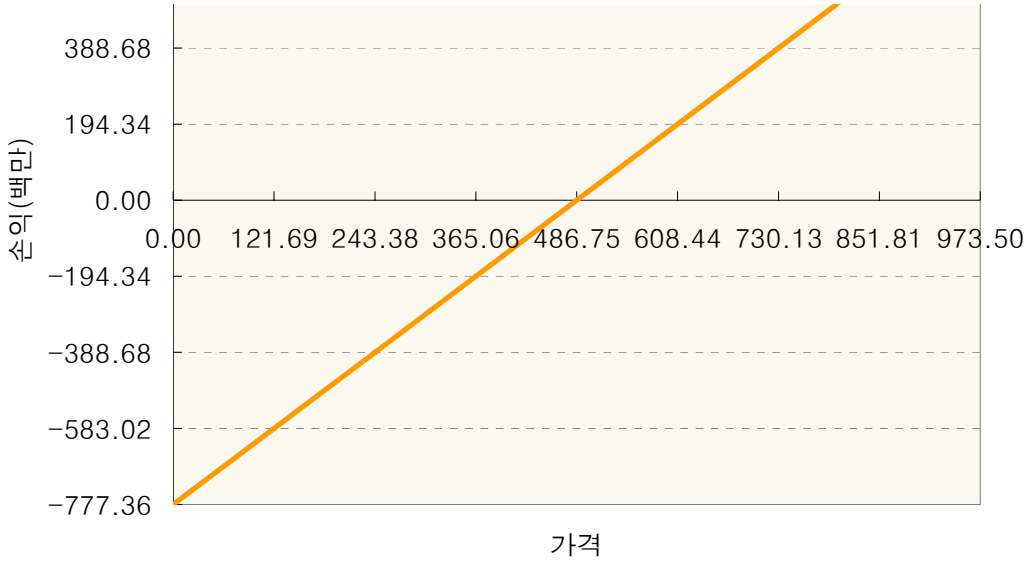



SX5-SOYBEAN FUTURE NOV15




WZ5-WHEAT FUTURE(CBT) DEC15






### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| BOZ5 | SOYBEAN OIL FUTR SEP15 | 40 |
| CTZ5 | COTTON NO.2 FUTR DEC15 | 32 |
| CZ5 | CORN FUTURE DEC15 | 89 |
| KCZ5 | COFFEE "C" FUTURE DEC15 | 38 |
| KWZ5 | KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) DEC15 | 25 |
| SBH6 | Sugar #11 (WORLD) MAR16 | 77 |
| SMZ5 | SOYBEAN MEAL FUTR DEC15 | 47 |
| SX5 | SOYBEAN FUTURE NOV15 | 93 |
| WZ5 | WHEAT FUTURE(CBT) DEC15 | 62 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 726 |