공시일	2015-10-14
기준일	2015-10-13

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	2015-10-14
기준일	2015-10-13

차곡차곡플러스모(주식혼합-파생)

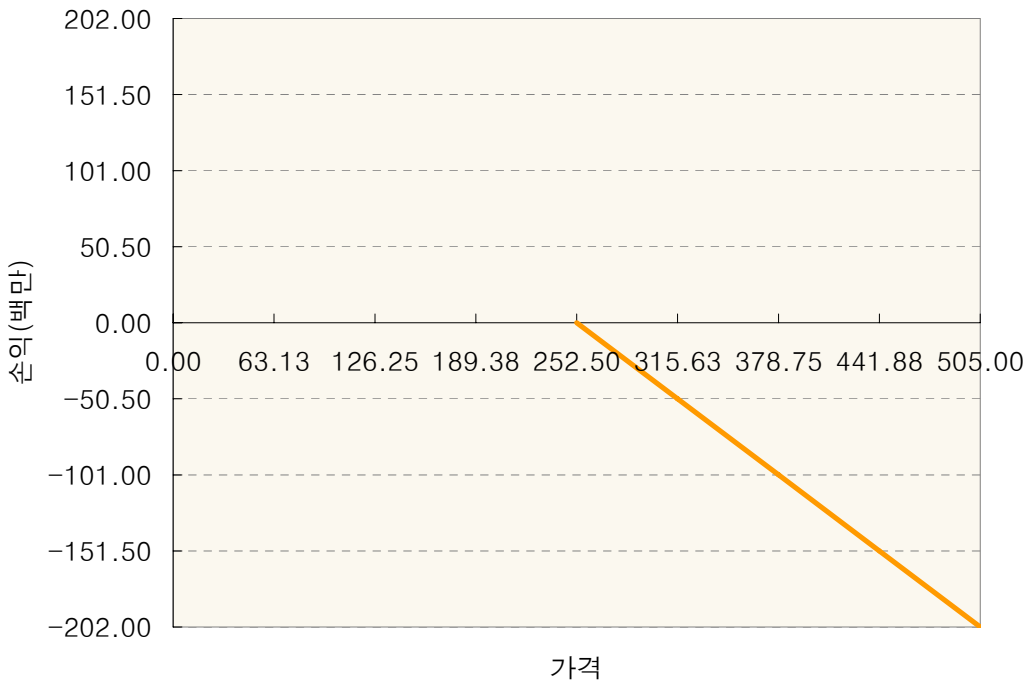
1. 계약금액

(단위:백만원)

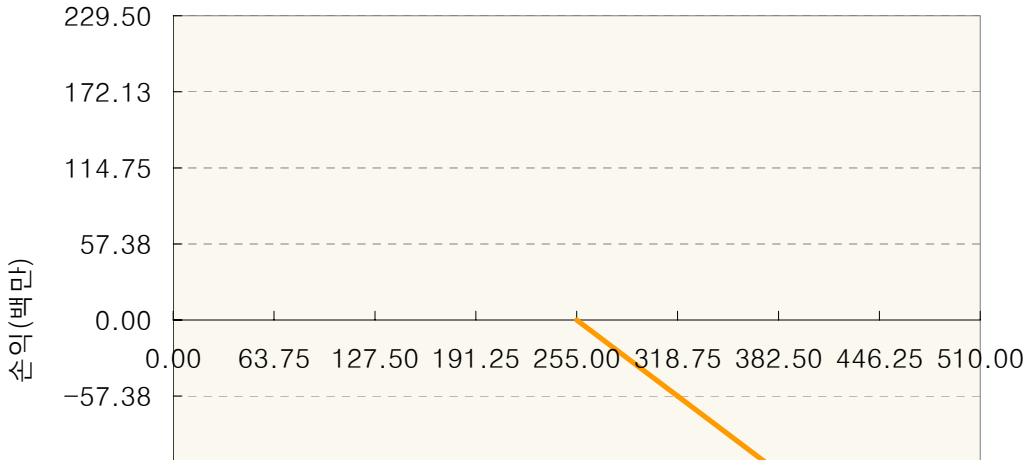
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	432	-432	장내

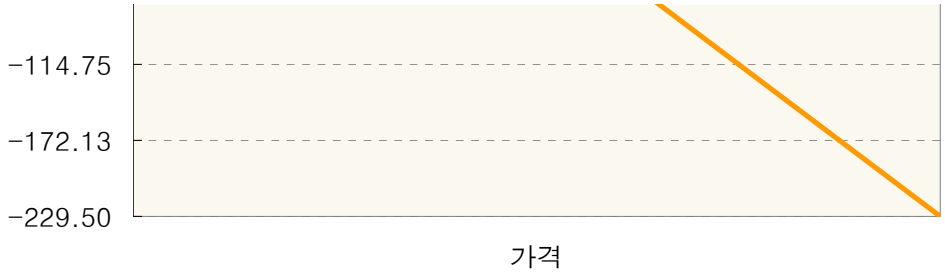
2. 만기시점의 손익구조

KR4201KB2524-2015-11 콜252.5



KR4201KB2557-2015-11 콜255





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201KB25 2015-11 콜252.5							51
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8	8	8	8	8	8	8
-5.33%	8	8	8	7	7	7	6
-2.67%	7	7	6	5	5	4	3
0%	4	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	-6	-7	-9	-11	-12	-14	-15
5.33%	-23	-24	-26	-27	-28	-30	-31
8.00%	-46	-46	-47	-48	-49	-50	-51
KR4201KB25 2015-11 콜255							51
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6	6	6	6	6	6	6
-5.33%	6	6	6	6	6	5	5
-2.67%	6	5	5	4	4	3	2
0%	3	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	-4	-6	-8	-9	-11	-13	-15
5.33%	-21	-22	-24	-25	-27	-29	-30
8.00%	-44	-45	-46	-47	-48	-50	-51

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

(단위:백만원)

91

공시일	2015-10-14
기준일	2015-10-13

스마트인덱스모

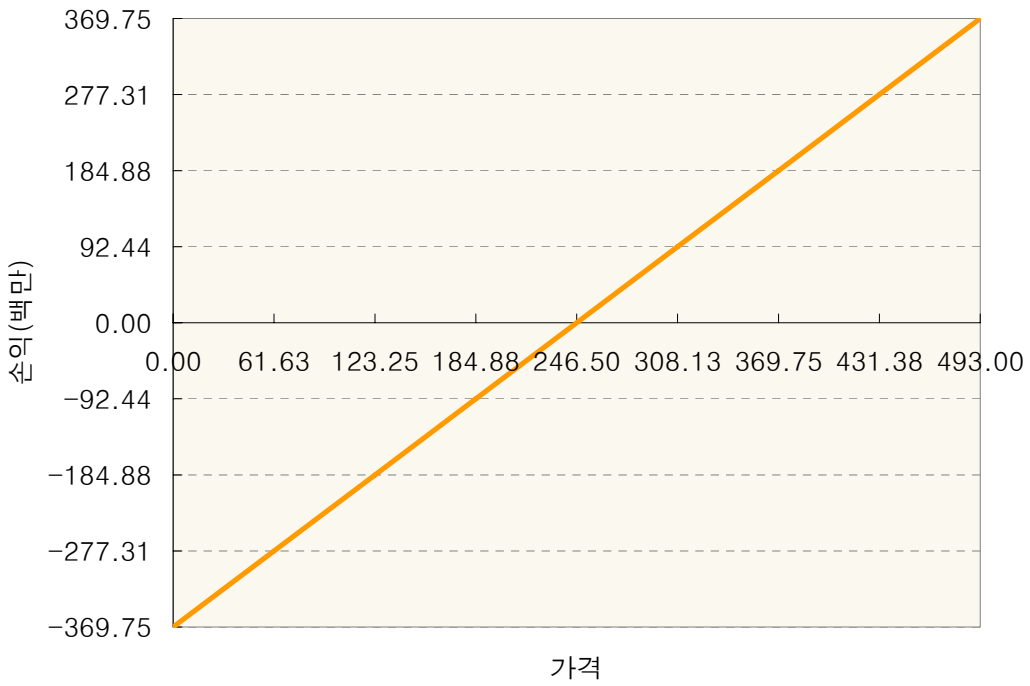
1. 계약금액

(단위:백만원)

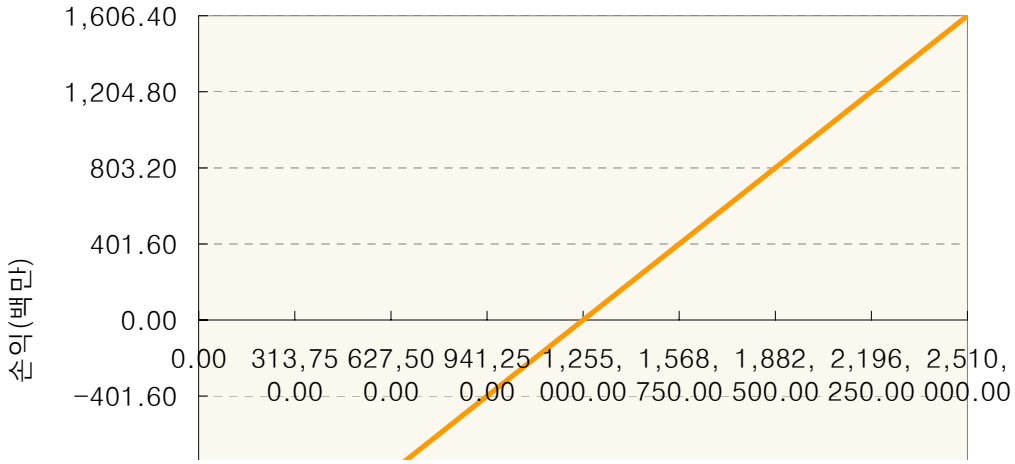
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	126	-126	장내
누계	유가증권	선물	1,976	0	1,976	장내

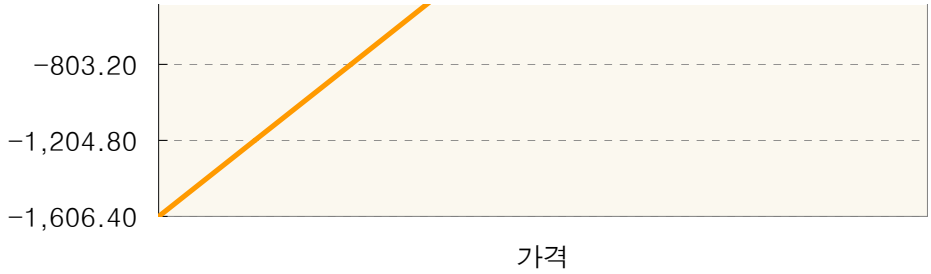
2. 만기시점의 손익구조

KR4101KC0007-2015-12 지수선물



KR4111KC0005-2015-12 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101KC0C 2015-12 지수선물							30
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
-5.33%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	10	10	10	10	10	10	10
5.33%	20	20	20	20	20	20	20
8.00%	30	30	30	30	30	30	30
KR4111KC0C 2015-12 삼성전자개별선물							128
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	43	43	43	43	43	43	43
5.33%	85	85	85	85	85	85	85
8.00%	128	128	128	128	128	128	128

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

(단위:백만원)

135

공시일	2015-10-14
기준일	2015-10-13

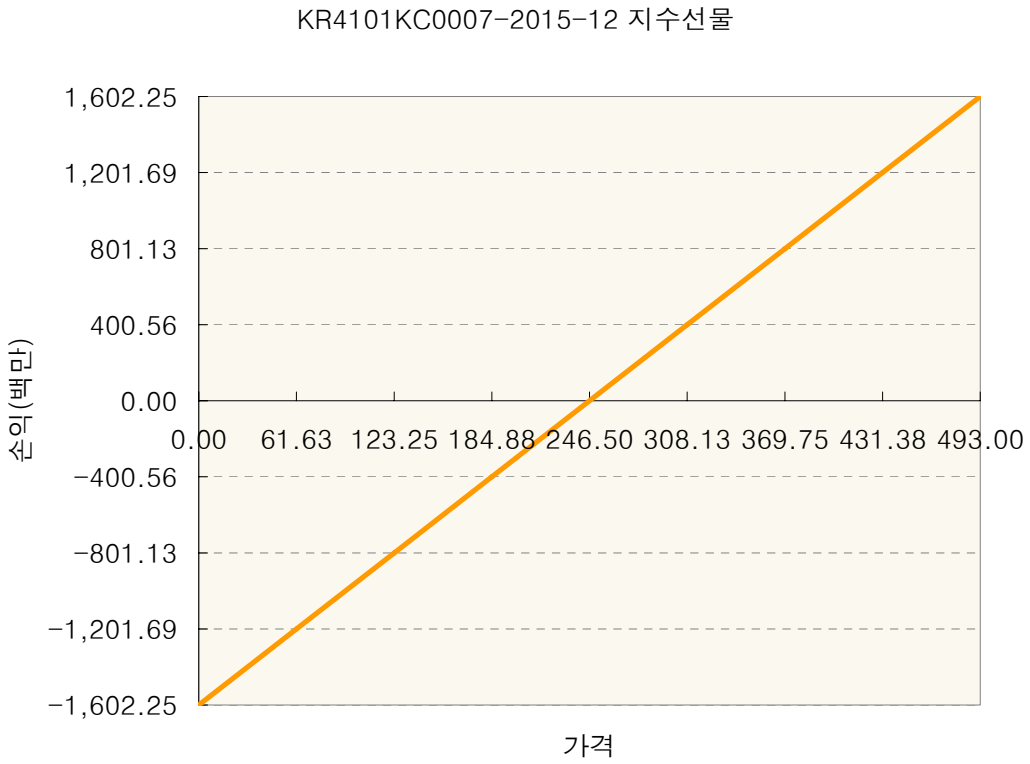
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,602	0	1,602	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101KC0C 2015-12 지수선물							128
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	43	43	43	43	43	43	43
5.33%	85	85	85	85	85	85	85
8.00%	128	128	128	128	128	128	128

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

95

공시일	2015-10-14
기준일	2015-10-13

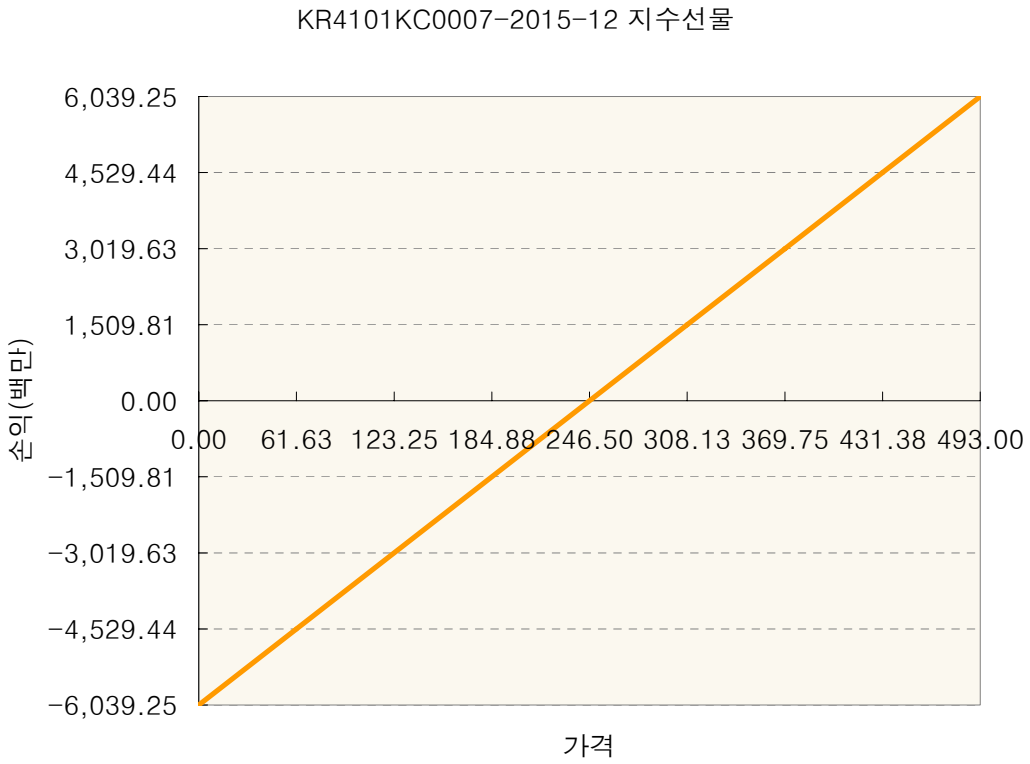
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	6,039	0	6,039	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101KC0C 2015-12 지수선물							482
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-482	-482	-482	-482	-482	-482	-482
-5.33%	-321	-321	-321	-321	-321	-321	-321
-2.67%	-161	-161	-161	-161	-161	-161	-161
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	161	161	161	161	161	161	161
5.33%	321	321	321	321	321	321	321
8.00%	482	482	482	482	482	482	482

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	359

공시일	2015-10-14
기준일	2015-10-13

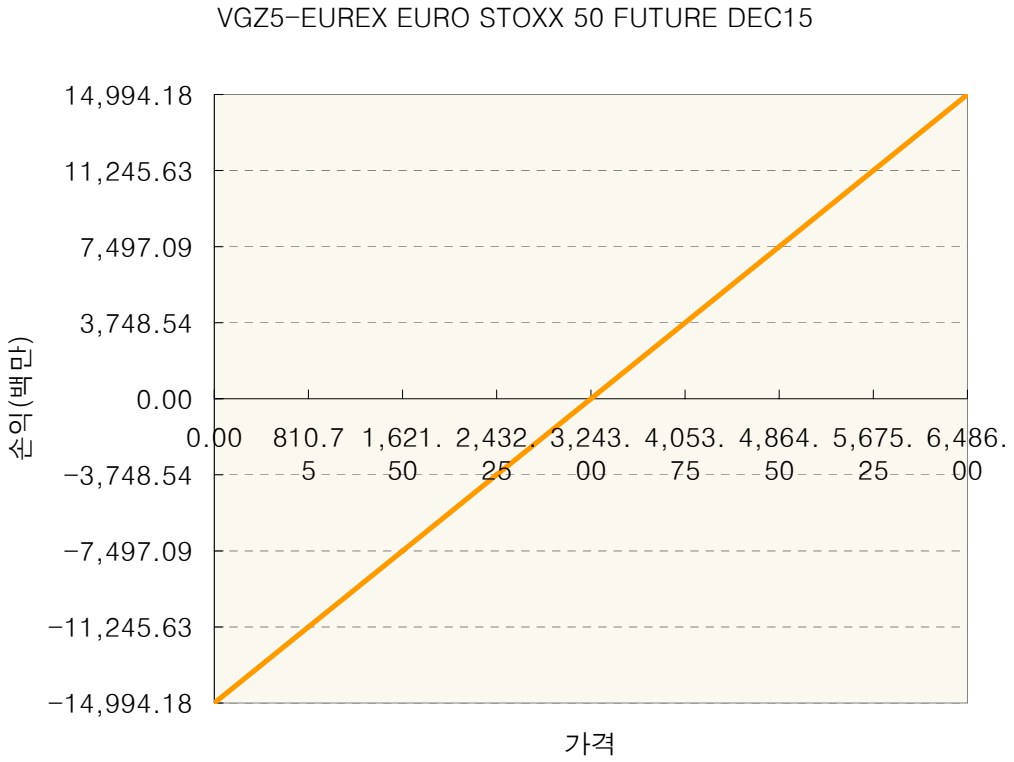
유로인덱스1호(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	14,994	0	14,994	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ5	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE DEC15	1,200

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

(단위:백만원)

1,280

공시일	2015-10-14
기준일	2015-10-13

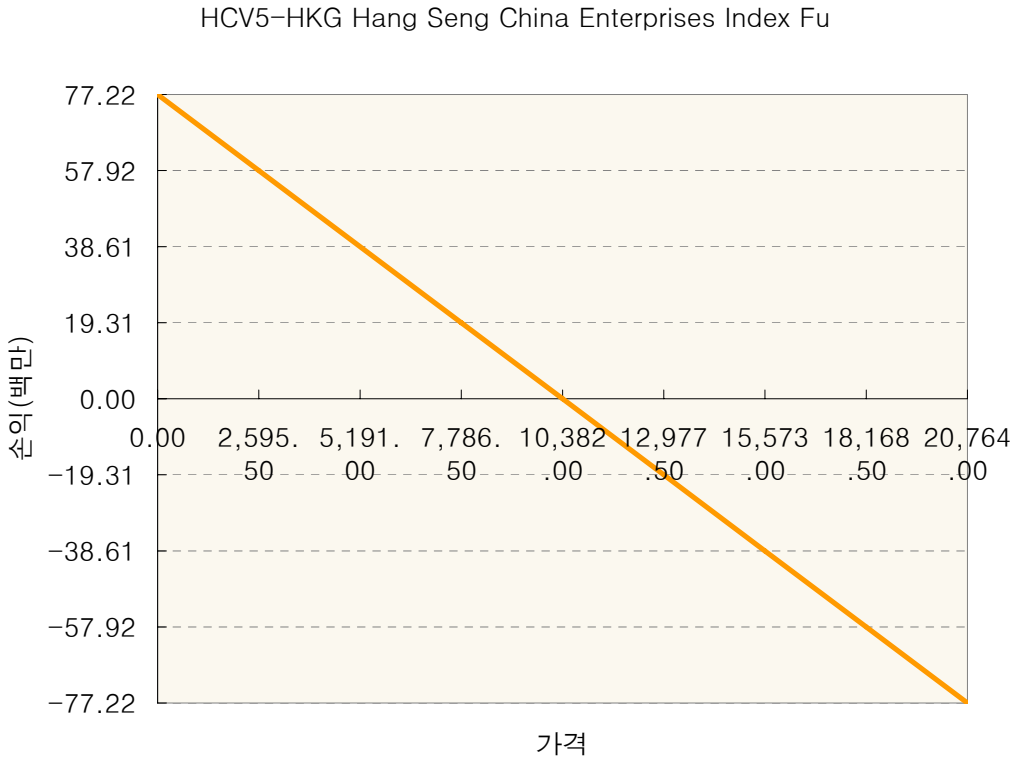
아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

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	0	77	-77	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV5	HKG Hang Seng China Enterprises Index Fu	6

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

(단위:백만원)

8

공시일	2015-10-14
기준일	2015-10-13

차이나인덱스(주식-파생형)(종)

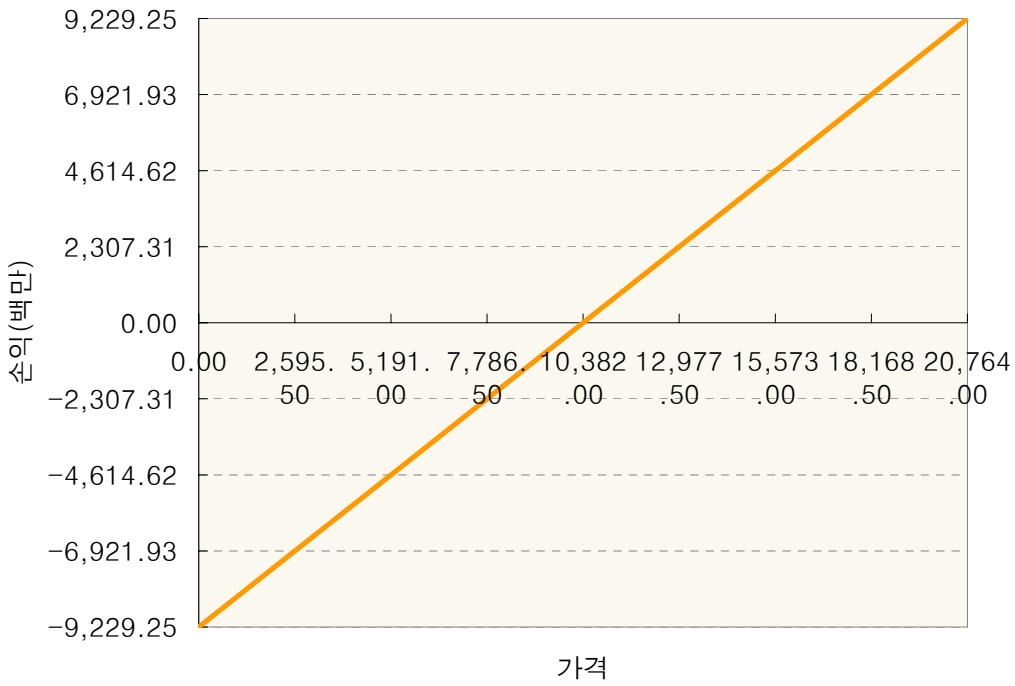
1. 계약금액

(단위:백만원)

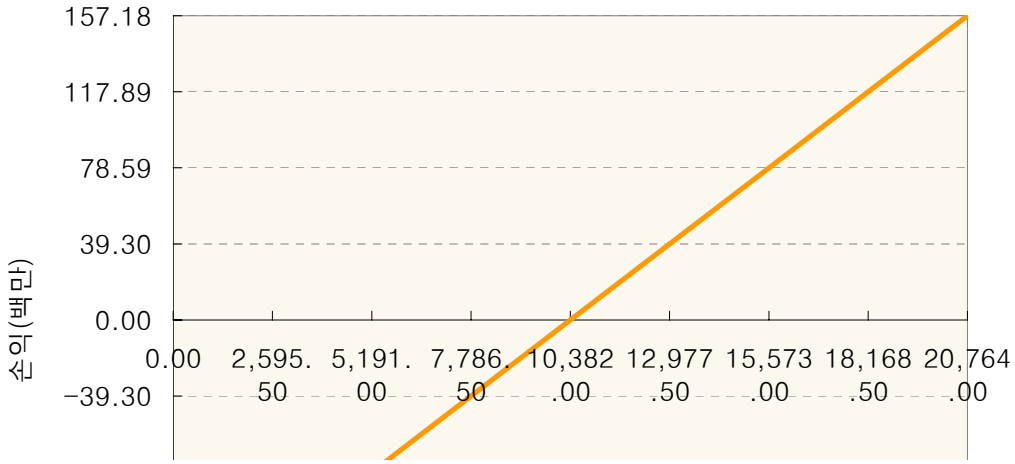
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,386	0	9,386	장내

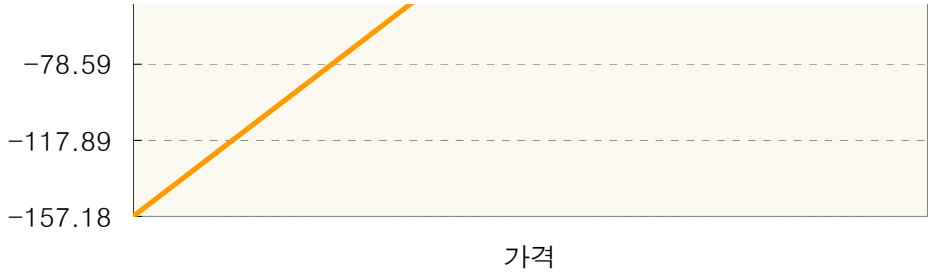
2. 만기시점의 손익구조

HCV5-HKG Hang Seng China Enterprises Index FU



MHCV5-HKG MINI HANG SENG CHINA H-SHR IDX Fu OC





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV5	HKG Hang Seng China Enterprises Index FU	738
MHCV5	HKG MINI HANG SENG CHINA H-SHR IDX Fu OC	13

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	959

공시일	2015-10-14
기준일	2015-10-13

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	2,434

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,802

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2015-10-14
기준일	2015-10-13

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	57

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

133

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2015-10-14
기준일	2015-10-13

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	461
SWCSI50000 신한CSI500미래S09092	142

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,559

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2015-10-14
기준일	2015-10-13

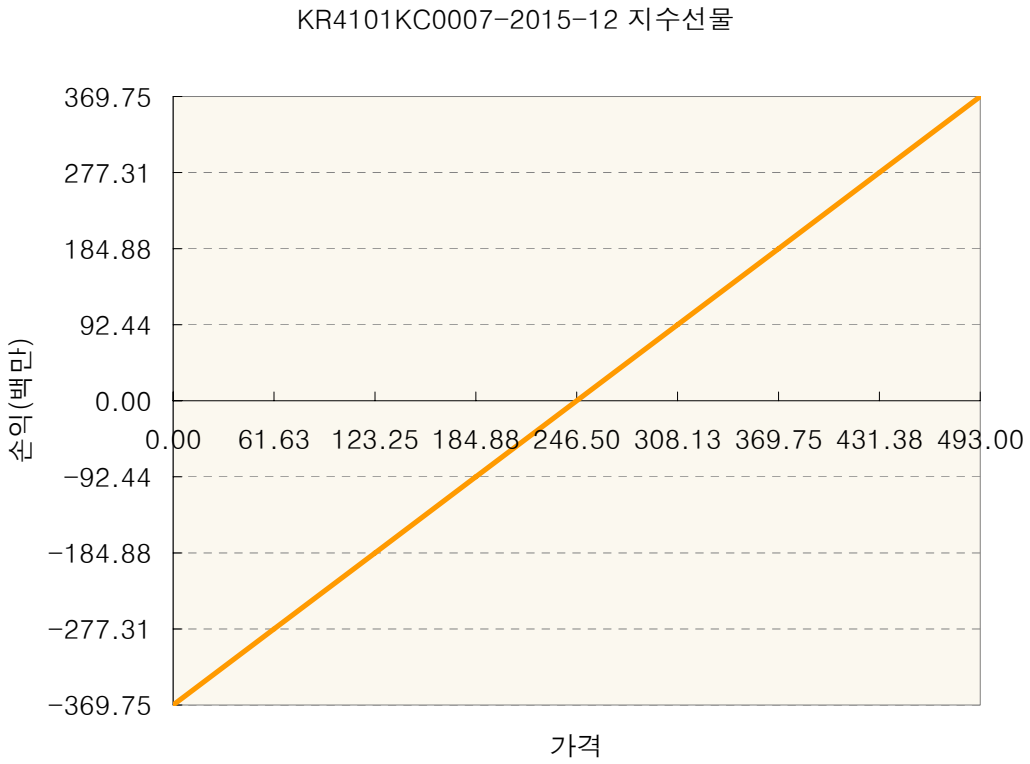
KOSPI200스마트레버리지목표전환

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	370	0	370	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101KC0C 2015-12 지수선물 30

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
-5.33%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	10	10	10	10	10	10	10
5.33%	20	20	20	20	20	20	20
8.00%	30	30	30	30	30	30	30

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

22

공시일	2015-10-14
기준일	2015-10-13

메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

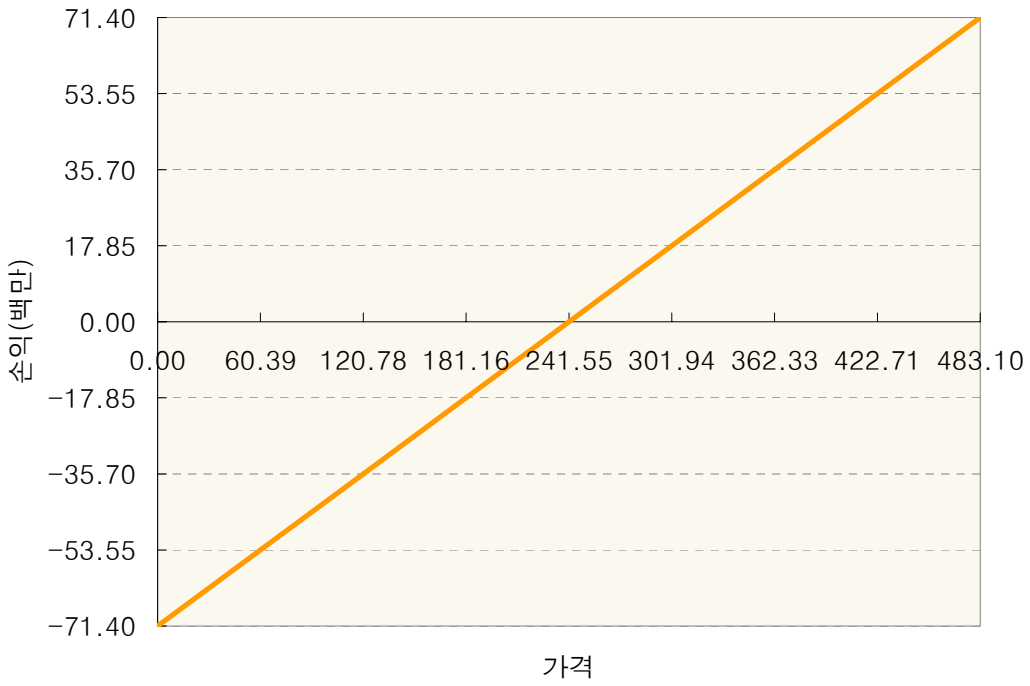
1. 계약금액

(단위:백만원)

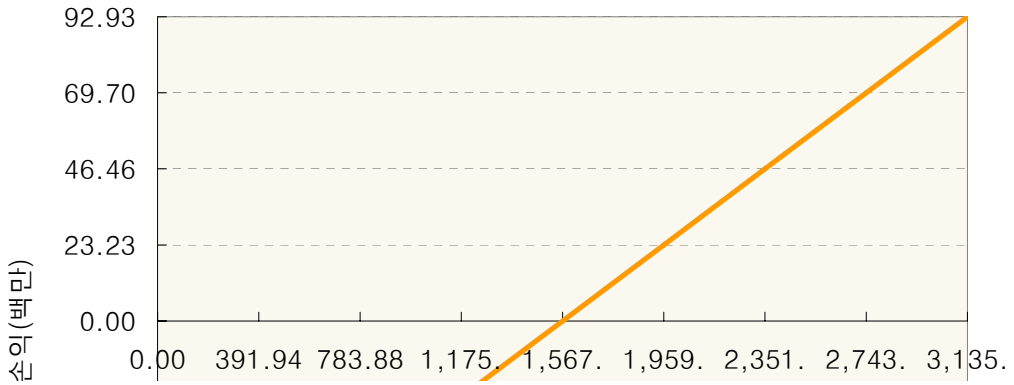
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	38	0	38	
누계	유가증권	선물	348	0	348	

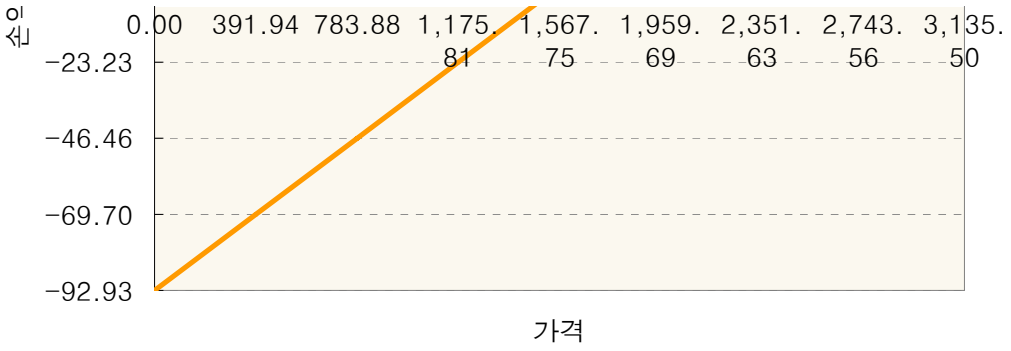
2. 만기시점의 손익구조

HGZ5-COPPER FUTURE DEC15

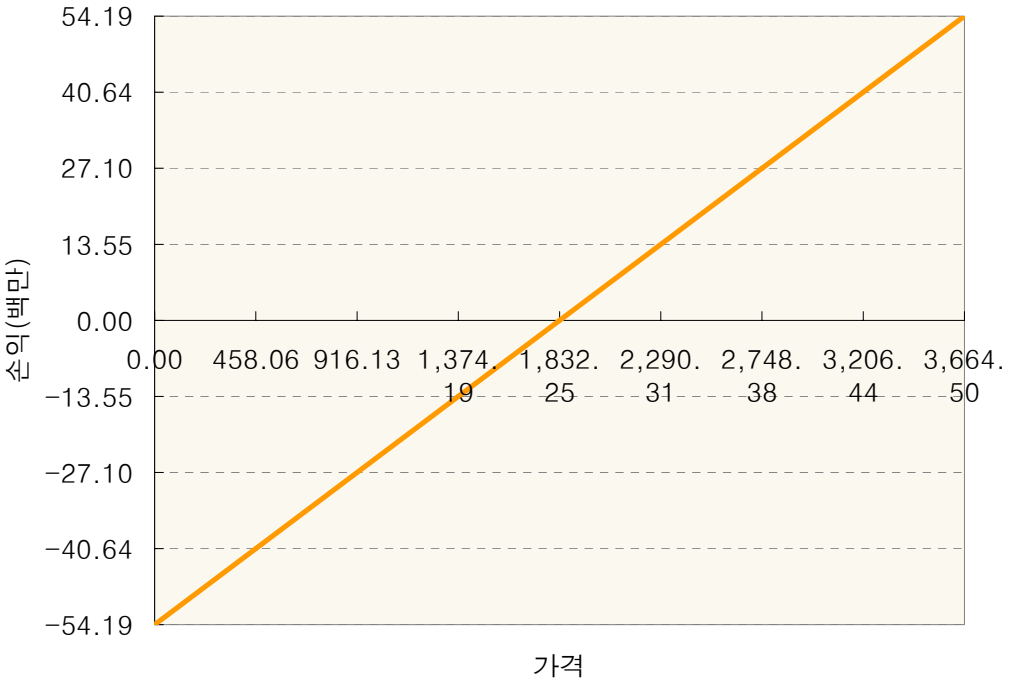


LAX5-LME PRI ALUM FUTR NOV15

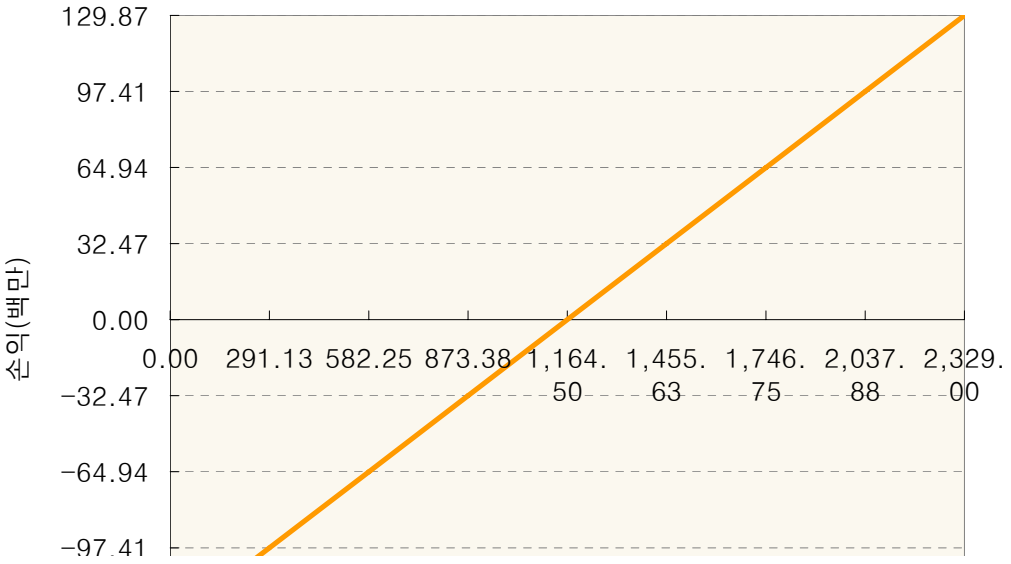


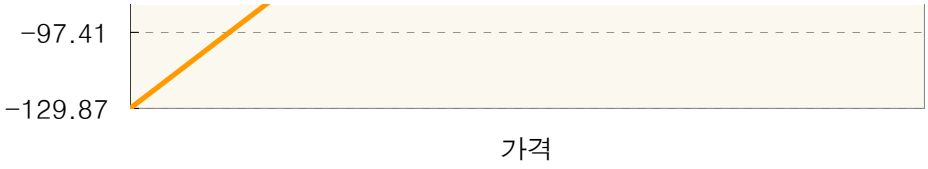


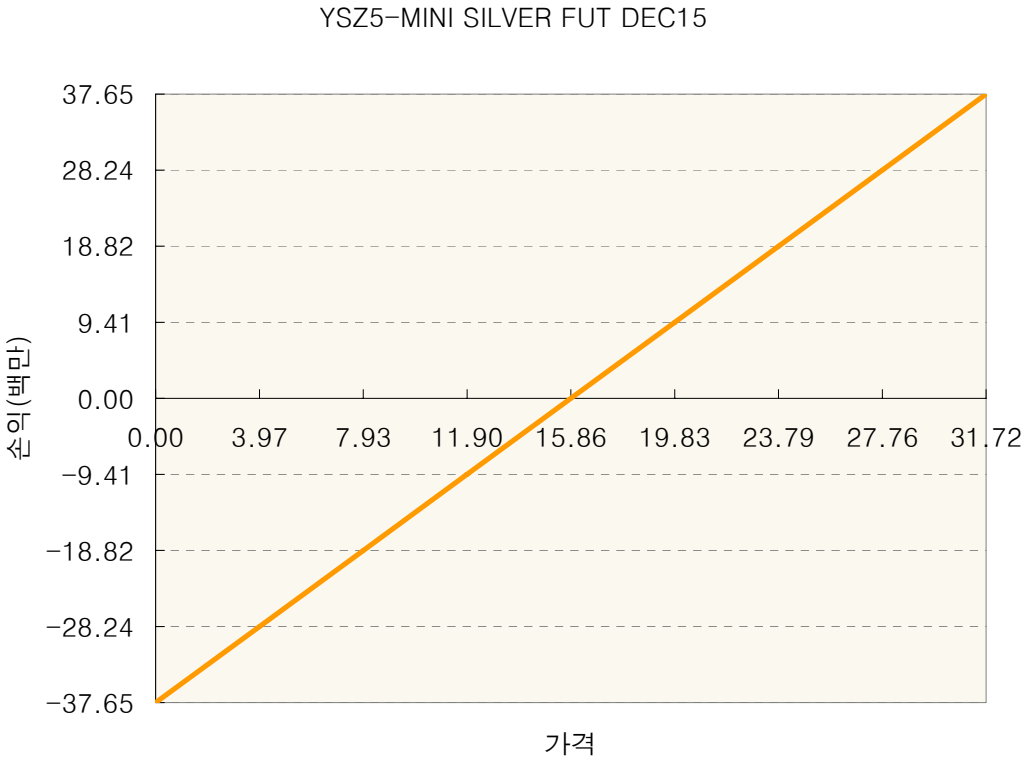
LXX5-LME ZINC FUTURE NOV15



XGZ5-MINI GOLD FUTURE DEC15







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGZ5	COPPER FUTURE DEC15	6
LAX5	LME PRI ALUM FUTR NOV15	7
LXX5	LME ZINC FUTURE NOV15	4
XGZ5	MINI GOLD FUTURE DEC15	10
YSZ5	MINI SILVER FUT DEC15	3

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

(단위:백만원)

30

공시일	2015-10-14
기준일	2015-10-13

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

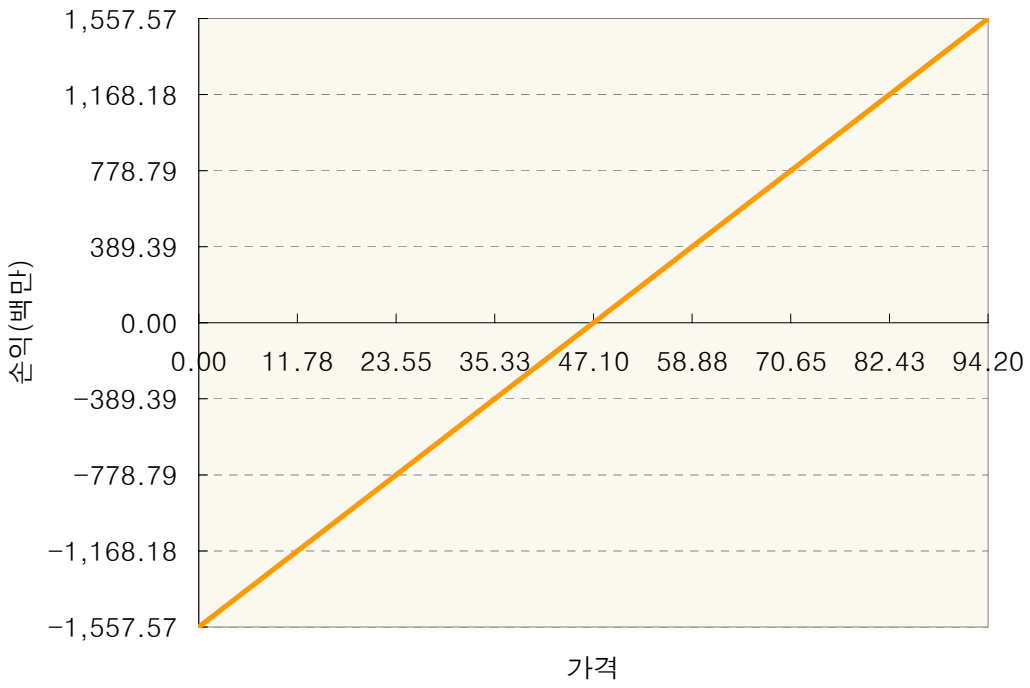
1. 계약금액

(단위:백만원)

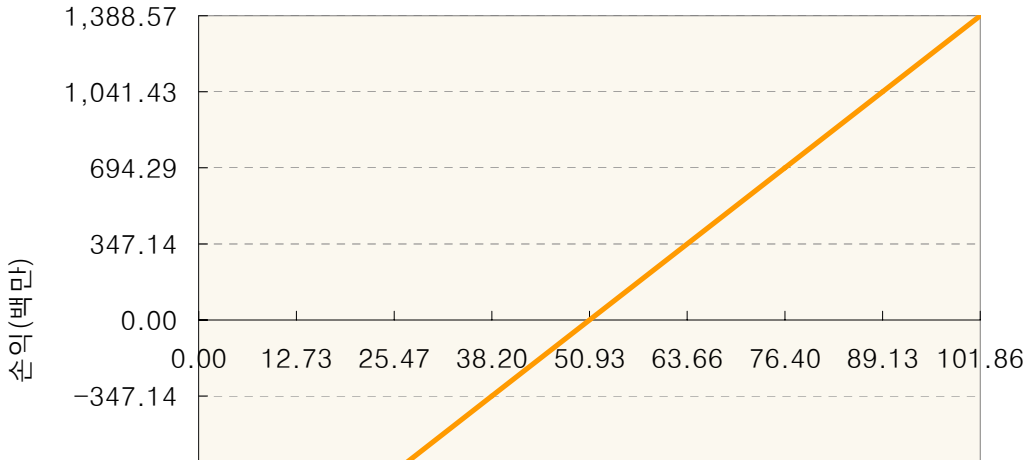
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,007	0	6,007	

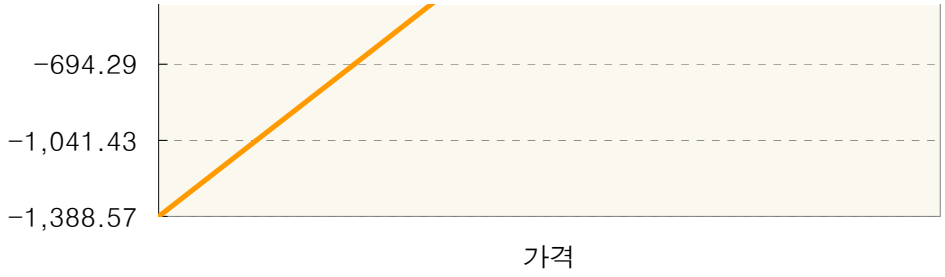
2. 만기시점의 손익구조

CLX5-WTI CRUDE FUTURE Nov15

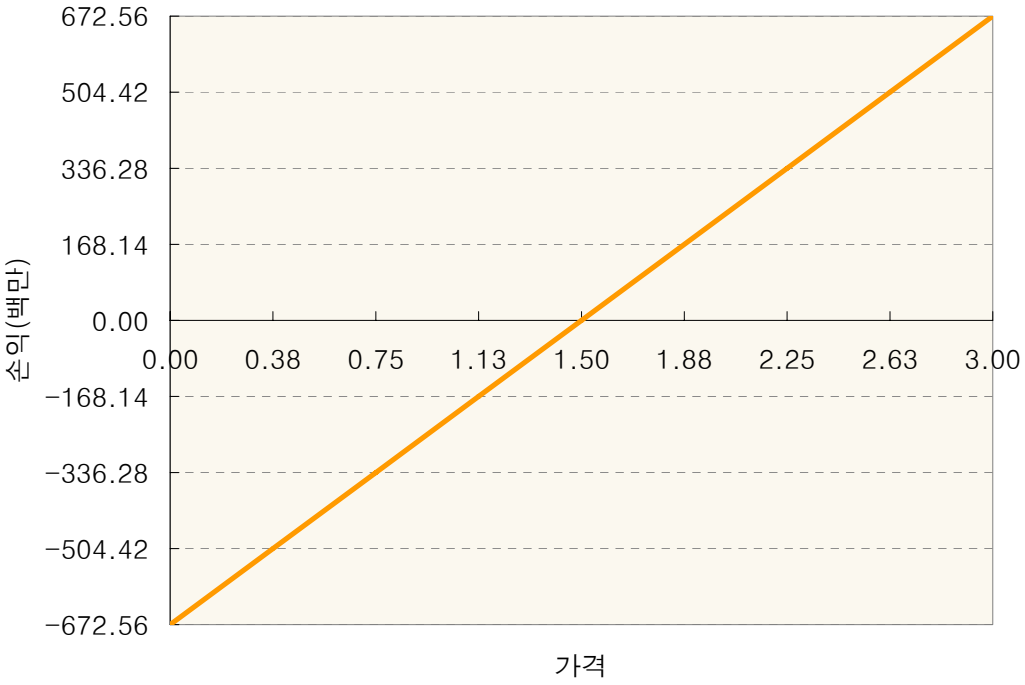


COF6-BRENT CRUDE FUTR JAN16

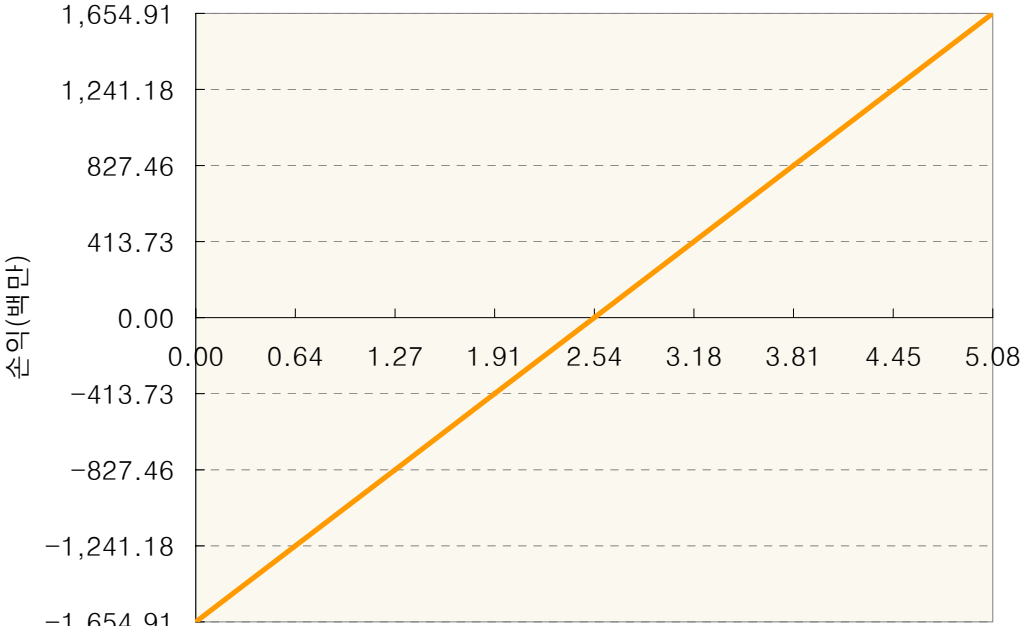


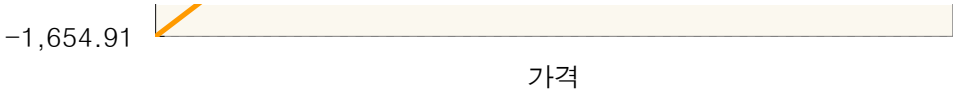


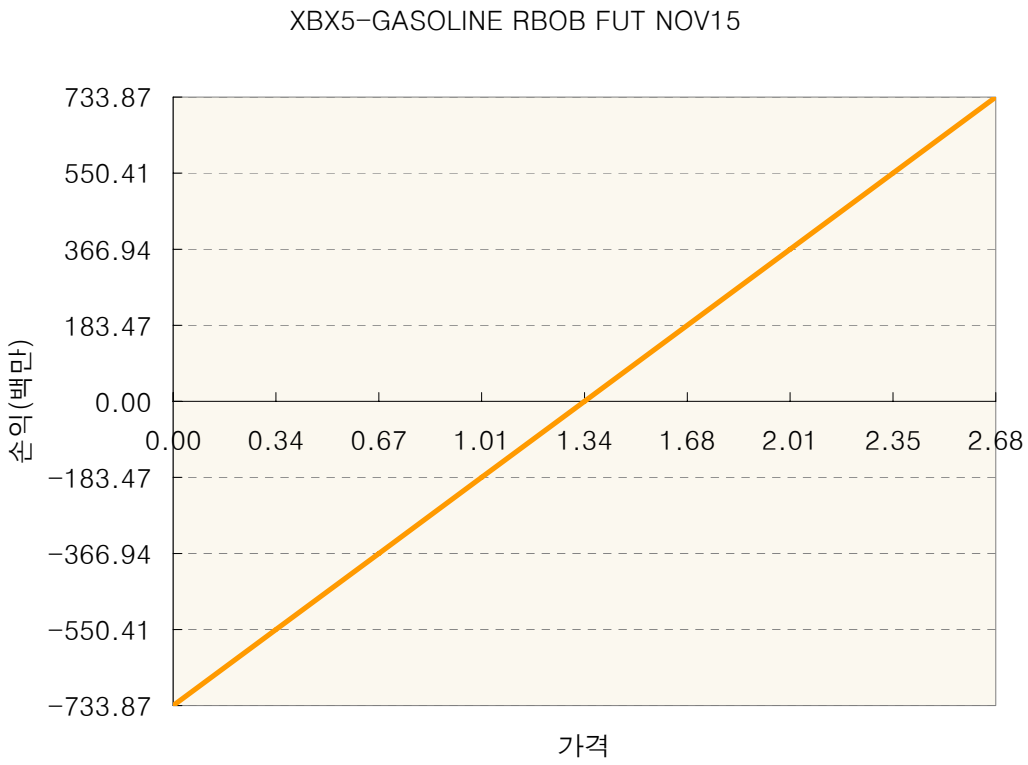
HOX5-NY Harb ULSD Fut Nov15



NGX5-NATURAL GAS FUTR NOV15







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLX5	WTI CRUDE FUTURE Nov15	125
COF6	BRENT CRUDE FUTR JAN16	111
HOX5	NY Harb ULSD Fut Nov15	54
NGX5	NATURAL GAS FUTR NOV15	132
XBX5	GASOLINE RBOB FUT NOV15	59

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

(단위:백만원)

1,222

공시일	2015-10-14
기준일	2015-10-13

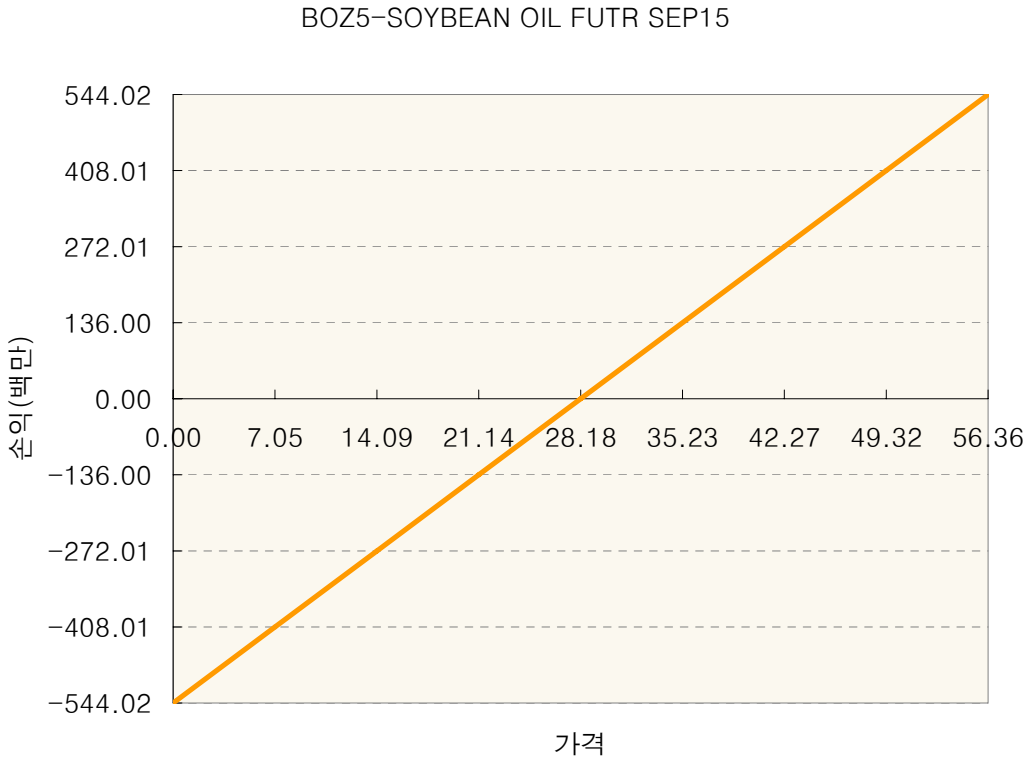
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

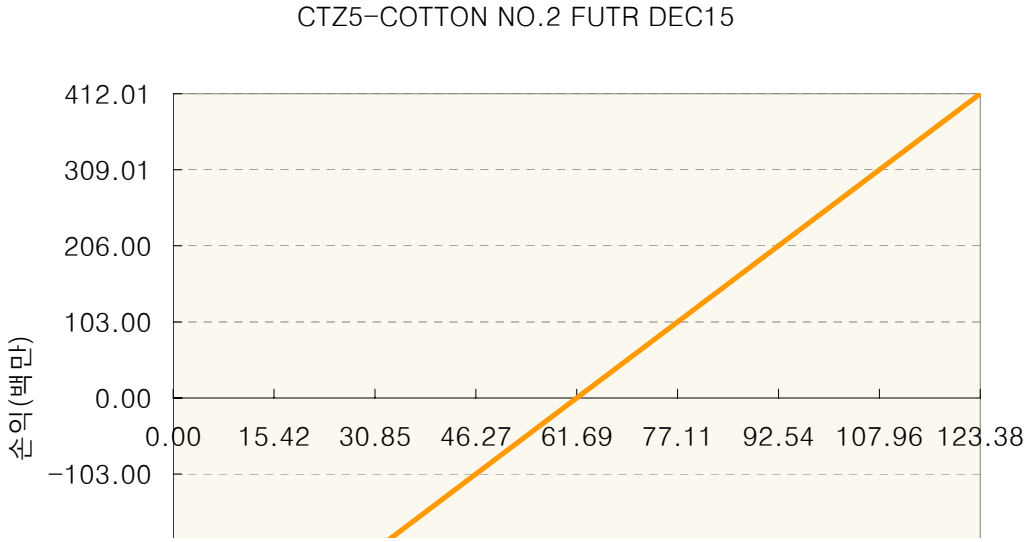
1. 계약금액

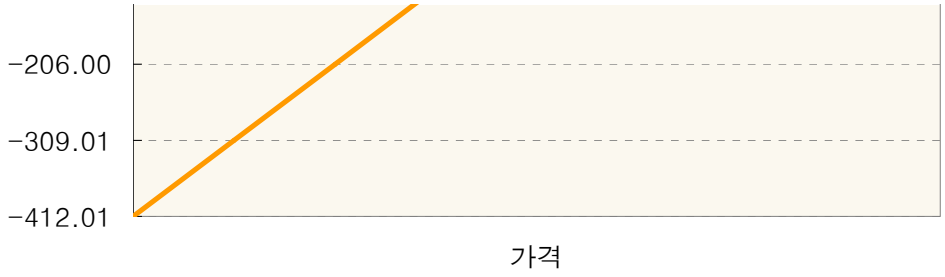
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,672	0	6,672	

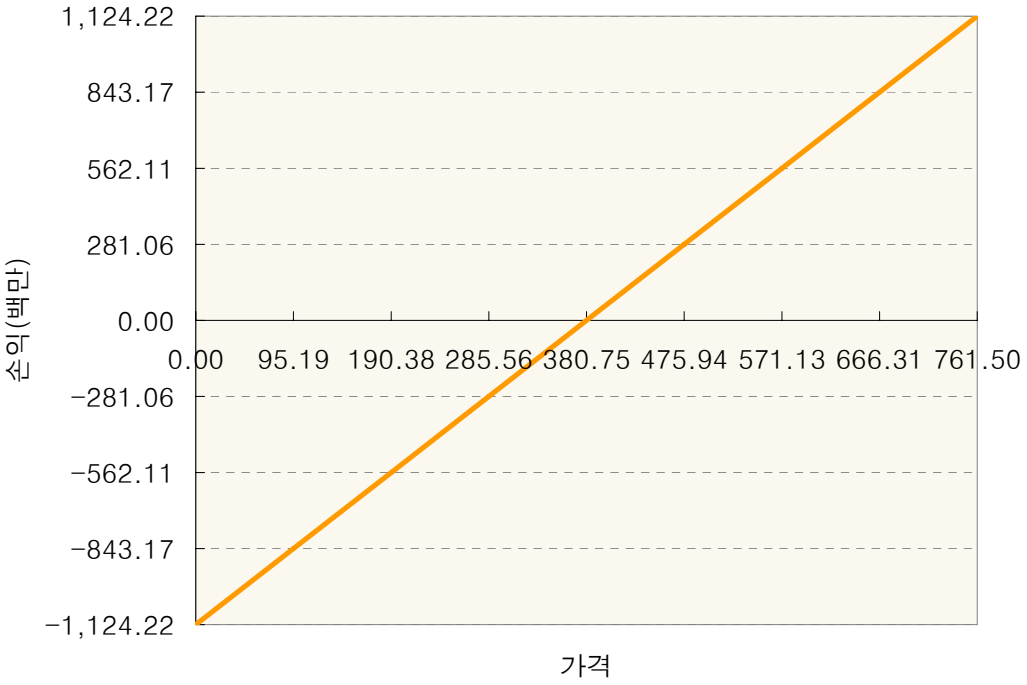
2. 만기시점의 손익구조



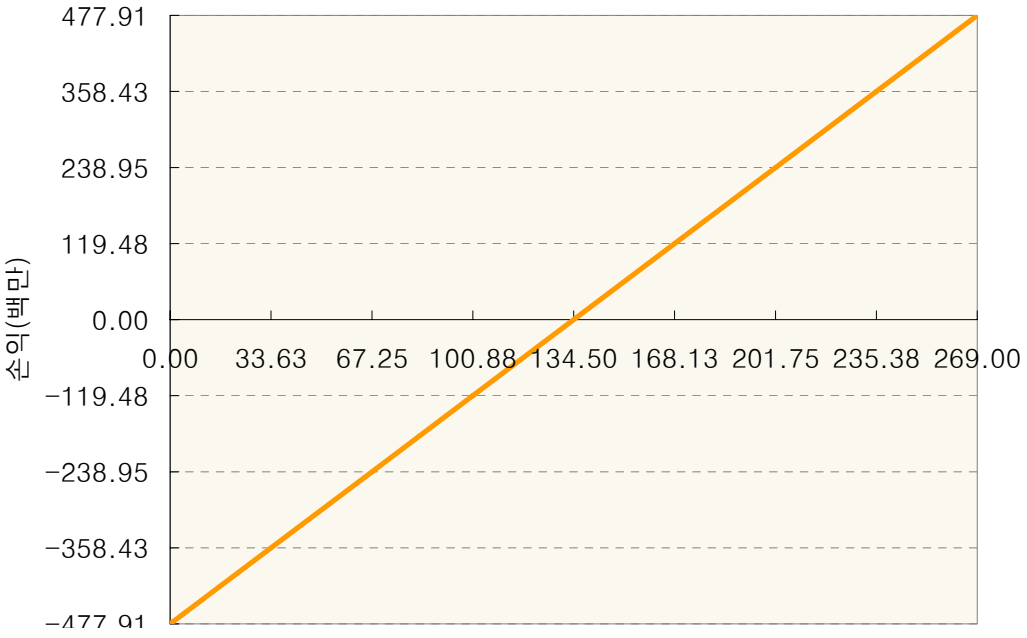


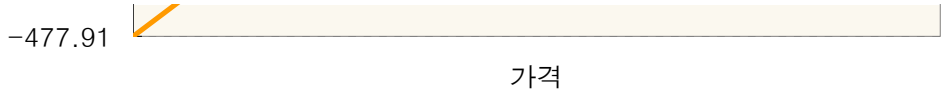


CZ5-CORN FUTURE DEC15

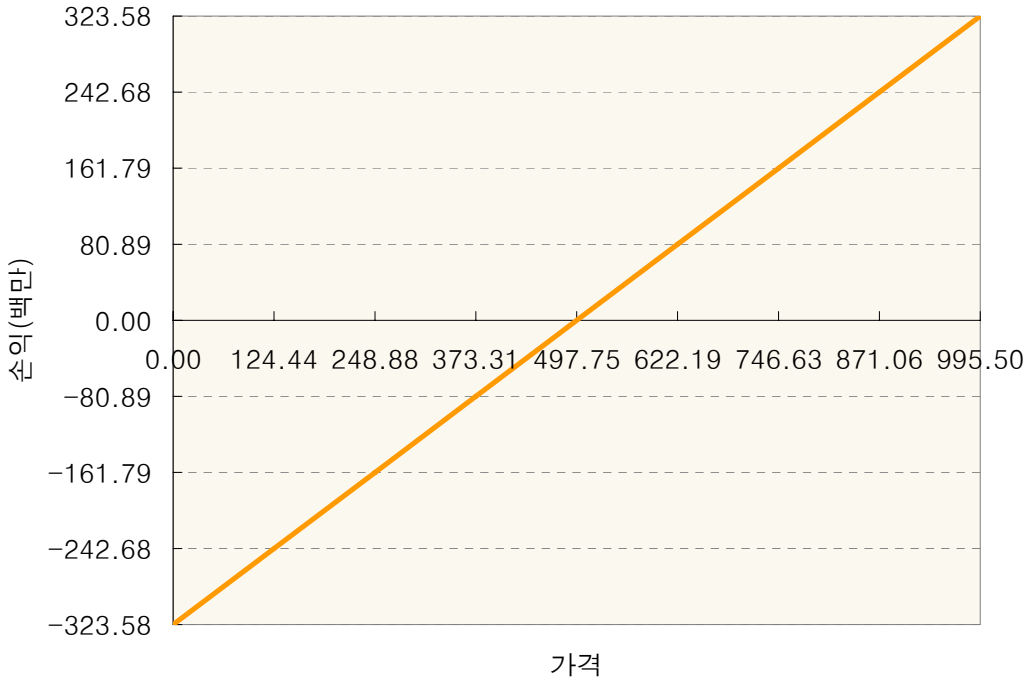


KCZ5-COFFEE "C" FUTURE DEC15

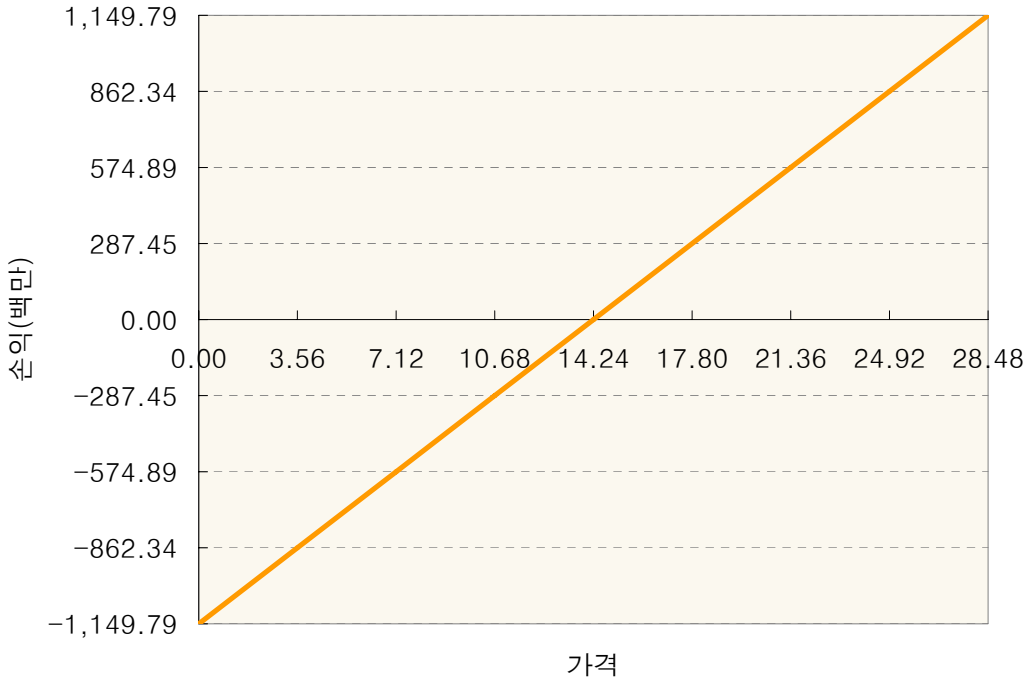




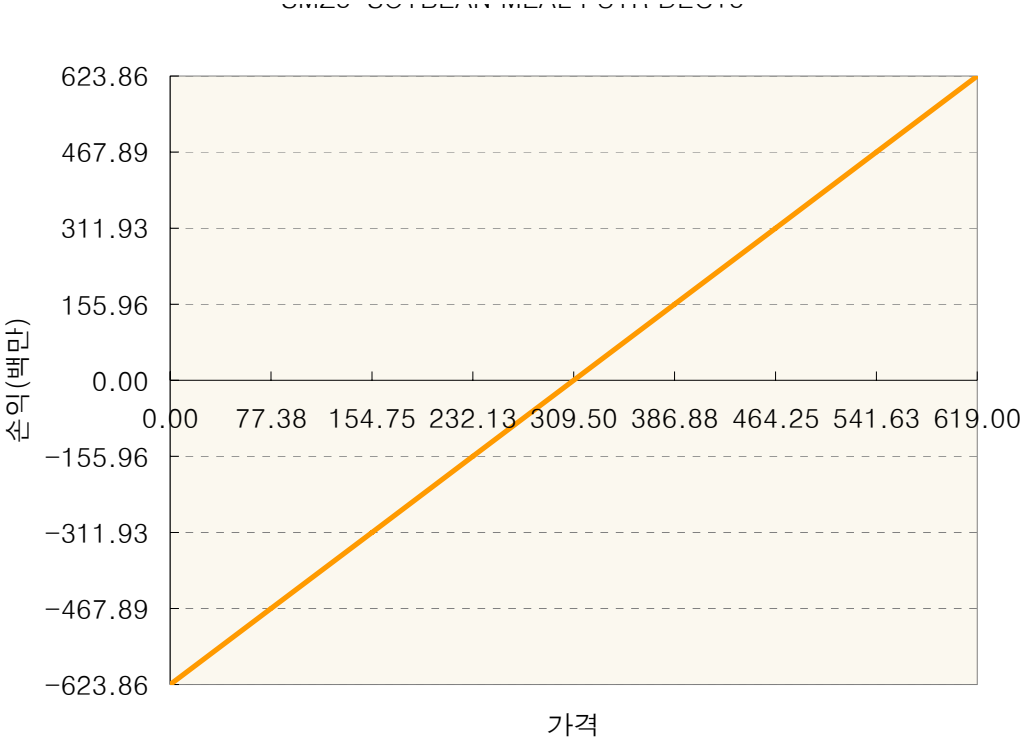
KWZ5-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) DEC15



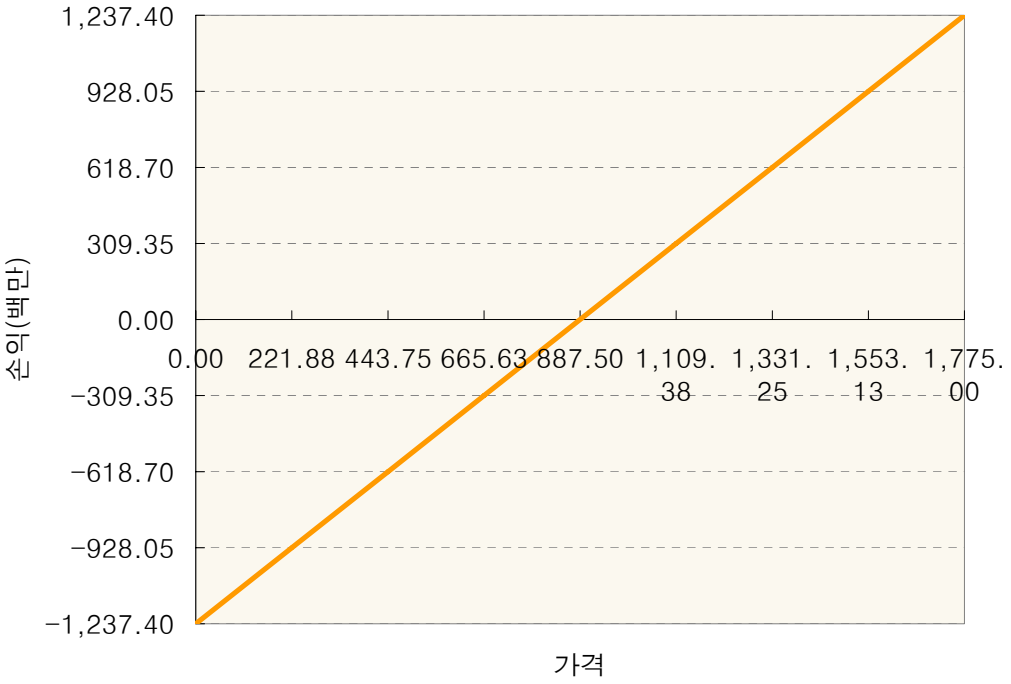
SBH6-Sugar #11 (WORLD) MAR16



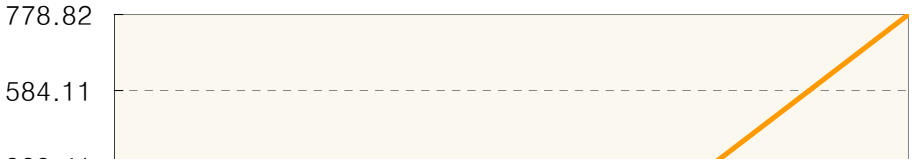
SMZ5-SOYBEAN MEAL FUTR DEC15

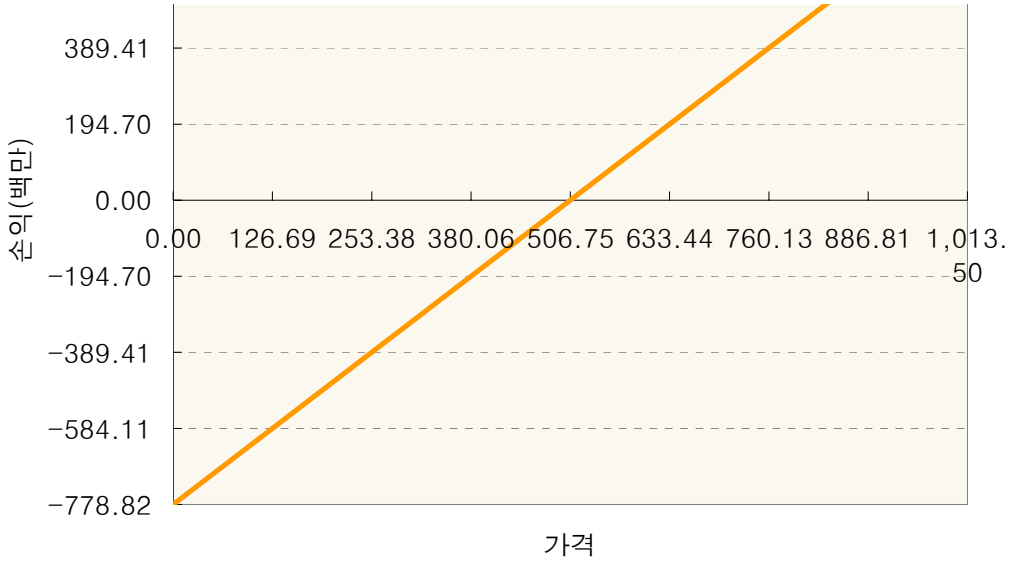


SX5-SOYBEAN FUTURE NOV15



WZ5-WHEAT FUTURE(CBT) DEC15





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ5	SOYBEAN OIL FUTR SEP15	44
CTZ5	COTTON NO.2 FUTR DEC15	33
CZ5	CORN FUTURE DEC15	90
KCZ5	COFFEE "C" FUTURE DEC15	38
KWZ5	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) DEC15	26
SBH6	Sugar #11 (WORLD) MAR16	92
SMZ5	SOYBEAN MEAL FUTR DEC15	50
SX5	SOYBEAN FUTURE NOV15	99
WZ5	WHEAT FUTURE(CBT) DEC15	62

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

(단위:백만원)

770