공시일	2015-11-04
기준일	2015-11-03

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	2015-11-04
기준일	2015-11-03

차곡차곡플러스모(주식혼합-파생)

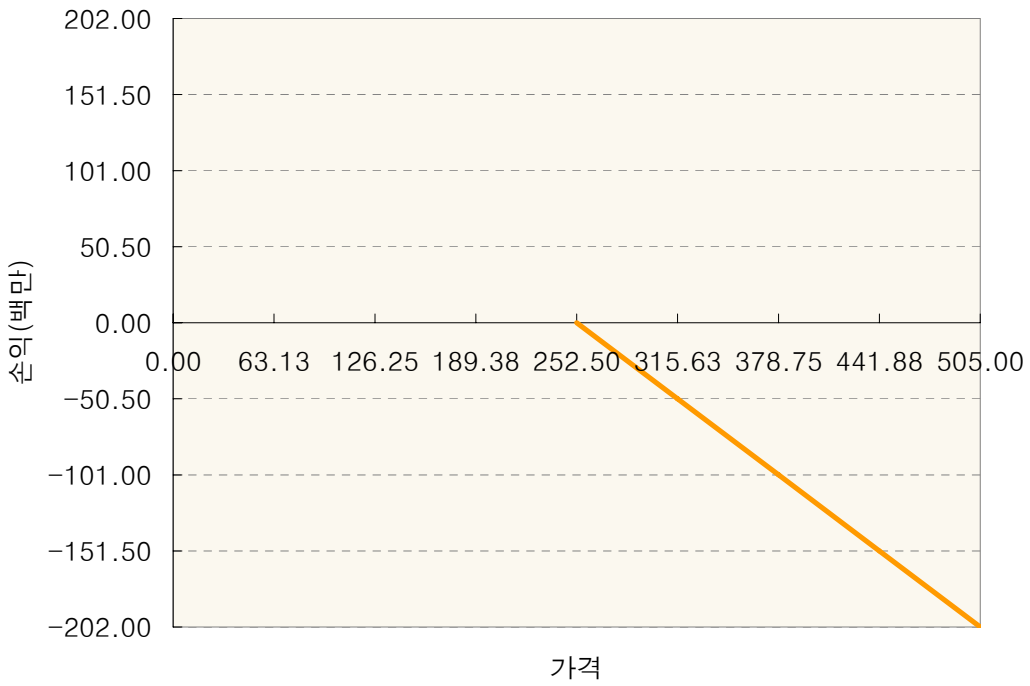
1. 계약금액

(단위:백만원)

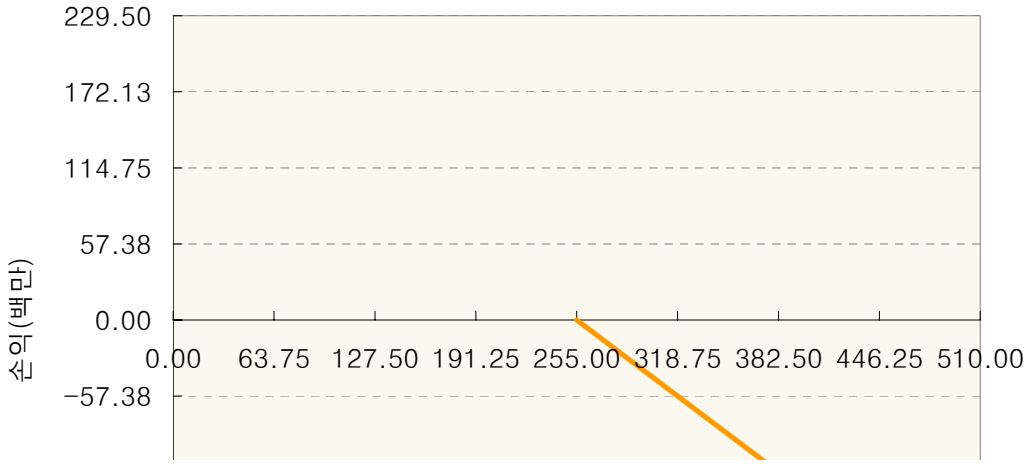
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	432	-432	장내

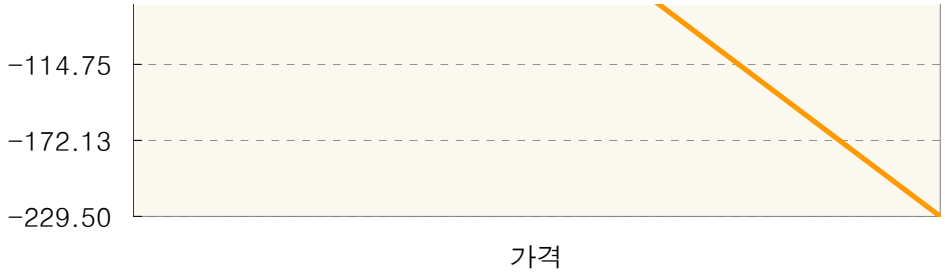
2. 만기시점의 손익구조

KR4201KB2524-2015-11 콜252.5



KR4201KB2557-2015-11 콜255





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201KB25 2015-11 콜252.5							72
	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	8	8	8	8
-2.67%	7	7	7	7	7	6	6
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	-18	-18	-19	-19	-19	-20	-20
5.33%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
8.00%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72
KR4201KB25 2015-11 콜255							74
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4	4	4	4	4	4	4
-5.33%	4	4	4	4	4	4	4
-2.67%	4	4	4	4	4	4	3
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	-15	-15	-16	-16	-17	-18	-18
5.33%	-43	-43	-43	-43	-44	-44	-44
8.00%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-74

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

(단위:백만원)

177

공시일	2015-11-04
기준일	2015-11-03

스마트인덱스모

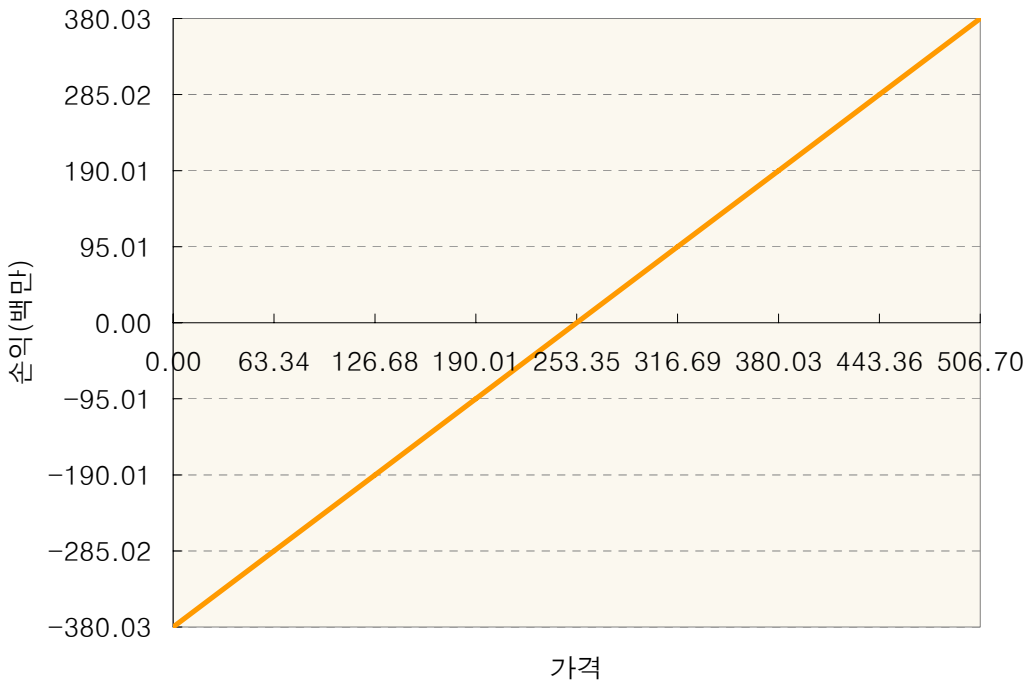
1. 계약금액

(단위:백만원)

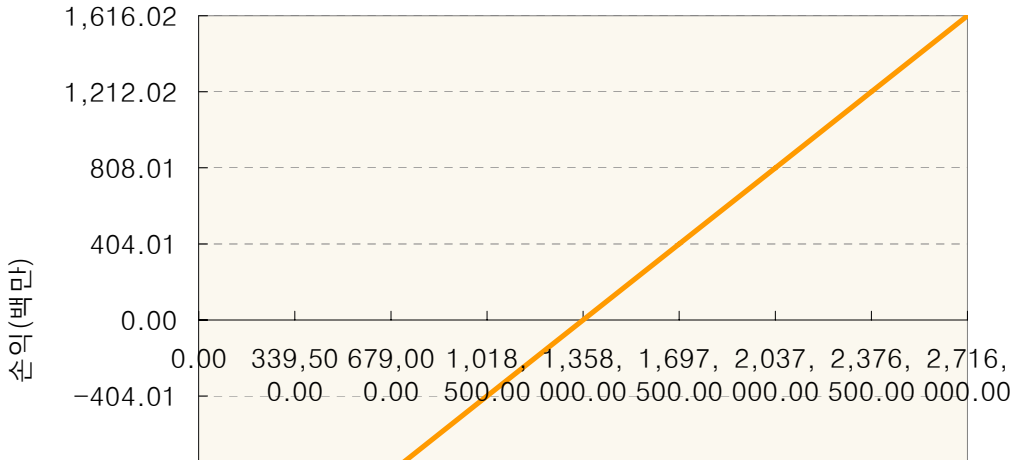
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,996	0	1,996	장내

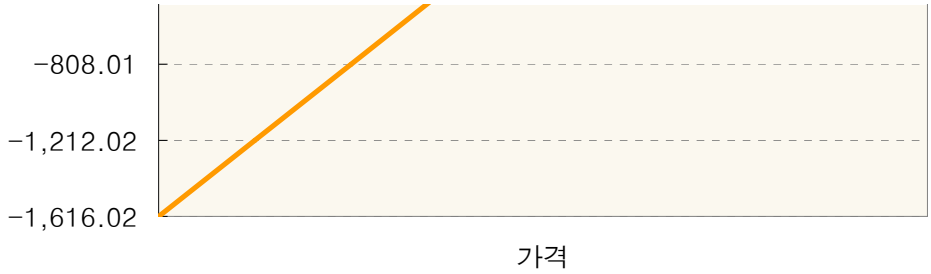
2. 만기시점의 손익구조

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							129
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-129	-129	-129	-129	-129	-129	-129
-5.33%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
-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%	86	86	86	86	86	86	86
8.00%	129	129	129	129	129	129	129

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

(단위:백만원)

130

공시일	2015-11-04
기준일	2015-11-03

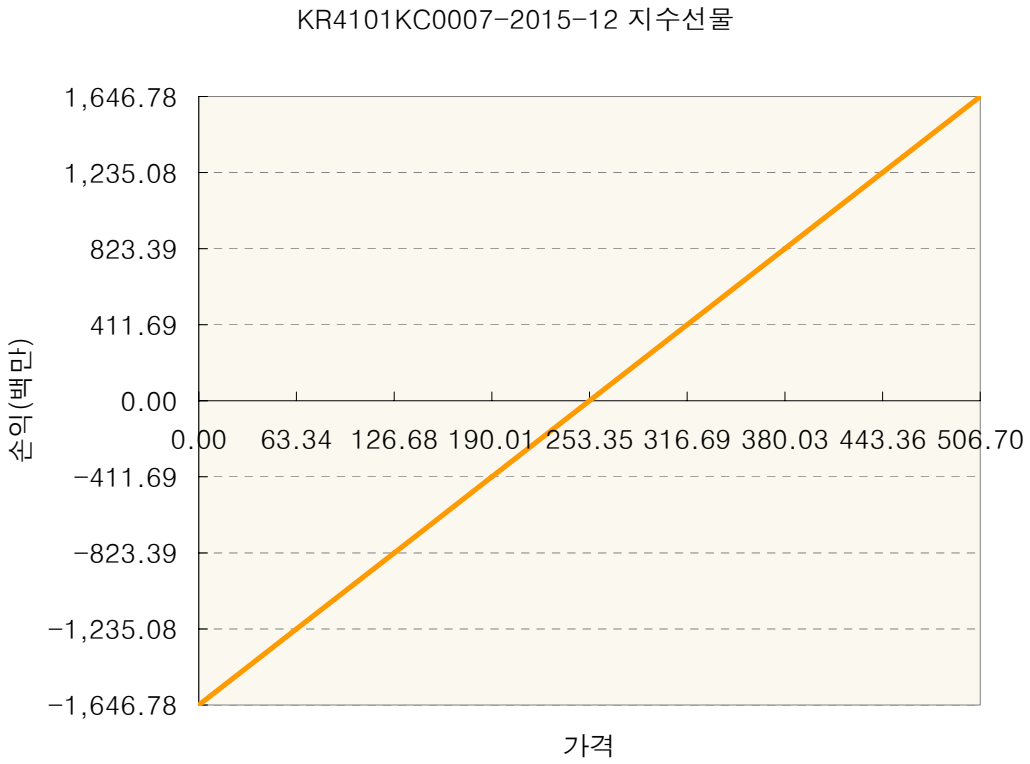
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,647	0	1,647	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101KC0C 2015-12 지수선물 131

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-5.33%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	44	44	44	44	44	44	44
5.33%	87	87	87	87	87	87	87
8.00%	131	131	131	131	131	131	131

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

95

공시일	2015-11-04
기준일	2015-11-03

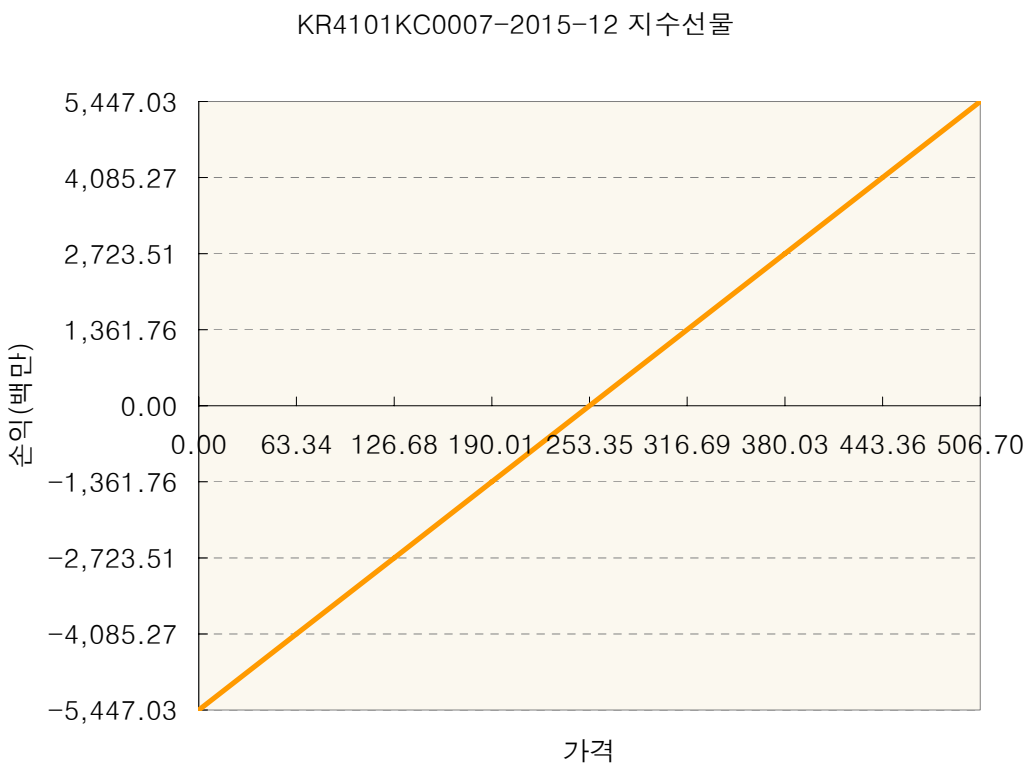
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	5,447	0	5,447	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101KC0C 2015-12 지수선물							434
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-434	-434	-434	-434	-434	-434	-434
-5.33%	-289	-289	-289	-289	-289	-289	-289
-2.67%	-145	-145	-145	-145	-145	-145	-145
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	145	145	145	145	145	145	145
5.33%	289	289	289	289	289	289	289
8.00%	434	434	434	434	434	434	434

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	315

공시일	2015-11-04
기준일	2015-11-03

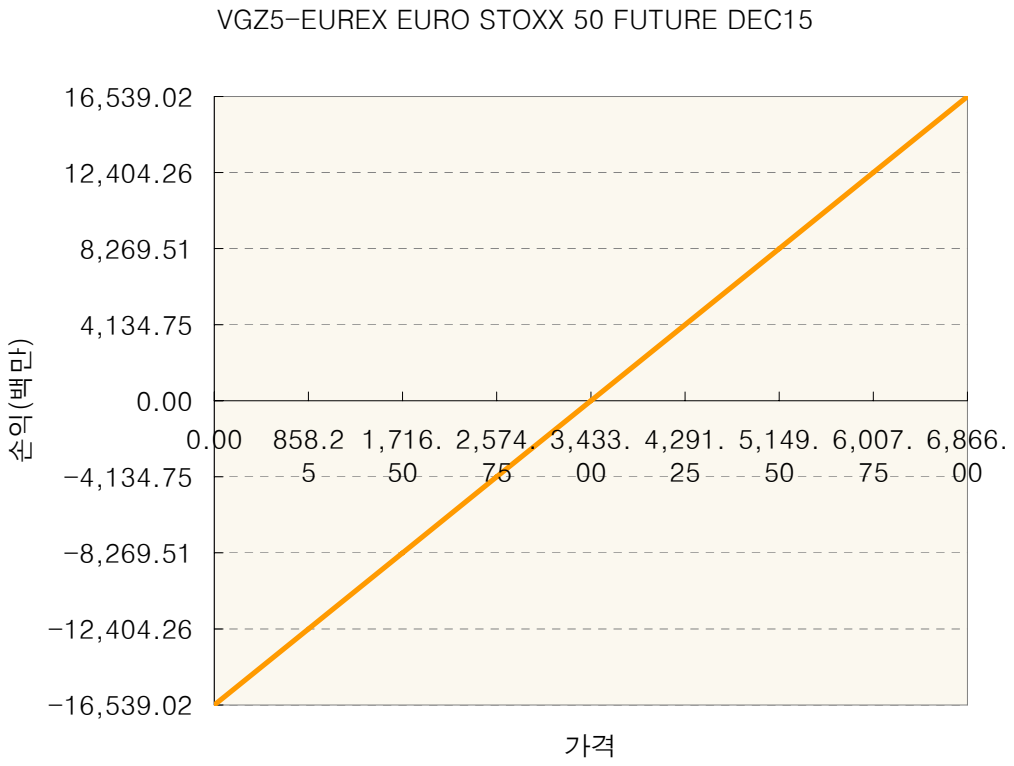
유로인덱스1호(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	16,539	0	16,539	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ5	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE DEC15	1,323

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

(단위:백만원)

1,426

공시일	2015-11-04
기준일	2015-11-03

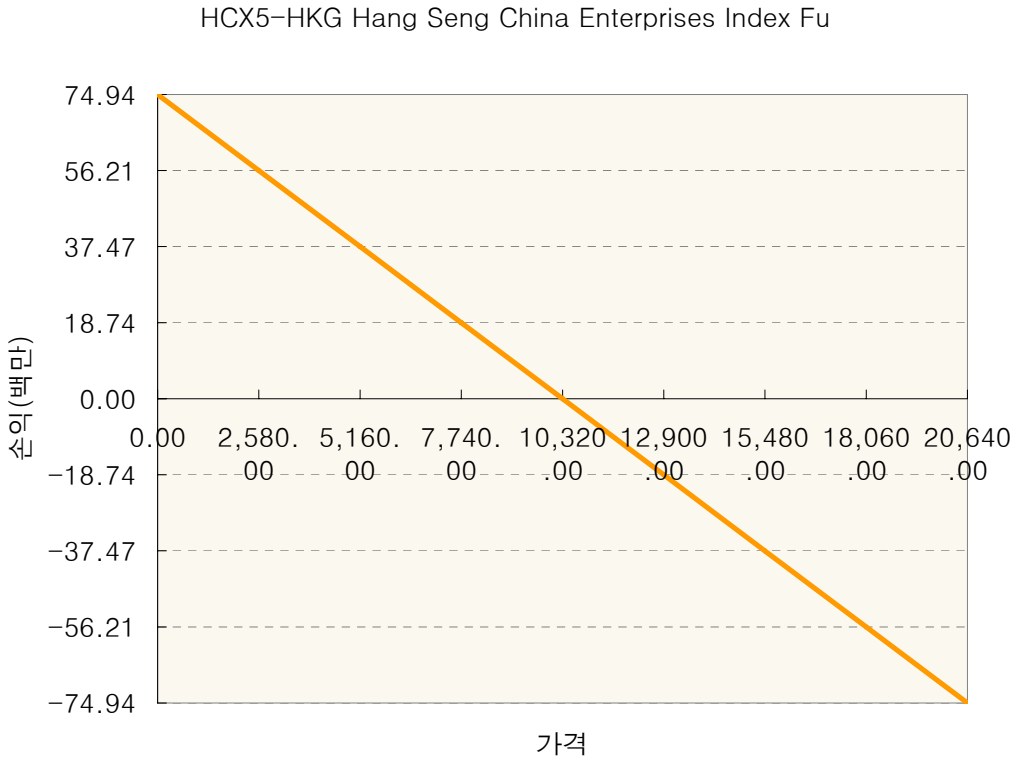
아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

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	75	-75	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCX5	HKG Hang Seng China Enterprises Index Fu	6

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

(단위:백만원)

8

공시일	2015-11-04
기준일	2015-11-03

차이나인덱스(주식-파생형)(종)

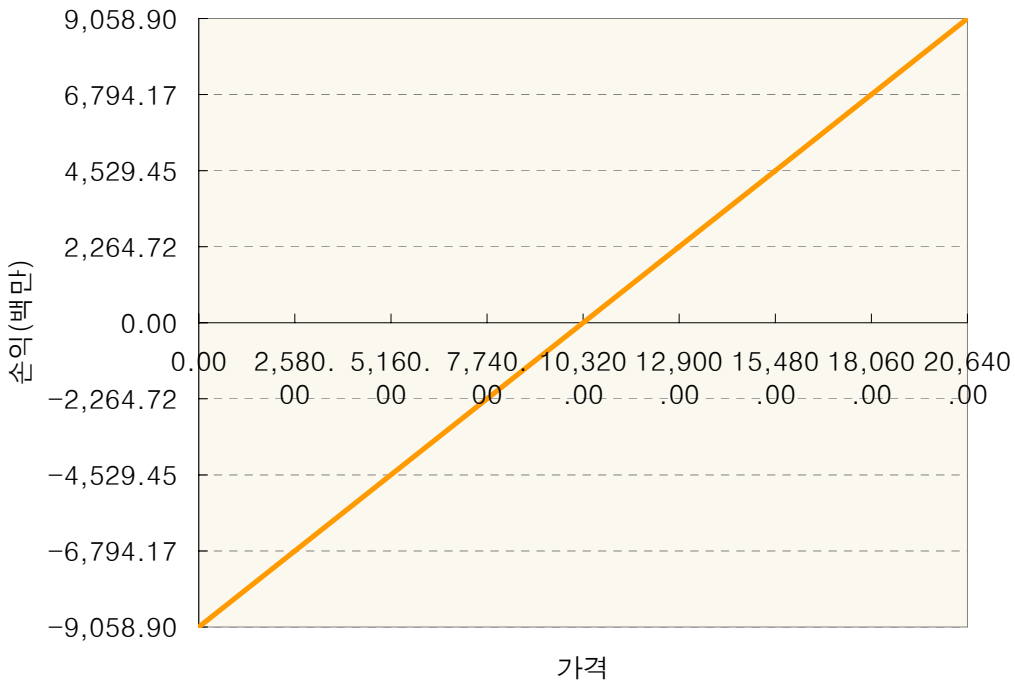
1. 계약금액

(단위:백만원)

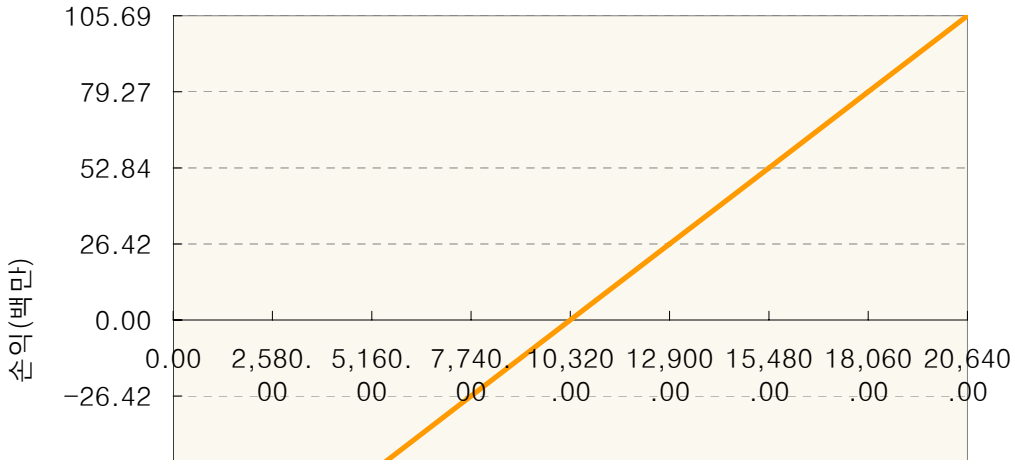
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,165	0	9,165	장내

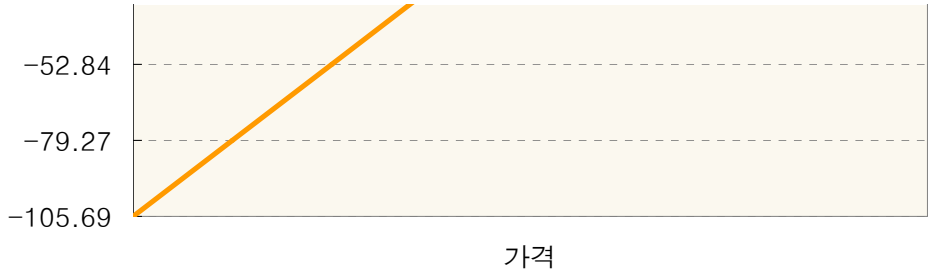
2. 만기시점의 손익구조

HCX5-HKG Hang Seng China Enterprises Index FU



MHCX5-HKG MINI HANG SENG CHINA H-SHR IDX Fu NO





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCX5	HKG Hang Seng China Enterprises Index FU	725
MHCX5	HKG MINI HANG SENG CHINA H-SHR IDX Fu NO	8

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

(단위:백만원)

941

공시일	2015-11-04
기준일	2015-11-03

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	31,207	0	31,207	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO00(신한MXWO 미래S 0521	2,494

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,832

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2015-11-04
기준일	2015-11-03

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	3

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

8

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2015-11-04
기준일	2015-11-03

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	468
SWCSI50000 신한CSI500미래S09092	145

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,613

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2015-11-04
기준일	2015-11-03

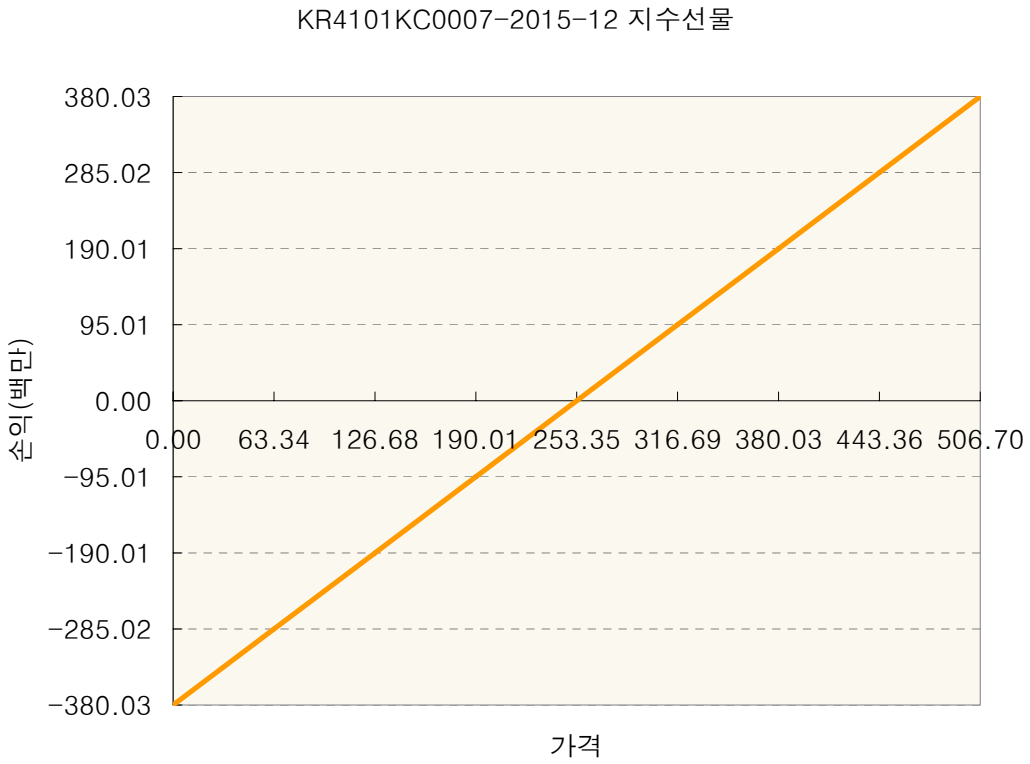
KOSPI200스마트레버리지목표전환

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	380	0	380	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	2015-11-04
기준일	2015-11-03

메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

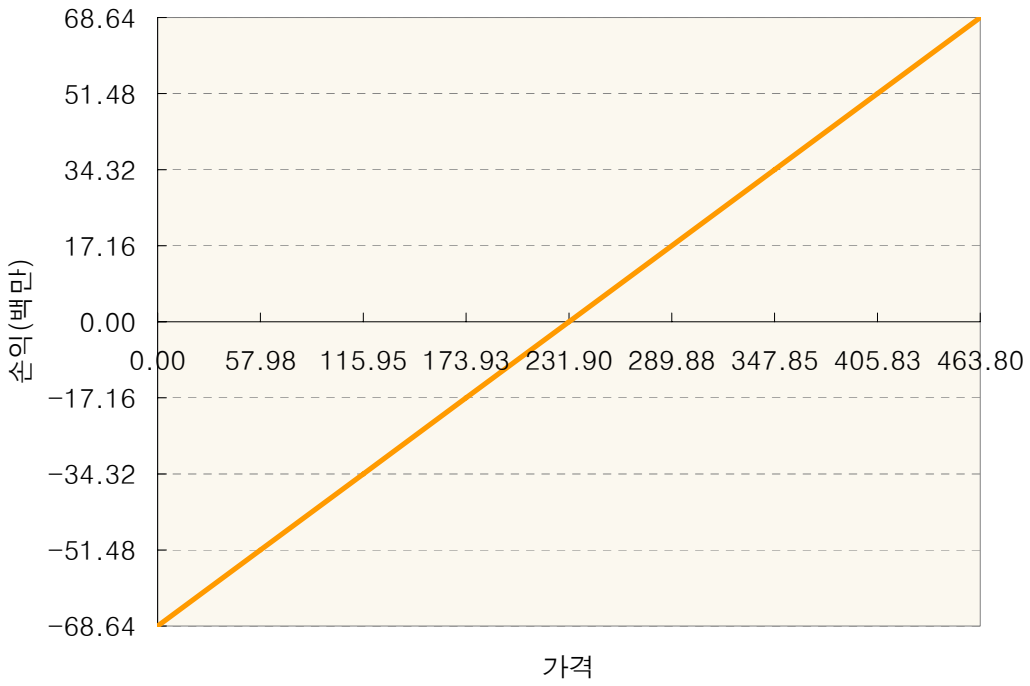
1. 계약금액

(단위:백만원)

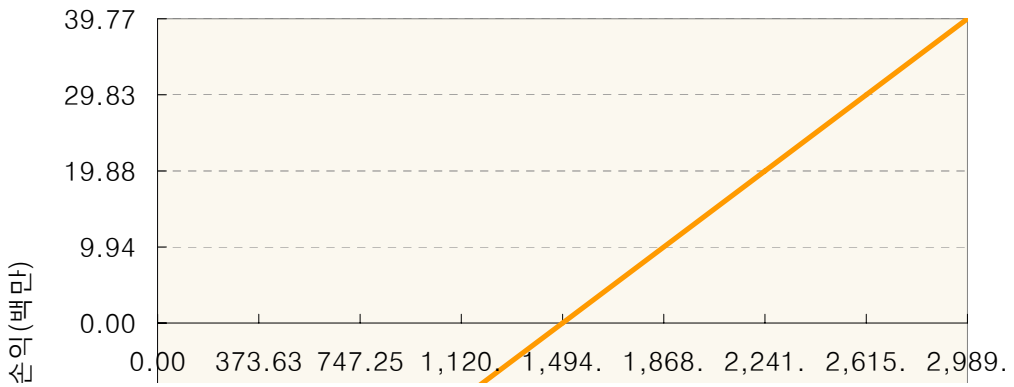
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	37	0	37	
누계	유가증권	선물	555	244	311	

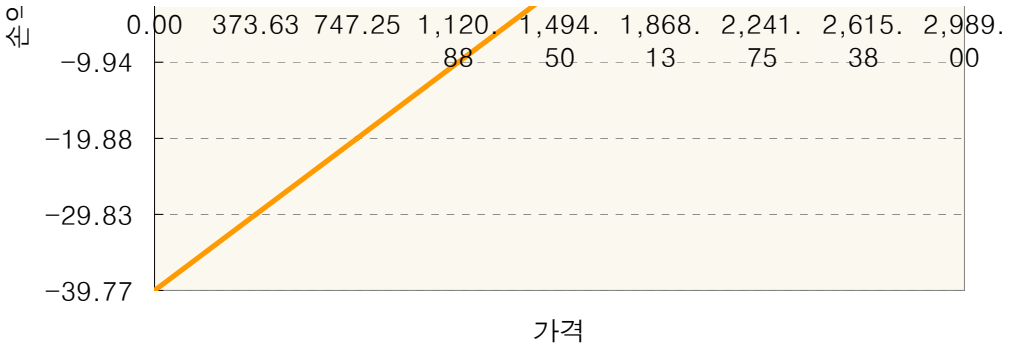
2. 만기시점의 손익구조

HGZ5-COPPER FUTURE DEC15

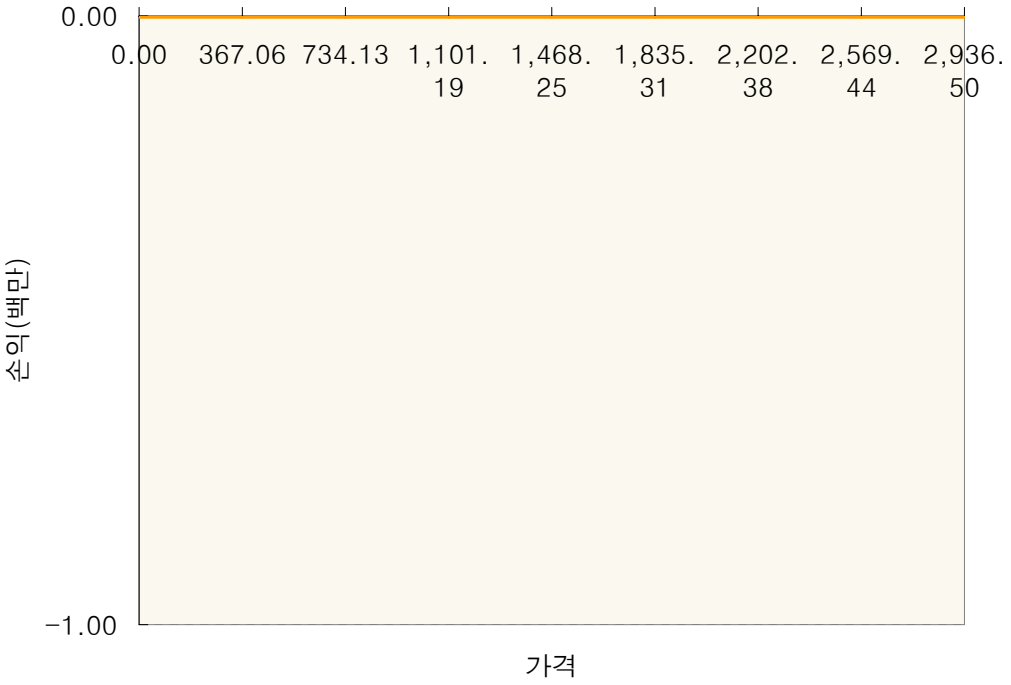


LAF6-LME PRI ALUM FUTR JAN16

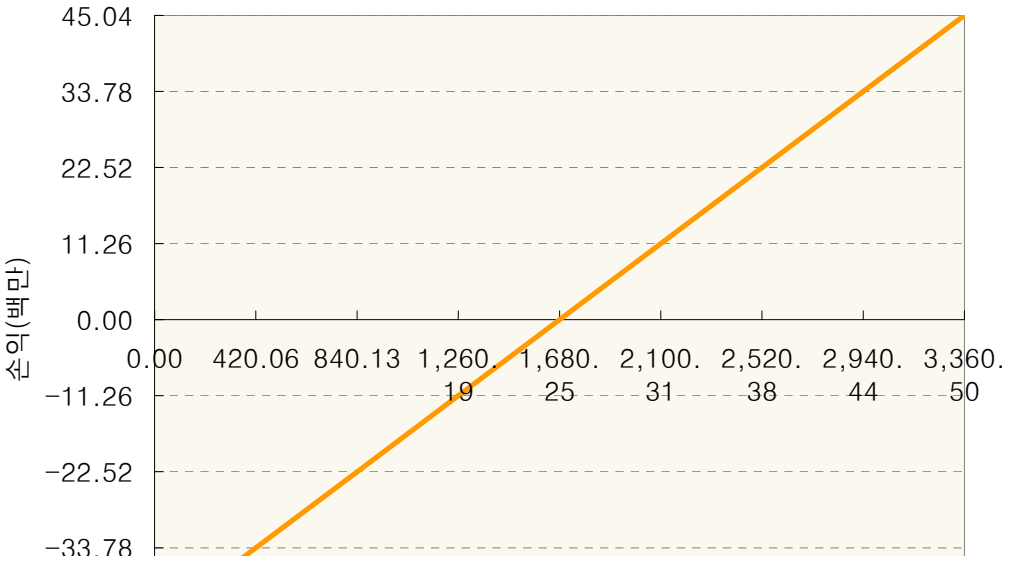


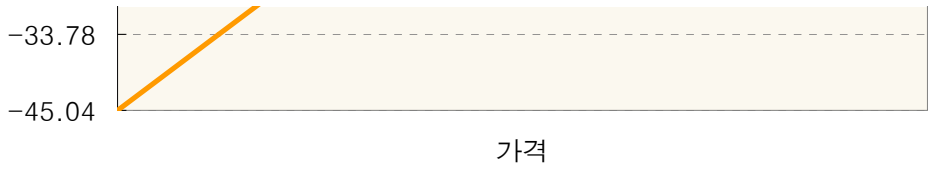


LAX5-LME PRI ALUM FUTR NOV15

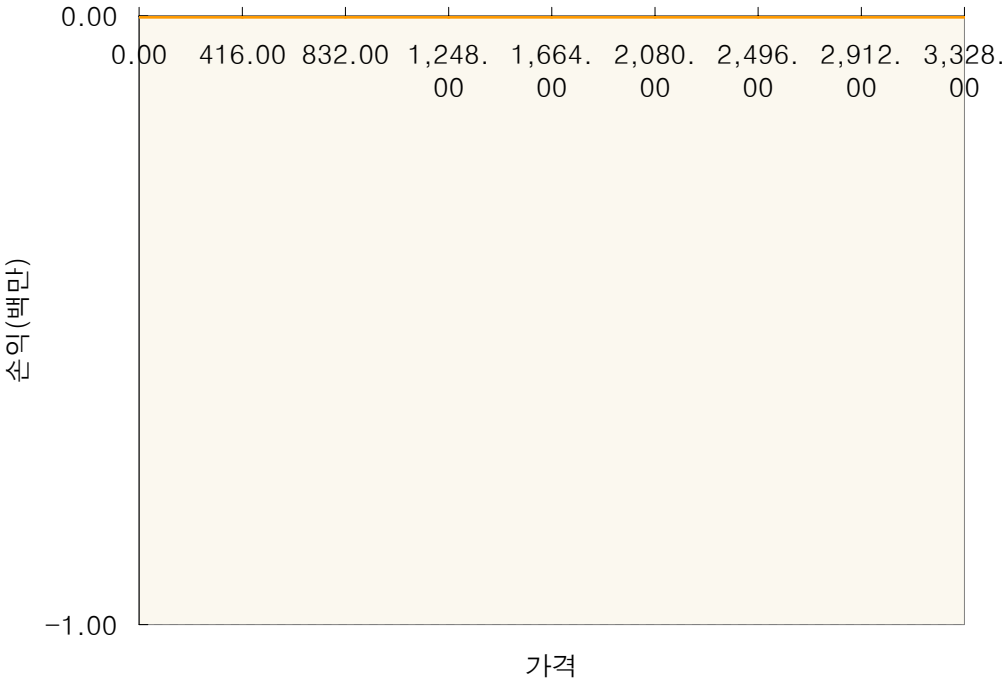


LXF6-LME ZINC FUTURE JAN16

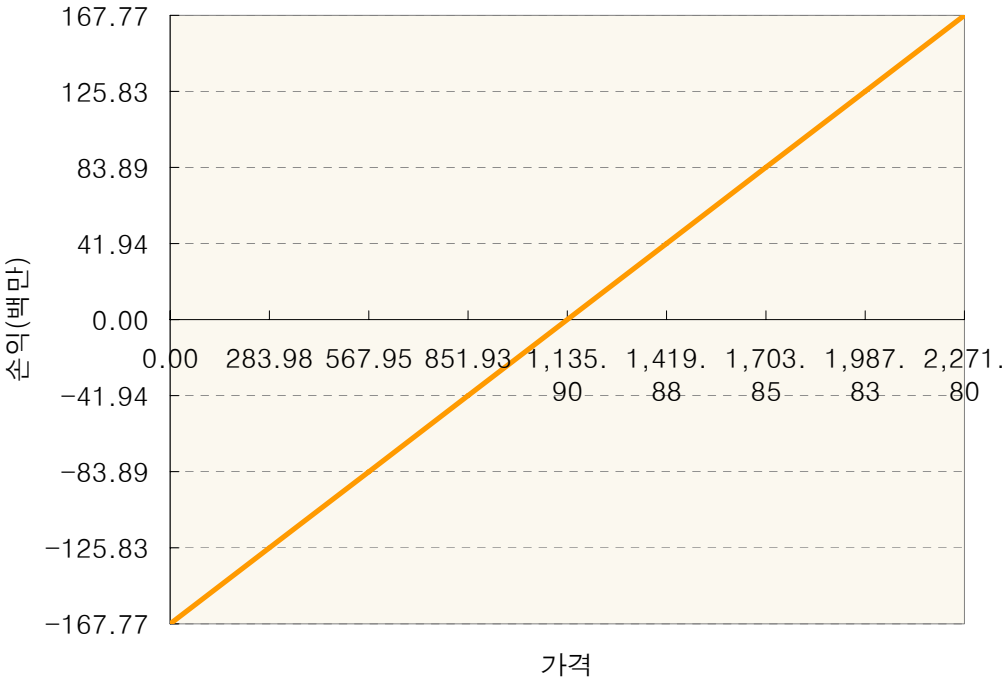


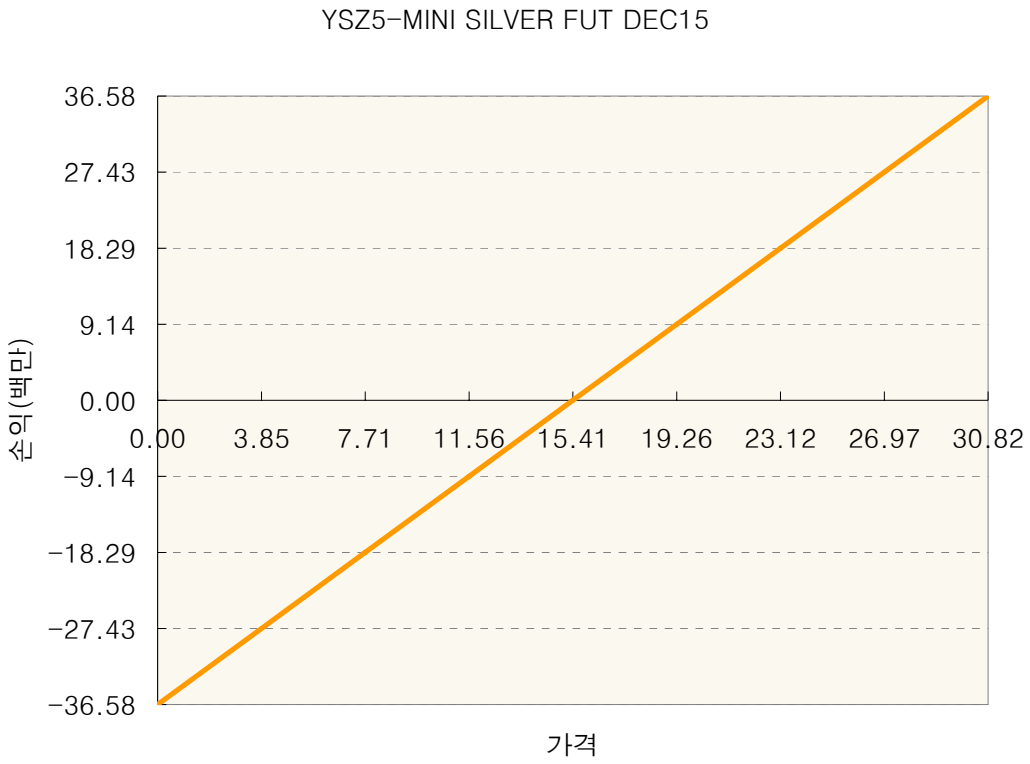


LXX5-LME ZINC FUTURE NOV15



XGZ5-MINI GOLD FUTURE DEC15





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGZ5	COPPER FUTURE DEC15	5
LAF6	LME PRI ALUM FUTR JAN16	3
LAX5	LME PRI ALUM FUTR NOV15	0.4
LXF6	LME ZINC FUTURE JAN16	4
LXX5	LME ZINC FUTURE NOV15	0.4
XGZ5	MINI GOLD FUTURE DEC15	13
YSZ5	MINI SILVER FUT DEC15	3

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

(단위:백만원)

27

공시일	2015-11-04
기준일	2015-11-03

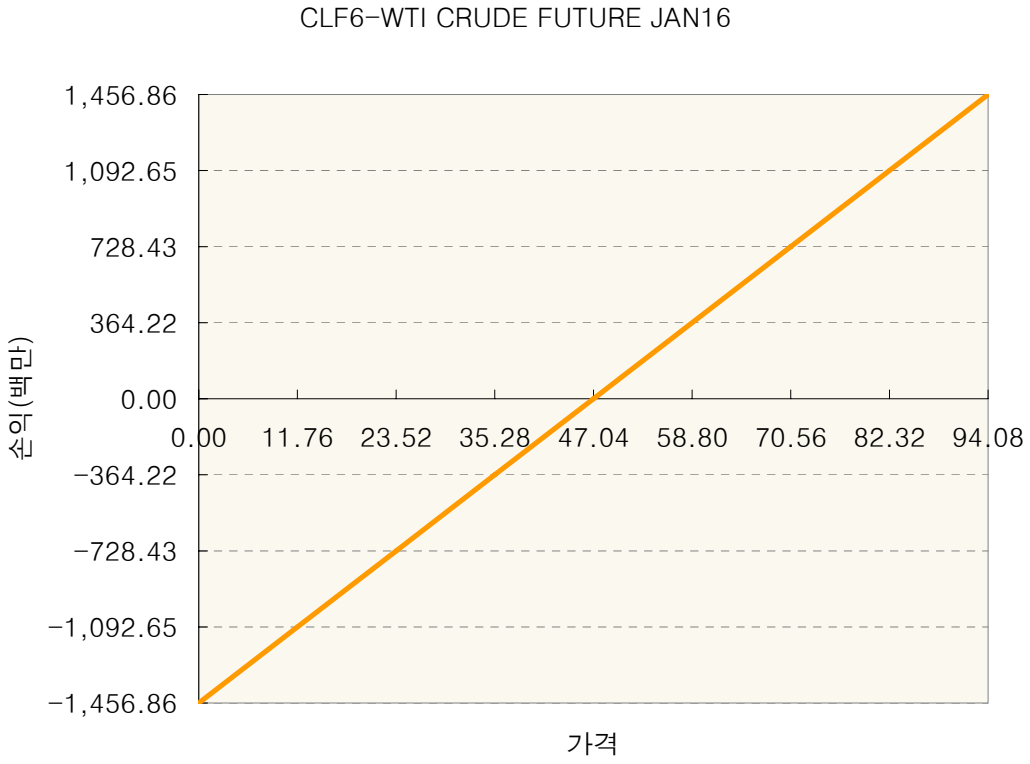
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

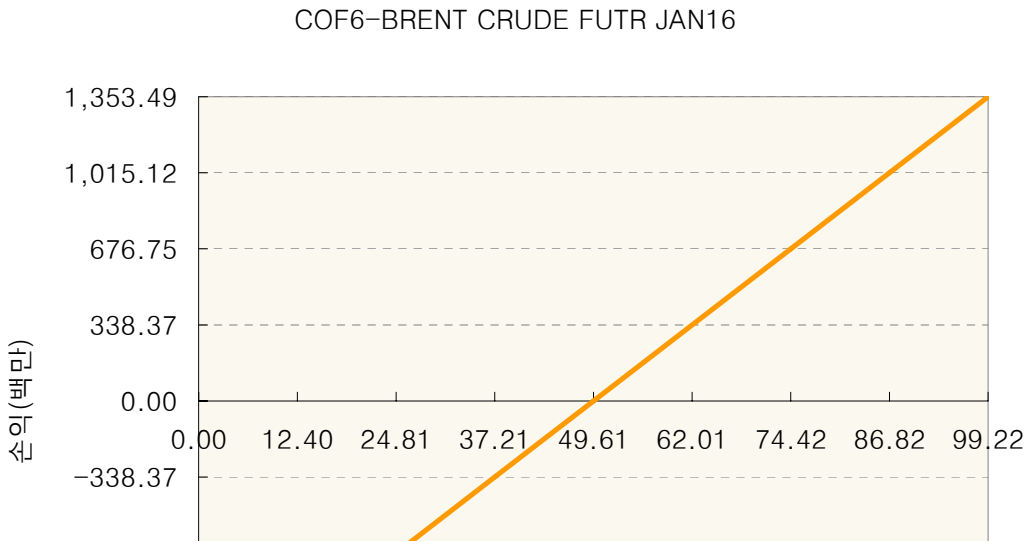
1. 계약금액

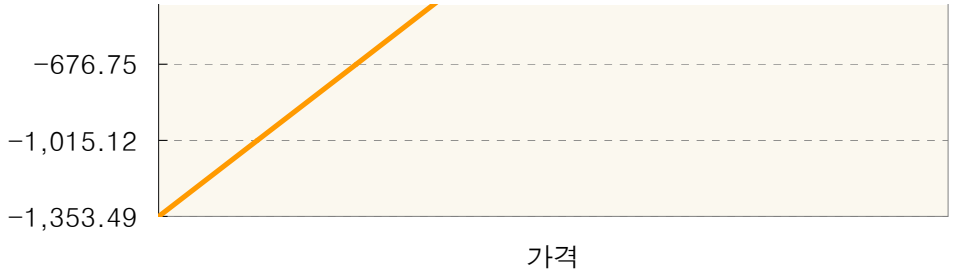
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,735	0	5,735	

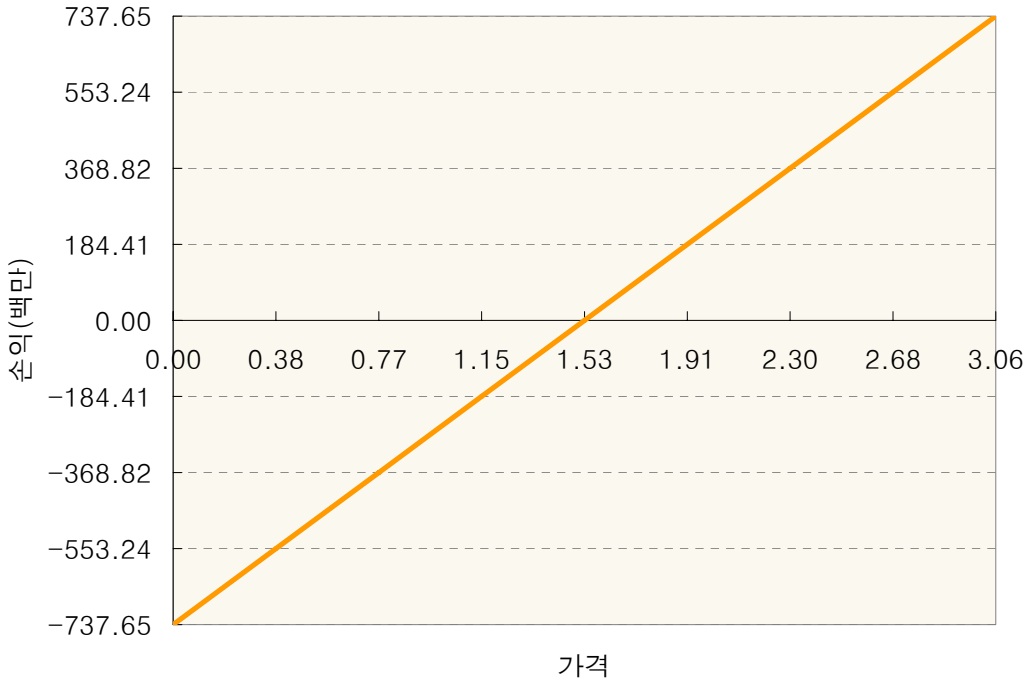
2. 만기시점의 손익구조



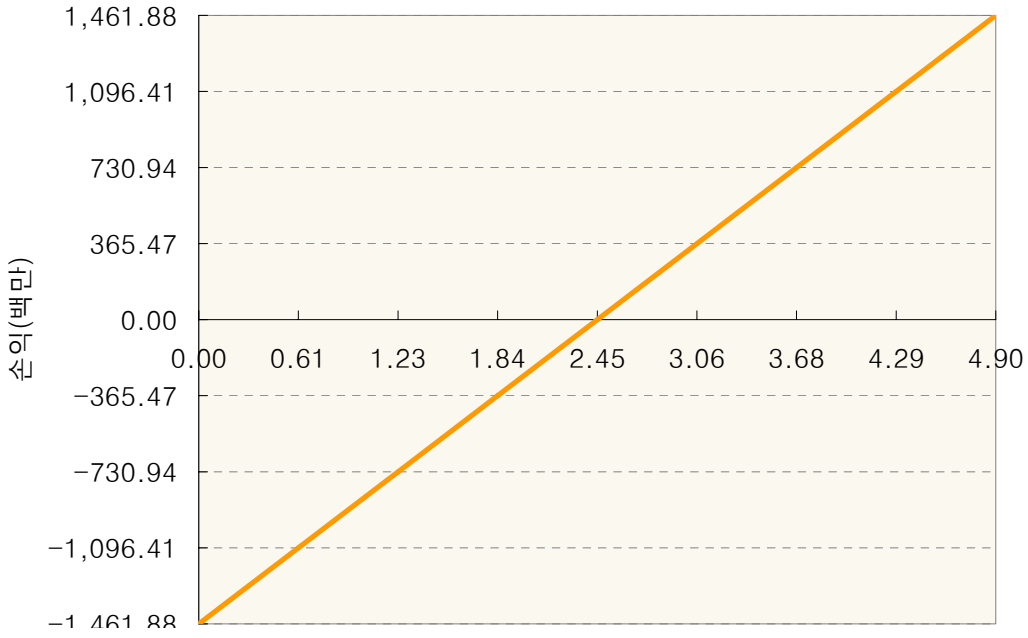


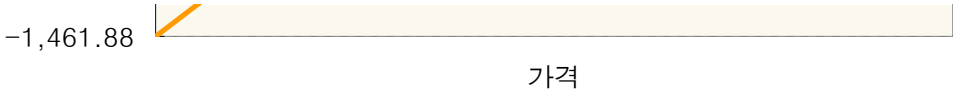


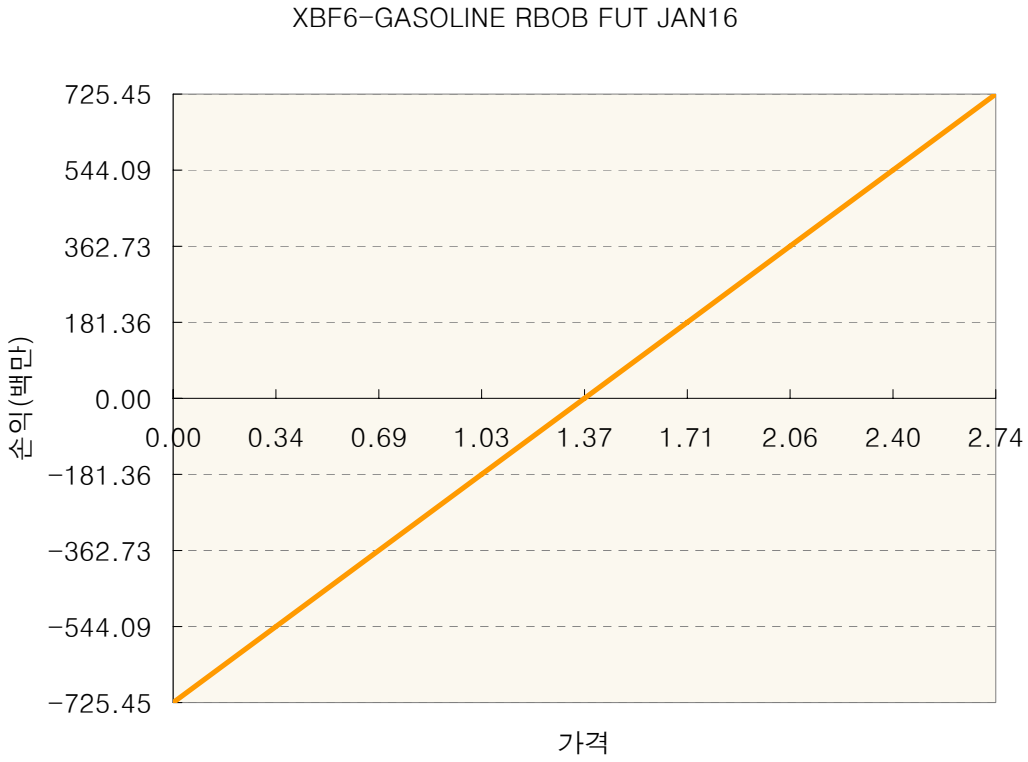
HOF6-NY Harb ULSD Fut JAN16



NGF6-NATURAL GAS FUTR JAN16







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLF6	WTI CRUDE FUTURE JAN16	117
COF6	BRENT CRUDE FUTR JAN16	108
HOF6	NY Harb ULSD Fut JAN16	59
NGF6	NATURAL GAS FUTR JAN16	117
XBF6	GASOLINE RBOB FUT JAN16	58

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

(단위:백만원)

1,188

공시일	2015-11-04
기준일	2015-11-03

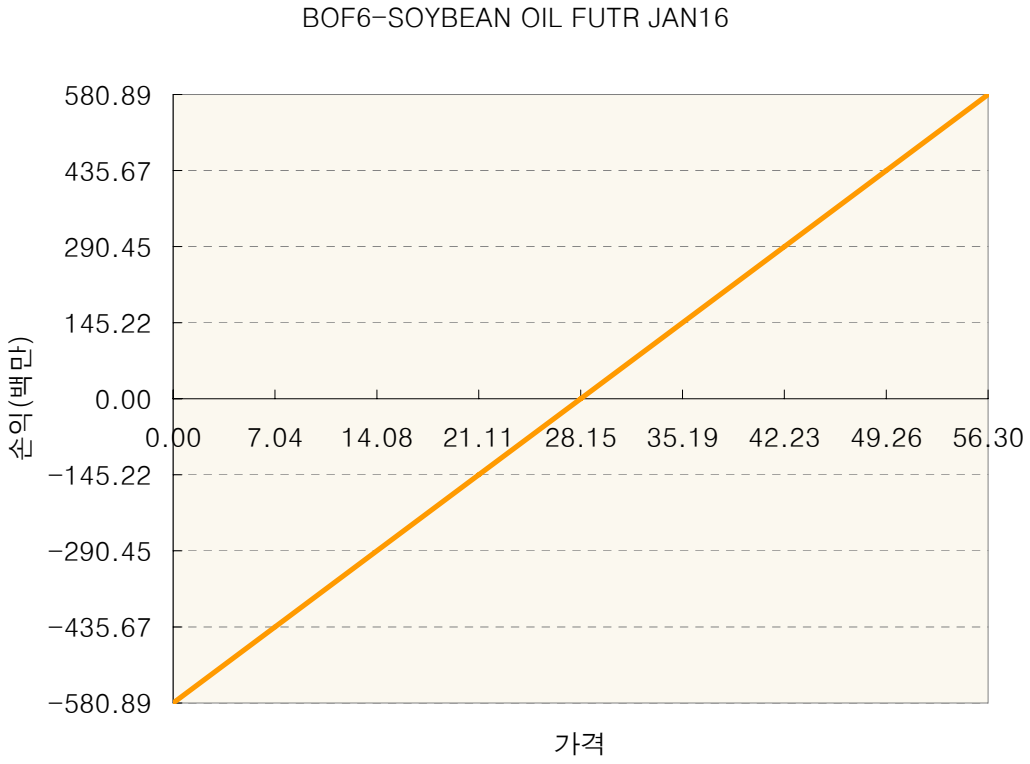
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

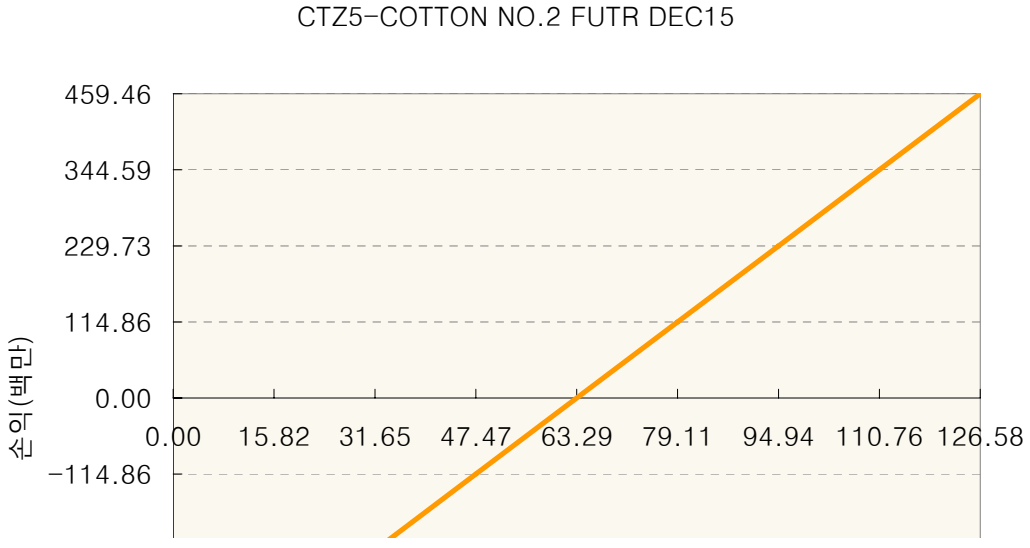
1. 계약금액

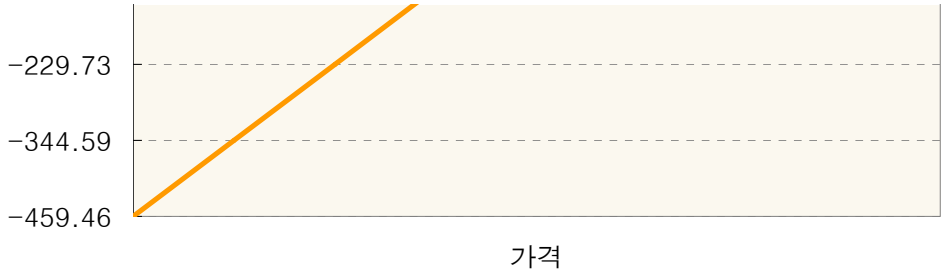
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,975	0	6,975	

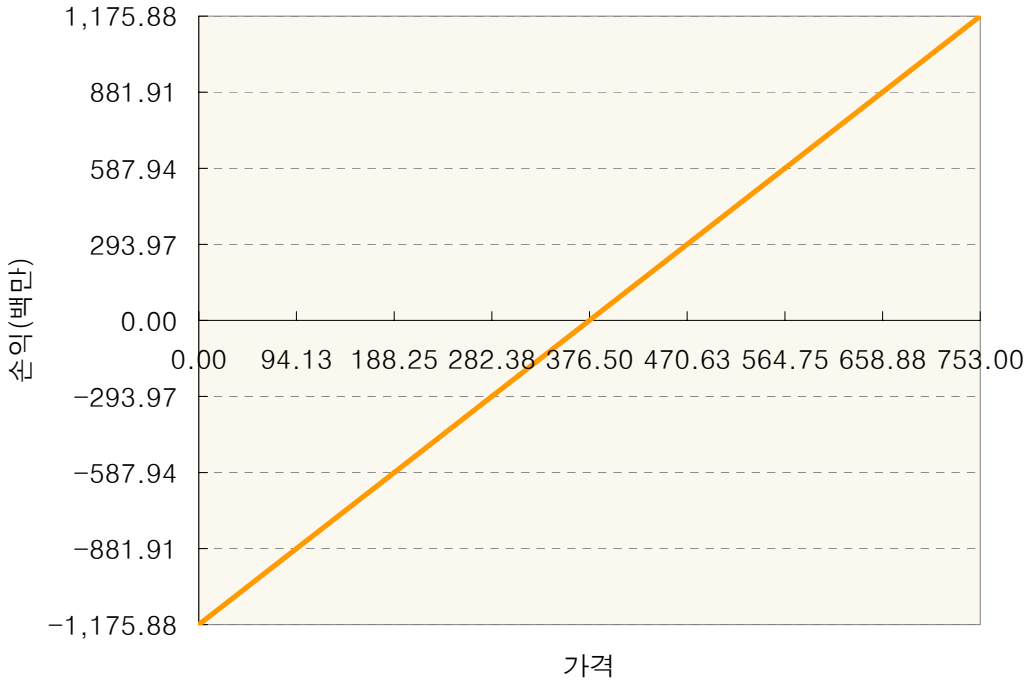
2. 만기시점의 손익구조



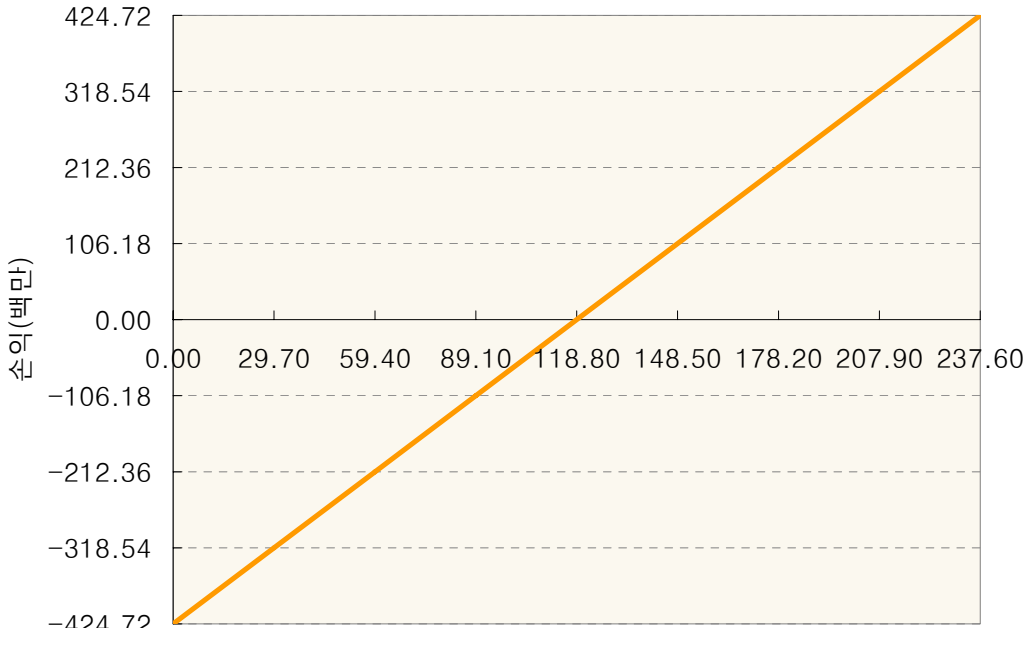


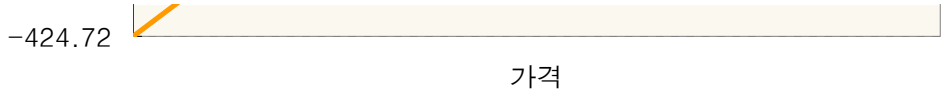


CZ5-CORN FUTURE DEC15

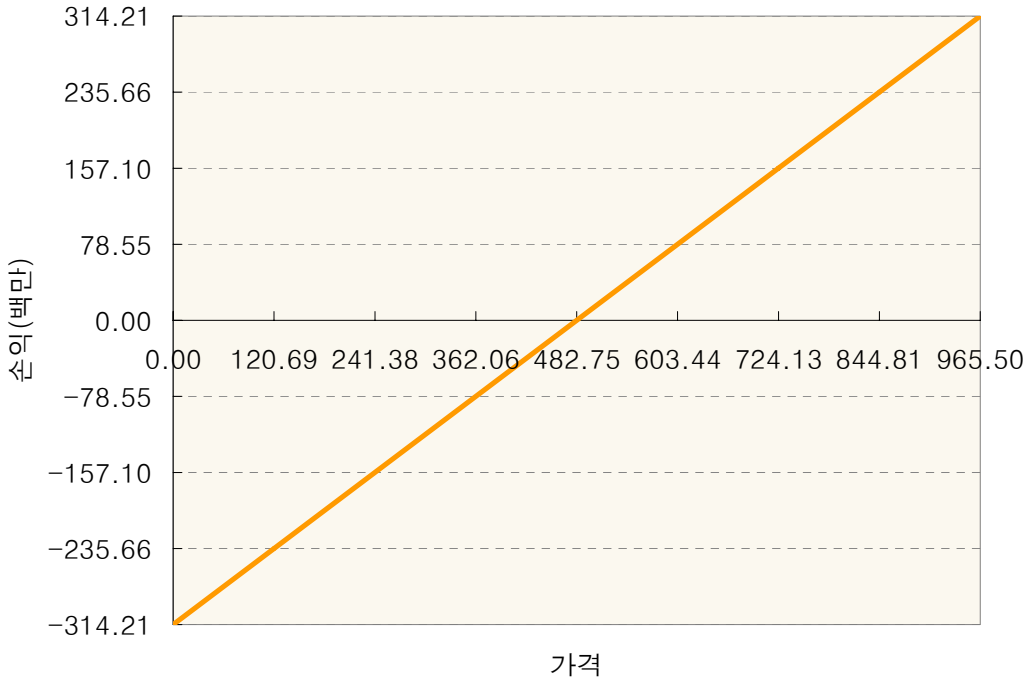


KCZ5-COFFEE "C" FUTURE DEC15

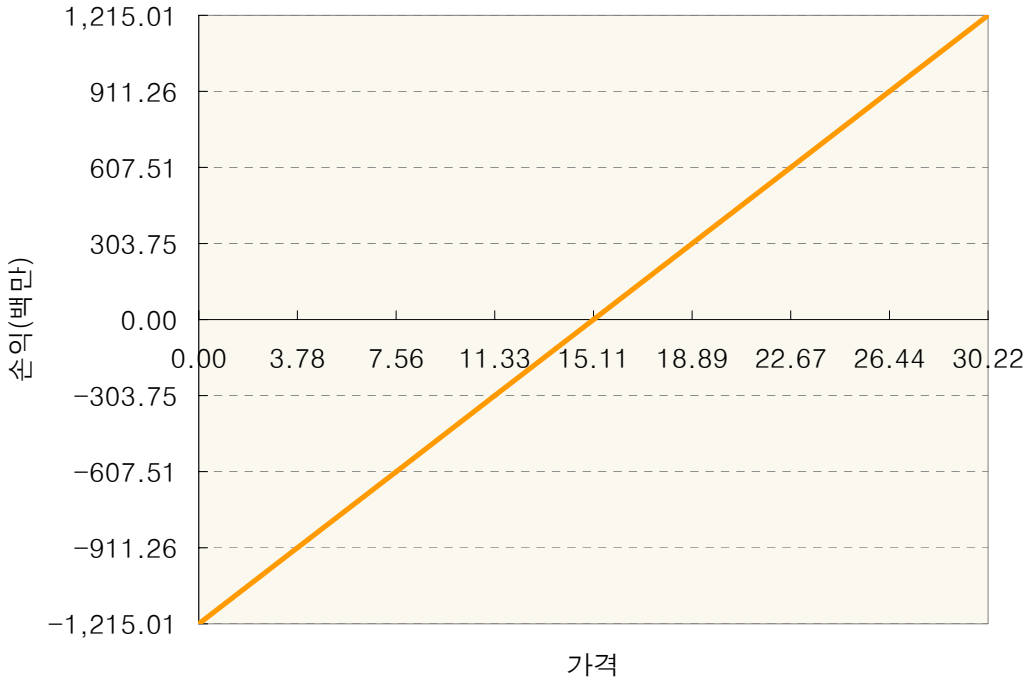




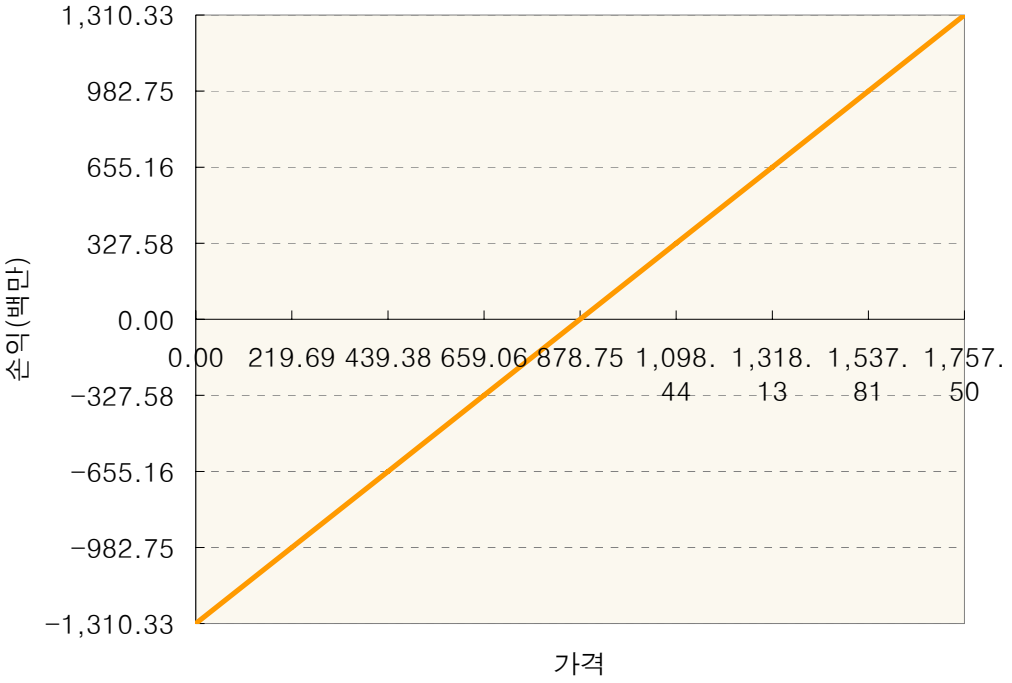
KWZ5-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) DEC15



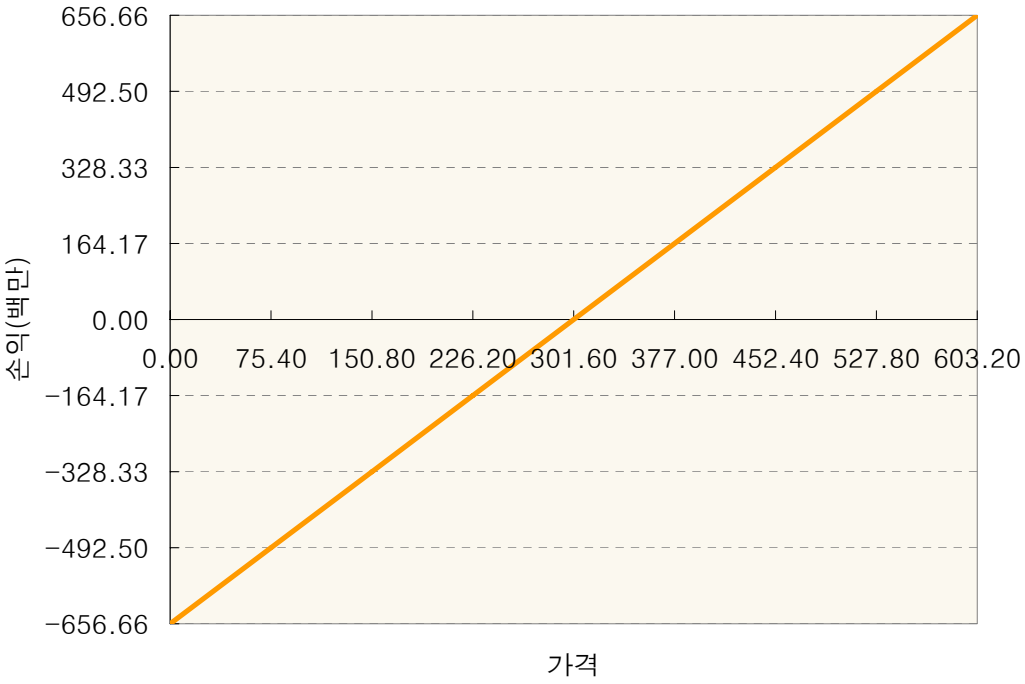
SBH6-Sugar #11 (WORLD) MAR16



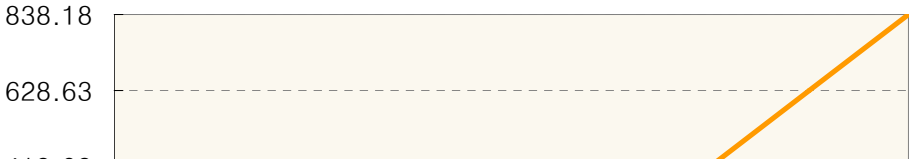
SF6-SOYBEAN FUTURE JAN16

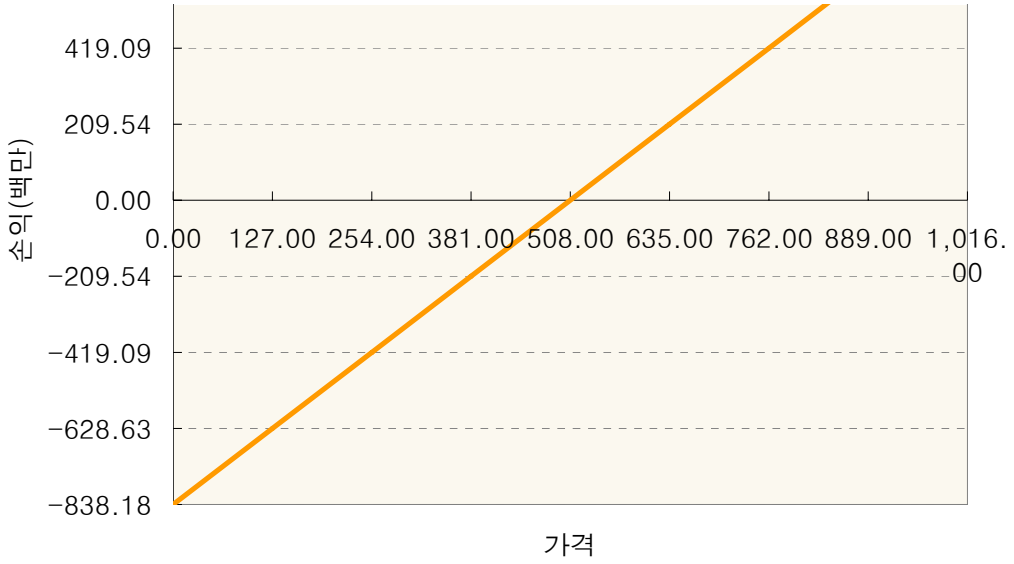


SMF6-SOYBEAN MEAL FUTR JAN16



WZ5-WHEAT FUTURE(CBT) DEC15





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF6	SOYBEAN OIL FUTR JAN16	46
CTZ5	COTTON NO.2 FUTR DEC15	37
CZ5	CORN FUTURE DEC15	94
KCZ5	COFFEE "C" FUTURE DEC15	34
KWZ5	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) DEC15	25
SBH6	Sugar #11 (WORLD) MAR16	97
SF6	SOYBEAN FUTURE JAN16	105
SMF6	SOYBEAN MEAL FUTR JAN16	53
WZ5	WHEAT FUTURE(CBT) DEC15	67

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

(단위:백만원)

797