공시일	2015-11-19
기준일	2015-11-18

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	2015-11-19
기준일	2015-11-18

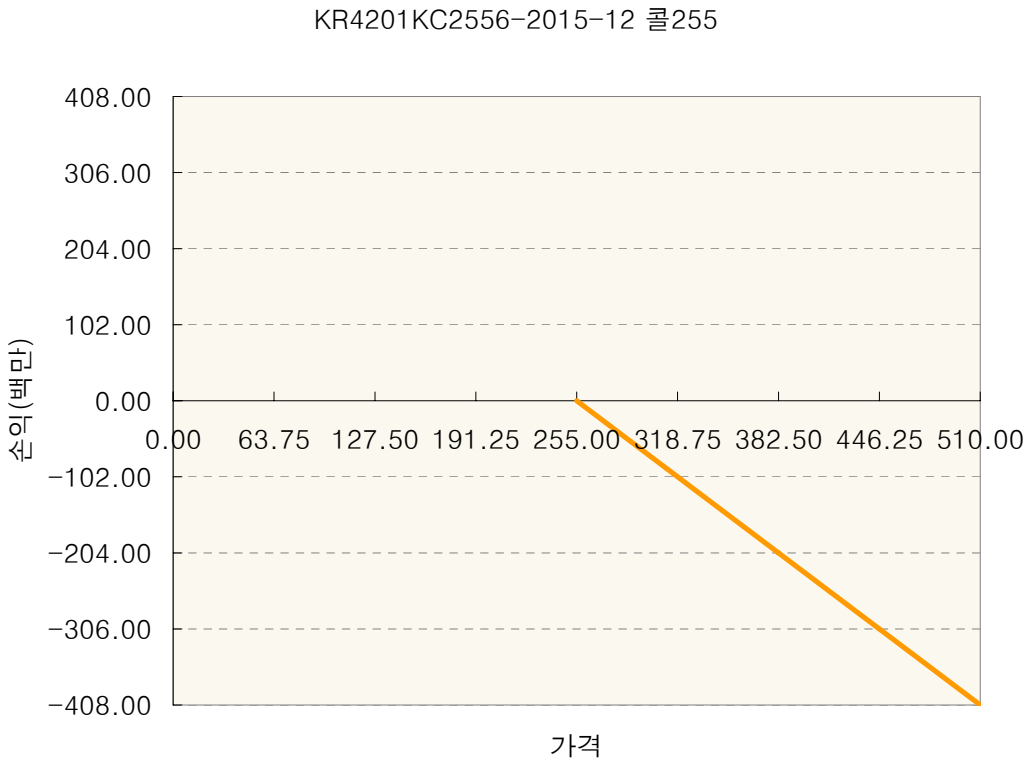
차곡차곡플러스모(주식혼합-파생)

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	408	-408	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201KC25 2015-12 콜255 62

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2	2	2	2	2	2	2
-5.33%	2	2	2	2	2	2	2
-2.67%	2	2	2	2	1	1	1
0%	1	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-2	-3	-5	-7	-8	-10	-12
5.33%	-17	-19	-22	-24	-26	-29	-31
8.00%	-50	-52	-54	-56	-58	-60	-62

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

36

공시일	2015-11-19
기준일	2015-11-18

스마트인덱스모

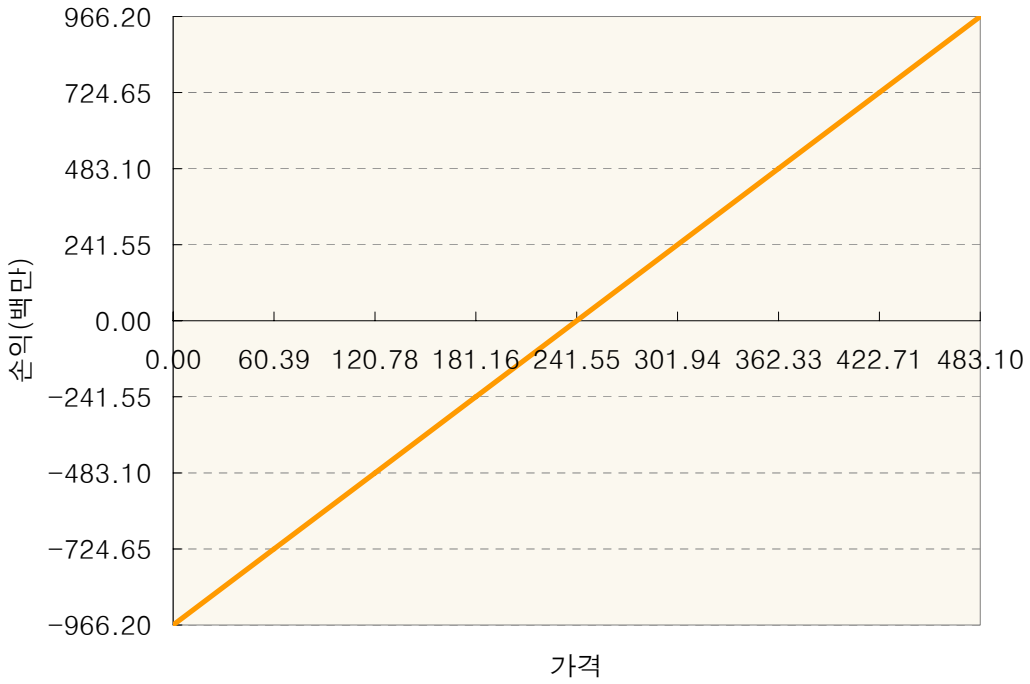
1. 계약금액

(단위:백만원)

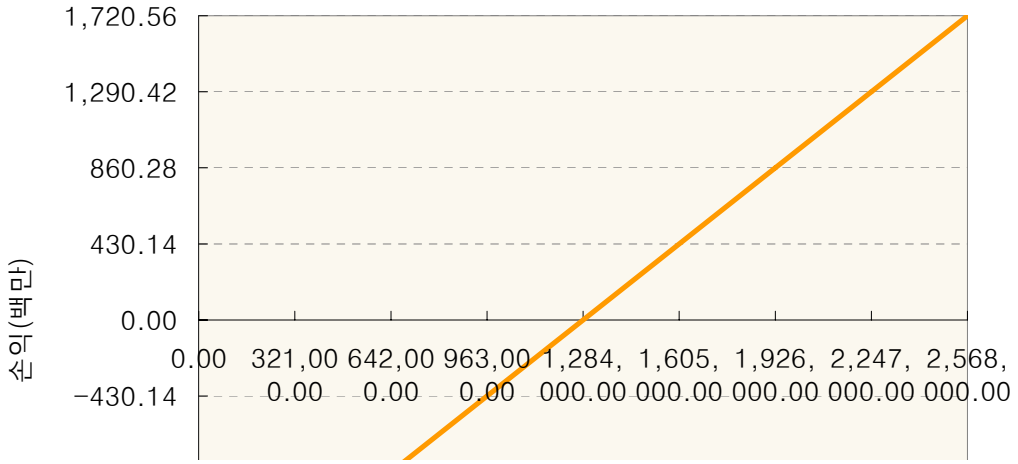
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,687	0	2,687	장내

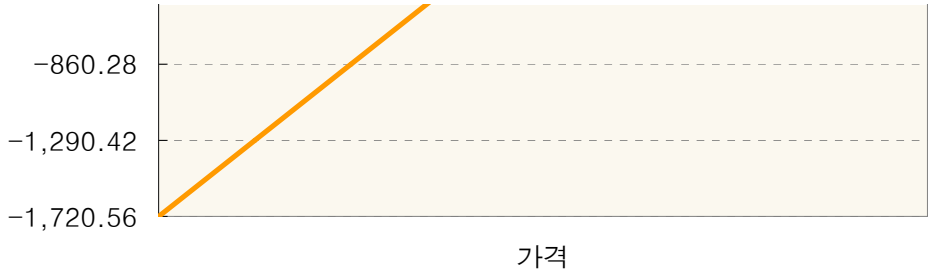
2. 만기시점의 손익구조

KR4101KC0007-2015-12 지수선물



KR4111KC0005-2015-12 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101KC0C 2015-12 지수선물							77
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
-5.33%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
-2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	26	26	26	26	26	26	26
5.33%	52	52	52	52	52	52	52
8.00%	77	77	77	77	77	77	77
KR4111KC0C 2015-12 삼성전자개별선물							137
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-137	-137	-137	-137	-137	-137	-137
-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%	137	137	137	137	137	137	137

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

(단위:백만원)

171

공시일	2015-11-19
기준일	2015-11-18

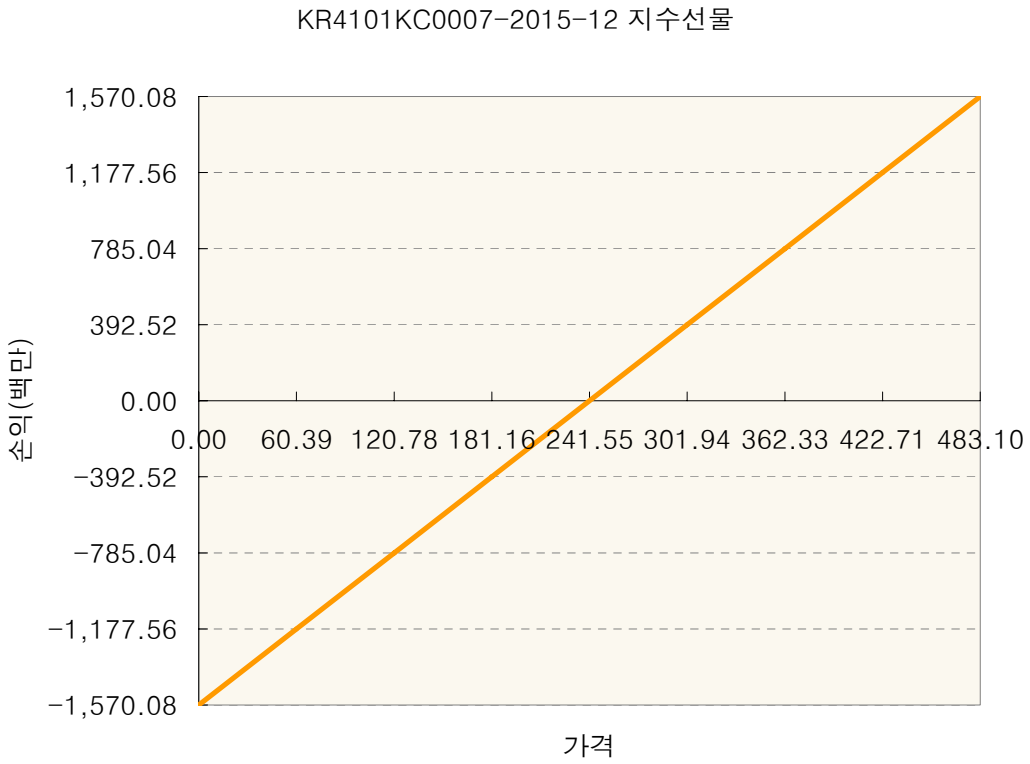
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,570	0	1,570	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101KC0C 2015-12 지수선물 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)

92

공시일	2015-11-19
기준일	2015-11-18

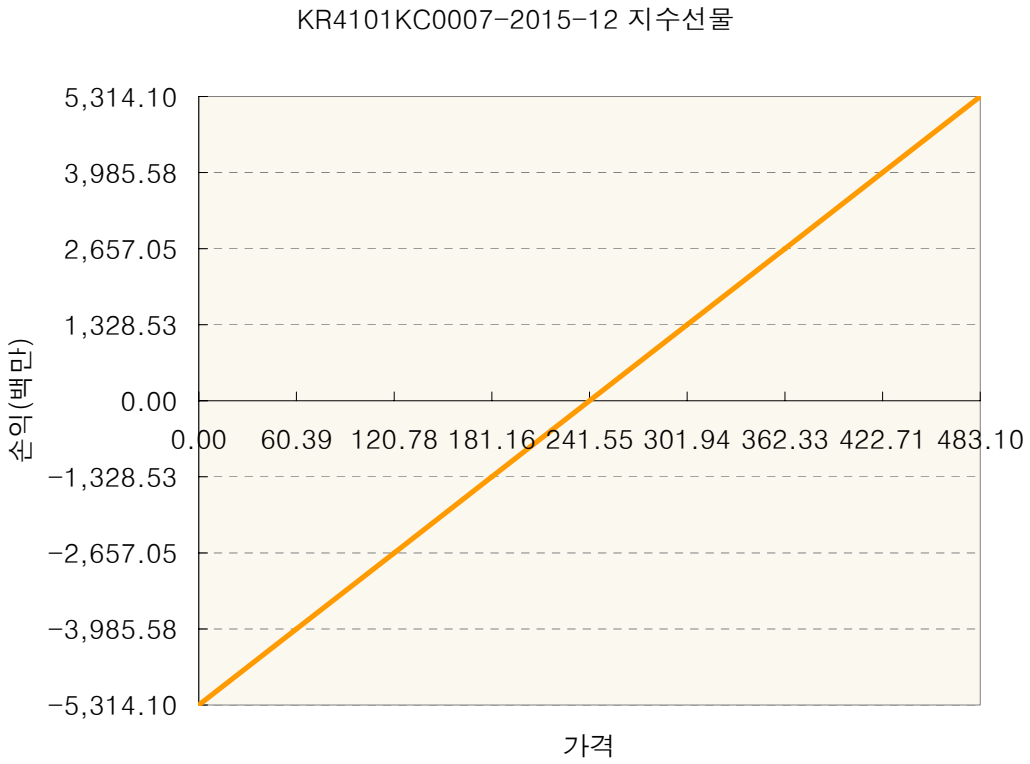
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	121	-121	장내
누계	유가증권	선물	5,314	0	5,314	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101KC0C 2015-12 지수선물							425
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-425	-425	-425	-425	-425	-425	-425
-5.33%	-283	-283	-283	-283	-283	-283	-283
-2.67%	-142	-142	-142	-142	-142	-142	-142
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	142	142	142	142	142	142	142
5.33%	283	283	283	283	283	283	283
8.00%	425	425	425	425	425	425	425

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	311

공시일	2015-11-19
기준일	2015-11-18

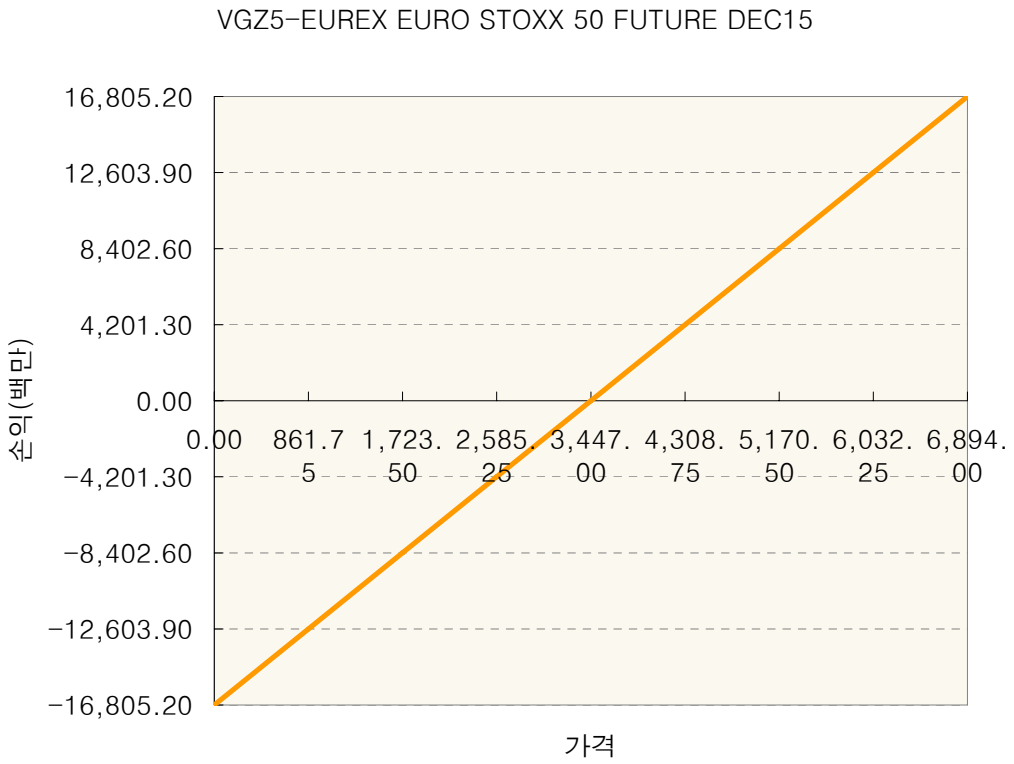
유로인덱스1호(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	16,805	0	16,805	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ5	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE DEC15	1,344

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

(단위:백만원)

1,461

공시일	2015-11-19
기준일	2015-11-18

아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

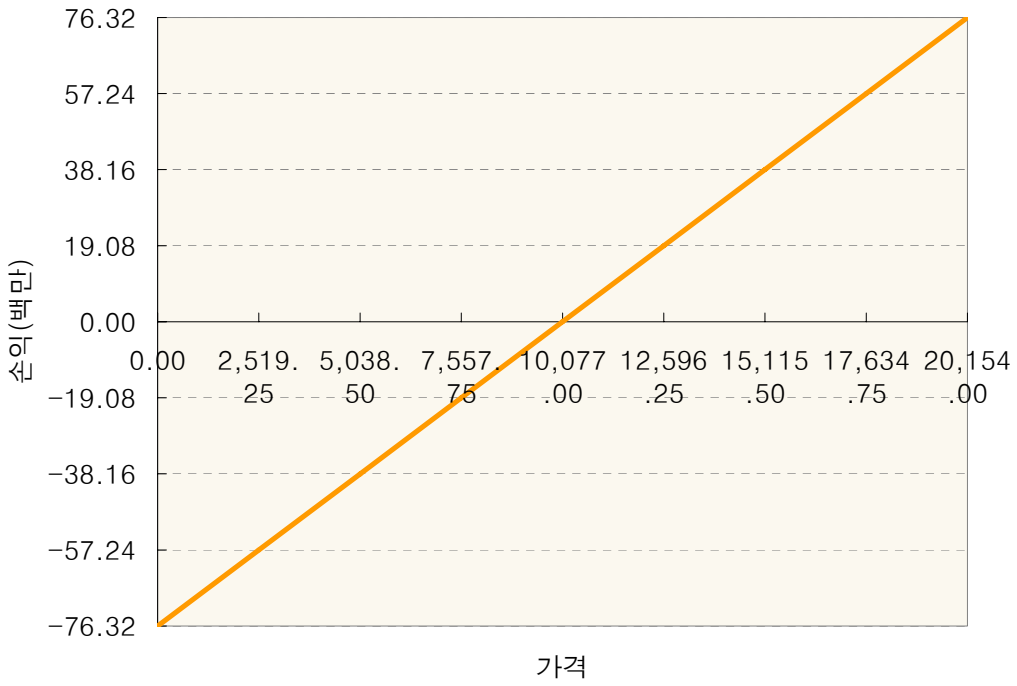
1. 계약금액

(단위:백만원)

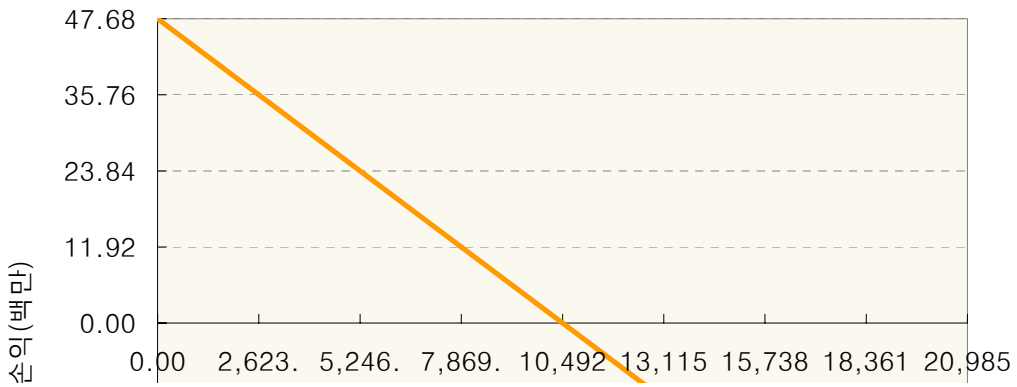
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	48	-48	
누계	유가증권	선물	76	0	76	장내

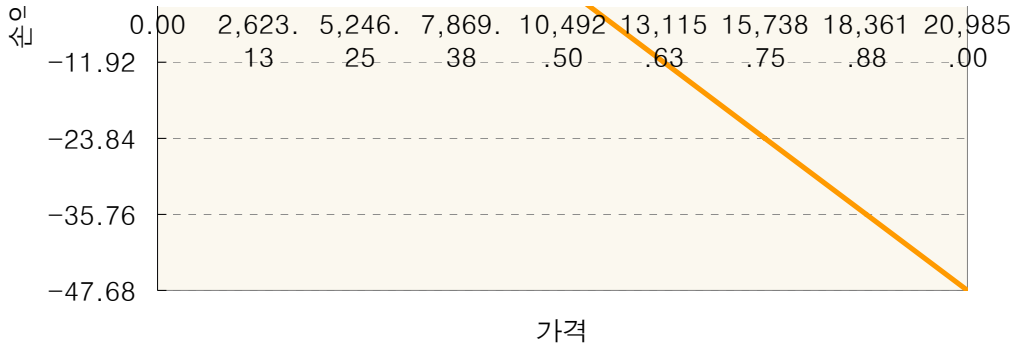
2. 만기시점의 손익구조

HCX5-HKG Hang Seng China Enterprises Index Fu



XUX5-SGX FTSE CHINA A50 FUTURE CONTRACT NOV





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCX5	HKG Hang Seng China Enterprises Index Fu	6
XUX5	SGX FTSE CHINA A50 FUTURE CONTRACT NOV	4

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

(단위:백만원)

16

공시일	2015-11-19
기준일	2015-11-18

차이나인덱스(주식-파생형)(종)

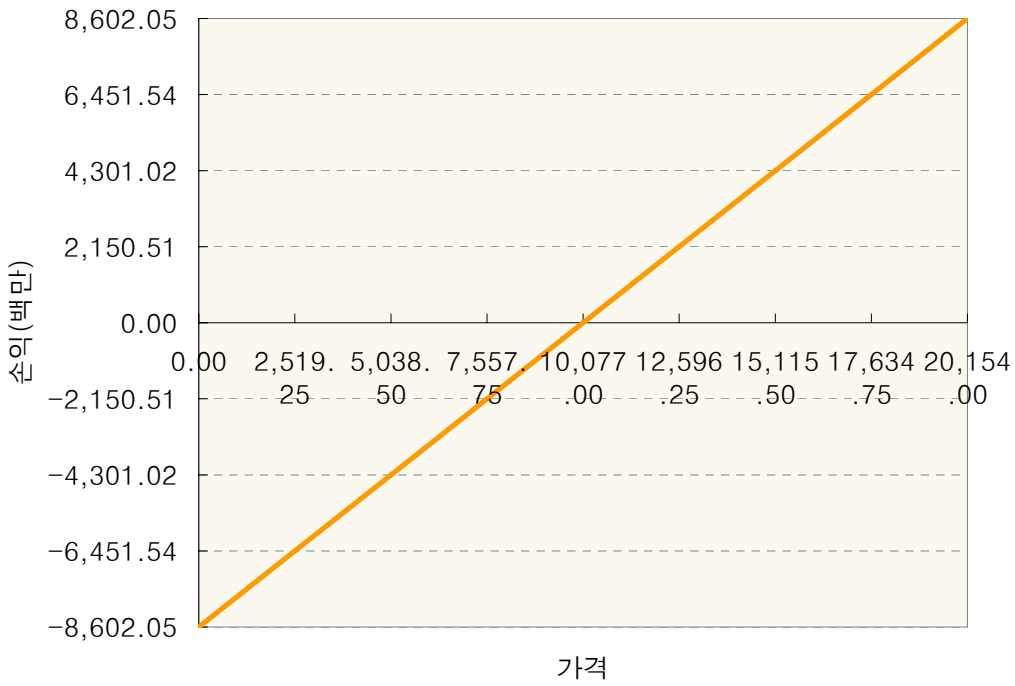
1. 계약금액

(단위:백만원)

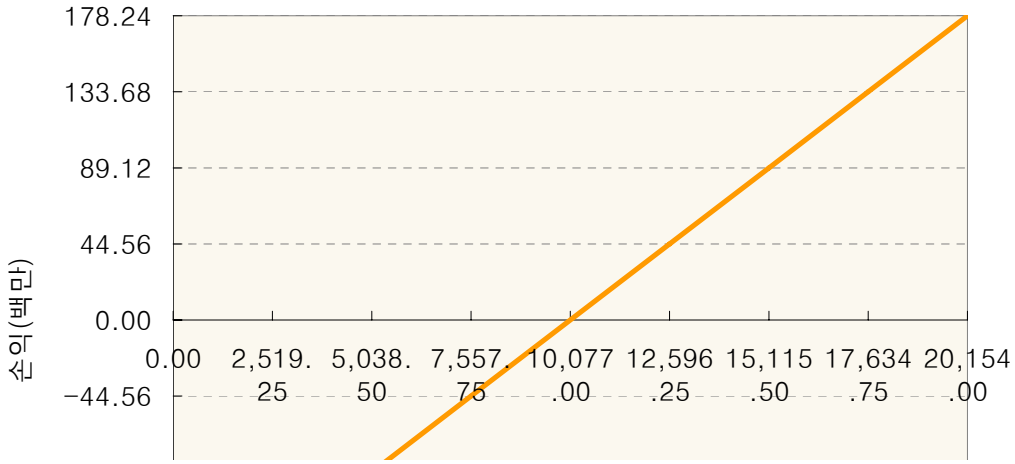
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,780	0	8,780	장내

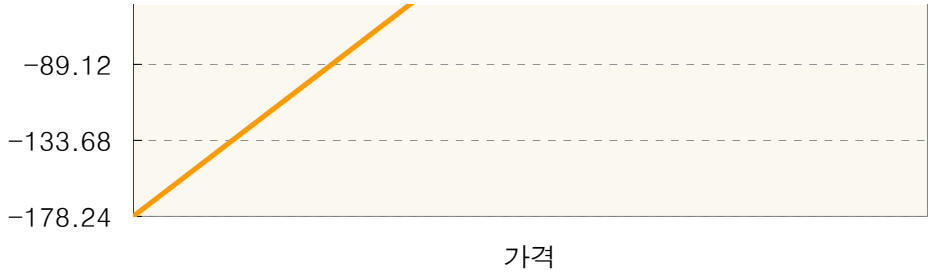
2. 만기시점의 손익구조

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	688
MHCX5	HKG MINI HANG SENG CHINA H-SHR IDX Fu NO	14

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

(단위:백만원)

906

공시일	2015-11-19
기준일	2015-11-18

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	15,951	0	15,951	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO00(신한MXWO 미래S 0521	1,248

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

926

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2015-11-19
기준일	2015-11-18

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	23

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

55

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2015-11-19
기준일	2015-11-18

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	507
SWCSI50000 신한CSI500미래S09092	156

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,754

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2015-11-19
기준일	2015-11-18

메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

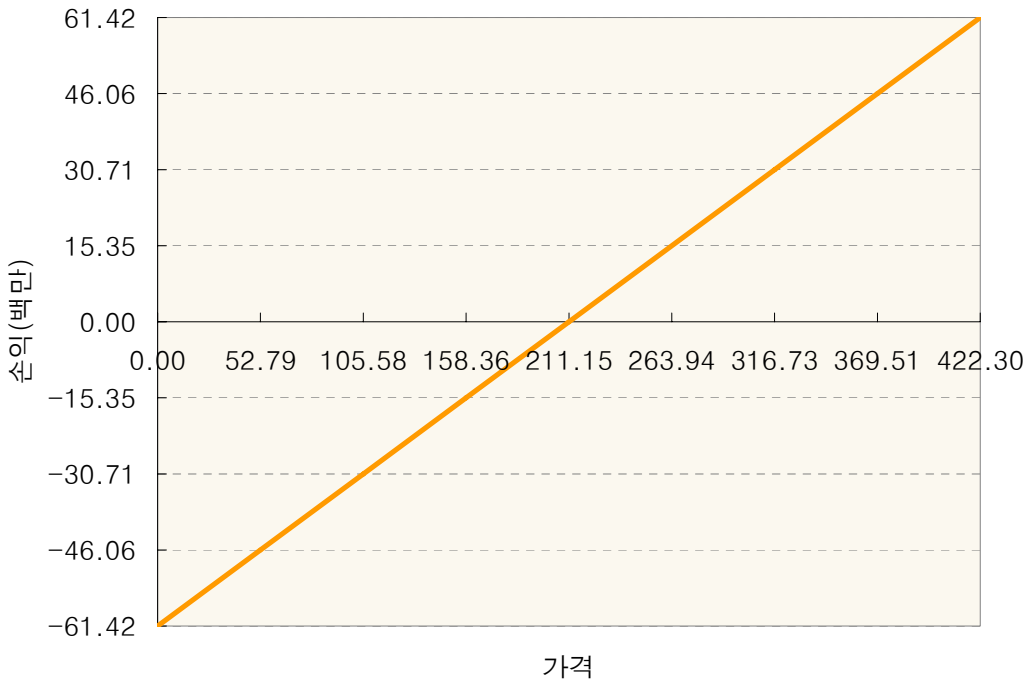
1. 계약금액

(단위:백만원)

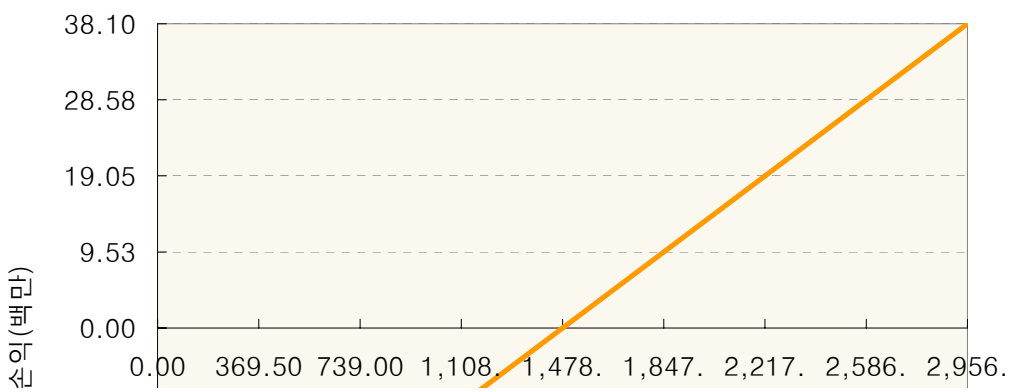
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	17	0	17	
누계	유가증권	선물	526	252	273	

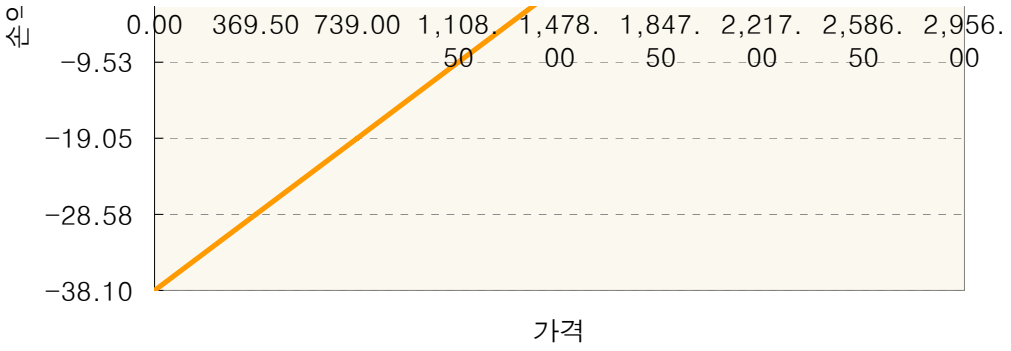
2. 만기시점의 손익구조

HGH6-COPPER FUTURE MAR16

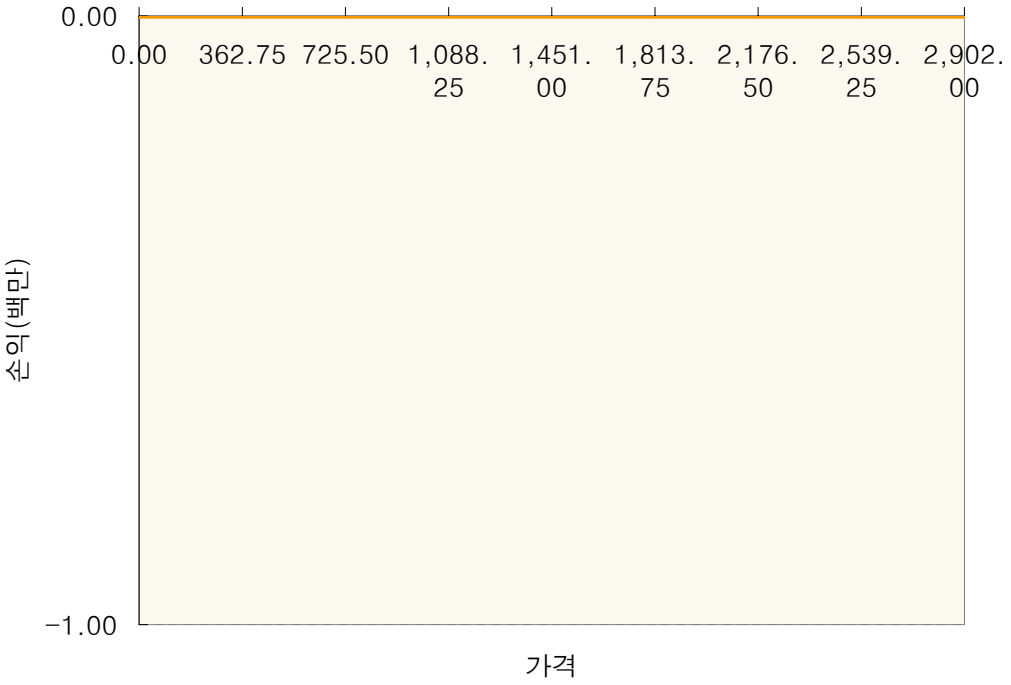


LAF6-LME PRI ALUM FUTR JAN16

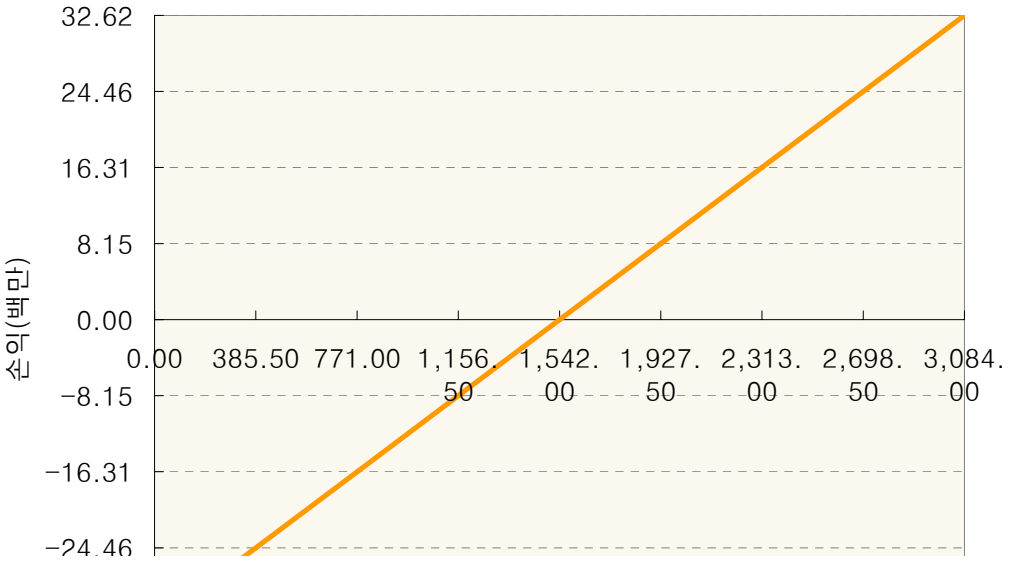


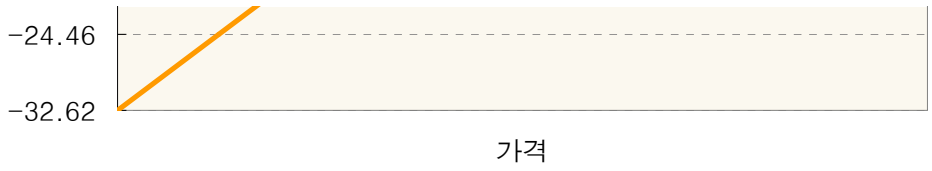


LAX5-LME PRI ALUM FUTR NOV15

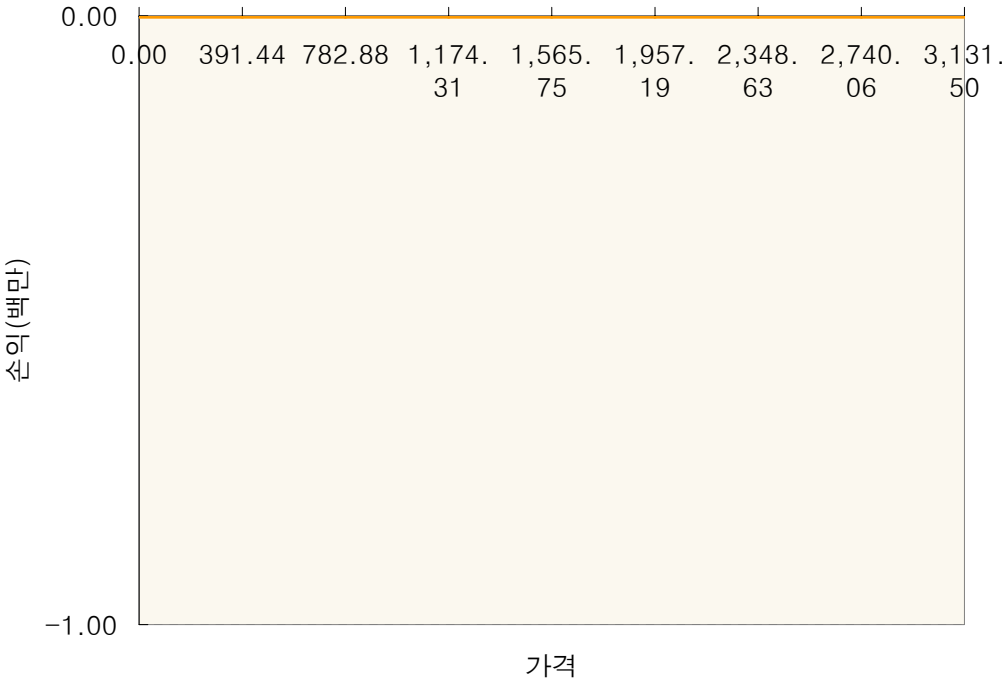


LXF6-LME ZINC FUTURE JAN16

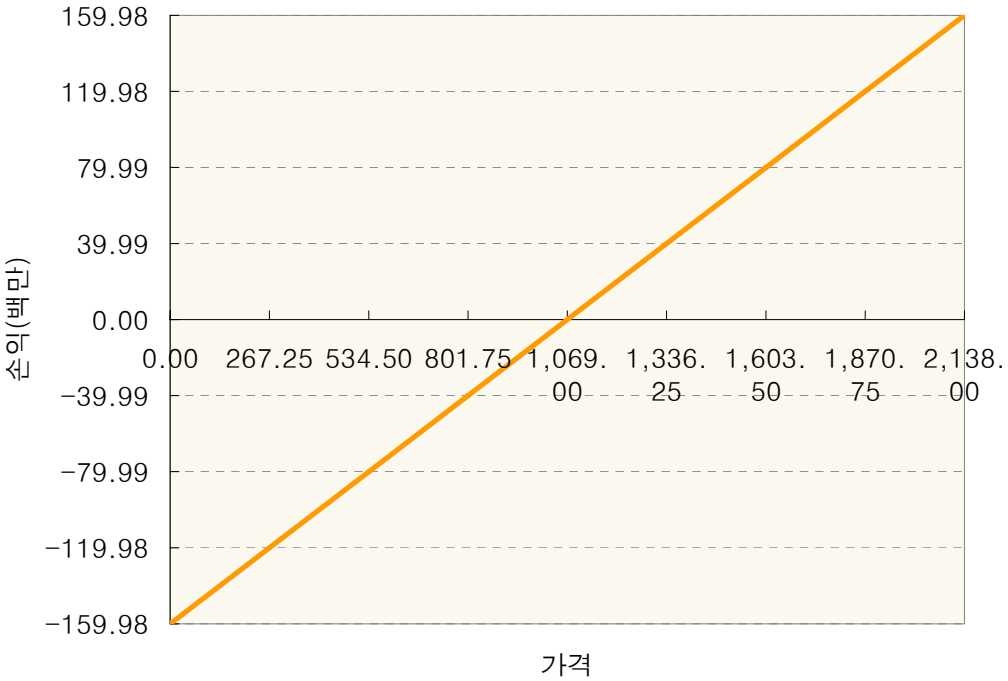


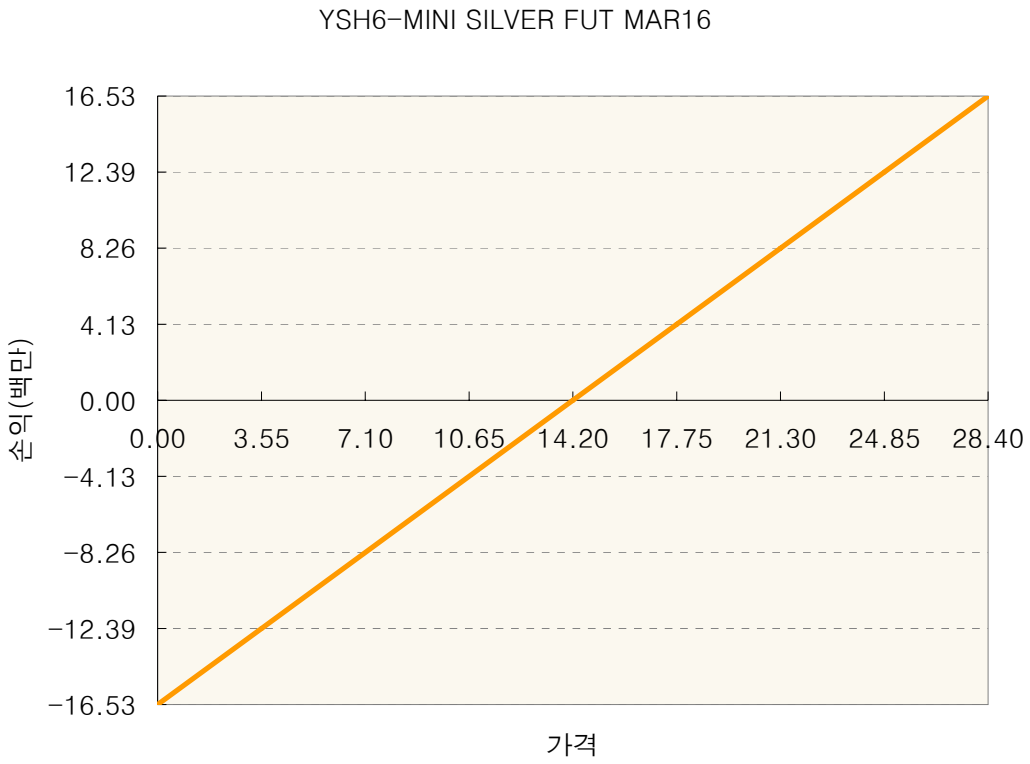


LXX5-LME ZINC FUTURE NOV15



XGG6-MINI GOLD FUTURE FEB16





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGH6	COPPER FUTURE MAR16	5
LAF6	LME PRI ALUM FUTR JAN16	3
LAX5	LME PRI ALUM FUTR NOV15	1
LXF6	LME ZINC FUTURE JAN16	3
LXX5	LME ZINC FUTURE NOV15	1
XGG6	MINI GOLD FUTURE FEB16	13
YSH6	MINI SILVER FUT MAR16	1

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

(단위:백만원)

24

공시일	2015-11-19
기준일	2015-11-18

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

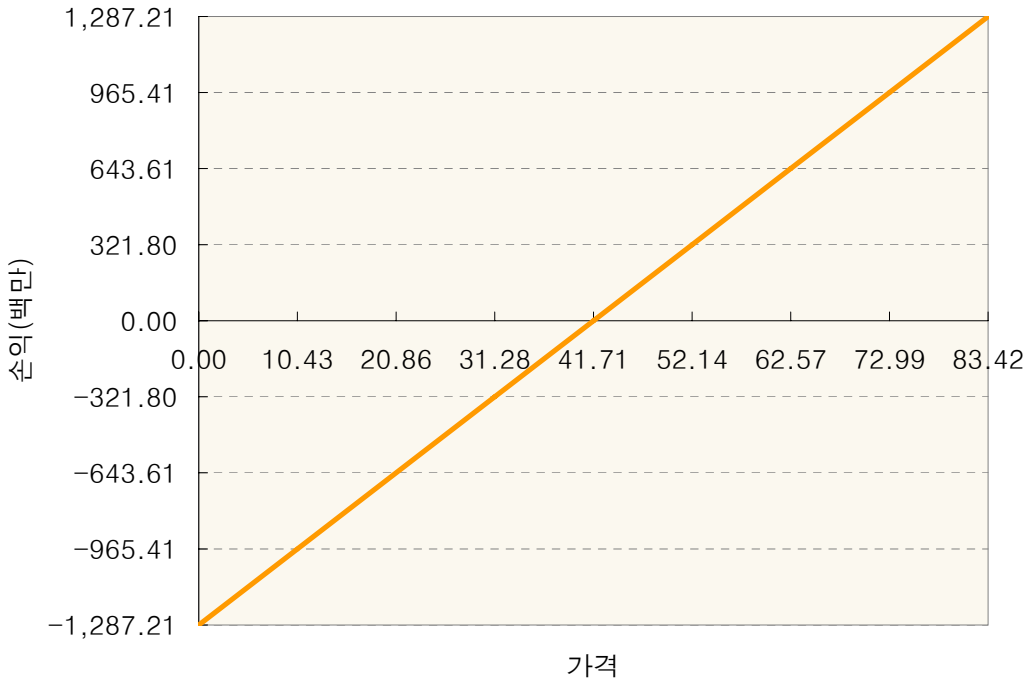
1. 계약금액

(단위:백만원)

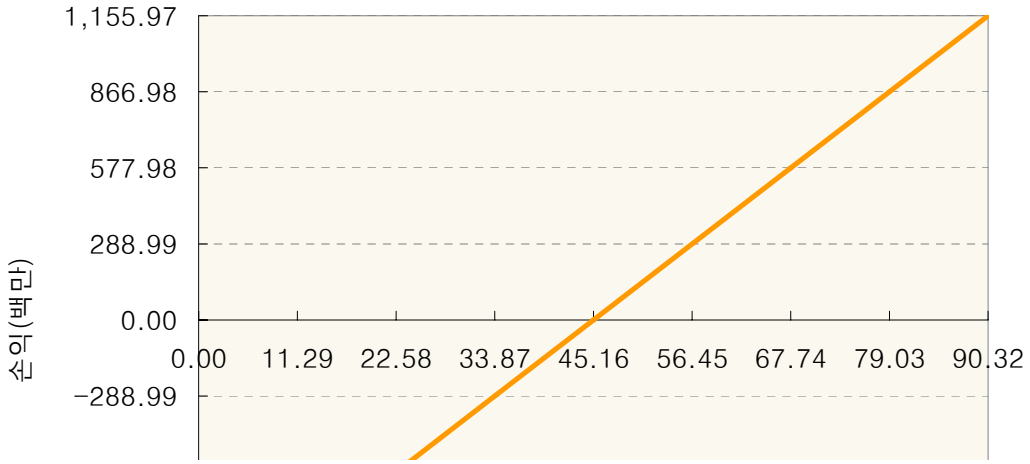
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,193	0	5,193	

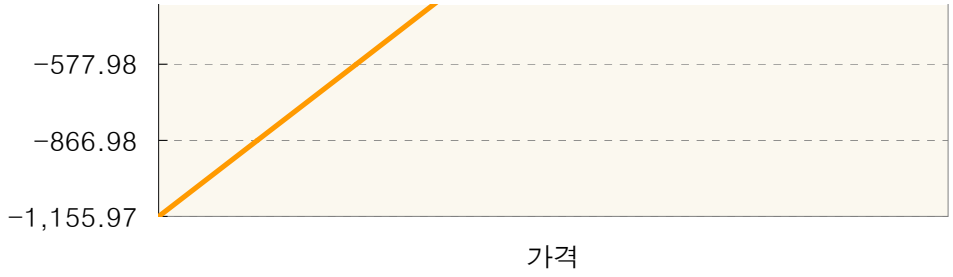
2. 만기시점의 손익구조

CLF6-WTI CRUDE FUTURE JAN16

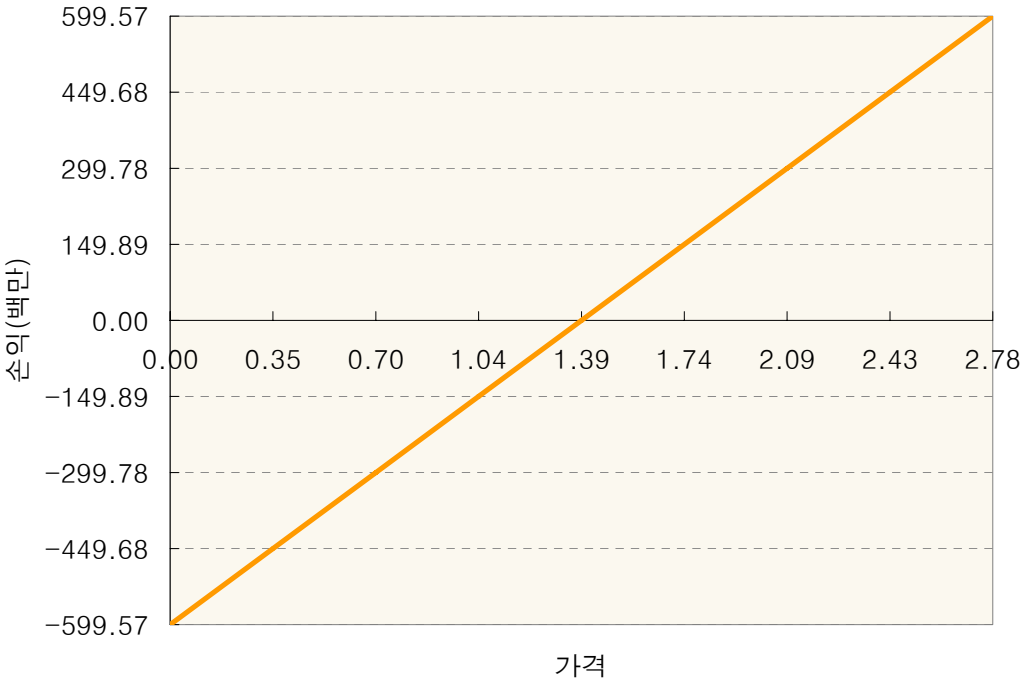


COH6-BRENT CRUDE FUTR MAR16

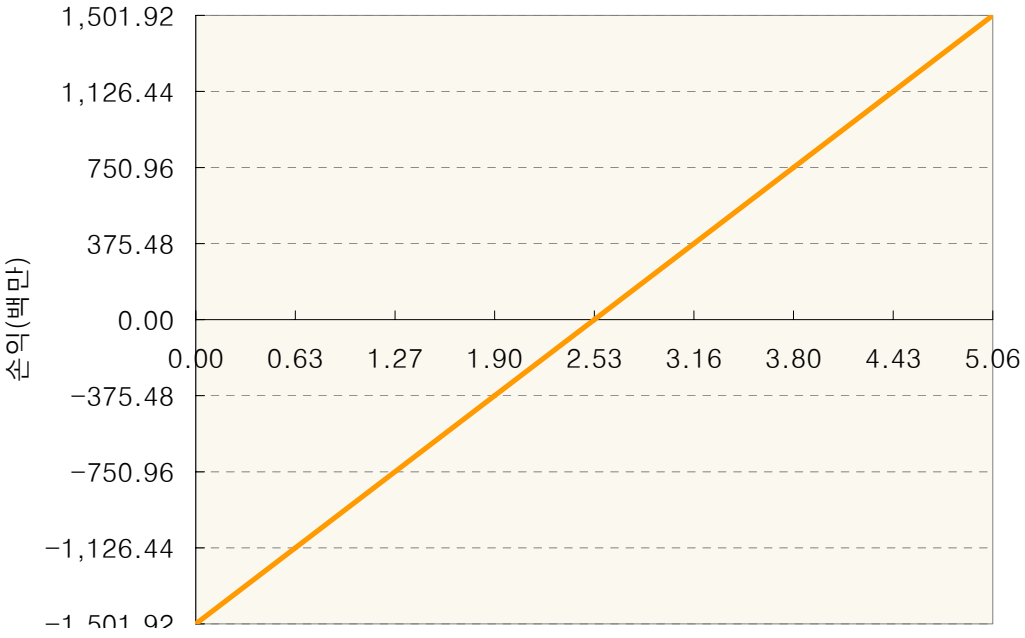


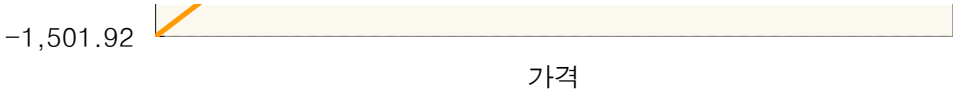


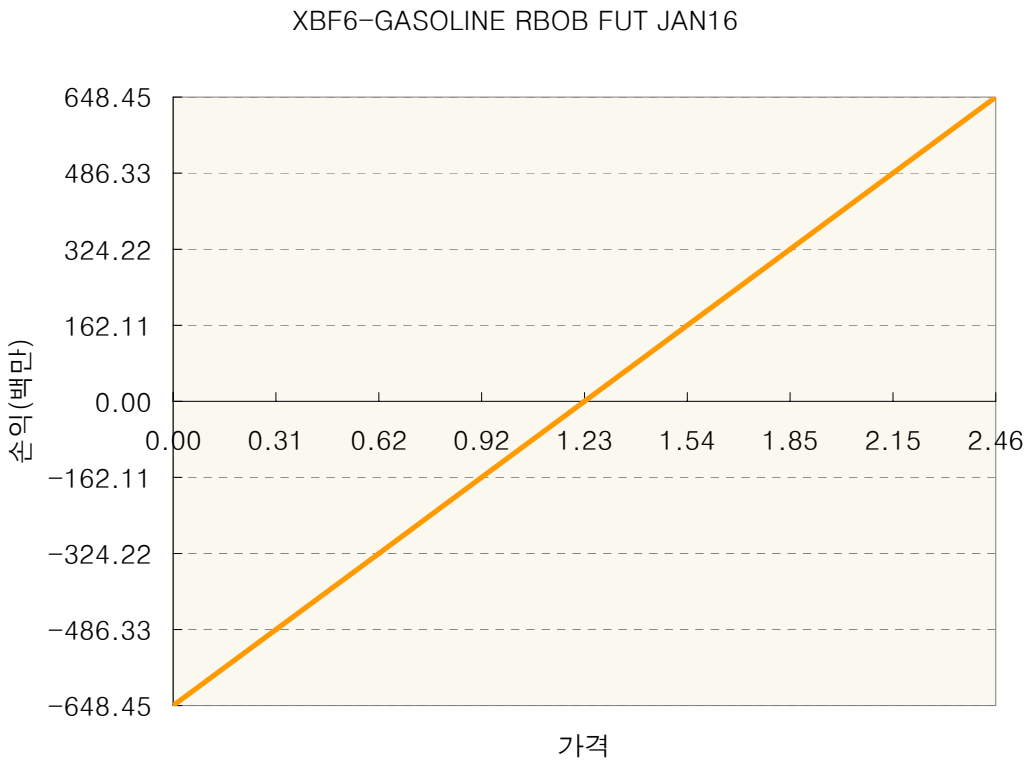
HOF6-NY Harb ULSD Fut JAN16



NGF6-NATURAL GAS FUTR JAN16







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLF6	WTI CRUDE FUTURE JAN16	103
COH6	BRENT CRUDE FUTR MAR16	92
HOF6	NY Harb ULSD Fut JAN16	48
NGF6	NATURAL GAS FUTR JAN16	120
XBF6	GASOLINE RBOB FUT JAN16	52

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

(단위:백만원)

1,078

공시일	2015-11-19
기준일	2015-11-18

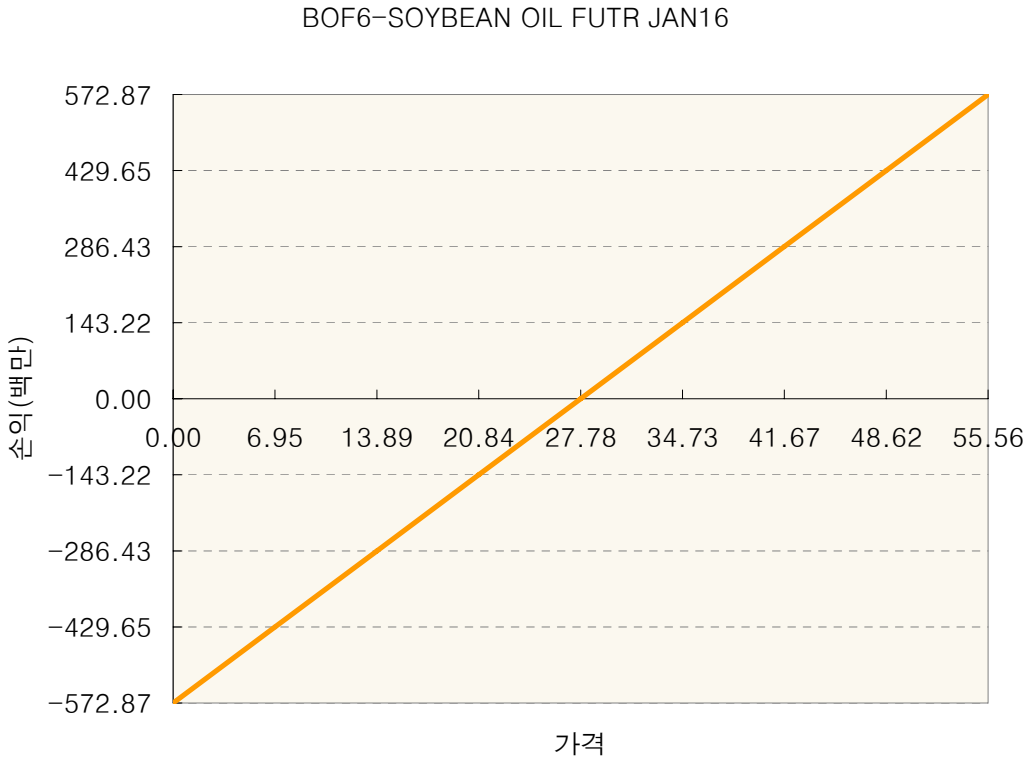
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

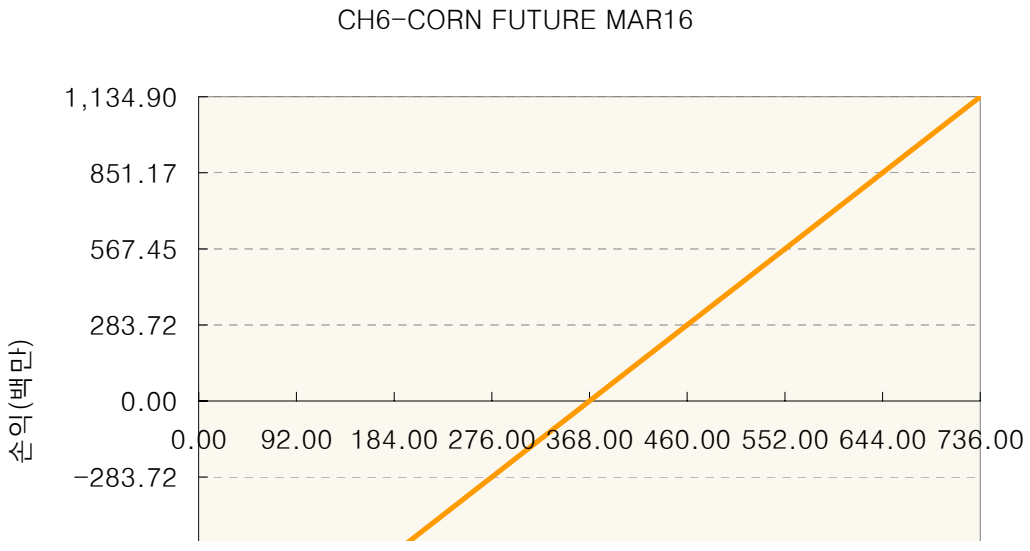
1. 계약금액

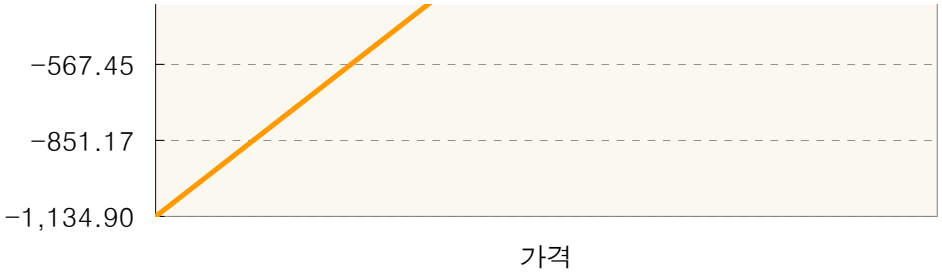
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,522	0	6,522	

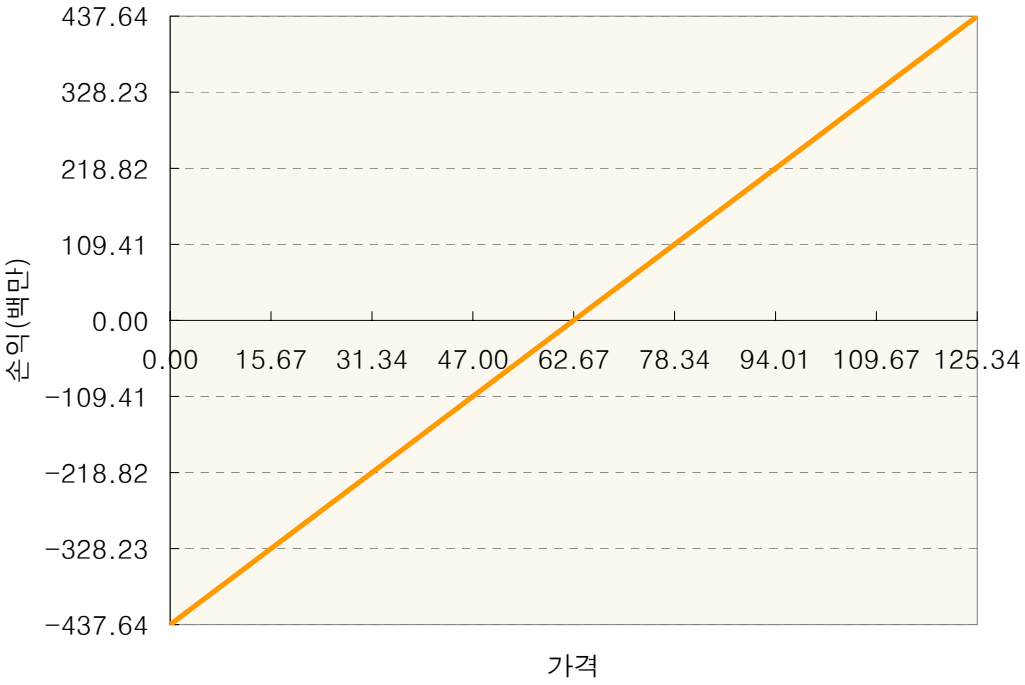
2. 만기시점의 손익구조



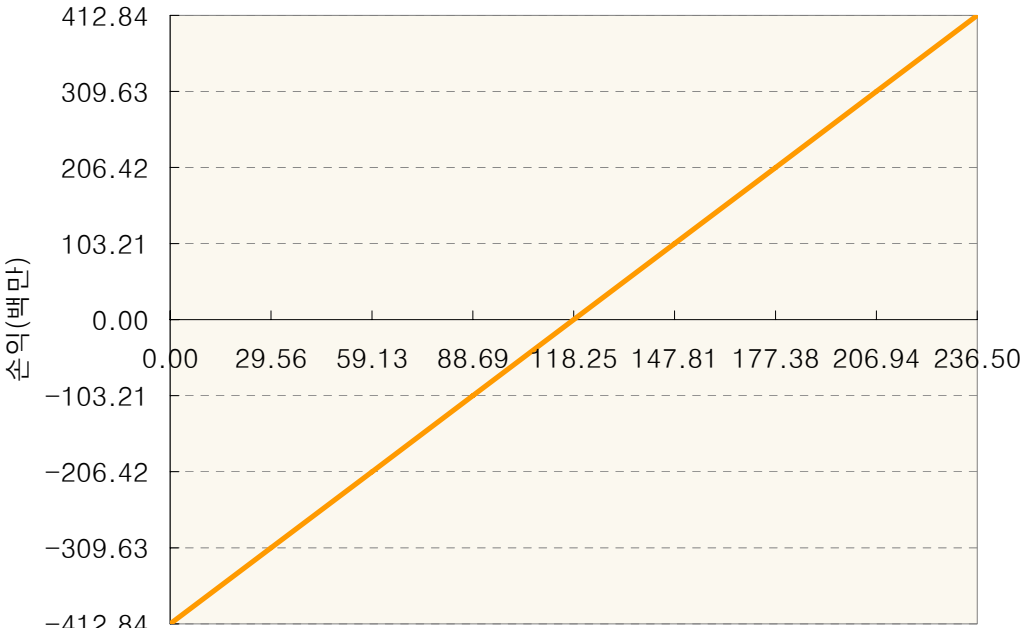


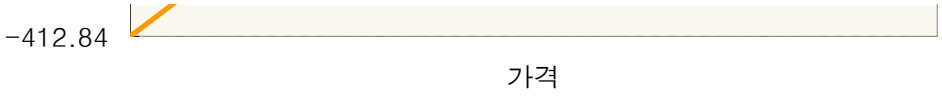


CTH6-COTTON NO.2 FUTR MAR16

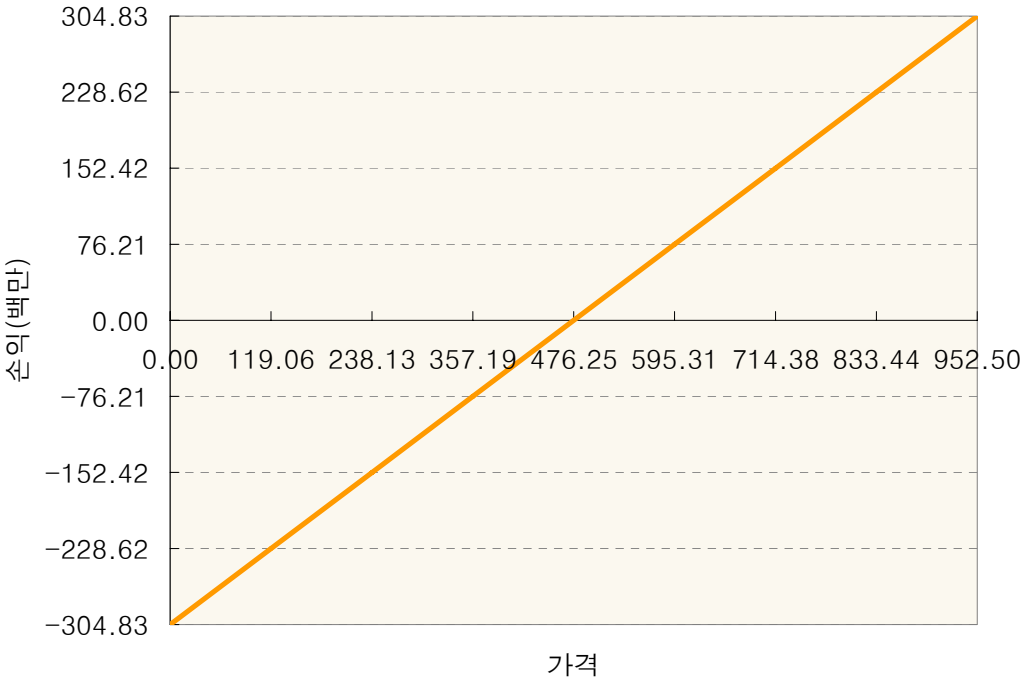


KCH6-COFFEE "C" FUTURE MAR16

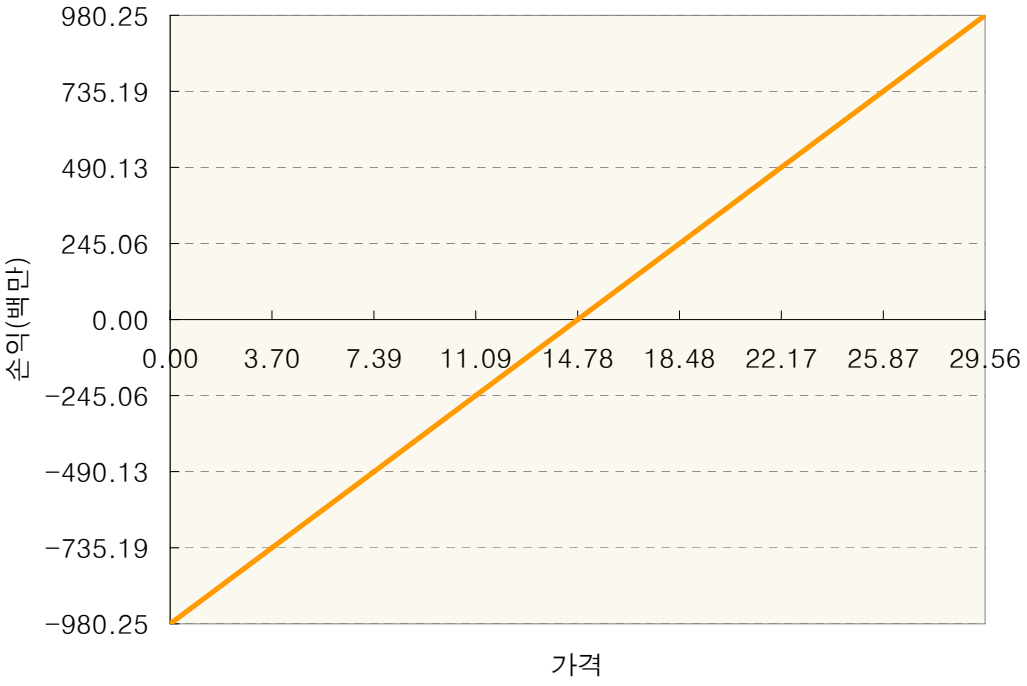




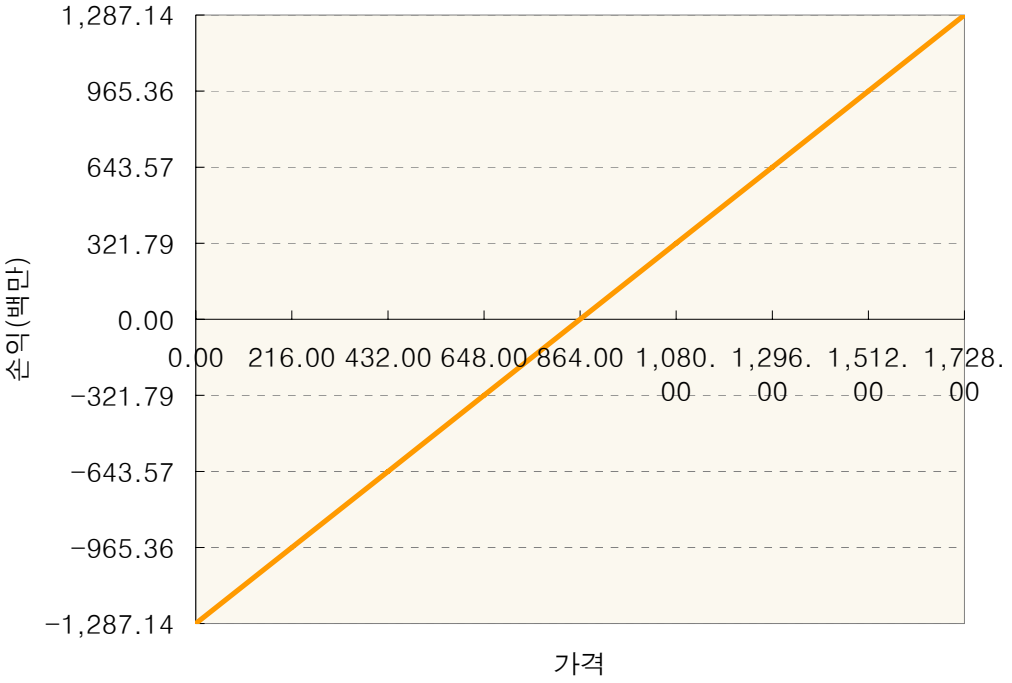
KWH6-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAR16



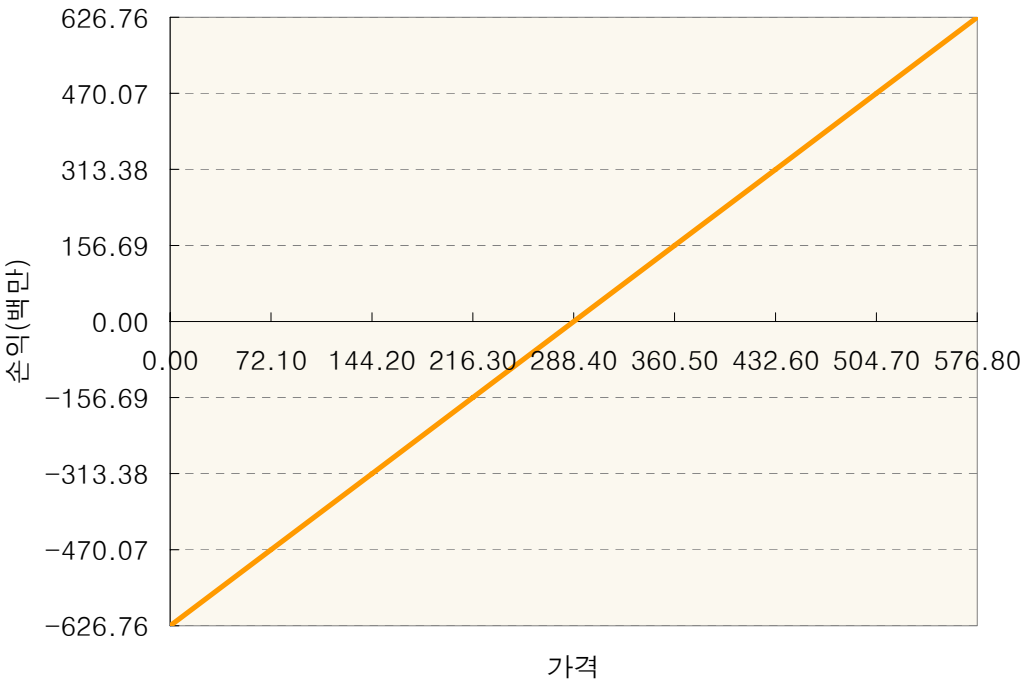
SBH6-Sugar #11 (WORLD) MAR16



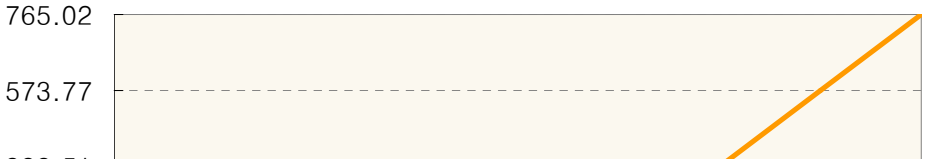
SF6-SOYBEAN FUTURE JAN16

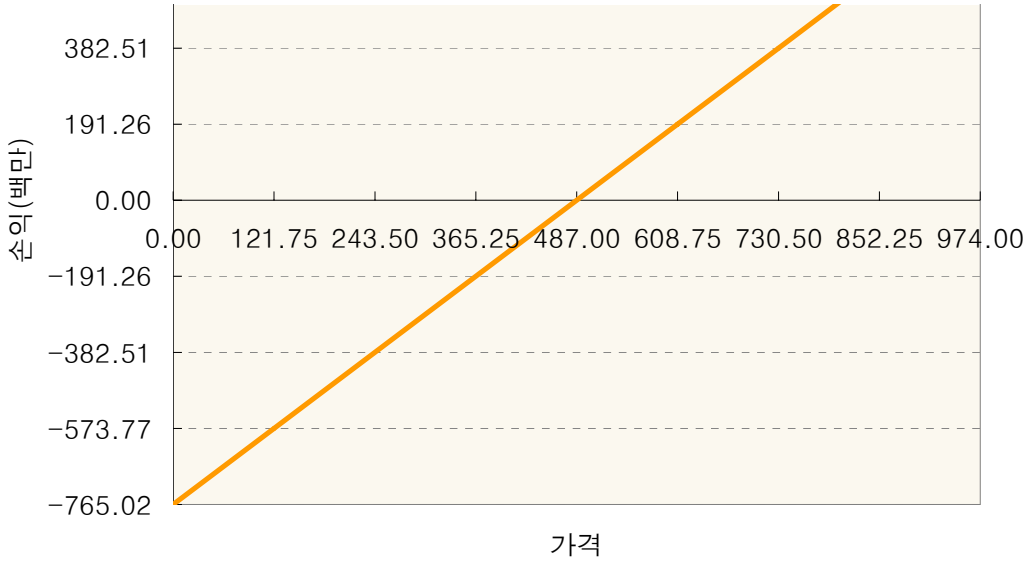


SMF6-SOYBEAN MEAL FUTR JAN16



WH6-WHEAT FUTURE(CBT) MAR16





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF6	SOYBEAN OIL FUTR JAN16	46
CH6	CORN FUTURE MAR16	91
CTH6	COTTON NO.2 FUTR MAR16	35
KCH6	COFFEE "C" FUTURE MAR16	33
KWH6	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAR16	24
SBH6	Sugar #11 (WORLD) MAR16	78
SF6	SOYBEAN FUTURE JAN16	103
SMF6	SOYBEAN MEAL FUTR JAN16	50
WH6	WHEAT FUTURE(CBT) MAR16	61

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

(단위:백만원)

737