| | |
|---|---|
| 공시일 | 2015-12-02 |
| 기준일 | 2015-12-01 |

# 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 | 2015-12-02 |
| 기준일 | 2015-12-01 |

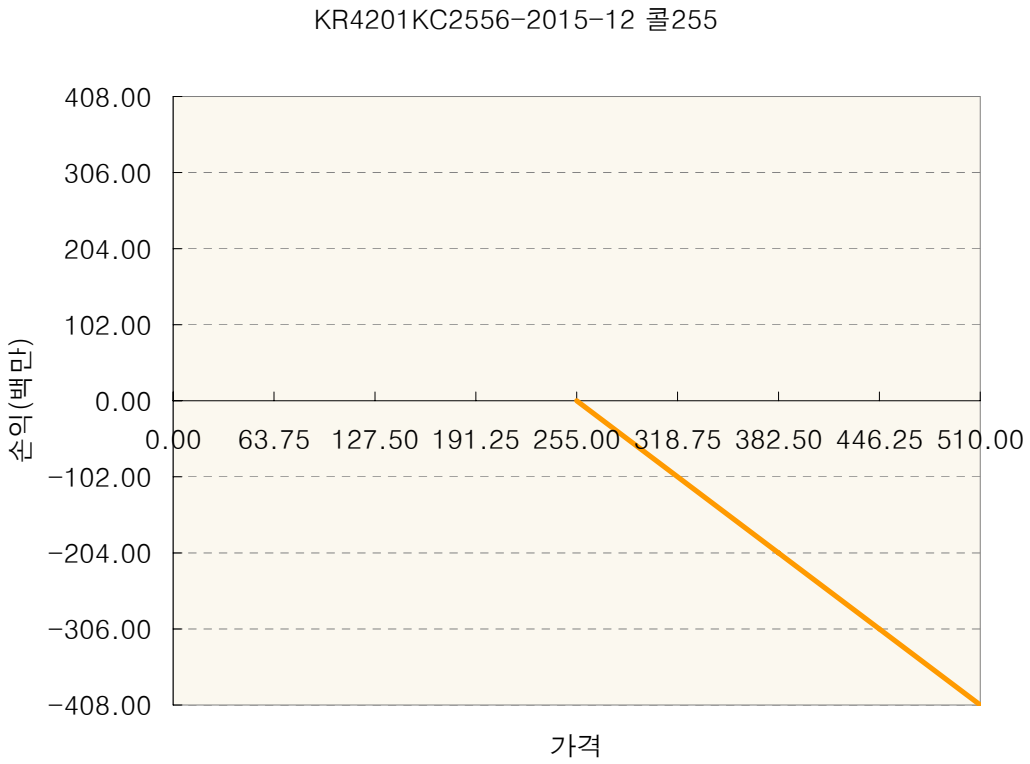
# 차곡차곡플러스모(주식혼합-파생)

## 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 107

| | 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 | 2 | 2 | 2 |
| 0% | 2 | 1 | 1 | 0 | -1 | -2 | -2 |
| 2.67% | -12 | -13 | -15 | -16 | -17 | -19 | -20 |
| 5.33% | -54 | -54 | -55 | -55 | -56 | -57 | -58 |
| 8.00% | -106 | -106 | -107 | -107 | -107 | -107 | -107 |

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

| 92 |
|---|

| 공시일 | 2015-12-02 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-12-01 |

# 스마트인덱스모

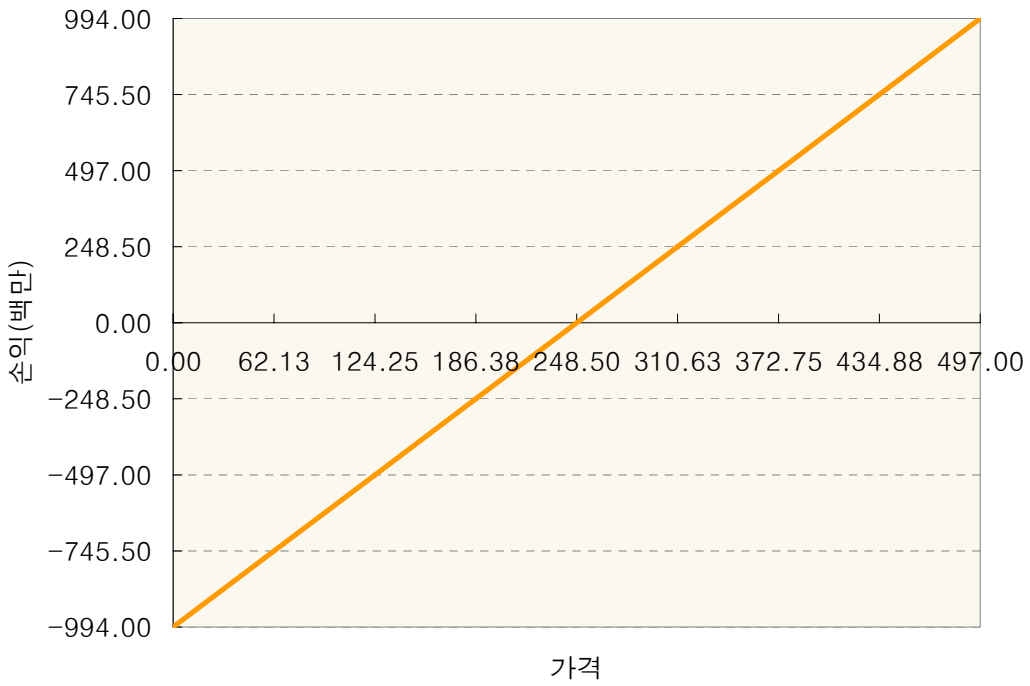
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

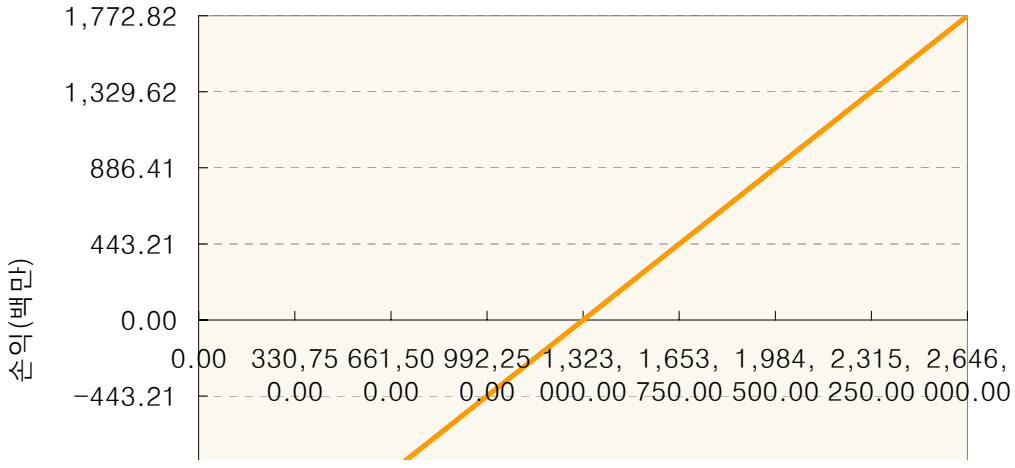
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,767 | 0 | 2,767 | 장내 |

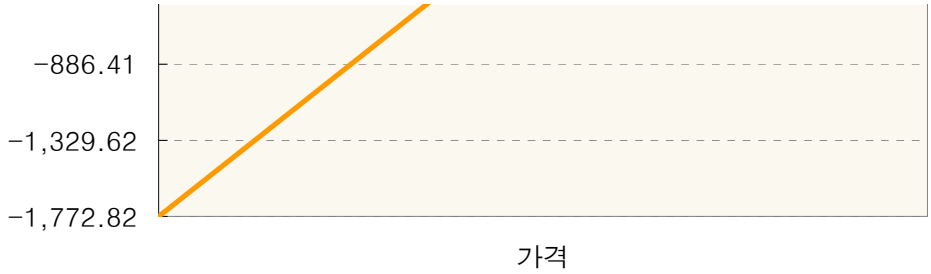
## 2. 만기시점의 손익구조

KR4101KC0007-2015-12 지수선물




KR4111KC0005-2015-12 삼성전자개별선물






### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101KC0C 2015-12 지수선물 | | | | | | | 80 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -80 | -80 | -80 | -80 | -80 | -80 | -80 |
| -5.33% | -53 | -53 | -53 | -53 | -53 | -53 | -53 |
| -2.67% | -27 | -27 | -27 | -27 | -27 | -27 | -27 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 27 | 27 | 27 | 27 | 27 | 27 | 27 |
| 5.33% | 53 | 53 | 53 | 53 | 53 | 53 | 53 |
| 8.00% | 80 | 80 | 80 | 80 | 80 | 80 | 80 |
| KR4111KC0C 2015-12 삼성전자개별선물 | | | | | | | 142 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -142 | -142 | -142 | -142 | -142 | -142 | -142 |
| -5.33% | -94 | -94 | -94 | -94 | -94 | -94 | -94 |
| -2.67% | -47 | -47 | -47 | -47 | -47 | -47 | -47 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 47 | 47 | 47 | 47 | 47 | 47 | 47 |
| 5.33% | 94 | 94 | 94 | 94 | 94 | 94 | 94 |
| 8.00% | 142 | 142 | 142 | 142 | 142 | 142 | 142 |

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

(단위:백만원)

| 183 |
|---|

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2015-12-02 |
| 기준일 | 2015-12-01 |

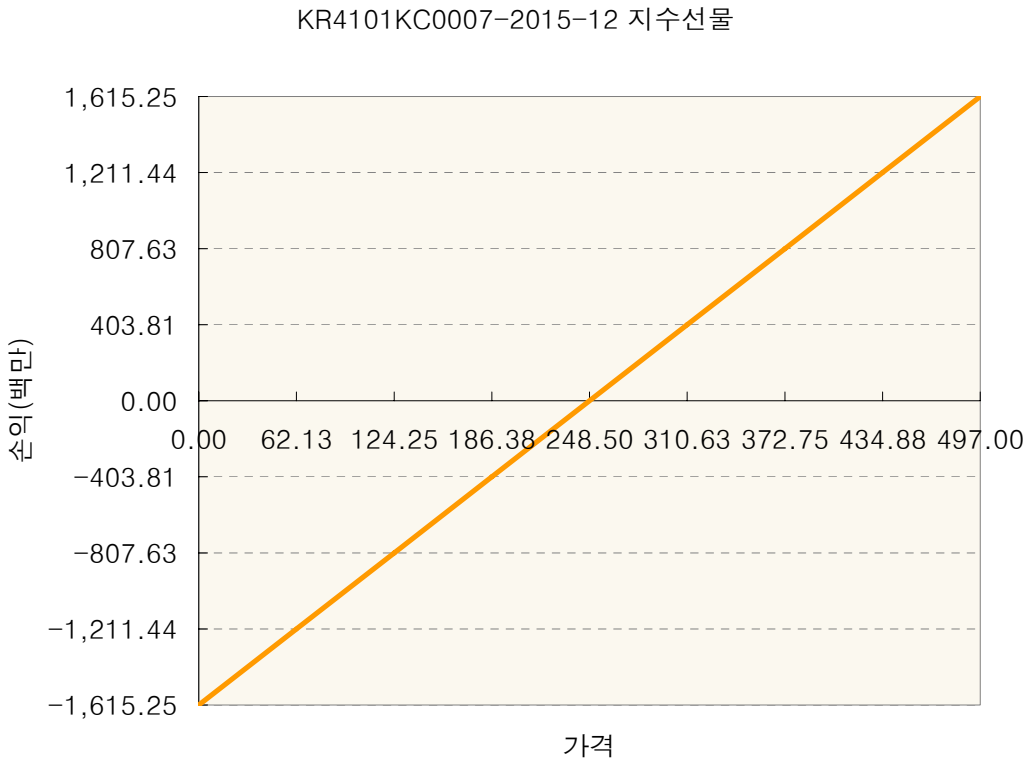
# 스마트레버리지목표전환형1호

## 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 | 1,615 | 0 | 1,615 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101KC0C 2015-12 지수선물 | | | | | | | 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)

| 97 |
|---|

| 공시일 | 2015-12-02 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-12-01 |

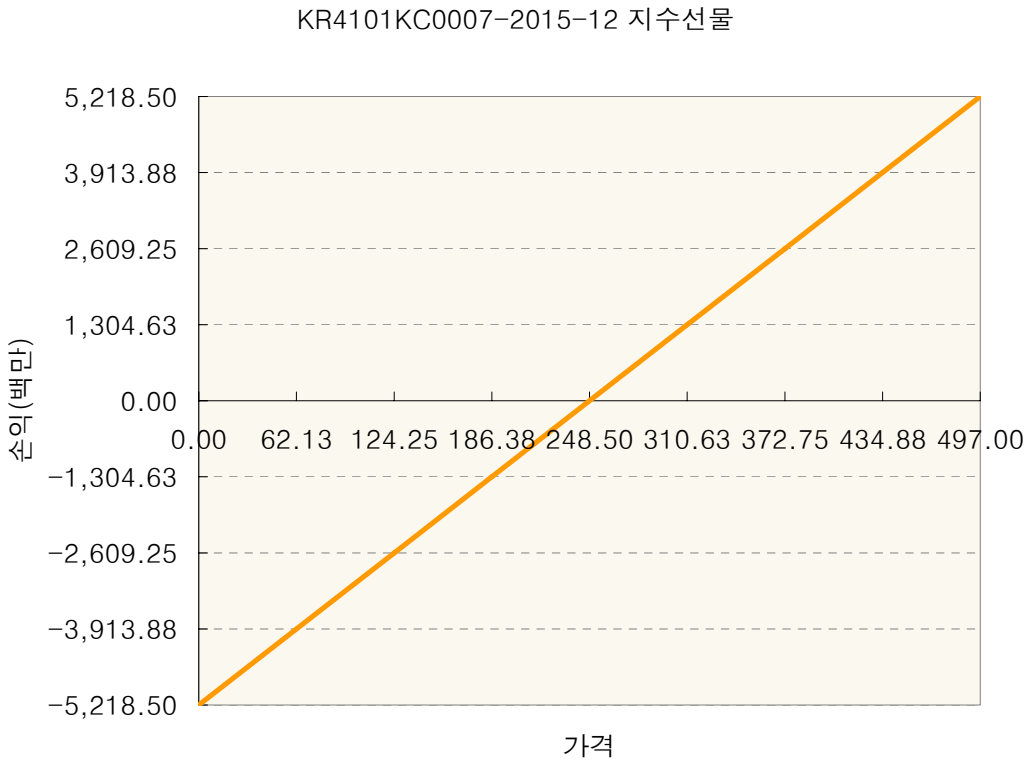
# 1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

## 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 | 5,219 | 0 | 5,219 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101KC0C 2015-12 지수선물 | | | | | | | 418 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -418 | -418 | -418 | -418 | -418 | -418 | -418 |
| -5.33% | -279 | -279 | -279 | -279 | -279 | -279 | -279 |
| -2.67% | -139 | -139 | -139 | -139 | -139 | -139 | -139 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 139 | 139 | 139 | 139 | 139 | 139 | 139 |
| 5.33% | 279 | 279 | 279 | 279 | 279 | 279 | 279 |
| 8.00% | 418 | 418 | 418 | 418 | 418 | 418 | 418 |

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

| 314 |
|---|

| 공시일 | 2015-12-02 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-12-01 |

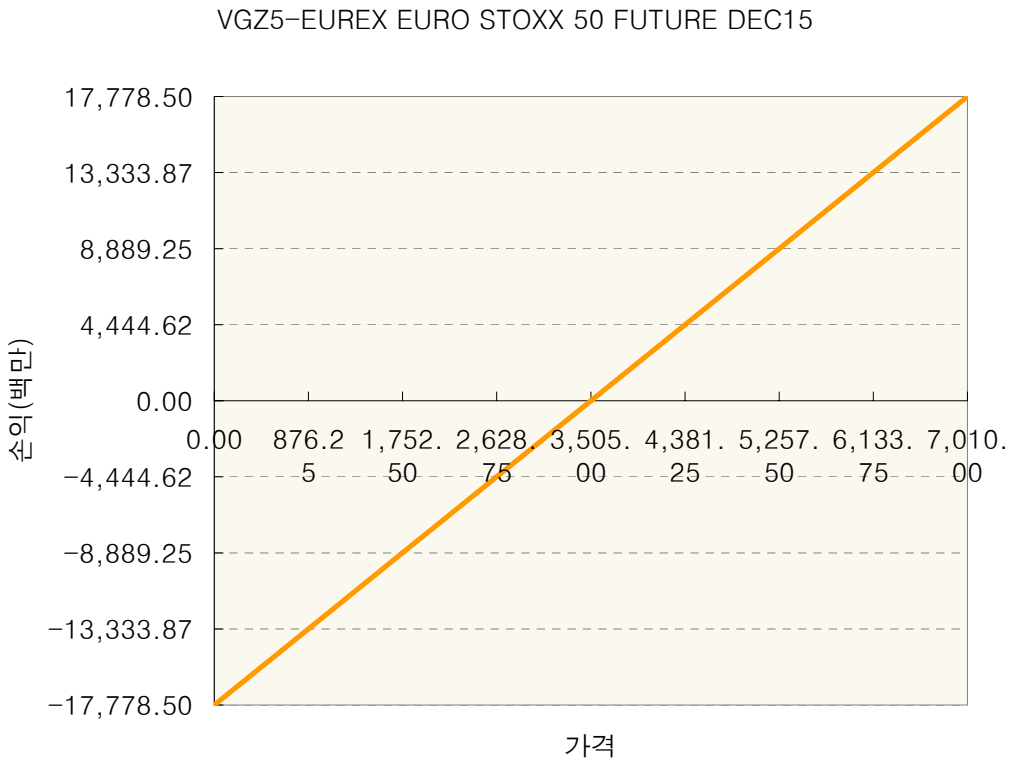
# 유로인덱스1호(주식-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 17,778 | 0 | 17,778 | |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| VGZ5 | EUREX EURO STOXX 50 FUTURE DEC15 | 1,422 |

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

(단위:백만원)

1,547

| 공시일 | 2015-12-02 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-12-01 |

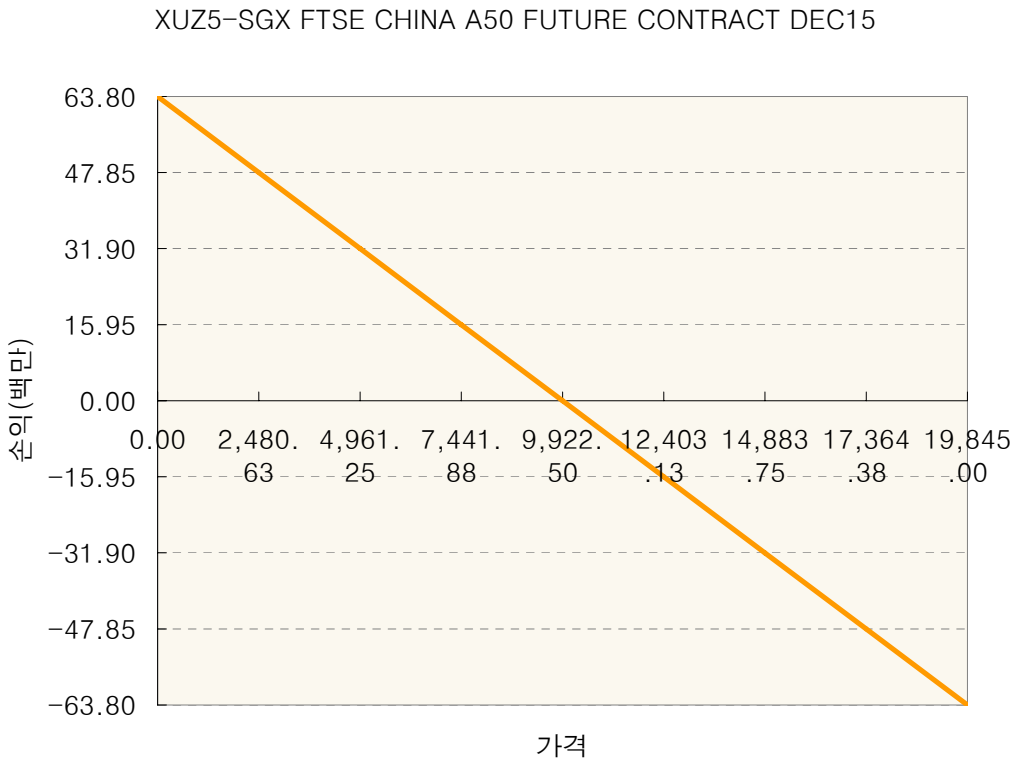
# 아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

## 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 | 64 | -64 | |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| XUZ5 | SGX FTSE CHINA A50 FUTURE CONTRACT DEC15 | 5 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 11 |

| 공시일 | 2015-12-02 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-12-01 |

# 차이나인덱스(주식-파생형)(종)

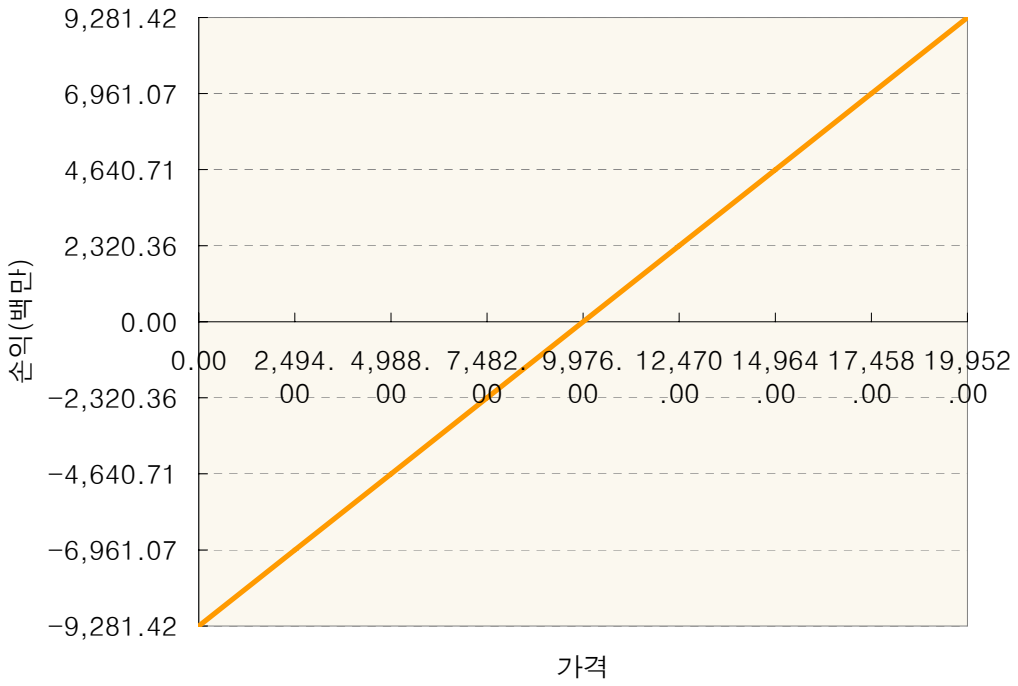
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

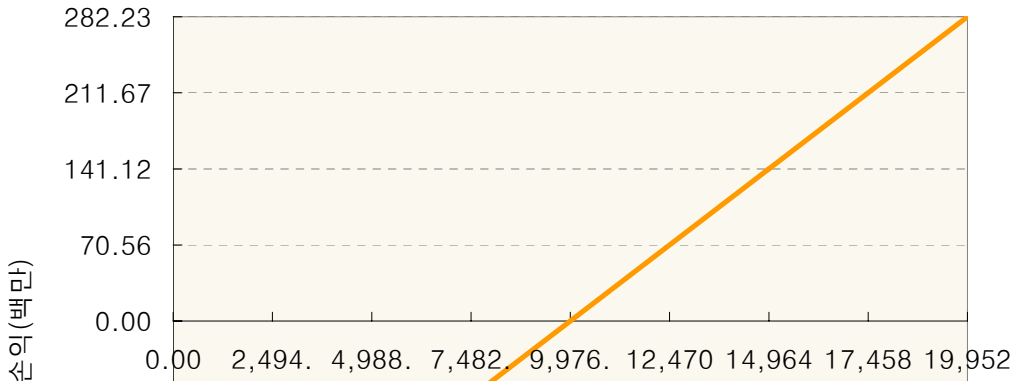
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 9,281 | 0 | 9,281 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 282 | 0 | 282 | 장내 |

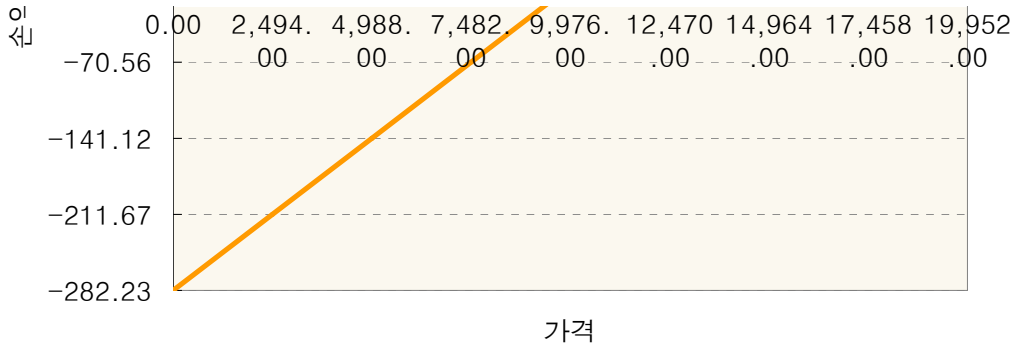
## 2. 만기시점의 손익구조

HCZ5-HKG Hang Seng China Enterprises Index FU




MHCZ5-HKG MINI HANG SENG CHINA H-SHR IDX FUT D






### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| HCZ5 | HKG Hang Seng China Enterprises Index FU | 742 |
| MHCZ5 | HKG MINI HANG SENG CHINA H-SHR IDX FUT D | 23 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 786 |

| 공시일 | 2015-12-02 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-12-01 |

# 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 | 15,791 | 0 | 15,791 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| SWMXWO00(신한MXWO 미래S1120 | 1,259 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

935

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| 공시일 | 2015-12-02 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-12-01 |

# 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 | 5 |
|---|---|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| 13 |
|---|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| 공시일 | 2015-12-02 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-12-01 |

# 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 | 500 |
| SWCSI50000 신한CSI500미래S09092 | 154 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 1,751 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2015-12-02 |
| 기준일 | 2015-12-01 |

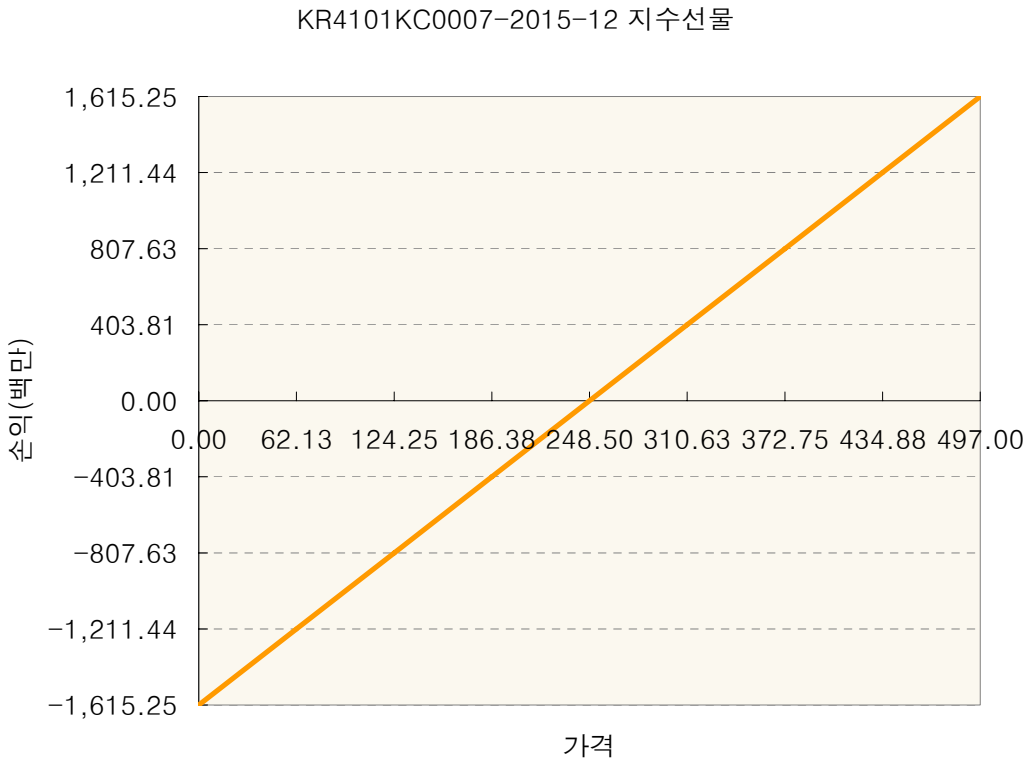
# KOSPI200 레버리지 목표전환형 3

## 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 | 1,615 | 0 | 1,615 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101KC0C 2015-12 지수선물 | | | | | | | 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)

| 97 |
|---|

| 공시일 | 2015-12-02 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-12-01 |

# 메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

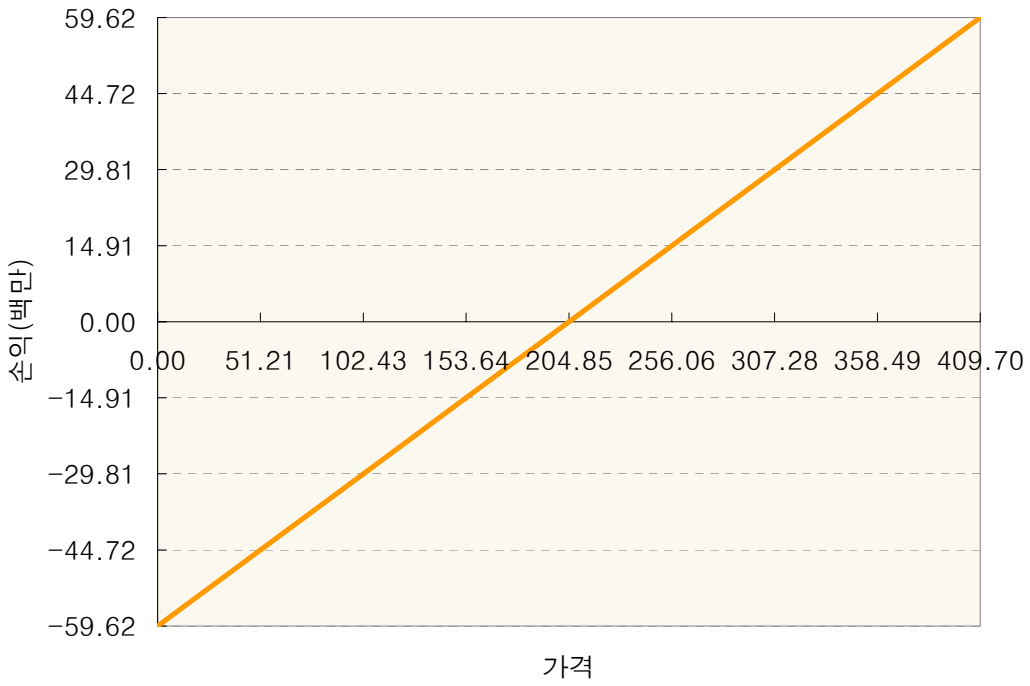
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

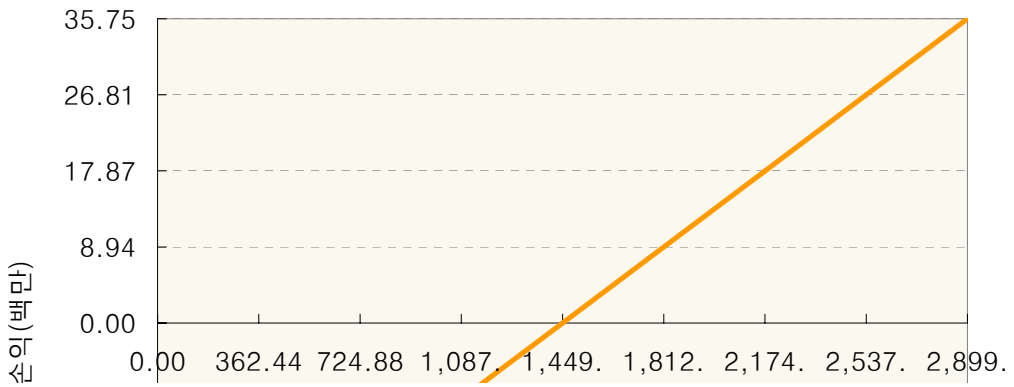
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 선물 | 유가증권 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 선물 | 유가증권 | 16 | 0 | 16 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 391 | 102 | 289 | |

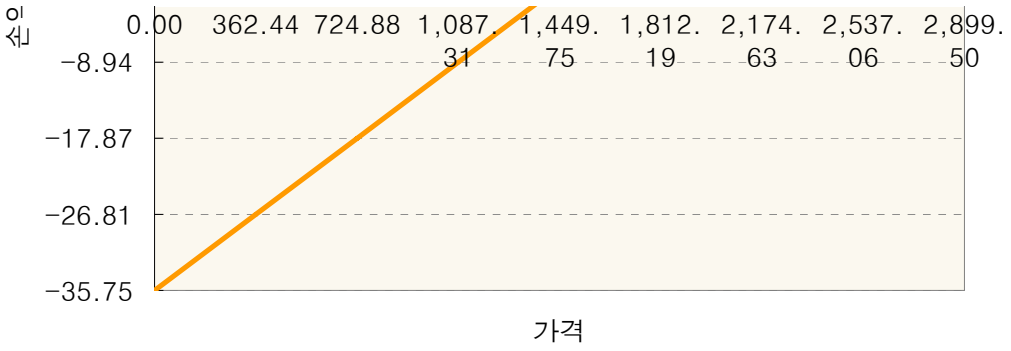
## 2. 만기시점의 손익구조

HGH6-COPPER FUTURE MAR16

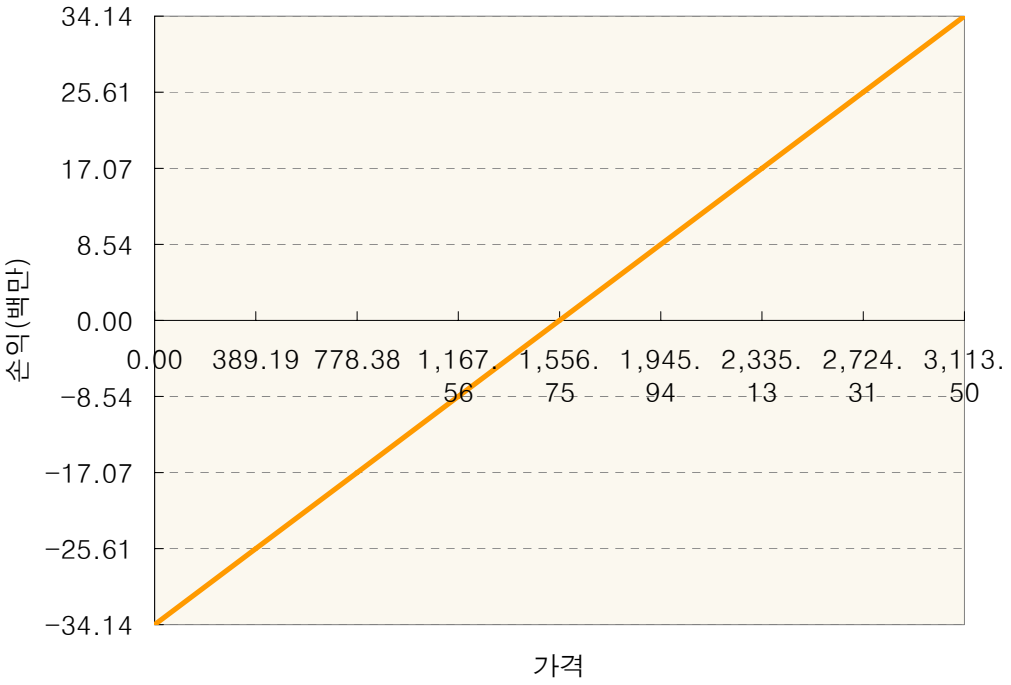



LAF6-LME PRI ALUM FUTR JAN16

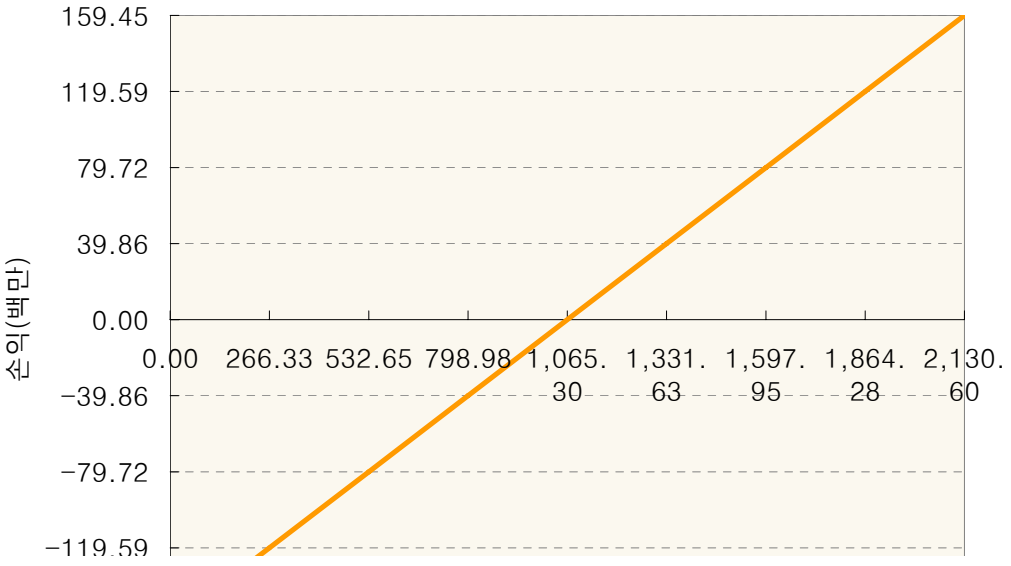


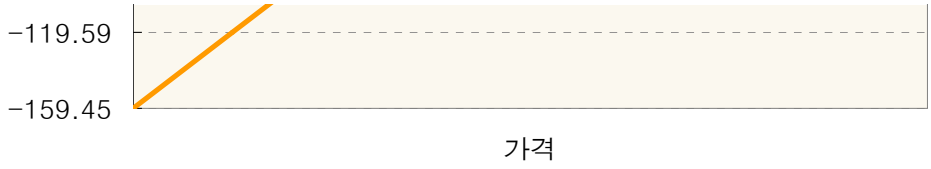



LXF6-LME ZINC FUTURE JAN16

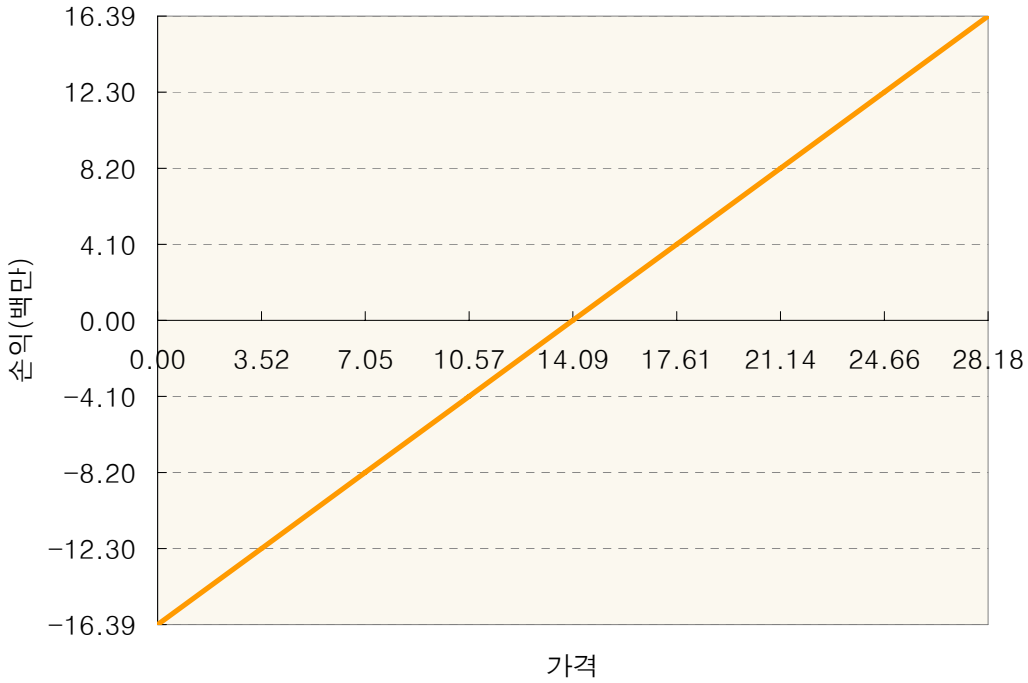



XGG6-MINI GOLD FUTURE FEB16






YSH6-MINI SILVER FUT MAR16




### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 22 |

| 공시일 | 2015-12-02 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-12-01 |

# 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

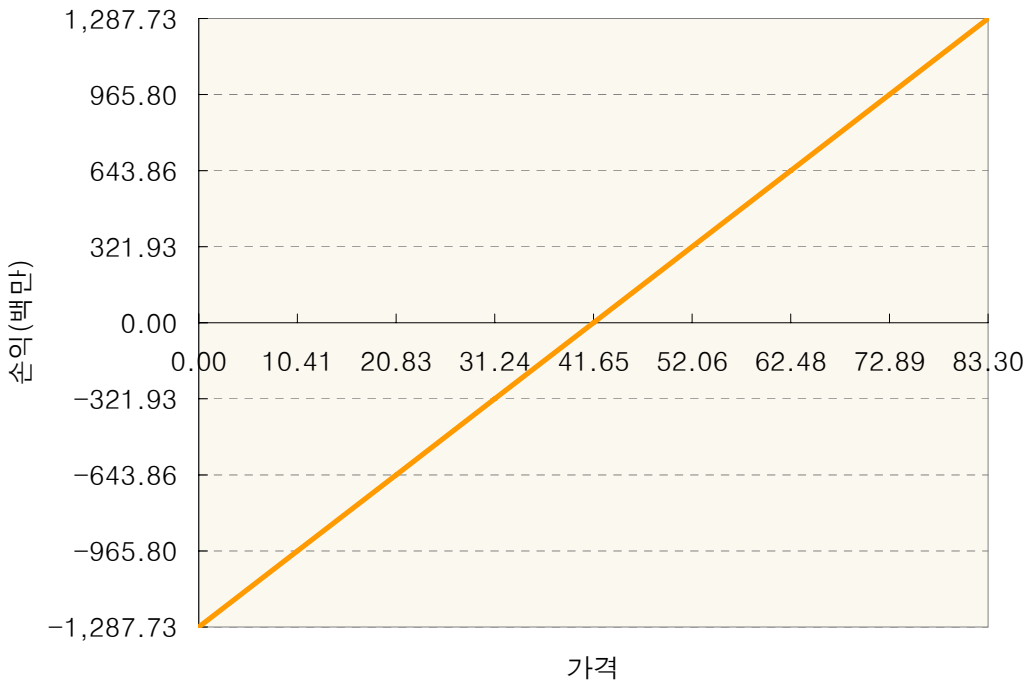
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

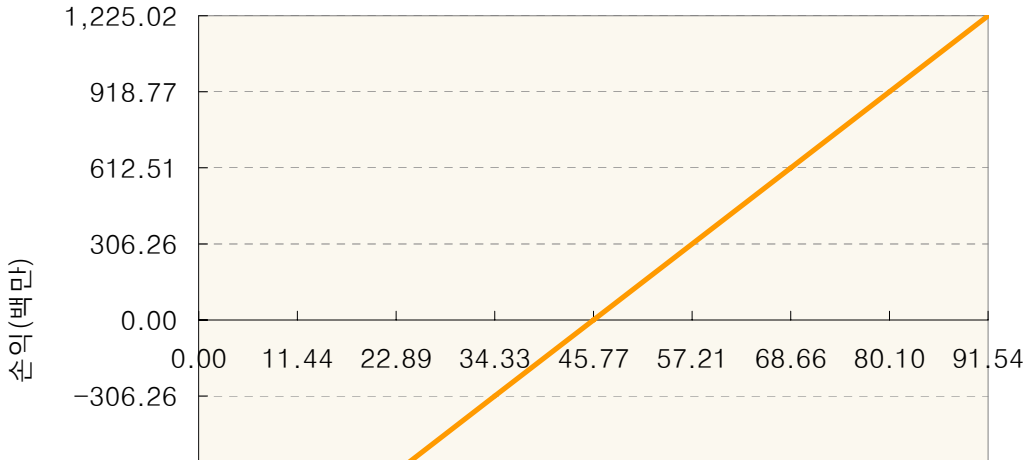
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 5,119 | 0 | 5,119 | |

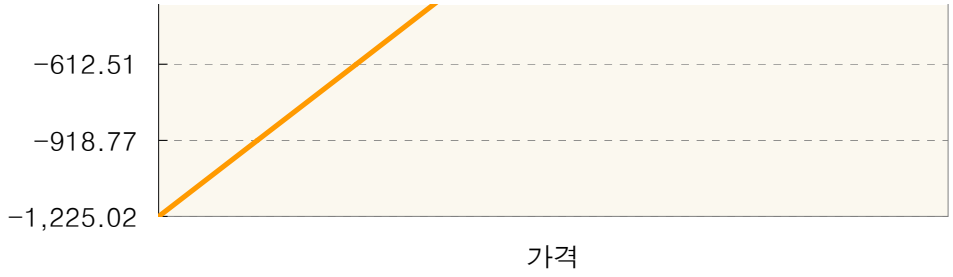
## 2. 만기시점의 손익구조

CLF6-WTI CRUDE FUTURE JAN16

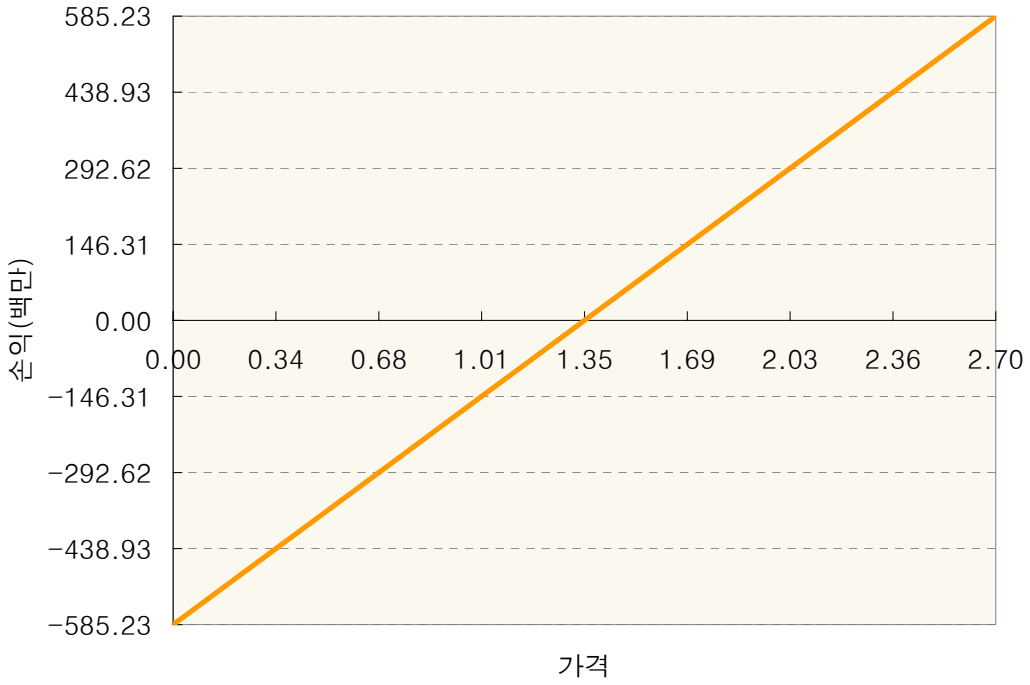



COH6-BRENT CRUDE FUTR MAR16

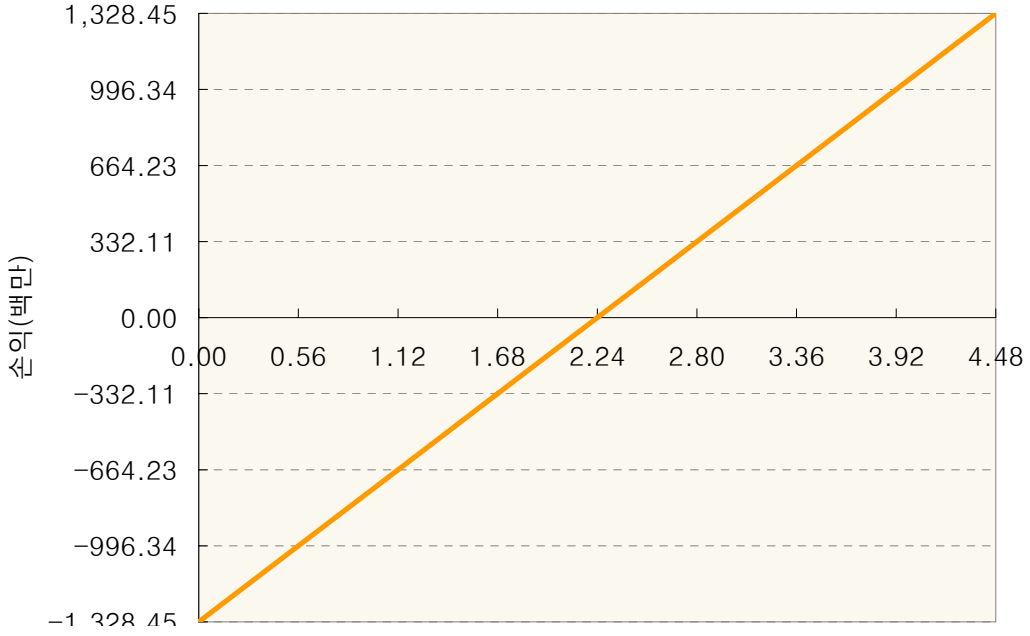


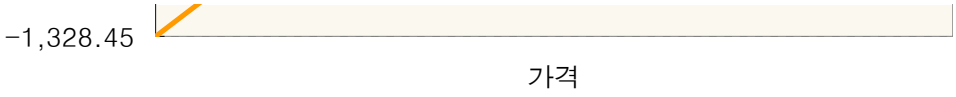


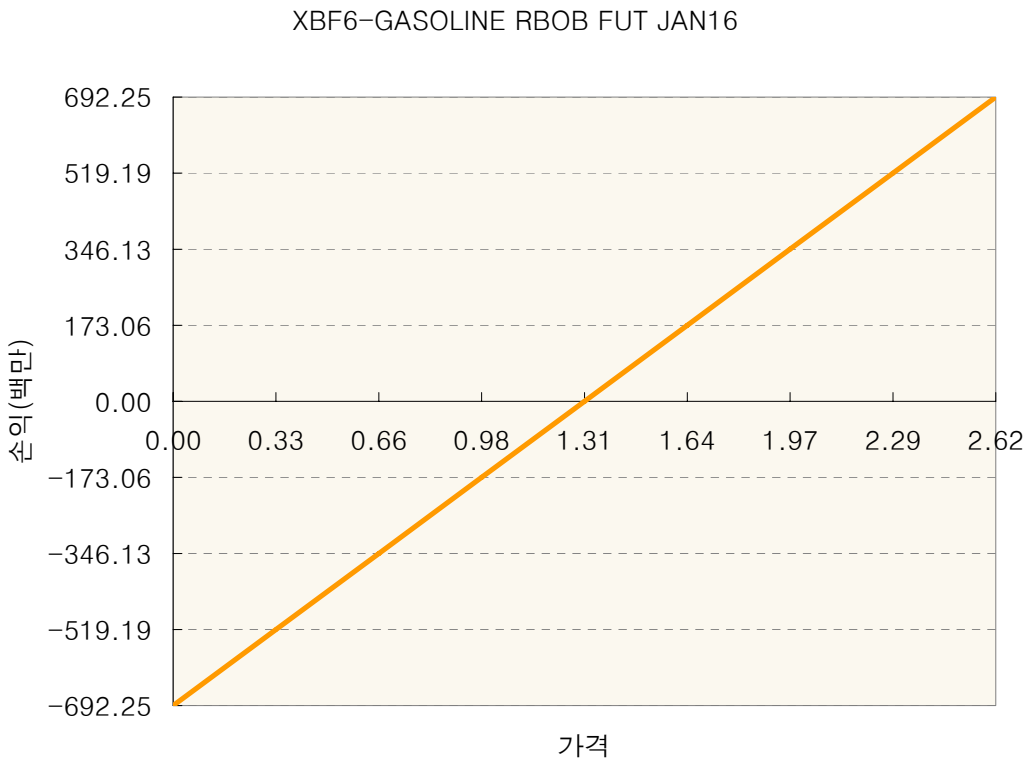

HOF6-NY Harb ULSD Fut JAN16




NGF6-NATURAL GAS FUTR JAN16






### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| CLF6 | WTI CRUDE FUTURE JAN16 | 103 |
| COH6 | BRENT CRUDE FUTR MAR16 | 98 |
| HOF6 | NY Harb ULSD Fut JAN16 | 47 |
| NGF6 | NATURAL GAS FUTR JAN16 | 106 |
| XBF6 | GASOLINE RBOB FUT JAN16 | 55 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 1,047 |

| 공시일 | 2015-12-02 |
|---|---|
| 기준일 | 2015-12-01 |

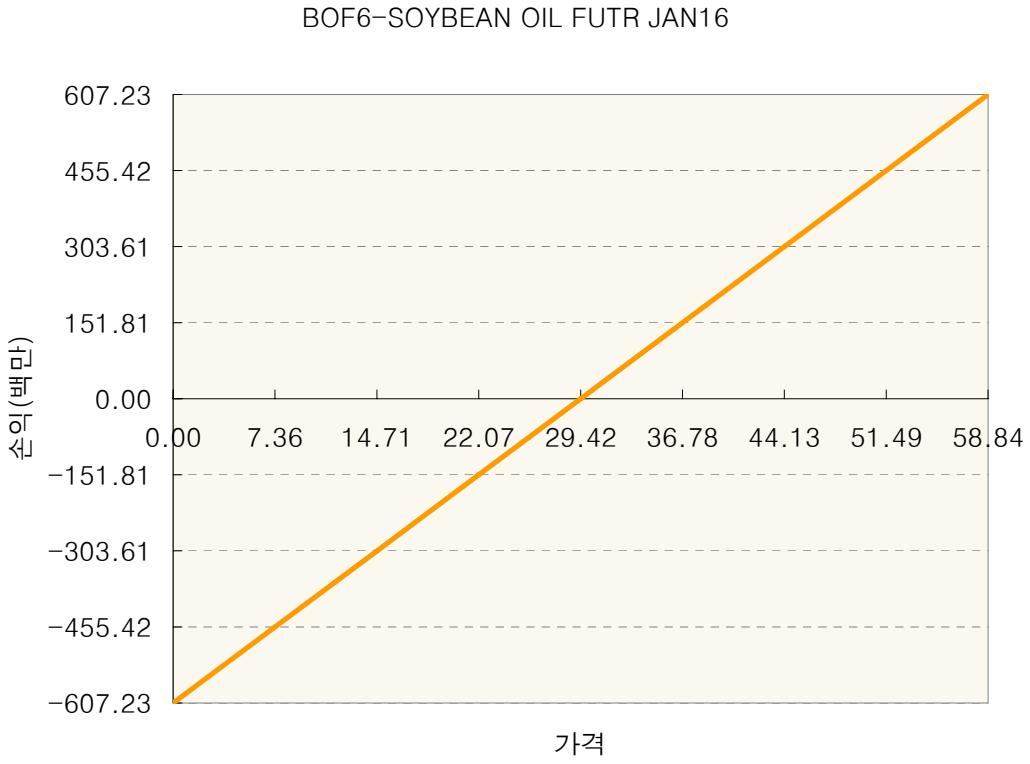
# 애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

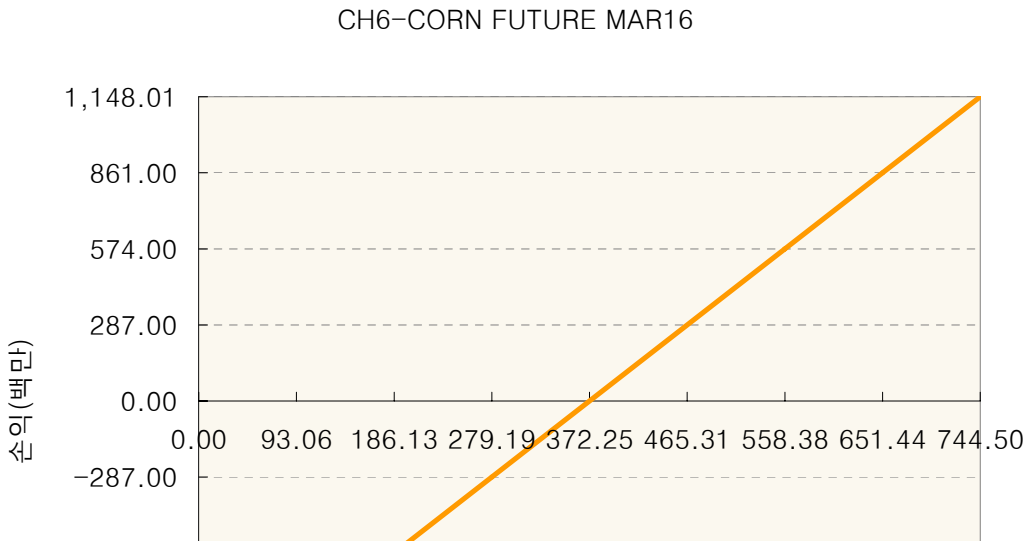
## 1. 계약금액

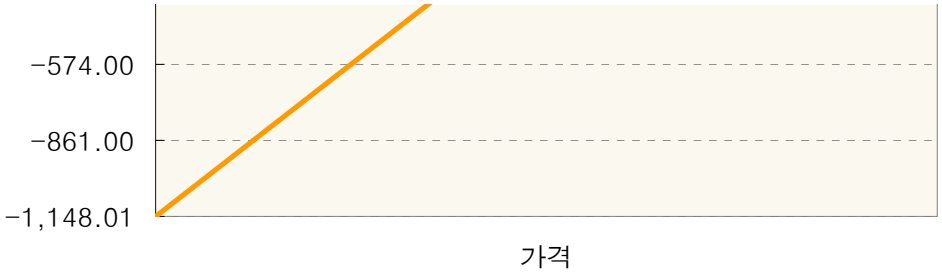
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 6,618 | 0 | 6,618 | |

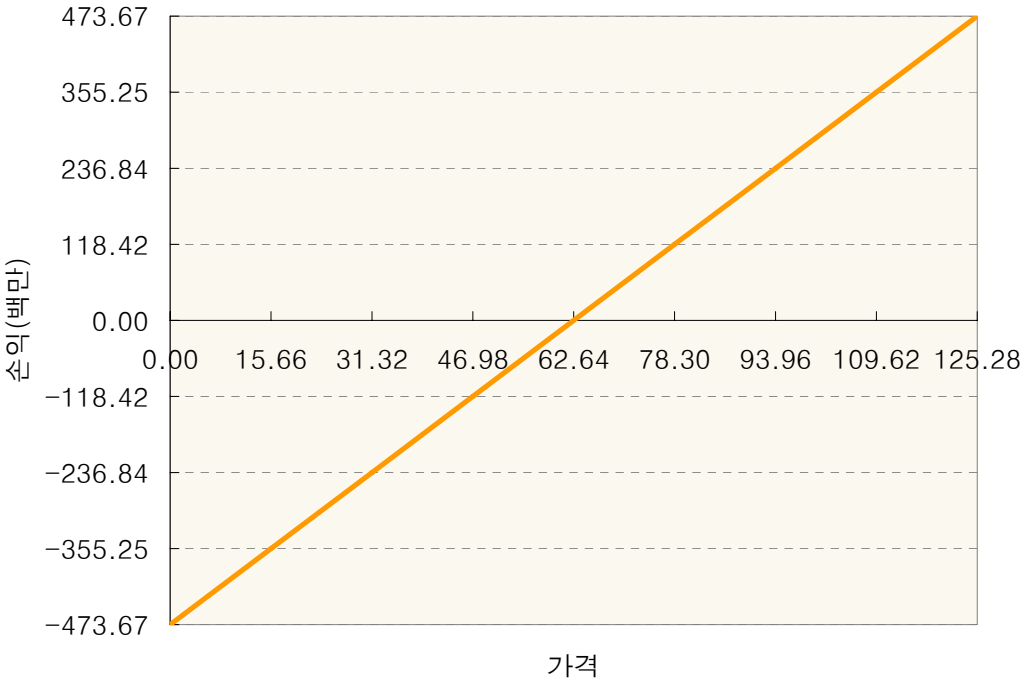
## 2. 만기시점의 손익구조



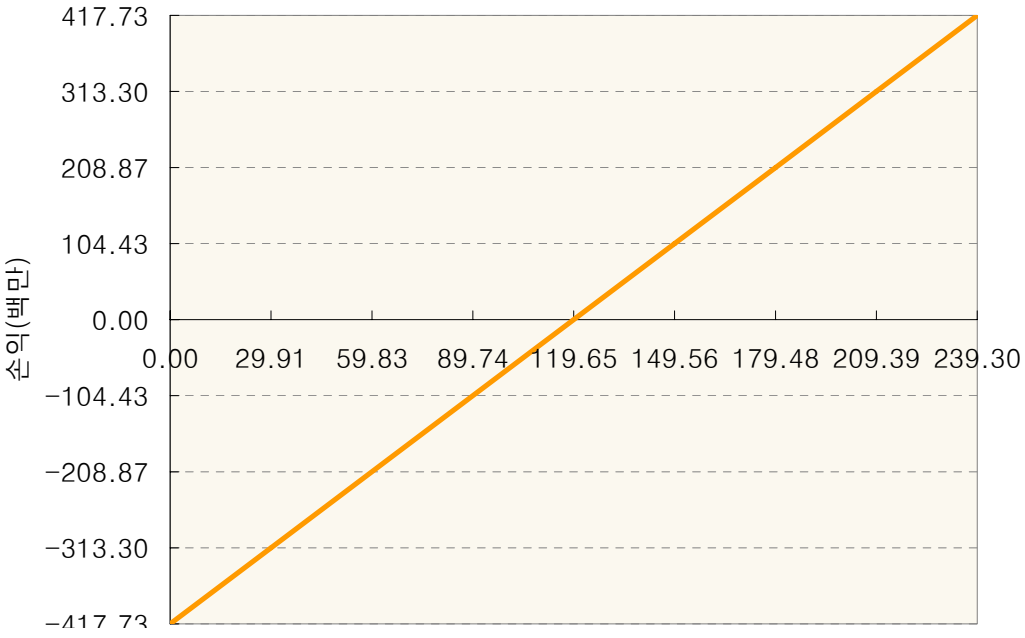



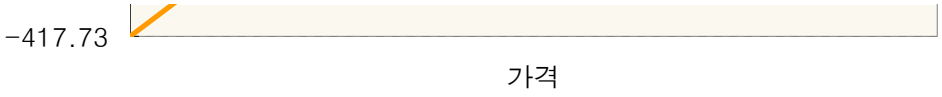



CTH6-COTTON NO.2 FUTR MAR16

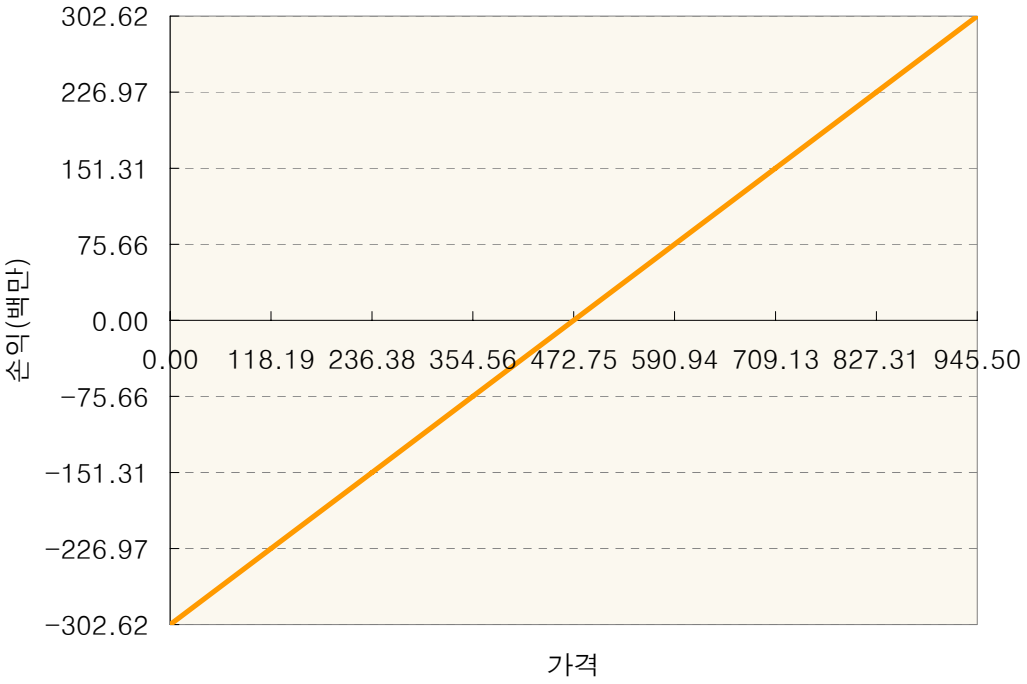



KCH6-COFFEE "C" FUTURE MAR16

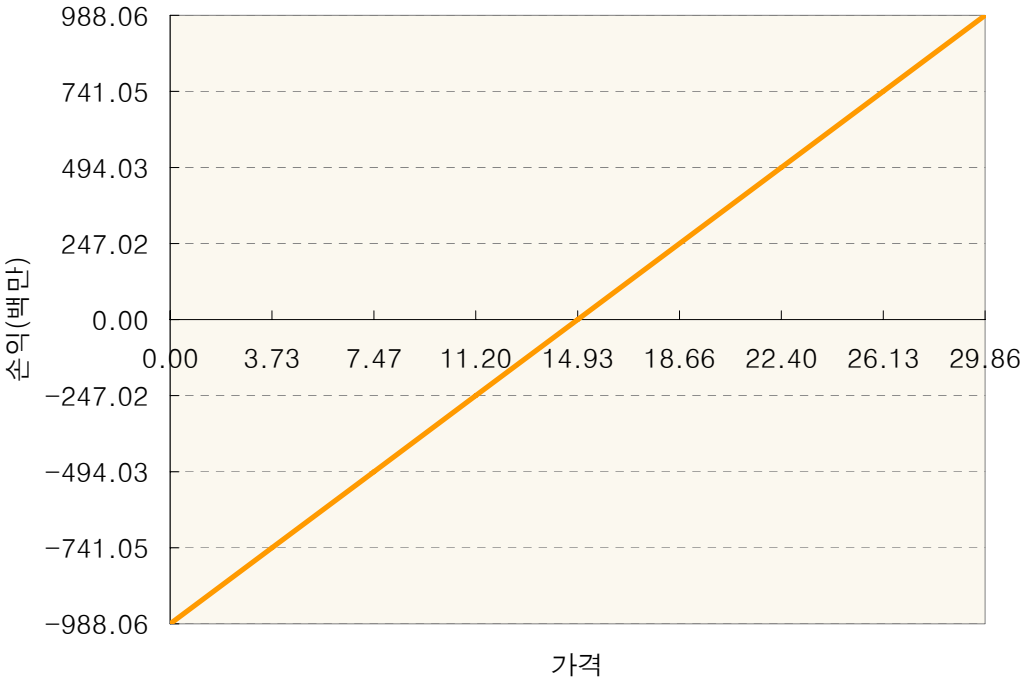




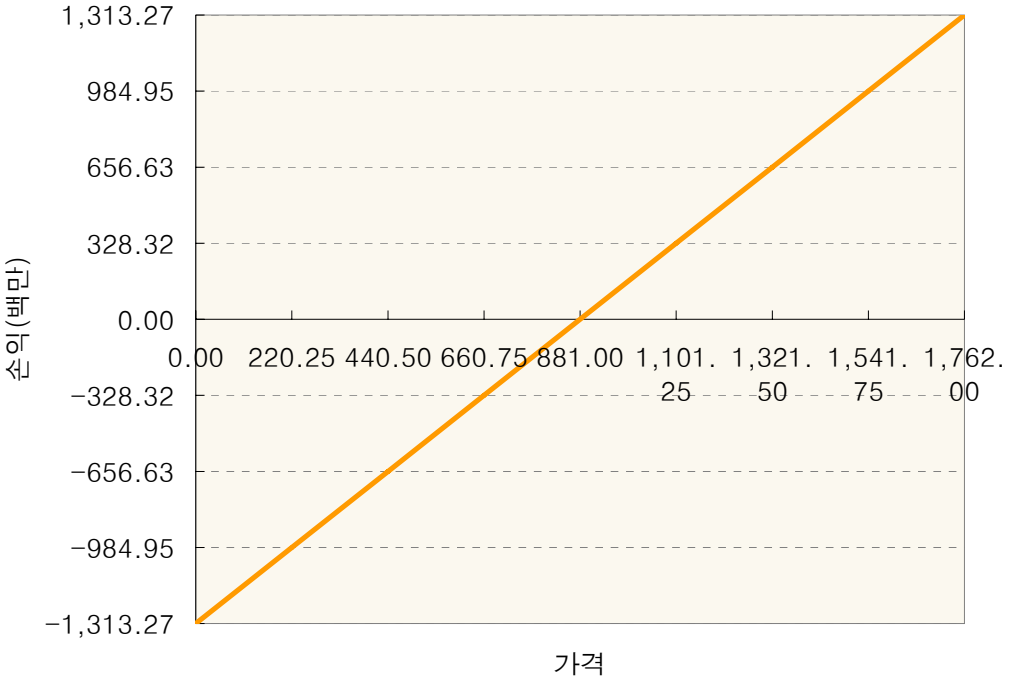

KWH6-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAR16



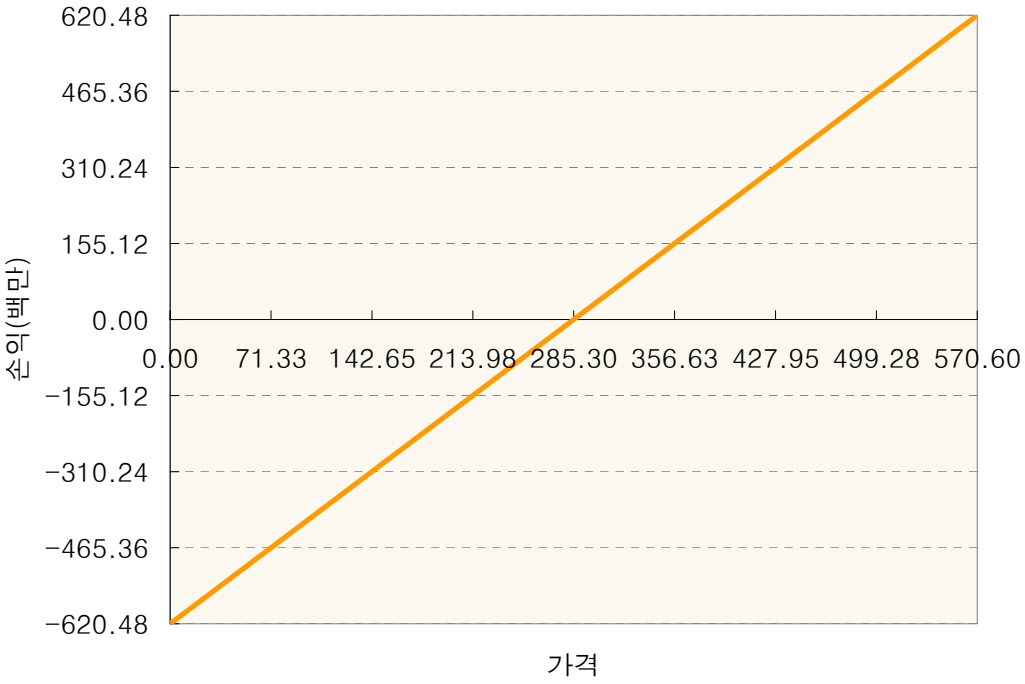

SBH6-Sugar #11 (WORLD) MAR16



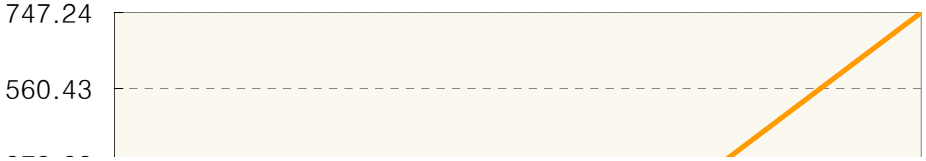

SF6-SOYBEAN FUTURE JAN16

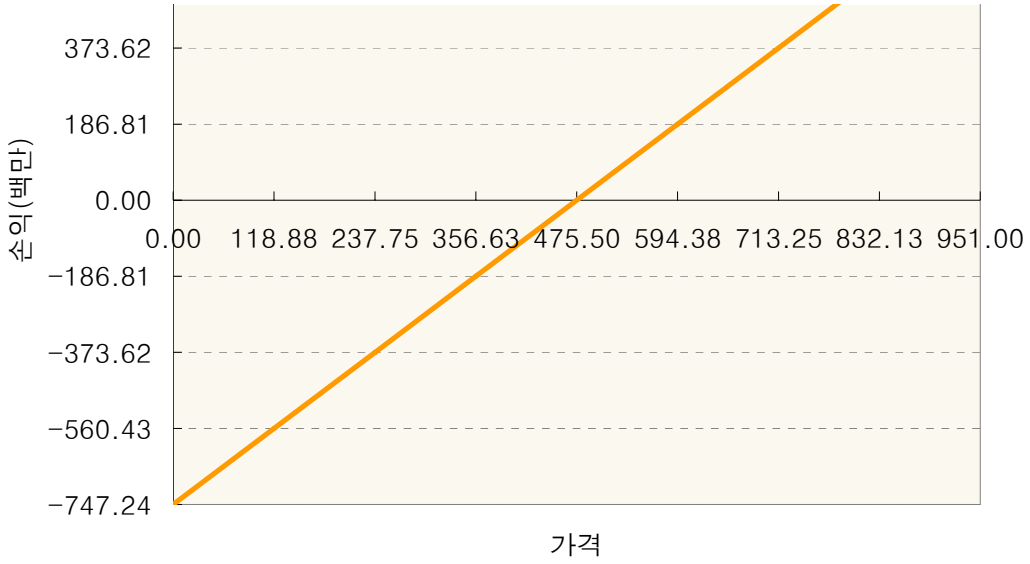



SMF6-SOYBEAN MEAL FUTR JAN16




WH6-WHEAT FUTURE(CBT) MAR16






### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| BOF6 | SOYBEAN OIL FUTR JAN16 | 49 |
| CH6 | CORN FUTURE MAR16 | 92 |
| CTH6 | COTTON NO.2 FUTR MAR16 | 38 |
| KCH6 | COFFEE "C" FUTURE MAR16 | 33 |
| KWH6 | KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAR16 | 24 |
| SBH6 | Sugar #11 (WORLD) MAR16 | 79 |
| SF6 | SOYBEAN FUTURE JAN16 | 105 |
| SMF6 | SOYBEAN MEAL FUTR JAN16 | 50 |
| WH6 | WHEAT FUTURE(CBT) MAR16 | 60 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **743** |