공시일	2015-12-03
기준일	2015-12-02

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	2015-12-03
기준일	2015-12-02

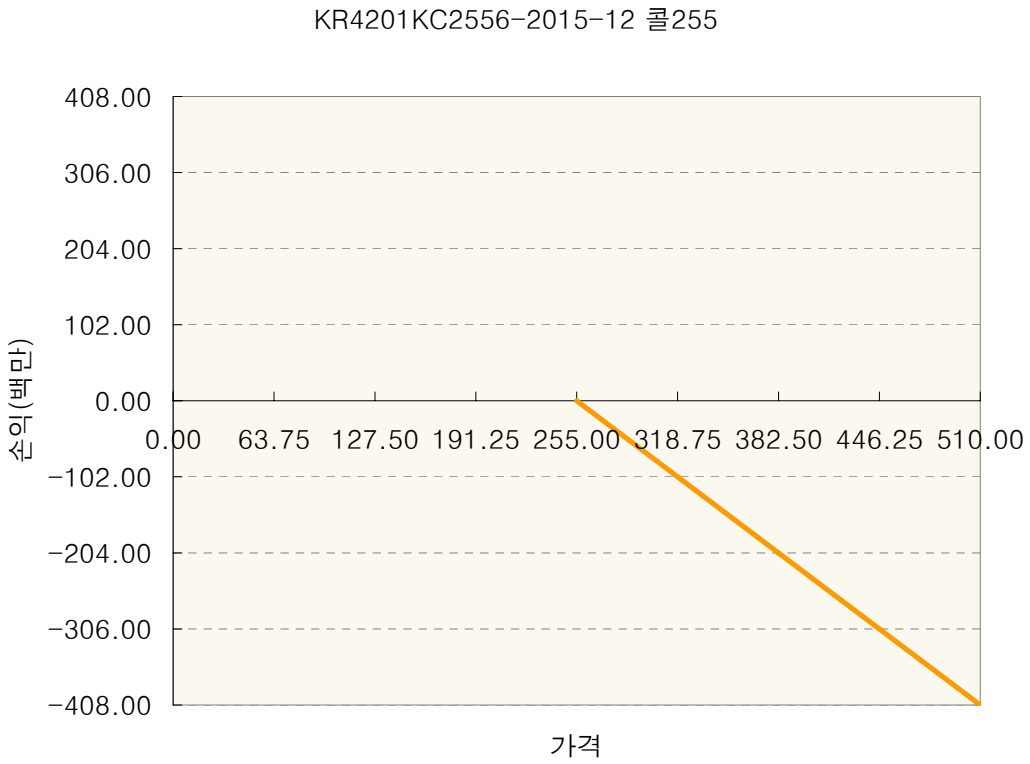
차곡차곡플러스모(주식혼합-파생)

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 | 91

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1
-2.67%	1	1	1	1	1	1	1
0%	1	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	-5	-6	-8	-9	-10	-11	-13
5.33%	-39	-40	-40	-41	-42	-43	-44
8.00%	-90	-90	-90	-90	-90	-91	-91

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	55

공시일	2015-12-03
기준일	2015-12-02

스마트인덱스모

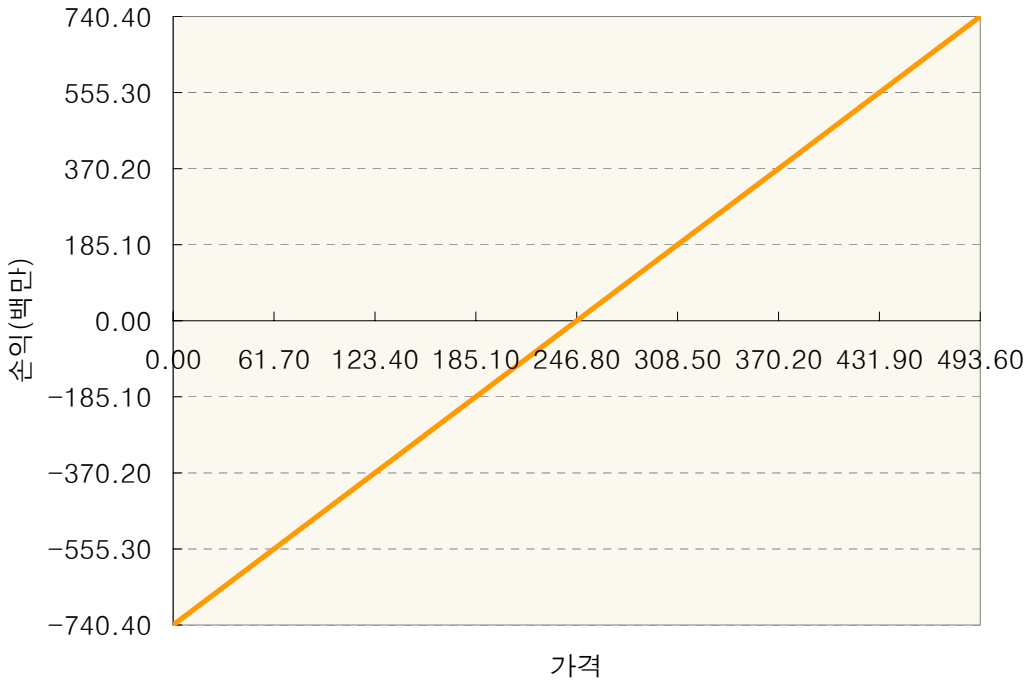
1. 계약금액

(단위:백만원)

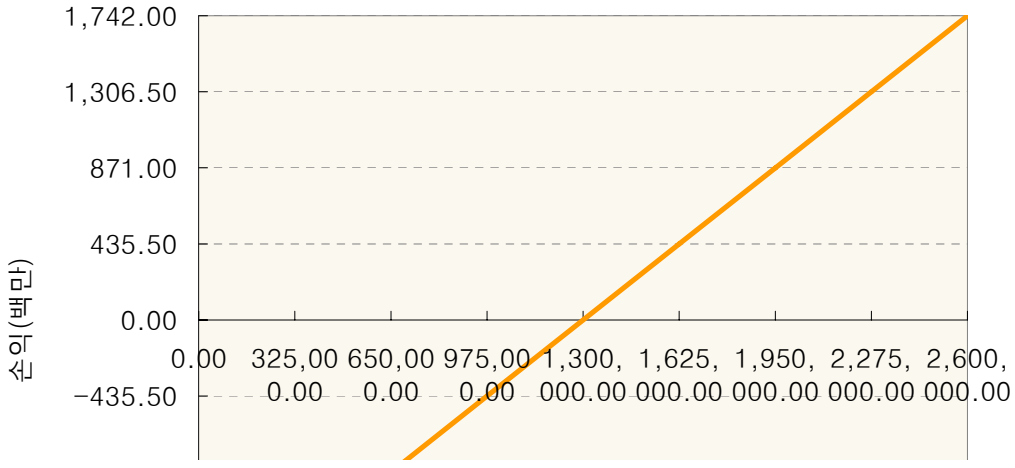
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	247	-247	장내
누계	유가증권	선물	2,482	0	2,482	장내

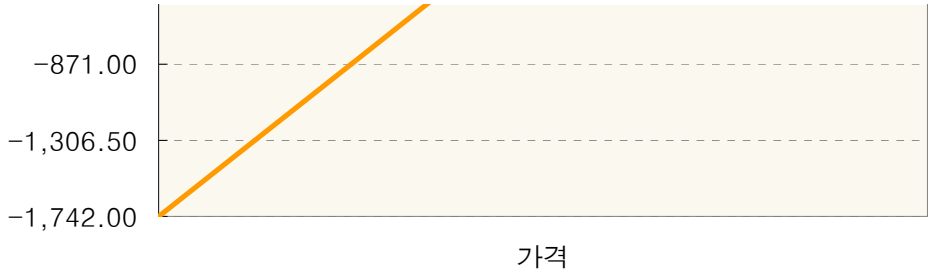
2. 만기시점의 손익구조

KR4101KC0007-2015-12 지수선물



KR4111KC0005-2015-12 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101KC0C 2015-12 지수선물							59
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
-5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-2.67%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	20	20	20	20	20	20	20
5.33%	39	39	39	39	39	39	39
8.00%	59	59	59	59	59	59	59
KR4111KC0C 2015-12 삼성전자개별선물							139
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-139	-139	-139	-139	-139	-139	-139
-5.33%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
-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%	93	93	93	93	93	93	93
8.00%	139	139	139	139	139	139	139

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

(단위:백만원)

166

공시일	2015-12-03
기준일	2015-12-02

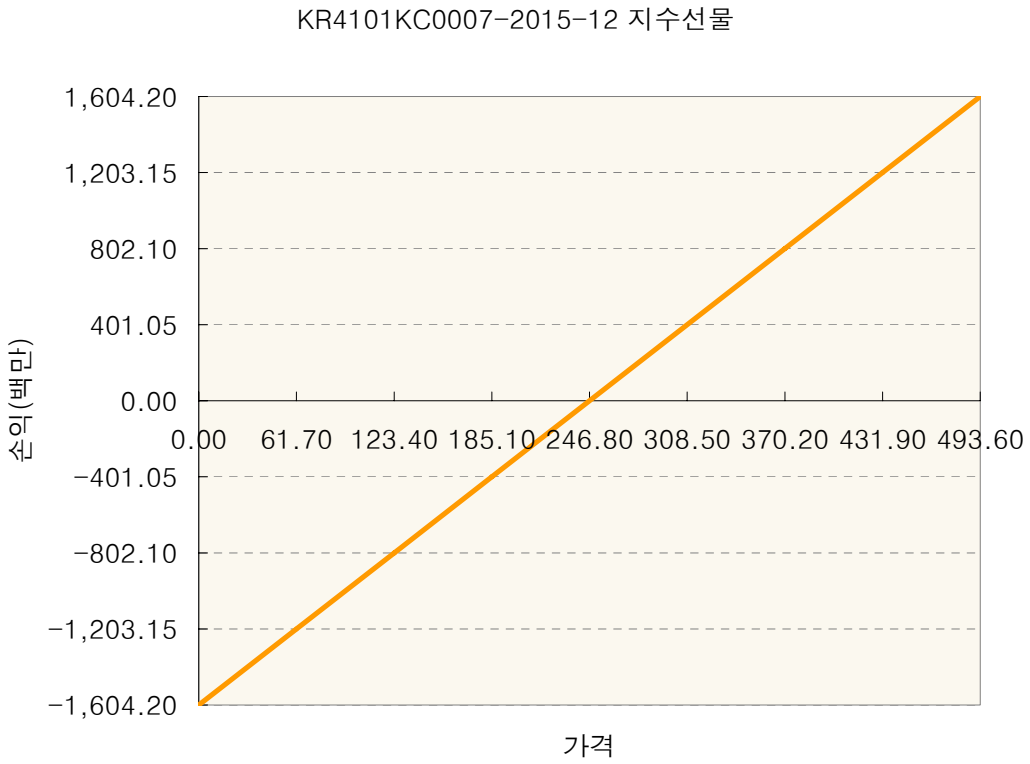
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,604	0	1,604	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)
	96

공시일	2015-12-03
기준일	2015-12-02

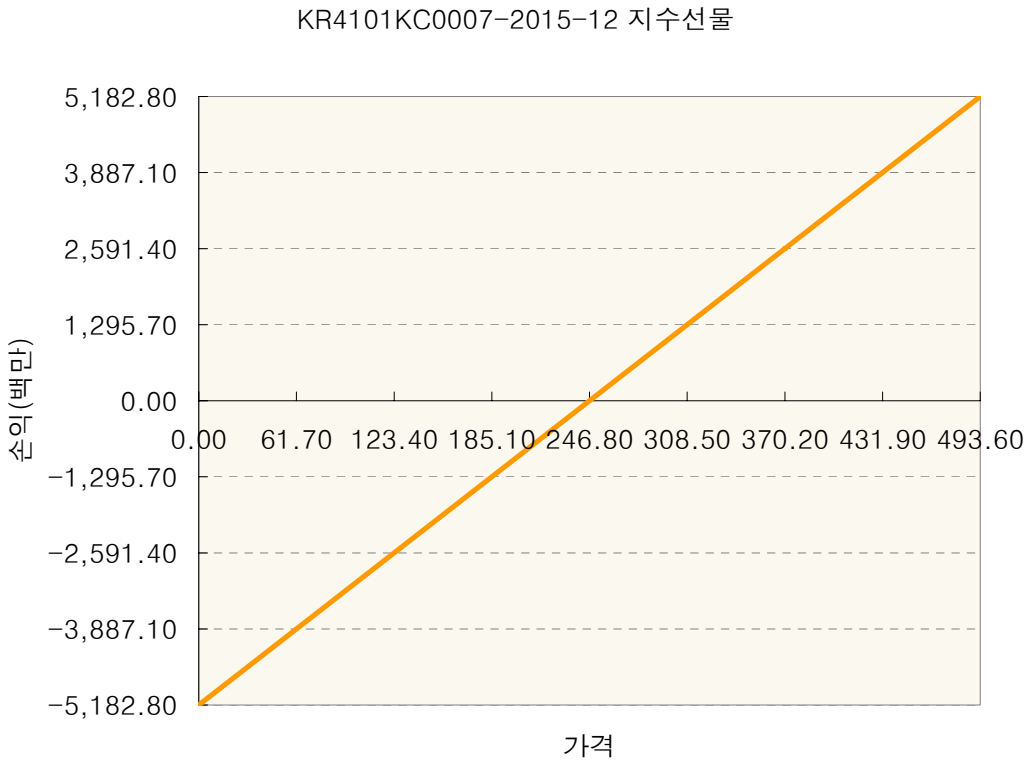
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	5,183	0	5,183	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101KC0C 2015-12 지수선물 414

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-414	-414	-414	-414	-414	-414	-414
-5.33%	-276	-276	-276	-276	-276	-276	-276
-2.67%	-138	-138	-138	-138	-138	-138	-138
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	138	138	138	138	138	138	138
5.33%	276	276	276	276	276	276	276
8.00%	414	414	414	414	414	414	414

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	312

공시일	2015-12-03
기준일	2015-12-02

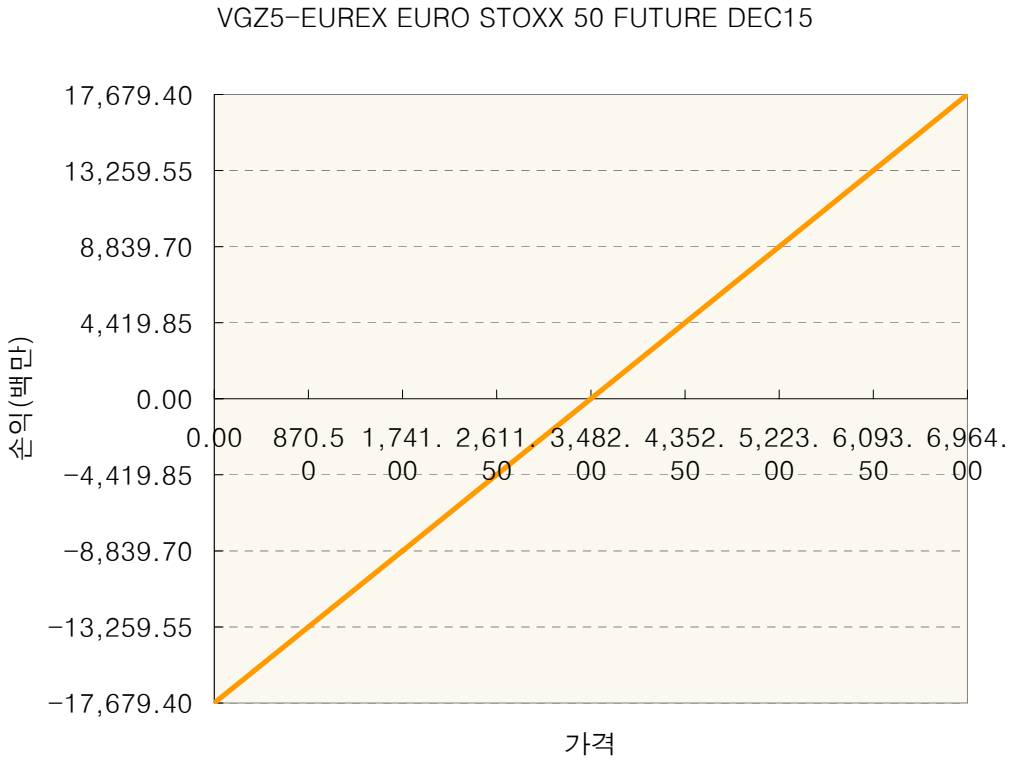
유로인덱스1호(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	17,679	0	17,679	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ5	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE DEC15	1,414

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

(단위:백만원)

1,536

공시일	2015-12-03
기준일	2015-12-02

차이나인덱스(주식-파생형)(종)

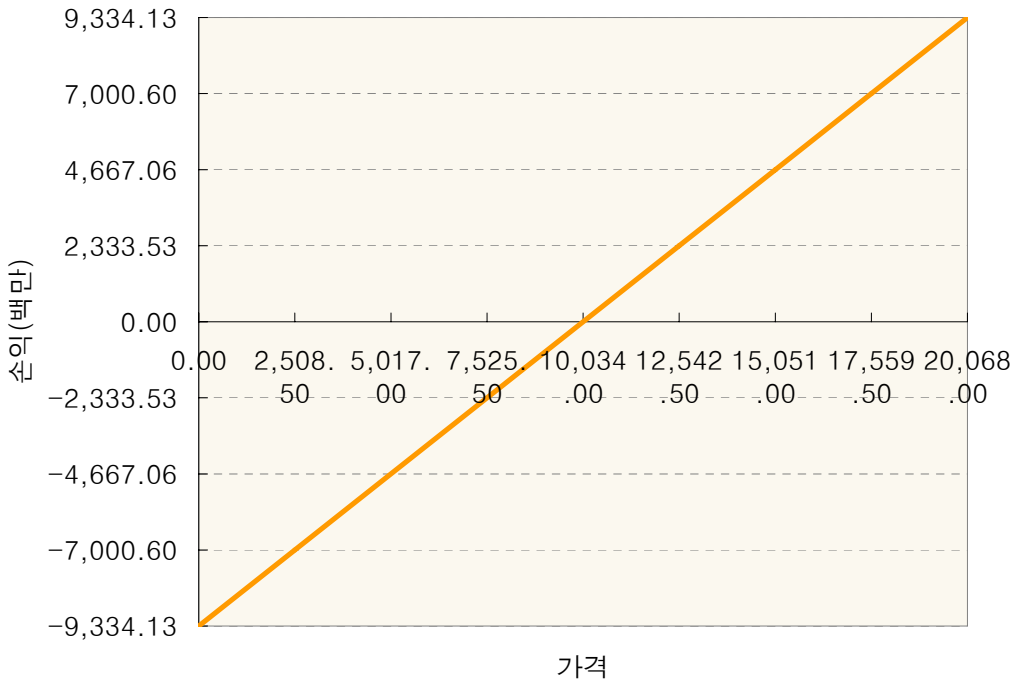
1. 계약금액

(단위:백만원)

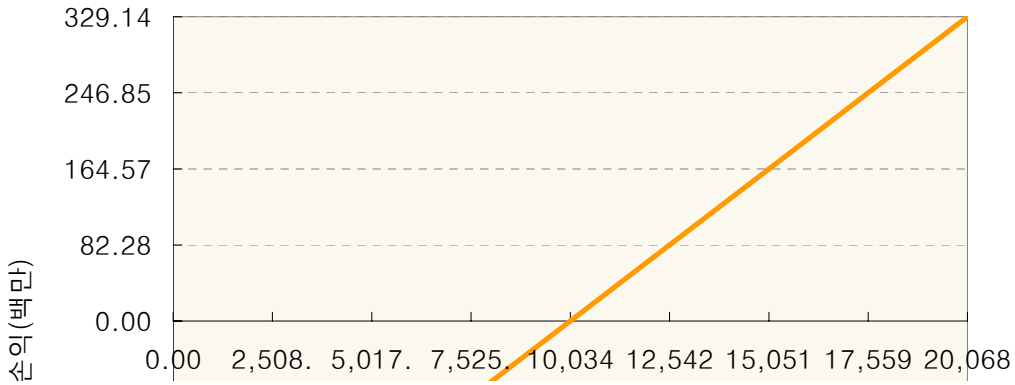
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,334	0	9,334	
누계	유가증권	선물	329	0	329	장내

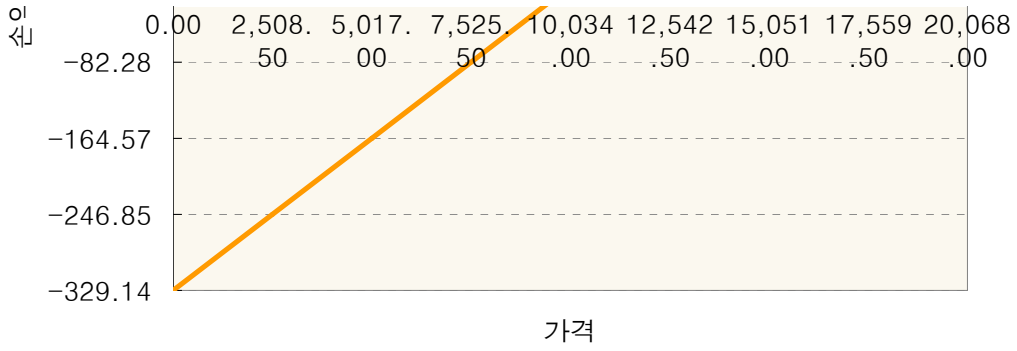
2. 만기시점의 손익구조

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	747
MHCZ5	HKG MINI HANG SENG CHINA H-SHR IDX FUT D	26

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

(단위:백만원)

799

공시일	2015-12-03
기준일	2015-12-02

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	1,271

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

946

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2015-12-03
기준일	2015-12-02

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	22

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

51

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2015-12-03
기준일	2015-12-02

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	497
SWCSI50000 신한CSI500미래S09092	153

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,742

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2015-12-03
기준일	2015-12-02

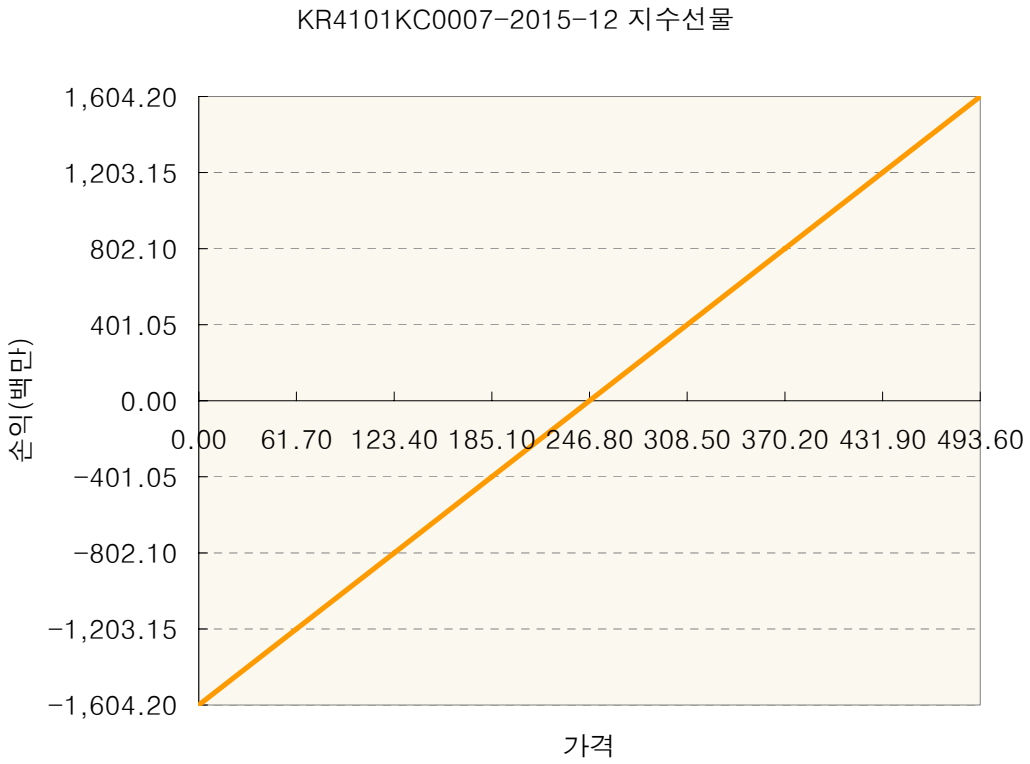
KOSPI200 레버리지 목표전환형 3

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	1,604	0	1,604	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)
	96

공시일	2015-12-03
기준일	2015-12-02

메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

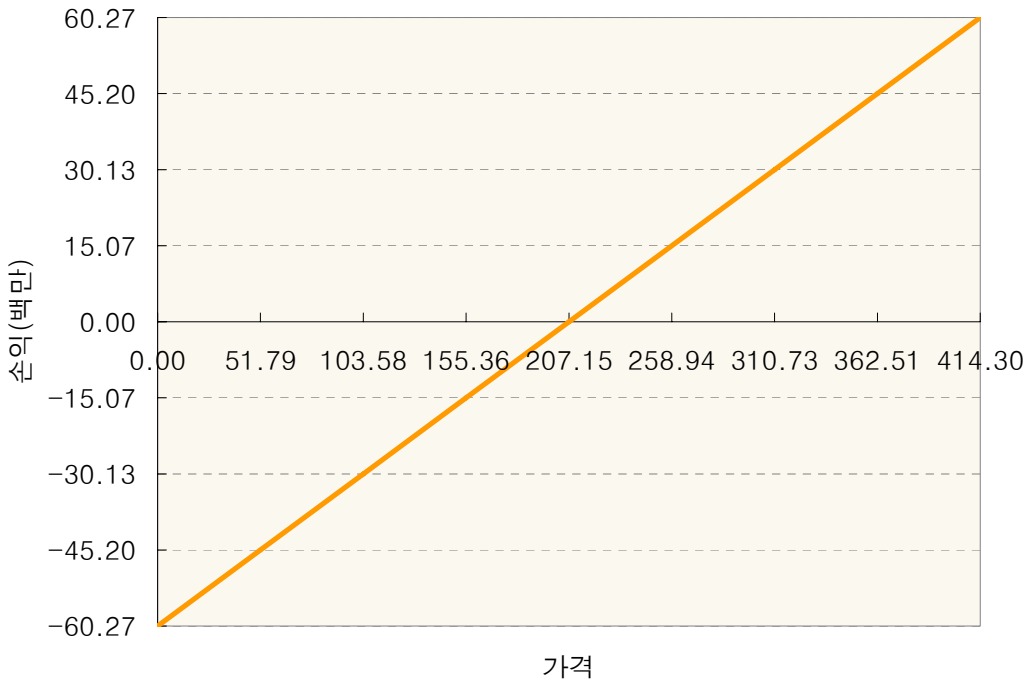
1. 계약금액

(단위:백만원)

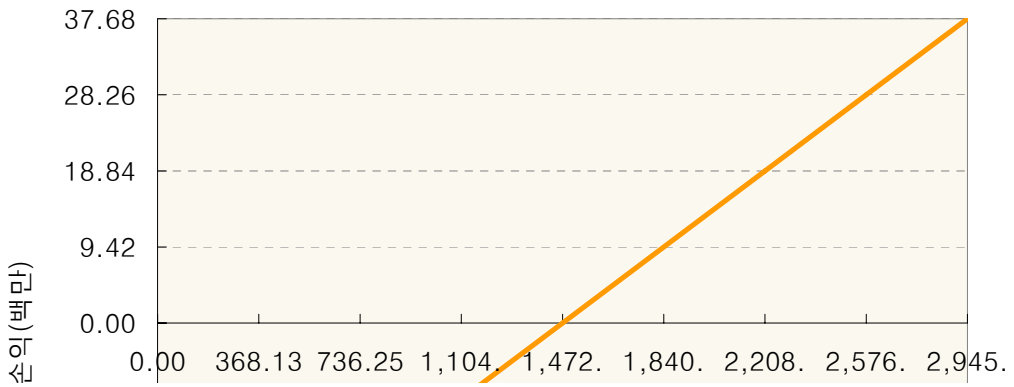
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	16	0	16	
누계	유가증권	선물	393	101	292	

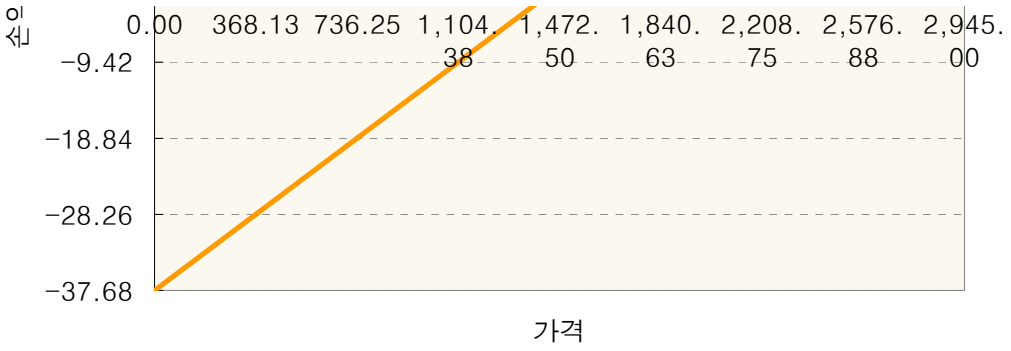
2. 만기시점의 손익구조

HGH6-COPPER FUTURE MAR16

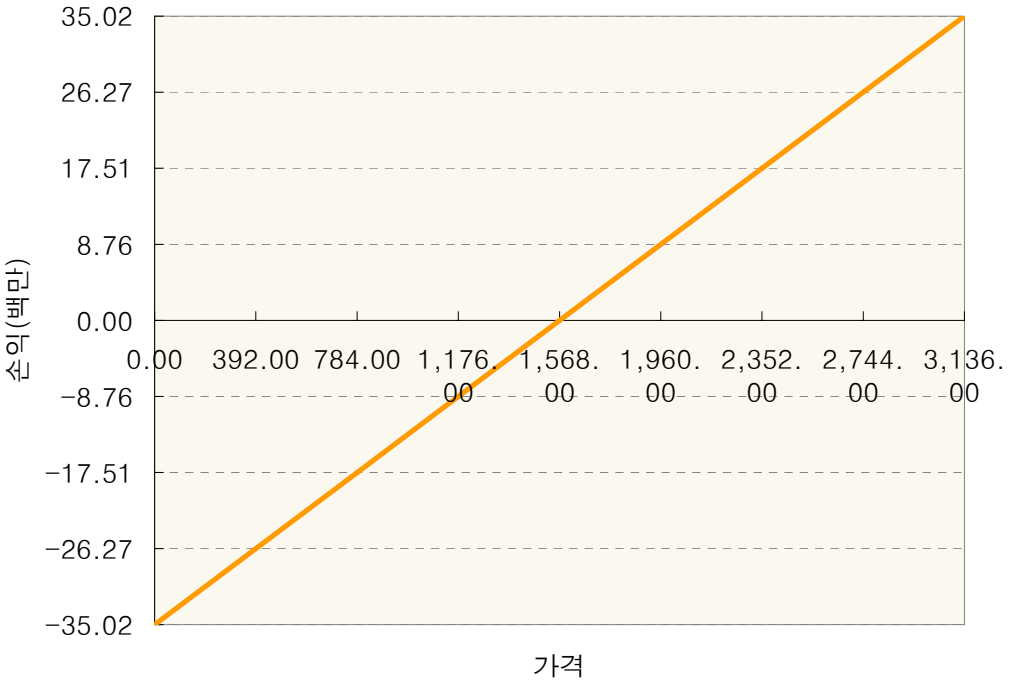


LAF6-LME PRI ALUM FUTR JAN16

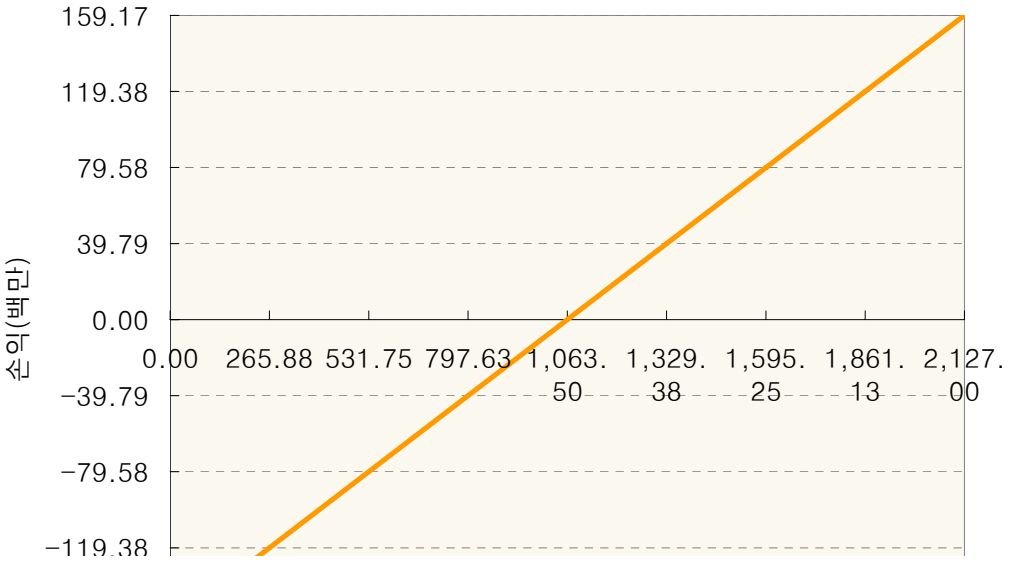


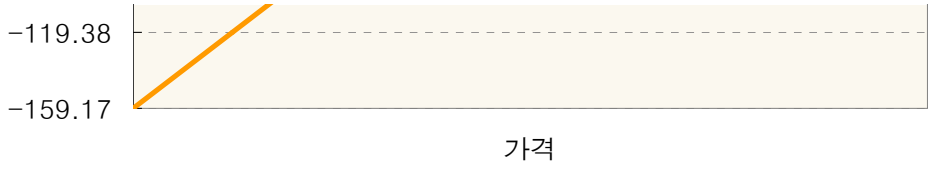


LXF6-LME ZINC FUTURE JAN16

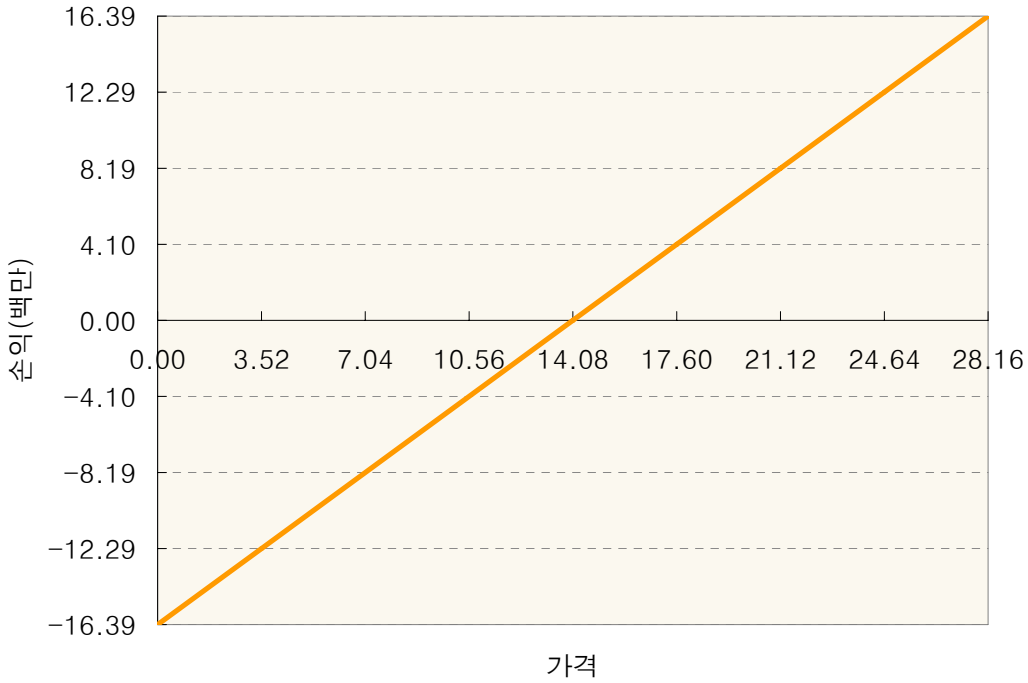


XGG6-MINI GOLD FUTURE FEB16





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	2015-12-03
기준일	2015-12-02

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

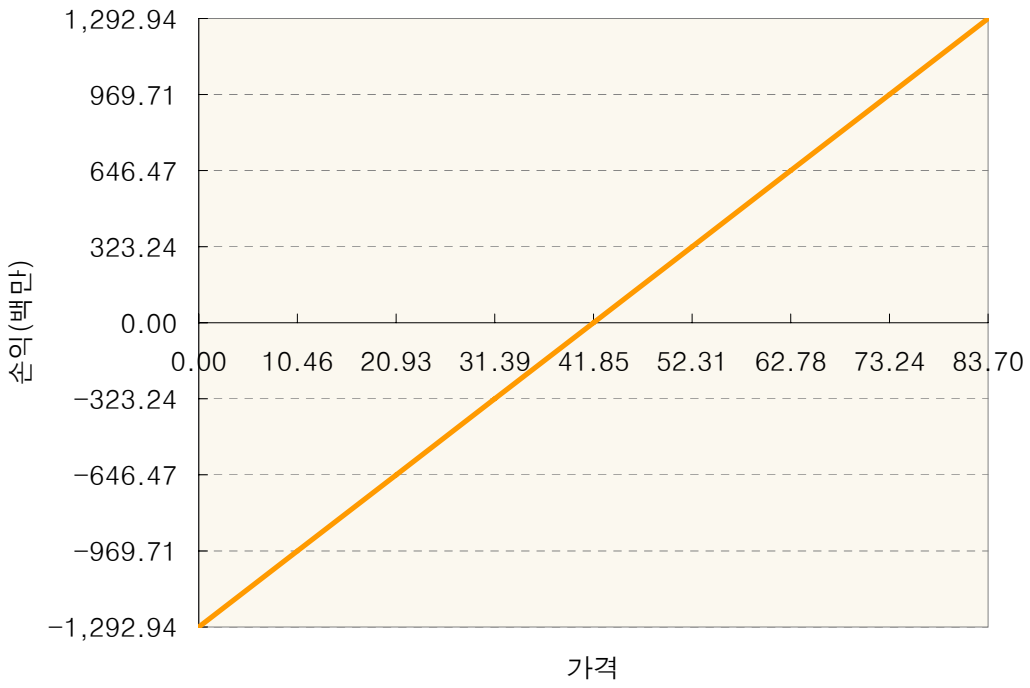
1. 계약금액

(단위:백만원)

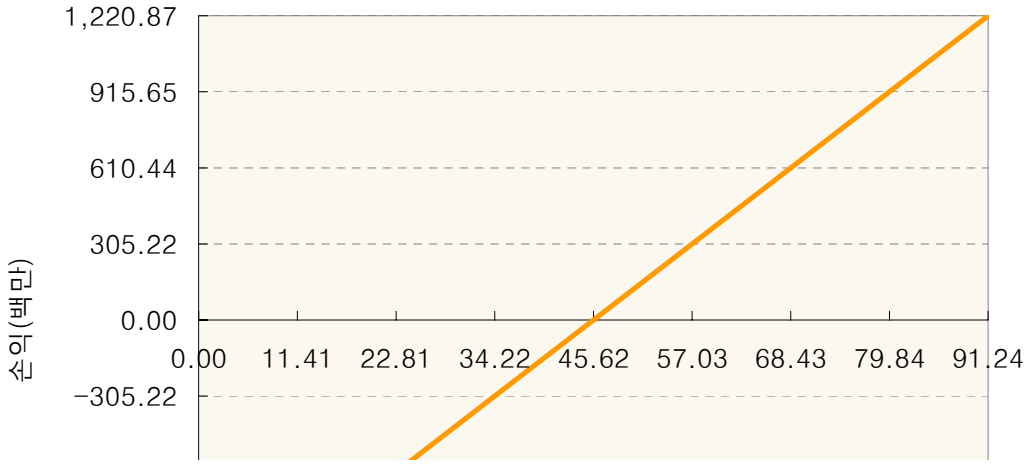
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,086	0	5,086	

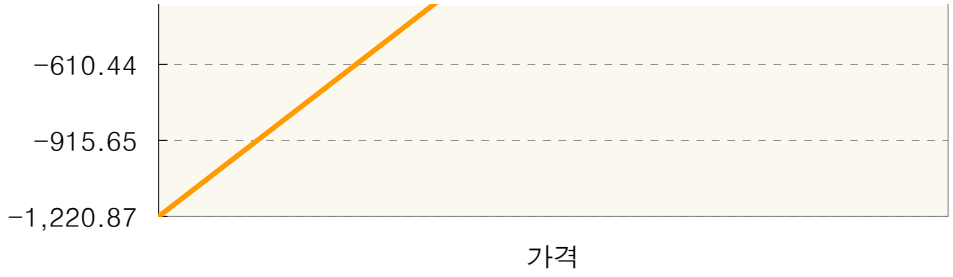
2. 만기시점의 손익구조

CLF6-WTI CRUDE FUTURE JAN16

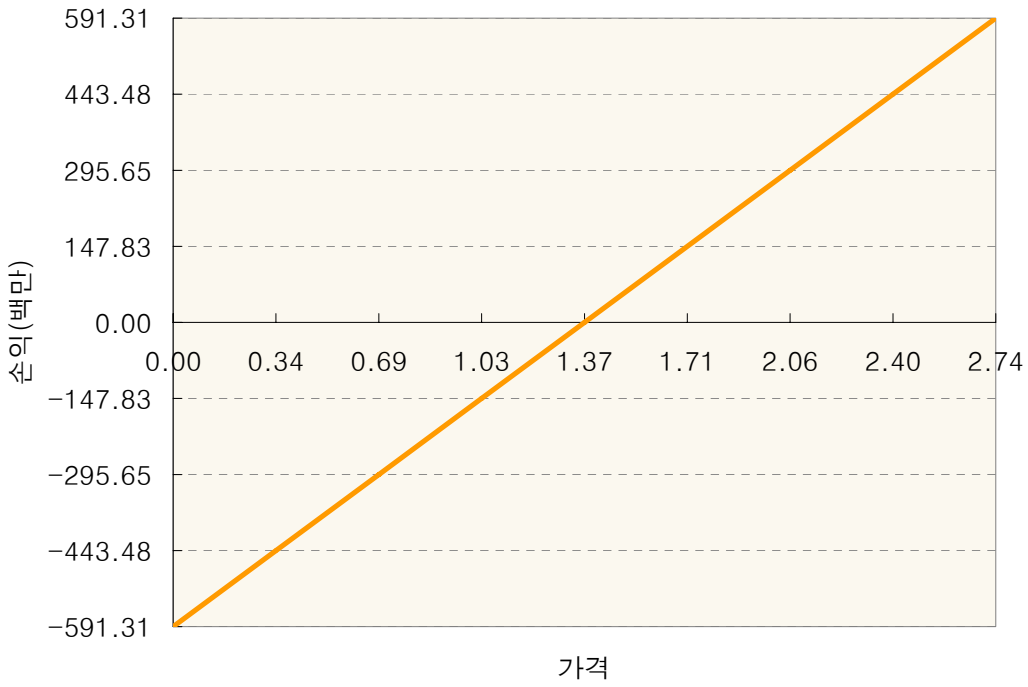


COH6-BRENT CRUDE FUTR MAR16

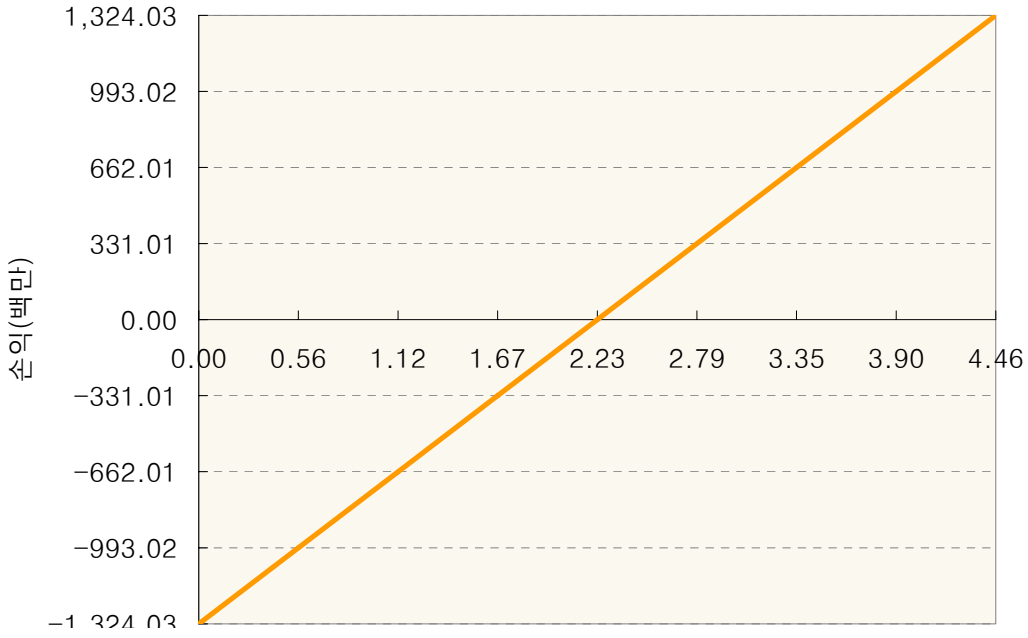


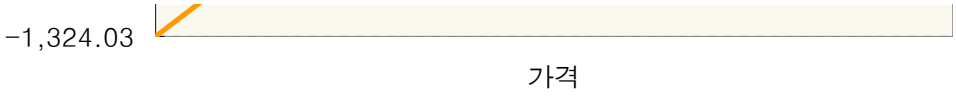


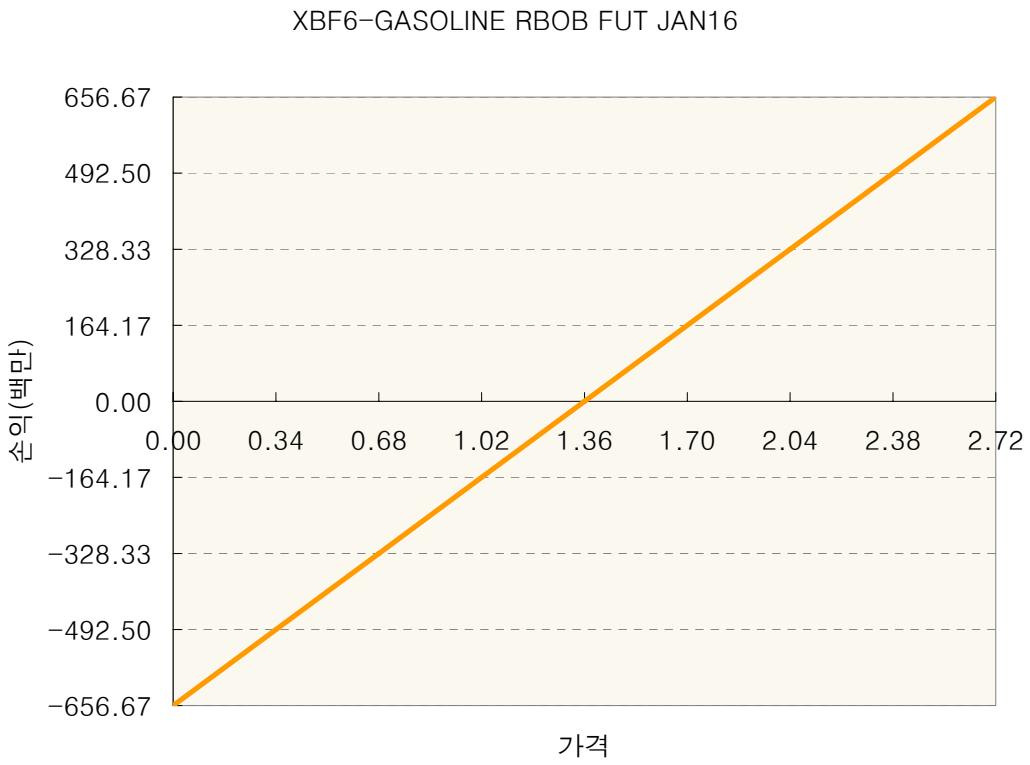
HOF6-NY Harb ULSD Fut JAN16



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	53

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,039

공시일	2015-12-03
기준일	2015-12-02

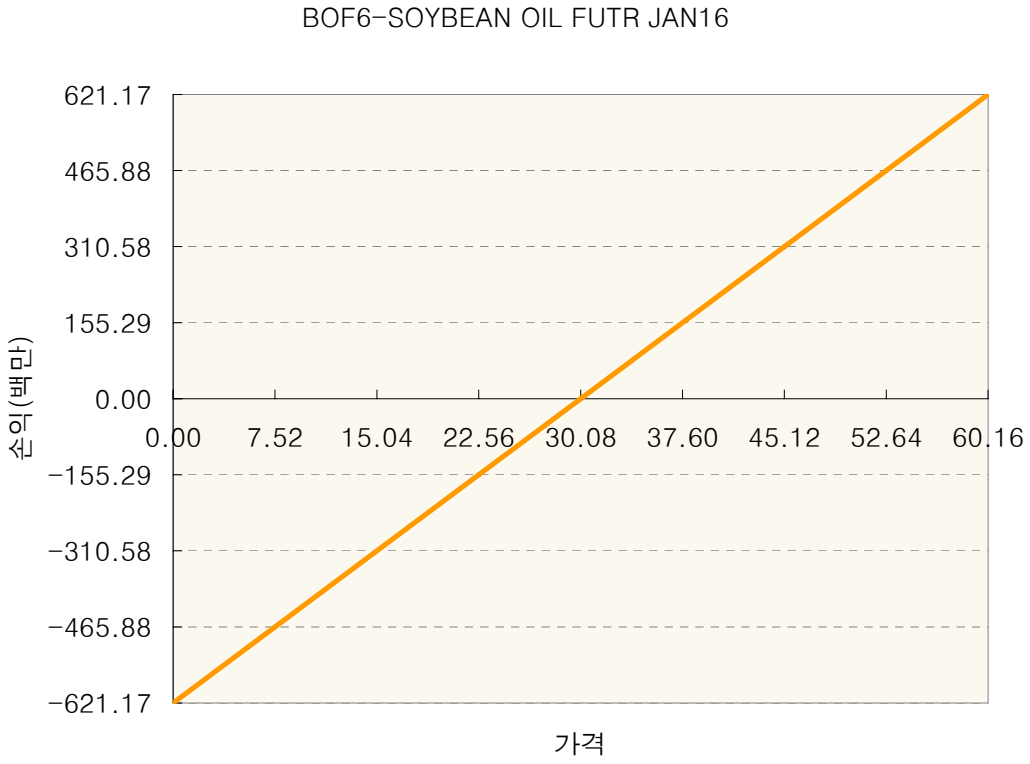
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

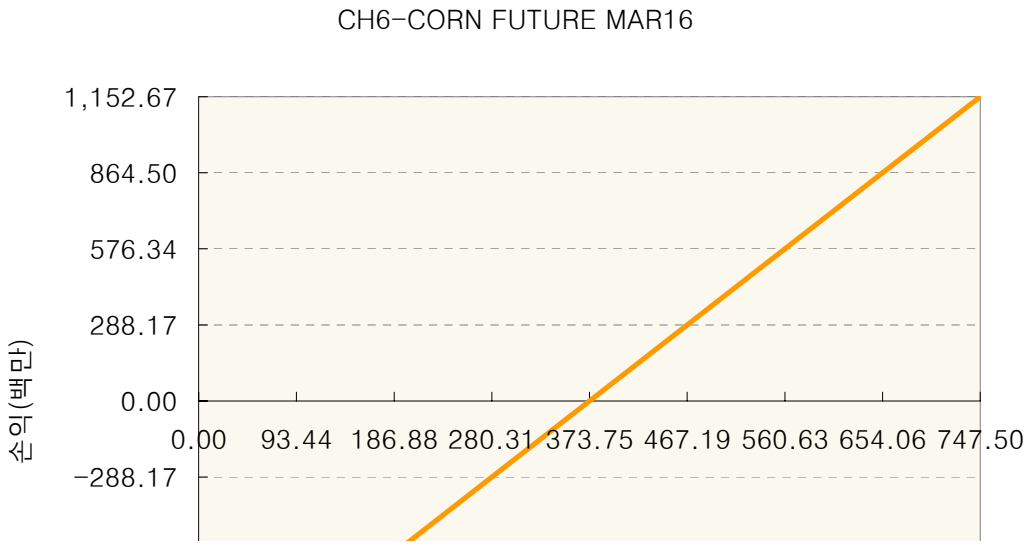
1. 계약금액

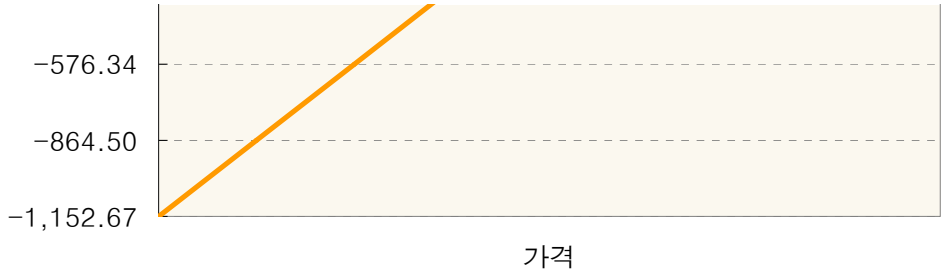
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,684	0	6,684	

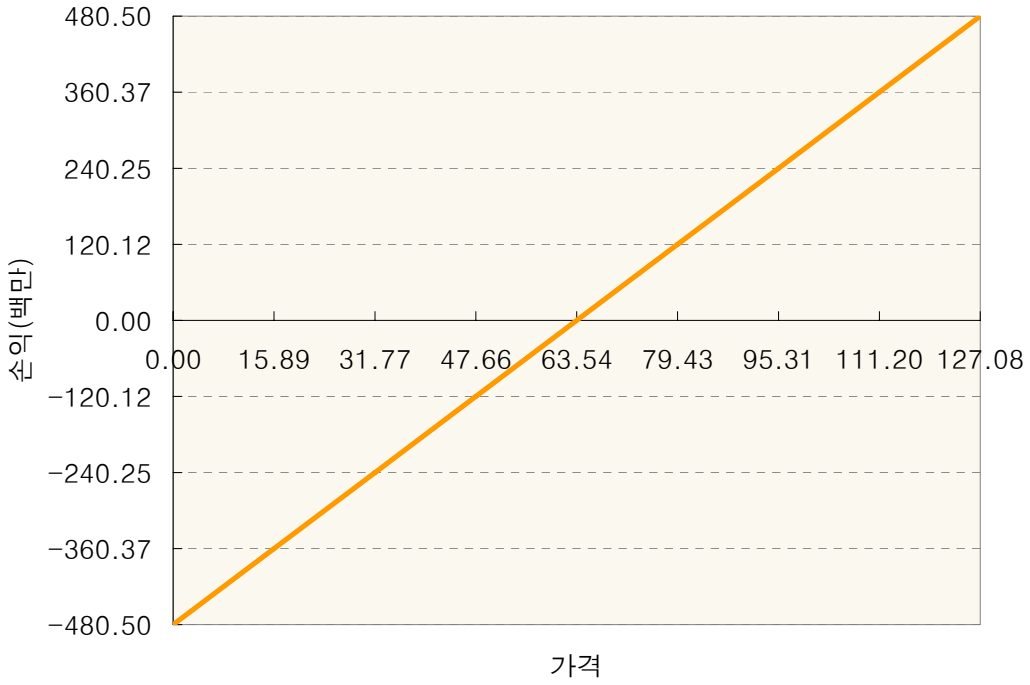
2. 만기시점의 손익구조



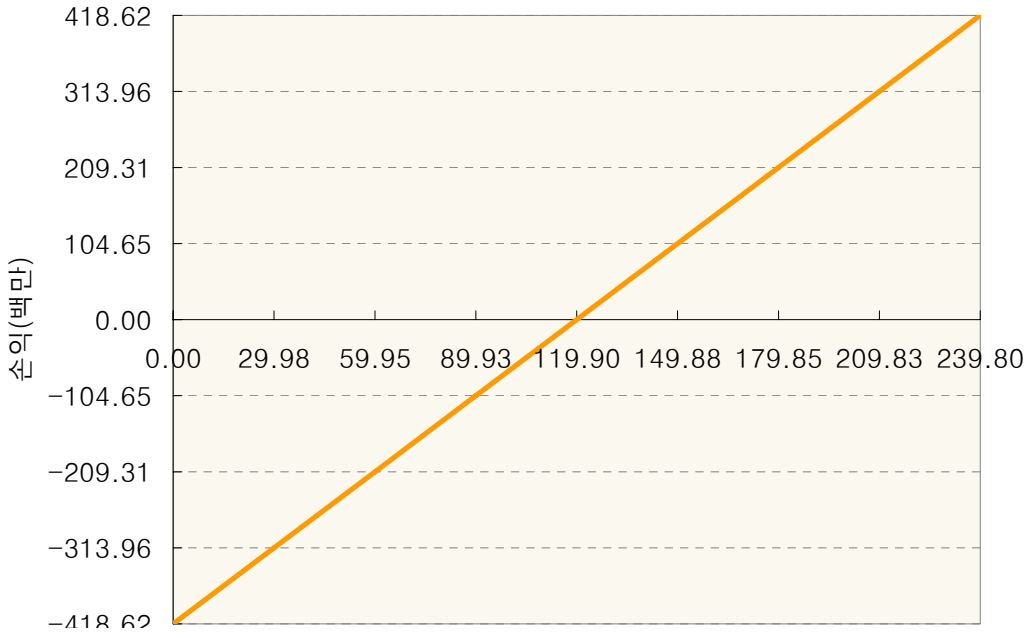


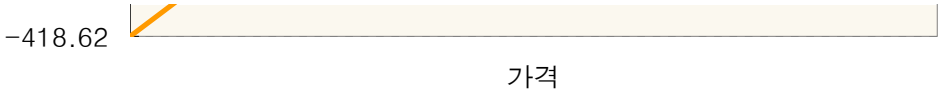


CTH6-COTTON NO.2 FUTR MAR16

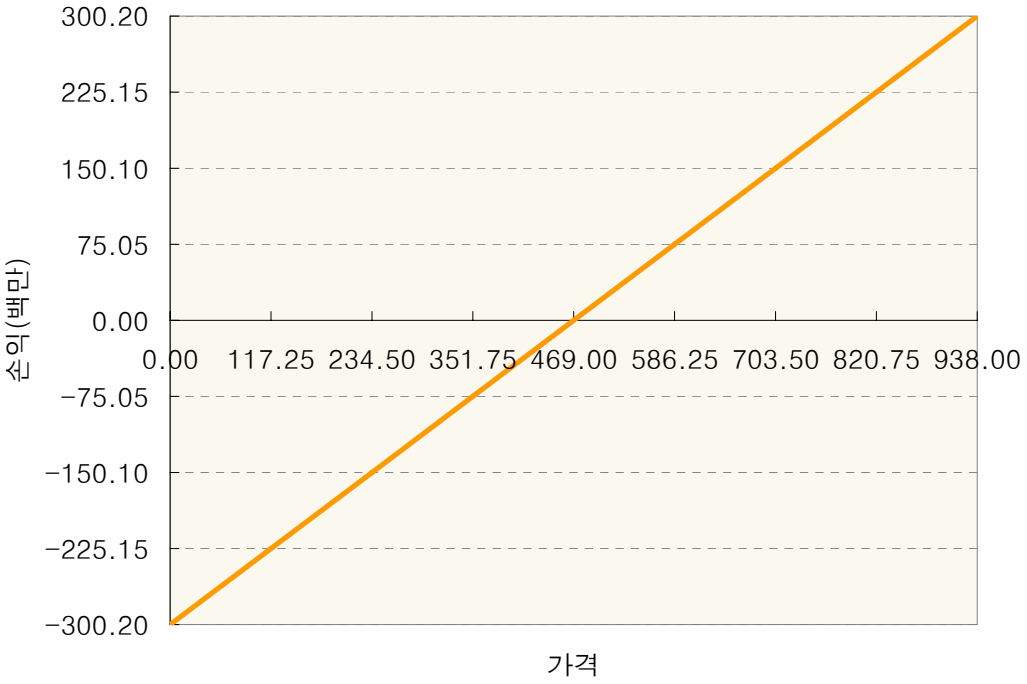


KCH6-COFFEE "C" FUTURE MAR16

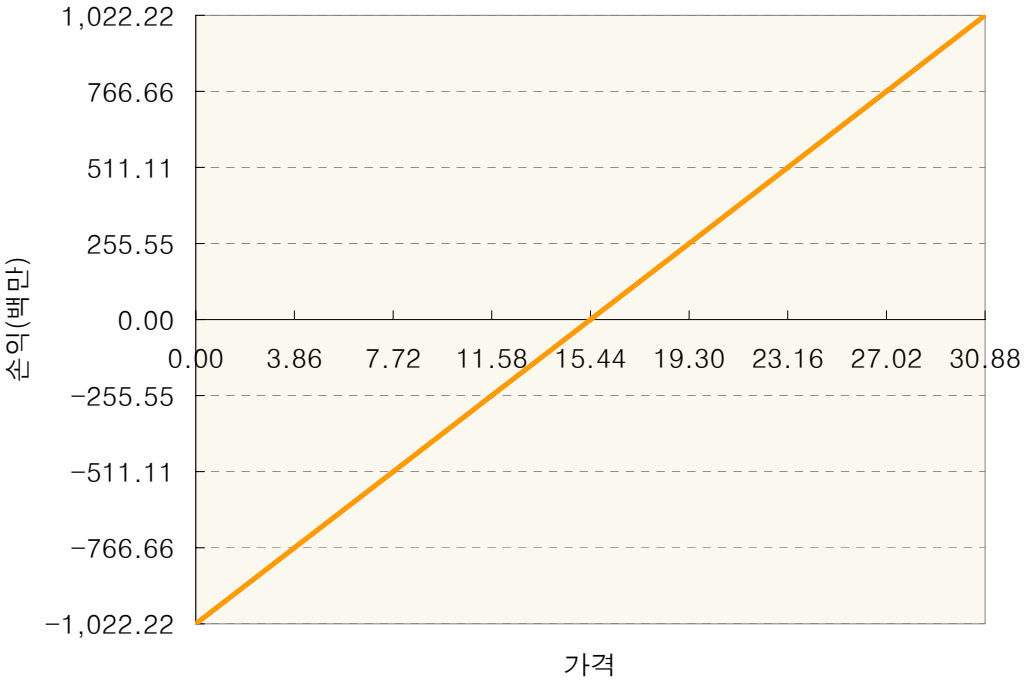




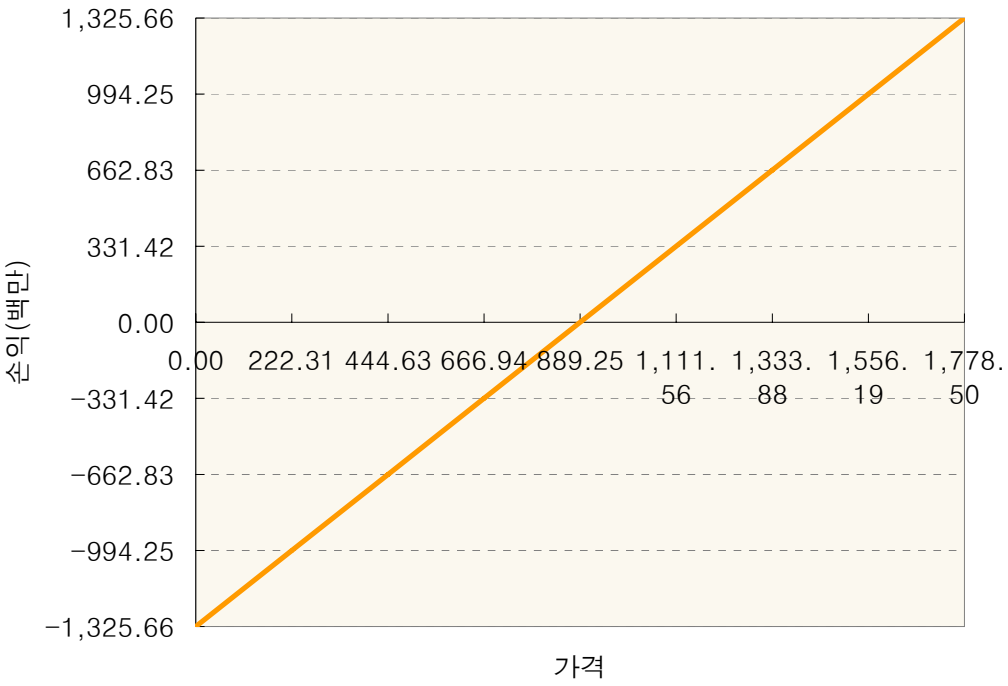
KWH6-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAR16



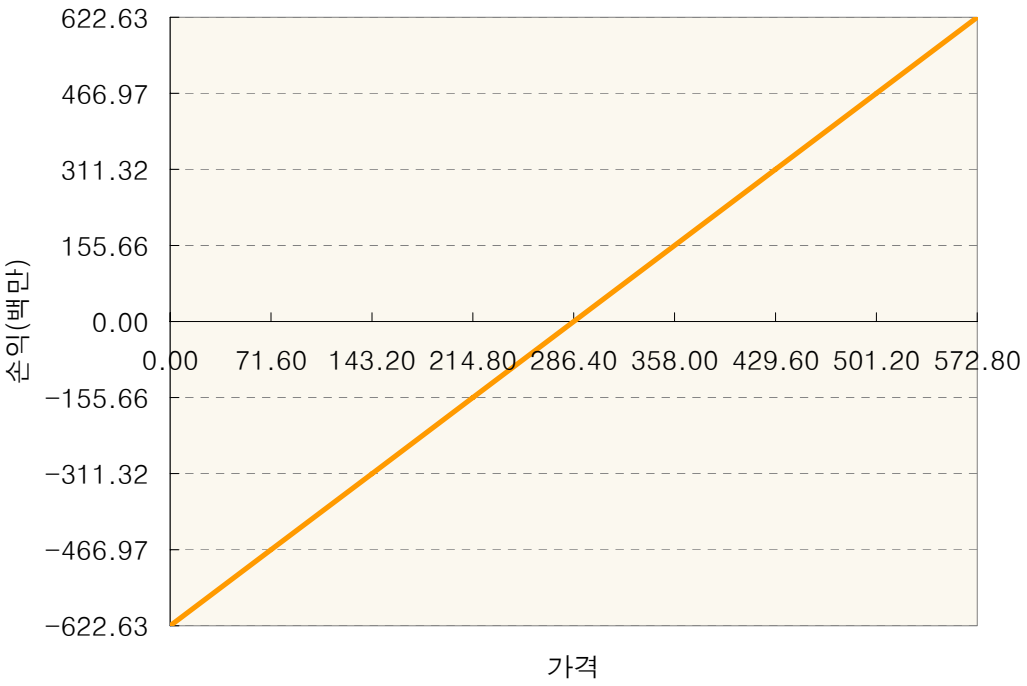
SBH6-Sugar #11 (WORLD) MAR16



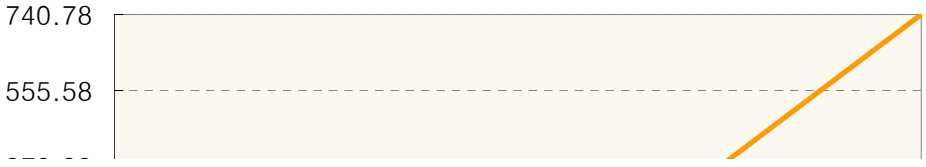
SF6-SOYBEAN FUTURE JAN16

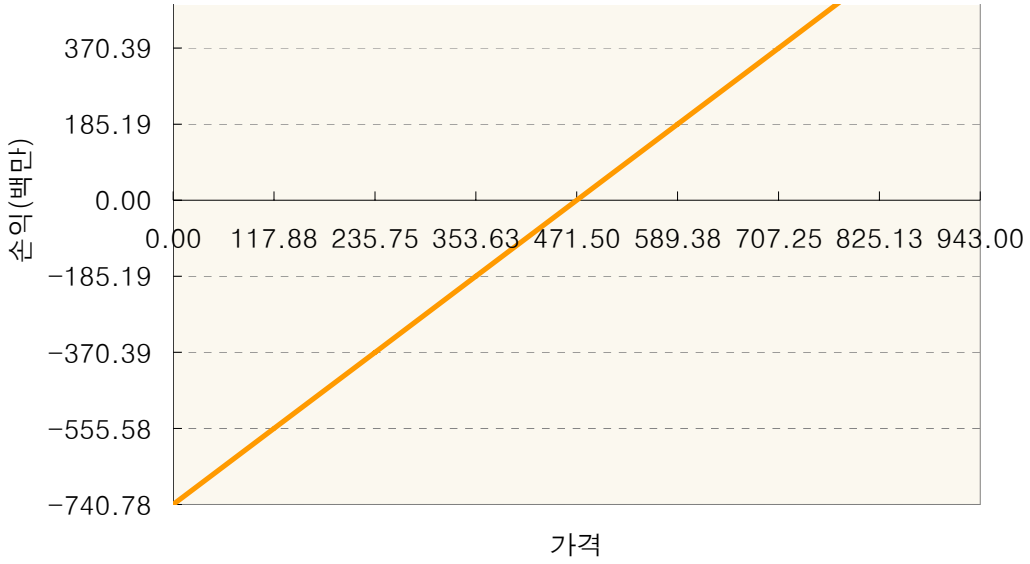


SMF6-SOYBEAN MEAL FUTR JAN16



WH6-WHEAT FUTURE(CBT) MAR16





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF6	SOYBEAN OIL FUTR JAN16	50
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	82
SF6	SOYBEAN FUTURE JAN16	106
SMF6	SOYBEAN MEAL FUTR JAN16	50
WH6	WHEAT FUTURE(CBT) MAR16	59

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

(단위:백만원)

750