| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-01-06 |
| 기준일 | 2017-01-05 |

# 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 | 10 | 0 | 10 | 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 | 2017-01-06 |
| 기준일 | 2017-01-05 |

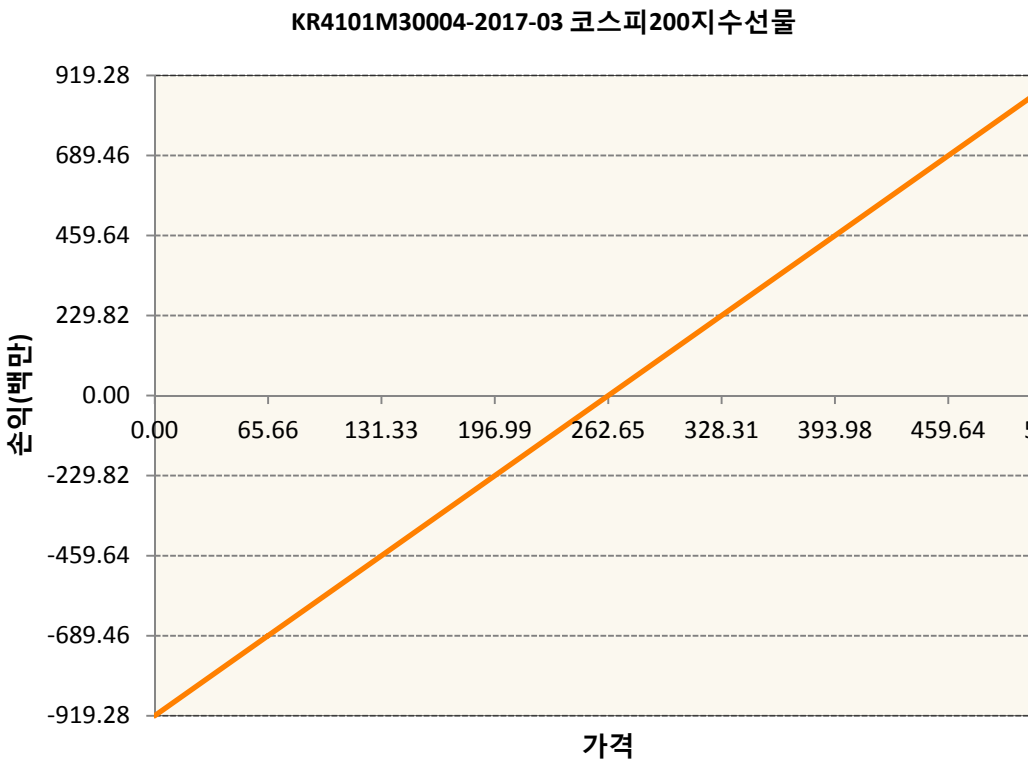
# 스마트인덱스모

## 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 | 919 | 0 | 919 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101M30( 2017-03 코스피200지수선물 | | | | | | | 73 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -73 | -73 | -73 | -73 | -73 | -73 | -73 |
| -5.33% | -49 | -49 | -49 | -49 | -49 | -49 | -49 |
| -2.67% | -24 | -24 | -24 | -24 | -24 | -24 | -24 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 24 | 24 | 24 | 24 | 24 | 24 | 24 |
| 5.33% | 49 | 49 | 49 | 49 | 49 | 49 | 49 |
| 8.00% | 73 | 73 | 73 | 73 | 73 | 73 | 73 |

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

| |
|---|
| **54** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-01-06 |
| 기준일 | 2017-01-05 |

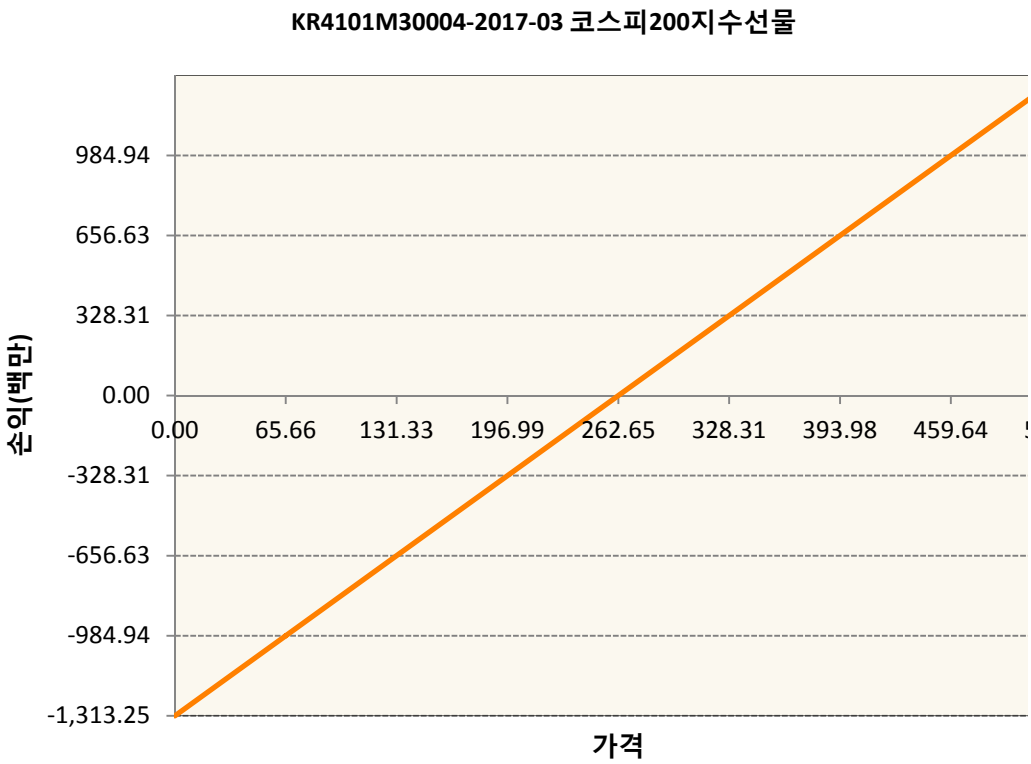
# 스마트레버리지목표전환형1호

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 131 | -131 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,313 | 0 | 1,313 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101M30( 2017-03 코스피200지수선물 | | | | | | | 105 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -105 | -105 | -105 | -105 | -105 | -105 | -105 |
| -5.33% | -70 | -70 | -70 | -70 | -70 | -70 | -70 |
| -2.67% | -35 | -35 | -35 | -35 | -35 | -35 | -35 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 35 | 35 | 35 | 35 | 35 | 35 | 35 |
| 5.33% | 70 | 70 | 70 | 70 | 70 | 70 | 70 |
| 8.00% | 105 | 105 | 105 | 105 | 105 | 105 | 105 |

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

| |
|---|
| **77** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-01-06 |
| 기준일 | 2017-01-05 |

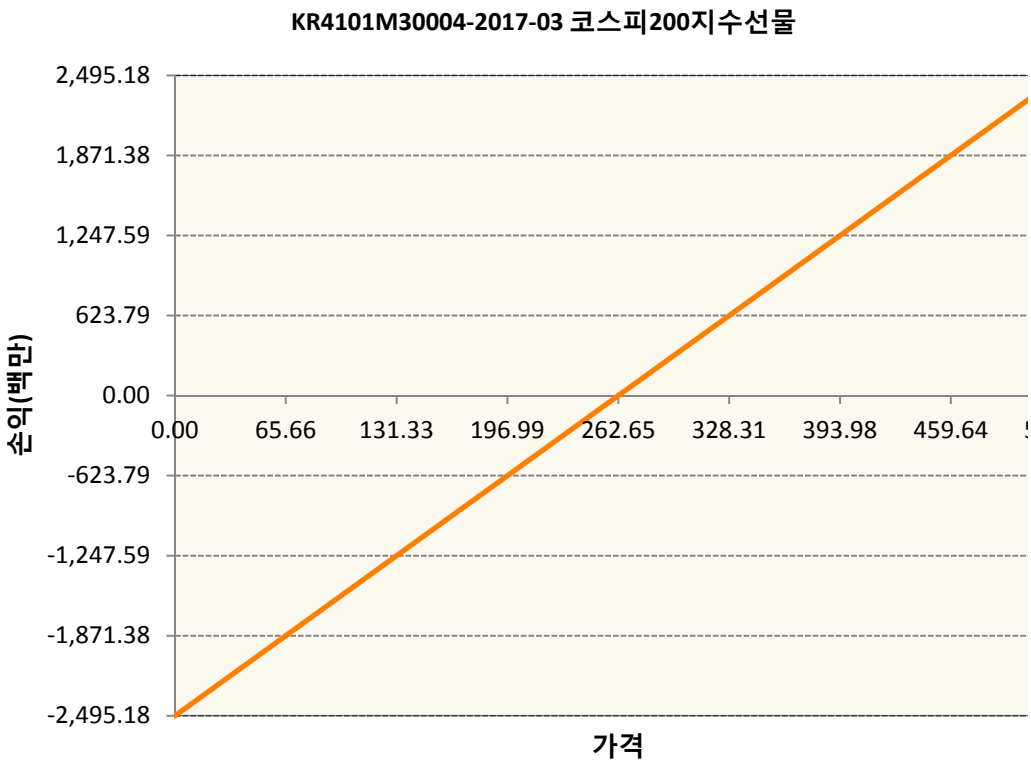
# 1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

## 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 | 2,495 | 0 | 2,495 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101M30( 2017-03 코스피200지수선물 | | | | | | | 199 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -199 | -199 | -199 | -199 | -199 | -199 | -199 |
| -5.33% | -133 | -133 | -133 | -133 | -133 | -133 | -133 |
| -2.67% | -66 | -66 | -66 | -66 | -66 | -66 | -66 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 66 | 66 | 66 | 66 | 66 | 66 | 66 |
| 5.33% | 133 | 133 | 133 | 133 | 133 | 133 | 133 |
| 8.00% | 199 | 199 | 199 | 199 | 199 | 199 | 199 |

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

| |
|---|
| **146** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-01-06 |
| 기준일 | 2017-01-05 |

# 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 | 11,013 | 0 | 11,013 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| SWMXWO0( 신한MXWO 미래S161122 | 916 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **708** |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| 공시일 | 2017-01-06 |
|---|---|
| 기준일 | 2017-01-05 |

# 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 | 4,972 | 0 | 4,972 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| SWCSI50000 신한CSI500미래S161208 | 387 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **678** |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-01-06 |
| 기준일 | 2017-01-05 |

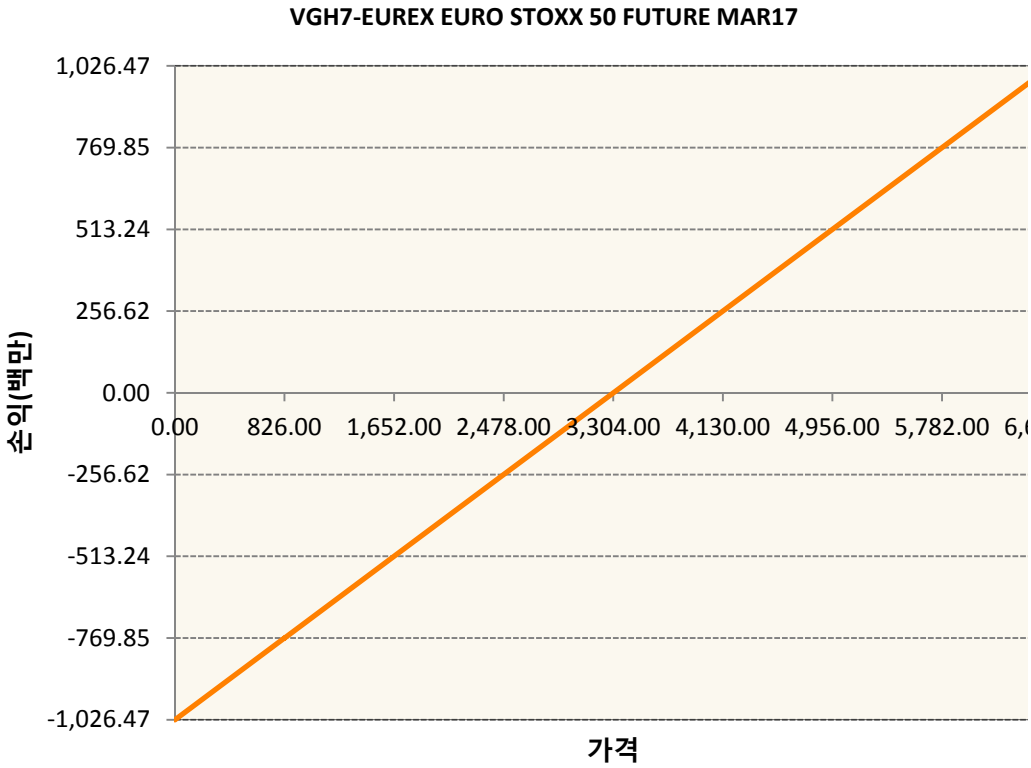
# 유로인덱스모(주식-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,026 | 0 | 1,026 | |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| VGH7 | EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17 | 82 |

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

(단위:백만원)

**94**

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-01-06 |
| 기준일 | 2017-01-05 |

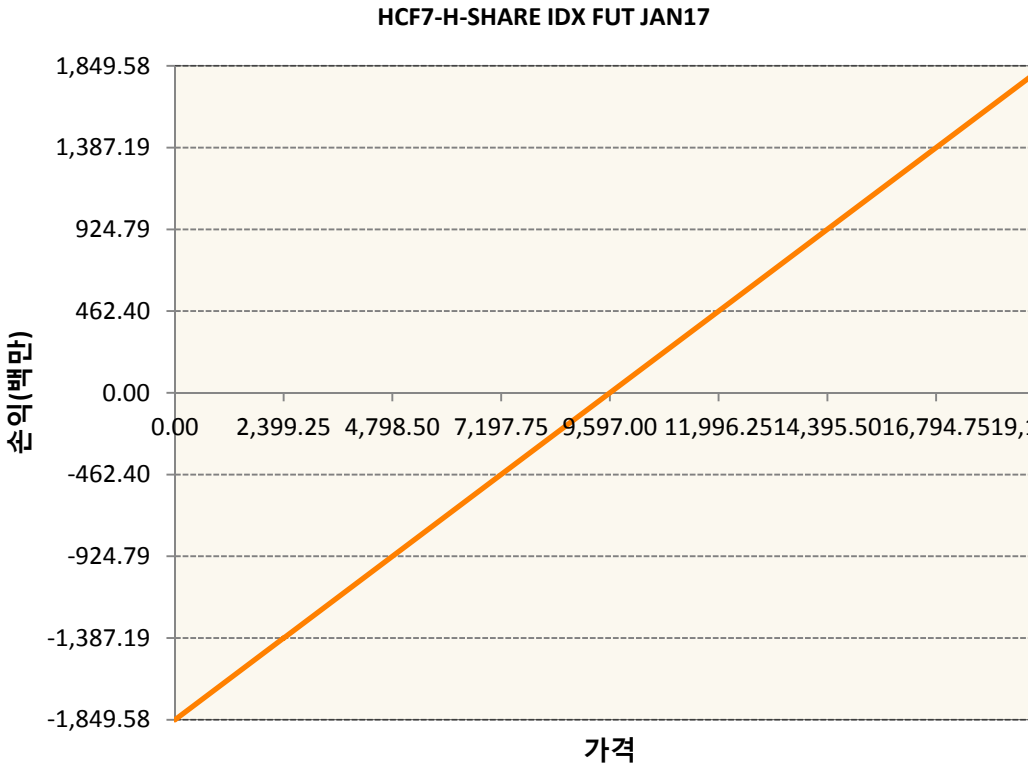
# 차이나인덱스모(주식-파생형)

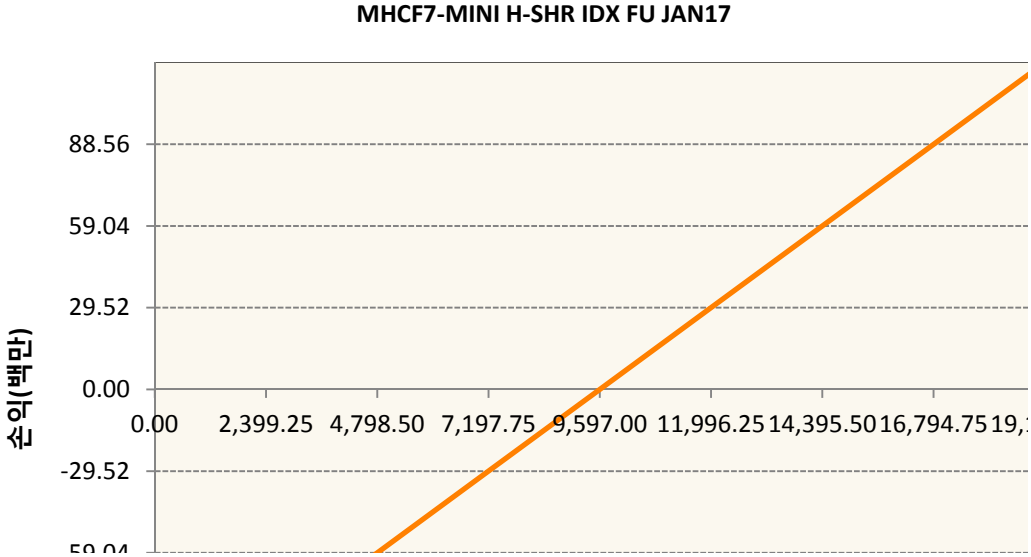
## 1. 계약금액

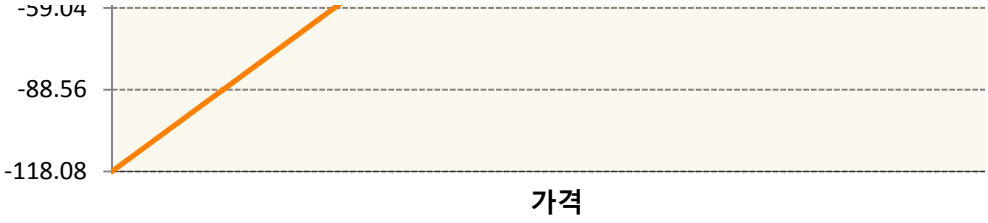
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,968 | 0 | 1,968 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조






| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---|---|
| HCF7 | H-SHARE IDX FUT JAN17 | 148 |
| MHCF7 | MINI H-SHR IDX FU JAN17 | 9 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|---|---|
| | **193** |

| 공시일 | 2017-01-06 |
|---|---|
| 기준일 | 2017-01-05 |

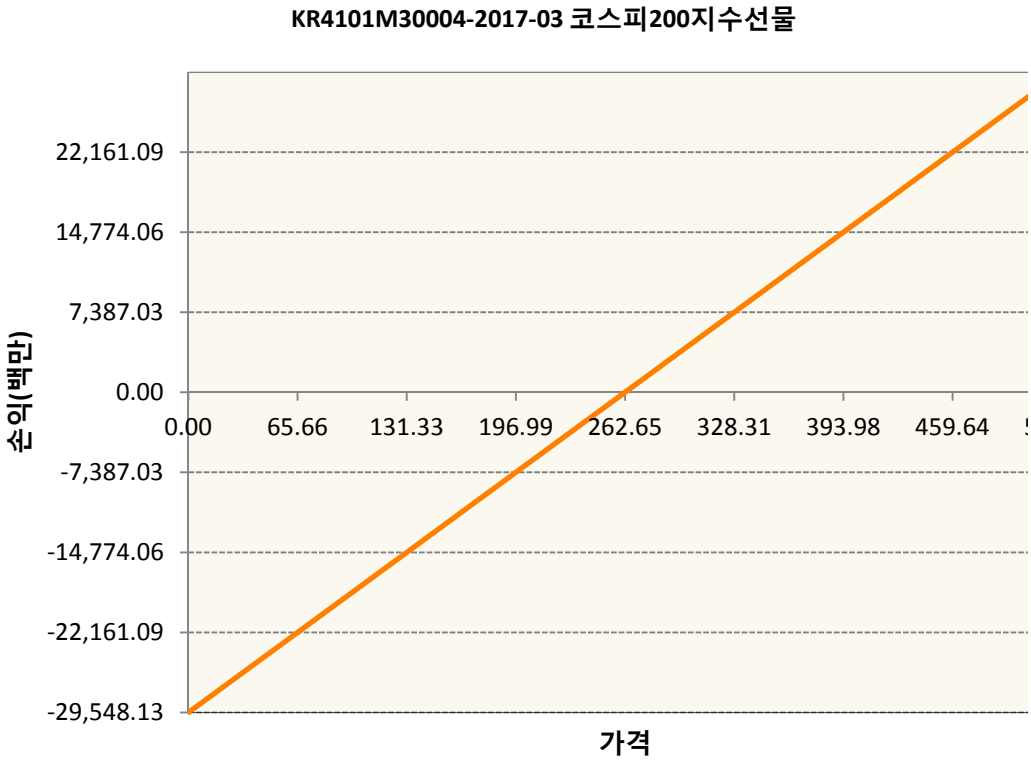
# 커버드콜(주식혼합-파생형)

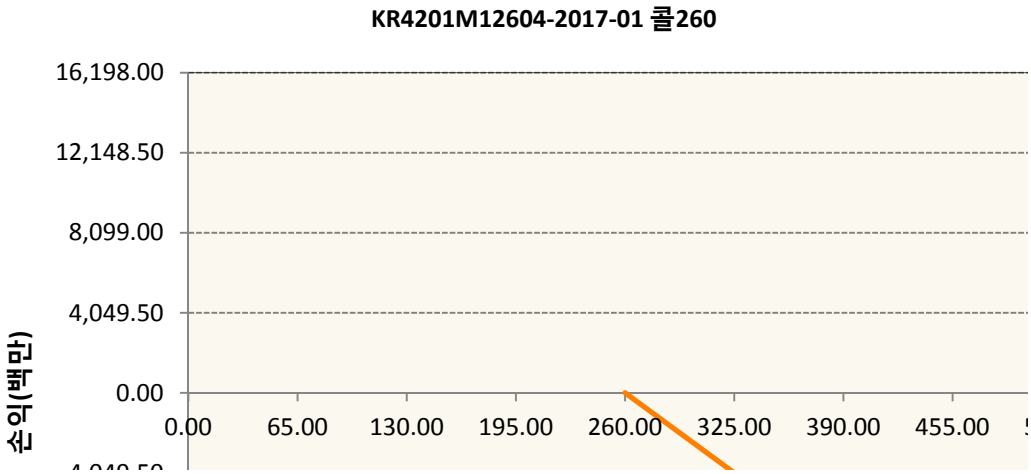
## 1. 계약금액

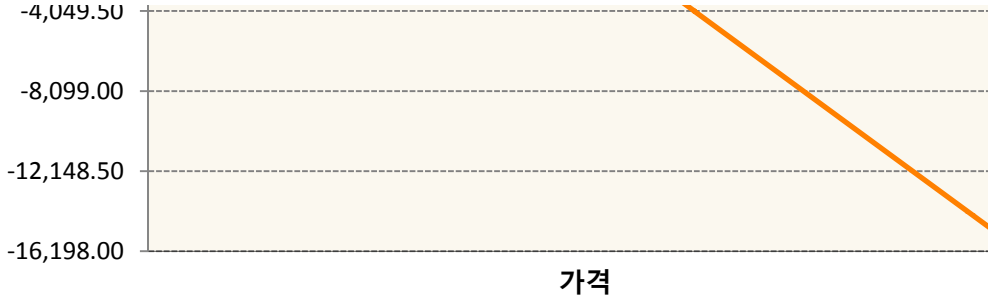
(단위:백만원)

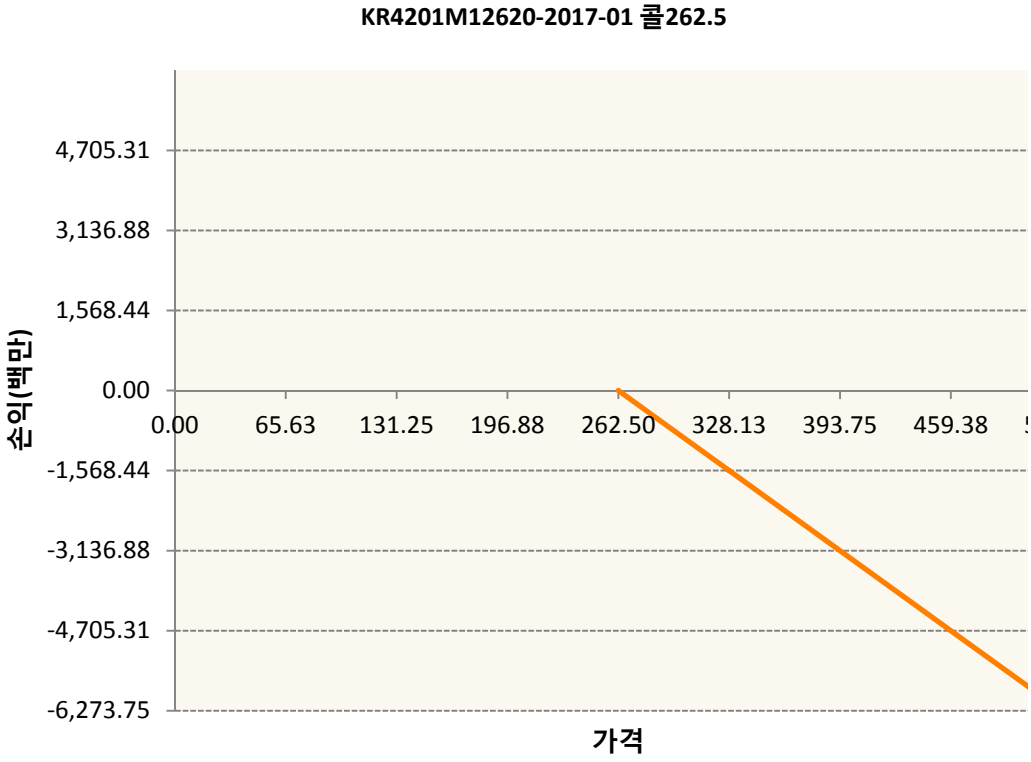
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 264 | -264 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 29,548 | 0 | 29,548 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 22,472 | -22,472 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조






**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| KR4101M30( 2017-03 코스피200지수선물 | | | | | | | 2,358 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -2,358 | -2,358 | -2,358 | -2,358 | -2,358 | -2,358 | -2,358 |
| -5.33% | -1,572 | -1,572 | -1,572 | -1,572 | -1,572 | -1,572 | -1,572 |
| -2.67% | -786 | -786 | -786 | -786 | -786 | -786 | -786 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 786 | 786 | 786 | 786 | 786 | 786 | 786 |
| 5.33% | 1,572 | 1,572 | 1,572 | 1,572 | 1,572 | 1,572 | 1,572 |
| 8.00% | 2,358 | 2,358 | 2,358 | 2,358 | 2,358 | 2,358 | 2,358 |
| KR4201M12( 2017-01 콜260 | | | | | | | 6,279 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |

| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| -8.00% | 863 | 863 | 863 | 863 | 863 | 863 | 863 |
| -5.33% | 863 | 863 | 863 | 862 | 862 | 861 | 859 |
| -2.67% | 846 | 835 | 820 | 804 | 784 | 763 | 739 |
| 0% | 105 | 71 | 36 | 0 | -37 | -74 | -112 |
| 2.67% | -1,928 | -1,929 | -1,931 | -1,933 | -1,938 | -1,944 | -1,952 |
| 5.33% | -4,103 | -4,103 | -4,103 | -4,103 | -4,103 | -4,103 | -4,103 |
| 8.00% | -6,279 | -6,279 | -6,279 | -6,279 | -6,279 | -6,279 | -6,279 |
| KR4201M12( | 2017-01 콜262.5 | | | | | | 2,280 |

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 161 | 161 | 161 | 161 | 161 | 161 | 161 |
| -5.33% | 161 | 161 | 161 | 161 | 161 | 161 | 161 |
| -2.67% | 161 | 160 | 158 | 156 | 153 | 149 | 145 |
| 0% | 47 | 32 | 16 | 0 | -16 | -32 | -47 |
| 2.67% | -613 | -615 | -618 | -622 | -627 | -633 | -640 |
| 5.33% | -1,445 | -1,445 | -1,445 | -1,445 | -1,445 | -1,445 | -1,446 |
| 8.00% | -2,280 | -2,280 | -2,280 | -2,280 | -2,280 | -2,280 | -2,280 |

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

| |
|---|
| **13,836** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-01-06 |
| 기준일 | 2017-01-05 |

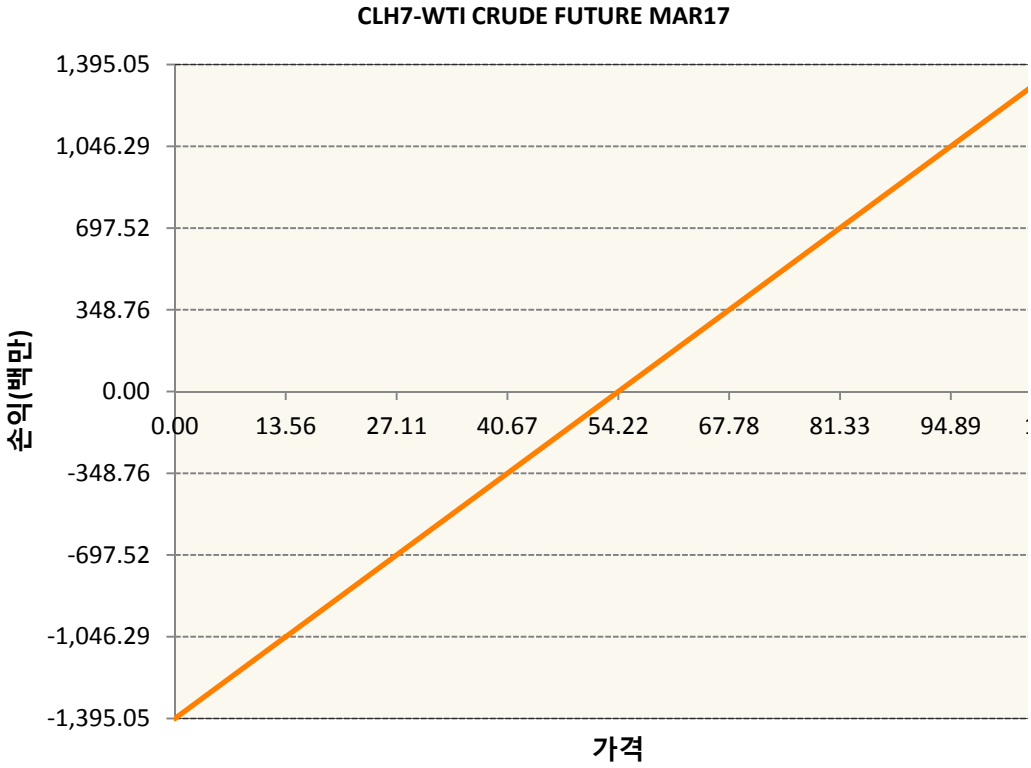
# 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

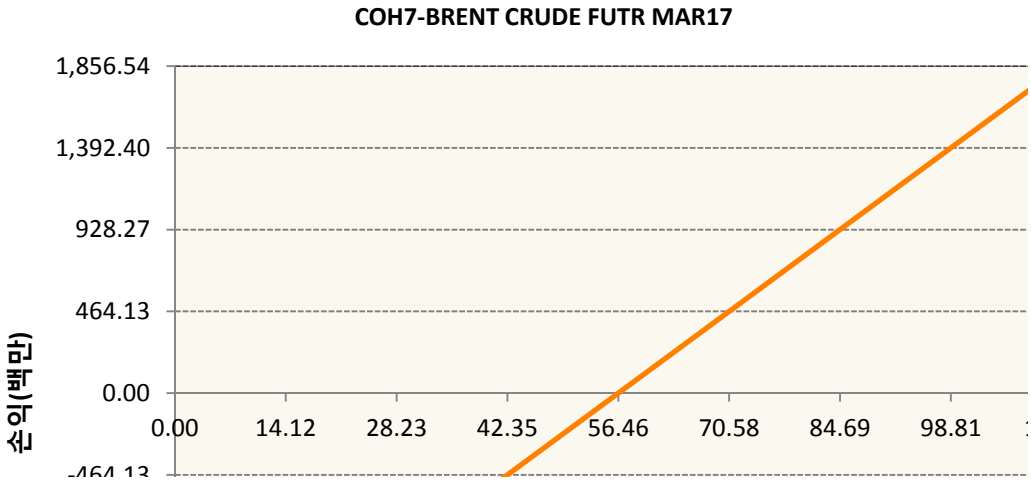
## 1. 계약금액

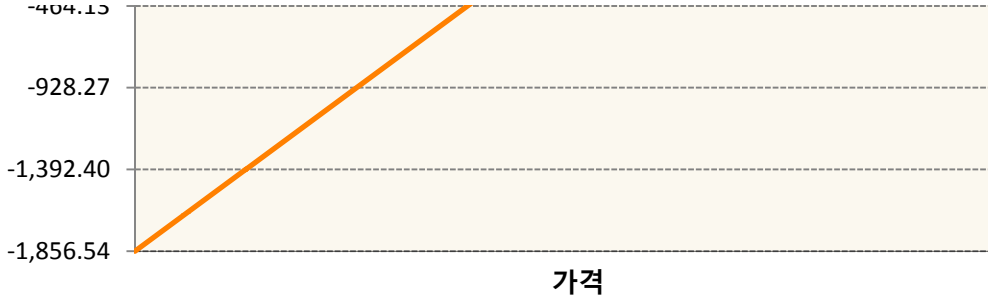
(단위:백만원)

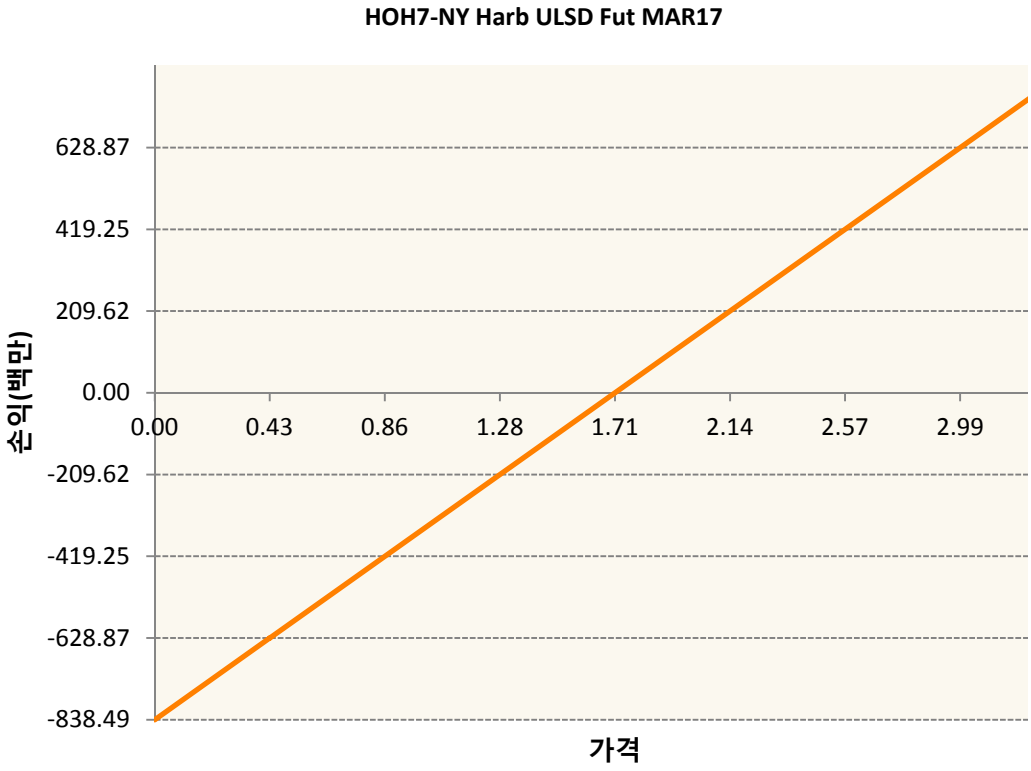
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 선물 | 유가증권 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 선물 | 유가증권 | 1,395 | 0 | 1,395 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 5,101 | 0 | 5,101 | |

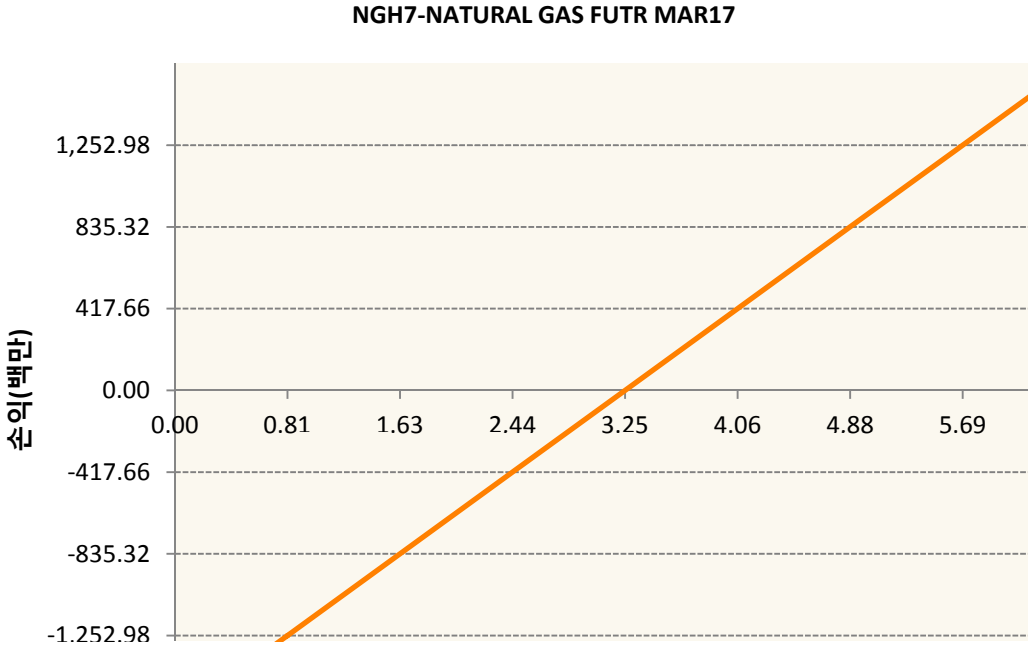
## 2. 만기시점의 손익구조

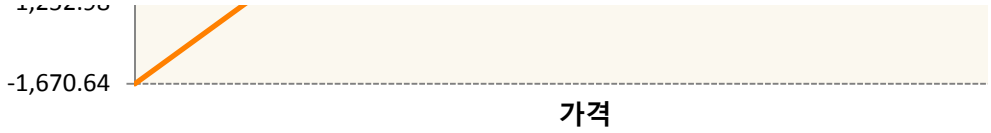


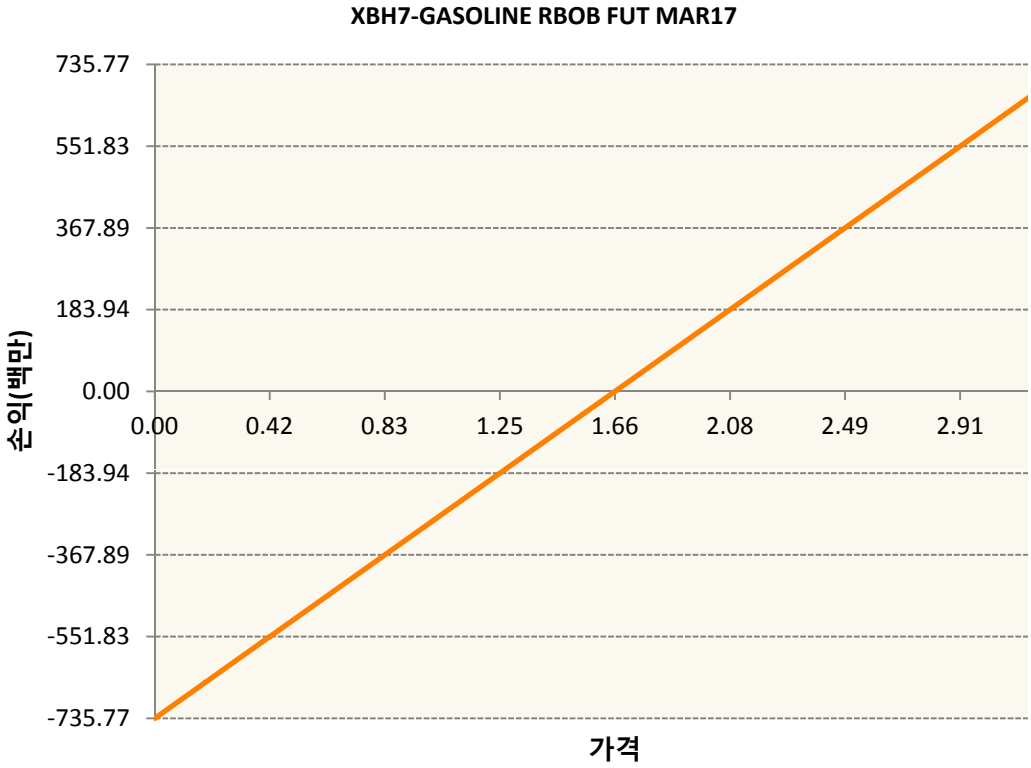




-928.27
-1,392.40
-1,856.54
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
628.87
419.25
209.62
0.00
-209.62
-419.25
-628.87
-838.49
0.00
0.43
0.86
1.28
1.71
2.14
2.57
2.99
순익(백만)
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,252.98
835.32
417.66
0.00
-417.66
-835.32
-1,252.98
0.00
0.81
1.63
2.44
3.25
4.06
4.88
5.69
순익(백만)




**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| CLH7 | WTI CRUDE FUTURE MAR17 | 112 |
| COH7 | BRENT CRUDE FUTR MAR17 | 149 |
| HOH7 | NY Harb ULSD Fut MAR17 | 67 |
| NGH7 | NATURAL GAS FUTR MAR17 | 134 |
| XBH7 | GASOLINE RBOB FUT MAR17 | 59 |

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

| |
|---|
| **1,186** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-01-06 |
| 기준일 | 2017-01-05 |

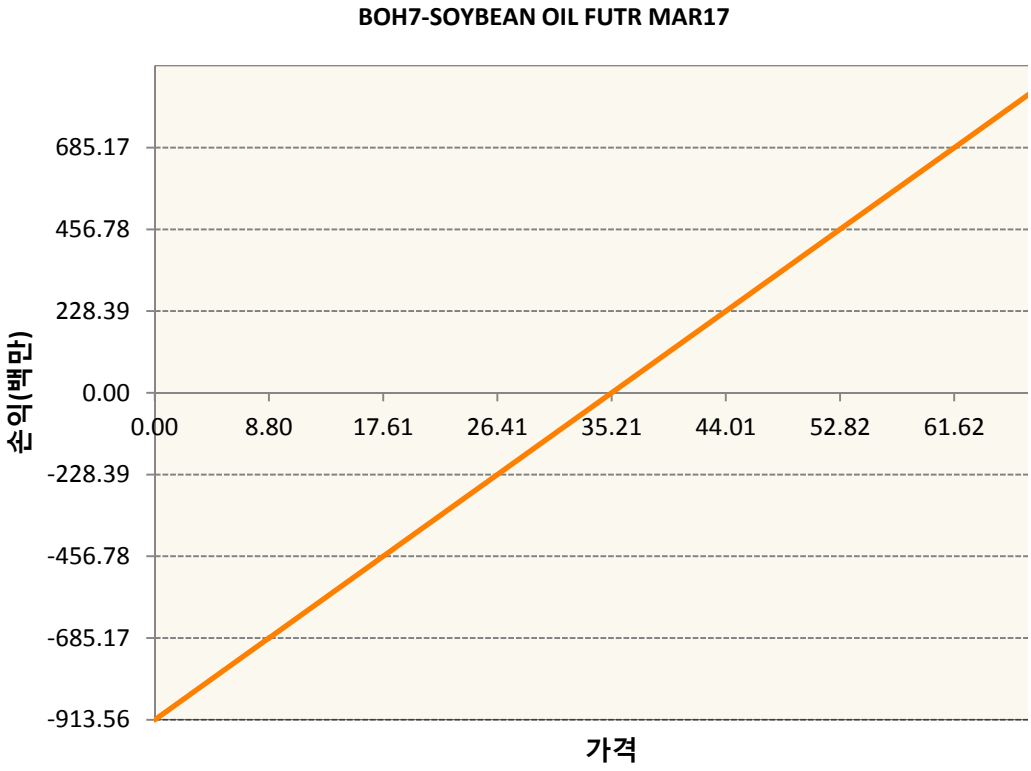
# 애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

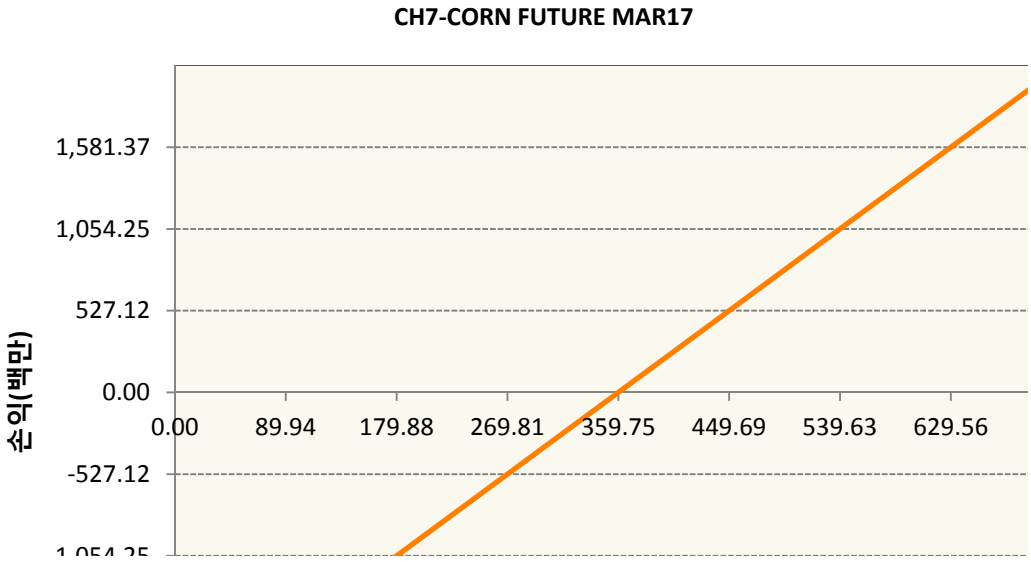
## 1. 계약금액

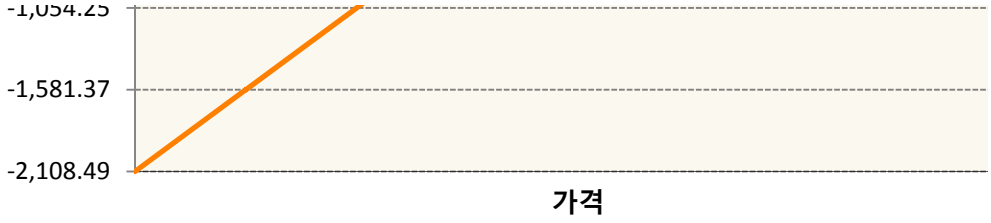
(단위:백만원)

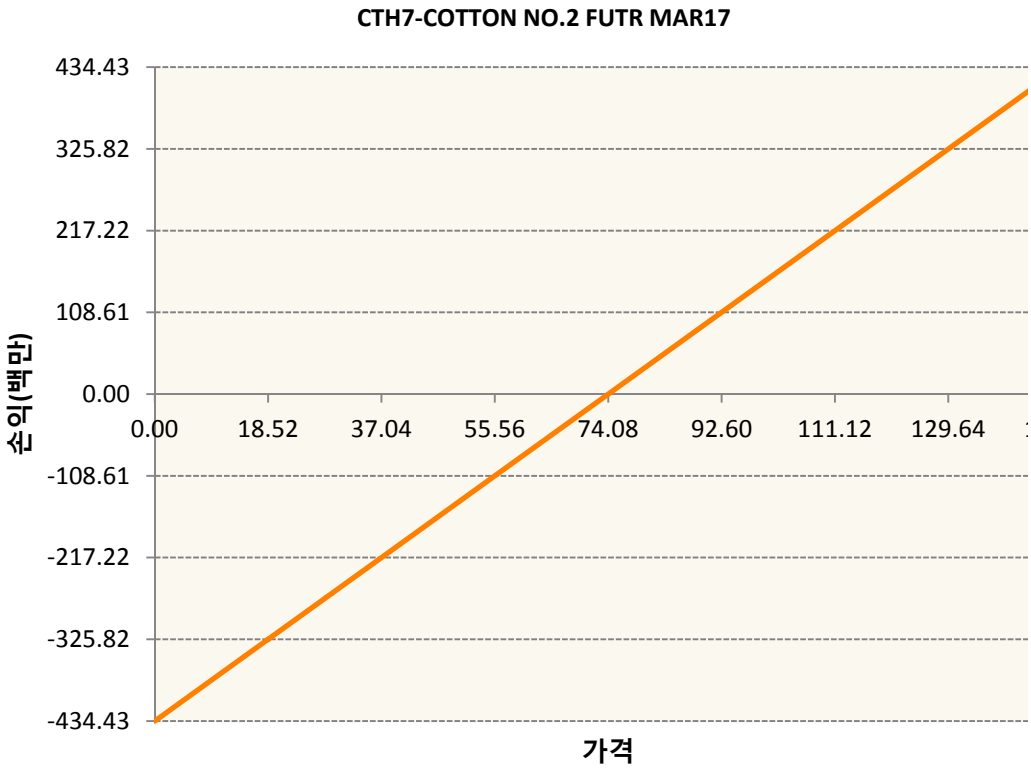
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 9,357 | 0 | 9,357 | |

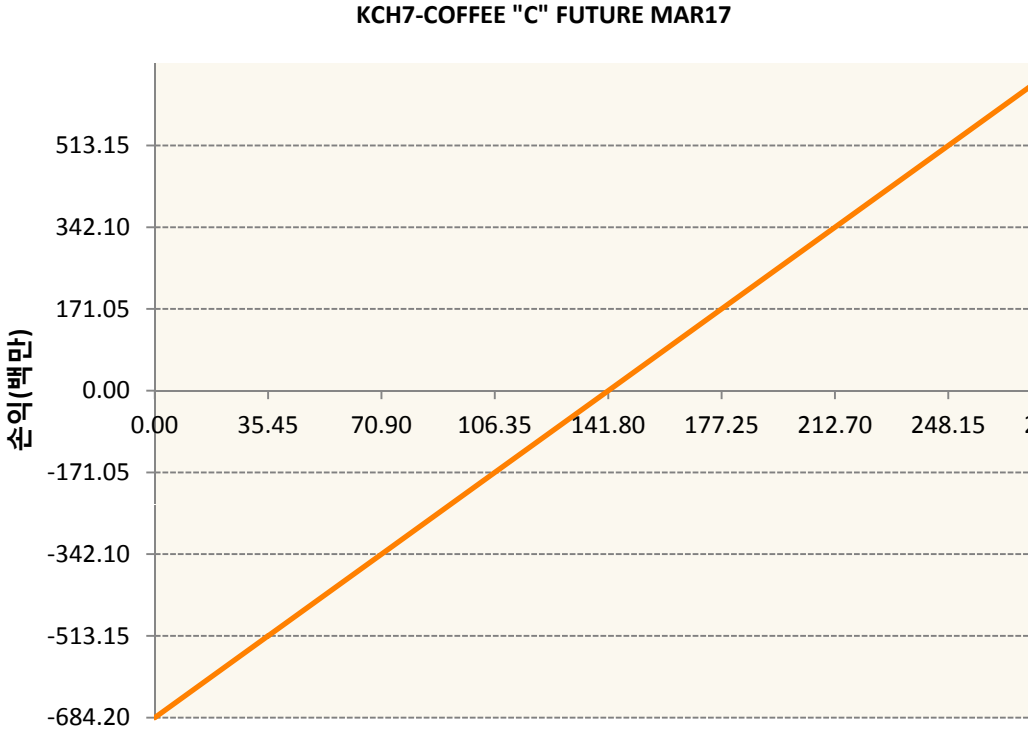
## 2. 만기시점의 손익구조



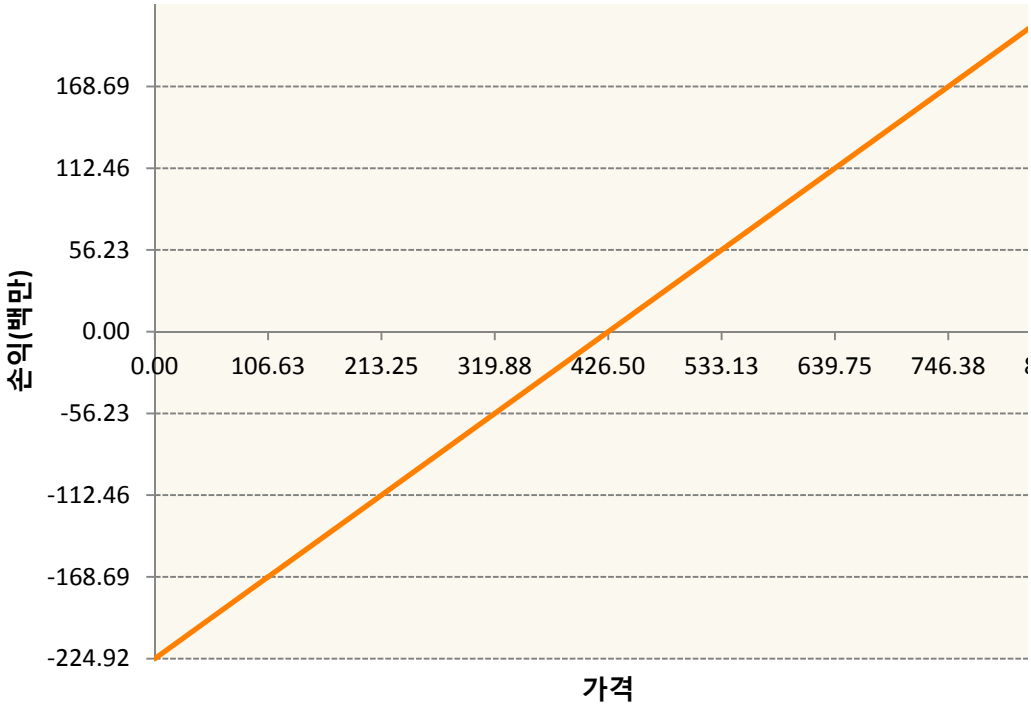

-1,581.37
-2,108.49
가격


CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
434.43
325.82
217.22
108.61
0.00
-108.61
-217.22
-325.82
-434.43
0.00
18.52
37.04
55.56
74.08
92.60
111.12
129.64
순익(백만)
가격

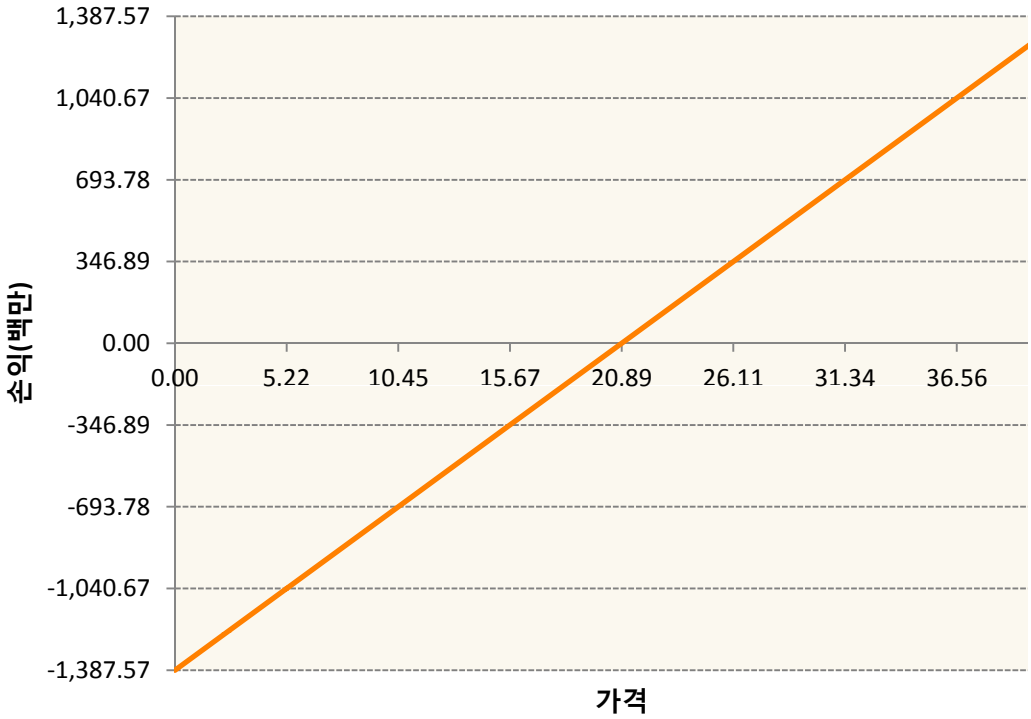

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
513.15
342.10
171.05
0.00
-171.05
-342.10
-513.15
-684.20
0.00
35.45
70.90
106.35
141.80
177.25
212.70
248.15
순익(백만)

가격

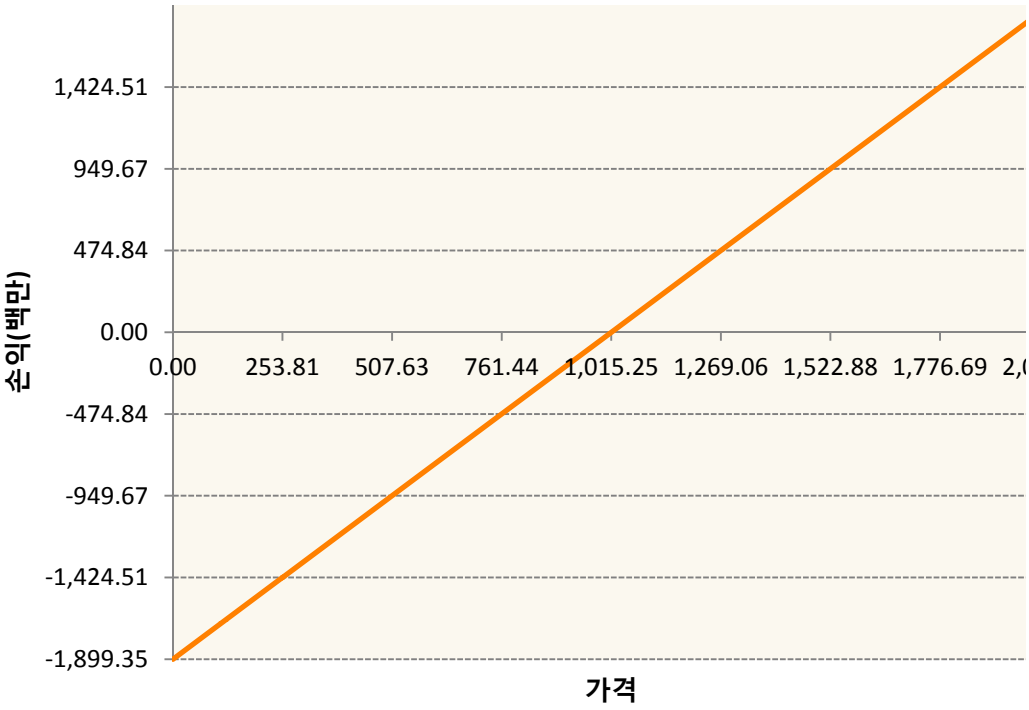
KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17



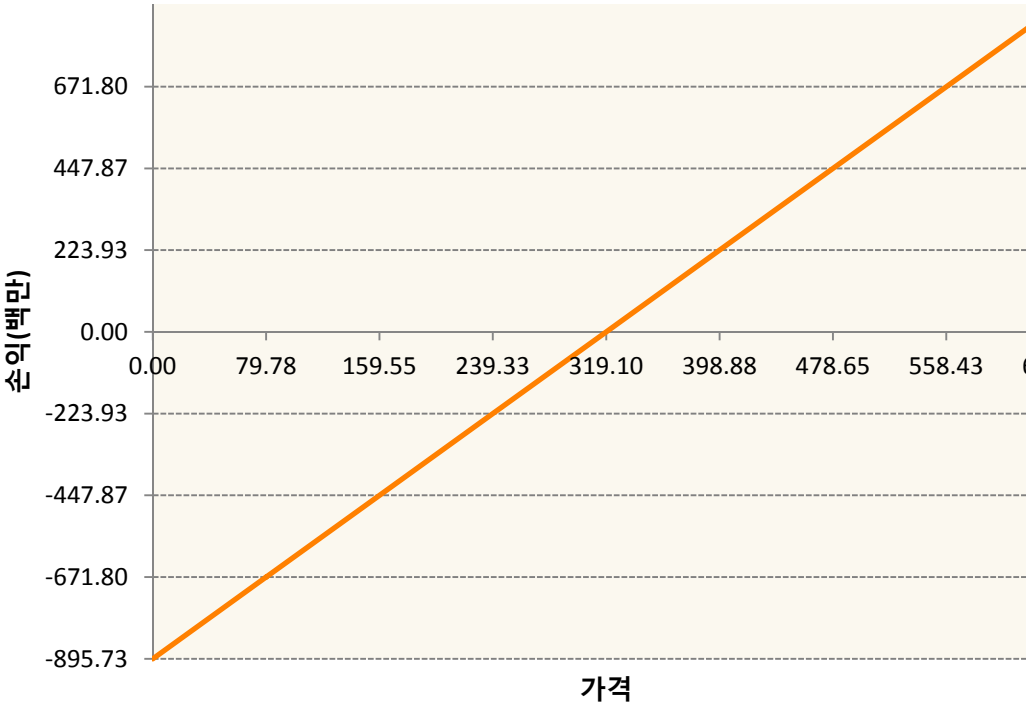

SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17



SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17

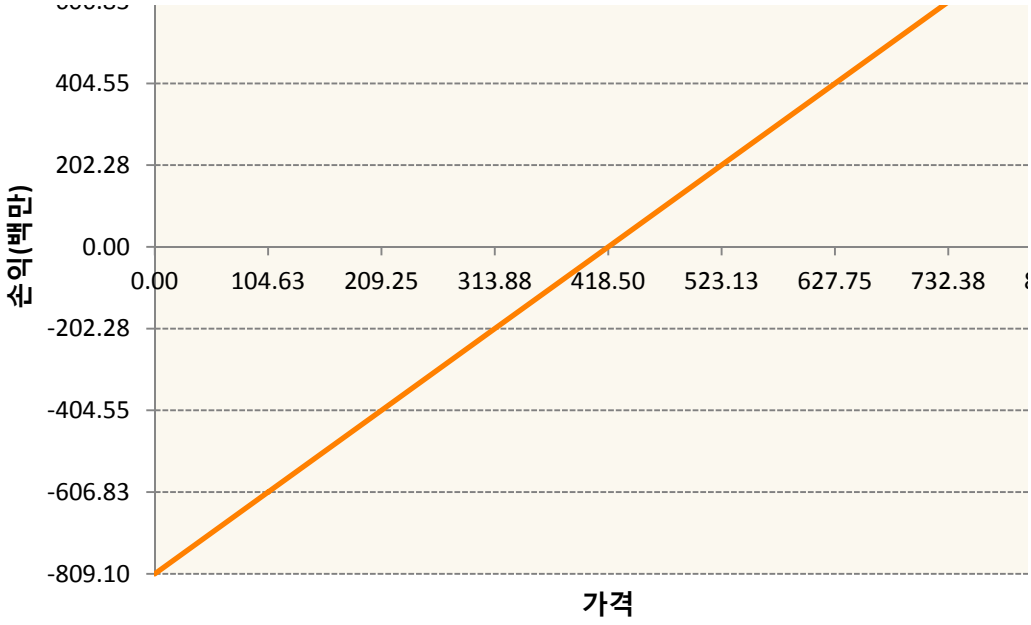



SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17




WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17






**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| BOH7 | SOYBEAN OIL FUTR MAR17 | 73 |
| CH7 | CORN FUTURE MAR17 | 169 |
| CTH7 | COTTON NO.2 FUTR MAR17 | 35 |
| KCH7 | COFFEE "C" FUTURE MAR17 | 55 |
| KWH7 | KC HRW WHEAT FUT MAR17 | 18 |
| SBH7 | Sugar #11 (WORLD) MAR17 | 111 |
| SH7 | SOYBEAN FUTURE MAR17 | 152 |
| SMH7 | SOYBEAN MEAL FUTR MAR17 | 72 |
| WH7 | WHEAT FUTURE(CBT) MAR17 | 65 |

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

| |
|---|
| **909** |