| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-01-16 |
| 기준일 | 2017-01-13 |

# 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 | 2017-01-16 |
| 기준일 | 2017-01-13 |

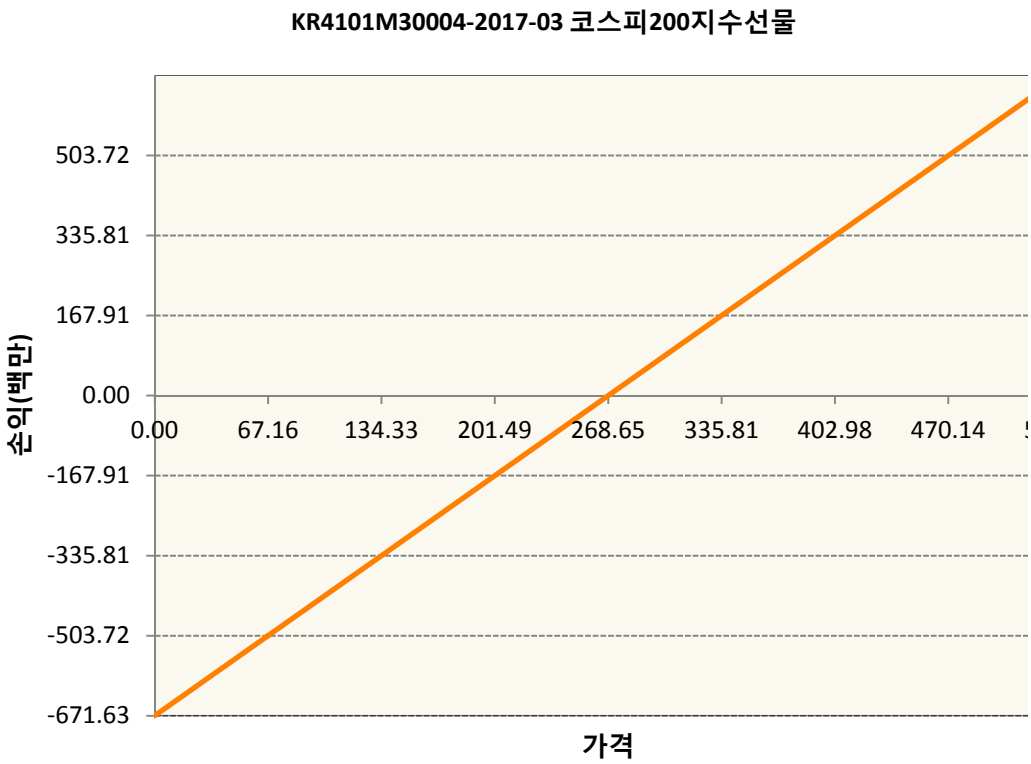
# 스마트인덱스모

## 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 | 672 | 0 | 672 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101M30( 2017-03 코스피200지수선물 | | | | | | | 54 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -54 | -54 | -54 | -54 | -54 | -54 | -54 |
| -5.33% | -36 | -36 | -36 | -36 | -36 | -36 | -36 |
| -2.67% | -18 | -18 | -18 | -18 | -18 | -18 | -18 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 18 | 18 | 18 | 18 | 18 | 18 | 18 |
| 5.33% | 36 | 36 | 36 | 36 | 36 | 36 | 36 |
| 8.00% | 54 | 54 | 54 | 54 | 54 | 54 | 54 |

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

| 39 |
|---|

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-01-16 |
| 기준일 | 2017-01-13 |

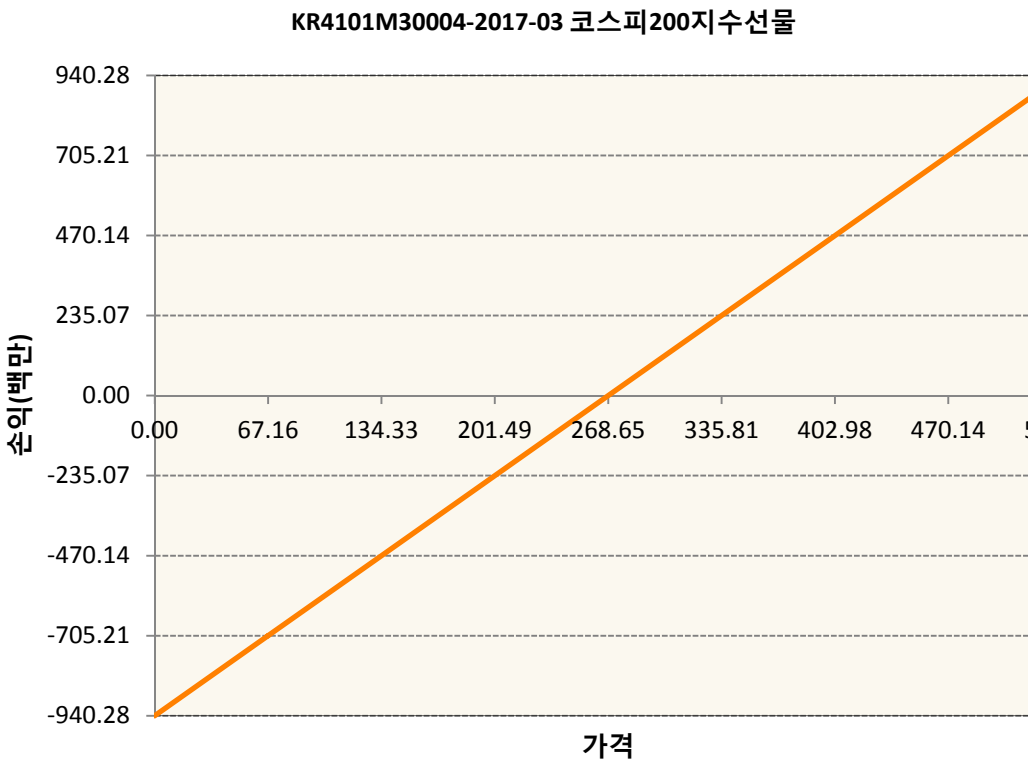
# 스마트레버리지목표전환형1호

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 269 | -269 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 940 | 0 | 940 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101M30( 2017-03 코스피200지수선물 | | | | | | | 75 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -75 | -75 | -75 | -75 | -75 | -75 | -75 |
| -5.33% | -50 | -50 | -50 | -50 | -50 | -50 | -50 |
| -2.67% | -25 | -25 | -25 | -25 | -25 | -25 | -25 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 |
| 5.33% | 50 | 50 | 50 | 50 | 50 | 50 | 50 |
| 8.00% | 75 | 75 | 75 | 75 | 75 | 75 | 75 |

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

| |
|---|
| **55** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-01-16 |
| 기준일 | 2017-01-13 |

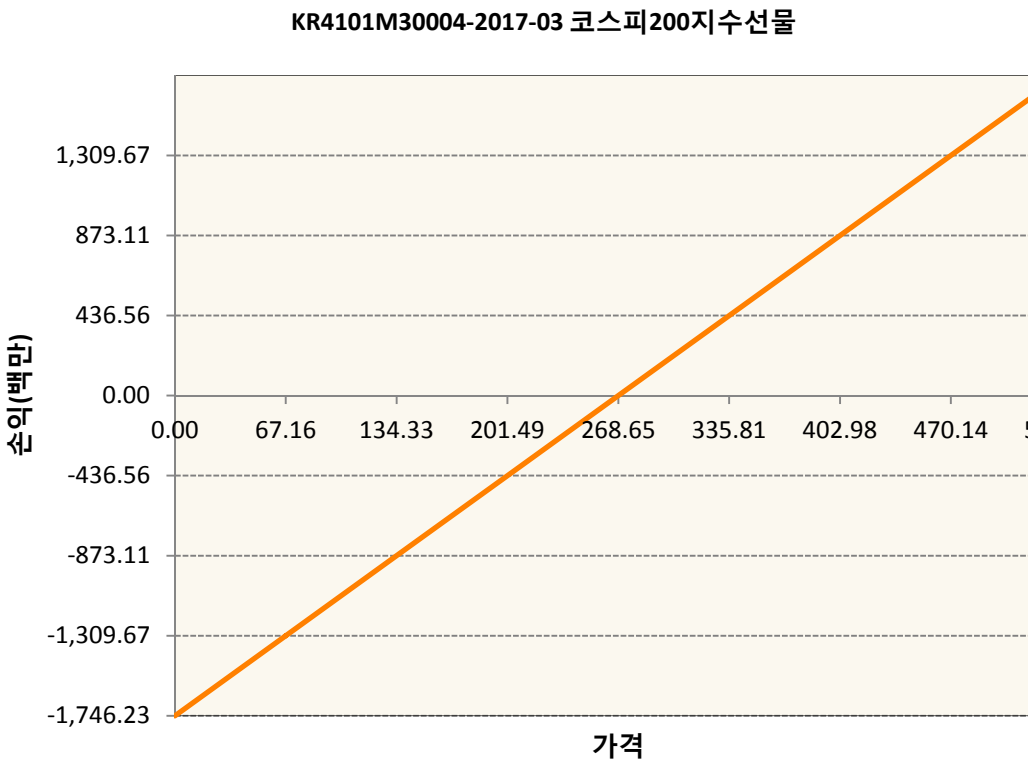
# 1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 134 | -134 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,746 | 0 | 1,746 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101M30( 2017-03 코스피200지수선물 | | | | | | | 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)

| |
|---|
| **102** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-01-16 |
| 기준일 | 2017-01-13 |

# 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 | 921 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **697** |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| 공시일 | 2017-01-16 |
|---|---|
| 기준일 | 2017-01-13 |

# 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 | 374 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **601** |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-01-16 |
| 기준일 | 2017-01-13 |

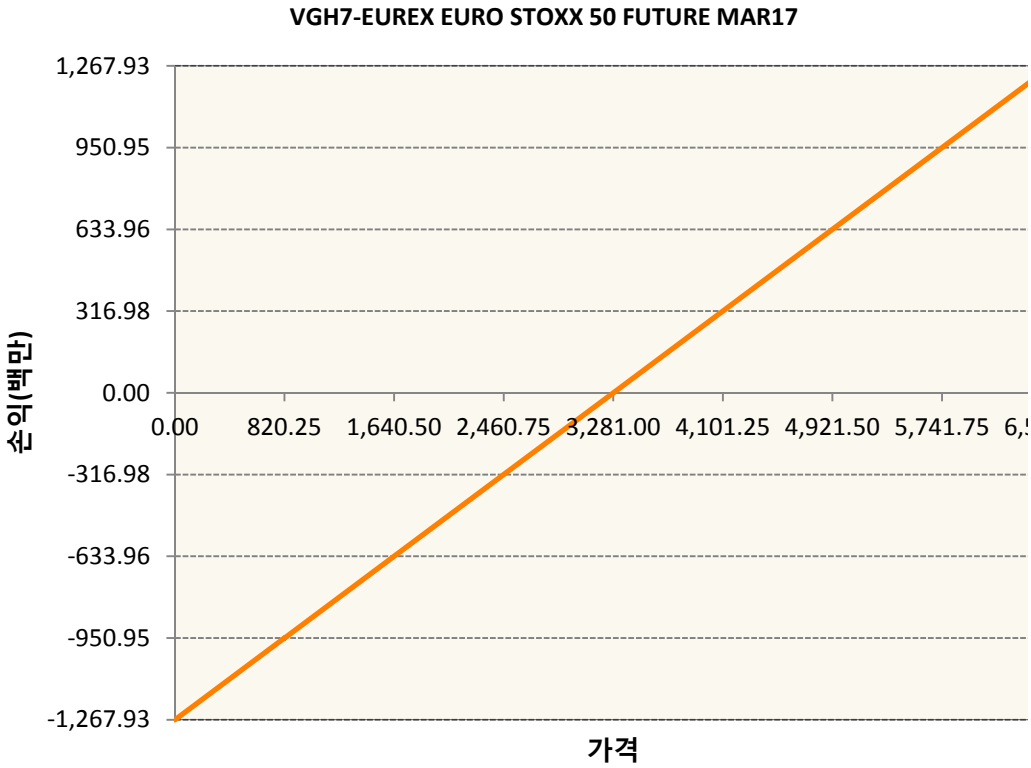
# 유로인덱스모(주식-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,268 | 0 | 1,268 | |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| VGH7 | EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17 | 101 |

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

(단위:백만원)

**115**

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-01-16 |
| 기준일 | 2017-01-13 |

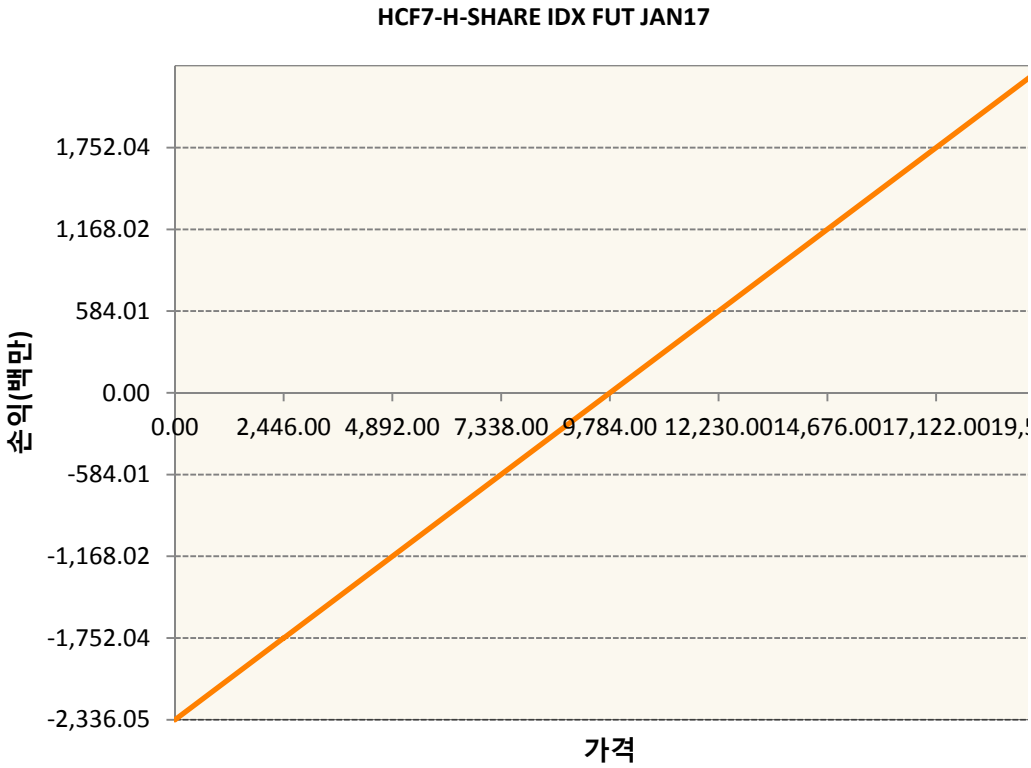
# 차이나인덱스모(주식-파생형)

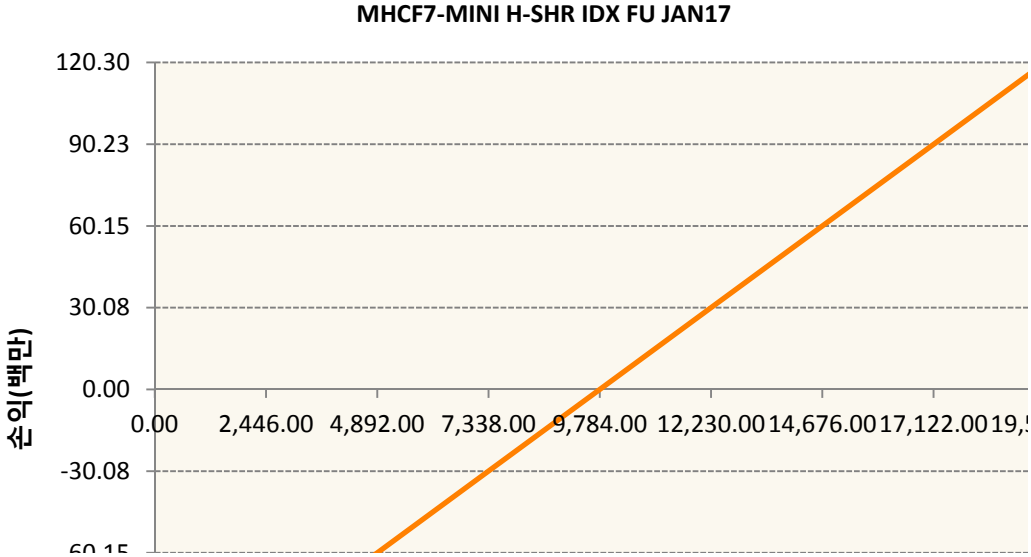
## 1. 계약금액

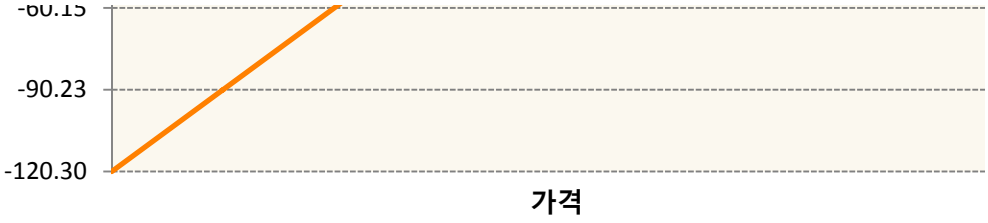
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,456 | 0 | 2,456 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조






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

| | | |
|---|---|---|
| HCF7 | H-SHARE IDX FUT JAN17 | 187 |
| MHCF7 | MINI H-SHR IDX FU JAN17 | 10 |

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

| |
|---|
| **239** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-01-16 |
| 기준일 | 2017-01-13 |

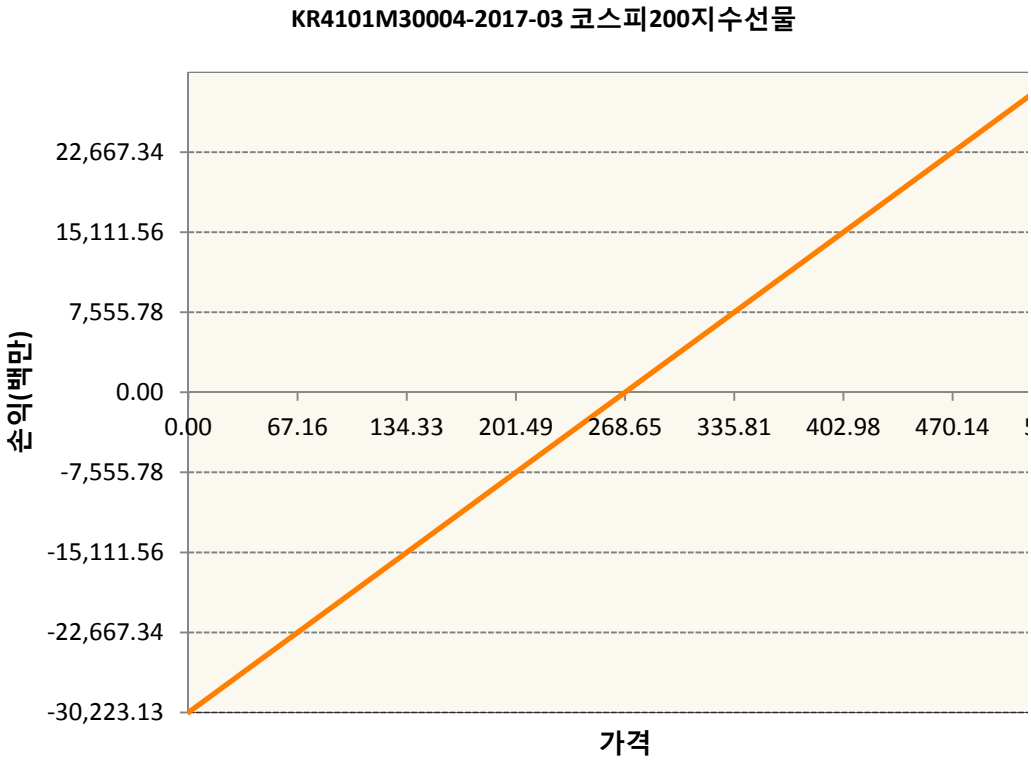
# 커버드콜(주식혼합-파생형)

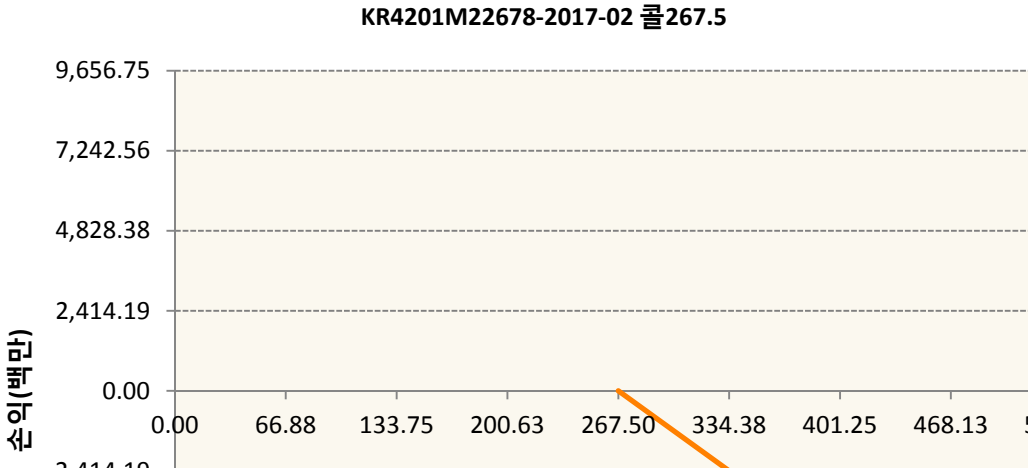
## 1. 계약금액

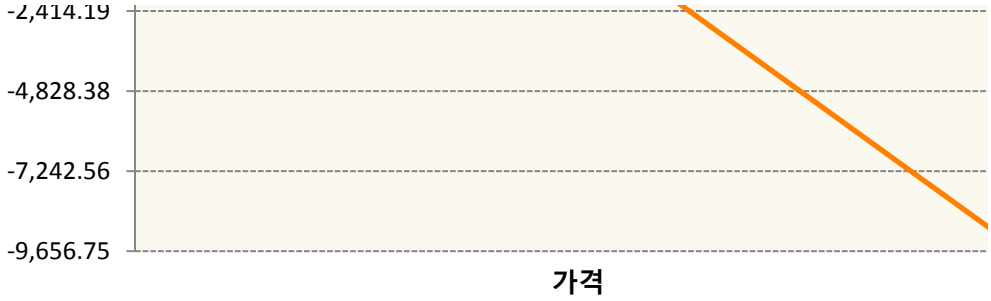
(단위:백만원)

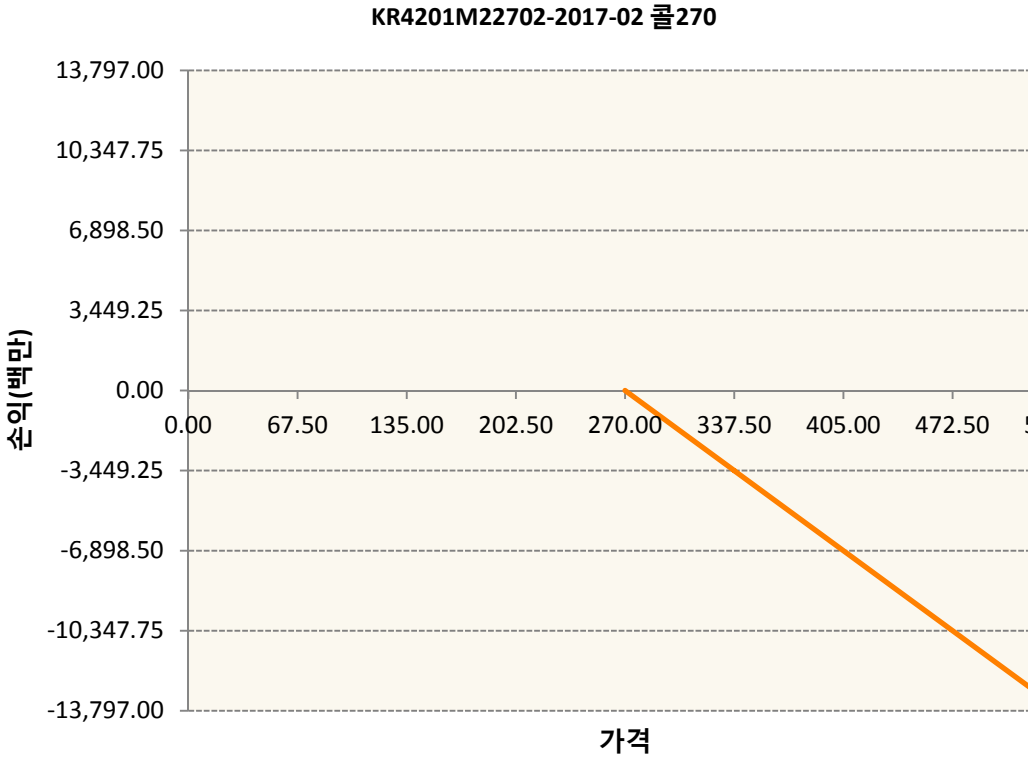
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 1,981 | 2,040 | -59 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 30,223 | 0 | 30,223 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 23,454 | -23,454 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조






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

| KR4101M30( 2017-03 코스피200지수선물 | | | | | | | 2,411 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -2,411 | -2,411 | -2,411 | -2,411 | -2,411 | -2,411 | -2,411 |
| -5.33% | -1,607 | -1,607 | -1,607 | -1,607 | -1,607 | -1,607 | -1,607 |
| -2.67% | -804 | -804 | -804 | -804 | -804 | -804 | -804 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 804 | 804 | 804 | 804 | 804 | 804 | 804 |
| 5.33% | 1,607 | 1,607 | 1,607 | 1,607 | 1,607 | 1,607 | 1,607 |
| 8.00% | 2,411 | 2,411 | 2,411 | 2,411 | 2,411 | 2,411 | 2,411 |
| KR4201M22( 2017-02 콜267.5 | | | | | | | 3,341 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |

| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| -8.00% | 606 | 606 | 606 | 605 | 604 | 601 | 598 |
| -5.33% | 603 | 600 | 594 | 586 | 576 | 563 | 548 |
| -2.67% | 541 | 515 | 486 | 455 | 422 | 387 | 351 |
| 0% | 142 | 95 | 47 | 0 | -47 | -95 | -142 |
| 2.67% | -808 | -832 | -859 | -888 | -920 | -954 | -990 |
| 5.33% | -2,044 | -2,048 | -2,053 | -2,062 | -2,073 | -2,086 | -2,102 |
| 8.00% | -3,329 | -3,329 | -3,330 | -3,331 | -3,333 | -3,336 | -3,341 |
| KR4201M22: 2017-02 콜270 | | | | | | | 4,394 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 570 | 570 | 570 | 569 | 569 | 567 | 565 |
| -5.33% | 569 | 567 | 564 | 558 | 549 | 538 | 524 |
| -2.67% | 533 | 511 | 484 | 452 | 417 | 379 | 337 |
| 0% | 193 | 130 | 65 | 0 | -65 | -131 | -197 |
| 2.67% | -891 | -941 | -994 | -1,049 | -1,107 | -1,165 | -1,225 |
| 5.33% | -2,553 | -2,565 | -2,581 | -2,602 | -2,626 | -2,655 | -2,688 |
| 8.00% | -4,363 | -4,364 | -4,366 | -4,369 | -4,375 | -4,383 | -4,394 |

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

| |
|---|
| **10,609** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-01-16 |
| 기준일 | 2017-01-13 |

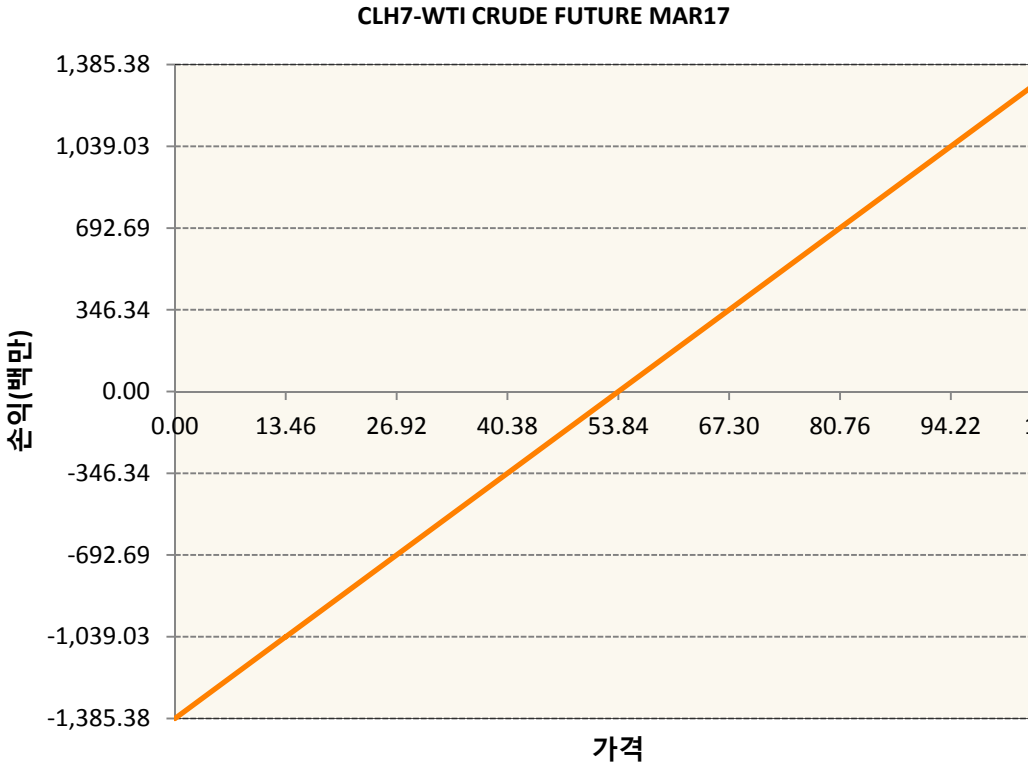
# 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

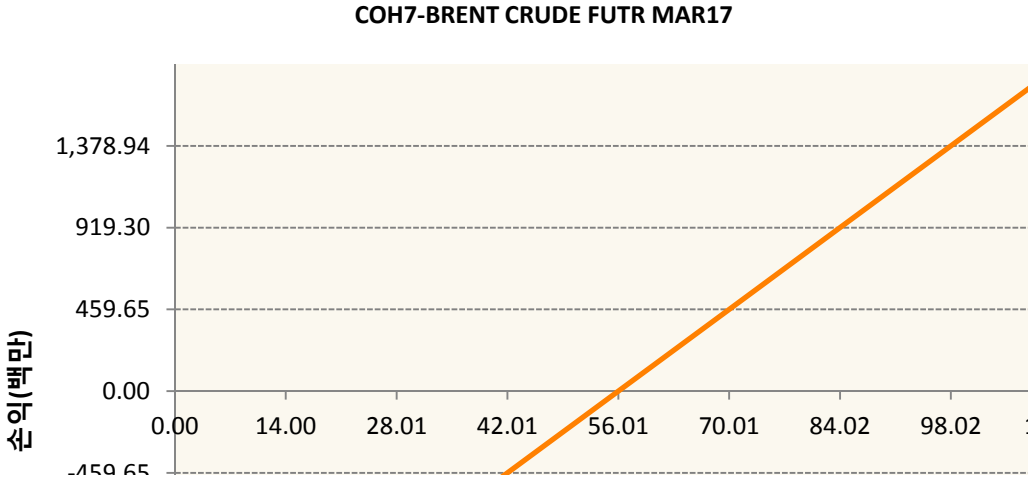
## 1. 계약금액

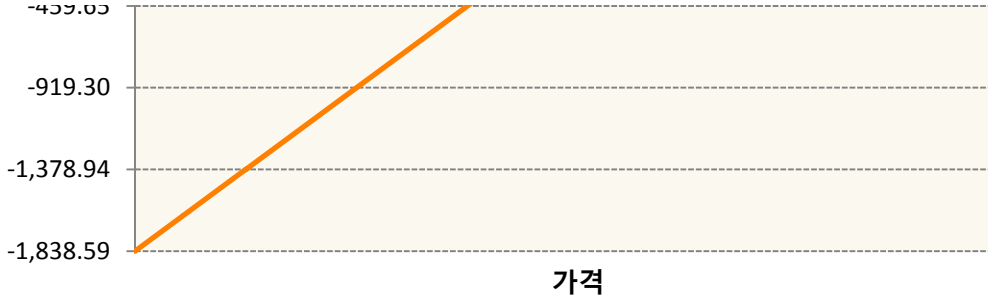
(단위:백만원)

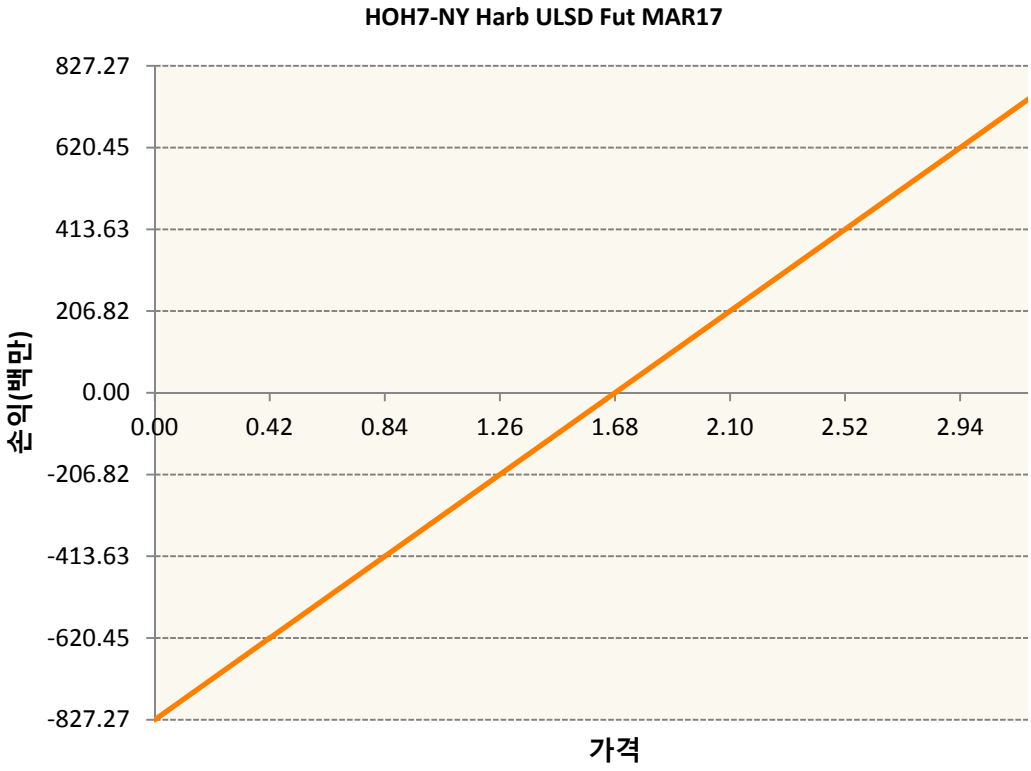
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 선물 | 유가증권 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 선물 | 유가증권 | 1,385 | 0 | 1,385 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 5,122 | 423 | 4,700 | |

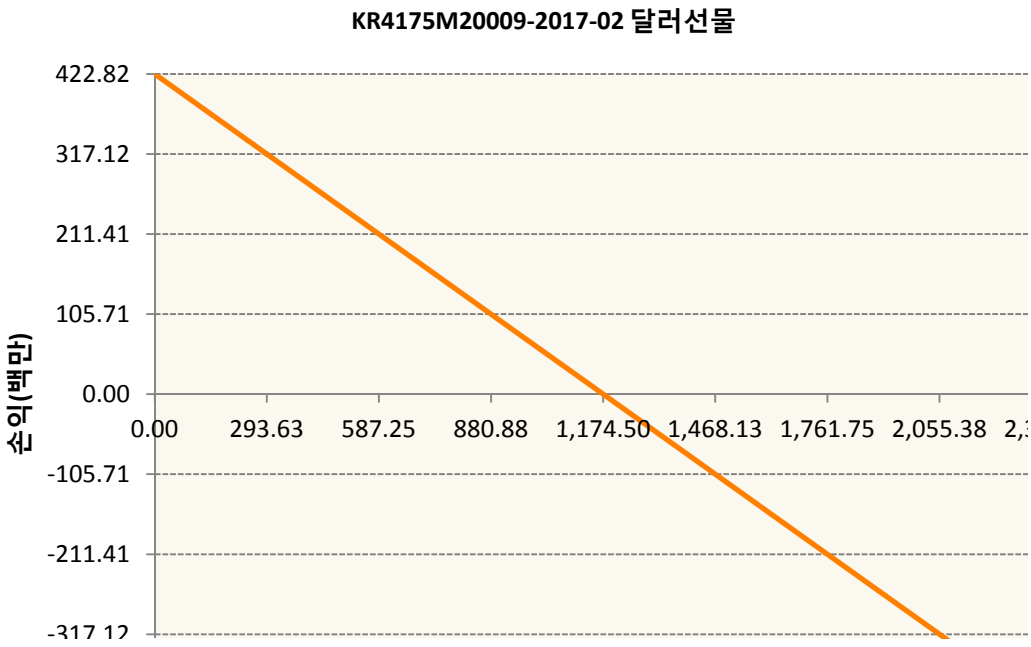
## 2. 만기시점의 손익구조

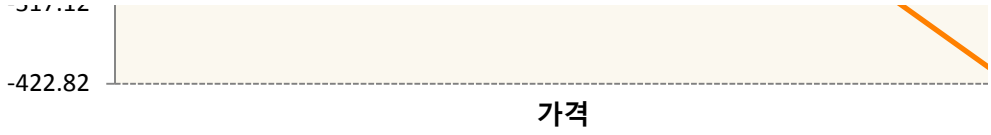


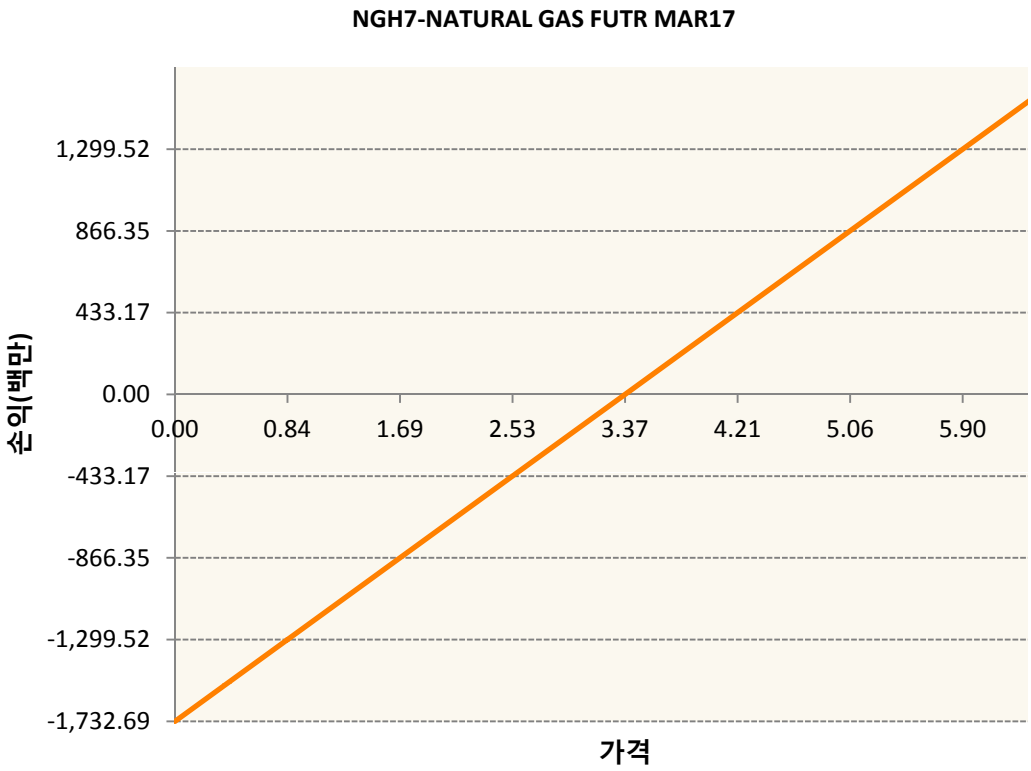



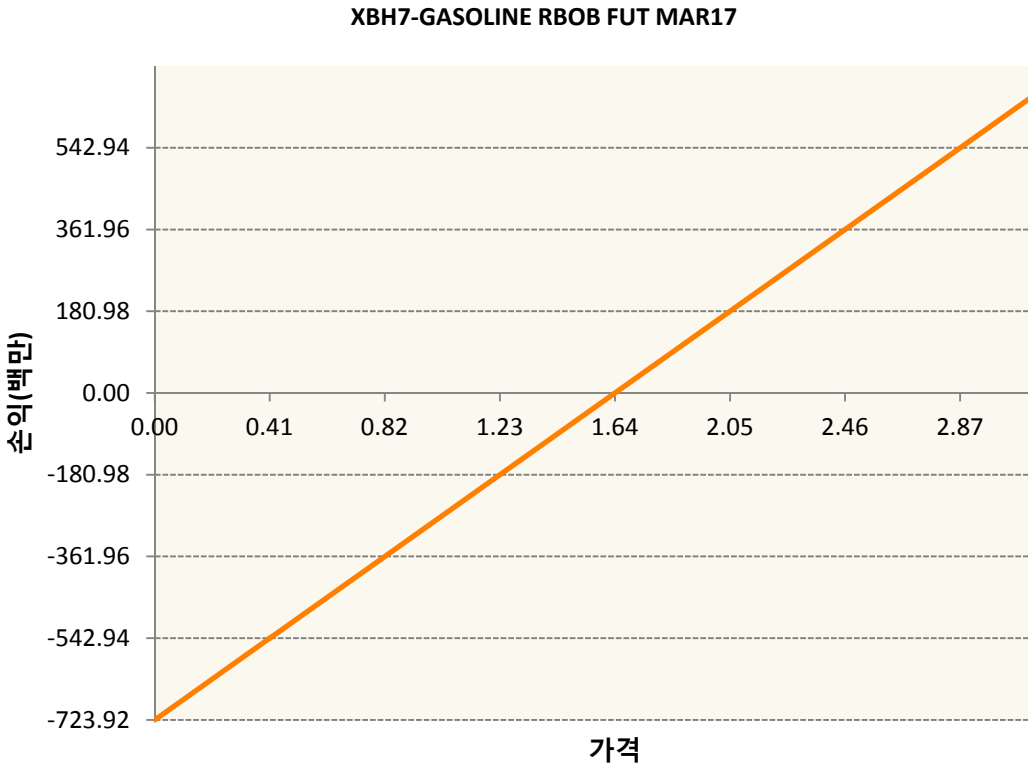

-919.30
-1,378.94
-1,838.59
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
827.27
620.45
413.63
206.82
0.00
-206.82
-413.63
-620.45
-827.27
0.00
0.42
0.84
1.26
1.68
2.10
2.52
2.94
순익(백만)
가격


KR4175M20009-2017-02 달러선물
422.82
317.12
211.41
105.71
0.00
-105.71
-211.41
-317.12
0.00
293.63
587.25
880.88
1,174.50
1,468.13
1,761.75
2,055.38
순익(백만)


-422.82
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,299.52
866.35
433.17
0.00
-433.17
-866.35
-1,299.52
-1,732.69
0.00
0.84
1.69
2.53
3.37
4.21
5.06
5.90
순익(백만)
가격


XBH7-GASOLINE RBOB FUT MAR17
542.94
361.96
180.98
0.00
-180.98
-361.96
-542.94
-723.92
0.00
0.41
0.82
1.23
1.64
2.05
2.46
2.87
순익(백만)
가격

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

| | | |
|---|---|---|
| CLH7 | WTI CRUDE FUTURE MAR17 | 111 |
| COH7 | BRENT CRUDE FUTR MAR17 | 147 |
| HOH7 | NY Harb ULSD Fut MAR17 | 66 |
| KR4175M20( | 2017-02 달러선물 | 34 |
| NGH7 | NATURAL GAS FUTR MAR17 | 139 |
| XBH7 | GASOLINE RBOB FUT MAR17 | 58 |

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

| |
|---|
| **1,209** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-01-16 |
| 기준일 | 2017-01-13 |

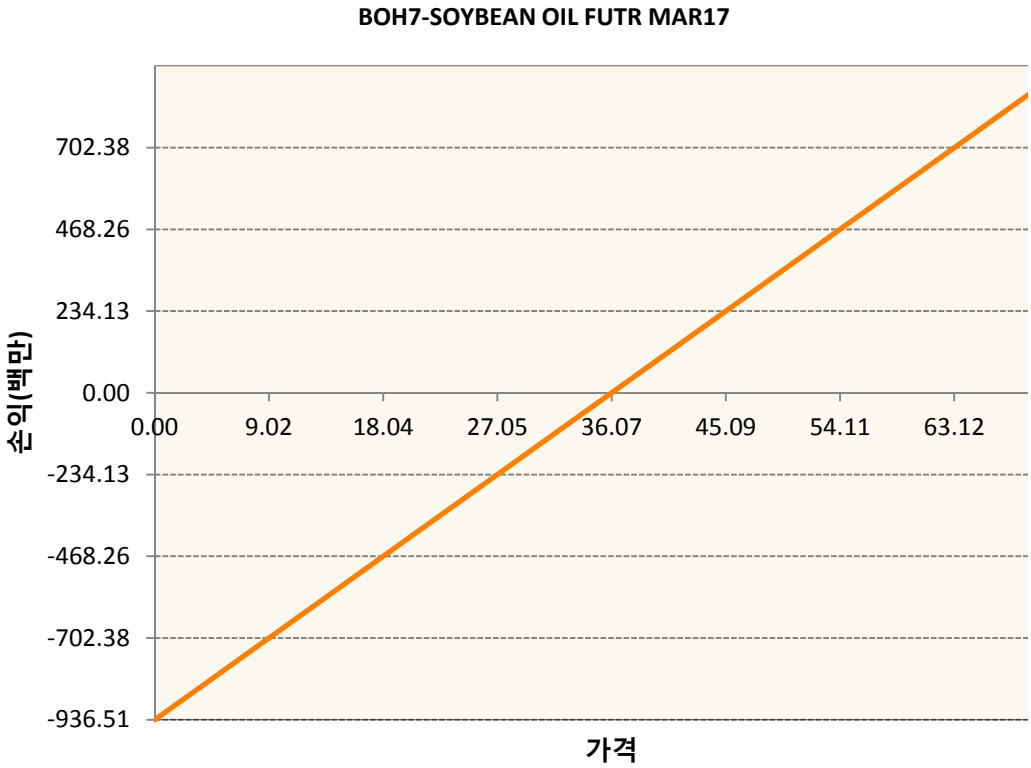
# 애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

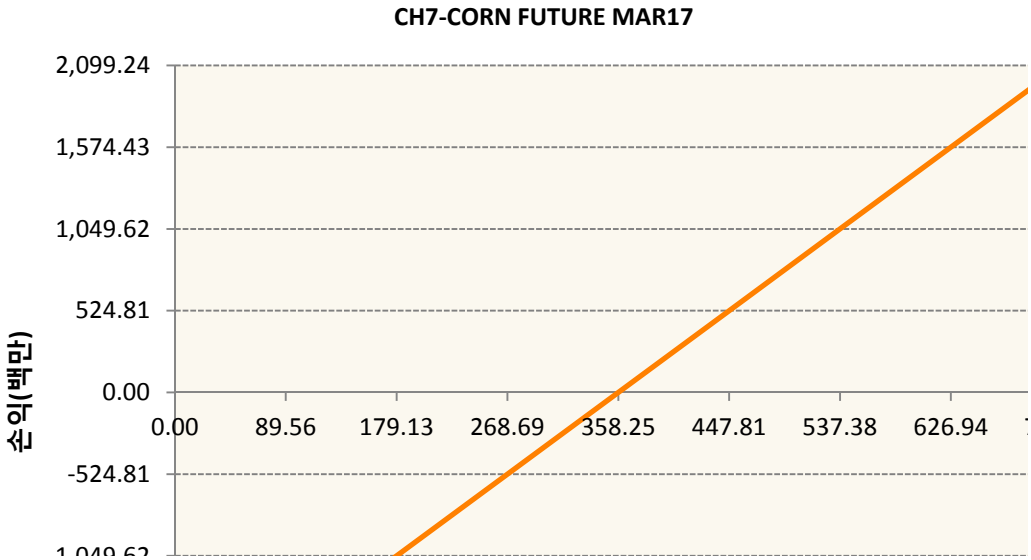
## 1. 계약금액

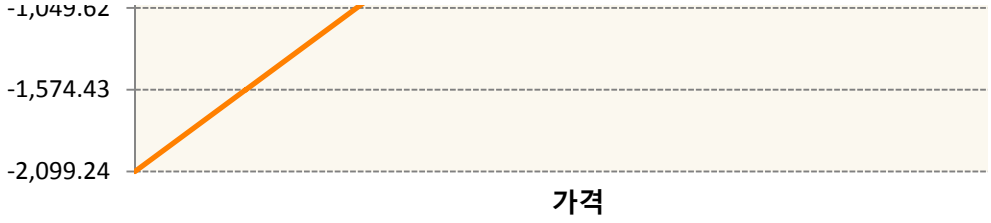
(단위:백만원)

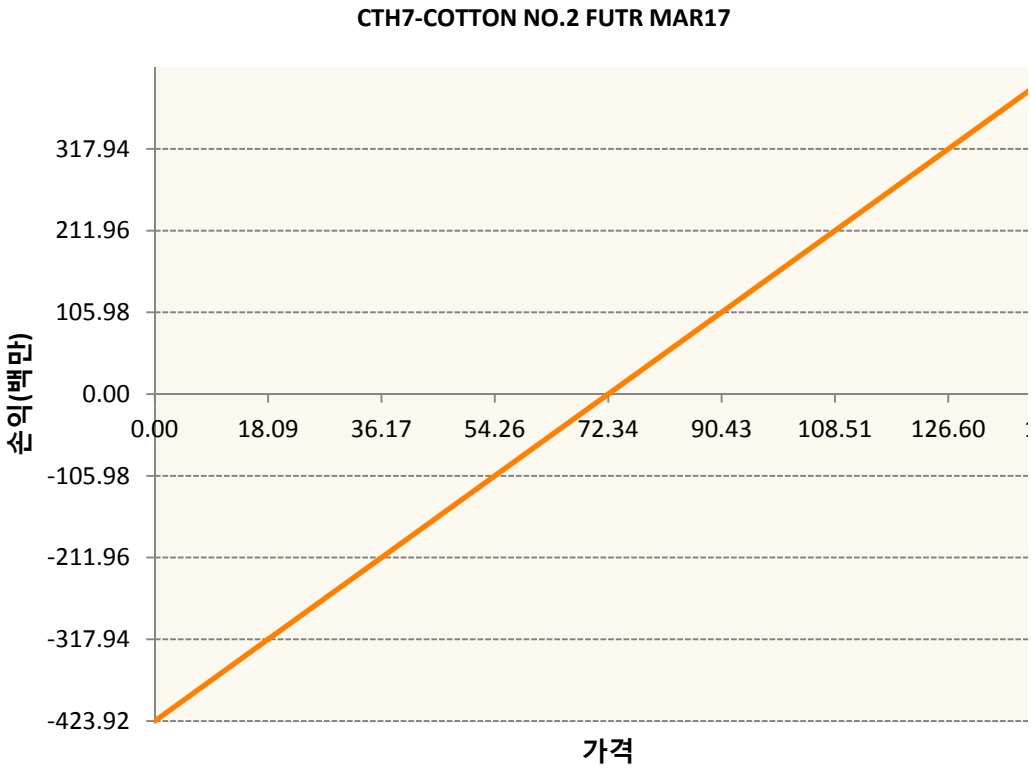
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 9,487 | 587 | 8,900 | |

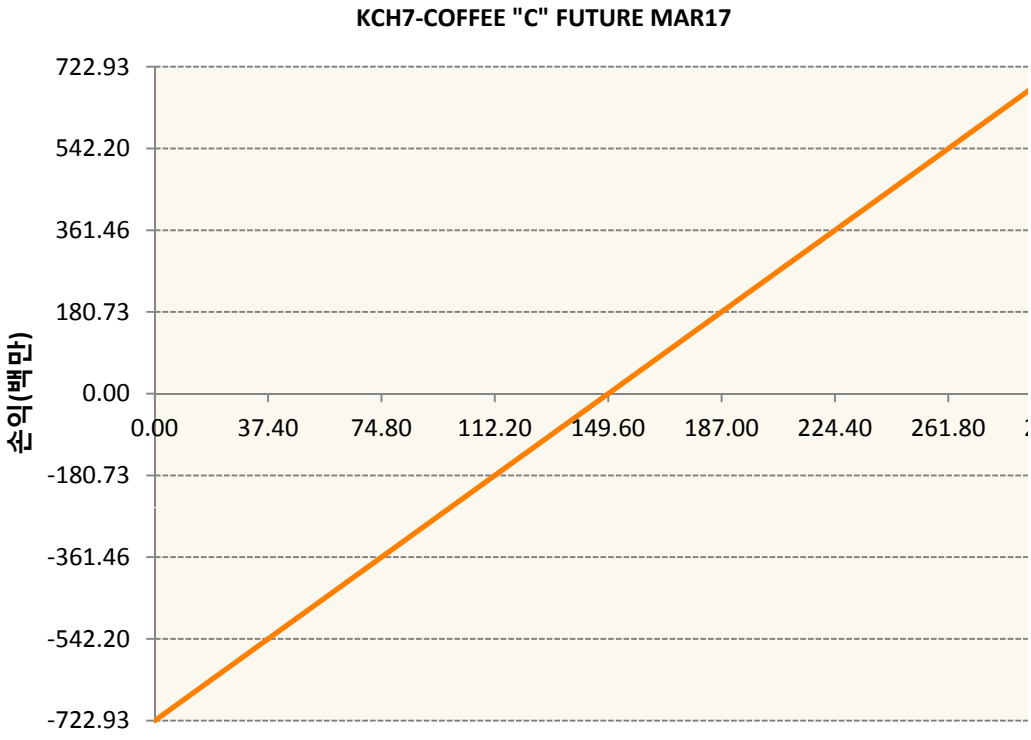
## 2. 만기시점의 손익구조



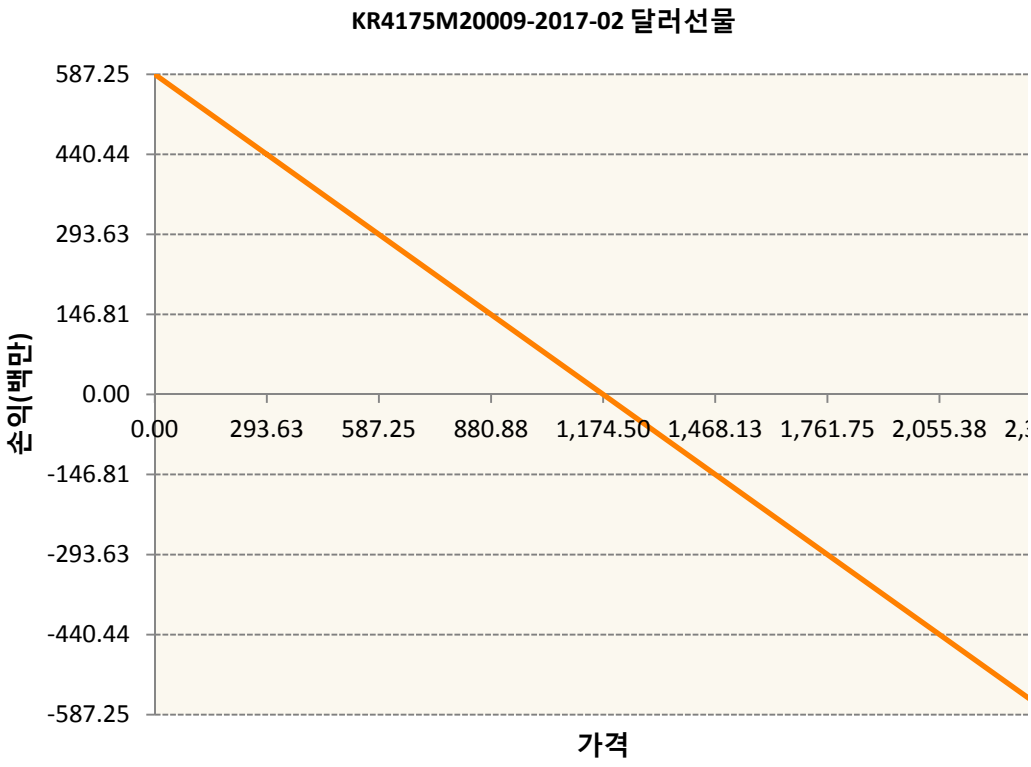



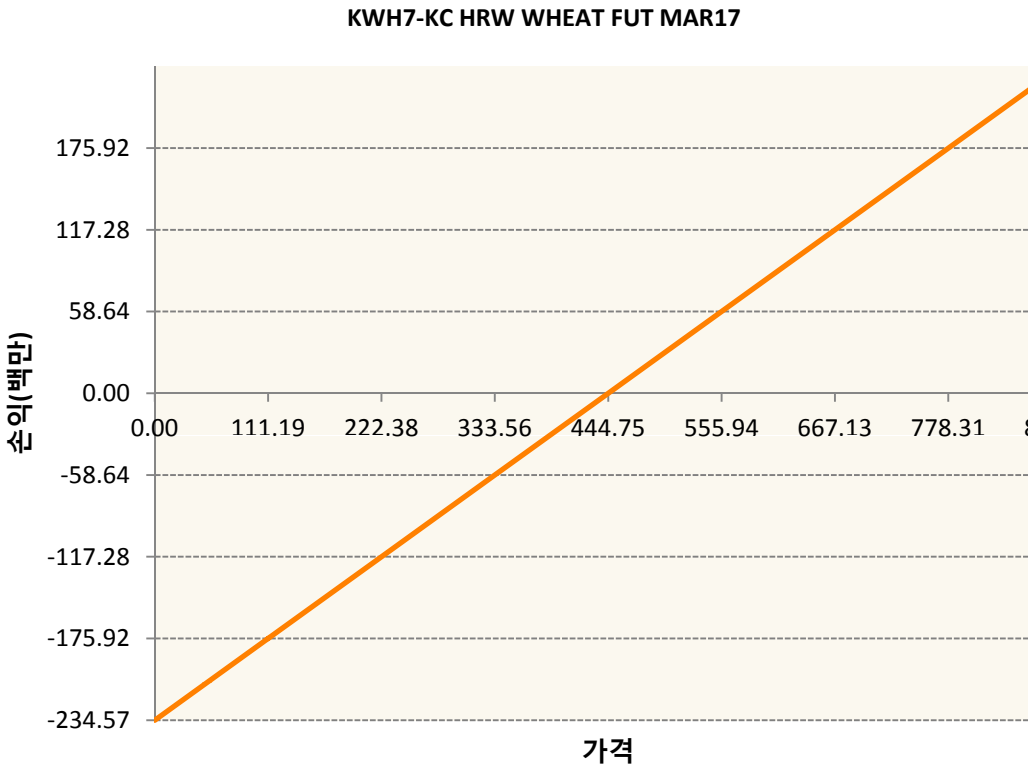

-1,049.62
-1,574.43
-2,099.24
가격

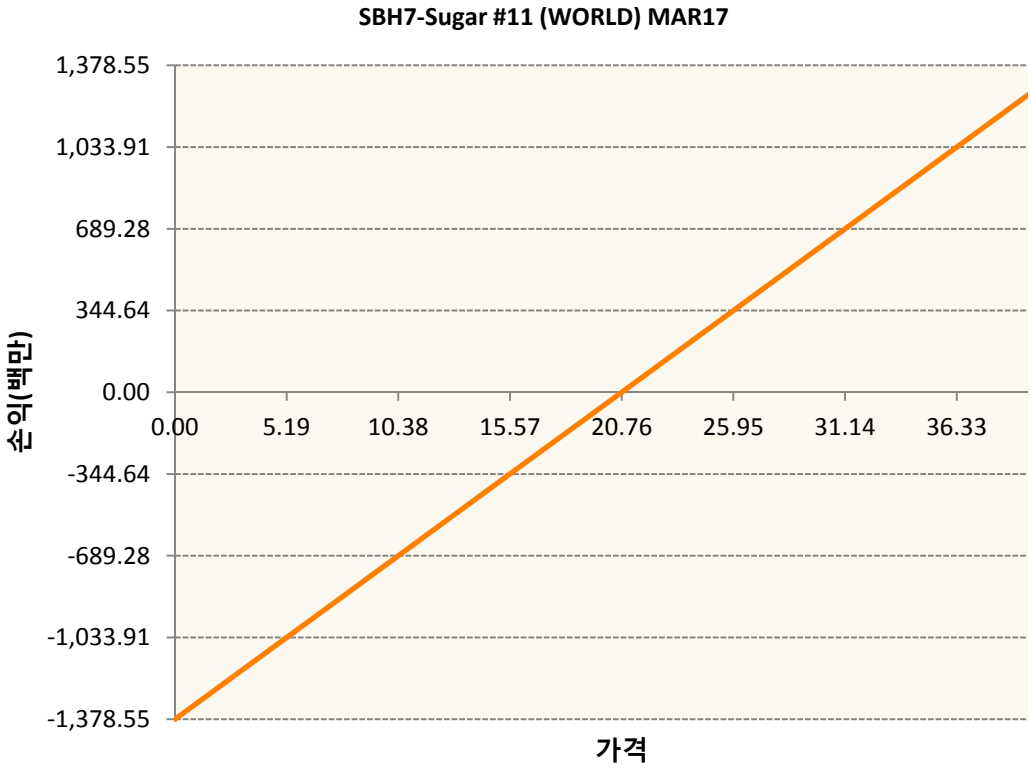

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
317.94
211.96
105.98
0.00
-105.98
-211.96
-317.94
-423.92
0.00
18.09
36.17
54.26
72.34
90.43
108.51
126.60
순익(백만)
가격

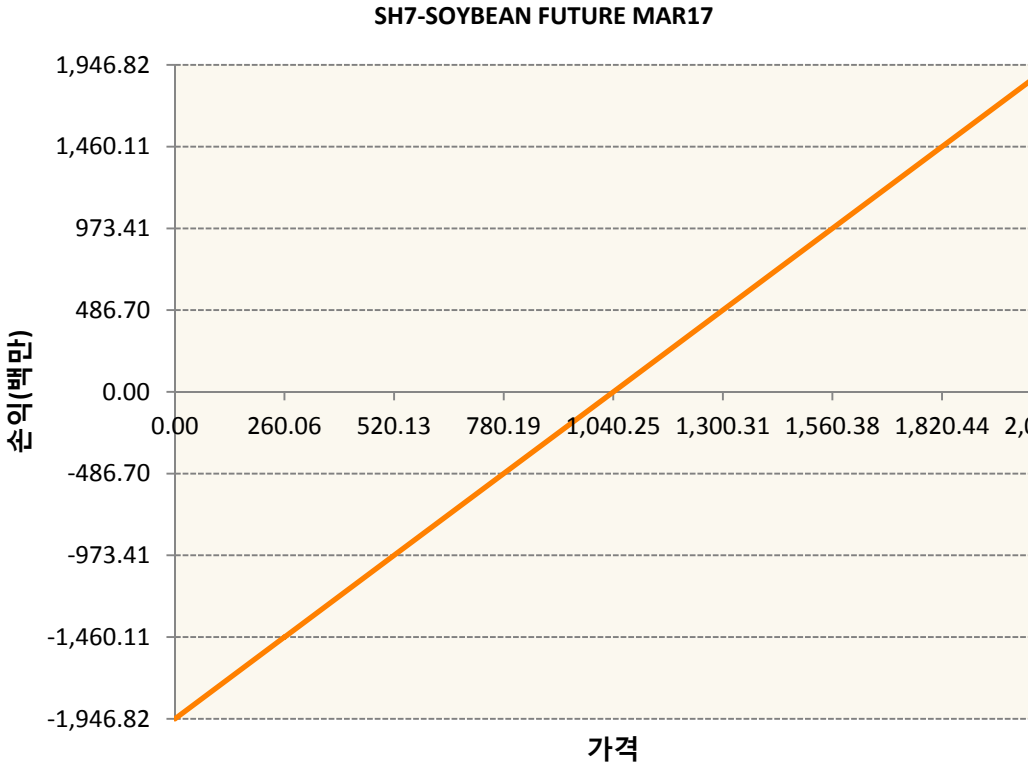

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
722.93
542.20
361.46
180.73
0.00
-180.73
-361.46
-542.20
-722.93
0.00
37.40
74.80
112.20
149.60
187.00
224.40
261.80
순익(백만)

가격

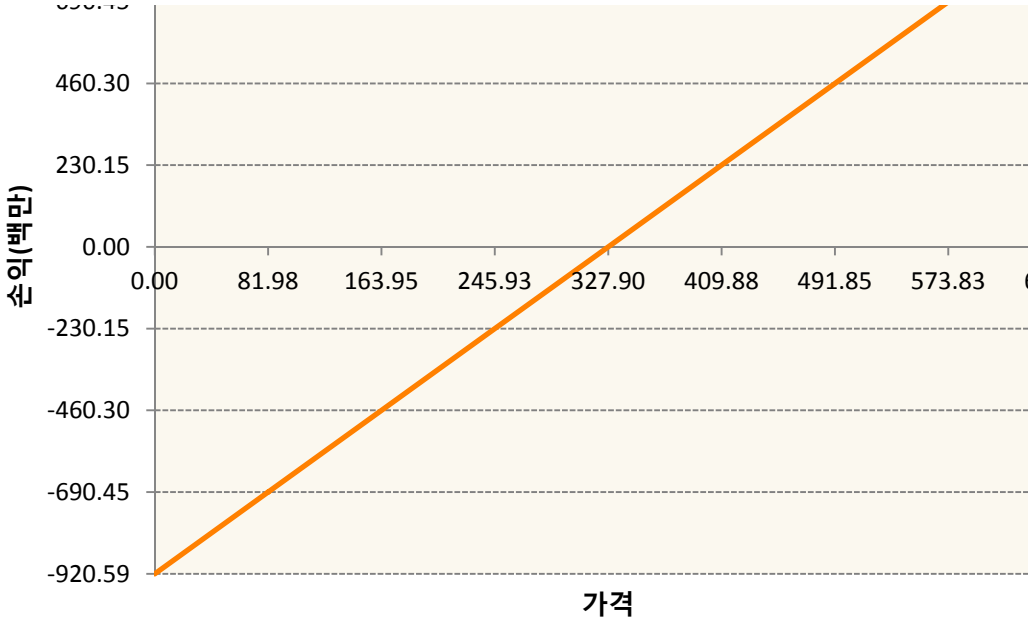

KR4175M20009-2017-02 달러선물
587.25
440.44
293.63
146.81
0.00
-146.81
-293.63
-440.44
-587.25
0.00
293.63
587.25
880.88
1,174.50
1,468.13
1,761.75
2,055.38
손익(백만)
가격


KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
175.92
117.28
58.64
0.00
-58.64
-117.28
-175.92
-234.57
0.00
111.19
222.38
333.56
444.75
555.94
667.13
778.31
손익(백만)
가격

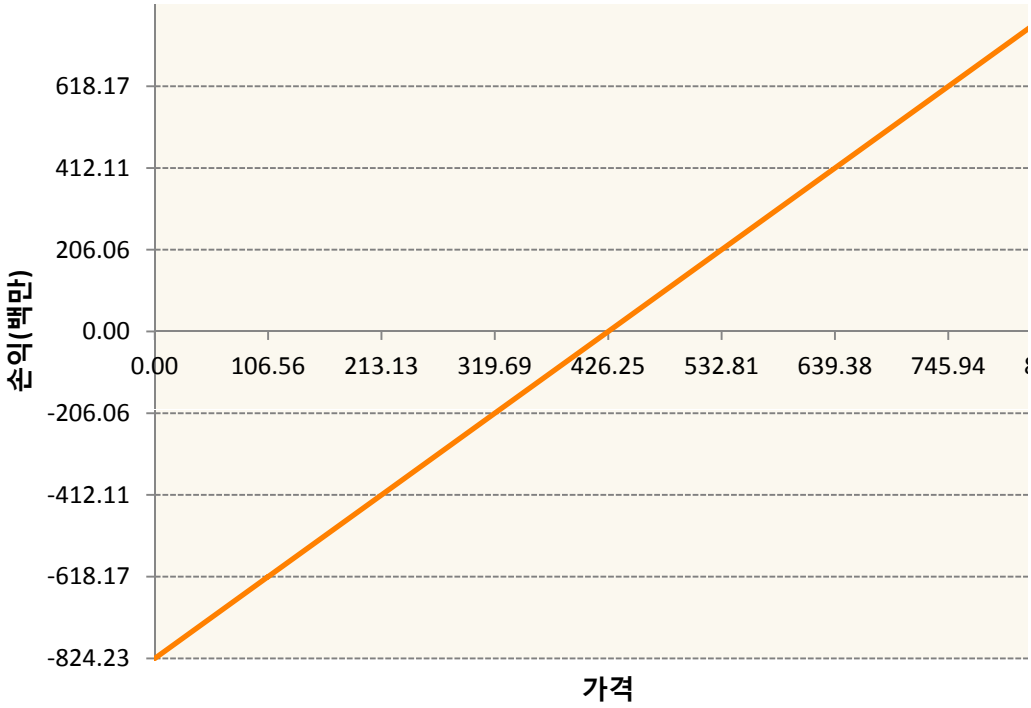

SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,378.55
1,033.91
689.28
344.64
0.00
-344.64
-689.28
-1,033.91
-1,378.55
0.00
5.19
10.38
15.57
20.76
25.95
31.14
36.33
손익(백만)
가격


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,946.82
1,460.11
973.41
486.70
0.00
-486.70
-973.41
-1,460.11
-1,946.82
0.00
260.06
520.13
780.19
1,040.25
1,300.31
1,560.38
1,820.44
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
920.59
690.45




WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17




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

| | | |
|---|---|---|
| BOH7 | SOYBEAN OIL FUTR MAR17 | 75 |
| CH7 | CORN FUTURE MAR17 | 168 |
| CTH7 | COTTON NO.2 FUTR MAR17 | 34 |
| KCH7 | COFFEE "C" FUTURE MAR17 | 58 |
| KR4175M20( | 2017-02 달러선물 | 47 |

| | | |
|---|---|---|
| KWH7 | KC HRW WHEAT FUT MAR17 | 19 |
| SBH7 | Sugar #11 (WORLD) MAR17 | 110 |
| SH7 | SOYBEAN FUTURE MAR17 | 156 |
| SMH7 | SOYBEAN MEAL FUTR MAR17 | 74 |
| WH7 | WHEAT FUTURE(CBT) MAR17 | 66 |

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

| |
|---|
| **936** |