| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-01-18 |
| 기준일 | 2017-01-17 |

# 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 | 2017-01-18 |
| 기준일 | 2017-01-17 |

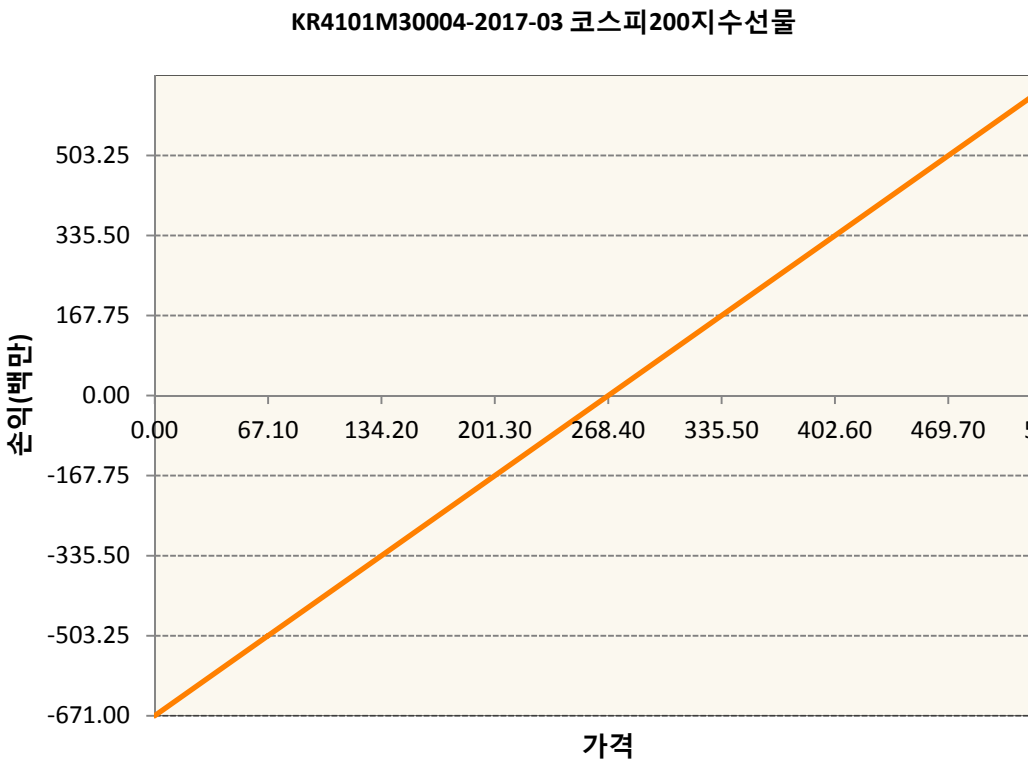
# 스마트인덱스모

## 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 | 671 | 0 | 671 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101M30( 2017-03 코스피200지수선물 | | | | | | | 53 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -53 | -53 | -53 | -53 | -53 | -53 | -53 |
| -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% | 53 | 53 | 53 | 53 | 53 | 53 | 53 |

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

| 39 |
|---|

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-01-18 |
| 기준일 | 2017-01-17 |

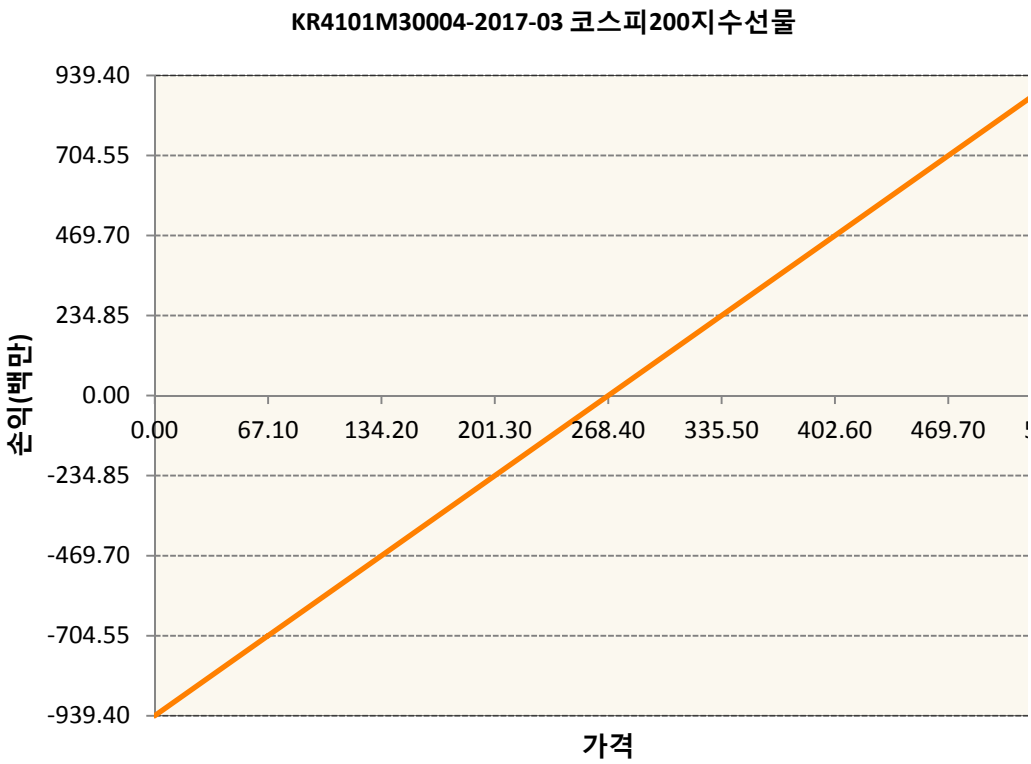
# 스마트레버리지목표전환형1호

## 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 | 939 | 0 | 939 | 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)

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

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-01-18 |
| 기준일 | 2017-01-17 |

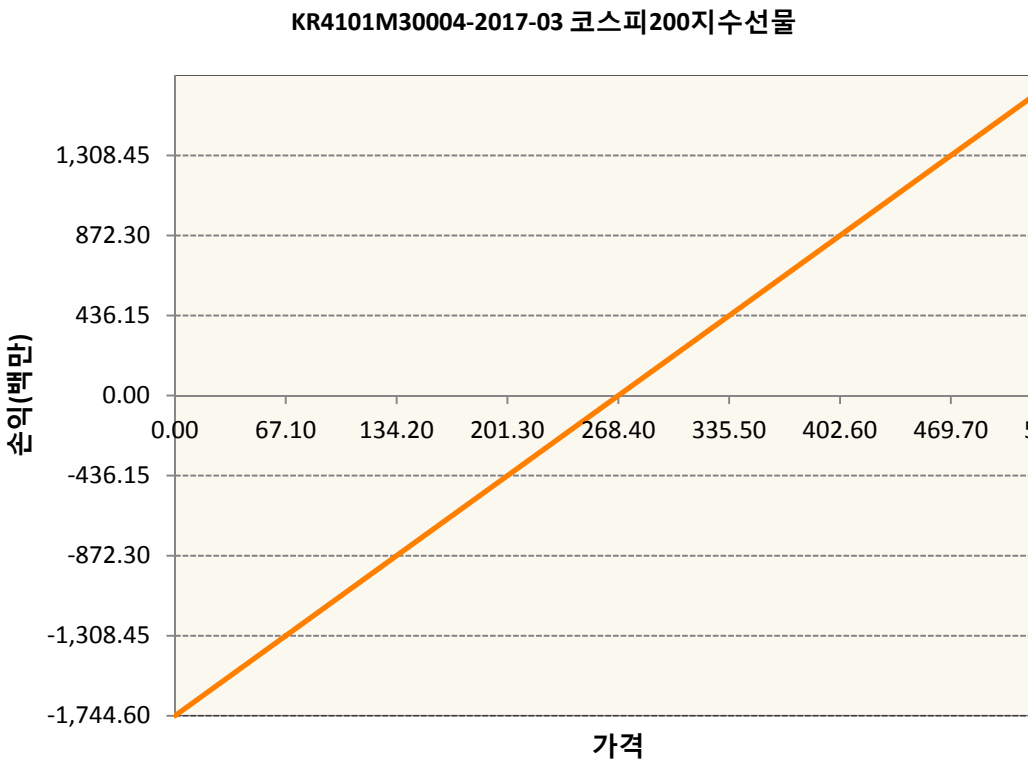
# 1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

## 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 | 1,745 | 0 | 1,745 | 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)

| |
|---|
| **101** |

| 공시일 | 2017-01-18 |
|---|---|
| 기준일 | 2017-01-17 |

# 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)

| **695** |
|---|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| 공시일 | 2017-01-18 |
|---|---|
| 기준일 | 2017-01-17 |

# 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 | 370 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **589** |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| 공시일 | 2017-01-18 |
|---|---|
| 기준일 | 2017-01-17 |

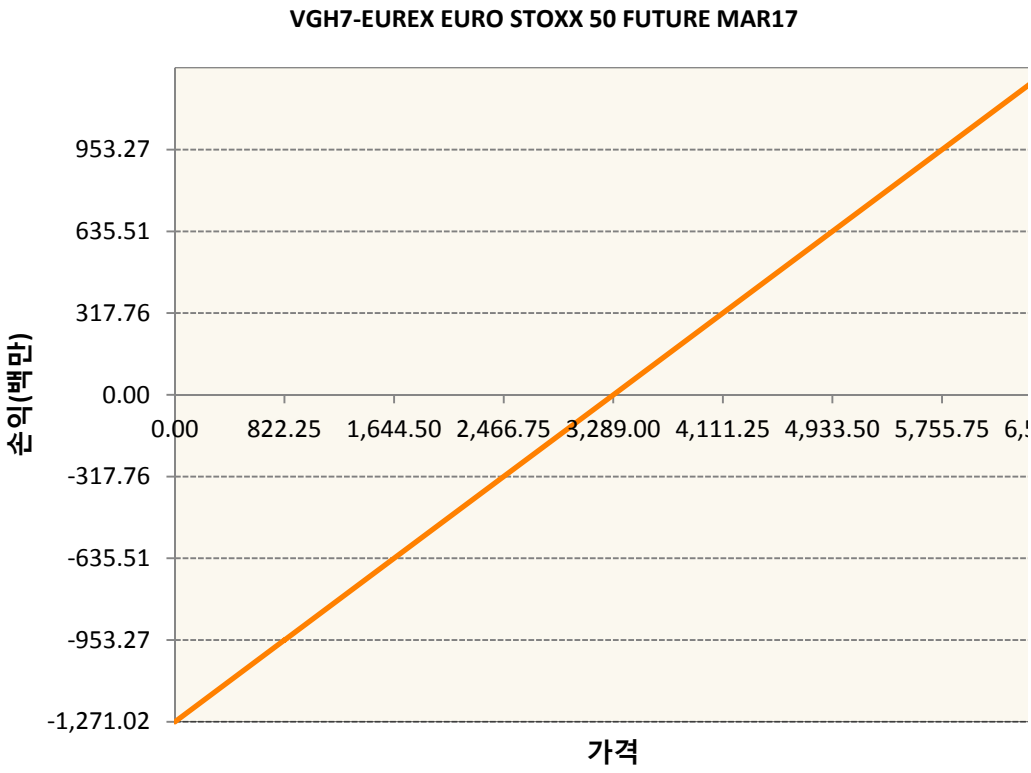
# 유로인덱스모(주식-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,271 | 0 | 1,271 | |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| VGH7 | EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17 | 102 |

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

(단위:백만원)

**111**

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-01-18 |
| 기준일 | 2017-01-17 |

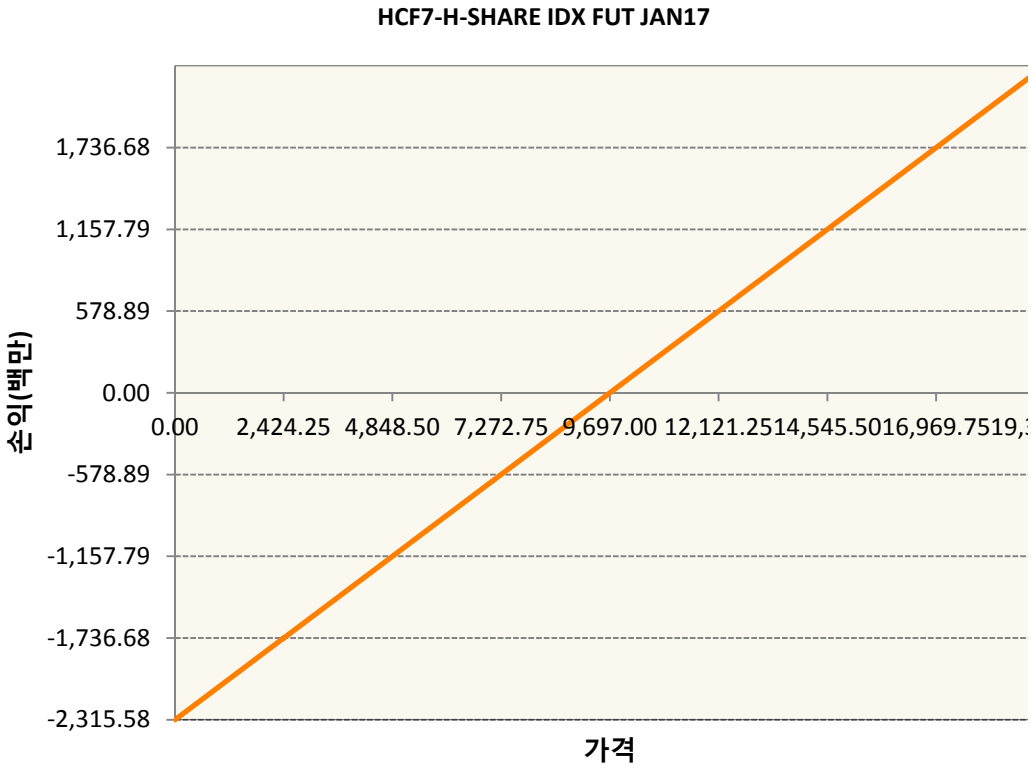
# 차이나인덱스모(주식-파생형)

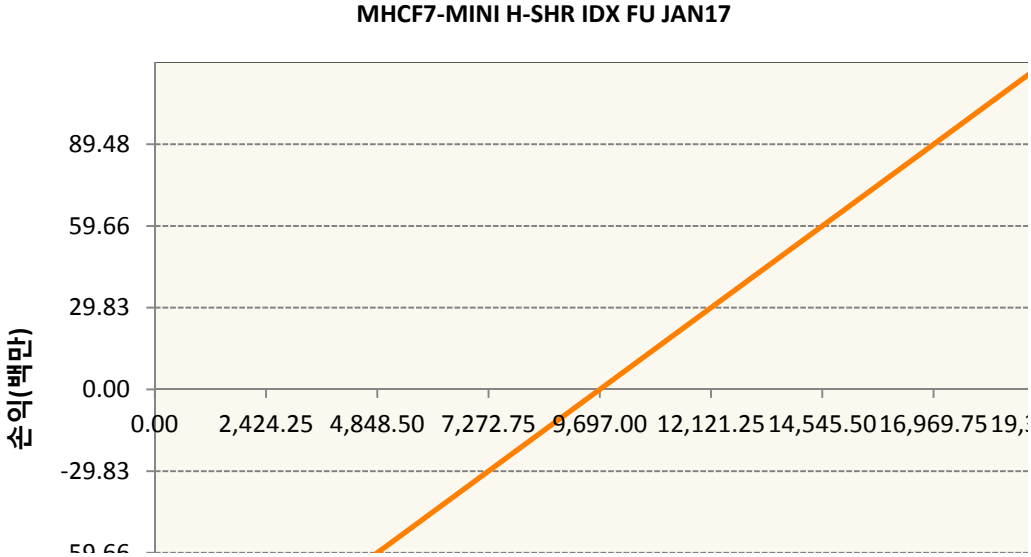
## 1. 계약금액

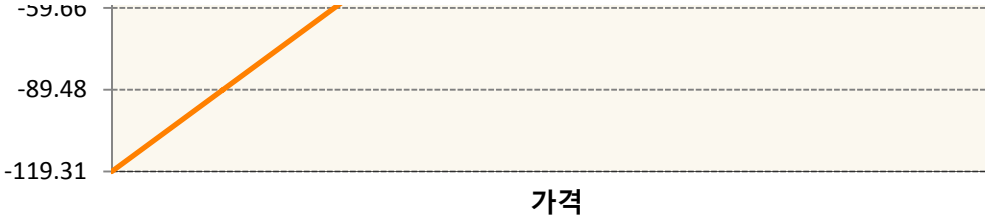
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,435 | 0 | 2,435 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조






| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---|---|
| HCF7 | H-SHARE IDX FUT JAN17 | 185 |
| MHCF7 | MINI H-SHR IDX FU JAN17 | 10 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|---|---|
| | **237** |

| 공시일 | 2017-01-18 |
|---|---|
| 기준일 | 2017-01-17 |

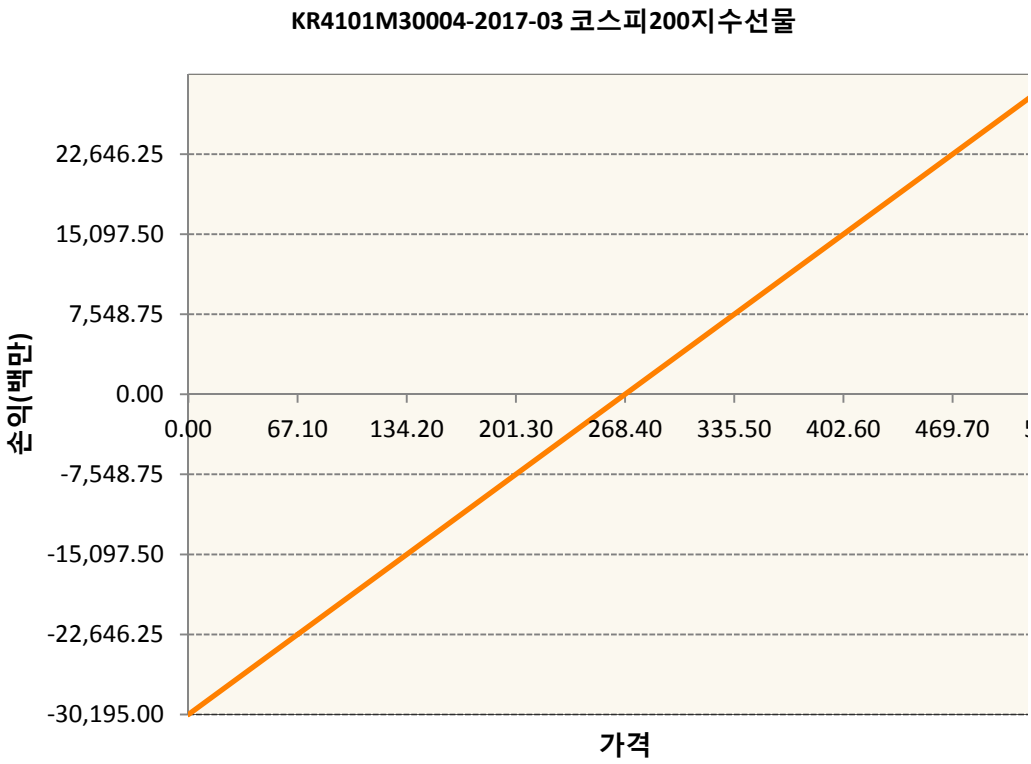
# 커버드콜(주식혼합-파생형)

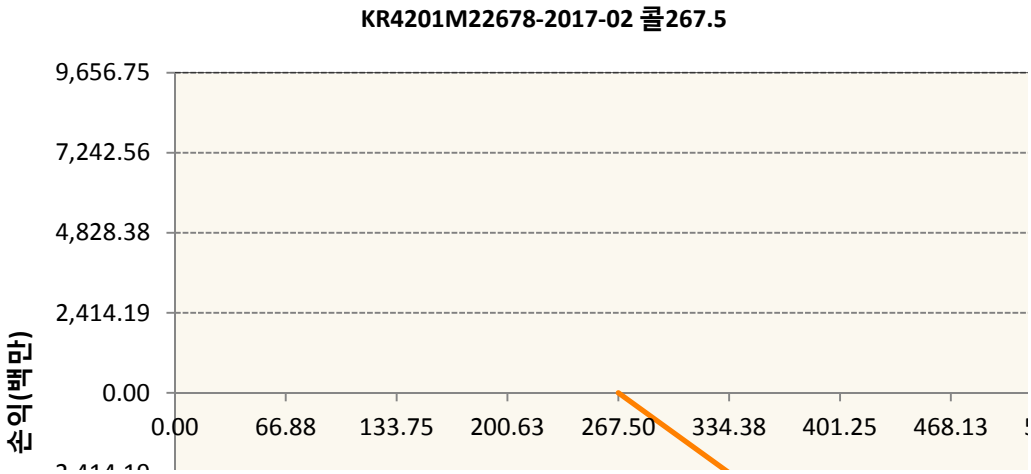
## 1. 계약금액

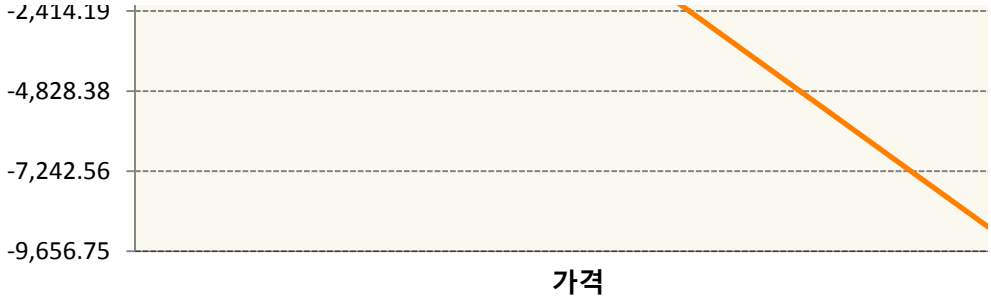
(단위:백만원)

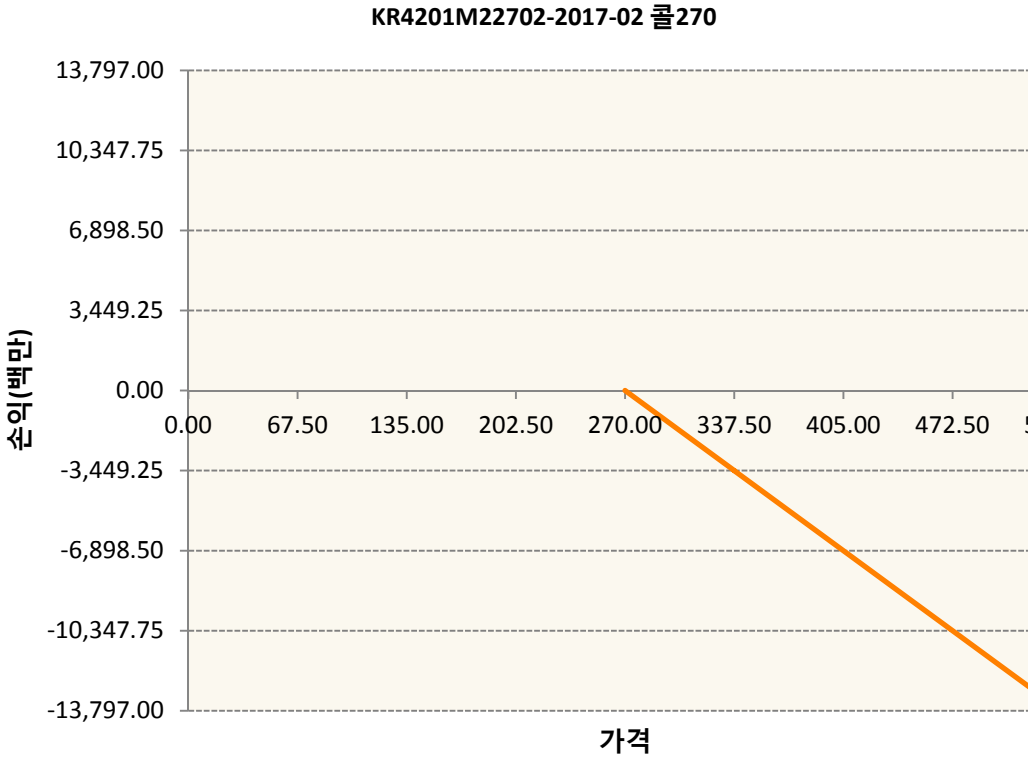
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 30,195 | 0 | 30,195 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 23,454 | -23,454 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조






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

| KR4101M30( 2017-03 코스피200지수선물 | | | | | | | 2,406 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -2,406 | -2,406 | -2,406 | -2,406 | -2,406 | -2,406 | -2,406 |
| -5.33% | -1,604 | -1,604 | -1,604 | -1,604 | -1,604 | -1,604 | -1,604 |
| -2.67% | -802 | -802 | -802 | -802 | -802 | -802 | -802 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 802 | 802 | 802 | 802 | 802 | 802 | 802 |
| 5.33% | 1,604 | 1,604 | 1,604 | 1,604 | 1,604 | 1,604 | 1,604 |
| 8.00% | 2,406 | 2,406 | 2,406 | 2,406 | 2,406 | 2,406 | 2,406 |
| KR4201M22( 2017-02 콜267.5 | | | | | | | 3,288 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |

| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| -8.00% | 556 | 556 | 556 | 555 | 554 | 552 | 549 |
| -5.33% | 554 | 551 | 547 | 540 | 531 | 519 | 505 |
| -2.67% | 502 | 479 | 452 | 423 | 392 | 358 | 324 |
| 0% | 142 | 95 | 47 | 0 | -47 | -95 | -142 |
| 2.67% | -769 | -795 | -825 | -856 | -890 | -926 | -963 |
| 5.33% | -1,993 | -1,997 | -2,004 | -2,013 | -2,026 | -2,040 | -2,058 |
| 8.00% | -3,275 | -3,275 | -3,276 | -3,277 | -3,279 | -3,283 | -3,288 |
| KR4201M22 2017-02 콜270 | | | | | | | 4,305 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 516 | 516 | 516 | 516 | 515 | 514 | 512 |
| -5.33% | 516 | 514 | 511 | 506 | 499 | 489 | 476 |
| -2.67% | 486 | 467 | 443 | 414 | 382 | 346 | 307 |
| 0% | 188 | 126 | 64 | 0 | -64 | -129 | -194 |
| 2.67% | -833 | -887 | -943 | -1,000 | -1,060 | -1,120 | -1,181 |
| 5.33% | -2,466 | -2,480 | -2,498 | -2,521 | -2,548 | -2,579 | -2,614 |
| 8.00% | -4,269 | -4,270 | -4,273 | -4,277 | -4,283 | -4,293 | -4,305 |

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

| |
|---|
| **10,327** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-01-18 |
| 기준일 | 2017-01-17 |

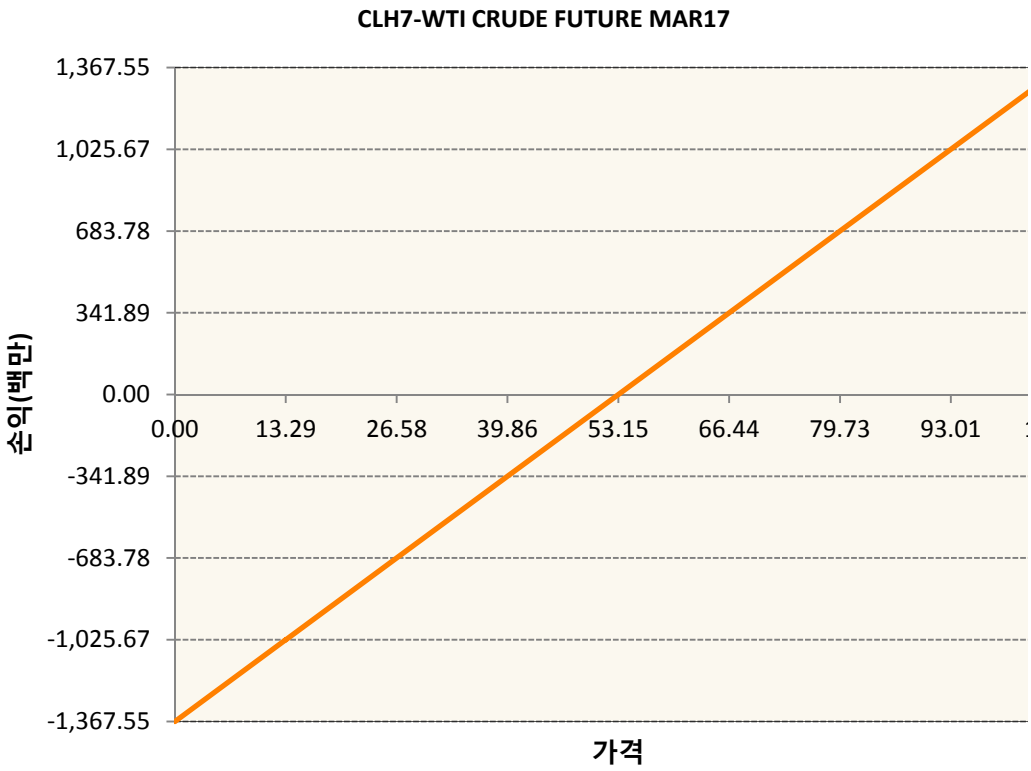
# 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

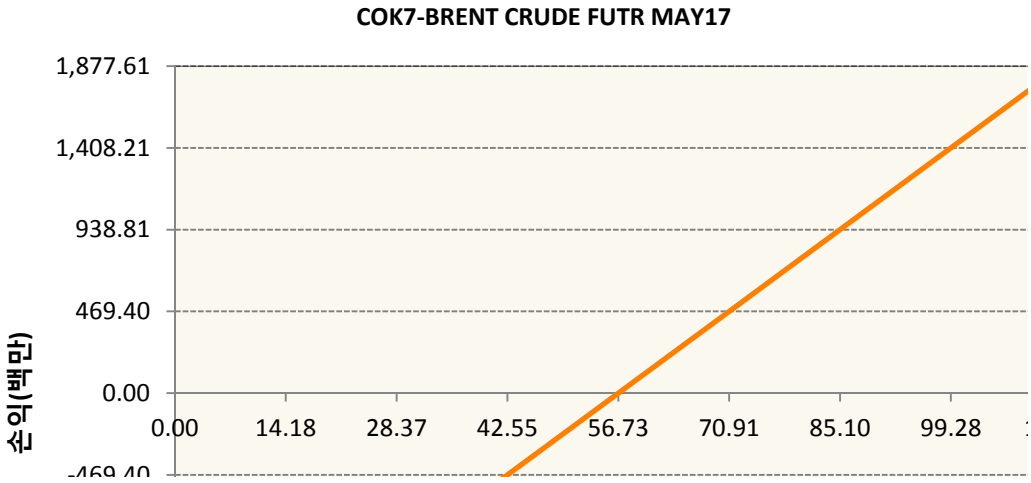
## 1. 계약금액

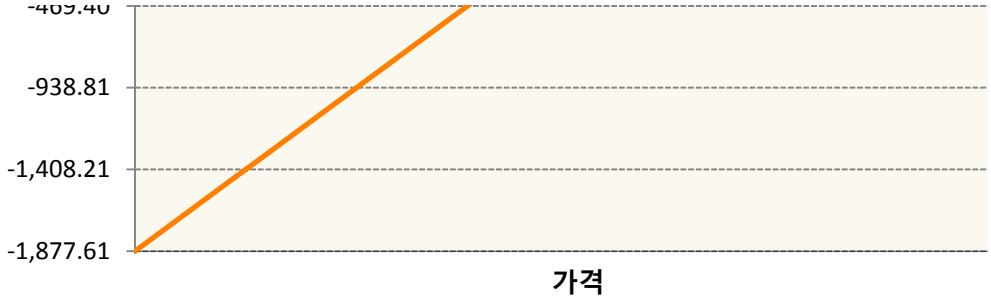
(단위:백만원)

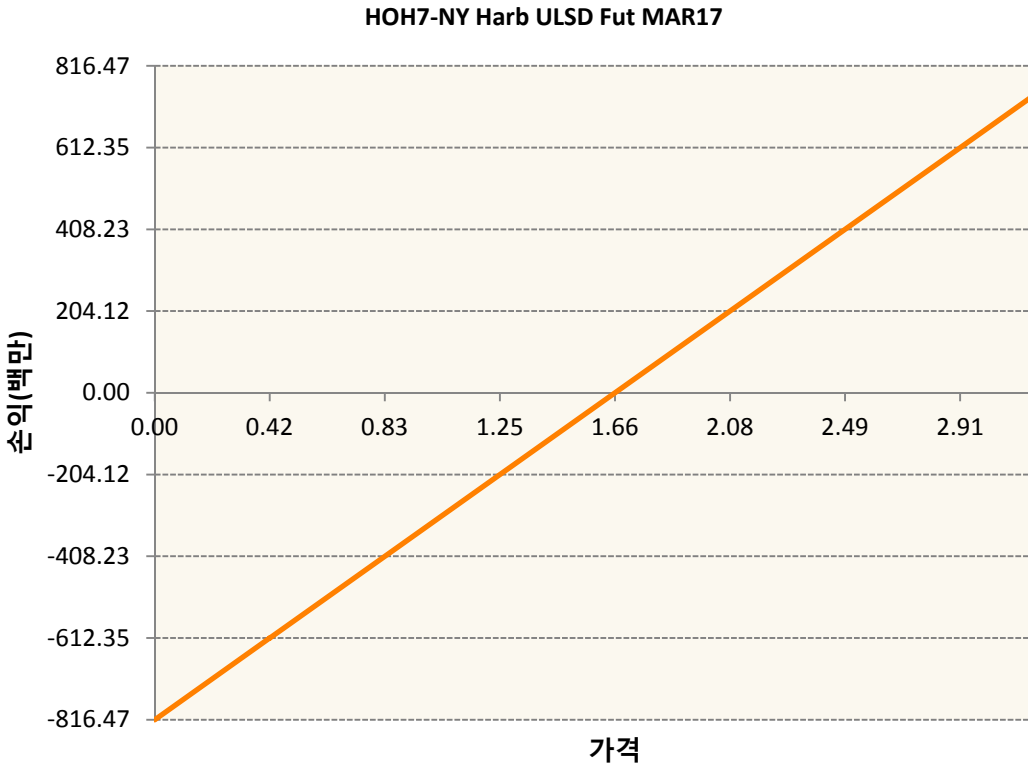
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 선물 | 유가증권 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 선물 | 유가증권 | 1,368 | 0 | 1,368 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 5,166 | 423 | 4,743 | |

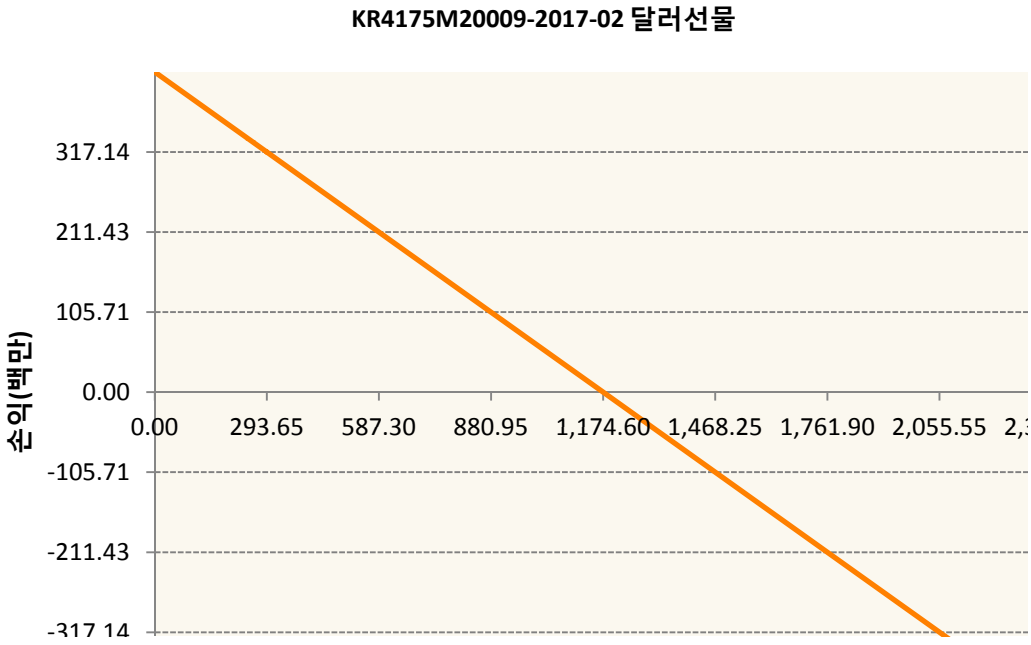
## 2. 만기시점의 손익구조

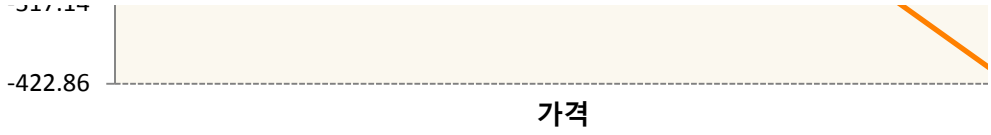


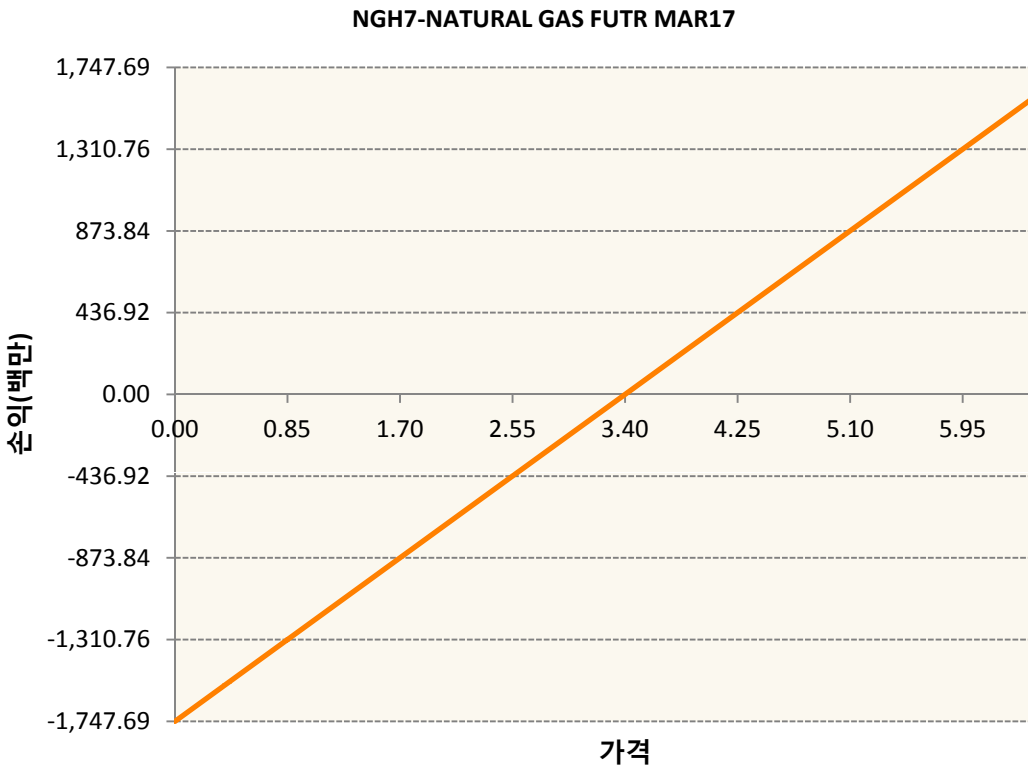



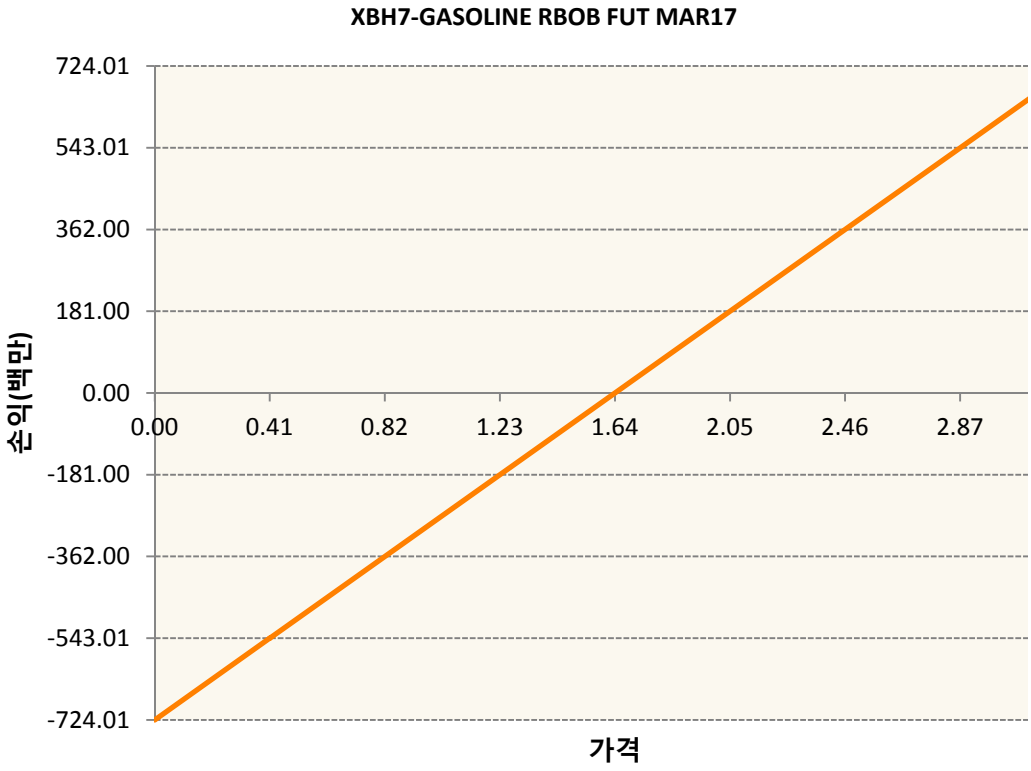

-938.81
-1,408.21
-1,877.61
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
816.47
612.35
408.23
204.12
0.00
-204.12
-408.23
-612.35
-816.47
0.00
0.42
0.83
1.25
1.66
2.08
2.49
2.91
순익(백만)
가격


KR4175M20009-2017-02 달러선물
317.14
211.43
105.71
0.00
-105.71
-211.43
0.00
293.65
587.30
880.95
1,174.60
1,468.25
1,761.90
2,055.55
순익(백만)


-422.86
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,747.69
1,310.76
873.84
436.92
0.00
-436.92
-873.84
-1,310.76
-1,747.69
0.00
0.85
1.70
2.55
3.40
4.25
5.10
5.95
순익(백만)
가격


XBH7-GASOLINE RBOB FUT MAR17
724.01
543.01
362.00
181.00
0.00
-181.00
-362.00
-543.01
-724.01
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 | 109 |
| COK7 | BRENT CRUDE FUTR MAY17 | 150 |
| HOH7 | NY Harb ULSD Fut MAR17 | 65 |
| KR4175M20( | 2017-02 달러선물 | 34 |
| NGH7 | NATURAL GAS FUTR MAR17 | 140 |
| XBH7 | GASOLINE RBOB FUT MAR17 | 58 |

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

| |
|---|
| **1,194** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-01-18 |
| 기준일 | 2017-01-17 |

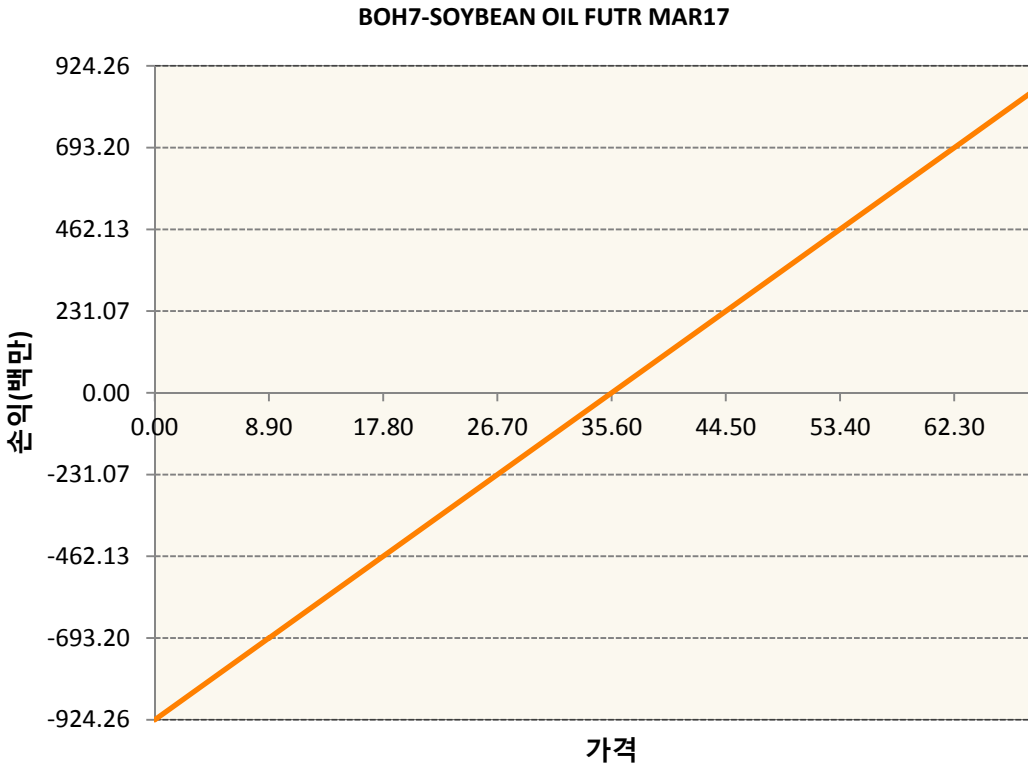
# 애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

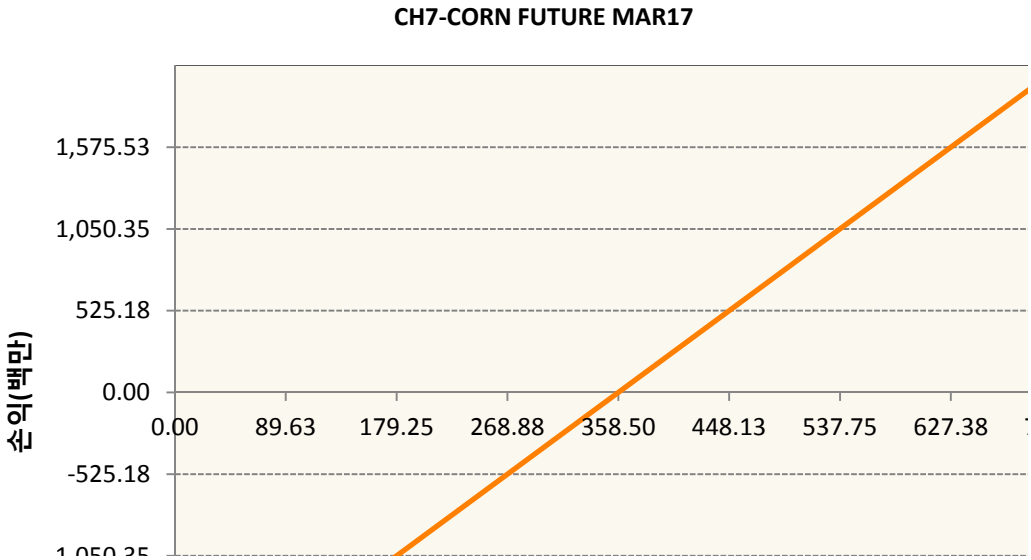
## 1. 계약금액

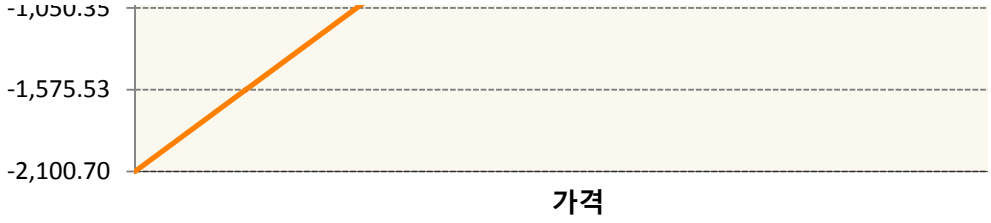
(단위:백만원)

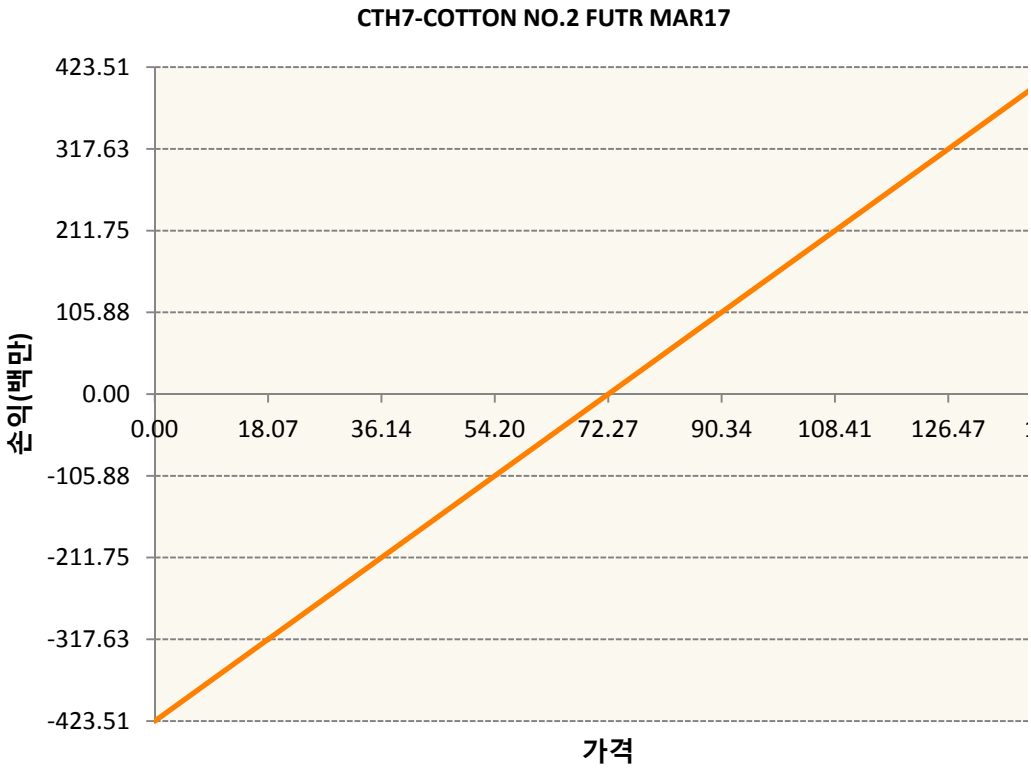
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 9,488 | 587 | 8,901 | |

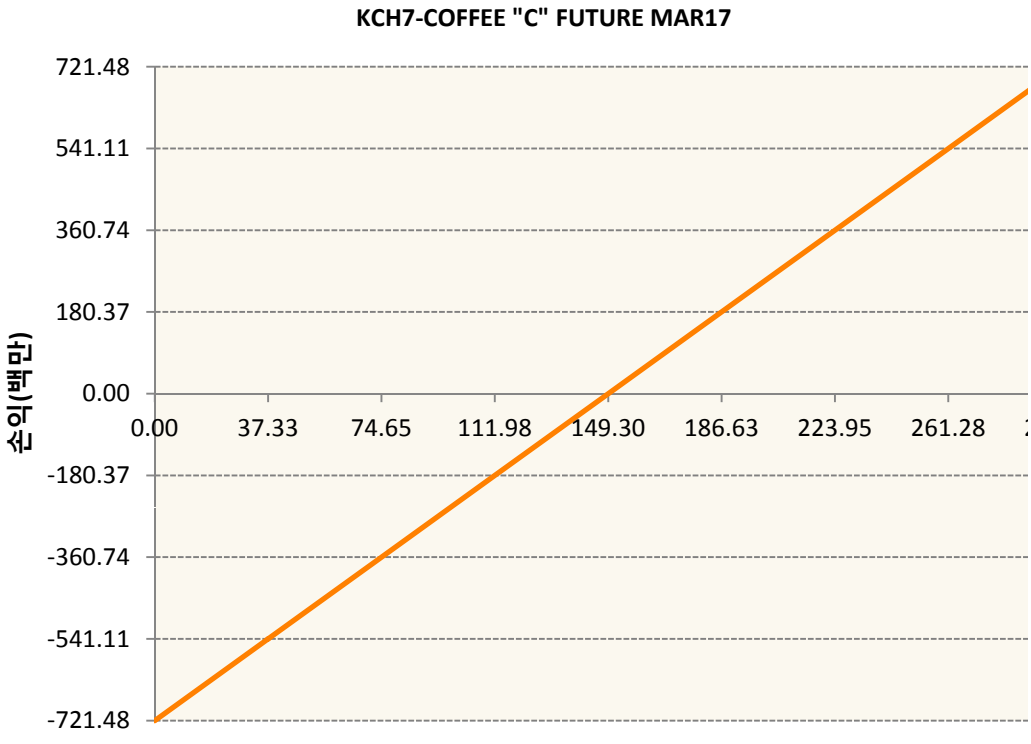
## 2. 만기시점의 손익구조



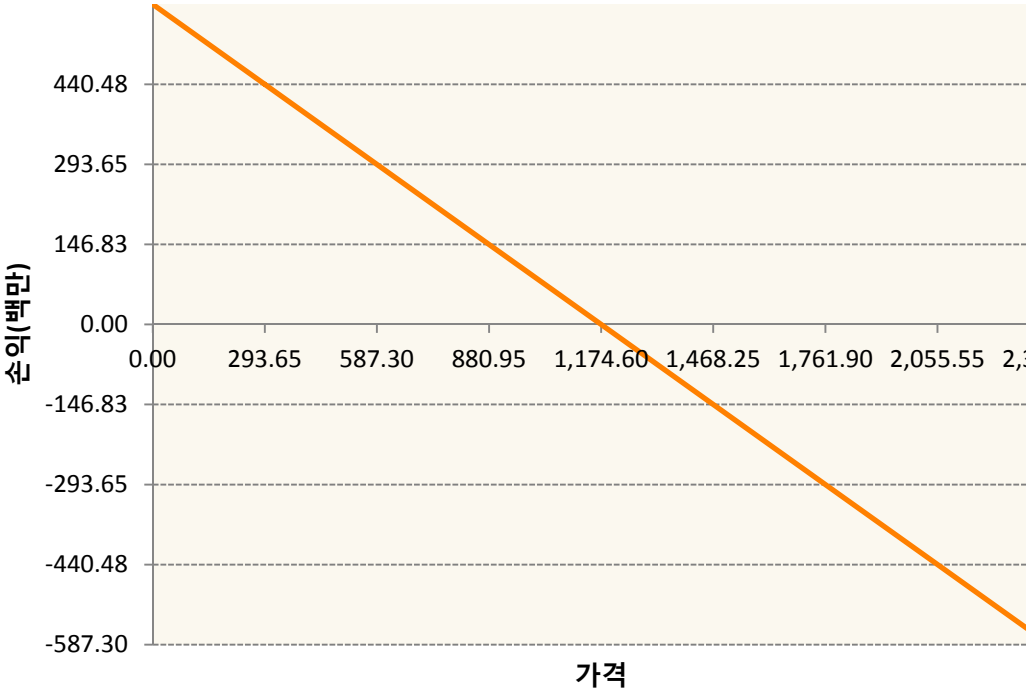

-1,575.53
-2,100.70
가격


CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
423.51
317.63
211.75
105.88
0.00
-105.88
-211.75
-317.63
-423.51
0.00
18.07
36.14
54.20
72.27
90.34
108.41
126.47
손익(백만)
가격

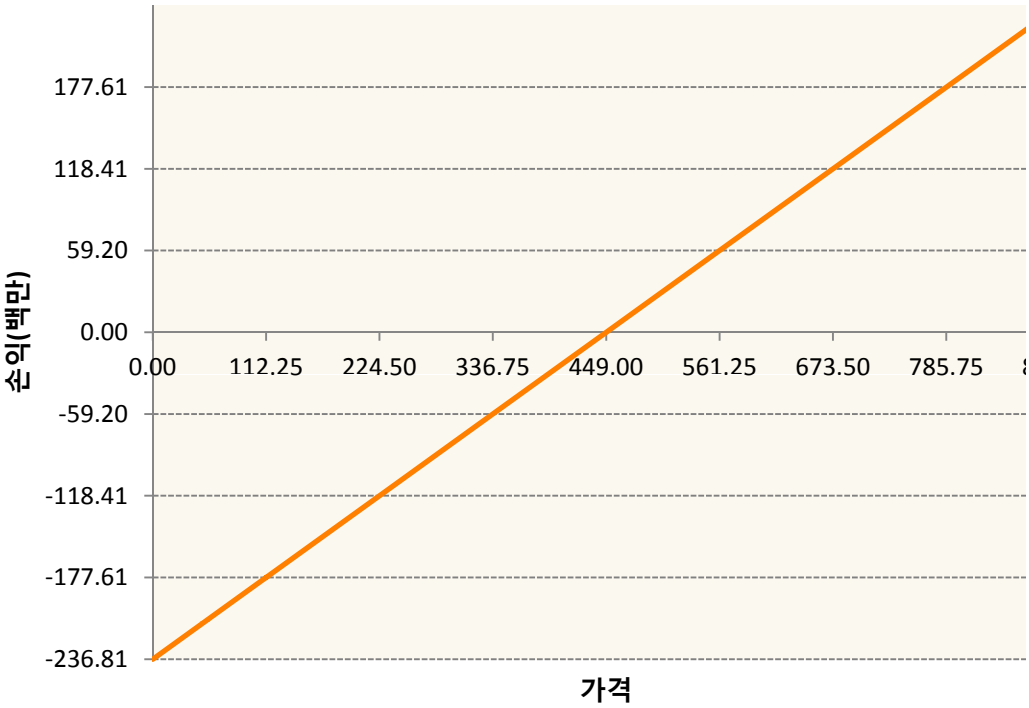

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
721.48
541.11
360.74
180.37
0.00
-180.37
-360.74
-541.11
-721.48
0.00
37.33
74.65
111.98
149.30
186.63
223.95
261.28
손익(백만)

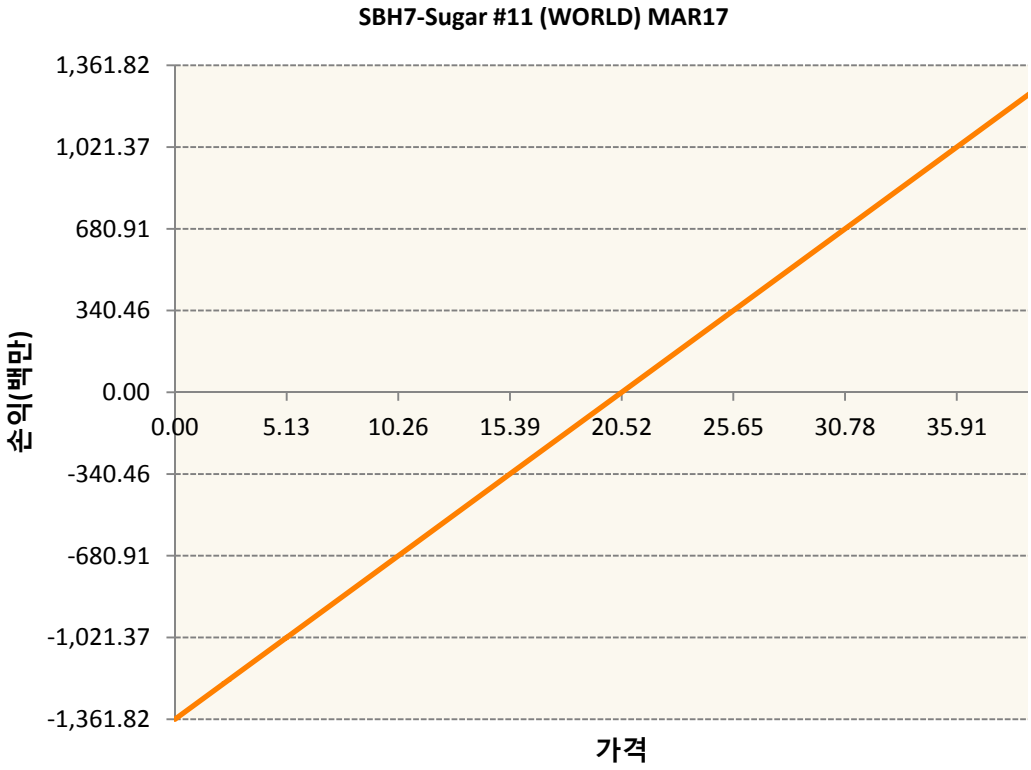
가격

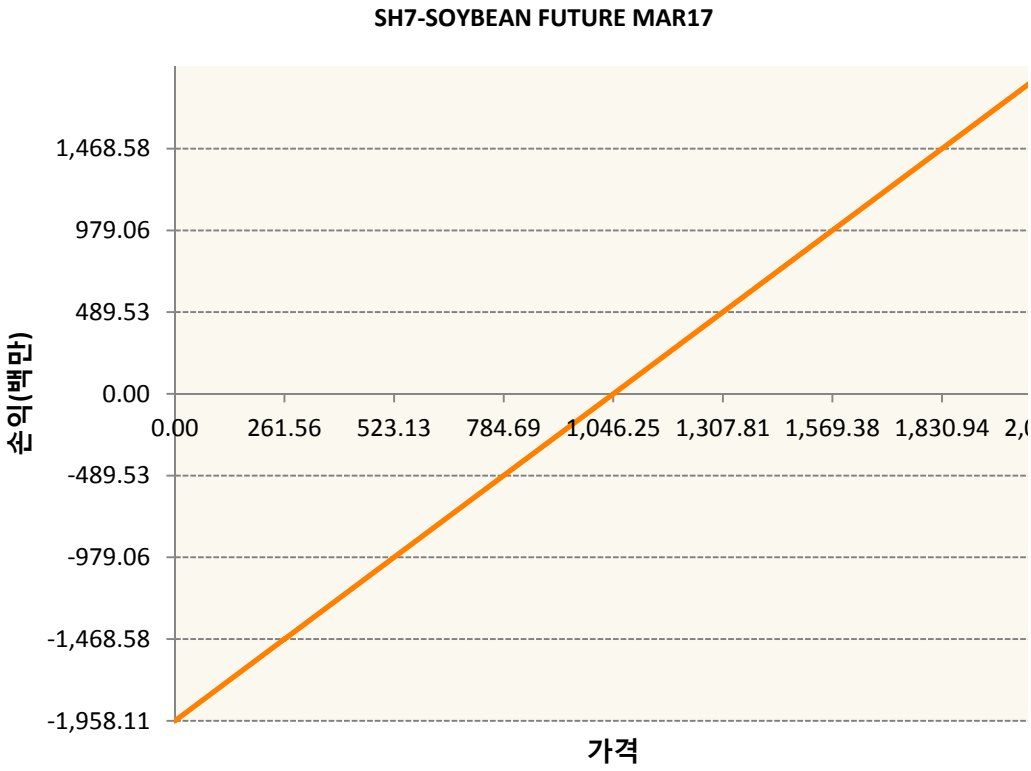
KR4175M20009-2017-02 달러선물



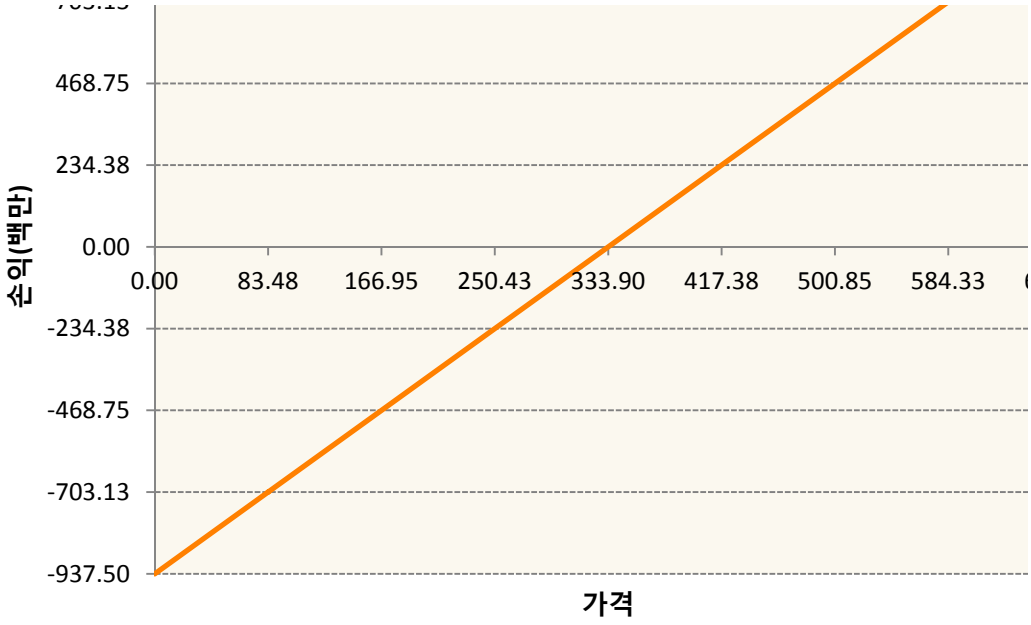

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17

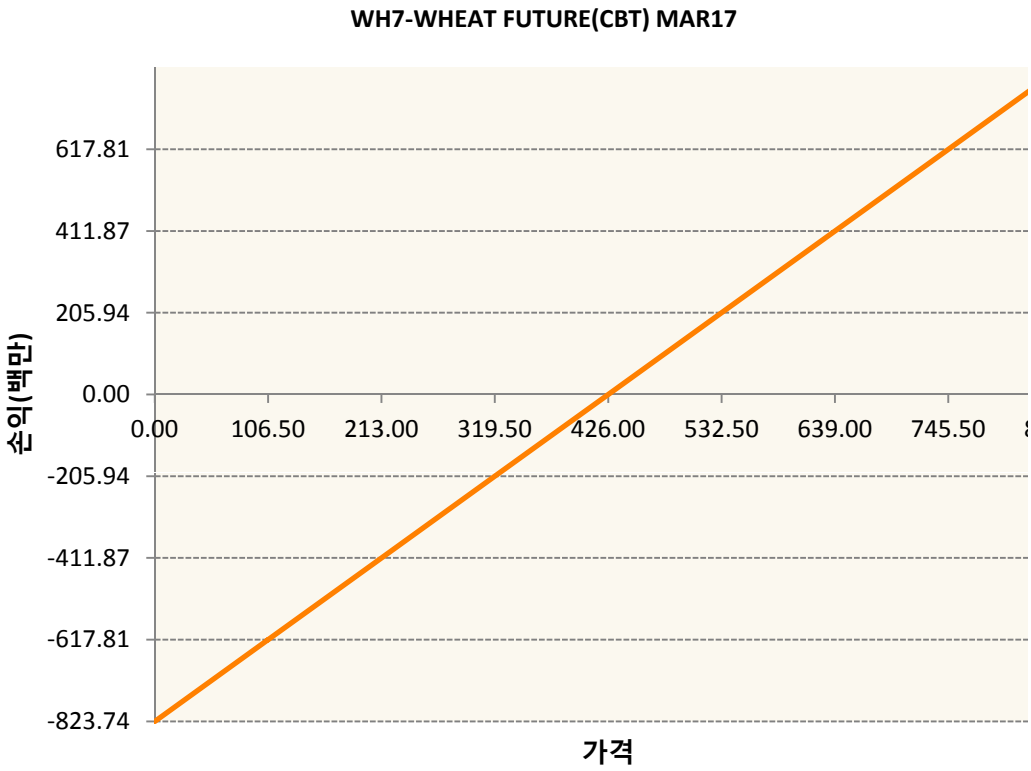



SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,361.82
1,021.37
680.91
340.46
0.00
-340.46
-680.91
-1,021.37
-1,361.82
0.00
5.13
10.26
15.39
20.52
25.65
30.78
35.91
손익(백만)
가격


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,468.58
979.06
489.53
0.00
-489.53
-979.06
-1,468.58
-1,958.11
0.00
261.56
523.13
784.69
1,046.25
1,307.81
1,569.38
1,830.94
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
937.50
703.13




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

| | | |
|---|---|---|
| BOH7 | SOYBEAN OIL FUTR MAR17 | 74 |
| 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 | 109 |
| SH7 | SOYBEAN FUTURE MAR17 | 157 |
| SMH7 | SOYBEAN MEAL FUTR MAR17 | 75 |
| WH7 | WHEAT FUTURE(CBT) MAR17 | 66 |

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

| |
|---|
| **923** |