공시일	2017-03-16
기준일	2017-03-15

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	2017-03-16
기준일	2017-03-15

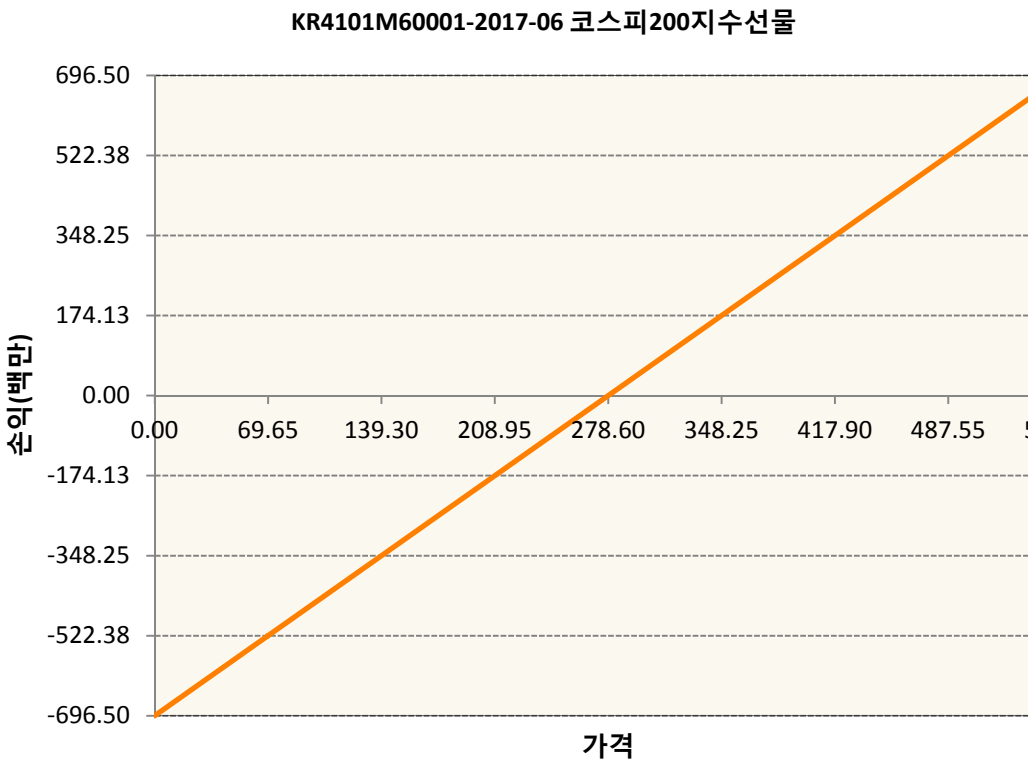
스마트인덱스모

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	697	0	697	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							56
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
-5.33%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
-2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	19	19	19	19	19	19	19
5.33%	37	37	37	37	37	37	37
8.00%	56	56	56	56	56	56	56

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

36

공시일	2017-03-16
기준일	2017-03-15

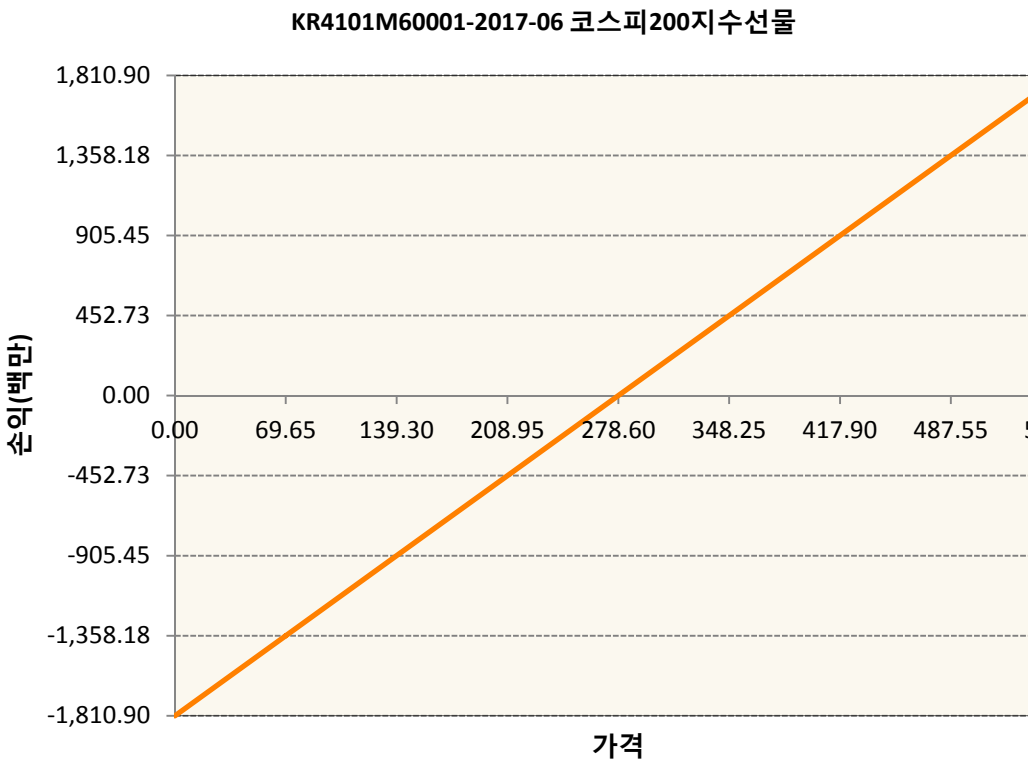
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,811	0	1,811	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							145
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-145	-145	-145	-145	-145	-145	-145
-5.33%	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96
-2.67%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	48	48	48	48	48	48	48
5.33%	96	96	96	96	96	96	96
8.00%	145	145	145	145	145	145	145

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

93

공시일	2017-03-16
기준일	2017-03-15

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	11,879	0	11,879	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S170222	952

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

582

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-16
기준일	2017-03-15

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	4,939	0	4,939	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S170308	392

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

451

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-16
기준일	2017-03-15

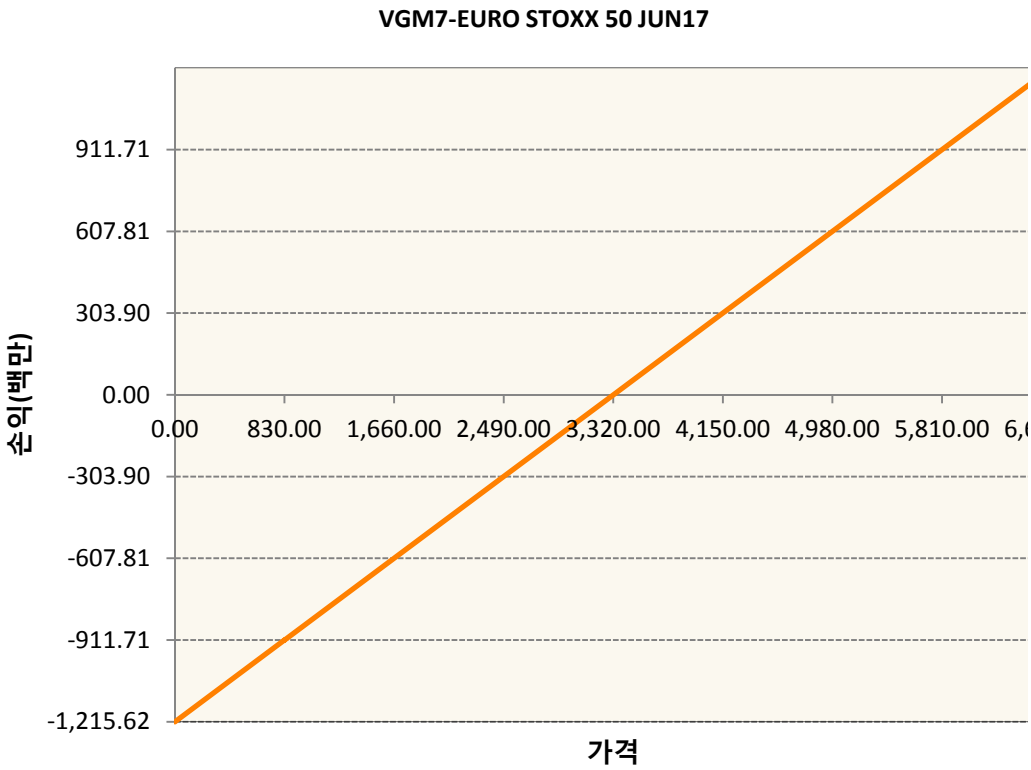
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,216	0	1,216	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM7	EURO STOXX 50 JUN17	97

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

(단위:백만원)

99

공시일	2017-03-16
기준일	2017-03-15

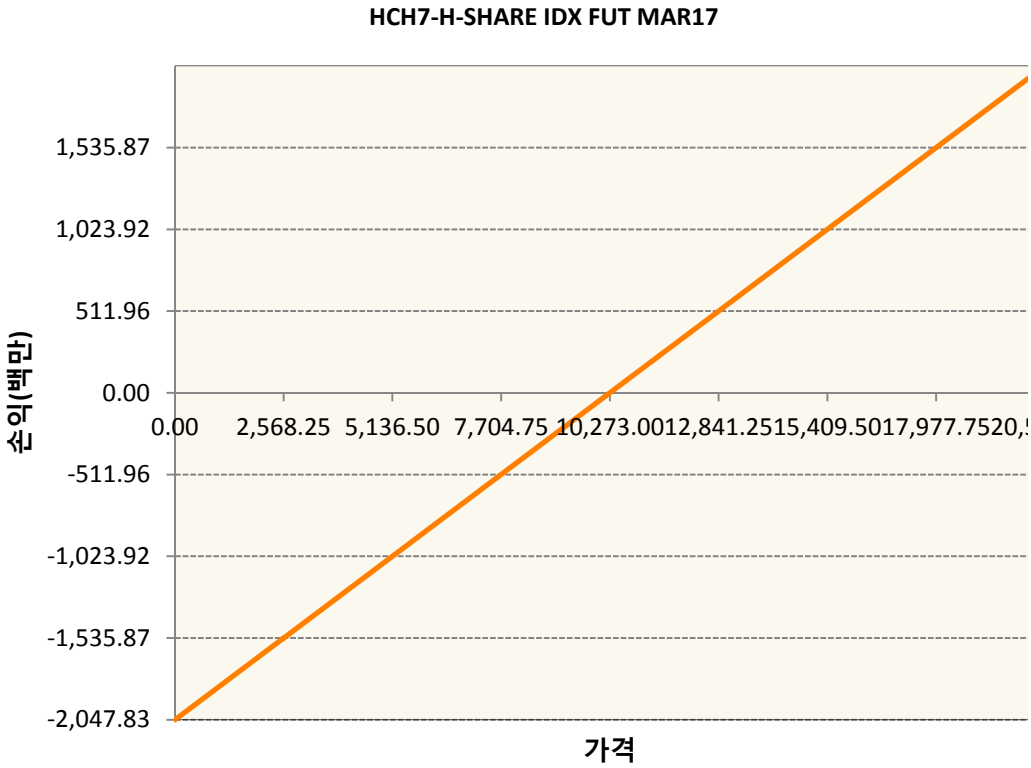
차이나인덱스모(주식-파생형)

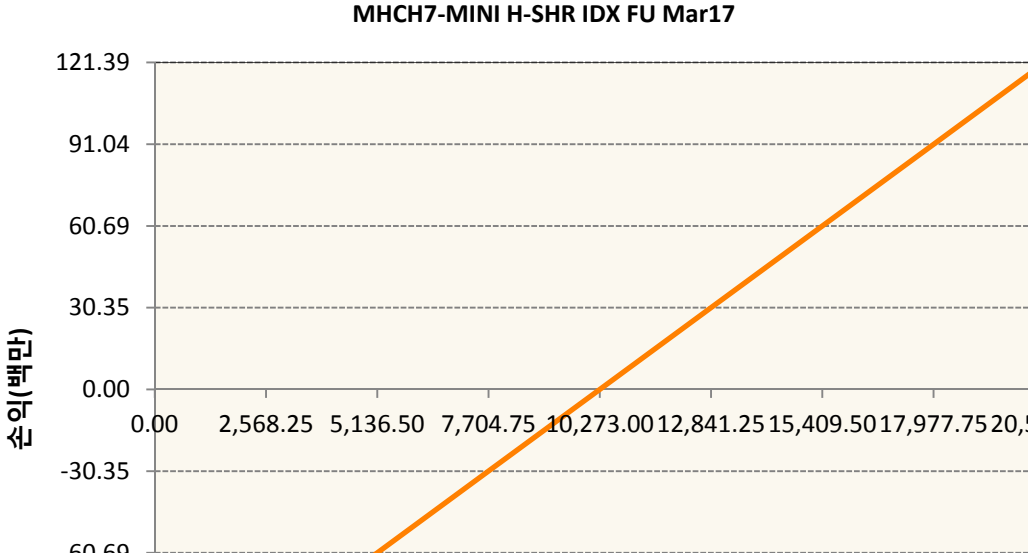
1. 계약금액

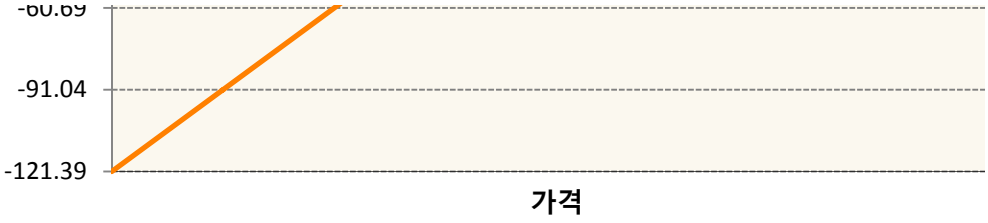
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,169	0	2,169	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH7	H-SHARE IDX FUT MAR17	164
MHCH7	MINI H-SHR IDX FU Mar17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	191

공시일	2017-03-16
기준일	2017-03-15

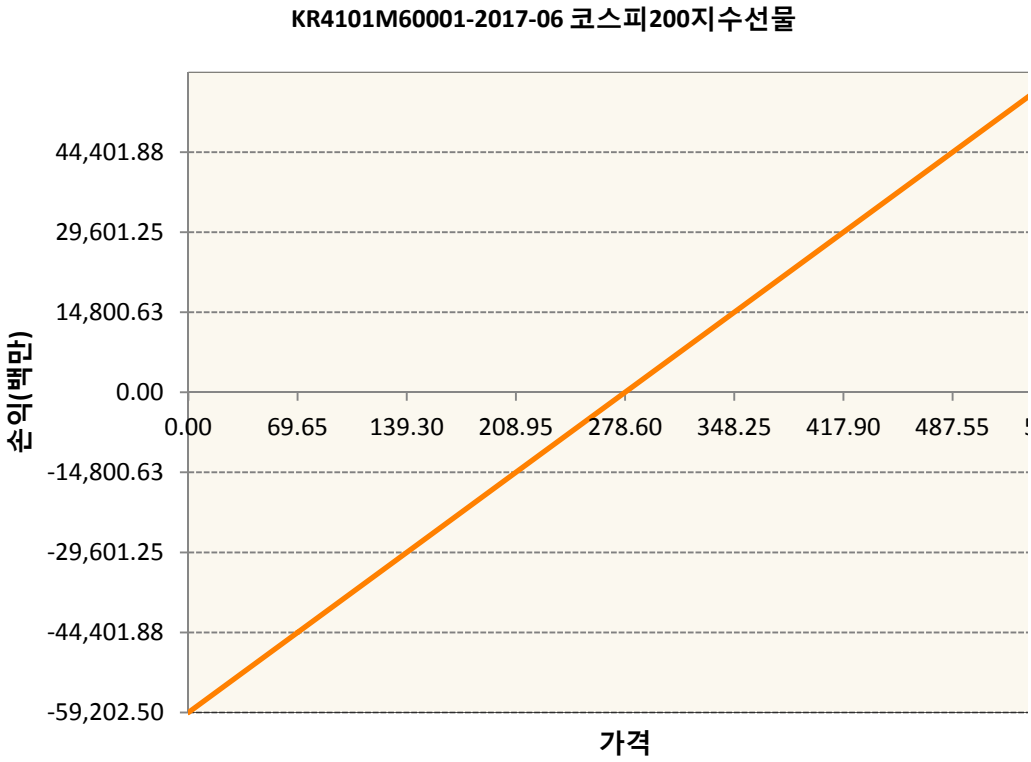
커버드콜모(주식혼합-파생형)

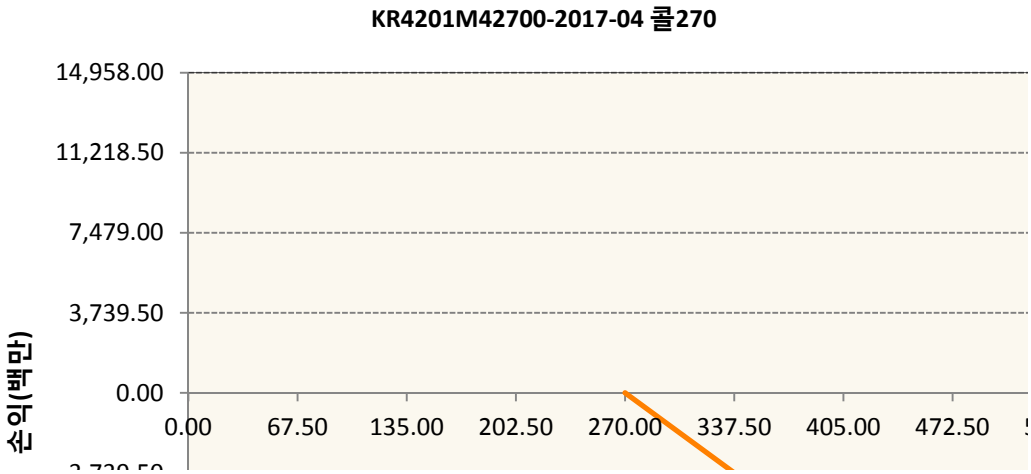
1. 계약금액

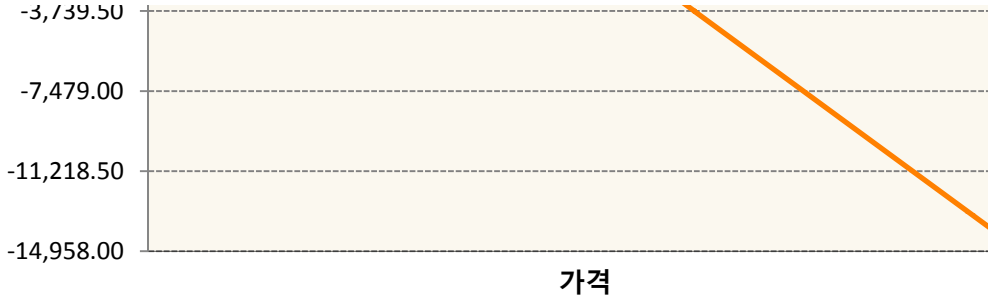
(단위:백만원)

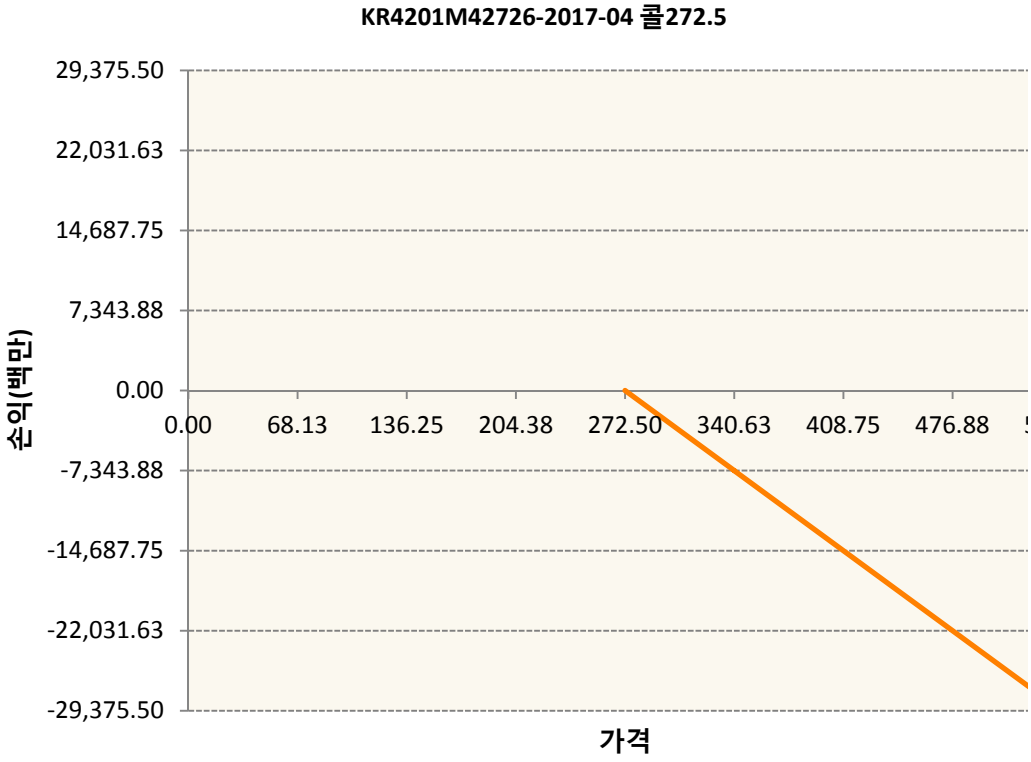
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	59,203	0	59,203	장내
누계	유가증권	옵션	0	44,334	-44,334	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							4,724
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,724	-4,724	-4,724	-4,724	-4,724	-4,724	-4,724
-5.33%	-3,149	-3,149	-3,149	-3,149	-3,149	-3,149	-3,149
-2.67%	-1,575	-1,575	-1,575	-1,575	-1,575	-1,575	-1,575
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,575	1,575	1,575	1,575	1,575	1,575	1,575
5.33%	3,149	3,149	3,149	3,149	3,149	3,149	3,149
8.00%	4,724	4,724	4,724	4,724	4,724	4,724	4,724
KR4201M42 2017-04 콜270							5,904
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,411	2,403	2,392	2,375	2,355	2,330	2,301
-5.33%	2,292	2,246	2,195	2,140	2,082	2,021	1,958
-2.67%	1,637	1,558	1,478	1,398	1,318	1,238	1,158
0%	144	101	53	0	-56	-116	-177
2.67%	-1,807	-1,815	-1,828	-1,844	-1,866	-1,892	-1,922
5.33%	-3,850	-3,851	-3,852	-3,855	-3,859	-3,866	-3,876
8.00%	-5,900	-5,900	-5,900	-5,900	-5,901	-5,902	-5,904
KR4201M42 2017-04 콜272.5							11,183

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,669	3,663	3,651	3,634	3,609	3,577	3,538
-5.33%	3,564	3,505	3,435	3,356	3,267	3,172	3,070
-2.67%	2,754	2,605	2,454	2,303	2,150	1,997	1,844
0%	373	255	130	0	-134	-271	-411
2.67%	-3,229	-3,261	-3,304	-3,357	-3,421	-3,493	-3,574
5.33%	-7,179	-7,182	-7,188	-7,200	-7,217	-7,240	-7,270
8.00%	-11,166	-11,166	-11,166	-11,168	-11,170	-11,175	-11,183

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

23,024

공시일	2017-03-16
기준일	2017-03-15

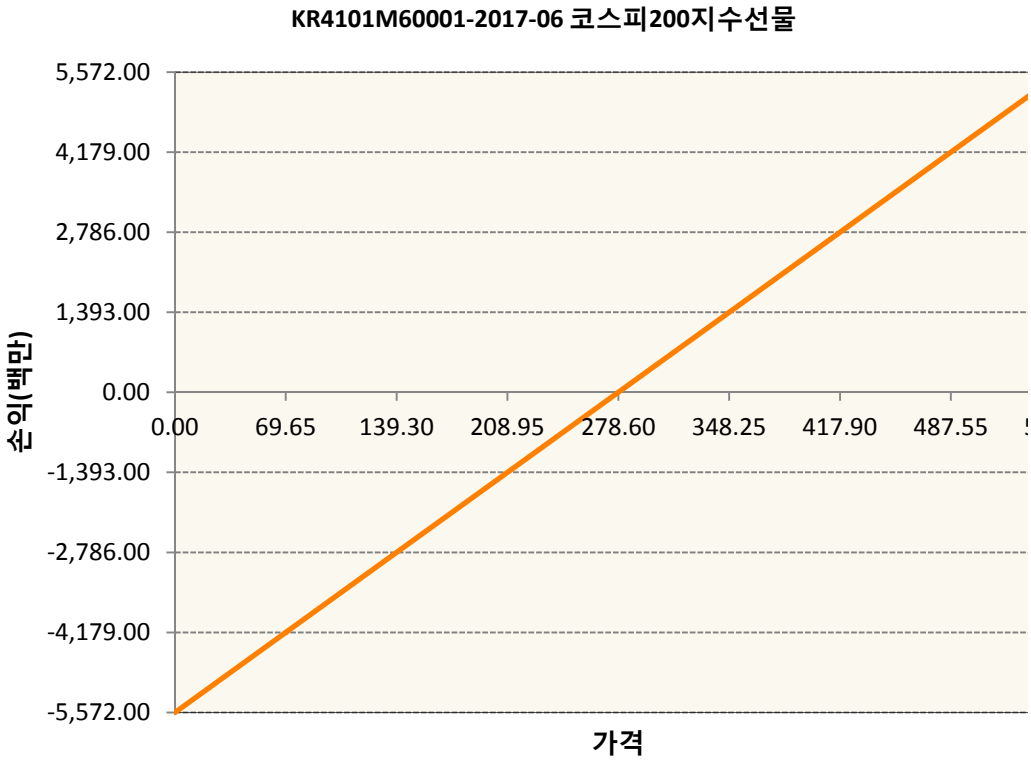
커버드콜목표전환형증권투자신탁

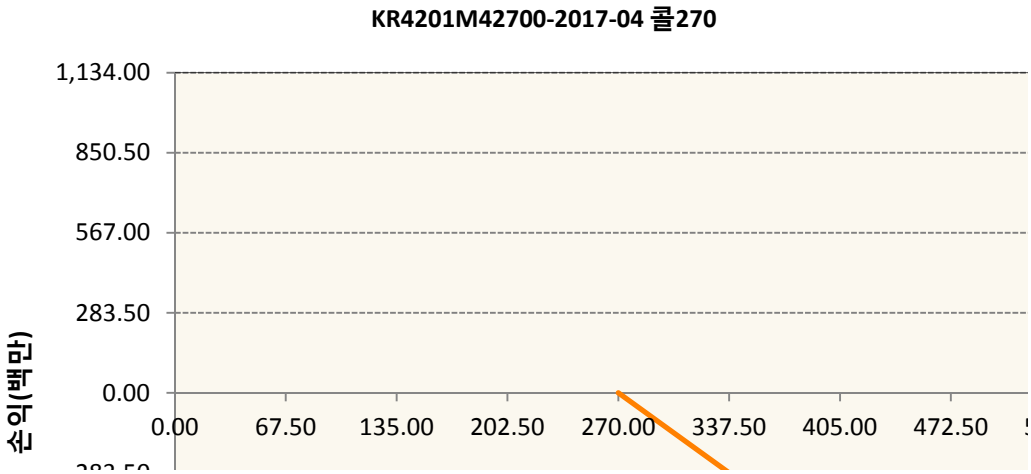
1. 계약금액

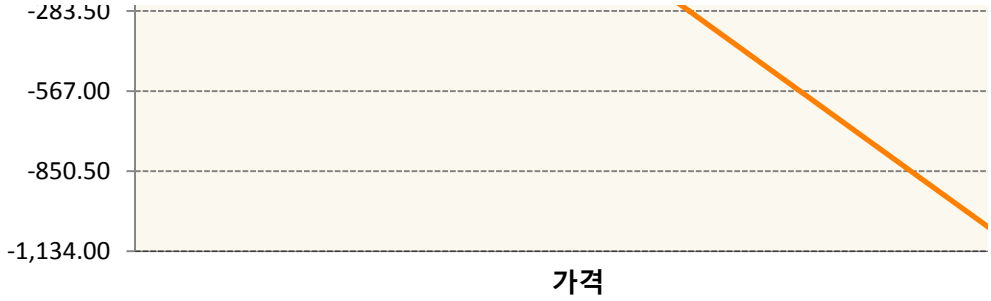
(단위:백만원)

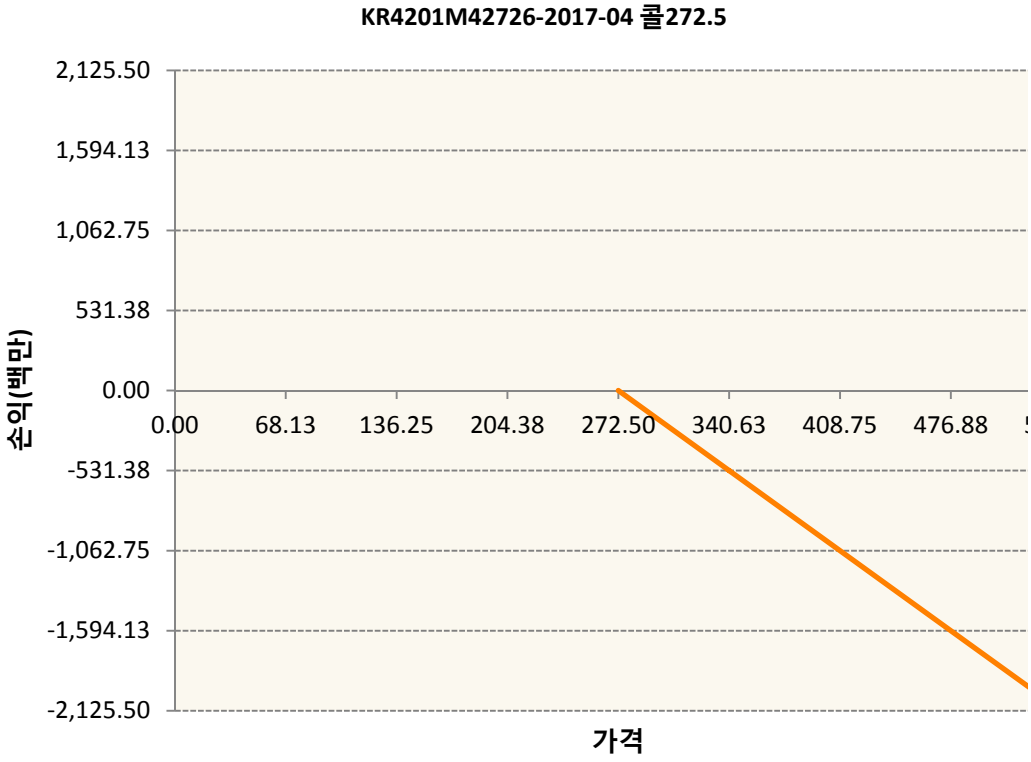
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,572	0	5,572	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,260	-3,260	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							445
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-445	-445	-445	-445	-445	-445	-445
-5.33%	-296	-296	-296	-296	-296	-296	-296
-2.67%	-148	-148	-148	-148	-148	-148	-148
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	148	148	148	148	148	148	148
5.33%	296	296	296	296	296	296	296
8.00%	445	445	445	445	445	445	445
KR4201M42 2017-04 콜270							448
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	183	182	181	180	179	177	174
-5.33%	174	170	166	162	158	153	148
-2.67%	124	118	112	106	100	94	88
0%	11	8	4	0	-4	-9	-13
2.67%	-137	-138	-139	-140	-141	-143	-146
5.33%	-292	-292	-292	-292	-293	-293	-294
8.00%	-447	-447	-447	-447	-447	-447	-448
KR4201M42 2017-04 콜272.5							809

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	266	265	264	263	261	259	256
-5.33%	258	254	249	243	236	230	222
-2.67%	199	188	178	167	156	145	133
0%	27	18	9	0	-10	-20	-30
2.67%	-234	-236	-239	-243	-248	-253	-259
5.33%	-519	-520	-520	-521	-522	-524	-526
8.00%	-808	-808	-808	-808	-808	-809	-809

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

1,756

공시일	2017-03-16
기준일	2017-03-15

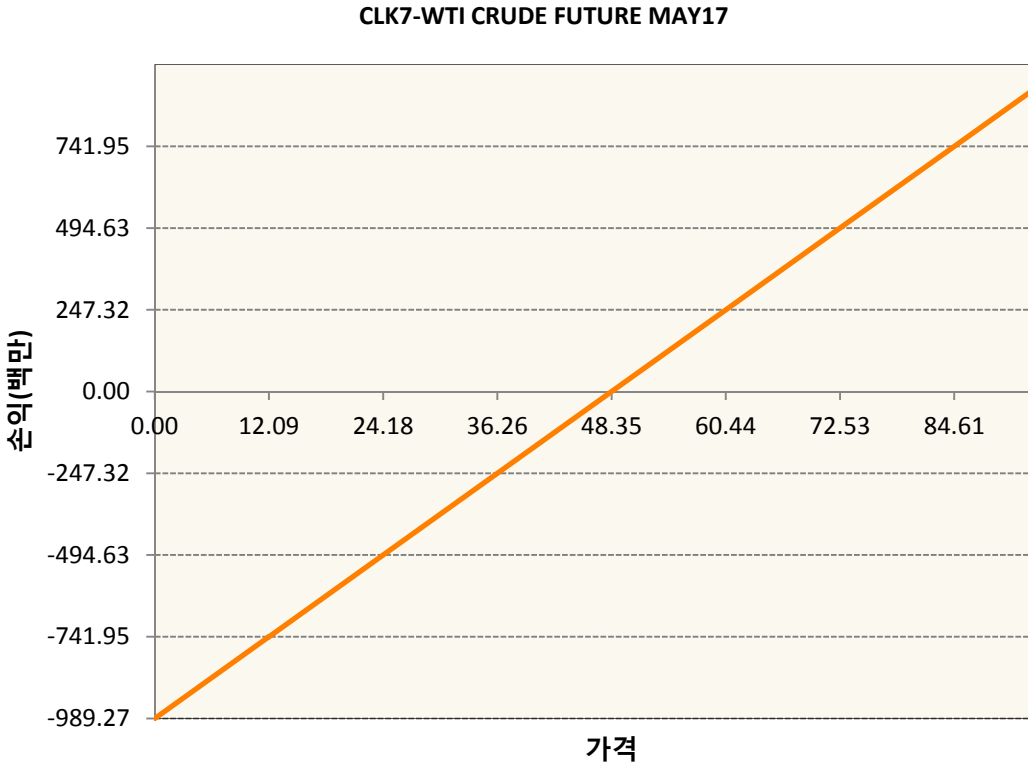
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

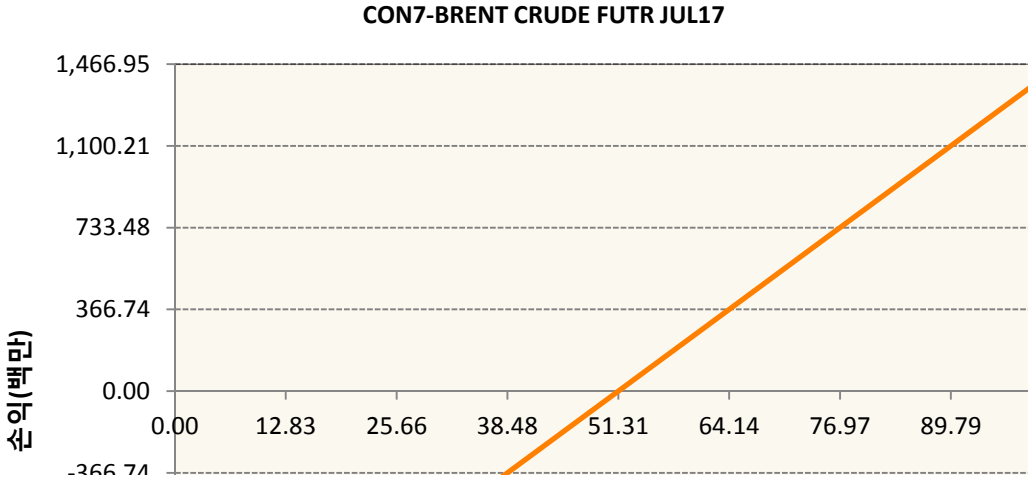
1. 계약금액

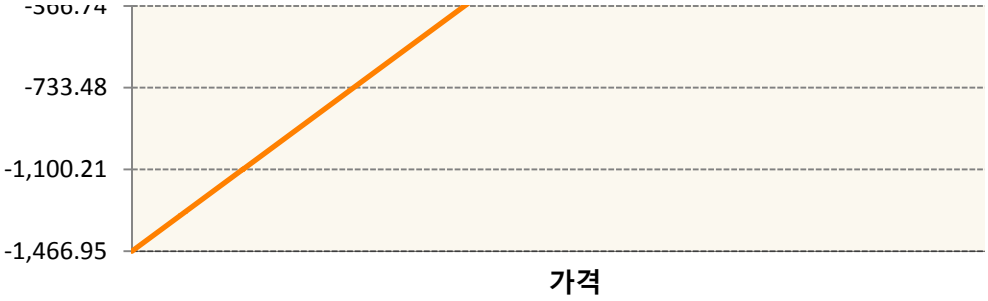
(단위:백만원)

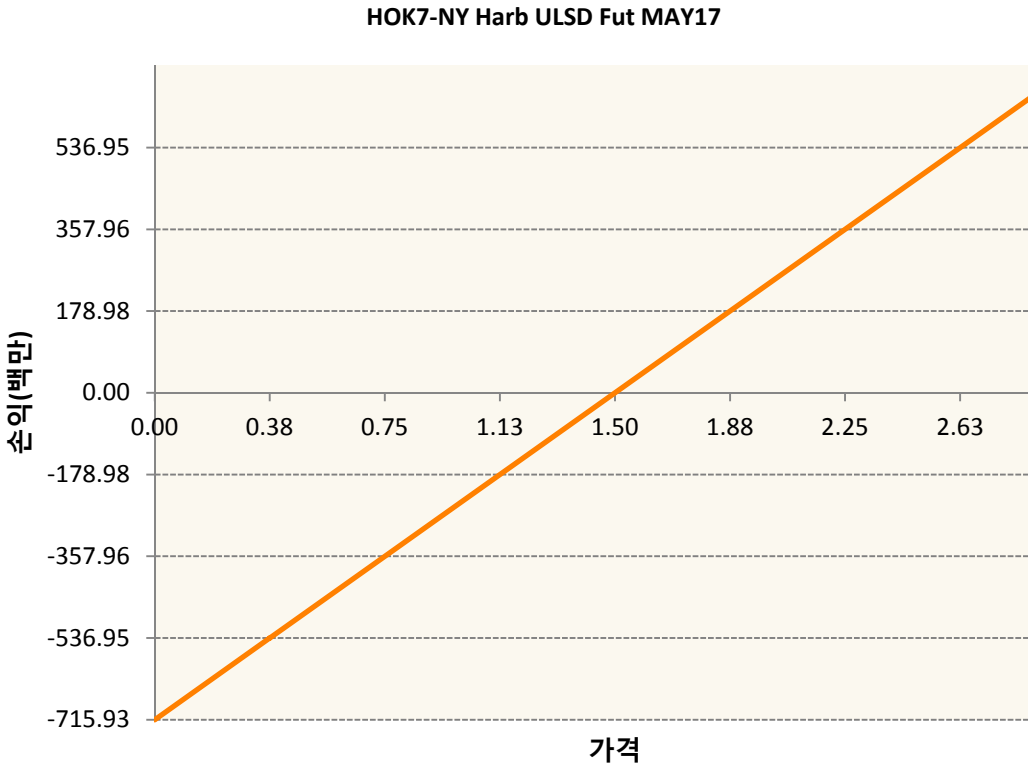
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	989	0	989	
누계	유가증권	선물	4,335	412	3,923	

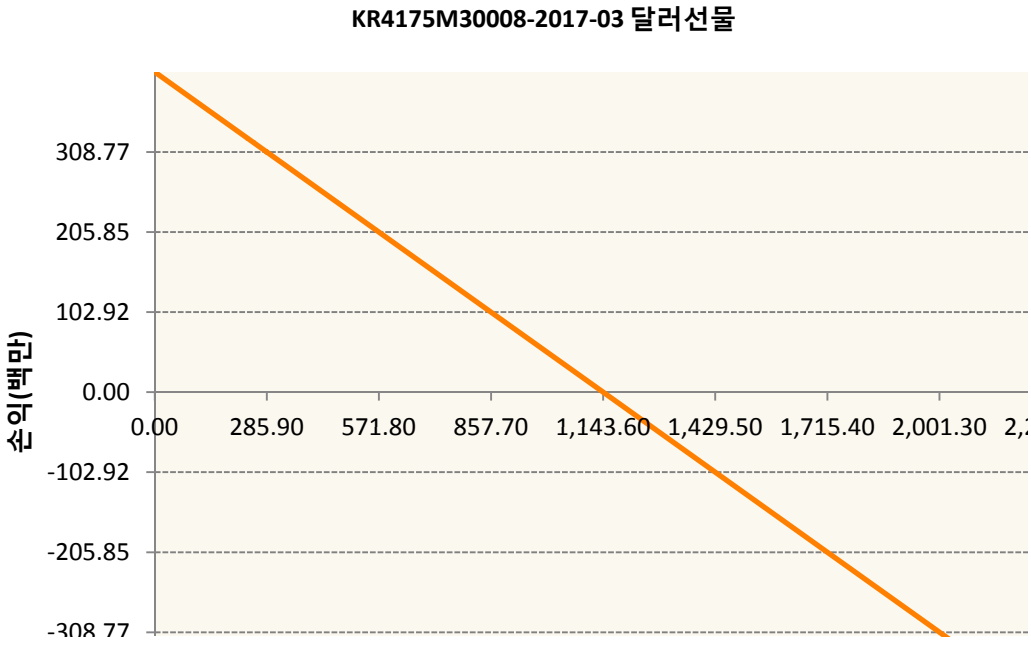
2. 만기시점의 손익구조

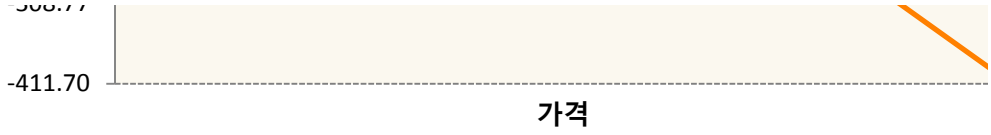


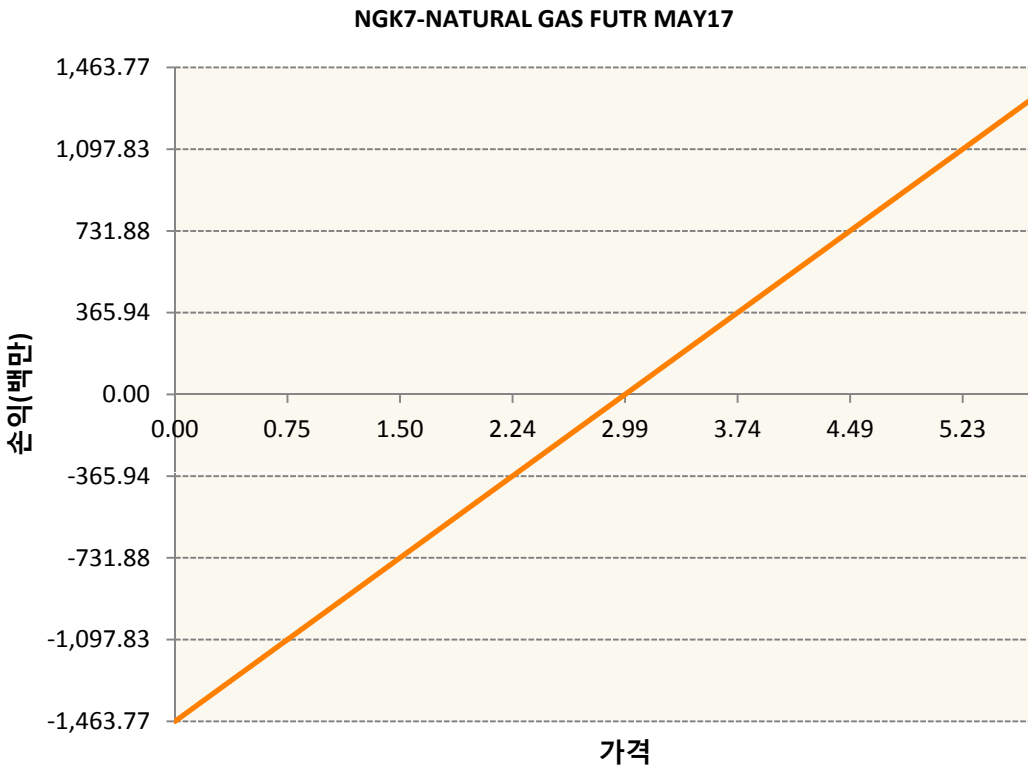


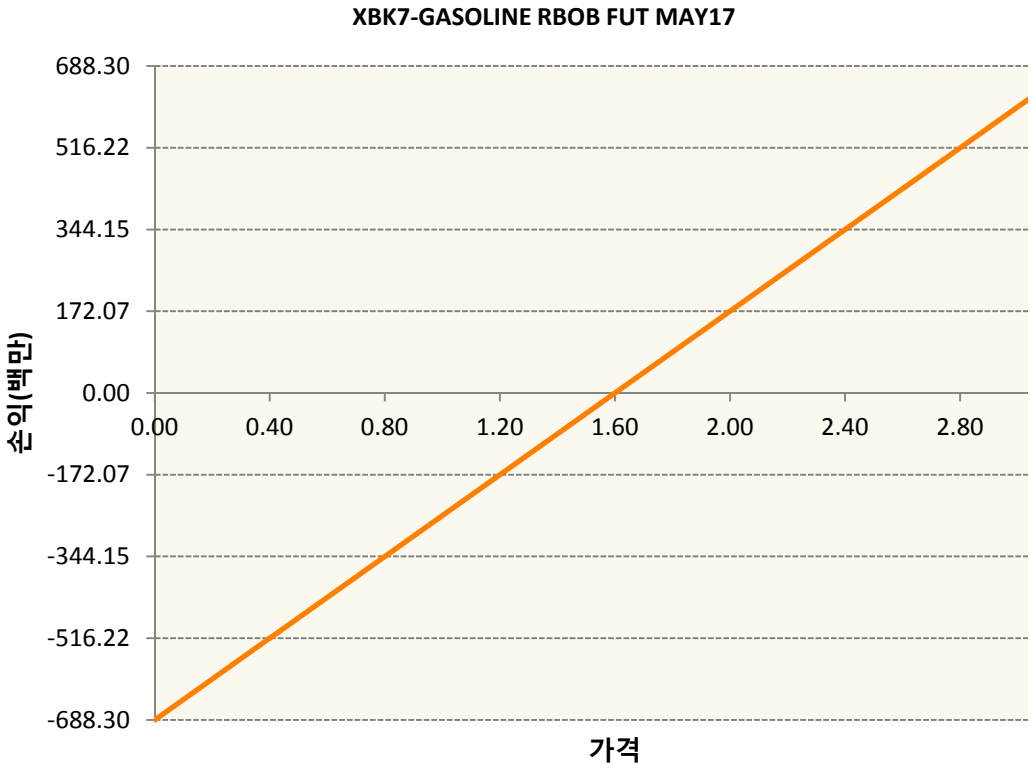

-733.48
-1,100.21
-1,466.95
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
536.95
357.96
178.98
0.00
-178.98
-357.96
-536.95
-715.93
0.00
0.38
0.75
1.13
1.50
1.88
2.25
2.63
순익(백만)
가격


KR4175M30008-2017-03 달러선물
308.77
205.85
102.92
0.00
-102.92
-205.85
-308.77
0.00
285.90
571.80
857.70
1,143.60
1,429.50
1,715.40
2,001.30
순익(백만)


-411.70
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,463.77
1,097.83
731.88
365.94
0.00
-365.94
-731.88
-1,097.83
-1,463.77
0.00
0.75
1.50
2.24
2.99
3.74
4.49
5.23
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
688.30
516.22
344.15
172.07
0.00
-172.07
-344.15
-516.22
-688.30
0.00
0.40
0.80
1.20
1.60
2.00
2.40
2.80
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK7	WTI CRUDE FUTURE MAY17	79
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	117
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	57
KR4175M30(	2017-03 달러선물	33
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	117
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	55

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

949

공시일	2017-03-16
기준일	2017-03-15

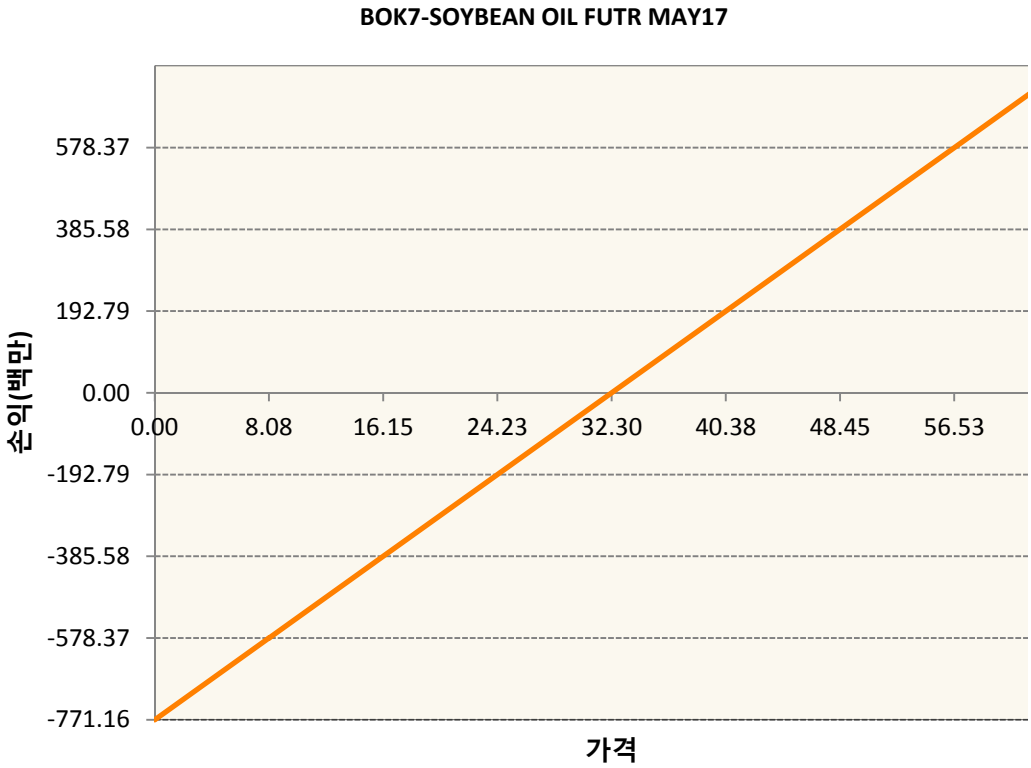
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

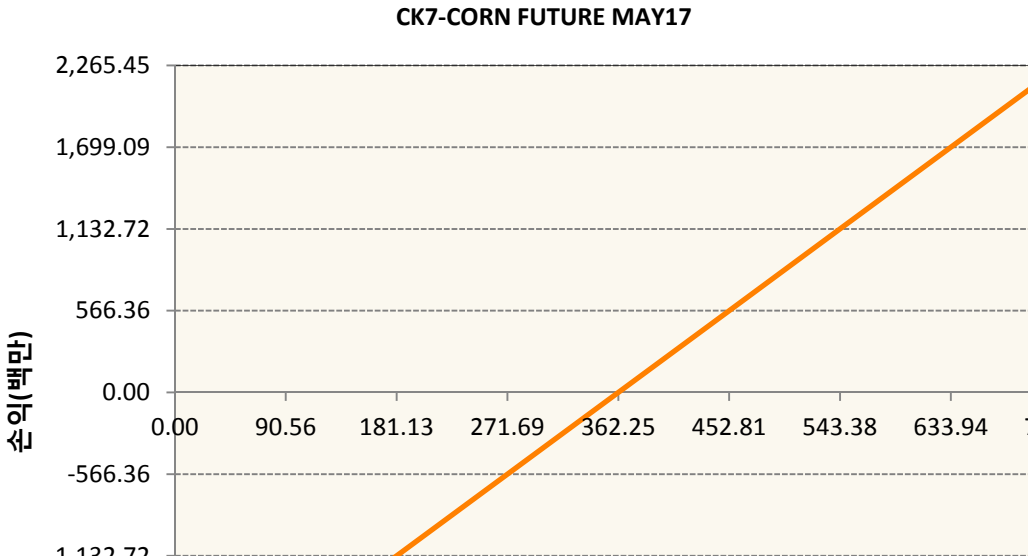
1. 계약금액

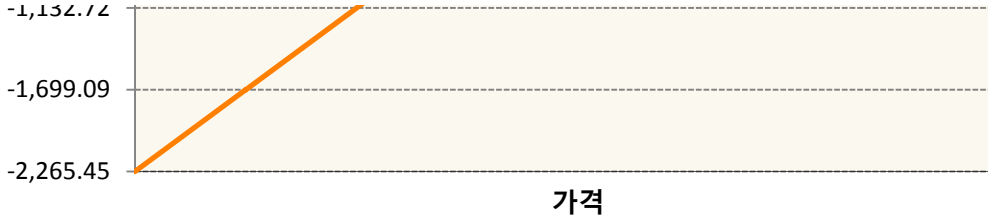
(단위:백만원)

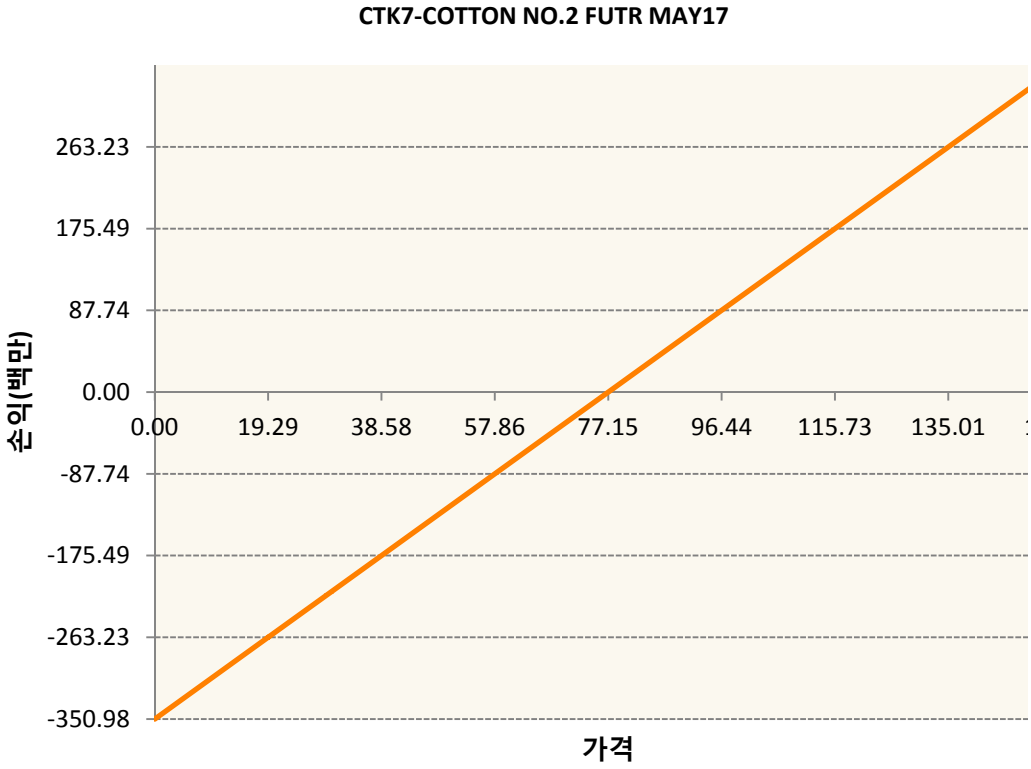
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,053	572	8,481	

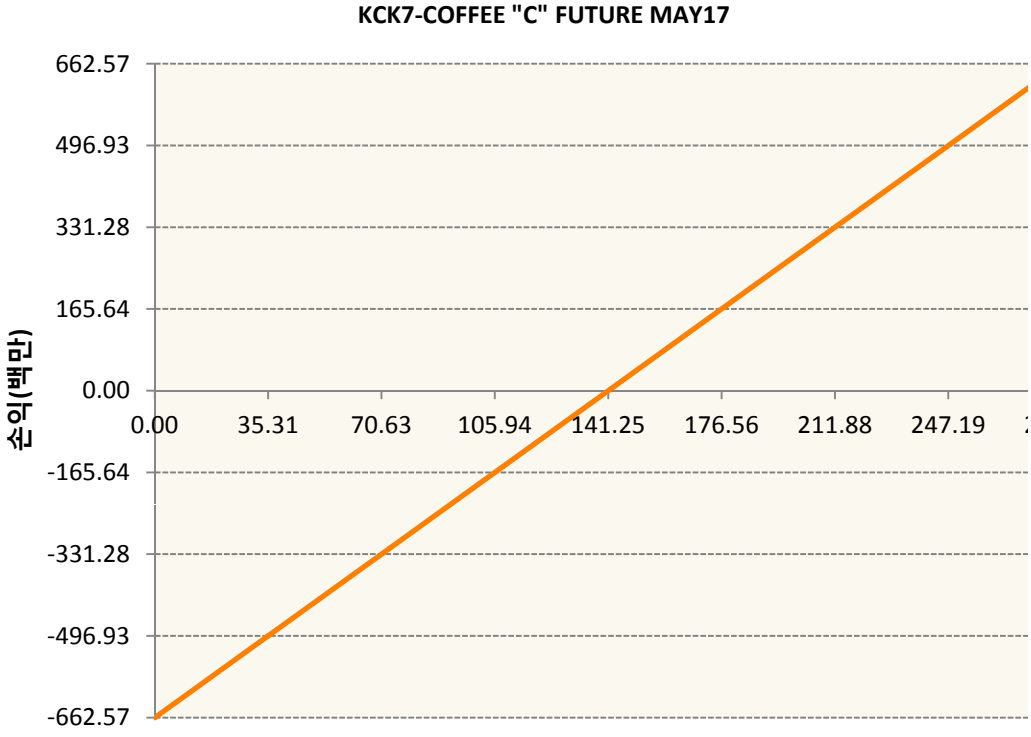
2. 만기시점의 손익구조



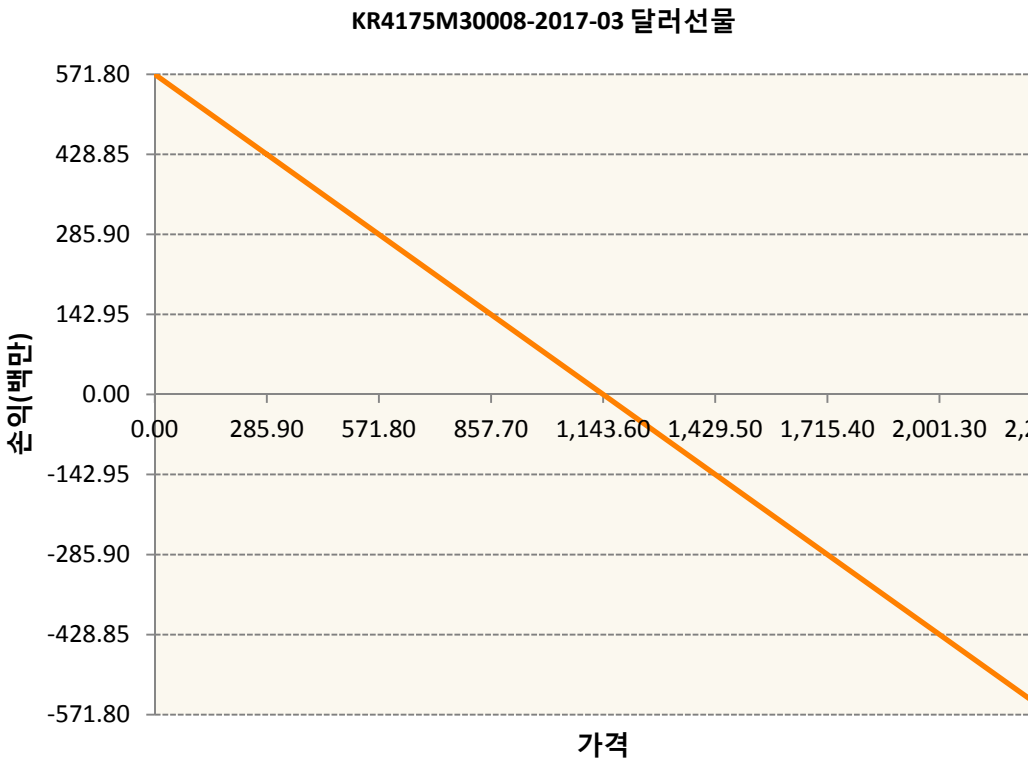


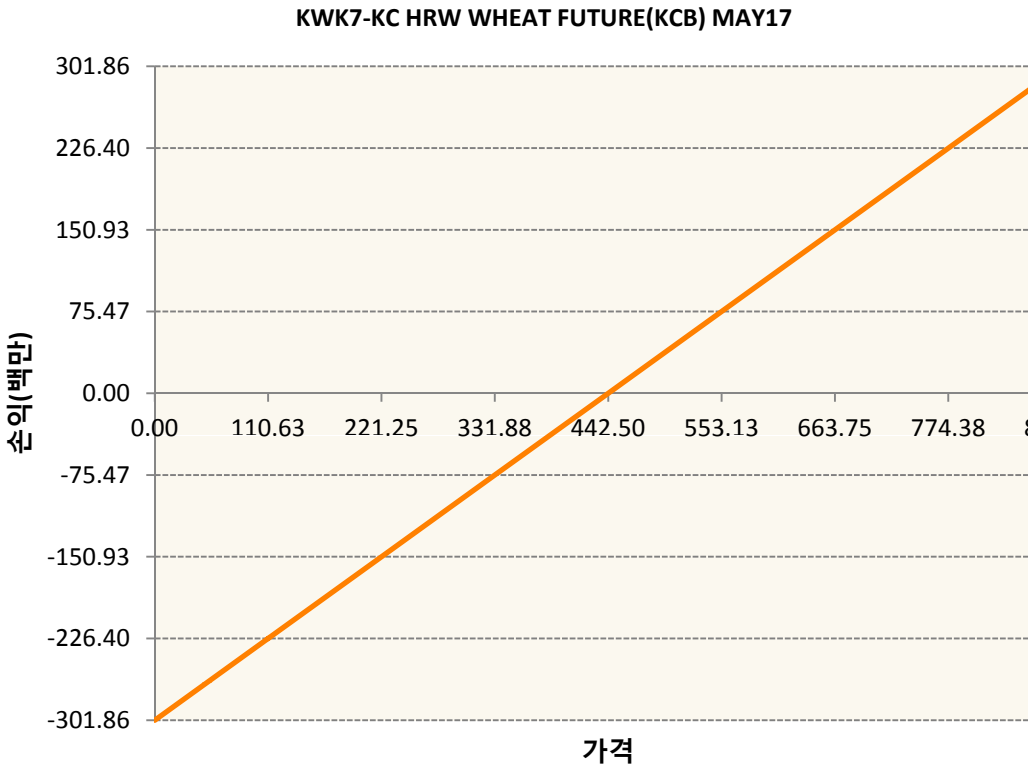

-1,699.09
-2,265.45
가격

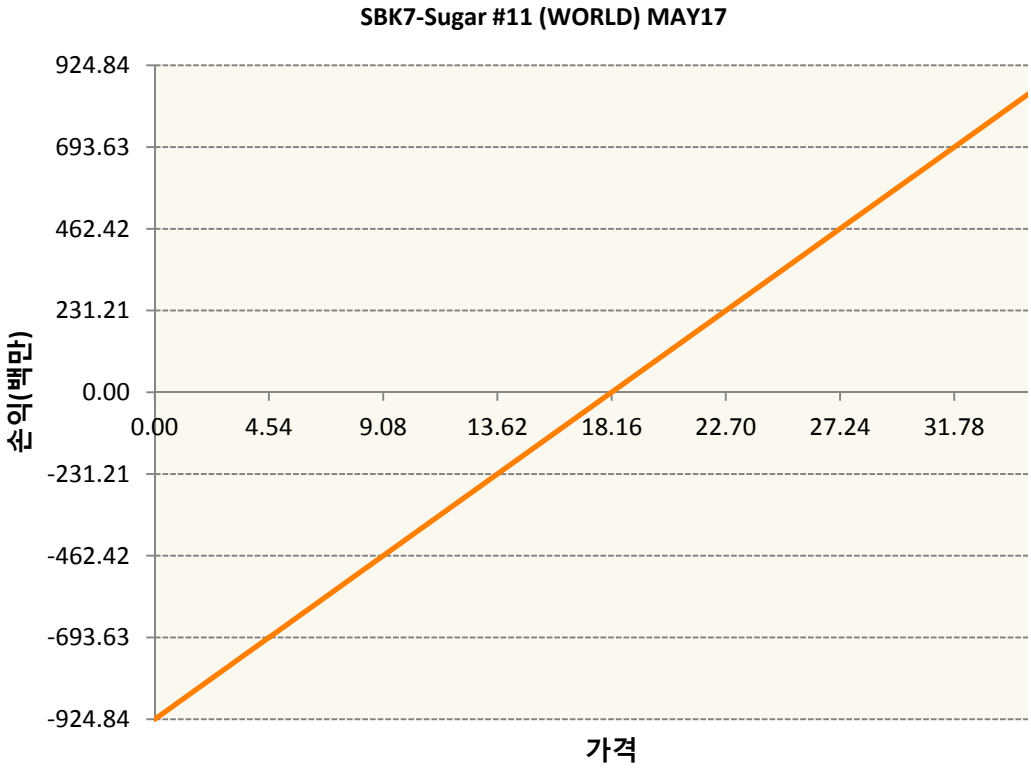

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
263.23
175.49
87.74
0.00
-87.74
-175.49
-263.23
-350.98
0.00
19.29
38.58
57.86
77.15
96.44
115.73
135.01
순익(백만)
가격

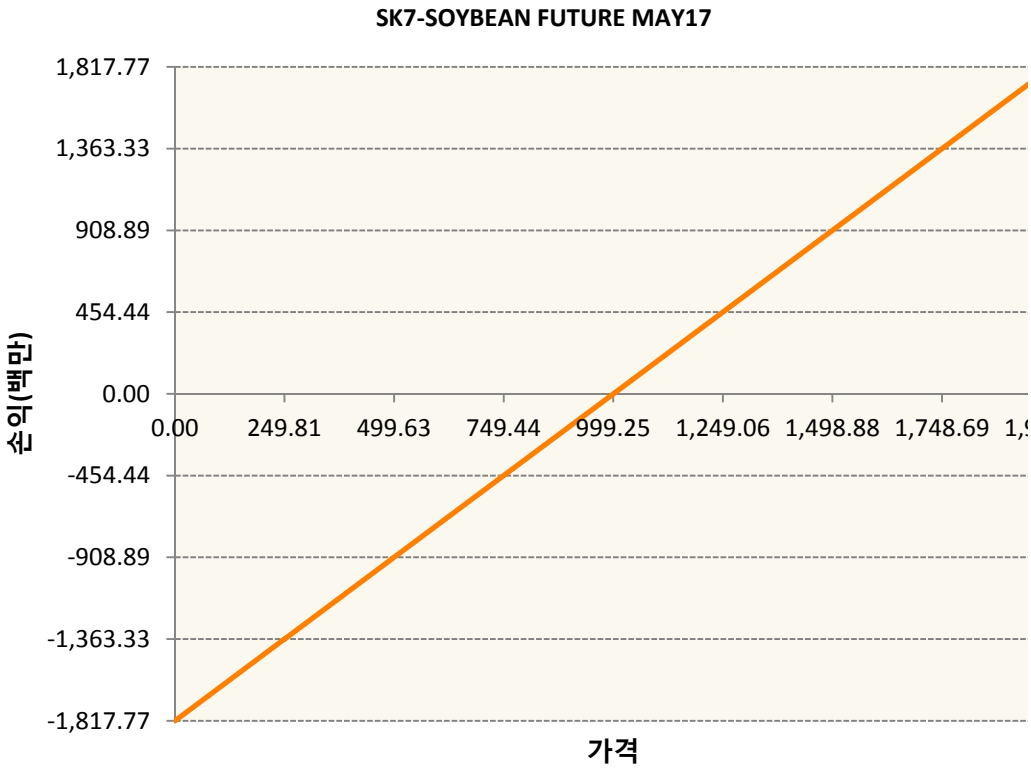

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
662.57
496.93
331.28
165.64
0.00
-165.64
-331.28
-496.93
-662.57
0.00
35.31
70.63
105.94
141.25
176.56
211.88
247.19
순익(백만)

가격

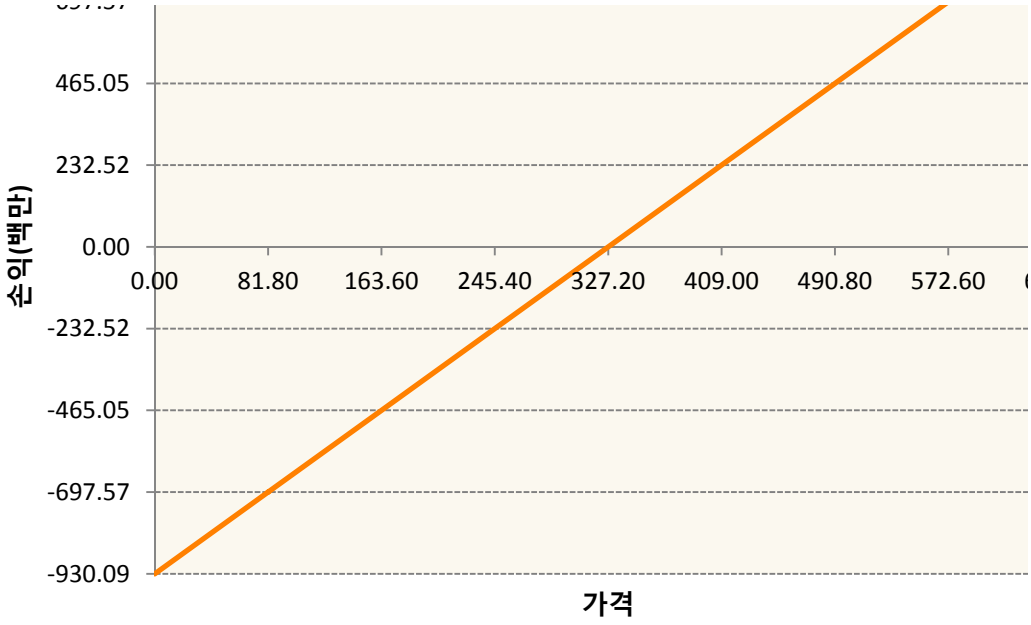

KR4175M30008-2017-03 달러선물
571.80
428.85
285.90
142.95
0.00
-142.95
-285.90
-428.85
-571.80
0.00
285.90
571.80
857.70
1,143.60
1,429.50
1,715.40
2,001.30
손익(백만)
가격

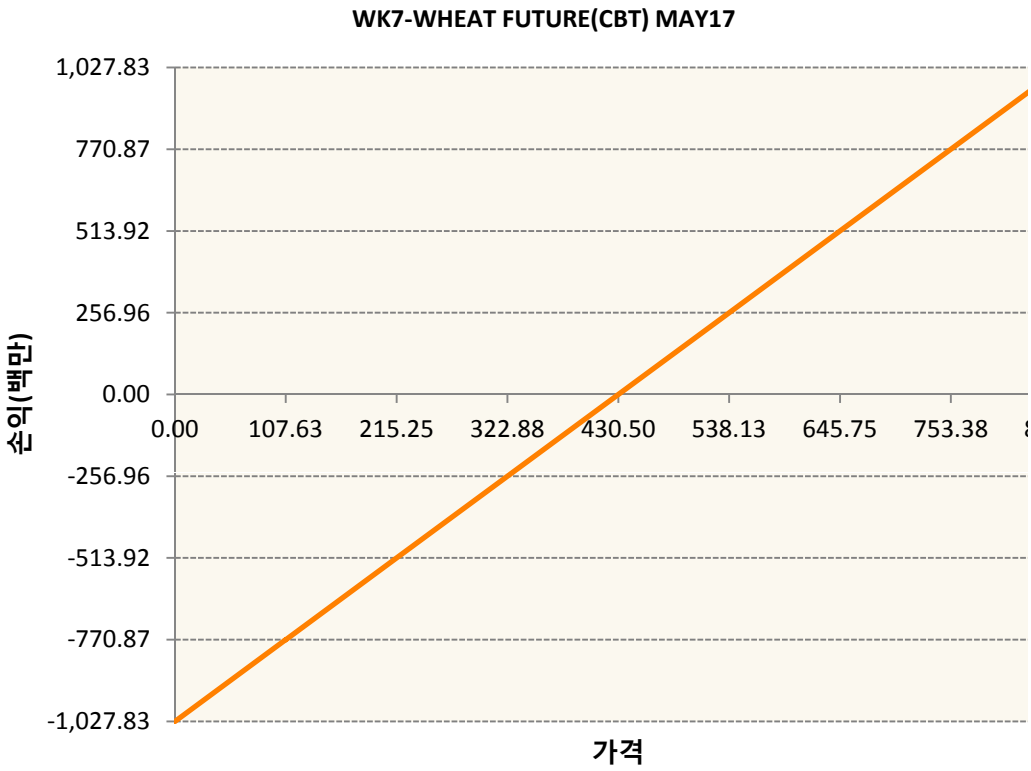

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
301.86
226.40
150.93
75.47
0.00
-75.47
-150.93
-226.40
-301.86
0.00
110.63
221.25
331.88
442.50
553.13
663.75
774.38
손익(백만)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
924.84
693.63
462.42
231.21
0.00
-231.21
-462.42
-693.63
-924.84
0.00
4.54
9.08
13.62
18.16
22.70
27.24
31.78
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,817.77
1,363.33
908.89
454.44
0.00
-454.44
-908.89
-1,363.33
-1,817.77
0.00
249.81
499.63
749.44
999.25
1,249.06
1,498.88
1,748.69
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
930.09
697.57





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	62
CK7	CORN FUTURE MAY17	181
CTK7	COTTON NO.2 FUTR MAY17	28
KCK7	COFFEE "C" FUTURE MAY17	53
KR4175M30(	2017-03 달러선물	46

KWK7	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17	24
SBK7	Sugar #11 (WORLD) MAY17	74
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	145
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	74
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	82

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

841