공시일	2017-03-17
기준일	2017-03-16

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	2017-03-17
기준일	2017-03-16

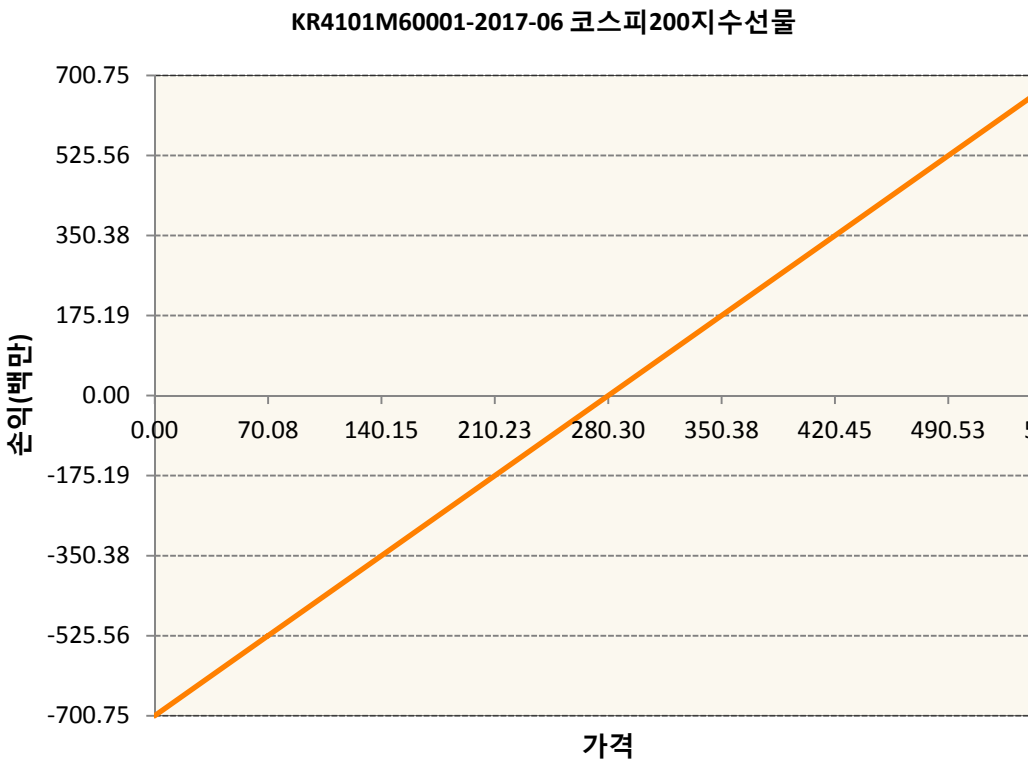
스마트인덱스모

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	701	0	701	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	2017-03-17
기준일	2017-03-16

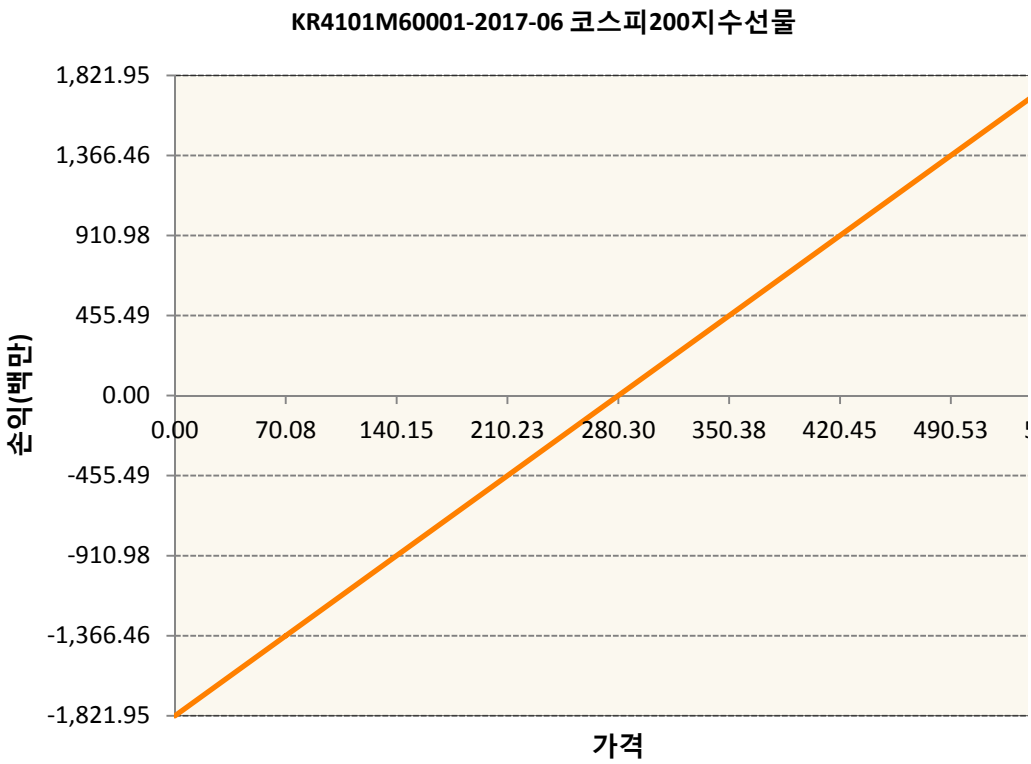
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,822	0	1,822	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							146
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-146	-146	-146	-146	-146	-146	-146
-5.33%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97
-2.67%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	49	49	49	49	49	49	49
5.33%	97	97	97	97	97	97	97
8.00%	146	146	146	146	146	146	146

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

94

공시일	2017-03-17
기준일	2017-03-16

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	958

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

585

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-17
기준일	2017-03-16

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	397

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

456

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-17
기준일	2017-03-16

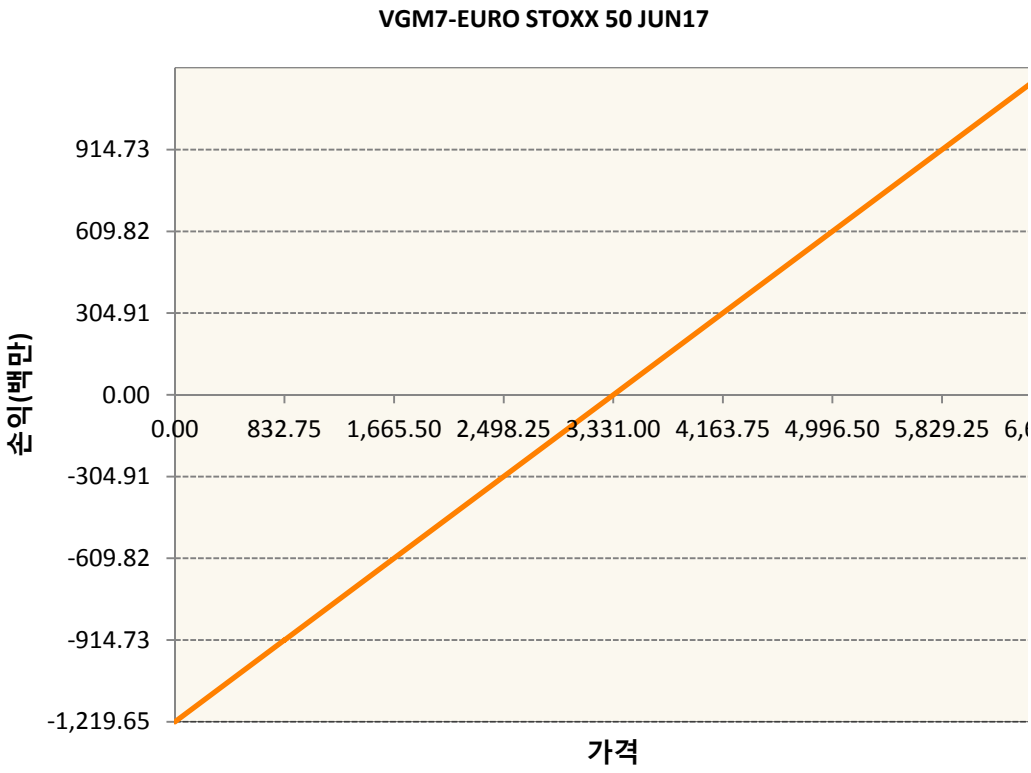
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,220	0	1,220	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM7	EURO STOXX 50 JUN17	98

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

(단위:백만원)

99

공시일	2017-03-17
기준일	2017-03-16

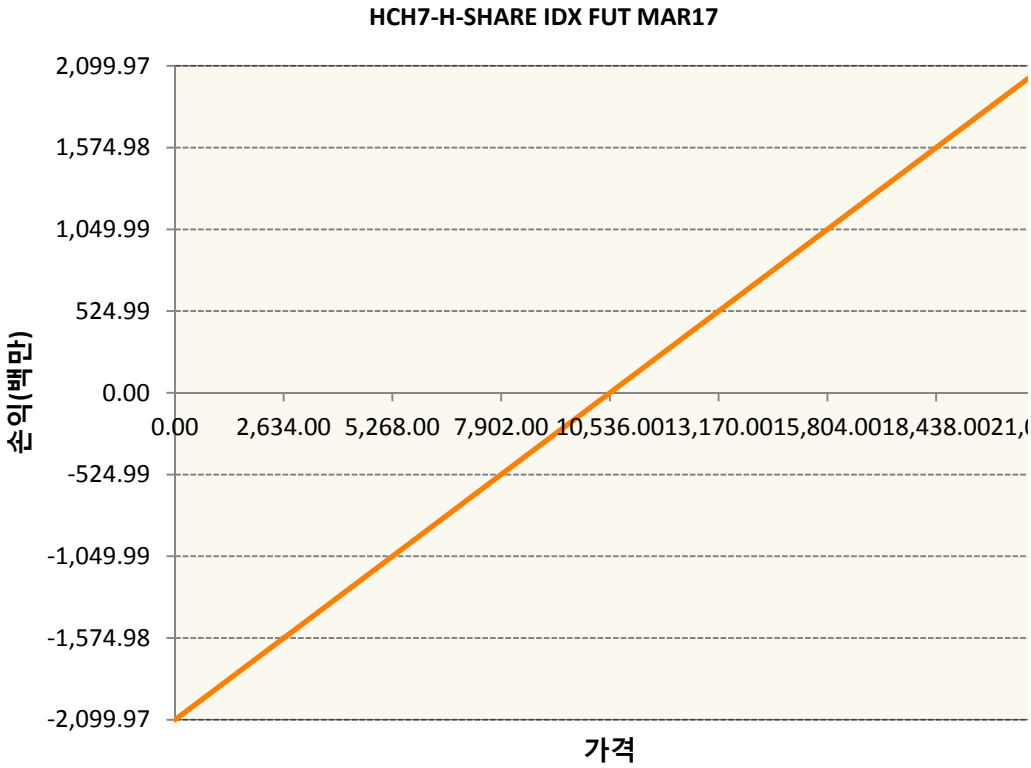
차이나인덱스모(주식-파생형)

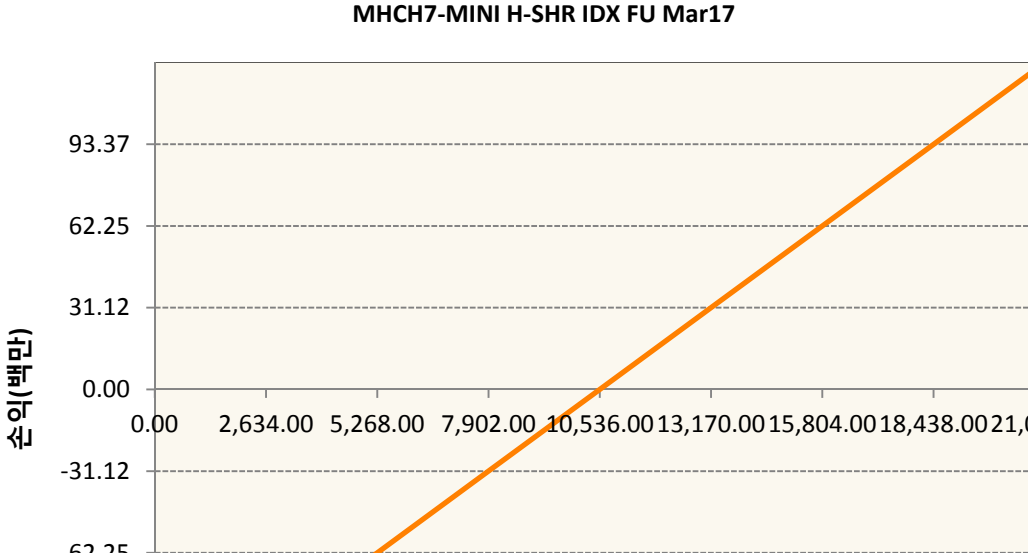
1. 계약금액

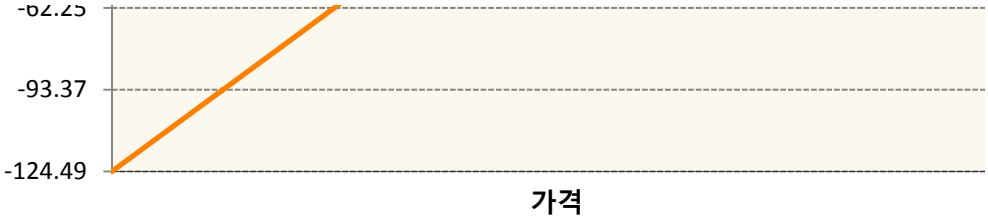
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,224	0	2,224	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH7	H-SHARE IDX FUT MAR17	168
MHCH7	MINI H-SHR IDX FU Mar17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	194

공시일	2017-03-17
기준일	2017-03-16

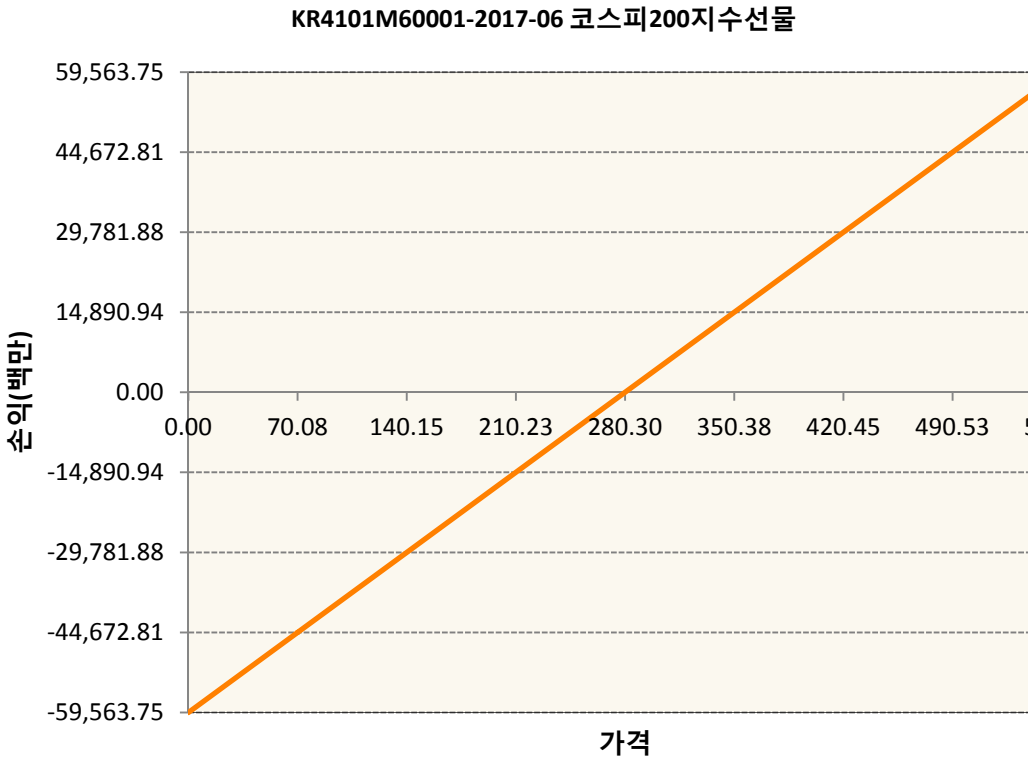
커버드콜모(주식혼합-파생형)

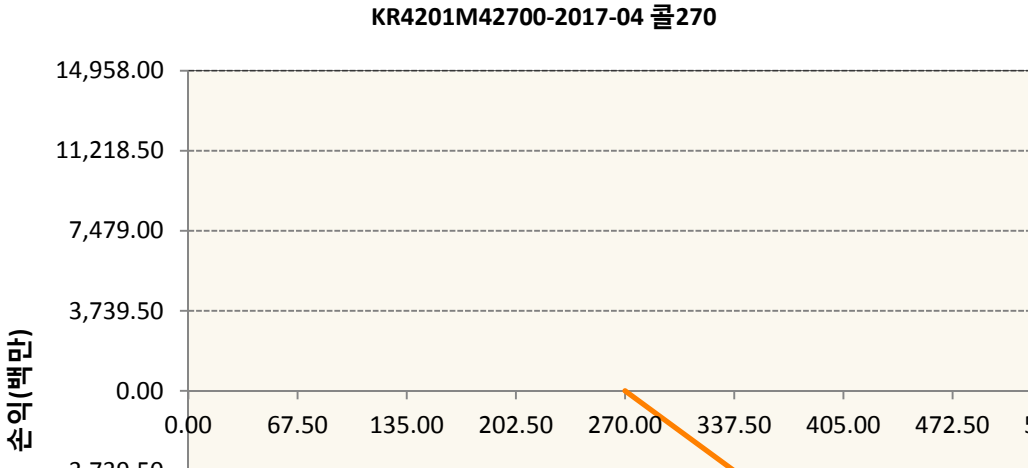
1. 계약금액

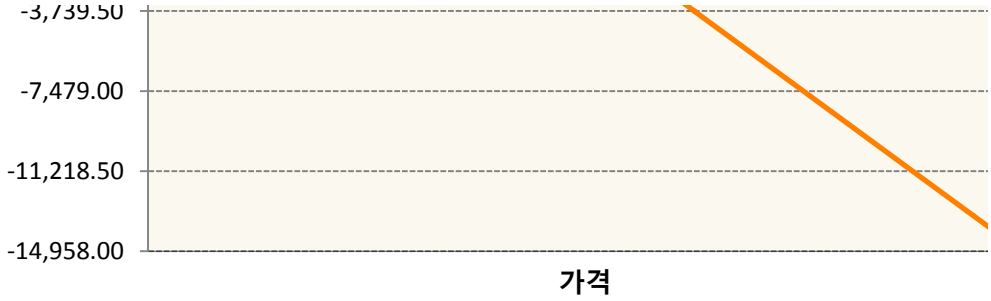
(단위:백만원)

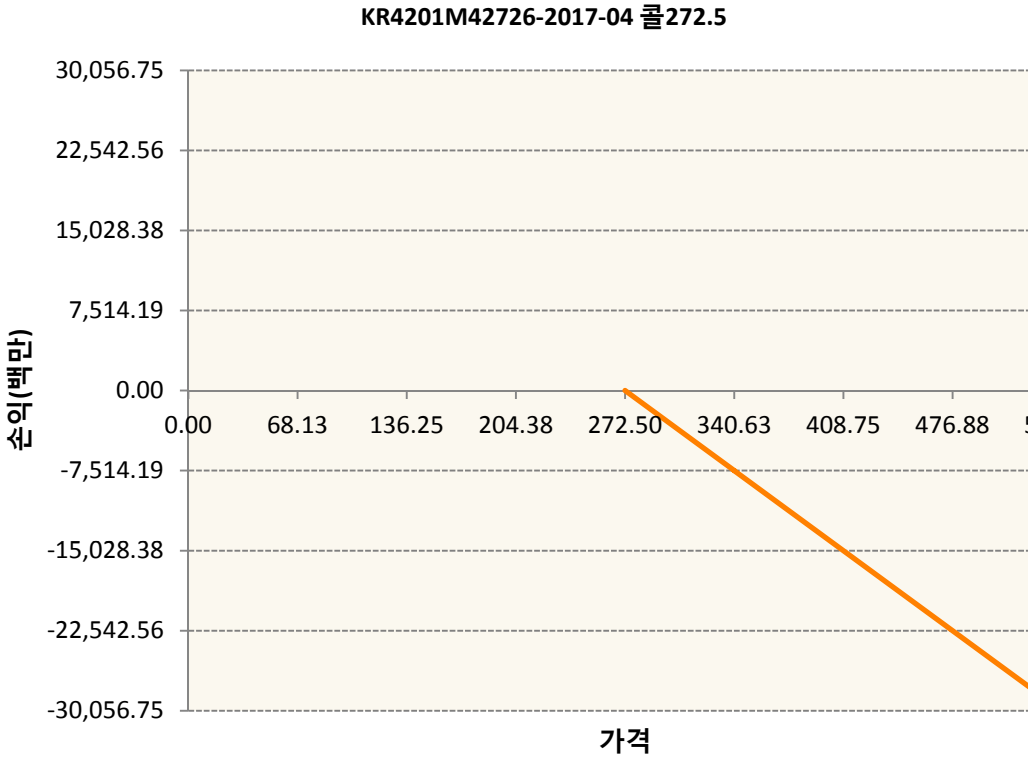
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	701	-701	장내
누계	유가증권	선물	59,564	0	59,564	장내
누계	유가증권	옵션	0	45,015	-45,015	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							4,762
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,762	-4,762	-4,762	-4,762	-4,762	-4,762	-4,762
-5.33%	-3,175	-3,175	-3,175	-3,175	-3,175	-3,175	-3,175
-2.67%	-1,587	-1,587	-1,587	-1,587	-1,587	-1,587	-1,587
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,587	1,587	1,587	1,587	1,587	1,587	1,587
5.33%	3,175	3,175	3,175	3,175	3,175	3,175	3,175
8.00%	4,762	4,762	4,762	4,762	4,762	4,762	4,762
KR4201M42 2017-04 콜270							6,064
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,906	2,894	2,877	2,856	2,830	2,799	2,765
-5.33%	2,708	2,650	2,590	2,527	2,462	2,396	2,328
-2.67%	1,809	1,737	1,665	1,591	1,517	1,443	1,368
0%	94	68	37	0	-41	-86	-135
2.67%	-1,931	-1,934	-1,940	-1,948	-1,960	-1,975	-1,994
5.33%	-3,996	-3,996	-3,996	-3,997	-3,999	-4,002	-4,007
8.00%	-6,062	-6,062	-6,062	-6,062	-6,062	-6,063	-6,064
KR4201M42: 2017-04 콜272.5							11,862

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,641	4,630	4,613	4,587	4,554	4,513	4,464
-5.33%	4,451	4,369	4,278	4,179	4,073	3,962	3,845
-2.67%	3,235	3,081	2,927	2,772	2,618	2,463	2,309
0%	280	196	102	0	-109	-224	-344
2.67%	-3,640	-3,654	-3,677	-3,707	-3,747	-3,795	-3,852
5.33%	-7,742	-7,743	-7,745	-7,749	-7,757	-7,769	-7,786
8.00%	-11,855	-11,855	-11,856	-11,856	-11,857	-11,859	-11,862

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

23,802

공시일	2017-03-17
기준일	2017-03-16

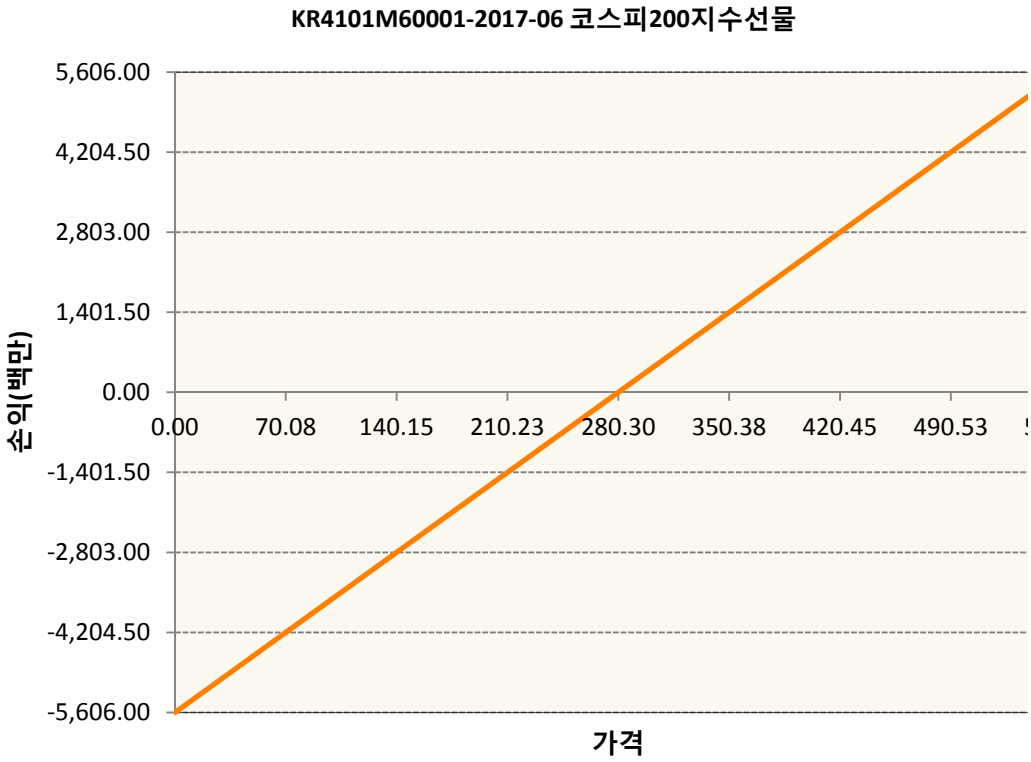
커버드콜목표전환형증권투자신탁

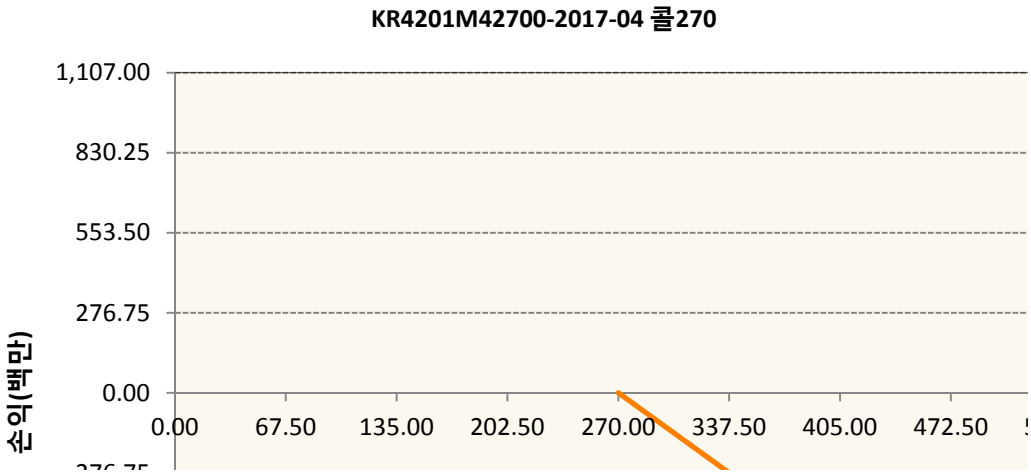
1. 계약금액

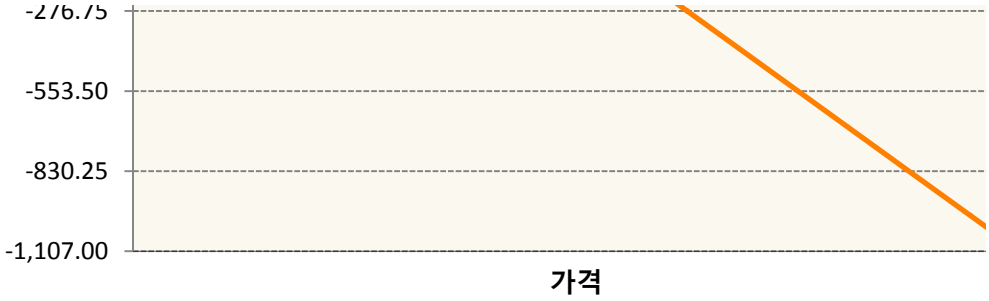
(단위:백만원)

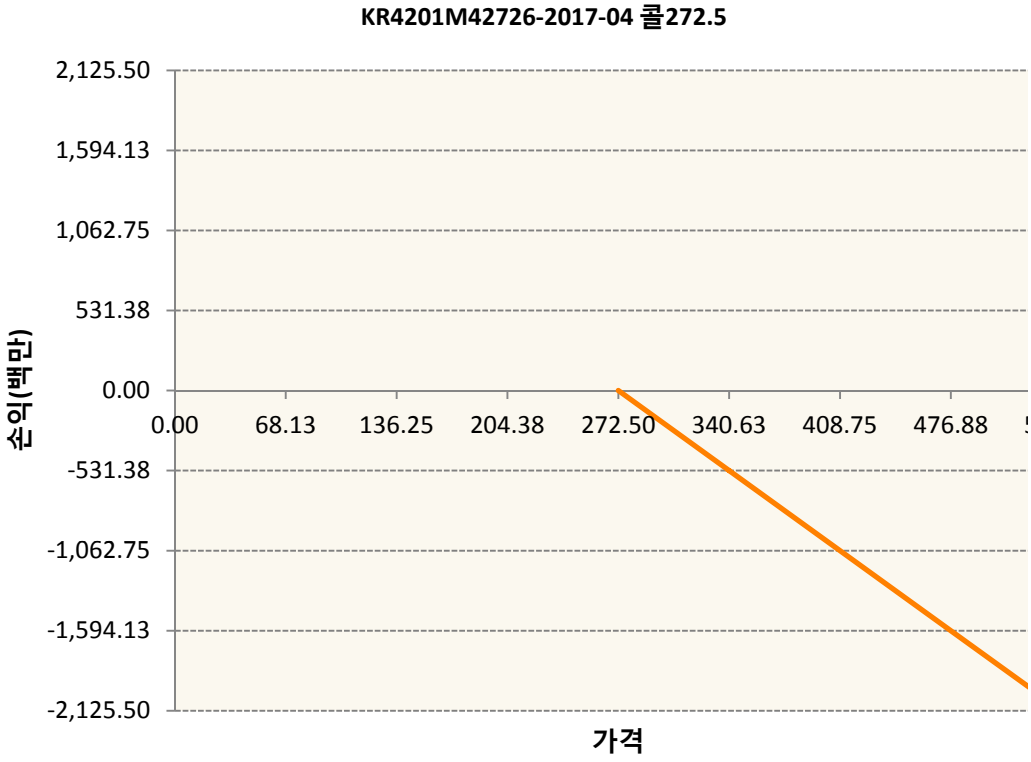
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	26	0	26	장내
누계	유가증권	선물	5,606	0	5,606	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,233	-3,233	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							448
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-448	-448	-448	-448	-448	-448	-448
-5.33%	-299	-299	-299	-299	-299	-299	-299
-2.67%	-149	-149	-149	-149	-149	-149	-149
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	149	149	149	149	149	149	149
5.33%	299	299	299	299	299	299	299
8.00%	448	448	448	448	448	448	448
KR4201M42 2017-04 콜270							449
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	215	214	213	211	209	207	205
-5.33%	200	196	192	187	182	177	172
-2.67%	134	129	123	118	112	107	101
0%	7	5	3	0	-3	-6	-10
2.67%	-143	-143	-144	-144	-145	-146	-148
5.33%	-296	-296	-296	-296	-296	-296	-297
8.00%	-449	-449	-449	-449	-449	-449	-449
KR4201M42 2017-04 콜272.5							839

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	328	327	326	324	322	319	316
-5.33%	315	309	303	296	288	280	272
-2.67%	229	218	207	196	185	174	163
0%	20	14	7	0	-8	-16	-24
2.67%	-257	-258	-260	-262	-265	-268	-272
5.33%	-547	-548	-548	-548	-549	-549	-551
8.00%	-838	-838	-838	-838	-838	-839	-839

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

1,778

공시일	2017-03-17
기준일	2017-03-16

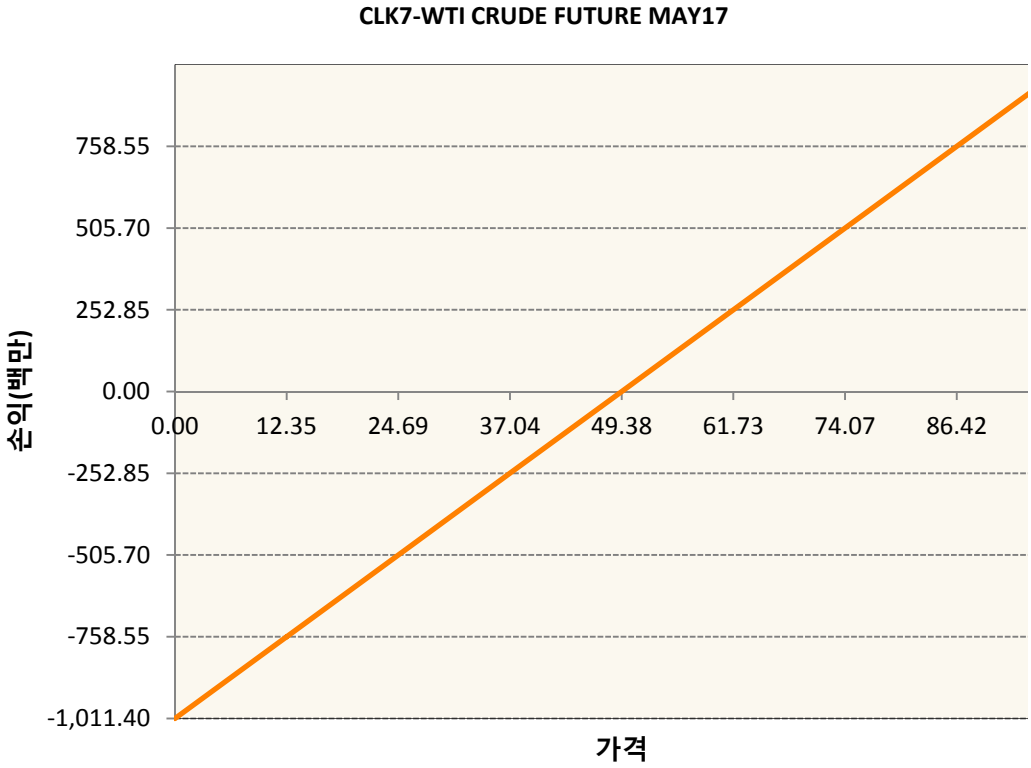
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

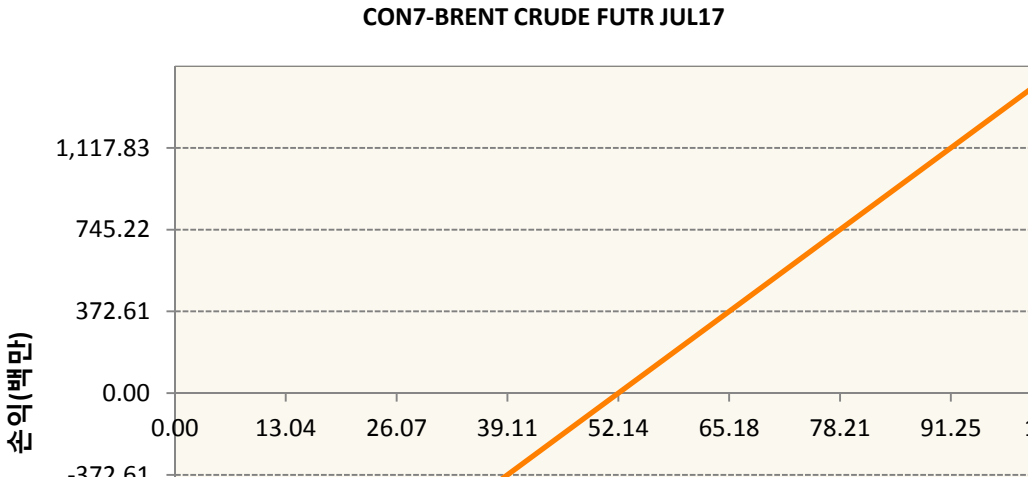
1. 계약금액

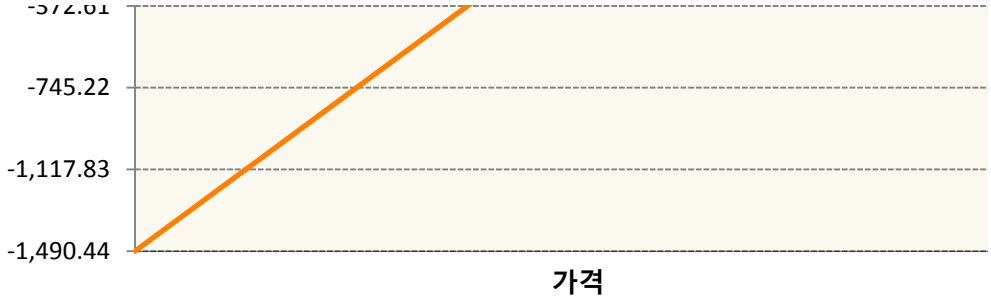
(단위:백만원)

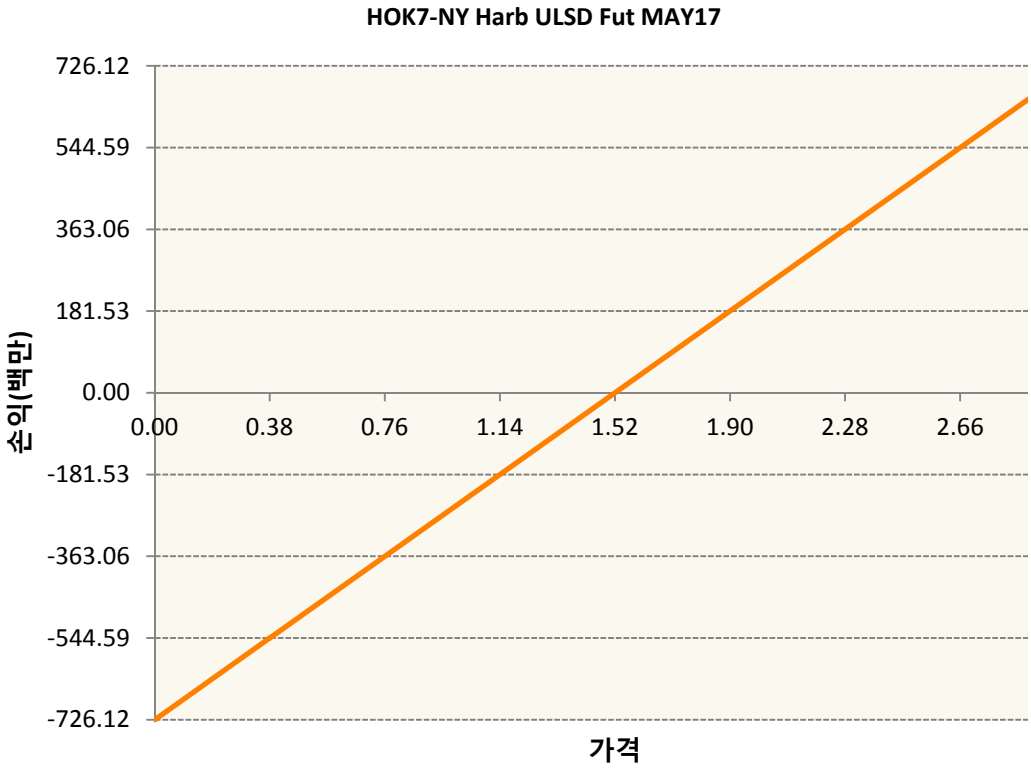
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,011	0	1,011	
누계	유가증권	선물	4,394	407	3,986	

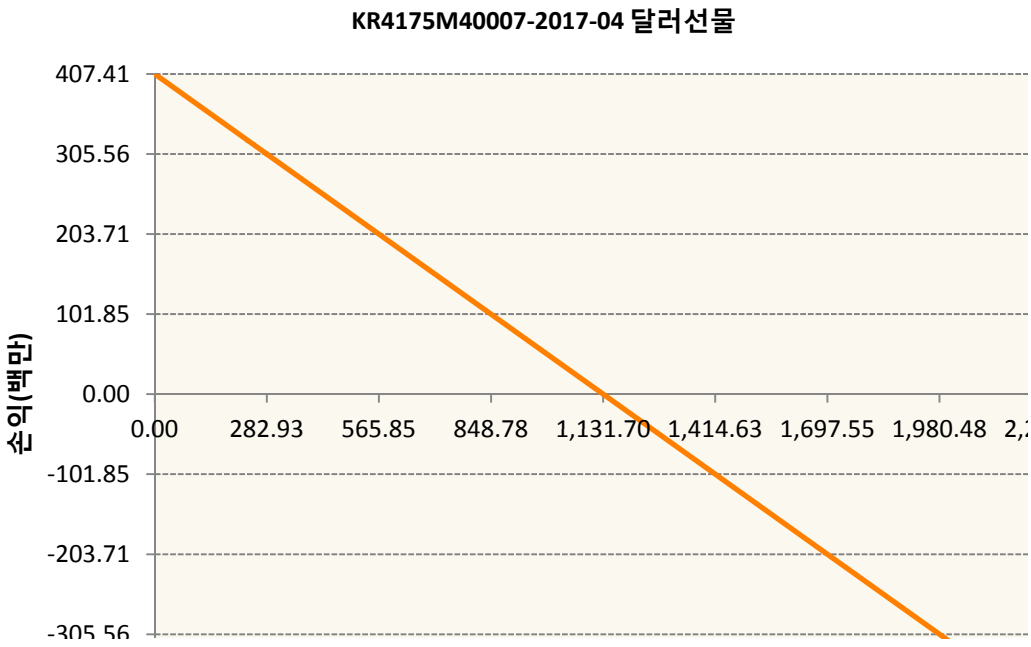
2. 만기시점의 손익구조

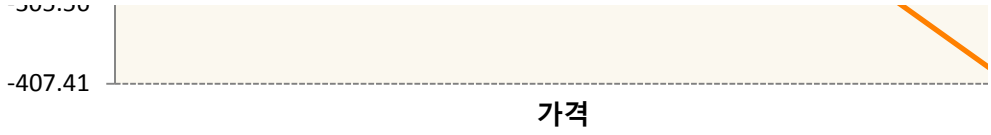


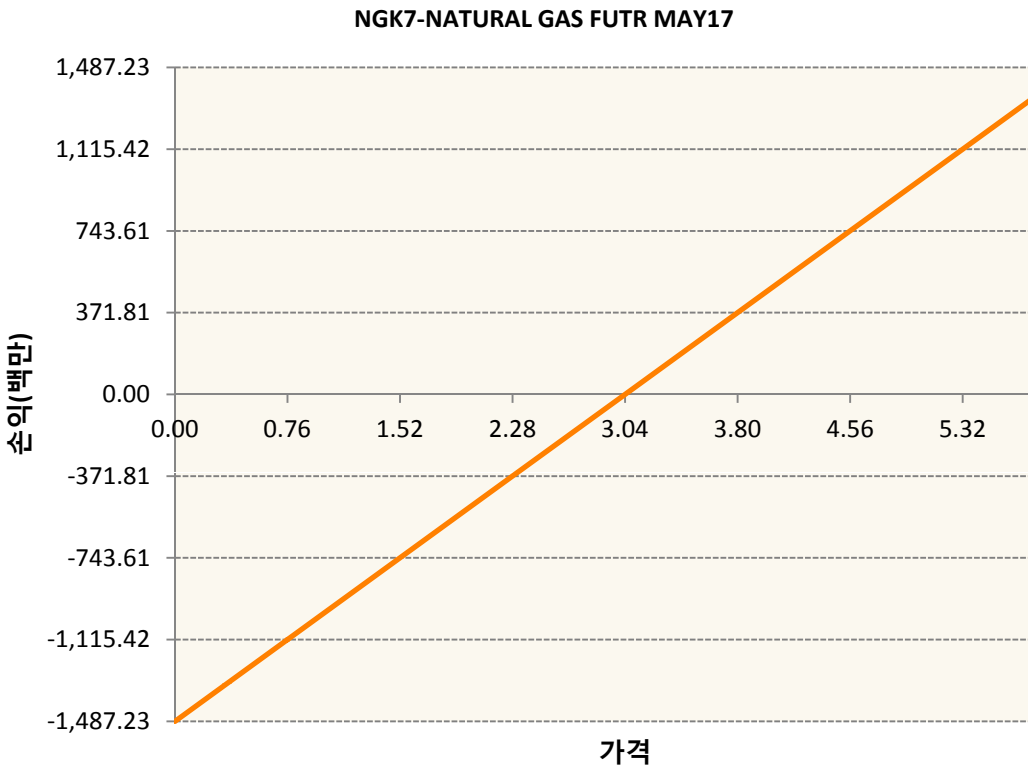


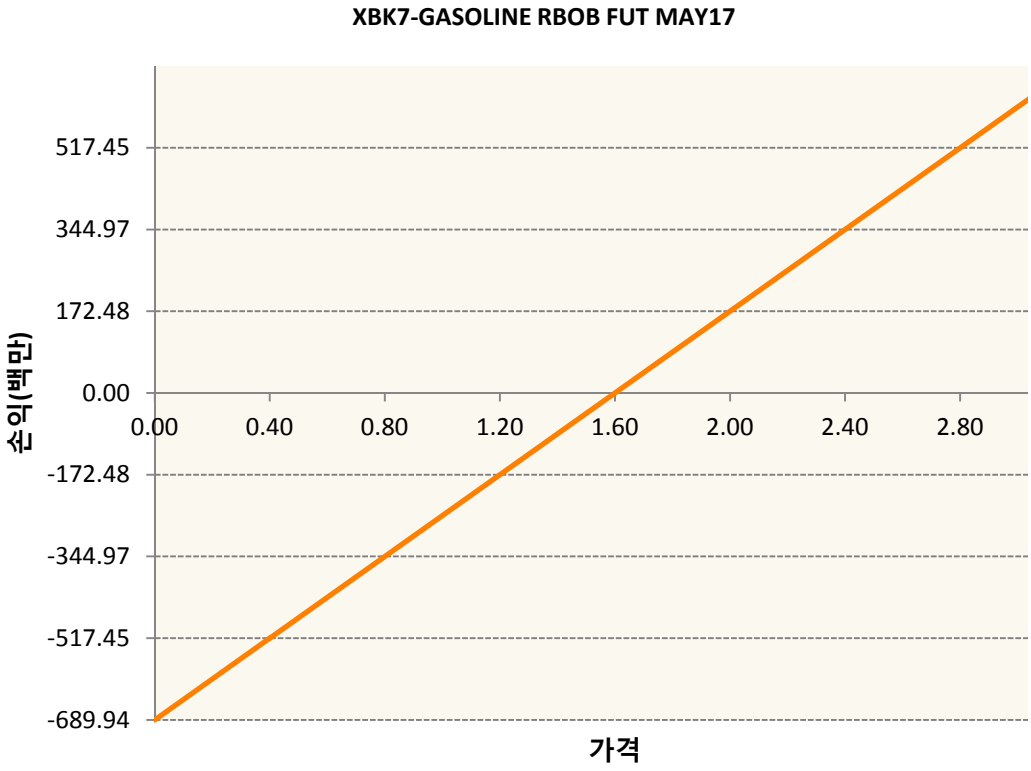

-745.22
-1,117.83
-1,490.44
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
726.12
544.59
363.06
181.53
0.00
-181.53
-363.06
-544.59
-726.12
0.00
0.38
0.76
1.14
1.52
1.90
2.28
2.66
순익(백만)
가격


KR4175M40007-2017-04 달러선물
407.41
305.56
203.71
101.85
0.00
-101.85
-203.71
-305.56
0.00
282.93
565.85
848.78
1,131.70
1,414.63
1,697.55
1,980.48
순익(백만)


-407.41
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,487.23
1,115.42
743.61
371.81
0.00
-371.81
-743.61
-1,115.42
-1,487.23
0.00
0.76
1.52
2.28
3.04
3.80
4.56
5.32
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
517.45
344.97
172.48
0.00
-172.48
-344.97
-517.45
-689.94
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	81
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	119
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	58
KR4175M40(	2017-04 달러선물	33
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	119
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	55

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

964

공시일	2017-03-17
기준일	2017-03-16

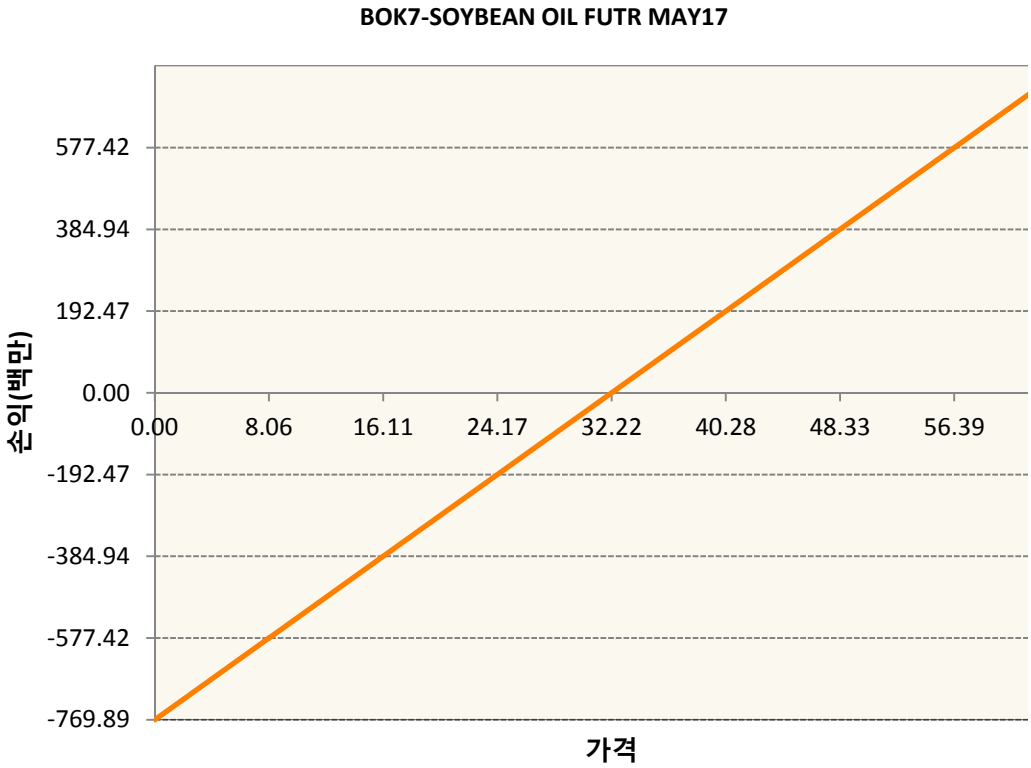
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

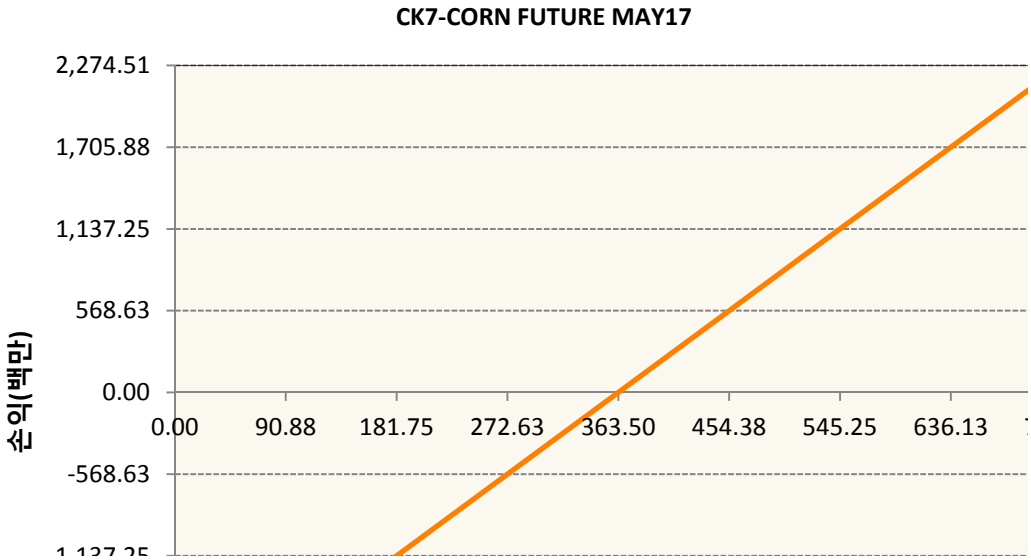
1. 계약금액

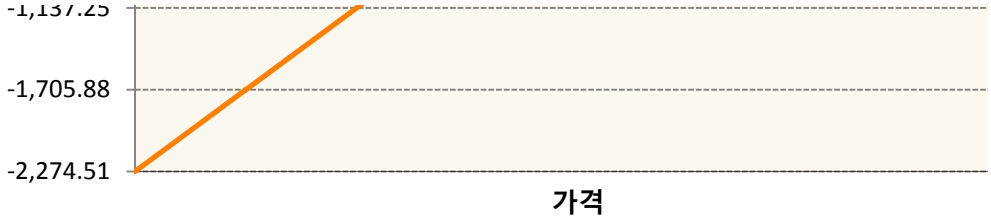
(단위:백만원)

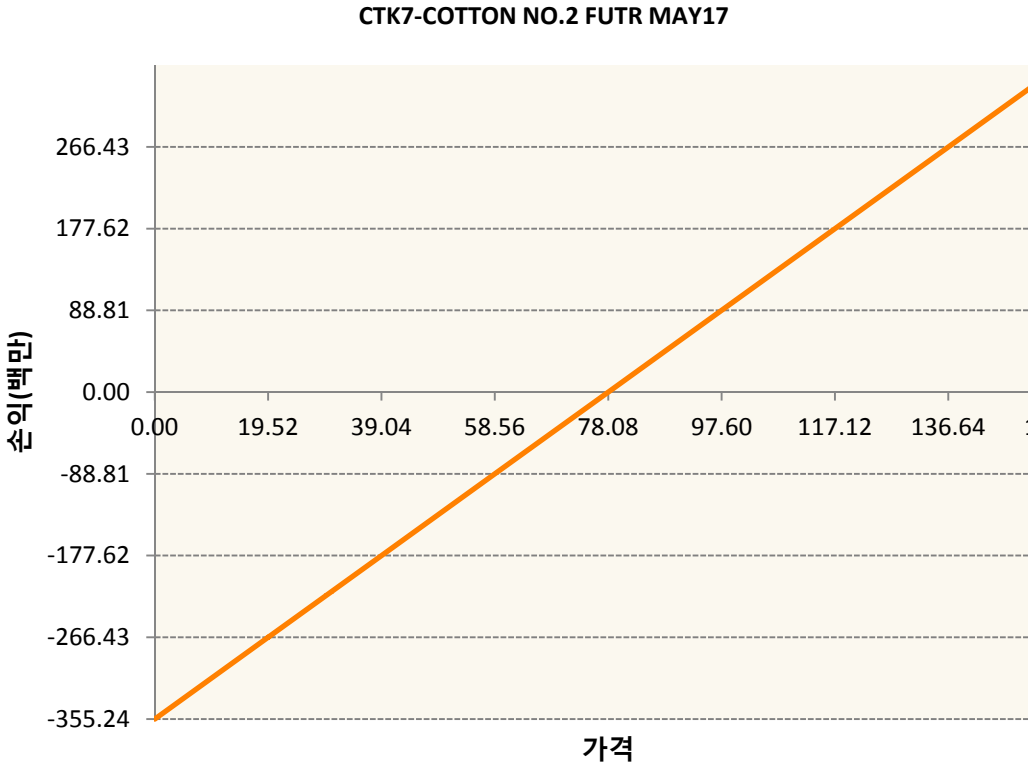
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,086	566	8,520	

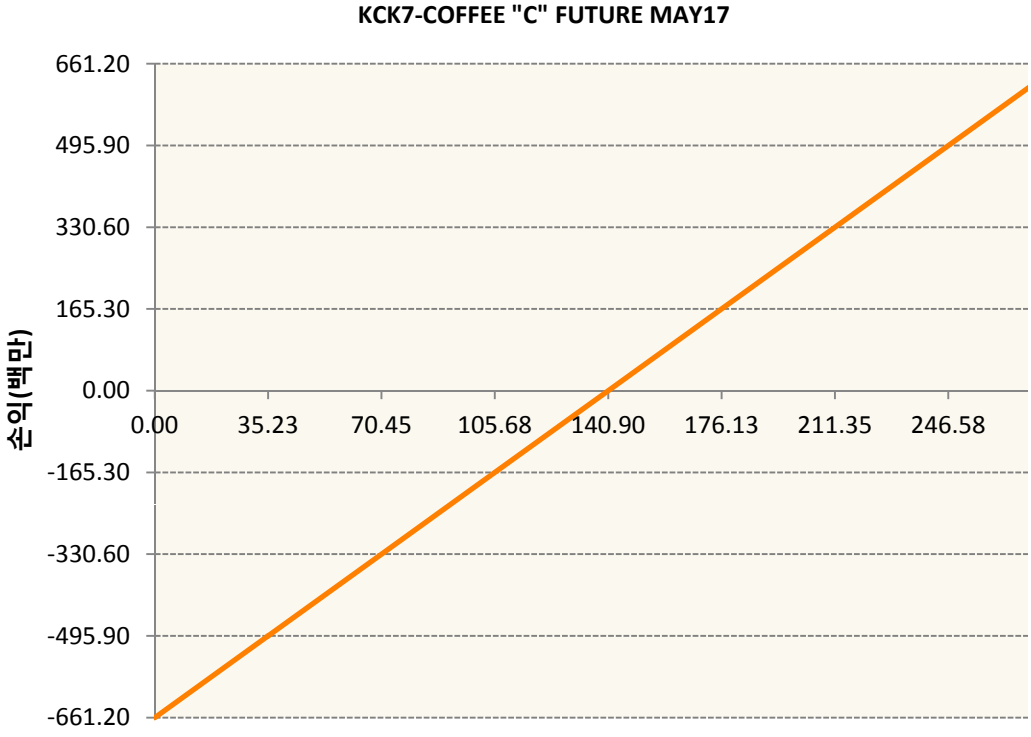
2. 만기시점의 손익구조



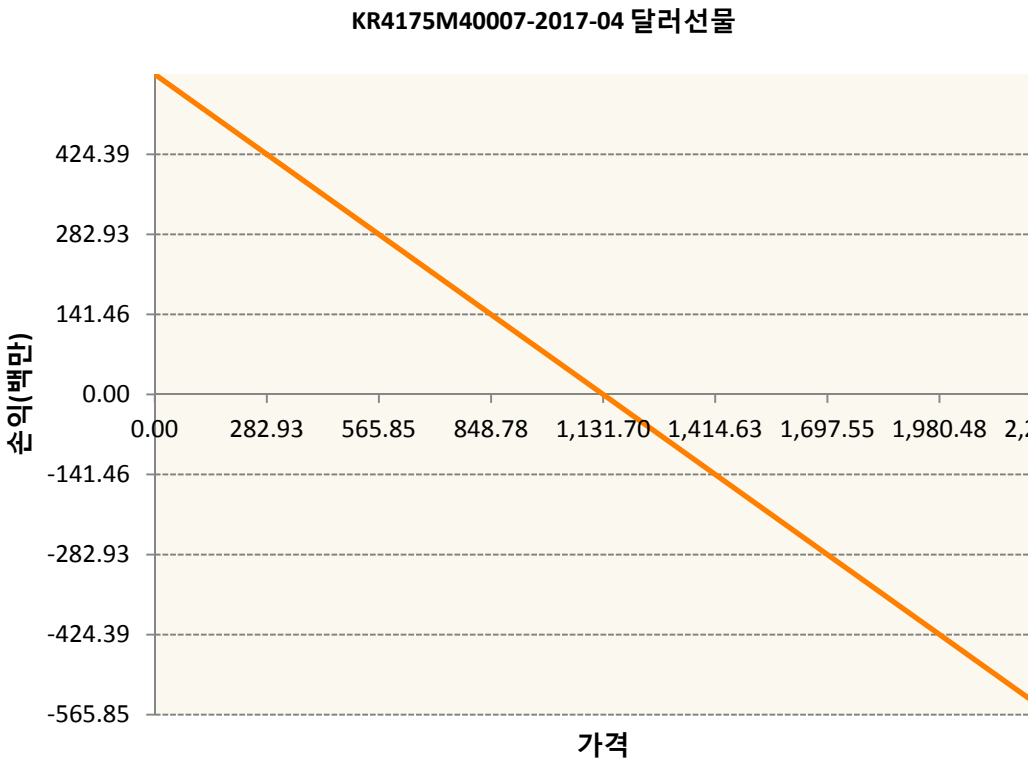


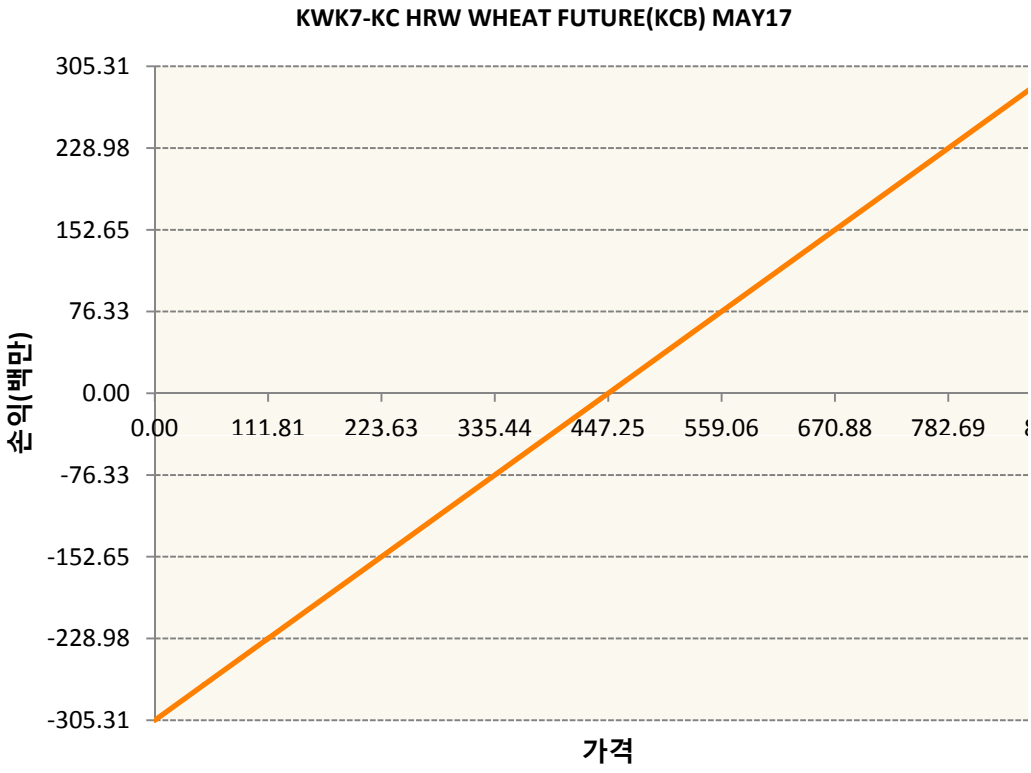

-1,705.88
-2,274.51
가격


CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
266.43
177.62
88.81
0.00
-88.81
-177.62
-266.43
-355.24
0.00
19.52
39.04
58.56
78.08
97.60
117.12
136.64
순익(백만)
가격

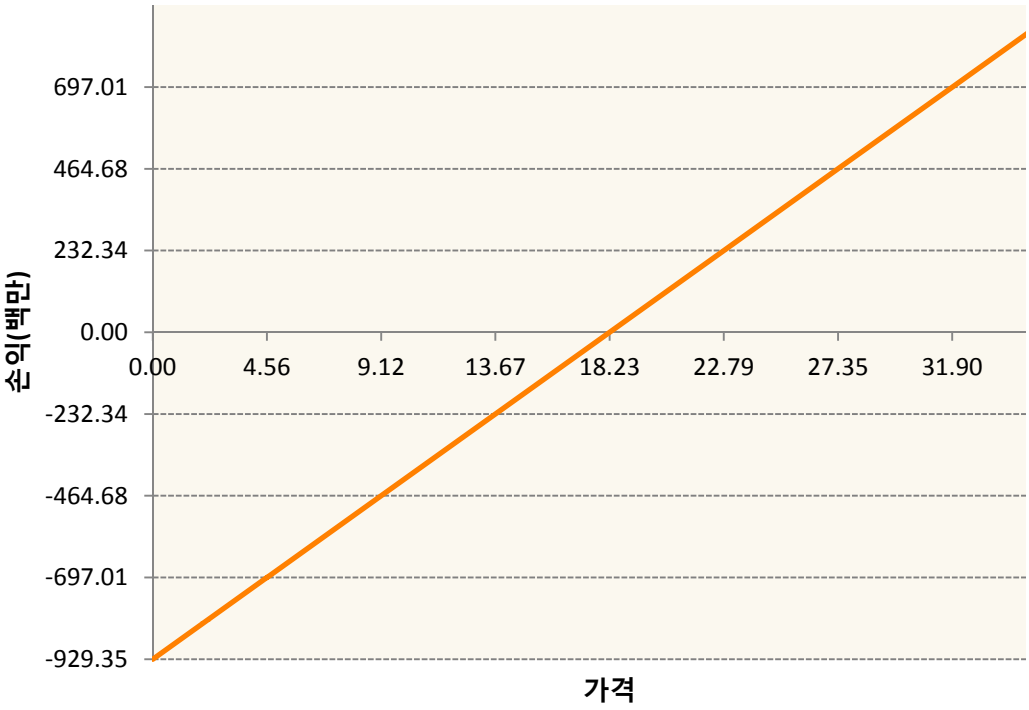

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
661.20
495.90
330.60
165.30
0.00
-165.30
-330.60
-495.90
-661.20
0.00
35.23
70.45
105.68
140.90
176.13
211.35
246.58
순익(백만)

가격

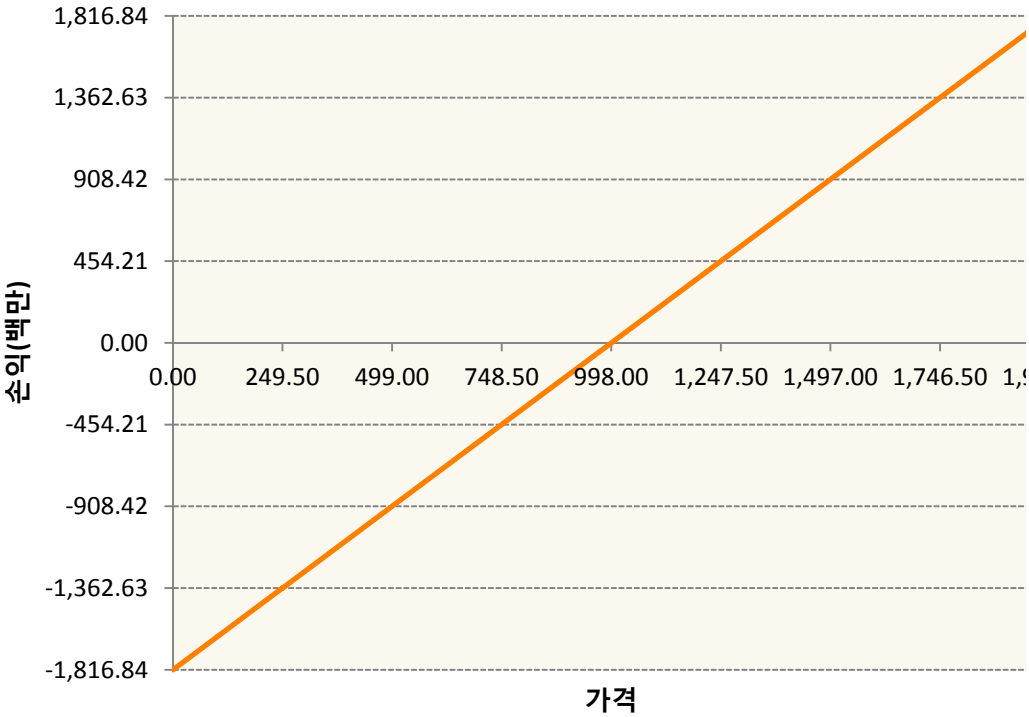

KR4175M40007-2017-04 달러선물
424.39
282.93
141.46
0.00
-141.46
-282.93
-424.39
-565.85
0.00
282.93
565.85
848.78
1,131.70
1,414.63
1,697.55
1,980.48
손익(백만)
가격


KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
305.31
228.98
152.65
76.33
0.00
-76.33
-152.65
-228.98
-305.31
0.00
111.81
223.63
335.44
447.25
559.06
670.88
782.69
손익(백만)
가격

SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17

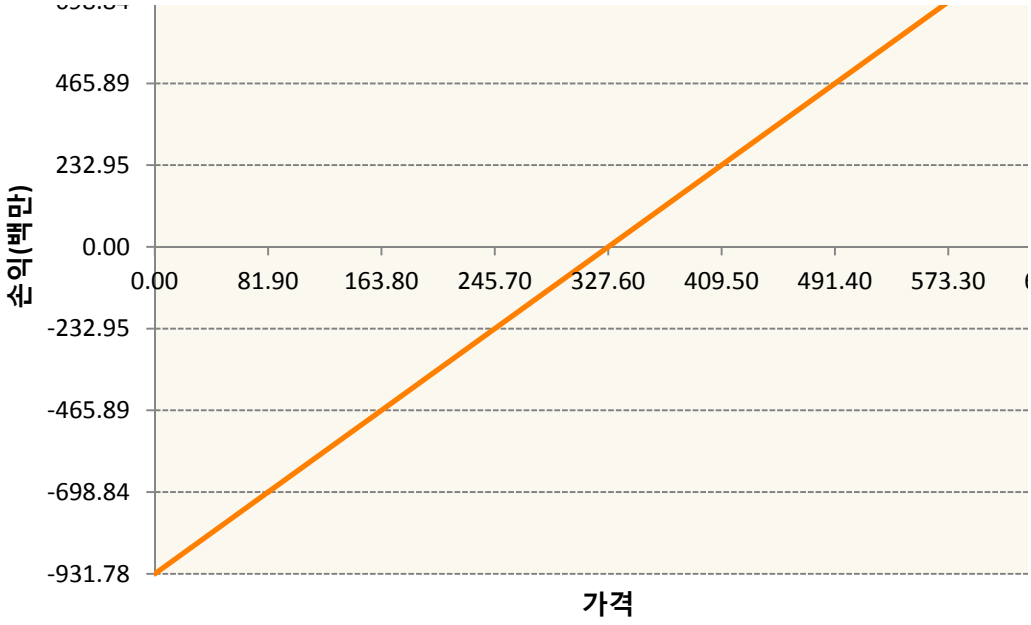


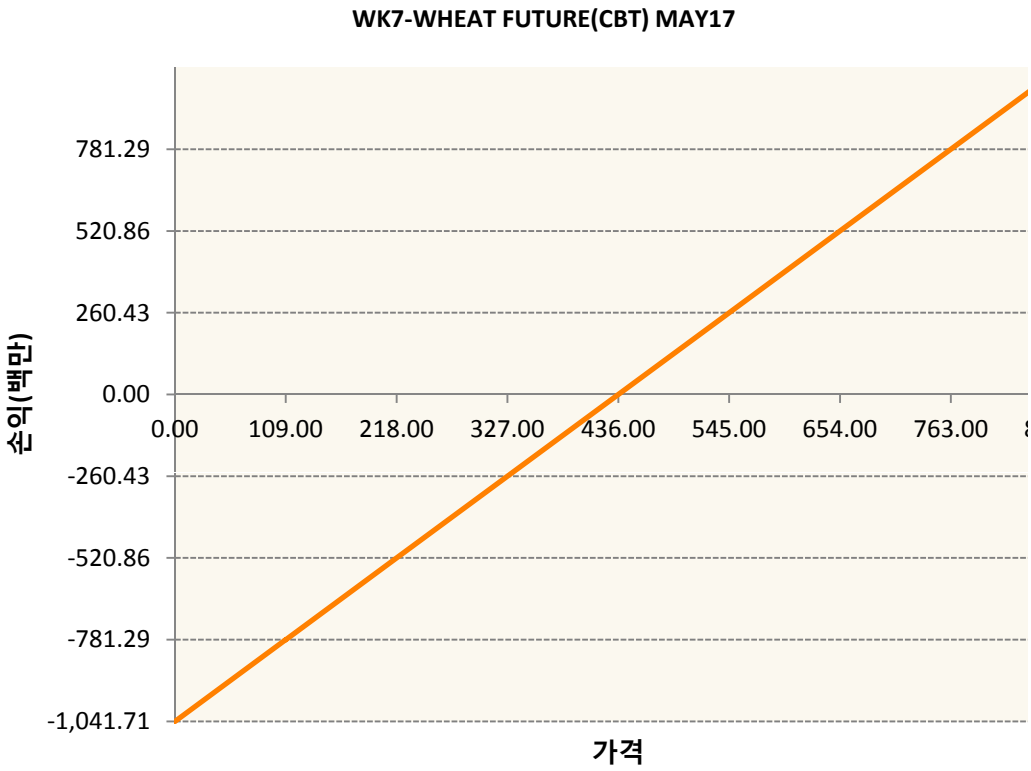
SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17



SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	62
CK7	CORN FUTURE MAY17	182
CTK7	COTTON NO.2 FUTR MAY17	28
KCK7	COFFEE "C" FUTURE MAY17	53
KR4175M40(	2017-04 달러선물	45

KWK7	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17	24
SBK7	Sugar #11 (WORLD) MAY17	74
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	145
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	75
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	83

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

845