공시일	2017-03-20
기준일	2017-03-17

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	2017-03-20
기준일	2017-03-17

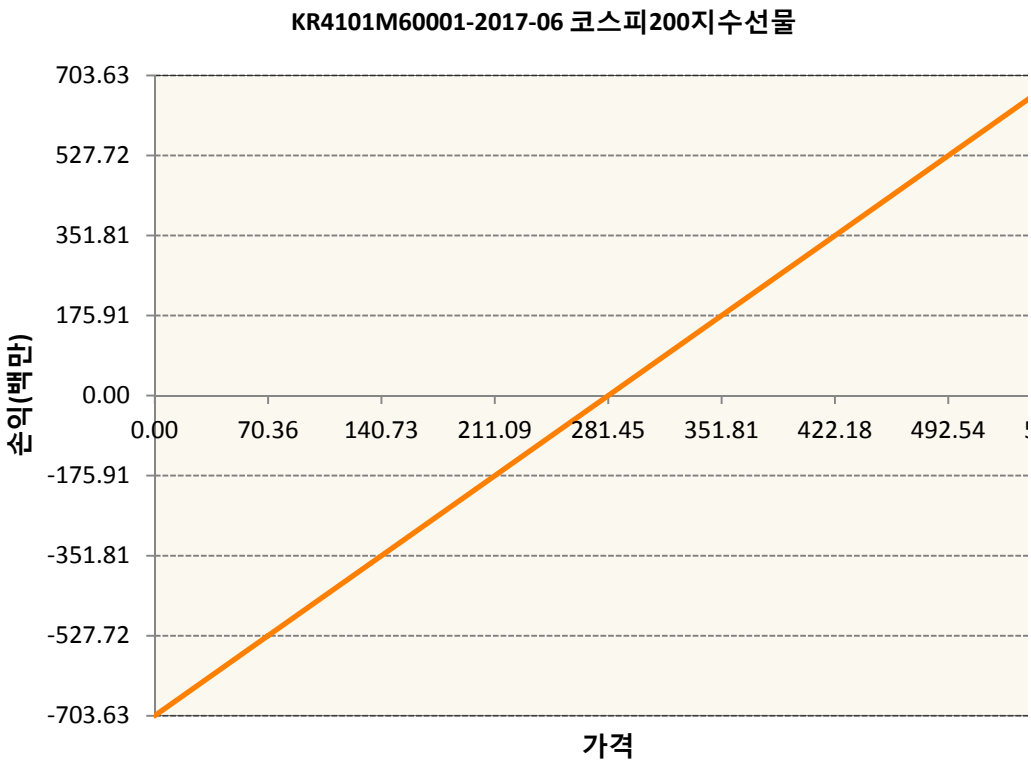
스마트인덱스모

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	704	0	704	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%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
-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%	38	38	38	38	38	38	38
8.00%	56	56	56	56	56	56	56

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

37

공시일	2017-03-20
기준일	2017-03-17

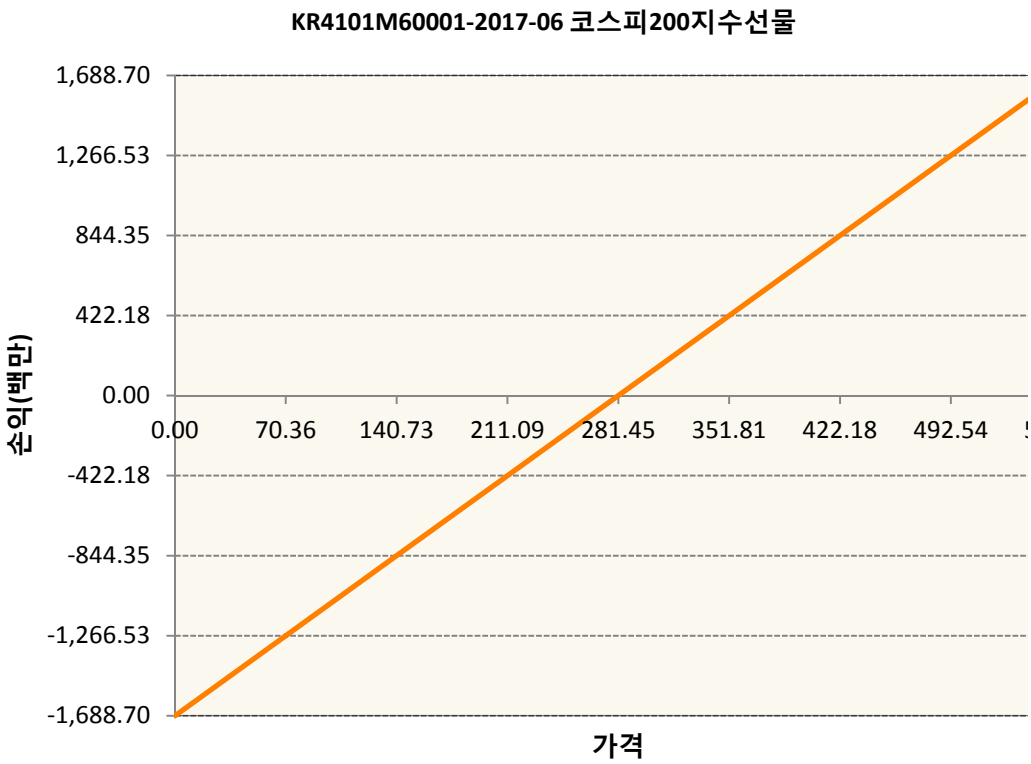
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	141	-141	장내
누계	유가증권	선물	1,689	0	1,689	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							135
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-135	-135	-135	-135	-135	-135	-135
-5.33%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90
-2.67%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	45	45	45	45	45	45	45
5.33%	90	90	90	90	90	90	90
8.00%	135	135	135	135	135	135	135

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

88

공시일	2017-03-20
기준일	2017-03-17

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	11,879	0	11,879	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S170222	963

* 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	2017-03-20
기준일	2017-03-17

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	4,939	0	4,939	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S170308	393

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

450

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-20
기준일	2017-03-17

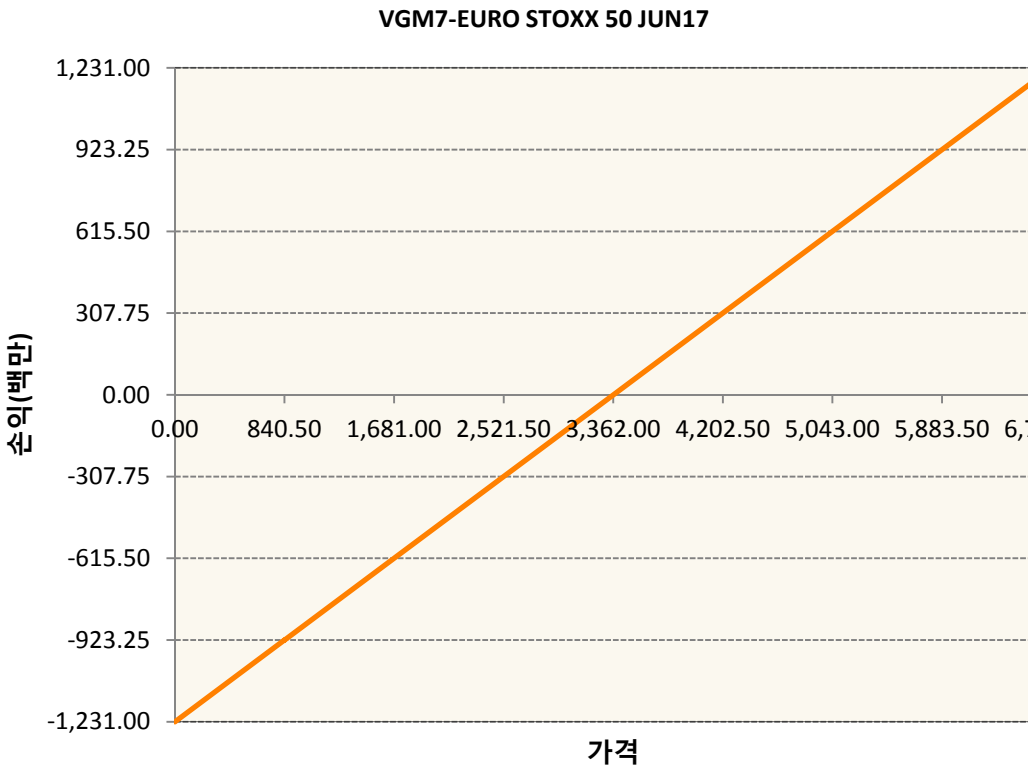
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,231	0	1,231	

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	2017-03-20
기준일	2017-03-17

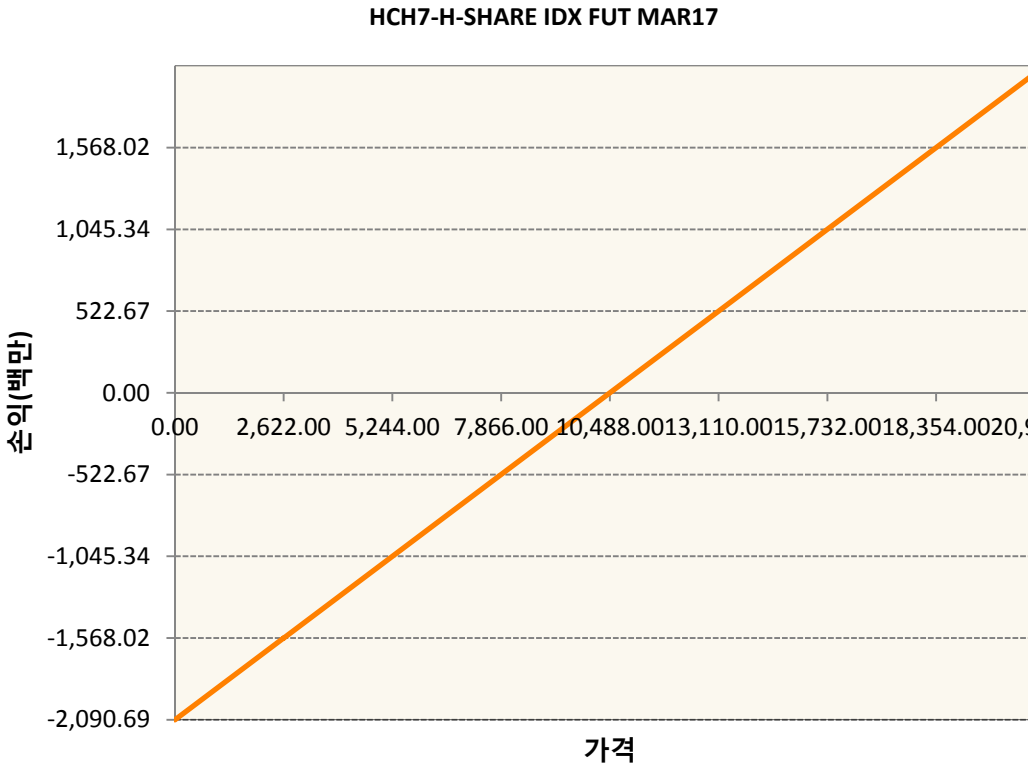
차이나인덱스모(주식-파생형)

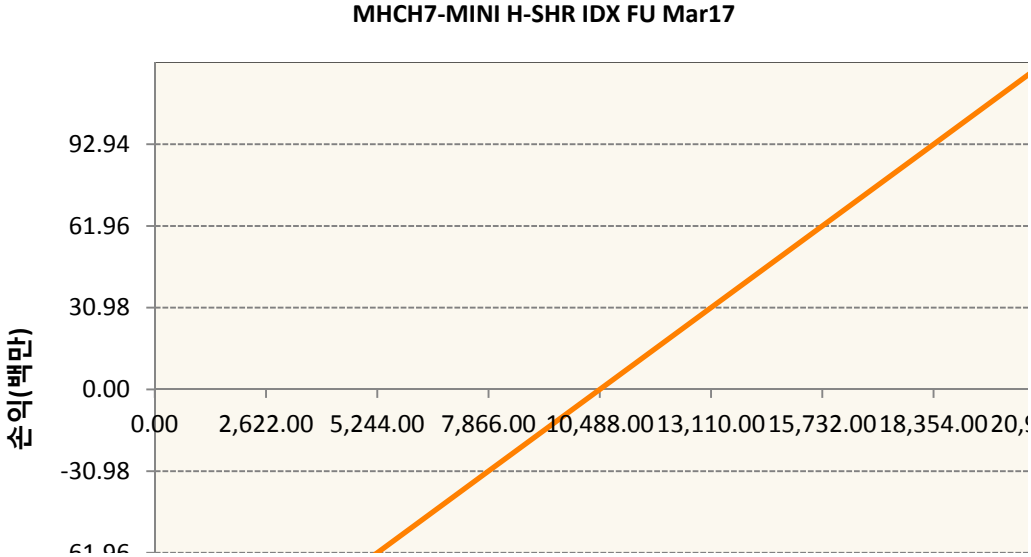
1. 계약금액

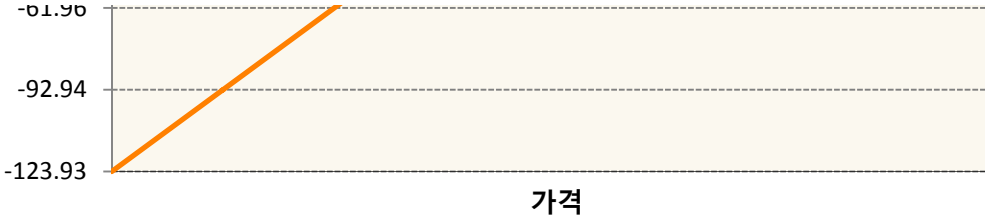
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,215	0	2,215	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH7	H-SHARE IDX FUT MAR17	167
MHCH7	MINI H-SHR IDX FU Mar17	10

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

공시일	2017-03-20
기준일	2017-03-17

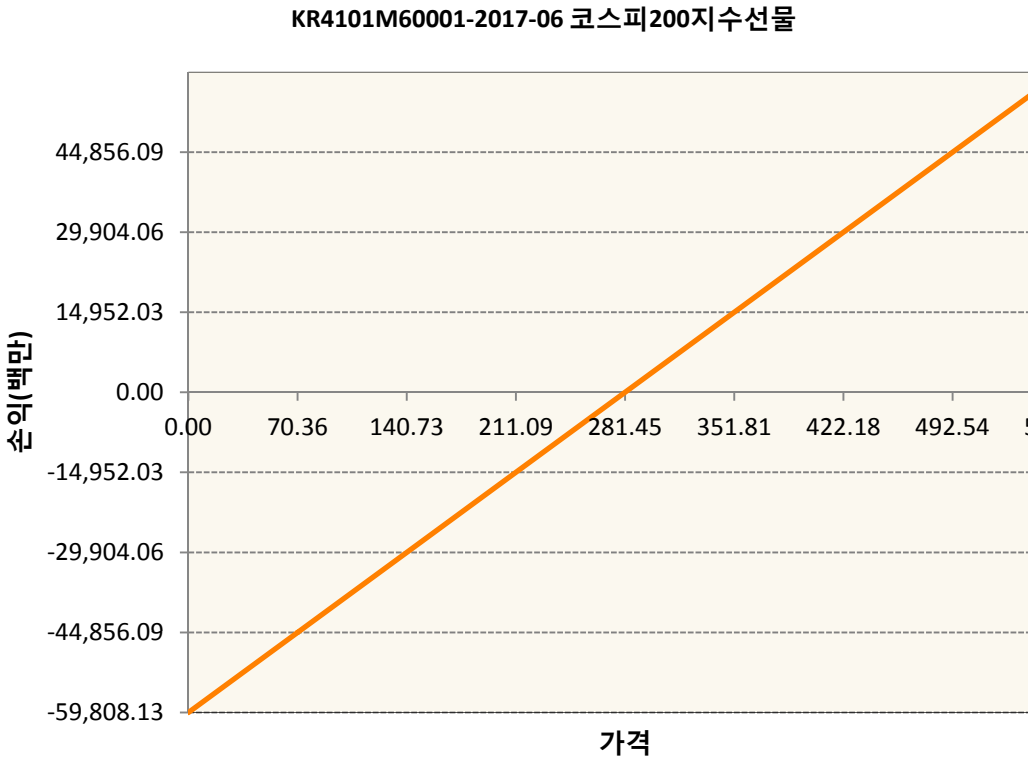
커버드콜모(주식혼합-파생형)

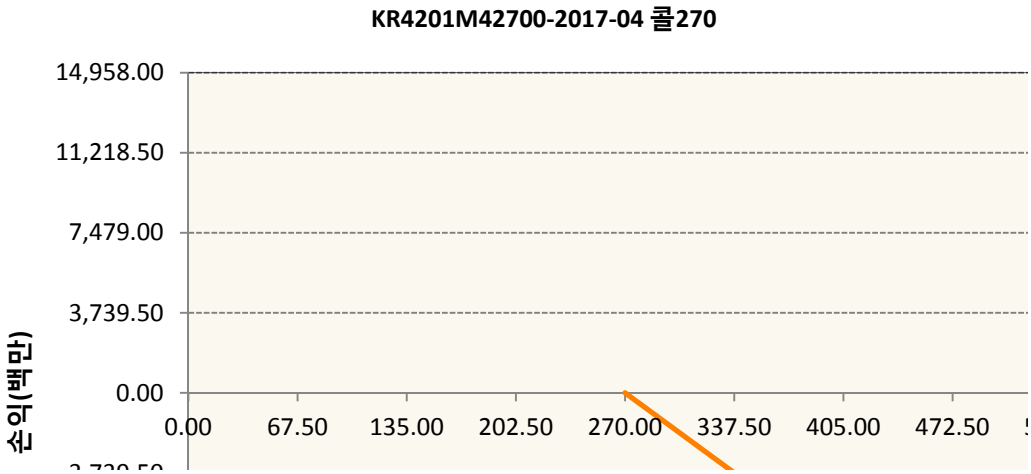
1. 계약금액

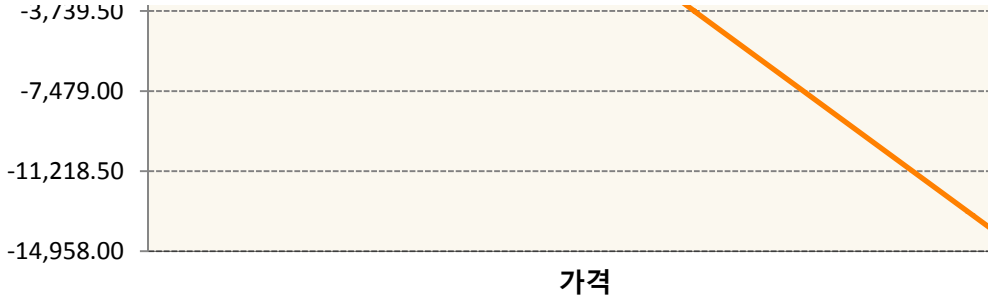
(단위:백만원)

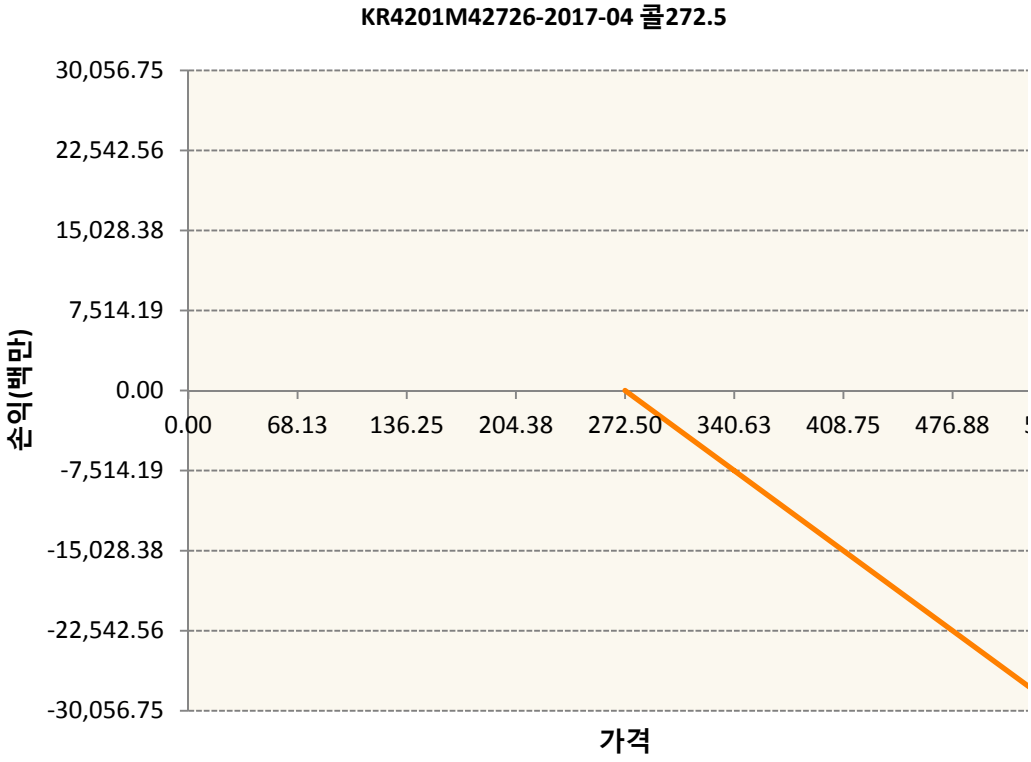
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	59,808	0	59,808	장내
누계	유가증권	옵션	0	45,015	-45,015	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							4,792
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,792	-4,792	-4,792	-4,792	-4,792	-4,792	-4,792
-5.33%	-3,194	-3,194	-3,194	-3,194	-3,194	-3,194	-3,194
-2.67%	-1,597	-1,597	-1,597	-1,597	-1,597	-1,597	-1,597
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,597	1,597	1,597	1,597	1,597	1,597	1,597
5.33%	3,194	3,194	3,194	3,194	3,194	3,194	3,194
8.00%	4,792	4,792	4,792	4,792	4,792	4,792	4,792
KR4201M42 2017-04 콜270							6,161
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,323	3,307	3,285	3,258	3,227	3,192	3,153
-5.33%	3,034	2,969	2,903	2,835	2,767	2,698	2,628
-2.67%	1,918	1,858	1,795	1,731	1,665	1,598	1,530
0%	59	45	25	0	-29	-63	-101
2.67%	-2,002	-2,003	-2,005	-2,010	-2,016	-2,025	-2,038
5.33%	-4,081	-4,081	-4,081	-4,081	-4,082	-4,084	-4,086
8.00%	-6,160	-6,160	-6,160	-6,160	-6,160	-6,160	-6,161
KR4201M42: 2017-04 콜272.5							12,124
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,413	5,397	5,374	5,341	5,301	5,252	5,196
-5.33%	5,121	5,022	4,916	4,804	4,687	4,566	4,442
-2.67%	3,529	3,385	3,240	3,094	2,948	2,801	2,654
0%	198	143	76	0	-85	-177	-275
2.67%	-3,845	-3,852	-3,863	-3,880	-3,904	-3,936	-3,975
5.33%	-7,981	-7,982	-7,982	-7,984	-7,988	-7,994	-8,003
8.00%	-12,121	-12,121	-12,121	-12,121	-12,122	-12,122	-12,124

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

23,874

공시일	2017-03-20
기준일	2017-03-17

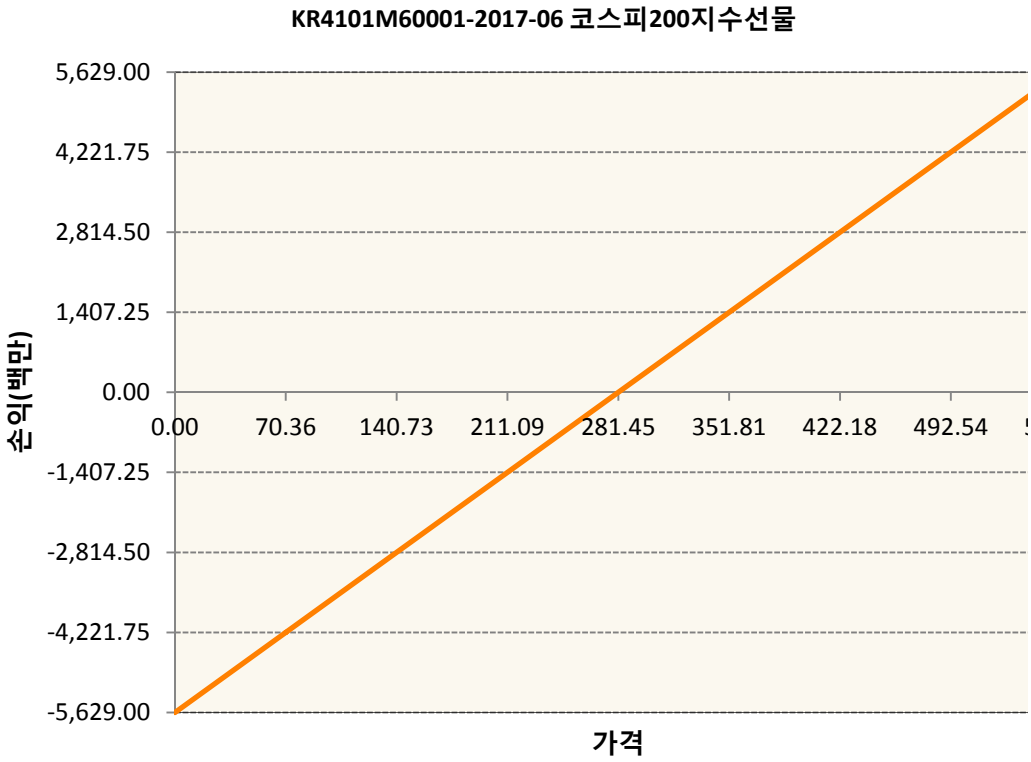
커버드콜목표전환형증권투자신탁

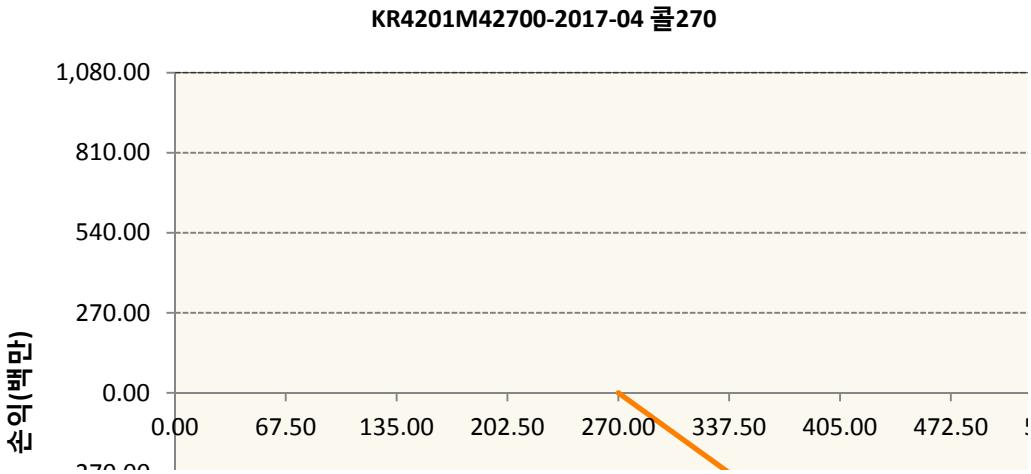
1. 계약금액

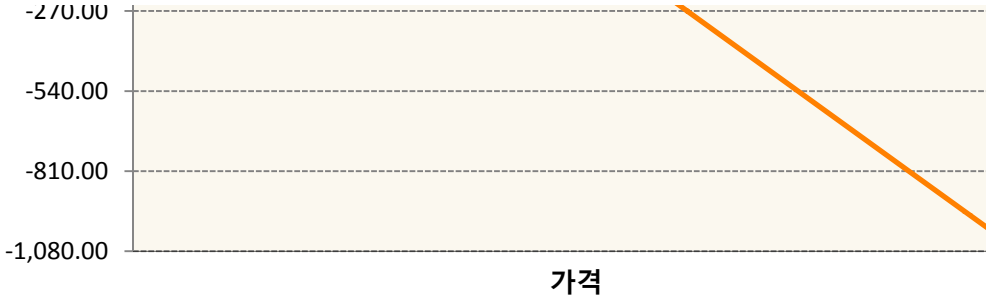
(단위:백만원)

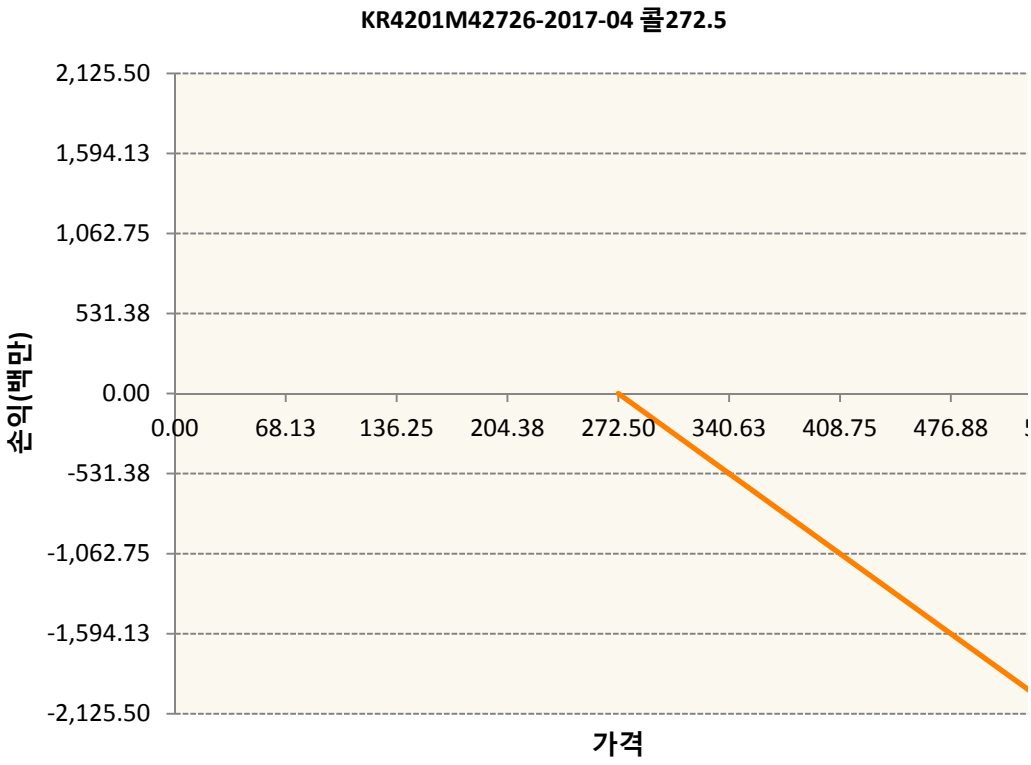
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	26	0	26	장내
누계	유가증권	선물	5,629	0	5,629	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,206	-3,206	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							451
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-451	-451	-451	-451	-451	-451	-451
-5.33%	-301	-301	-301	-301	-301	-301	-301
-2.67%	-150	-150	-150	-150	-150	-150	-150
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	150	150	150	150	150	150	150
5.33%	301	301	301	301	301	301	301
8.00%	451	451	451	451	451	451	451
KR4201M42 2017-04 콜270							445
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	240	239	237	235	233	230	228
-5.33%	219	214	210	205	200	195	190
-2.67%	138	134	130	125	120	115	110
0%	4	3	2	0	-2	-5	-7
2.67%	-145	-145	-145	-145	-146	-146	-147
5.33%	-295	-295	-295	-295	-295	-295	-295
8.00%	-445	-445	-445	-445	-445	-445	-445
KR4201M42 2017-04 콜272.5							857

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	383	382	380	378	375	371	367
-5.33%	362	355	348	340	331	323	314
-2.67%	250	239	229	219	208	198	188
0%	14	10	5	0	-6	-13	-19
2.67%	-272	-272	-273	-274	-276	-278	-281
5.33%	-564	-564	-564	-565	-565	-565	-566
8.00%	-857	-857	-857	-857	-857	-857	-857

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

1,771

공시일	2017-03-20
기준일	2017-03-17

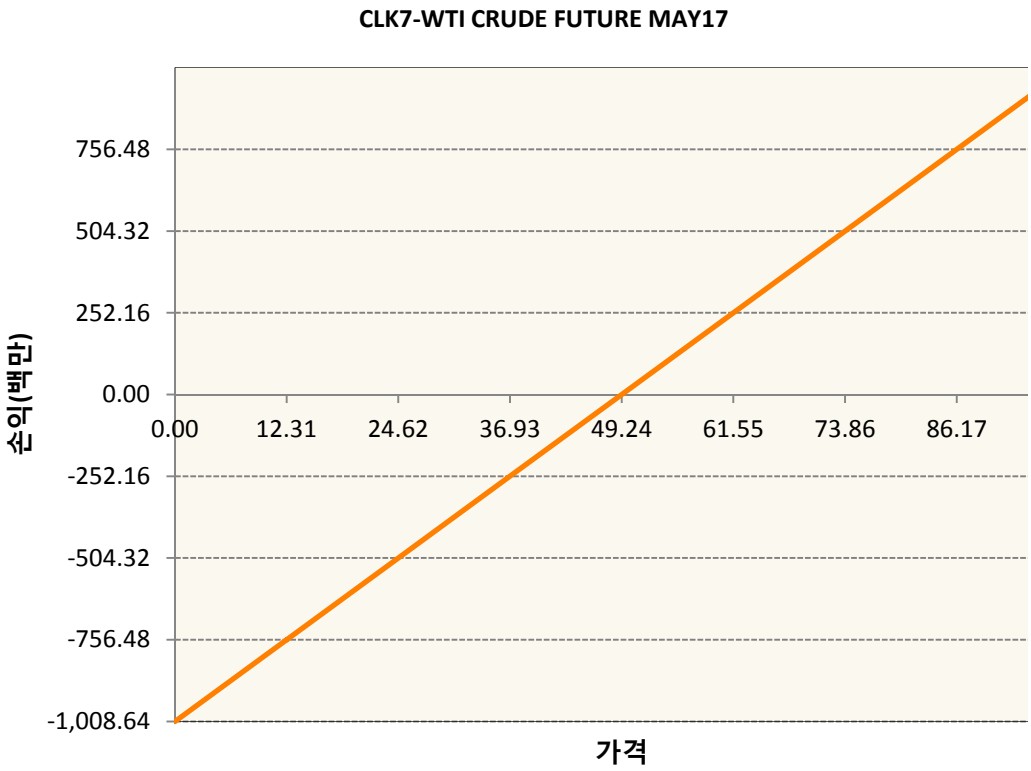
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

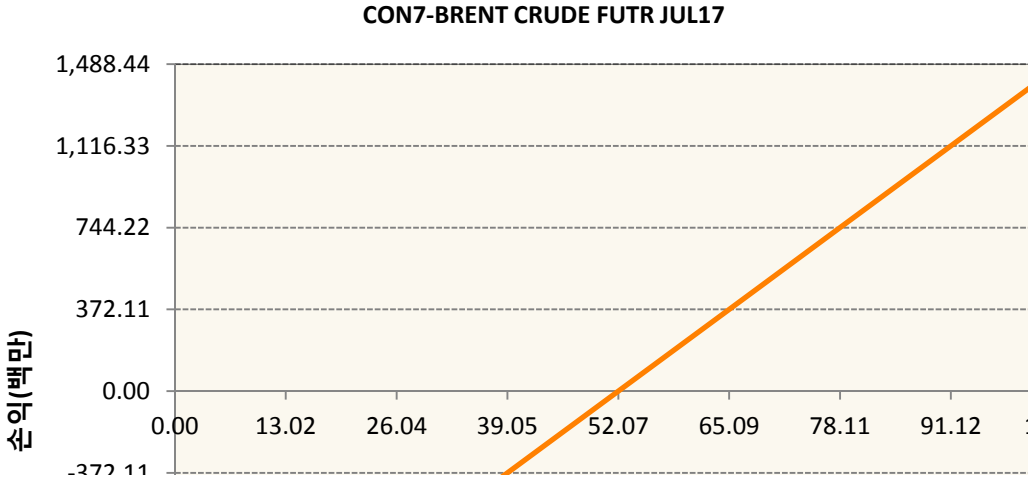
1. 계약금액

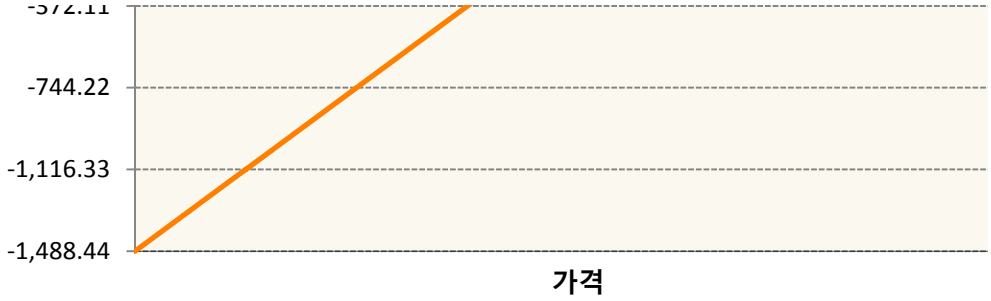
(단위:백만원)

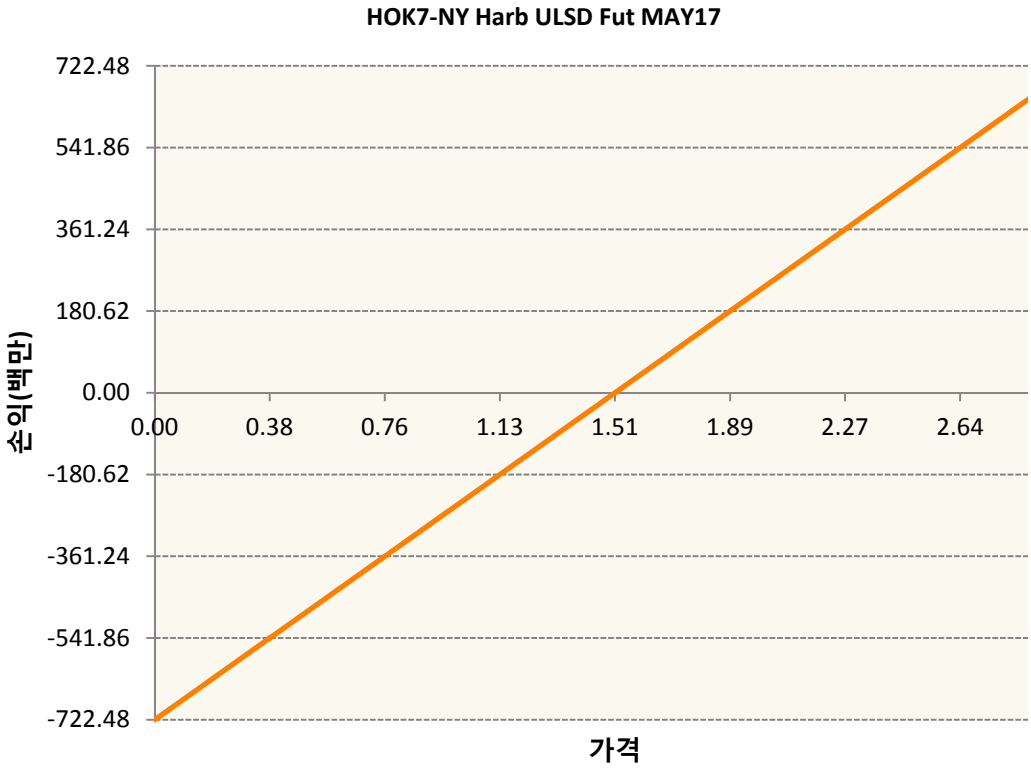
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,009	0	1,009	
누계	유가증권	선물	4,356	407	3,949	

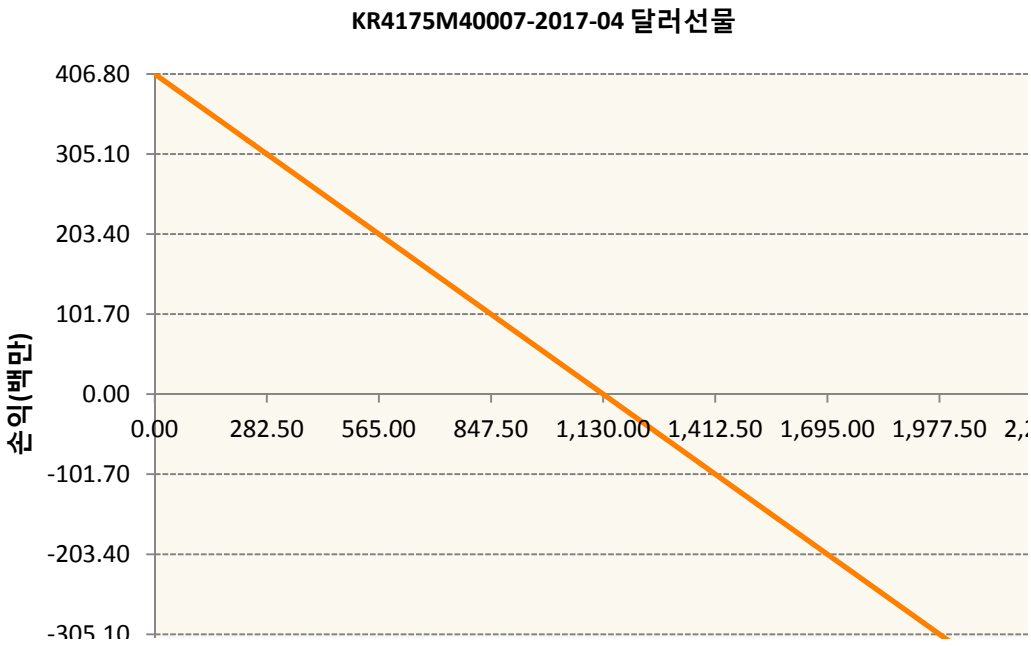
2. 만기시점의 손익구조

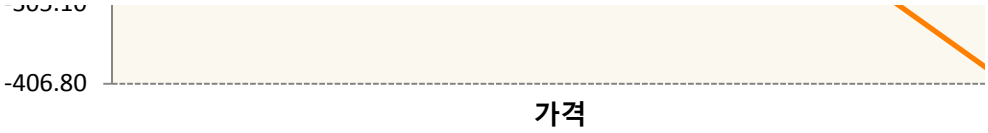


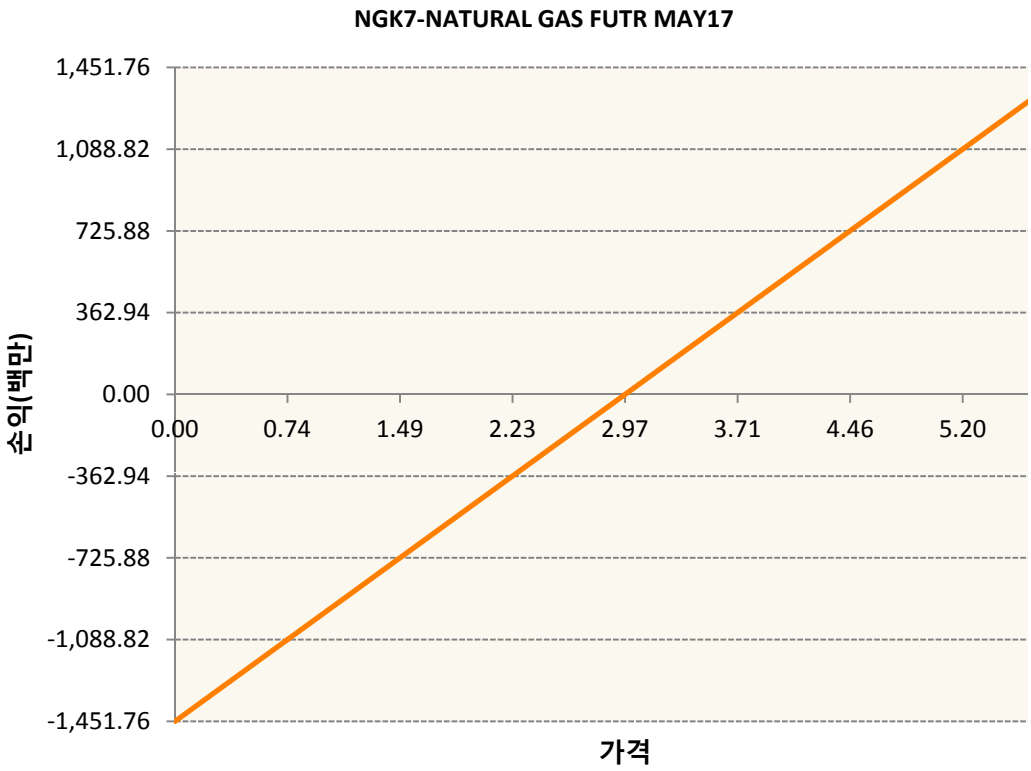


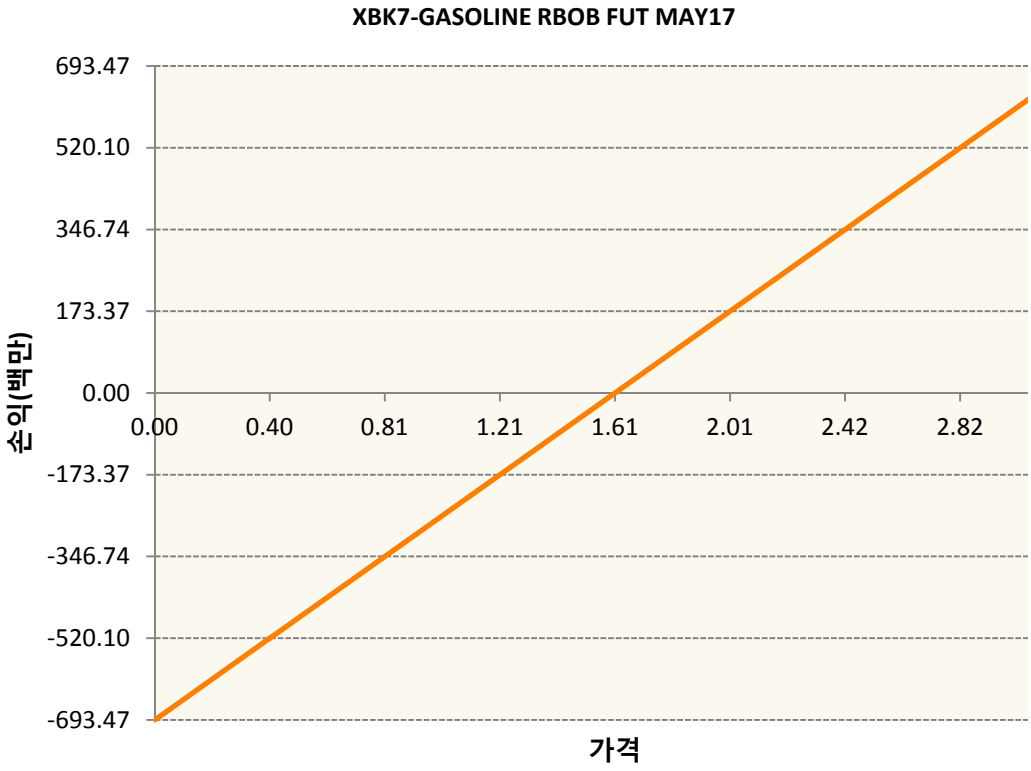

-744.22
-1,116.33
-1,488.44
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
722.48
541.86
361.24
180.62
0.00
-180.62
-361.24
-541.86
-722.48
0.00
0.38
0.76
1.13
1.51
1.89
2.27
2.64
순익(백만)
가격


KR4175M40007-2017-04 달러선물
406.80
305.10
203.40
101.70
0.00
-101.70
-203.40
0.00
282.50
565.00
847.50
1,130.00
1,412.50
1,695.00
1,977.50
순익(백만)


-406.80
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,451.76
1,088.82
725.88
362.94
0.00
-362.94
-725.88
-1,088.82
-1,451.76
0.00
0.74
1.49
2.23
2.97
3.71
4.46
5.20
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
693.47
520.10
346.74
173.37
0.00
-173.37
-346.74
-520.10
-693.47
0.00
0.40
0.81
1.21
1.61
2.01
2.42
2.82
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	116
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	55

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

954

공시일	2017-03-20
기준일	2017-03-17

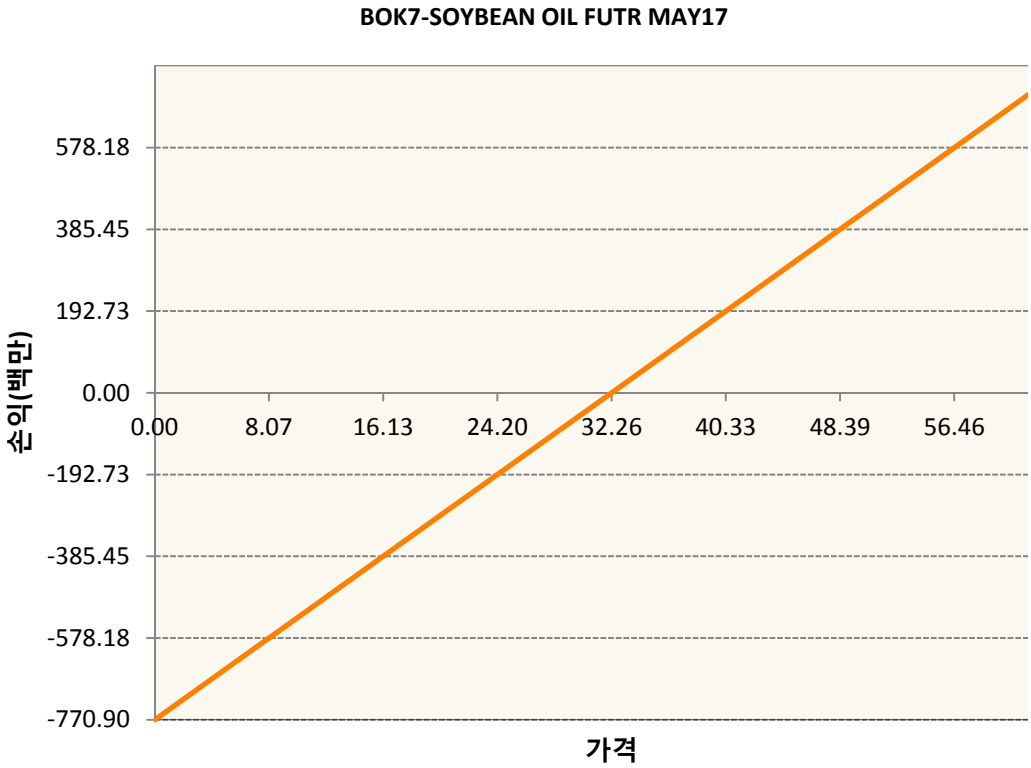
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

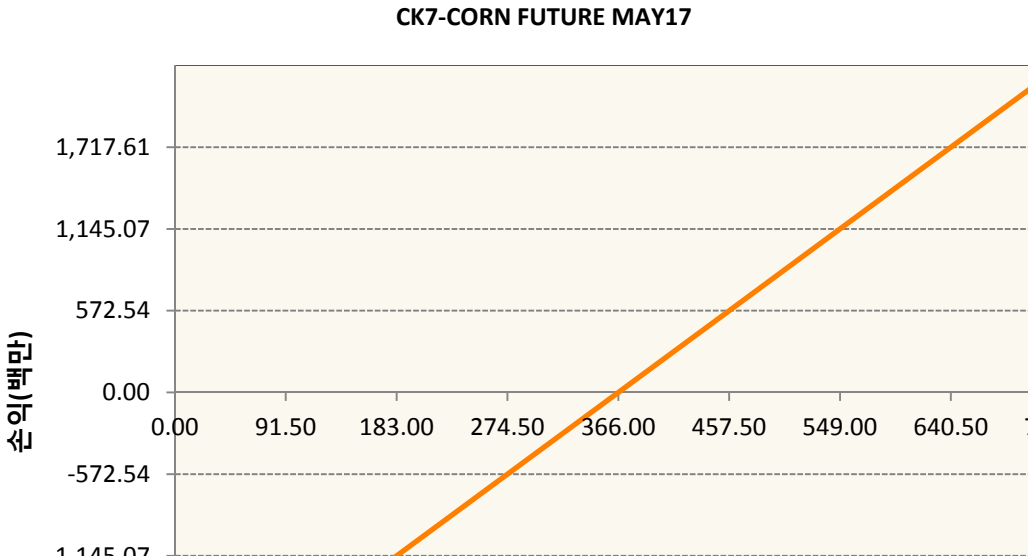
1. 계약금액

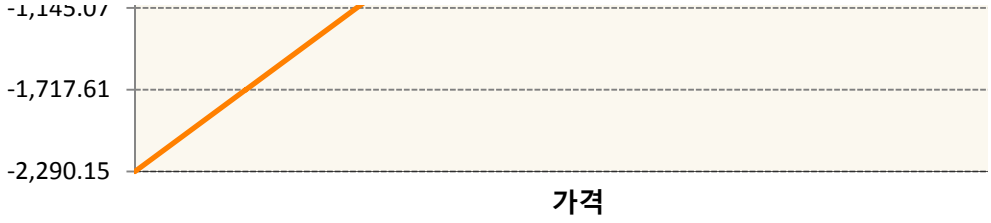
(단위:백만원)

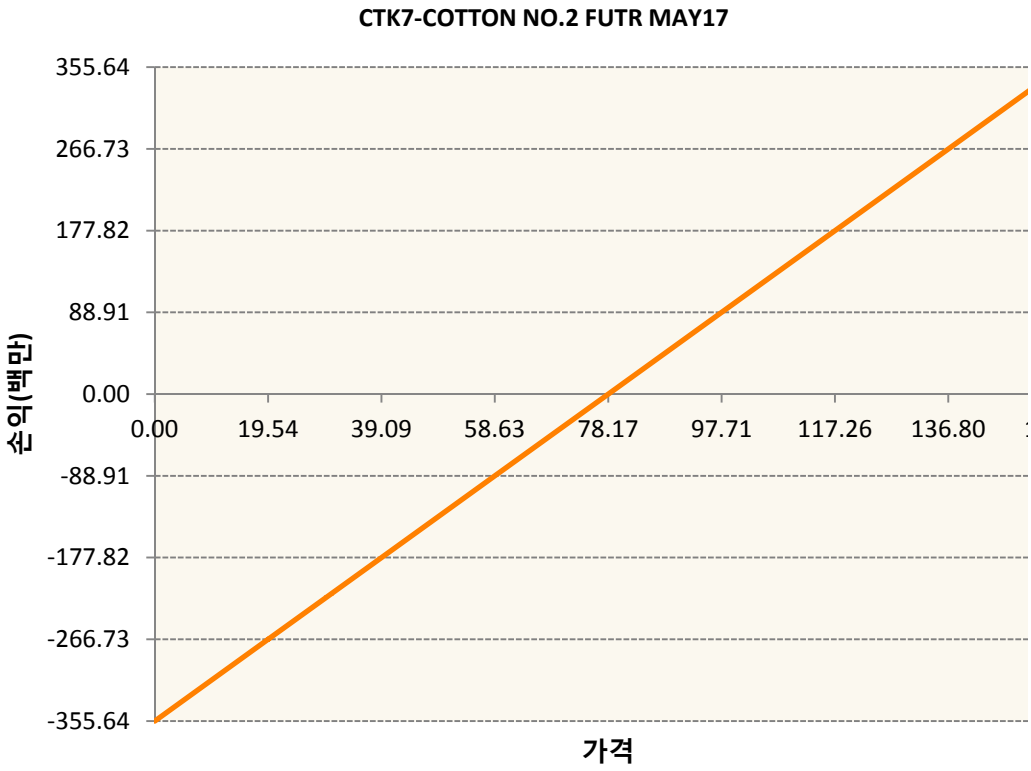
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,120	565	8,555	

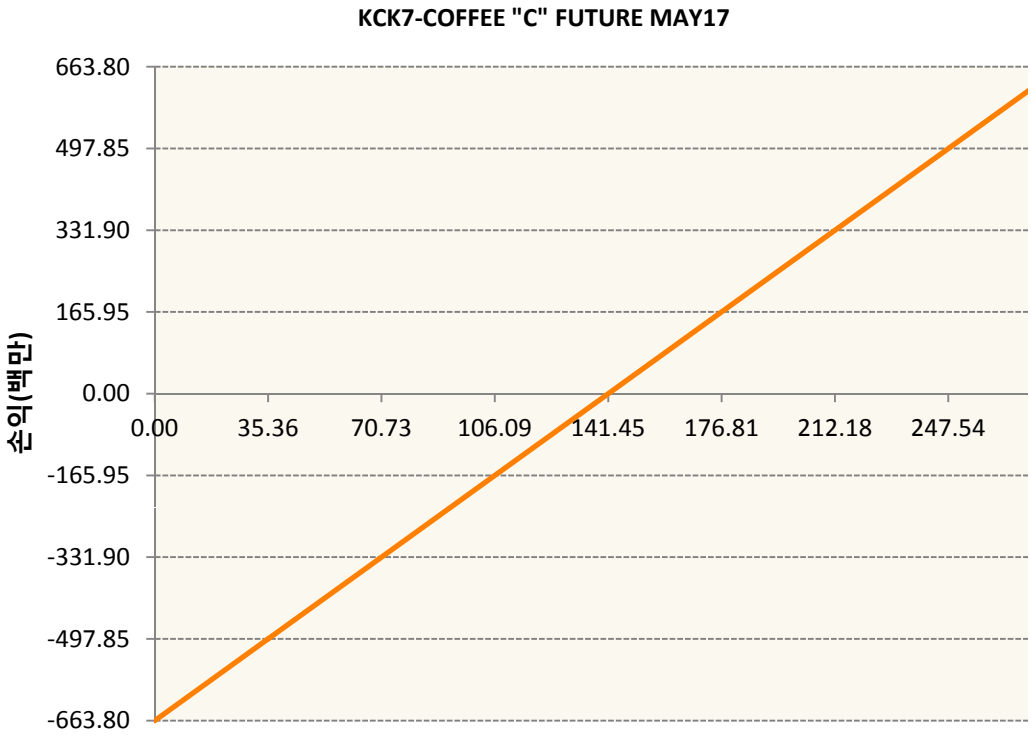
2. 만기시점의 손익구조



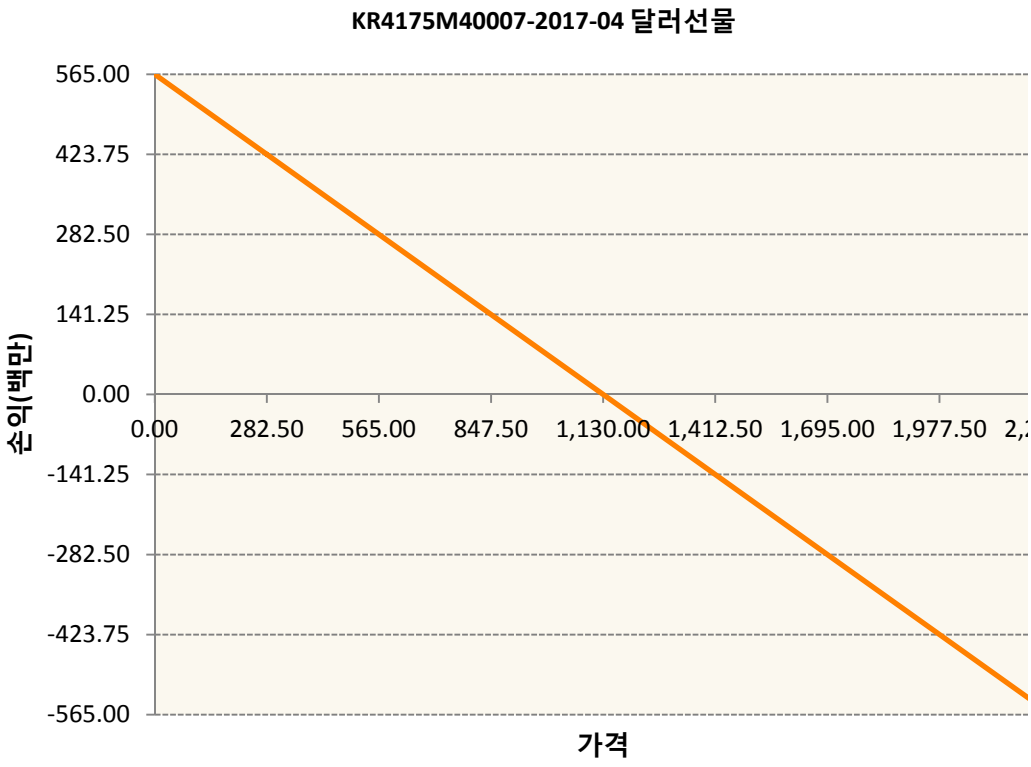


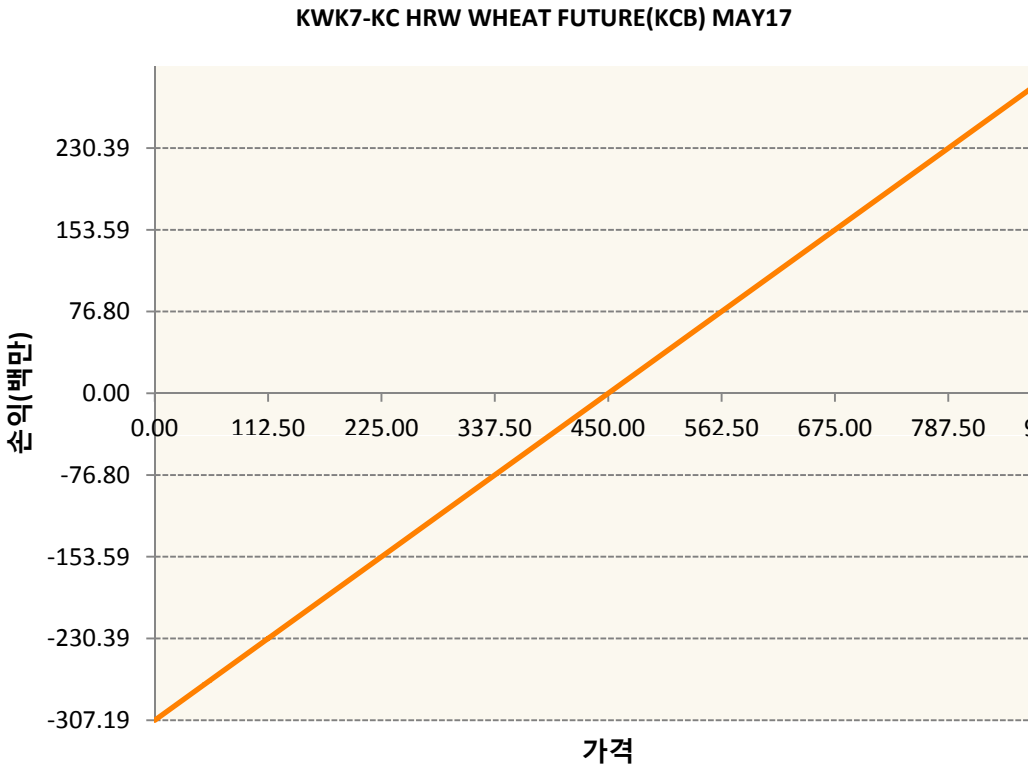

-1,145.07
-1,717.61
-2,290.15
가격

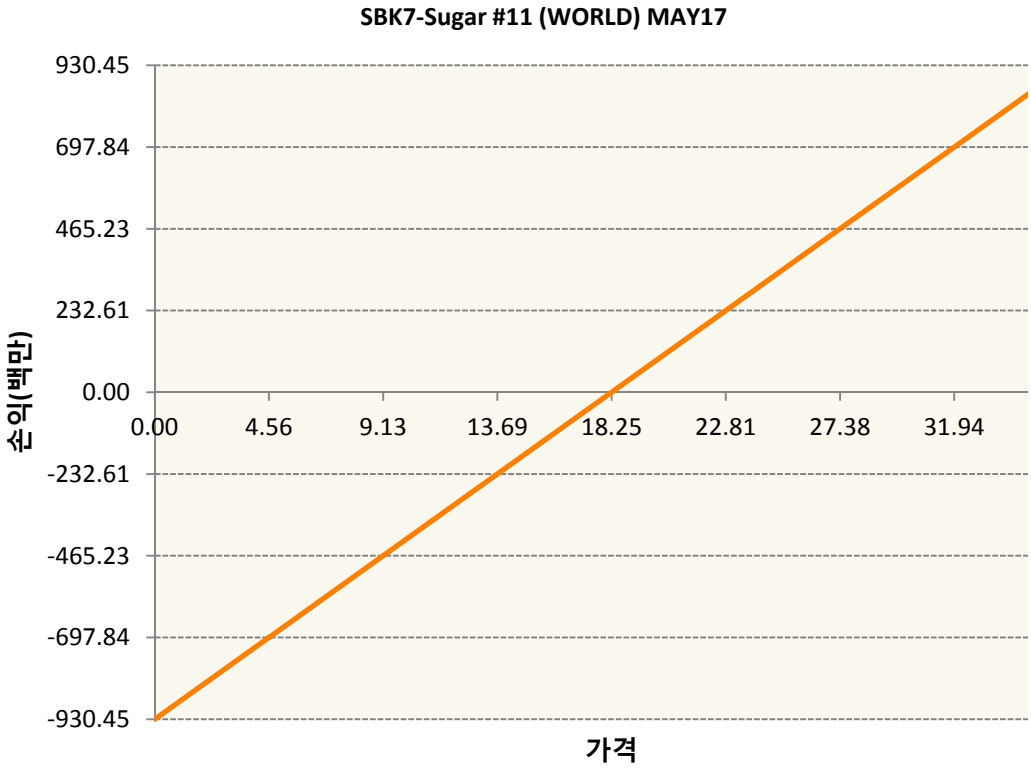

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
355.64
266.73
177.82
88.91
0.00
-88.91
-177.82
-266.73
-355.64
0.00
19.54
39.09
58.63
78.17
97.71
117.26
136.80
순익(백만)
가격

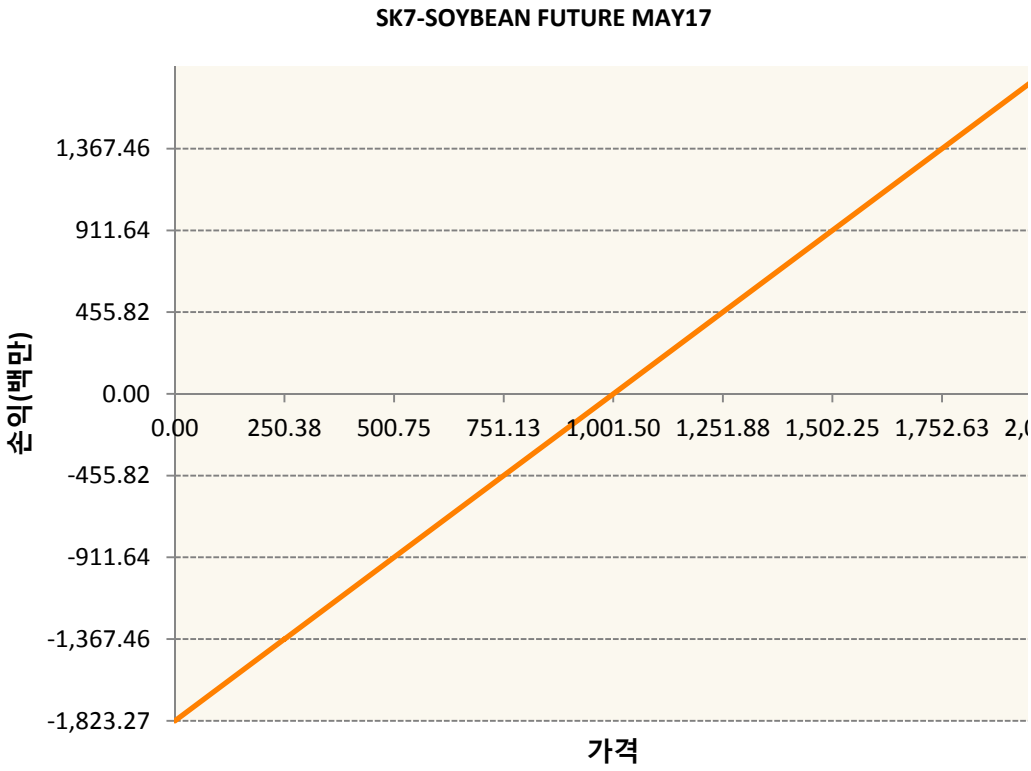

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
663.80
497.85
331.90
165.95
0.00
-165.95
-331.90
-497.85
-663.80
0.00
35.36
70.73
106.09
141.45
176.81
212.18
247.54
순익(백만)

가격

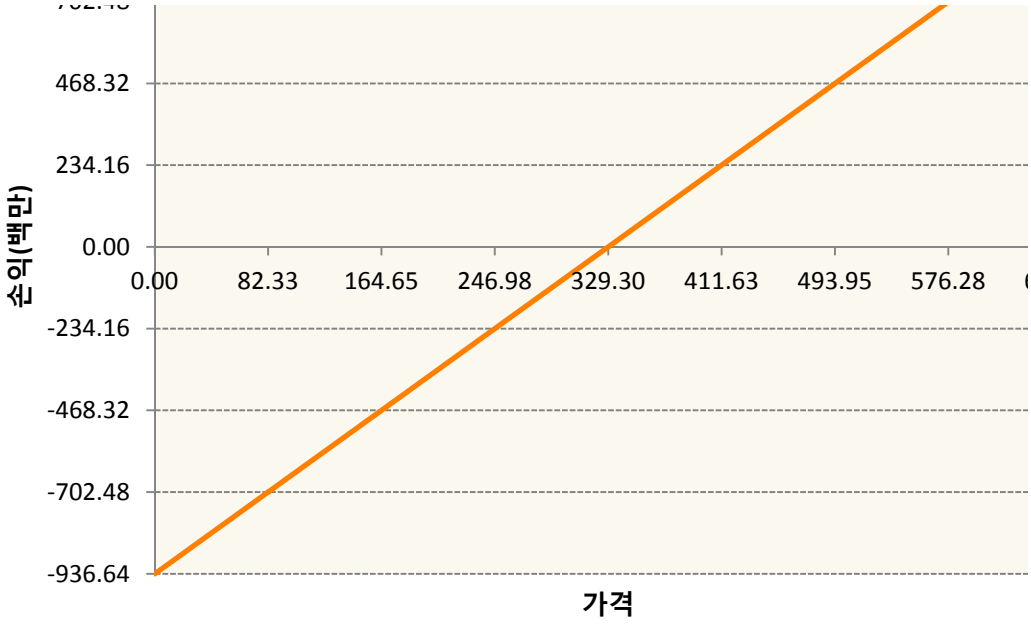

KR4175M40007-2017-04 달러선물
565.00
423.75
282.50
141.25
0.00
-141.25
-282.50
-423.75
-565.00
0.00
282.50
565.00
847.50
1,130.00
1,412.50
1,695.00
1,977.50
순이(백만)
가격

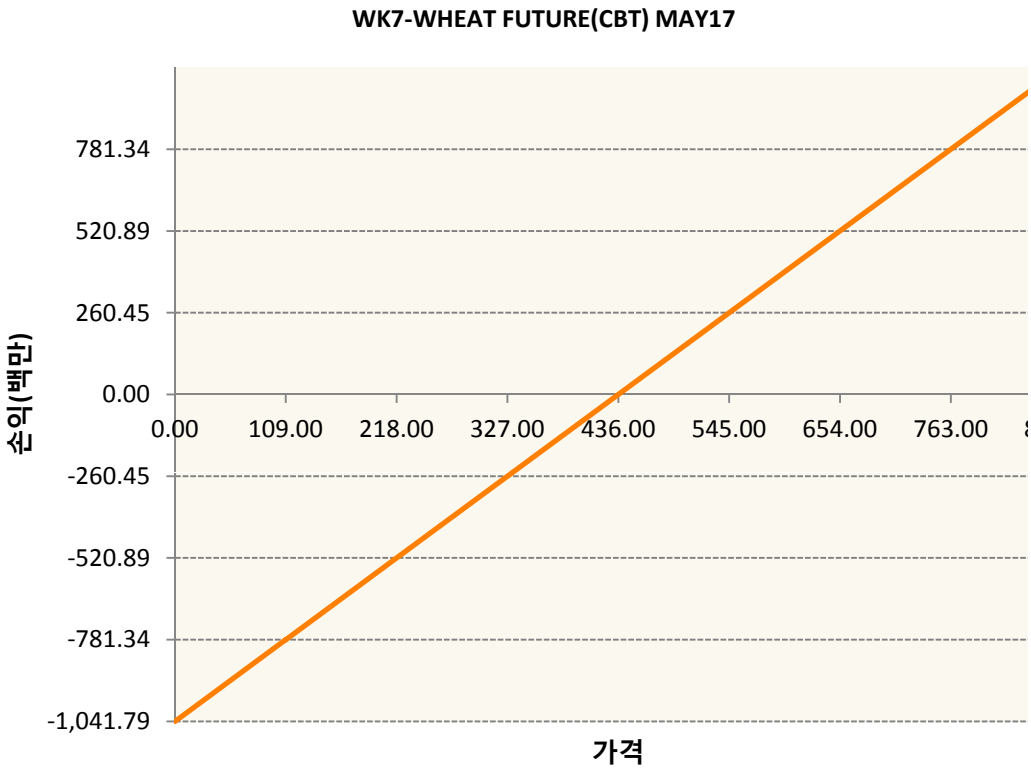

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
230.39
153.59
76.80
0.00
-76.80
-153.59
-230.39
-307.19
0.00
112.50
225.00
337.50
450.00
562.50
675.00
787.50
순이(백만)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
930.45
697.84
465.23
232.61
0.00
-232.61
-465.23
-697.84
-930.45
0.00
4.56
9.13
13.69
18.25
22.81
27.38
31.94
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,367.46
911.64
455.82
0.00
-455.82
-911.64
-1,367.46
-1,823.27
0.00
250.38
500.75
751.13
1,001.50
1,251.88
1,502.25
1,752.63
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
936.64
702.48





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	62
CK7	CORN FUTURE MAY17	183
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	25
SBK7	Sugar #11 (WORLD) MAY17	74
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	146
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	75
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	83

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

848