공시일	2017-03-21
기준일	2017-03-20

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	2017-03-21
기준일	2017-03-20

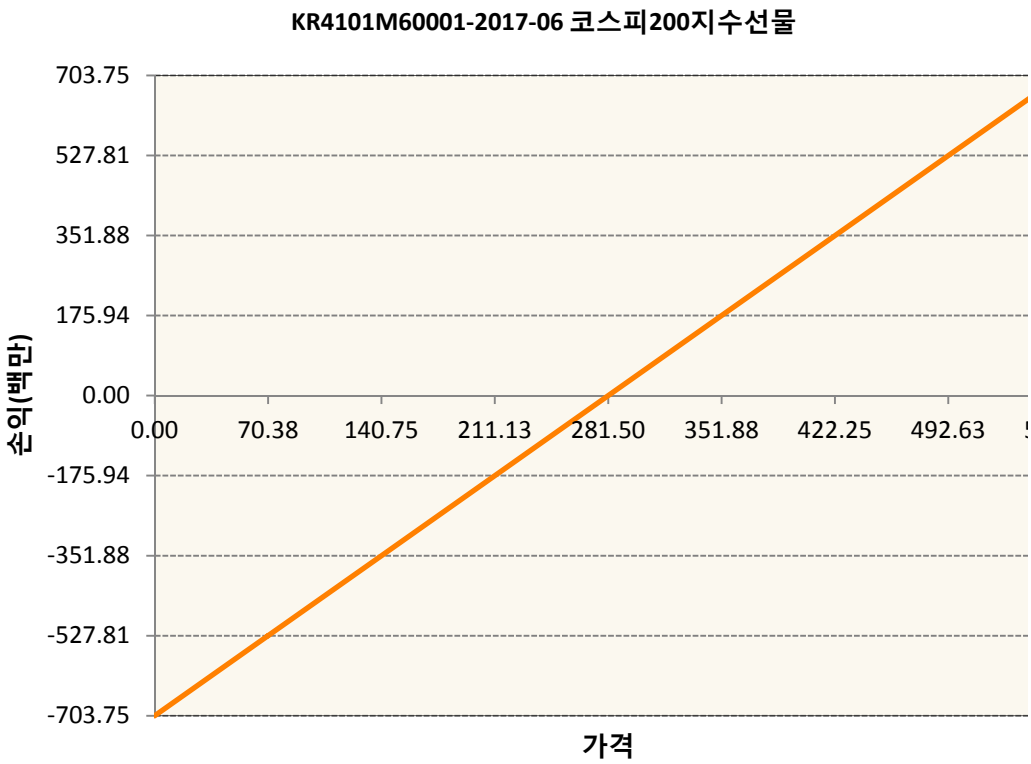
스마트인덱스모

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%	-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	2017-03-21
기준일	2017-03-20

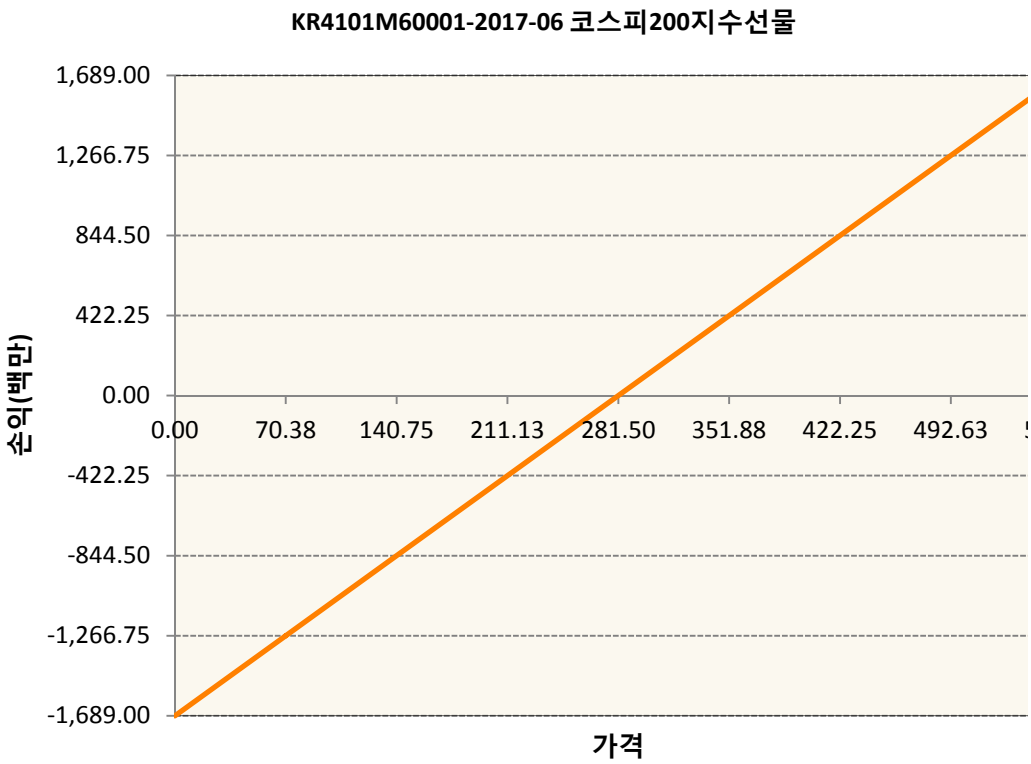
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,689	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)

87

공시일	2017-03-21
기준일	2017-03-20

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	962

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

584

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-21
기준일	2017-03-20

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)

445

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-21
기준일	2017-03-20

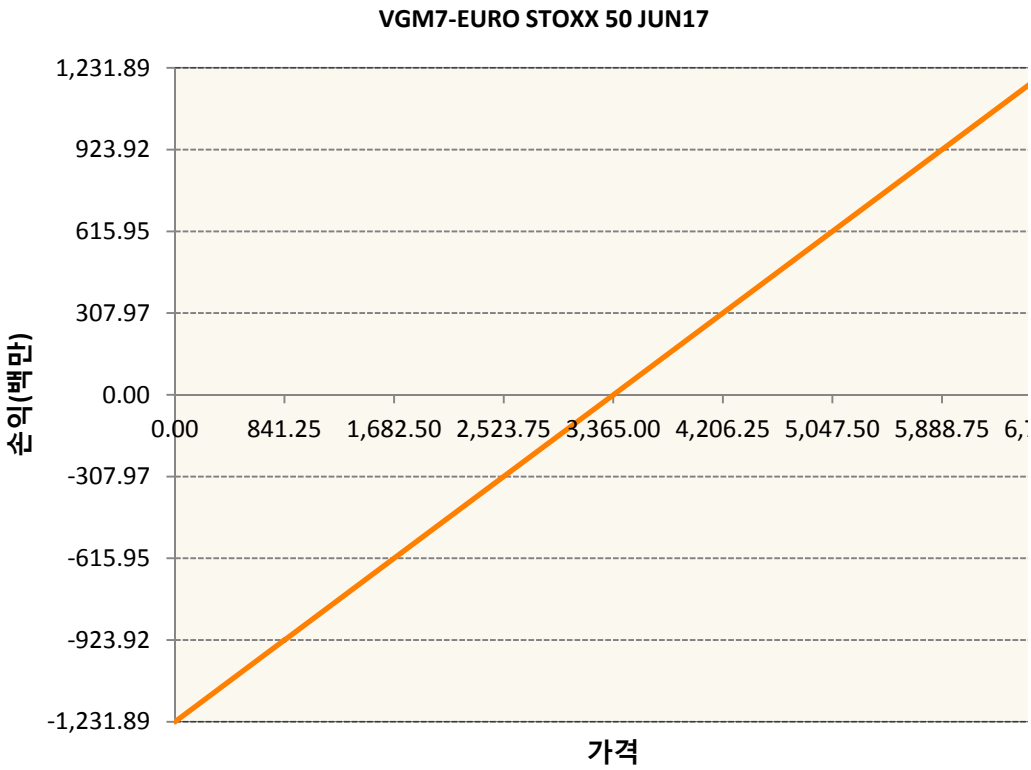
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,232	0	1,232	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM7	EURO STOXX 50 JUN17	99

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

(단위:백만원)

100

공시일	2017-03-21
기준일	2017-03-20

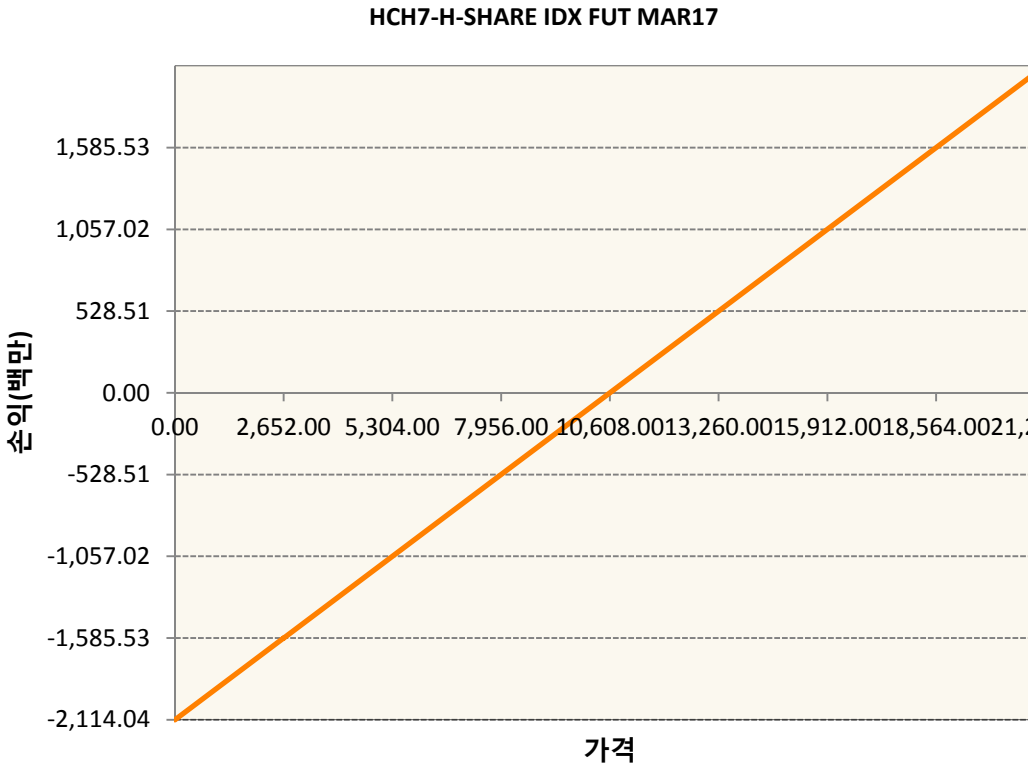
차이나인덱스모(주식-파생형)

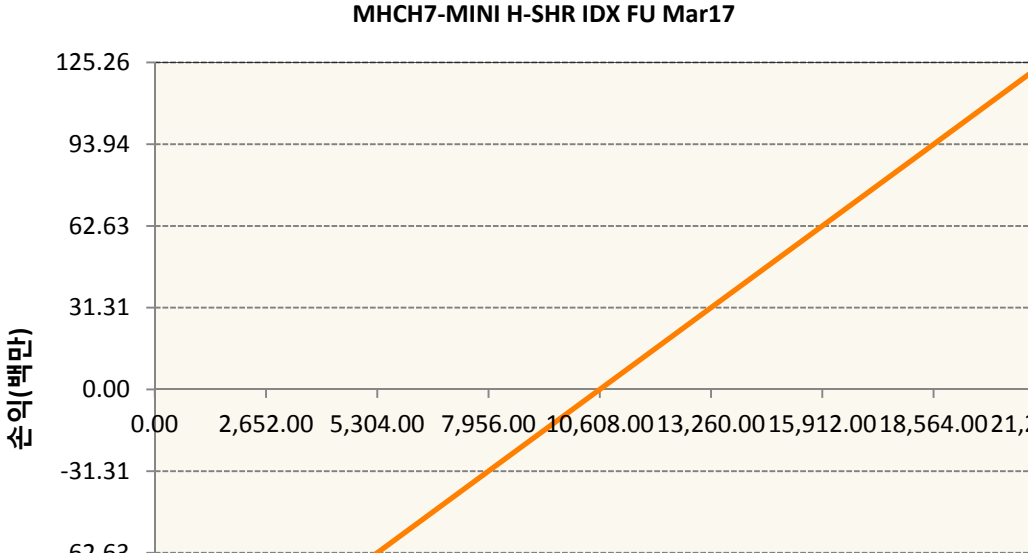
1. 계약금액

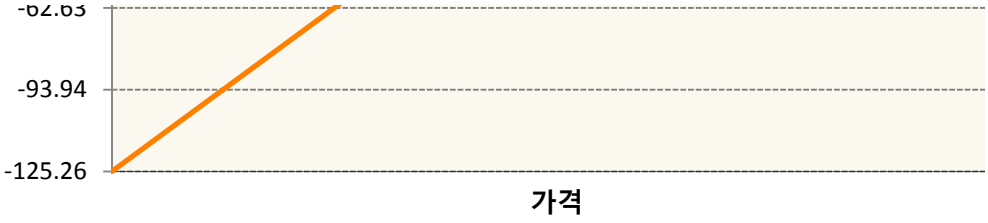
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,239	0	2,239	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH7	H-SHARE IDX FUT MAR17	169
MHCH7	MINI H-SHR IDX FU Mar17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	196

공시일	2017-03-21
기준일	2017-03-20

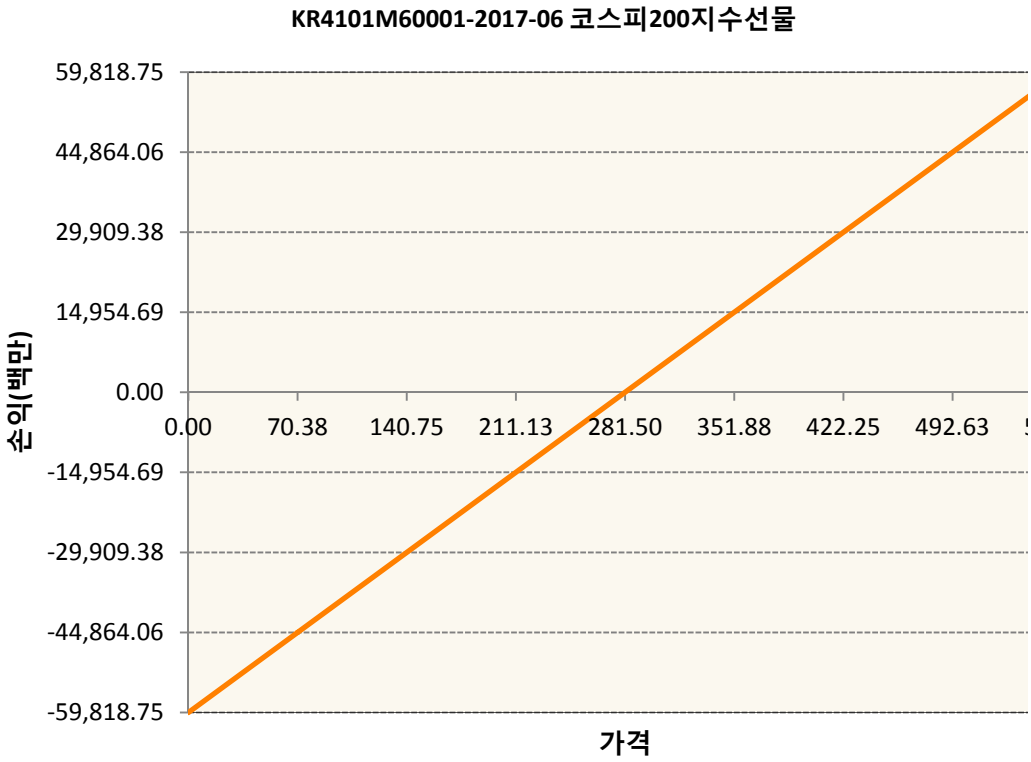
커버드콜모(주식혼합-파생형)

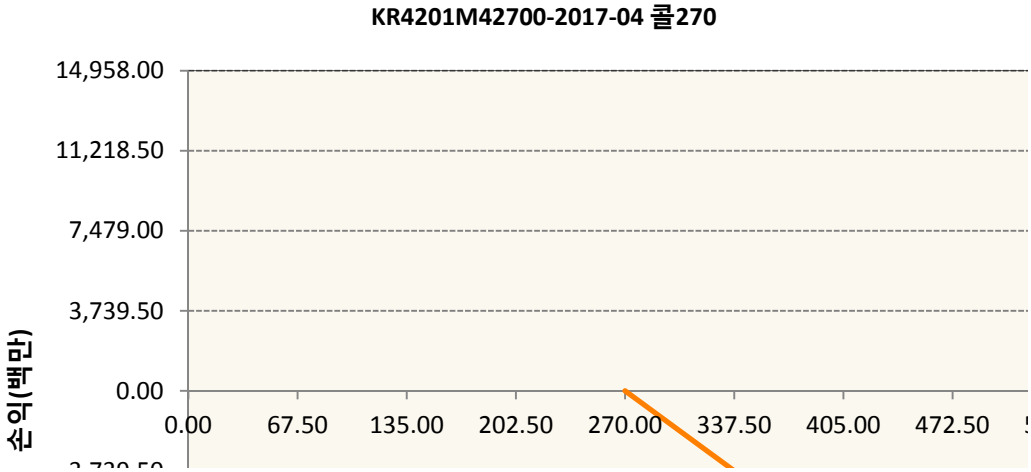
1. 계약금액

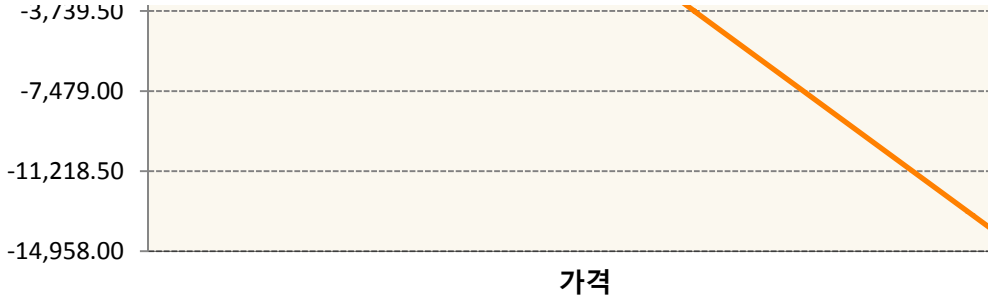
(단위:백만원)

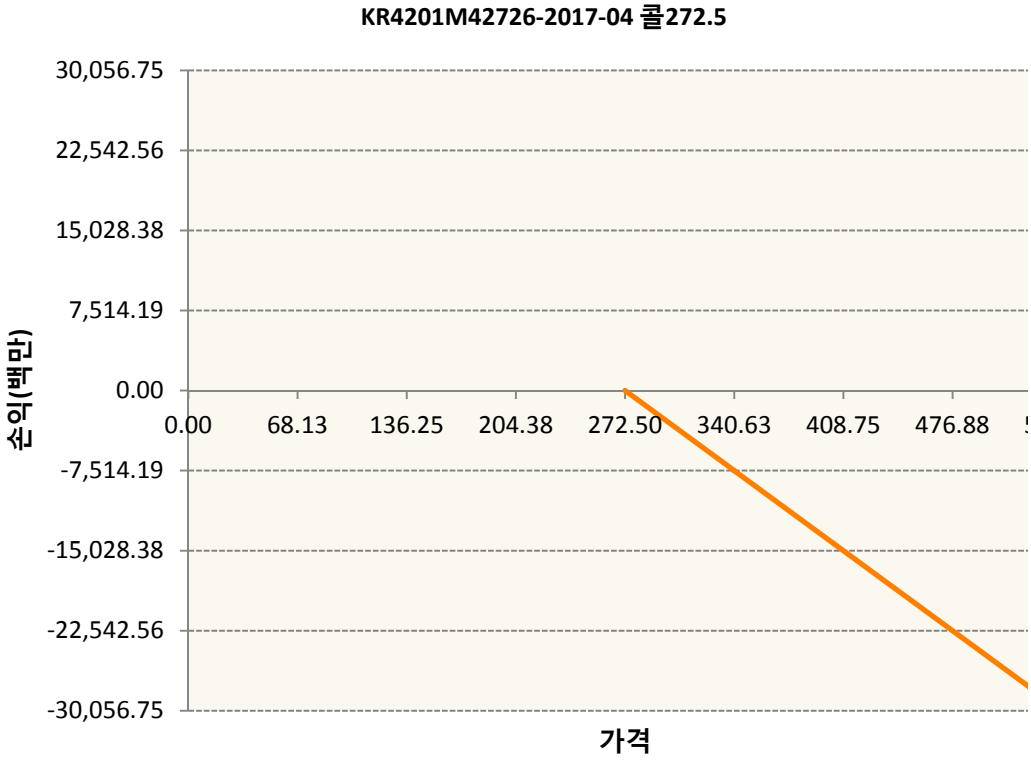
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	59,819	0	59,819	장내
누계	유가증권	옵션	0	45,015	-45,015	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							4,773
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,773	-4,773	-4,773	-4,773	-4,773	-4,773	-4,773
-5.33%	-3,182	-3,182	-3,182	-3,182	-3,182	-3,182	-3,182
-2.67%	-1,591	-1,591	-1,591	-1,591	-1,591	-1,591	-1,591
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,591	1,591	1,591	1,591	1,591	1,591	1,591
5.33%	3,182	3,182	3,182	3,182	3,182	3,182	3,182
8.00%	4,773	4,773	4,773	4,773	4,773	4,773	4,773
KR4201M42 2017-04 콜270							6,126
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,041	3,031	3,016	2,997	2,974	2,946	2,916
-5.33%	2,838	2,782	2,724	2,664	2,603	2,540	2,476
-2.67%	1,864	1,801	1,737	1,671	1,605	1,538	1,470
0%	66	49	27	0	-31	-67	-106
2.67%	-1,983	-1,984	-1,987	-1,991	-1,998	-2,008	-2,020
5.33%	-4,054	-4,054	-4,054	-4,054	-4,055	-4,056	-4,059
8.00%	-6,125	-6,125	-6,125	-6,125	-6,125	-6,125	-6,126
KR4201M42: 2017-04 콜272.5							12,031

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,859	4,850	4,836	4,815	4,787	4,752	4,709
-5.33%	4,673	4,596	4,510	4,416	4,316	4,212	4,102
-2.67%	3,363	3,220	3,077	2,934	2,791	2,647	2,504
0%	217	154	82	0	-89	-185	-286
2.67%	-3,785	-3,792	-3,805	-3,824	-3,849	-3,883	-3,923
5.33%	-7,904	-7,905	-7,905	-7,907	-7,911	-7,917	-7,927
8.00%	-12,029	-12,029	-12,029	-12,029	-12,029	-12,030	-12,031

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

24,046

공시일	2017-03-21
기준일	2017-03-20

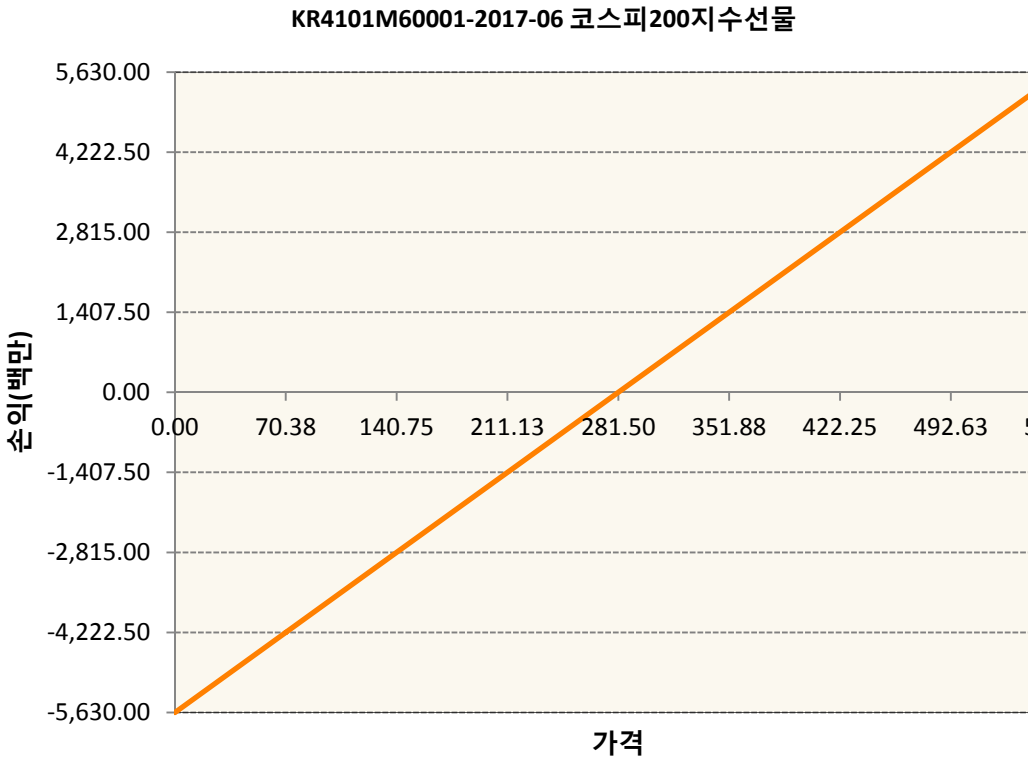
커버드콜목표전환형증권투자신탁

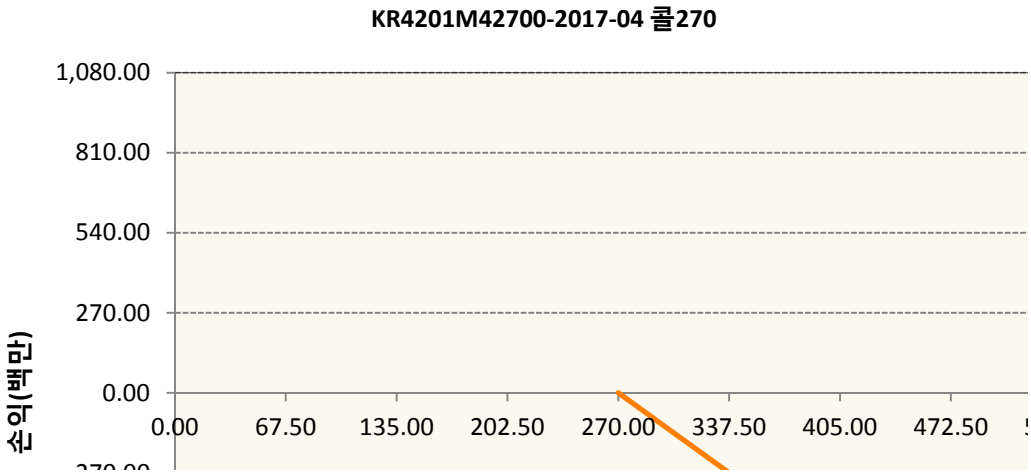
1. 계약금액

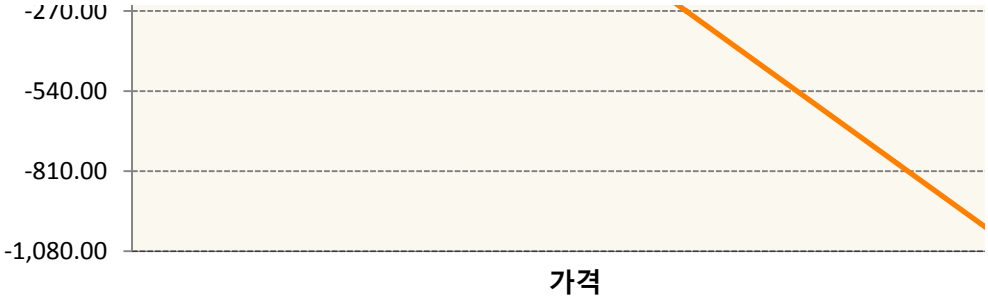
(단위:백만원)

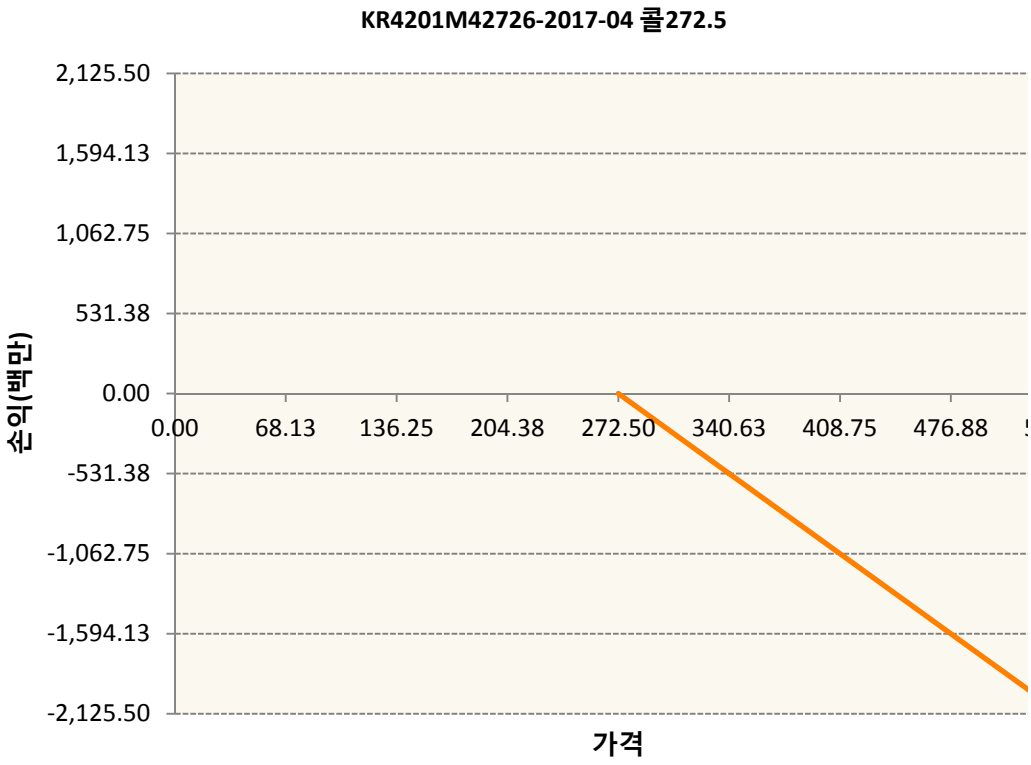
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,630	0	5,630	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,206	-3,206	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							449
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-449	-449	-449	-449	-449	-449	-449
-5.33%	-299	-299	-299	-299	-299	-299	-299
-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%	299	299	299	299	299	299	299
8.00%	449	449	449	449	449	449	449
KR4201M42 2017-04 콜270							442
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	220	219	218	216	215	213	211
-5.33%	205	201	197	192	188	183	179
-2.67%	135	130	125	121	116	111	106
0%	5	4	2	0	-2	-5	-8
2.67%	-143	-143	-143	-144	-144	-145	-146
5.33%	-293	-293	-293	-293	-293	-293	-293
8.00%	-442	-442	-442	-442	-442	-442	-442
KR4201M42 2017-04 콜272.5							851

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	344	343	342	341	339	336	333
-5.33%	330	325	319	312	305	298	290
-2.67%	238	228	218	207	197	187	177
0%	15	11	6	0	-6	-13	-20
2.67%	-268	-268	-269	-270	-272	-275	-277
5.33%	-559	-559	-559	-559	-559	-560	-561
8.00%	-851	-851	-851	-851	-851	-851	-851

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

1,783

공시일	2017-03-21
기준일	2017-03-20

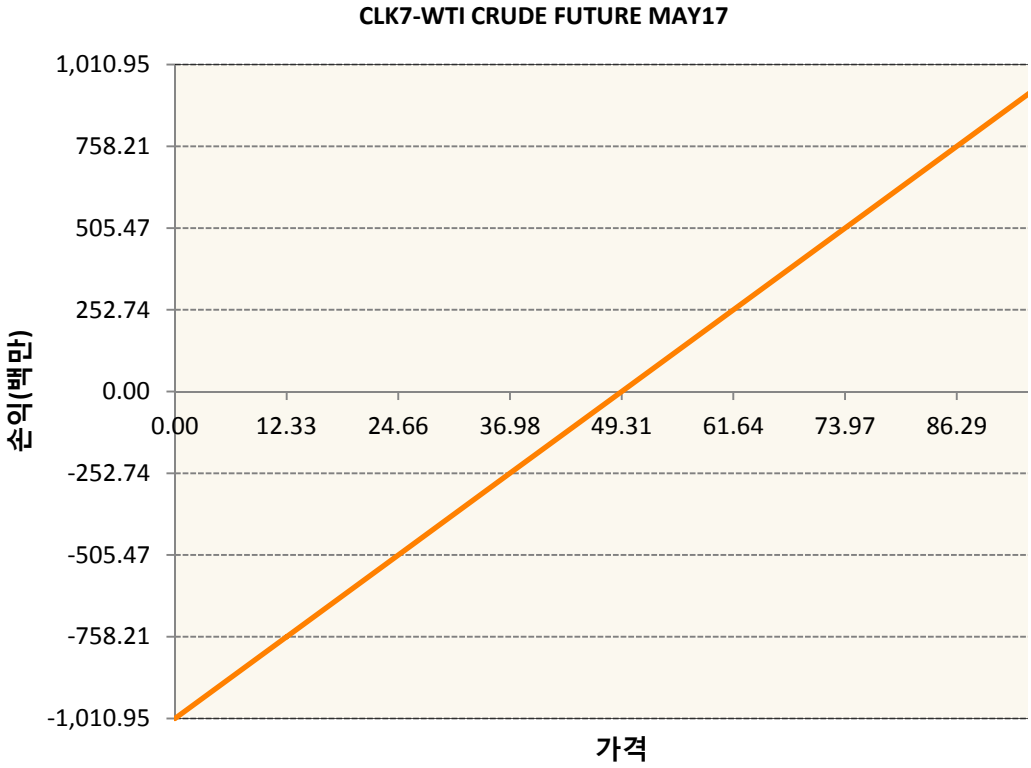
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

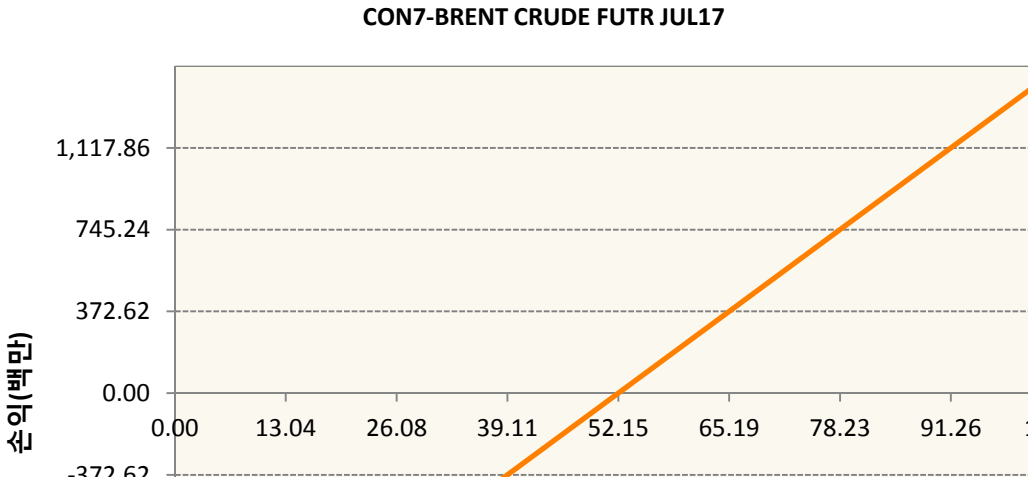
1. 계약금액

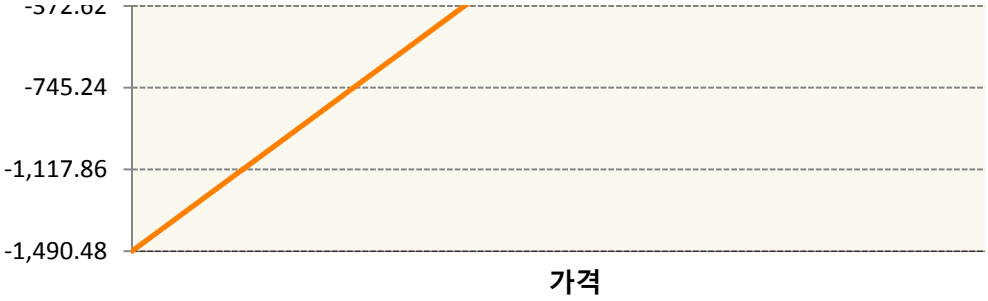
(단위:백만원)

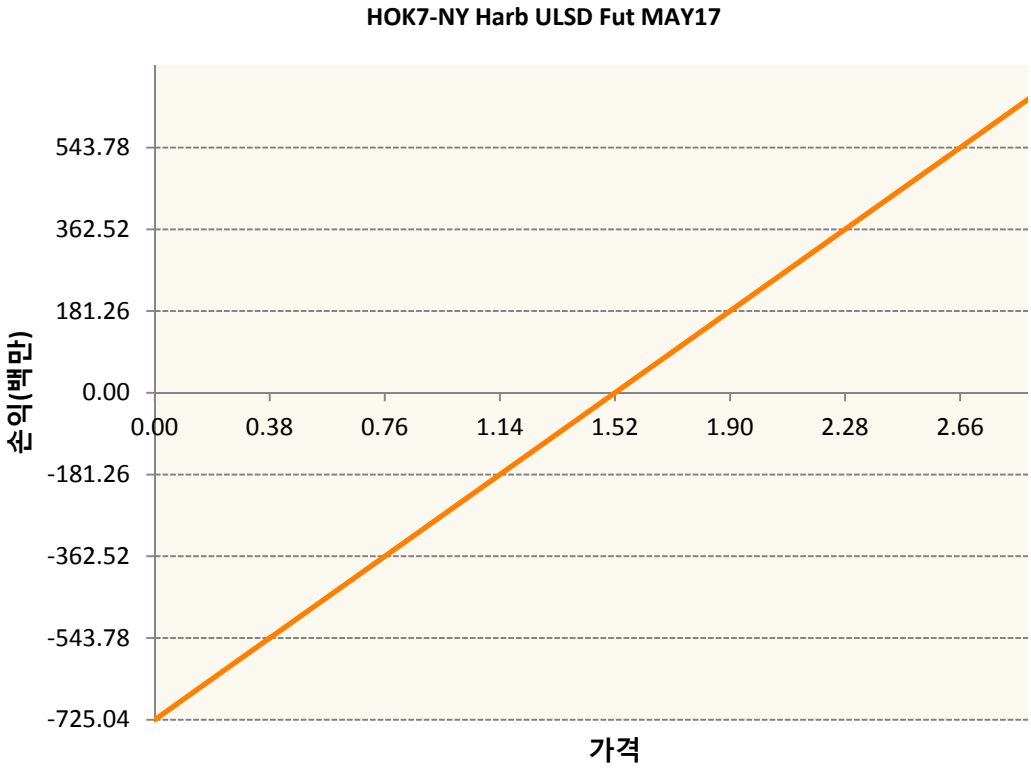
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,011	0	1,011	
누계	유가증권	선물	4,381	403	3,978	

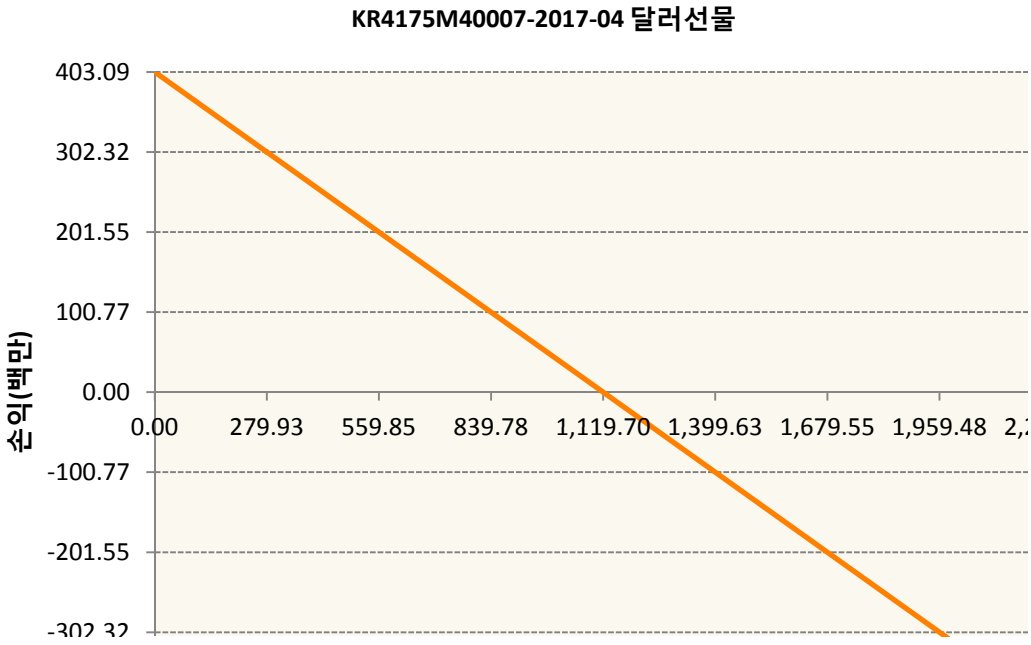
2. 만기시점의 손익구조

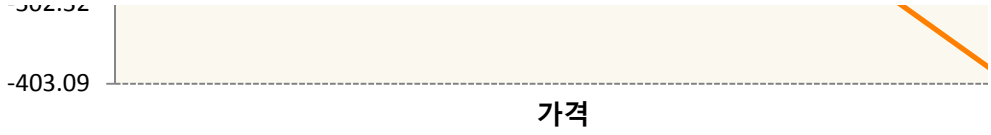


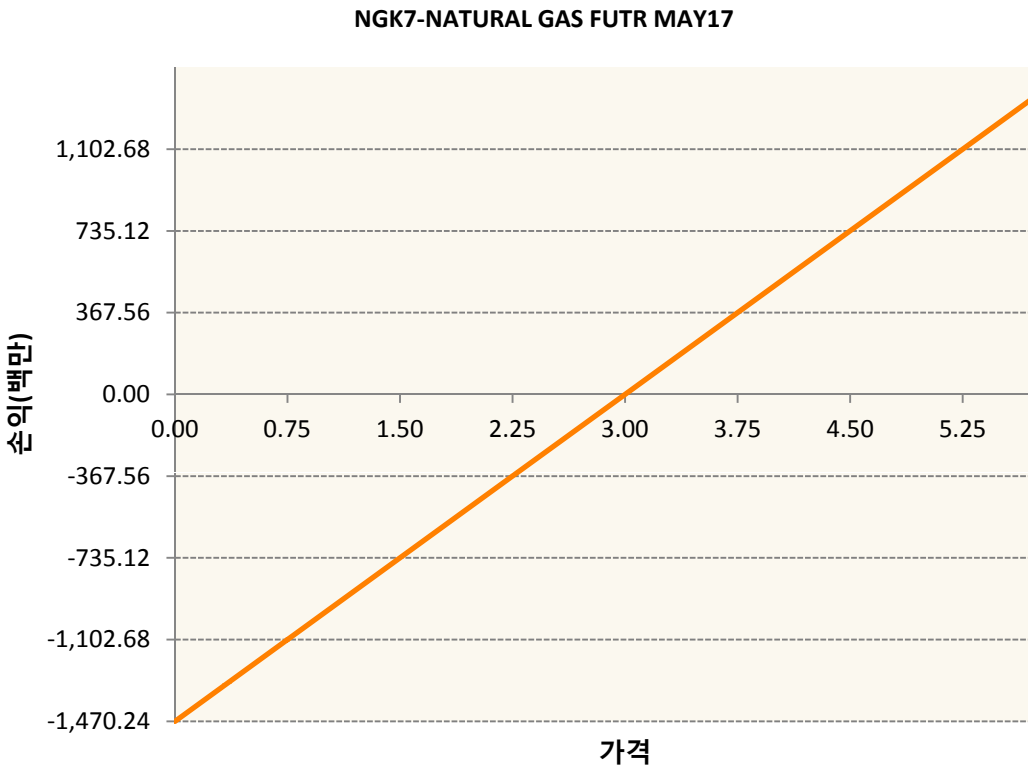


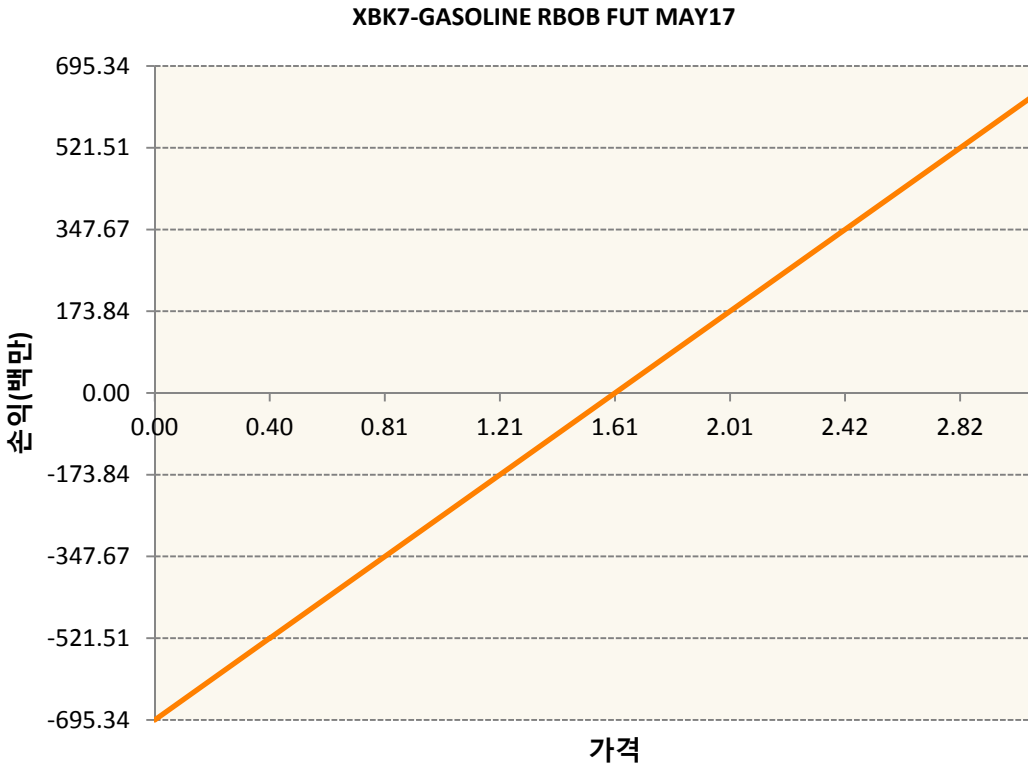

-745.24
-1,117.86
-1,490.48
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
543.78
362.52
181.26
0.00
-181.26
-362.52
-543.78
-725.04
0.00
0.38
0.76
1.14
1.52
1.90
2.28
2.66
순익(백만)
가격


KR4175M40007-2017-04 달러선물
403.09
302.32
201.55
100.77
0.00
-100.77
-201.55
0.00
279.93
559.85
839.78
1,119.70
1,399.63
1,679.55
1,959.48
순익(백만)


-403.09
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,102.68
735.12
367.56
0.00
-367.56
-735.12
-1,102.68
-1,470.24
0.00
0.75
1.50
2.25
3.00
3.75
4.50
5.25
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
695.34
521.51
347.67
173.84
0.00
-173.84
-347.67
-521.51
-695.34
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	32
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	118
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	56

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

958

공시일	2017-03-21
기준일	2017-03-20

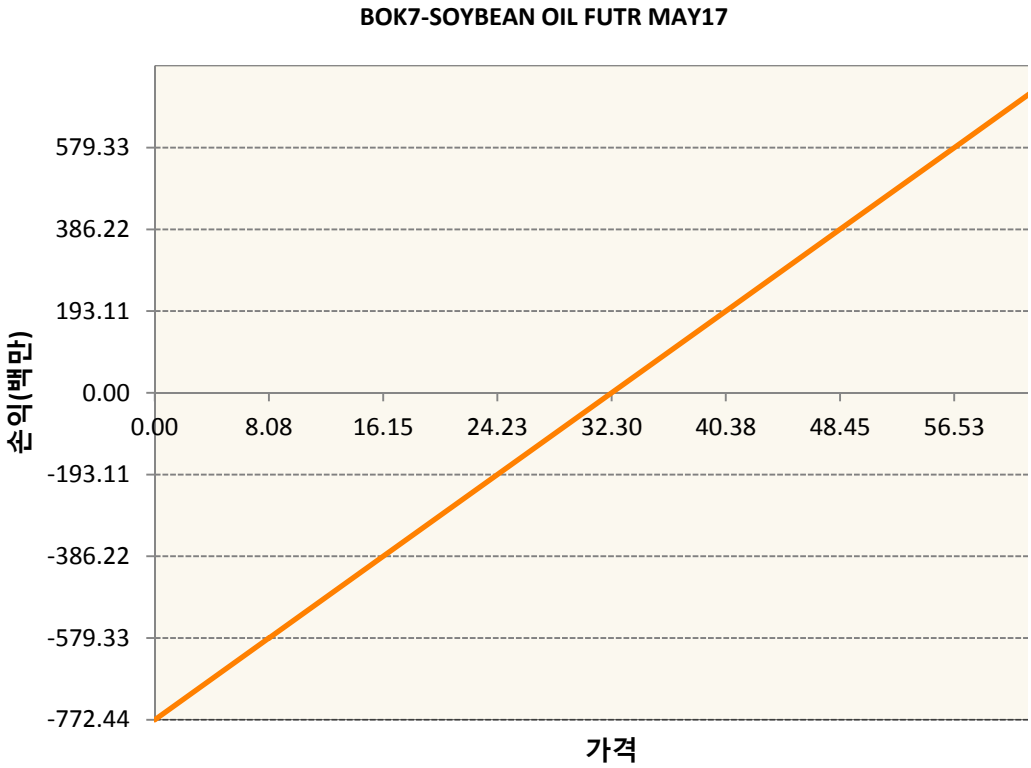
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

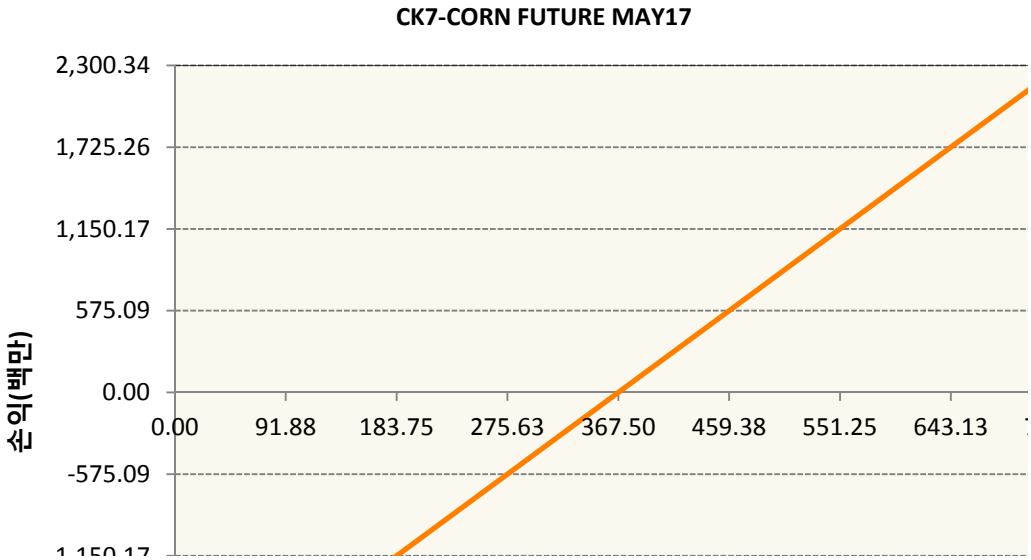
1. 계약금액

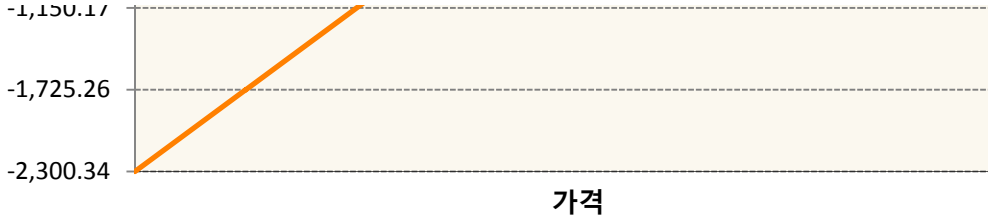
(단위:백만원)

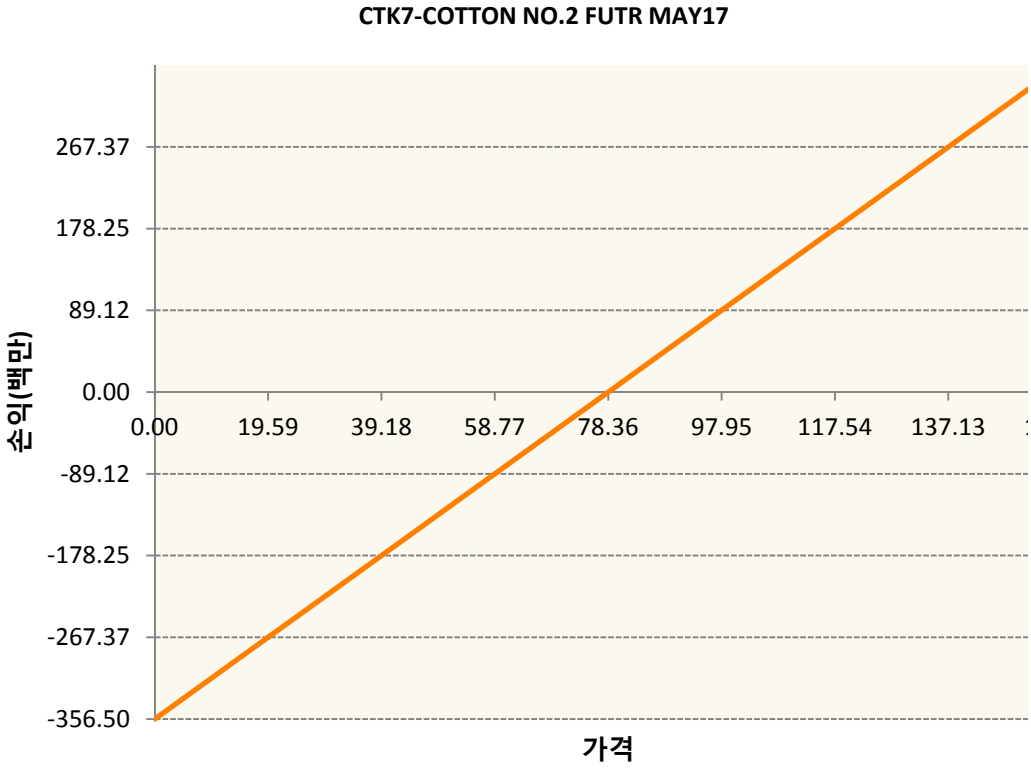
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,134	560	8,574	

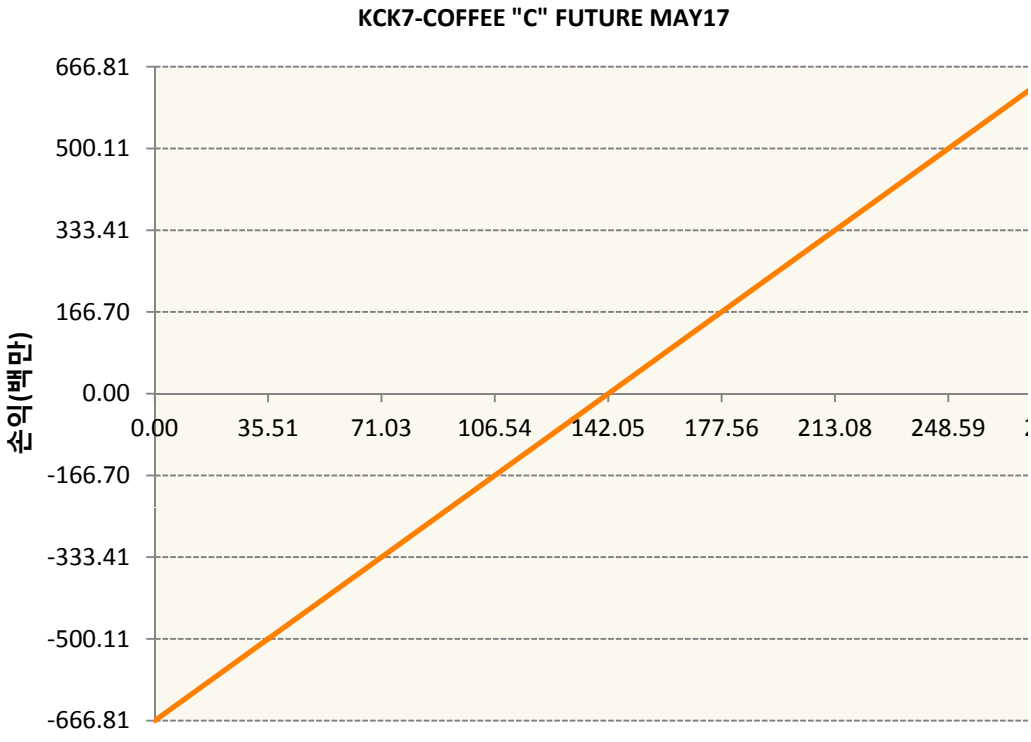
2. 만기시점의 손익구조



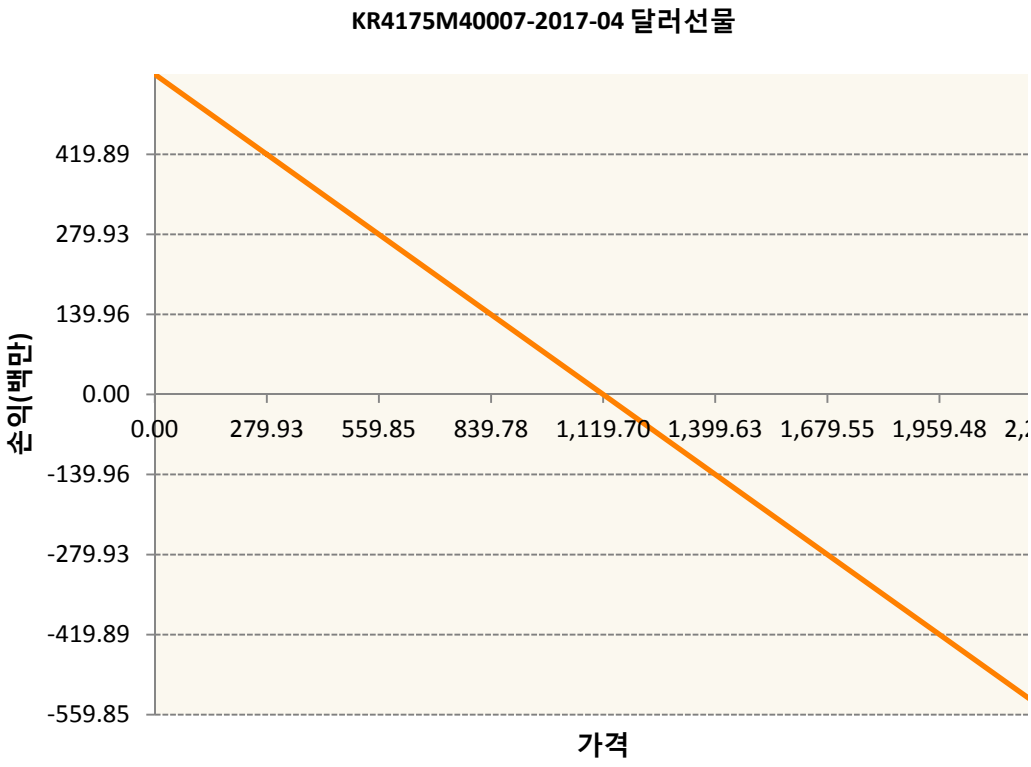


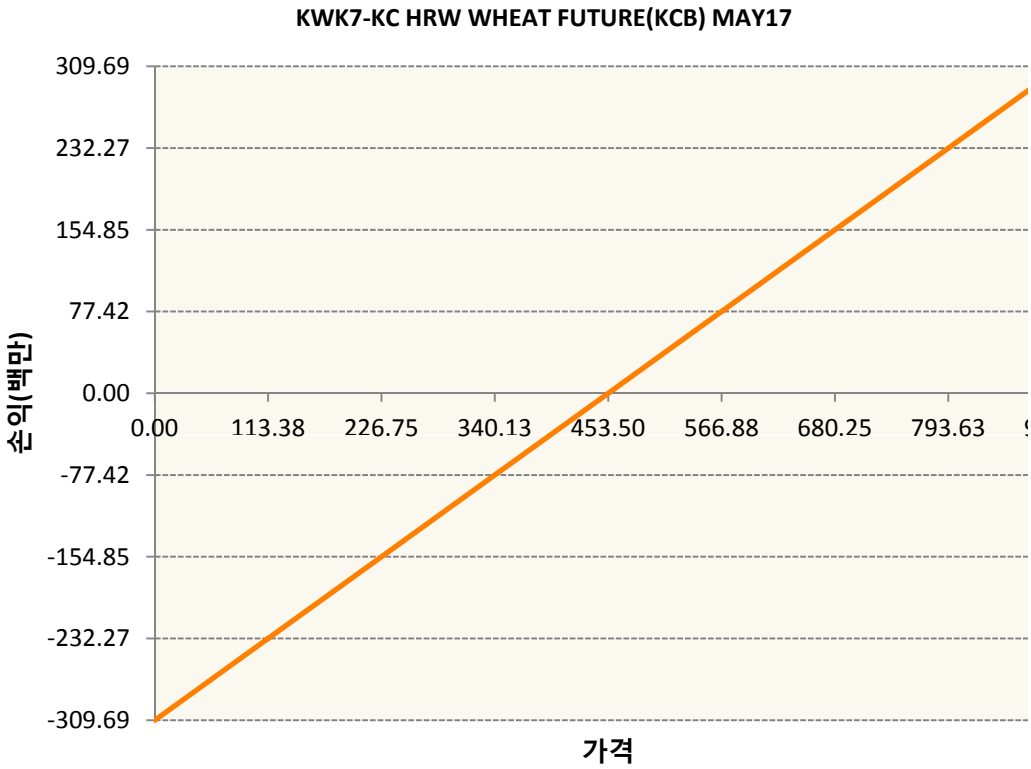

-1,725.26
-2,300.34
가격

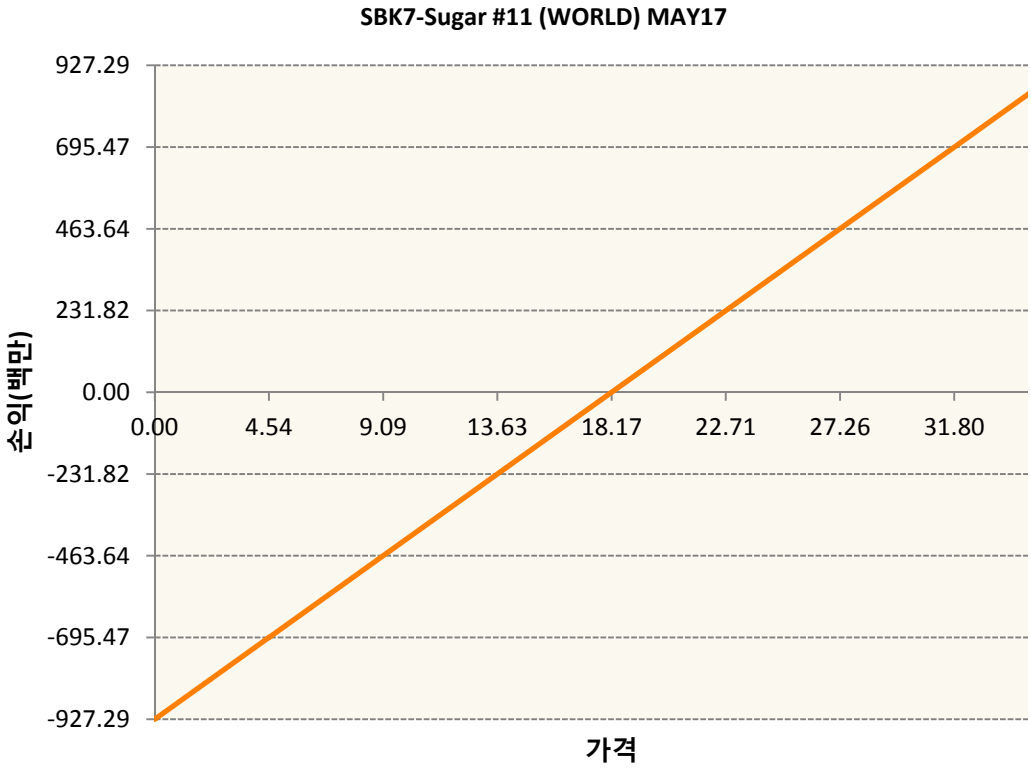

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
267.37
178.25
89.12
0.00
-89.12
-178.25
-267.37
-356.50
0.00
19.59
39.18
58.77
78.36
97.95
117.54
137.13
순익(백만)
가격

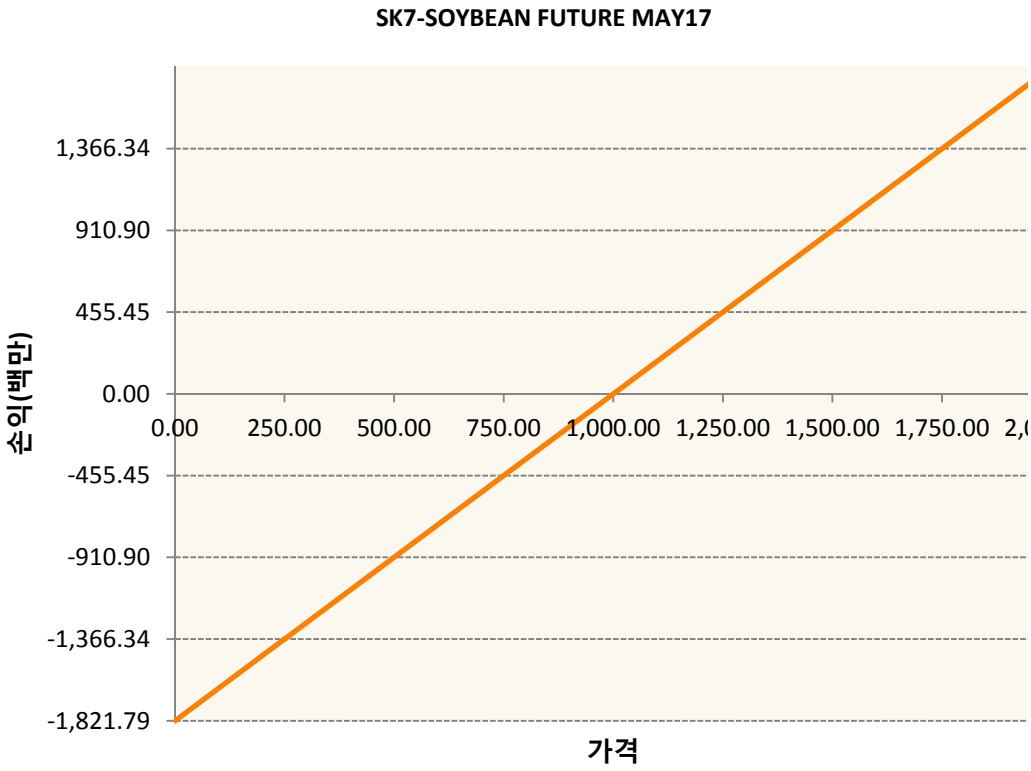

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
666.81
500.11
333.41
166.70
0.00
-166.70
-333.41
-500.11
-666.81
0.00
35.51
71.03
106.54
142.05
177.56
213.08
248.59
순익(백만)

가격

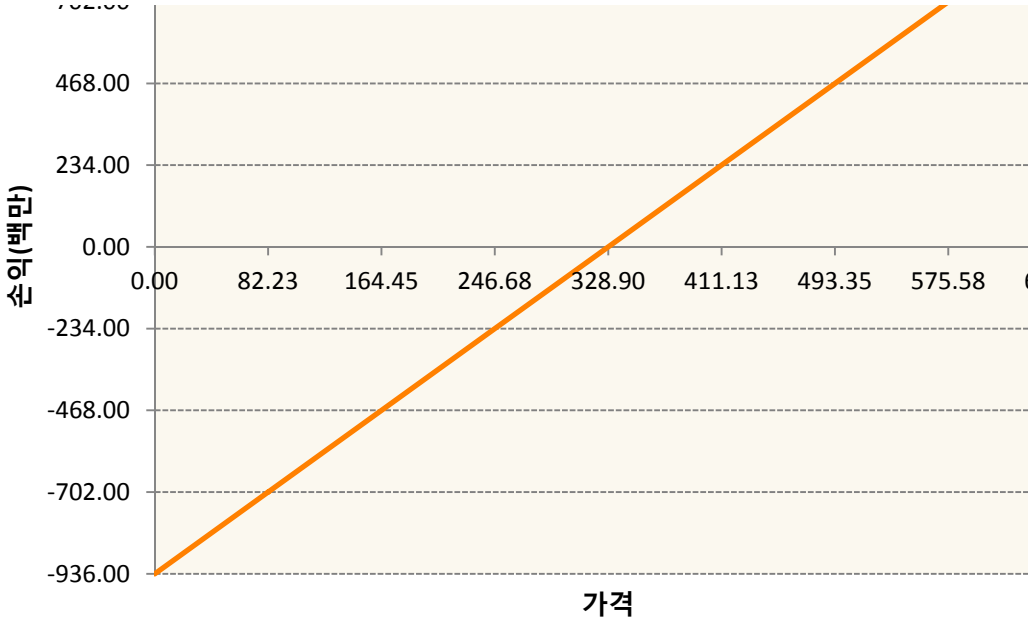

KR4175M40007-2017-04 달러선물
419.89
279.93
139.96
0.00
-139.96
-279.93
-419.89
-559.85
0.00
279.93
559.85
839.78
1,119.70
1,399.63
1,679.55
1,959.48
손익(백만)
가격

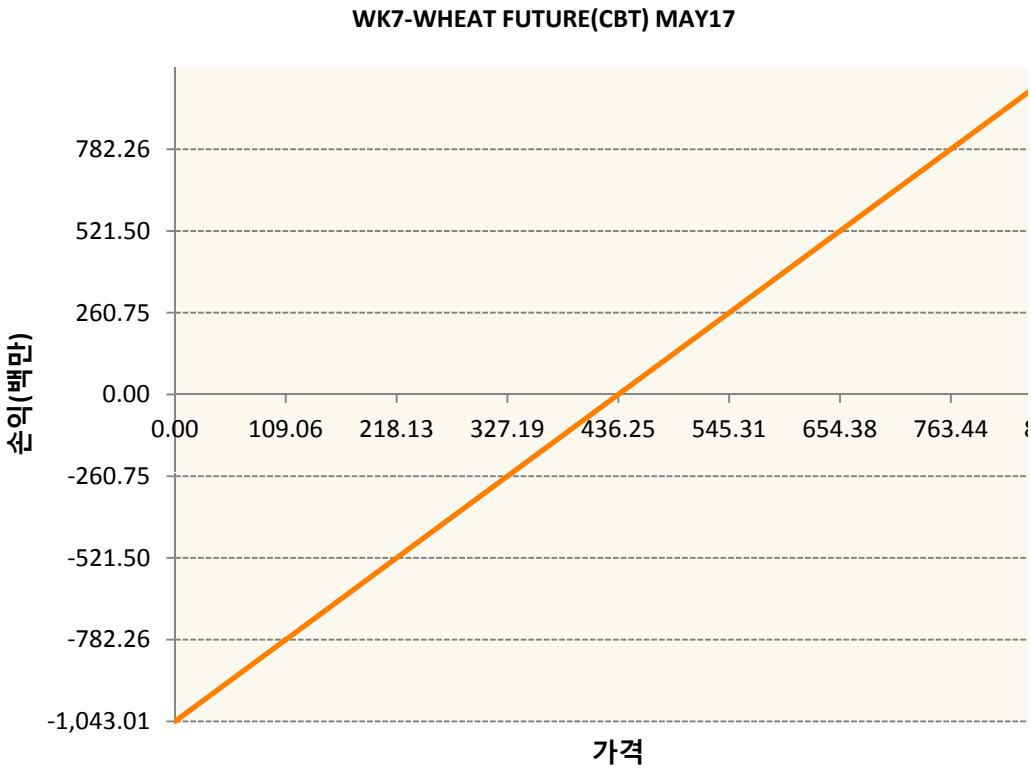

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
309.69
232.27
154.85
77.42
0.00
-77.42
-154.85
-232.27
-309.69
0.00
113.38
226.75
340.13
453.50
566.88
680.25
793.63
손익(백만)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
927.29
695.47
463.64
231.82
0.00
-231.82
-463.64
-695.47
-927.29
0.00
4.54
9.09
13.63
18.17
22.71
27.26
31.80
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,366.34
910.90
455.45
0.00
-455.45
-910.90
-1,366.34
-1,821.79
0.00
250.00
500.00
750.00
1,000.00
1,250.00
1,500.00
1,750.00
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
936.00
702.00





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	62
CK7	CORN FUTURE MAY17	184
CTK7	COTTON NO.2 FUTR MAY17	29
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)

846