공시일	2017-03-22
기준일	2017-03-21

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	2017-03-22
기준일	2017-03-21

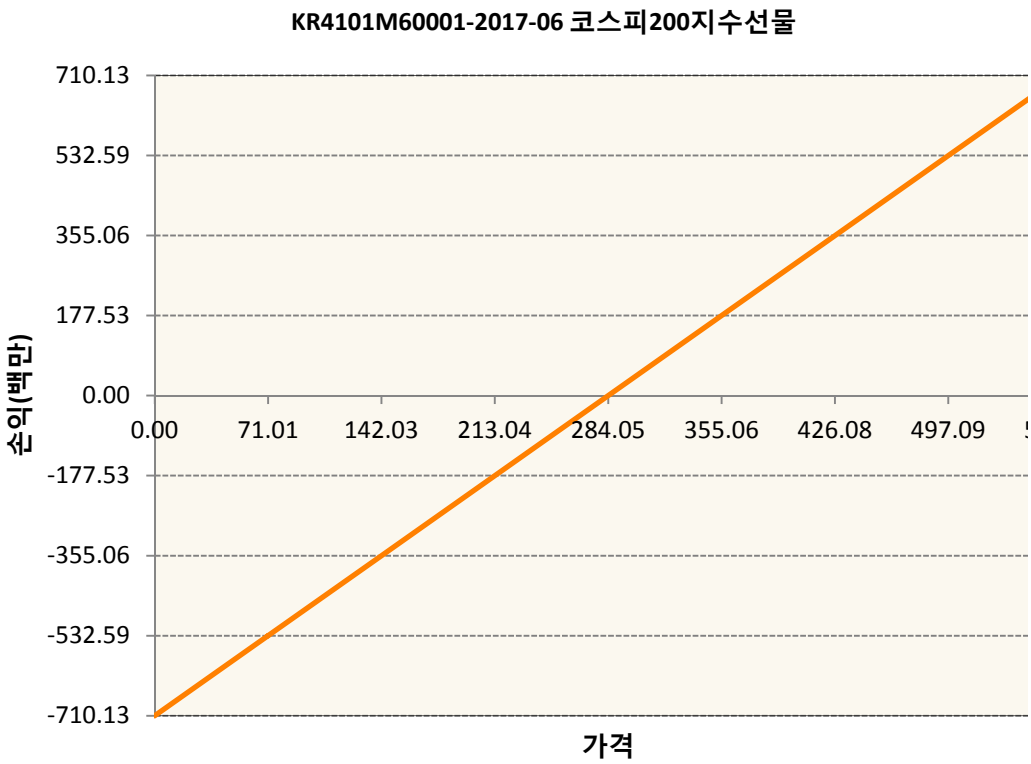
스마트인덱스모

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	710	0	710	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							57
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
-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%	57	57	57	57	57	57	57

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

37

공시일	2017-03-22
기준일	2017-03-21

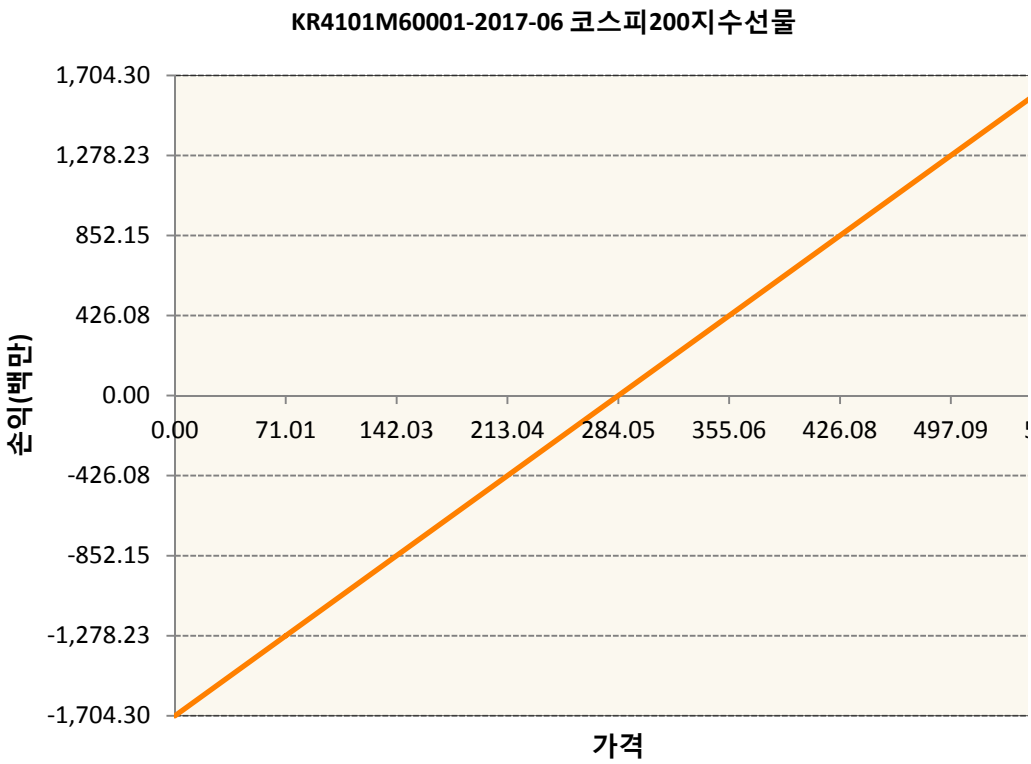
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,704	0	1,704	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							136
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-136	-136	-136	-136	-136	-136	-136
-5.33%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
-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%	91	91	91	91	91	91	91
8.00%	136	136	136	136	136	136	136

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

89

공시일	2017-03-22
기준일	2017-03-21

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	961

* 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	2017-03-22
기준일	2017-03-21

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	395

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

437

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-22
기준일	2017-03-21

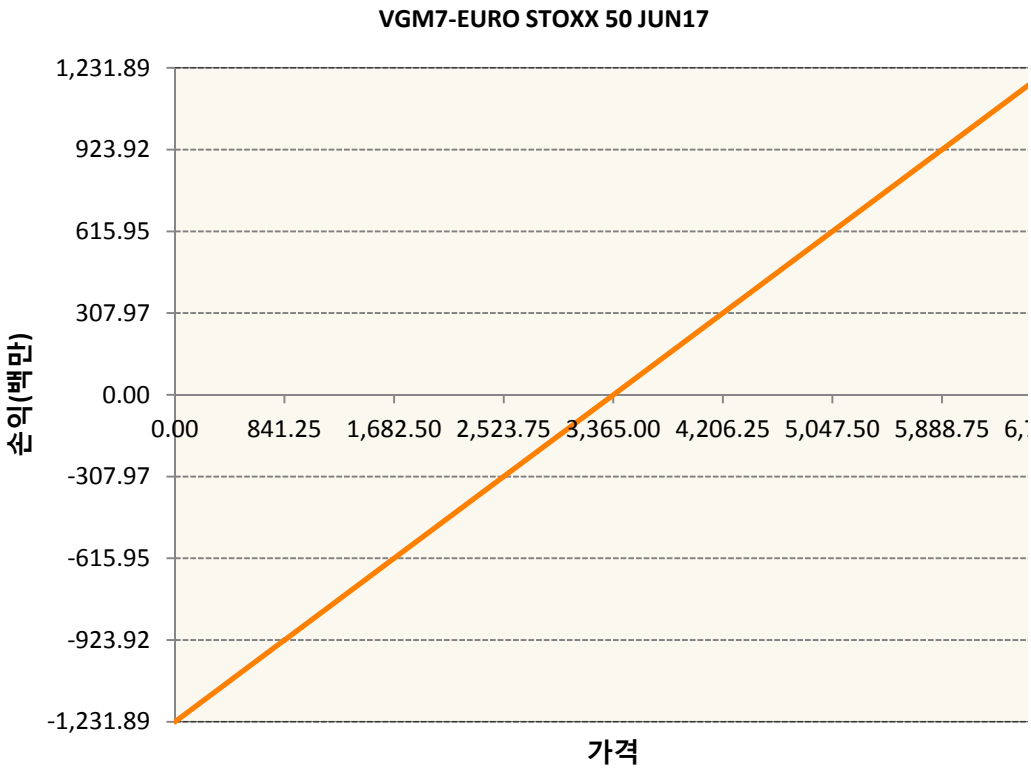
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2017-03-22
기준일	2017-03-21

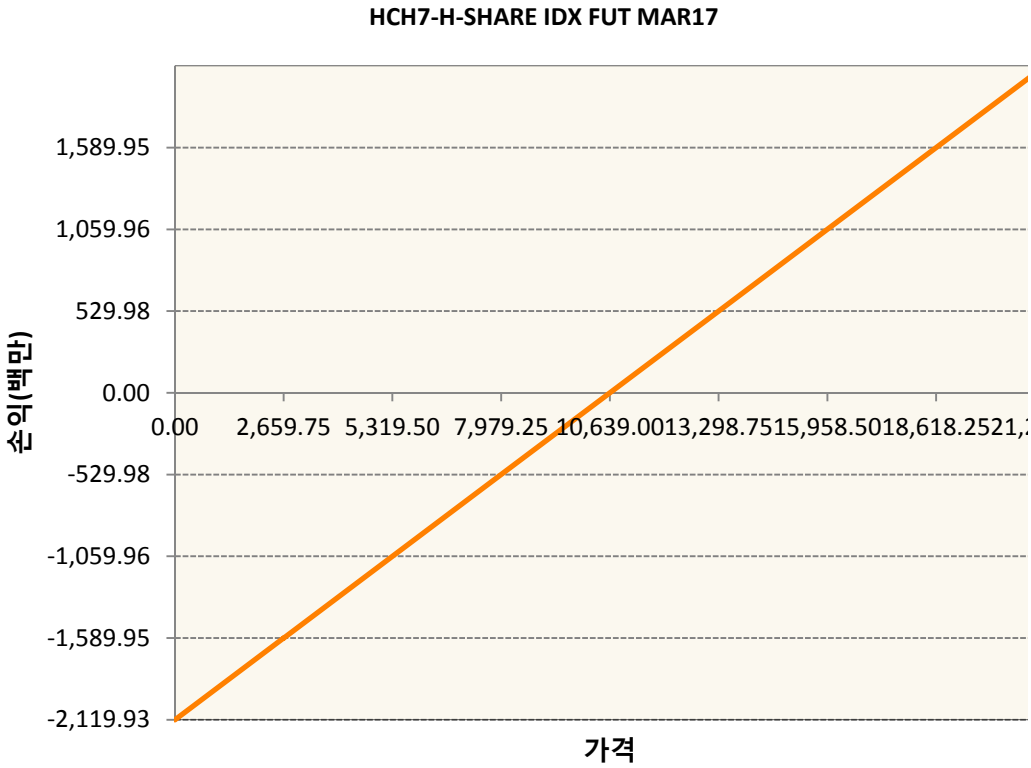
차이나인덱스모(주식-파생형)

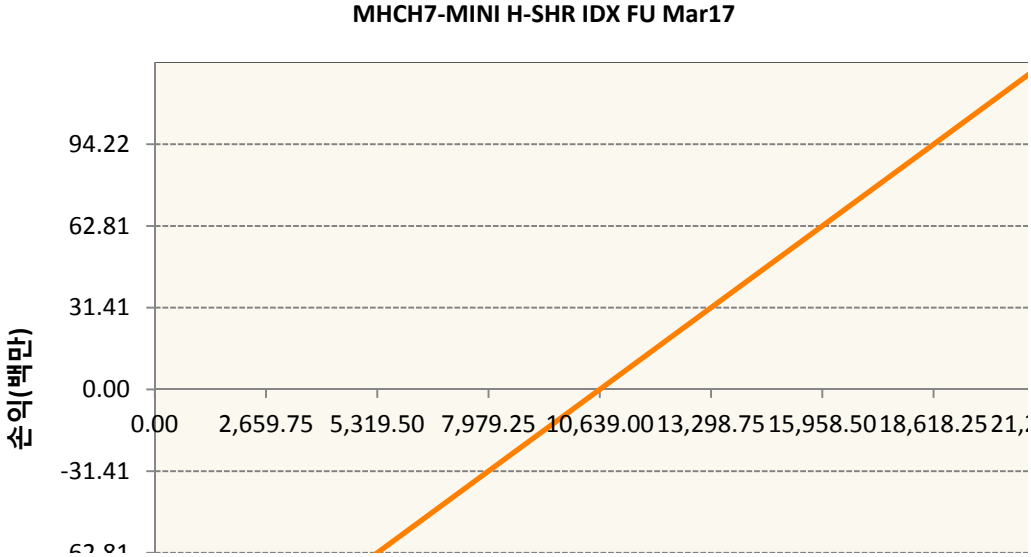
1. 계약금액

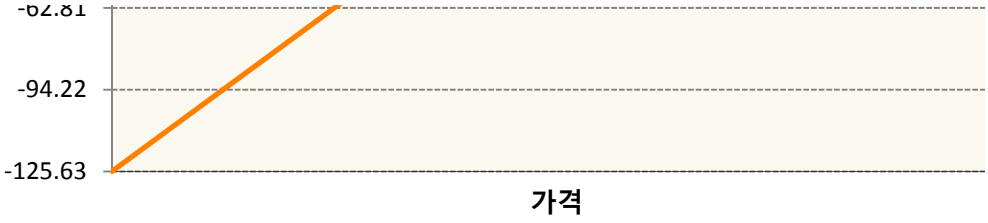
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,246	0	2,246	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH7	H-SHARE IDX FUT MAR17	170
MHCH7	MINI H-SHR IDX FU Mar17	10

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

공시일	2017-03-22
기준일	2017-03-21

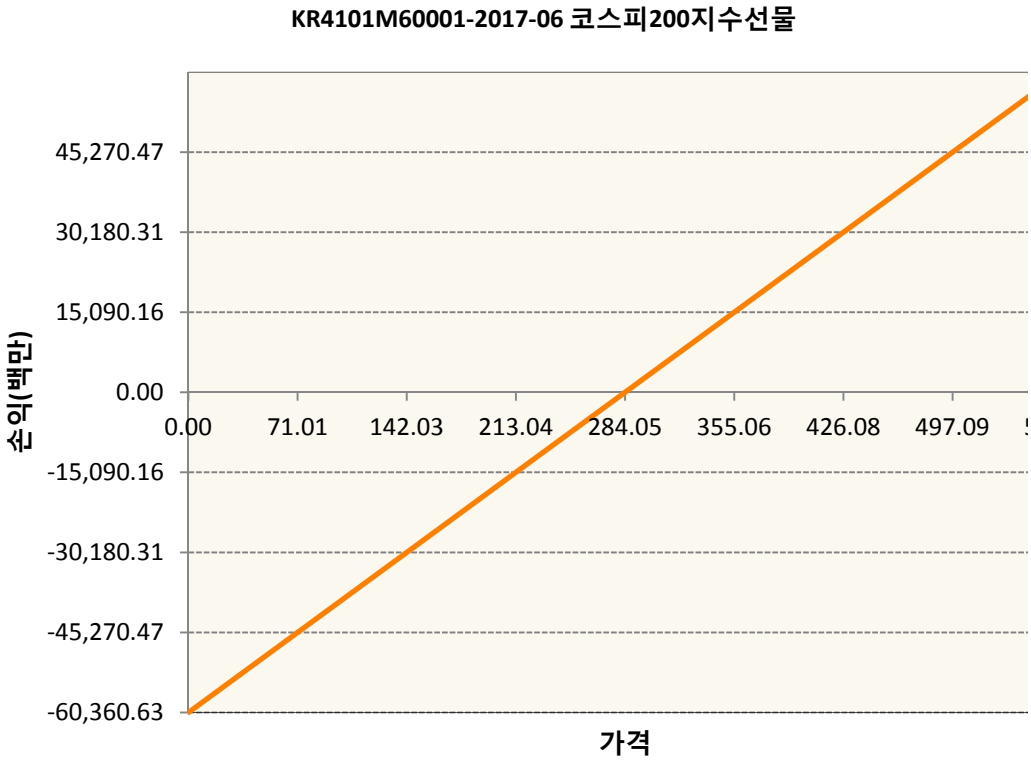
커버드콜모(주식혼합-파생형)

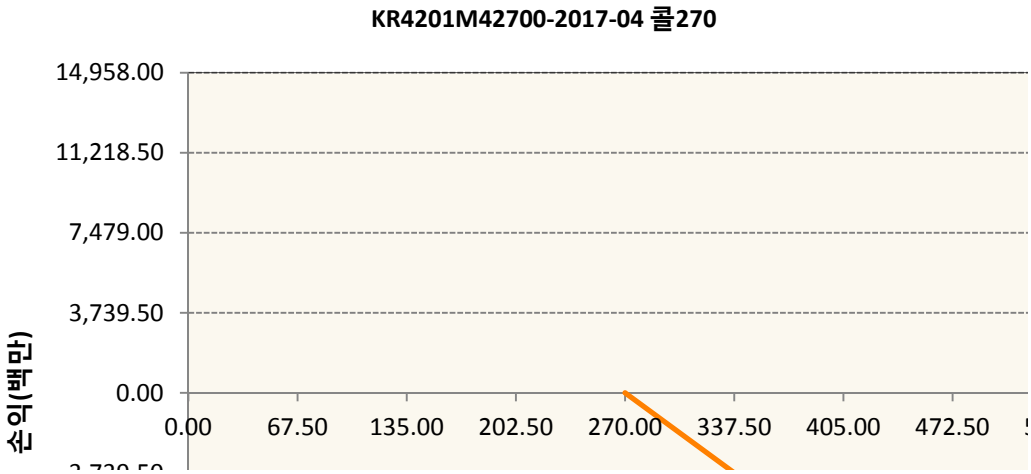
1. 계약금액

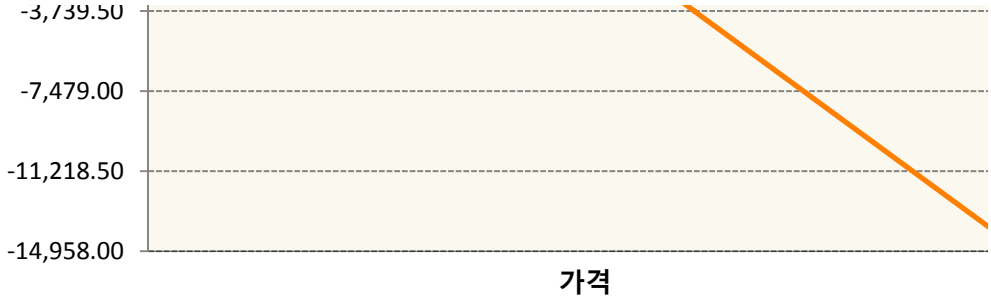
(단위:백만원)

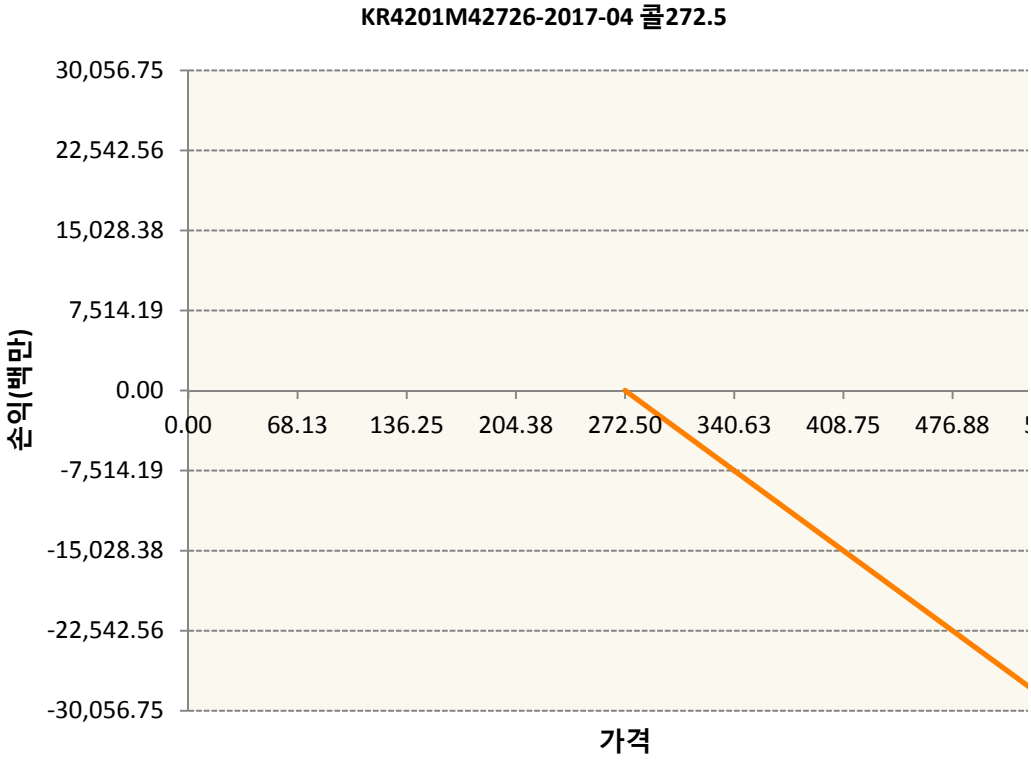
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	60,361	0	60,361	장내
누계	유가증권	옵션	0	45,015	-45,015	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							4,825
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,825	-4,825	-4,825	-4,825	-4,825	-4,825	-4,825
-5.33%	-3,217	-3,217	-3,217	-3,217	-3,217	-3,217	-3,217
-2.67%	-1,608	-1,608	-1,608	-1,608	-1,608	-1,608	-1,608
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,608	1,608	1,608	1,608	1,608	1,608	1,608
5.33%	3,217	3,217	3,217	3,217	3,217	3,217	3,217
8.00%	4,825	4,825	4,825	4,825	4,825	4,825	4,825
KR4201M42 2017-04 콜270							6,233
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,816	3,788	3,754	3,715	3,672	3,625	3,576
-5.33%	3,357	3,283	3,208	3,133	3,059	2,984	2,908
-2.67%	1,999	1,950	1,897	1,840	1,780	1,719	1,655
0%	41	32	18	0	-23	-50	-82
2.67%	-2,044	-2,044	-2,046	-2,049	-2,053	-2,060	-2,069
5.33%	-4,138	-4,138	-4,138	-4,138	-4,139	-4,140	-4,142
8.00%	-6,232	-6,232	-6,232	-6,232	-6,232	-6,233	-6,233
KR4201M42 2017-04 콜272.5							12,311

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,387	6,355	6,314	6,262	6,201	6,132	6,056
-5.33%	5,867	5,740	5,608	5,473	5,336	5,197	5,056
-2.67%	3,779	3,648	3,513	3,375	3,235	3,092	2,949
0%	147	109	60	0	-69	-147	-232
2.67%	-3,971	-3,974	-3,981	-3,993	-4,010	-4,034	-4,065
5.33%	-8,139	-8,139	-8,140	-8,141	-8,143	-8,147	-8,154
8.00%	-12,309	-12,309	-12,309	-12,309	-12,309	-12,310	-12,311

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

23,681

공시일	2017-03-22
기준일	2017-03-21

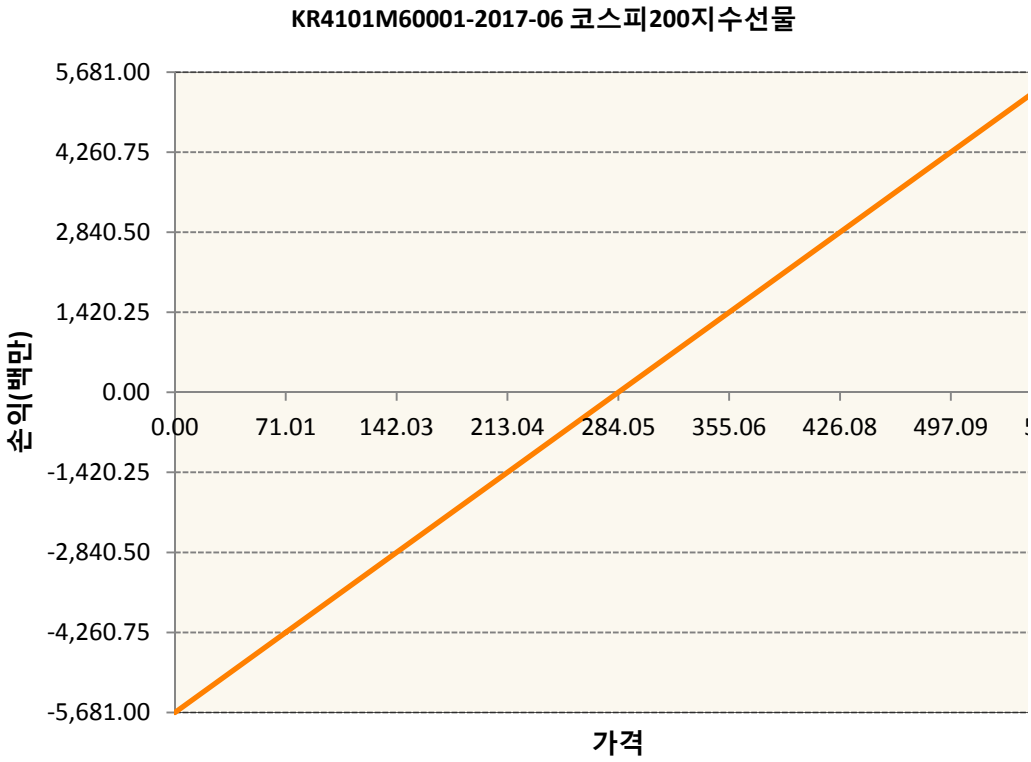
커버드콜목표전환형증권투자신탁

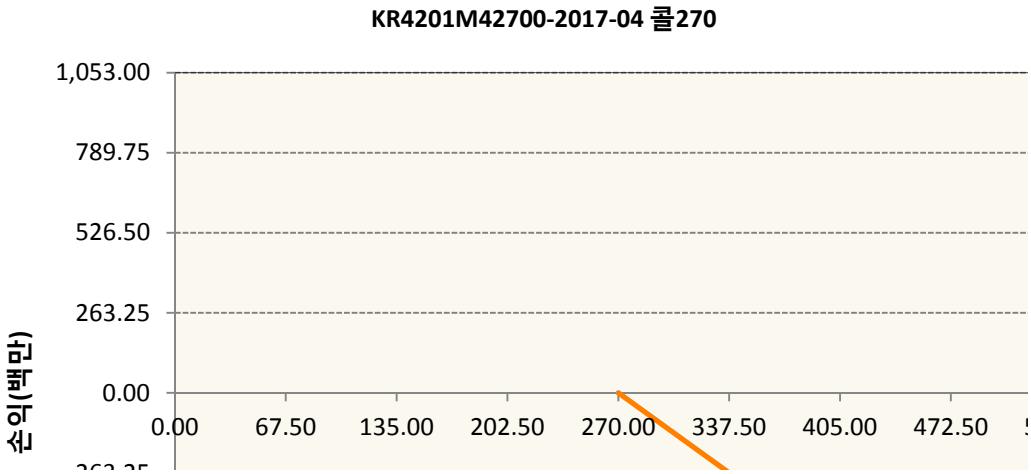
1. 계약금액

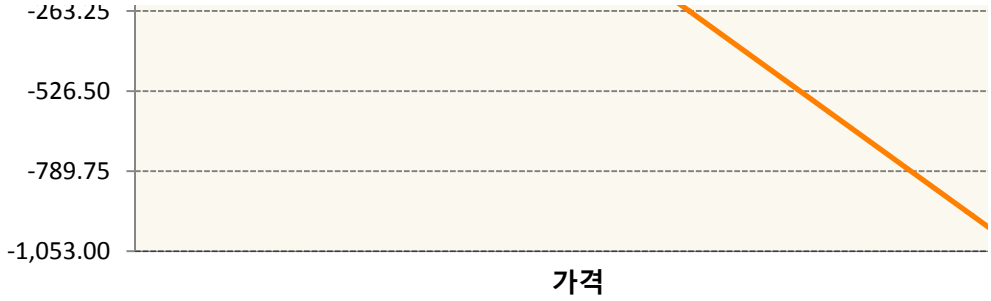
(단위:백만원)

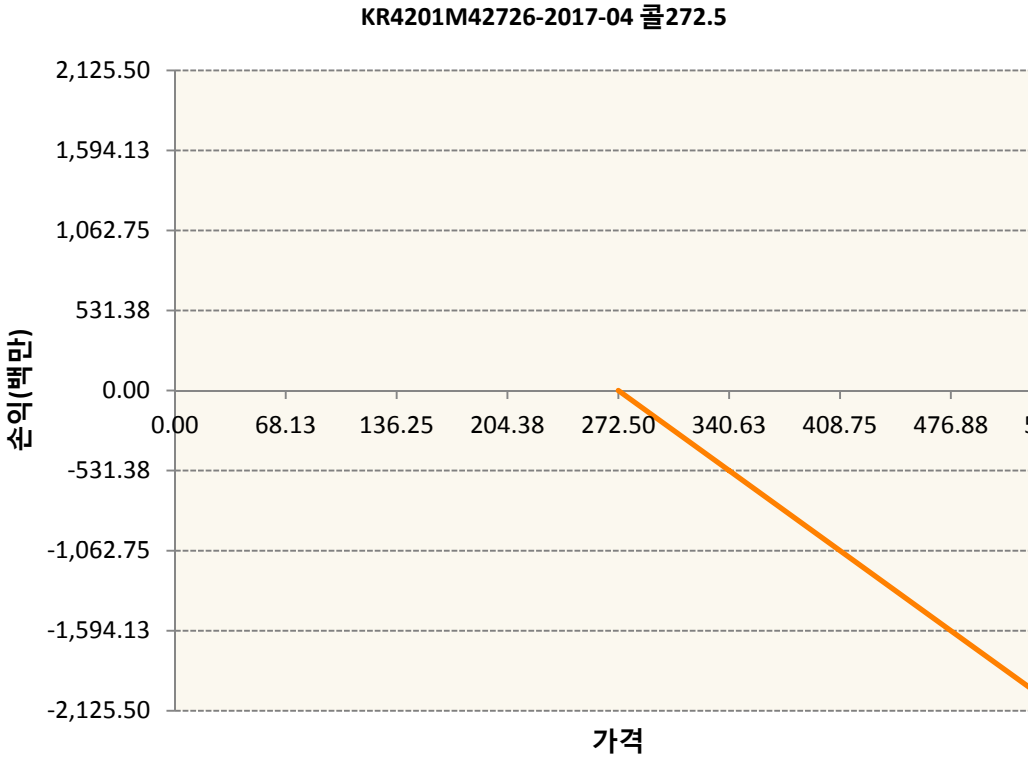
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	26	0	26	장내
누계	유가증권	선물	5,681	0	5,681	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,179	-3,179	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							454
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-454	-454	-454	-454	-454	-454	-454
-5.33%	-303	-303	-303	-303	-303	-303	-303
-2.67%	-151	-151	-151	-151	-151	-151	-151
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	151	151	151	151	151	151	151
5.33%	303	303	303	303	303	303	303
8.00%	454	454	454	454	454	454	454
KR4201M42 2017-04 콜270							439
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	269	267	264	262	258	255	252
-5.33%	236	231	226	221	215	210	205
-2.67%	141	137	134	130	125	121	117
0%	3	2	1	0	-2	-4	-6
2.67%	-144	-144	-144	-144	-145	-145	-146
5.33%	-291	-291	-291	-291	-291	-291	-292
8.00%	-439	-439	-439	-439	-439	-439	-439
KR4201M42 2017-04 콜272.5							871

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	452	449	446	443	439	434	428
-5.33%	415	406	397	387	377	367	358
-2.67%	267	258	248	239	229	219	209
0%	10	8	4	0	-5	-10	-16
2.67%	-281	-281	-282	-282	-284	-285	-287
5.33%	-576	-576	-576	-576	-576	-576	-577
8.00%	-870	-870	-870	-870	-870	-870	-871

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

1,746

공시일	2017-03-22
기준일	2017-03-21

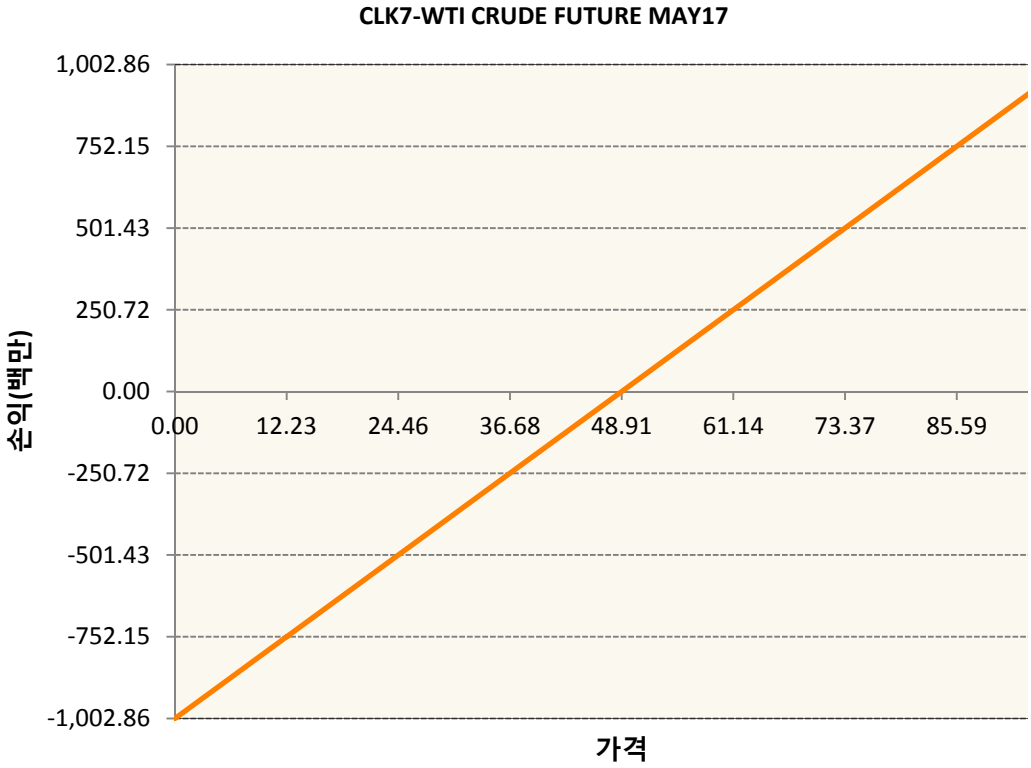
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

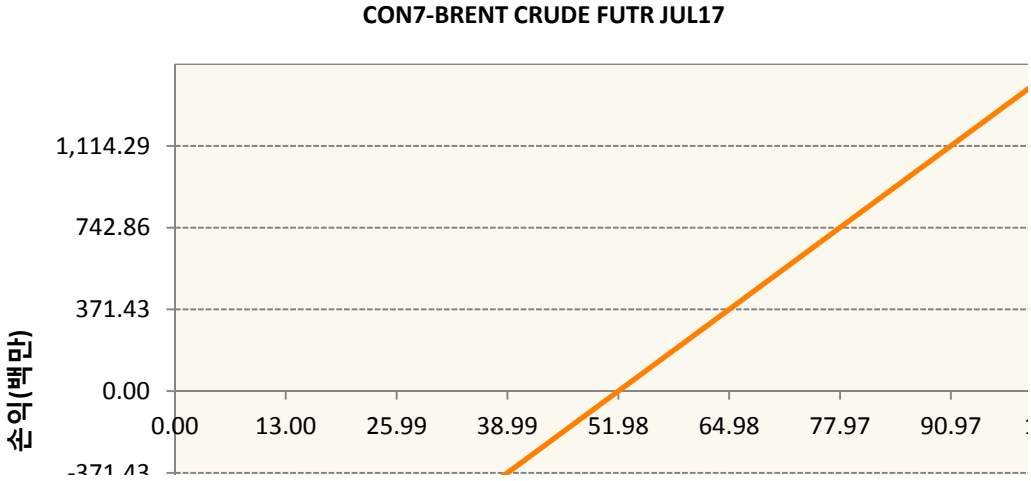
1. 계약금액

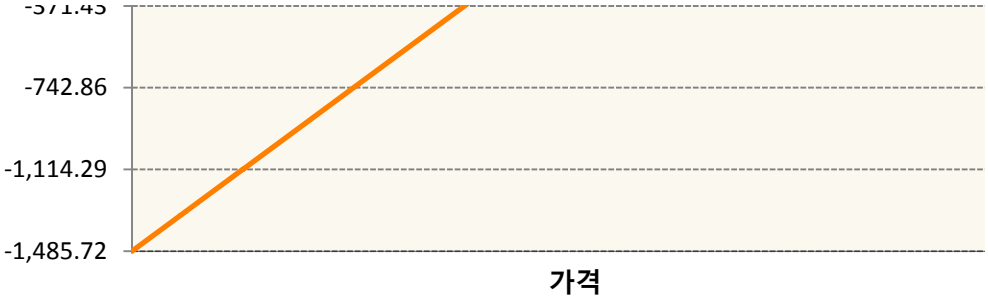
(단위:백만원)

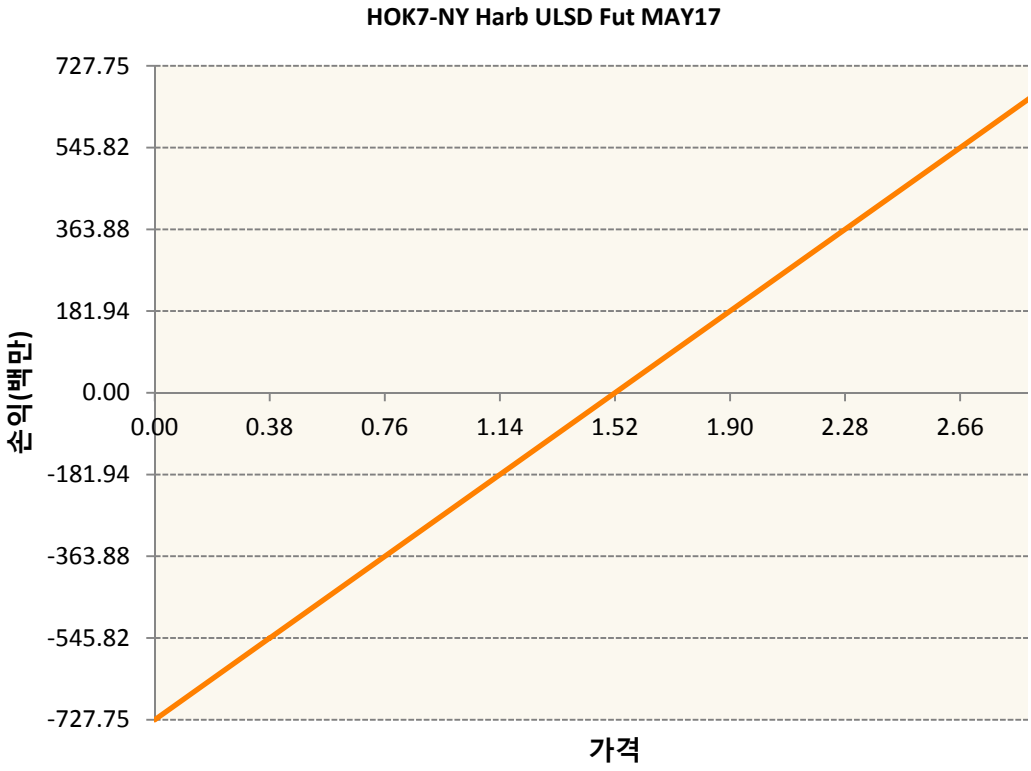
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,003	0	1,003	
누계	유가증권	선물	4,429	403	4,026	

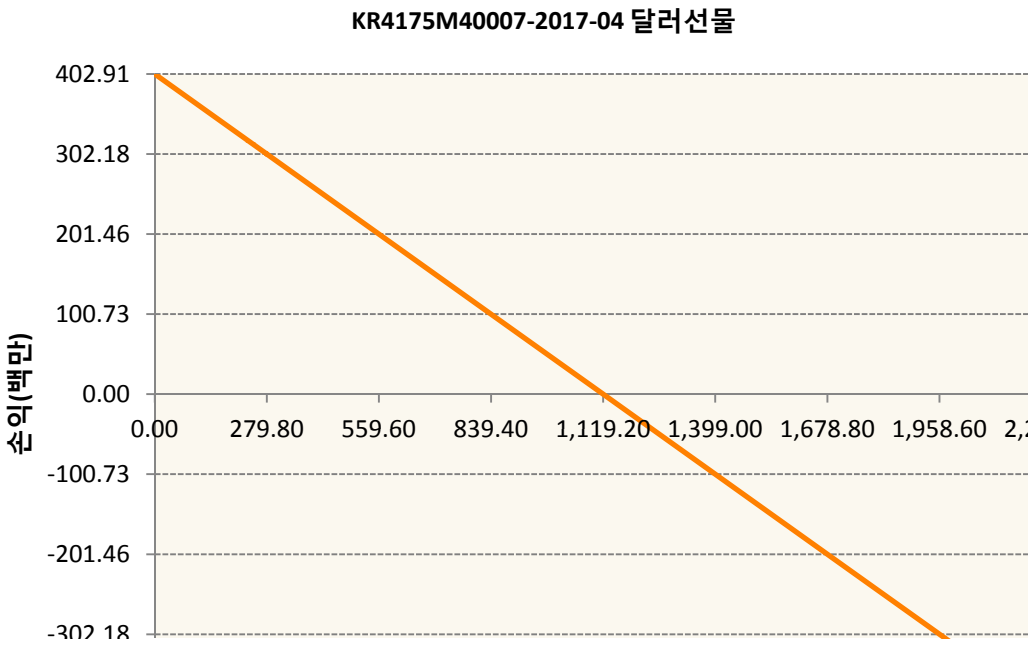
2. 만기시점의 손익구조

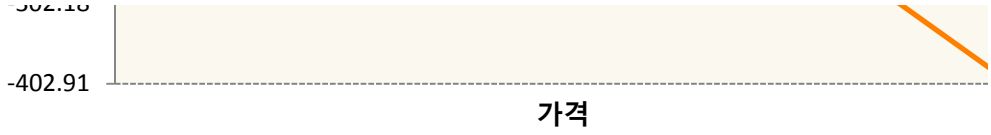


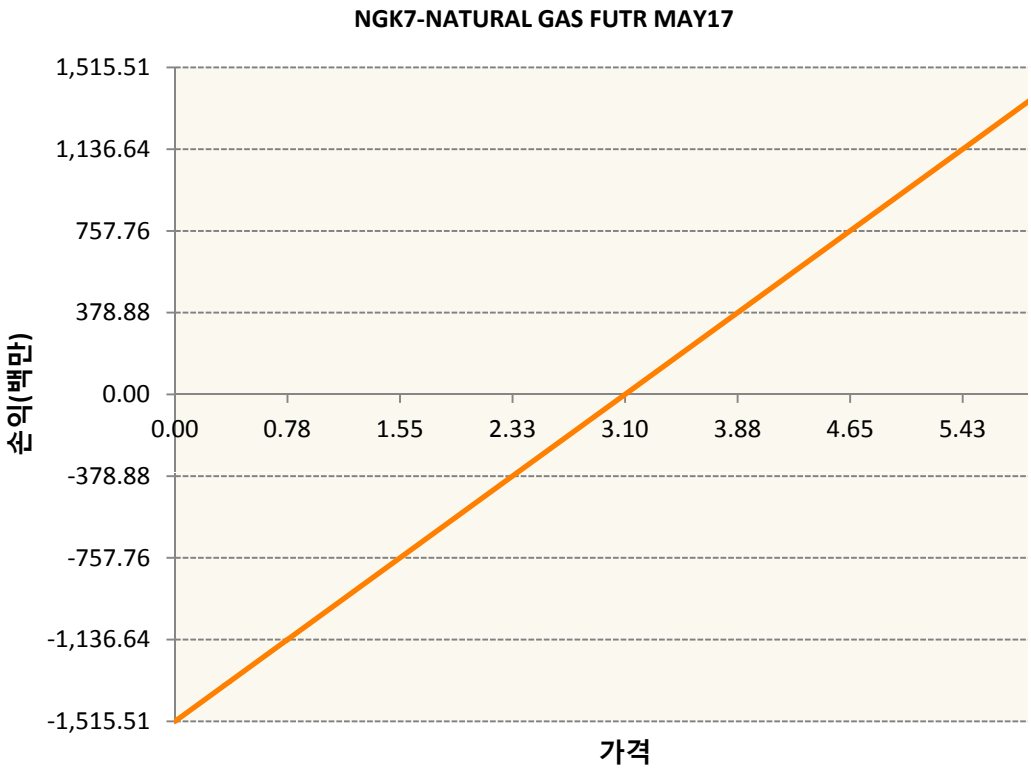


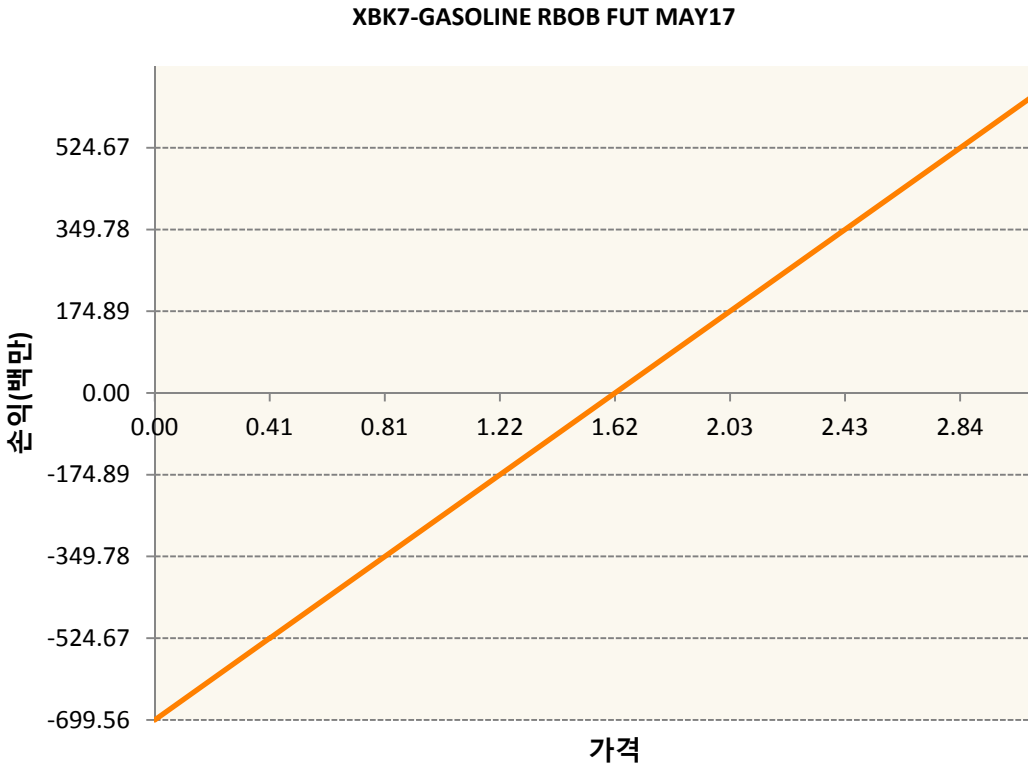

-742.86
-1,114.29
-1,485.72
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
727.75
545.82
363.88
181.94
0.00
-181.94
-363.88
-545.82
-727.75
0.00
0.38
0.76
1.14
1.52
1.90
2.28
2.66
순익(백만)
가격


KR4175M40007-2017-04 달러선물
402.91
302.18
201.46
100.73
0.00
-100.73
-201.46
0.00
279.80
559.60
839.40
1,119.20
1,399.00
1,678.80
1,958.60
순익(백만)


-402.91
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,515.51
1,136.64
757.76
378.88
0.00
-378.88
-757.76
-1,136.64
-1,515.51
0.00
0.78
1.55
2.33
3.10
3.88
4.65
5.43
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
524.67
349.78
174.89
0.00
-174.89
-349.78
-524.67
-699.56
0.00
0.41
0.81
1.22
1.62
2.03
2.43
2.84
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK7	WTI CRUDE FUTURE MAY17	80
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	119
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	58
KR4175M40(	2017-04 달러선물	32
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	121
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	56

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

966

공시일	2017-03-22
기준일	2017-03-21

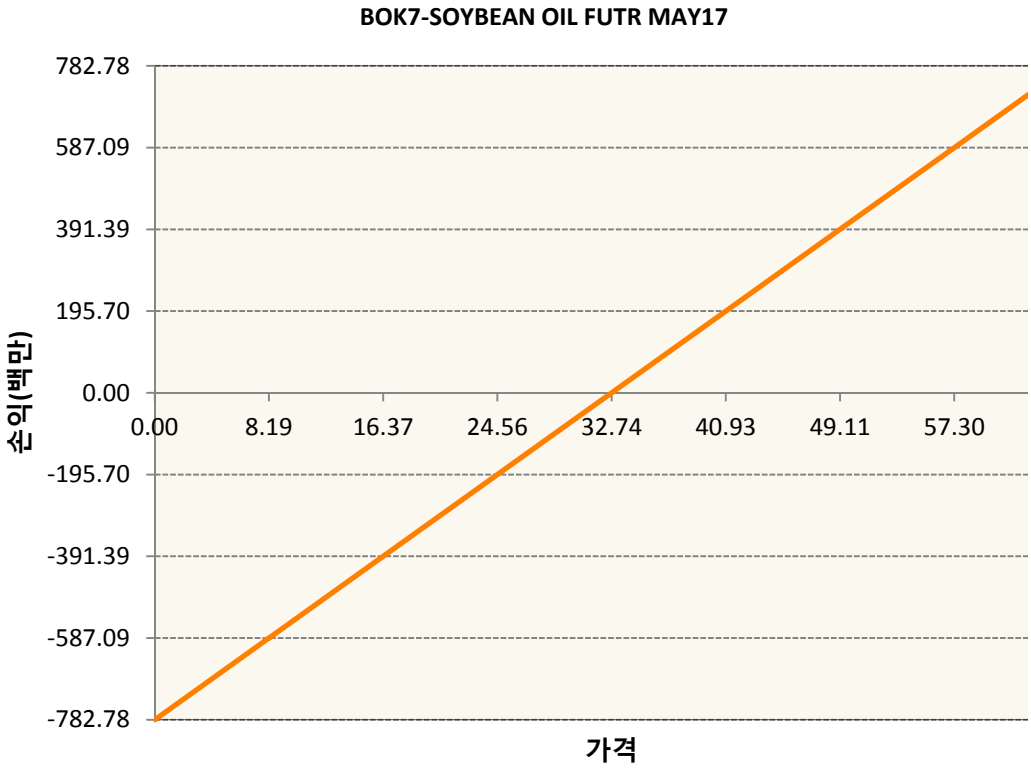
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

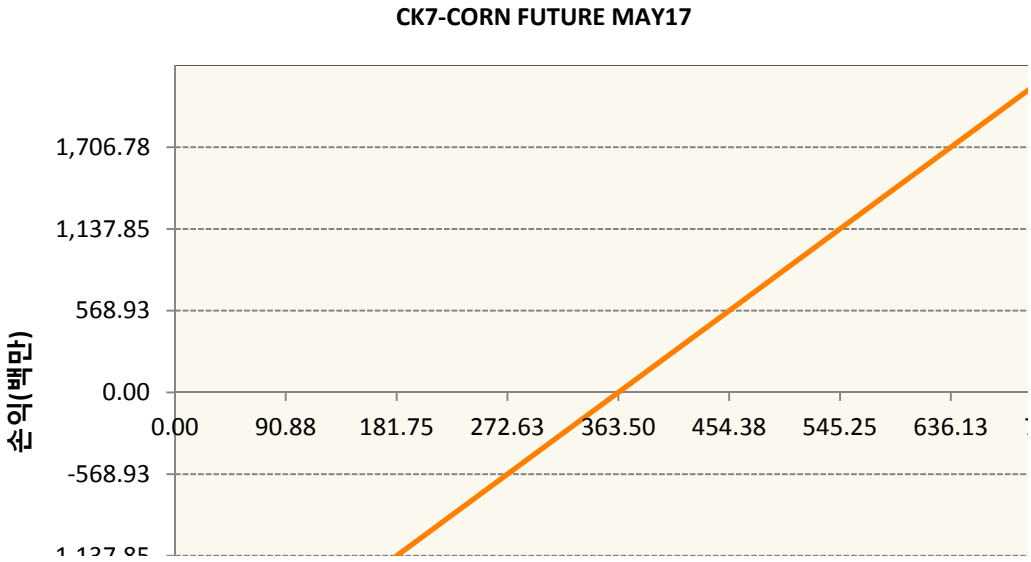
1. 계약금액

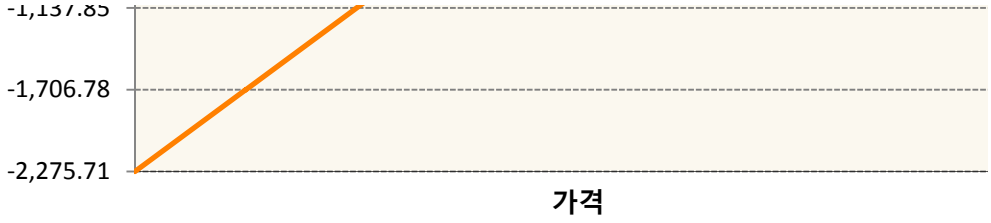
(단위:백만원)

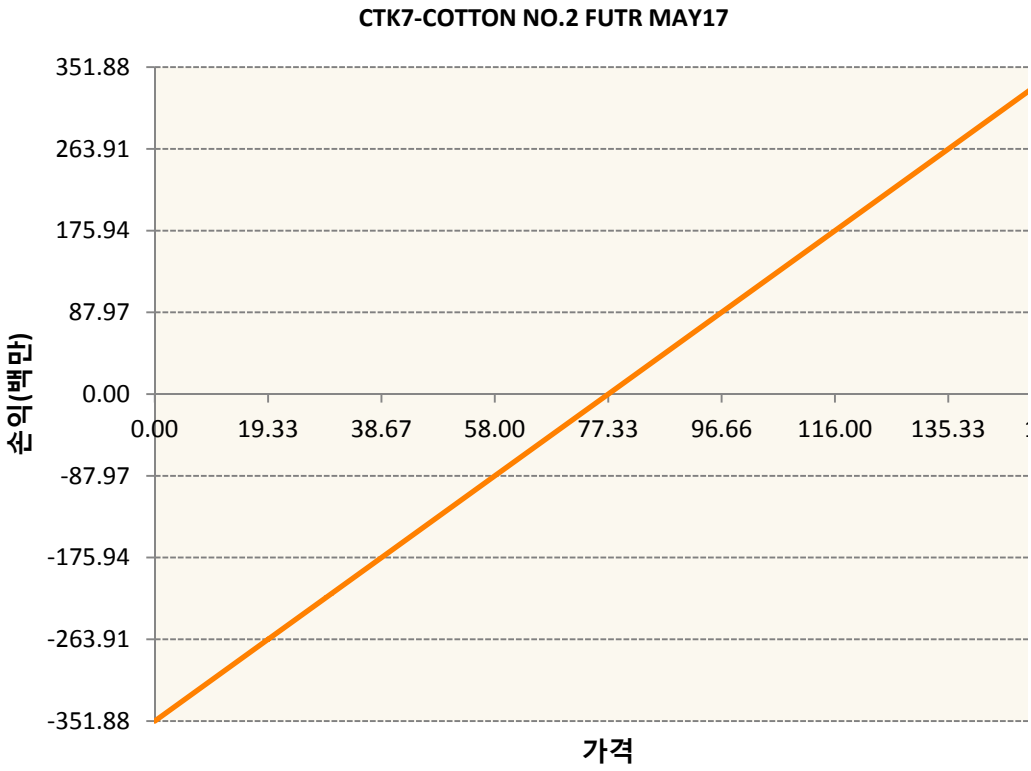
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,079	560	8,519	

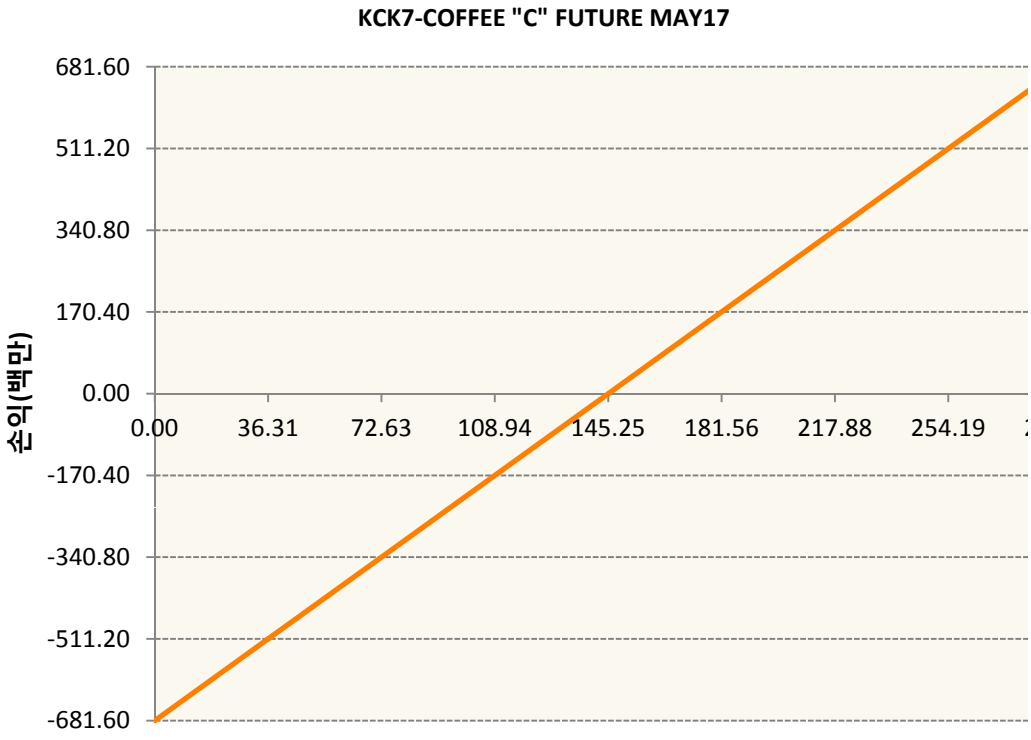
2. 만기시점의 손익구조



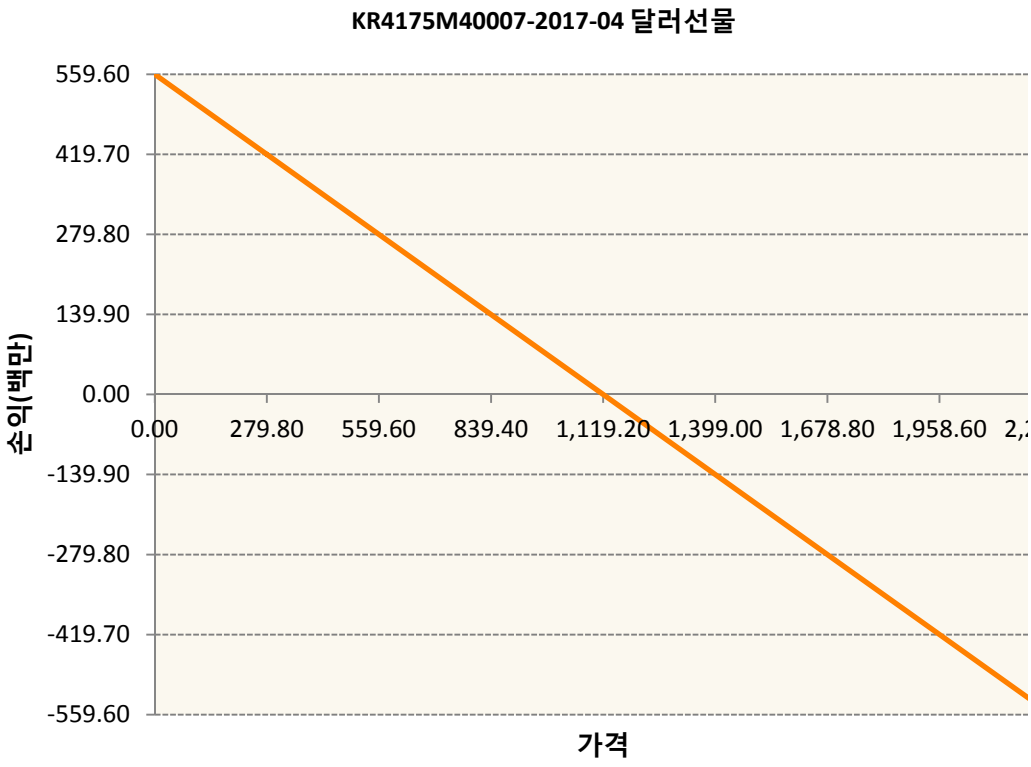


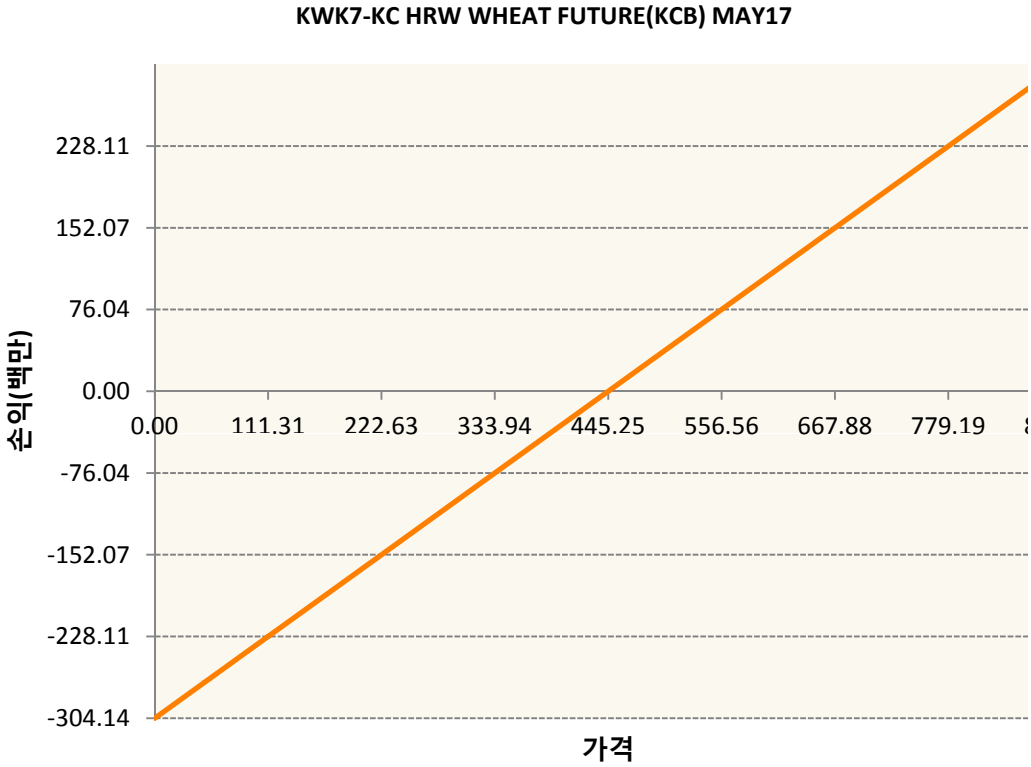

-1,706.78
-2,275.71
가격


CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
351.88
263.91
175.94
87.97
0.00
-87.97
-175.94
-263.91
-351.88
0.00
19.33
38.67
58.00
77.33
96.66
116.00
135.33
순익(백만)
가격

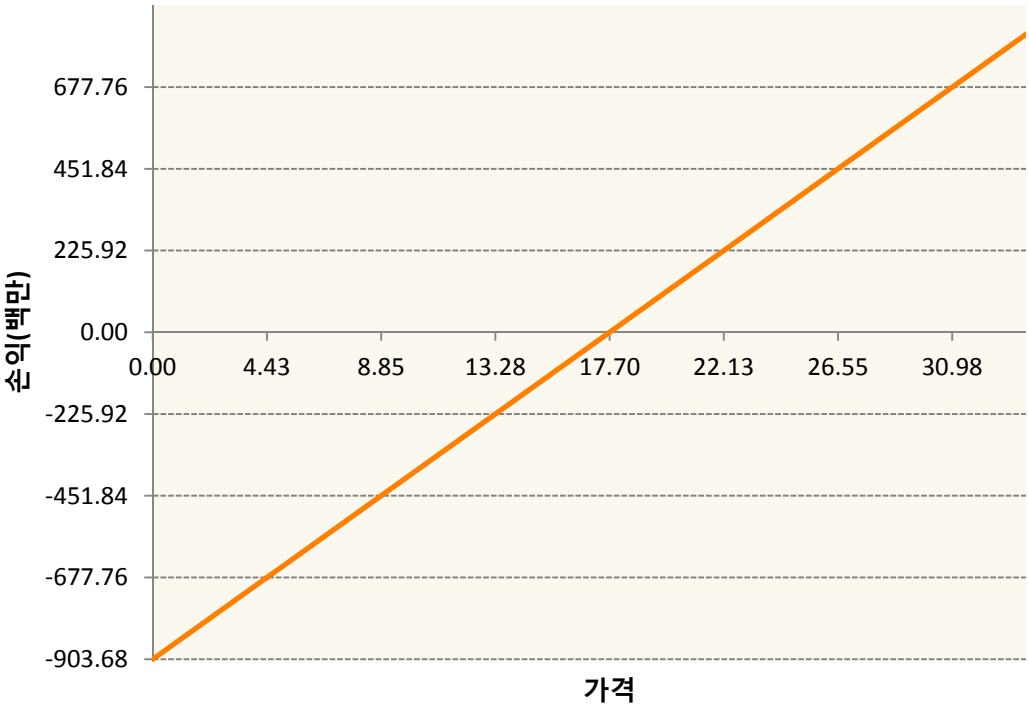

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
681.60
511.20
340.80
170.40
0.00
-170.40
-340.80
-511.20
-681.60
0.00
36.31
72.63
108.94
145.25
181.56
217.88
254.19
순익(백만)

가격

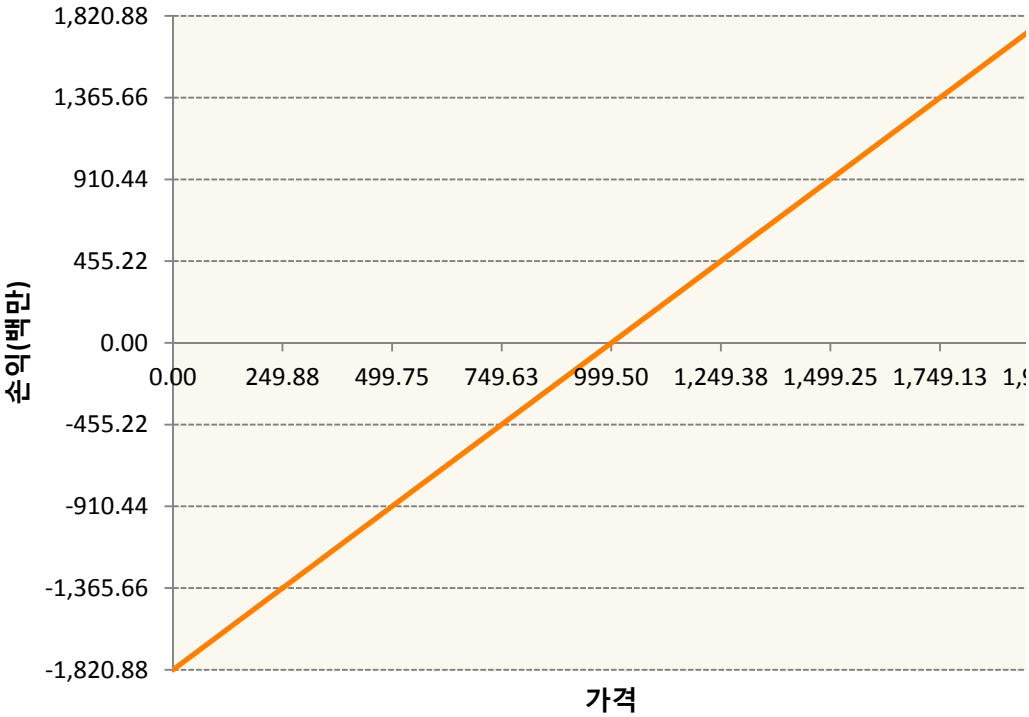

KR4175M40007-2017-04 달러선물
559.60
419.70
279.80
139.90
0.00
-139.90
-279.80
-419.70
-559.60
0.00
279.80
559.60
839.40
1,119.20
1,399.00
1,678.80
1,958.60
손익(백만)
가격


KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
228.11
152.07
76.04
0.00
-76.04
-152.07
-228.11
-304.14
0.00
111.31
222.63
333.94
445.25
556.56
667.88
779.19
손익(백만)
가격

SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17

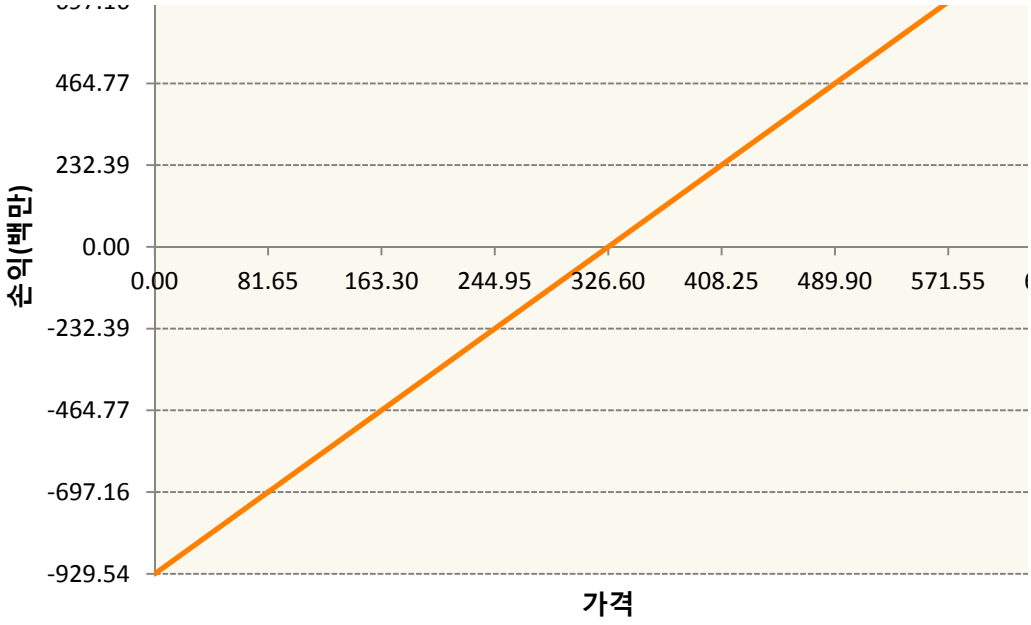


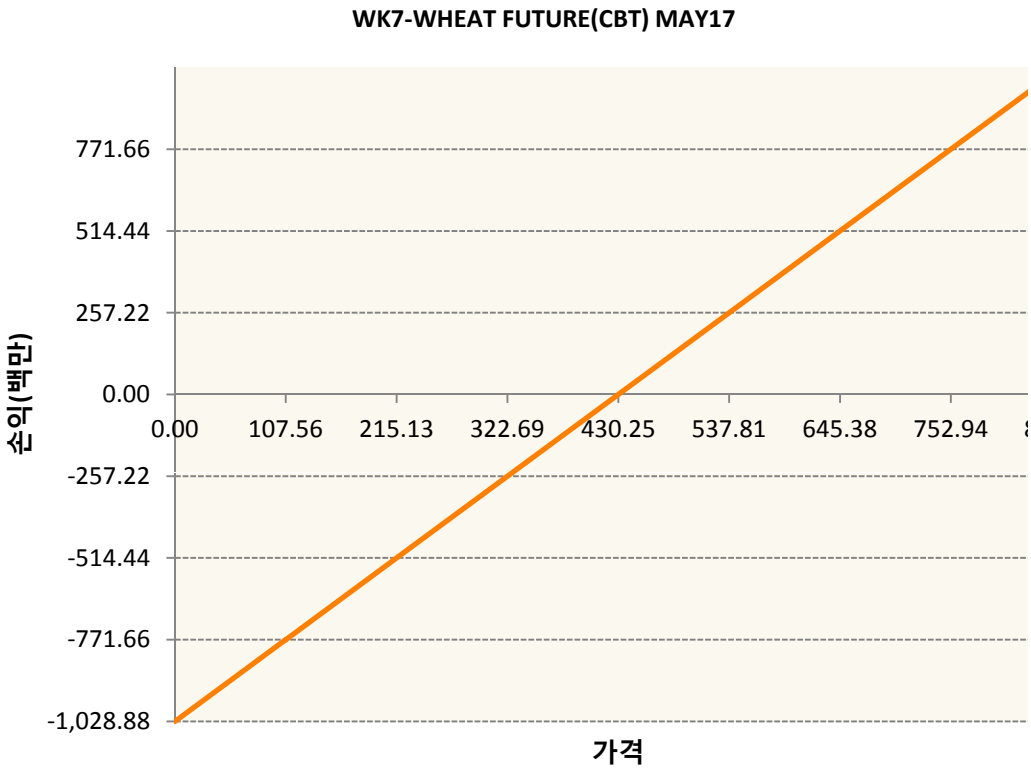
SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17



SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	63
CK7	CORN FUTURE MAY17	182
CTK7	COTTON NO.2 FUTR MAY17	28
KCK7	COFFEE "C" FUTURE MAY17	55
KR4175M40(	2017-04 달러선물	45

KWK7	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17	24
SBK7	Sugar #11 (WORLD) MAY17	72
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	146
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	74
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	82

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

841