공시일	2017-03-23
기준일	2017-03-22

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	2017-03-23
기준일	2017-03-22

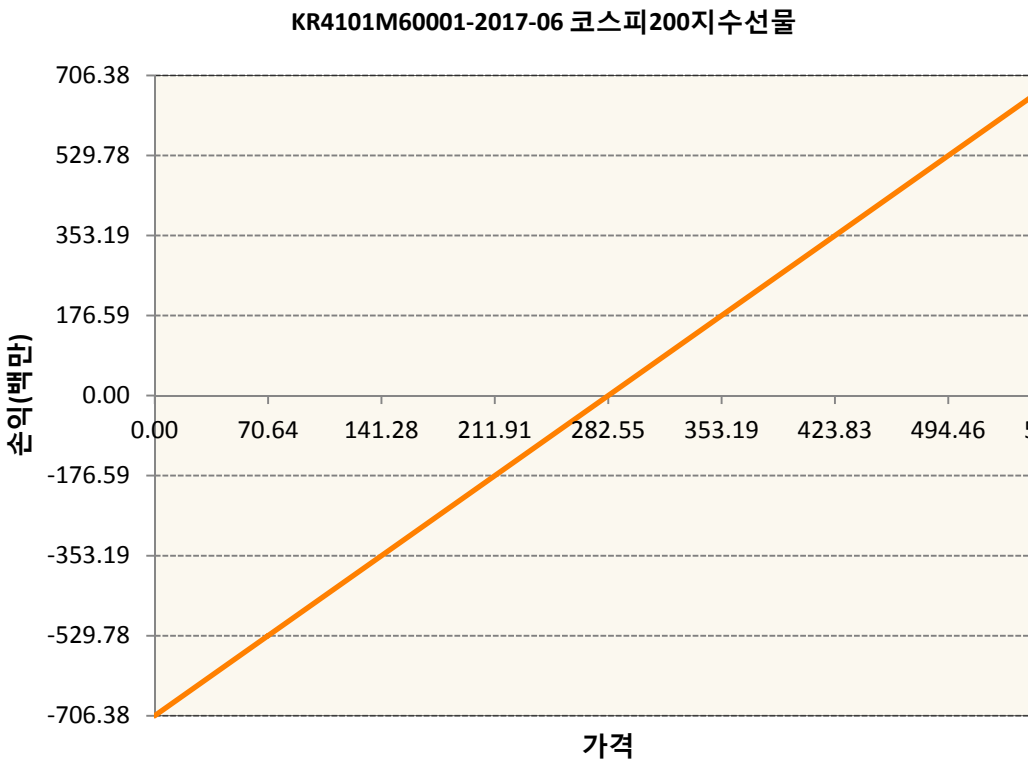
스마트인덱스모

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	706	0	706	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	2017-03-23
기준일	2017-03-22

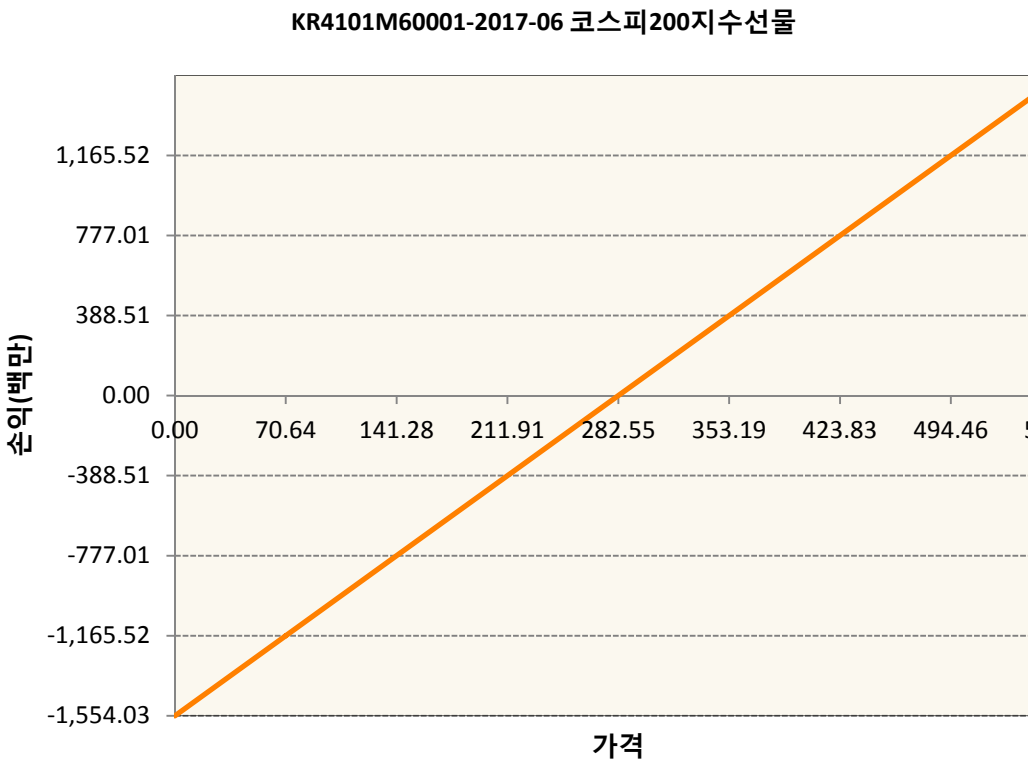
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,554	0	1,554	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							124
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	41	41	41	41	41	41	41
5.33%	83	83	83	83	83	83	83
8.00%	124	124	124	124	124	124	124

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

81

공시일	2017-03-23
기준일	2017-03-22

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	954

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

581

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-23
기준일	2017-03-22

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	394

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

433

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-23
기준일	2017-03-22

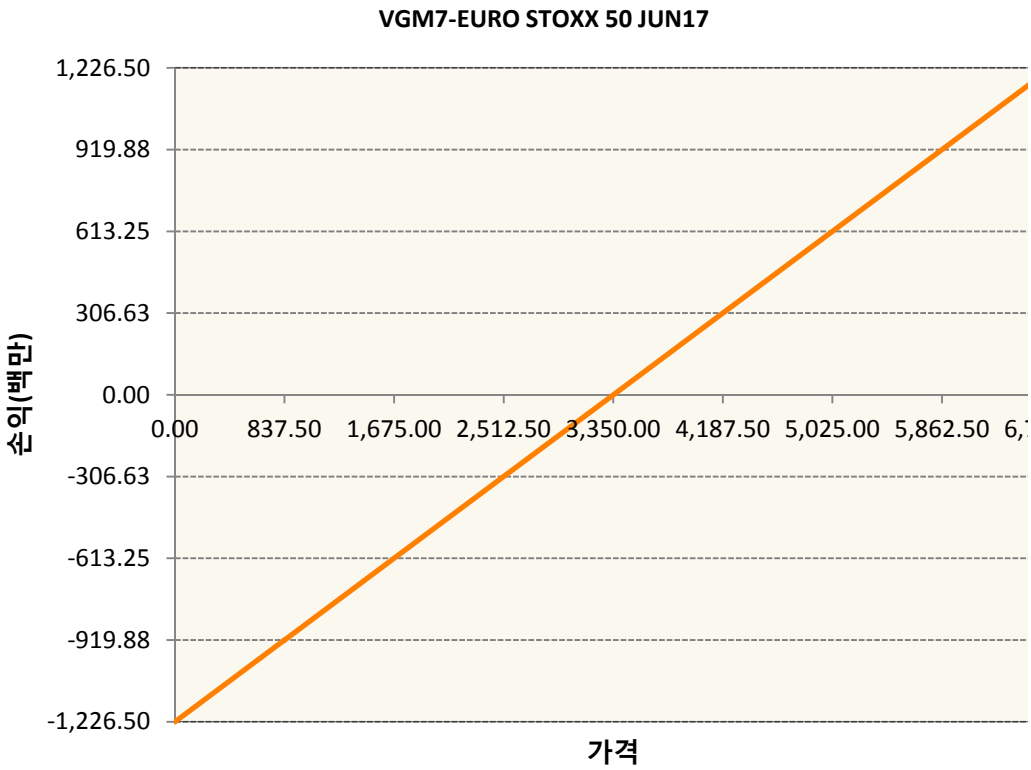
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,227	0	1,227	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM7	EURO STOXX 50 JUN17	98

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

(단위:백만원)

100

공시일	2017-03-23
기준일	2017-03-22

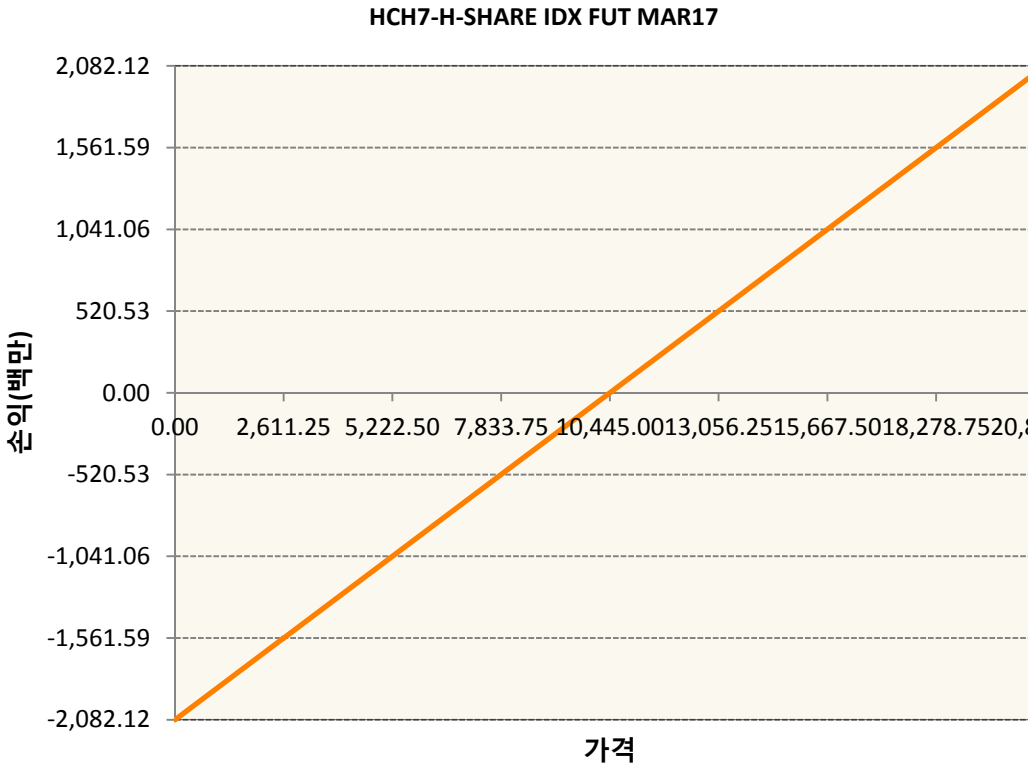
차이나인덱스모(주식-파생형)

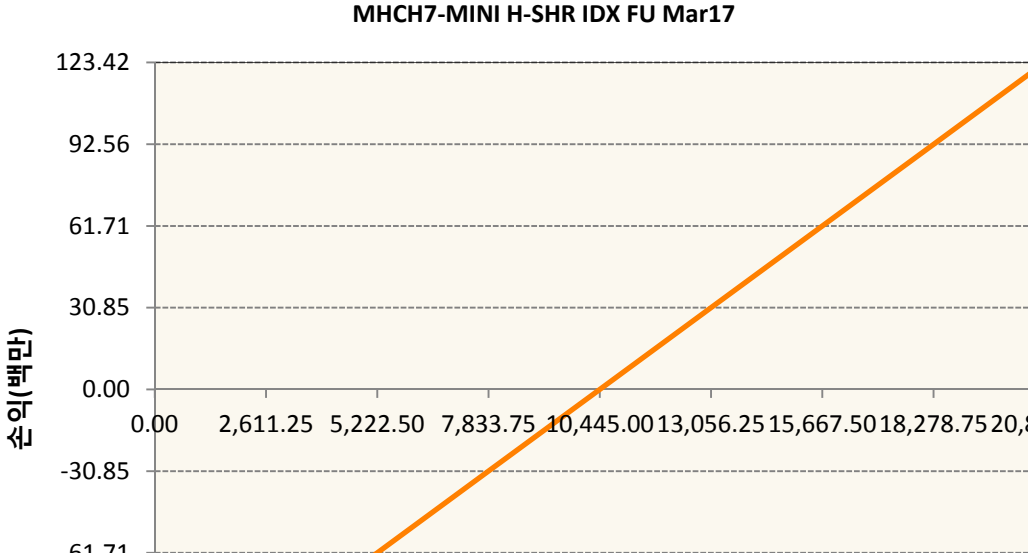
1. 계약금액

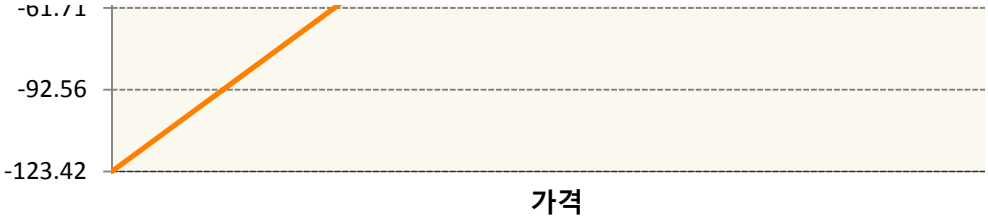
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,206	0	2,206	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)
	190

공시일	2017-03-23
기준일	2017-03-22

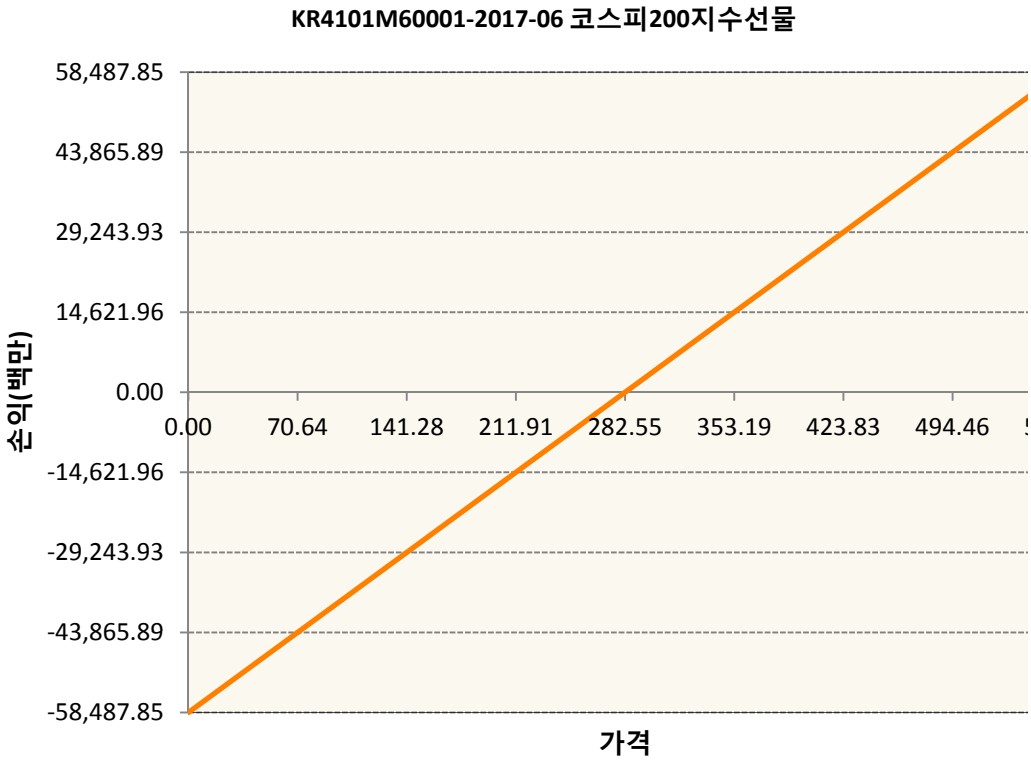
커버드콜모(주식혼합-파생형)

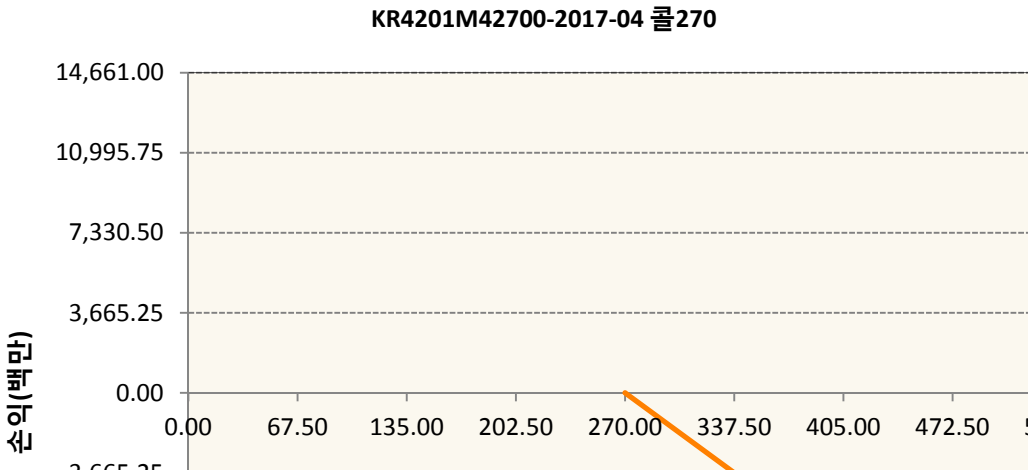
1. 계약금액

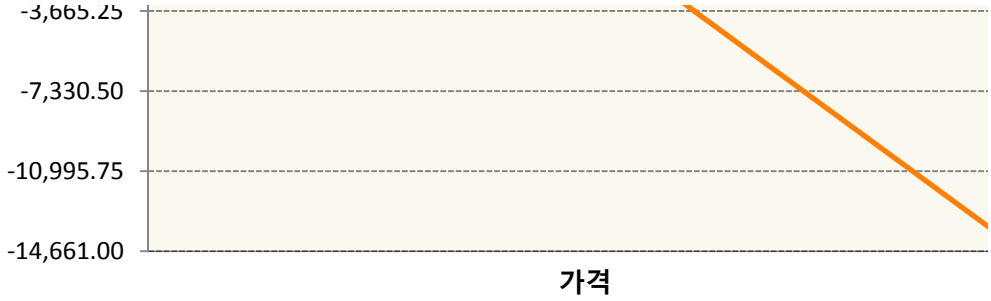
(단위:백만원)

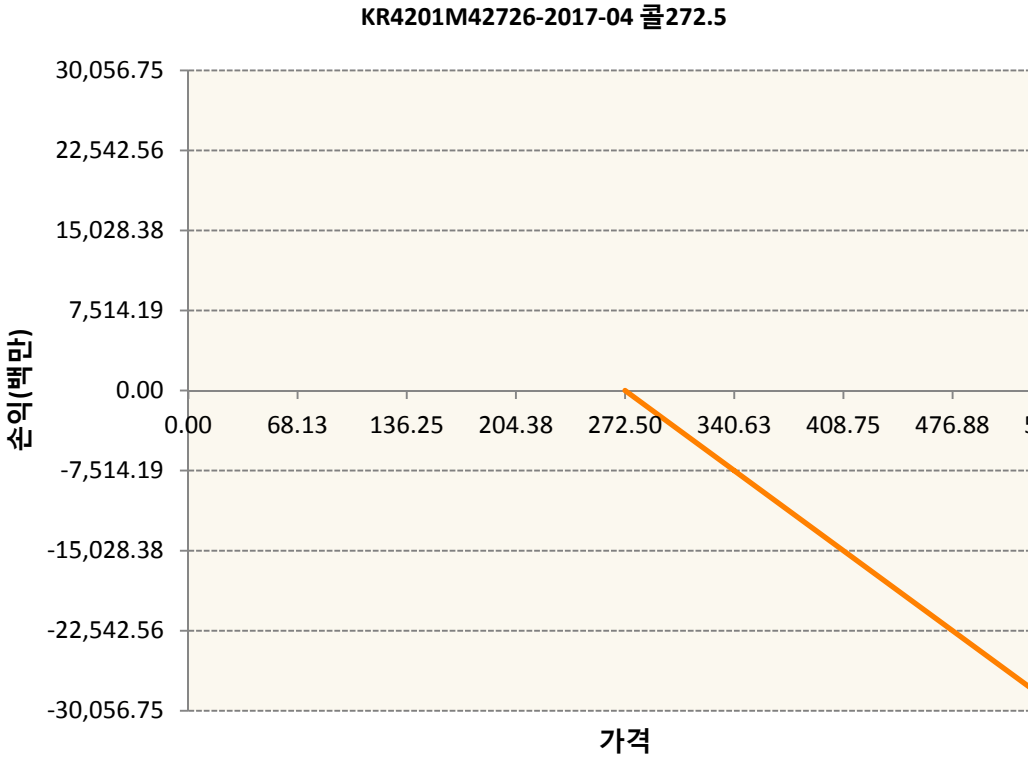
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	1,553	-1,553	장내
신규	유가증권	옵션	284	0	284	장내
누계	유가증권	선물	58,488	0	58,488	장내
누계	유가증권	옵션	0	44,718	-44,718	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							4,680
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,680	-4,680	-4,680	-4,680	-4,680	-4,680	-4,680
-5.33%	-3,120	-3,120	-3,120	-3,120	-3,120	-3,120	-3,120
-2.67%	-1,560	-1,560	-1,560	-1,560	-1,560	-1,560	-1,560
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,560	1,560	1,560	1,560	1,560	1,560	1,560
5.33%	3,120	3,120	3,120	3,120	3,120	3,120	3,120
8.00%	4,680	4,680	4,680	4,680	4,680	4,680	4,680
KR4201M42 2017-04 콜270							6,063
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,451	3,429	3,402	3,370	3,333	3,293	3,249
-5.33%	3,099	3,030	2,960	2,889	2,818	2,746	2,674
-2.67%	1,912	1,855	1,796	1,734	1,670	1,605	1,539
0%	54	41	23	0	-28	-60	-95
2.67%	-1,975	-1,976	-1,978	-1,982	-1,988	-1,997	-2,009
5.33%	-4,019	-4,019	-4,019	-4,019	-4,020	-4,021	-4,024
8.00%	-6,063	-6,063	-6,063	-6,063	-6,063	-6,063	-6,063
KR4201M42: 2017-04 콜272.5							12,188

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,807	5,784	5,752	5,710	5,659	5,600	5,533
-5.33%	5,422	5,308	5,188	5,064	4,935	4,804	4,670
-2.67%	3,631	3,488	3,343	3,196	3,049	2,901	2,752
0%	186	135	73	0	-82	-171	-268
2.67%	-3,884	-3,890	-3,901	-3,917	-3,940	-3,970	-4,008
5.33%	-8,033	-8,033	-8,034	-8,036	-8,040	-8,046	-8,055
8.00%	-12,185	-12,185	-12,185	-12,186	-12,186	-12,187	-12,188

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

23,566

공시일	2017-03-23
기준일	2017-03-22

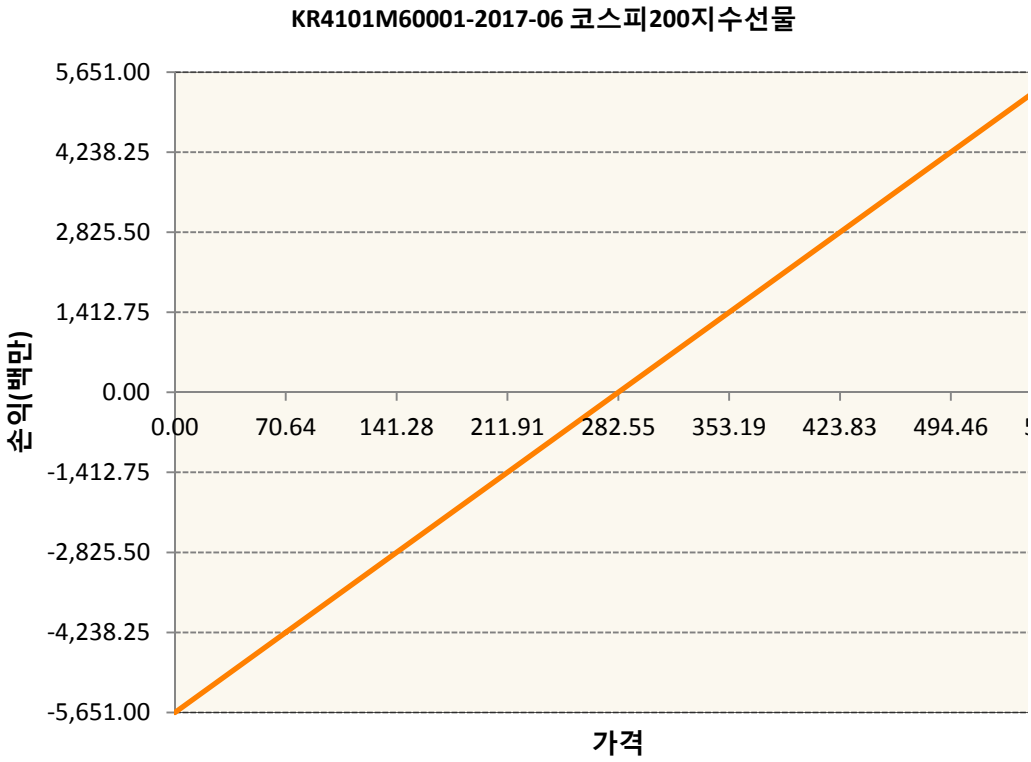
커버드콜목표전환형증권투자신탁

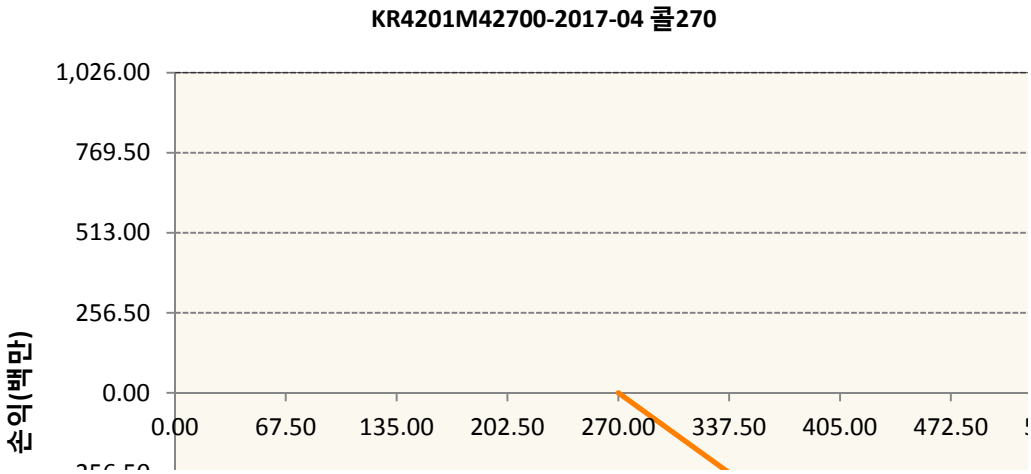
1. 계약금액

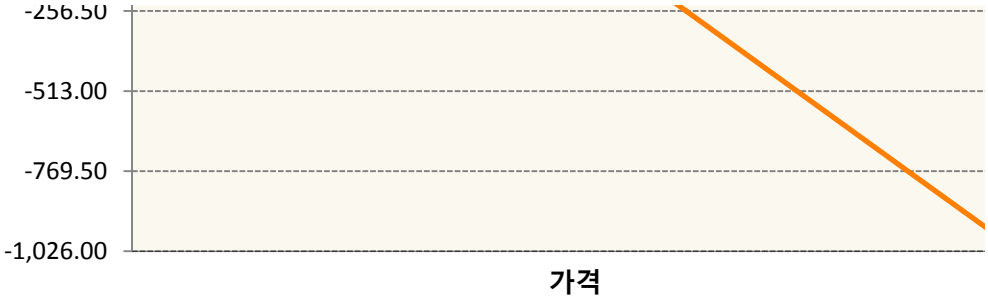
(단위:백만원)

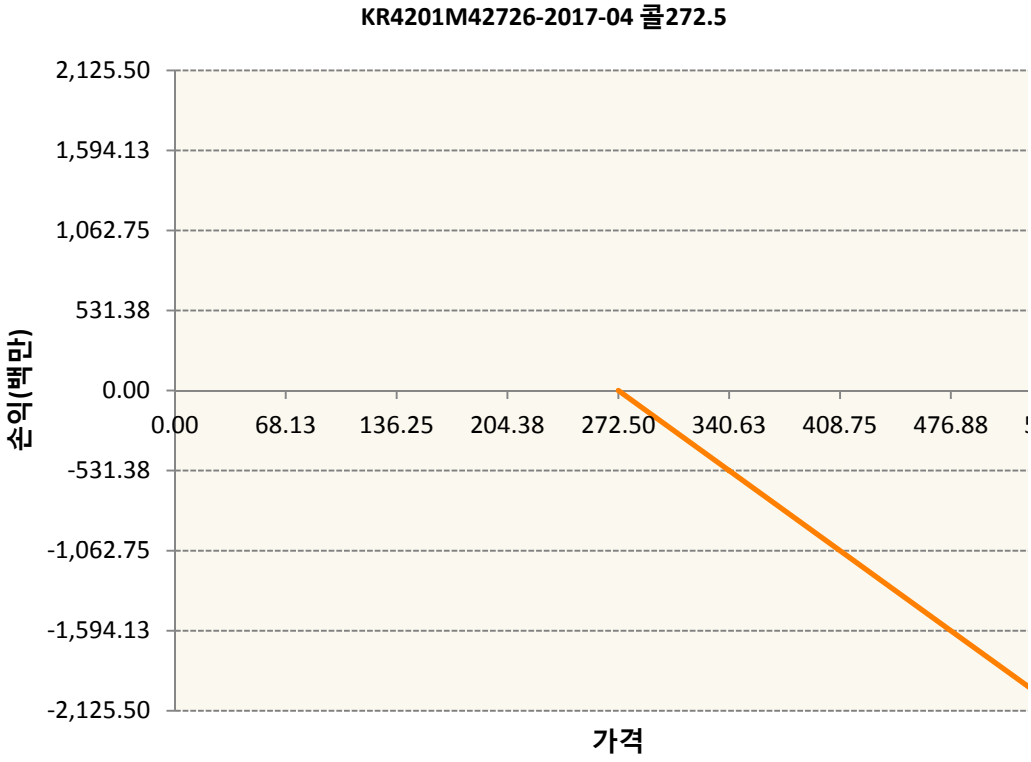
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	26	0	26	장내
누계	유가증권	선물	5,651	0	5,651	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,152	-3,152	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							452
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-452	-452	-452	-452	-452	-452	-452
-5.33%	-301	-301	-301	-301	-301	-301	-301
-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%	301	301	301	301	301	301	301
8.00%	452	452	452	452	452	452	452
KR4201M42 2017-04 콜270							424
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	241	240	238	236	233	230	227
-5.33%	217	212	207	202	197	192	187
-2.67%	134	130	126	121	117	112	108
0%	4	3	2	0	-2	-4	-7
2.67%	-138	-138	-138	-139	-139	-140	-141
5.33%	-281	-281	-281	-281	-281	-281	-282
8.00%	-424	-424	-424	-424	-424	-424	-424
KR4201M42 2017-04 콜272.5							862

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	411	409	407	404	400	396	391
-5.33%	383	375	367	358	349	340	330
-2.67%	257	247	236	226	216	205	195
0%	13	10	5	0	-6	-12	-19
2.67%	-275	-275	-276	-277	-279	-281	-283
5.33%	-568	-568	-568	-568	-569	-569	-570
8.00%	-862	-862	-862	-862	-862	-862	-862

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

1,741

공시일	2017-03-23
기준일	2017-03-22

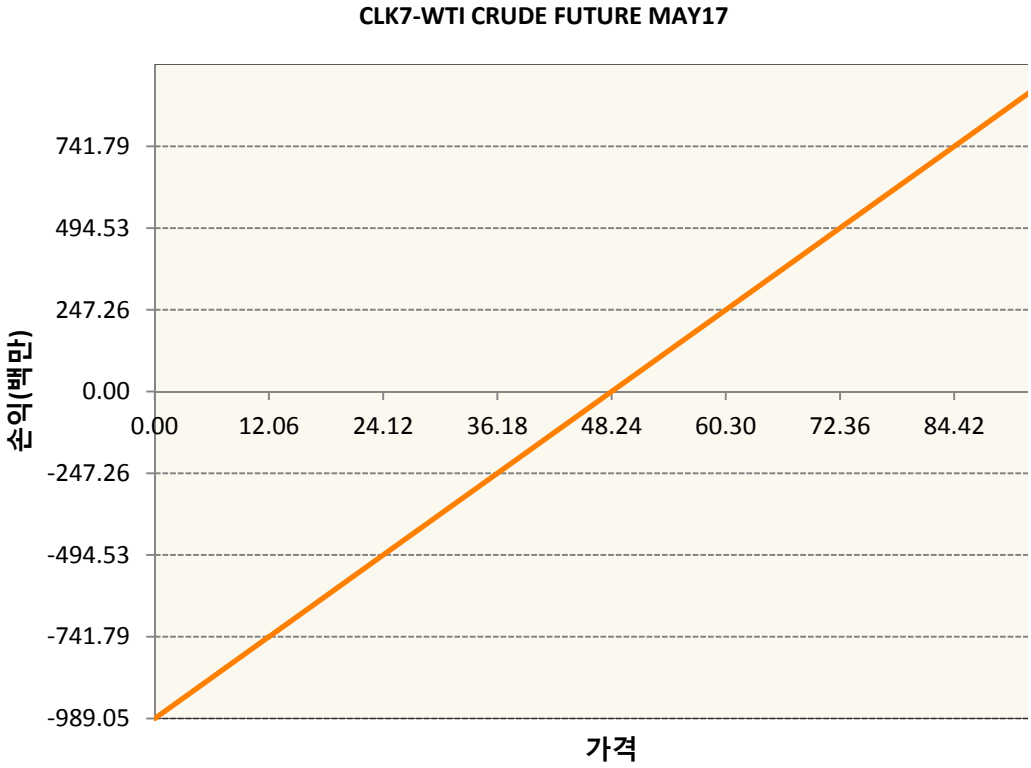
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

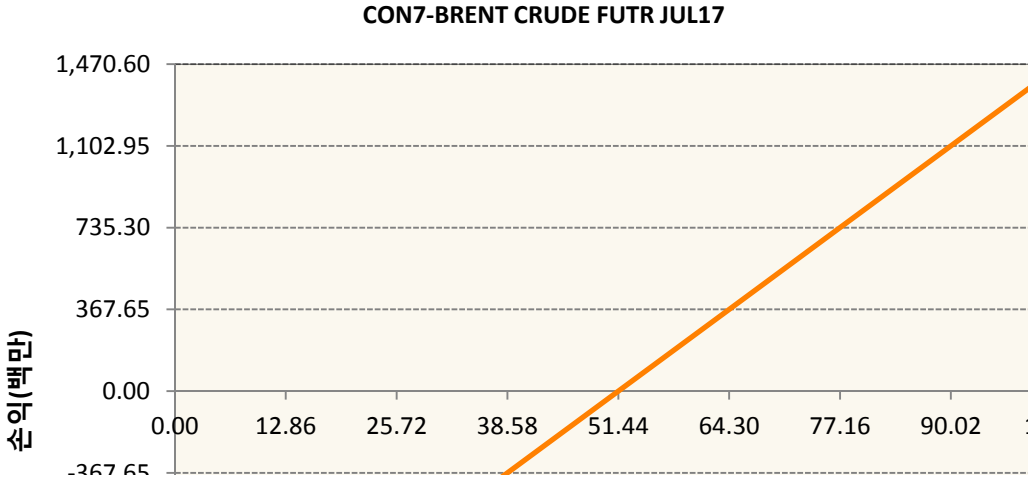
1. 계약금액

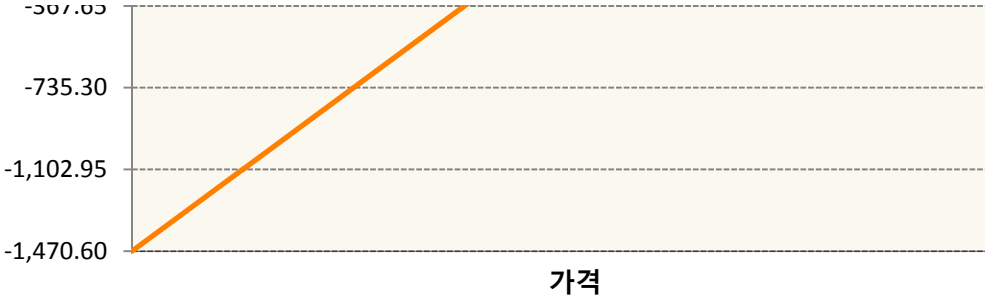
(단위:백만원)

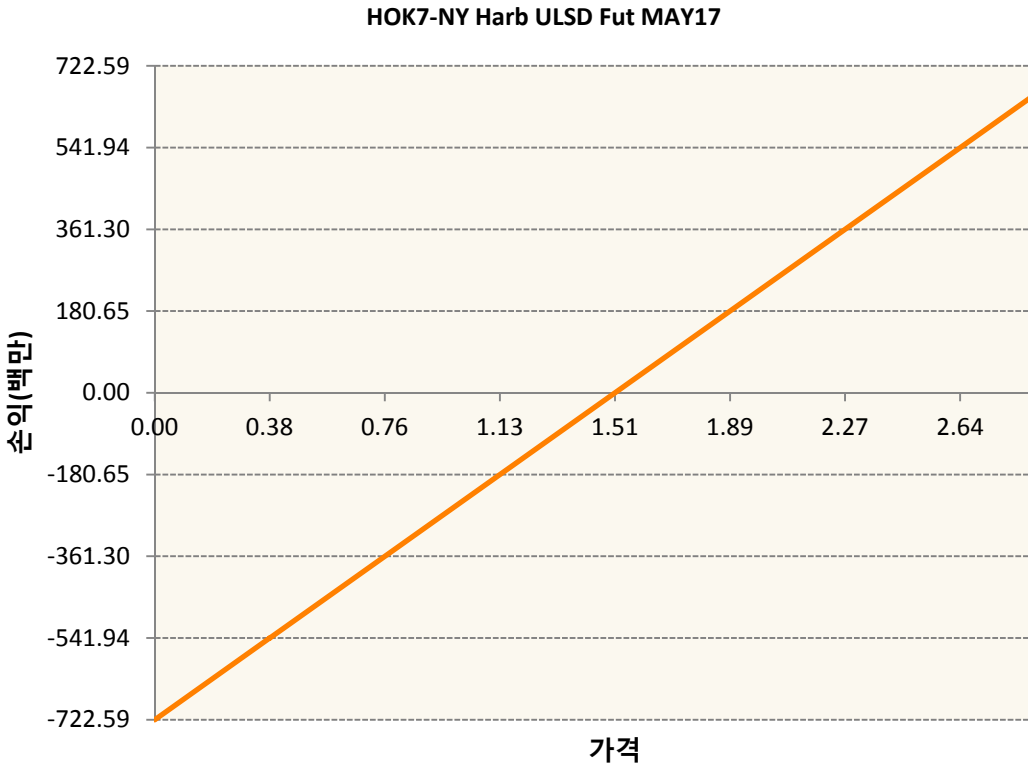
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	989	0	989	
누계	유가증권	선물	4,432	404	4,028	

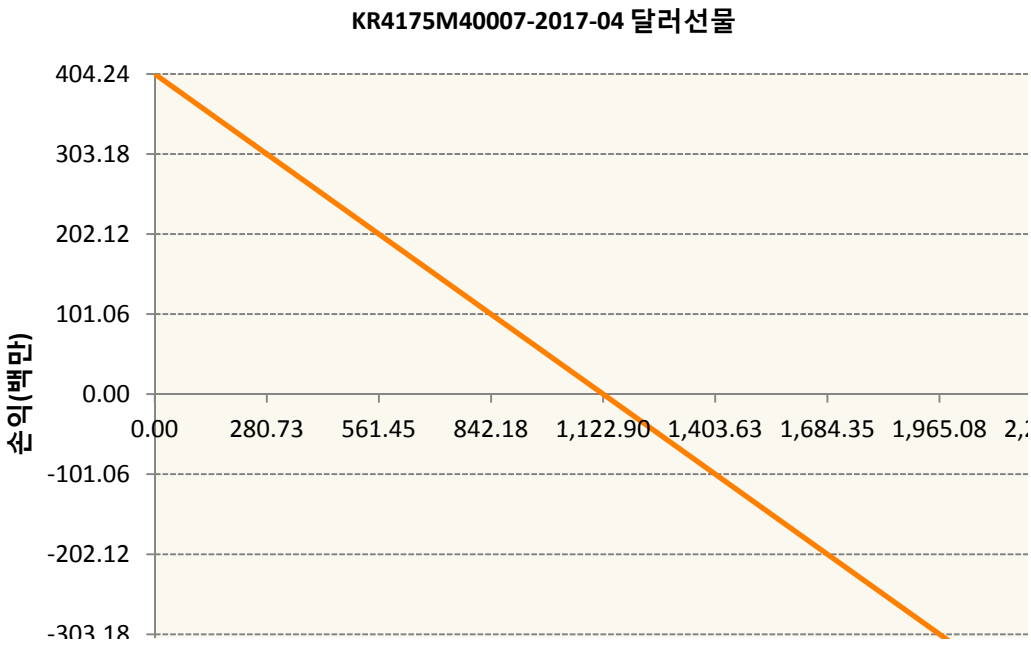
2. 만기시점의 손익구조

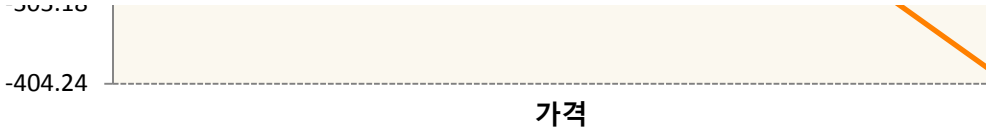


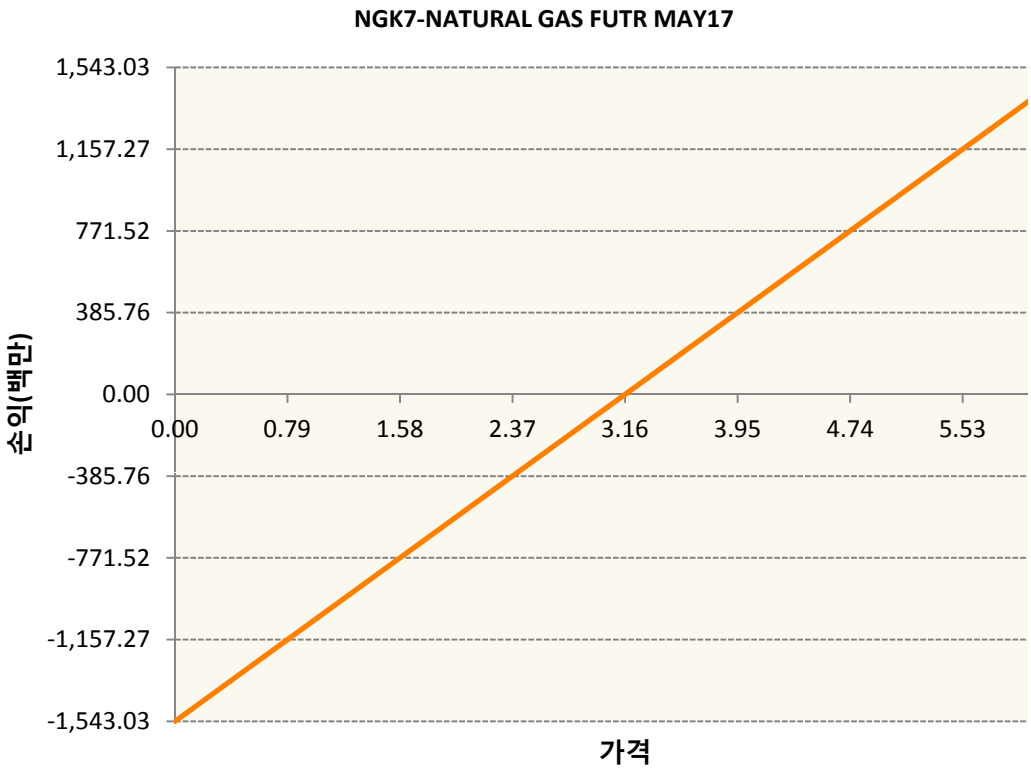


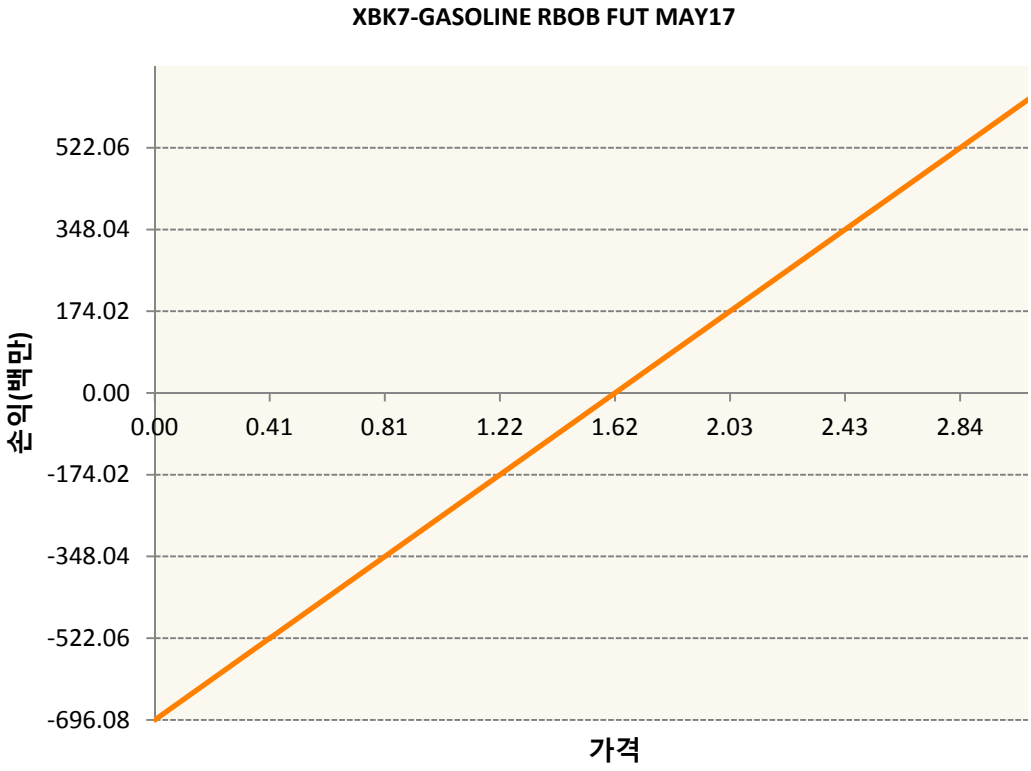

-735.30
-1,102.95
-1,470.60
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
722.59
541.94
361.30
180.65
0.00
-180.65
-361.30
-541.94
-722.59
0.00
0.38
0.76
1.13
1.51
1.89
2.27
2.64
순익(백만)
가격


KR4175M40007-2017-04 달러선물
404.24
303.18
202.12
101.06
0.00
-101.06
-202.12
-303.18
0.00
280.73
561.45
842.18
1,122.90
1,403.63
1,684.35
1,965.08
순익(백만)


-404.24
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,543.03
1,157.27
771.52
385.76
0.00
-385.76
-771.52
-1,157.27
-1,543.03
0.00
0.79
1.58
2.37
3.16
3.95
4.74
5.53
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
522.06
348.04
174.02
0.00
-174.02
-348.04
-522.06
-696.08
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	79
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	118
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	58
KR4175M40(	2017-04 달러선물	32
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	123
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	56

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

965

공시일	2017-03-23
기준일	2017-03-22

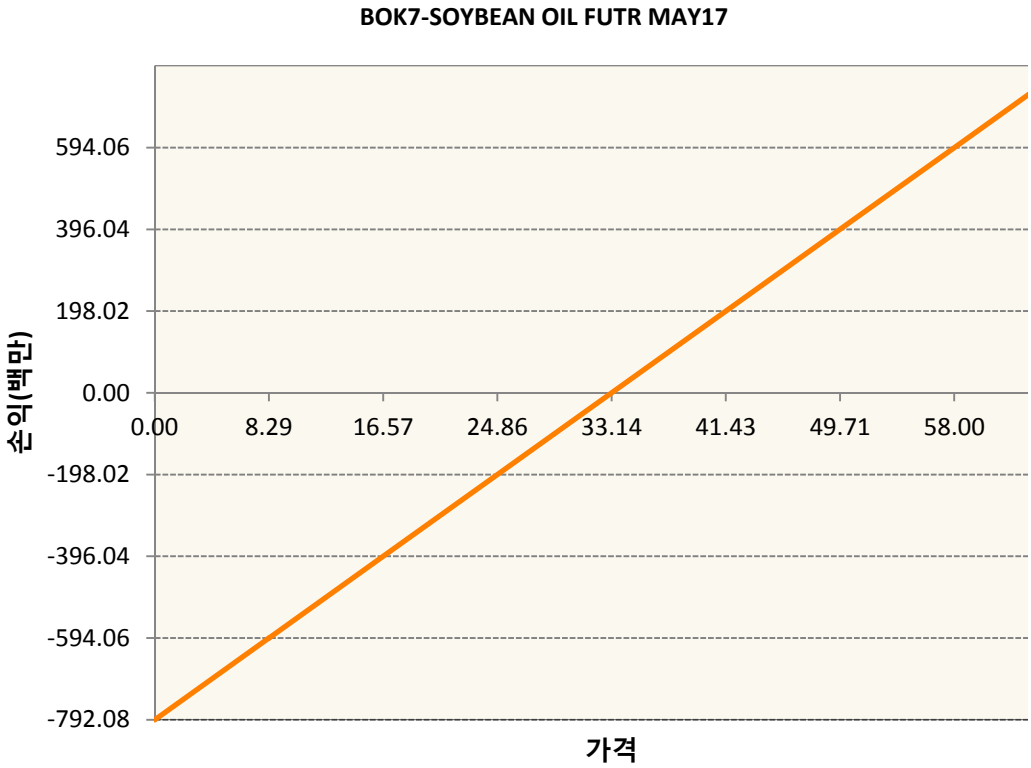
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

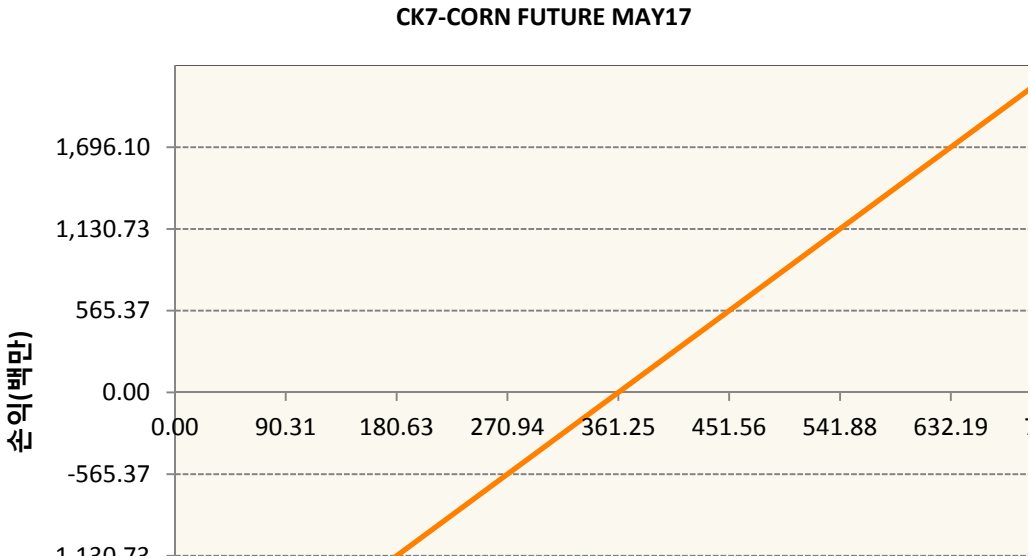
1. 계약금액

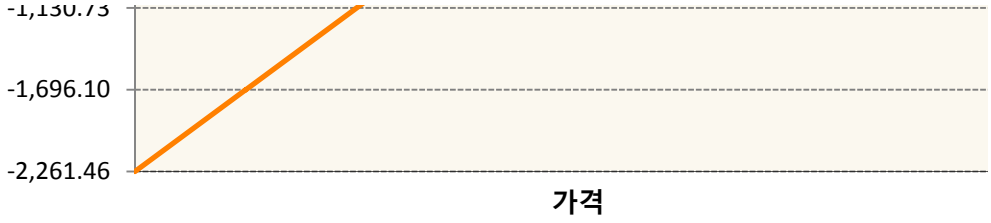
(단위:백만원)

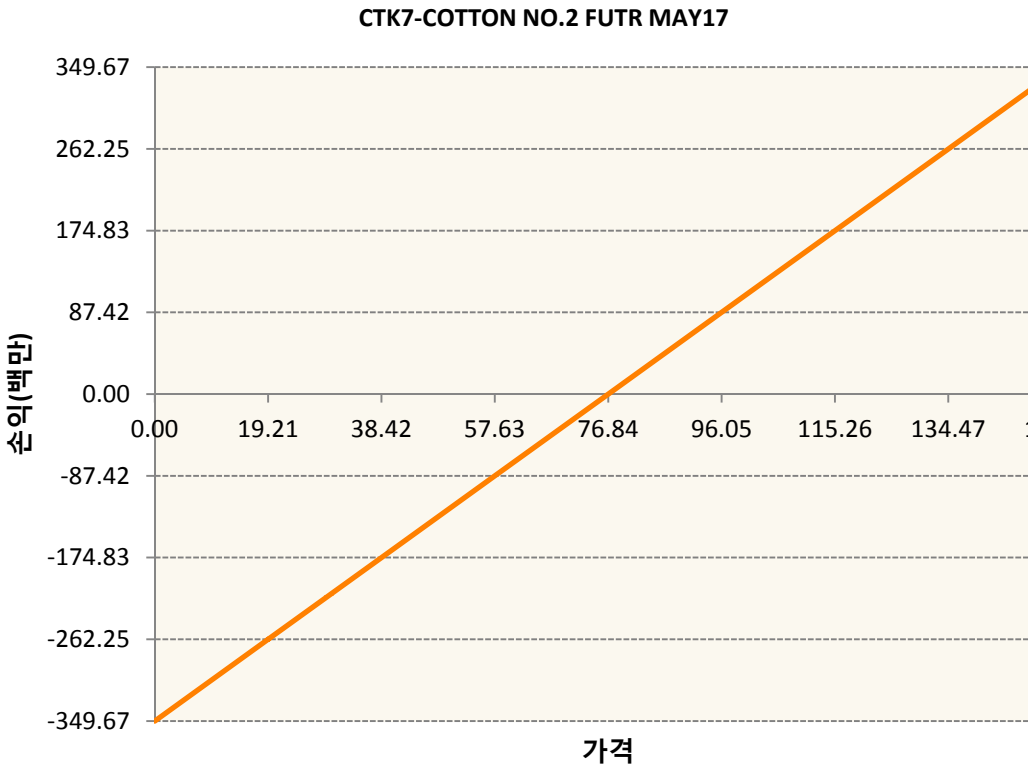
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,036	561	8,474	

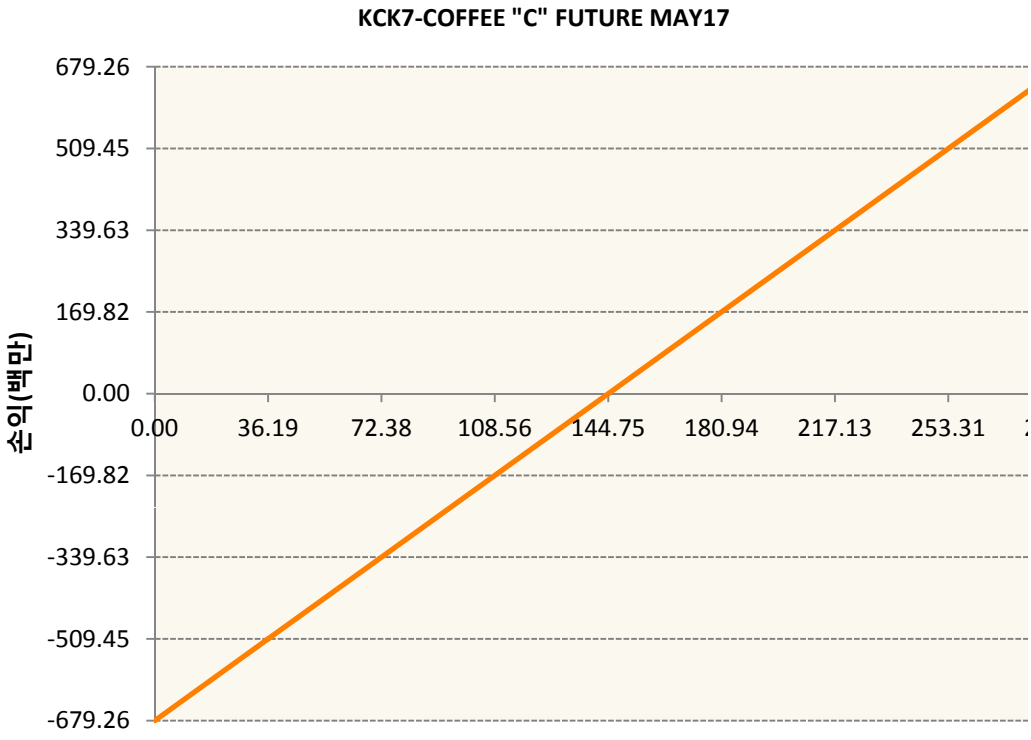
2. 만기시점의 손익구조



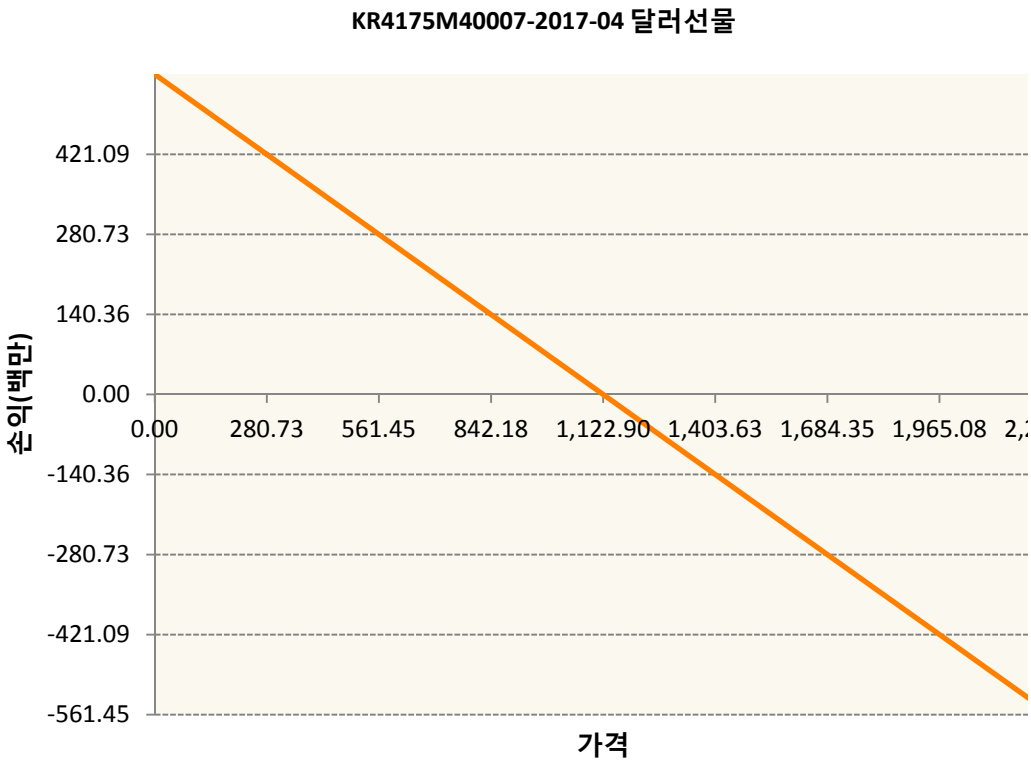


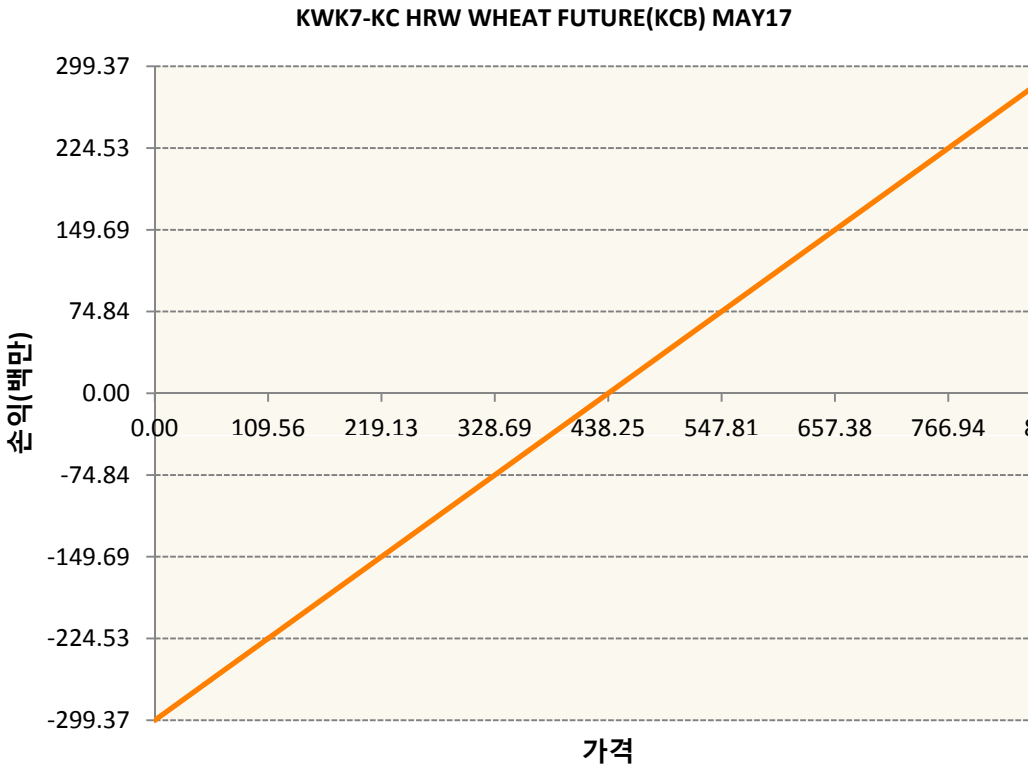

-1,696.10
-2,261.46
가격

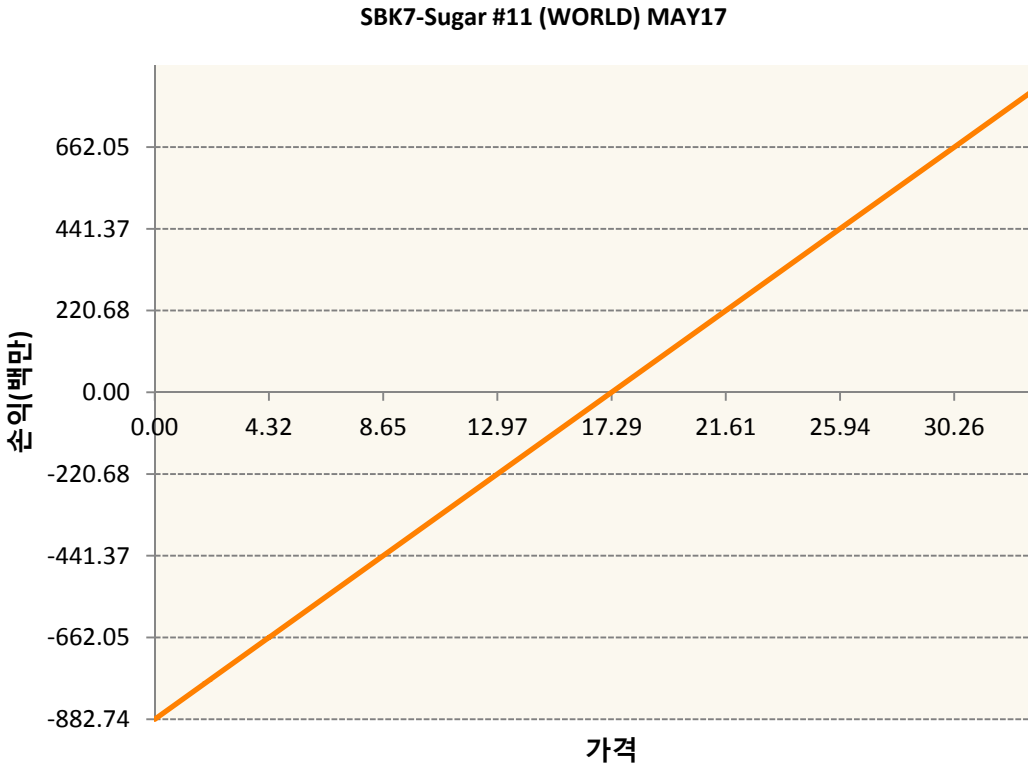

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
349.67
262.25
174.83
87.42
0.00
-87.42
-174.83
-262.25
-349.67
0.00
19.21
38.42
57.63
76.84
96.05
115.26
134.47
손익(백만)
가격

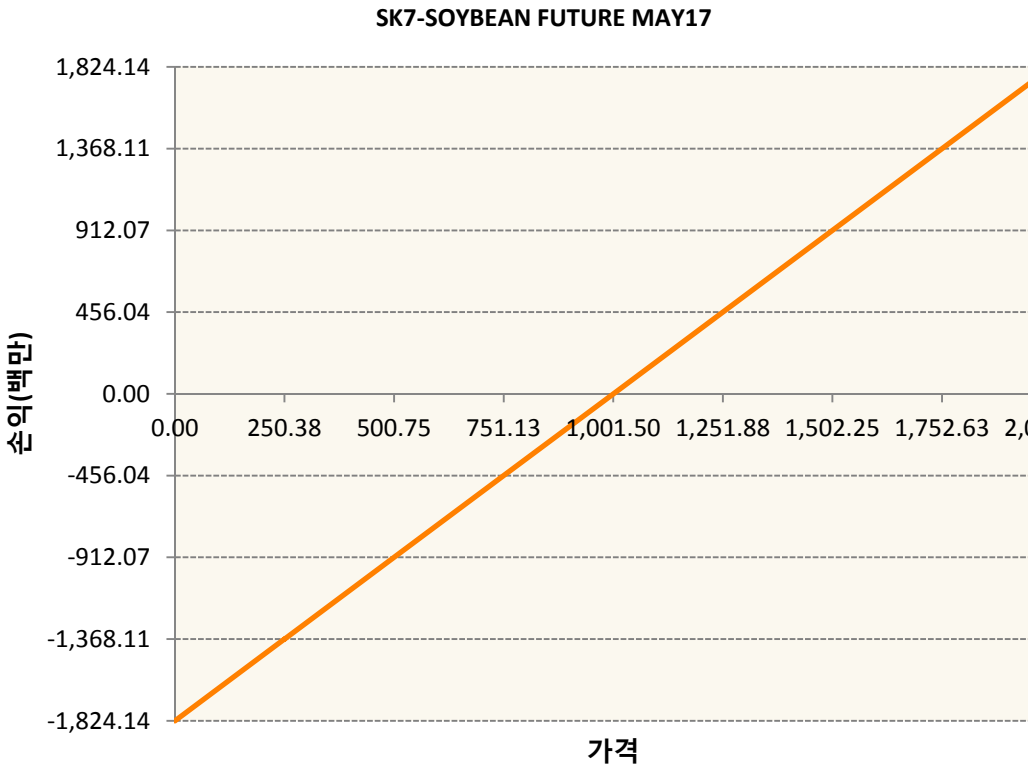

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
679.26
509.45
339.63
169.82
0.00
-169.82
-339.63
-509.45
-679.26
0.00
36.19
72.38
108.56
144.75
180.94
217.13
253.31
손익(백만)

가격

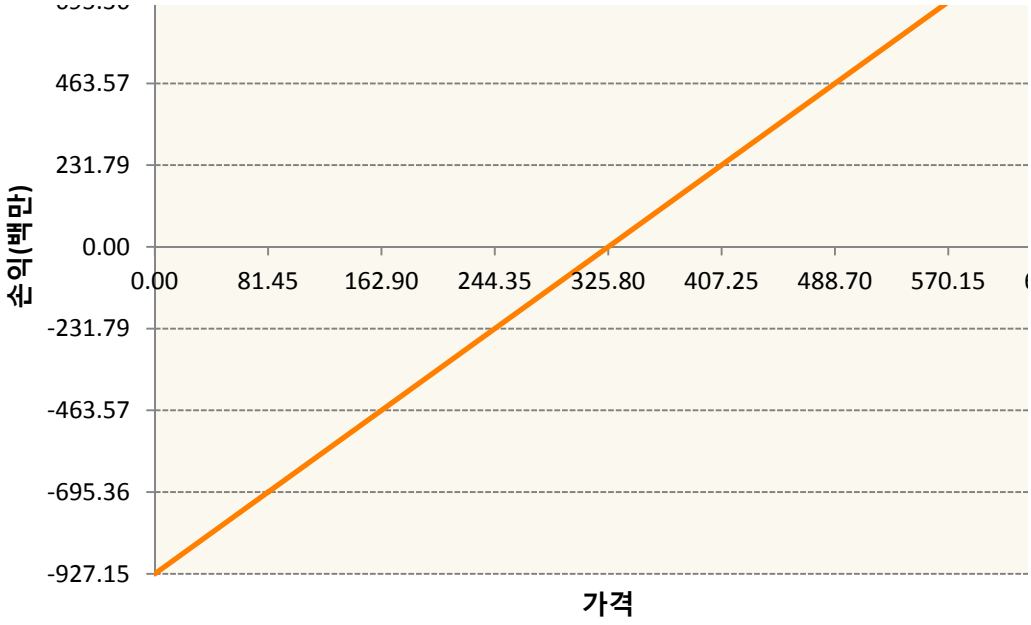

KR4175M40007-2017-04 달러선물
421.09
280.73
140.36
0.00
-140.36
-280.73
-421.09
-561.45
0.00
280.73
561.45
842.18
1,122.90
1,403.63
1,684.35
1,965.08
손익(백만)
가격

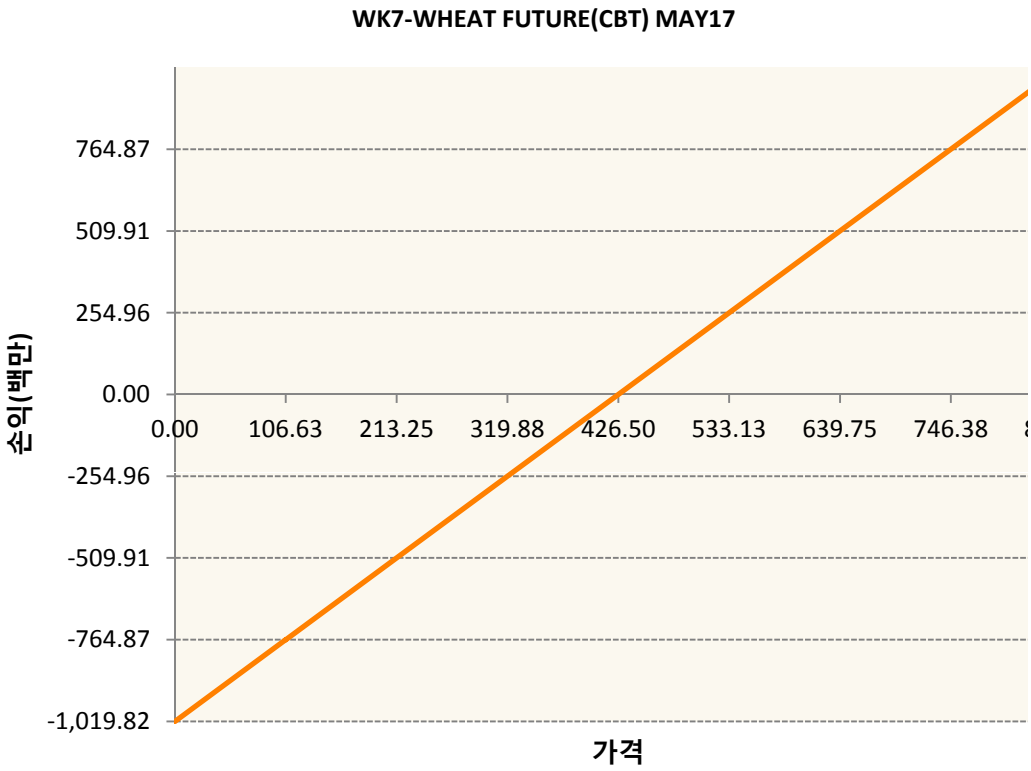

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
299.37
224.53
149.69
74.84
0.00
-74.84
-149.69
-224.53
-299.37
0.00
109.56
219.13
328.69
438.25
547.81
657.38
766.94
손익(백만)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
662.05
441.37
220.68
0.00
-220.68
-441.37
-662.05
-882.74
0.00
4.32
8.65
12.97
17.29
21.61
25.94
30.26
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,824.14
1,368.11
912.07
456.04
0.00
-456.04
-912.07
-1,368.11
-1,824.14
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
927.15
695.36





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	63
CK7	CORN FUTURE MAY17	181
CTK7	COTTON NO.2 FUTR MAY17	28
KCK7	COFFEE "C" FUTURE MAY17	54
KR4175M40(	2017-04 달러선물	45

KWK7	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17	24
SBK7	Sugar #11 (WORLD) MAY17	71
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)

836