공시일	2017-03-24
기준일	2017-03-23

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	2017-03-24
기준일	2017-03-23

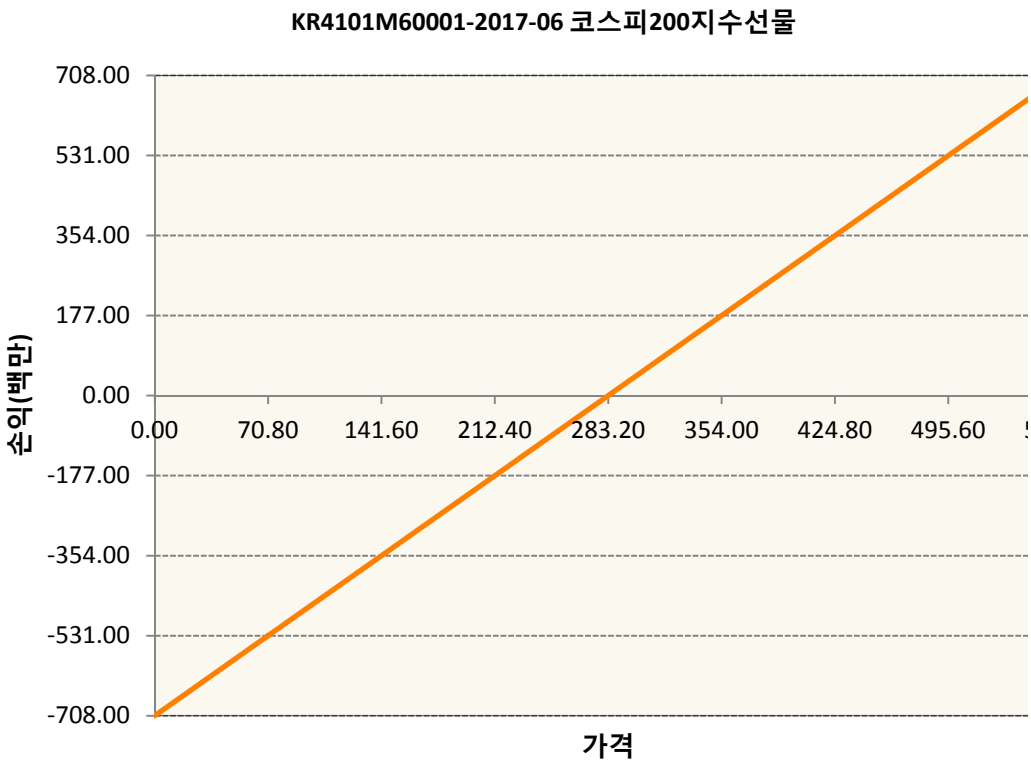
스마트인덱스모

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	708	0	708	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	2017-03-24
기준일	2017-03-23

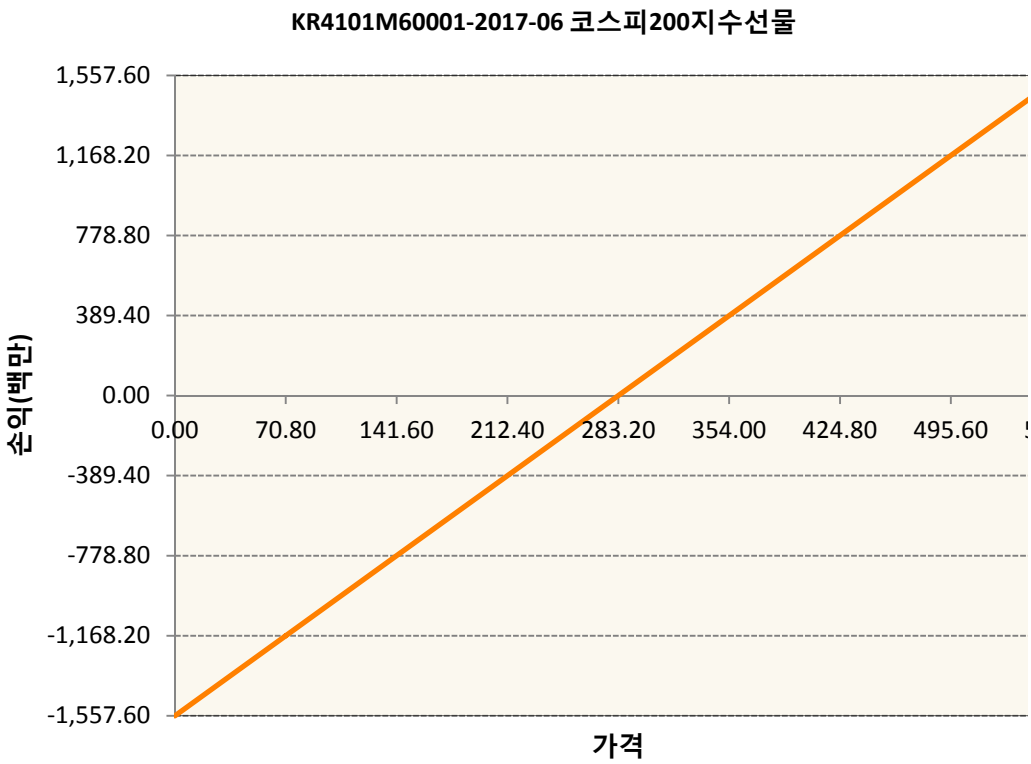
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,558	0	1,558	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	2017-03-24
기준일	2017-03-23

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	952

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

553

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-24
기준일	2017-03-23

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)

434

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-24
기준일	2017-03-23

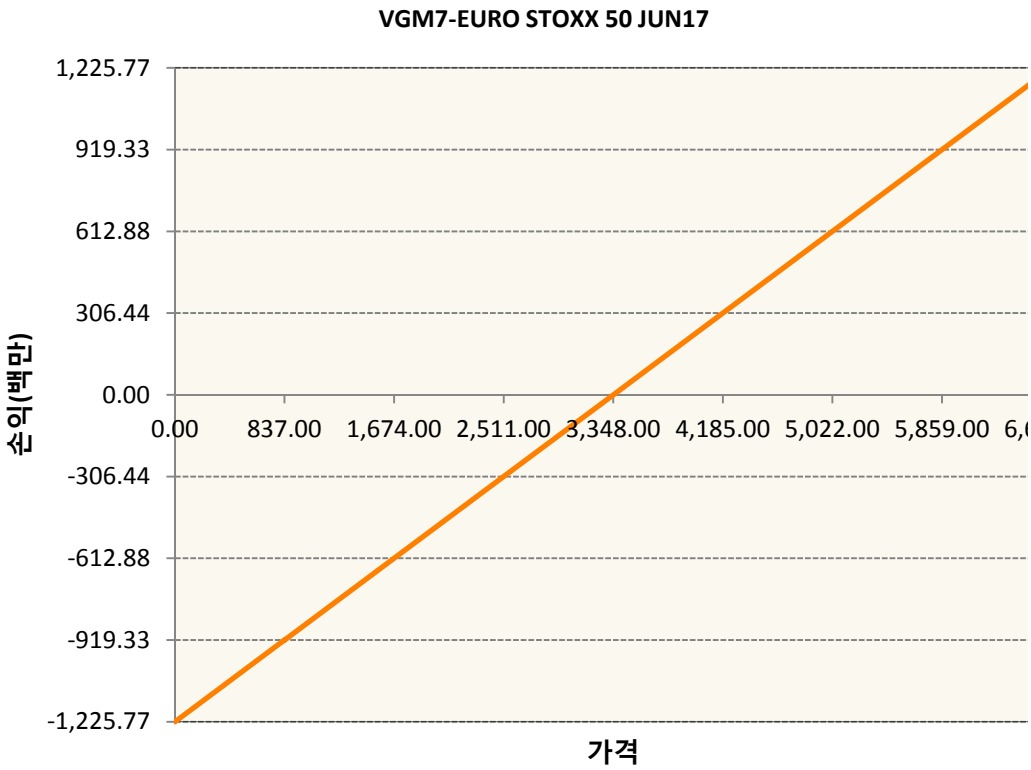
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,226	0	1,226	

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	2017-03-24
기준일	2017-03-23

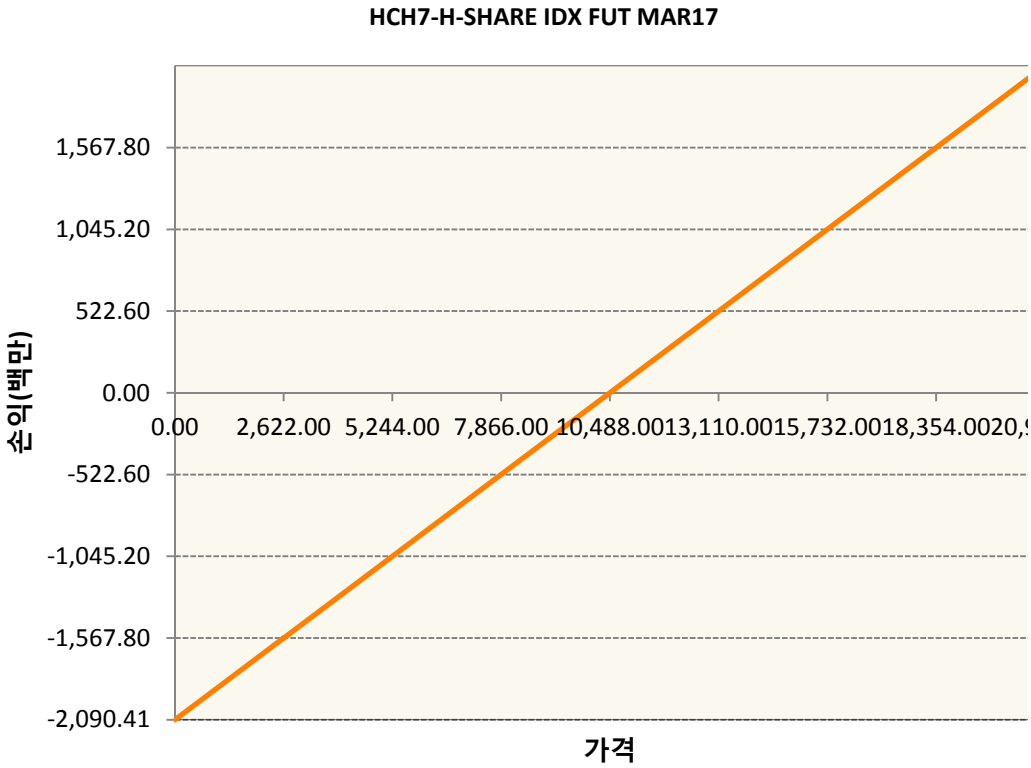
차이나인덱스모(주식-파생형)

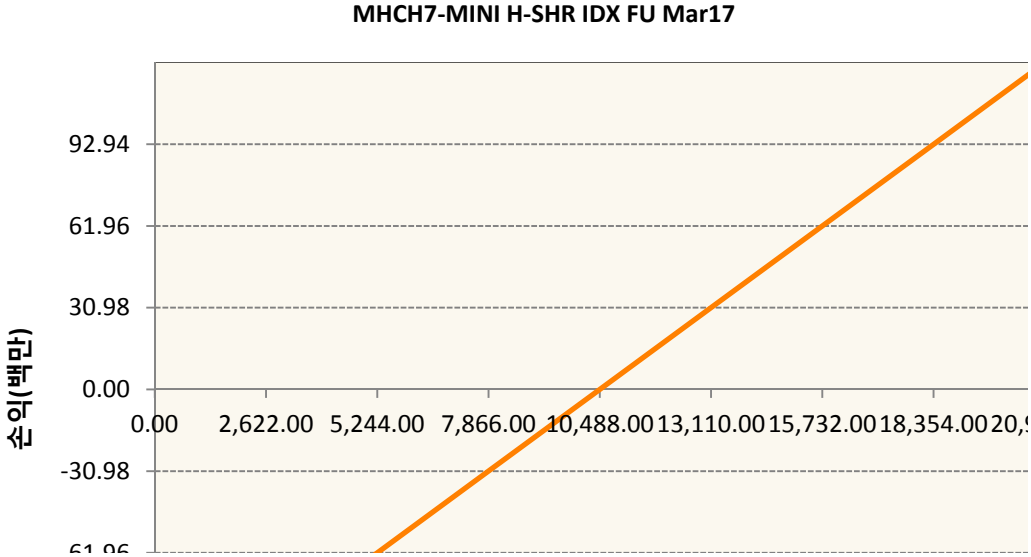
1. 계약금액

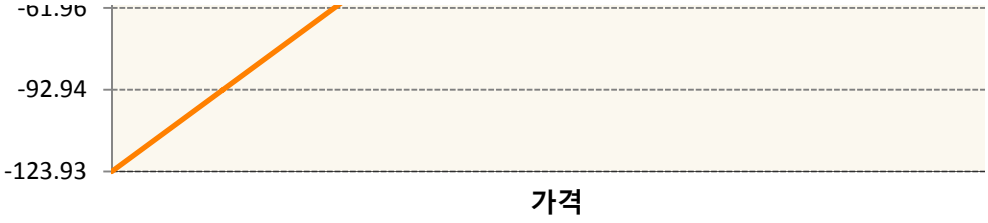
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,214	0	2,214	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)
	191

공시일	2017-03-24
기준일	2017-03-23

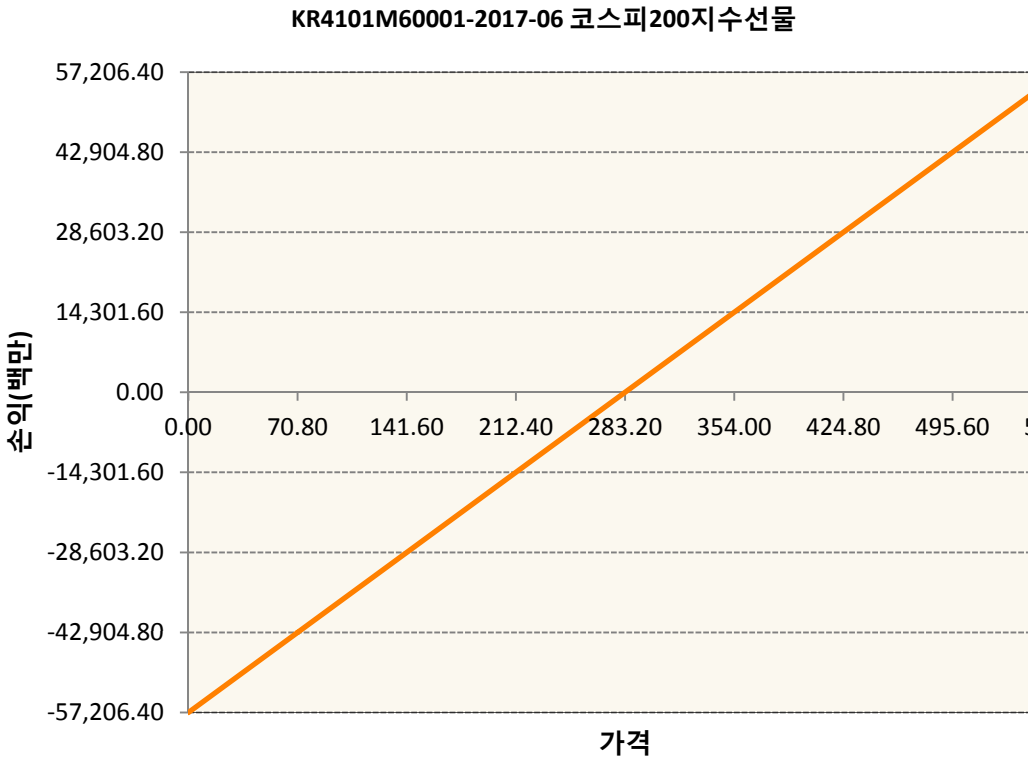
커버드콜모(주식혼합-파생형)

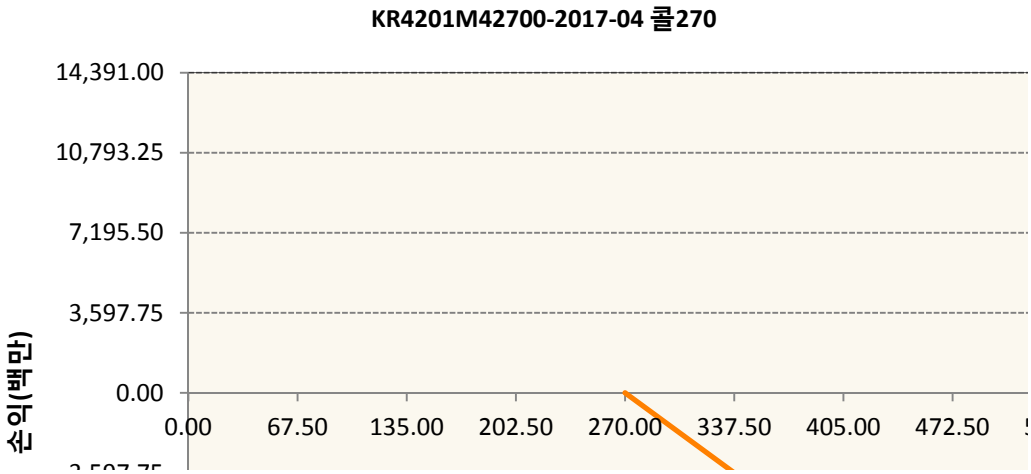
1. 계약금액

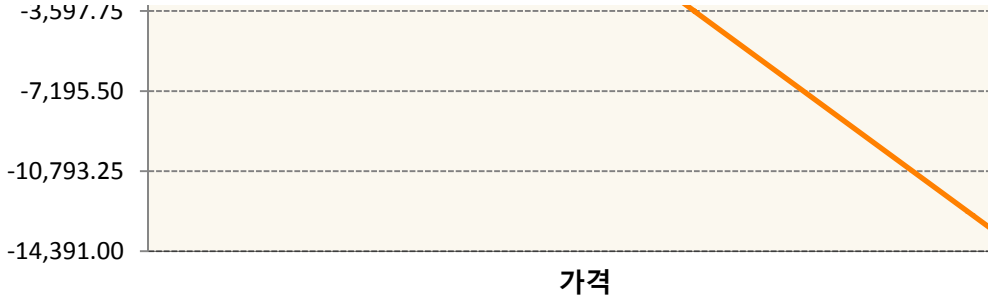
(단위:백만원)

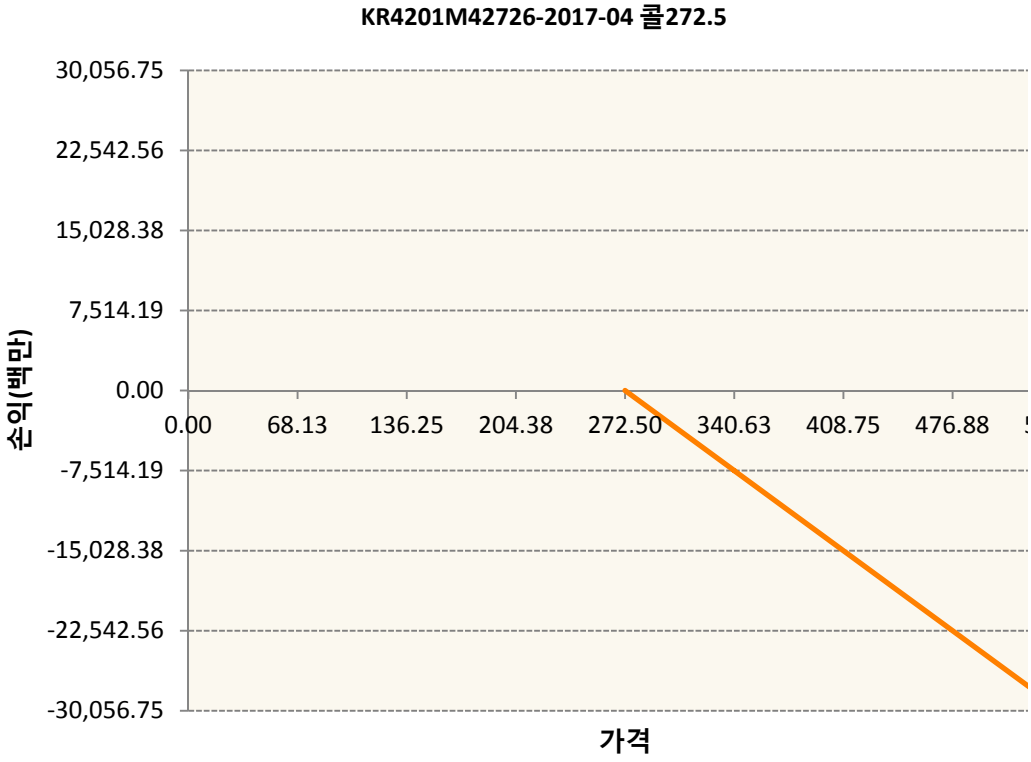
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	1,420	-1,420	장내
신규	유가증권	옵션	256	0	256	장내
누계	유가증권	선물	57,206	0	57,206	장내
누계	유가증권	옵션	0	44,448	-44,448	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							4,570
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,570	-4,570	-4,570	-4,570	-4,570	-4,570	-4,570
-5.33%	-3,047	-3,047	-3,047	-3,047	-3,047	-3,047	-3,047
-2.67%	-1,523	-1,523	-1,523	-1,523	-1,523	-1,523	-1,523
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,523	1,523	1,523	1,523	1,523	1,523	1,523
5.33%	3,047	3,047	3,047	3,047	3,047	3,047	3,047
8.00%	4,570	4,570	4,570	4,570	4,570	4,570	4,570
KR4201M42 2017-04 콜270							5,973
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,425	3,406	3,383	3,355	3,322	3,287	3,248
-5.33%	3,089	3,025	2,959	2,893	2,827	2,760	2,693
-2.67%	1,894	1,845	1,792	1,736	1,679	1,620	1,560
0%	41	32	18	0	-22	-48	-78
2.67%	-1,957	-1,958	-1,959	-1,961	-1,965	-1,972	-1,980
5.33%	-3,965	-3,965	-3,965	-3,965	-3,965	-3,966	-3,968
8.00%	-5,973	-5,973	-5,973	-5,973	-5,973	-5,973	-5,973
KR4201M42: 2017-04 콜272.5							12,252

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,857	5,838	5,811	5,776	5,732	5,680	5,621
-5.33%	5,497	5,390	5,278	5,160	5,039	4,915	4,789
-2.67%	3,675	3,542	3,407	3,270	3,132	2,993	2,853
0%	153	112	61	0	-70	-148	-233
2.67%	-3,942	-3,946	-3,953	-3,964	-3,981	-4,004	-4,034
5.33%	-8,096	-8,096	-8,096	-8,097	-8,099	-8,103	-8,109
8.00%	-12,251	-12,251	-12,251	-12,251	-12,251	-12,251	-12,252

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

23,431

공시일	2017-03-24
기준일	2017-03-23

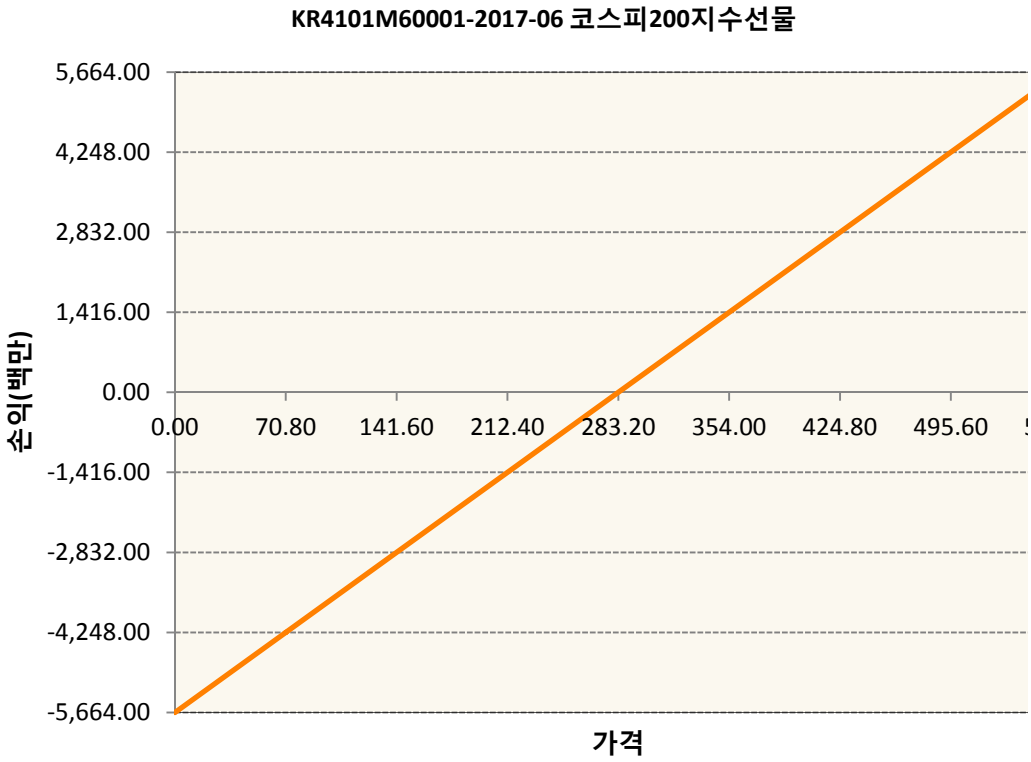
커버드콜목표전환형증권투자신탁

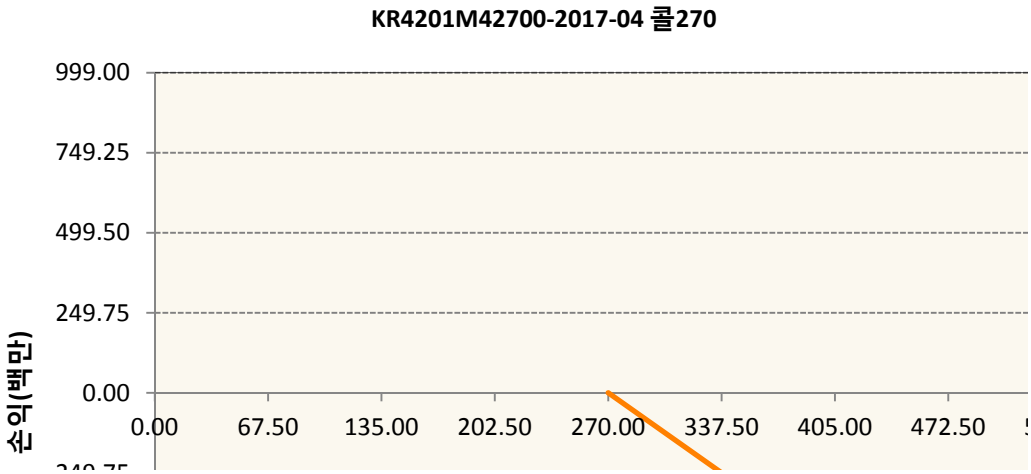
1. 계약금액

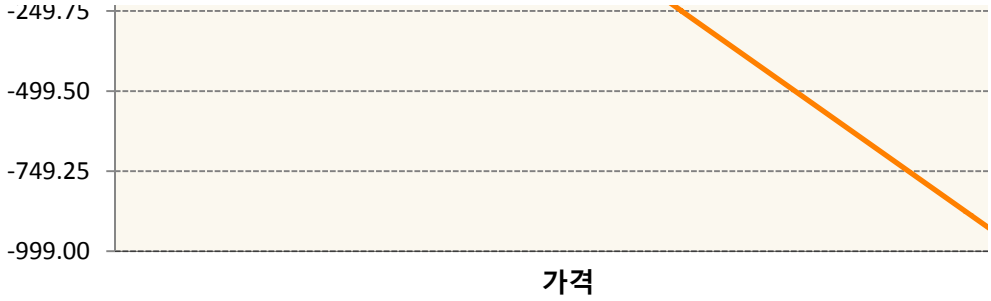
(단위:백만원)

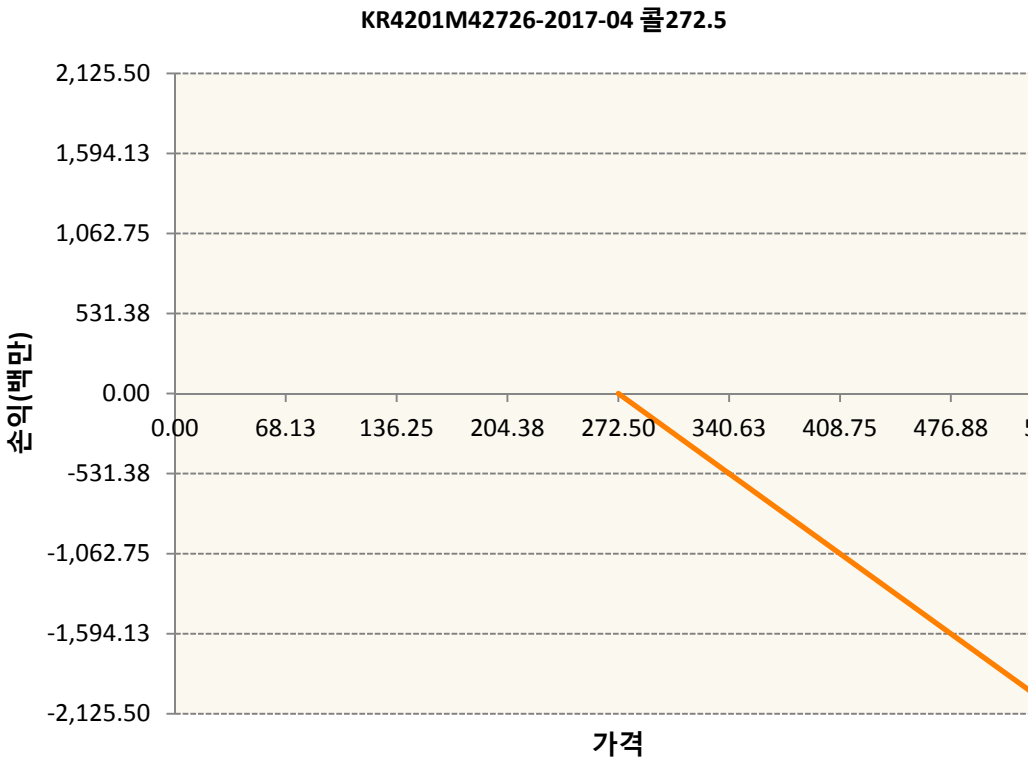
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	26	0	26	장내
누계	유가증권	선물	5,664	0	5,664	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,125	-3,125	장내

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%	-302	-302	-302	-302	-302	-302	-302
-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%	302	302	302	302	302	302	302
8.00%	452	452	452	452	452	452	452
KR4201M42 2017-04 콜270							415
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	238	236	235	233	231	228	225
-5.33%	214	210	205	201	196	192	187
-2.67%	131	128	124	121	117	112	108
0%	3	2	1	0	-2	-3	-5
2.67%	-136	-136	-136	-136	-136	-137	-137
5.33%	-275	-275	-275	-275	-275	-275	-275
8.00%	-415	-415	-415	-415	-415	-415	-415
KR4201M42 2017-04 콜272.5							866

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	414	413	411	408	405	402	397
-5.33%	389	381	373	365	356	348	339
-2.67%	260	250	241	231	221	212	202
0%	11	8	4	0	-5	-10	-16
2.67%	-279	-279	-280	-280	-282	-283	-285
5.33%	-573	-573	-573	-573	-573	-573	-573
8.00%	-866	-866	-866	-866	-866	-866	-866

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

1,733

공시일	2017-03-24
기준일	2017-03-23

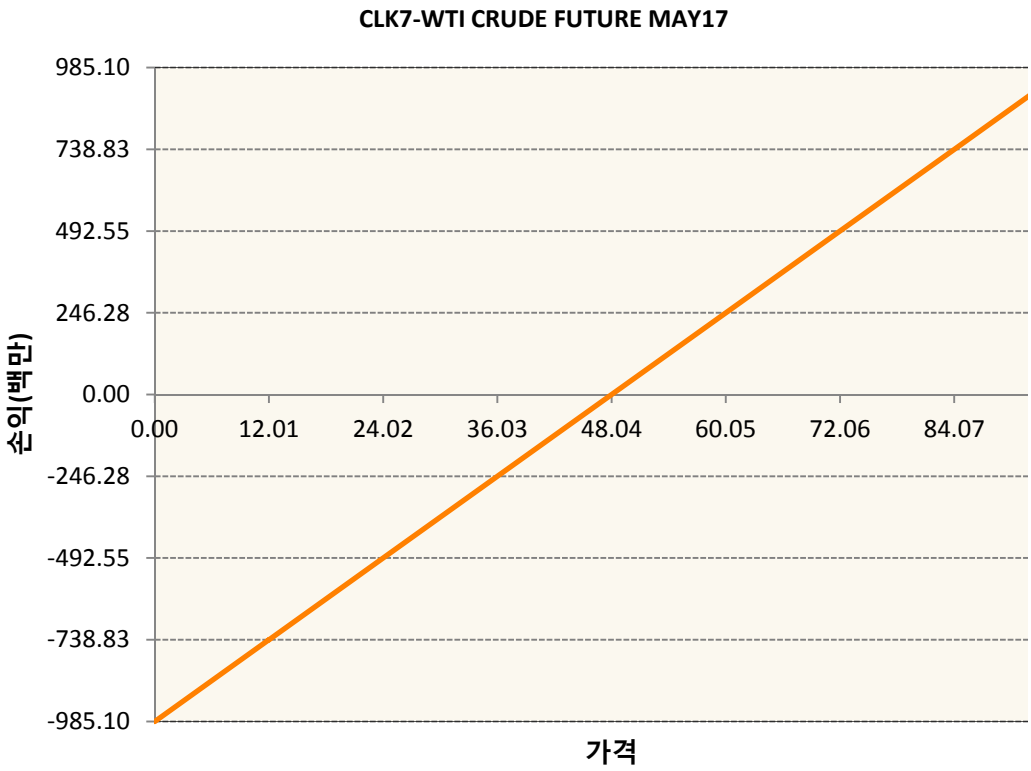
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

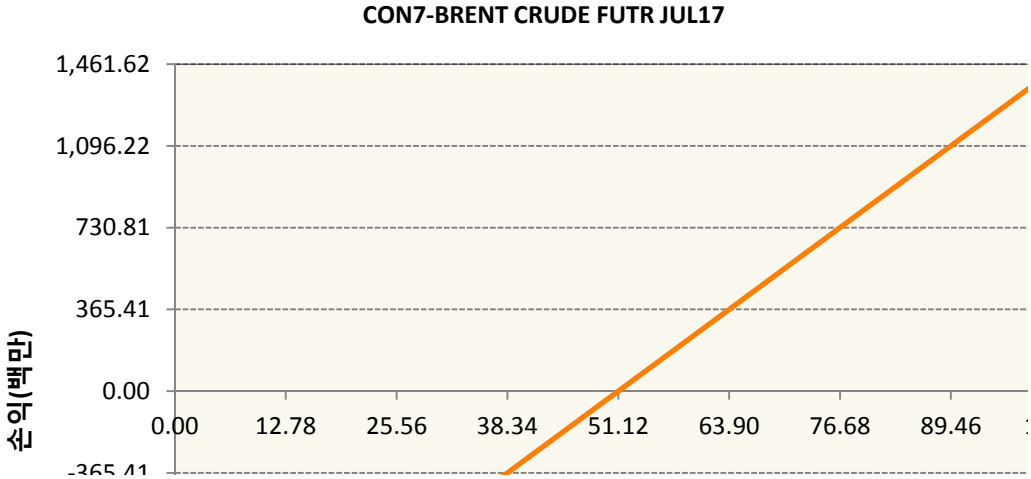
1. 계약금액

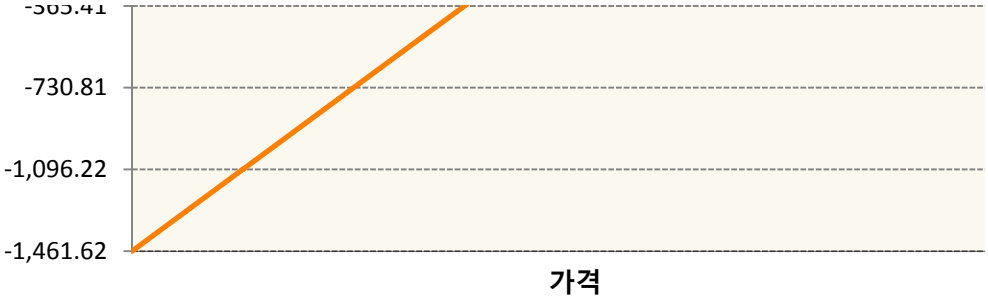
(단위:백만원)

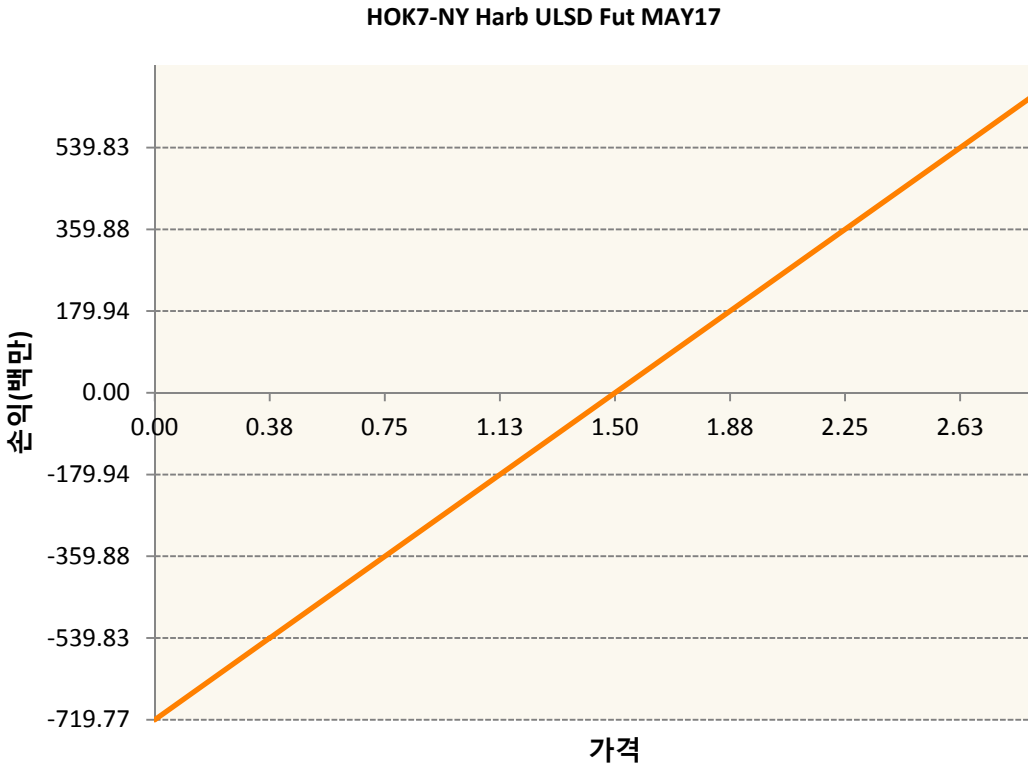
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	985	0	985	
누계	유가증권	선물	4,379	404	3,975	

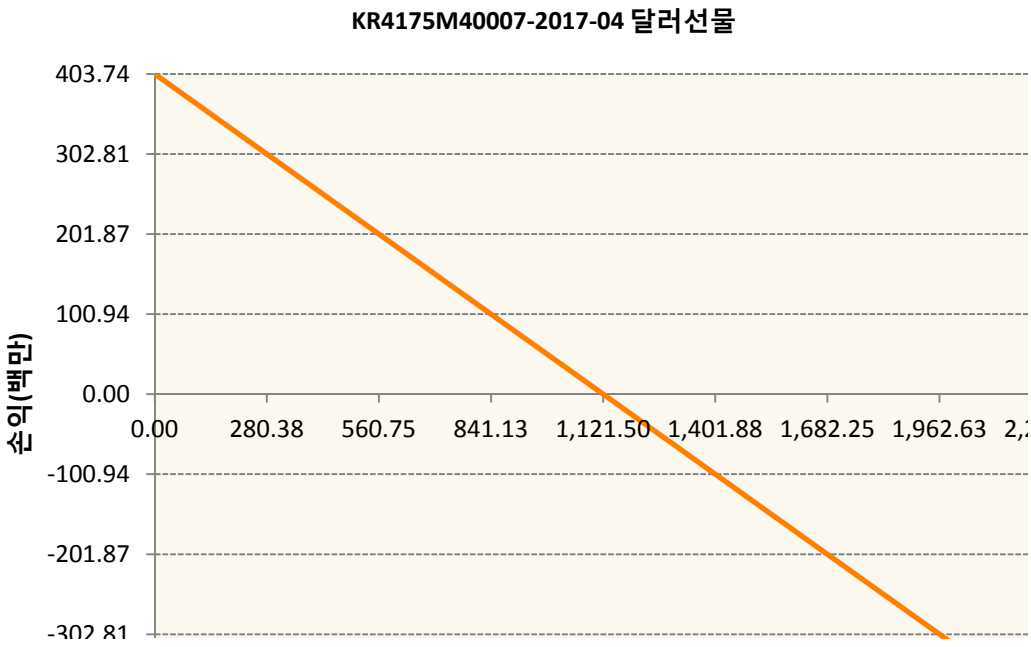
2. 만기시점의 손익구조

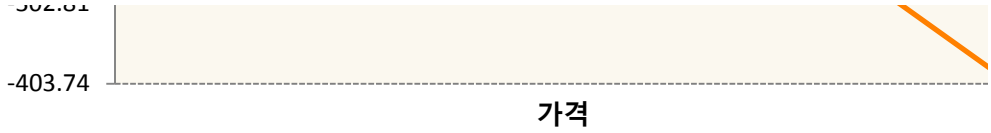


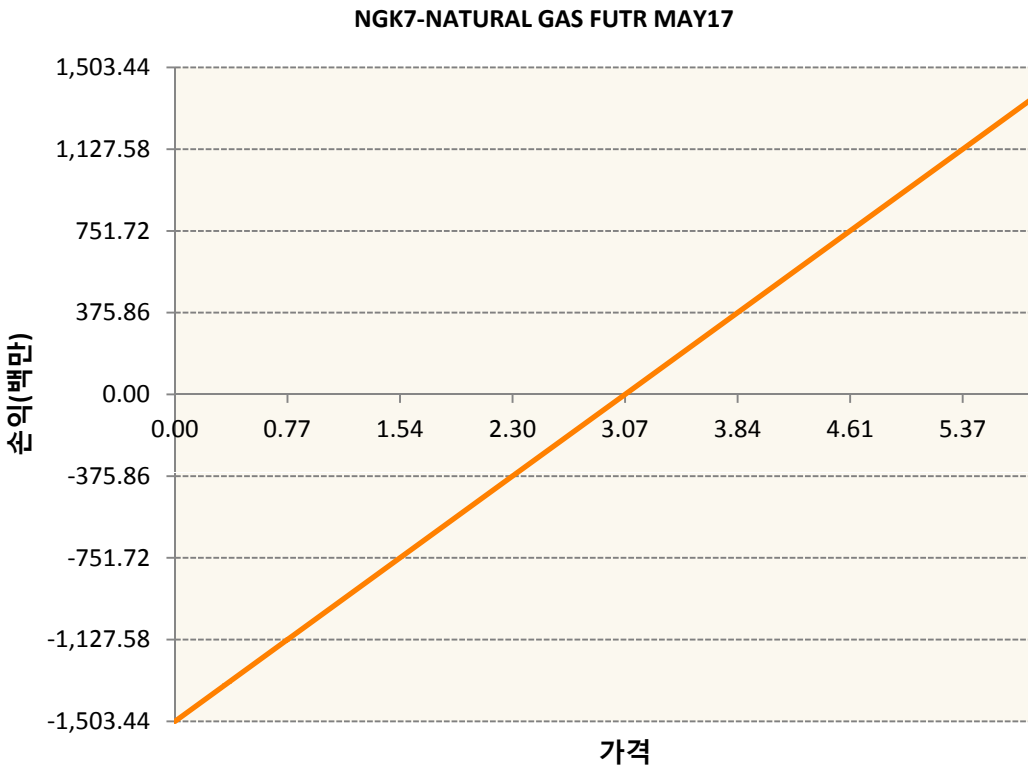


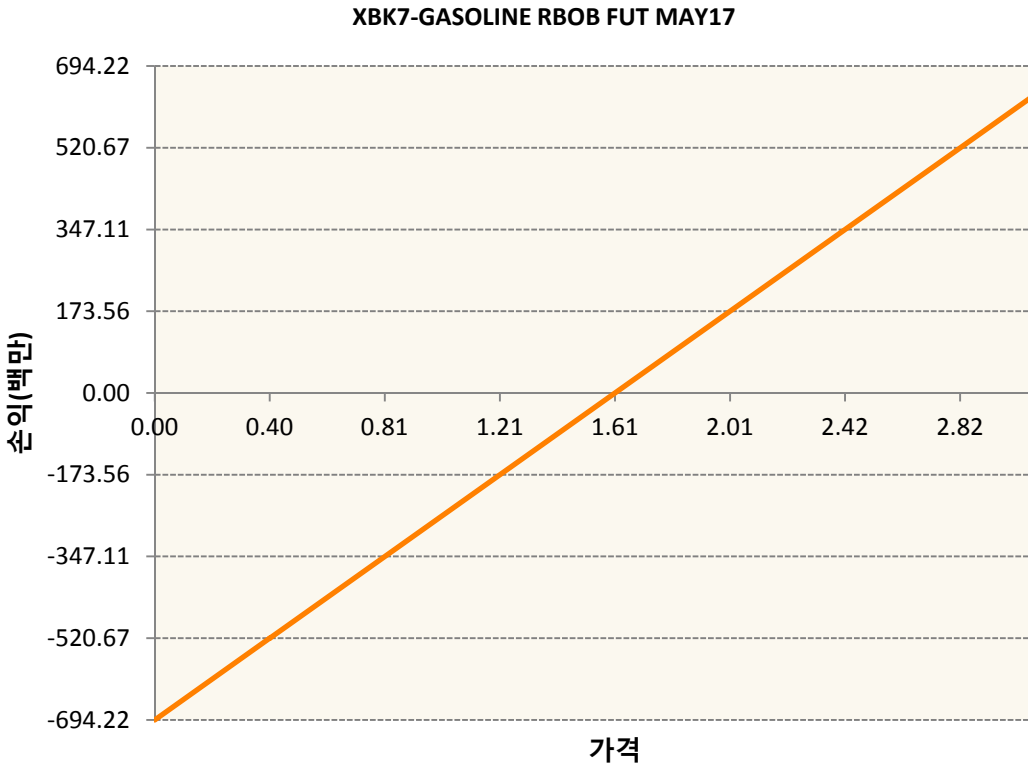

-730.81
-1,096.22
-1,461.62
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
539.83
359.88
179.94
0.00
-179.94
-359.88
-539.83
-719.77
0.00
0.38
0.75
1.13
1.50
1.88
2.25
2.63
순익(백만)
가격


KR4175M40007-2017-04 달러선물
403.74
302.81
201.87
100.94
0.00
-100.94
-201.87
0.00
280.38
560.75
841.13
1,121.50
1,401.88
1,682.25
1,962.63
순익(백만)


-403.74
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,503.44
1,127.58
751.72
375.86
0.00
-375.86
-751.72
-1,127.58
-1,503.44
0.00
0.77
1.54
2.30
3.07
3.84
4.61
5.37
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
694.22
520.67
347.11
173.56
0.00
-173.56
-347.11
-520.67
-694.22
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	79
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	117
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	58
KR4175M40(	2017-04 달러선물	32
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	120
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	56

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

954

공시일	2017-03-24
기준일	2017-03-23

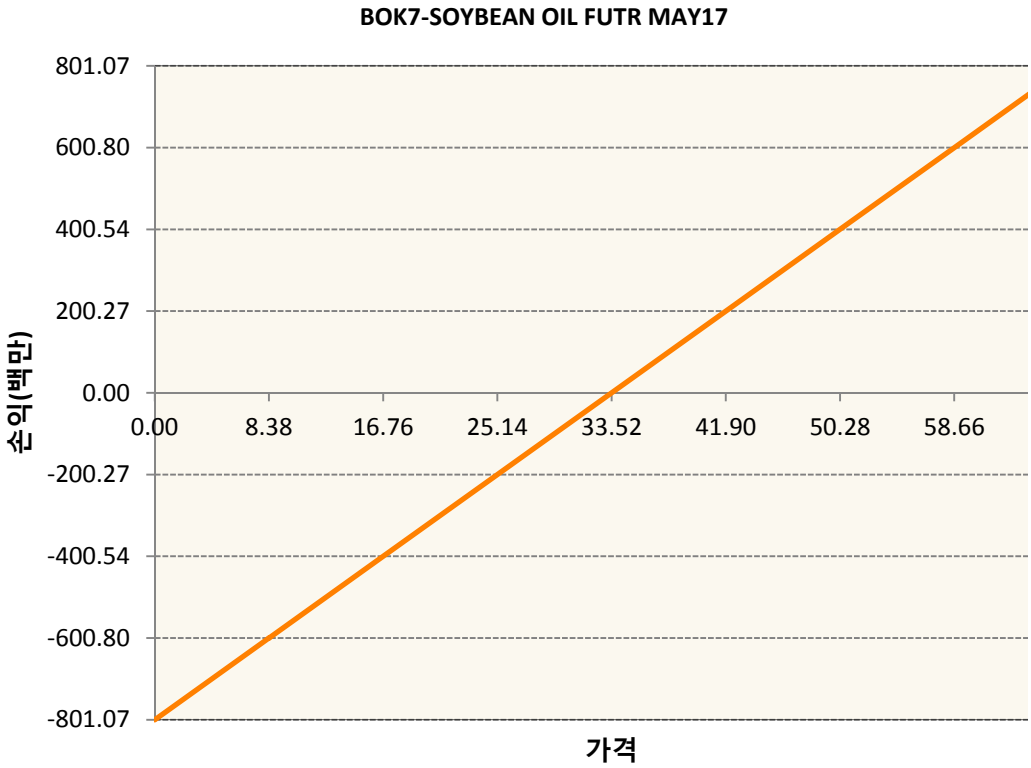
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

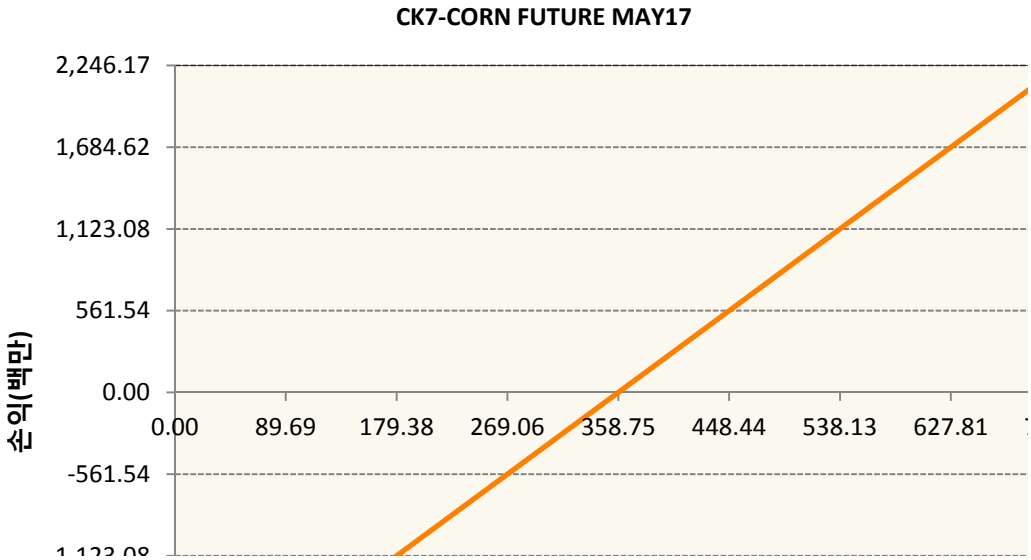
1. 계약금액

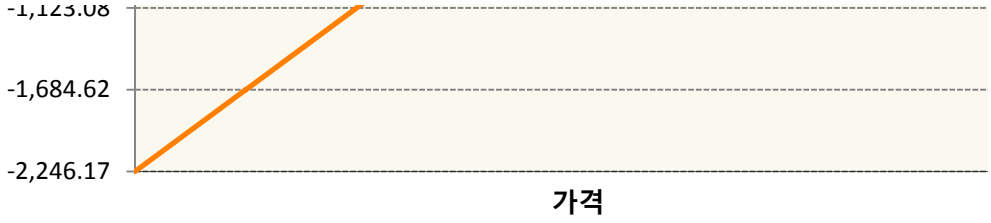
(단위:백만원)

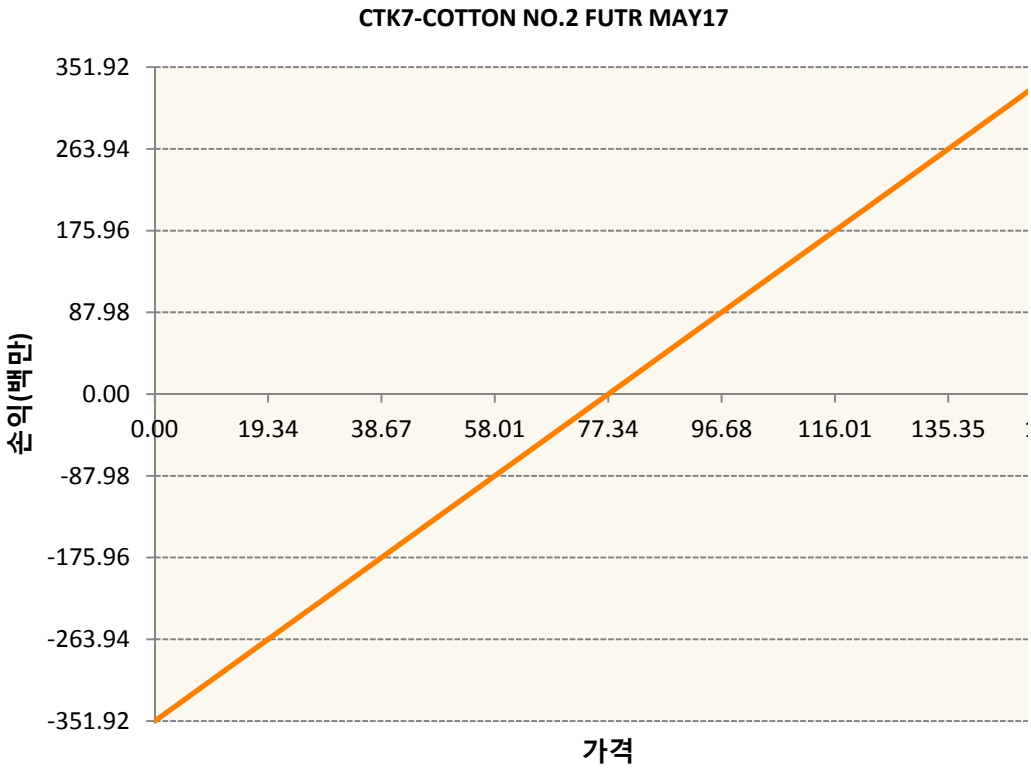
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,995	561	8,434	

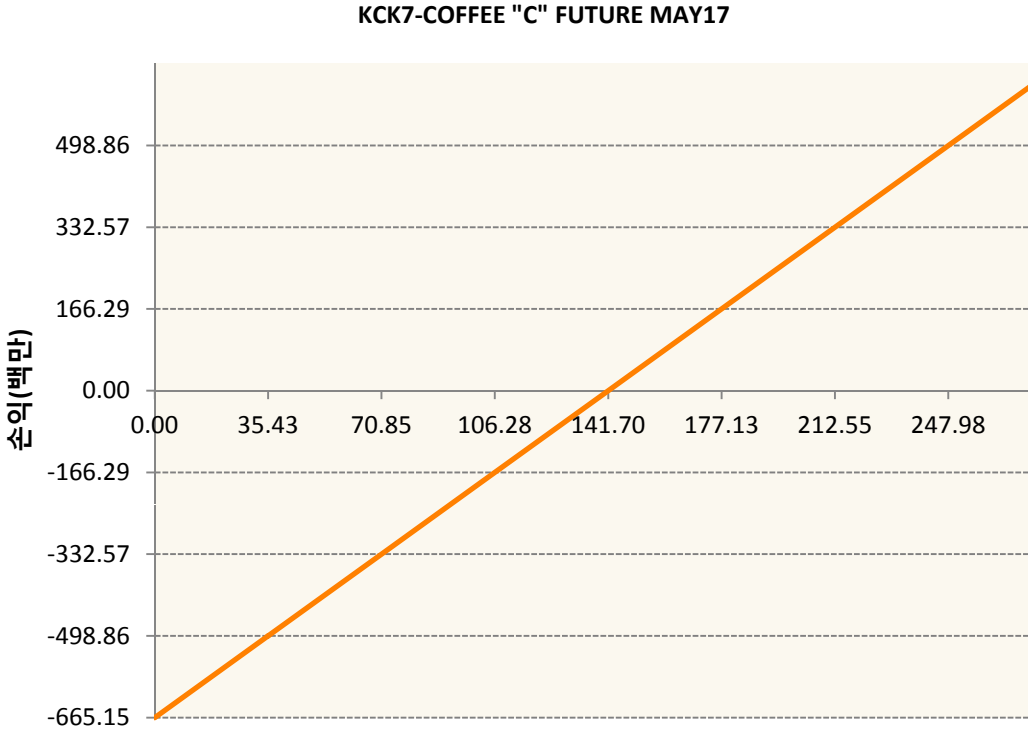
2. 만기시점의 손익구조



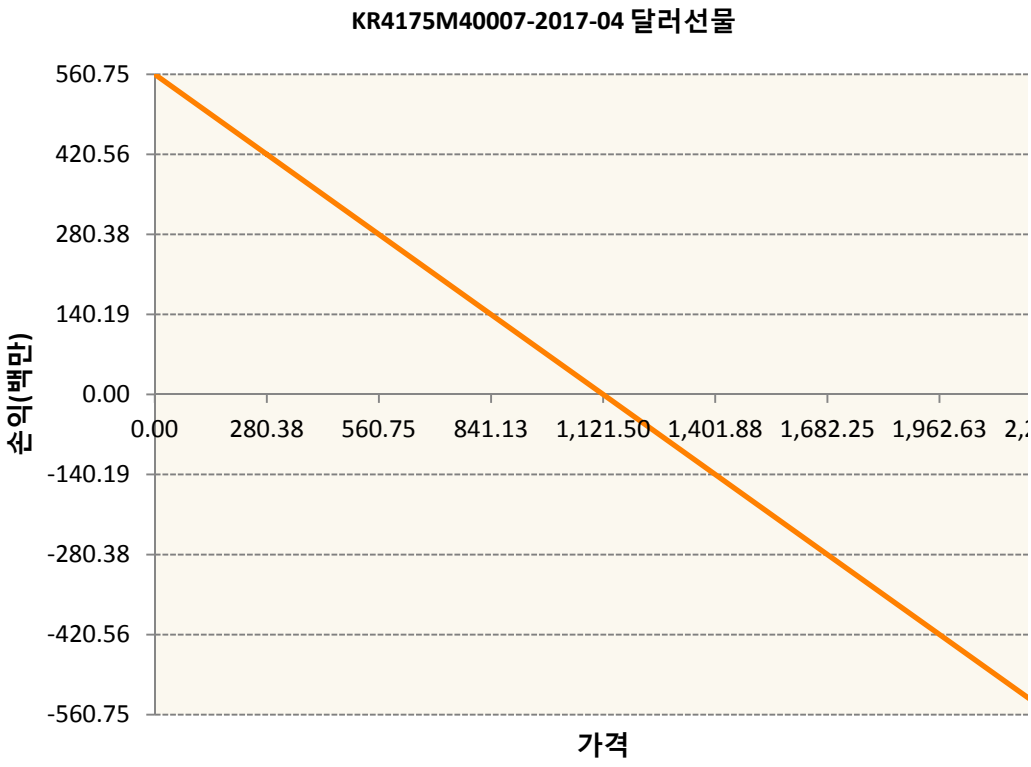


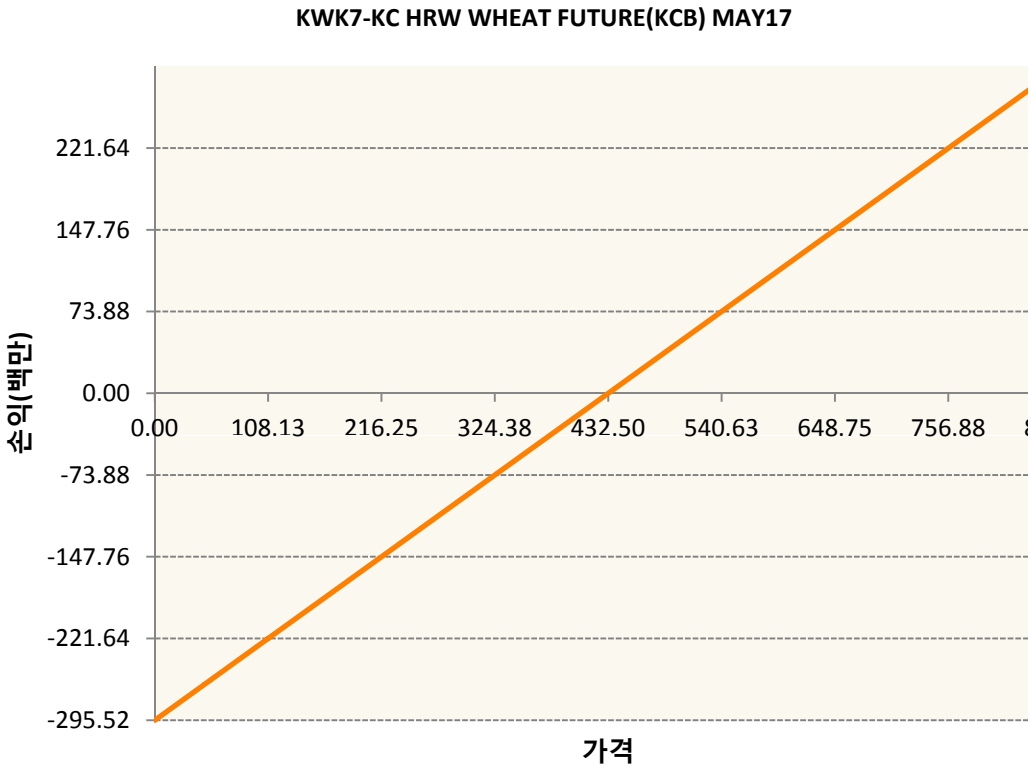

-1,123.08
-1,684.62
-2,246.17
가격

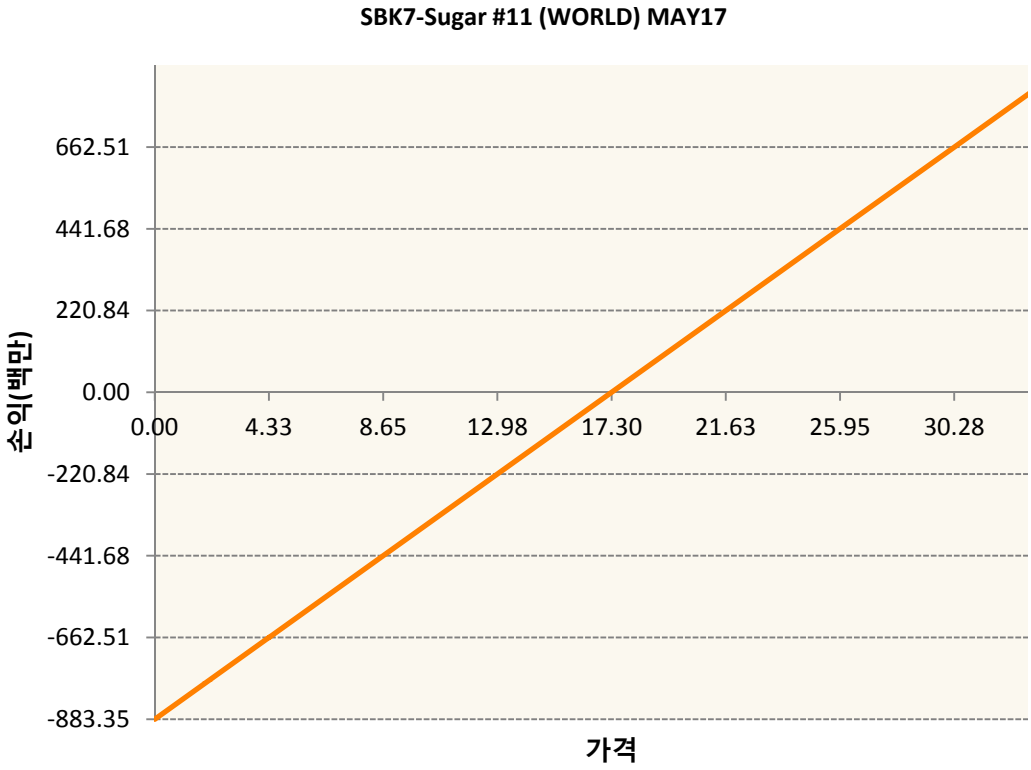

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
351.92
263.94
175.96
87.98
0.00
-87.98
-175.96
-263.94
-351.92
0.00
19.34
38.67
58.01
77.34
96.68
116.01
135.35
손익(백만)
가격

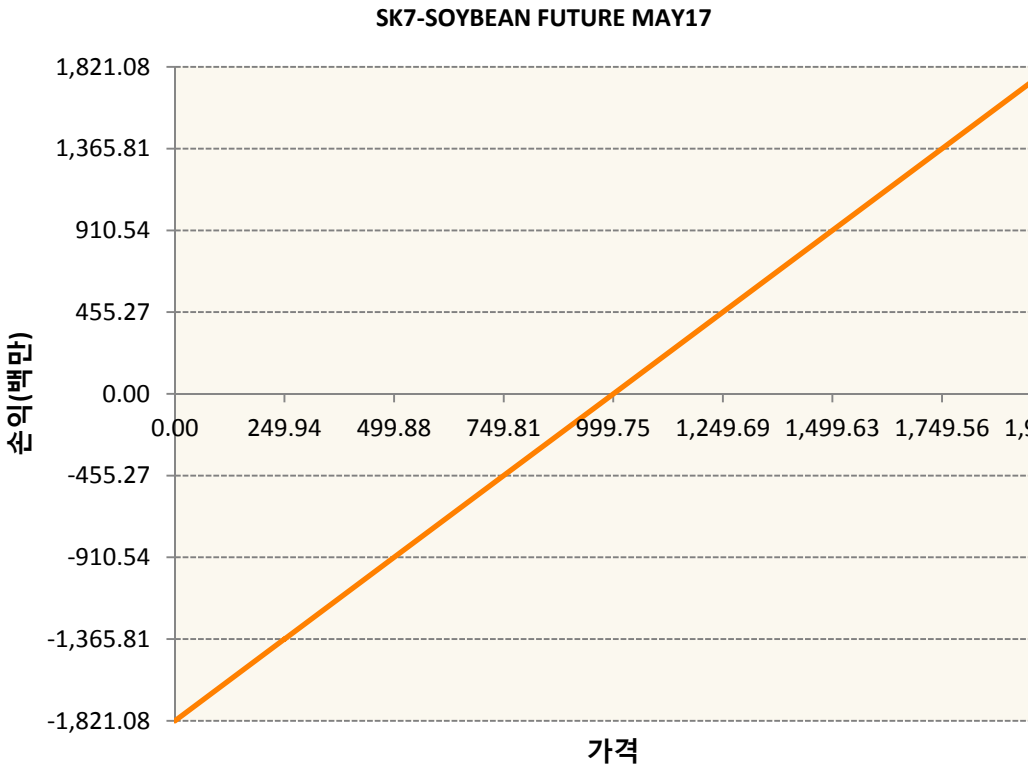

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
498.86
332.57
166.29
0.00
-166.29
-332.57
-498.86
-665.15
0.00
35.43
70.85
106.28
141.70
177.13
212.55
247.98
손익(백만)

가격

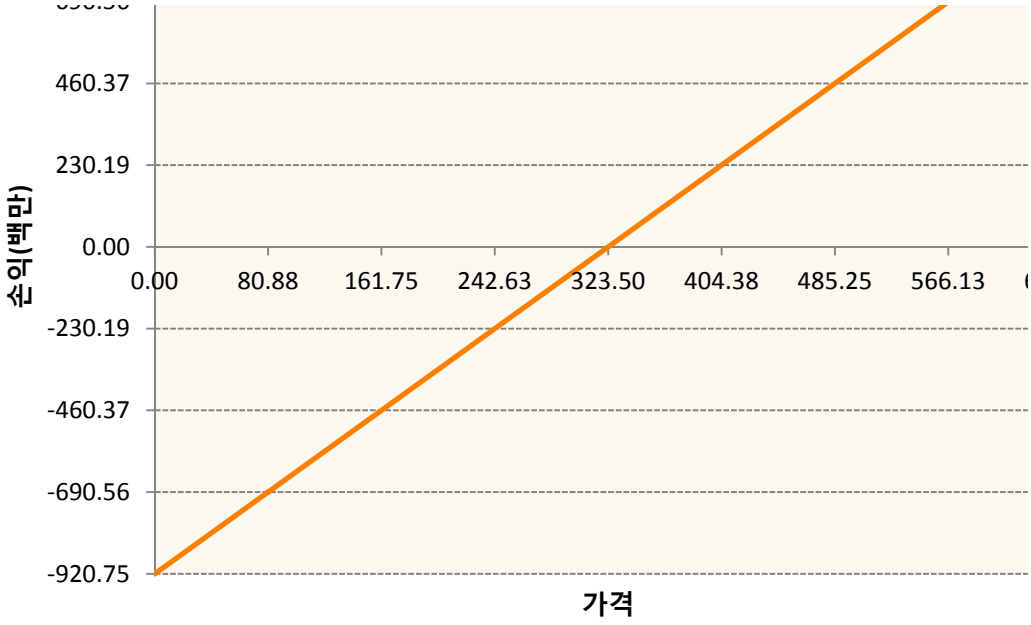

KR4175M40007-2017-04 달러선물
560.75
420.56
280.38
140.19
0.00
-140.19
-280.38
-420.56
-560.75
0.00
280.38
560.75
841.13
1,121.50
1,401.88
1,682.25
1,962.63
손익(백만)
가격

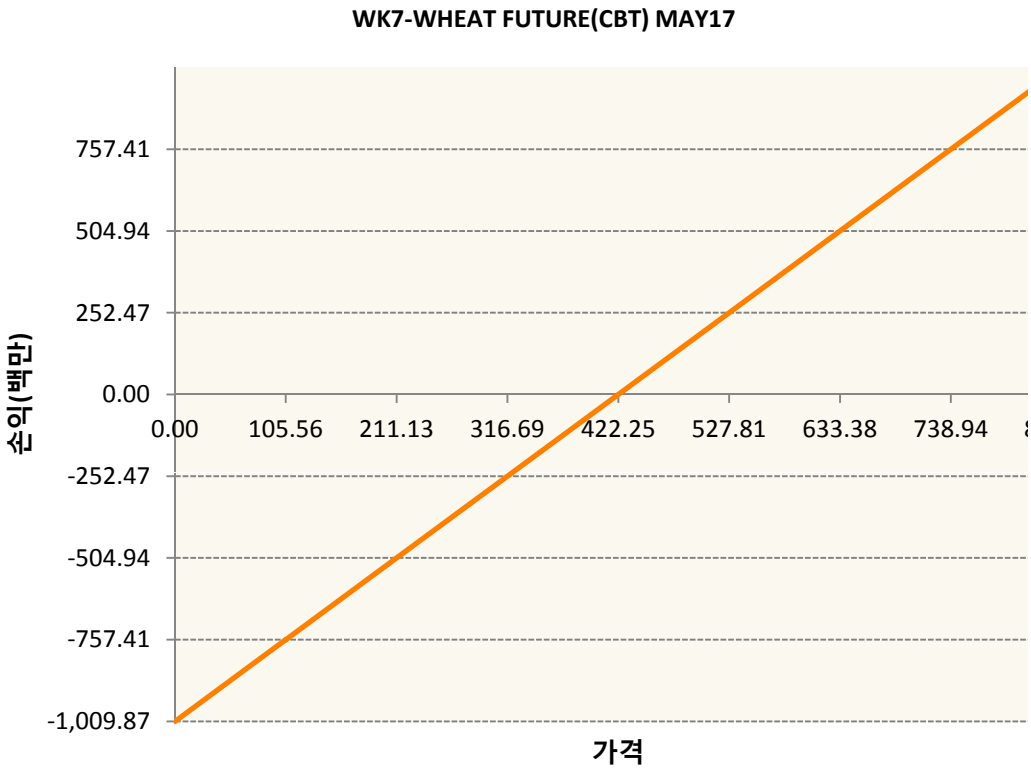

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
221.64
147.76
73.88
0.00
-73.88
-147.76
-221.64
-295.52
0.00
108.13
216.25
324.38
432.50
540.63
648.75
756.88
손익(백만)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
662.51
441.68
220.84
0.00
-220.84
-441.68
-662.51
-883.35
0.00
4.33
8.65
12.98
17.30
21.63
25.95
30.28
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,821.08
1,365.81
910.54
455.27
0.00
-455.27
-910.54
-1,365.81
-1,821.08
0.00
249.94
499.88
749.81
999.75
1,249.69
1,499.63
1,749.56
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
920.75
690.56





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	64
CK7	CORN FUTURE MAY17	180
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	71
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	146
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	74
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	81

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

831