공시일	2017-03-27
기준일	2017-03-24

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	2017-03-27
기준일	2017-03-24

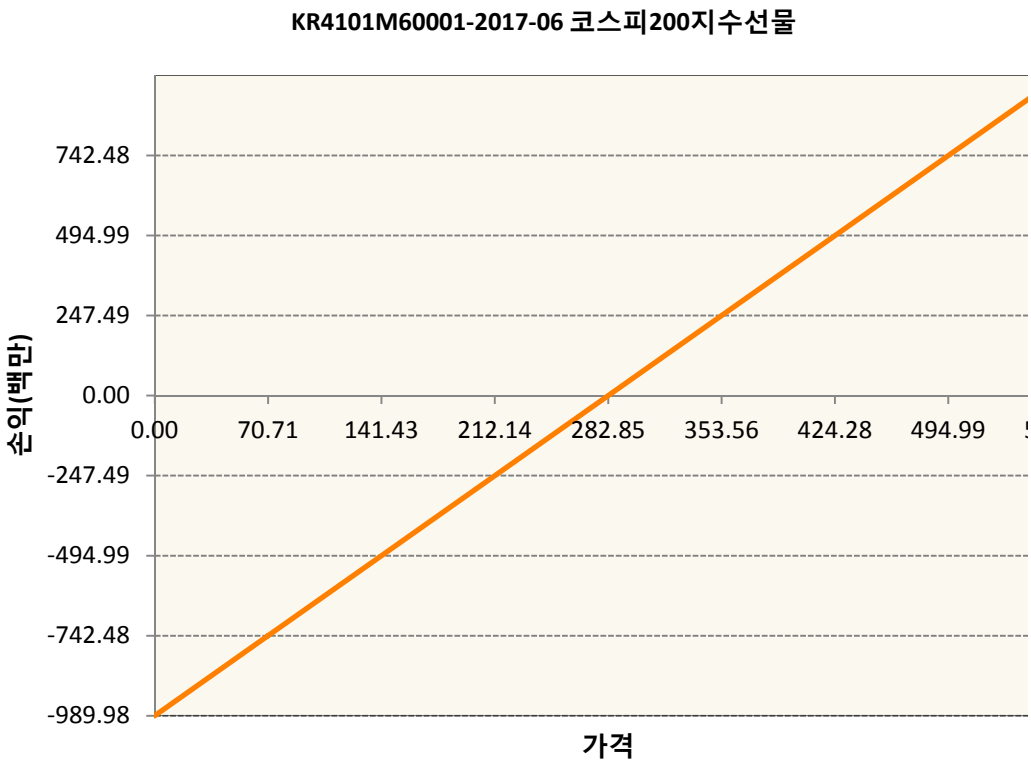
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	283	0	283	장내
누계	유가증권	선물	990	0	990	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							79
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	26	26	26	26	26	26	26
5.33%	53	53	53	53	53	53	53
8.00%	79	79	79	79	79	79	79

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

51

공시일	2017-03-27
기준일	2017-03-24

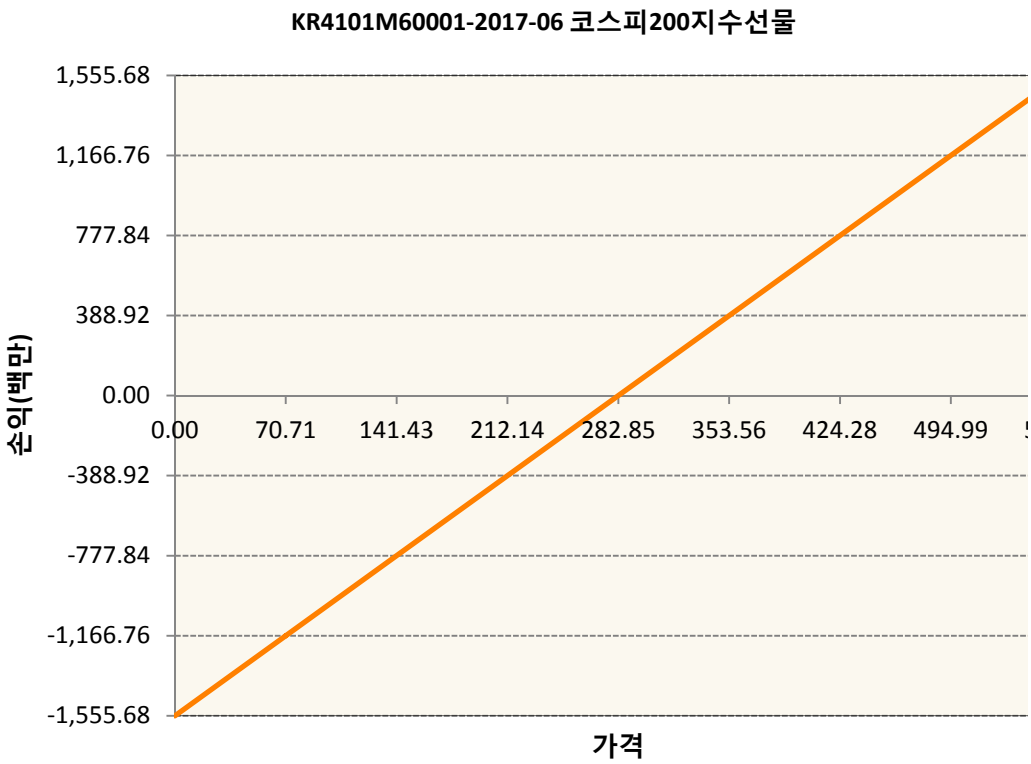
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,556	0	1,556	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	2017-03-27
기준일	2017-03-24

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	953

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

554

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-27
기준일	2017-03-24

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	397

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

436

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-27
기준일	2017-03-24

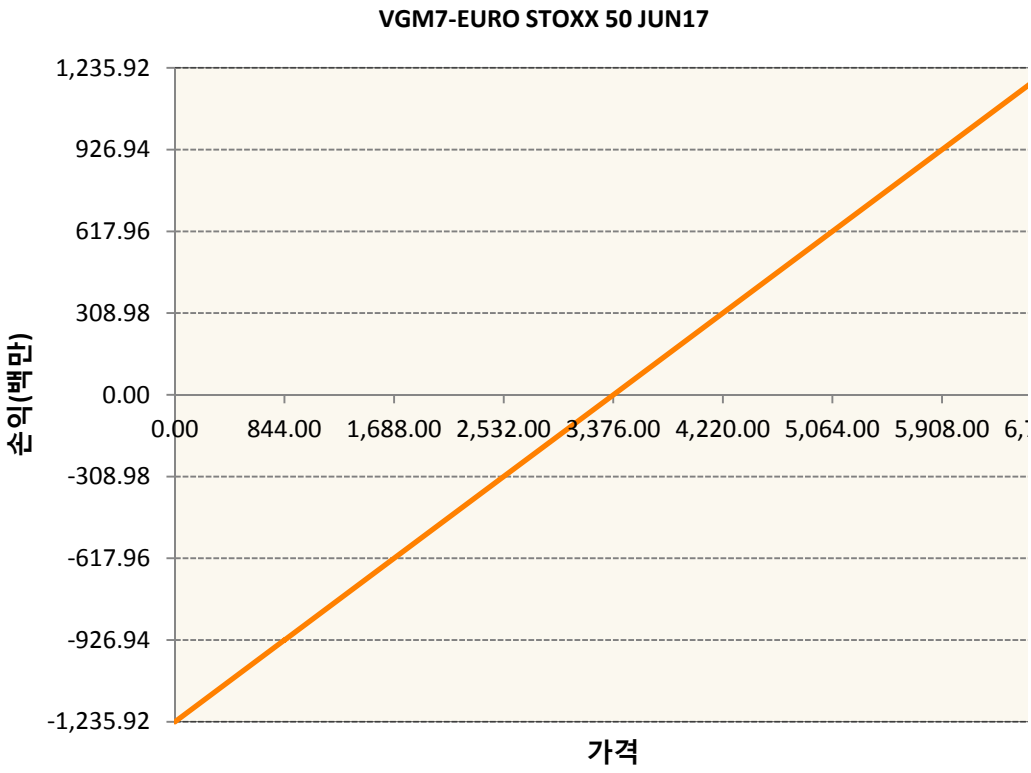
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,236	0	1,236	

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	2017-03-27
기준일	2017-03-24

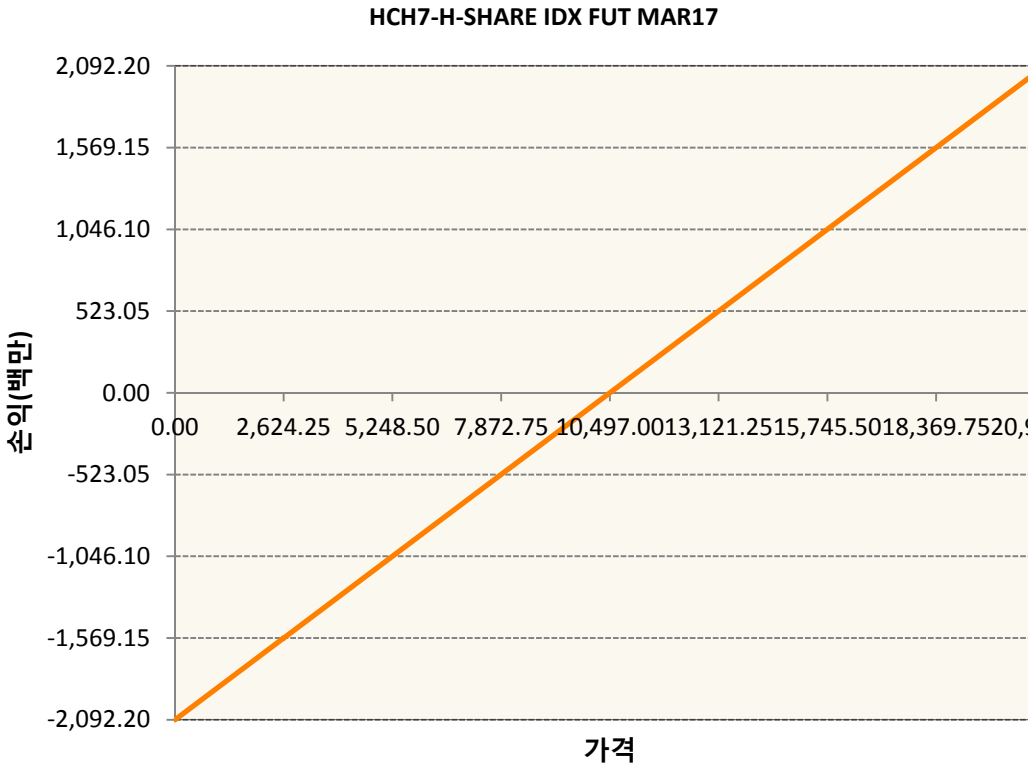
차이나인덱스모(주식-파생형)

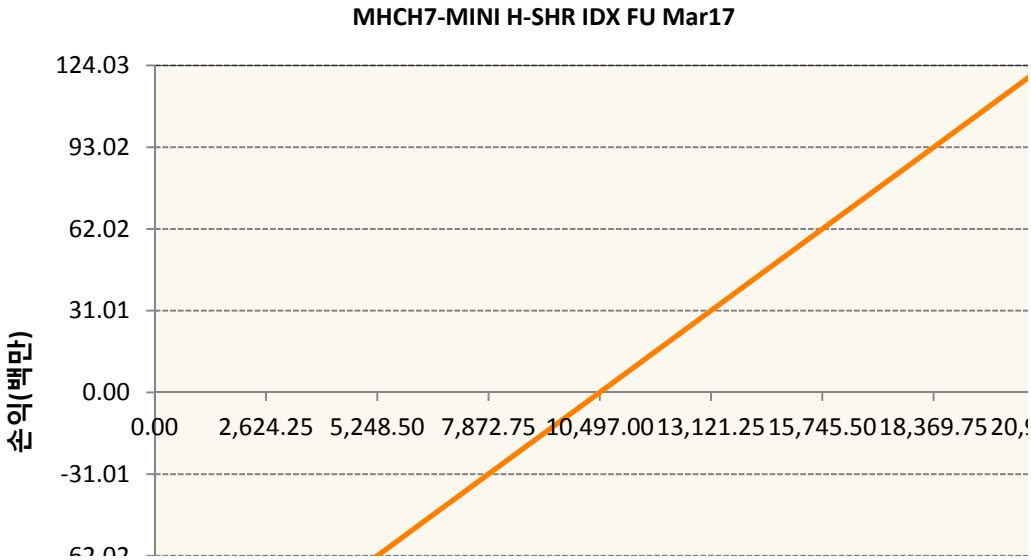
1. 계약금액

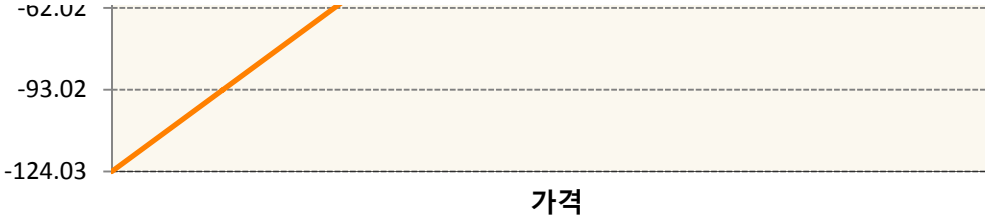
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,216	0	2,216	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	2017-03-27
기준일	2017-03-24

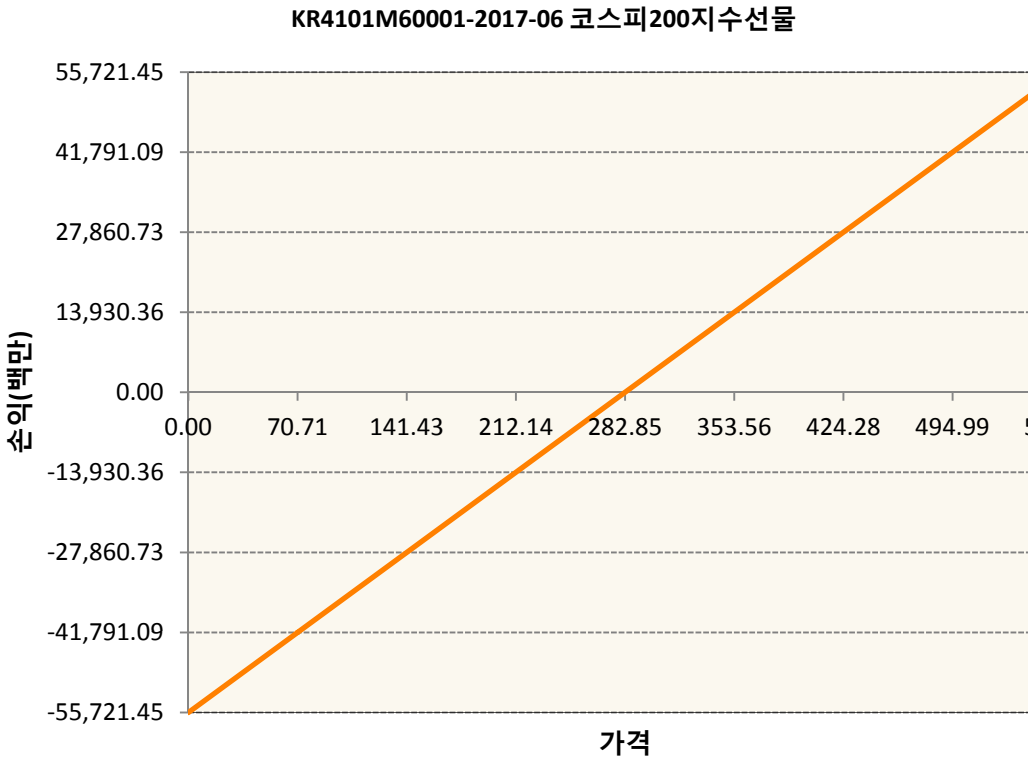
커버드콜모(주식혼합-파생형)

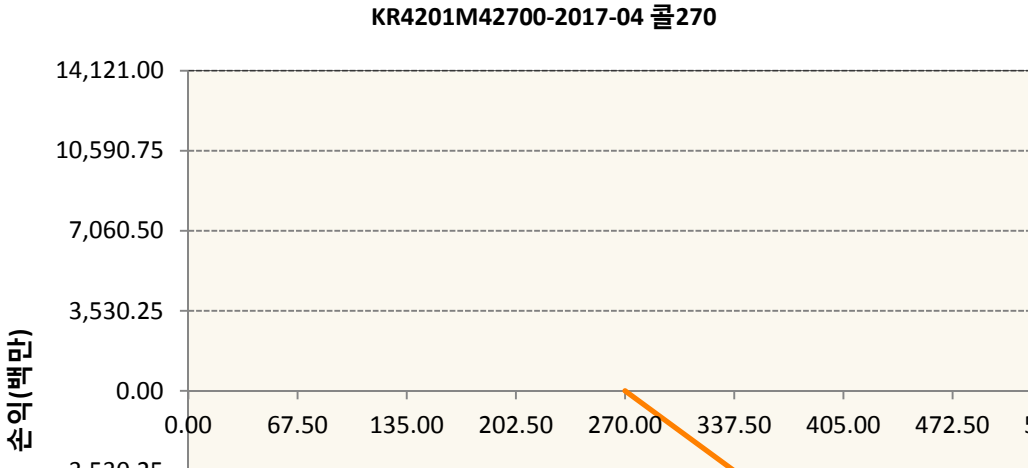
1. 계약금액

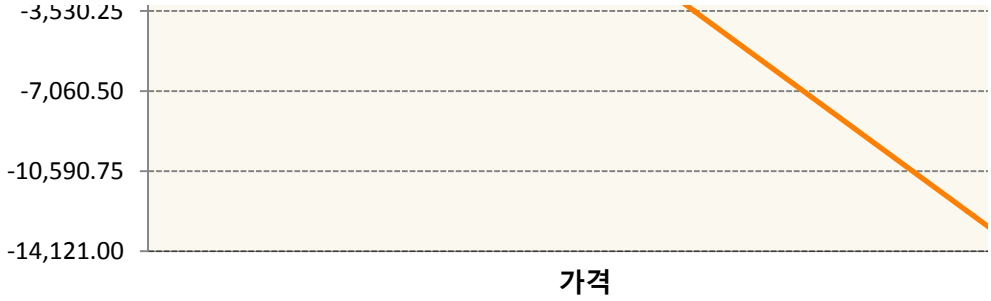
(단위:백만원)

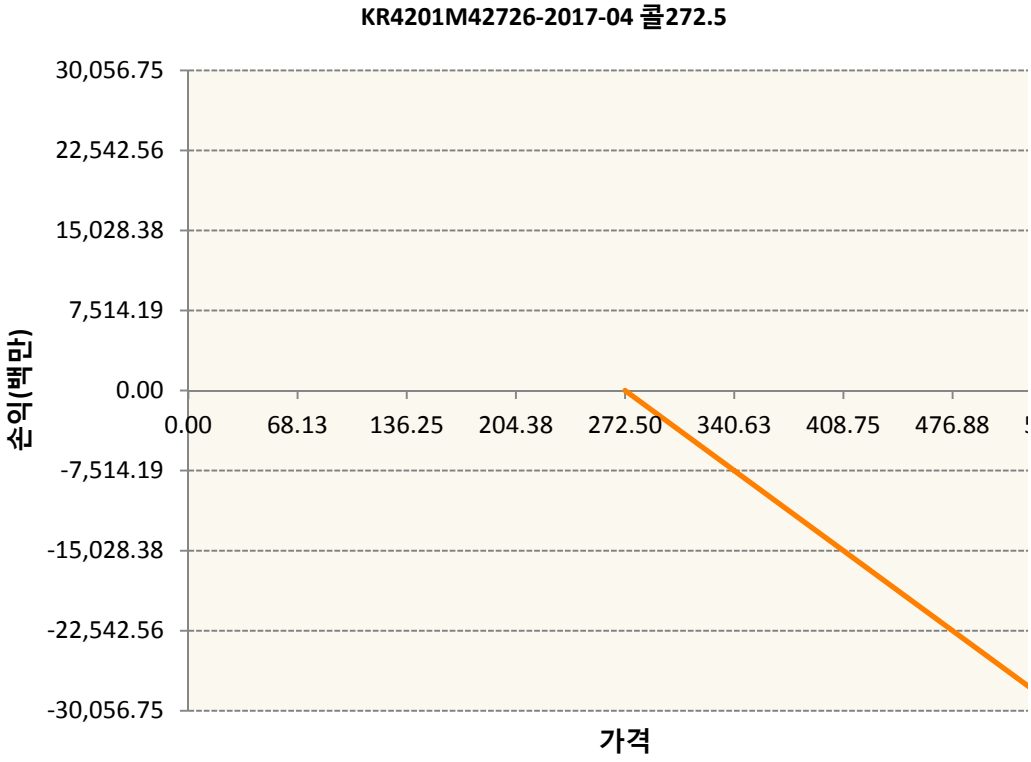
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	1,416	-1,416	장내
신규	유가증권	옵션	257	0	257	장내
누계	유가증권	선물	55,721	0	55,721	장내
누계	유가증권	옵션	0	44,178	-44,178	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							4,449
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,449	-4,449	-4,449	-4,449	-4,449	-4,449	-4,449
-5.33%	-2,966	-2,966	-2,966	-2,966	-2,966	-2,966	-2,966
-2.67%	-1,483	-1,483	-1,483	-1,483	-1,483	-1,483	-1,483
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,483	1,483	1,483	1,483	1,483	1,483	1,483
5.33%	2,966	2,966	2,966	2,966	2,966	2,966	2,966
8.00%	4,449	4,449	4,449	4,449	4,449	4,449	4,449
KR4201M42 2017-04 콜270							5,858
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,235	3,222	3,206	3,185	3,161	3,133	3,101
-5.33%	2,969	2,912	2,854	2,796	2,736	2,676	2,616
-2.67%	1,850	1,804	1,754	1,703	1,649	1,595	1,538
0%	35	27	15	0	-19	-42	-68
2.67%	-1,925	-1,925	-1,926	-1,927	-1,930	-1,935	-1,942
5.33%	-3,891	-3,891	-3,891	-3,891	-3,892	-3,892	-3,893
8.00%	-5,858	-5,858	-5,858	-5,858	-5,858	-5,858	-5,858
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%	5,570	5,559	5,542	5,518	5,486	5,447	5,402
-5.33%	5,305	5,216	5,120	5,018	4,912	4,802	4,689
-2.67%	3,632	3,505	3,377	3,247	3,116	2,984	2,851
0%	139	102	56	0	-64	-135	-214
2.67%	-3,957	-3,959	-3,964	-3,973	-3,986	-4,005	-4,030
5.33%	-8,104	-8,104	-8,104	-8,104	-8,106	-8,108	-8,112
8.00%	-12,252	-12,252	-12,252	-12,252	-12,252	-12,252	-12,252

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

23,370

공시일	2017-03-27
기준일	2017-03-24

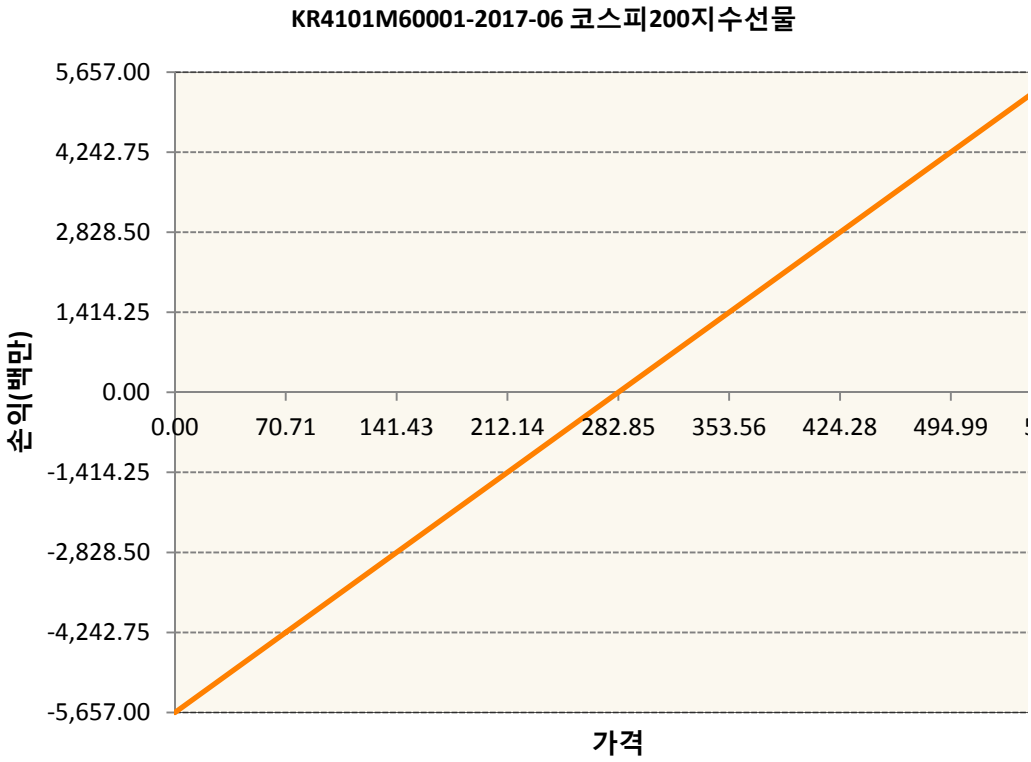
커버드콜목표전환형증권투자신탁

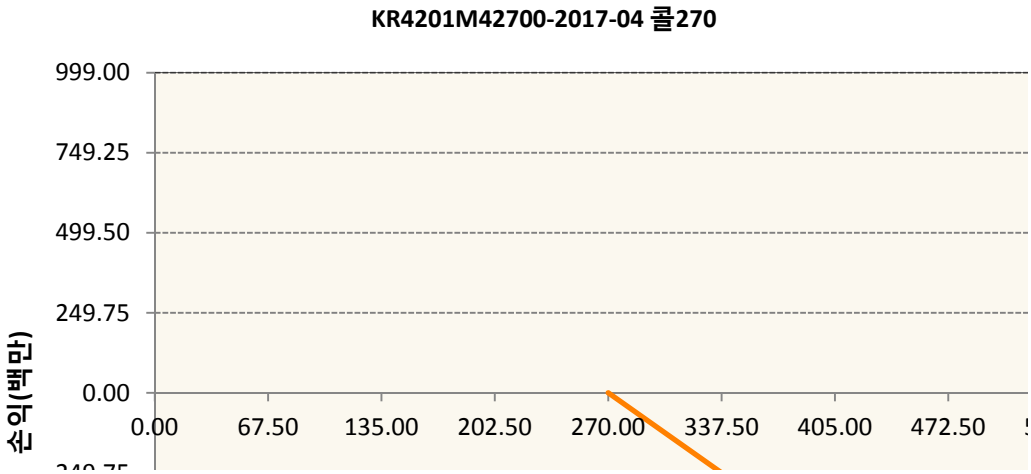
1. 계약금액

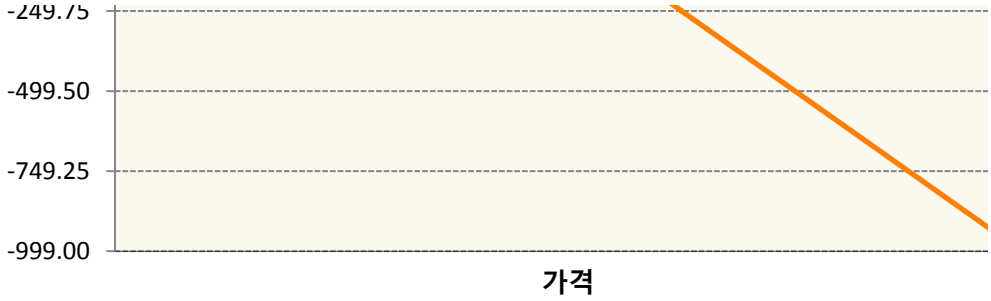
(단위:백만원)

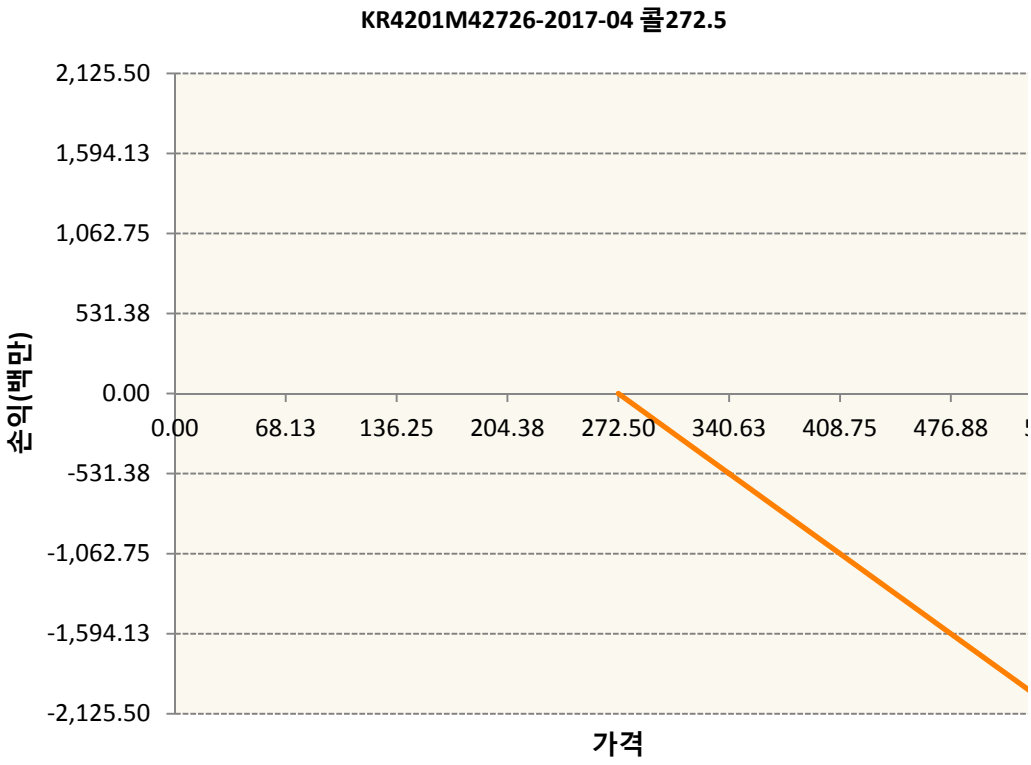
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,657	0	5,657	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,125	-3,125	장내

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%	-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							414
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	229	228	227	225	224	222	219
-5.33%	210	206	202	198	194	189	185
-2.67%	131	128	124	120	117	113	109
0%	2	2	1	0	-1	-3	-5
2.67%	-136	-136	-136	-136	-137	-137	-137
5.33%	-275	-275	-275	-275	-275	-275	-275
8.00%	-414	-414	-414	-414	-414	-414	-414
KR4201M42 : 2017-04 콜272.5							866

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	394	393	392	390	388	385	382
-5.33%	375	369	362	355	347	340	332
-2.67%	257	248	239	230	220	211	202
0%	10	7	4	0	-5	-10	-15
2.67%	-280	-280	-280	-281	-282	-283	-285
5.33%	-573	-573	-573	-573	-573	-573	-574
8.00%	-866	-866	-866	-866	-866	-866	-866

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

1,742

공시일	2017-03-27
기준일	2017-03-24

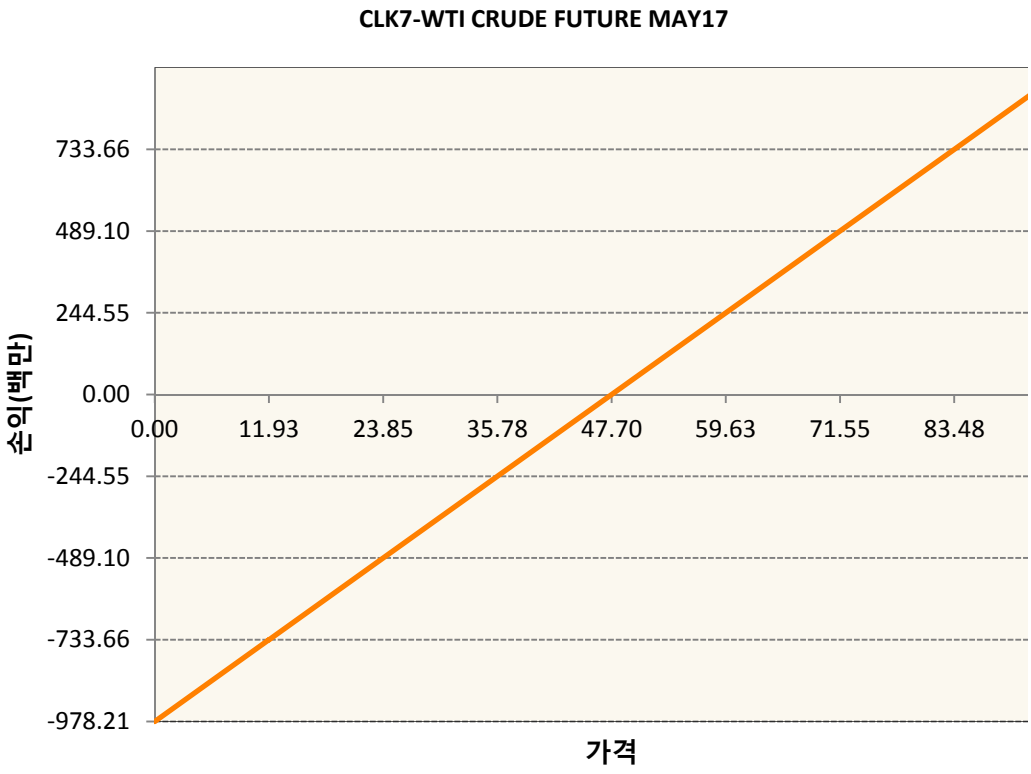
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

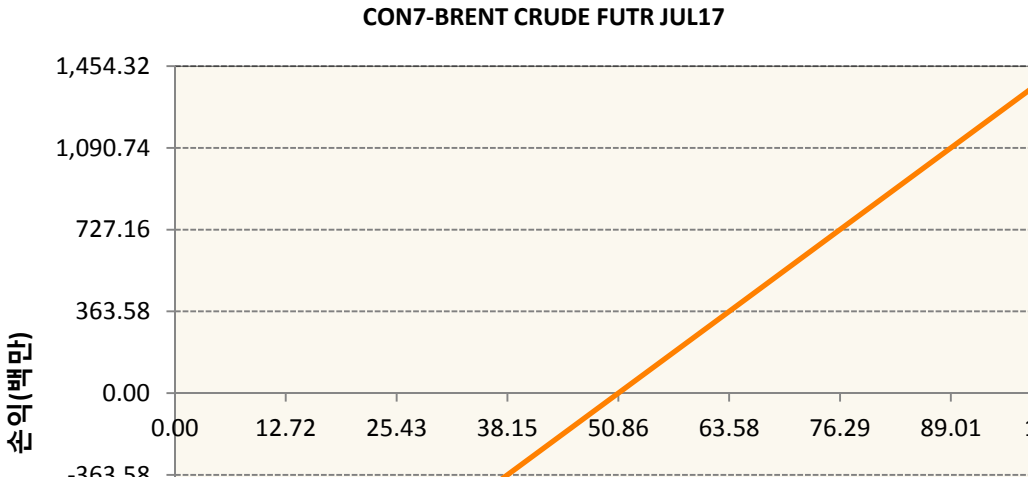
1. 계약금액

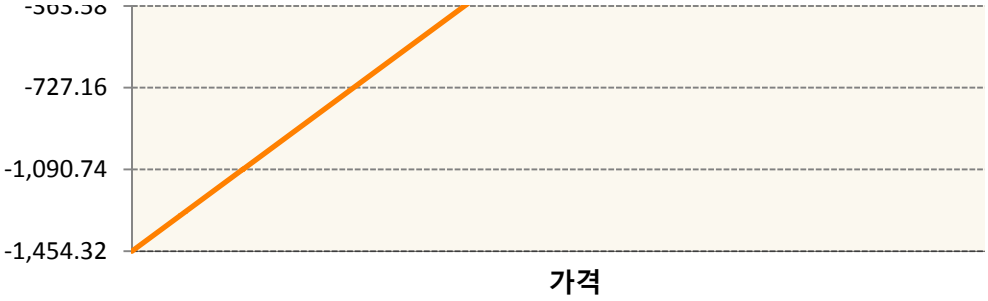
(단위:백만원)

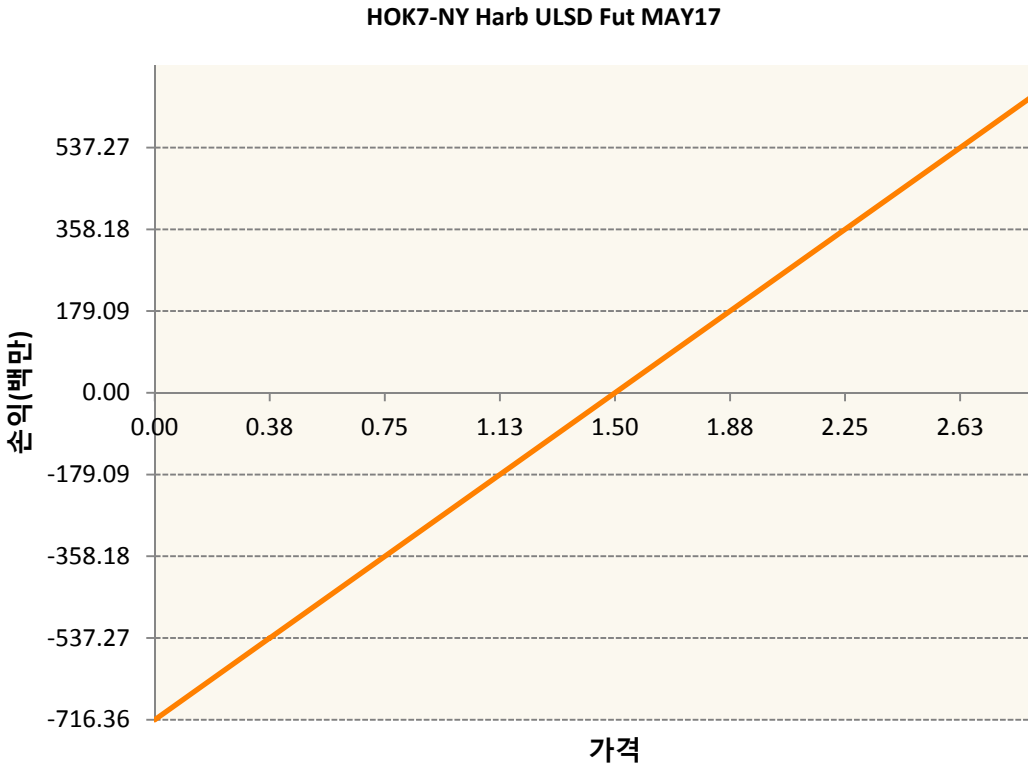
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	978	0	978	
누계	유가증권	선물	4,543	404	4,139	

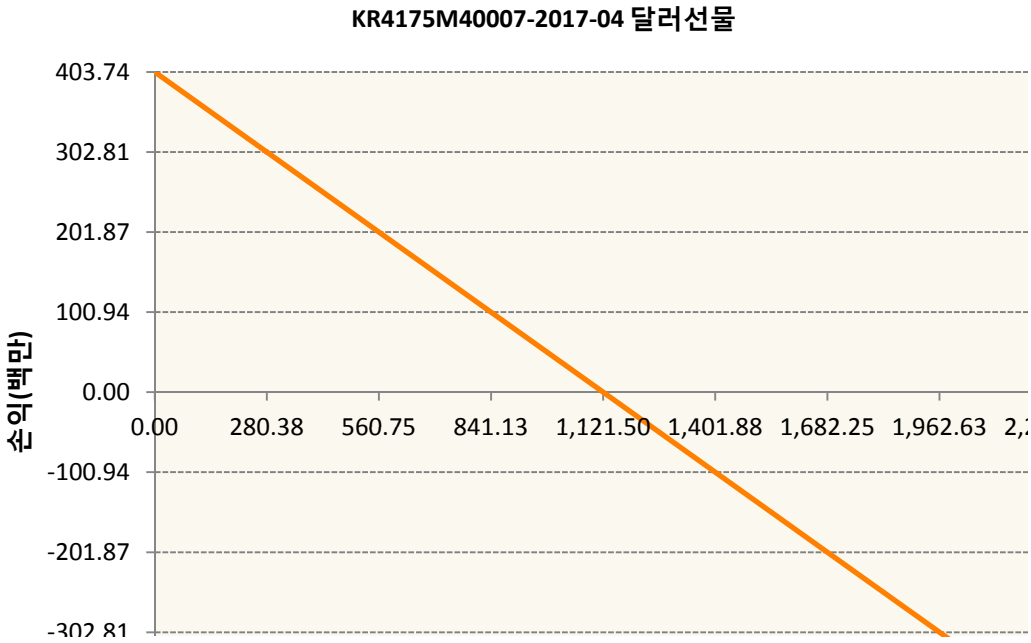
2. 만기시점의 손익구조

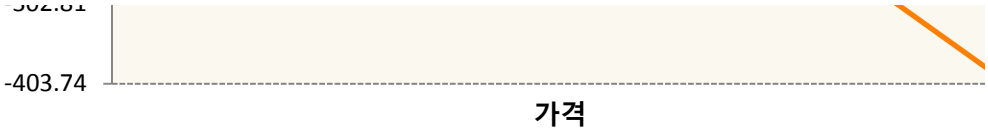


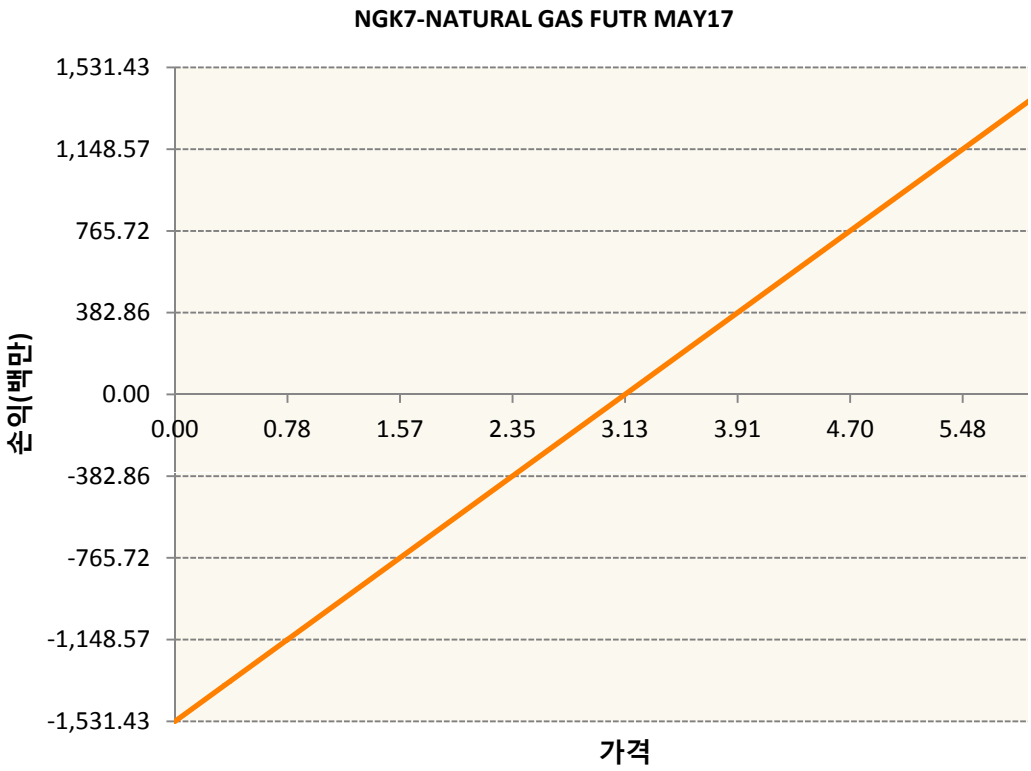


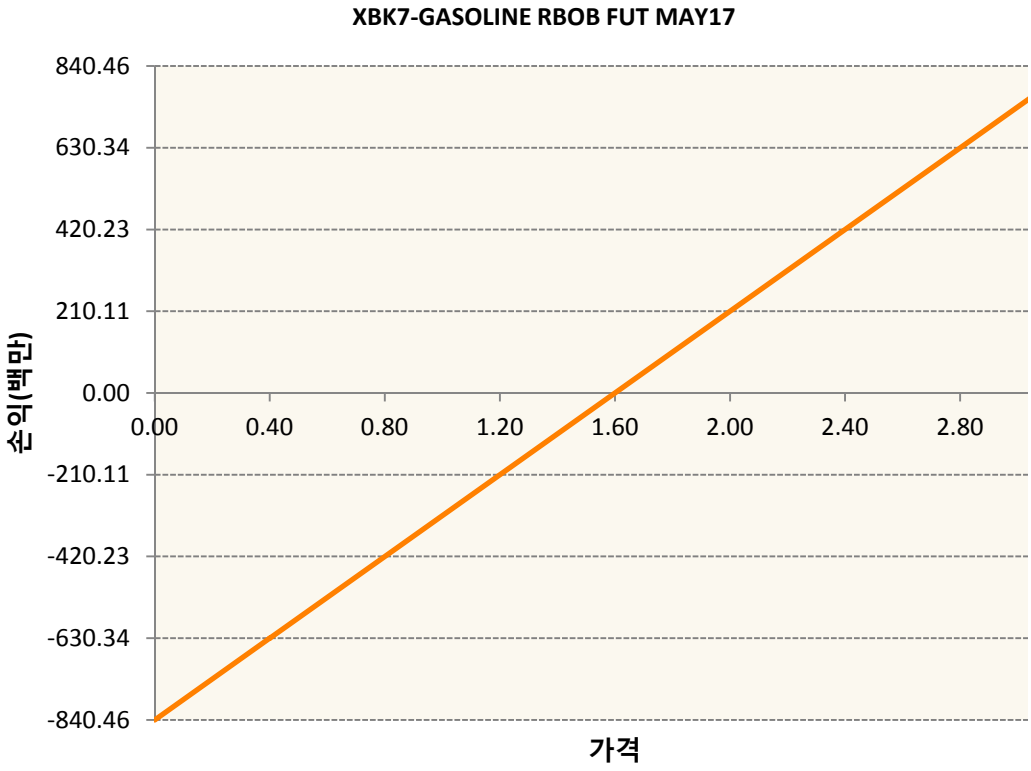

-727.16
-1,090.74
-1,454.32
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
537.27
358.18
179.09
0.00
-179.09
-358.18
-537.27
-716.36
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
1,531.43
1,148.57
765.72
382.86
0.00
-382.86
-765.72
-1,148.57
-1,531.43
0.00
0.78
1.57
2.35
3.13
3.91
4.70
5.48
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
840.46
630.34
420.23
210.11
0.00
-210.11
-420.23
-630.34
-840.46
0.00
0.40
0.80
1.20
1.60
2.00
2.40
2.80
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK7	WTI CRUDE FUTURE MAY17	78
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	116
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	57
KR4175M40(	2017-04 달러선물	32
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	123
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	67

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

981

공시일	2017-03-27
기준일	2017-03-24

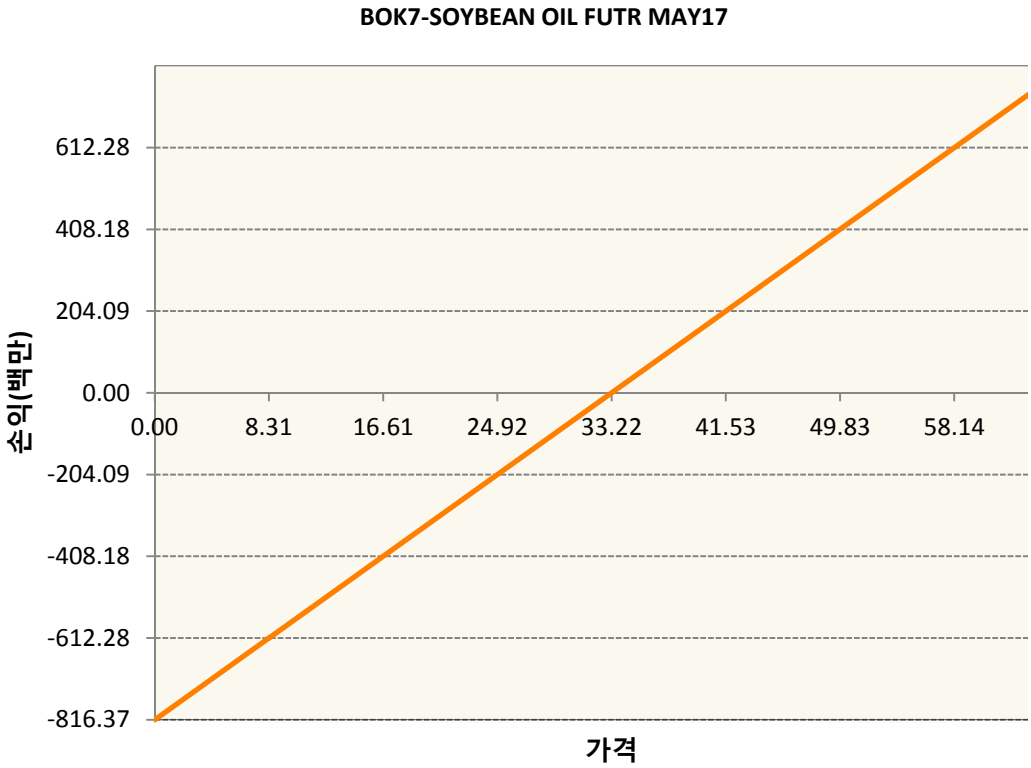
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

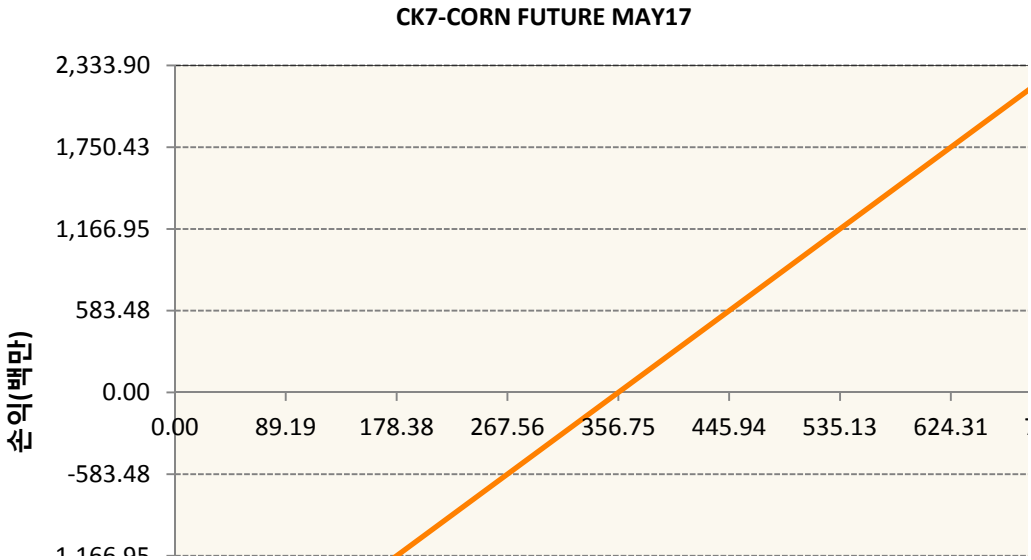
1. 계약금액

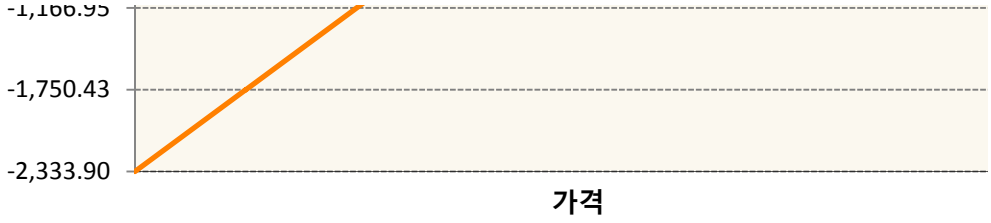
(단위:백만원)

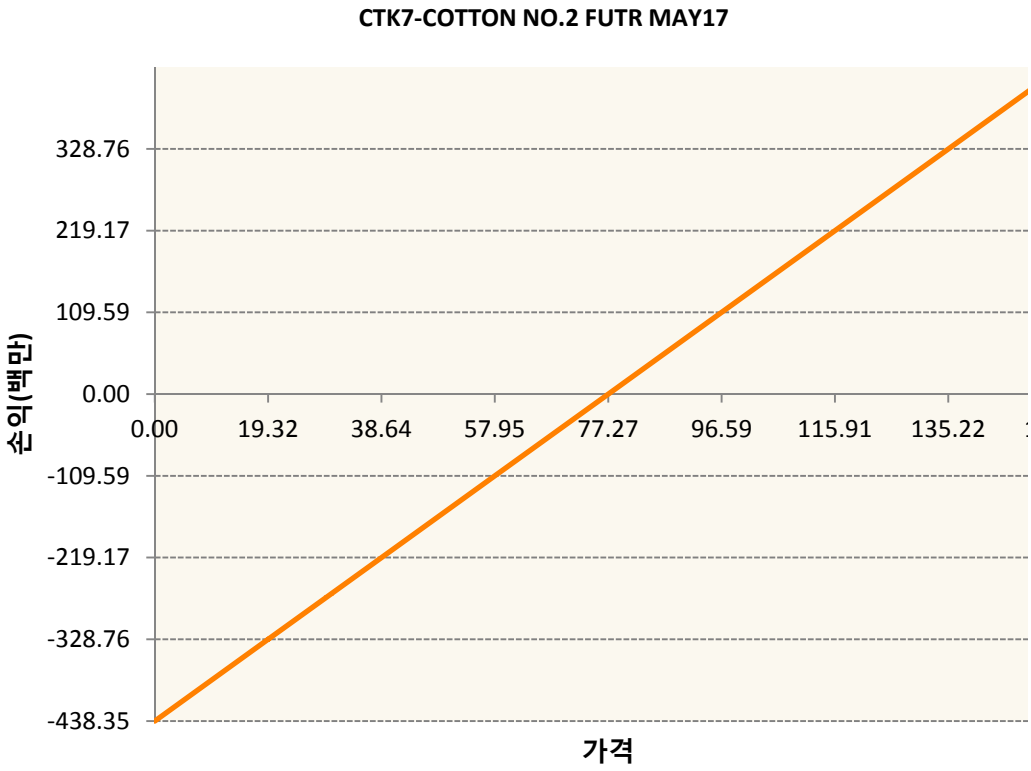
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,210	561	8,650	

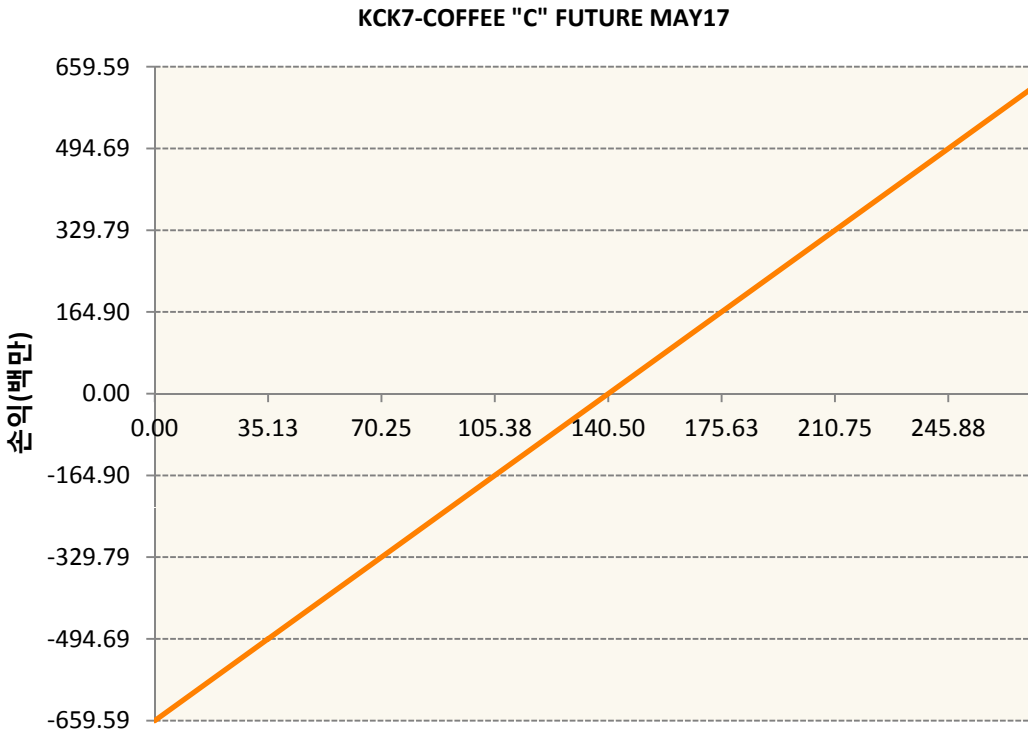
2. 만기시점의 손익구조



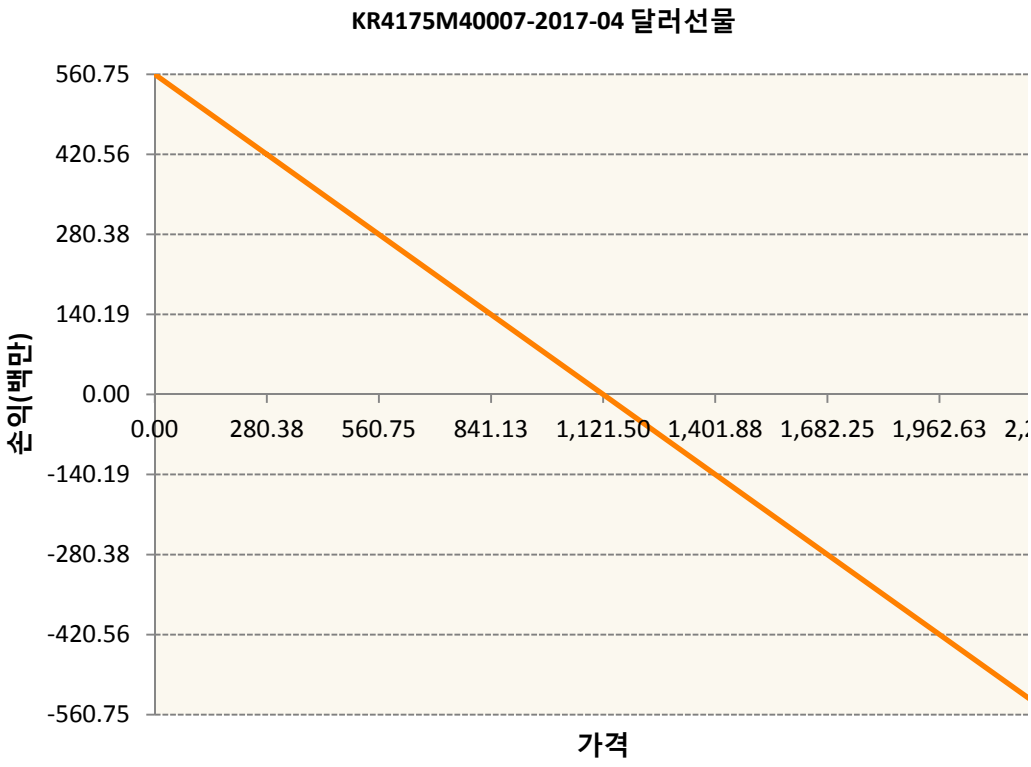


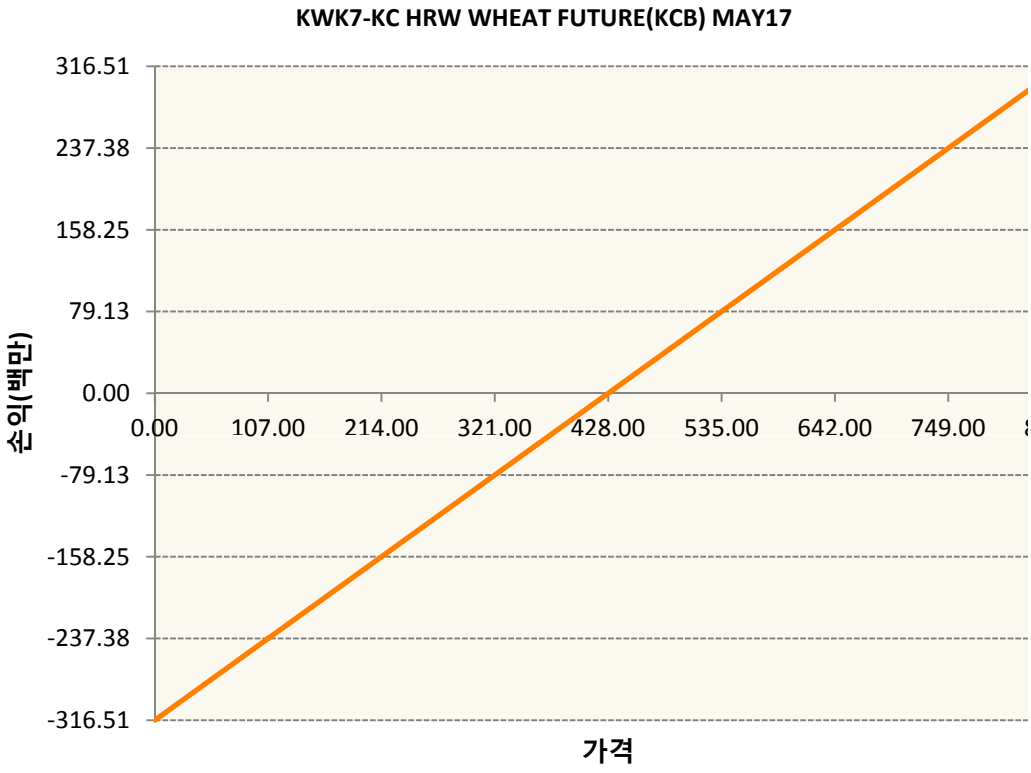

-1,166.95
-1,750.43
-2,333.90
가격

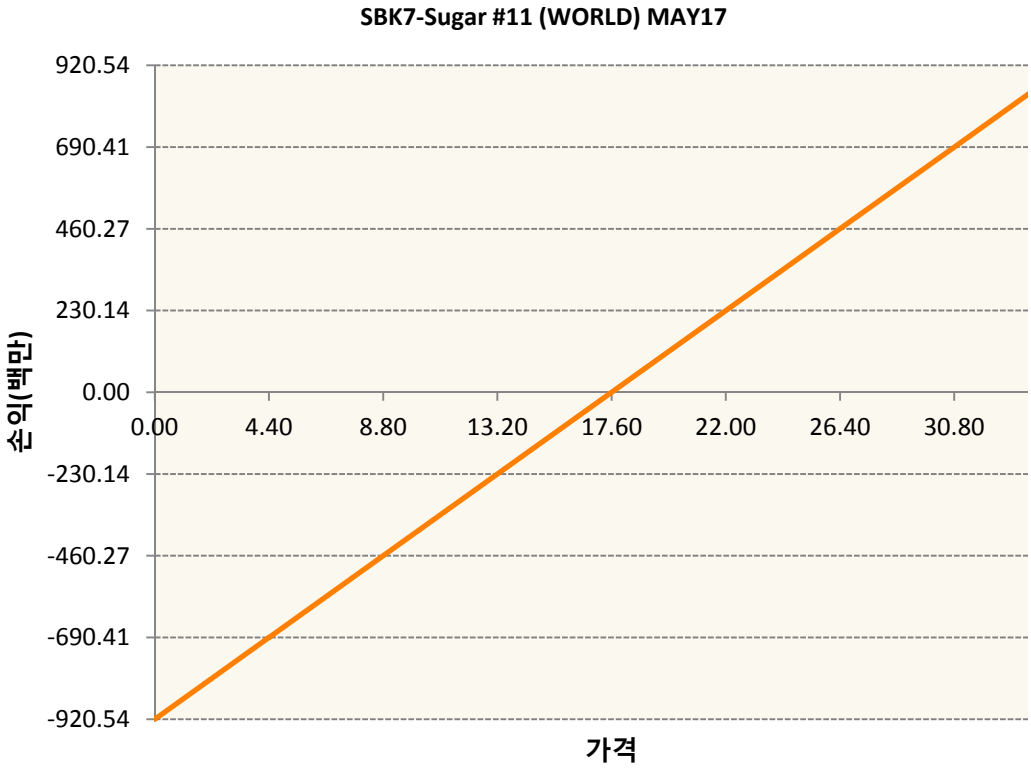

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
328.76
219.17
109.59
0.00
-109.59
-219.17
-328.76
-438.35
0.00
19.32
38.64
57.95
77.27
96.59
115.91
135.22
순익(백만)
가격

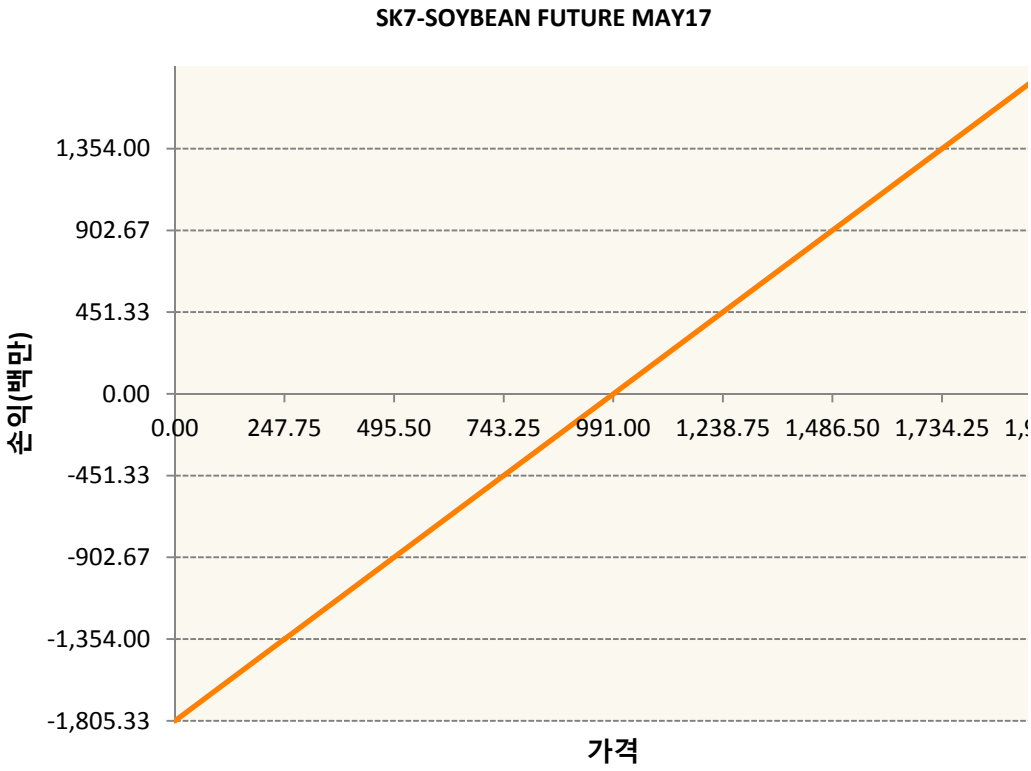

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
659.59
494.69
329.79
164.90
0.00
-164.90
-329.79
-494.69
-659.59
0.00
35.13
70.25
105.38
140.50
175.63
210.75
245.88
순익(백만)

가격

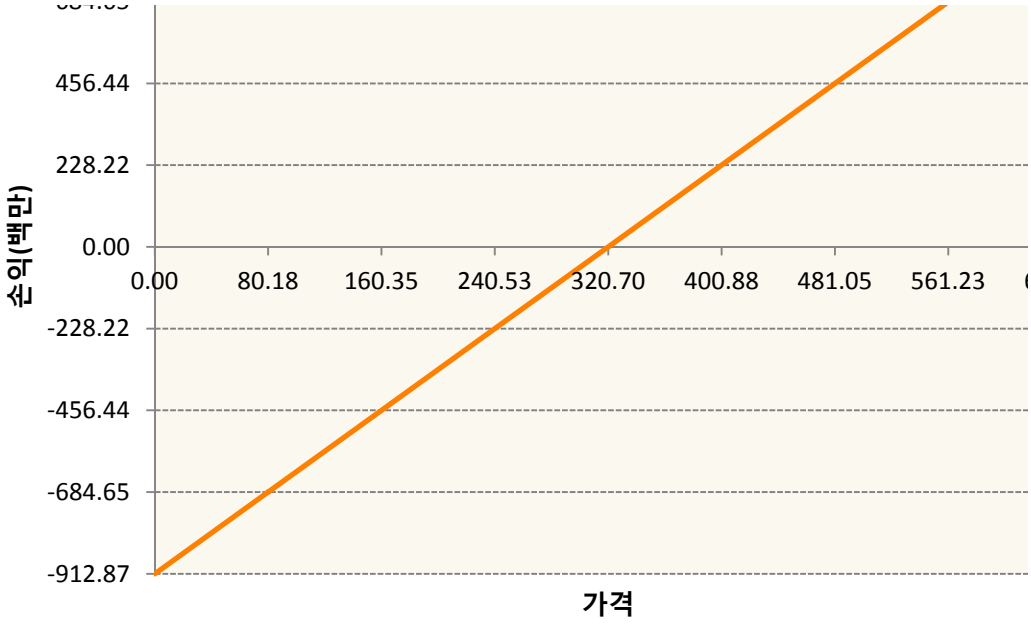

KR4175M40007-2017-04 달러선물
560.75
420.56
280.38
140.19
0.00
-140.19
-280.38
-420.56
-560.75
0.00
280.38
560.75
841.13
1,121.50
1,401.88
1,682.25
1,962.63
손익(백만)
가격

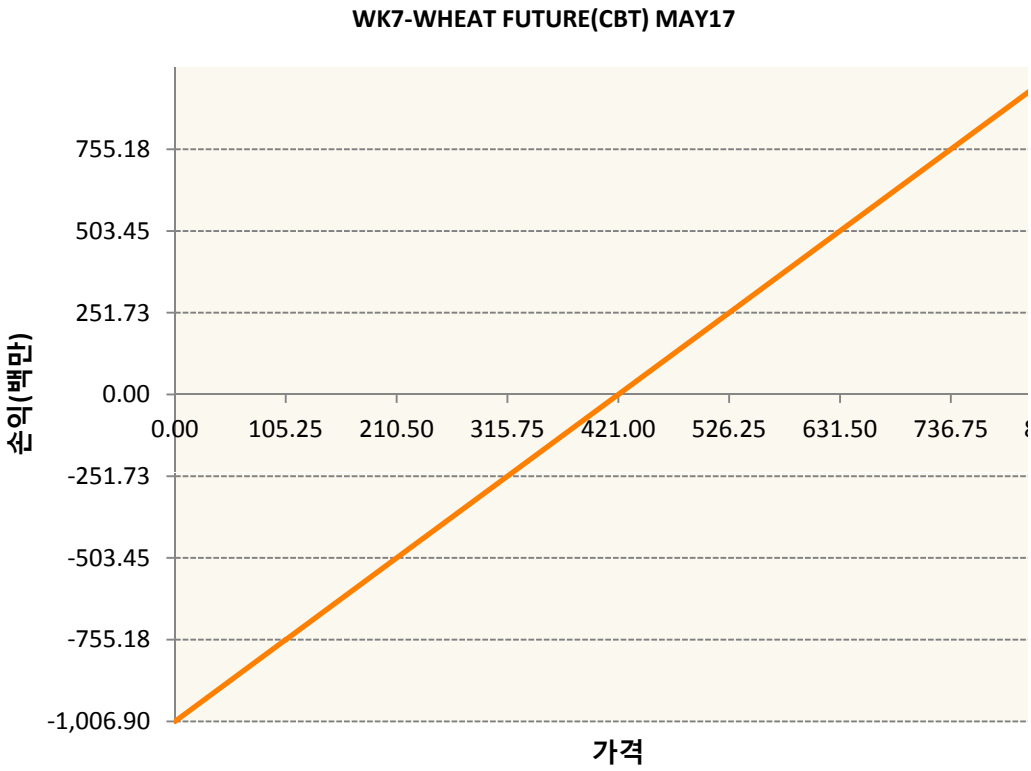

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
316.51
237.38
158.25
79.13
0.00
-79.13
-158.25
-237.38
-316.51
0.00
107.00
214.00
321.00
428.00
535.00
642.00
749.00
손익(백만)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
920.54
690.41
460.27
230.14
0.00
-230.14
-460.27
-690.41
-920.54
0.00
4.40
8.80
13.20
17.60
22.00
26.40
30.80
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,354.00
902.67
451.33
0.00
-451.33
-902.67
-1,354.00
-1,805.33
0.00
247.75
495.50
743.25
991.00
1,238.75
1,486.50
1,734.25
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
684.65





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	65
CK7	CORN FUTURE MAY17	187
CTK7	COTTON NO.2 FUTR MAY17	35
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	144
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	73
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	81

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

851