공시일	2017-03-28
기준일	2017-03-27

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	2017-03-28
기준일	2017-03-27

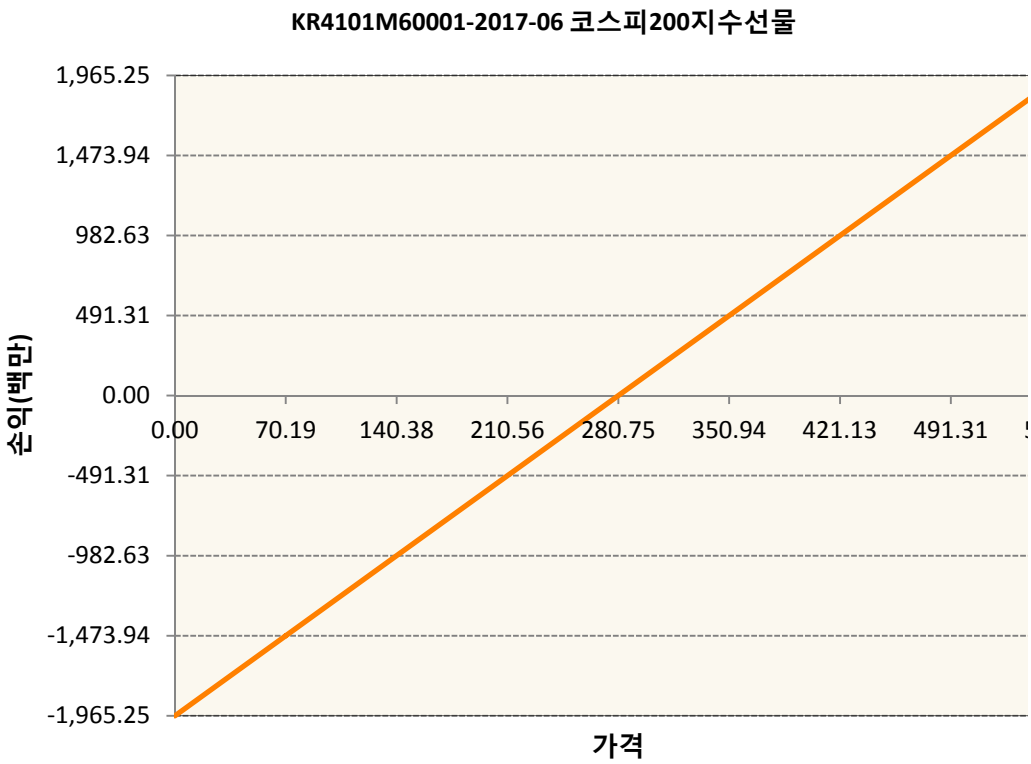
스마트인덱스모

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	1,965	0	1,965	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							157
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-5.33%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-2.67%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	52	52	52	52	52	52	52
5.33%	105	105	105	105	105	105	105
8.00%	157	157	157	157	157	157	157

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

102

공시일	2017-03-28
기준일	2017-03-27

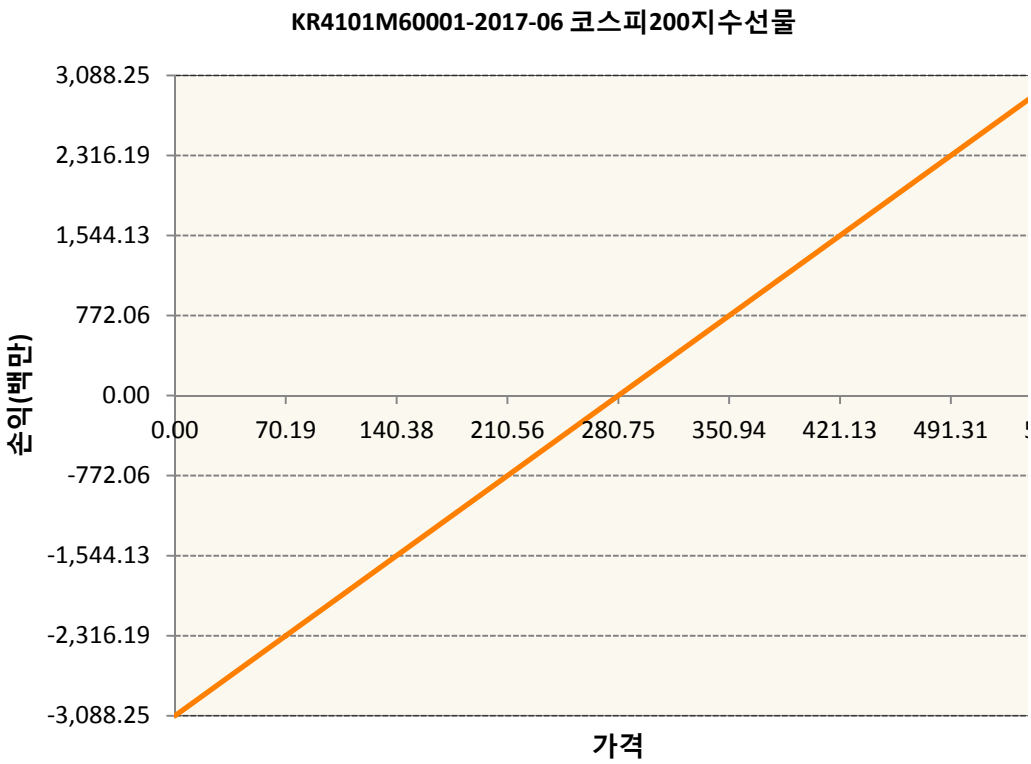
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	3,088	0	3,088	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							247
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-247	-247	-247	-247	-247	-247	-247
-5.33%	-164	-164	-164	-164	-164	-164	-164
-2.67%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	82	82	82	82	82	82	82
5.33%	164	164	164	164	164	164	164
8.00%	247	247	247	247	247	247	247

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

161

공시일	2017-03-28
기준일	2017-03-27

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)

553

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-28
기준일	2017-03-27

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)

432

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-28
기준일	2017-03-27

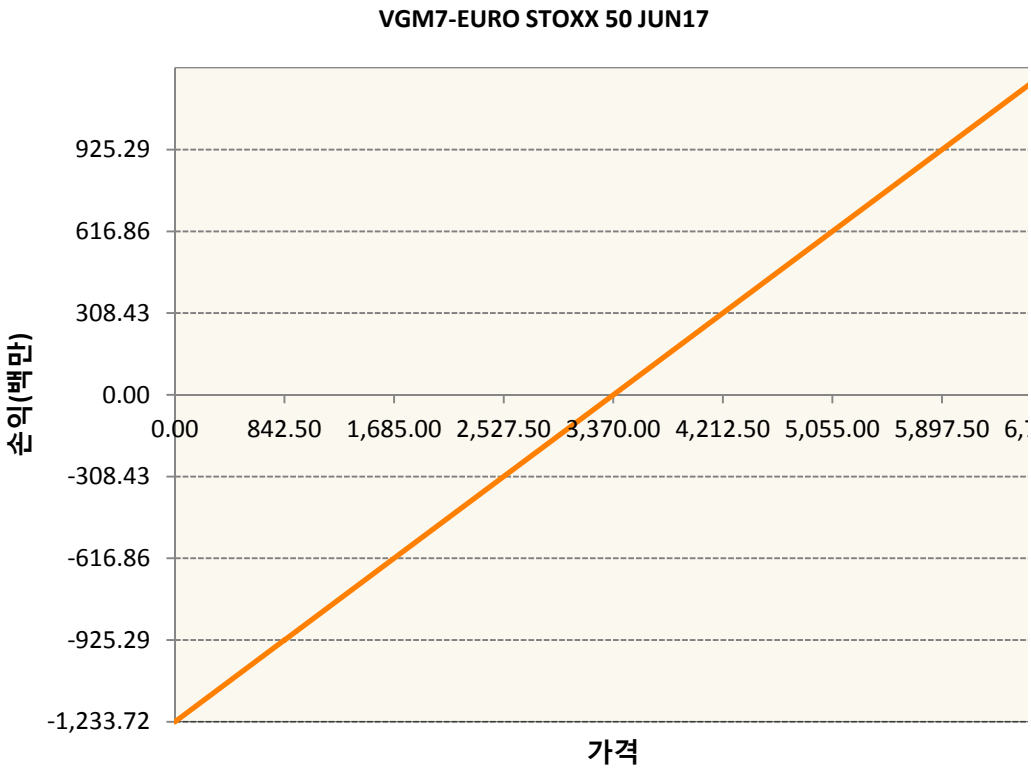
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,234	0	1,234	

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	2017-03-28
기준일	2017-03-27

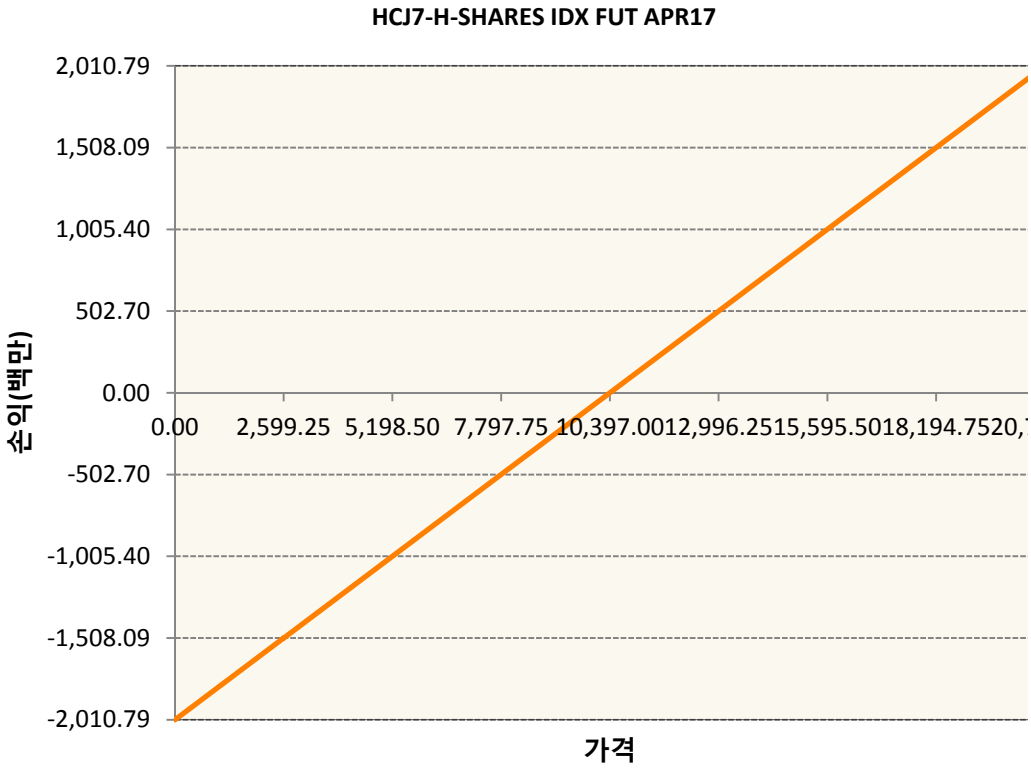
차이나인덱스모(주식-파생형)

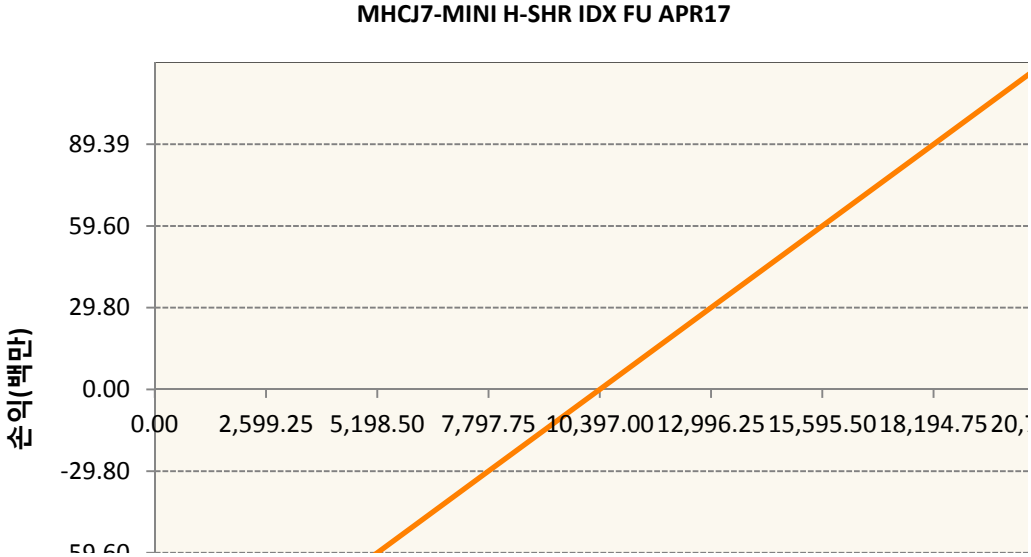
1. 계약금액

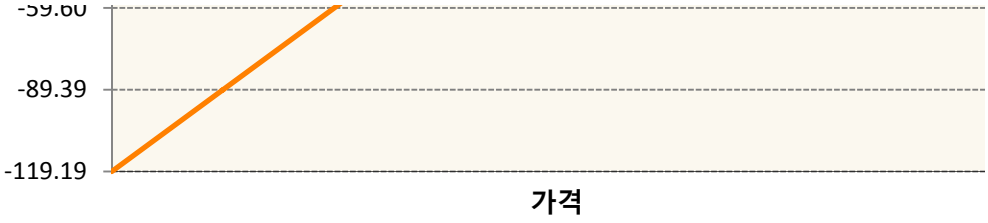
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,130	0	2,130	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ7	H-SHARES IDX FUT APR17	161
MHCJ7	MINI H-SHR IDX FU APR17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	183

공시일	2017-03-28
기준일	2017-03-27

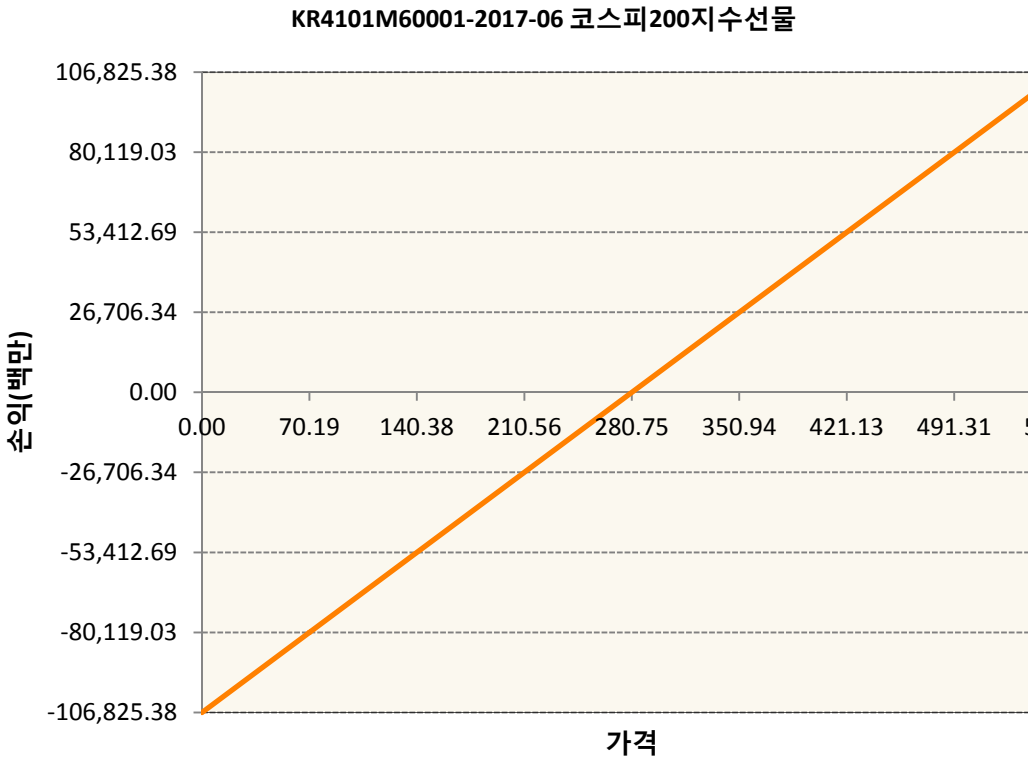
커버드콜모(주식혼합-파생형)

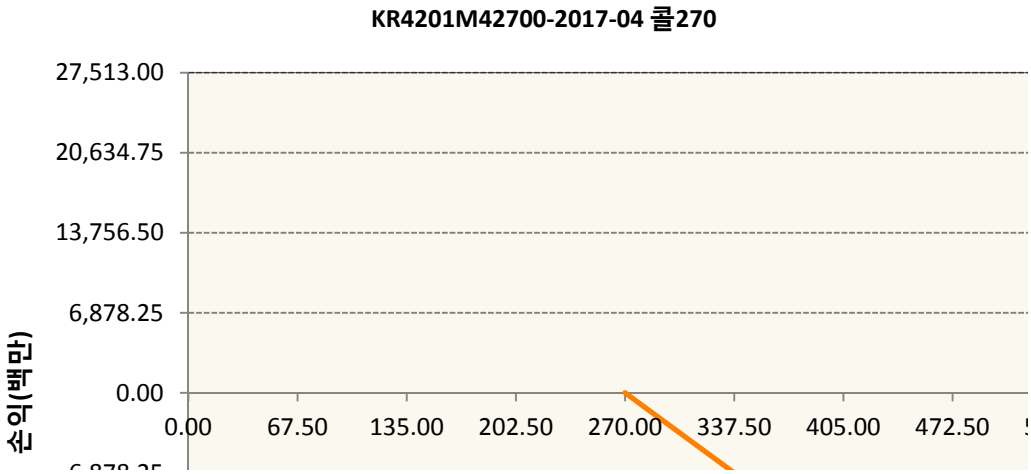
1. 계약금액

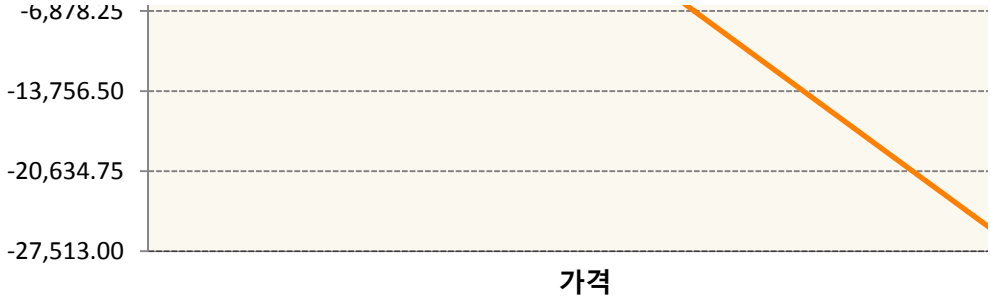
(단위:백만원)

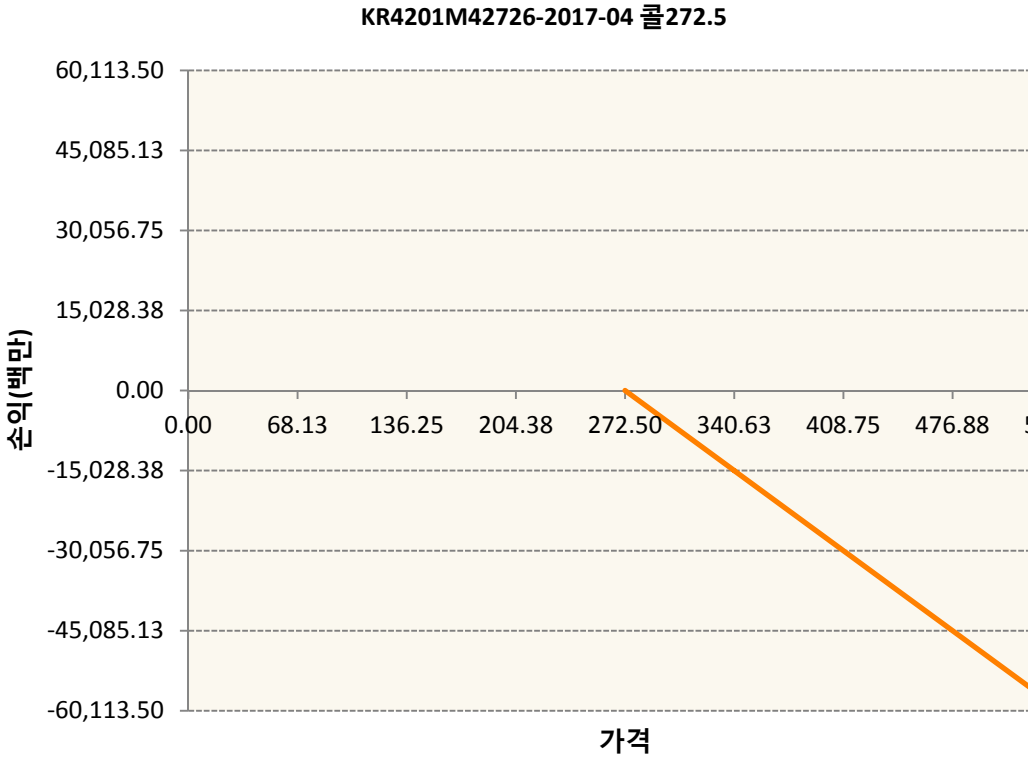
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	3,797	-3,797	장내
신규	유가증권	옵션	699	0	699	장내
누계	유가증권	선물	106,825	0	106,825	장내
누계	유가증권	옵션	0	87,627	-87,627	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							8,534
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,534	-8,534	-8,534	-8,534	-8,534	-8,534	-8,534
-5.33%	-5,689	-5,689	-5,689	-5,689	-5,689	-5,689	-5,689
-2.67%	-2,845	-2,845	-2,845	-2,845	-2,845	-2,845	-2,845
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	2,845	2,845	2,845	2,845	2,845	2,845	2,845
5.33%	5,689	5,689	5,689	5,689	5,689	5,689	5,689
8.00%	8,534	8,534	8,534	8,534	8,534	8,534	8,534
KR4201M42 2017-04 콜270							11,292
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,377	5,367	5,350	5,328	5,299	5,264	5,222
-5.33%	5,104	5,020	4,930	4,836	4,738	4,638	4,535
-2.67%	3,422	3,315	3,207	3,096	2,984	2,870	2,756
0%	97	73	40	0	-48	-102	-163
2.67%	-3,680	-3,681	-3,684	-3,689	-3,697	-3,709	-3,725
5.33%	-7,485	-7,485	-7,486	-7,486	-7,486	-7,488	-7,490
8.00%	-11,292	-11,292	-11,292	-11,292	-11,292	-11,292	-11,292
KR4201M42 2017-04 콜272.5							24,147

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,199	9,192	9,177	9,153	9,120	9,074	9,018
-5.33%	8,961	8,846	8,713	8,564	8,402	8,228	8,046
-2.67%	6,640	6,378	6,116	5,853	5,591	5,329	5,066
0%	371	266	141	0	-156	-324	-503
2.67%	-7,671	-7,679	-7,695	-7,721	-7,758	-7,807	-7,868
5.33%	-15,905	-15,906	-15,906	-15,908	-15,912	-15,919	-15,930
8.00%	-24,145	-24,145	-24,145	-24,145	-24,145	-24,146	-24,147

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

46,919

공시일	2017-03-28
기준일	2017-03-27

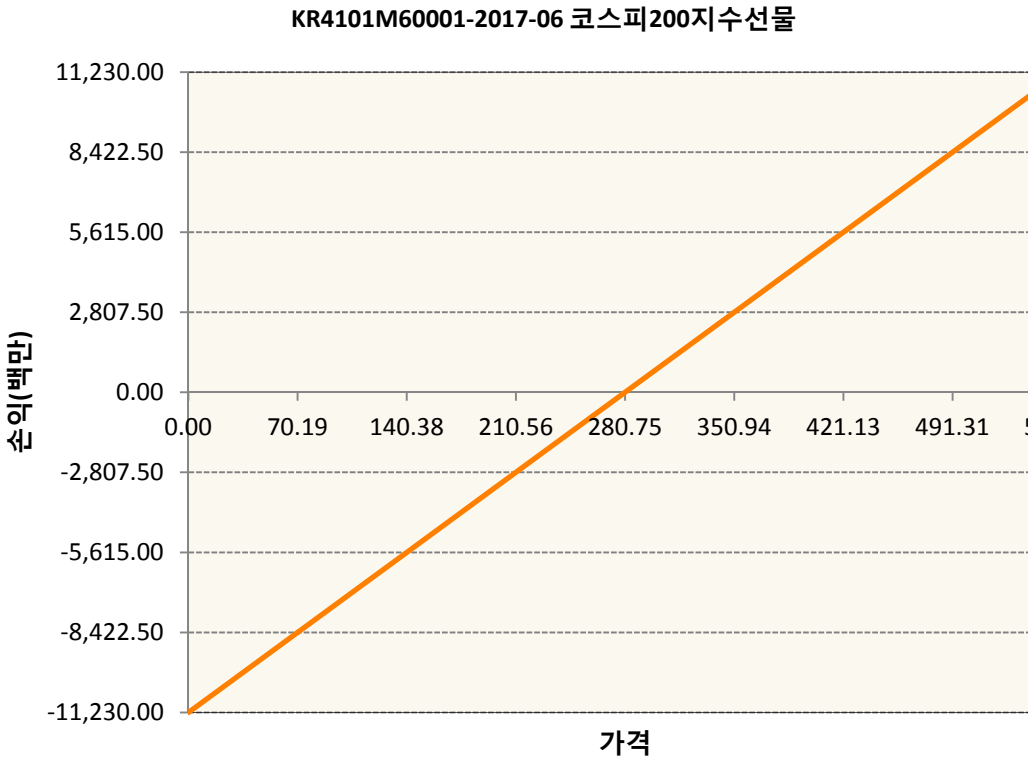
커버드콜목표전환형증권투자신탁

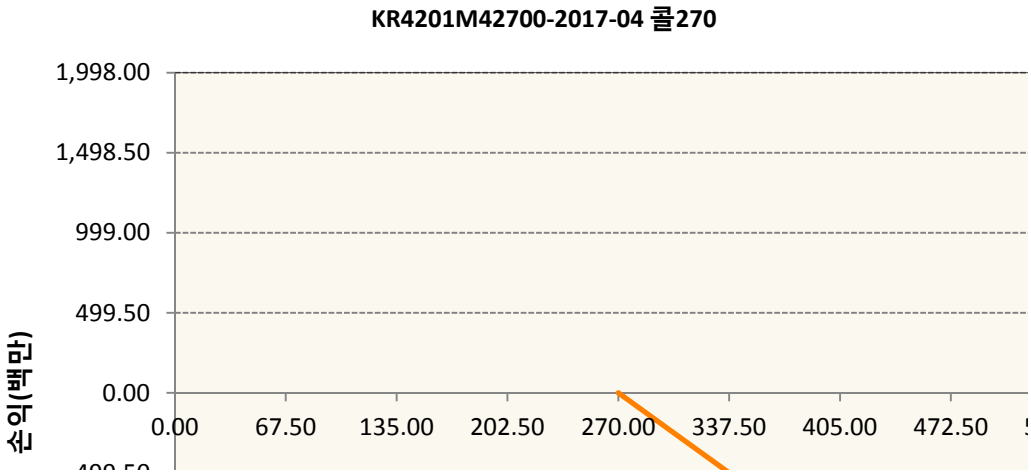
1. 계약금액

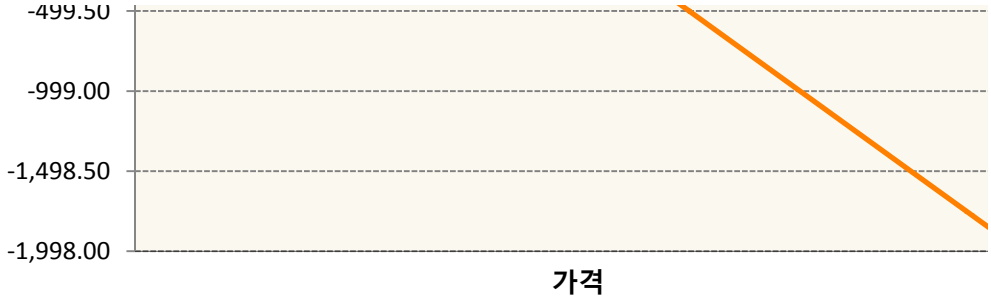
(단위:백만원)

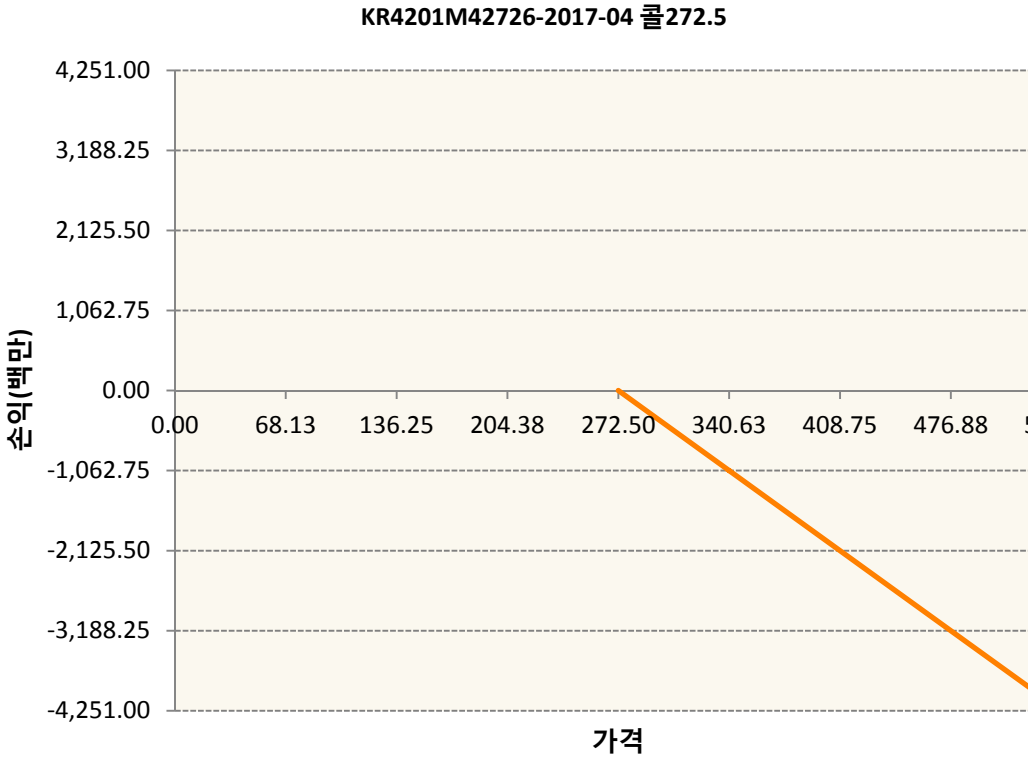
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,230	0	11,230	장내
누계	유가증권	옵션	0	6,249	-6,249	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							897
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-897	-897	-897	-897	-897	-897	-897
-5.33%	-598	-598	-598	-598	-598	-598	-598
-2.67%	-299	-299	-299	-299	-299	-299	-299
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	299	299	299	299	299	299	299
5.33%	598	598	598	598	598	598	598
8.00%	897	897	897	897	897	897	897
KR4201M42 2017-04 콜270							820
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	390	390	389	387	385	382	379
-5.33%	371	365	358	351	344	337	329
-2.67%	248	241	233	225	217	208	200
0%	7	5	3	0	-3	-7	-12
2.67%	-267	-267	-268	-268	-268	-269	-271
5.33%	-544	-544	-544	-544	-544	-544	-544
8.00%	-820	-820	-820	-820	-820	-820	-820
KR4201M42 : 2017-04 콜272.5							1,708

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	651	650	649	647	645	642	638
-5.33%	634	626	616	606	594	582	569
-2.67%	470	451	432	414	395	377	358
0%	26	19	10	0	-11	-23	-36
2.67%	-542	-543	-544	-546	-549	-552	-556
5.33%	-1,125	-1,125	-1,125	-1,125	-1,125	-1,126	-1,126
8.00%	-1,707	-1,707	-1,707	-1,707	-1,707	-1,707	-1,708

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

3,534

공시일	2017-03-28
기준일	2017-03-27

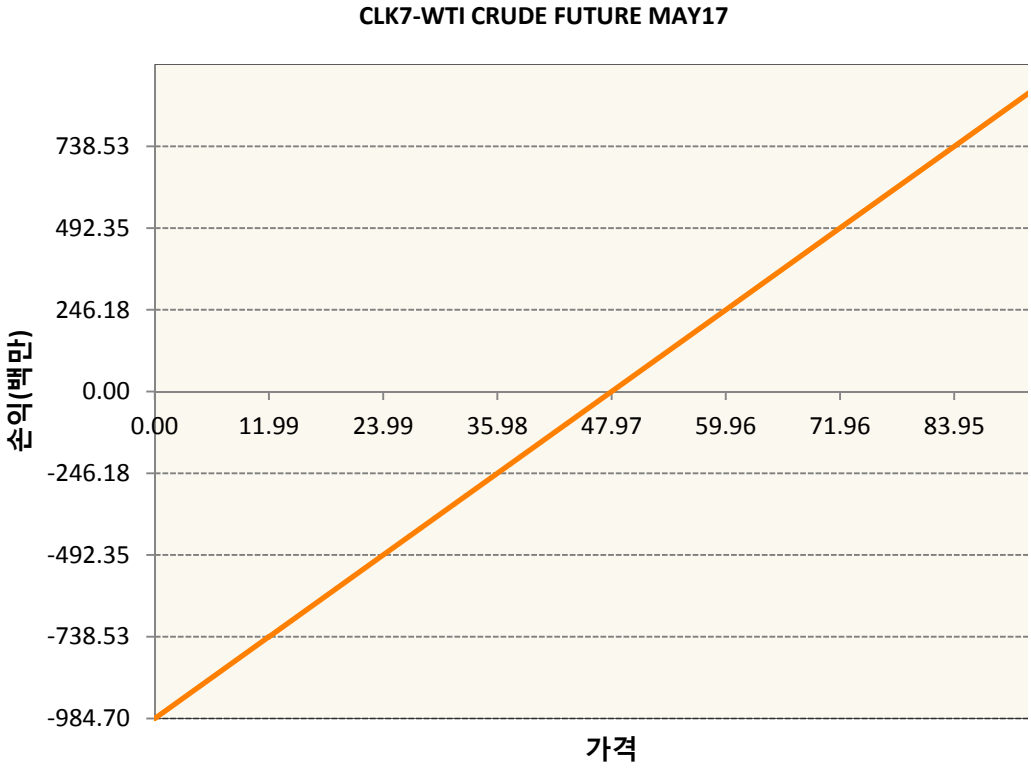
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

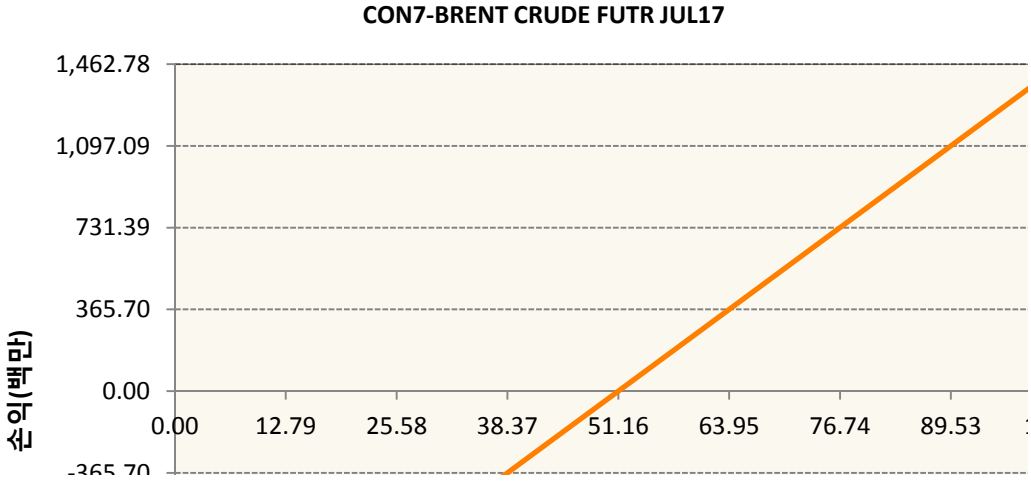
1. 계약금액

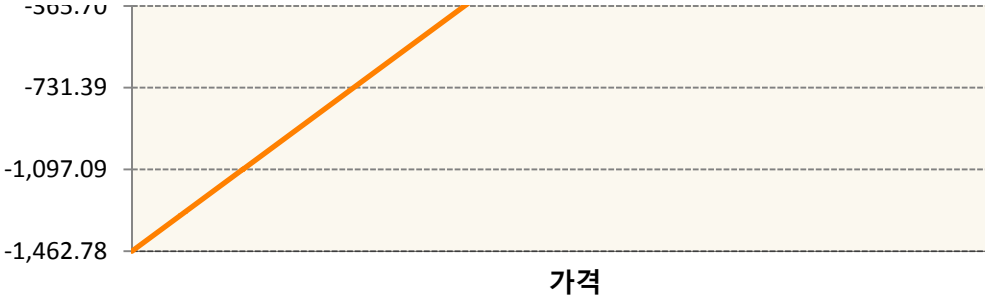
(단위:백만원)

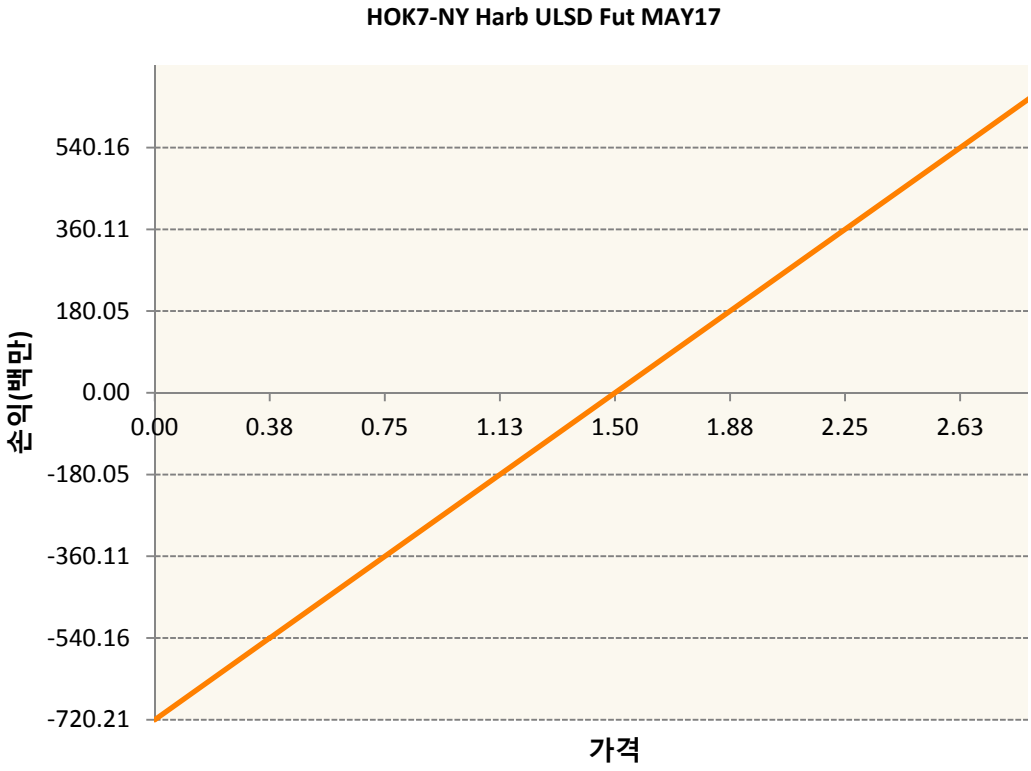
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	985	0	985	
누계	유가증권	선물	4,573	401	4,173	

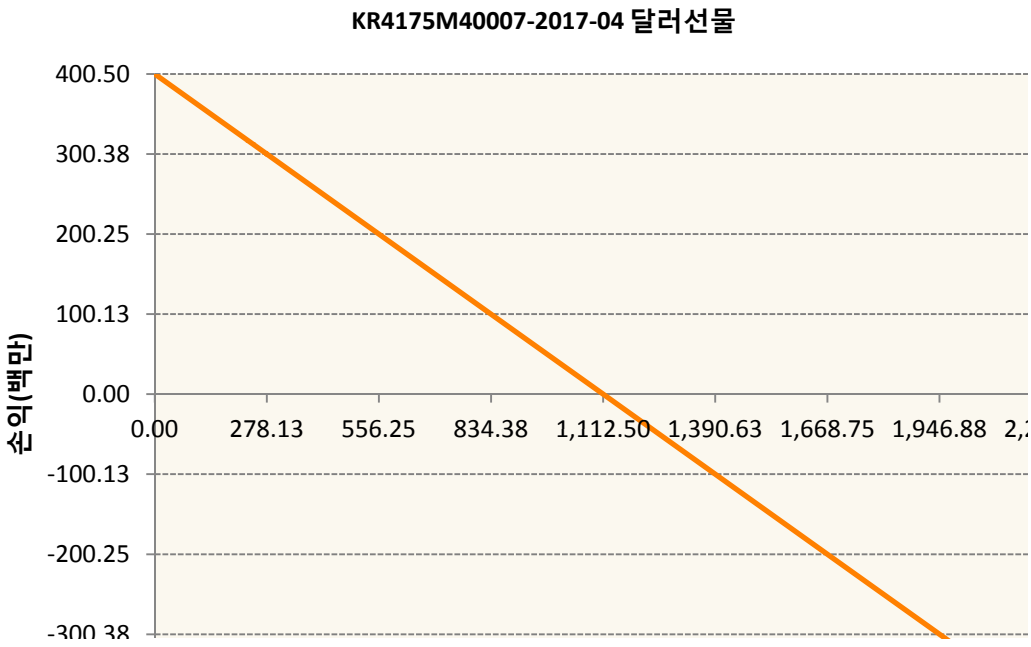
2. 만기시점의 손익구조

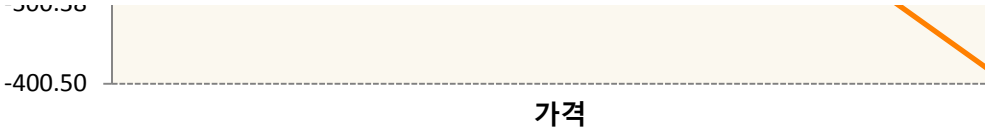


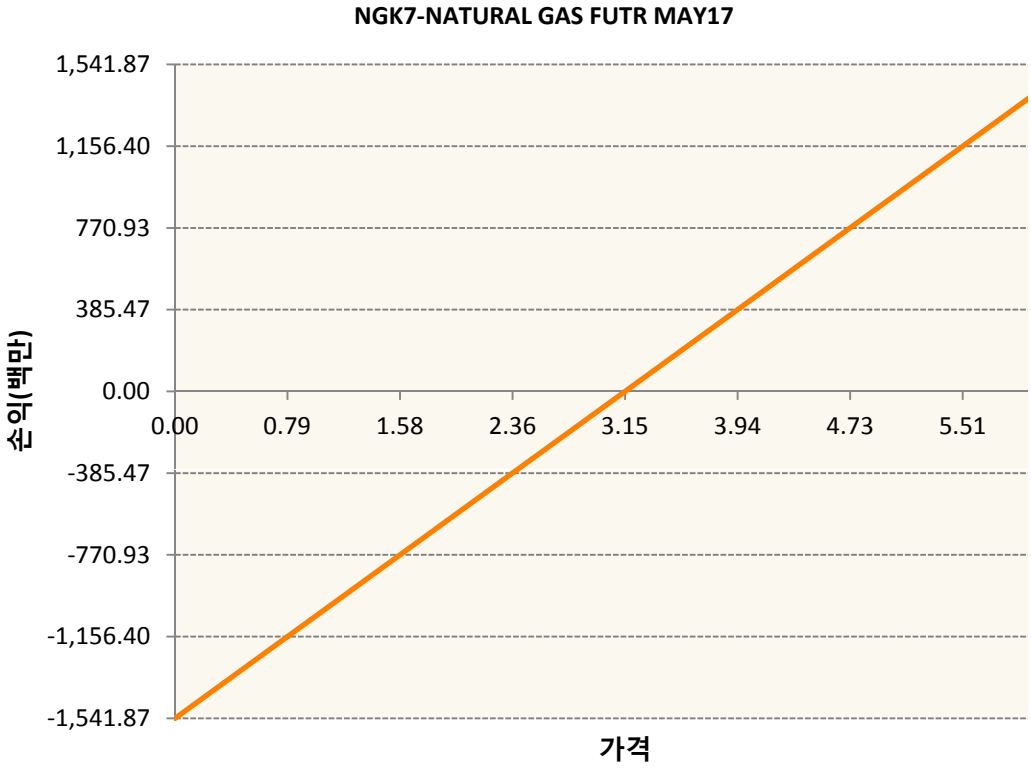


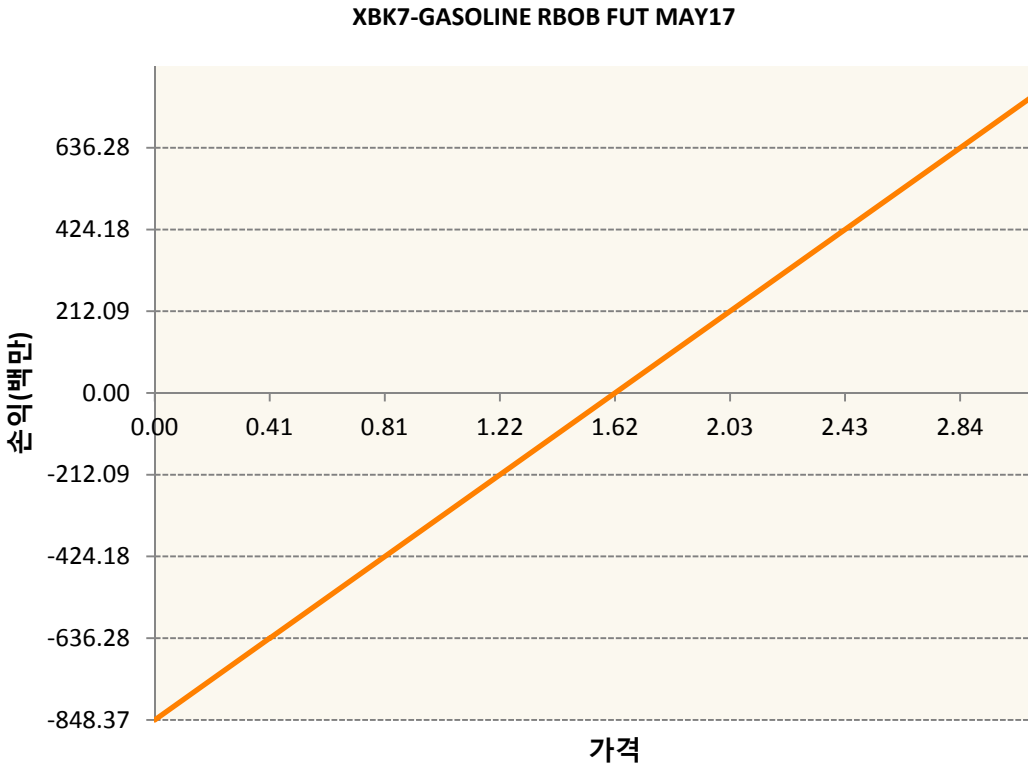

-731.39
-1,097.09
-1,462.78
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
540.16
360.11
180.05
0.00
-180.05
-360.11
-540.16
-720.21
0.00
0.38
0.75
1.13
1.50
1.88
2.25
2.63
순익(백만)
가격


KR4175M40007-2017-04 달러선물
400.50
300.38
200.25
100.13
0.00
-100.13
-200.25
-300.38
0.00
278.13
556.25
834.38
1,112.50
1,390.63
1,668.75
1,946.88
순익(백만)


-400.50
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,541.87
1,156.40
770.93
385.47
0.00
-385.47
-770.93
-1,156.40
-1,541.87
0.00
0.79
1.58
2.36
3.15
3.94
4.73
5.51
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
636.28
424.18
212.09
0.00
-212.09
-424.18
-636.28
-848.37
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	117
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	58
KR4175M40(	2017-04 달러선물	32
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	123
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	68

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

987

공시일	2017-03-28
기준일	2017-03-27

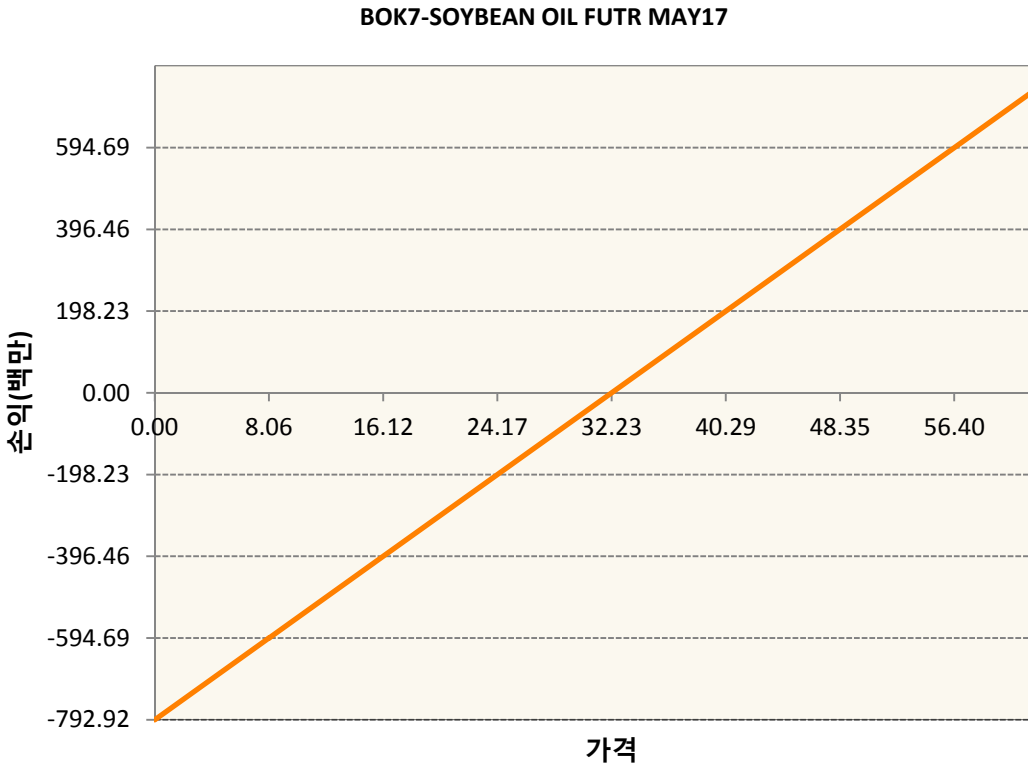
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

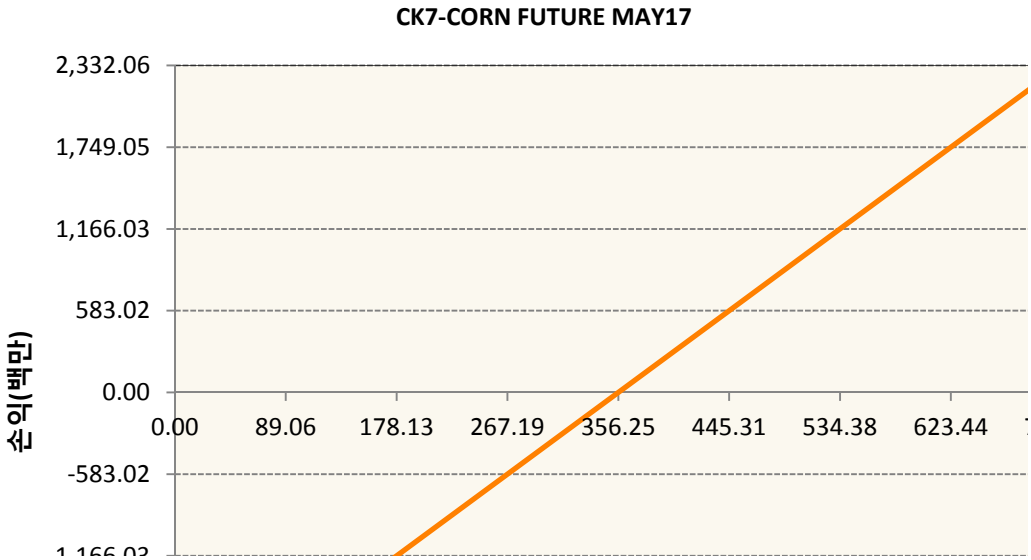
1. 계약금액

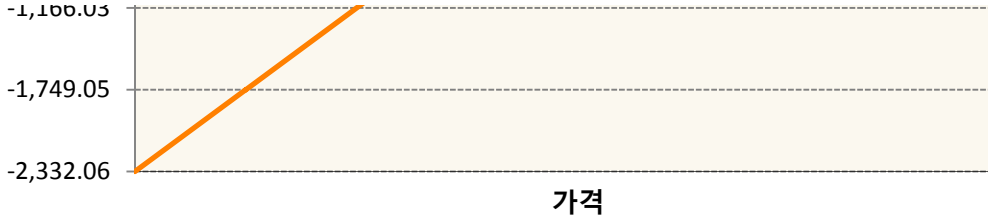
(단위:백만원)

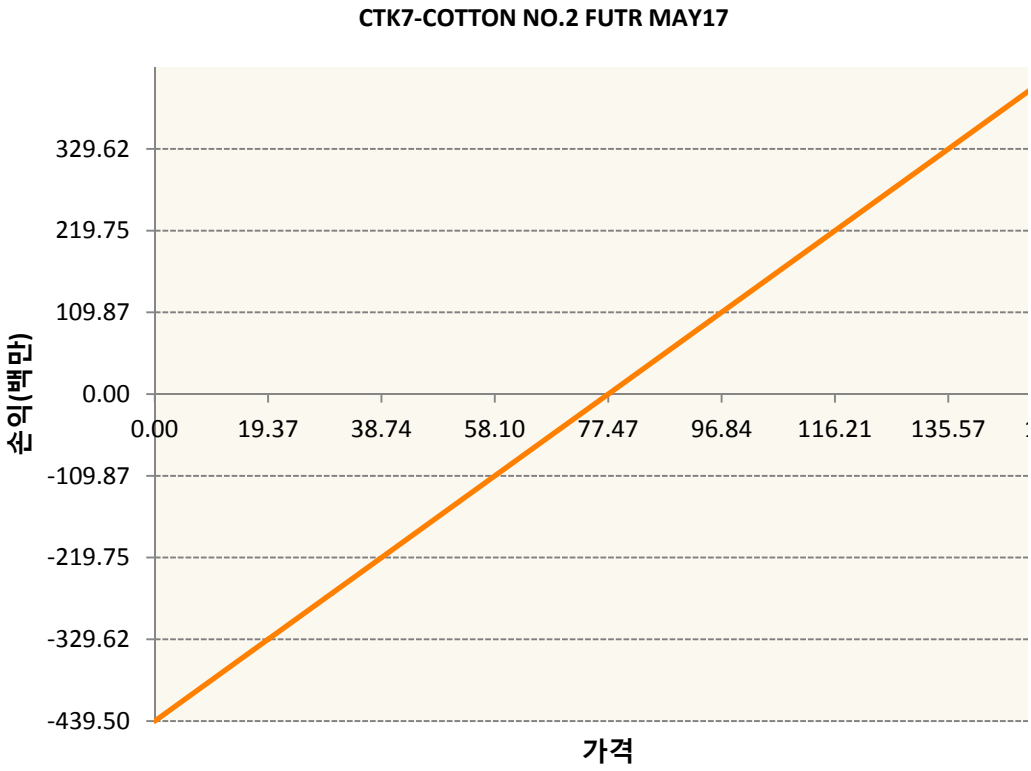
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,158	556	8,601	

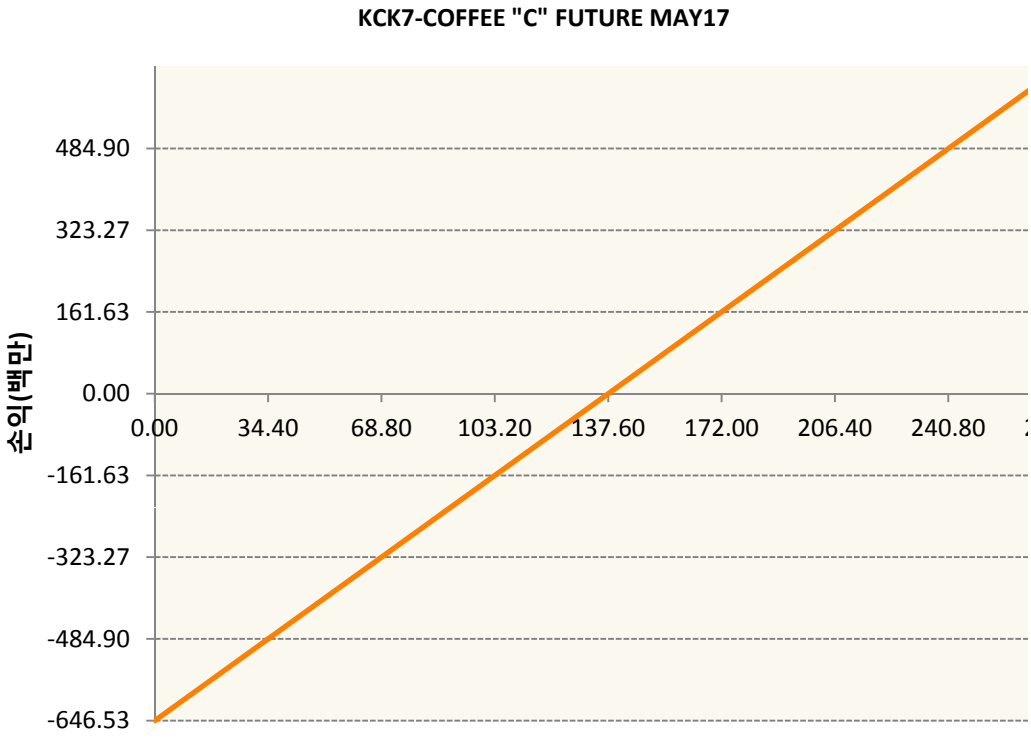
2. 만기시점의 손익구조



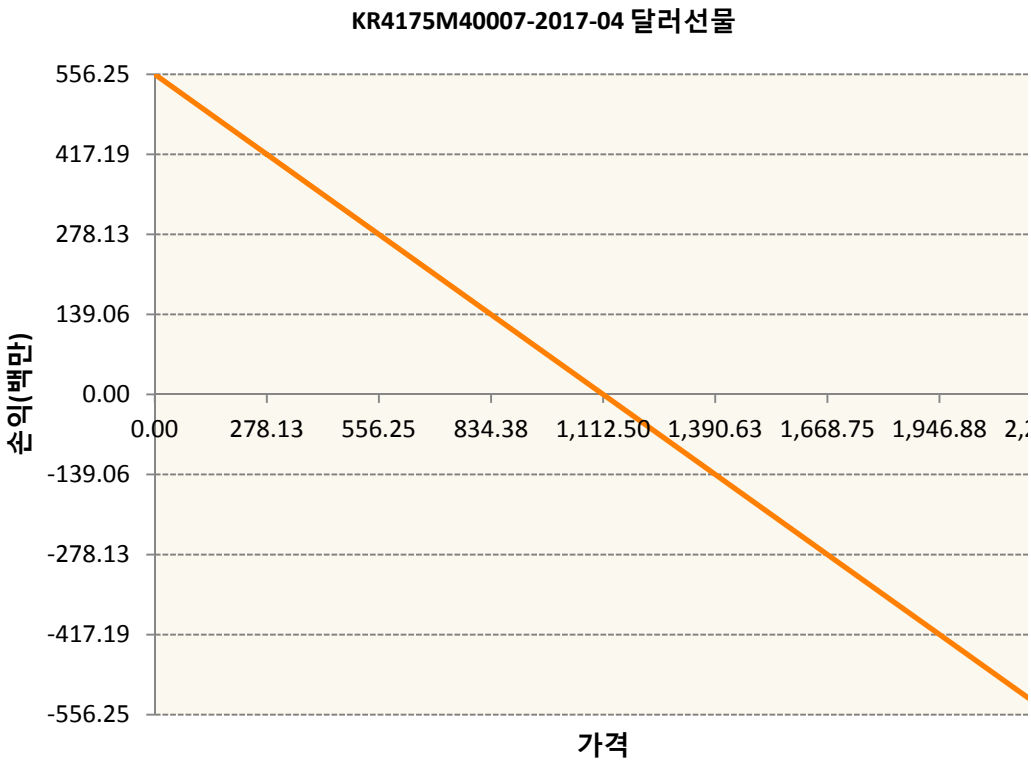


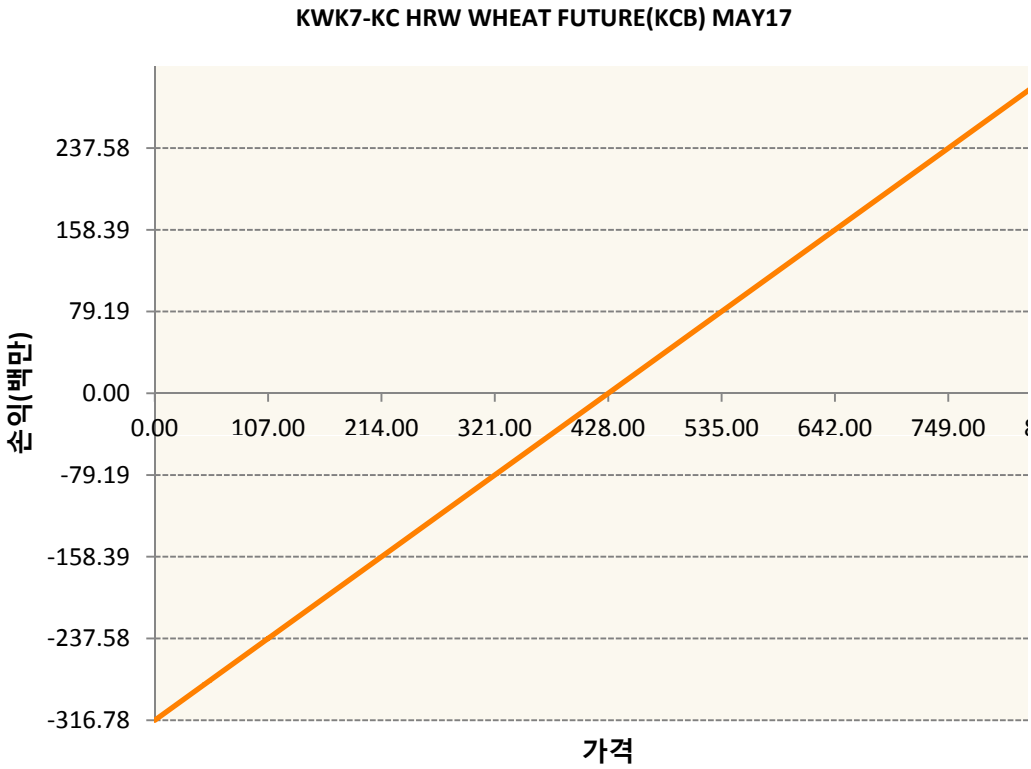

-1,166.03
-1,749.05
-2,332.06
가격

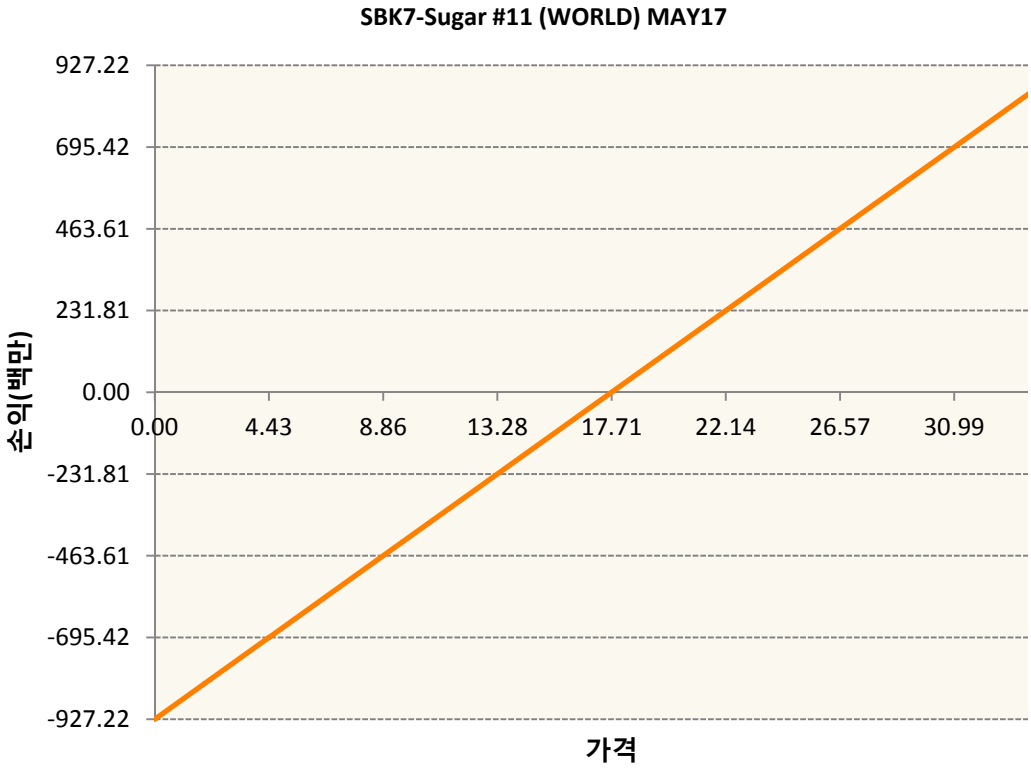

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
329.62
219.75
109.87
0.00
-109.87
-219.75
-329.62
-439.50
0.00
19.37
38.74
58.10
77.47
96.84
116.21
135.57
순익(백만)
가격

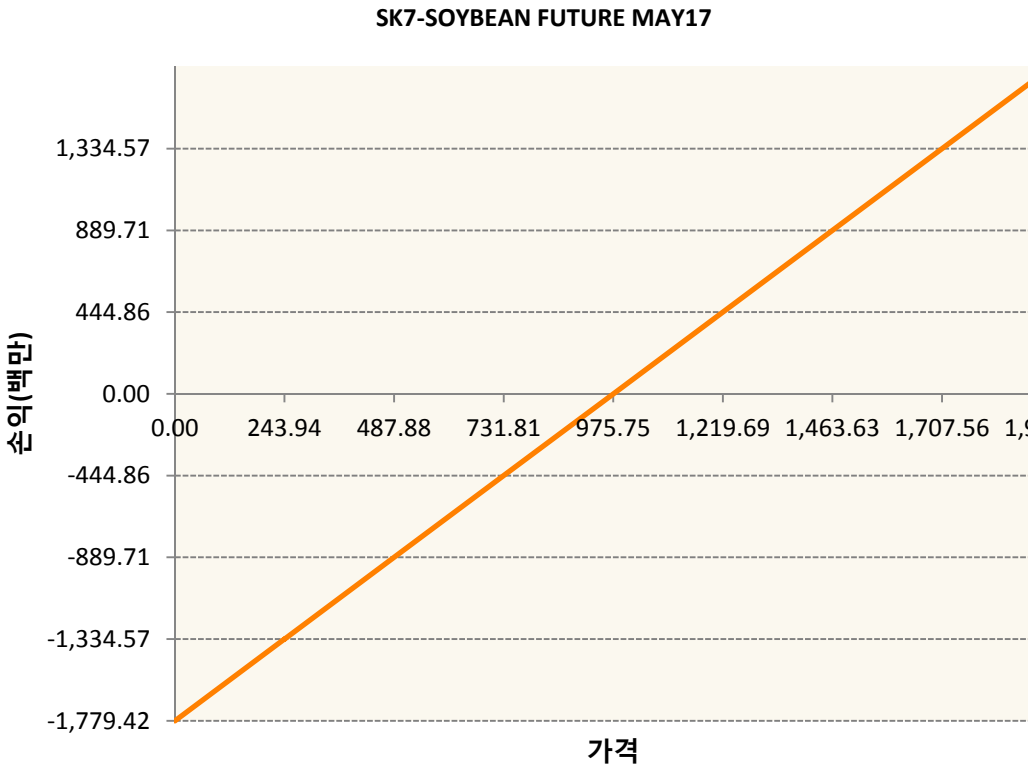

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
484.90
323.27
161.63
0.00
-161.63
-323.27
-484.90
-646.53
0.00
34.40
68.80
103.20
137.60
172.00
206.40
240.80
순익(백만)

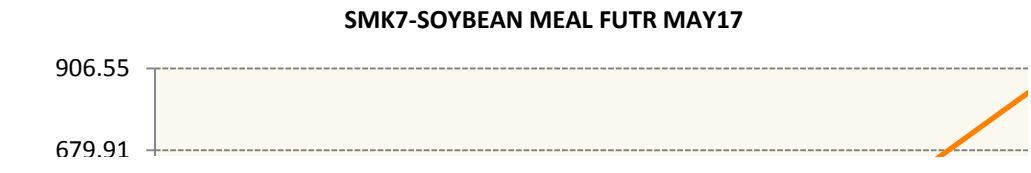
가격

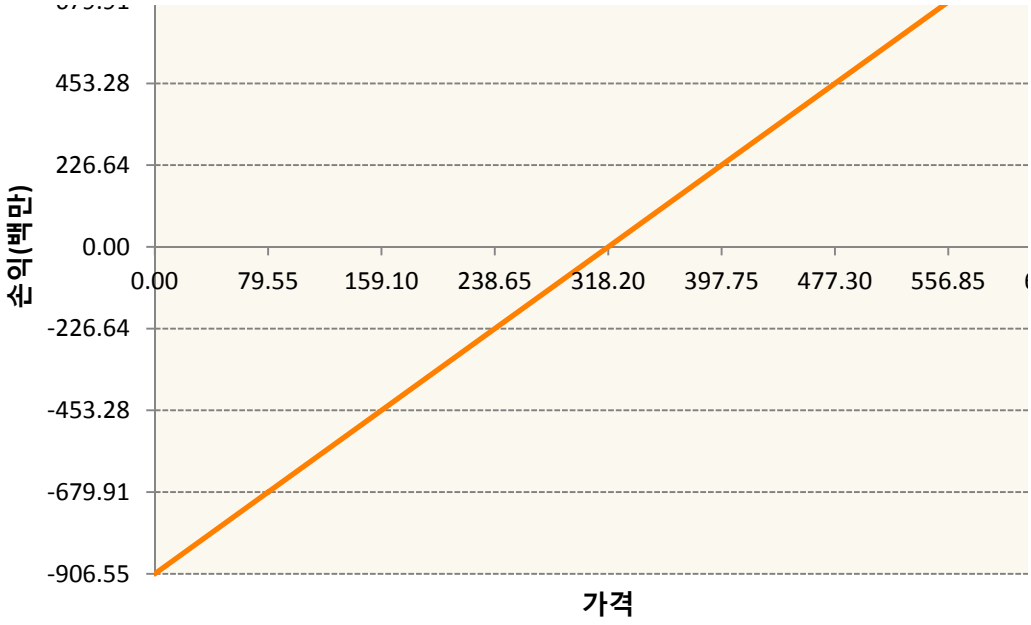

KR4175M40007-2017-04 달러선물
556.25
417.19
278.13
139.06
0.00
-139.06
-278.13
-417.19
-556.25
0.00
278.13
556.25
834.38
1,112.50
1,390.63
1,668.75
1,946.88
순이(백만)
가격

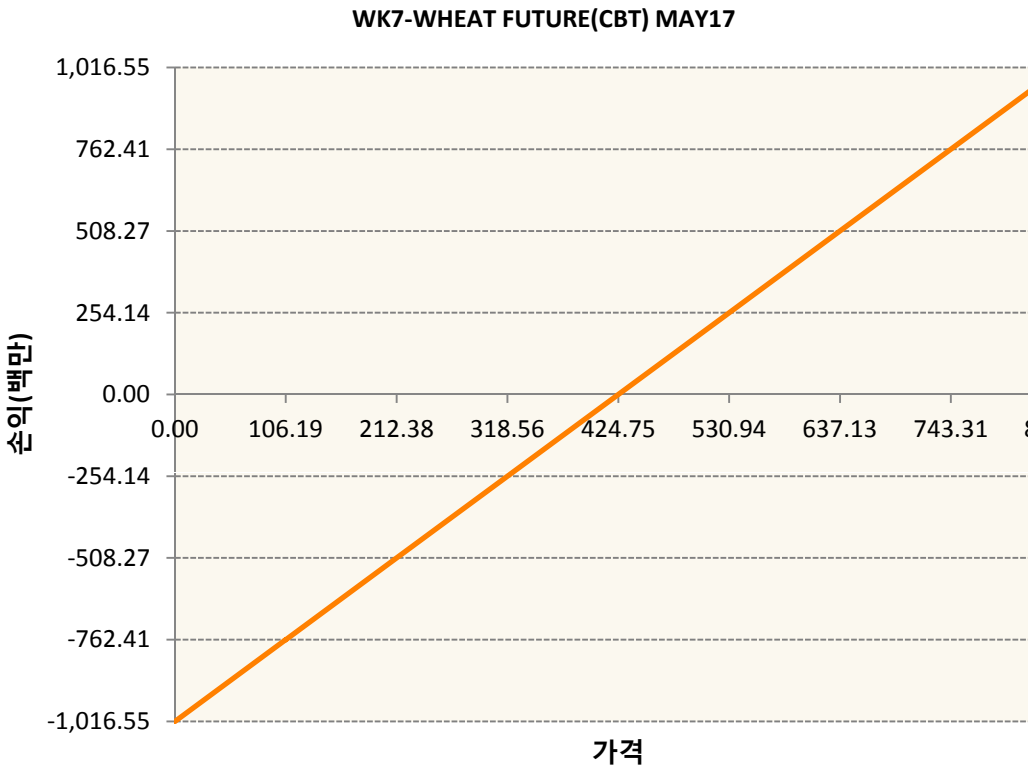

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
237.58
158.39
79.19
0.00
-79.19
-158.39
-237.58
-316.78
0.00
107.00
214.00
321.00
428.00
535.00
642.00
749.00
순이(백만)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
927.22
695.42
463.61
231.81
0.00
-231.81
-463.61
-695.42
-927.22
0.00
4.43
8.86
13.28
17.71
22.14
26.57
30.99
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,334.57
889.71
444.86
0.00
-444.86
-889.71
-1,334.57
-1,779.42
0.00
243.94
487.88
731.81
975.75
1,219.69
1,463.63
1,707.56
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
906.55
679.91





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	63
CK7	CORN FUTURE MAY17	187
CTK7	COTTON NO.2 FUTR MAY17	35
KCK7	COFFEE "C" FUTURE MAY17	52
KR4175M40(	2017-04 달러선물	45

KWK7	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17	25
SBK7	Sugar #11 (WORLD) MAY17	74
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	142
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	73
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	81

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

847