공시일	2017-03-29
기준일	2017-03-28

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	2017-03-29
기준일	2017-03-28

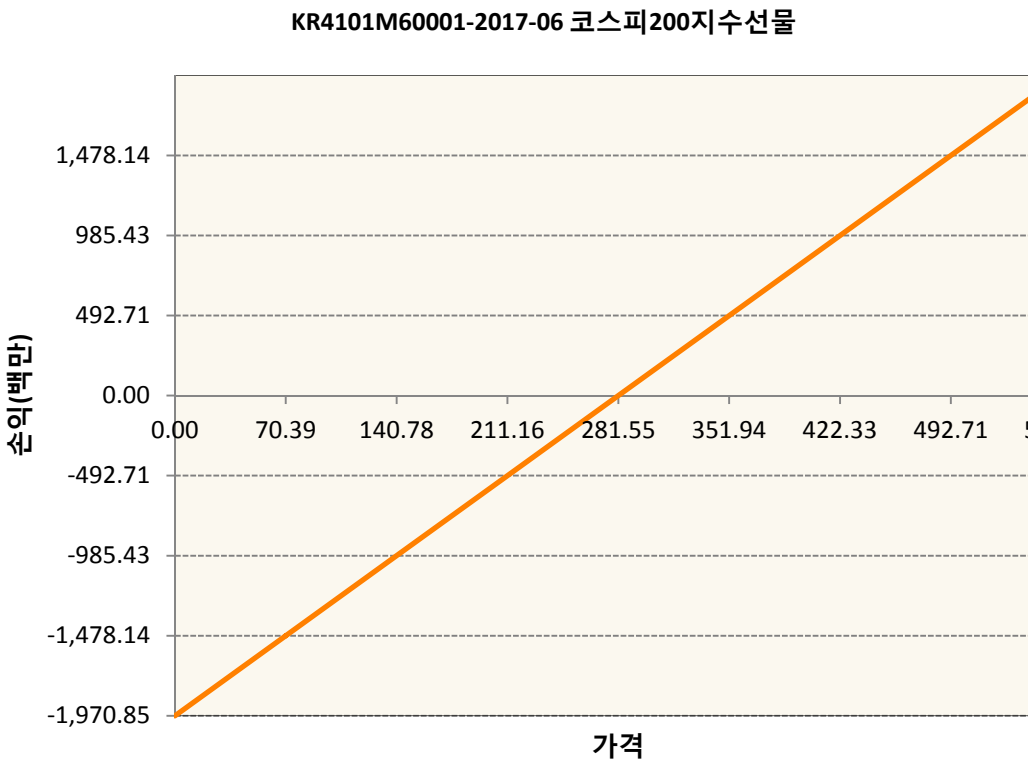
스마트인덱스모

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	1,971	0	1,971	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%	52	52	52	52	52	52	52
8.00%	79	79	79	79	79	79	79

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

51

공시일	2017-03-29
기준일	2017-03-28

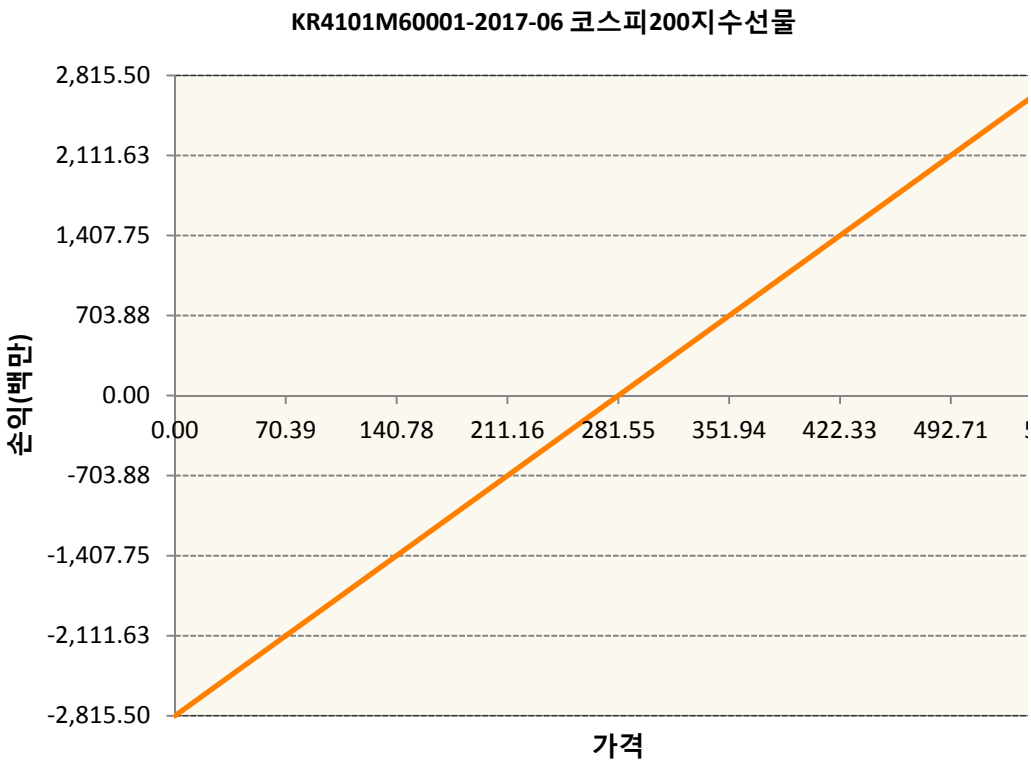
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	281	-281	장내
누계	유가증권	선물	2,816	0	2,816	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							113
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-113	-113	-113	-113	-113	-113	-113
-5.33%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-2.67%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	38	38	38	38	38	38	38
5.33%	75	75	75	75	75	75	75
8.00%	113	113	113	113	113	113	113

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

73

공시일	2017-03-29
기준일	2017-03-28

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	2017-03-29
기준일	2017-03-28

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)

431

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-29
기준일	2017-03-28

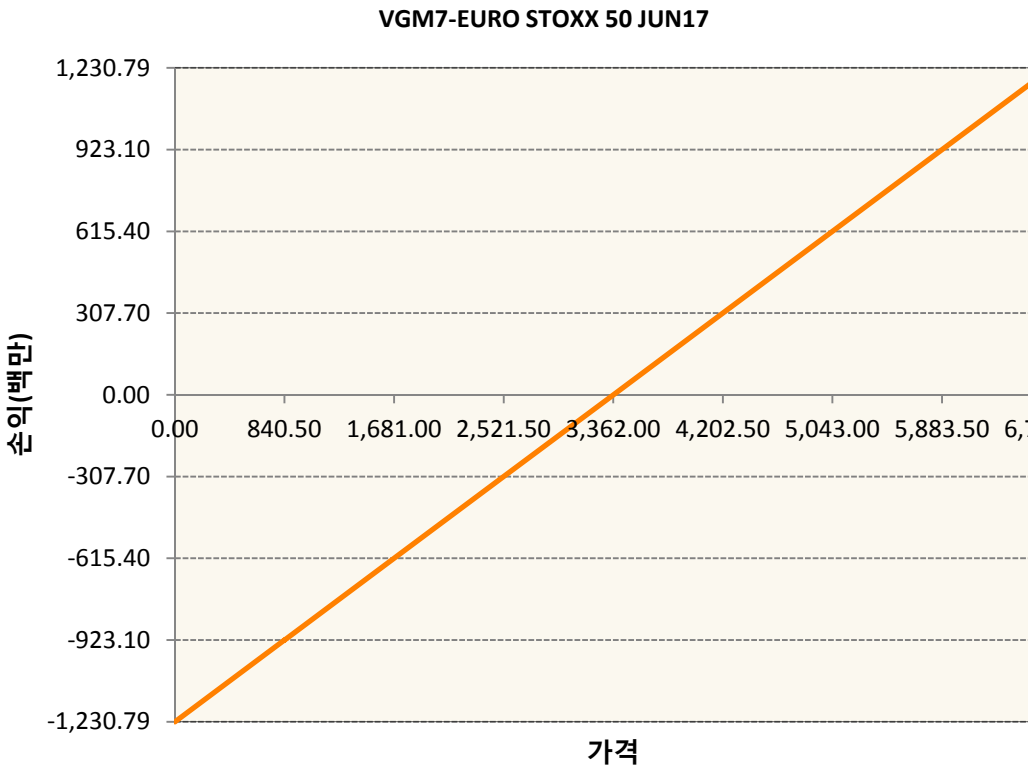
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,231	0	1,231	

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	2017-03-29
기준일	2017-03-28

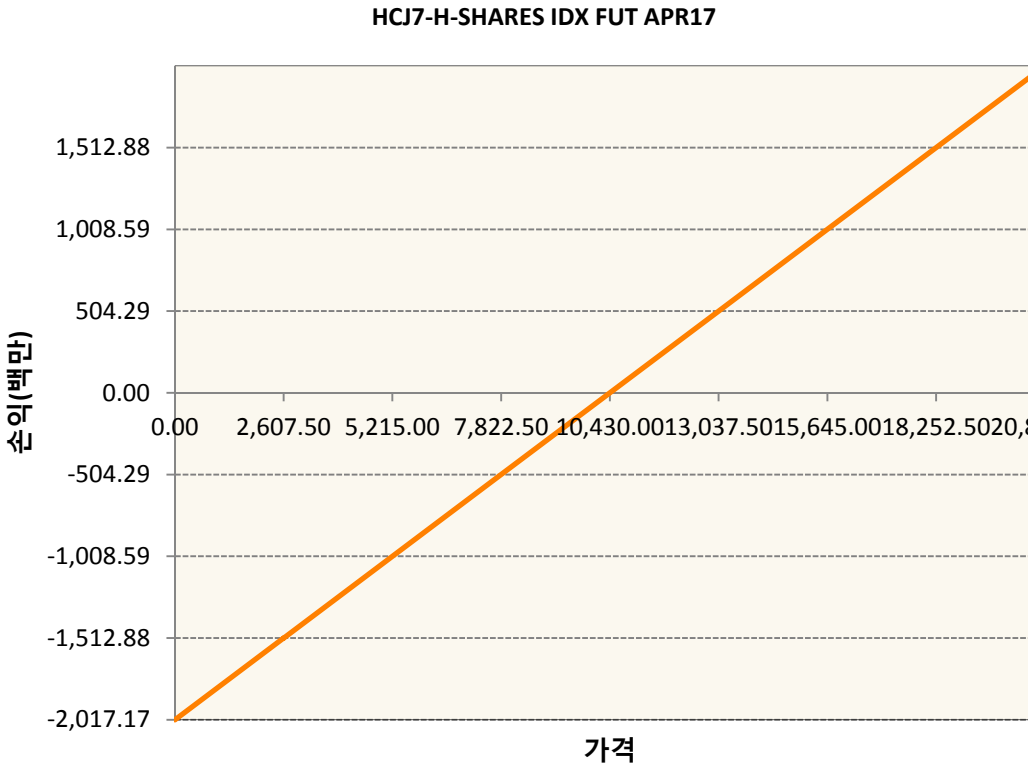
차이나인덱스모(주식-파생형)

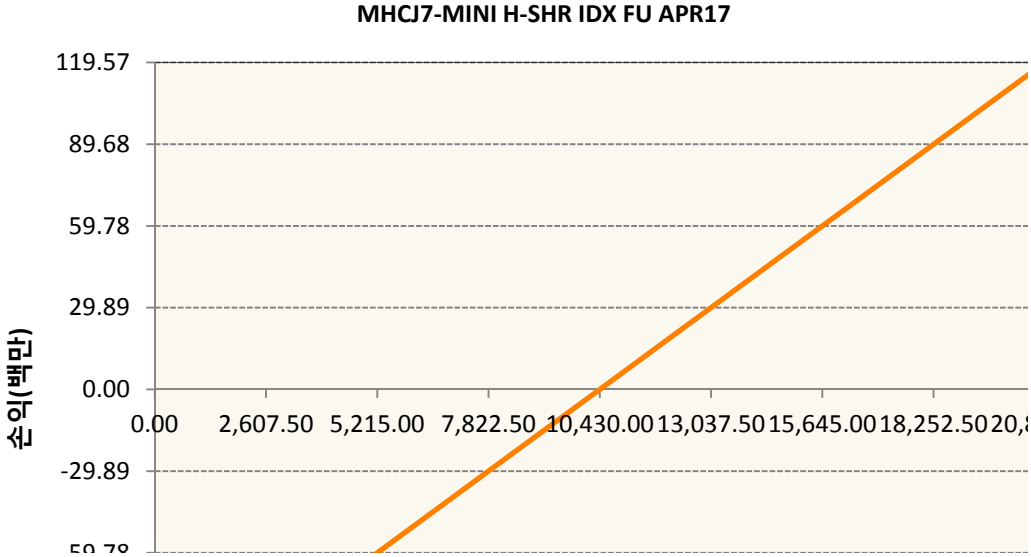
1. 계약금액

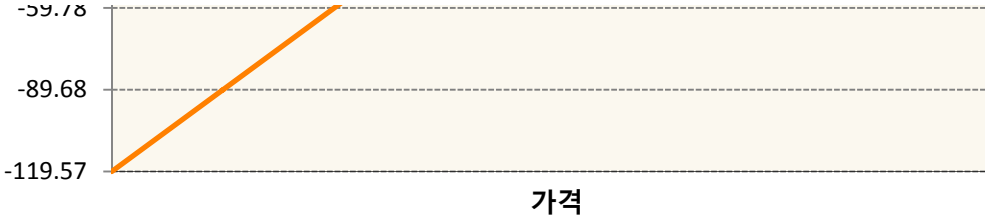
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,137	0	2,137	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)
	184

공시일	2017-03-29
기준일	2017-03-28

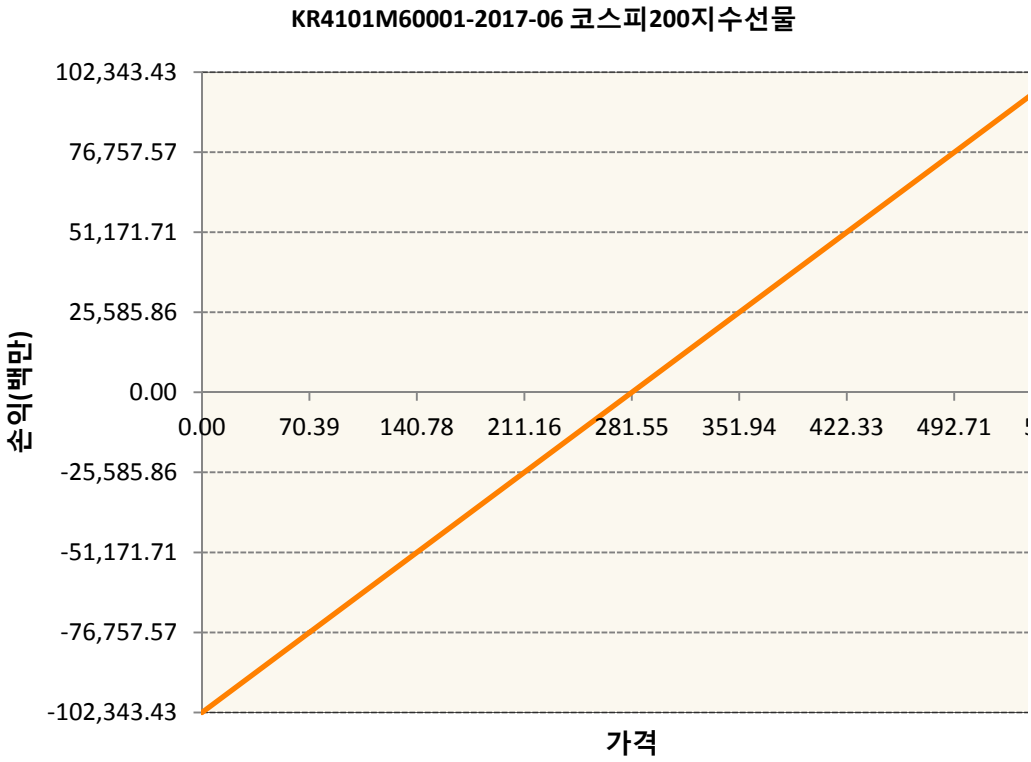
커버드콜모(주식혼합-파생형)

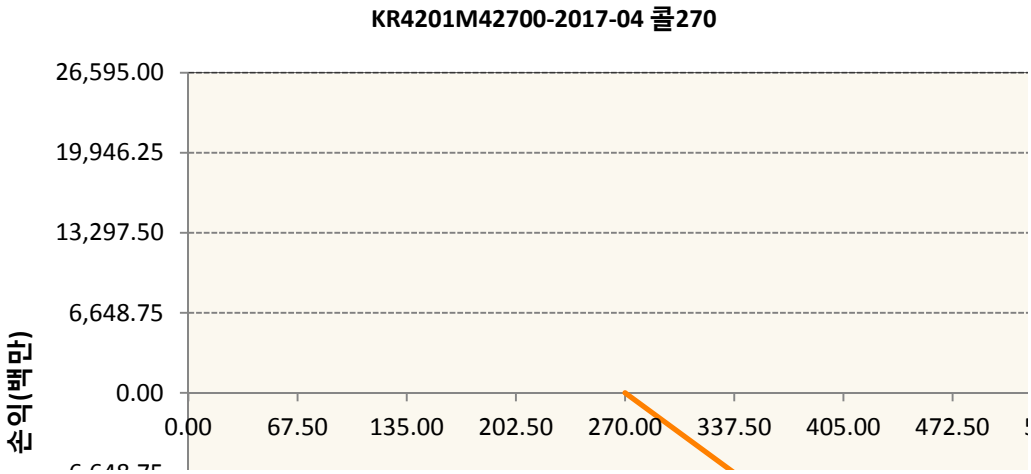
1. 계약금액

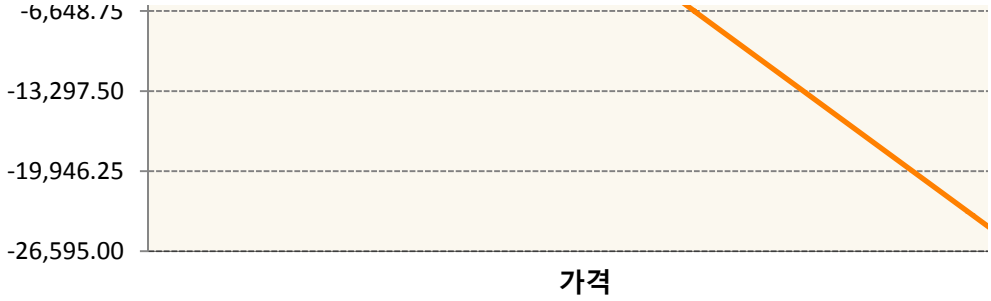
(단위:백만원)

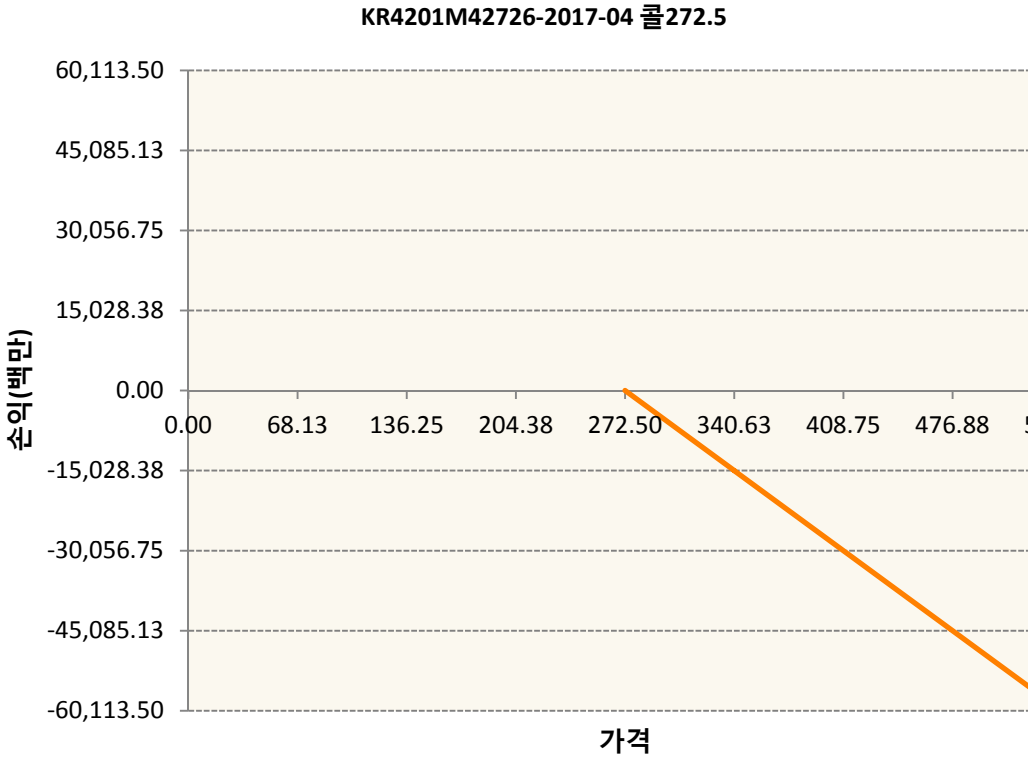
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	4,783	-4,783	장내
신규	유가증권	옵션	880	0	880	장내
누계	유가증권	선물	102,343	0	102,343	장내
누계	유가증권	옵션	0	86,709	-86,709	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							4,089
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,089	-4,089	-4,089	-4,089	-4,089	-4,089	-4,089
-5.33%	-2,726	-2,726	-2,726	-2,726	-2,726	-2,726	-2,726
-2.67%	-1,363	-1,363	-1,363	-1,363	-1,363	-1,363	-1,363
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,363	1,363	1,363	1,363	1,363	1,363	1,363
5.33%	2,726	2,726	2,726	2,726	2,726	2,726	2,726
8.00%	4,089	4,089	4,089	4,089	4,089	4,089	4,089
KR4201M42 2017-04 콜270							5,503
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,791	2,786	2,779	2,769	2,755	2,739	2,721
-5.33%	2,640	2,599	2,556	2,511	2,465	2,417	2,369
-2.67%	1,716	1,674	1,629	1,583	1,536	1,488	1,439
0%	28	21	12	0	-15	-34	-55
2.67%	-1,812	-1,812	-1,813	-1,814	-1,816	-1,818	-1,823
5.33%	-3,658	-3,658	-3,658	-3,658	-3,658	-3,658	-3,658
8.00%	-5,503	-5,503	-5,503	-5,503	-5,503	-5,503	-5,503
KR4201M42 2017-04 콜272.5							12,224

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,981	4,977	4,971	4,960	4,945	4,925	4,899
-5.33%	4,849	4,791	4,724	4,650	4,570	4,486	4,397
-2.67%	3,509	3,390	3,270	3,149	3,029	2,908	2,786
0%	126	93	51	0	-58	-123	-193
2.67%	-3,958	-3,960	-3,963	-3,969	-3,979	-3,993	-4,012
5.33%	-8,091	-8,091	-8,091	-8,091	-8,092	-8,093	-8,095
8.00%	-12,224	-12,224	-12,224	-12,224	-12,224	-12,224	-12,224

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

23,071

공시일	2017-03-29
기준일	2017-03-28

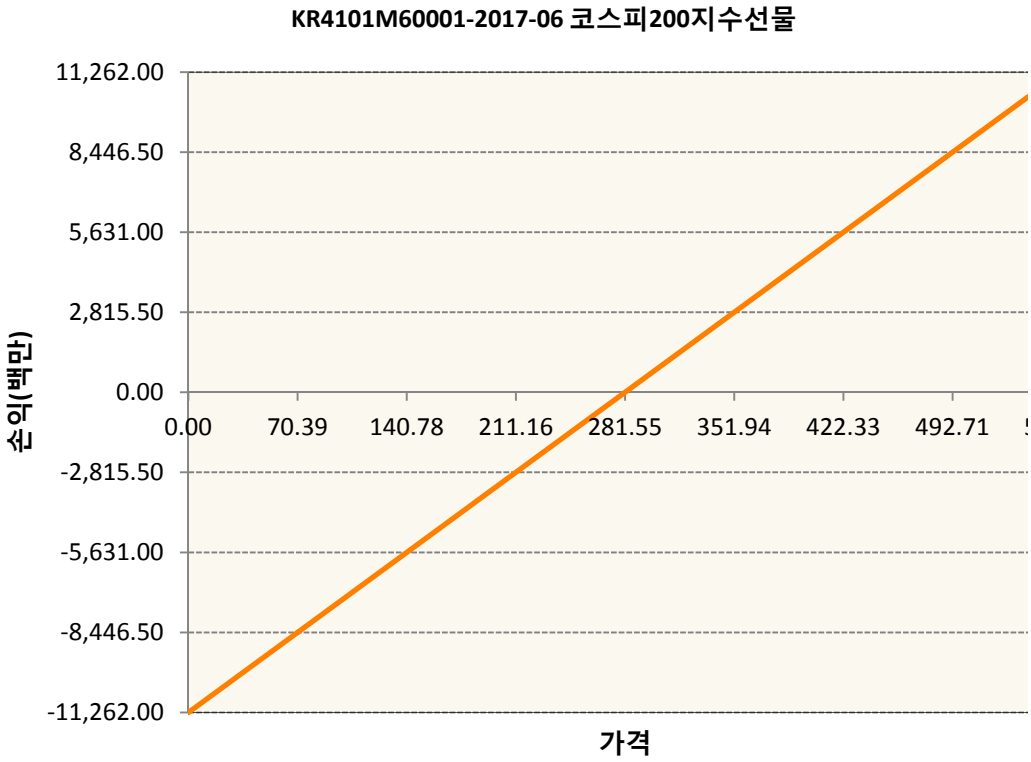
커버드콜목표전환형증권투자신탁

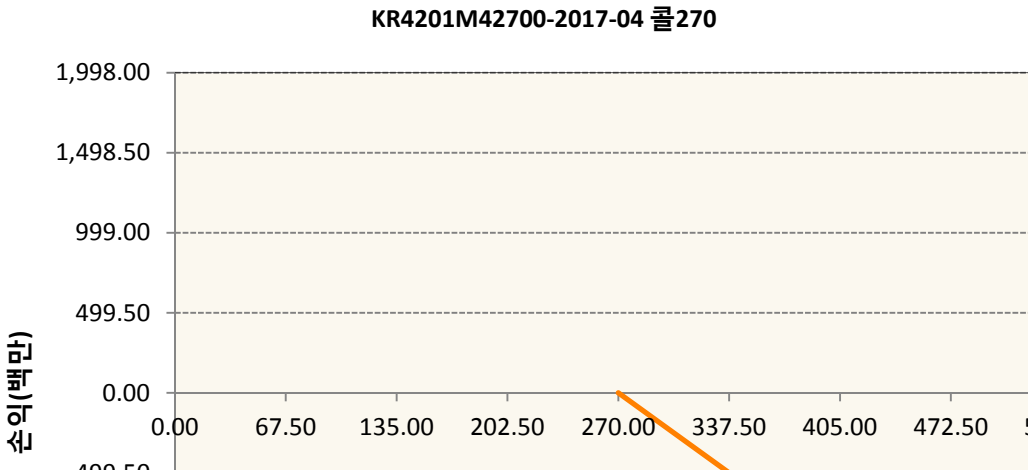
1. 계약금액

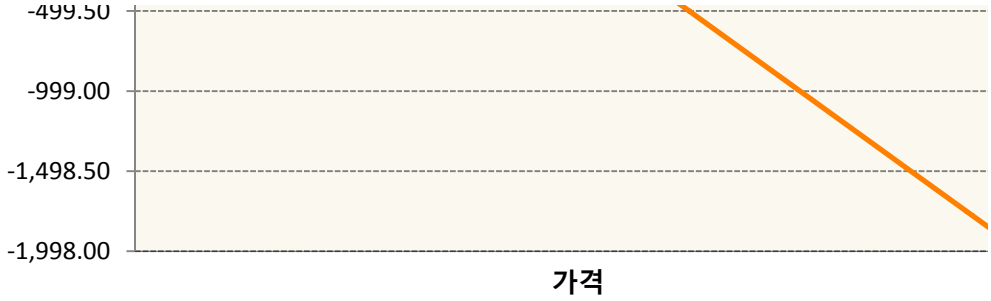
(단위:백만원)

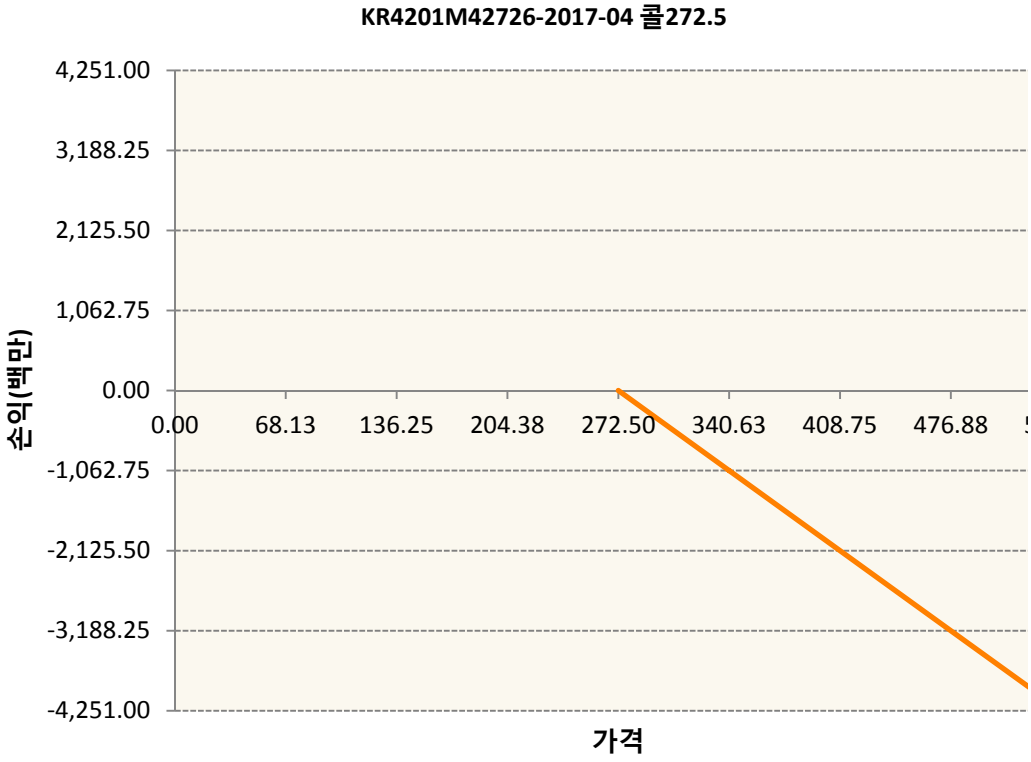
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,262	0	11,262	장내
누계	유가증권	옵션	0	6,249	-6,249	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							450
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-450	-450	-450	-450	-450	-450	-450
-5.33%	-300	-300	-300	-300	-300	-300	-300
-2.67%	-150	-150	-150	-150	-150	-150	-150
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	150	150	150	150	150	150	150
5.33%	300	300	300	300	300	300	300
8.00%	450	450	450	450	450	450	450
KR4201M42 2017-04 콜270							413
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	210	209	209	208	207	206	204
-5.33%	198	195	192	189	185	182	178
-2.67%	129	126	122	119	115	112	108
0%	2	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	-136	-136	-136	-136	-136	-137	-137
5.33%	-275	-275	-275	-275	-275	-275	-275
8.00%	-413	-413	-413	-413	-413	-413	-413
KR4201M42 2017-04 콜272.5							864

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	352	352	352	351	350	348	346
-5.33%	343	339	334	329	323	317	311
-2.67%	248	240	231	223	214	206	197
0%	9	7	4	0	-4	-9	-14
2.67%	-280	-280	-280	-281	-281	-282	-284
5.33%	-572	-572	-572	-572	-572	-572	-572
8.00%	-864	-864	-864	-864	-864	-864	-864

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

1,763

공시일	2017-03-29
기준일	2017-03-28

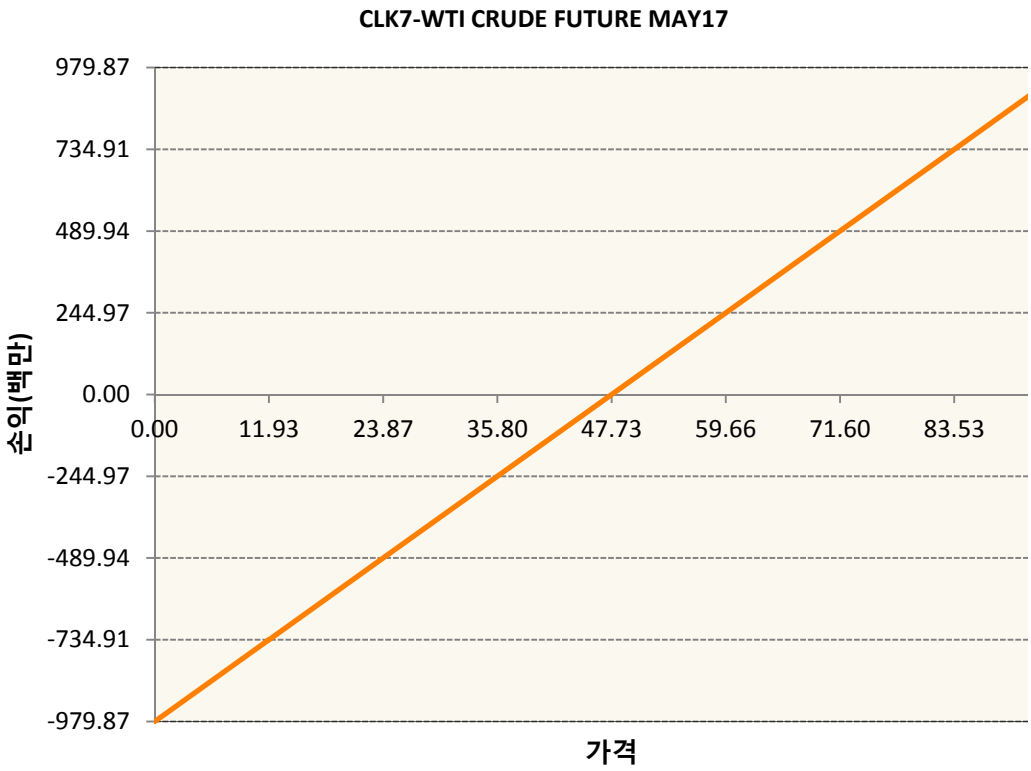
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

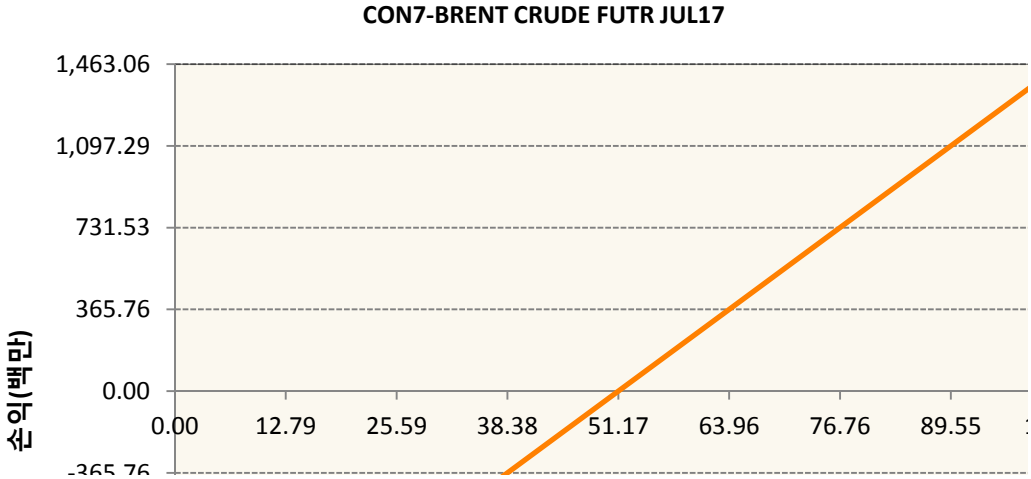
1. 계약금액

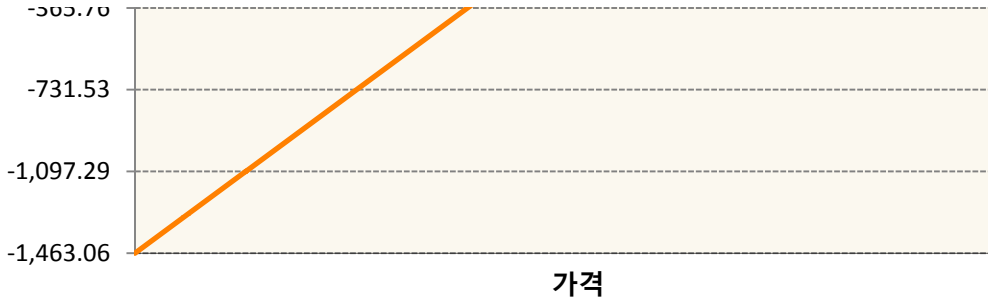
(단위:백만원)

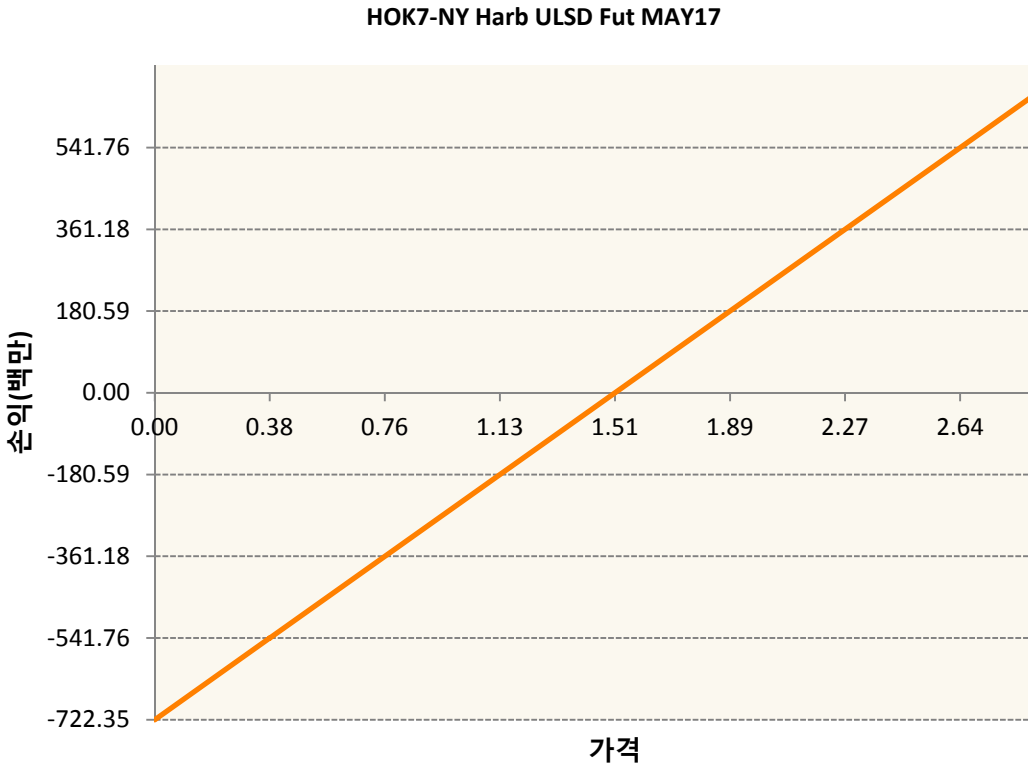
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	980	0	980	
누계	유가증권	선물	4,571	401	4,170	

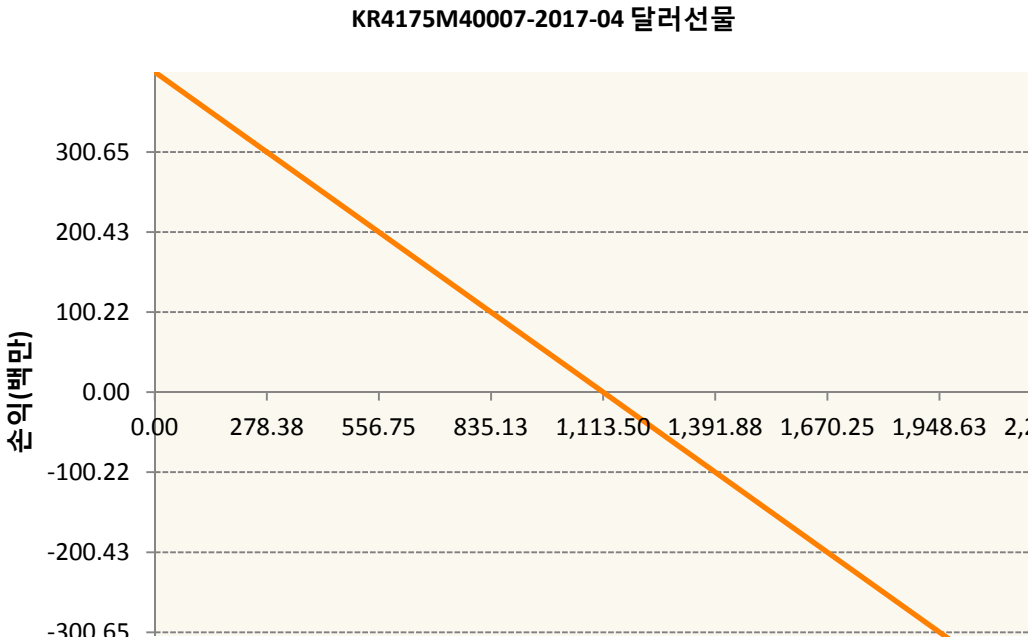
2. 만기시점의 손익구조

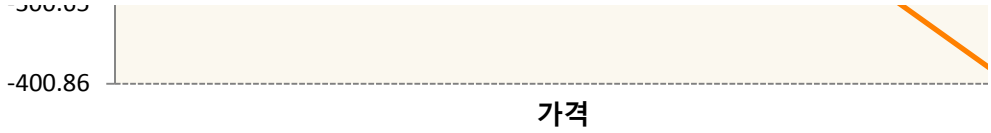


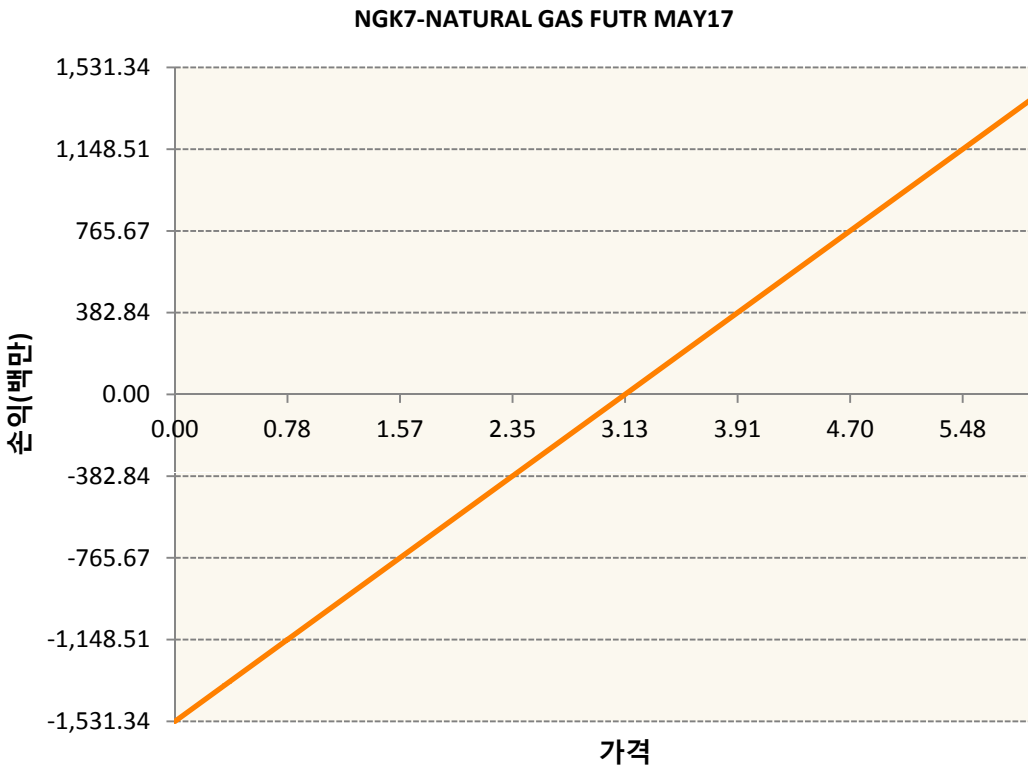


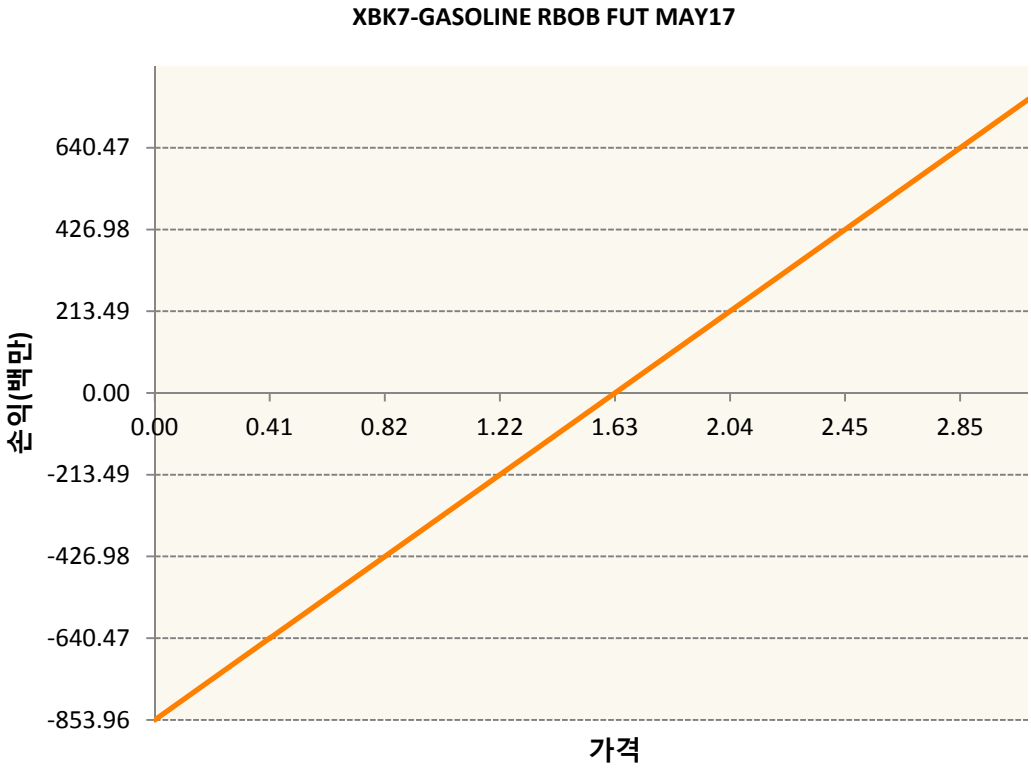

-731.53
-1,097.29
-1,463.06
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
541.76
361.18
180.59
0.00
-180.59
-361.18
-541.76
-722.35
0.00
0.38
0.76
1.13
1.51
1.89
2.27
2.64
순익(백만)
가격


KR4175M40007-2017-04 달러선물
300.65
200.43
100.22
0.00
-100.22
-200.43
-300.65
0.00
278.38
556.75
835.13
1,113.50
1,391.88
1,670.25
1,948.63
순익(백만)


-400.86
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,531.34
1,148.51
765.67
382.84
0.00
-382.84
-765.67
-1,148.51
-1,531.34
0.00
0.78
1.57
2.35
3.13
3.91
4.70
5.48
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
640.47
426.98
213.49
0.00
-213.49
-426.98
-640.47
-853.96
0.00
0.41
0.82
1.22
1.63
2.04
2.45
2.85
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK7	WTI CRUDE FUTURE MAY17	78
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)

984

공시일	2017-03-29
기준일	2017-03-28

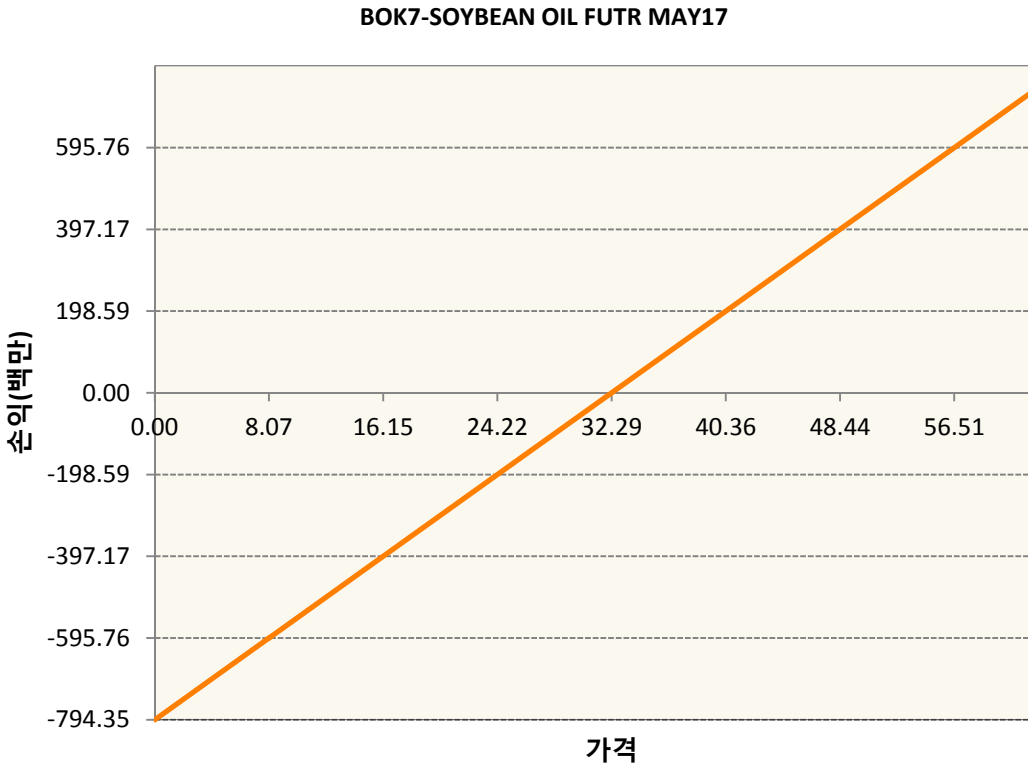
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

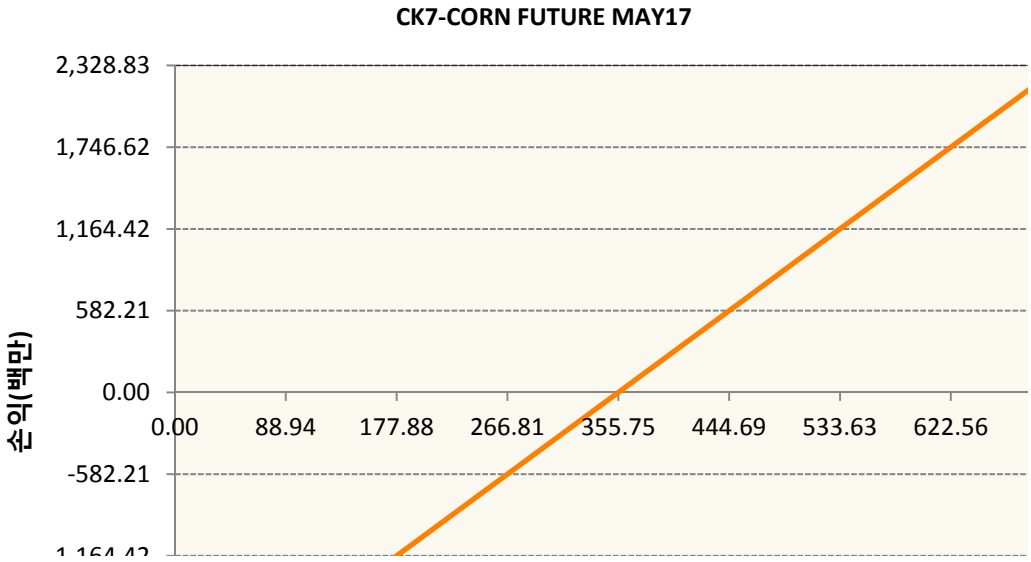
1. 계약금액

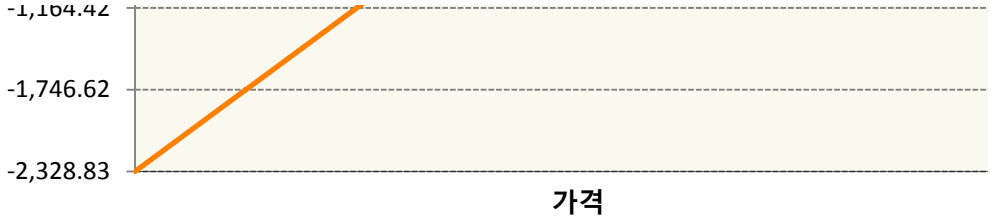
(단위:백만원)

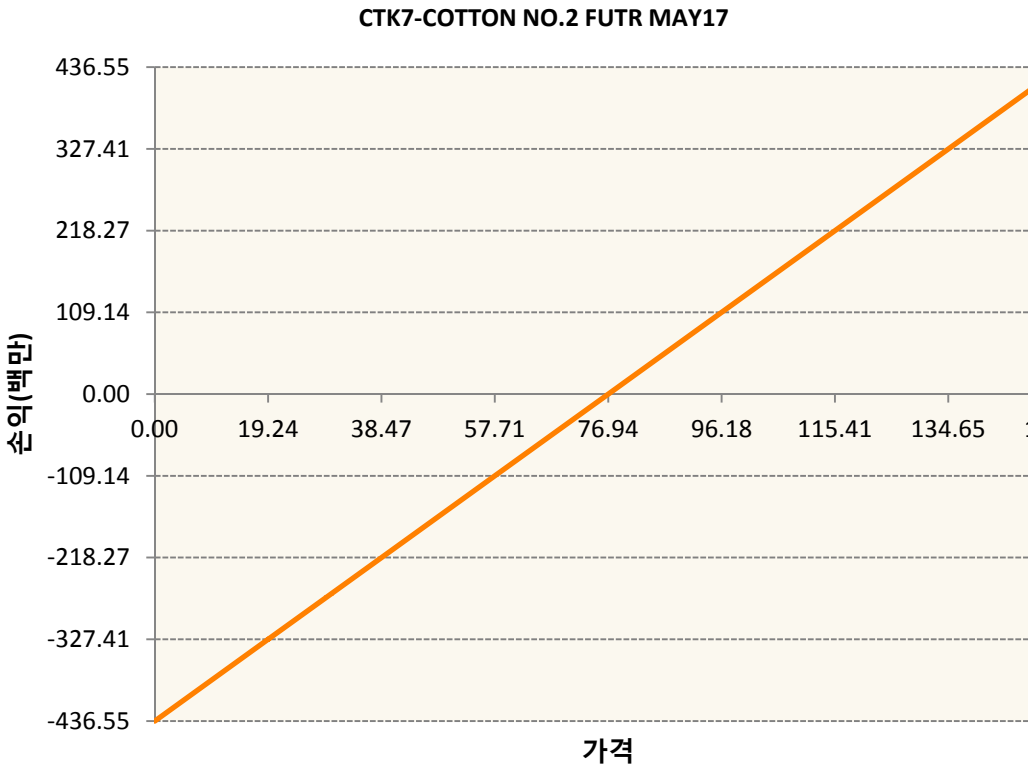
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,130	390	8,740	

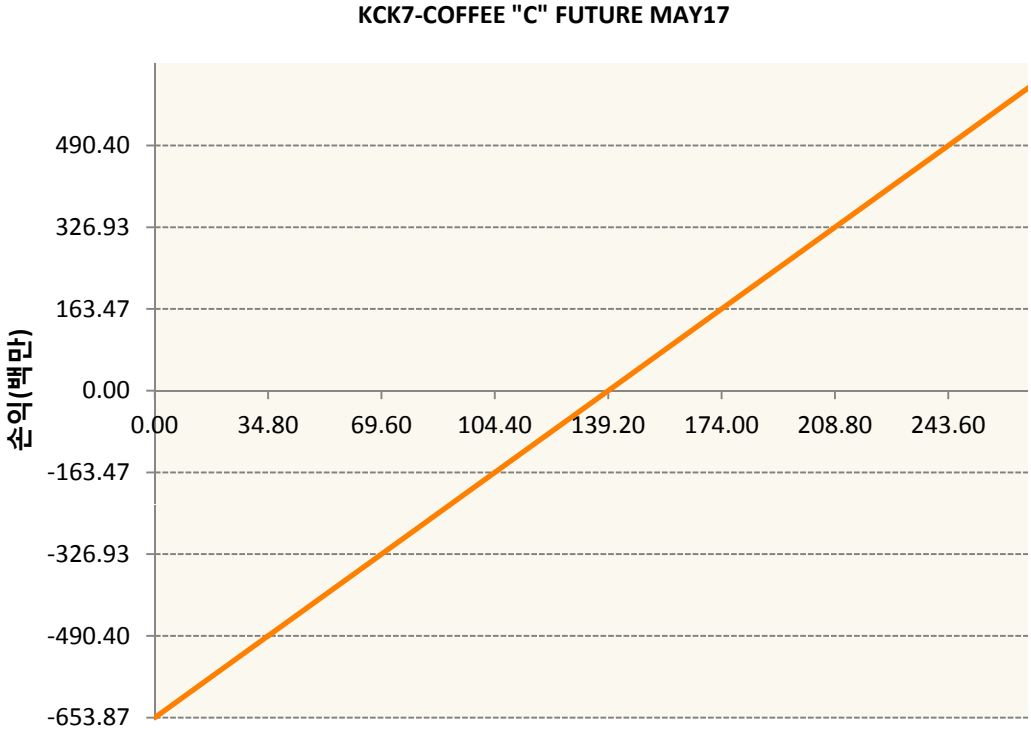
2. 만기시점의 손익구조



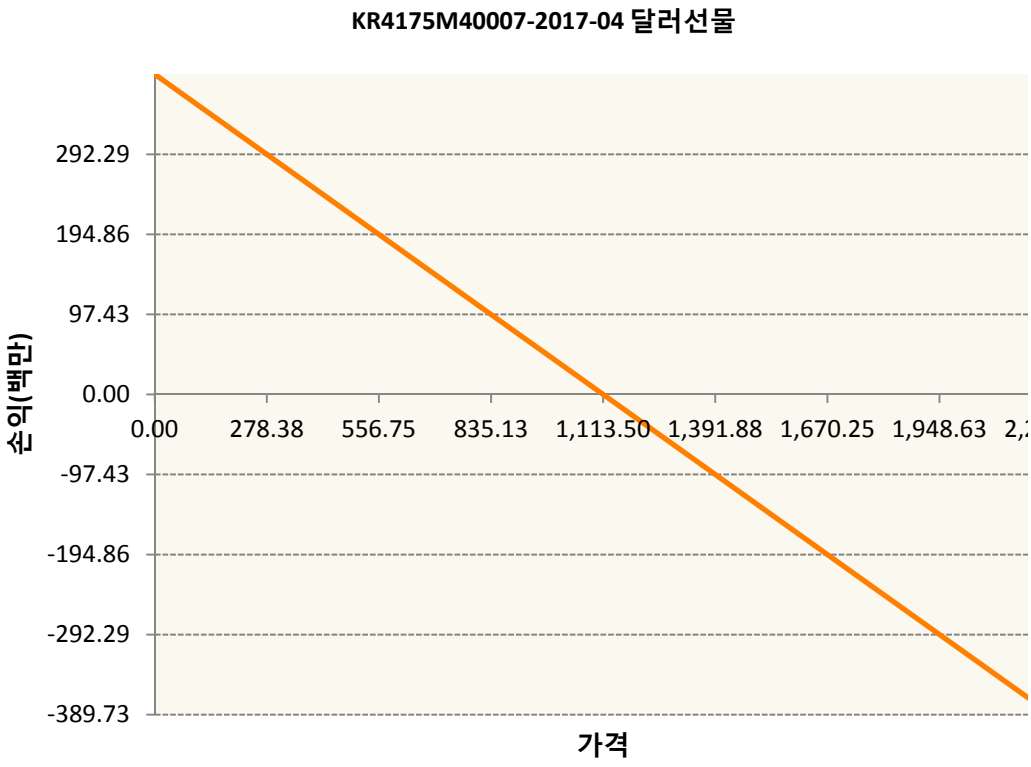


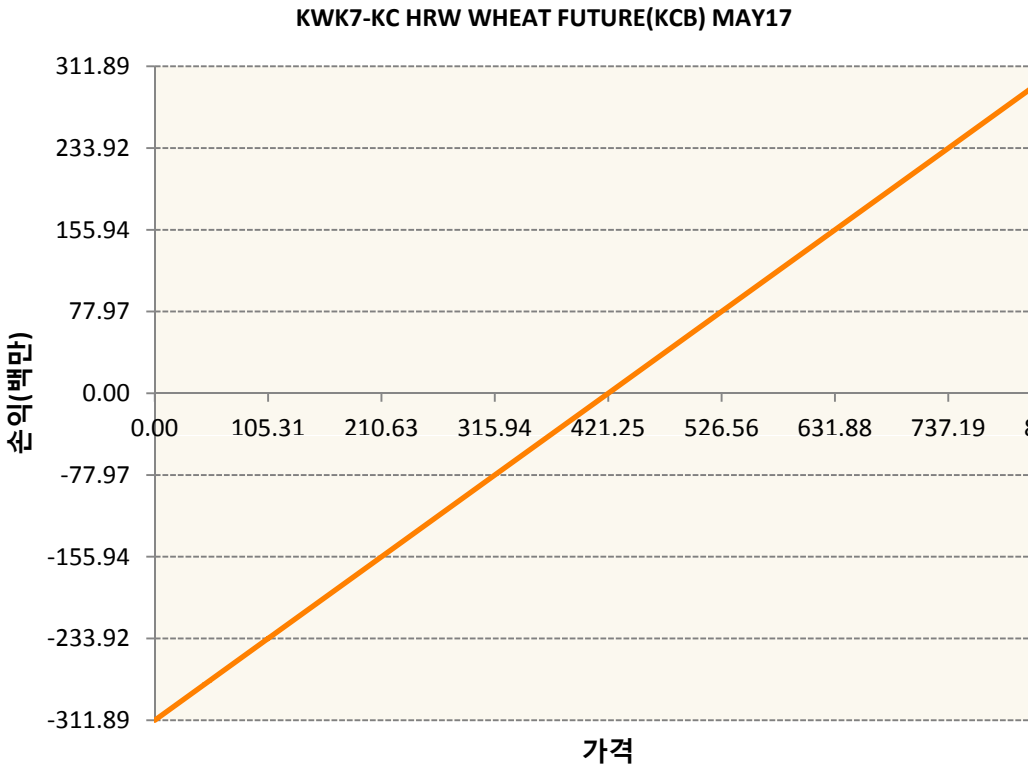

-1,746.62
-2,328.83
가격

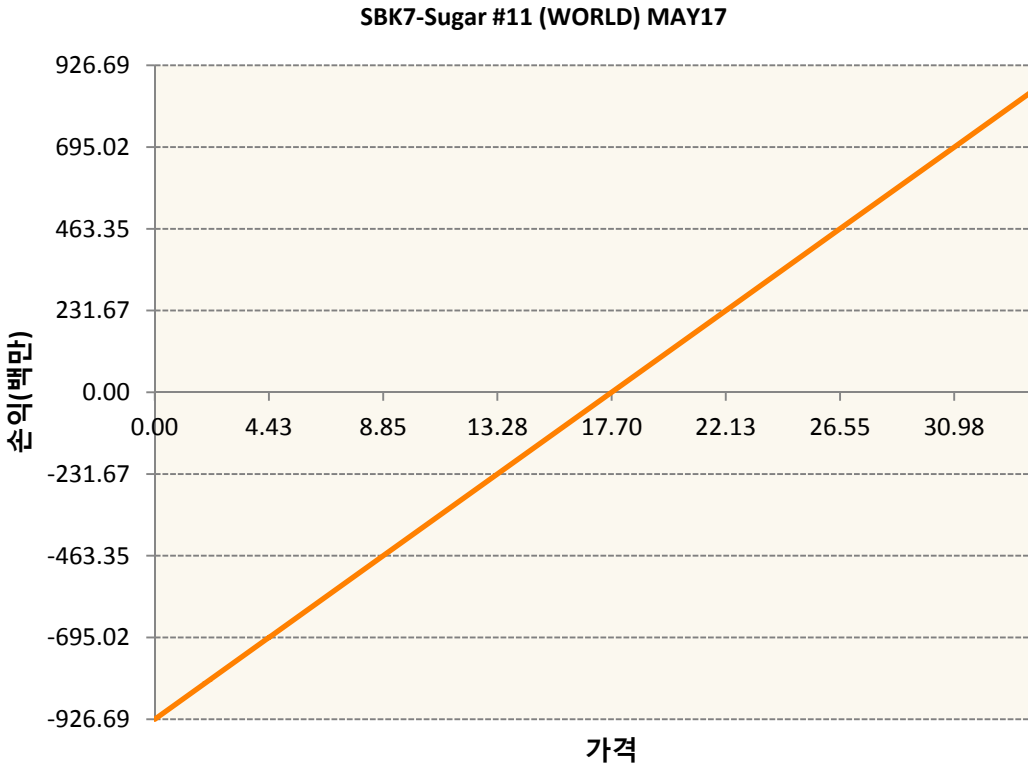

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
436.55
327.41
218.27
109.14
0.00
-109.14
-218.27
-327.41
-436.55
0.00
19.24
38.47
57.71
76.94
96.18
115.41
134.65
순익(백만)
가격

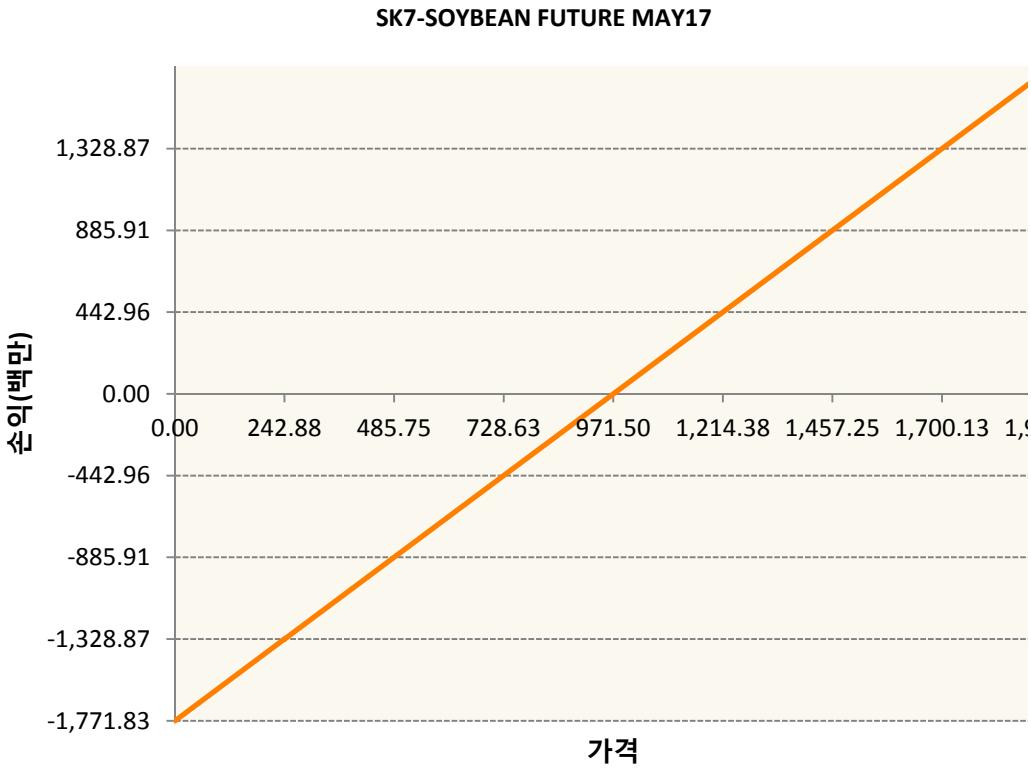

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
490.40
326.93
163.47
0.00
-163.47
-326.93
-490.40
-653.87
0.00
34.80
69.60
104.40
139.20
174.00
208.80
243.60
순익(백만)

가격

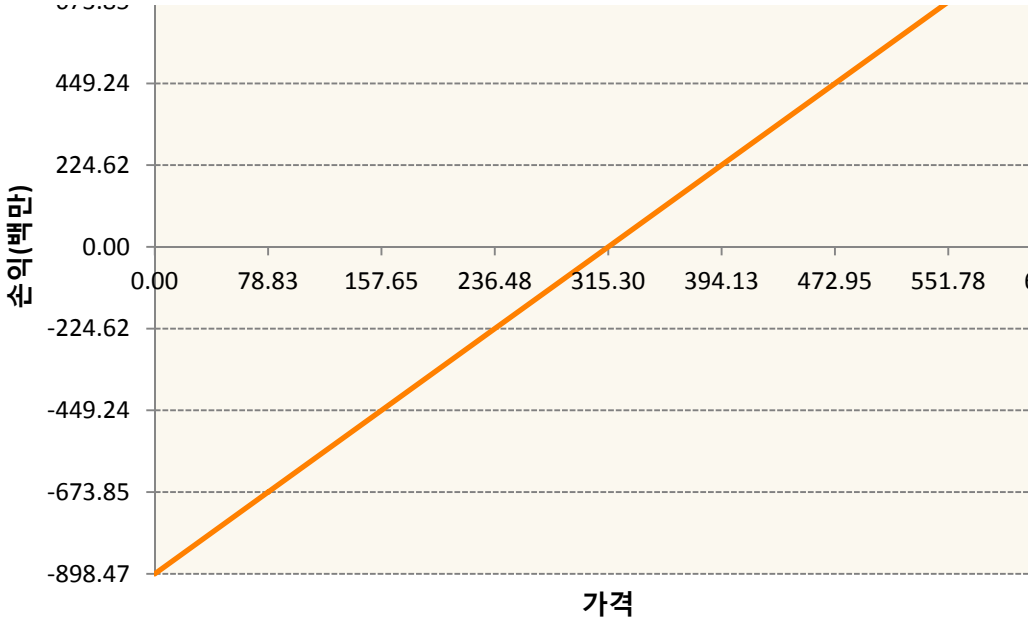

KR4175M40007-2017-04 달러선물
292.29
194.86
97.43
0.00
-97.43
-194.86
-292.29
-389.73
0.00
278.38
556.75
835.13
1,113.50
1,391.88
1,670.25
1,948.63
손익(백만)
가격

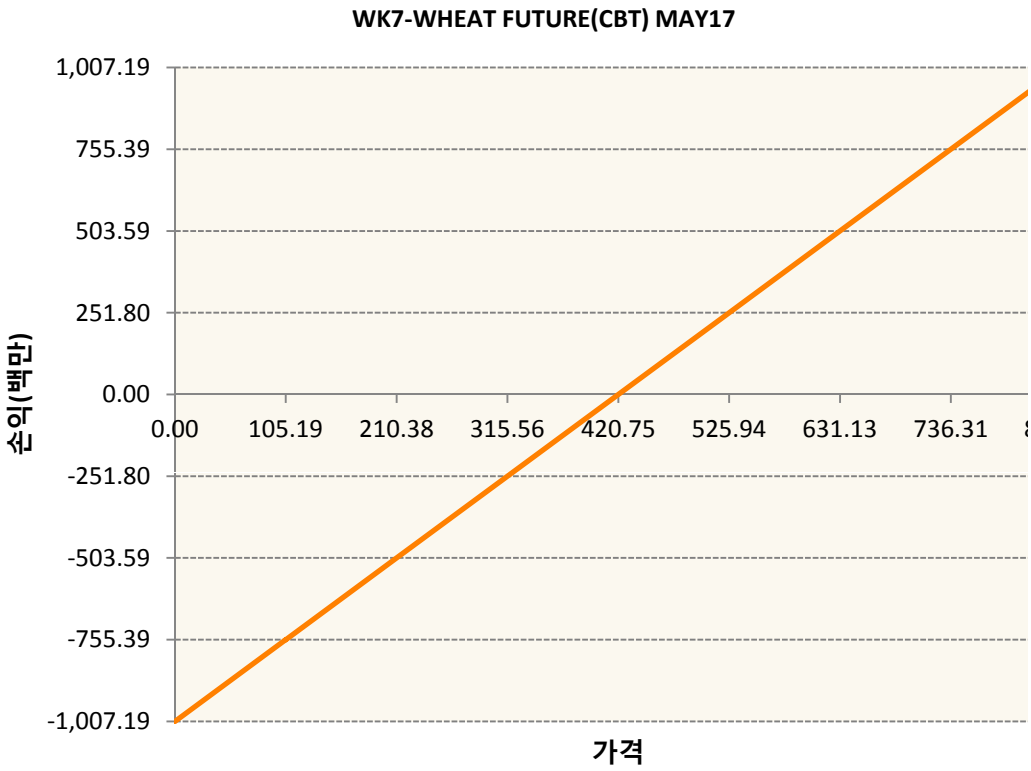

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
311.89
233.92
155.94
77.97
0.00
-77.97
-155.94
-233.92
-311.89
0.00
105.31
210.63
315.94
421.25
526.56
631.88
737.19
손익(백만)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
926.69
695.02
463.35
231.67
0.00
-231.67
-463.35
-695.02
-926.69
0.00
4.43
8.85
13.28
17.70
22.13
26.55
30.98
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,328.87
885.91
442.96
0.00
-442.96
-885.91
-1,328.87
-1,771.83
0.00
242.88
485.75
728.63
971.50
1,214.38
1,457.25
1,700.13
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
898.47
673.85





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	64
CK7	CORN FUTURE MAY17	186
CTK7	COTTON NO.2 FUTR MAY17	35
KCK7	COFFEE "C" FUTURE MAY17	52
KR4175M40(	2017-04 달러선물	31

KWK7	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17	25
SBK7	Sugar #11 (WORLD) MAY17	74
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	142
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	72
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	81

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

837