공시일	2017-03-30
기준일	2017-03-29

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	2017-03-30
기준일	2017-03-29

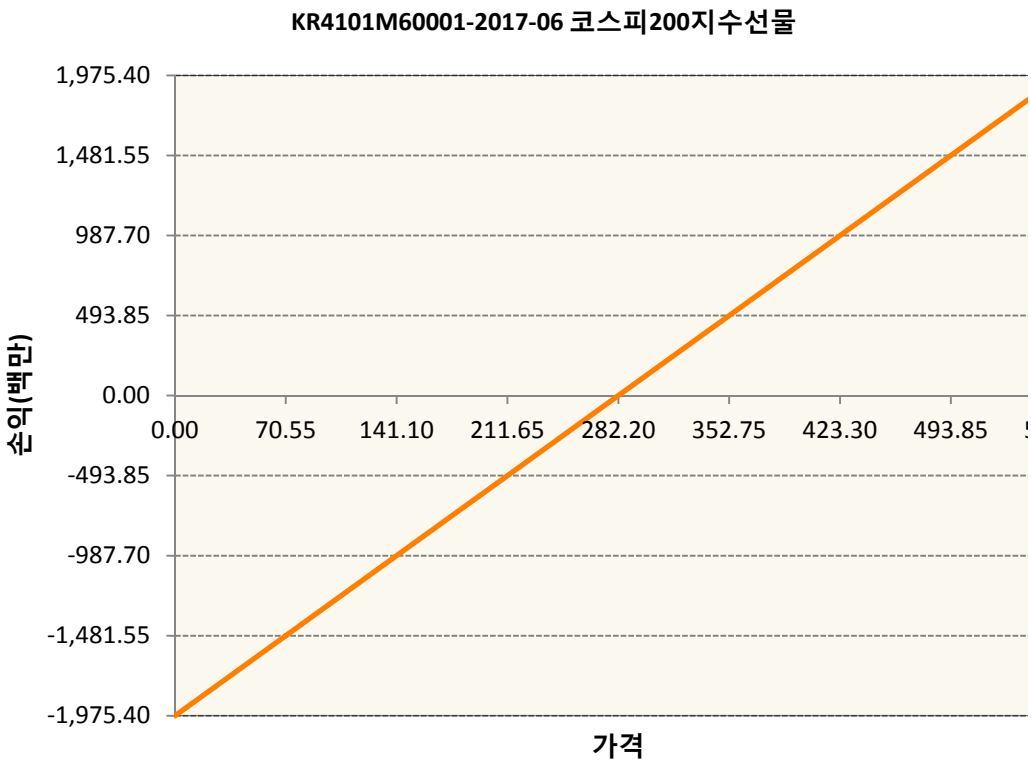
스마트인덱스모

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	1,975	0	1,975	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	2017-03-30
기준일	2017-03-29

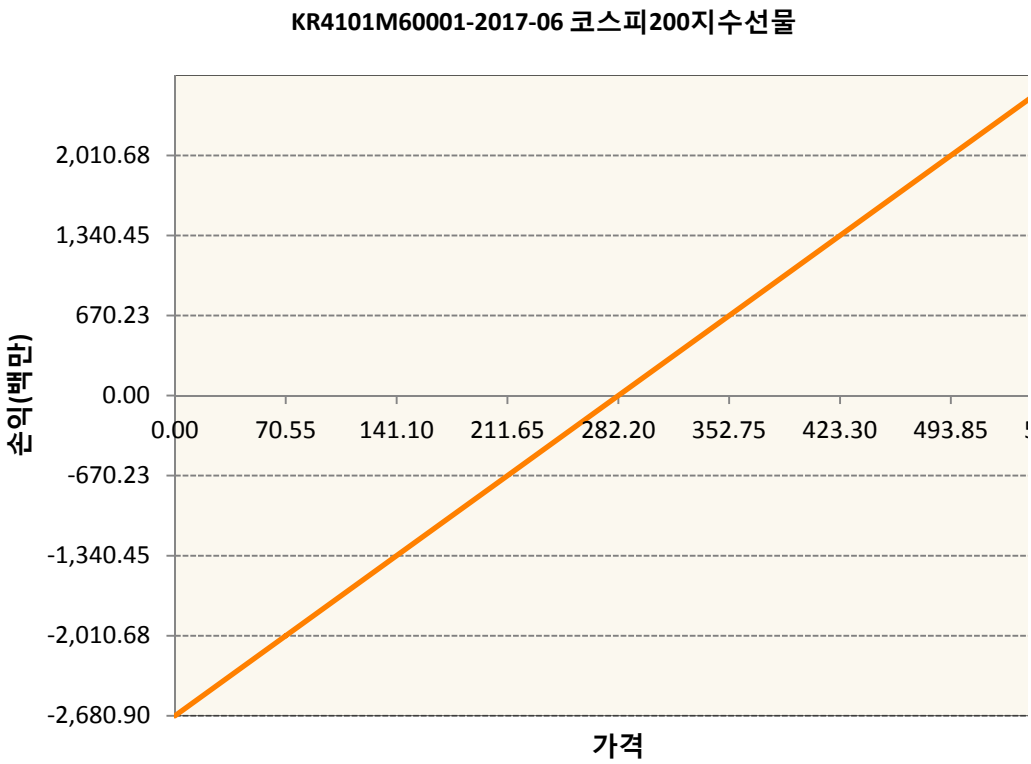
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	2,681	0	2,681	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							107
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107
-5.33%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71
-2.67%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	36	36	36	36	36	36	36
5.33%	71	71	71	71	71	71	71
8.00%	107	107	107	107	107	107	107

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

70

공시일	2017-03-30
기준일	2017-03-29

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	961

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

558

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-30
기준일	2017-03-29

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	393

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

429

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-30
기준일	2017-03-29

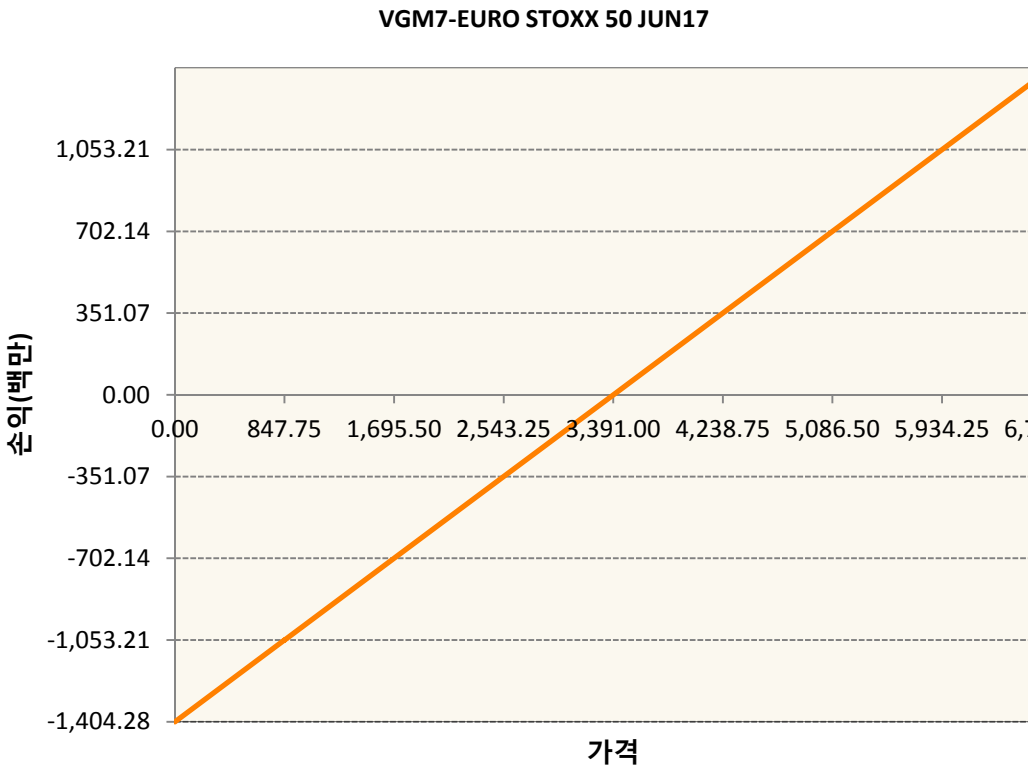
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM7	EURO STOXX 50 JUN17	112

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

(단위:백만원)

114

공시일	2017-03-30
기준일	2017-03-29

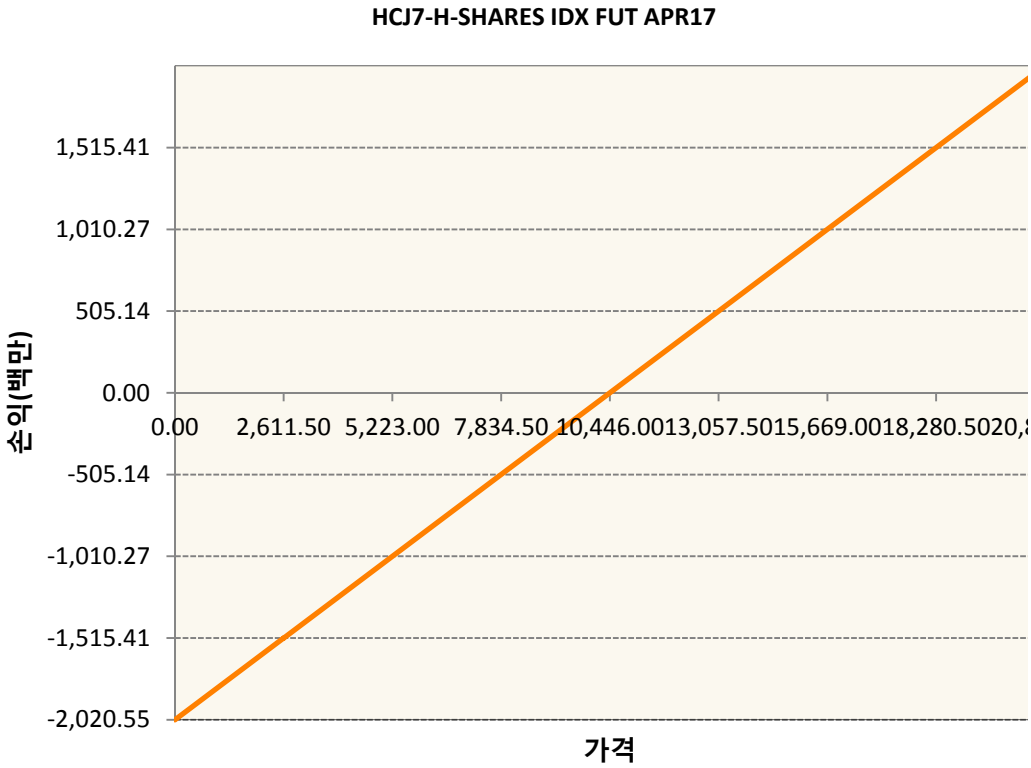
차이나인덱스모(주식-파생형)

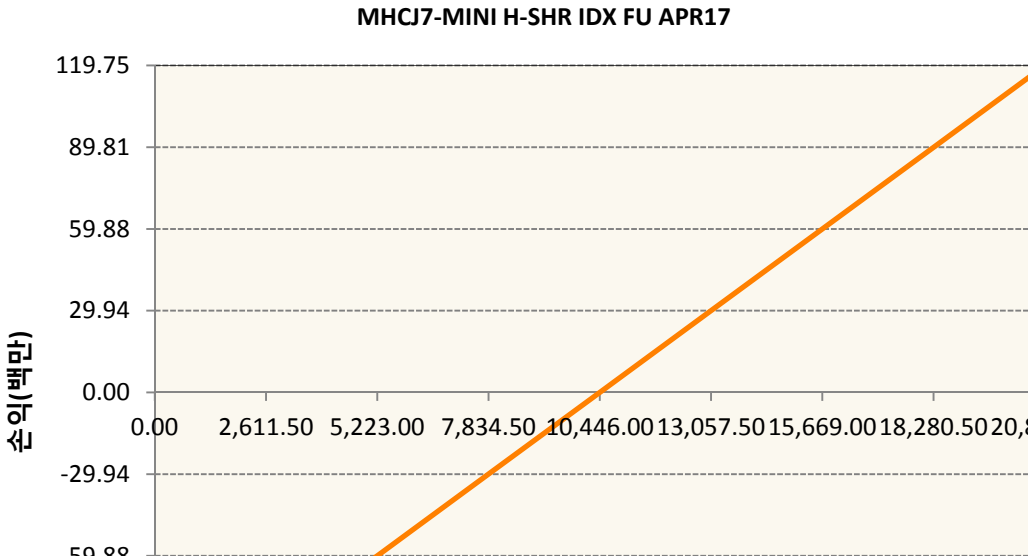
1. 계약금액

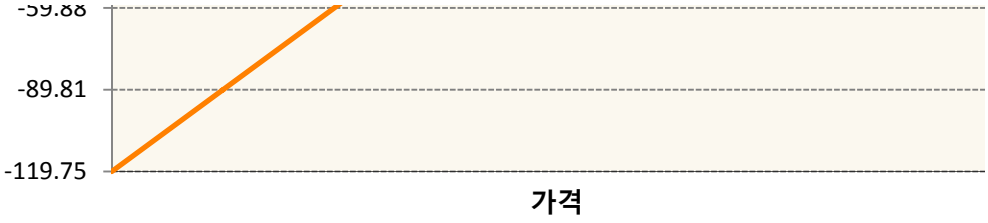
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,140	0	2,140	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ7	H-SHARES IDX FUT APR17	162
MHCJ7	MINI H-SHR IDX FU APR17	10

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

공시일	2017-03-30
기준일	2017-03-29

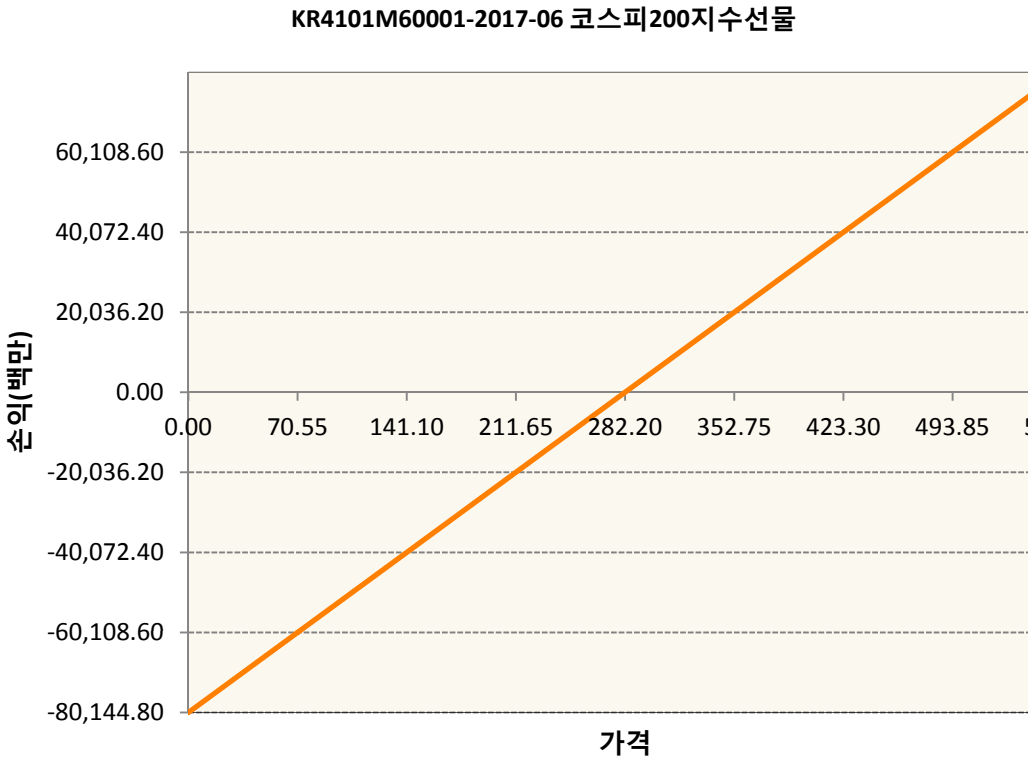
커버드콜모(주식혼합-파생형)

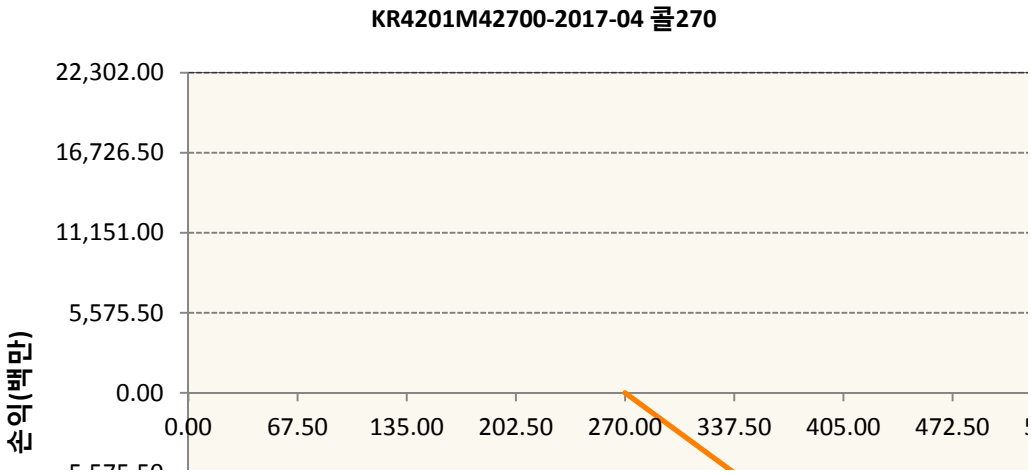
1. 계약금액

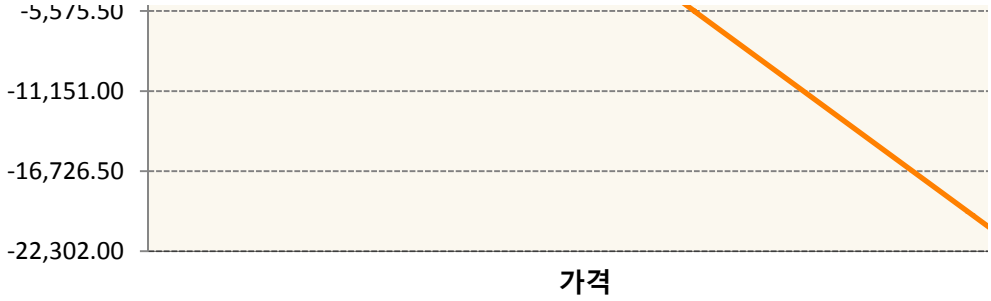
(단위:백만원)

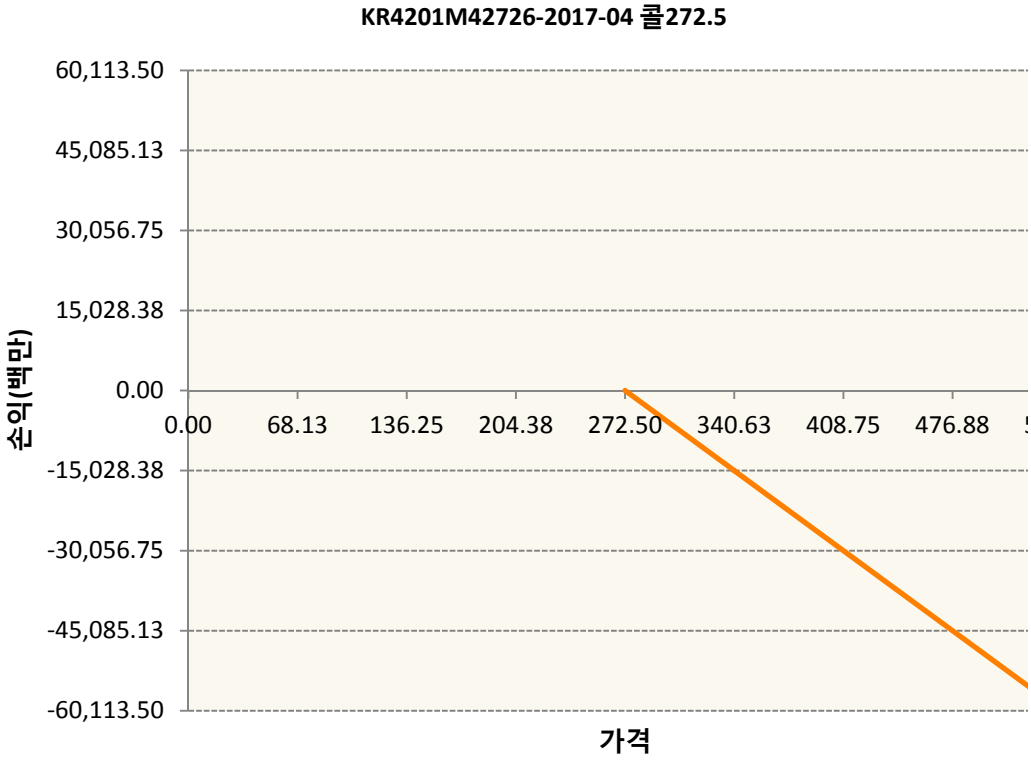
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	22,418	-22,418	장내
신규	유가증권	옵션	4,108	0	4,108	장내
누계	유가증권	선물	80,145	0	80,145	장내
누계	유가증권	옵션	0	82,416	-82,416	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							3,202
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,202	-3,202	-3,202	-3,202	-3,202	-3,202	-3,202
-5.33%	-2,135	-2,135	-2,135	-2,135	-2,135	-2,135	-2,135
-2.67%	-1,067	-1,067	-1,067	-1,067	-1,067	-1,067	-1,067
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,067	1,067	1,067	1,067	1,067	1,067	1,067
5.33%	2,135	2,135	2,135	2,135	2,135	2,135	2,135
8.00%	3,202	3,202	3,202	3,202	3,202	3,202	3,202
KR4201M42 2017-04 콜270							4,640
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,453	2,450	2,445	2,439	2,430	2,419	2,405
-5.33%	2,325	2,292	2,258	2,223	2,187	2,150	2,113
-2.67%	1,478	1,450	1,420	1,388	1,355	1,321	1,286
0%	12	10	6	0	-8	-18	-30
2.67%	-1,538	-1,538	-1,538	-1,538	-1,539	-1,540	-1,541
5.33%	-3,089	-3,089	-3,089	-3,089	-3,089	-3,089	-3,089
8.00%	-4,640	-4,640	-4,640	-4,640	-4,640	-4,640	-4,640
KR4201M42 2017-04 콜272.5							12,329

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,241	5,239	5,235	5,228	5,216	5,201	5,181
-5.33%	5,119	5,065	5,004	4,936	4,863	4,786	4,704
-2.67%	3,656	3,552	3,446	3,339	3,232	3,124	3,015
0%	77	59	33	0	-40	-86	-138
2.67%	-4,044	-4,044	-4,045	-4,048	-4,052	-4,059	-4,068
5.33%	-8,186	-8,186	-8,186	-8,186	-8,186	-8,187	-8,188
8.00%	-12,329	-12,329	-12,329	-12,329	-12,329	-12,329	-12,329

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

21,365

공시일	2017-03-30
기준일	2017-03-29

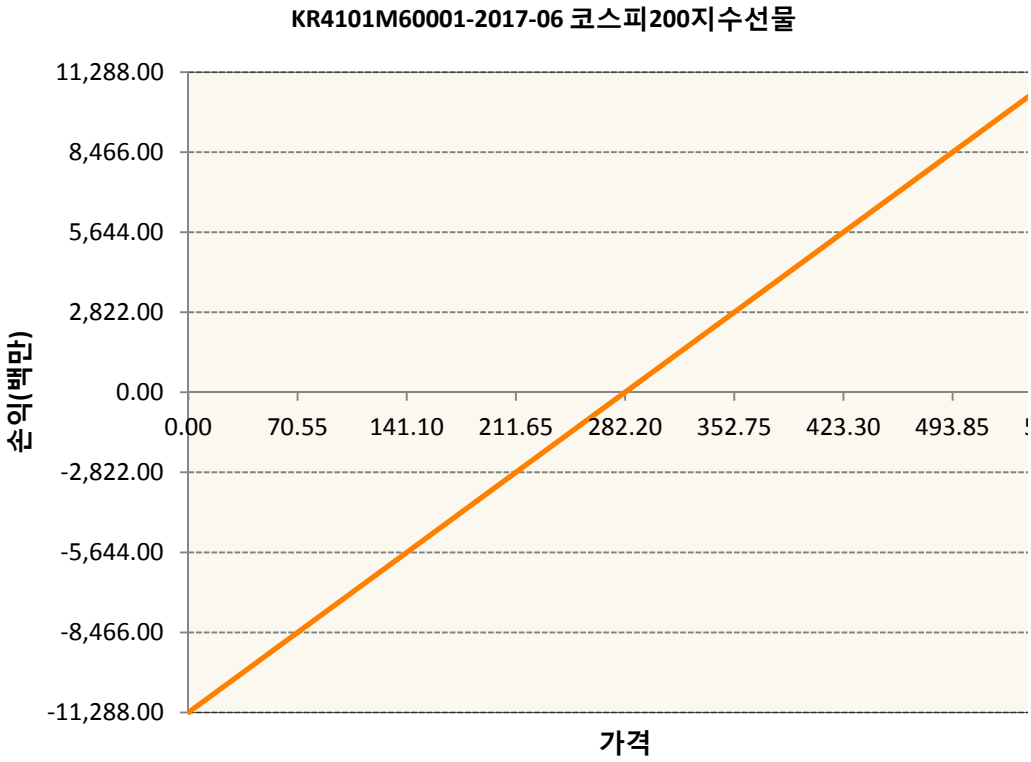
커버드콜목표전환형증권투자신탁

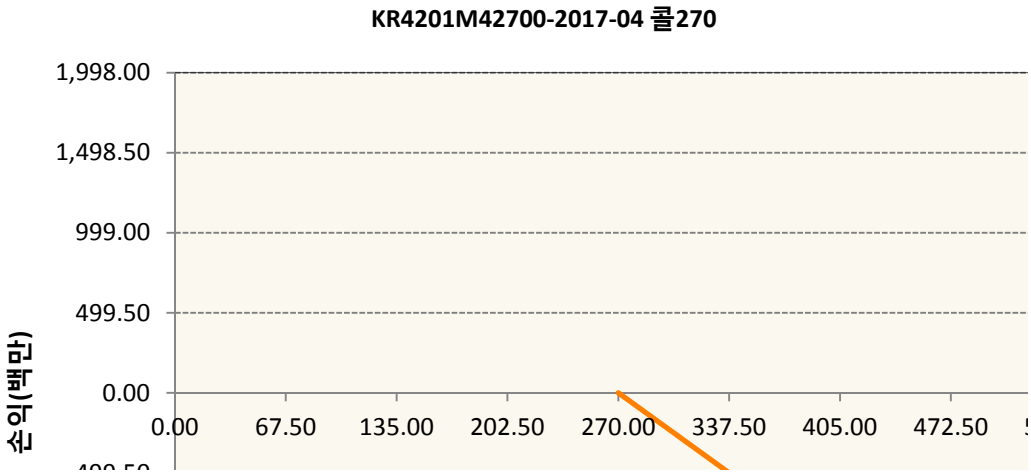
1. 계약금액

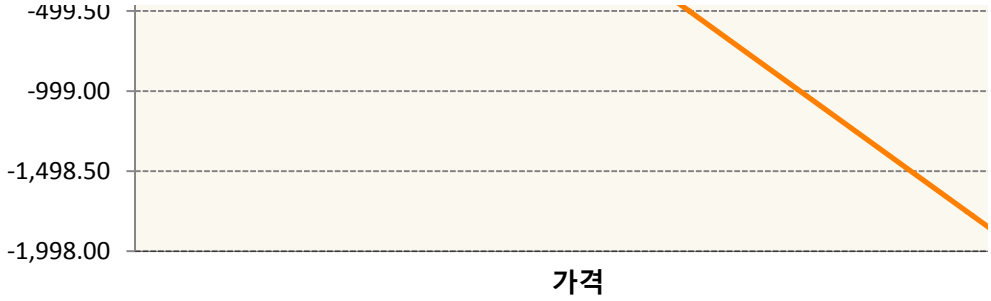
(단위:백만원)

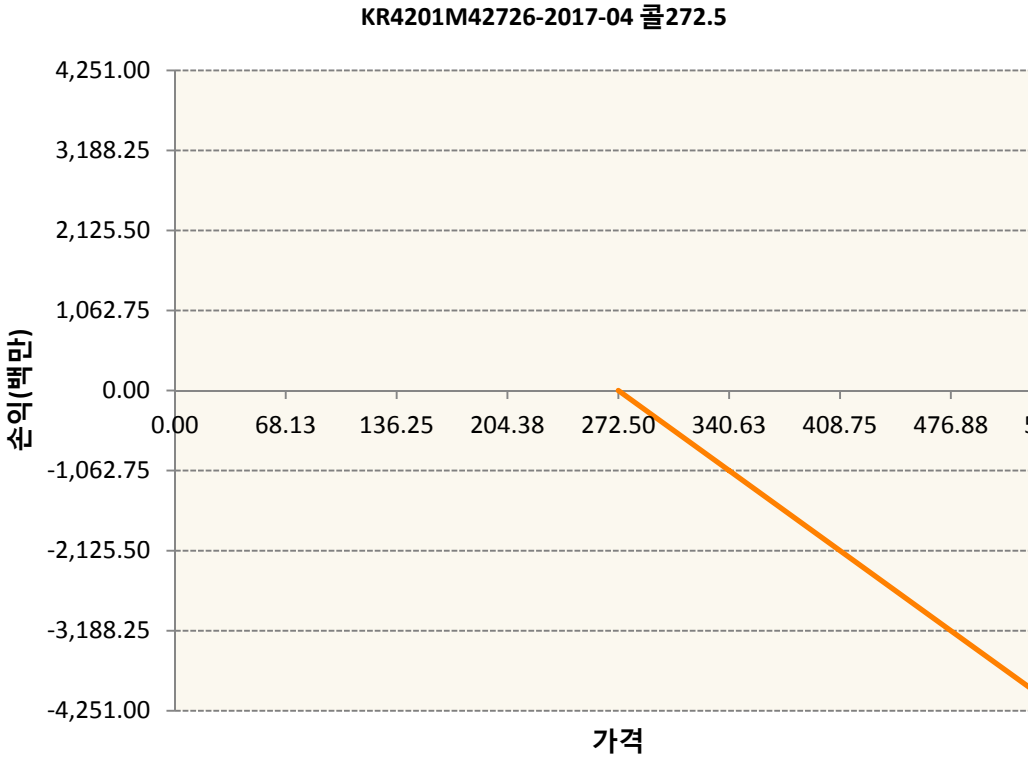
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,288	0	11,288	장내
누계	유가증권	옵션	0	6,249	-6,249	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							451
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-451	-451	-451	-451	-451	-451	-451
-5.33%	-301	-301	-301	-301	-301	-301	-301
-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%	301	301	301	301	301	301	301
8.00%	451	451	451	451	451	451	451
KR4201M42 2017-04 콜270							416
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	220	220	219	218	218	217	215
-5.33%	208	205	202	199	196	193	189
-2.67%	132	130	127	124	121	118	115
0%	1	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-138	-138	-138	-138	-138	-138	-138
5.33%	-277	-277	-277	-277	-277	-277	-277
8.00%	-416	-416	-416	-416	-416	-416	-416
KR4201M42 2017-04 콜272.5							872

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	371	371	370	370	369	368	366
-5.33%	362	358	354	349	344	338	333
-2.67%	259	251	244	236	229	221	213
0%	5	4	2	0	-3	-6	-10
2.67%	-286	-286	-286	-286	-287	-287	-288
5.33%	-579	-579	-579	-579	-579	-579	-579
8.00%	-872	-872	-872	-872	-872	-872	-872

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

1,753

공시일	2017-03-30
기준일	2017-03-29

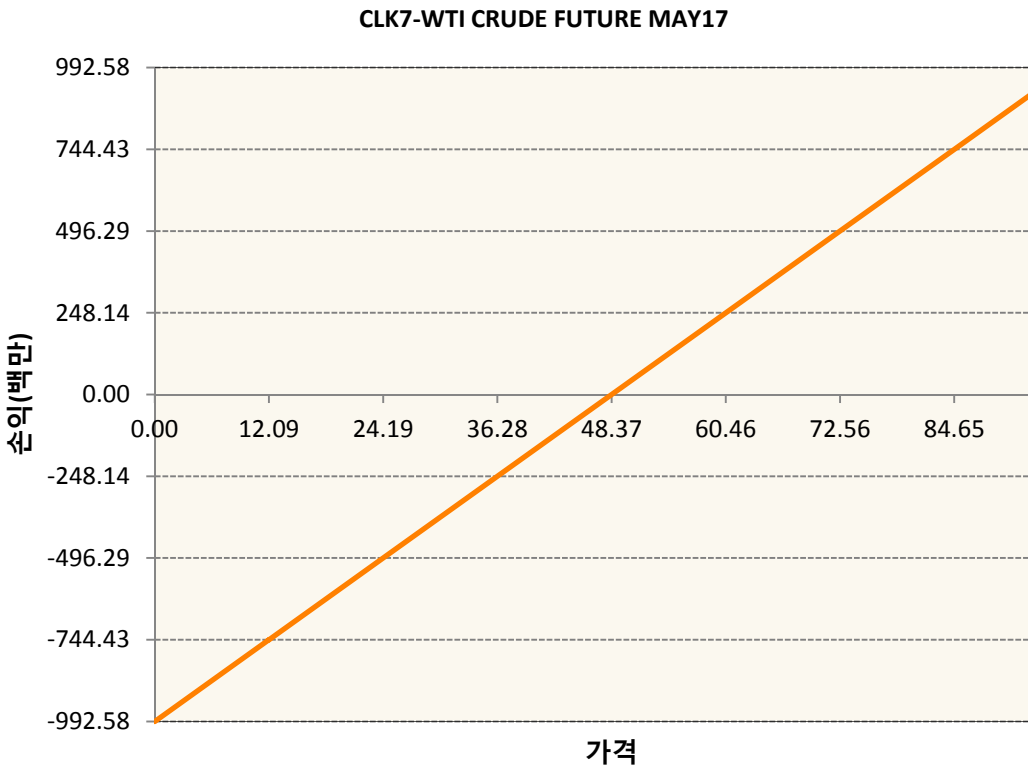
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

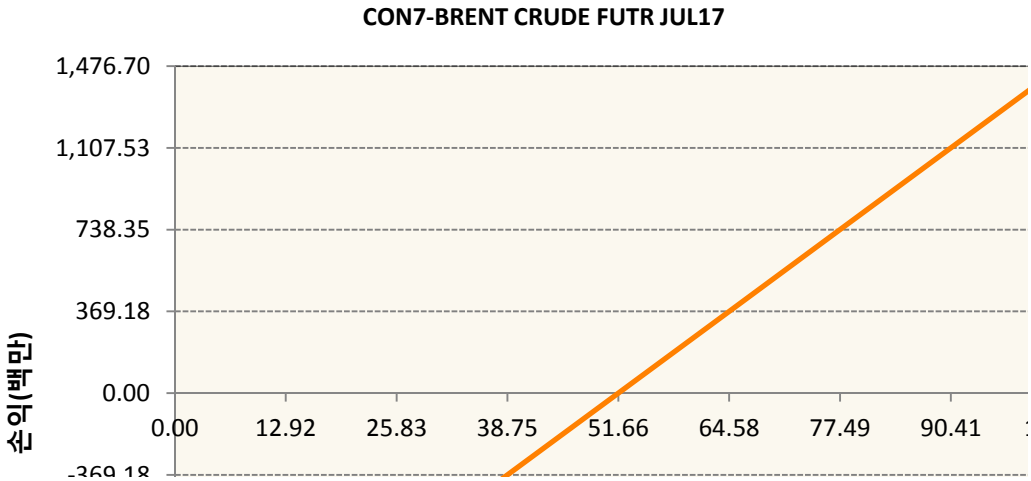
1. 계약금액

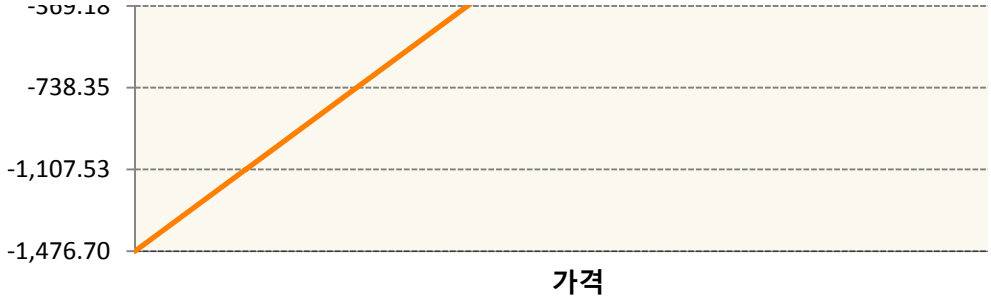
(단위:백만원)

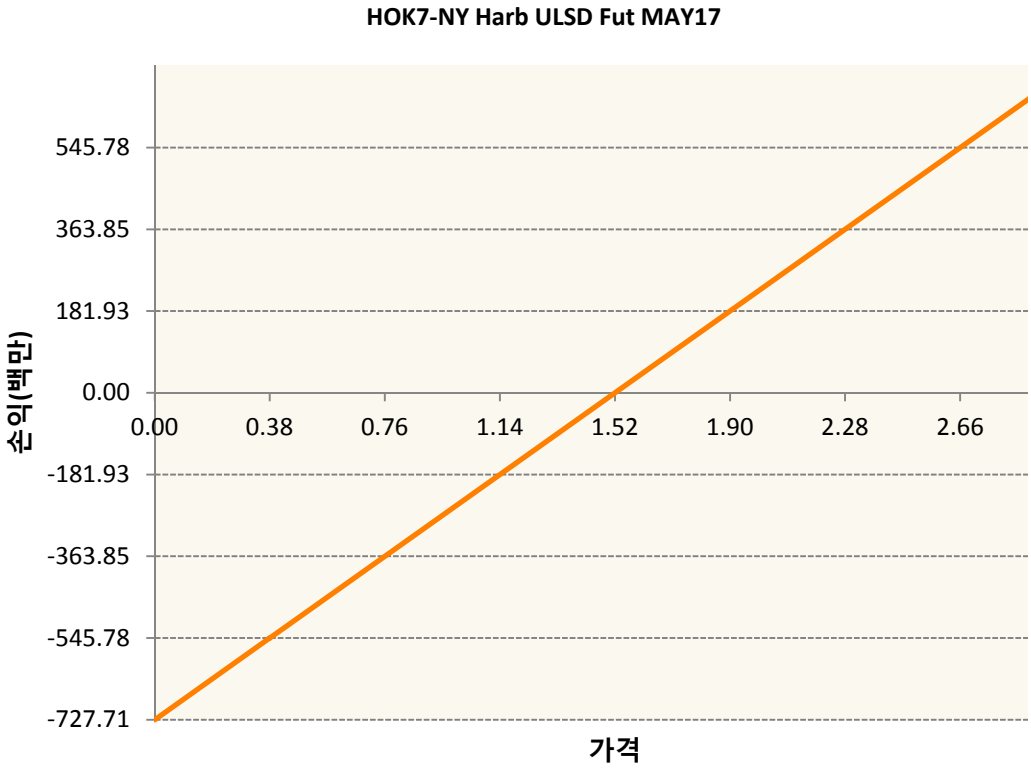
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	993	0	993	
누계	유가증권	선물	4,617	401	4,216	

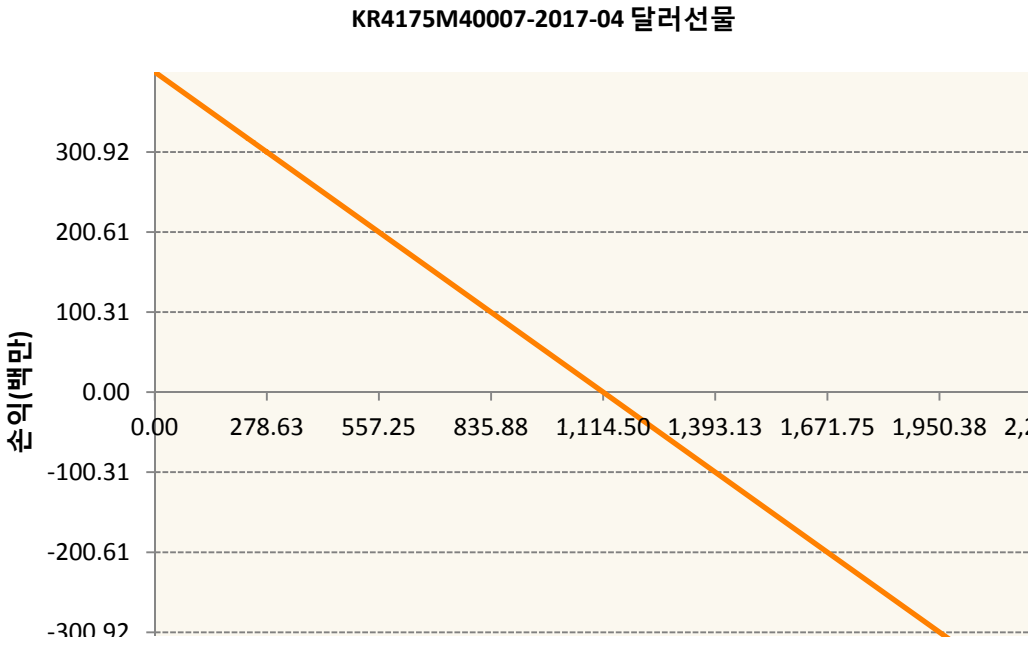
2. 만기시점의 손익구조

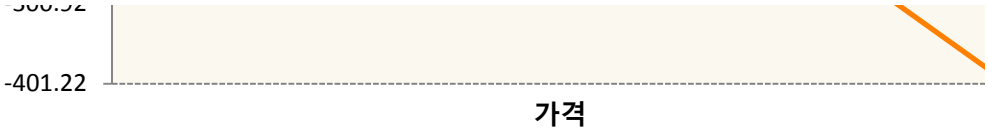


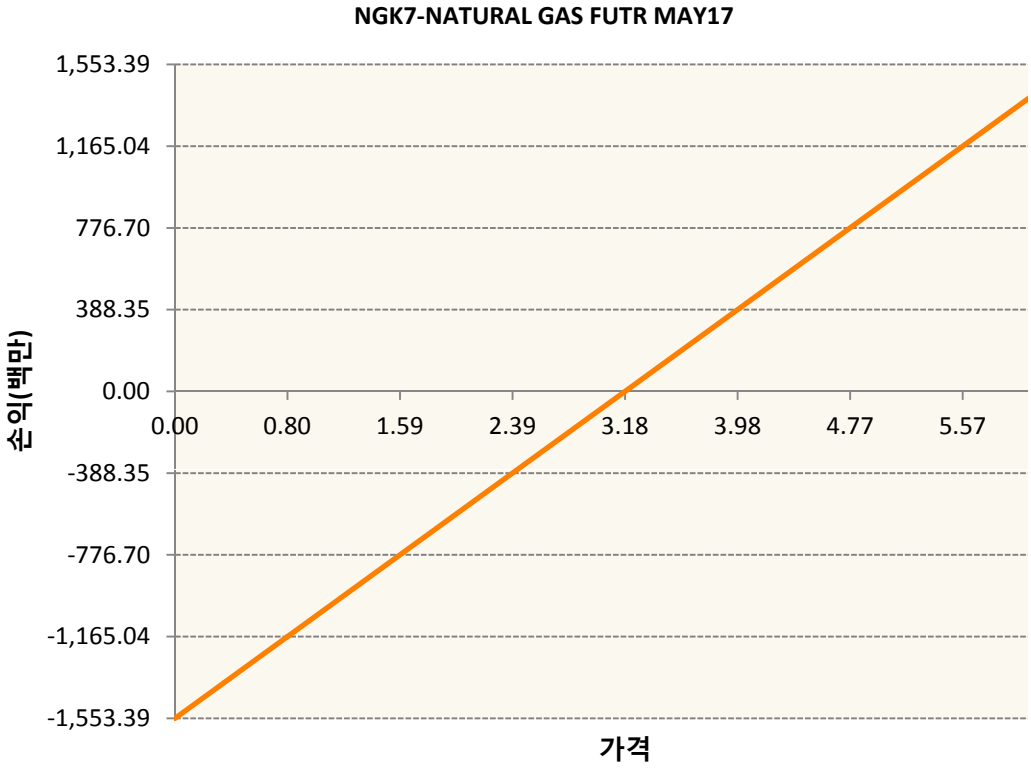


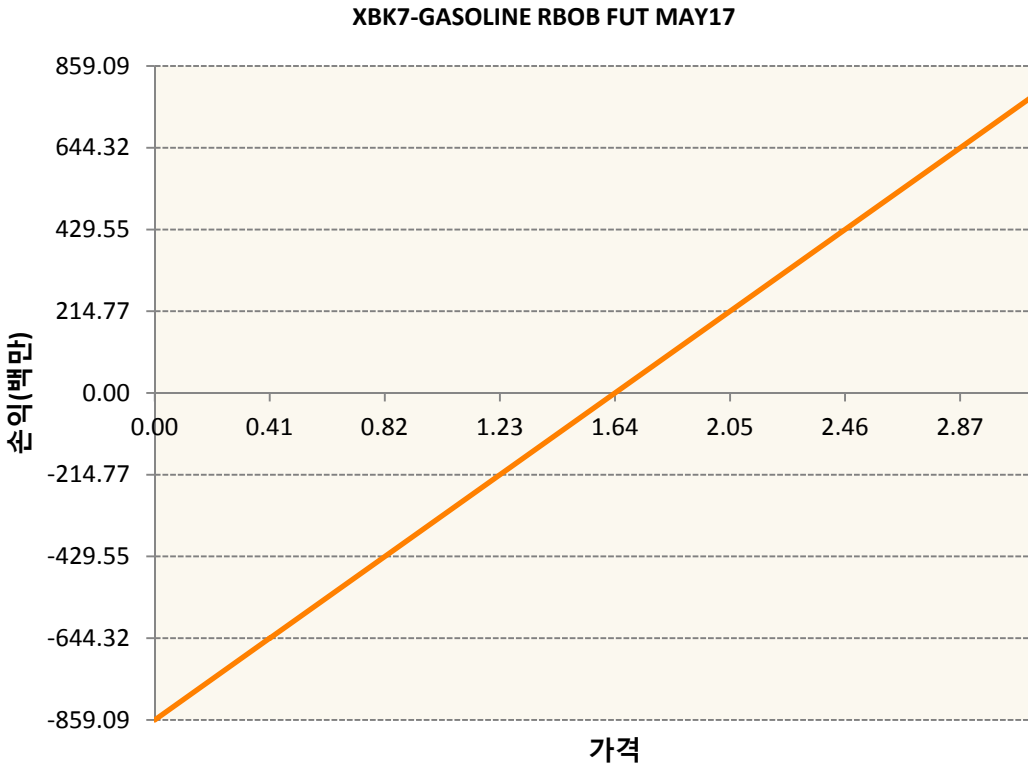

-738.35
-1,107.53
-1,476.70
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
545.78
363.85
181.93
0.00
-181.93
-363.85
-545.78
-727.71
0.00
0.38
0.76
1.14
1.52
1.90
2.28
2.66
순익(백만)
가격


KR4175M40007-2017-04 달러선물
300.92
200.61
100.31
0.00
-100.31
-200.61
0.00
278.63
557.25
835.88
1,114.50
1,393.13
1,671.75
1,950.38
순익(백만)


-401.22
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,553.39
1,165.04
776.70
388.35
0.00
-388.35
-776.70
-1,165.04
-1,553.39
0.00
0.80
1.59
2.39
3.18
3.98
4.77
5.57
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
859.09
644.32
429.55
214.77
0.00
-214.77
-429.55
-644.32
-859.09
0.00
0.41
0.82
1.23
1.64
2.05
2.46
2.87
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	124
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	69

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

995

공시일	2017-03-30
기준일	2017-03-29

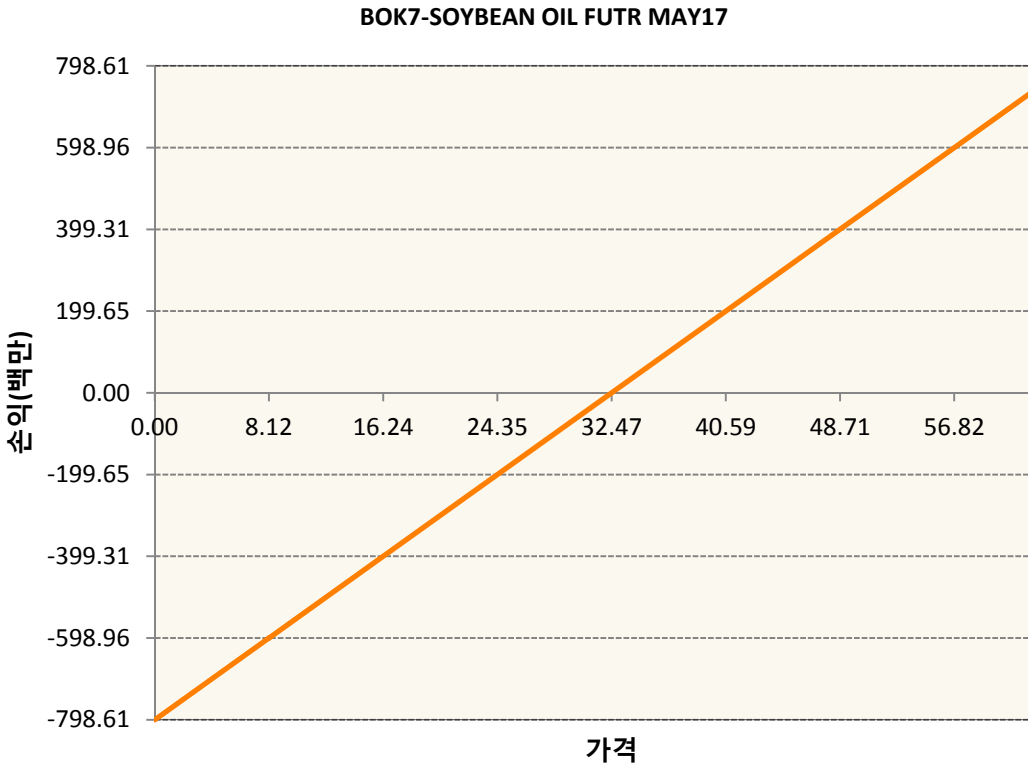
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

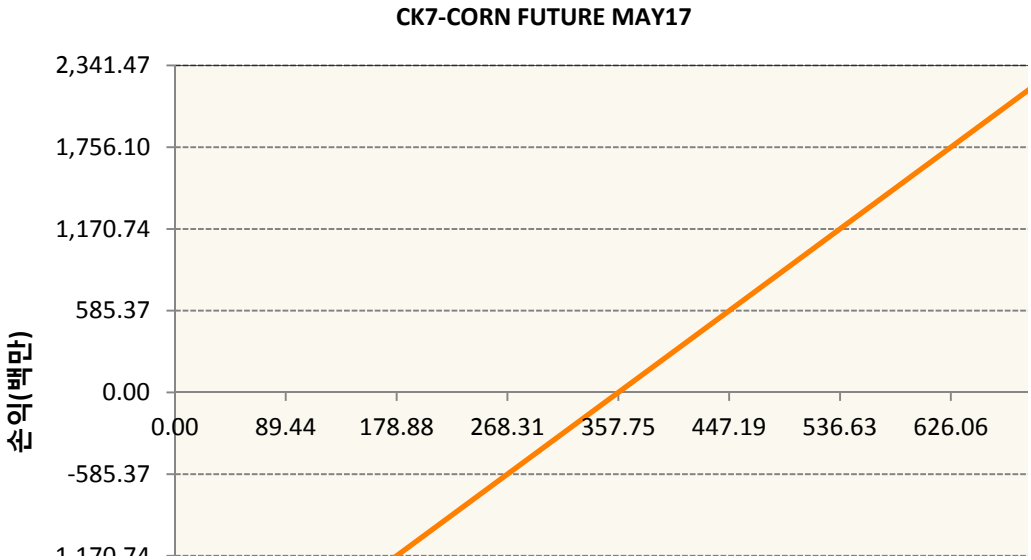
1. 계약금액

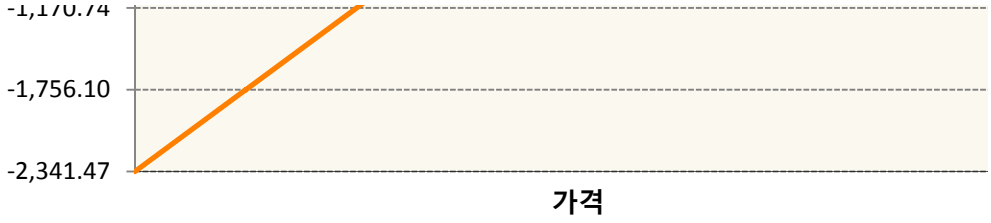
(단위:백만원)

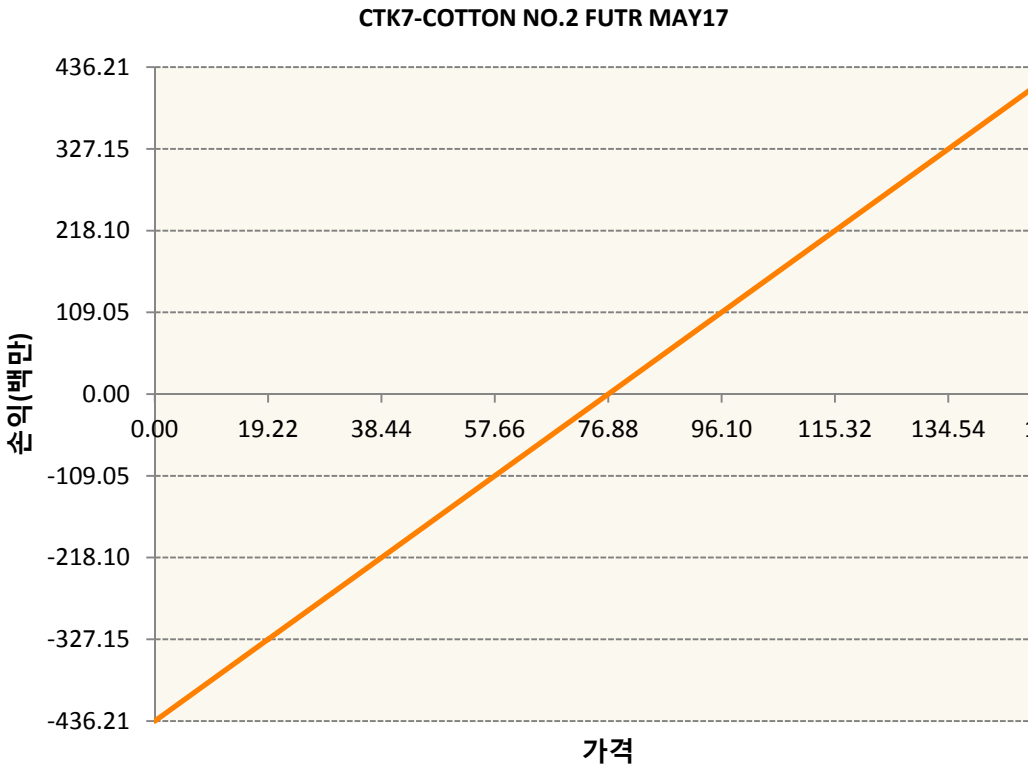
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,149	390	8,758	

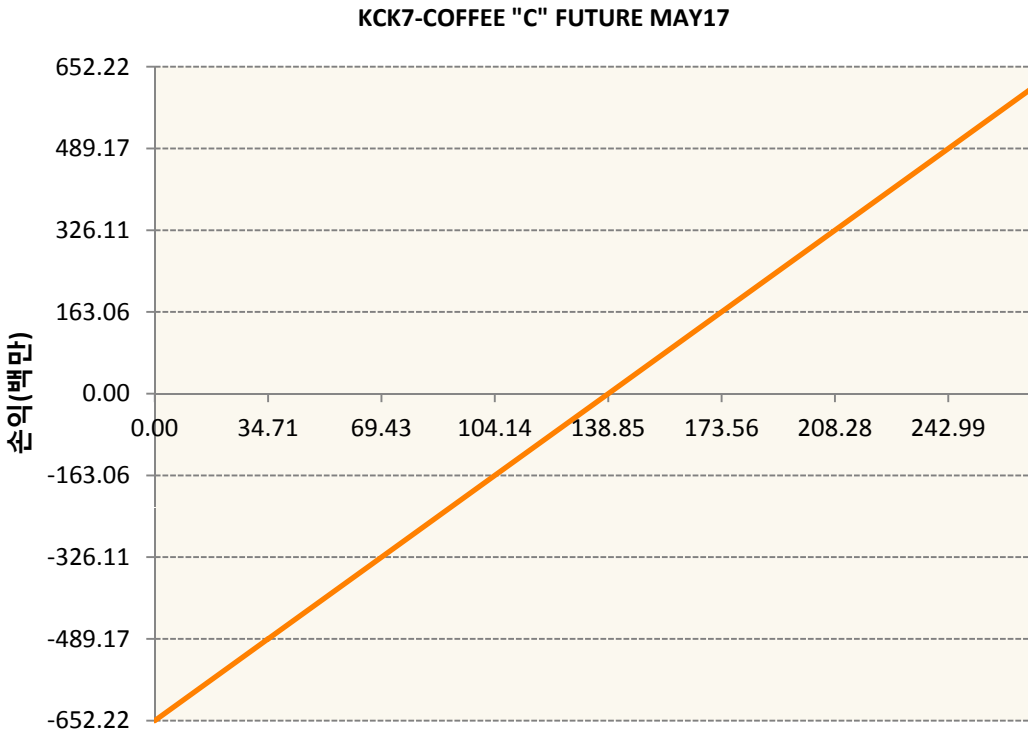
2. 만기시점의 손익구조



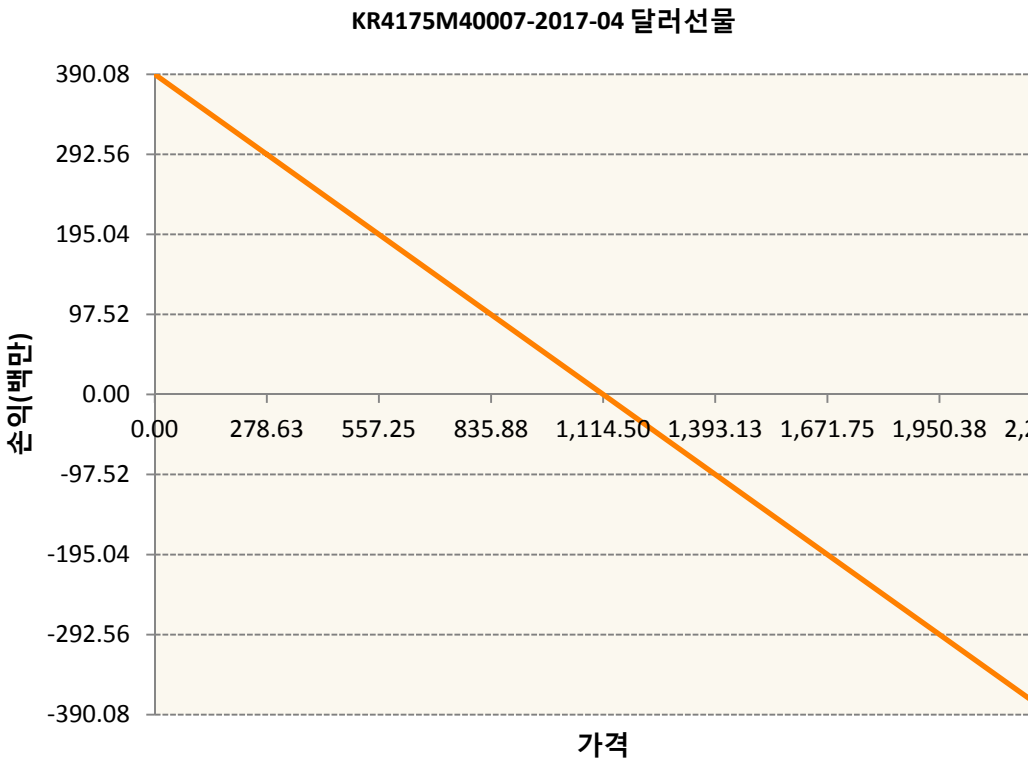


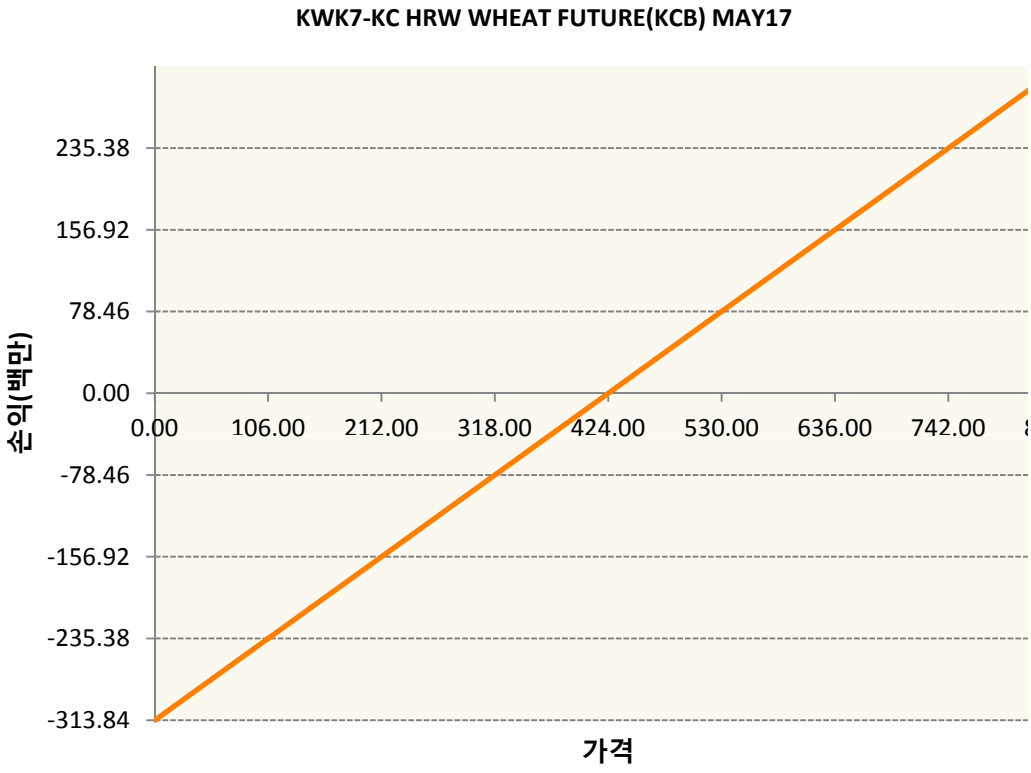

-1,756.10
-2,341.47
가격

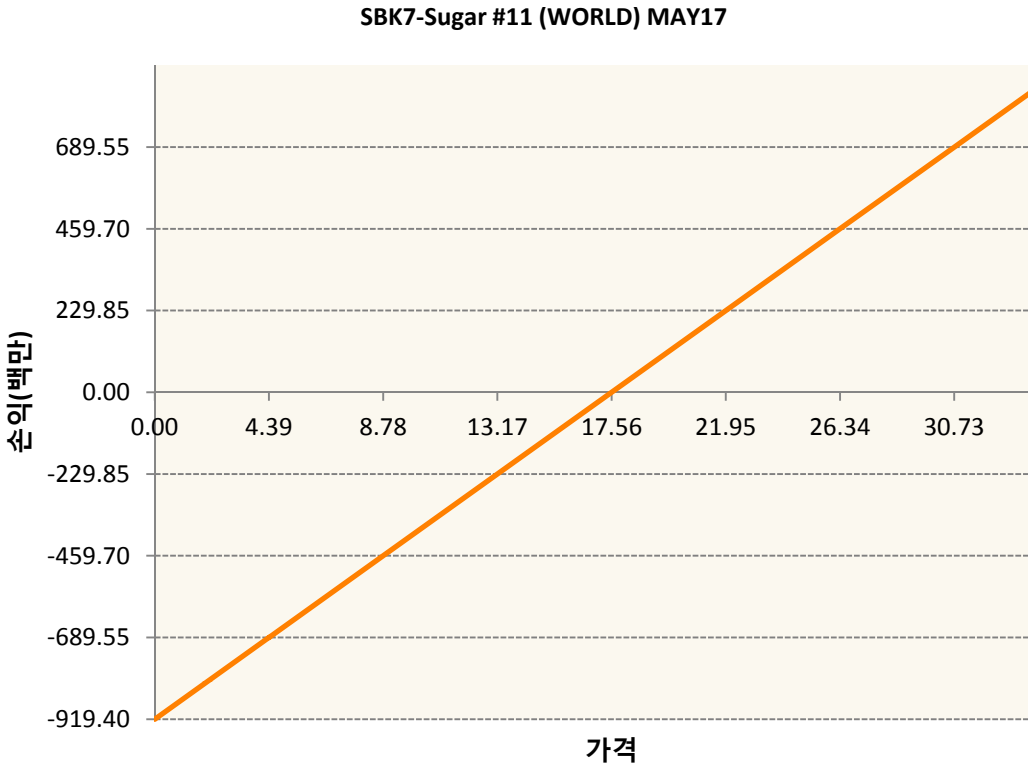

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
436.21
327.15
218.10
109.05
0.00
-109.05
-218.10
-327.15
-436.21
0.00
19.22
38.44
57.66
76.88
96.10
115.32
134.54
순익(백만)
가격

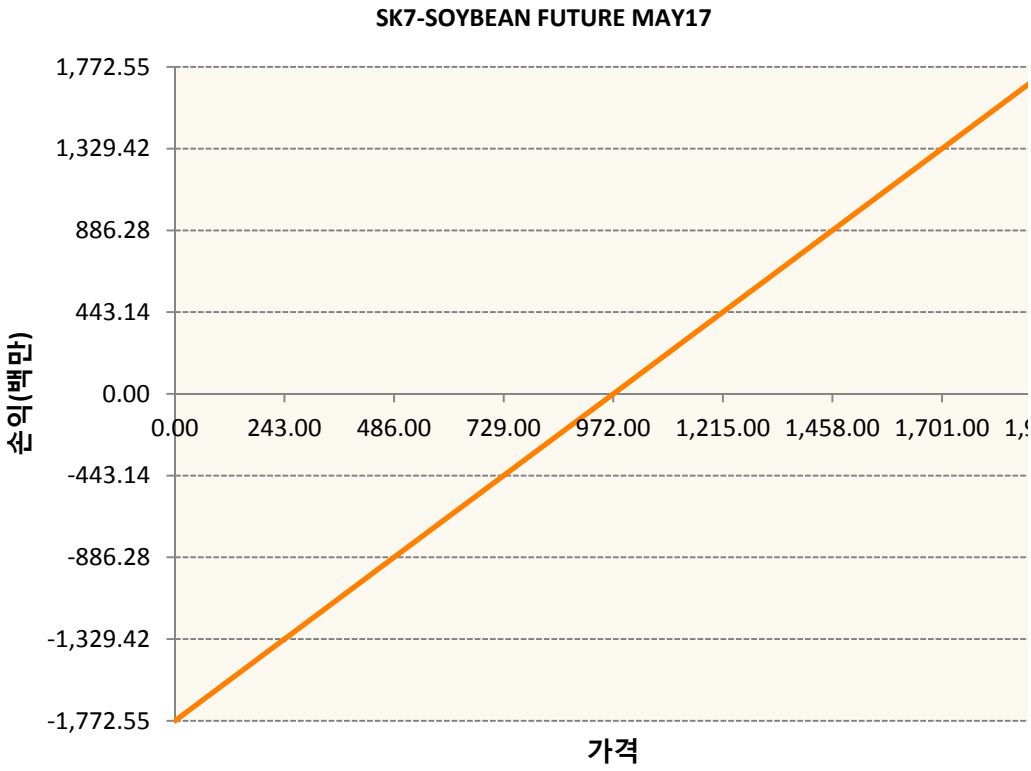

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
652.22
489.17
326.11
163.06
0.00
-163.06
-326.11
-489.17
-652.22
0.00
34.71
69.43
104.14
138.85
173.56
208.28
242.99
순익(백만)

가격

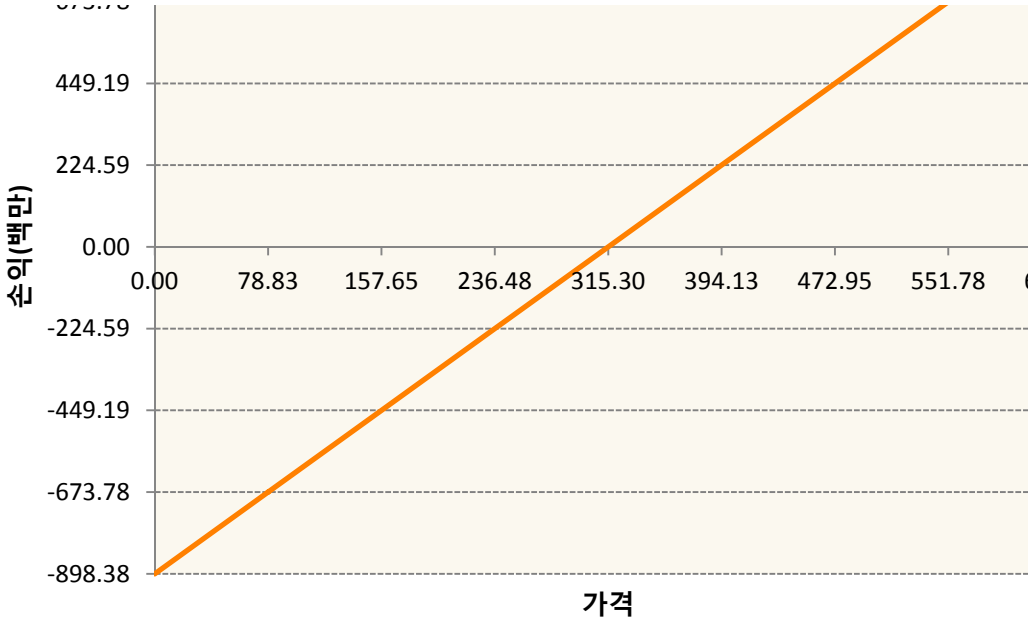

KR4175M40007-2017-04 달러선물
390.08
292.56
195.04
97.52
0.00
-97.52
-195.04
-292.56
-390.08
0.00
278.63
557.25
835.88
1,114.50
1,393.13
1,671.75
1,950.38
순이(백만)
가격

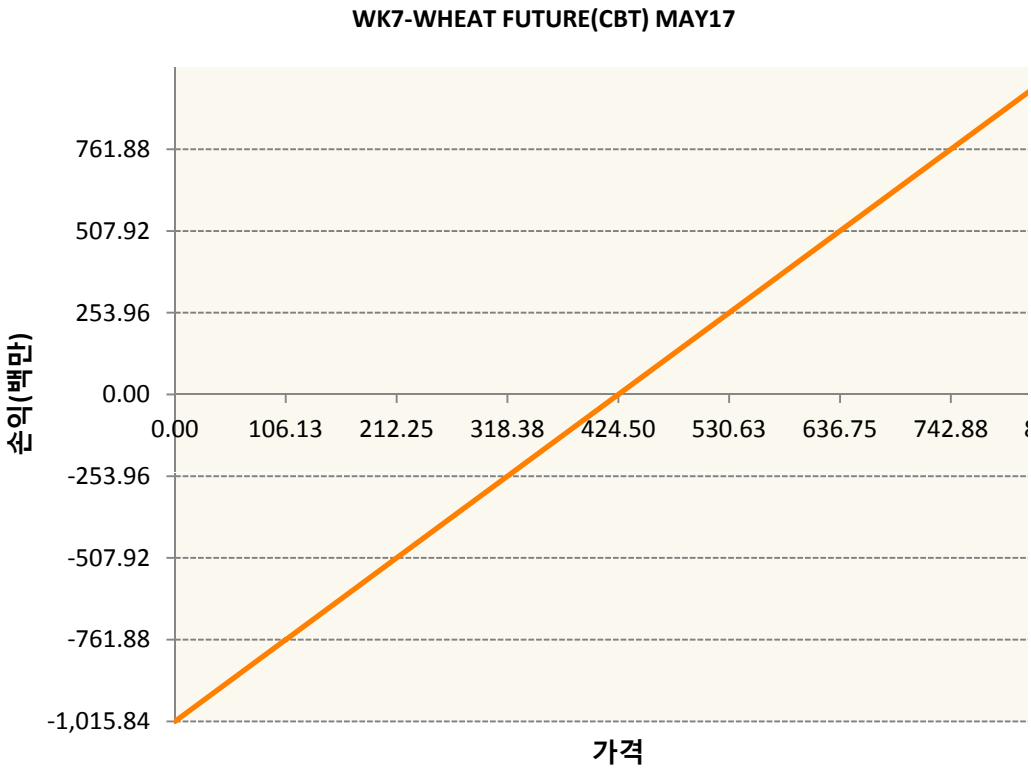

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
235.38
156.92
78.46
0.00
-78.46
-156.92
-235.38
-313.84
0.00
106.00
212.00
318.00
424.00
530.00
636.00
742.00
순이(백만)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
689.55
459.70
229.85
0.00
-229.85
-459.70
-689.55
-919.40
0.00
4.39
8.78
13.17
17.56
21.95
26.34
30.73
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,772.55
1,329.42
886.28
443.14
0.00
-443.14
-886.28
-1,329.42
-1,772.55
0.00
243.00
486.00
729.00
972.00
1,215.00
1,458.00
1,701.00
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
898.38
673.78





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	64
CK7	CORN FUTURE MAY17	187
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)

838