공시일	2017-03-31
기준일	2017-03-30

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	2017-03-31
기준일	2017-03-30

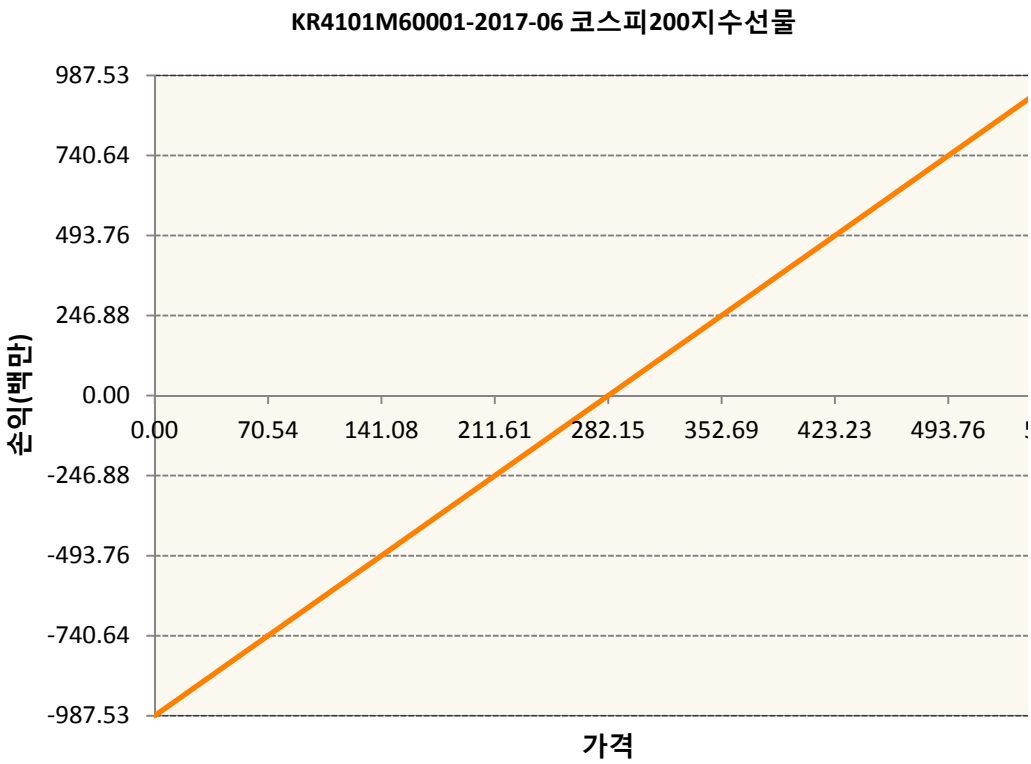
스마트인덱스모

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	988	0	988	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	2017-03-31
기준일	2017-03-30

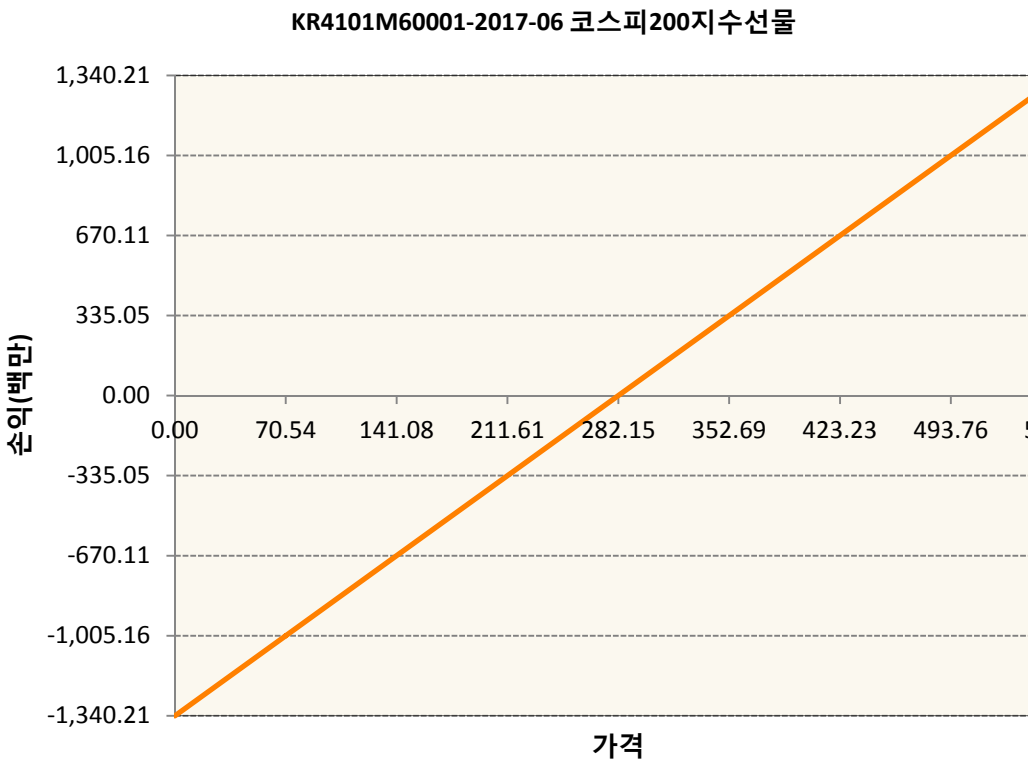
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,340	0	1,340	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	2017-03-31
기준일	2017-03-30

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	960

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

556

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-31
기준일	2017-03-30

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	387

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

420

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-31
기준일	2017-03-30

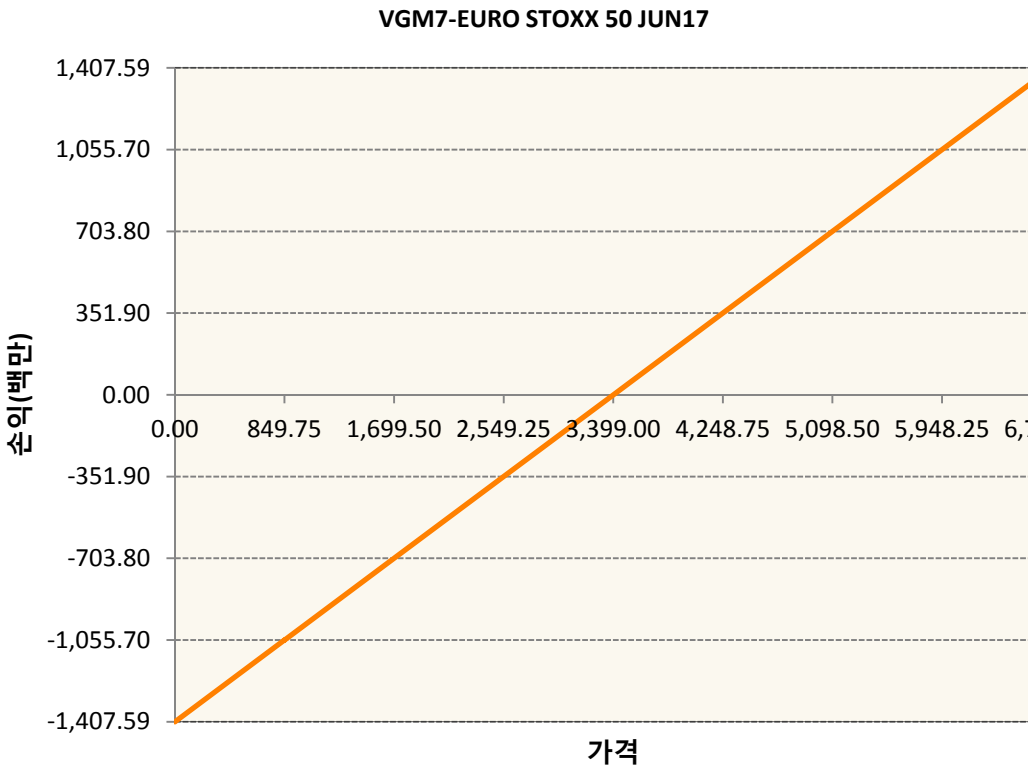
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,408	0	1,408	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM7	EURO STOXX 50 JUN17	113

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

(단위:백만원)

114

공시일	2017-03-31
기준일	2017-03-30

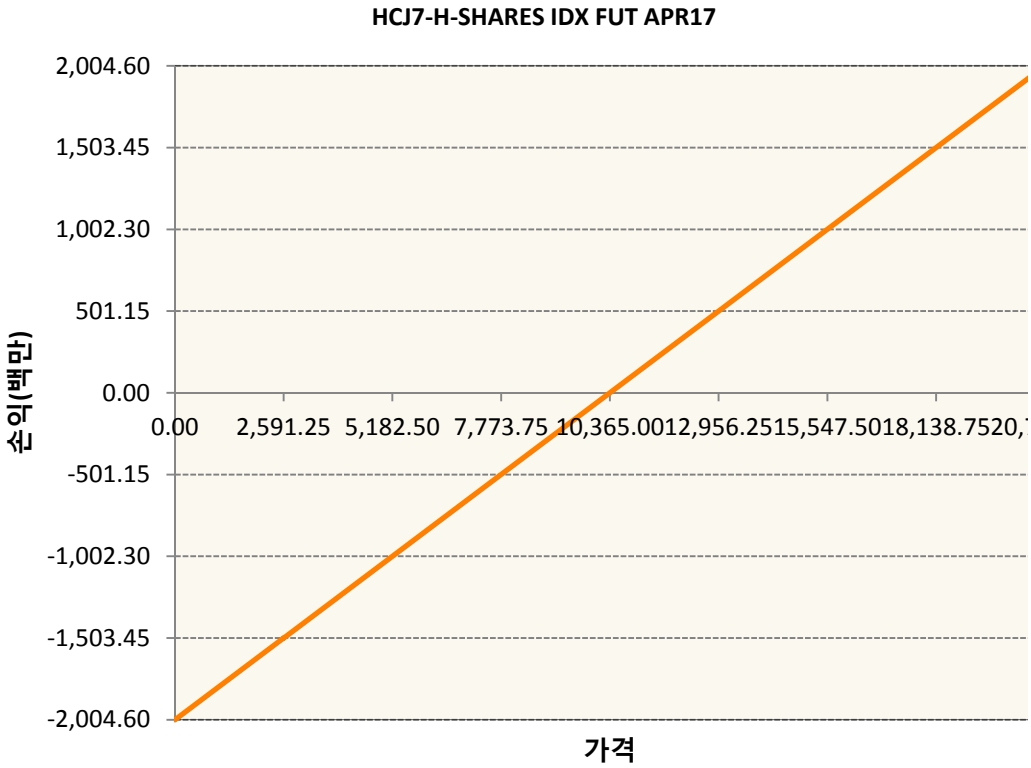
차이나인덱스모(주식-파생형)

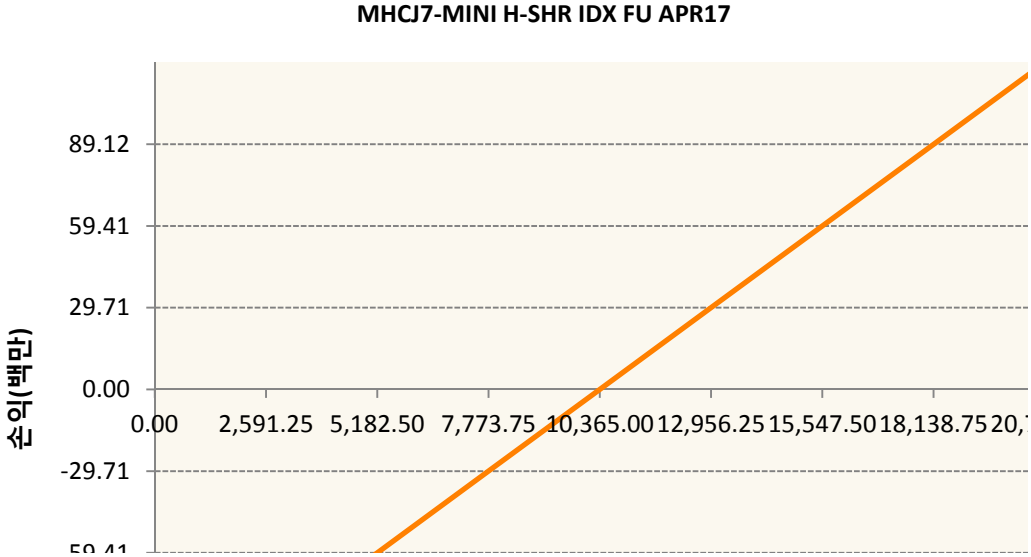
1. 계약금액

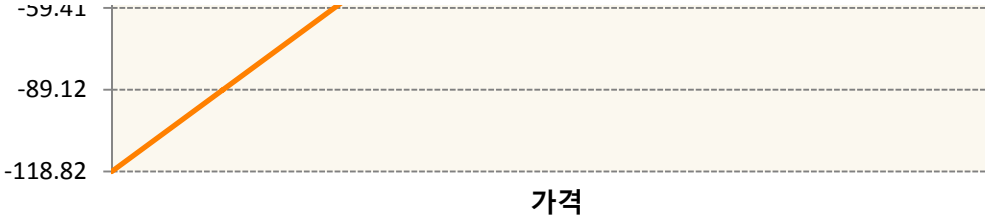
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,123	0	2,123	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCJ7	H-SHARES IDX FUT APR17	160
MHCJ7	MINI H-SHR IDX FU APR17	10

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

182

공시일	2017-03-31
기준일	2017-03-30

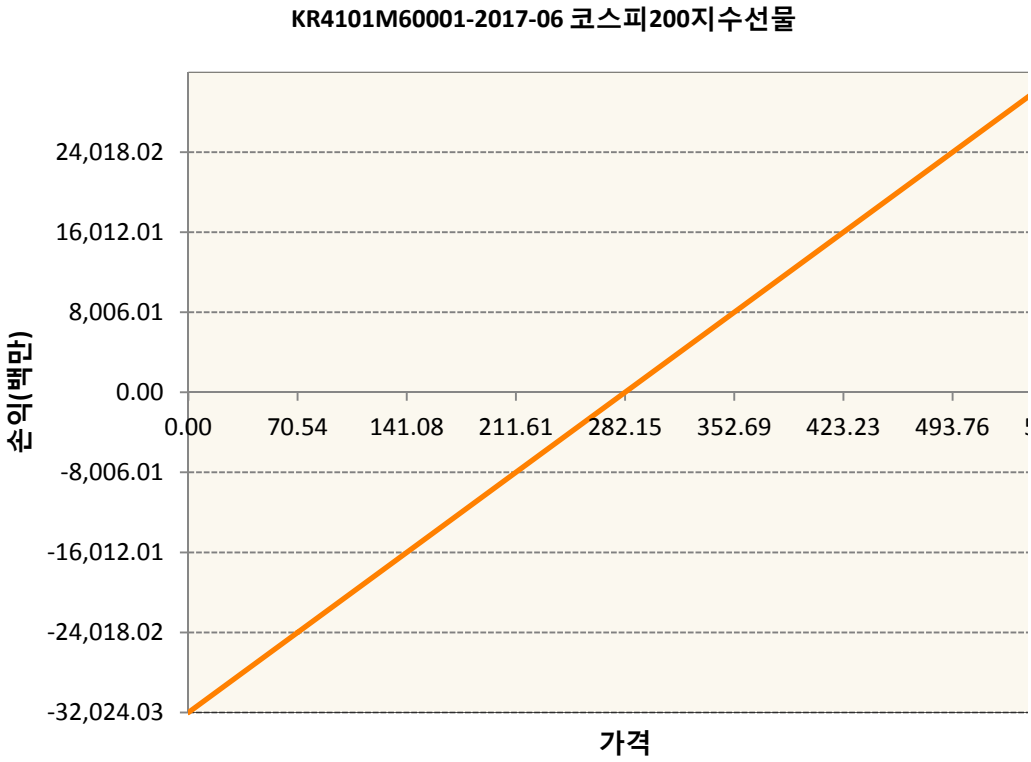
커버드콜모(주식혼합-파생형)

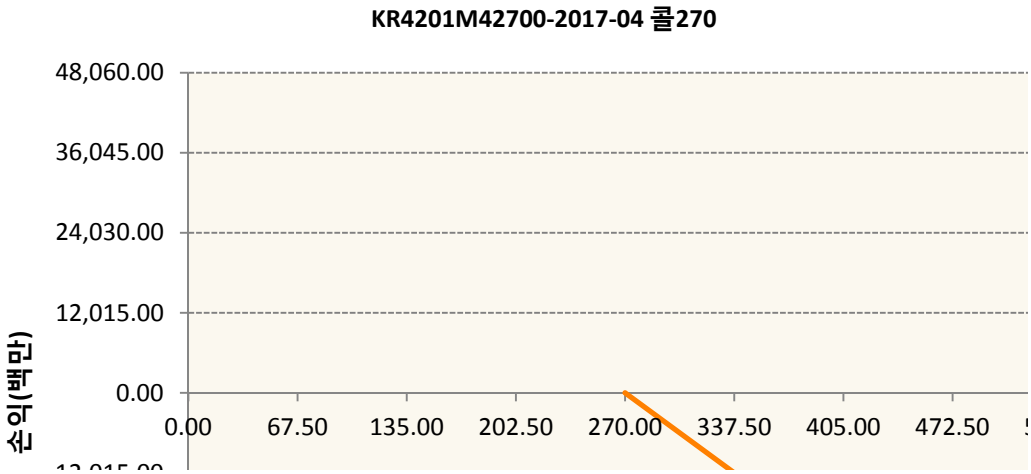
1. 계약금액

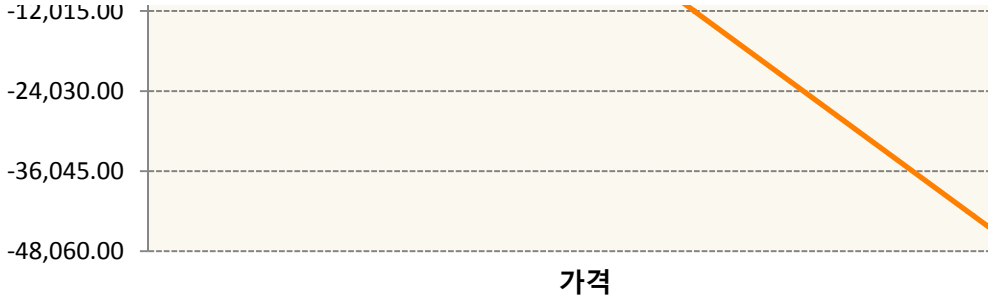
(단위:백만원)

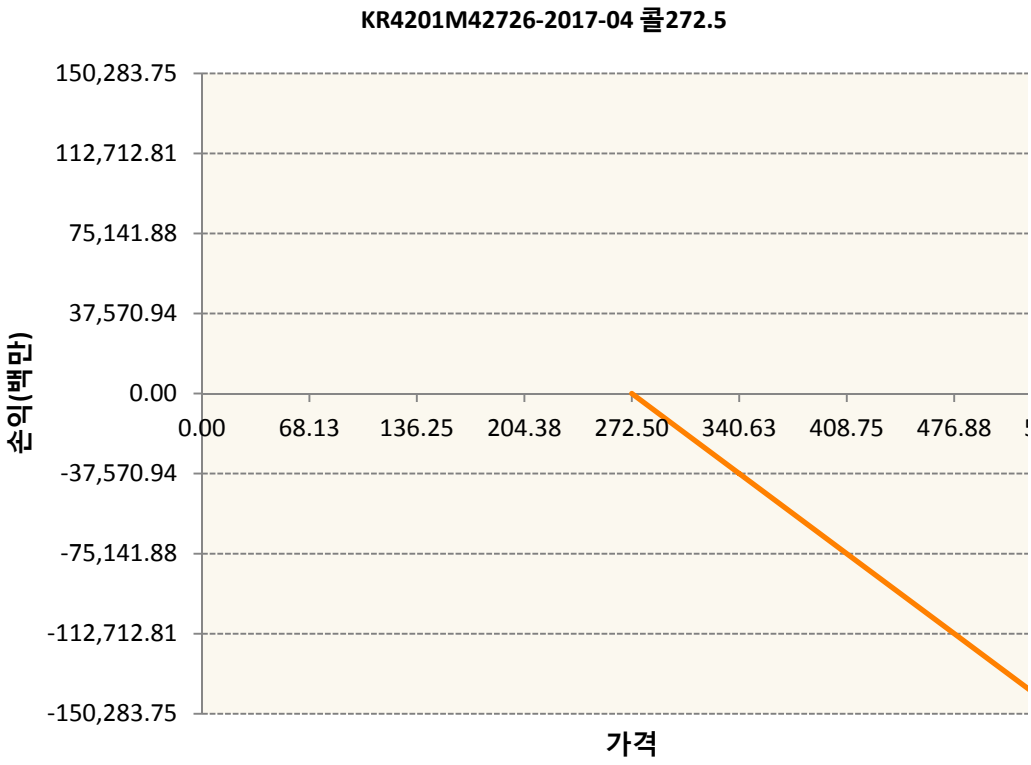
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	8,040	-8,040	장내
신규	유가증권	옵션	7,361	0	7,361	장내
누계	유가증권	선물	32,024	0	32,024	장내
누계	유가증권	옵션	0	198,344	-198,344	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							2,557
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,557	-2,557	-2,557	-2,557	-2,557	-2,557	-2,557
-5.33%	-1,705	-1,705	-1,705	-1,705	-1,705	-1,705	-1,705
-2.67%	-852	-852	-852	-852	-852	-852	-852
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	852	852	852	852	852	852	852
5.33%	1,705	1,705	1,705	1,705	1,705	1,705	1,705
8.00%	2,557	2,557	2,557	2,557	2,557	2,557	2,557
KR4201M42 2017-04 콜270							4,001
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,076	2,075	2,073	2,069	2,064	2,057	2,049
-5.33%	1,992	1,968	1,942	1,916	1,888	1,860	1,831
-2.67%	1,279	1,258	1,235	1,210	1,185	1,158	1,131
0%	7	6	3	0	-5	-11	-19
2.67%	-1,329	-1,329	-1,329	-1,329	-1,329	-1,329	-1,330
5.33%	-2,665	-2,665	-2,665	-2,665	-2,665	-2,665	-2,665
8.00%	-4,001	-4,001	-4,001	-4,001	-4,001	-4,001	-4,001
KR4201M42 2017-04 콜272.5							12,347

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,106	5,106	5,104	5,100	5,094	5,084	5,072
-5.33%	5,026	4,985	4,936	4,882	4,821	4,756	4,688
-2.67%	3,665	3,569	3,472	3,373	3,274	3,175	3,075
0%	58	45	26	0	-32	-69	-113
2.67%	-4,068	-4,068	-4,068	-4,069	-4,072	-4,076	-4,082
5.33%	-8,207	-8,207	-8,207	-8,207	-8,207	-8,207	-8,208
8.00%	-12,347	-12,347	-12,347	-12,347	-12,347	-12,347	-12,347

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

20,264

공시일	2017-03-31
기준일	2017-03-30

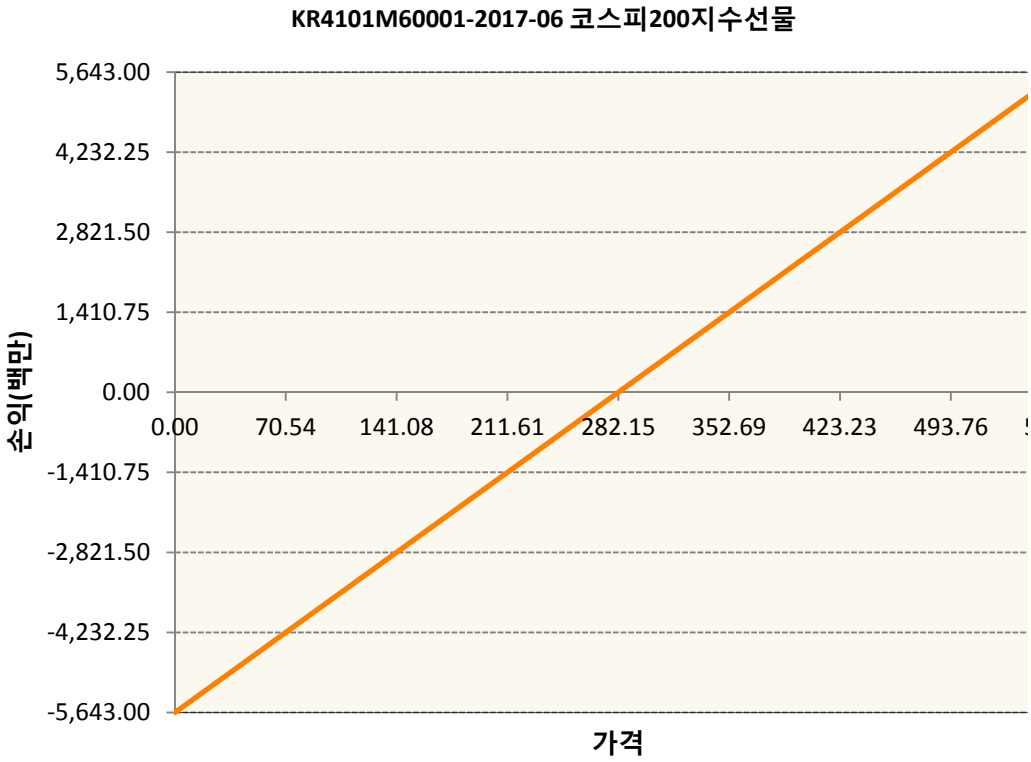
커버드콜목표전환형증권투자신탁

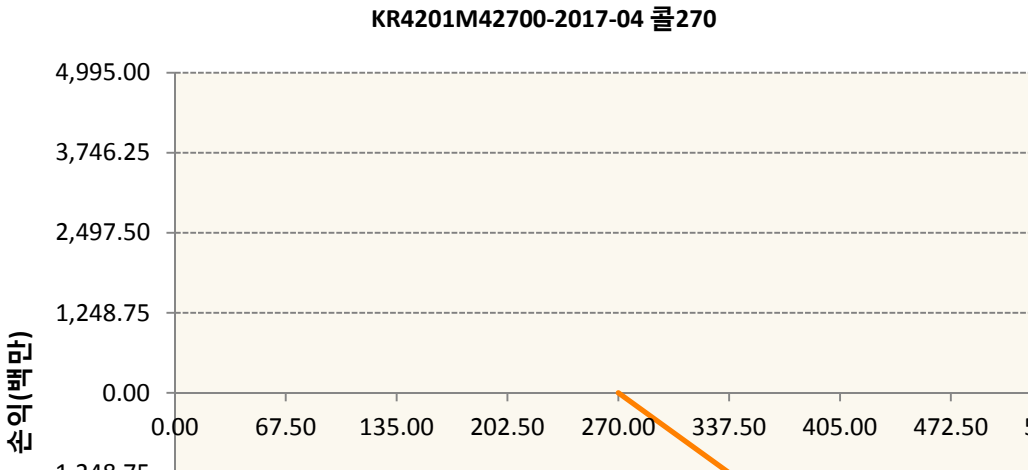
1. 계약금액

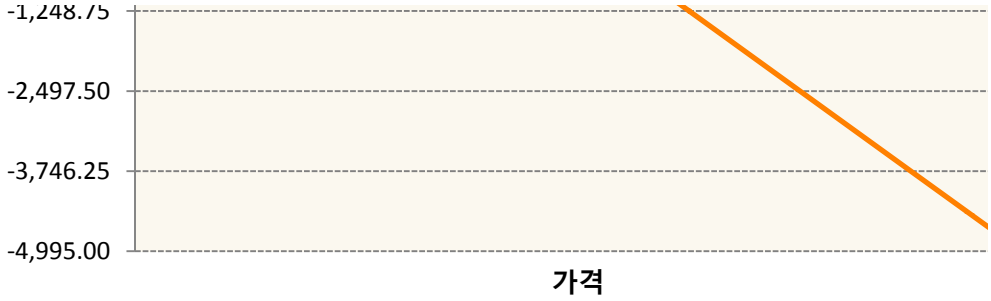
(단위:백만원)

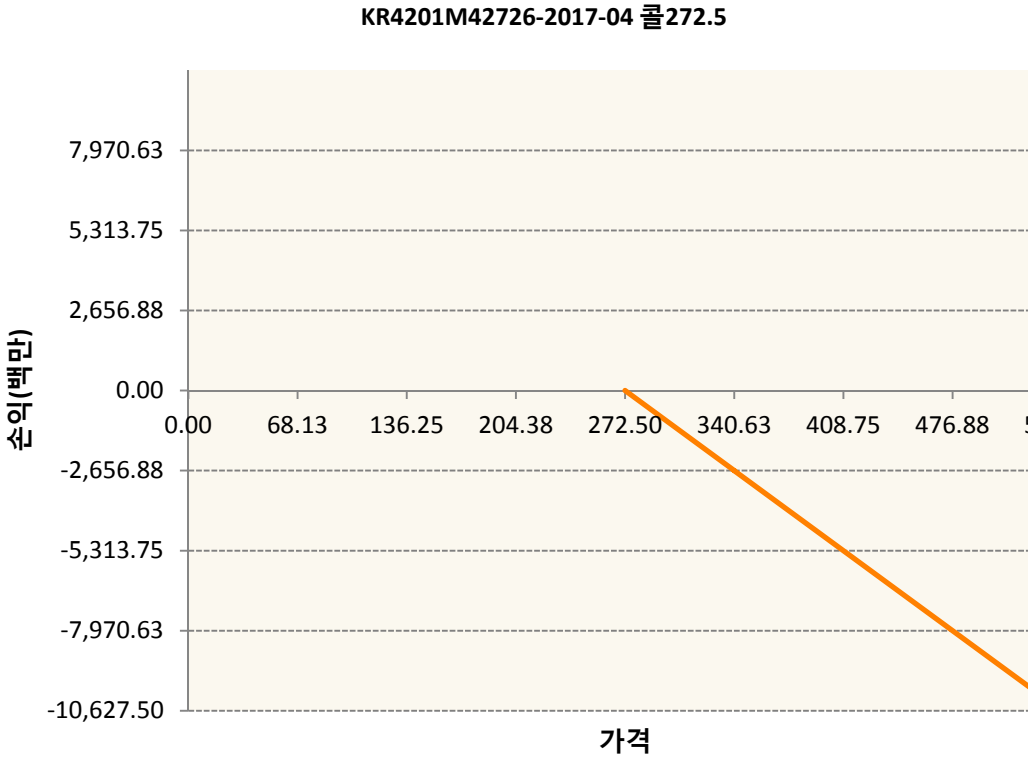
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,643	0	5,643	장내
누계	유가증권	옵션	0	15,623	-15,623	장내

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%	-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%	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%	216	216	215	215	215	214	213
-5.33%	207	204	202	199	196	193	190
-2.67%	133	131	128	126	123	120	118
0%	1	1	0	0	0	-1	-2
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							873

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	361	361	361	361	360	360	359
-5.33%	355	353	349	345	341	336	331
-2.67%	259	252	245	239	232	225	217
0%	4	3	2	0	-2	-5	-8
2.67%	-288	-288	-288	-288	-288	-288	-289
5.33%	-580	-580	-580	-580	-580	-580	-580
8.00%	-873	-873	-873	-873	-873	-873	-873

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

1,753

공시일	2017-03-31
기준일	2017-03-30

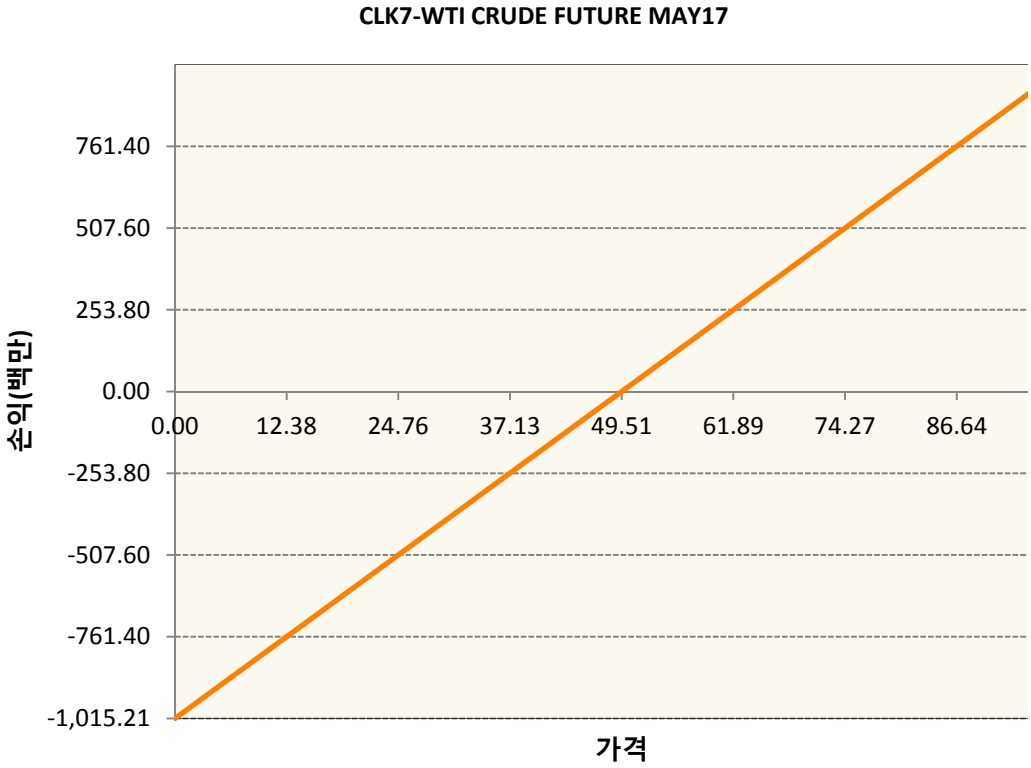
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

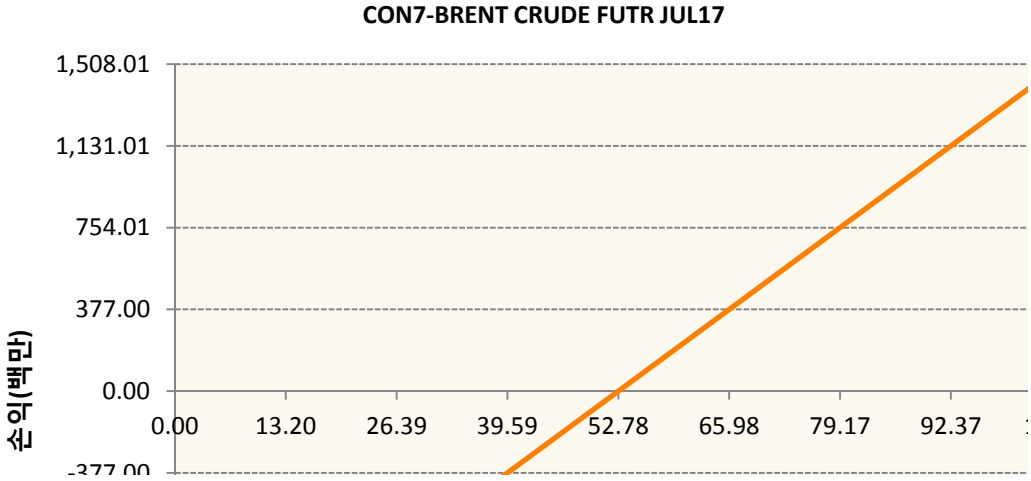
1. 계약금액

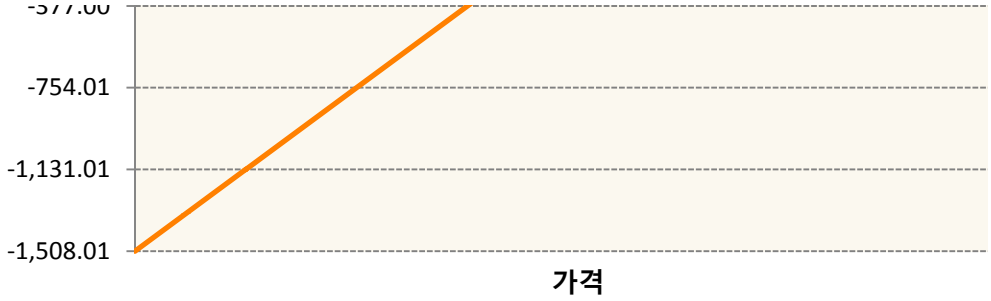
(단위:백만원)

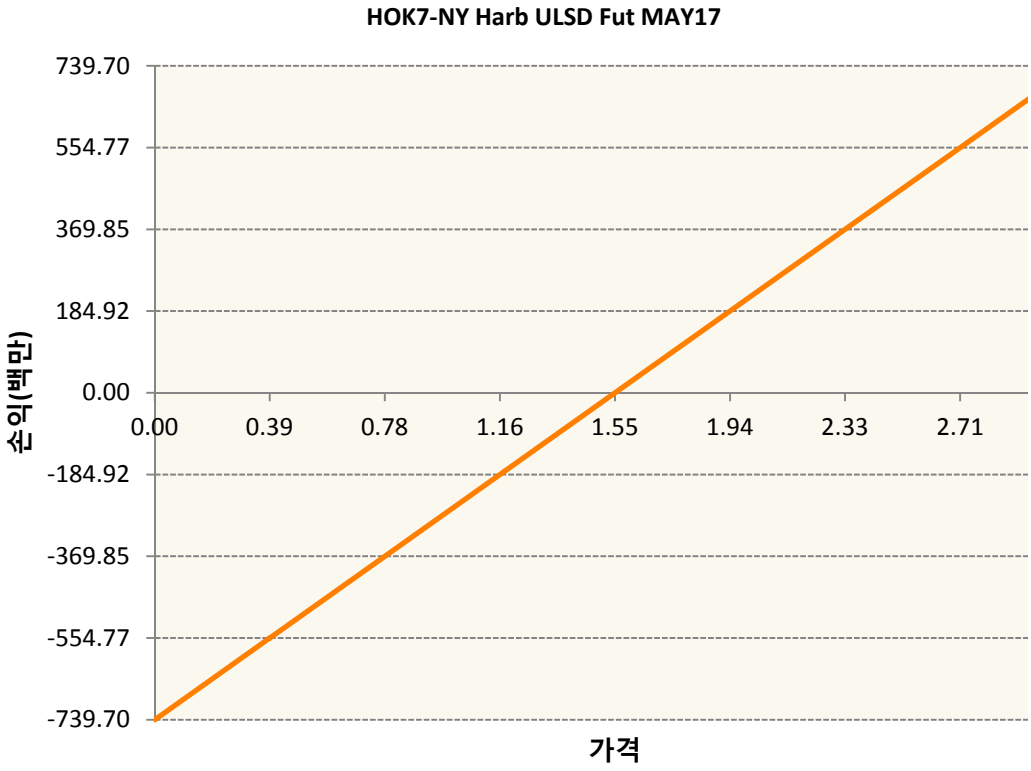
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,015	0	1,015	
누계	유가증권	선물	4,705	402	4,303	

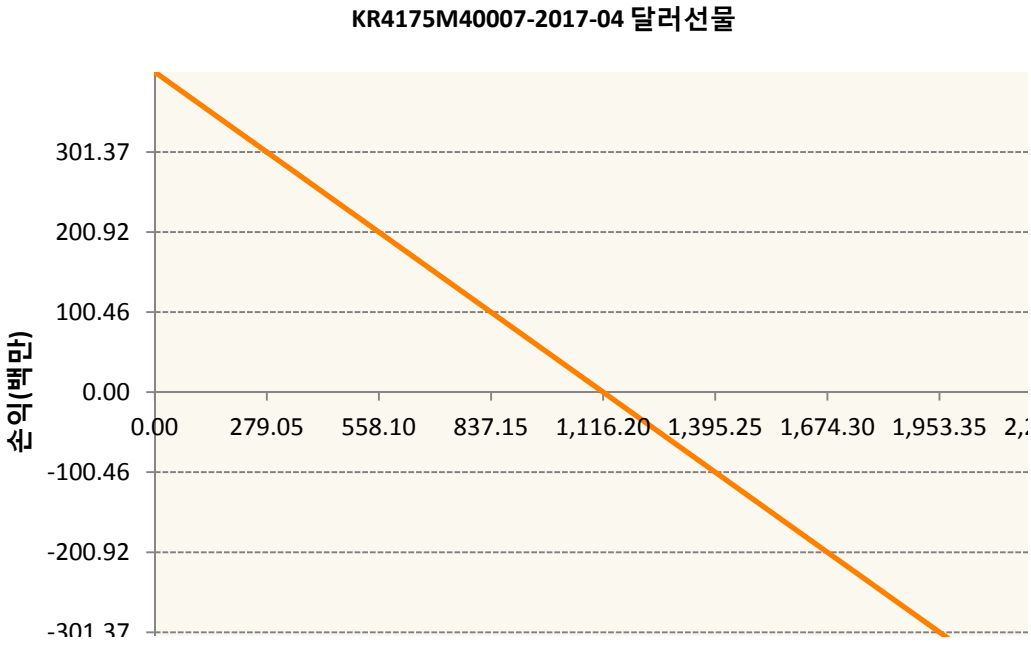
2. 만기시점의 손익구조

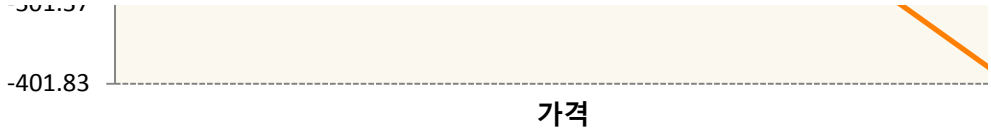


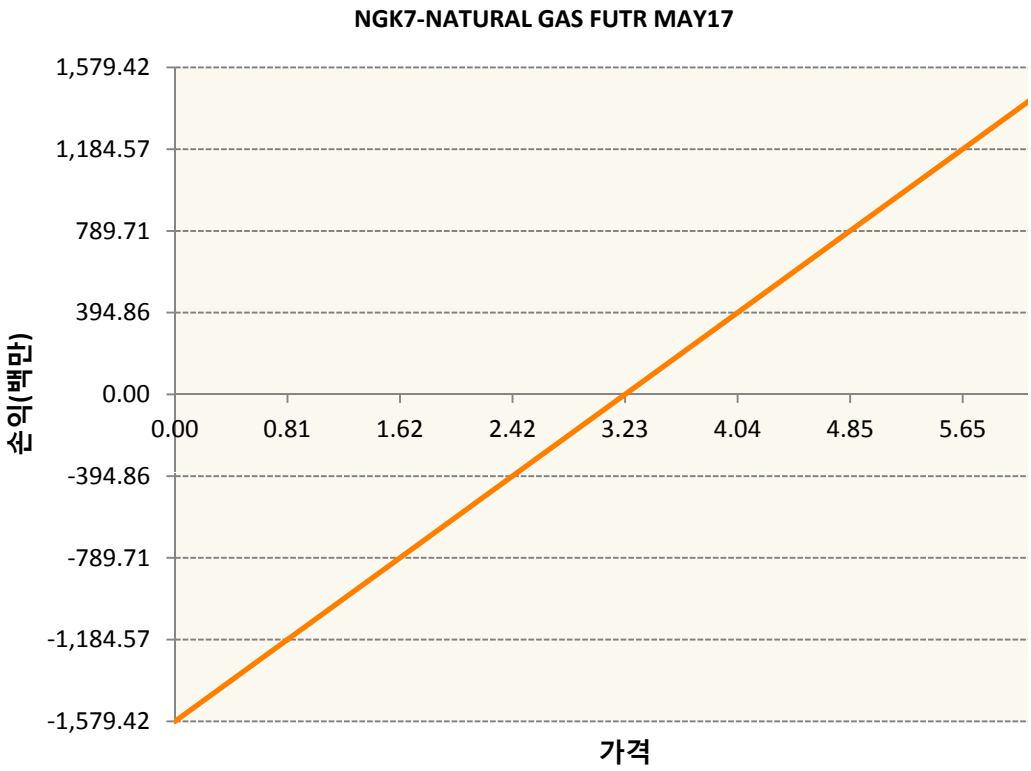


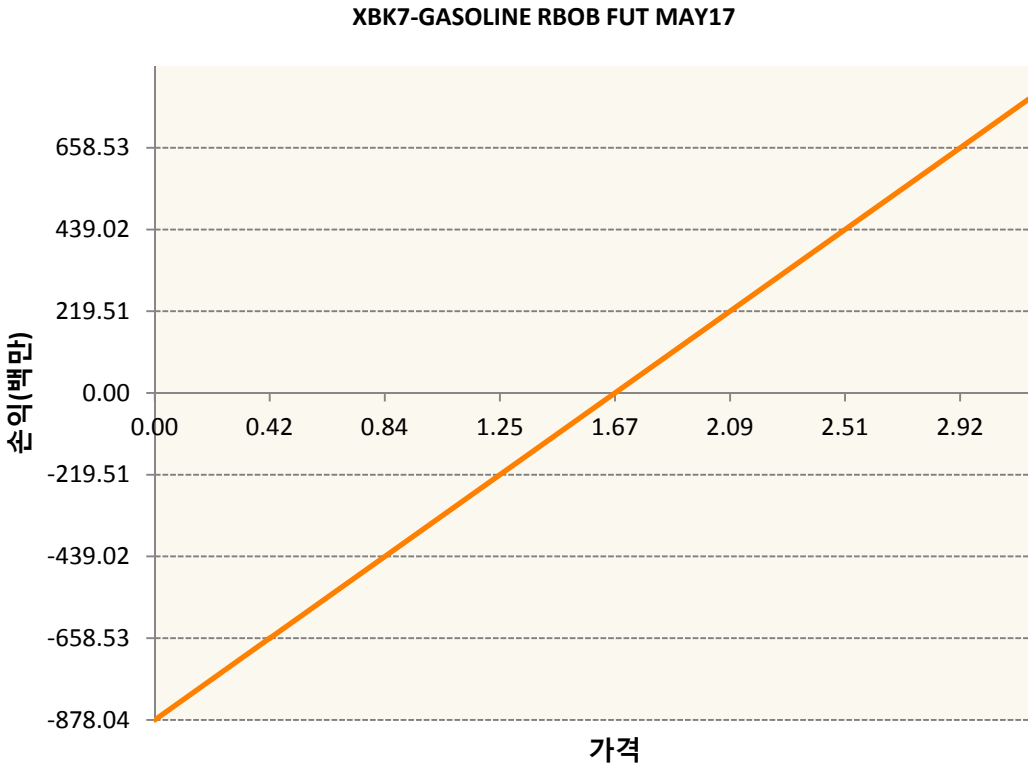

-754.01
-1,131.01
-1,508.01
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
739.70
554.77
369.85
184.92
0.00
-184.92
-369.85
-554.77
-739.70
0.00
0.39
0.78
1.16
1.55
1.94
2.33
2.71
순익(백만)
가격


KR4175M40007-2017-04 달러선물
301.37
200.92
100.46
0.00
-100.46
-200.92
-301.37
0.00
279.05
558.10
837.15
1,116.20
1,395.25
1,674.30
1,953.35
순익(백만)


-401.83
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,579.42
1,184.57
789.71
394.86
0.00
-394.86
-789.71
-1,184.57
-1,579.42
0.00
0.81
1.62
2.42
3.23
4.04
4.85
5.65
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
658.53
439.02
219.51
0.00
-219.51
-439.02
-658.53
-878.04
0.00
0.42
0.84
1.25
1.67
2.09
2.51
2.92
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK7	WTI CRUDE FUTURE MAY17	81
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	121
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	59
KR4175M40(	2017-04 달러선물	32
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	126
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	70

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

1,014

공시일	2017-03-31
기준일	2017-03-30

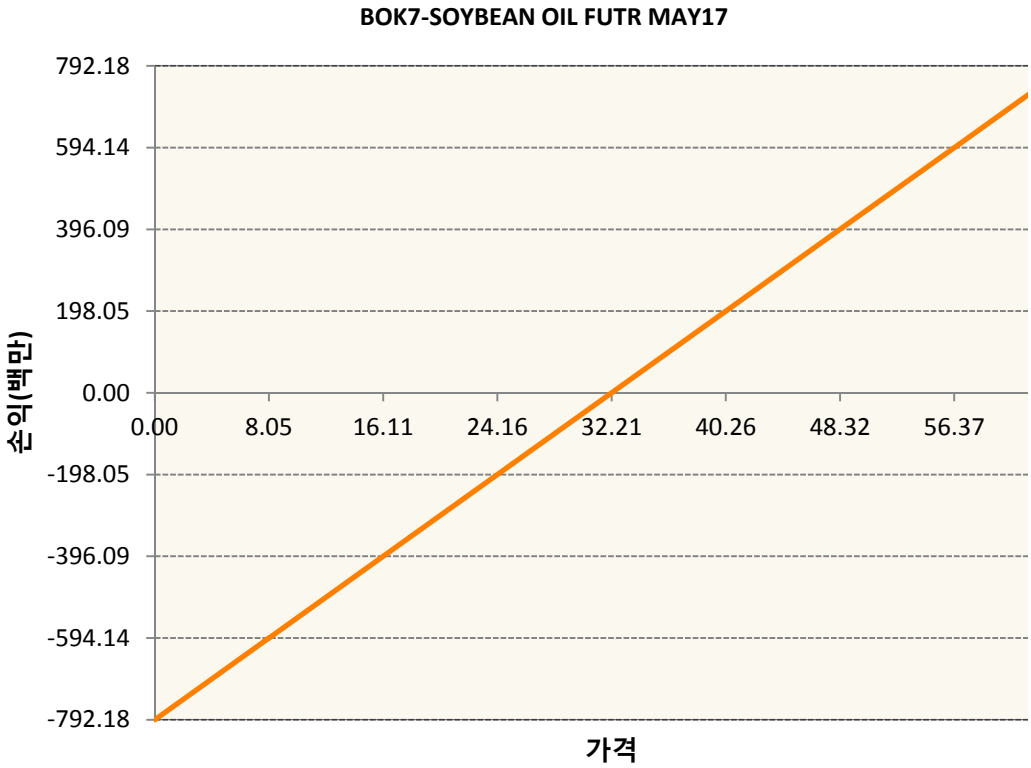
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

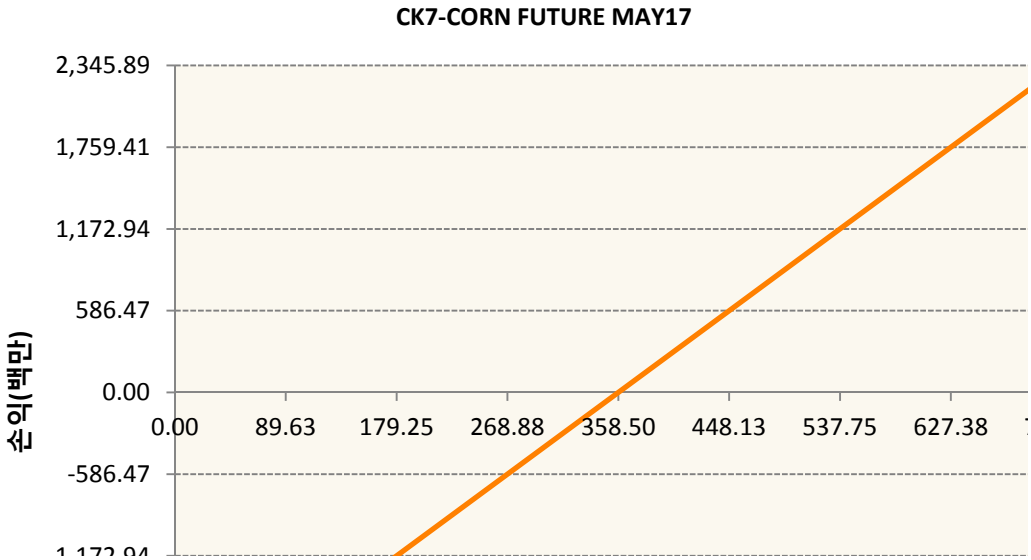
1. 계약금액

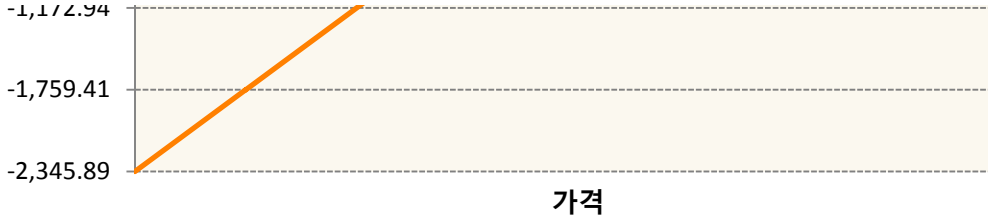
(단위:백만원)

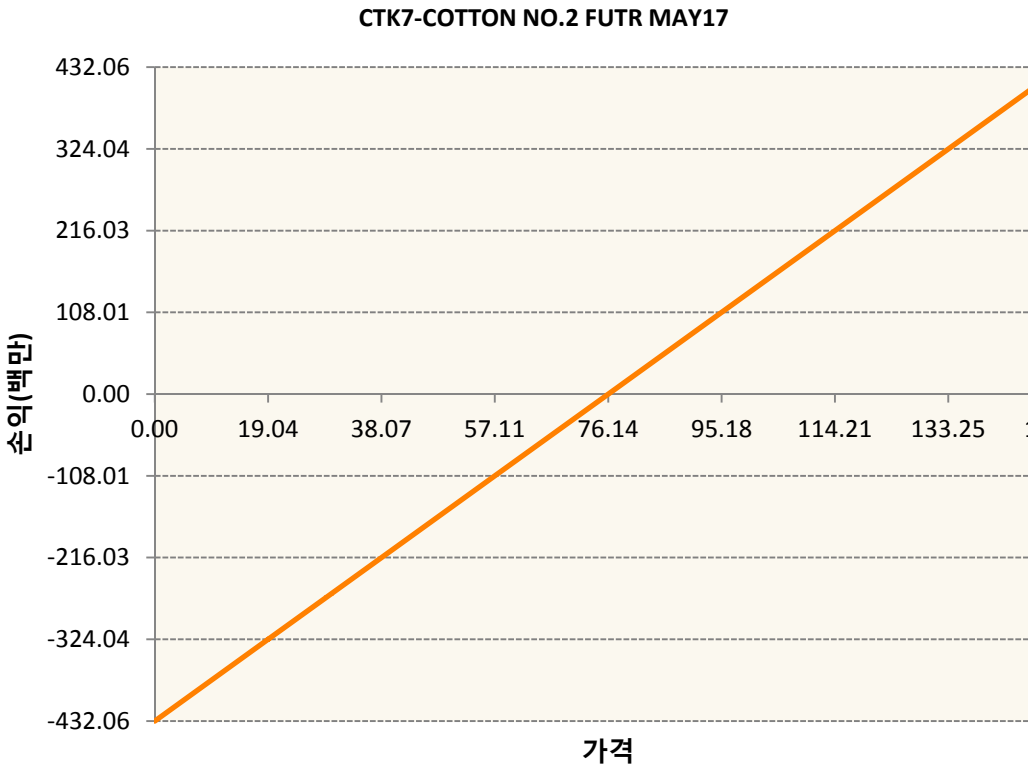
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,118	391	8,728	

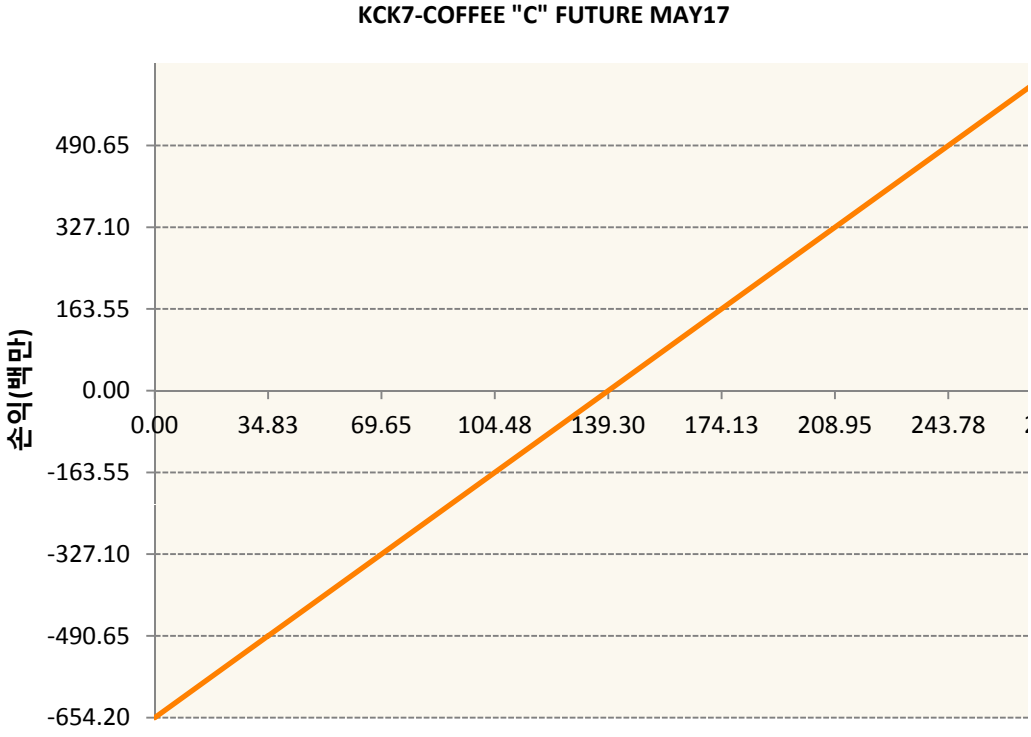
2. 만기시점의 손익구조





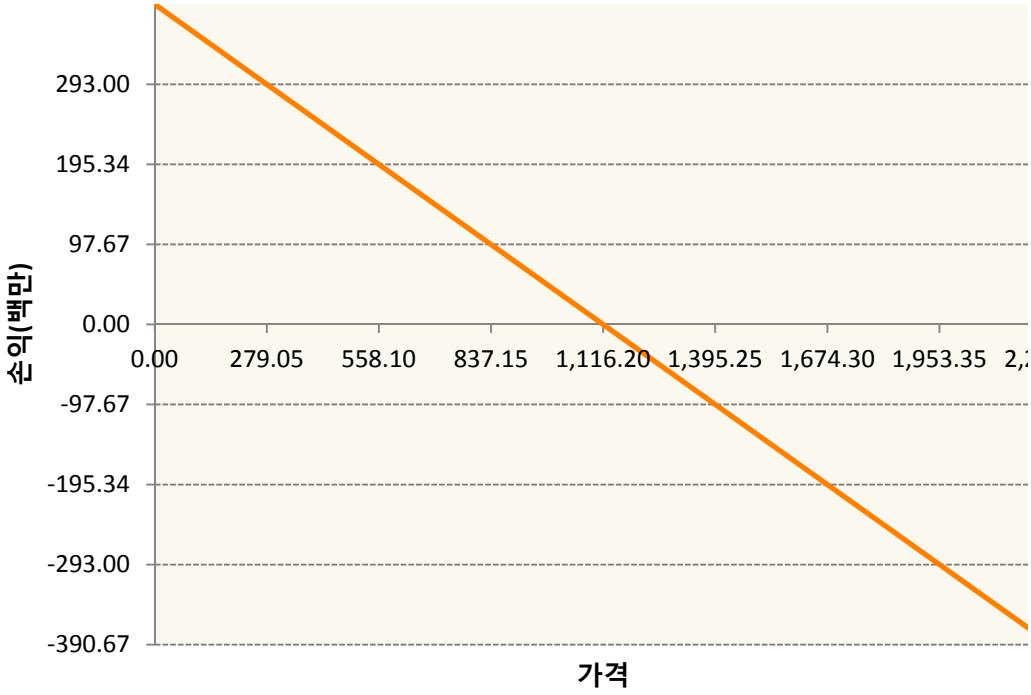

-1,759.41
-2,345.89
가격


CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
432.06
324.04
216.03
108.01
0.00
-108.01
-216.03
-324.04
-432.06
0.00
19.04
38.07
57.11
76.14
95.18
114.21
133.25
순익(백만)
가격

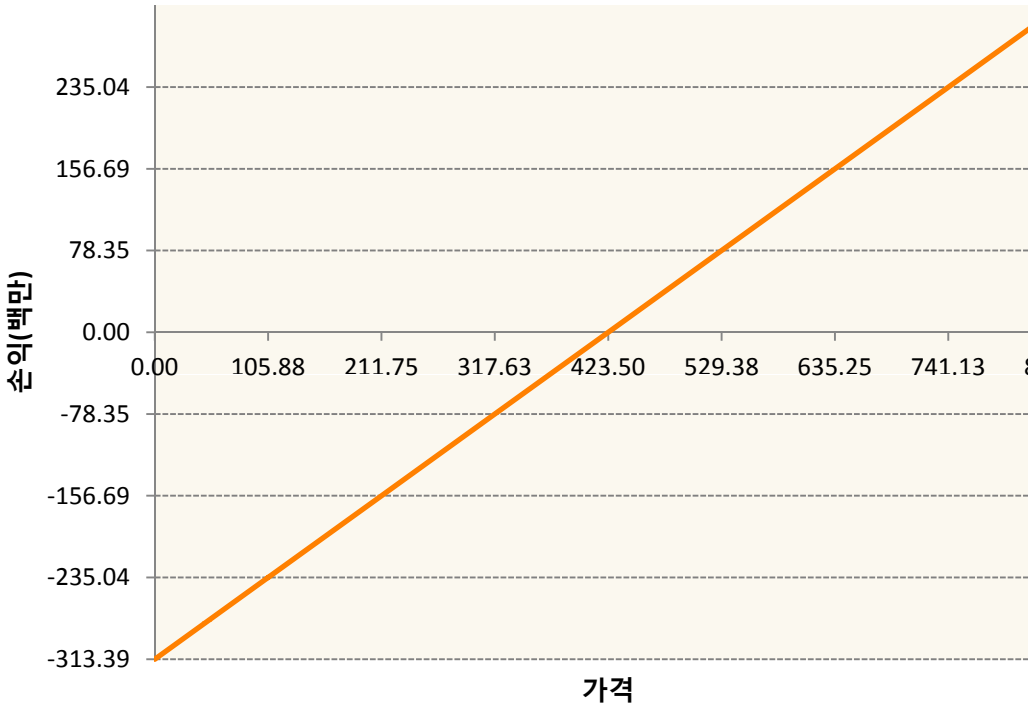

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
490.65
327.10
163.55
0.00
-163.55
-327.10
-490.65
-654.20
0.00
34.83
69.65
104.48
139.30
174.13
208.95
243.78
순익(백만)

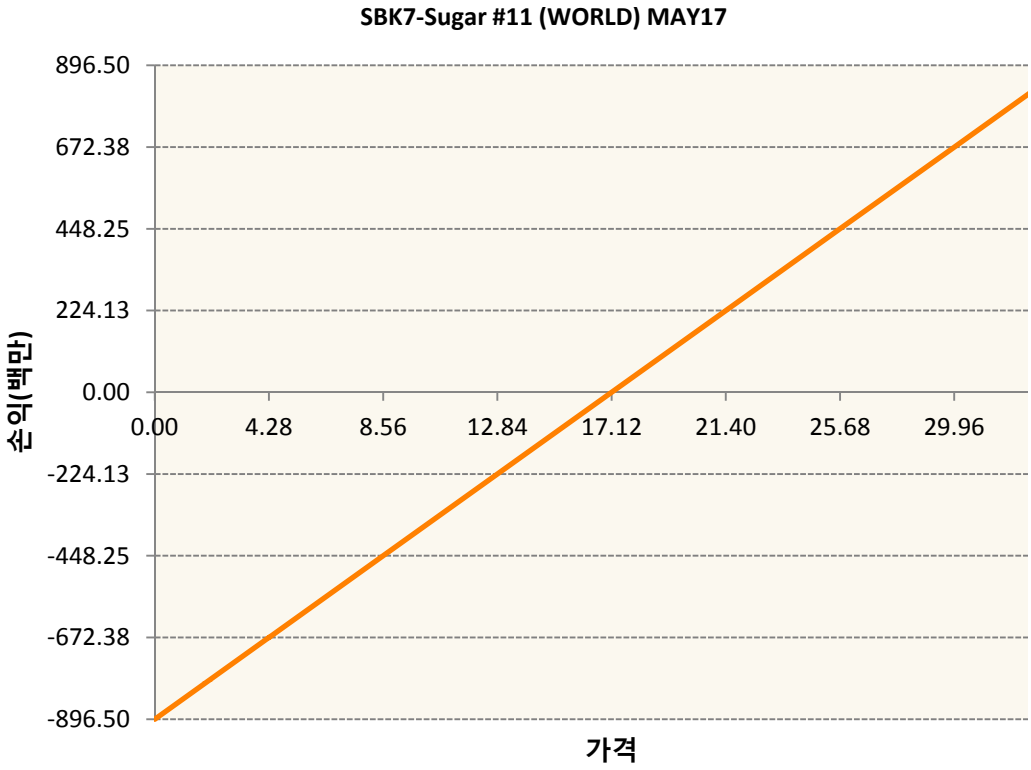
가격

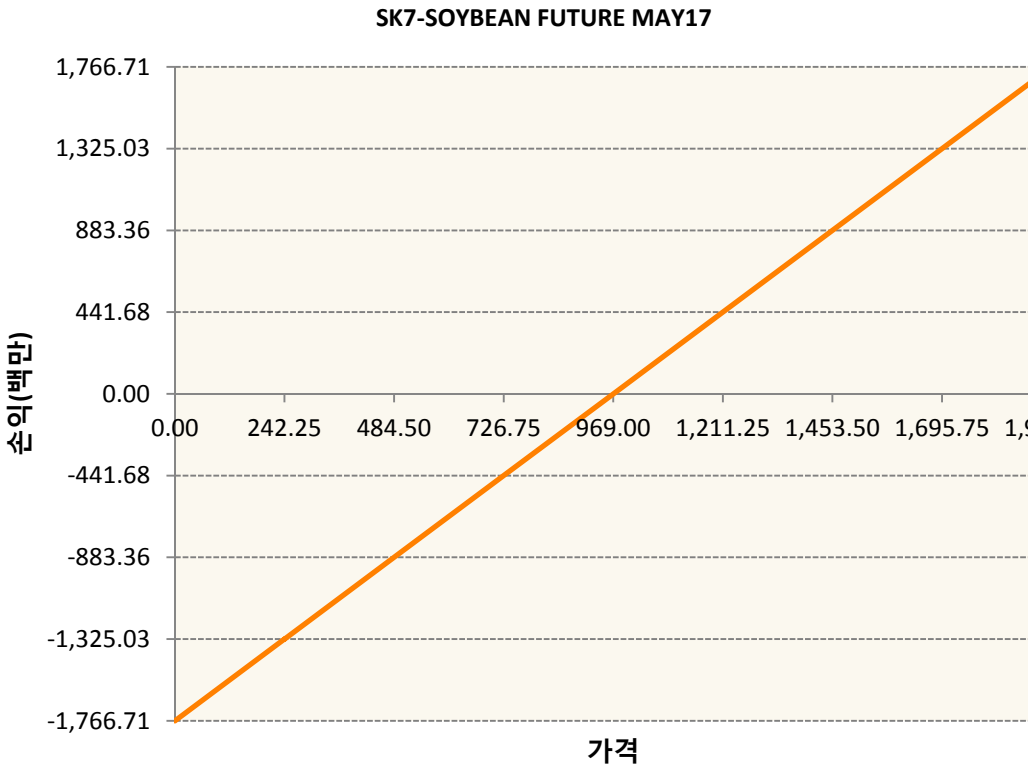
KR4175M40007-2017-04 달러선물

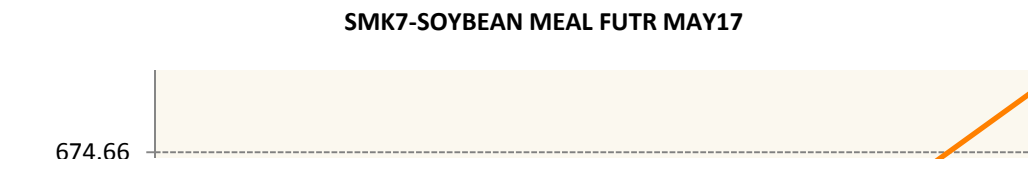


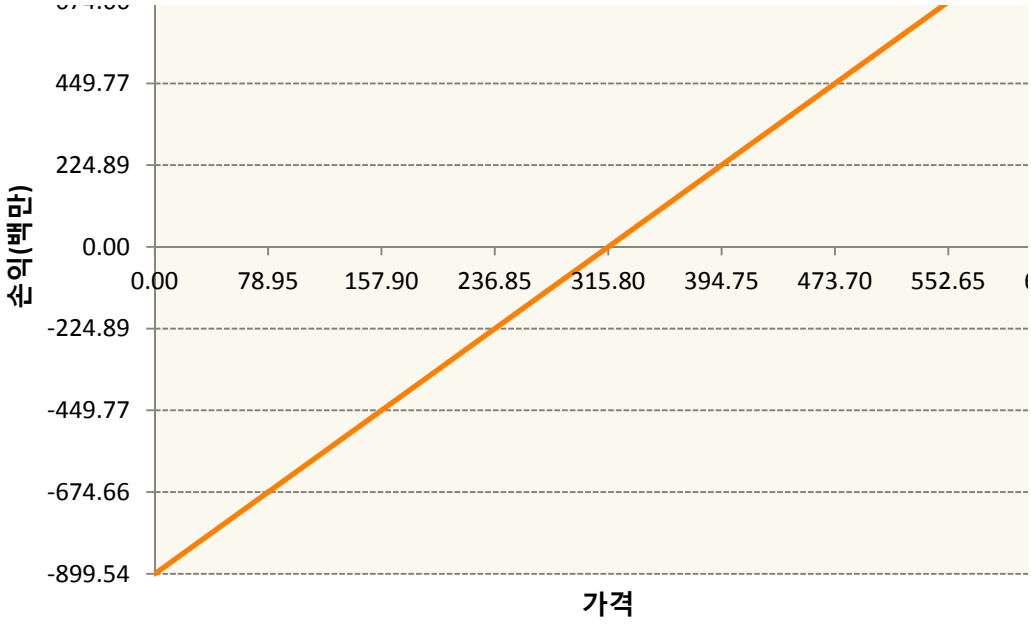
KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17

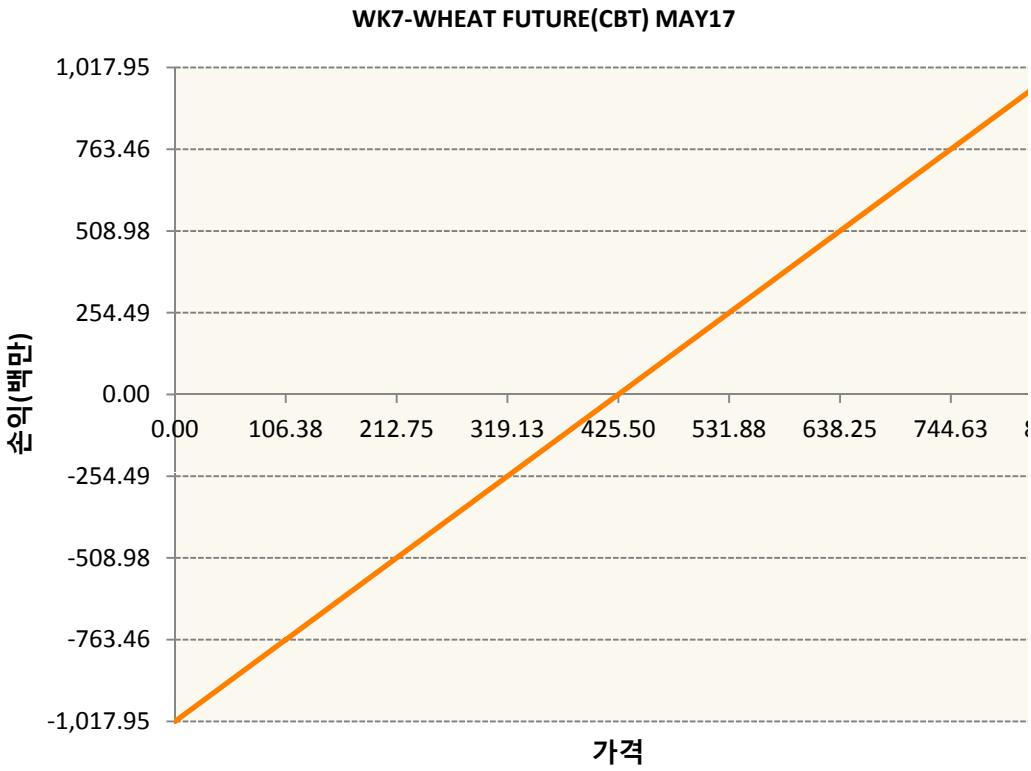



SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
896.50
672.38
448.25
224.13
0.00
-224.13
-448.25
-672.38
-896.50
0.00
4.28
8.56
12.84
17.12
21.40
25.68
29.96
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,766.71
1,325.03
883.36
441.68
0.00
-441.68
-883.36
-1,325.03
-1,766.71
0.00
242.25
484.50
726.75
969.00
1,211.25
1,453.50
1,695.75
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
674.66





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	63
CK7	CORN FUTURE MAY17	188
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	72
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	141
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	72
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	81

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

835