공시일	2017-04-03
기준일	2017-03-31

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	2017-04-03
기준일	2017-03-31

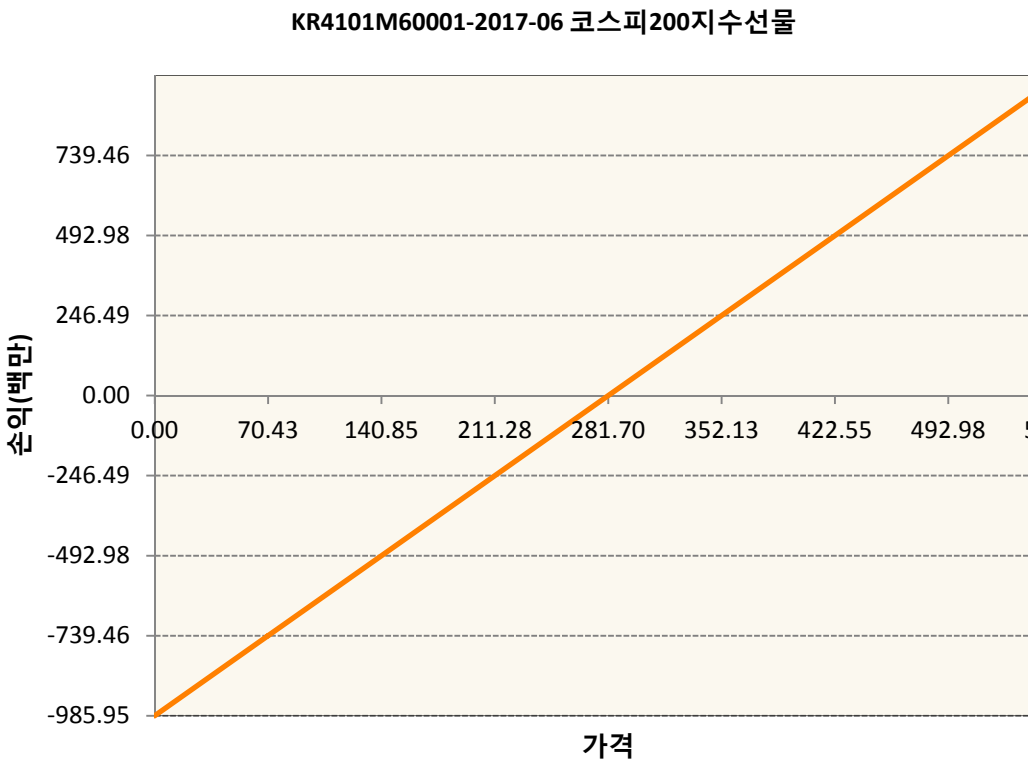
스마트인덱스모

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	986	0	986	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%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
-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	2017-04-03
기준일	2017-03-31

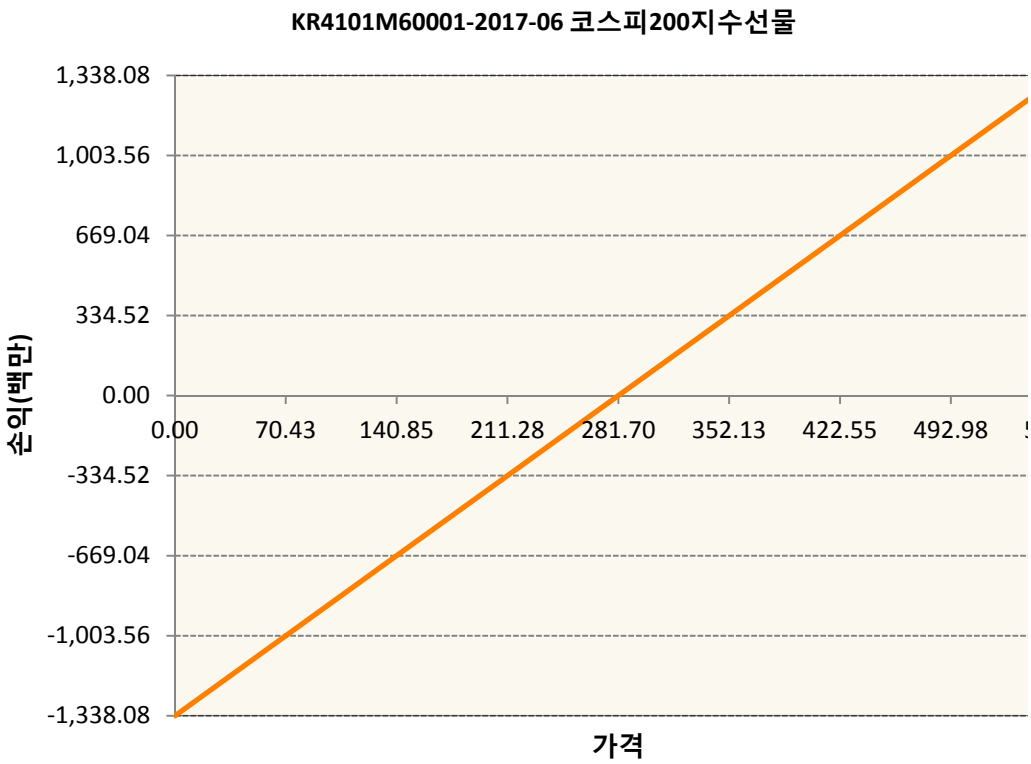
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,338	0	1,338	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)

69

공시일	2017-04-03
기준일	2017-03-31

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	962

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

555

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-04-03
기준일	2017-03-31

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	388

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

414

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-04-03
기준일	2017-03-31

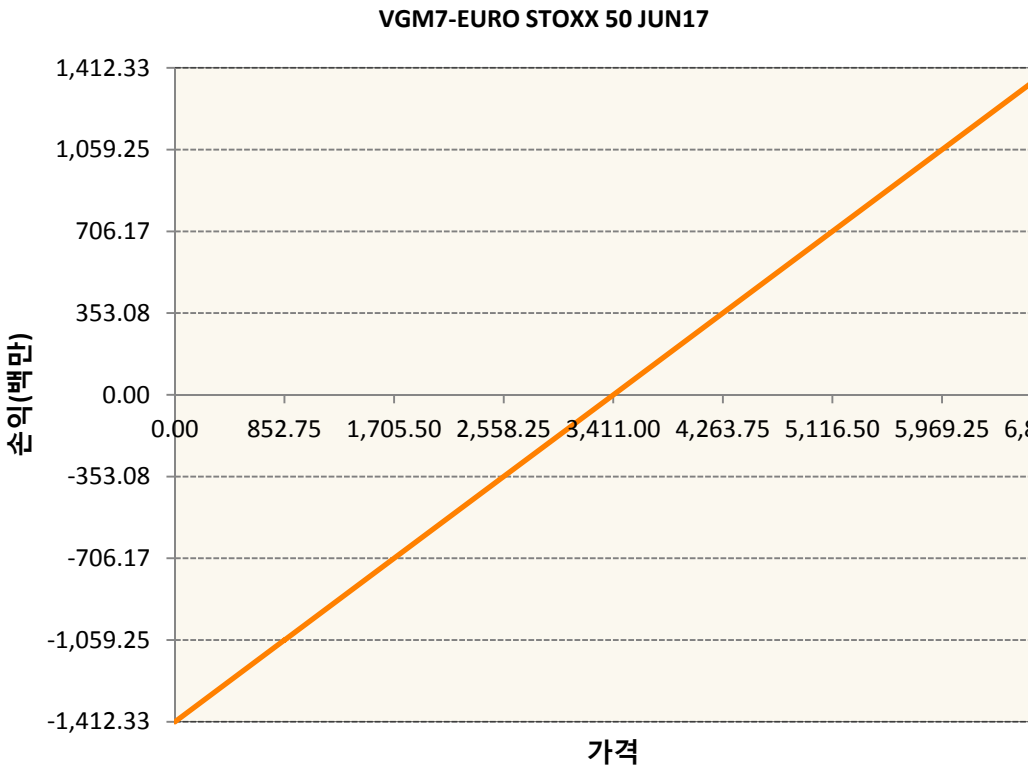
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,412	0	1,412	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM7	EURO STOXX 50 JUN17	113

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

(단위:백만원)

115

공시일	2017-04-03
기준일	2017-03-31

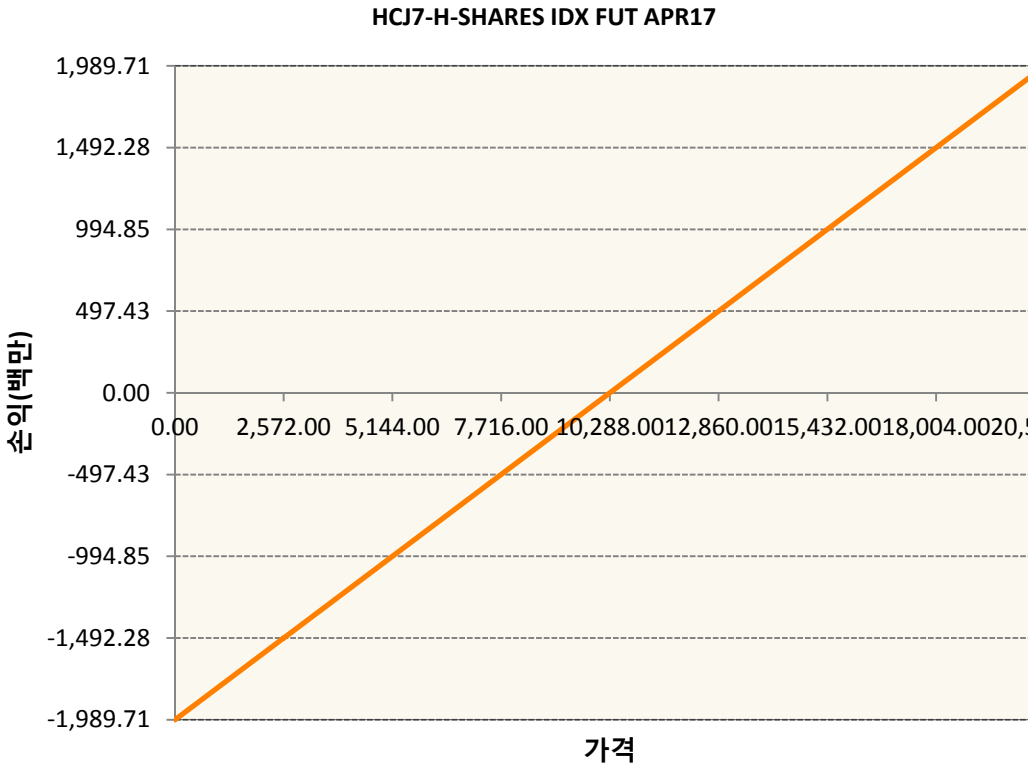
차이나인덱스모(주식-파생형)

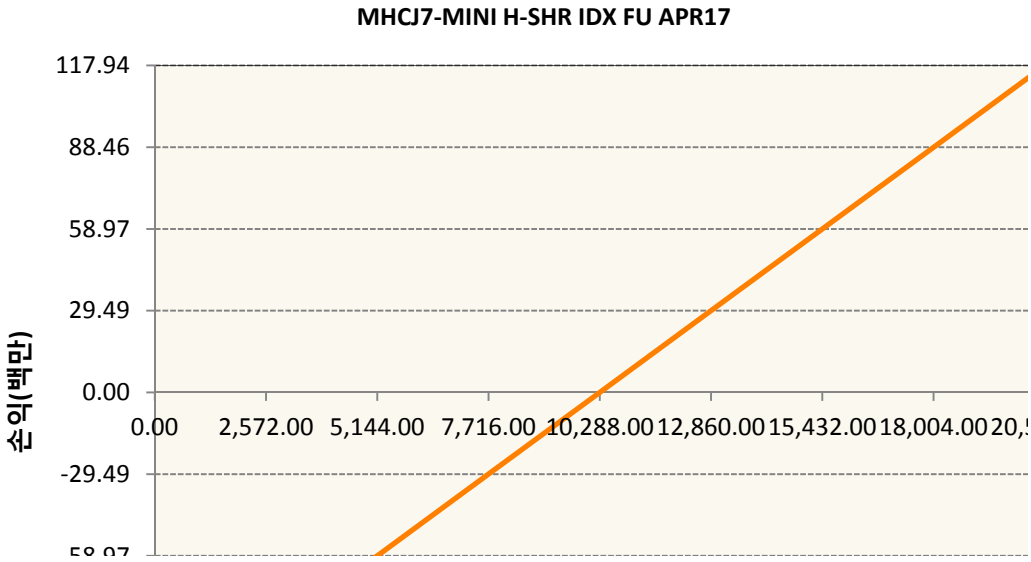
1. 계약금액

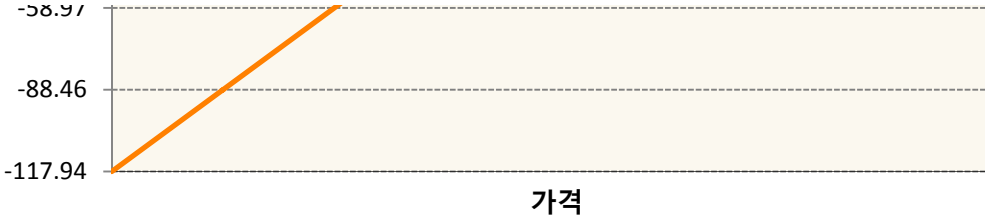
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,108	0	2,108	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCJ7	H-SHARES IDX FUT APR17	159
MHCJ7	MINI H-SHR IDX FU APR17	9

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

181

공시일	2017-04-03
기준일	2017-03-31

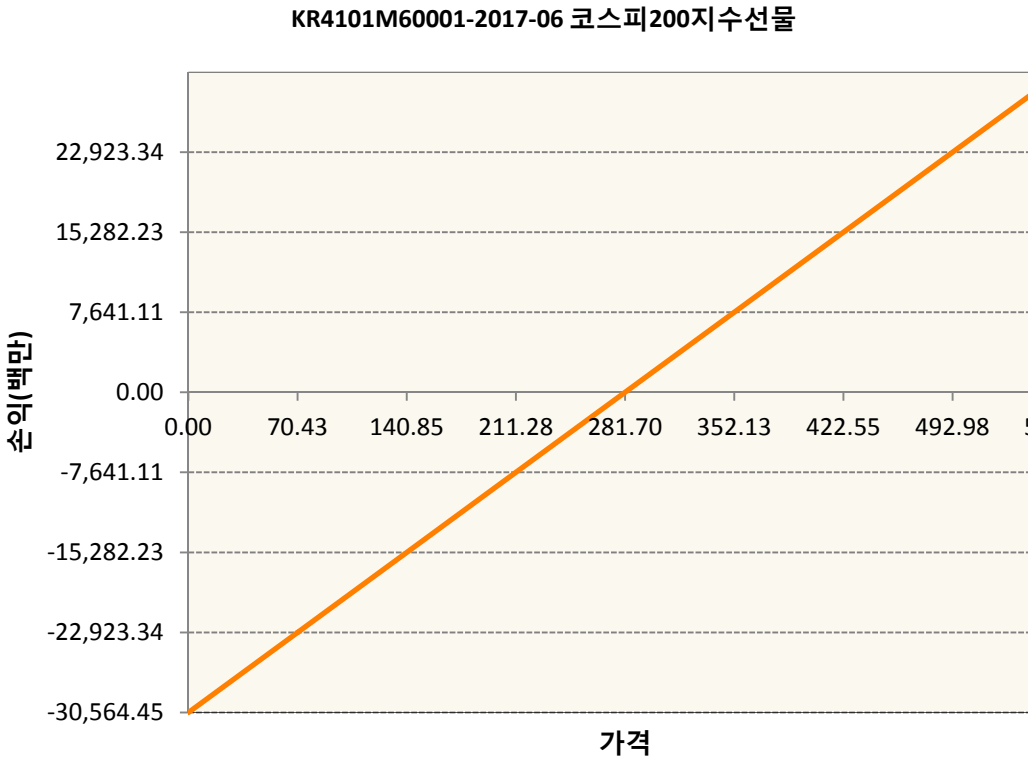
커버드콜모(주식혼합-파생형)

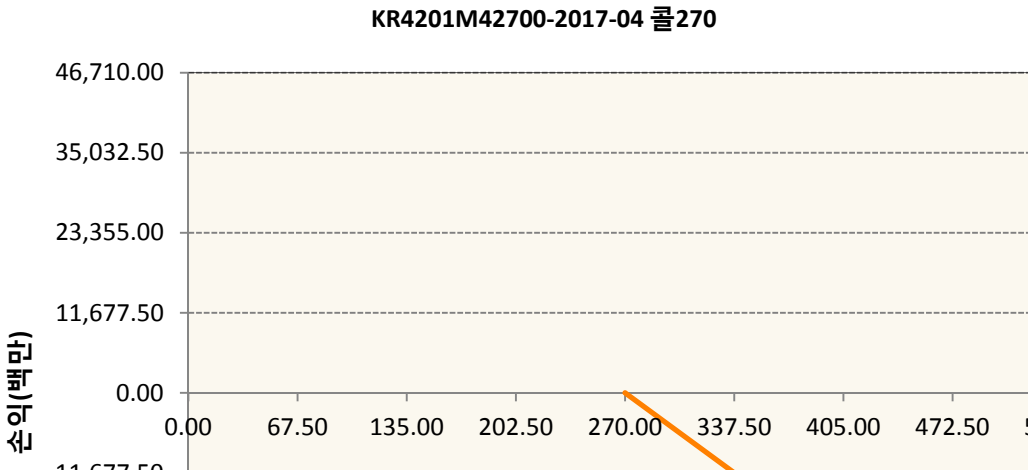
1. 계약금액

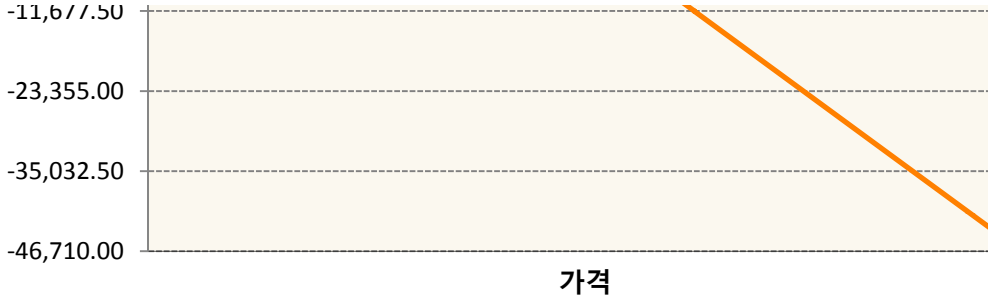
(단위:백만원)

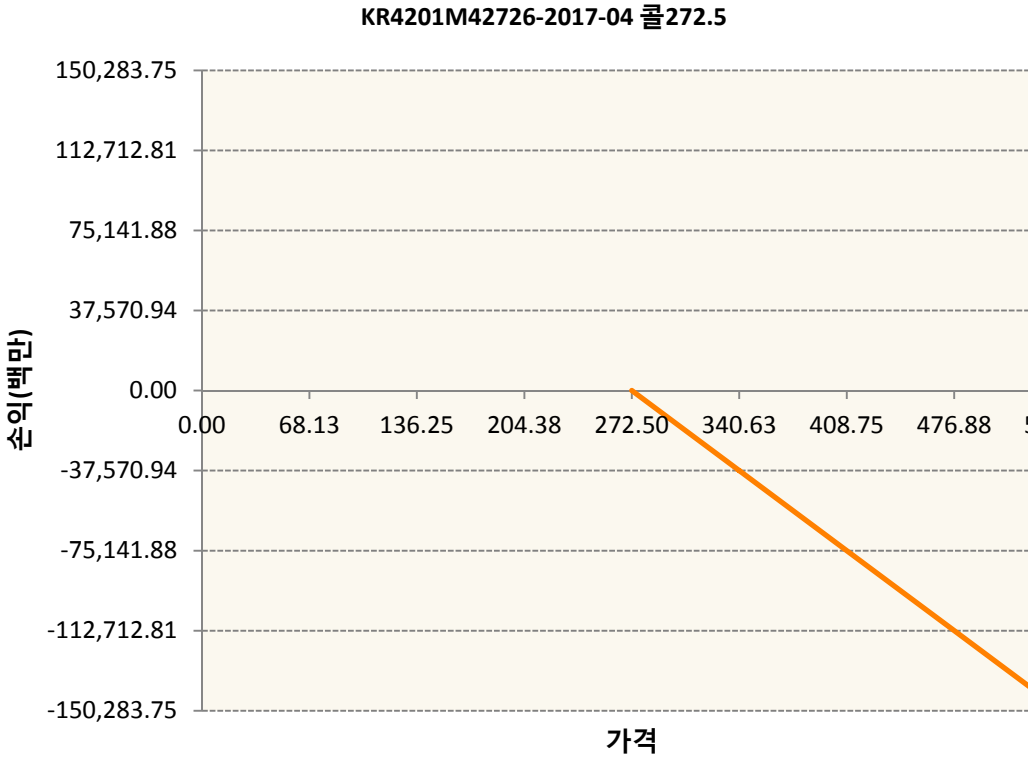
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	1,408	-1,408	장내
신규	유가증권	옵션	1,294	0	1,294	장내
누계	유가증권	선물	30,564	0	30,564	장내
누계	유가증권	옵션	0	196,994	-196,994	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							2,436
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,436	-2,436	-2,436	-2,436	-2,436	-2,436	-2,436
-5.33%	-1,624	-1,624	-1,624	-1,624	-1,624	-1,624	-1,624
-2.67%	-812	-812	-812	-812	-812	-812	-812
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	812	812	812	812	812	812	812
5.33%	1,624	1,624	1,624	1,624	1,624	1,624	1,624
8.00%	2,436	2,436	2,436	2,436	2,436	2,436	2,436
KR4201M42 2017-04 콜270							3,872
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,845	1,844	1,843	1,841	1,838	1,834	1,829
-5.33%	1,796	1,778	1,759	1,737	1,715	1,691	1,667
-2.67%	1,215	1,191	1,166	1,140	1,114	1,087	1,059
0%	8	7	4	0	-6	-13	-21
2.67%	-1,284	-1,284	-1,284	-1,285	-1,285	-1,285	-1,286
5.33%	-2,578	-2,578	-2,578	-2,578	-2,578	-2,578	-2,578
8.00%	-3,872	-3,872	-3,872	-3,872	-3,872	-3,872	-3,872
KR4201M42 2017-04 콜272.5							12,280

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,568	4,567	4,567	4,565	4,562	4,556	4,548
-5.33%	4,528	4,501	4,467	4,427	4,381	4,330	4,274
-2.67%	3,487	3,389	3,290	3,191	3,092	2,993	2,894
0%	73	55	31	0	-37	-80	-128
2.67%	-4,031	-4,031	-4,031	-4,033	-4,036	-4,040	-4,047
5.33%	-8,155	-8,155	-8,155	-8,155	-8,155	-8,155	-8,156
8.00%	-12,280	-12,280	-12,280	-12,280	-12,280	-12,280	-12,280

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

20,425

공시일	2017-04-03
기준일	2017-03-31

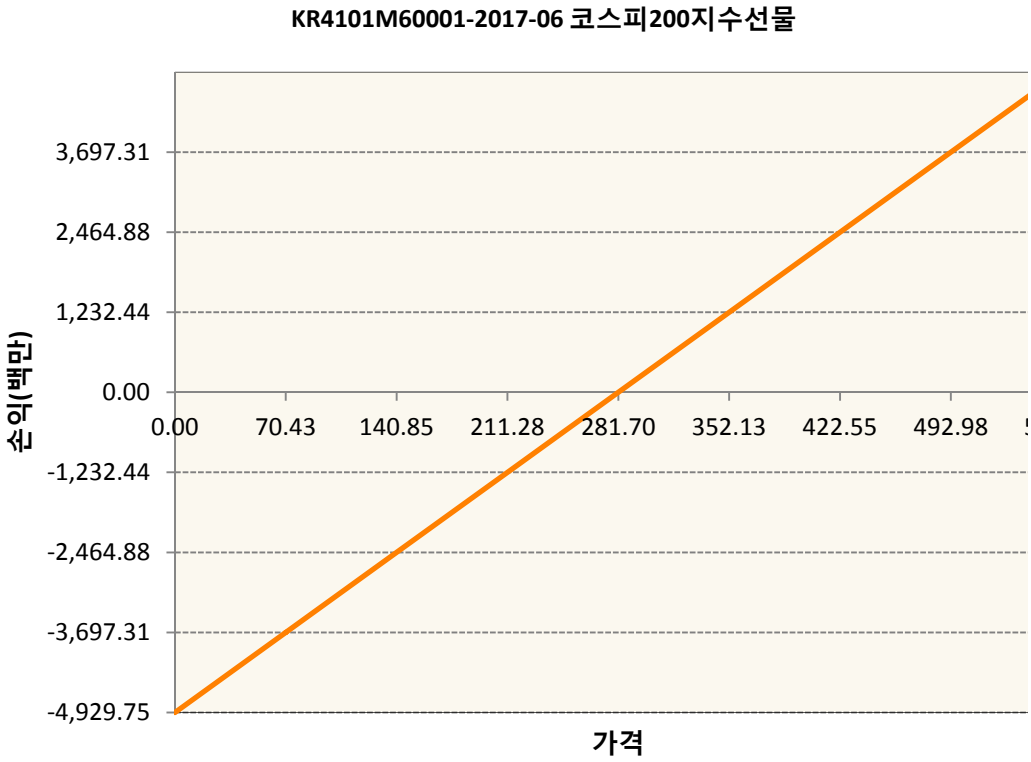
커버드콜목표전환형증권투자신탁

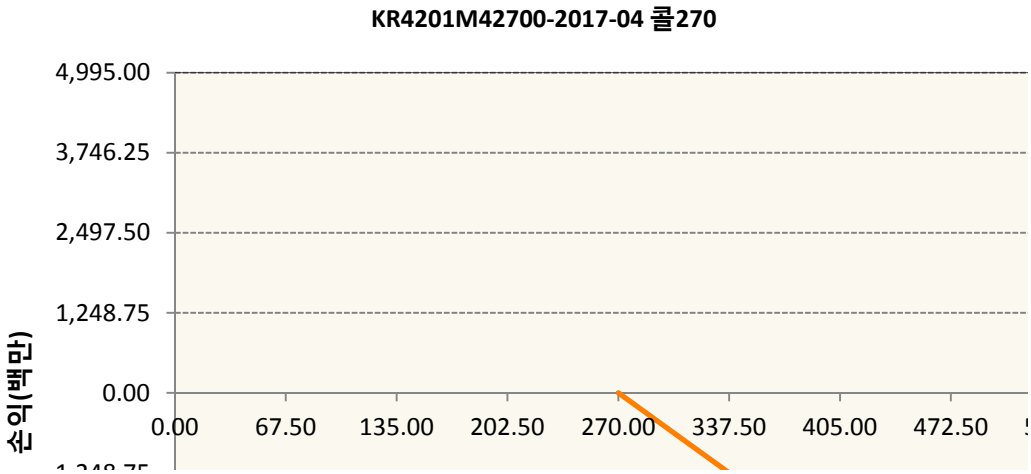
1. 계약금액

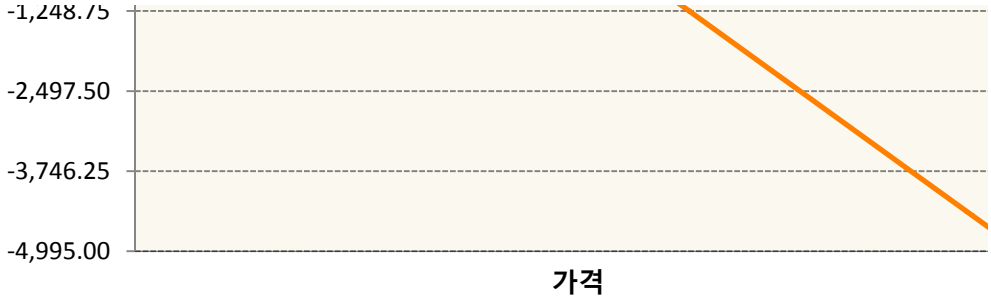
(단위:백만원)

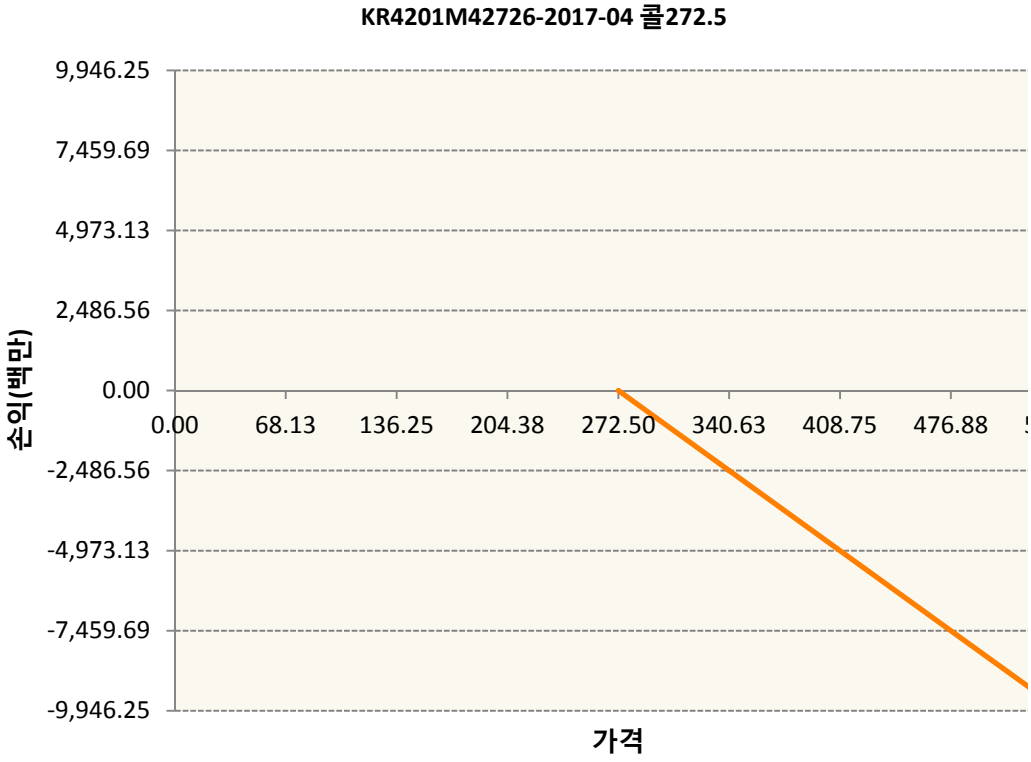
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	705	-705	장내
신규	유가증권	옵션	659	0	659	장내
누계	유가증권	선물	4,930	0	4,930	장내
누계	유가증권	옵션	0	14,941	-14,941	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							393
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-393	-393	-393	-393	-393	-393	-393
-5.33%	-262	-262	-262	-262	-262	-262	-262
-2.67%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	131	131	131	131	131	131	131
5.33%	262	262	262	262	262	262	262
8.00%	393	393	393	393	393	393	393
KR4201M42 2017-04 콜270							414
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	197	197	197	197	197	196	196
-5.33%	192	190	188	186	183	181	178
-2.67%	130	127	125	122	119	116	113
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	-137	-137	-137	-137	-137	-137	-138
5.33%	-276	-276	-276	-276	-276	-276	-276
8.00%	-414	-414	-414	-414	-414	-414	-414
KR4201M42 2017-04 콜272.5							813

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	302	302	302	302	302	302	301
-5.33%	300	298	296	293	290	287	283
-2.67%	231	224	218	211	205	198	192
0%	5	4	2	0	-2	-5	-8
2.67%	-267	-267	-267	-267	-267	-267	-268
5.33%	-540	-540	-540	-540	-540	-540	-540
8.00%	-813	-813	-813	-813	-813	-813	-813

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

1,677

공시일	2017-04-03
기준일	2017-03-31

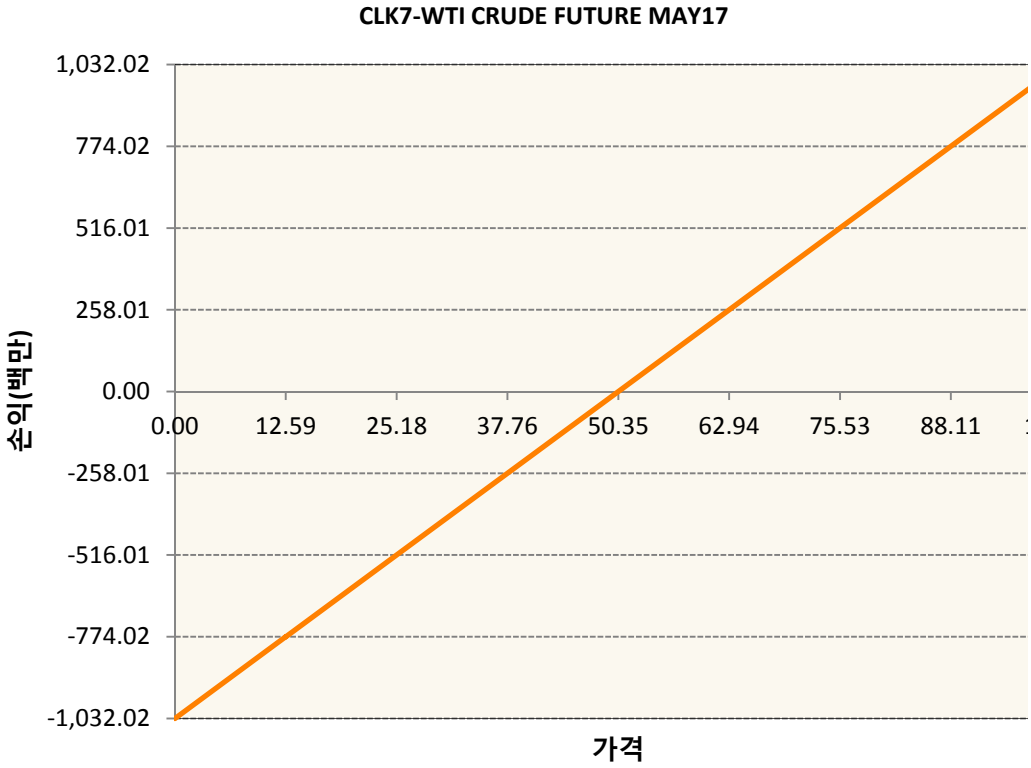
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

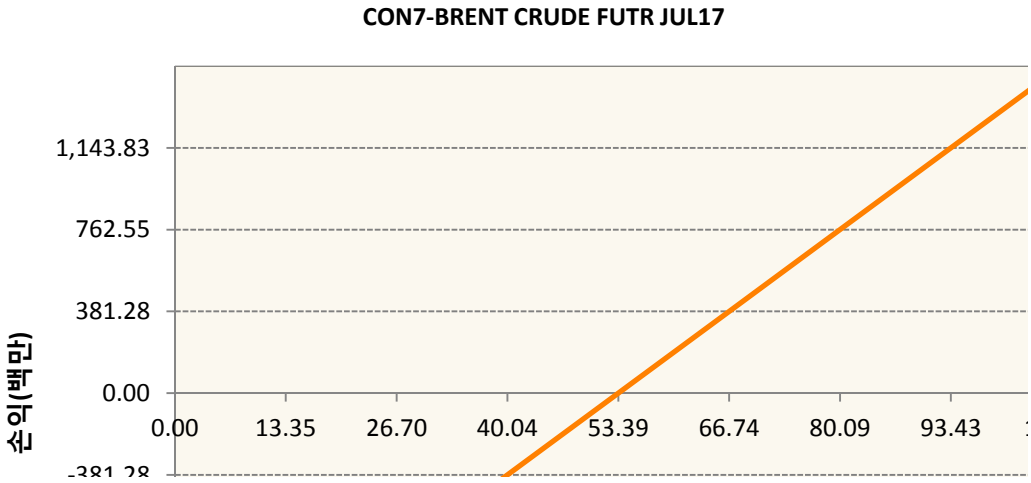
1. 계약금액

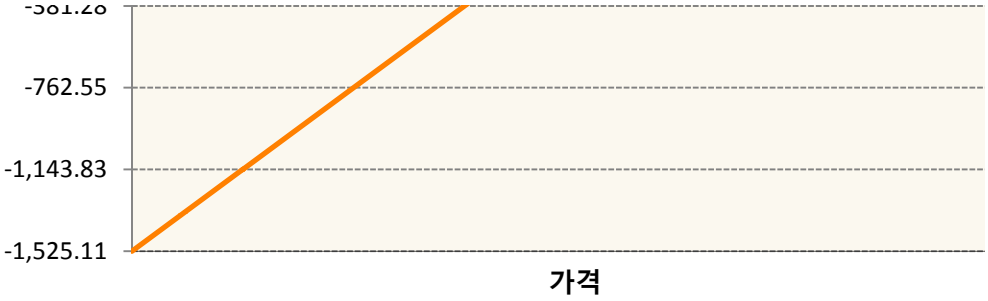
(단위:백만원)

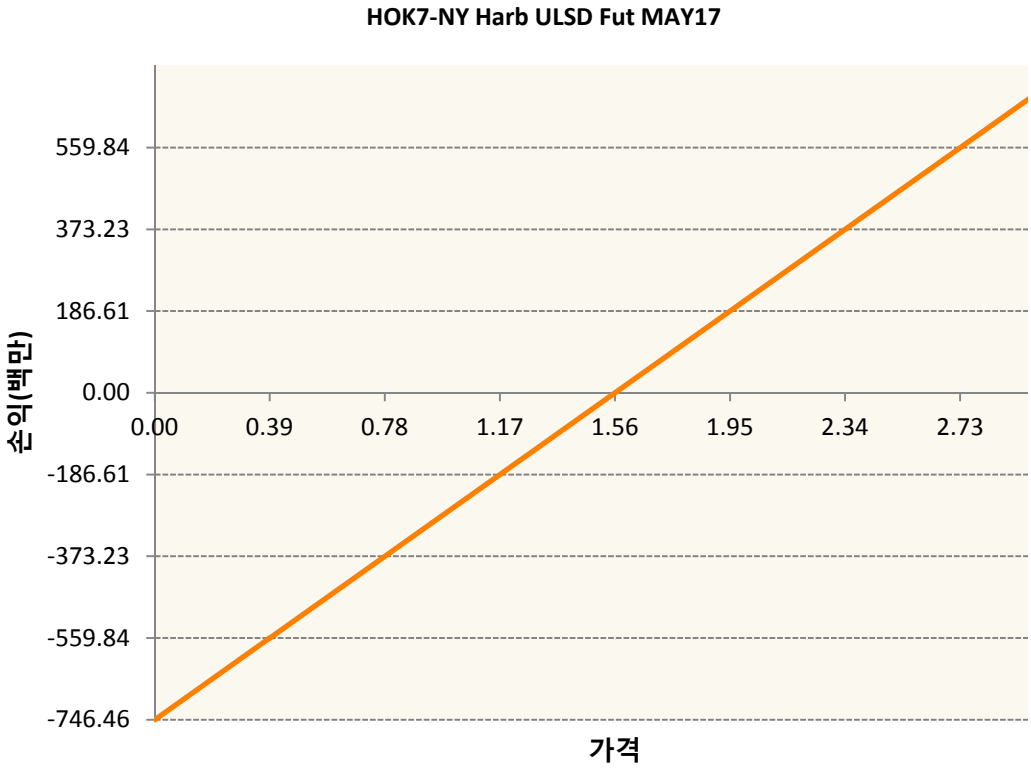
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,032	0	1,032	
누계	유가증권	선물	4,715	403	4,313	

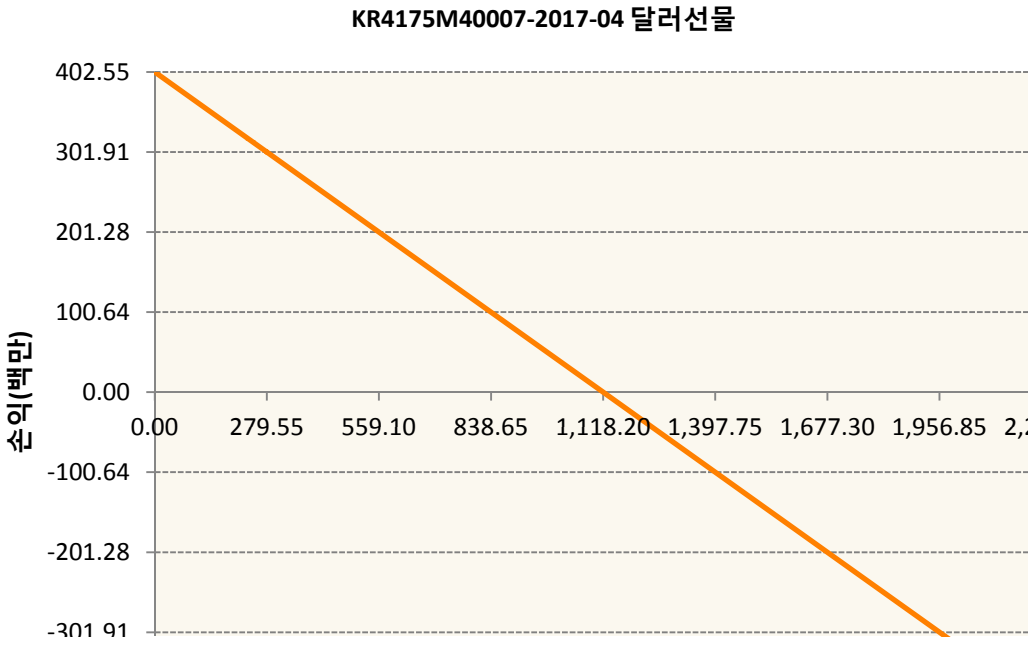
2. 만기시점의 손익구조

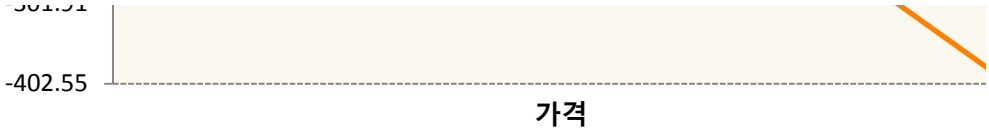


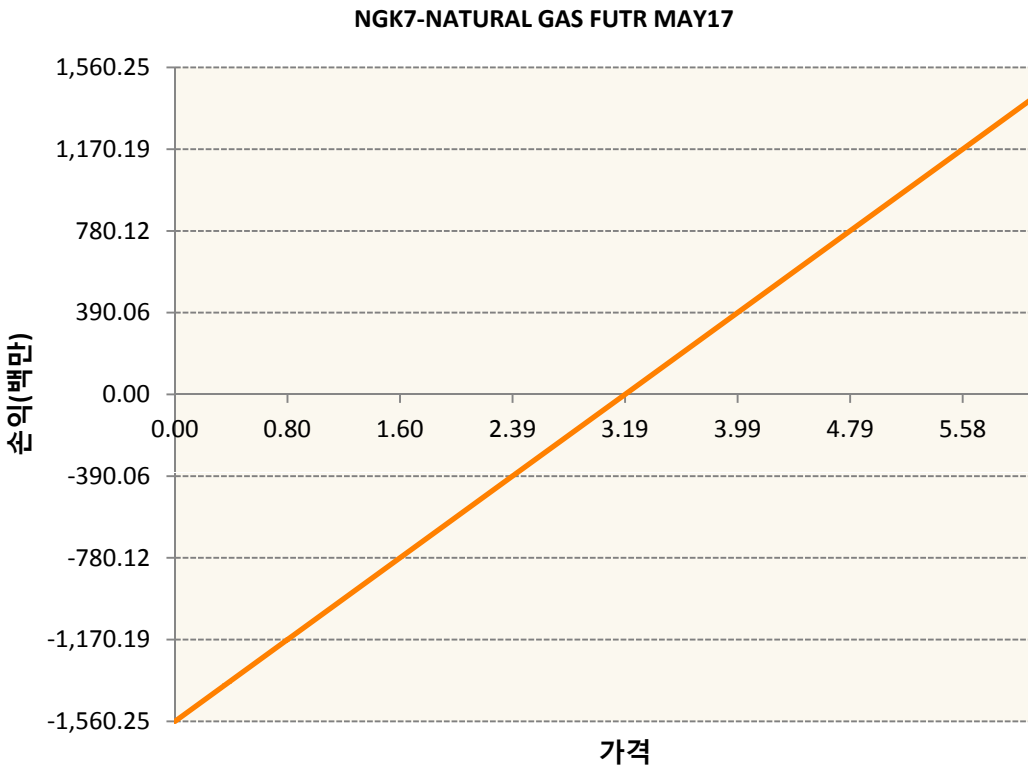


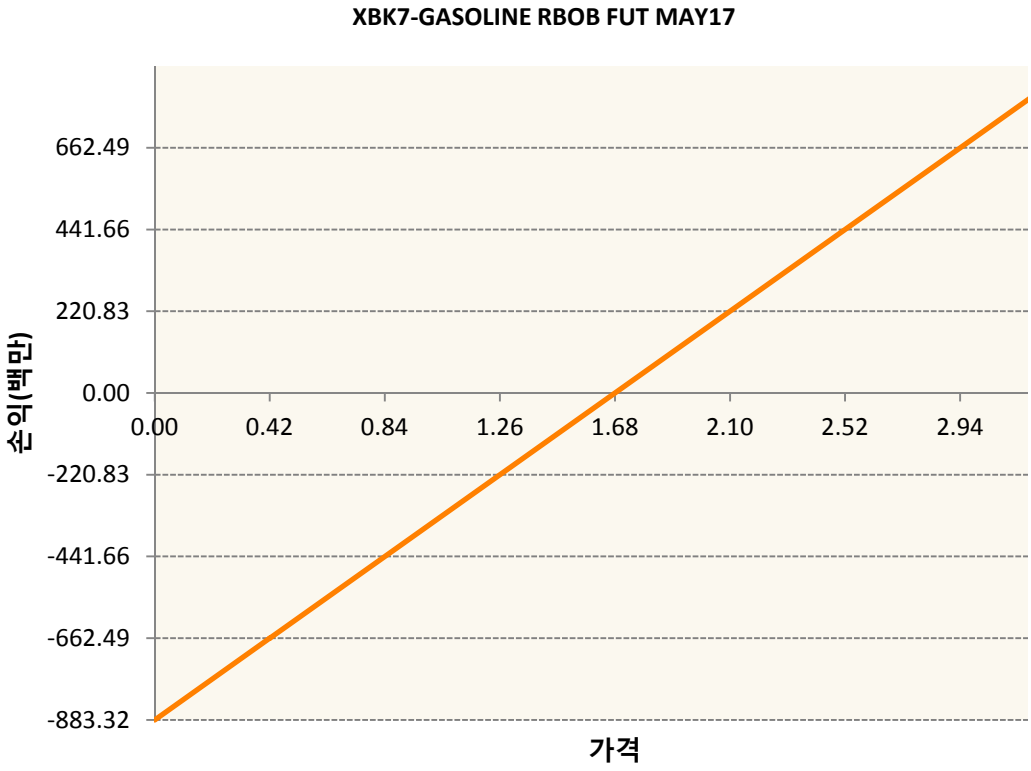

-762.55
-1,143.83
-1,525.11
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
559.84
373.23
186.61
0.00
-186.61
-373.23
-559.84
-746.46
0.00
0.39
0.78
1.17
1.56
1.95
2.34
2.73
순익(백만)
가격


KR4175M40007-2017-04 달러선물
402.55
301.91
201.28
100.64
0.00
-100.64
-201.28
0.00
279.55
559.10
838.65
1,118.20
1,397.75
1,677.30
1,956.85
순익(백만)


-402.55
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,560.25
1,170.19
780.12
390.06
0.00
-390.06
-780.12
-1,170.19
-1,560.25
0.00
0.80
1.60
2.39
3.19
3.99
4.79
5.58
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
662.49
441.66
220.83
0.00
-220.83
-441.66
-662.49
-883.32
0.00
0.42
0.84
1.26
1.68
2.10
2.52
2.94
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK7	WTI CRUDE FUTURE MAY17	83
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	122
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	60
KR4175M40(	2017-04 달러선물	32
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	125
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	71

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

1,013

공시일	2017-04-03
기준일	2017-03-31

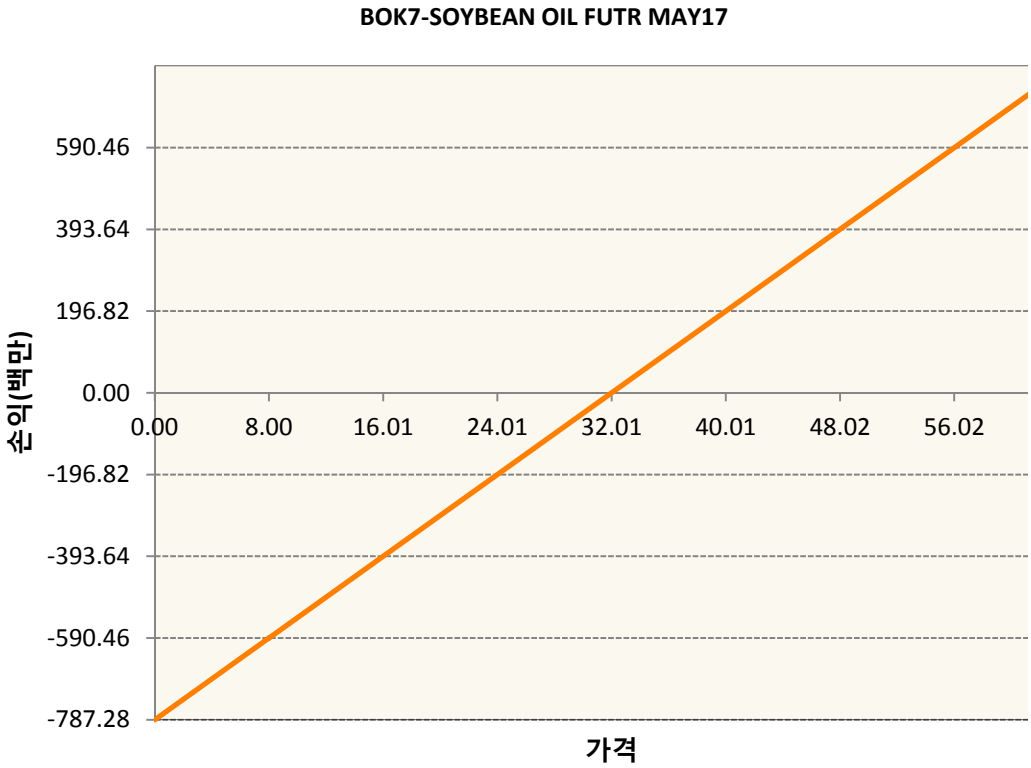
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

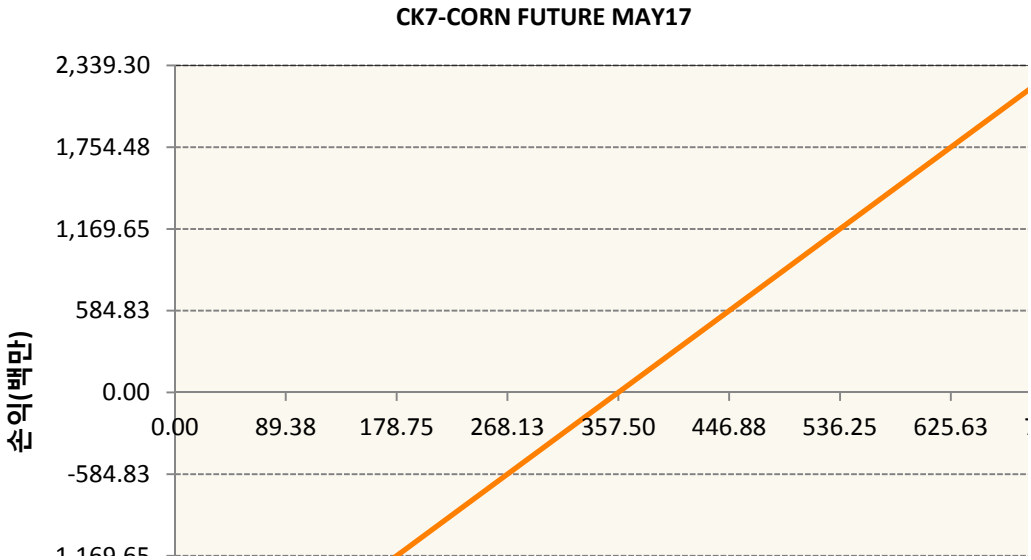
1. 계약금액

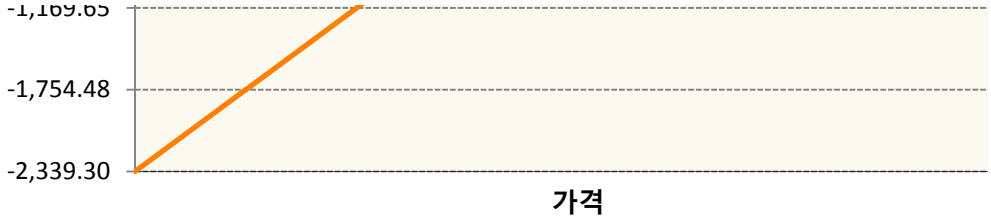
(단위:백만원)

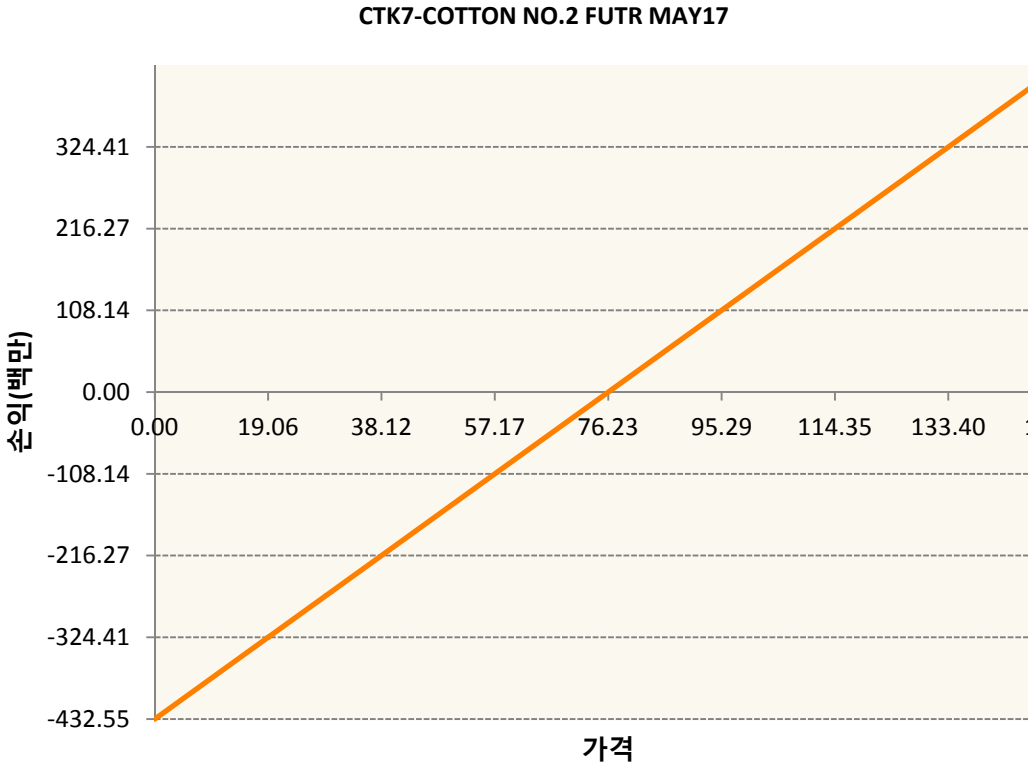
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,063	391	8,671	

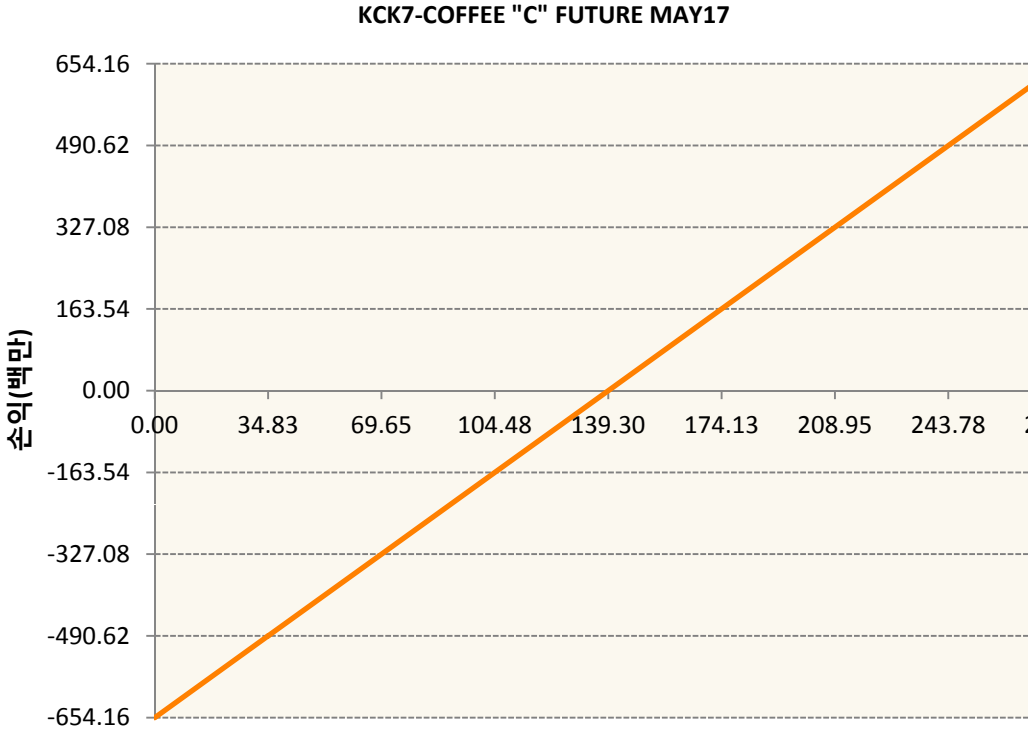
2. 만기시점의 손익구조



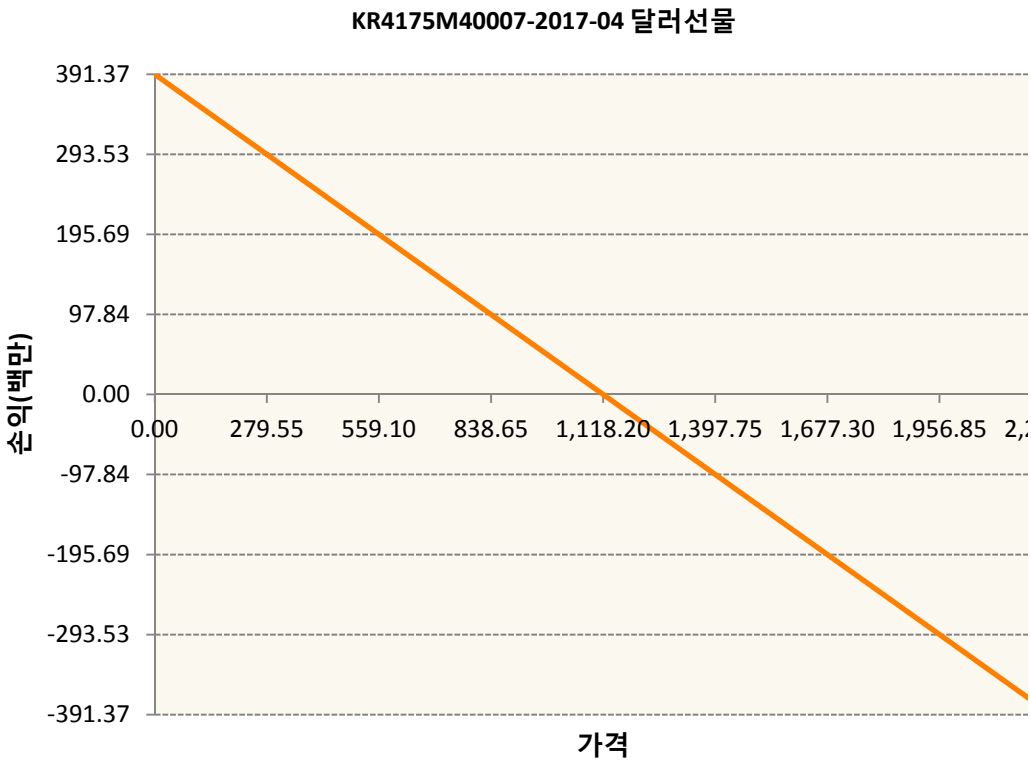


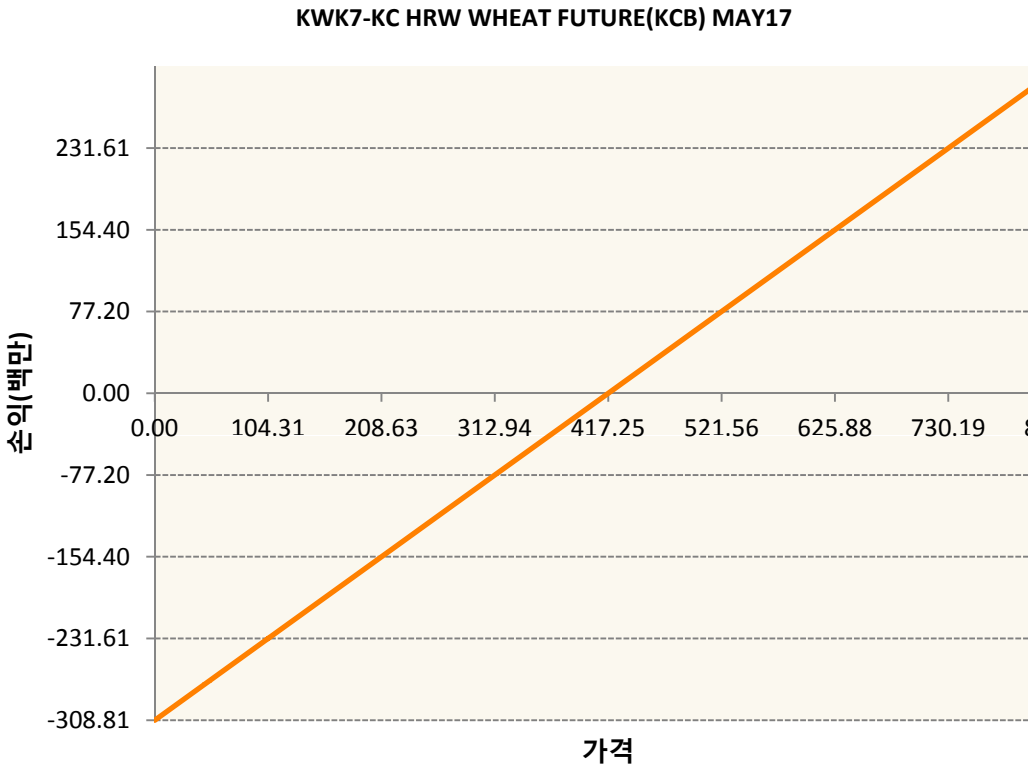

-1,754.48
-2,339.30
가격


CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
324.41
216.27
108.14
0.00
-108.14
-216.27
-324.41
-432.55
0.00
19.06
38.12
57.17
76.23
95.29
114.35
133.40
순익(백만)
가격

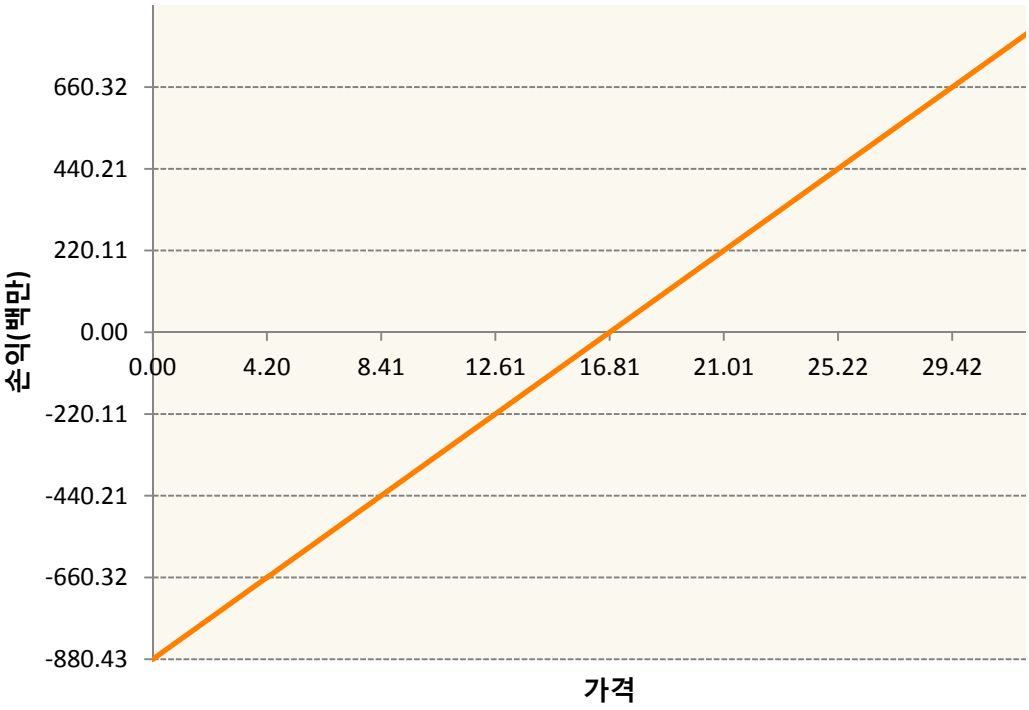

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
654.16
490.62
327.08
163.54
0.00
-163.54
-327.08
-490.62
-654.16
0.00
34.83
69.65
104.48
139.30
174.13
208.95
243.78
순익(백만)

가격

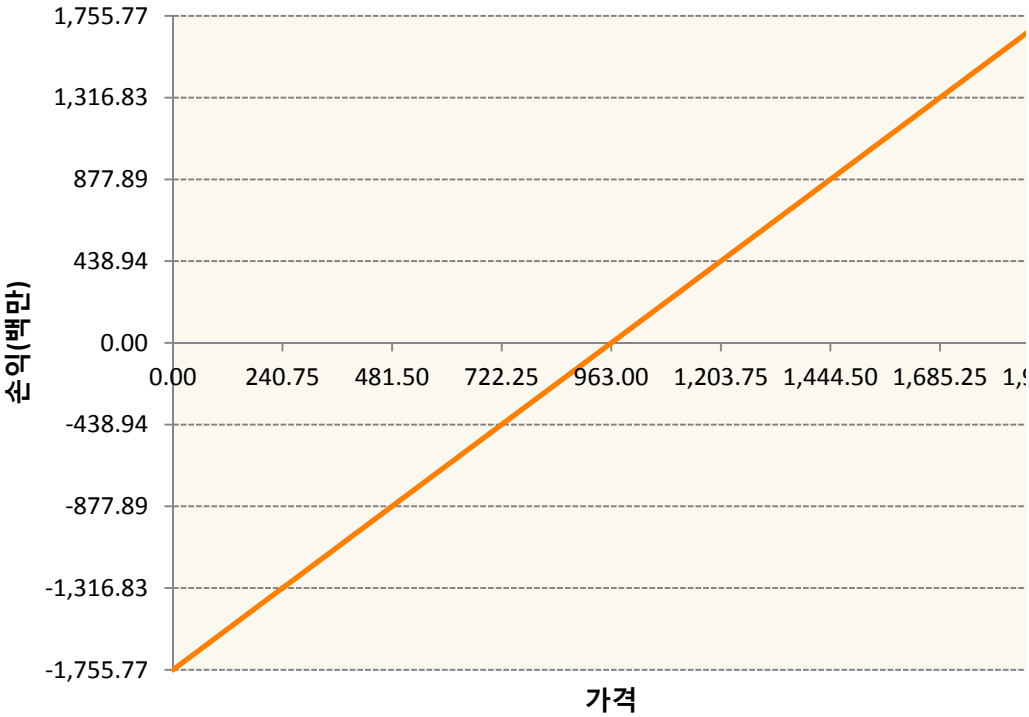

KR4175M40007-2017-04 달러선물
391.37
293.53
195.69
97.84
0.00
-97.84
-195.69
-293.53
-391.37
0.00
279.55
559.10
838.65
1,118.20
1,397.75
1,677.30
1,956.85
순이(백만)
가격


KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
231.61
154.40
77.20
0.00
-77.20
-154.40
-231.61
-308.81
0.00
104.31
208.63
312.94
417.25
521.56
625.88
730.19
순이(백만)
가격

SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17

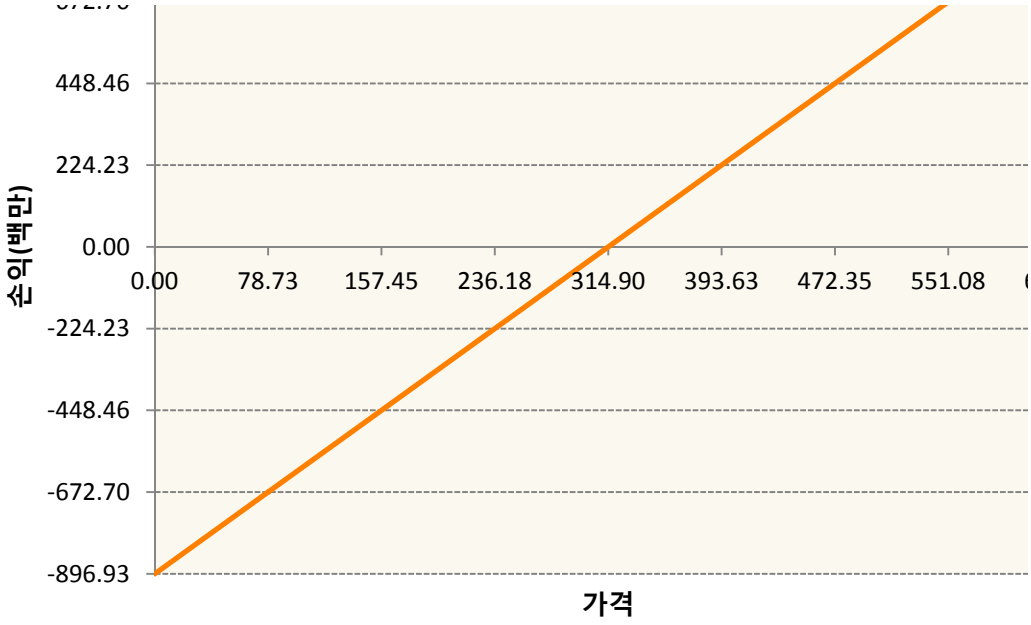


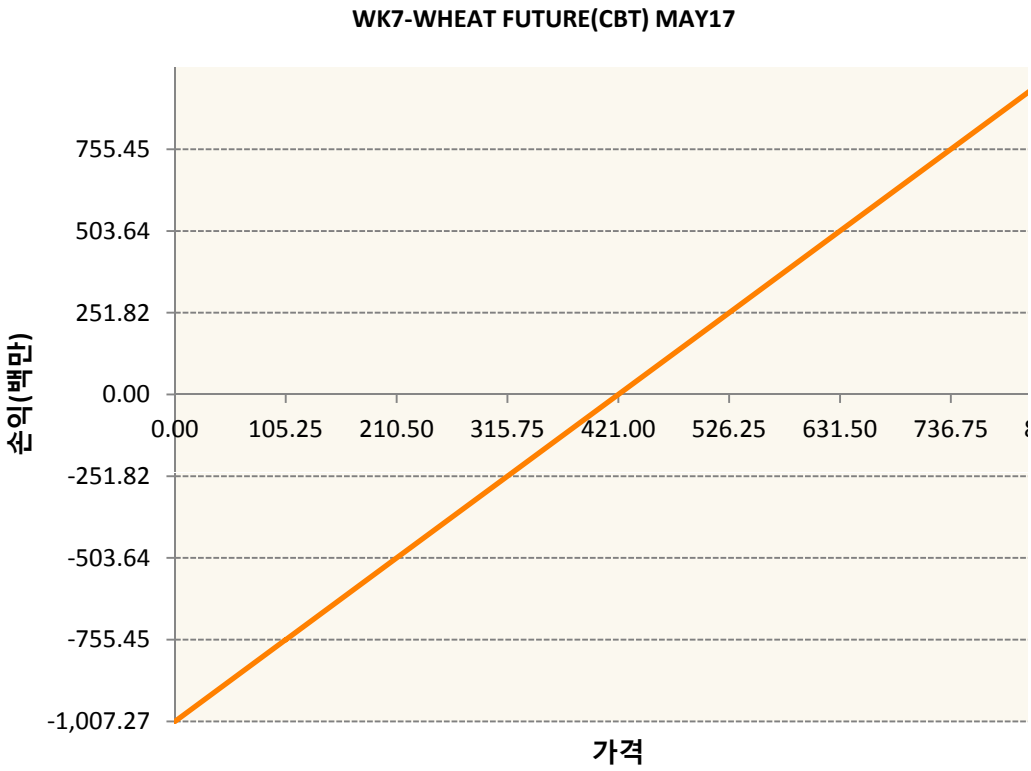
SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17



SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17







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	31

KWK7	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17	25
SBK7	Sugar #11 (WORLD) MAY17	70
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	140
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	72
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	81

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

827