공시일	2017-04-04
기준일	2017-04-03

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	2017-04-04
기준일	2017-04-03

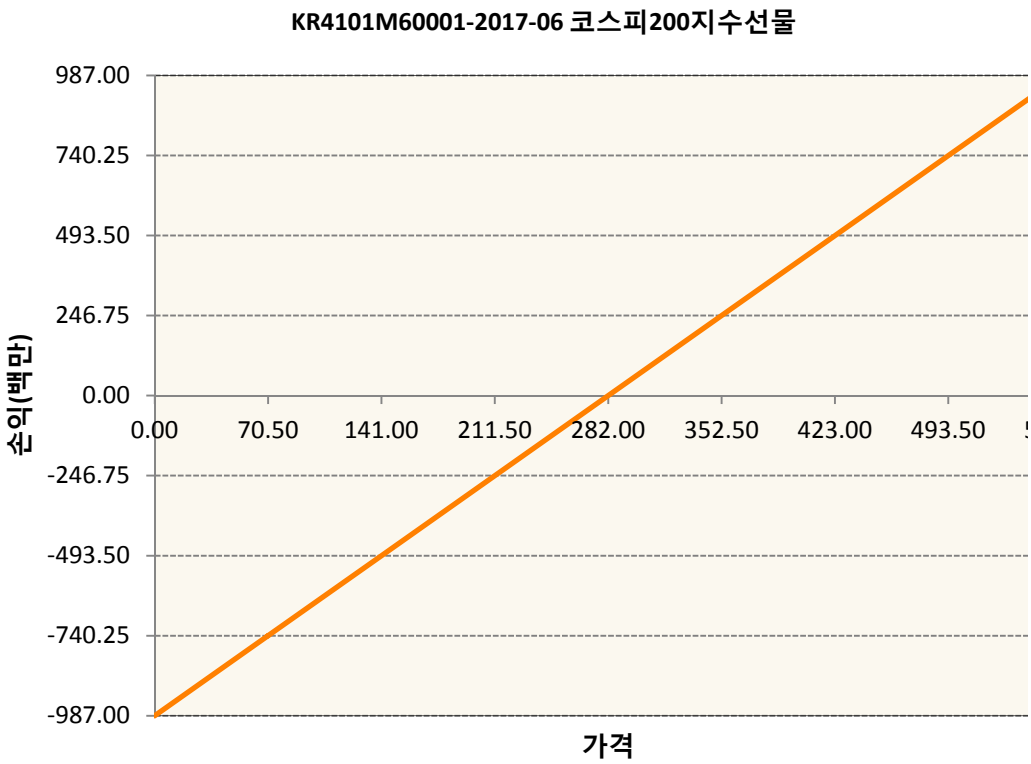
스마트인덱스모

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	987	0	987	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	2017-04-04
기준일	2017-04-03

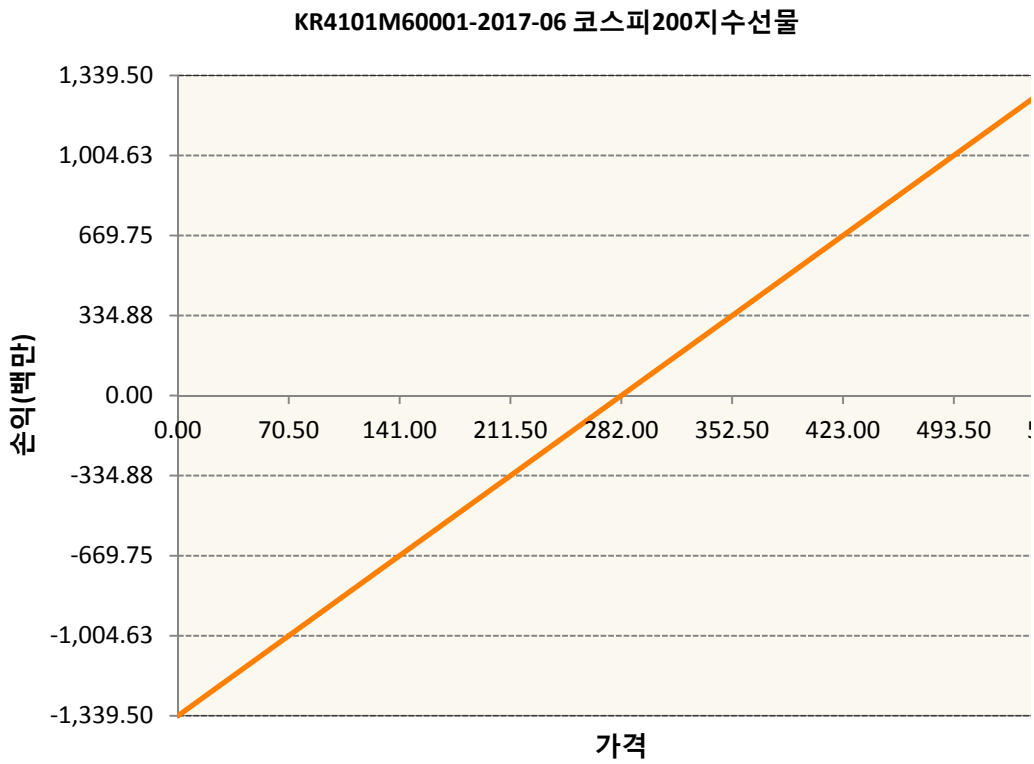
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	2017-04-04
기준일	2017-04-03

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	959

* 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	2017-04-04
기준일	2017-04-03

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	2017-04-04
기준일	2017-04-03

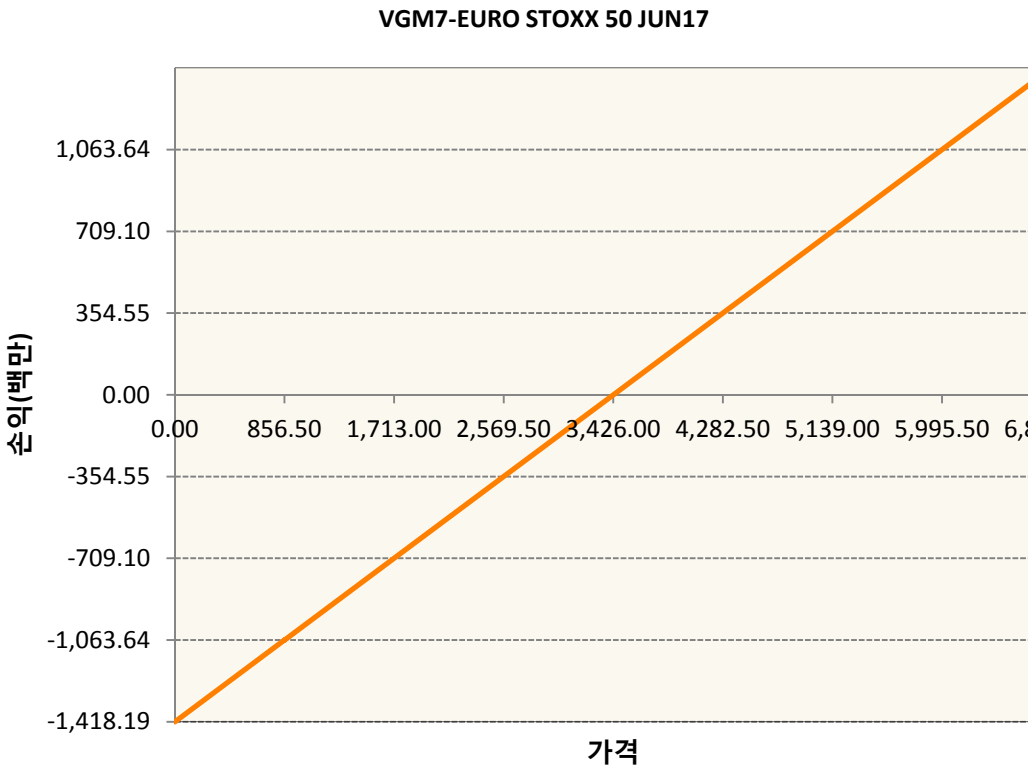
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,418	0	1,418	

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	2017-04-04
기준일	2017-04-03

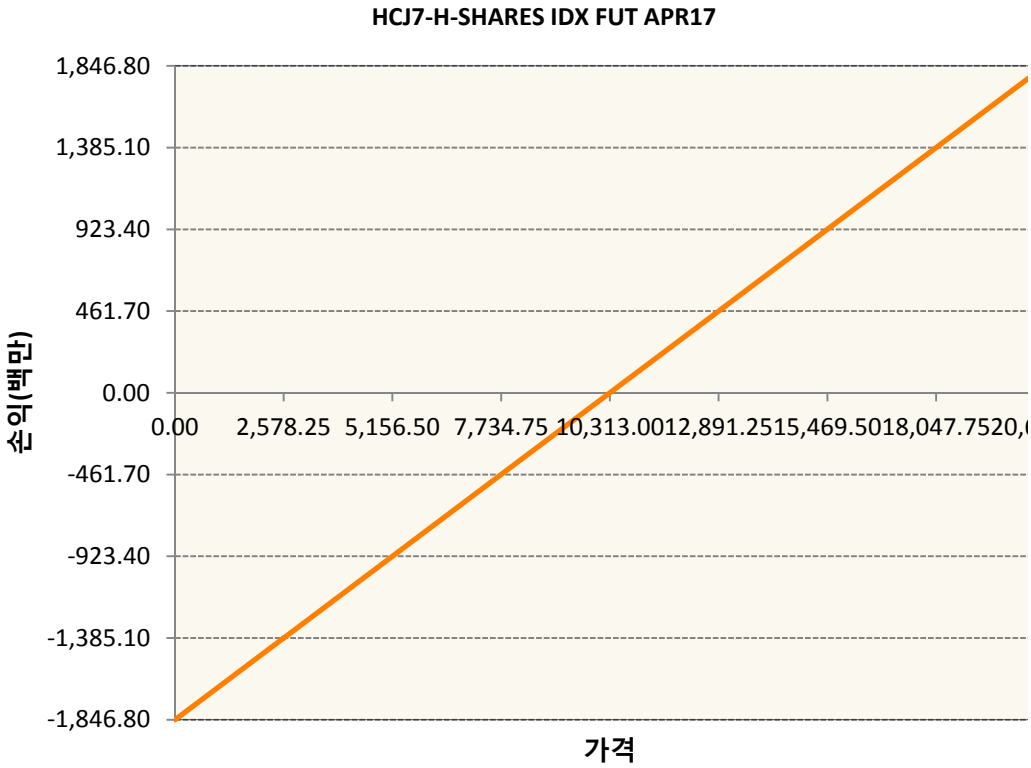
차이나인덱스모(주식-파생형)

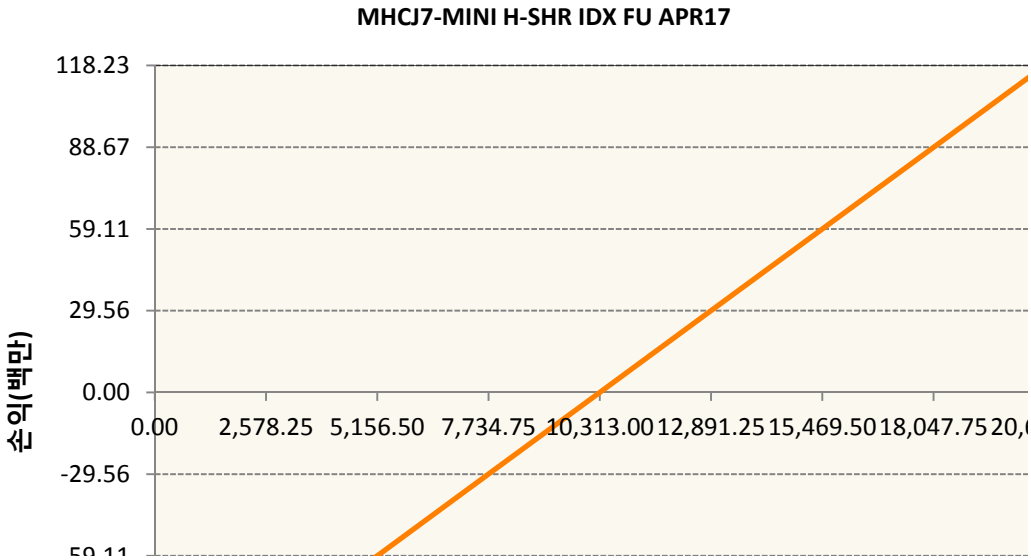
1. 계약금액

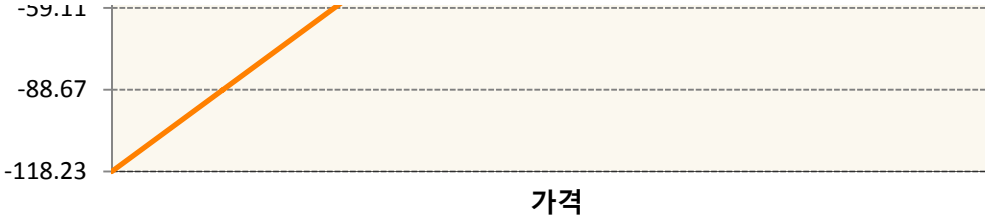
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,965	0	1,965	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ7	H-SHARES IDX FUT APR17	148
MHCJ7	MINI H-SHR IDX FU APR17	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	168

공시일	2017-04-04
기준일	2017-04-03

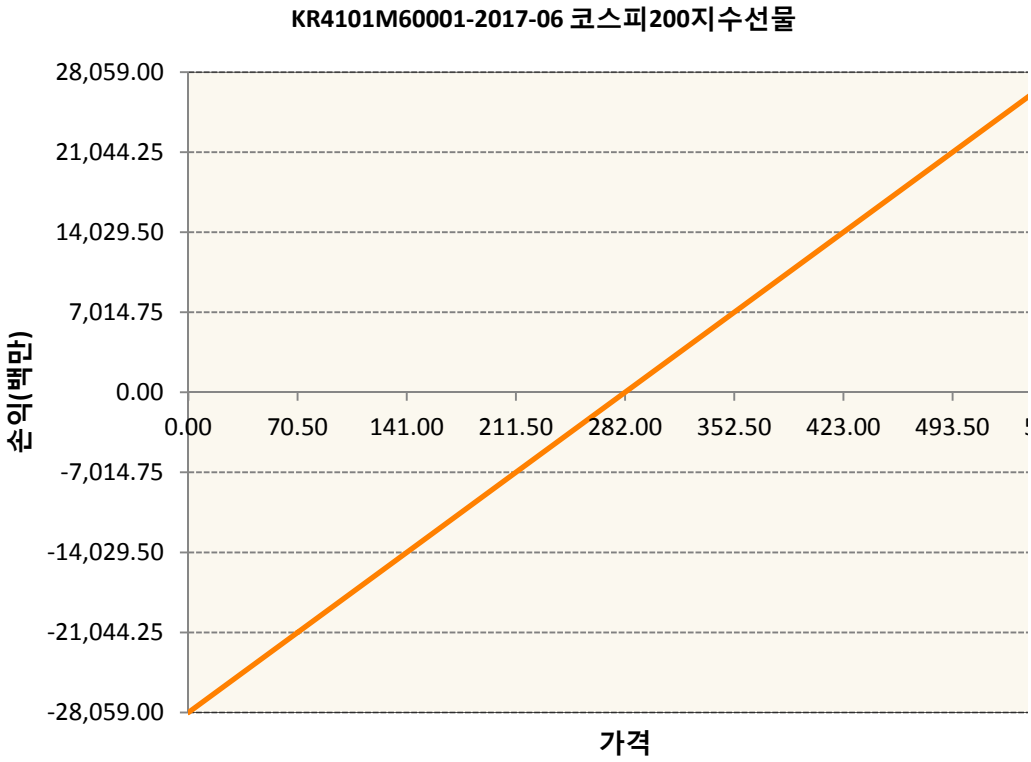
커버드콜모(주식혼합-파생형)

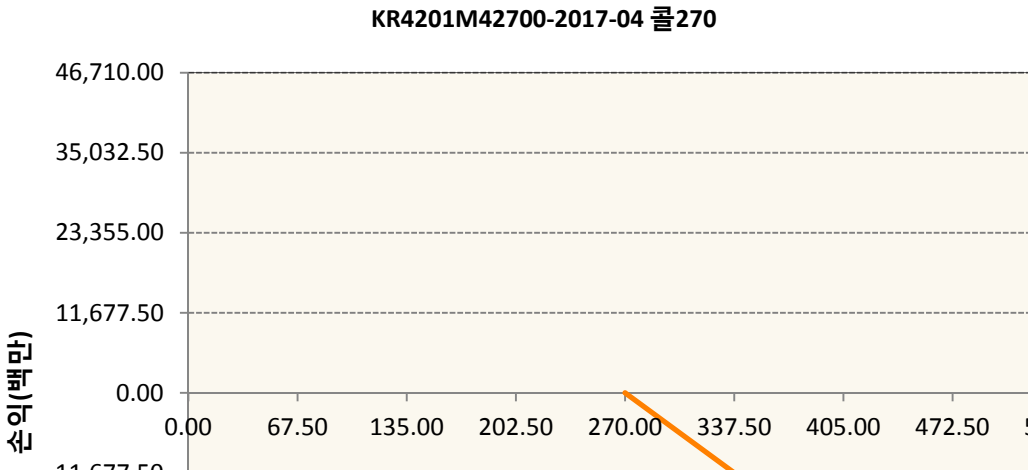
1. 계약금액

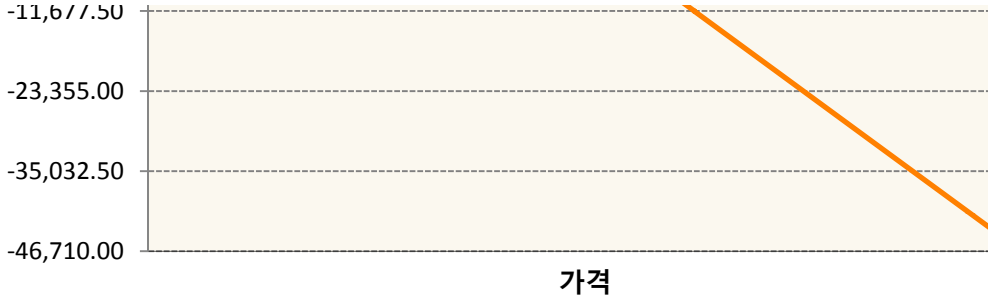
(단위:백만원)

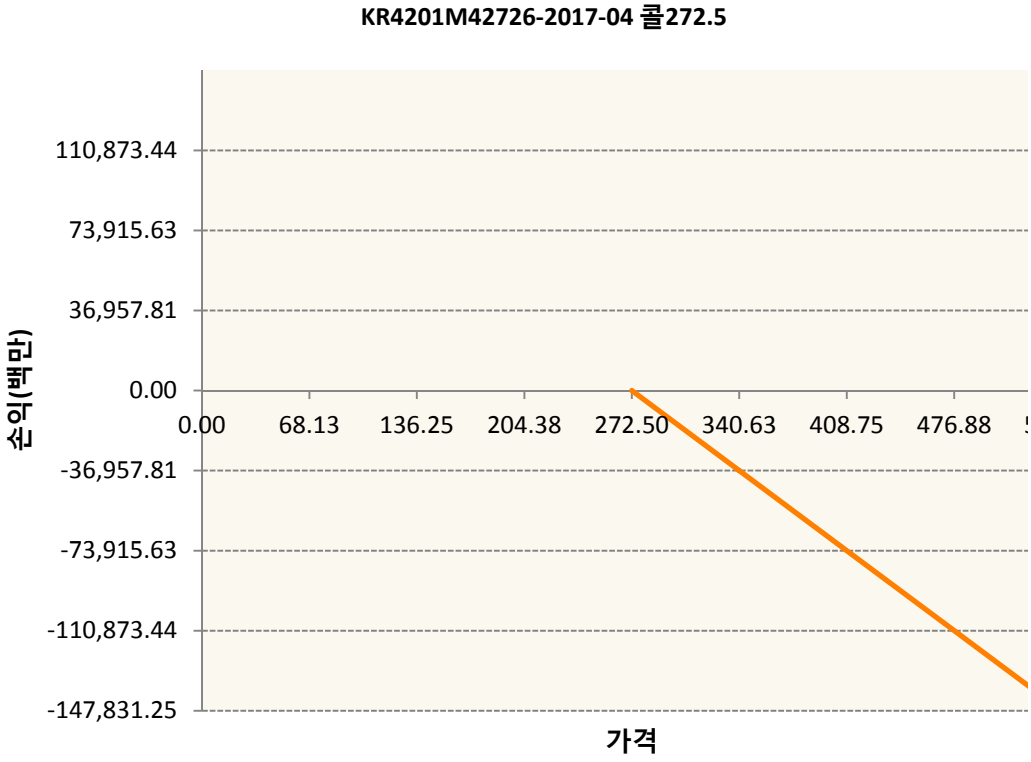
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	2,538	-2,538	장내
신규	유가증권	옵션	2,371	0	2,371	장내
누계	유가증권	선물	28,059	0	28,059	장내
누계	유가증권	옵션	0	194,541	-194,541	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							2,242
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,242	-2,242	-2,242	-2,242	-2,242	-2,242	-2,242
-5.33%	-1,494	-1,494	-1,494	-1,494	-1,494	-1,494	-1,494
-2.67%	-747	-747	-747	-747	-747	-747	-747
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	747	747	747	747	747	747	747
5.33%	1,494	1,494	1,494	1,494	1,494	1,494	1,494
8.00%	2,242	2,242	2,242	2,242	2,242	2,242	2,242
KR4201M42 2017-04 콜270							3,893
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,005	2,005	2,004	2,003	2,001	1,998	1,994
-5.33%	1,952	1,935	1,916	1,896	1,875	1,853	1,831
-2.67%	1,262	1,247	1,230	1,212	1,192	1,172	1,151
0%	2	2	1	0	-2	-5	-9
2.67%	-1,296	-1,296	-1,296	-1,296	-1,296	-1,296	-1,297
5.33%	-2,595	-2,595	-2,595	-2,595	-2,595	-2,595	-2,595
8.00%	-3,893	-3,893	-3,893	-3,893	-3,893	-3,893	-3,893
KR4201M42 2017-04 콜272.5							12,185

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,955	4,955	4,955	4,954	4,952	4,949	4,944
-5.33%	4,919	4,895	4,865	4,830	4,789	4,744	4,695
-2.67%	3,682	3,603	3,523	3,442	3,360	3,278	3,195
0%	27	21	13	0	-17	-39	-65
2.67%	-4,041	-4,041	-4,041	-4,042	-4,042	-4,043	-4,045
5.33%	-8,113	-8,113	-8,113	-8,113	-8,113	-8,113	-8,113
8.00%	-12,185	-12,185	-12,185	-12,185	-12,185	-12,185	-12,185

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

19,544

공시일	2017-04-04
기준일	2017-04-03

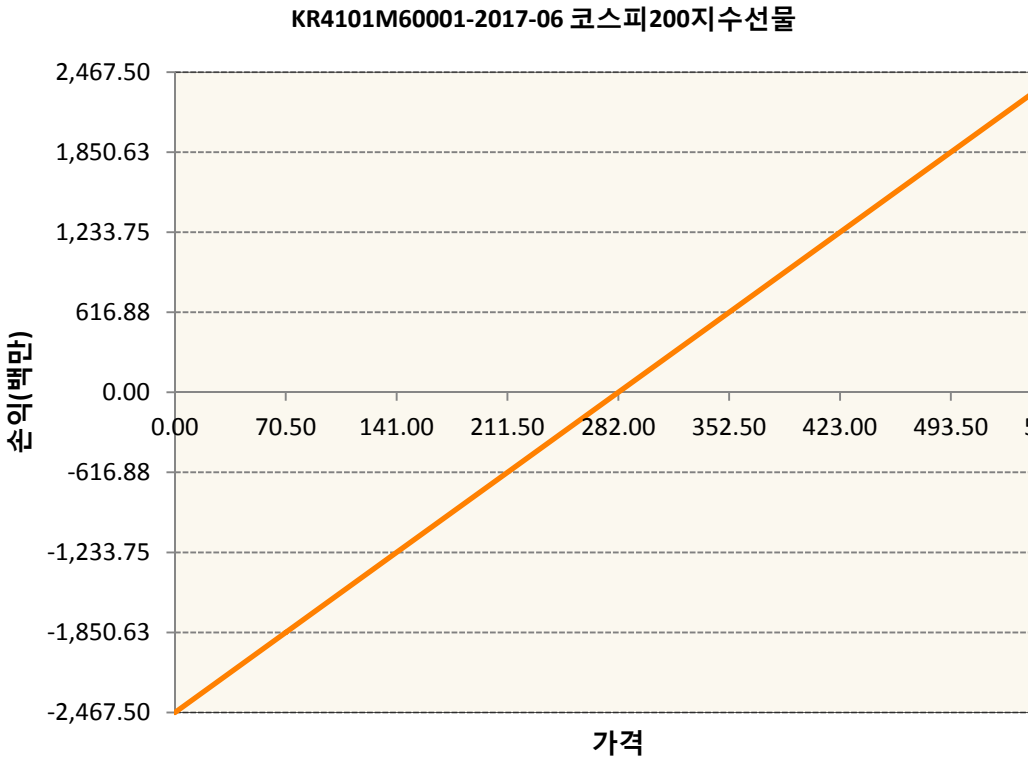
커버드콜목표전환형증권투자신탁

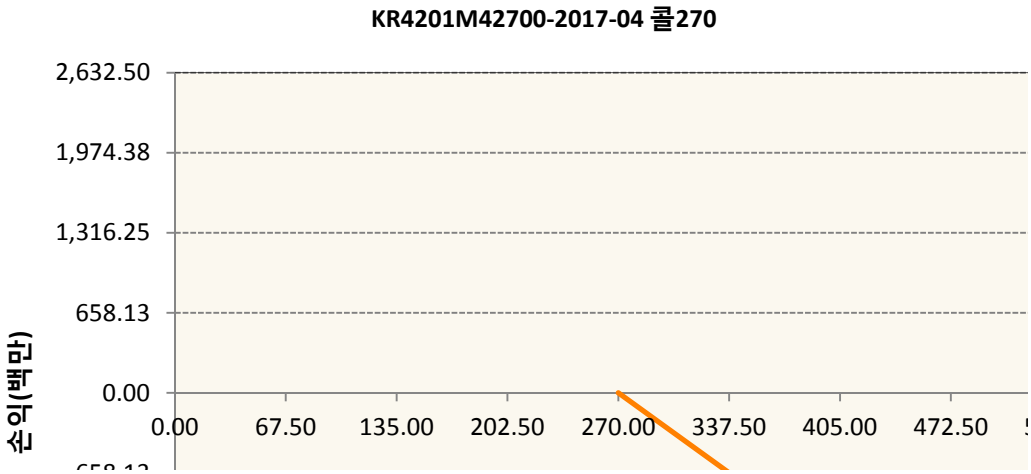
1. 계약금액

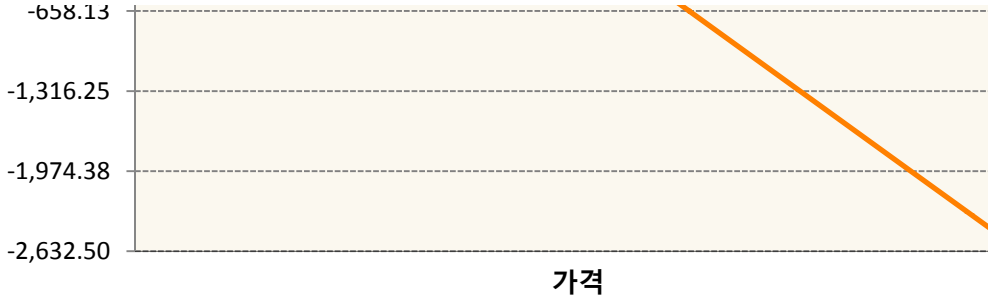
(단위:백만원)

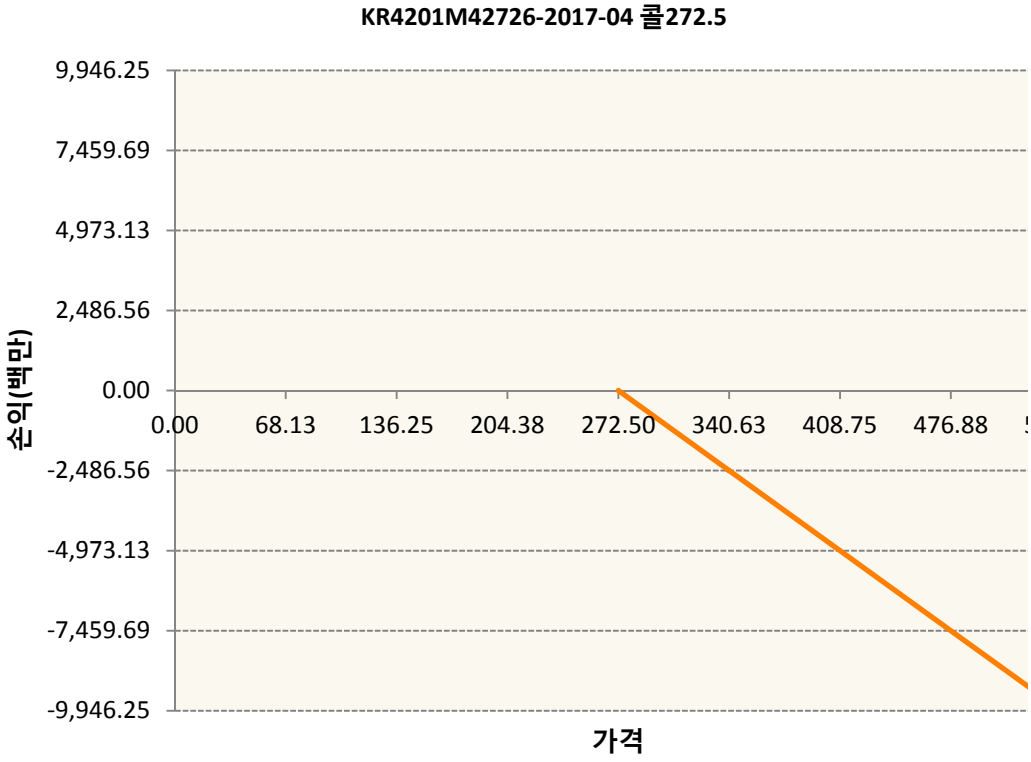
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	2,468	-2,468	장내
신규	유가증권	옵션	2,262	0	2,262	장내
누계	유가증권	선물	2,468	0	2,468	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,579	-12,579	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							197
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197
-5.33%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-2.67%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	66	66	66	66	66	66	66
5.33%	131	131	131	131	131	131	131
8.00%	197	197	197	197	197	197	197
KR4201M42 2017-04 콜270							219
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	113	113	113	113	113	113	112
-5.33%	110	109	108	107	106	104	103
-2.67%	71	70	69	68	67	66	65
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73
5.33%	-146	-146	-146	-146	-146	-146	-146
8.00%	-219	-219	-219	-219	-219	-219	-219
	KR4201M42 2017-04 콜272.5						820

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	333	333	333	333	333	333	333
-5.33%	331	329	327	325	322	319	316
-2.67%	248	242	237	232	226	221	215
0%	2	1	1	0	-1	-3	-4
2.67%	-272	-272	-272	-272	-272	-272	-272
5.33%	-546	-546	-546	-546	-546	-546	-546
8.00%	-820	-820	-820	-820	-820	-820	-820

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

1,300

공시일	2017-04-04
기준일	2017-04-03

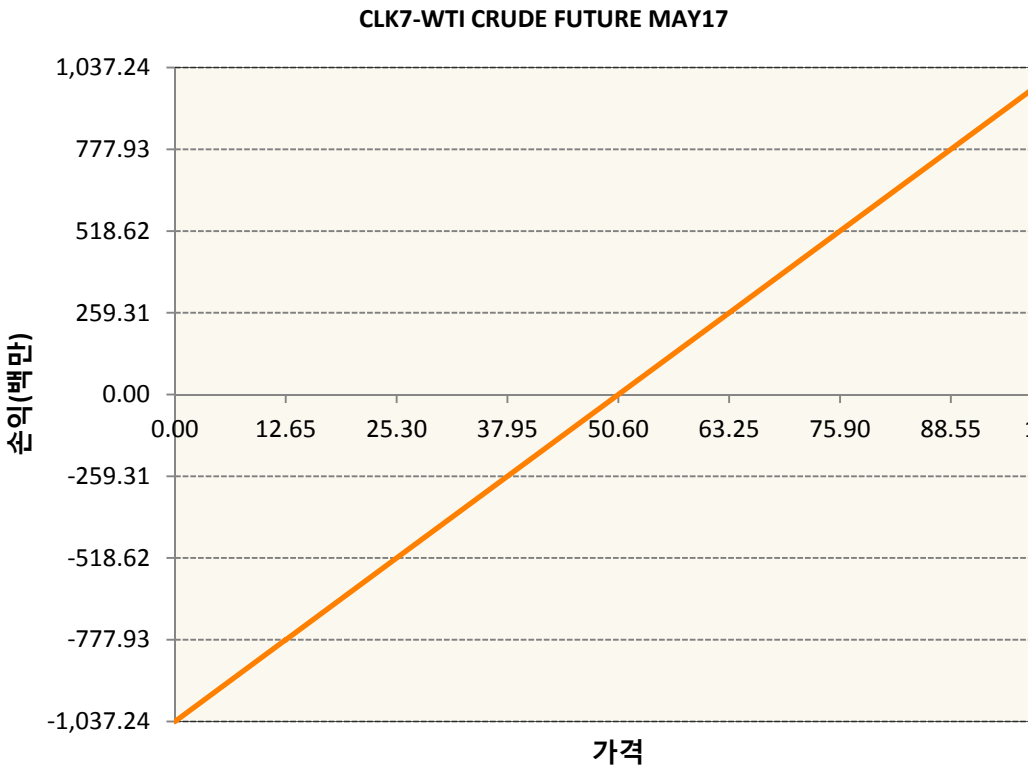
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

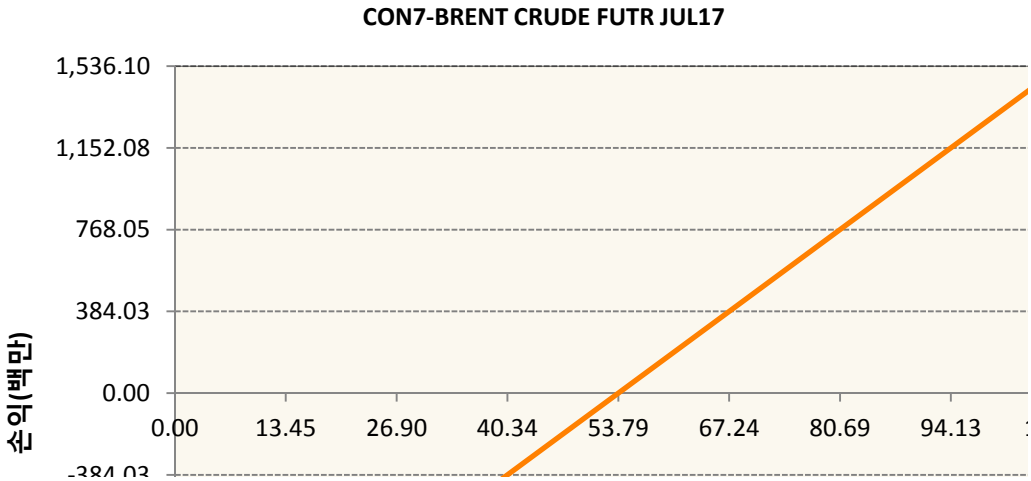
1. 계약금액

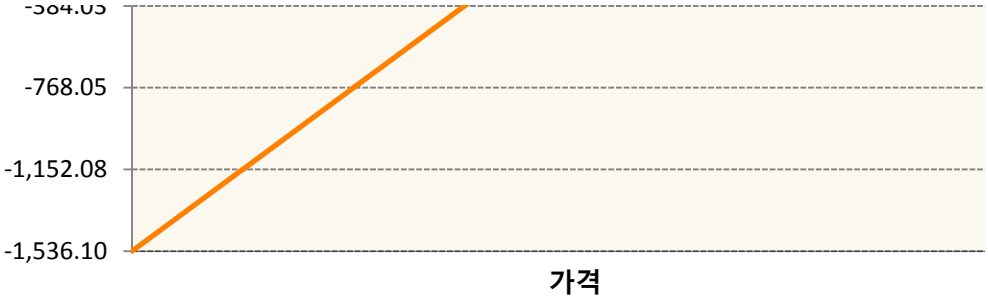
(단위:백만원)

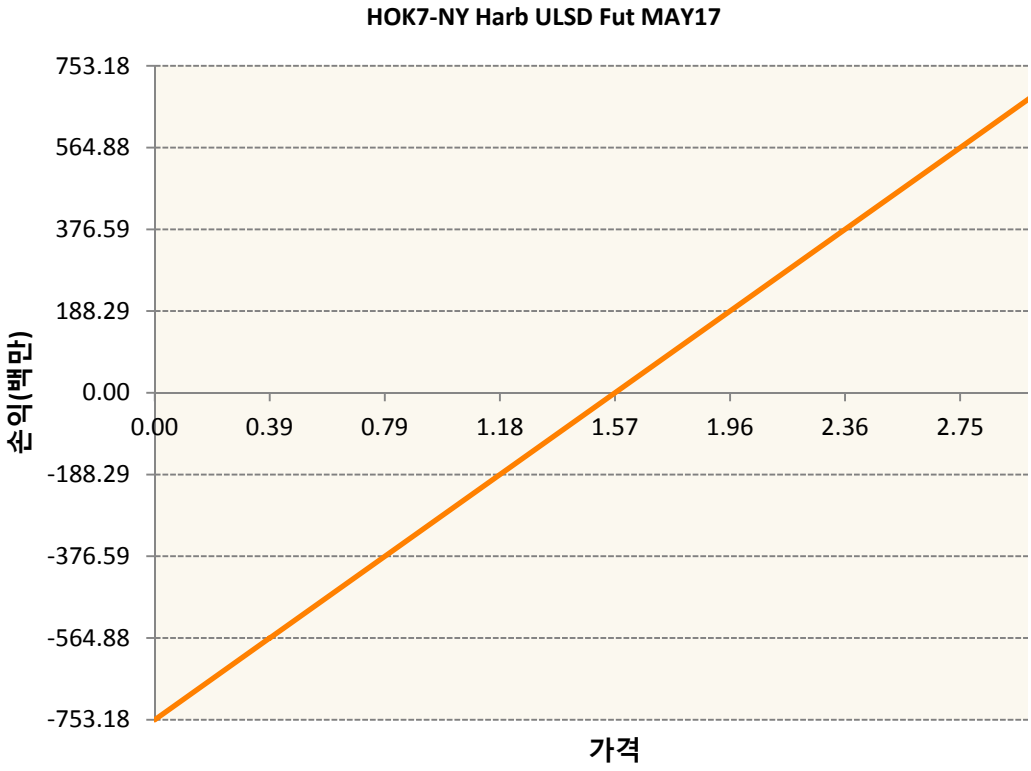
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,037	0	1,037	
누계	유가증권	선물	4,742	402	4,341	

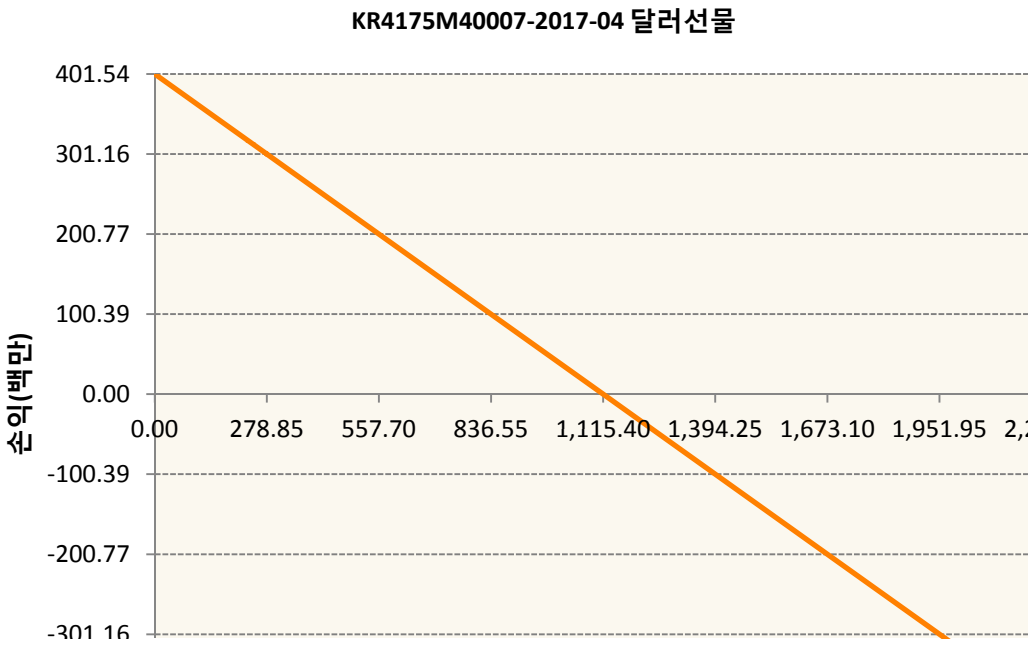
2. 만기시점의 손익구조

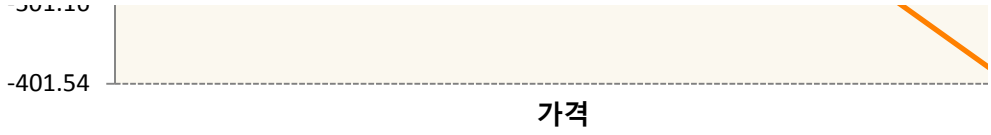


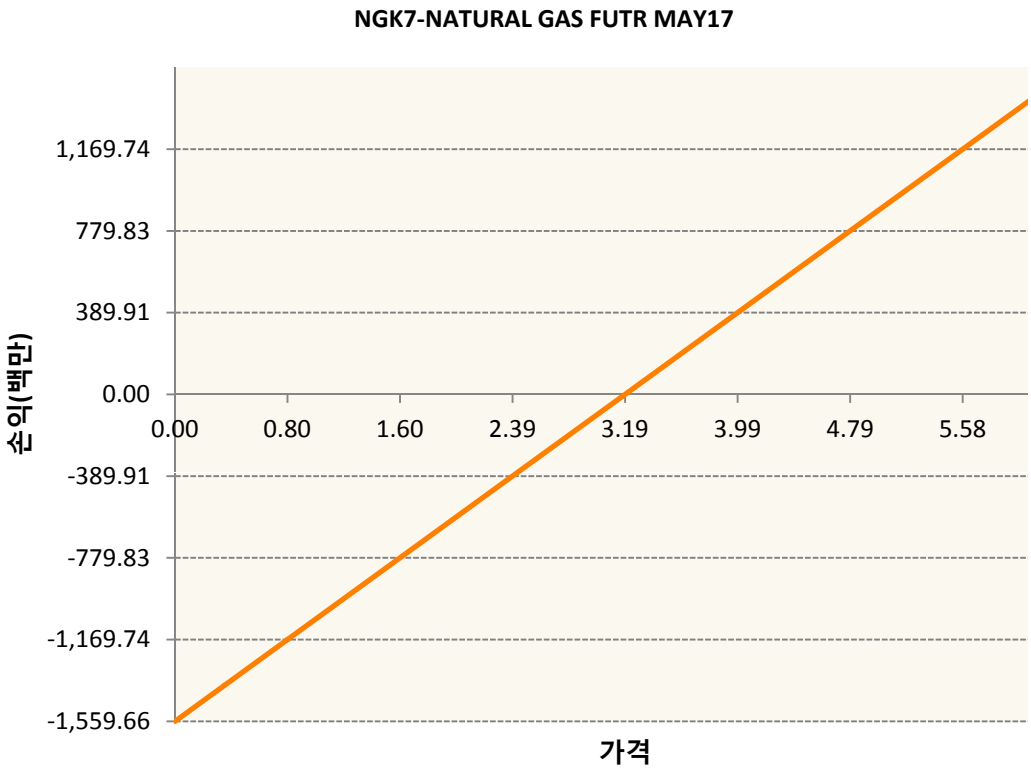


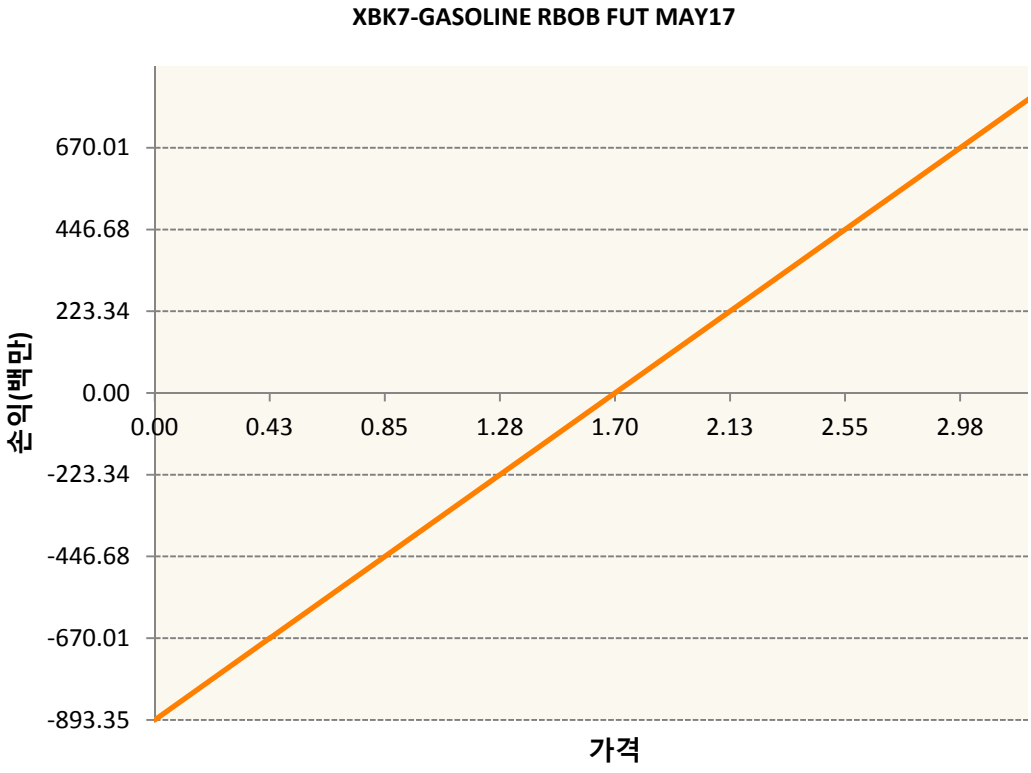

-768.05
-1,152.08
-1,536.10
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
753.18
564.88
376.59
188.29
0.00
-188.29
-376.59
-564.88
-753.18
0.00
0.39
0.79
1.18
1.57
1.96
2.36
2.75
순익(백만)
가격


KR4175M40007-2017-04 달러선물
401.54
301.16
200.77
100.39
0.00
-100.39
-200.77
0.00
278.85
557.70
836.55
1,115.40
1,394.25
1,673.10
1,951.95
순익(백만)


-401.54
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,169.74
779.83
389.91
0.00
-389.91
-779.83
-1,169.74
-1,559.66
0.00
0.80
1.60
2.39
3.19
3.99
4.79
5.58
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
670.01
446.68
223.34
0.00
-223.34
-446.68
-670.01
-893.35
0.00
0.43
0.85
1.28
1.70
2.13
2.55
2.98
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK7	WTI CRUDE FUTURE MAY17	83
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	123
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)

1,018

공시일	2017-04-04
기준일	2017-04-03

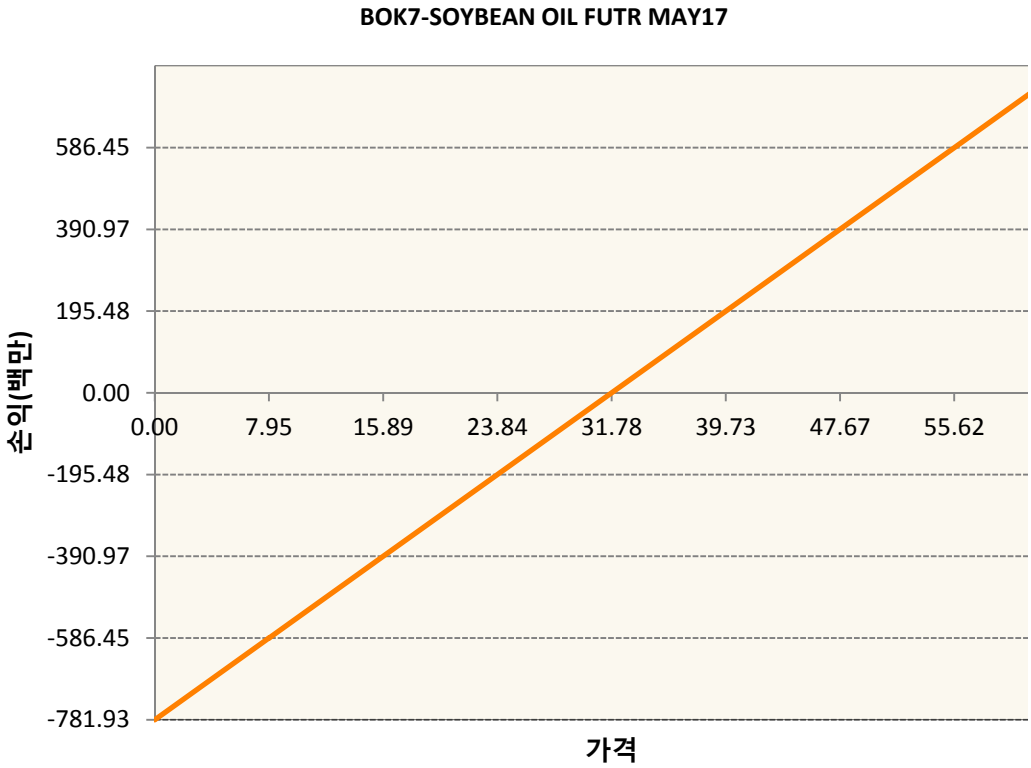
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

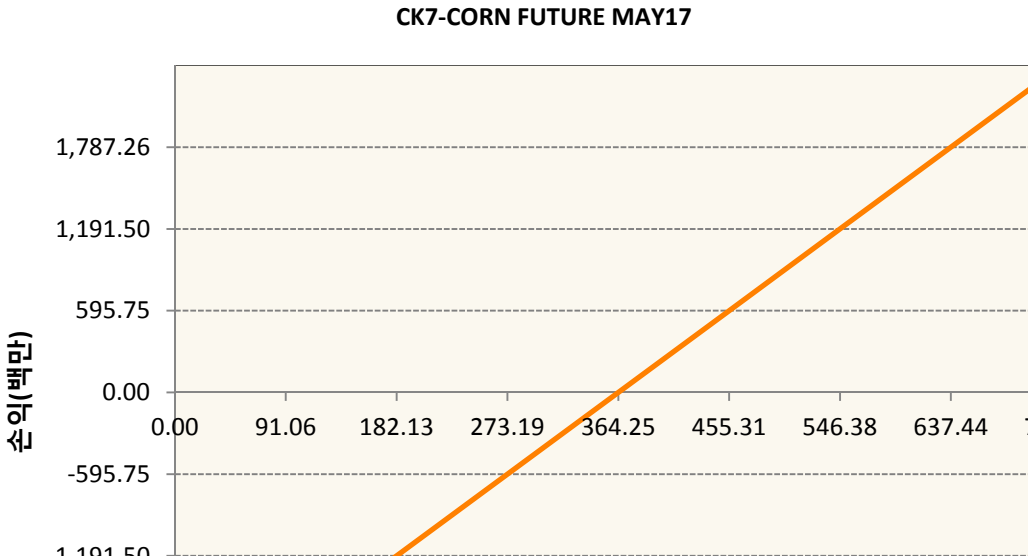
1. 계약금액

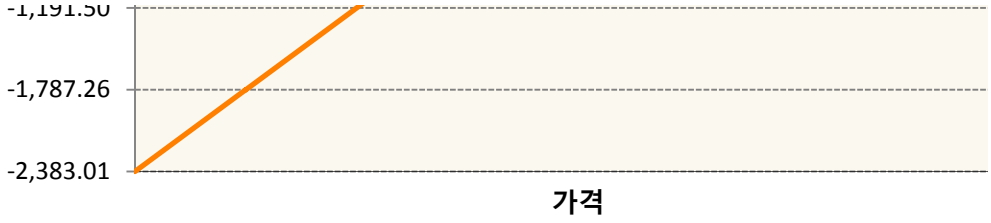
(단위:백만원)

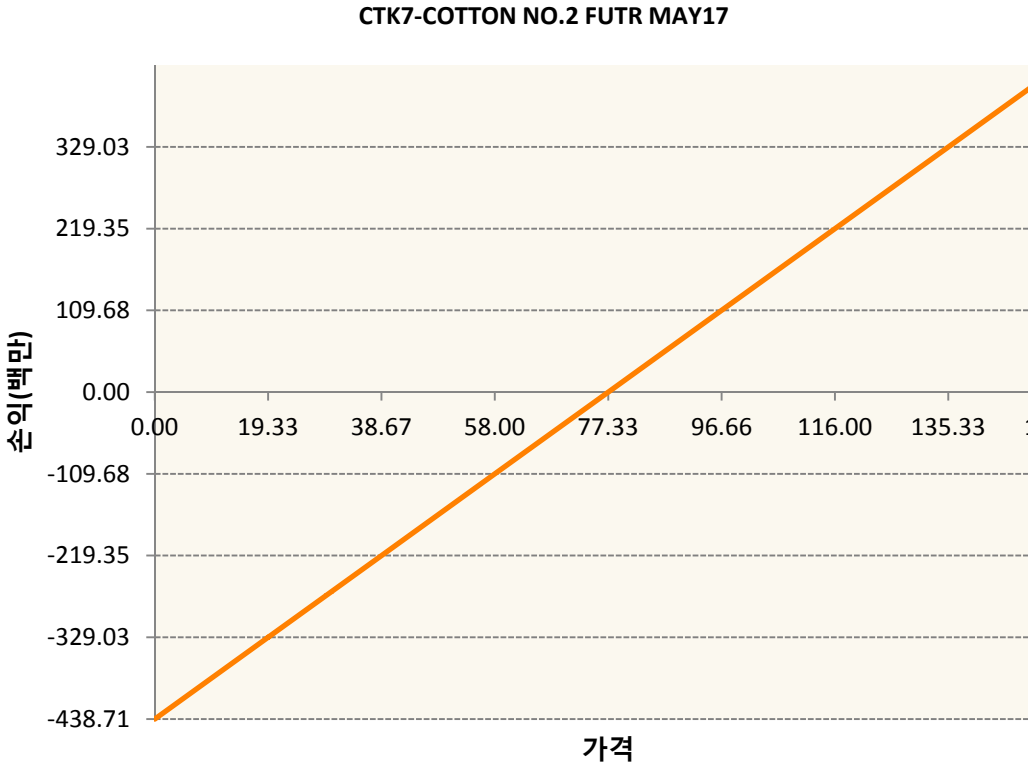
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,073	390	8,683	

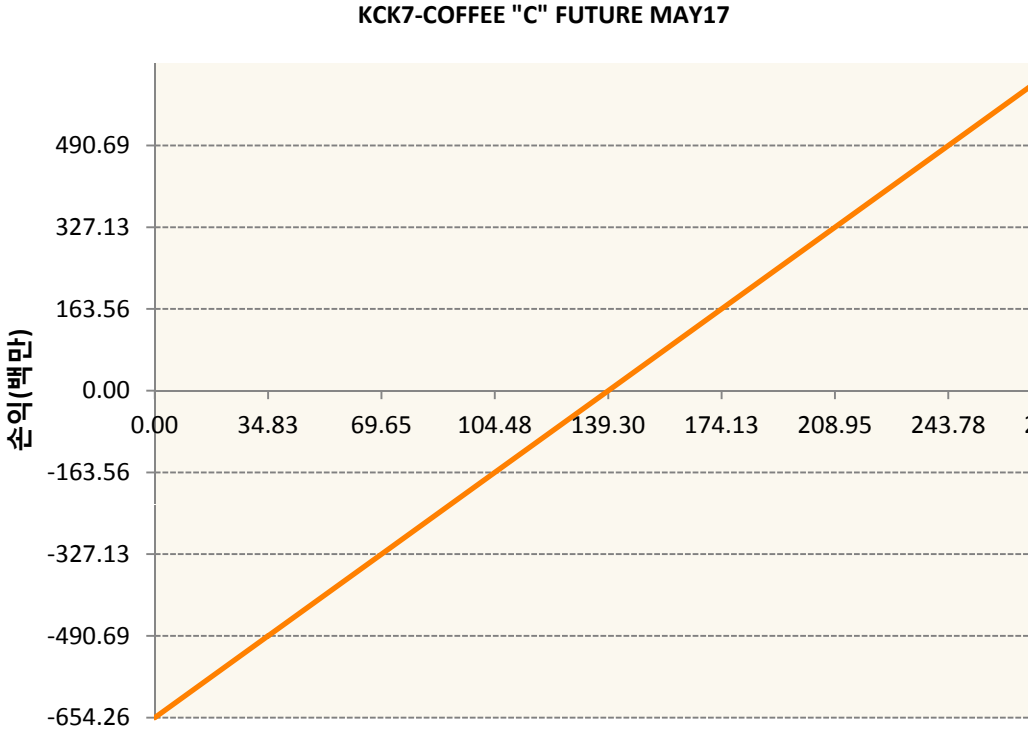
2. 만기시점의 손익구조



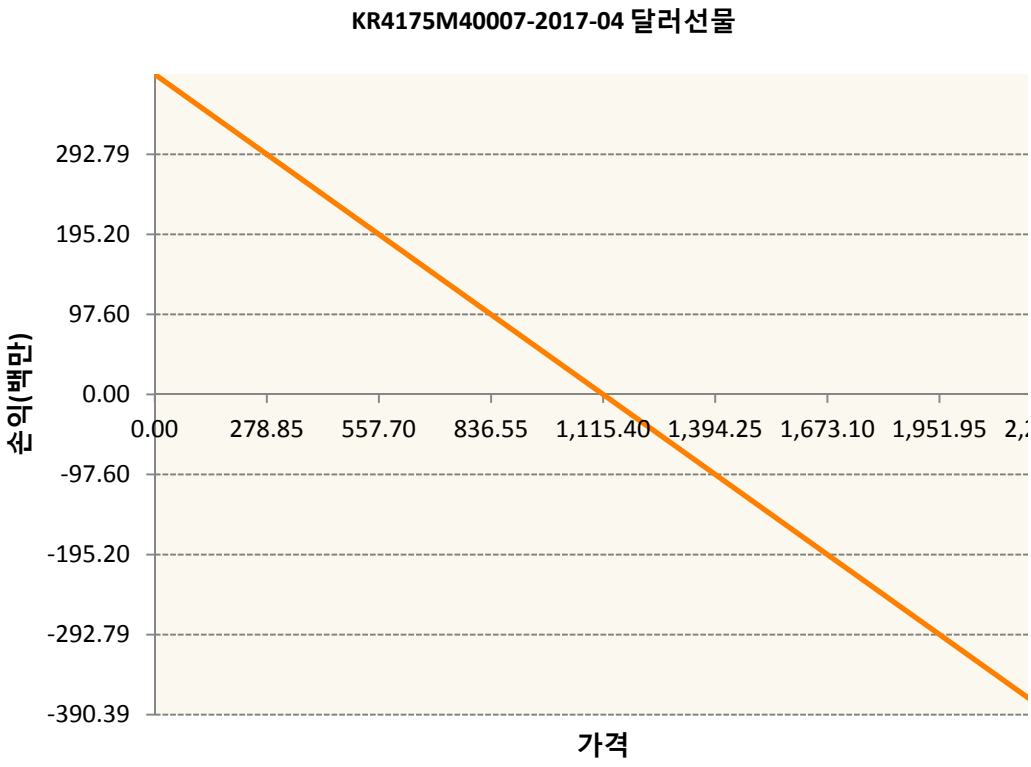


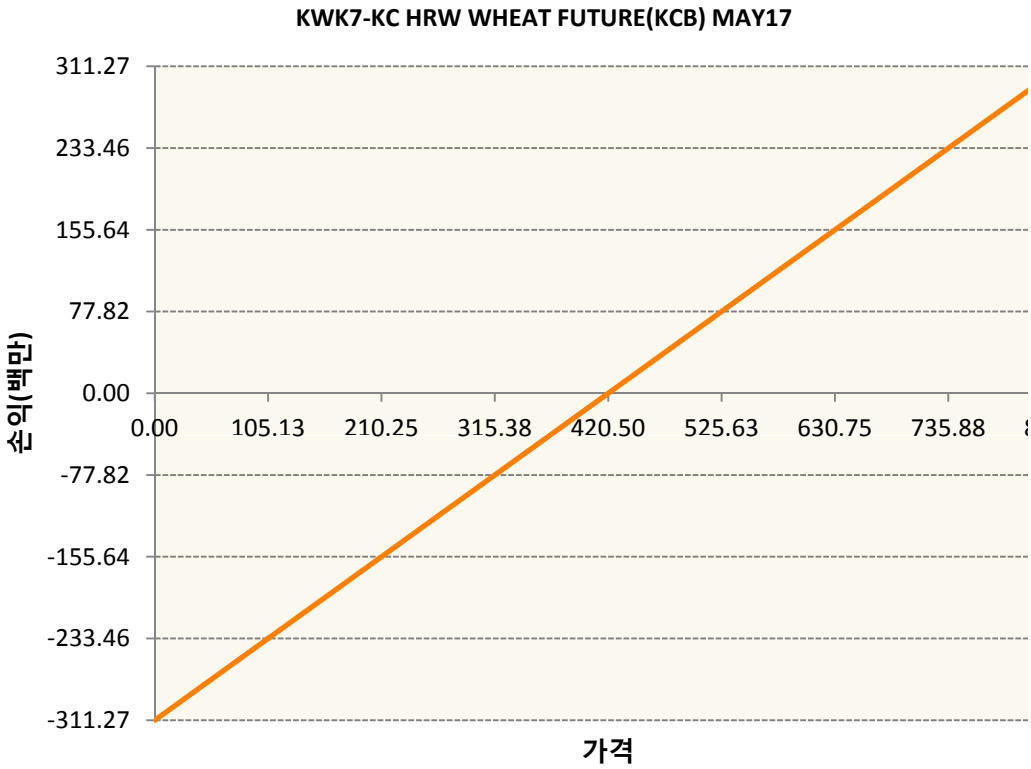

-1,787.26
-2,383.01
가격

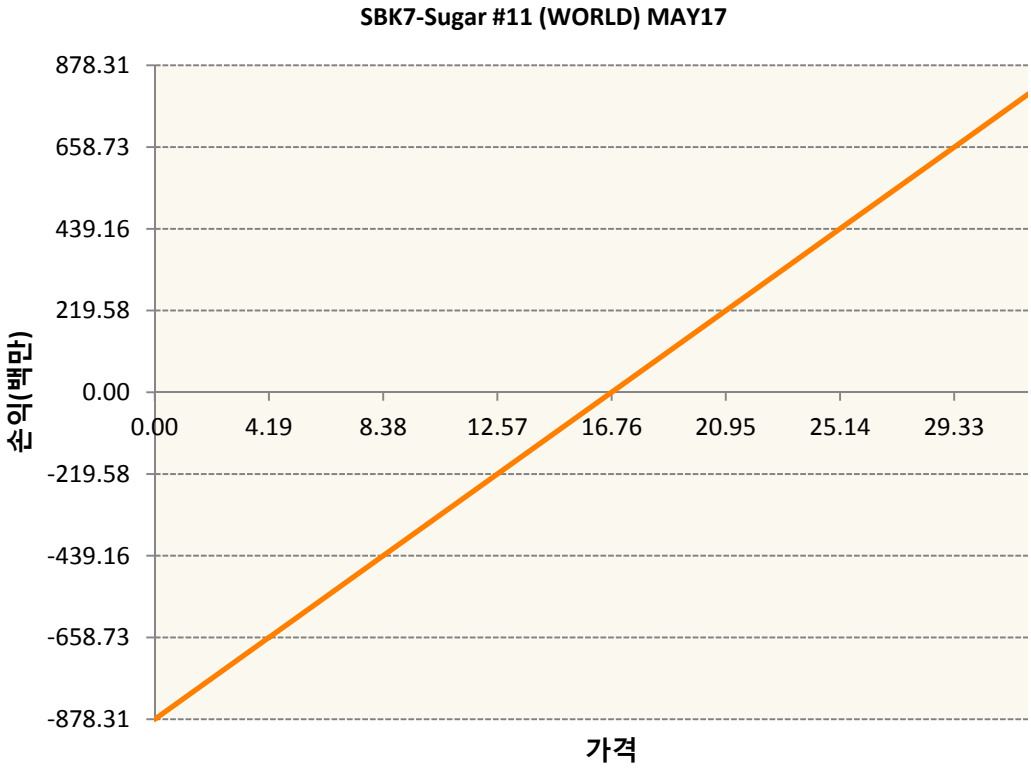

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
329.03
219.35
109.68
0.00
-109.68
-219.35
-329.03
-438.71
0.00
19.33
38.67
58.00
77.33
96.66
116.00
135.33
순익(백만)
가격

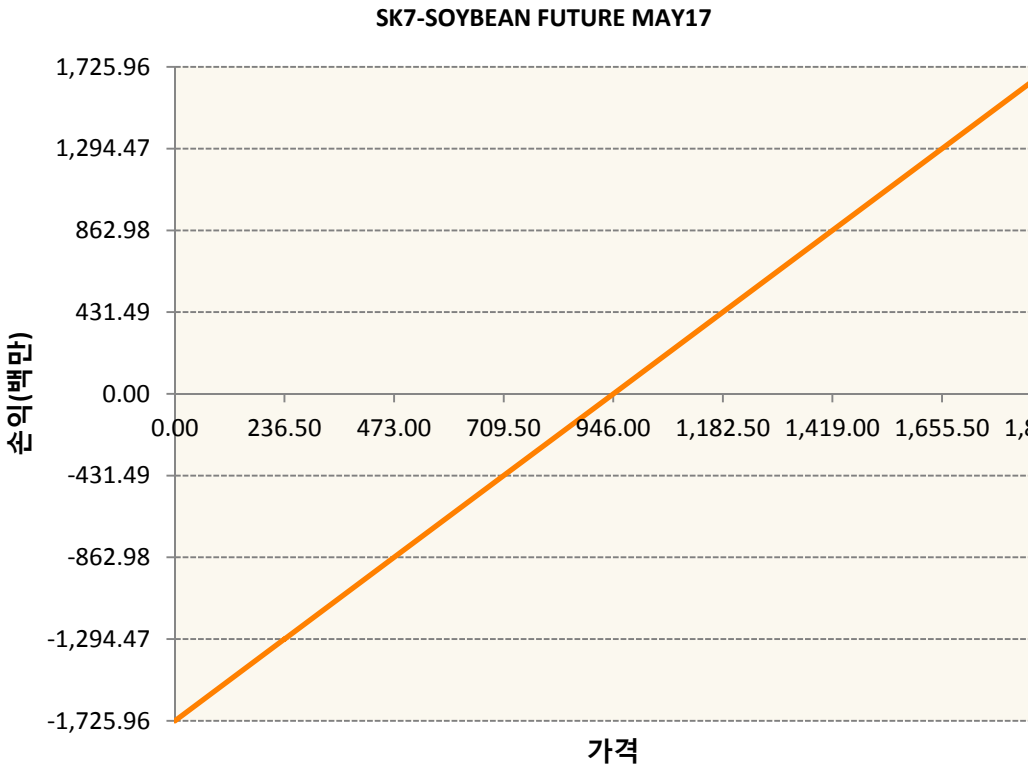

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
490.69
327.13
163.56
0.00
-163.56
-327.13
-490.69
-654.26
0.00
34.83
69.65
104.48
139.30
174.13
208.95
243.78
순익(백만)

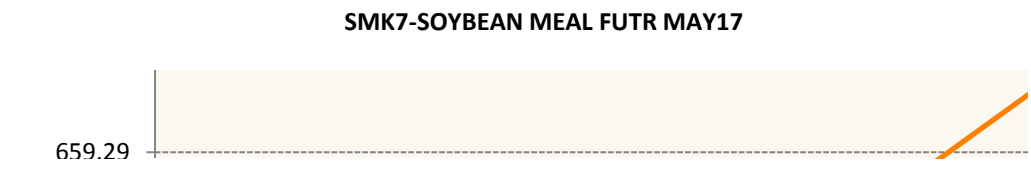
가격

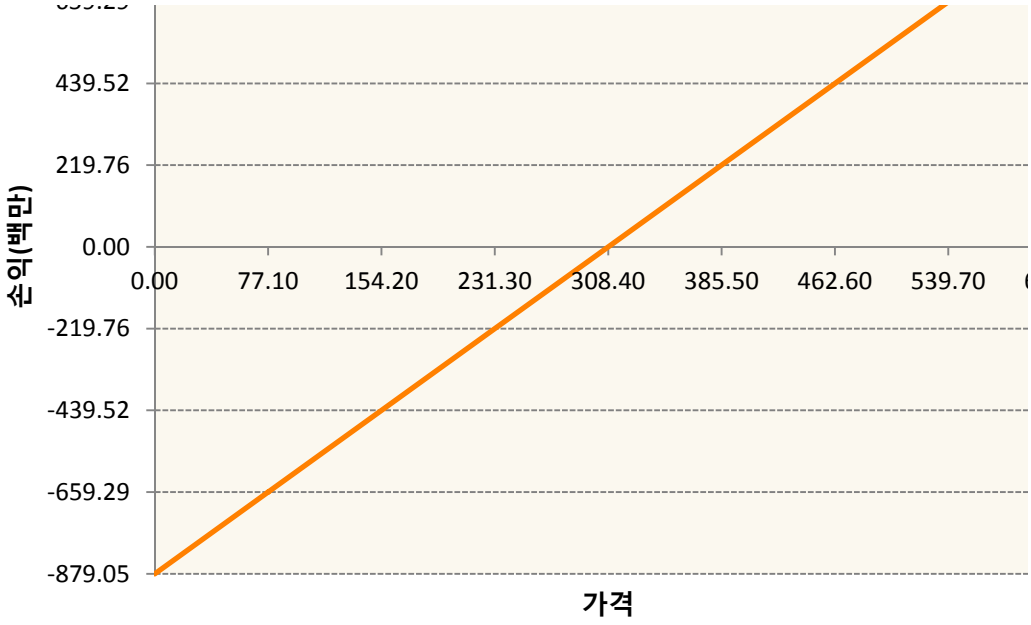

KR4175M40007-2017-04 달러선물
292.79
195.20
97.60
0.00
-97.60
-195.20
-292.79
-390.39
0.00
278.85
557.70
836.55
1,115.40
1,394.25
1,673.10
1,951.95
손익(백만)
가격

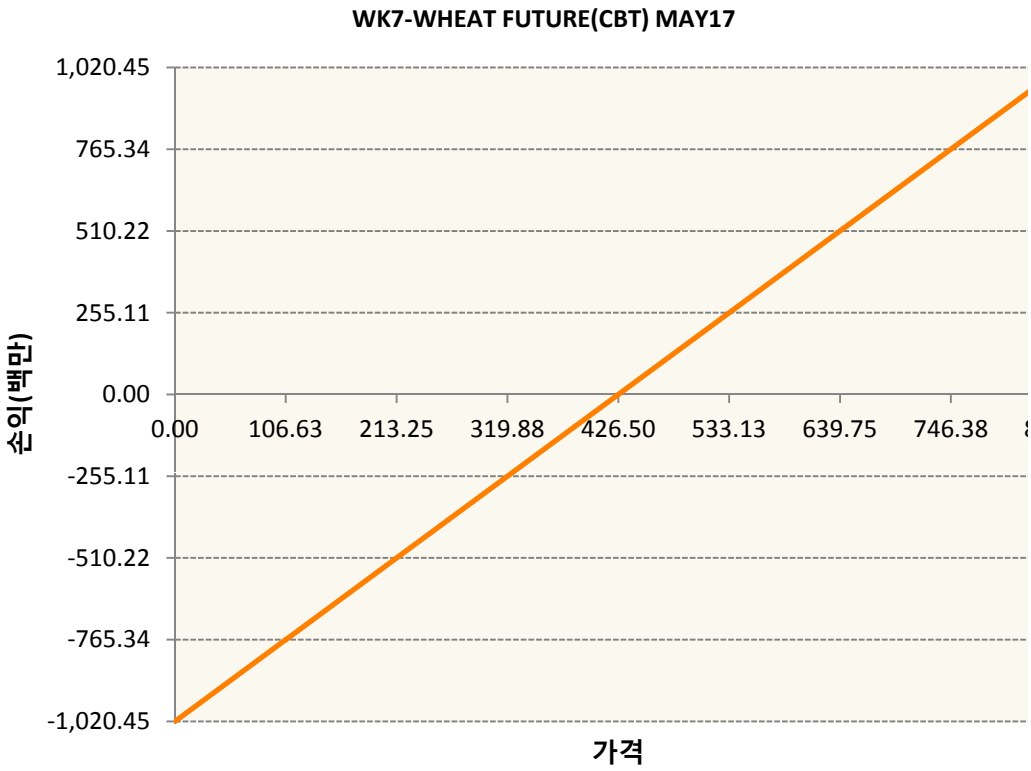

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
311.27
233.46
155.64
77.82
0.00
-77.82
-155.64
-233.46
-311.27
0.00
105.13
210.25
315.38
420.50
525.63
630.75
735.88
손익(백만)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
878.31
658.73
439.16
219.58
0.00
-219.58
-439.16
-658.73
-878.31
0.00
4.19
8.38
12.57
16.76
20.95
25.14
29.33
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,725.96
1,294.47
862.98
431.49
0.00
-431.49
-862.98
-1,294.47
-1,725.96
0.00
236.50
473.00
709.50
946.00
1,182.50
1,419.00
1,655.50
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
659.29





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	63
CK7	CORN FUTURE MAY17	191
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	138
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	70
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	82

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

830