공시일	2017-04-05
기준일	2017-04-04

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	2017-04-05
기준일	2017-04-04

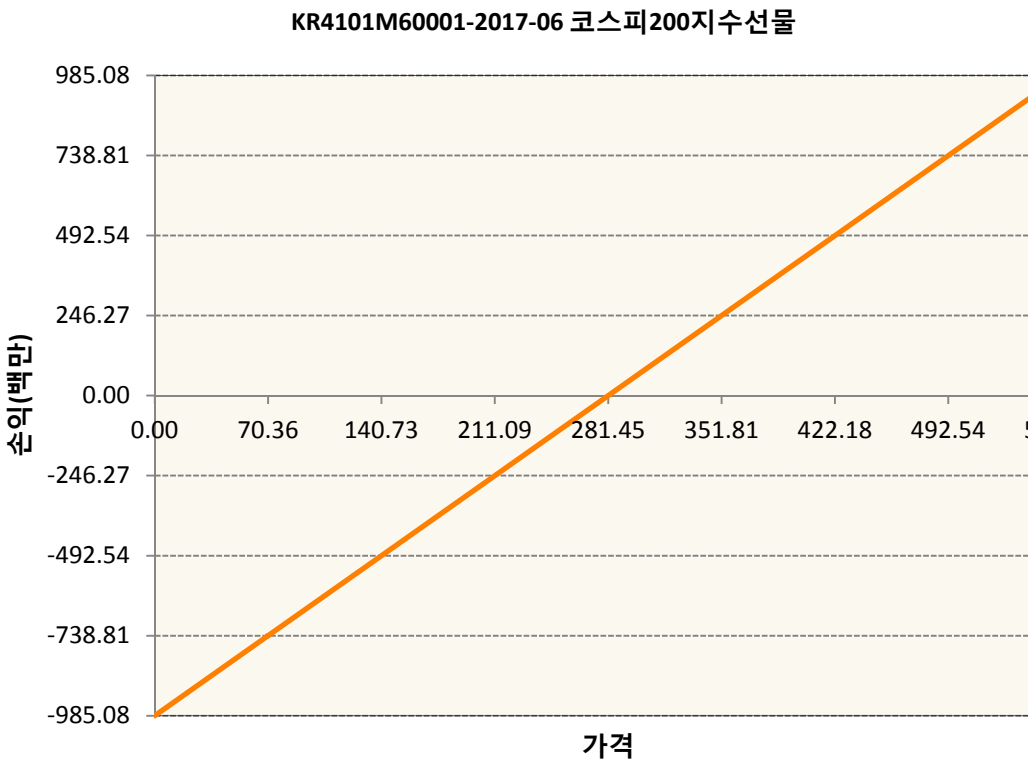
스마트인덱스모

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	985	0	985	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	2017-04-05
기준일	2017-04-04

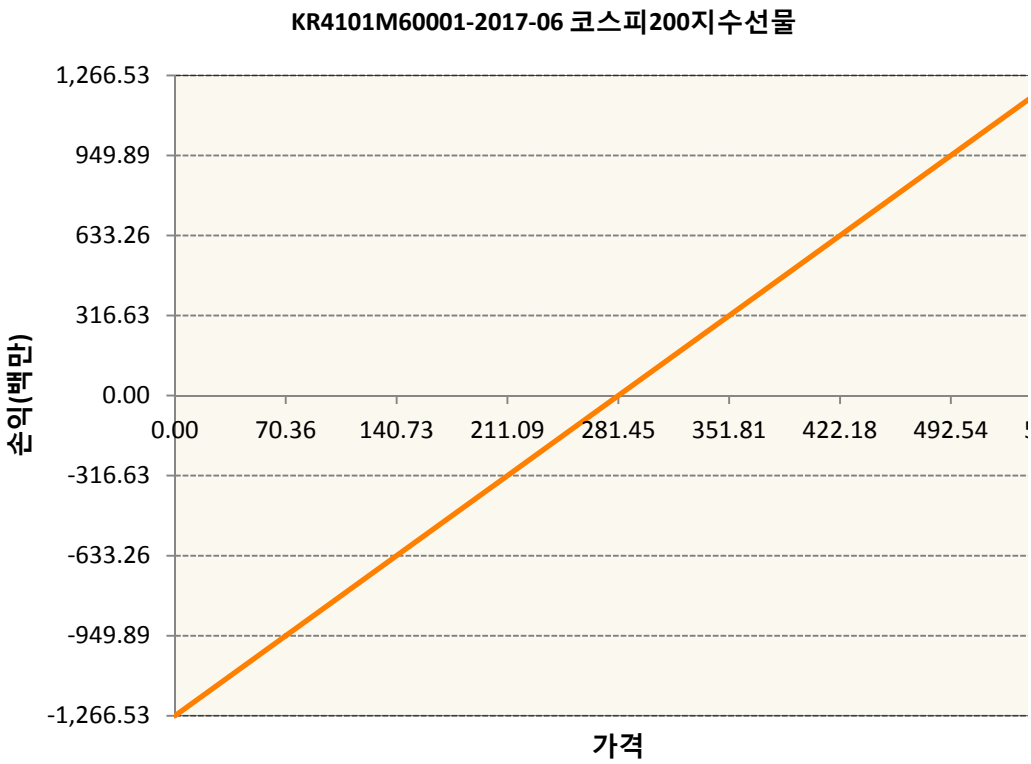
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	70	-70	장내
누계	유가증권	선물	1,267	0	1,267	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							101
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-101	-101	-101	-101	-101	-101	-101
-5.33%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67
-2.67%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	34	34	34	34	34	34	34
5.33%	67	67	67	67	67	67	67
8.00%	101	101	101	101	101	101	101

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

65

공시일	2017-04-05
기준일	2017-04-04

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	957

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

551

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-04-05
기준일	2017-04-04

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	2017-04-05
기준일	2017-04-04

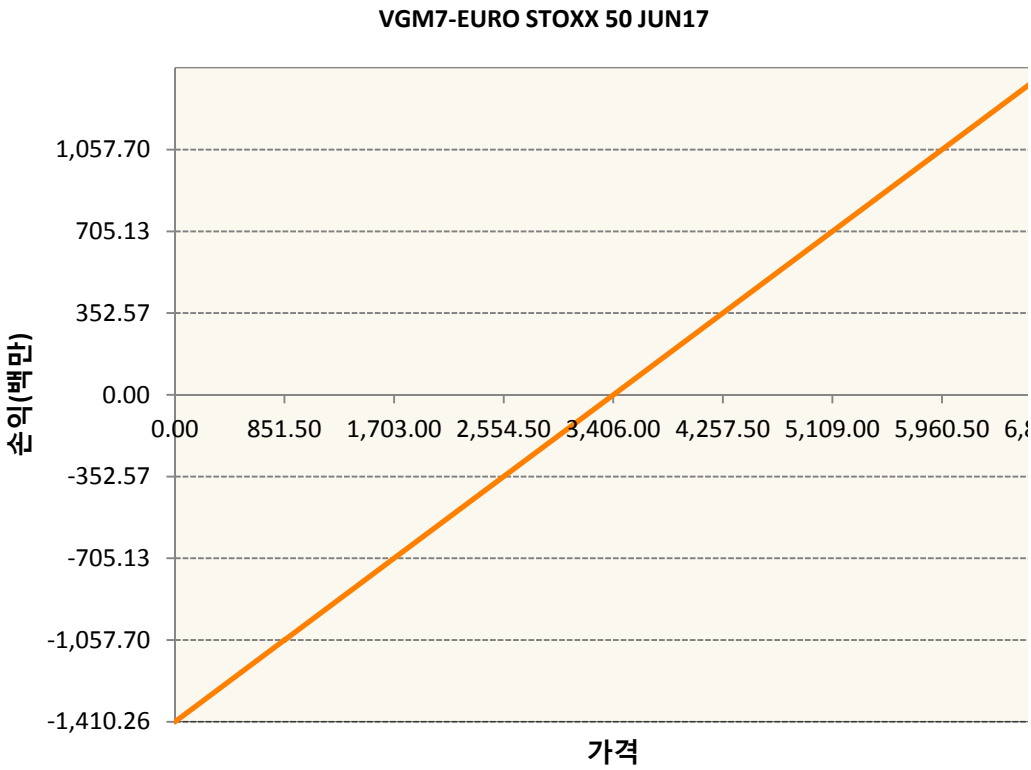
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,410	0	1,410	

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	2017-04-05
기준일	2017-04-04

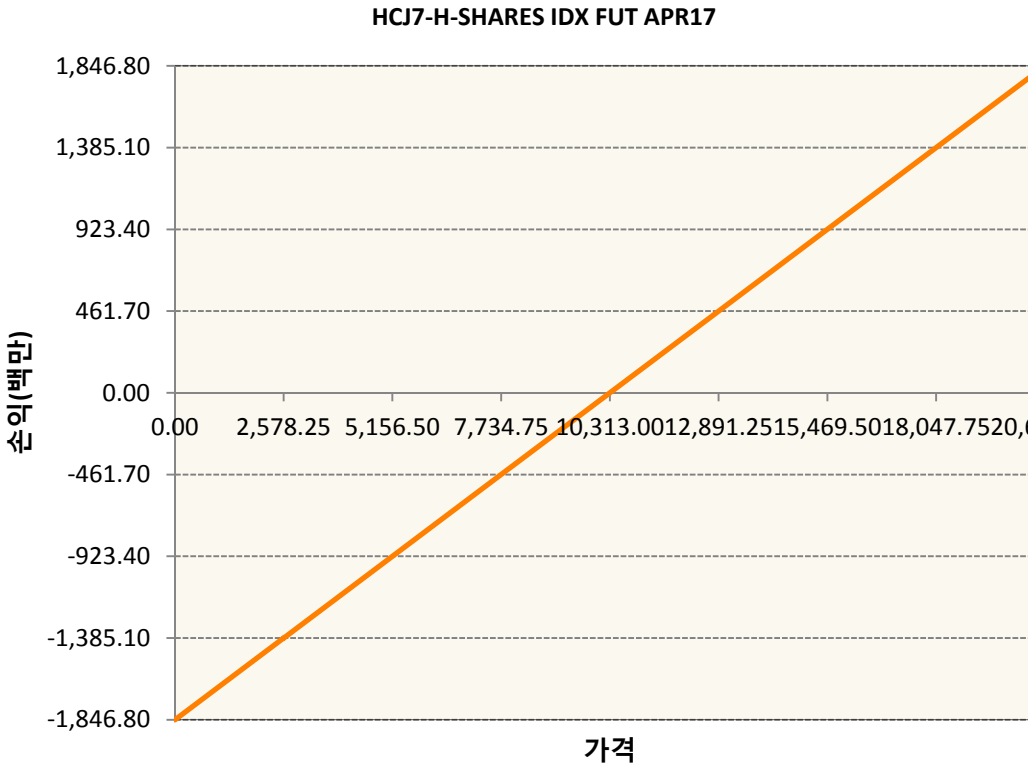
차이나인덱스모(주식-파생형)

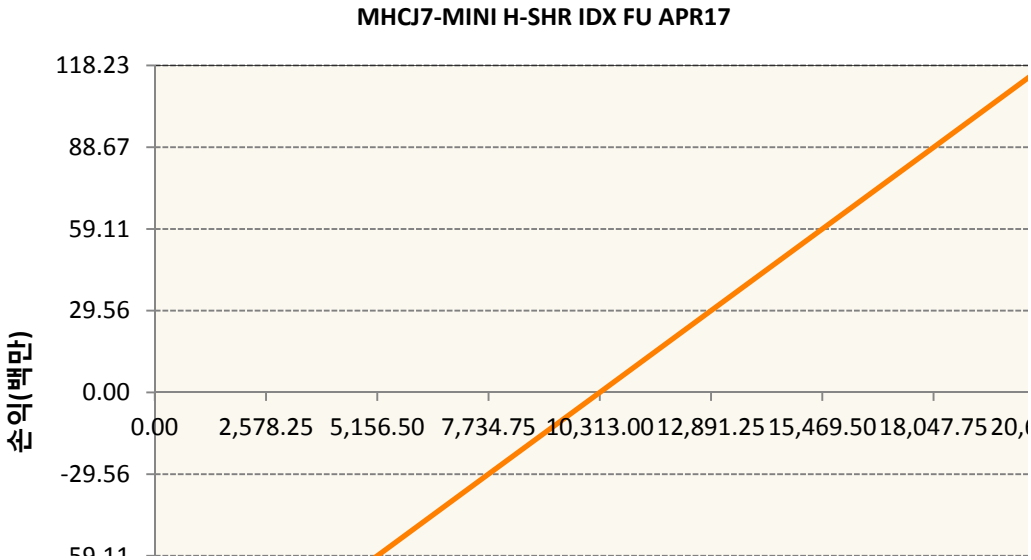
1. 계약금액

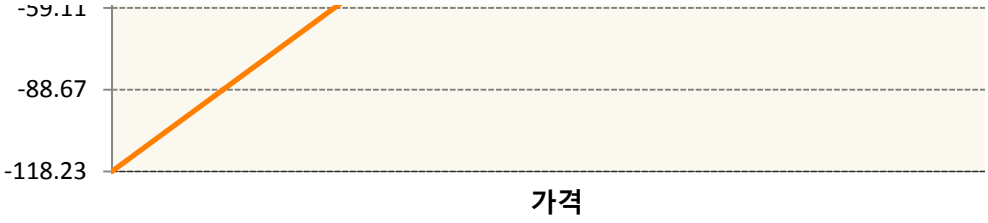
(단위:백만원)

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	2017-04-05
기준일	2017-04-04

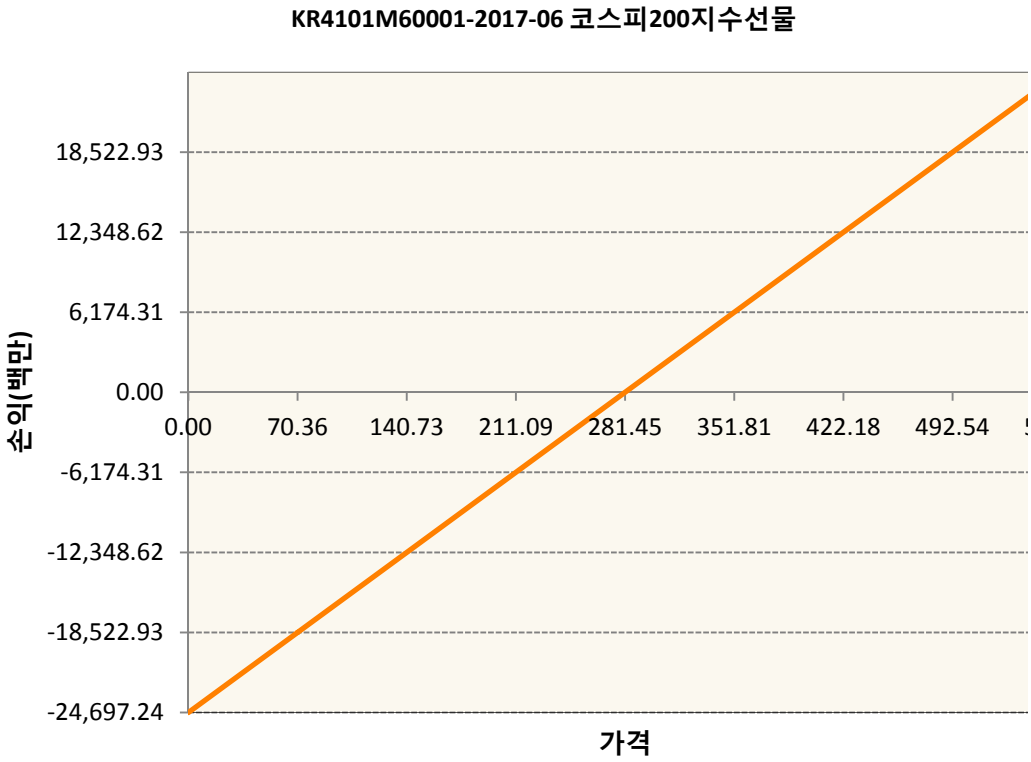
커버드콜모(주식혼합-파생형)

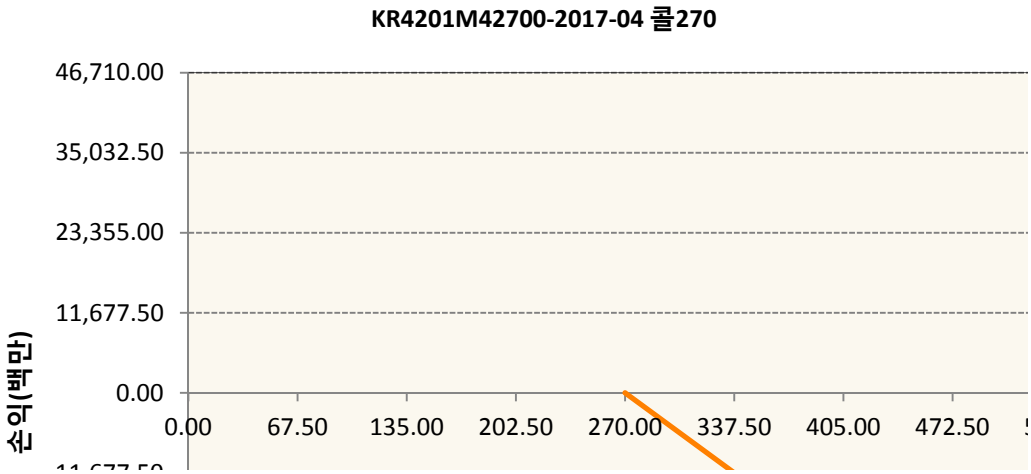
1. 계약금액

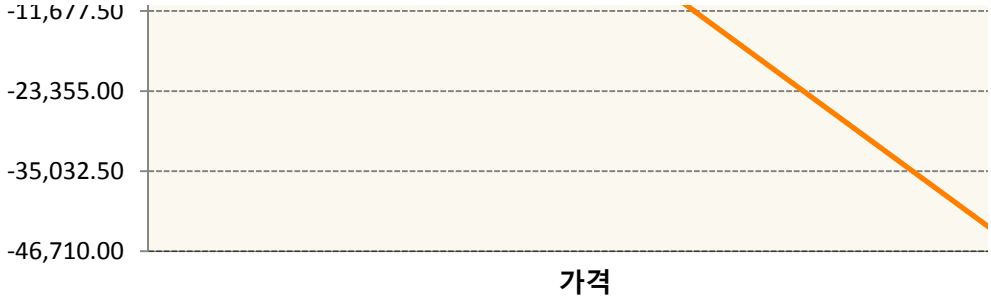
(단위:백만원)

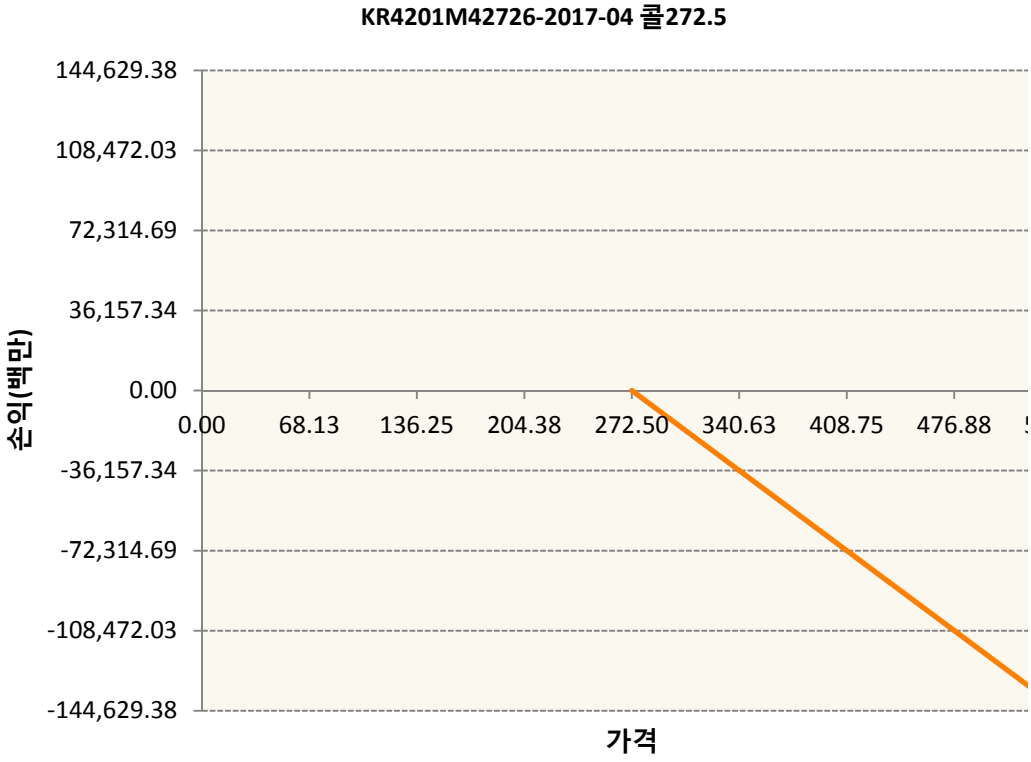
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	3,311	-3,311	장내
신규	유가증권	옵션	3,098	0	3,098	장내
누계	유가증권	선물	24,697	0	24,697	장내
누계	유가증권	옵션	0	191,339	-191,339	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							1,972
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,972	-1,972	-1,972	-1,972	-1,972	-1,972	-1,972
-5.33%	-1,315	-1,315	-1,315	-1,315	-1,315	-1,315	-1,315
-2.67%	-657	-657	-657	-657	-657	-657	-657
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	657	657	657	657	657	657	657
5.33%	1,315	1,315	1,315	1,315	1,315	1,315	1,315
8.00%	1,972	1,972	1,972	1,972	1,972	1,972	1,972
KR4201M42 2017-04 콜270							3,884
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,888	1,888	1,887	1,887	1,886	1,884	1,882
-5.33%	1,857	1,843	1,829	1,812	1,795	1,777	1,757
-2.67%	1,249	1,233	1,215	1,196	1,176	1,155	1,134
0%	2	2	1	0	-2	-5	-9
2.67%	-1,293	-1,293	-1,293	-1,293	-1,293	-1,293	-1,293
5.33%	-2,589	-2,589	-2,589	-2,589	-2,589	-2,589	-2,589
8.00%	-3,884	-3,884	-3,884	-3,884	-3,884	-3,884	-3,884
KR4201M42 2017-04 콜272.5							11,890

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,491	4,491	4,491	4,490	4,490	4,488	4,486
-5.33%	4,474	4,460	4,440	4,416	4,387	4,353	4,315
-2.67%	3,502	3,424	3,346	3,268	3,189	3,111	3,032
0%	28	23	13	0	-18	-39	-65
2.67%	-3,942	-3,942	-3,942	-3,942	-3,942	-3,943	-3,945
5.33%	-7,916	-7,916	-7,916	-7,916	-7,916	-7,916	-7,916
8.00%	-11,890	-11,890	-11,890	-11,890	-11,890	-11,890	-11,890

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

19,300

공시일	2017-04-05
기준일	2017-04-04

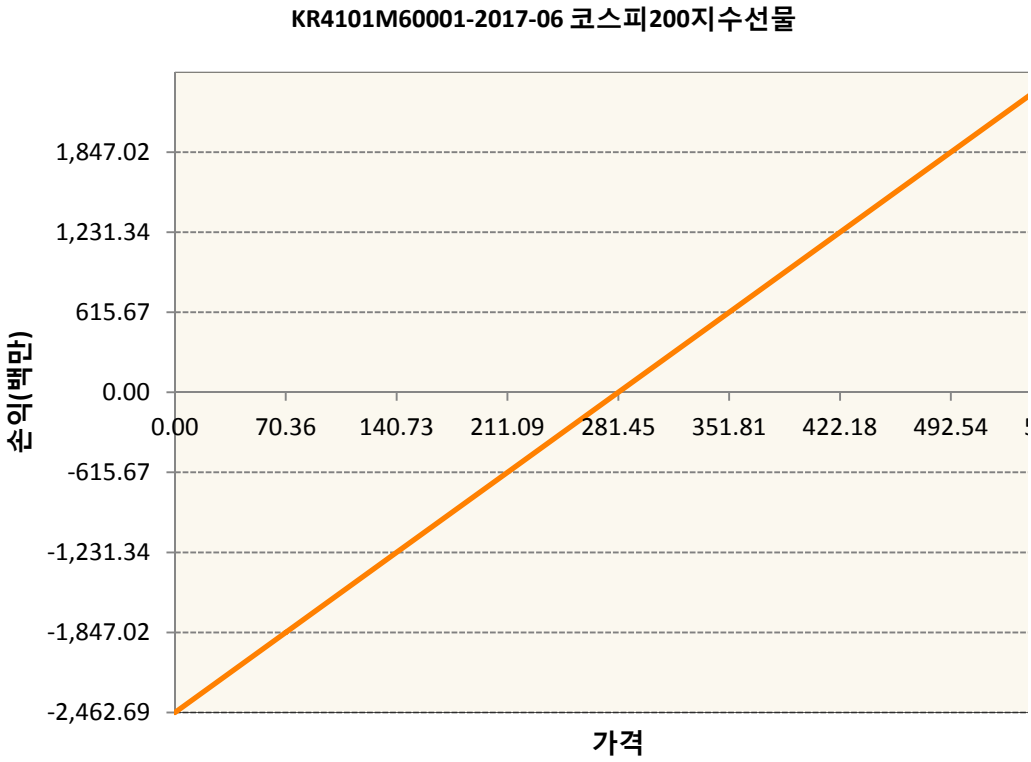
커버드콜목표전환형증권투자신탁

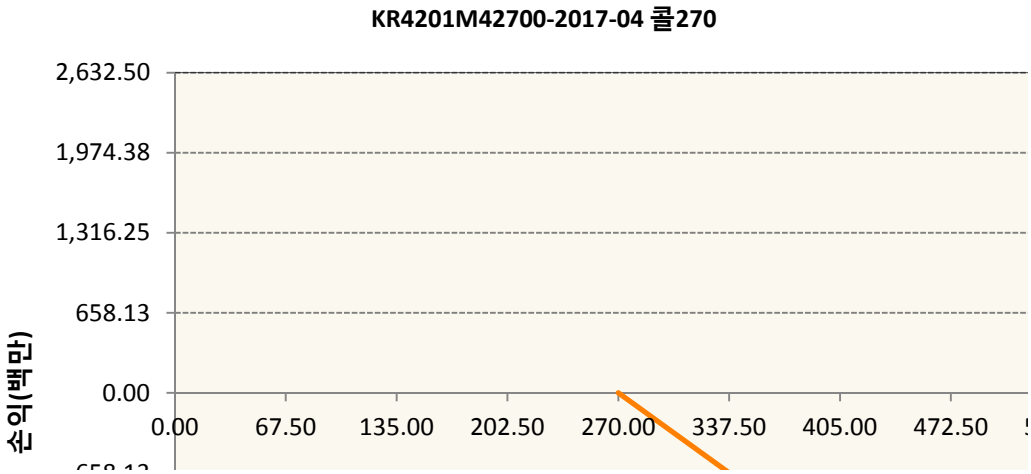
1. 계약금액

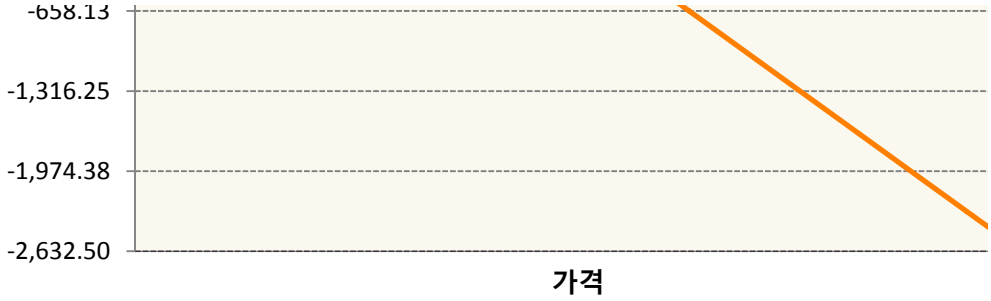
(단위:백만원)

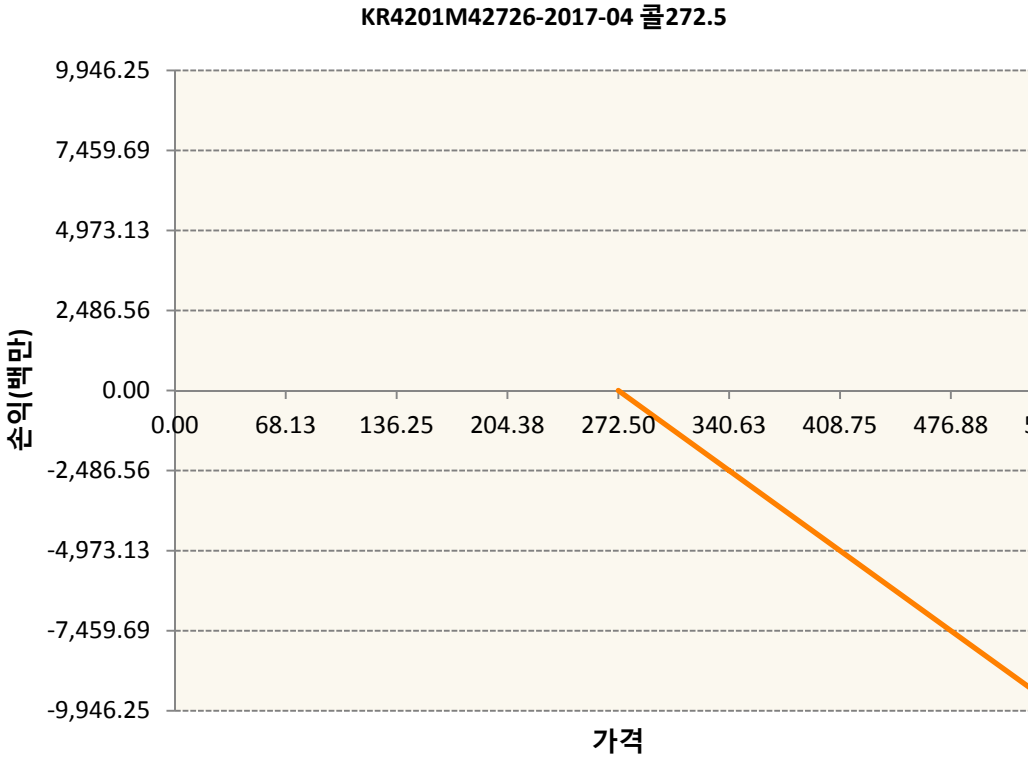
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,463	0	2,463	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,579	-12,579	장내

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%	106	106	106	106	106	106	106
-5.33%	105	104	103	102	101	100	99
-2.67%	70	69	68	67	66	65	64
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						818

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	309	309	309	309	309	309	308
-5.33%	308	307	305	304	302	299	297
-2.67%	241	236	230	225	219	214	208
0%	2	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	-271	-271	-271	-271	-271	-271	-271
5.33%	-544	-544	-544	-544	-544	-544	-544
8.00%	-818	-818	-818	-818	-818	-818	-818

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

1,315

공시일	2017-04-05
기준일	2017-04-04

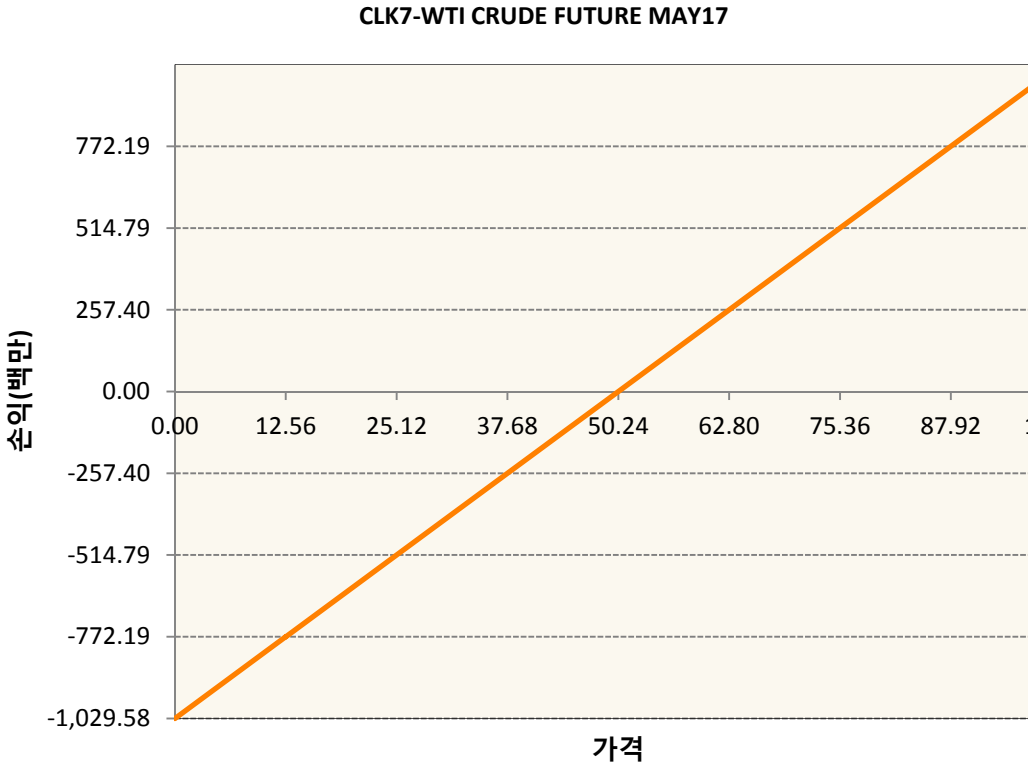
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

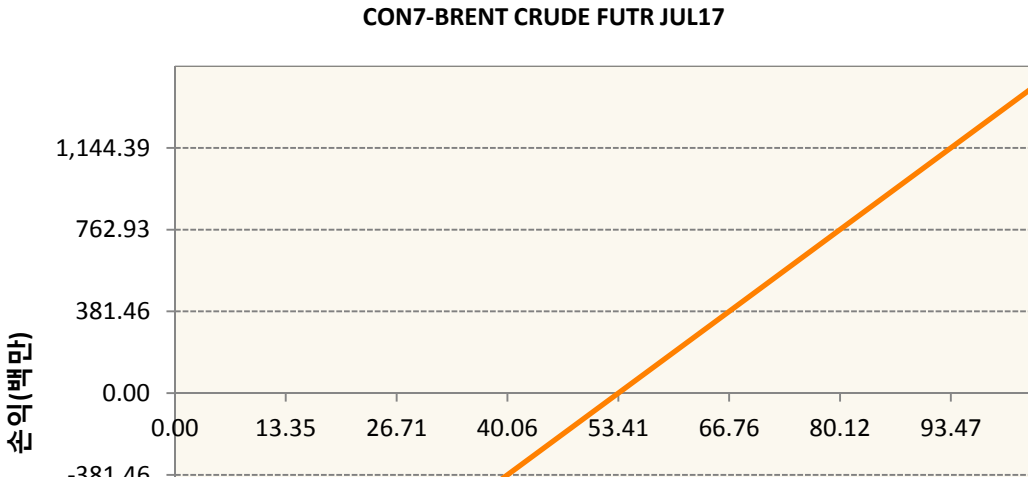
1. 계약금액

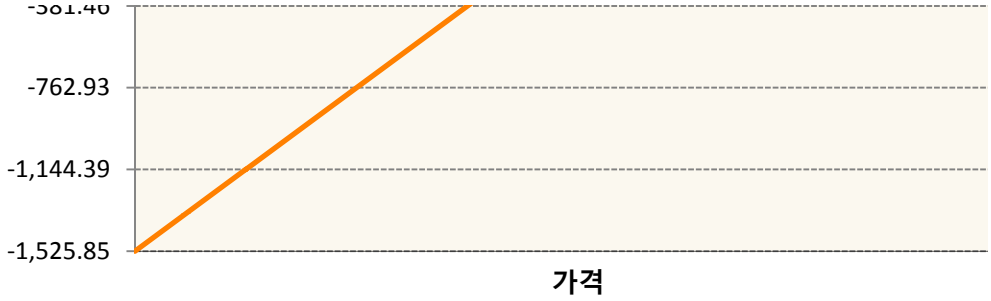
(단위:백만원)

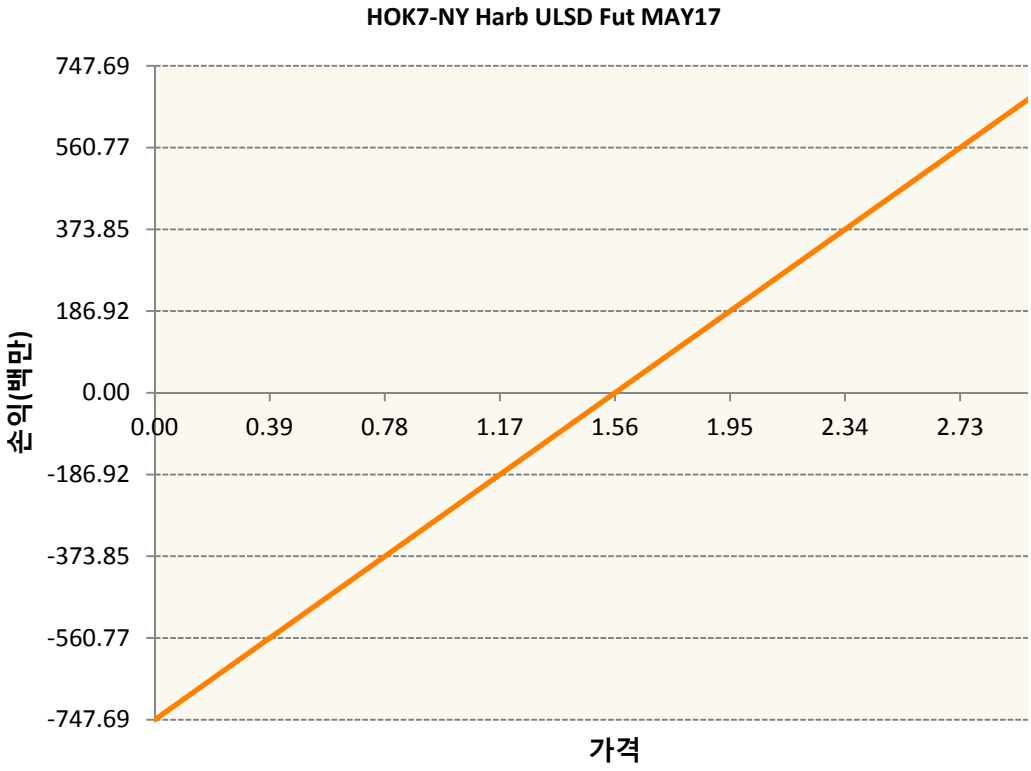
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,030	0	1,030	
누계	유가증권	선물	4,692	404	4,288	

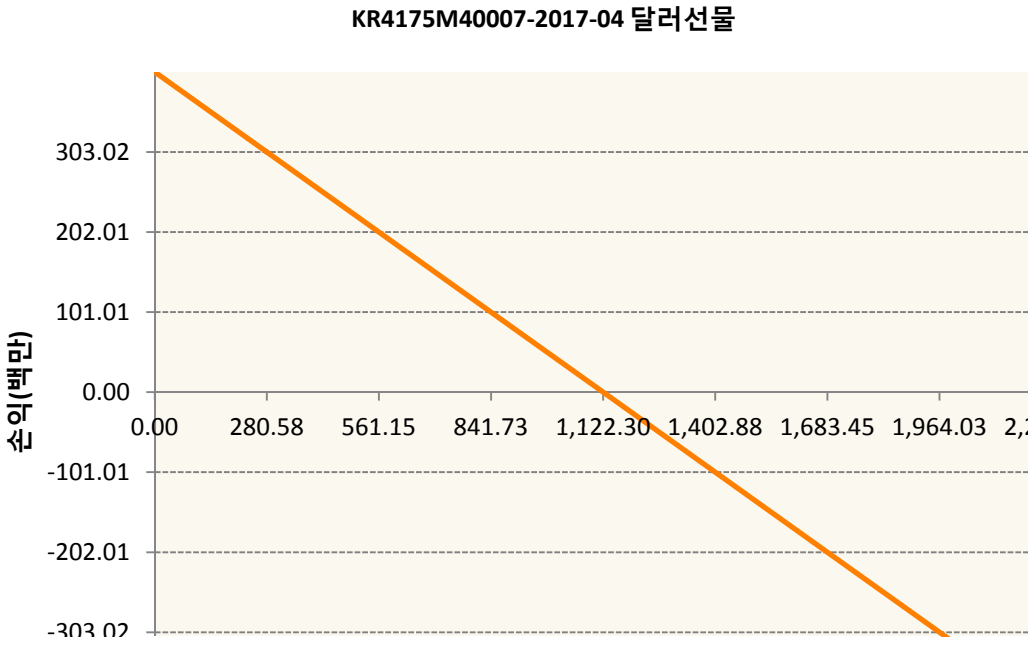
2. 만기시점의 손익구조

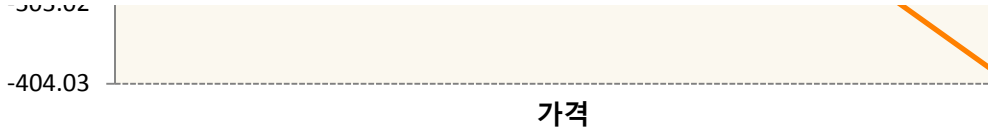


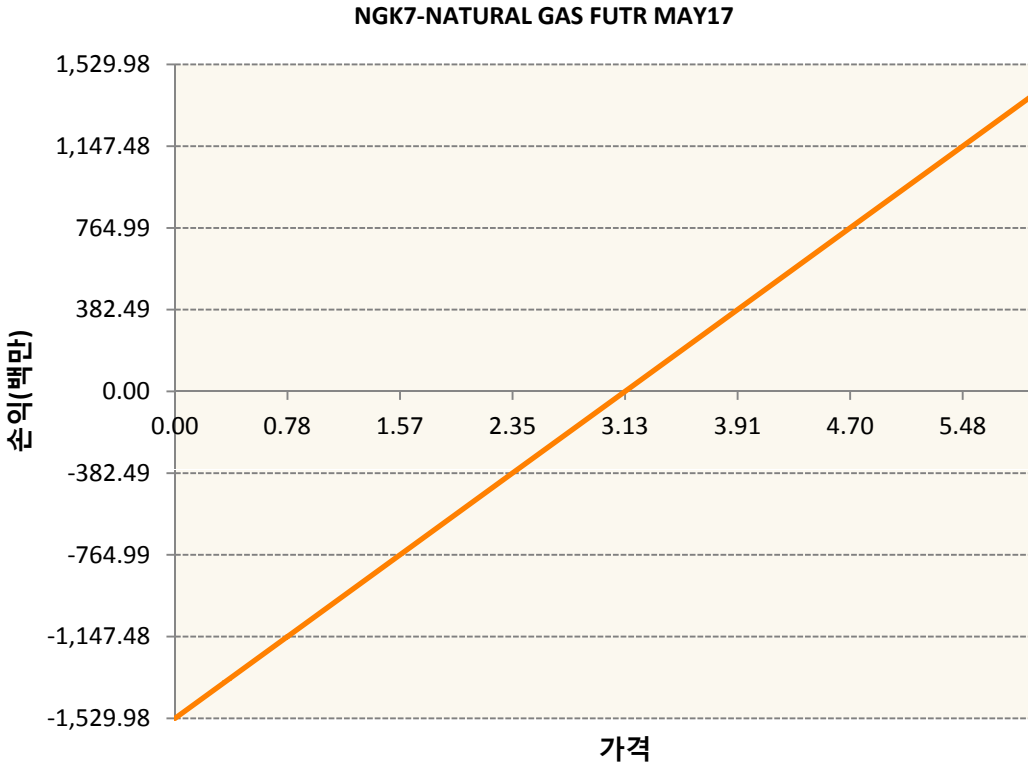


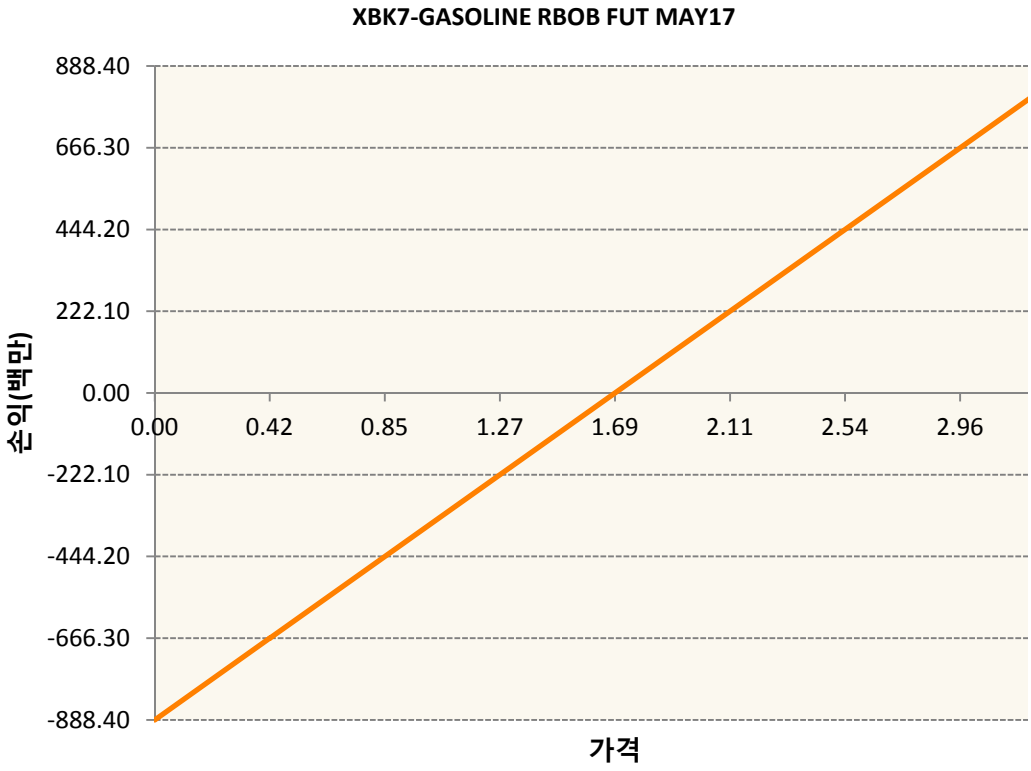

-762.93
-1,144.39
-1,525.85
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
747.69
560.77
373.85
186.92
0.00
-186.92
-373.85
-560.77
-747.69
0.00
0.39
0.78
1.17
1.56
1.95
2.34
2.73
순익(백만)
가격


KR4175M40007-2017-04 달러선물
303.02
202.01
101.01
0.00
-101.01
-202.01
-303.02
0.00
280.58
561.15
841.73
1,122.30
1,402.88
1,683.45
1,964.03
순익(백만)


-404.03
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,529.98
1,147.48
764.99
382.49
0.00
-382.49
-764.99
-1,147.48
-1,529.98
0.00
0.78
1.57
2.35
3.13
3.91
4.70
5.48
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
888.40
666.30
444.20
222.10
0.00
-222.10
-444.20
-666.30
-888.40
0.00
0.42
0.85
1.27
1.69
2.11
2.54
2.96
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK7	WTI CRUDE FUTURE MAY17	82
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	122
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	60
KR4175M40(	2017-04 달러선물	32
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	122
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	71

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

1,005

공시일	2017-04-05
기준일	2017-04-04

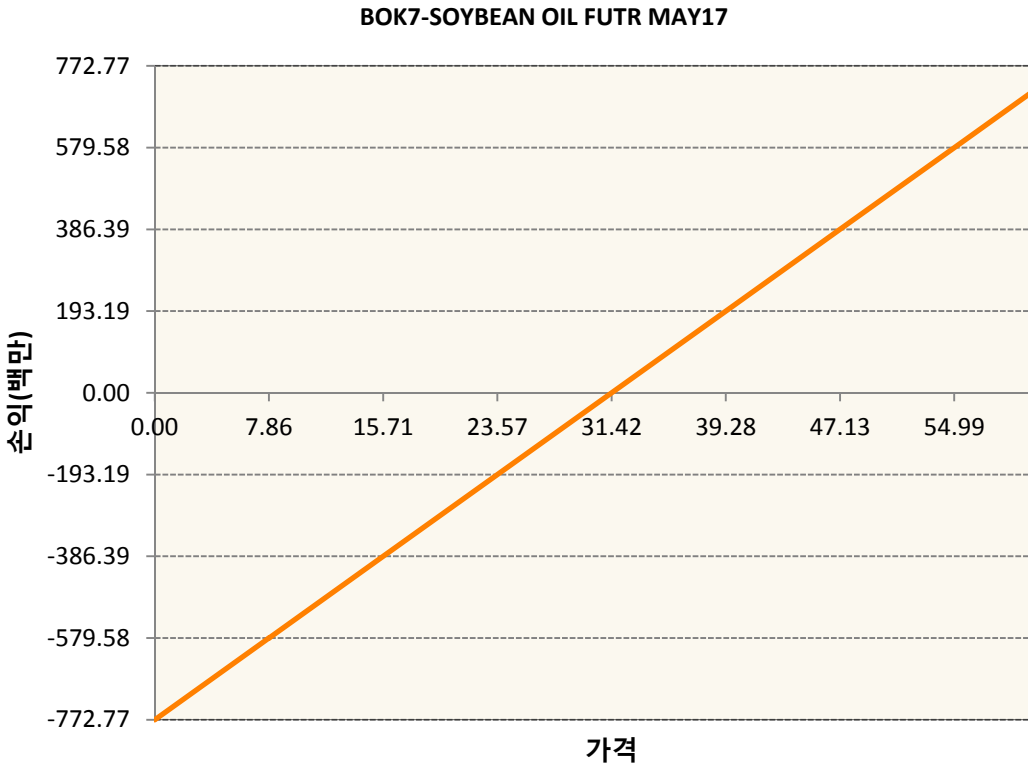
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

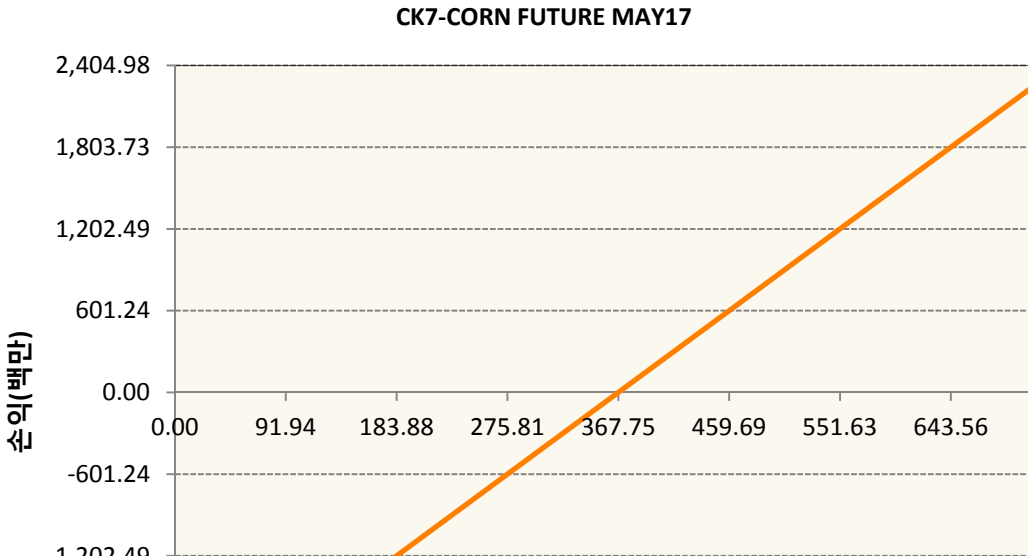
1. 계약금액

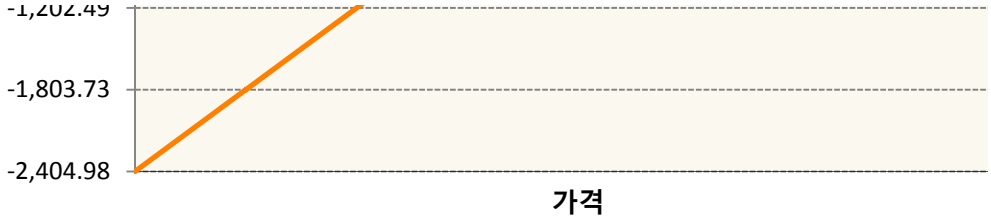
(단위:백만원)

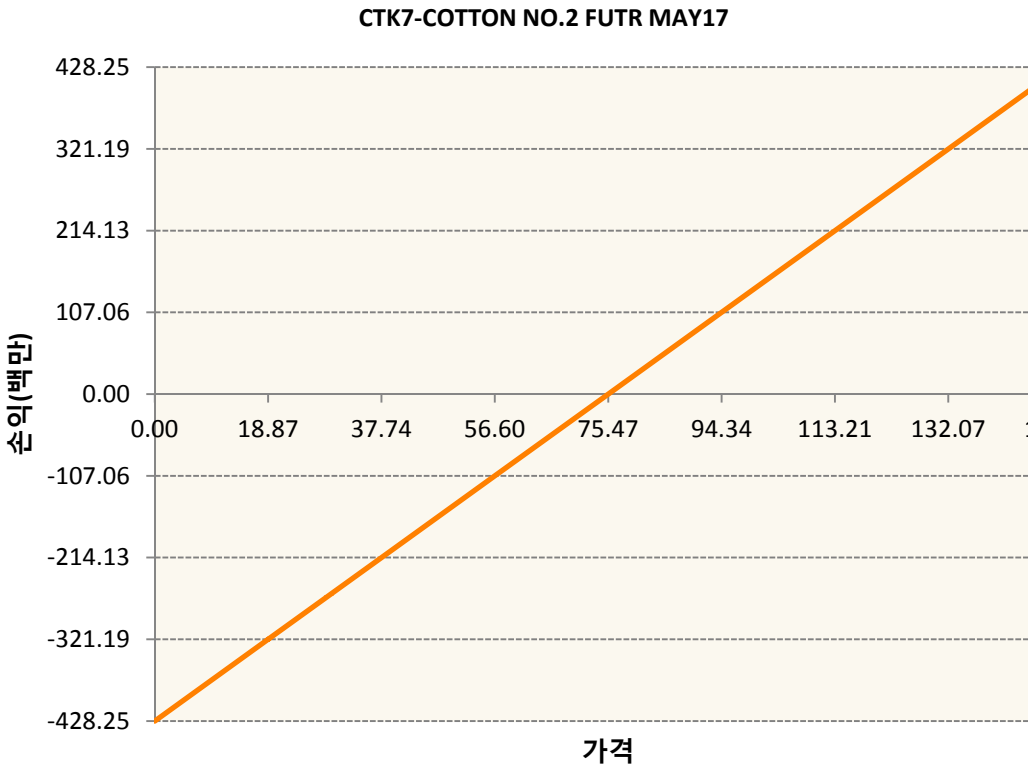
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,039	393	8,646	

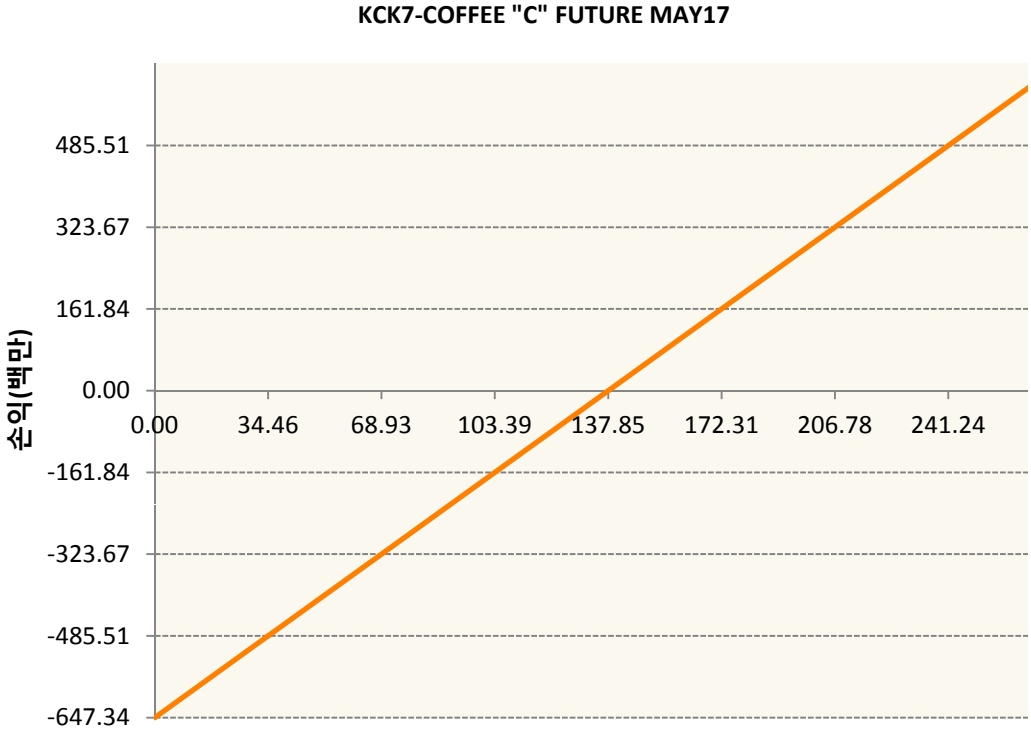
2. 만기시점의 손익구조





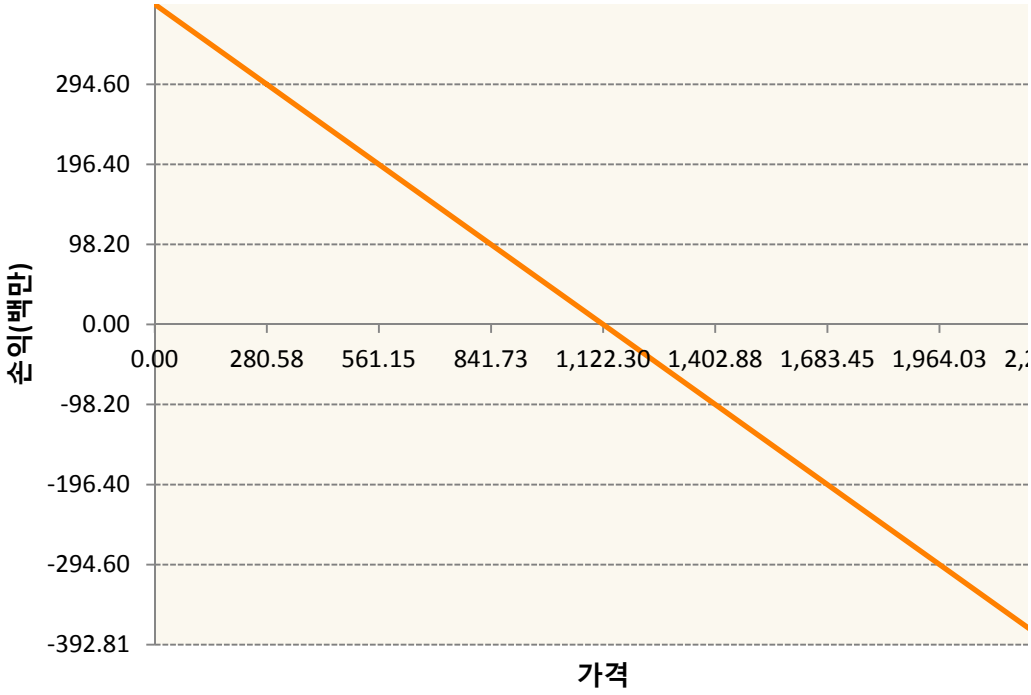

-1,803.73
-2,404.98
가격


CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
428.25
321.19
214.13
107.06
0.00
-107.06
-214.13
-321.19
-428.25
0.00
18.87
37.74
56.60
75.47
94.34
113.21
132.07
손익(백만)
가격

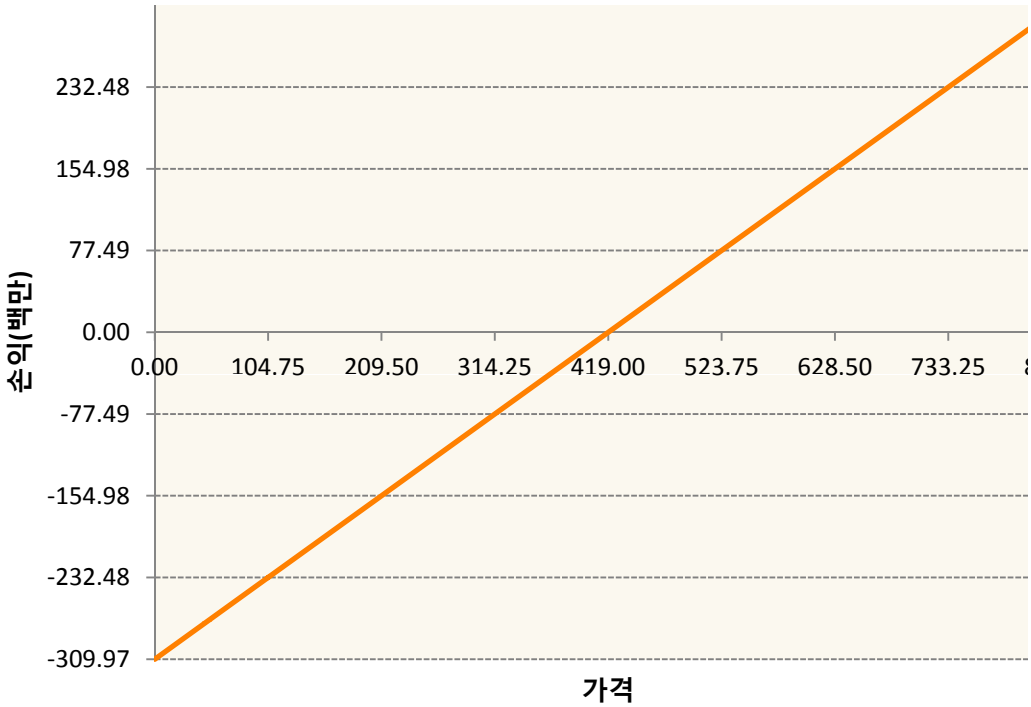

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
485.51
323.67
161.84
0.00
-161.84
-323.67
-485.51
-647.34
0.00
34.46
68.93
103.39
137.85
172.31
206.78
241.24
손익(백만)

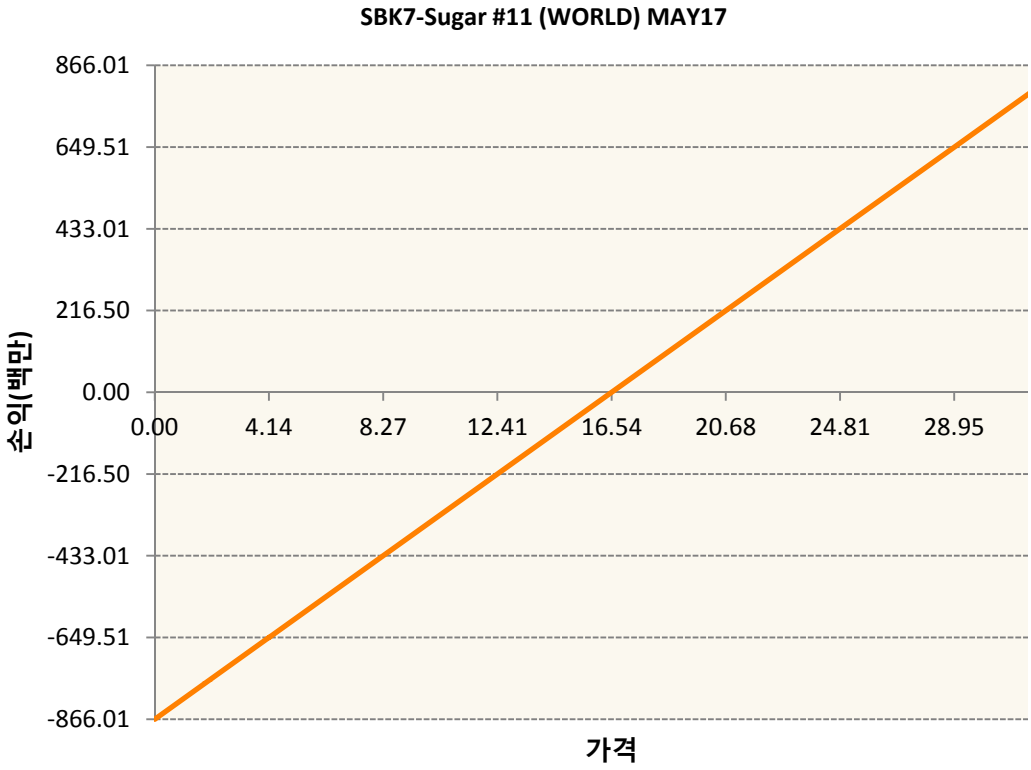
가격

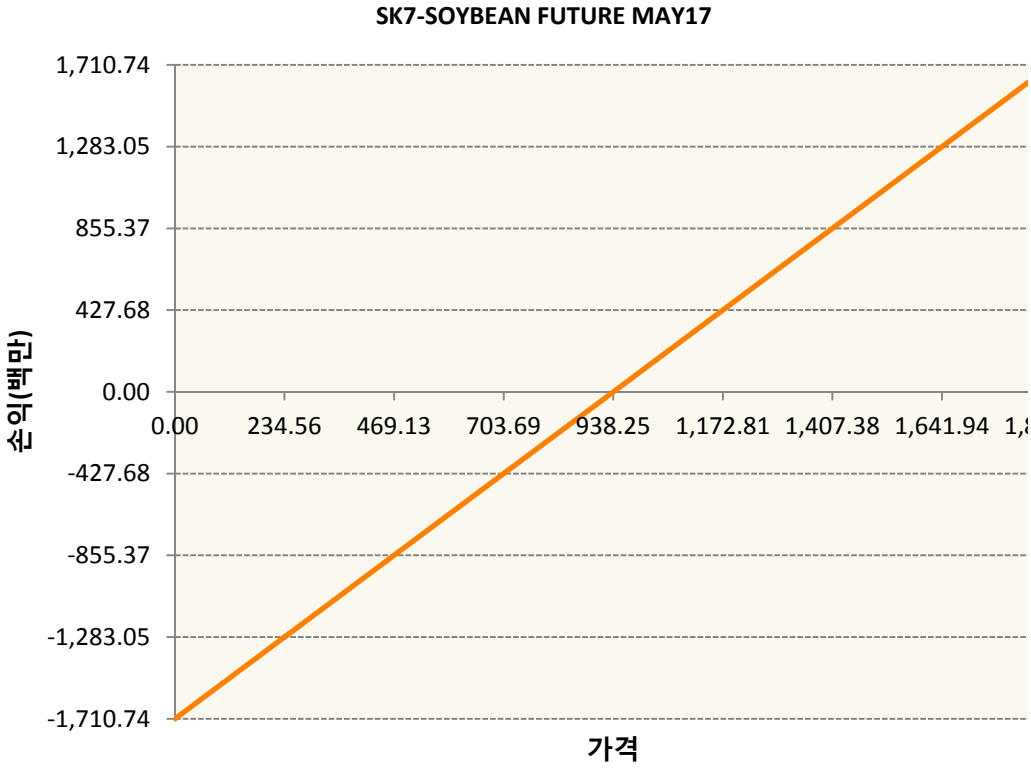
KR4175M40007-2017-04 달러선물

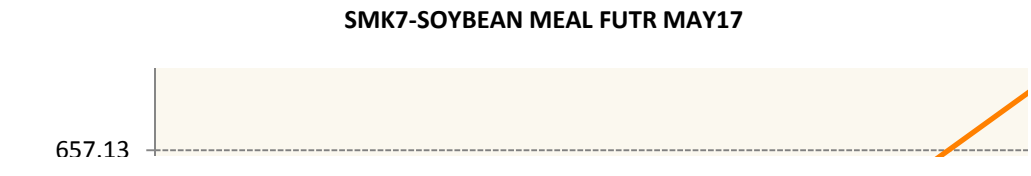


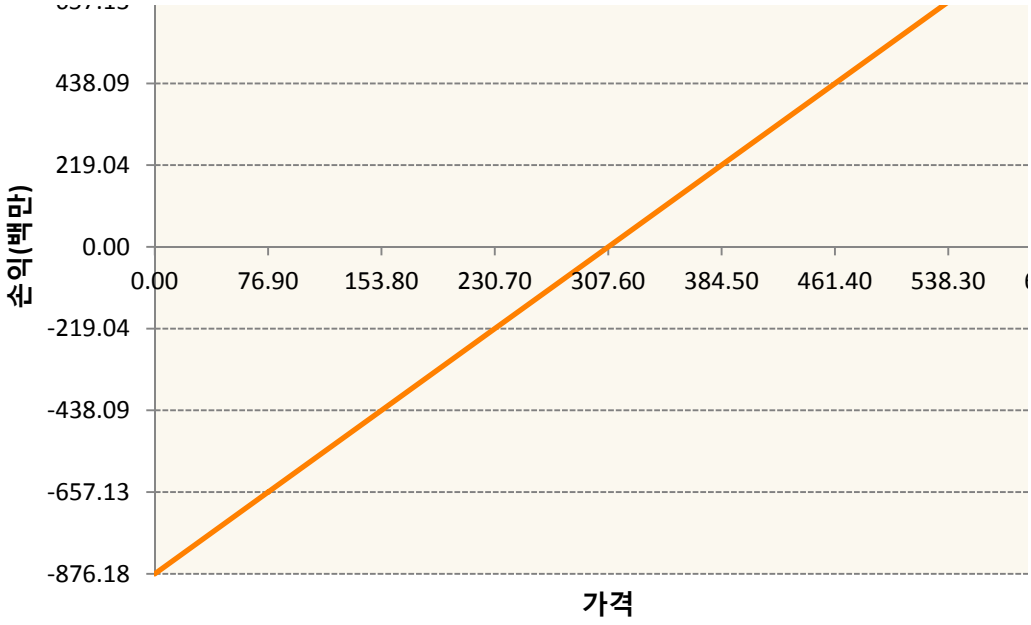
KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17

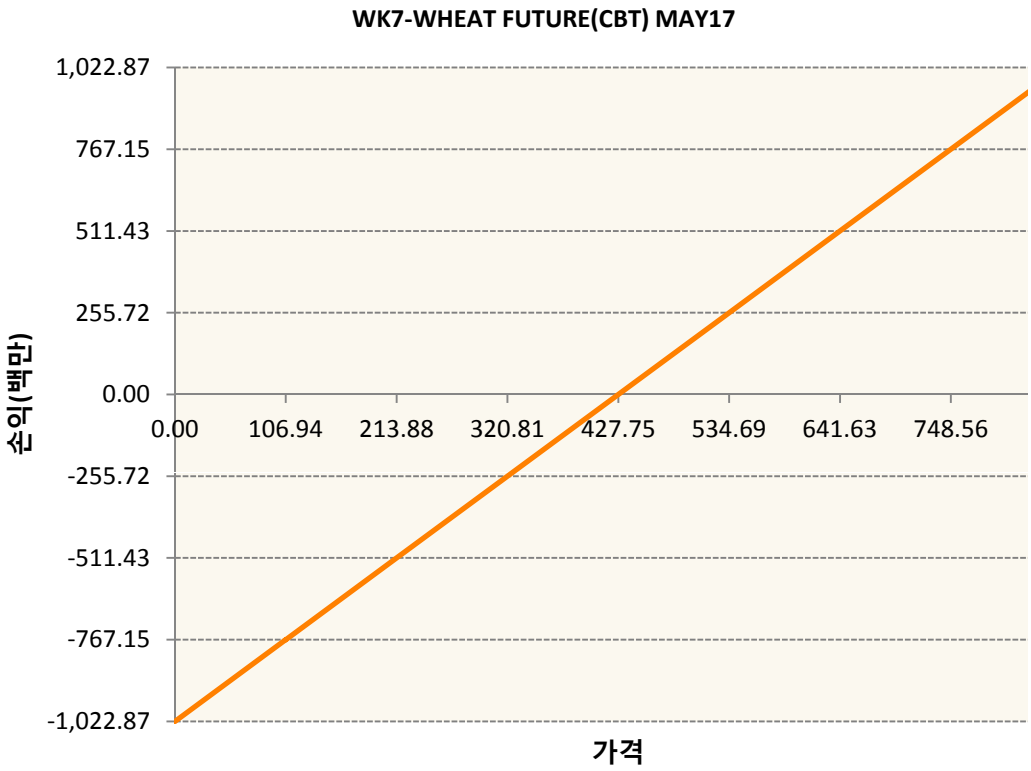



SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
866.01
649.51
433.01
216.50
0.00
-216.50
-433.01
-649.51
-866.01
0.00
4.14
8.27
12.41
16.54
20.68
24.81
28.95
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,710.74
1,283.05
855.37
427.68
0.00
-427.68
-855.37
-1,283.05
-1,710.74
0.00
234.56
469.13
703.69
938.25
1,172.81
1,407.38
1,641.94
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
657.13





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	62
CK7	CORN FUTURE MAY17	192
CTK7	COTTON NO.2 FUTR MAY17	34
KCK7	COFFEE "C" FUTURE MAY17	52
KR4175M40(	2017-04 달러선물	31

KWK7	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17	25
SBK7	Sugar #11 (WORLD) MAY17	69
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	137
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	70
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	82

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

827