공시일	2017-04-06
기준일	2017-04-05

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	2017-04-06
기준일	2017-04-05

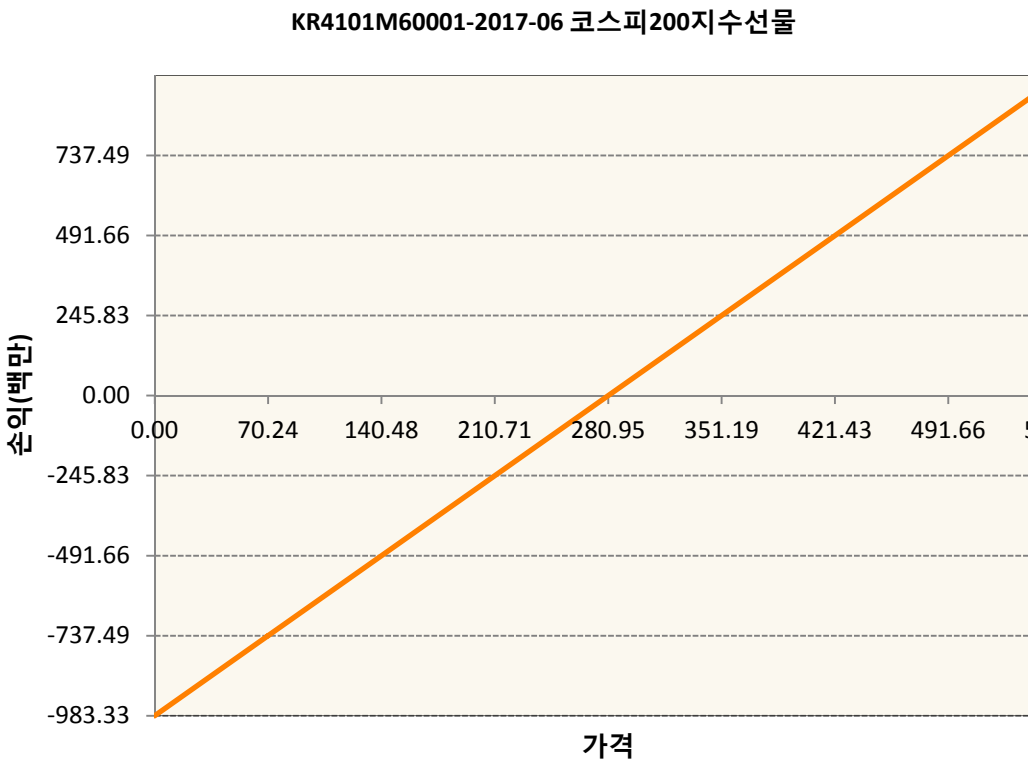
스마트인덱스모

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	983	0	983	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	2017-04-06
기준일	2017-04-05

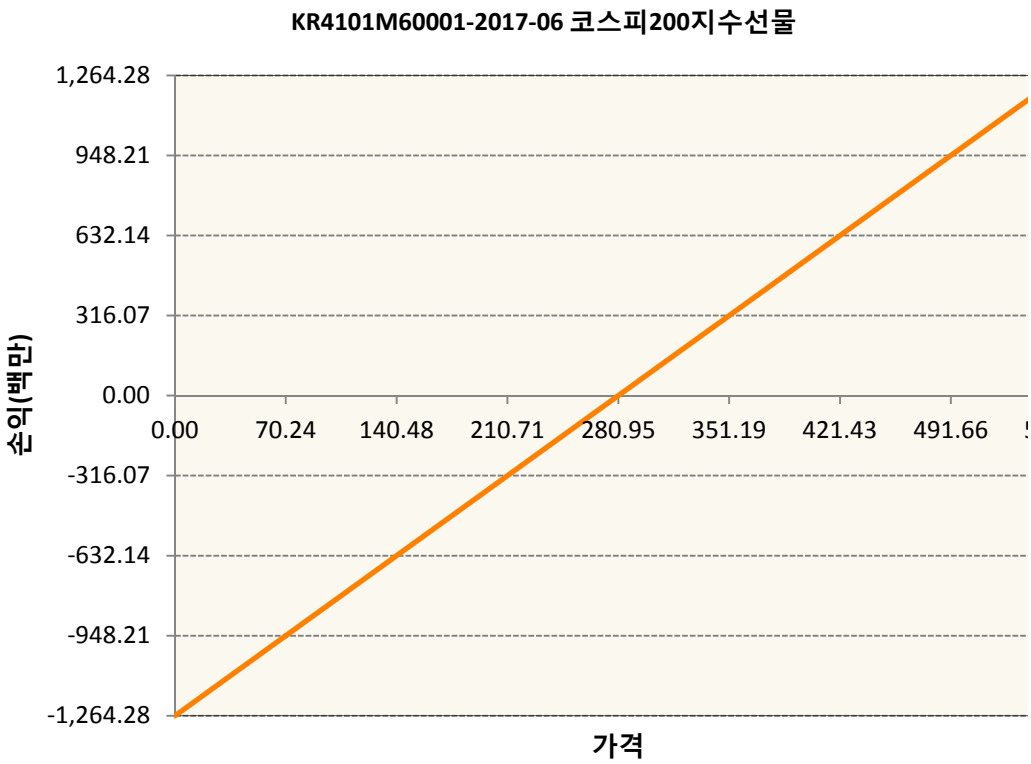
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,264	0	1,264	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	2017-04-06
기준일	2017-04-05

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	2017-04-06
기준일	2017-04-05

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	396

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

422

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-04-06
기준일	2017-04-05

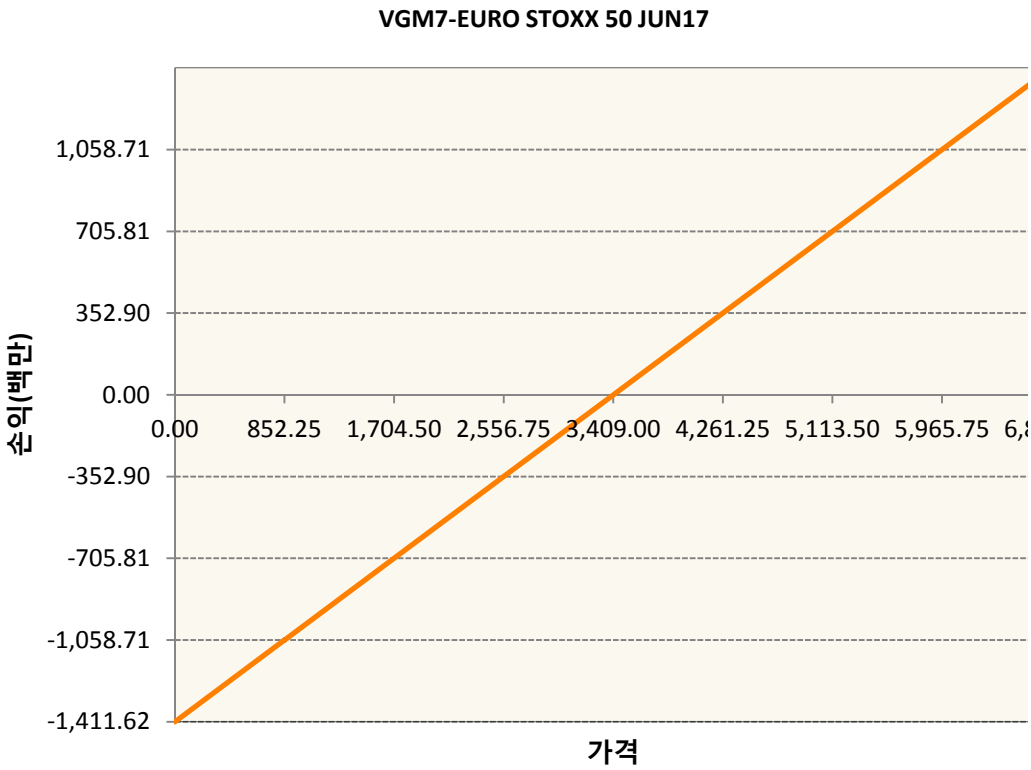
유로인덱스모(주식-파생형)

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)

114

공시일	2017-04-06
기준일	2017-04-05

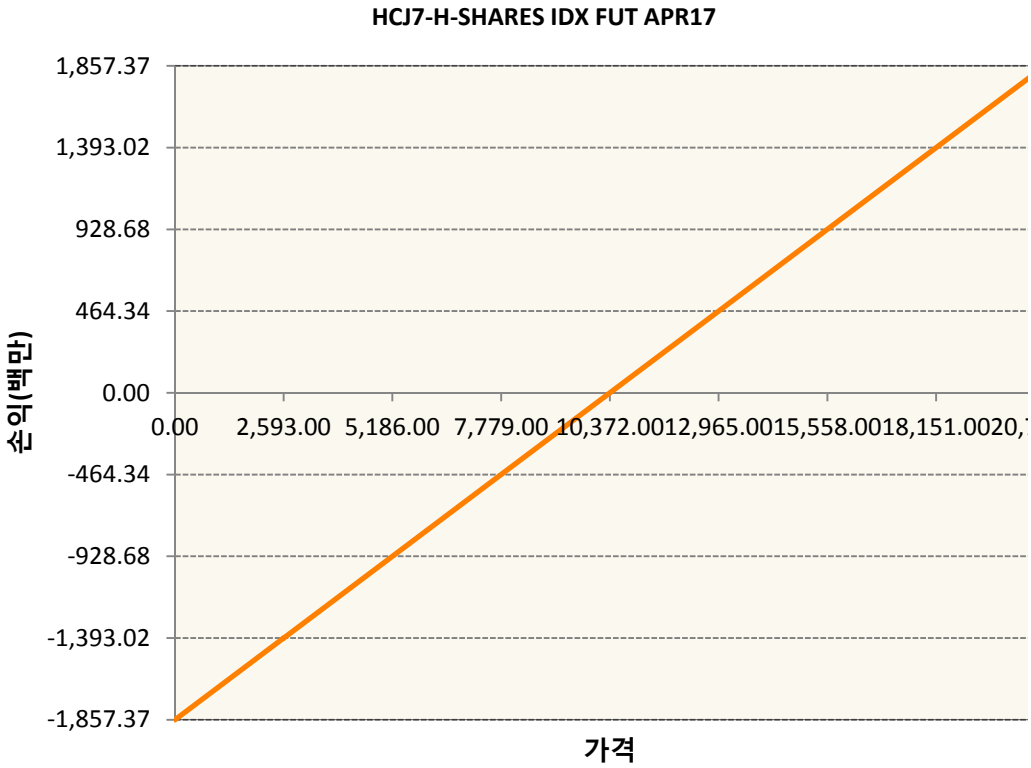
차이나인덱스모(주식-파생형)

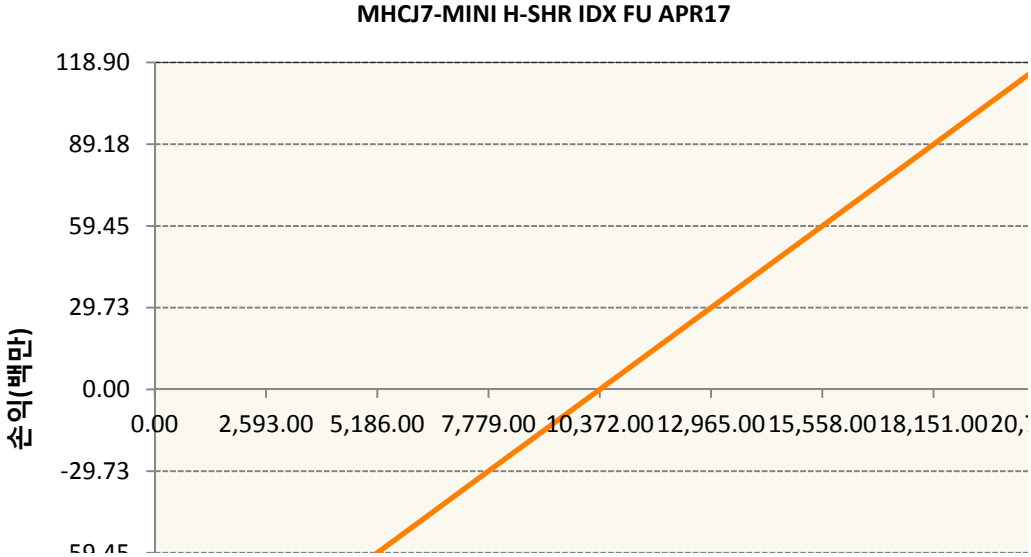
1. 계약금액

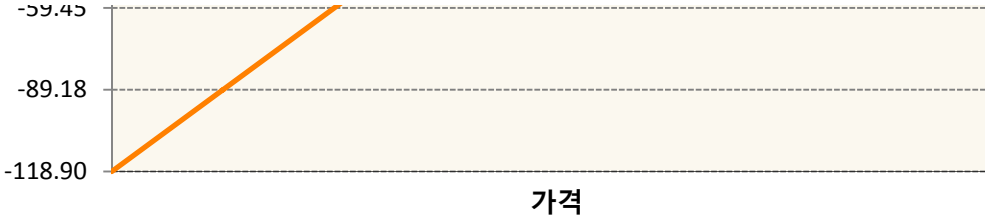
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,976	0	1,976	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCJ7	H-SHARES IDX FUT APR17	149
MHCJ7	MINI H-SHR IDX FU APR17	10

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

169

공시일	2017-04-06
기준일	2017-04-05

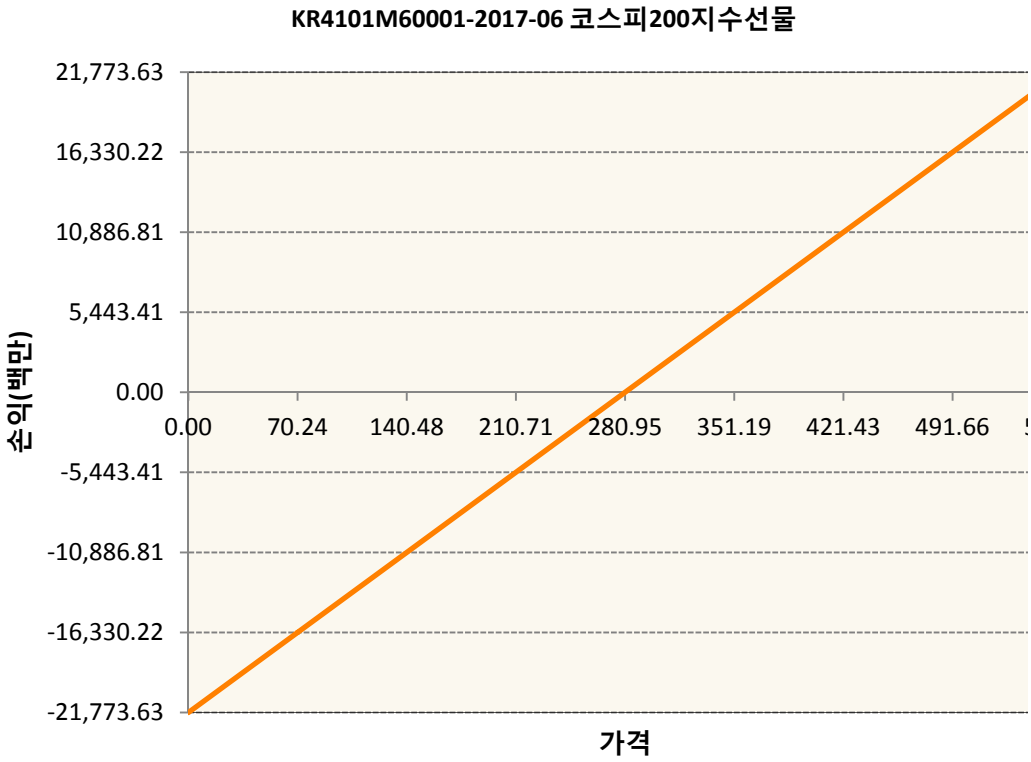
커버드콜모(주식혼합-파생형)

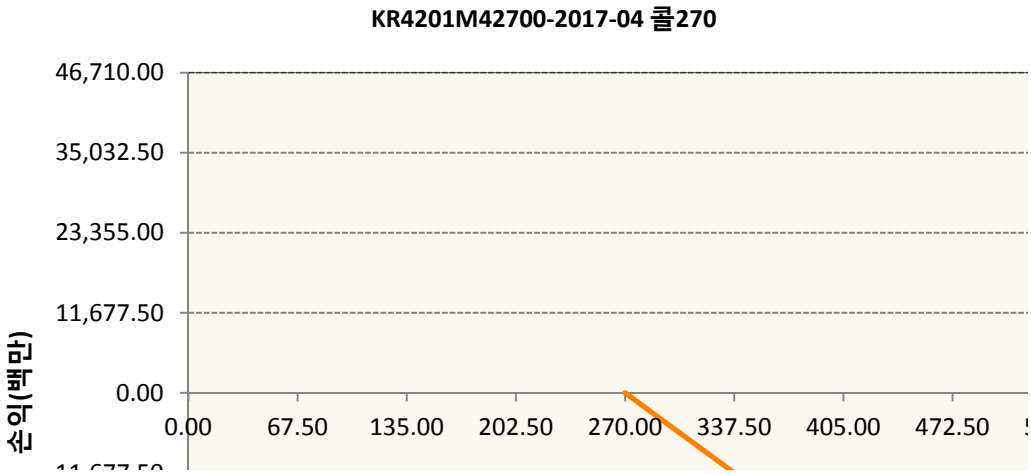
1. 계약금액

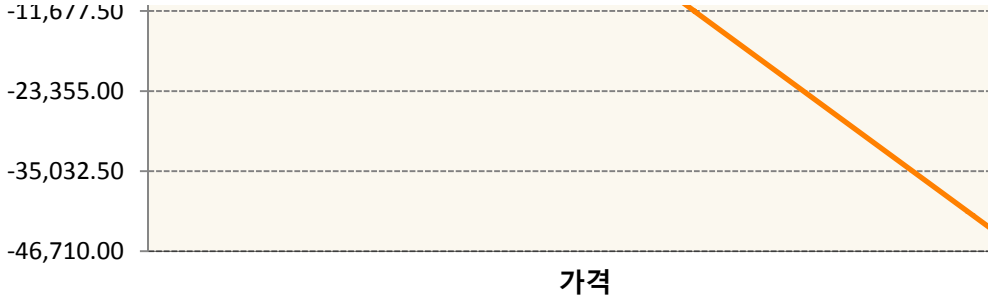
(단위:백만원)

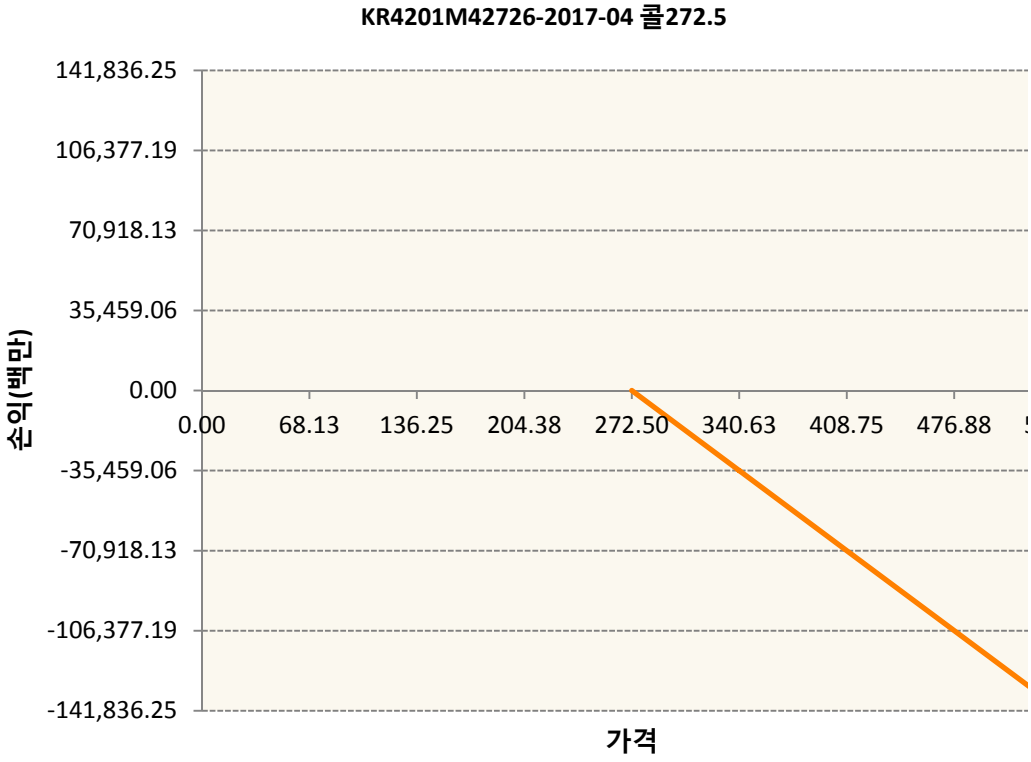
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	2,878	-2,878	장내
신규	유가증권	옵션	2,712	0	2,712	장내
누계	유가증권	선물	21,774	0	21,774	장내
누계	유가증권	옵션	0	188,546	-188,546	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							1,741
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,741	-1,741	-1,741	-1,741	-1,741	-1,741	-1,741
-5.33%	-1,160	-1,160	-1,160	-1,160	-1,160	-1,160	-1,160
-2.67%	-580	-580	-580	-580	-580	-580	-580
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	580	580	580	580	580	580	580
5.33%	1,160	1,160	1,160	1,160	1,160	1,160	1,160
8.00%	1,741	1,741	1,741	1,741	1,741	1,741	1,741
KR4201M42 2017-04 콜270							3,882
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,856	1,856	1,856	1,856	1,855	1,854	1,853
-5.33%	1,834	1,823	1,811	1,797	1,782	1,766	1,749
-2.67%	1,252	1,236	1,219	1,202	1,183	1,163	1,143
0%	1	1	1	0	-1	-4	-7
2.67%	-1,293	-1,293	-1,293	-1,293	-1,293	-1,293	-1,293
5.33%	-2,588	-2,588	-2,588	-2,588	-2,588	-2,588	-2,588
8.00%	-3,882	-3,882	-3,882	-3,882	-3,882	-3,882	-3,882
KR4201M42 2017-04 콜272.5							11,661

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,304	4,304	4,304	4,304	4,304	4,303	4,302
-5.33%	4,295	4,285	4,272	4,254	4,231	4,205	4,174
-2.67%	3,429	3,357	3,284	3,212	3,139	3,066	2,993
0%	22	18	11	0	-14	-32	-54
2.67%	-3,870	-3,870	-3,870	-3,870	-3,870	-3,871	-3,872
5.33%	-7,765	-7,765	-7,765	-7,765	-7,765	-7,765	-7,765
8.00%	-11,661	-11,661	-11,661	-11,661	-11,661	-11,661	-11,661

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

18,892

공시일	2017-04-06
기준일	2017-04-05

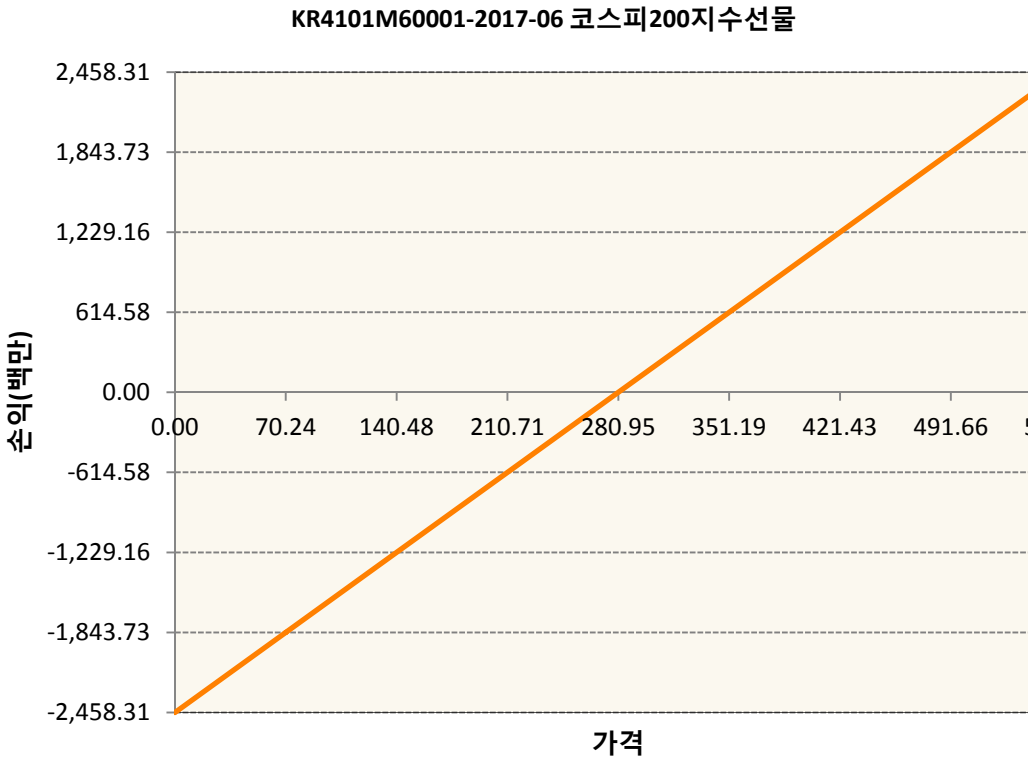
커버드콜목표전환형증권투자신탁

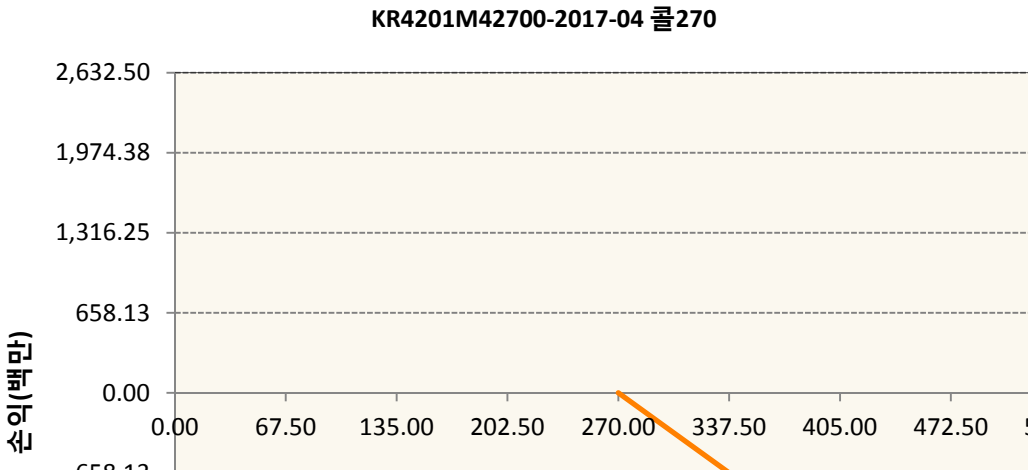
1. 계약금액

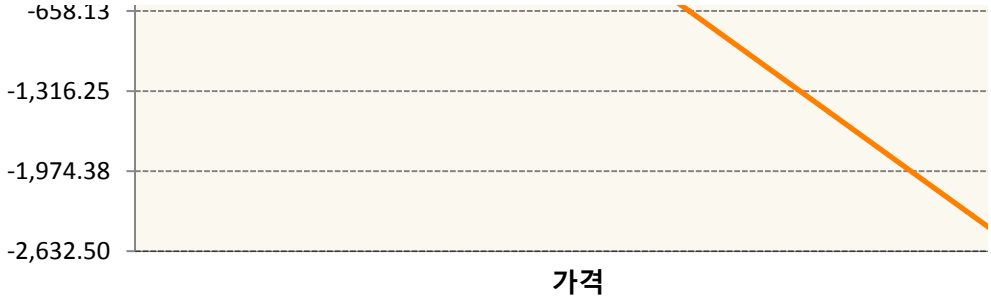
(단위:백만원)

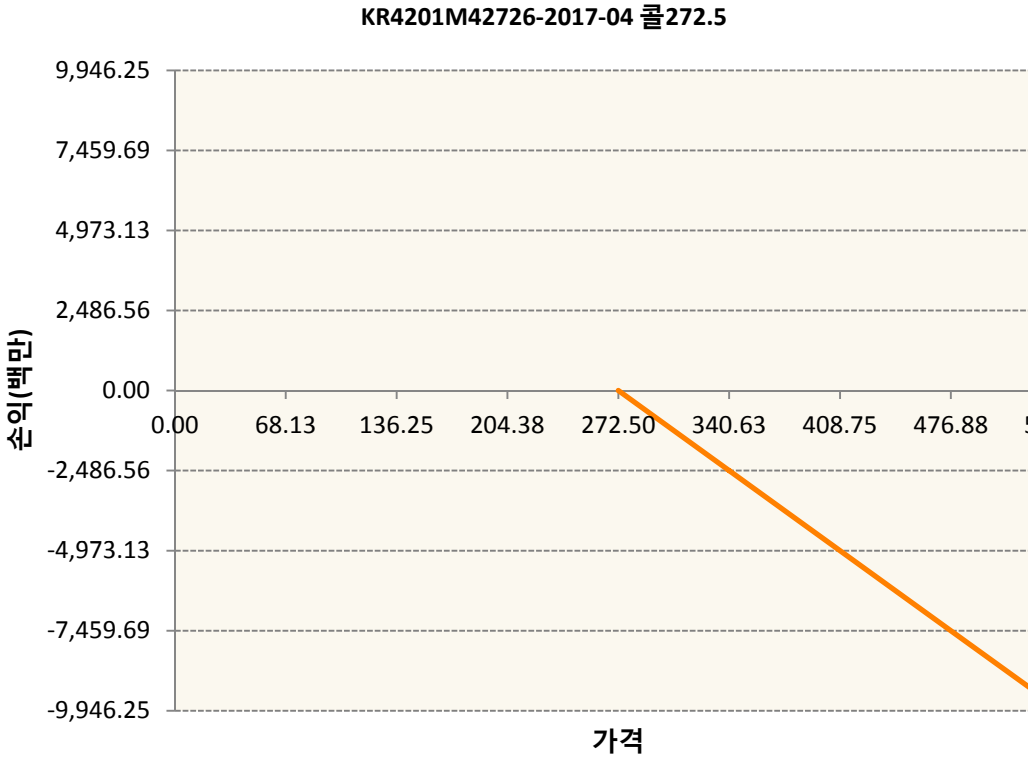
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,458	0	2,458	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,579	-12,579	장내

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%	105	105	105	105	105	105	104
-5.33%	103	103	102	101	100	100	99
-2.67%	71	70	69	68	67	66	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%	302	302	302	302	302	302	302
-5.33%	301	301	300	298	297	295	293
-2.67%	240	235	230	225	220	215	210
0%	2	1	1	0	-1	-2	-4
2.67%	-271	-271	-271	-271	-271	-271	-272
5.33%	-545	-545	-545	-545	-545	-545	-545
8.00%	-818	-818	-818	-818	-818	-818	-818

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

1,315

공시일	2017-04-06
기준일	2017-04-05

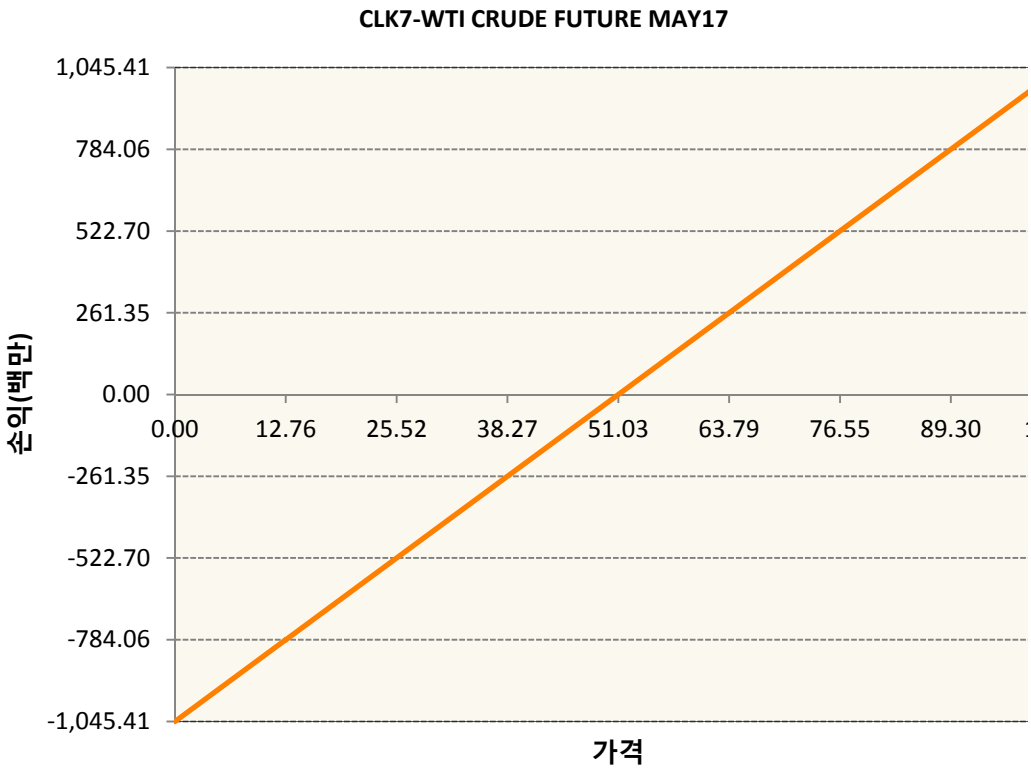
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

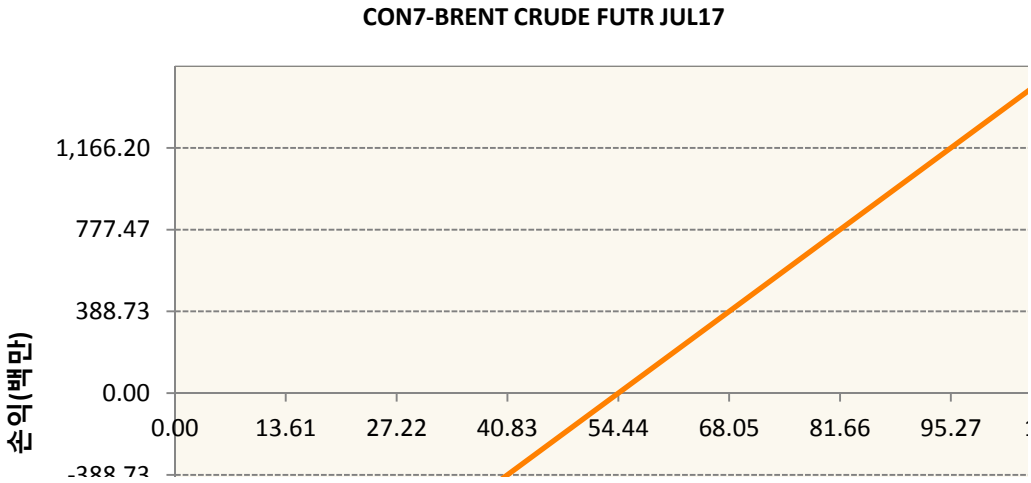
1. 계약금액

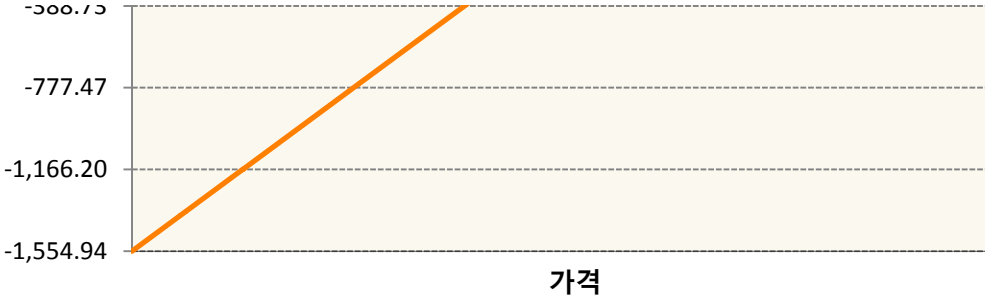
(단위:백만원)

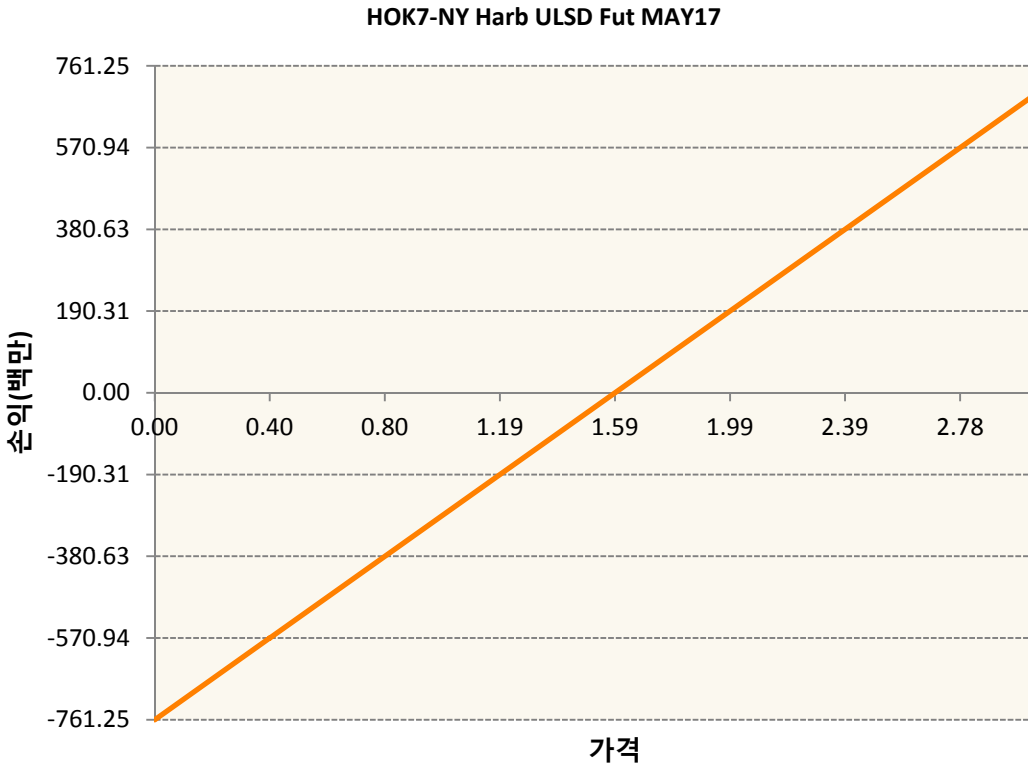
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,045	0	1,045	
누계	유가증권	선물	4,829	405	4,424	

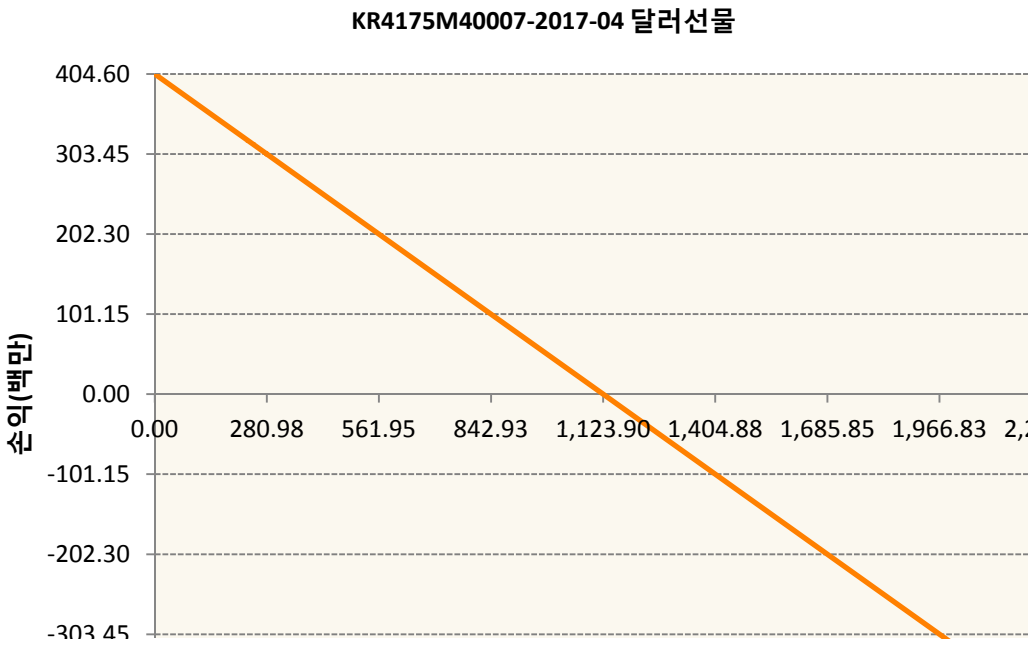
2. 만기시점의 손익구조

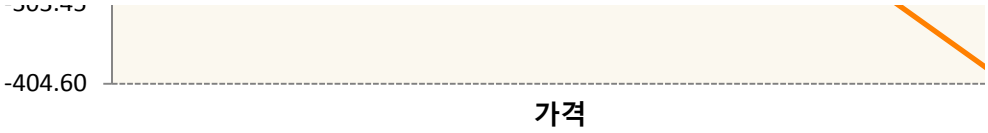


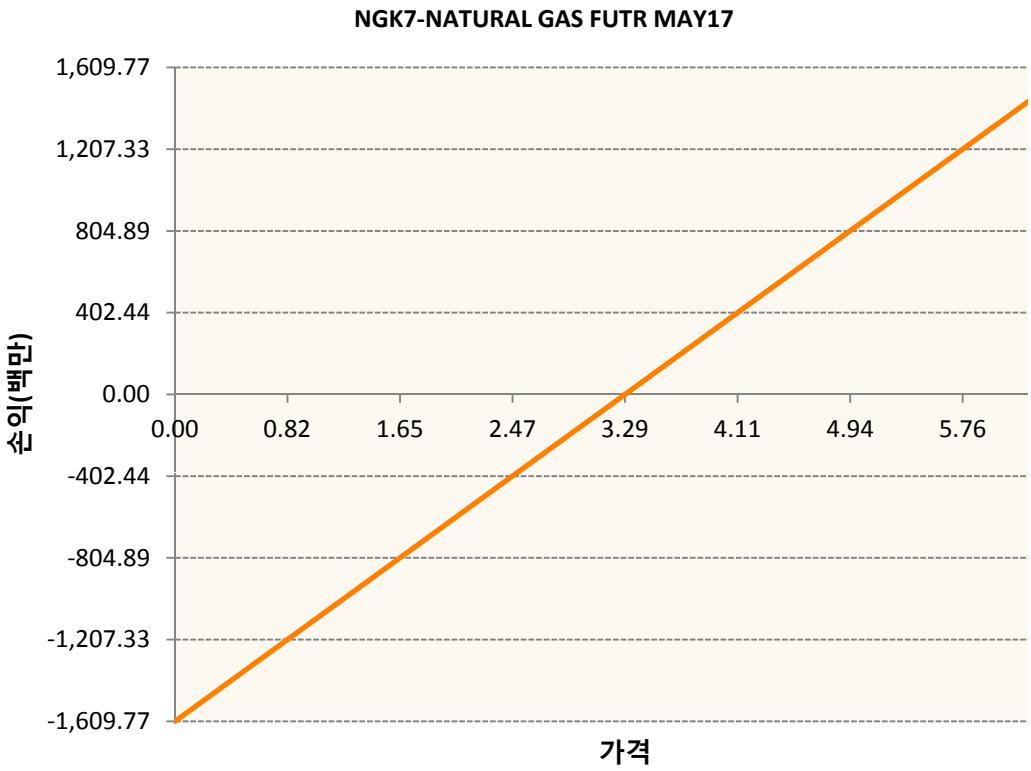


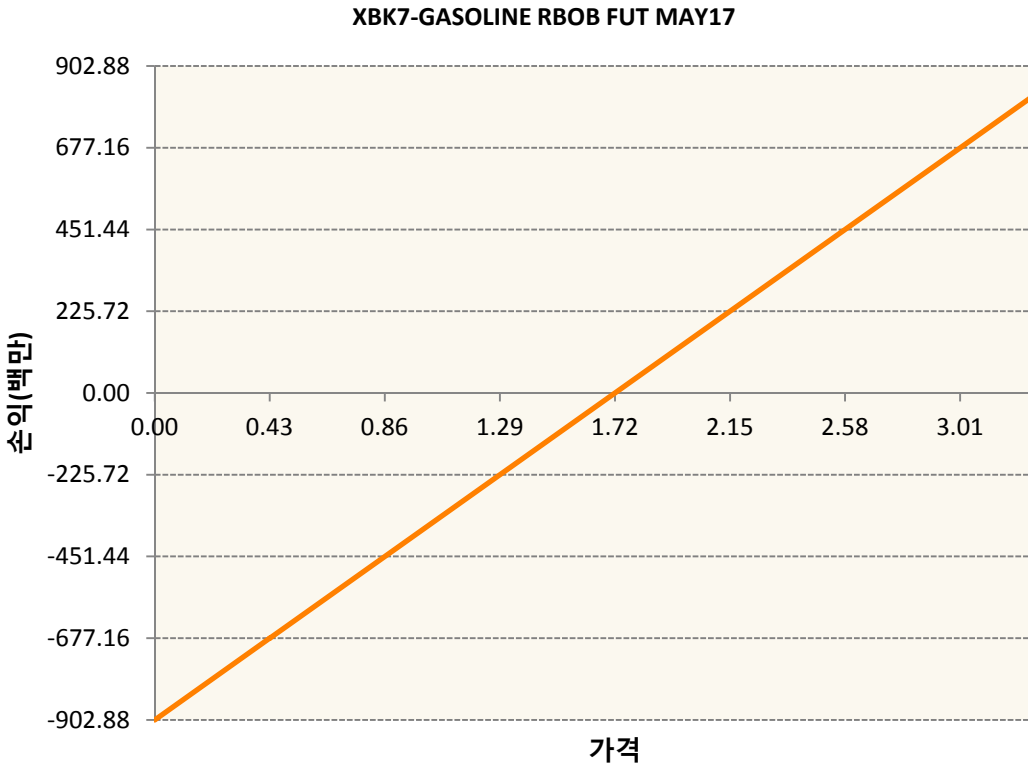

-777.47
-1,166.20
-1,554.94
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
761.25
570.94
380.63
190.31
0.00
-190.31
-380.63
-570.94
-761.25
0.00
0.40
0.80
1.19
1.59
1.99
2.39
2.78
순익(백만)
가격


KR4175M40007-2017-04 달러선물
404.60
303.45
202.30
101.15
0.00
-101.15
-202.30
-303.45
0.00
280.98
561.95
842.93
1,123.90
1,404.88
1,685.85
1,966.83
순익(백만)


-404.60
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,609.77
1,207.33
804.89
402.44
0.00
-402.44
-804.89
-1,207.33
-1,609.77
0.00
0.82
1.65
2.47
3.29
4.11
4.94
5.76
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
902.88
677.16
451.44
225.72
0.00
-225.72
-451.44
-677.16
-902.88
0.00
0.43
0.86
1.29
1.72
2.15
2.58
3.01
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK7	WTI CRUDE FUTURE MAY17	84
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	124
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	61
KR4175M40(	2017-04 달러선물	32
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	129
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	72

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

1,028

공시일	2017-04-06
기준일	2017-04-05

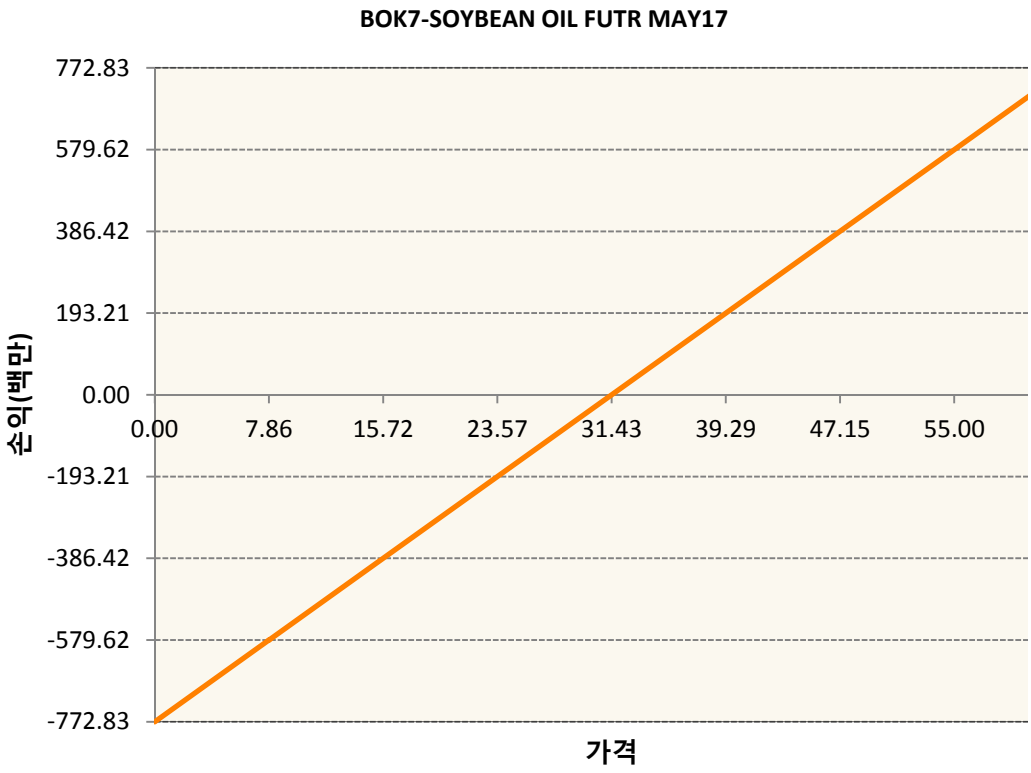
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

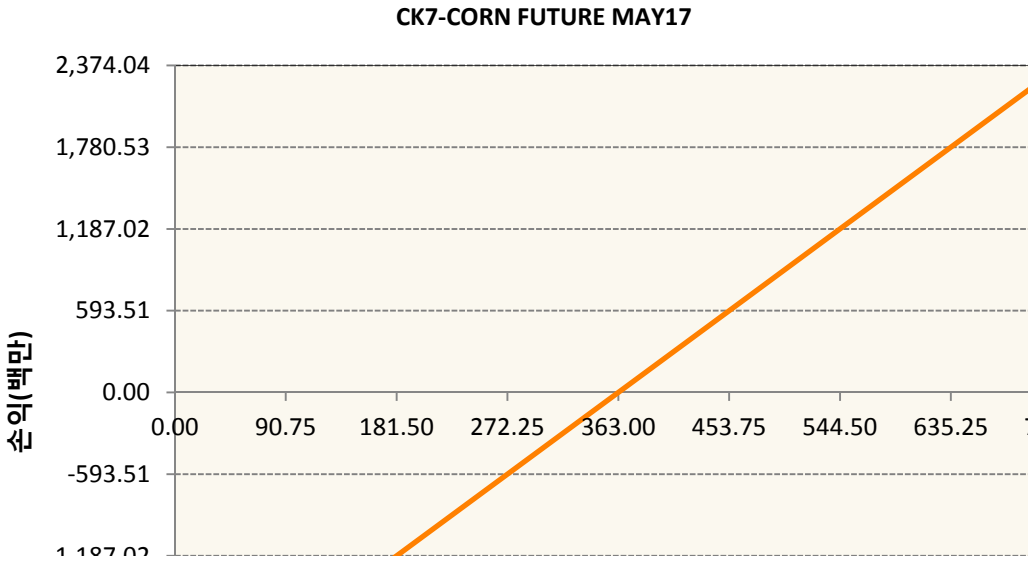
1. 계약금액

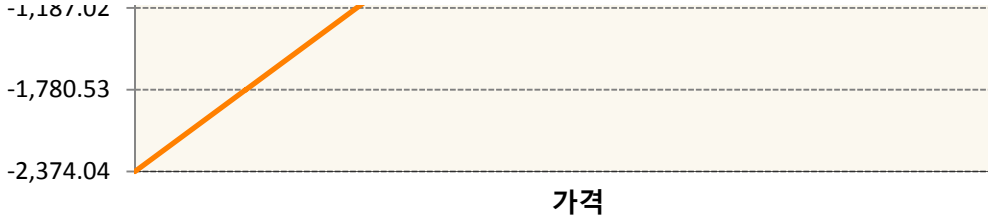
(단위:백만원)

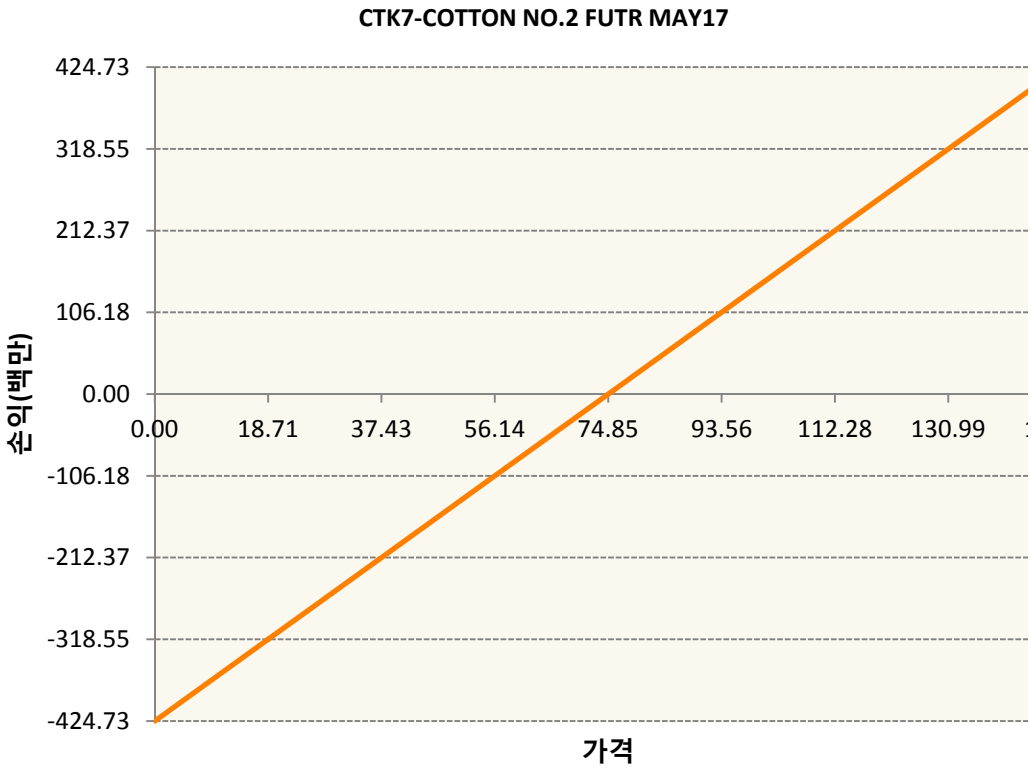
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,984	393	8,590	

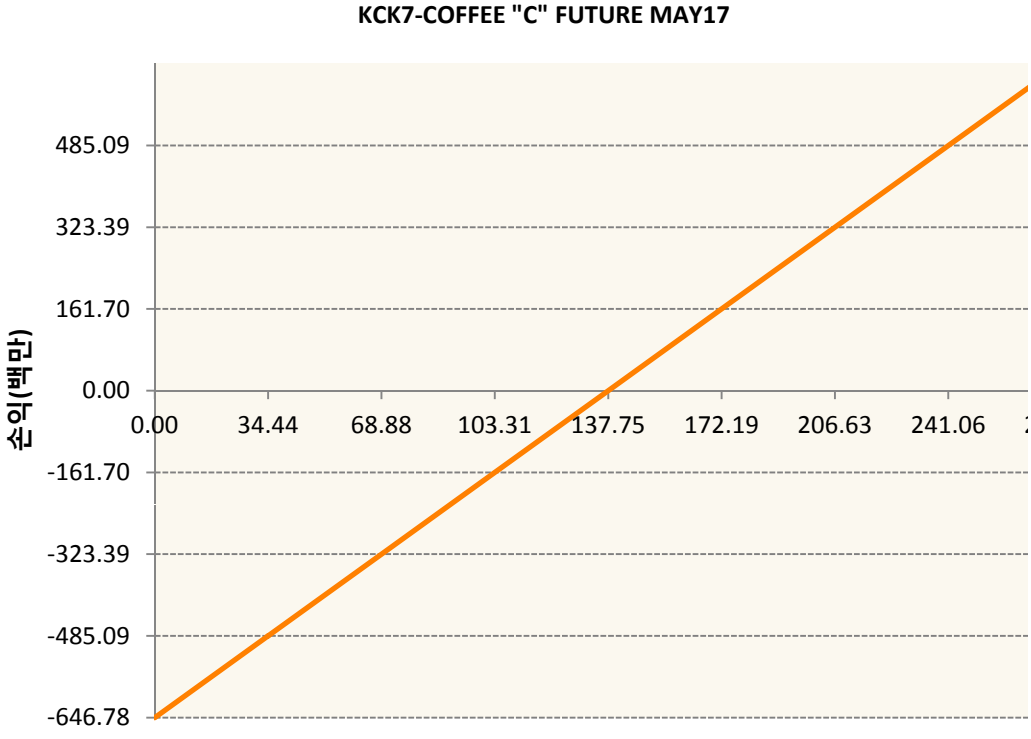
2. 만기시점의 손익구조





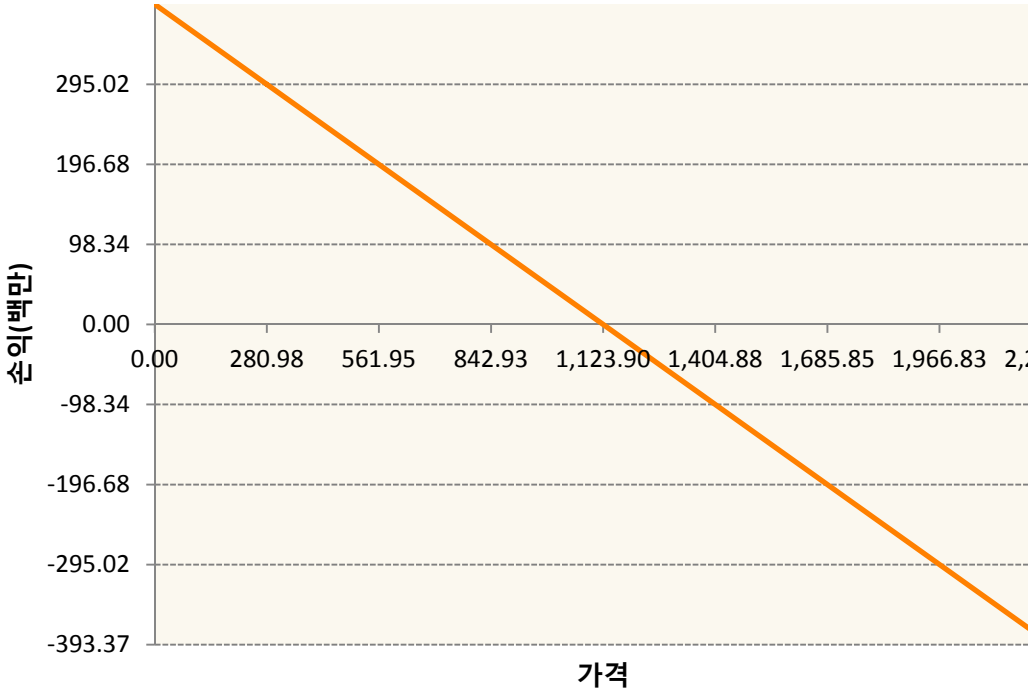

-1,780.53
-2,374.04
가격


CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
424.73
318.55
212.37
106.18
0.00
-106.18
-212.37
-318.55
-424.73
0.00
18.71
37.43
56.14
74.85
93.56
112.28
130.99
순익(백만)
가격

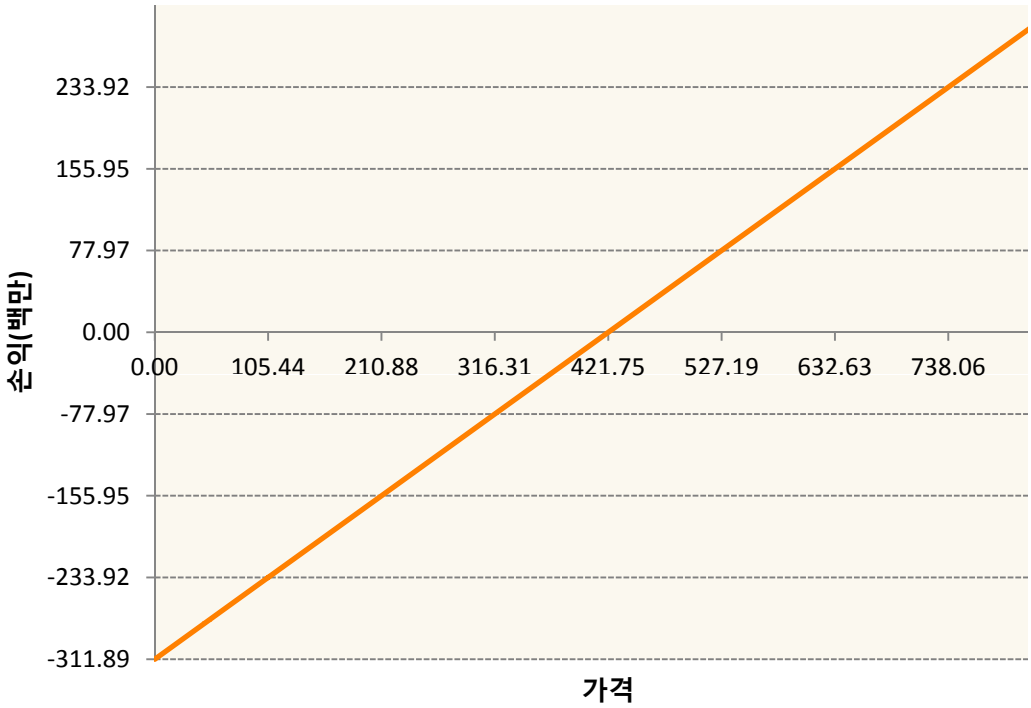

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
485.09
323.39
161.70
0.00
-161.70
-323.39
-485.09
-646.78
0.00
34.44
68.88
103.31
137.75
172.19
206.63
241.06
순익(백만)

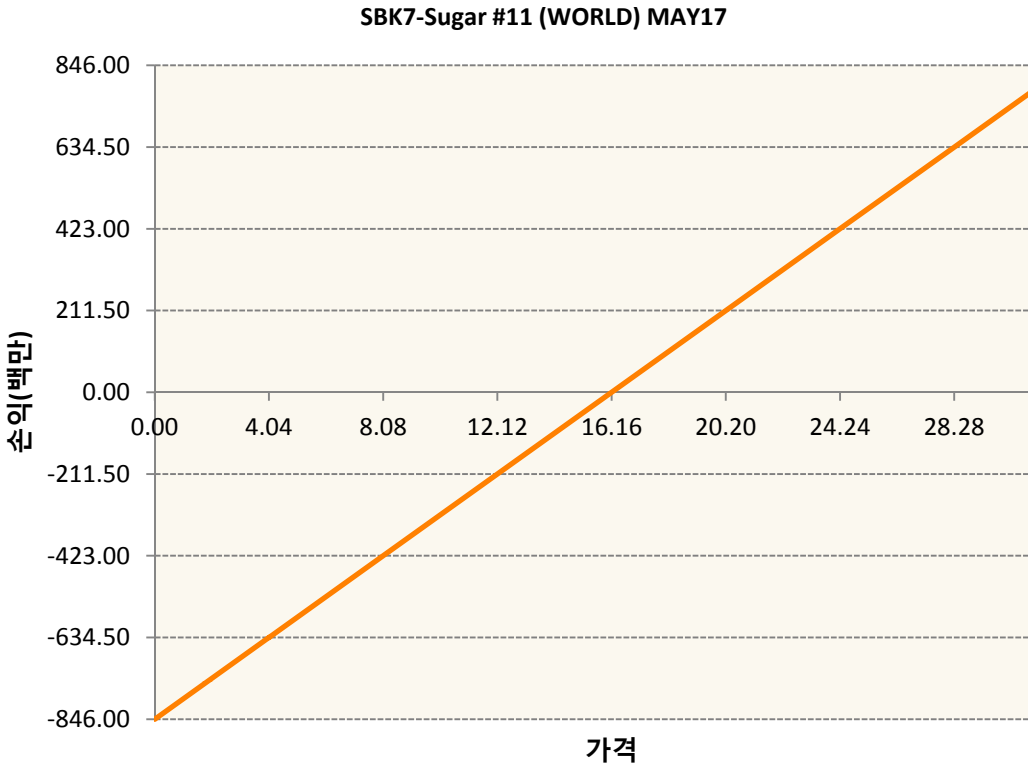
가격

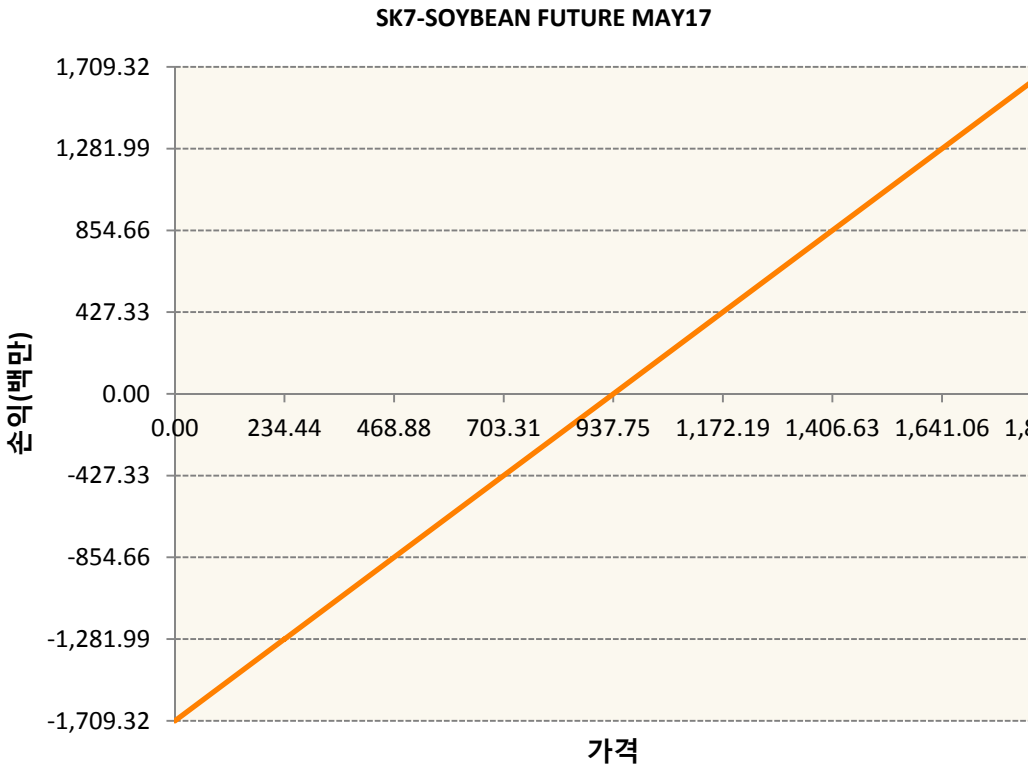
KR4175M40007-2017-04 달러선물



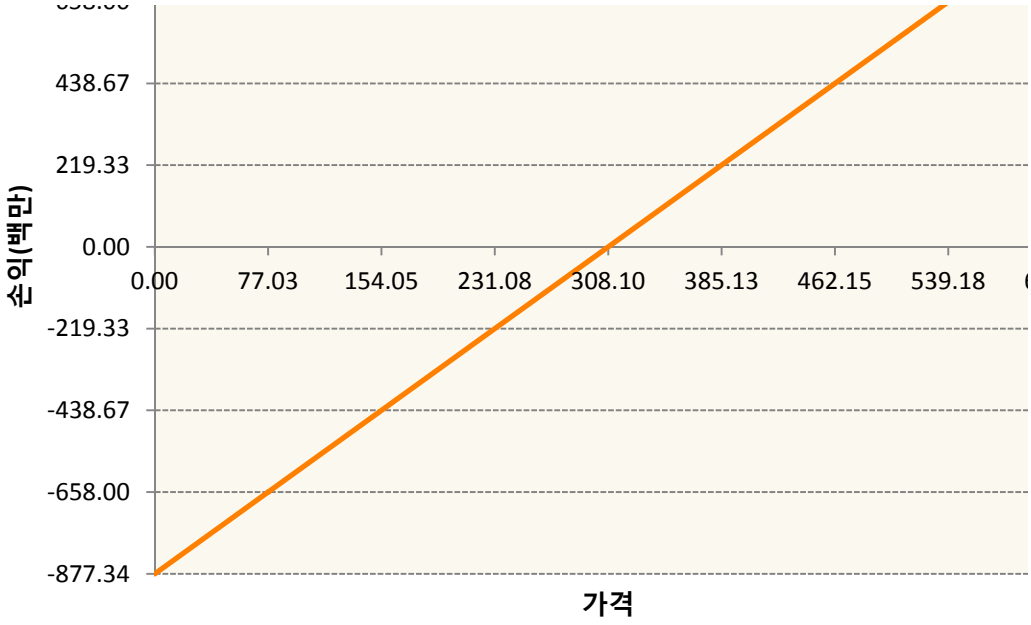
KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17

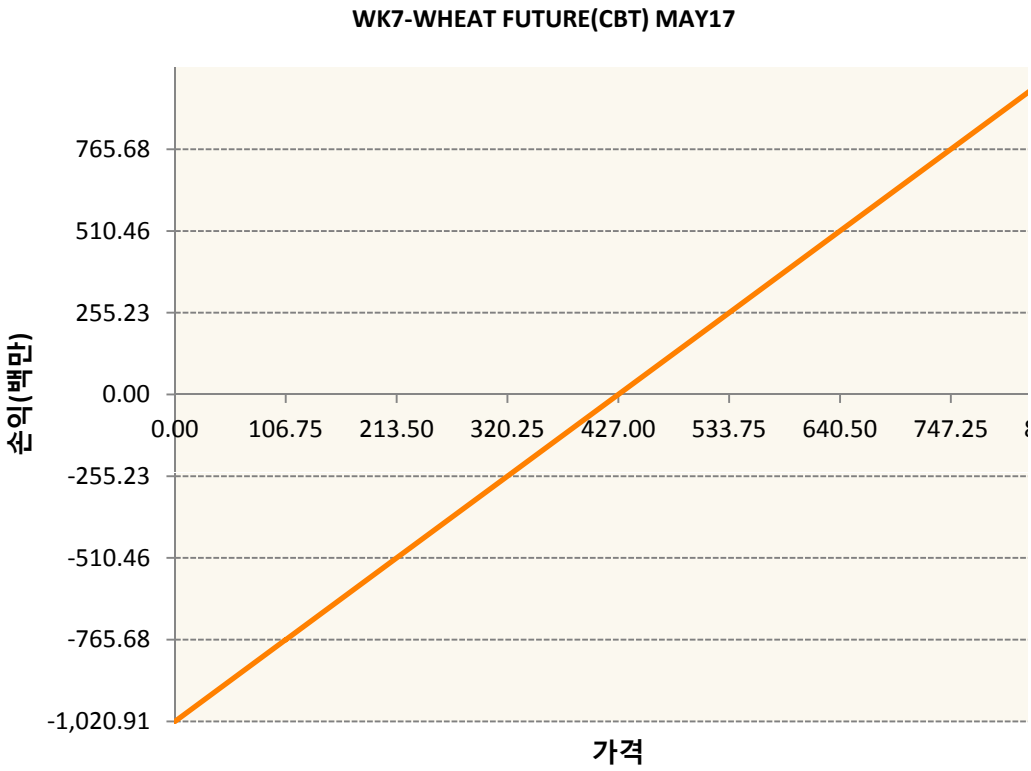



SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
846.00
634.50
423.00
211.50
0.00
-211.50
-423.00
-634.50
-846.00
0.00
4.04
8.08
12.12
16.16
20.20
24.24
28.28
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,709.32
1,281.99
854.66
427.33
0.00
-427.33
-854.66
-1,281.99
-1,709.32
0.00
234.44
468.88
703.31
937.75
1,172.19
1,406.63
1,641.06
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
877.34
658.00





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	62
CK7	CORN FUTURE MAY17	190
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	68
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)

821