공시일	2017-04-07
기준일	2017-04-06

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	2017-04-07
기준일	2017-04-06

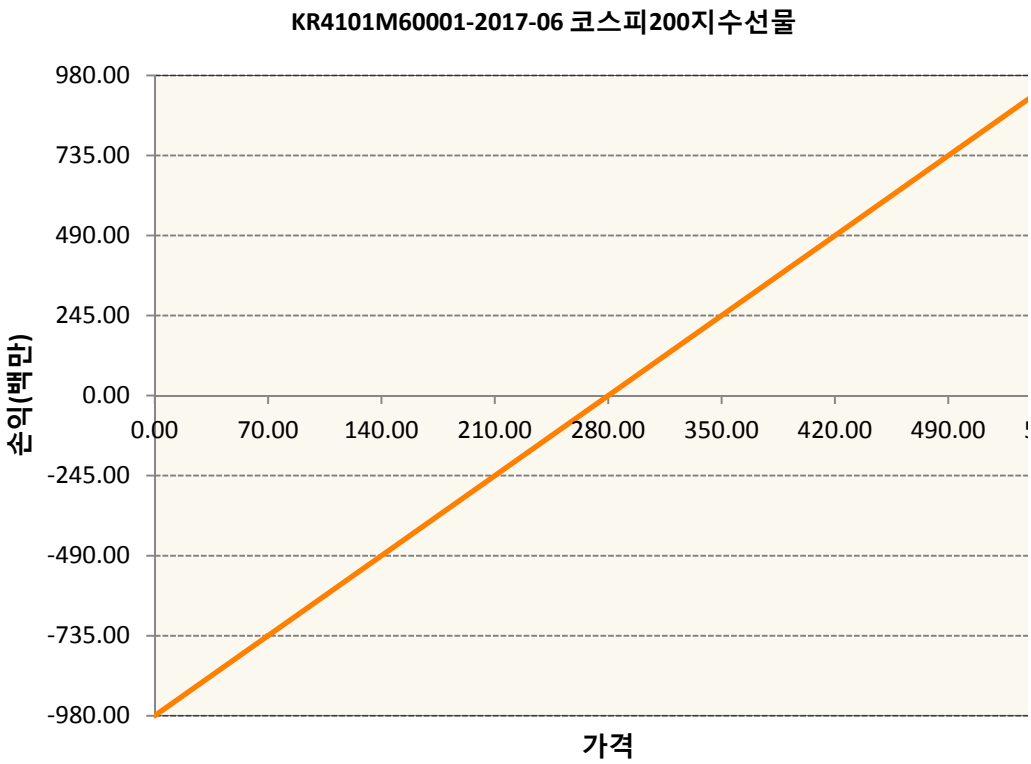
스마트인덱스모

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	980	0	980	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							78
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
-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%	78	78	78	78	78	78	78

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

50

공시일	2017-04-07
기준일	2017-04-06

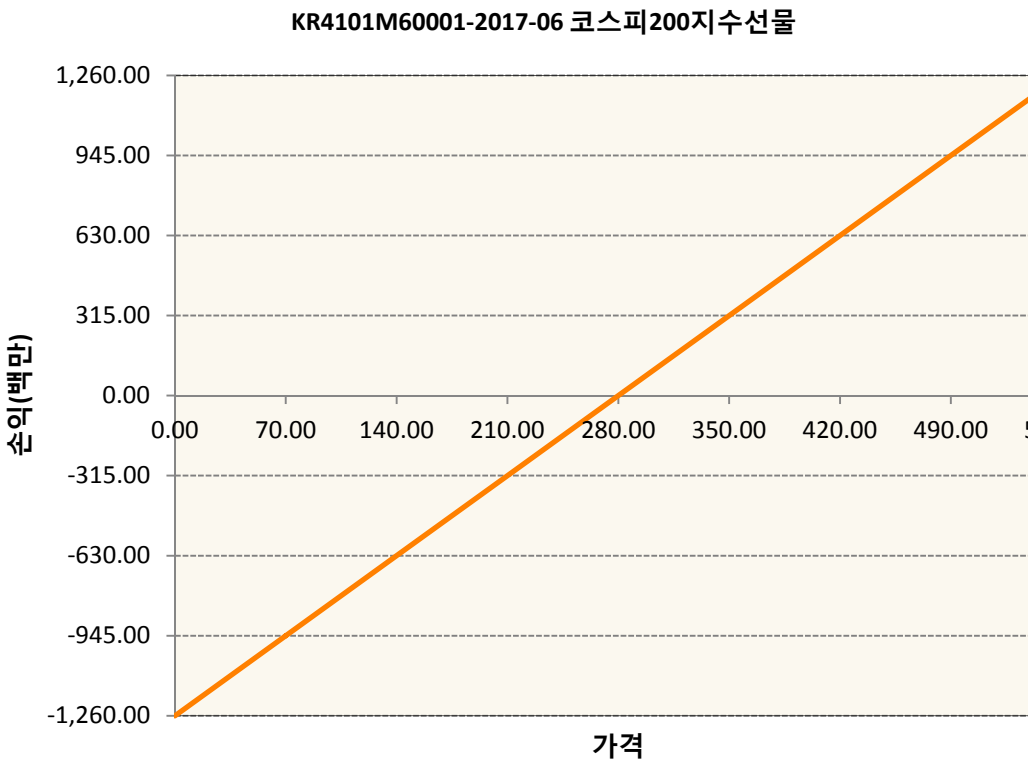
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,260	0	1,260	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	2017-04-07
기준일	2017-04-06

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	955

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

549

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-04-07
기준일	2017-04-06

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	398

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

423

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-04-07
기준일	2017-04-06

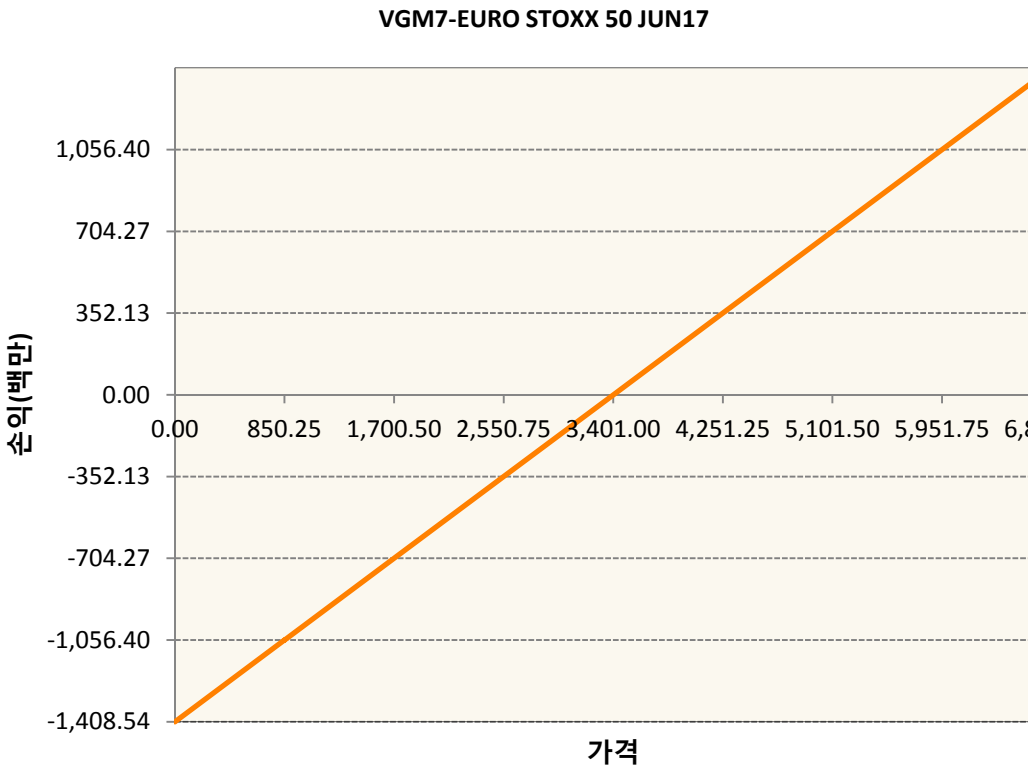
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,409	0	1,409	

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	2017-04-07
기준일	2017-04-06

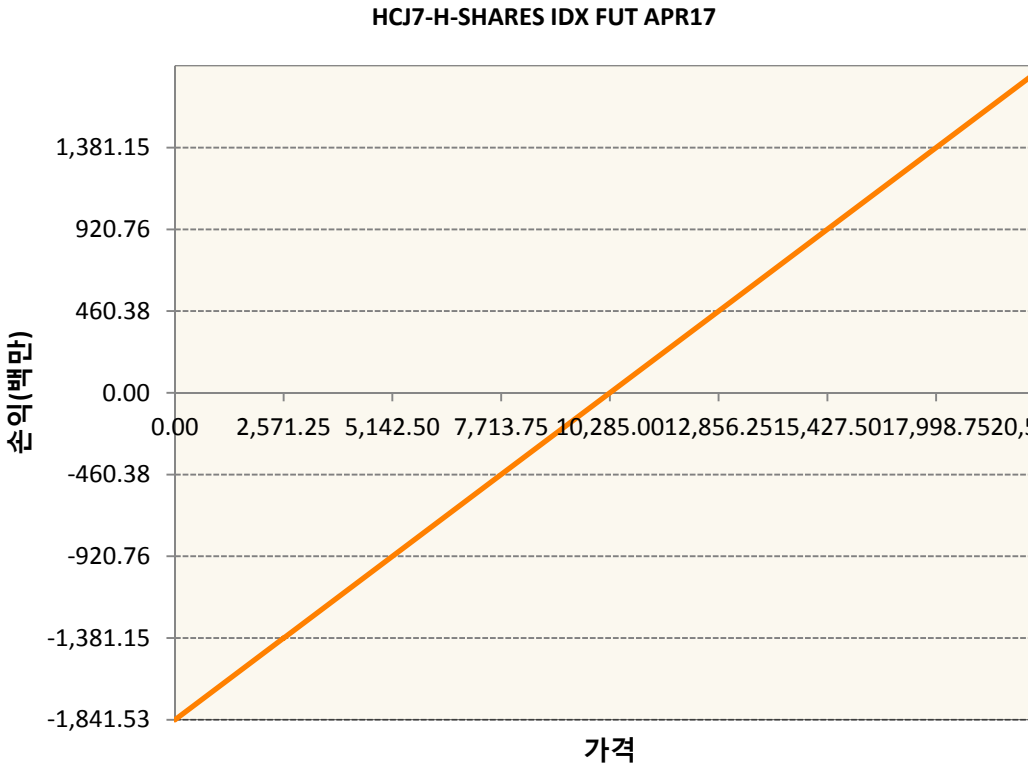
차이나인덱스모(주식-파생형)

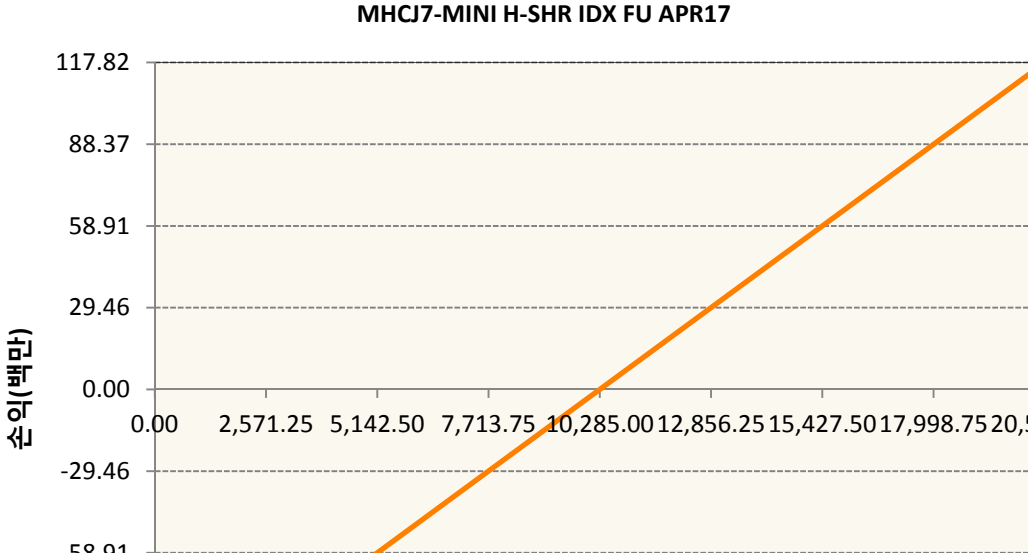
1. 계약금액

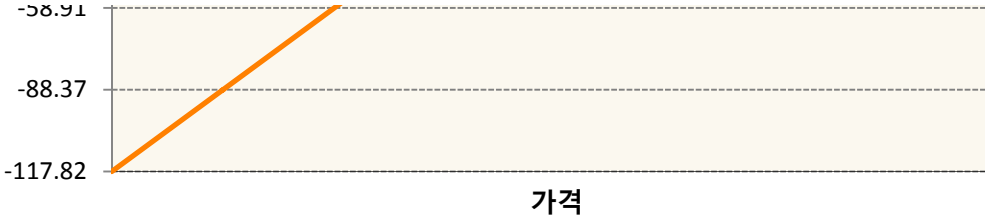
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,959	0	1,959	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCJ7	H-SHARES IDX FUT APR17	147
MHCJ7	MINI H-SHR IDX FU APR17	9

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

168

공시일	2017-04-07
기준일	2017-04-06

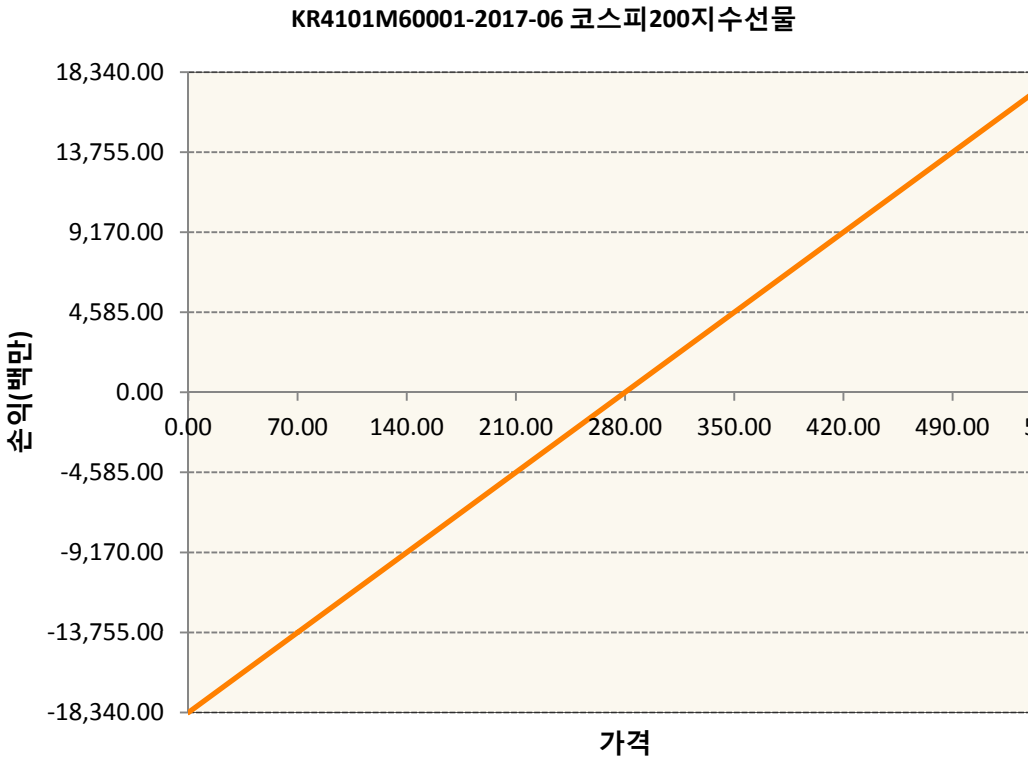
커버드콜모(주식혼합-파생형)

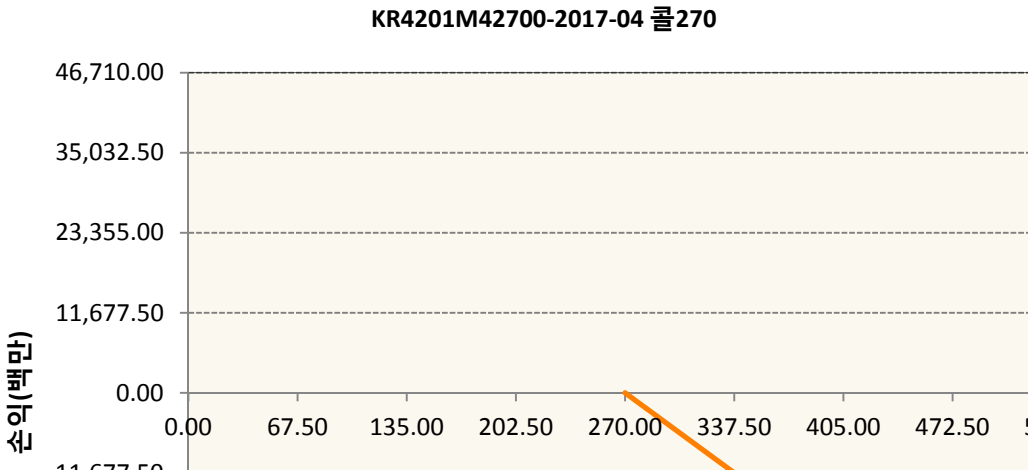
1. 계약금액

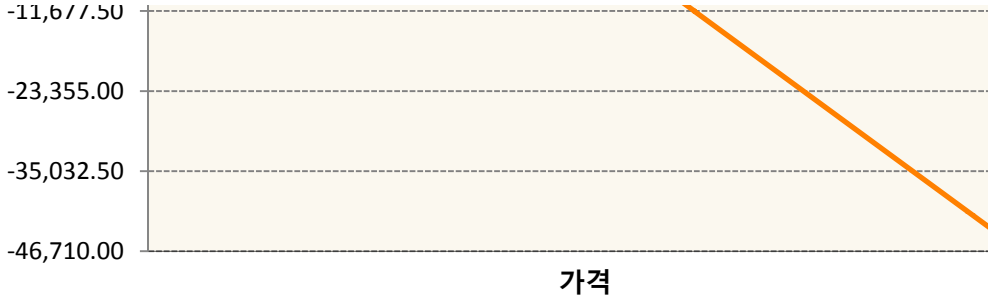
(단위:백만원)

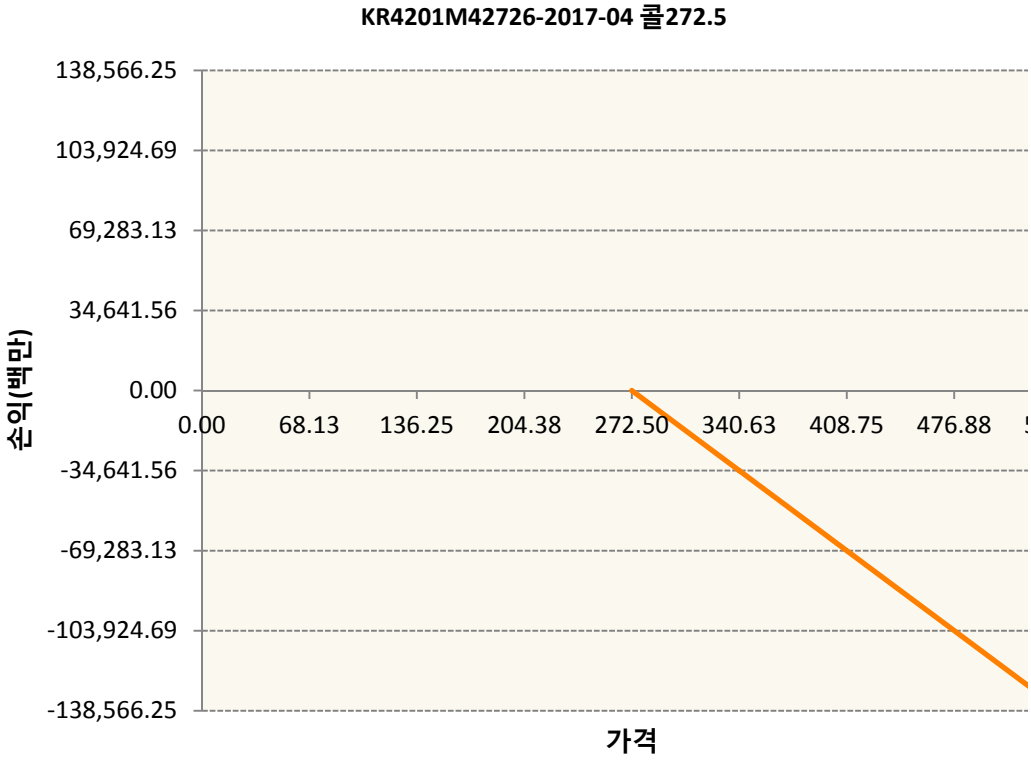
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	3,350	-3,350	장내
신규	유가증권	옵션	3,193	6,818	-3,625	장내
누계	유가증권	선물	18,340	0	18,340	장내
누계	유가증권	옵션	0	192,089	-192,089	장내

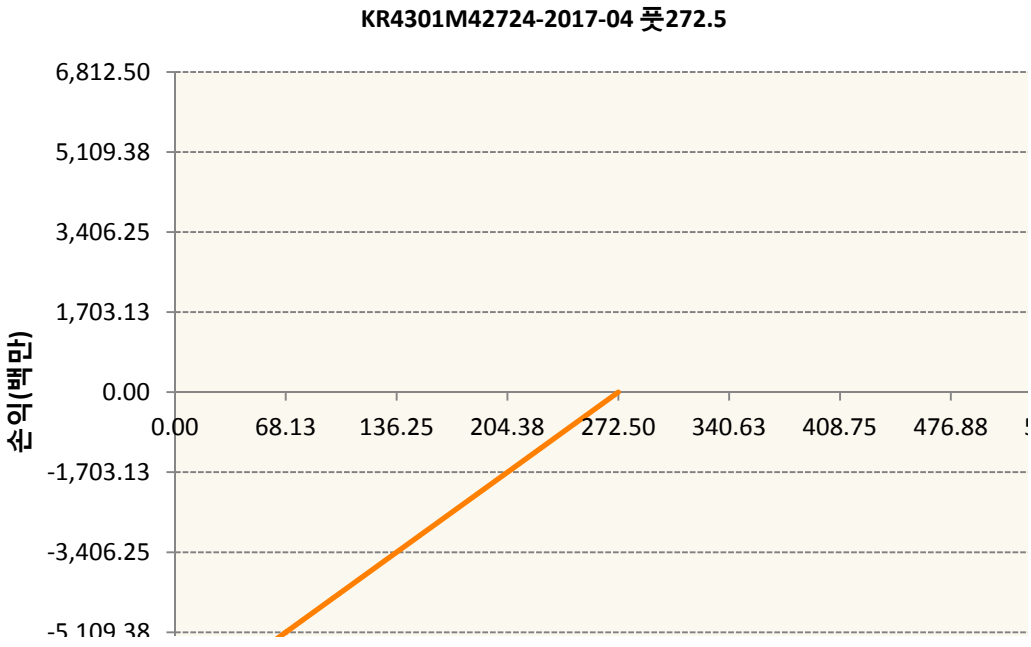
2. 만기시점의 손익구조

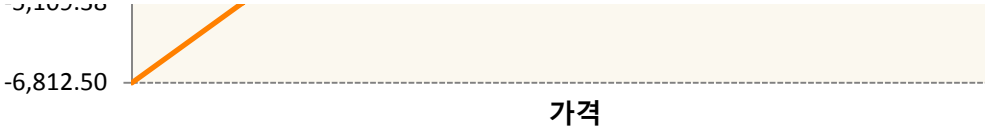





-11,677.50
-23,355.00
-35,032.50
-46,710.00
가격


KR4201M42726-2017-04 콜272.5
138,566.25
103,924.69
69,283.13
34,641.56
0.00
-34,641.56
-69,283.13
-103,924.69
-138,566.25
0.00
68.13
136.25
204.38
272.50
340.63
408.75
476.88
순익(백만)
가격


KR4301M42724-2017-04 풋272.5
6,812.50
5,109.38
3,406.25
1,703.13
0.00
-1,703.13
-3,406.25
-5,109.38
0.00
68.13
136.25
204.38
272.50
340.63
408.75
476.88
순익(백만)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							1,464
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,464	-1,464	-1,464	-1,464	-1,464	-1,464	-1,464
-5.33%	-976	-976	-976	-976	-976	-976	-976
-2.67%	-488	-488	-488	-488	-488	-488	-488
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	488	488	488	488	488	488	488
5.33%	976	976	976	976	976	976	976
8.00%	1,464	1,464	1,464	1,464	1,464	1,464	1,464
KR4201M42 2017-04 콜270							3,863
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,639	1,639	1,639	1,639	1,639	1,638	1,637
-5.33%	1,630	1,624	1,616	1,606	1,595	1,582	1,569
-2.67%	1,203	1,183	1,162	1,140	1,118	1,095	1,073
0%	3	3	2	0	-3	-6	-11
2.67%	-1,285	-1,285	-1,285	-1,285	-1,285	-1,285	-1,285
5.33%	-2,574	-2,574	-2,574	-2,574	-2,574	-2,574	-2,574
8.00%	-3,863	-3,863	-3,863	-3,863	-3,863	-3,863	-3,863
KR4201M42 2017-04 콜272.5							11,314
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,587	3,587	3,587	3,587	3,587	3,587	3,586
-5.33%	3,584	3,580	3,573	3,562	3,548	3,531	3,509
-2.67%	3,054	2,983	2,911	2,839	2,767	2,695	2,623
0%	41	32	18	0	-22	-49	-79
2.67%	-3,737	-3,737	-3,738	-3,738	-3,738	-3,739	-3,741
5.33%	-7,526	-7,526	-7,526	-7,526	-7,526	-7,526	-7,526
8.00%	-11,314	-11,314	-11,314	-11,314	-11,314	-11,314	-11,314
KR4301M42 2017-04 풋272.5							382
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-382	-382	-382	-382	-382	-382	-382
-5.33%	-196	-197	-197	-197	-198	-199	-200
-2.67%	-36	-40	-43	-47	-50	-54	-57

0%	2	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	3	3	2	2	2	2	2
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

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

19,382

공시일	2017-04-07
기준일	2017-04-06

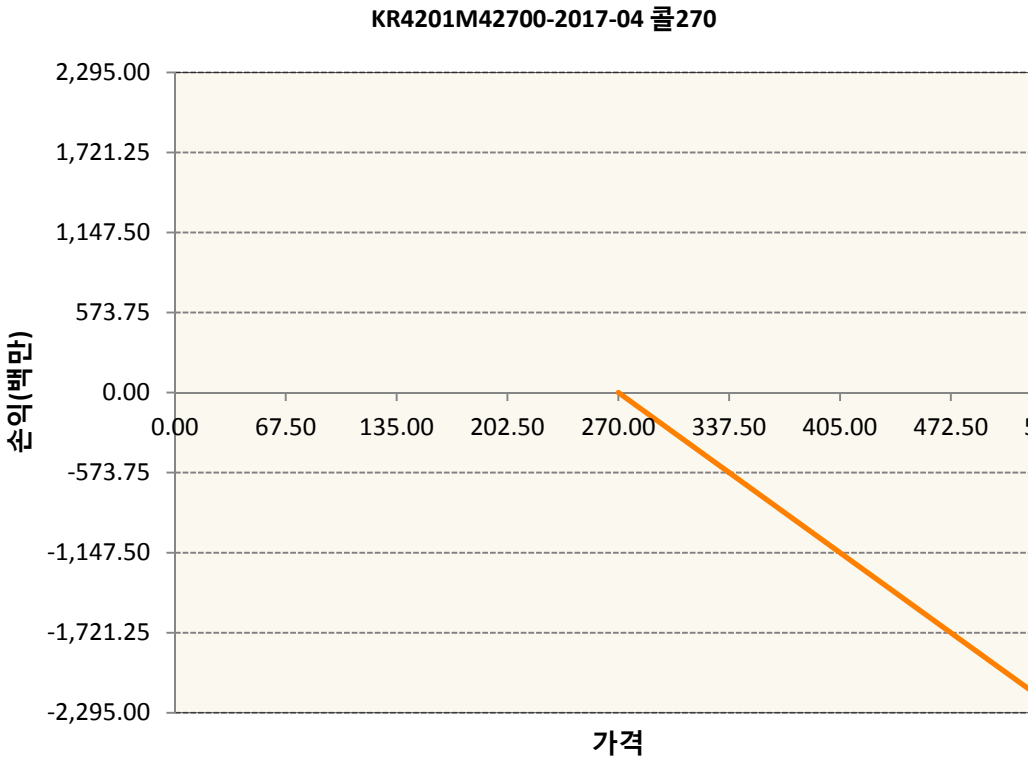
커버드콜목표전환형증권투자신탁

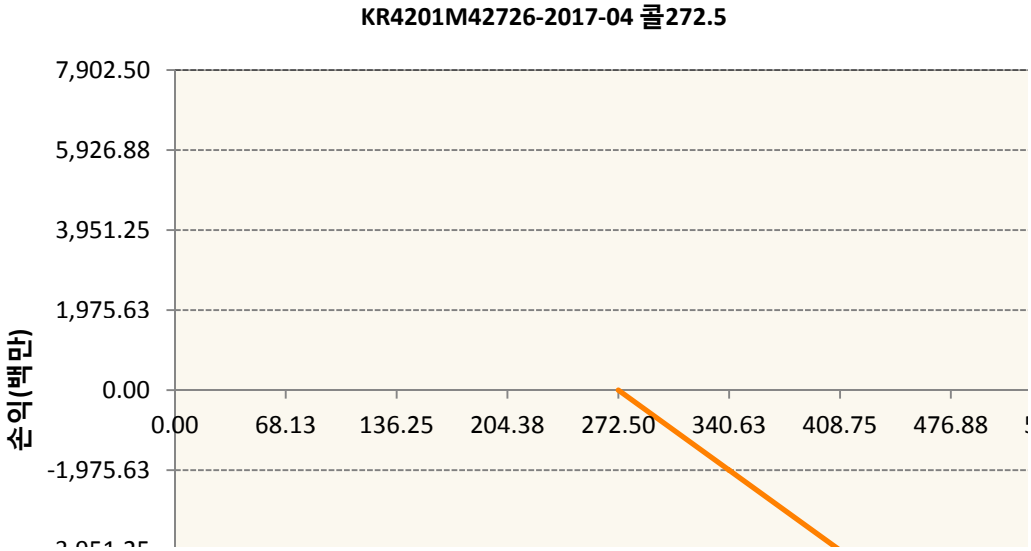
1. 계약금액

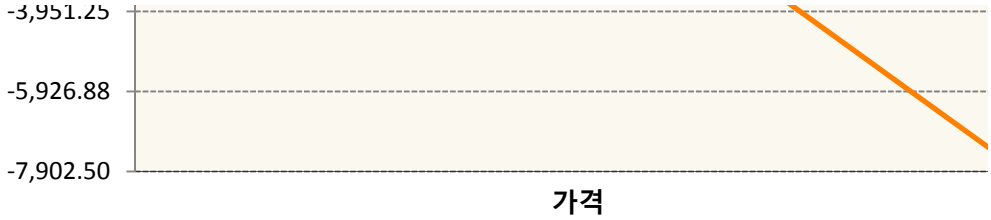
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	2,322	0	2,322	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,198	-10,198	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M42: 2017-04 콜270							190
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	81	81	81	81	81	80	80
-5.33%	80	80	79	79	78	78	77
-2.67%	59	58	57	56	55	54	53
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
5.33%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
8.00%	-190	-190	-190	-190	-190	-190	-190

KR4201M42: 2017-04 콜272.5							645
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	205	205	205	205	205	205	205
-5.33%	204	204	204	203	202	201	200
-2.67%	174	170	166	162	158	154	150
0%	2	2	1	0	-1	-3	-5
2.67%	-213	-213	-213	-213	-213	-213	-213
5.33%	-429	-429	-429	-429	-429	-429	-429
8.00%	-645	-645	-645	-645	-645	-645	-645

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

1,001

공시일	2017-04-07
기준일	2017-04-06

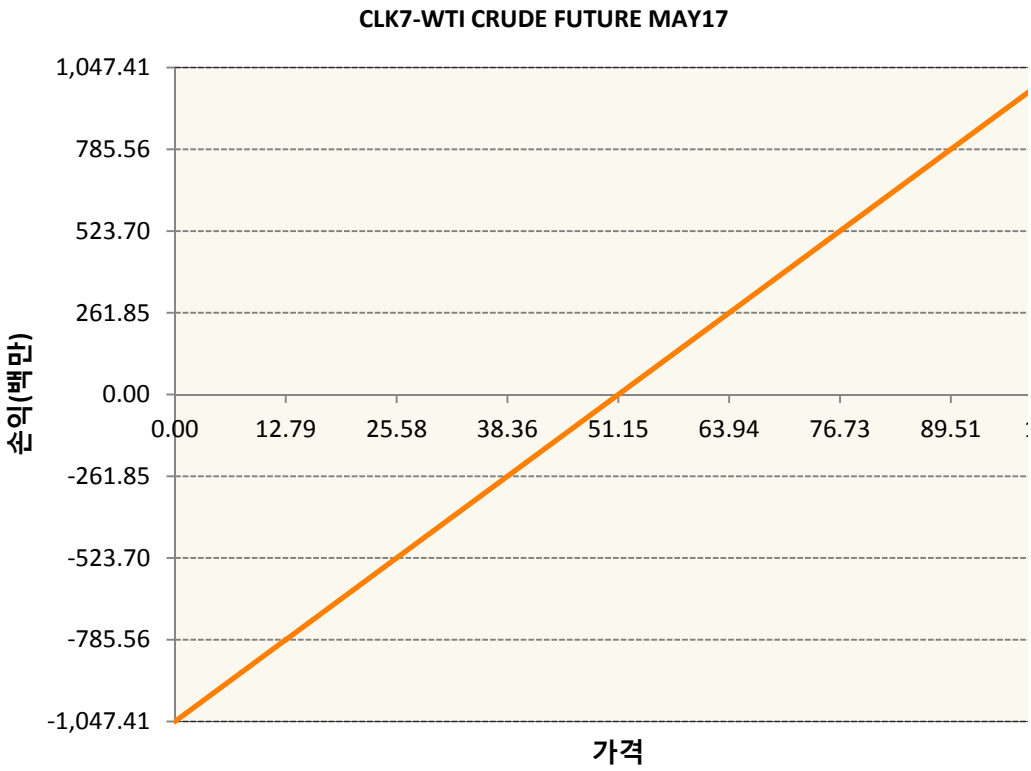
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

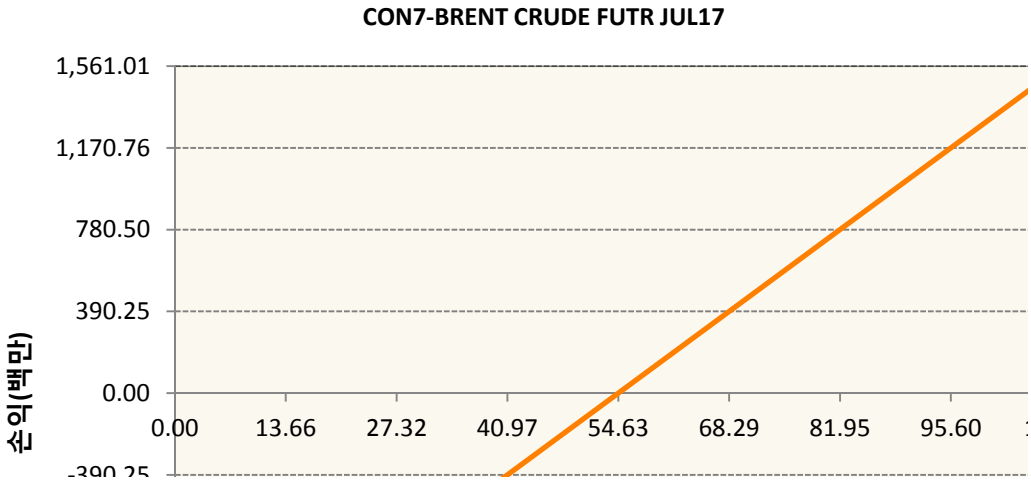
1. 계약금액

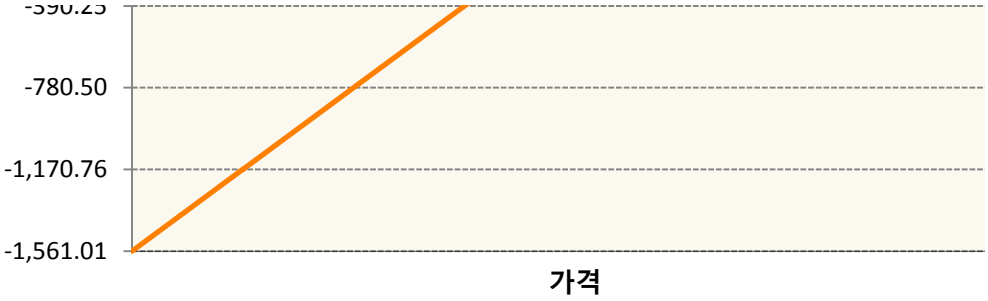
(단위:백만원)

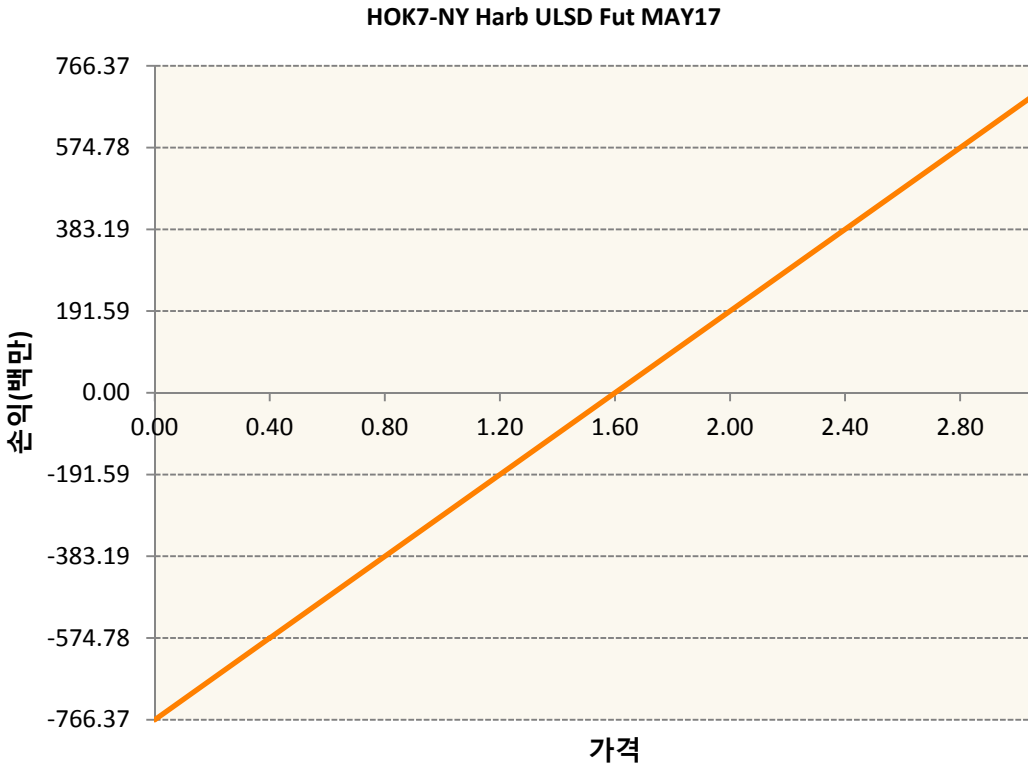
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,047	0	1,047	
누계	유가증권	선물	4,824	408	4,416	

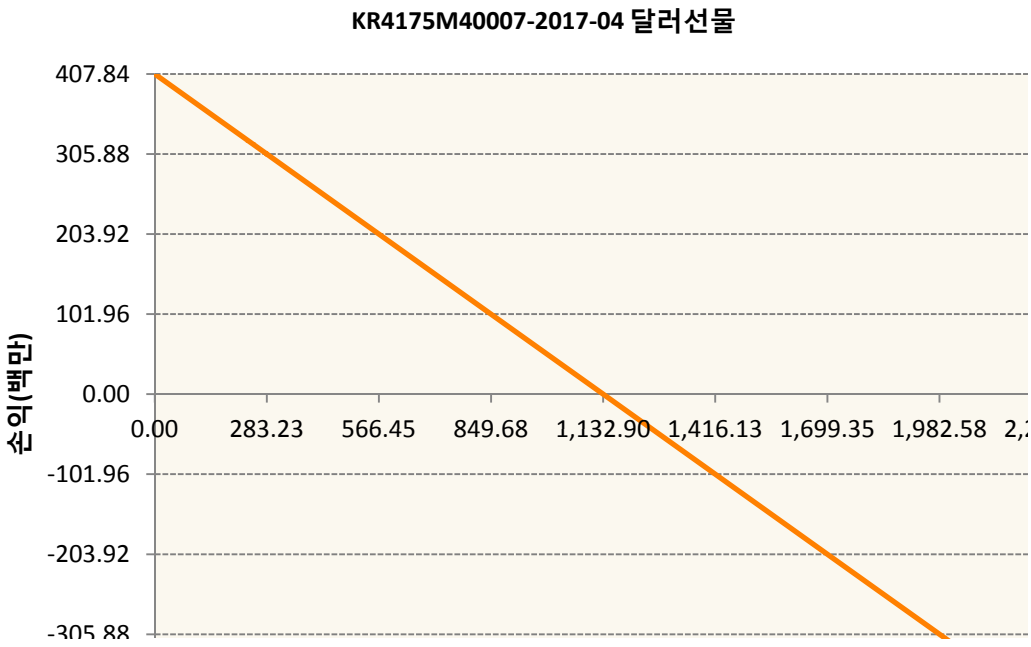
2. 만기시점의 손익구조

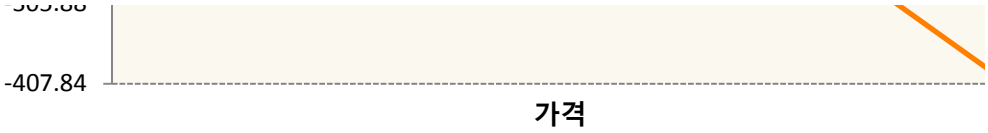


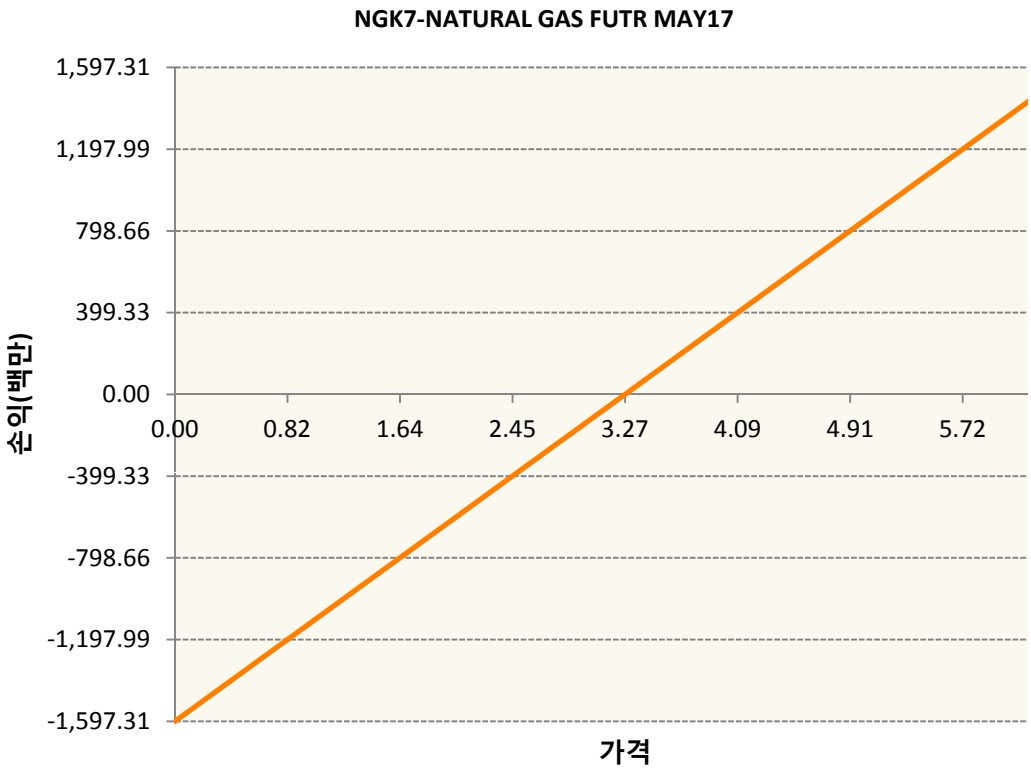


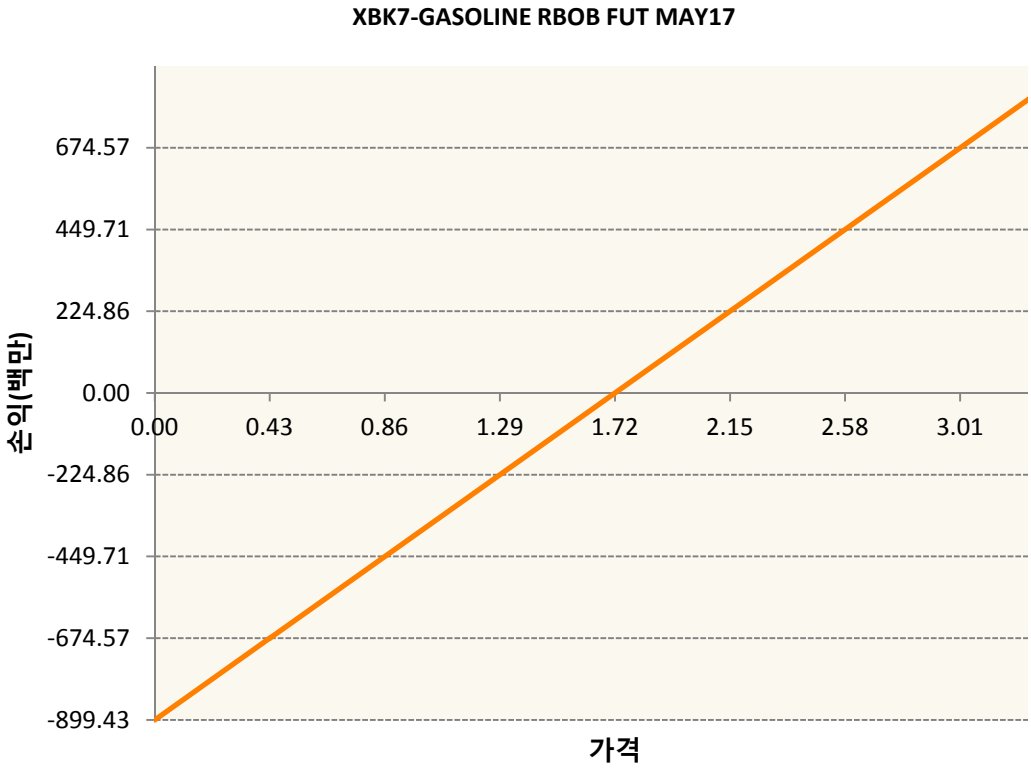

-780.50
-1,170.76
-1,561.01
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
766.37
574.78
383.19
191.59
0.00
-191.59
-383.19
-574.78
-766.37
0.00
0.40
0.80
1.20
1.60
2.00
2.40
2.80
순익(백만)
가격


KR4175M40007-2017-04 달러선물
407.84
305.88
203.92
101.96
0.00
-101.96
-203.92
-305.88
0.00
283.23
566.45
849.68
1,132.90
1,416.13
1,699.35
1,982.58
순익(백만)


-407.84
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,597.31
1,197.99
798.66
399.33
0.00
-399.33
-798.66
-1,197.99
-1,597.31
0.00
0.82
1.64
2.45
3.27
4.09
4.91
5.72
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
674.57
449.71
224.86
0.00
-224.86
-449.71
-674.57
-899.43
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	125
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	61
KR4175M40(	2017-04 달러선물	33
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	128
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	72

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

1,026

공시일	2017-04-07
기준일	2017-04-06

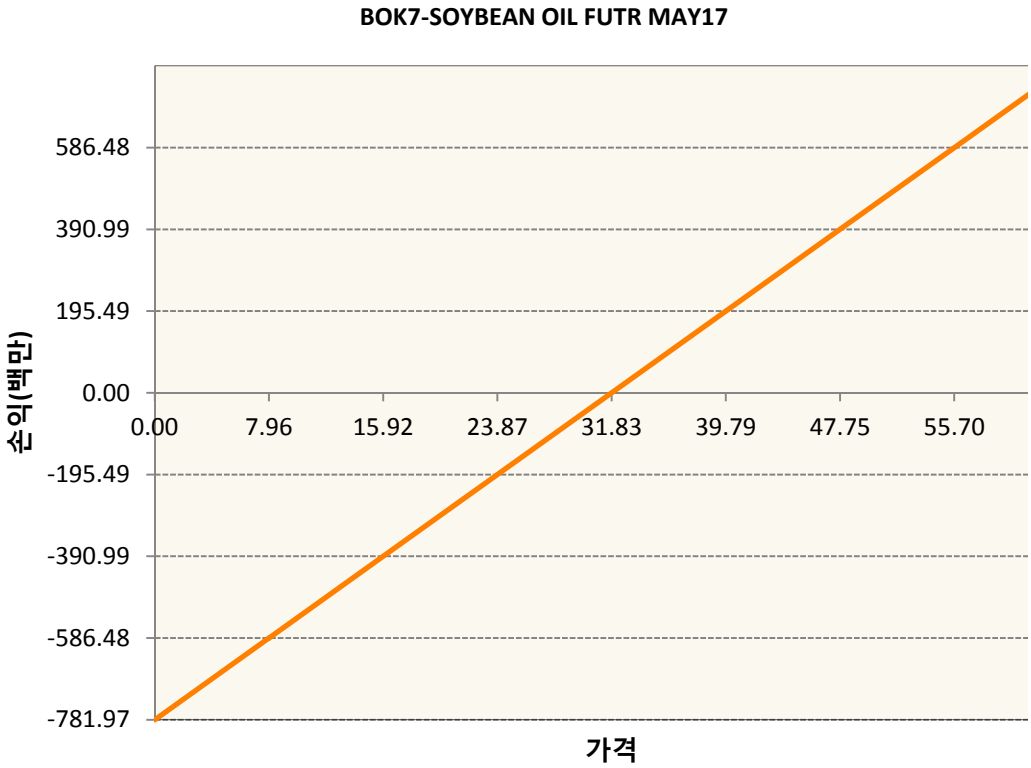
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

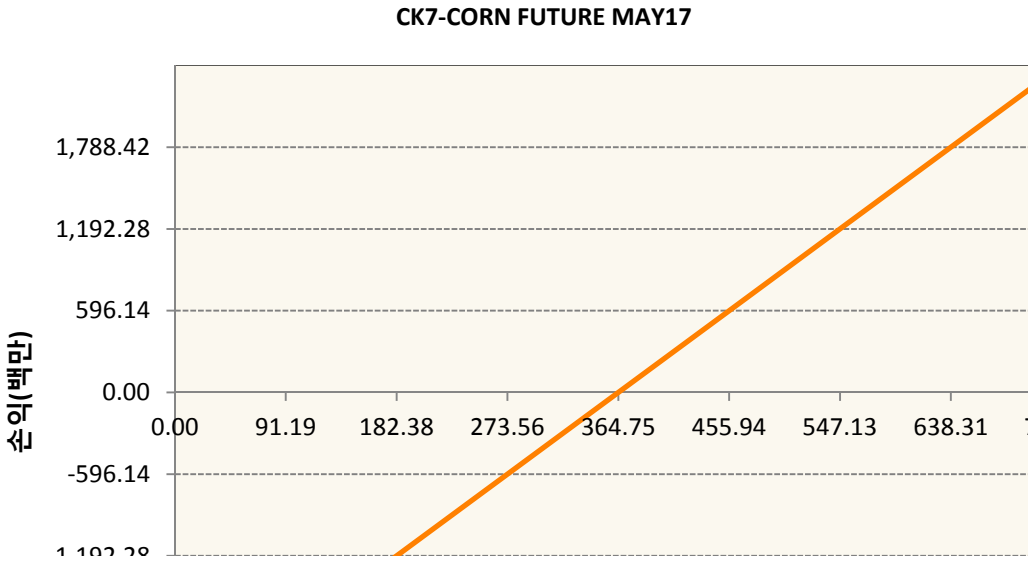
1. 계약금액

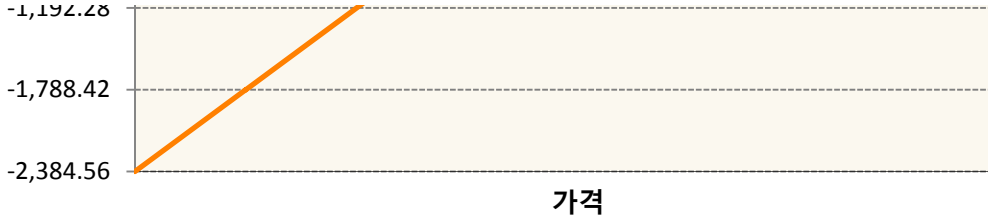
(단위:백만원)

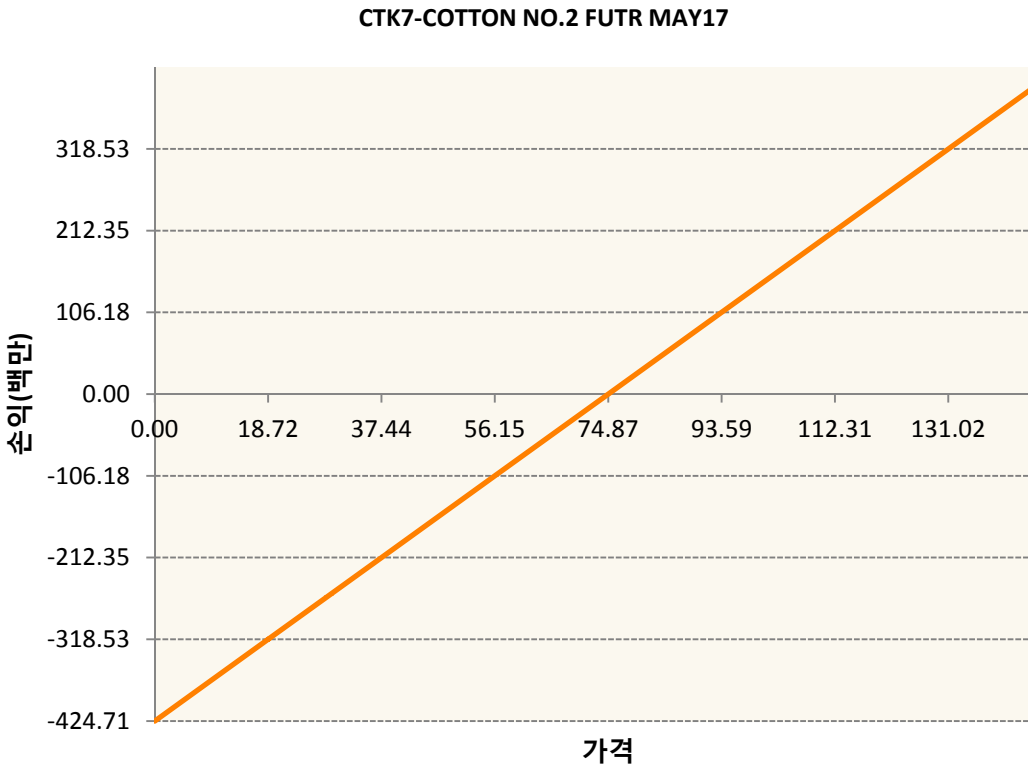
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,018	397	8,622	

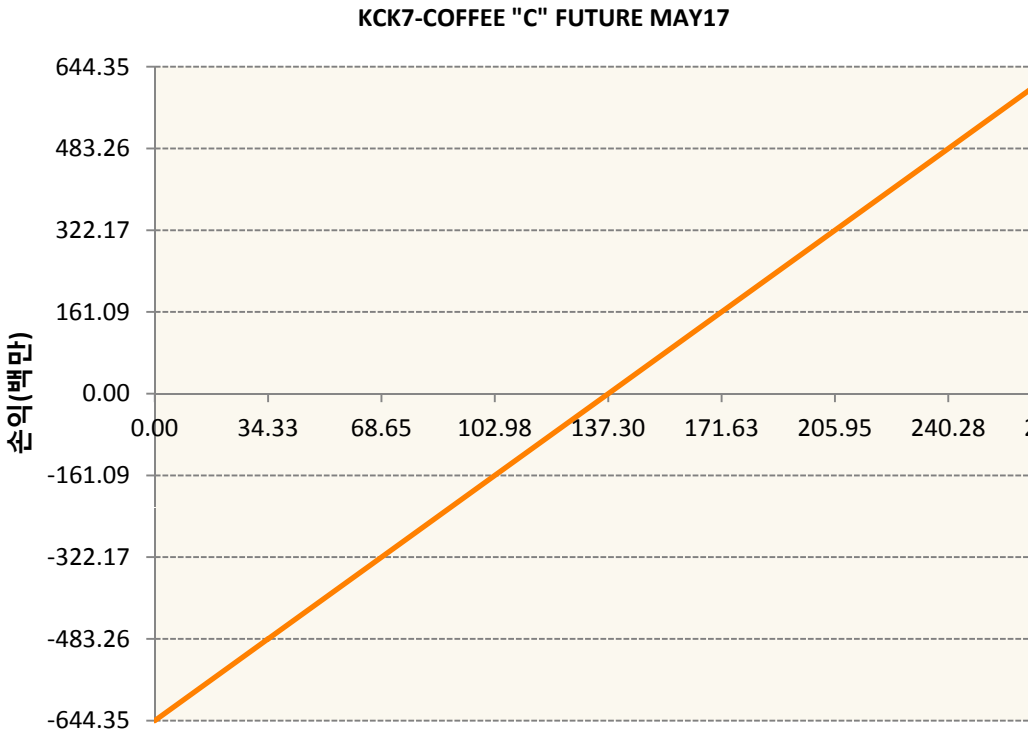
2. 만기시점의 손익구조



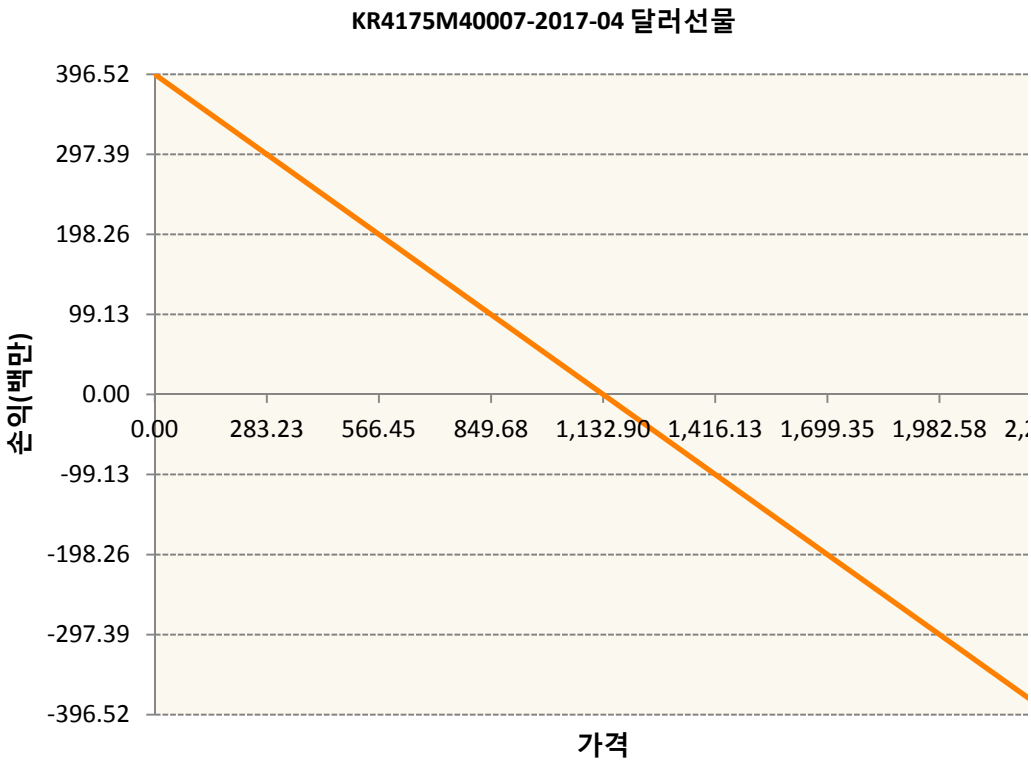


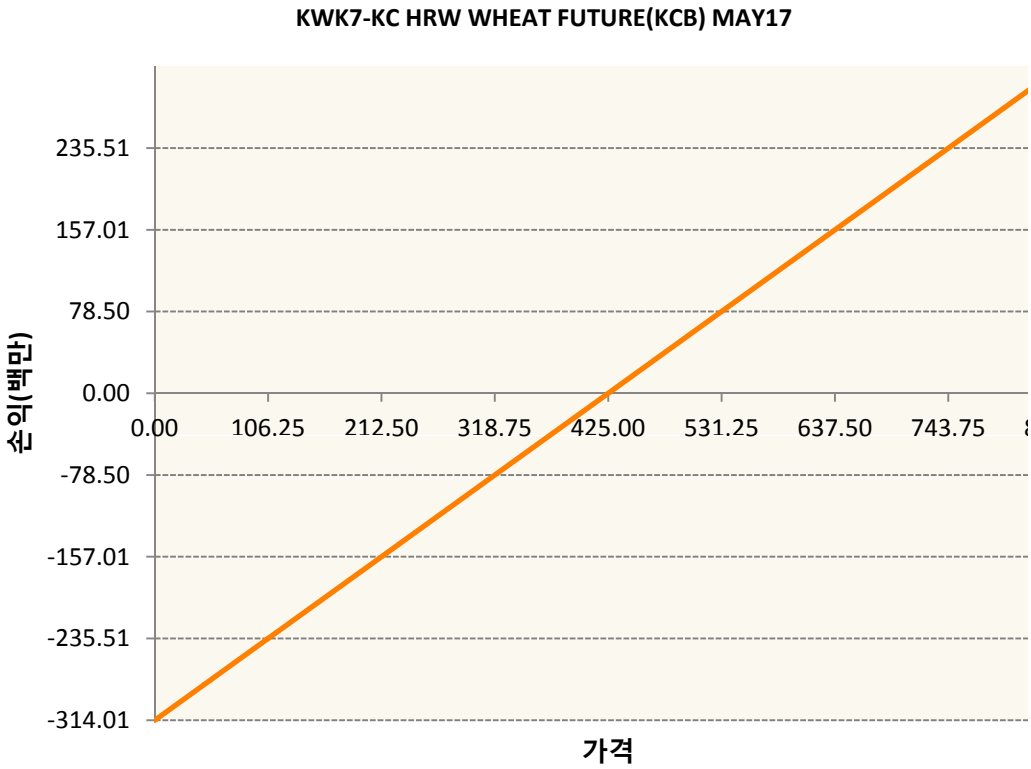

-1,192.28
-1,788.42
-2,384.56
가격

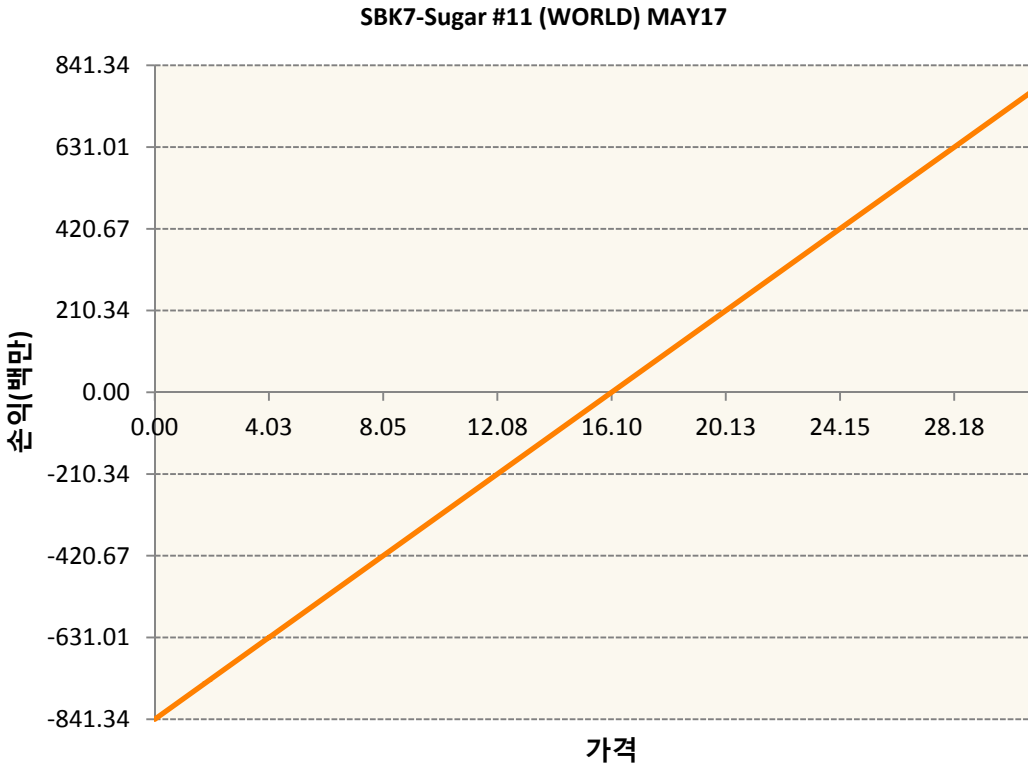

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
318.53
212.35
106.18
0.00
-106.18
-212.35
-318.53
-424.71
0.00
18.72
37.44
56.15
74.87
93.59
112.31
131.02
손익(백만)
가격

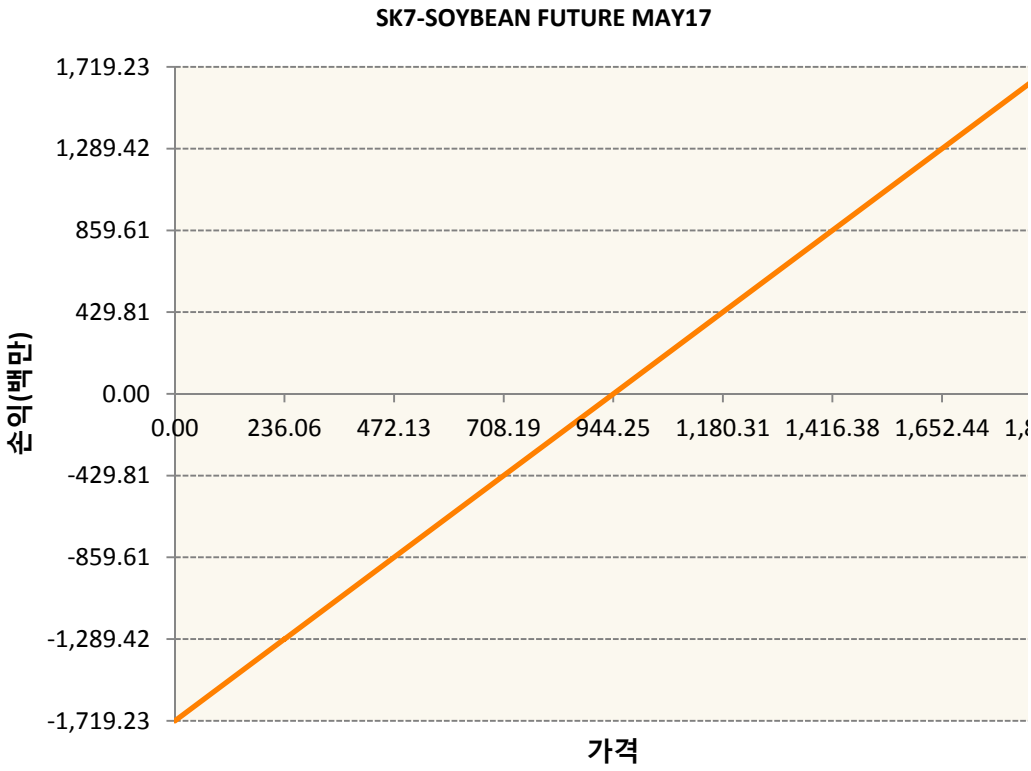

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
644.35
483.26
322.17
161.09
0.00
-161.09
-322.17
-483.26
-644.35
0.00
34.33
68.65
102.98
137.30
171.63
205.95
240.28
손익(백만)

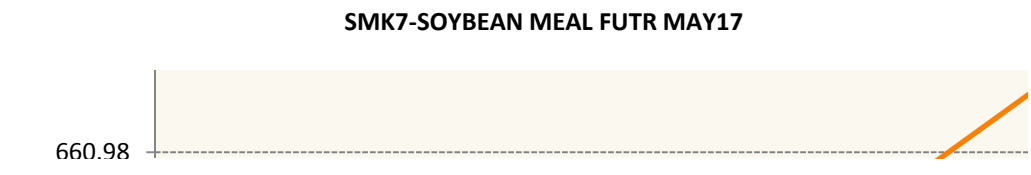
가격

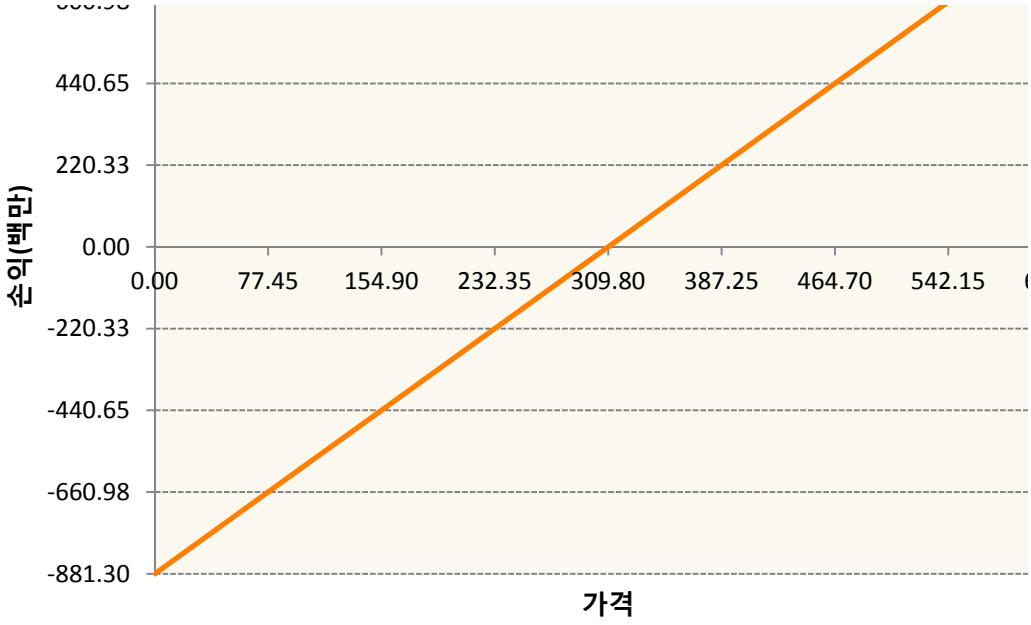

KR4175M40007-2017-04 달러선물
396.52
297.39
198.26
99.13
0.00
-99.13
-198.26
-297.39
-396.52
0.00
283.23
566.45
849.68
1,132.90
1,416.13
1,699.35
1,982.58
손익(백만)
가격

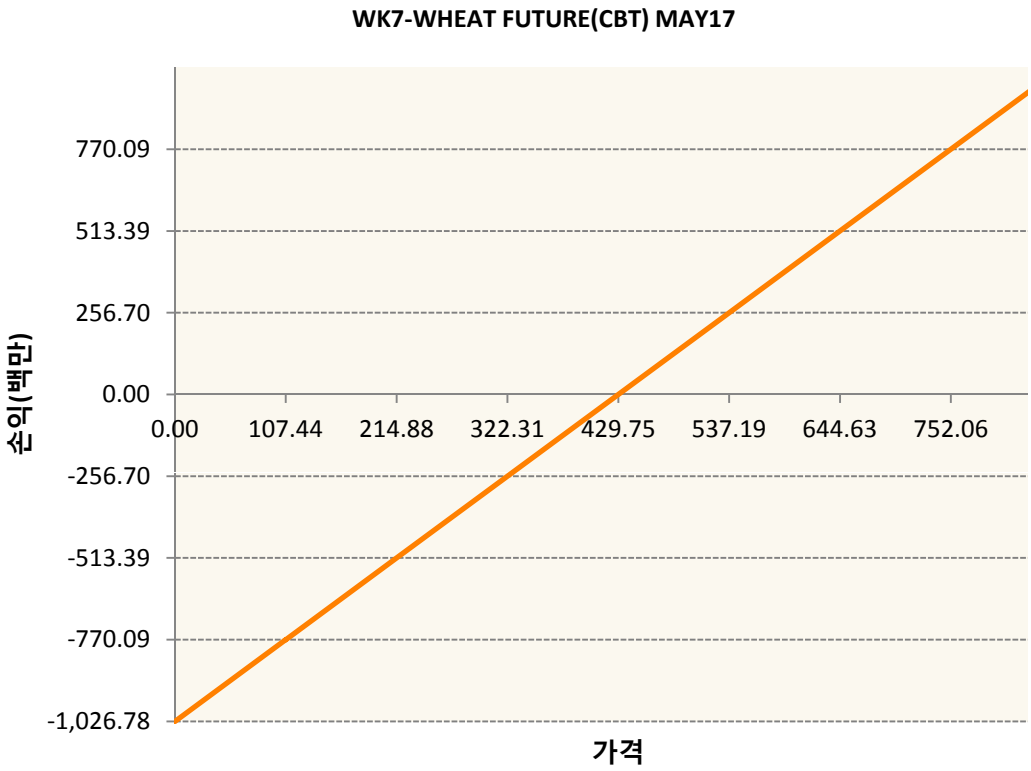

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
235.51
157.01
78.50
0.00
-78.50
-157.01
-235.51
-314.01
0.00
106.25
212.50
318.75
425.00
531.25
637.50
743.75
손익(백만)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
841.34
631.01
420.67
210.34
0.00
-210.34
-420.67
-631.01
-841.34
0.00
4.03
8.05
12.08
16.10
20.13
24.15
28.18
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,719.23
1,289.42
859.61
429.81
0.00
-429.81
-859.61
-1,289.42
-1,719.23
0.00
236.06
472.13
708.19
944.25
1,180.31
1,416.38
1,652.44
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
660.98





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	63
CK7	CORN FUTURE MAY17	191
CTK7	COTTON NO.2 FUTR MAY17	34
KCK7	COFFEE "C" FUTURE MAY17	52
KR4175M40(	2017-04 달러선물	32

KWK7	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17	25
SBK7	Sugar #11 (WORLD) MAY17	67
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	138
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	71
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	82

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

824