공시일	2017-04-10
기준일	2017-04-07

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	2017-04-10
기준일	2017-04-07

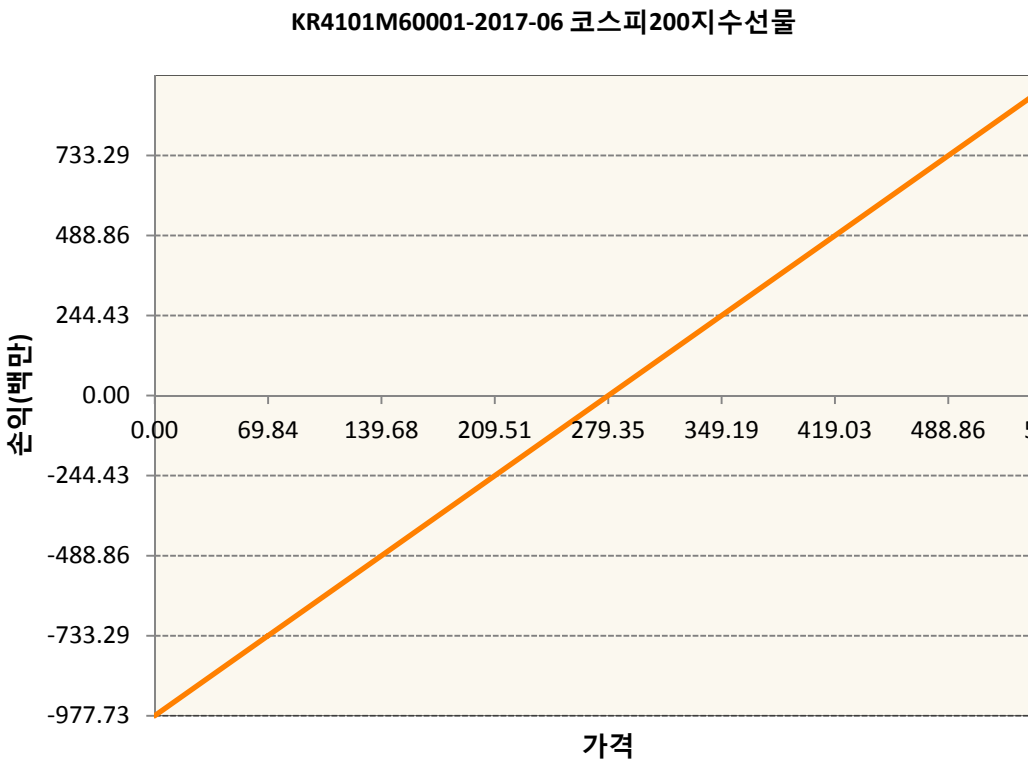
스마트인덱스모

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	978	0	978	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	2017-04-10
기준일	2017-04-07

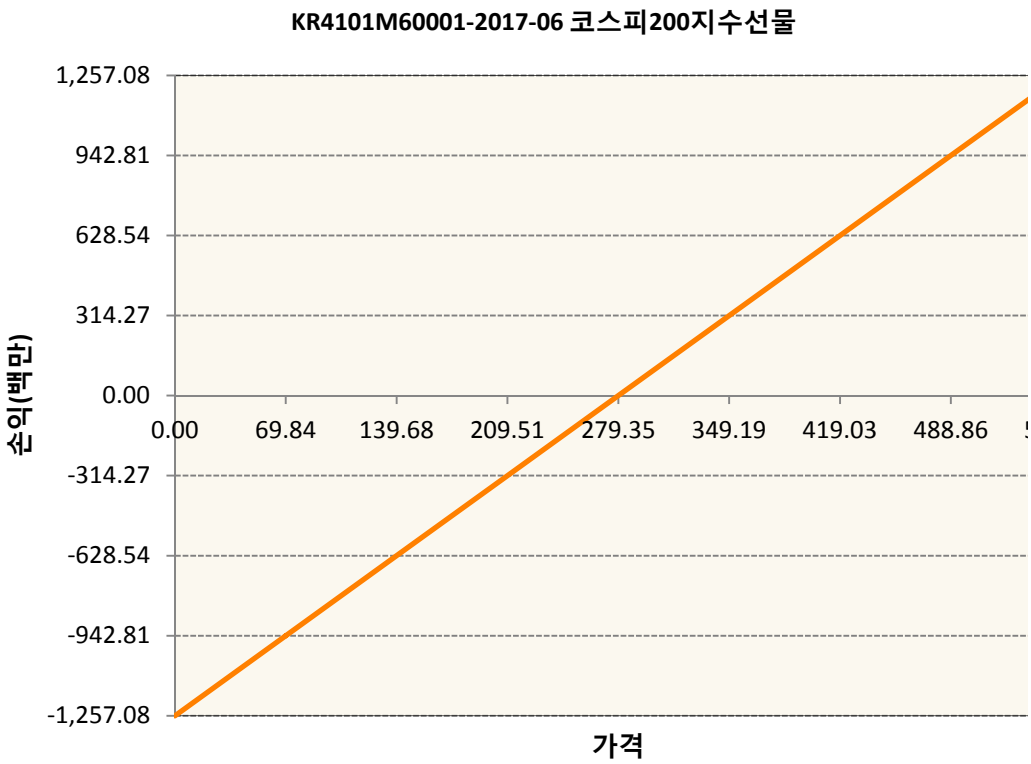
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,257	0	1,257	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							100
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-100	-100	-100	-100	-100	-100	-100
-5.33%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67
-2.67%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	33	33	33	33	33	33	33
5.33%	67	67	67	67	67	67	67
8.00%	100	100	100	100	100	100	100

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

65

공시일	2017-04-10
기준일	2017-04-07

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	956

* 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	2017-04-10
기준일	2017-04-07

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	2017-04-10
기준일	2017-04-07

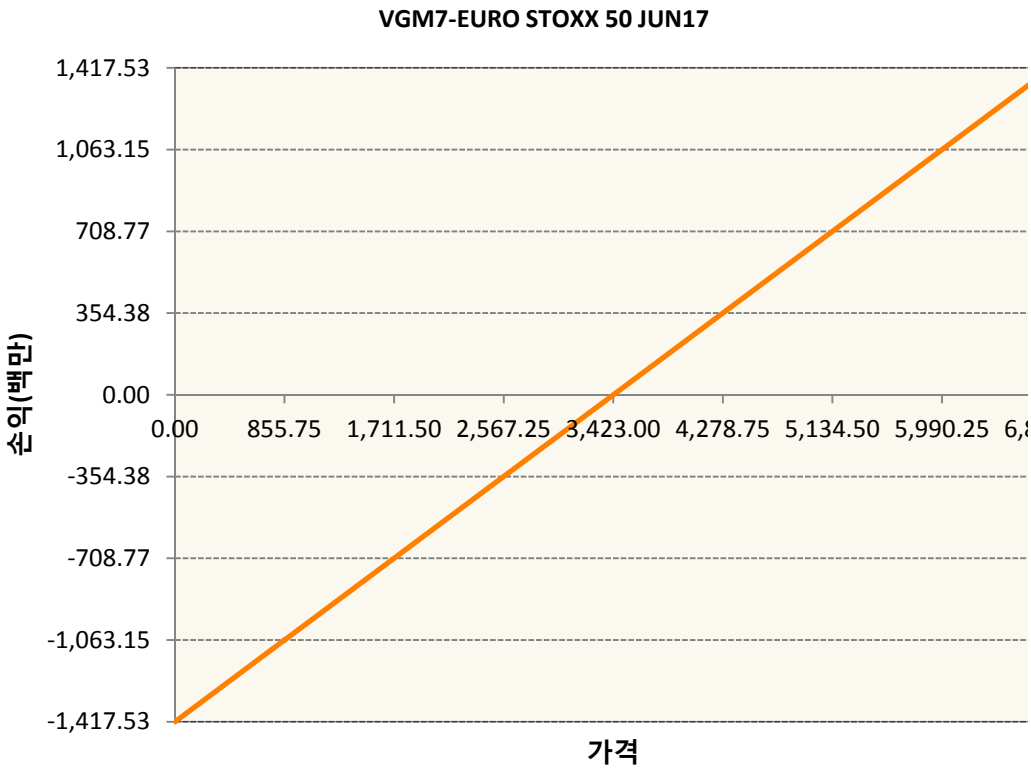
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2017-04-10
기준일	2017-04-07

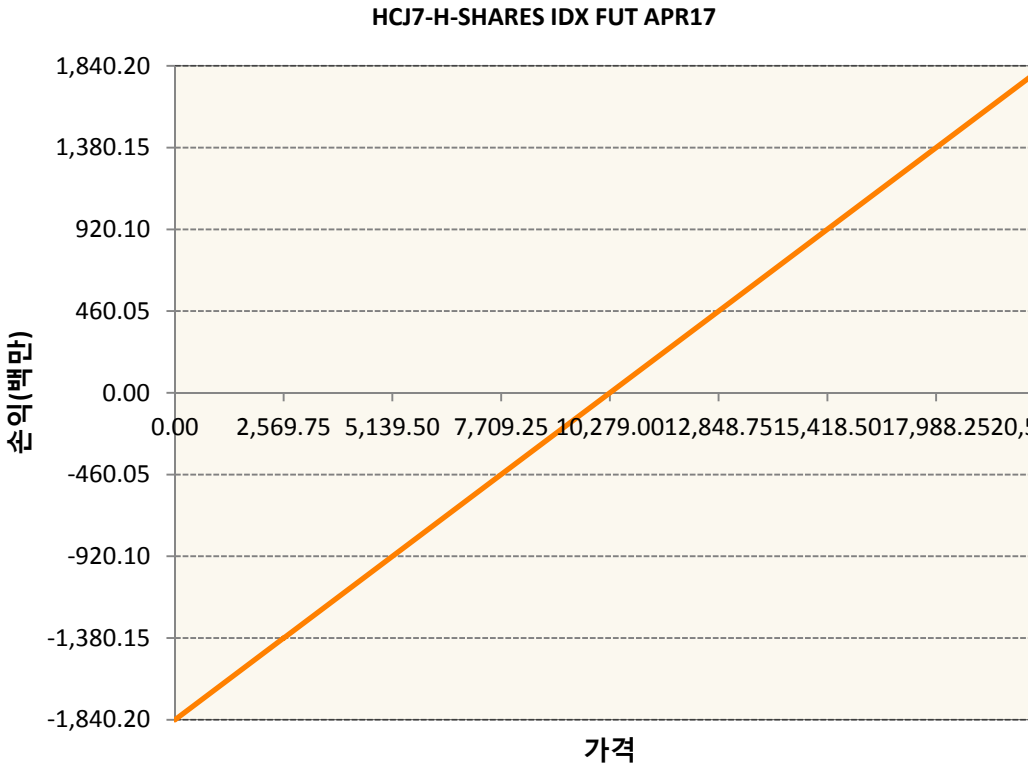
차이나인덱스모(주식-파생형)

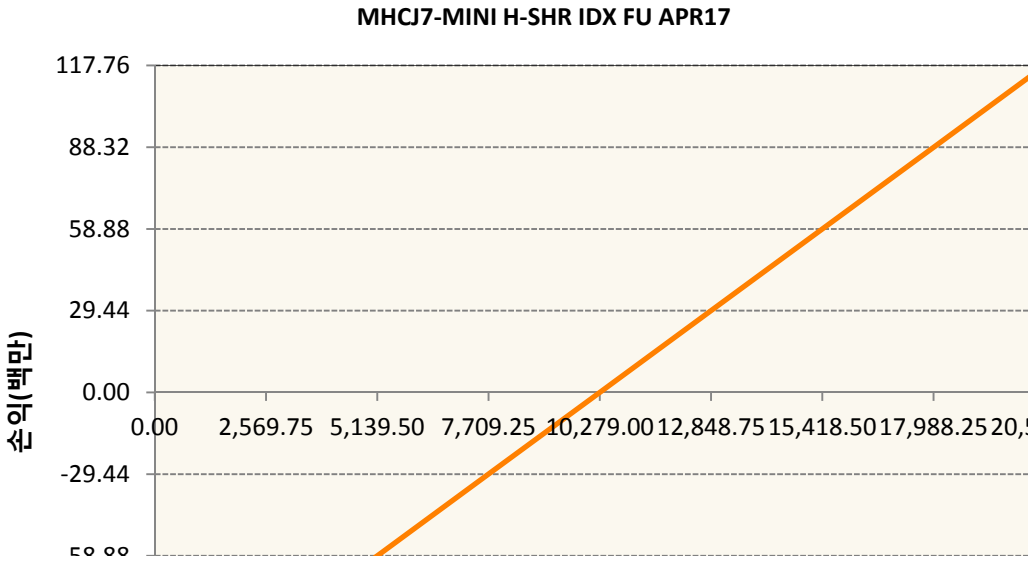
1. 계약금액

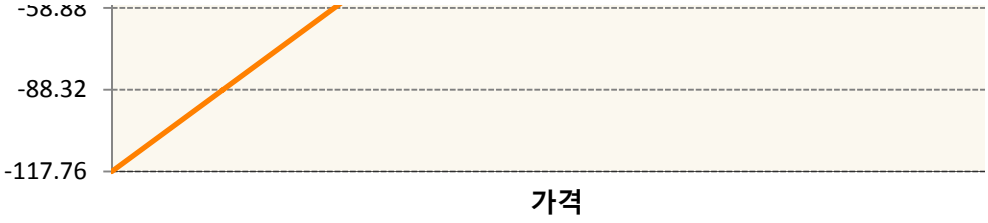
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,958	0	1,958	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	2017-04-10
기준일	2017-04-07

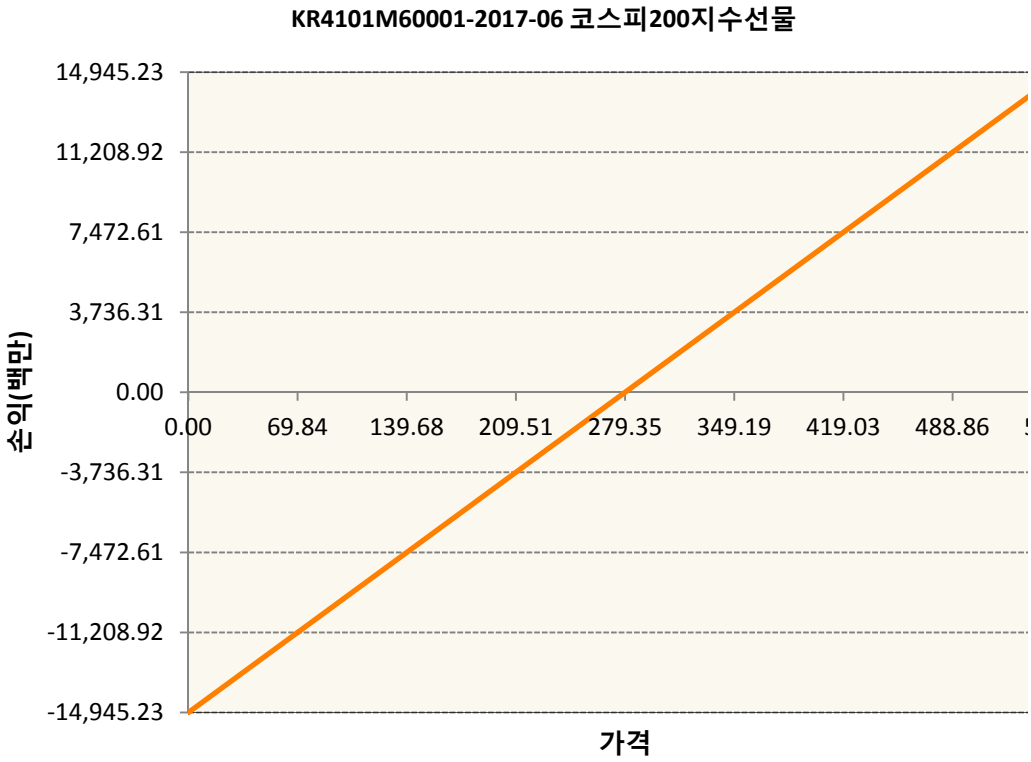
커버드콜모(주식혼합-파생형)

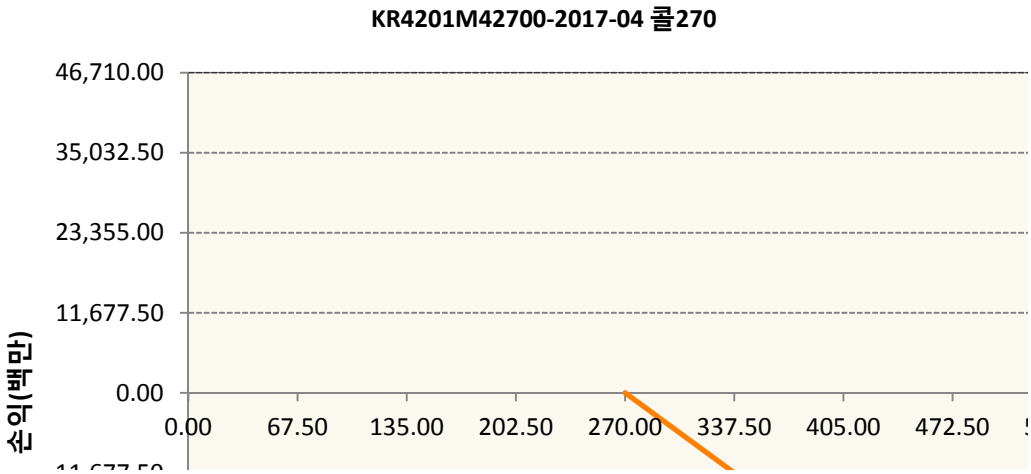
1. 계약금액

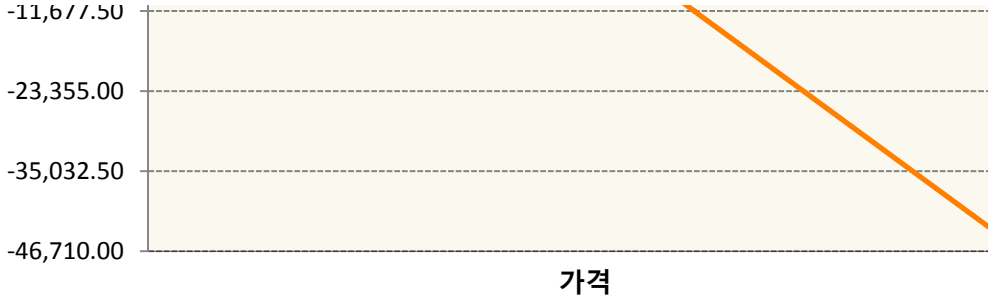
(단위:백만원)

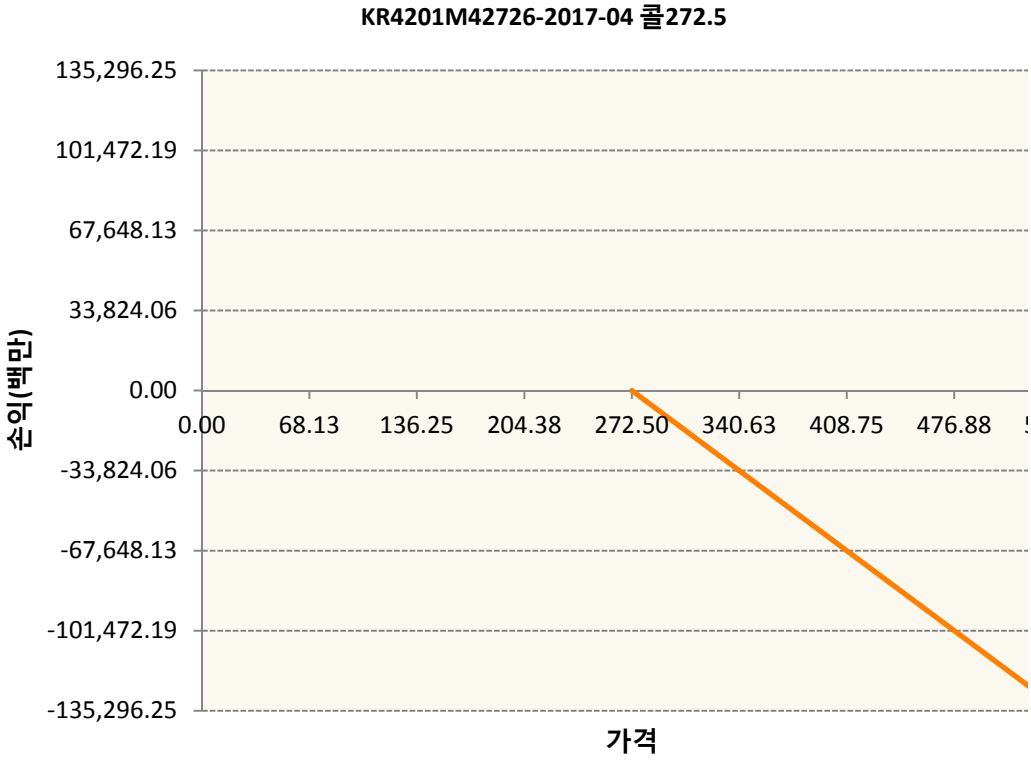
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	3,351	-3,351	장내
신규	유가증권	옵션	3,192	6,820	-3,627	장내
누계	유가증권	선물	14,945	0	14,945	장내
누계	유가증권	옵션	0	195,631	-195,631	장내

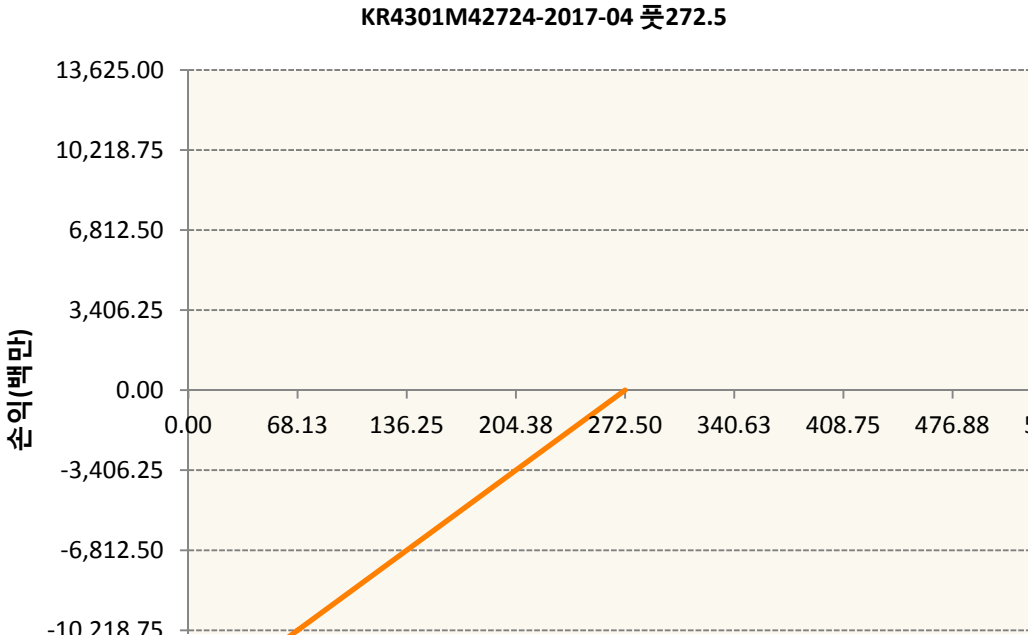
2. 만기시점의 손익구조

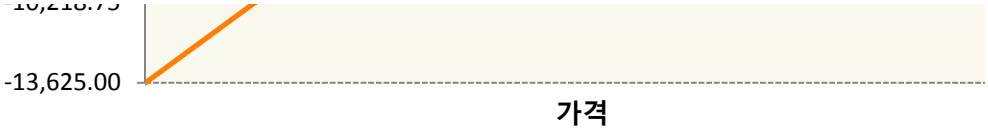





-11,677.50
-23,355.00
-35,032.50
-46,710.00
가격


KR4201M42726-2017-04 콜272.5
135,296.25
101,472.19
67,648.13
33,824.06
0.00
-33,824.06
-67,648.13
-101,472.19
-135,296.25
0.00
68.13
136.25
204.38
272.50
340.63
408.75
476.88
순익(백만)
가격


KR4301M42724-2017-04 풋272.5
13,625.00
10,218.75
6,812.50
3,406.25
0.00
-3,406.25
-6,812.50
-10,218.75
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							1,194
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194
-5.33%	-796	-796	-796	-796	-796	-796	-796
-2.67%	-398	-398	-398	-398	-398	-398	-398
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	398	398	398	398	398	398	398
5.33%	796	796	796	796	796	796	796
8.00%	1,194	1,194	1,194	1,194	1,194	1,194	1,194
KR4201M42 2017-04 콜270							3,856
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,560	1,560	1,560	1,560	1,560	1,560	1,559
-5.33%	1,555	1,550	1,545	1,537	1,528	1,518	1,507
-2.67%	1,186	1,165	1,143	1,121	1,099	1,077	1,054
0%	4	3	2	0	-3	-7	-12
2.67%	-1,283	-1,283	-1,283	-1,283	-1,283	-1,283	-1,283
5.33%	-2,570	-2,570	-2,570	-2,570	-2,570	-2,570	-2,570
8.00%	-3,856	-3,856	-3,856	-3,856	-3,856	-3,856	-3,856
KR4201M42 2017-04 콜272.5							11,025
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,280	3,280	3,280	3,280	3,280	3,280	3,279
-5.33%	3,279	3,276	3,272	3,265	3,255	3,243	3,227
-2.67%	2,871	2,805	2,739	2,673	2,606	2,539	2,472
0%	43	33	19	0	-23	-50	-80
2.67%	-3,639	-3,639	-3,639	-3,639	-3,639	-3,640	-3,642
5.33%	-7,332	-7,332	-7,332	-7,332	-7,332	-7,332	-7,332
8.00%	-11,025	-11,025	-11,025	-11,025	-11,025	-11,025	-11,025
KR4301M42 2017-04 풋272.5							785
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-785	-785	-785	-785	-785	-785	-785
-5.33%	-414	-414	-414	-415	-416	-417	-419
-2.67%	-83	-89	-96	-103	-109	-116	-123

0%	4	3	2	0	-2	-5	-8
2.67%	5	5	5	5	5	5	5
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

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

19,477

공시일	2017-04-10
기준일	2017-04-07

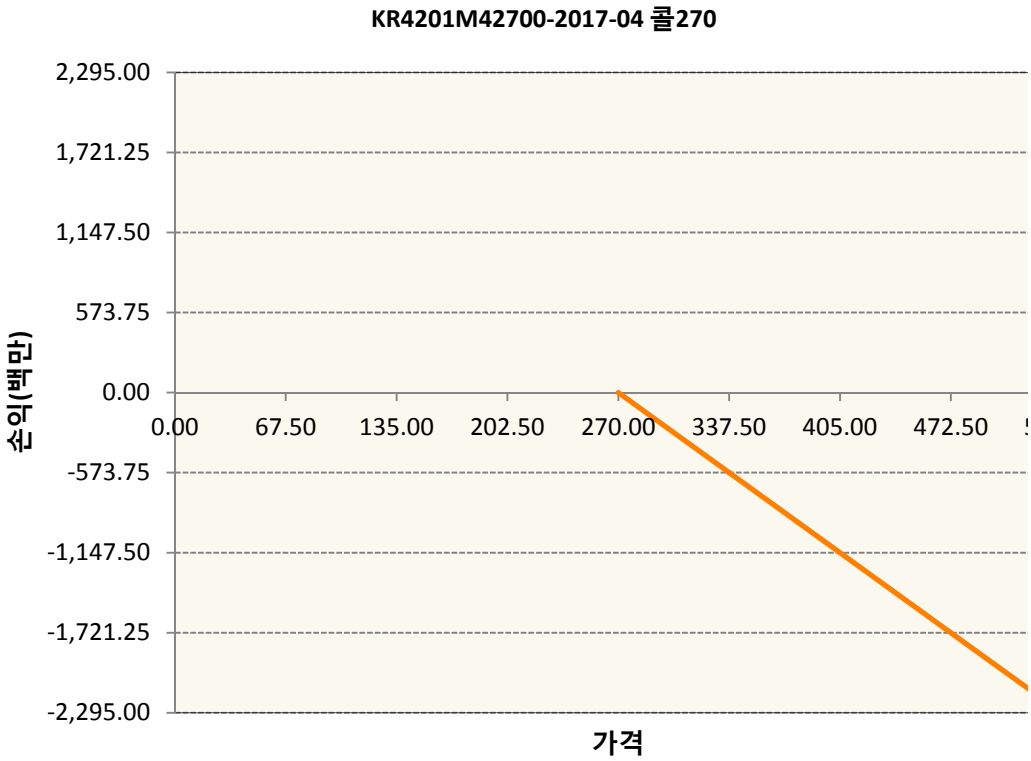
커버드콜목표전환형증권투자신탁

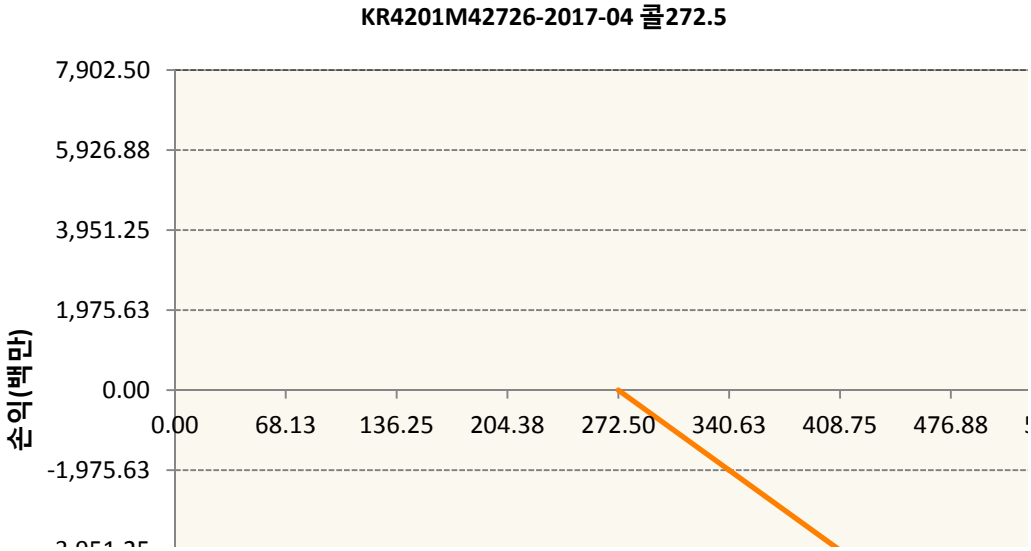
1. 계약금액

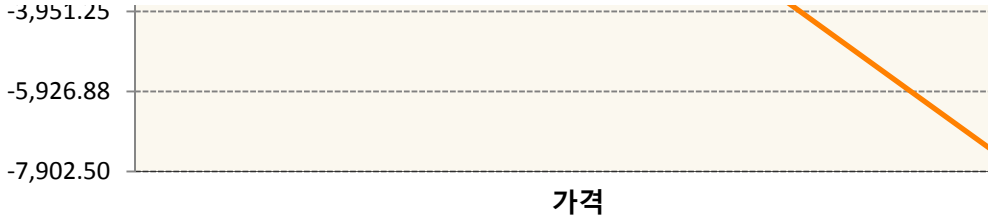
(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201M42: 2017-04 콜270							189
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	77	77	77	77	77	77	77
-5.33%	76	76	76	76	75	75	74
-2.67%	58	57	56	55	54	53	52
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%	-189	-189	-189	-189	-189	-189	-189

KR4201M42: 2017-04 콜272.5							644
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	192	192	192	192	192	192	192
-5.33%	191	191	191	191	190	189	188
-2.67%	168	164	160	156	152	148	144
0%	3	2	1	0	-1	-3	-5
2.67%	-213	-213	-213	-213	-213	-213	-213
5.33%	-428	-428	-428	-428	-428	-428	-428
8.00%	-644	-644	-644	-644	-644	-644	-644

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

(단위:백만원)

1,015

공시일	2017-04-10
기준일	2017-04-07

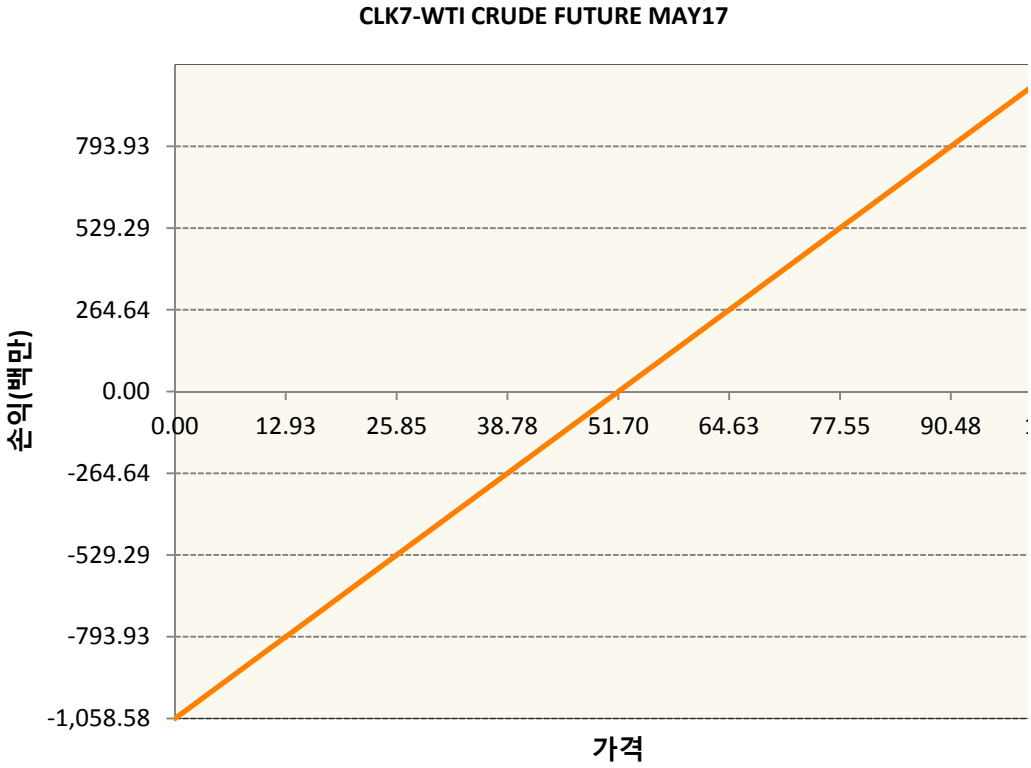
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

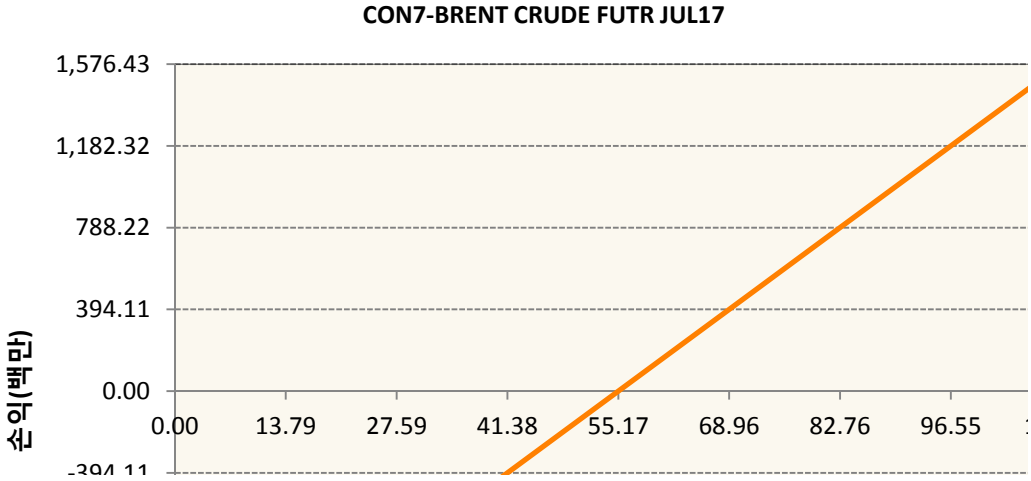
1. 계약금액

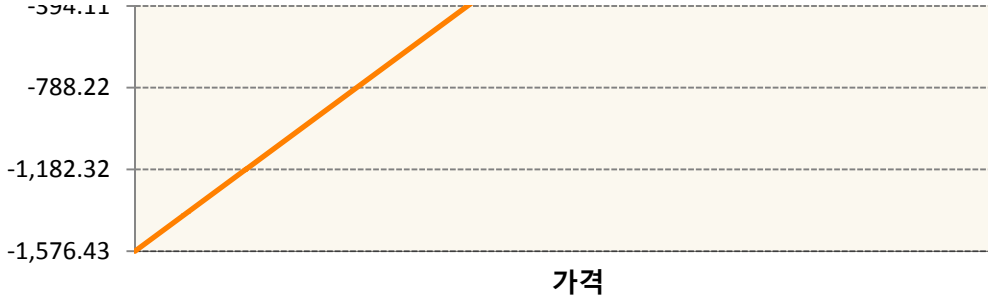
(단위:백만원)

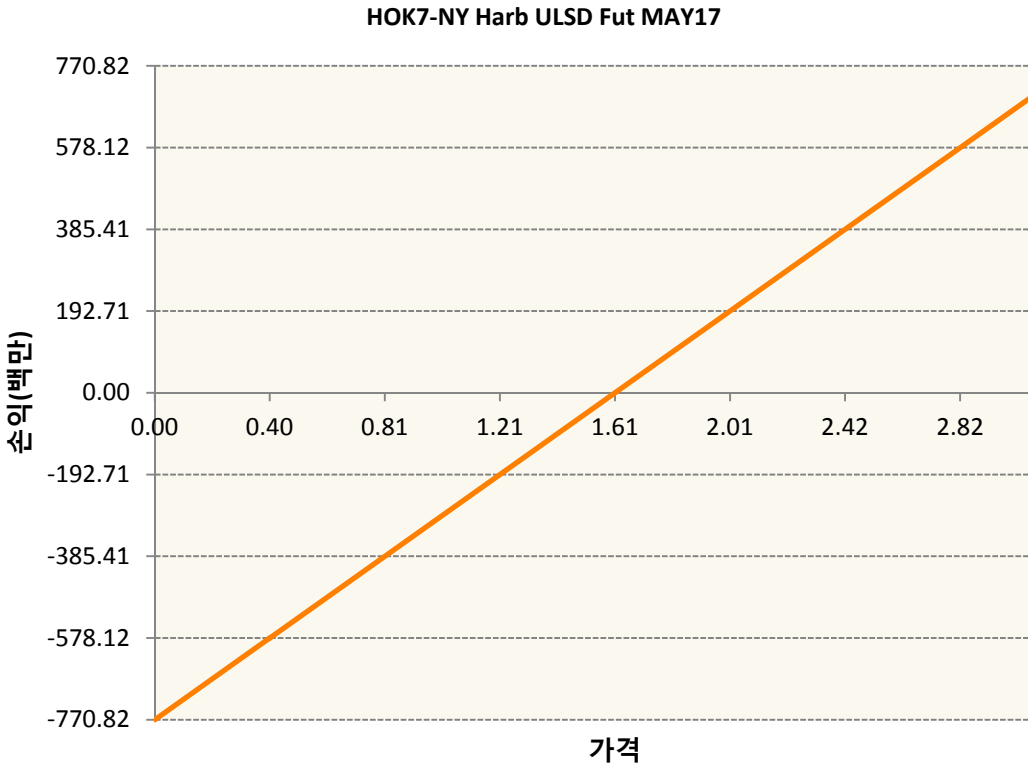
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,059	0	1,059	
누계	유가증권	선물	4,883	408	4,475	

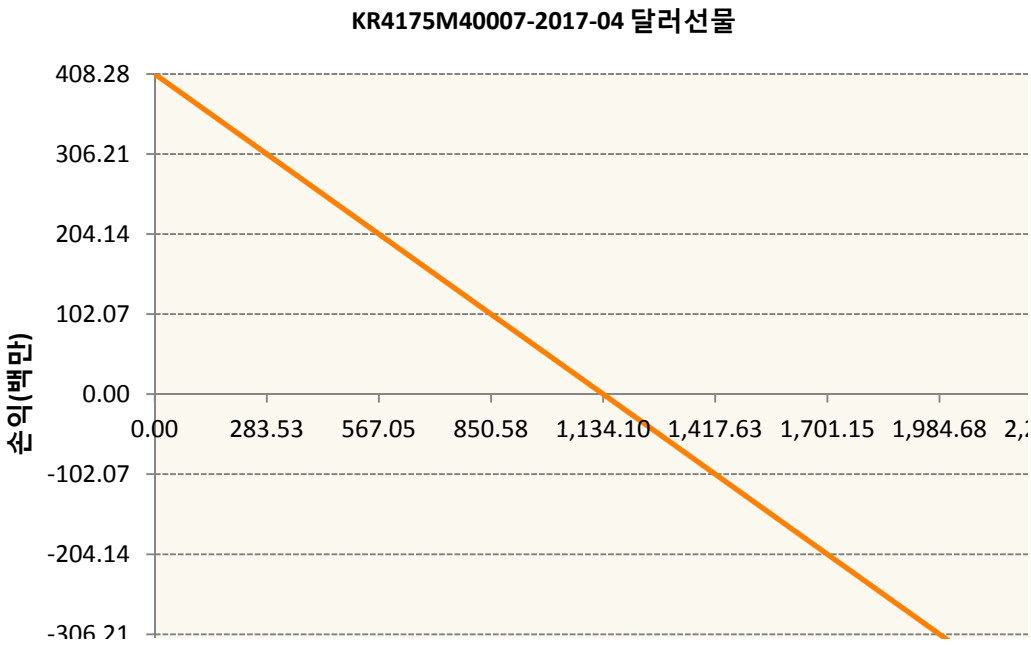
2. 만기시점의 손익구조

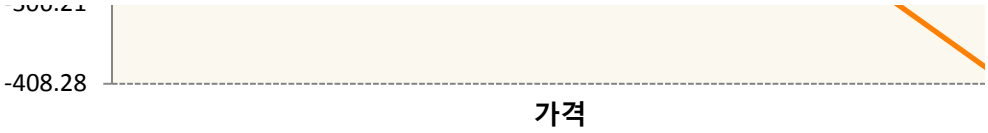


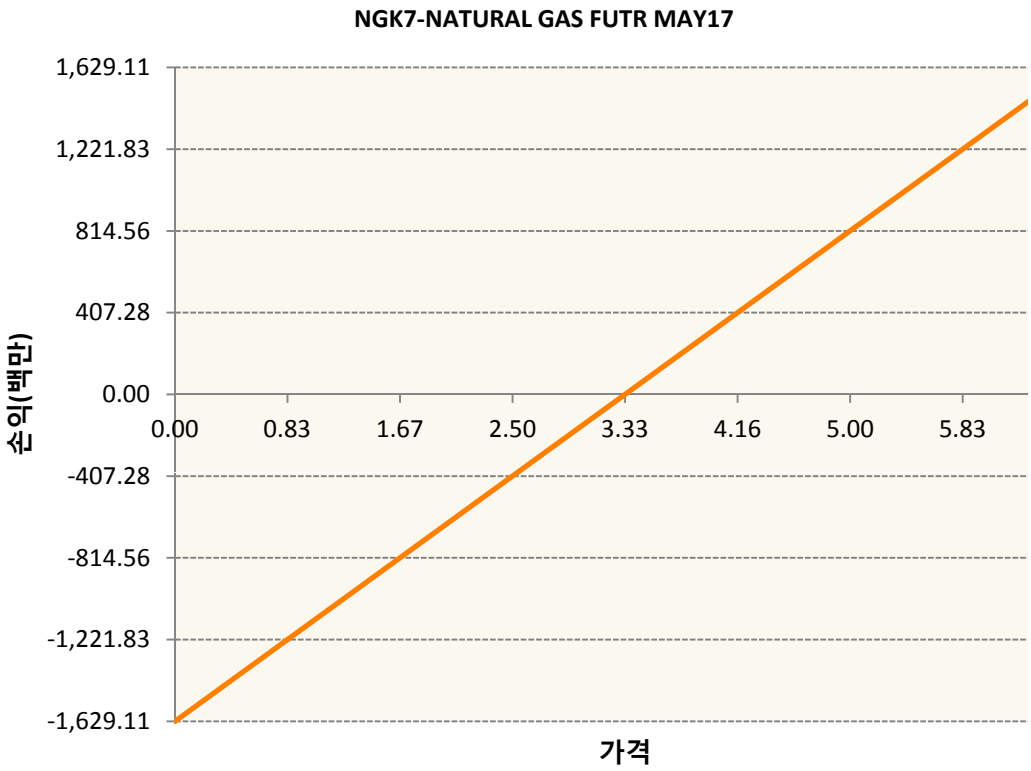


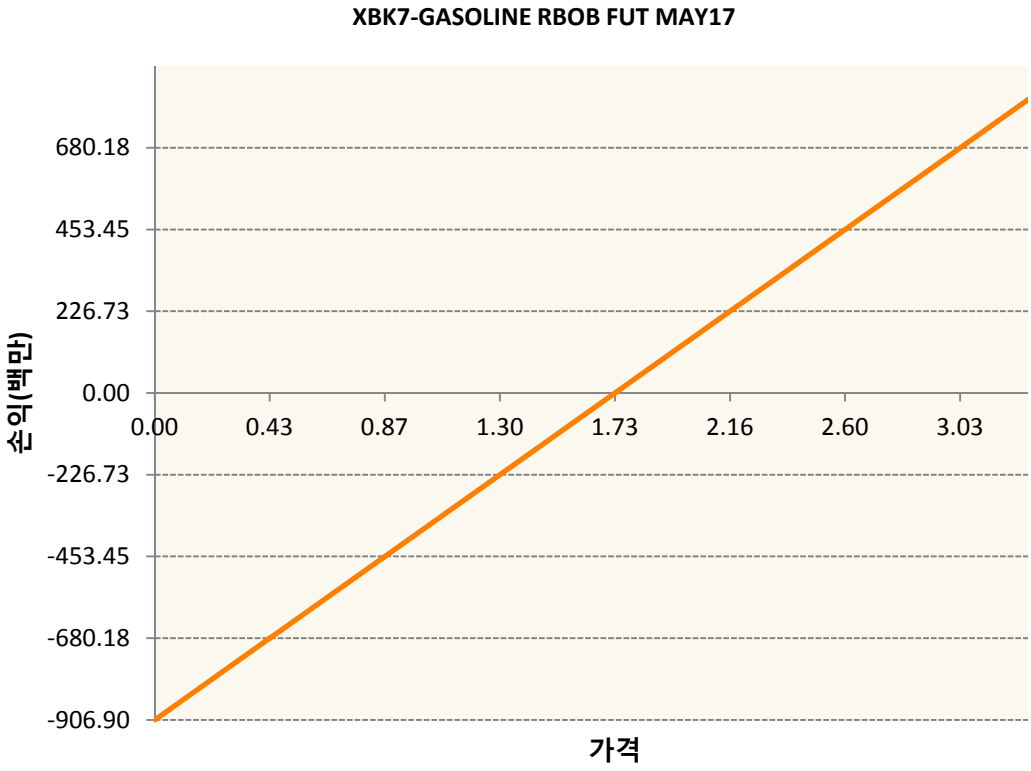

-788.22
-1,182.32
-1,576.43
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
770.82
578.12
385.41
192.71
0.00
-192.71
-385.41
-578.12
-770.82
0.00
0.40
0.81
1.21
1.61
2.01
2.42
2.82
순익(백만)
가격


KR4175M40007-2017-04 달러선물
408.28
306.21
204.14
102.07
0.00
-102.07
-204.14
-306.21
0.00
283.53
567.05
850.58
1,134.10
1,417.63
1,701.15
1,984.68
순익(백만)


-408.28
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,629.11
1,221.83
814.56
407.28
0.00
-407.28
-814.56
-1,221.83
-1,629.11
0.00
0.83
1.67
2.50
3.33
4.16
5.00
5.83
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
680.18
453.45
226.73
0.00
-226.73
-453.45
-680.18
-906.90
0.00
0.43
0.87
1.30
1.73
2.16
2.60
3.03
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK7	WTI CRUDE FUTURE MAY17	85
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	126
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	62
KR4175M40(	2017-04 달러선물	33
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	130
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	73

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

1,038

공시일	2017-04-10
기준일	2017-04-07

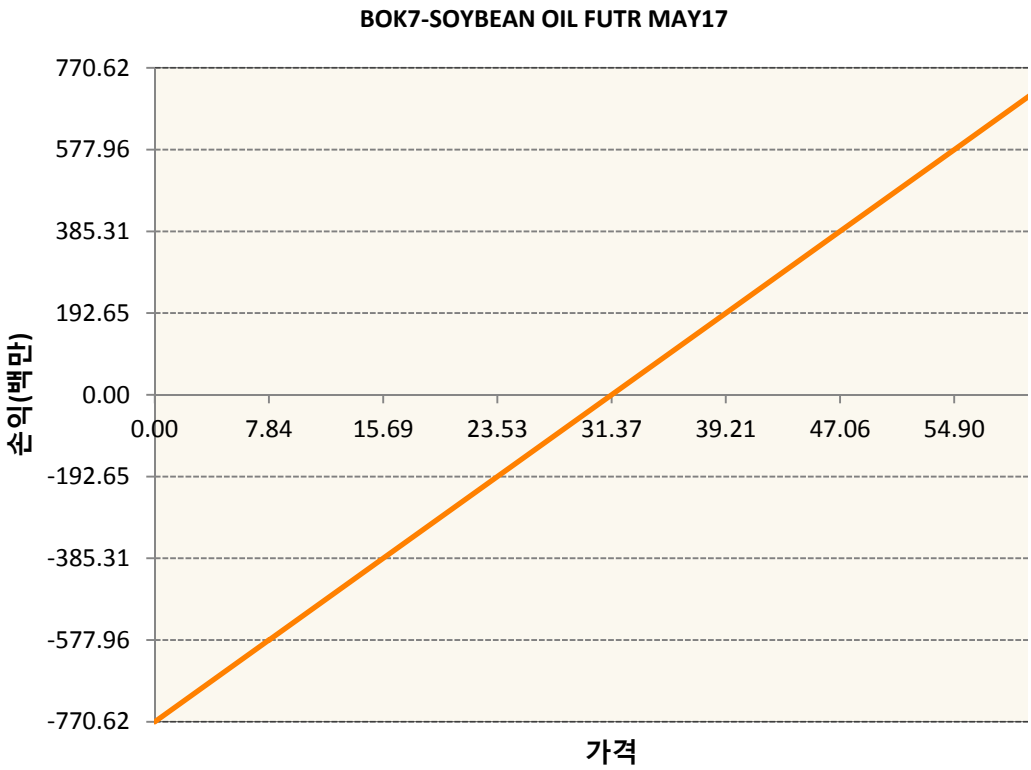
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

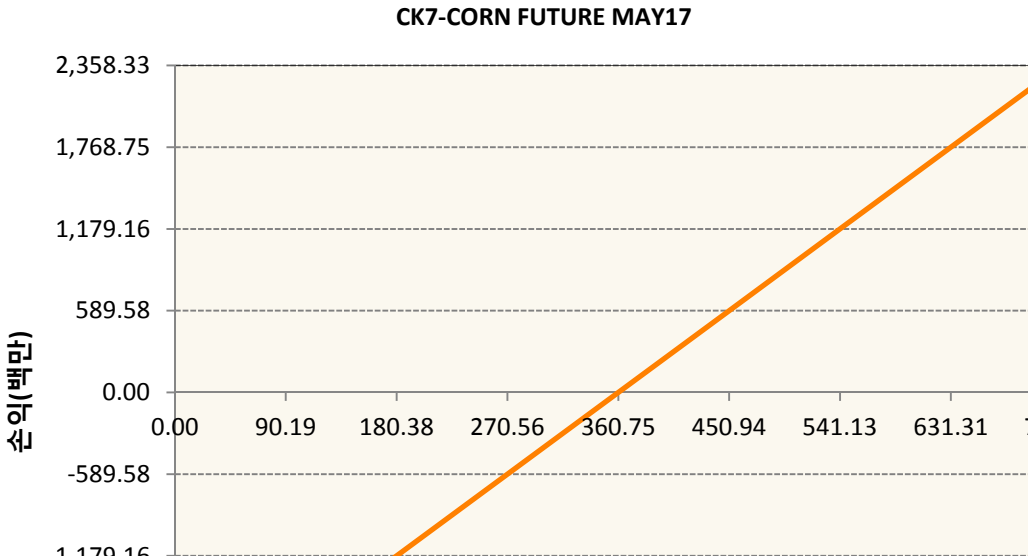
1. 계약금액

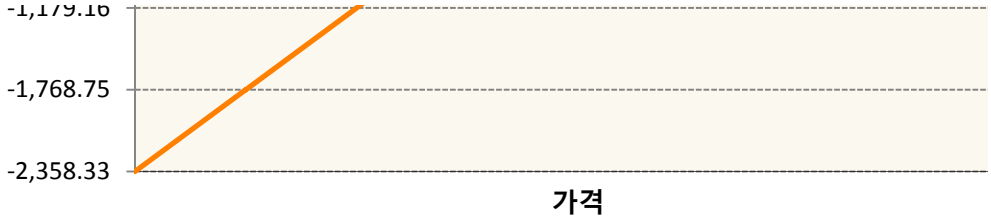
(단위:백만원)

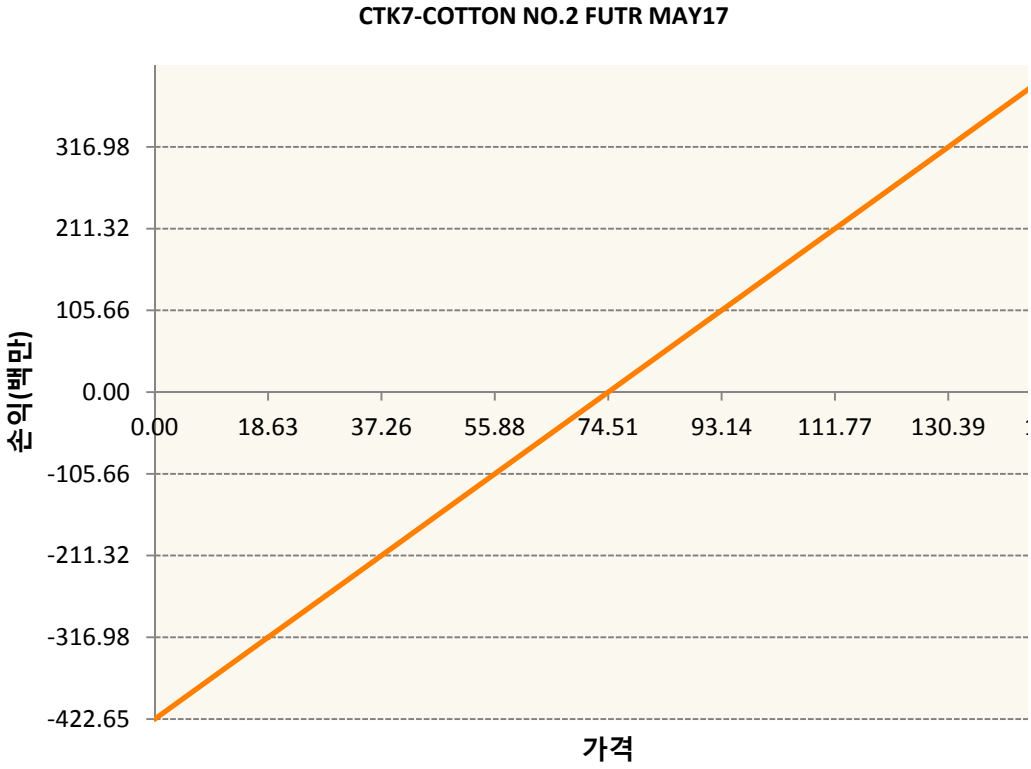
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,971	397	8,574	

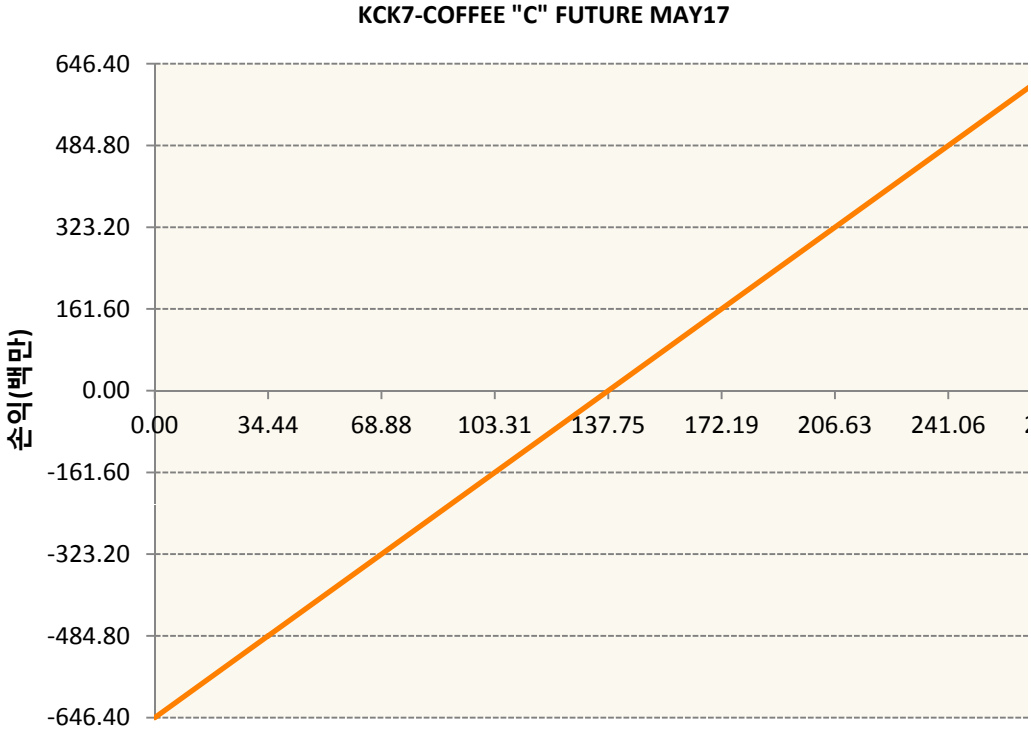
2. 만기시점의 손익구조





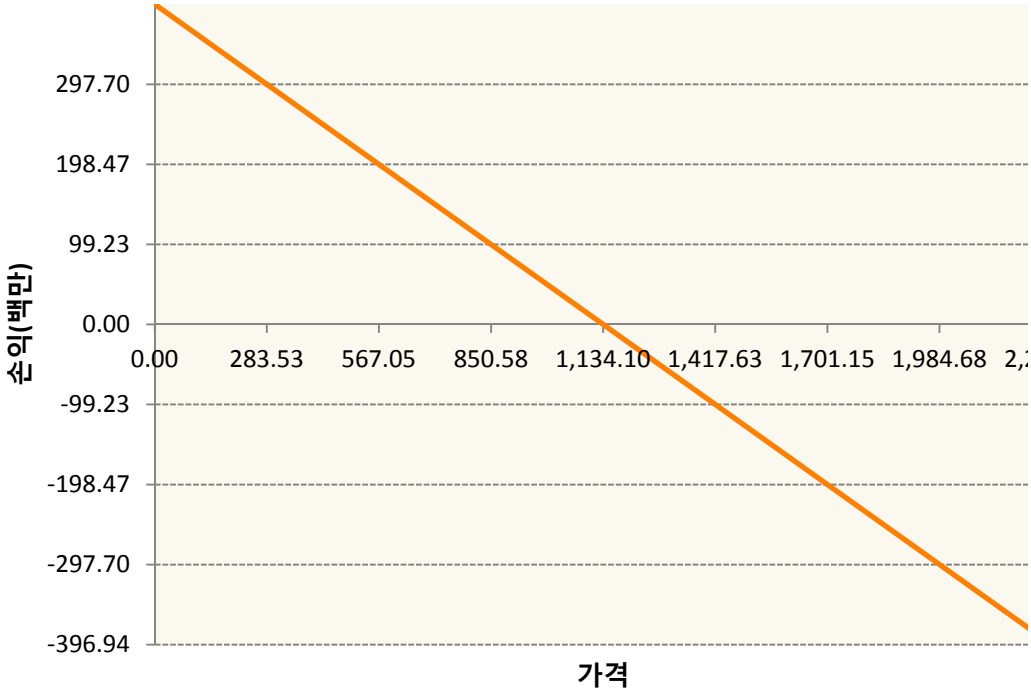

-1,768.75
-2,358.33
가격


CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
316.98
211.32
105.66
0.00
-105.66
-211.32
-316.98
-422.65
0.00
18.63
37.26
55.88
74.51
93.14
111.77
130.39
순익(백만)
가격

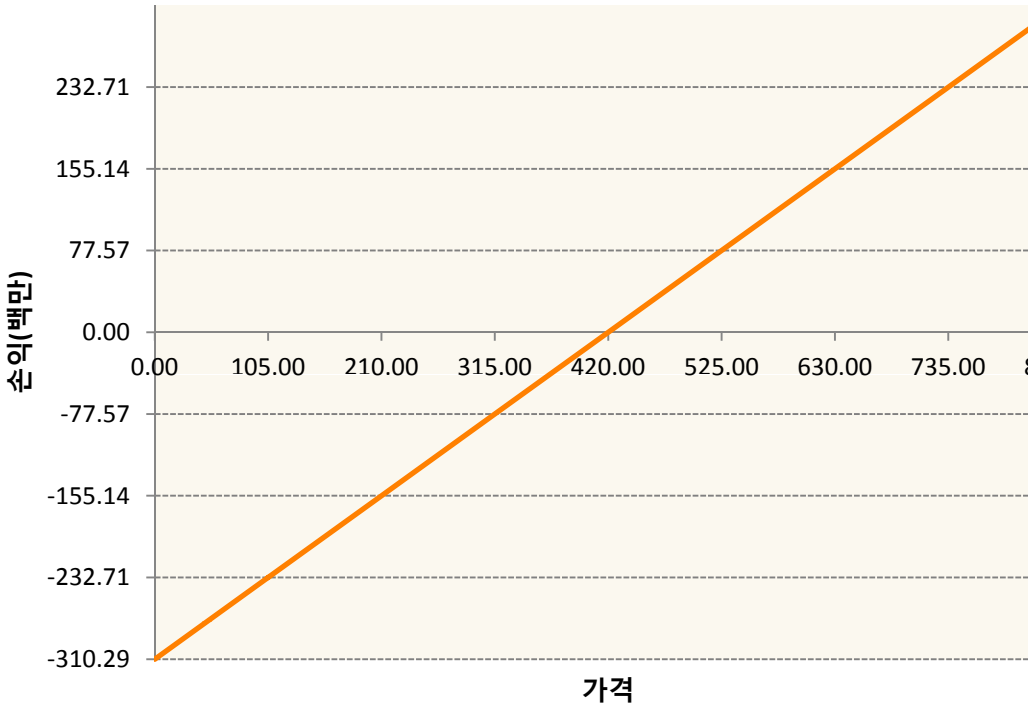

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
646.40
484.80
323.20
161.60
0.00
-161.60
-323.20
-484.80
-646.40
0.00
34.44
68.88
103.31
137.75
172.19
206.63
241.06
순익(백만)

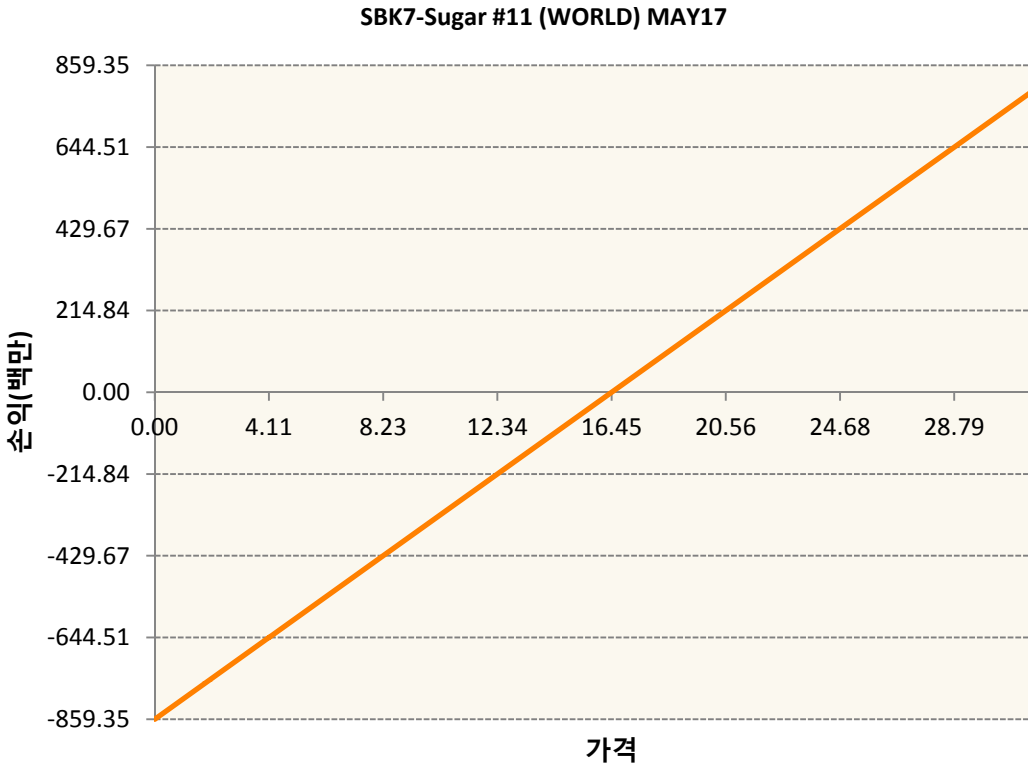
가격

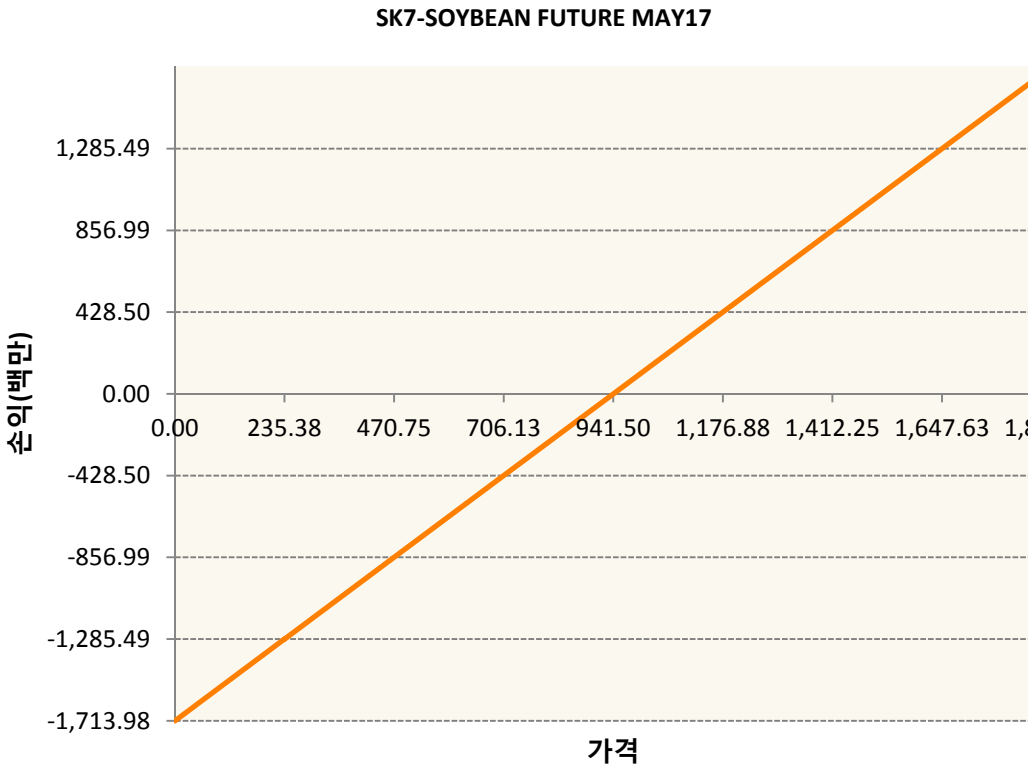
KR4175M40007-2017-04 달러선물



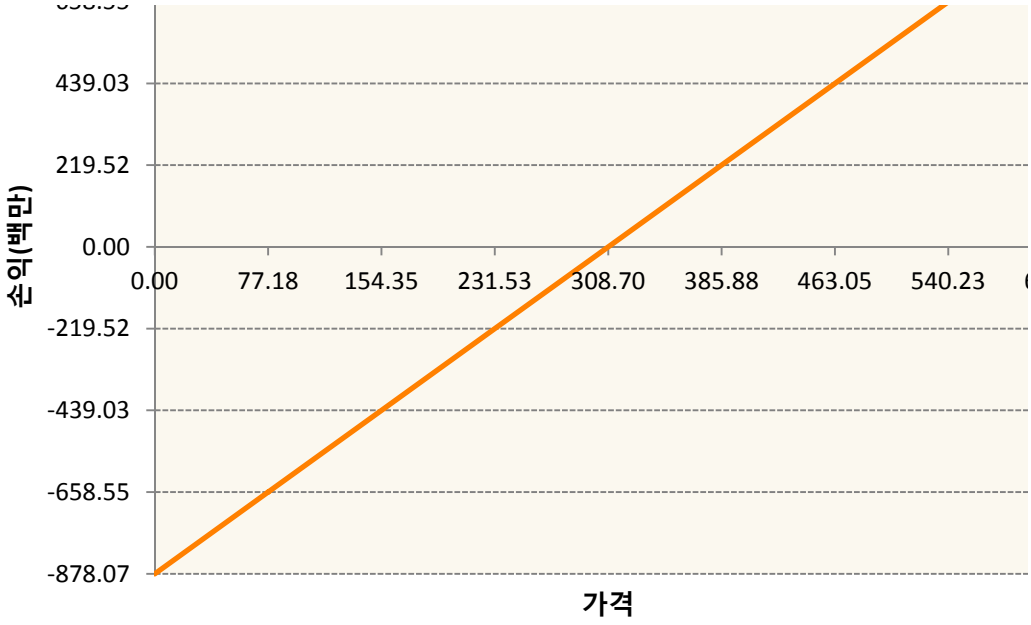
KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17

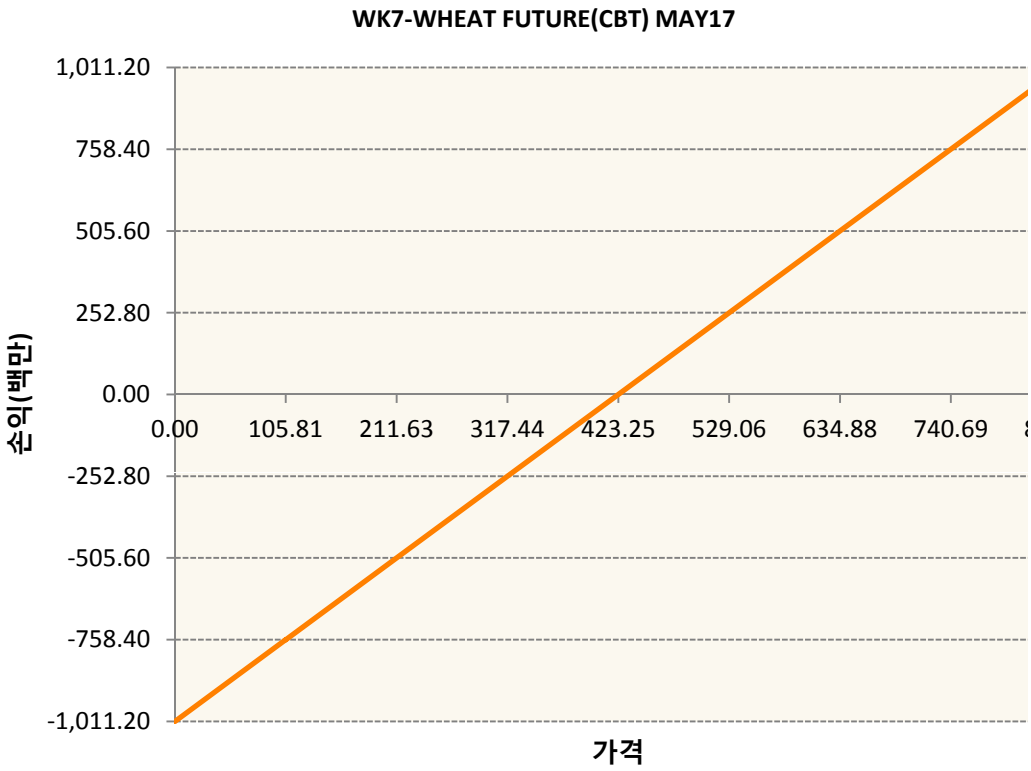



SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
859.35
644.51
429.67
214.84
0.00
-214.84
-429.67
-644.51
-859.35
0.00
4.11
8.23
12.34
16.45
20.56
24.68
28.79
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,285.49
856.99
428.50
0.00
-428.50
-856.99
-1,285.49
-1,713.98
0.00
235.38
470.75
706.13
941.50
1,176.88
1,412.25
1,647.63
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
878.07
658.55





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	62
CK7	CORN FUTURE MAY17	189
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	69
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	137
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	70
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	81

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

819