공시일	2017-04-11
기준일	2017-04-10

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	2017-04-11
기준일	2017-04-10

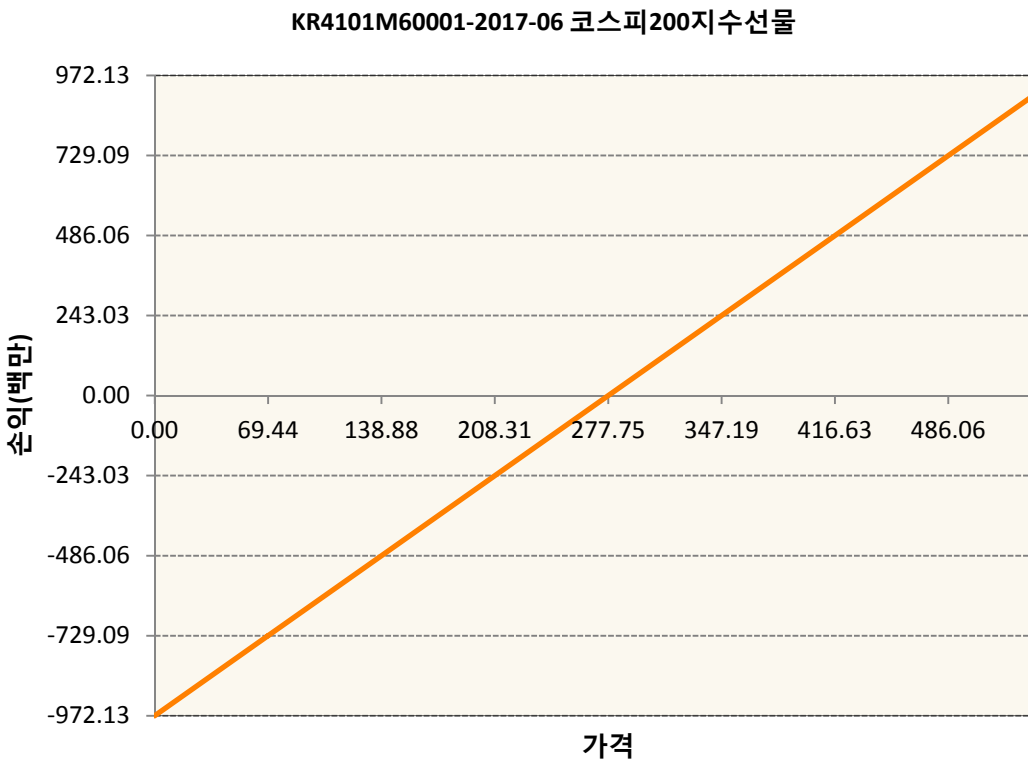
스마트인덱스모

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	972	0	972	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	2017-04-11
기준일	2017-04-10

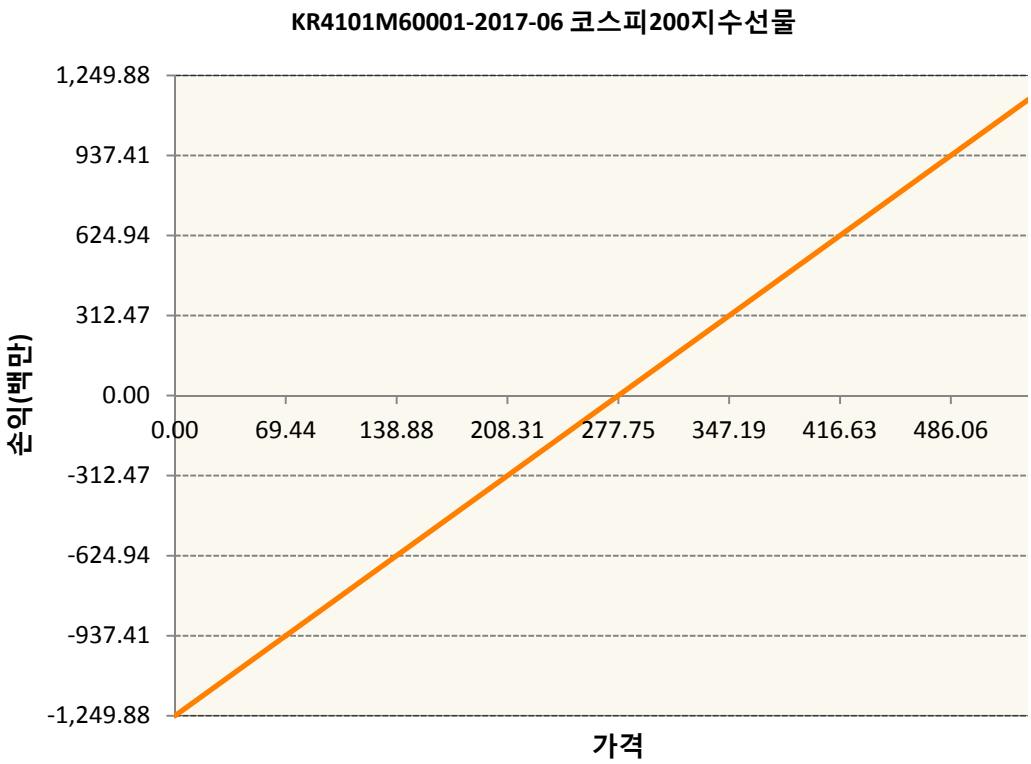
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,250	0	1,250	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)

64

공시일	2017-04-11
기준일	2017-04-10

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	2017-04-11
기준일	2017-04-10

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)

422

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-04-11
기준일	2017-04-10

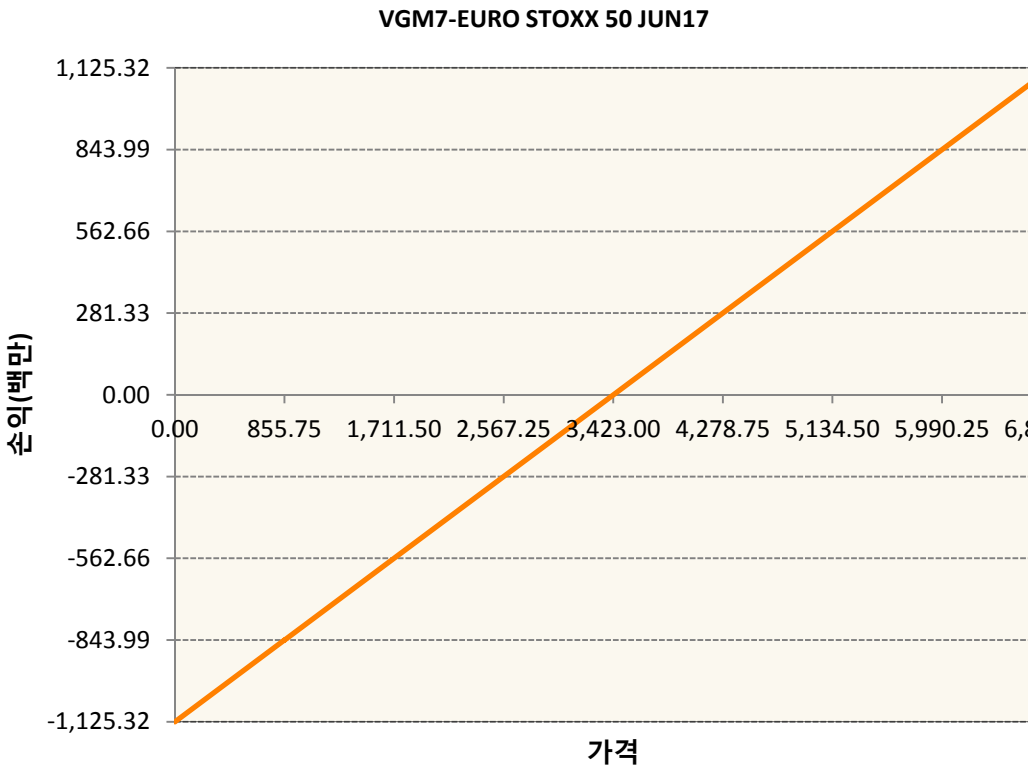
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,125	0	1,125	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM7	EURO STOXX 50 JUN17	90

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

(단위:백만원)

91

공시일	2017-04-11
기준일	2017-04-10

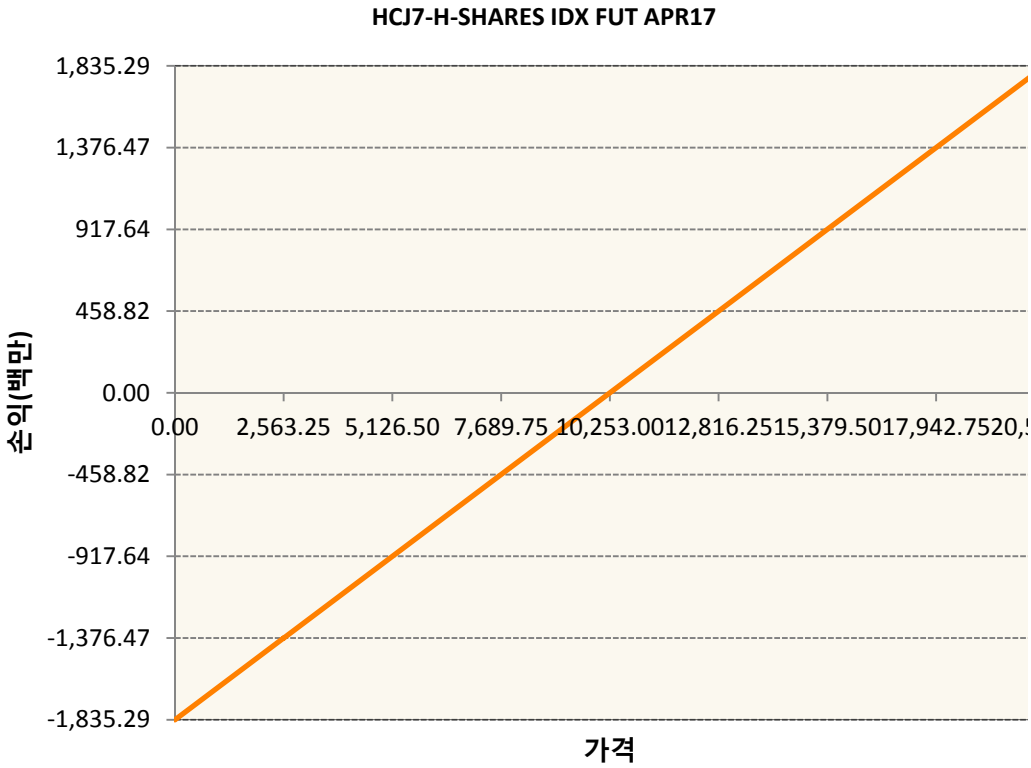
차이나인덱스모(주식-파생형)

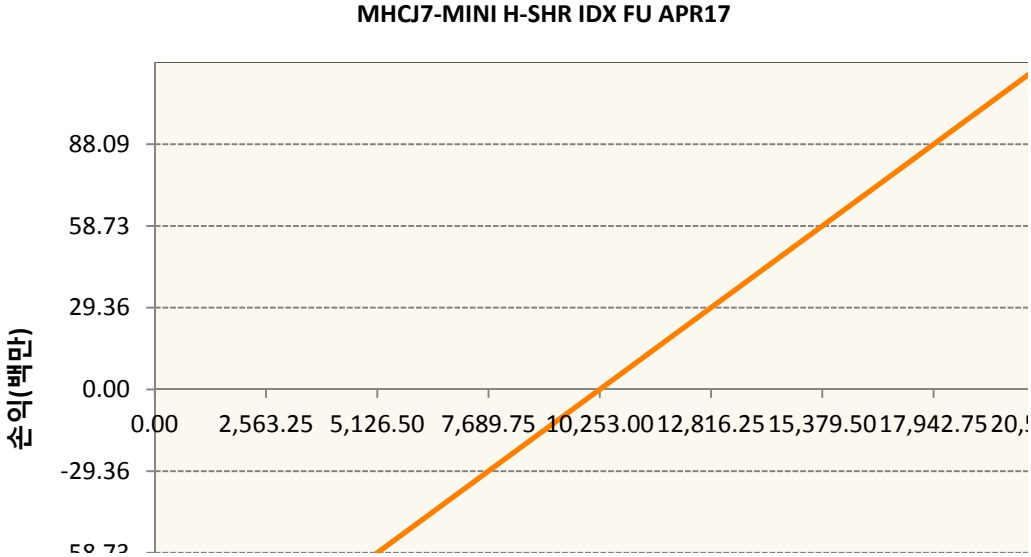
1. 계약금액

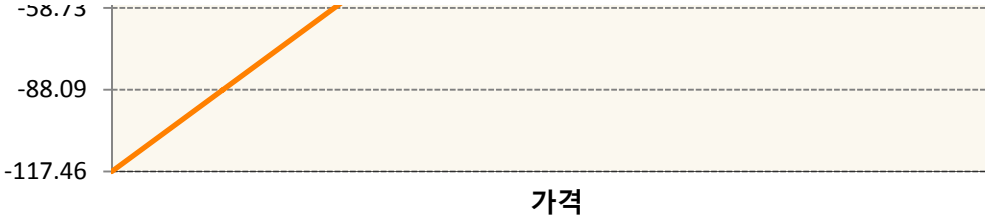
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,953	0	1,953	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)

167

공시일	2017-04-11
기준일	2017-04-10

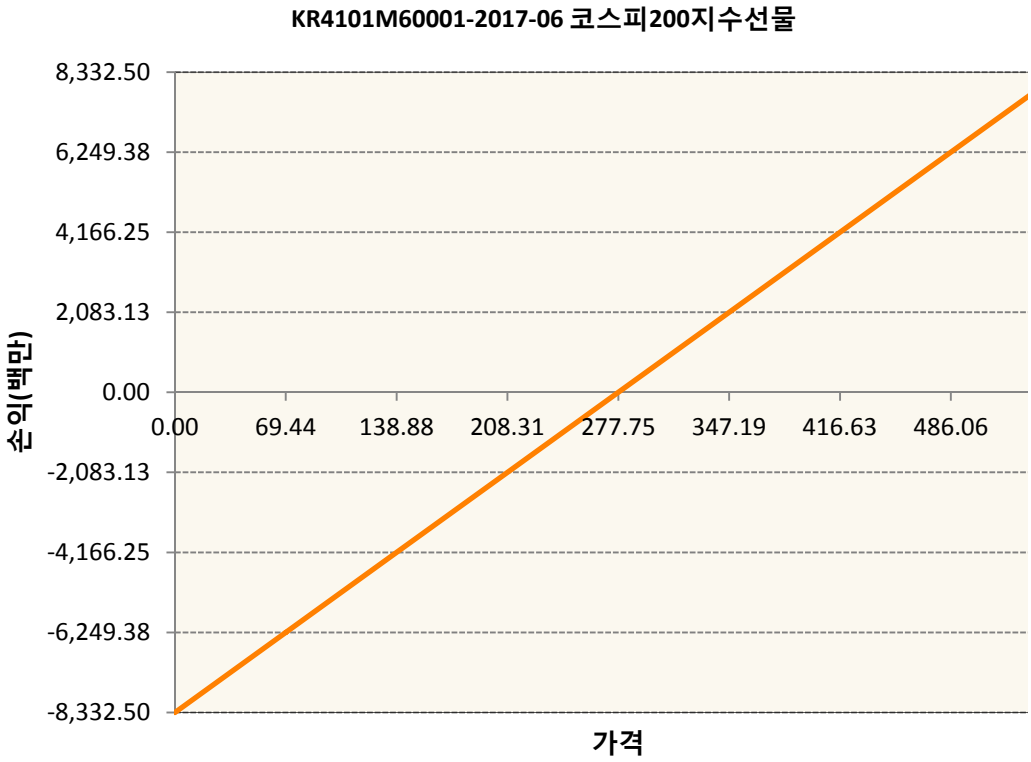
커버드콜모(주식혼합-파생형)

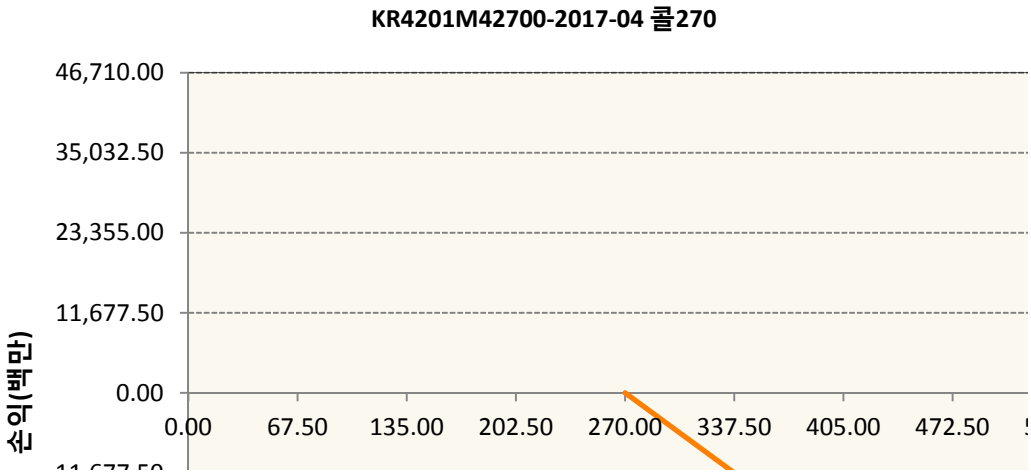
1. 계약금액

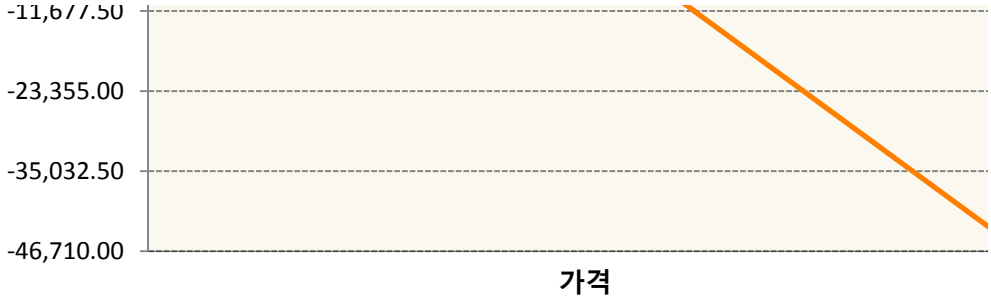
(단위:백만원)

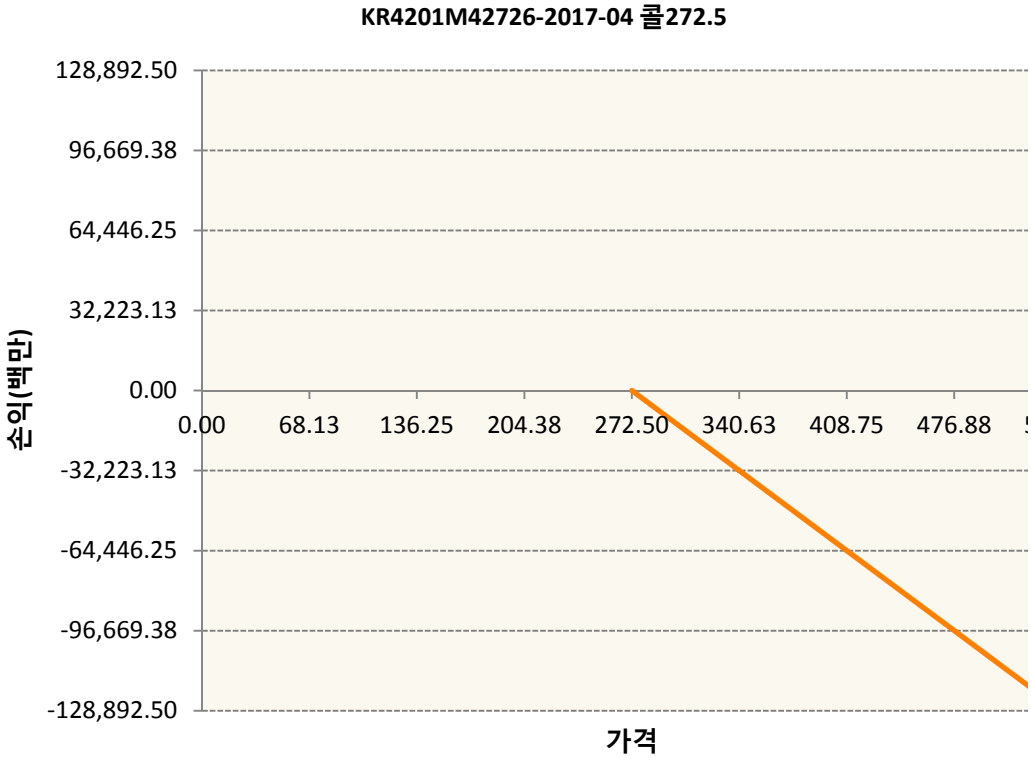
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	6,526	-6,526	장내
신규	유가증권	옵션	6,284	27,290	-21,006	장내
누계	유가증권	선물	8,333	0	8,333	장내
누계	유가증권	옵션	0	216,478	-216,478	장내

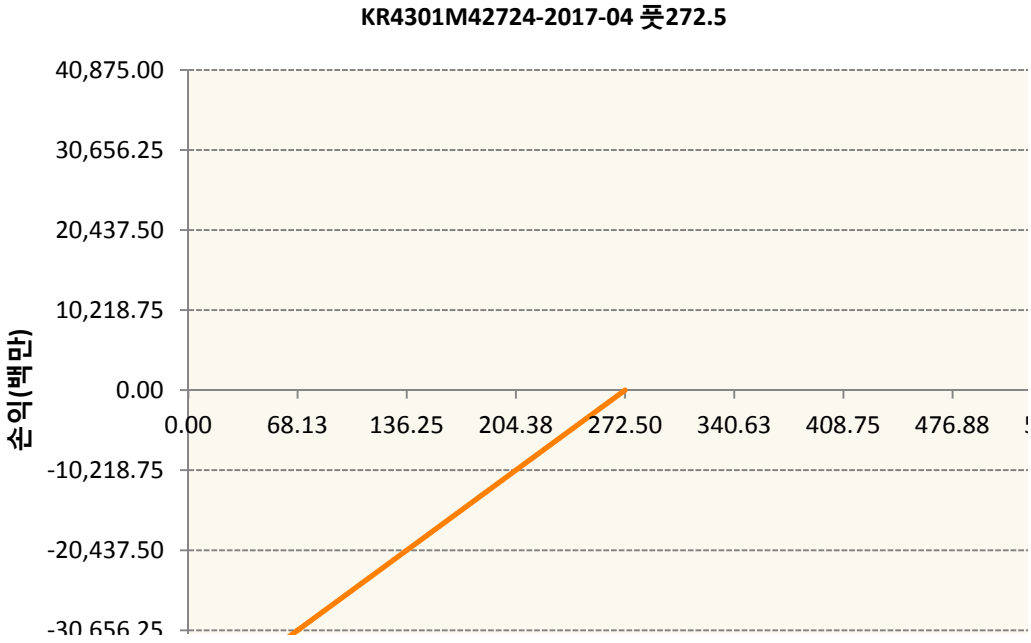
2. 만기시점의 손익구조

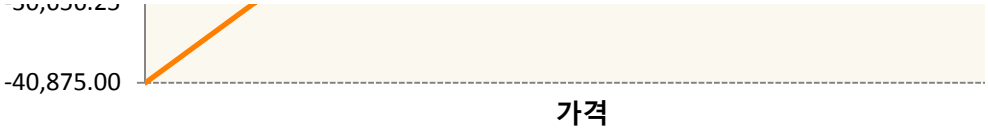





-11,677.50
-23,355.00
-35,032.50
-46,710.00
가격


KR4201M42726-2017-04 콜272.5
128,892.50
96,669.38
64,446.25
32,223.13
0.00
-32,223.13
-64,446.25
-96,669.38
-128,892.50
0.00
68.13
136.25
204.38
272.50
340.63
408.75
476.88
순익(백만)
가격


KR4301M42724-2017-04 풋272.5
40,875.00
30,656.25
20,437.50
10,218.75
0.00
-10,218.75
-20,437.50
-30,656.25
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							665
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-665	-665	-665	-665	-665	-665	-665
-5.33%	-444	-444	-444	-444	-444	-444	-444
-2.67%	-222	-222	-222	-222	-222	-222	-222
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	222	222	222	222	222	222	222
5.33%	444	444	444	444	444	444	444
8.00%	665	665	665	665	665	665	665
KR4201M42 2017-04 콜270							3,833
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,249	1,249	1,249	1,249	1,249	1,249	1,249
-5.33%	1,249	1,249	1,248	1,248	1,246	1,244	1,241
-2.67%	1,094	1,075	1,056	1,037	1,018	999	980
0%	3	3	2	0	-2	-5	-9
2.67%	-1,275	-1,275	-1,275	-1,275	-1,275	-1,275	-1,275
5.33%	-2,554	-2,554	-2,554	-2,554	-2,554	-2,554	-2,554
8.00%	-3,833	-3,833	-3,833	-3,833	-3,833	-3,833	-3,833
KR4201M42 2017-04 콜272.5							10,429
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,284	2,284	2,284	2,284	2,284	2,284	2,284
-5.33%	2,284	2,283	2,283	2,283	2,282	2,281	2,279
-2.67%	2,199	2,168	2,134	2,098	2,059	2,019	1,977
0%	44	33	18	0	-22	-46	-73
2.67%	-3,437	-3,437	-3,437	-3,437	-3,438	-3,438	-3,439
5.33%	-6,933	-6,933	-6,933	-6,933	-6,933	-6,933	-6,933
8.00%	-10,429	-10,429	-10,429	-10,429	-10,429	-10,429	-10,429
KR4301M42 2017-04 풋272.5							2,602
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,602	-2,602	-2,602	-2,602	-2,602	-2,602	-2,602
-5.33%	-1,493	-1,493	-1,493	-1,493	-1,494	-1,494	-1,495
-2.67%	-411	-421	-432	-443	-456	-468	-482

0%	14	10	6	0	-7	-15	-23
2.67%	19	19	19	19	19	18	18
5.33%	19	19	19	19	19	19	19
8.00%	19	19	19	19	19	19	19

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

21,788

공시일	2017-04-11
기준일	2017-04-10

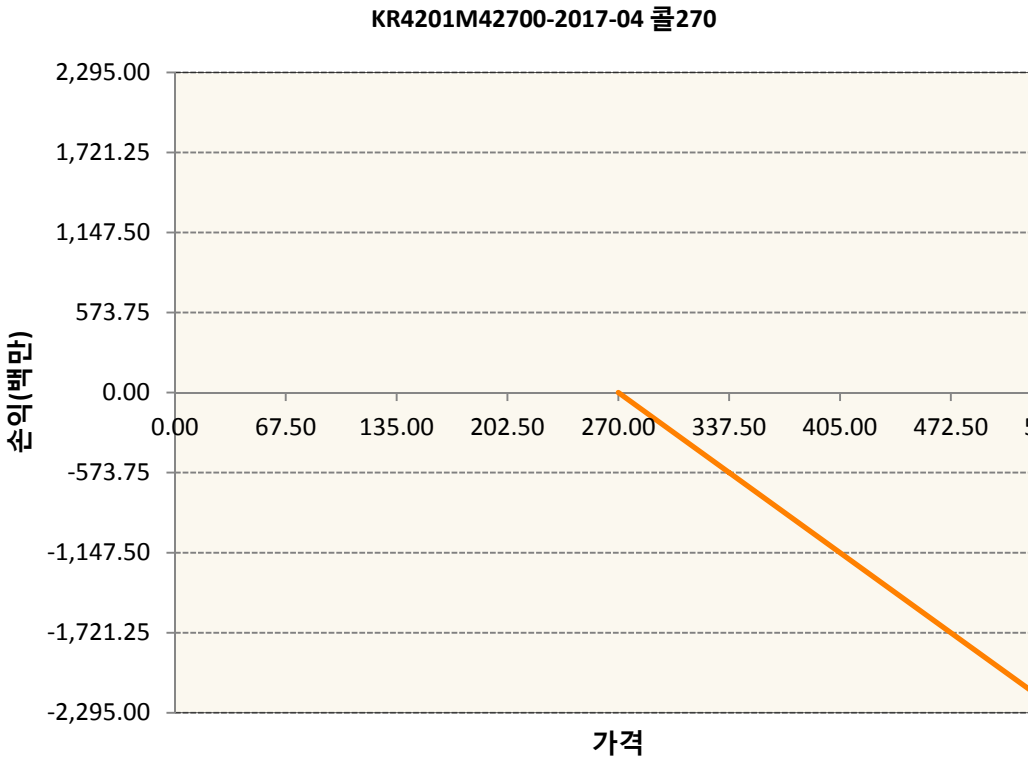
커버드콜목표전환형증권투자신탁

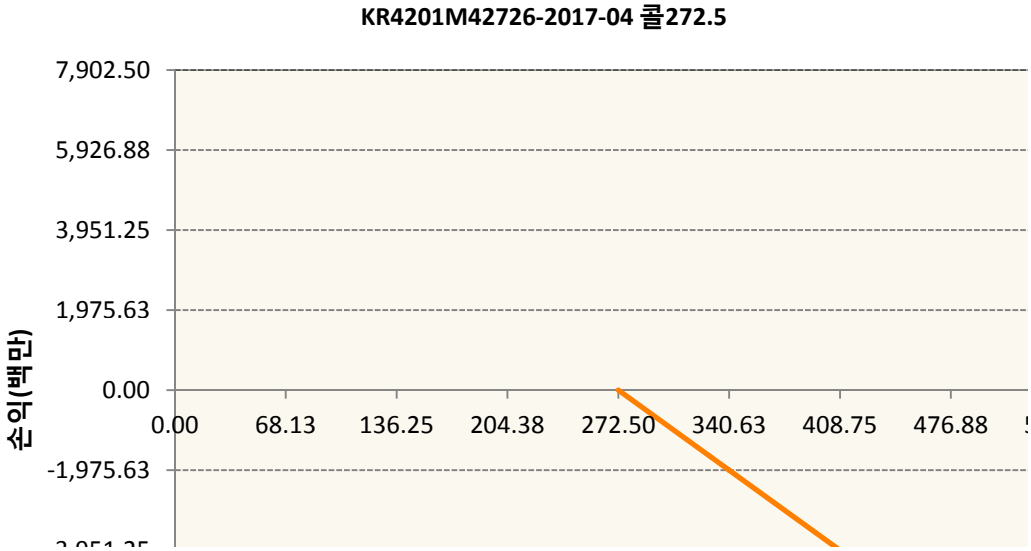
1. 계약금액

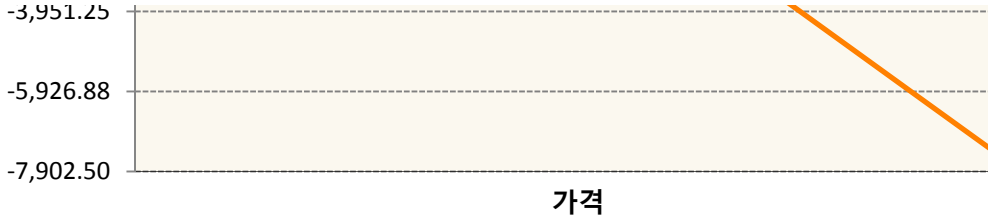
(단위:백만원)

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							188
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	61	61	61	61	61	61	61
-5.33%	61	61	61	61	61	61	61
-2.67%	54	53	52	51	50	49	48
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
5.33%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125
8.00%	-188	-188	-188	-188	-188	-188	-188

KR4201M42 2017-04 콜272.5							639
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	140	140	140	140	140	140	140
-5.33%	140	140	140	140	140	140	140
-2.67%	135	133	131	129	126	124	121
0%	3	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	-211	-211	-211	-211	-211	-211	-211
5.33%	-425	-425	-425	-425	-425	-425	-425
8.00%	-639	-639	-639	-639	-639	-639	-639

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

1,089

공시일	2017-04-11
기준일	2017-04-10

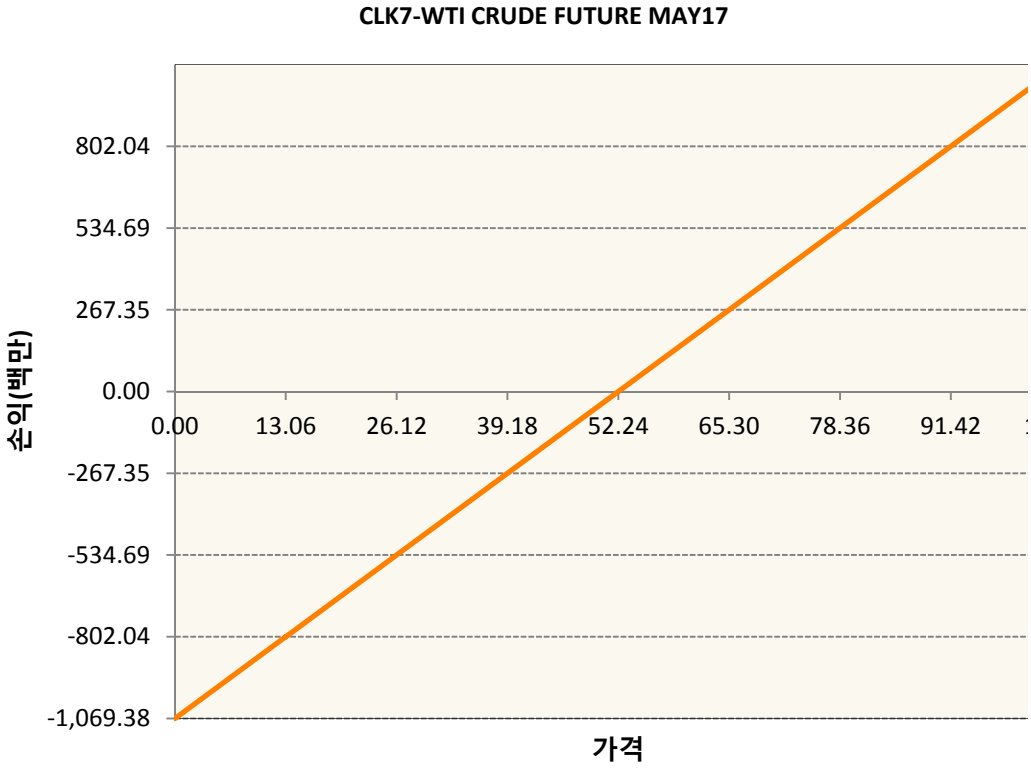
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

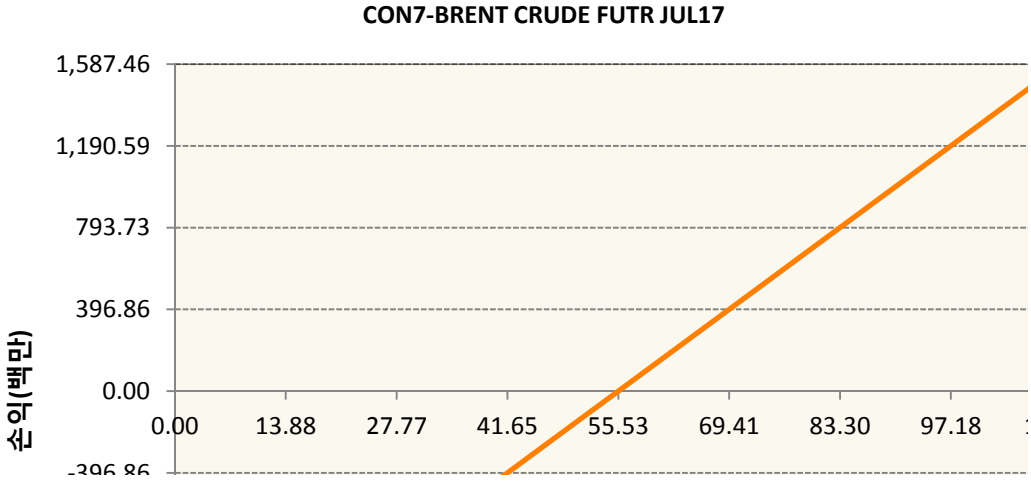
1. 계약금액

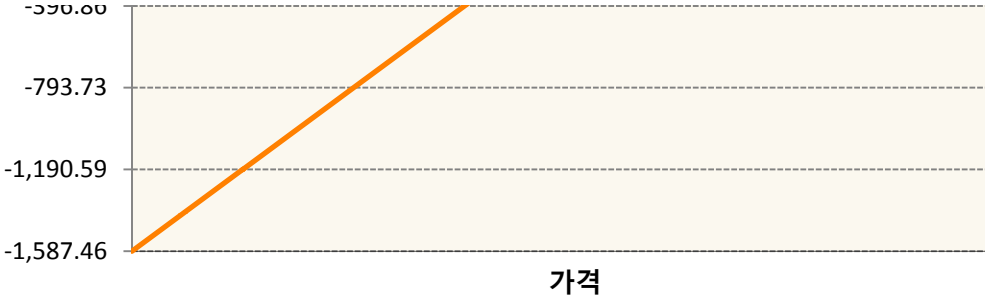
(단위:백만원)

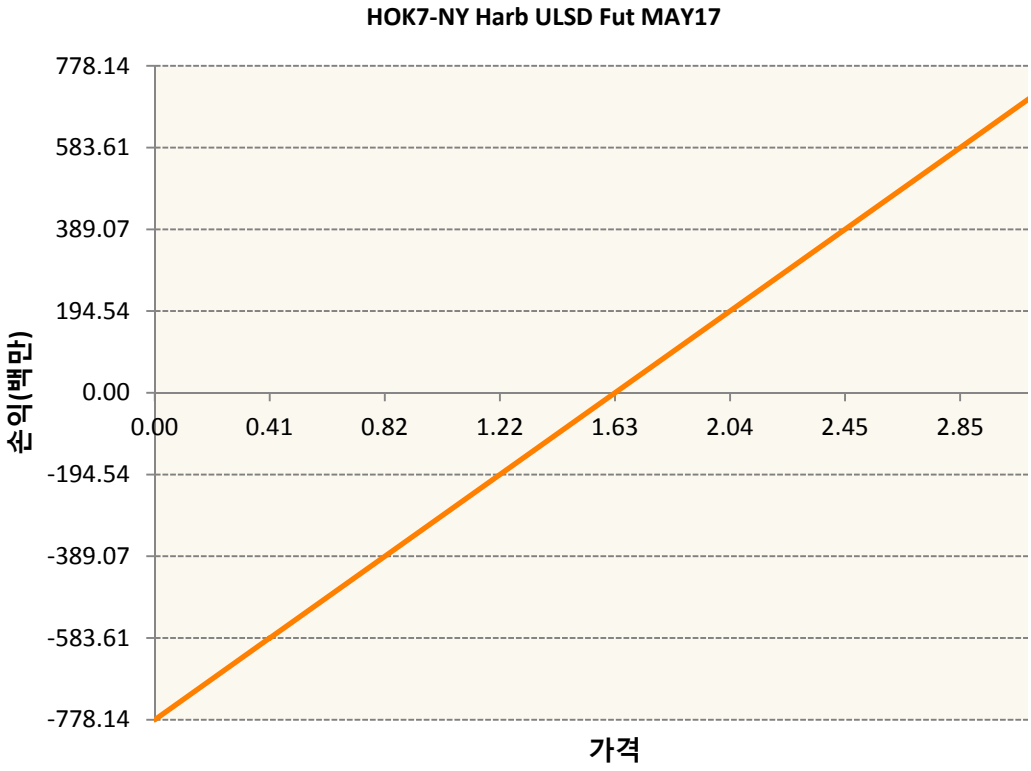
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,069	0	1,069	
누계	유가증권	선물	4,877	411	4,465	

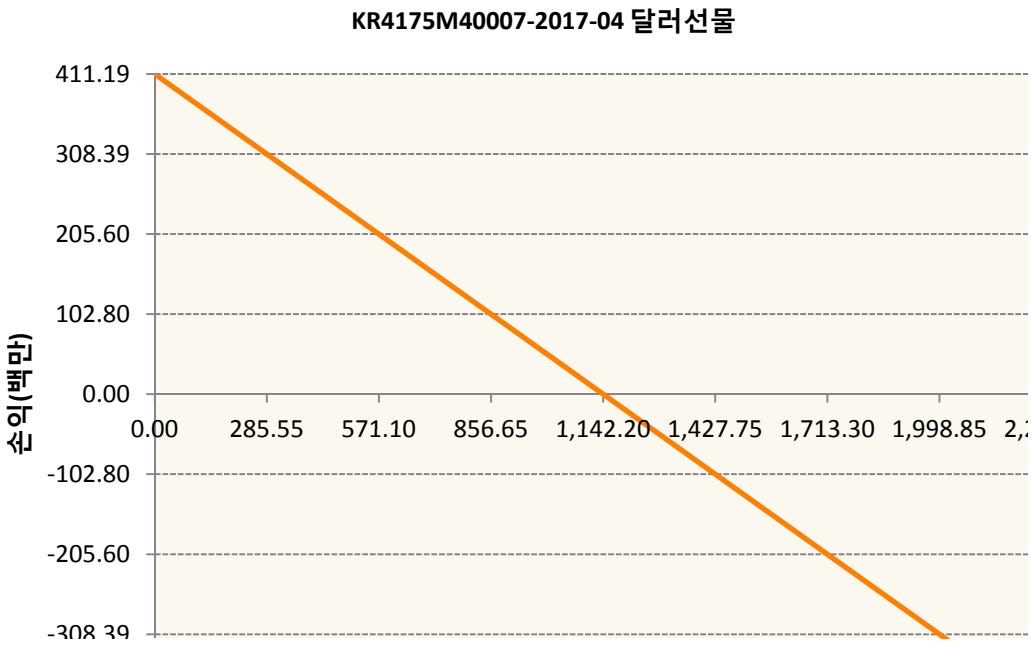
2. 만기시점의 손익구조

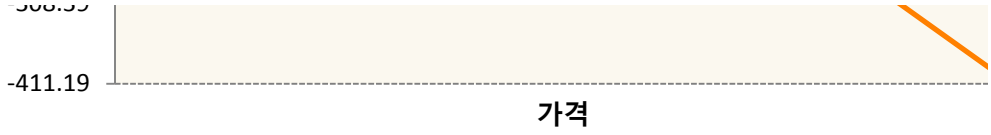


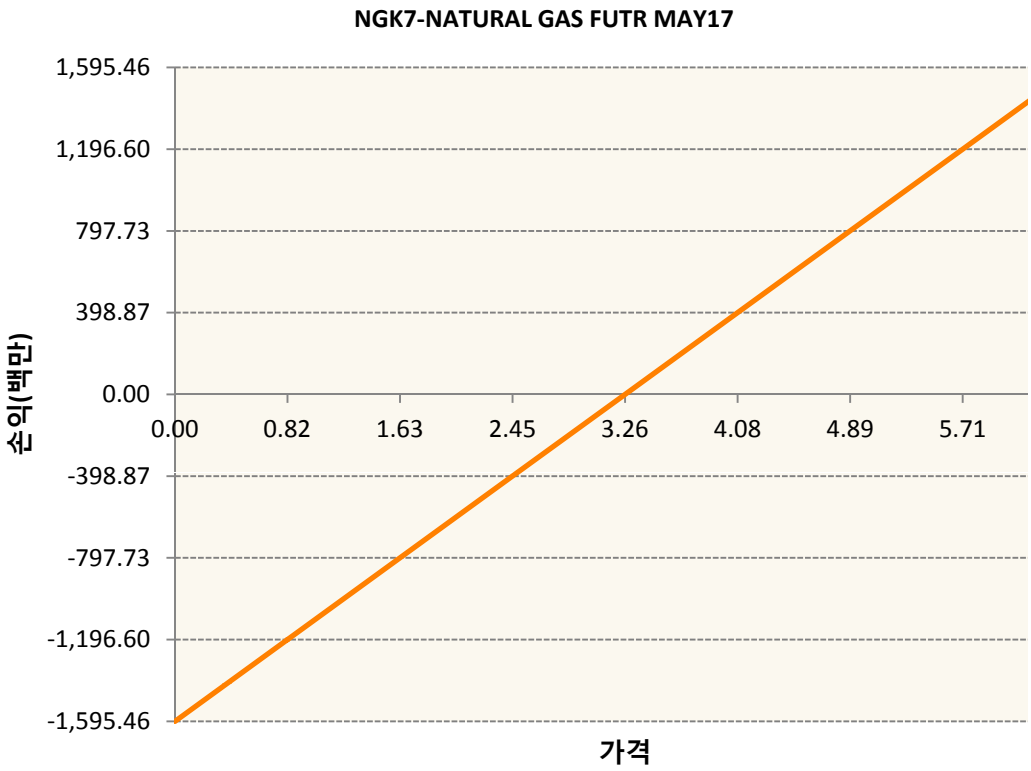


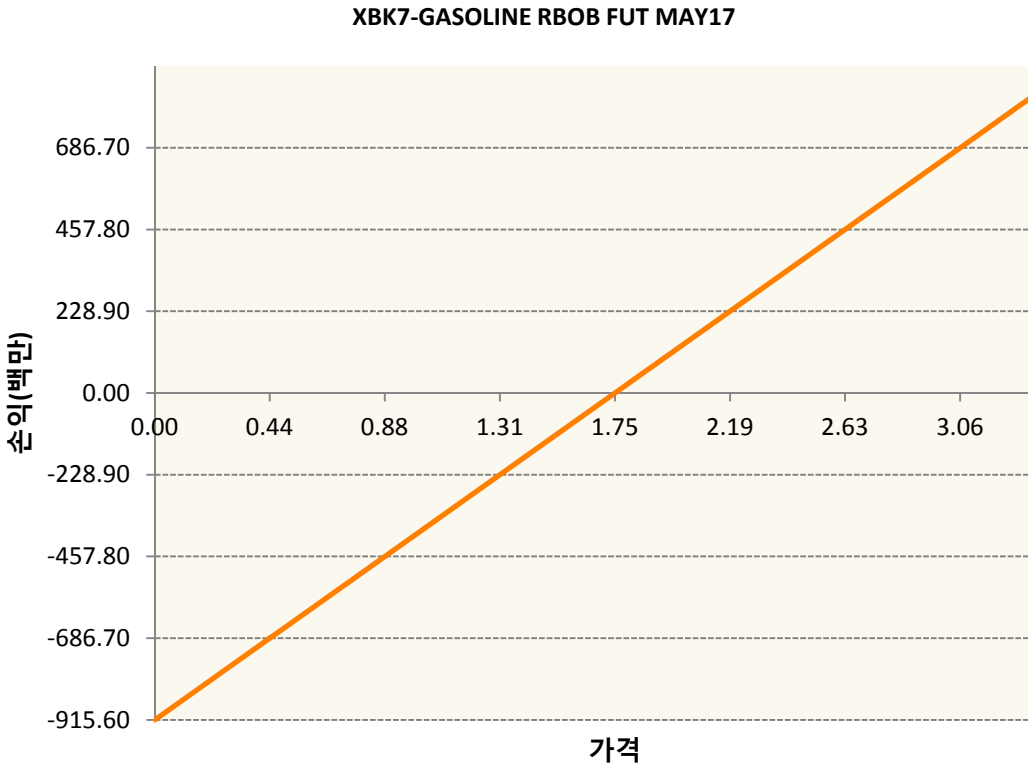

-793.73
-1,190.59
-1,587.46
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
778.14
583.61
389.07
194.54
0.00
-194.54
-389.07
-583.61
-778.14
0.00
0.41
0.82
1.22
1.63
2.04
2.45
2.85
순익(백만)
가격


KR4175M40007-2017-04 달러선물
411.19
308.39
205.60
102.80
0.00
-102.80
-205.60
-308.39
0.00
285.55
571.10
856.65
1,142.20
1,427.75
1,713.30
1,998.85
순익(백만)


-411.19
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,595.46
1,196.60
797.73
398.87
0.00
-398.87
-797.73
-1,196.60
-1,595.46
0.00
0.82
1.63
2.45
3.26
4.08
4.89
5.71
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
686.70
457.80
228.90
0.00
-228.90
-457.80
-686.70
-915.60
0.00
0.44
0.88
1.31
1.75
2.19
2.63
3.06
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK7	WTI CRUDE FUTURE MAY17	86
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	127
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	62
KR4175M40(	2017-04 달러선물	33
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	128
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	73

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

1,037

공시일	2017-04-11
기준일	2017-04-10

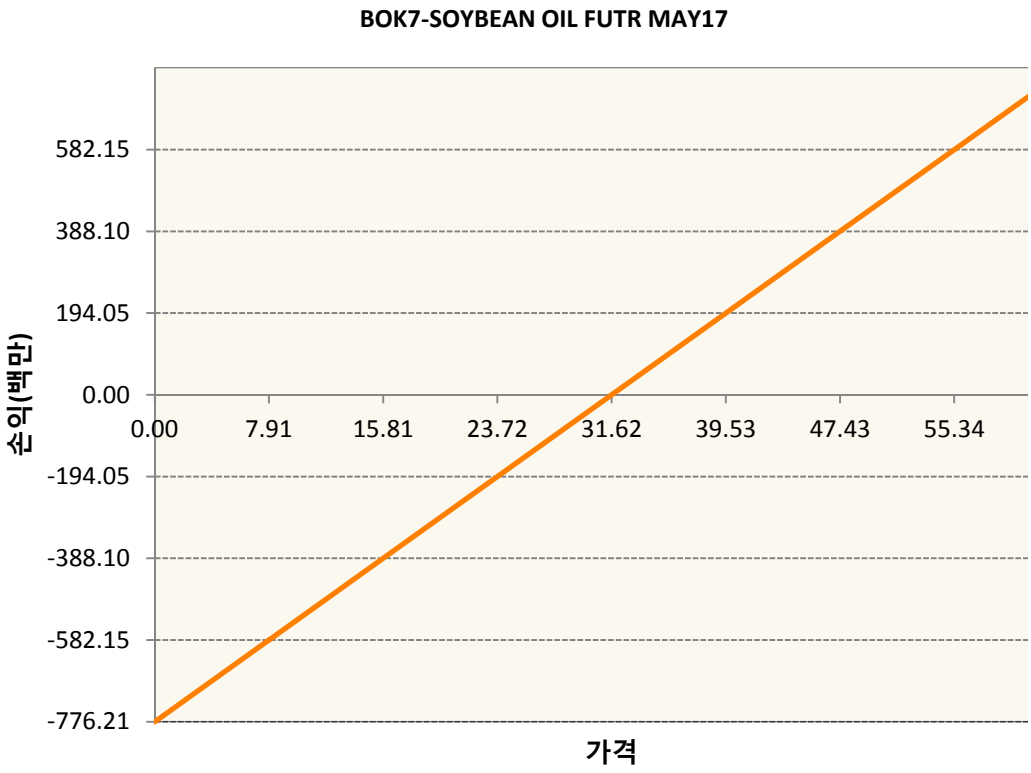
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

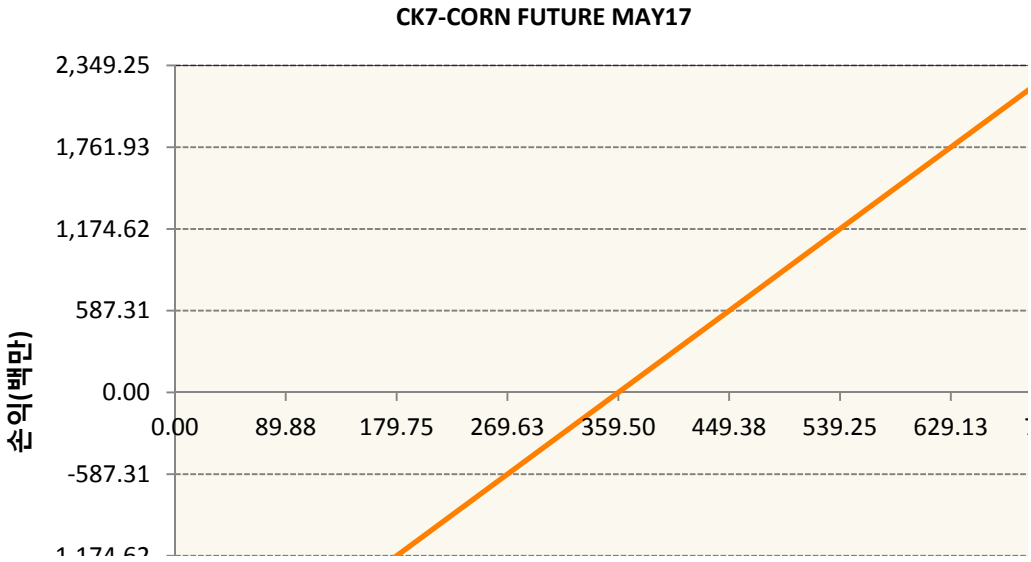
1. 계약금액

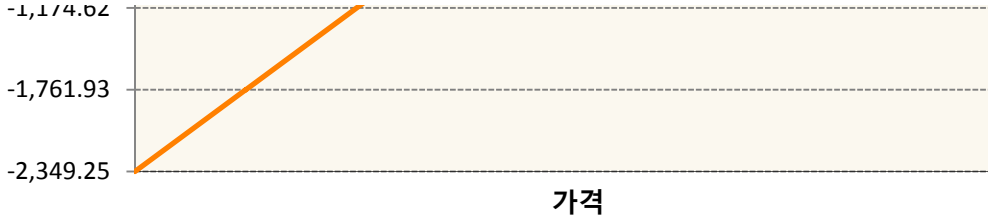
(단위:백만원)

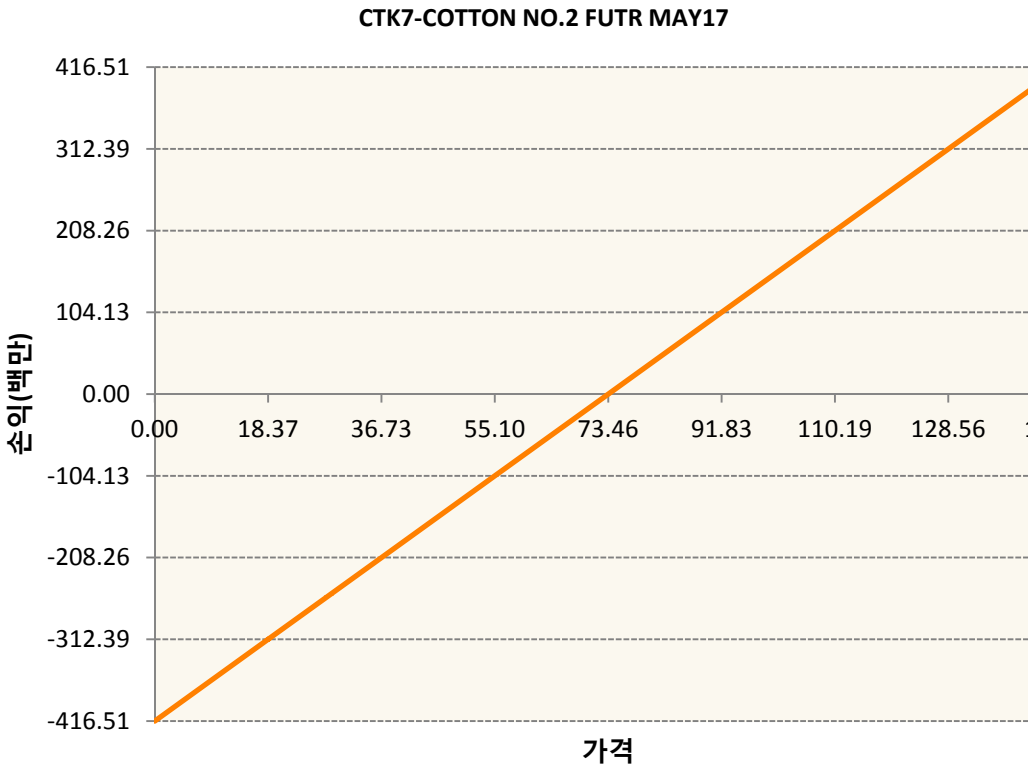
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,984	400	8,585	

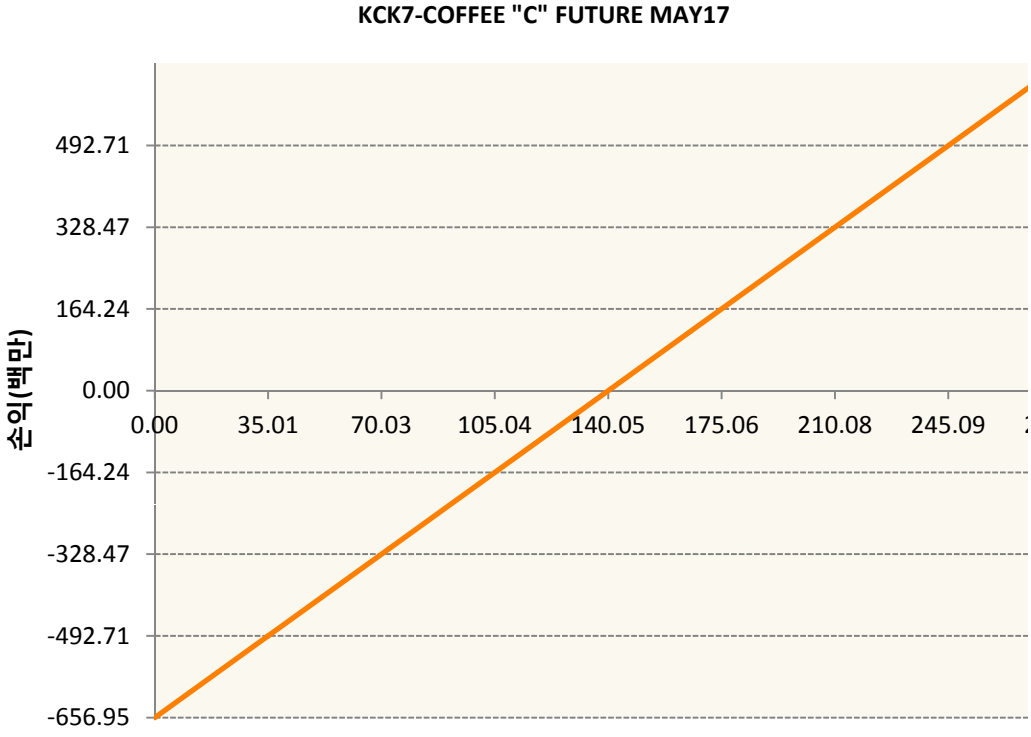
2. 만기시점의 손익구조



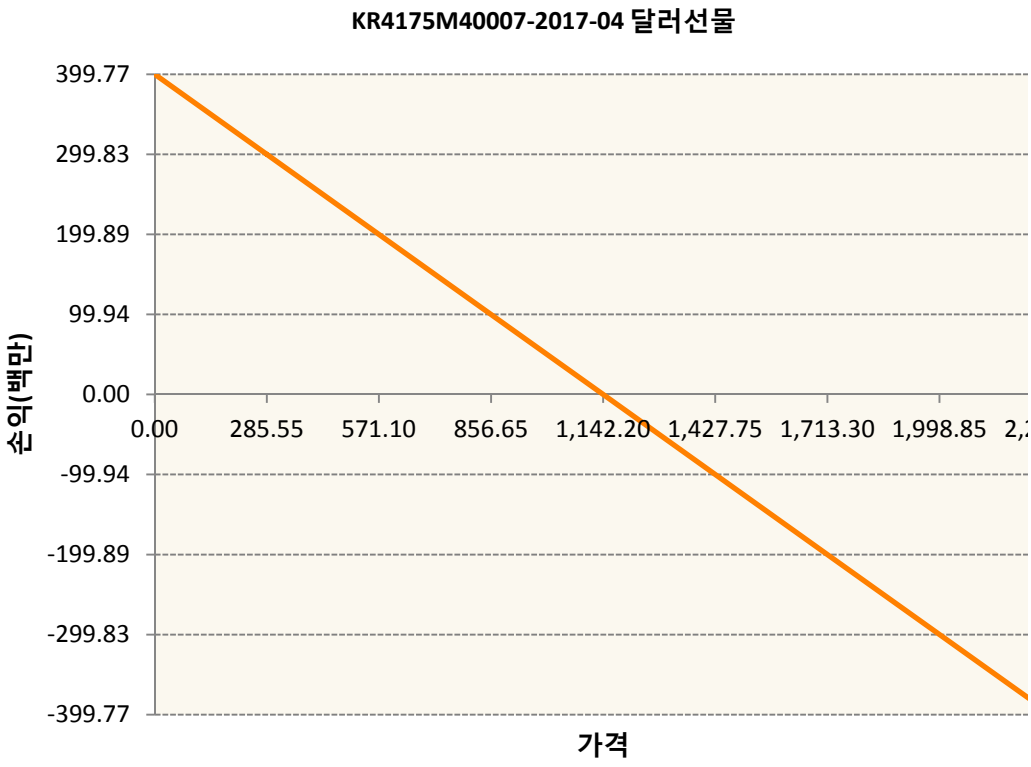


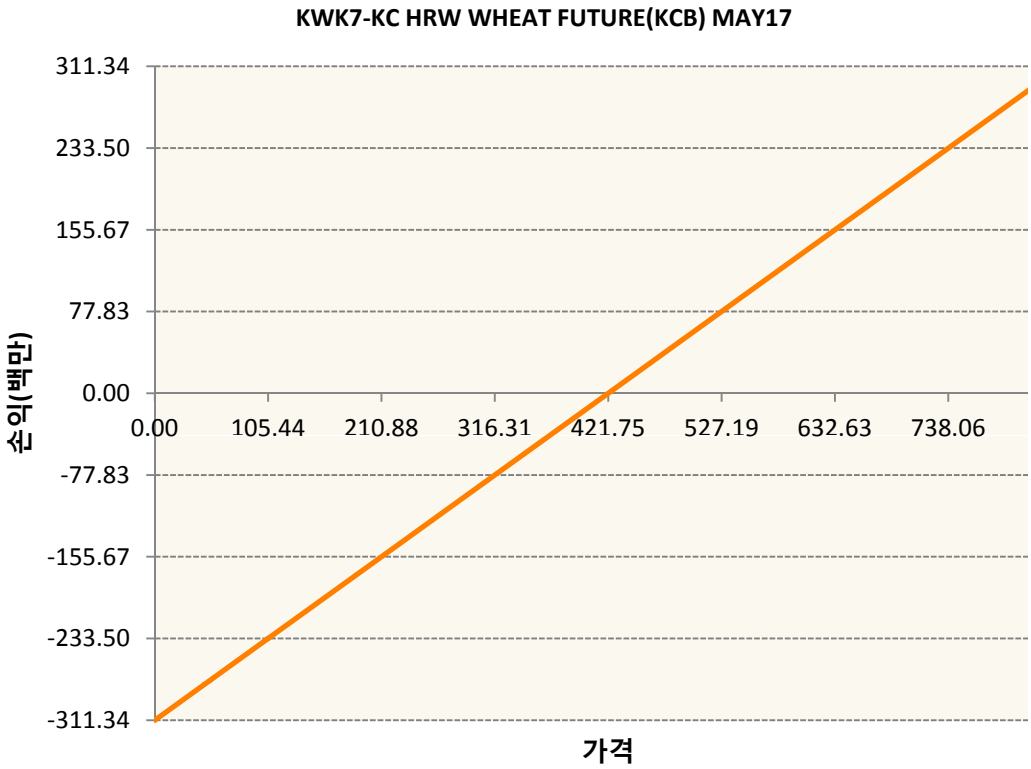

-1,761.93
-2,349.25
가격

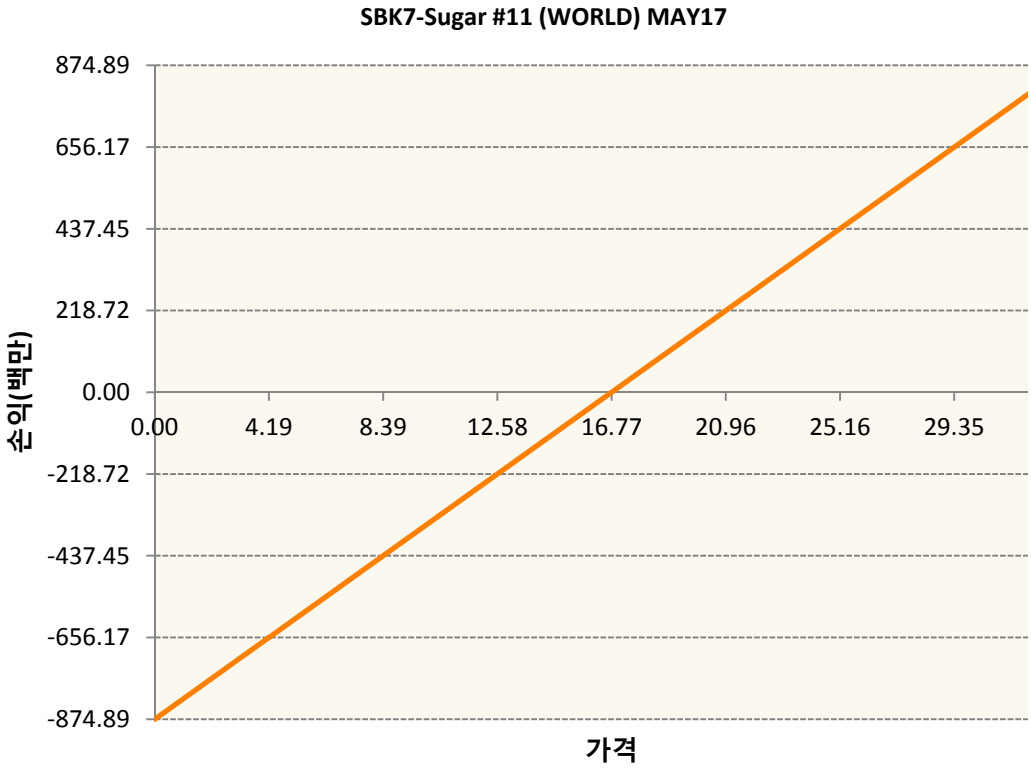

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
416.51
312.39
208.26
104.13
0.00
-104.13
-208.26
-312.39
-416.51
0.00
18.37
36.73
55.10
73.46
91.83
110.19
128.56
손익(백만)
가격

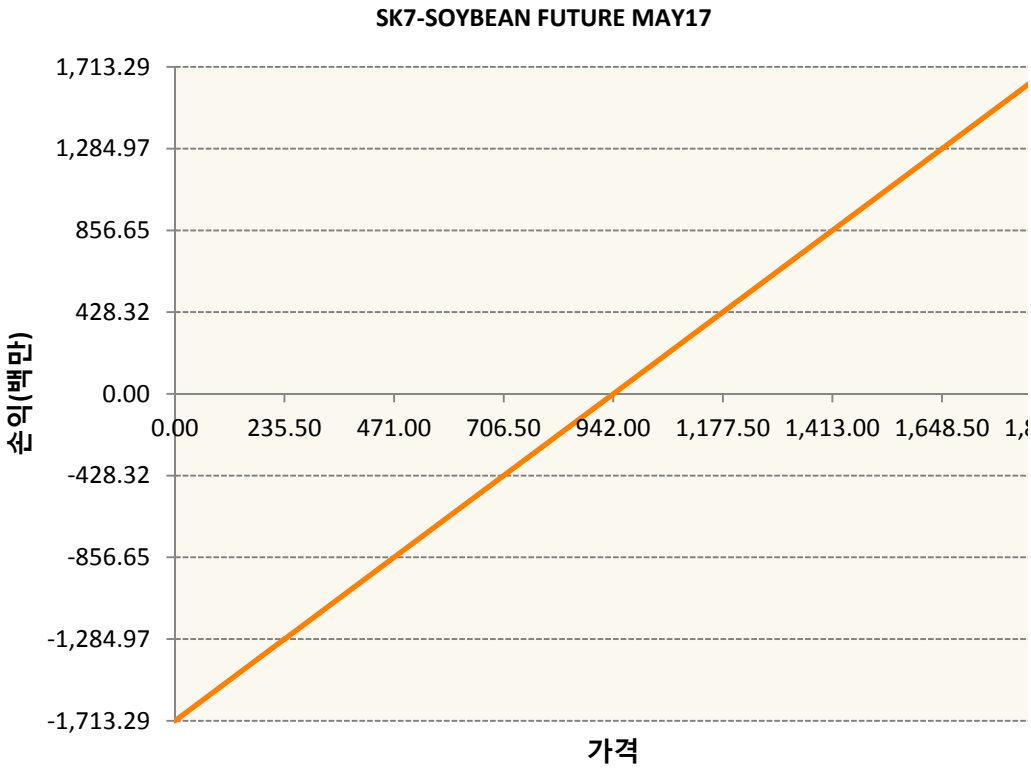

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
492.71
328.47
164.24
0.00
-164.24
-328.47
-492.71
-656.95
0.00
35.01
70.03
105.04
140.05
175.06
210.08
245.09
손익(백만)

가격

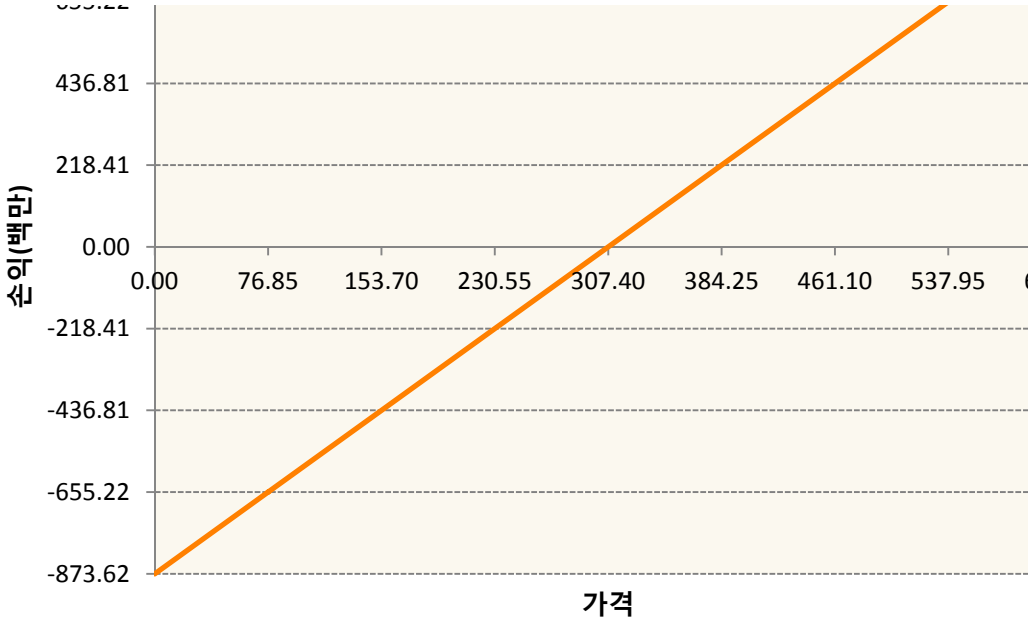

KR4175M40007-2017-04 달러선물
399.77
299.83
199.89
99.94
0.00
-99.94
-199.89
-299.83
-399.77
0.00
285.55
571.10
856.65
1,142.20
1,427.75
1,713.30
1,998.85
손익(백만)
가격

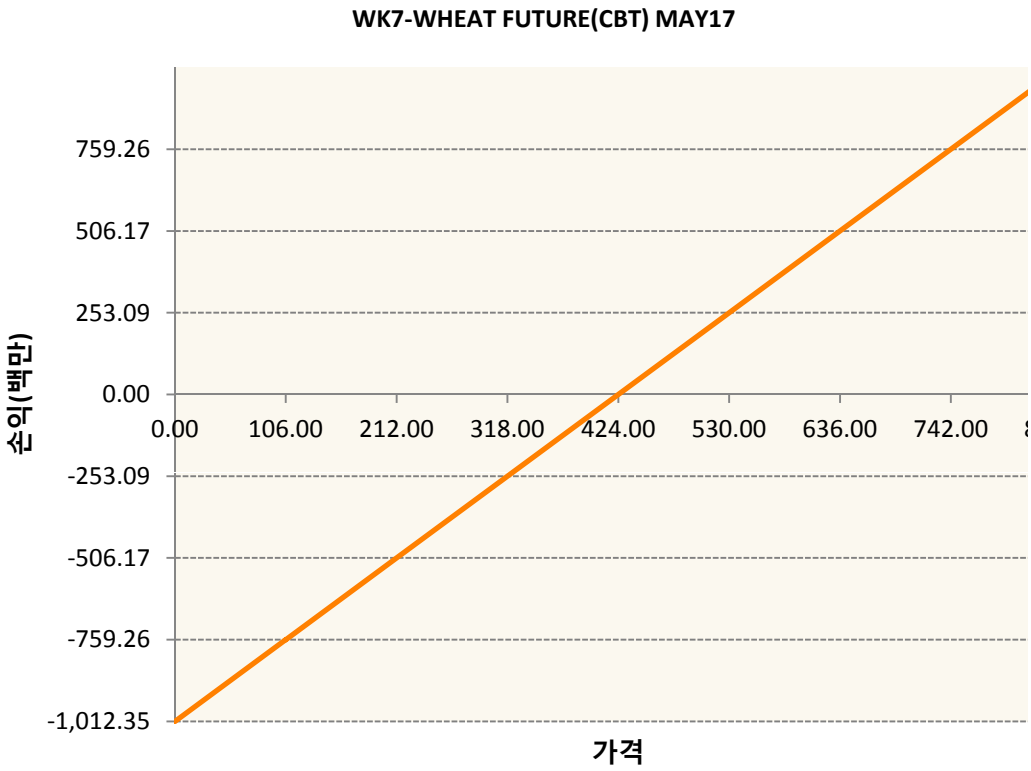

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
311.34
233.50
155.67
77.83
0.00
-77.83
-155.67
-233.50
-311.34
0.00
105.44
210.88
316.31
421.75
527.19
632.63
738.06
손익(백만)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
874.89
656.17
437.45
218.72
0.00
-218.72
-437.45
-656.17
-874.89
0.00
4.19
8.39
12.58
16.77
20.96
25.16
29.35
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,713.29
1,284.97
856.65
428.32
0.00
-428.32
-856.65
-1,284.97
-1,713.29
0.00
235.50
471.00
706.50
942.00
1,177.50
1,413.00
1,648.50
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
873.62
655.22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	62
CK7	CORN FUTURE MAY17	188
CTK7	COTTON NO.2 FUTR MAY17	33
KCK7	COFFEE "C" FUTURE MAY17	53
KR4175M40(	2017-04 달러선물	32

KWK7	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17	25
SBK7	Sugar #11 (WORLD) MAY17	70
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)

821