공시일	2017-04-12
기준일	2017-04-11

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	2017-04-12
기준일	2017-04-11

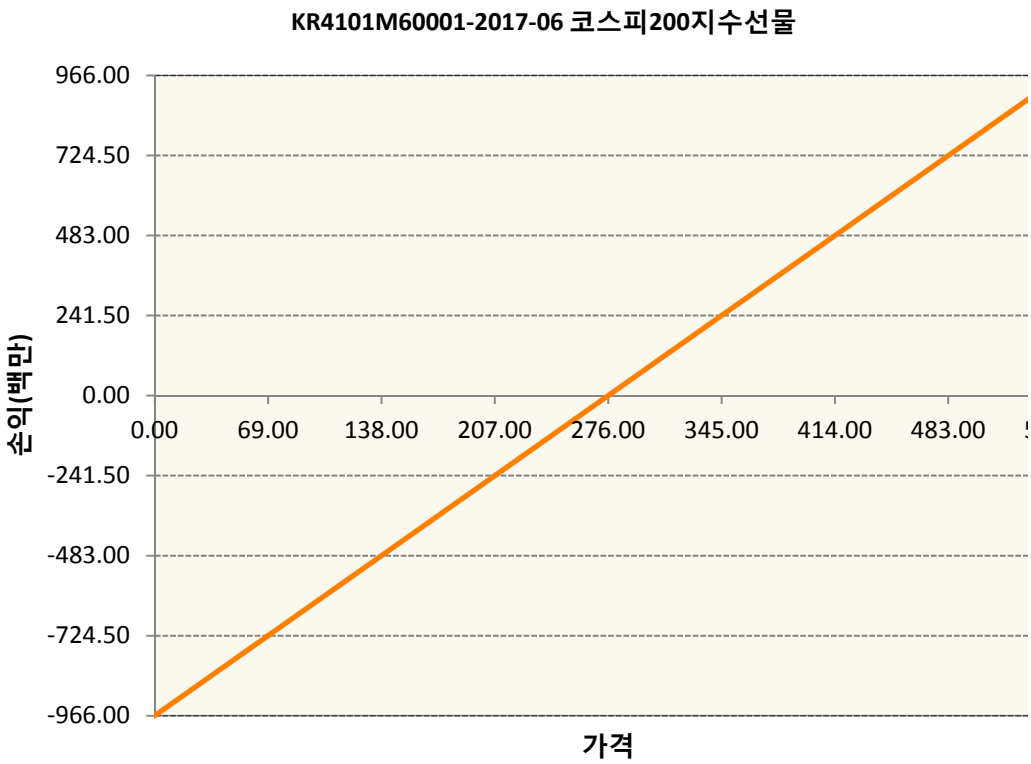
스마트인덱스모

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	966	0	966	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							77
	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%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
-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%	51	51	51	51	51	51	51
8.00%	77	77	77	77	77	77	77

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

50

공시일	2017-04-12
기준일	2017-04-11

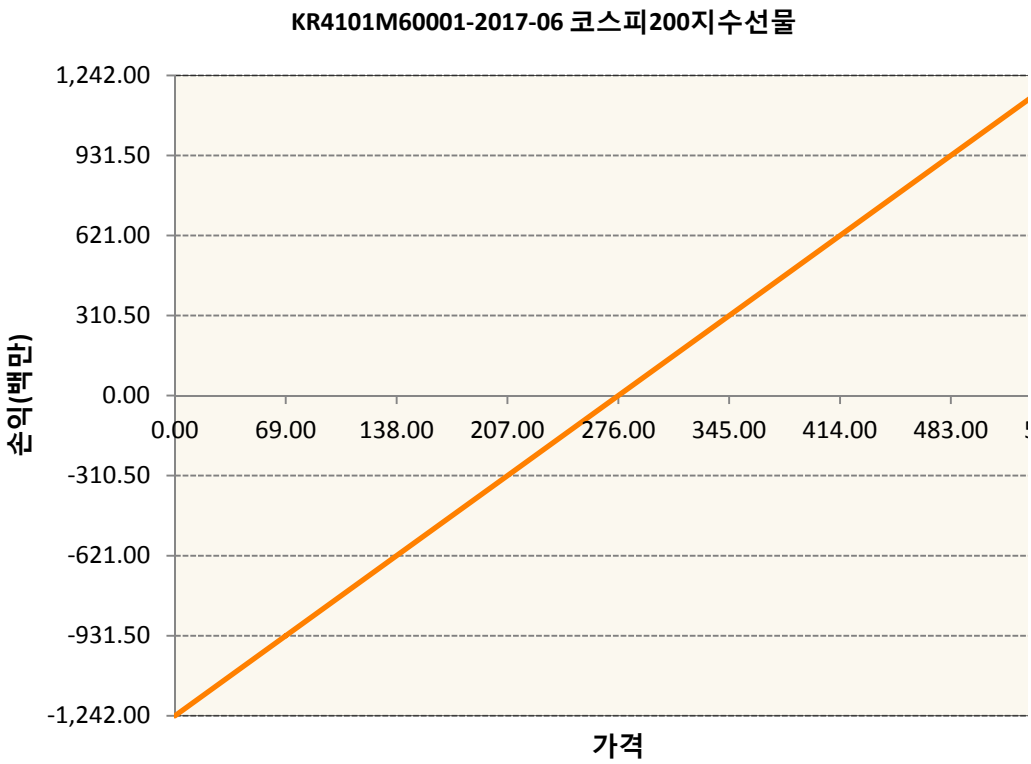
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,242	0	1,242	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							99
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99
-5.33%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
-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%	66	66	66	66	66	66	66
8.00%	99	99	99	99	99	99	99

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

64

공시일	2017-04-12
기준일	2017-04-11

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	2017-04-12
기준일	2017-04-11

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	401

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

424

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-04-12
기준일	2017-04-11

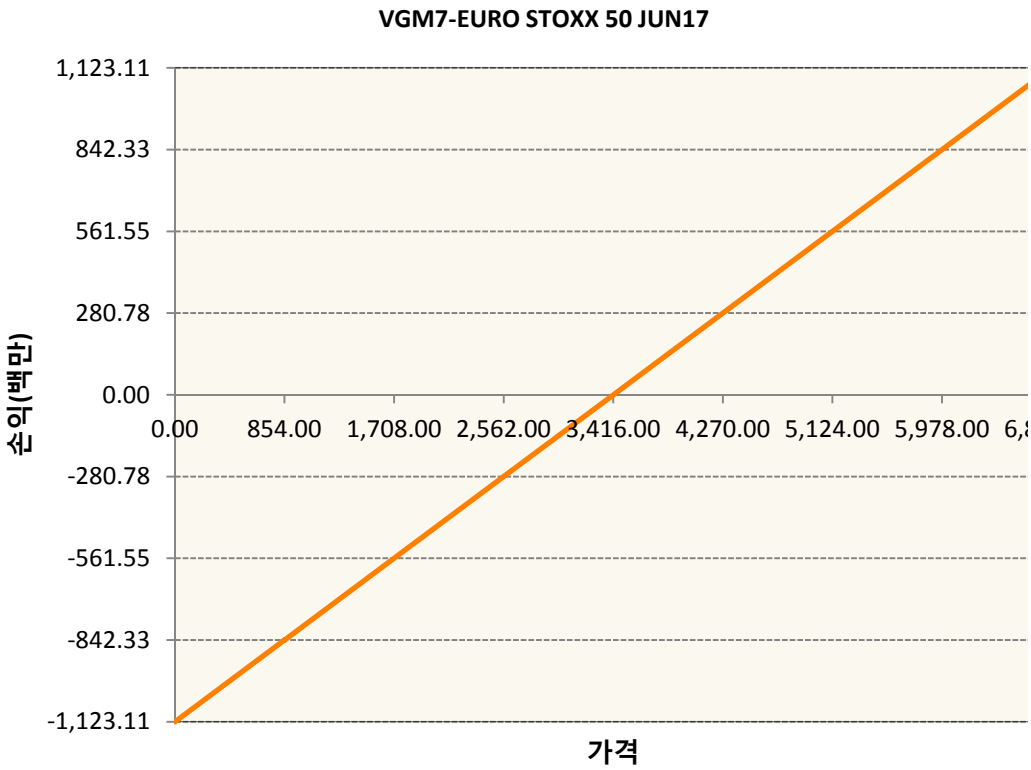
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,123	0	1,123	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM7	EURO STOXX 50 JUN17	90

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

(단위:백만원)

90

공시일	2017-04-12
기준일	2017-04-11

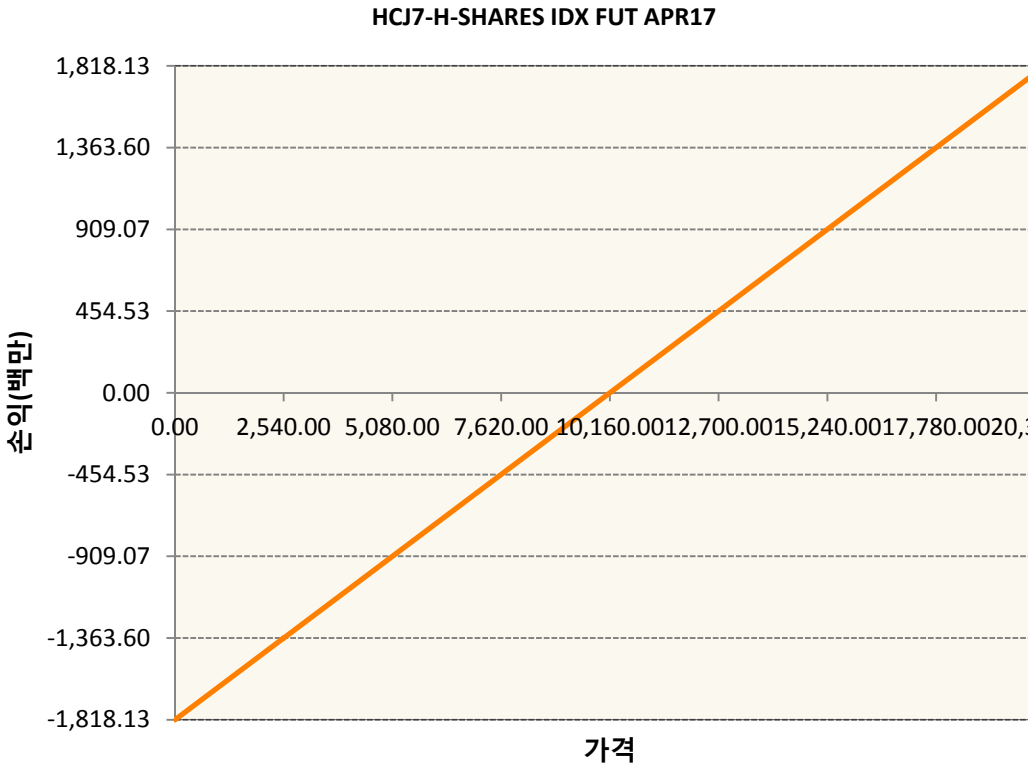
차이나인덱스모(주식-파생형)

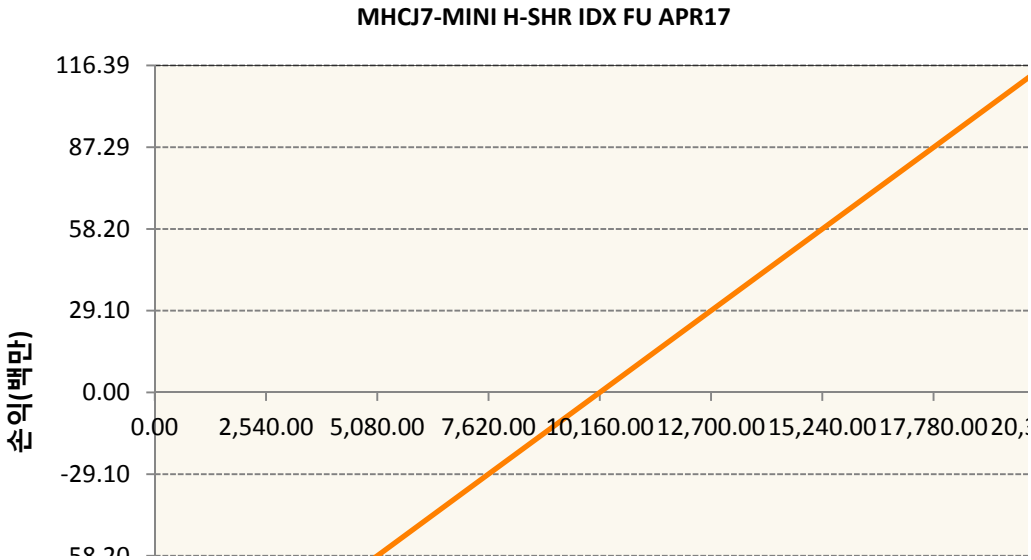
1. 계약금액

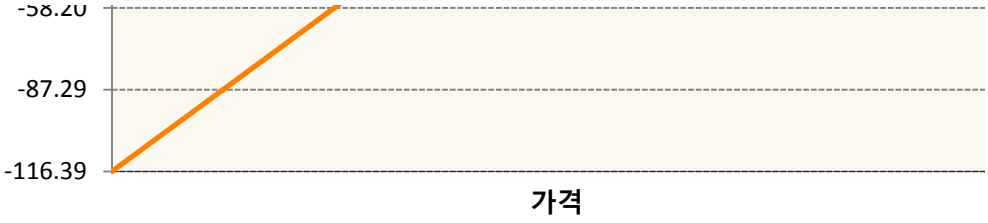
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,935	0	1,935	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCJ7	H-SHARES IDX FUT APR17	145
MHCJ7	MINI H-SHR IDX FU APR17	9

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

165

공시일	2017-04-12
기준일	2017-04-11

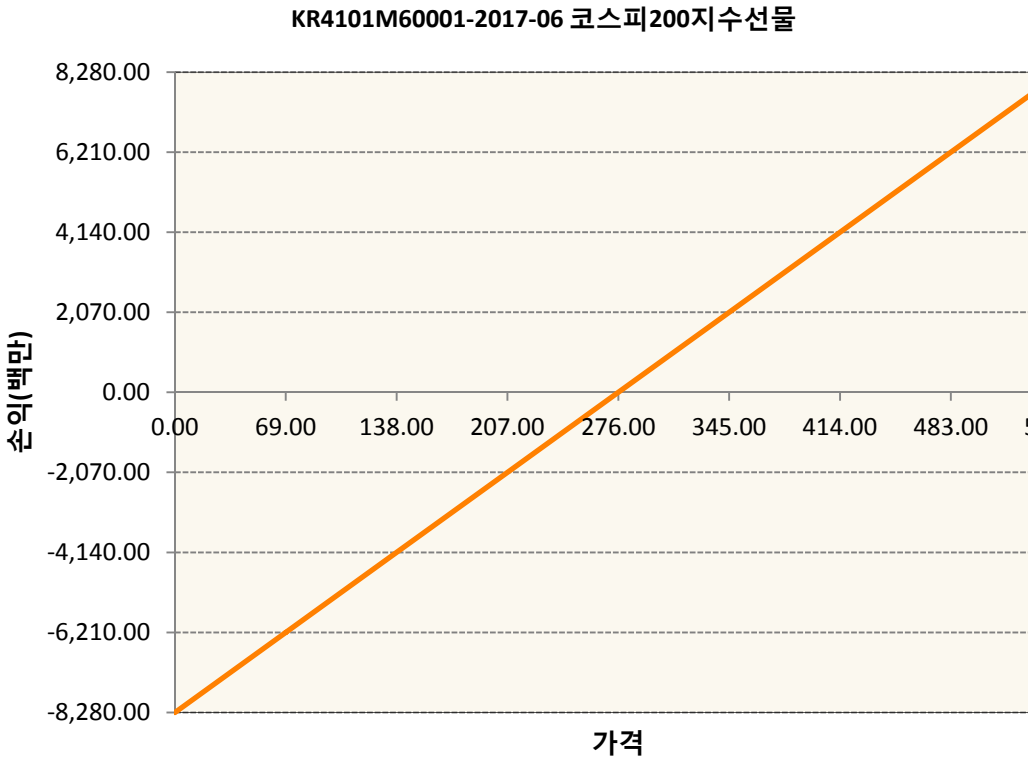
커버드콜모(주식혼합-파생형)

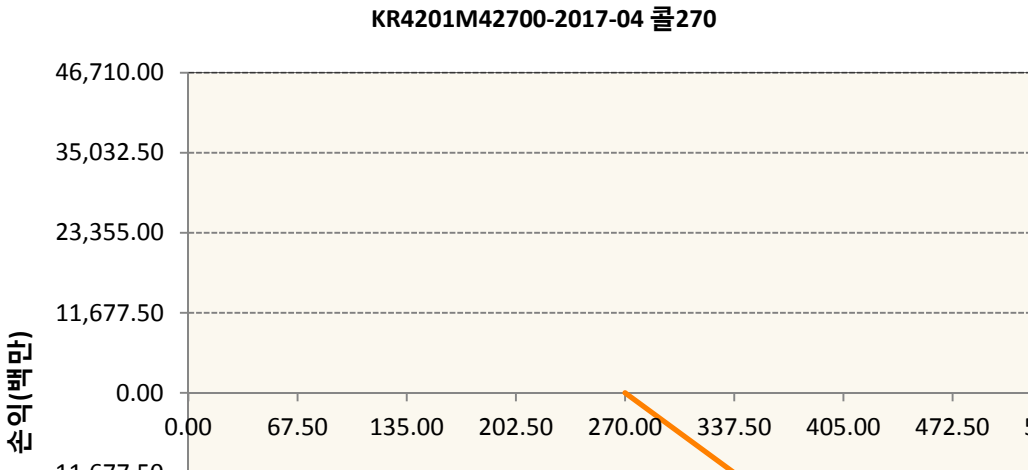
1. 계약금액

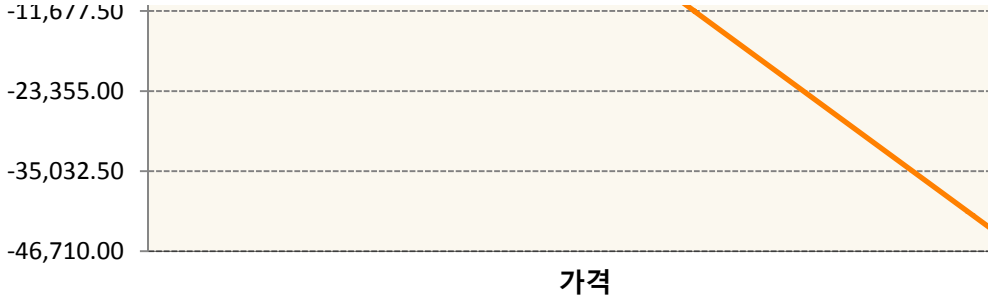
(단위:백만원)

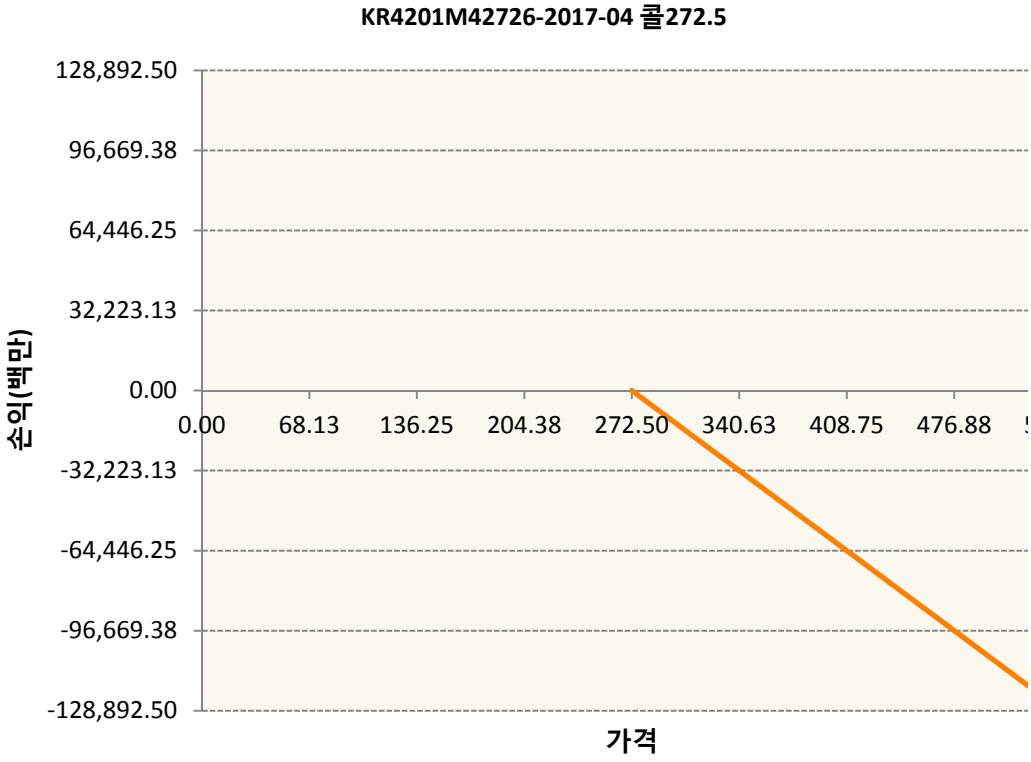
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	13,510	-13,510	장내
누계	유가증권	선물	8,280	0	8,280	장내
누계	유가증권	옵션	0	229,978	-229,978	장내

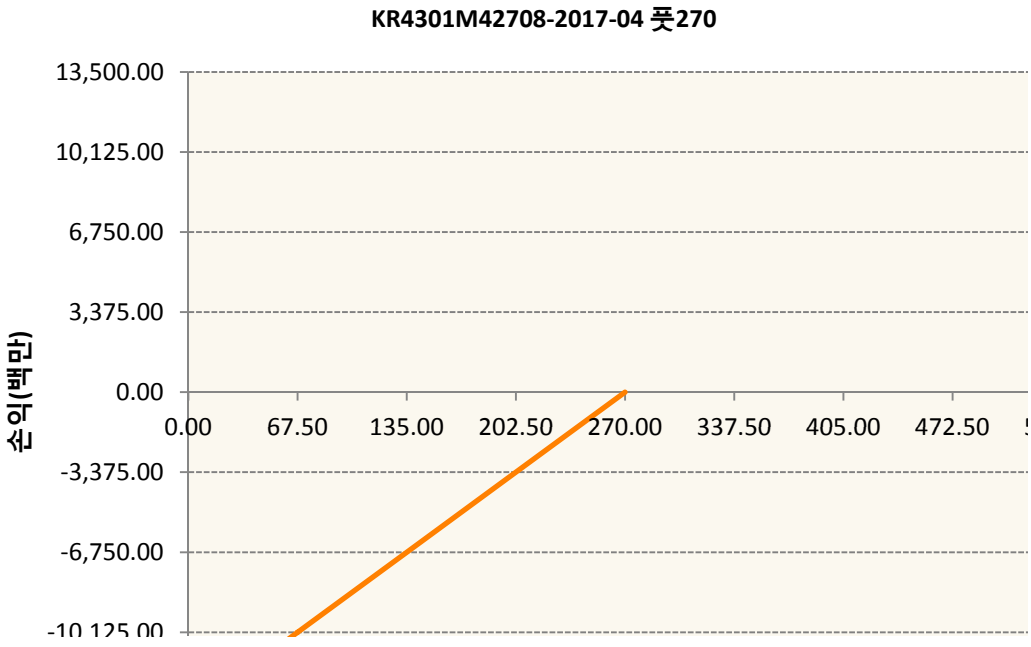
2. 만기시점의 손익구조

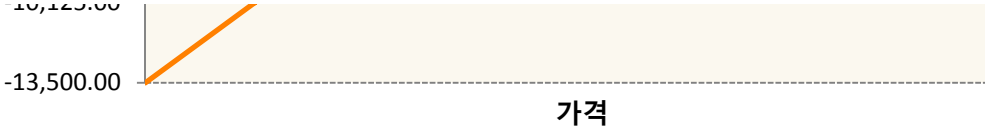


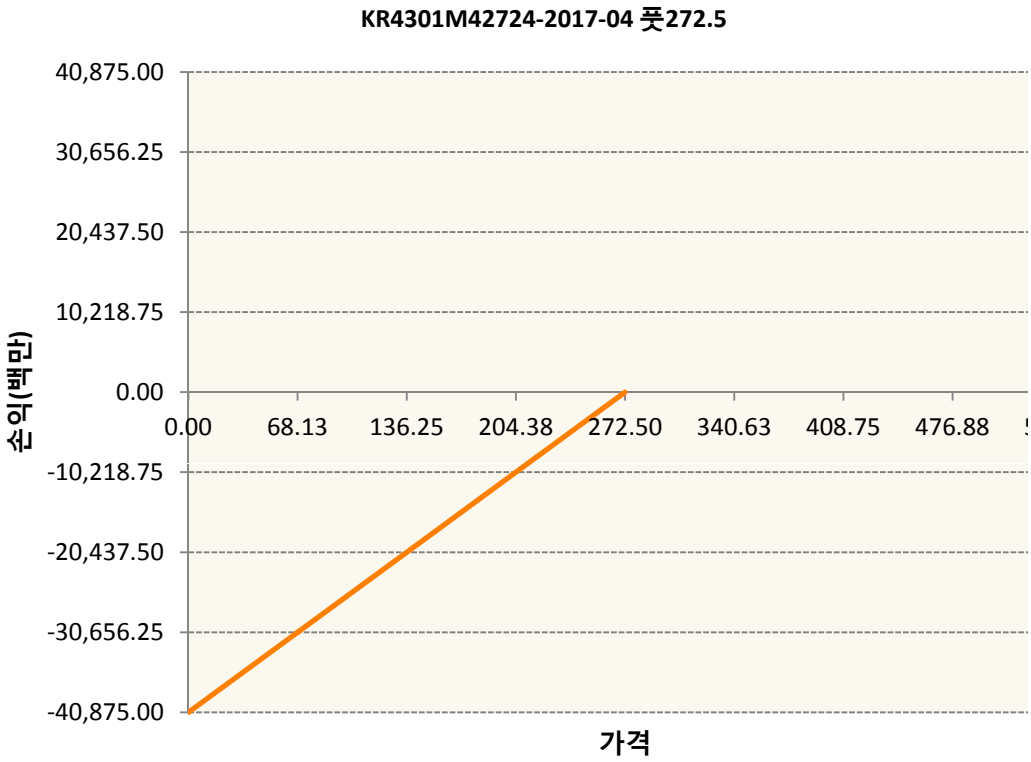



-11,677.50
-23,355.00
-35,032.50
-46,710.00
가격


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


KR4301M42708-2017-04 풋270
13,500.00
10,125.00
6,750.00
3,375.00
0.00
-3,375.00
-6,750.00
-10,125.00
0.00
67.50
135.00
202.50
270.00
337.50
405.00
472.50
순익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							661
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-661	-661	-661	-661	-661	-661	-661
-5.33%	-441	-441	-441	-441	-441	-441	-441
-2.67%	-220	-220	-220	-220	-220	-220	-220
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	220	220	220	220	220	220	220
5.33%	441	441	441	441	441	441	441
8.00%	661	661	661	661	661	661	661
KR4201M42 2017-04 콜270							3,800
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	961	961	961	961	961	961	961
-5.33%	961	961	961	961	961	960	959
-2.67%	905	890	875	859	842	825	808

0%	10	8	5	0	-6	-12	-20
2.67%	-1,258	-1,258	-1,258	-1,258	-1,258	-1,258	-1,259
5.33%	-2,529	-2,529	-2,529	-2,529	-2,529	-2,529	-2,529
8.00%	-3,800	-3,800	-3,800	-3,800	-3,800	-3,800	-3,800
	KR4201M42: 2017-04 콜272.5						10,259
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,577	1,577	1,577	1,577	1,577	1,577	1,577
-5.33%	1,577	1,577	1,577	1,577	1,577	1,576	1,576
-2.67%	1,558	1,544	1,527	1,507	1,483	1,456	1,427
0%	95	66	35	0	-37	-76	-116
2.67%	-3,310	-3,310	-3,310	-3,310	-3,311	-3,313	-3,315
5.33%	-6,784	-6,784	-6,784	-6,784	-6,784	-6,784	-6,784
8.00%	-10,259	-10,259	-10,259	-10,259	-10,259	-10,259	-10,259
	KR4301M42: 2017-04 풋270						824
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-824	-824	-824	-824	-824	-824	-824
-5.33%	-457	-457	-457	-457	-457	-457	-458
-2.67%	-106	-110	-115	-119	-124	-129	-134
0%	3	2	1	0	-2	-4	-6
2.67%	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	4	4	4	4	4	4	4
	KR4301M42: 2017-04 풋272.5						2,805
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,805	-2,805	-2,805	-2,805	-2,805	-2,805	-2,805
-5.33%	-1,704	-1,704	-1,704	-1,704	-1,704	-1,704	-1,704
-2.67%	-608	-612	-617	-624	-632	-640	-649
0%	30	21	11	0	-12	-24	-37
2.67%	52	52	52	52	52	51	51
5.33%	52	52	52	52	52	52	52
8.00%	52	52	52	52	52	52	52

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

24,548

공시일	2017-04-12
기준일	2017-04-11

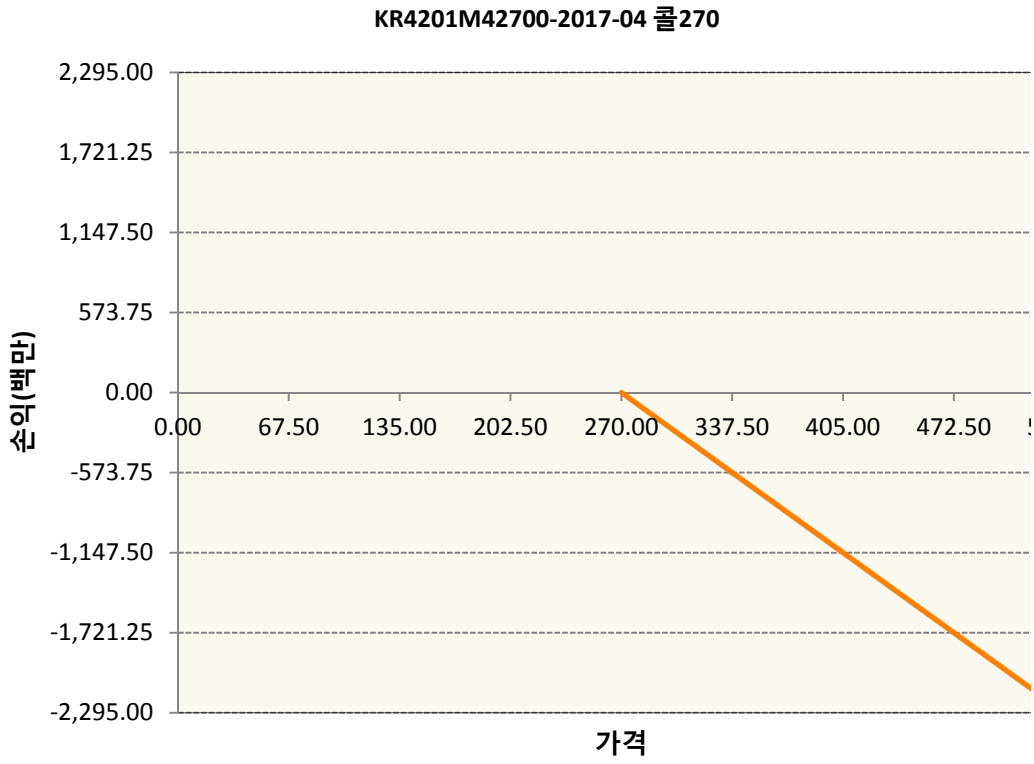
커버드콜목표전환형증권투자신탁

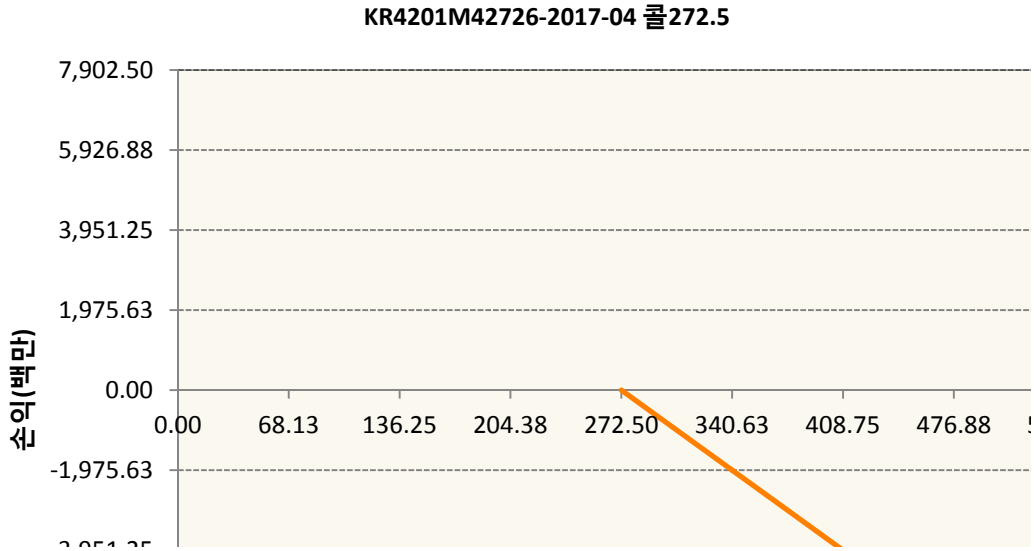
1. 계약금액

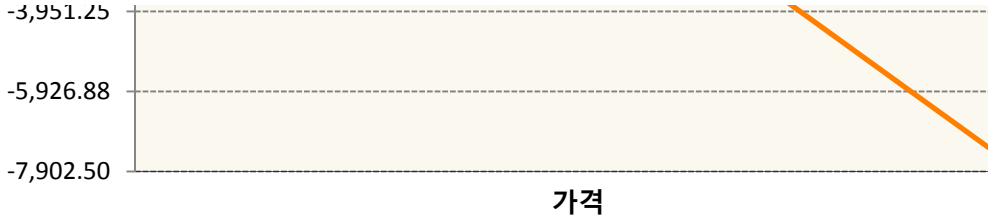
(단위:백만원)

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							187
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	47	47	47	47	47	47	47
-5.33%	47	47	47	47	47	47	47
-2.67%	44	44	43	42	41	41	40
0%	1	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
5.33%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124
8.00%	-187	-187	-187	-187	-187	-187	-187

KR4201M42 : 2017-04 콜272.5							629
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	97	97	97	97	97	97	97
-5.33%	97	97	97	97	97	97	97
-2.67%	96	95	94	92	91	89	88
0%	6	4	2	0	-2	-5	-7
2.67%	-203	-203	-203	-203	-203	-203	-203
5.33%	-416	-416	-416	-416	-416	-416	-416
8.00%	-629	-629	-629	-629	-629	-629	-629

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

(단위:백만원)

1,155

공시일	2017-04-12
기준일	2017-04-11

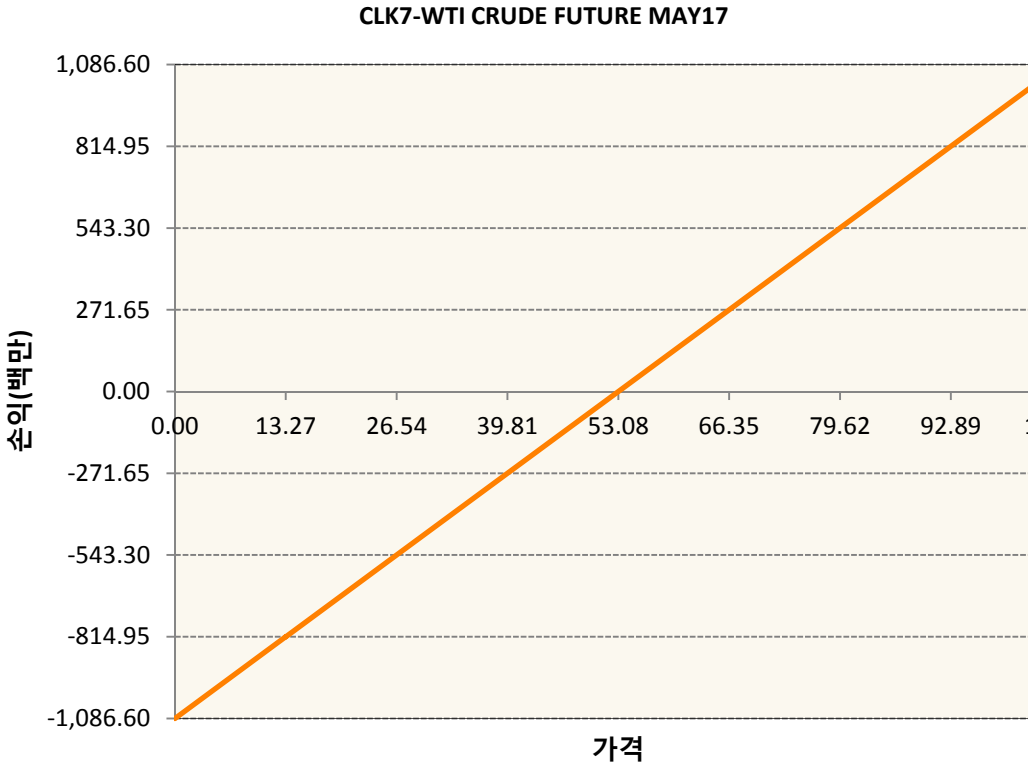
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

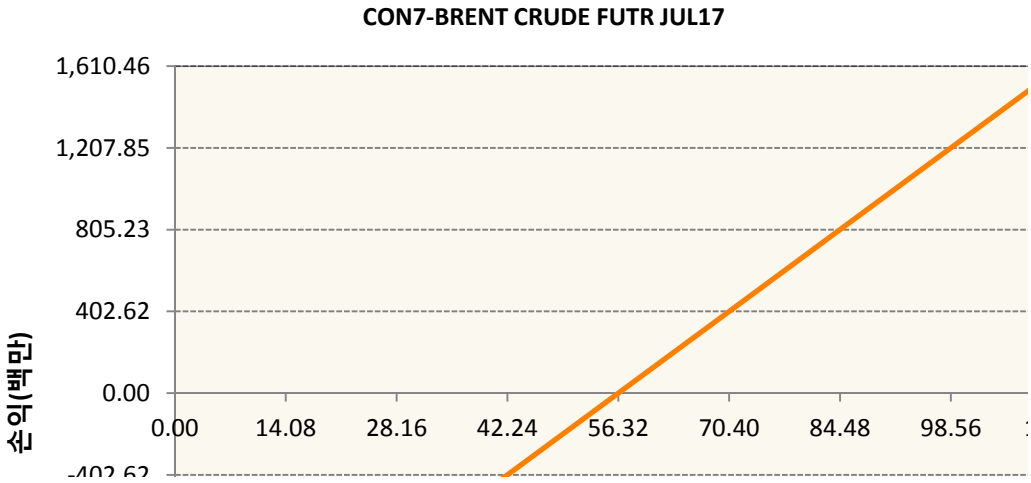
1. 계약금액

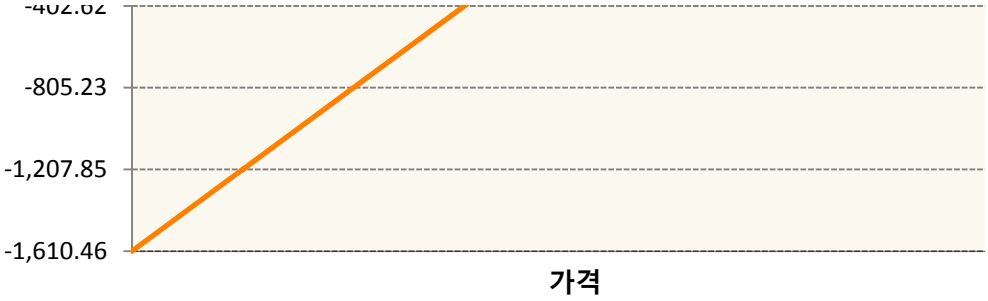
(단위:백만원)

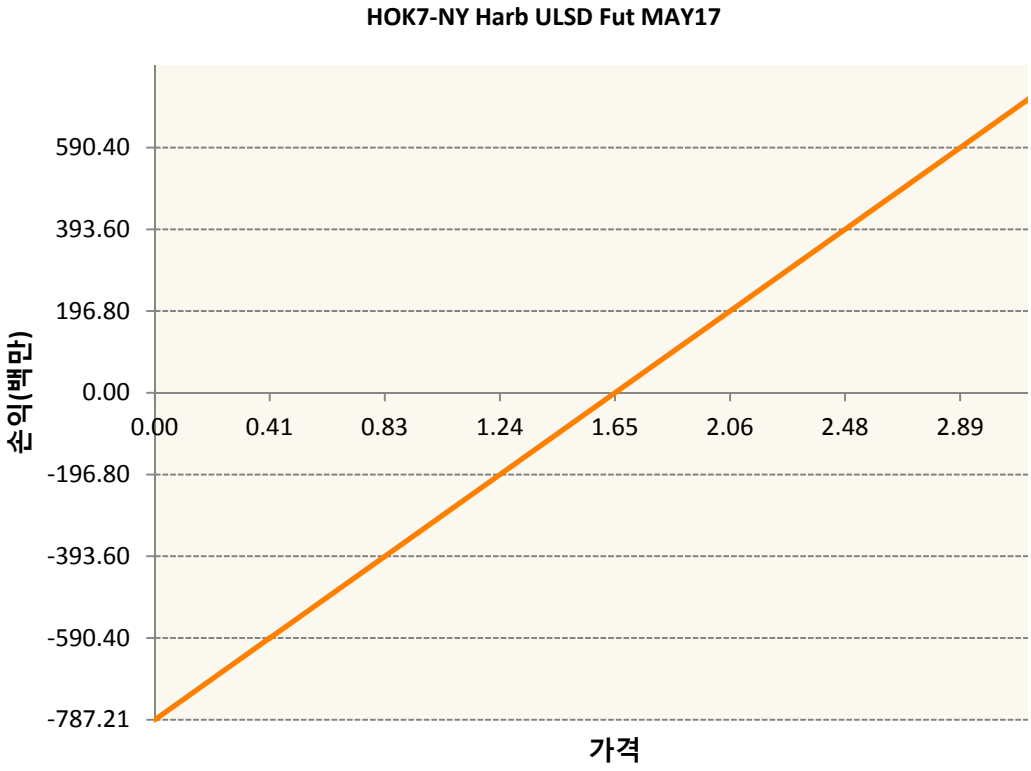
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,087	0	1,087	
누계	유가증권	선물	4,904	413	4,491	

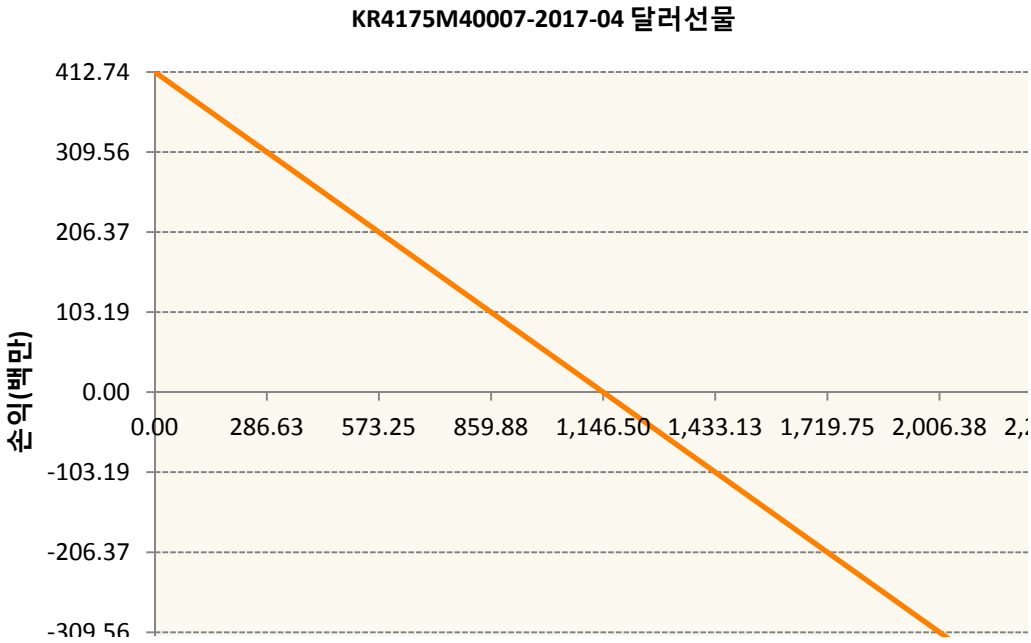
2. 만기시점의 손익구조

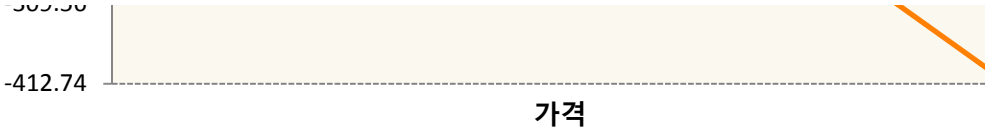


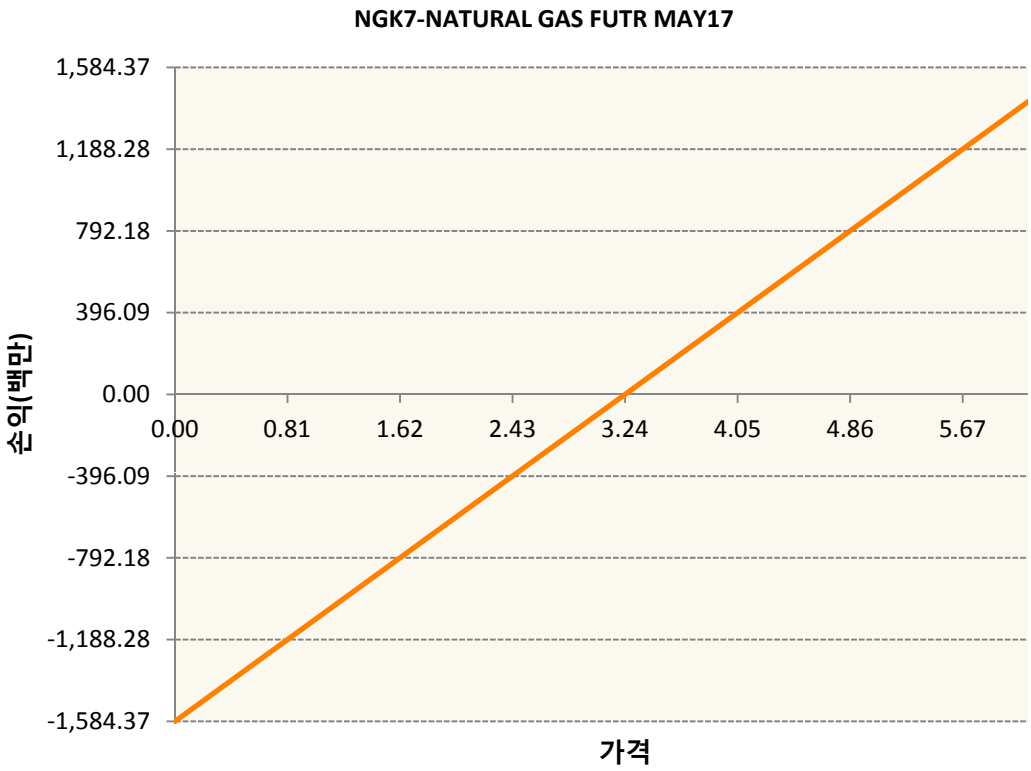


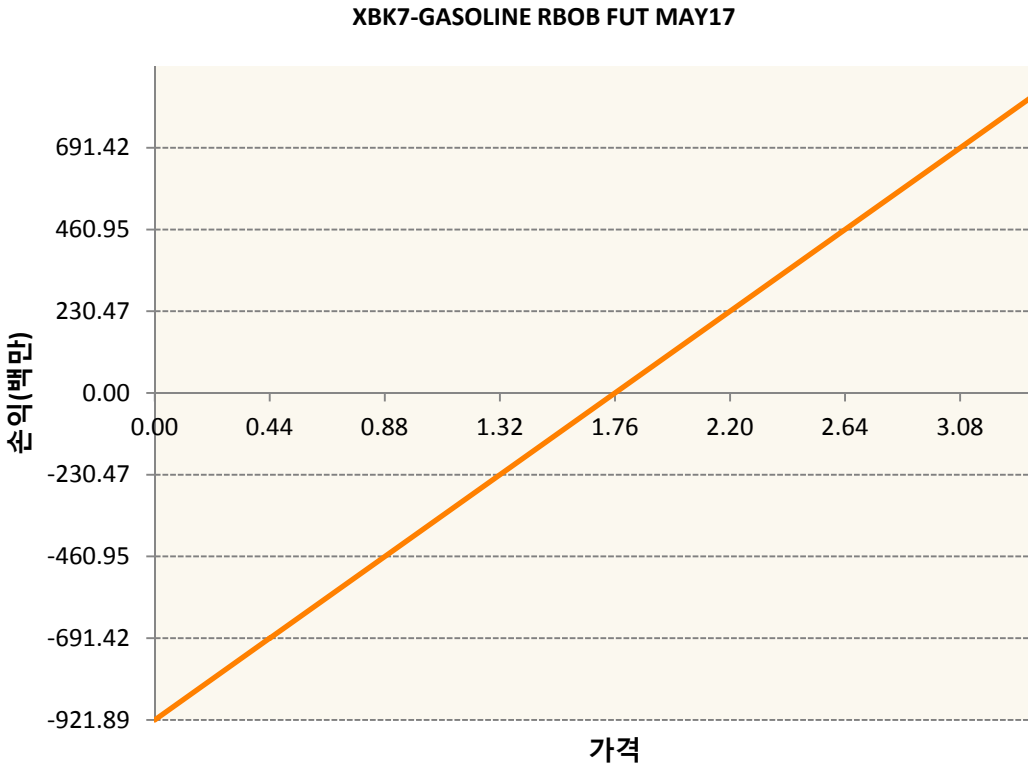

-805.23
-1,207.85
-1,610.46
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
590.40
393.60
196.80
0.00
-196.80
-393.60
-590.40
-787.21
0.00
0.41
0.83
1.24
1.65
2.06
2.48
2.89
순익(백만)
가격


KR4175M40007-2017-04 달러선물
412.74
309.56
206.37
103.19
0.00
-103.19
-206.37
-309.56
0.00
286.63
573.25
859.88
1,146.50
1,433.13
1,719.75
2,006.38
순익(백만)


-412.74
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,584.37
1,188.28
792.18
396.09
0.00
-396.09
-792.18
-1,188.28
-1,584.37
0.00
0.81
1.62
2.43
3.24
4.05
4.86
5.67
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
691.42
460.95
230.47
0.00
-230.47
-460.95
-691.42
-921.89
0.00
0.44
0.88
1.32
1.76
2.20
2.64
3.08
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK7	WTI CRUDE FUTURE MAY17	87
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	129
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	63
KR4175M40(	2017-04 달러선물	33
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	127
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	74

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

1,042

공시일	2017-04-12
기준일	2017-04-11

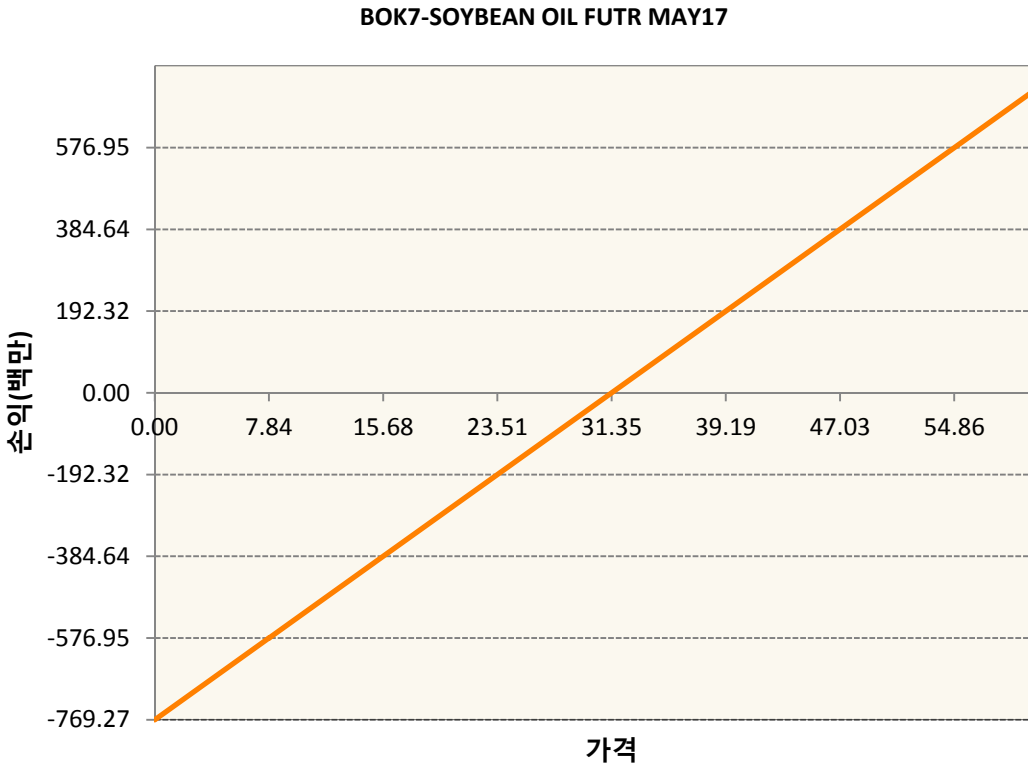
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

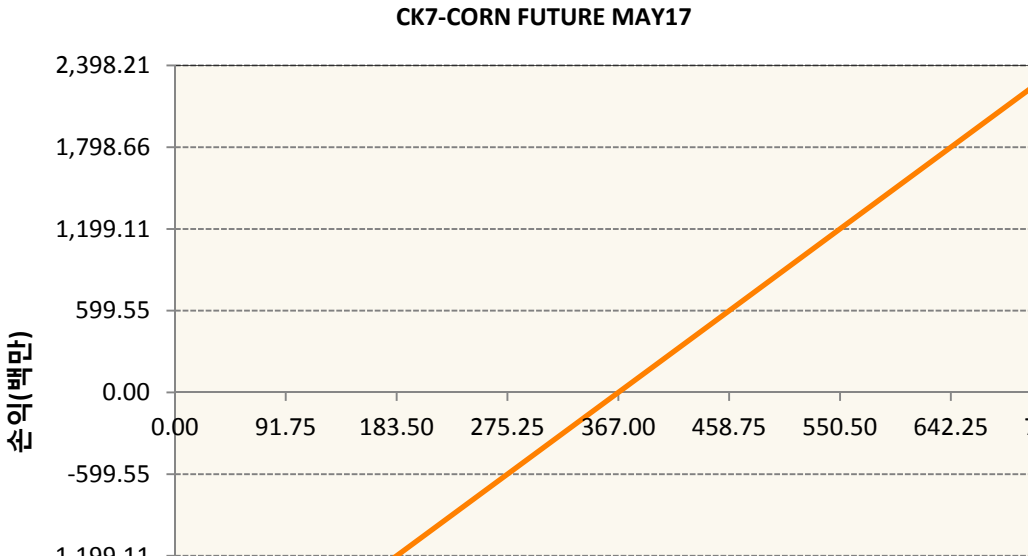
1. 계약금액

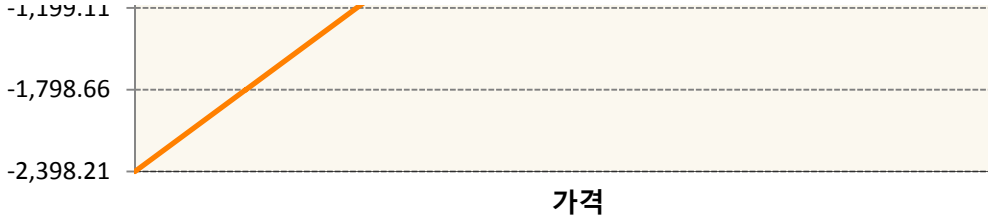
(단위:백만원)

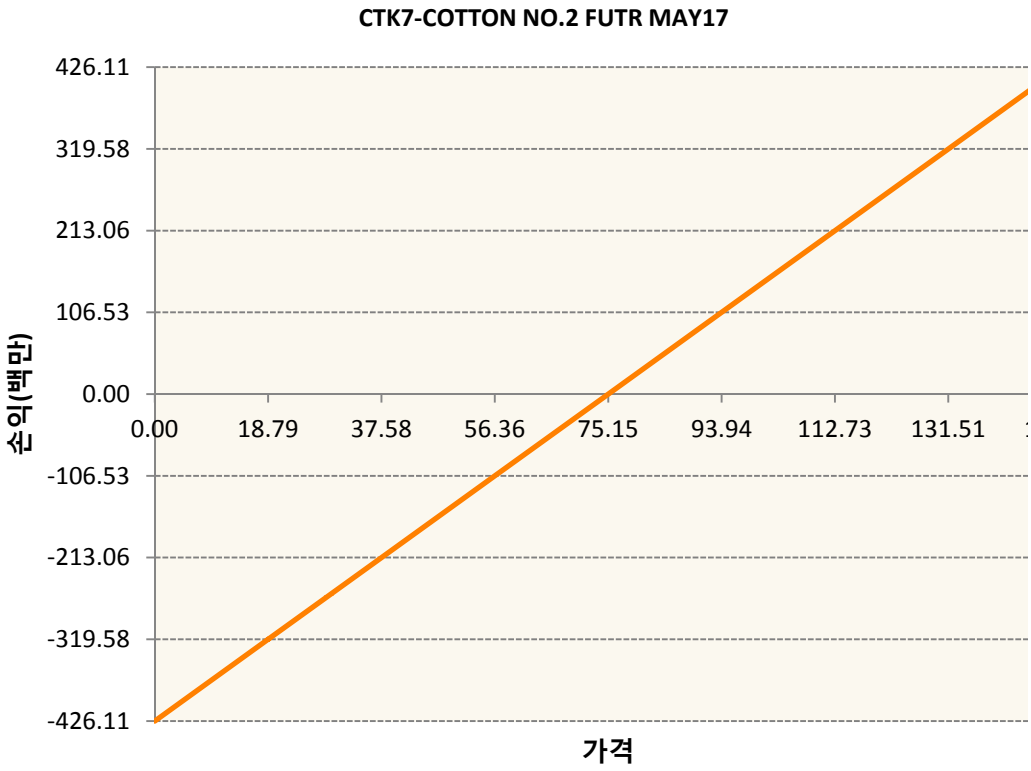
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,044	401	8,643	

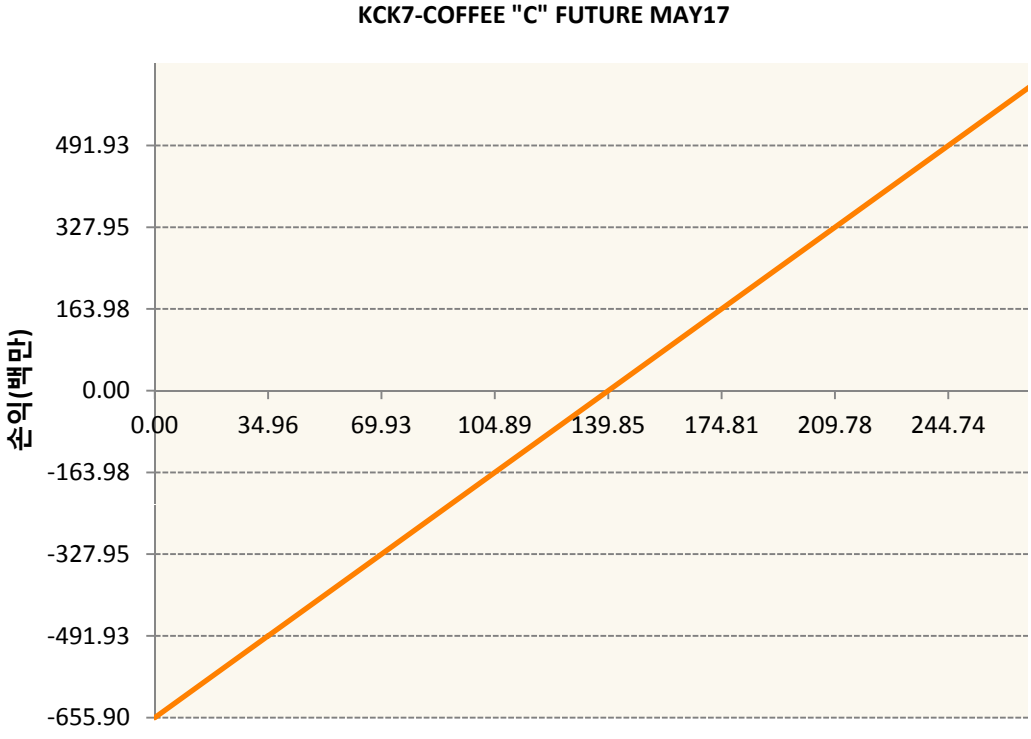
2. 만기시점의 손익구조



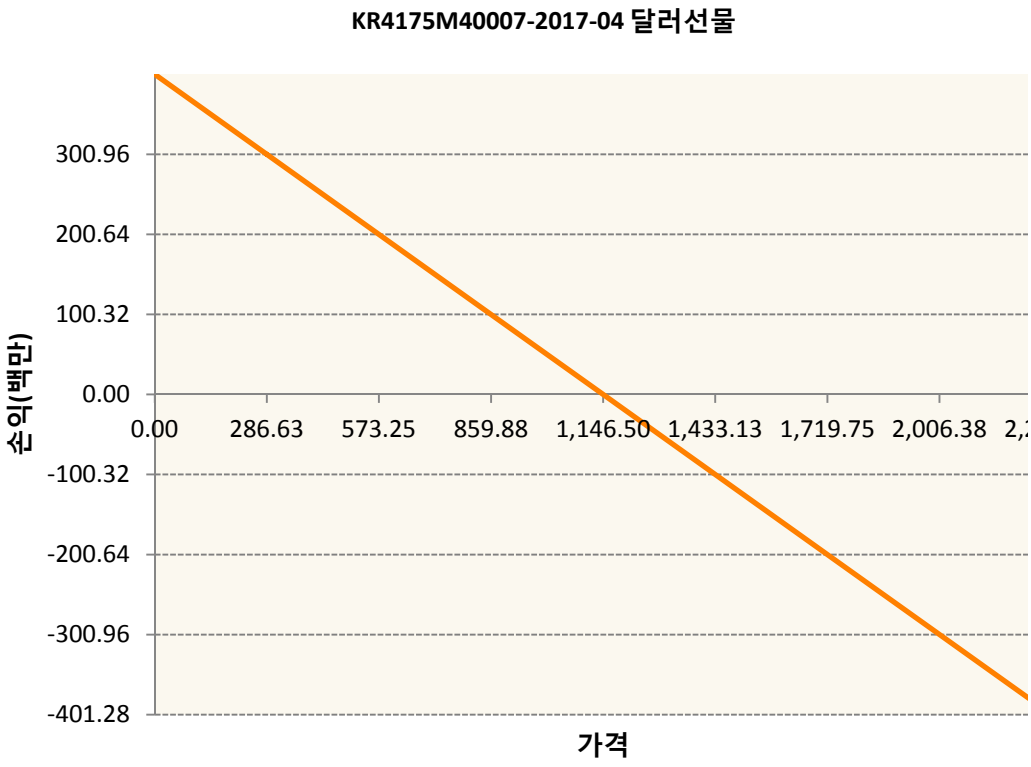


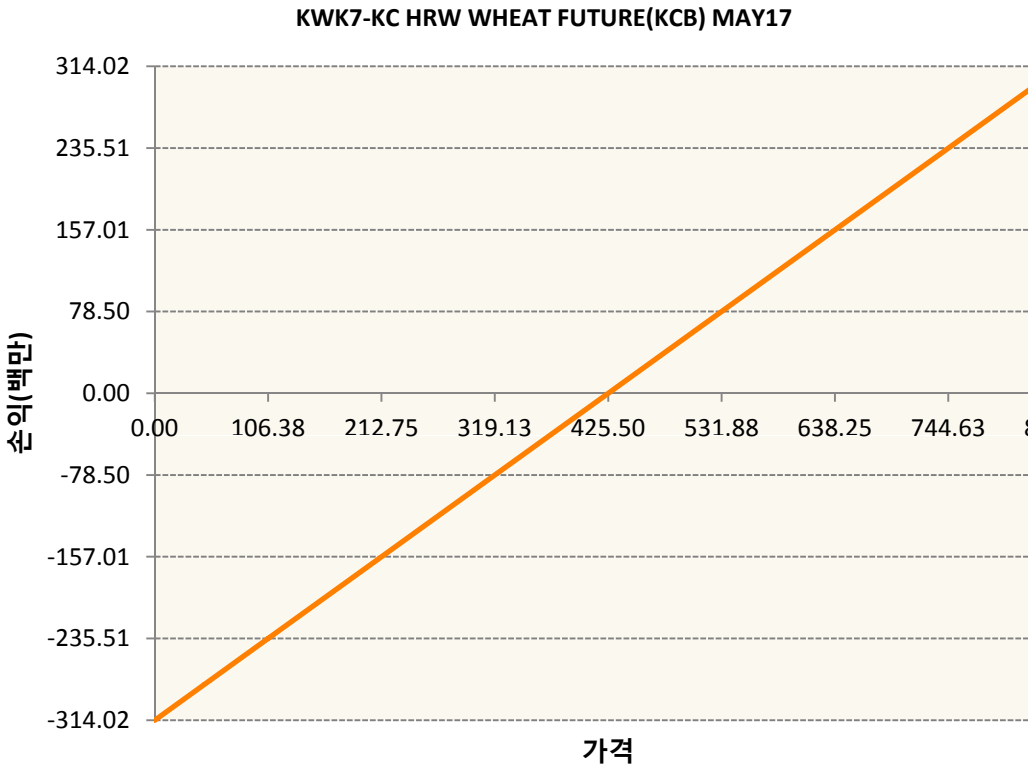

-1,199.11
-1,798.66
-2,398.21
가격


CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
426.11
319.58
213.06
106.53
0.00
-106.53
-213.06
-319.58
-426.11
0.00
18.79
37.58
56.36
75.15
93.94
112.73
131.51
순익(백만)
가격

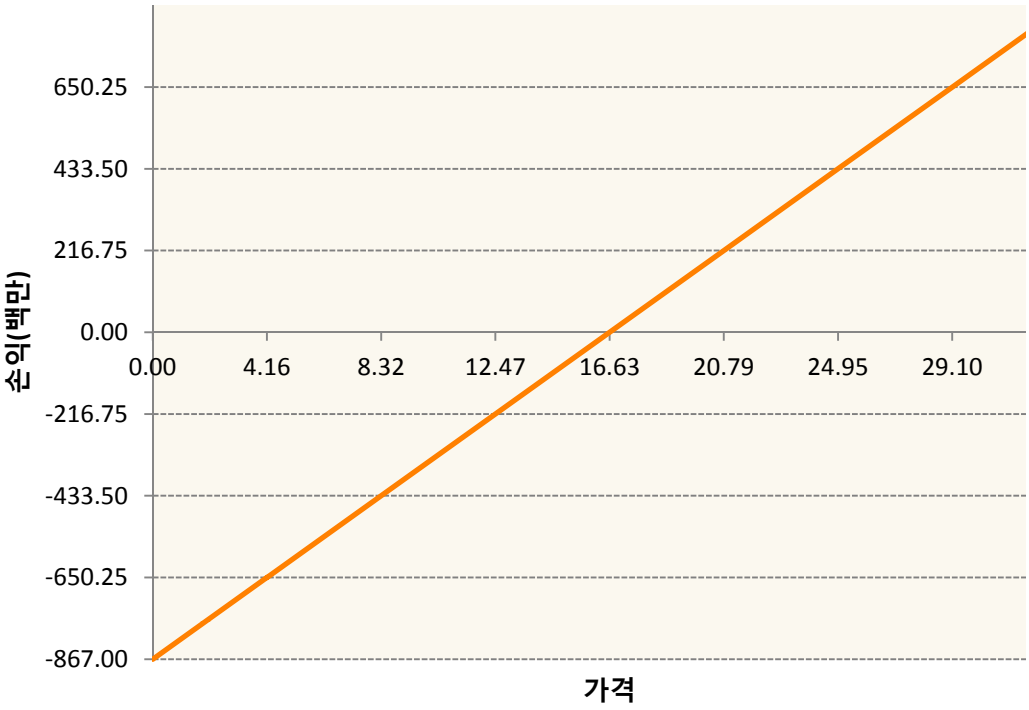

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
491.93
327.95
163.98
0.00
-163.98
-327.95
-491.93
-655.90
0.00
34.96
69.93
104.89
139.85
174.81
209.78
244.74
순익(백만)

가격

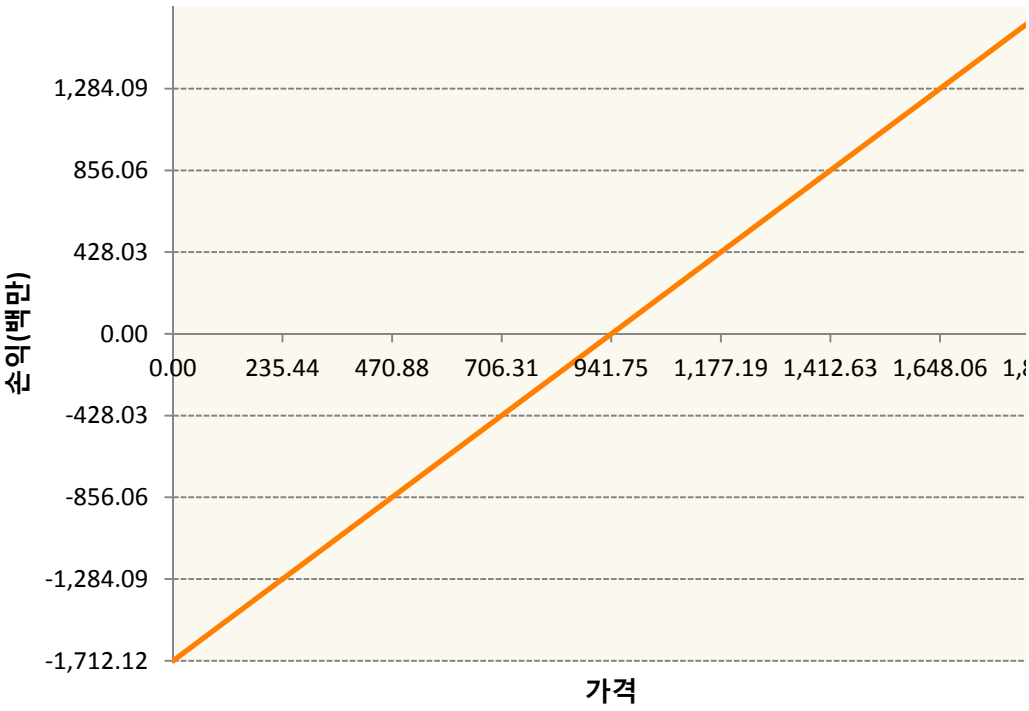

KR4175M40007-2017-04 달러선물
300.96
200.64
100.32
0.00
-100.32
-200.64
-300.96
-401.28
0.00
286.63
573.25
859.88
1,146.50
1,433.13
1,719.75
2,006.38
손익(백만)
가격


KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
314.02
235.51
157.01
78.50
0.00
-78.50
-157.01
-235.51
-314.02
0.00
106.38
212.75
319.13
425.50
531.88
638.25
744.63
손익(백만)
가격

SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17

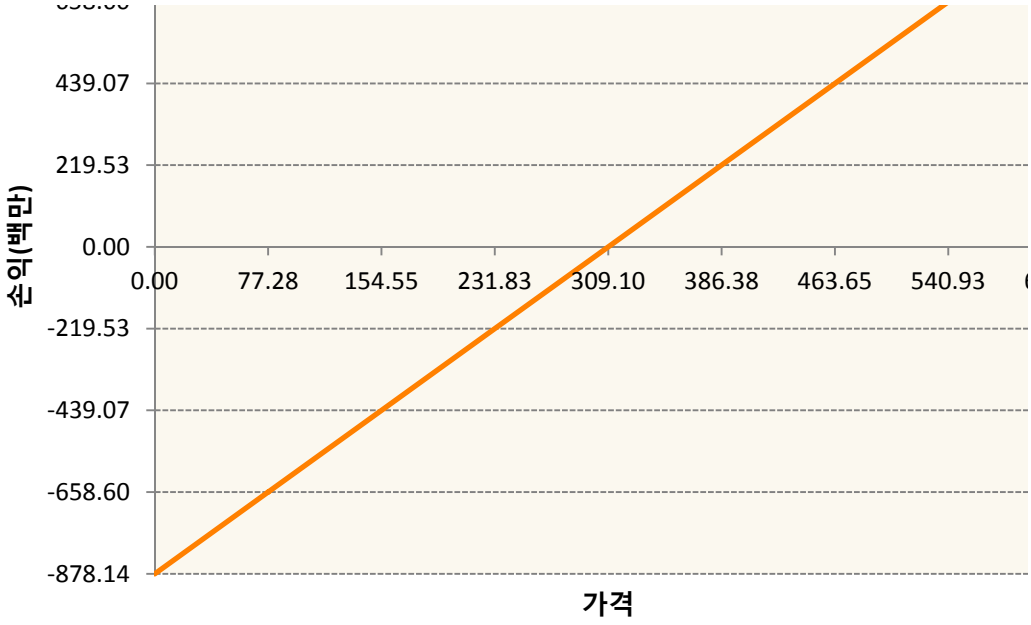


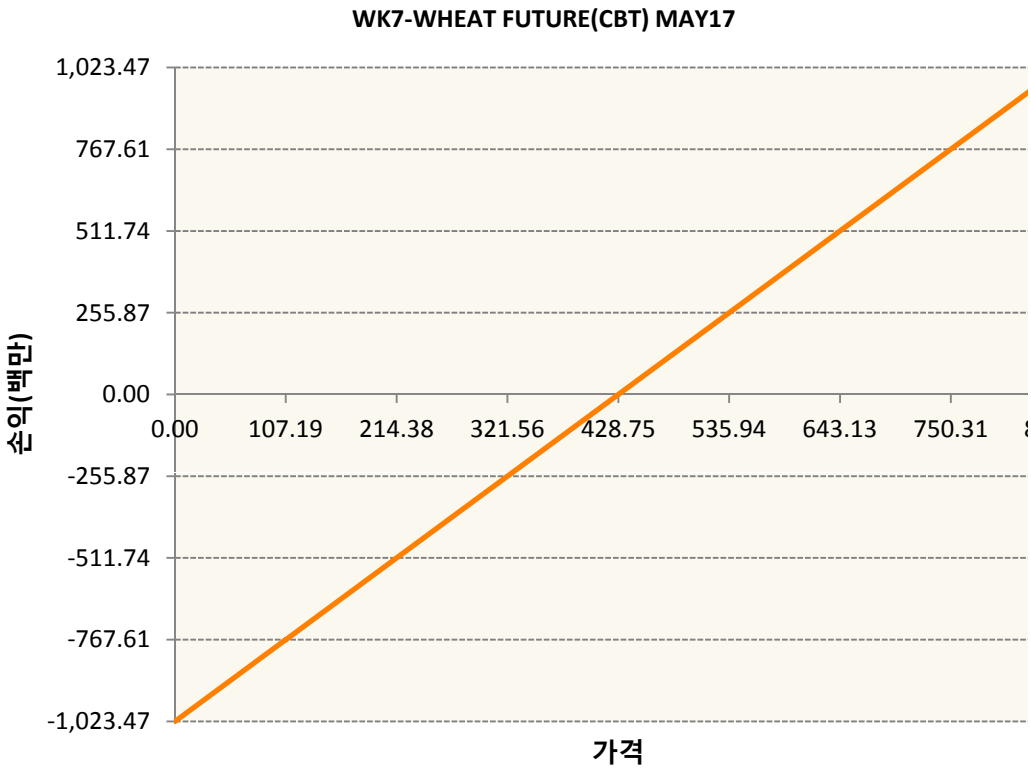
SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17



SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17







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	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	82

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

825