공시일	2017-04-13
기준일	2017-04-12

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	2017-04-13
기준일	2017-04-12

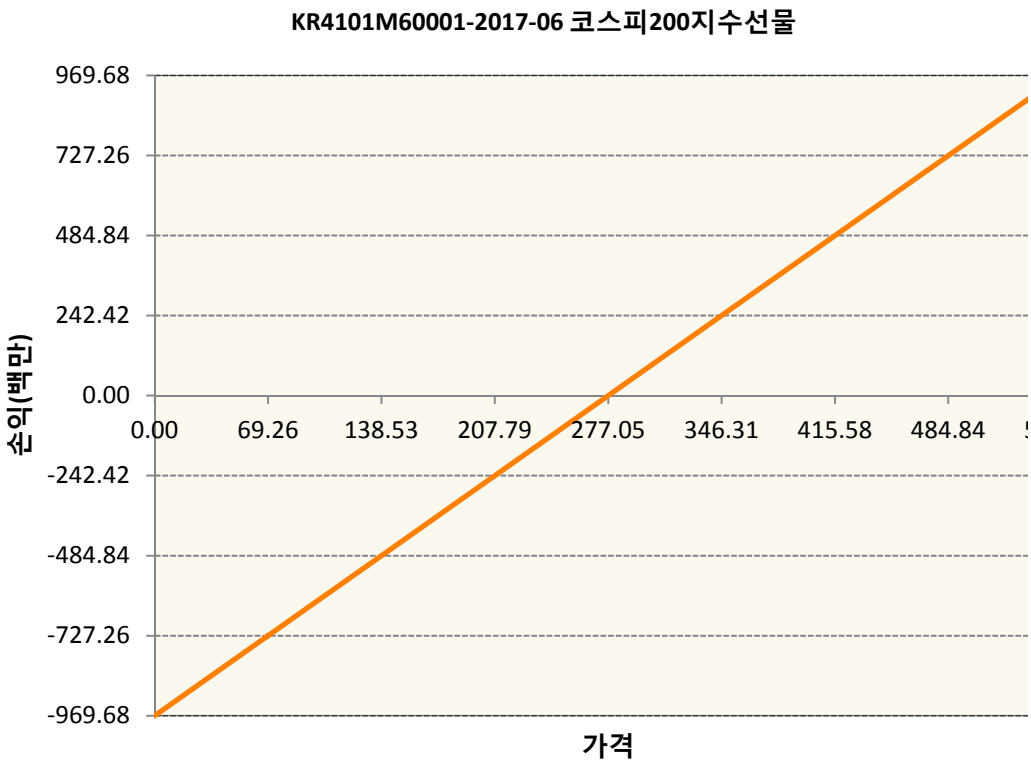
스마트인덱스모

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	970	0	970	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%	-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%	77	77	77	77	77	77	77

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

50

공시일	2017-04-13
기준일	2017-04-12

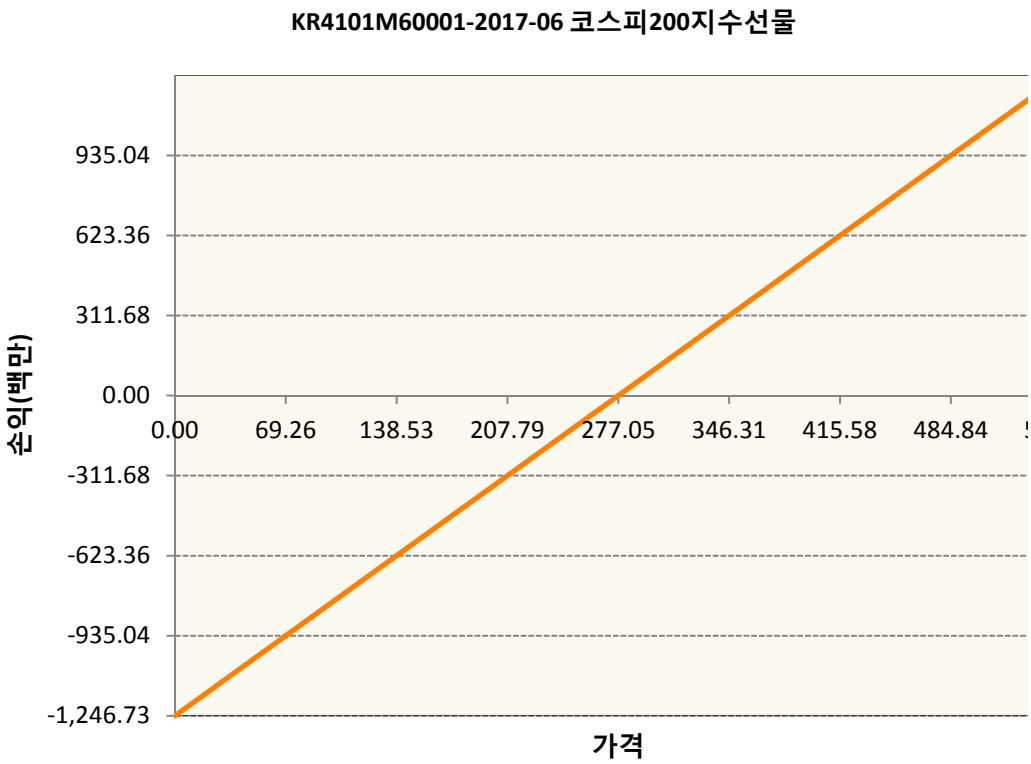
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,247	0	1,247	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	2017-04-13
기준일	2017-04-12

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)

550

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-04-13
기준일	2017-04-12

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)

418

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-04-13
기준일	2017-04-12

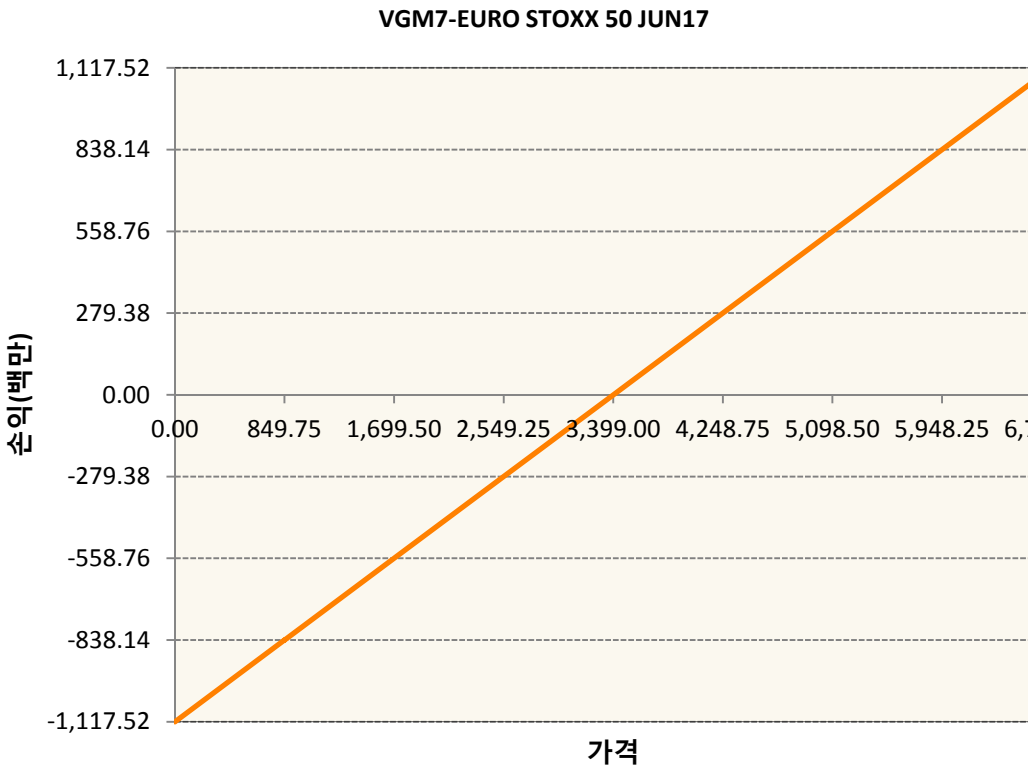
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,118	0	1,118	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM7	EURO STOXX 50 JUN17	89

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

(단위:백만원)

90

공시일	2017-04-13
기준일	2017-04-12

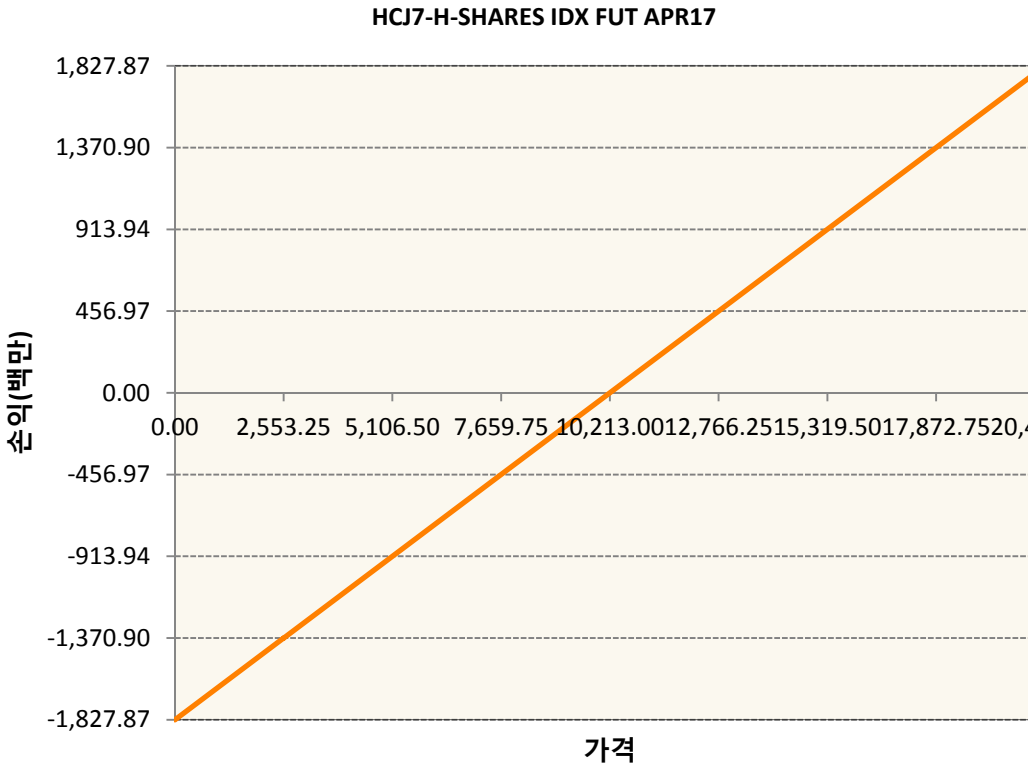
차이나인덱스모(주식-파생형)

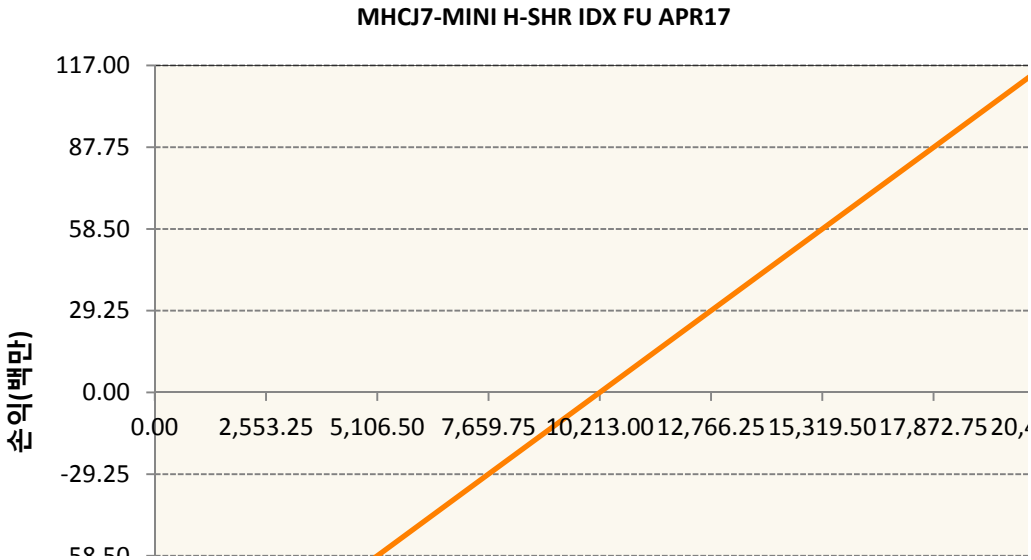
1. 계약금액

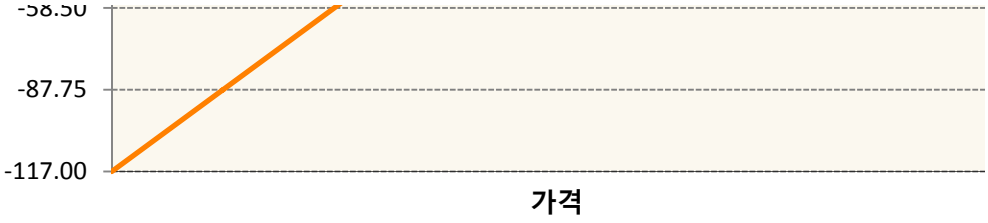
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,945	0	1,945	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCJ7	H-SHARES IDX FUT APR17	146
MHCJ7	MINI H-SHR IDX FU APR17	9

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

166

공시일	2017-04-13
기준일	2017-04-12

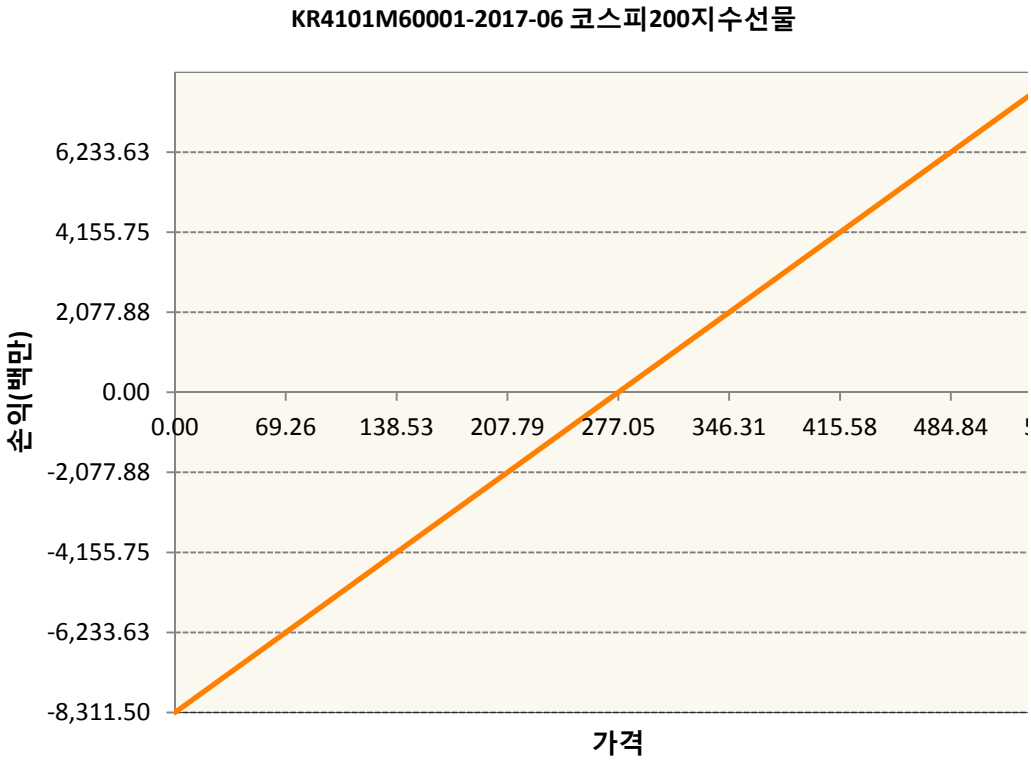
커버드콜모(주식혼합-파생형)

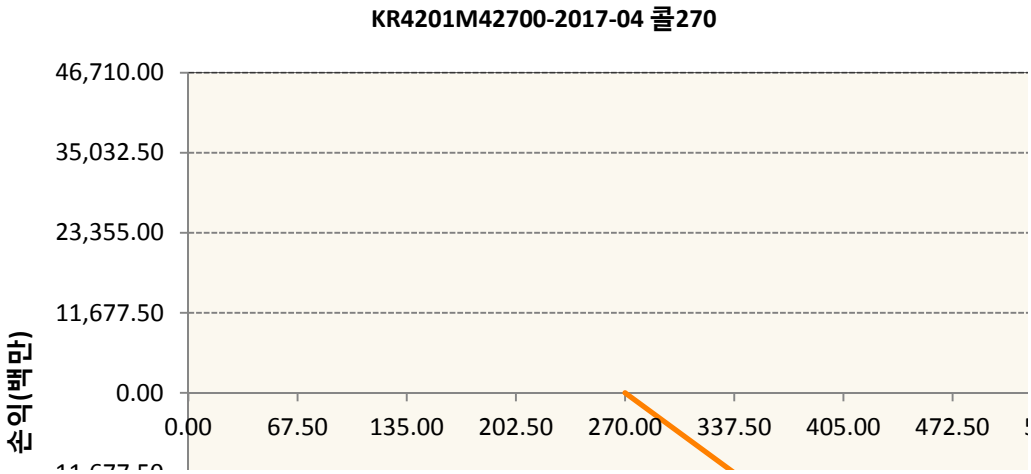
1. 계약금액

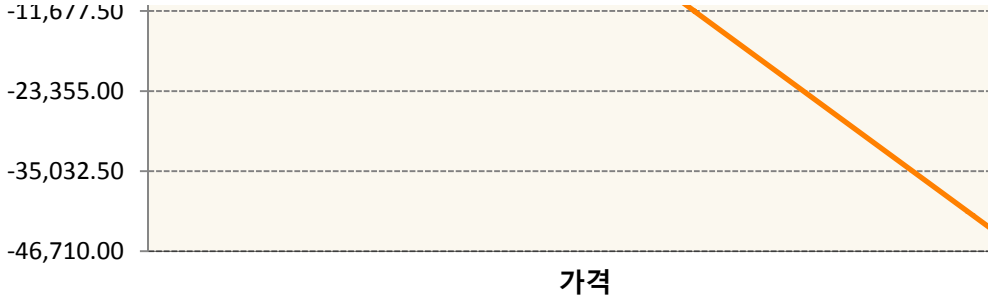
(단위:백만원)

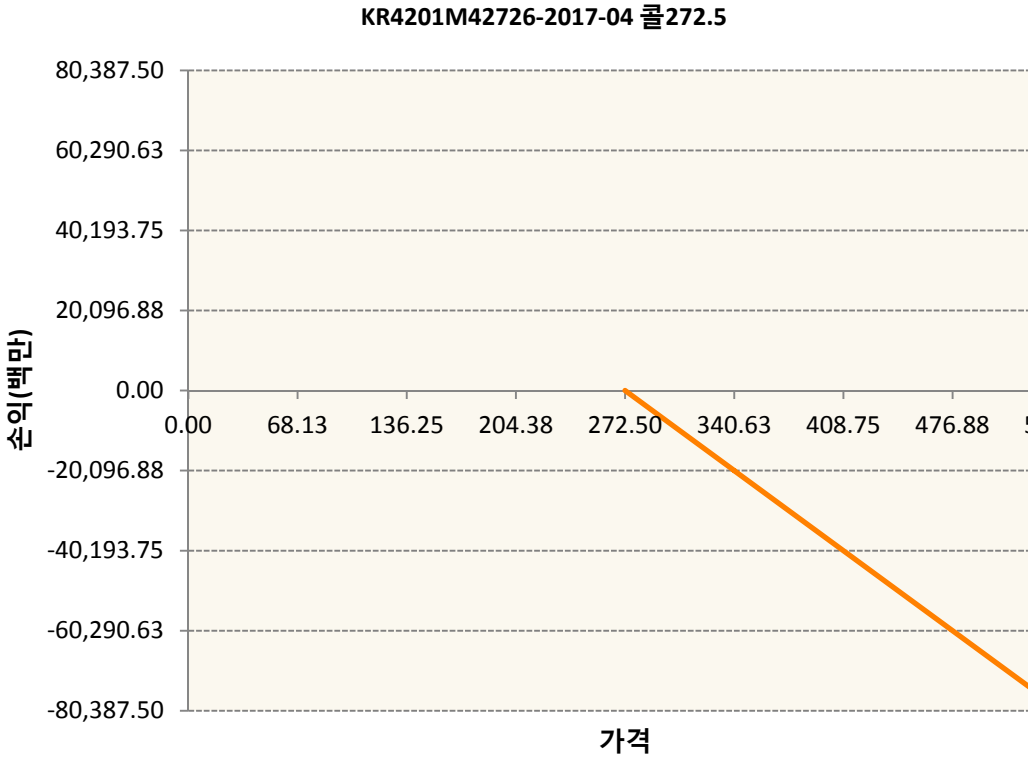
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	54,634	56,765	-2,131	장내
누계	유가증권	선물	8,312	0	8,312	장내
누계	유가증권	옵션	3,438	233,860	-230,423	장내

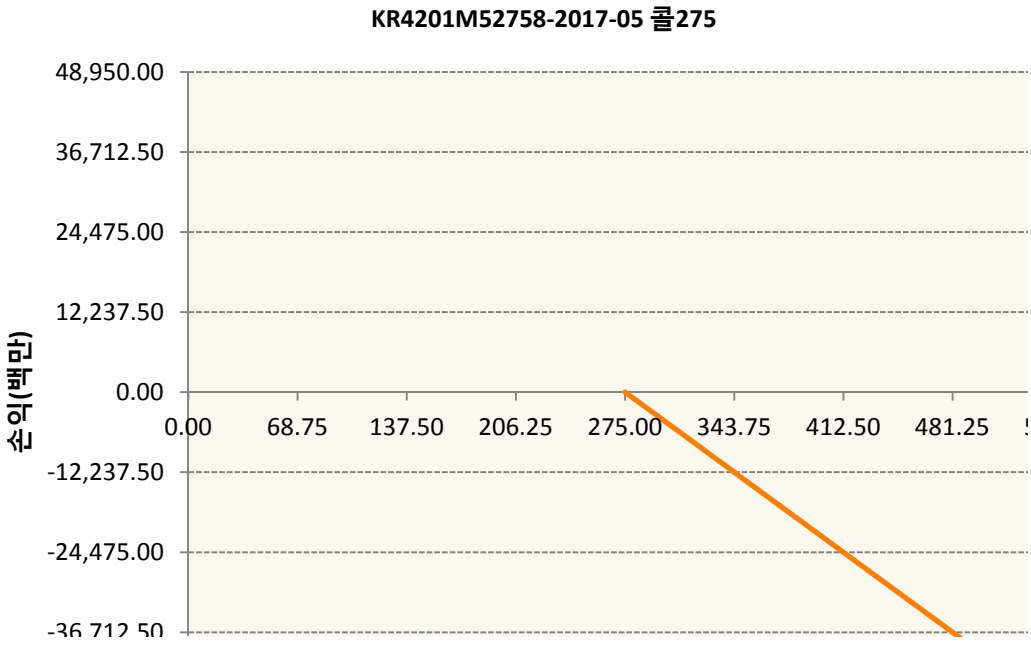
2. 만기시점의 손익구조

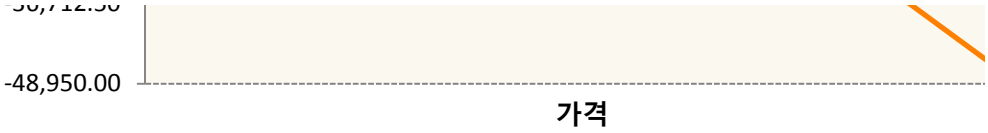


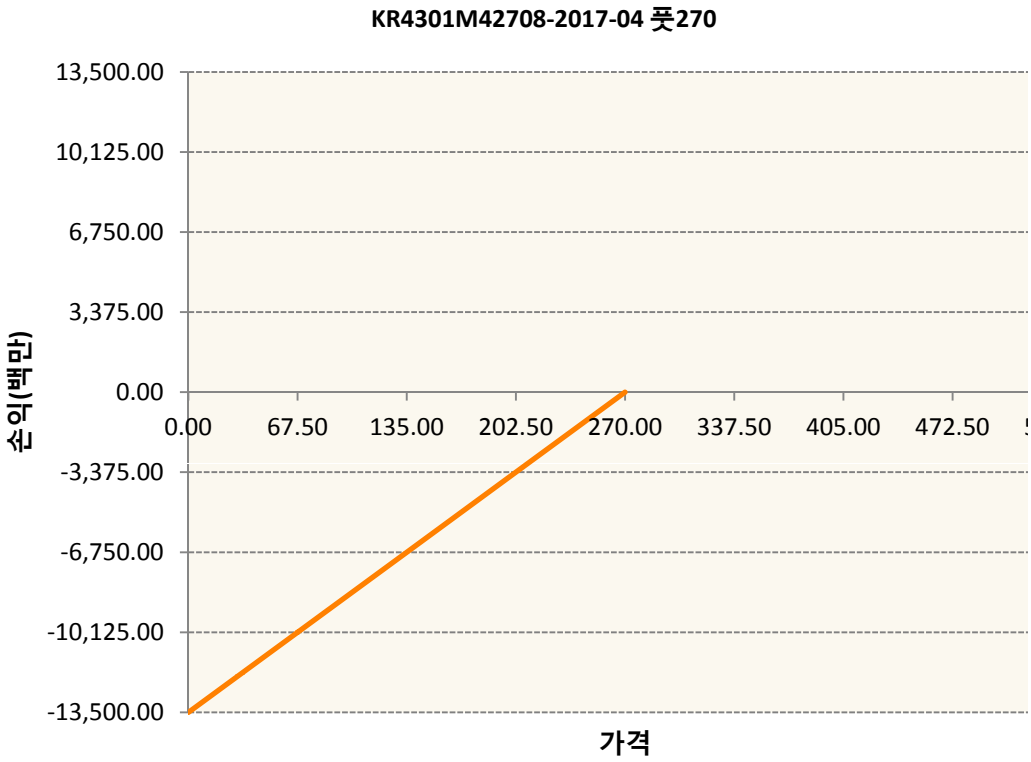


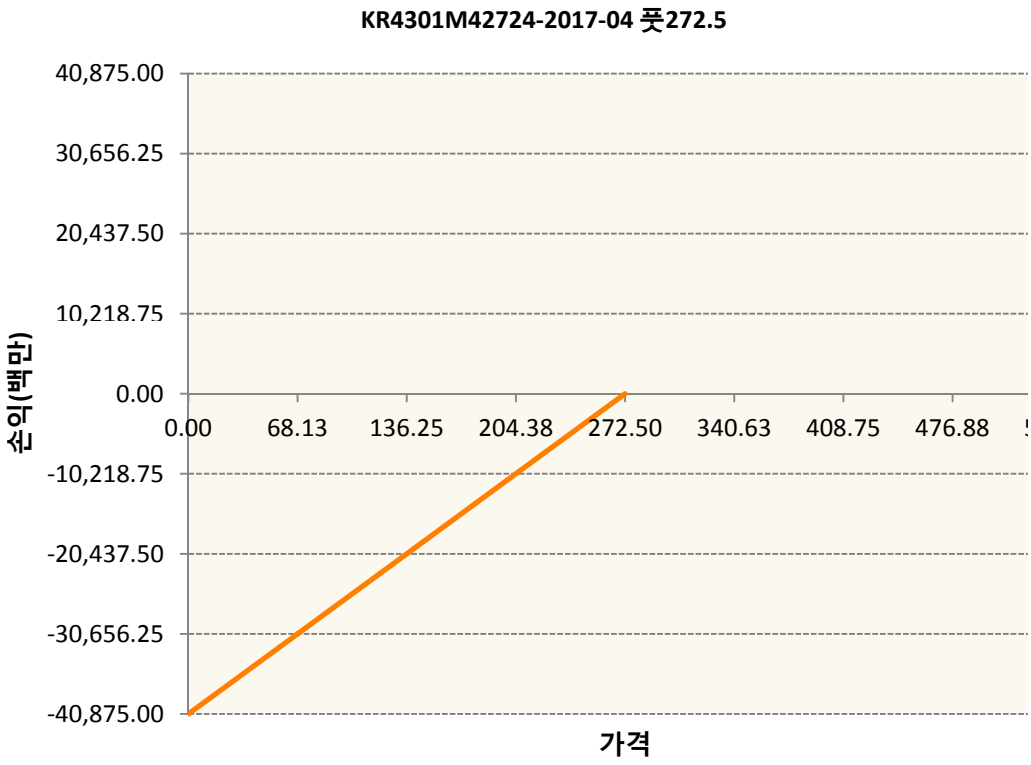

-11,677.50
-23,355.00
-35,032.50
-46,710.00
가격


KR4201M42726-2017-04 콜272.5
80,387.50
60,290.63
40,193.75
20,096.88
0.00
-20,096.88
-40,193.75
-60,290.63
-80,387.50
0.00
68.13
136.25
204.38
272.50
340.63
408.75
476.88
순익(백만)
가격


KR4201M52758-2017-05 콜275
48,950.00
36,712.50
24,475.00
12,237.50
0.00
-12,237.50
-24,475.00
-36,712.50
0.00
68.75
137.50
206.25
275.00
343.75
412.50
481.25
순익(백만)


-48,950.00
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
-13,500.00
0.00
67.50
135.00
202.50
270.00
337.50
405.00
472.50
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
-40,875.00
0.00
68.13
136.25
204.38
272.50
340.63
408.75
476.88
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							663
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-663	-663	-663	-663	-663	-663	-663
-5.33%	-442	-442	-442	-442	-442	-442	-442
-2.67%	-221	-221	-221	-221	-221	-221	-221
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	221	221	221	221	221	221	221
5.33%	442	442	442	442	442	442	442
8.00%	663	663	663	663	663	663	663

KR4201M42 2017-04 콜270							3,822
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,074	1,074	1,074	1,074	1,074	1,074	1,074
-5.33%	1,074	1,074	1,074	1,074	1,074	1,074	1,074
-2.67%	1,029	1,018	1,006	995	983	971	958
0%	1	0	0	0	-1	-1	-3
2.67%	-1,274	-1,274	-1,274	-1,274	-1,274	-1,274	-1,274
5.33%	-2,548	-2,548	-2,548	-2,548	-2,548	-2,548	-2,548
8.00%	-3,822	-3,822	-3,822	-3,822	-3,822	-3,822	-3,822

KR4201M42 2017-04 콜272.5							6,501
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,111	1,111	1,111	1,111	1,111	1,111	1,111
-5.33%	1,111	1,111	1,111	1,111	1,111	1,111	1,111
-2.67%	1,108	1,105	1,100	1,094	1,087	1,078	1,068
0%	14	11	6	0	-7	-16	-26
2.67%	-2,155	-2,155	-2,155	-2,155	-2,155	-2,155	-2,155
5.33%	-4,328	-4,328	-4,328	-4,328	-4,328	-4,328	-4,328
8.00%	-6,501	-6,501	-6,501	-6,501	-6,501	-6,501	-6,501

KR4201M52 2017-05 콜275							3,228
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,007	1,000	989	974	955	932	906
-5.33%	960	931	897	859	816	770	721
-2.67%	755	693	630	564	497	430	361
0%	226	151	75	0	-75	-151	-226
2.67%	-682	-736	-794	-854	-917	-982	-1,048
5.33%	-1,849	-1,873	-1,903	-1,938	-1,978	-2,021	-2,068
8.00%	-3,125	-3,132	-3,142	-3,157	-3,176	-3,200	-3,228

KR4301M42: 2017-04 풋270							794
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-794	-794	-794	-794	-794	-794	-794
-5.33%	-426	-426	-426	-426	-426	-426	-426
-2.67%	-71	-74	-77	-81	-84	-88	-91
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0
KR4301M42: 2017-04 풋272.5							2,749
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,749	-2,749	-2,749	-2,749	-2,749	-2,749	-2,749
-5.33%	-1,644	-1,644	-1,644	-1,644	-1,644	-1,644	-1,645
-2.67%	-541	-543	-545	-549	-552	-557	-562
0%	7	5	3	0	-4	-8	-13
2.67%	9	9	9	9	9	9	9
5.33%	9	9	9	9	9	9	9
8.00%	9	9	9	9	9	9	9

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

21,844

공시일	2017-04-13
기준일	2017-04-12

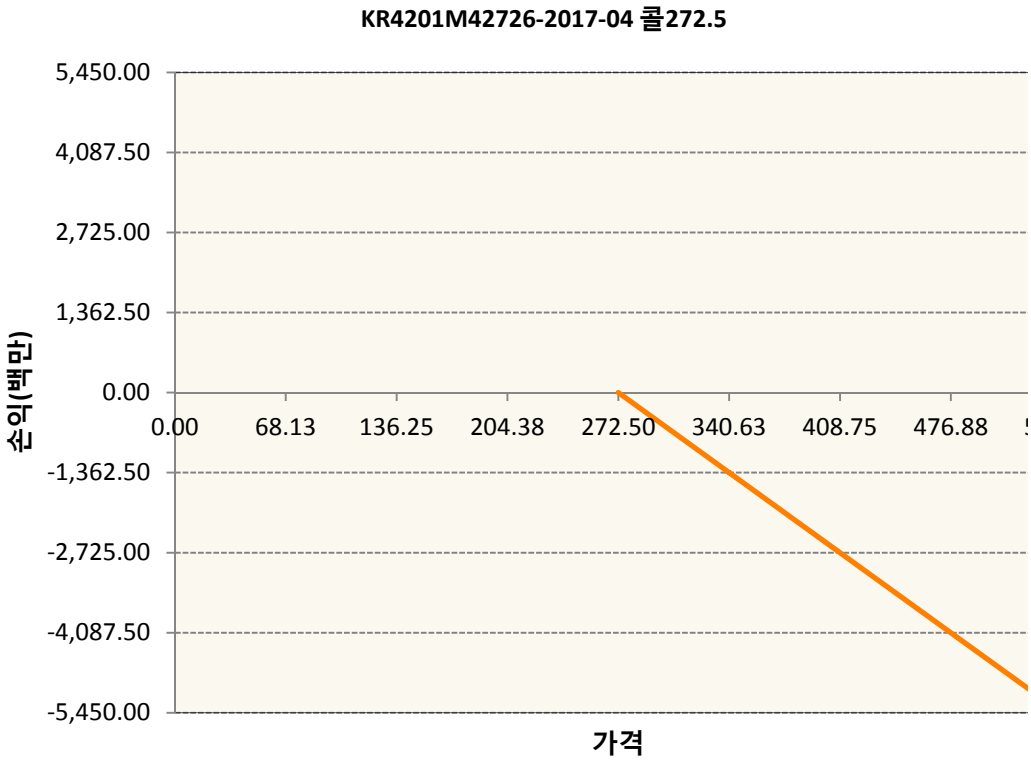
커버드콜목표전환형증권투자신탁

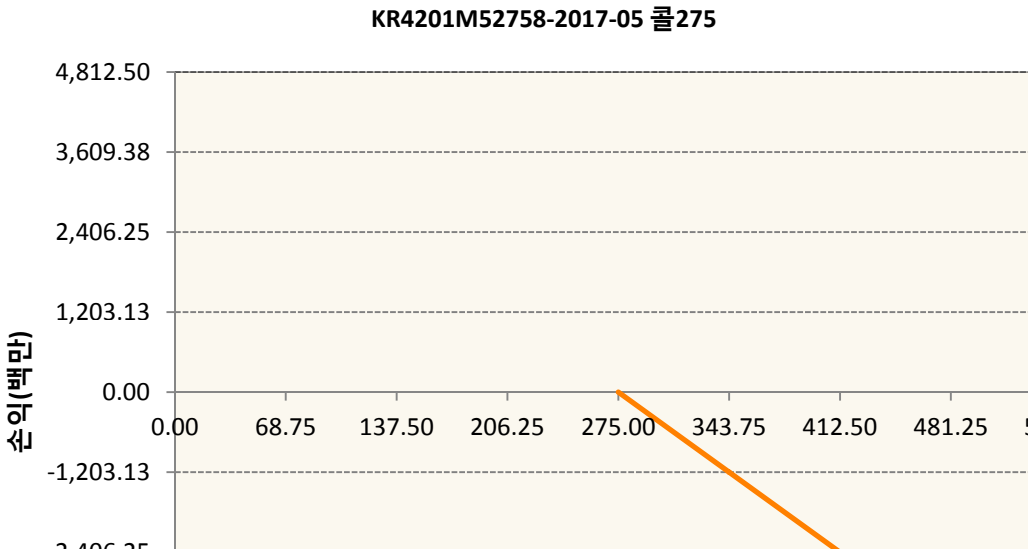
1. 계약금액

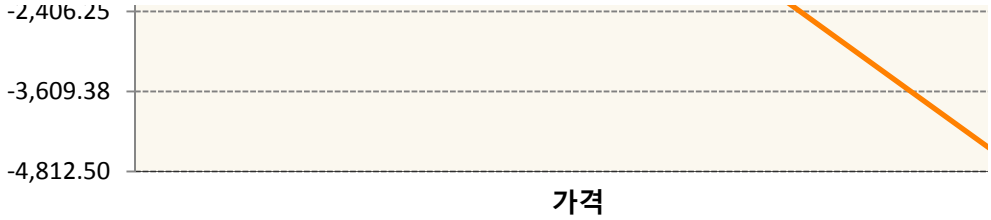
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	2,422	4,898	-2,476	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,263	-10,263	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M42 : 2017-04 콜272.5							441
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	75	75	75	75	75	75	75
-5.33%	75	75	75	75	75	75	75
-2.67%	75	75	75	74	74	73	72
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	-146	-146	-146	-146	-146	-146	-146
5.33%	-293	-293	-293	-293	-293	-293	-293
8.00%	-441	-441	-441	-441	-441	-441	-441

KR4201M52 : 2017-05 콜275							317
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	99	98	97	96	94	92	89
-5.33%	94	92	88	84	80	76	71
-2.67%	74	68	62	55	49	42	35
0%	22	15	7	0	-7	-15	-22
2.67%	-67	-72	-78	-84	-90	-97	-103
5.33%	-182	-184	-187	-191	-194	-199	-203
8.00%	-307	-308	-309	-310	-312	-315	-317

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

975

공시일	2017-04-13
기준일	2017-04-12

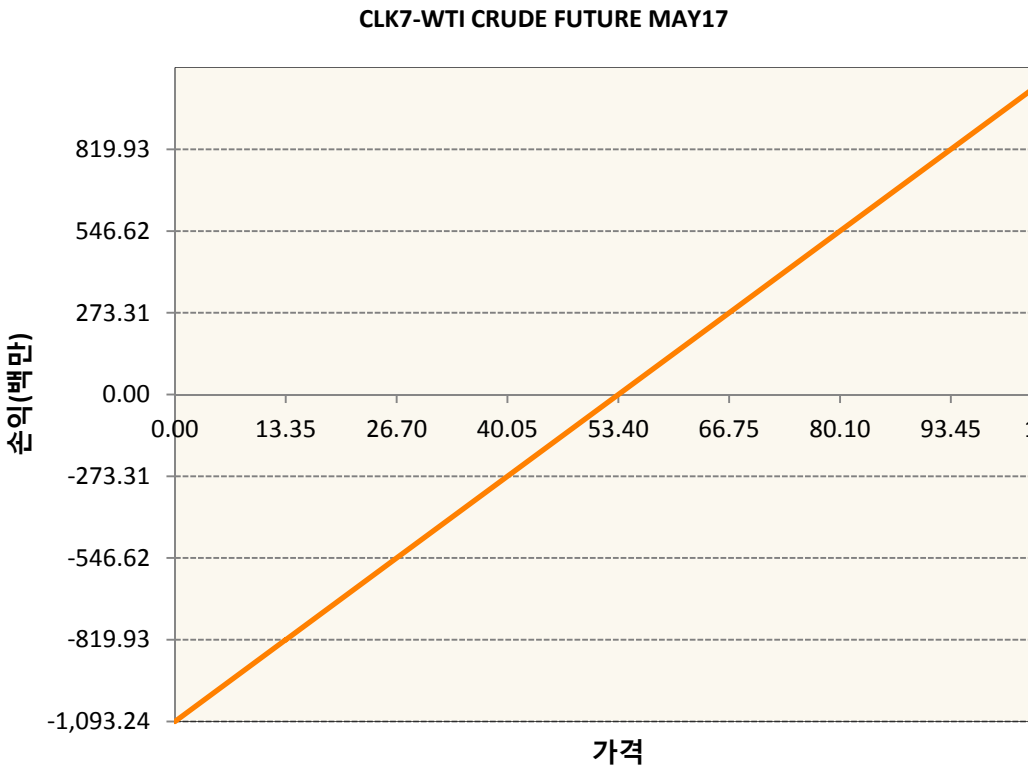
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

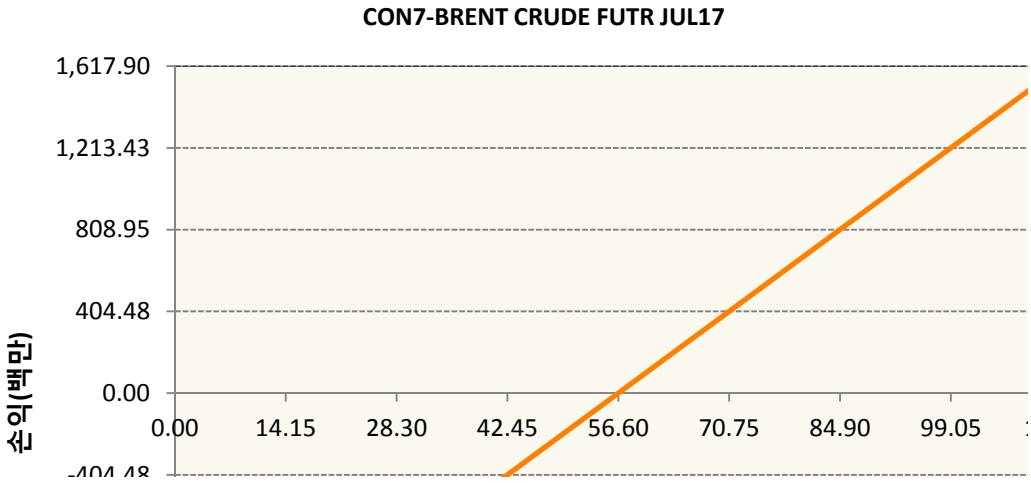
1. 계약금액

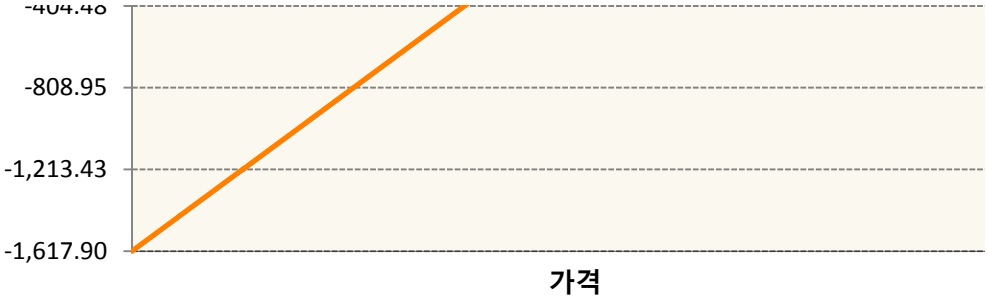
(단위:백만원)

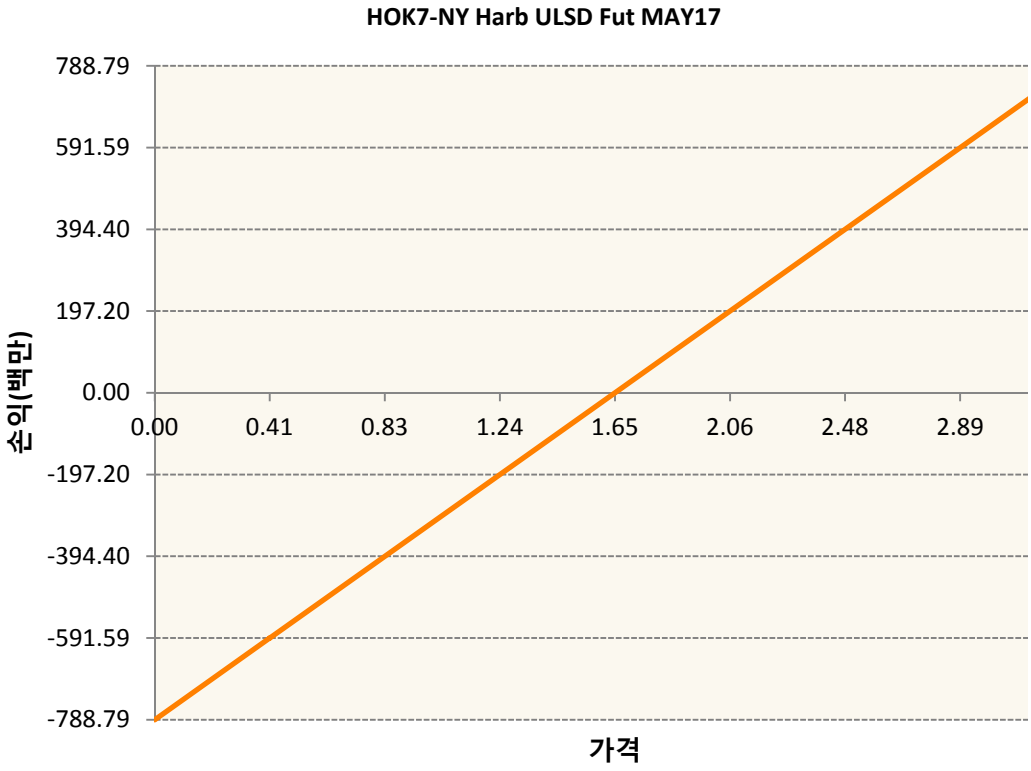
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,093	0	1,093	
누계	유가증권	선물	4,869	411	4,458	

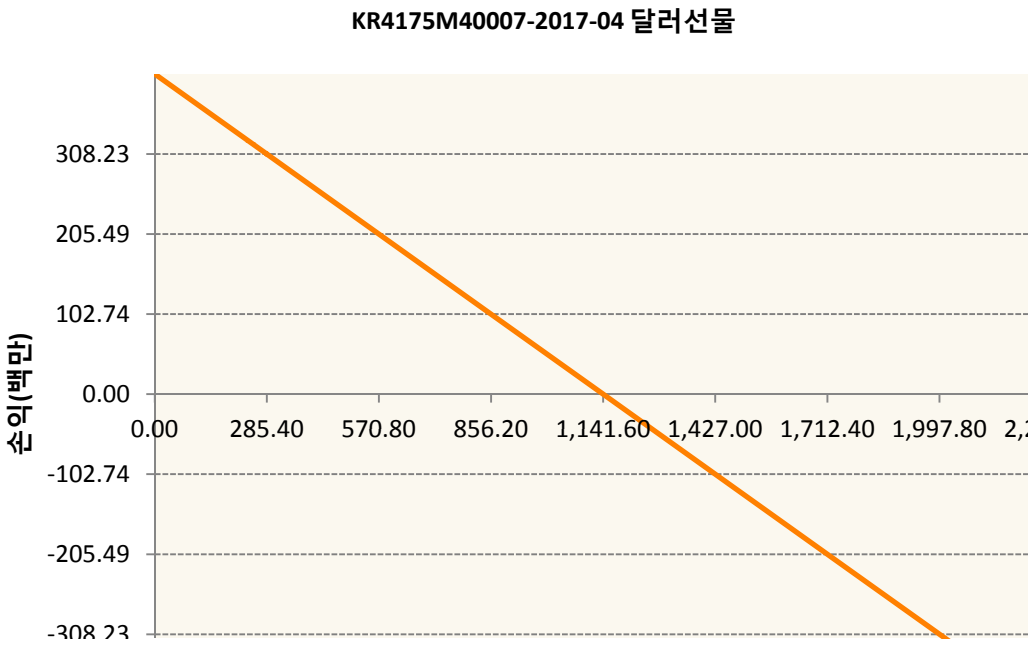
2. 만기시점의 손익구조

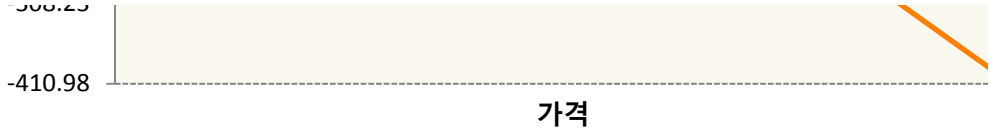


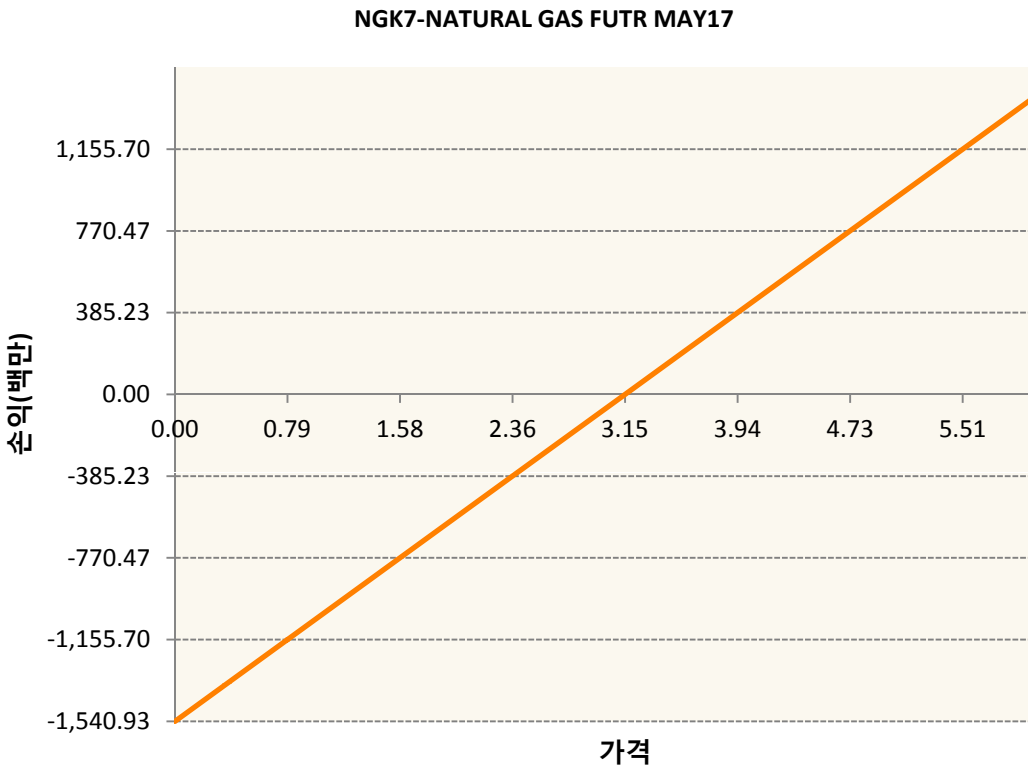


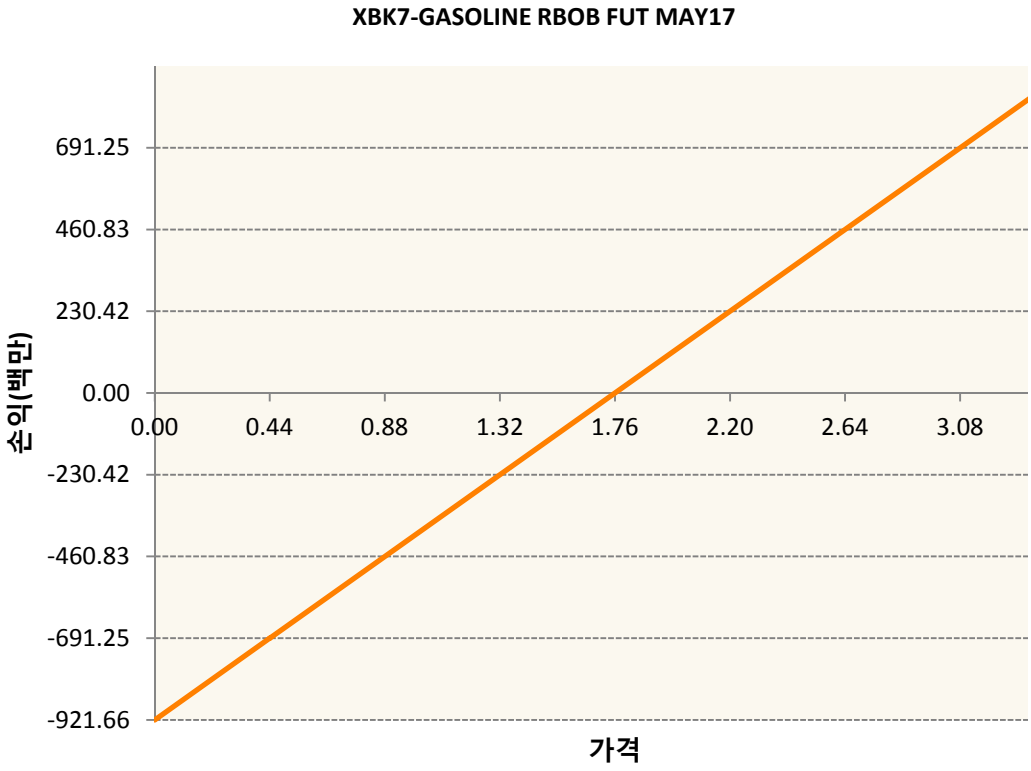

-808.95
-1,213.43
-1,617.90
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
788.79
591.59
394.40
197.20
0.00
-197.20
-394.40
-591.59
-788.79
0.00
0.41
0.83
1.24
1.65
2.06
2.48
2.89
순익(백만)
가격


KR4175M40007-2017-04 달러선물
308.23
205.49
102.74
0.00
-102.74
-205.49
-308.23
0.00
285.40
570.80
856.20
1,141.60
1,427.00
1,712.40
1,997.80
순익(백만)


-410.98
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,155.70
770.47
385.23
0.00
-385.23
-770.47
-1,155.70
-1,540.93
0.00
0.79
1.58
2.36
3.15
3.94
4.73
5.51
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
691.25
460.83
230.42
0.00
-230.42
-460.83
-691.25
-921.66
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	123
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	74

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

1,036

공시일	2017-04-13
기준일	2017-04-12

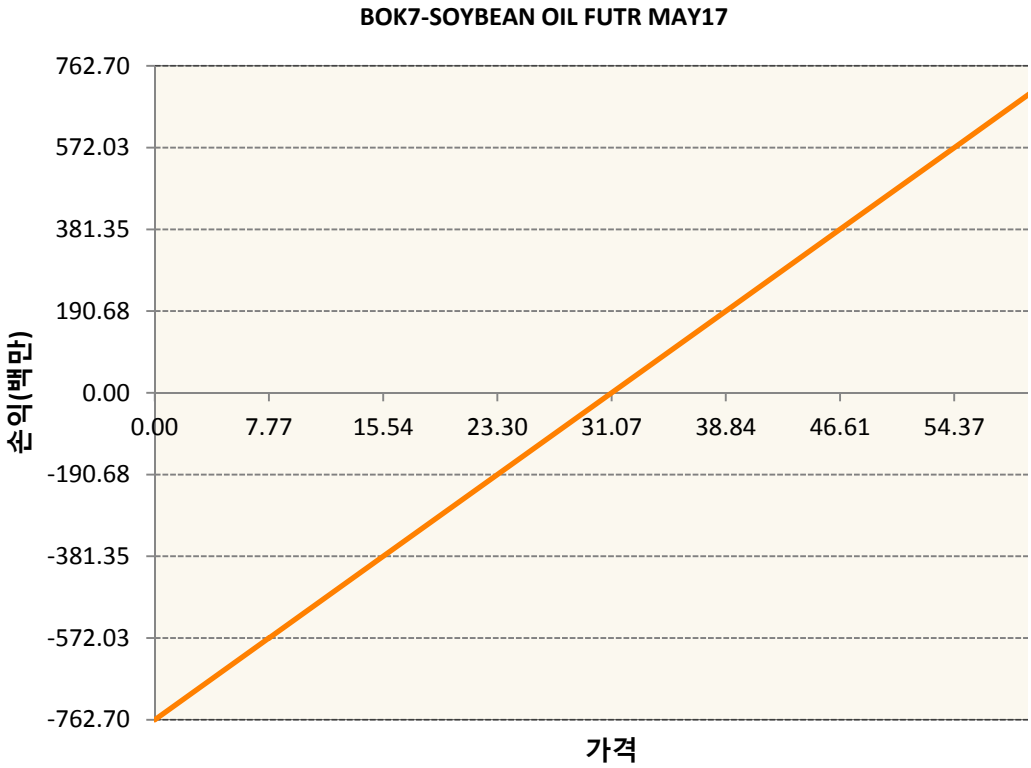
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

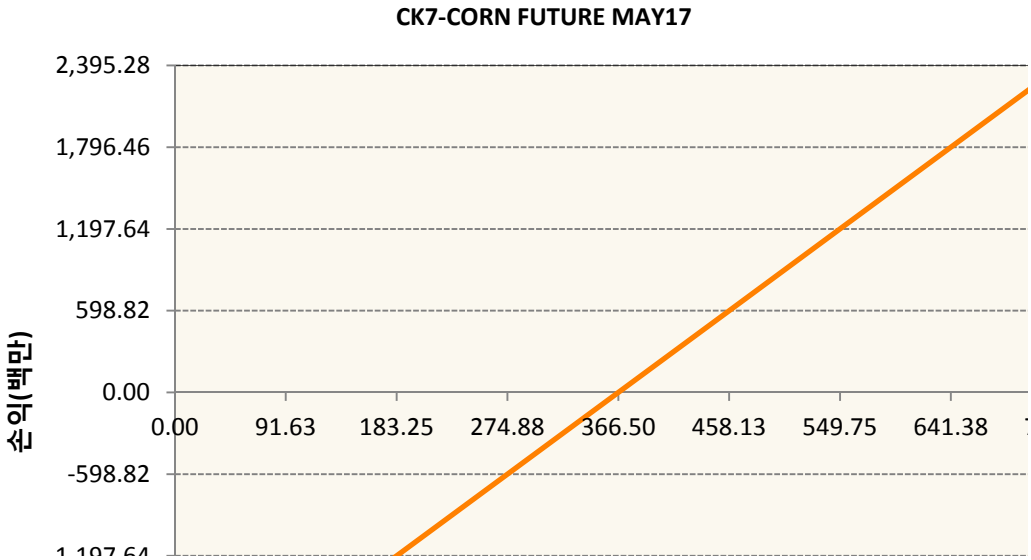
1. 계약금액

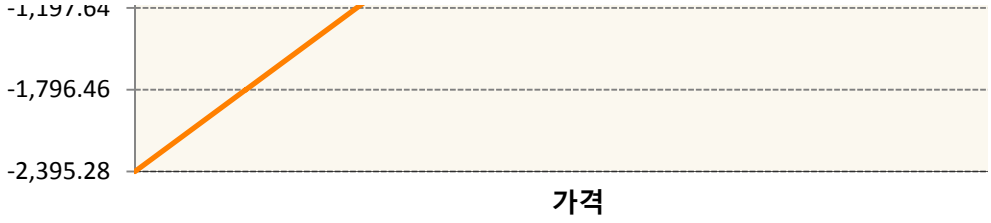
(단위:백만원)

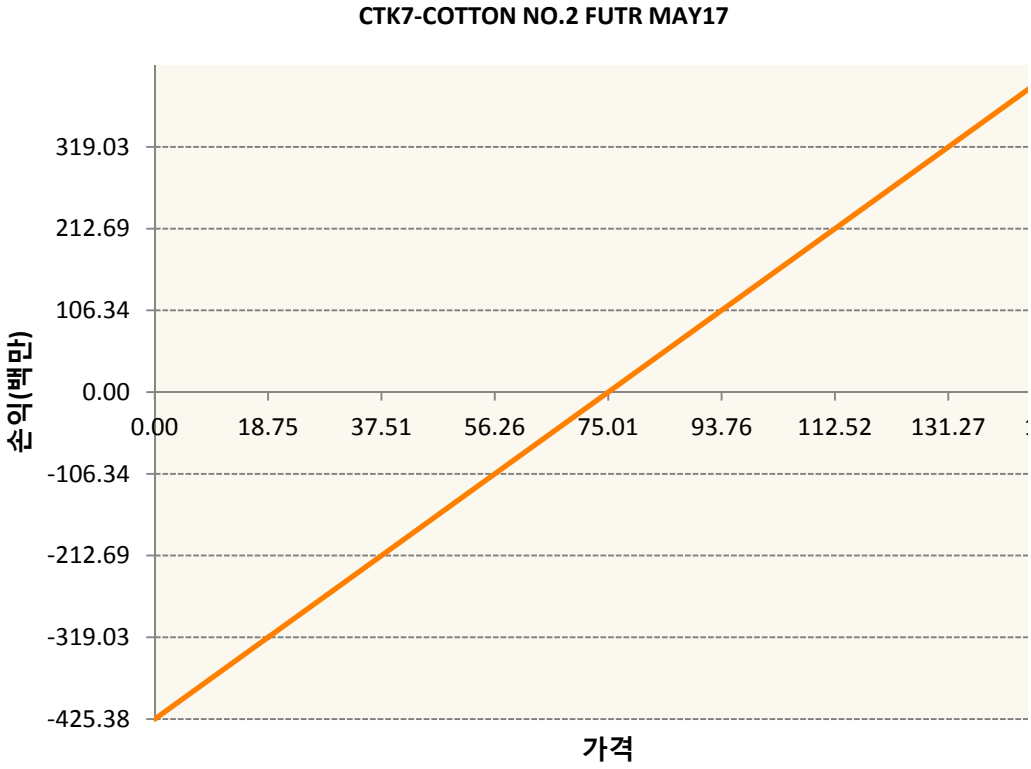
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,053	400	8,653	

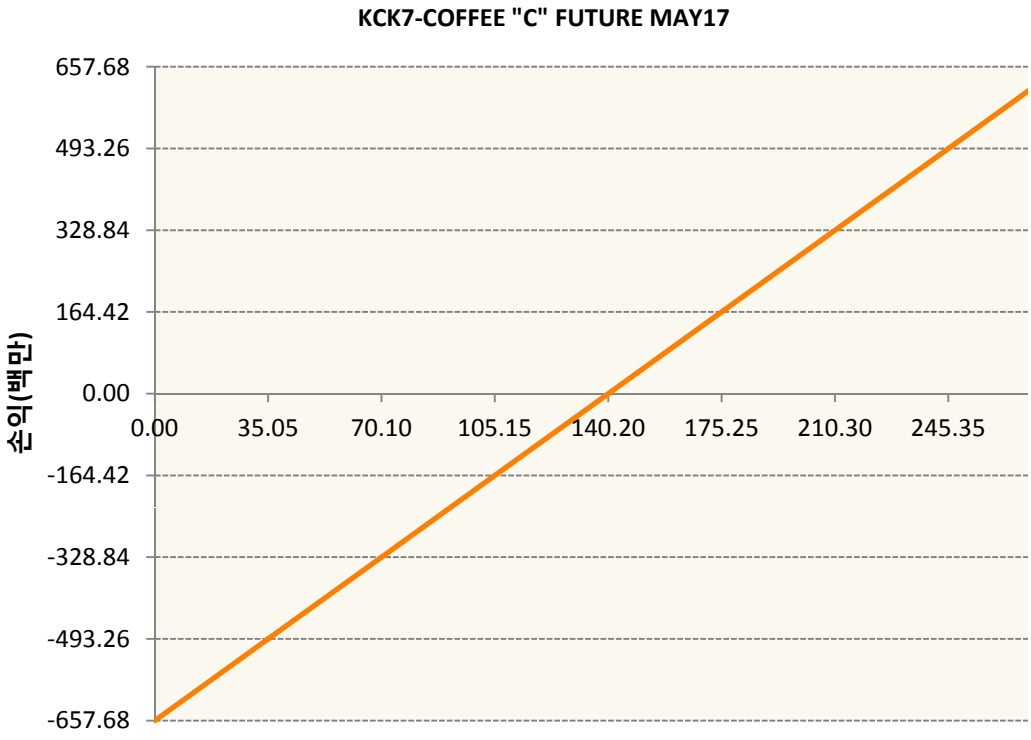
2. 만기시점의 손익구조



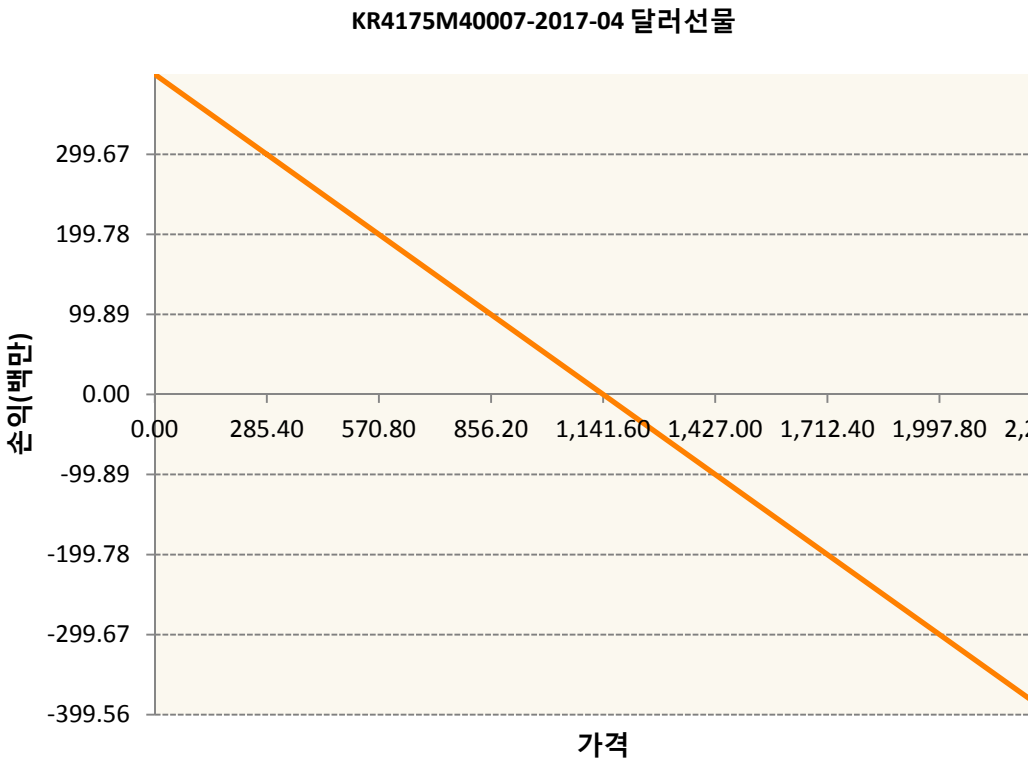


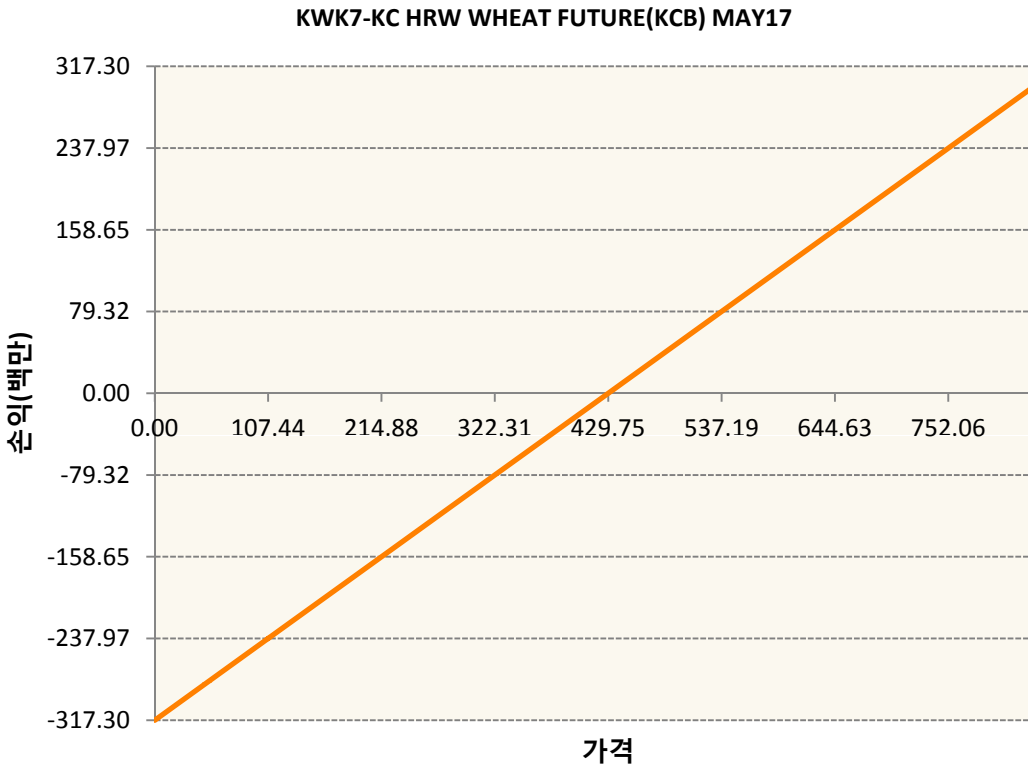

-1,796.46
-2,395.28
가격


CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
319.03
212.69
106.34
0.00
-106.34
-212.69
-319.03
-425.38
0.00
18.75
37.51
56.26
75.01
93.76
112.52
131.27
순익(백만)
가격

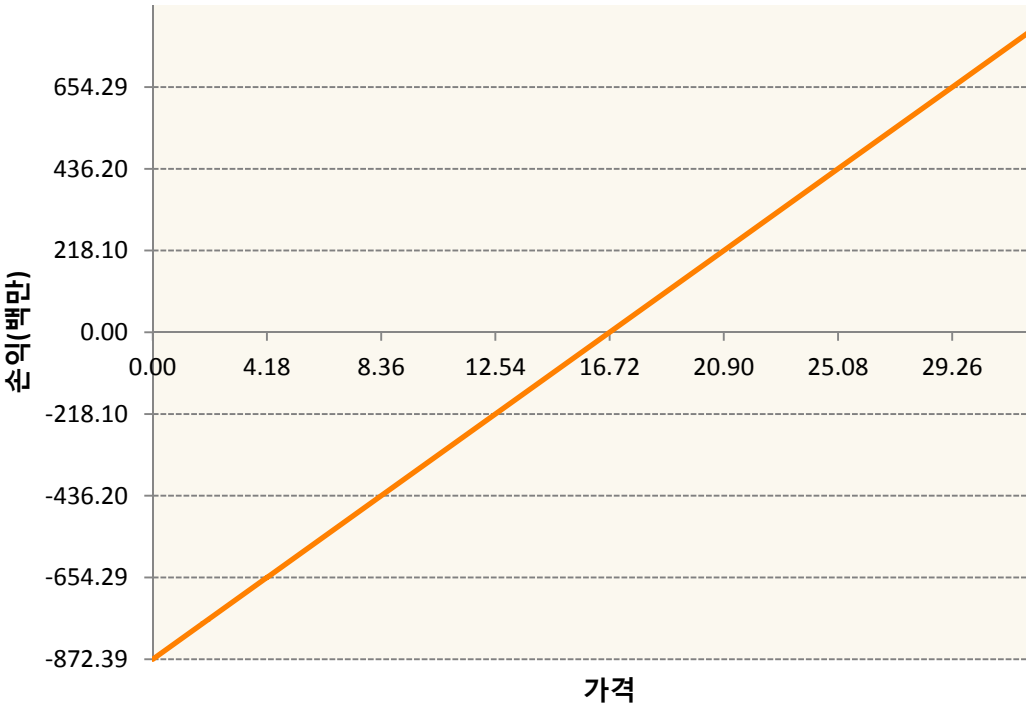

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
657.68
493.26
328.84
164.42
0.00
-164.42
-328.84
-493.26
-657.68
0.00
35.05
70.10
105.15
140.20
175.25
210.30
245.35
순익(백만)

가격

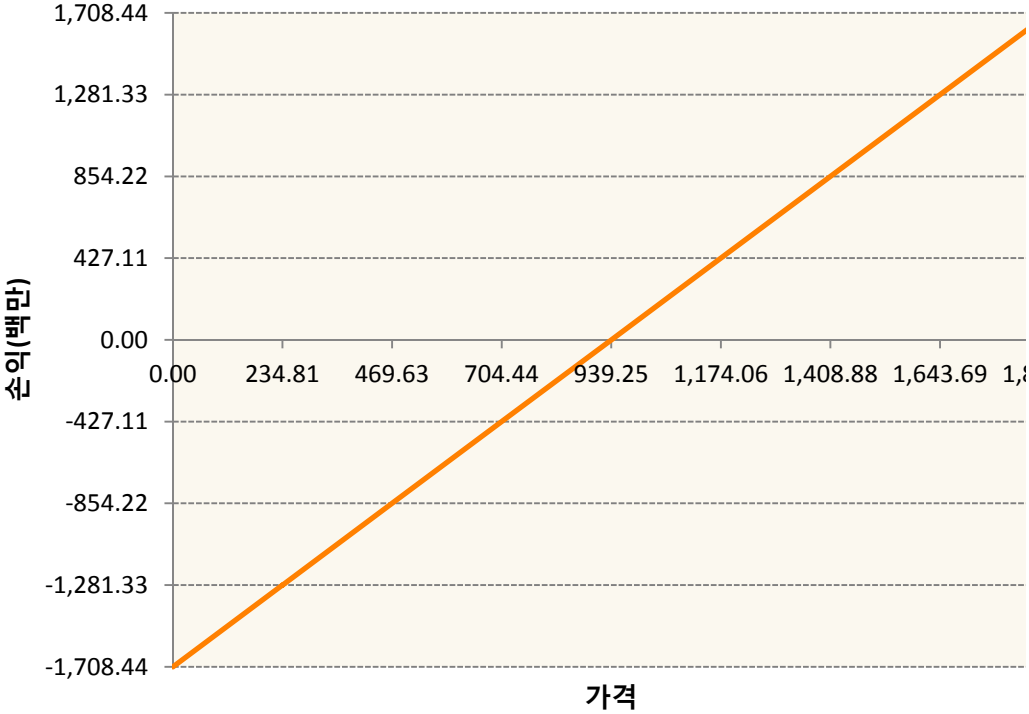

KR4175M40007-2017-04 달러선물
299.67
199.78
99.89
0.00
-99.89
-199.78
-299.67
-399.56
0.00
285.40
570.80
856.20
1,141.60
1,427.00
1,712.40
1,997.80
손익(백만)
가격


KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
317.30
237.97
158.65
79.32
0.00
-79.32
-158.65
-237.97
-317.30
0.00
107.44
214.88
322.31
429.75
537.19
644.63
752.06
손익(백만)
가격

SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17

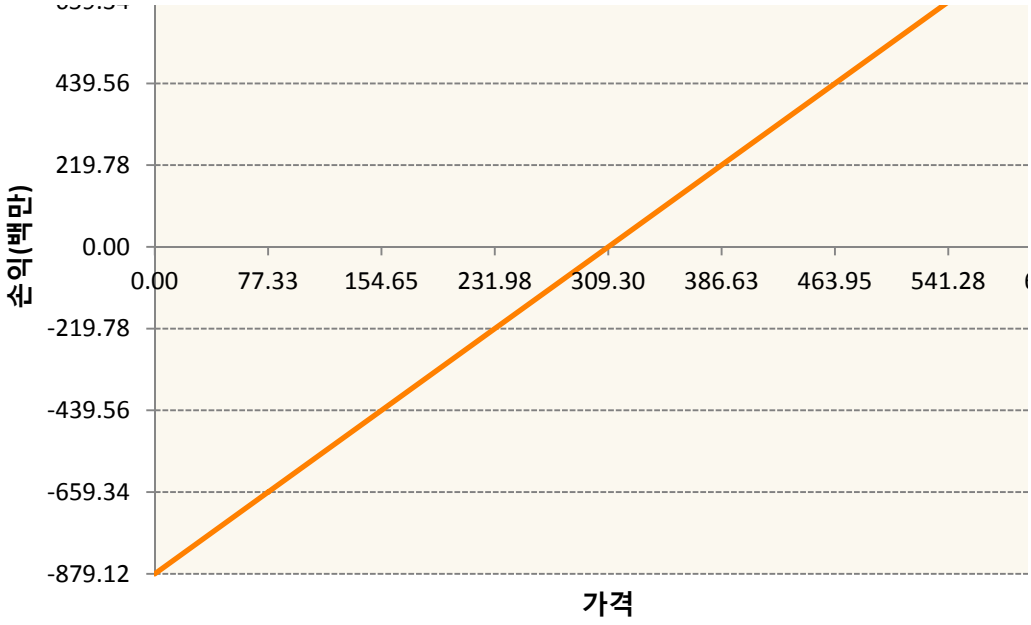


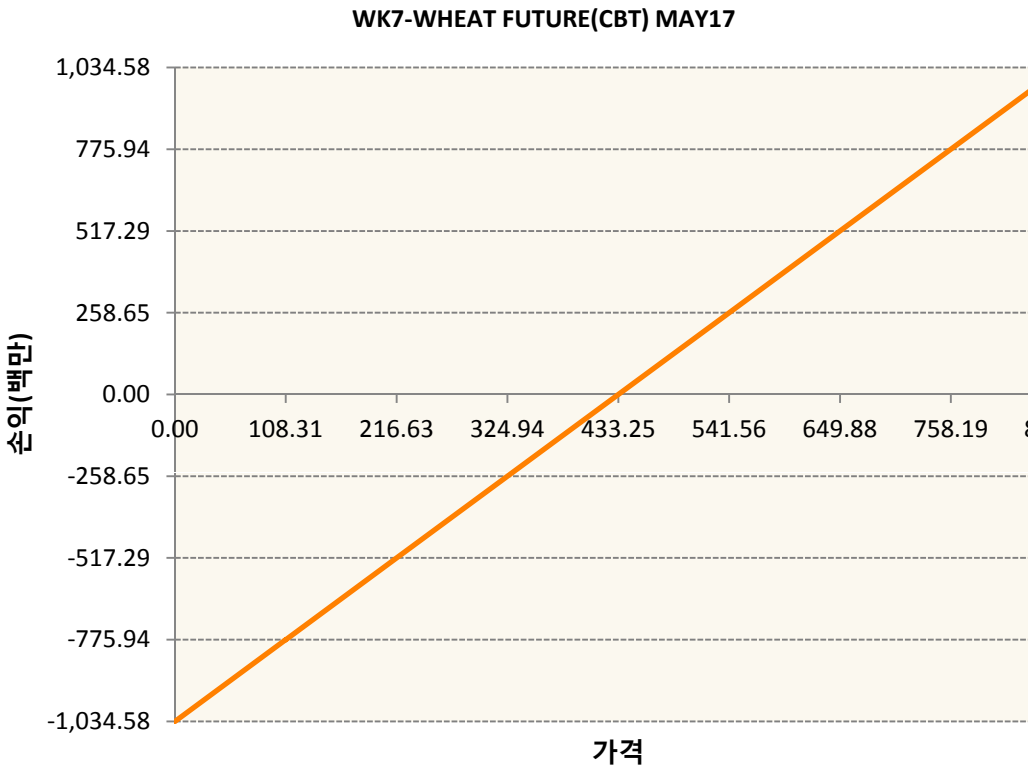
SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17



SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	61
CK7	CORN FUTURE MAY17	192
CTK7	COTTON NO.2 FUTR MAY17	34
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	83

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

825