공시일	2017-04-14
기준일	2017-04-13

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	2017-04-14
기준일	2017-04-13

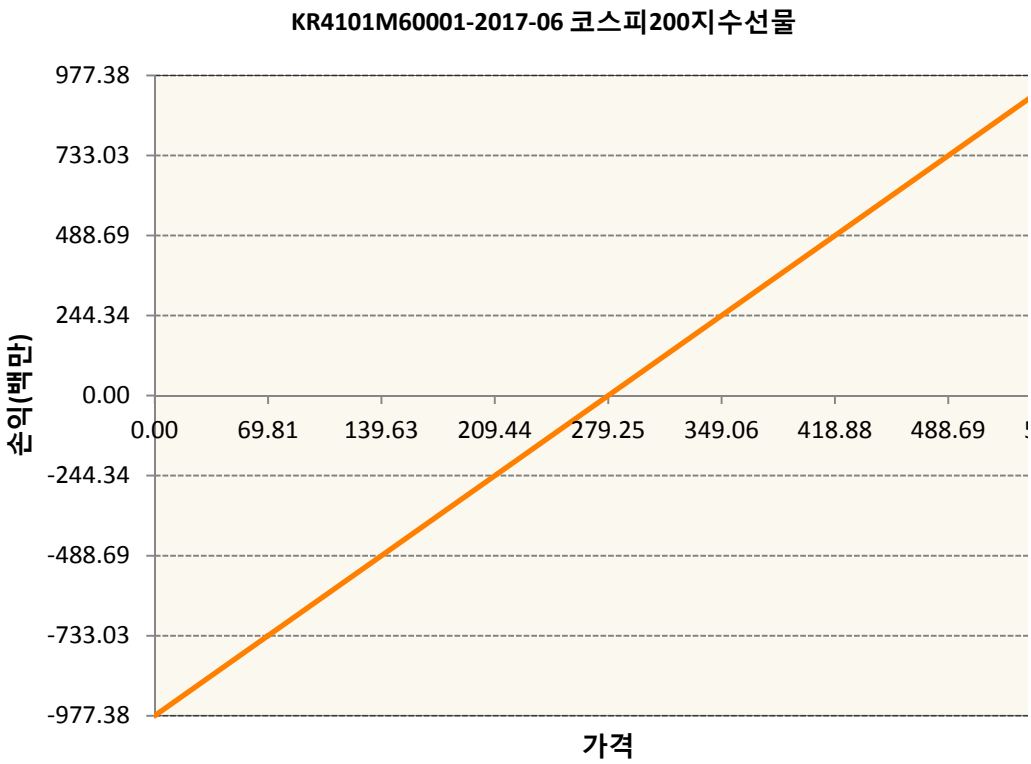
스마트인덱스모

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	977	0	977	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)

51

공시일	2017-04-14
기준일	2017-04-13

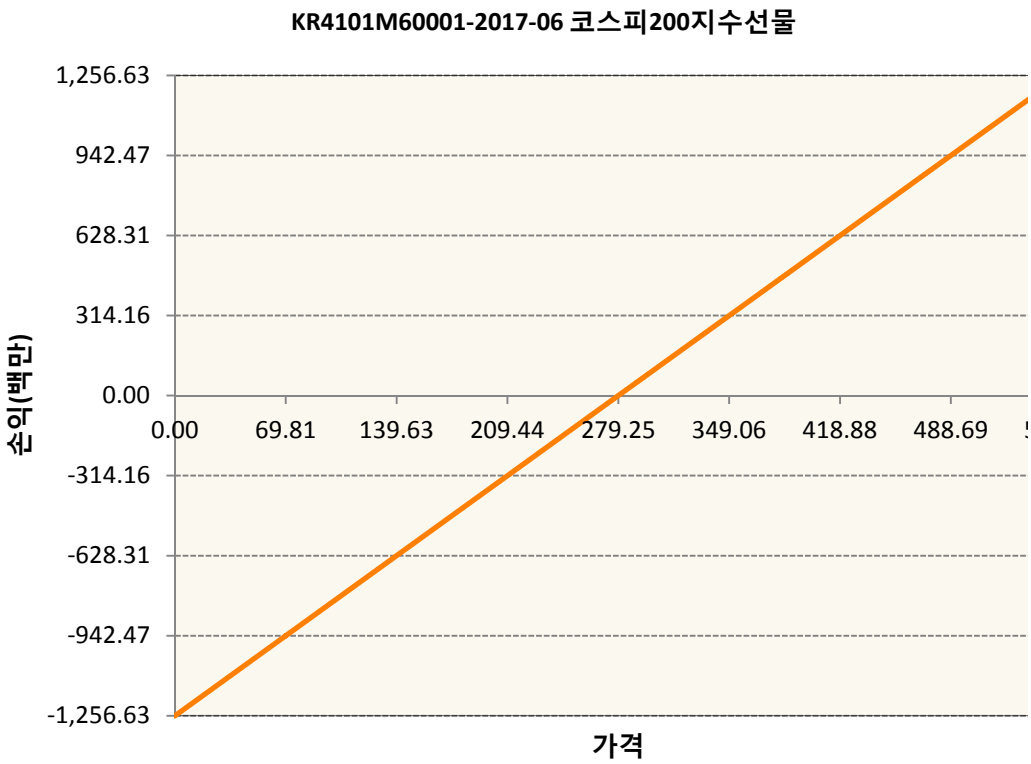
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	2017-04-14
기준일	2017-04-13

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	954

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

548

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-04-14
기준일	2017-04-13

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)

422

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-04-14
기준일	2017-04-13

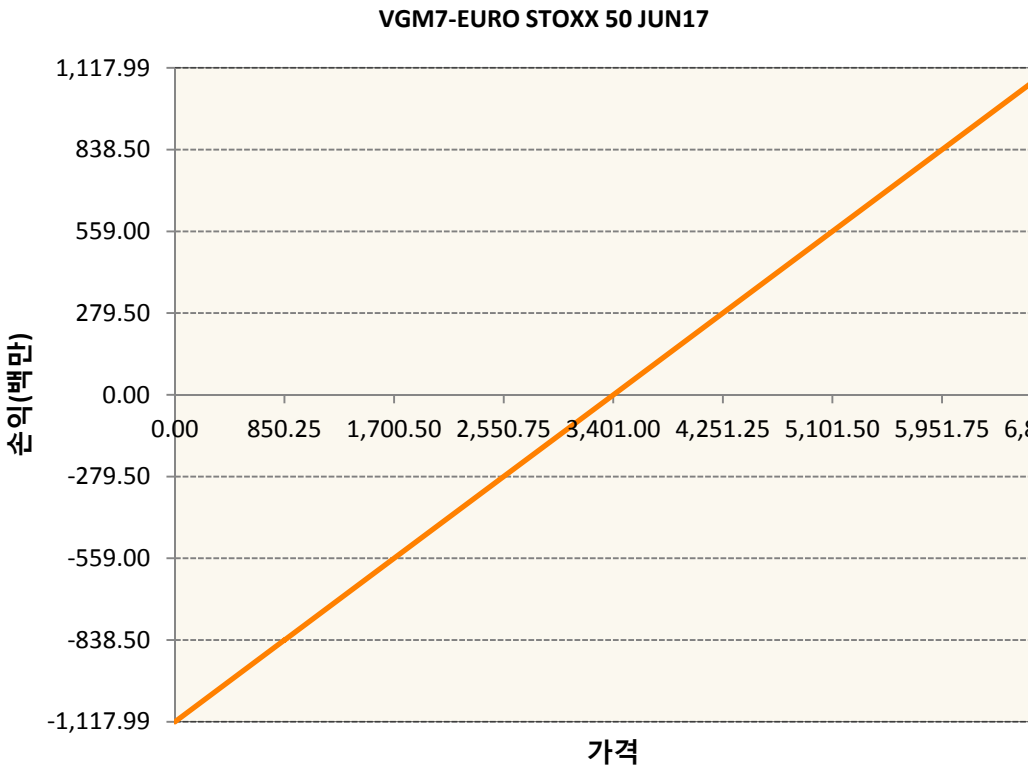
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2017-04-14
기준일	2017-04-13

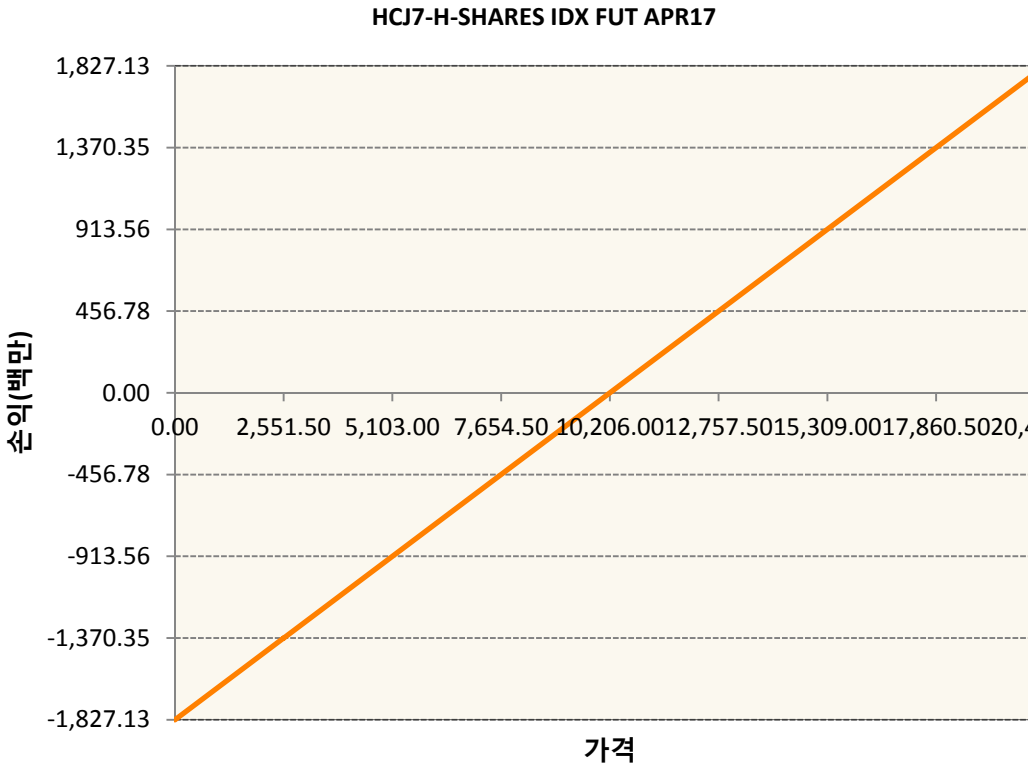
차이나인덱스모(주식-파생형)

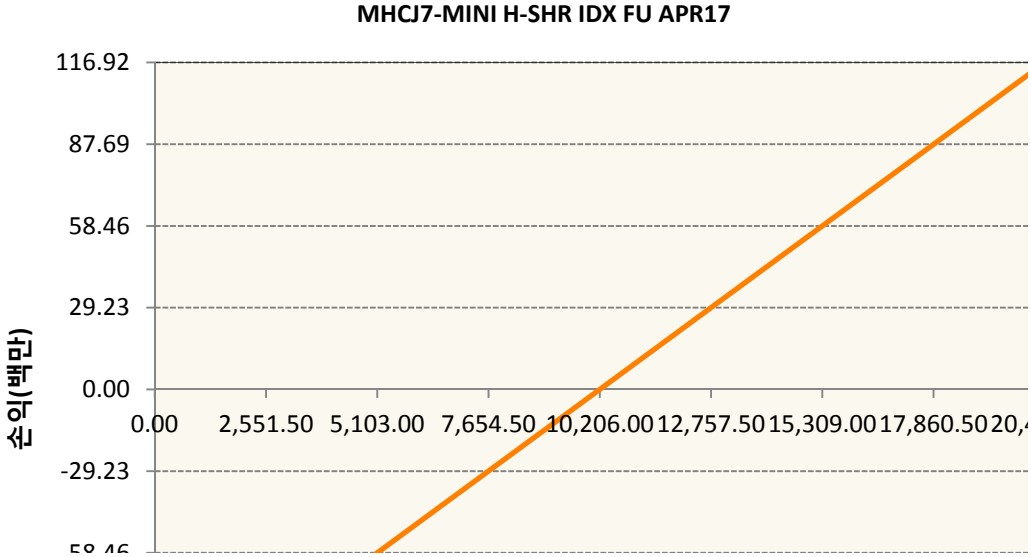
1. 계약금액

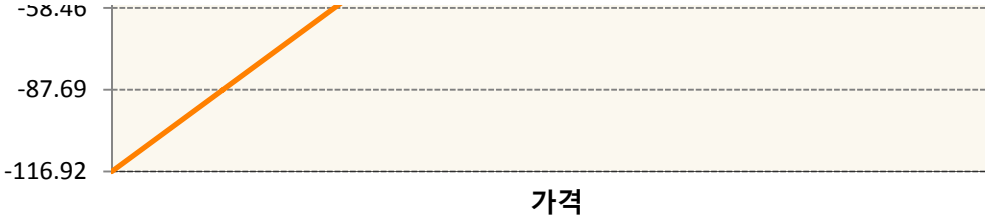
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,944	0	1,944	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	2017-04-14
기준일	2017-04-13

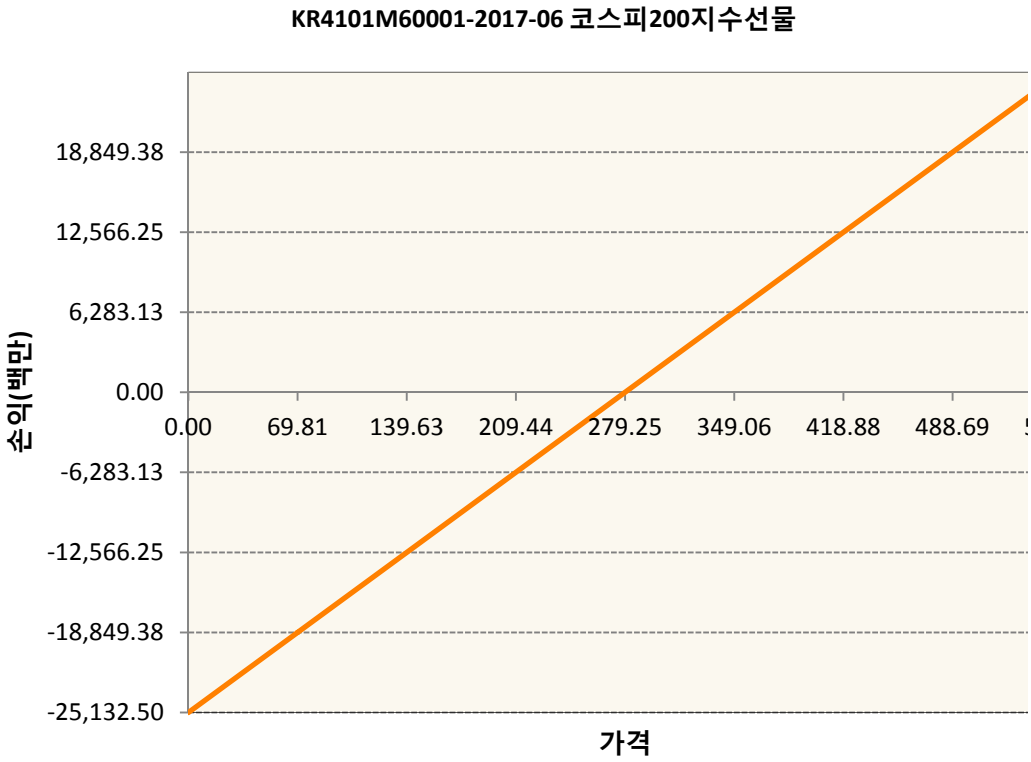
커버드콜모(주식혼합-파생형)

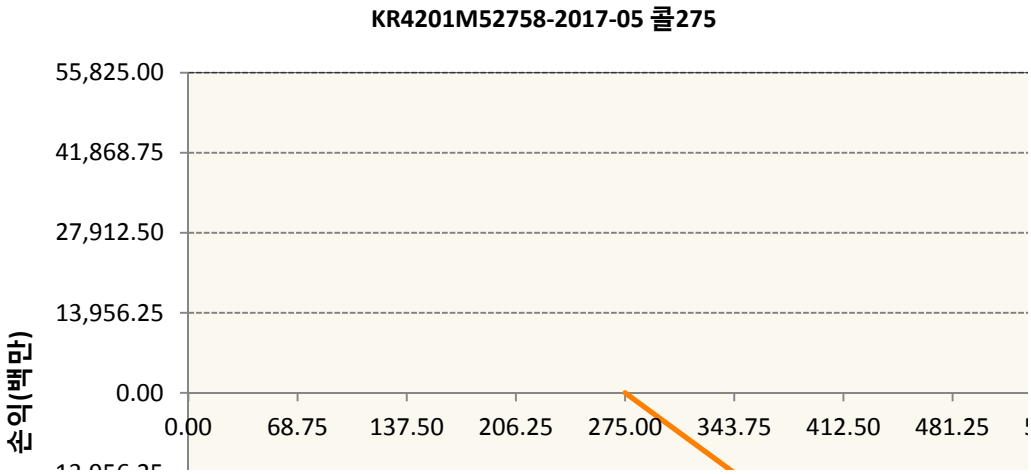
1. 계약금액

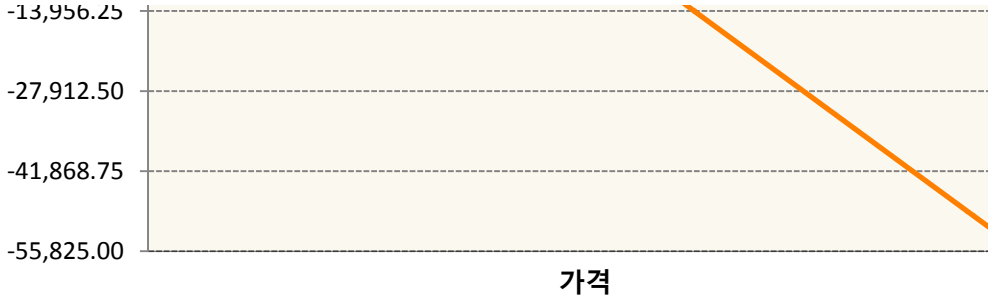
(단위:백만원)

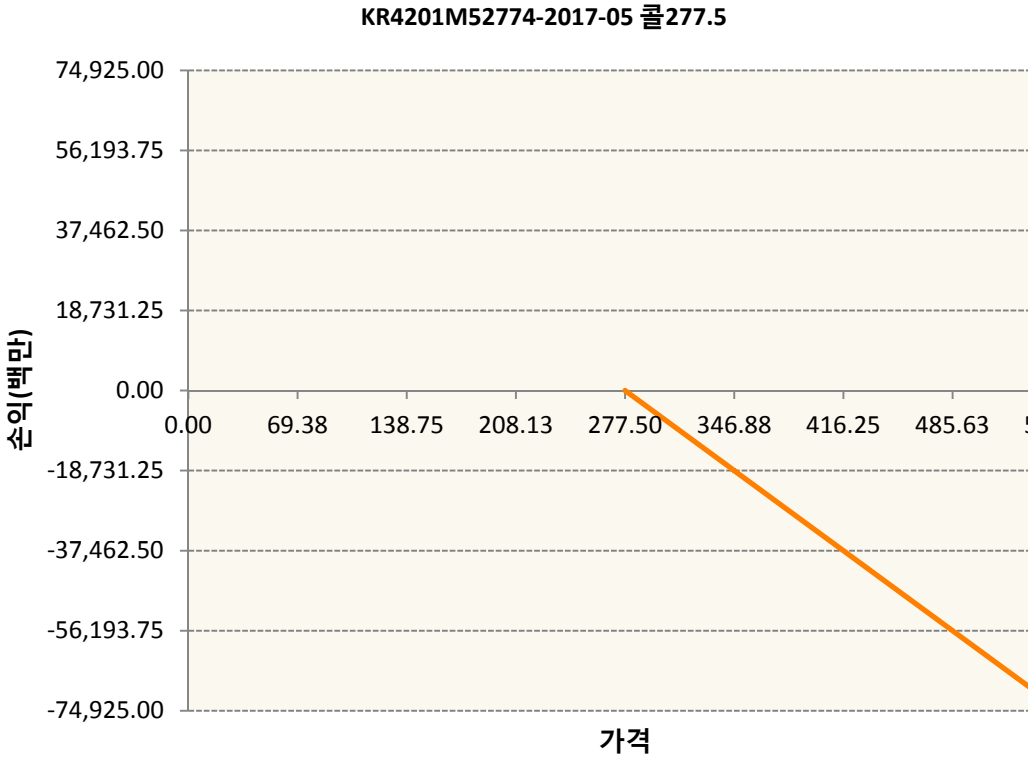
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	16,741	0	16,741	장내
신규	유가증권	옵션	0	139,043	-139,043	장내
누계	유가증권	선물	25,133	0	25,133	장내
누계	유가증권	옵션	0	186,250	-186,250	장내

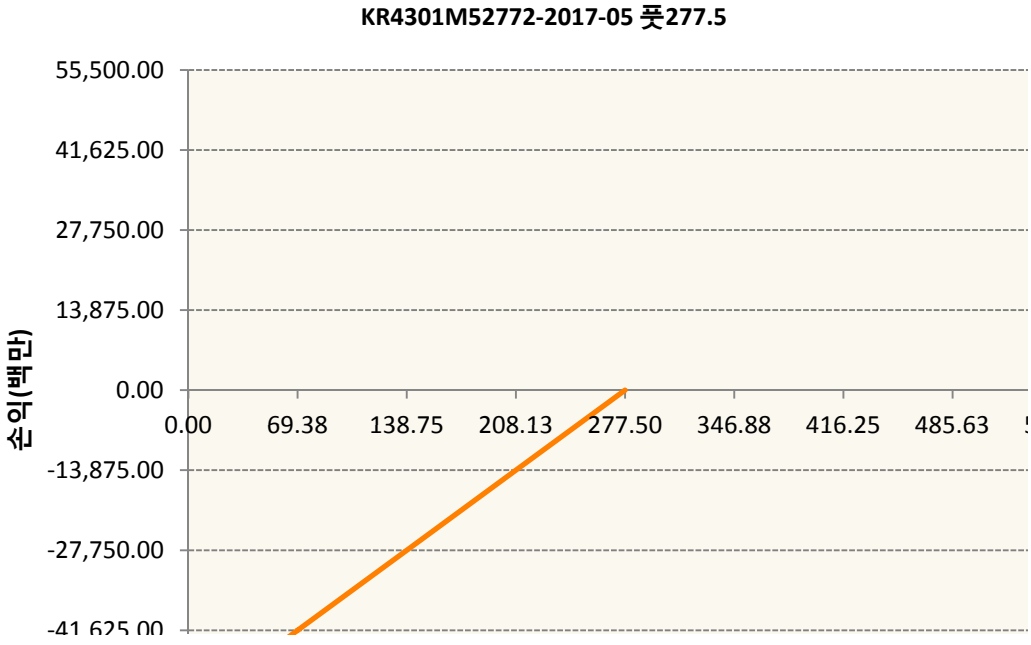
2. 만기시점의 손익구조

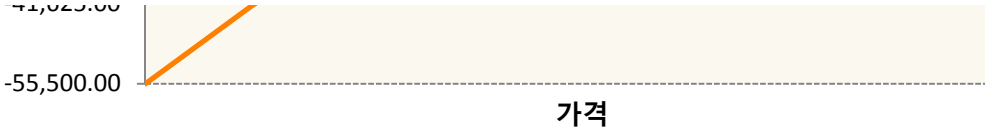





-13,956.25
-27,912.50
-41,868.75
-55,825.00
가격


KR4201M52774-2017-05 콜277.5
74,925.00
56,193.75
37,462.50
18,731.25
0.00
-18,731.25
-37,462.50
-56,193.75
-74,925.00
0.00
69.38
138.75
208.13
277.50
346.88
416.25
485.63
순익(백만)
가격


KR4301M52772-2017-05 풋277.5
55,500.00
41,625.00
27,750.00
13,875.00
0.00
-13,875.00
-27,750.00
-41,625.00
0.00
69.38
138.75
208.13
277.50
346.88
416.25
485.63
순익(백만)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							2,010
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,010	-2,010	-2,010	-2,010	-2,010	-2,010	-2,010
-5.33%	-1,340	-1,340	-1,340	-1,340	-1,340	-1,340	-1,340
-2.67%	-670	-670	-670	-670	-670	-670	-670
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	670	670	670	670	670	670	670
5.33%	1,340	1,340	1,340	1,340	1,340	1,340	1,340
8.00%	2,010	2,010	2,010	2,010	2,010	2,010	2,010
KR4201M52 2017-05 콜275							4,049
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,328	1,322	1,314	1,302	1,287	1,267	1,245
-5.33%	1,274	1,245	1,211	1,173	1,131	1,087	1,039
-2.67%	982	917	851	785	717	650	582
0%	194	131	66	0	-67	-134	-202
2.67%	-1,058	-1,087	-1,121	-1,160	-1,202	-1,248	-1,297
5.33%	-2,516	-2,523	-2,533	-2,547	-2,565	-2,587	-2,613
8.00%	-4,020	-4,021	-4,022	-4,026	-4,031	-4,039	-4,049
KR4201M52 2017-05 콜277.5							5,138
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,367	1,363	1,357	1,347	1,334	1,316	1,294
-5.33%	1,332	1,307	1,275	1,238	1,194	1,146	1,093
-2.67%	1,088	1,015	938	859	777	694	610
0%	282	188	94	0	-94	-189	-284
2.67%	-1,206	-1,262	-1,323	-1,389	-1,459	-1,533	-1,609
5.33%	-3,086	-3,102	-3,124	-3,153	-3,187	-3,227	-3,272
8.00%	-5,076	-5,078	-5,083	-5,091	-5,102	-5,118	-5,138
KR4301M52 2017-05 풋277.5							3,502
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,448	-3,450	-3,455	-3,462	-3,472	-3,485	-3,502
-5.33%	-1,987	-2,005	-2,029	-2,056	-2,089	-2,124	-2,163
-2.67%	-681	-735	-792	-850	-911	-972	-1,035

0%	209	140	70	0	-70	-140	-210
2.67%	593	552	507	458	406	351	295
5.33%	687	676	659	638	612	583	549
8.00%	700	698	695	689	680	669	654

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

15,329

공시일	2017-04-14
기준일	2017-04-13

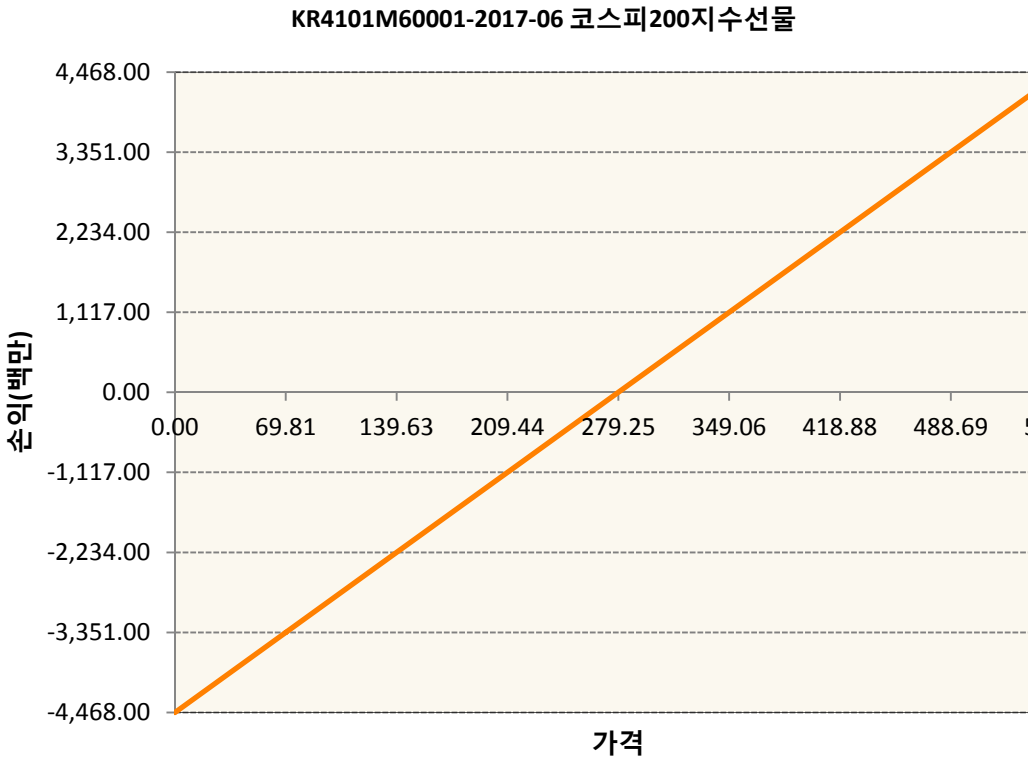
커버드콜목표전환형증권투자신탁

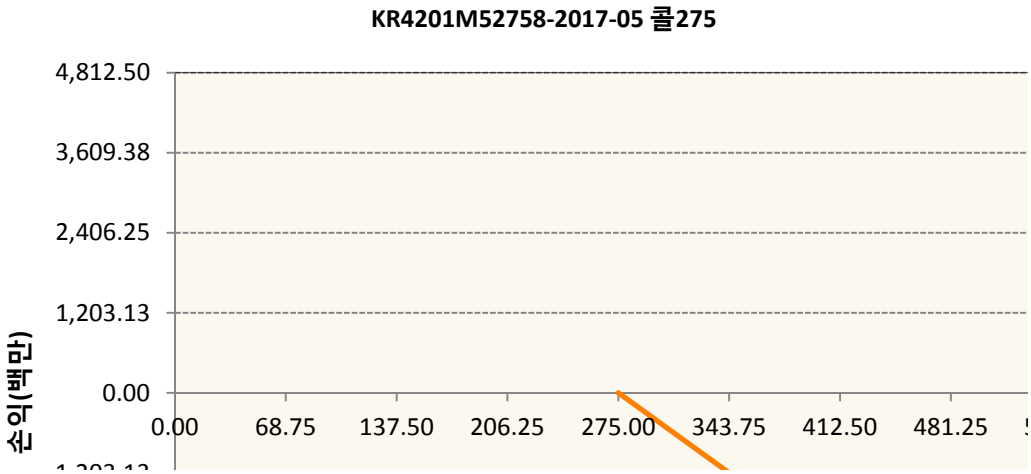
1. 계약금액

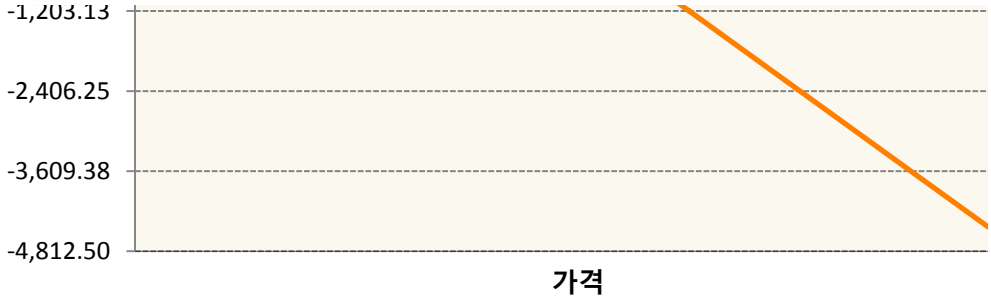
(단위:백만원)

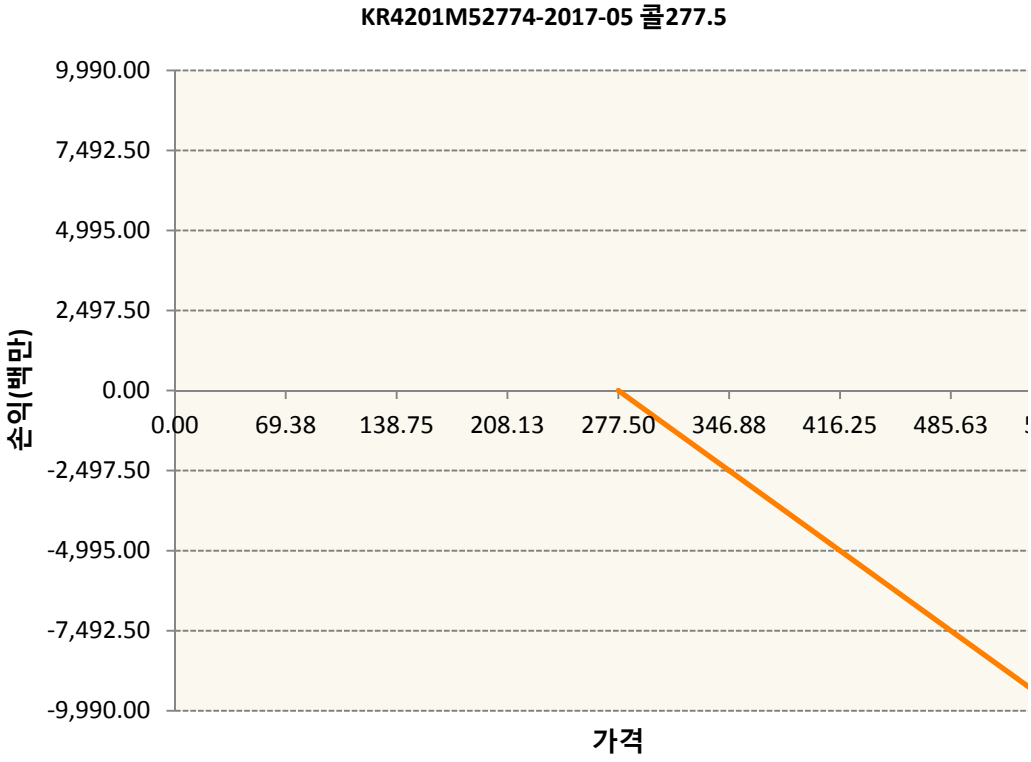
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	4,463	0	4,463	장내
신규	유가증권	옵션	0	10,127	-10,127	장내
누계	유가증권	선물	4,468	0	4,468	장내
누계	유가증권	옵션	0	14,803	-14,803	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							357
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-357	-357	-357	-357	-357	-357	-357
-5.33%	-238	-238	-238	-238	-238	-238	-238
-2.67%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	119	119	119	119	119	119	119
5.33%	238	238	238	238	238	238	238
8.00%	357	357	357	357	357	357	357
KR4201M52 2017-05 콜275							349
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	114	114	113	112	111	109	107
-5.33%	110	107	104	101	98	94	90
-2.67%	85	79	73	68	62	56	50
0%	17	11	6	0	-6	-12	-17
2.67%	-91	-94	-97	-100	-104	-108	-112
5.33%	-217	-217	-218	-220	-221	-223	-225
8.00%	-347	-347	-347	-347	-348	-348	-349
KR4201M52 2017-05 콜277.5							685

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	182	182	181	180	178	175	172
-5.33%	178	174	170	165	159	153	146
-2.67%	145	135	125	115	104	93	81
0%	38	25	13	0	-13	-25	-38
2.67%	-161	-168	-176	-185	-195	-204	-214
5.33%	-411	-414	-417	-420	-425	-430	-436
8.00%	-677	-677	-678	-679	-680	-682	-685

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

1,390

공시일	2017-04-14
기준일	2017-04-13

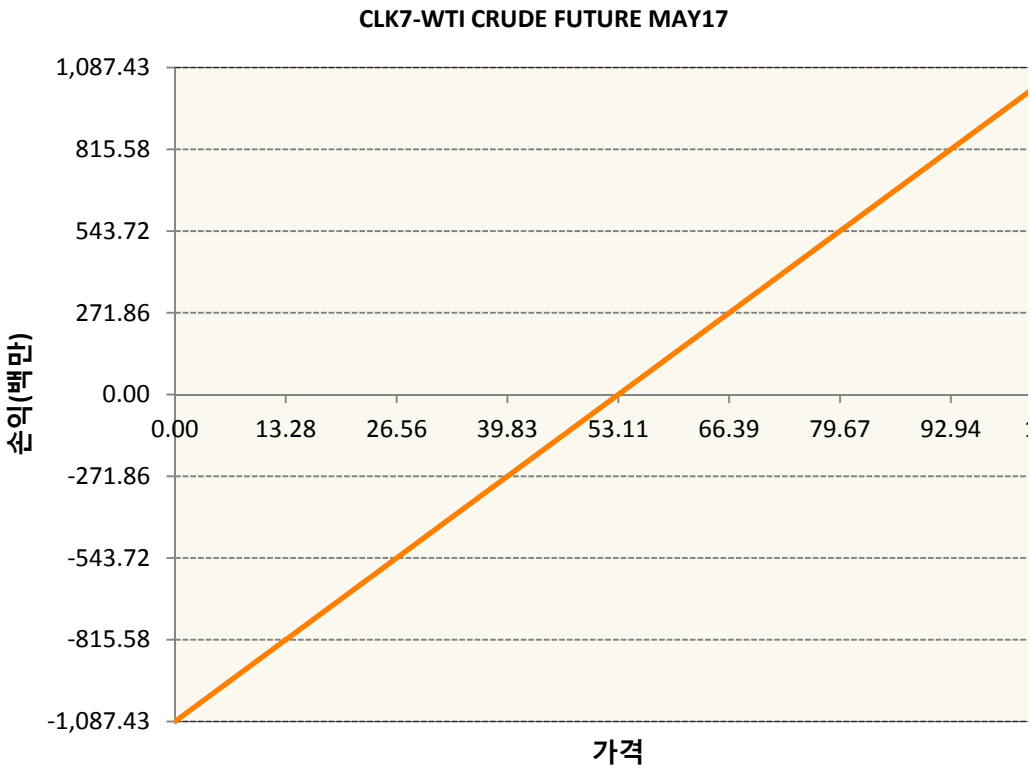
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

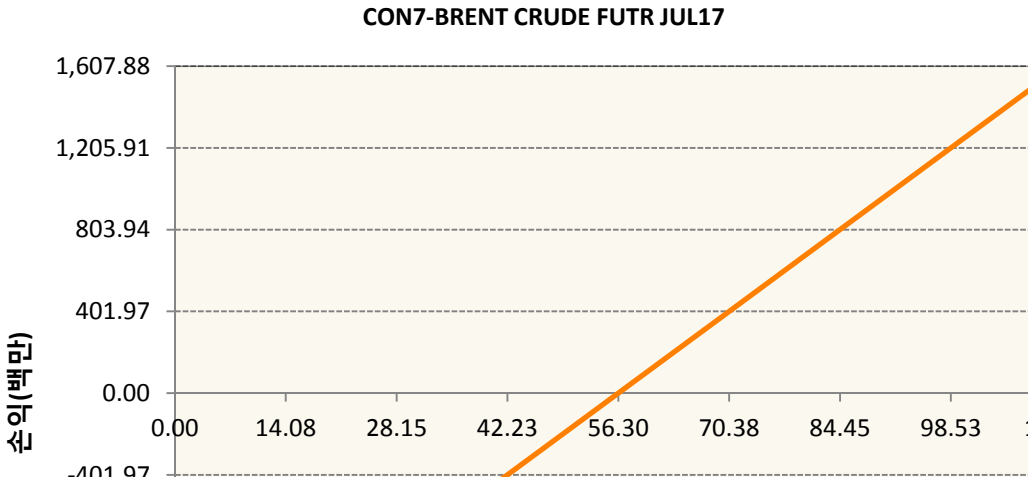
1. 계약금액

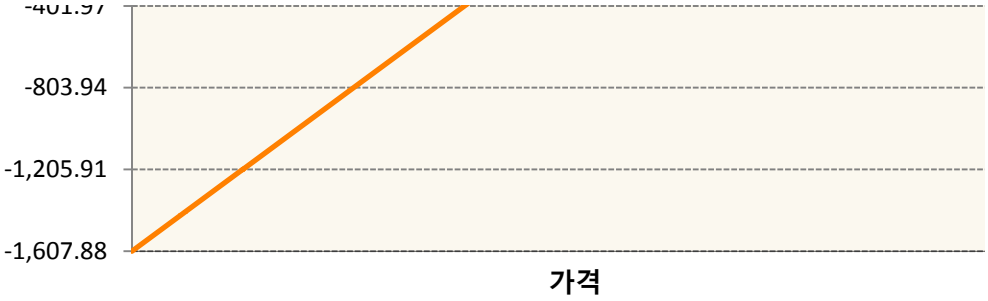
(단위:백만원)

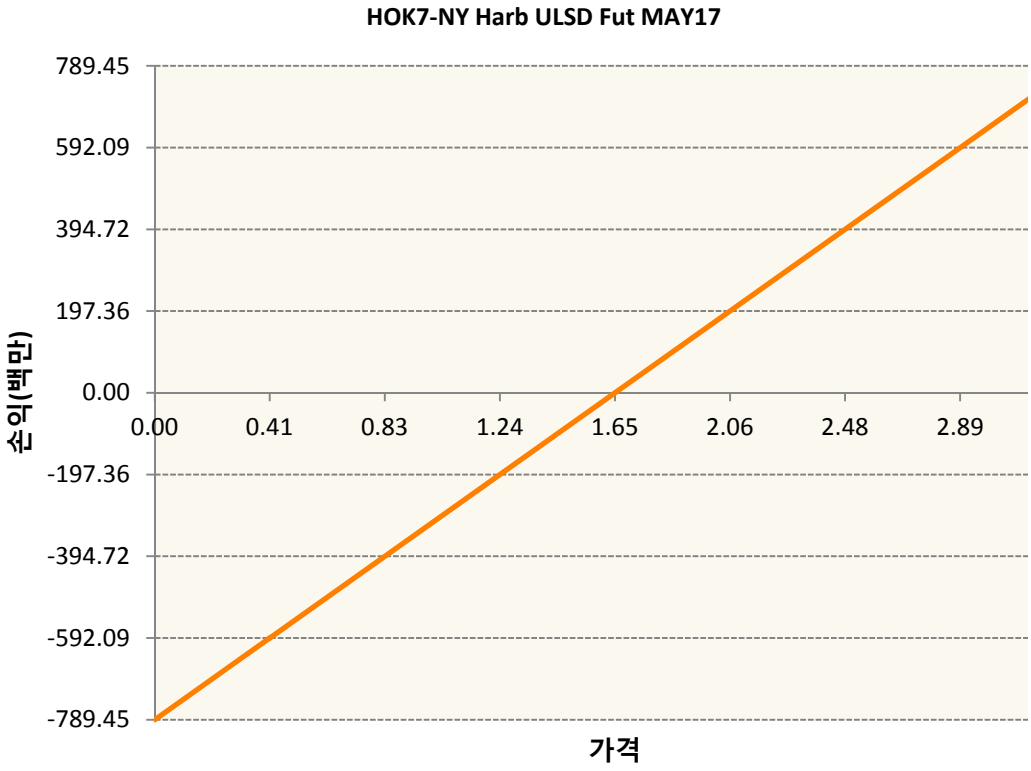
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,087	0	1,087	
누계	유가증권	선물	4,869	407	4,462	

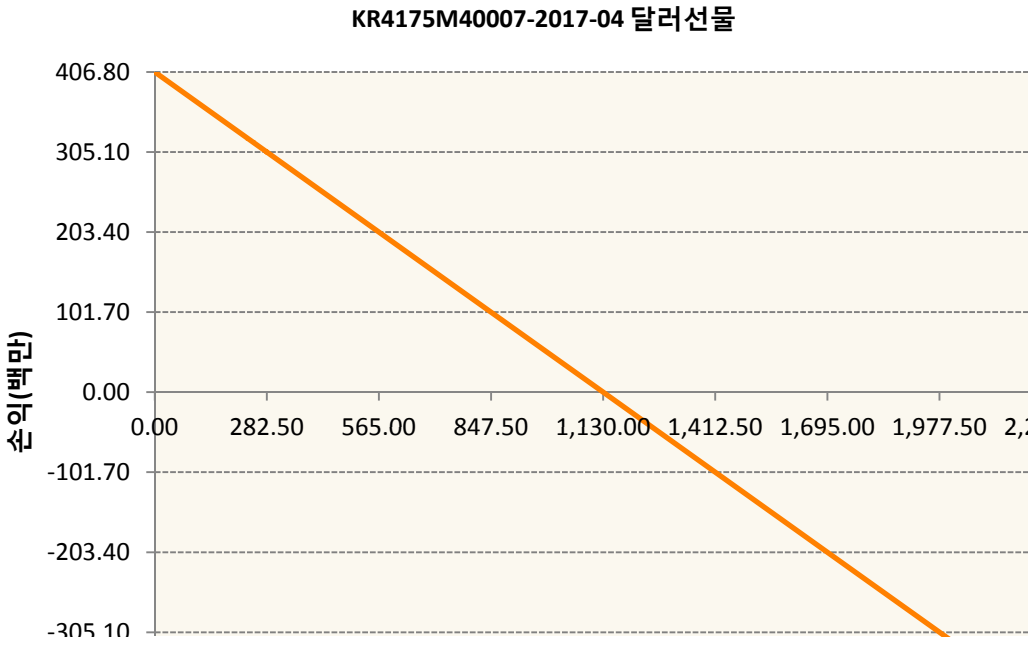
2. 만기시점의 손익구조

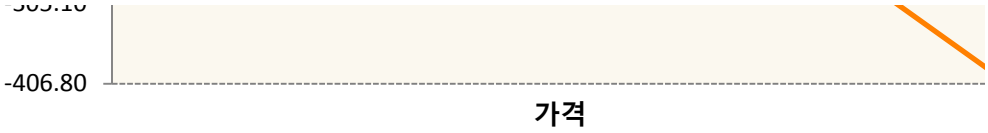


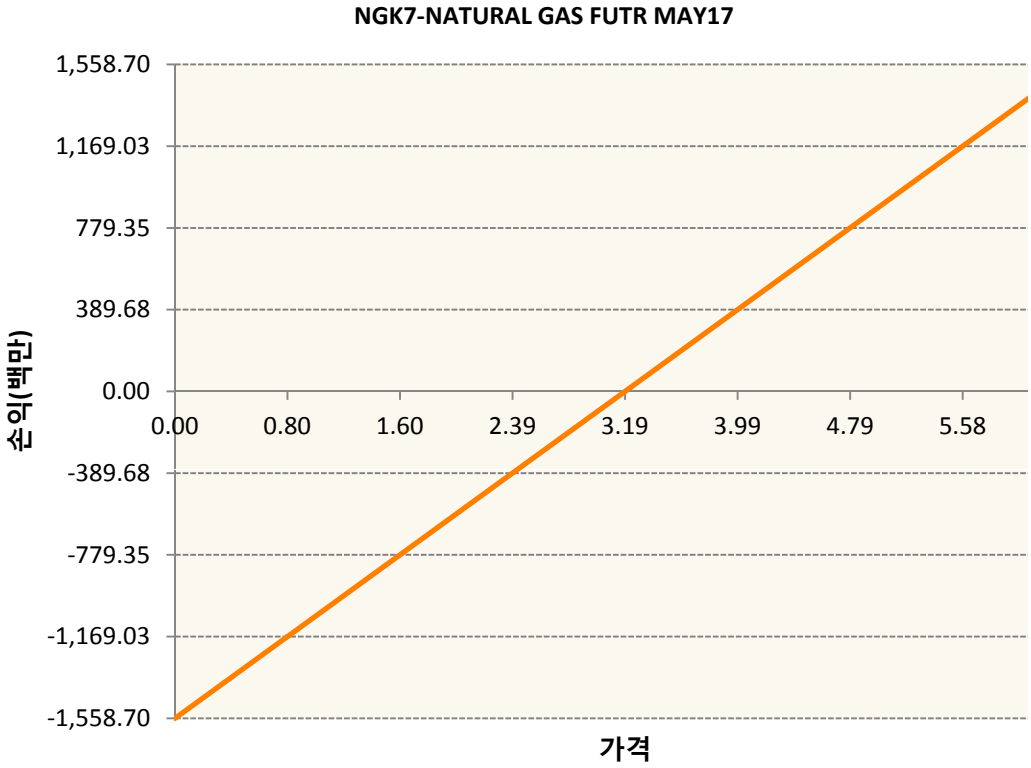


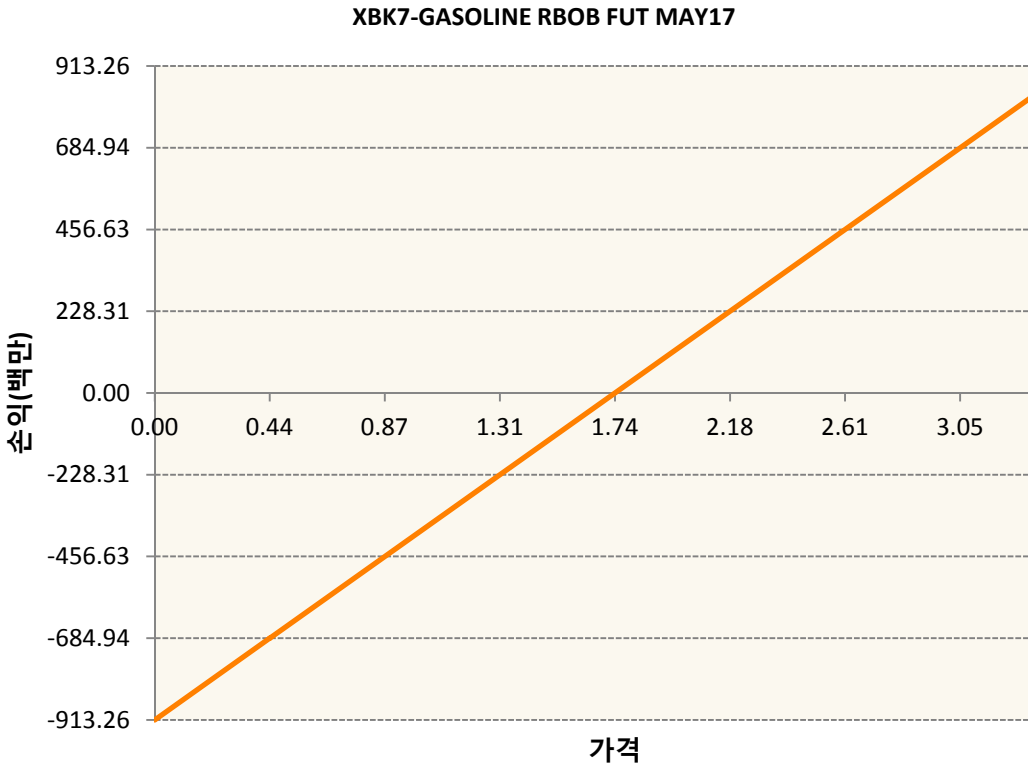

-803.94
-1,205.91
-1,607.88
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
789.45
592.09
394.72
197.36
0.00
-197.36
-394.72
-592.09
-789.45
0.00
0.41
0.83
1.24
1.65
2.06
2.48
2.89
순익(백만)
가격


KR4175M40007-2017-04 달러선물
406.80
305.10
203.40
101.70
0.00
-101.70
-203.40
0.00
282.50
565.00
847.50
1,130.00
1,412.50
1,695.00
1,977.50
순익(백만)


-406.80
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,558.70
1,169.03
779.35
389.68
0.00
-389.68
-779.35
-1,169.03
-1,558.70
0.00
0.80
1.60
2.39
3.19
3.99
4.79
5.58
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
913.26
684.94
456.63
228.31
0.00
-228.31
-456.63
-684.94
-913.26
0.00
0.44
0.87
1.31
1.74
2.18
2.61
3.05
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	125
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	73

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

1,035

공시일	2017-04-14
기준일	2017-04-13

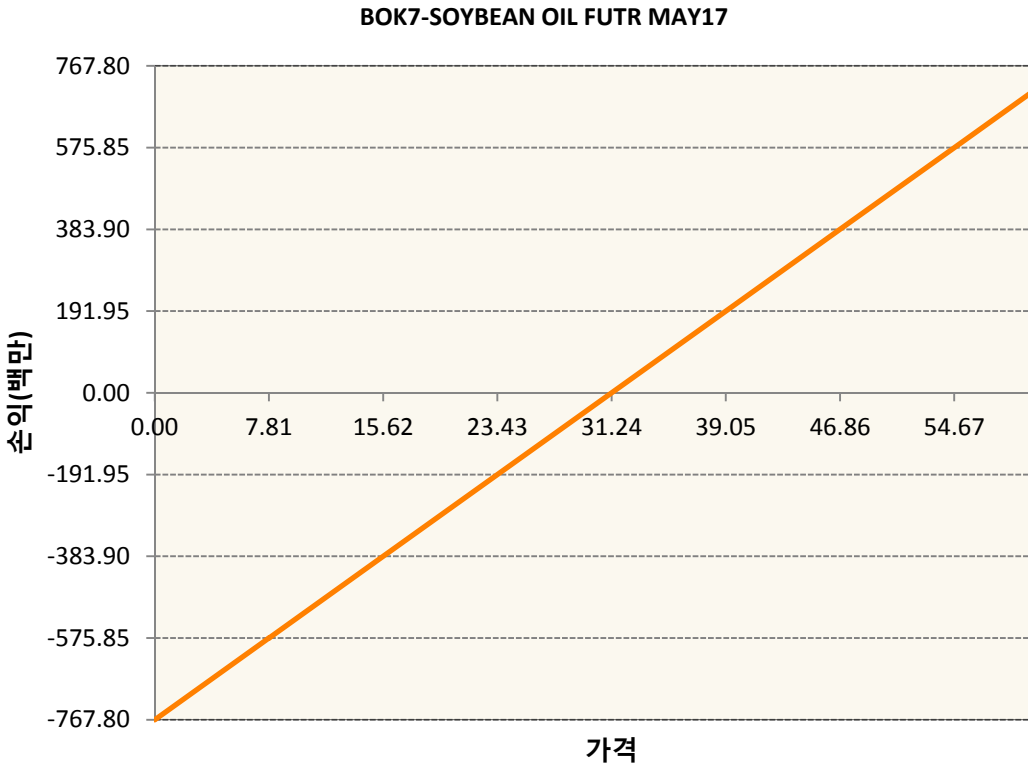
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

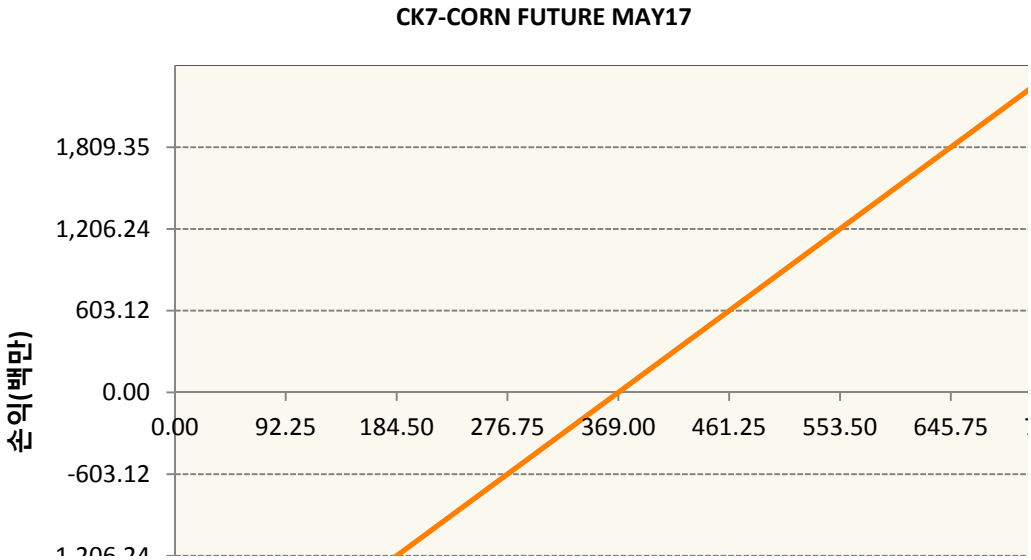
1. 계약금액

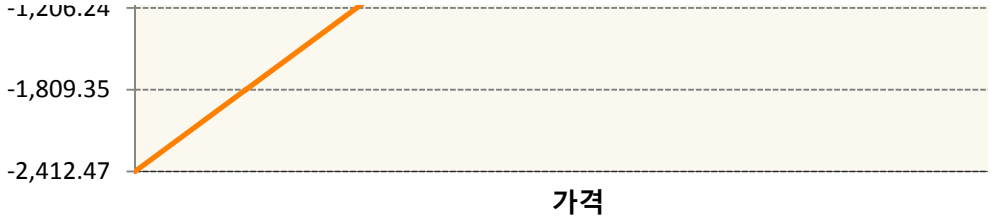
(단위:백만원)

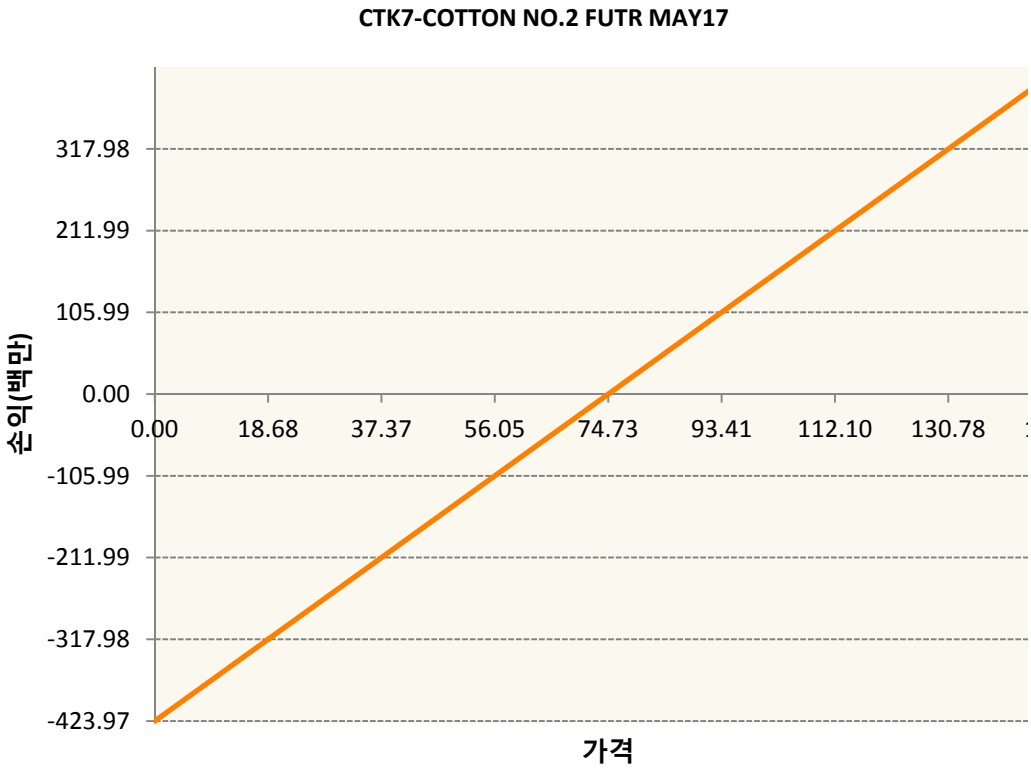
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,096	396	8,700	

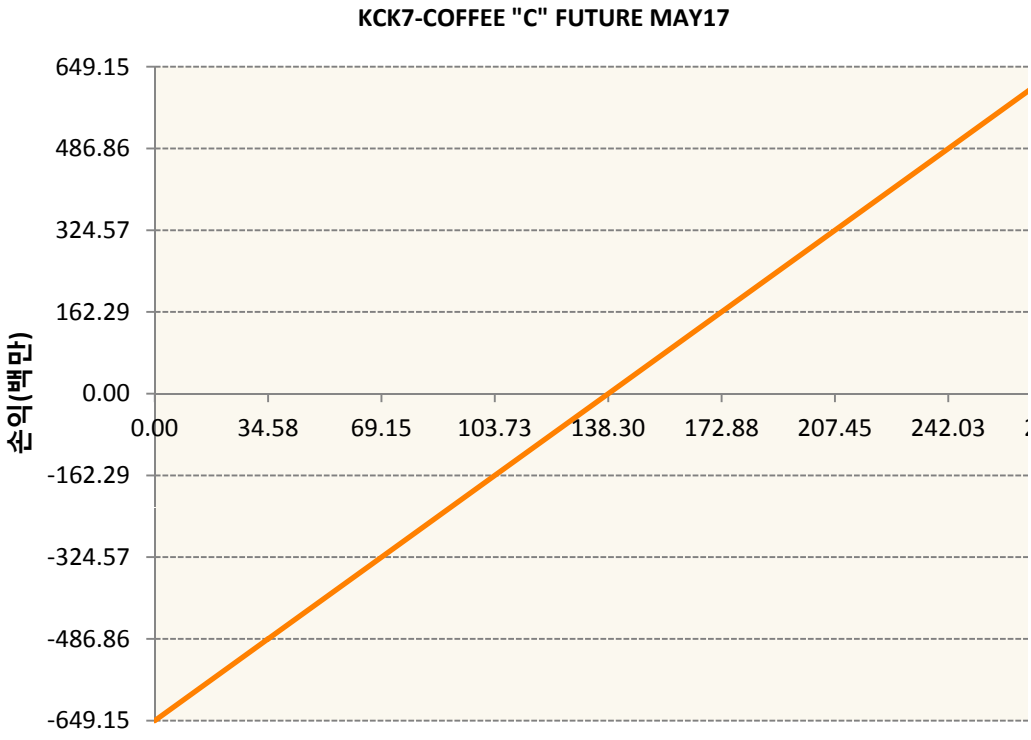
2. 만기시점의 손익구조



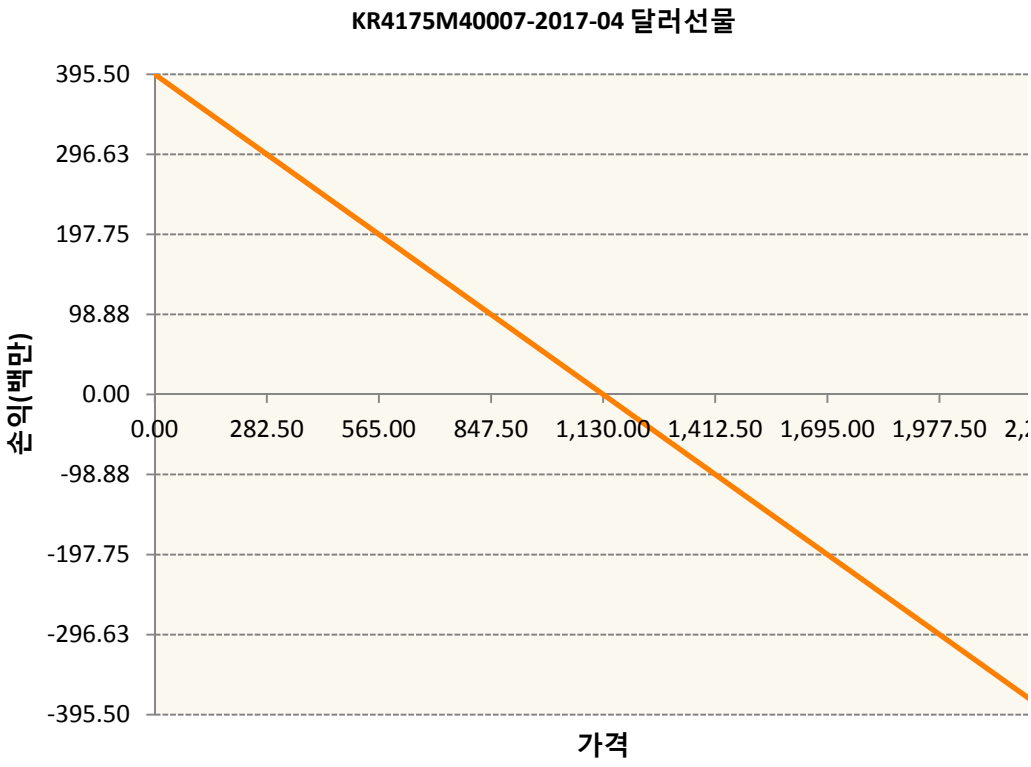


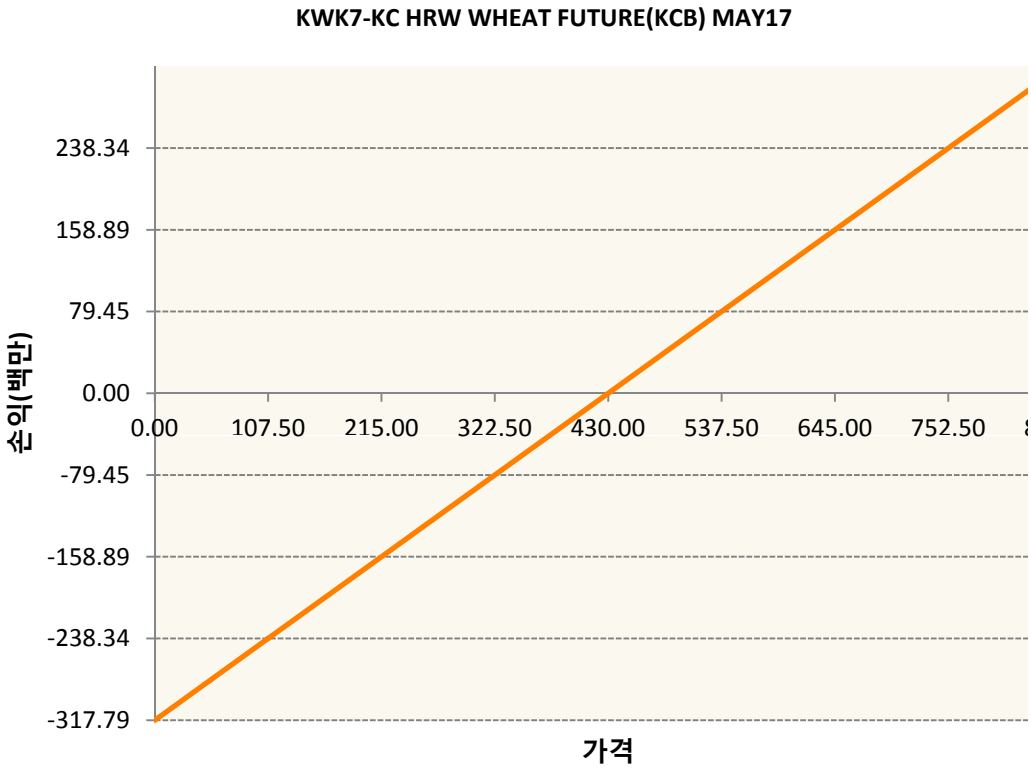

-1,206.24
-1,809.35
-2,412.47
가격

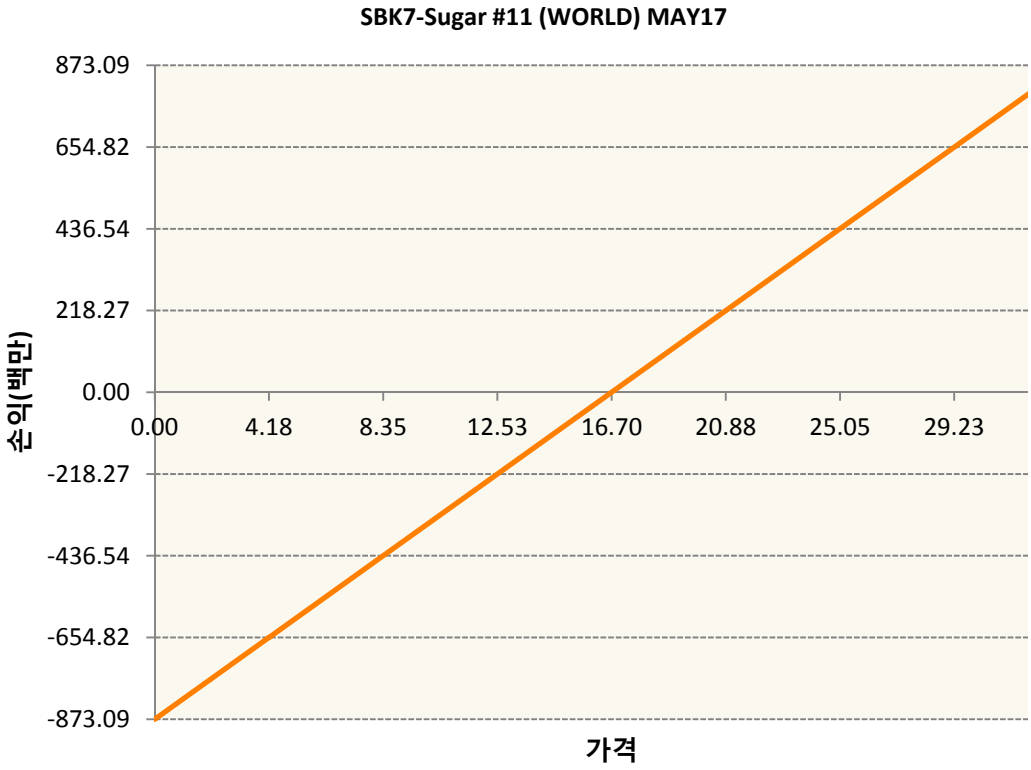

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
317.98
211.99
105.99
0.00
-105.99
-211.99
-317.98
-423.97
0.00
18.68
37.37
56.05
74.73
93.41
112.10
130.78
순익(백만)
가격

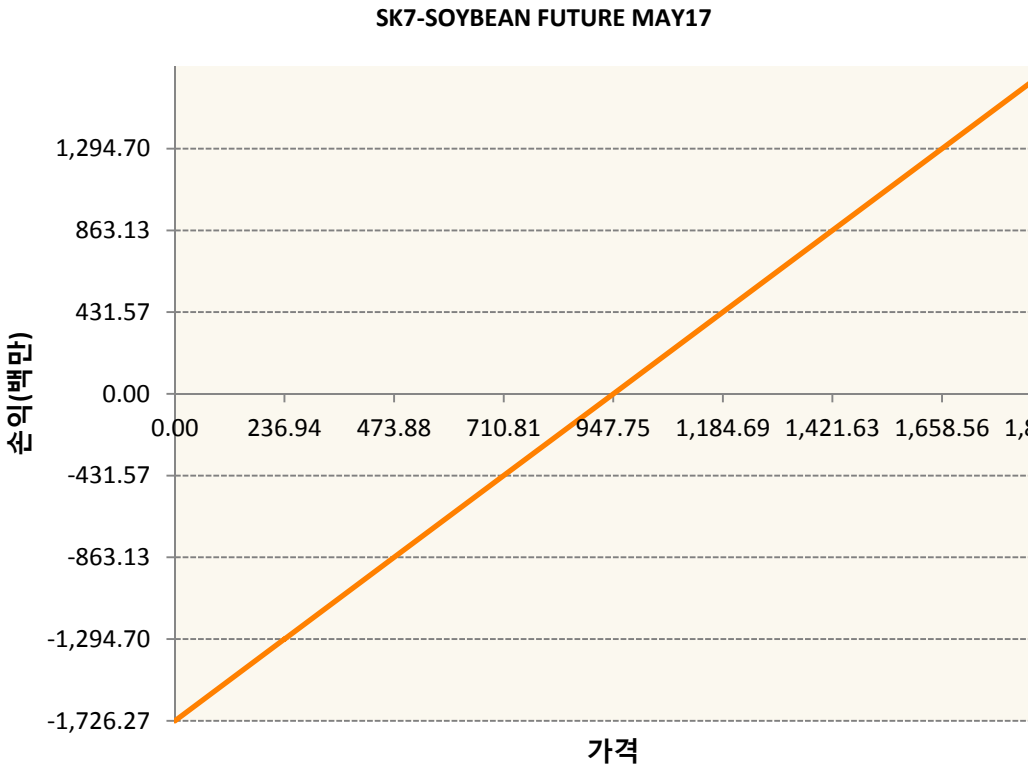

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
649.15
486.86
324.57
162.29
0.00
-162.29
-324.57
-486.86
-649.15
0.00
34.58
69.15
103.73
138.30
172.88
207.45
242.03
순익(백만)

가격

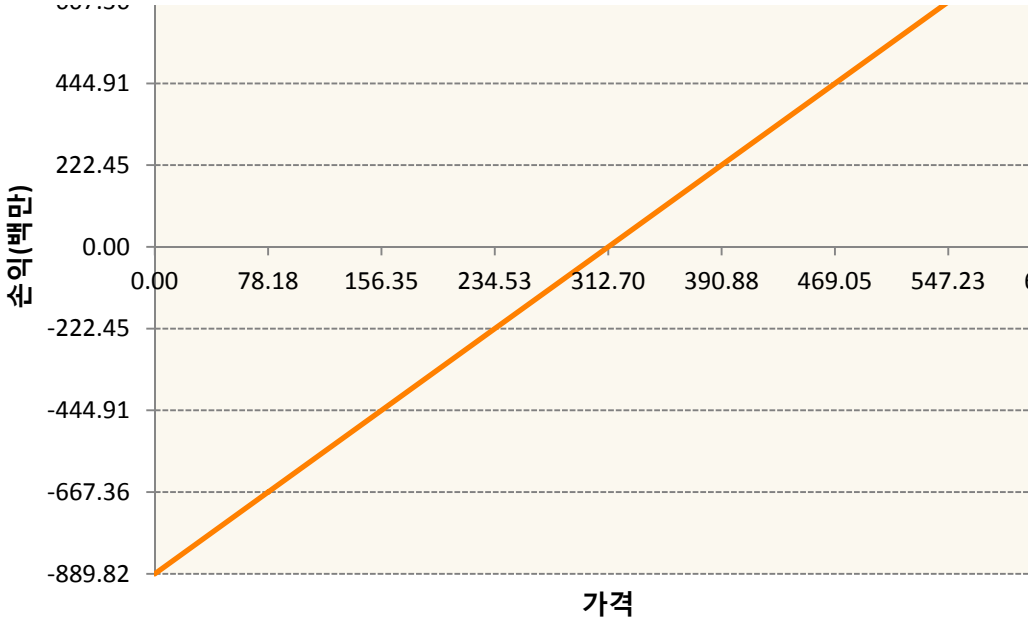

KR4175M40007-2017-04 달러선물
395.50
296.63
197.75
98.88
0.00
-98.88
-197.75
-296.63
-395.50
0.00
282.50
565.00
847.50
1,130.00
1,412.50
1,695.00
1,977.50
순이익(만)
가격

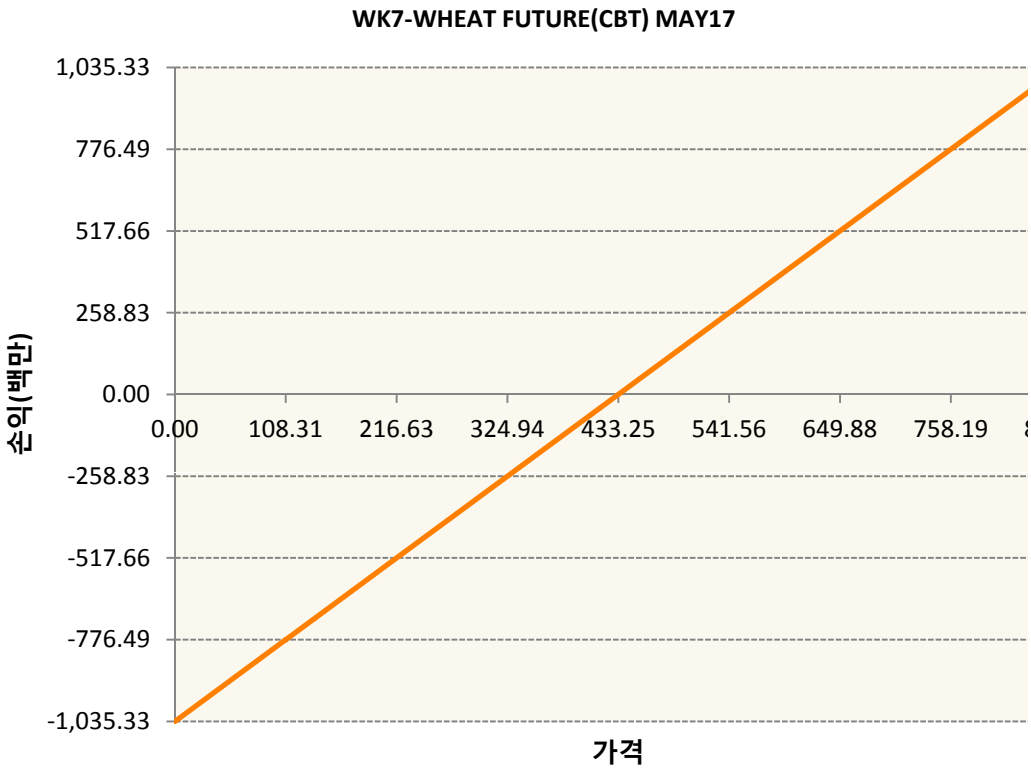

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
238.34
158.89
79.45
0.00
-79.45
-158.89
-238.34
-317.79
0.00
107.50
215.00
322.50
430.00
537.50
645.00
752.50
순이익(만)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
873.09
654.82
436.54
218.27
0.00
-218.27
-436.54
-654.82
-873.09
0.00
4.18
8.35
12.53
16.70
20.88
25.05
29.23
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,294.70
863.13
431.57
0.00
-431.57
-863.13
-1,294.70
-1,726.27
0.00
236.94
473.88
710.81
947.75
1,184.69
1,421.63
1,658.56
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
889.82
667.36





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	61
CK7	CORN FUTURE MAY17	193
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	70
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	138
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	71
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	83

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

828