공시일	2017-04-17
기준일	2017-04-14

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	2017-04-17
기준일	2017-04-14

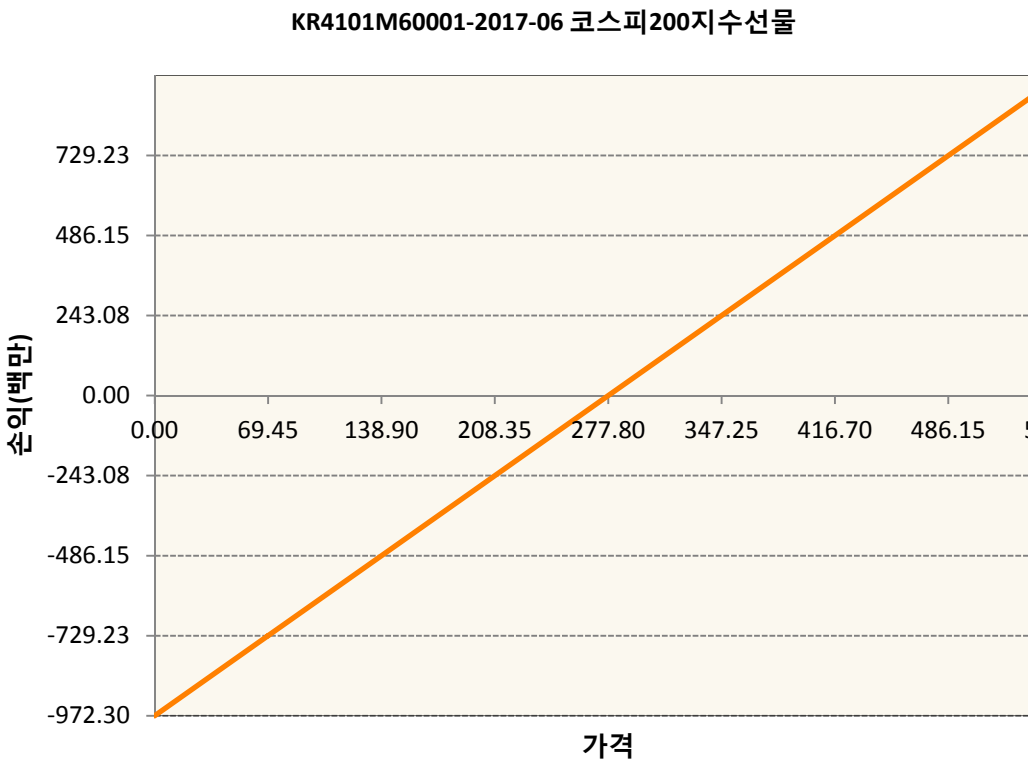
스마트인덱스모

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)

49

공시일	2017-04-17
기준일	2017-04-14

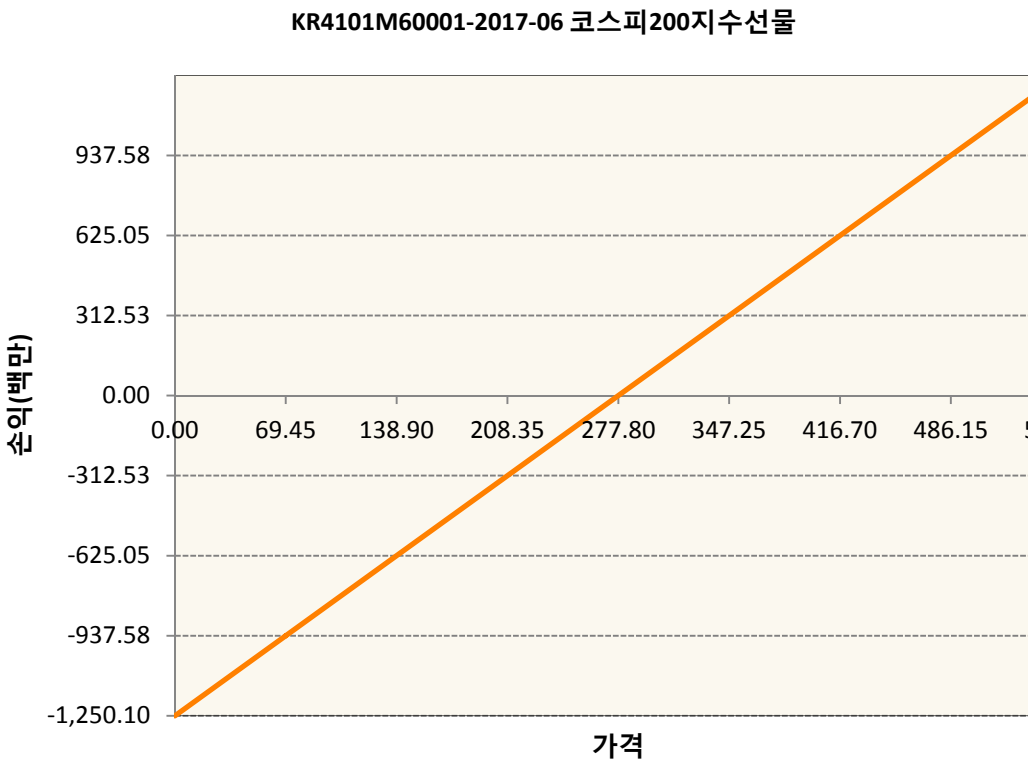
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	2017-04-17
기준일	2017-04-14

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	949

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

546

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-04-17
기준일	2017-04-14

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	397

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

414

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-04-17
기준일	2017-04-14

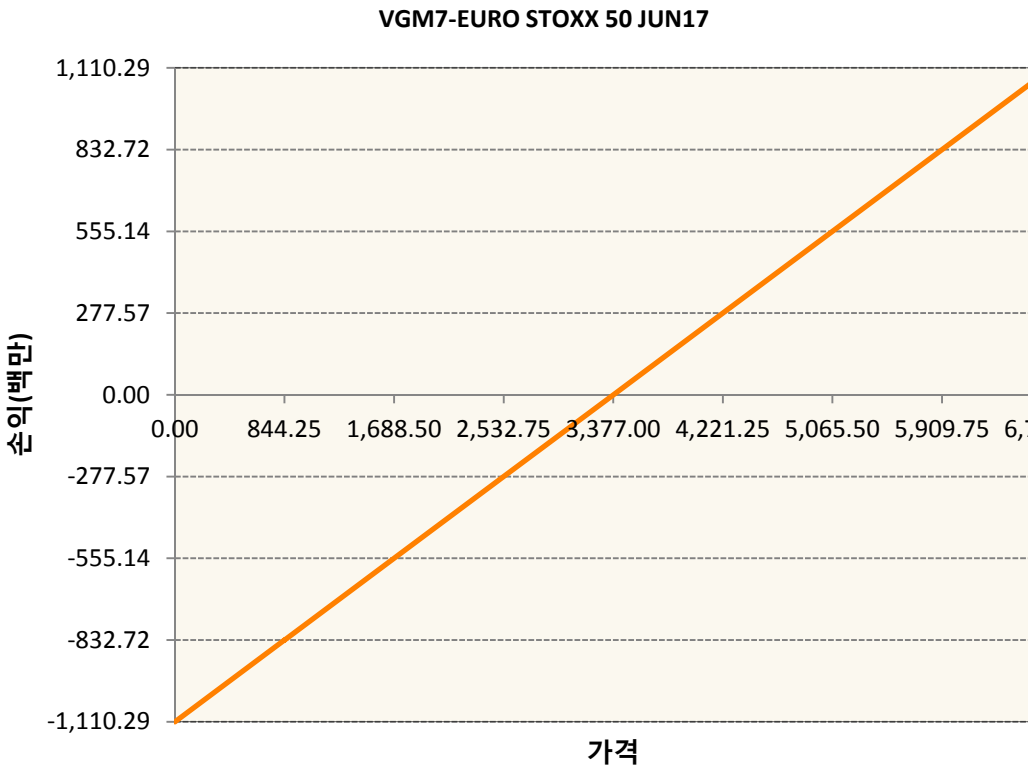
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,110	0	1,110	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM7	EURO STOXX 50 JUN17	89

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

(단위:백만원)

89

공시일	2017-04-17
기준일	2017-04-14

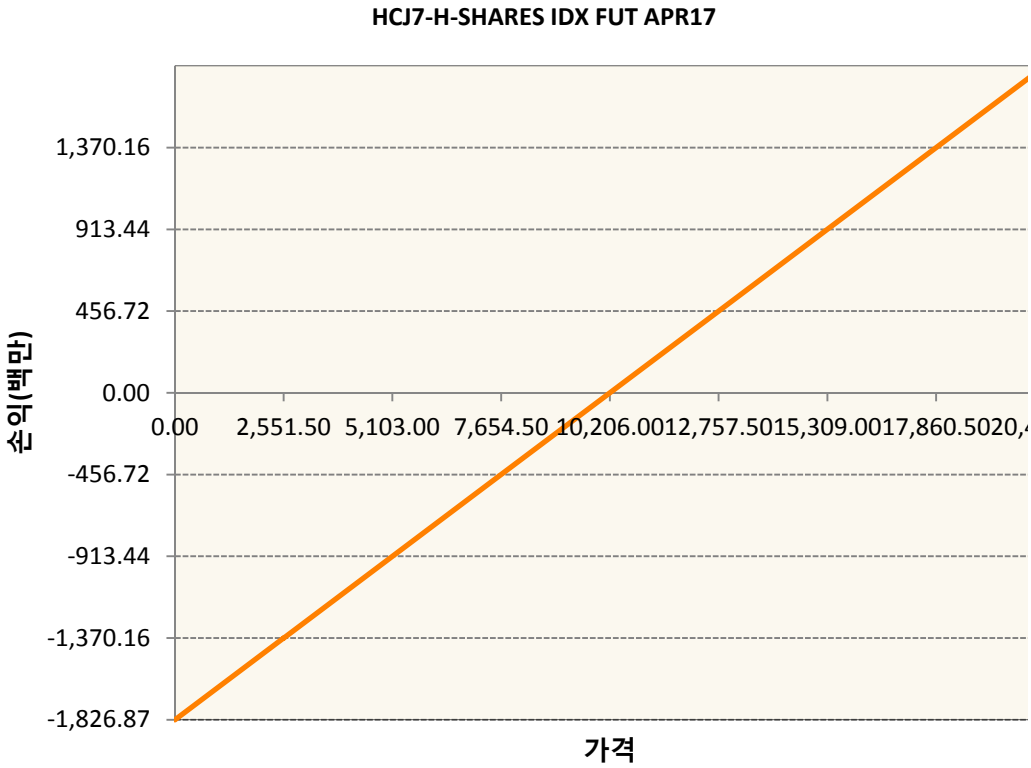
차이나인덱스모(주식-파생형)

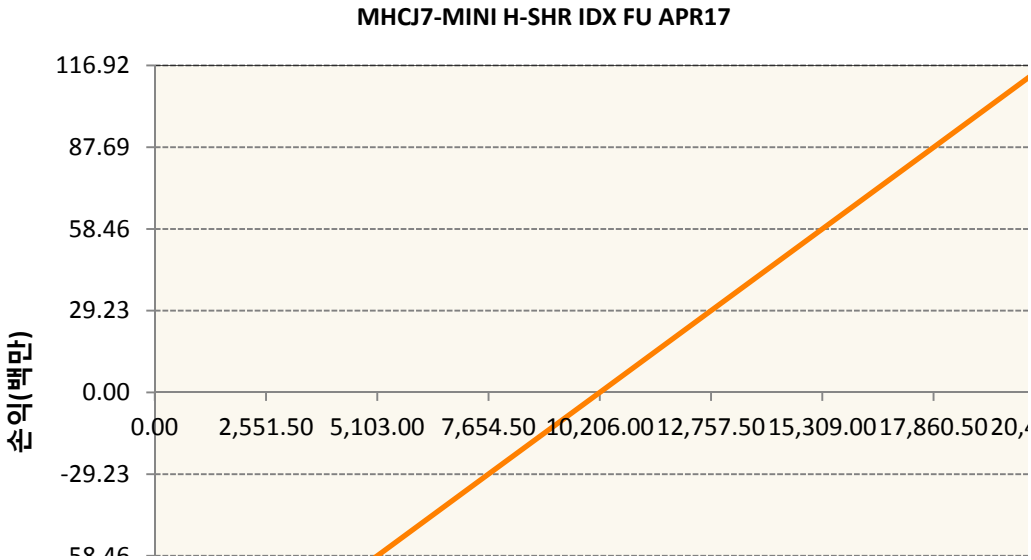
1. 계약금액

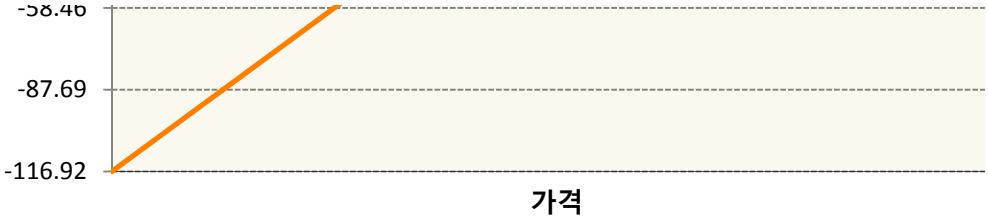
(단위:백만원)

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	2017-04-17
기준일	2017-04-14

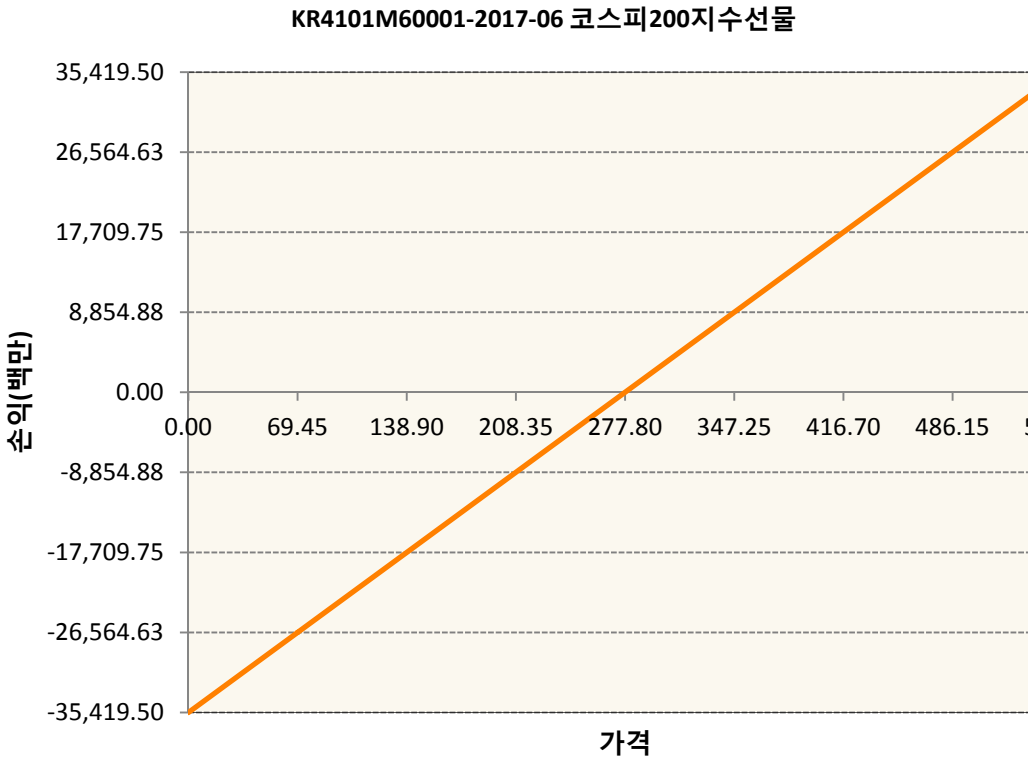
커버드콜모(주식혼합-파생형)

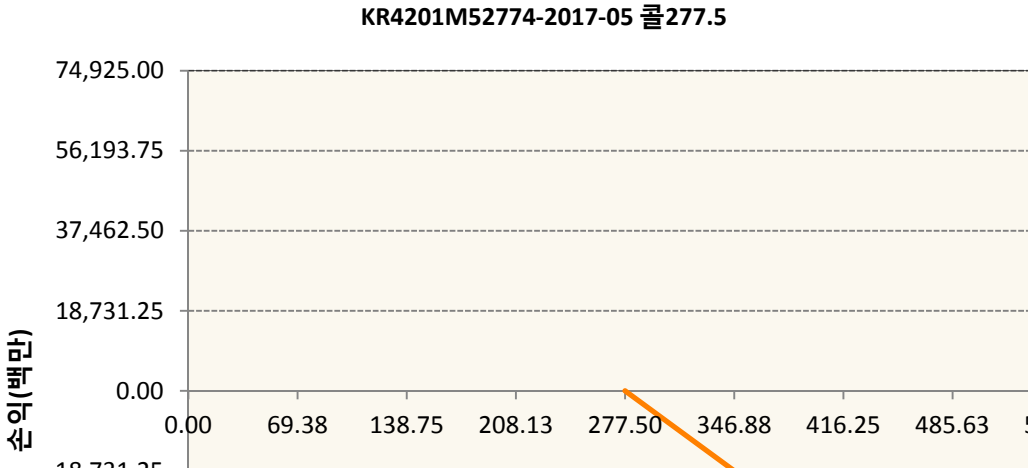
1. 계약금액

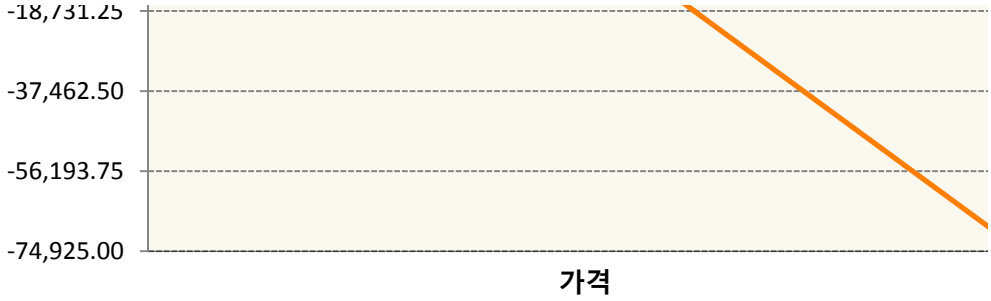
(단위:백만원)

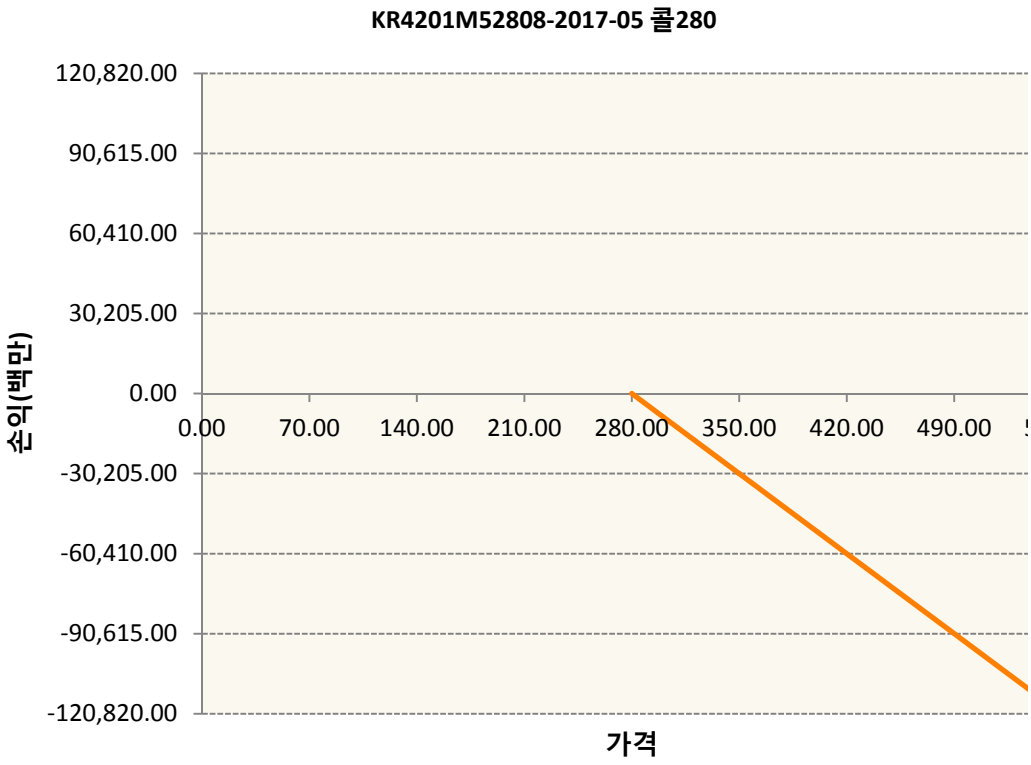
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	10,424	0	10,424	장내
신규	유가증권	옵션	0	121,865	-121,865	장내
누계	유가증권	선물	35,420	0	35,420	장내
누계	유가증권	옵션	0	251,245	-251,245	장내

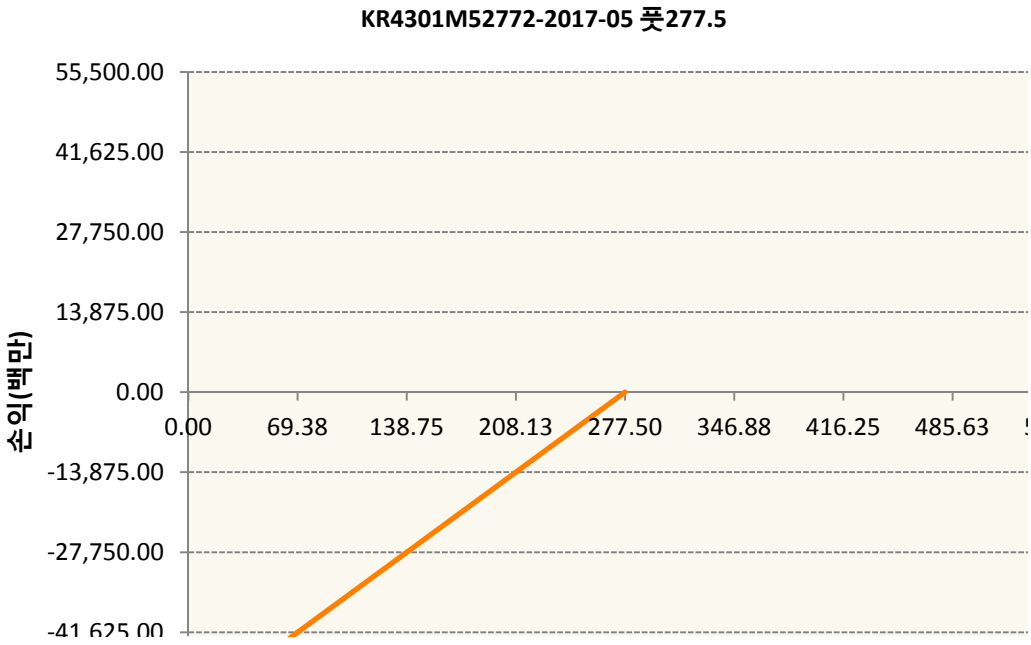
2. 만기시점의 손익구조

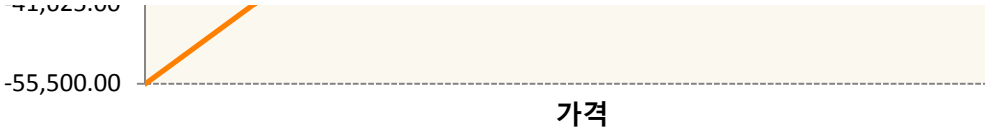





-18,731.25
-37,462.50
-56,193.75
-74,925.00
가격


KR4201M52808-2017-05 콜280
120,820.00
90,615.00
60,410.00
30,205.00
0.00
-30,205.00
-60,410.00
-90,615.00
-120,820.00
0.00
70.00
140.00
210.00
280.00
350.00
420.00
490.00
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							2,829
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,829	-2,829	-2,829	-2,829	-2,829	-2,829	-2,829
-5.33%	-1,886	-1,886	-1,886	-1,886	-1,886	-1,886	-1,886
-2.67%	-943	-943	-943	-943	-943	-943	-943
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	943	943	943	943	943	943	943
5.33%	1,886	1,886	1,886	1,886	1,886	1,886	1,886
8.00%	2,829	2,829	2,829	2,829	2,829	2,829	2,829
KR4201M52 2017-05 콜277.5							4,868
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,152	1,149	1,144	1,136	1,124	1,108	1,087
-5.33%	1,127	1,107	1,081	1,048	1,009	964	915
-2.67%	947	881	810	736	658	578	496
0%	296	198	99	0	-99	-198	-296
2.67%	-1,022	-1,094	-1,171	-1,251	-1,334	-1,419	-1,506
5.33%	-2,810	-2,837	-2,871	-2,912	-2,960	-3,012	-3,070
8.00%	-4,767	-4,773	-4,782	-4,796	-4,815	-4,839	-4,868
KR4201M52 2017-05 콜280							7,260
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,370	1,368	1,363	1,356	1,344	1,326	1,303
-5.33%	1,352	1,333	1,306	1,269	1,224	1,170	1,107
-2.67%	1,187	1,108	1,019	922	816	705	589
0%	457	306	153	0	-154	-309	-464
2.67%	-1,294	-1,434	-1,577	-1,724	-1,872	-2,022	-2,174
5.33%	-3,951	-4,018	-4,096	-4,184	-4,281	-4,385	-4,496
8.00%	-7,023	-7,040	-7,066	-7,100	-7,145	-7,198	-7,260
KR4301M52 2017-05 풋277.5							3,626
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,578	-3,580	-3,584	-3,590	-3,599	-3,611	-3,626
-5.33%	-2,119	-2,134	-2,154	-2,178	-2,207	-2,240	-2,276
-2.67%	-776	-824	-877	-932	-989	-1,049	-1,110

0%	220	146	73	0	-73	-146	-220
2.67%	720	667	610	551	489	426	362
5.33%	873	853	827	797	762	723	680
8.00%	900	896	889	879	865	847	825

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

18,568

공시일	2017-04-17
기준일	2017-04-14

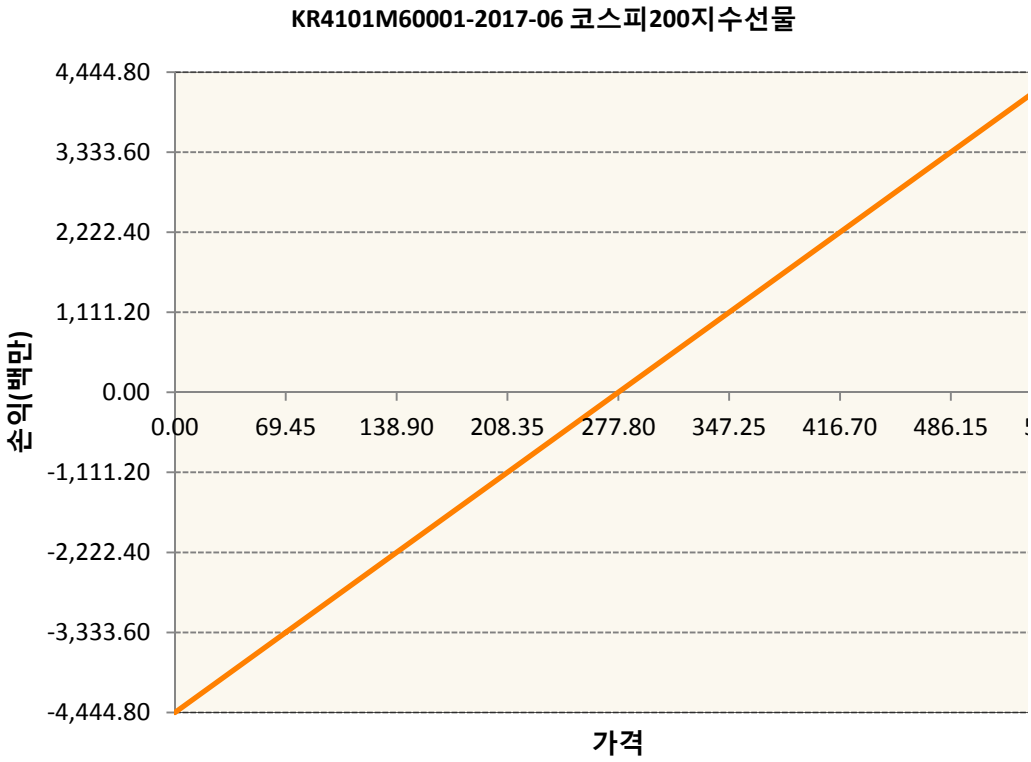
커버드콜목표전환형증권투자신탁

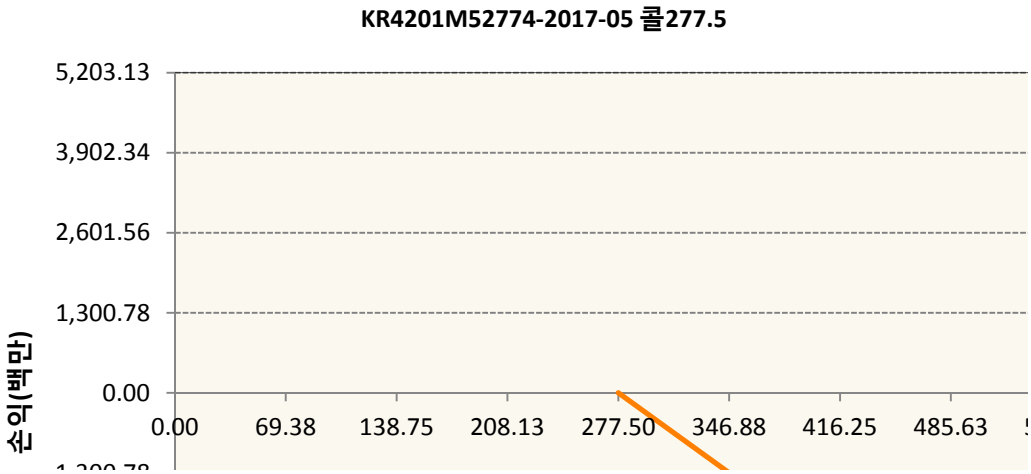
1. 계약금액

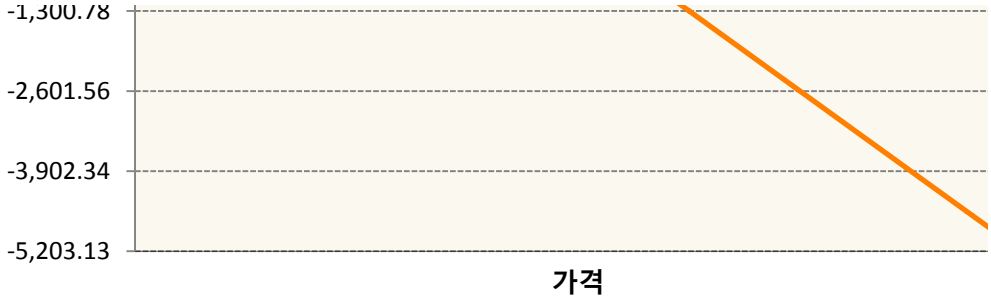
(단위:백만원)

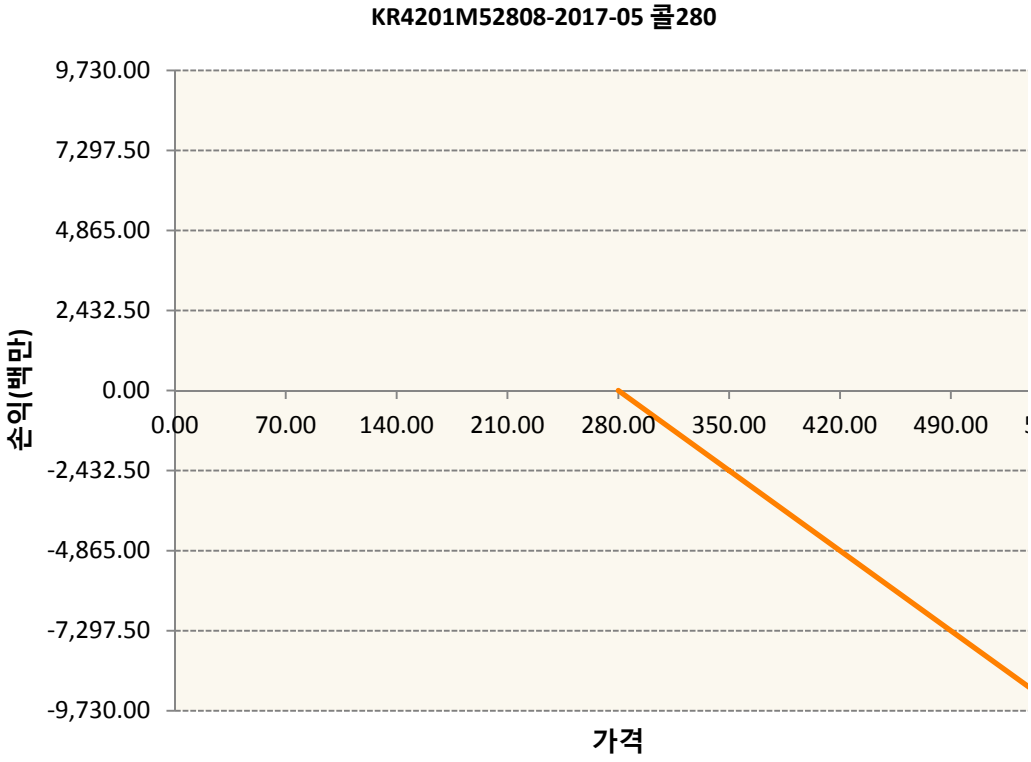
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	4,722	9,814	-5,092	장내
누계	유가증권	선물	4,445	0	4,445	장내
누계	유가증권	옵션	0	14,933	-14,933	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							355
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-355	-355	-355	-355	-355	-355	-355
-5.33%	-237	-237	-237	-237	-237	-237	-237
-2.67%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	118	118	118	118	118	118	118
5.33%	237	237	237	237	237	237	237
8.00%	355	355	355	355	355	355	355
KR4201M52 2017-05 콜277.5							338
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	80	80	79	79	78	77	76
-5.33%	78	77	75	73	70	67	64
-2.67%	66	61	56	51	46	40	34
0%	21	14	7	0	-7	-14	-21
2.67%	-71	-76	-81	-87	-93	-99	-105
5.33%	-195	-197	-199	-202	-206	-209	-213
8.00%	-331	-331	-332	-333	-334	-336	-338
	KR4201M52(	2017-05 콜280					585

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	110	110	110	109	108	107	105
-5.33%	109	107	105	102	99	94	89
-2.67%	96	89	82	74	66	57	47
0%	37	25	12	0	-12	-25	-37
2.67%	-104	-115	-127	-139	-151	-163	-175
5.33%	-318	-324	-330	-337	-345	-353	-362
8.00%	-566	-567	-569	-572	-575	-580	-585

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

1,202

공시일	2017-04-17
기준일	2017-04-14

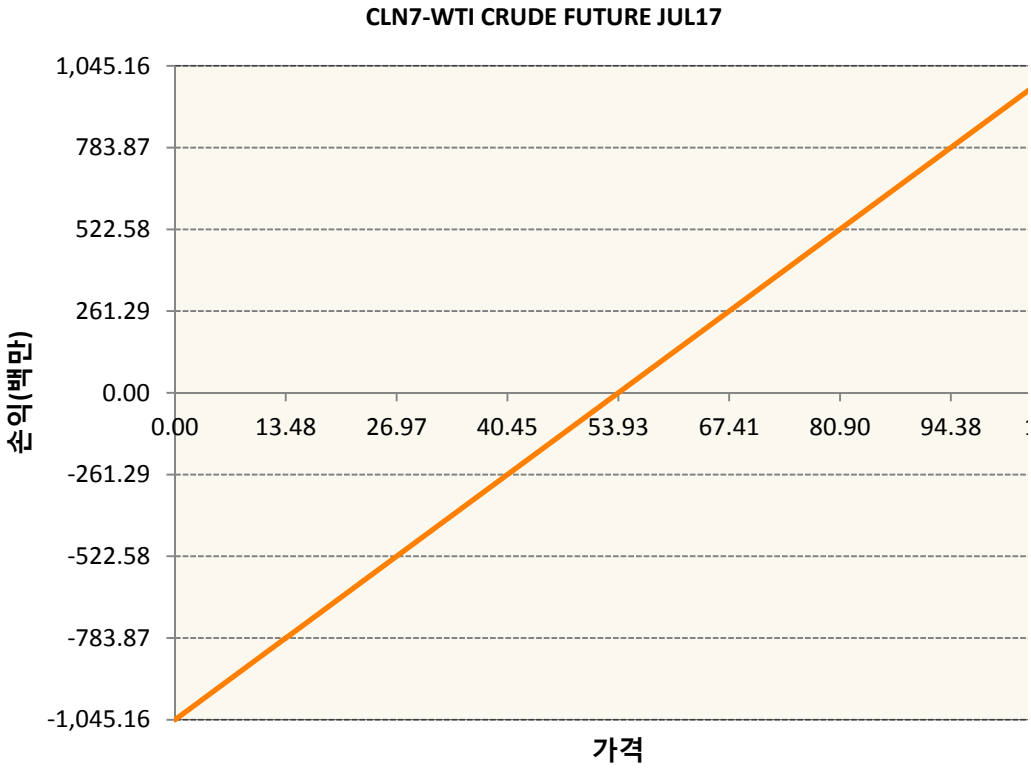
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

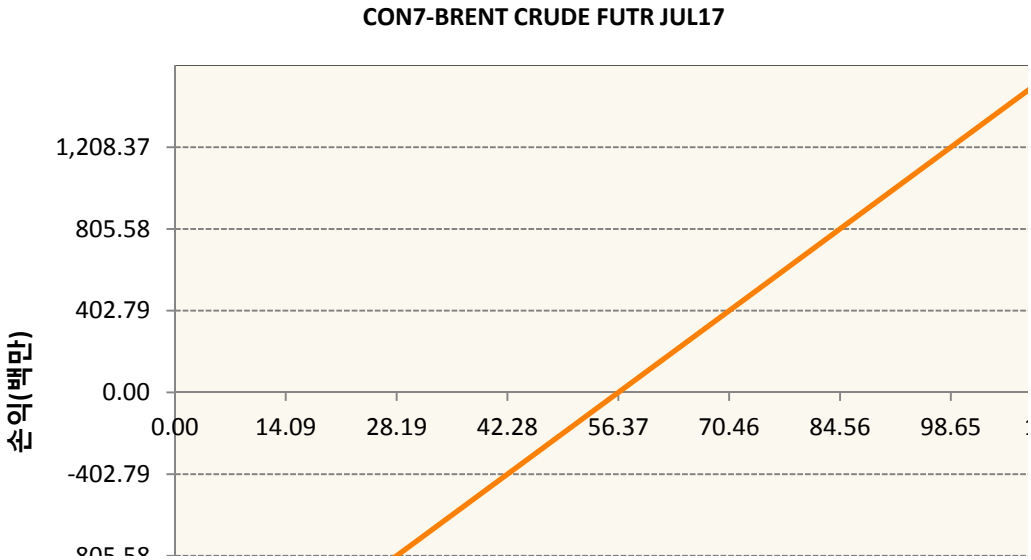
1. 계약금액

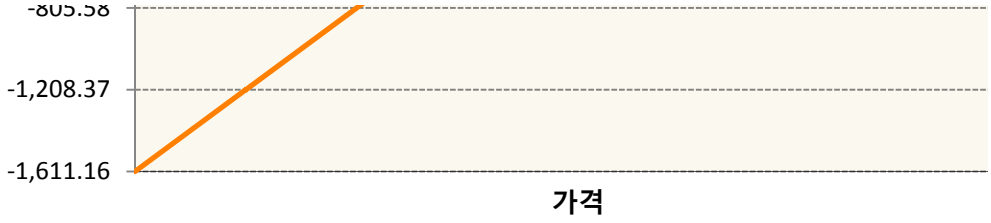
(단위:백만원)

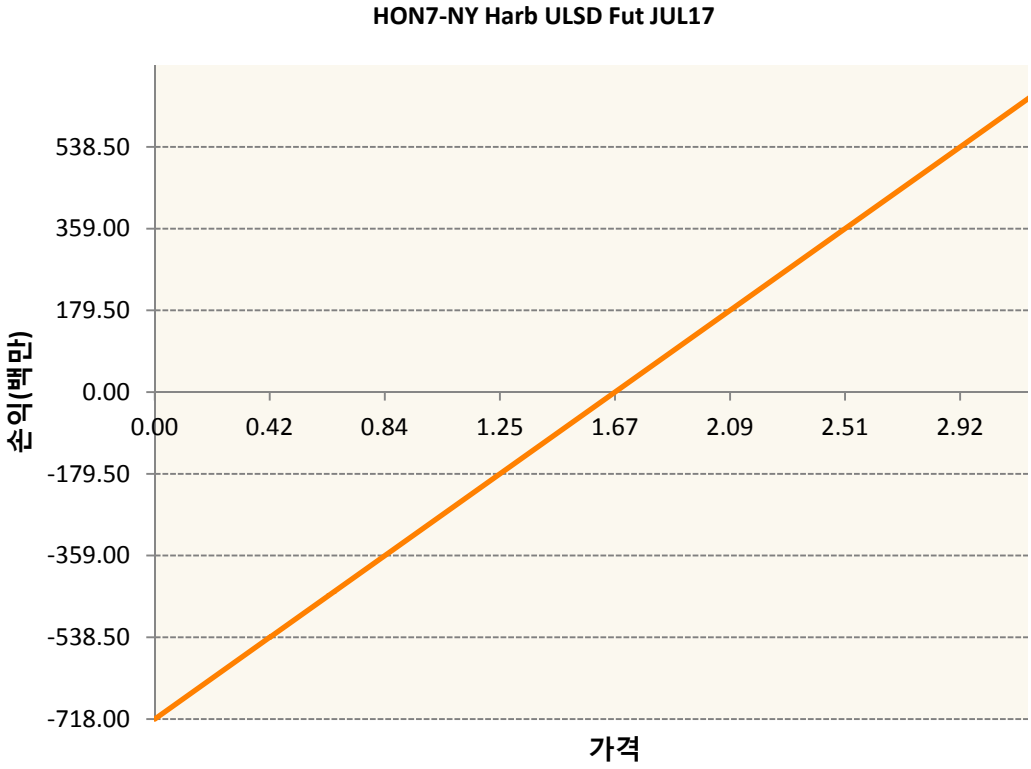
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,785	410	5,375	

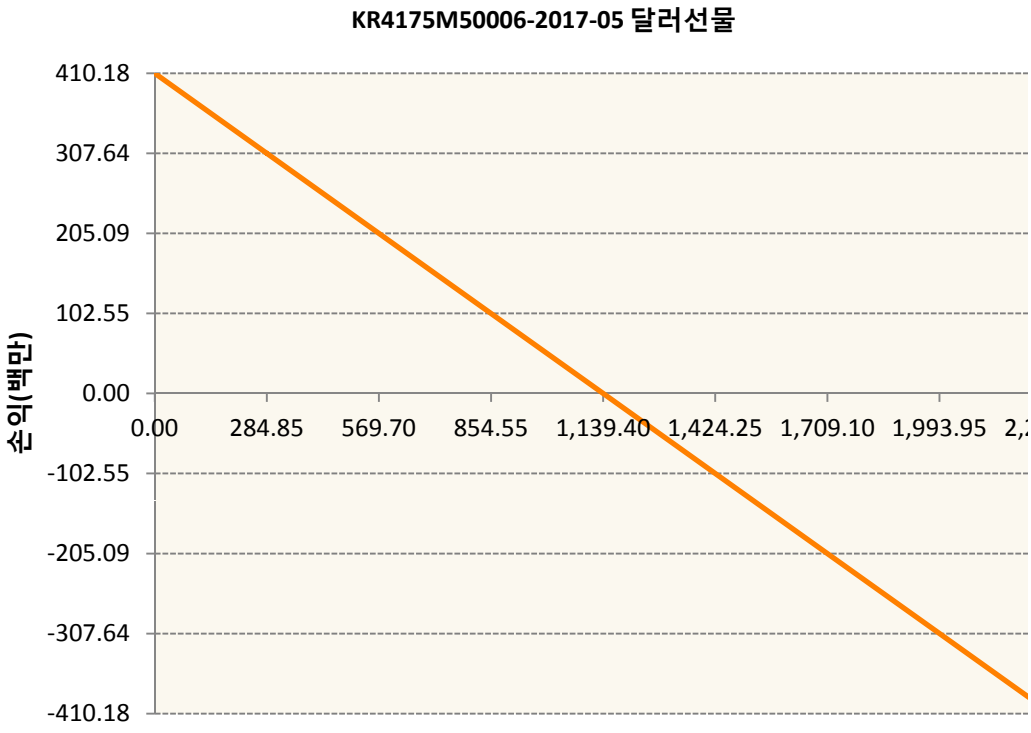
2. 만기시점의 손익구조



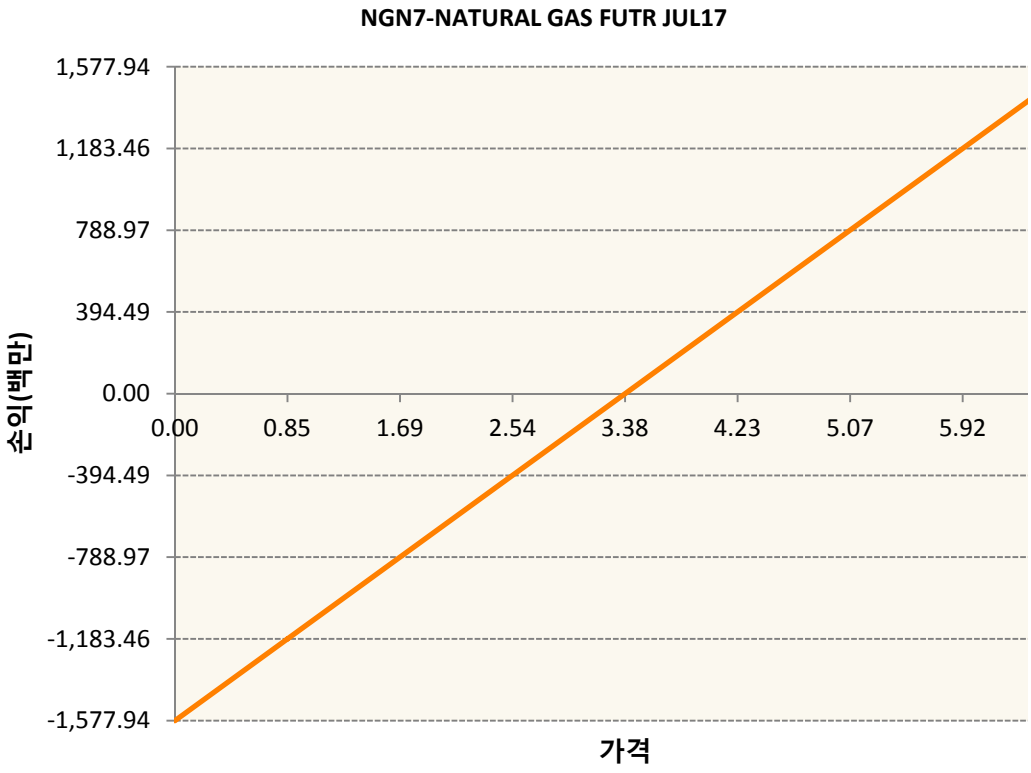


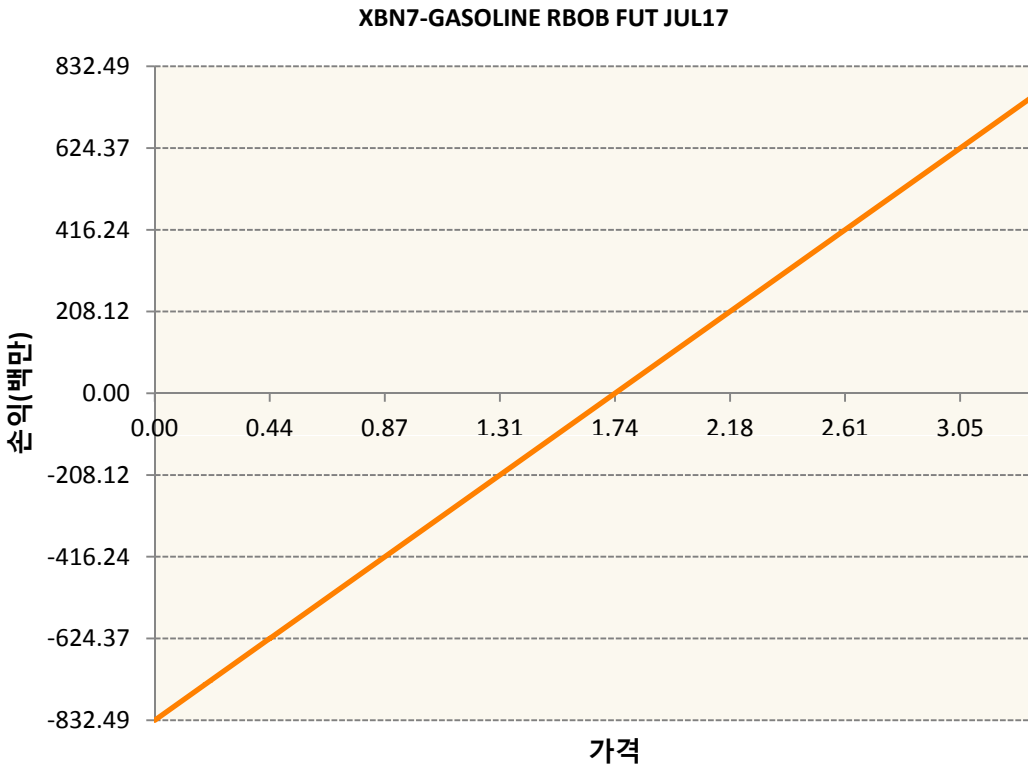

-1,208.37
-1,611.16
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
538.50
359.00
179.50
0.00
-179.50
-359.00
-538.50
-718.00
0.00
0.42
0.84
1.25
1.67
2.09
2.51
2.92
순이익(백만)
가격


KR4175M50006-2017-05 달러선물
410.18
307.64
205.09
102.55
0.00
-102.55
-205.09
-307.64
-410.18
0.00
284.85
569.70
854.55
1,139.40
1,424.25
1,709.10
1,993.95
순이익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,577.94
1,183.46
788.97
394.49
0.00
-394.49
-788.97
-1,183.46
-1,577.94
0.00
0.85
1.69
2.54
3.38
4.23
5.07
5.92
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
832.49
624.37
416.24
208.12
0.00
-208.12
-416.24
-624.37
-832.49
0.00
0.44
0.87
1.31
1.74
2.18
2.61
3.05
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN7	WTI CRUDE FUTURE JUL17	84
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	129
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	57
KR4175M50(	2017-05 달러선물	33
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	126
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	67

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

1,007

공시일	2017-04-17
기준일	2017-04-14

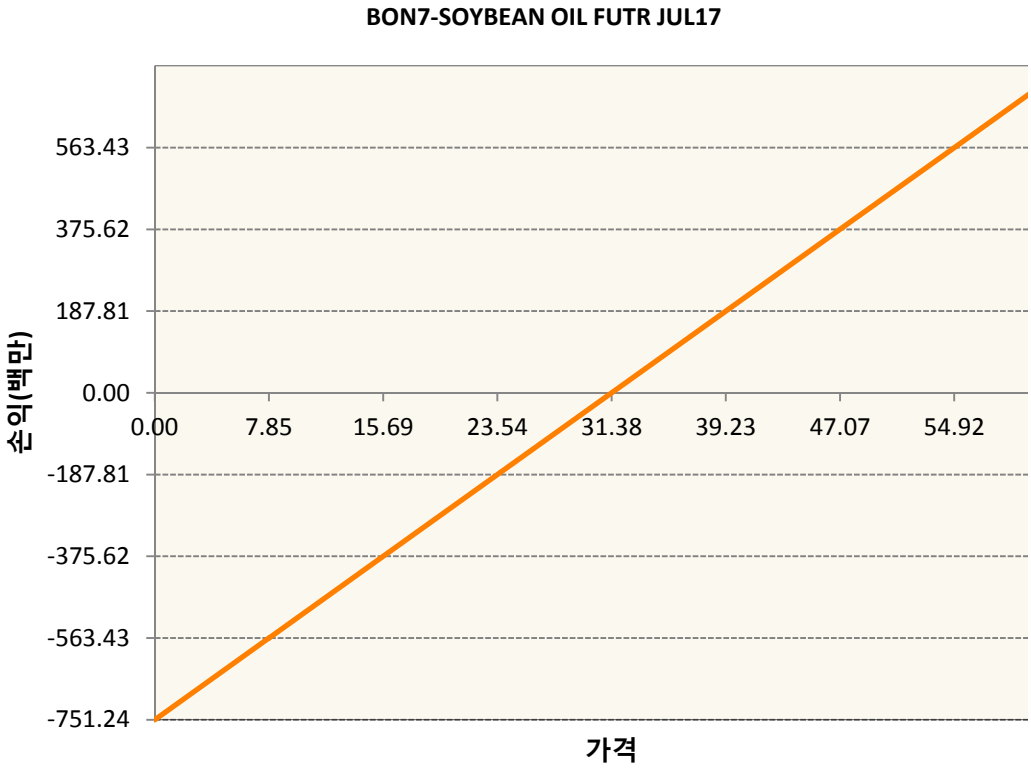
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

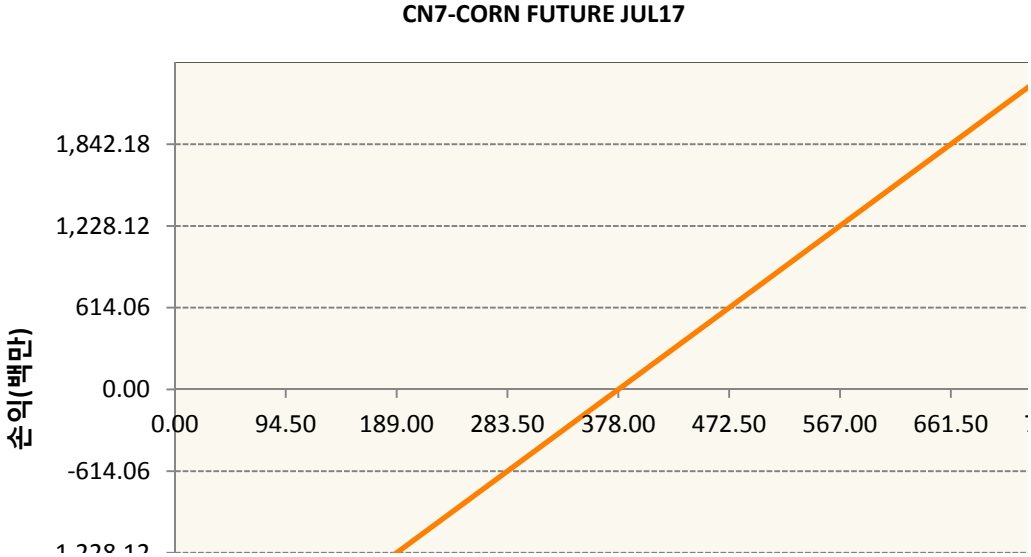
1. 계약금액

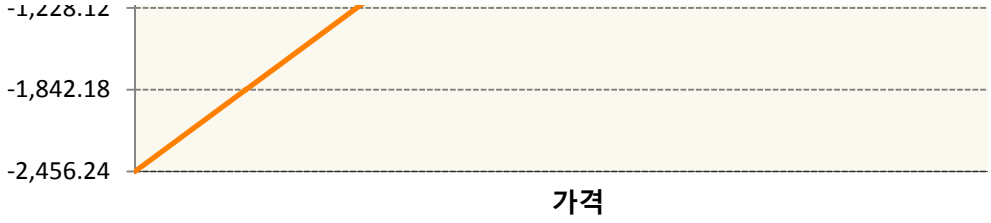
(단위:백만원)

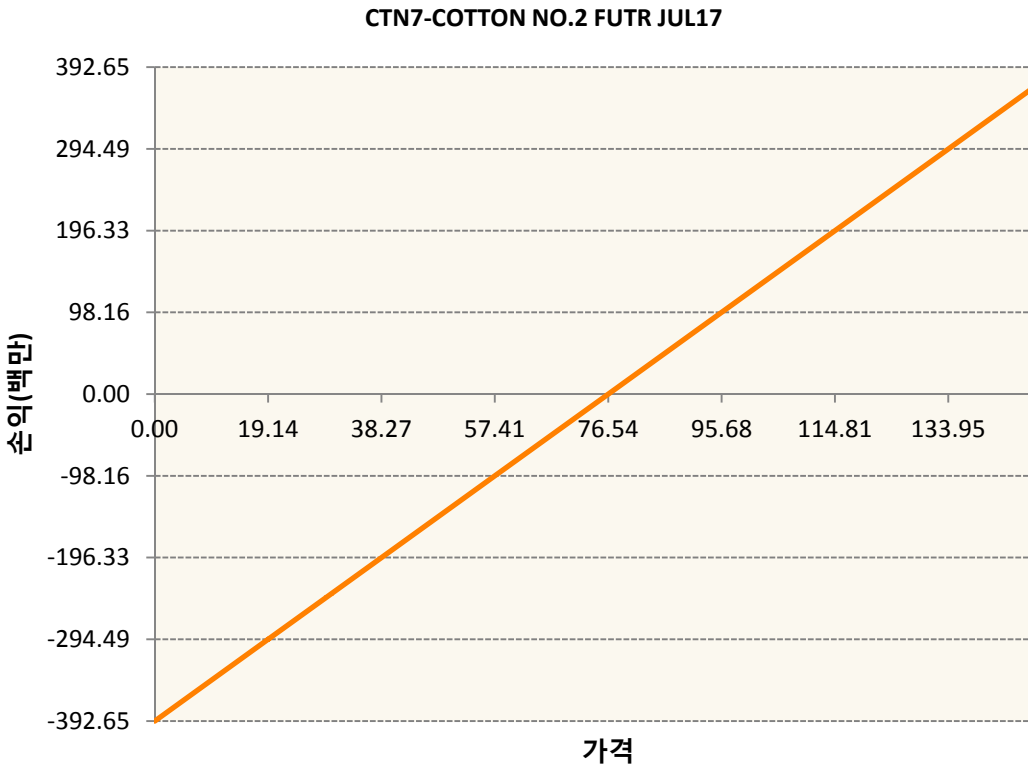
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,034	399	8,635	

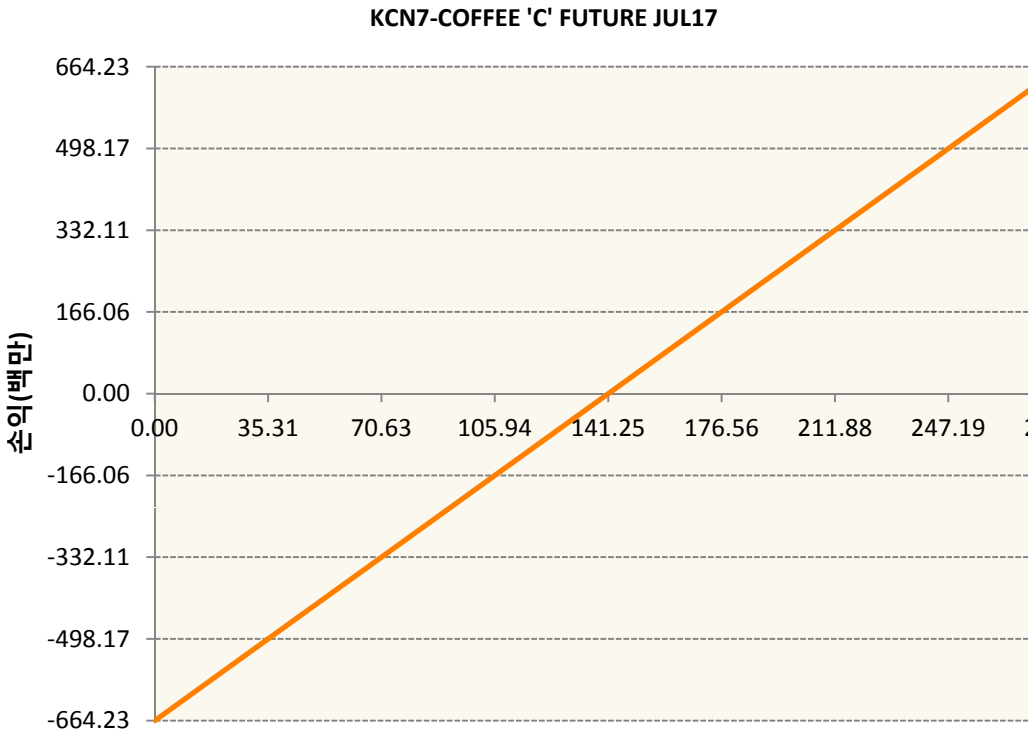
2. 만기시점의 손익구조



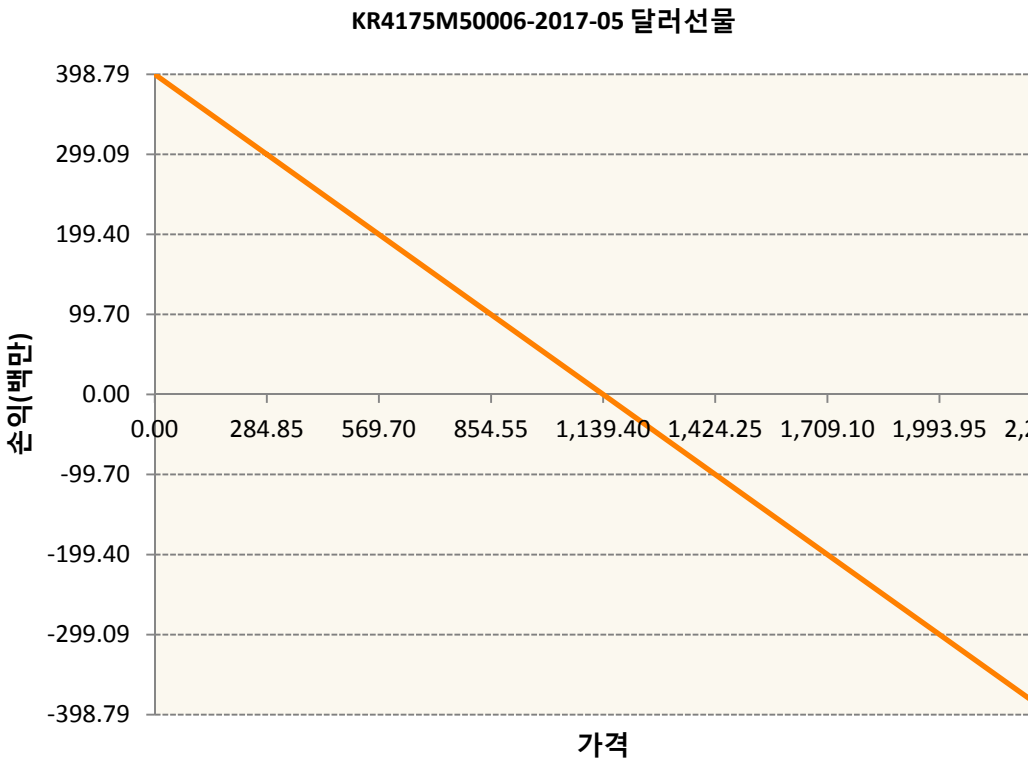


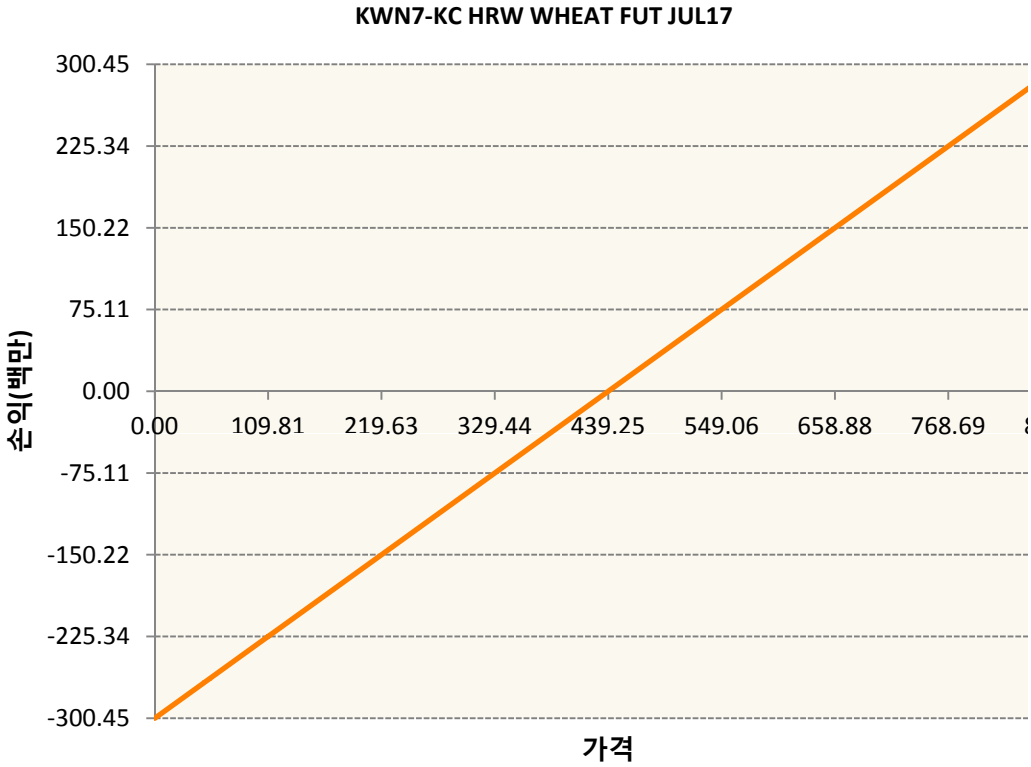

-1,842.18
-2,456.24
가격

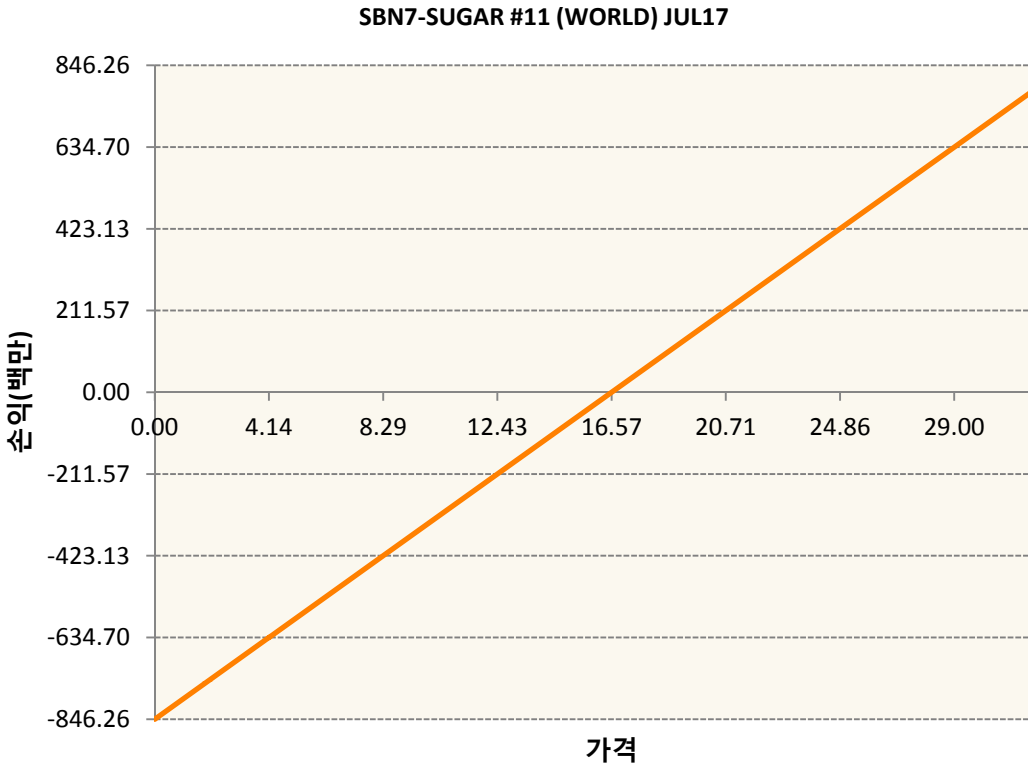

CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
392.65
294.49
196.33
98.16
0.00
-98.16
-196.33
-294.49
-392.65
0.00
19.14
38.27
57.41
76.54
95.68
114.81
133.95
순익(백만)
가격

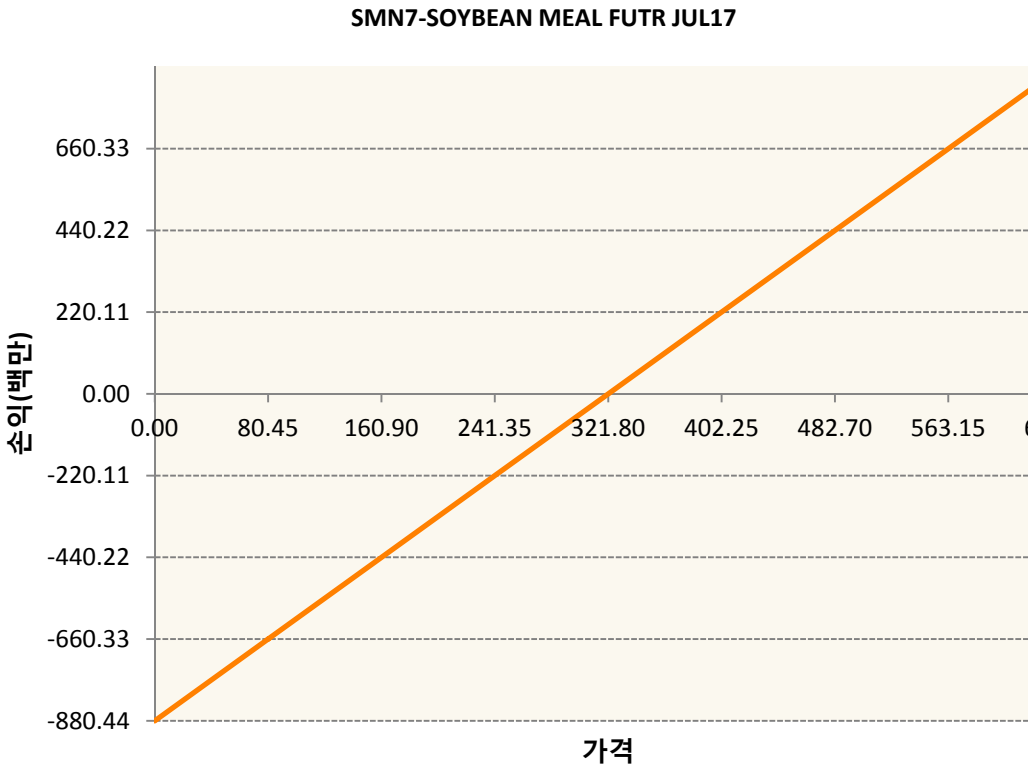

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
664.23
498.17
332.11
166.06
0.00
-166.06
-332.11
-498.17
-664.23
0.00
35.31
70.63
105.94
141.25
176.56
211.88
247.19
순익(백만)

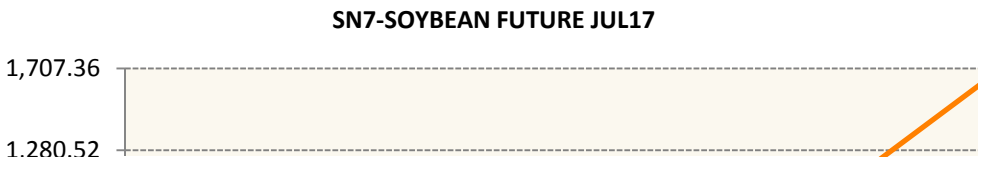
가격

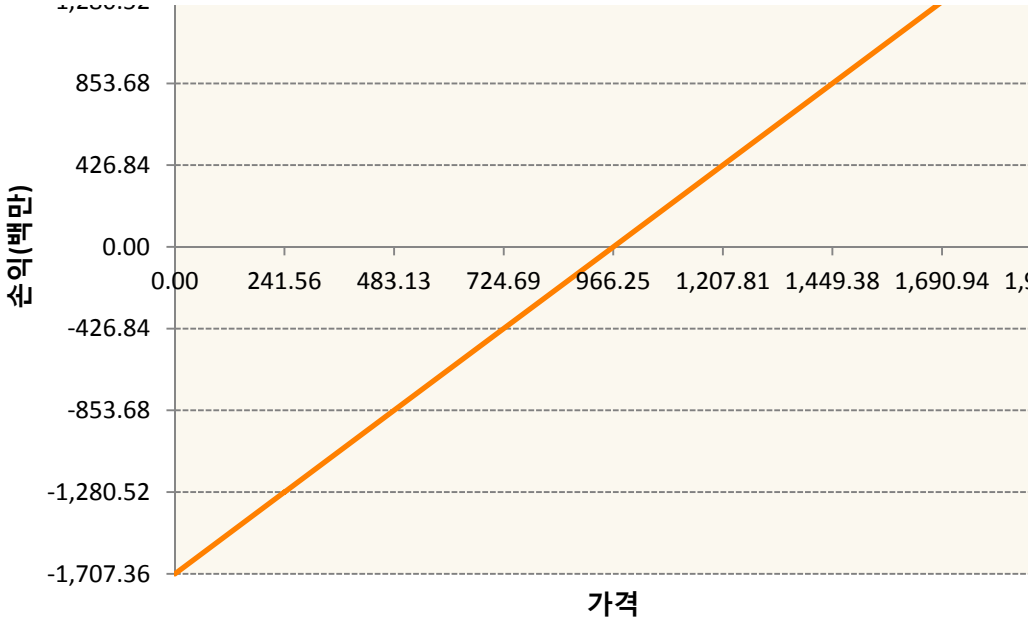

KR4175M50006-2017-05 달러선물
398.79
299.09
199.40
99.70
0.00
-99.70
-199.40
-299.09
-398.79
0.00
284.85
569.70
854.55
1,139.40
1,424.25
1,709.10
1,993.95
손익(백만)
가격

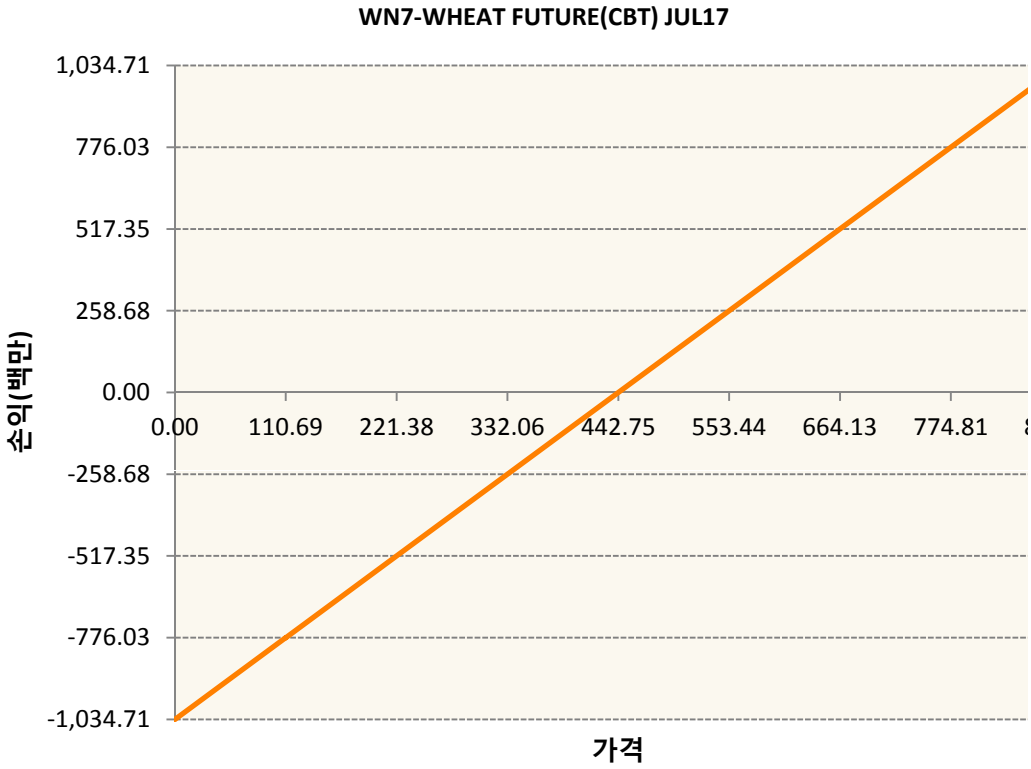

KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17
300.45
225.34
150.22
75.11
0.00
-75.11
-150.22
-225.34
-300.45
0.00
109.81
219.63
329.44
439.25
549.06
658.88
768.69
손익(백만)
가격


SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
846.26
634.70
423.13
211.57
0.00
-211.57
-423.13
-634.70
-846.26
0.00
4.14
8.29
12.43
16.57
20.71
24.86
29.00
손익(백만)
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
660.33
440.22
220.11
0.00
-220.11
-440.22
-660.33
-880.44
0.00
80.45
160.90
241.35
321.80
402.25
482.70
563.15
손익(백만)
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,707.36
1,280.52





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	60
CN7	CORN FUTURE JUL17	196
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	31
KCN7	COFFEE 'C' FUTURE JUL17	53
KR4175M50(	2017-05 달러선물	32

KWN7	KC HRW WHEAT FUT JUL17	24
SBN7	SUGAR #11 (WORLD) JUL17	68
SMN7	SOYBEAN MEAL FUTR JUL17	70
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	137
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	83

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

887