공시일	2017-04-18
기준일	2017-04-17

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	2017-04-18
기준일	2017-04-17

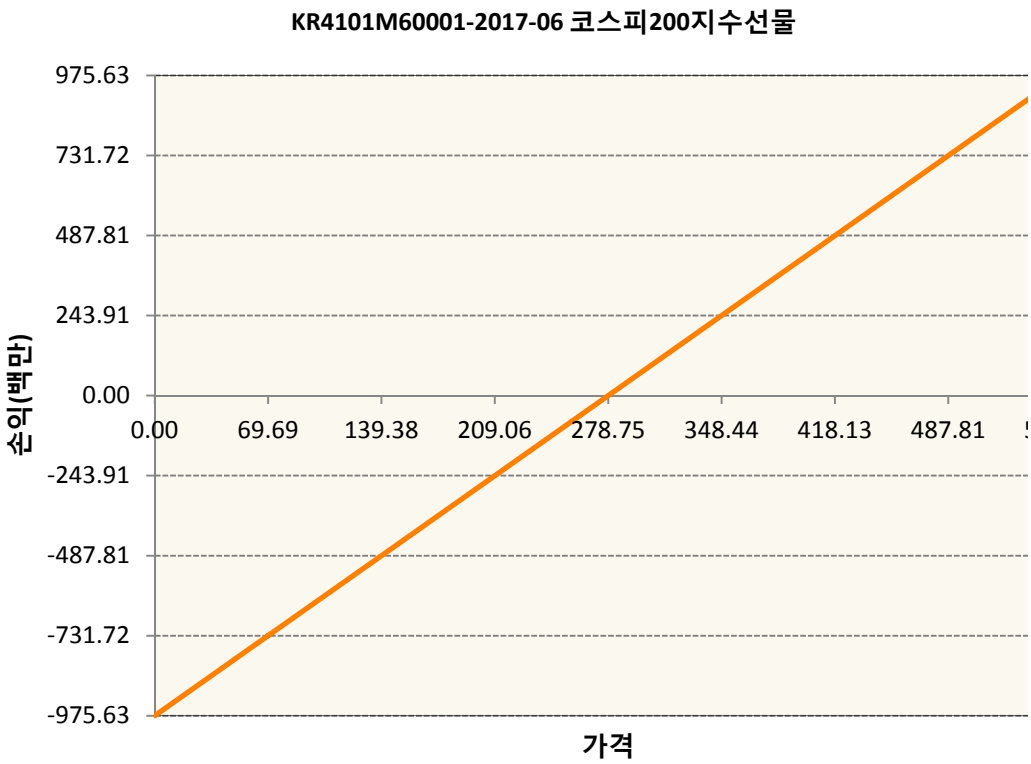
스마트인덱스모

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	976	0	976	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	2017-04-18
기준일	2017-04-17

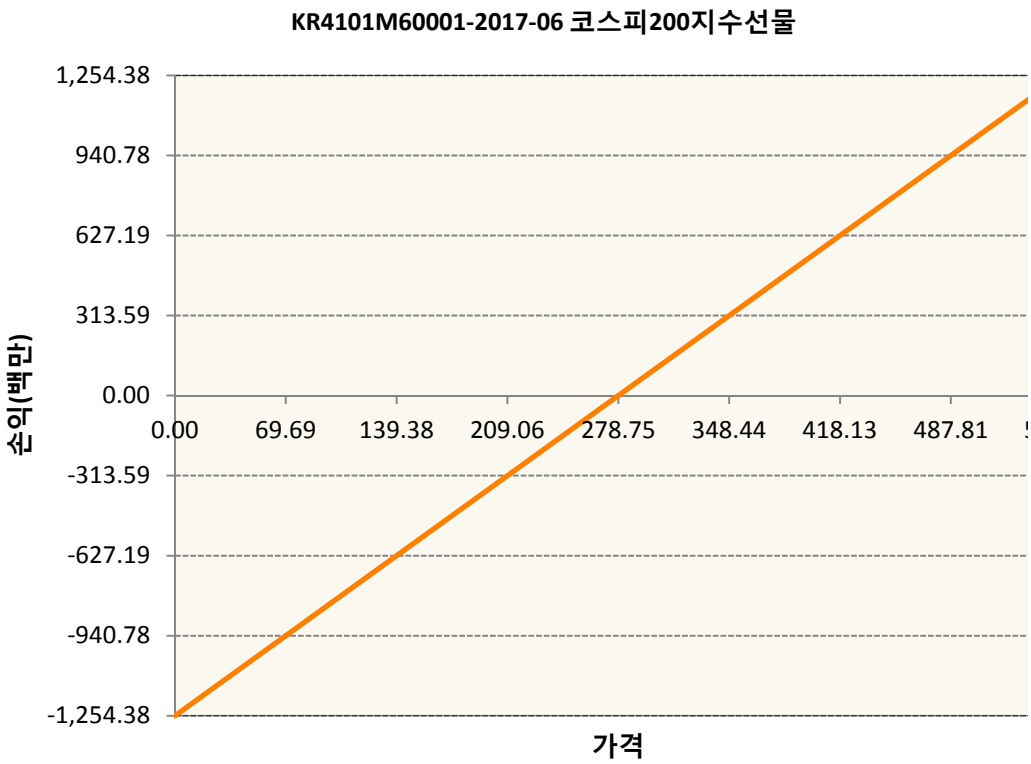
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,254	0	1,254	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	2017-04-18
기준일	2017-04-17

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)

545

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-04-18
기준일	2017-04-17

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	392

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

410

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-04-18
기준일	2017-04-17

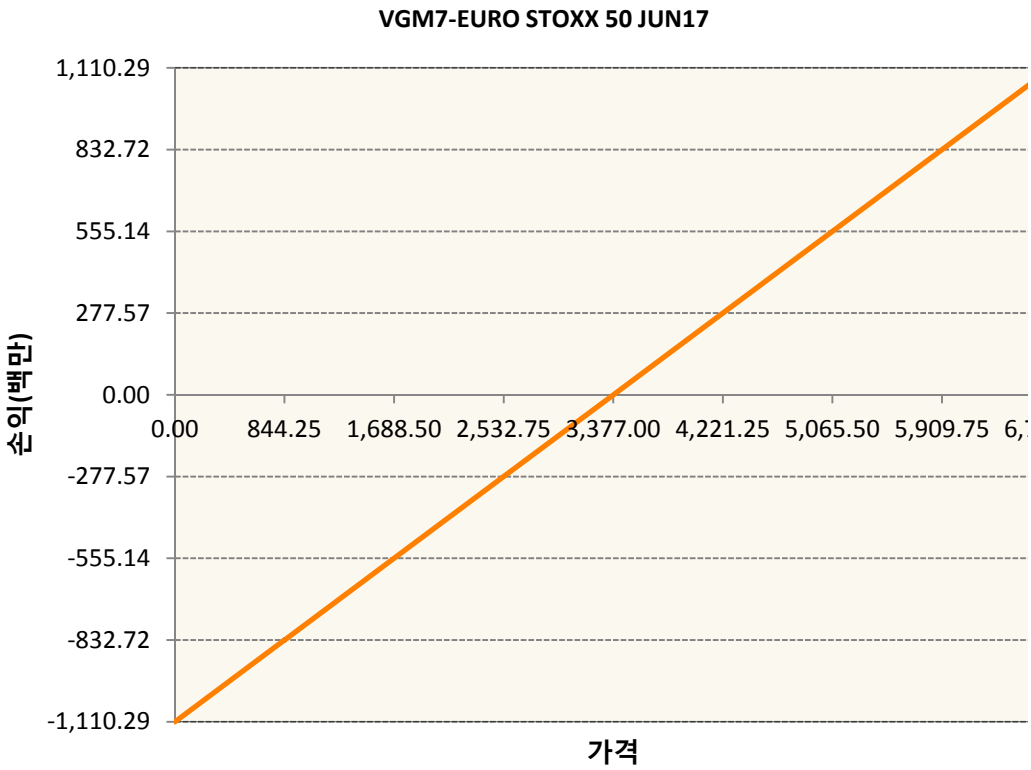
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2017-04-18
기준일	2017-04-17

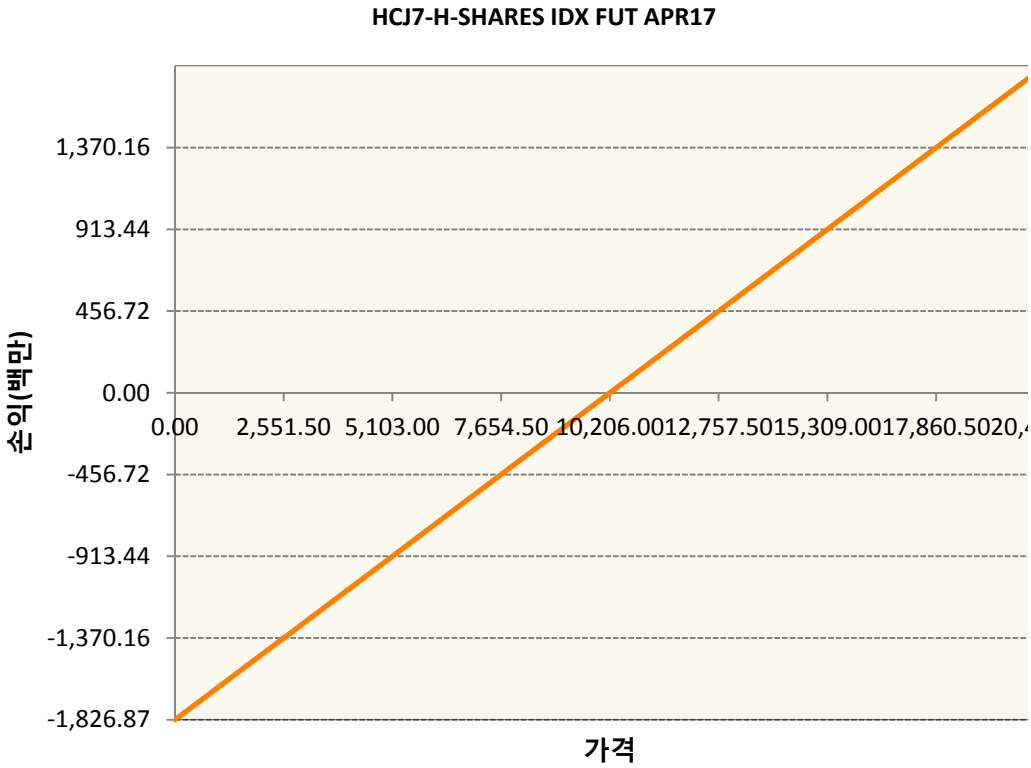
차이나인덱스모(주식-파생형)

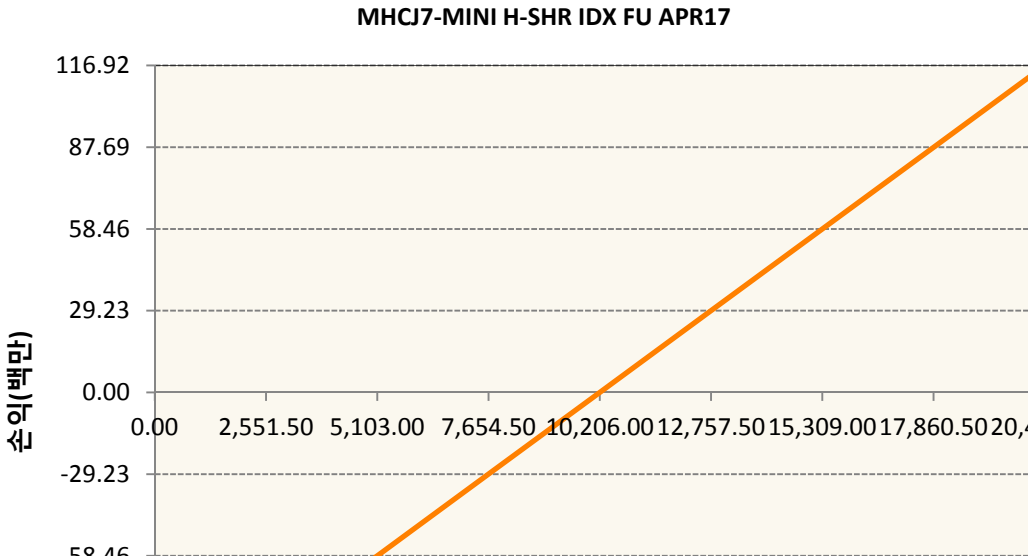
1. 계약금액

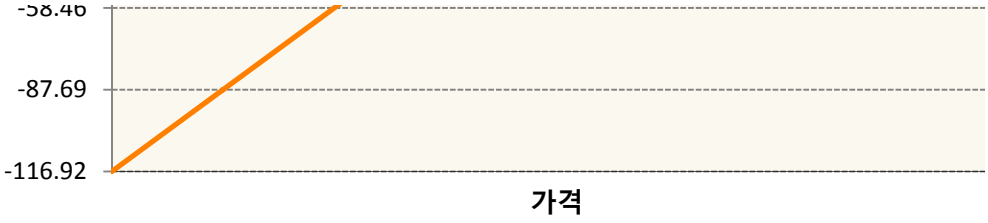
(단위:백만원)

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	2017-04-18
기준일	2017-04-17

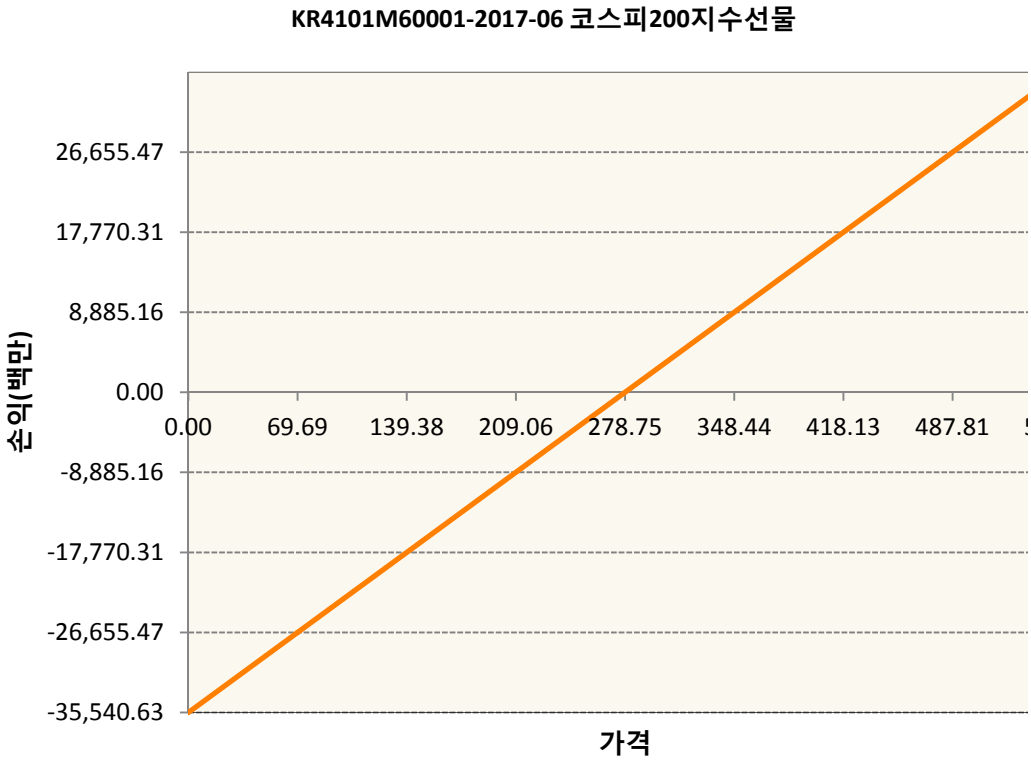
커버드콜모(주식혼합-파생형)

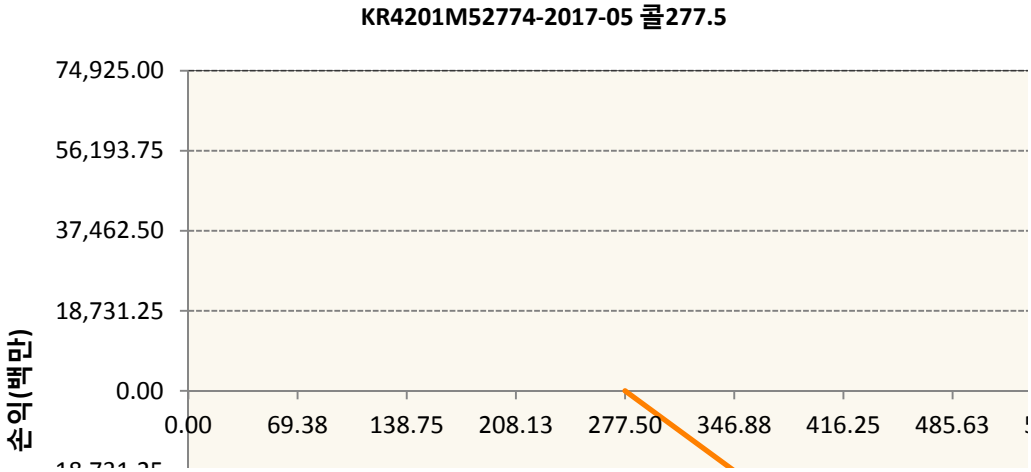
1. 계약금액

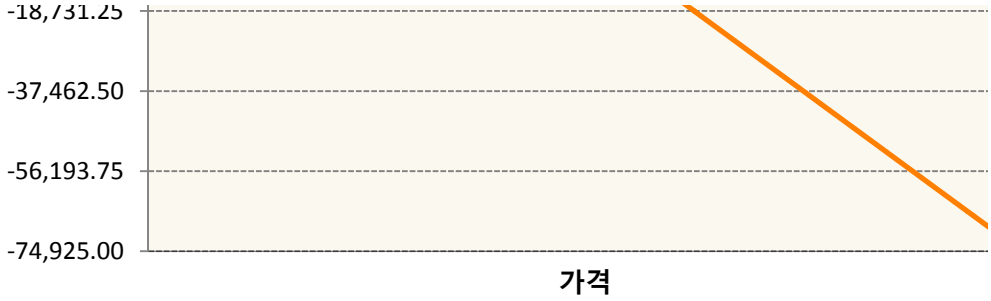
(단위:백만원)

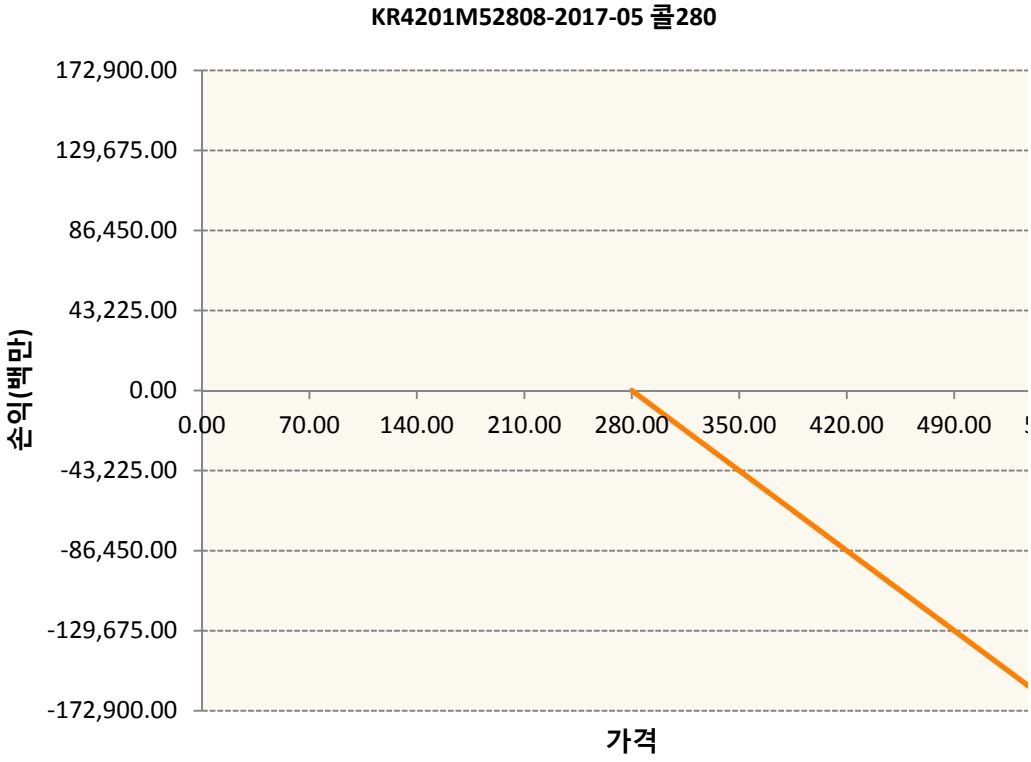
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	52,585	-52,585	장내
누계	유가증권	선물	35,541	0	35,541	장내
누계	유가증권	옵션	0	303,325	-303,325	장내

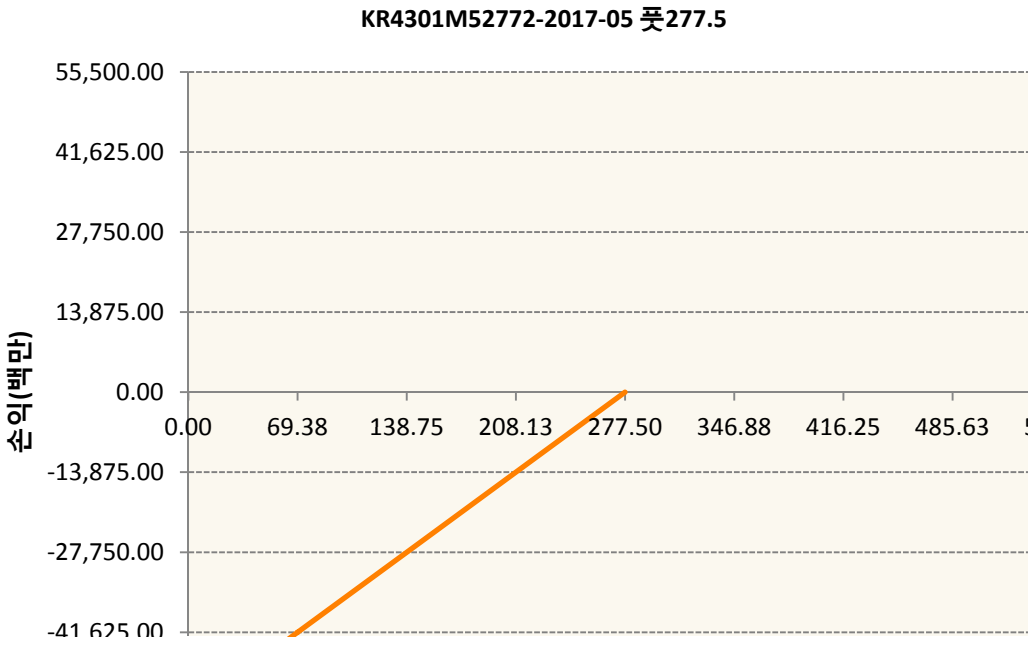
2. 만기시점의 손익구조

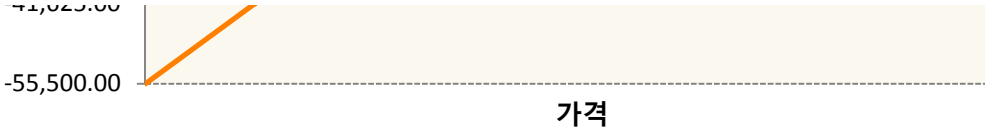





-18,731.25
-37,462.50
-56,193.75
-74,925.00
가격


KR4201M52808-2017-05 콜280
172,900.00
129,675.00
86,450.00
43,225.00
0.00
-43,225.00
-86,450.00
-129,675.00
-172,900.00
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							2,837
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,837	-2,837	-2,837	-2,837	-2,837	-2,837	-2,837
-5.33%	-1,891	-1,891	-1,891	-1,891	-1,891	-1,891	-1,891
-2.67%	-946	-946	-946	-946	-946	-946	-946
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	946	946	946	946	946	946	946
5.33%	1,891	1,891	1,891	1,891	1,891	1,891	1,891
8.00%	2,837	2,837	2,837	2,837	2,837	2,837	2,837
KR4201M52 2017-05 콜277.5							4,988
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,246	1,243	1,238	1,229	1,216	1,199	1,177
-5.33%	1,217	1,195	1,166	1,130	1,089	1,043	992
-2.67%	1,010	940	866	789	709	627	544
0%	292	195	98	0	-98	-195	-293
2.67%	-1,101	-1,166	-1,236	-1,311	-1,389	-1,469	-1,552
5.33%	-2,931	-2,953	-2,982	-3,018	-3,060	-3,107	-3,159
8.00%	-4,904	-4,908	-4,915	-4,926	-4,942	-4,962	-4,988
KR4201M52 2017-05 콜280							10,689
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,133	2,130	2,123	2,111	2,092	2,066	2,031
-5.33%	2,103	2,072	2,029	1,973	1,903	1,822	1,728
-2.67%	1,828	1,707	1,572	1,425	1,268	1,104	933
0%	659	440	220	0	-221	-443	-665
2.67%	-2,026	-2,213	-2,407	-2,606	-2,809	-3,015	-3,224
5.33%	-5,955	-6,036	-6,133	-6,245	-6,371	-6,508	-6,654
8.00%	-10,402	-10,421	-10,450	-10,491	-10,545	-10,611	-10,689
KR4301M52 2017-05 풋277.5							3,573
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,521	-3,524	-3,528	-3,534	-3,544	-3,557	-3,573
-5.33%	-2,061	-2,078	-2,099	-2,126	-2,156	-2,190	-2,228
-2.67%	-734	-785	-840	-897	-956	-1,017	-1,079

0%	217	144	72	0	-72	-145	-217
2.67%	666	618	566	511	453	393	332
5.33%	792	776	754	728	697	662	623
8.00%	812	809	804	795	784	769	750

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

22,447

공시일	2017-04-18
기준일	2017-04-17

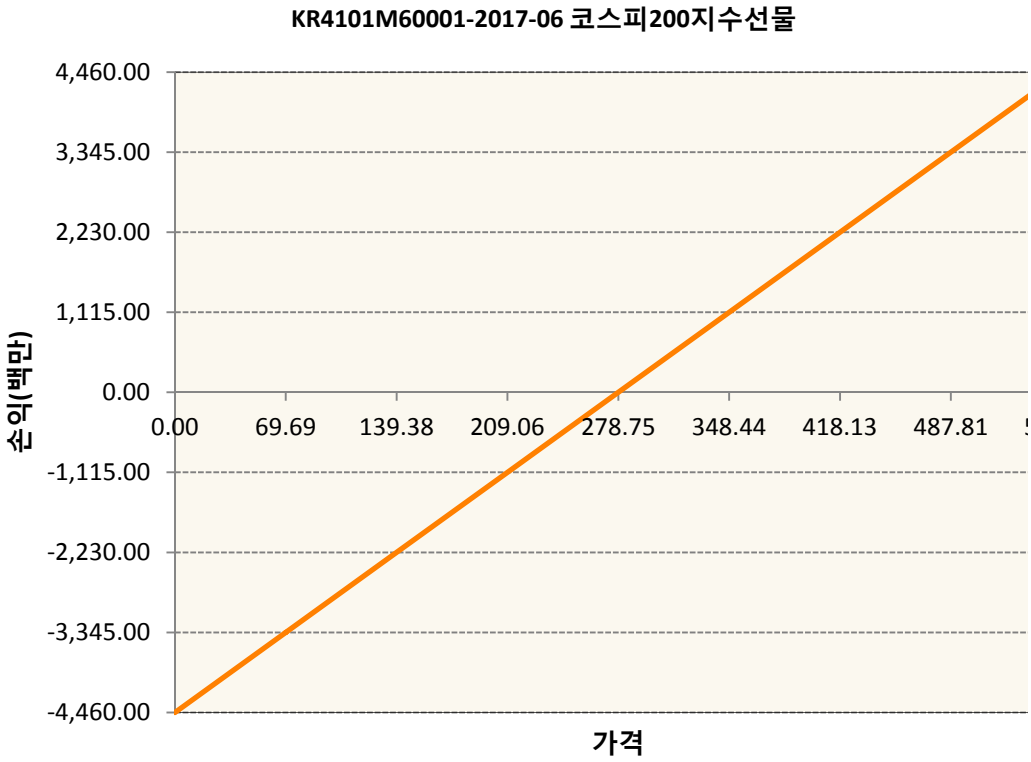
커버드콜목표전환형증권투자신탁

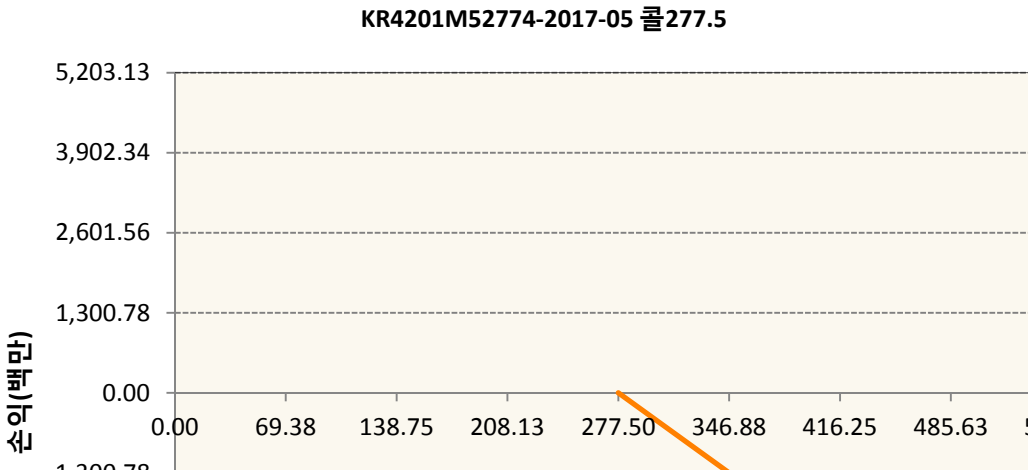
1. 계약금액

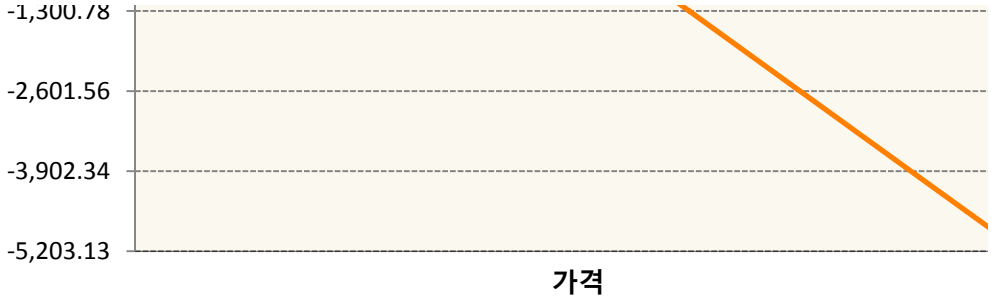
(단위:백만원)

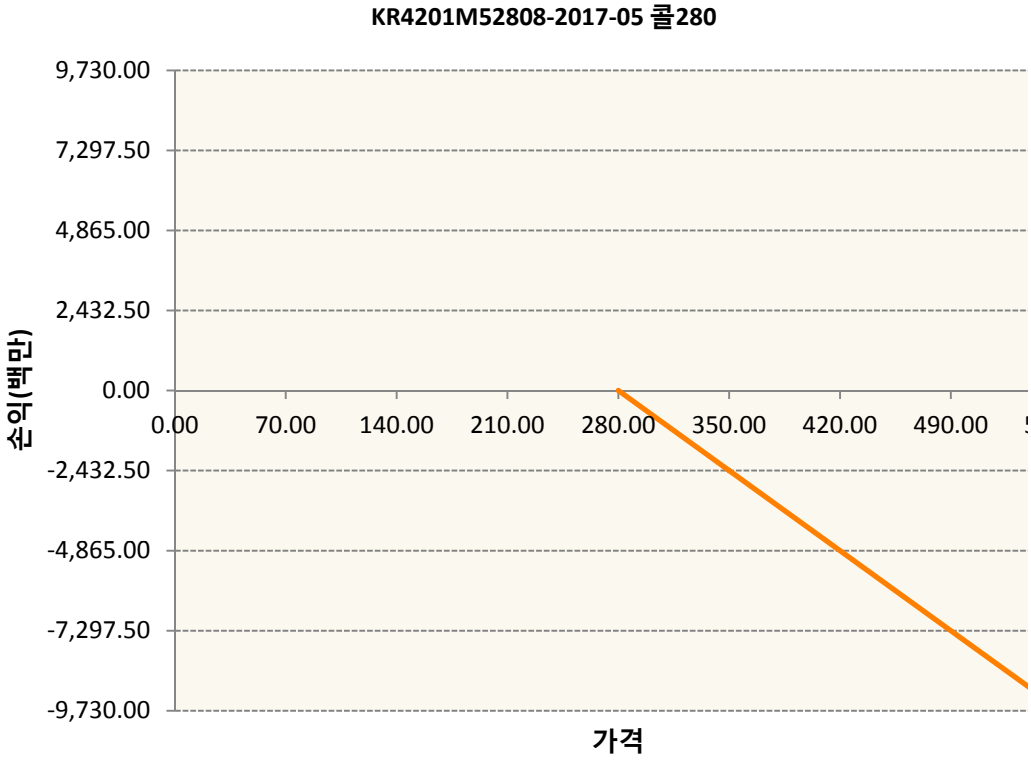
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,460	0	4,460	장내
누계	유가증권	옵션	0	14,933	-14,933	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							356
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-356	-356	-356	-356	-356	-356	-356
-5.33%	-237	-237	-237	-237	-237	-237	-237
-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%	237	237	237	237	237	237	237
8.00%	356	356	356	356	356	356	356
KR4201M52 2017-05 콜277.5							346
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	87	86	86	85	84	83	82
-5.33%	85	83	81	79	76	72	69
-2.67%	70	65	60	55	49	44	38
0%	20	14	7	0	-7	-14	-20
2.67%	-76	-81	-86	-91	-96	-102	-108
5.33%	-204	-205	-207	-210	-212	-216	-219
8.00%	-341	-341	-341	-342	-343	-345	-346
KR4201M52(	2017-05 콜280						602

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	120	120	119	119	118	116	114
-5.33%	118	117	114	111	107	103	97
-2.67%	103	96	88	80	71	62	52
0%	37	25	12	0	-12	-25	-37
2.67%	-114	-125	-135	-147	-158	-170	-181
5.33%	-335	-340	-345	-351	-359	-366	-374
8.00%	-585	-586	-588	-590	-593	-597	-602

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

1,244

공시일	2017-04-18
기준일	2017-04-17

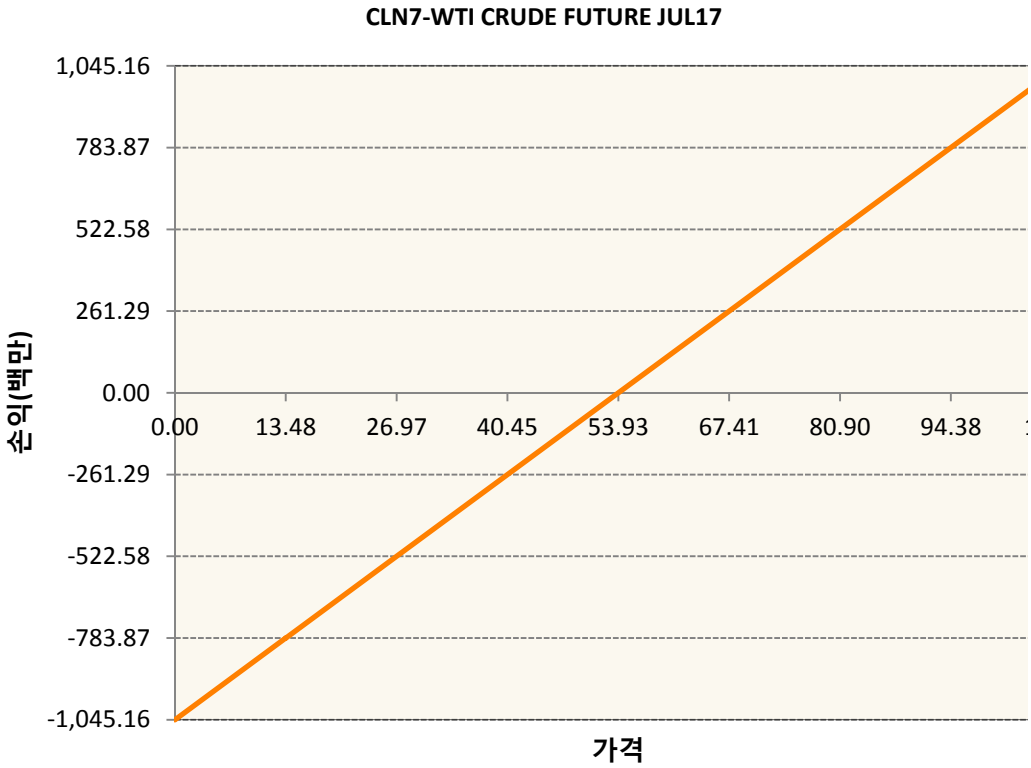
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

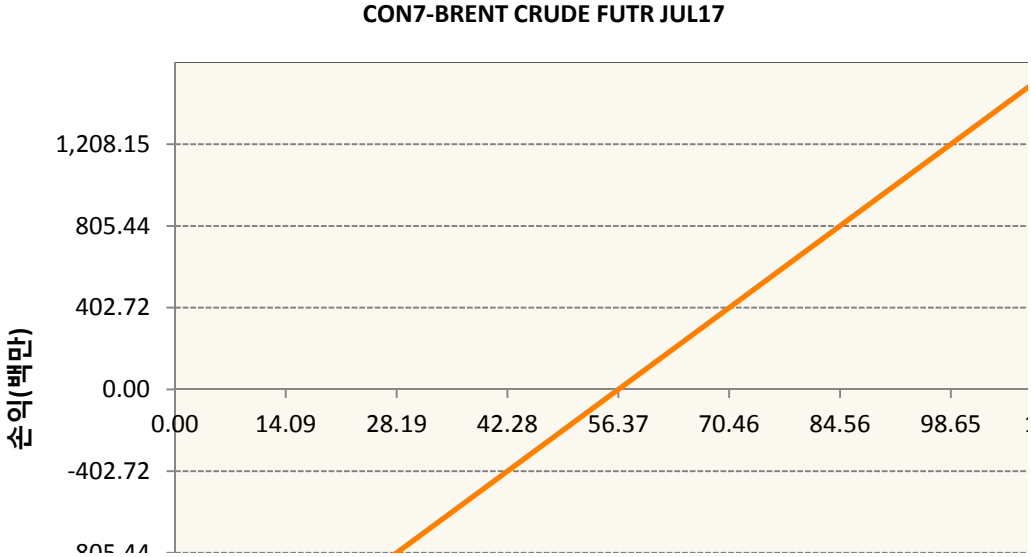
1. 계약금액

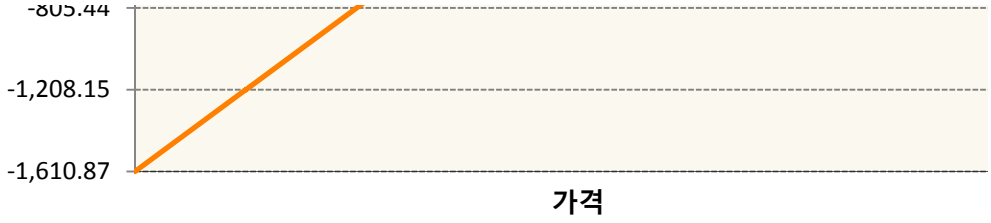
(단위:백만원)

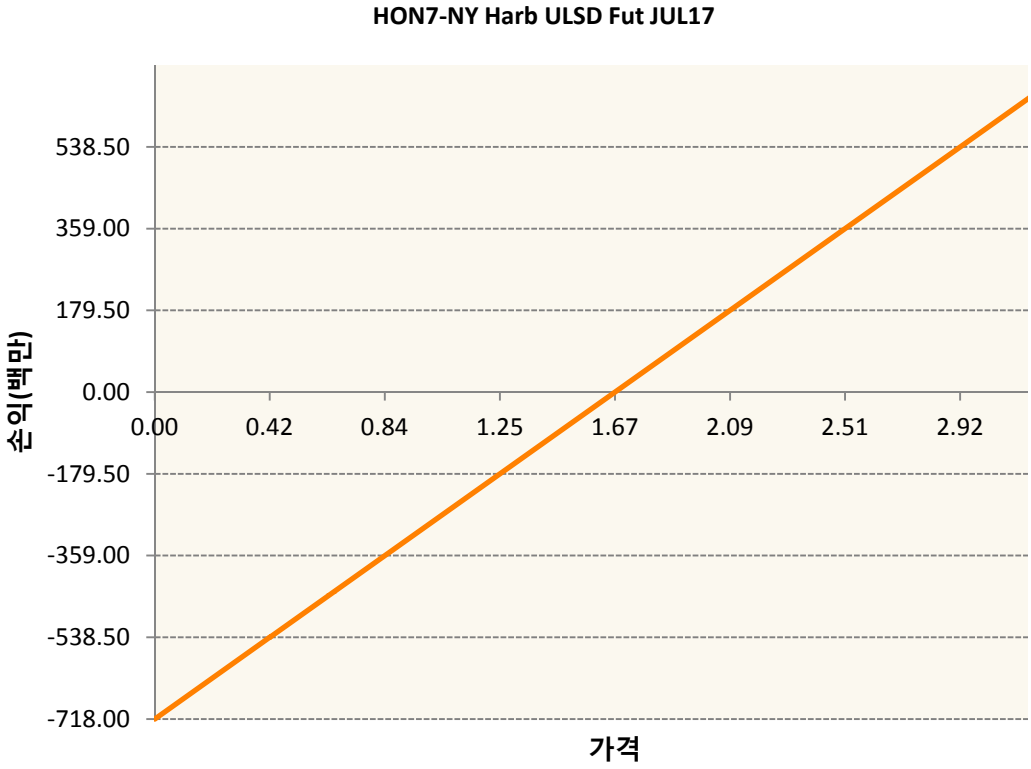
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,784	410	5,375	

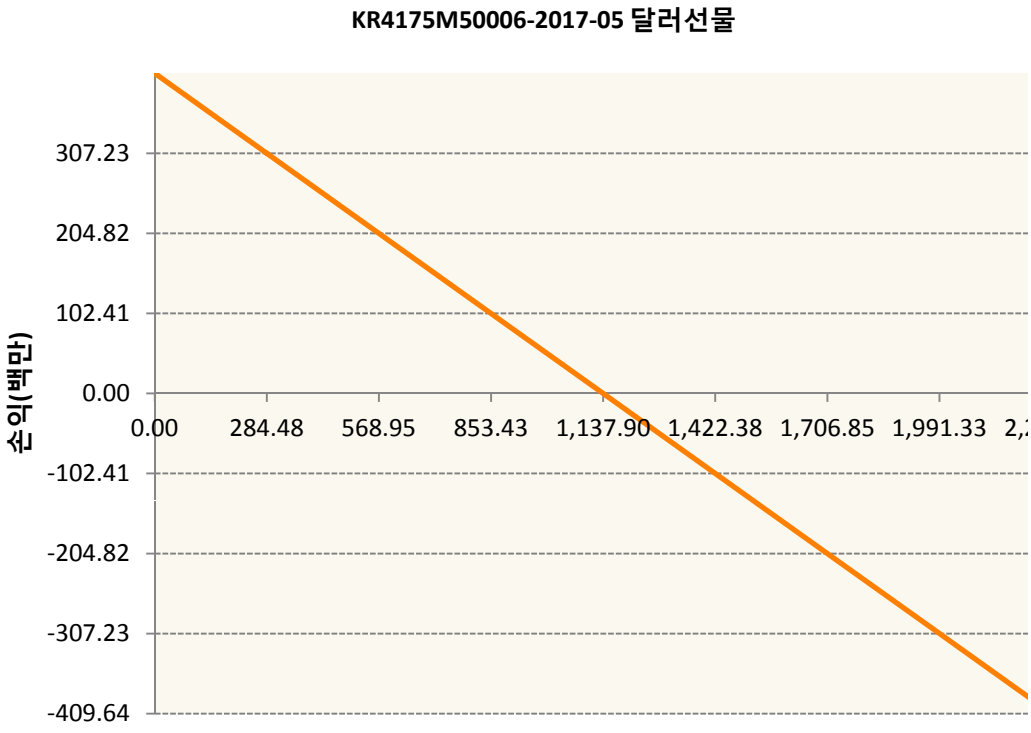
2. 만기시점의 손익구조



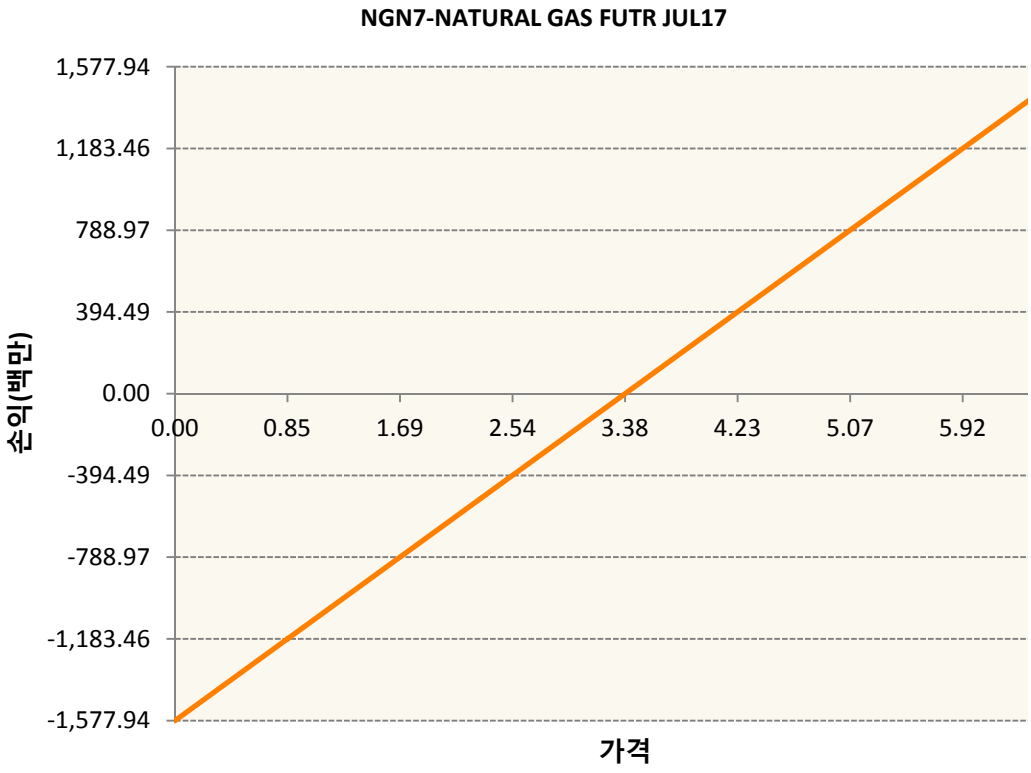


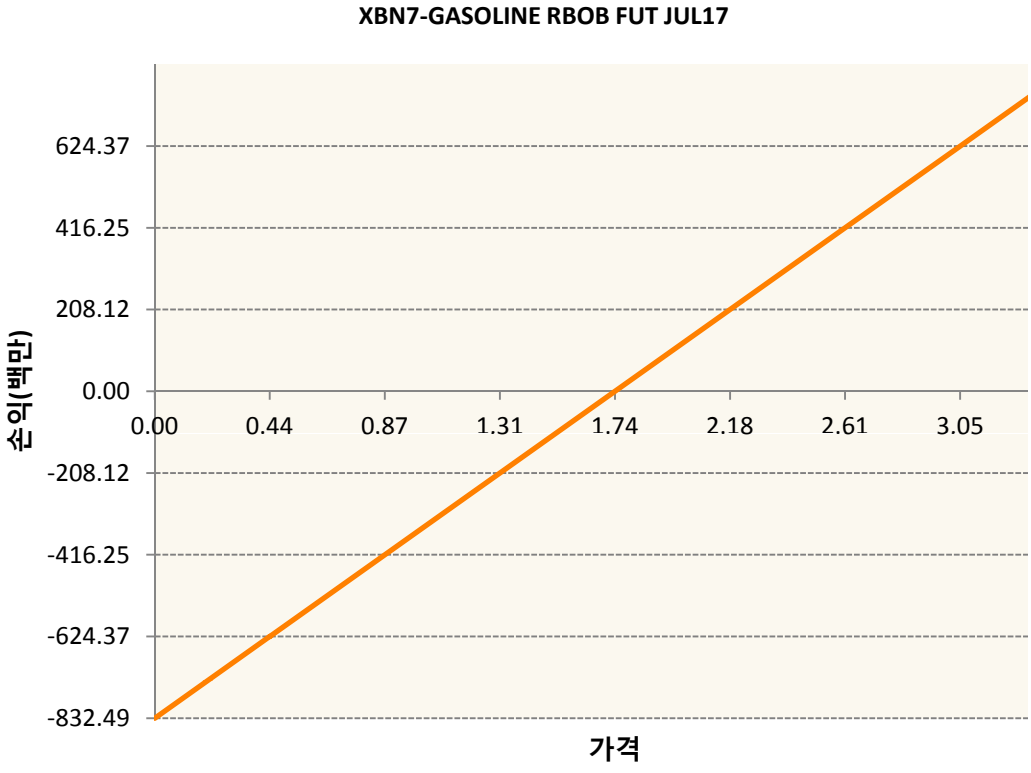

-805.44
-1,208.15
-1,610.87
가격


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
307.23
204.82
102.41
0.00
-102.41
-204.82
-307.23
-409.64
0.00
284.48
568.95
853.43
1,137.90
1,422.38
1,706.85
1,991.33
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
624.37
416.25
208.12
0.00
-208.12
-416.25
-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)

972

공시일	2017-04-18
기준일	2017-04-17

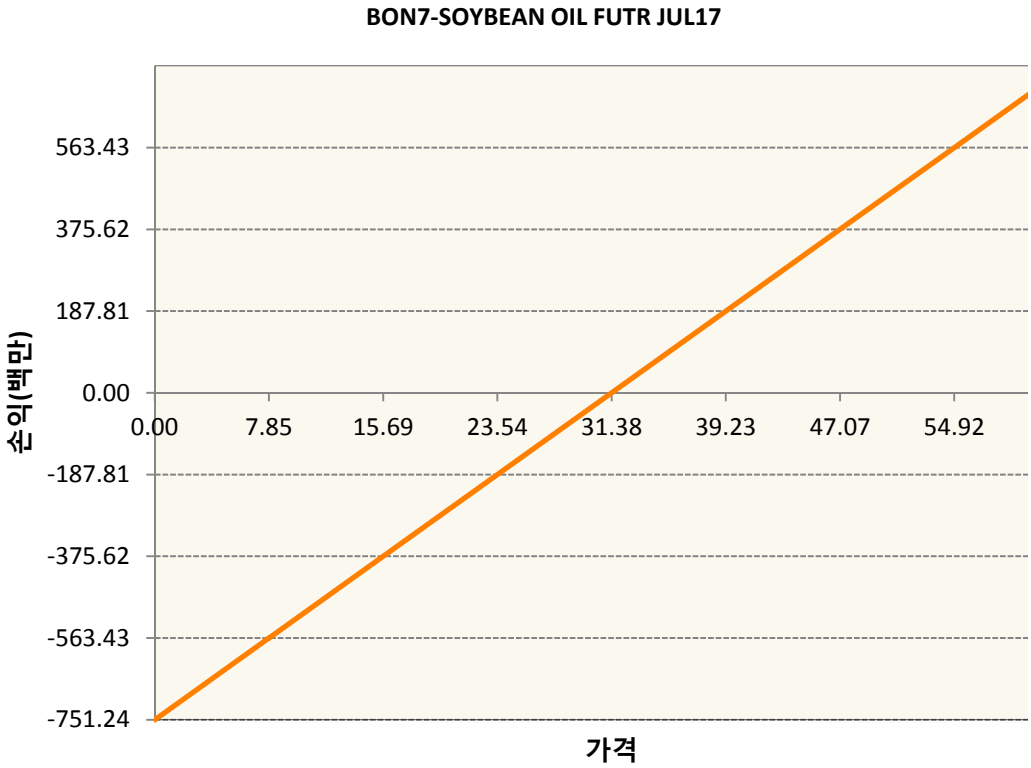
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

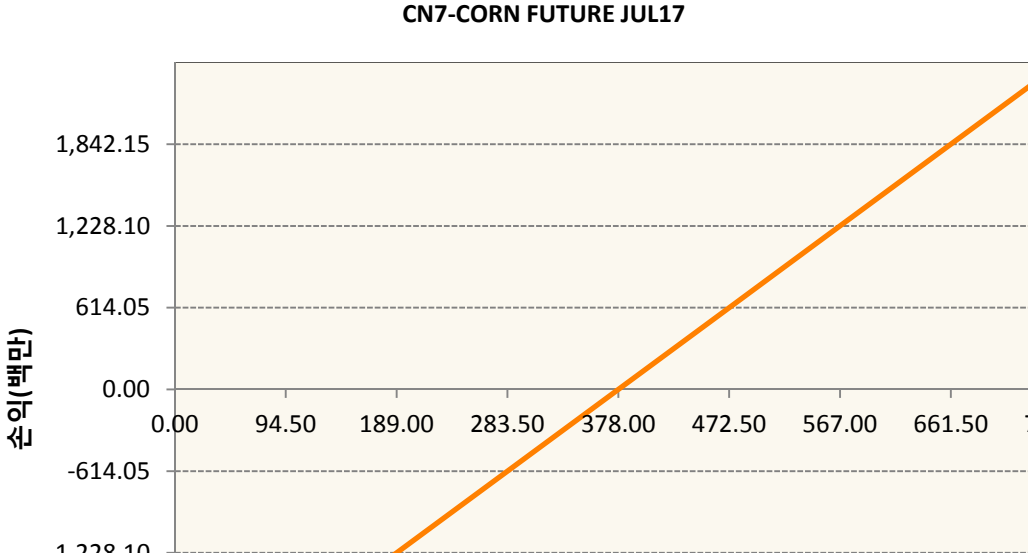
1. 계약금액

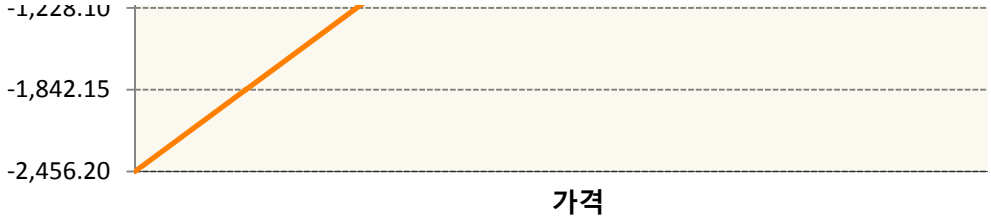
(단위:백만원)

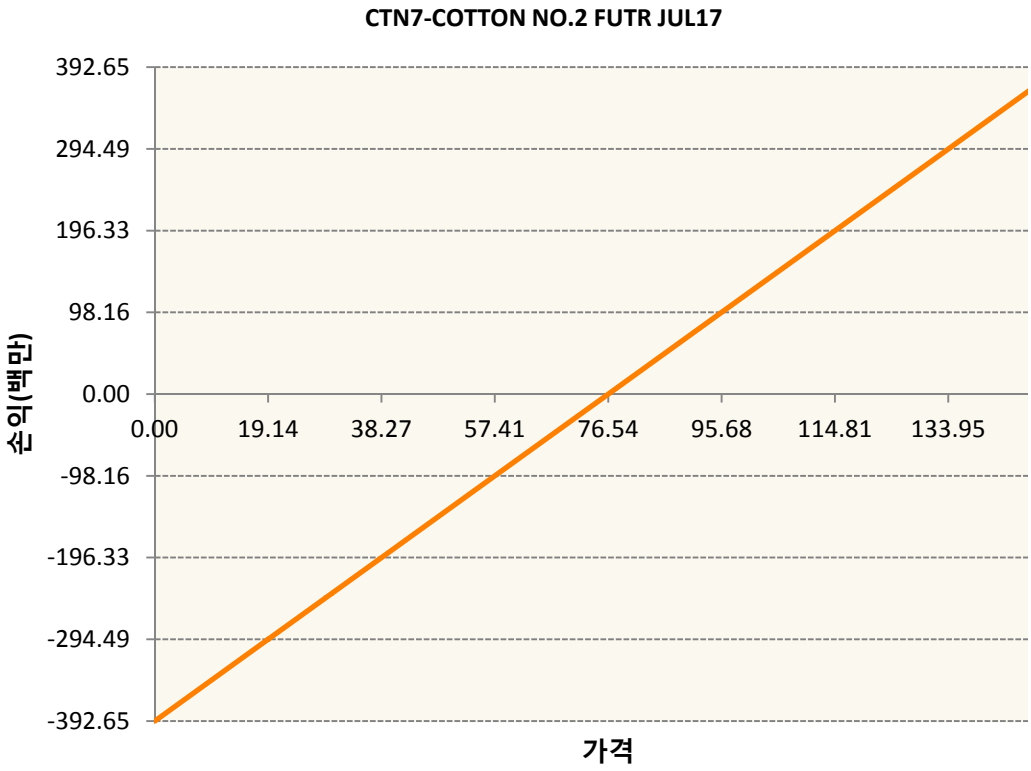
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,034	398	8,635	

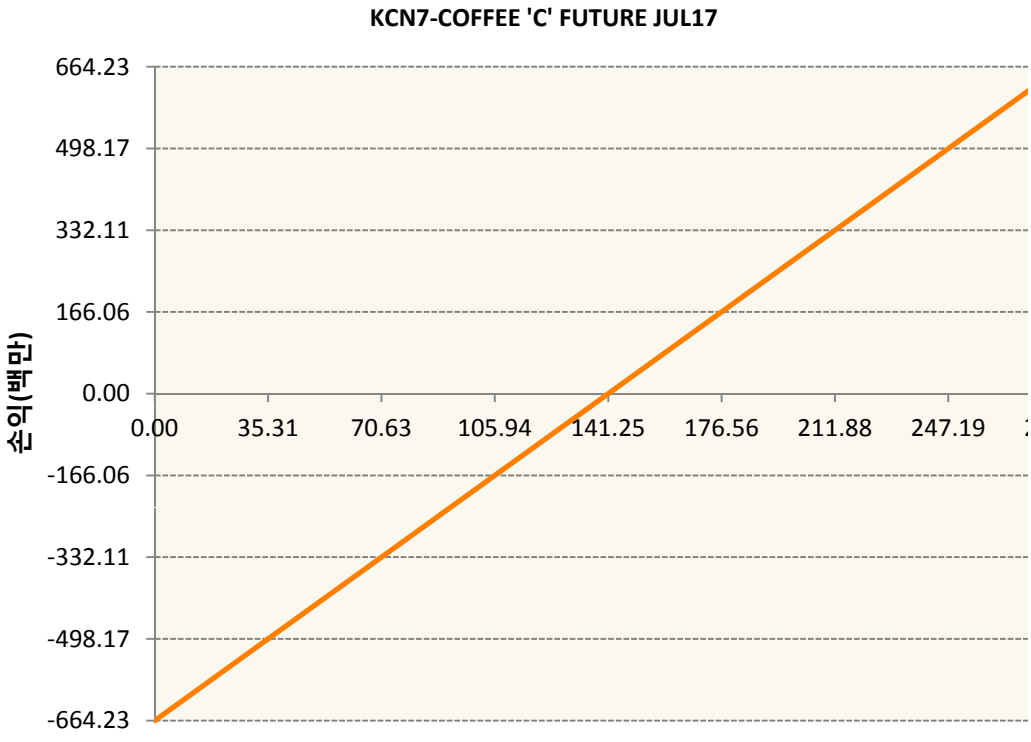
2. 만기시점의 손익구조





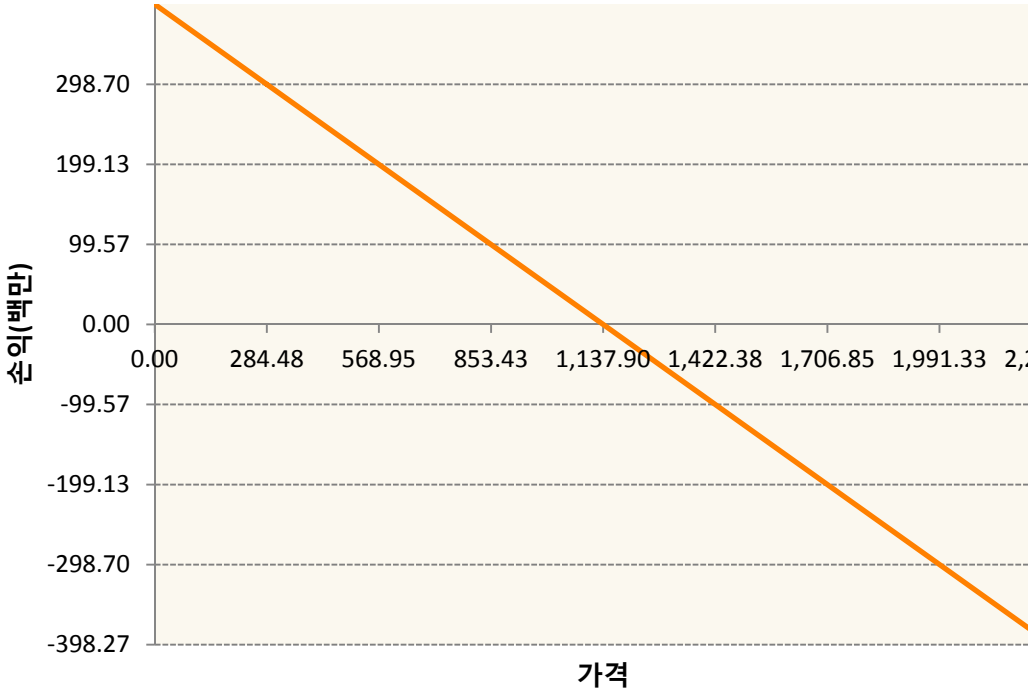

-1,228.10
-1,842.15
-2,456.20
가격


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

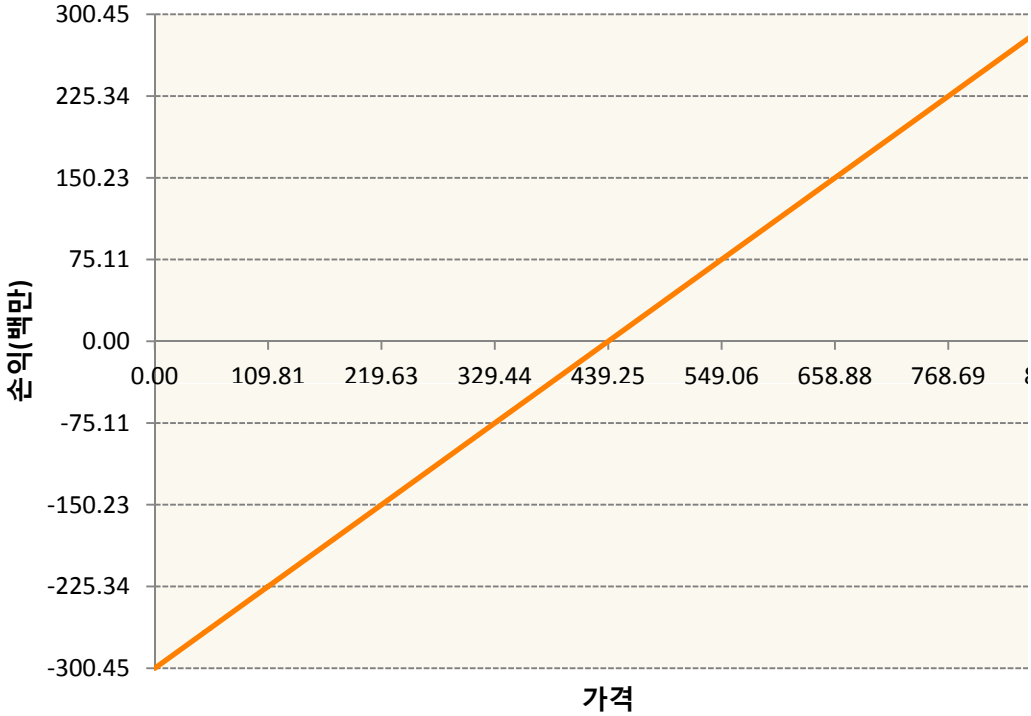

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
664.23
498.17
332.11
166.06
0.00
-166.06
-332.11
-498.17
-664.23
0.00
35.31
70.63
105.94
141.25
176.56
211.88
247.19
순익(백만)

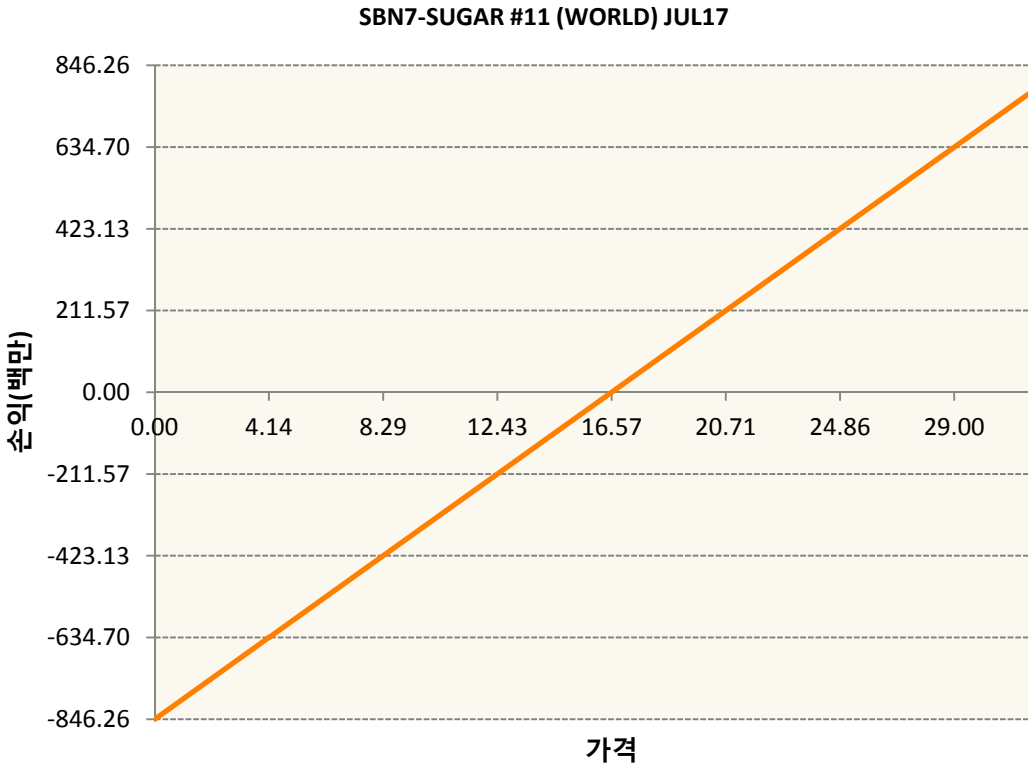
가격

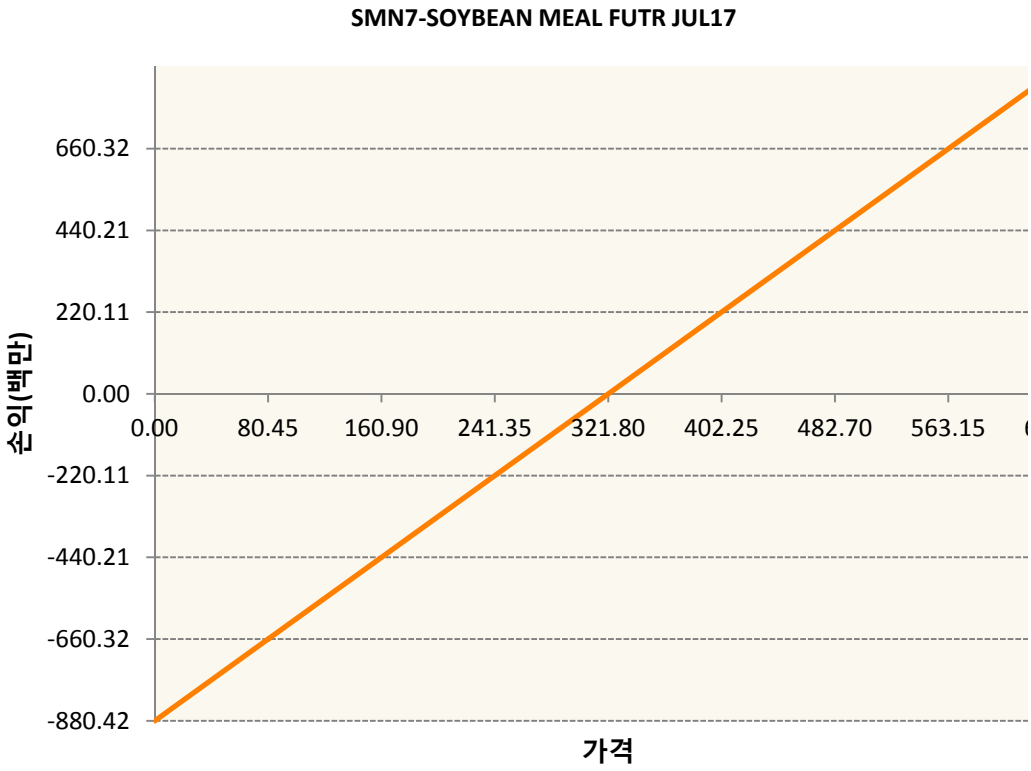
KR4175M50006-2017-05 달러선물

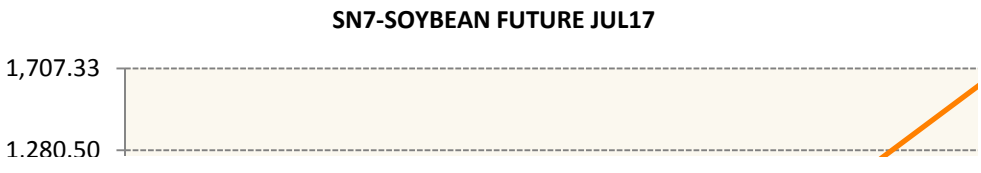


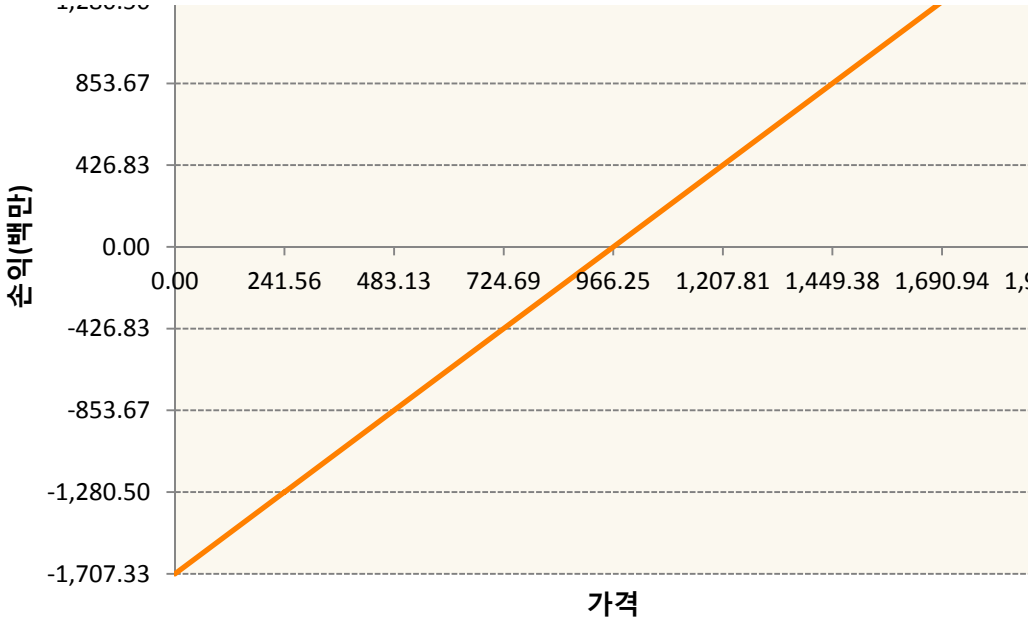
KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17

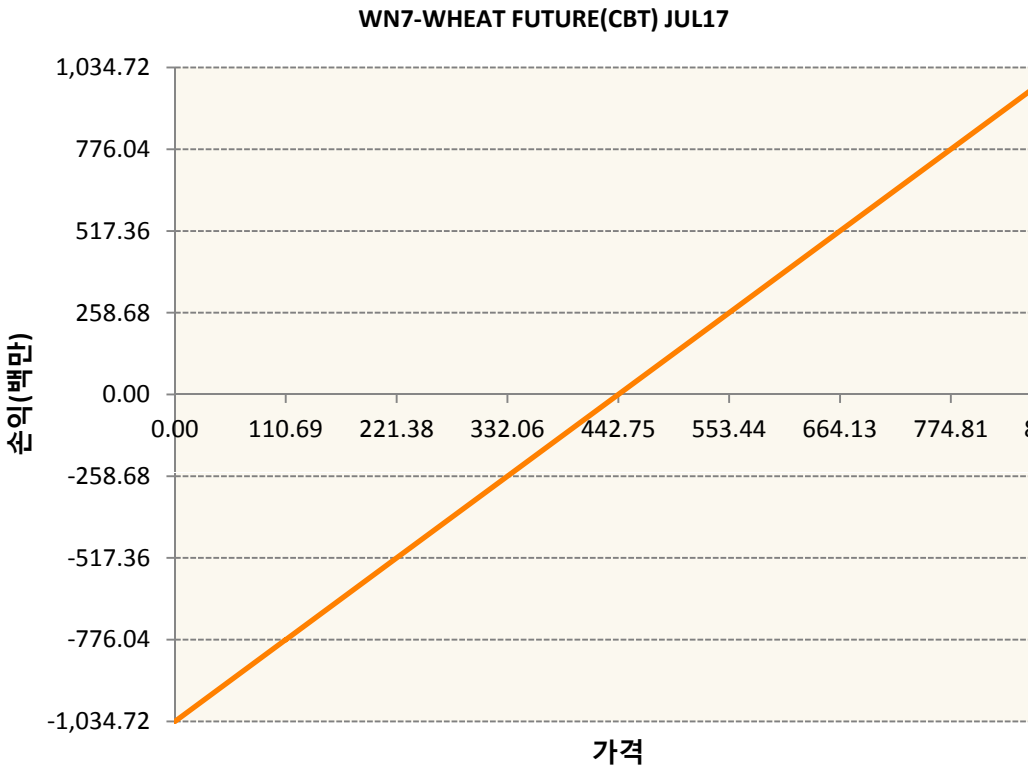



SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
846.26
634.70
423.13
211.57
0.00
-211.57
-423.13
-634.70
-846.26
0.00
4.14
8.29
12.43
16.57
20.71
24.86
29.00
손익(백만)
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
660.32
440.21
220.11
0.00
-220.11
-440.21
-660.32
-880.42
0.00
80.45
160.90
241.35
321.80
402.25
482.70
563.15
손익(백만)
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,707.33
1,280.50





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