공시일	2017-04-19
기준일	2017-04-18

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	2017-04-19
기준일	2017-04-18

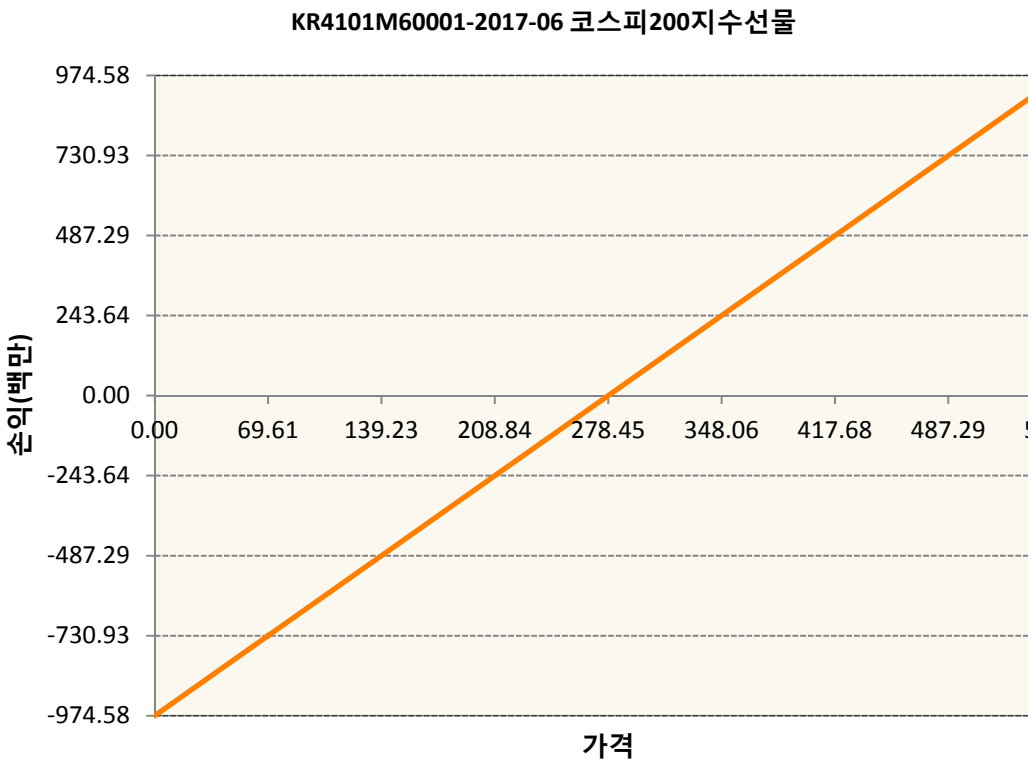
스마트인덱스모

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	975	0	975	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	2017-04-19
기준일	2017-04-18

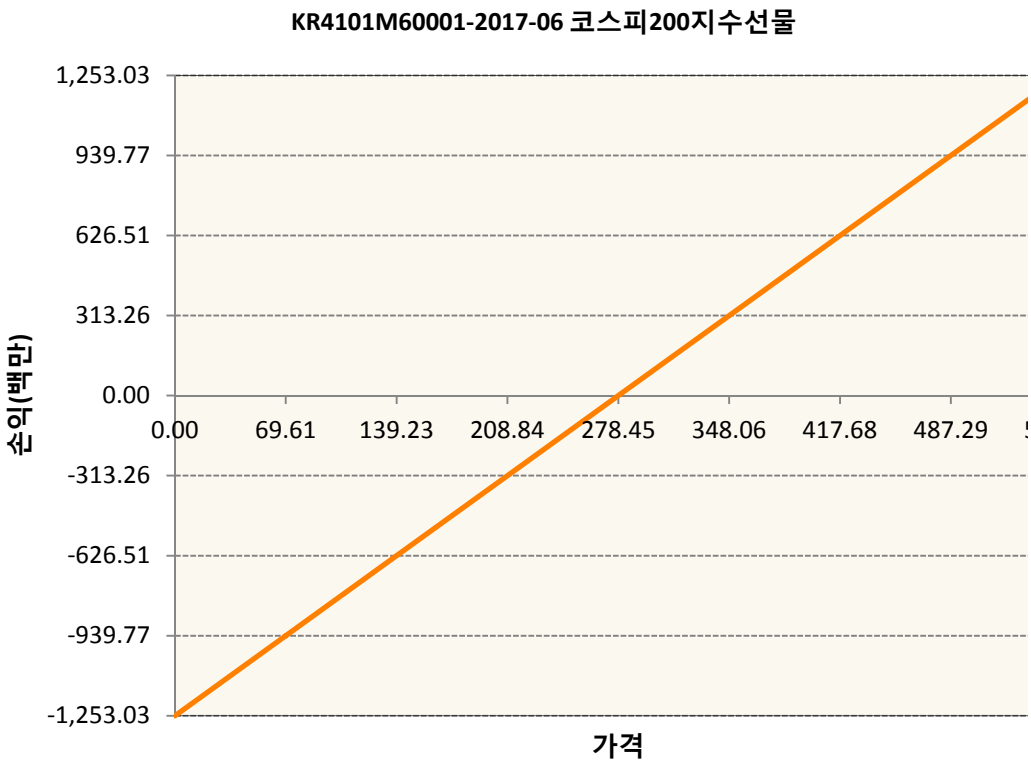
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,253	0	1,253	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	2017-04-19
기준일	2017-04-18

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	2017-04-19
기준일	2017-04-18

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	389

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

407

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-04-19
기준일	2017-04-18

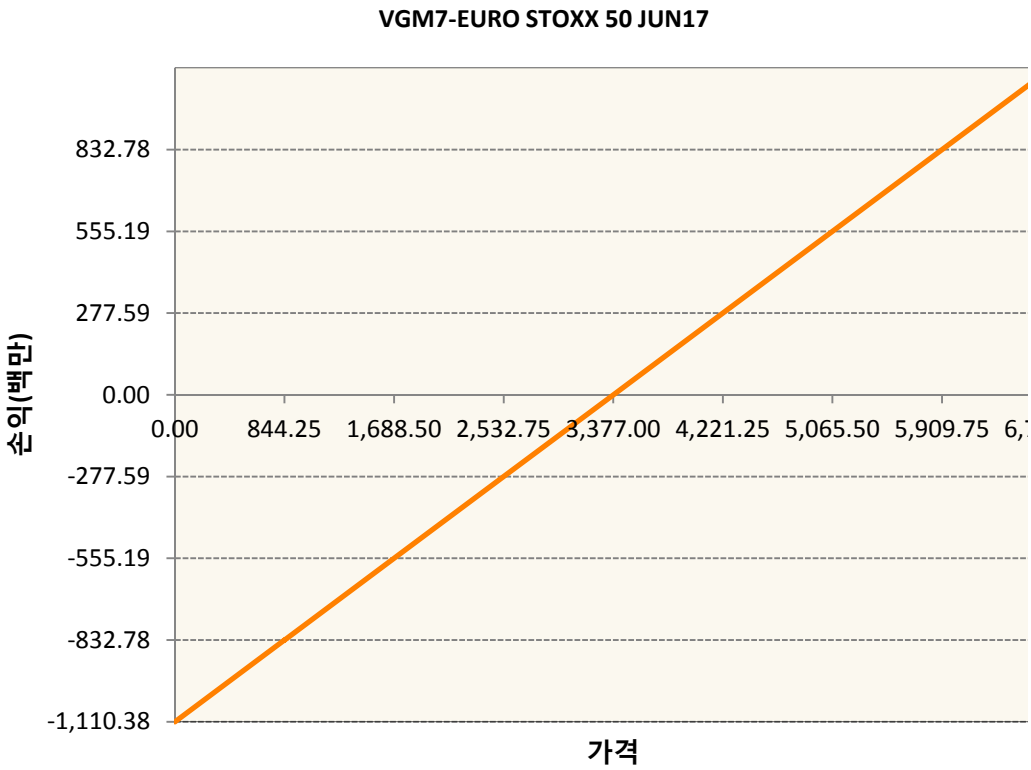
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2017-04-19
기준일	2017-04-18

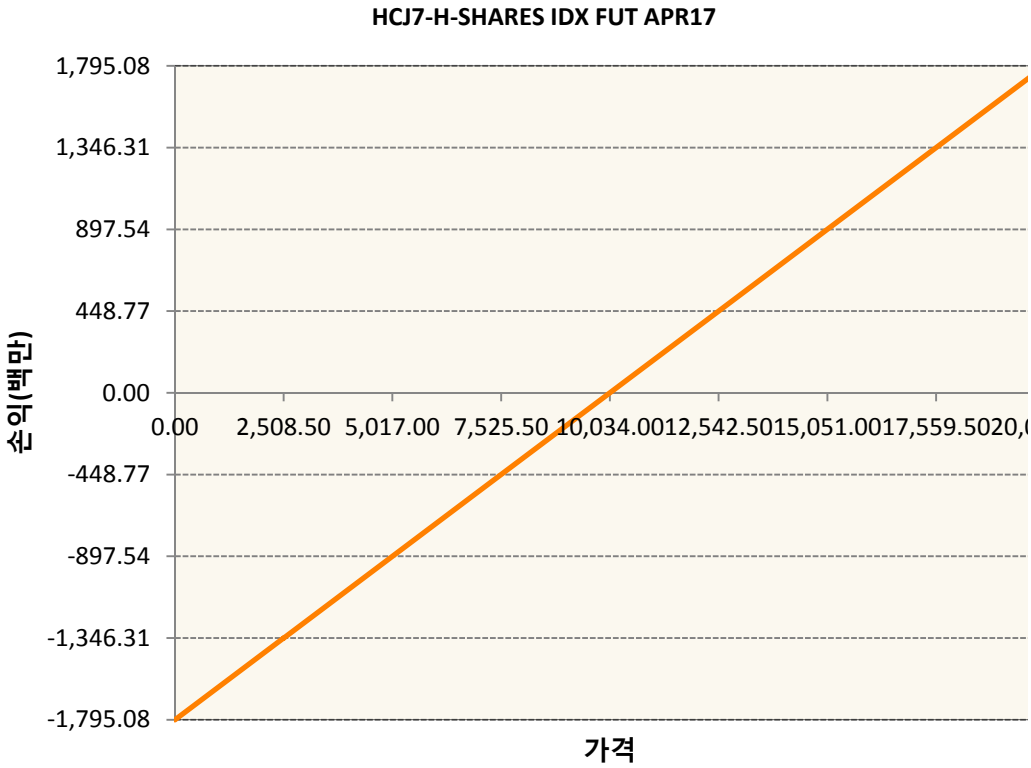
차이나인덱스모(주식-파생형)

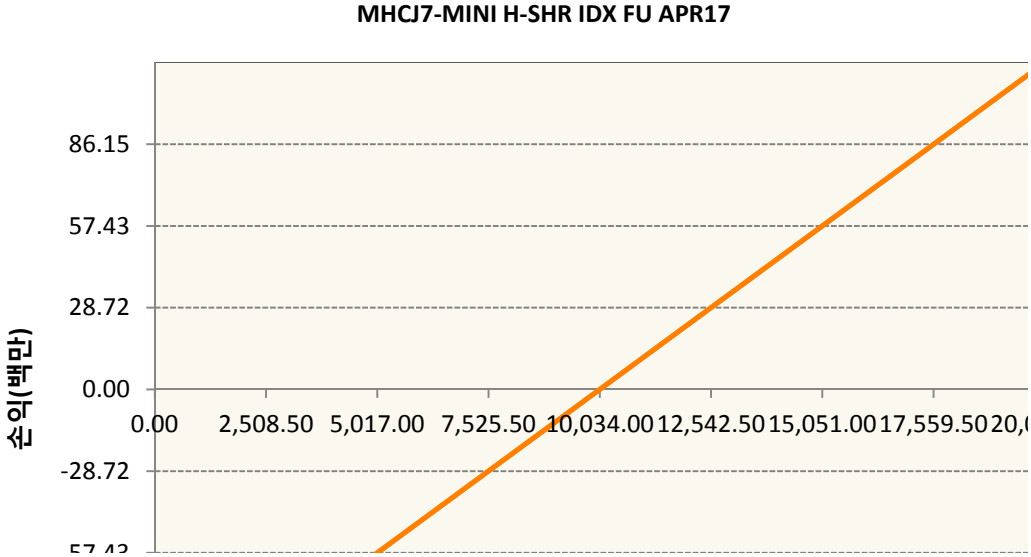
1. 계약금액

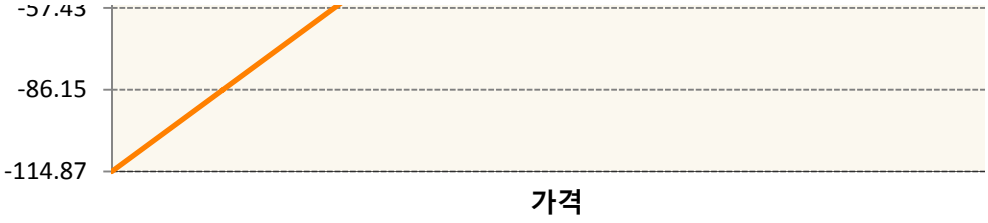
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,910	0	1,910	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCJ7	H-SHARES IDX FUT APR17	144
MHCJ7	MINI H-SHR IDX FU APR17	9

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

163

공시일	2017-04-19
기준일	2017-04-18

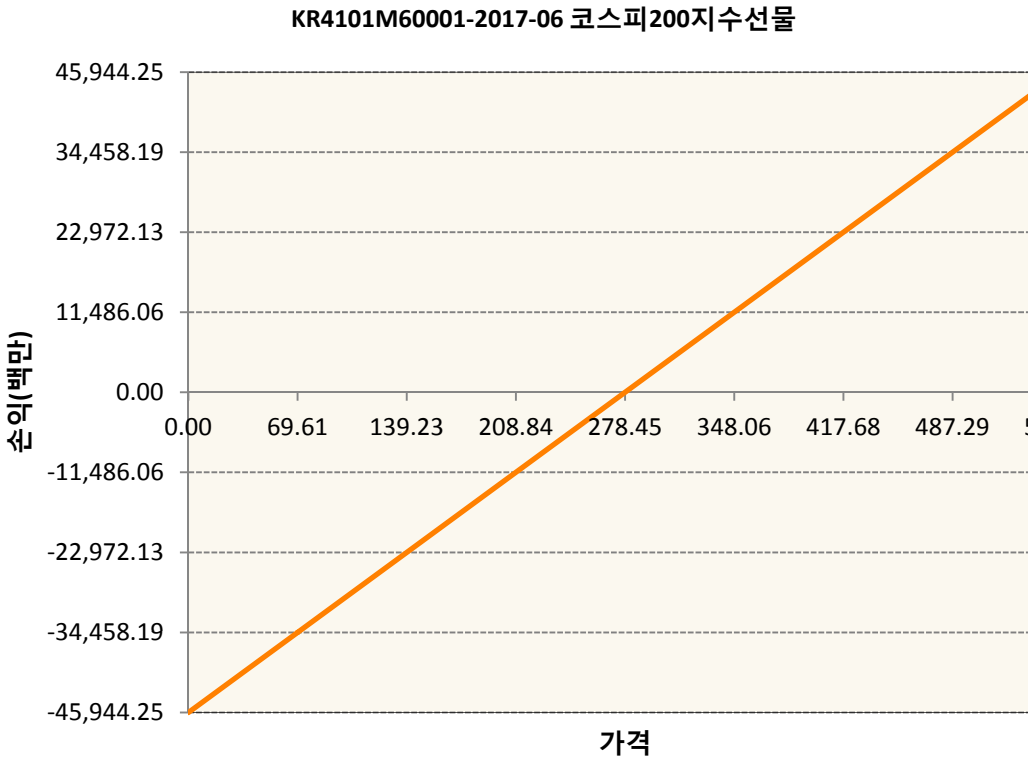
커버드콜모(주식혼합-파생형)

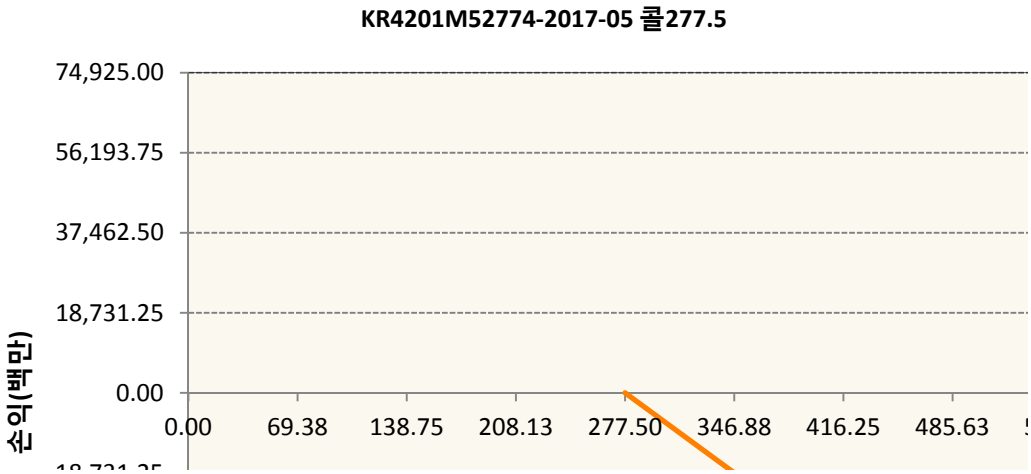
1. 계약금액

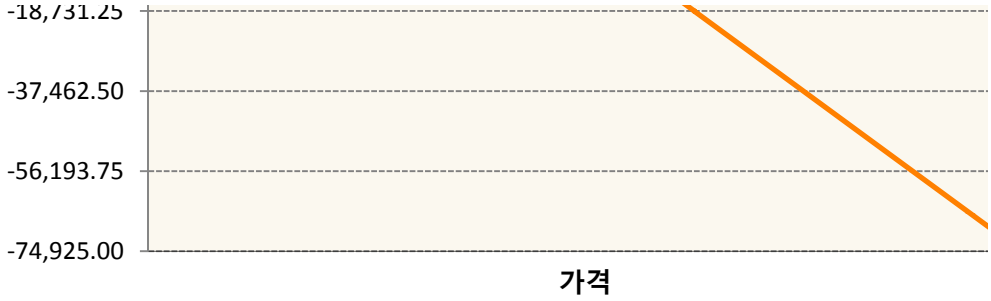
(단위:백만원)

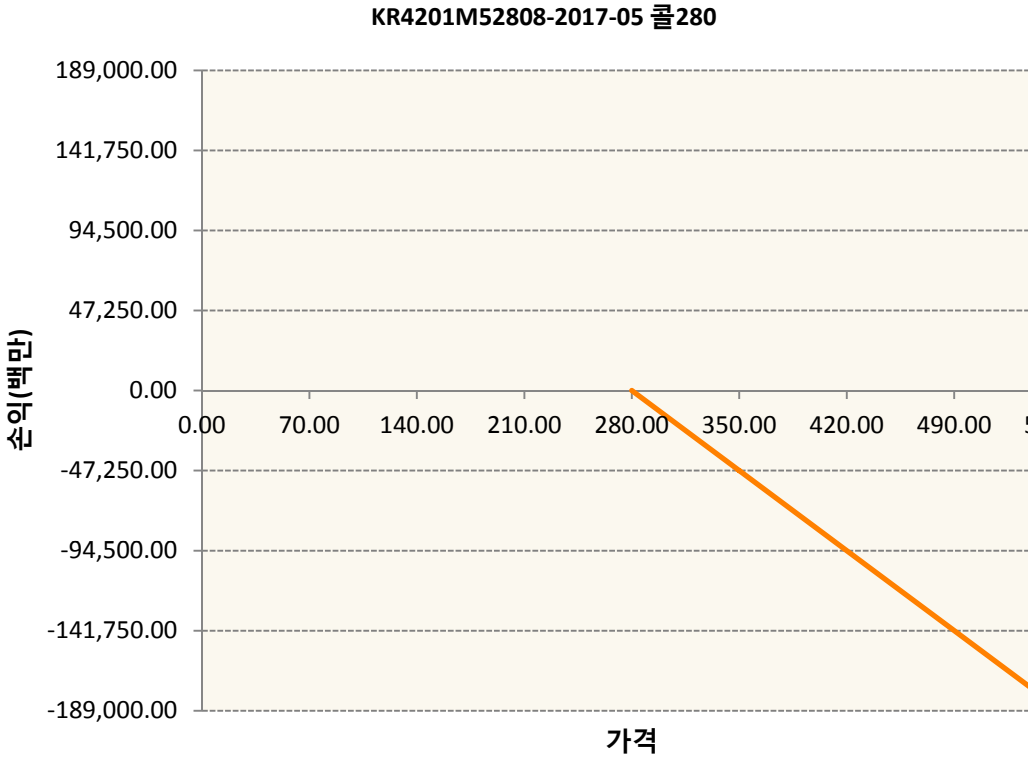
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	10,452	0	10,452	장내
신규	유가증권	옵션	0	16,251	-16,251	장내
누계	유가증권	선물	45,944	0	45,944	장내
누계	유가증권	옵션	0	319,425	-319,425	장내

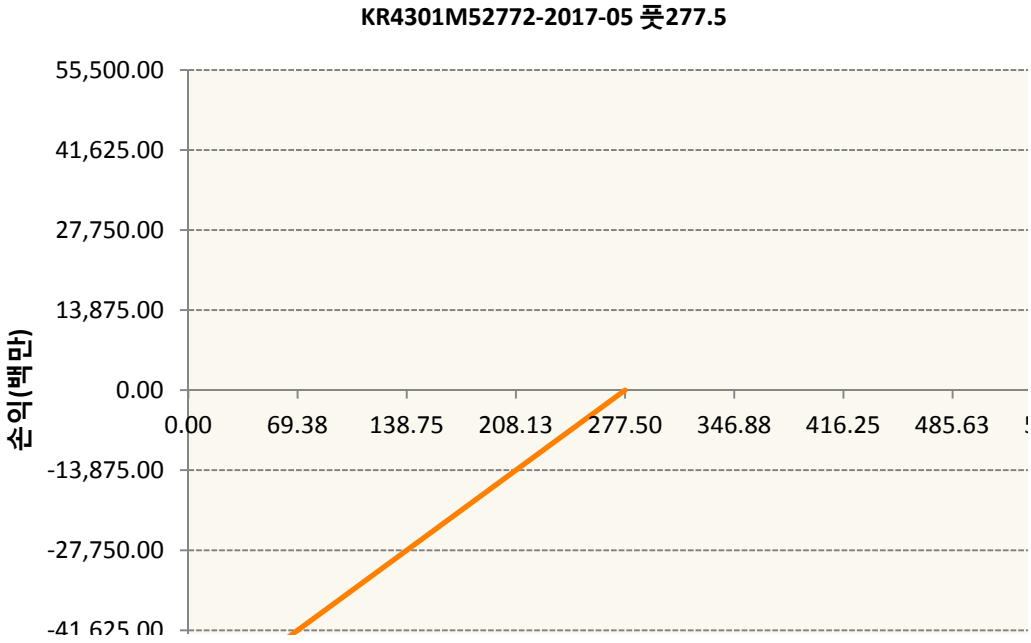
2. 만기시점의 손익구조

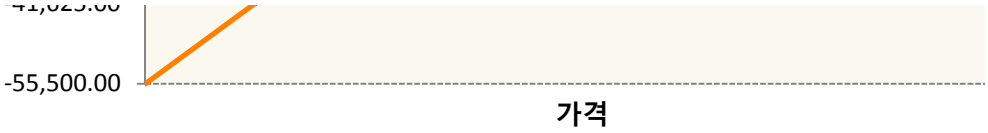





-18,731.25
-37,462.50
-56,193.75
-74,925.00
가격


KR4201M52808-2017-05 콜280
189,000.00
141,750.00
94,500.00
47,250.00
0.00
-47,250.00
-94,500.00
-141,750.00
-189,000.00
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							3,673
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,673	-3,673	-3,673	-3,673	-3,673	-3,673	-3,673
-5.33%	-2,448	-2,448	-2,448	-2,448	-2,448	-2,448	-2,448
-2.67%	-1,224	-1,224	-1,224	-1,224	-1,224	-1,224	-1,224
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,224	1,224	1,224	1,224	1,224	1,224	1,224
5.33%	2,448	2,448	2,448	2,448	2,448	2,448	2,448
8.00%	3,673	3,673	3,673	3,673	3,673	3,673	3,673
KR4201M52 2017-05 콜277.5							5,026
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,234	1,232	1,227	1,219	1,208	1,192	1,173
-5.33%	1,208	1,187	1,160	1,127	1,088	1,044	996
-2.67%	1,006	939	868	793	715	636	554
0%	284	190	95	0	-95	-190	-285
2.67%	-1,129	-1,191	-1,257	-1,328	-1,402	-1,478	-1,558
5.33%	-2,976	-2,995	-3,021	-3,053	-3,091	-3,135	-3,183
8.00%	-4,954	-4,957	-4,963	-4,973	-4,986	-5,004	-5,026
KR4201M52 2017-05 콜280							11,778
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,294	2,291	2,285	2,273	2,256	2,230	2,196
-5.33%	2,265	2,235	2,192	2,135	2,064	1,981	1,885
-2.67%	1,979	1,852	1,710	1,555	1,390	1,217	1,036
0%	702	469	235	0	-236	-472	-708
2.67%	-2,274	-2,469	-2,672	-2,881	-3,094	-3,312	-3,532
5.33%	-6,619	-6,698	-6,795	-6,908	-7,035	-7,175	-7,326
8.00%	-11,502	-11,519	-11,546	-11,585	-11,636	-11,701	-11,778
KR4301M52 2017-05 풋277.5							3,578
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,532	-3,534	-3,538	-3,544	-3,552	-3,564	-3,578
-5.33%	-2,070	-2,085	-2,105	-2,130	-2,158	-2,191	-2,227
-2.67%	-737	-787	-840	-895	-952	-1,011	-1,072

0%	211	140	70	0	-70	-141	-211
2.67%	646	600	551	499	444	387	328
5.33%	760	746	727	703	675	643	607
8.00%	777	775	770	763	753	740	724

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

24,342

공시일	2017-04-19
기준일	2017-04-18

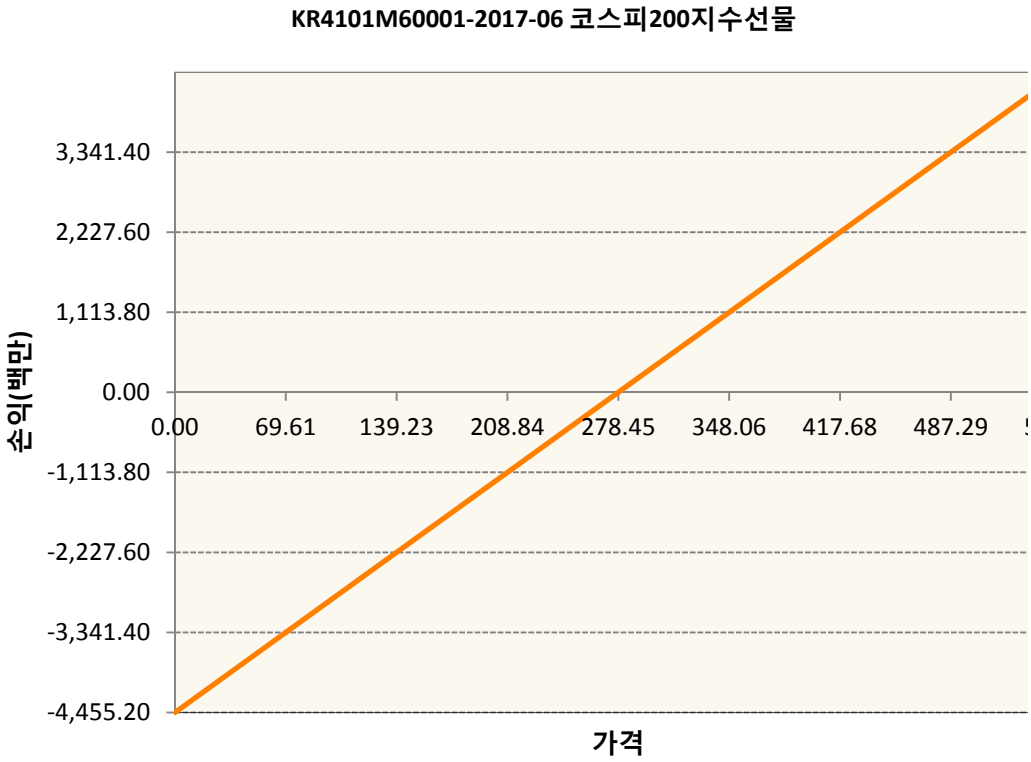
커버드콜목표전환형증권투자신탁

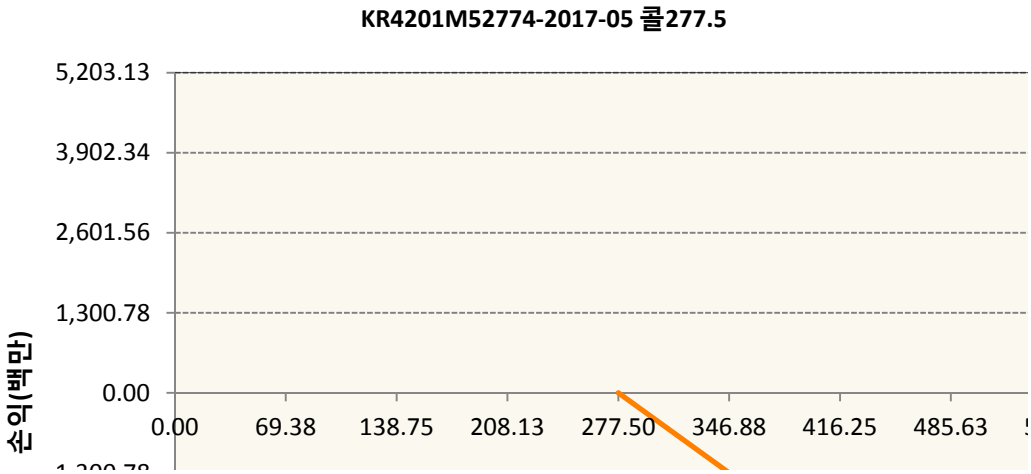
1. 계약금액

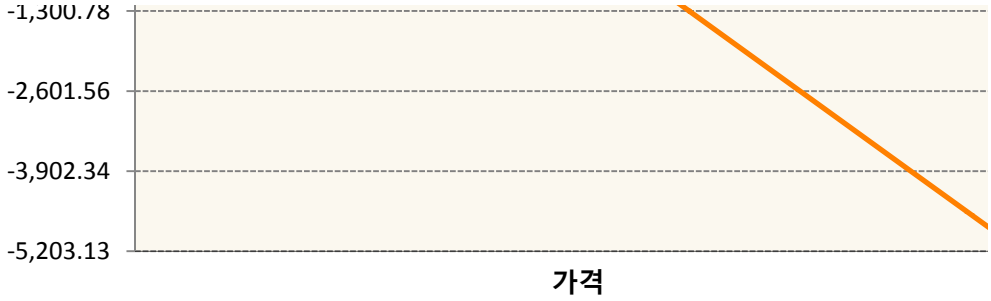
(단위:백만원)

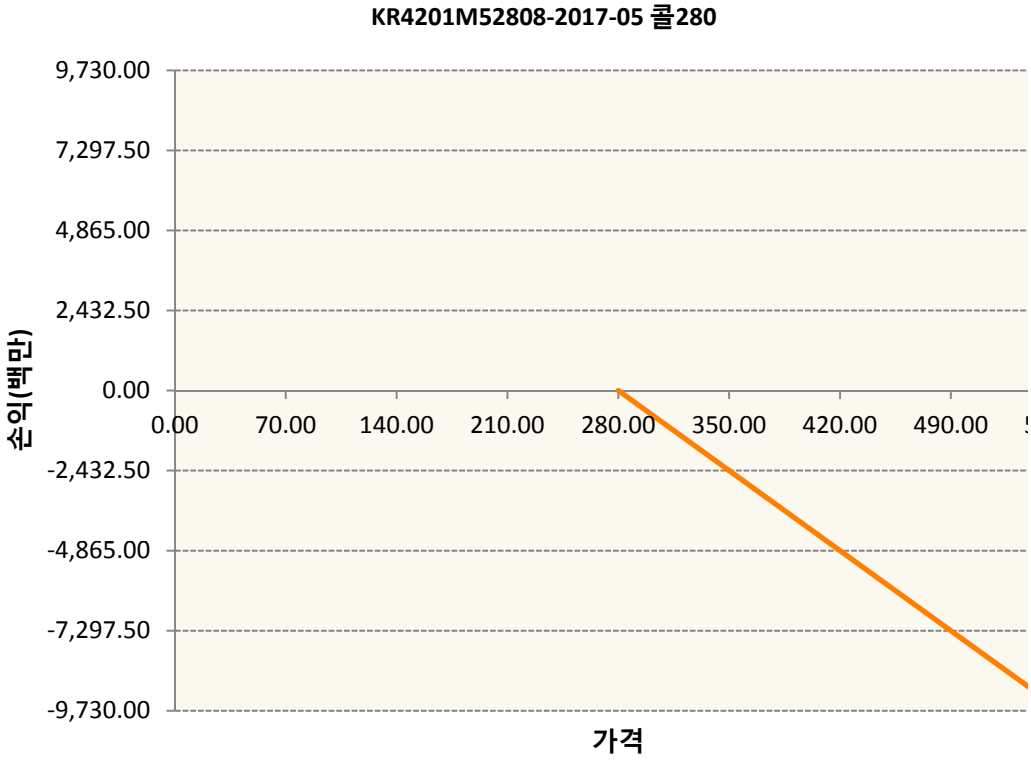
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,455	0	4,455	장내
누계	유가증권	옵션	0	14,933	-14,933	장내

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							349
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	86	86	85	85	84	83	81
-5.33%	84	82	81	78	76	73	69
-2.67%	70	65	60	55	50	44	38
0%	20	13	7	0	-7	-13	-20
2.67%	-78	-83	-87	-92	-97	-103	-108
5.33%	-207	-208	-210	-212	-215	-218	-221
8.00%	-344	-344	-345	-345	-346	-347	-349
KR4201M52(	2017-05 콜280						606

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	118	118	118	117	116	115	113
-5.33%	117	115	113	110	106	102	97
-2.67%	102	95	88	80	72	63	53
0%	36	24	12	0	-12	-24	-36
2.67%	-117	-127	-138	-148	-159	-170	-182
5.33%	-341	-345	-350	-356	-362	-369	-377
8.00%	-592	-593	-594	-596	-599	-602	-606

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

1,261

공시일	2017-04-19
기준일	2017-04-18

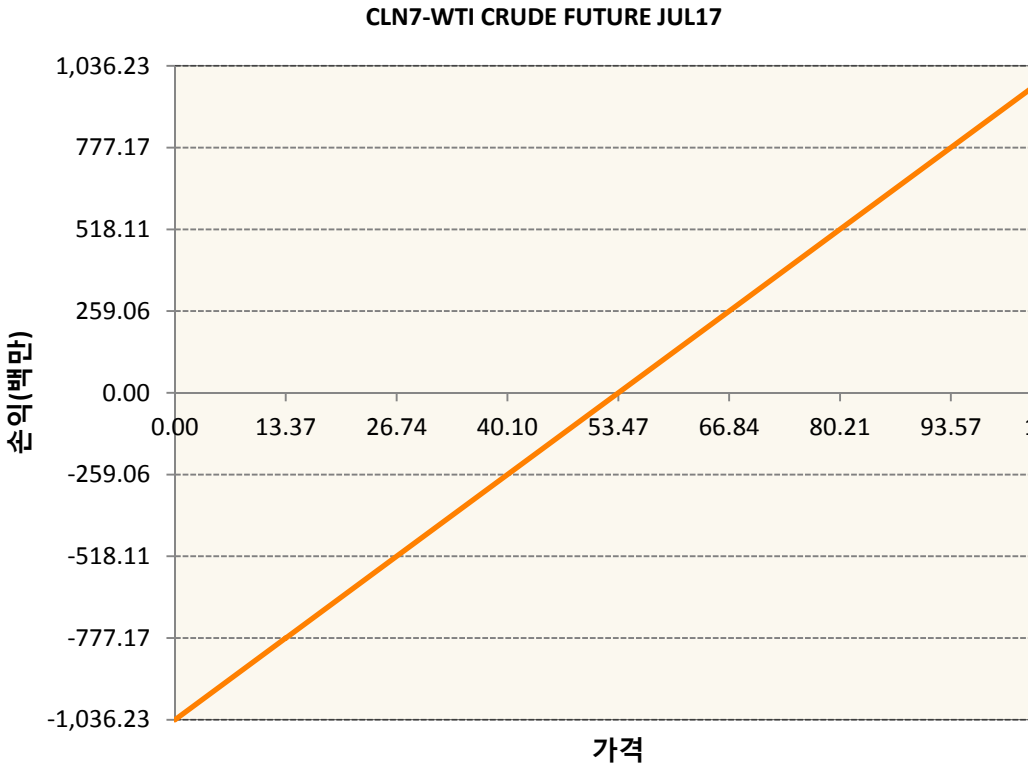
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

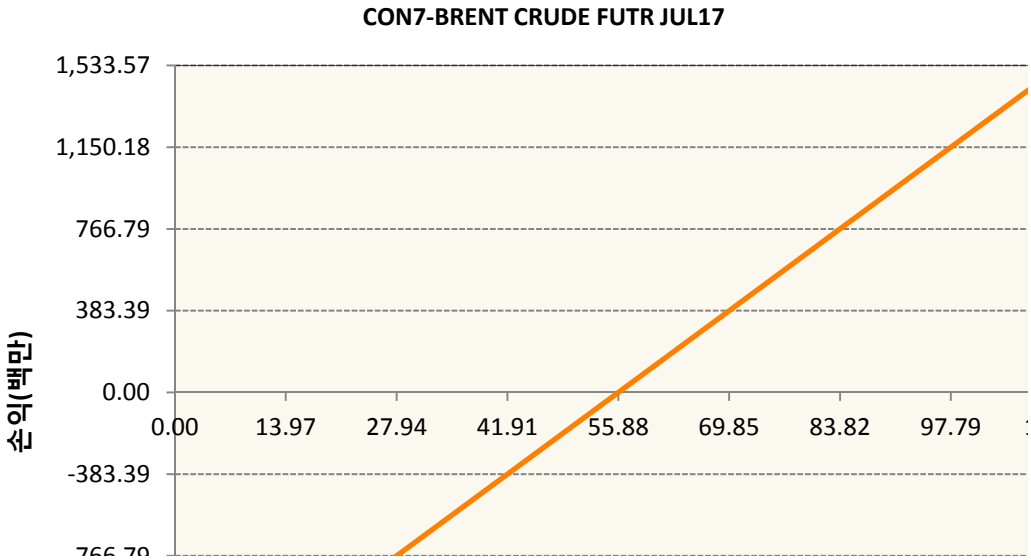
1. 계약금액

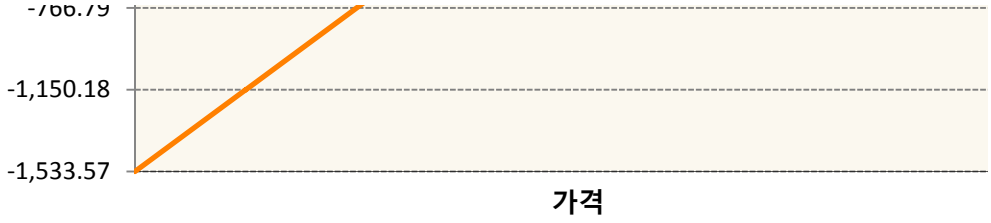
(단위:백만원)

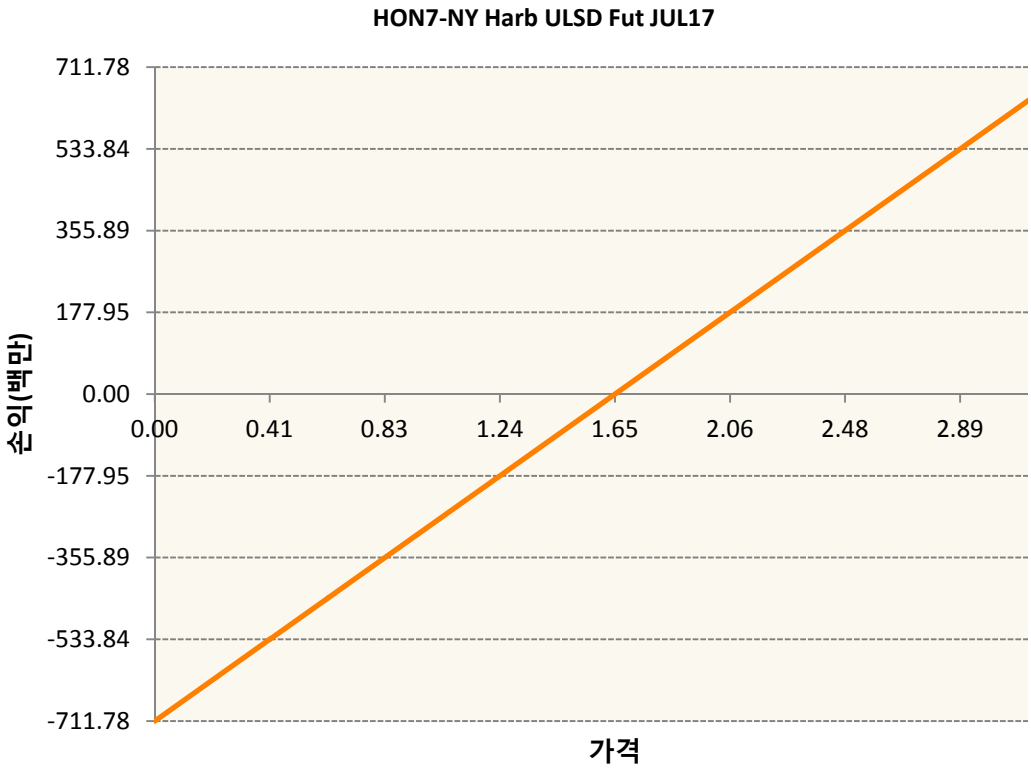
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,581	411	5,170	

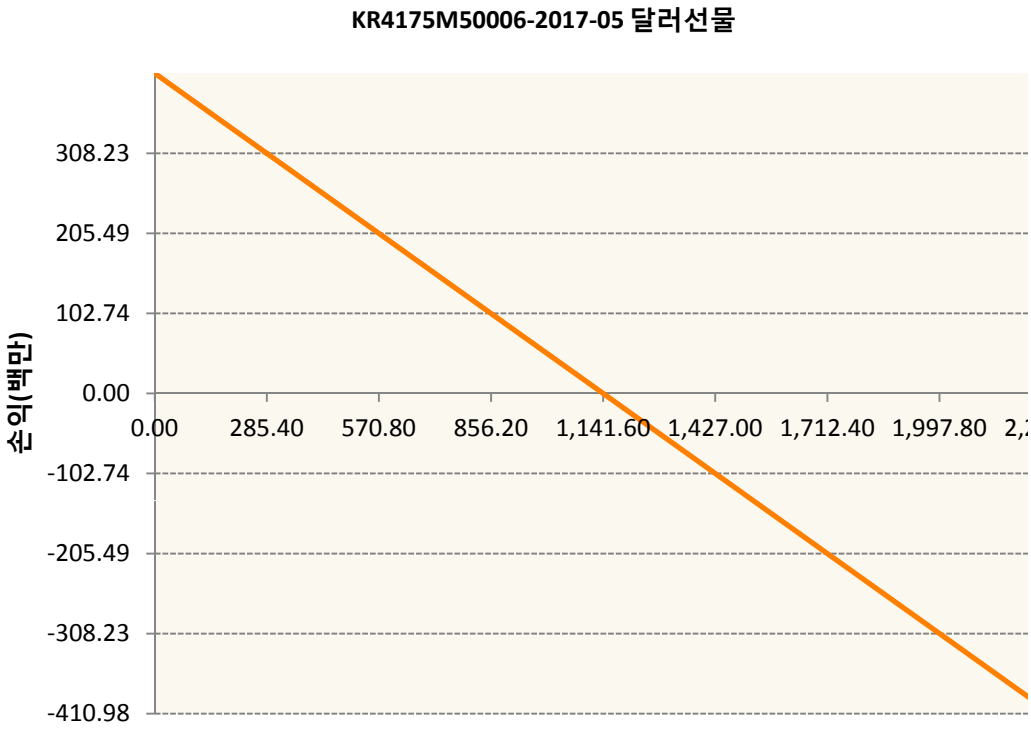
2. 만기시점의 손익구조



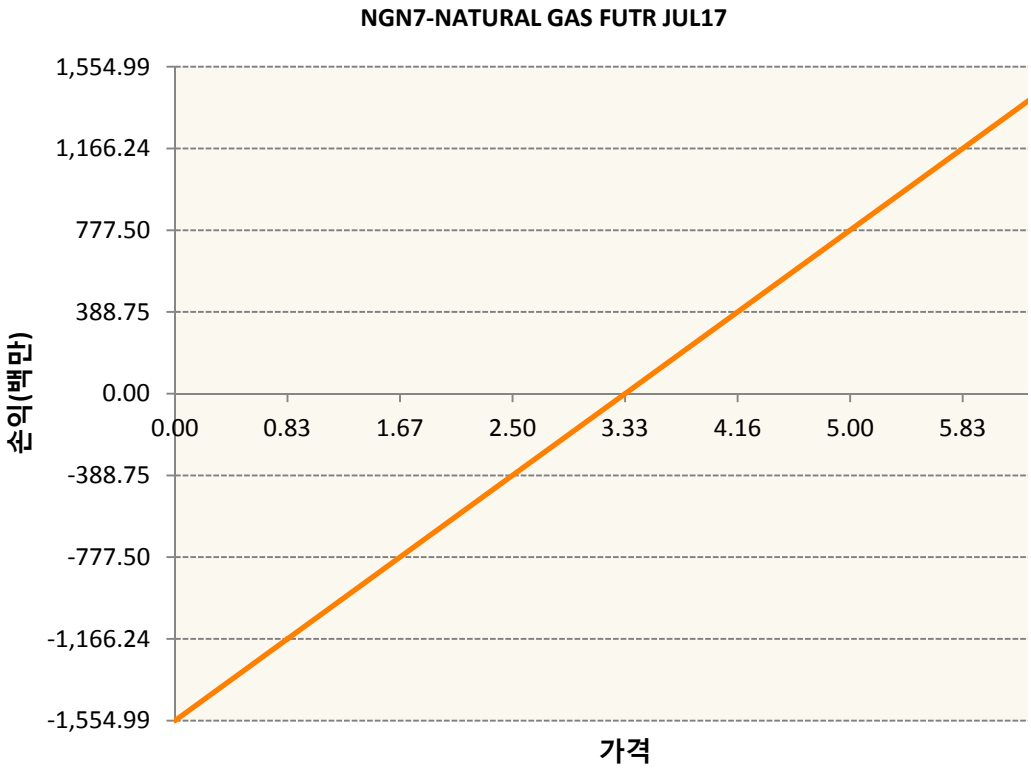


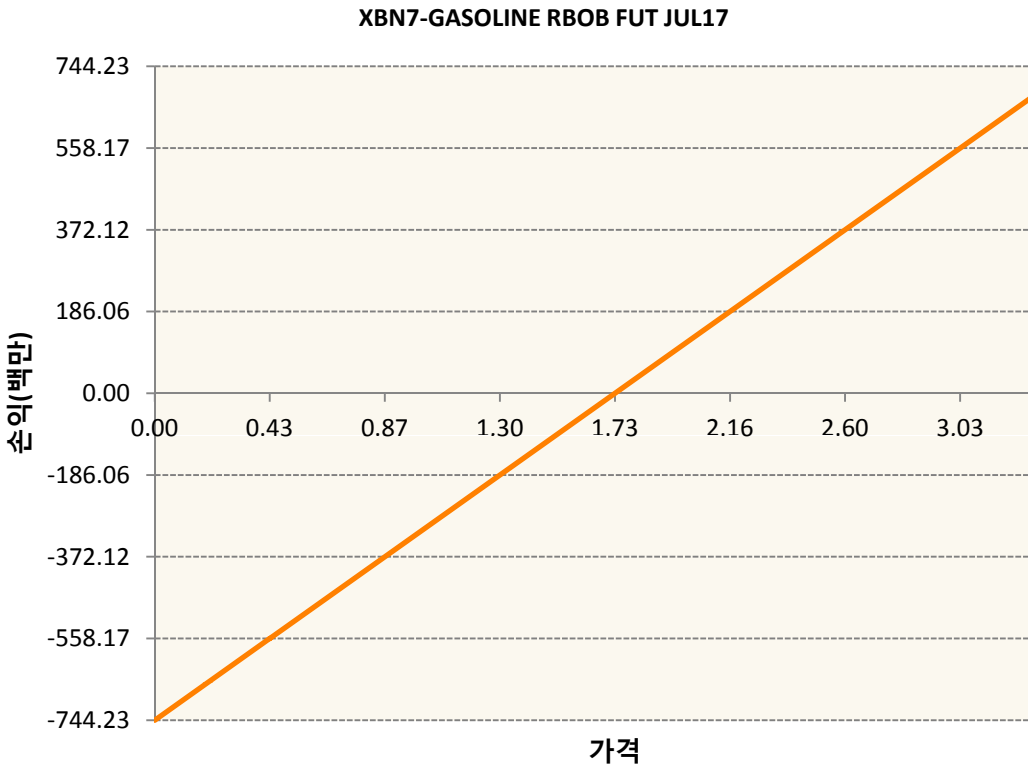

-1,150.18
-1,533.57
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
711.78
533.84
355.89
177.95
0.00
-177.95
-355.89
-533.84
-711.78
0.00
0.41
0.83
1.24
1.65
2.06
2.48
2.89
순이익(백만)
가격


KR4175M50006-2017-05 달러선물
308.23
205.49
102.74
0.00
-102.74
-205.49
-308.23
-410.98
0.00
285.40
570.80
856.20
1,141.60
1,427.00
1,712.40
1,997.80
순이익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,554.99
1,166.24
777.50
388.75
0.00
-388.75
-777.50
-1,166.24
-1,554.99
0.00
0.83
1.67
2.50
3.33
4.16
5.00
5.83
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
744.23
558.17
372.12
186.06
0.00
-186.06
-372.12
-558.17
-744.23
0.00
0.43
0.87
1.30
1.73
2.16
2.60
3.03
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN7	WTI CRUDE FUTURE JUL17	83
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	123
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	57
KR4175M50(	2017-05 달러선물	33
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	124
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	60

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

972

공시일	2017-04-19
기준일	2017-04-18

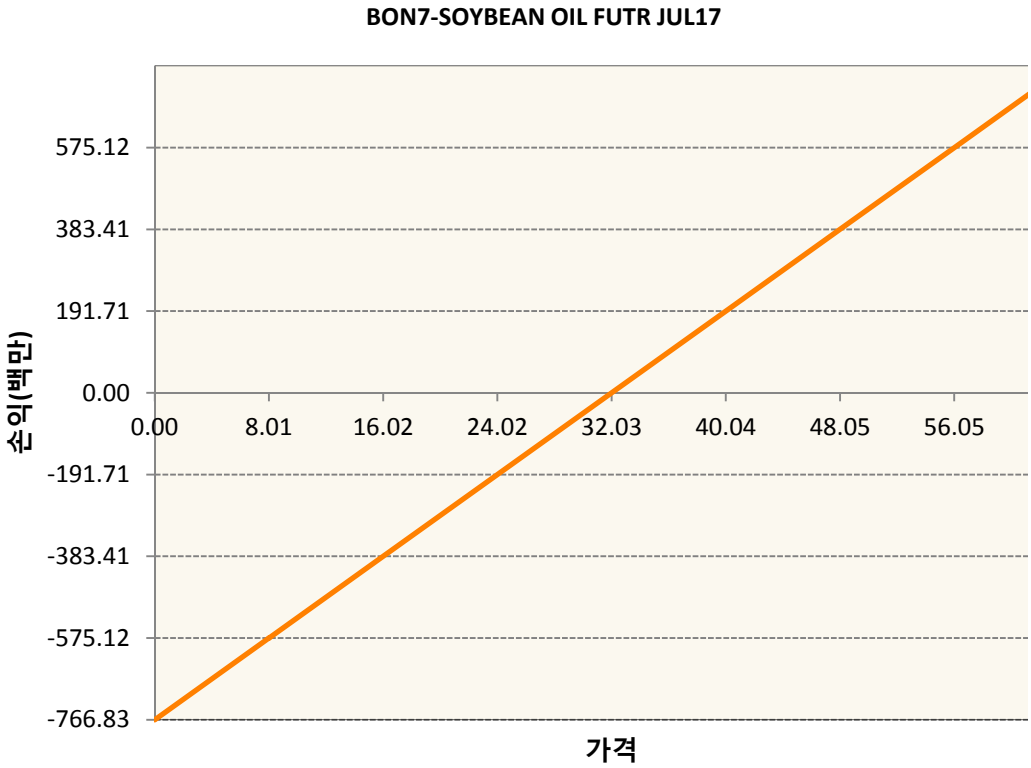
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

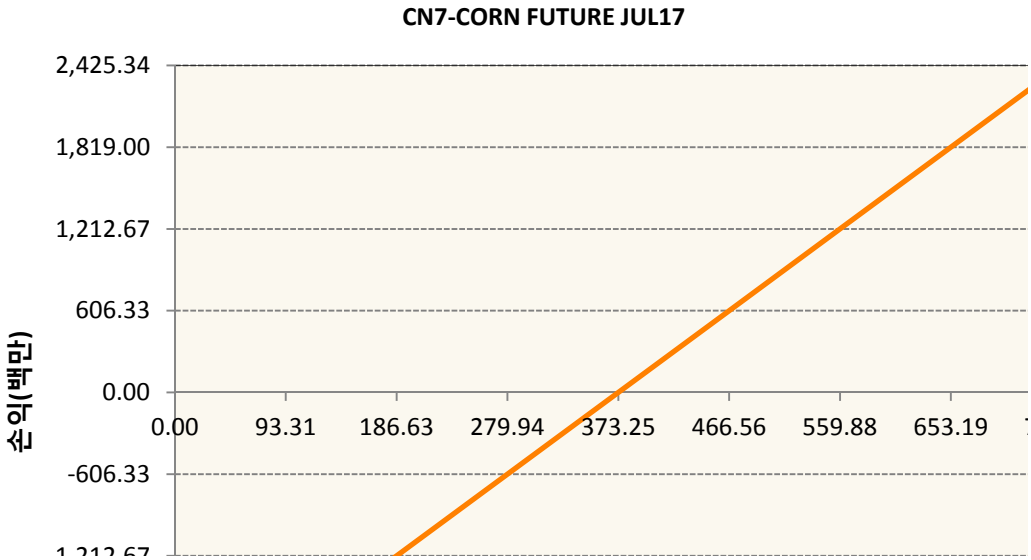
1. 계약금액

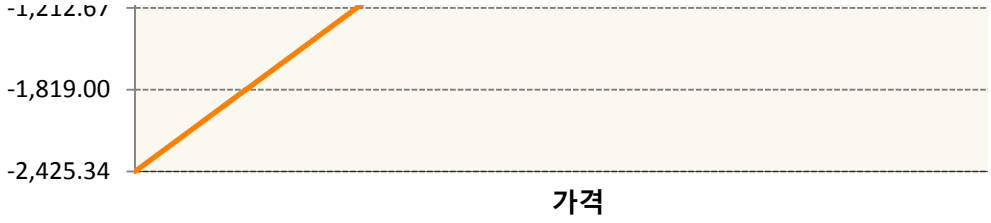
(단위:백만원)

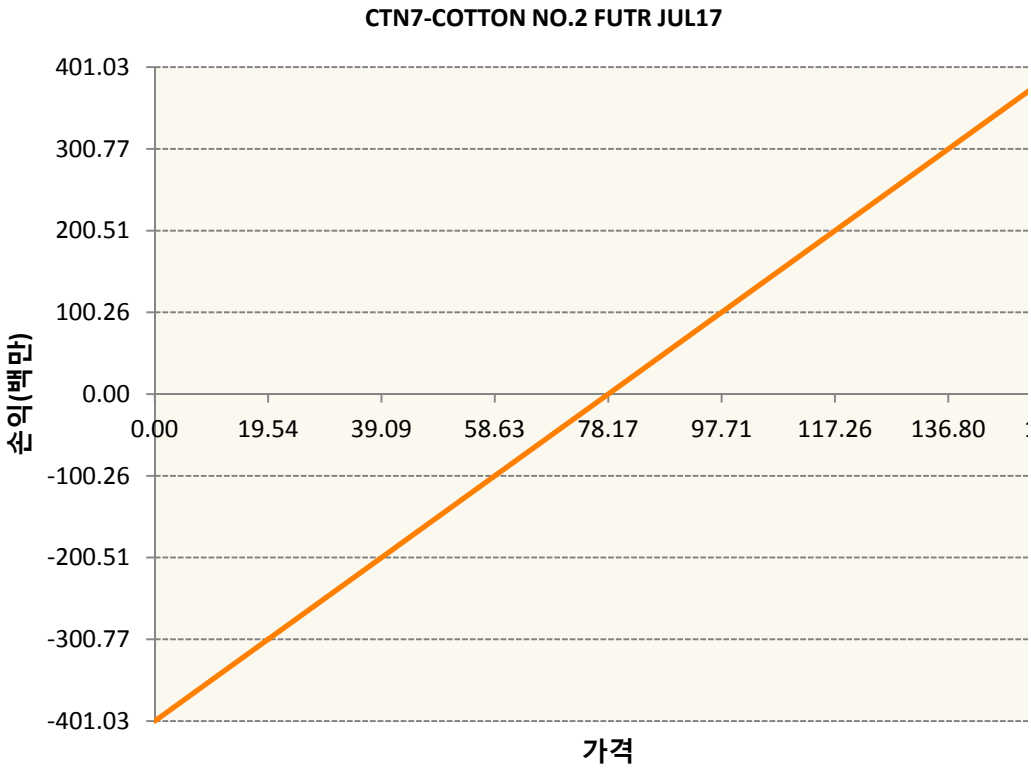
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,996	400	8,596	

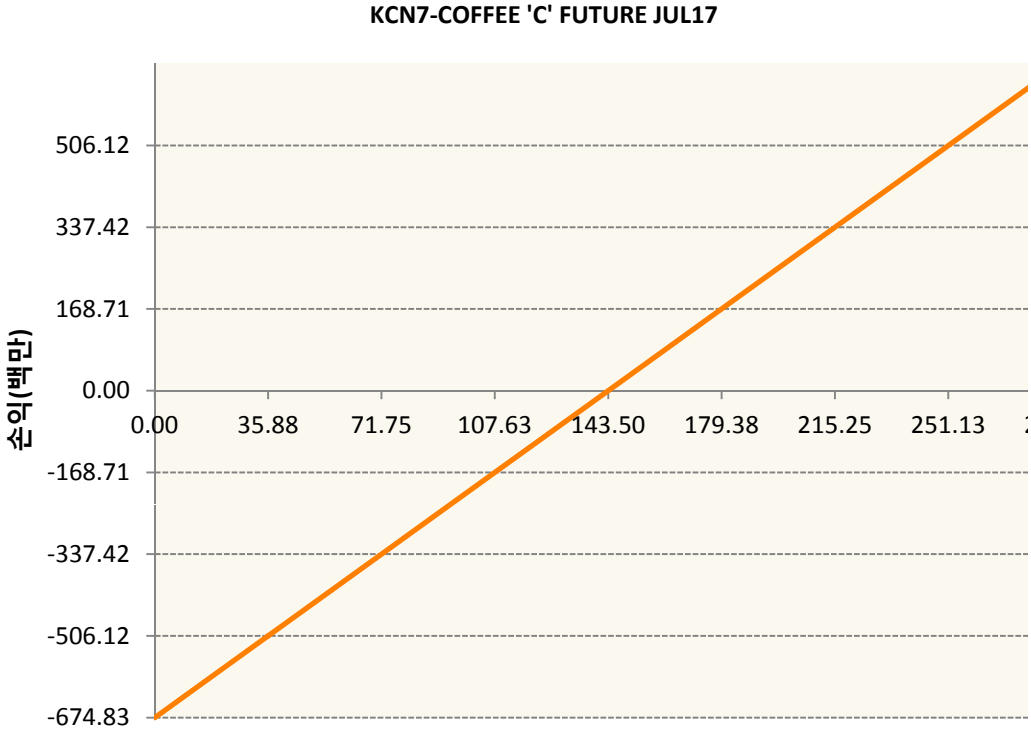
2. 만기시점의 손익구조





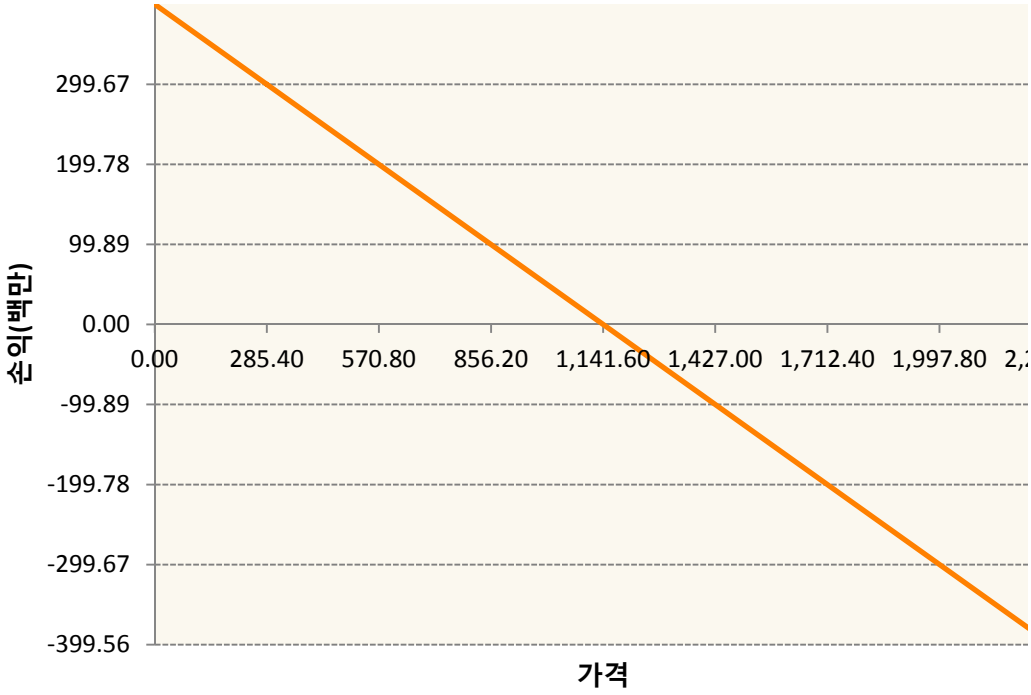

-1,819.00
-2,425.34
가격


CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
401.03
300.77
200.51
100.26
0.00
-100.26
-200.51
-300.77
-401.03
0.00
19.54
39.09
58.63
78.17
97.71
117.26
136.80
순익(백만)
가격

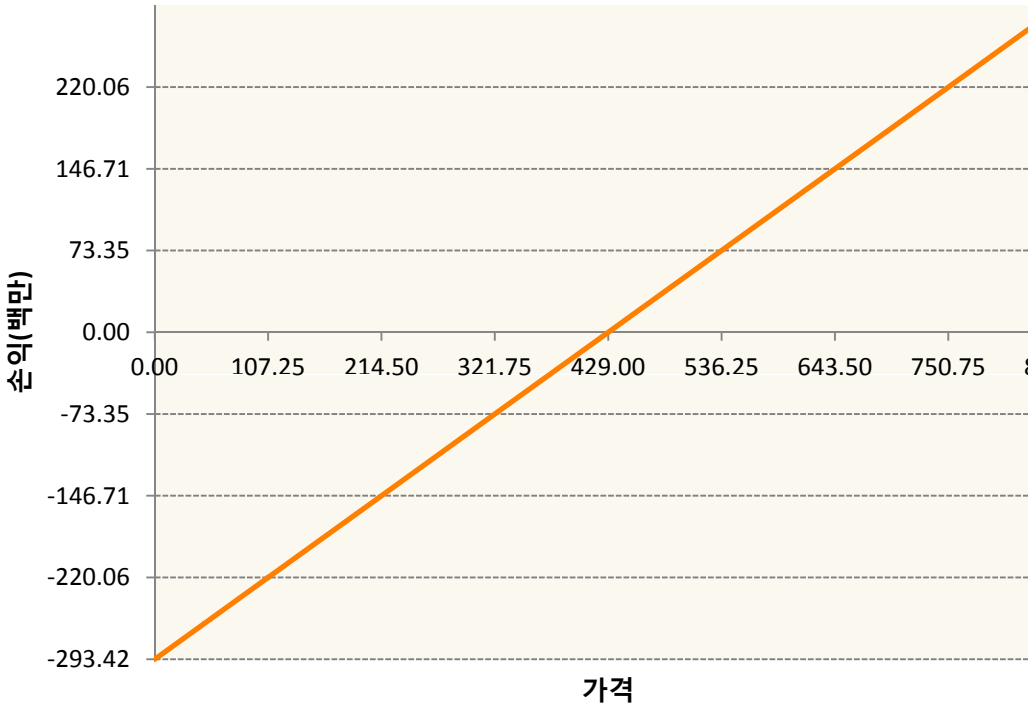

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
506.12
337.42
168.71
0.00
-168.71
-337.42
-506.12
-674.83
0.00
35.88
71.75
107.63
143.50
179.38
215.25
251.13
순익(백만)

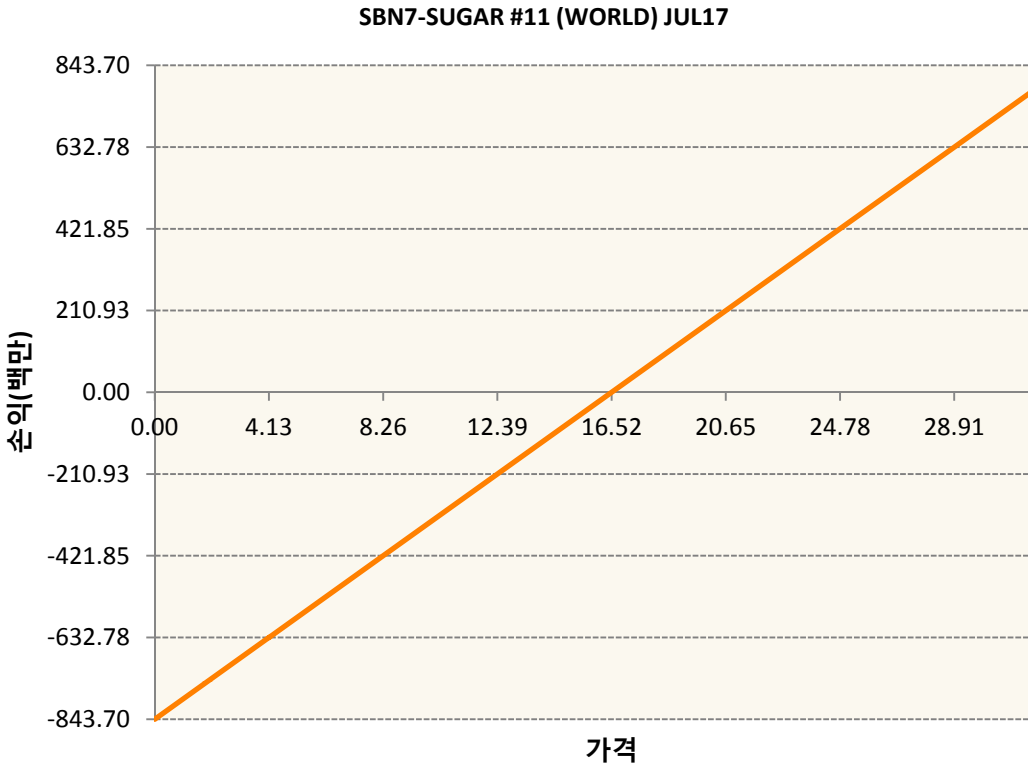
가격

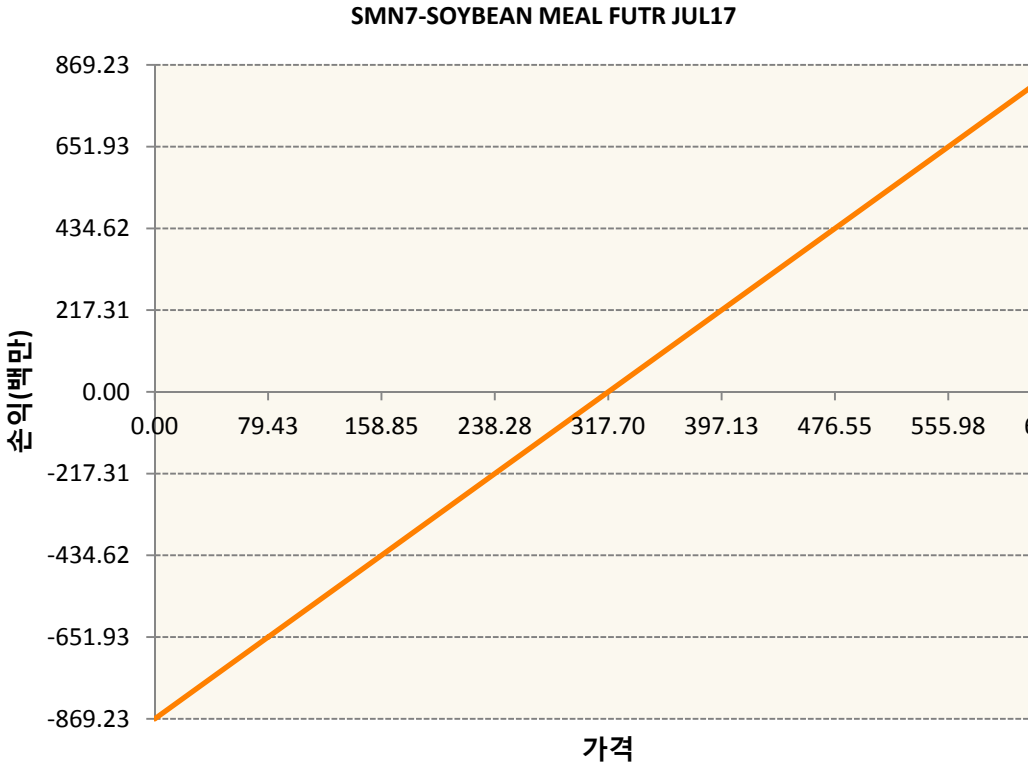
KR4175M50006-2017-05 달러선물

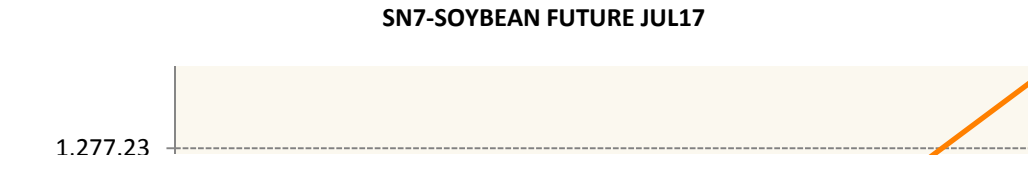


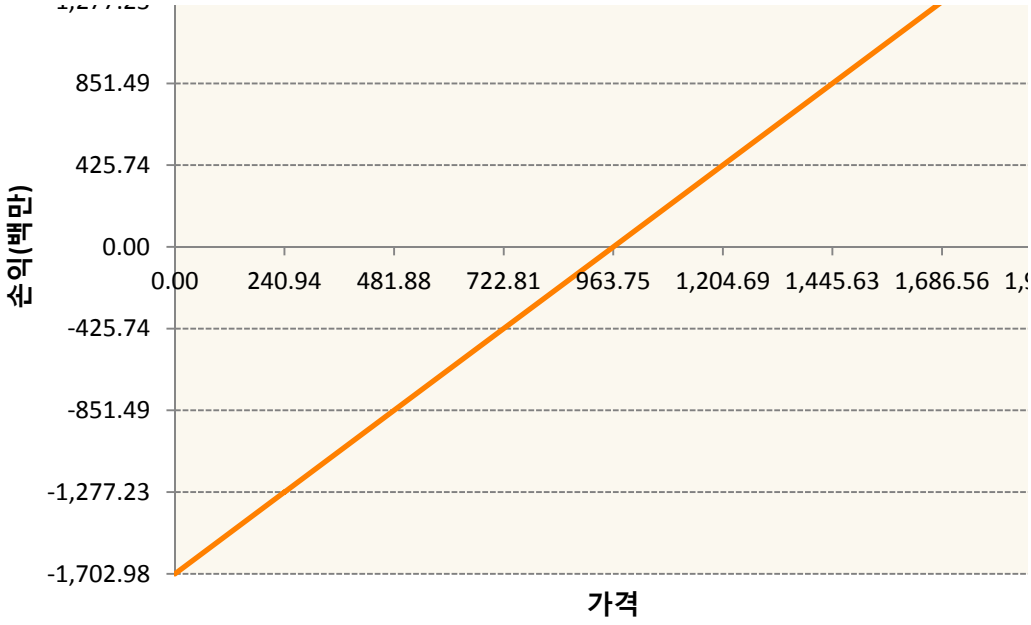
KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17

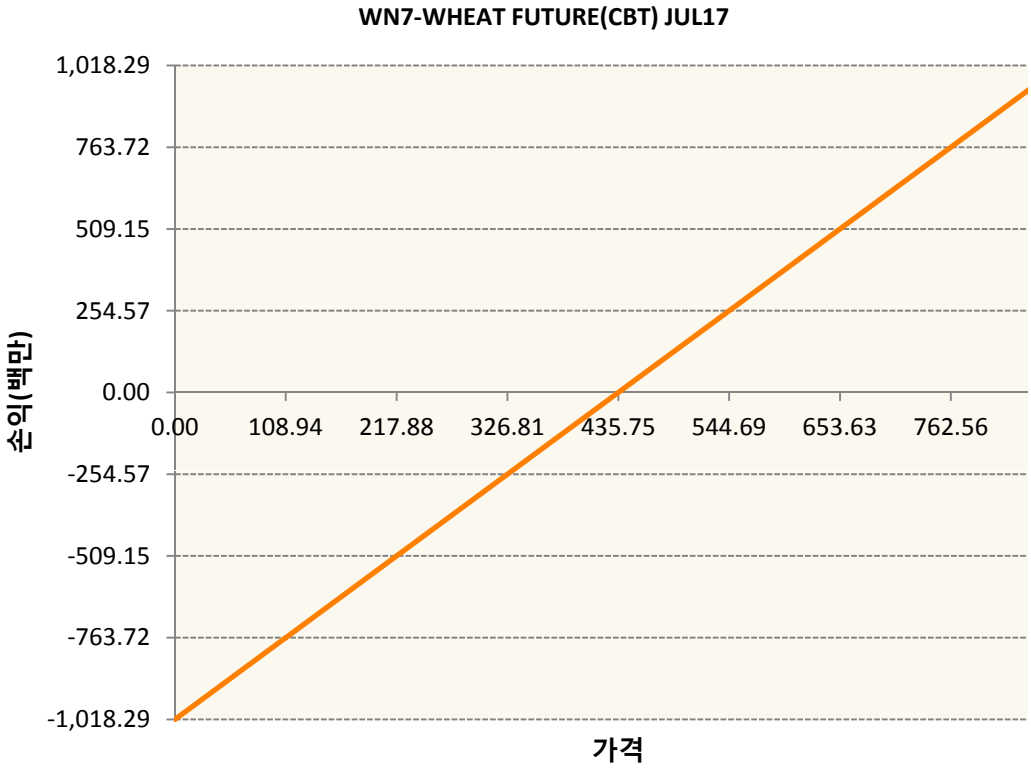



SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
843.70
632.78
421.85
210.93
0.00
-210.93
-421.85
-632.78
-843.70
0.00
4.13
8.26
12.39
16.52
20.65
24.78
28.91
손익(백만)
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
869.23
651.93
434.62
217.31
0.00
-217.31
-434.62
-651.93
-869.23
0.00
79.43
158.85
238.28
317.70
397.13
476.55
555.98
손익(백만)
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,277.23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	61
CN7	CORN FUTURE JUL17	194
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	32
KCN7	COFFEE 'C' FUTURE JUL17	54
KR4175M50(	2017-05 달러선물	32

KWN7	KC HRW WHEAT FUT JUL17	23
SBN7	SUGAR #11 (WORLD) JUL17	67
SMN7	SOYBEAN MEAL FUTR JUL17	70
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	136
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	81

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

881