공시일	2017-04-20
기준일	2017-04-19

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	2017-04-20
기준일	2017-04-19

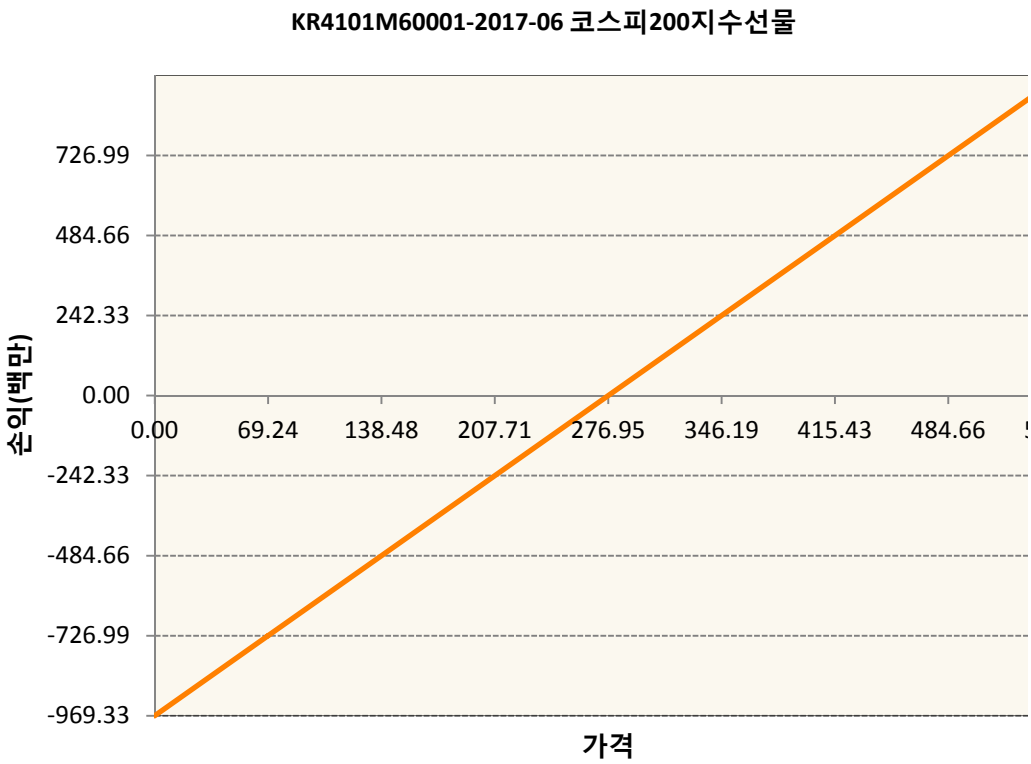
스마트인덱스모

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	969	0	969	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)

49

공시일	2017-04-20
기준일	2017-04-19

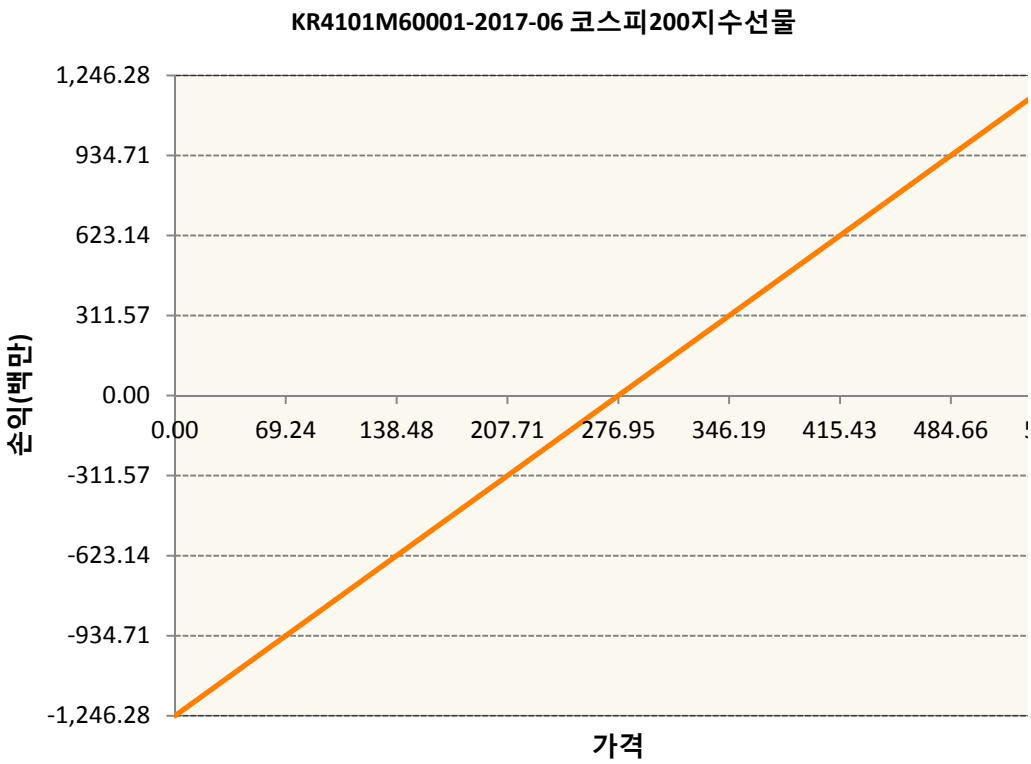
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,246	0	1,246	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%	-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%	100	100	100	100	100	100	100

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

64

공시일	2017-04-20
기준일	2017-04-19

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	952

* 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	2017-04-20
기준일	2017-04-19

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	385

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

403

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-04-20
기준일	2017-04-19

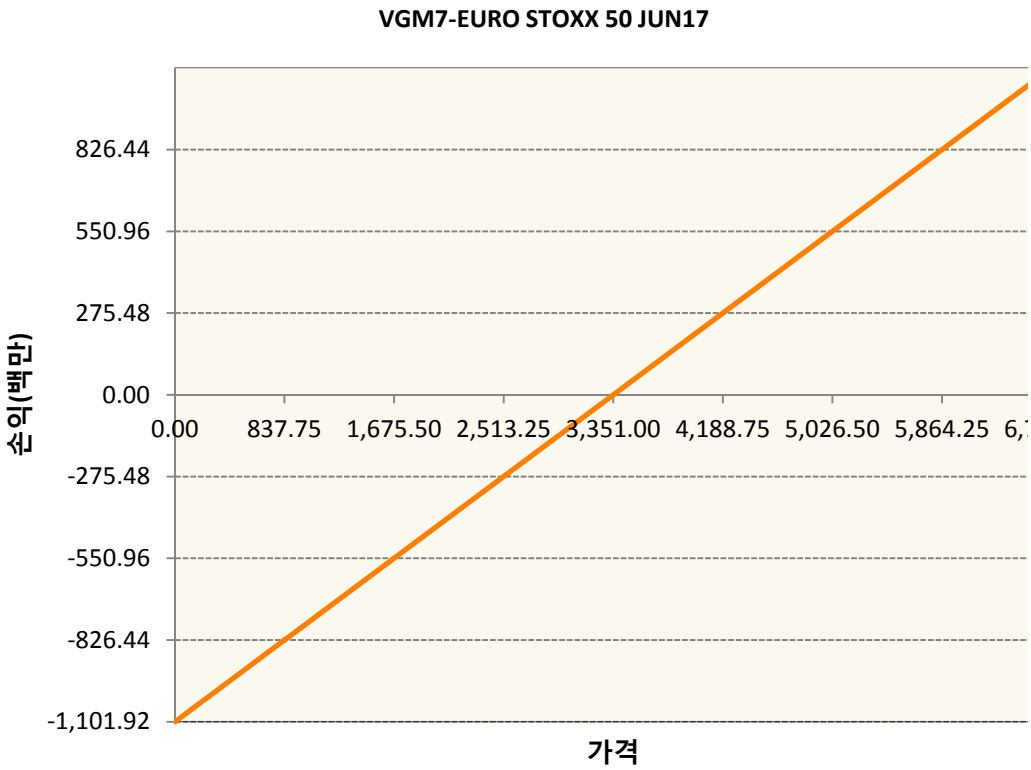
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,102	0	1,102	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM7	EURO STOXX 50 JUN17	88

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

(단위:백만원)

89

공시일	2017-04-20
기준일	2017-04-19

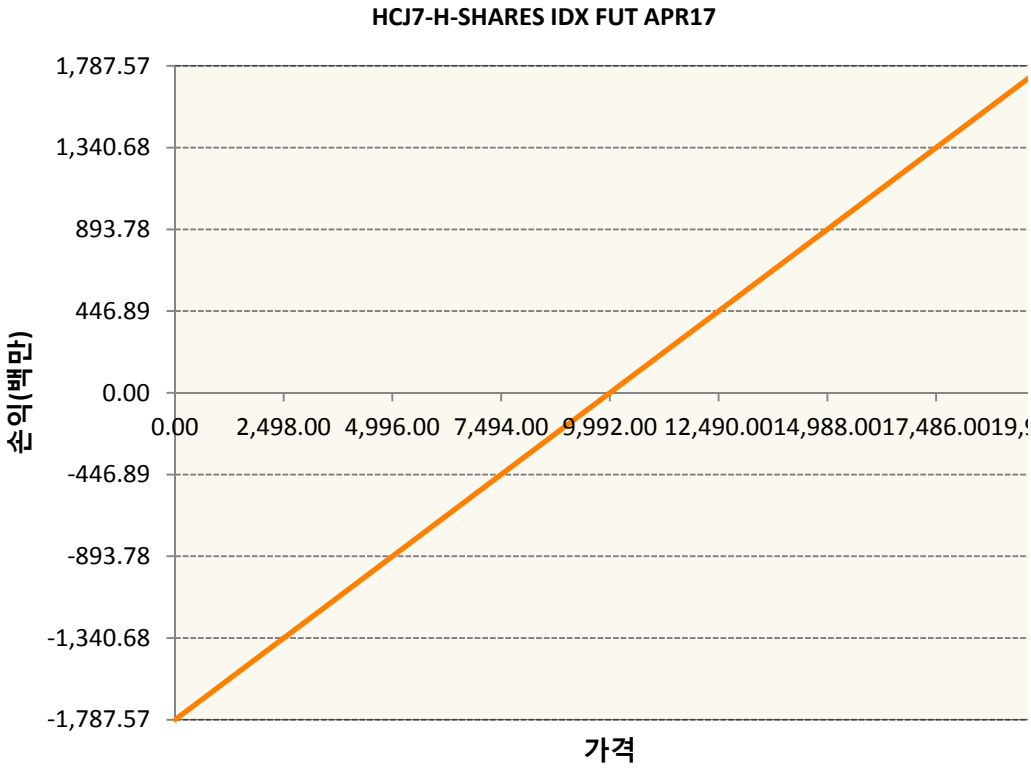
차이나인덱스모(주식-파생형)

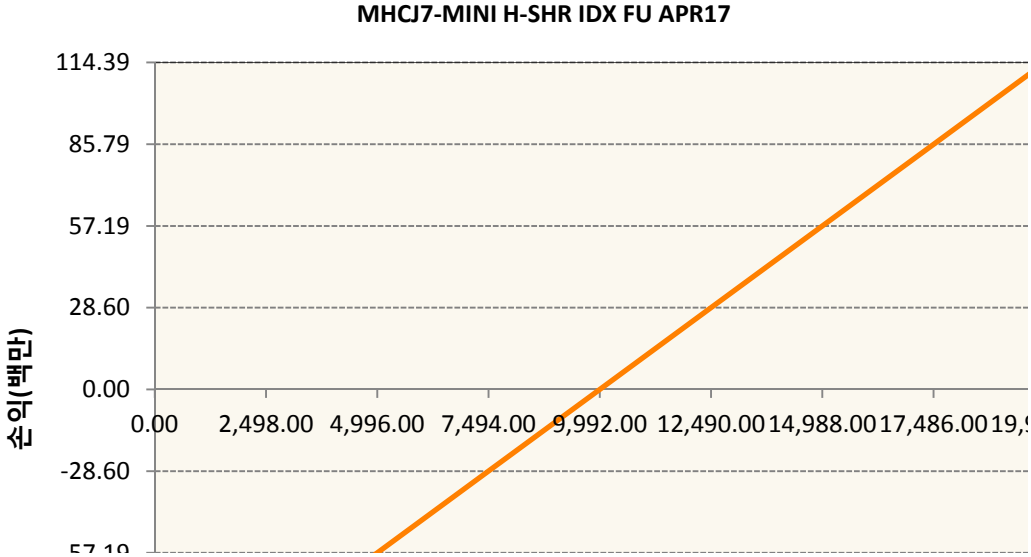
1. 계약금액

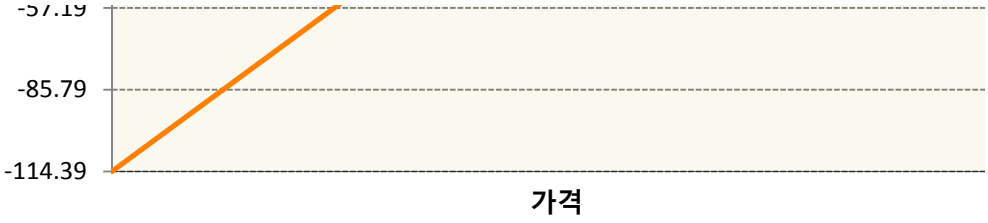
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,902	0	1,902	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCJ7	H-SHARES IDX FUT APR17	143
MHCJ7	MINI H-SHR IDX FU APR17	9

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

163

공시일	2017-04-20
기준일	2017-04-19

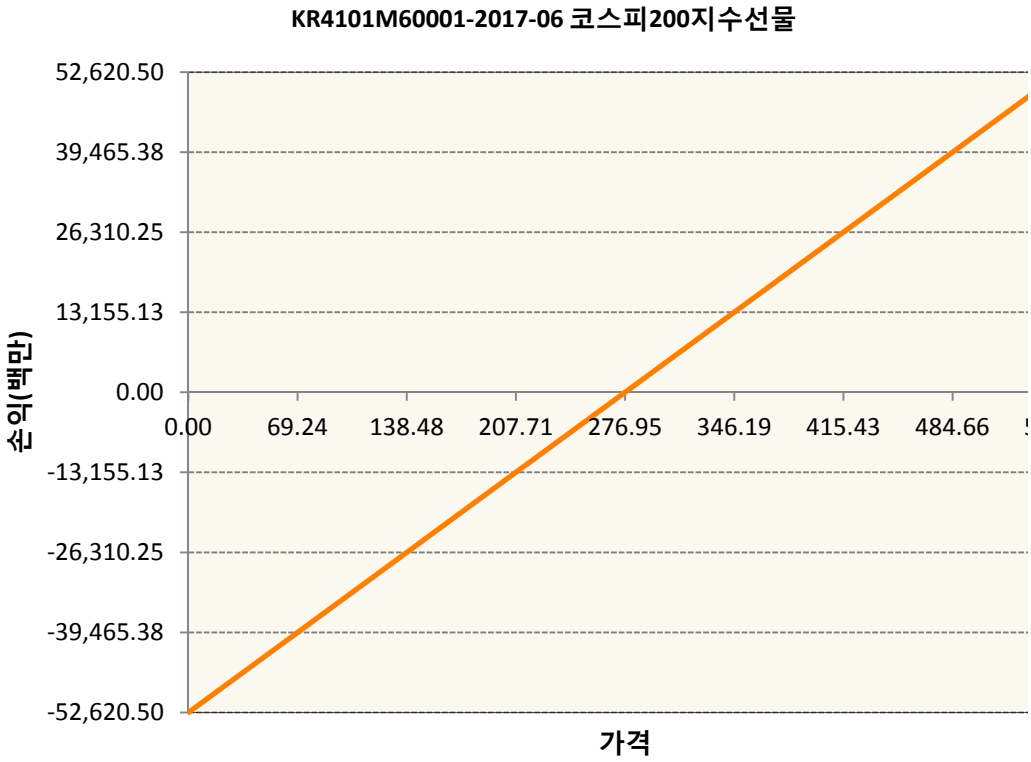
커버드콜모(주식혼합-파생형)

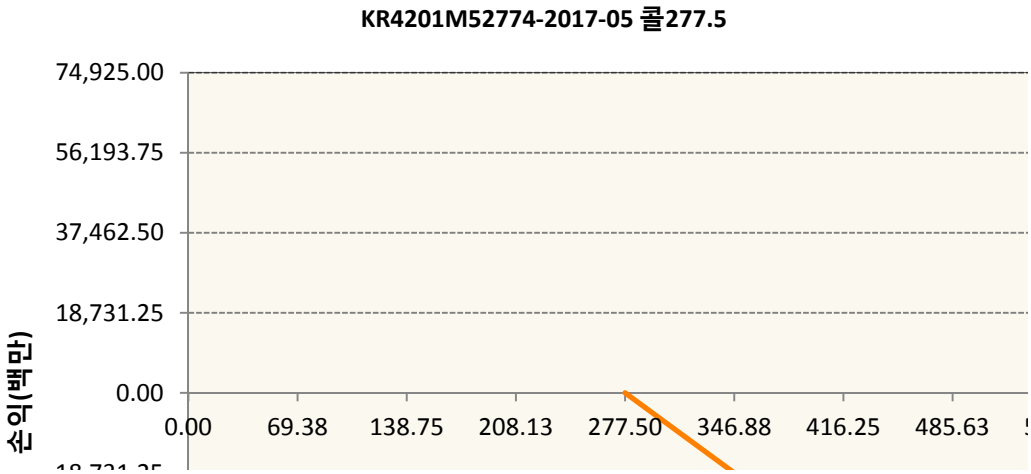
1. 계약금액

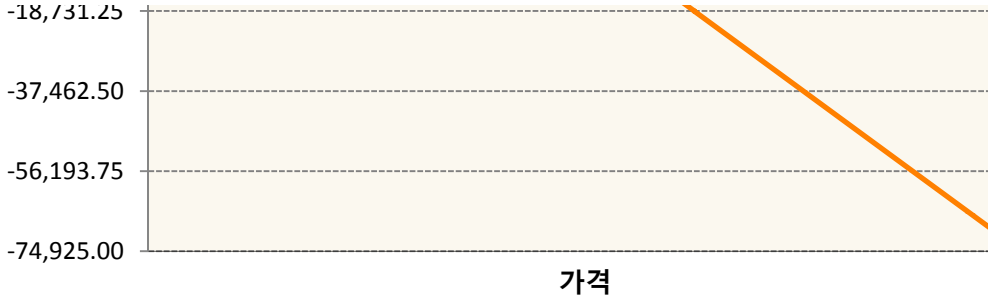
(단위:백만원)

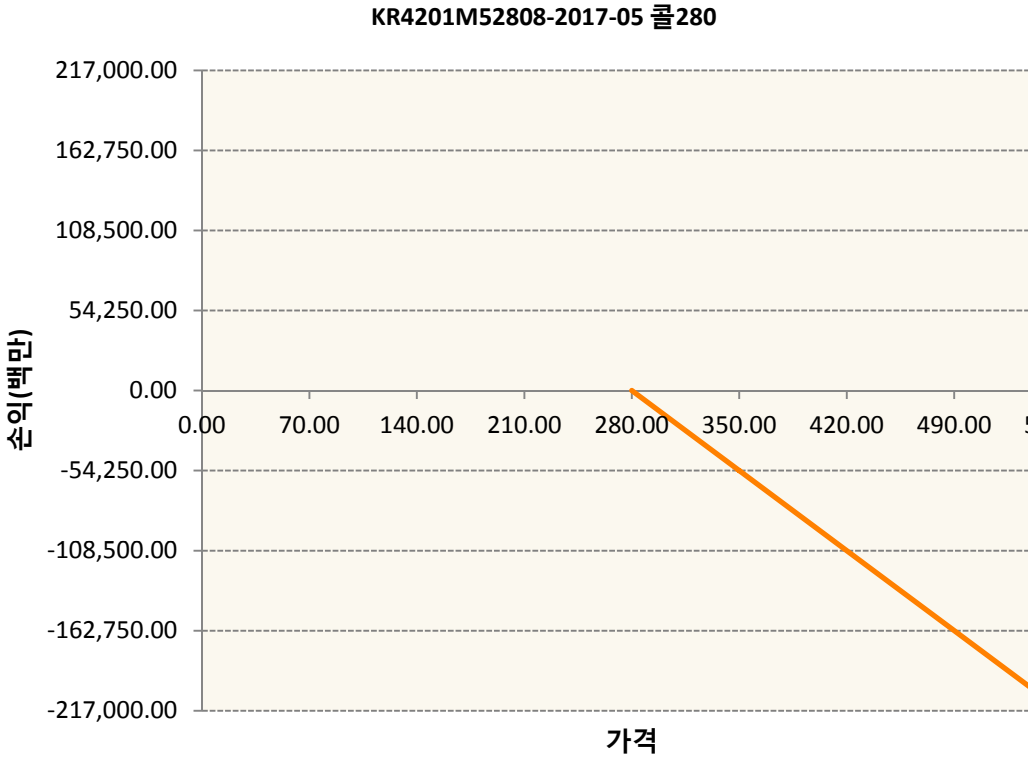
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	6,921	0	6,921	장내
신규	유가증권	옵션	0	28,179	-28,179	장내
누계	유가증권	선물	52,621	0	52,621	장내
누계	유가증권	옵션	0	347,425	-347,425	장내

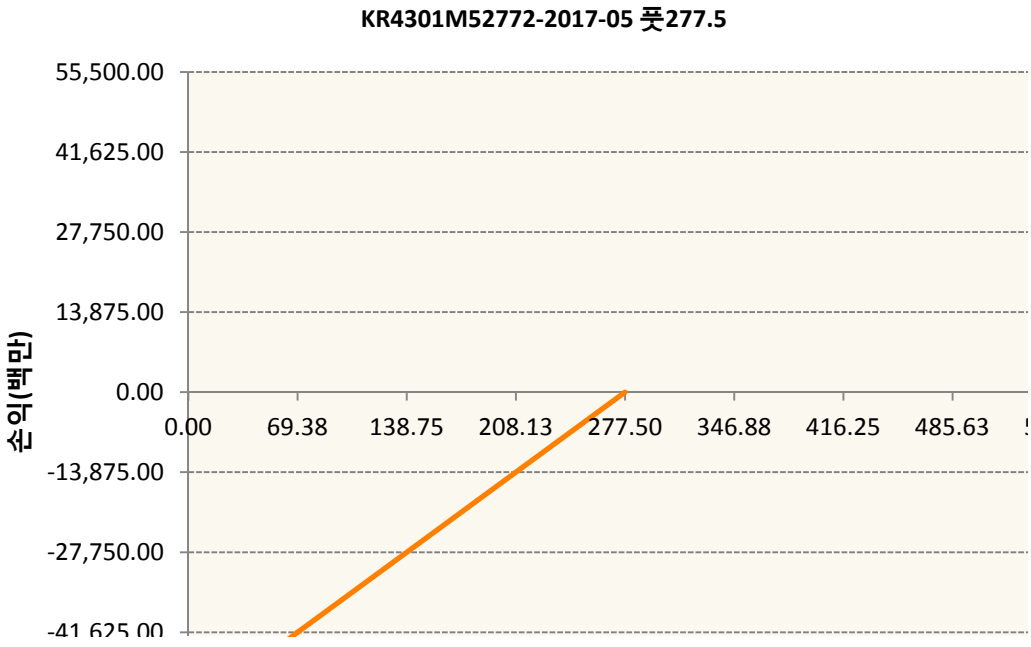
2. 만기시점의 손익구조

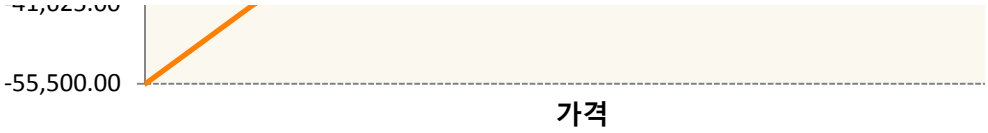





-18,731.25
-37,462.50
-56,193.75
-74,925.00
가격


KR4201M52808-2017-05 콜280
217,000.00
162,750.00
108,500.00
54,250.00
0.00
-54,250.00
-108,500.00
-162,750.00
-217,000.00
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							4,203
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,203	-4,203	-4,203	-4,203	-4,203	-4,203	-4,203
-5.33%	-2,802	-2,802	-2,802	-2,802	-2,802	-2,802	-2,802
-2.67%	-1,401	-1,401	-1,401	-1,401	-1,401	-1,401	-1,401
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,401	1,401	1,401	1,401	1,401	1,401	1,401
5.33%	2,802	2,802	2,802	2,802	2,802	2,802	2,802
8.00%	4,203	4,203	4,203	4,203	4,203	4,203	4,203
KR4201M52 2017-05 콜277.5							4,796
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	976	975	972	968	960	950	936
-5.33%	963	950	932	909	880	846	807
-2.67%	835	782	724	660	594	524	451
0%	276	184	92	0	-92	-185	-277
2.67%	-981	-1,051	-1,125	-1,202	-1,282	-1,363	-1,446
5.33%	-2,754	-2,780	-2,812	-2,850	-2,894	-2,943	-2,997
8.00%	-4,709	-4,713	-4,721	-4,733	-4,749	-4,770	-4,796
KR4201M52 2017-05 콜280							12,759
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,018	2,017	2,013	2,006	1,994	1,975	1,949
-5.33%	2,003	1,984	1,953	1,910	1,852	1,781	1,696
-2.67%	1,810	1,704	1,579	1,437	1,281	1,112	934
0%	742	498	251	0	-253	-508	-765
2.67%	-2,178	-2,422	-2,670	-2,922	-3,177	-3,434	-3,693
5.33%	-6,874	-6,988	-7,121	-7,272	-7,437	-7,614	-7,802
8.00%	-12,379	-12,405	-12,445	-12,501	-12,572	-12,658	-12,759
KR4301M52 2017-05 풋277.5							3,726
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,696	-3,697	-3,699	-3,703	-3,708	-3,716	-3,726
-5.33%	-2,233	-2,242	-2,256	-2,273	-2,294	-2,320	-2,348
-2.67%	-854	-894	-937	-984	-1,033	-1,085	-1,139

0%	205	136	68	0	-68	-137	-205
2.67%	746	694	639	582	524	463	402
5.33%	906	887	863	835	802	766	726
8.00%	931	928	922	913	901	886	866

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

25,235

공시일	2017-04-20
기준일	2017-04-19

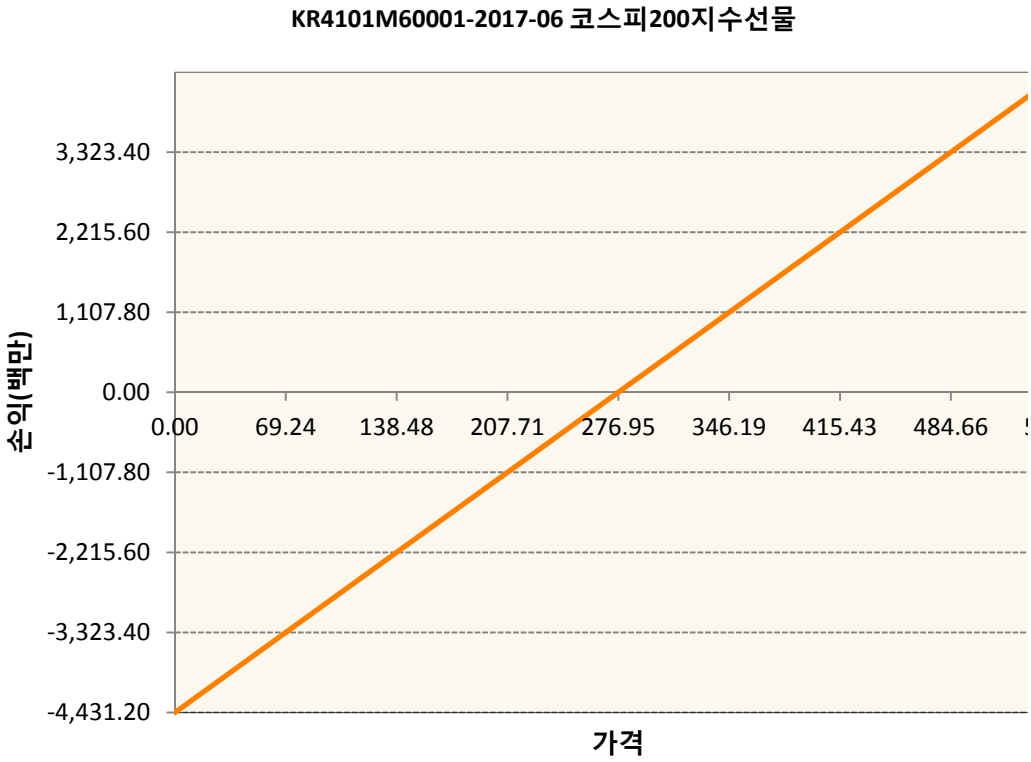
커버드콜목표전환형증권투자신탁

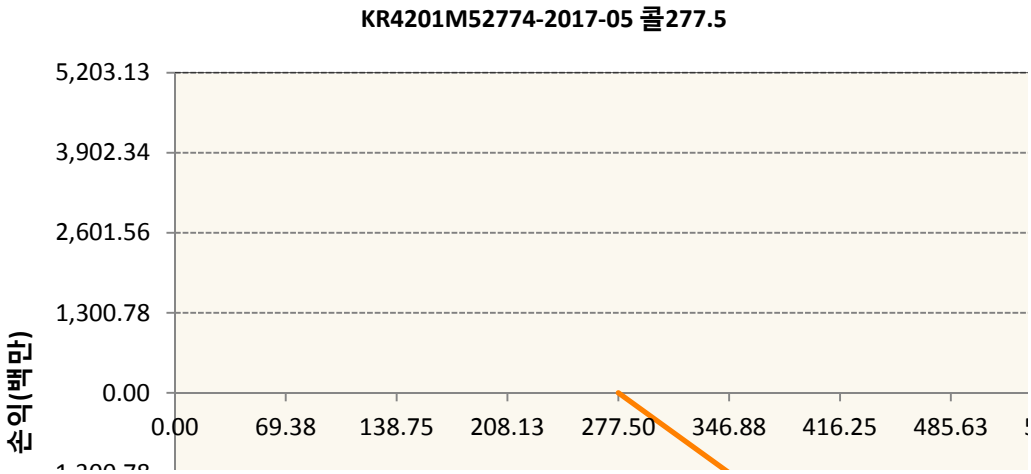
1. 계약금액

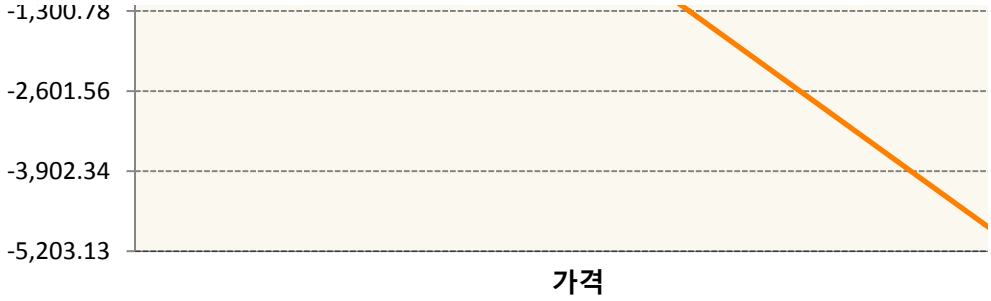
(단위:백만원)

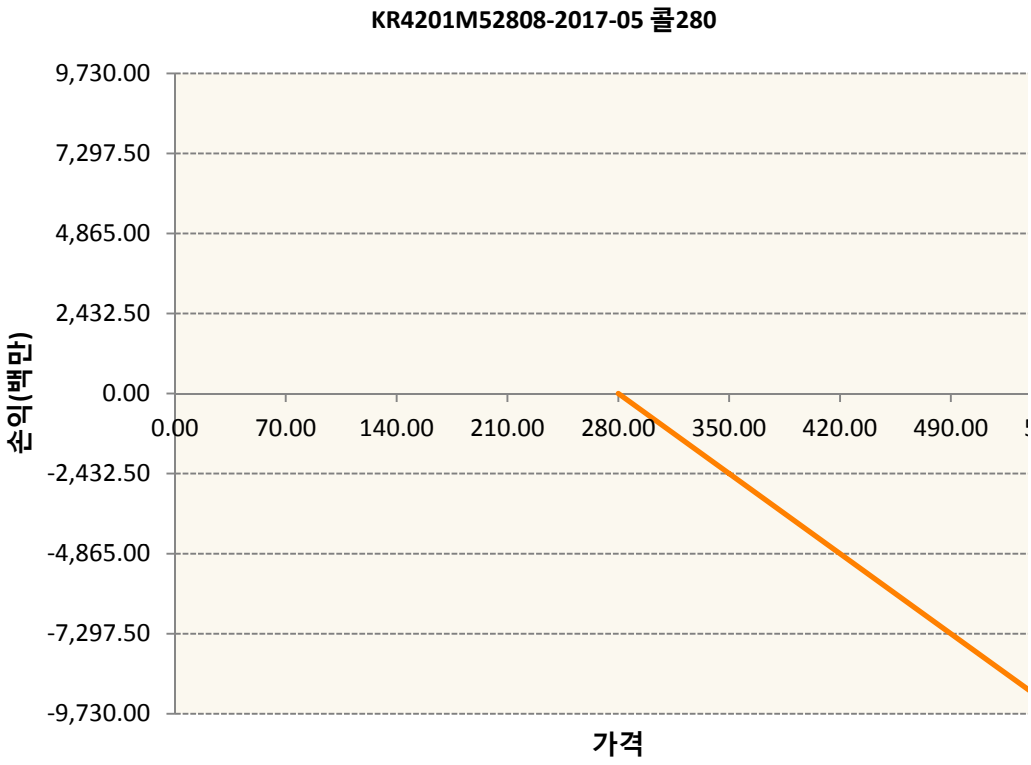
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,431	0	4,431	장내
누계	유가증권	옵션	0	14,933	-14,933	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							354
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-354	-354	-354	-354	-354	-354	-354
-5.33%	-236	-236	-236	-236	-236	-236	-236
-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%	236	236	236	236	236	236	236
8.00%	354	354	354	354	354	354	354
KR4201M52 2017-05 콜277.5							333
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	68	68	68	67	67	66	65
-5.33%	67	66	65	63	61	59	56
-2.67%	58	54	50	46	41	36	31
0%	19	13	6	0	-6	-13	-19
2.67%	-68	-73	-78	-84	-89	-95	-100
5.33%	-191	-193	-195	-198	-201	-204	-208
8.00%	-327	-327	-328	-329	-330	-331	-333
	KR4201M52(	2017-05 콜280					572

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	90	90	90	90	89	89	87
-5.33%	90	89	88	86	83	80	76
-2.67%	81	76	71	64	57	50	42
0%	33	22	11	0	-11	-23	-34
2.67%	-98	-109	-120	-131	-142	-154	-166
5.33%	-308	-313	-319	-326	-333	-341	-350
8.00%	-555	-556	-558	-561	-564	-568	-572

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

1,180

공시일	2017-04-20
기준일	2017-04-19

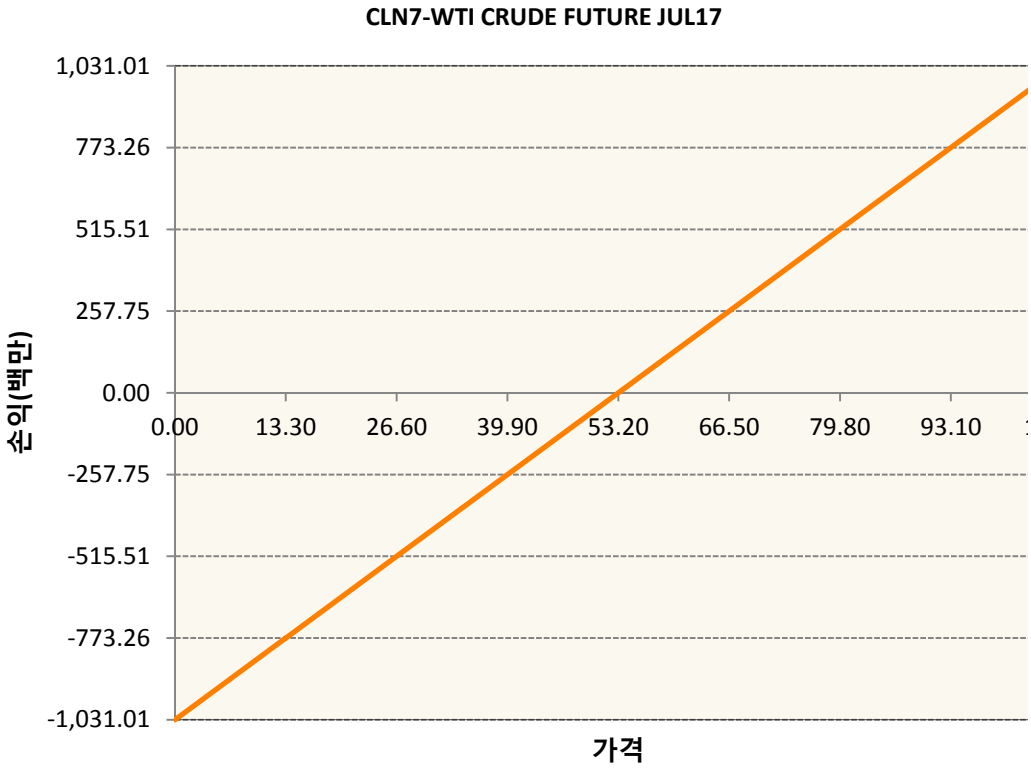
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

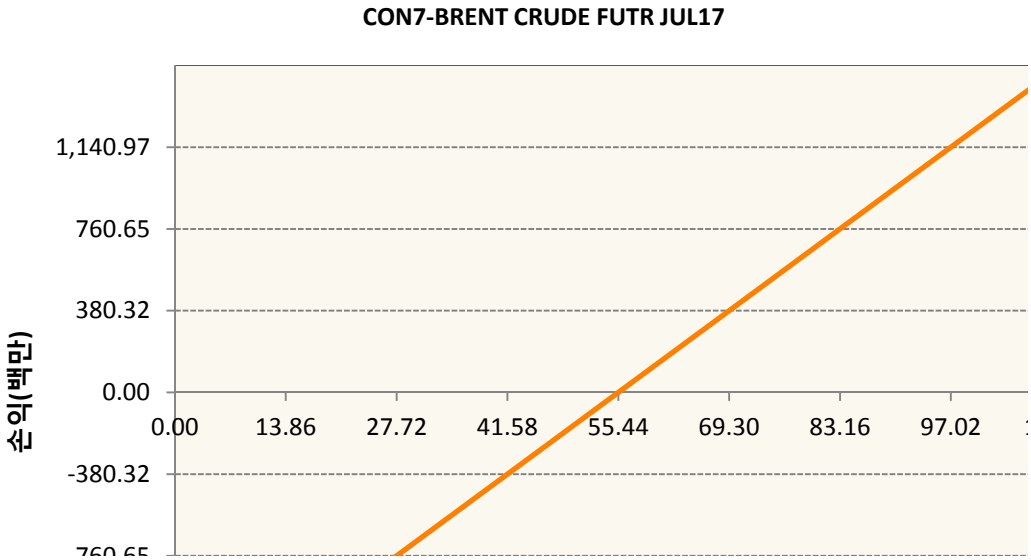
1. 계약금액

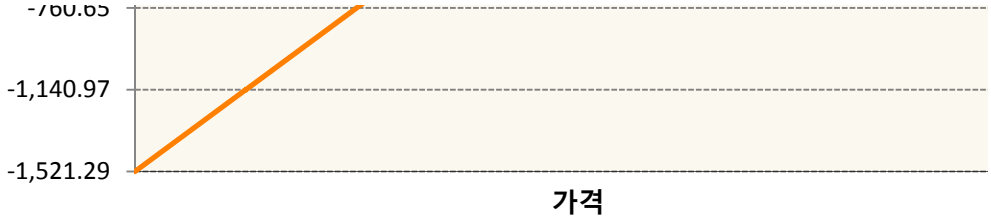
(단위:백만원)

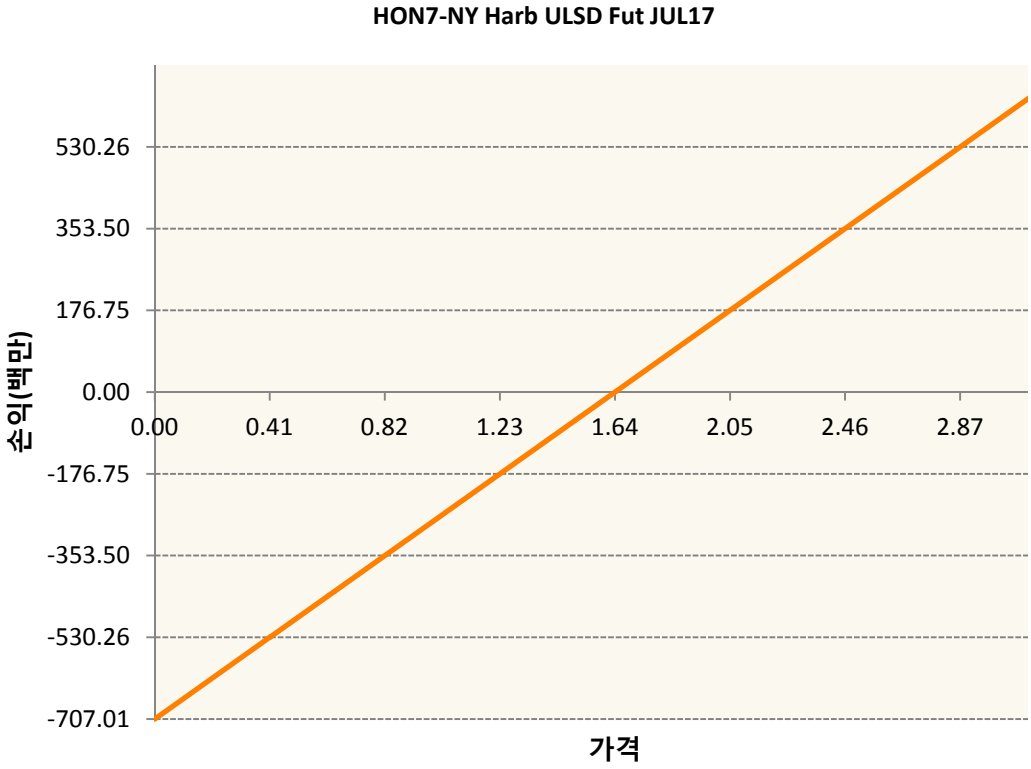
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,547	410	5,137	

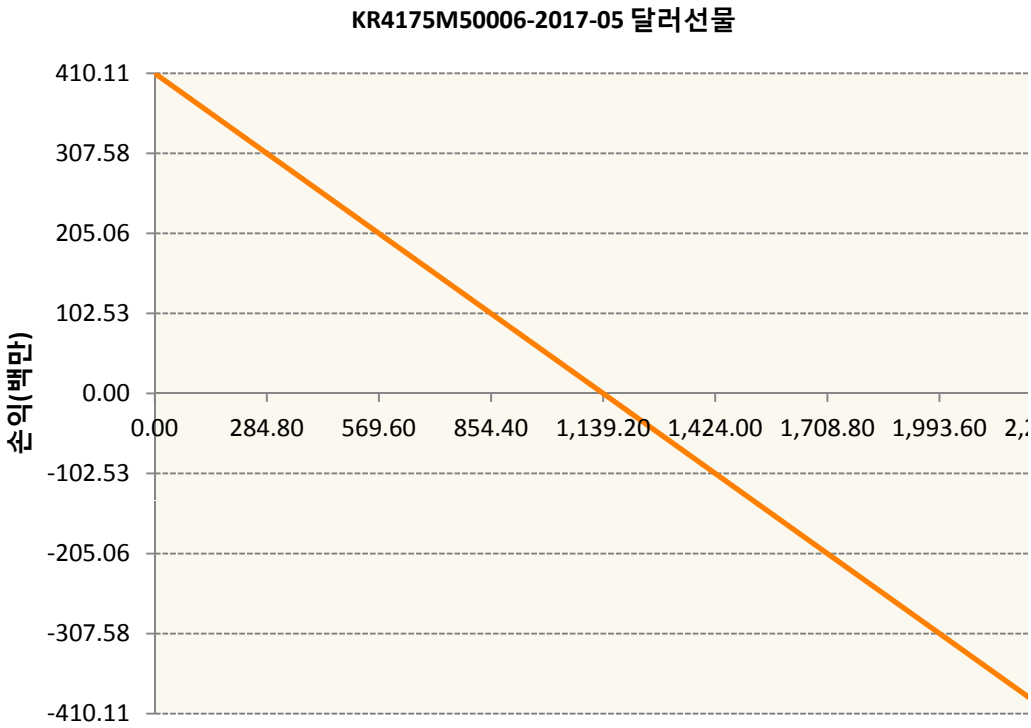
2. 만기시점의 손익구조



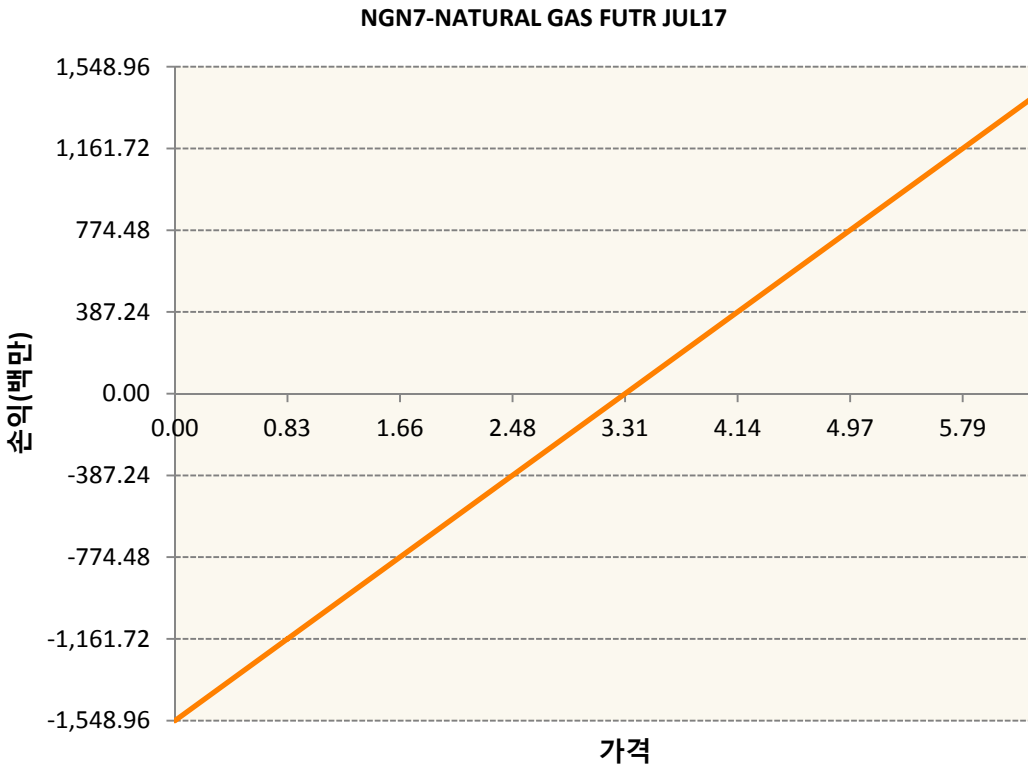


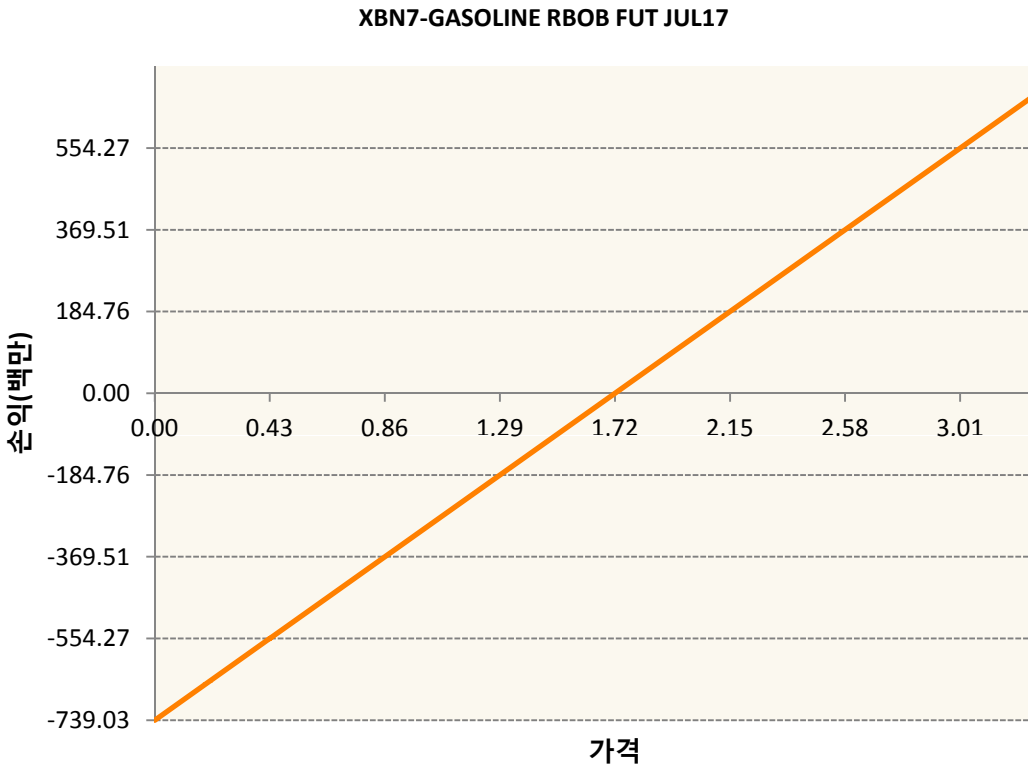

-760.65
-1,140.97
-1,521.29
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
530.26
353.50
176.75
0.00
-176.75
-353.50
-530.26
-707.01
0.00
0.41
0.82
1.23
1.64
2.05
2.46
2.87
순이익(백만)
가격


KR4175M50006-2017-05 달러선물
410.11
307.58
205.06
102.53
0.00
-102.53
-205.06
-307.58
-410.11
0.00
284.80
569.60
854.40
1,139.20
1,424.00
1,708.80
1,993.60
순이익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,548.96
1,161.72
774.48
387.24
0.00
-387.24
-774.48
-1,161.72
-1,548.96
0.00
0.83
1.66
2.48
3.31
4.14
4.97
5.79
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
554.27
369.51
184.76
0.00
-184.76
-369.51
-554.27
-739.03
0.00
0.43
0.86
1.29
1.72
2.15
2.58
3.01
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN7	WTI CRUDE FUTURE JUL17	82
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	122
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	57
KR4175M50(	2017-05 달러선물	33
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	124
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	59

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

966

공시일	2017-04-20
기준일	2017-04-19

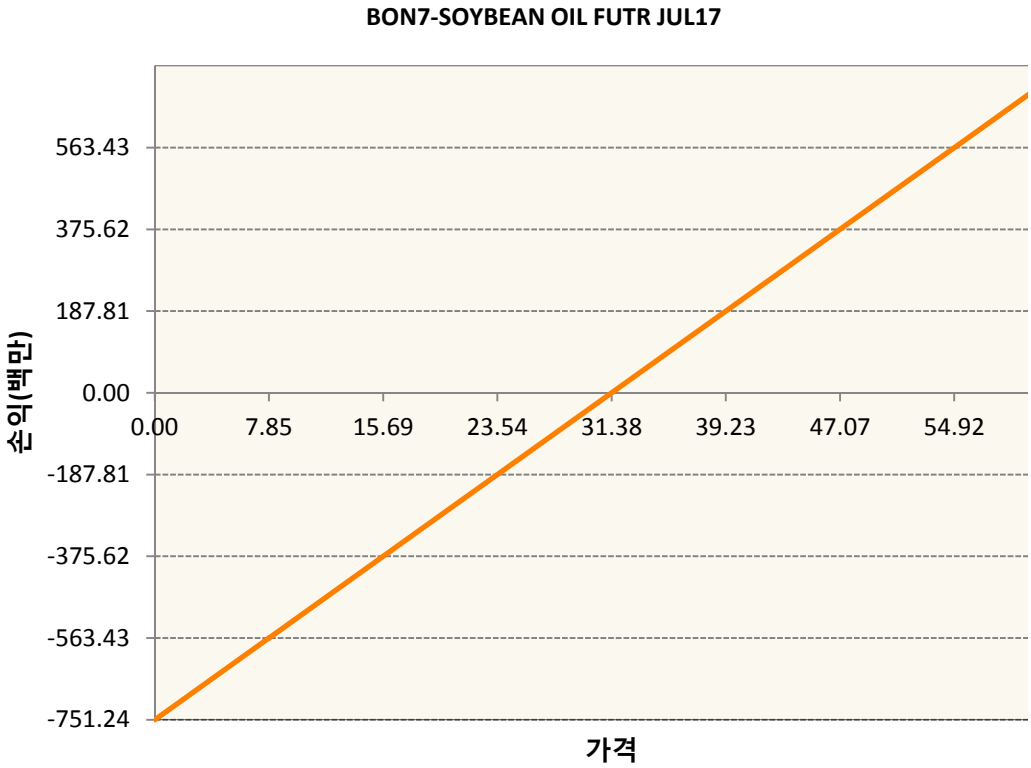
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

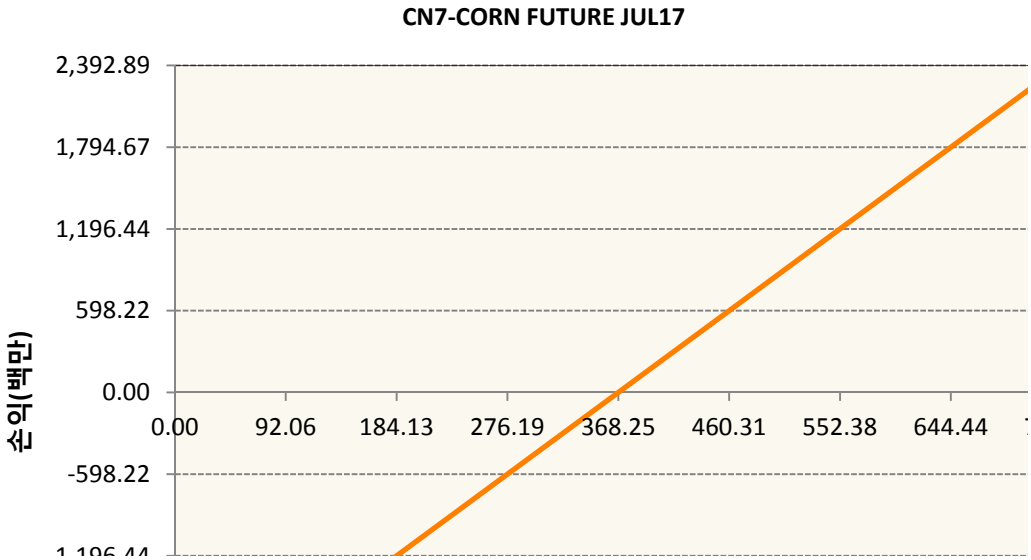
1. 계약금액

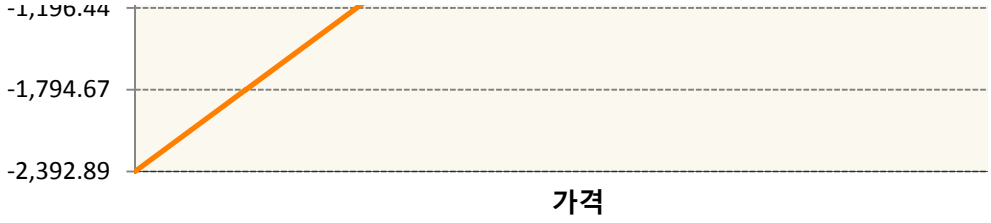
(단위:백만원)

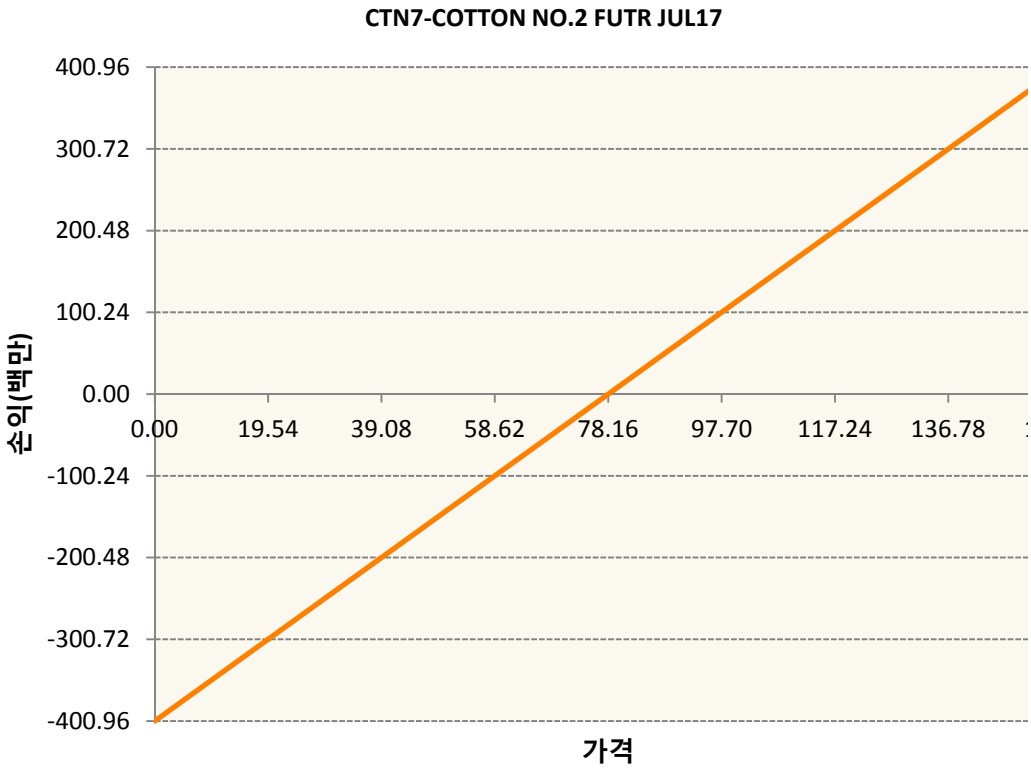
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,962	399	8,563	

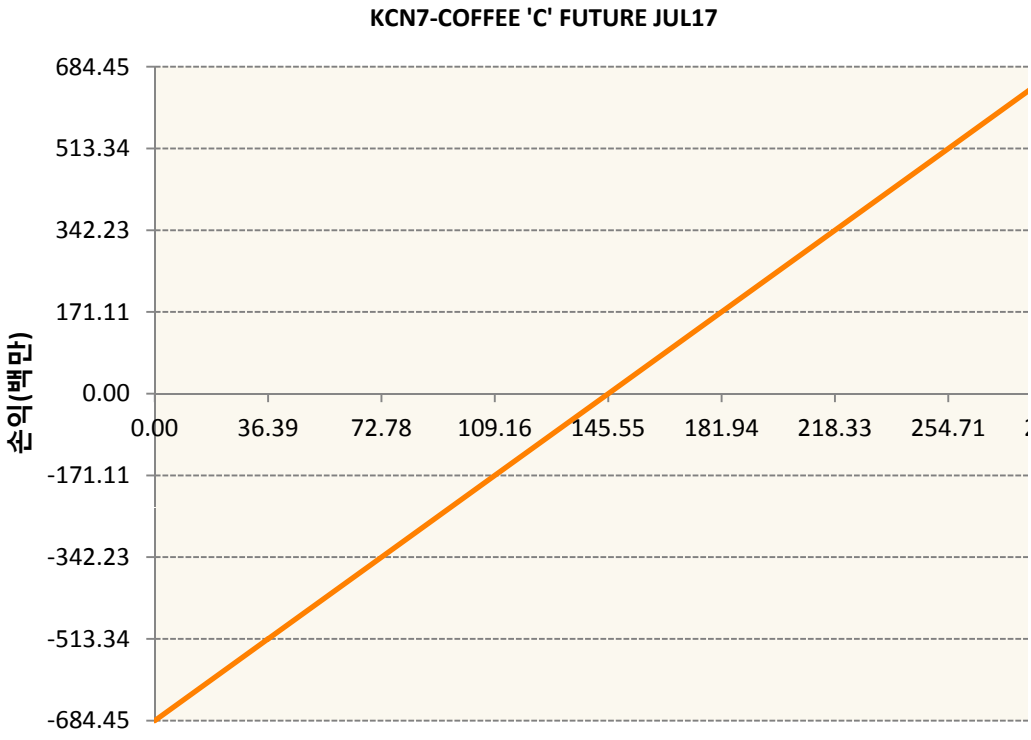
2. 만기시점의 손익구조



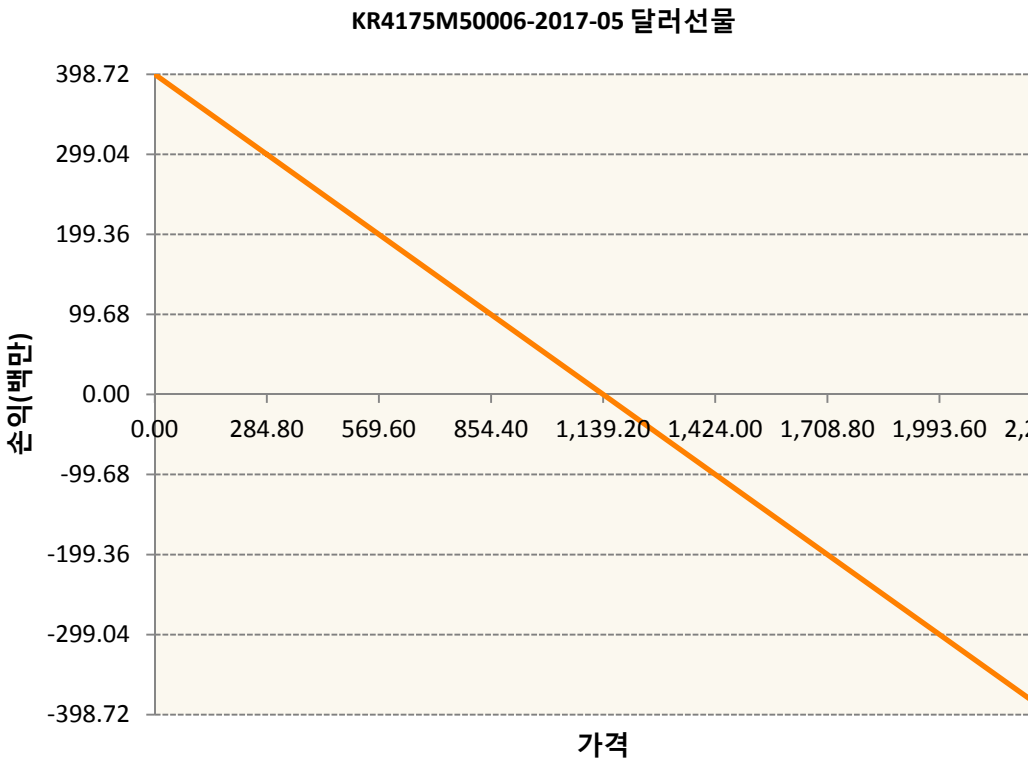


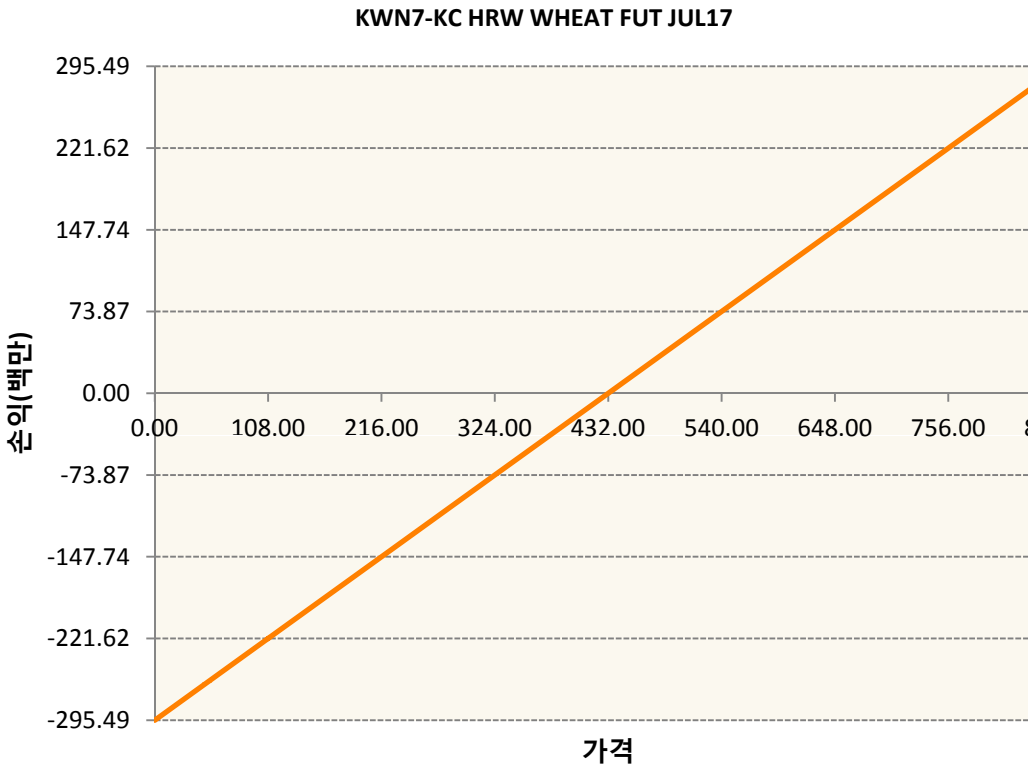

-1,196.44
-1,794.67
-2,392.89
가격


CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
400.96
300.72
200.48
100.24
0.00
-100.24
-200.48
-300.72
-400.96
0.00
19.54
39.08
58.62
78.16
97.70
117.24
136.78
순익(백만)
가격

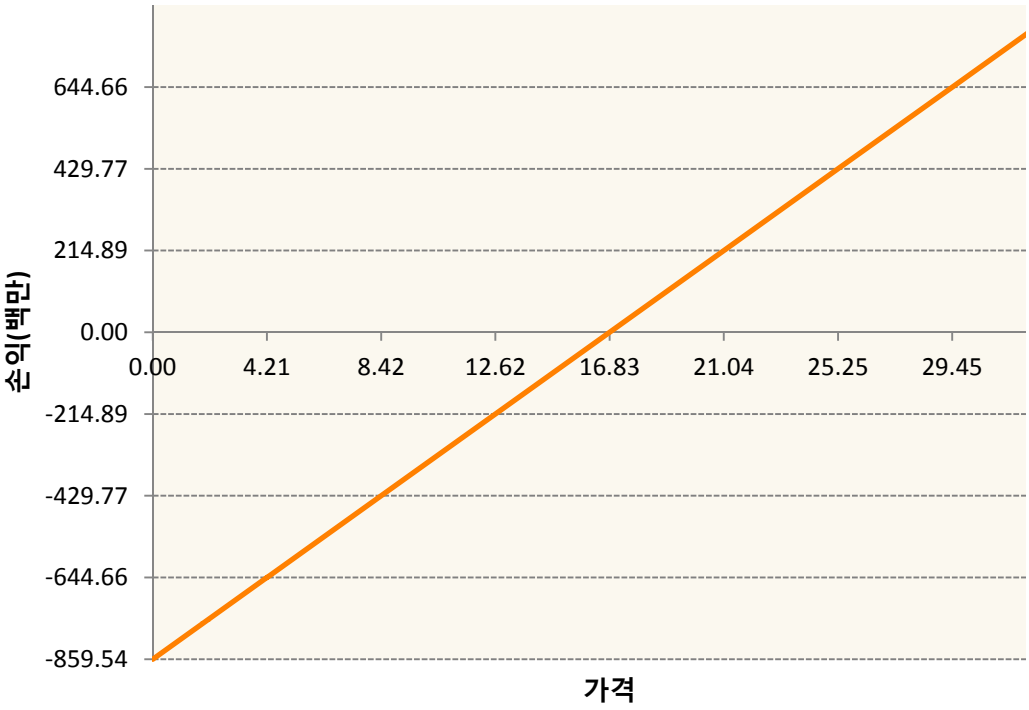

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
684.45
513.34
342.23
171.11
0.00
-171.11
-342.23
-513.34
-684.45
0.00
36.39
72.78
109.16
145.55
181.94
218.33
254.71
순익(백만)

가격

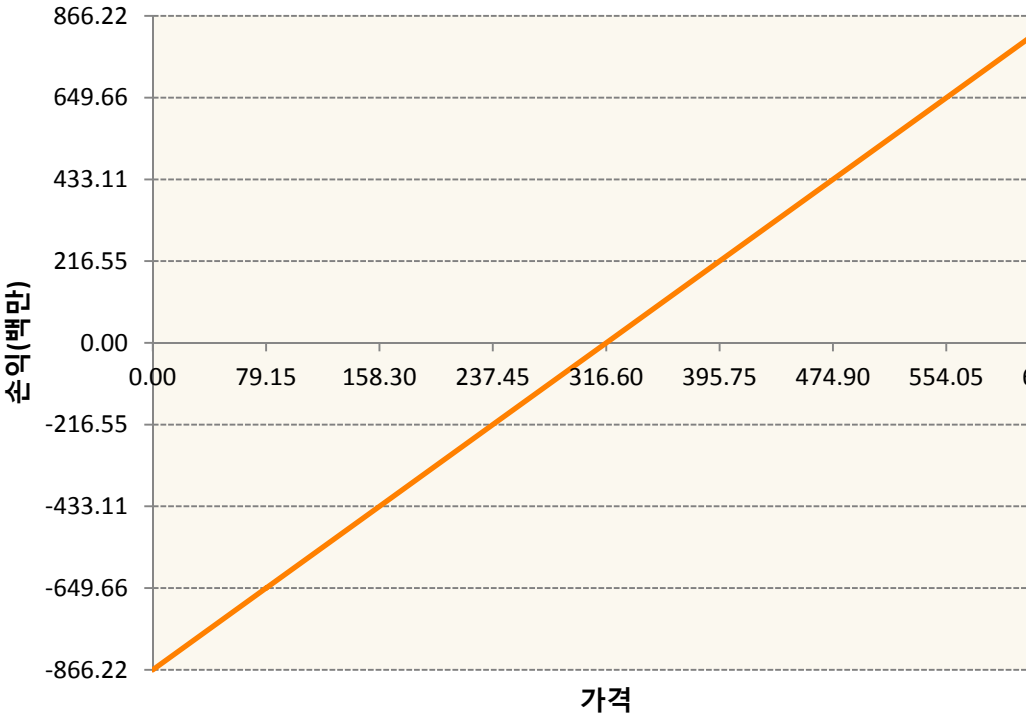

KR4175M50006-2017-05 달러선물
398.72
299.04
199.36
99.68
0.00
-99.68
-199.36
-299.04
-398.72
0.00
284.80
569.60
854.40
1,139.20
1,424.00
1,708.80
1,993.60
손익(백만)
가격


KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17
295.49
221.62
147.74
73.87
0.00
-73.87
-147.74
-221.62
-295.49
0.00
108.00
216.00
324.00
432.00
540.00
648.00
756.00
손익(백만)
가격

SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17

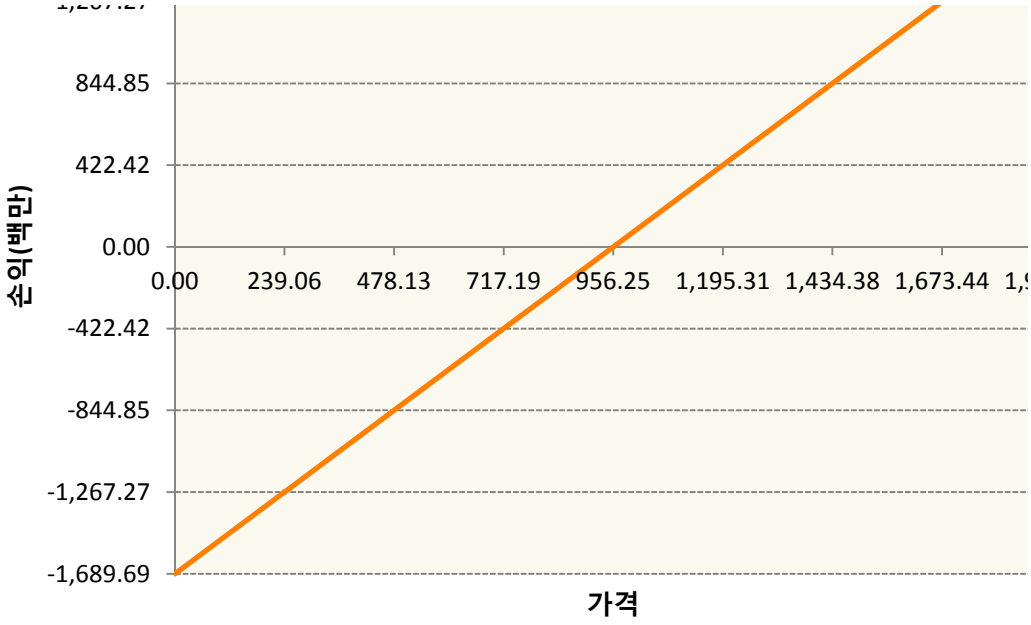


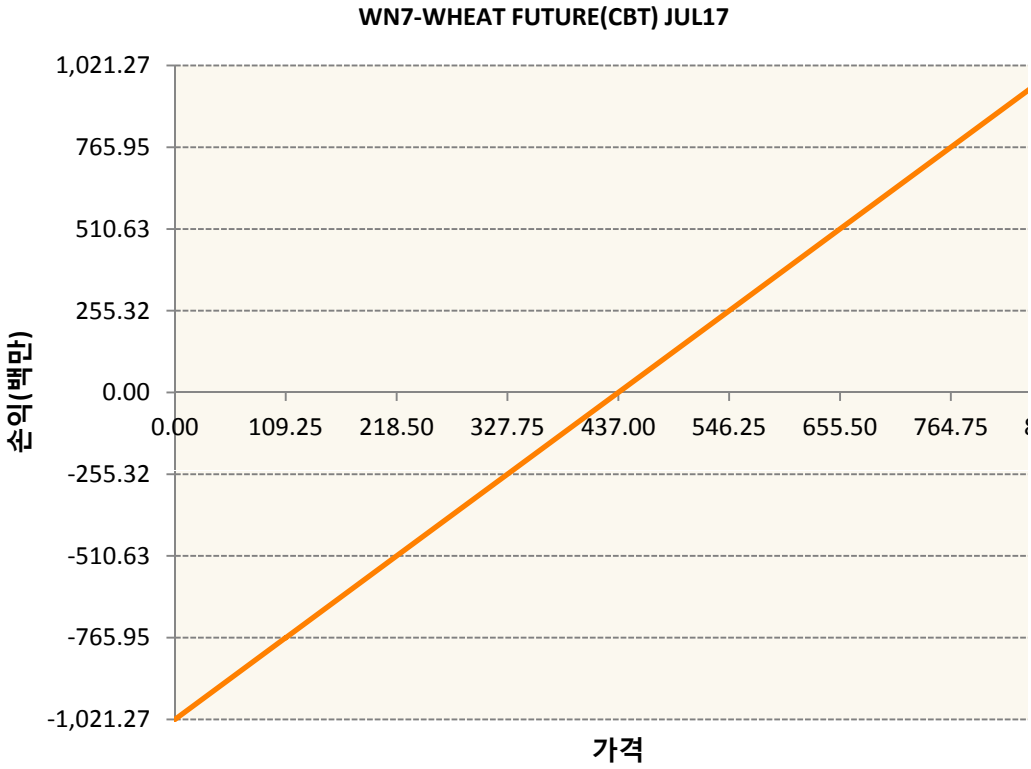
SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17



SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	60
CN7	CORN FUTURE JUL17	191
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	32
KCN7	COFFEE 'C' FUTURE JUL17	55
KR4175M50(	2017-05 달러선물	32

KWN7	KC HRW WHEAT FUT JUL17	24
SBN7	SUGAR #11 (WORLD) JUL17	69
SMN7	SOYBEAN MEAL FUTR JUL17	69
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	135
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	82

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

877