공시일	2017-04-21
기준일	2017-04-20

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	2017-04-21
기준일	2017-04-20

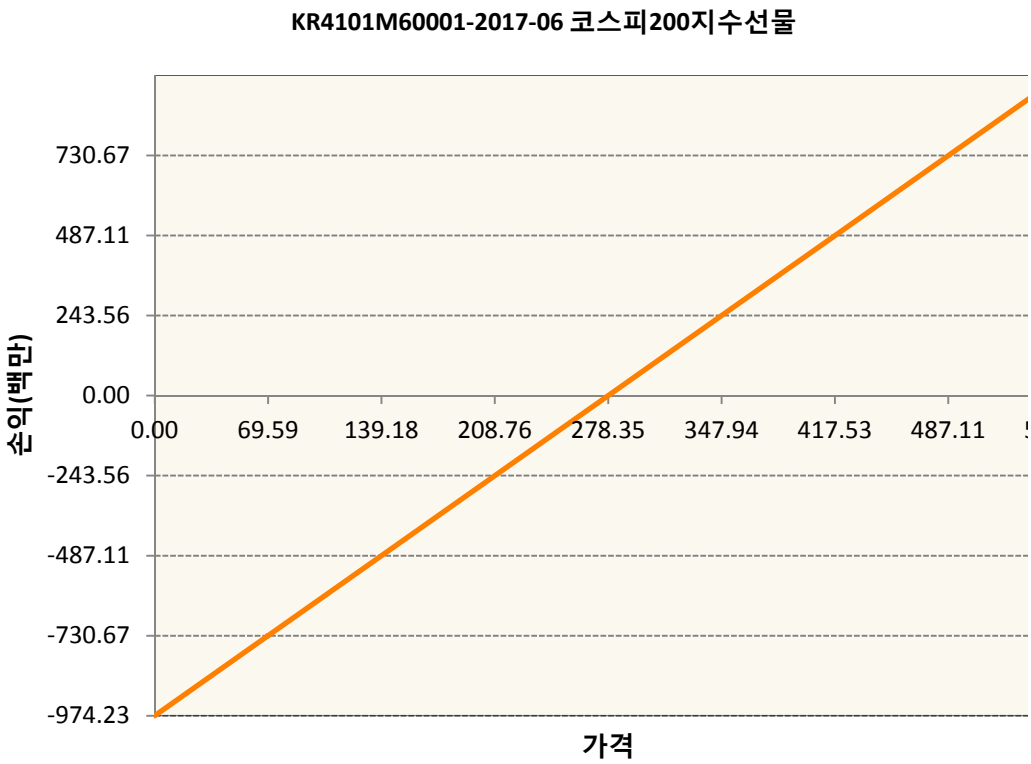
스마트인덱스모

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	974	0	974	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	2017-04-21
기준일	2017-04-20

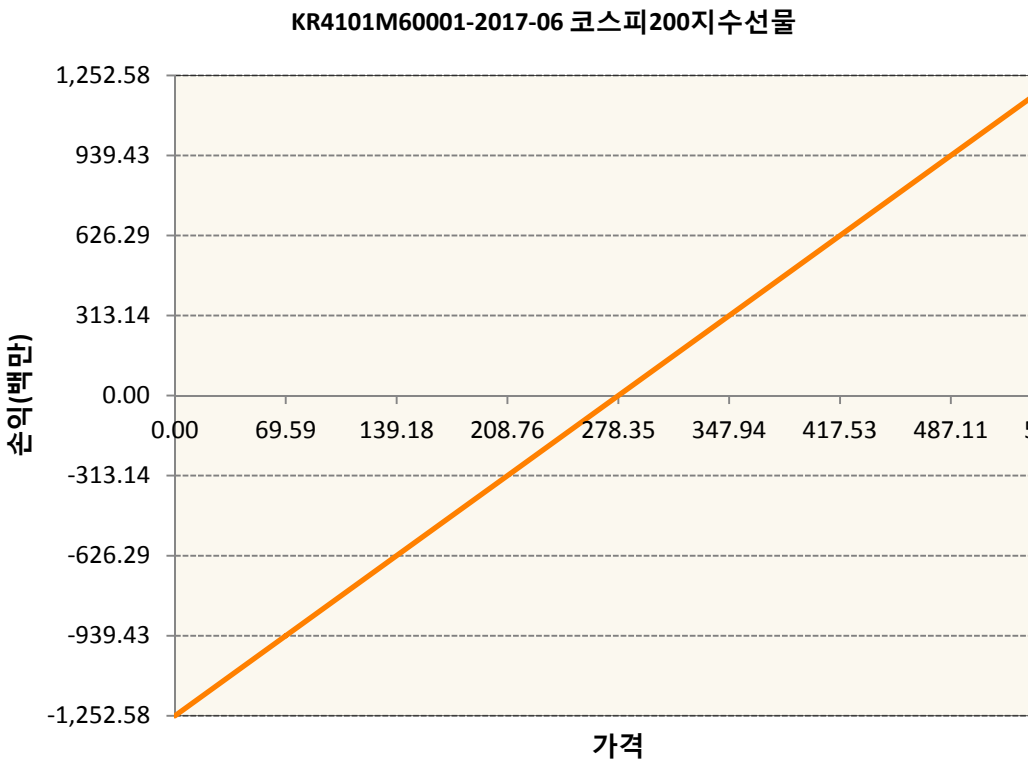
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	2017-04-21
기준일	2017-04-20

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	951

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

544

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-04-21
기준일	2017-04-20

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	386

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

391

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-04-21
기준일	2017-04-20

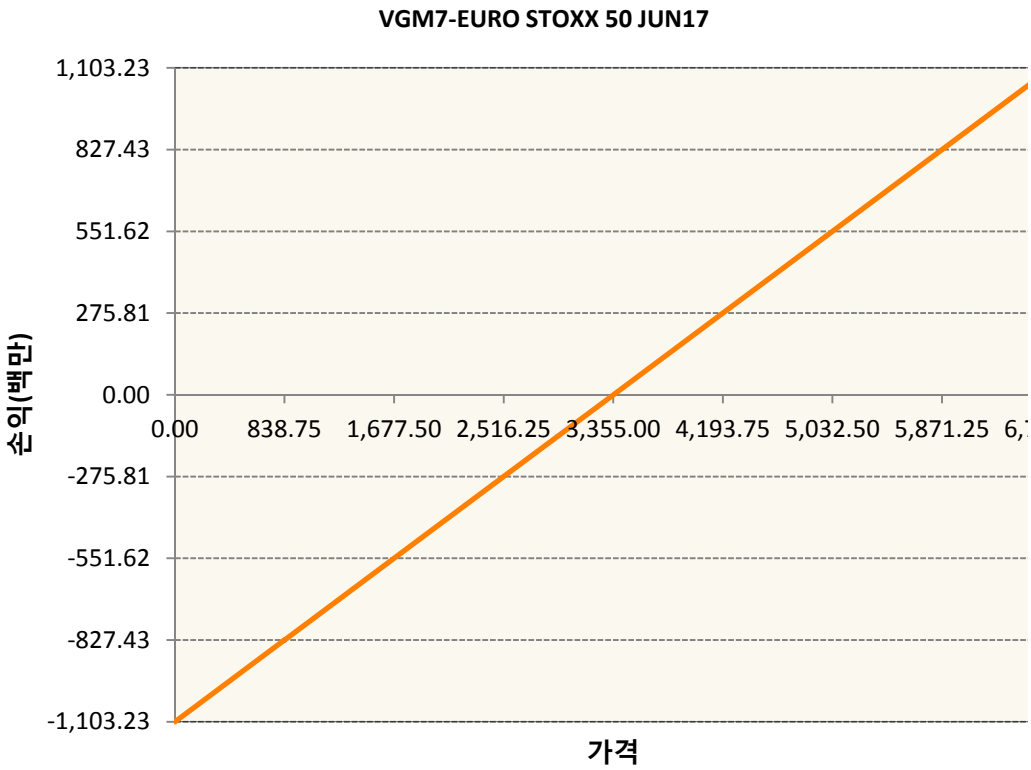
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,103	0	1,103	

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	2017-04-21
기준일	2017-04-20

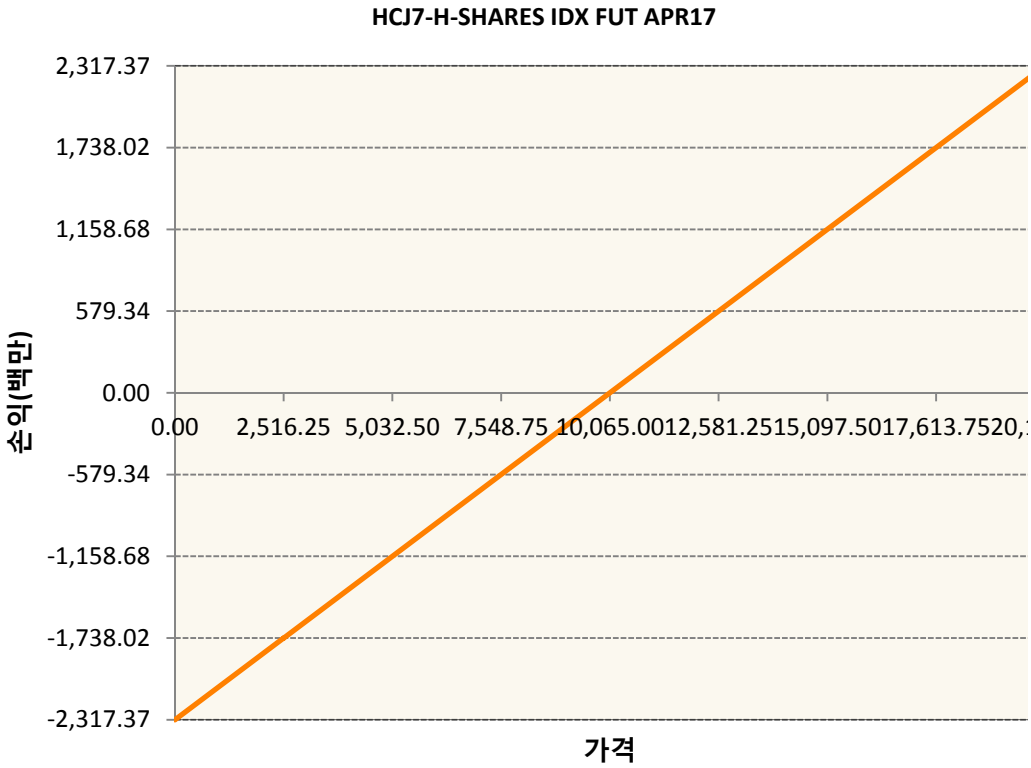
차이나인덱스모(주식-파생형)

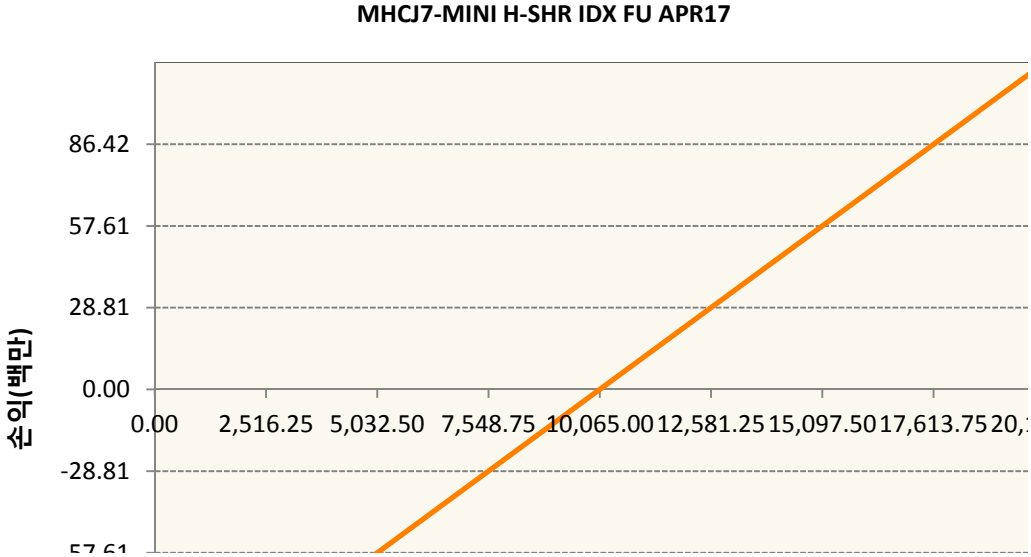
1. 계약금액

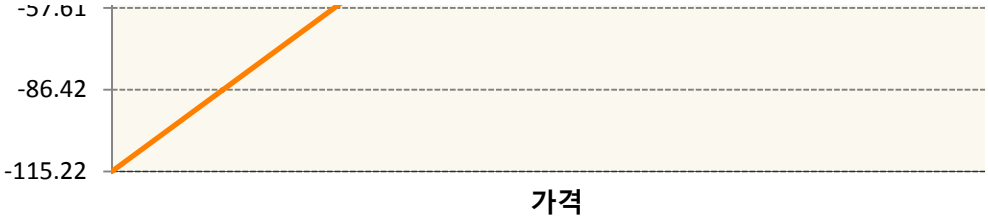
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,433	0	2,433	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCJ7	H-SHARES IDX FUT APR17	185
MHCJ7	MINI H-SHR IDX FU APR17	9

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

207

공시일	2017-04-21
기준일	2017-04-20

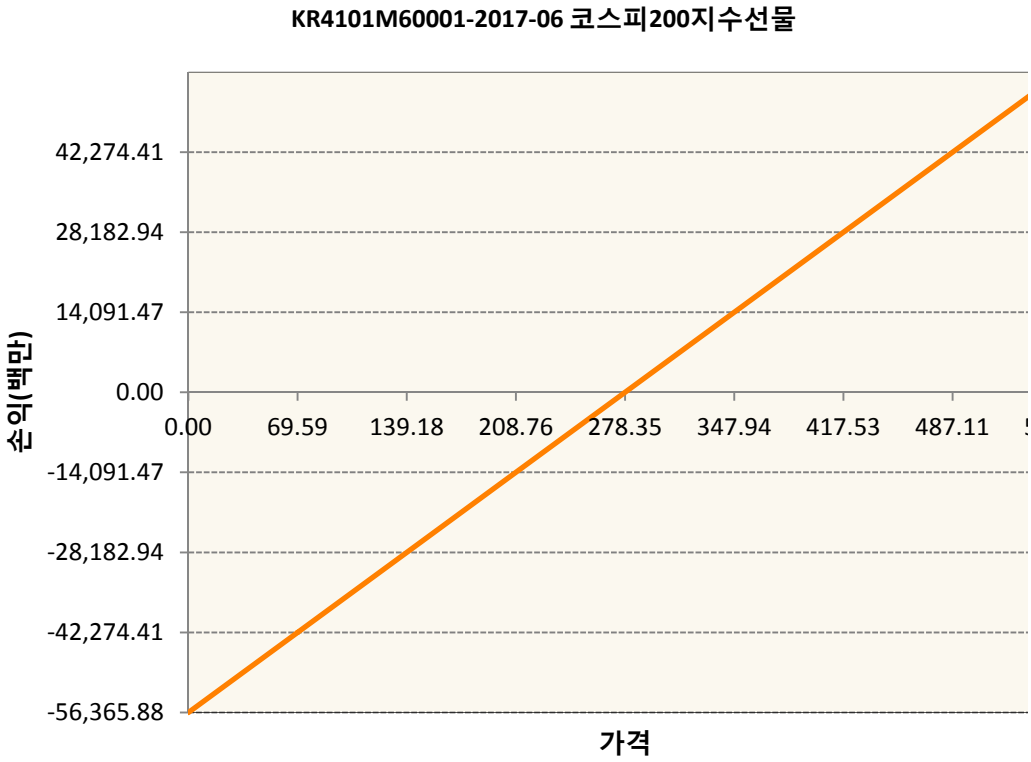
커버드콜모(주식혼합-파생형)

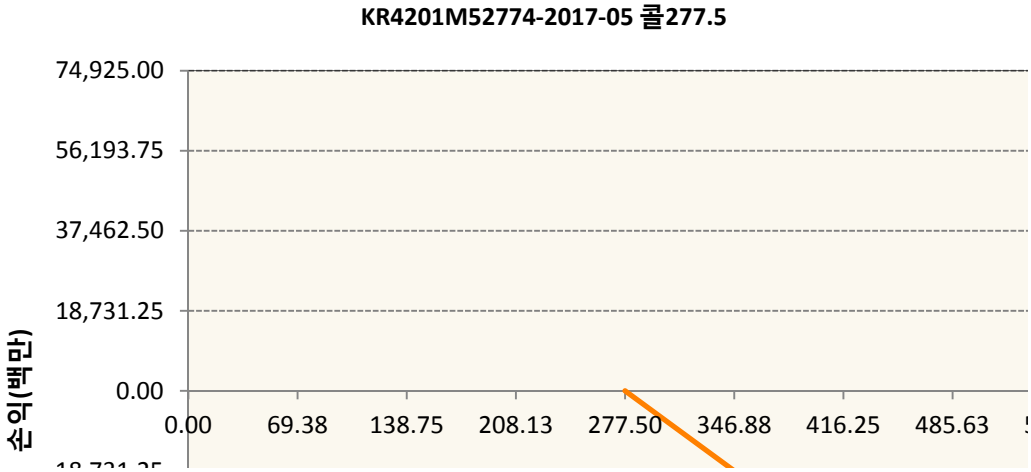
1. 계약금액

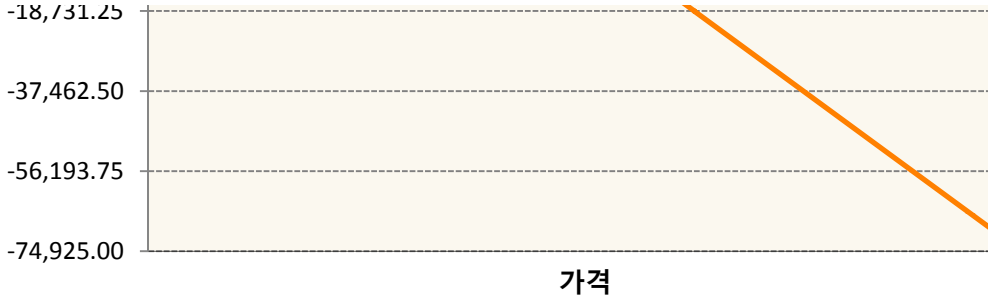
(단위:백만원)

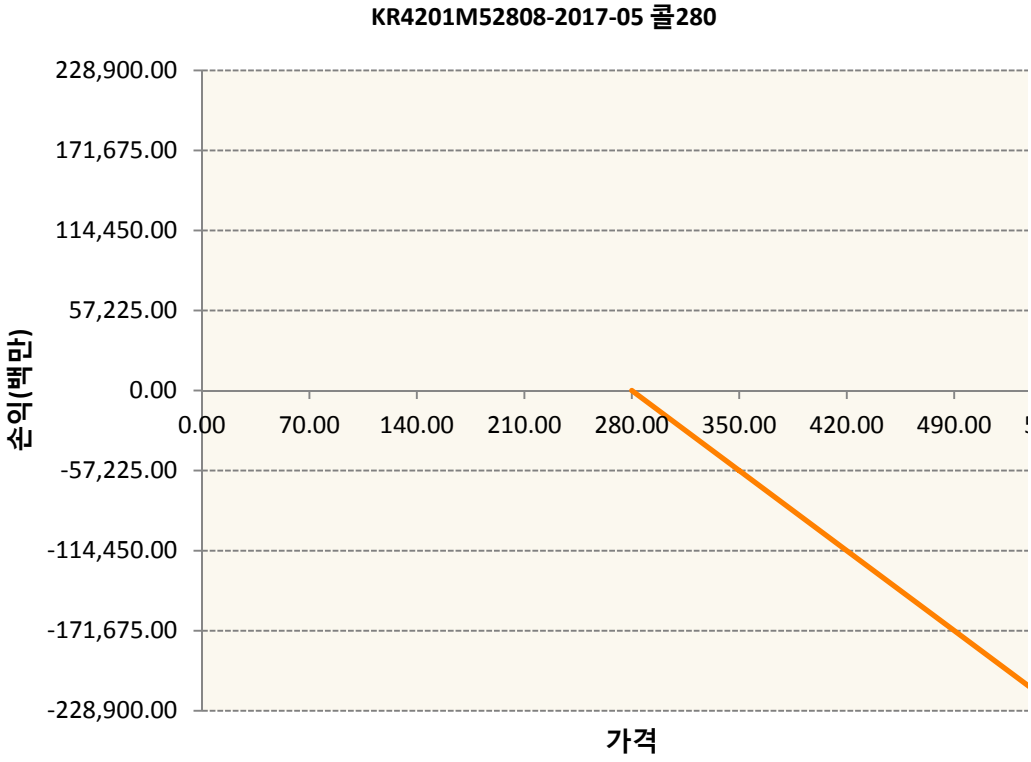
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3,476	0	3,476	장내
신규	유가증권	옵션	0	11,979	-11,979	장내
누계	유가증권	선물	56,366	0	56,366	장내
누계	유가증권	옵션	0	359,325	-359,325	장내

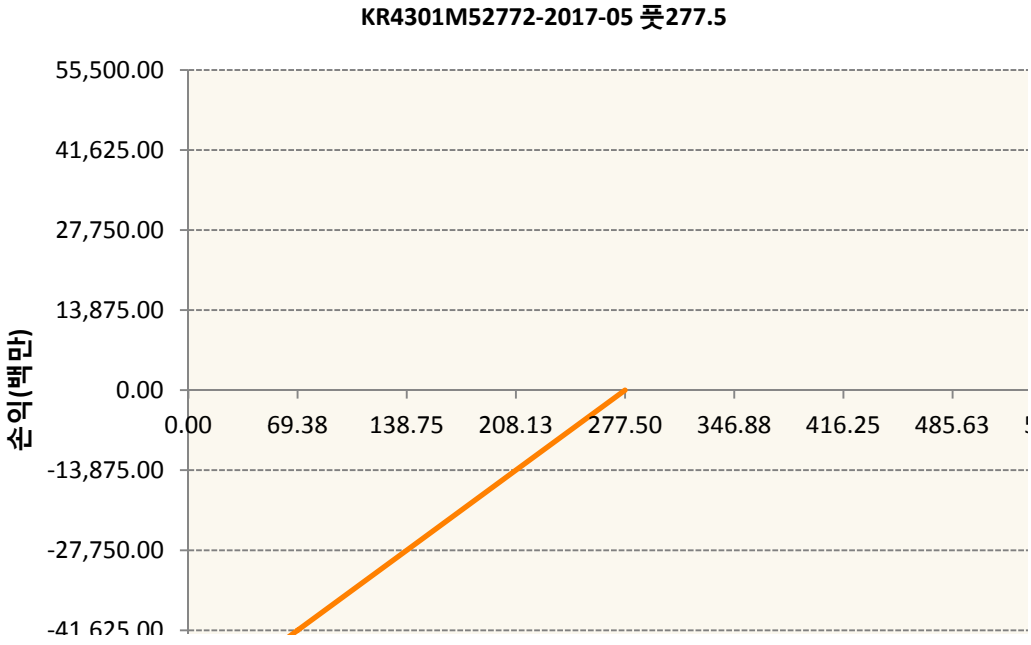
2. 만기시점의 손익구조

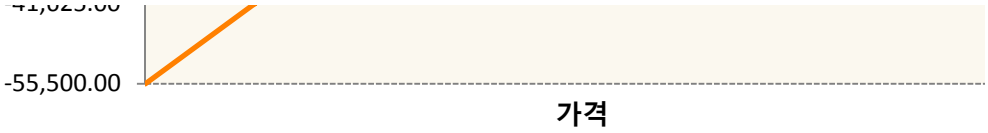





-18,731.25
-37,462.50
-56,193.75
-74,925.00
가격


KR4201M52808-2017-05 콜280
228,900.00
171,675.00
114,450.00
57,225.00
0.00
-57,225.00
-114,450.00
-171,675.00
-228,900.00
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							4,500
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,500	-4,500	-4,500	-4,500	-4,500	-4,500	-4,500
-5.33%	-3,000	-3,000	-3,000	-3,000	-3,000	-3,000	-3,000
-2.67%	-1,500	-1,500	-1,500	-1,500	-1,500	-1,500	-1,500
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,500	1,500	1,500	1,500	1,500	1,500	1,500
5.33%	3,000	3,000	3,000	3,000	3,000	3,000	3,000
8.00%	4,500	4,500	4,500	4,500	4,500	4,500	4,500
KR4201M52 2017-05 콜277.5							5,097
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	987	987	986	984	980	974	967
-5.33%	980	972	960	943	922	897	868
-2.67%	863	817	767	712	654	594	531
0%	239	159	80	0	-80	-159	-239
2.67%	-1,188	-1,234	-1,285	-1,339	-1,397	-1,458	-1,522
5.33%	-3,077	-3,087	-3,101	-3,119	-3,143	-3,171	-3,203
8.00%	-5,066	-5,067	-5,069	-5,072	-5,078	-5,086	-5,097
KR4201M52 2017-05 콜280							14,377
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,074	2,074	2,073	2,070	2,065	2,055	2,041
-5.33%	2,067	2,056	2,037	2,009	1,969	1,917	1,855
-2.67%	1,903	1,812	1,703	1,579	1,442	1,294	1,136
0%	697	467	234	0	-235	-472	-709
2.67%	-2,834	-3,024	-3,223	-3,430	-3,642	-3,858	-4,078
5.33%	-8,238	-8,294	-8,367	-8,457	-8,563	-8,682	-8,813
8.00%	-14,215	-14,221	-14,234	-14,254	-14,284	-14,325	-14,377
KR4301M52 2017-05 풋277.5							3,724
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,709	-3,709	-3,710	-3,711	-3,714	-3,718	-3,724
-5.33%	-2,234	-2,240	-2,249	-2,261	-2,277	-2,295	-2,317
-2.67%	-840	-874	-912	-952	-995	-1,040	-1,086

0%	177	118	59	0	-59	-118	-177
2.67%	600	566	528	488	445	400	353
5.33%	680	673	663	649	632	611	587
8.00%	687	686	685	683	678	672	664

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

28,731

공시일	2017-04-21
기준일	2017-04-20

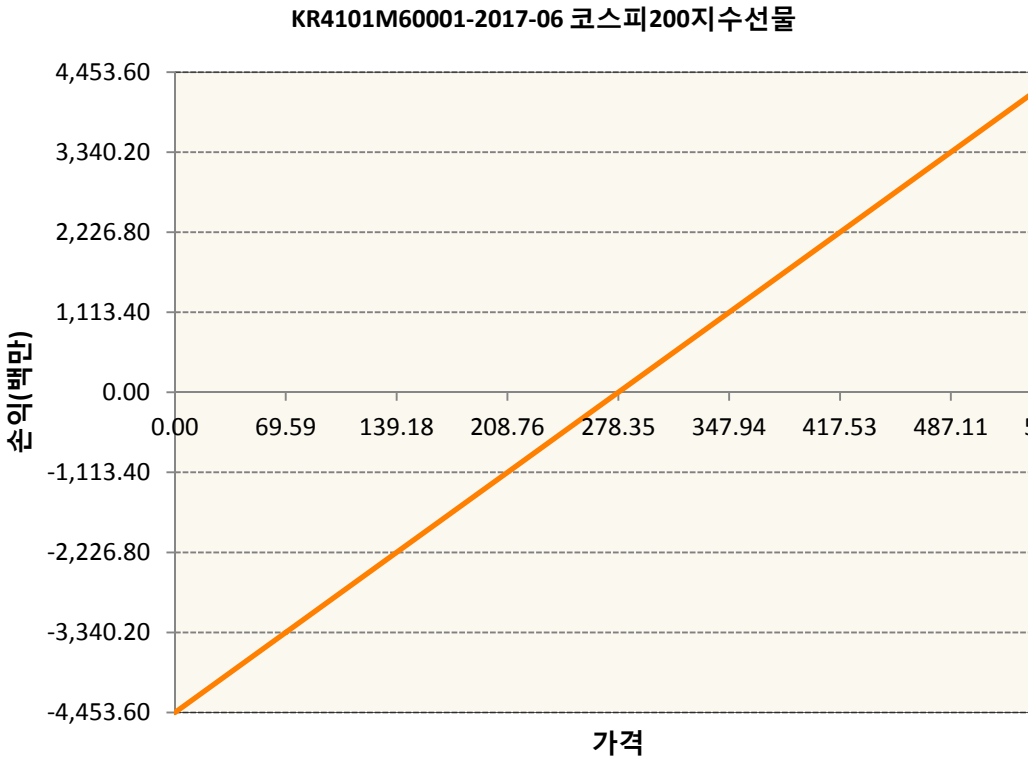
커버드콜목표전환형증권투자신탁

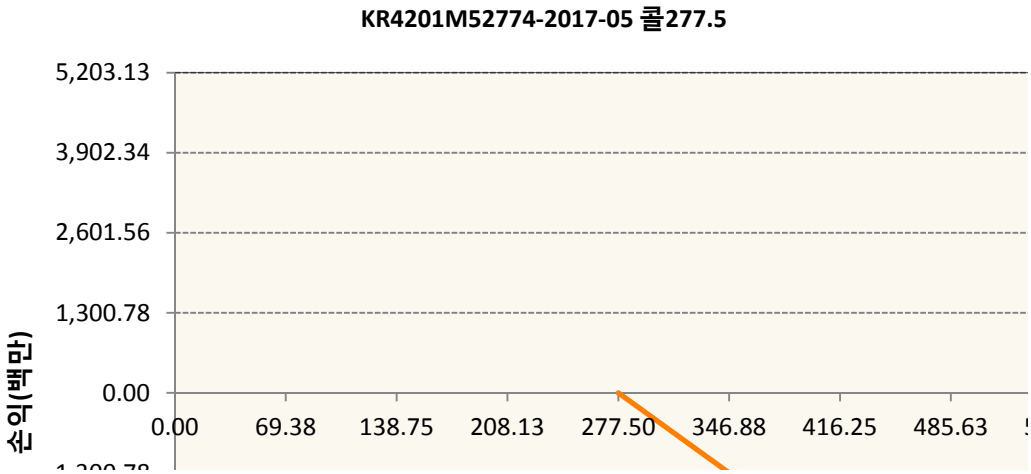
1. 계약금액

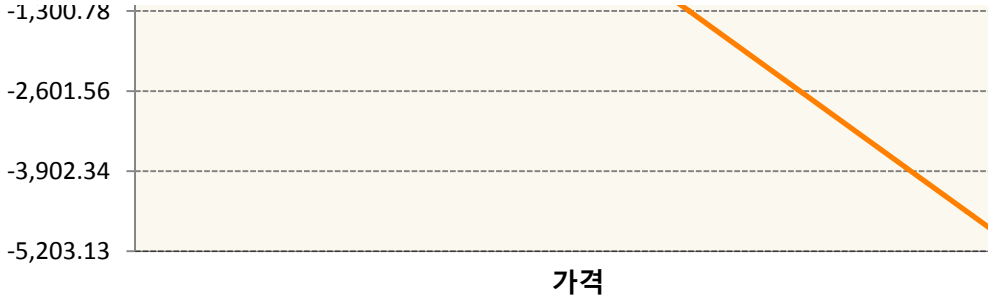
(단위:백만원)

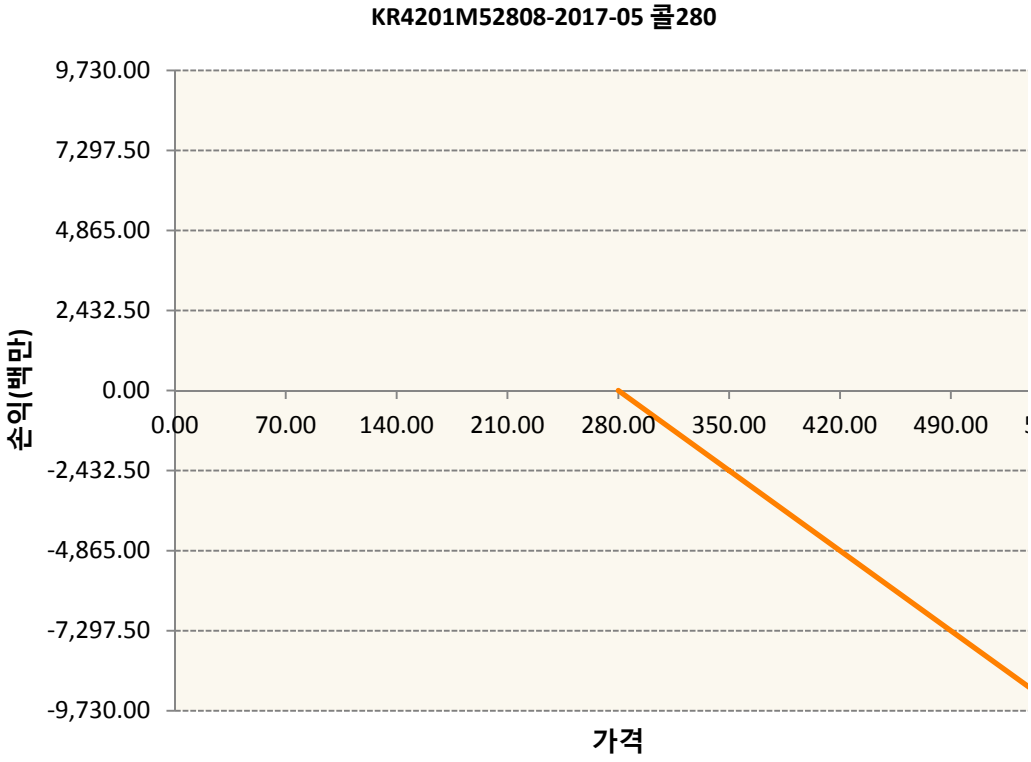
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,454	0	4,454	장내
누계	유가증권	옵션	0	14,933	-14,933	장내

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							354
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	69	69	68	68	68	68	67
-5.33%	68	67	67	65	64	62	60
-2.67%	60	57	53	49	45	41	37
0%	17	11	6	0	-6	-11	-17
2.67%	-83	-86	-89	-93	-97	-101	-106
5.33%	-214	-214	-215	-217	-218	-220	-222
8.00%	-352	-352	-352	-352	-353	-353	-354
	KR4201M52(	2017-05 콜280					611

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	88	88	88	88	88	87	87
-5.33%	88	87	87	85	84	82	79
-2.67%	81	77	72	67	61	55	48
0%	30	20	10	0	-10	-20	-30
2.67%	-120	-129	-137	-146	-155	-164	-173
5.33%	-350	-353	-356	-360	-364	-369	-375
8.00%	-604	-605	-605	-606	-607	-609	-611

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

1,304

공시일	2017-04-21
기준일	2017-04-20

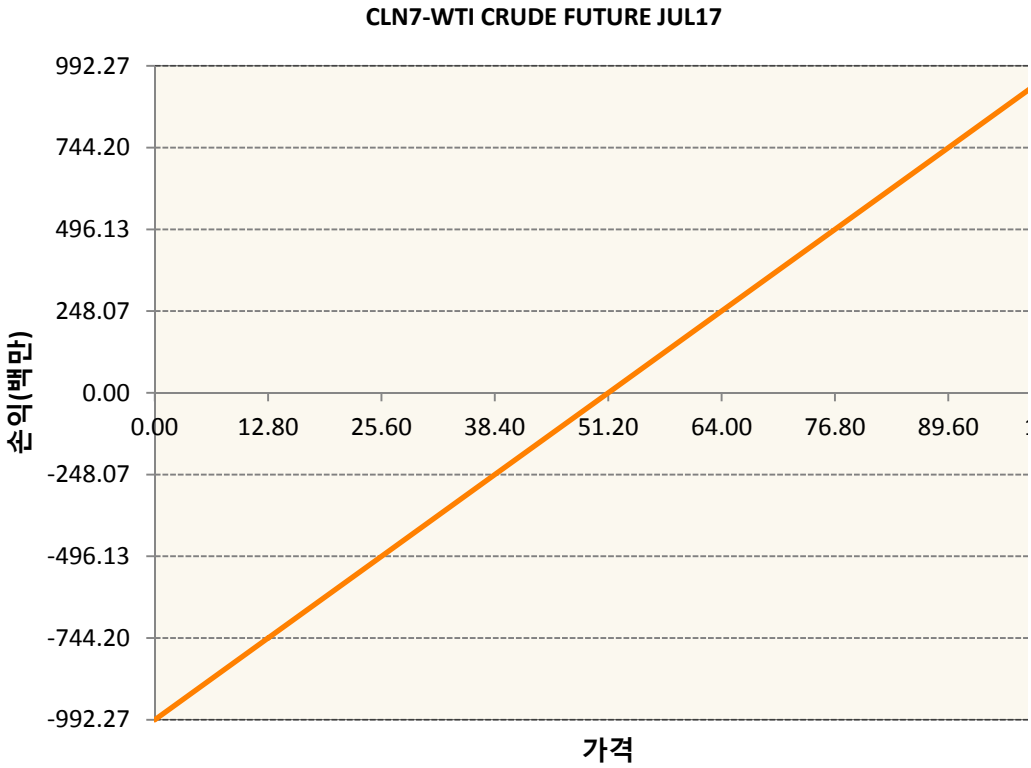
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

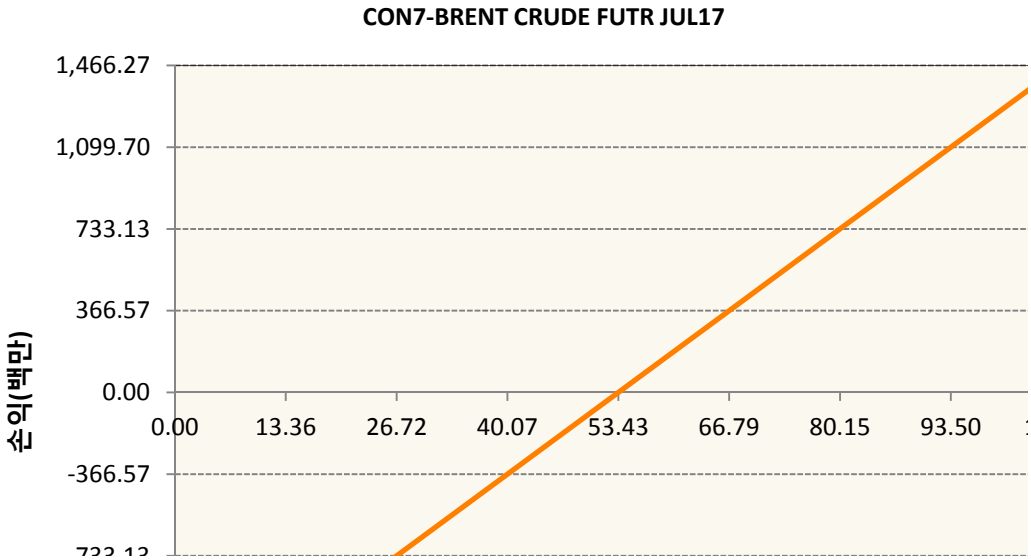
1. 계약금액

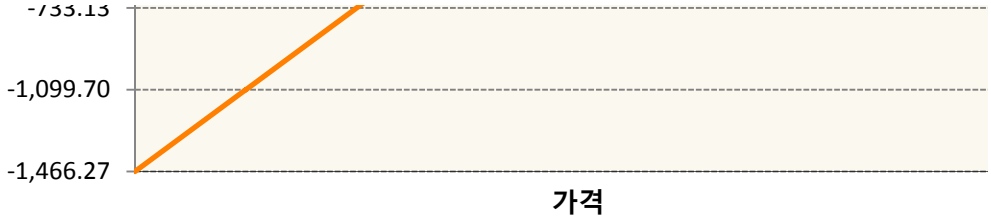
(단위:백만원)

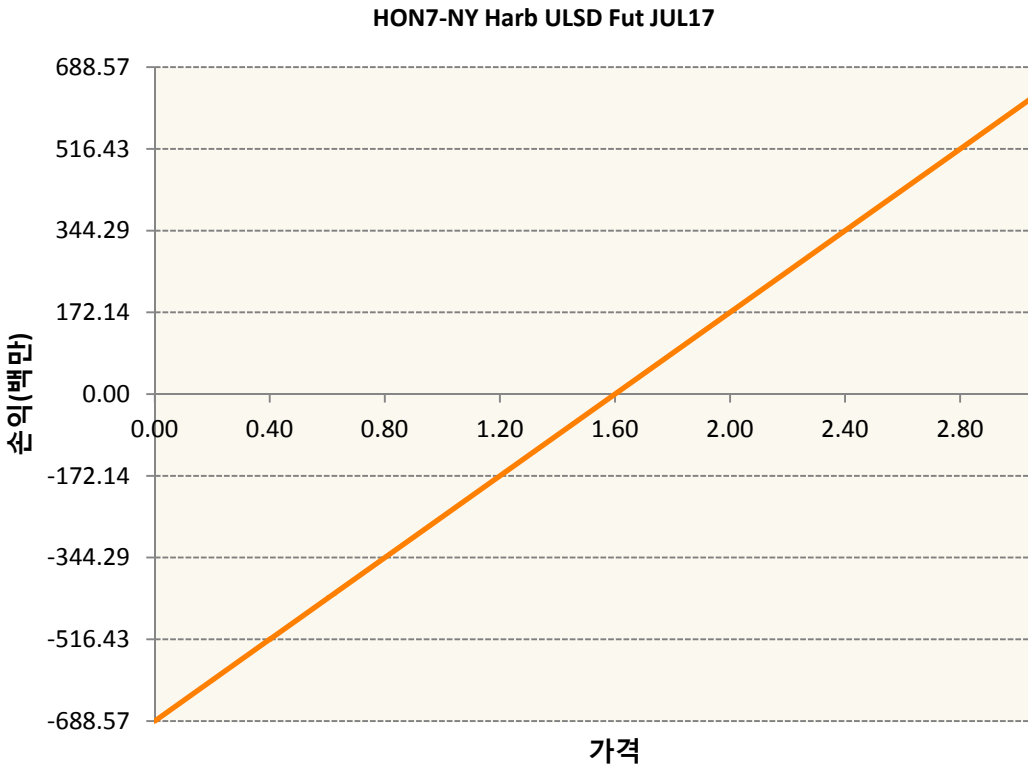
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,431	410	5,021	

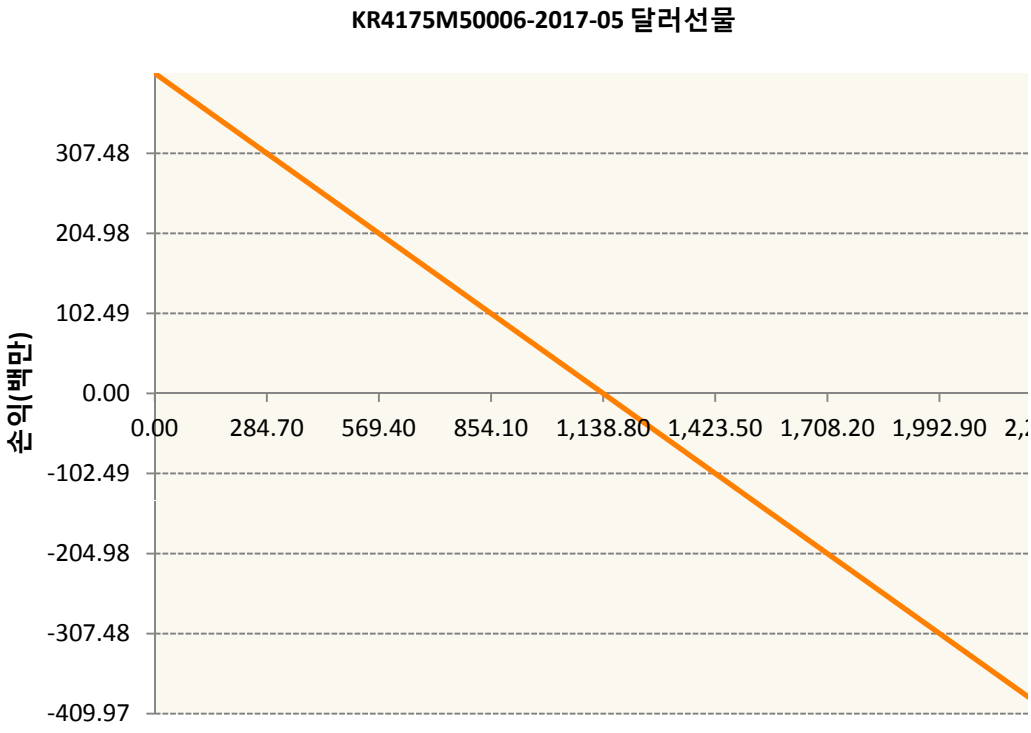
2. 만기시점의 손익구조



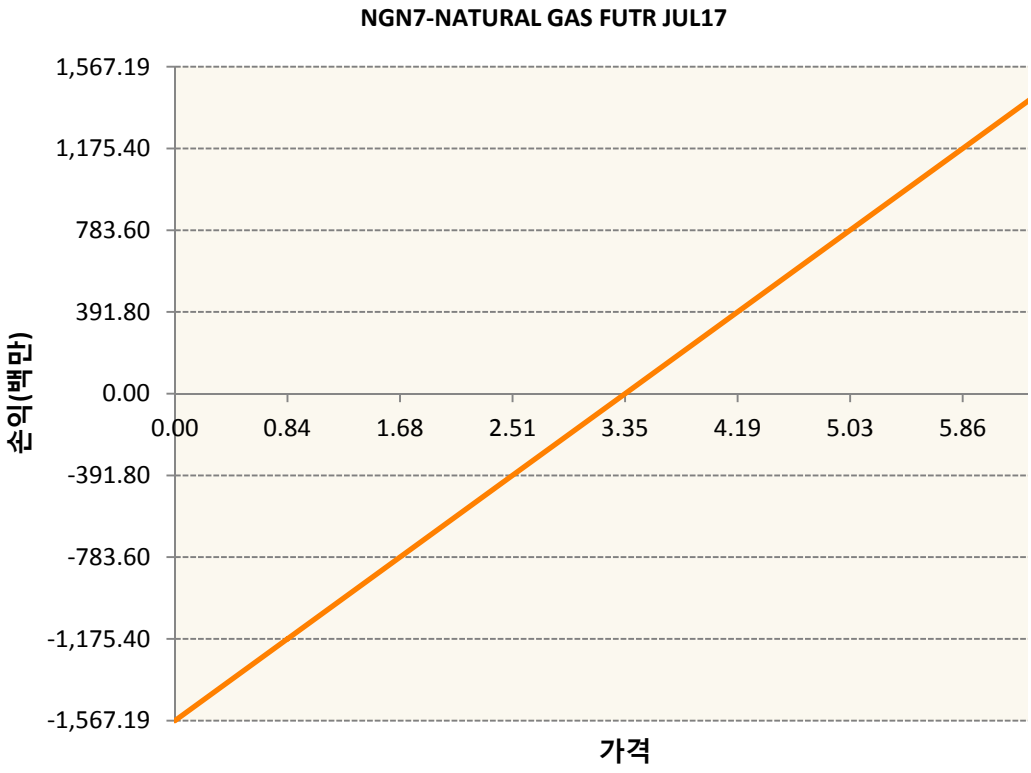


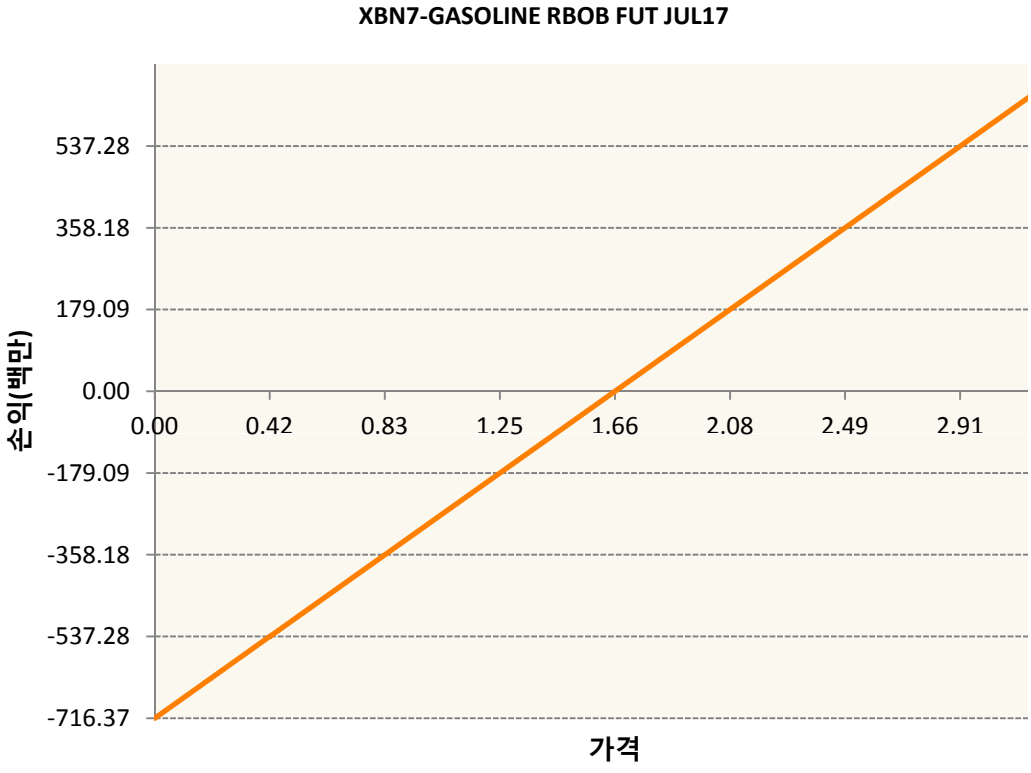

-1,099.70
-1,466.27
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
688.57
516.43
344.29
172.14
0.00
-172.14
-344.29
-516.43
-688.57
0.00
0.40
0.80
1.20
1.60
2.00
2.40
2.80
손익(백만)
가격


KR4175M50006-2017-05 달러선물
307.48
204.98
102.49
0.00
-102.49
-204.98
-307.48
-409.97
0.00
284.70
569.40
854.10
1,138.80
1,423.50
1,708.20
1,992.90
손익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,567.19
1,175.40
783.60
391.80
0.00
-391.80
-783.60
-1,175.40
-1,567.19
0.00
0.84
1.68
2.51
3.35
4.19
5.03
5.86
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
537.28
358.18
179.09
0.00
-179.09
-358.18
-537.28
-716.37
0.00
0.42
0.83
1.25
1.66
2.08
2.49
2.91
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN7	WTI CRUDE FUTURE JUL17	79
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	117
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	55
KR4175M50(	2017-05 달러선물	33
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	125
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	57

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

948

공시일	2017-04-21
기준일	2017-04-20

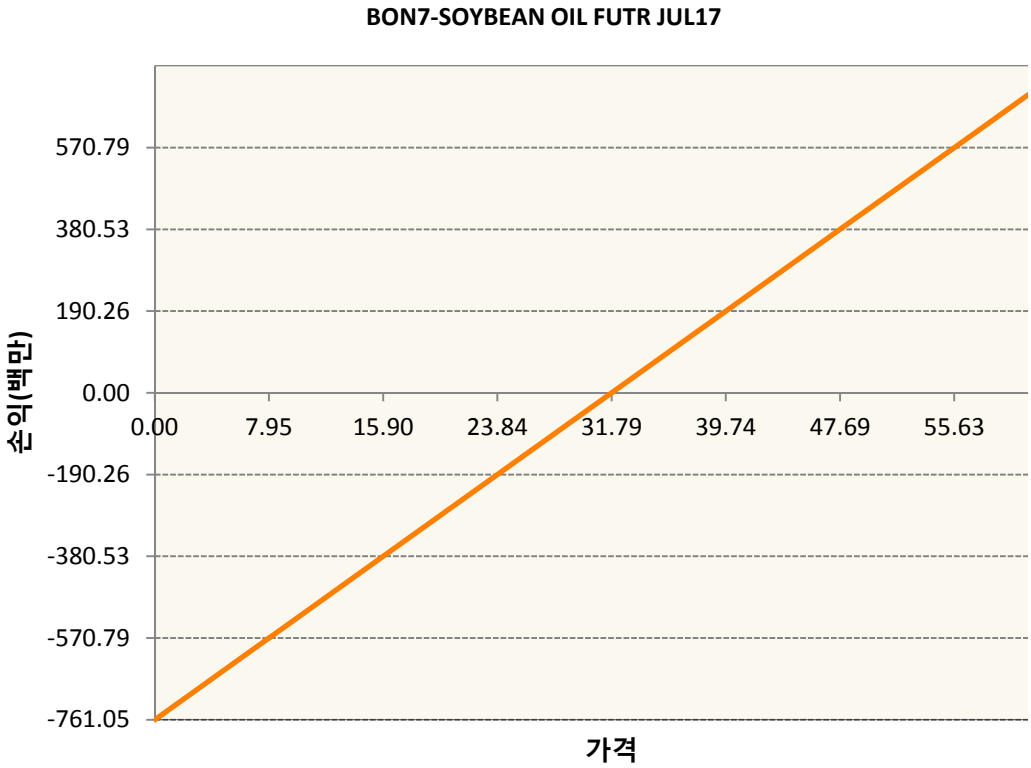
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

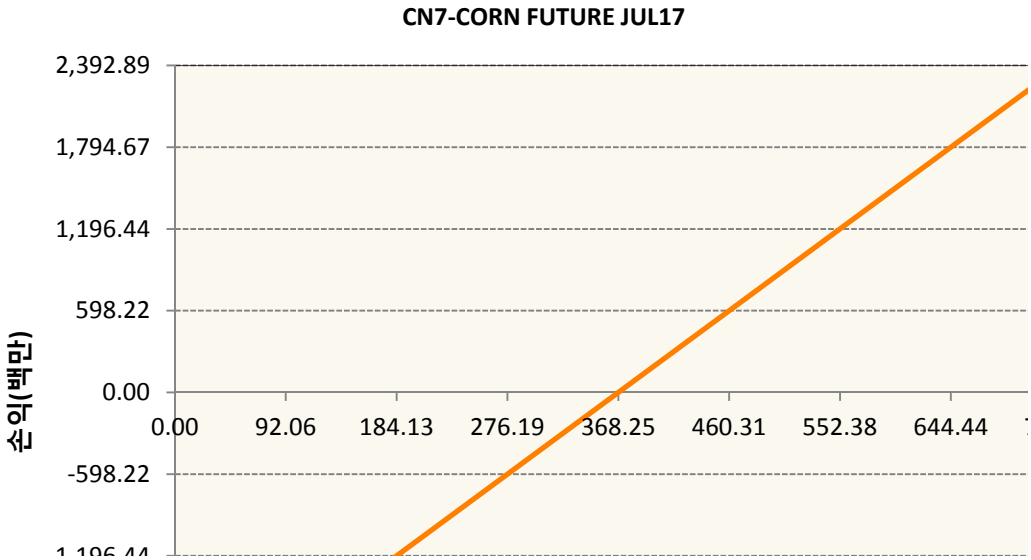
1. 계약금액

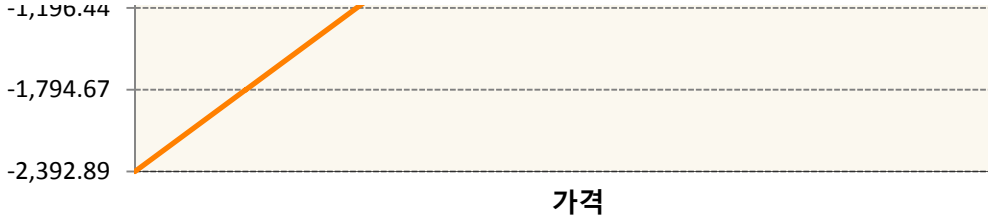
(단위:백만원)

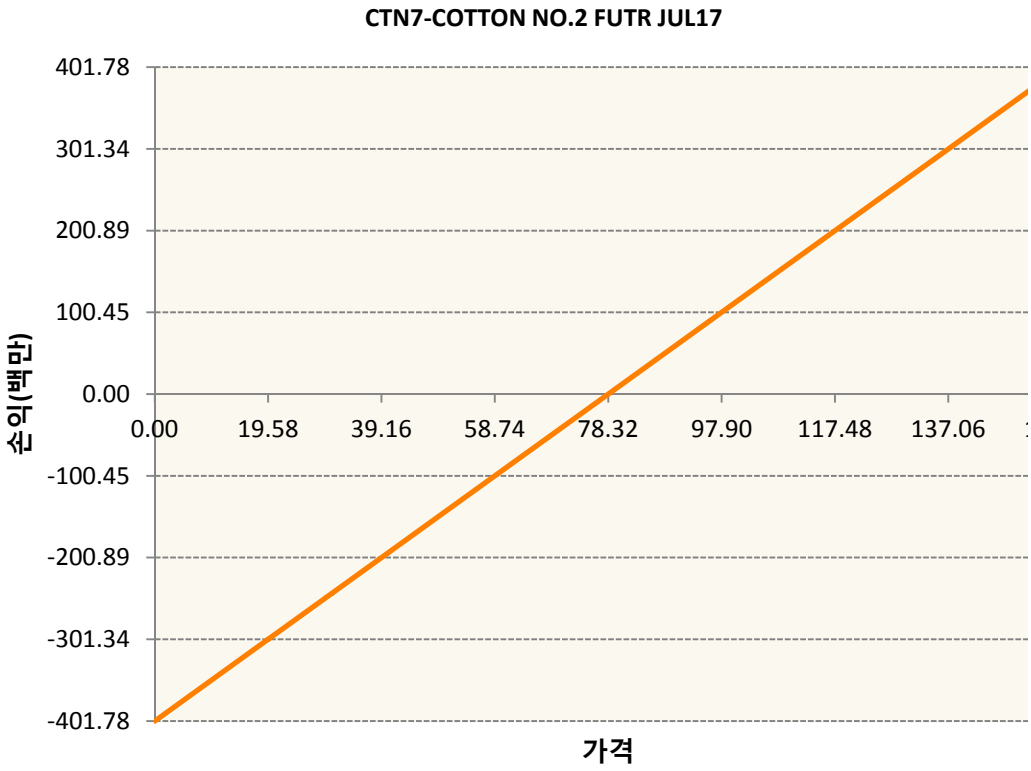
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,930	399	8,531	

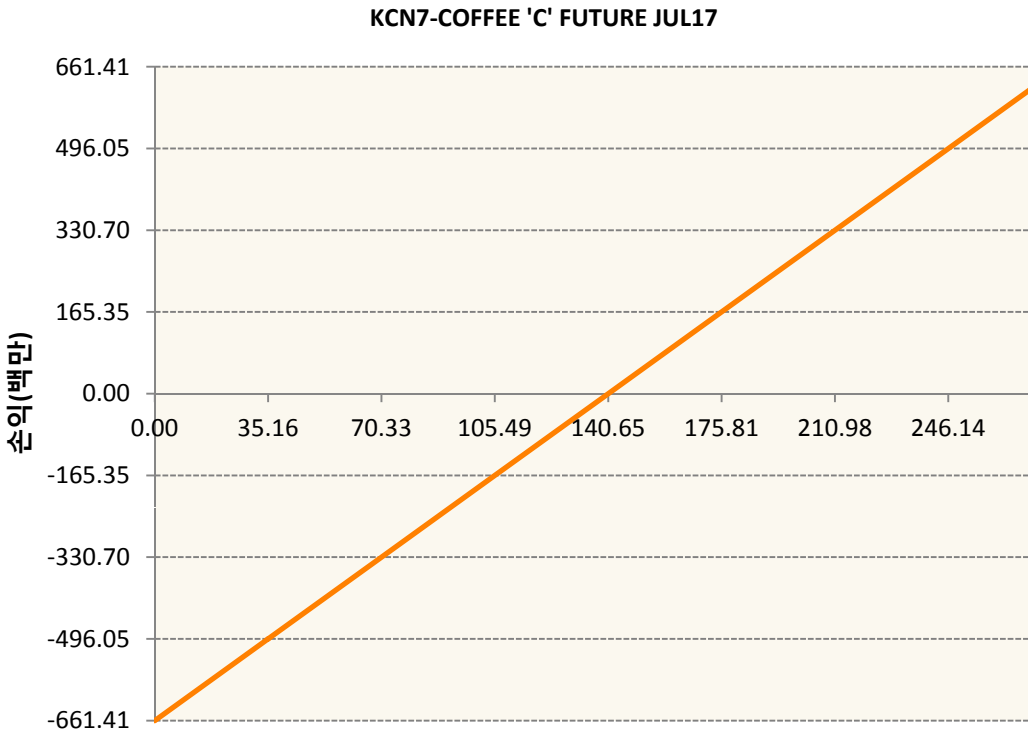
2. 만기시점의 손익구조



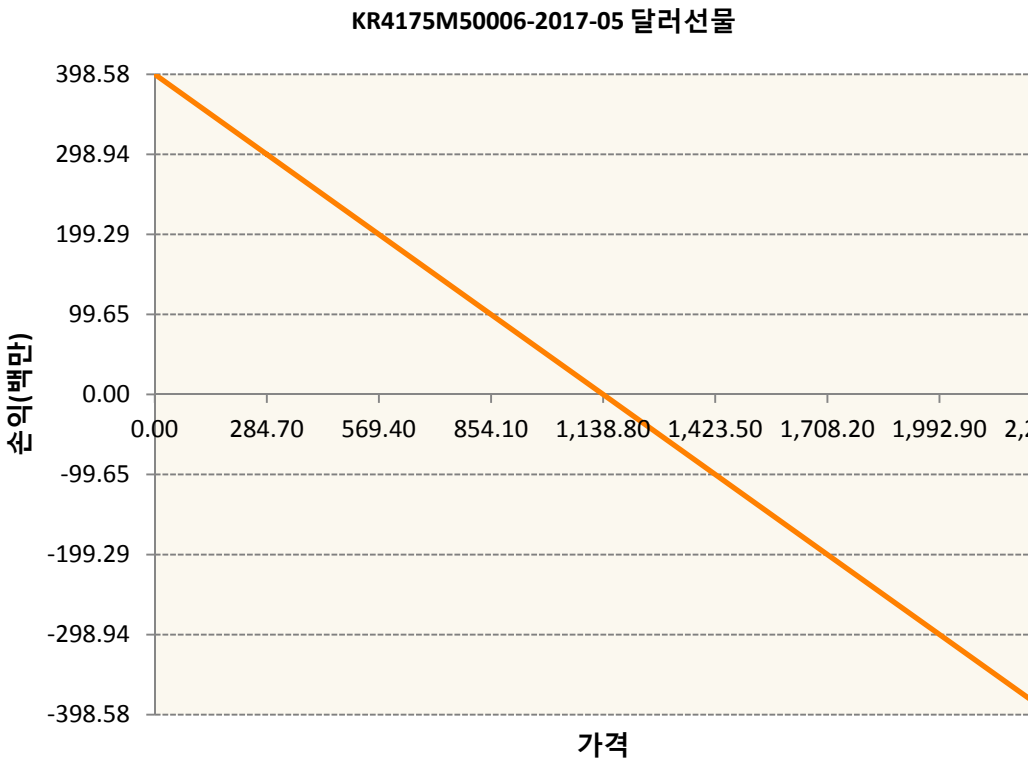


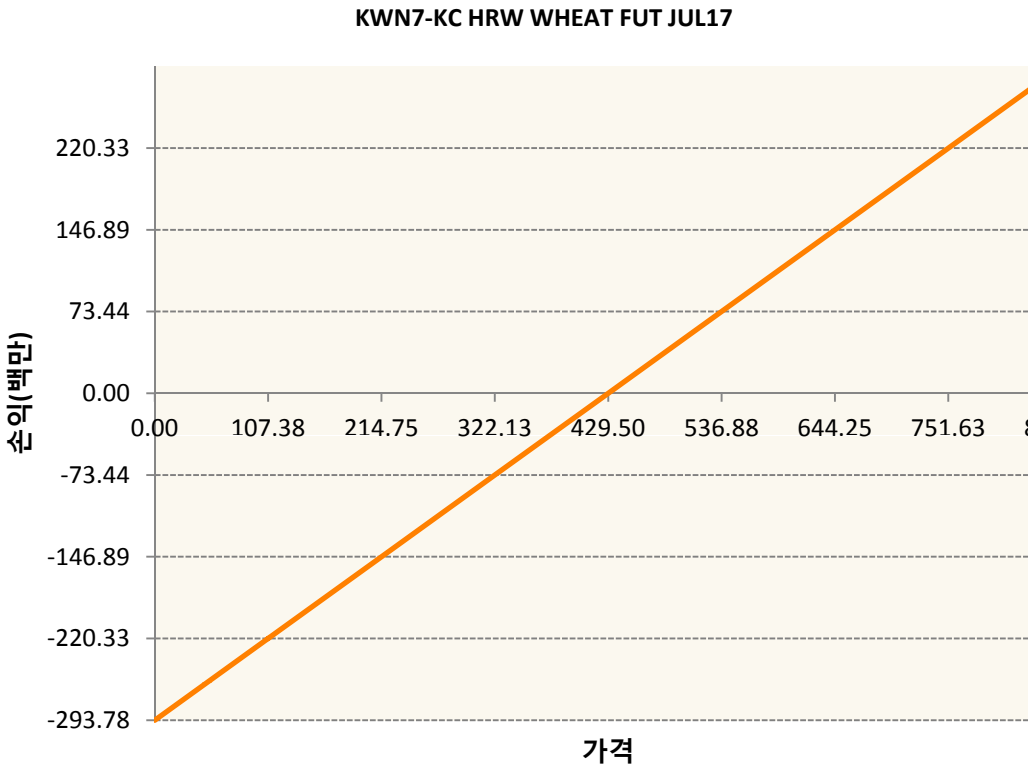

-1,196.44
-1,794.67
-2,392.89
가격


CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
401.78
301.34
200.89
100.45
0.00
-100.45
-200.89
-301.34
-401.78
0.00
19.58
39.16
58.74
78.32
97.90
117.48
137.06
순익(백만)
가격

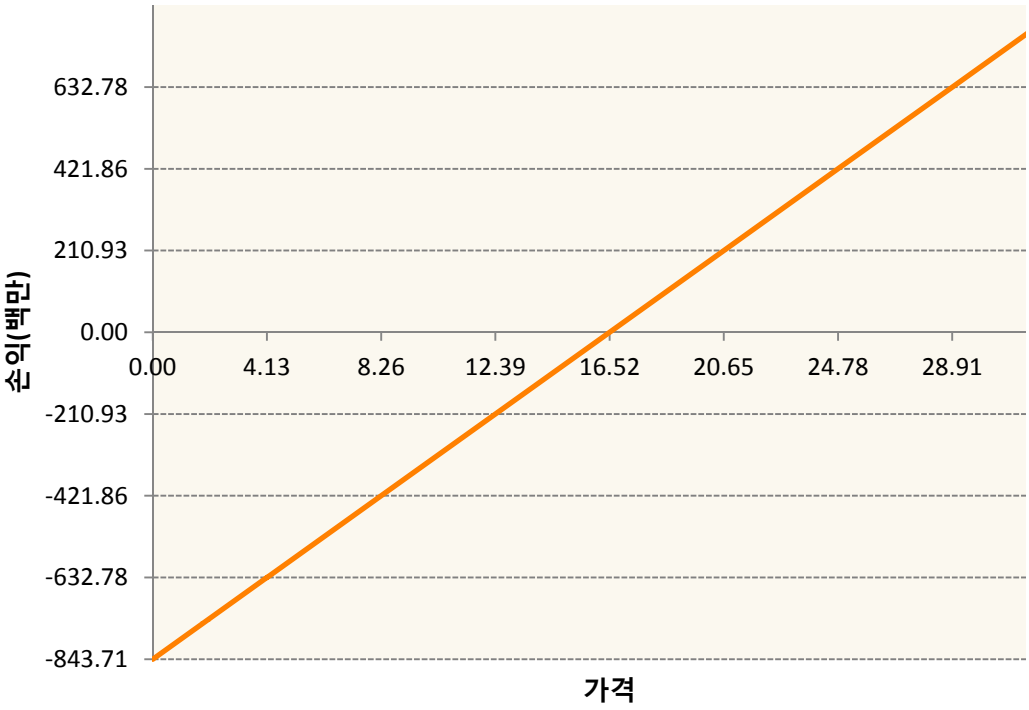

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
661.41
496.05
330.70
165.35
0.00
-165.35
-330.70
-496.05
-661.41
0.00
35.16
70.33
105.49
140.65
175.81
210.98
246.14
순익(백만)

가격

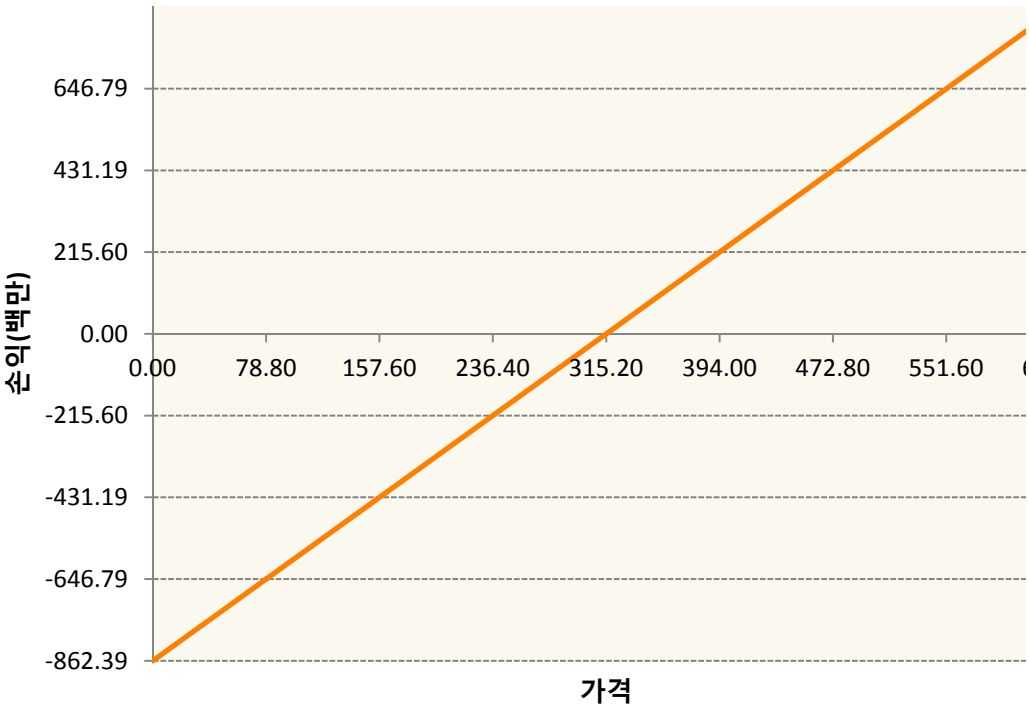

KR4175M50006-2017-05 달러선물
398.58
298.94
199.29
99.65
0.00
-99.65
-199.29
-298.94
-398.58
0.00
284.70
569.40
854.10
1,138.80
1,423.50
1,708.20
1,992.90
순이익(만)
가격


KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17
220.33
146.89
73.44
0.00
-73.44
-146.89
-220.33
-293.78
0.00
107.38
214.75
322.13
429.50
536.88
644.25
751.63
순이익(만)
가격

SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17

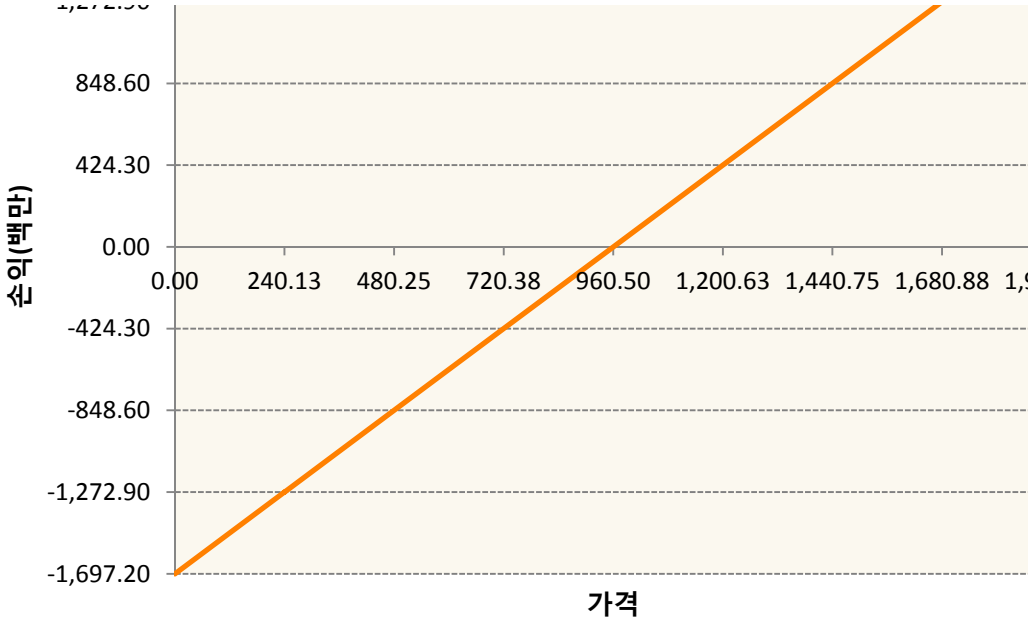


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17

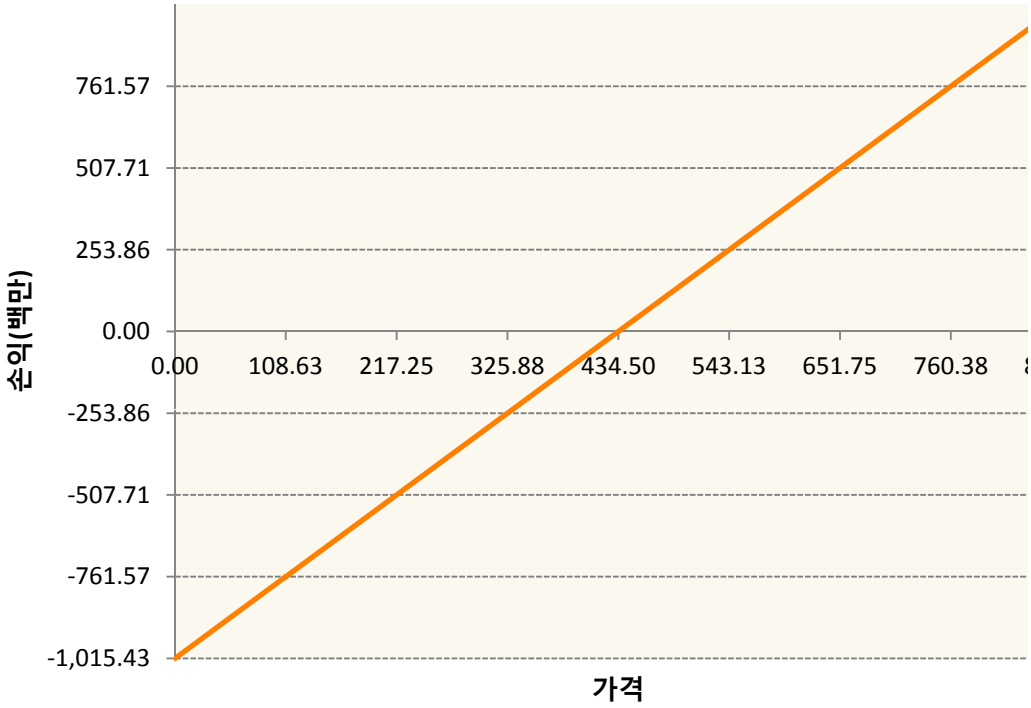


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17





WN7-WHEAT FUTURE(CBT) JUL17



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	61
CN7	CORN FUTURE JUL17	191
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	32
KCN7	COFFEE 'C' FUTURE JUL17	53
KR4175M50(	2017-05 달러선물	32

KWN7	KC HRW WHEAT FUT JUL17	24
SBN7	SUGAR #11 (WORLD) JUL17	67
SMN7	SOYBEAN MEAL FUTR JUL17	69
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	136
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	81

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

871