공시일	2017-04-24
기준일	2017-04-21

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	2017-04-24
기준일	2017-04-21

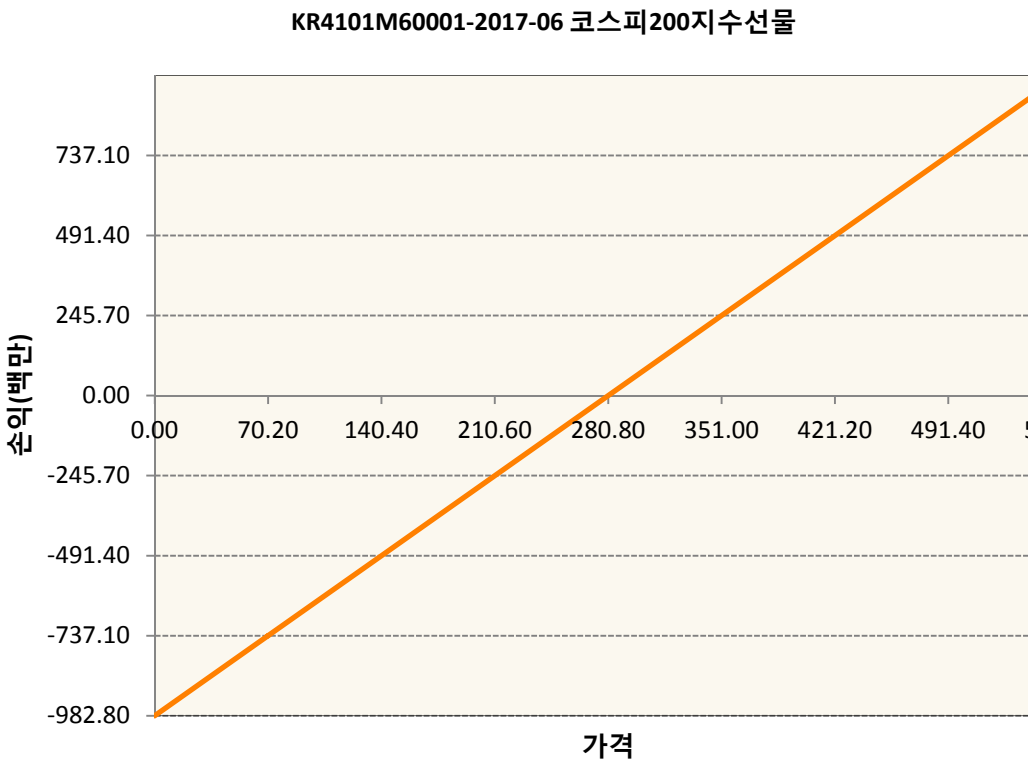
스마트인덱스모

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	983	0	983	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	2017-04-24
기준일	2017-04-21

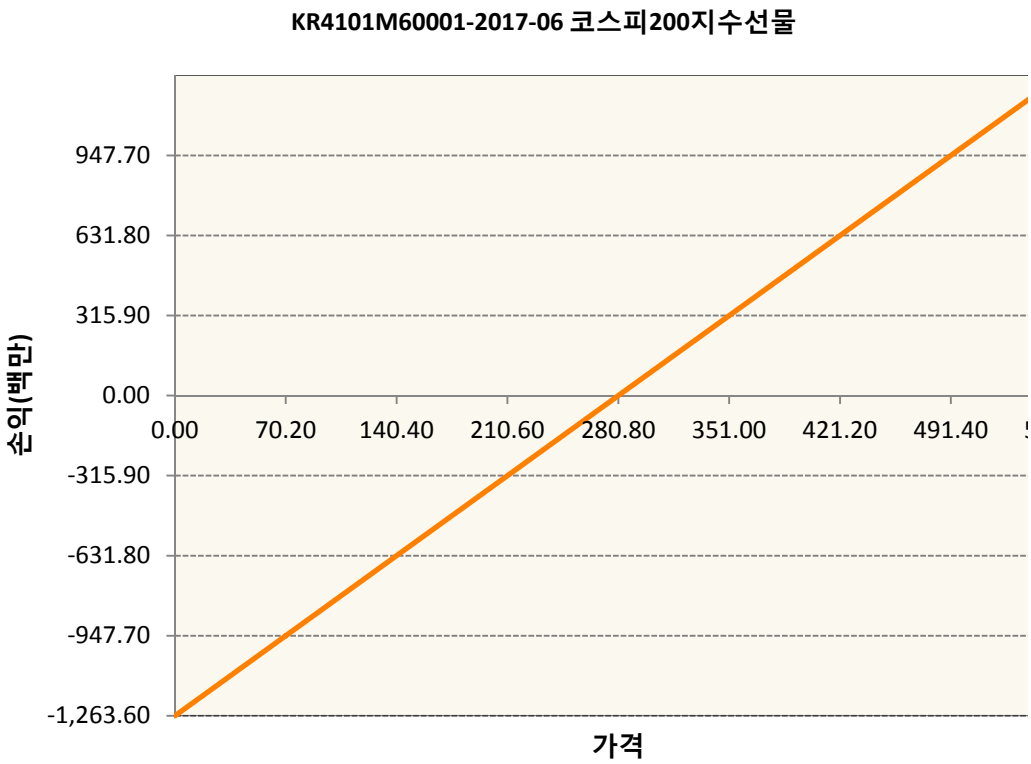
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,264	0	1,264	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							101
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-101	-101	-101	-101	-101	-101	-101
-5.33%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67
-2.67%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	34	34	34	34	34	34	34
5.33%	67	67	67	67	67	67	67
8.00%	101	101	101	101	101	101	101

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

64

공시일	2017-04-24
기준일	2017-04-21

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	957

* 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	2017-04-24
기준일	2017-04-21

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	383

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

387

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-04-24
기준일	2017-04-21

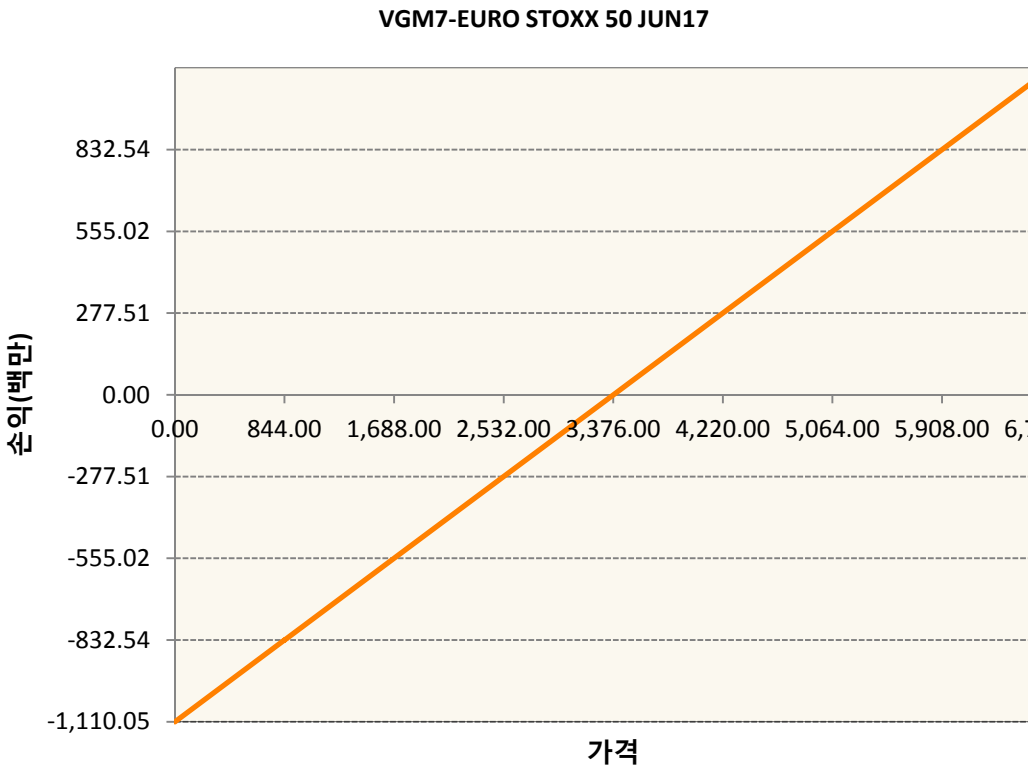
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2017-04-24
기준일	2017-04-21

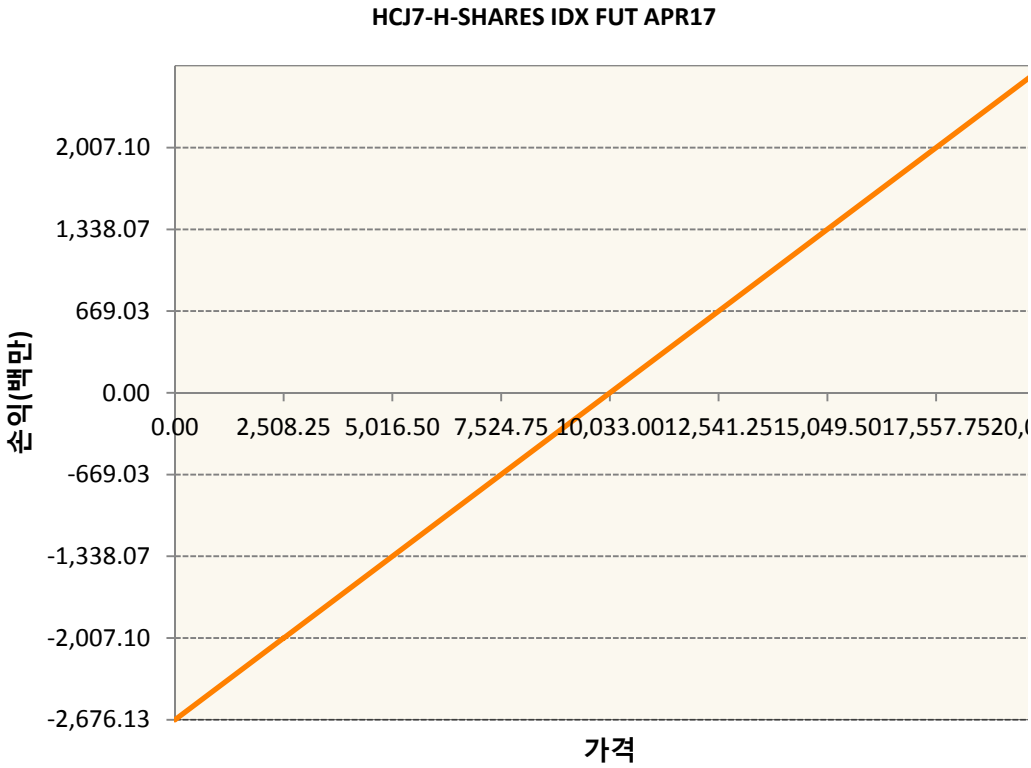
차이나인덱스모(주식-파생형)

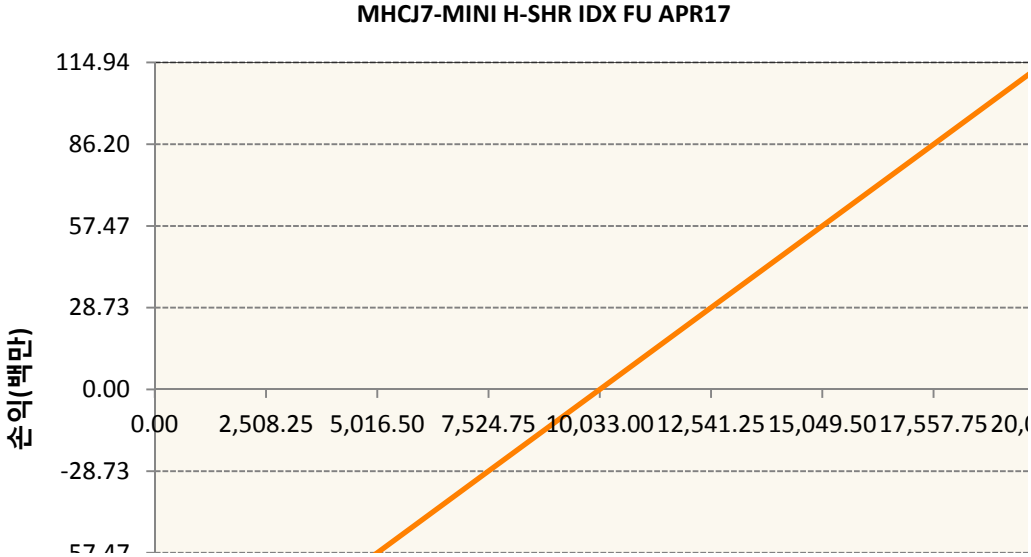
1. 계약금액

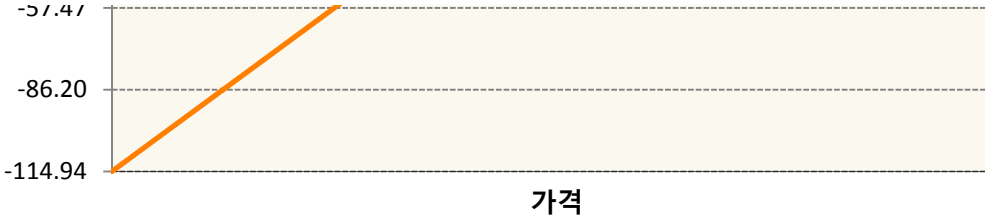
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,791	0	2,791	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCJ7	H-SHARES IDX FUT APR17	214
MHCJ7	MINI H-SHR IDX FU APR17	9

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

238

공시일	2017-04-24
기준일	2017-04-21

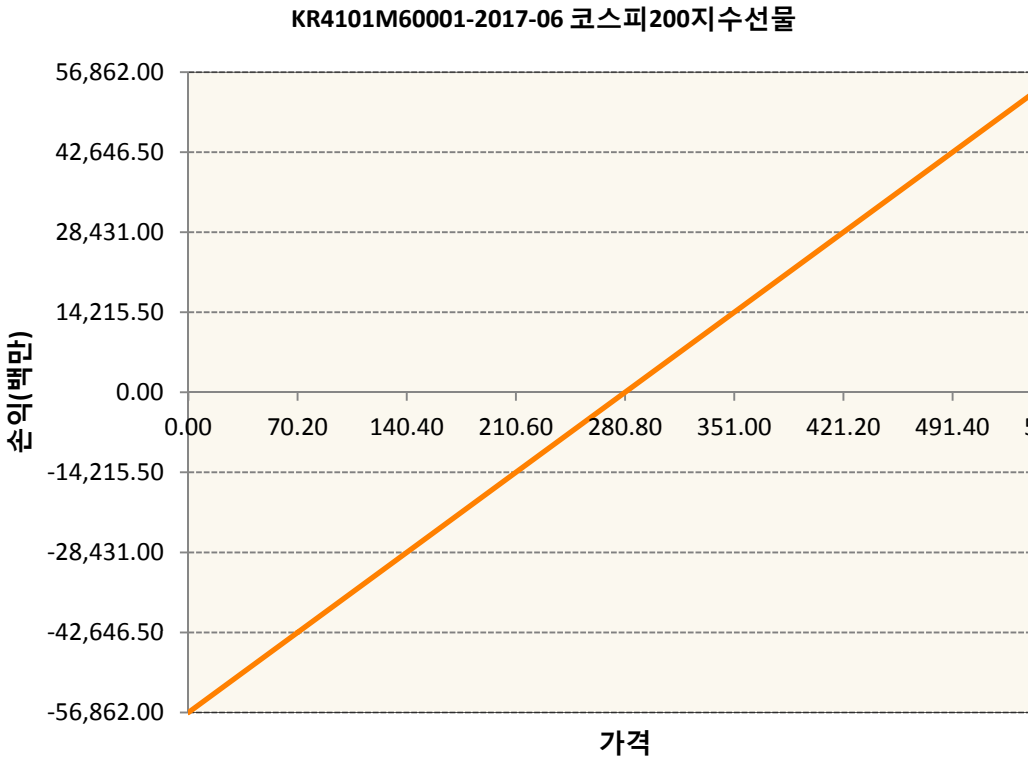
커버드콜모(주식혼합-파생형)

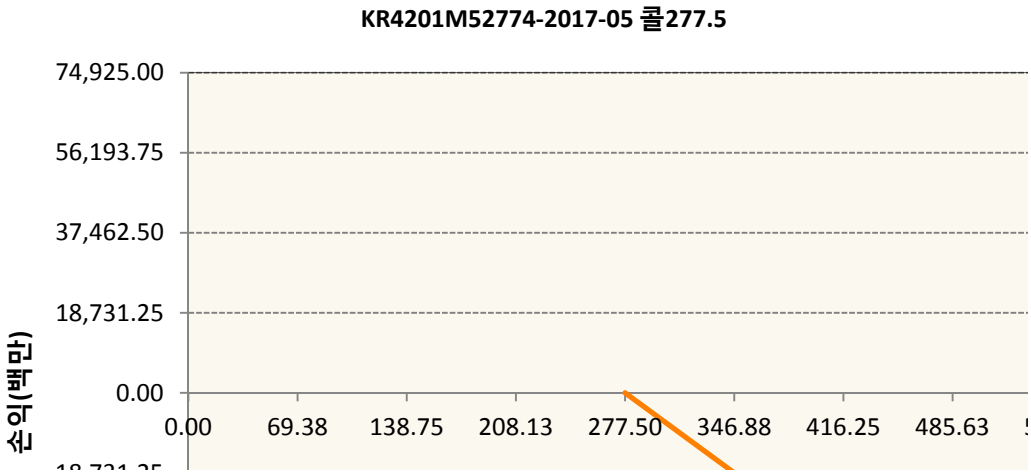
1. 계약금액

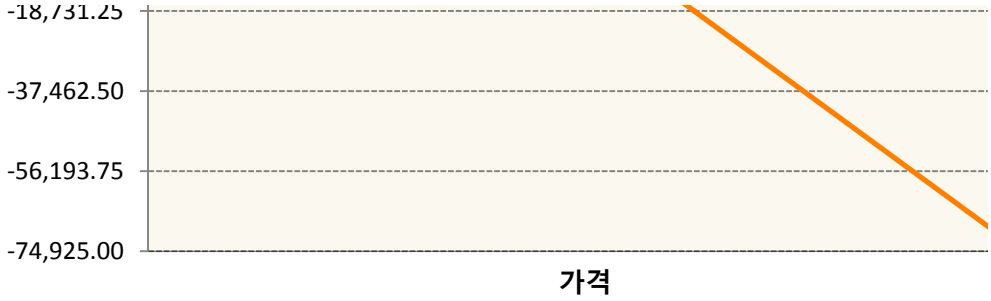
(단위:백만원)

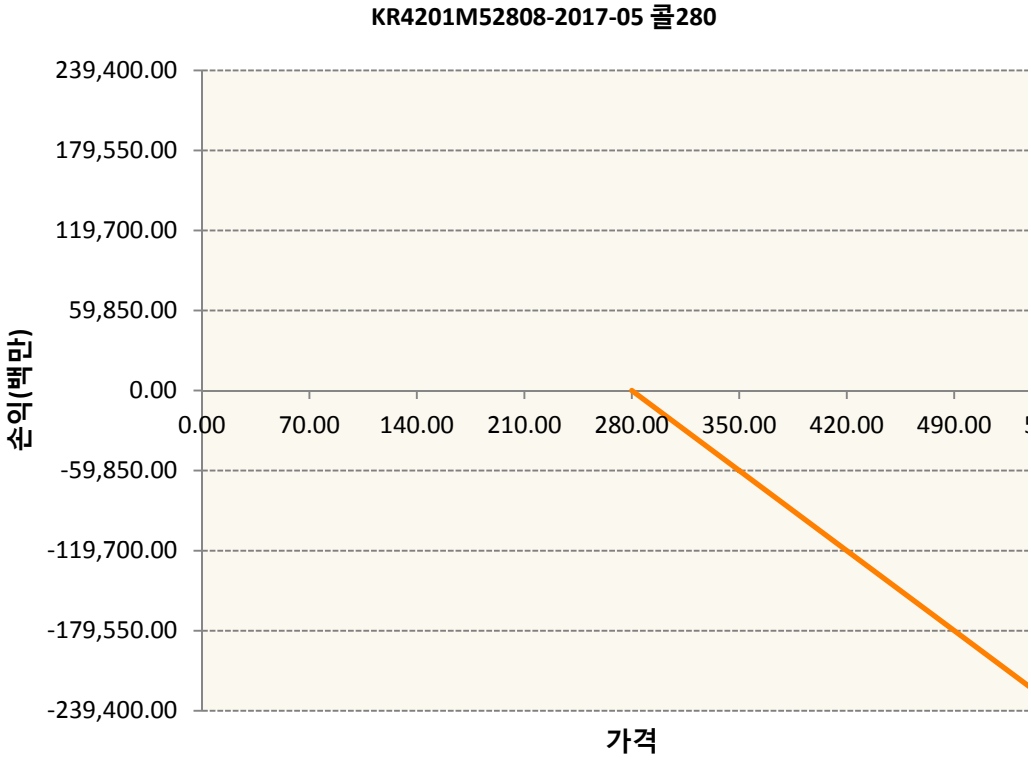
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	10,614	-10,614	장내
누계	유가증권	선물	56,862	0	56,862	장내
누계	유가증권	옵션	0	369,825	-369,825	장내

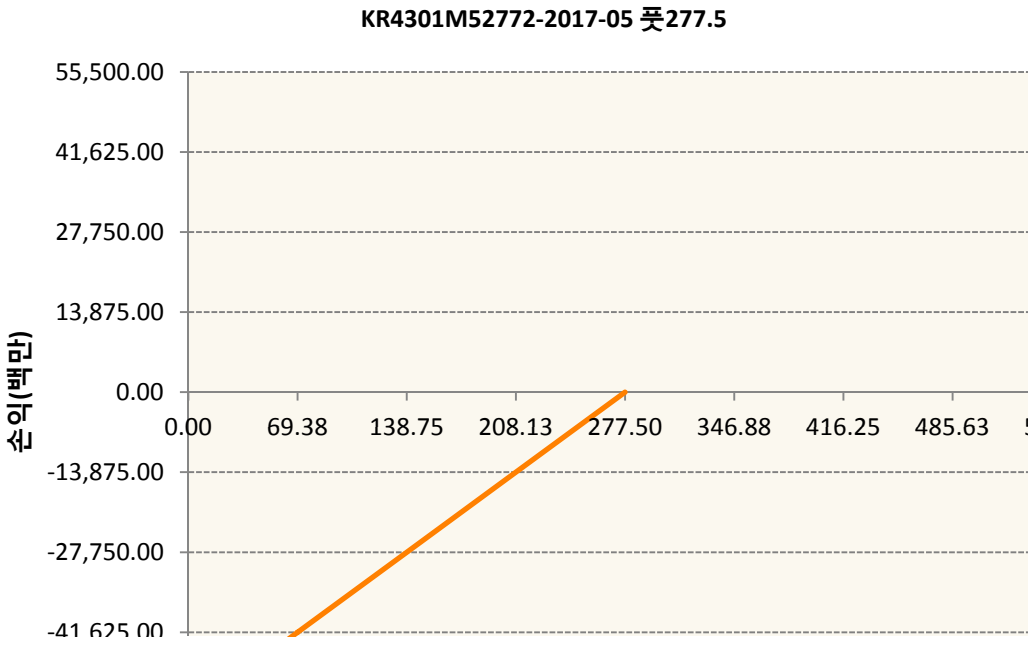
2. 만기시점의 손익구조

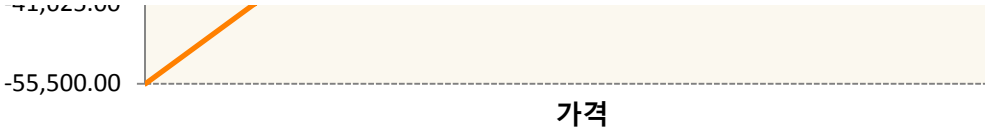





-18,731.25
-37,462.50
-56,193.75
-74,925.00
가격


KR4201M52808-2017-05 콜280
239,400.00
179,550.00
119,700.00
59,850.00
0.00
-59,850.00
-119,700.00
-179,550.00
-239,400.00
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							4,537
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,537	-4,537	-4,537	-4,537	-4,537	-4,537	-4,537
-5.33%	-3,025	-3,025	-3,025	-3,025	-3,025	-3,025	-3,025
-2.67%	-1,512	-1,512	-1,512	-1,512	-1,512	-1,512	-1,512
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,512	1,512	1,512	1,512	1,512	1,512	1,512
5.33%	3,025	3,025	3,025	3,025	3,025	3,025	3,025
8.00%	4,537	4,537	4,537	4,537	4,537	4,537	4,537
KR4201M52 2017-05 콜277.5							5,437
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,297	1,296	1,295	1,292	1,287	1,280	1,270
-5.33%	1,283	1,270	1,253	1,231	1,204	1,174	1,139
-2.67%	1,087	1,030	969	907	842	777	710
0%	217	145	73	0	-74	-147	-222
2.67%	-1,443	-1,469	-1,502	-1,539	-1,581	-1,627	-1,676
5.33%	-3,412	-3,416	-3,422	-3,431	-3,443	-3,460	-3,480
8.00%	-5,425	-5,425	-5,425	-5,426	-5,429	-5,432	-5,437
KR4201M52 2017-05 콜280							16,301
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,928	2,927	2,925	2,921	2,913	2,901	2,882
-5.33%	2,913	2,894	2,865	2,823	2,769	2,702	2,623
-2.67%	2,608	2,479	2,334	2,177	2,009	1,832	1,648
0%	730	487	243	0	-243	-487	-730
2.67%	-3,811	-3,947	-4,099	-4,264	-4,439	-4,623	-4,814
5.33%	-9,866	-9,891	-9,929	-9,981	-10,047	-10,127	-10,220
8.00%	-16,223	-16,225	-16,229	-16,237	-16,251	-16,272	-16,301
KR4301M52 2017-05 풋277.5							3,536
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,516	-3,516	-3,518	-3,520	-3,523	-3,529	-3,536
-5.33%	-2,034	-2,043	-2,056	-2,073	-2,092	-2,115	-2,141
-2.67%	-687	-730	-774	-821	-868	-917	-967

0%	161	108	54	0	-54	-109	-164
2.67%	424	404	380	352	321	287	251
5.33%	457	454	450	443	434	422	407
8.00%	458	458	458	457	455	453	449

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

32,117

공시일	2017-04-24
기준일	2017-04-21

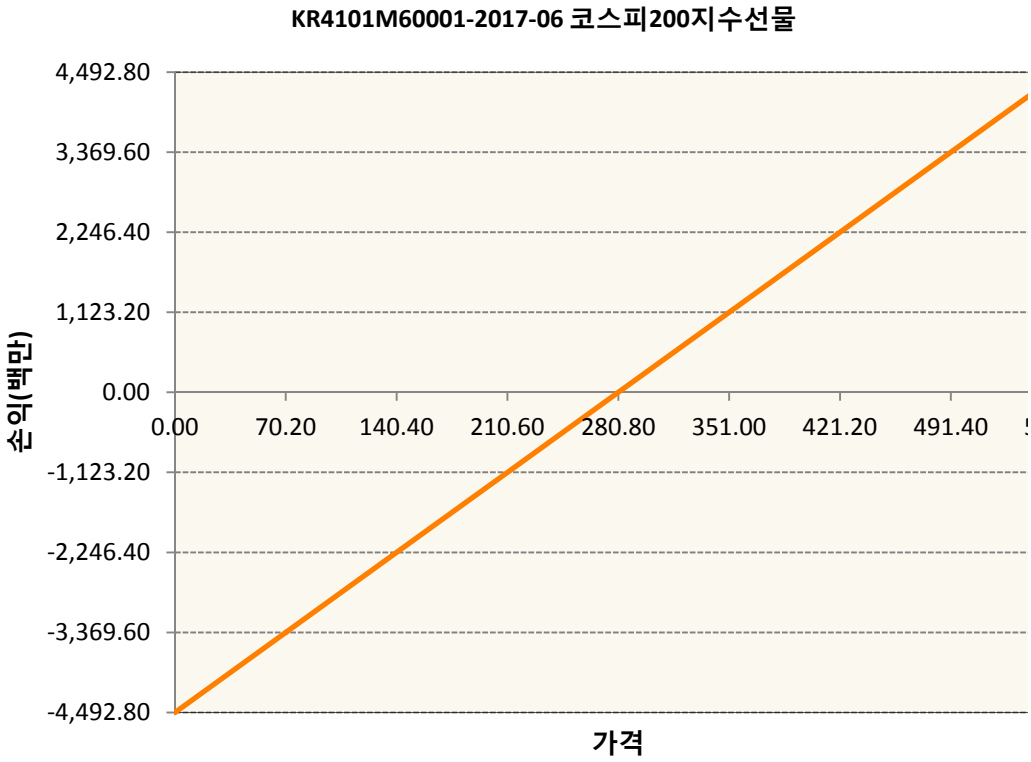
커버드콜목표전환형증권투자신탁

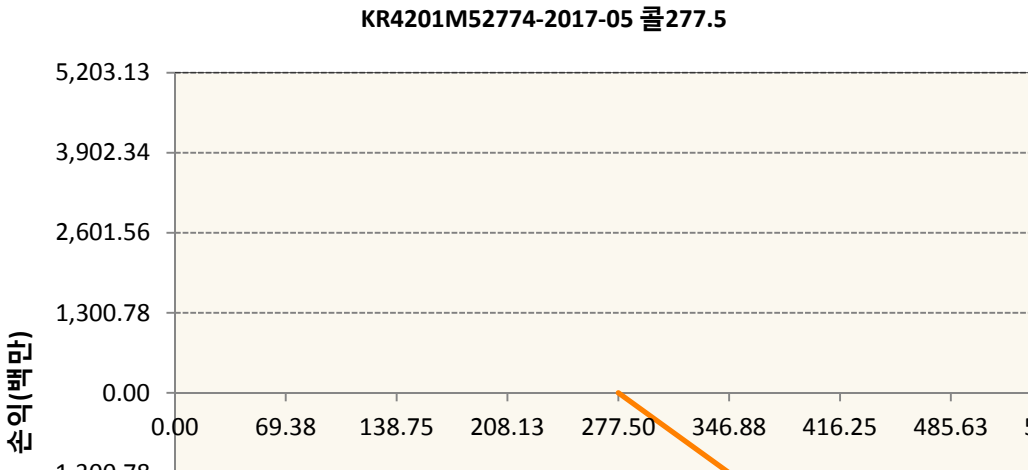
1. 계약금액

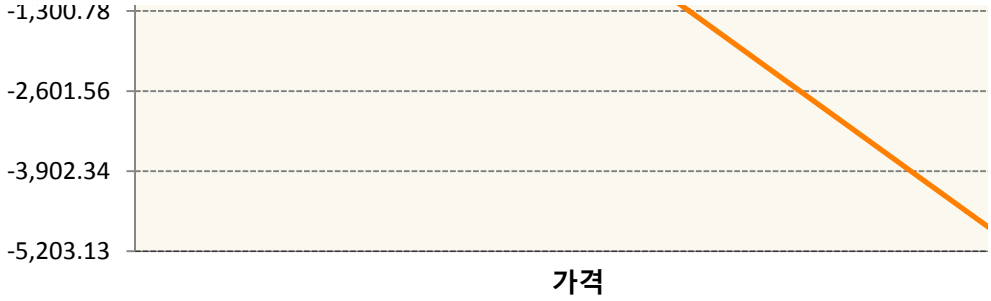
(단위:백만원)

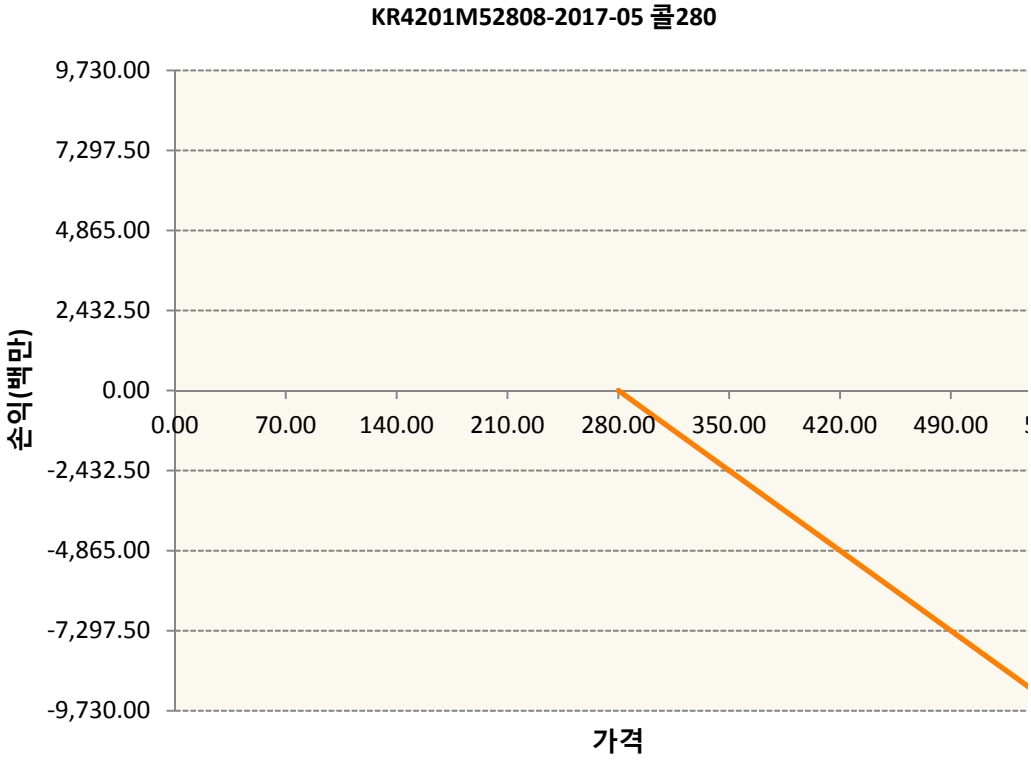
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,493	0	4,493	장내
누계	유가증권	옵션	0	14,933	-14,933	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물						358
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-358	-358	-358	-358	-358	-358	-358
-5.33%	-239	-239	-239	-239	-239	-239	-239
-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%	239	239	239	239	239	239	239
8.00%	358	358	358	358	358	358	358
	KR4201M52 2017-05 콜277.5						378
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	90	90	90	90	89	89	88
-5.33%	89	88	87	85	84	82	79
-2.67%	75	71	67	63	59	54	49
0%	15	10	5	0	-5	-10	-15
2.67%	-100	-102	-104	-107	-110	-113	-116
5.33%	-237	-237	-238	-238	-239	-240	-242
8.00%	-377	-377	-377	-377	-377	-377	-378
KR4201M52(	2017-05 콜280						663

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	119	119	119	119	118	118	117
-5.33%	118	118	116	115	113	110	107
-2.67%	106	101	95	88	82	74	67
0%	30	20	10	0	-10	-20	-30
2.67%	-155	-160	-167	-173	-180	-188	-196
5.33%	-401	-402	-404	-406	-408	-412	-415
8.00%	-659	-659	-660	-660	-660	-661	-663

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

1,446

공시일	2017-04-24
기준일	2017-04-21

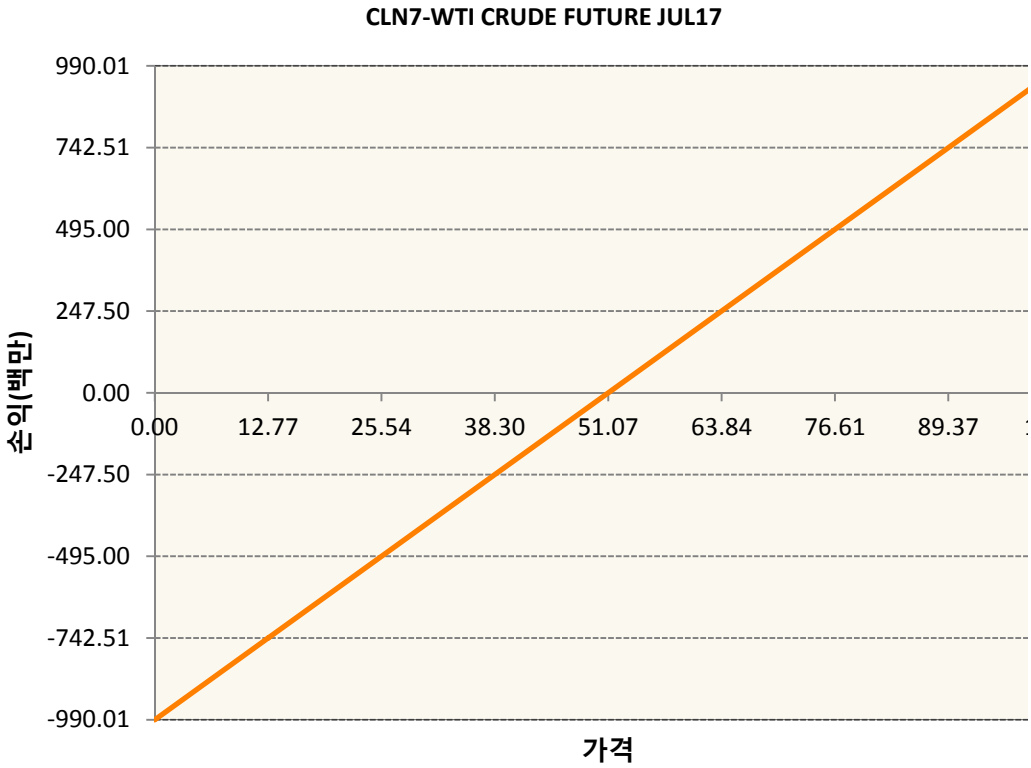
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

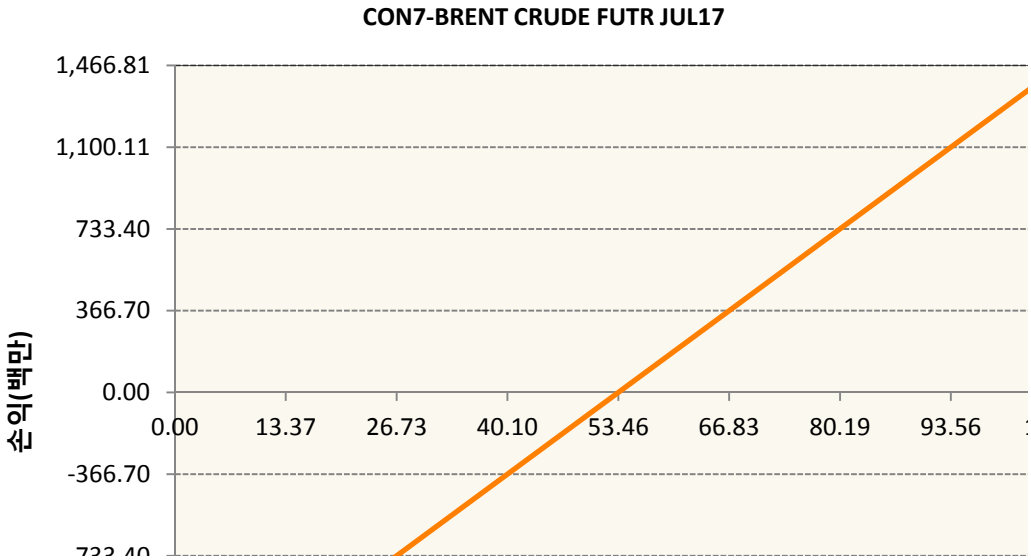
1. 계약금액

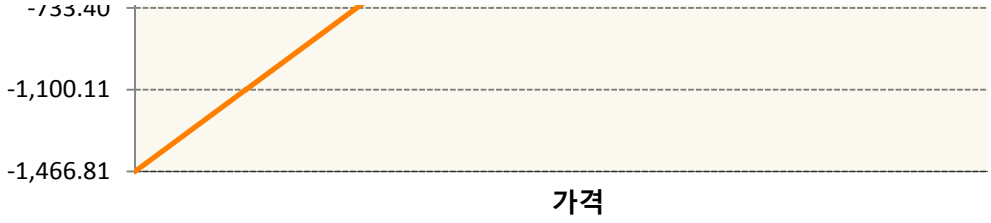
(단위:백만원)

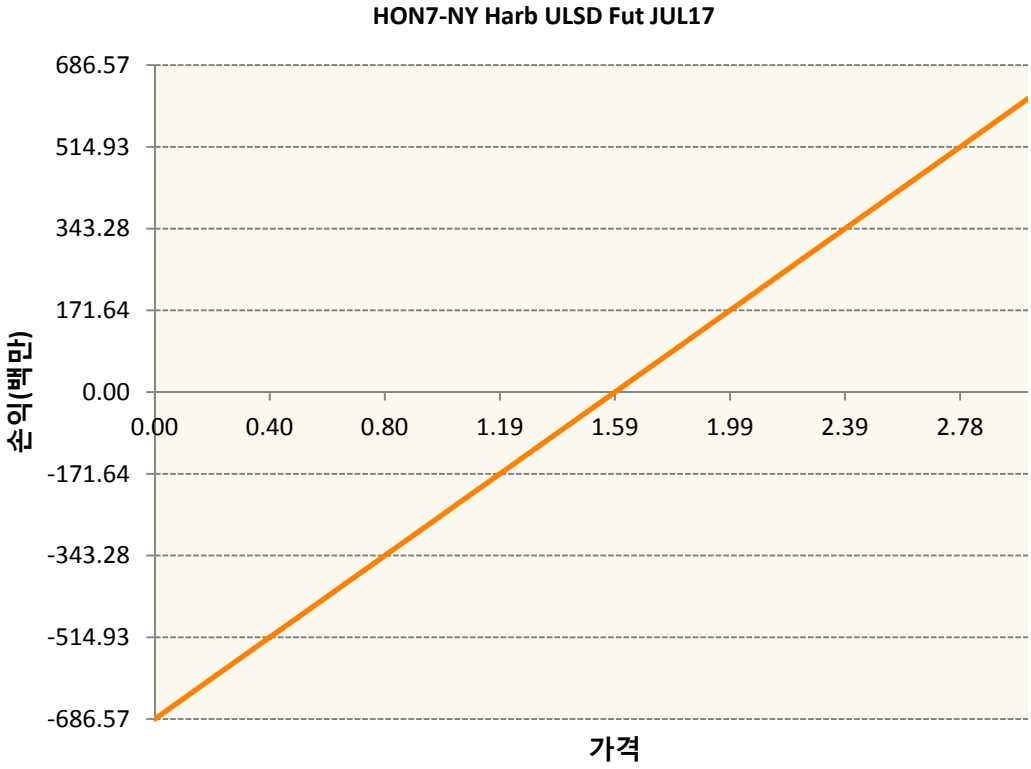
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,418	408	5,010	

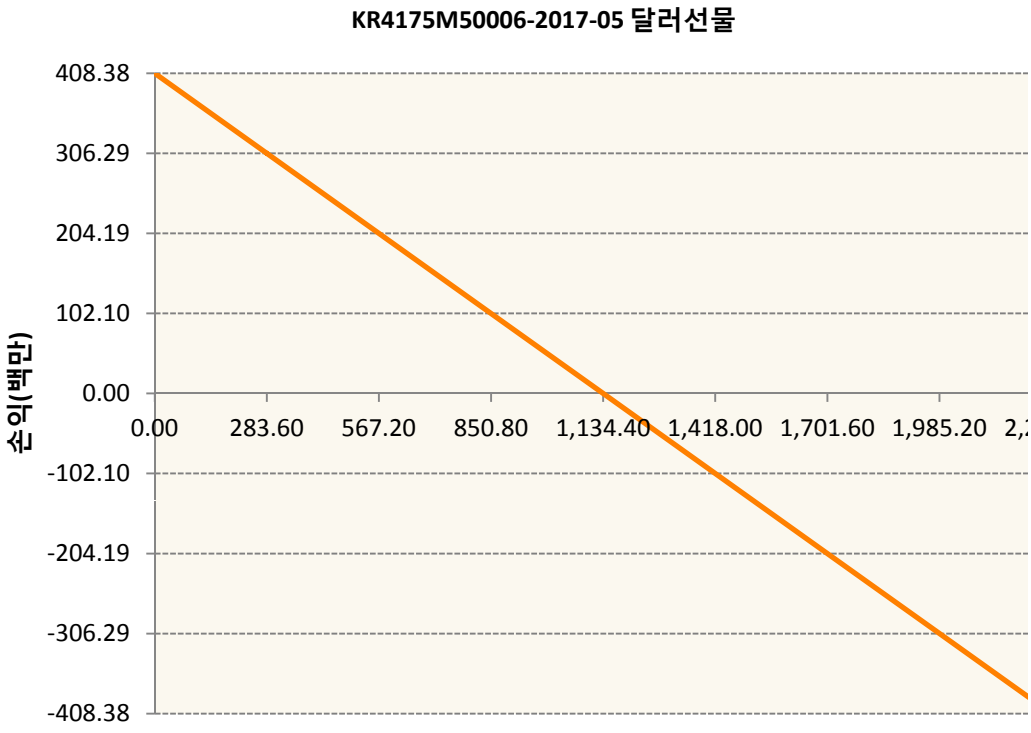
2. 만기시점의 손익구조



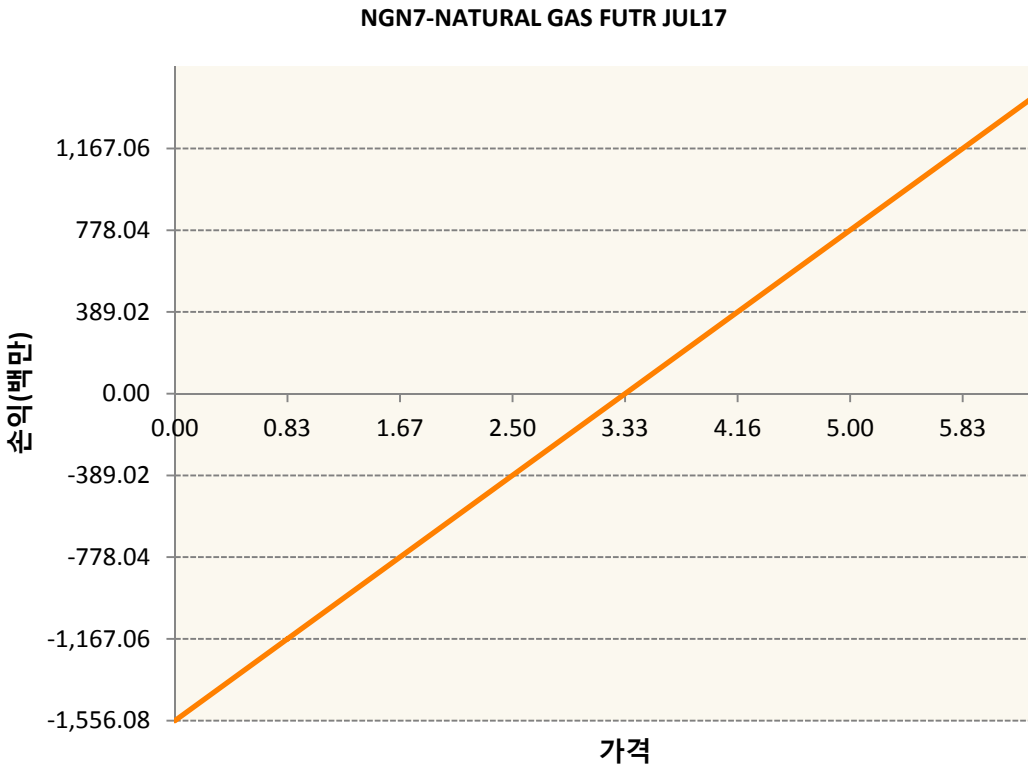


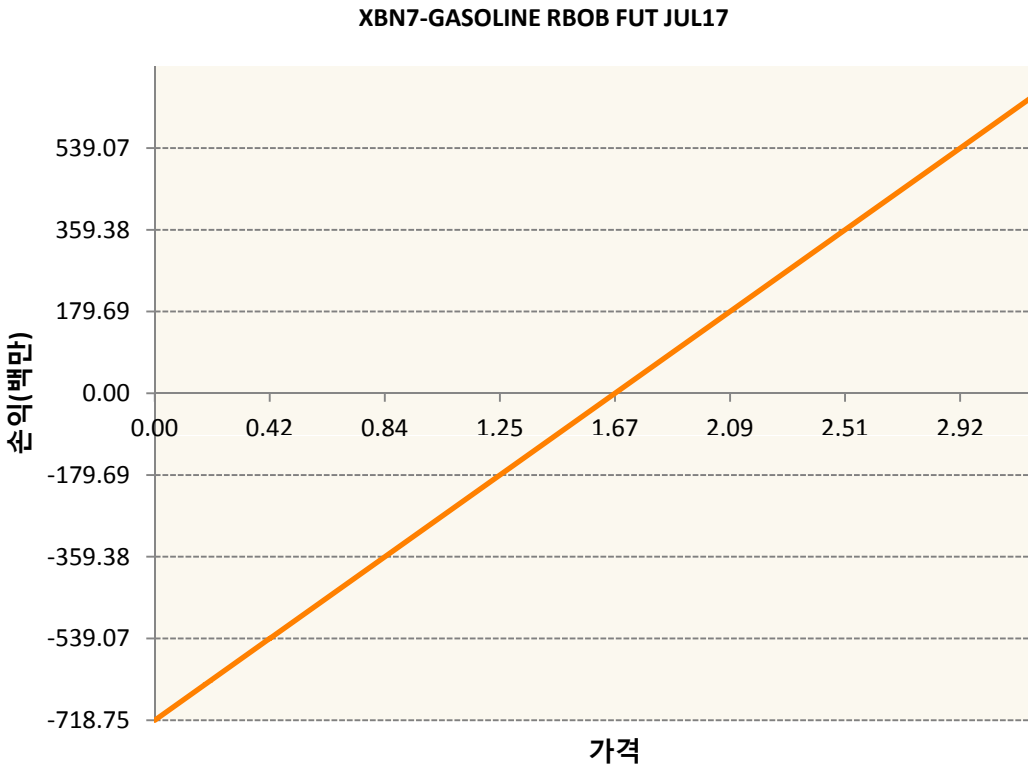

-1,100.11
-1,466.81
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
686.57
514.93
343.28
171.64
0.00
-171.64
-343.28
-514.93
-686.57
0.00
0.40
0.80
1.19
1.59
1.99
2.39
2.78
순이익(백만)
가격


KR4175M50006-2017-05 달러선물
408.38
306.29
204.19
102.10
0.00
-102.10
-204.19
-306.29
-408.38
0.00
283.60
567.20
850.80
1,134.40
1,418.00
1,701.60
1,985.20
순이익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,167.06
778.04
389.02
0.00
-389.02
-778.04
-1,167.06
-1,556.08
0.00
0.83
1.67
2.50
3.33
4.16
5.00
5.83
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
539.07
359.38
179.69
0.00
-179.69
-359.38
-539.07
-718.75
0.00
0.42
0.84
1.25
1.67
2.09
2.51
2.92
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	124
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	58

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

944

공시일	2017-04-24
기준일	2017-04-21

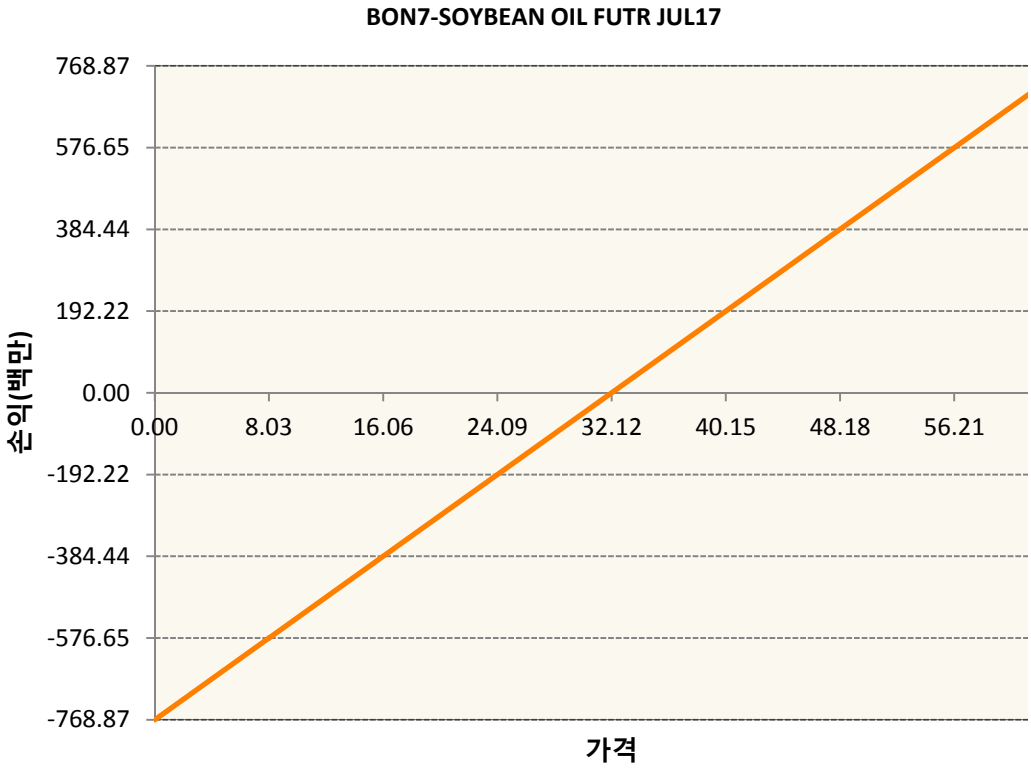
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

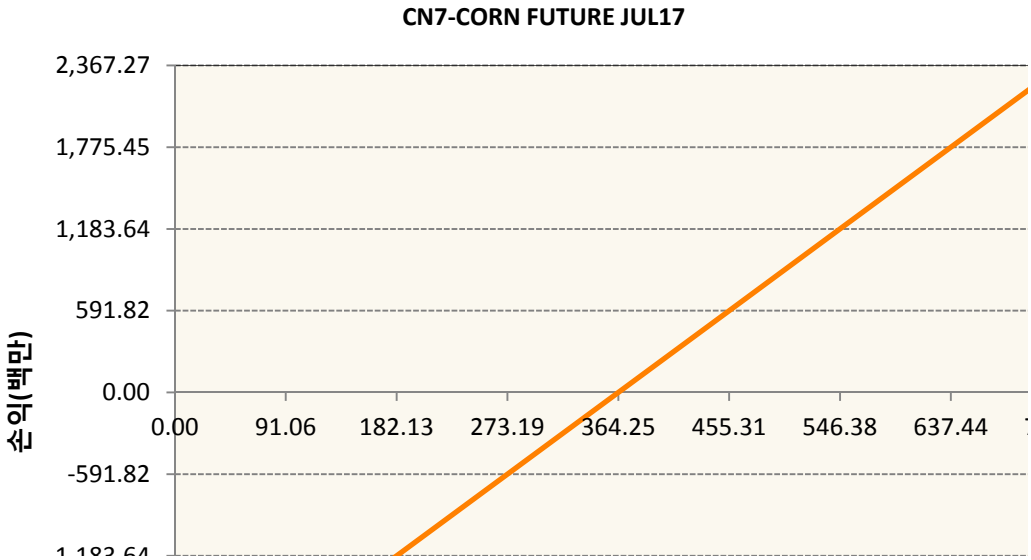
1. 계약금액

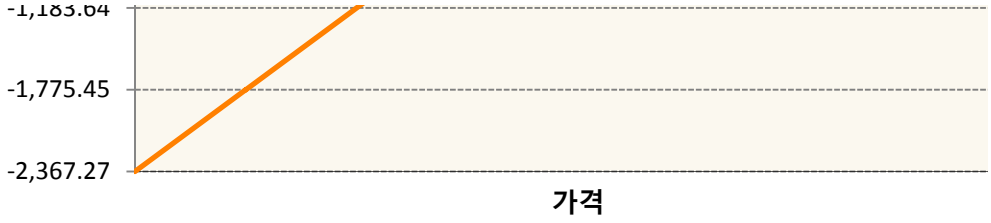
(단위:백만원)

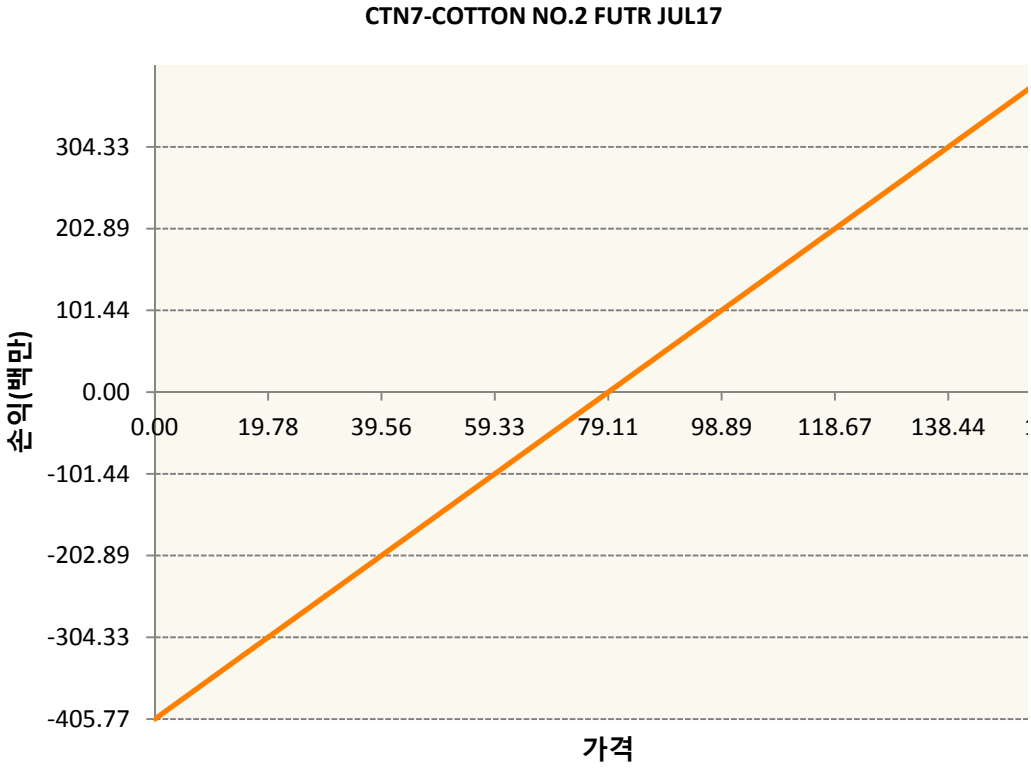
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,826	397	8,429	

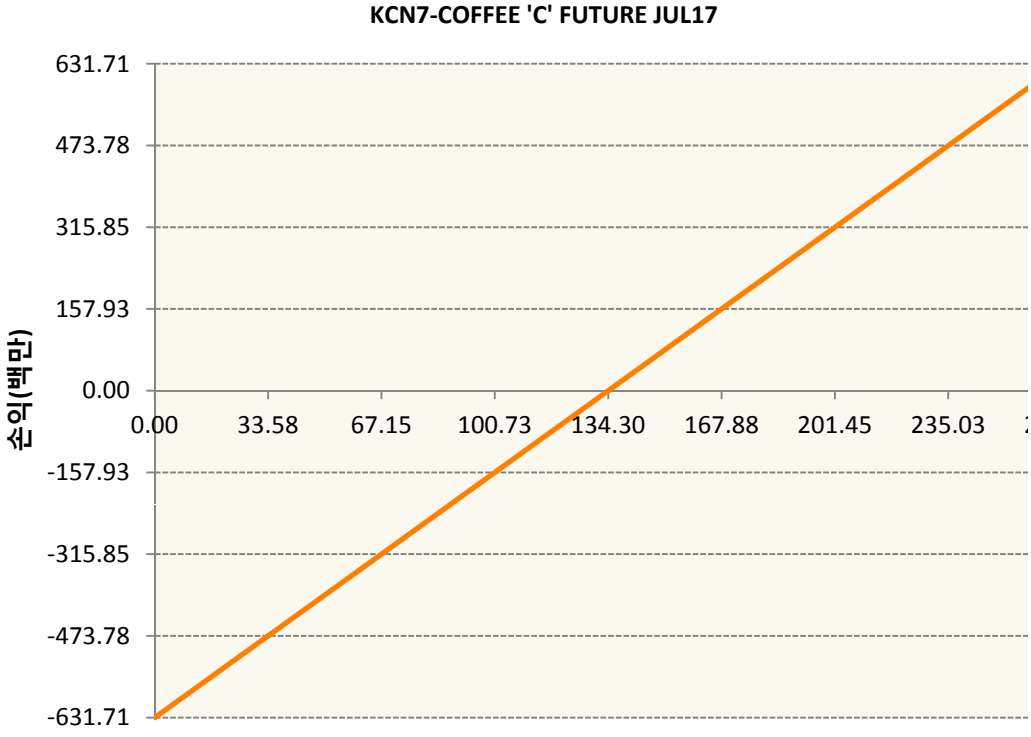
2. 만기시점의 손익구조



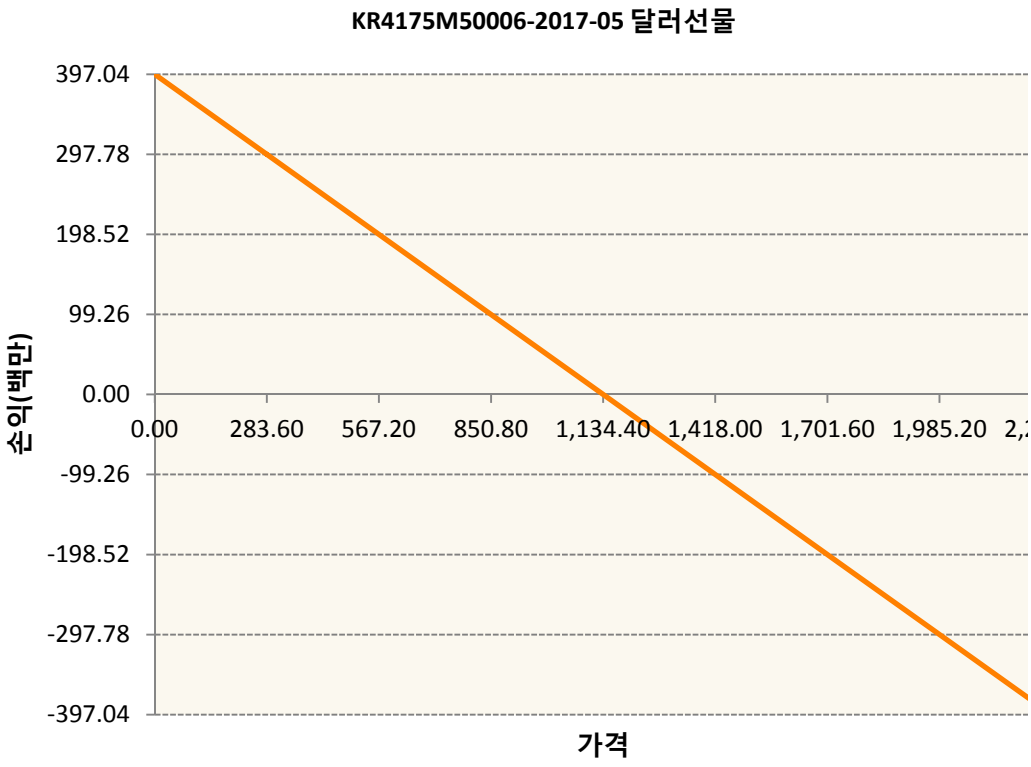


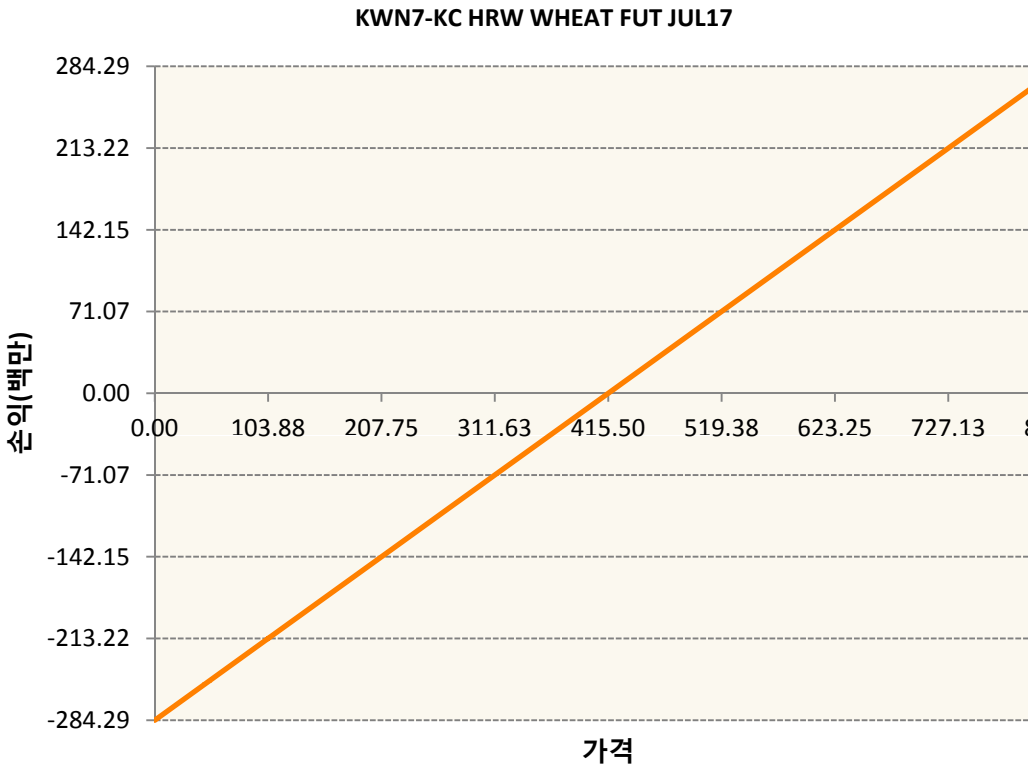

-1,775.45
-2,367.27
가격


CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
304.33
202.89
101.44
0.00
-101.44
-202.89
-304.33
-405.77
0.00
19.78
39.56
59.33
79.11
98.89
118.67
138.44
순익(백만)
가격

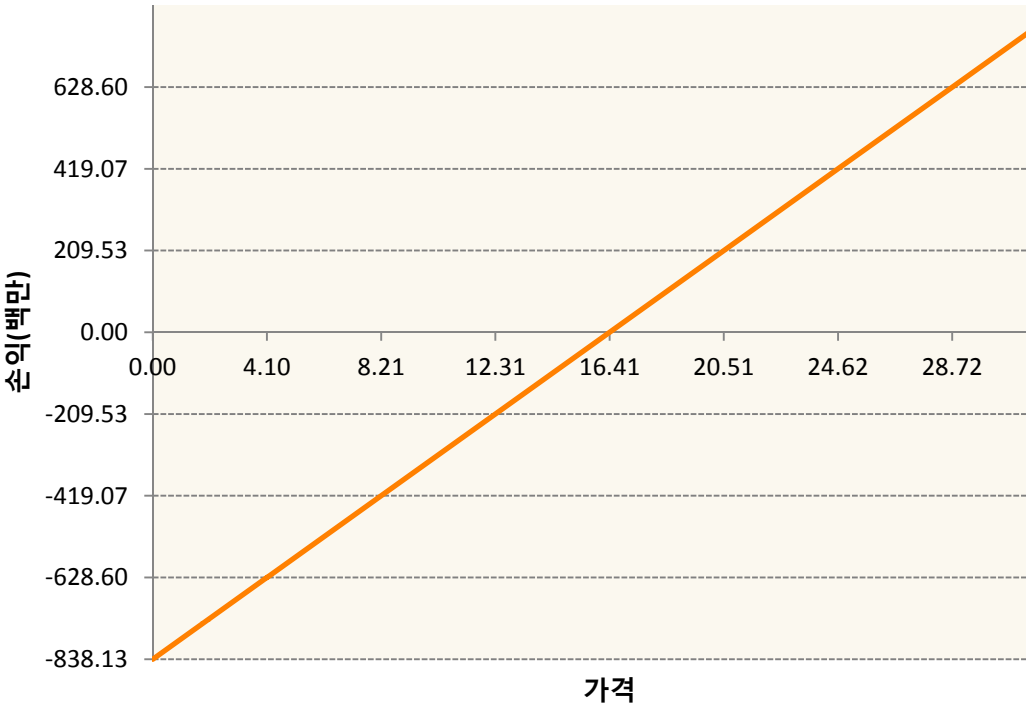

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
631.71
473.78
315.85
157.93
0.00
-157.93
-315.85
-473.78
-631.71
0.00
33.58
67.15
100.73
134.30
167.88
201.45
235.03
순익(백만)

가격

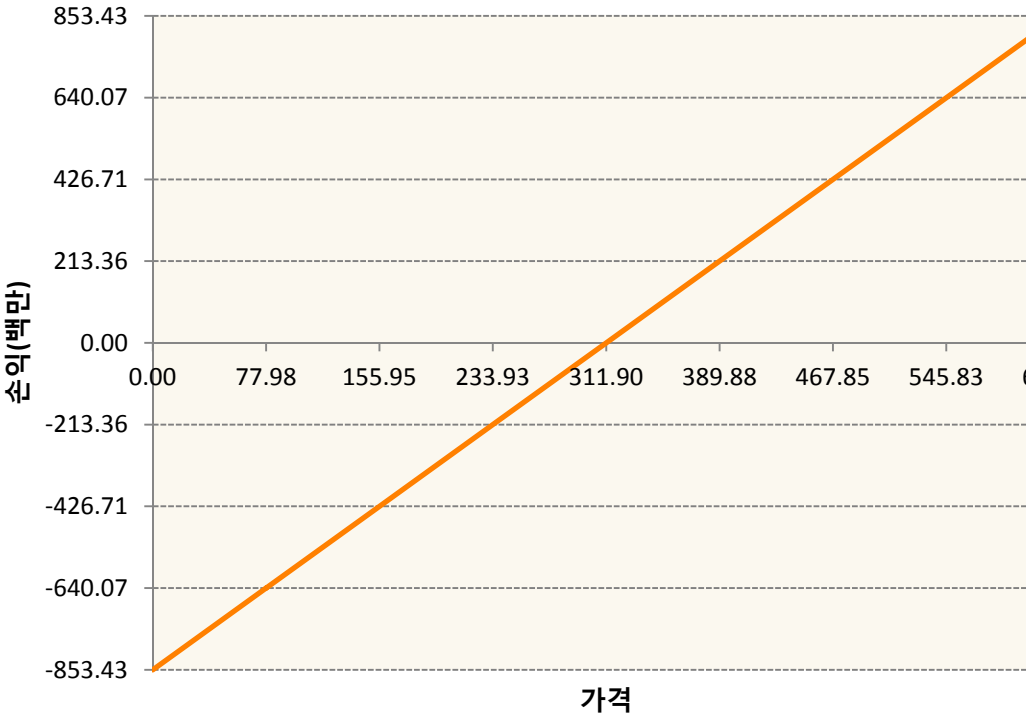

KR4175M50006-2017-05 달러선물
397.04
297.78
198.52
99.26
0.00
-99.26
-198.52
-297.78
-397.04
0.00
283.60
567.20
850.80
1,134.40
1,418.00
1,701.60
1,985.20
손익(백만)
가격


KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17
284.29
213.22
142.15
71.07
0.00
-71.07
-142.15
-213.22
-284.29
0.00
103.88
207.75
311.63
415.50
519.38
623.25
727.13
손익(백만)
가격

SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17

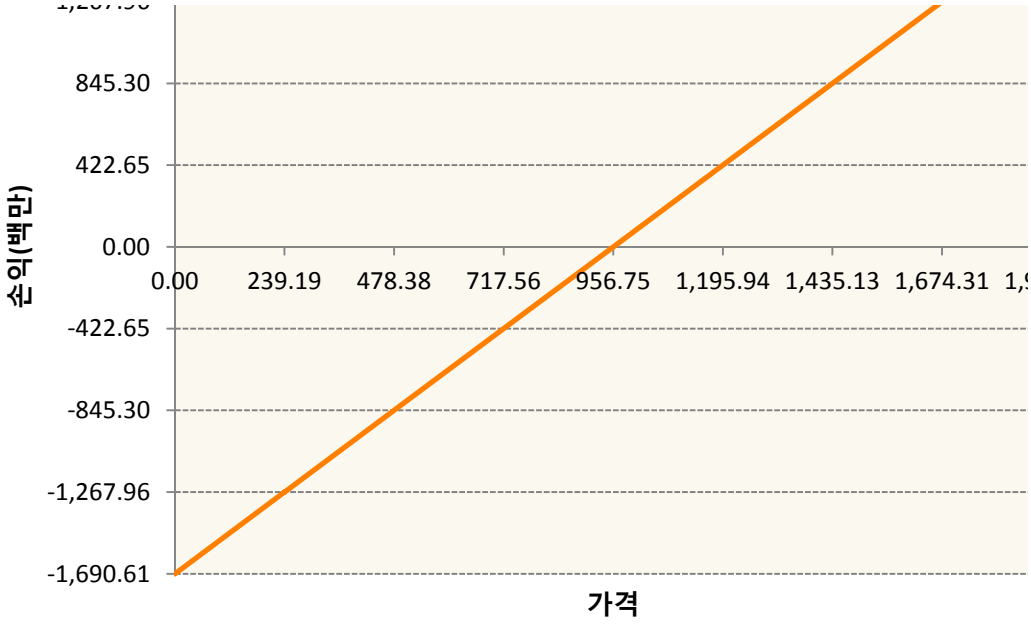


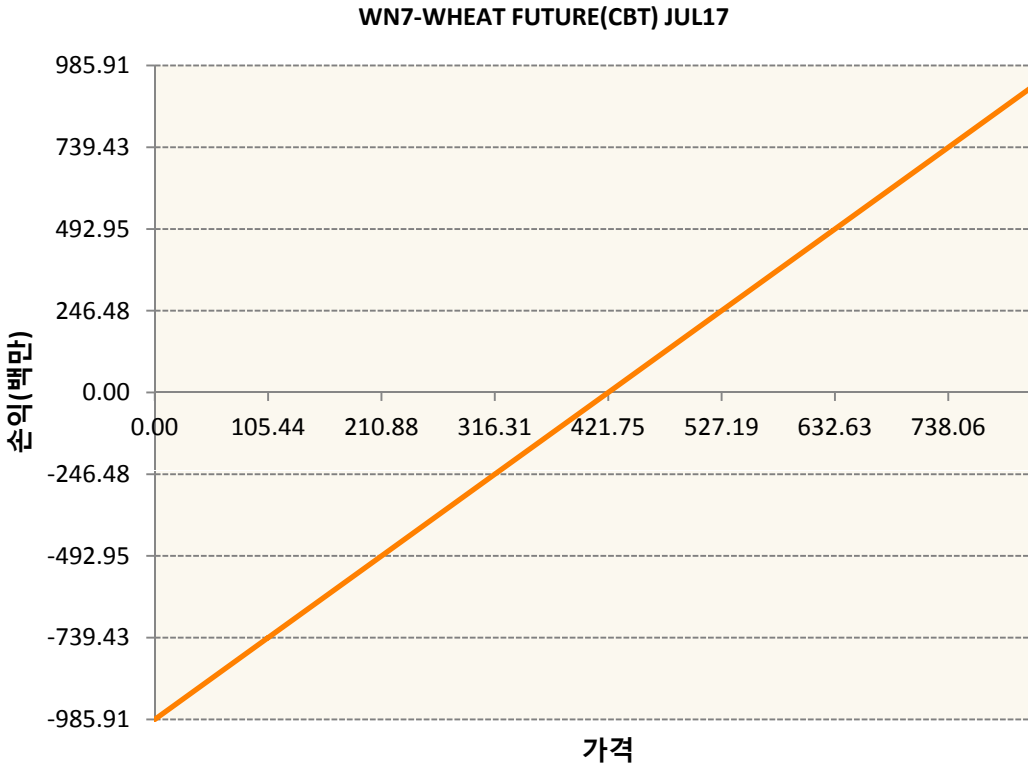
SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17



SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	62
CN7	CORN FUTURE JUL17	189
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	32
KCN7	COFFEE 'C' FUTURE JUL17	51
KR4175M50(	2017-05 달러선물	32

KWN7	KC HRW WHEAT FUT JUL17	23
SBN7	SUGAR #11 (WORLD) JUL17	67
SMN7	SOYBEAN MEAL FUTR JUL17	68
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	135
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	79

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

861