공시일	2017-04-25
기준일	2017-04-24

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	2017-04-25
기준일	2017-04-24

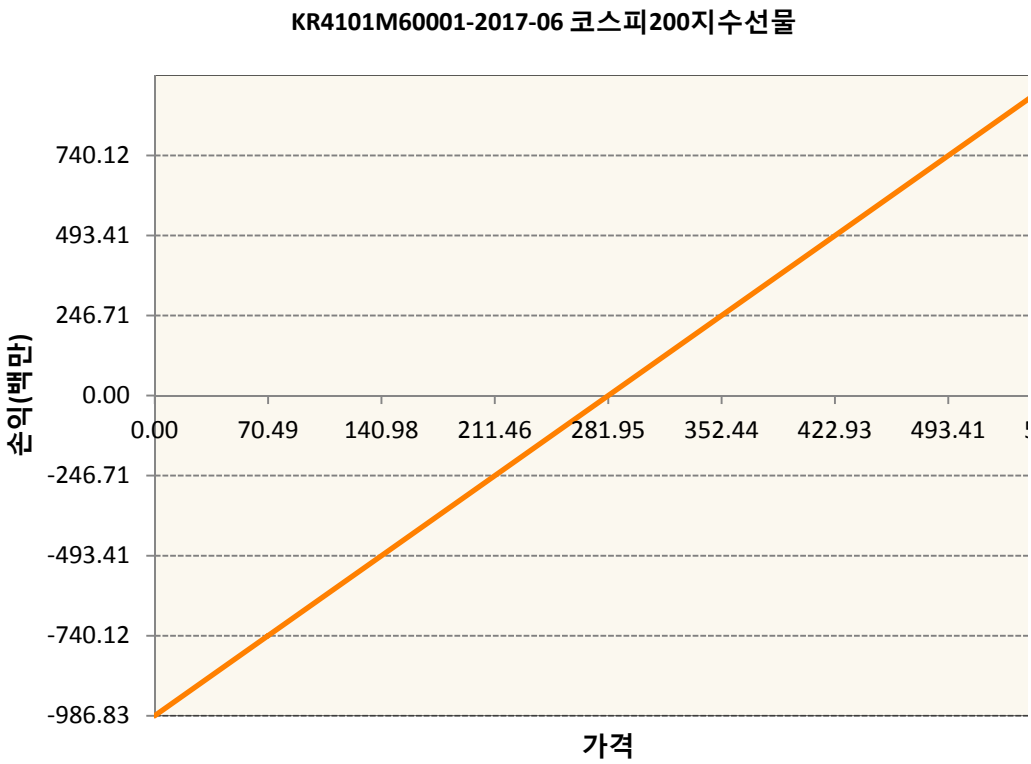
스마트인덱스모

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	987	0	987	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							79
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-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%	53	53	53	53	53	53	53
8.00%	79	79	79	79	79	79	79

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

50

공시일	2017-04-25
기준일	2017-04-24

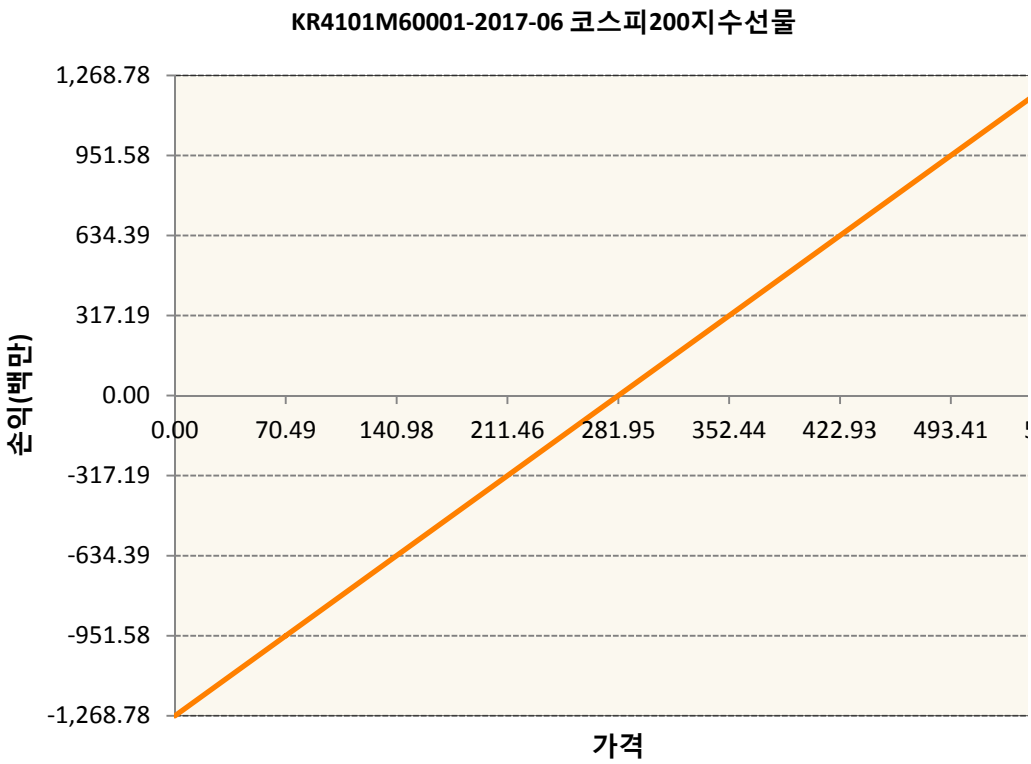
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,269	0	1,269	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							102
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-102	-102	-102	-102	-102	-102	-102
-5.33%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68
-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%	68	68	68	68	68	68	68
8.00%	102	102	102	102	102	102	102

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

65

공시일	2017-04-25
기준일	2017-04-24

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	954

* 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	2017-04-25
기준일	2017-04-24

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	373

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

377

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-04-25
기준일	2017-04-24

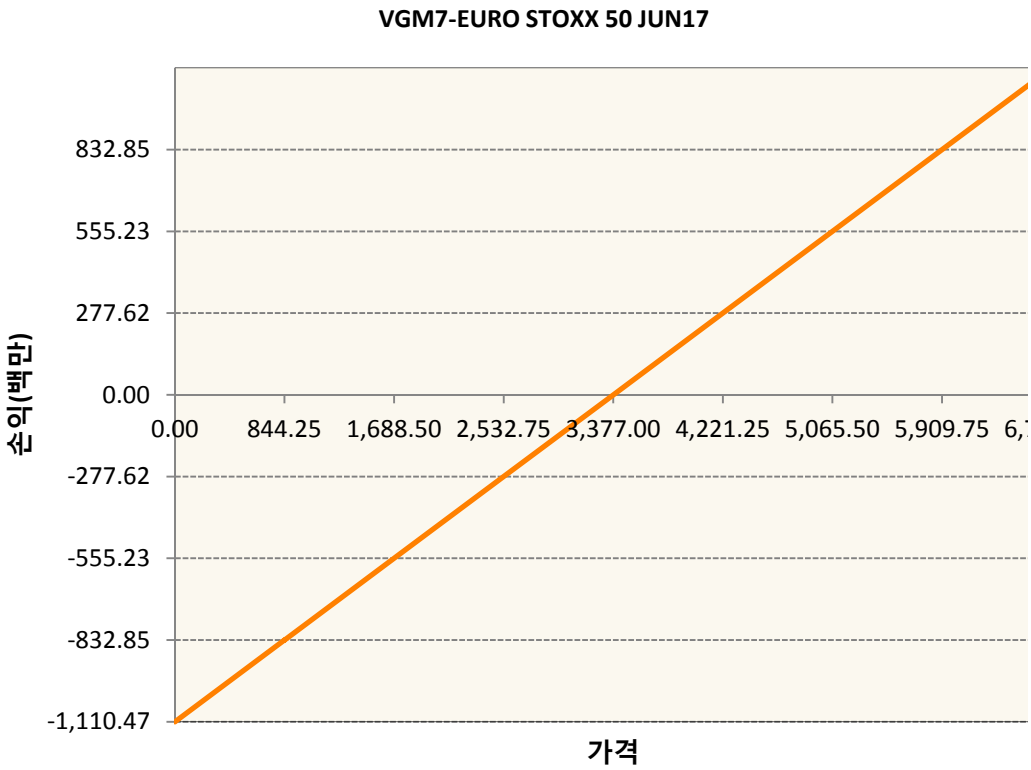
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2017-04-25
기준일	2017-04-24

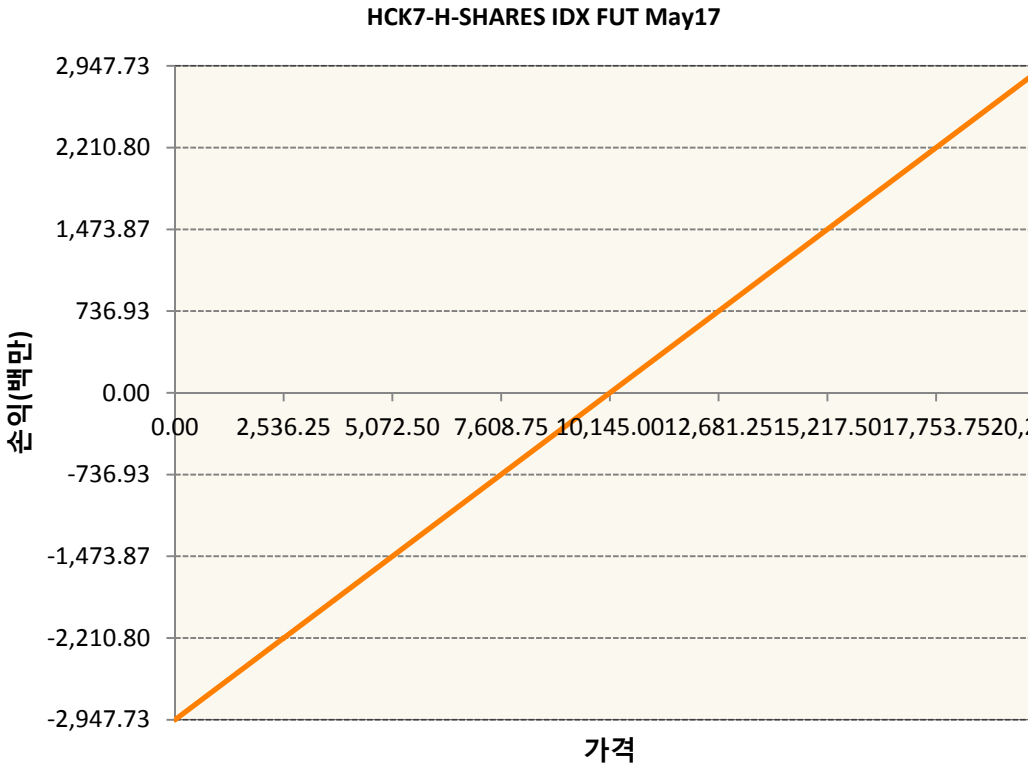
차이나인덱스모(주식-파생형)

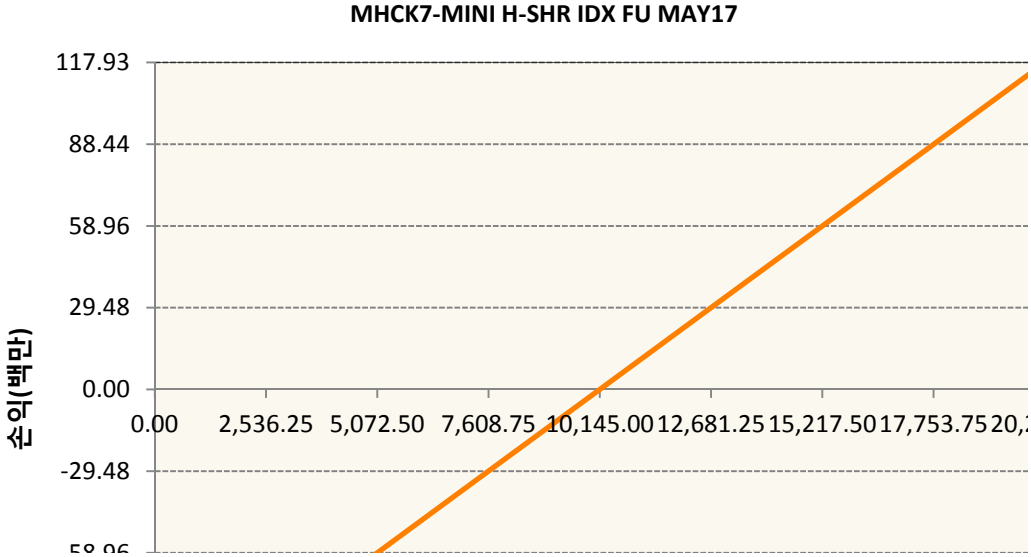
1. 계약금액

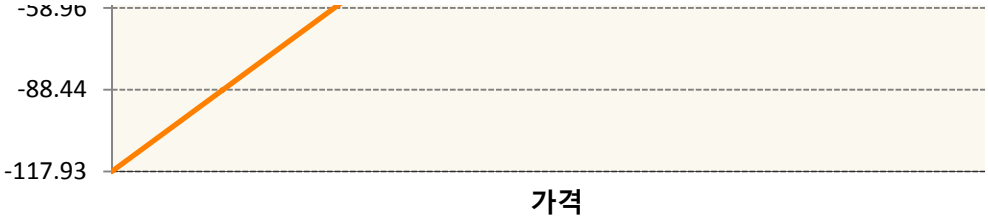
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,066	0	3,066	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCK7	H-SHARES IDX FUT May17	236
MHCK7	MINI H-SHR IDX FU MAY17	9

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

261

공시일	2017-04-25
기준일	2017-04-24

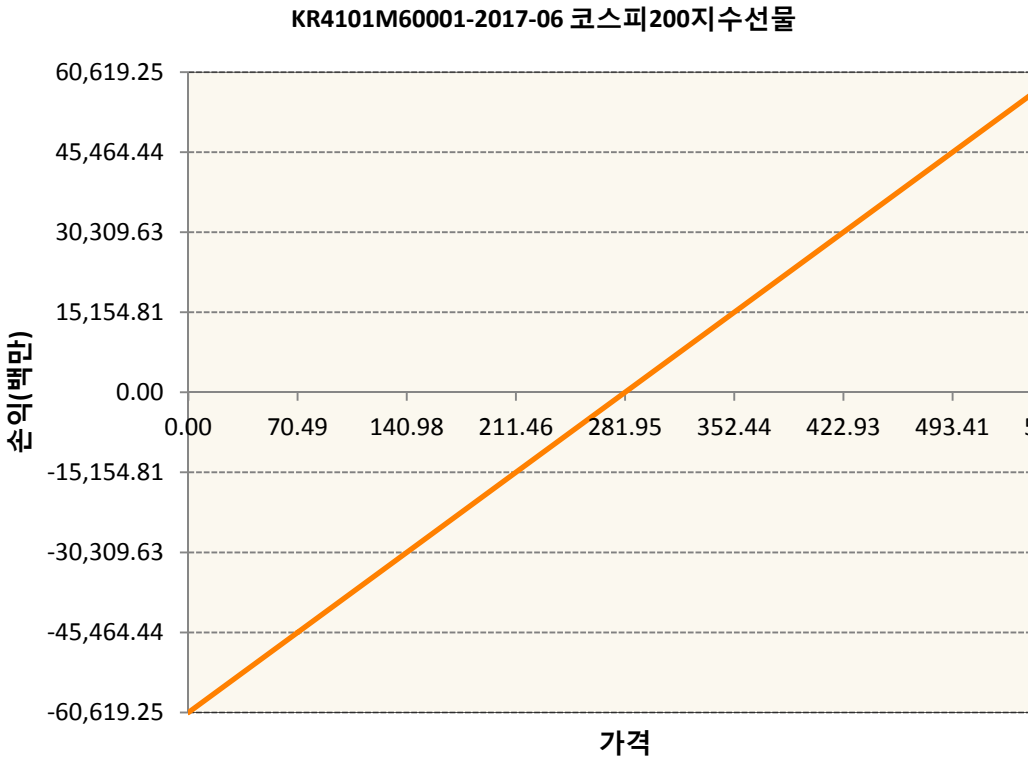
커버드콜모(주식혼합-파생형)

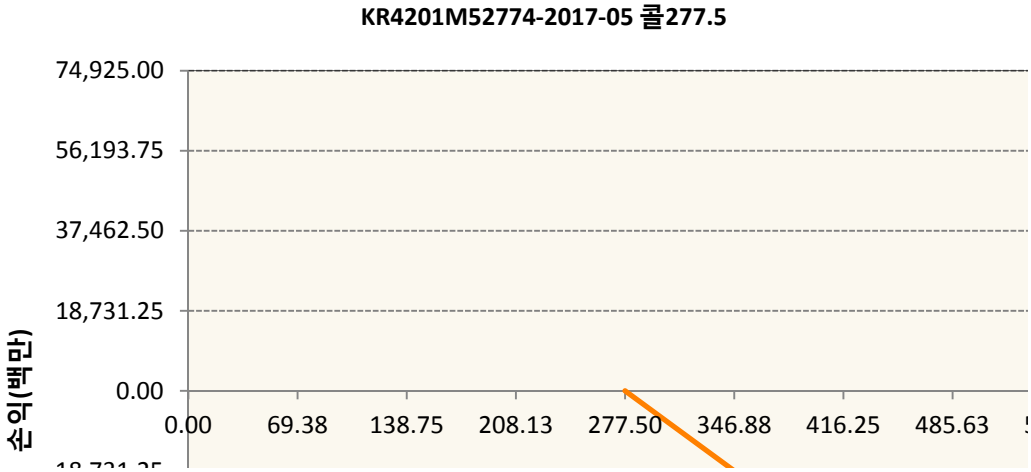
1. 계약금액

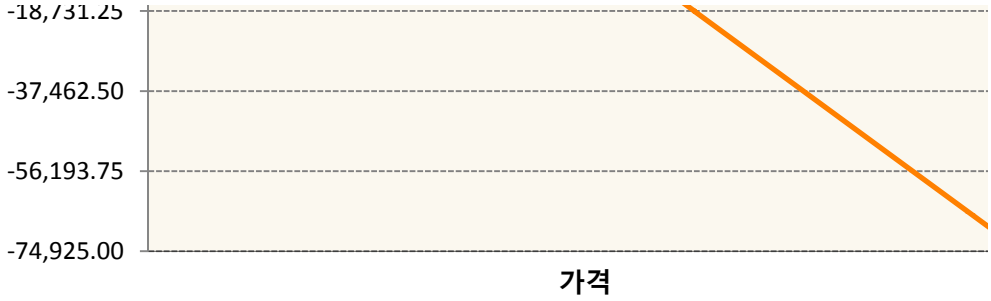
(단위:백만원)

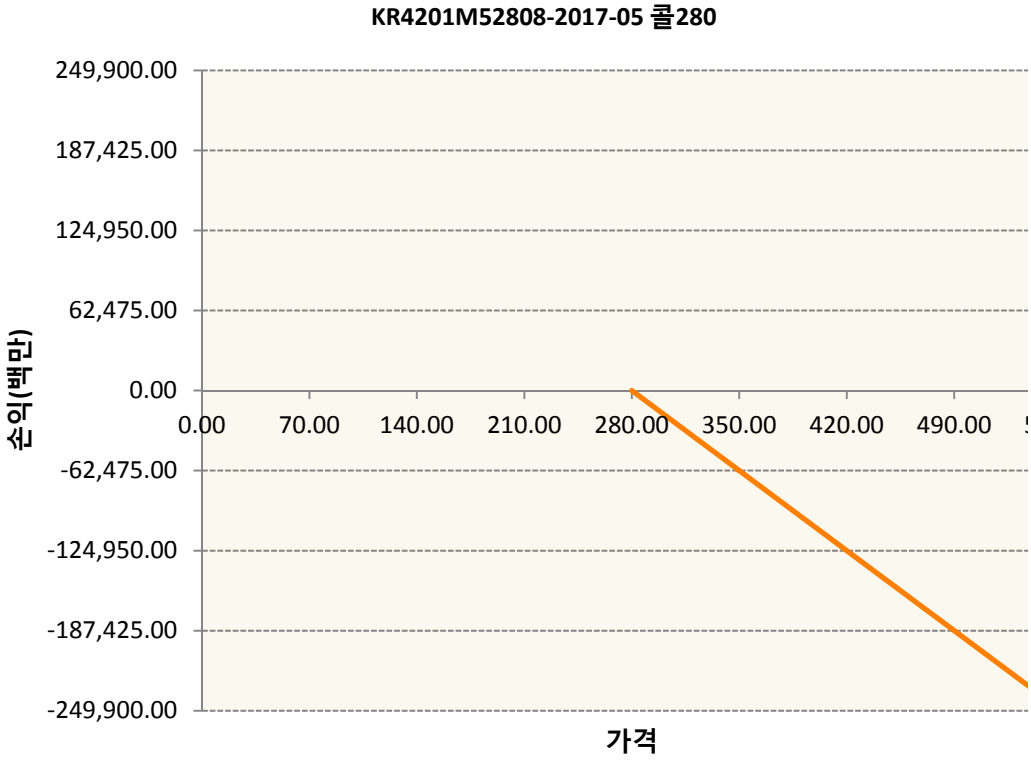
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3,520	0	3,520	장내
신규	유가증권	옵션	0	10,621	-10,621	장내
누계	유가증권	선물	60,619	0	60,619	장내
누계	유가증권	옵션	0	380,325	-380,325	장내

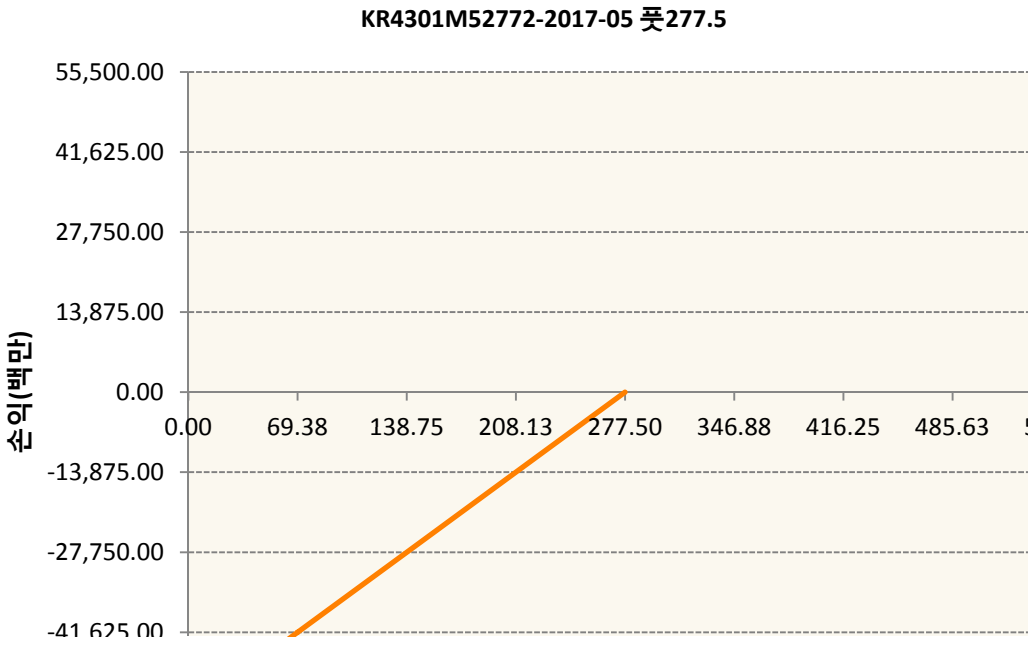
2. 만기시점의 손익구조

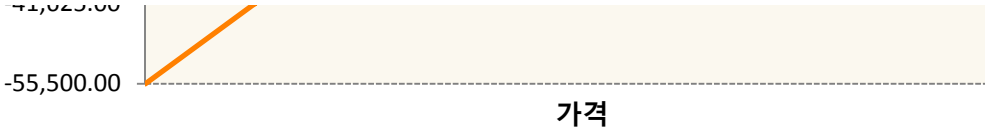





-18,731.25
-37,462.50
-56,193.75
-74,925.00
가격


KR4201M52808-2017-05 콜280
249,900.00
187,425.00
124,950.00
62,475.00
0.00
-62,475.00
-124,950.00
-187,425.00
-249,900.00
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							4,850
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,850	-4,850	-4,850	-4,850	-4,850	-4,850	-4,850
-5.33%	-3,233	-3,233	-3,233	-3,233	-3,233	-3,233	-3,233
-2.67%	-1,617	-1,617	-1,617	-1,617	-1,617	-1,617	-1,617
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,617	1,617	1,617	1,617	1,617	1,617	1,617
5.33%	3,233	3,233	3,233	3,233	3,233	3,233	3,233
8.00%	4,850	4,850	4,850	4,850	4,850	4,850	4,850
KR4201M52 2017-05 콜277.5							5,736
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,548	1,547	1,546	1,544	1,540	1,535	1,527
-5.33%	1,532	1,520	1,503	1,481	1,456	1,427	1,395
-2.67%	1,273	1,214	1,154	1,093	1,032	969	906
0%	162	110	56	0	-58	-117	-177
2.67%	-1,687	-1,697	-1,711	-1,729	-1,752	-1,778	-1,808
5.33%	-3,705	-3,706	-3,707	-3,709	-3,713	-3,719	-3,727
8.00%	-5,733	-5,733	-5,734	-5,734	-5,734	-5,735	-5,736
KR4201M52 2017-05 콜280							18,207
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,651	3,651	3,650	3,647	3,642	3,632	3,618
-5.33%	3,637	3,619	3,590	3,551	3,499	3,436	3,361
-2.67%	3,229	3,086	2,932	2,768	2,596	2,417	2,234
0%	647	433	217	0	-219	-438	-658
2.67%	-4,887	-4,955	-5,041	-5,141	-5,255	-5,381	-5,517
5.33%	-11,485	-11,491	-11,501	-11,519	-11,545	-11,581	-11,626
8.00%	-18,188	-18,188	-18,188	-18,190	-18,193	-18,198	-18,207
KR4301M52 2017-05 풋277.5							3,377
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,361	-3,362	-3,362	-3,364	-3,367	-3,371	-3,377
-5.33%	-1,870	-1,879	-1,892	-1,908	-1,927	-1,948	-1,972
-2.67%	-560	-603	-648	-693	-738	-785	-832

0%	120	82	42	0	-43	-87	-131
2.67%	253	246	235	222	205	186	163
5.33%	261	260	259	258	255	251	245
8.00%	261	261	261	261	260	260	259

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

35,908

공시일	2017-04-25
기준일	2017-04-24

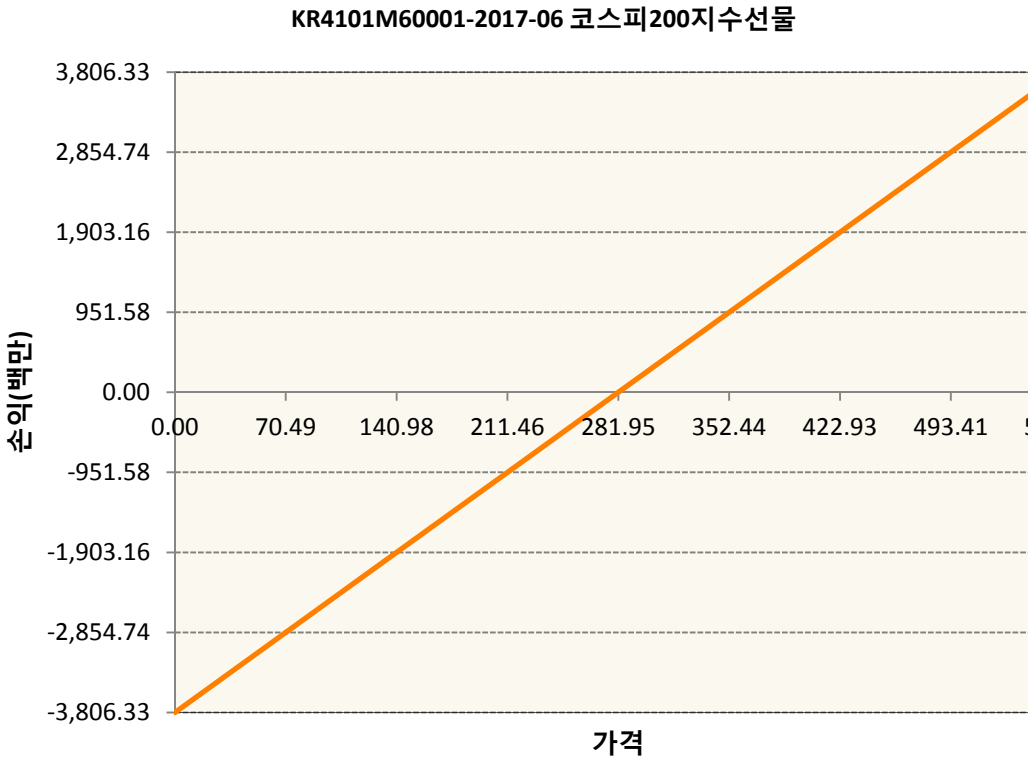
커버드콜목표전환형증권투자신탁

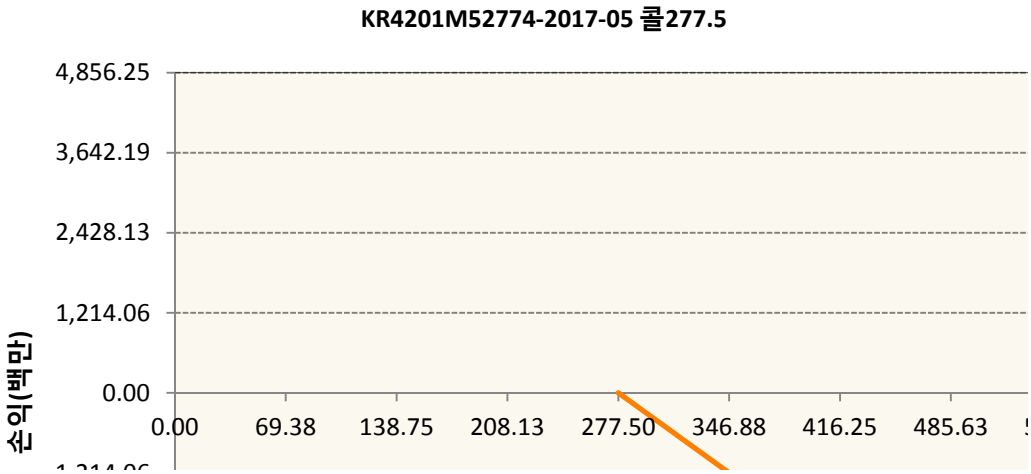
1. 계약금액

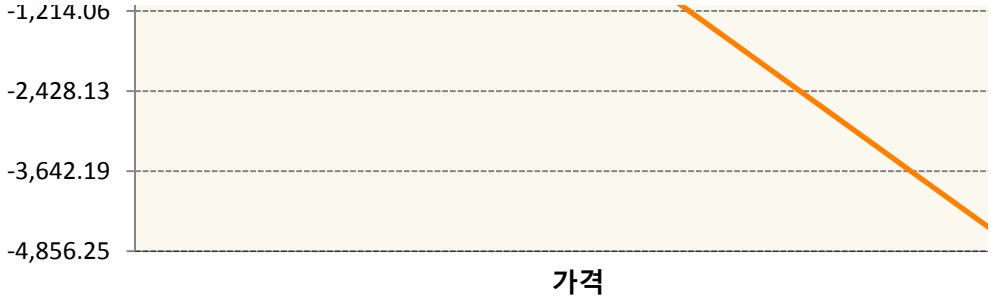
(단위:백만원)

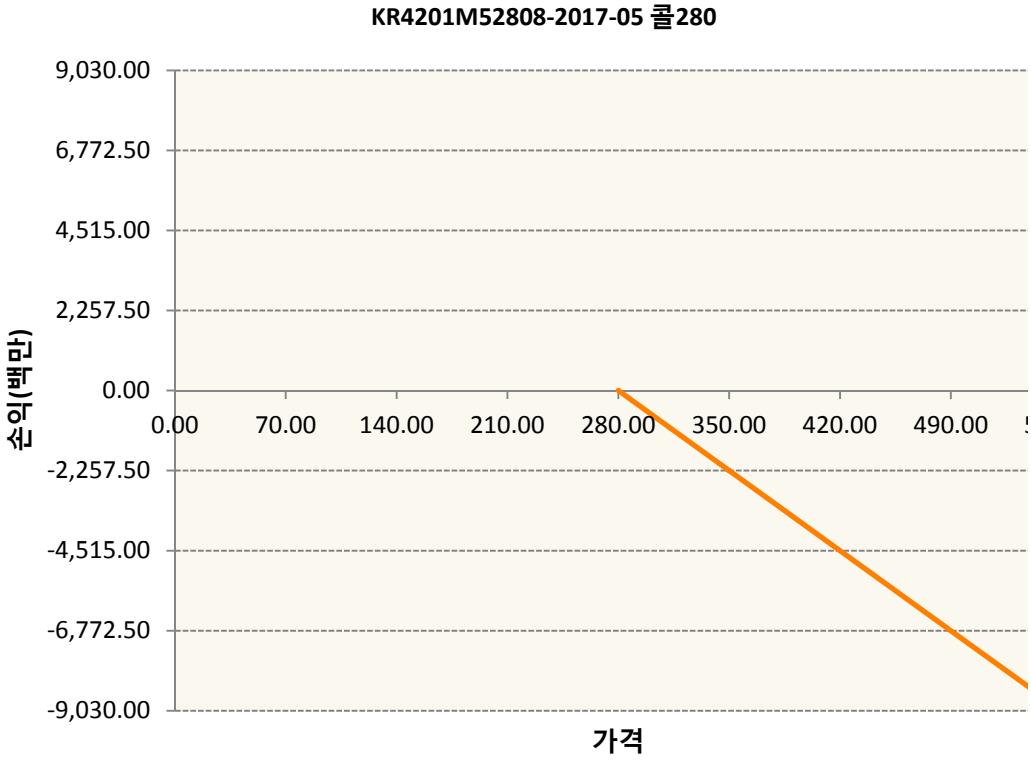
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	704	-704	장내
신규	유가증권	옵션	1,032	0	1,032	장내
누계	유가증권	선물	3,806	0	3,806	장내
누계	유가증권	옵션	0	13,886	-13,886	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							305
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-305	-305	-305	-305	-305	-305	-305
-5.33%	-203	-203	-203	-203	-203	-203	-203
-2.67%	-102	-102	-102	-102	-102	-102	-102
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	102	102	102	102	102	102	102
5.33%	203	203	203	203	203	203	203
8.00%	305	305	305	305	305	305	305
KR4201M52 2017-05 콜277.5							372
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	100	100	100	100	100	99	99
-5.33%	99	99	97	96	94	92	90
-2.67%	82	79	75	71	67	63	59
0%	10	7	4	0	-4	-8	-11
2.67%	-109	-110	-111	-112	-114	-115	-117
5.33%	-240	-240	-240	-240	-241	-241	-242
8.00%	-372	-372	-372	-372	-372	-372	-372
	KR4201M52(	2017-05 콜280					658

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	132	132	132	132	132	131	131
-5.33%	131	131	130	128	126	124	121
-2.67%	117	112	106	100	94	87	81
0%	23	16	8	0	-8	-16	-24
2.67%	-177	-179	-182	-186	-190	-194	-199
5.33%	-415	-415	-416	-416	-417	-418	-420
8.00%	-657	-657	-657	-657	-657	-658	-658

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

1,455

공시일	2017-04-25
기준일	2017-04-24

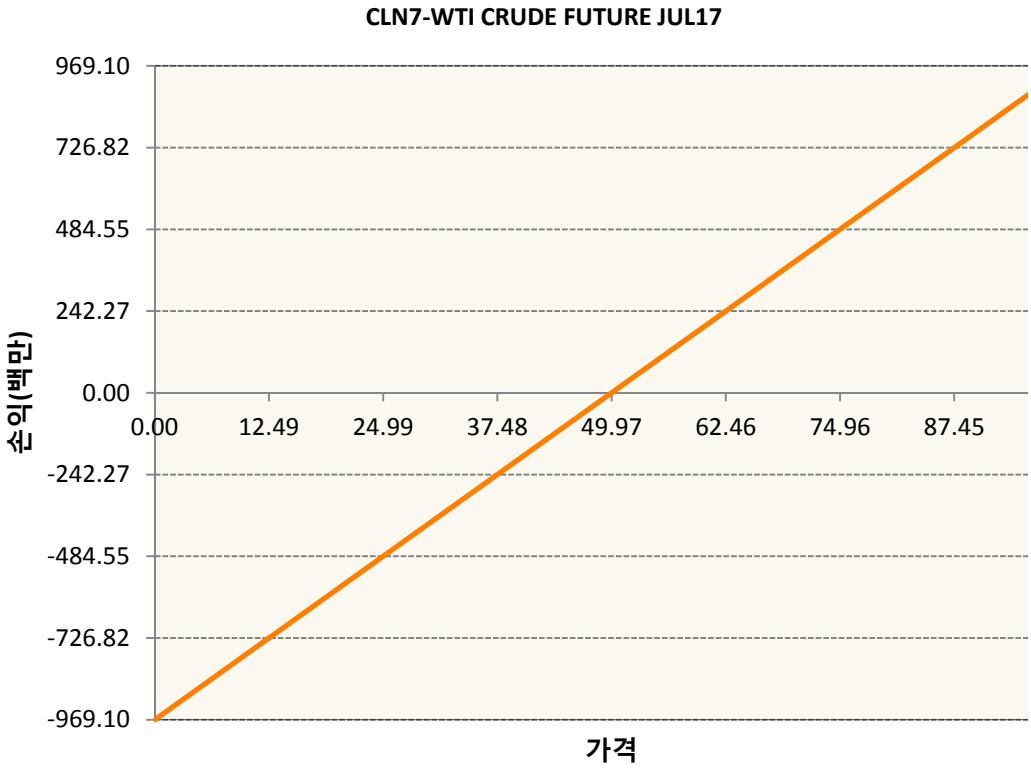
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

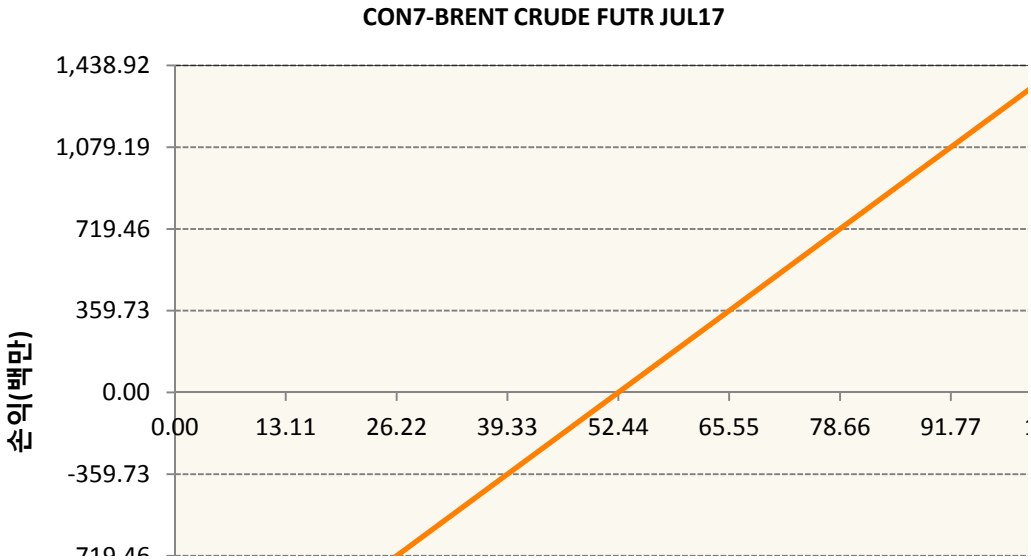
1. 계약금액

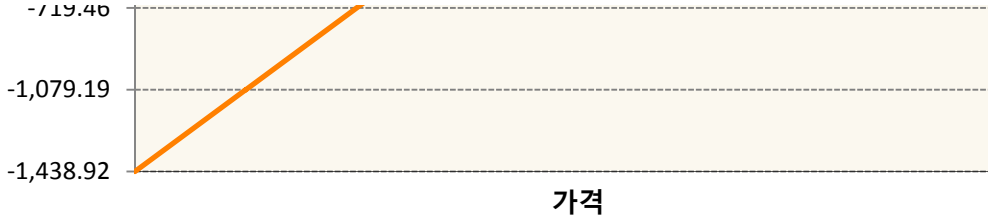
(단위:백만원)

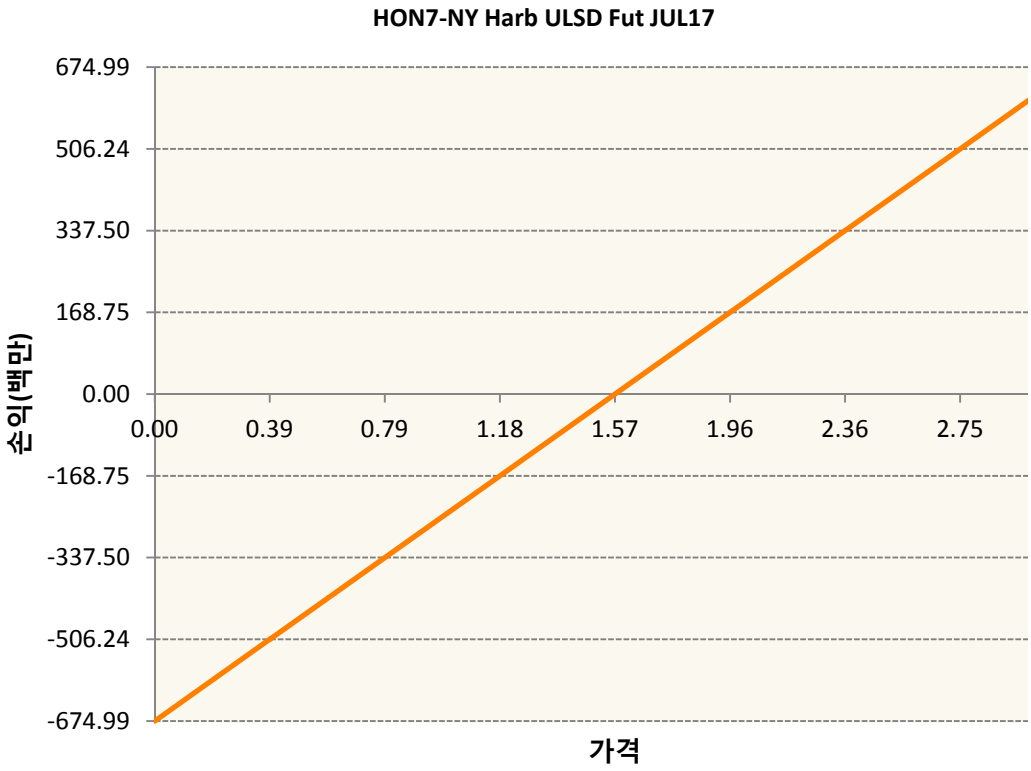
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,320	407	4,913	

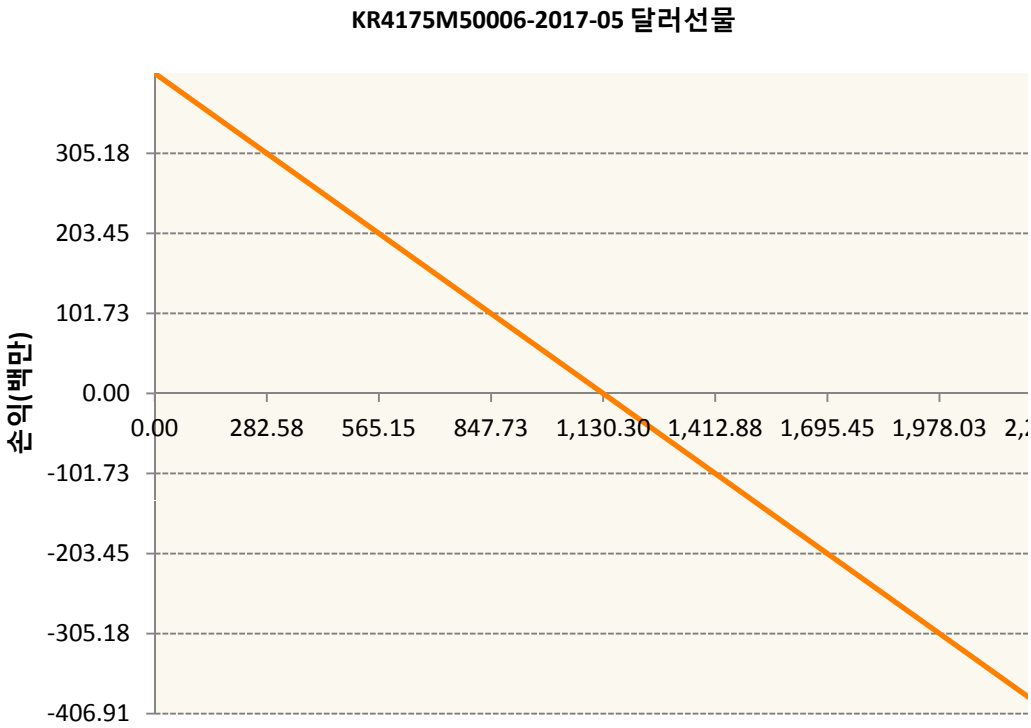
2. 만기시점의 손익구조



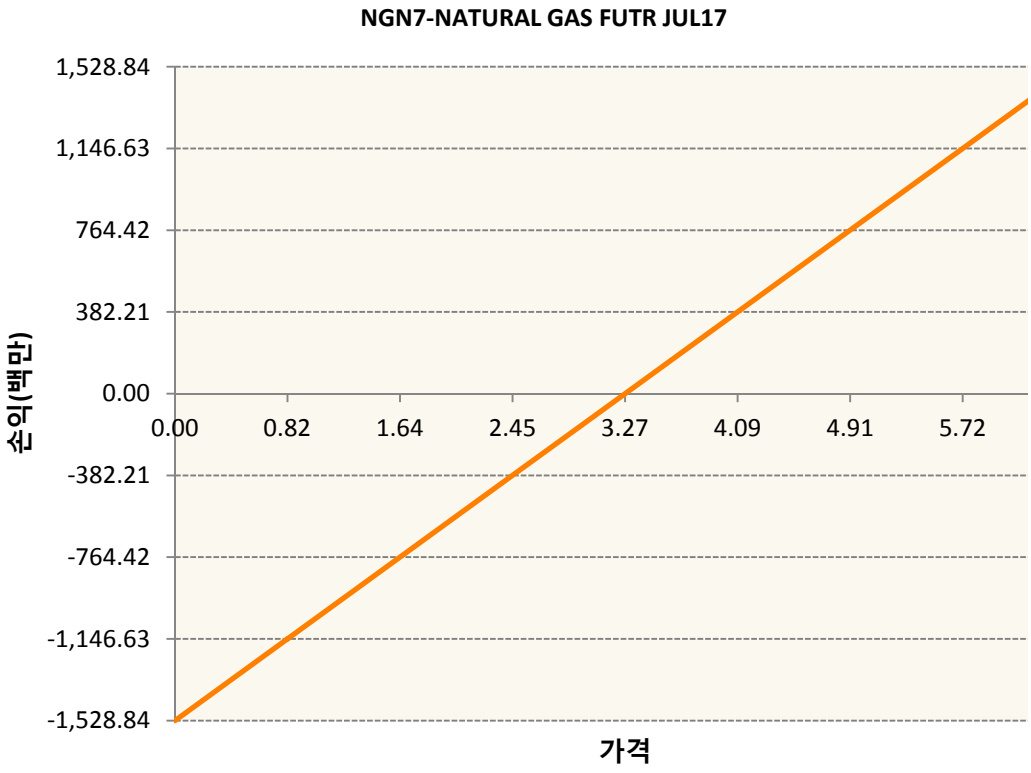


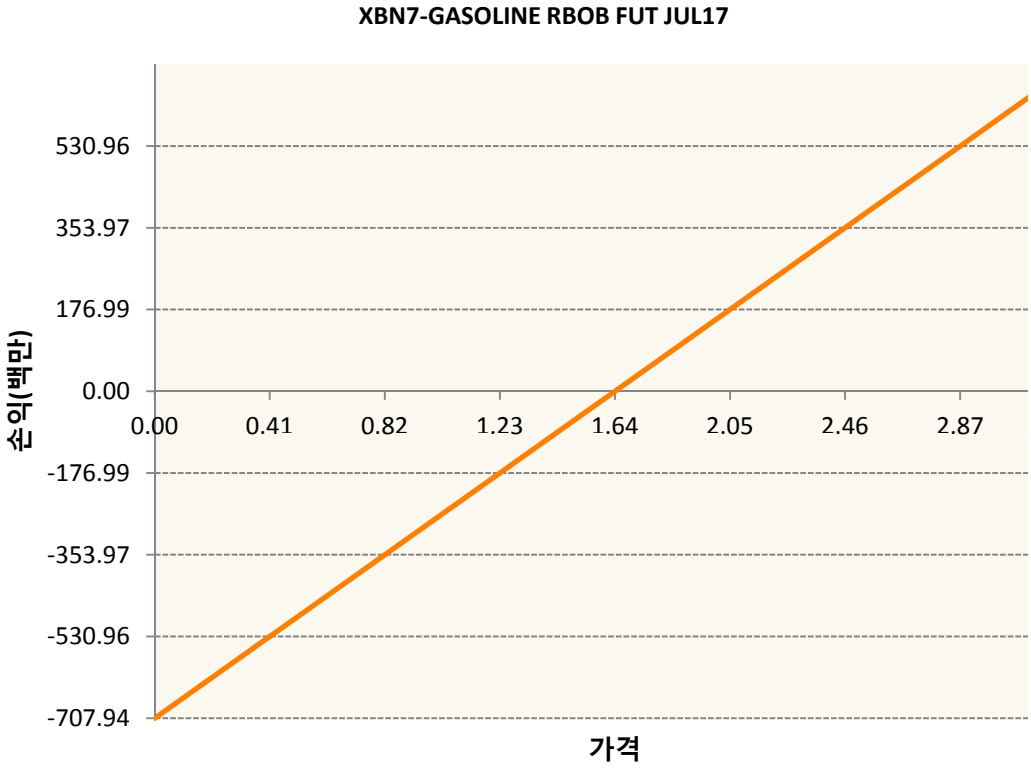

-719.46
-1,079.19
-1,438.92
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
674.99
506.24
337.50
168.75
0.00
-168.75
-337.50
-506.24
-674.99
0.00
0.39
0.79
1.18
1.57
1.96
2.36
2.75
손익(백만)
가격


KR4175M50006-2017-05 달러선물
305.18
203.45
101.73
0.00
-101.73
-203.45
-305.18
-406.91
0.00
282.58
565.15
847.73
1,130.30
1,412.88
1,695.45
1,978.03
손익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,528.84
1,146.63
764.42
382.21
0.00
-382.21
-764.42
-1,146.63
-1,528.84
0.00
0.82
1.64
2.45
3.27
4.09
4.91
5.72
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
530.96
353.97
176.99
0.00
-176.99
-353.97
-530.96
-707.94
0.00
0.41
0.82
1.23
1.64
2.05
2.46
2.87
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN7	WTI CRUDE FUTURE JUL17	78
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	115
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	54
KR4175M50(	2017-05 달러선물	33
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	122
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	57

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

927