공시일	2017-04-26
기준일	2017-04-25

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	2017-04-26
기준일	2017-04-25

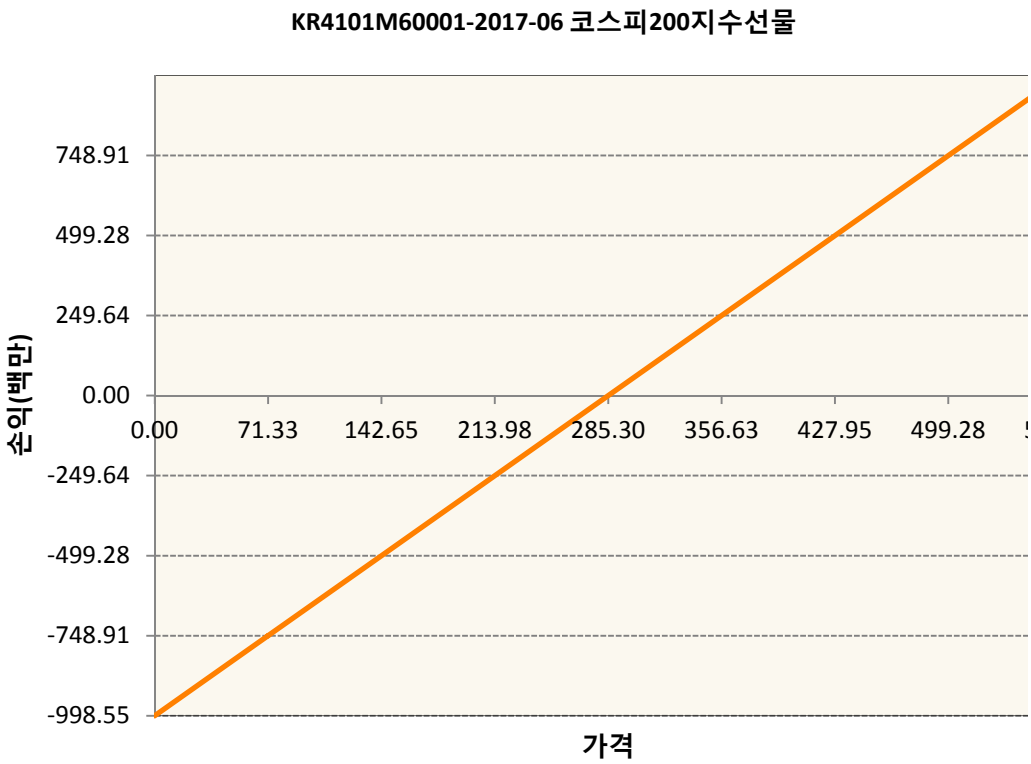
스마트인덱스모

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	999	0	999	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							80
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
-5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	27	27	27	27	27	27	27
5.33%	53	53	53	53	53	53	53
8.00%	80	80	80	80	80	80	80

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

51

공시일	2017-04-26
기준일	2017-04-25

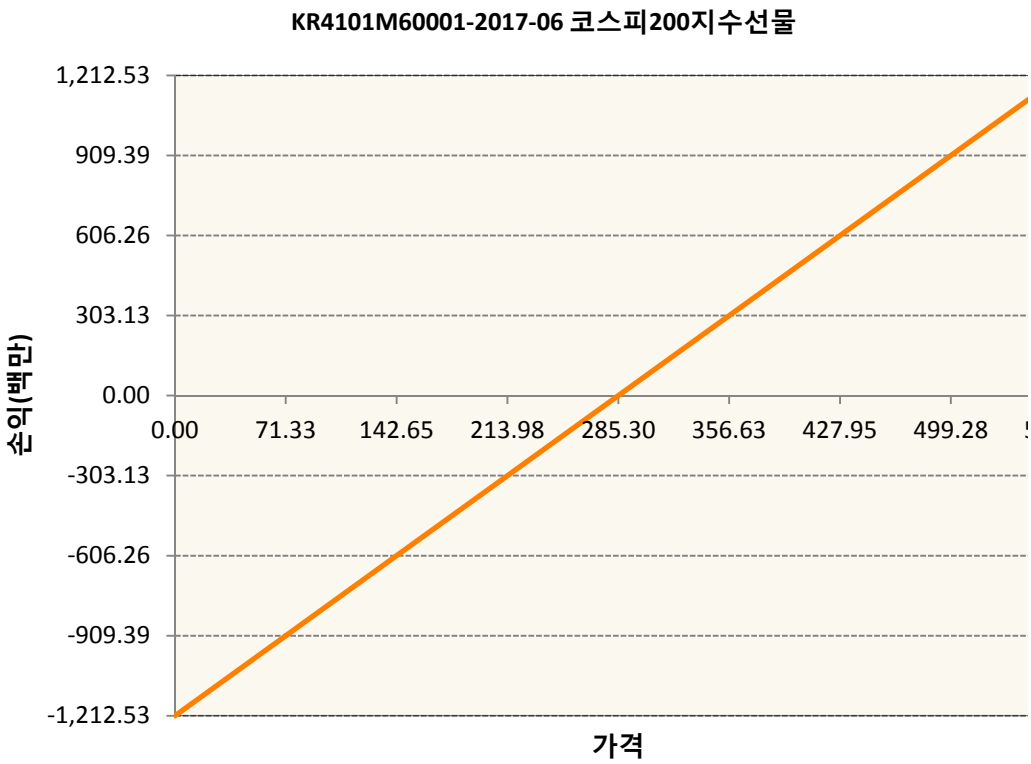
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	71	-71	장내
누계	유가증권	선물	1,213	0	1,213	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							97
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97
-5.33%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
-2.67%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	32	32	32	32	32	32	32
5.33%	65	65	65	65	65	65	65
8.00%	97	97	97	97	97	97	97

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

62

공시일	2017-04-26
기준일	2017-04-25

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	970

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

555

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-04-26
기준일	2017-04-25

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	374

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

382

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-04-26
기준일	2017-04-25

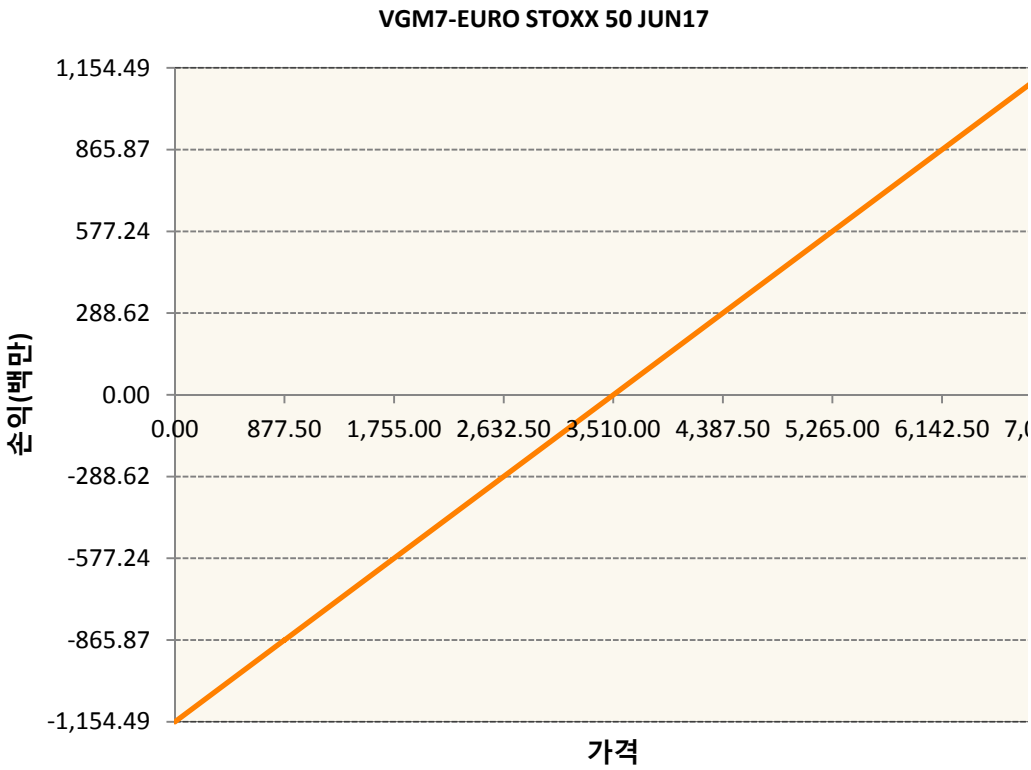
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,154	0	1,154	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM7	EURO STOXX 50 JUN17	92

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

(단위:백만원)

94

공시일	2017-04-26
기준일	2017-04-25

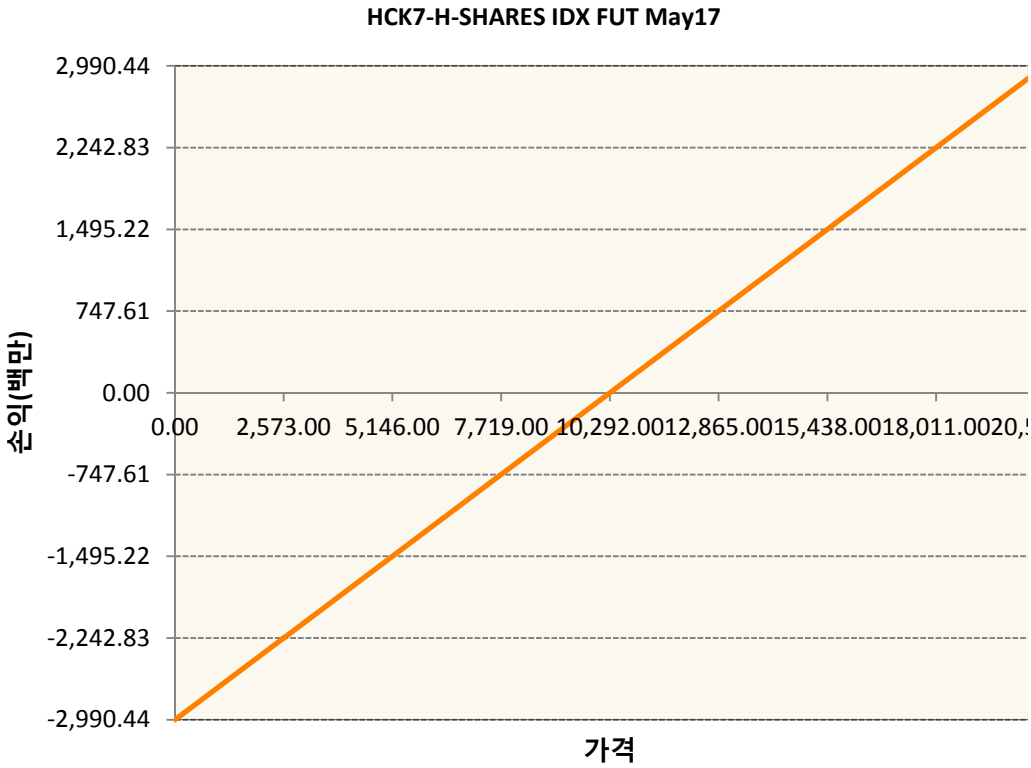
차이나인덱스모(주식-파생형)

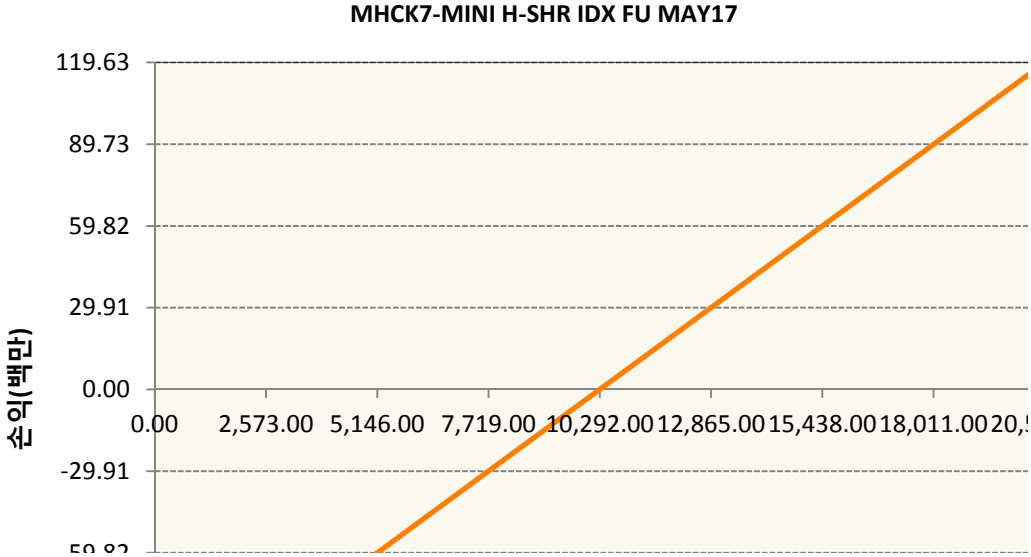
1. 계약금액

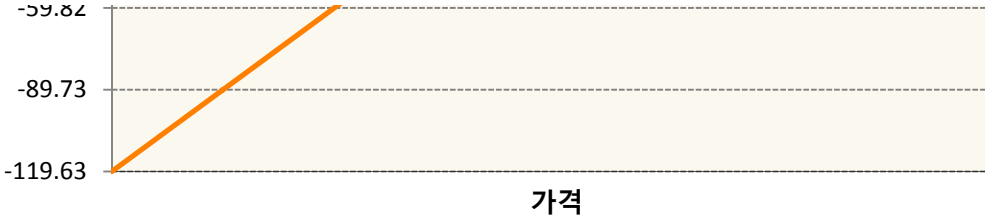
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,110	0	3,110	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCK7	H-SHARES IDX FUT May17	239
MHCK7	MINI H-SHR IDX FU MAY17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	265

공시일	2017-04-26
기준일	2017-04-25

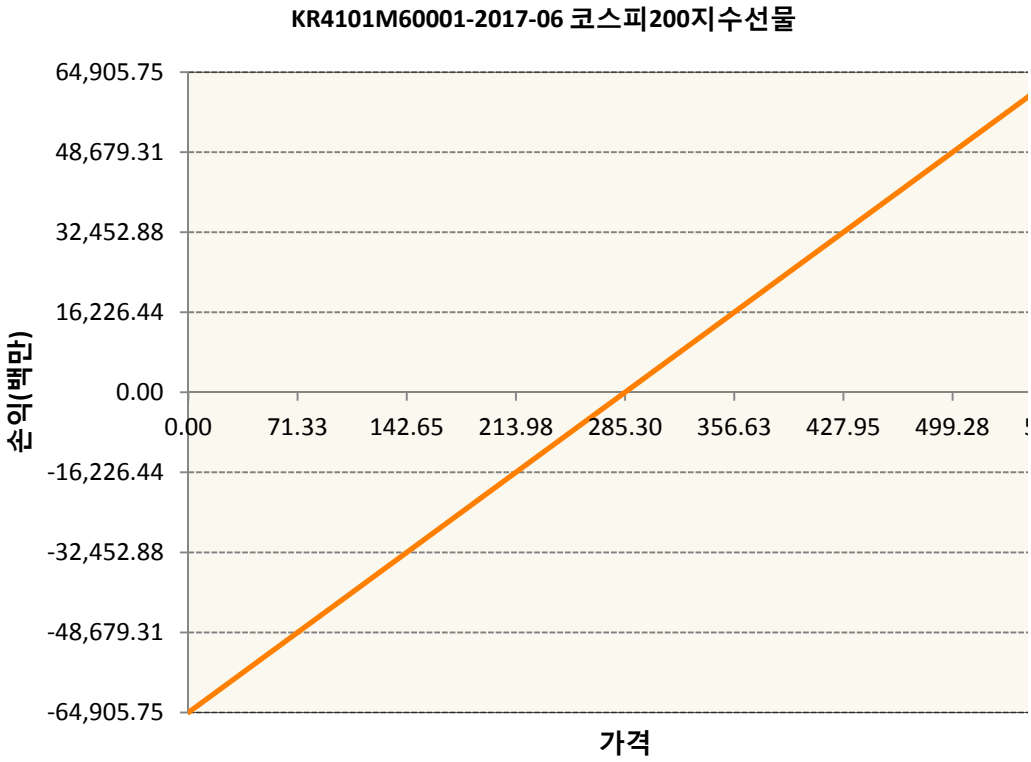
커버드콜모(주식혼합-파생형)

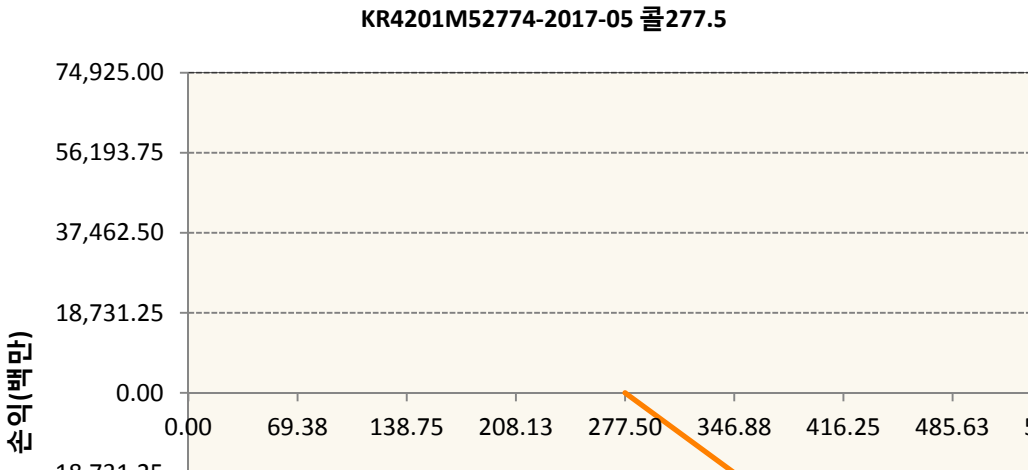
1. 계약금액

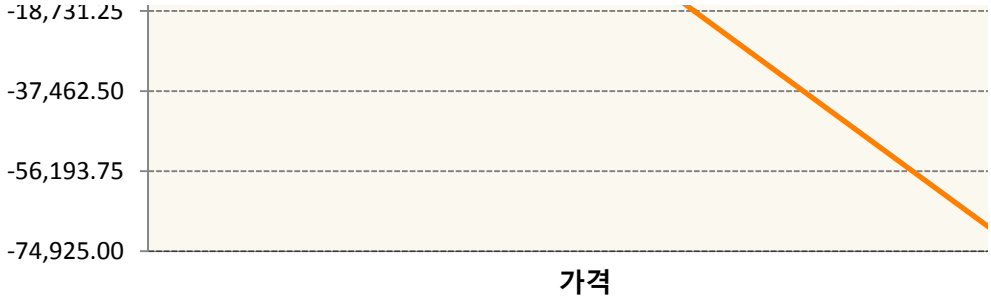
(단위:백만원)

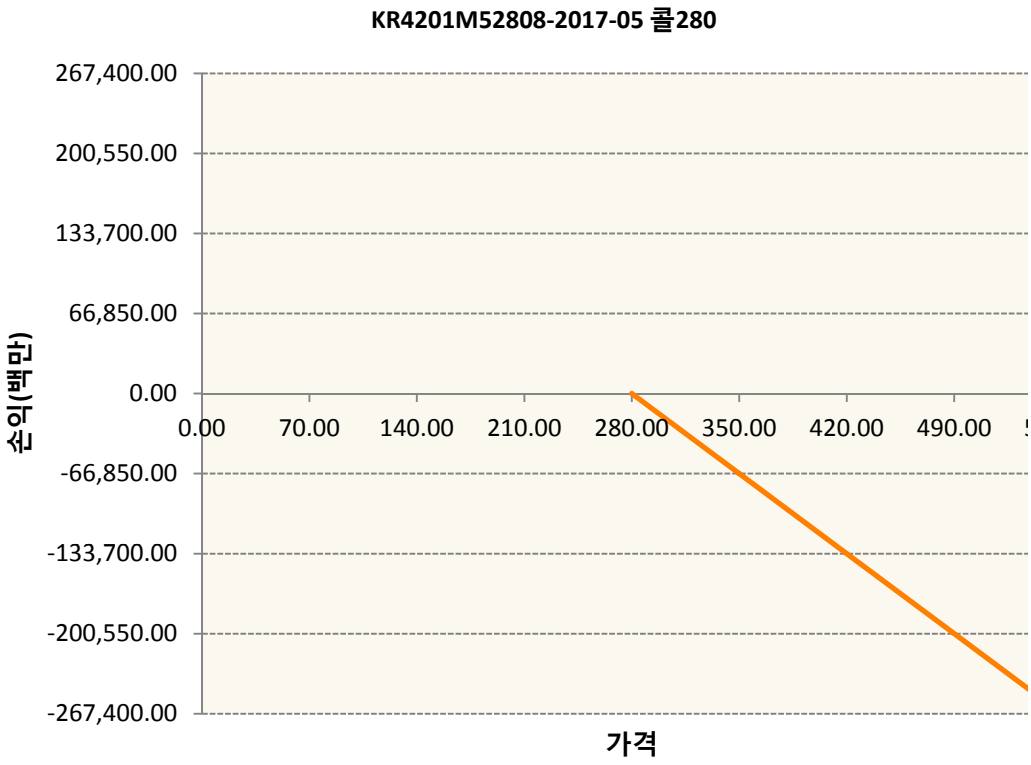
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3,548	0	3,548	장내
신규	유가증권	옵션	0	24,817	-24,817	장내
누계	유가증권	선물	64,906	0	64,906	장내
누계	유가증권	옵션	0	404,825	-404,825	장내

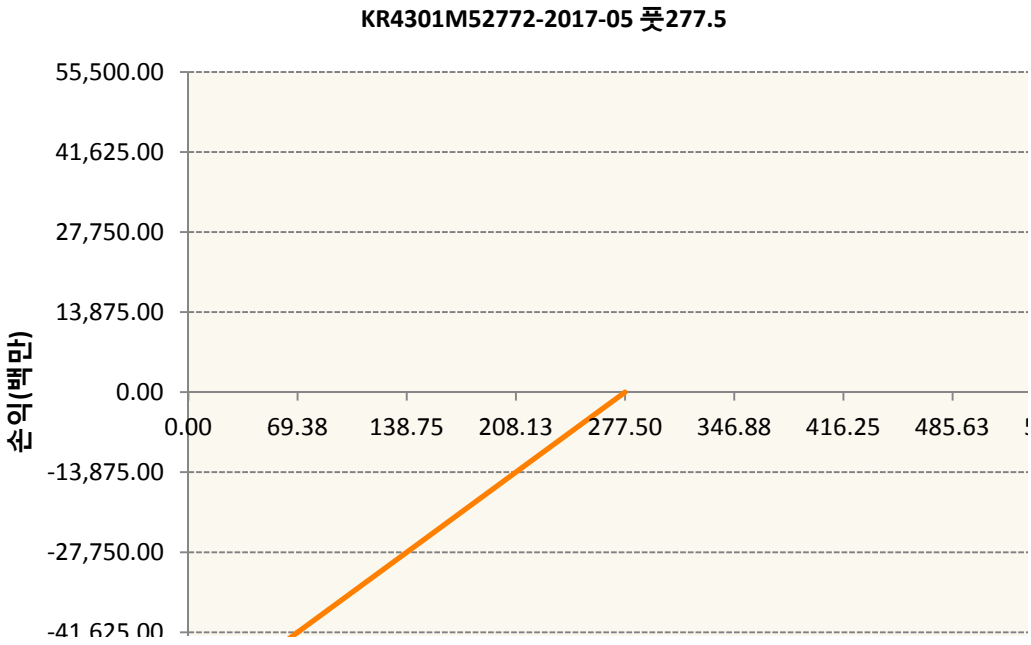
2. 만기시점의 손익구조



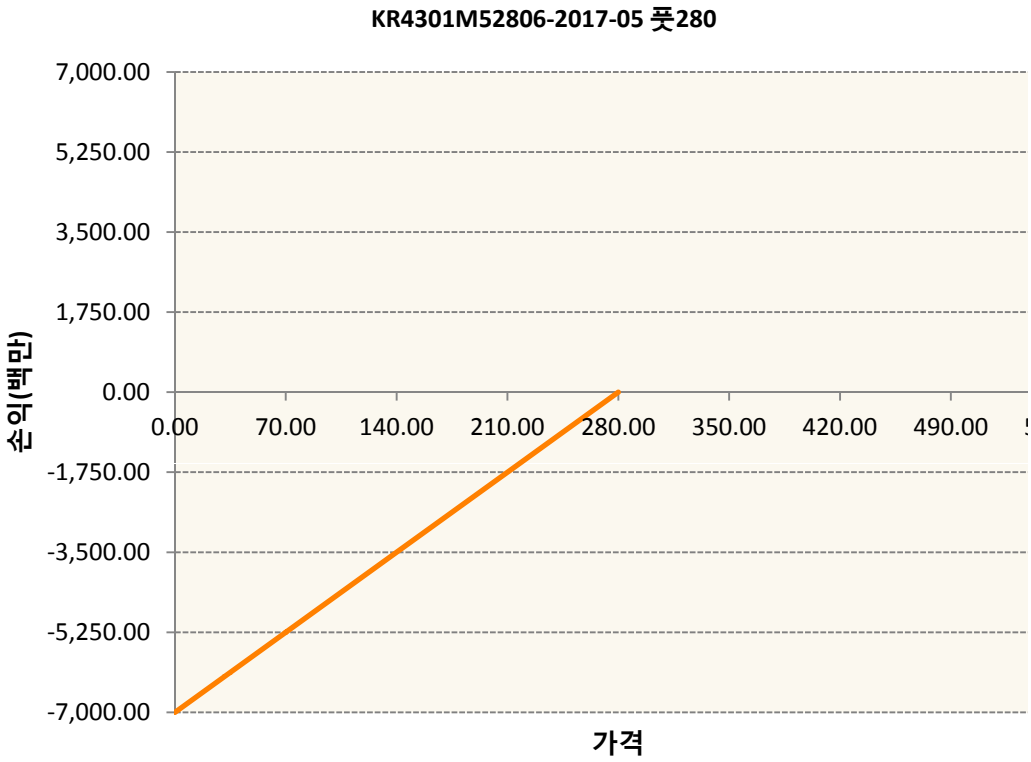



-18,731.25
-37,462.50
-56,193.75
-74,925.00
가격


KR4201M52808-2017-05 콜280
267,400.00
200,550.00
133,700.00
66,850.00
0.00
-66,850.00
-133,700.00
-200,550.00
-267,400.00
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							5,194
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,194	-5,194	-5,194	-5,194	-5,194	-5,194	-5,194
-5.33%	-3,463	-3,463	-3,463	-3,463	-3,463	-3,463	-3,463
-2.67%	-1,731	-1,731	-1,731	-1,731	-1,731	-1,731	-1,731
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,731	1,731	1,731	1,731	1,731	1,731	1,731
5.33%	3,463	3,463	3,463	3,463	3,463	3,463	3,463
8.00%	5,194	5,194	5,194	5,194	5,194	5,194	5,194
KR4201M52 2017-05 콜277.5							6,063
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,224	2,224	2,222	2,220	2,216	2,210	2,202
-5.33%	2,190	2,171	2,147	2,119	2,089	2,055	2,019
-2.67%	1,667	1,609	1,552	1,494	1,436	1,379	1,321

0%	67	49	26	0	-30	-63	-98
2.67%	-1,957	-1,957	-1,959	-1,962	-1,967	-1,974	-1,983
5.33%	-4,010	-4,010	-4,010	-4,010	-4,010	-4,011	-4,012
8.00%	-6,063	-6,063	-6,063	-6,063	-6,063	-6,063	-6,063
	KR4201M52	2017-05 콜280					21,067
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,863	5,863	5,861	5,858	5,853	5,843	5,829
-5.33%	5,830	5,800	5,757	5,701	5,634	5,555	5,465
-2.67%	4,888	4,701	4,511	4,319	4,124	3,929	3,732
0%	399	278	144	0	-152	-312	-477
2.67%	-6,546	-6,556	-6,574	-6,600	-6,636	-6,682	-6,739
5.33%	-13,802	-13,803	-13,803	-13,804	-13,807	-13,813	-13,821
8.00%	-21,066	-21,066	-21,066	-21,066	-21,066	-21,066	-21,067
	KR4301M52	2017-05 풋277.5					2,932
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,915	-2,916	-2,917	-2,919	-2,922	-2,926	-2,932
-5.33%	-1,420	-1,434	-1,452	-1,472	-1,495	-1,520	-1,547
-2.67%	-286	-329	-372	-414	-457	-500	-543
0%	50	36	20	0	-22	-46	-73
2.67%	72	71	70	68	64	59	52
5.33%	72	72	72	72	72	71	70
8.00%	72	72	72	72	72	72	72
	KR4301M52	2017-05 풋280					418
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-417	-417	-417	-417	-417	-417	-418
-5.33%	-228	-228	-230	-231	-233	-235	-237
-2.67%	-62	-67	-72	-77	-82	-87	-92
0%	10	7	4	0	-4	-8	-12
2.67%	19	19	18	17	16	15	14
5.33%	19	19	19	19	19	19	18
8.00%	19	19	19	19	19	19	19

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

39,660

공시일	2017-04-26
기준일	2017-04-25

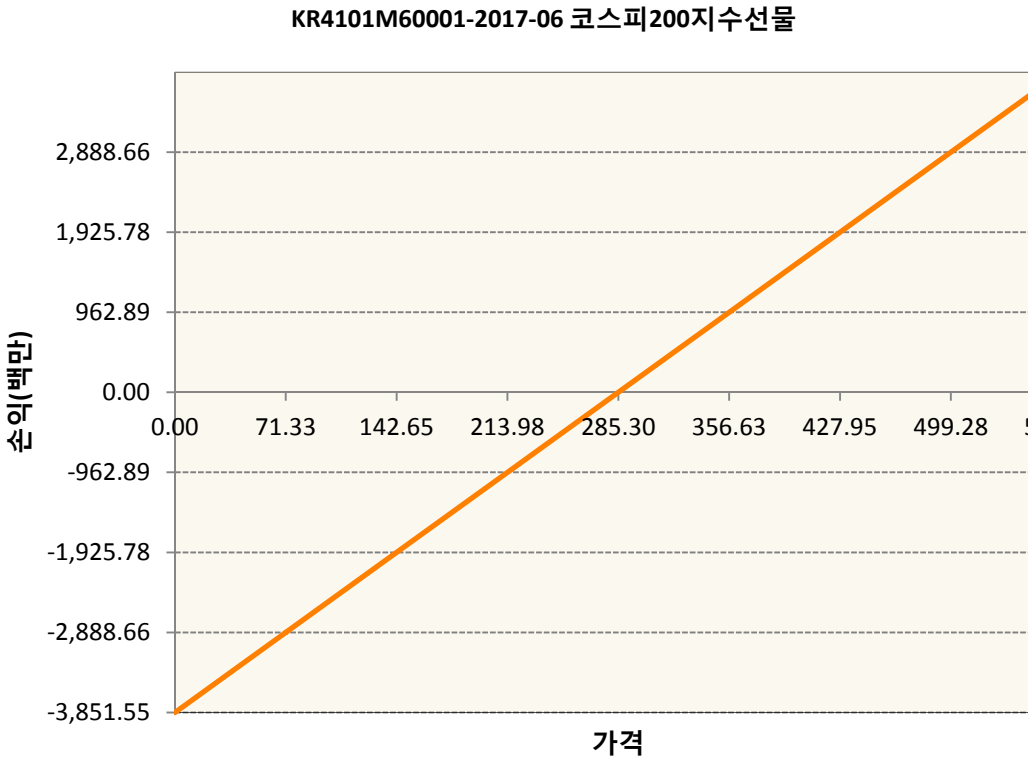
커버드콜목표전환형증권투자신탁

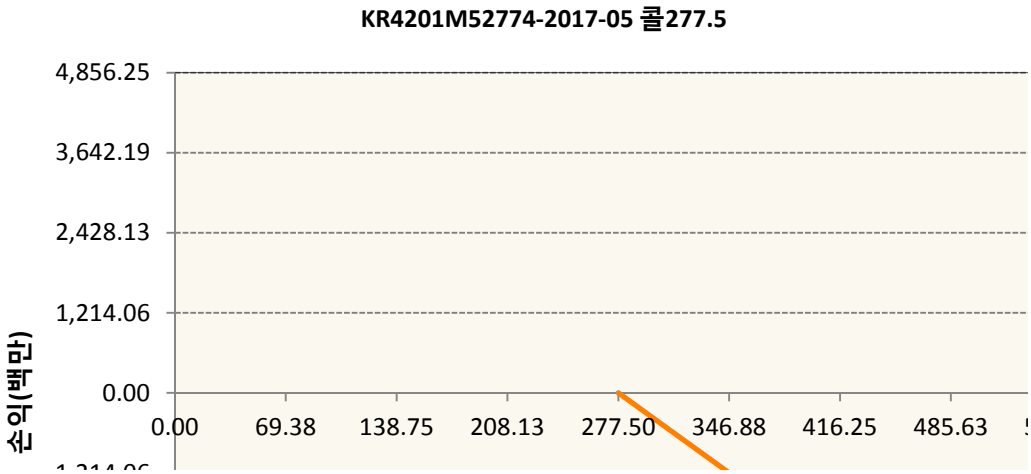
1. 계약금액

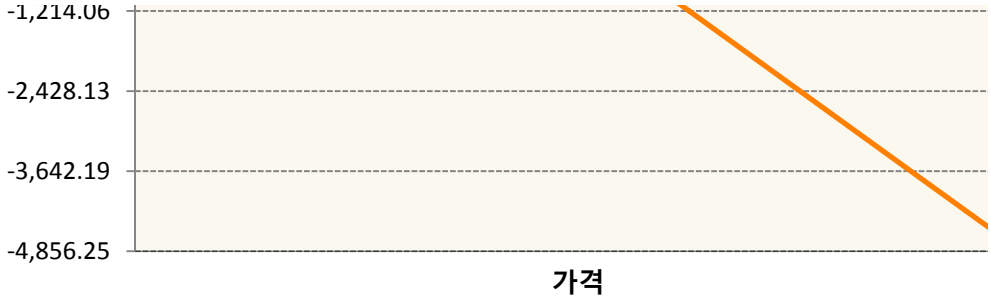
(단위:백만원)

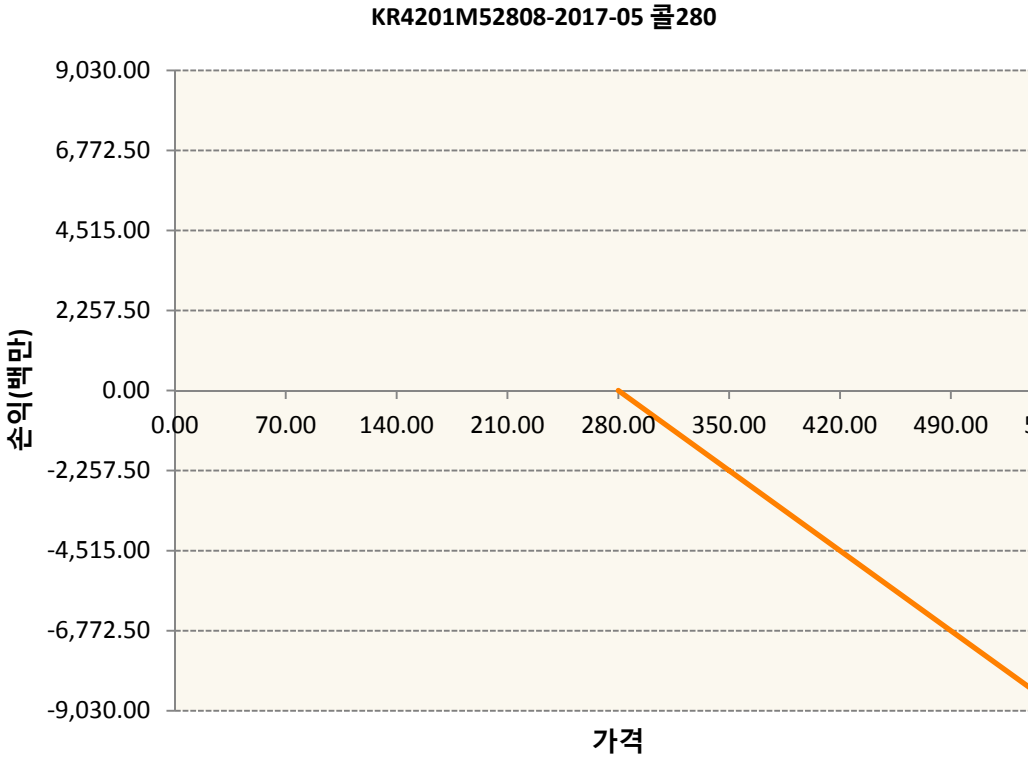
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,852	0	3,852	장내
누계	유가증권	옵션	0	13,886	-13,886	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							308
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-308	-308	-308	-308	-308	-308	-308
-5.33%	-205	-205	-205	-205	-205	-205	-205
-2.67%	-103	-103	-103	-103	-103	-103	-103
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	103	103	103	103	103	103	103
5.33%	205	205	205	205	205	205	205
8.00%	308	308	308	308	308	308	308
KR4201M52 2017-05 콜277.5							393
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	144	144	144	144	144	143	143
-5.33%	142	141	139	137	135	133	131
-2.67%	108	104	101	97	93	89	86
0%	4	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	-127	-127	-127	-127	-127	-128	-129
5.33%	-260	-260	-260	-260	-260	-260	-260
8.00%	-393	-393	-393	-393	-393	-393	-393
	KR4201M52(	2017-05 콜280					711

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	198	198	198	198	198	197	197
-5.33%	197	196	194	193	190	188	185
-2.67%	165	159	152	146	139	133	126
0%	13	9	5	0	-5	-11	-16
2.67%	-221	-221	-222	-223	-224	-226	-228
5.33%	-466	-466	-466	-466	-466	-466	-467
8.00%	-711	-711	-711	-711	-711	-711	-711

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

1,556

공시일	2017-04-26
기준일	2017-04-25

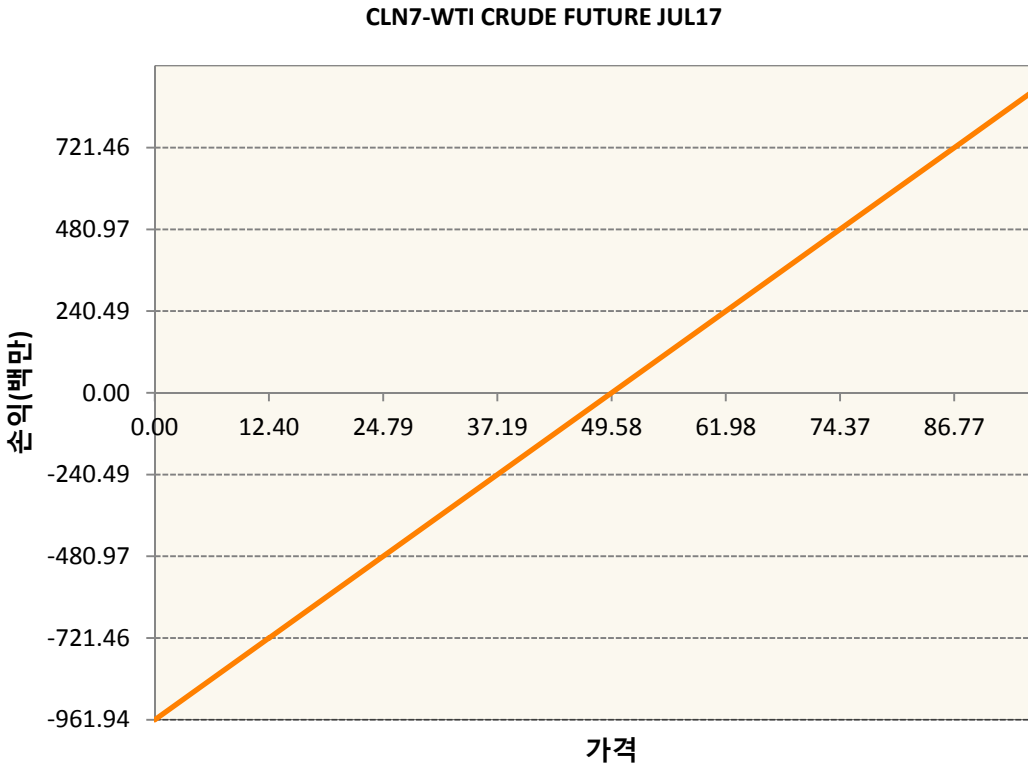
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

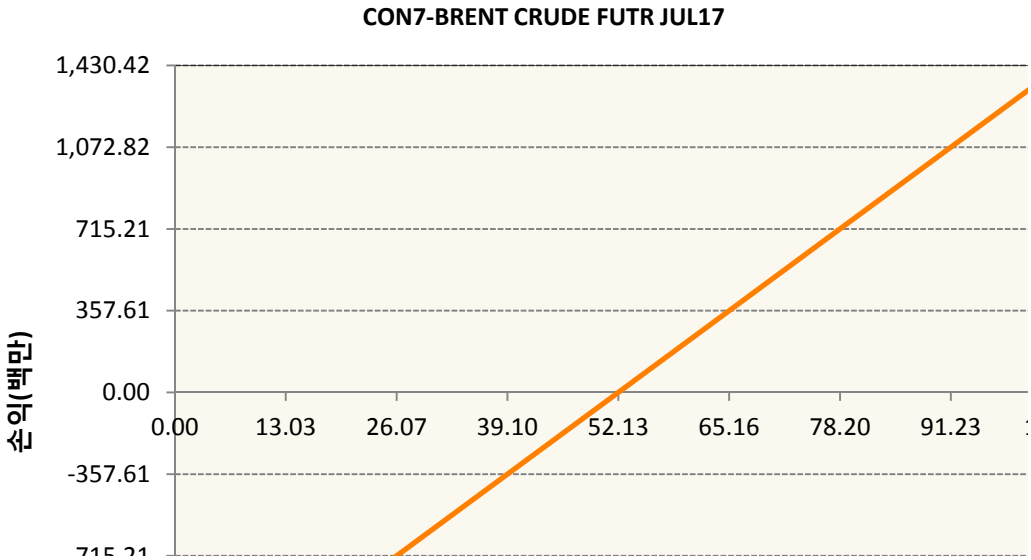
1. 계약금액

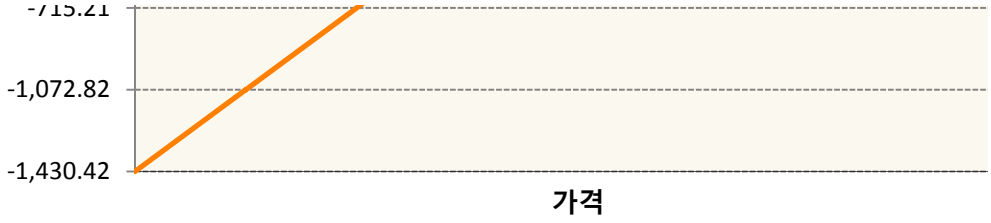
(단위:백만원)

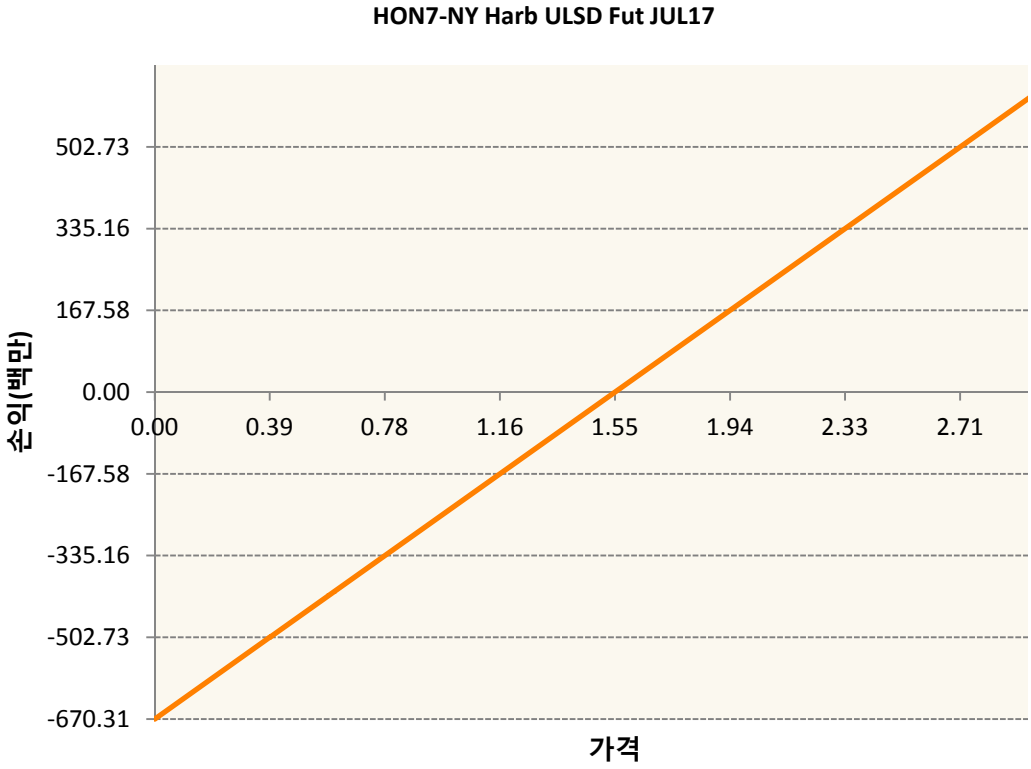
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,280	405	4,875	

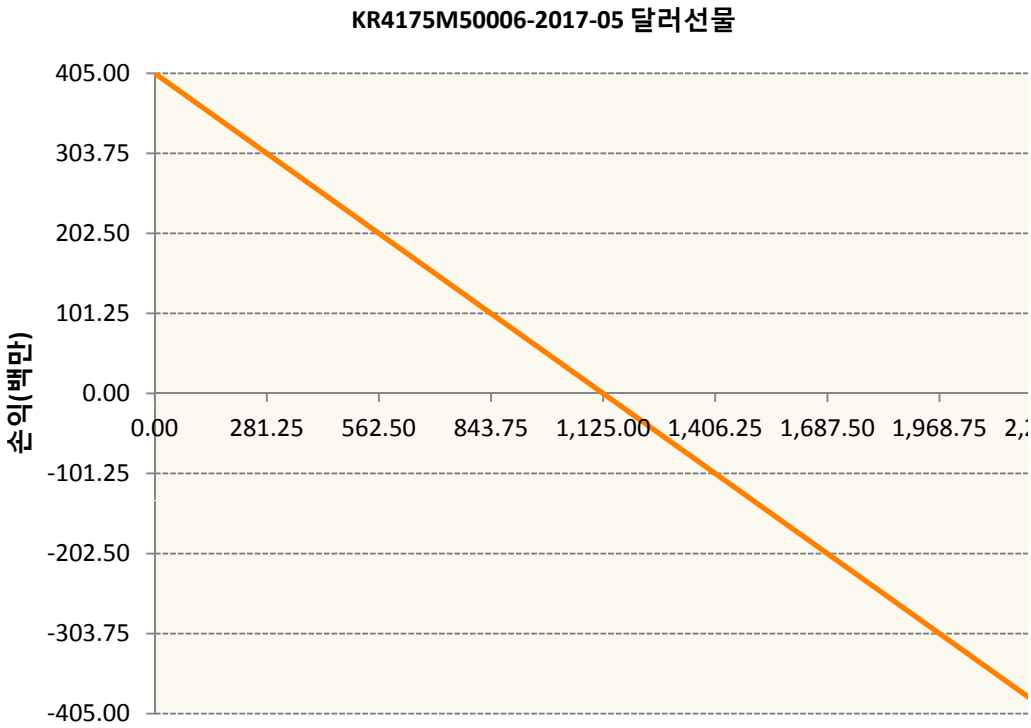
2. 만기시점의 손익구조



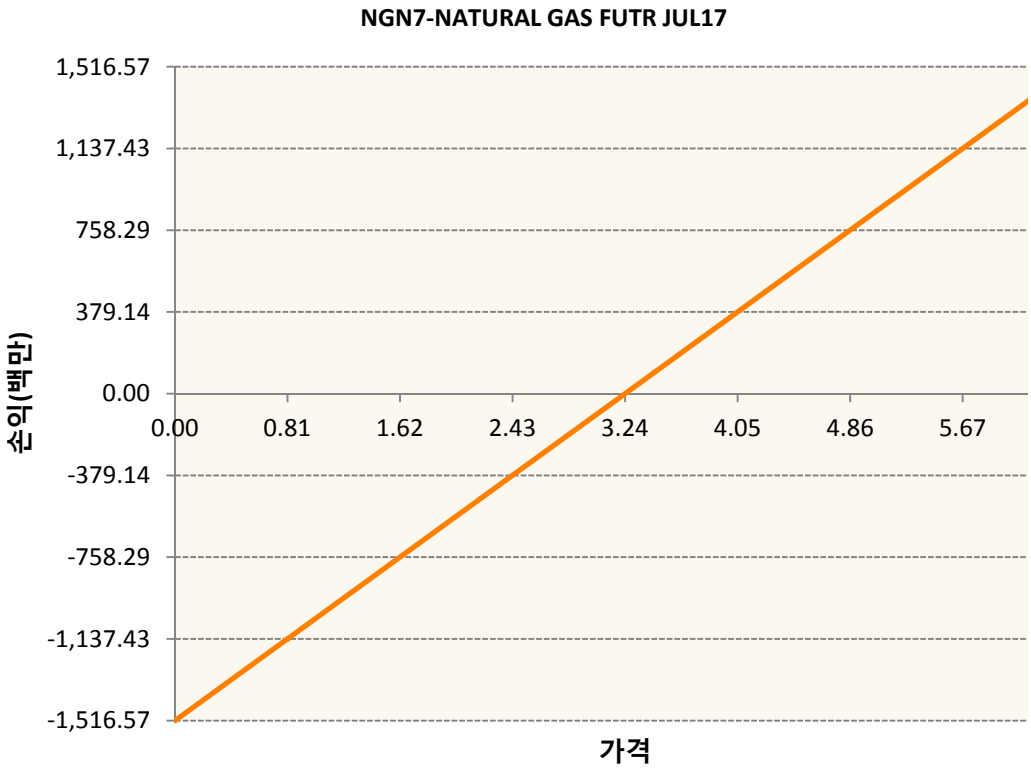


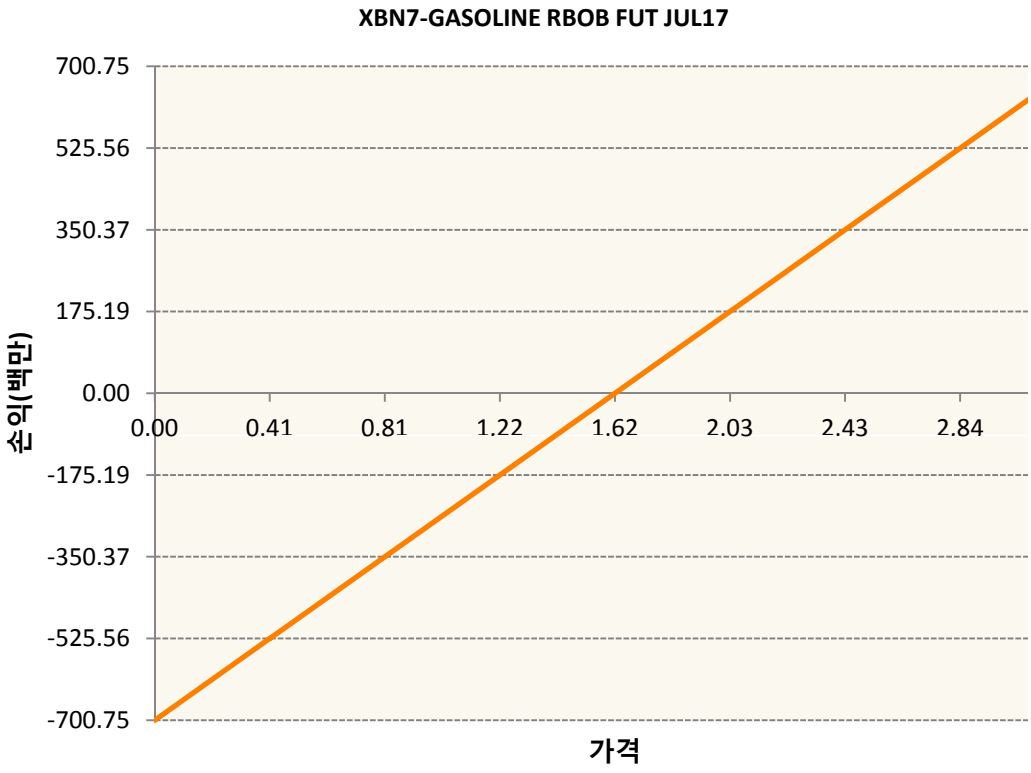

-1,072.82
-1,430.42
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
502.73
335.16
167.58
0.00
-167.58
-335.16
-502.73
-670.31
0.00
0.39
0.78
1.16
1.55
1.94
2.33
2.71
순이익(백만)
가격


KR4175M50006-2017-05 달러선물
405.00
303.75
202.50
101.25
0.00
-101.25
-202.50
-303.75
-405.00
0.00
281.25
562.50
843.75
1,125.00
1,406.25
1,687.50
1,968.75
순이익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,516.57
1,137.43
758.29
379.14
0.00
-379.14
-758.29
-1,137.43
-1,516.57
0.00
0.81
1.62
2.43
3.24
4.05
4.86
5.67
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
700.75
525.56
350.37
175.19
0.00
-175.19
-350.37
-525.56
-700.75
0.00
0.41
0.81
1.22
1.62
2.03
2.43
2.84
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN7	WTI CRUDE FUTURE JUL17	77
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	114
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	54
KR4175M50(	2017-05 달러선물	32
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	121
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	56

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

920

공시일	2017-04-26
기준일	2017-04-25

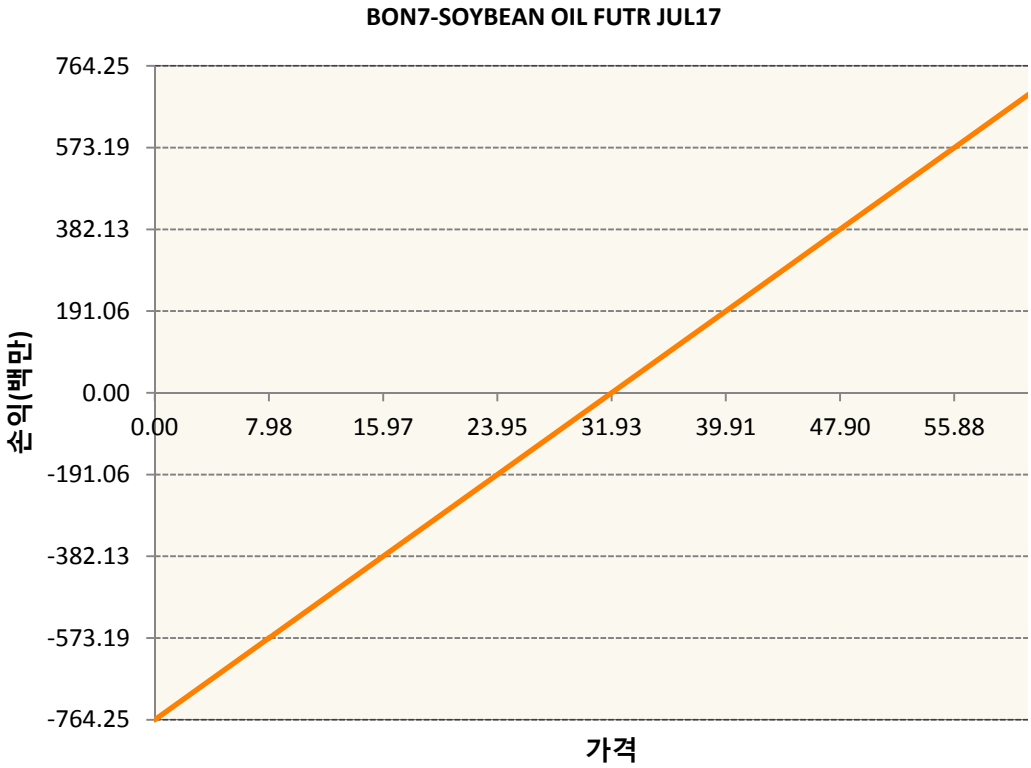
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

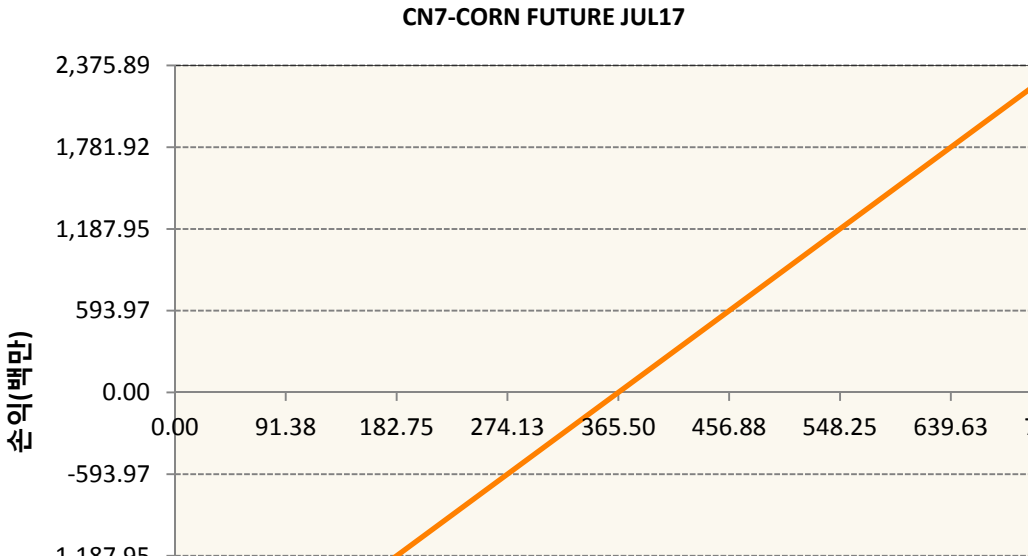
1. 계약금액

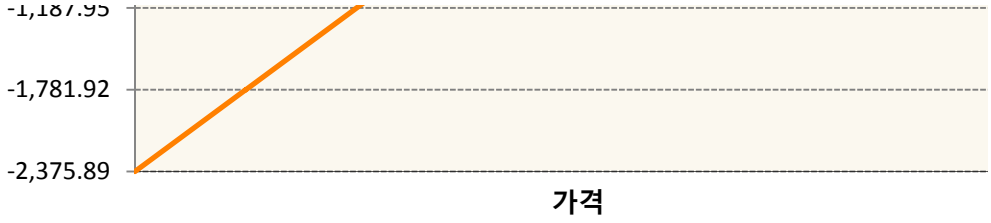
(단위:백만원)

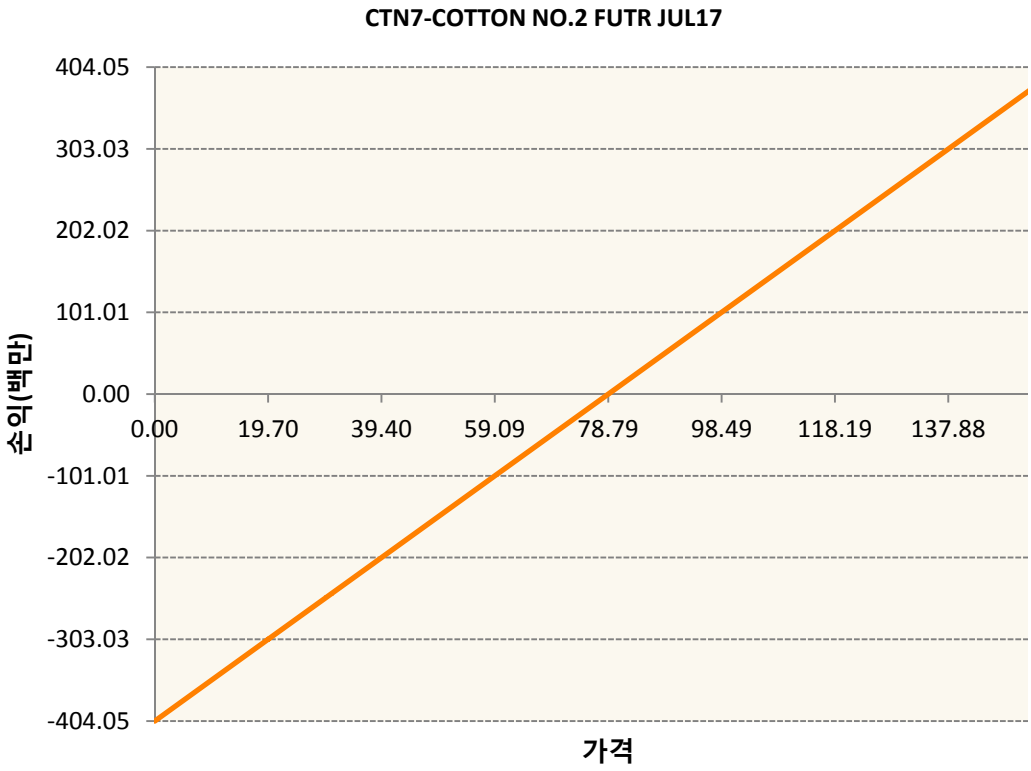
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,857	394	8,463	

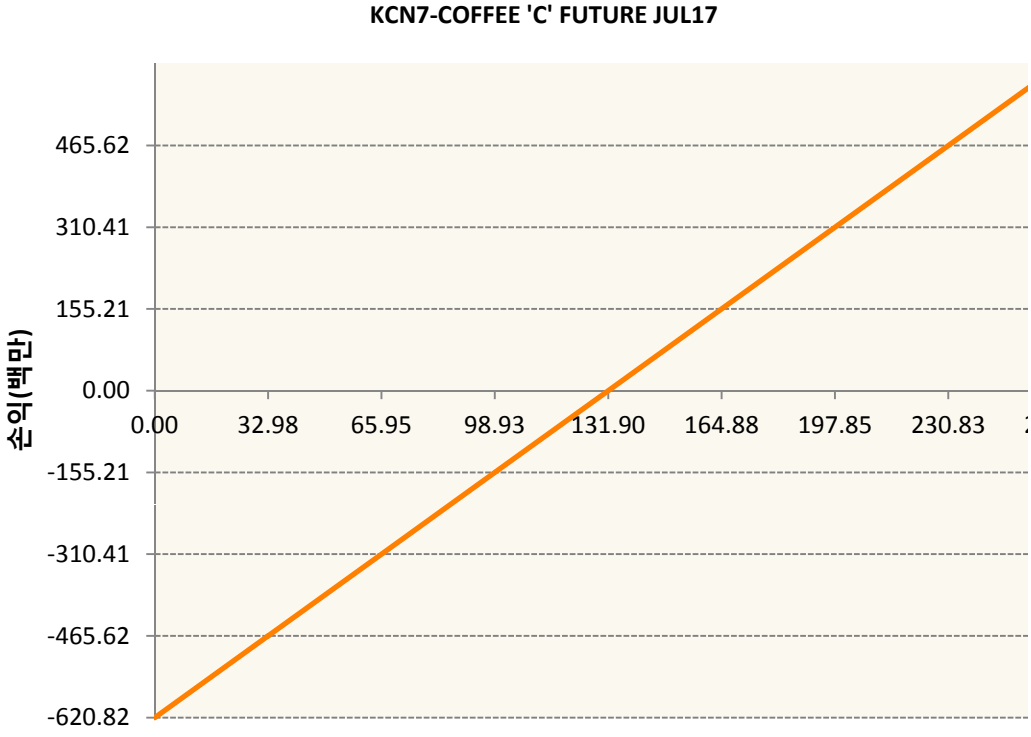
2. 만기시점의 손익구조





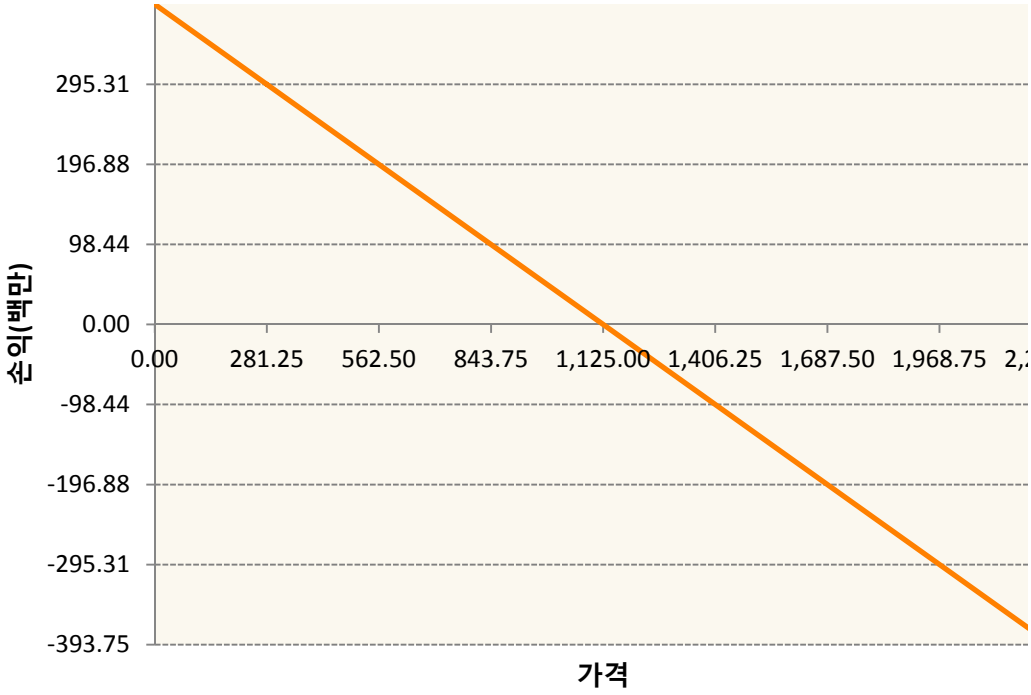

-1,781.92
-2,375.89
가격


CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
404.05
303.03
202.02
101.01
0.00
-101.01
-202.02
-303.03
-404.05
0.00
19.70
39.40
59.09
78.79
98.49
118.19
137.88
순익(백만)
가격

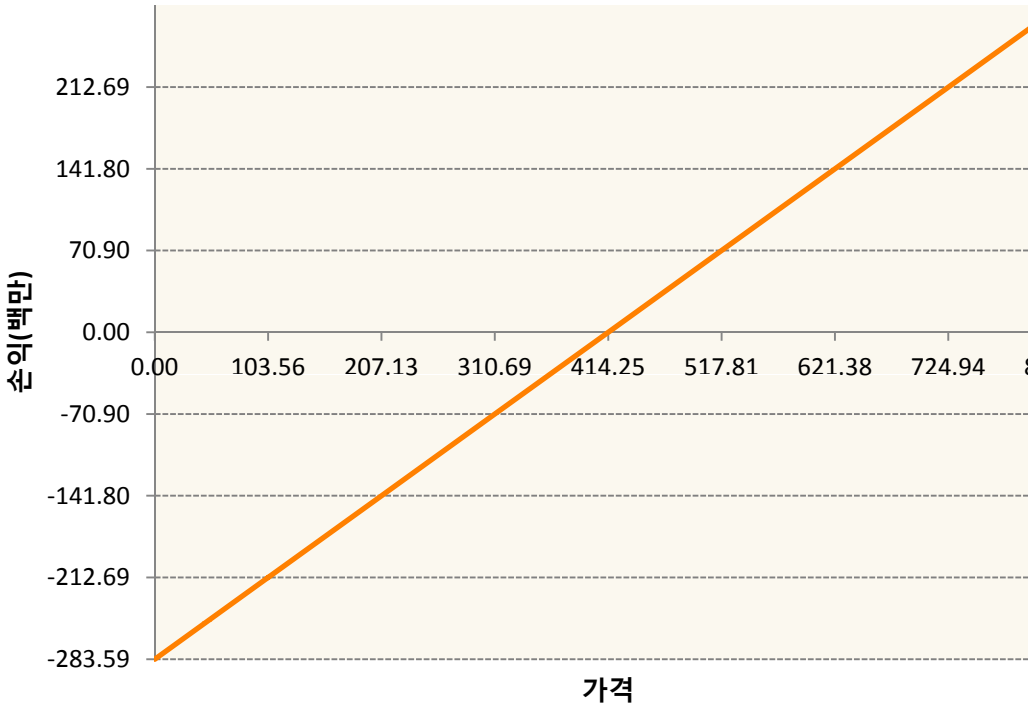

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
465.62
310.41
155.21
0.00
-155.21
-310.41
-465.62
-620.82
0.00
32.98
65.95
98.93
131.90
164.88
197.85
230.83
순익(백만)

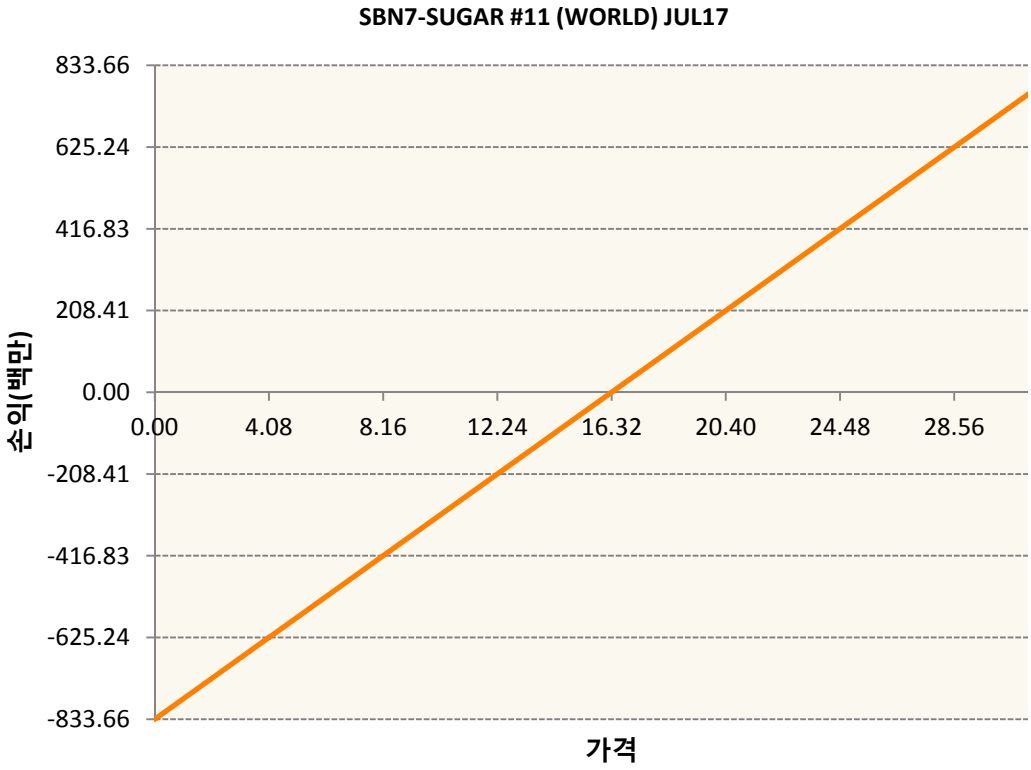
가격

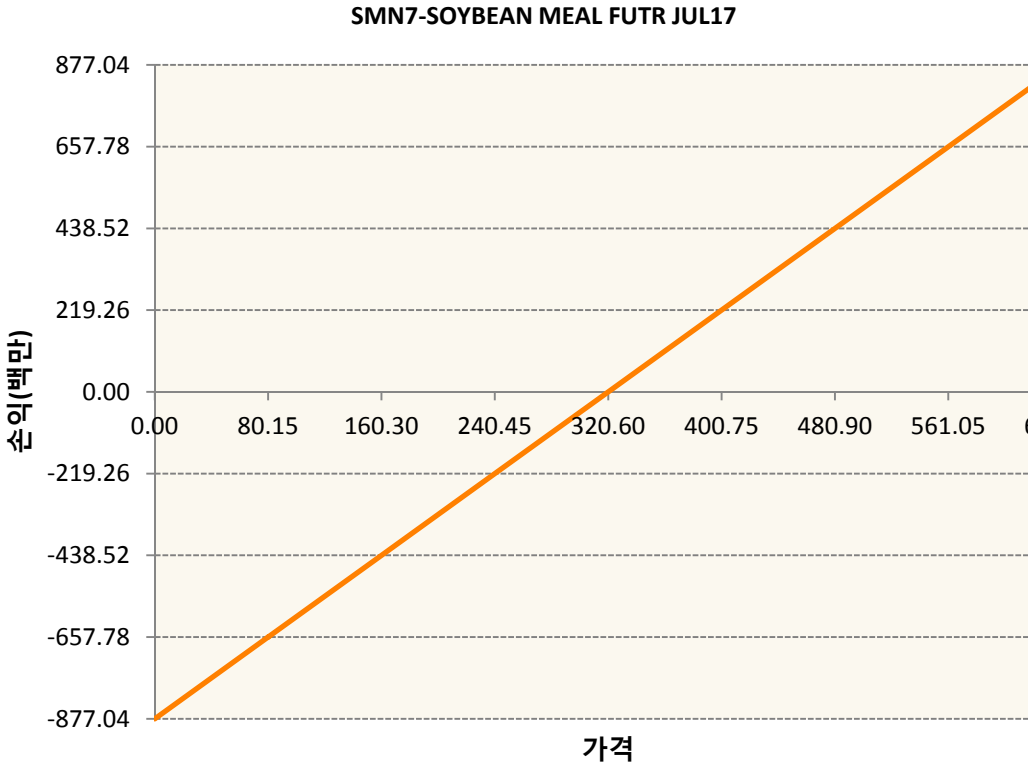
KR4175M50006-2017-05 달러선물

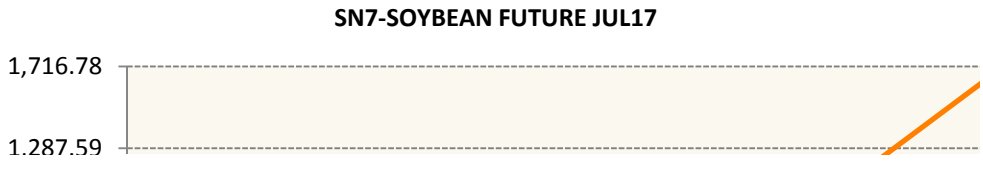


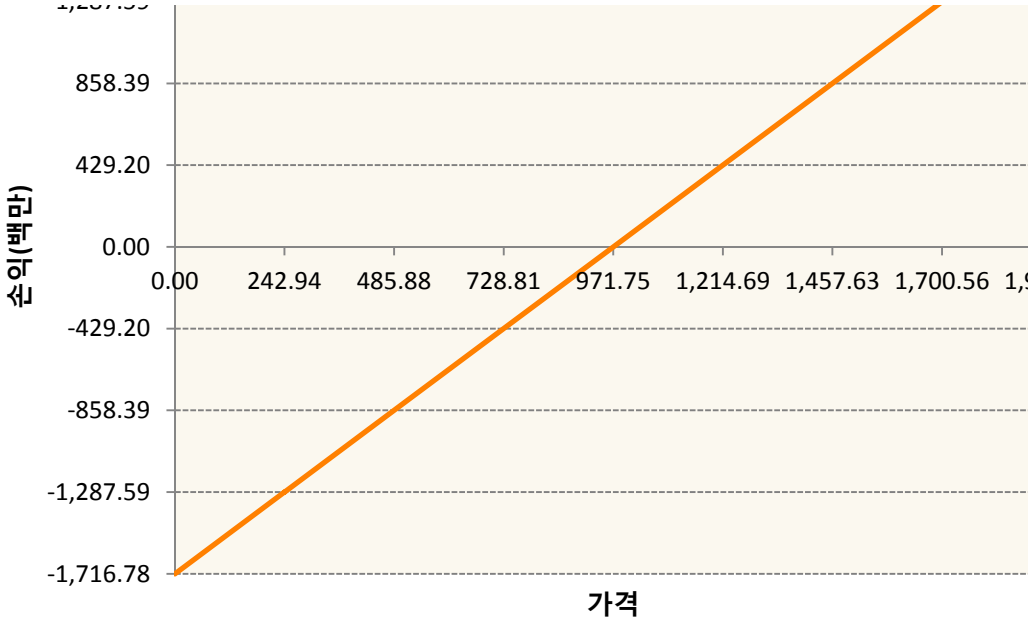
KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17

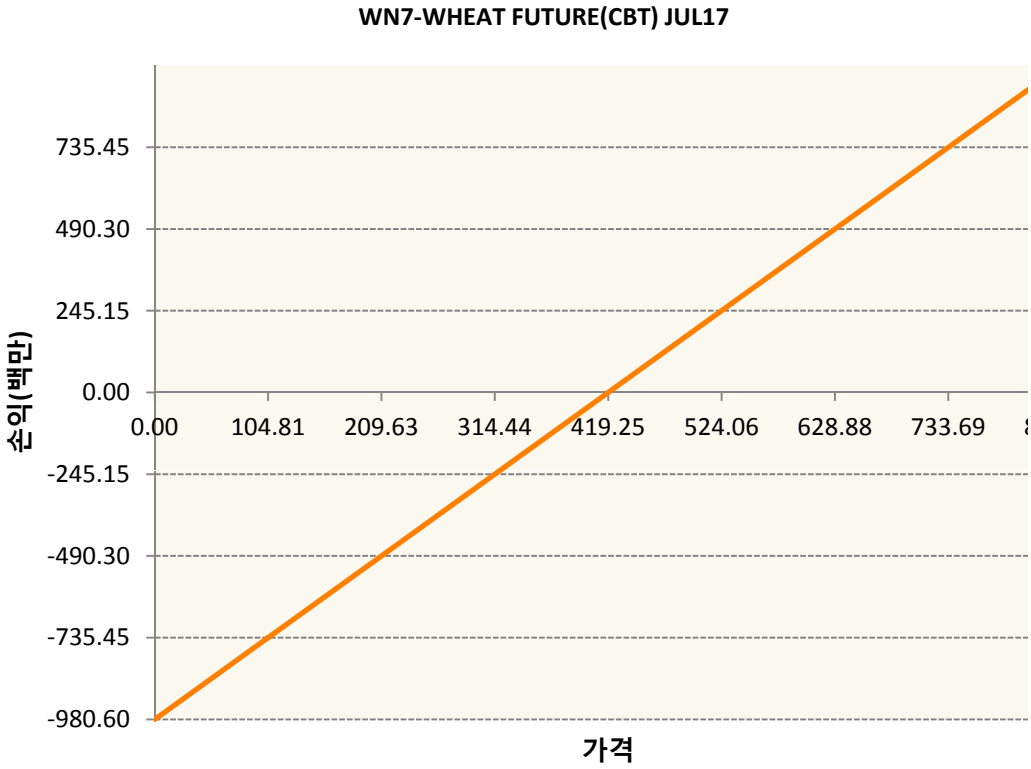



SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
833.66
625.24
416.83
208.41
0.00
-208.41
-416.83
-625.24
-833.66
0.00
4.08
8.16
12.24
16.32
20.40
24.48
28.56
손익(백만)
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
877.04
657.78
438.52
219.26
0.00
-219.26
-438.52
-657.78
-877.04
0.00
80.15
160.30
240.45
320.60
400.75
480.90
561.05
손익(백만)
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,716.78
1,287.59





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	61
CN7	CORN FUTURE JUL17	190
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	32
KCN7	COFFEE 'C' FUTURE JUL17	50
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	137
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	78

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

803