공시일	2017-04-27
기준일	2017-04-26

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	2017-04-27
기준일	2017-04-26

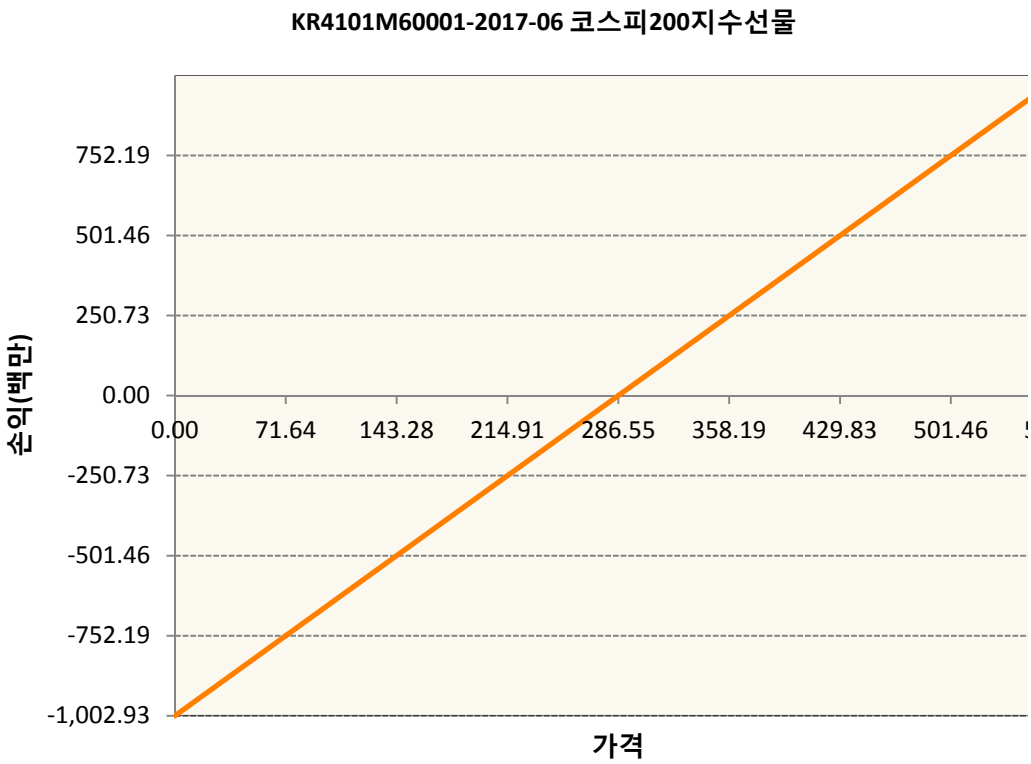
스마트인덱스모

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	1,003	0	1,003	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%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-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%	54	54	54	54	54	54	54
8.00%	80	80	80	80	80	80	80

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

52

공시일	2017-04-27
기준일	2017-04-26

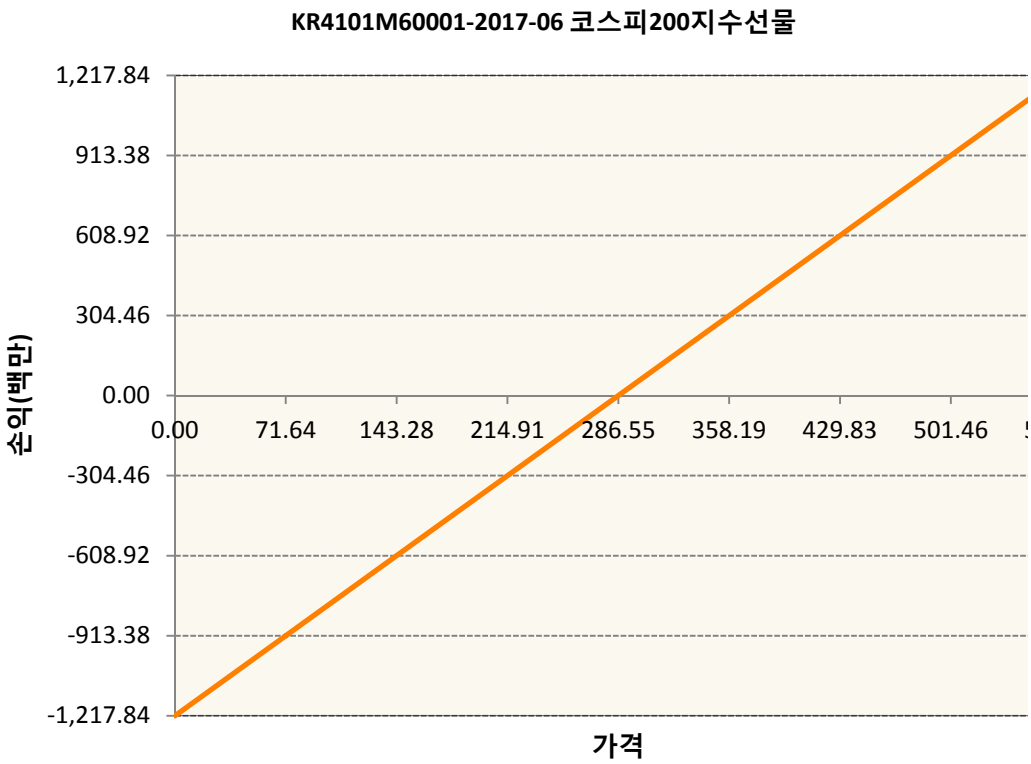
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,218	0	1,218	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							98
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98
-5.33%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
-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%	65	65	65	65	65	65	65
8.00%	98	98	98	98	98	98	98

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

63

공시일	2017-04-27
기준일	2017-04-26

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	975

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

559

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-04-27
기준일	2017-04-26

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	375

* 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	2017-04-27
기준일	2017-04-26

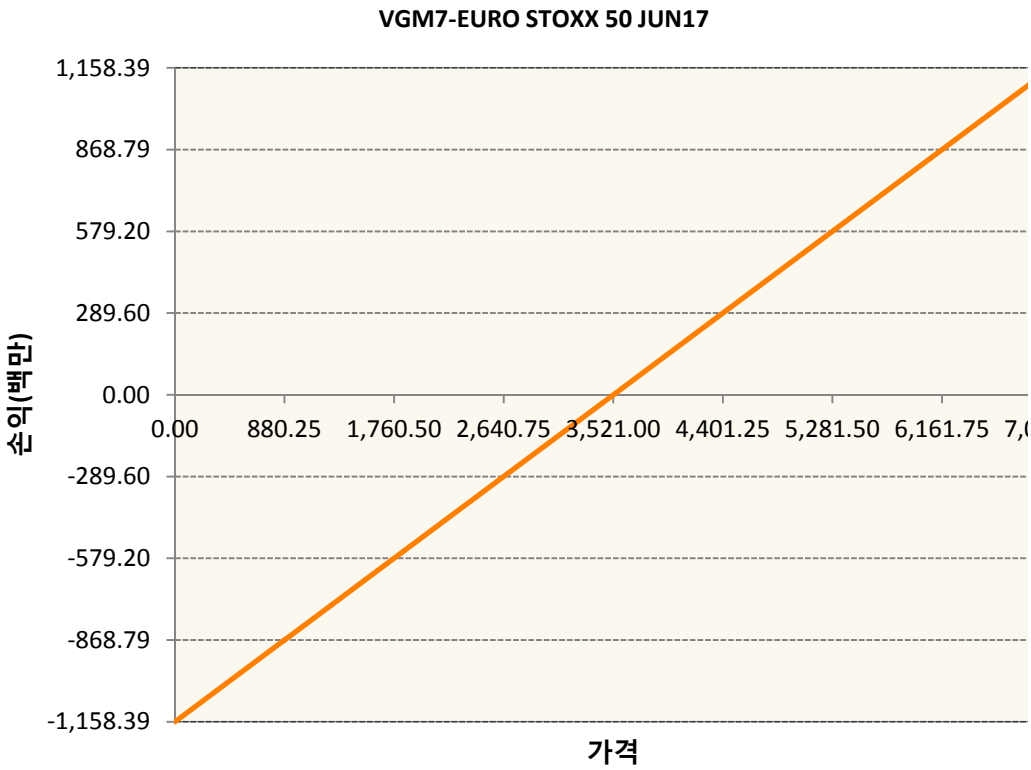
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,158	0	1,158	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM7	EURO STOXX 50 JUN17	93

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

(단위:백만원)

94

공시일	2017-04-27
기준일	2017-04-26

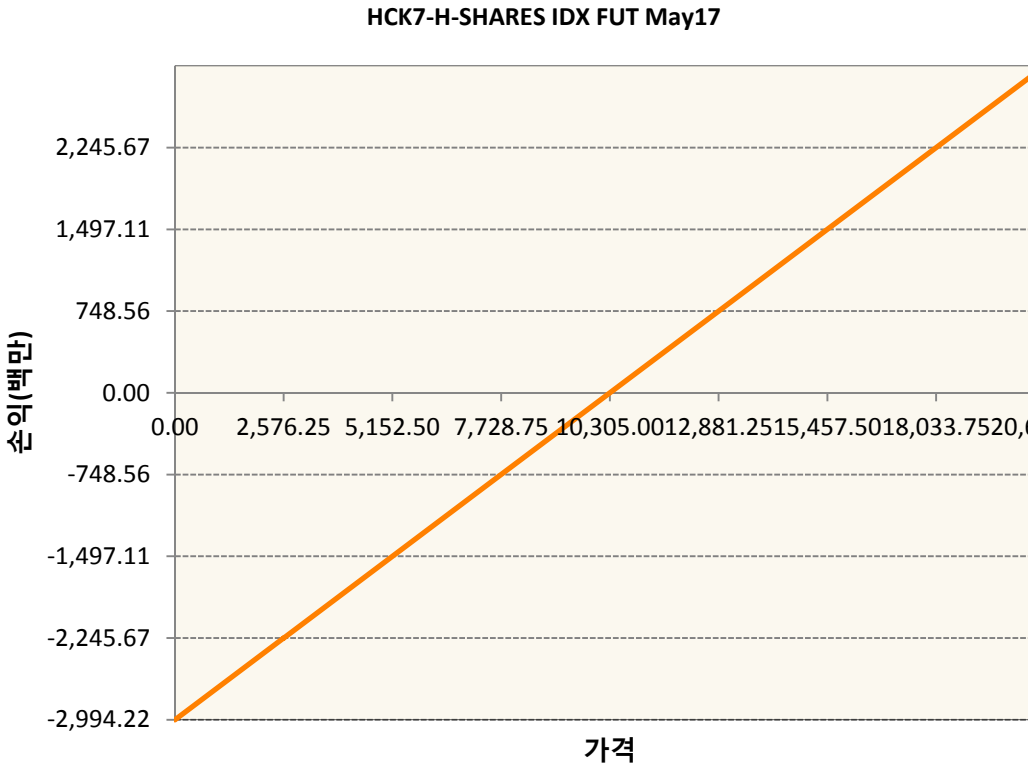
차이나인덱스모(주식-파생형)

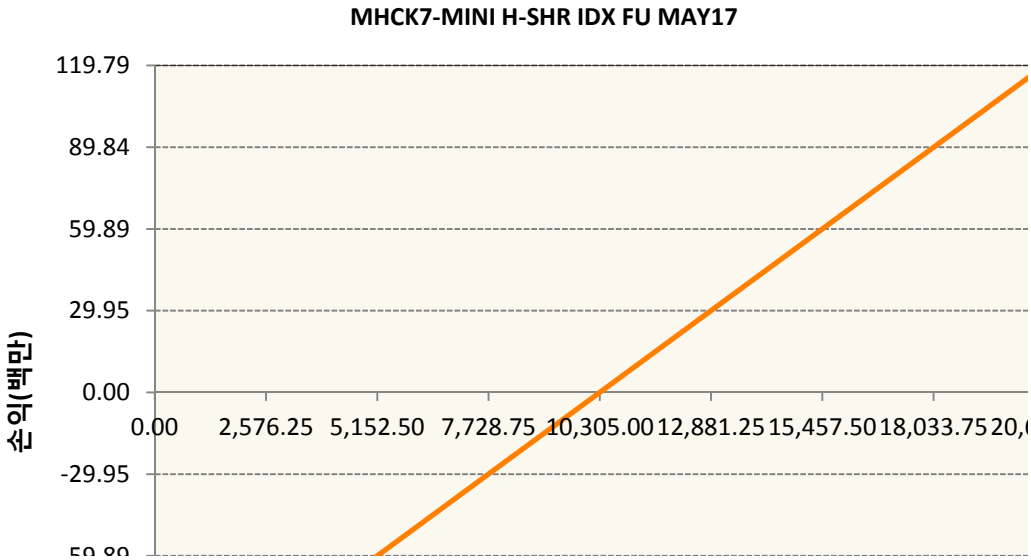
1. 계약금액

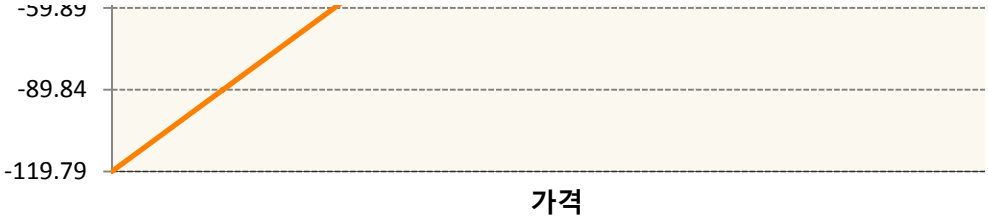
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,114	0	3,114	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCK7	H-SHARES IDX FUT May17	240
MHCK7	MINI H-SHR IDX FU MAY17	10

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

265

공시일	2017-04-27
기준일	2017-04-26

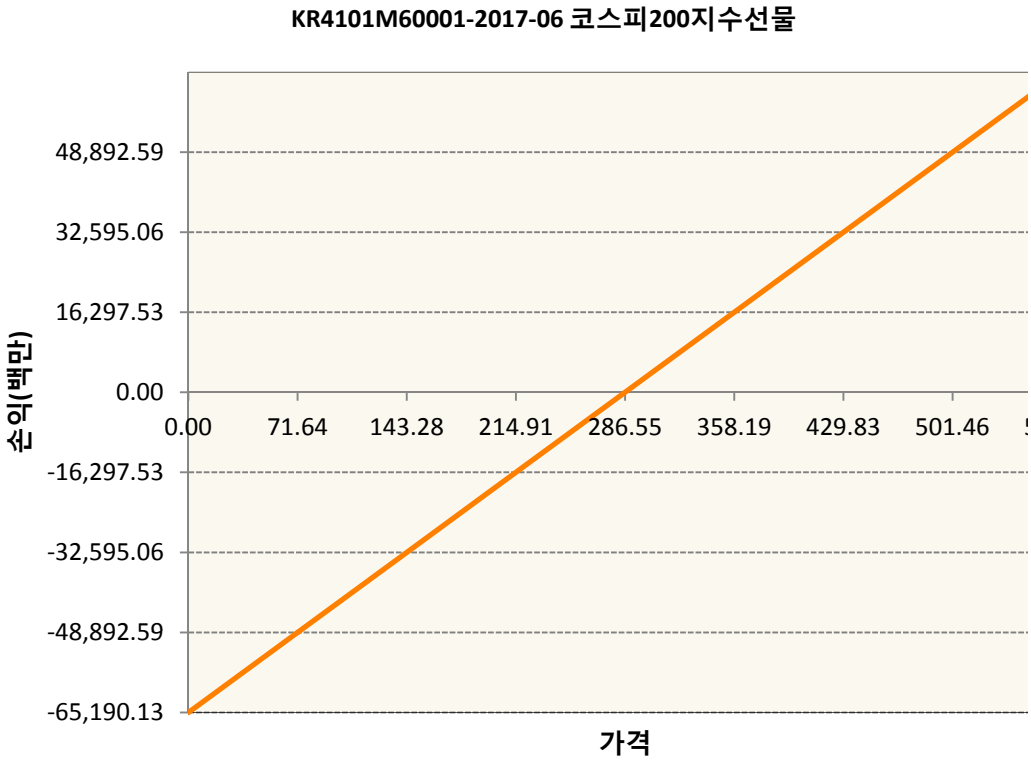
커버드콜모(주식혼합-파생형)

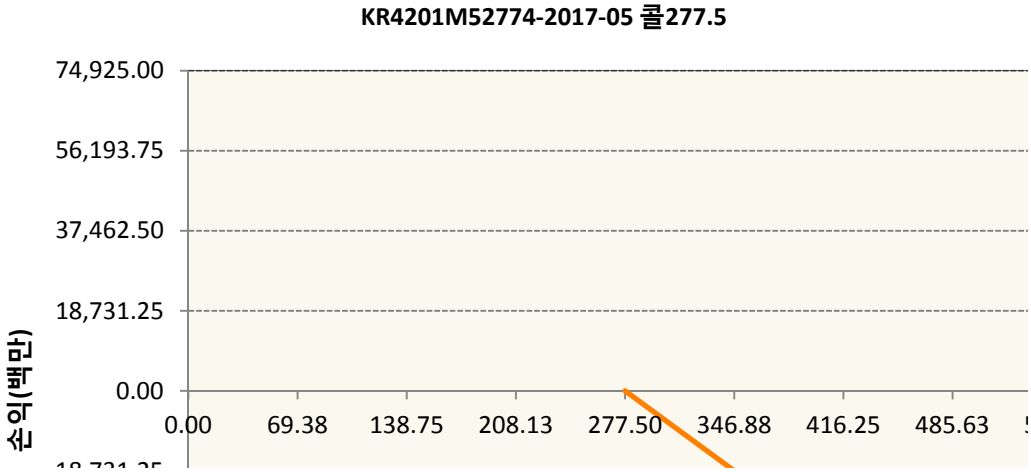
1. 계약금액

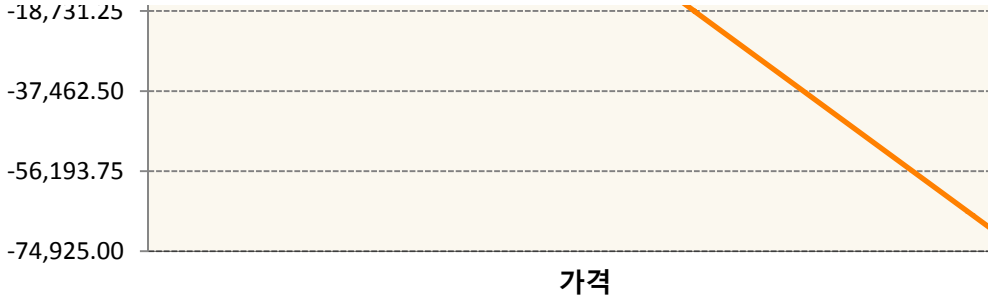
(단위:백만원)

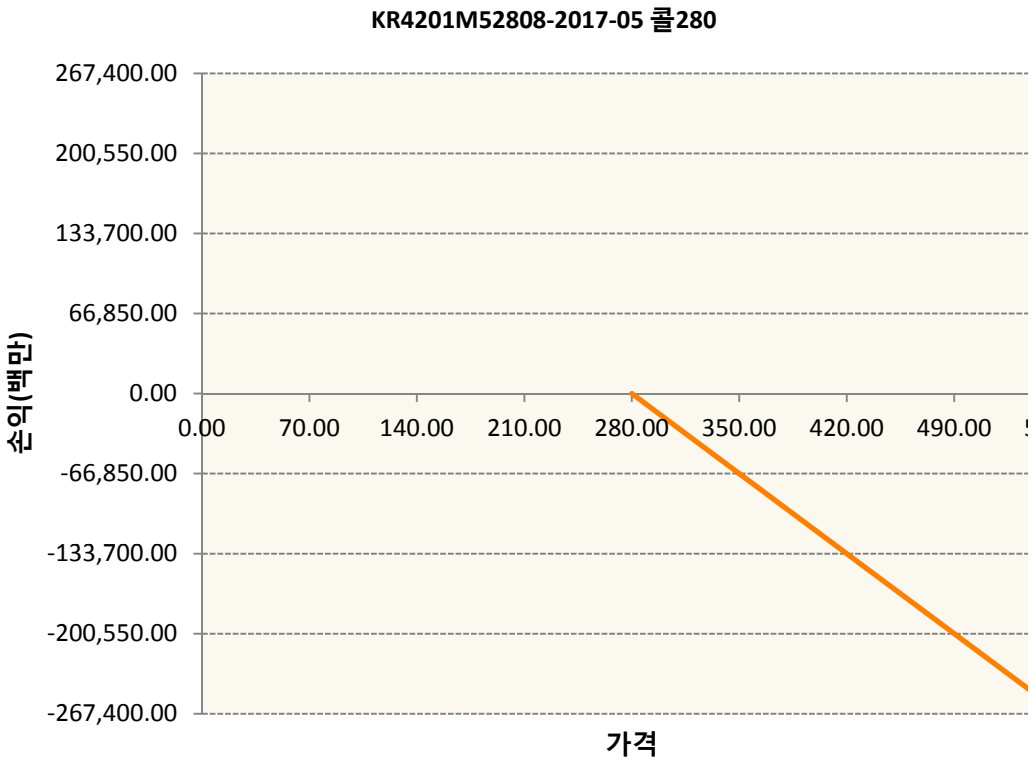
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	7,012	-7,012	장내
누계	유가증권	선물	65,190	0	65,190	장내
누계	유가증권	옵션	0	411,825	-411,825	장내

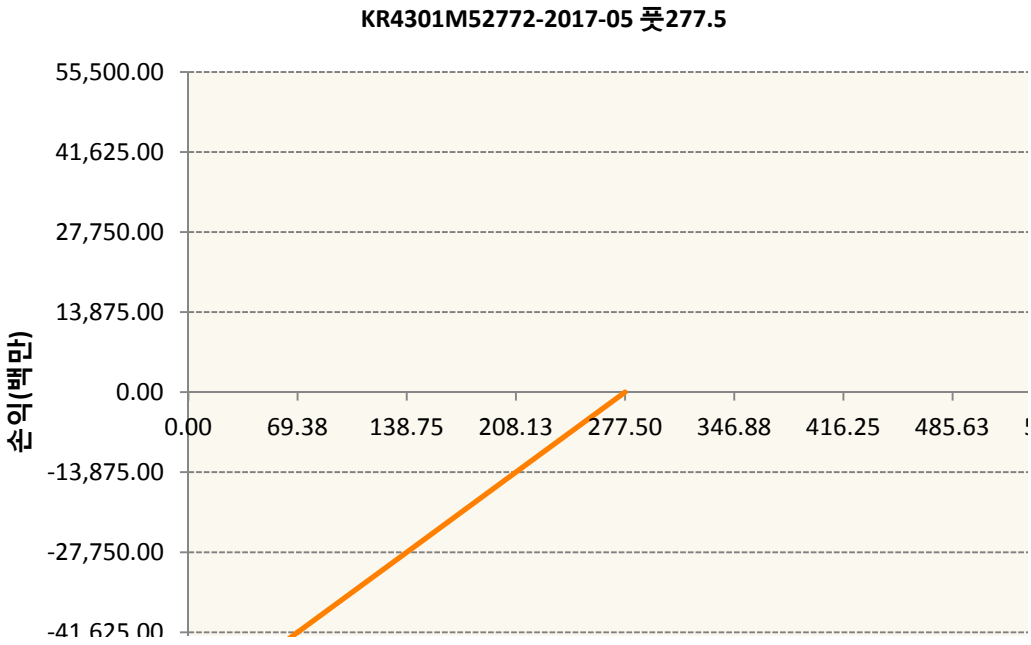
2. 만기시점의 손익구조



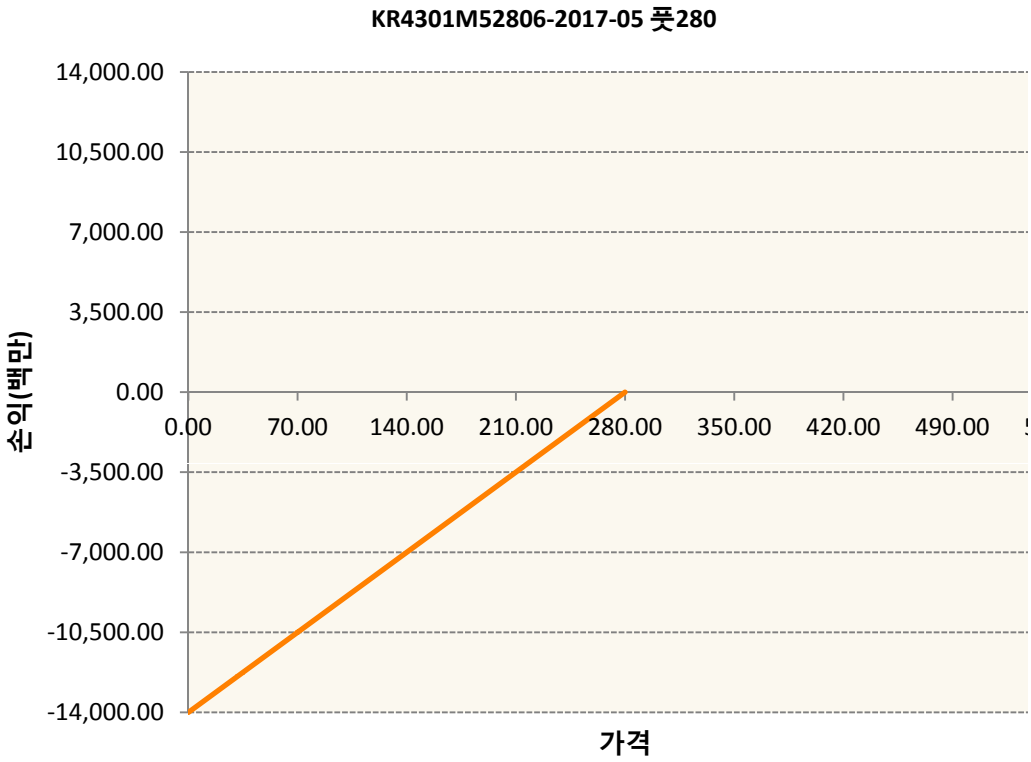



-18,731.25
-37,462.50
-56,193.75
-74,925.00
가격


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							5,219
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,219	-5,219	-5,219	-5,219	-5,219	-5,219	-5,219
-5.33%	-3,480	-3,480	-3,480	-3,480	-3,480	-3,480	-3,480
-2.67%	-1,740	-1,740	-1,740	-1,740	-1,740	-1,740	-1,740
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,740	1,740	1,740	1,740	1,740	1,740	1,740
5.33%	3,480	3,480	3,480	3,480	3,480	3,480	3,480
8.00%	5,219	5,219	5,219	5,219	5,219	5,219	5,219
KR4201M52 2017-05 콜277.5							6,128
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,559	2,558	2,555	2,551	2,545	2,536	2,525
-5.33%	2,497	2,469	2,438	2,403	2,366	2,326	2,284
-2.67%	1,794	1,739	1,684	1,628	1,572	1,516	1,459

0%	47	35	20	0	-23	-50	-79
2.67%	-2,002	-2,002	-2,003	-2,004	-2,007	-2,012	-2,018
5.33%	-4,065	-4,065	-4,065	-4,065	-4,065	-4,065	-4,066
8.00%	-6,128	-6,128	-6,128	-6,128	-6,128	-6,128	-6,128
	KR4201M52(	2017-05 콜280					21,404
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,939	6,938	6,936	6,930	6,921	6,906	6,886
-5.33%	6,872	6,824	6,761	6,685	6,596	6,497	6,387
-2.67%	5,487	5,285	5,082	4,879	4,676	4,472	4,269
0%	309	220	117	0	-127	-264	-408
2.67%	-6,810	-6,815	-6,825	-6,841	-6,865	-6,898	-6,940
5.33%	-14,105	-14,105	-14,106	-14,106	-14,108	-14,111	-14,116
8.00%	-21,404	-21,404	-21,404	-21,404	-21,404	-21,404	-21,404
	KR4301M52(	2017-05 풋277.5					2,715
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,690	-2,691	-2,693	-2,696	-2,700	-2,706	-2,715
-5.33%	-1,207	-1,228	-1,251	-1,277	-1,305	-1,334	-1,365
-2.67%	-199	-240	-281	-322	-364	-406	-448
0%	35	26	14	0	-17	-37	-58
2.67%	46	46	45	44	41	38	33
5.33%	46	46	46	46	46	46	45
8.00%	46	46	46	46	46	46	46
	KR4301M52(	2017-05 풋280					786
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-783	-783	-783	-783	-784	-785	-786
-5.33%	-404	-407	-410	-414	-419	-424	-430
-2.67%	-95	-105	-116	-127	-137	-148	-159
0%	16	12	6	0	-7	-14	-21
2.67%	26	25	25	24	23	21	19
5.33%	26	26	26	26	26	25	25
8.00%	26	26	26	26	26	26	26

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

39,195

공시일	2017-04-27
기준일	2017-04-26

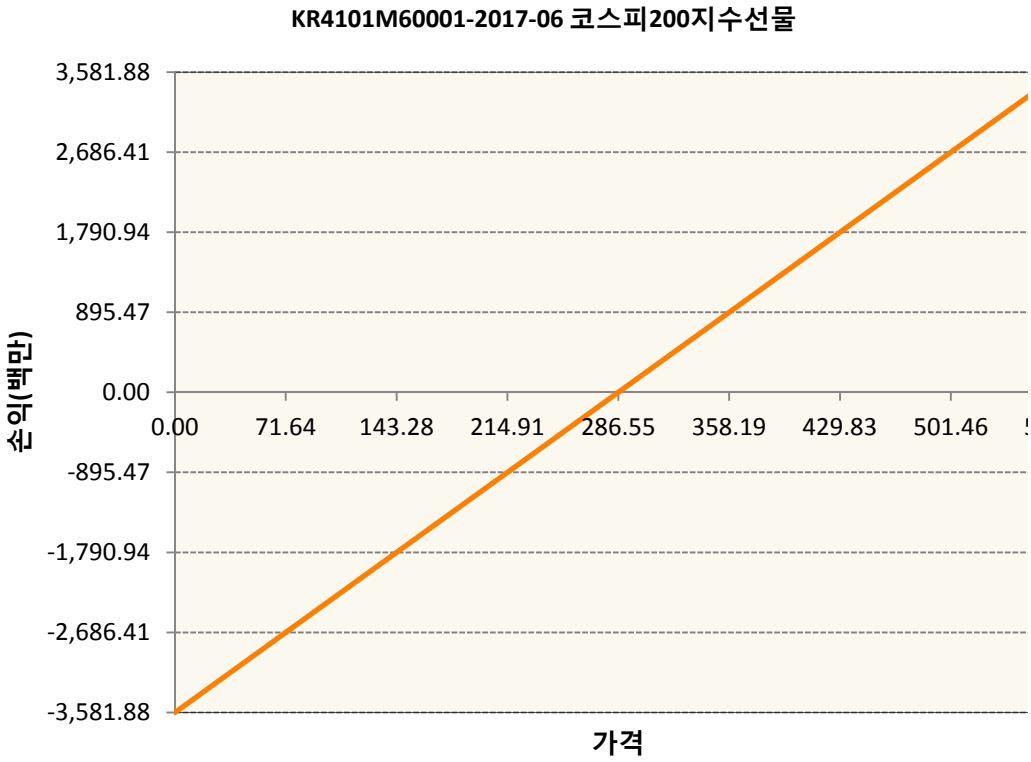
커버드콜목표전환형증권투자신탁

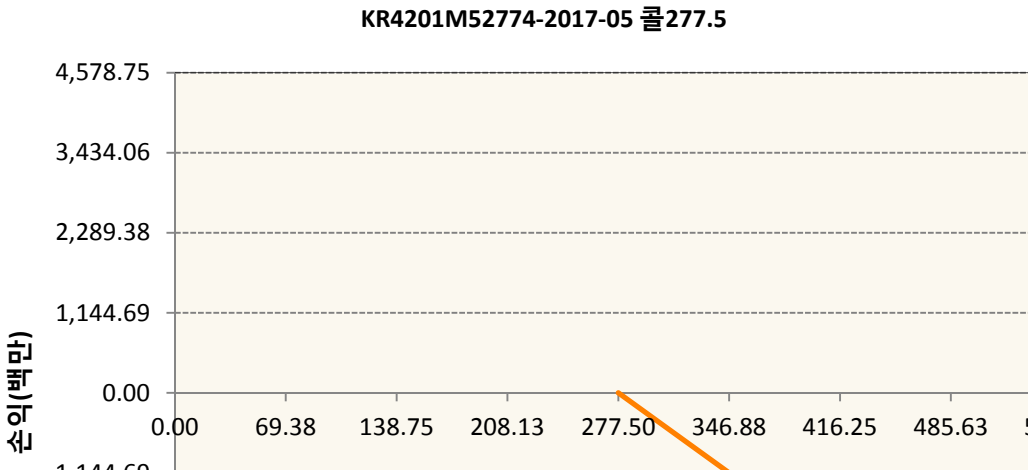
1. 계약금액

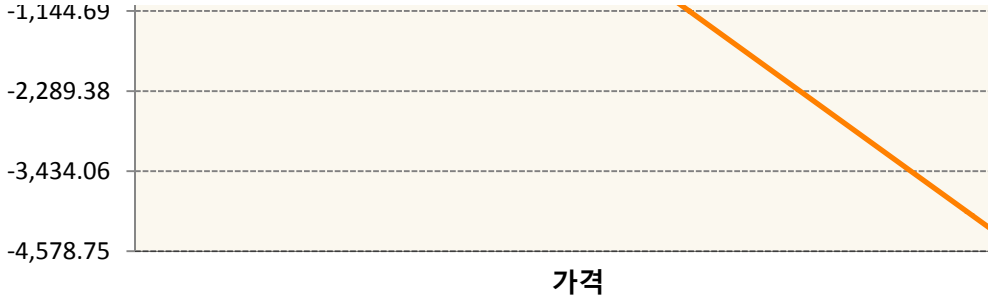
(단위:백만원)

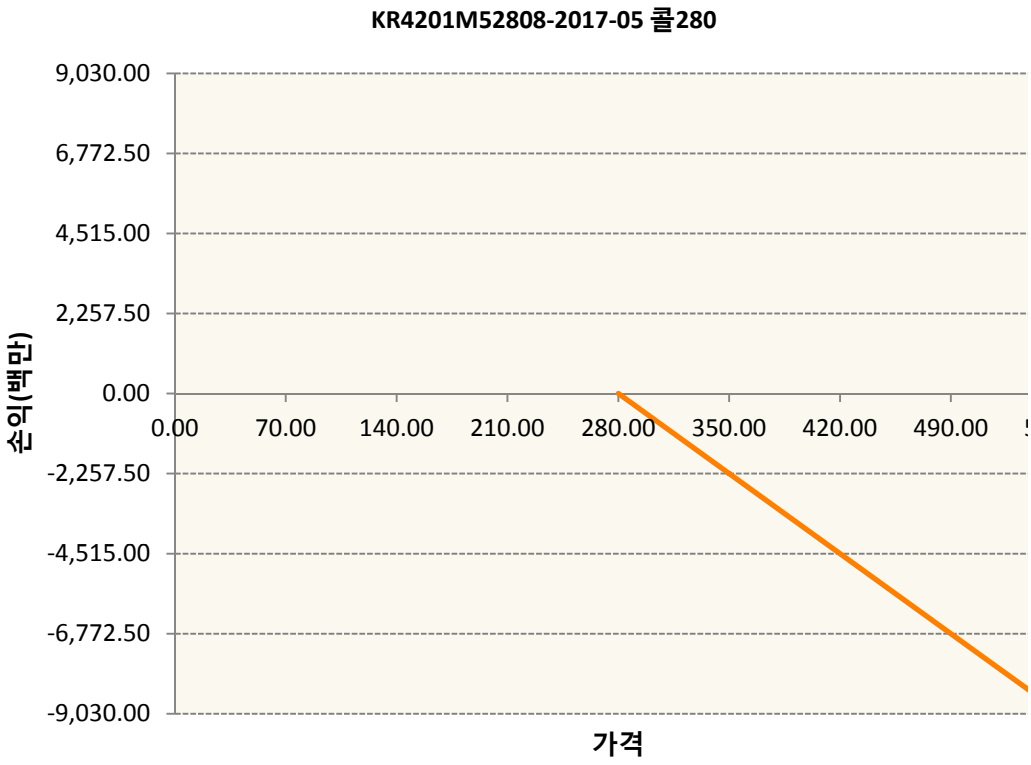
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	287	-287	장내
신규	유가증권	옵션	268	0	268	장내
누계	유가증권	선물	3,582	0	3,582	장내
누계	유가증권	옵션	0	13,609	-13,609	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							287
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-287	-287	-287	-287	-287	-287	-287
-5.33%	-191	-191	-191	-191	-191	-191	-191
-2.67%	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	96	96	96	96	96	96	96
5.33%	191	191	191	191	191	191	191
8.00%	287	287	287	287	287	287	287
KR4201M52 2017-05 콜277.5							375
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	156	156	156	156	156	155	154
-5.33%	153	151	149	147	145	142	140
-2.67%	110	106	103	99	96	93	89
0%	3	2	1	0	-1	-3	-5
2.67%	-122	-122	-122	-122	-123	-123	-123
5.33%	-248	-248	-248	-248	-248	-248	-248
8.00%	-375	-375	-375	-375	-375	-375	-375
	KR4201M52(	2017-05 콜280					723

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	234	234	234	234	234	233	233
-5.33%	232	230	228	226	223	219	216
-2.67%	185	178	172	165	158	151	144
0%	10	7	4	0	-4	-9	-14
2.67%	-230	-230	-230	-231	-232	-233	-234
5.33%	-476	-476	-476	-476	-476	-477	-477
8.00%	-723	-723	-723	-723	-723	-723	-723

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

1,502

공시일	2017-04-27
기준일	2017-04-26

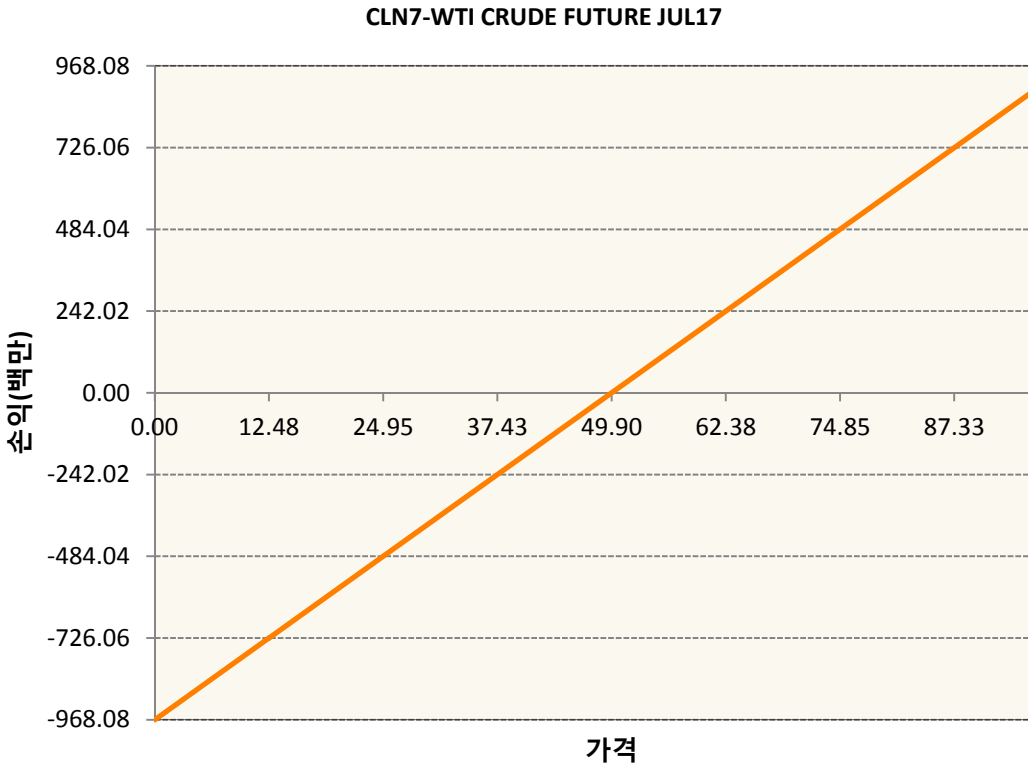
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

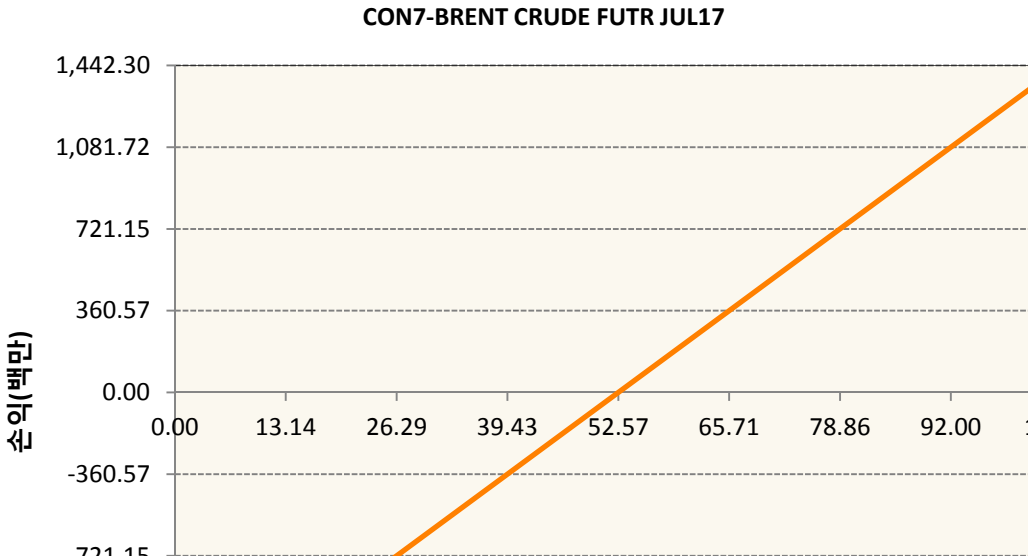
1. 계약금액

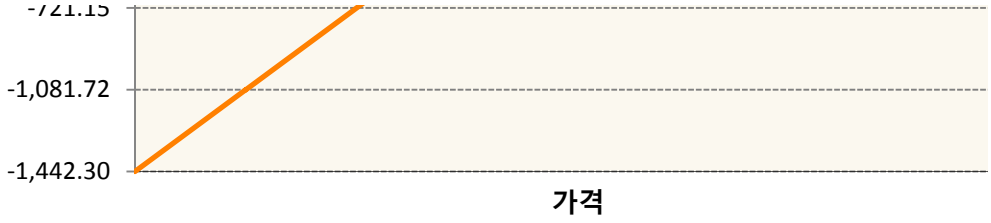
(단위:백만원)

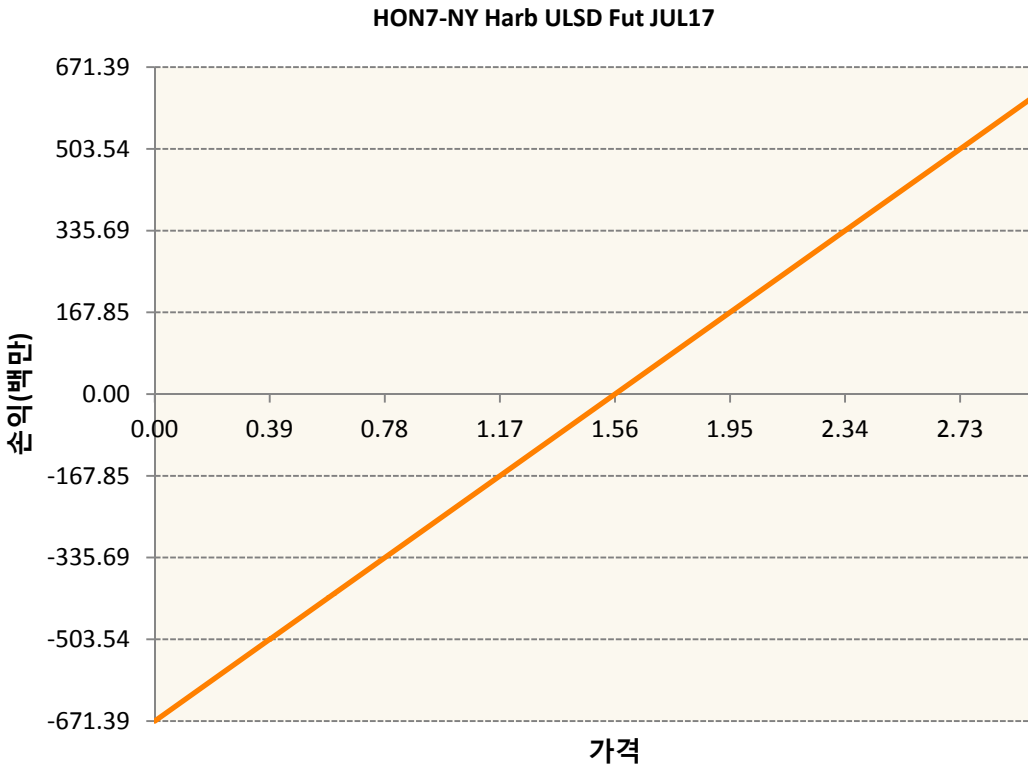
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,303	406	4,897	

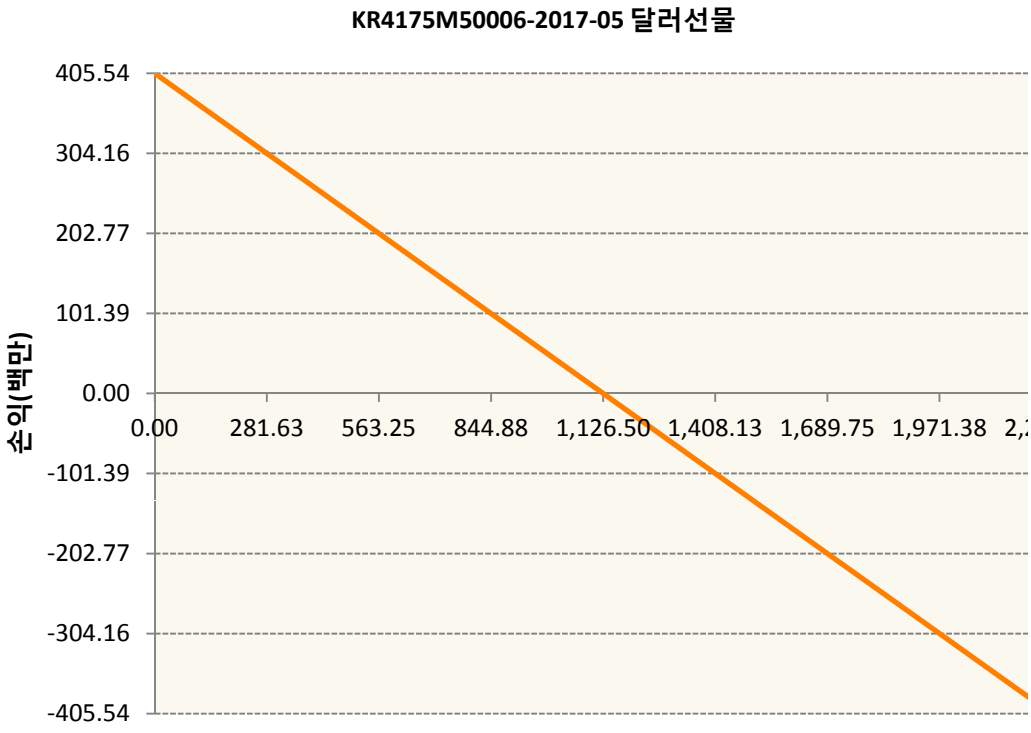
2. 만기시점의 손익구조



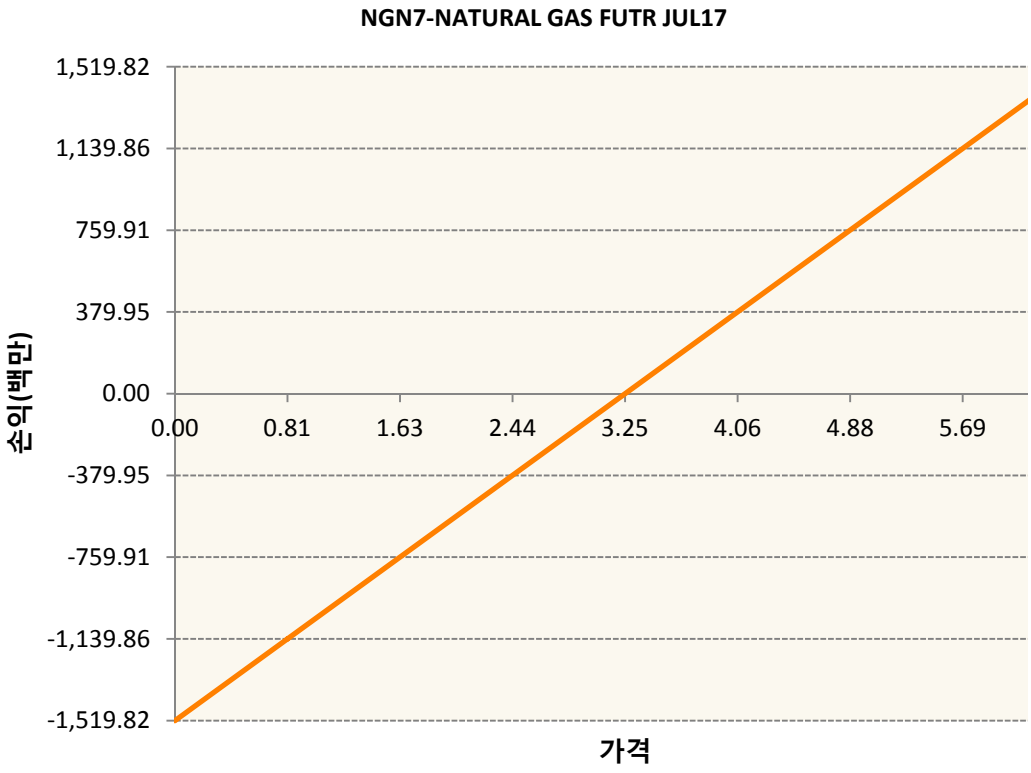


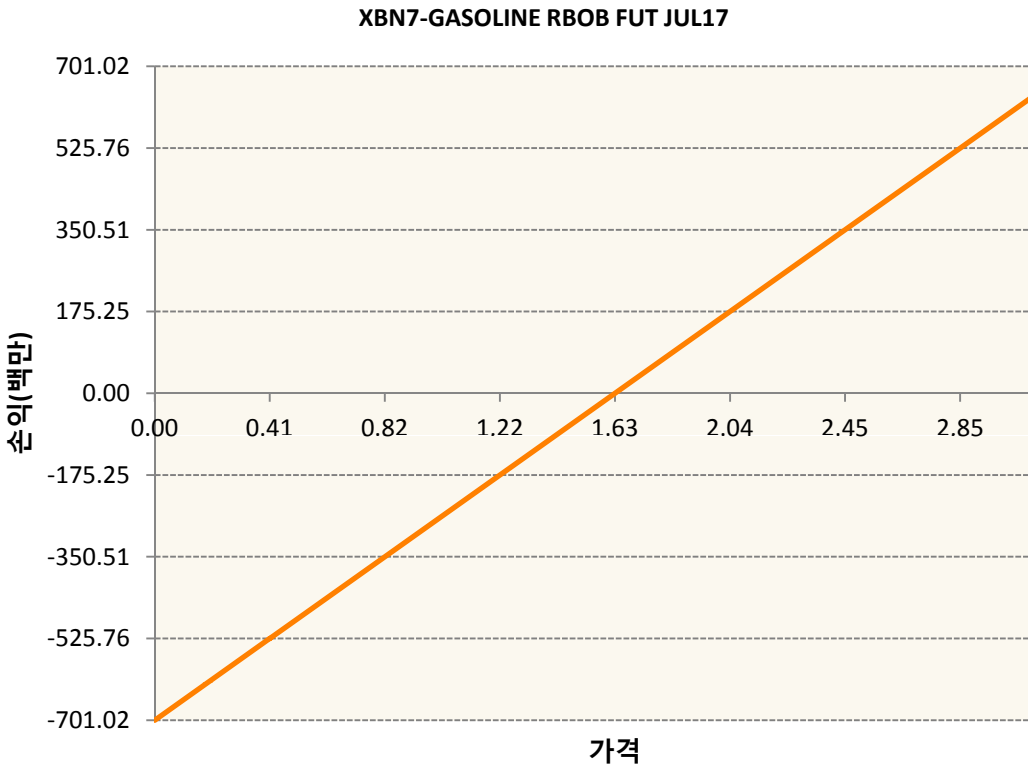

-1,081.72
-1,442.30
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
671.39
503.54
335.69
167.85
0.00
-167.85
-335.69
-503.54
-671.39
0.00
0.39
0.78
1.17
1.56
1.95
2.34
2.73
순이익(백만)
가격


KR4175M50006-2017-05 달러선물
405.54
304.16
202.77
101.39
0.00
-101.39
-202.77
-304.16
-405.54
0.00
281.63
563.25
844.88
1,126.50
1,408.13
1,689.75
1,971.38
순이익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,519.82
1,139.86
759.91
379.95
0.00
-379.95
-759.91
-1,139.86
-1,519.82
0.00
0.81
1.63
2.44
3.25
4.06
4.88
5.69
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
701.02
525.76
350.51
175.25
0.00
-175.25
-350.51
-525.76
-701.02
0.00
0.41
0.82
1.22
1.63
2.04
2.45
2.85
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN7	WTI CRUDE FUTURE JUL17	77
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	115
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	54
KR4175M50(	2017-05 달러선물	32
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	122
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	56

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

923

공시일	2017-04-27
기준일	2017-04-26

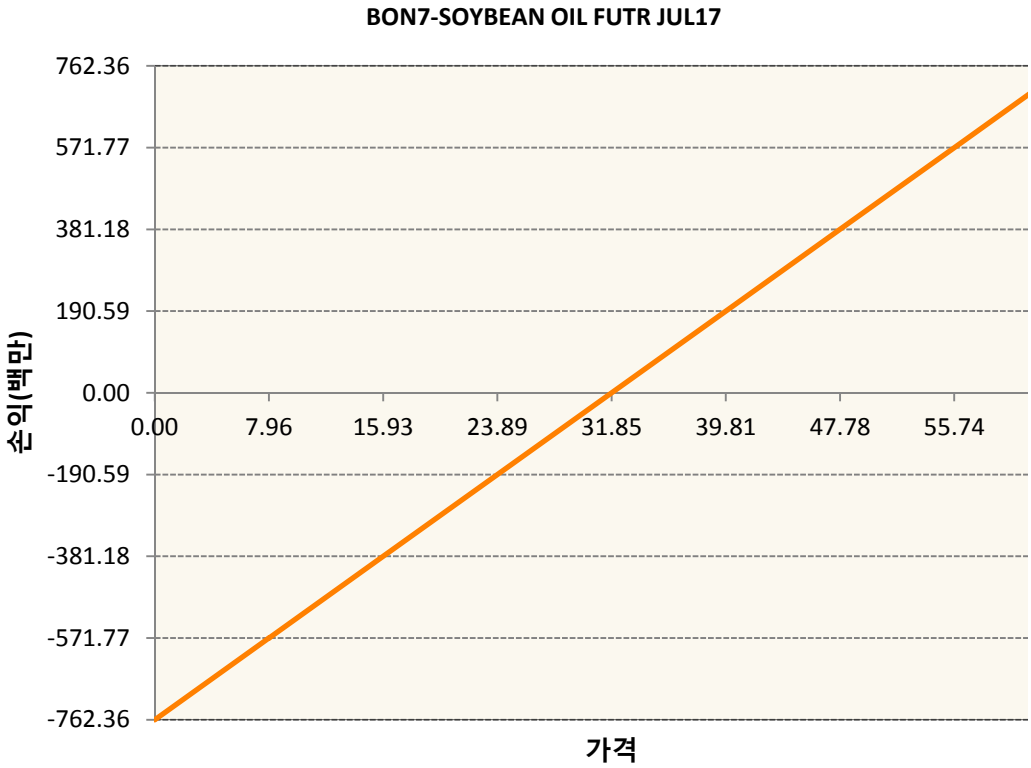
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

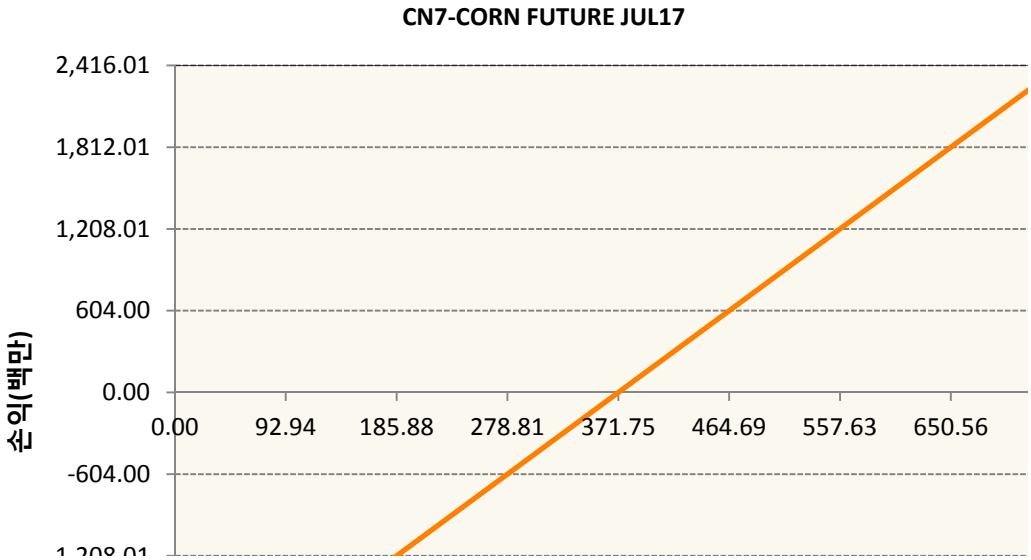
1. 계약금액

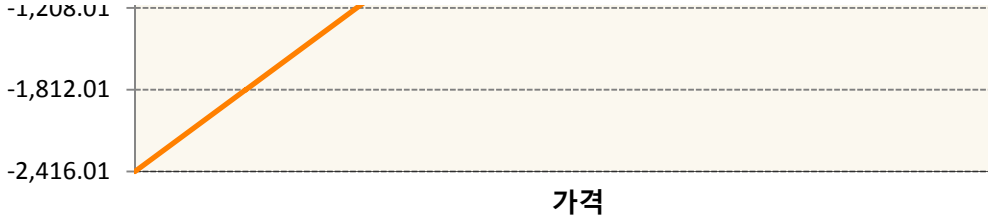
(단위:백만원)

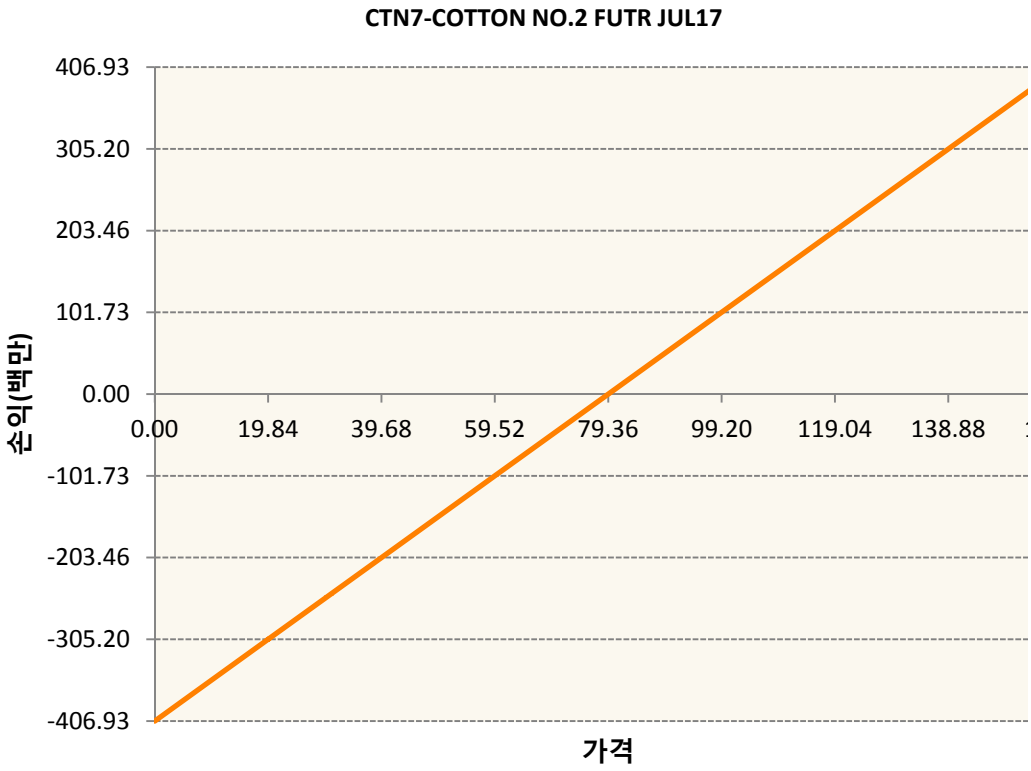
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,903	394	8,509	

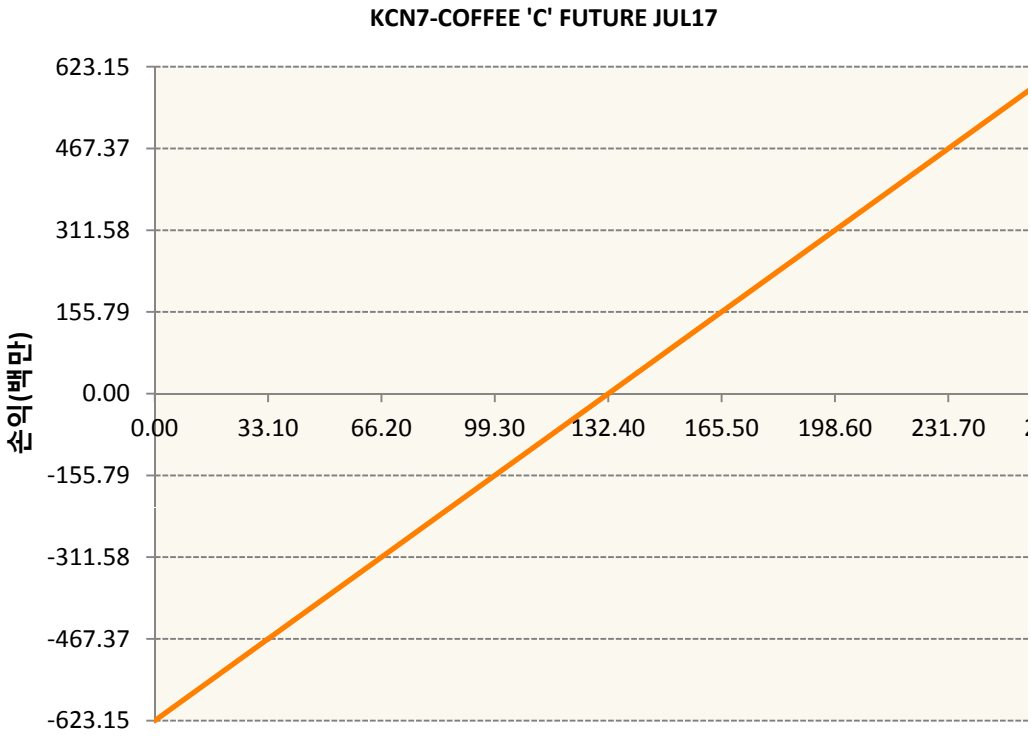
2. 만기시점의 손익구조



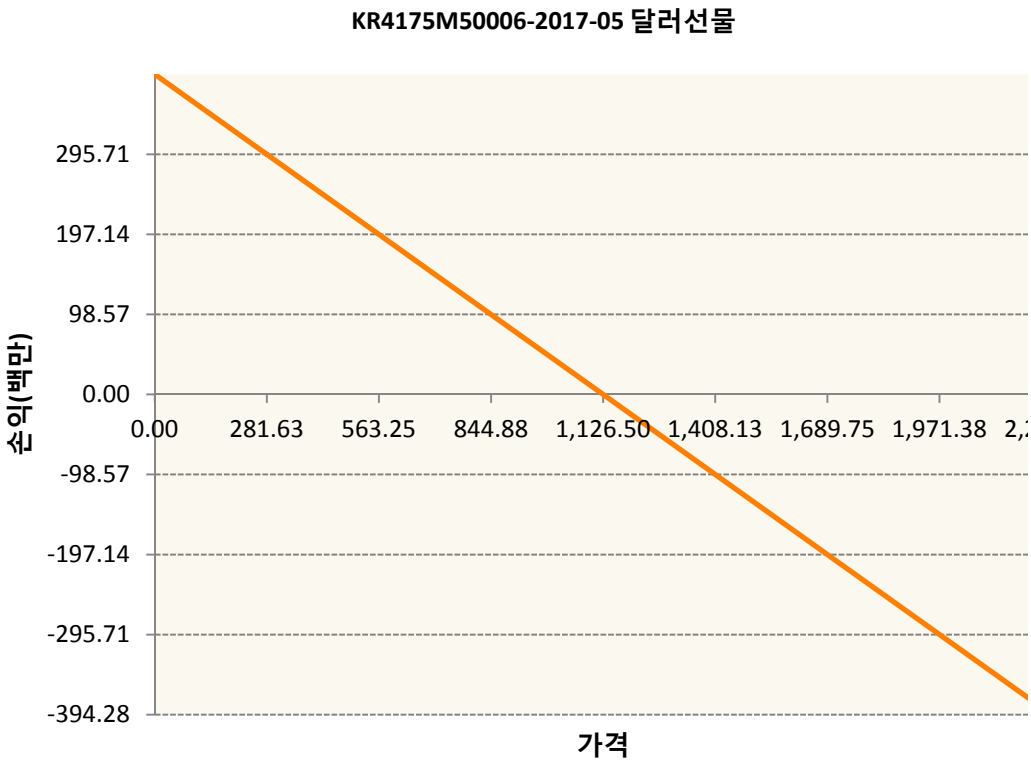


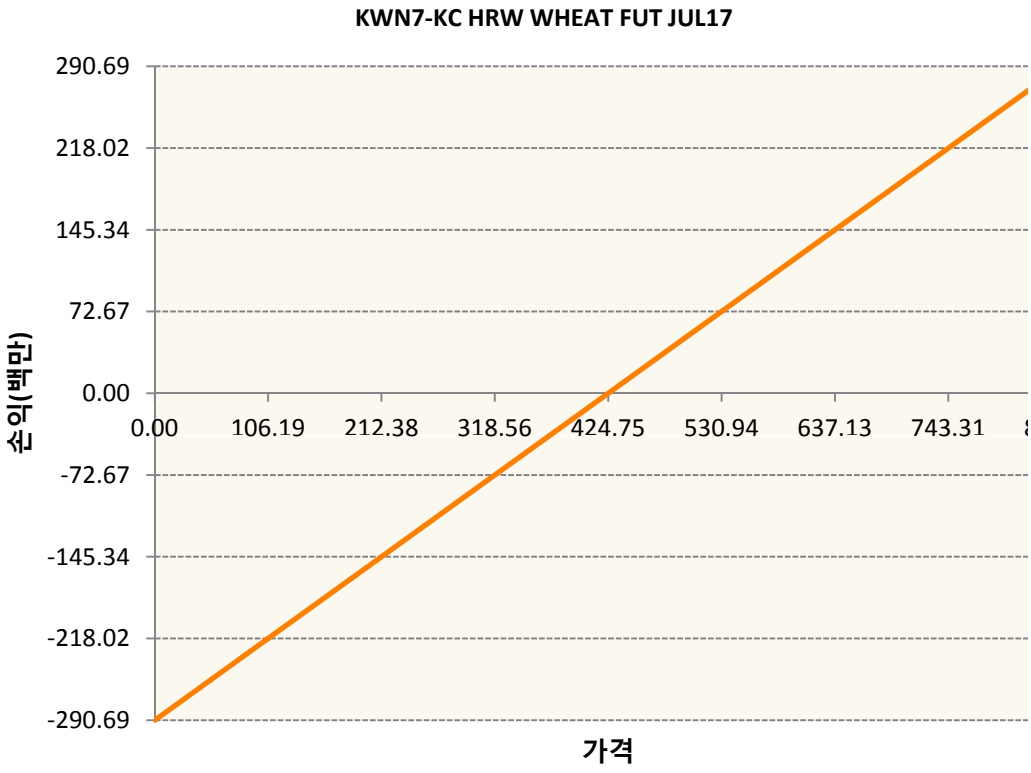

-1,812.01
-2,416.01
가격

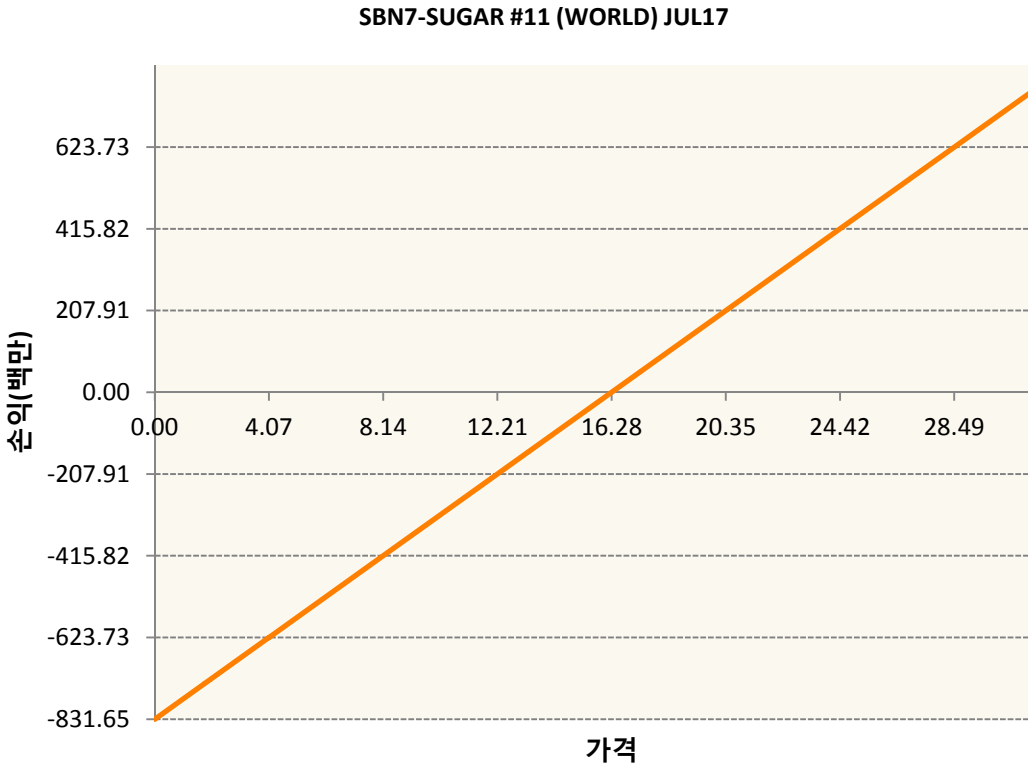

CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
406.93
305.20
203.46
101.73
0.00
-101.73
-203.46
-305.20
-406.93
0.00
19.84
39.68
59.52
79.36
99.20
119.04
138.88
순익(백만)
가격

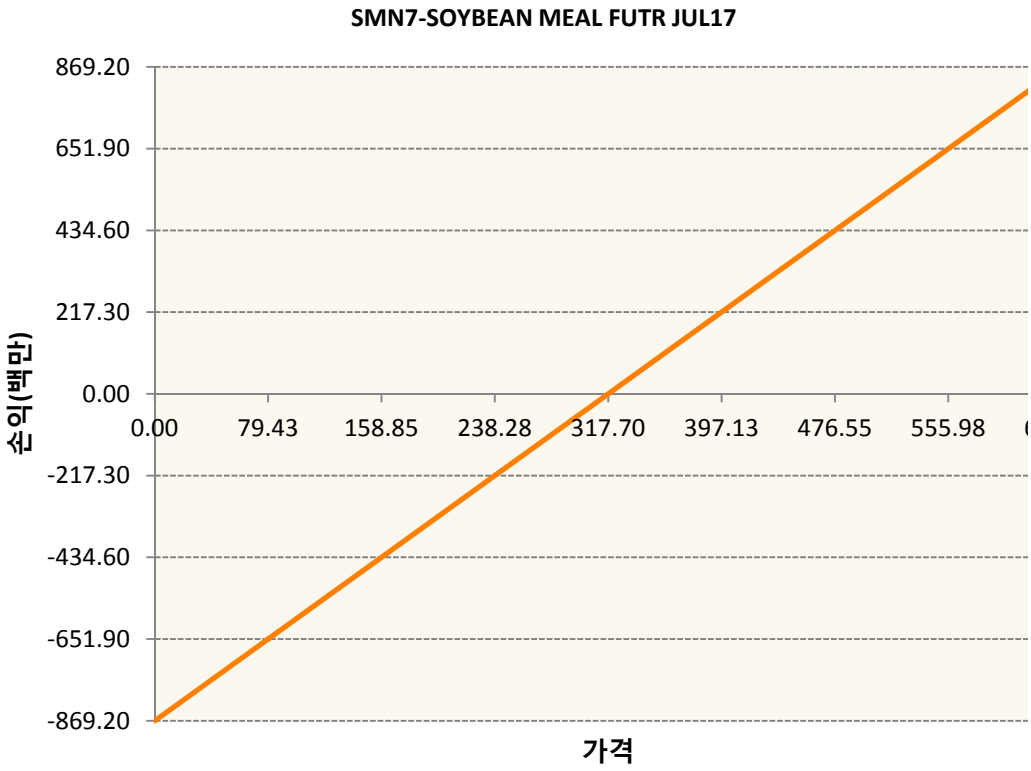

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
623.15
467.37
311.58
155.79
0.00
-155.79
-311.58
-467.37
-623.15
0.00
33.10
66.20
99.30
132.40
165.50
198.60
231.70
순익(백만)

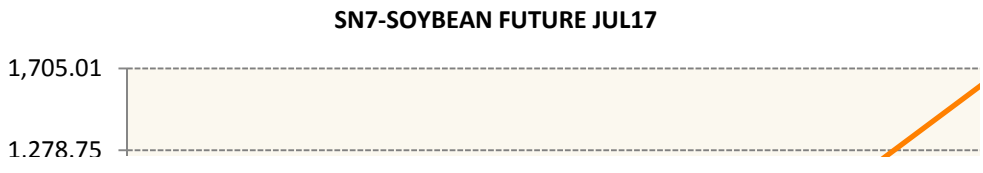
가격

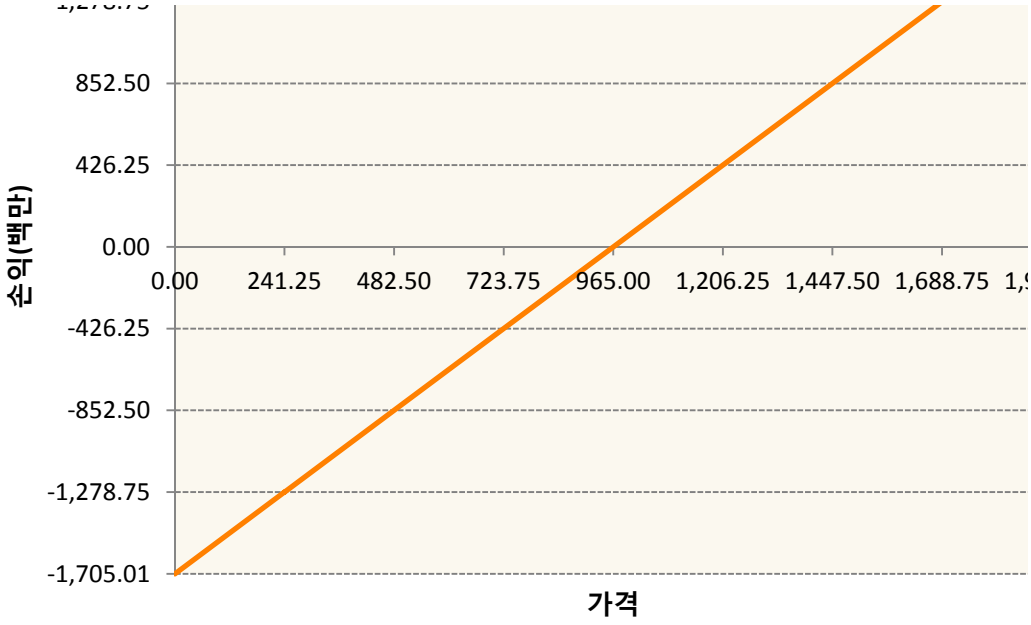

KR4175M50006-2017-05 달러선물
295.71
197.14
98.57
0.00
-98.57
-197.14
-295.71
-394.28
0.00
281.63
563.25
844.88
1,126.50
1,408.13
1,689.75
1,971.38
손익(백만)
가격

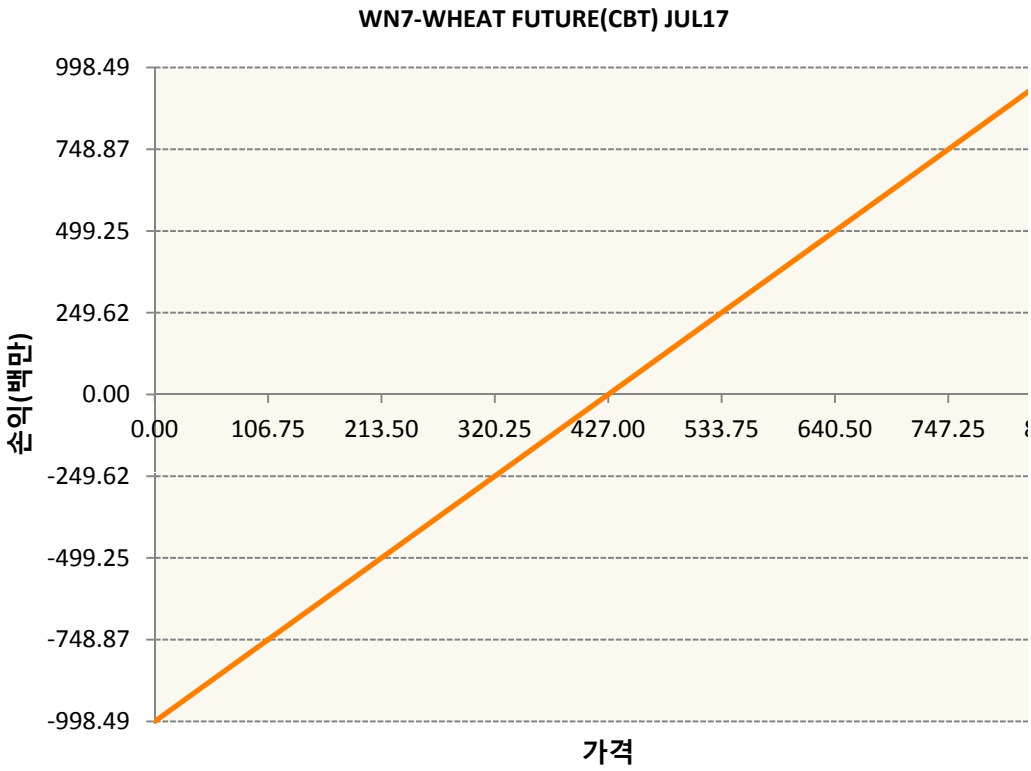

KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17
290.69
218.02
145.34
72.67
0.00
-72.67
-145.34
-218.02
-290.69
0.00
106.19
212.38
318.56
424.75
530.94
637.13
743.31
손익(백만)
가격


SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
623.73
415.82
207.91
0.00
-207.91
-415.82
-623.73
-831.65
0.00
4.07
8.14
12.21
16.28
20.35
24.42
28.49
손익(백만)
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
869.20
651.90
434.60
217.30
0.00
-217.30
-434.60
-651.90
-869.20
0.00
79.43
158.85
238.28
317.70
397.13
476.55
555.98
손익(백만)
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,705.01
1,278.75





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	61
CN7	CORN FUTURE JUL17	193
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	33
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	136
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	80

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

808