공시일	2017-04-28
기준일	2017-04-27

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	2017-04-28
기준일	2017-04-27

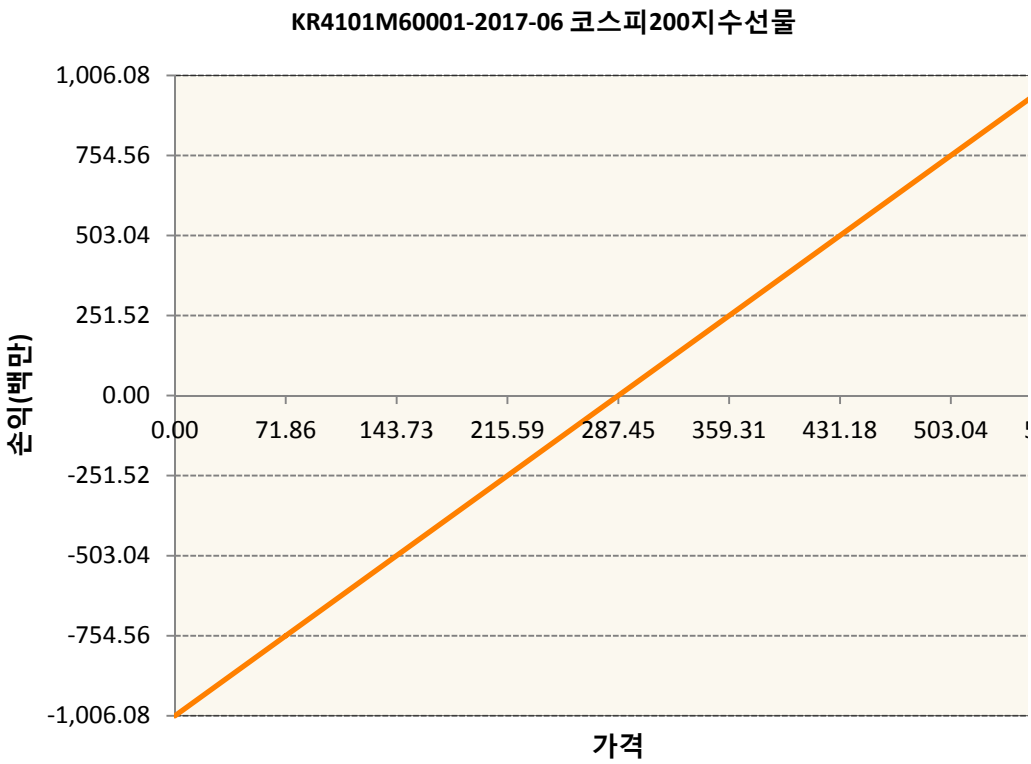
스마트인덱스모

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	1,006	0	1,006	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	2017-04-28
기준일	2017-04-27

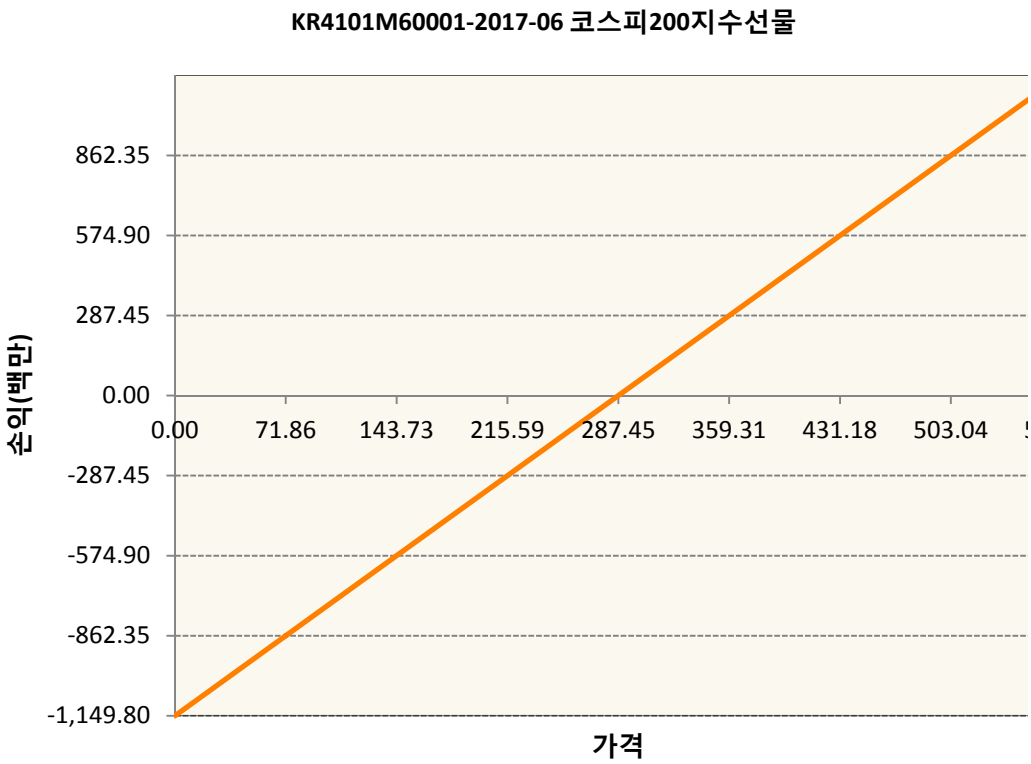
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	72	-72	장내
누계	유가증권	선물	1,150	0	1,150	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							92
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
-5.33%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61
-2.67%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	31	31	31	31	31	31	31
5.33%	61	61	61	61	61	61	61
8.00%	92	92	92	92	92	92	92

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

59

공시일	2017-04-28
기준일	2017-04-27

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	2017-04-28
기준일	2017-04-27

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	376

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

383

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-04-28
기준일	2017-04-27

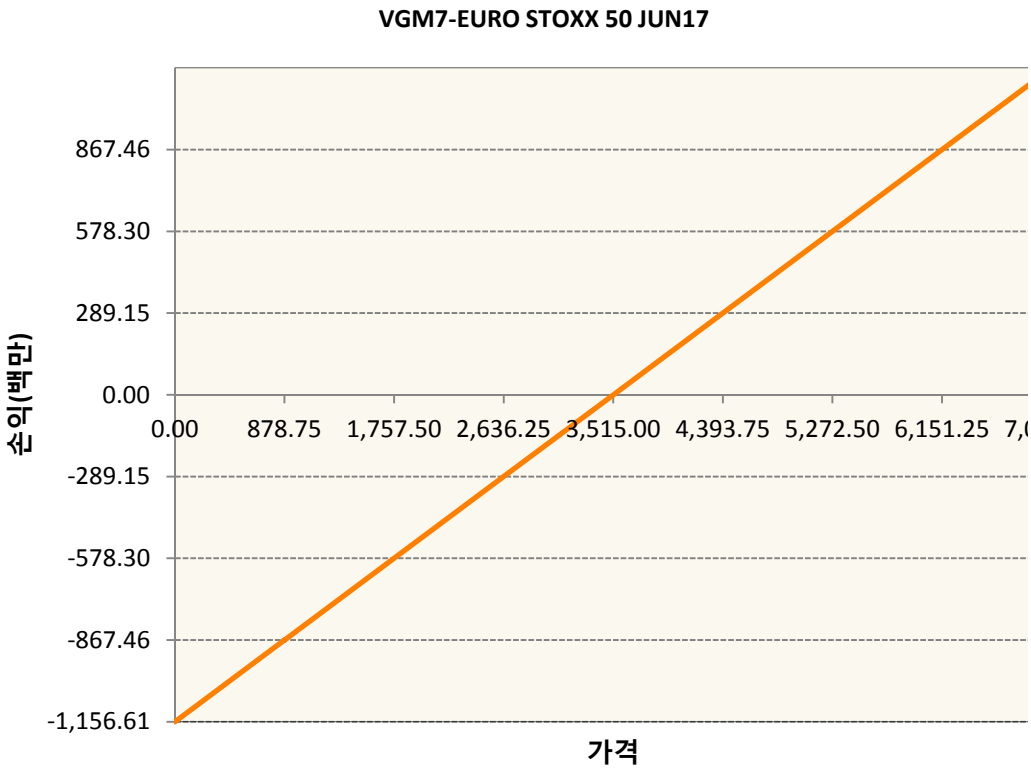
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,157	0	1,157	

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	2017-04-28
기준일	2017-04-27

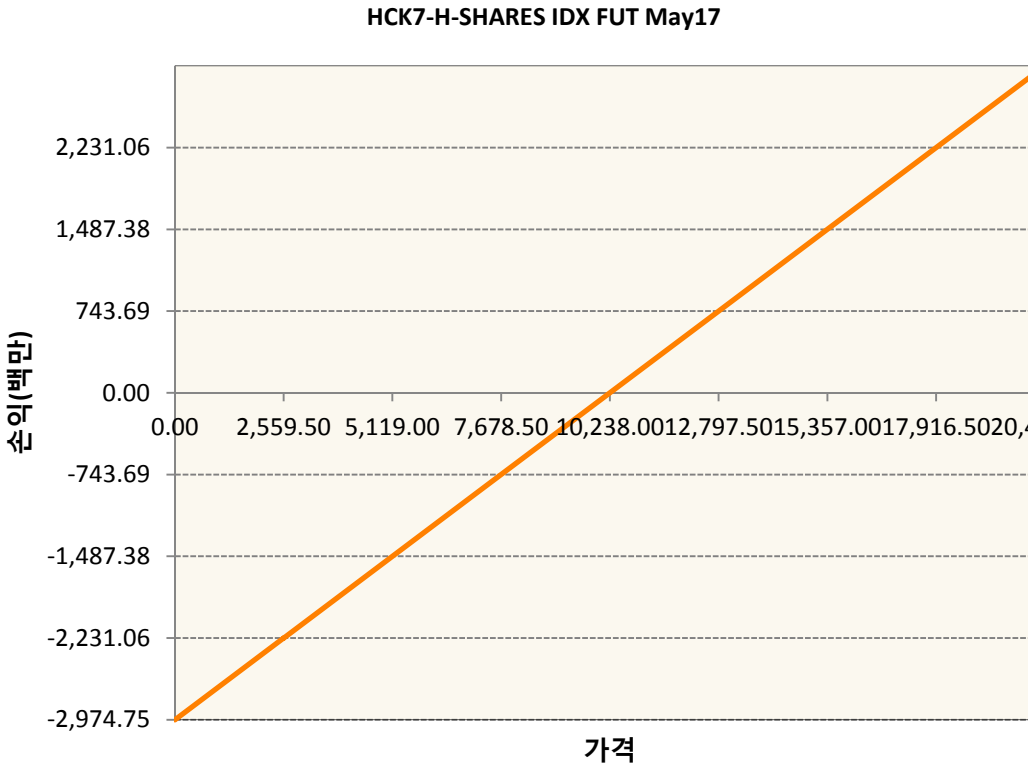
차이나인덱스모(주식-파생형)

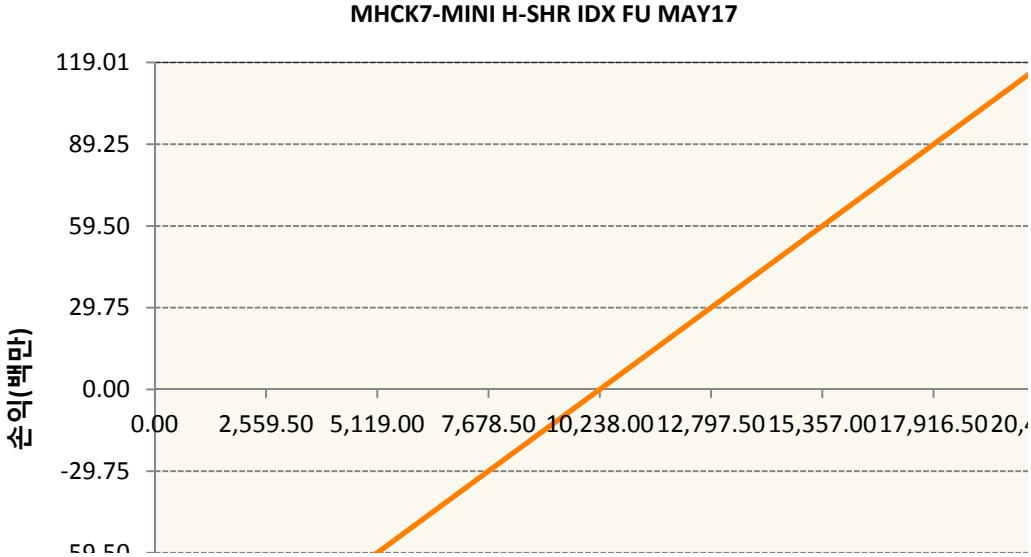
1. 계약금액

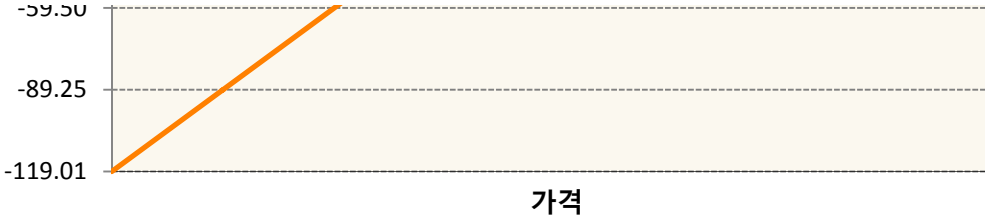
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,094	0	3,094	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCK7	H-SHARES IDX FUT May17	238
MHCK7	MINI H-SHR IDX FU MAY17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	264

공시일	2017-04-28
기준일	2017-04-27

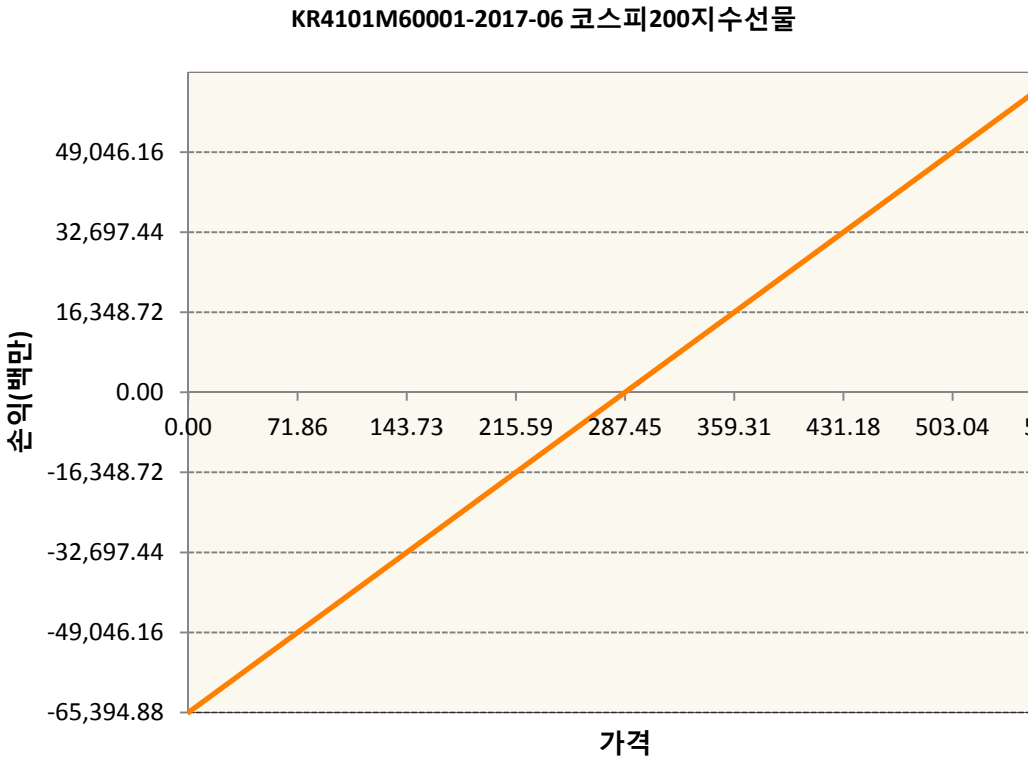
커버드콜모(주식혼합-파생형)

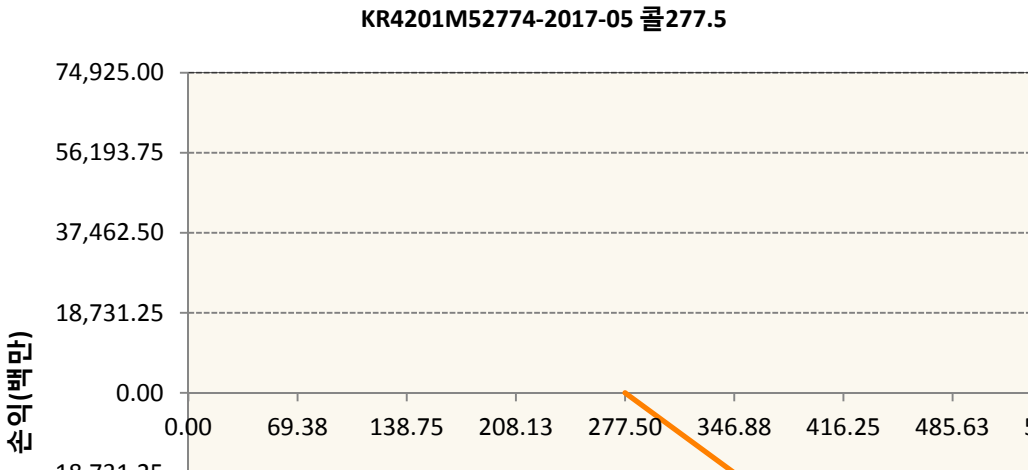
1. 계약금액

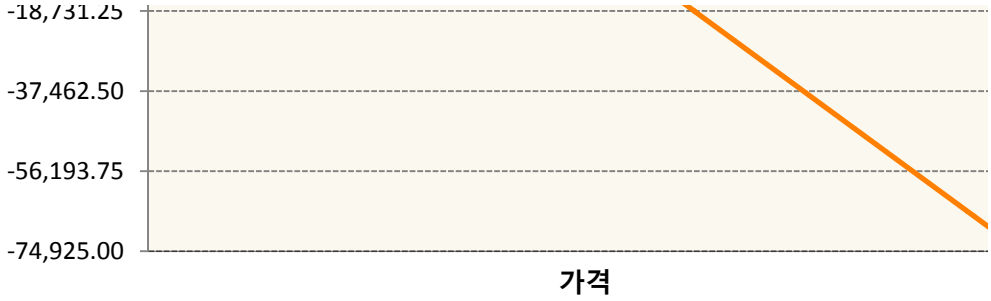
(단위:백만원)

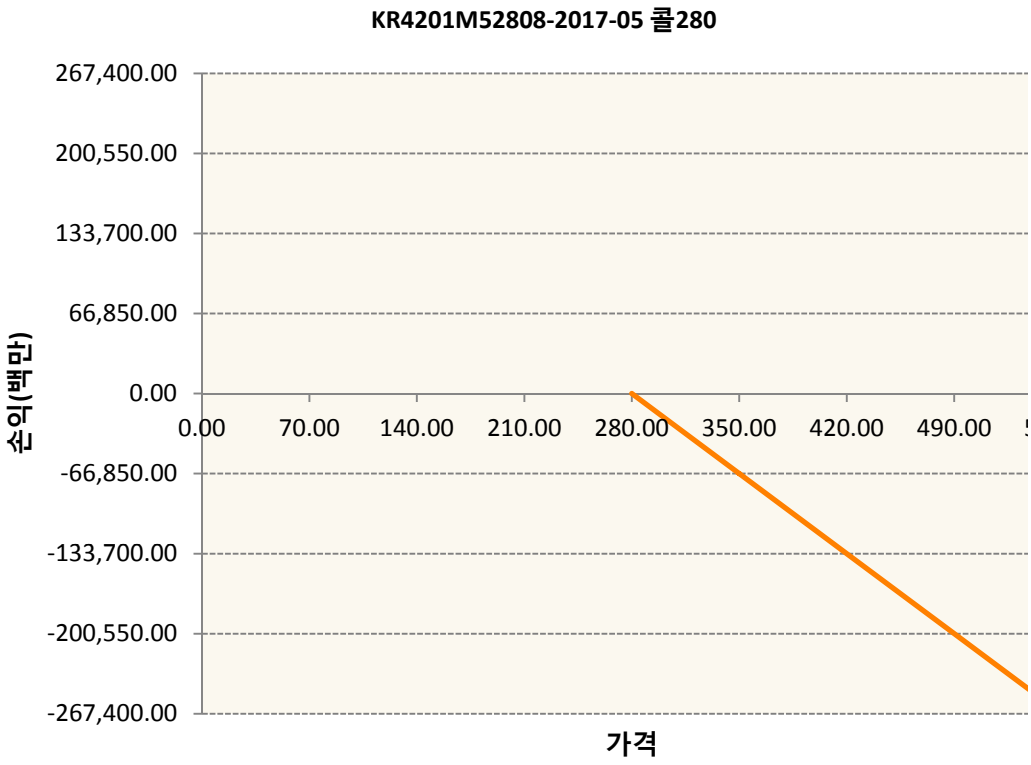
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	7,009	-7,009	장내
누계	유가증권	선물	65,395	0	65,395	장내
누계	유가증권	옵션	0	418,825	-418,825	장내

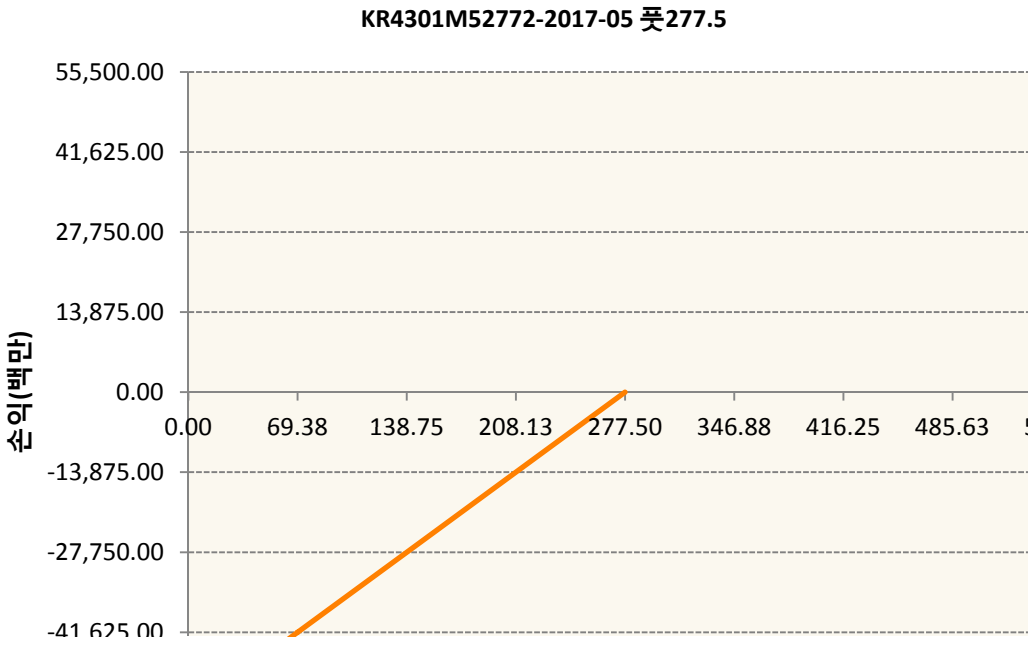
2. 만기시점의 손익구조



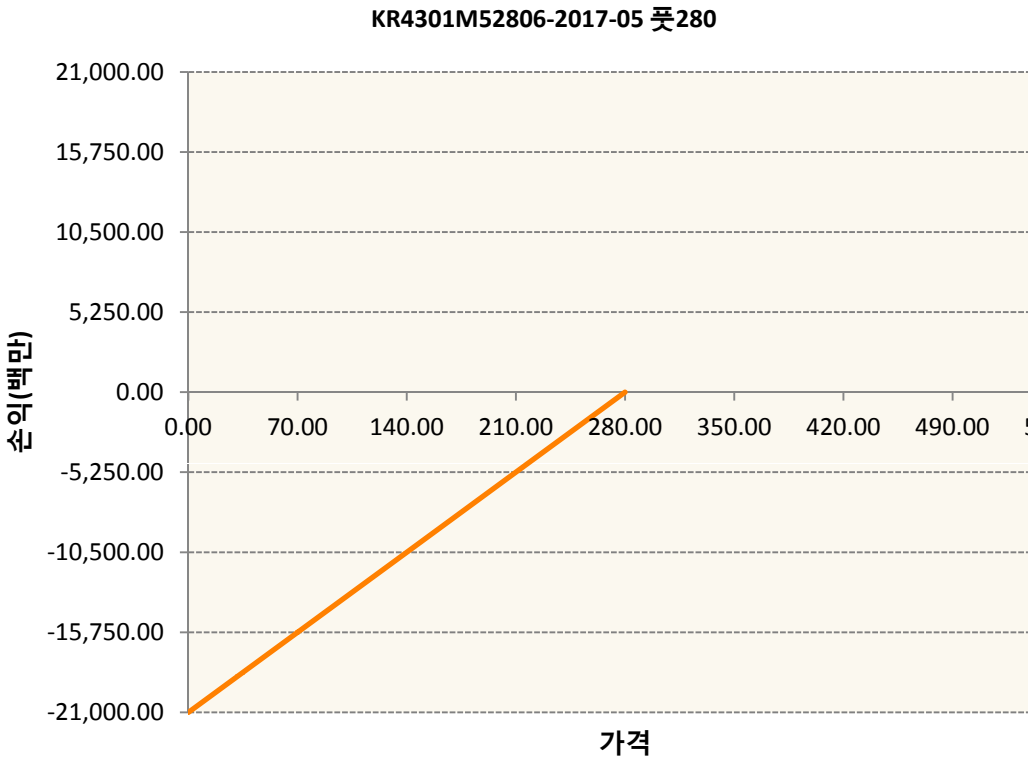



-18,731.25
-37,462.50
-56,193.75
-74,925.00
가격


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							5,230
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,230	-5,230	-5,230	-5,230	-5,230	-5,230	-5,230
-5.33%	-3,486	-3,486	-3,486	-3,486	-3,486	-3,486	-3,486
-2.67%	-1,743	-1,743	-1,743	-1,743	-1,743	-1,743	-1,743
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,743	1,743	1,743	1,743	1,743	1,743	1,743
5.33%	3,486	3,486	3,486	3,486	3,486	3,486	3,486
8.00%	5,230	5,230	5,230	5,230	5,230	5,230	5,230
KR4201M52 2017-05 콜277.5							6,162
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,690	2,688	2,686	2,682	2,677	2,669	2,659
-5.33%	2,623	2,595	2,564	2,529	2,492	2,453	2,412
-2.67%	1,851	1,801	1,750	1,699	1,647	1,594	1,542

0%	33	25	14	0	-18	-38	-62
2.67%	-2,027	-2,027	-2,027	-2,028	-2,030	-2,032	-2,036
5.33%	-4,094	-4,094	-4,094	-4,094	-4,094	-4,094	-4,095
8.00%	-6,162	-6,162	-6,162	-6,162	-6,162	-6,162	-6,162
	KR4201M52	2017-05 콜280					21,585
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,338	7,337	7,335	7,330	7,322	7,309	7,291
-5.33%	7,269	7,221	7,159	7,084	6,998	6,901	6,794
-2.67%	5,739	5,544	5,349	5,154	4,958	4,763	4,568
0%	241	174	94	0	-105	-220	-344
2.67%	-6,960	-6,962	-6,968	-6,977	-6,992	-7,014	-7,044
5.33%	-14,272	-14,272	-14,272	-14,272	-14,273	-14,274	-14,277
8.00%	-21,585	-21,585	-21,585	-21,585	-21,585	-21,585	-21,585
	KR4301M52	2017-05 풋277.5					2,625
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,602	-2,603	-2,605	-2,608	-2,612	-2,617	-2,625
-5.33%	-1,120	-1,140	-1,164	-1,189	-1,217	-1,246	-1,276
-2.67%	-161	-197	-235	-273	-312	-350	-389
0%	24	19	11	0	-13	-28	-46
2.67%	30	30	30	29	28	26	23
5.33%	30	30	30	30	30	30	30
8.00%	30	30	30	30	30	30	30
	KR4301M52	2017-05 풋280					1,150
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,147	-1,147	-1,147	-1,147	-1,148	-1,149	-1,150
-5.33%	-578	-582	-586	-592	-599	-607	-615
-2.67%	-124	-139	-154	-170	-185	-200	-216
0%	19	14	7	0	-8	-17	-27
2.67%	28	28	27	26	25	23	21
5.33%	28	28	28	28	28	28	27
8.00%	28	28	28	28	28	28	28

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

39,186

공시일	2017-04-28
기준일	2017-04-27

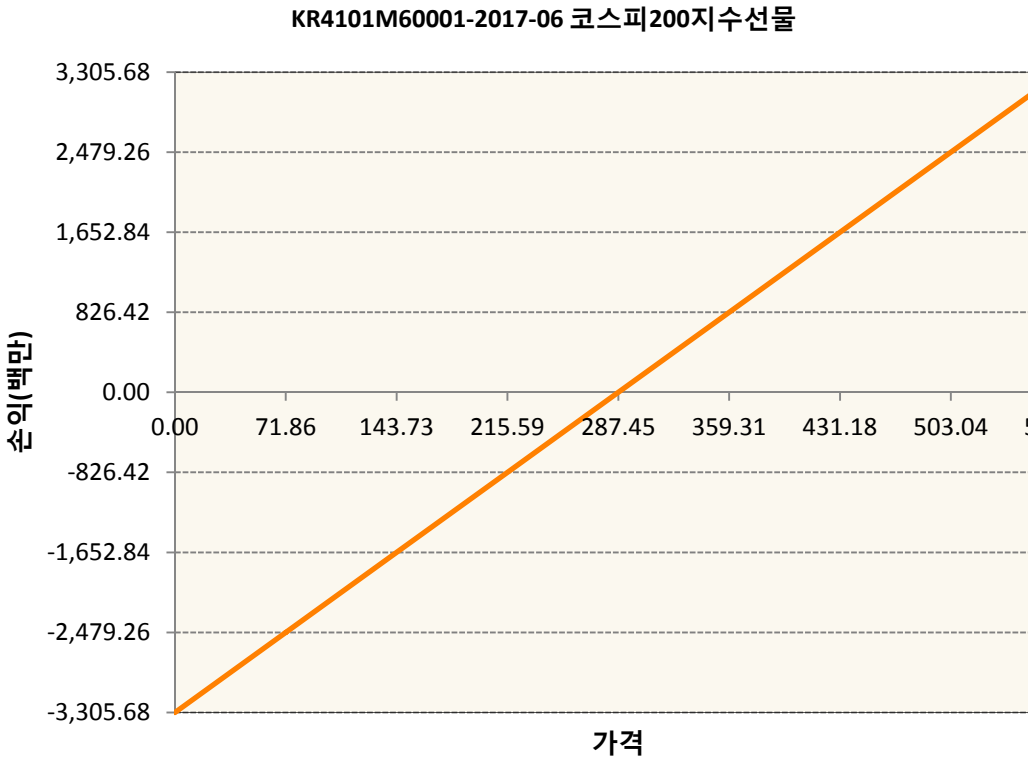
커버드콜목표전환형증권투자신탁

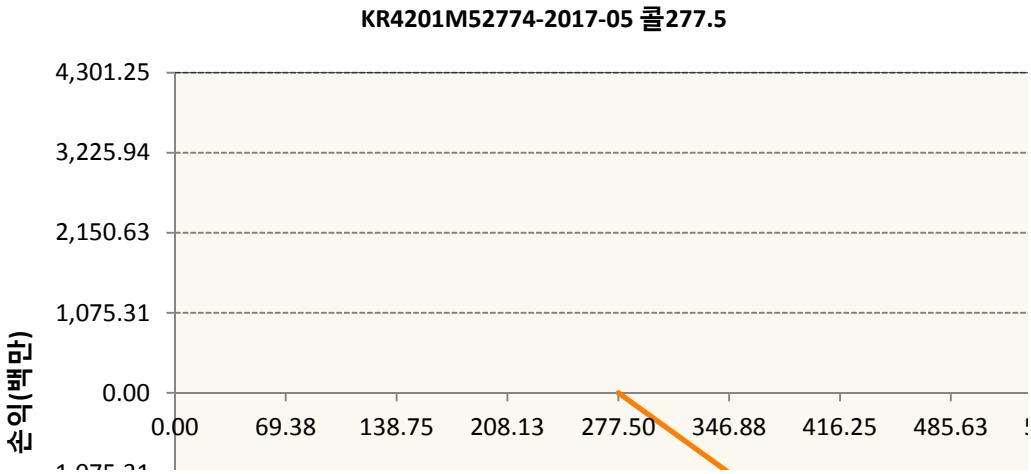
1. 계약금액

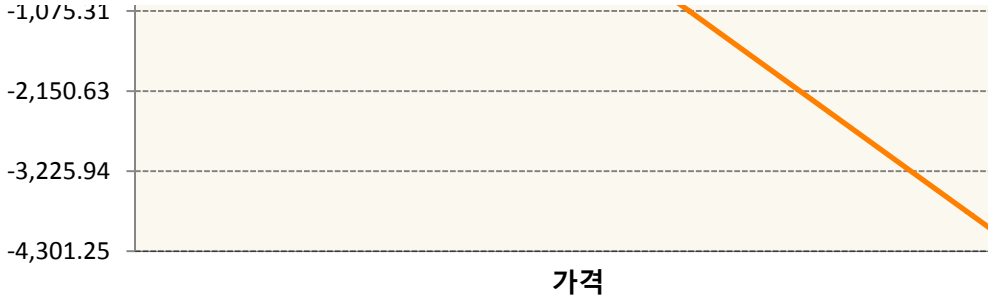
(단위:백만원)

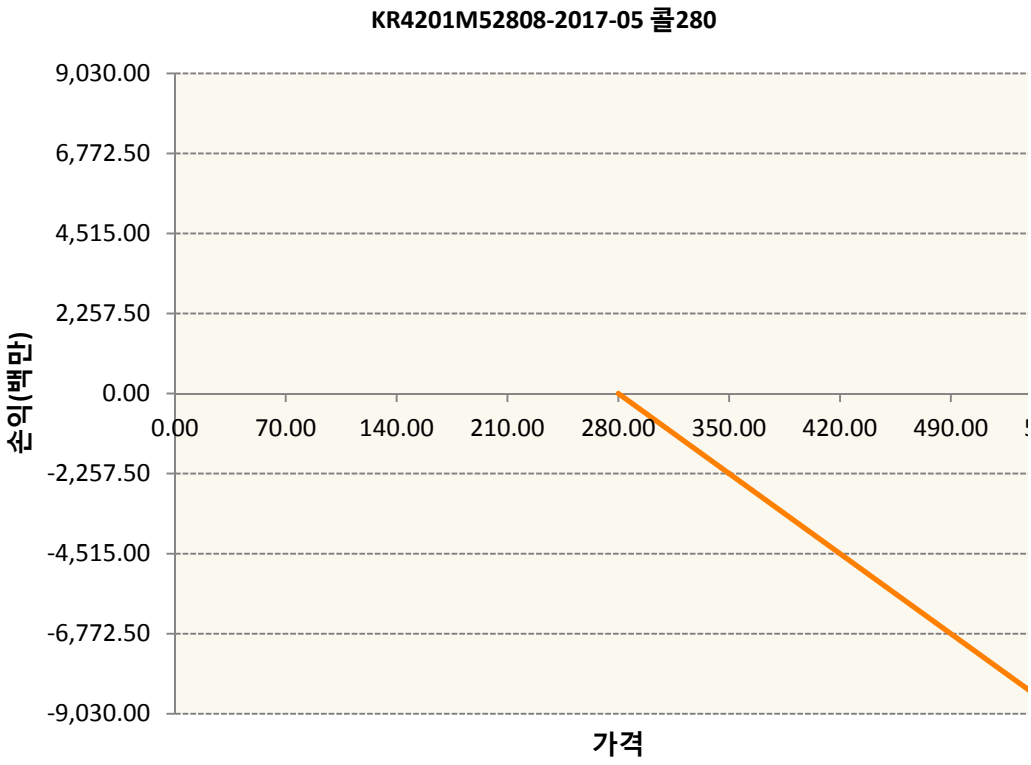
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	287	-287	장내
신규	유가증권	옵션	268	0	268	장내
누계	유가증권	선물	3,306	0	3,306	장내
누계	유가증권	옵션	0	13,331	-13,331	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							264
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-264	-264	-264	-264	-264	-264	-264
-5.33%	-176	-176	-176	-176	-176	-176	-176
-2.67%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	88	88	88	88	88	88	88
5.33%	176	176	176	176	176	176	176
8.00%	264	264	264	264	264	264	264
KR4201M52 2017-05 콜277.5							354
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	154	154	154	154	154	153	153
-5.33%	151	149	147	145	143	141	138
-2.67%	106	103	100	98	95	92	89
0%	2	1	1	0	-1	-2	-4
2.67%	-116	-116	-116	-116	-117	-117	-117
5.33%	-235	-235	-235	-235	-235	-235	-235
8.00%	-354	-354	-354	-354	-354	-354	-354
KR4201M52(	2017-05 콜280						729

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	248	248	248	248	247	247	246
-5.33%	245	244	242	239	236	233	229
-2.67%	194	187	181	174	167	161	154
0%	8	6	3	0	-4	-7	-12
2.67%	-235	-235	-235	-236	-236	-237	-238
5.33%	-482	-482	-482	-482	-482	-482	-482
8.00%	-729	-729	-729	-729	-729	-729	-729

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

1,459

공시일	2017-04-28
기준일	2017-04-27

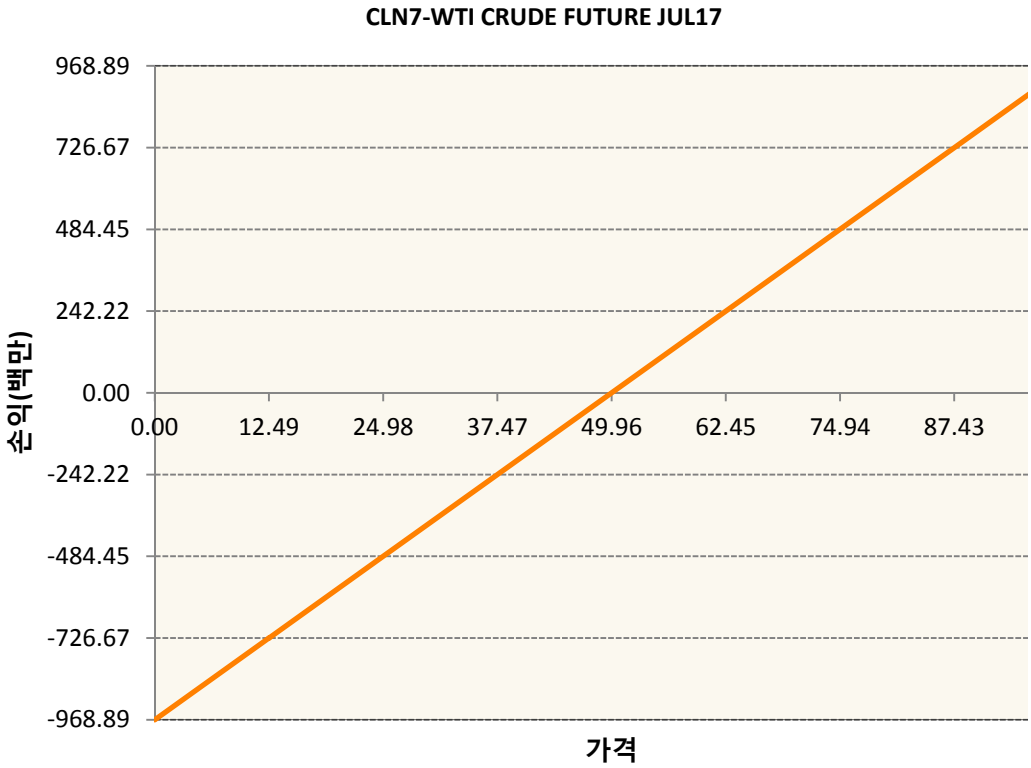
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

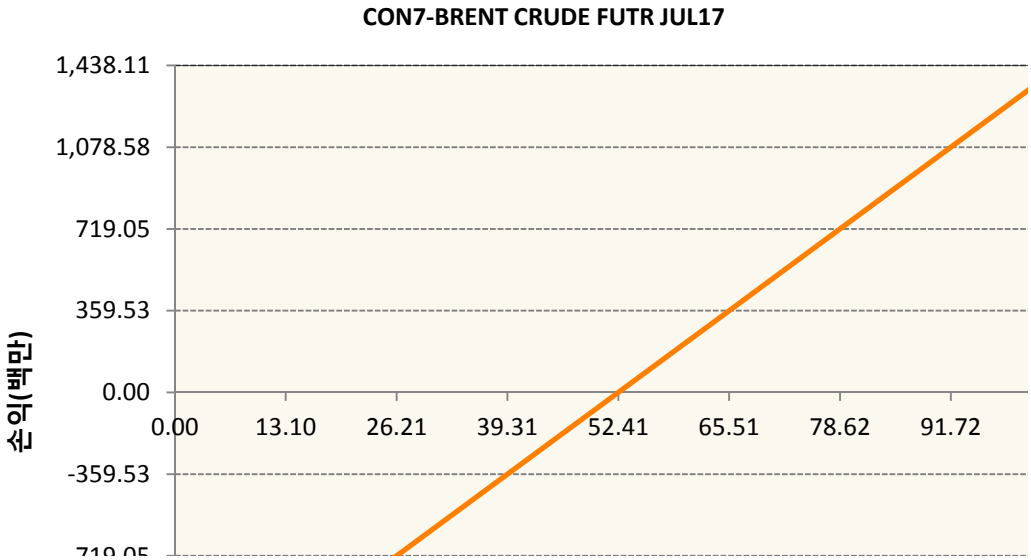
1. 계약금액

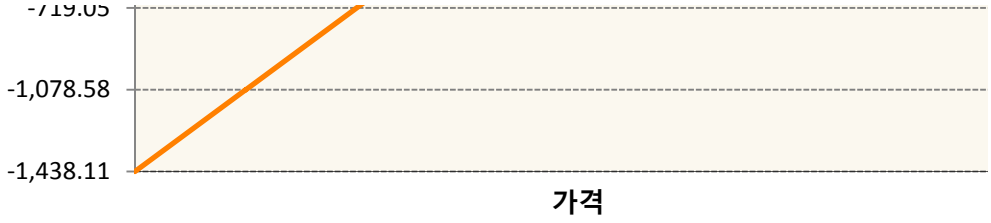
(단위:백만원)

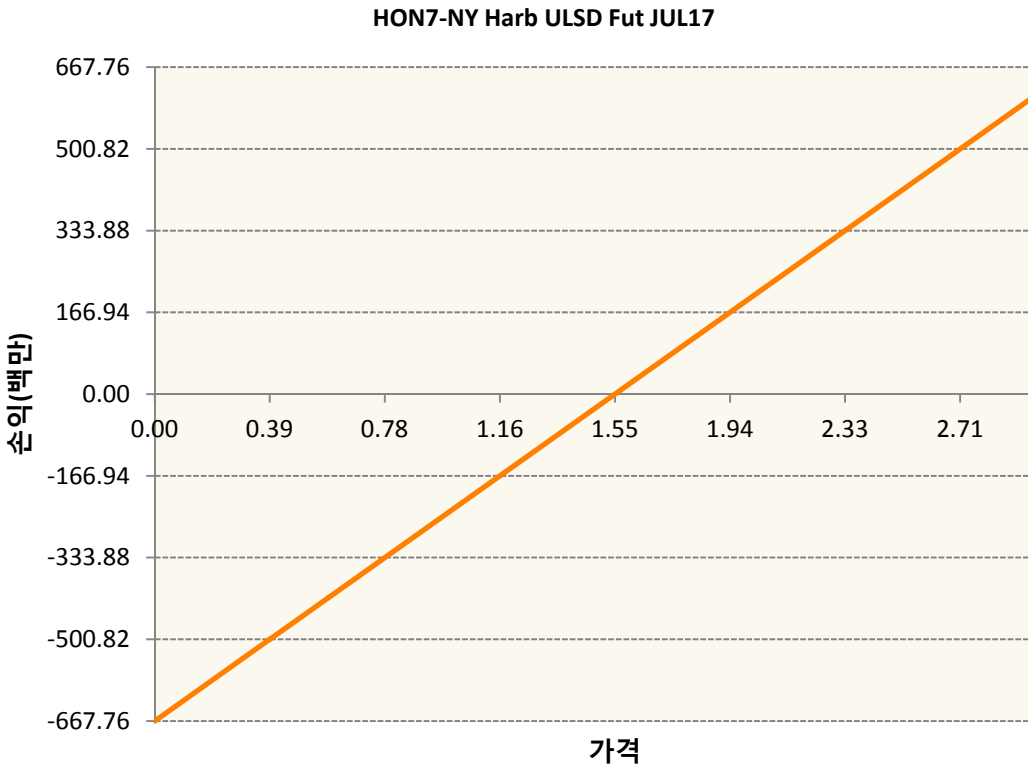
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,329	407	4,923	

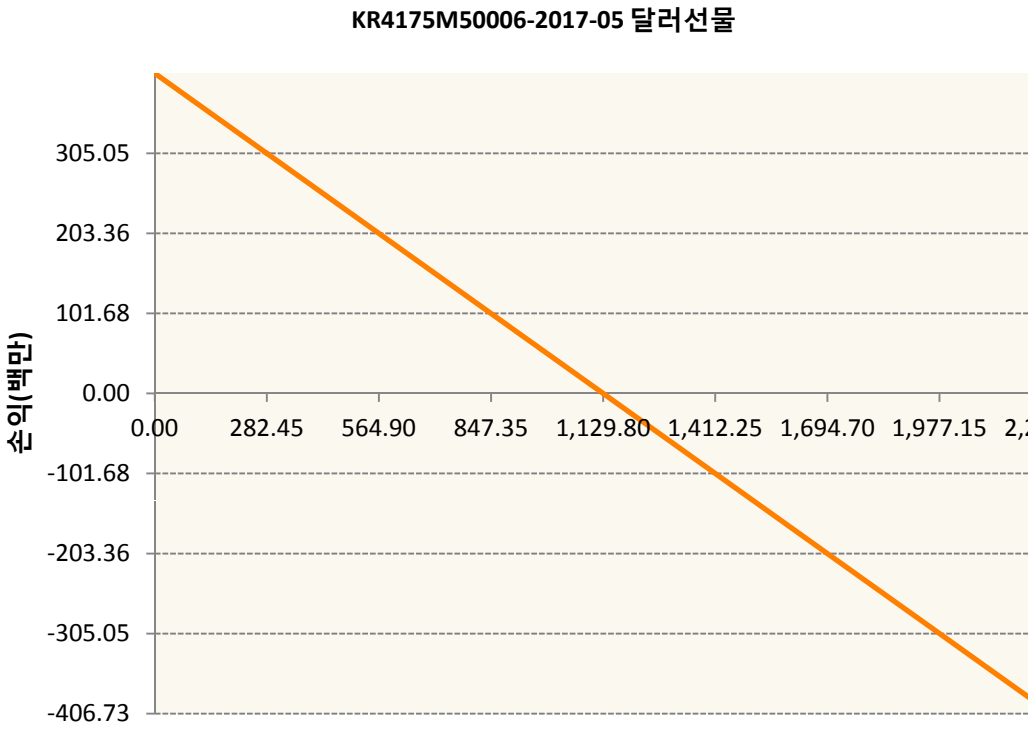
2. 만기시점의 손익구조



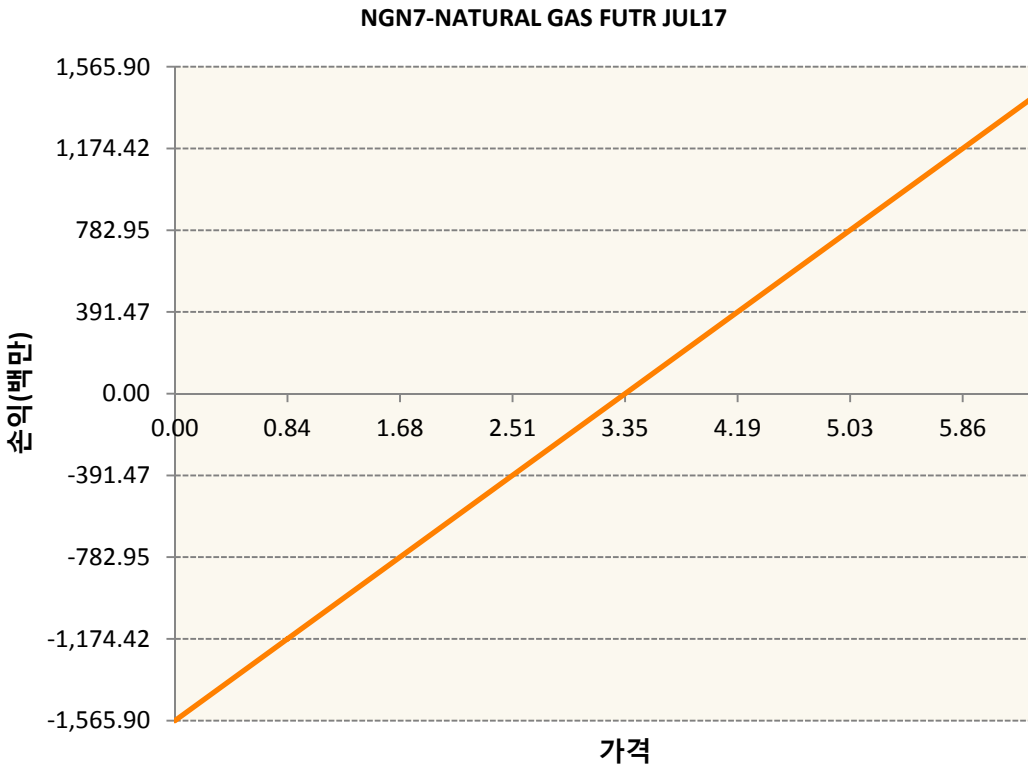


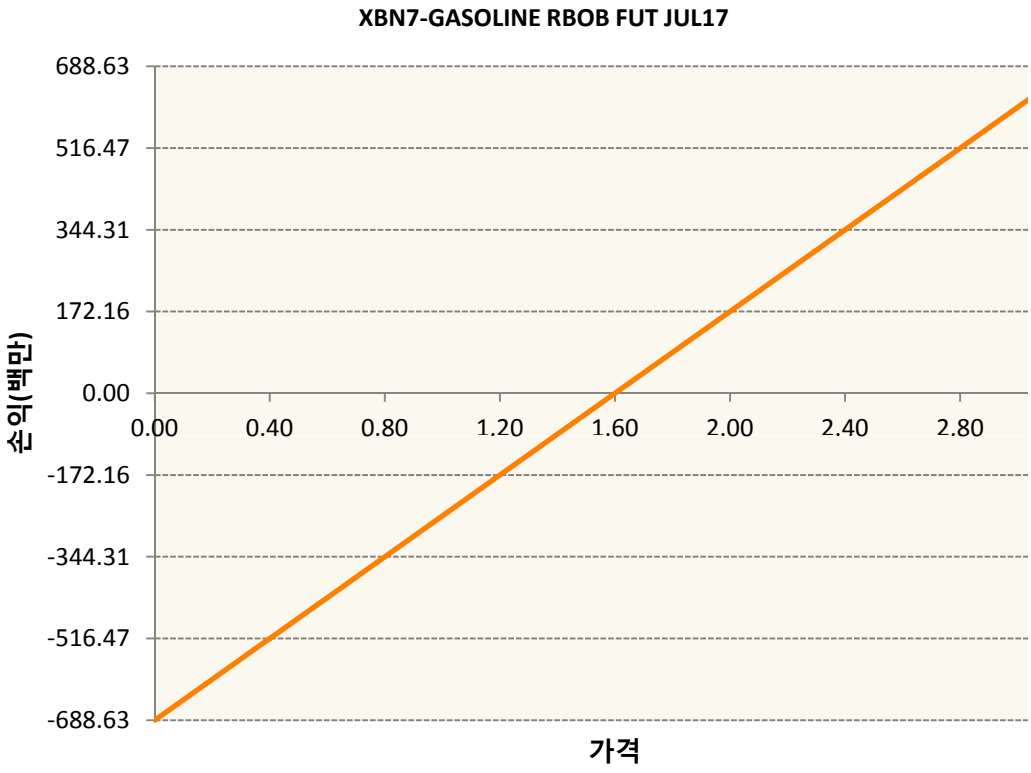

-719.05
-1,078.58
-1,438.11
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
667.76
500.82
333.88
166.94
0.00
-166.94
-333.88
-500.82
-667.76
0.00
0.39
0.78
1.16
1.55
1.94
2.33
2.71
순이익(백만)
가격


KR4175M50006-2017-05 달러선물
305.05
203.36
101.68
0.00
-101.68
-203.36
-305.05
-406.73
0.00
282.45
564.90
847.35
1,129.80
1,412.25
1,694.70
1,977.15
순이익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,565.90
1,174.42
782.95
391.47
0.00
-391.47
-782.95
-1,174.42
-1,565.90
0.00
0.84
1.68
2.51
3.35
4.19
5.03
5.86
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
688.63
516.47
344.31
172.16
0.00
-172.16
-344.31
-516.47
-688.63
0.00
0.40
0.80
1.20
1.60
2.00
2.40
2.80
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	53
KR4175M50(	2017-05 달러선물	33
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	125
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	55

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

928

공시일	2017-04-28
기준일	2017-04-27

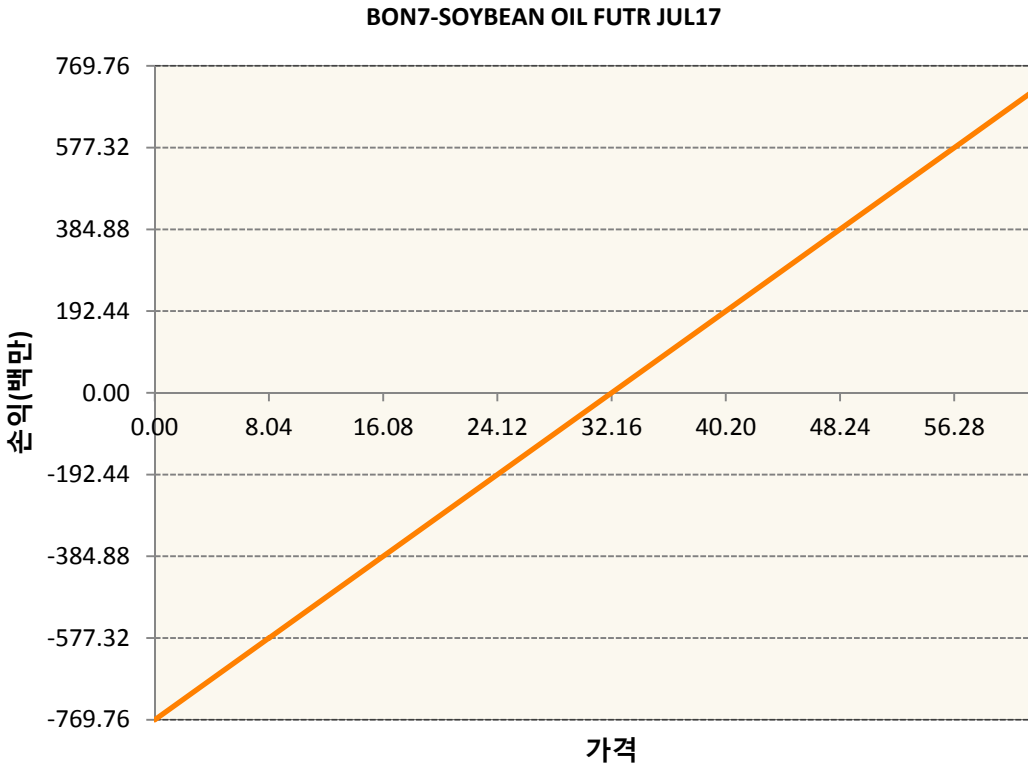
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

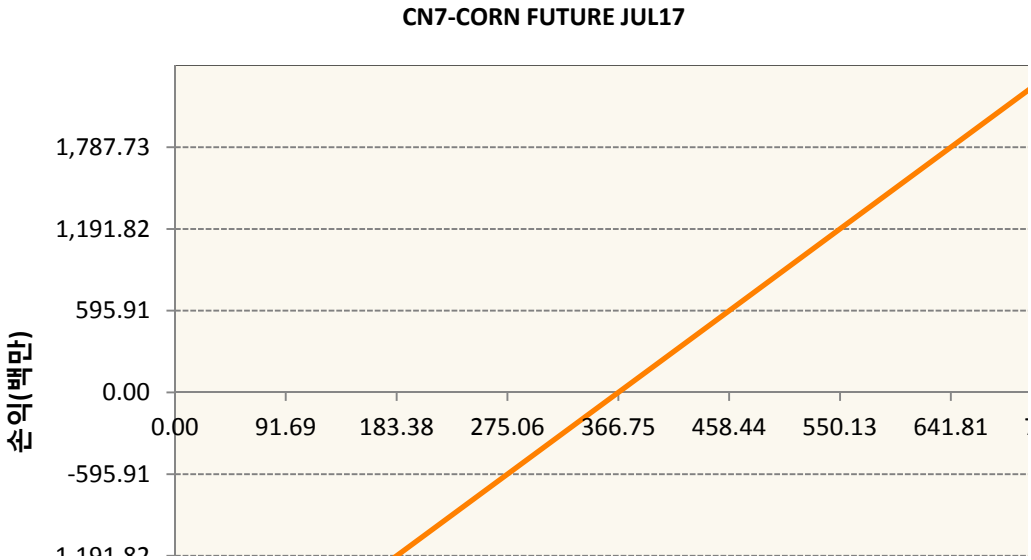
1. 계약금액

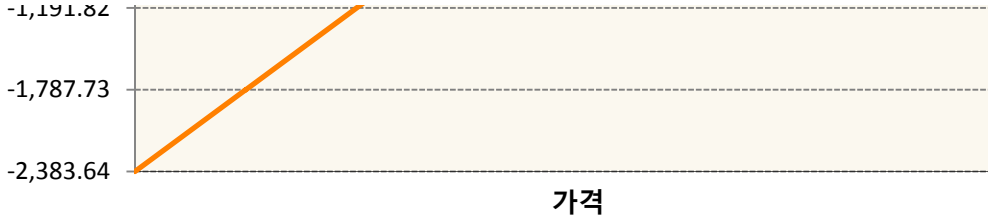
(단위:백만원)

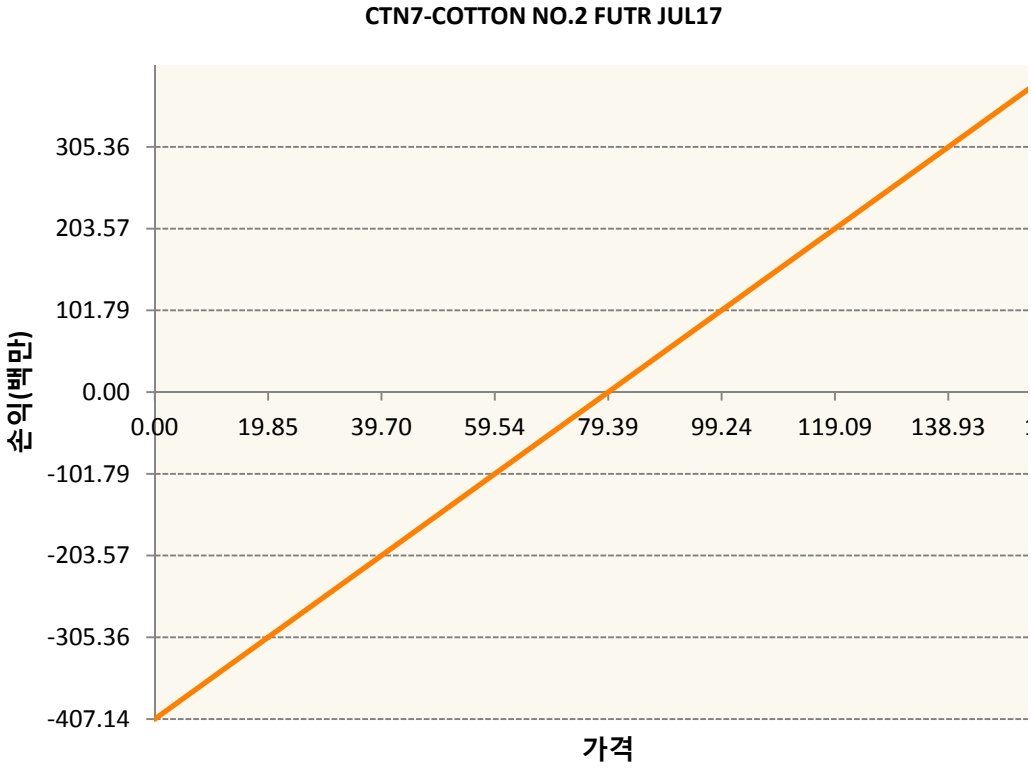
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,808	395	8,412	

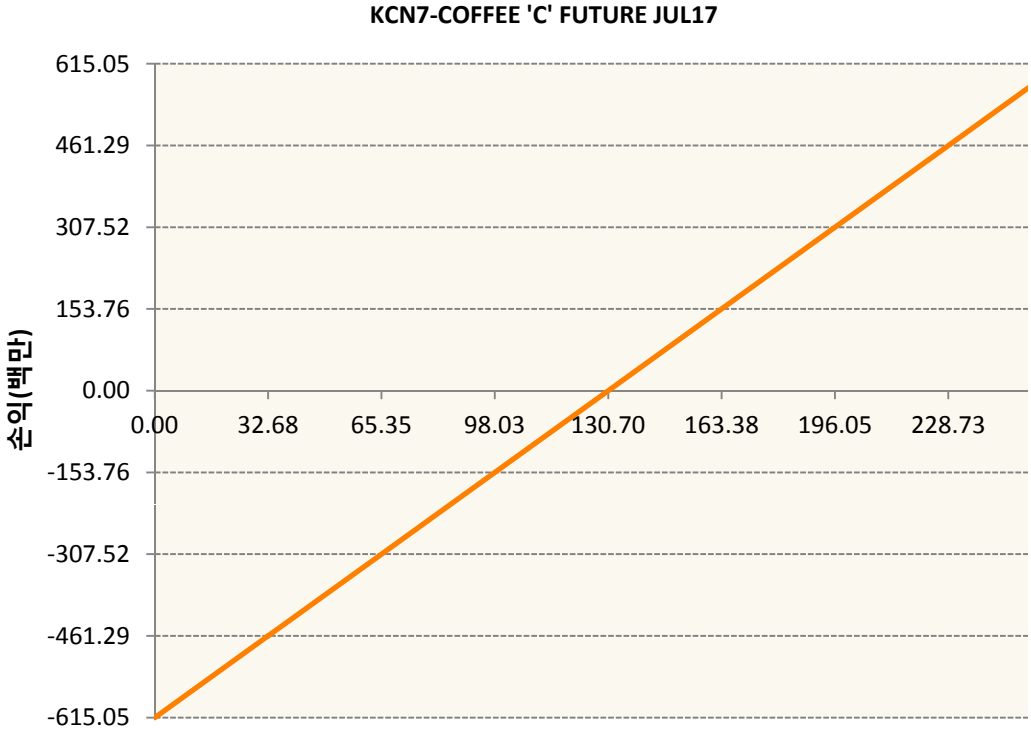
2. 만기시점의 손익구조





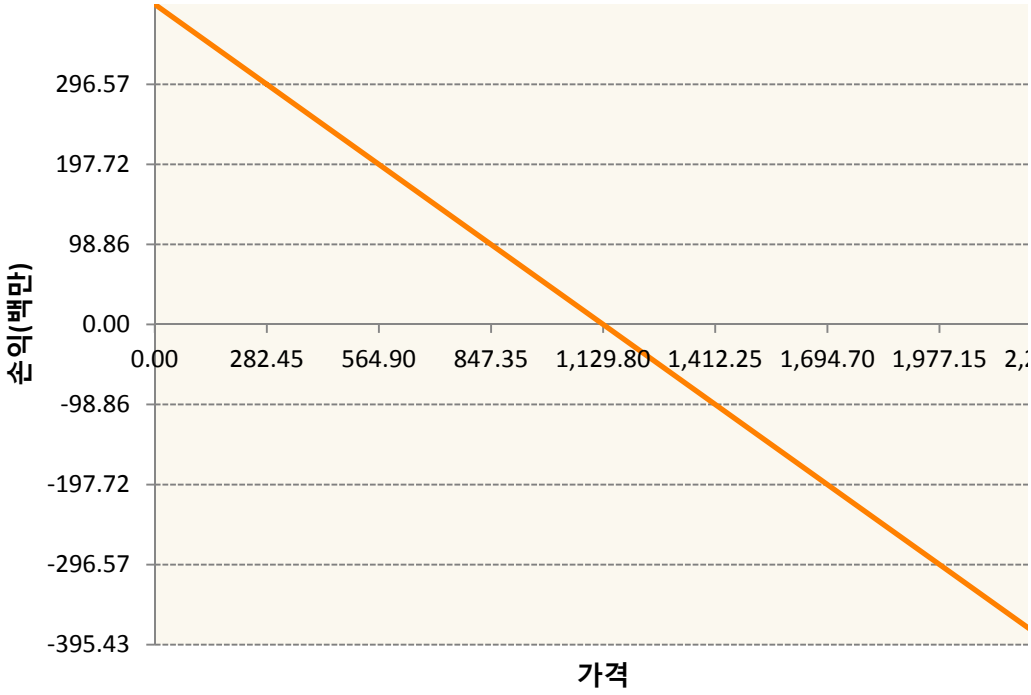

-1,787.73
-2,383.64
가격


CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
305.36
203.57
101.79
0.00
-101.79
-203.57
-305.36
-407.14
0.00
19.85
39.70
59.54
79.39
99.24
119.09
138.93
순익(백만)
가격

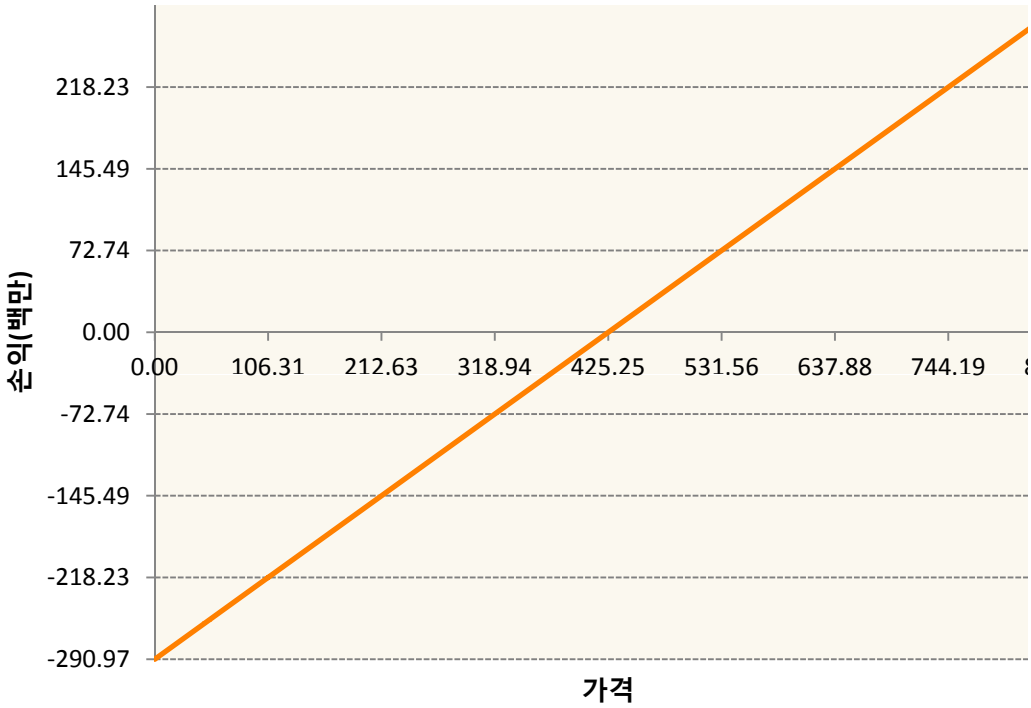

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
615.05
461.29
307.52
153.76
0.00
-153.76
-307.52
-461.29
-615.05
0.00
32.68
65.35
98.03
130.70
163.38
196.05
228.73
순익(백만)

가격

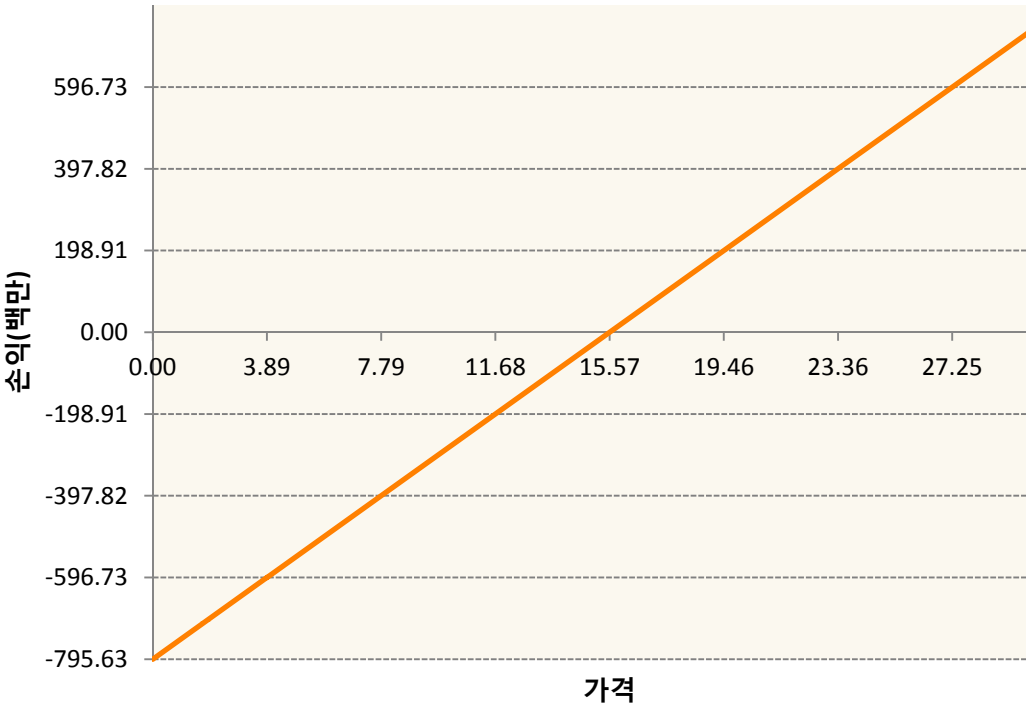
KR4175M50006-2017-05 달러선물



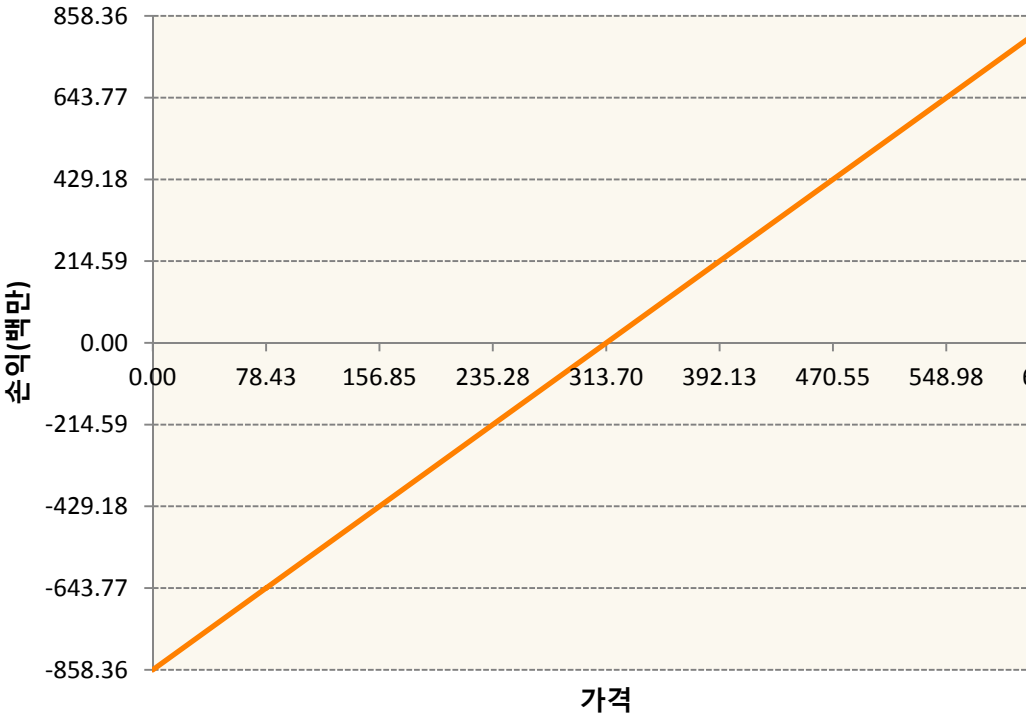
KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17



SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17

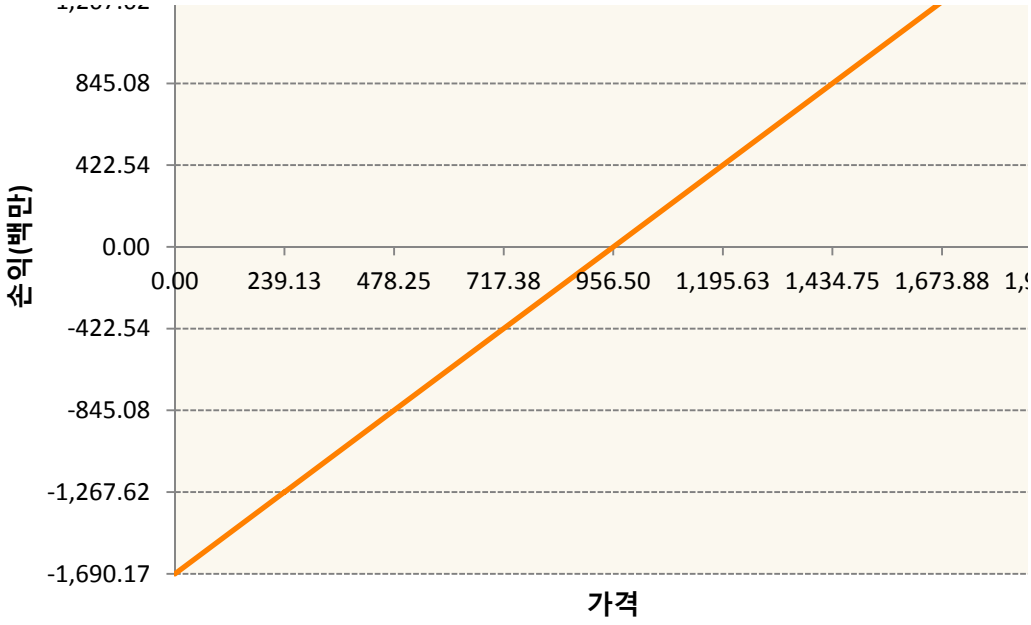


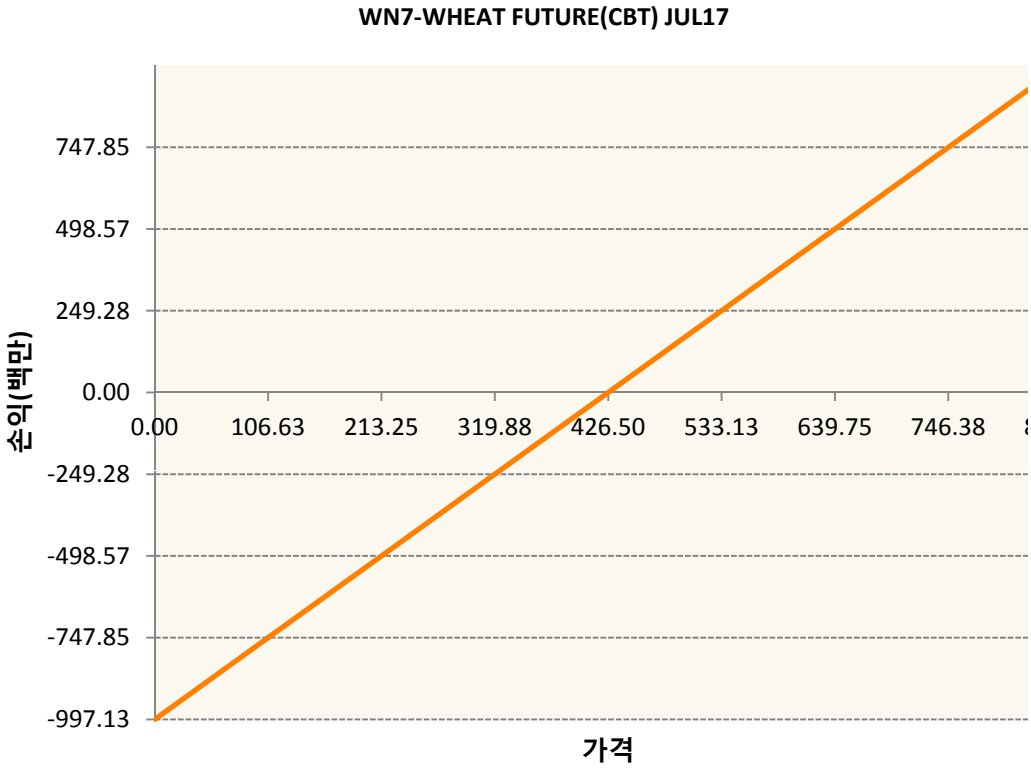
SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17



SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	62
CN7	CORN FUTURE JUL17	191
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	33
KCN7	COFFEE 'C' FUTURE JUL17	49
KR4175M50(	2017-05 달러선물	32

KWN7	KC HRW WHEAT FUT JUL17	23
SBN7	SUGAR #11 (WORLD) JUL17	64
SMN7	SOYBEAN MEAL FUTR JUL17	69
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	135
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	80

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

799