공시일	2017-05-02
기준일	2017-04-28

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	2017-05-02
기준일	2017-04-28

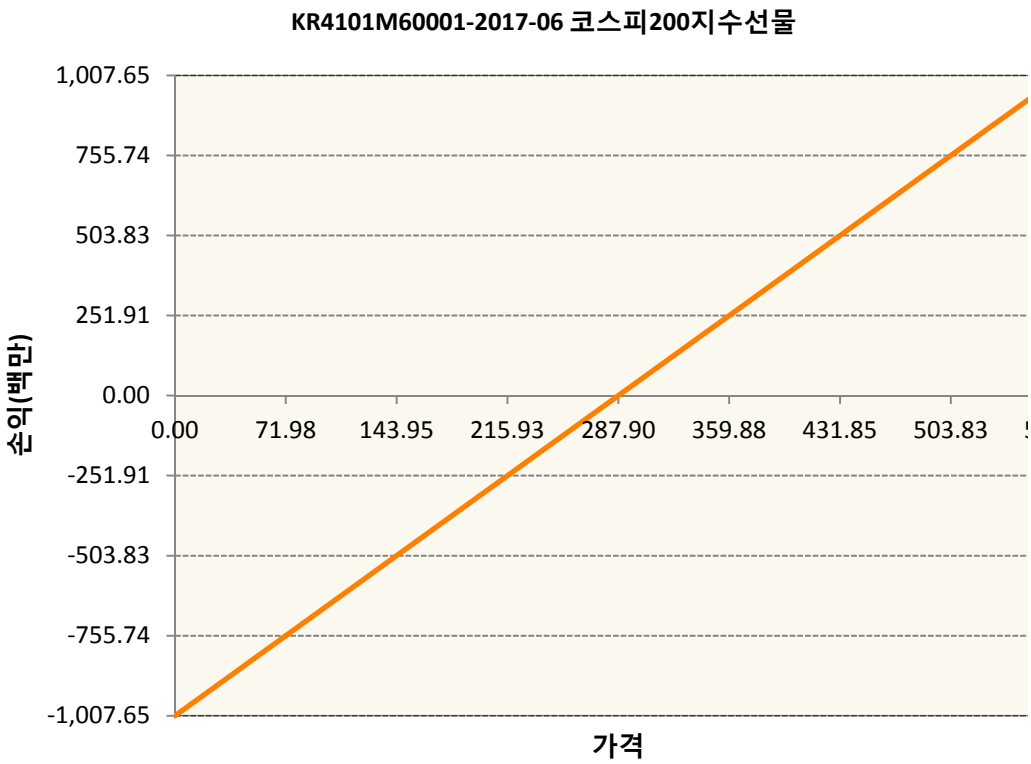
스마트인덱스모

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	1,008	0	1,008	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)

51

공시일	2017-05-02
기준일	2017-04-28

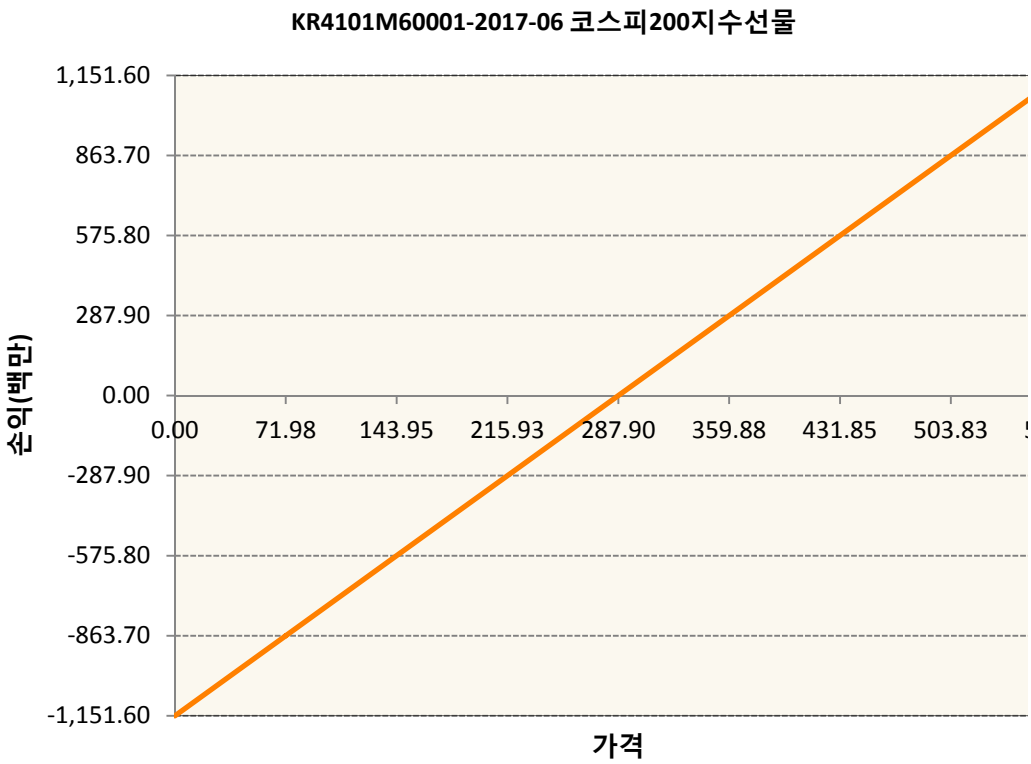
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,152	0	1,152	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	2017-05-02
기준일	2017-04-28

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)

555

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-05-02
기준일	2017-04-28

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	377

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

384

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-05-02
기준일	2017-04-28

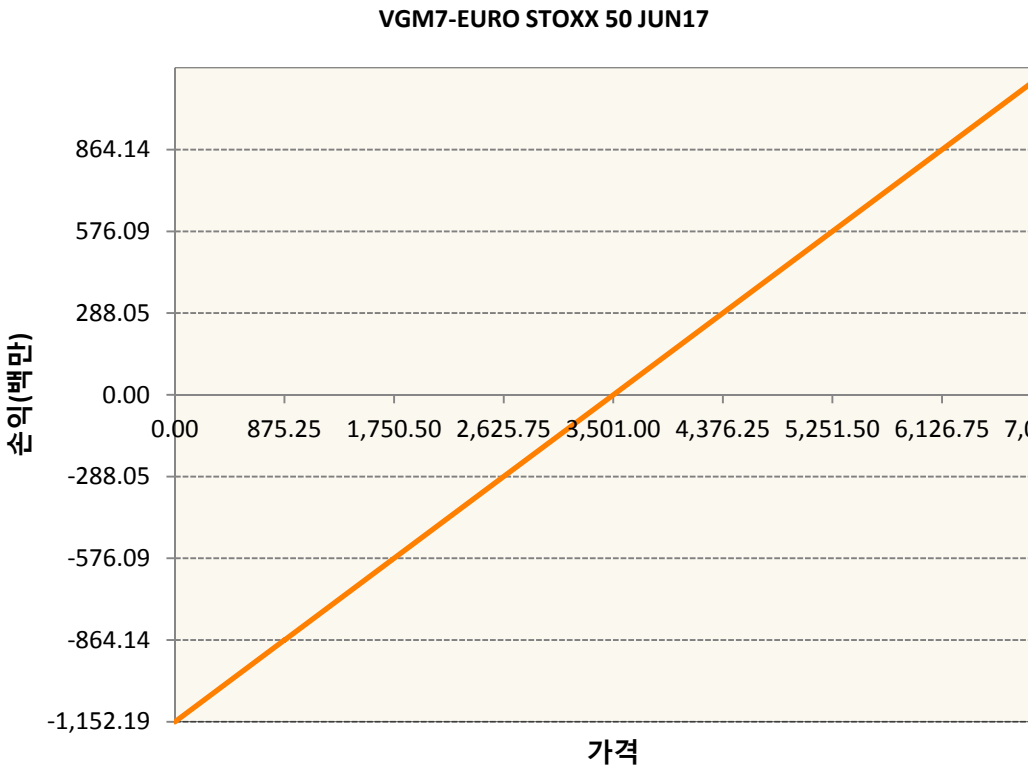
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,152	0	1,152	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM7	EURO STOXX 50 JUN17	92

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

(단위:백만원)

93

공시일	2017-05-02
기준일	2017-04-28

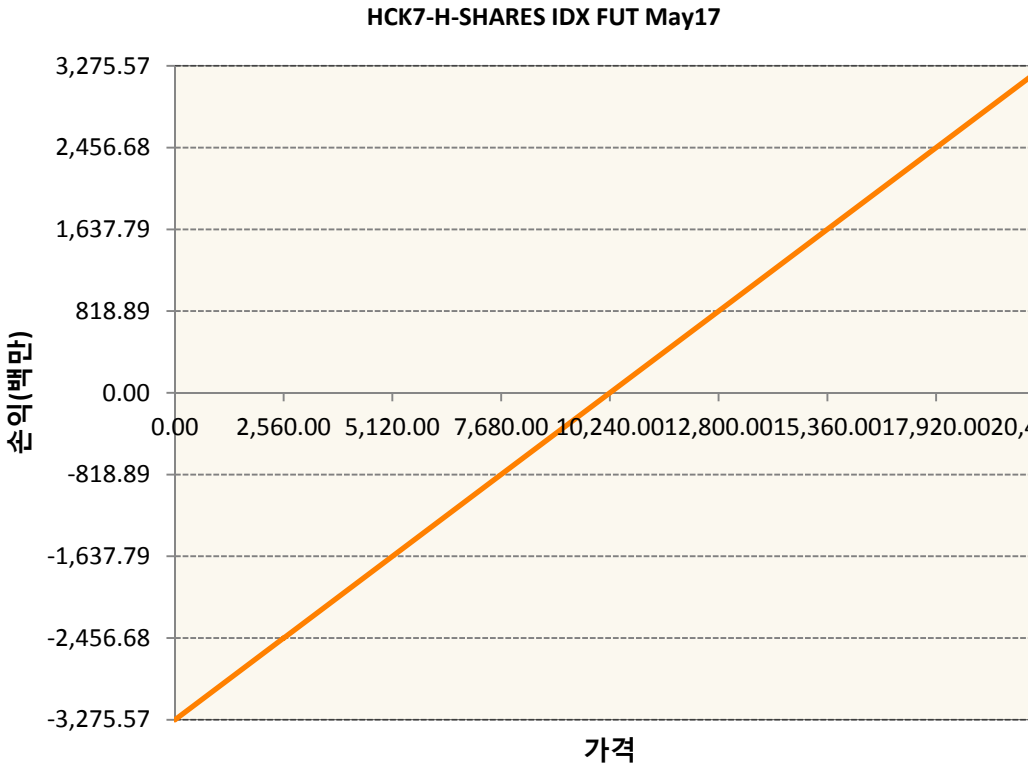
차이나인덱스모(주식-파생형)

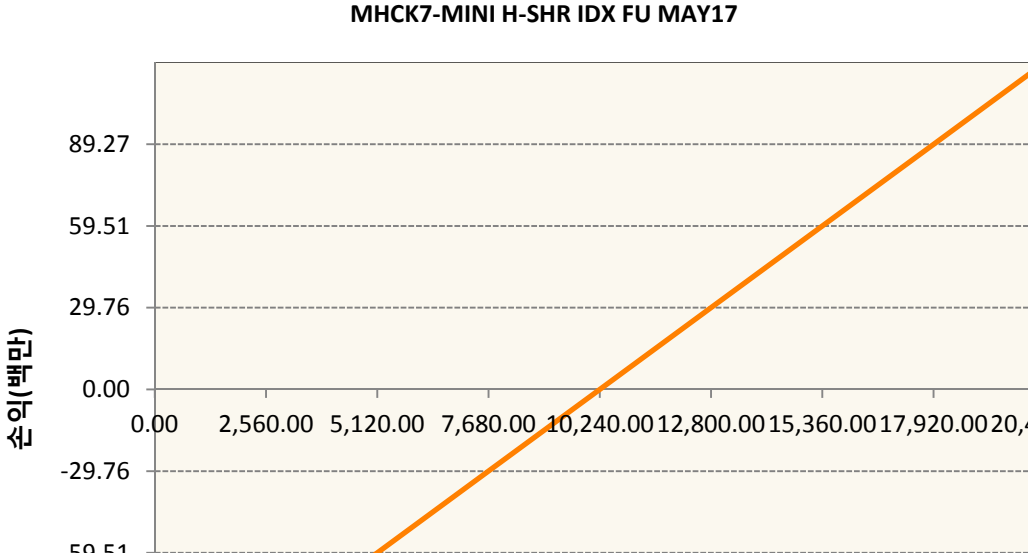
1. 계약금액

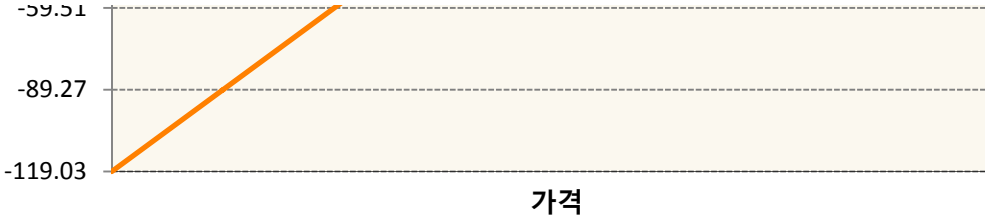
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,395	0	3,395	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCK7	H-SHARES IDX FUT May17	262
MHCK7	MINI H-SHR IDX FU MAY17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	289

공시일	2017-05-02
기준일	2017-04-28

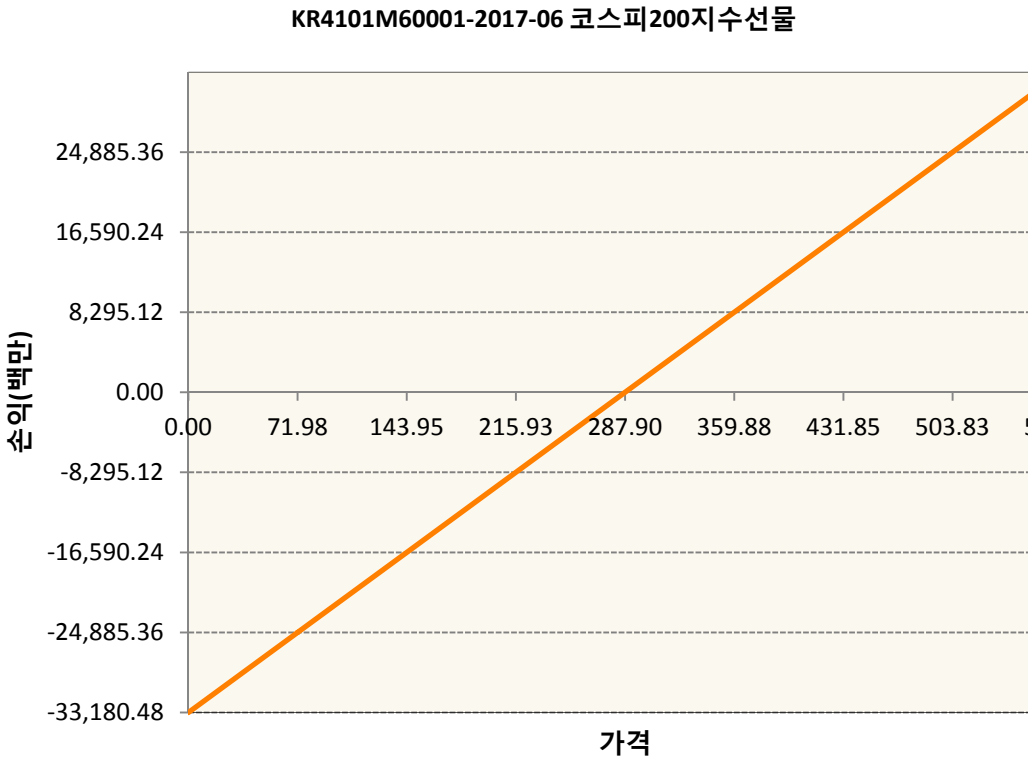
커버드콜모(주식혼합-파생형)

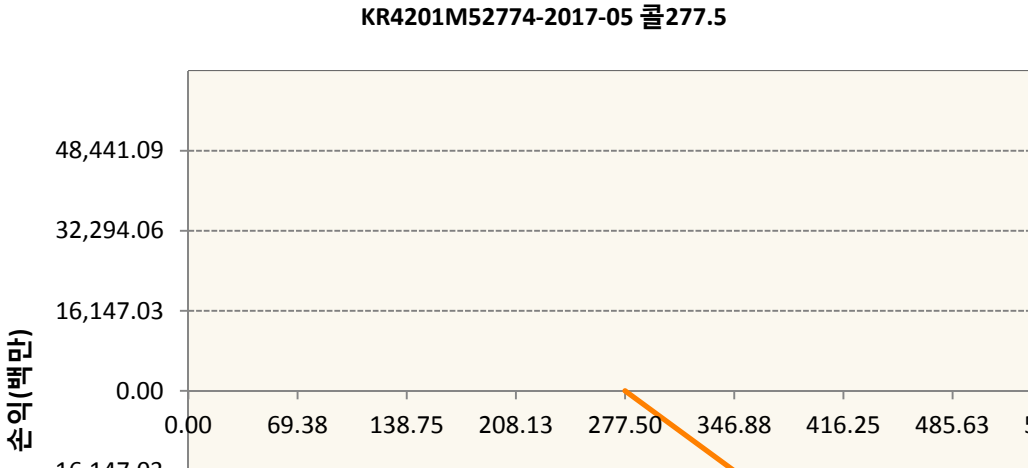
1. 계약금액

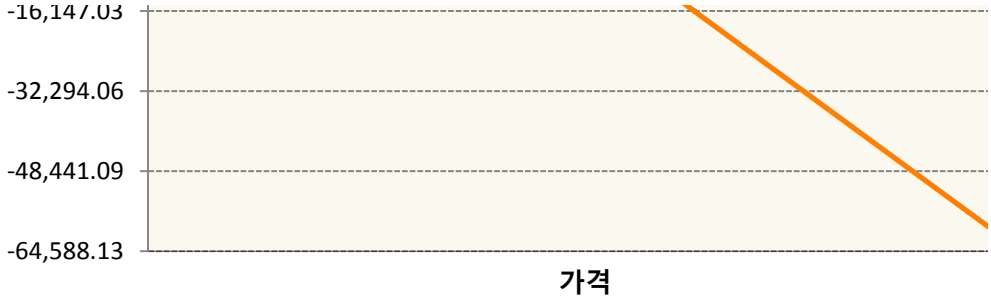
(단위:백만원)

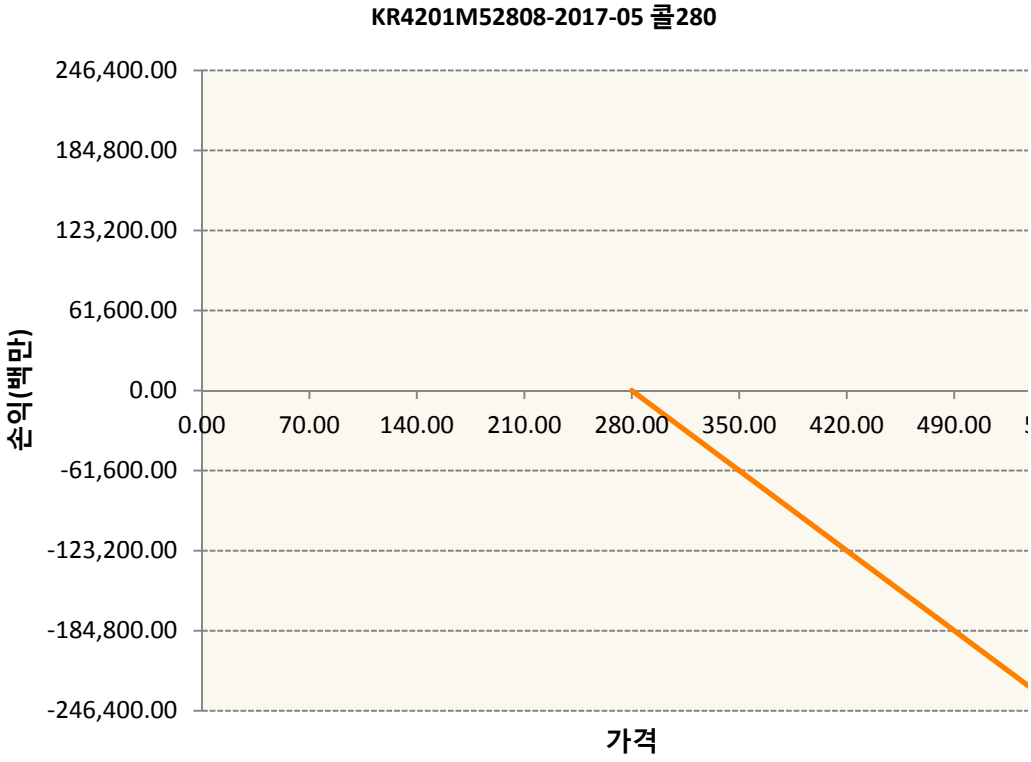
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	32,301	-32,301	장내
신규	유가증권	옵션	30,376	0	30,376	장내
누계	유가증권	선물	33,180	0	33,180	장내
누계	유가증권	옵션	0	387,488	-387,488	장내

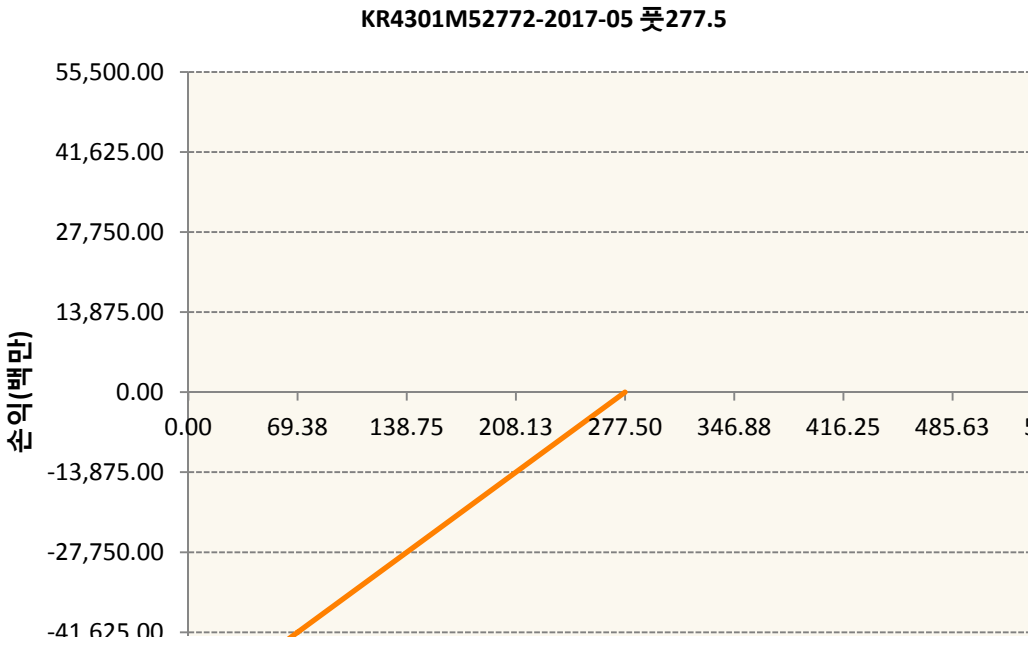
2. 만기시점의 손익구조



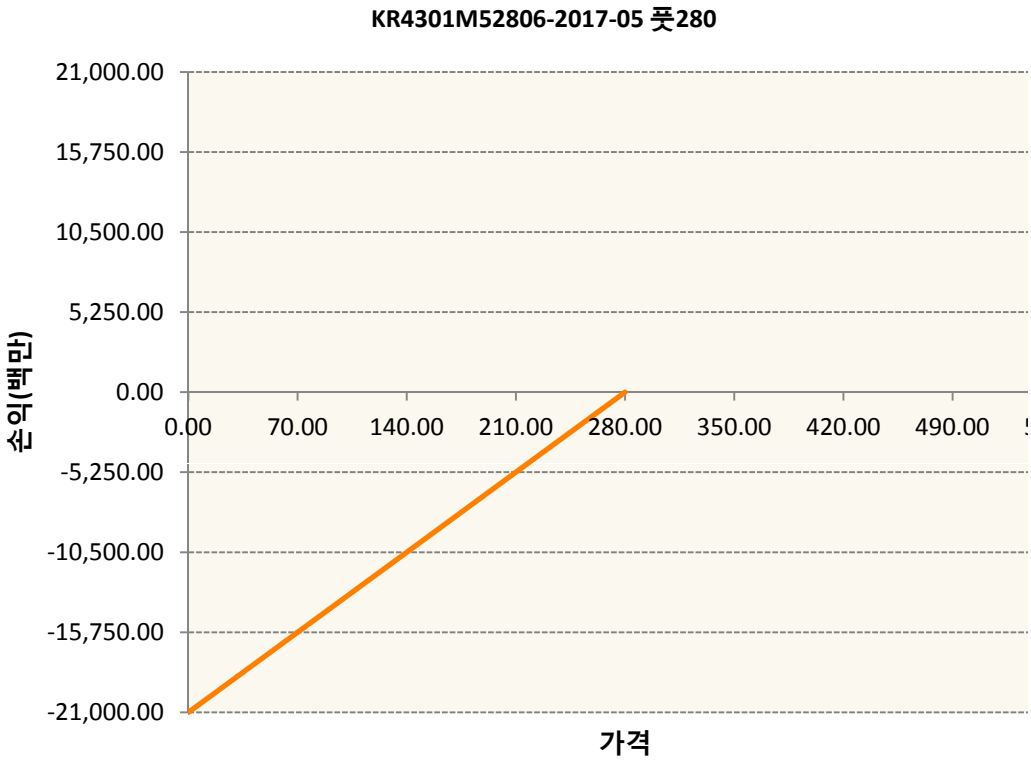



-16,147.03
-32,294.06
-48,441.09
-64,588.13
가격


KR4201M52808-2017-05 콜280
246,400.00
184,800.00
123,200.00
61,600.00
0.00
-61,600.00
-123,200.00
-184,800.00
-246,400.00
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							2,648
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,648	-2,648	-2,648	-2,648	-2,648	-2,648	-2,648
-5.33%	-1,765	-1,765	-1,765	-1,765	-1,765	-1,765	-1,765
-2.67%	-883	-883	-883	-883	-883	-883	-883
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	883	883	883	883	883	883	883
5.33%	1,765	1,765	1,765	1,765	1,765	1,765	1,765
8.00%	2,648	2,648	2,648	2,648	2,648	2,648	2,648
KR4201M52 2017-05 콜277.5							5,313
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,283	2,283	2,281	2,279	2,275	2,269	2,262
-5.33%	2,236	2,214	2,189	2,162	2,133	2,101	2,069
-2.67%	1,594	1,552	1,510	1,466	1,423	1,379	1,335

0%	26	20	11	0	-14	-31	-50
2.67%	-1,750	-1,750	-1,750	-1,751	-1,752	-1,754	-1,757
5.33%	-3,531	-3,531	-3,531	-3,531	-3,531	-3,531	-3,532
8.00%	-5,313	-5,313	-5,313	-5,313	-5,313	-5,313	-5,313
KR4201M52(	2017-05 콜280						19,903
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,619	6,619	6,618	6,615	6,609	6,600	6,587
-5.33%	6,570	6,533	6,484	6,424	6,353	6,273	6,184
-2.67%	5,254	5,080	4,907	4,734	4,560	4,386	4,213
0%	209	152	82	0	-92	-193	-301
2.67%	-6,432	-6,434	-6,438	-6,445	-6,457	-6,474	-6,498
5.33%	-13,167	-13,167	-13,167	-13,167	-13,168	-13,169	-13,171
8.00%	-19,903	-19,903	-19,903	-19,903	-19,903	-19,903	-19,903
KR4301M52(	2017-05 풋277.5						2,649
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,631	-2,631	-2,632	-2,634	-2,638	-2,642	-2,649
-5.33%	-1,141	-1,159	-1,180	-1,204	-1,229	-1,256	-1,284
-2.67%	-161	-197	-234	-271	-308	-346	-384
0%	22	17	10	0	-12	-26	-43
2.67%	27	27	27	26	25	24	21
5.33%	27	27	27	27	27	27	27
8.00%	27	27	27	27	27	27	27
KR4301M52(	2017-05 풋280						1,161
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,158	-1,158	-1,158	-1,158	-1,159	-1,160	-1,161
-5.33%	-588	-591	-595	-601	-607	-614	-621
-2.67%	-126	-141	-156	-171	-185	-200	-215
0%	18	13	7	0	-8	-16	-26
2.67%	26	26	25	25	24	22	20
5.33%	26	26	26	26	26	26	26
8.00%	26	26	26	26	26	26	26

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

34,647

공시일	2017-05-02
기준일	2017-04-28

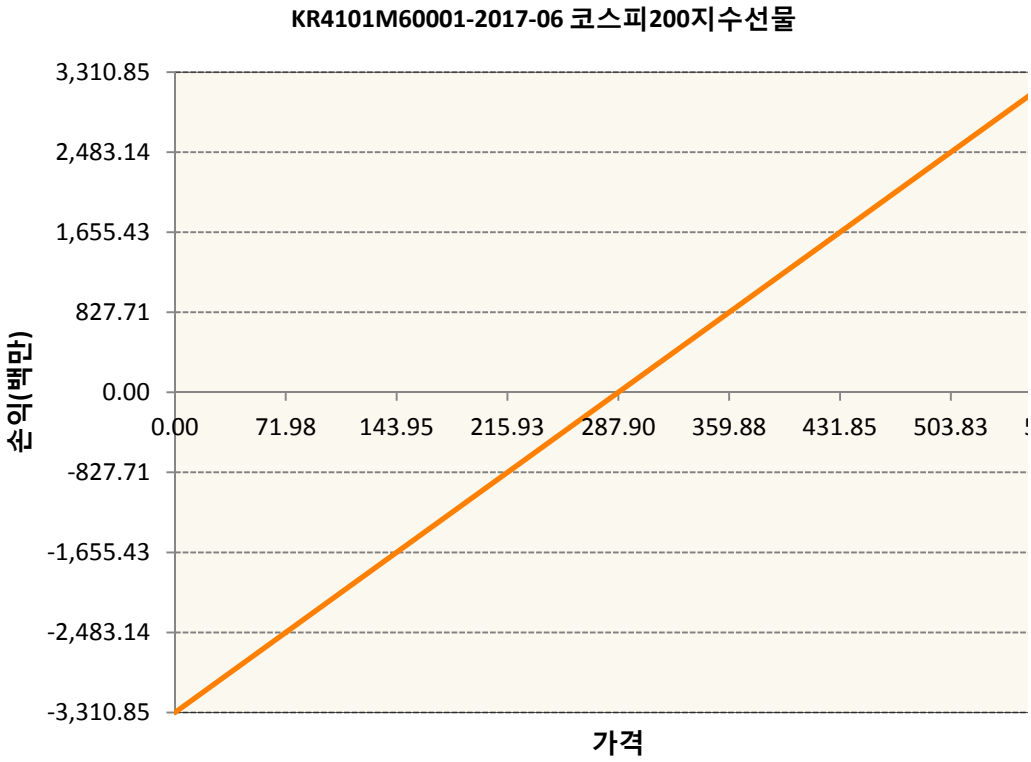
커버드콜목표전환형증권투자신탁

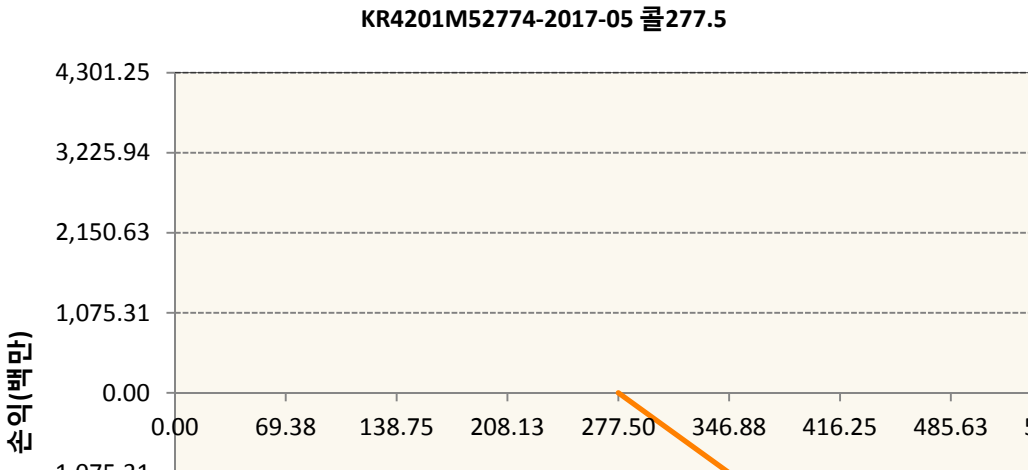
1. 계약금액

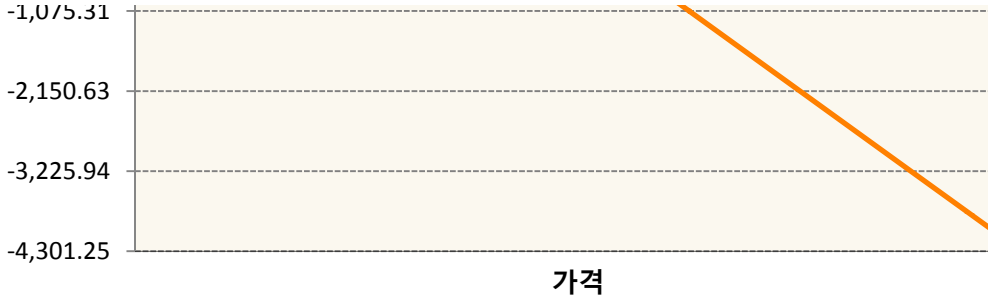
(단위:백만원)

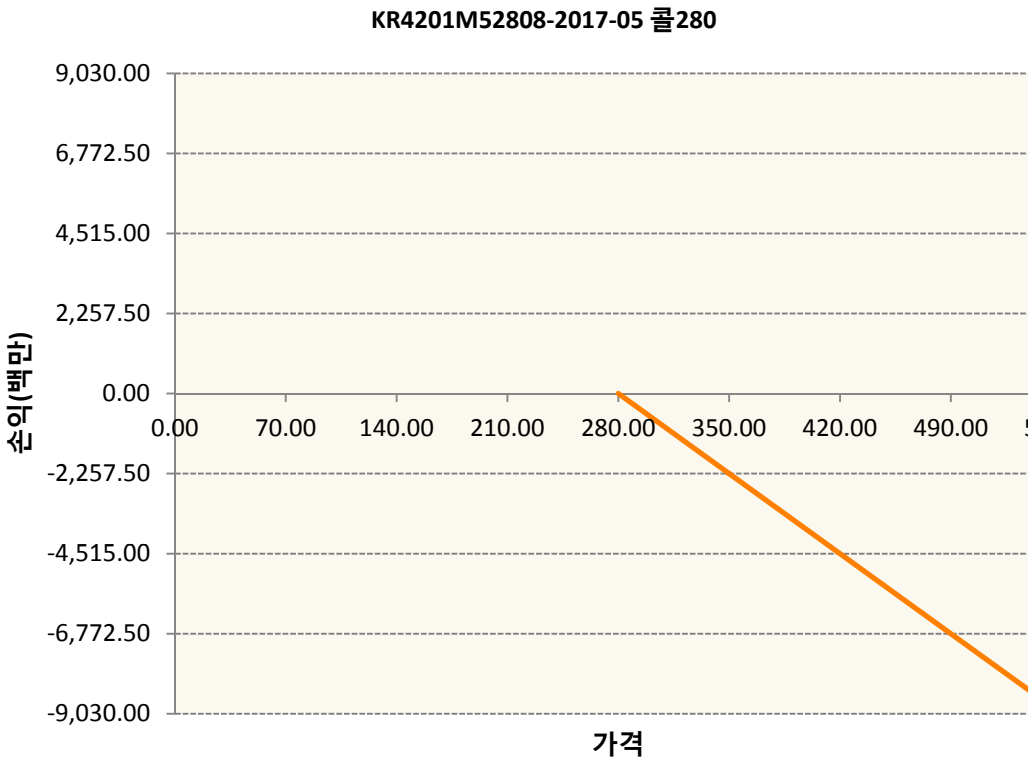
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,311	0	3,311	장내
누계	유가증권	옵션	0	13,331	-13,331	장내

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%	152	152	152	152	151	151	151
-5.33%	149	147	146	144	142	140	138
-2.67%	106	103	101	98	95	92	89
0%	2	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-117	-117	-117	-117	-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%	243	243	243	242	242	242	241
-5.33%	241	239	238	235	233	230	227
-2.67%	193	186	180	173	167	161	154
0%	8	6	3	0	-3	-7	-11
2.67%	-236	-236	-236	-236	-237	-237	-238
5.33%	-483	-483	-483	-483	-483	-483	-483
8.00%	-729	-729	-729	-729	-729	-729	-729

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

1,463

공시일	2017-05-02
기준일	2017-04-28

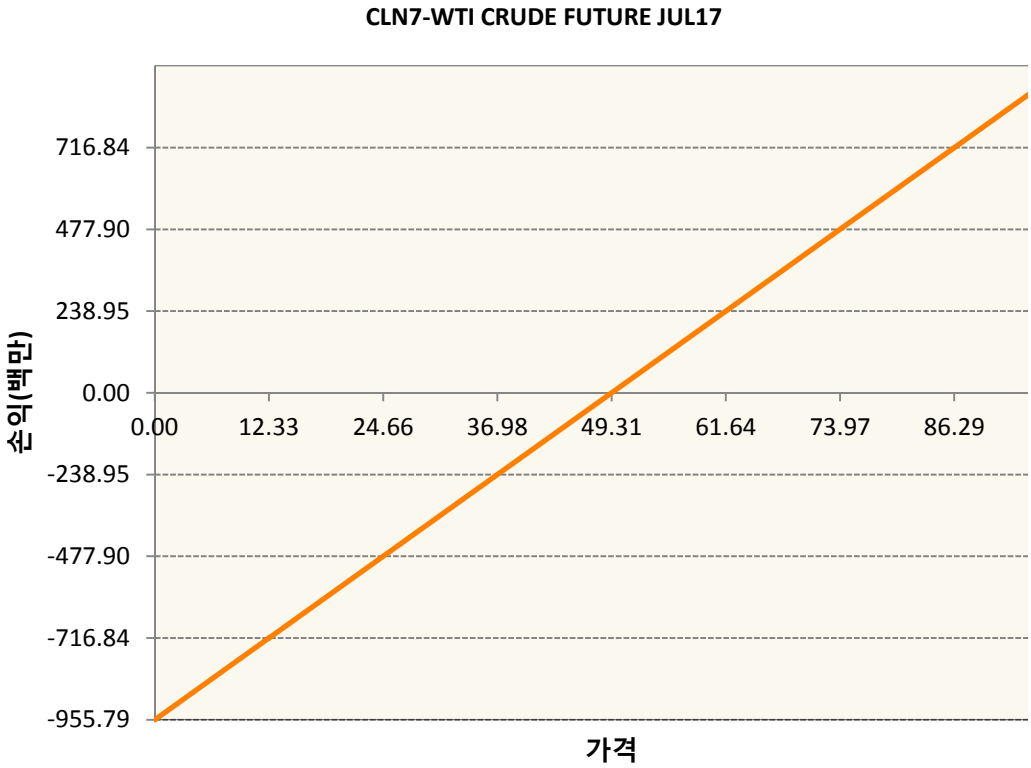
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

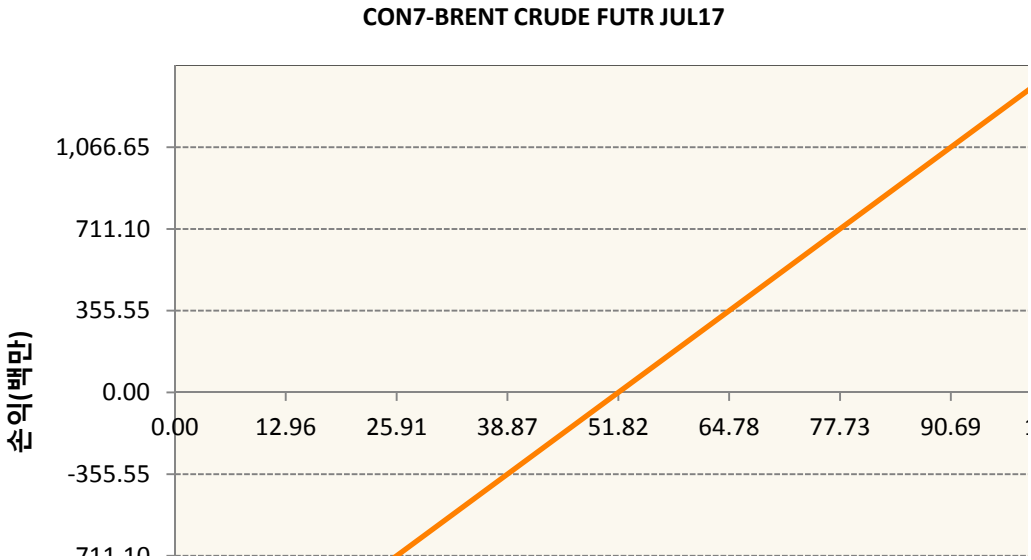
1. 계약금액

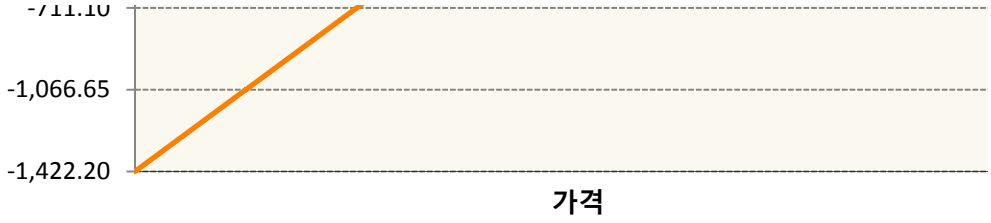
(단위:백만원)

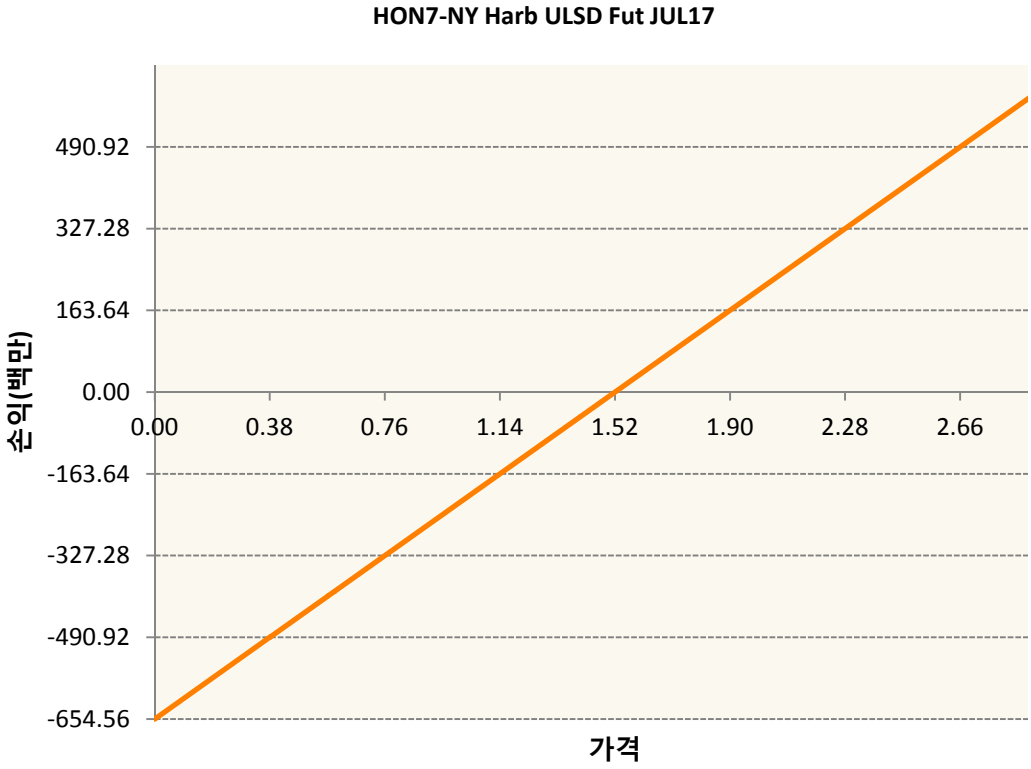
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,256	409	4,847	

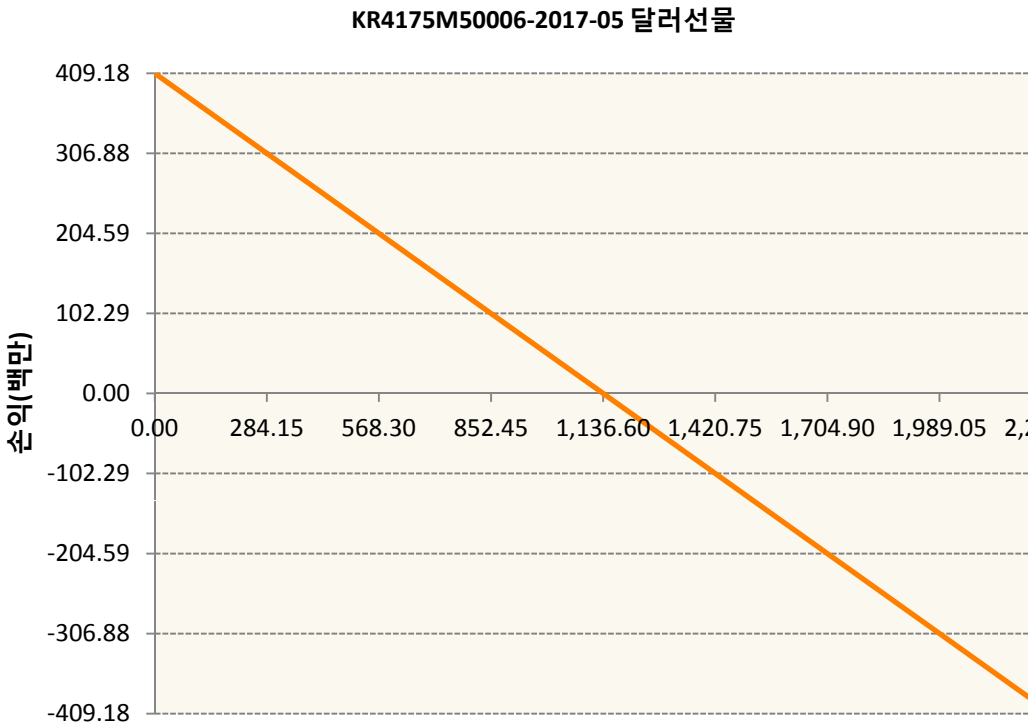
2. 만기시점의 손익구조



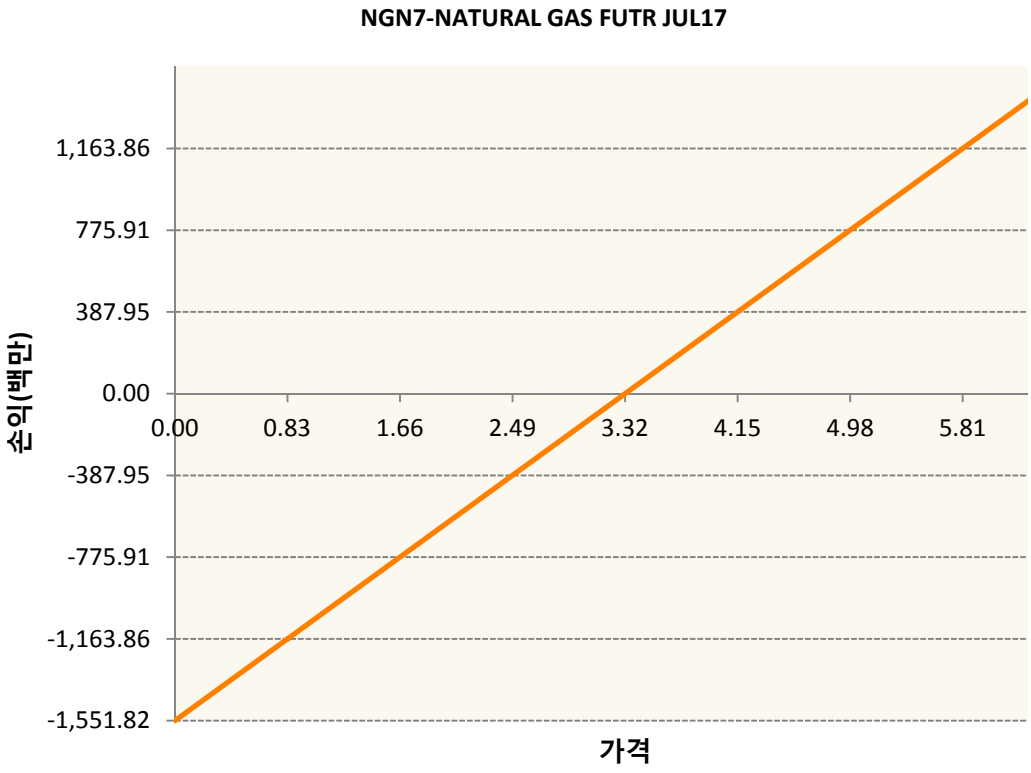


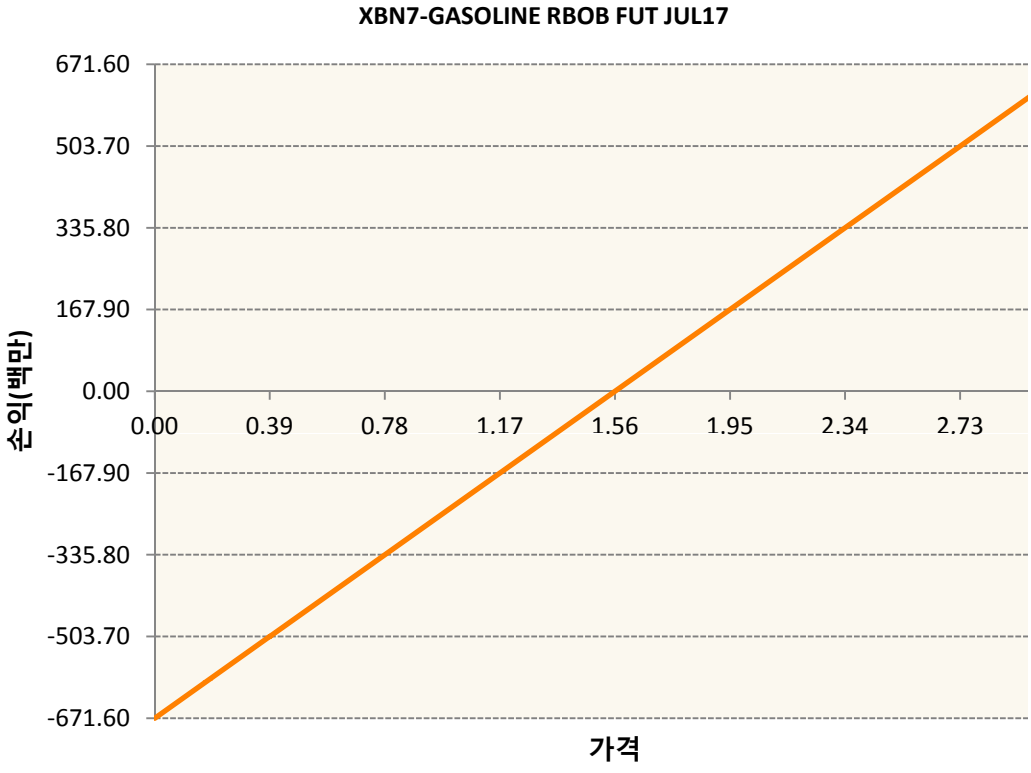

-1,066.65
-1,422.20
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
490.92
327.28
163.64
0.00
-163.64
-327.28
-490.92
-654.56
0.00
0.38
0.76
1.14
1.52
1.90
2.28
2.66
순이익(백만)
가격


KR4175M50006-2017-05 달러선물
409.18
306.88
204.59
102.29
0.00
-102.29
-204.59
-306.88
-409.18
0.00
284.15
568.30
852.45
1,136.60
1,420.75
1,704.90
1,989.05
순이익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,163.86
775.91
387.95
0.00
-387.95
-775.91
-1,163.86
-1,551.82
0.00
0.83
1.66
2.49
3.32
4.15
4.98
5.81
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
671.60
503.70
335.80
167.90
0.00
-167.90
-335.80
-503.70
-671.60
0.00
0.39
0.78
1.17
1.56
1.95
2.34
2.73
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN7	WTI CRUDE FUTURE JUL17	76
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	114
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	52
KR4175M50(	2017-05 달러선물	33
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	124
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	54

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

915

공시일	2017-05-02
기준일	2017-04-28

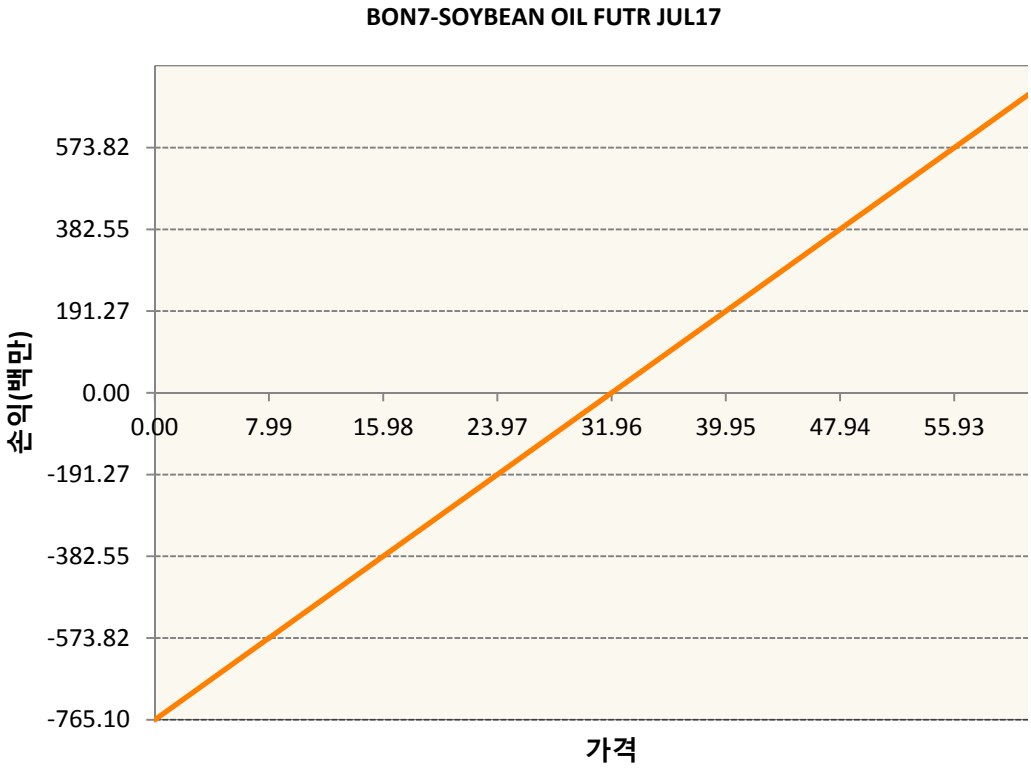
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

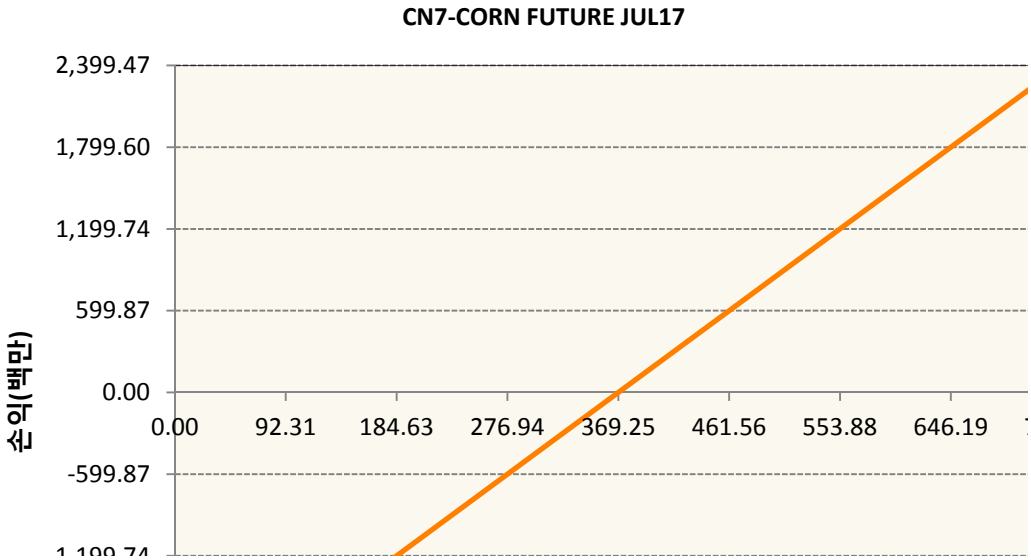
1. 계약금액

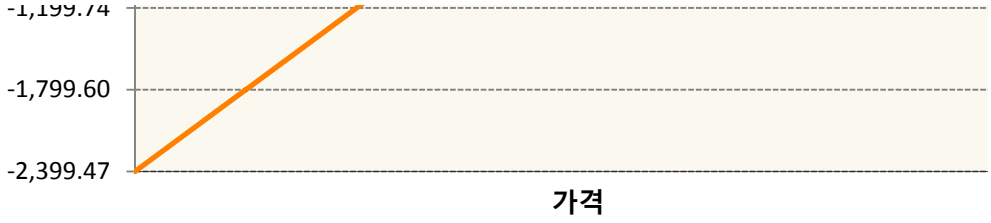
(단위:백만원)

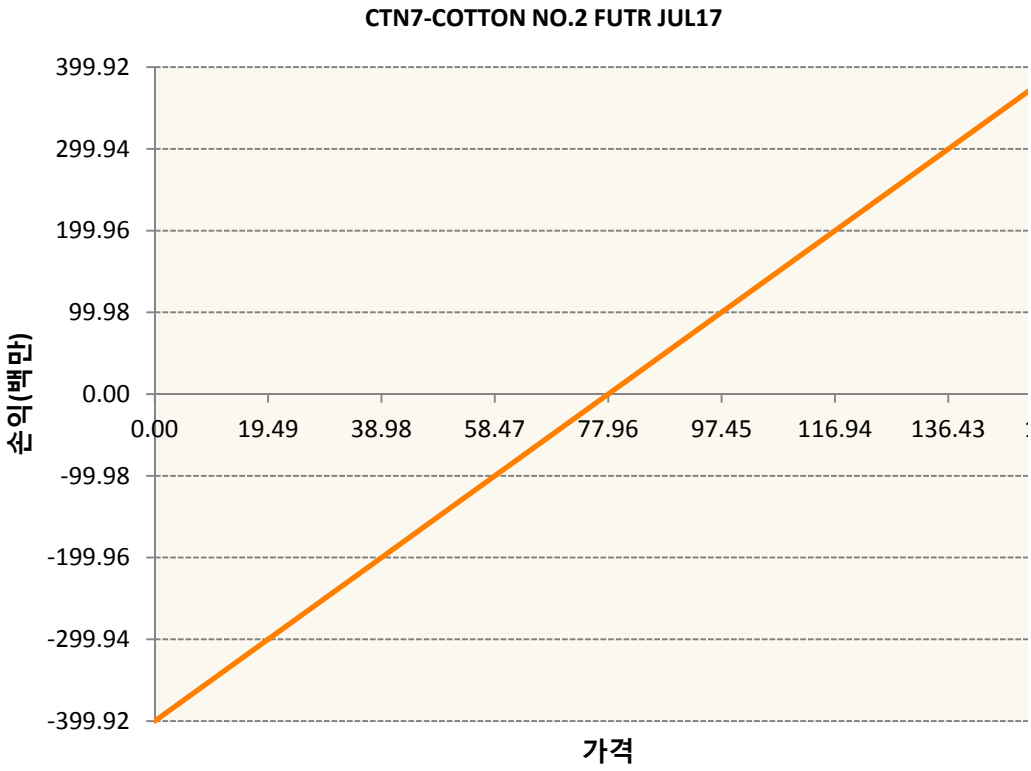
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,819	398	8,421	

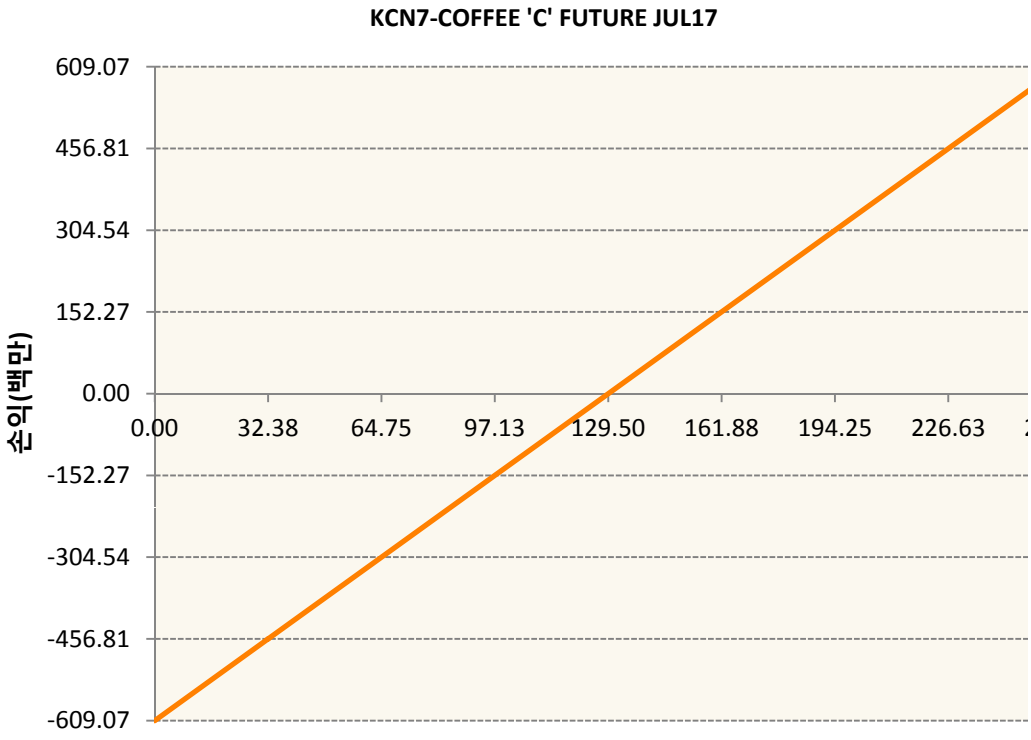
2. 만기시점의 손익구조





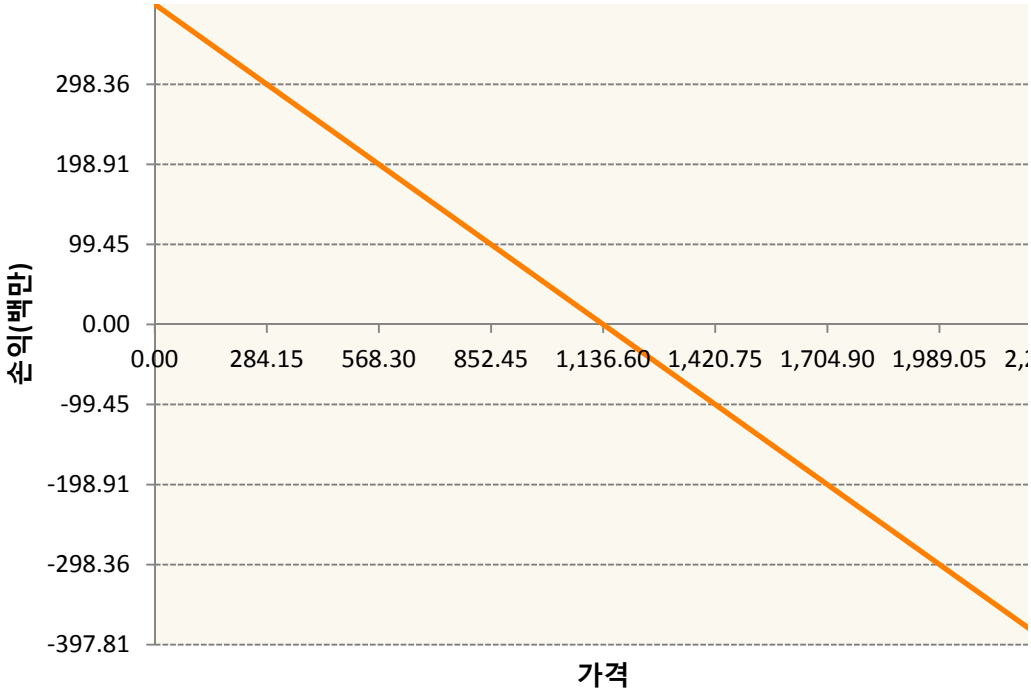

-1,799.60
-2,399.47
가격


CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
399.92
299.94
199.96
99.98
0.00
-99.98
-199.96
-299.94
-399.92
0.00
19.49
38.98
58.47
77.96
97.45
116.94
136.43
순익(백만)
가격

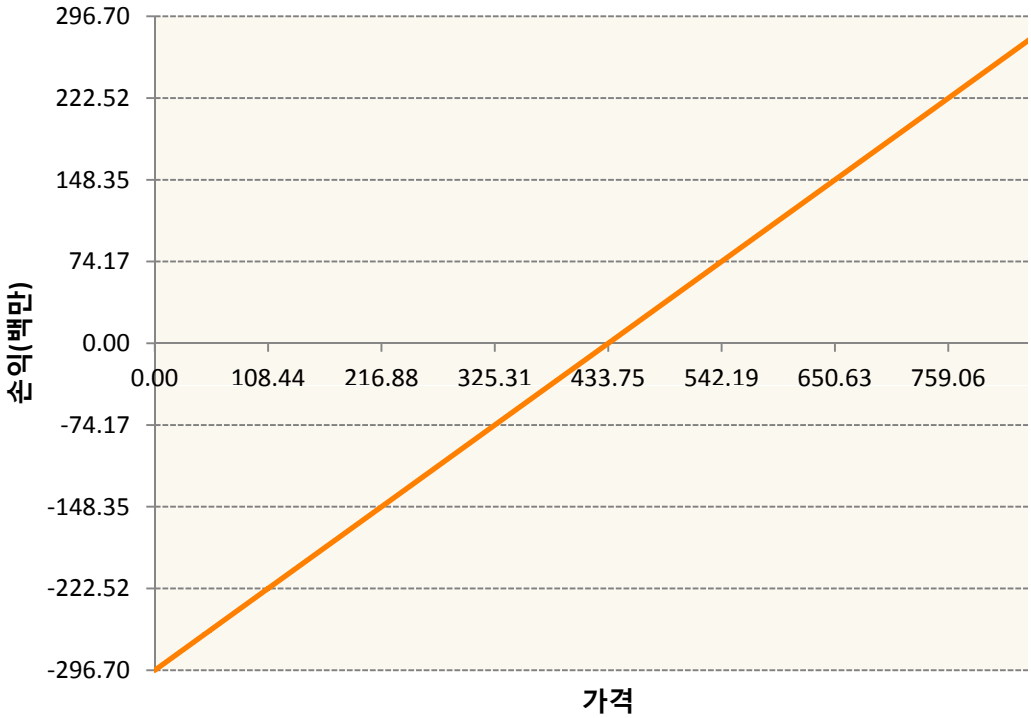

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
609.07
456.81
304.54
152.27
0.00
-152.27
-304.54
-456.81
-609.07
0.00
32.38
64.75
97.13
129.50
161.88
194.25
226.63
순익(백만)

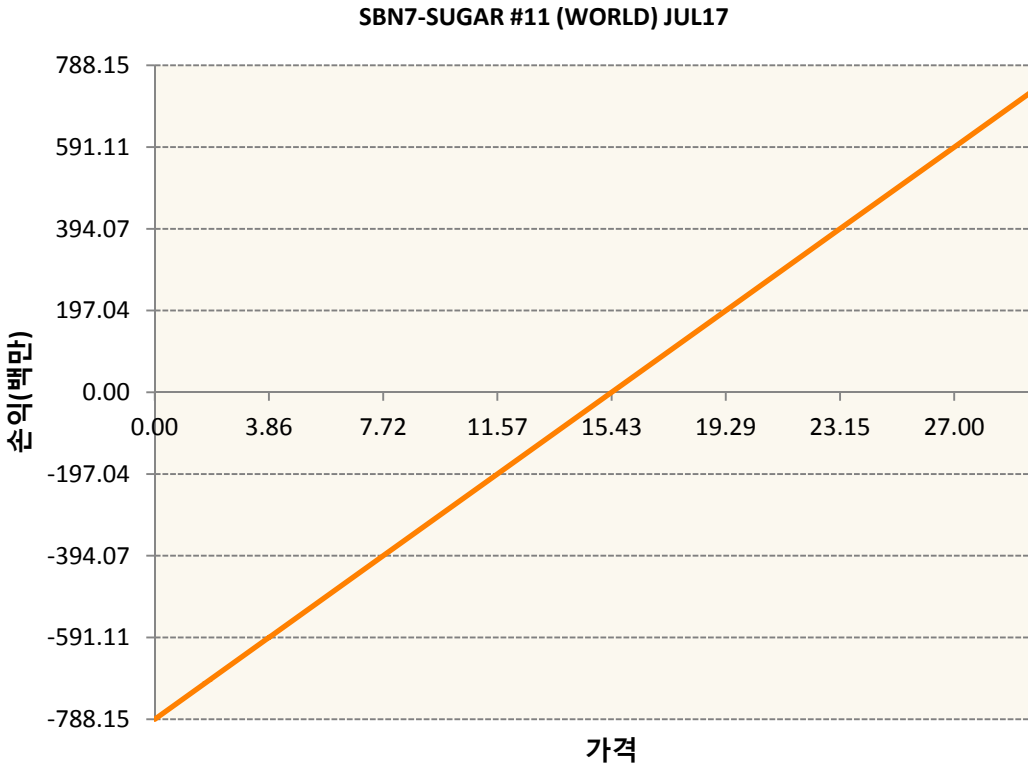
가격

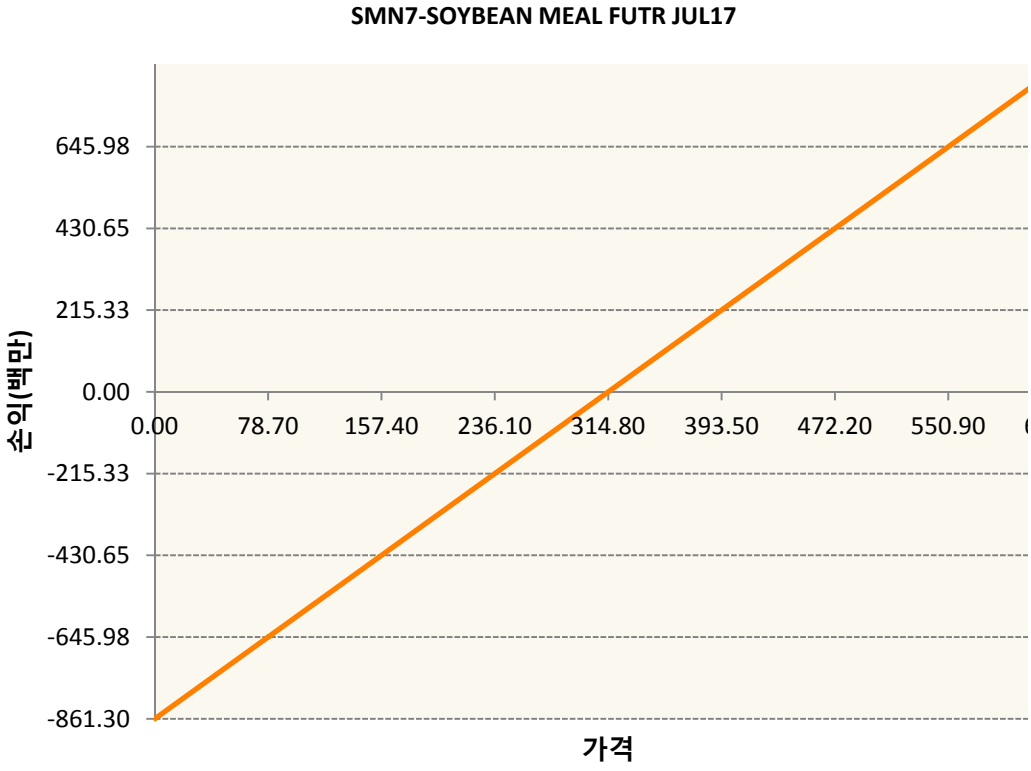
KR4175M50006-2017-05 달러선물

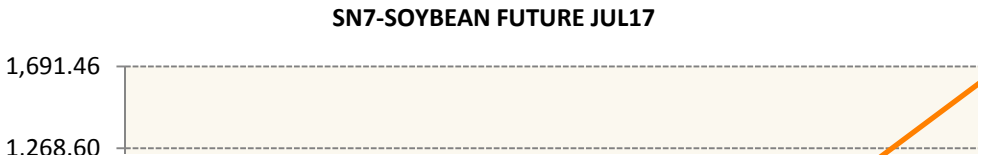


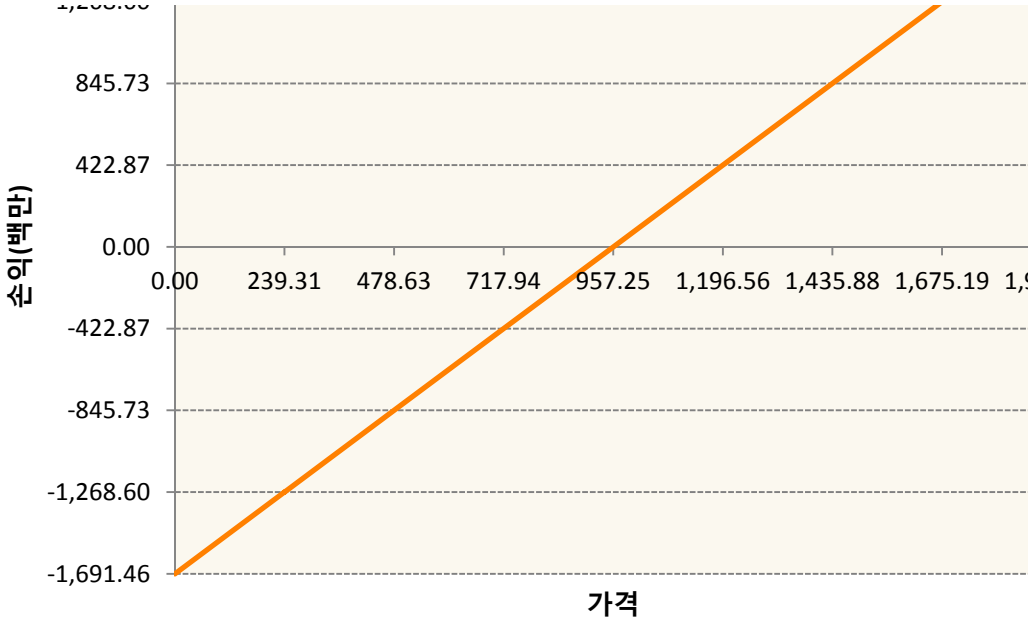
KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17



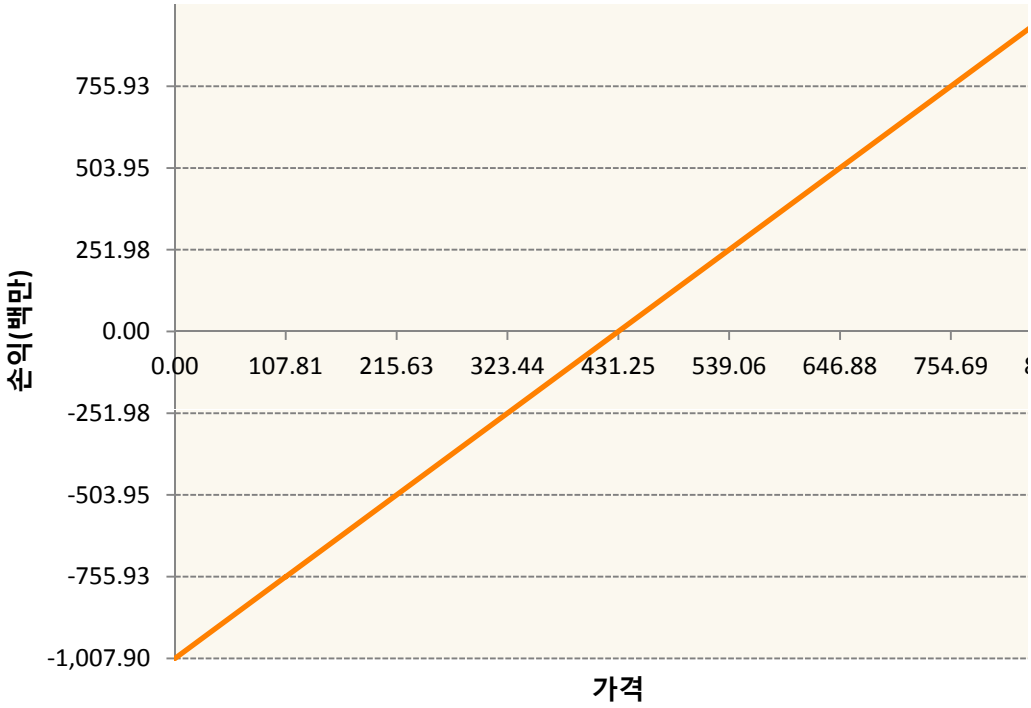

SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
788.15
591.11
394.07
197.04
0.00
-197.04
-394.07
-591.11
-788.15
0.00
3.86
7.72
11.57
15.43
19.29
23.15
27.00
손익(백만)
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
645.98
430.65
215.33
0.00
-215.33
-430.65
-645.98
-861.30
0.00
78.70
157.40
236.10
314.80
393.50
472.20
550.90
손익(백만)
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,691.46
1,268.60



WN7-WHEAT FUTURE(CBT) JUL17



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	61
CN7	CORN FUTURE JUL17	192
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	32
KCN7	COFFEE 'C' FUTURE JUL17	49
KR4175M50(	2017-05 달러선물	32

KWN7	KC HRW WHEAT FUT JUL17	24
SBN7	SUGAR #11 (WORLD) JUL17	63
SMN7	SOYBEAN MEAL FUTR JUL17	69
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	135
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	81

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

799