공시일	2017-05-04
기준일	2017-05-02

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	2017-05-04
기준일	2017-05-02

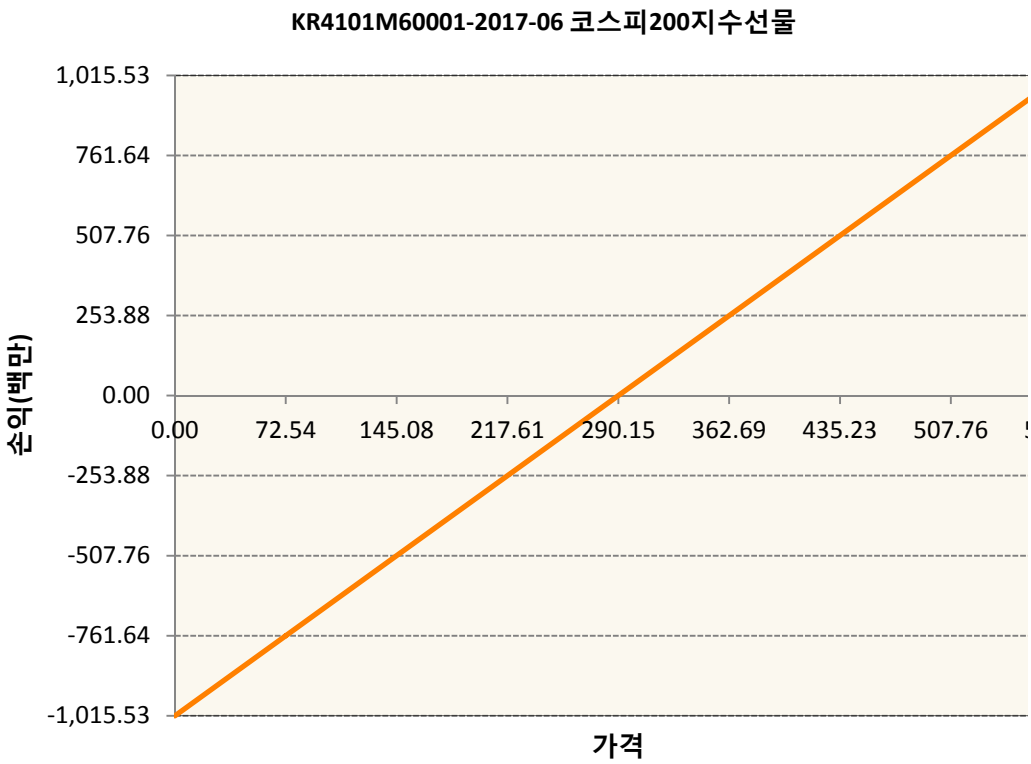
스마트인덱스모

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	1,016	0	1,016	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							81
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
-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%	81	81	81	81	81	81	81

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

52

공시일	2017-05-04
기준일	2017-05-02

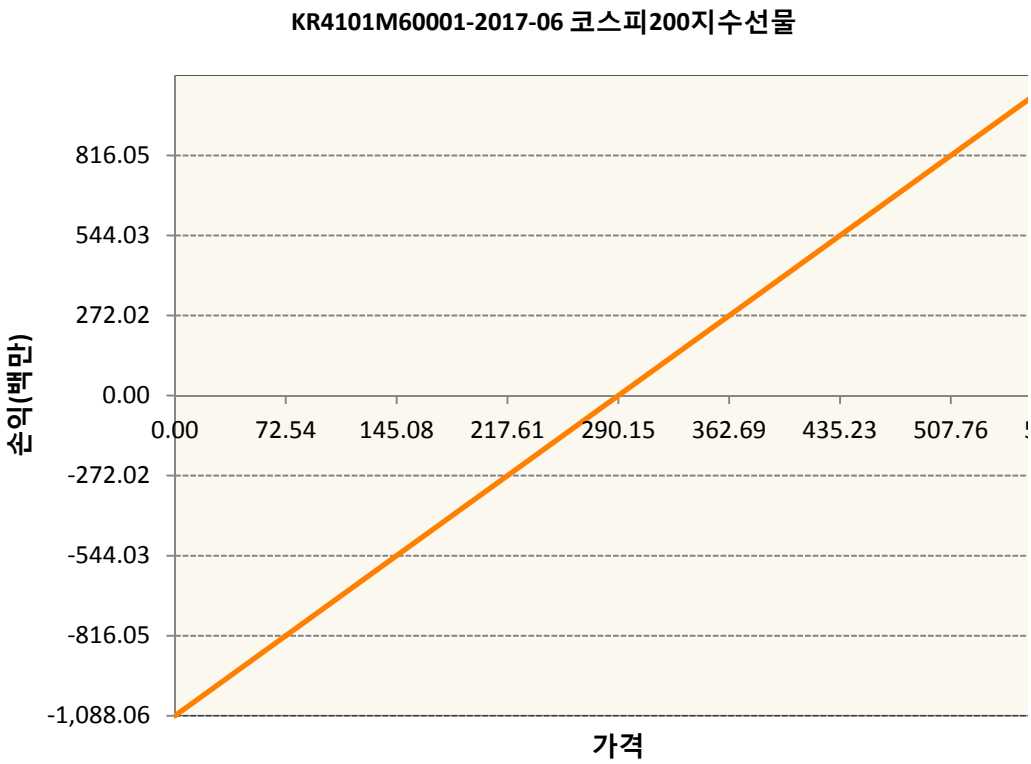
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,088	0	1,088	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							87
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-5.33%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	29	29	29	29	29	29	29
5.33%	58	58	58	58	58	58	58
8.00%	87	87	87	87	87	87	87

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

56

공시일	2017-05-04
기준일	2017-05-02

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	976

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

554

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-05-04
기준일	2017-05-02

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	2017-05-04
기준일	2017-05-02

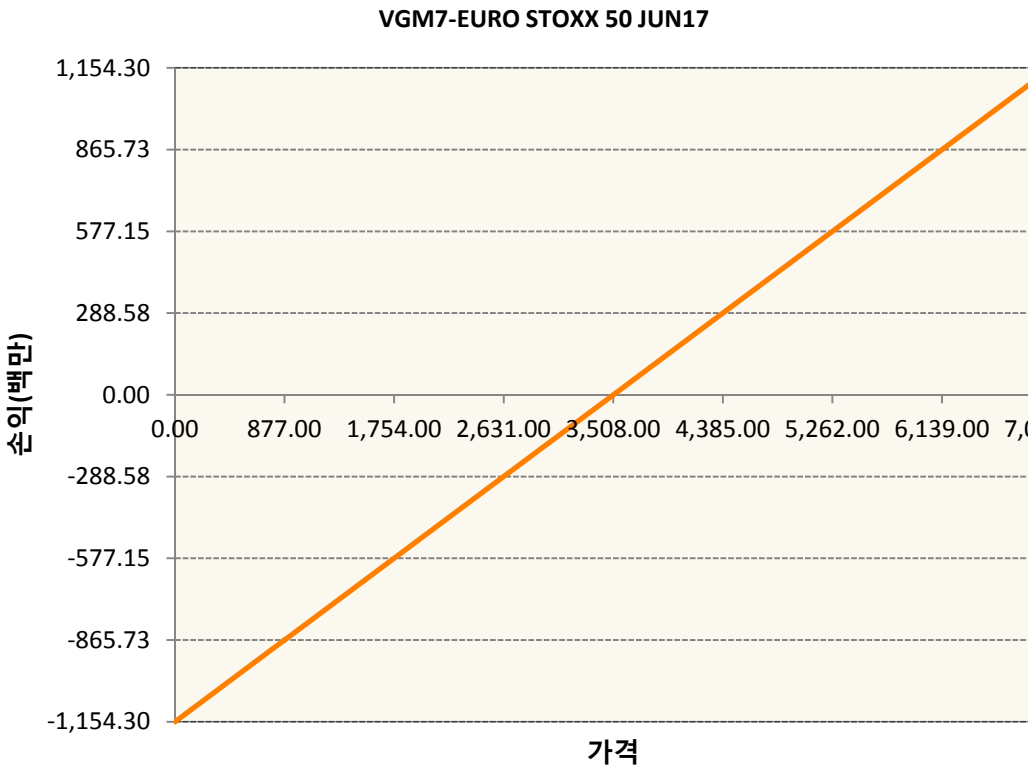
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2017-05-04
기준일	2017-05-02

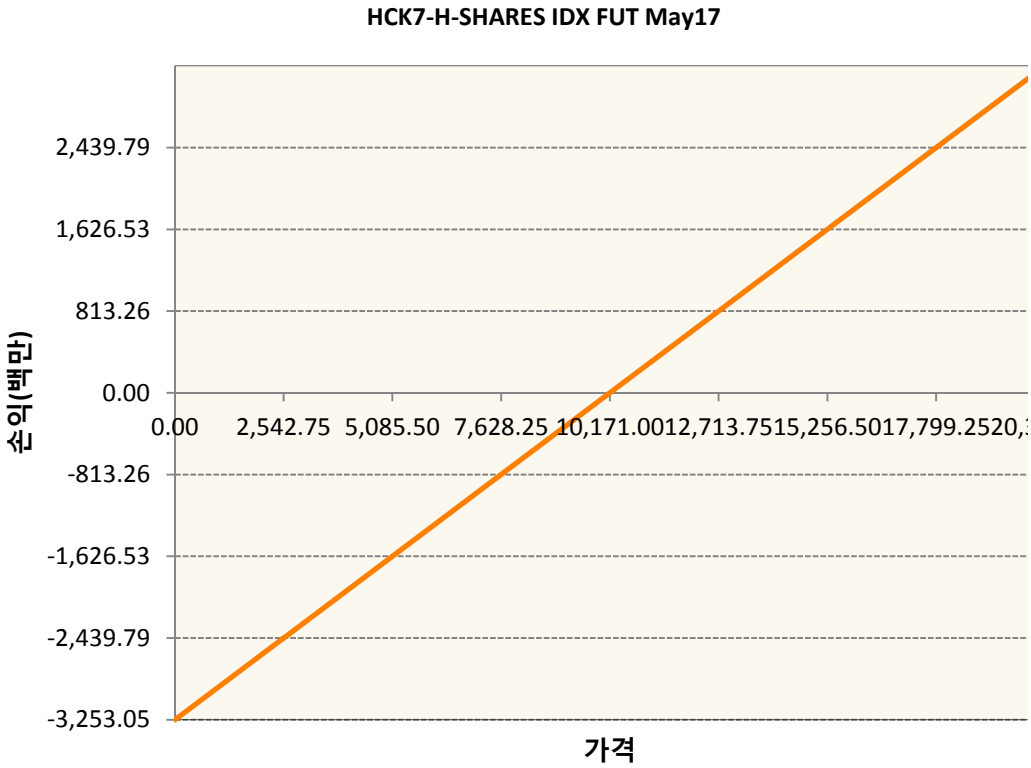
차이나인덱스모(주식-파생형)

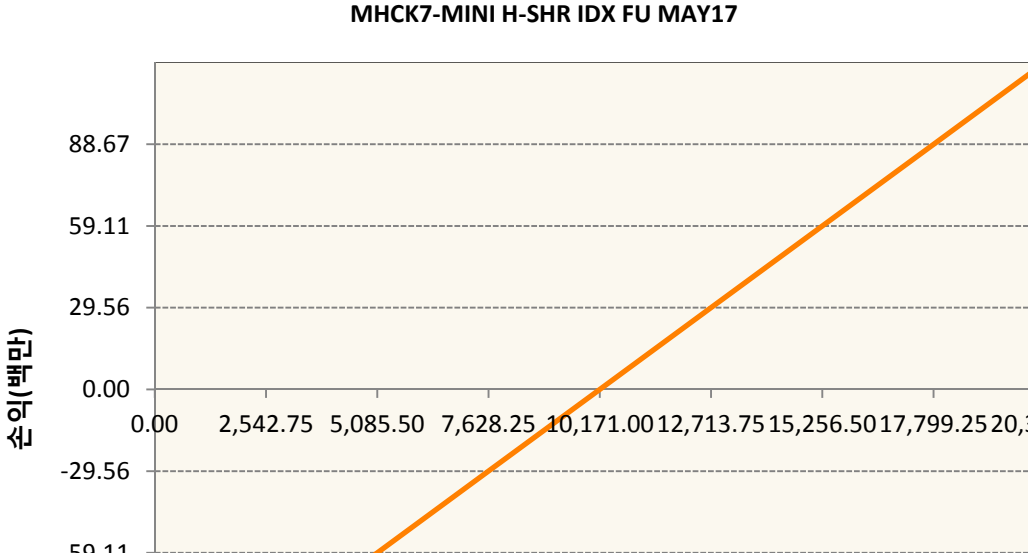
1. 계약금액

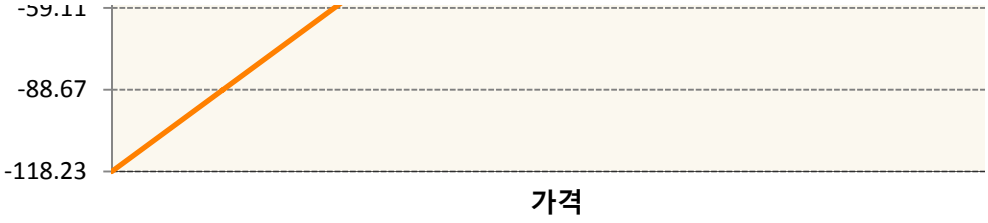
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,371	0	3,371	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCK7	H-SHARES IDX FUT May17	260
MHCK7	MINI H-SHR IDX FU MAY17	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	287

공시일	2017-05-04
기준일	2017-05-02

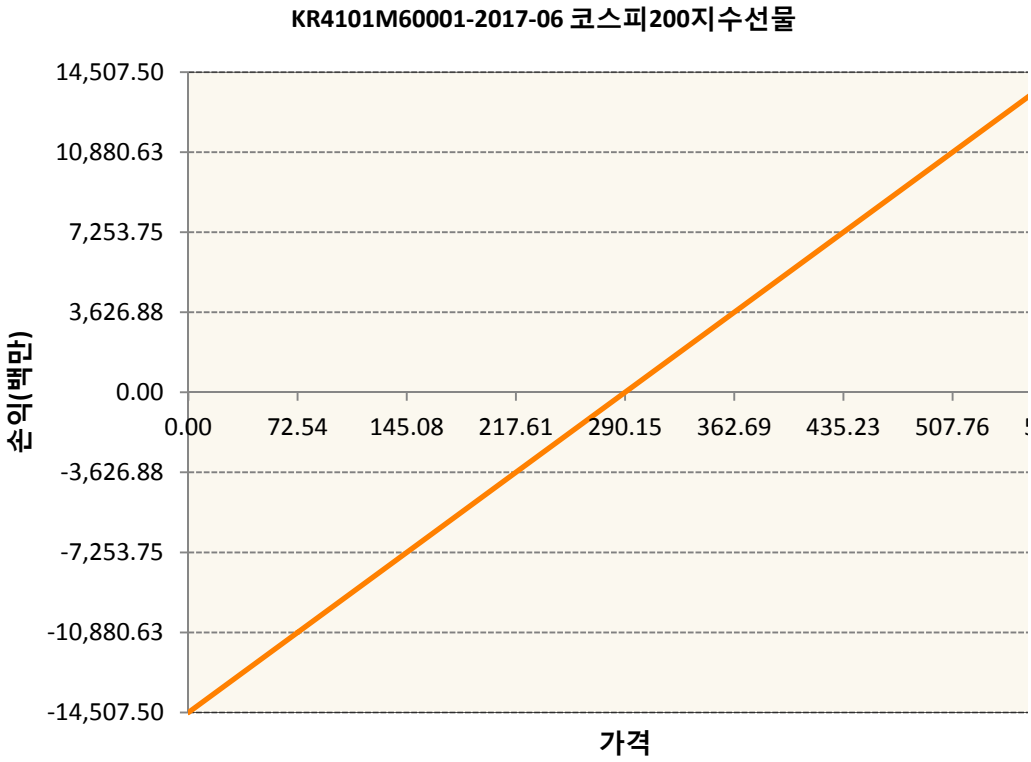
커버드콜모(주식혼합-파생형)

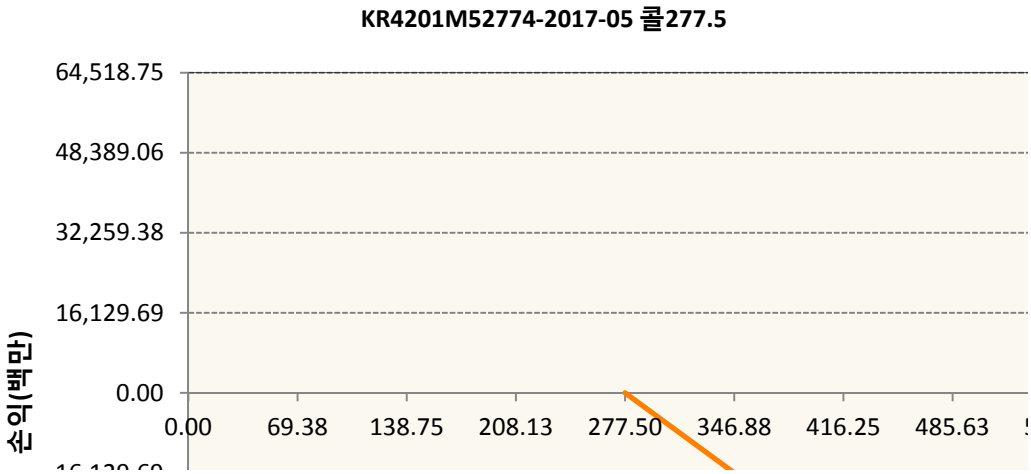
1. 계약금액

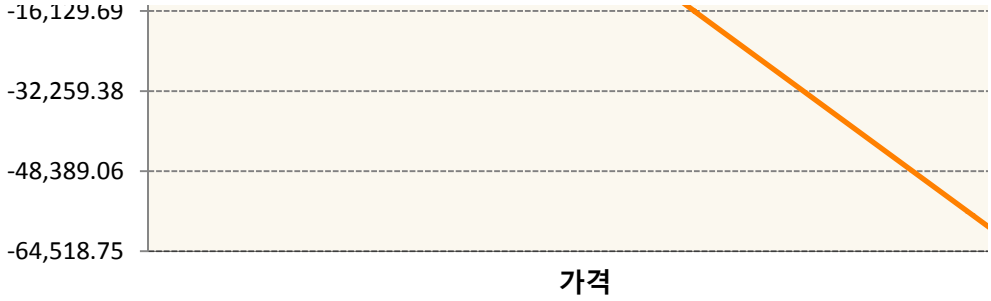
(단위:백만원)

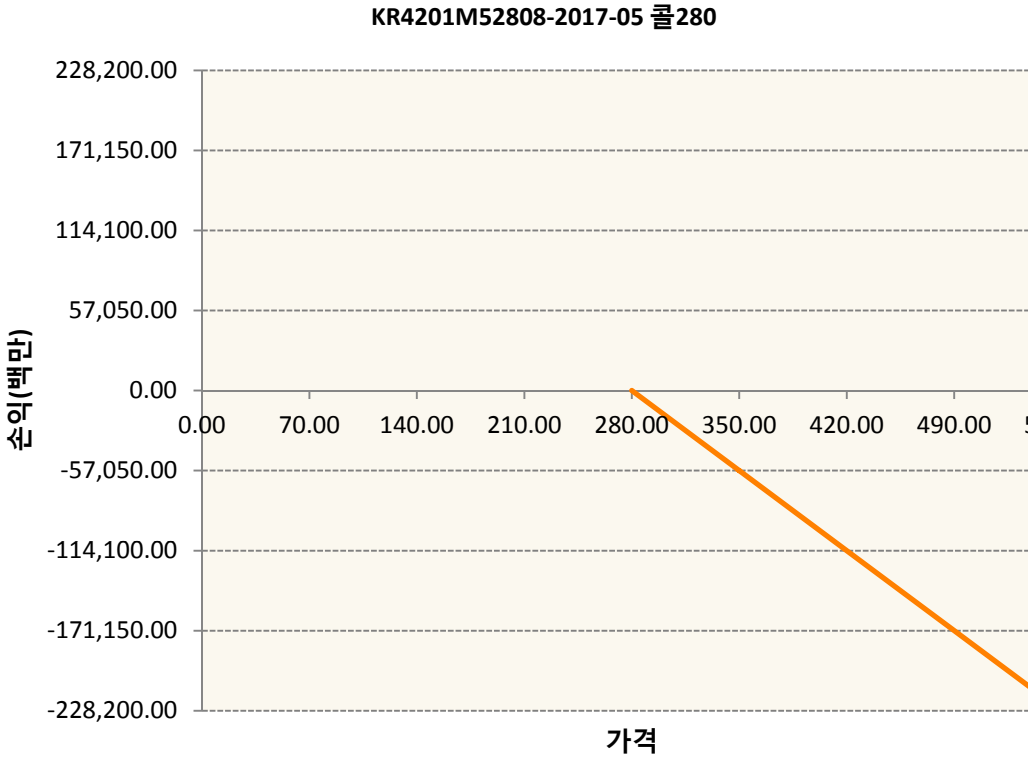
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	18,958	-18,958	장내
신규	유가증권	옵션	17,593	18,209	-616	장내
누계	유가증권	선물	14,508	0	14,508	장내
누계	유가증권	옵션	0	387,419	-387,419	장내

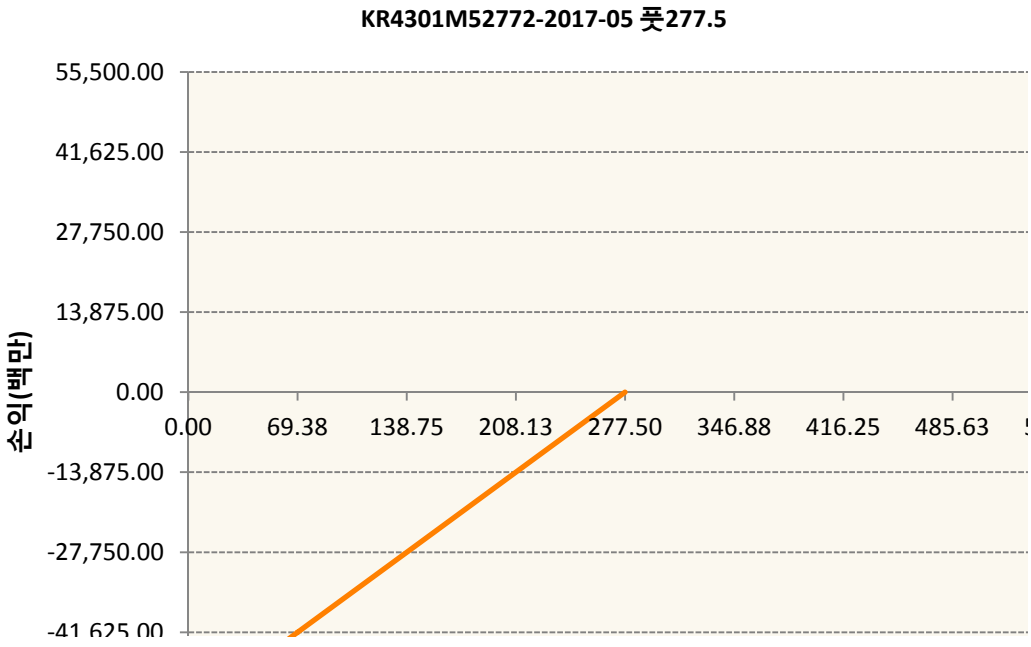
2. 만기시점의 손익구조



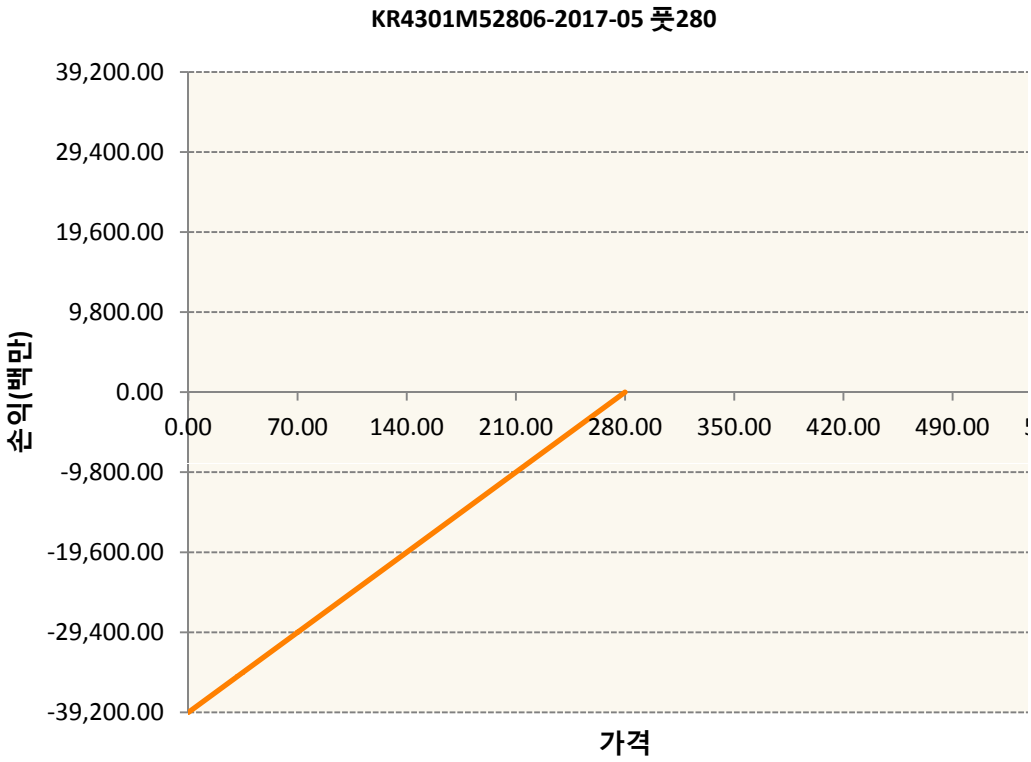



-16,129.69
-32,259.38
-48,389.06
-64,518.75
가격


KR4201M52808-2017-05 콜280
228,200.00
171,150.00
114,100.00
57,050.00
0.00
-57,050.00
-114,100.00
-171,150.00
-228,200.00
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							1,159
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,159	-1,159	-1,159	-1,159	-1,159	-1,159	-1,159
-5.33%	-772	-772	-772	-772	-772	-772	-772
-2.67%	-386	-386	-386	-386	-386	-386	-386
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	386	386	386	386	386	386	386
5.33%	772	772	772	772	772	772	772
8.00%	1,159	1,159	1,159	1,159	1,159	1,159	1,159
KR4201M52 2017-05 콜277.5							5,379
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,825	2,823	2,821	2,817	2,812	2,804	2,795
-5.33%	2,718	2,687	2,655	2,621	2,586	2,551	2,514
-2.67%	1,734	1,709	1,681	1,652	1,621	1,588	1,555

0%	6	5	3	0	-5	-11	-19
2.67%	-1,789	-1,789	-1,789	-1,789	-1,789	-1,789	-1,790
5.33%	-3,584	-3,584	-3,584	-3,584	-3,584	-3,584	-3,584
8.00%	-5,379	-5,379	-5,379	-5,379	-5,379	-5,379	-5,379
	KR4201M52	2017-05 콜280					18,802
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,921	7,920	7,918	7,913	7,906	7,895	7,879
-5.33%	7,810	7,752	7,684	7,607	7,521	7,429	7,331
-2.67%	5,670	5,536	5,399	5,260	5,120	4,979	4,837
0%	63	50	29	0	-37	-83	-136
2.67%	-6,217	-6,217	-6,218	-6,218	-6,220	-6,224	-6,230
5.33%	-12,509	-12,509	-12,509	-12,509	-12,509	-12,510	-12,510
8.00%	-18,802	-18,802	-18,802	-18,802	-18,802	-18,802	-18,802
	KR4301M52	2017-05 풋277.5					2,228
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,203	-2,204	-2,206	-2,209	-2,214	-2,220	-2,228
-5.33%	-750	-777	-805	-834	-863	-894	-925
-2.67%	-53	-74	-98	-123	-150	-178	-207
0%	5	4	3	0	-4	-9	-16
2.67%	5	5	5	5	5	5	4
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	5	5	5	5	5	5	5
	KR4301M52	2017-05 풋280					1,889
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,882	-1,882	-1,883	-1,883	-1,885	-1,886	-1,889
-5.33%	-820	-830	-842	-855	-870	-886	-902
-2.67%	-107	-130	-153	-177	-201	-226	-250
0%	11	9	5	0	-6	-14	-23
2.67%	13	13	13	13	12	12	11
5.33%	13	13	13	13	13	13	13
8.00%	13	13	13	13	13	13	13

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

29,934

공시일	2017-05-04
기준일	2017-05-02

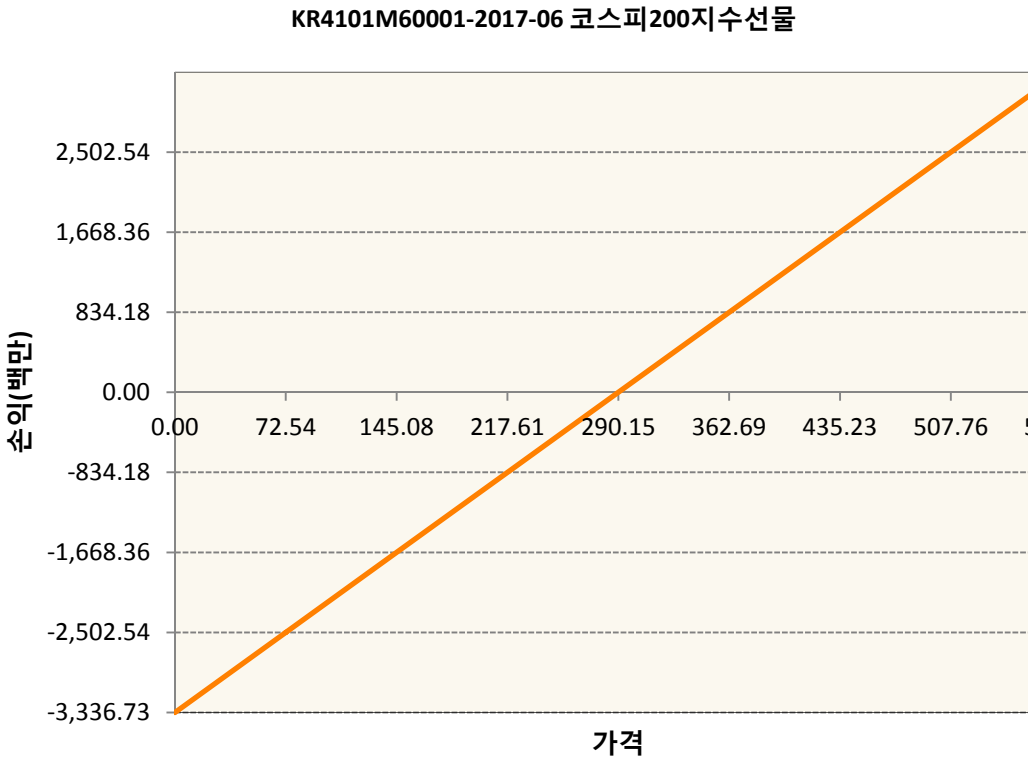
커버드콜목표전환형증권투자신탁

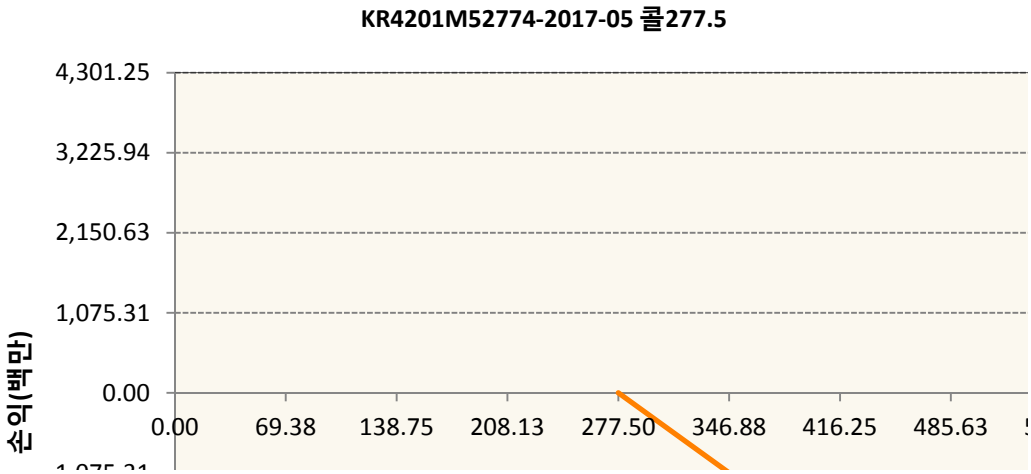
1. 계약금액

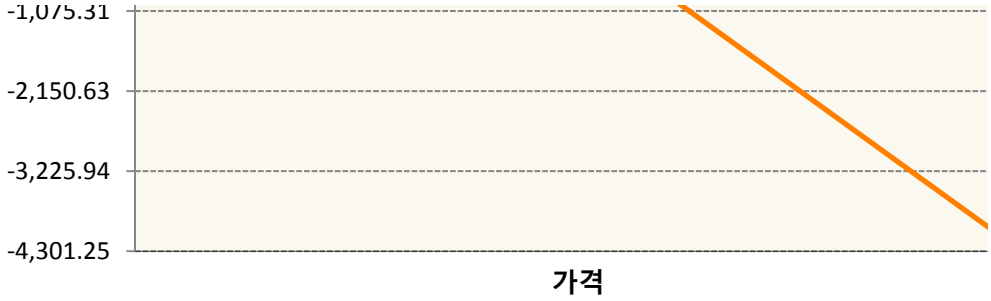
(단위:백만원)

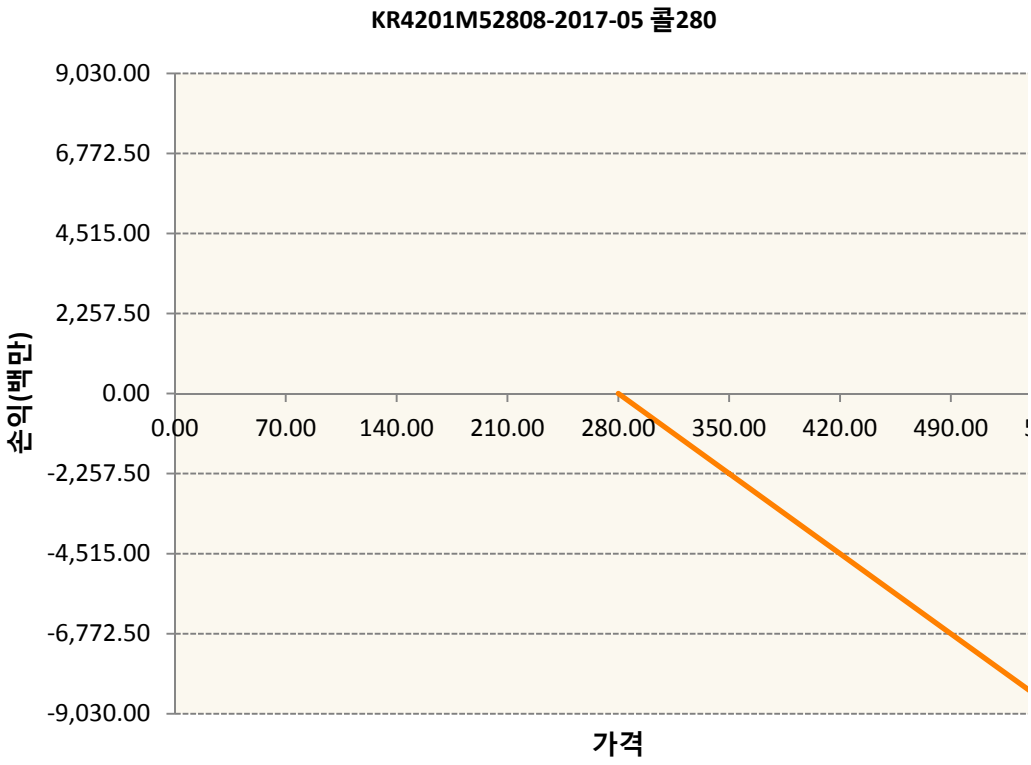
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,337	0	3,337	장내
누계	유가증권	옵션	0	13,331	-13,331	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							266
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-266	-266	-266	-266	-266	-266	-266
-5.33%	-178	-178	-178	-178	-178	-178	-178
-2.67%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	89	89	89	89	89	89	89
5.33%	178	178	178	178	178	178	178
8.00%	266	266	266	266	266	266	266
KR4201M52 2017-05 콜277.5							359
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	188	188	188	188	187	187	186
-5.33%	181	179	177	175	172	170	168
-2.67%	116	114	112	110	108	106	104
0%	0	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119
5.33%	-239	-239	-239	-239	-239	-239	-239
8.00%	-359	-359	-359	-359	-359	-359	-359
KR4201M52(	2017-05 콜280						744

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	313	313	313	313	313	312	312
-5.33%	309	307	304	301	298	294	290
-2.67%	224	219	214	208	203	197	191
0%	3	2	1	0	-1	-3	-5
2.67%	-246	-246	-246	-246	-246	-246	-247
5.33%	-495	-495	-495	-495	-495	-495	-495
8.00%	-744	-744	-744	-744	-744	-744	-744

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

1,407

공시일	2017-05-04
기준일	2017-05-02

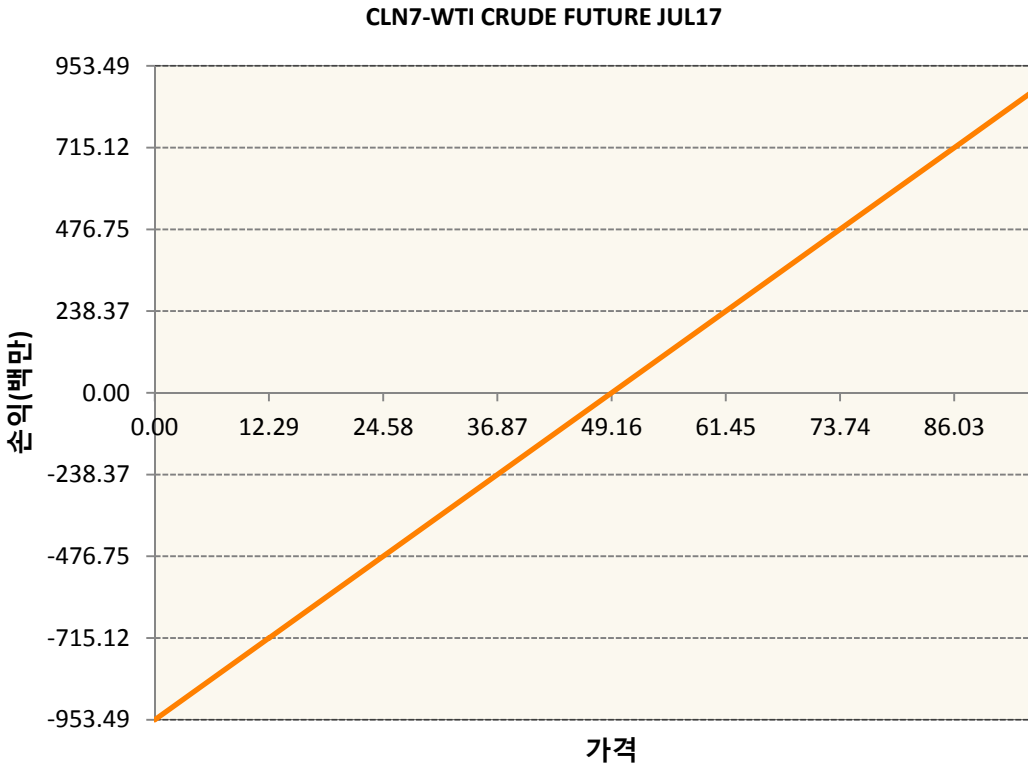
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

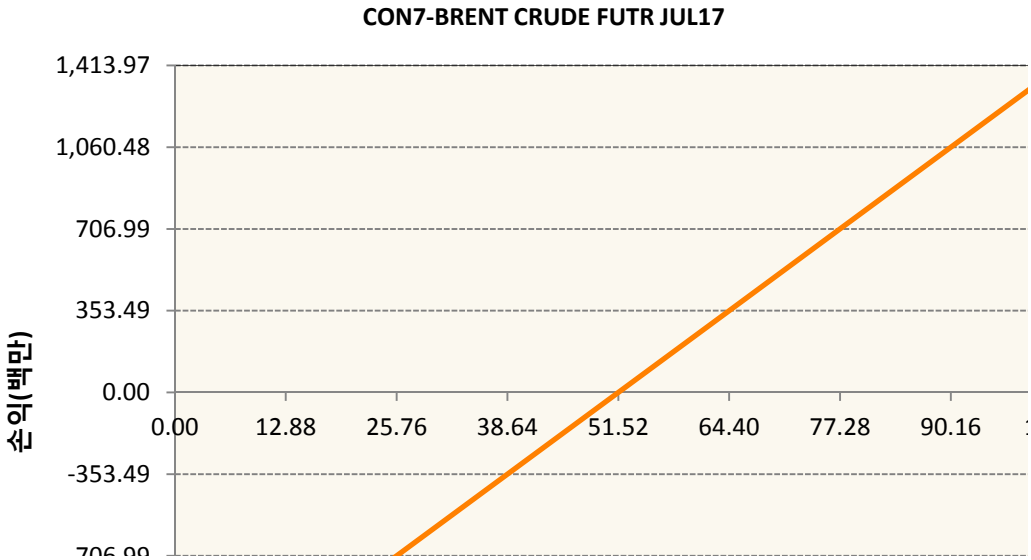
1. 계약금액

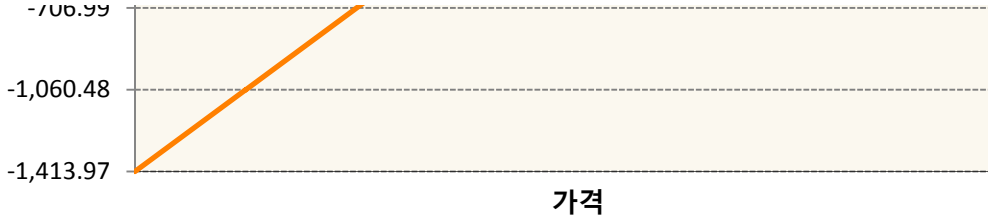
(단위:백만원)

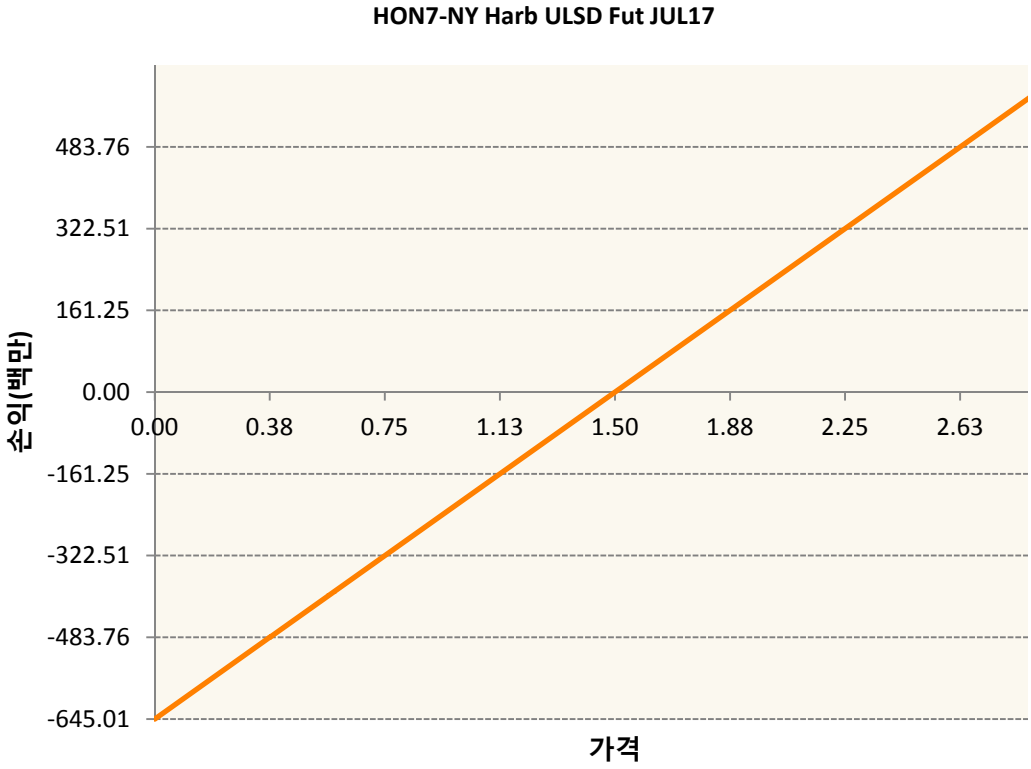
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,213	407	4,806	

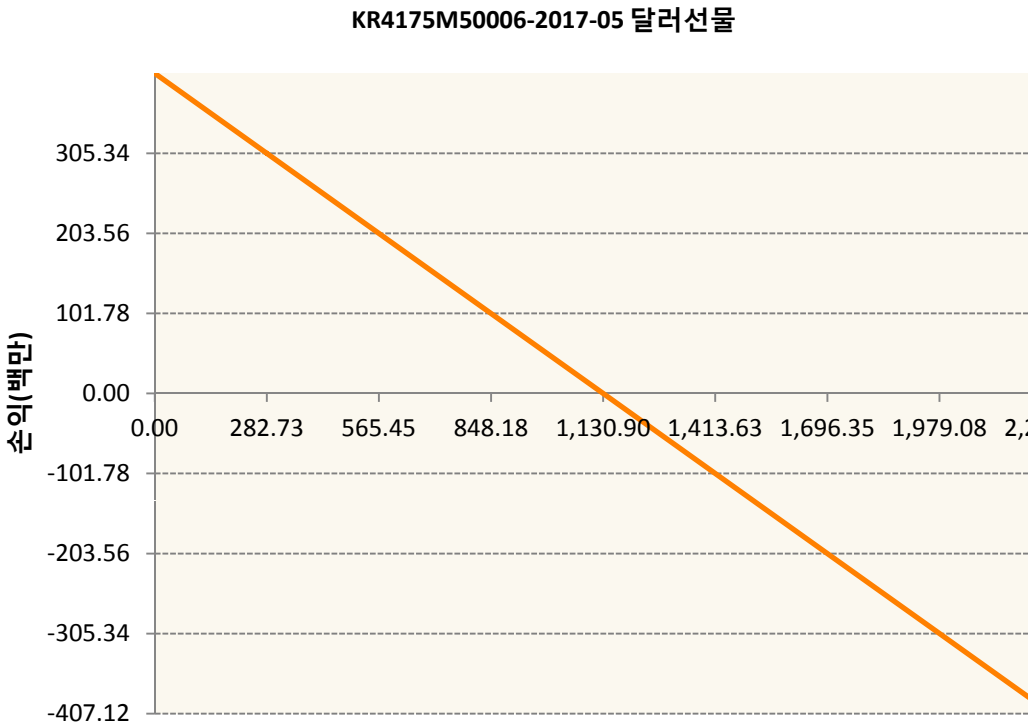
2. 만기시점의 손익구조



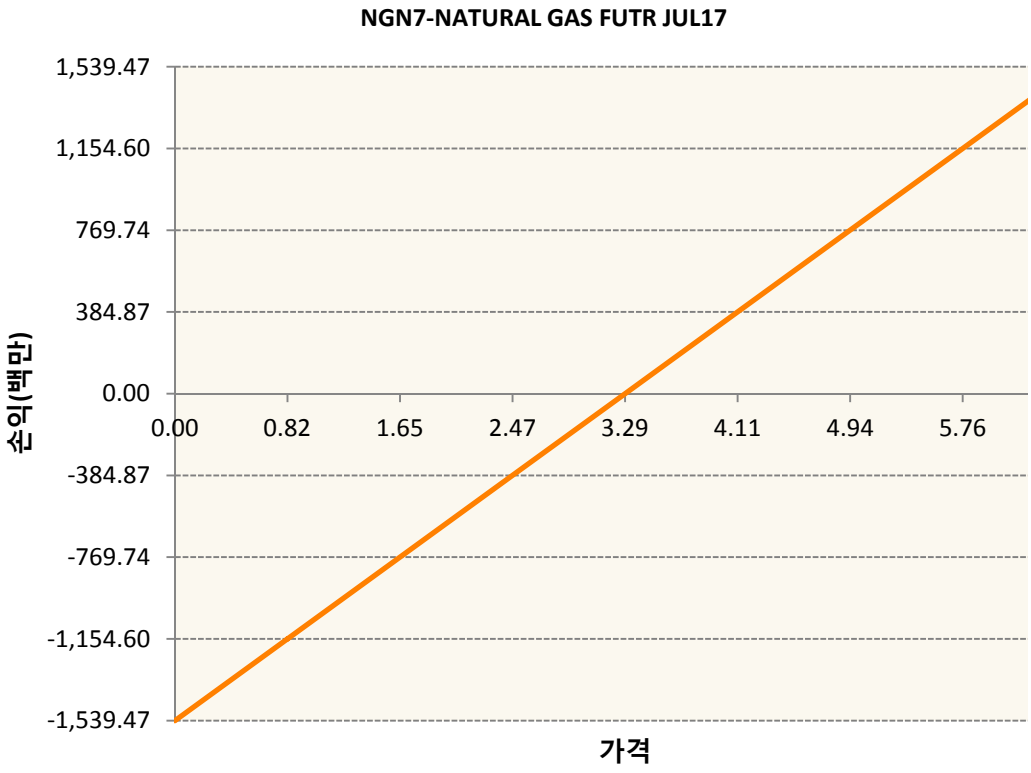


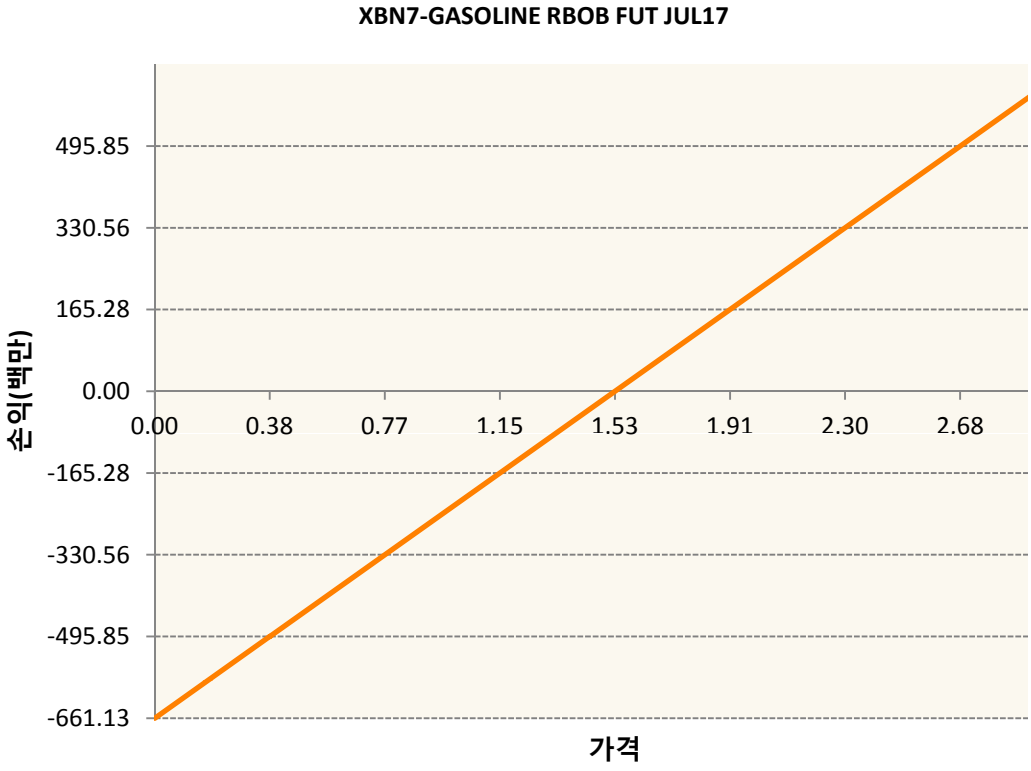

-1,060.48
-1,413.97
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
483.76
322.51
161.25
0.00
-161.25
-322.51
-483.76
-645.01
0.00
0.38
0.75
1.13
1.50
1.88
2.25
2.63
순이익(백만)
가격


KR4175M50006-2017-05 달러선물
305.34
203.56
101.78
0.00
-101.78
-203.56
-305.34
-407.12
0.00
282.73
565.45
848.18
1,130.90
1,413.63
1,696.35
1,979.08
순이익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,539.47
1,154.60
769.74
384.87
0.00
-384.87
-769.74
-1,154.60
-1,539.47
0.00
0.82
1.65
2.47
3.29
4.11
4.94
5.76
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
495.85
330.56
165.28
0.00
-165.28
-330.56
-495.85
-661.13
0.00
0.38
0.77
1.15
1.53
1.91
2.30
2.68
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN7	WTI CRUDE FUTURE JUL17	76
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	113
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	52
KR4175M50(	2017-05 달러선물	33
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	123
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	53

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

905

공시일	2017-05-04
기준일	2017-05-02

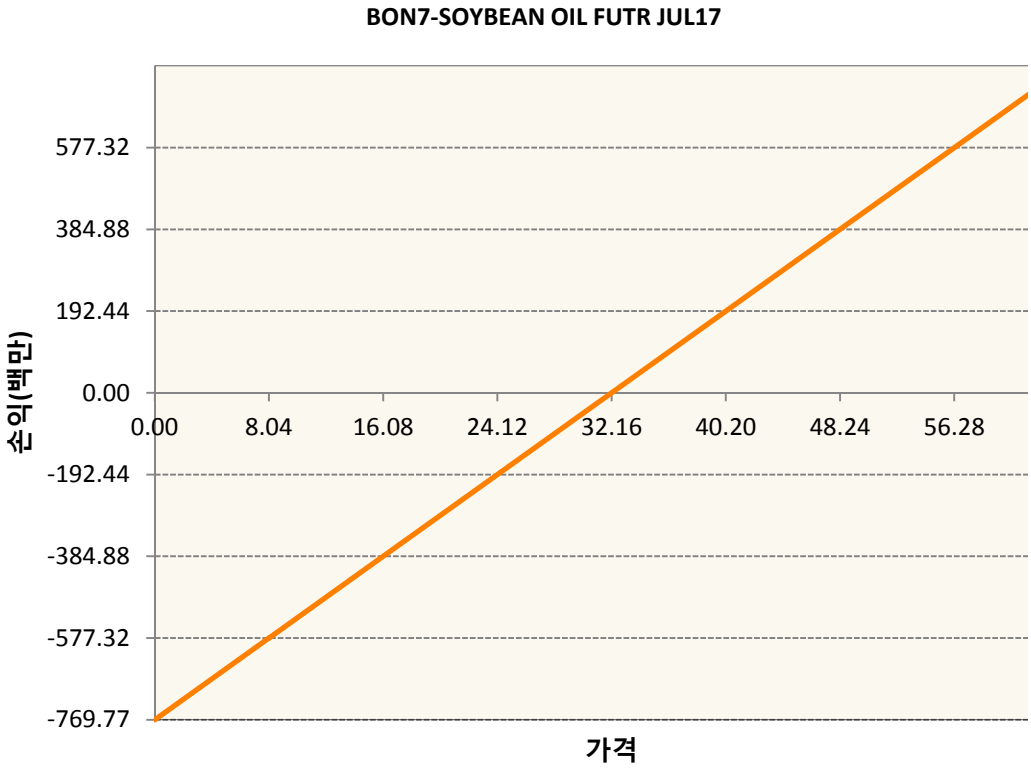
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

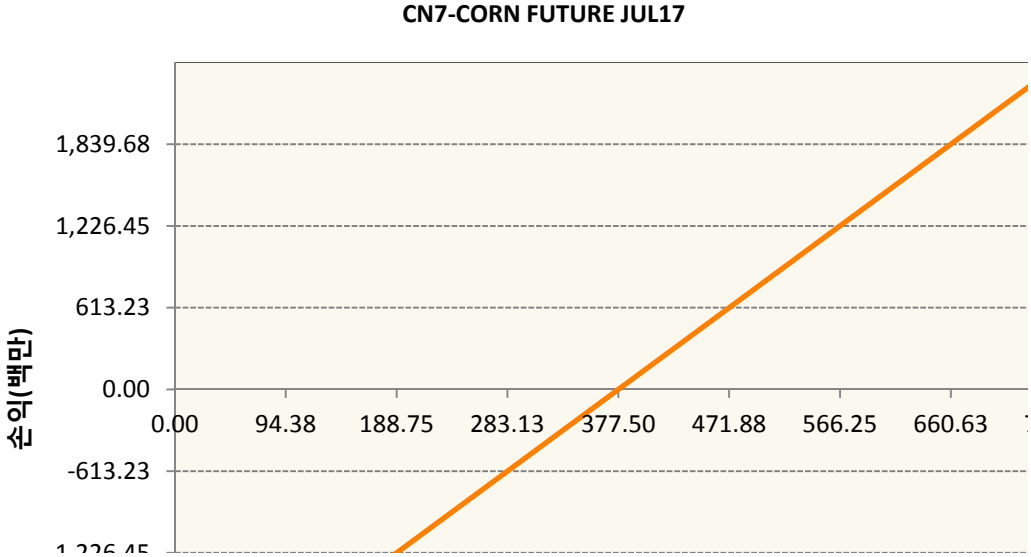
1. 계약금액

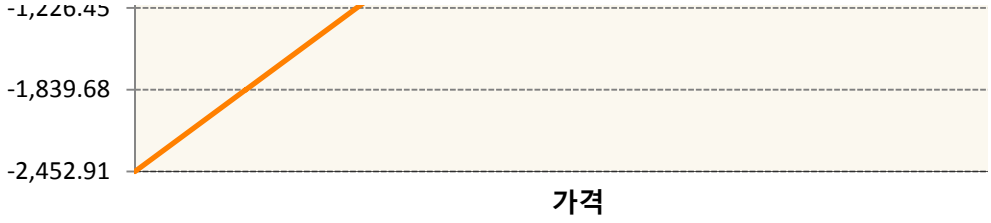
(단위:백만원)

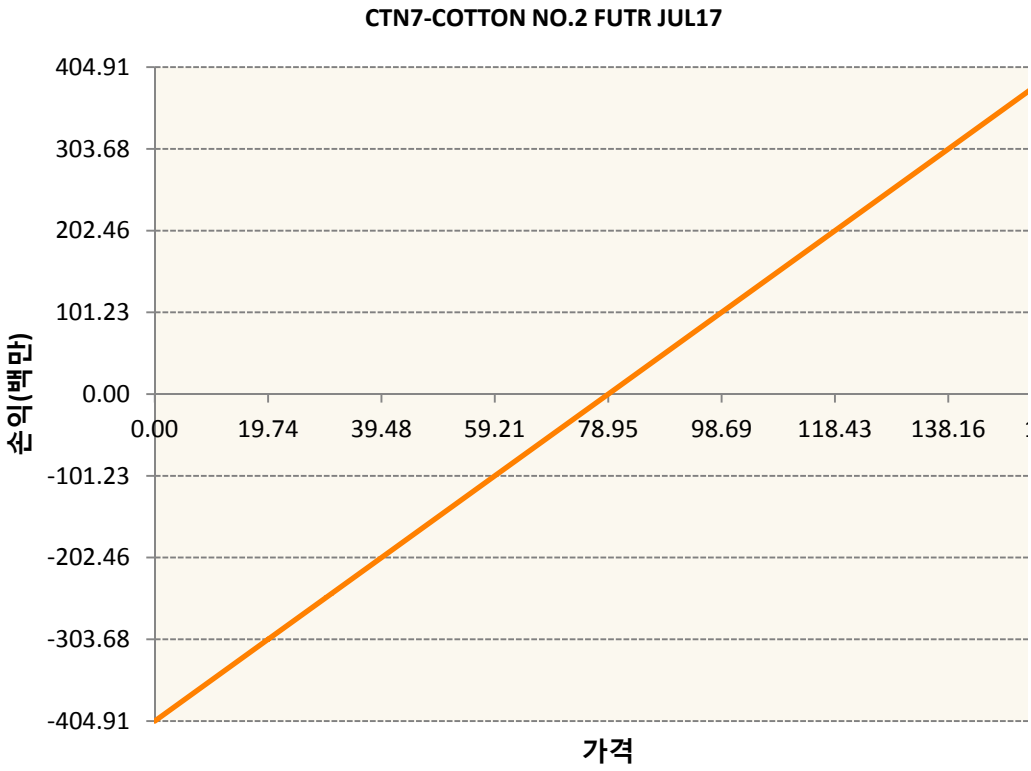
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,063	396	8,667	

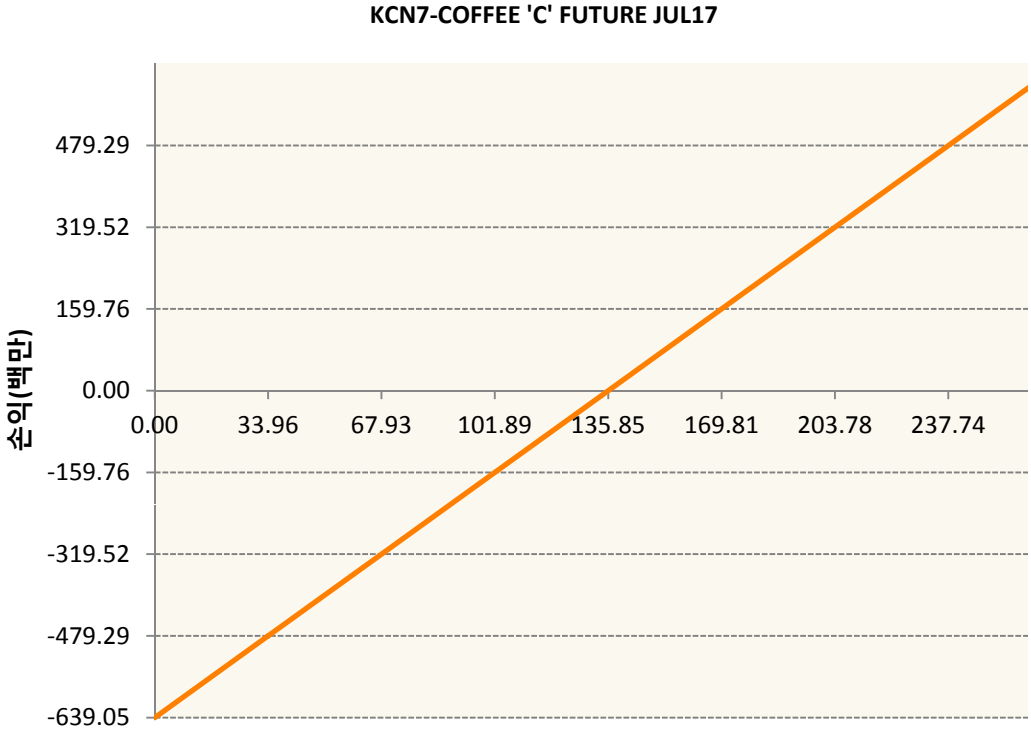
2. 만기시점의 손익구조



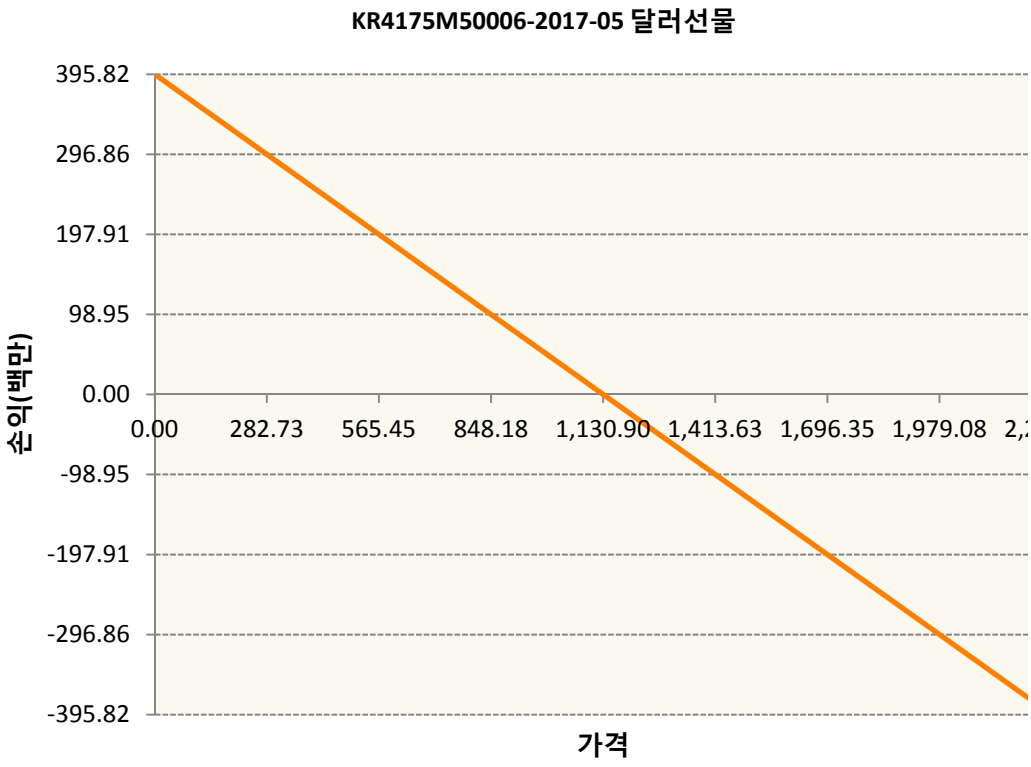


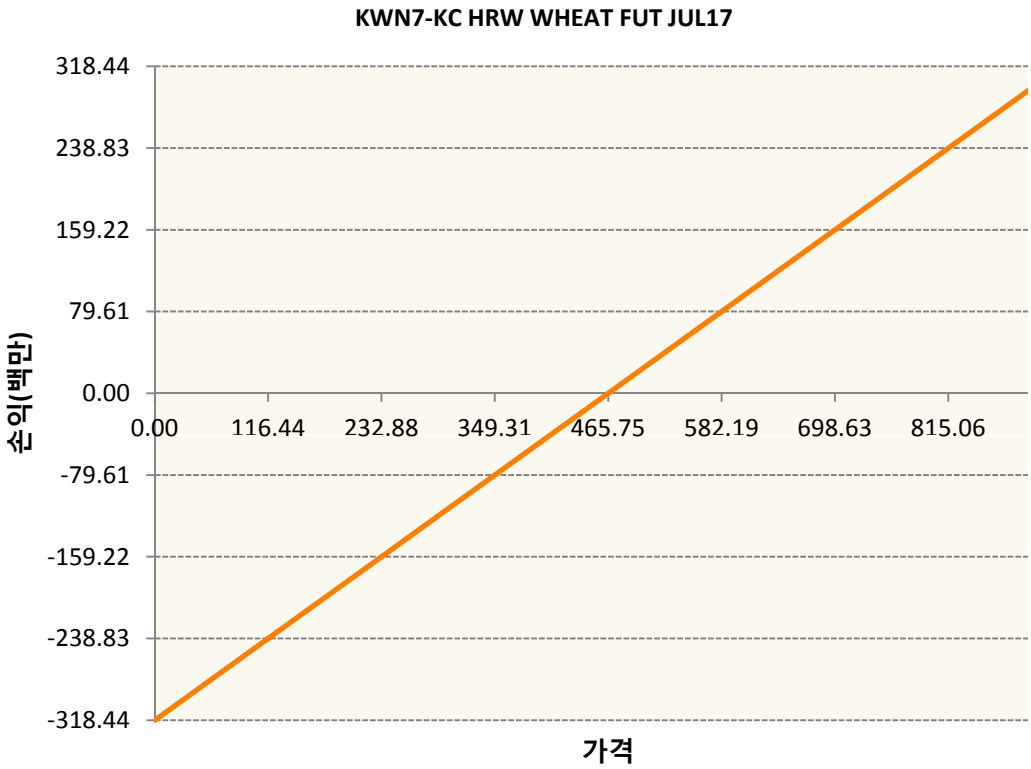

-1,839.68
-2,452.91
가격

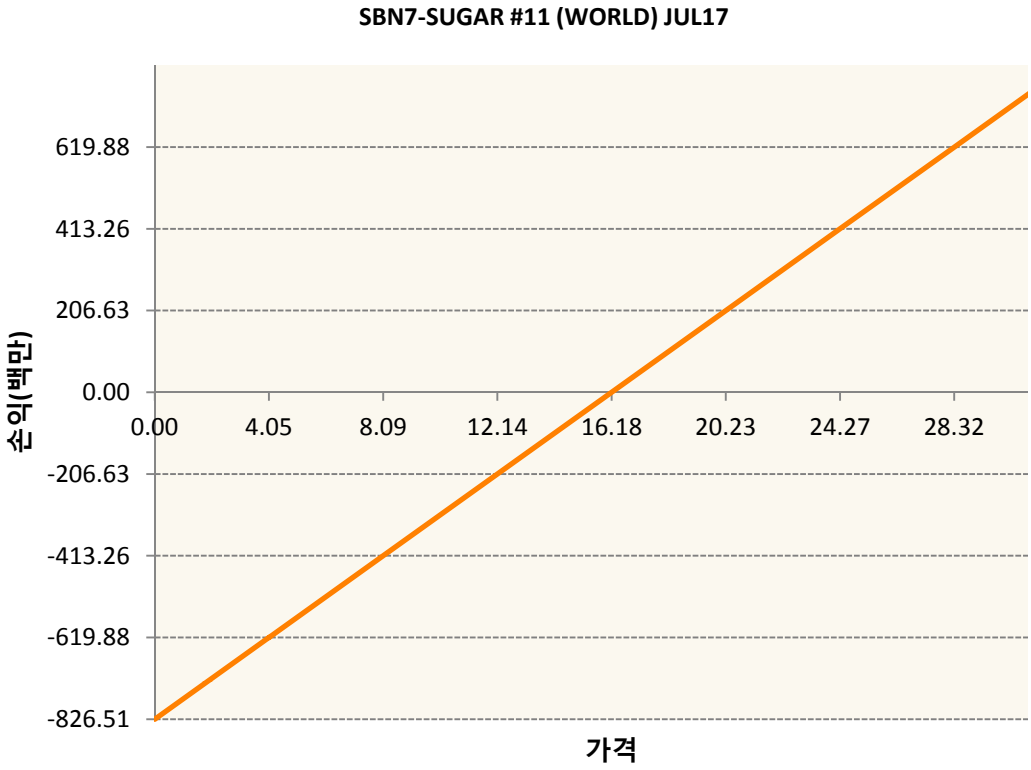

CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
404.91
303.68
202.46
101.23
0.00
-101.23
-202.46
-303.68
-404.91
0.00
19.74
39.48
59.21
78.95
98.69
118.43
138.16
순익(백만)
가격

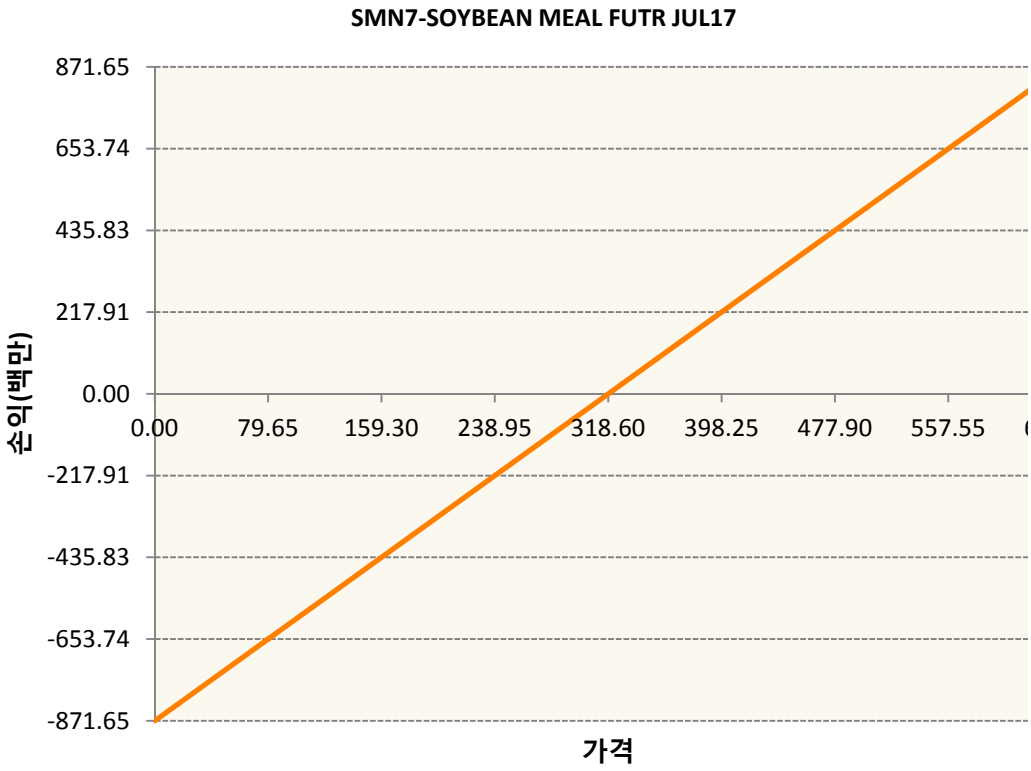

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
479.29
319.52
159.76
0.00
-159.76
-319.52
-479.29
-639.05
0.00
33.96
67.93
101.89
135.85
169.81
203.78
237.74
순익(백만)

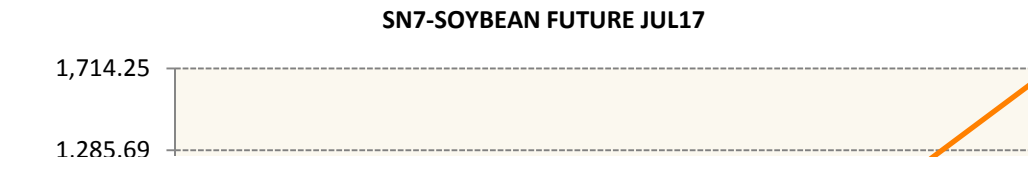
가격

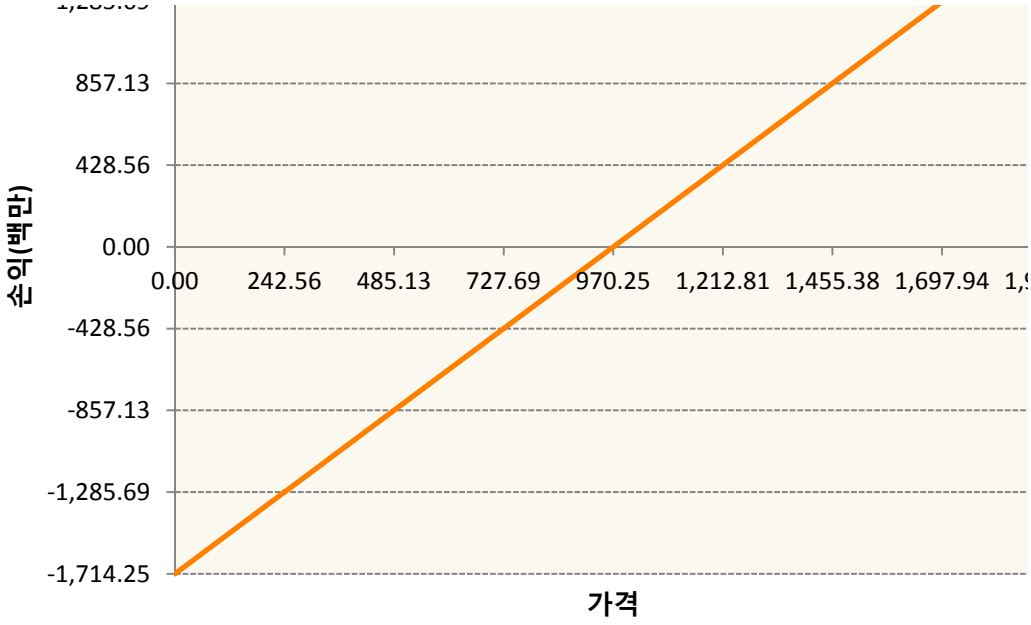

KR4175M50006-2017-05 달러선물
395.82
296.86
197.91
98.95
0.00
-98.95
-197.91
-296.86
-395.82
0.00
282.73
565.45
848.18
1,130.90
1,413.63
1,696.35
1,979.08
순이(백만)
가격

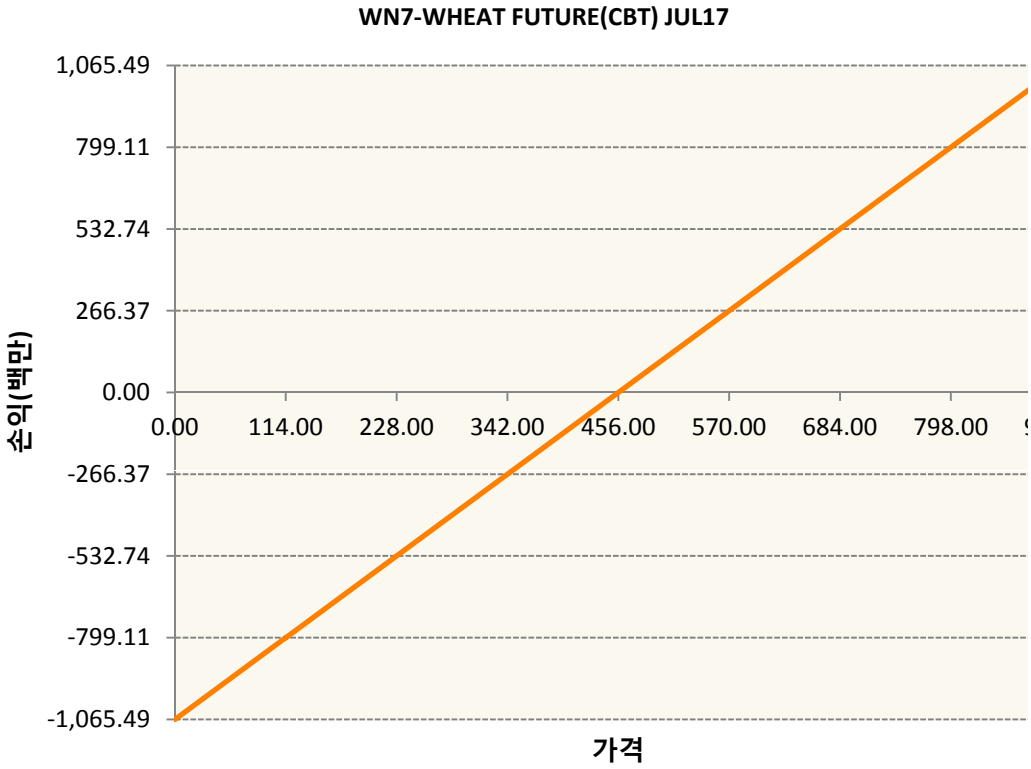

KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17
318.44
238.83
159.22
79.61
0.00
-79.61
-159.22
-238.83
-318.44
0.00
116.44
232.88
349.31
465.75
582.19
698.63
815.06
순이(백만)
가격


SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
619.88
413.26
206.63
0.00
-206.63
-413.26
-619.88
-826.51
0.00
4.05
8.09
12.14
16.18
20.23
24.27
28.32
손익(백만)
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
871.65
653.74
435.83
217.91
0.00
-217.91
-435.83
-653.74
-871.65
0.00
79.65
159.30
238.95
318.60
398.25
477.90
557.55
손익(백만)
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,714.25
1,285.69





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	62
CN7	CORN FUTURE JUL17	196
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	32
KCN7	COFFEE 'C' FUTURE JUL17	51
KR4175M50(	2017-05 달러선물	32

KWN7	KC HRW WHEAT FUT JUL17	25
SBN7	SUGAR #11 (WORLD) JUL17	66
SMN7	SOYBEAN MEAL FUTR JUL17	70
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	137
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	85

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

828