공시일	2017-05-08
기준일	2017-05-04

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	2017-05-08
기준일	2017-05-04

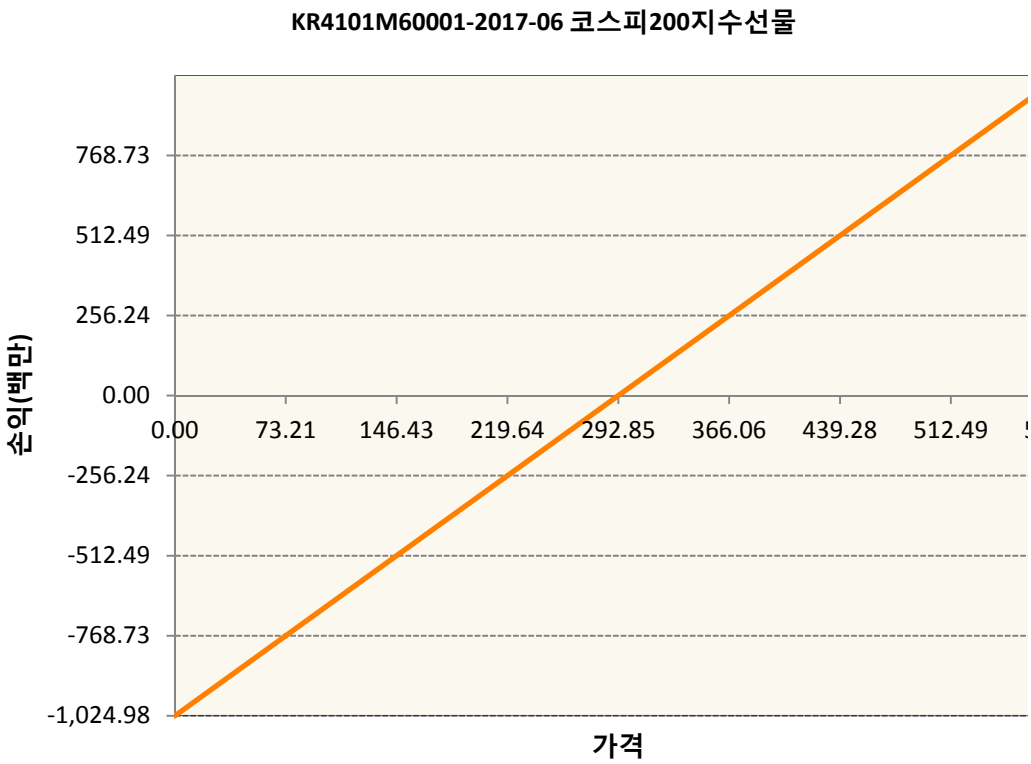
스마트인덱스모

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	1,025	0	1,025	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							82
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-5.33%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-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%	55	55	55	55	55	55	55
8.00%	82	82	82	82	82	82	82

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

52

공시일	2017-05-08
기준일	2017-05-04

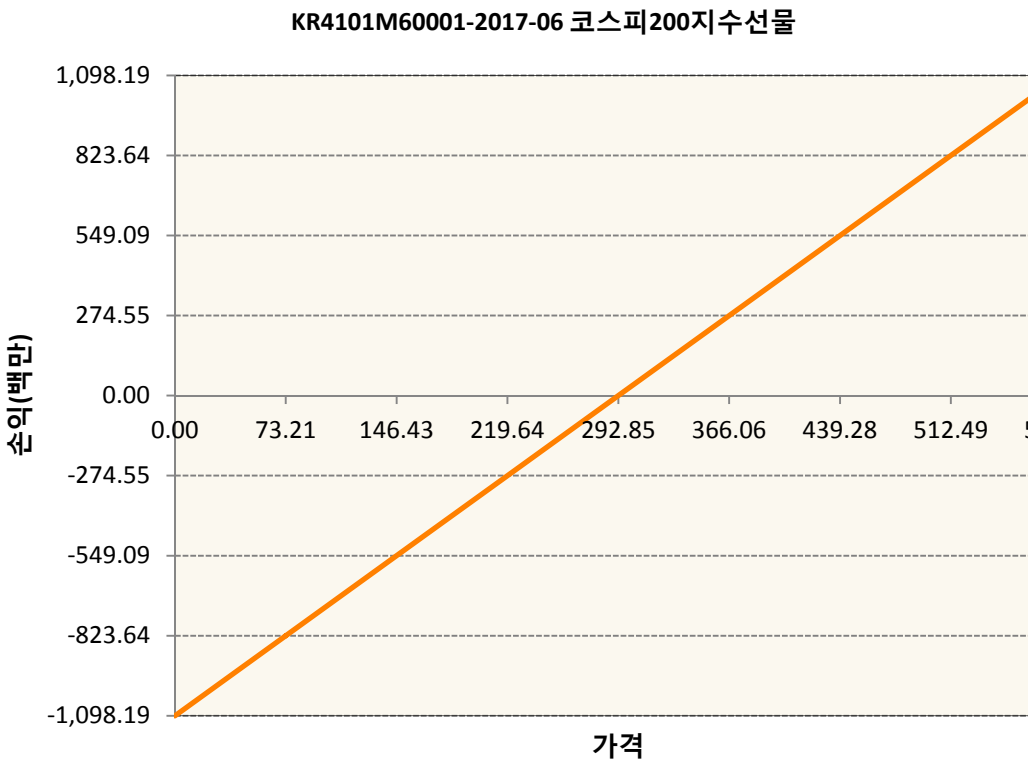
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,098	0	1,098	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							88
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-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%	88	88	88	88	88	88	88

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

56

공시일	2017-05-08
기준일	2017-05-04

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)

551

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-05-08
기준일	2017-05-04

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	2017-05-08
기준일	2017-05-04

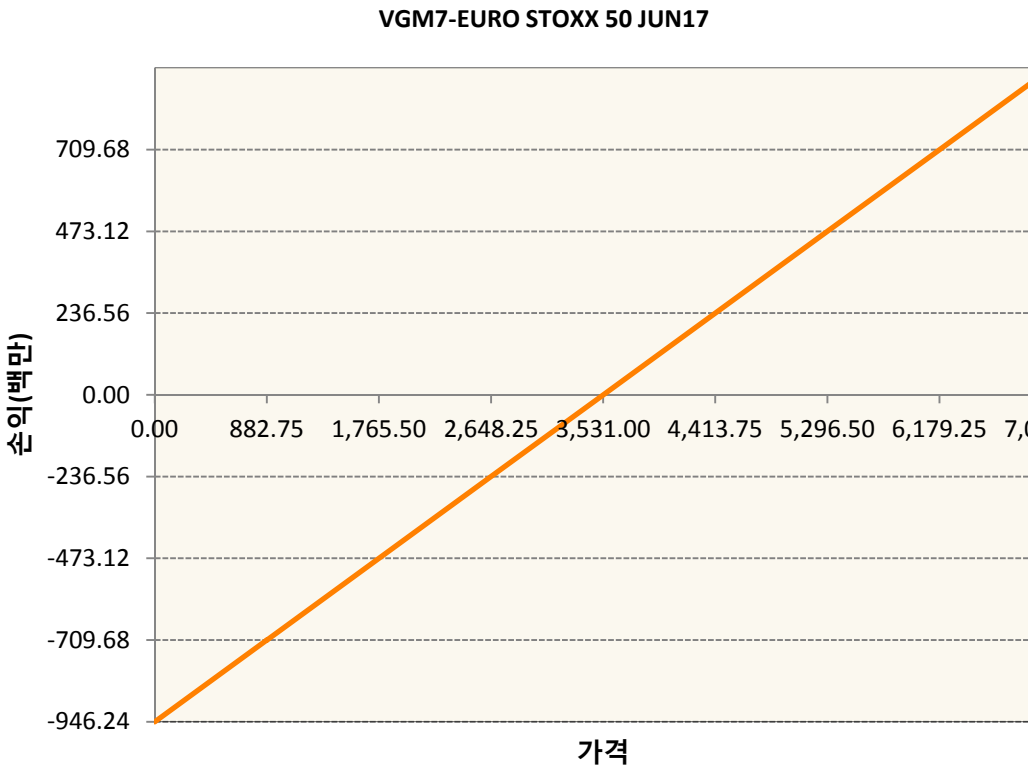
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	946	0	946	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM7	EURO STOXX 50 JUN17	76

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

(단위:백만원)

76

공시일	2017-05-08
기준일	2017-05-04

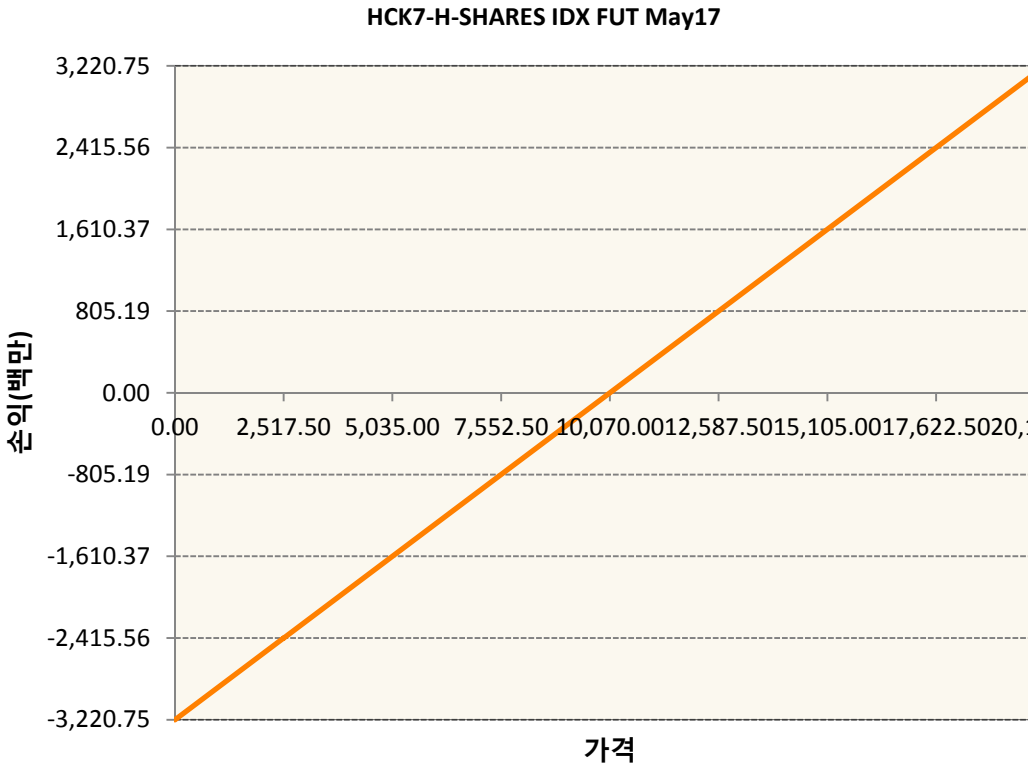
차이나인덱스모(주식-파생형)

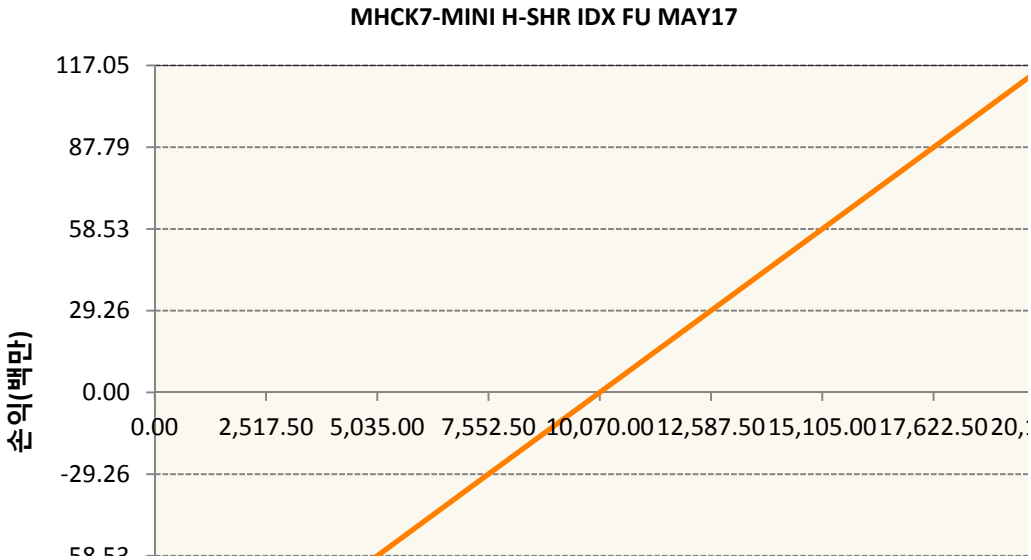
1. 계약금액

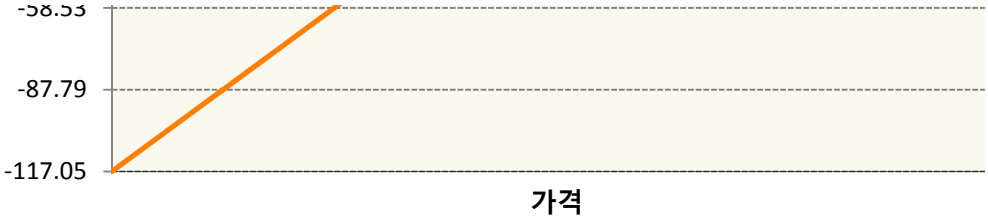
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,338	0	3,338	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCK7	H-SHARES IDX FUT May17	258
MHCK7	MINI H-SHR IDX FU MAY17	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	284

공시일	2017-05-08
기준일	2017-05-04

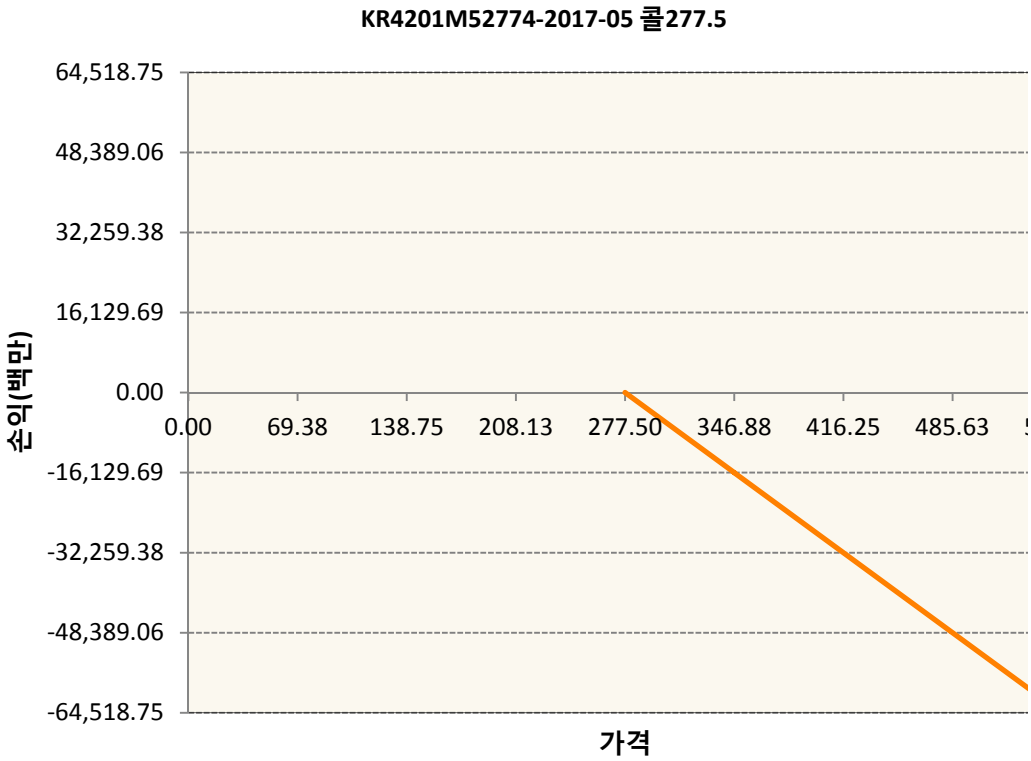
커버드콜모(주식혼합-파생형)

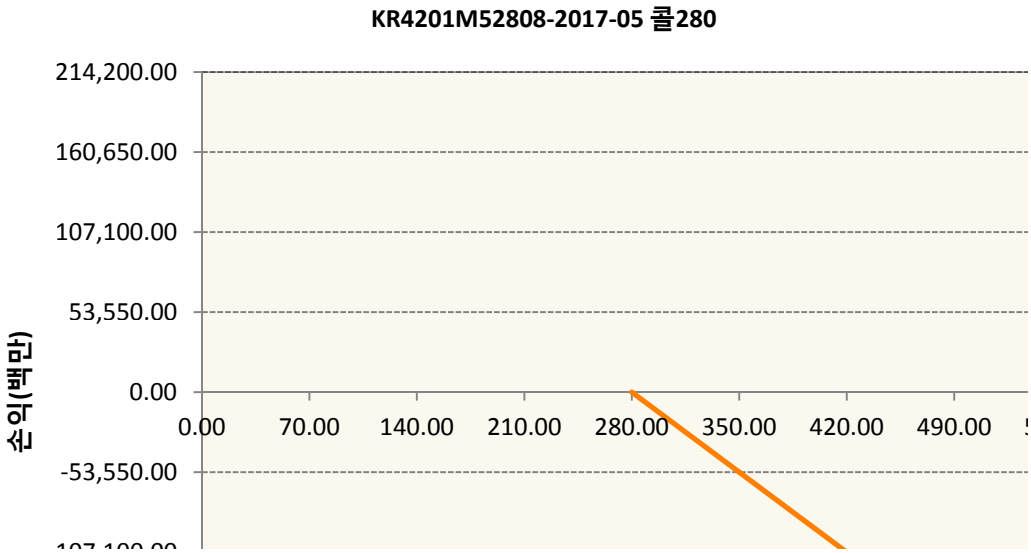
1. 계약금액

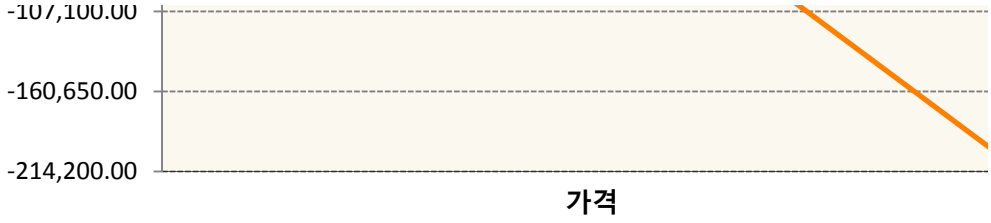
(단위:백만원)

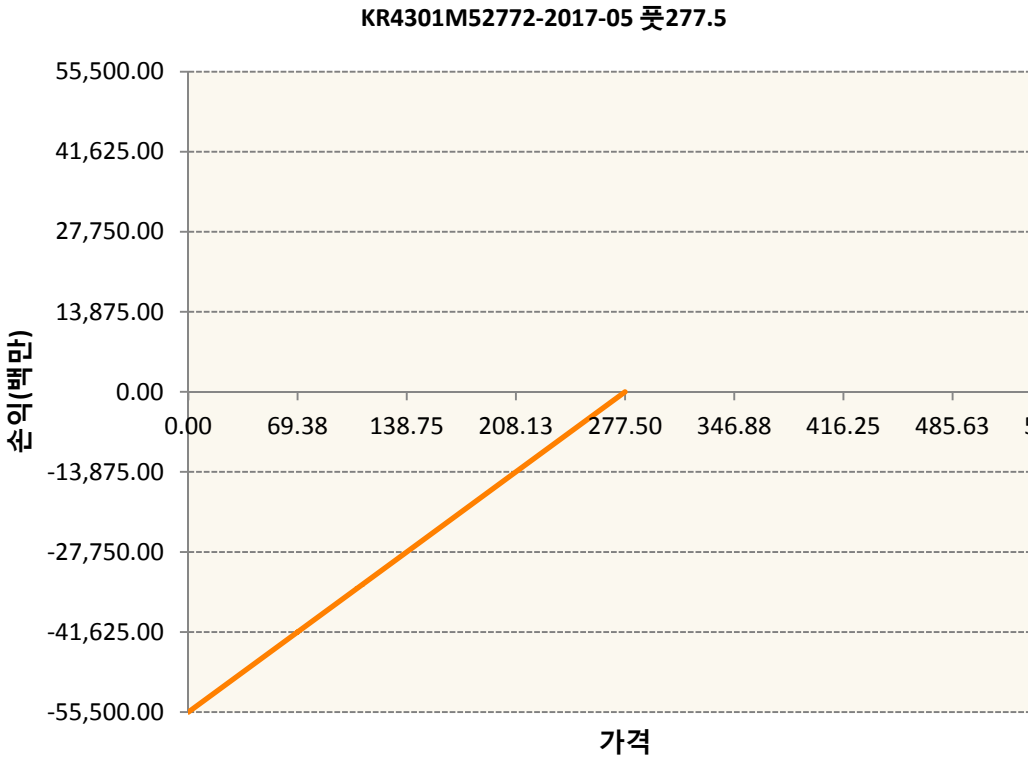
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	13,433	7,002	6,431	장내
누계	유가증권	옵션	0	380,419	-380,419	장내

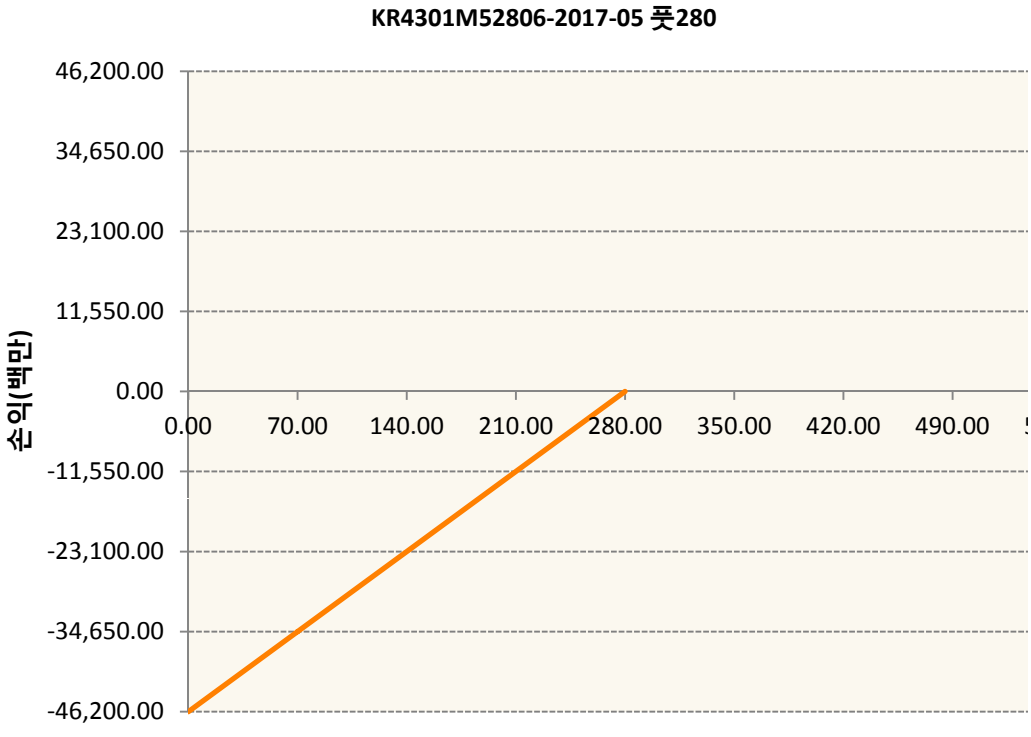
2. 만기시점의 손익구조






-107,100.00
-160,650.00
-214,200.00
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
-55,500.00
0.00
69.38
138.75
208.13
277.50
346.88
416.25
485.63
손익(백만)
가격


KR4301M52806-2017-05 풋280
46,200.00
34,650.00
23,100.00
11,550.00
0.00
-11,550.00
-23,100.00
-34,650.00
-46,200.00
0.00
70.00
140.00
210.00
280.00
350.00
420.00
490.00
손익(백만)

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M52	2017-05 콜277.5						5,438
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,474	3,470	3,465	3,458	3,449	3,437	3,424
-5.33%	3,204	3,166	3,129	3,091	3,053	3,016	2,978
-2.67%	1,804	1,796	1,786	1,774	1,759	1,742	1,723
0%	1	0	0	0	-1	-2	-4
2.67%	-1,812	-1,812	-1,812	-1,812	-1,812	-1,812	-1,812
5.33%	-3,625	-3,625	-3,625	-3,625	-3,625	-3,625	-3,625
8.00%	-5,438	-5,438	-5,438	-5,438	-5,438	-5,438	-5,438
KR4201M52	2017-05 콜280						17,884
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,533	9,531	9,526	9,518	9,506	9,489	9,467
-5.33%	9,221	9,130	9,034	8,933	8,829	8,722	8,612
-2.67%	5,824	5,761	5,688	5,608	5,523	5,432	5,337
0%	9	8	5	0	-8	-20	-37
2.67%	-5,955	-5,955	-5,955	-5,955	-5,956	-5,956	-5,956
5.33%	-11,920	-11,920	-11,920	-11,920	-11,920	-11,920	-11,920
8.00%	-17,884	-17,884	-17,884	-17,884	-17,884	-17,884	-17,884
KR4301M52	2017-05 풋277.5						1,733
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,690	-1,693	-1,697	-1,703	-1,711	-1,721	-1,733
-5.33%	-363	-395	-427	-460	-492	-525	-557
-2.67%	-8	-14	-23	-33	-46	-61	-77
0%	0	0	0	0	-1	-2	-3
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0
KR4301M52	2017-05 풋280						1,817
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,803	-1,804	-1,805	-1,806	-1,809	-1,813	-1,817
-5.33%	-584	-604	-624	-646	-669	-692	-715
-2.67%	-30	-44	-60	-77	-95	-115	-135
0%	2	2	1	0	-2	-4	-8
2.67%	2	2	2	2	2	2	2

5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

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

25,316

공시일	2017-05-08
기준일	2017-05-04

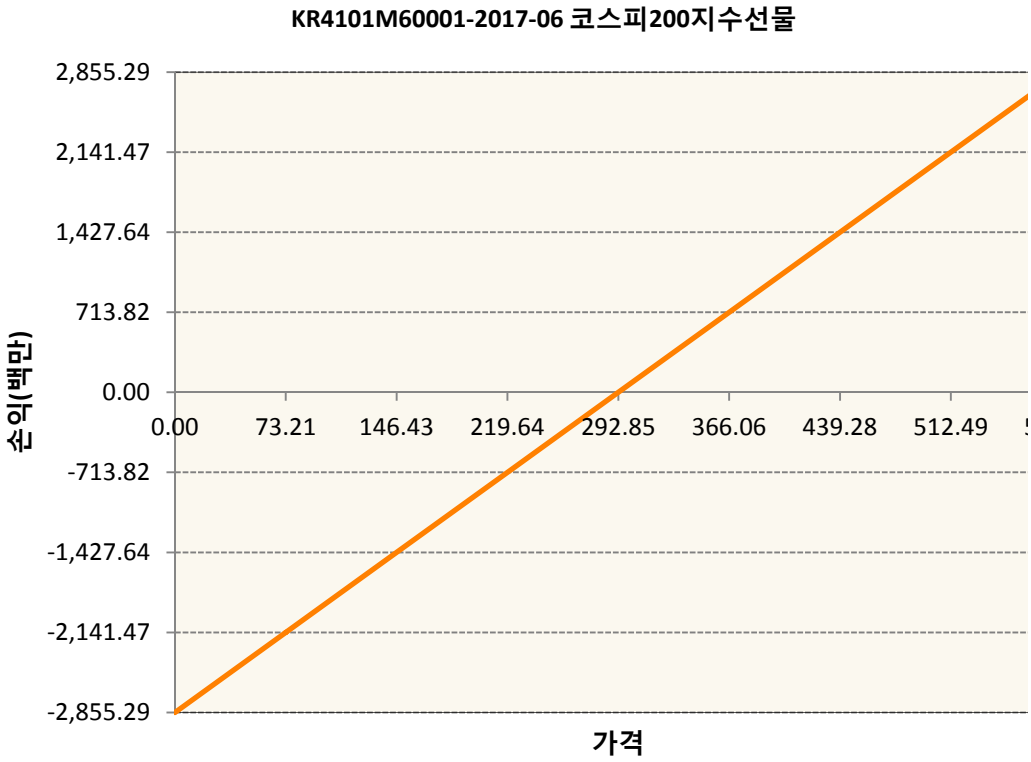
커버드콜목표전환형증권투자신탁

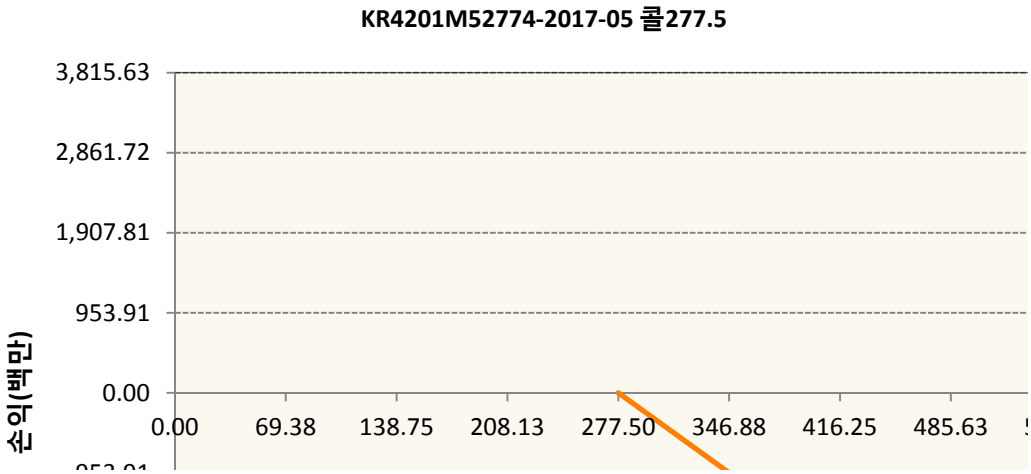
1. 계약금액

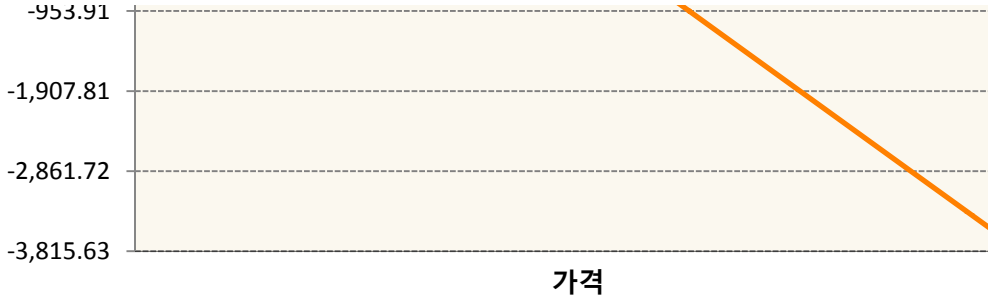
(단위:백만원)

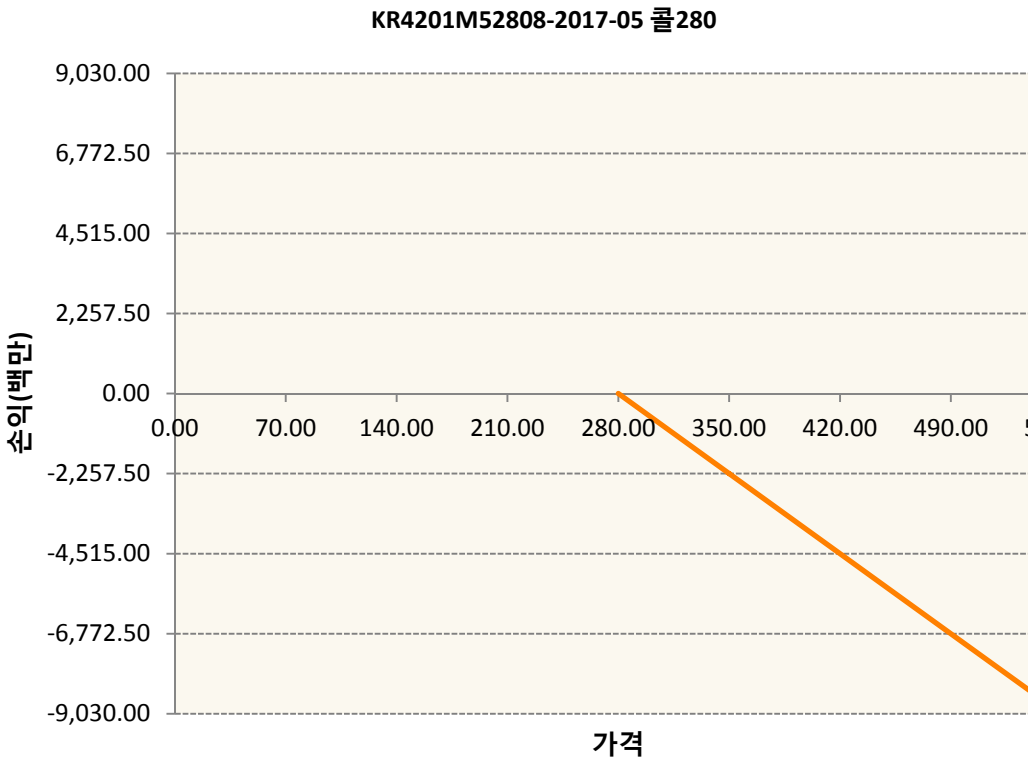
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	510	-510	장내
신규	유가증권	옵션	462	0	462	장내
누계	유가증권	선물	2,855	0	2,855	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,846	-12,846	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							228
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-228	-228	-228	-228	-228	-228	-228
-5.33%	-152	-152	-152	-152	-152	-152	-152
-2.67%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	76	76	76	76	76	76	76
5.33%	152	152	152	152	152	152	152
8.00%	228	228	228	228	228	228	228
KR4201M52 2017-05 콜277.5							322
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	205	205	205	204	204	203	202
-5.33%	189	187	185	183	181	178	176
-2.67%	107	106	106	105	104	103	102
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107
5.33%	-214	-214	-214	-214	-214	-214	-214
8.00%	-322	-322	-322	-322	-322	-322	-322
KR4201M52(	2017-05 콜280						754

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	402	402	402	401	401	400	399
-5.33%	389	385	381	377	372	368	363
-2.67%	246	243	240	236	233	229	225
0%	0	0	0	0	0	-1	-2
2.67%	-251	-251	-251	-251	-251	-251	-251
5.33%	-503	-503	-503	-503	-503	-503	-503
8.00%	-754	-754	-754	-754	-754	-754	-754

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

1,275

공시일	2017-05-08
기준일	2017-05-04

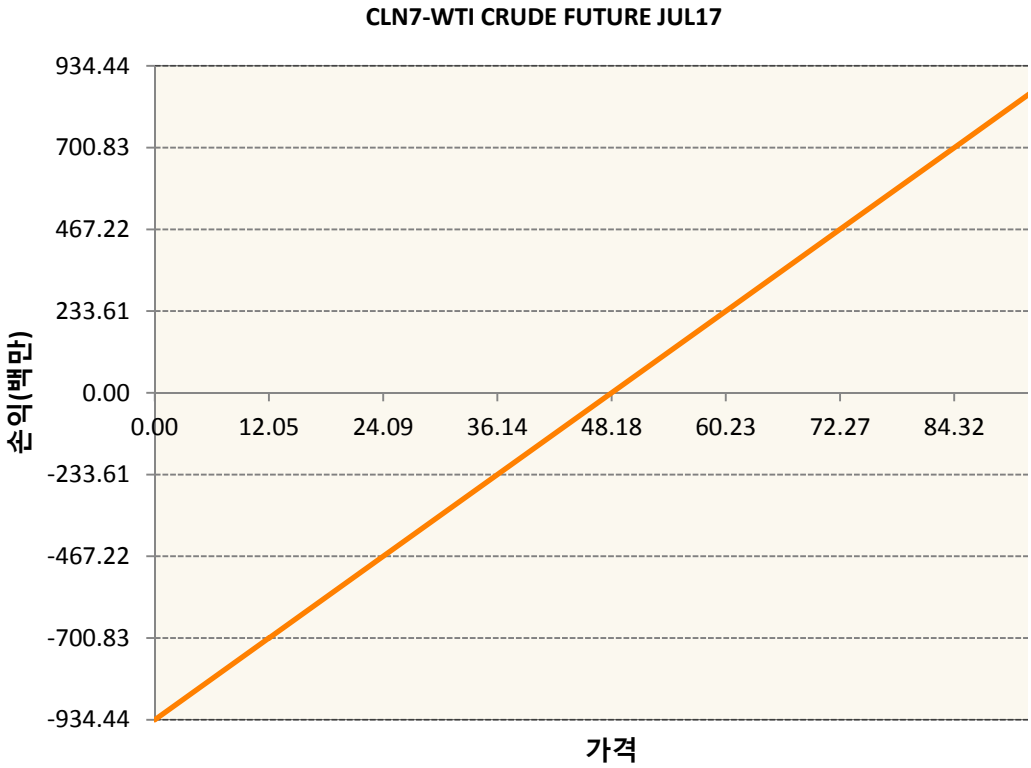
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

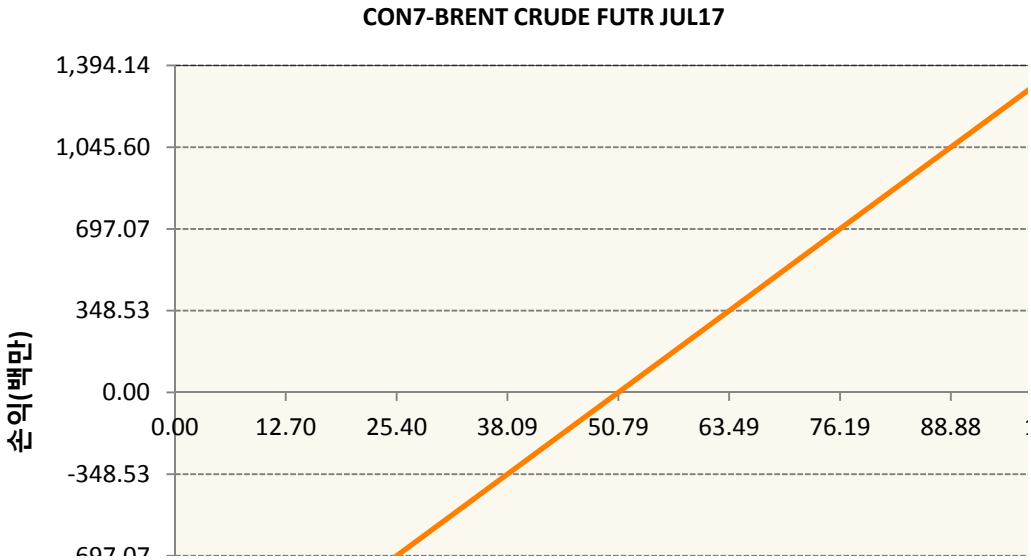
1. 계약금액

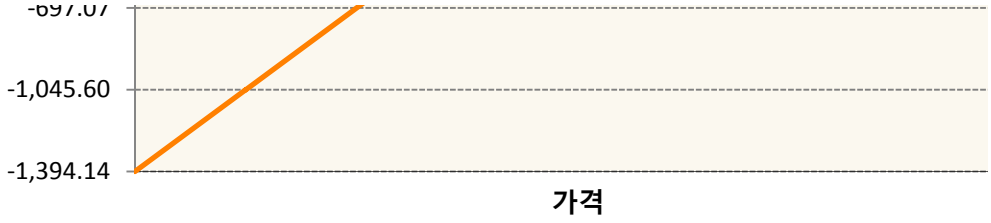
(단위:백만원)

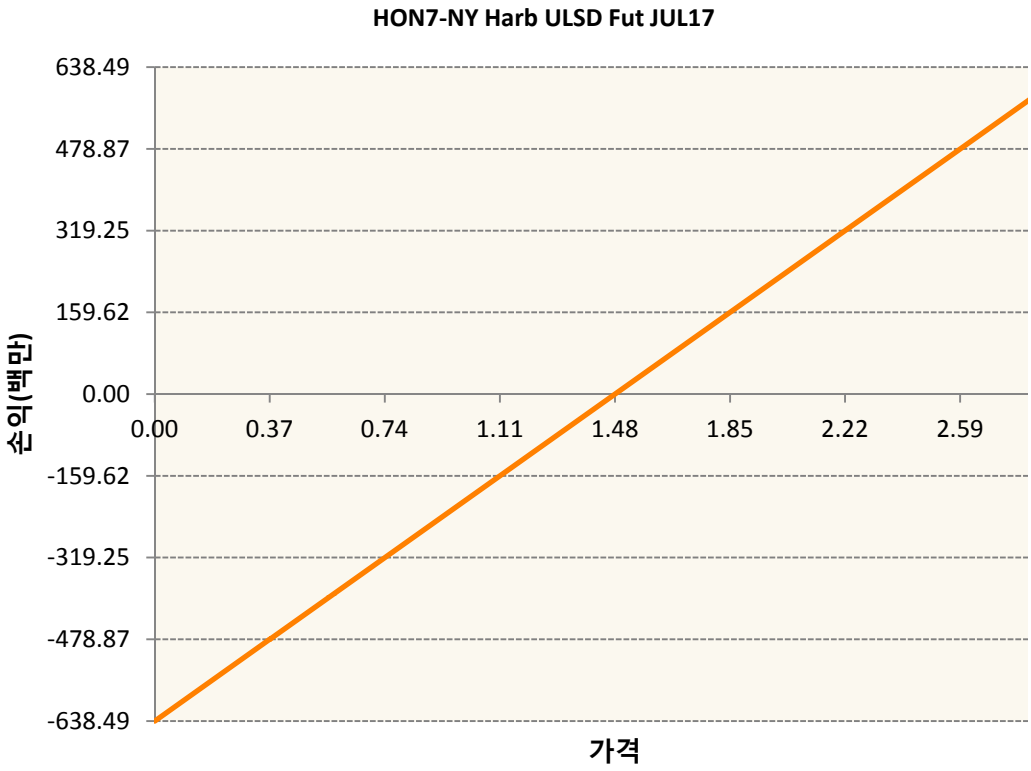
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,177	408	4,769	

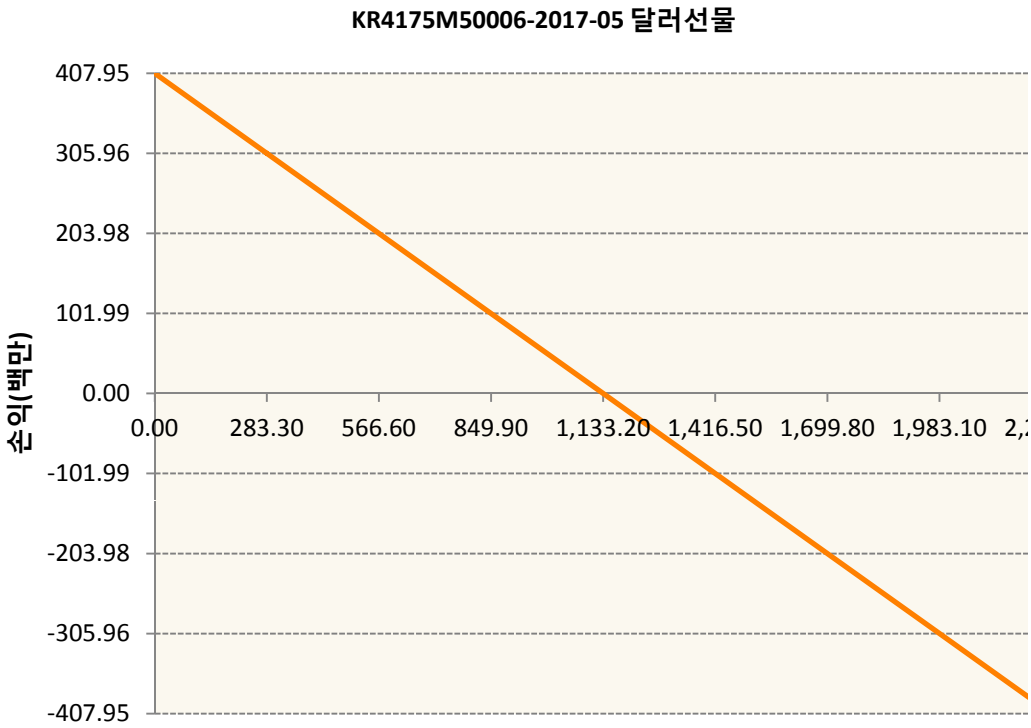
2. 만기시점의 손익구조



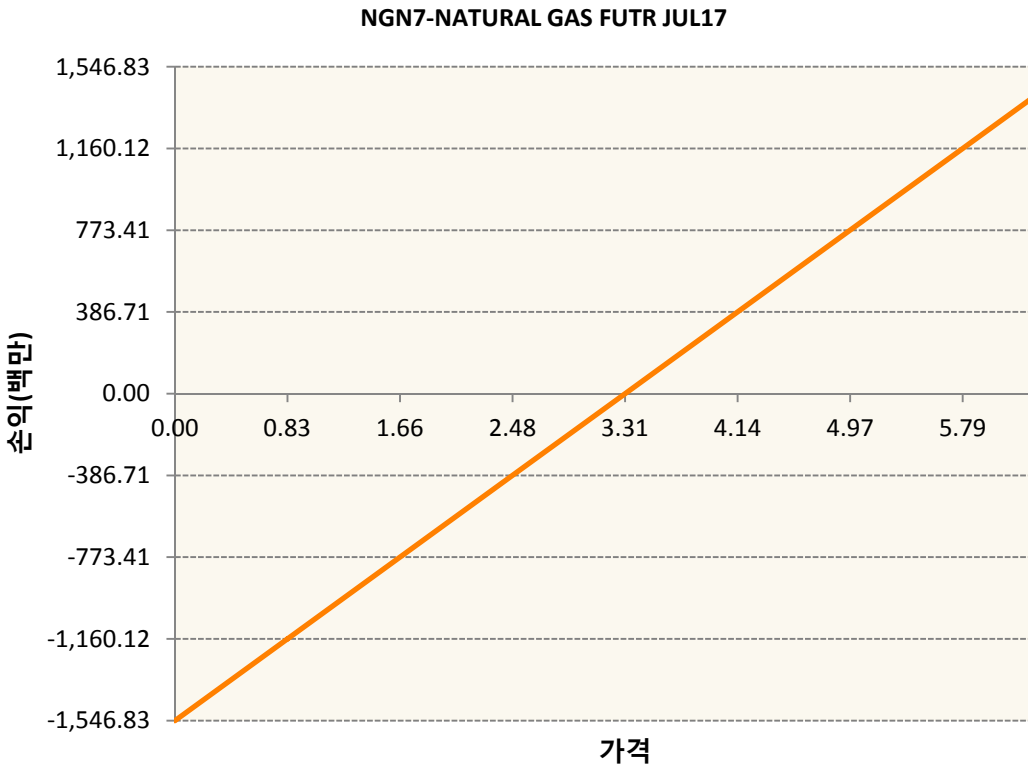


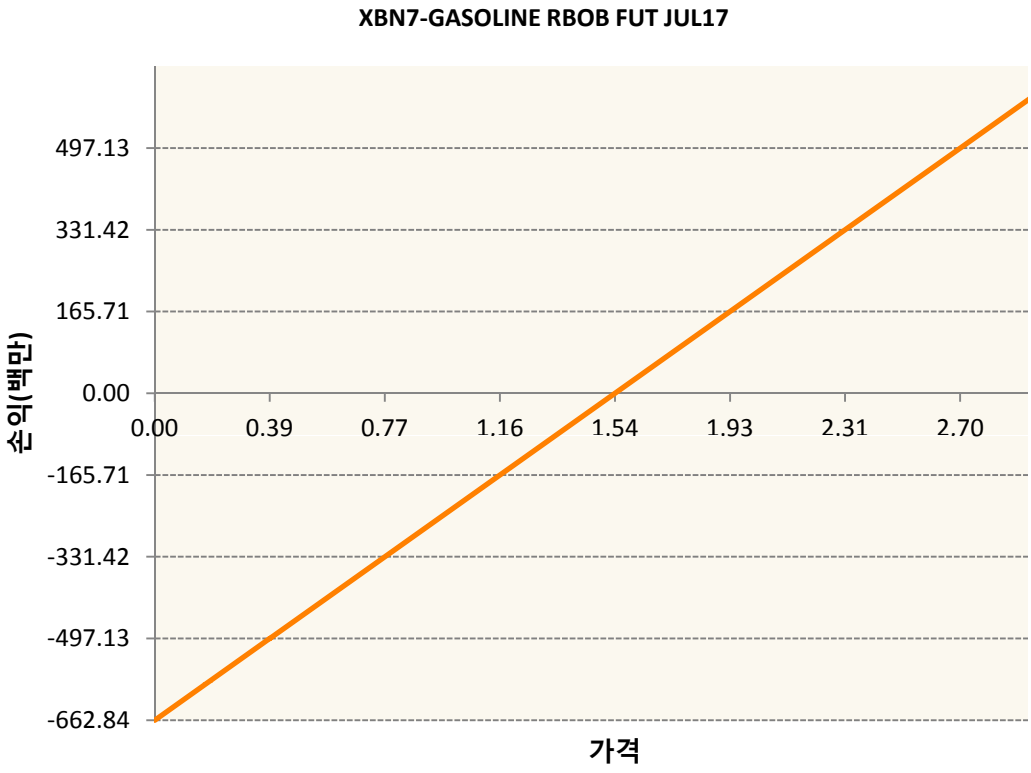

-1,045.60
-1,394.14
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
638.49
478.87
319.25
159.62
0.00
-159.62
-319.25
-478.87
-638.49
0.00
0.37
0.74
1.11
1.48
1.85
2.22
2.59
순이익(백만)
가격


KR4175M50006-2017-05 달러선물
407.95
305.96
203.98
101.99
0.00
-101.99
-203.98
-305.96
-407.95
0.00
283.30
566.60
849.90
1,133.20
1,416.50
1,699.80
1,983.10
순이익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,546.83
1,160.12
773.41
386.71
0.00
-386.71
-773.41
-1,160.12
-1,546.83
0.00
0.83
1.66
2.48
3.31
4.14
4.97
5.79
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
497.13
331.42
165.71
0.00
-165.71
-331.42
-497.13
-662.84
0.00
0.39
0.77
1.16
1.54
1.93
2.31
2.70
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN7	WTI CRUDE FUTURE JUL17	75
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	112
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	51
KR4175M50(	2017-05 달러선물	33
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	124
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	53

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

899

공시일	2017-05-08
기준일	2017-05-04

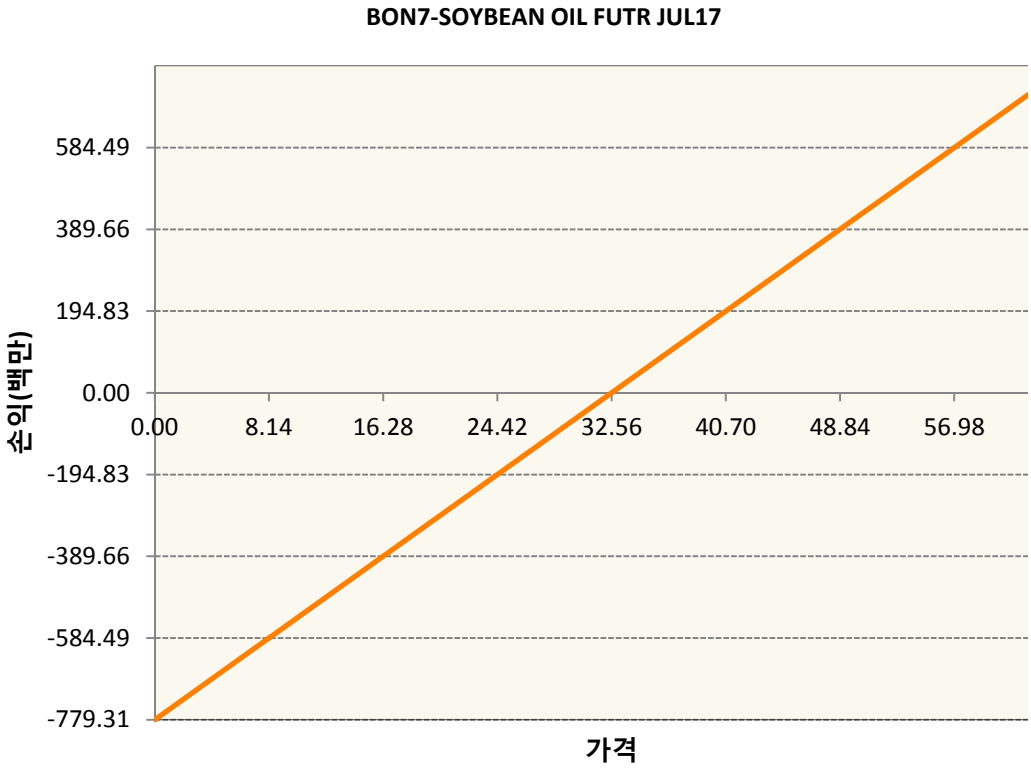
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

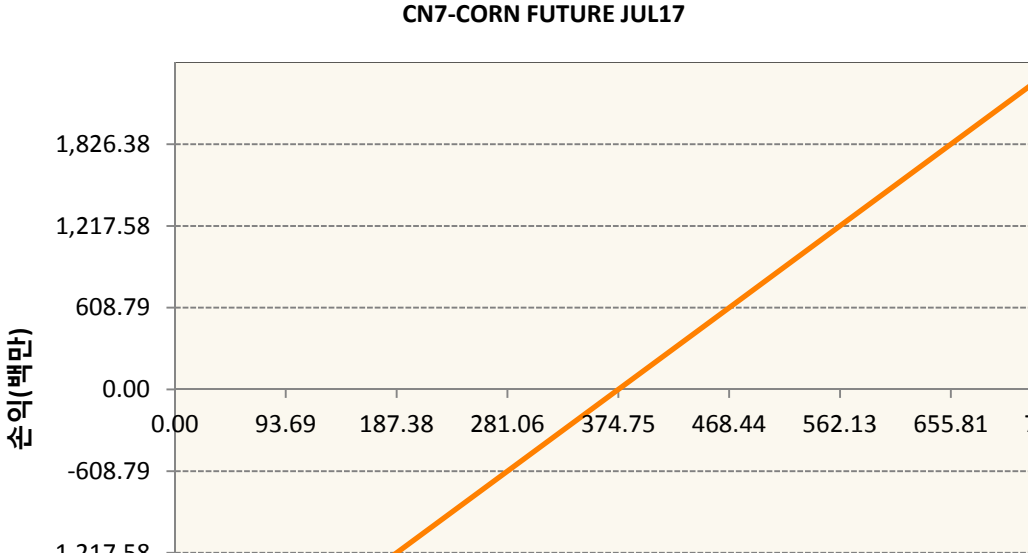
1. 계약금액

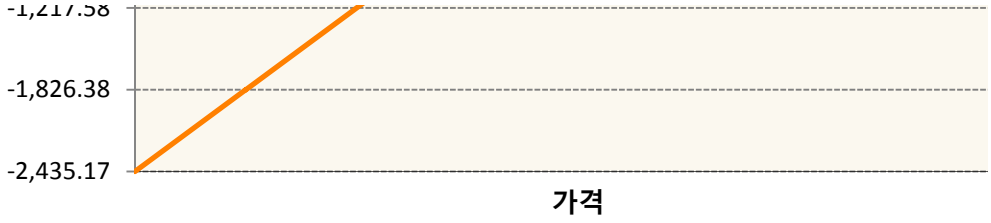
(단위:백만원)

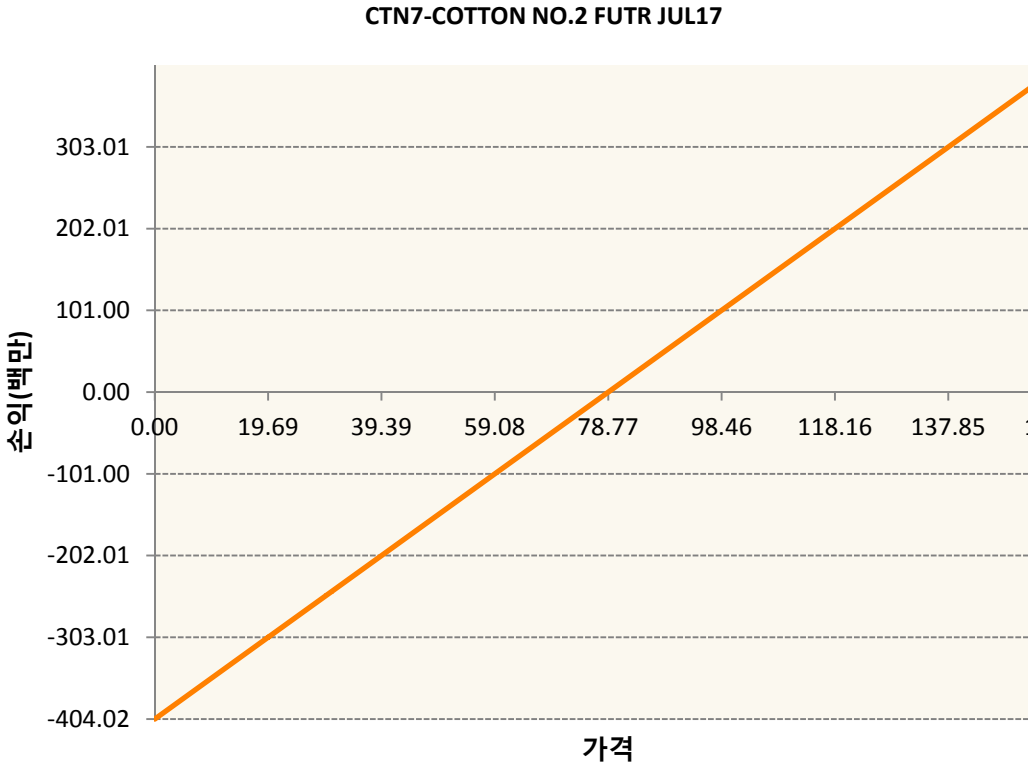
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,044	397	8,647	

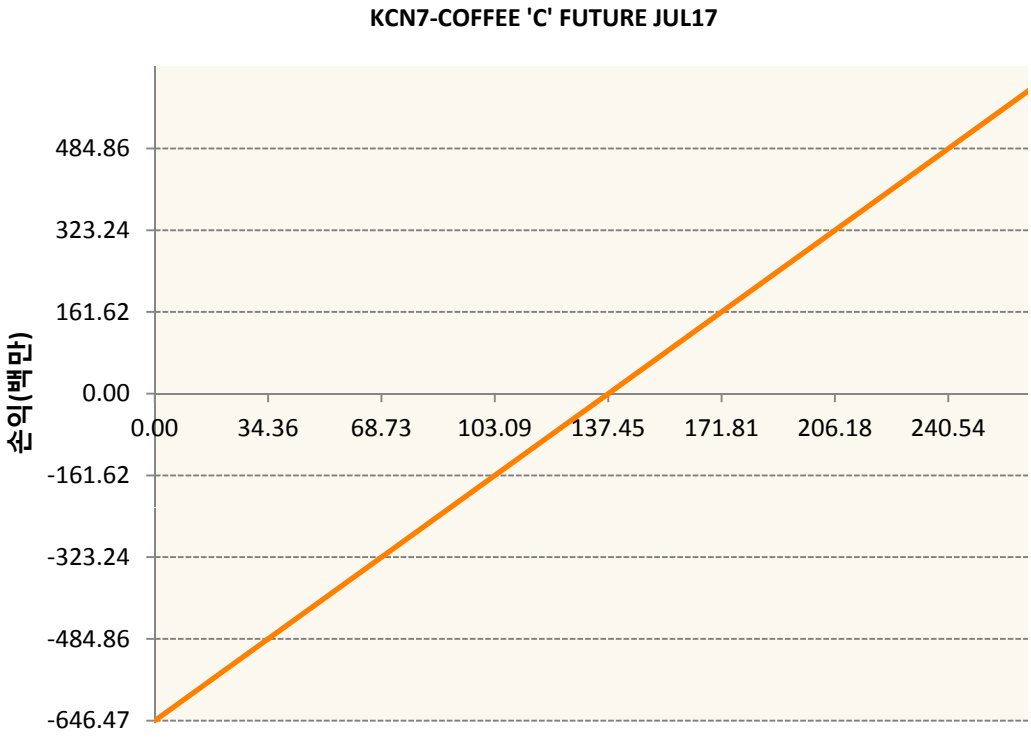
2. 만기시점의 손익구조



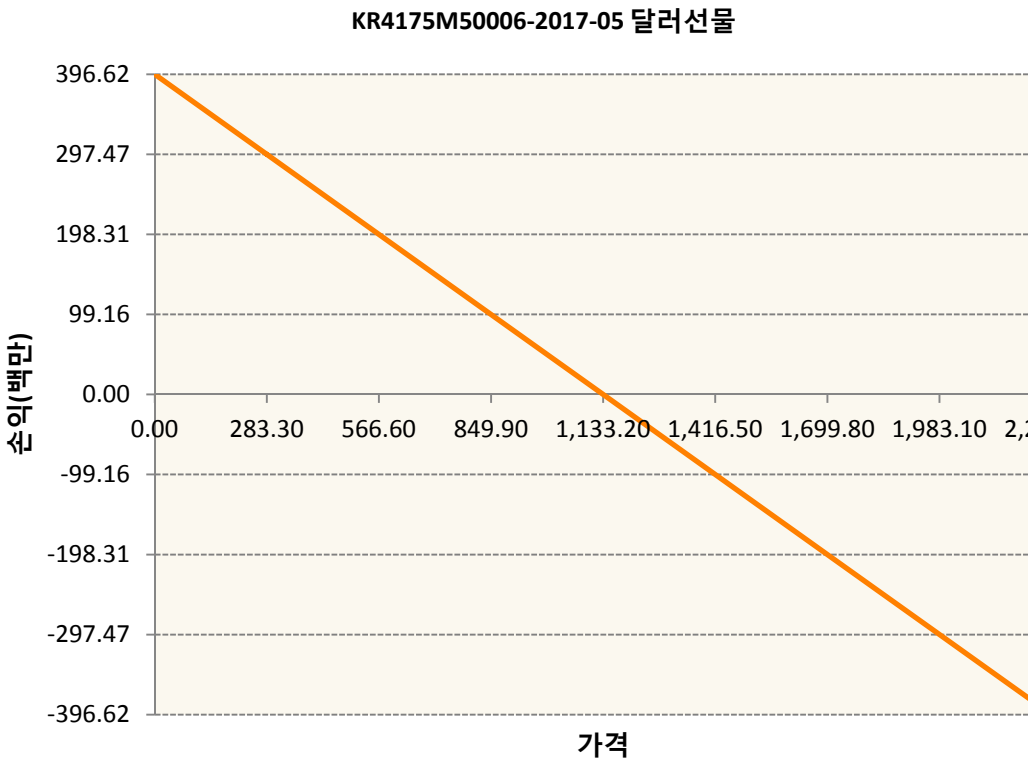


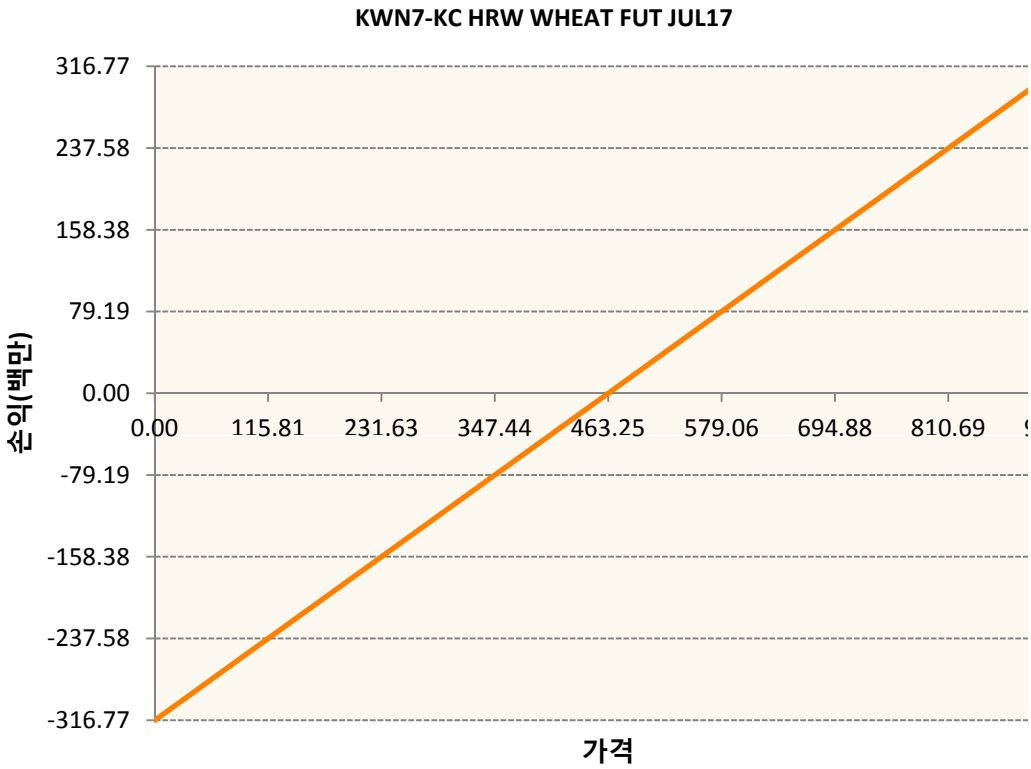

-1,826.38
-2,435.17
가격

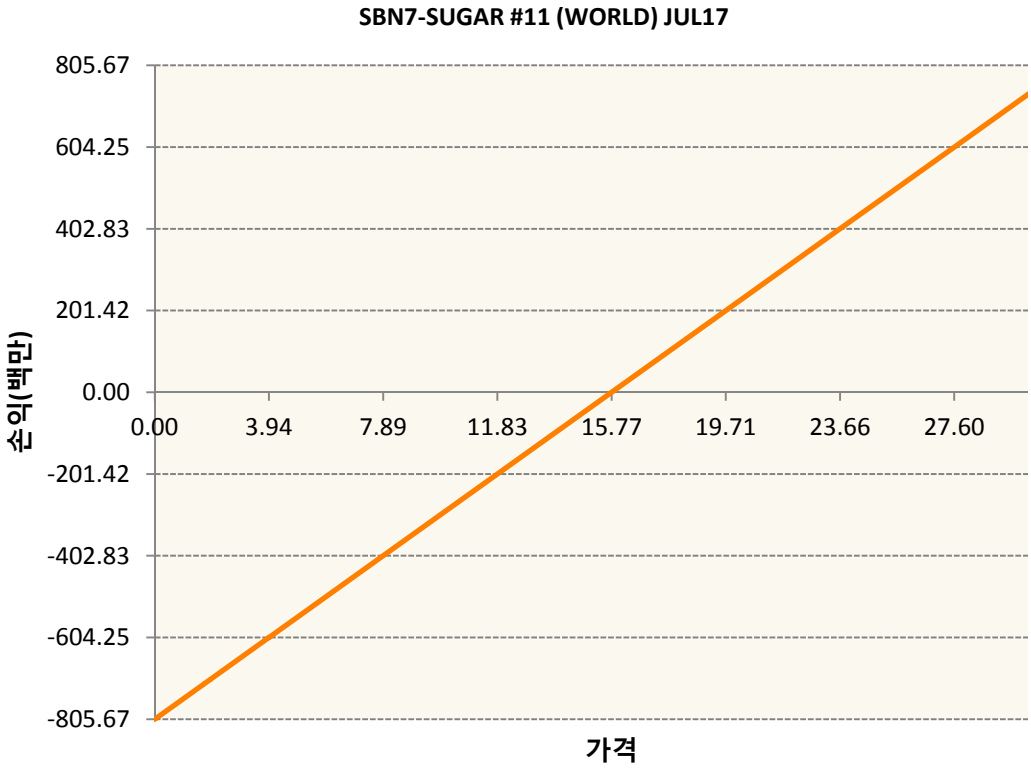

CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
303.01
202.01
101.00
0.00
-101.00
-202.01
-303.01
-404.02
0.00
19.69
39.39
59.08
78.77
98.46
118.16
137.85
순익(백만)
가격

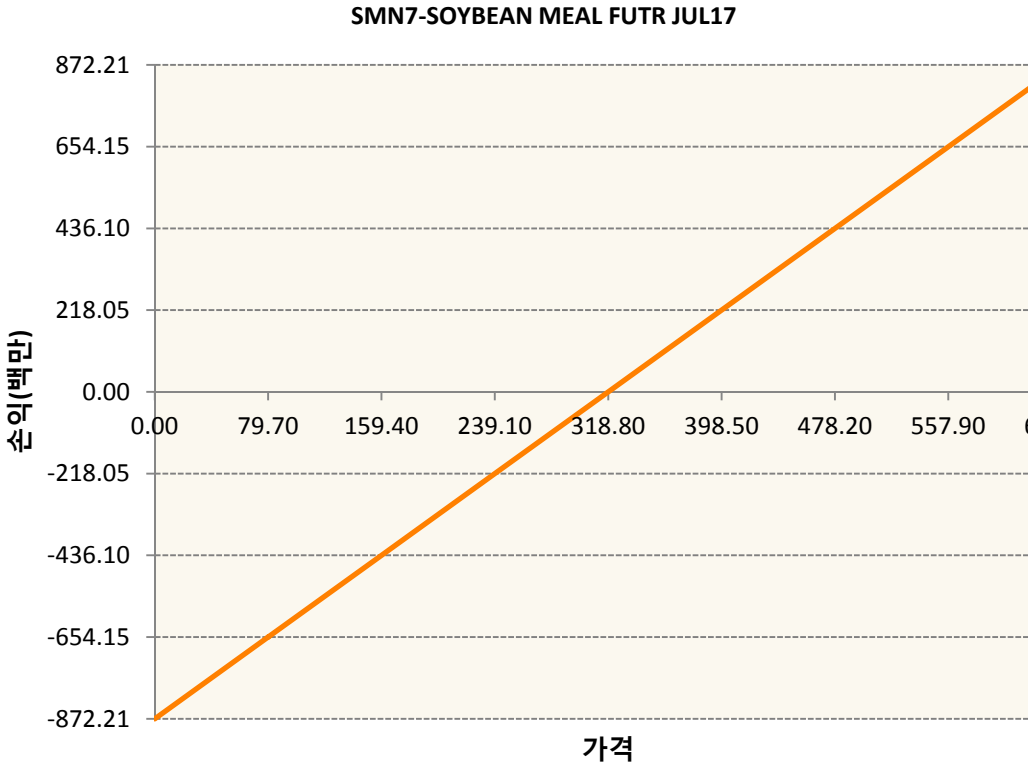

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
484.86
323.24
161.62
0.00
-161.62
-323.24
-484.86
-646.47
0.00
34.36
68.73
103.09
137.45
171.81
206.18
240.54
순익(백만)

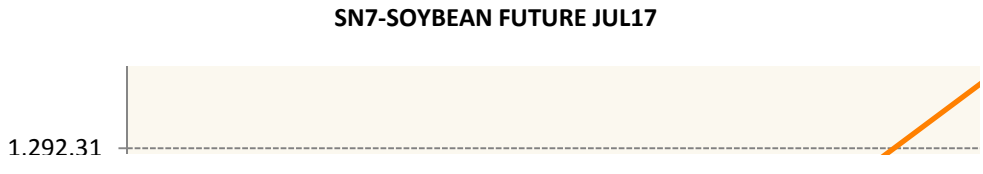
가격

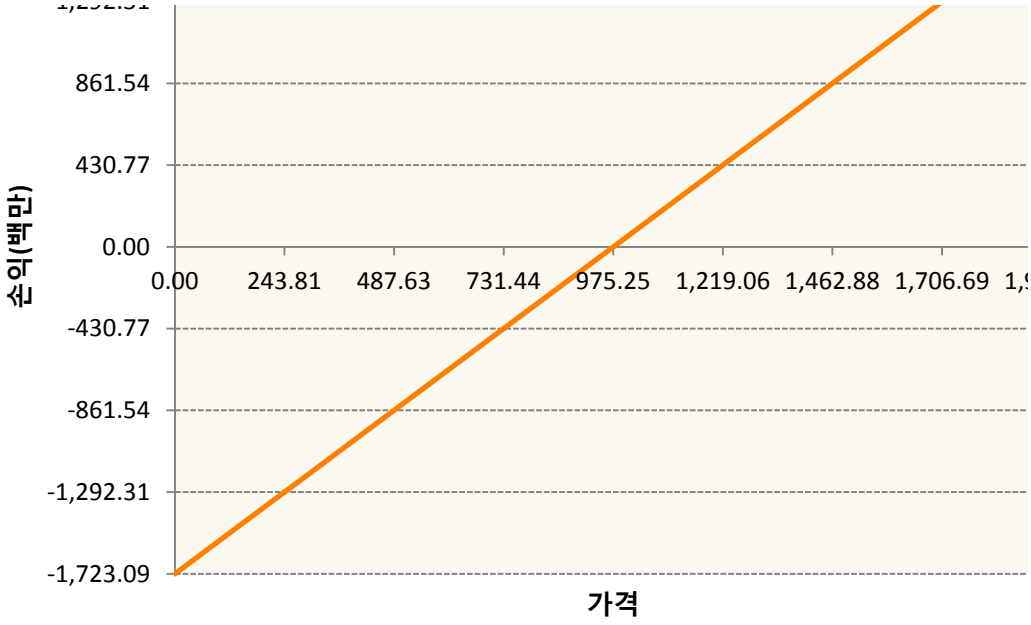

KR4175M50006-2017-05 달러선물
396.62
297.47
198.31
99.16
0.00
-99.16
-198.31
-297.47
-396.62
0.00
283.30
566.60
849.90
1,133.20
1,416.50
1,699.80
1,983.10
손익(백만)
가격

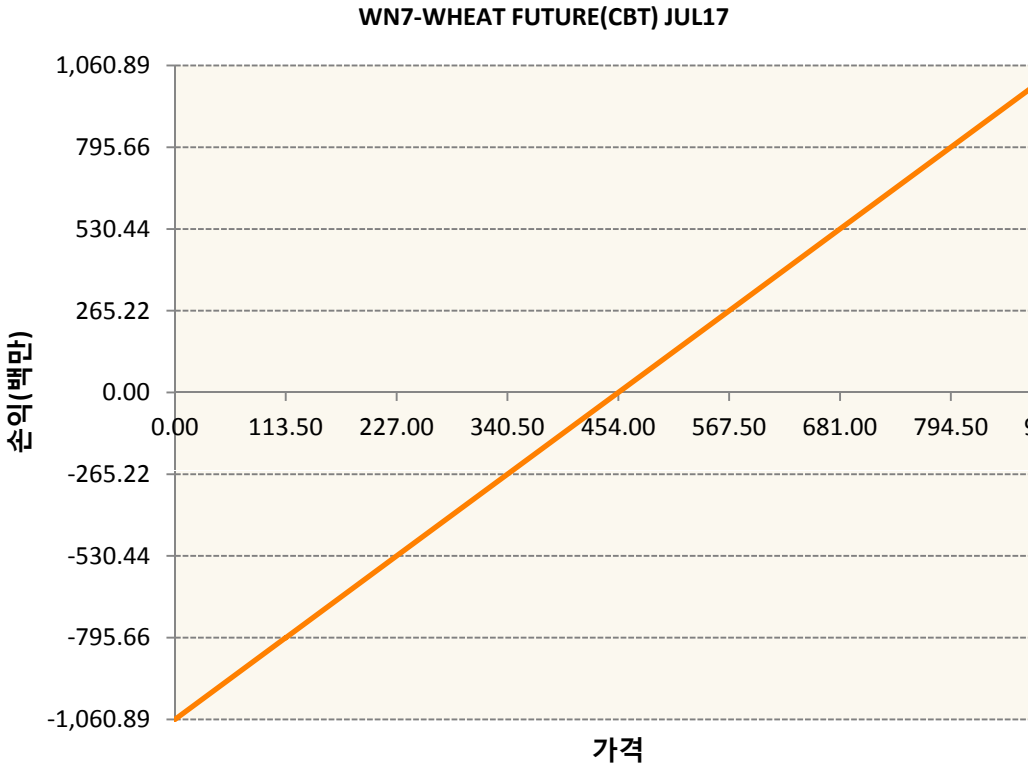

KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17
316.77
237.58
158.38
79.19
0.00
-79.19
-158.38
-237.58
-316.77
0.00
115.81
231.63
347.44
463.25
579.06
694.88
810.69
손익(백만)
가격


SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
805.67
604.25
402.83
201.42
0.00
-201.42
-402.83
-604.25
-805.67
0.00
3.94
7.89
11.83
15.77
19.71
23.66
27.60
손익(백만)
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
872.21
654.15
436.10
218.05
0.00
-218.05
-436.10
-654.15
-872.21
0.00
79.70
159.40
239.10
318.80
398.50
478.20
557.90
손익(백만)
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,292.31





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	62
CN7	CORN FUTURE JUL17	195
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	32
KCN7	COFFEE 'C' FUTURE JUL17	52
KR4175M50(	2017-05 달러선물	32

KWN7	KC HRW WHEAT FUT JUL17	25
SBN7	SUGAR #11 (WORLD) JUL17	64
SMN7	SOYBEAN MEAL FUTR JUL17	70
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	138
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	85

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

824