공시일	2017-05-10
기준일	2017-05-08

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	2017-05-10
기준일	2017-05-08

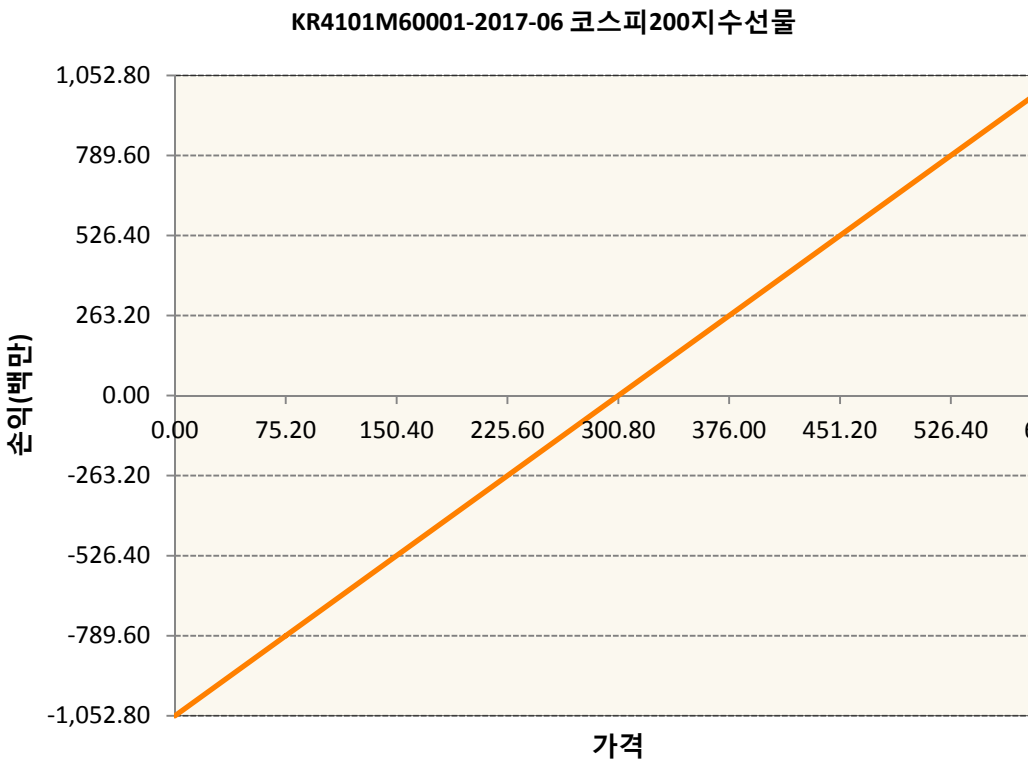
스마트인덱스모

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	1,053	0	1,053	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물 84

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
-5.33%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
-2.67%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	28	28	28	28	28	28	28
5.33%	56	56	56	56	56	56	56
8.00%	84	84	84	84	84	84	84

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

55

공시일	2017-05-10
기준일	2017-05-08

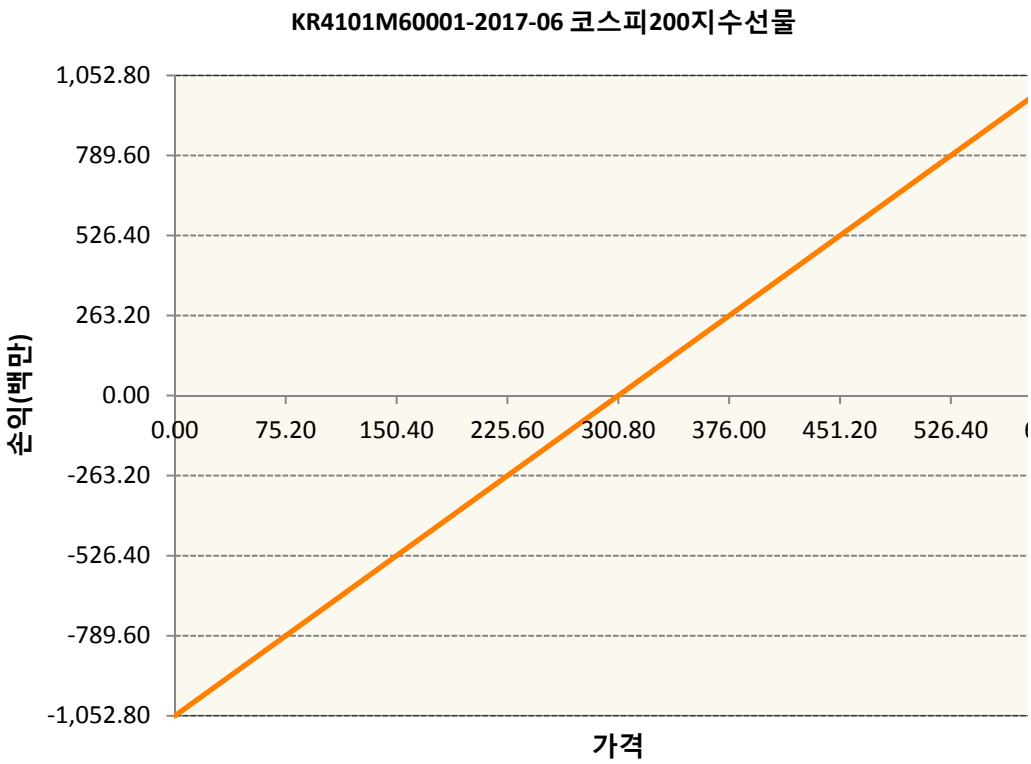
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	75	-75	장내
누계	유가증권	선물	1,053	0	1,053	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							84
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
-5.33%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
-2.67%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	28	28	28	28	28	28	28
5.33%	56	56	56	56	56	56	56
8.00%	84	84	84	84	84	84	84

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

55

공시일	2017-05-10
기준일	2017-05-08

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	983

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

553

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-05-10
기준일	2017-05-08

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	363

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

364

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-05-10
기준일	2017-05-08

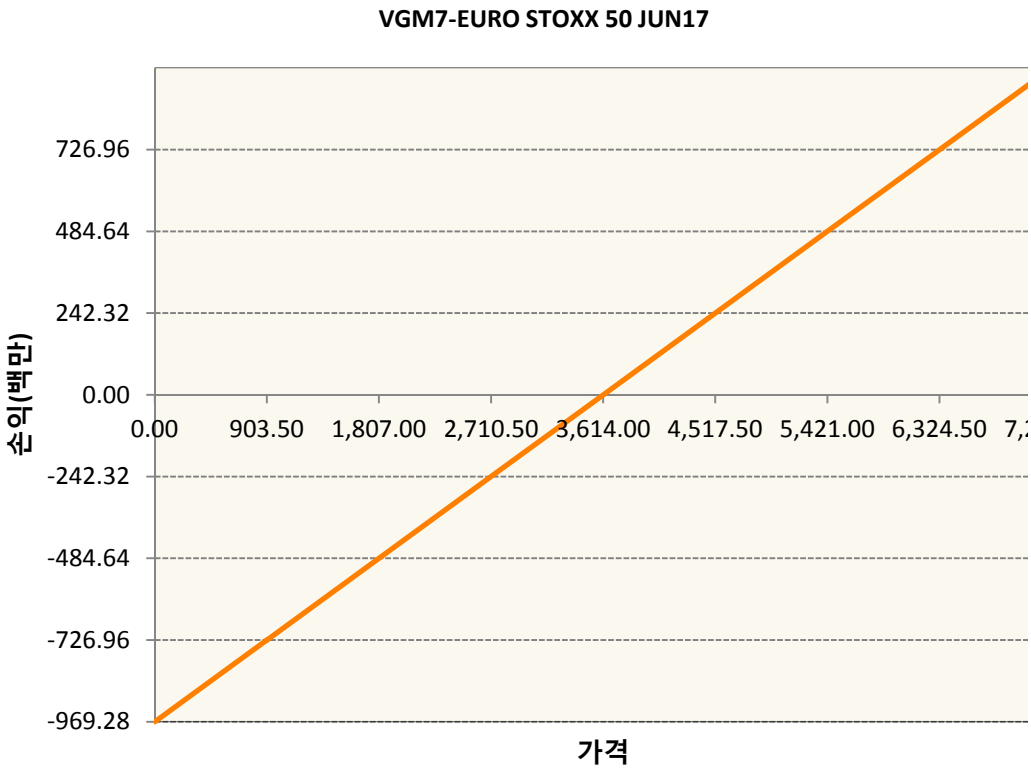
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	969	0	969	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM7	EURO STOXX 50 JUN17	78

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

(단위:백만원)

78

공시일	2017-05-10
기준일	2017-05-08

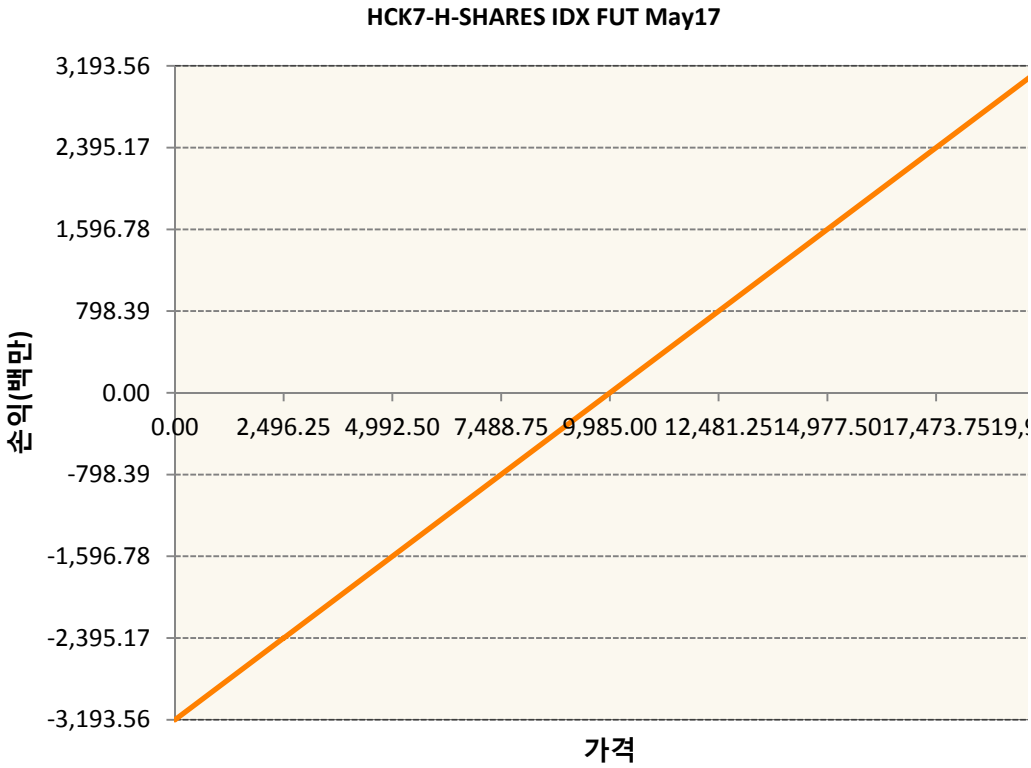
차이나인덱스모(주식-파생형)

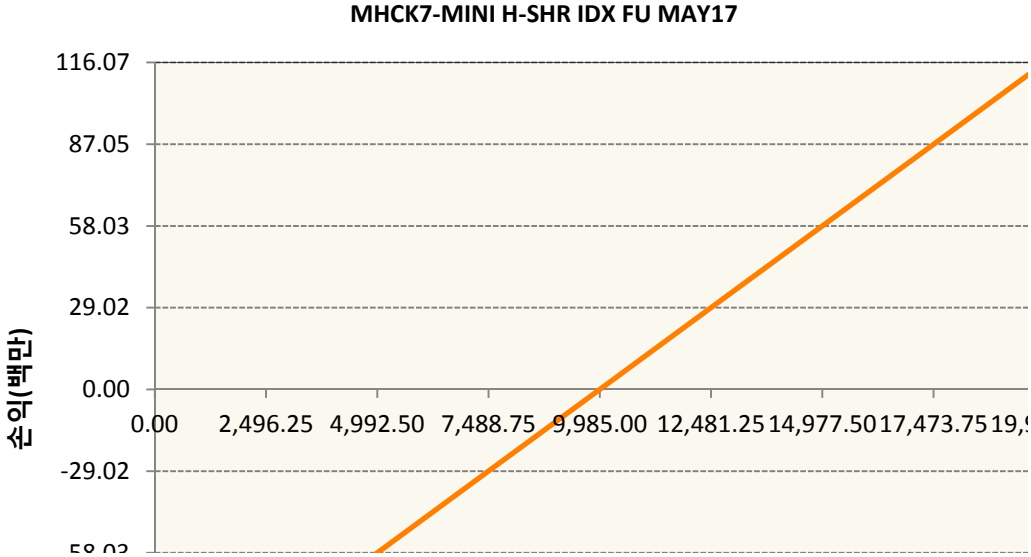
1. 계약금액

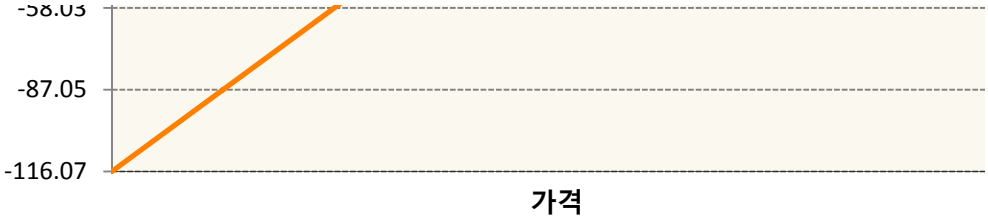
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,310	0	3,310	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCK7	H-SHARES IDX FUT May17	255
MHCK7	MINI H-SHR IDX FU MAY17	9

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

281

공시일	2017-05-10
기준일	2017-05-08

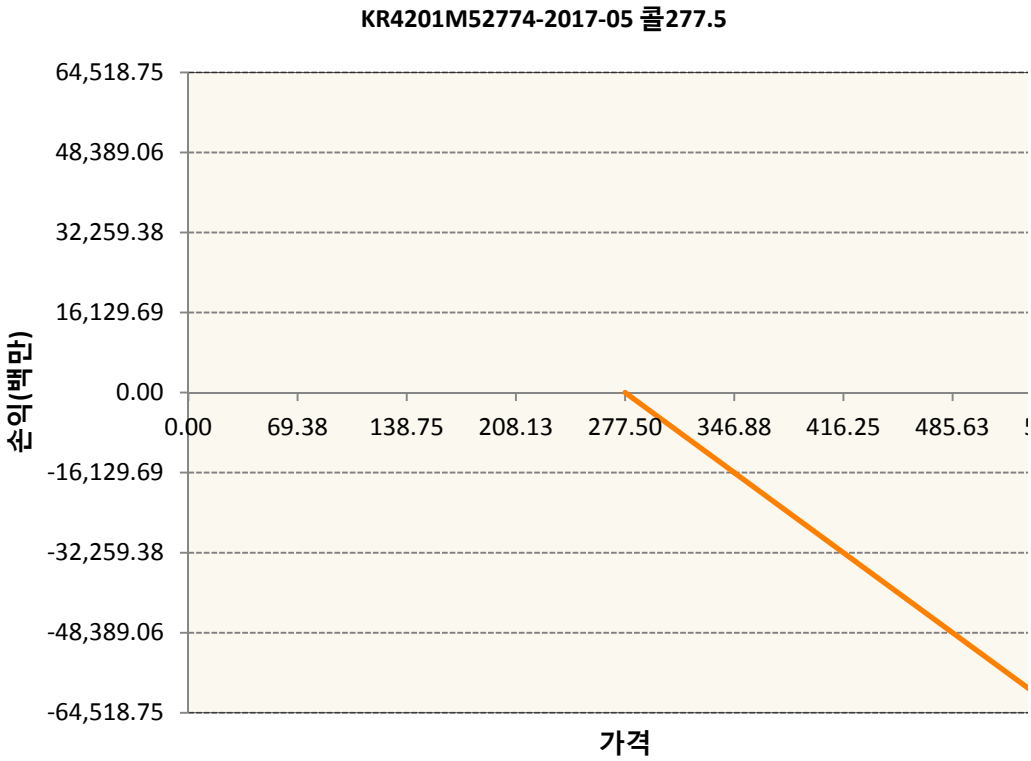
커버드콜모(주식혼합-파생형)

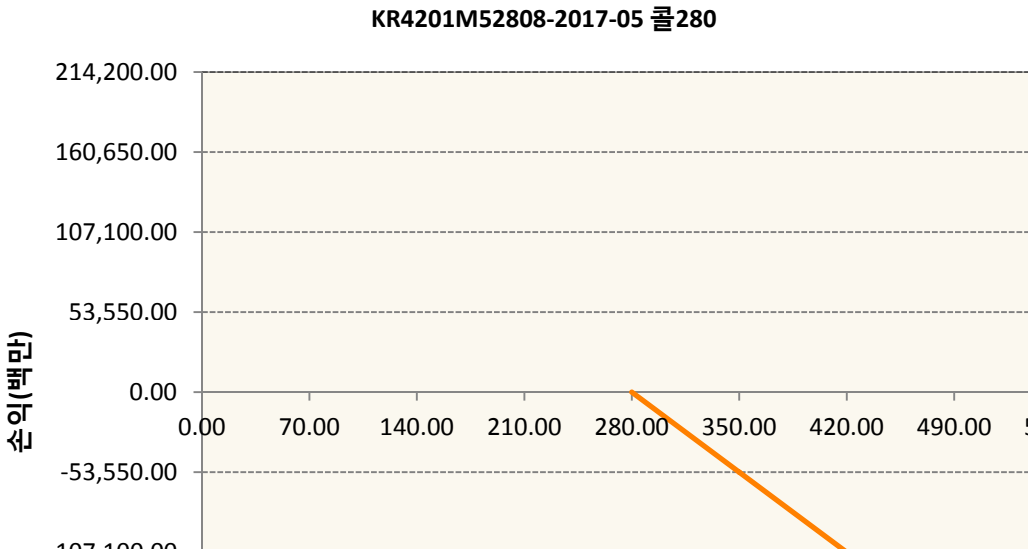
1. 계약금액

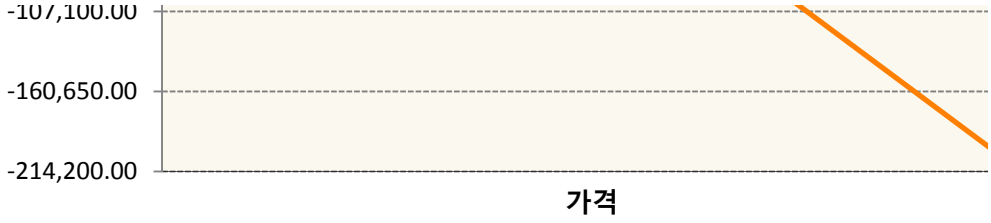
(단위:백만원)

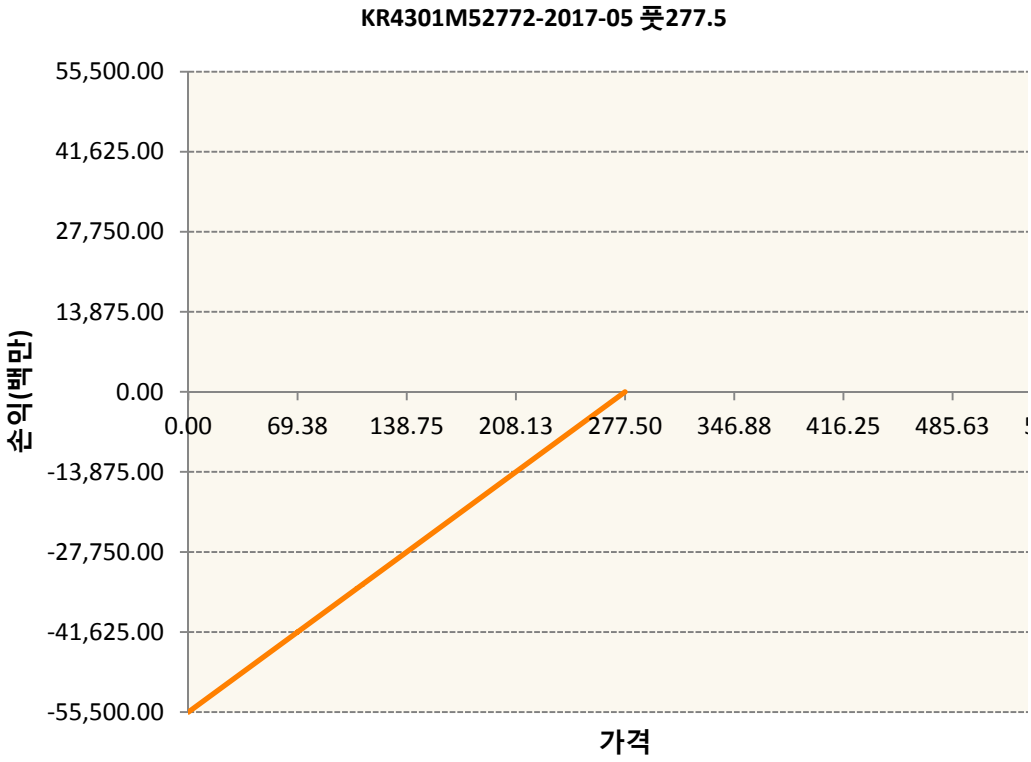
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	380,419	-380,419	장내

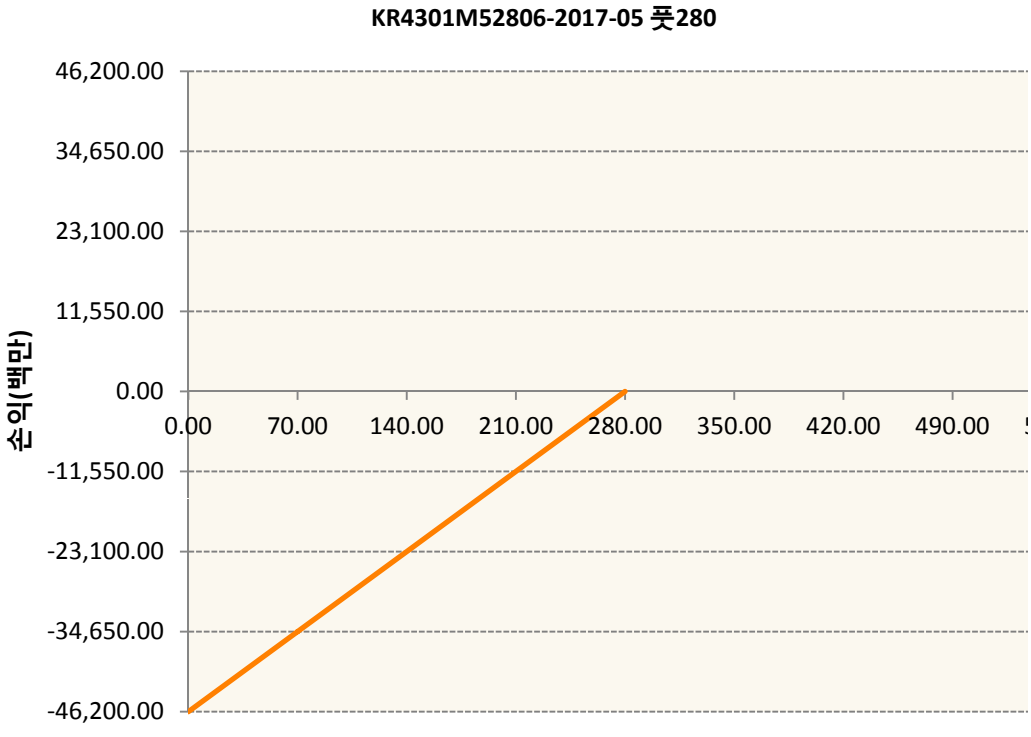
2. 만기시점의 손익구조






-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						5,577
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,074	5,047	5,020	4,993	4,965	4,937	4,909
-5.33%	3,714	3,710	3,704	3,697	3,687	3,676	3,663
-2.67%	1,859	1,859	1,859	1,859	1,859	1,859	1,858
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-1,859	-1,859	-1,859	-1,859	-1,859	-1,859	-1,859
5.33%	-3,718	-3,718	-3,718	-3,718	-3,718	-3,718	-3,718
8.00%	-5,577	-5,577	-5,577	-5,577	-5,577	-5,577	-5,577
KR4201M52	2017-05 콜280						18,349
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15,105	15,064	15,016	14,961	14,901	14,837	14,768
-5.33%	12,127	12,079	12,024	11,964	11,898	11,828	11,755
-2.67%	6,116	6,116	6,116	6,115	6,113	6,109	6,104
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-6,116	-6,116	-6,116	-6,116	-6,116	-6,116	-6,116
5.33%	-12,233	-12,233	-12,233	-12,233	-12,233	-12,233	-12,233
8.00%	-18,349	-18,349	-18,349	-18,349	-18,349	-18,349	-18,349
KR4301M52	2017-05 풋277.5						575
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-433	-455	-478	-502	-526	-550	-575
-5.33%	-3	-7	-12	-18	-26	-36	-47
-2.67%	0	0	0	0	0	0	-1
0%	0	0	0	0	0	0	0
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						772
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-700	-709	-719	-731	-744	-758	-772
-5.33%	-23	-33	-45	-58	-72	-87	-103
-2.67%	0	0	0	0	-1	-1	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
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

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

23,937

공시일	2017-05-10
기준일	2017-05-08

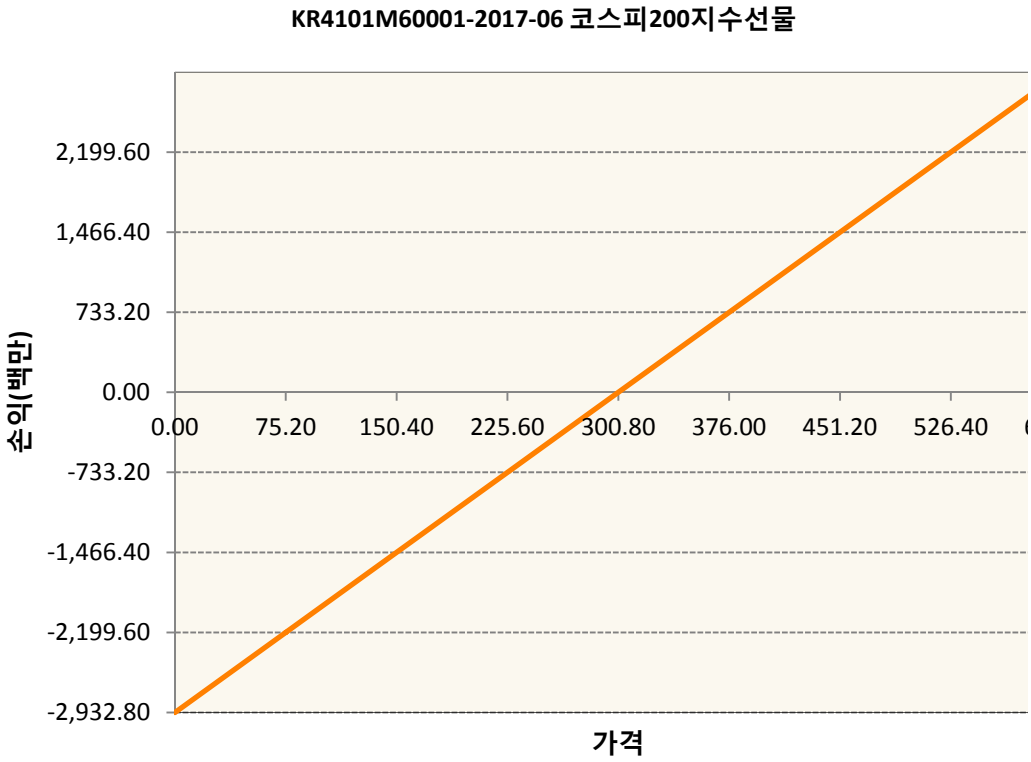
커버드콜목표전환형증권투자신탁

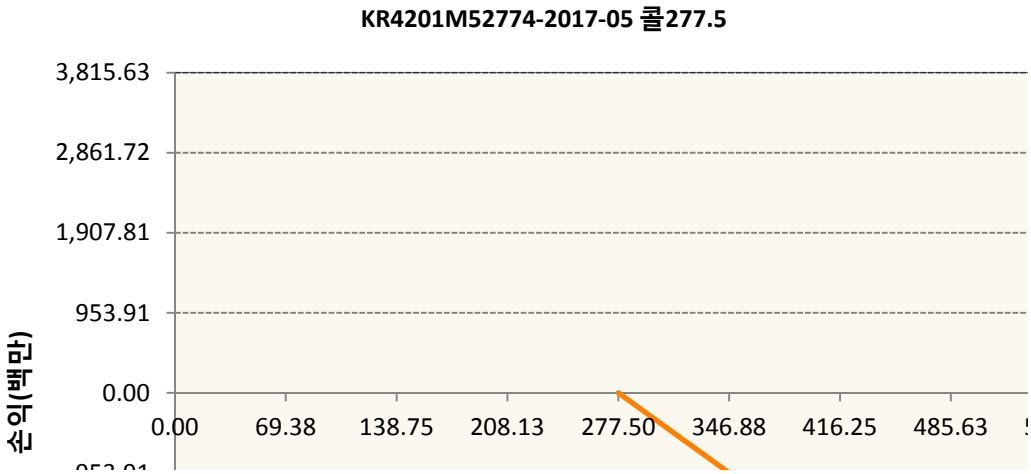
1. 계약금액

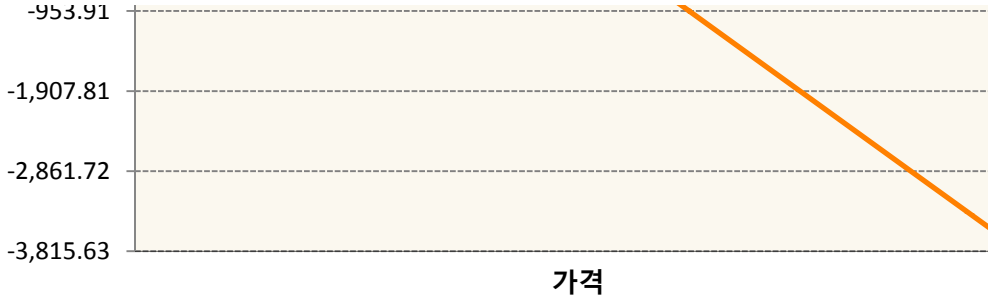
(단위:백만원)

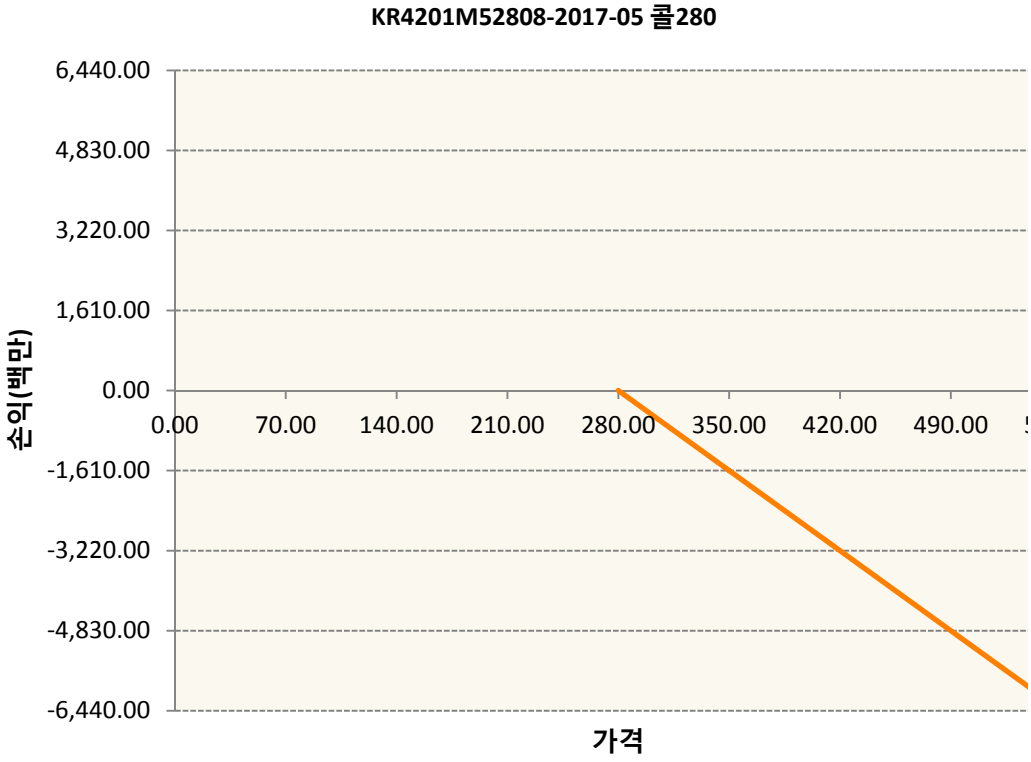
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	2,450	0	2,450	장내
누계	유가증권	선물	2,933	0	2,933	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,256	-10,256	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							234
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-234	-234	-234	-234	-234	-234	-234
-5.33%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
-2.67%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	78	78	78	78	78	78	78
5.33%	156	156	156	156	156	156	156
8.00%	234	234	234	234	234	234	234
KR4201M52 2017-05 콜277.5							330
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	300	299	297	295	294	292	290
-5.33%	220	219	219	219	218	217	217
-2.67%	110	110	110	110	110	110	110
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-110	-110	-110	-110	-110	-110	-110
5.33%	-220	-220	-220	-220	-220	-220	-220
8.00%	-330	-330	-330	-330	-330	-330	-330
	KR4201M52(	2017-05 콜280					552
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	454	453	451	450	448	446	444
-5.33%	365	363	362	360	358	356	353
-2.67%	184	184	184	184	184	184	184
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
5.33%	-368	-368	-368	-368	-368	-368	-368
8.00%	-552	-552	-552	-552	-552	-552	-552

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

1,035

공시일	2017-05-10
기준일	2017-05-08

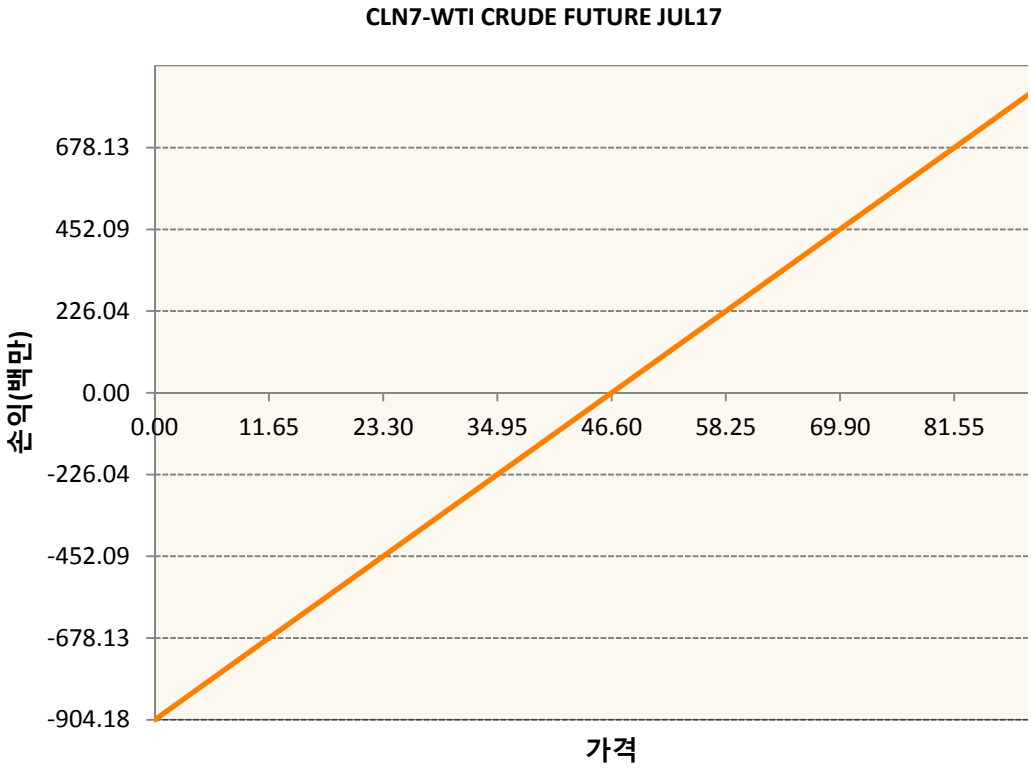
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

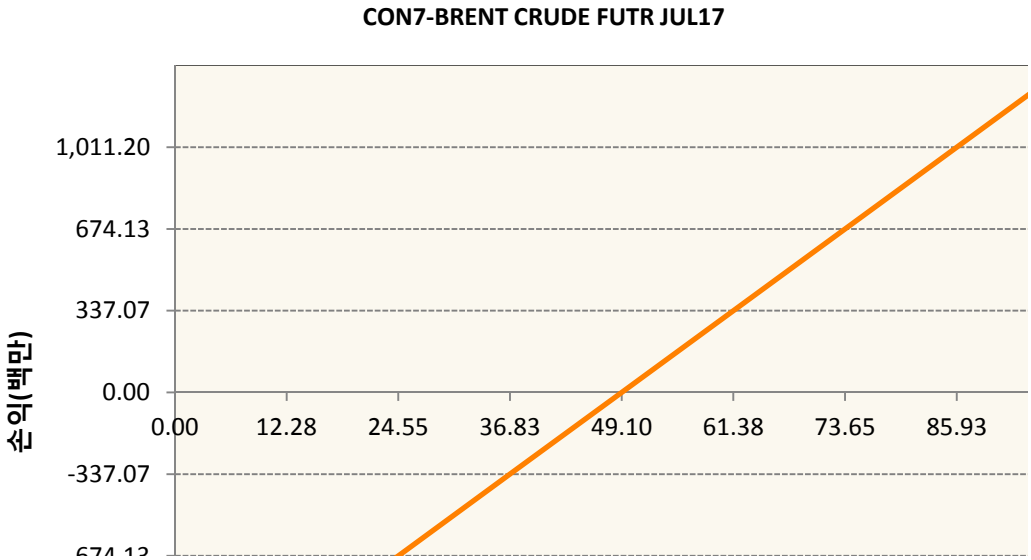
1. 계약금액

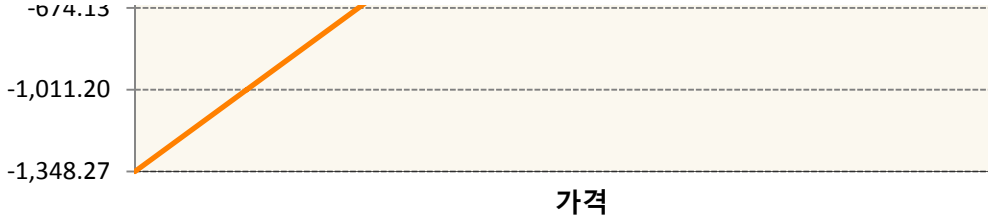
(단위:백만원)

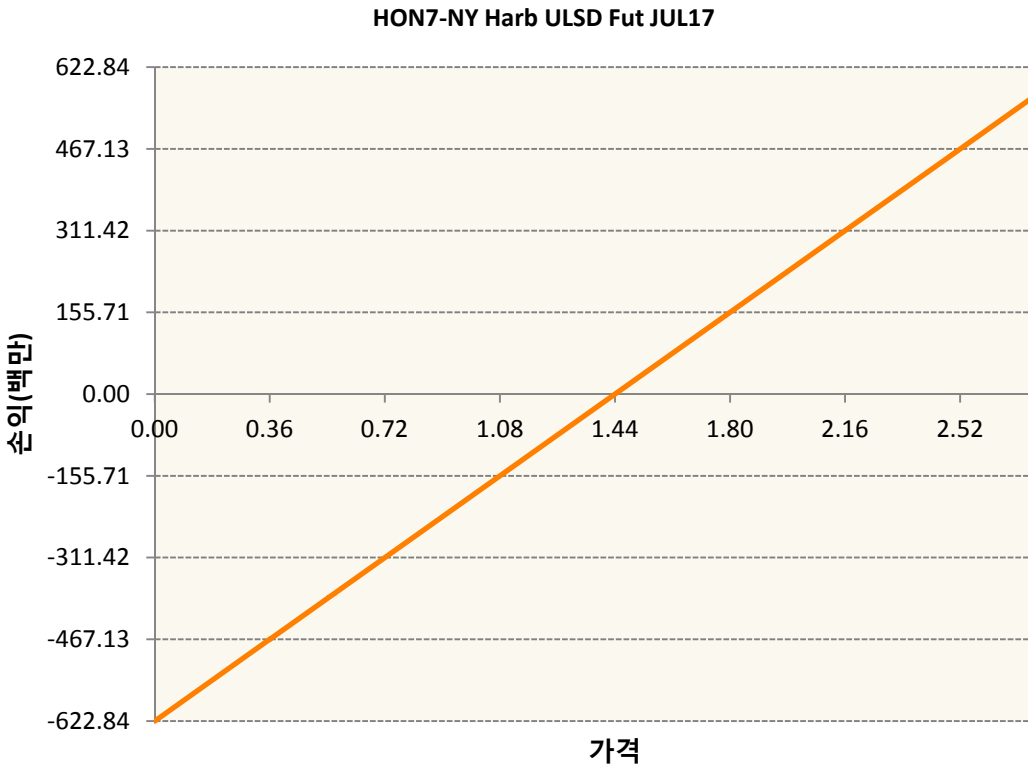
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,092	407	4,684	

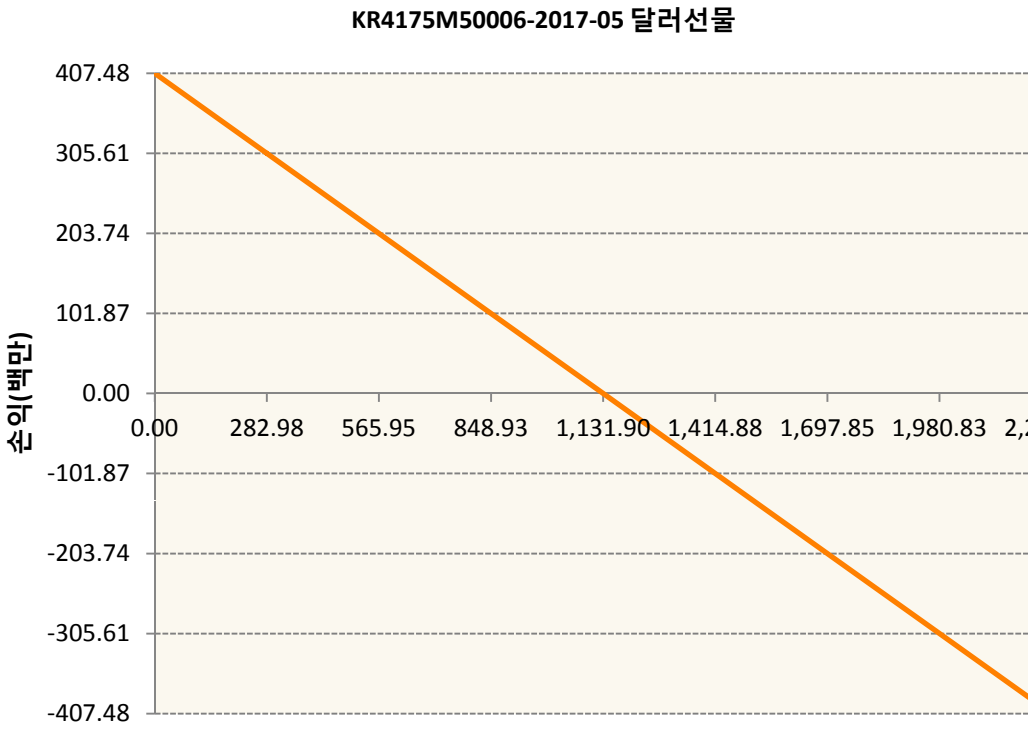
2. 만기시점의 손익구조



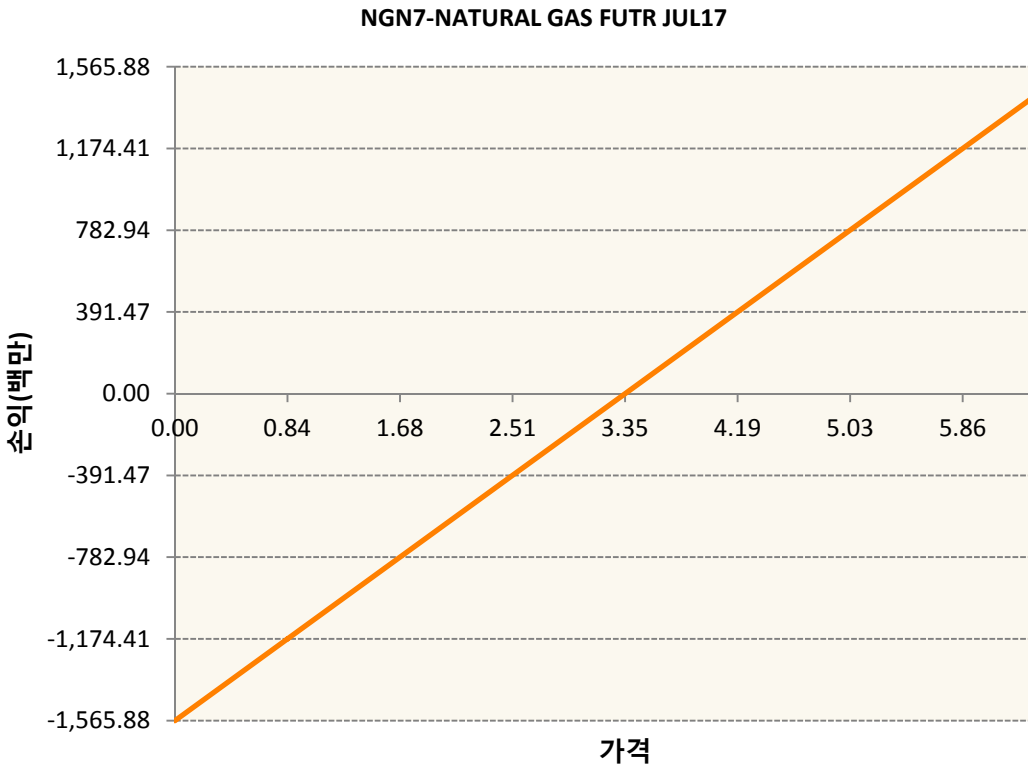


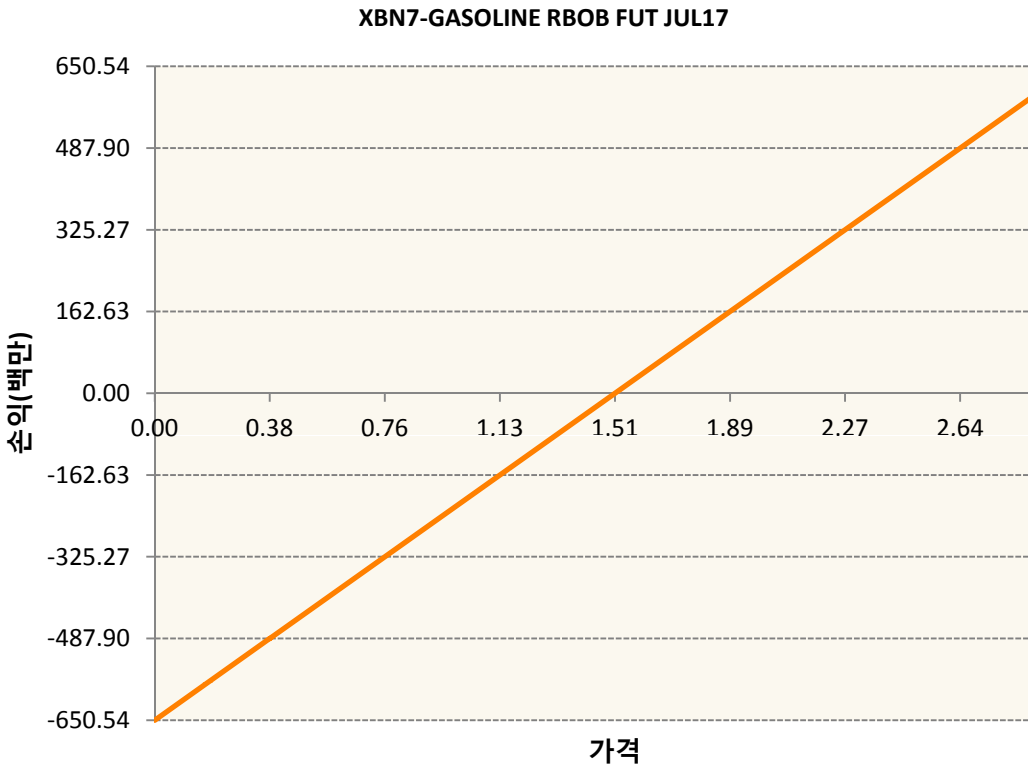

-1,011.20
-1,348.27
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
622.84
467.13
311.42
155.71
0.00
-155.71
-311.42
-467.13
-622.84
0.00
0.36
0.72
1.08
1.44
1.80
2.16
2.52
순이익(백만)
가격


KR4175M50006-2017-05 달러선물
407.48
305.61
203.74
101.87
0.00
-101.87
-203.74
-305.61
-407.48
0.00
282.98
565.95
848.93
1,131.90
1,414.88
1,697.85
1,980.83
순이익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,565.88
1,174.41
782.94
391.47
0.00
-391.47
-782.94
-1,174.41
-1,565.88
0.00
0.84
1.68
2.51
3.35
4.19
5.03
5.86
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
650.54
487.90
325.27
162.63
0.00
-162.63
-325.27
-487.90
-650.54
0.00
0.38
0.76
1.13
1.51
1.89
2.27
2.64
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN7	WTI CRUDE FUTURE JUL17	72
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	108
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	50
KR4175M50(	2017-05 달러선물	33
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	125
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	52

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

888

공시일	2017-05-10
기준일	2017-05-08

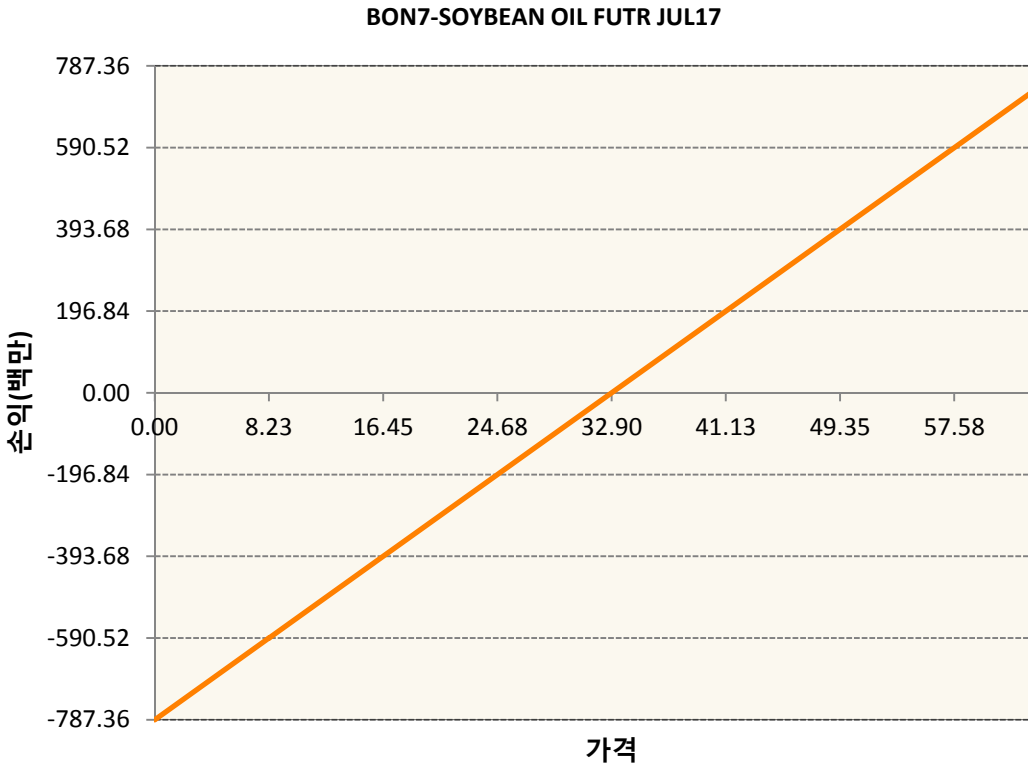
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

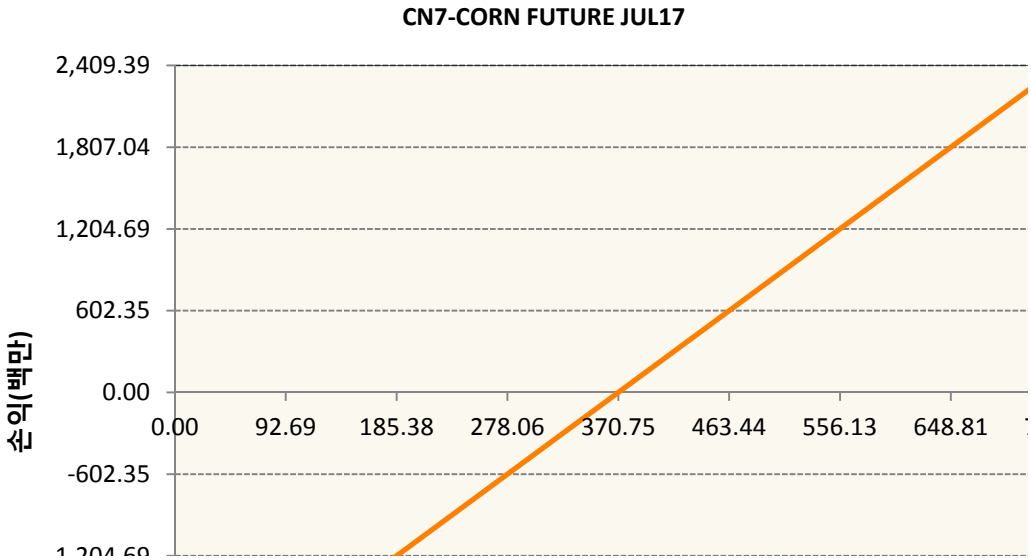
1. 계약금액

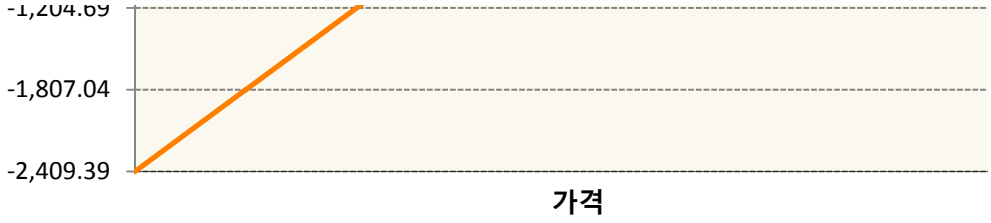
(단위:백만원)

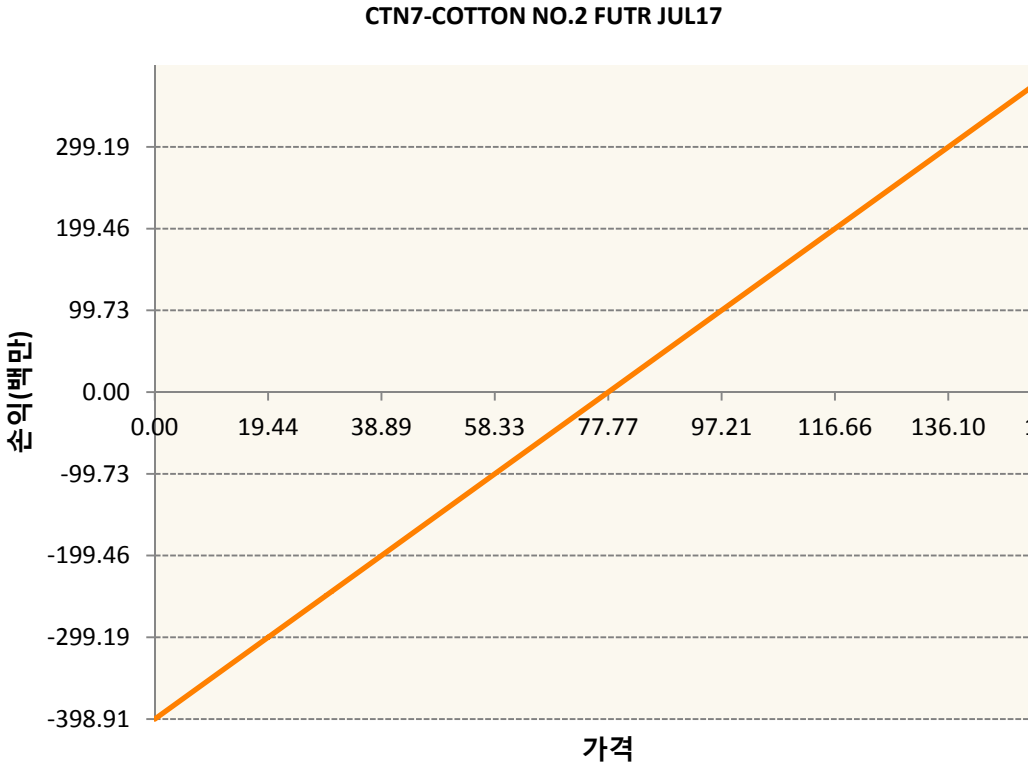
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,944	396	8,548	

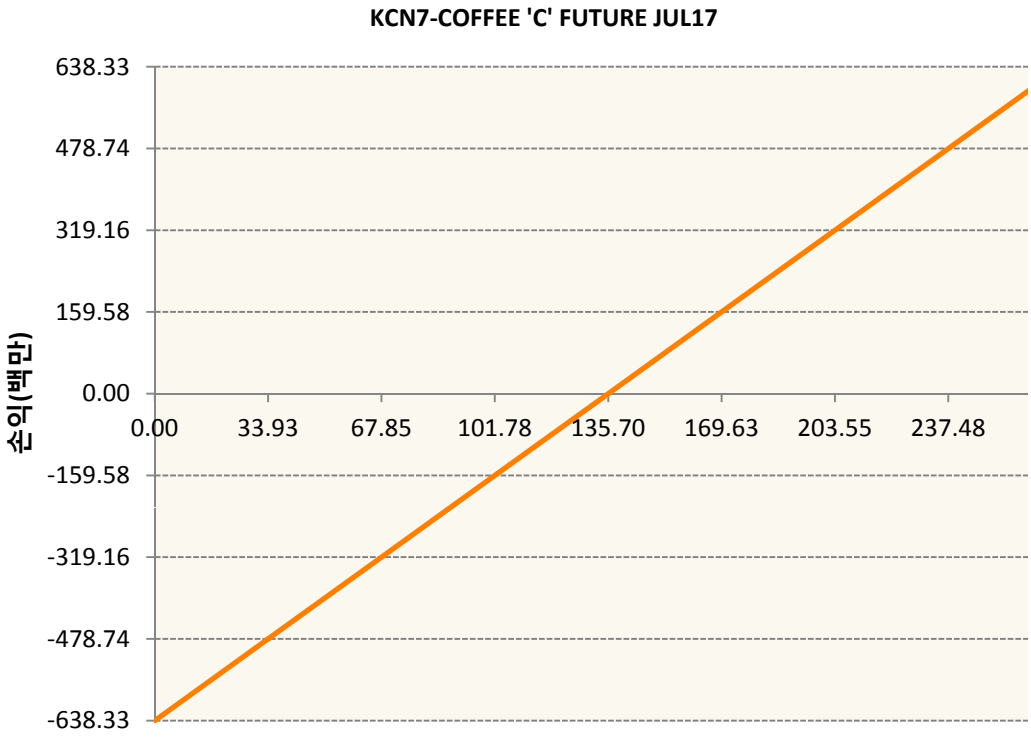
2. 만기시점의 손익구조



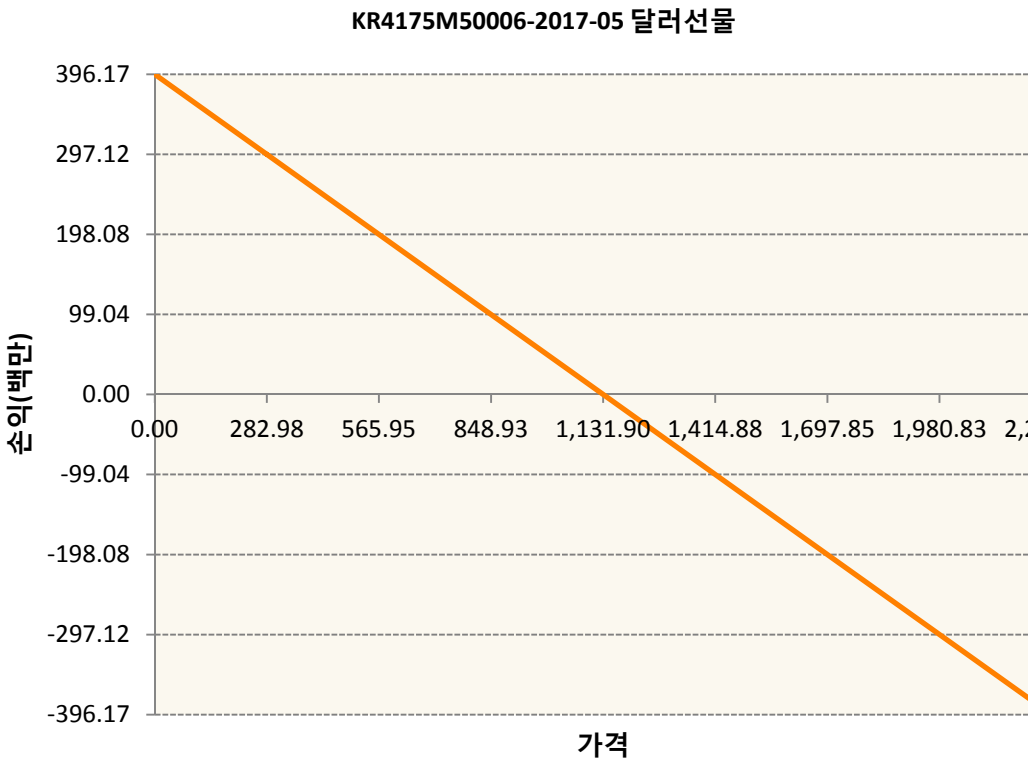


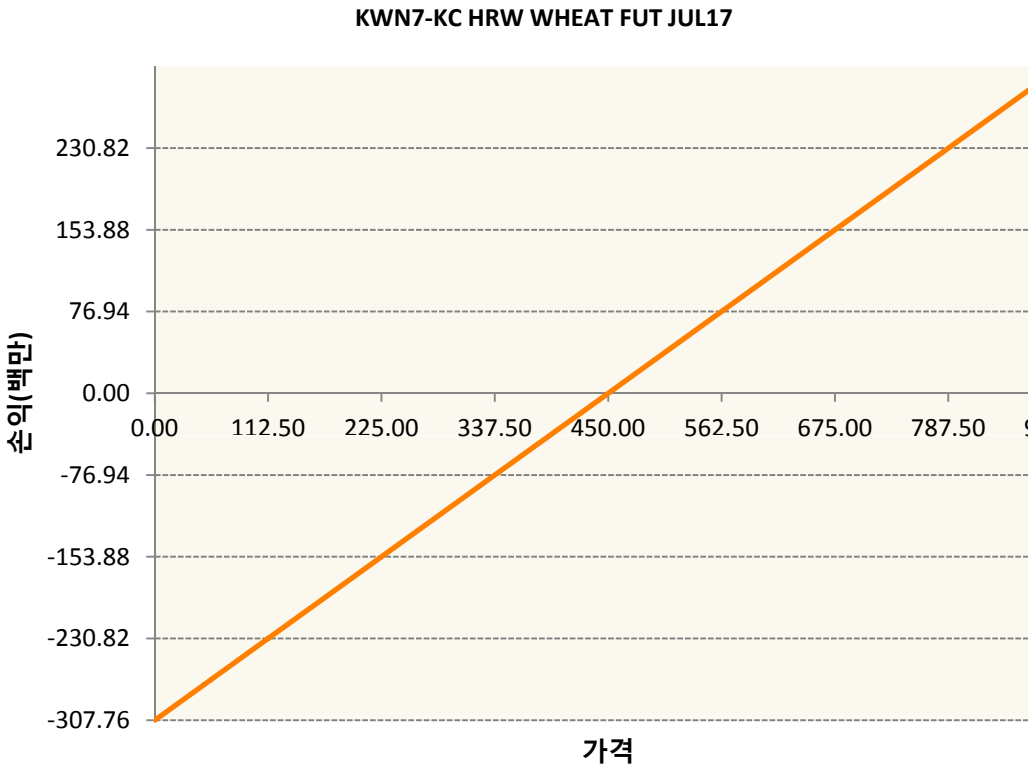

-1,807.04
-2,409.39
가격

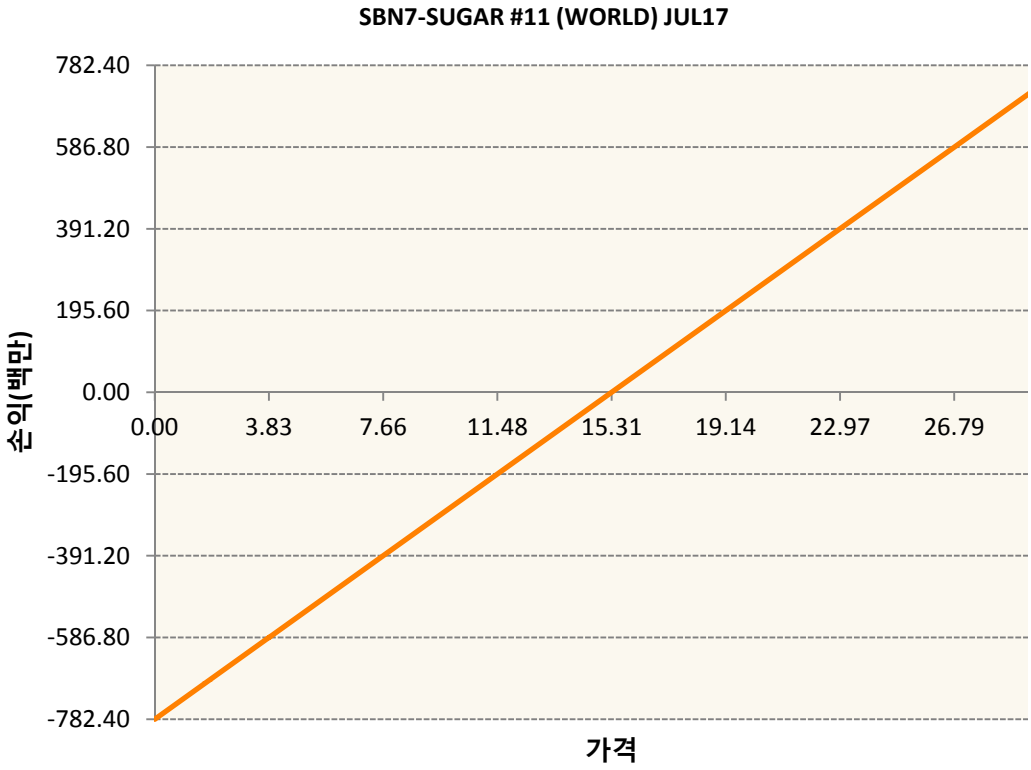

CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
299.19
199.46
99.73
0.00
-99.73
-199.46
-299.19
-398.91
0.00
19.44
38.89
58.33
77.77
97.21
116.66
136.10
순익(백만)
가격

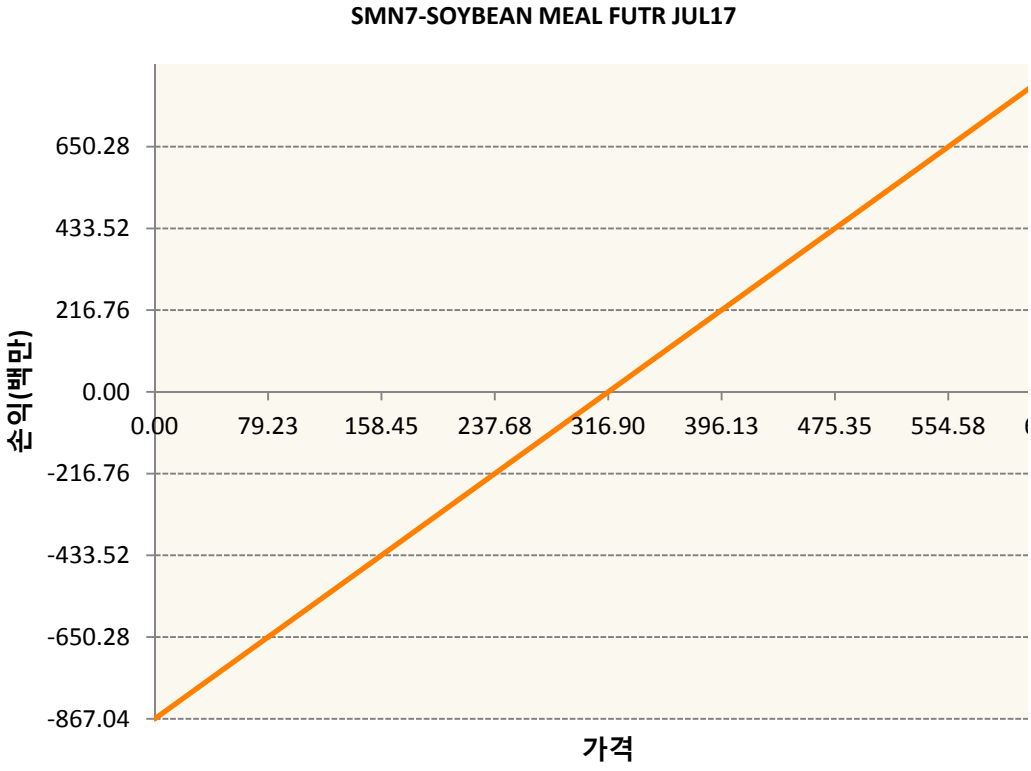

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
638.33
478.74
319.16
159.58
0.00
-159.58
-319.16
-478.74
-638.33
0.00
33.93
67.85
101.78
135.70
169.63
203.55
237.48
순익(백만)

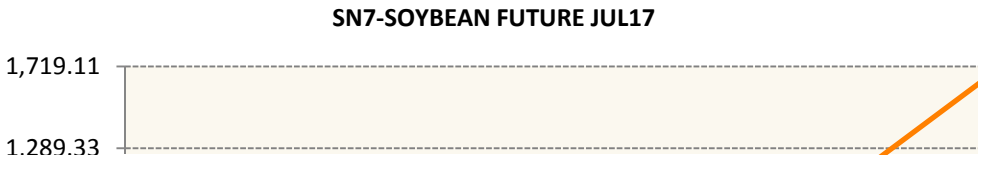
가격

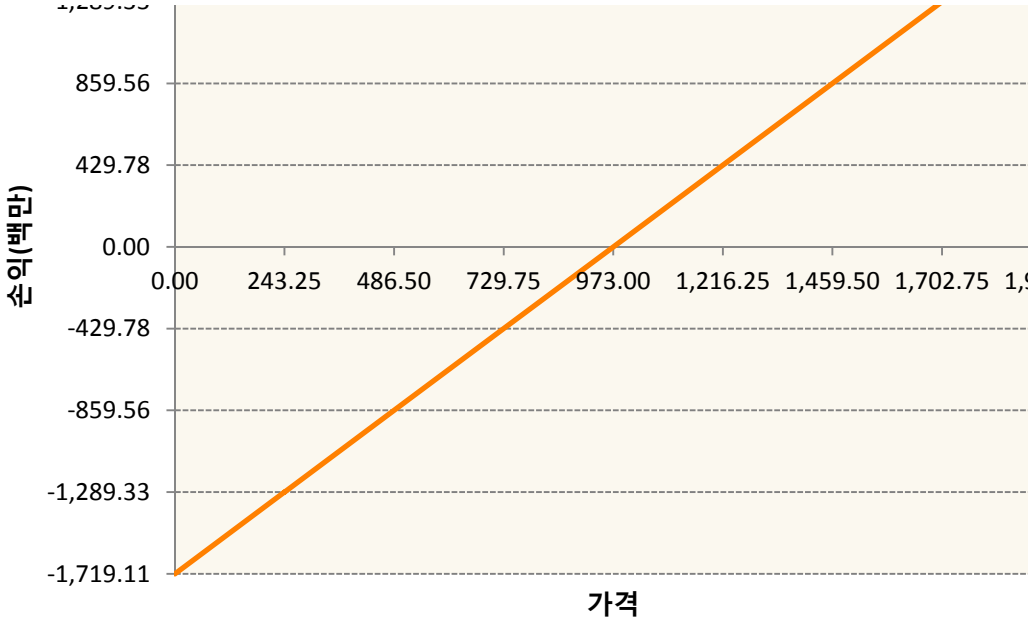

KR4175M50006-2017-05 달러선물
396.17
297.12
198.08
99.04
0.00
-99.04
-198.08
-297.12
-396.17
0.00
282.98
565.95
848.93
1,131.90
1,414.88
1,697.85
1,980.83
손익(백만)
가격


KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17
230.82
153.88
76.94
0.00
-76.94
-153.88
-230.82
-307.76
0.00
112.50
225.00
337.50
450.00
562.50
675.00
787.50
손익(백만)
가격

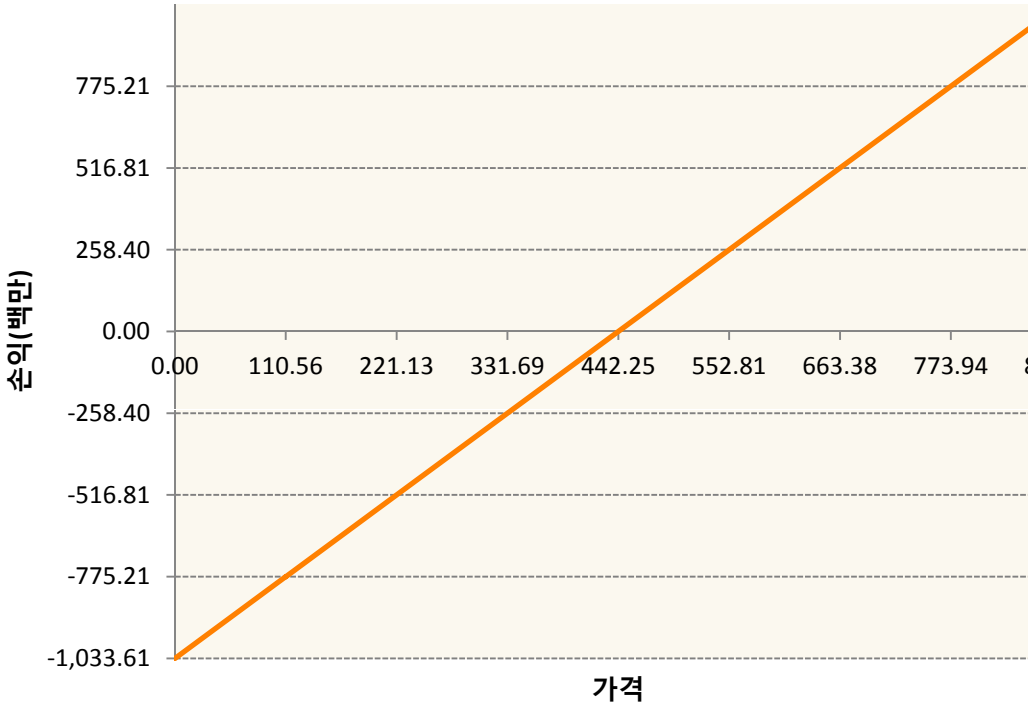

SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
782.40
586.80
391.20
195.60
0.00
-195.60
-391.20
-586.80
-782.40
0.00
3.83
7.66
11.48
15.31
19.14
22.97
26.79
손익(백만)
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
650.28
433.52
216.76
0.00
-216.76
-433.52
-650.28
-867.04
0.00
79.23
158.45
237.68
316.90
396.13
475.35
554.58
손익(백만)
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,719.11
1,289.33



WN7-WHEAT FUTURE(CBT) JUL17



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	63
CN7	CORN FUTURE JUL17	193
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	63
SMN7	SOYBEAN MEAL FUTR JUL17	69
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	138
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	83

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

814