공시일	2017-05-11
기준일	2017-05-10

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	2017-05-11
기준일	2017-05-10

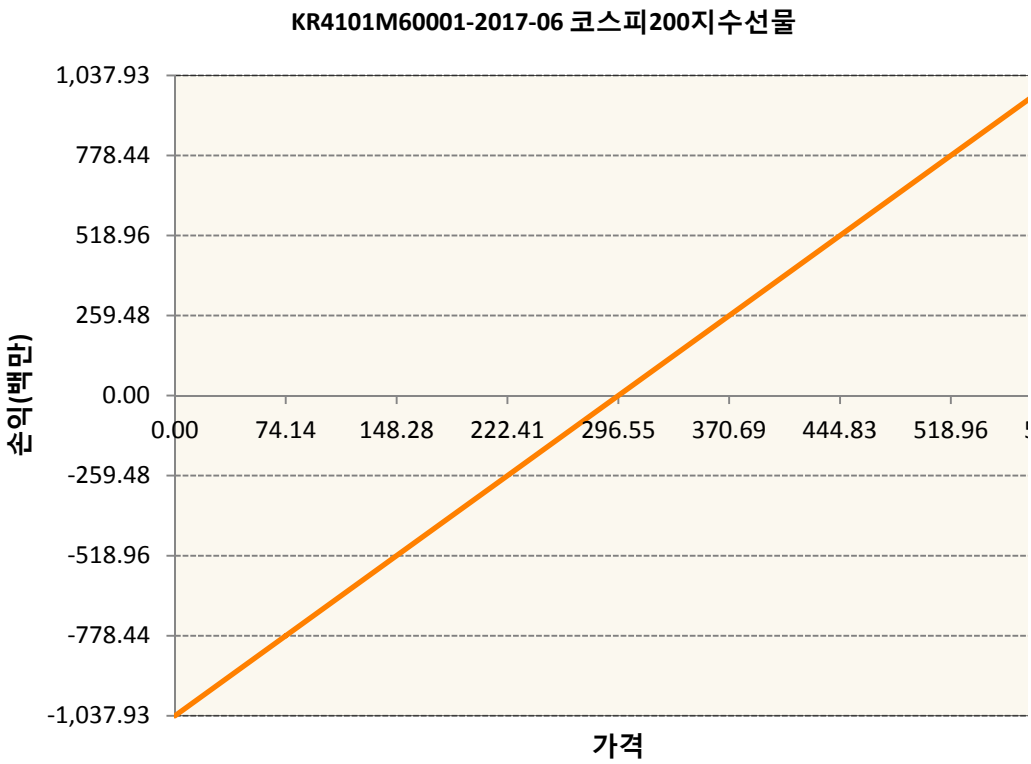
스마트인덱스모

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	1,038	0	1,038	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							83
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-5.33%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-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%	55	55	55	55	55	55	55
8.00%	83	83	83	83	83	83	83

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

55

공시일	2017-05-11
기준일	2017-05-10

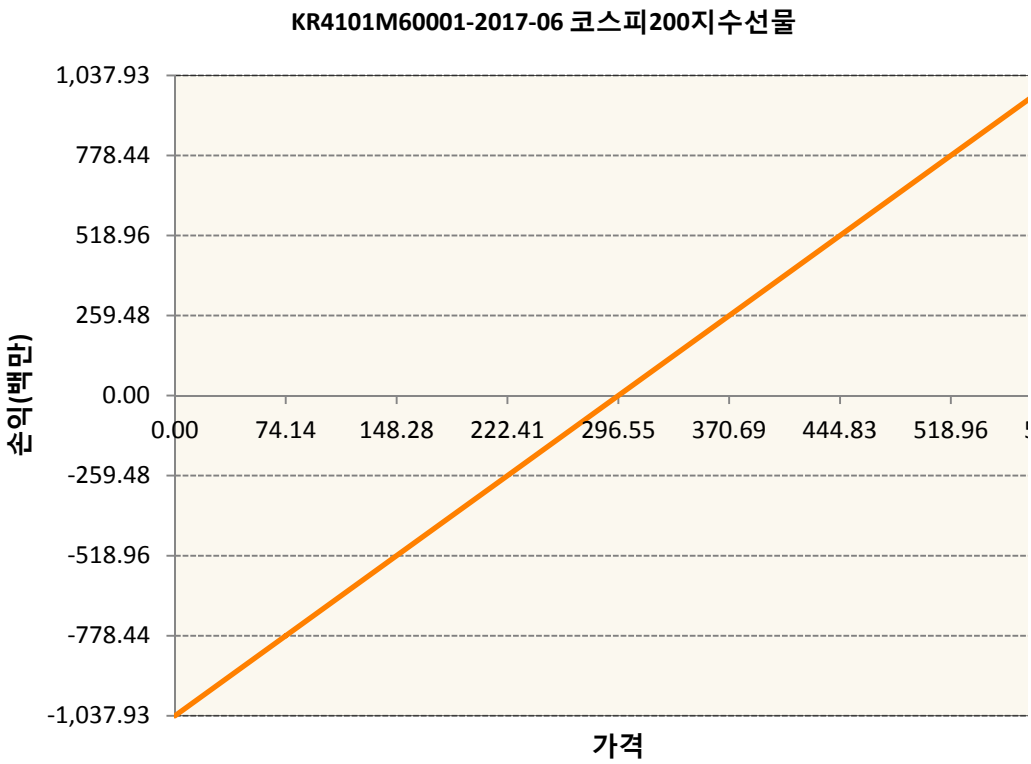
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,038	0	1,038	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							83
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-5.33%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-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%	55	55	55	55	55	55	55
8.00%	83	83	83	83	83	83	83

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

55

공시일	2017-05-11
기준일	2017-05-10

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	982

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

549

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-05-11
기준일	2017-05-10

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	357

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

365

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-05-11
기준일	2017-05-10

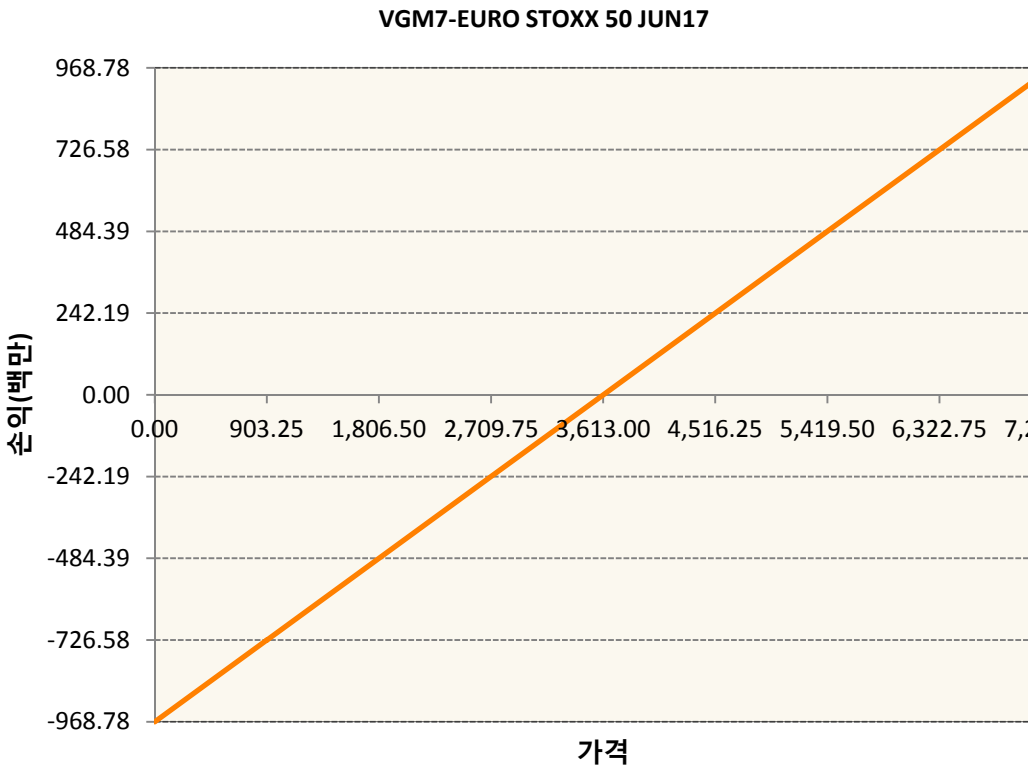
유로인덱스모(주식-파생형)

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)

77

공시일	2017-05-11
기준일	2017-05-10

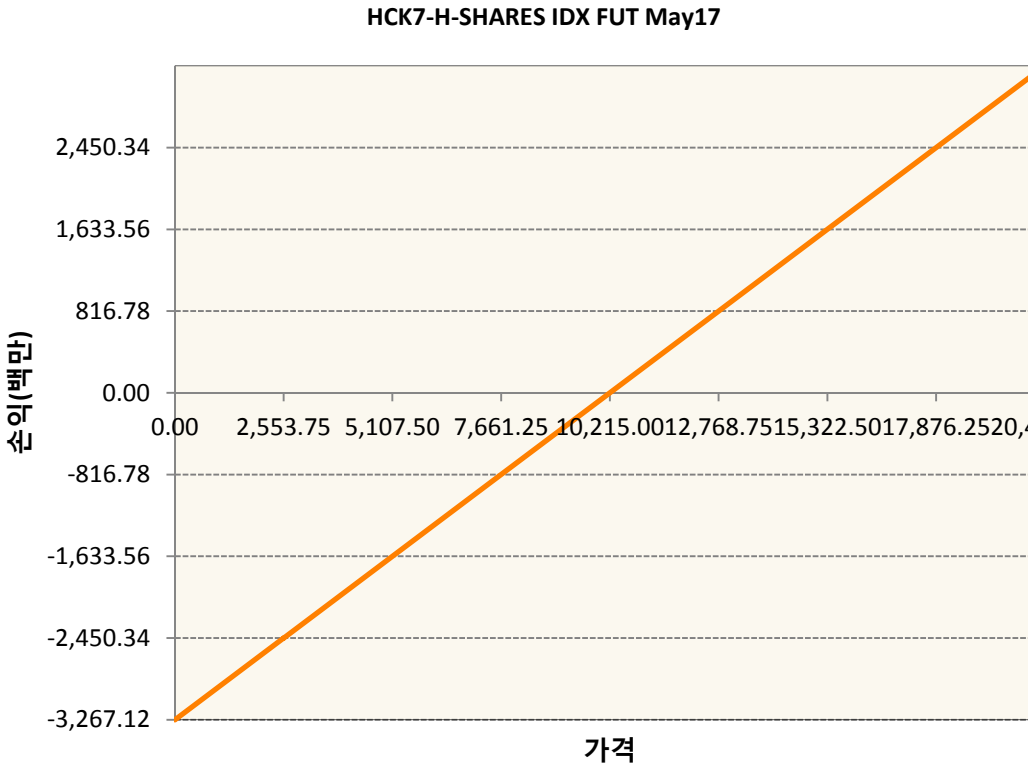
차이나인덱스모(주식-파생형)

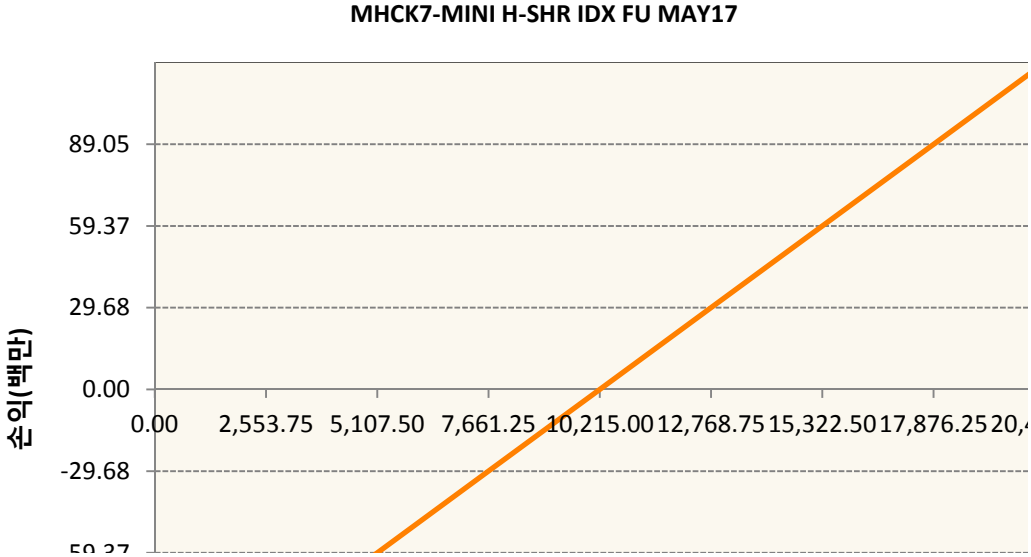
1. 계약금액

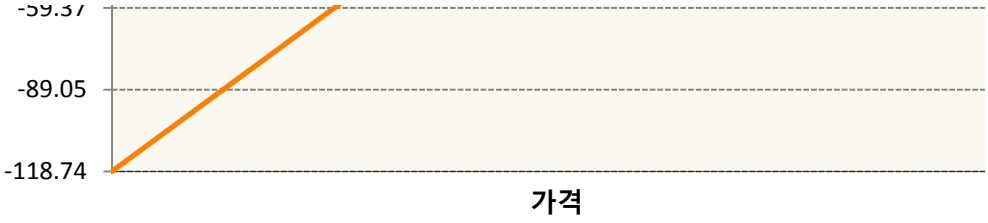
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,386	0	3,386	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCK7	H-SHARES IDX FUT May17	261
MHCK7	MINI H-SHR IDX FU MAY17	9

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

287

공시일	2017-05-11
기준일	2017-05-10

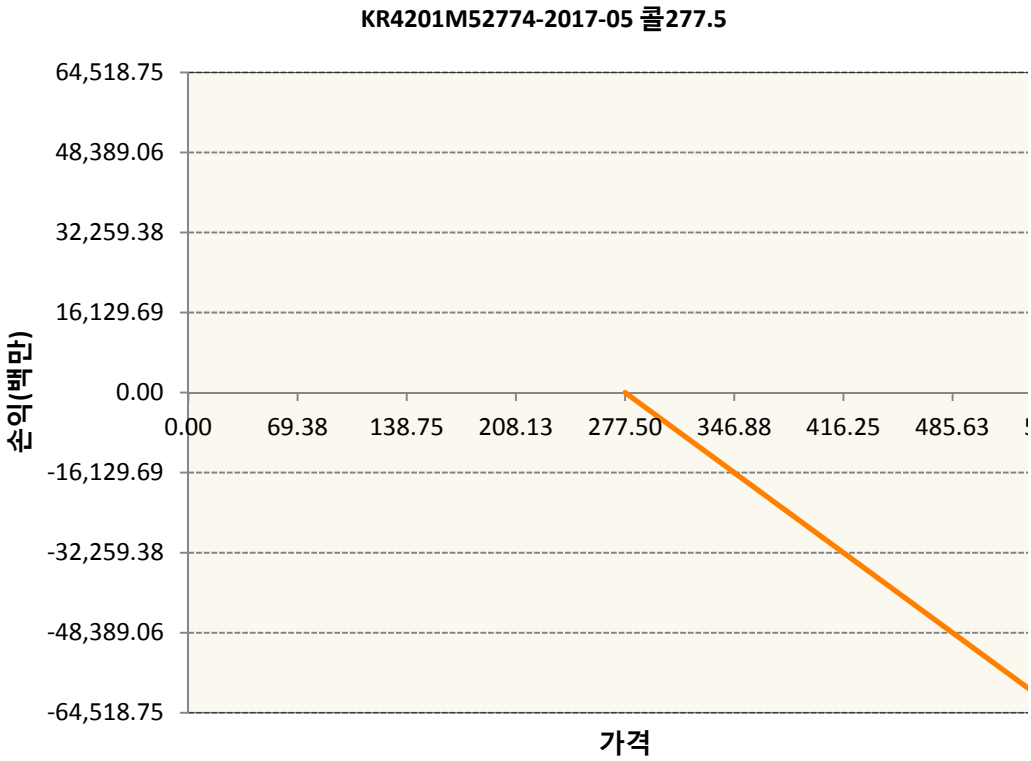
커버드콜모(주식혼합-파생형)

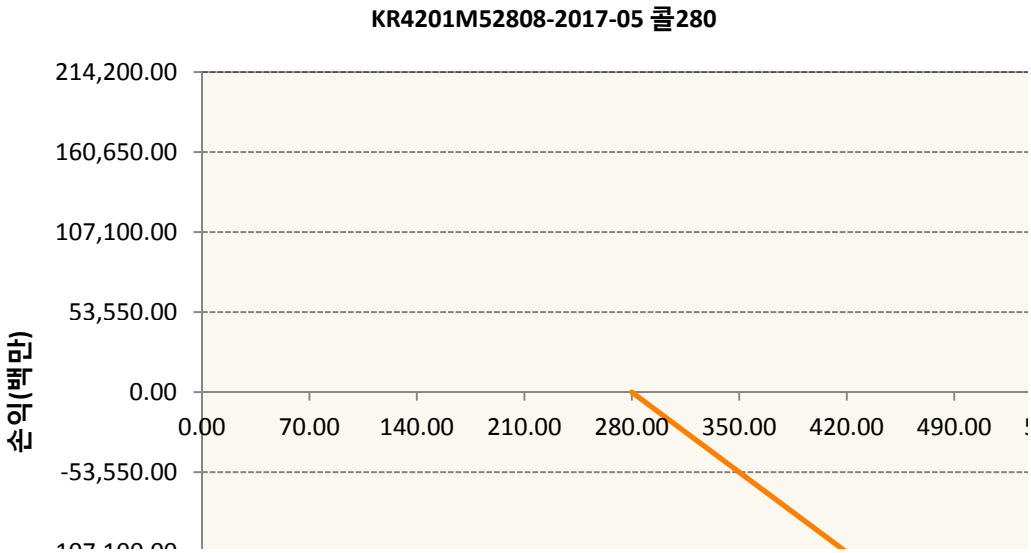
1. 계약금액

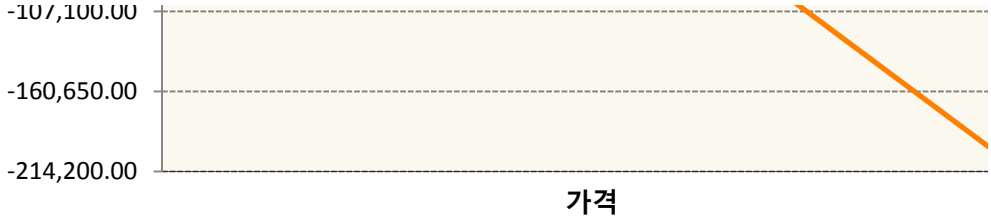
(단위:백만원)

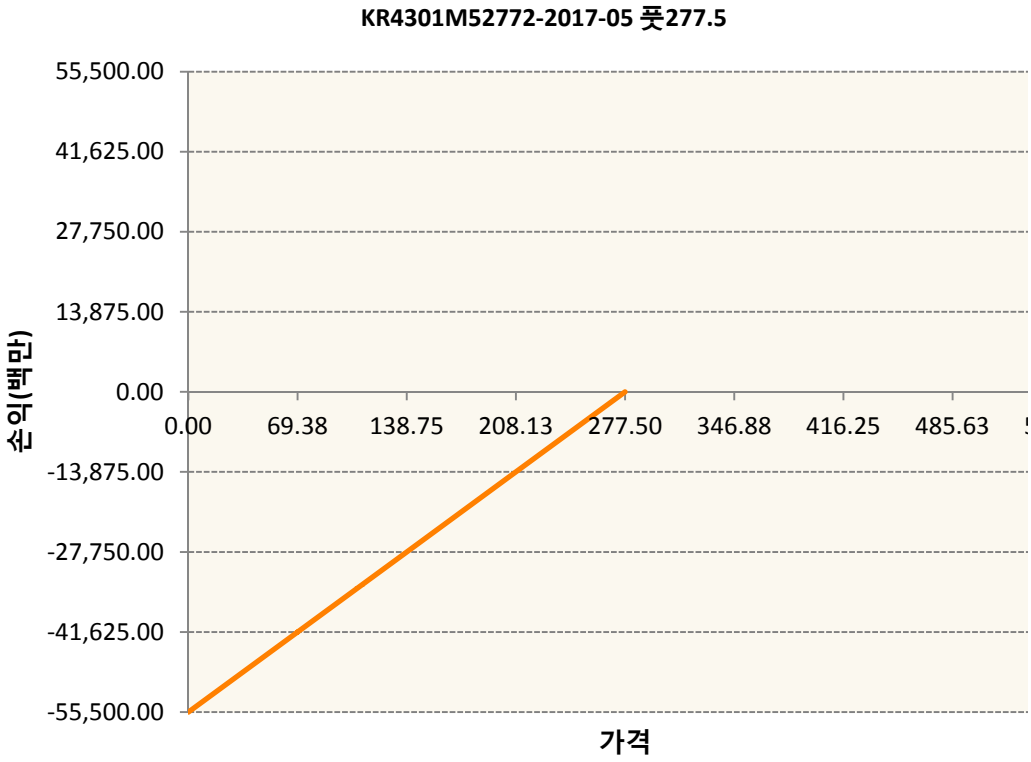
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	380,419	-380,419	장내

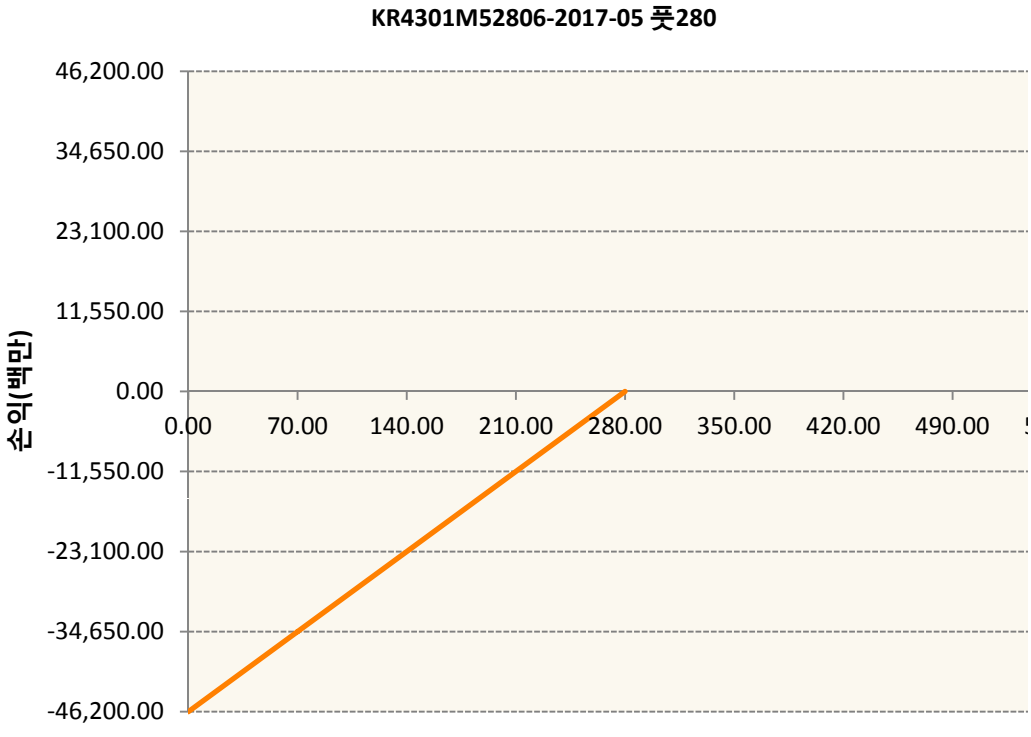
2. 만기시점의 손익구조






-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						5,509
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,344	4,344	4,343	4,341	4,339	4,335	4,331
-5.33%	3,662	3,656	3,649	3,640	3,630	3,619	3,608
-2.67%	1,836	1,836	1,836	1,836	1,836	1,836	1,836
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-1,836	-1,836	-1,836	-1,836	-1,836	-1,836	-1,836
5.33%	-3,673	-3,673	-3,673	-3,673	-3,673	-3,673	-3,673
8.00%	-5,509	-5,509	-5,509	-5,509	-5,509	-5,509	-5,509
KR4201M52	2017-05 콜280						18,126
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12,383	12,383	12,383	12,383	12,382	12,381	12,379
-5.33%	11,661	11,600	11,538	11,477	11,415	11,354	11,292
-2.67%	6,042	6,042	6,042	6,042	6,041	6,041	6,039
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-6,042	-6,042	-6,042	-6,042	-6,042	-6,042	-6,042
5.33%	-12,084	-12,084	-12,084	-12,084	-12,084	-12,084	-12,084
8.00%	-18,126	-18,126	-18,126	-18,126	-18,126	-18,126	-18,126
KR4301M52	2017-05 풋277.5						1,013
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,002	-1,002	-1,003	-1,005	-1,007	-1,010	-1,013
-5.33%	-9	-14	-21	-28	-37	-46	-56
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
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						1,240
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,239	-1,239	-1,239	-1,239	-1,239	-1,239	-1,240
-5.33%	-91	-104	-118	-131	-144	-158	-171
-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

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

23,638

공시일	2017-05-11
기준일	2017-05-10

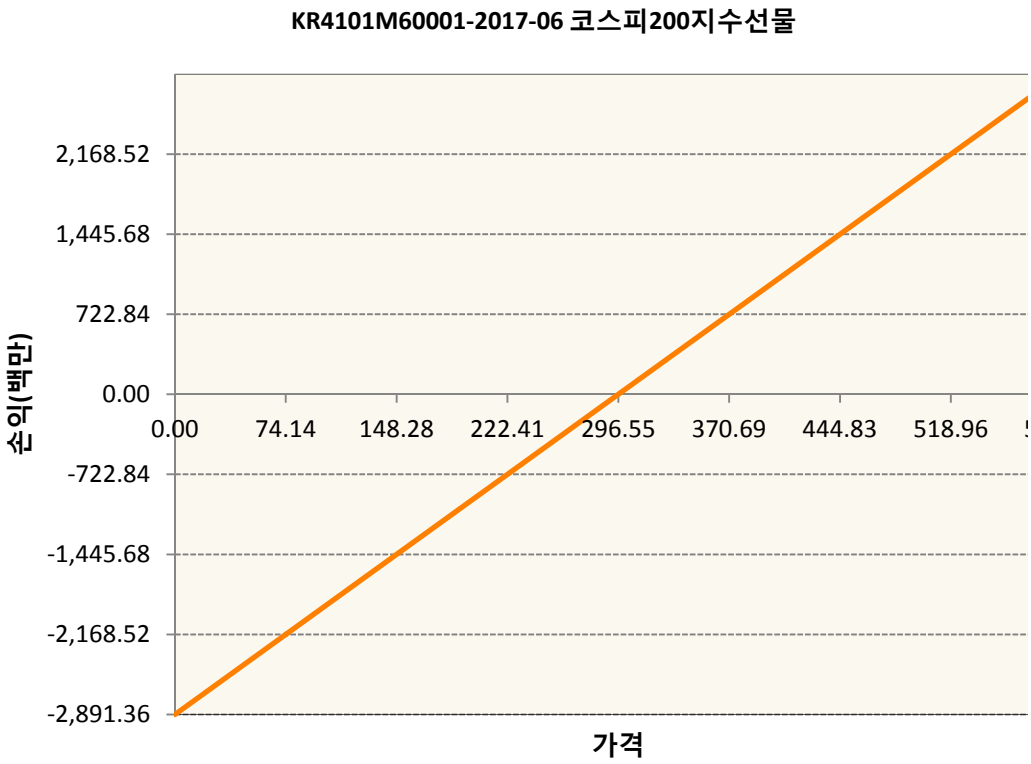
커버드콜목표전환형증권투자신탁

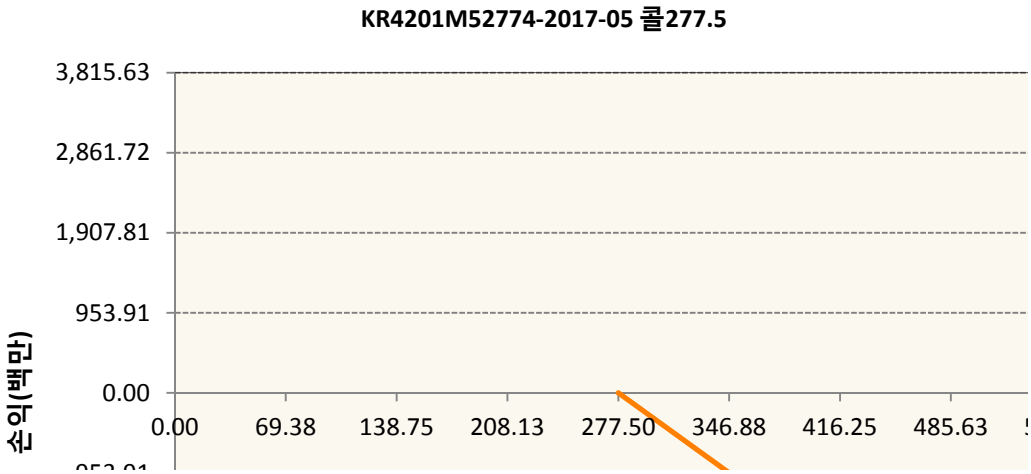
1. 계약금액

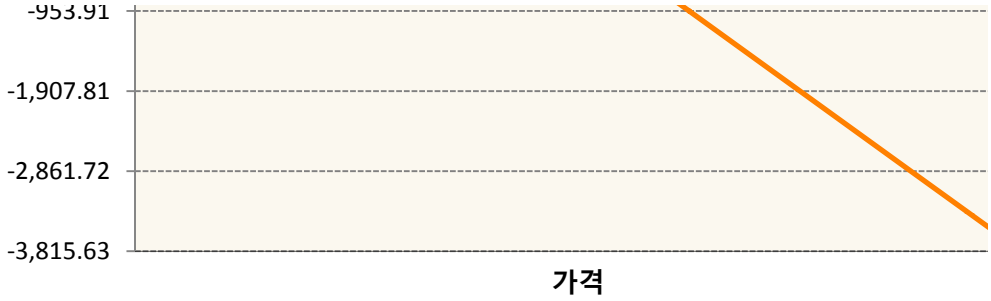
(단위:백만원)

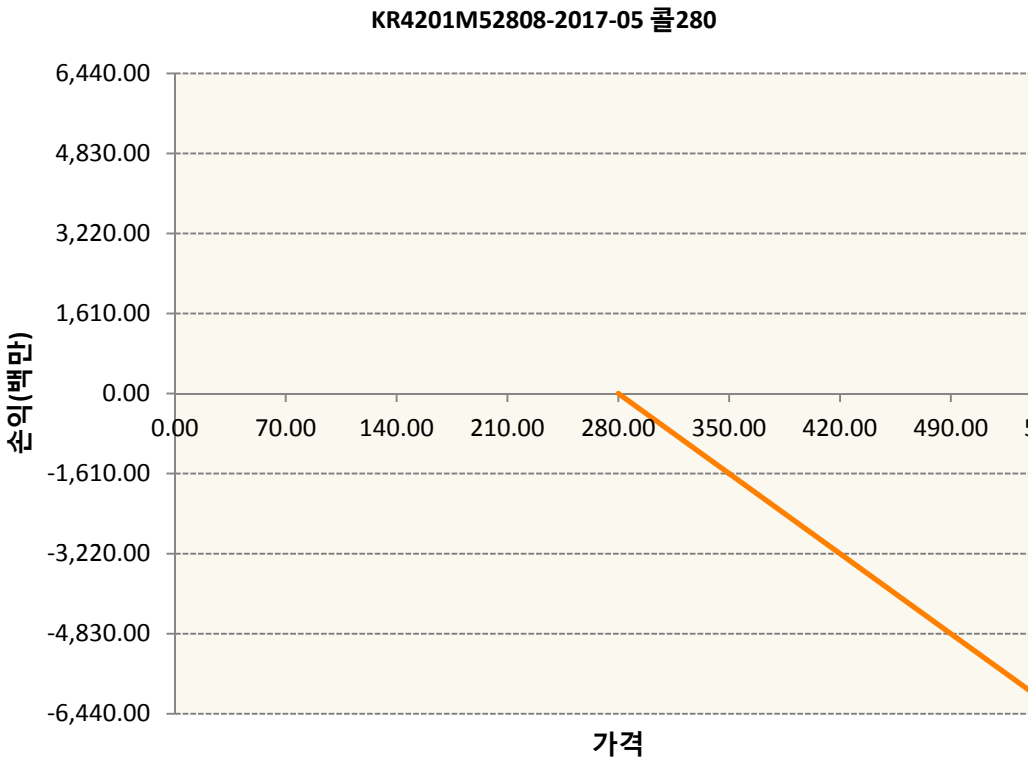
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,891	0	2,891	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,256	-10,256	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							231
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-231	-231	-231	-231	-231	-231	-231
-5.33%	-154	-154	-154	-154	-154	-154	-154
-2.67%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	77	77	77	77	77	77	77
5.33%	154	154	154	154	154	154	154
8.00%	231	231	231	231	231	231	231
KR4201M52 2017-05 콜277.5							326
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	257	257	257	257	257	256	256
-5.33%	217	216	216	215	215	214	213
-2.67%	109	109	109	109	109	109	109
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-109	-109	-109	-109	-109	-109	-109
5.33%	-217	-217	-217	-217	-217	-217	-217
8.00%	-326	-326	-326	-326	-326	-326	-326
	KR4201M52(	2017-05 콜280					545

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	372	372	372	372	372	372	372
-5.33%	351	349	347	345	343	341	339
-2.67%	182	182	182	182	182	182	182
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182
5.33%	-363	-363	-363	-363	-363	-363	-363
8.00%	-545	-545	-545	-545	-545	-545	-545

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

1,023

공시일	2017-05-11
기준일	2017-05-10

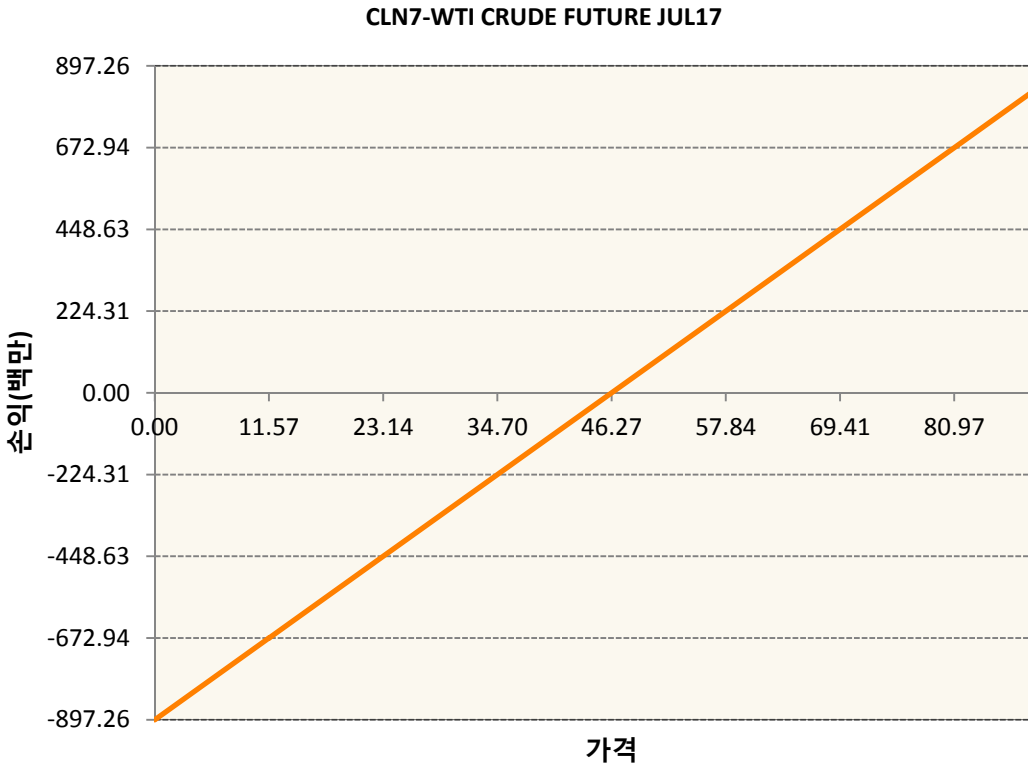
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

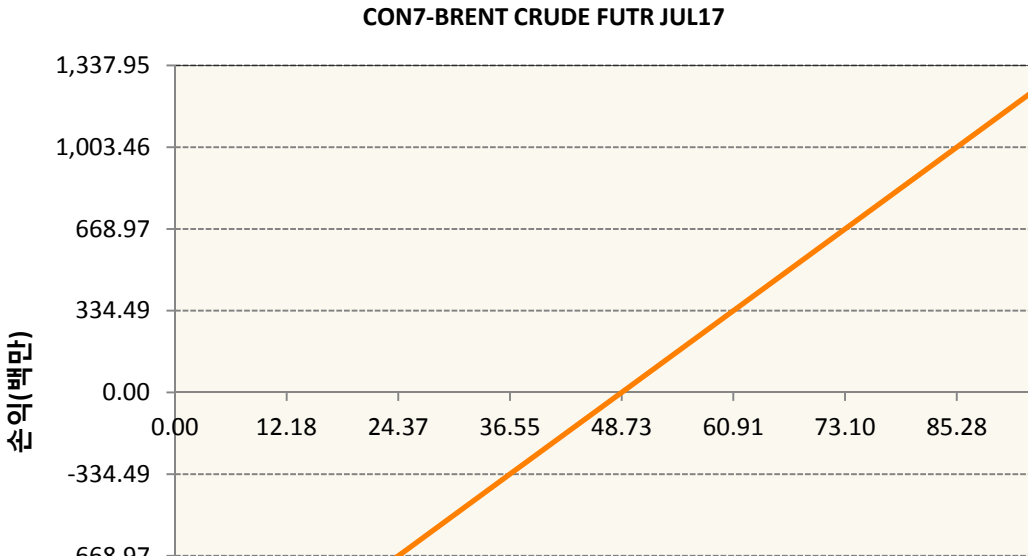
1. 계약금액

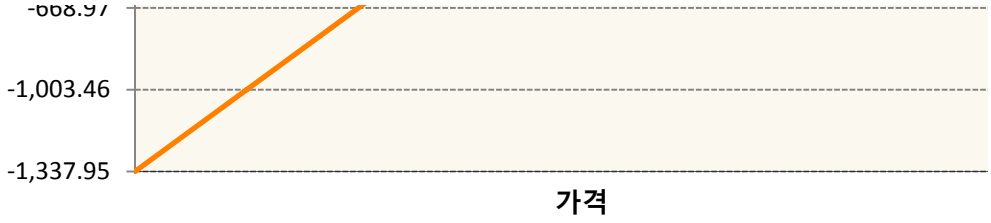
(단위:백만원)

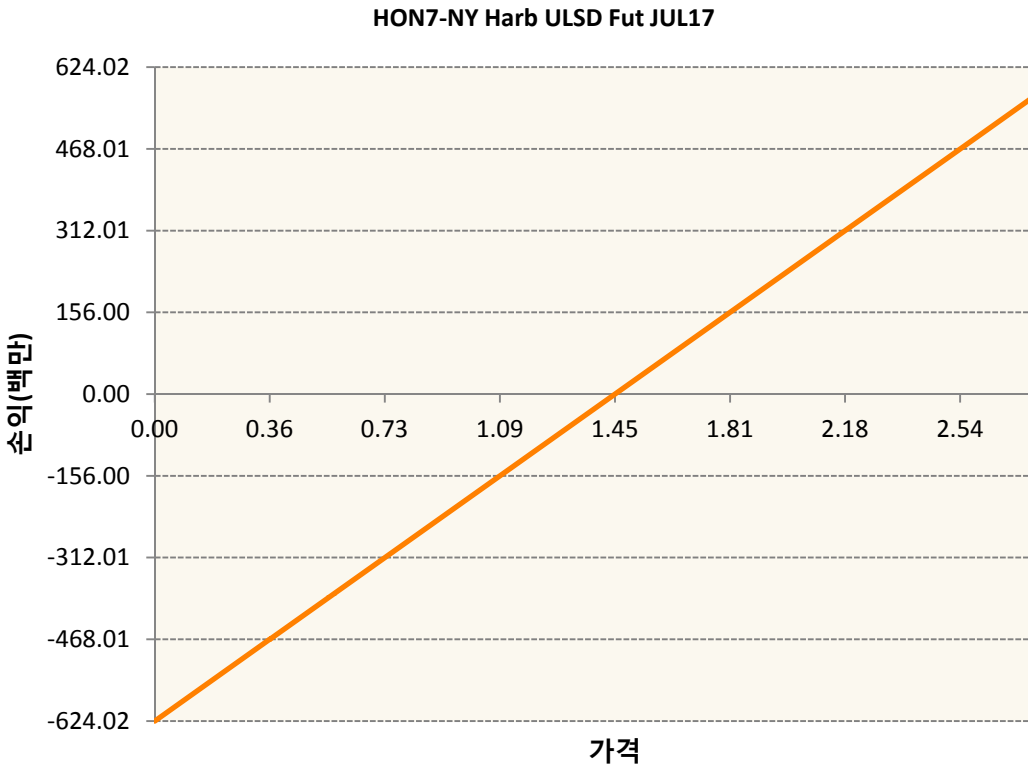
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,053	409	4,643	

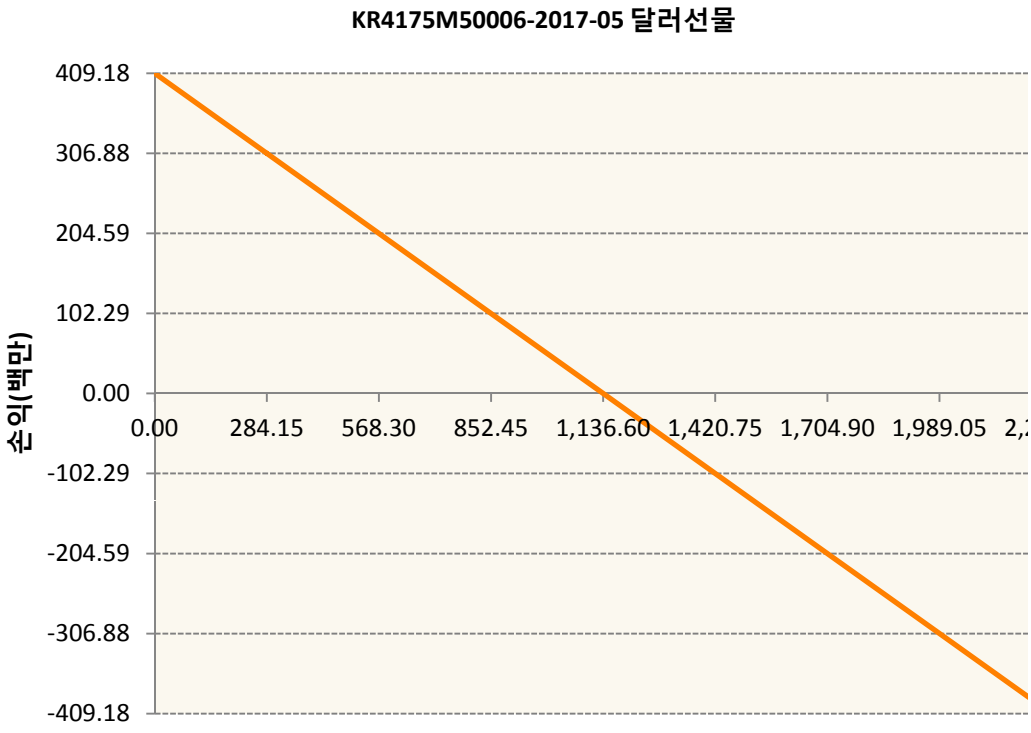
2. 만기시점의 손익구조



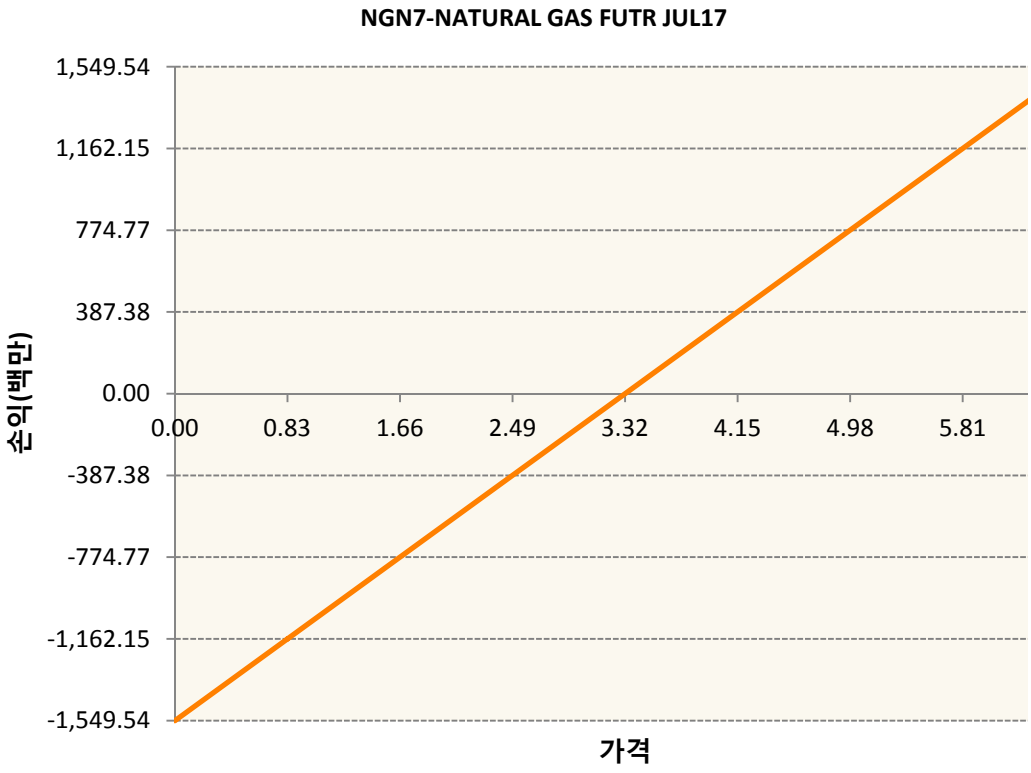


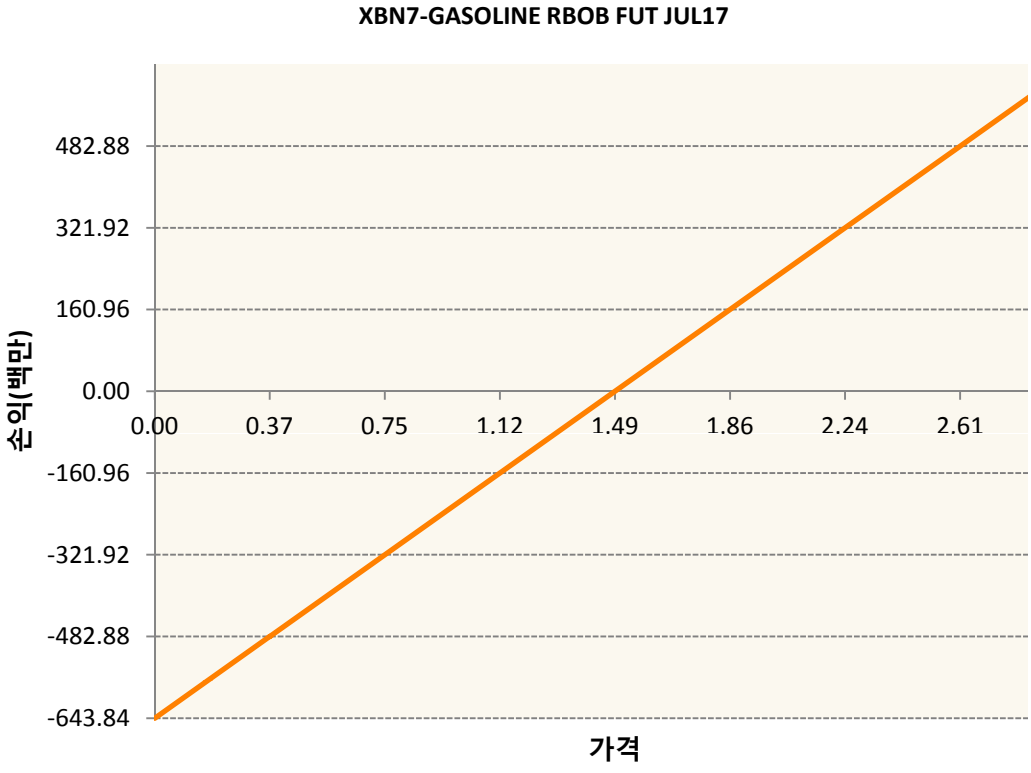

-668.97
-1,003.46
-1,337.95
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
624.02
468.01
312.01
156.00
0.00
-156.00
-312.01
-468.01
-624.02
0.00
0.36
0.73
1.09
1.45
1.81
2.18
2.54
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
1,549.54
1,162.15
774.77
387.38
0.00
-387.38
-774.77
-1,162.15
-1,549.54
0.00
0.83
1.66
2.49
3.32
4.15
4.98
5.81
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
482.88
321.92
160.96
0.00
-160.96
-321.92
-482.88
-643.84
0.00
0.37
0.75
1.12
1.49
1.86
2.24
2.61
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN7	WTI CRUDE FUTURE JUL17	72
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	107
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	50
KR4175M50(	2017-05 달러선물	33
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	124
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	52

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

878

공시일	2017-05-11
기준일	2017-05-10

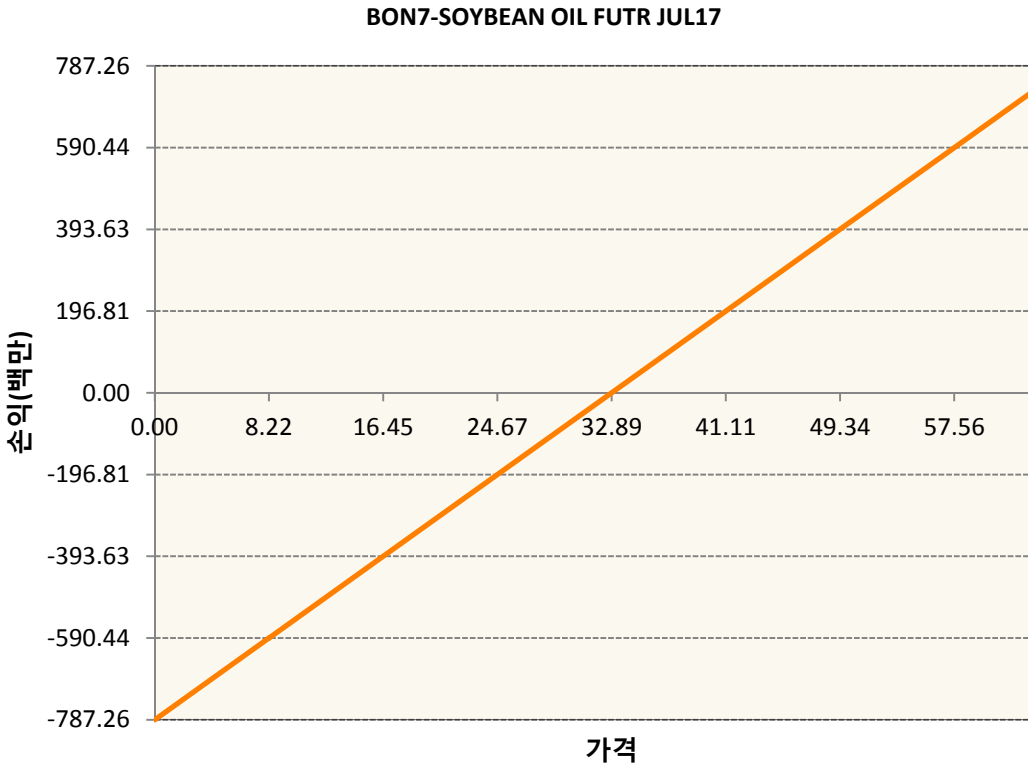
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

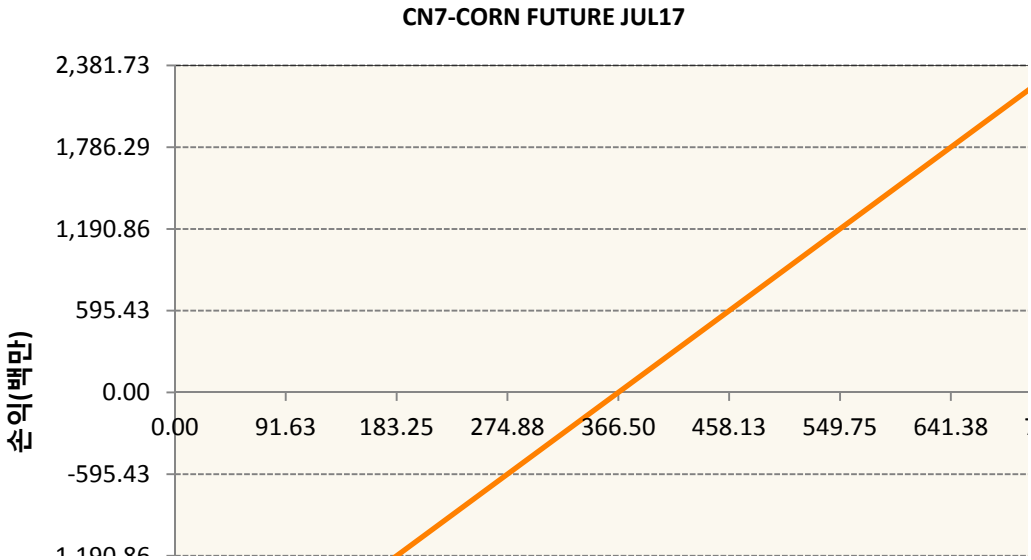
1. 계약금액

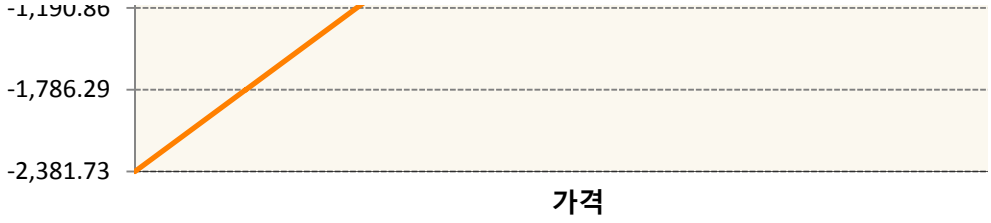
(단위:백만원)

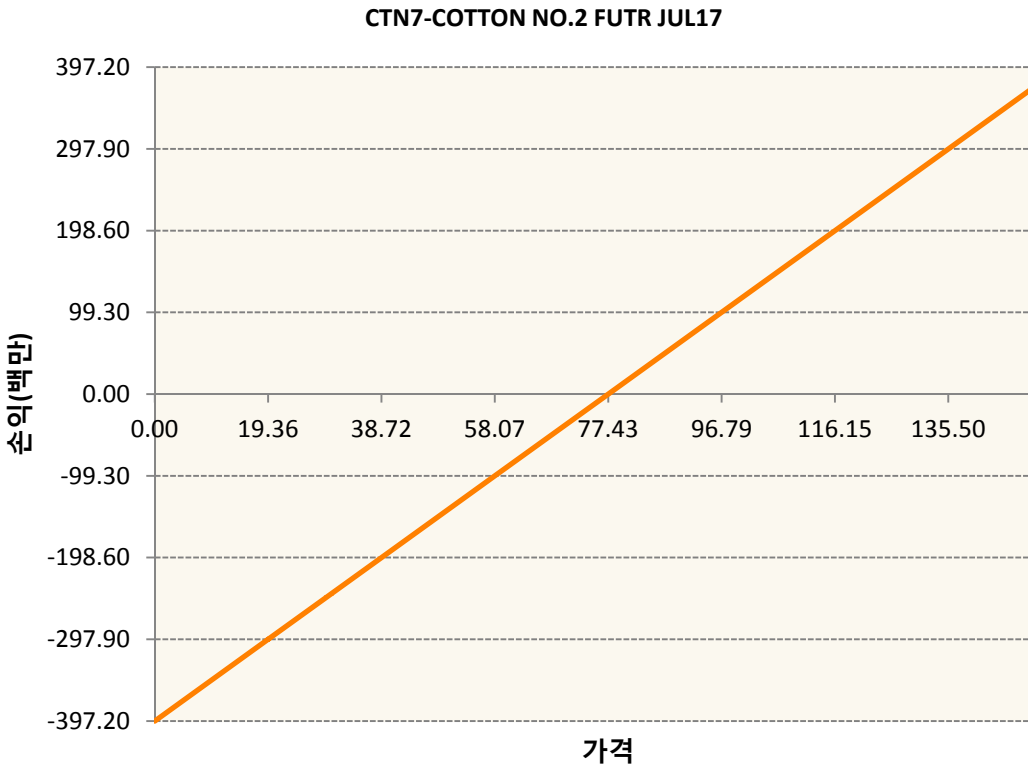
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,887	398	8,489	

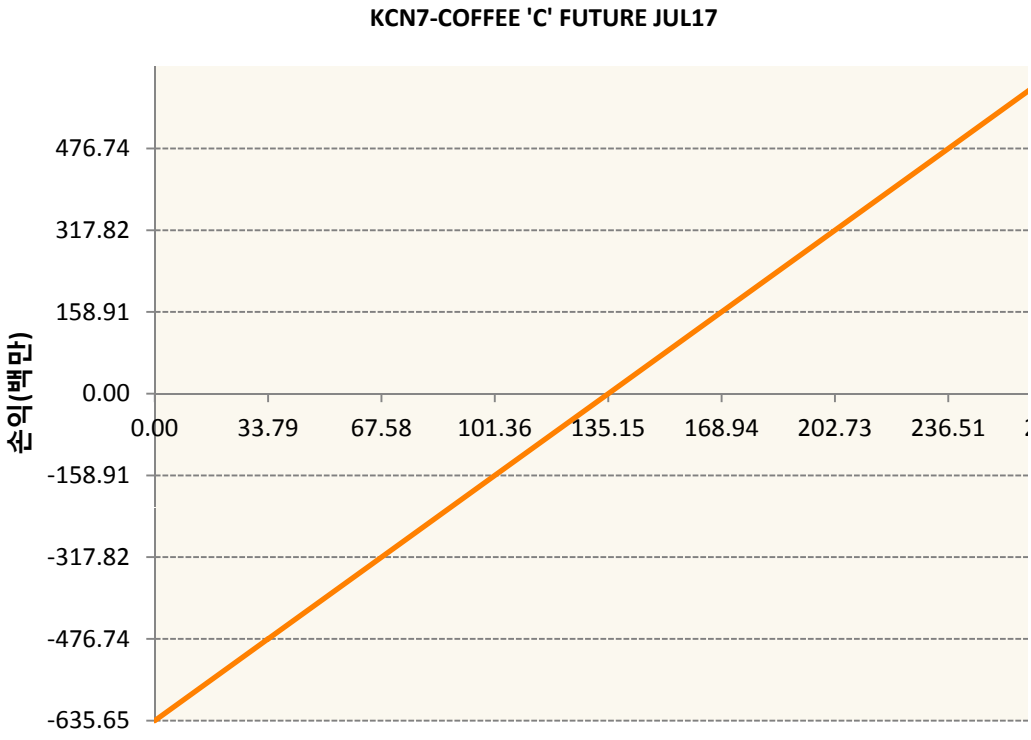
2. 만기시점의 손익구조



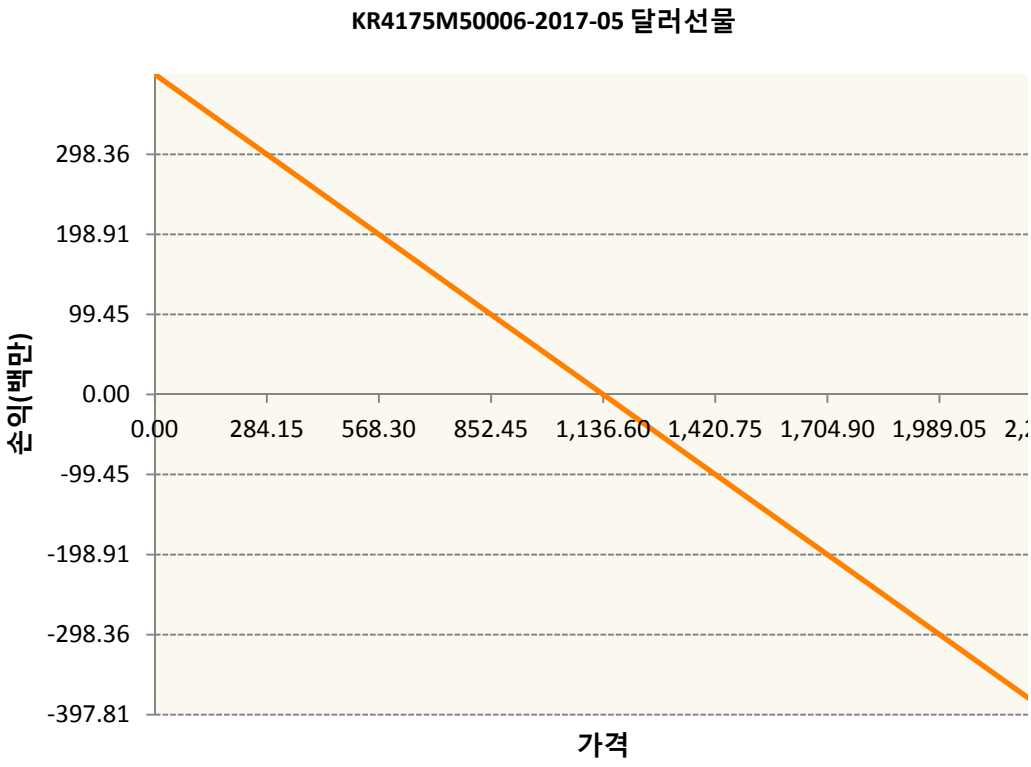


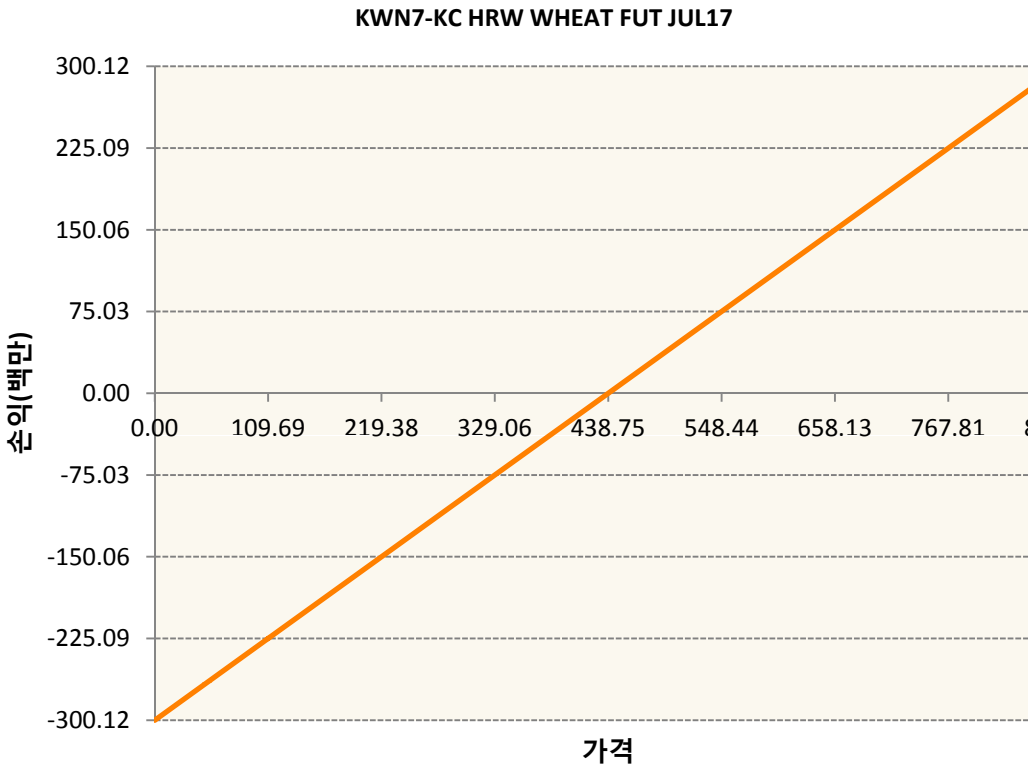

-1,786.29
-2,381.73
가격

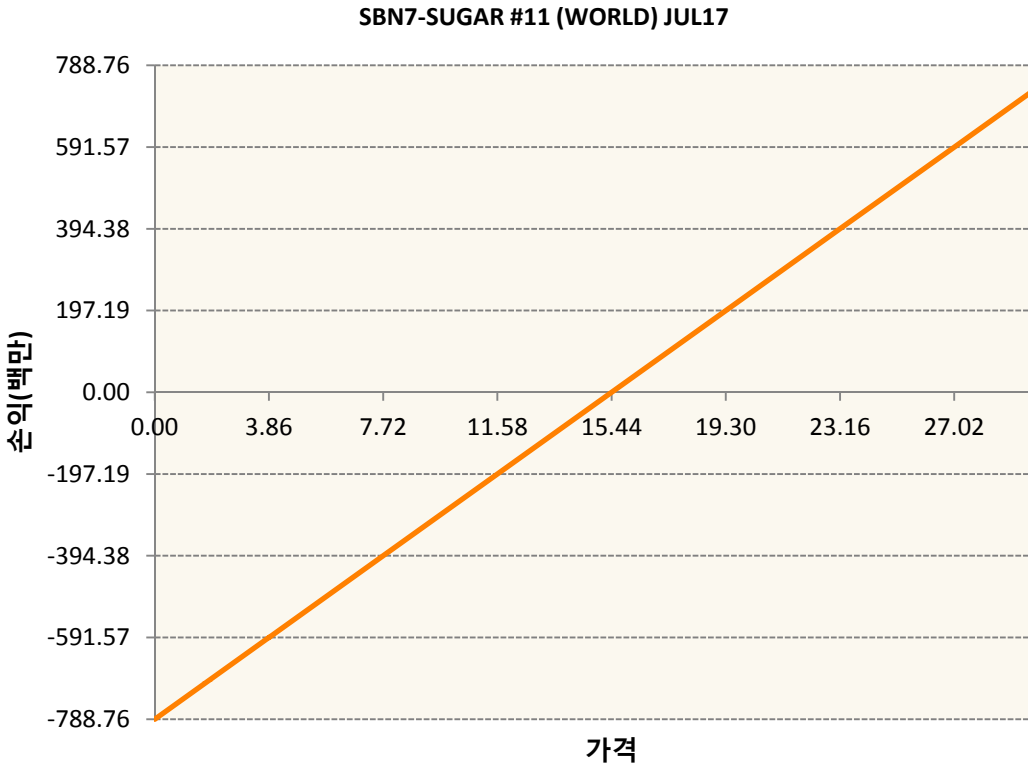

CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
397.20
297.90
198.60
99.30
0.00
-99.30
-198.60
-297.90
-397.20
0.00
19.36
38.72
58.07
77.43
96.79
116.15
135.50
순익(백만)
가격

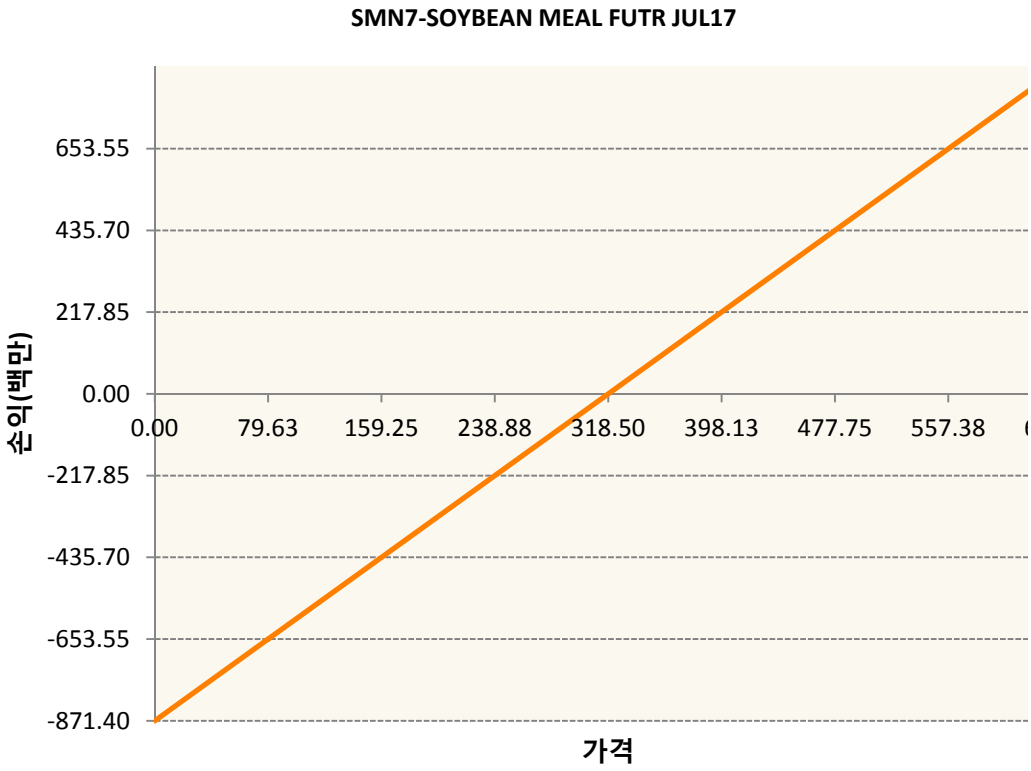

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
476.74
317.82
158.91
0.00
-158.91
-317.82
-476.74
-635.65
0.00
33.79
67.58
101.36
135.15
168.94
202.73
236.51
순익(백만)

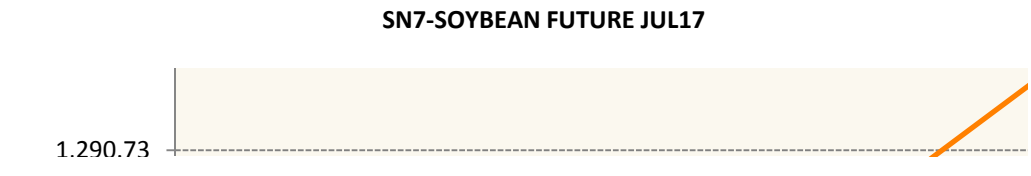
가격

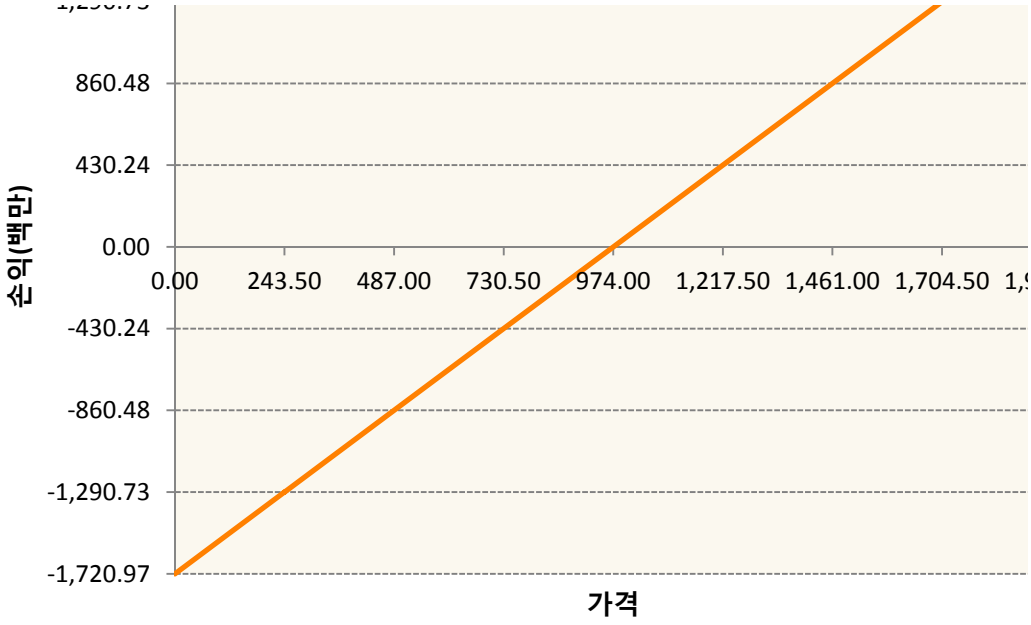

KR4175M50006-2017-05 달러선물
298.36
198.91
99.45
0.00
-99.45
-198.91
-298.36
-397.81
0.00
284.15
568.30
852.45
1,136.60
1,420.75
1,704.90
1,989.05
손익(백만)
가격

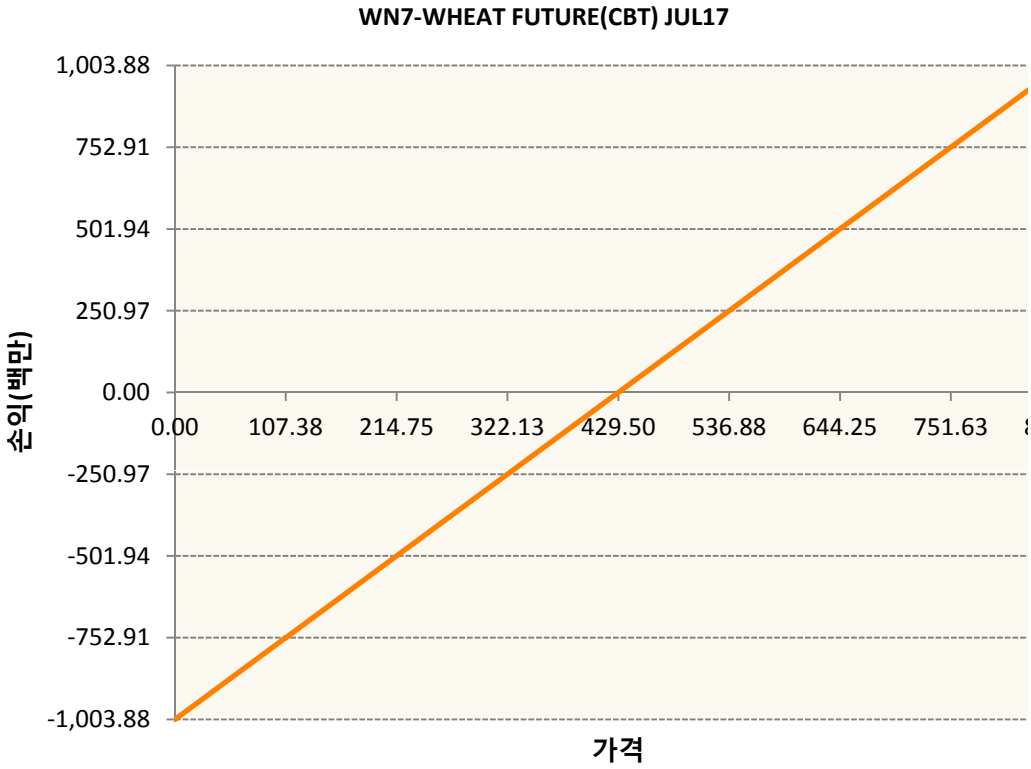

KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17
300.12
225.09
150.06
75.03
0.00
-75.03
-150.06
-225.09
-300.12
0.00
109.69
219.38
329.06
438.75
548.44
658.13
767.81
손익(백만)
가격


SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
788.76
591.57
394.38
197.19
0.00
-197.19
-394.38
-591.57
-788.76
손익(백만)
0.00
3.86
7.72
11.58
15.44
19.30
23.16
27.02
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
653.55
435.70
217.85
0.00
-217.85
-435.70
-653.55
-871.40
손익(백만)
0.00
79.63
159.25
238.88
318.50
398.13
477.75
557.38
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,290.73





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	63
CN7	CORN FUTURE JUL17	191
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	32
KCN7	COFFEE 'C' FUTURE JUL17	51
KR4175M50(	2017-05 달러선물	32

KWN7	KC HRW WHEAT FUT JUL17	24
SBN7	SUGAR #11 (WORLD) JUL17	63
SMN7	SOYBEAN MEAL FUTR JUL17	70
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	138
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	80

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

808