공시일	2017-05-12
기준일	2017-05-11

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	2017-05-12
기준일	2017-05-11

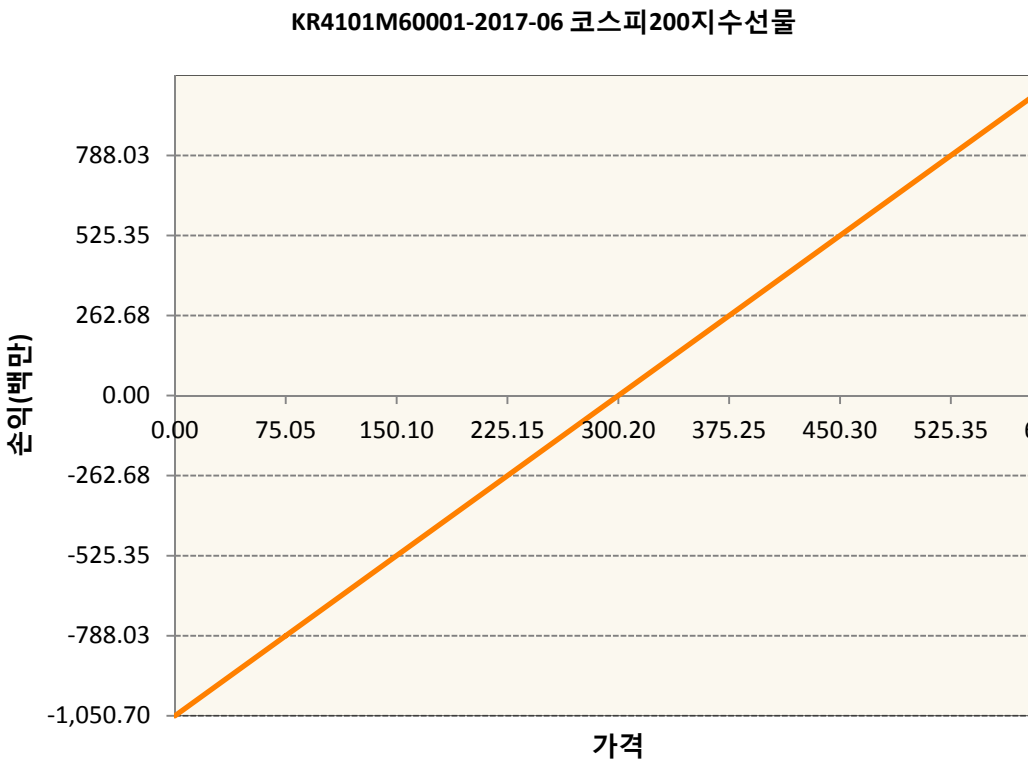
스마트인덱스모

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	1,051	0	1,051	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)

56

공시일	2017-05-12
기준일	2017-05-11

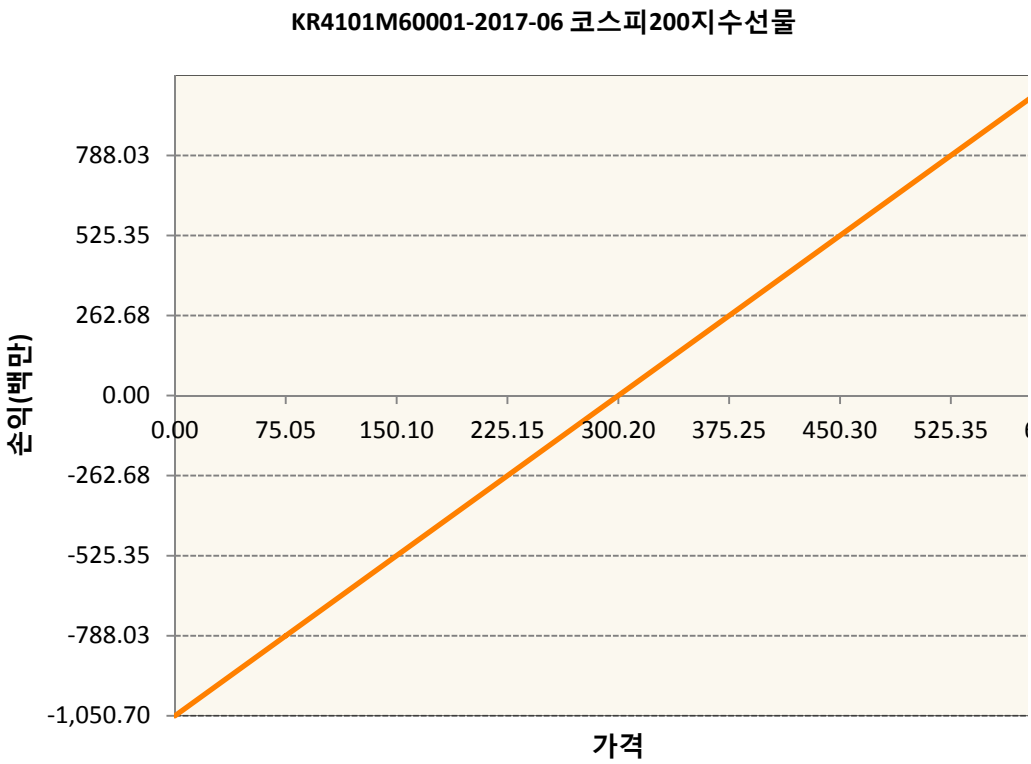
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,051	0	1,051	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)

56

공시일	2017-05-12
기준일	2017-05-11

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	984

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

550

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-05-12
기준일	2017-05-11

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	356

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

334

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-05-12
기준일	2017-05-11

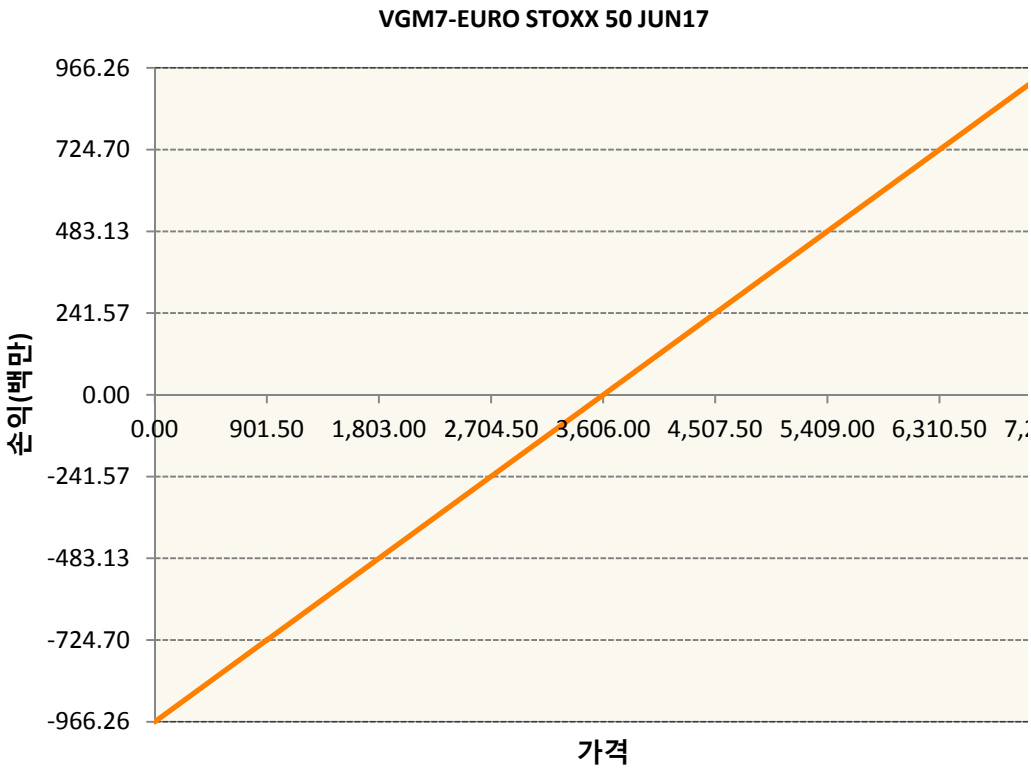
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	966	0	966	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM7	EURO STOXX 50 JUN17	77

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

(단위:백만원)

77

공시일	2017-05-12
기준일	2017-05-11

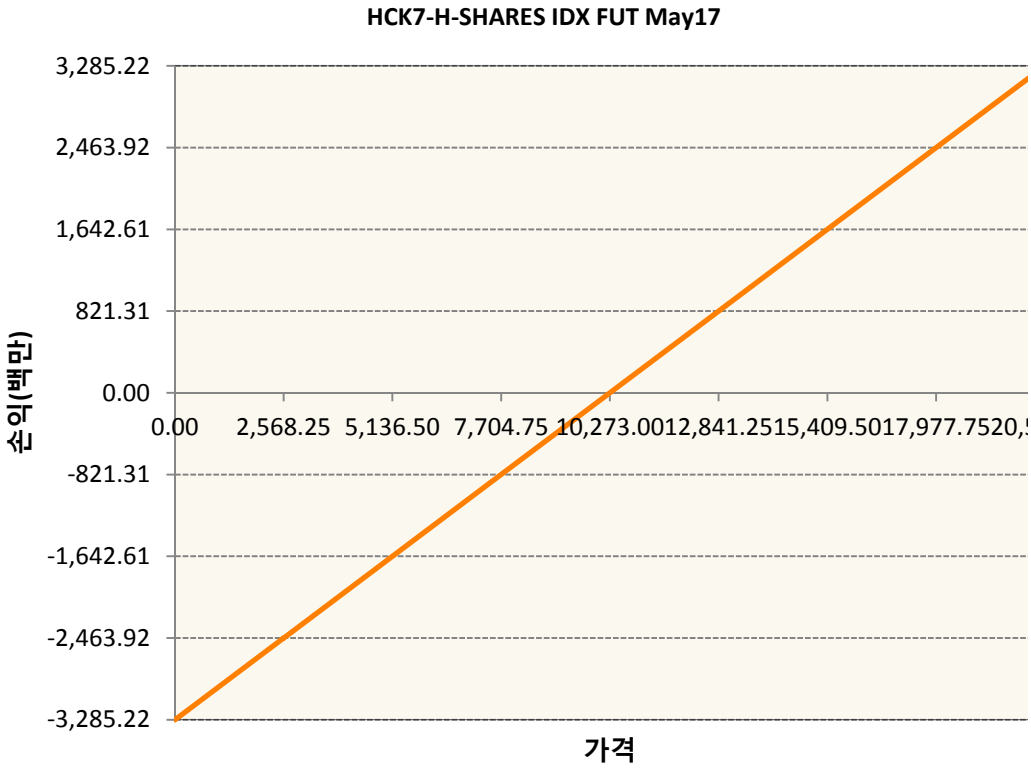
차이나인덱스모(주식-파생형)

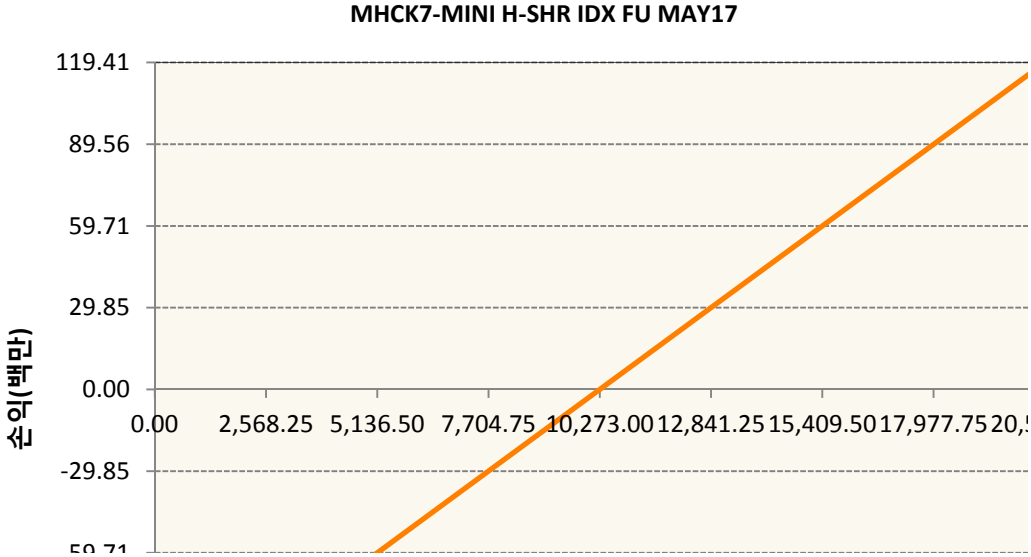
1. 계약금액

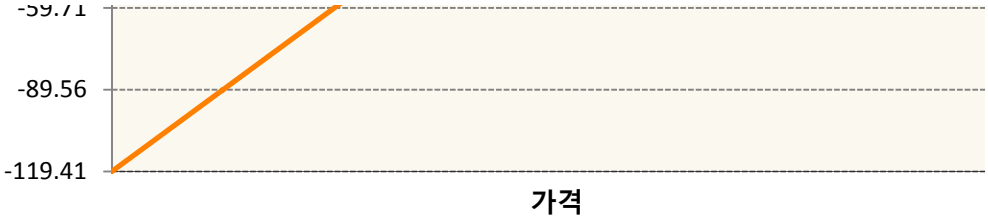
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,405	0	3,405	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCK7	H-SHARES IDX FUT May17	263
MHCK7	MINI H-SHR IDX FU MAY17	10

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

공시일	2017-05-12
기준일	2017-05-11

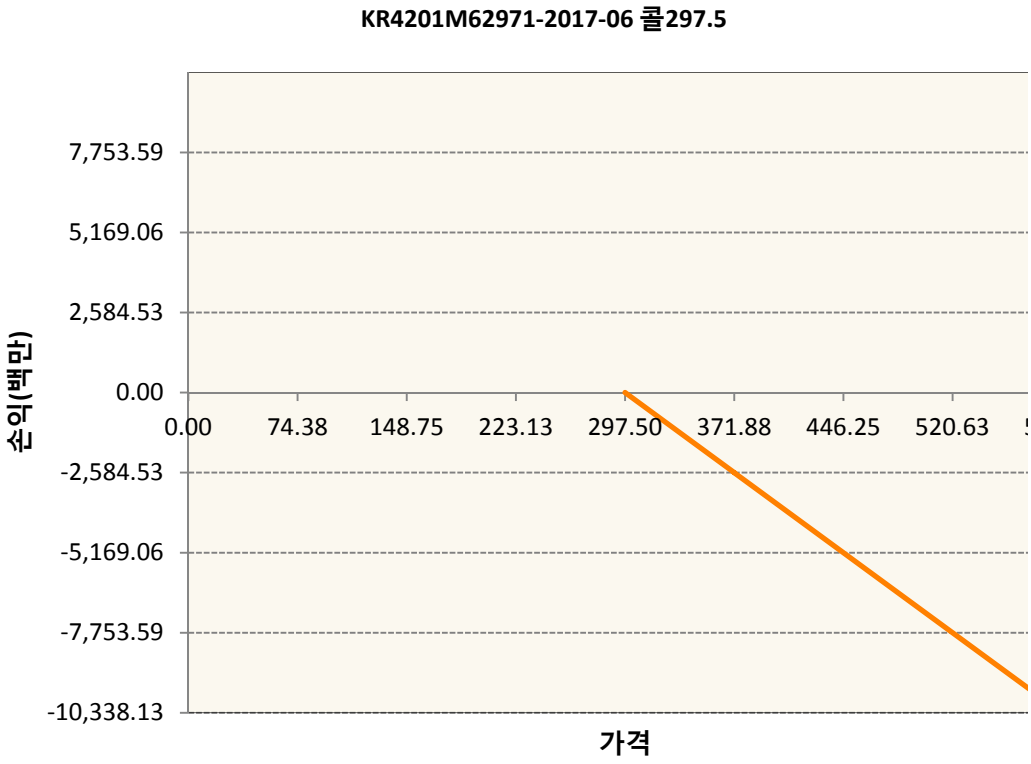
커버드콜모(주식혼합-파생형)

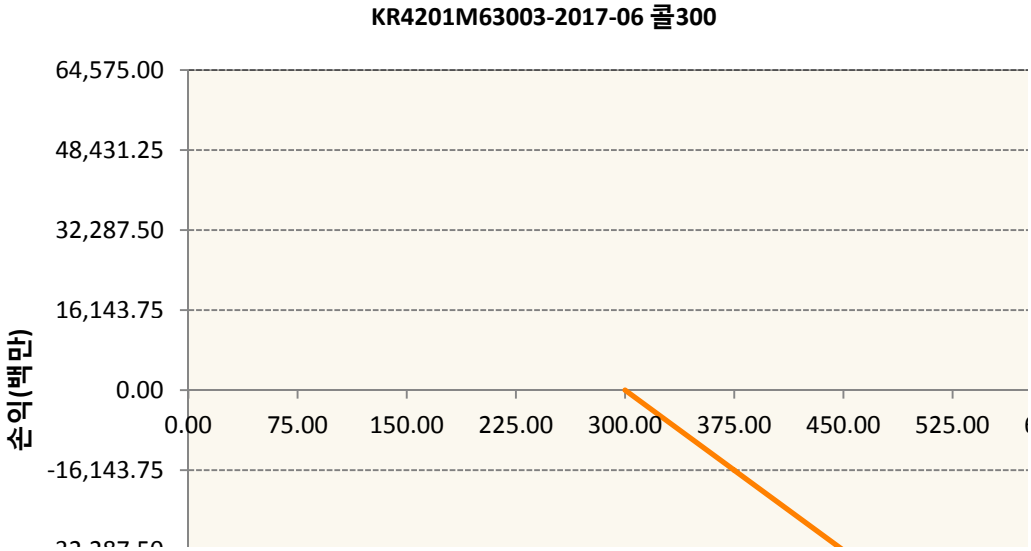
1. 계약금액

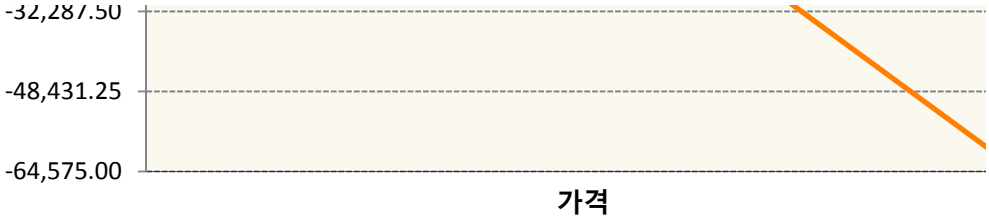
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	75,959	-75,959	장내
누계	유가증권	옵션	0	74,913	-74,913	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M62(2017-06 콜297.5							706
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	215	214	212	210	206	203	198
-5.33%	206	201	195	188	180	171	162
-2.67%	163	151	138	125	112	99	86
0%	43	29	14	0	-14	-29	-43
2.67%	-163	-172	-181	-192	-203	-214	-226
5.33%	-420	-423	-427	-432	-438	-445	-452
8.00%	-693	-694	-695	-697	-699	-702	-706
KR4201M63(2017-06 콜300							4,155
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,053	1,049	1,043	1,033	1,019	1,001	979
-5.33%	1,024	1,002	974	940	900	856	808
-2.67%	847	784	717	647	574	499	422
0%	272	181	91	0	-91	-181	-272
2.67%	-848	-917	-990	-1,065	-1,143	-1,223	-1,304
5.33%	-2,365	-2,394	-2,430	-2,472	-2,520	-2,572	-2,629
8.00%	-4,041	-4,048	-4,060	-4,076	-4,097	-4,124	-4,155

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

5,209

공시일	2017-05-12
기준일	2017-05-11

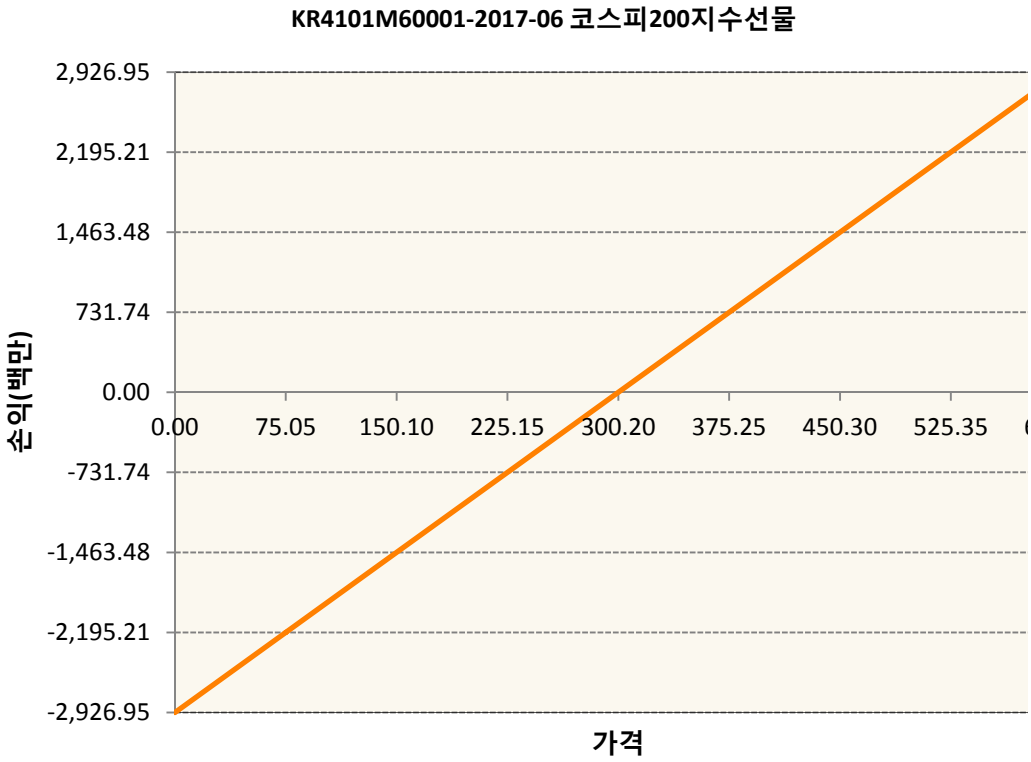
커버드콜목표전환형증권투자신탁

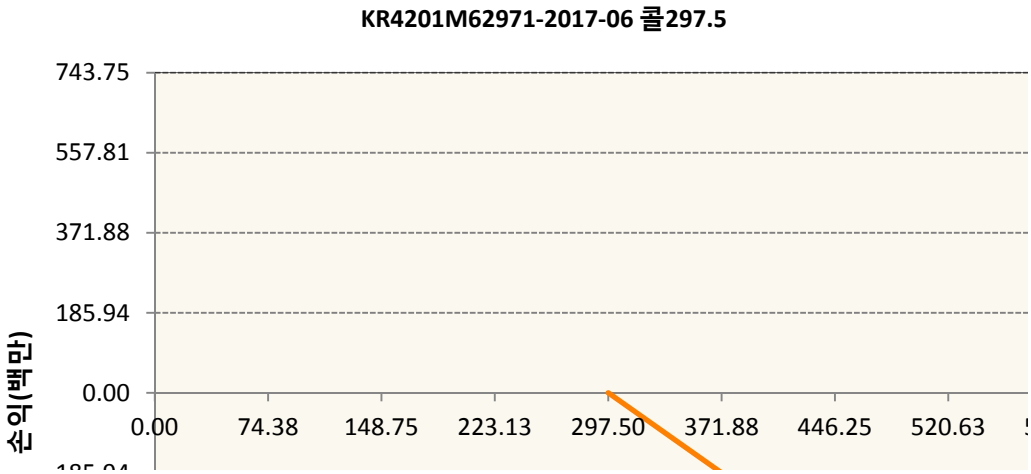
1. 계약금액

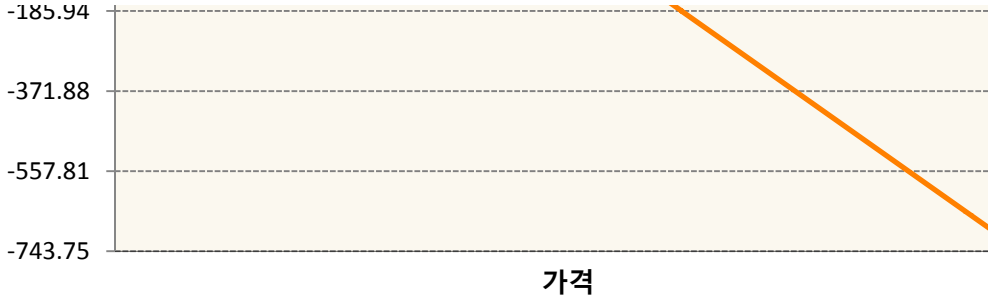
(단위:백만원)

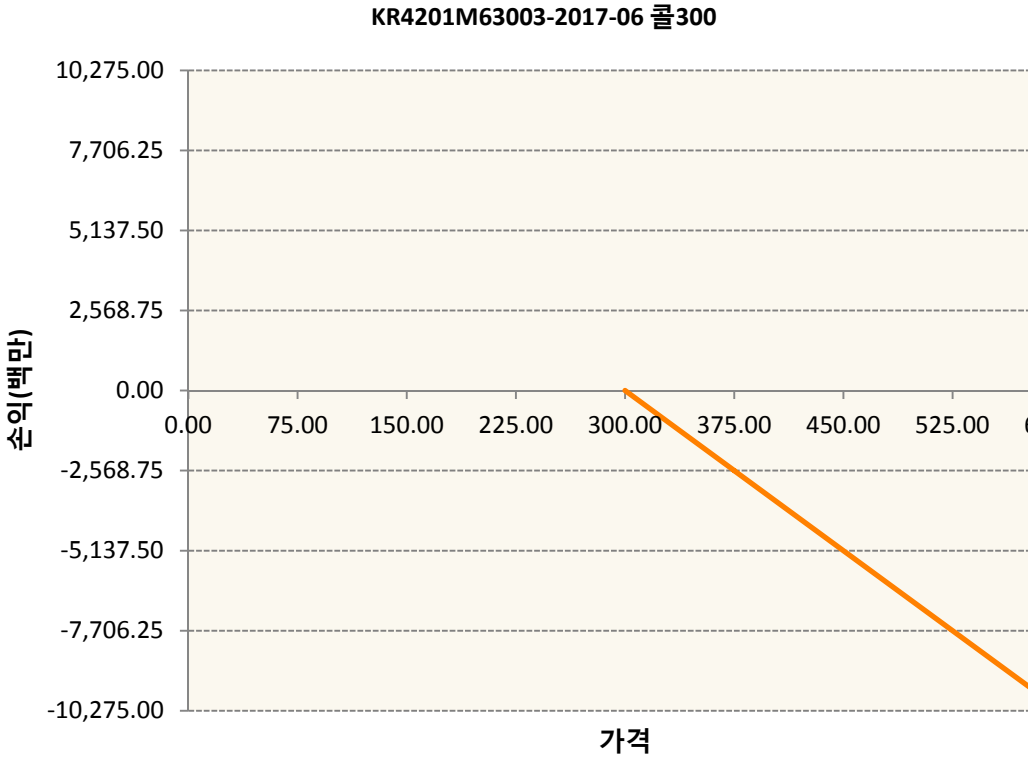
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	13,051	-13,051	장내
누계	유가증권	선물	2,927	0	2,927	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,878	-12,878	장내

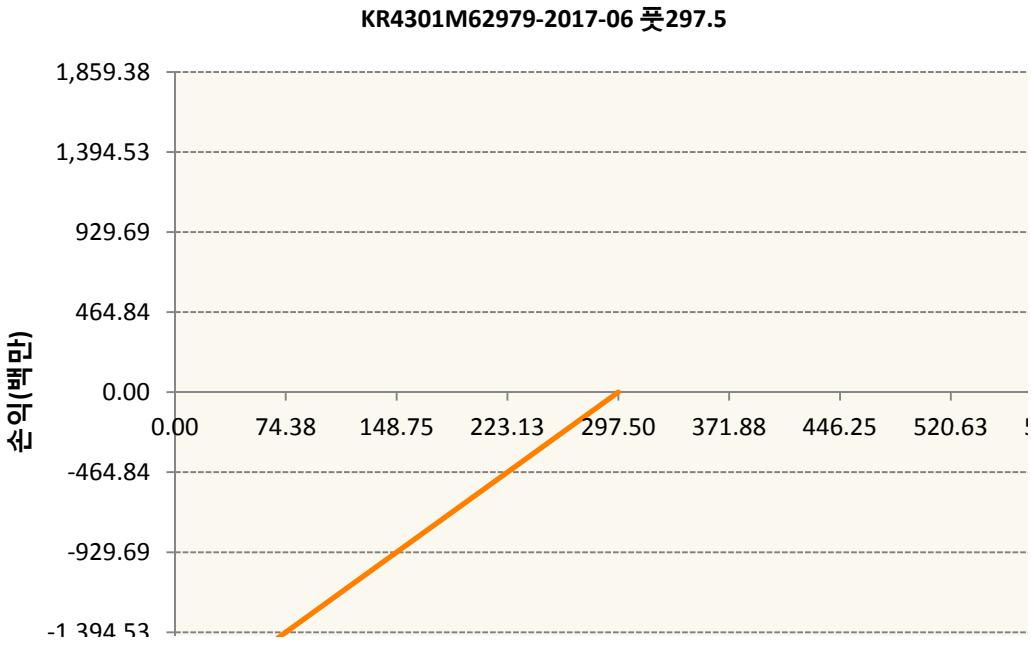
2. 만기시점의 손익구조

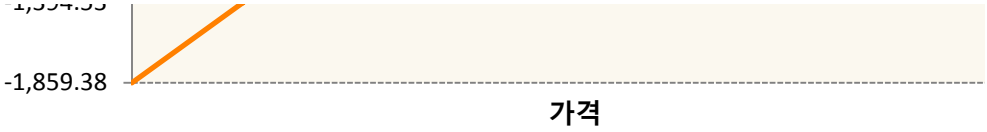





-185.94
-371.88
-557.81
-743.75
가격


KR4201M63003-2017-06 콜300
10,275.00
7,706.25
5,137.50
2,568.75
0.00
-2,568.75
-5,137.50
-7,706.25
-10,275.00
0.00
75.00
150.00
225.00
300.00
375.00
450.00
525.00
순익(백만)
가격


KR4301M62979-2017-06 풋297.5
1,859.38
1,394.53
929.69
464.84
0.00
-464.84
-929.69
-1,394.53
0.00
74.38
148.75
223.13
297.50
371.88
446.25
520.63
순익(백만)



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

KR4201M62(2017-06 콜297.5							51
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15	15	15	15	15	15	14
-5.33%	15	14	14	14	13	12	12
-2.67%	12	11	10	9	8	7	6
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-12	-12	-13	-14	-15	-15	-16
5.33%	-30	-30	-31	-31	-32	-32	-33
8.00%	-50	-50	-50	-50	-50	-51	-51

KR4201M63(2017-06 콜300							661
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	168	167	166	164	162	159	156
-5.33%	163	159	155	150	143	136	128
-2.67%	135	125	114	103	91	79	67
0%	43	29	14	0	-14	-29	-43
2.67%	-135	-146	-157	-169	-182	-195	-207
5.33%	-376	-381	-387	-393	-401	-409	-418
8.00%	-643	-644	-646	-649	-652	-656	-661

KR4301M62(2017-06 풋297.5							114
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-111	-111	-112	-112	-113	-113	-114
-5.33%	-63	-64	-65	-66	-67	-69	-71
-2.67%	-21	-23	-25	-27	-30	-32	-34

0%	8	5	3	0	-3	-5	-8
2.67%	21	19	17	15	13	11	9
5.33%	24	24	23	22	21	20	18
8.00%	25	25	25	24	24	23	23

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

1,034

공시일	2017-05-12
기준일	2017-05-11

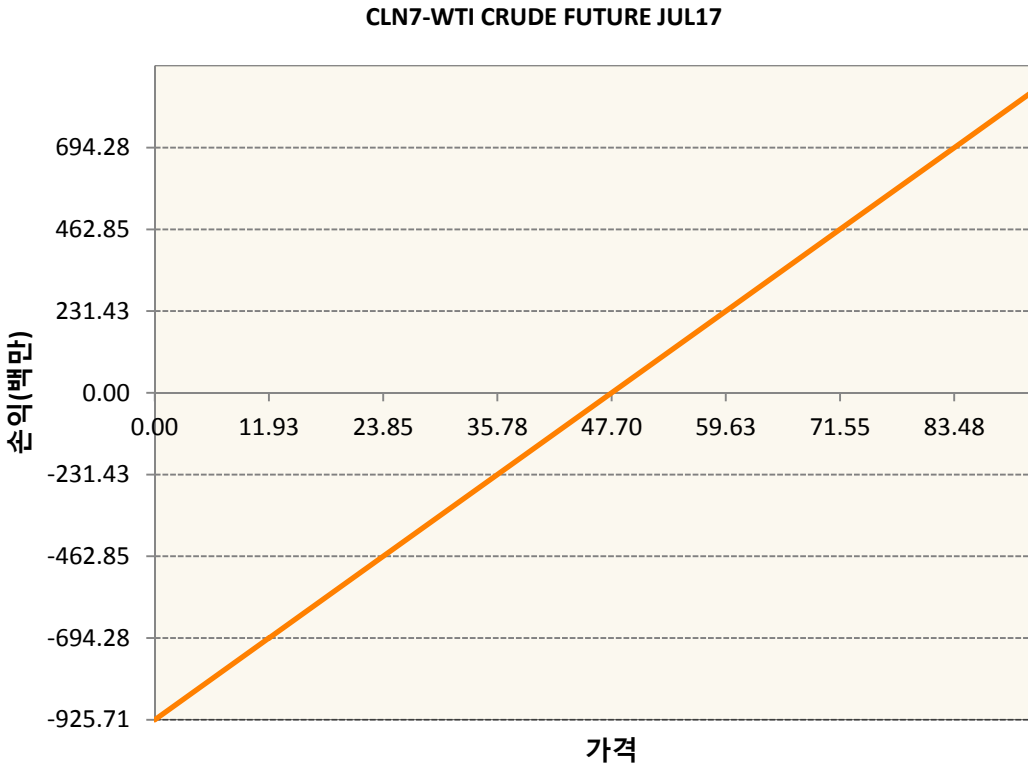
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

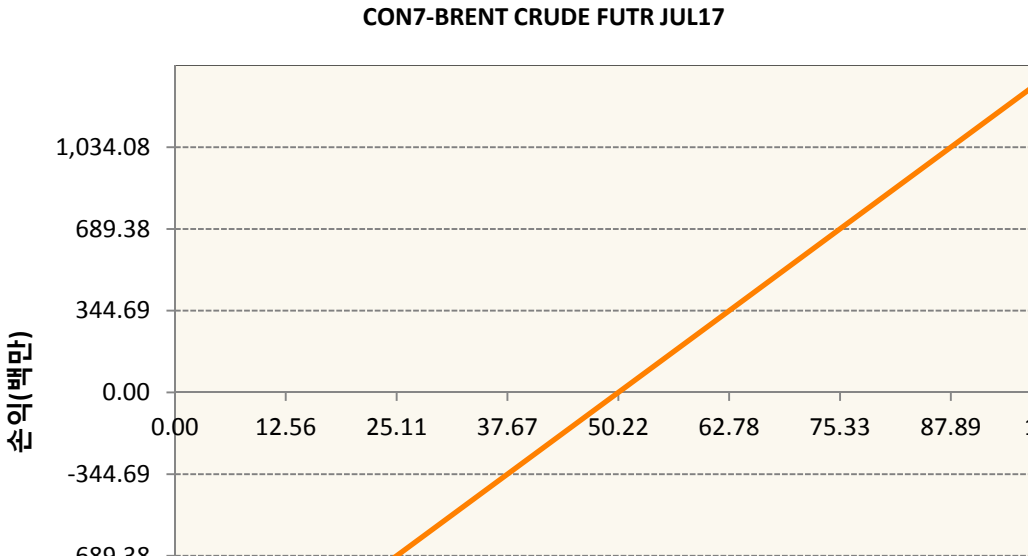
1. 계약금액

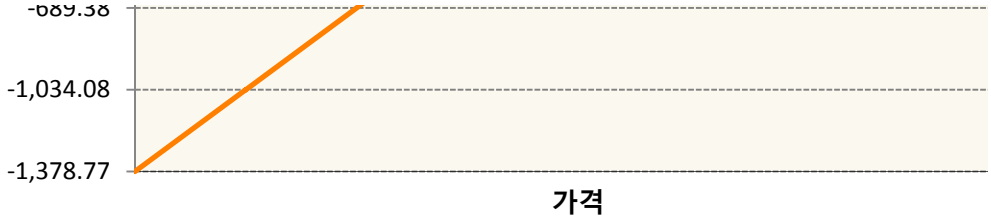
(단위:백만원)

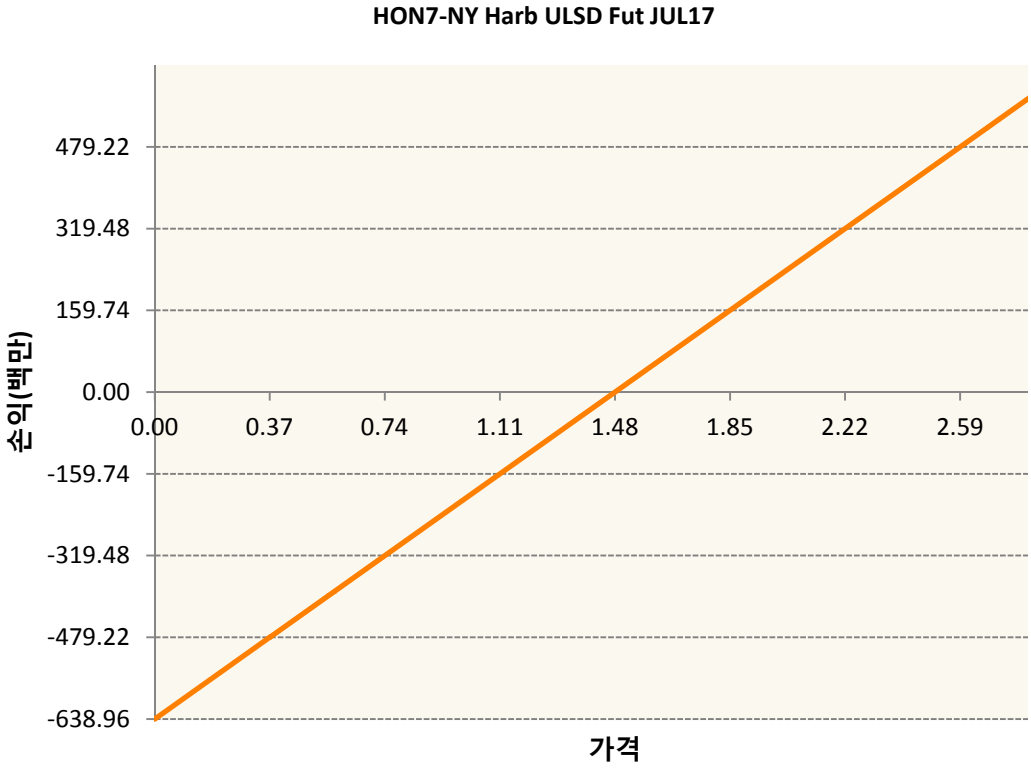
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,188	226	4,963	

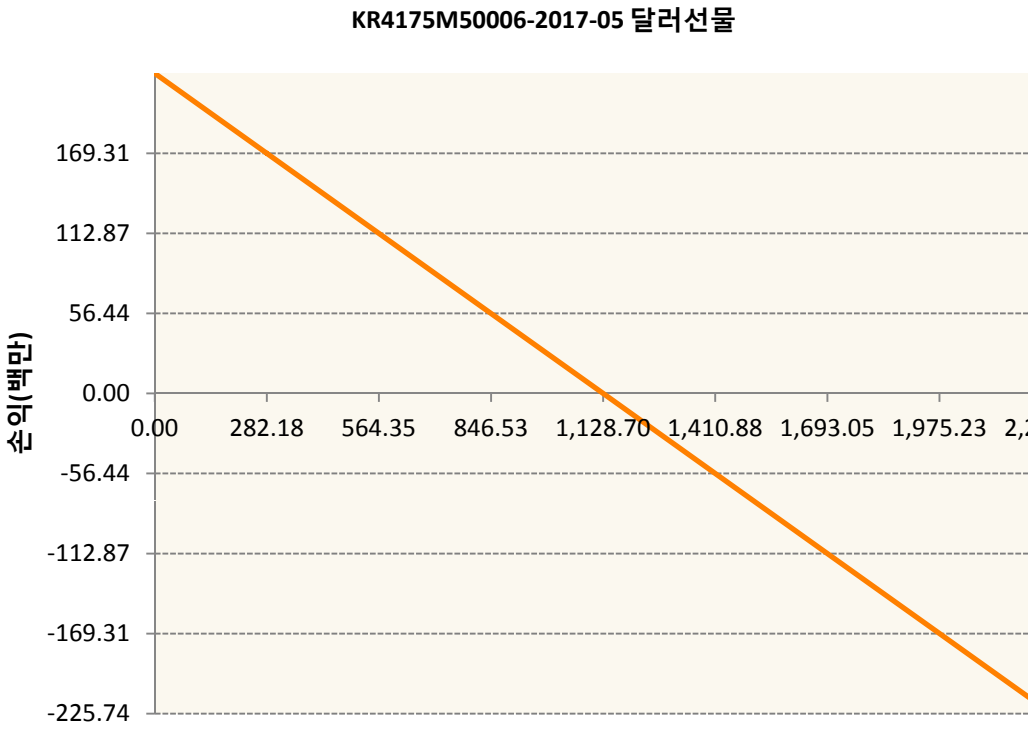
2. 만기시점의 손익구조



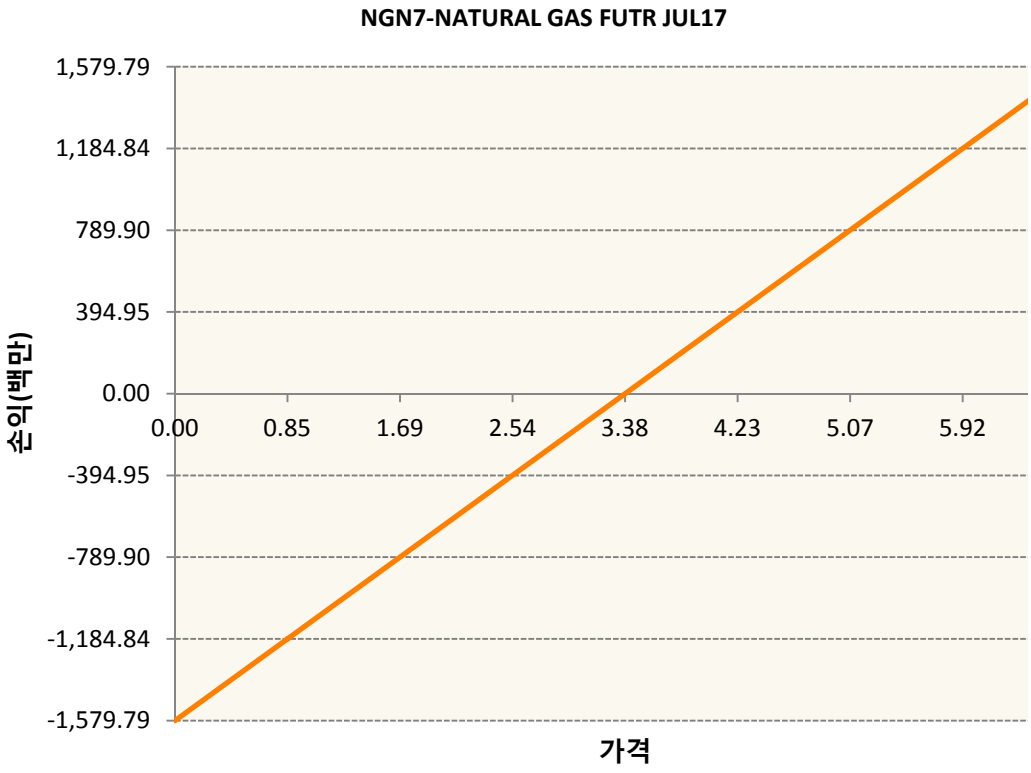


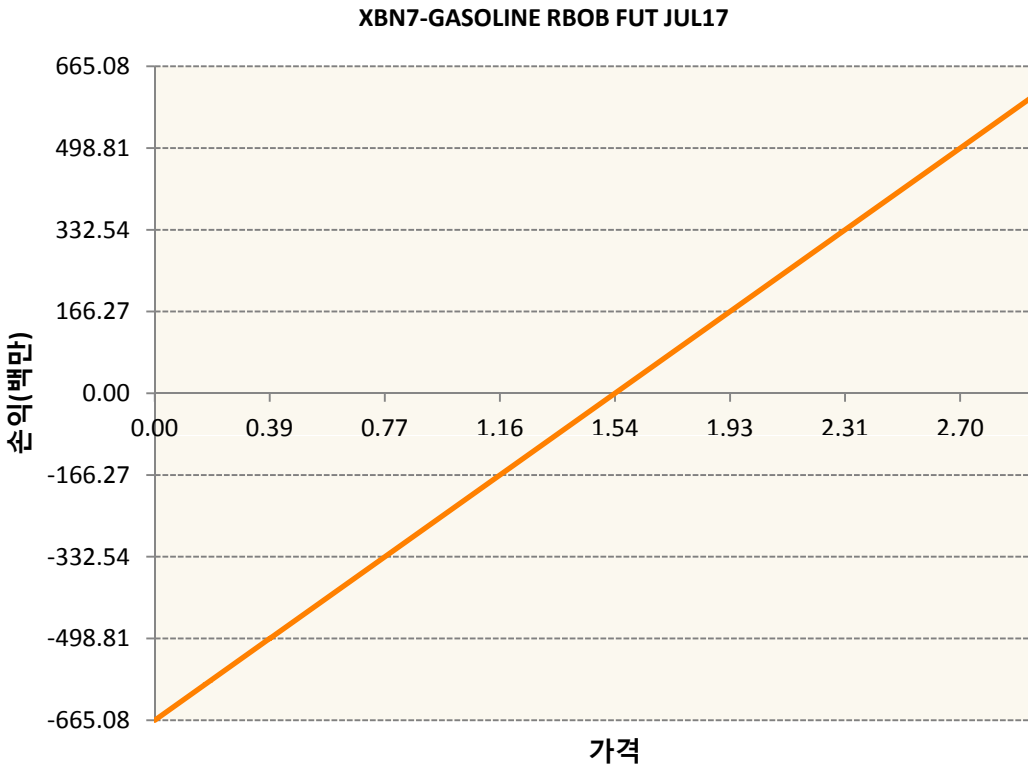

-1,034.08
-1,378.77
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
479.22
319.48
159.74
0.00
-159.74
-319.48
-479.22
-638.96
0.00
0.37
0.74
1.11
1.48
1.85
2.22
2.59
순이익(백만)
가격


KR4175M50006-2017-05 달러선물
169.31
112.87
56.44
0.00
-56.44
-112.87
-169.31
-225.74
0.00
282.18
564.35
846.53
1,128.70
1,410.88
1,693.05
1,975.23
순이익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,579.79
1,184.84
789.90
394.95
0.00
-394.95
-789.90
-1,184.84
-1,579.79
0.00
0.85
1.69
2.54
3.38
4.23
5.07
5.92
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
665.08
498.81
332.54
166.27
0.00
-166.27
-332.54
-498.81
-665.08
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	74
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	110
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	51
KR4175M50(	2017-05 달러선물	18
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	126
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	53

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

895

공시일	2017-05-12
기준일	2017-05-11

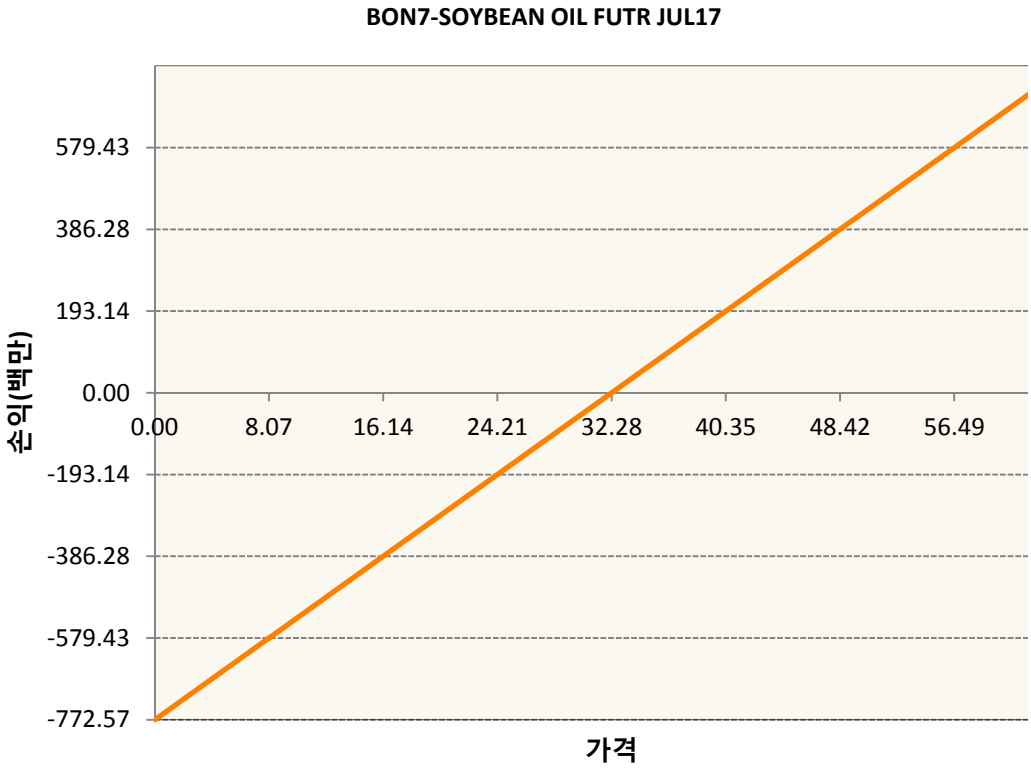
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

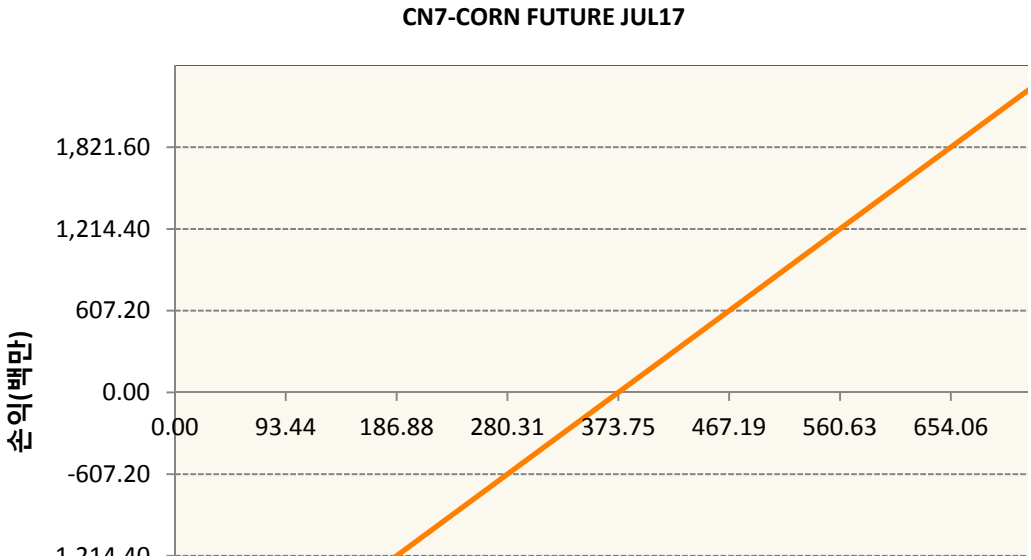
1. 계약금액

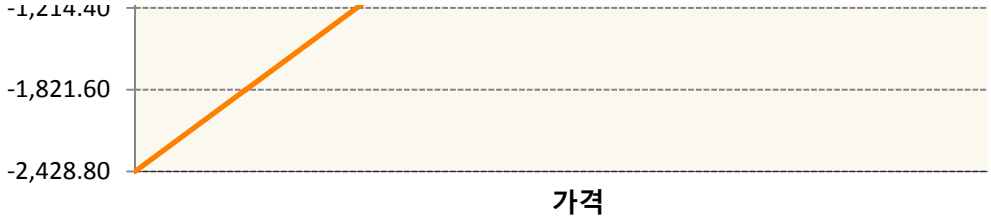
(단위:백만원)

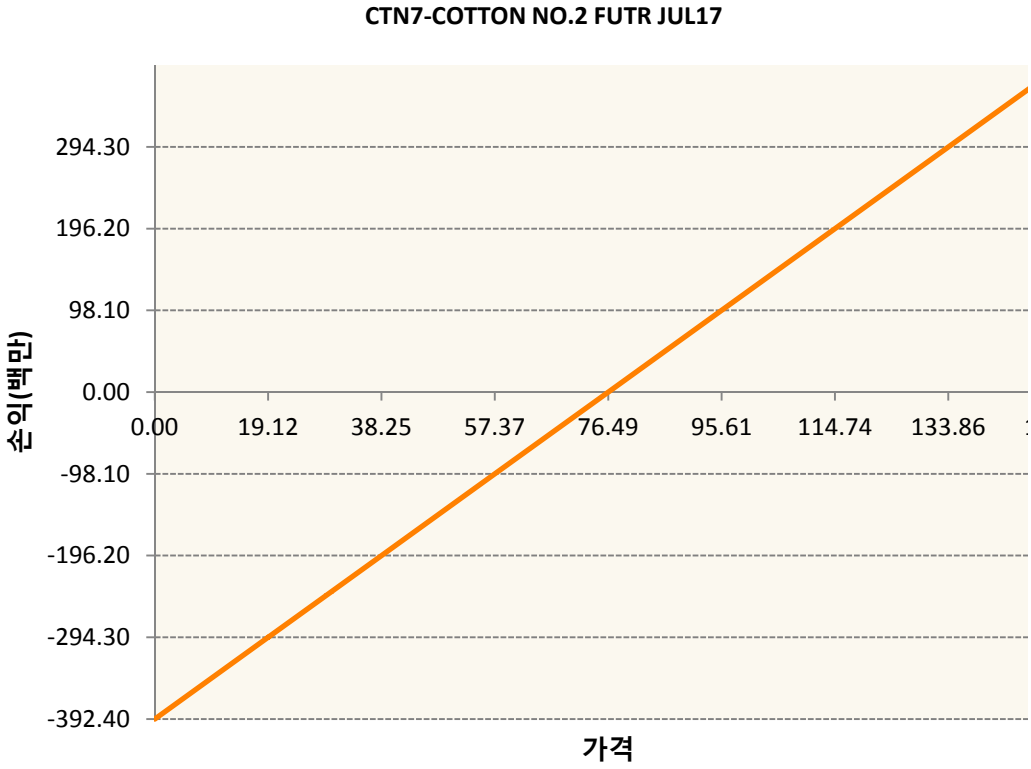
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,939	395	8,544	

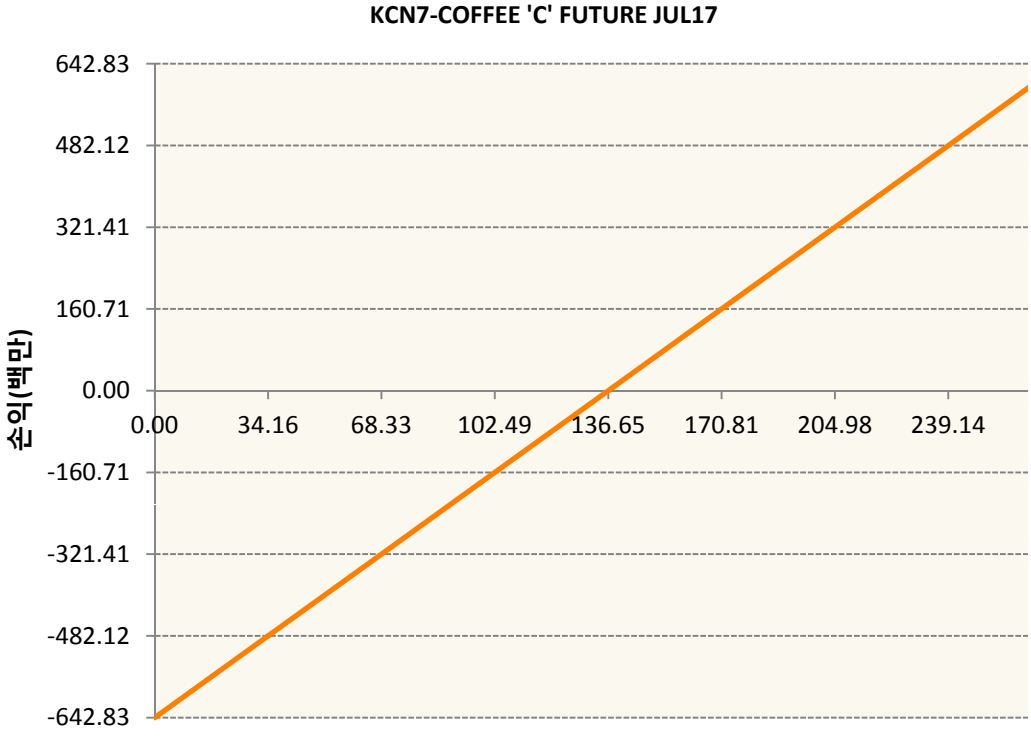
2. 만기시점의 손익구조



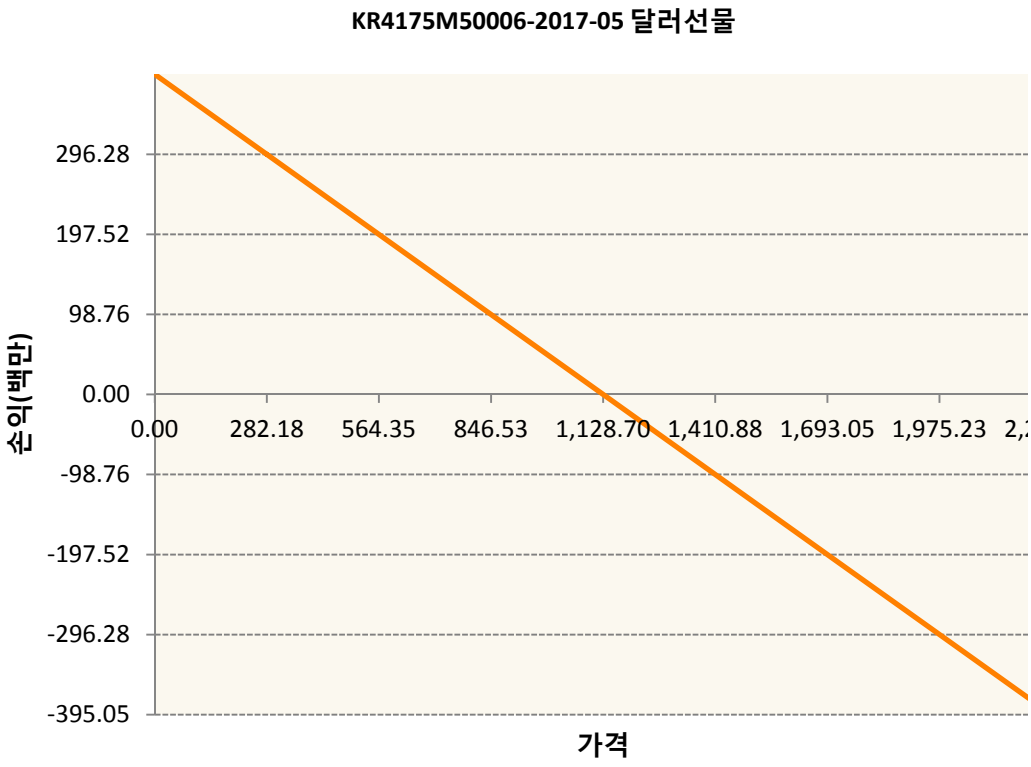


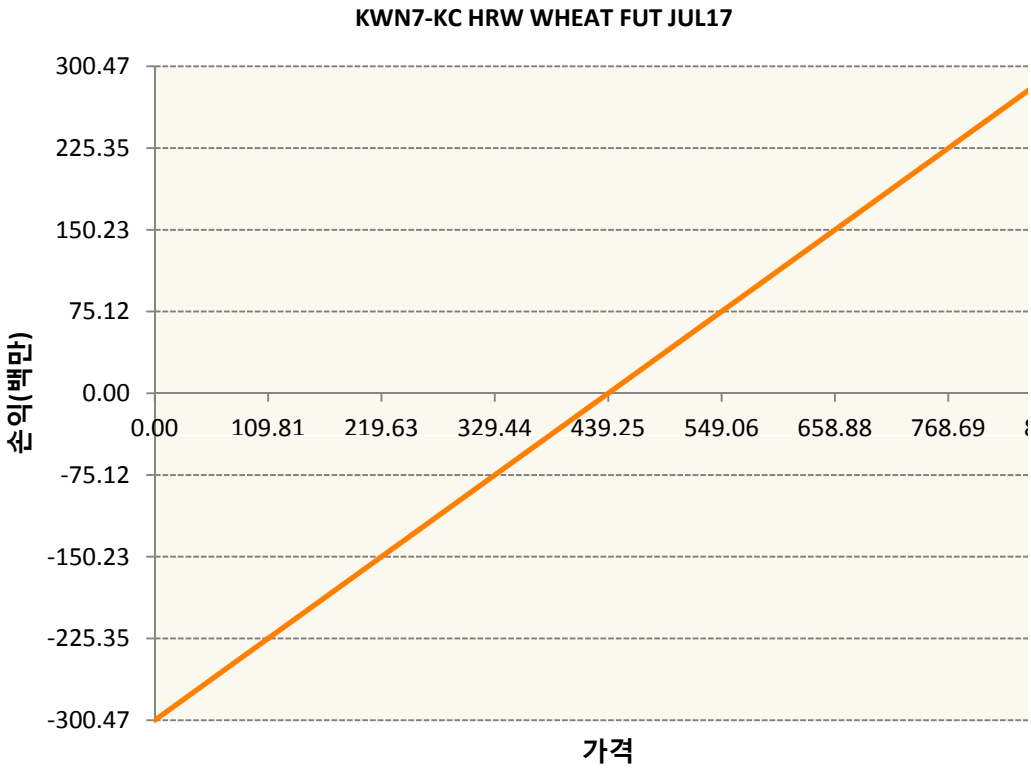

-1,821.60
-2,428.80
가격

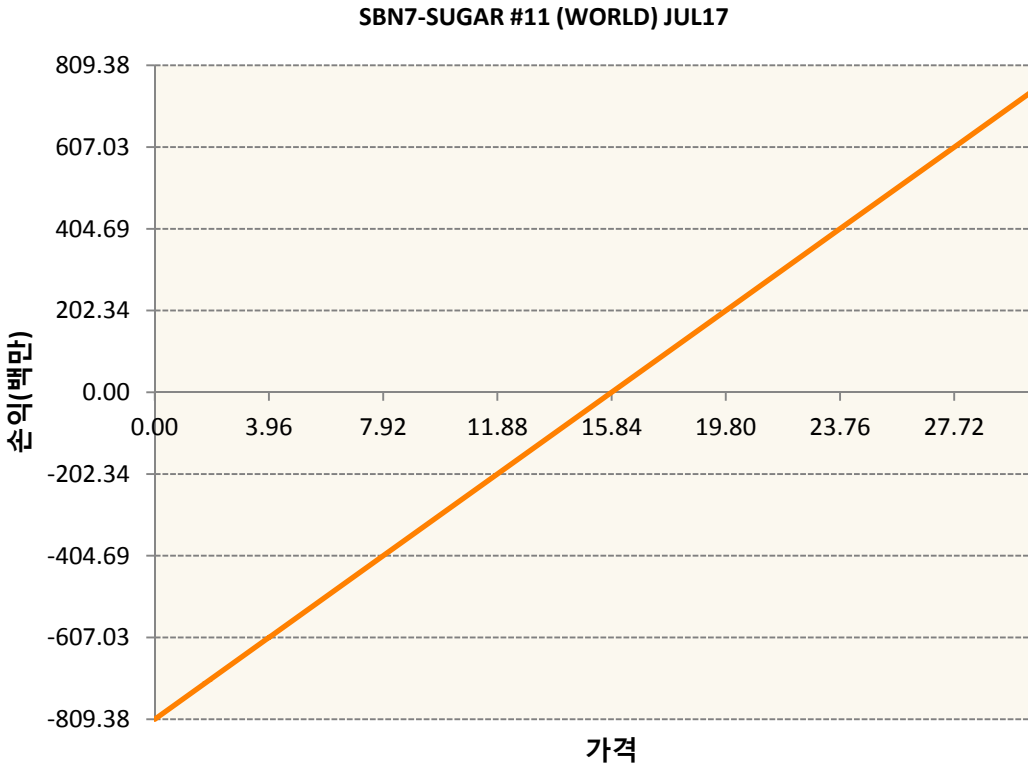

CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
294.30
196.20
98.10
0.00
-98.10
-196.20
-294.30
-392.40
0.00
19.12
38.25
57.37
76.49
95.61
114.74
133.86
순익(백만)
가격

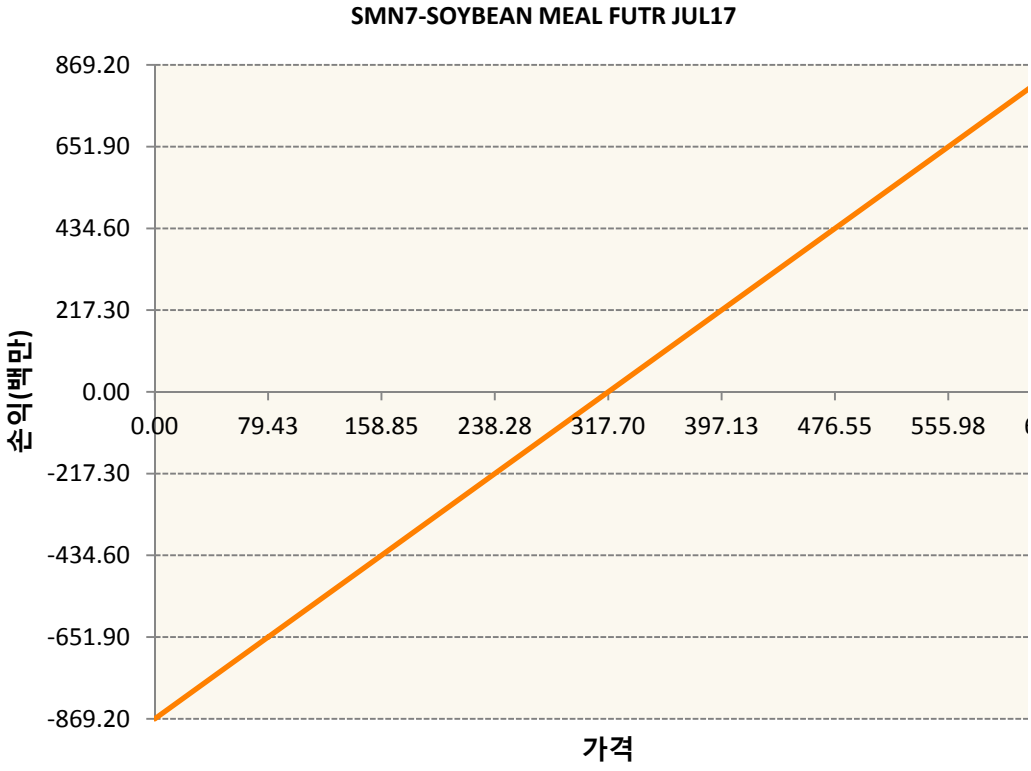

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
642.83
482.12
321.41
160.71
0.00
-160.71
-321.41
-482.12
-642.83
0.00
34.16
68.33
102.49
136.65
170.81
204.98
239.14
순익(백만)

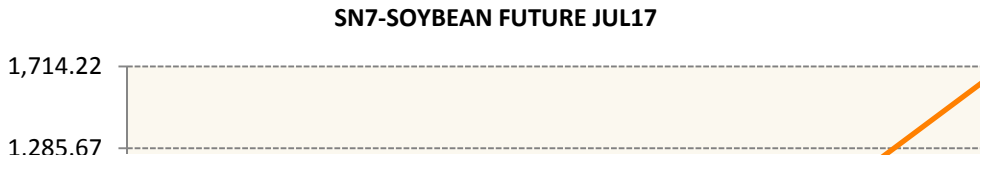
가격

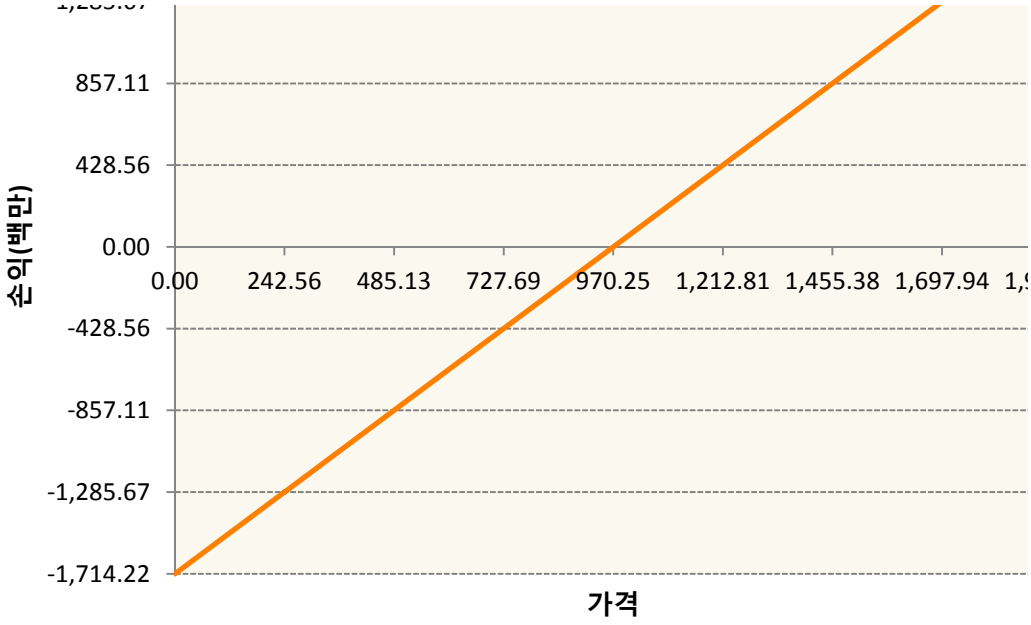

KR4175M50006-2017-05 달러선물
296.28
197.52
98.76
0.00
-98.76
-197.52
-296.28
-395.05
0.00
282.18
564.35
846.53
1,128.70
1,410.88
1,693.05
1,975.23
손익(백만)
가격


KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17
300.47
225.35
150.23
75.12
0.00
-75.12
-150.23
-225.35
-300.47
0.00
109.81
219.63
329.44
439.25
549.06
658.88
768.69
손익(백만)
가격

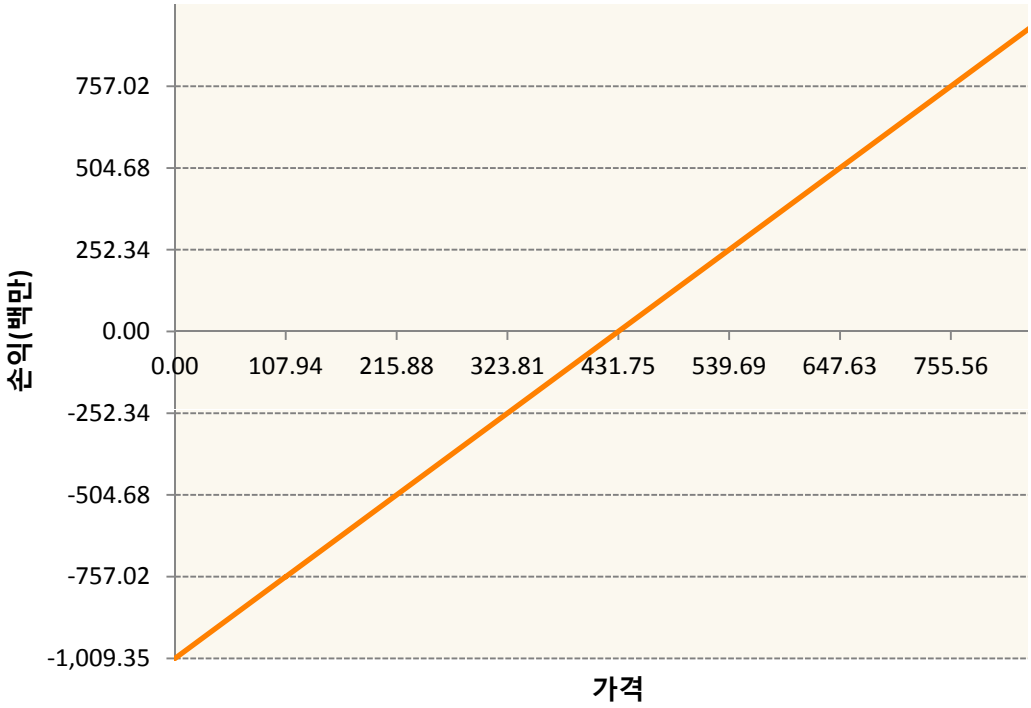

SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
809.38
607.03
404.69
202.34
0.00
-202.34
-404.69
-607.03
-809.38
0.00
3.96
7.92
11.88
15.84
19.80
23.76
27.72
손익(백만)
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
869.20
651.90
434.60
217.30
0.00
-217.30
-434.60
-651.90
-869.20
0.00
79.43
158.85
238.28
317.70
397.13
476.55
555.98
손익(백만)
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,714.22
1,285.67



WN7-WHEAT FUTURE(CBT) JUL17



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	62
CN7	CORN FUTURE JUL17	194
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	31
KCN7	COFFEE 'C' FUTURE JUL17	51
KR4175M50(	2017-05 달러선물	32

KWN7	KC HRW WHEAT FUT JUL17	24
SBN7	SUGAR #11 (WORLD) JUL17	65
SMN7	SOYBEAN MEAL FUTR JUL17	70
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	137
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	81

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

813