공시일	2017-05-15
기준일	2017-05-12

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	2017-05-15
기준일	2017-05-12

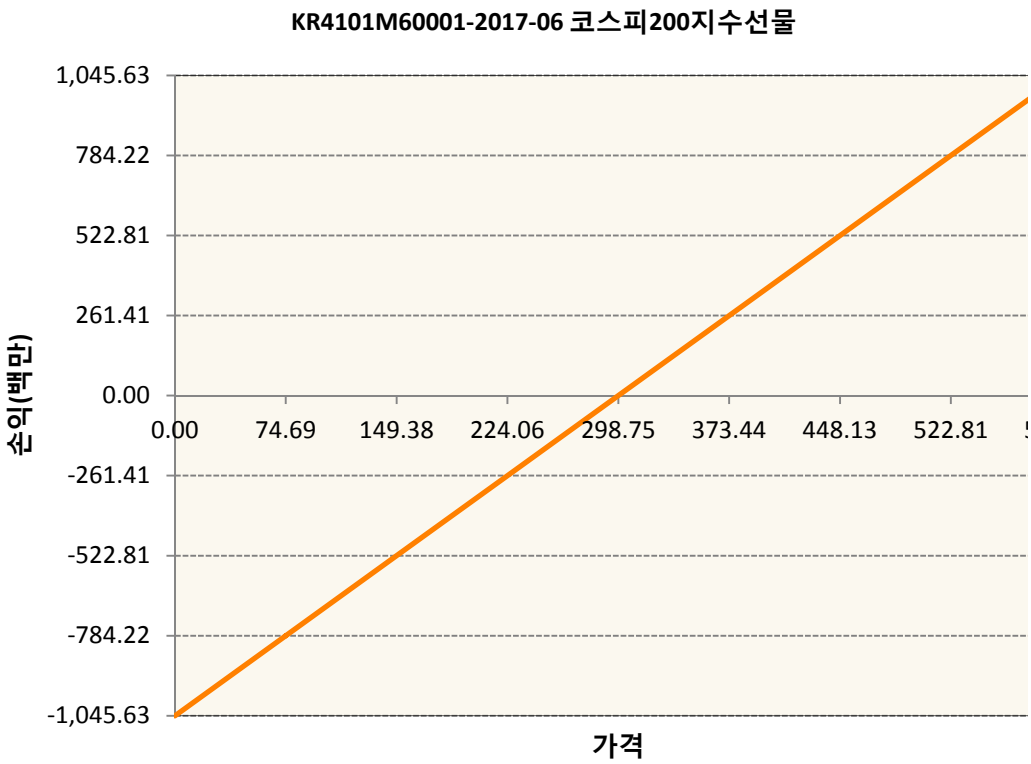
스마트인덱스모

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	1,046	0	1,046	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	2017-05-15
기준일	2017-05-12

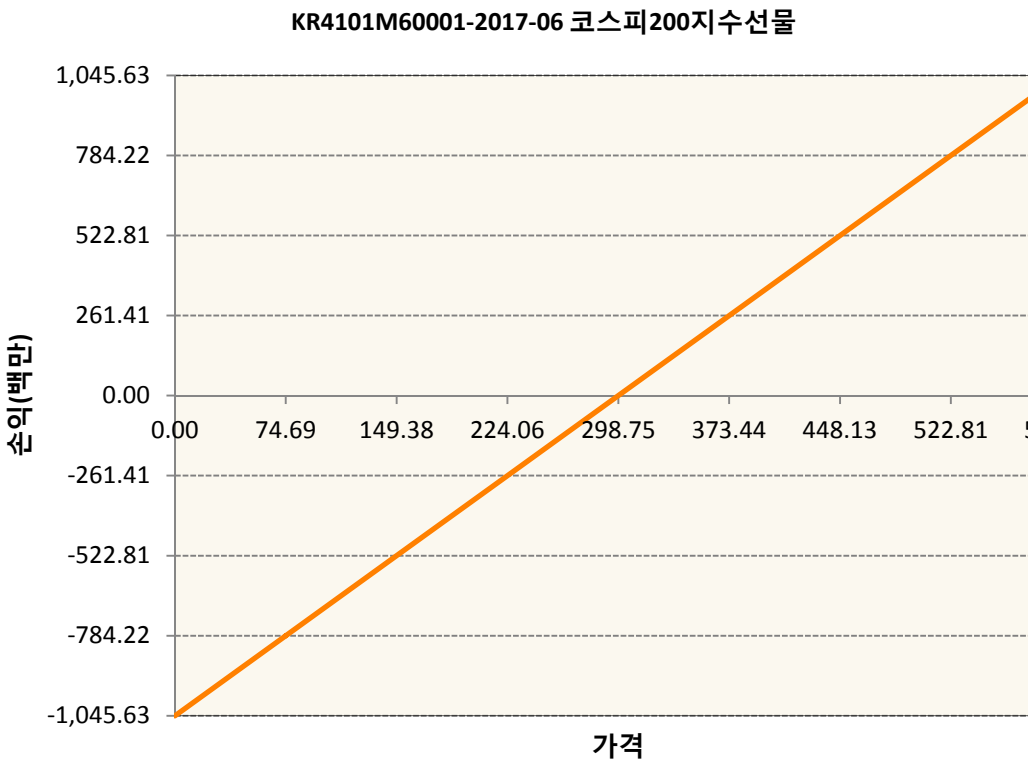
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,046	0	1,046	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	2017-05-15
기준일	2017-05-12

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	981

* 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	2017-05-15
기준일	2017-05-12

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)

333

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-05-15
기준일	2017-05-12

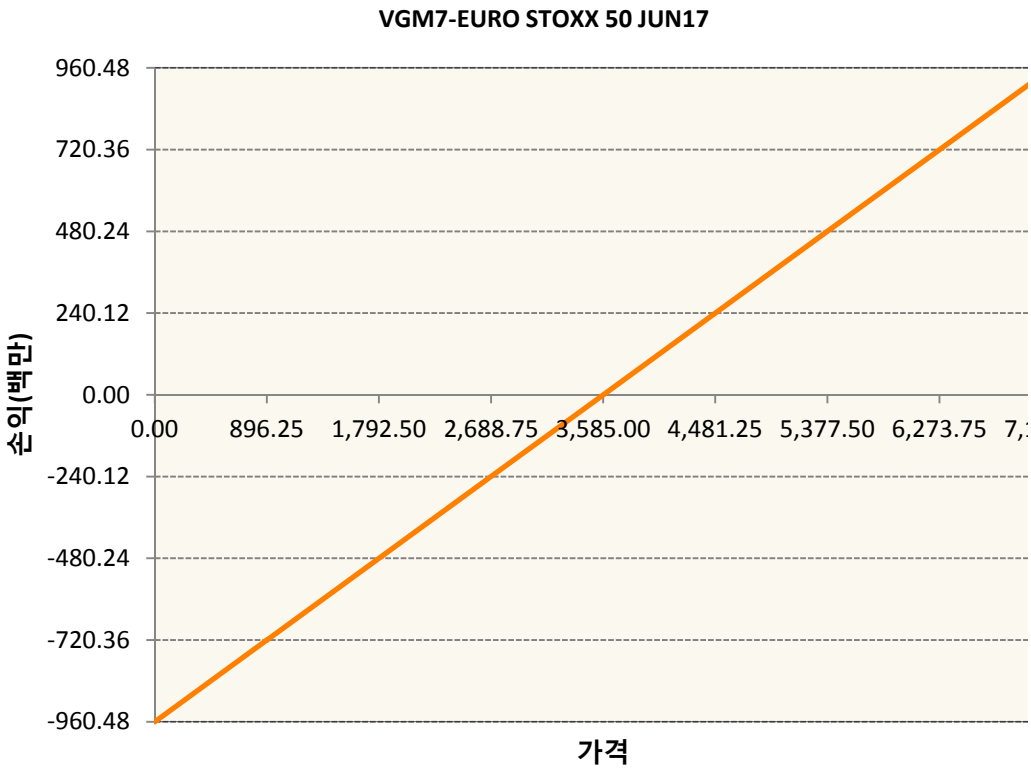
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	960	0	960	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM7	EURO STOXX 50 JUN17	77

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

(단위:백만원)

76

공시일	2017-05-15
기준일	2017-05-12

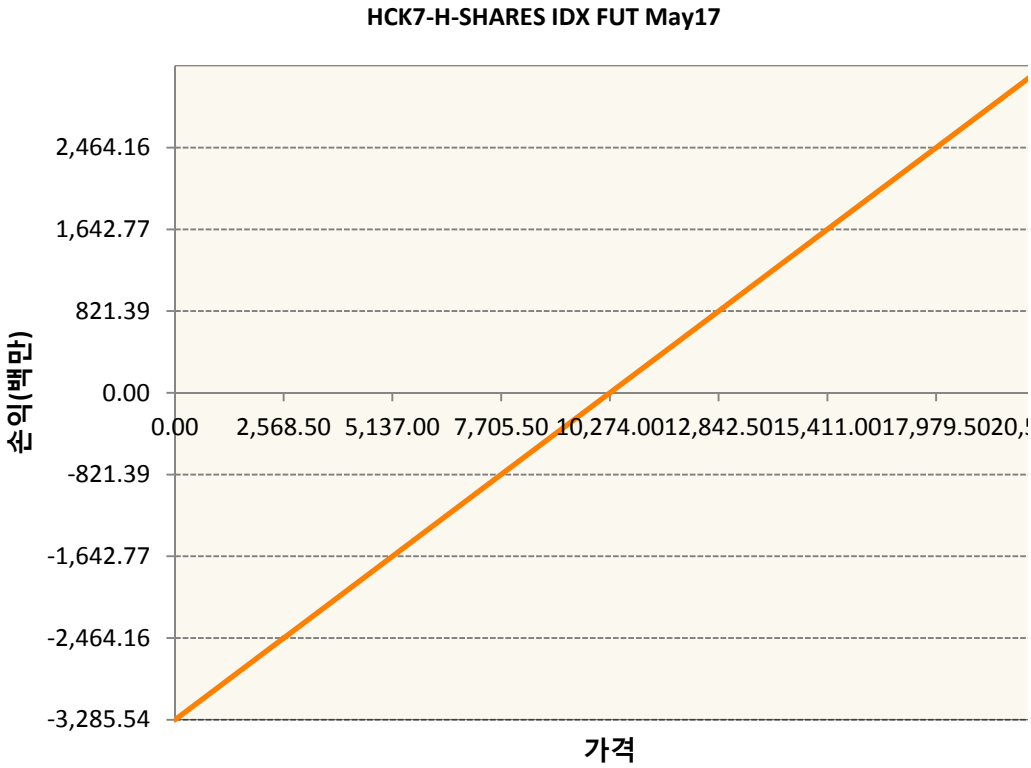
차이나인덱스모(주식-파생형)

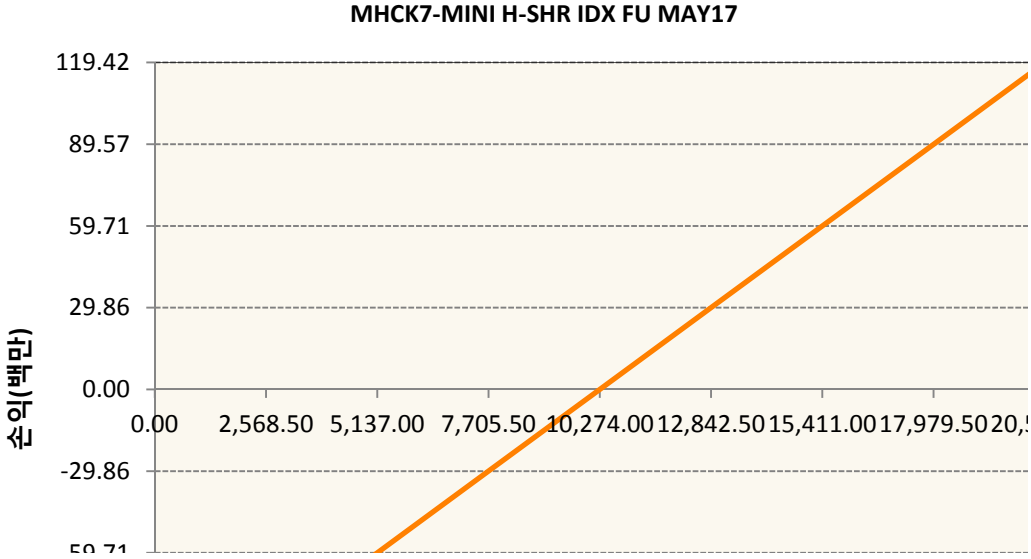
1. 계약금액

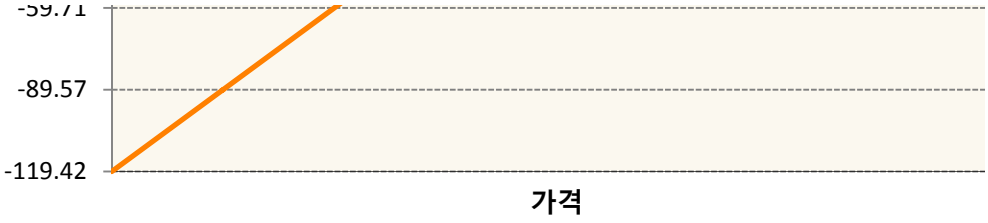
(단위:백만원)

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	2017-05-15
기준일	2017-05-12

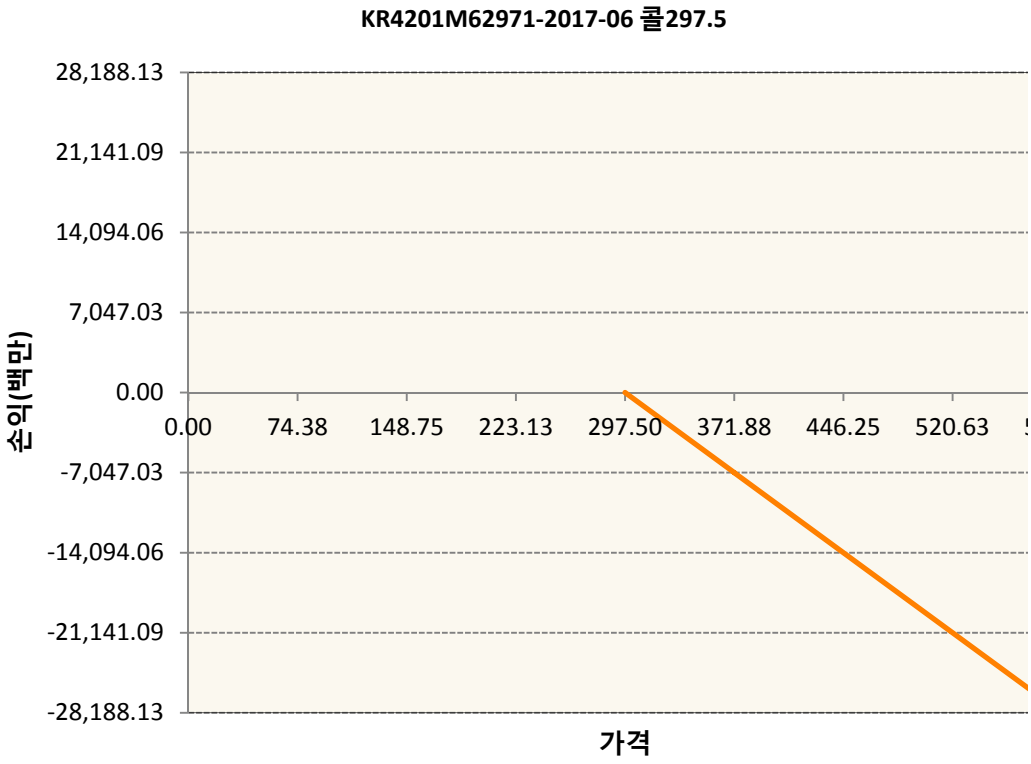
커버드콜모(주식혼합-파생형)

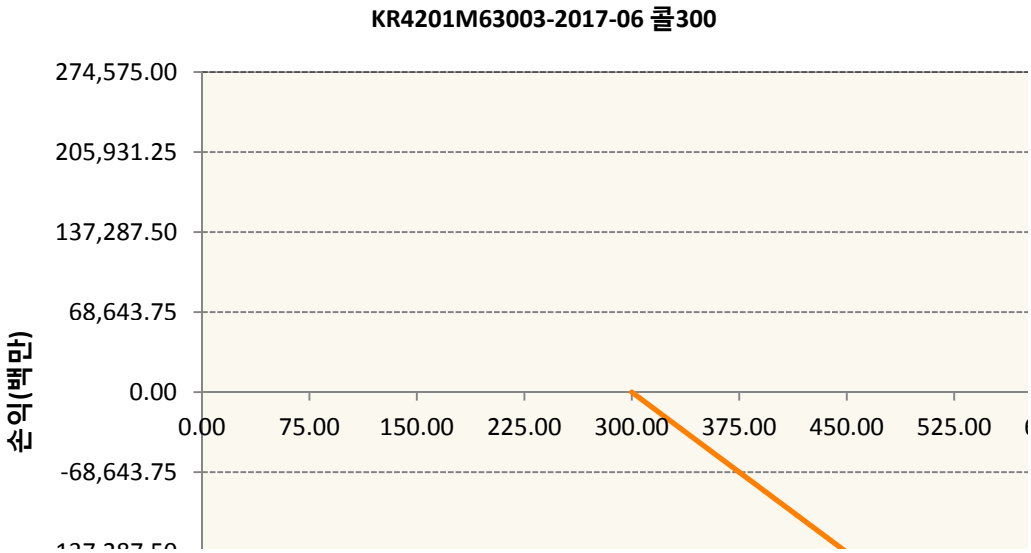
1. 계약금액

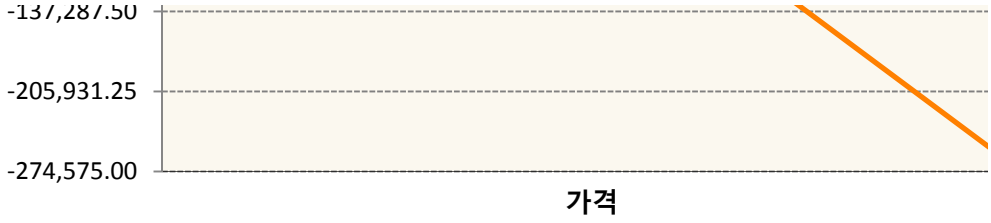
(단위:백만원)

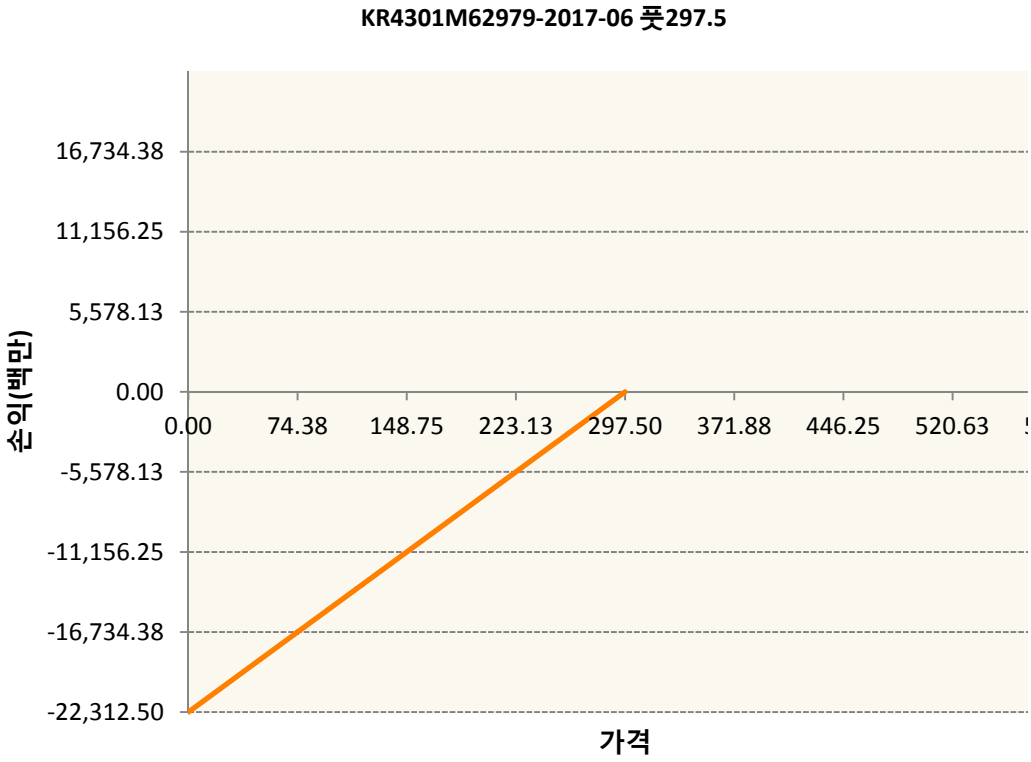
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	443,056	-443,056	장내
누계	유가증권	옵션	0	512,576	-512,576	장내

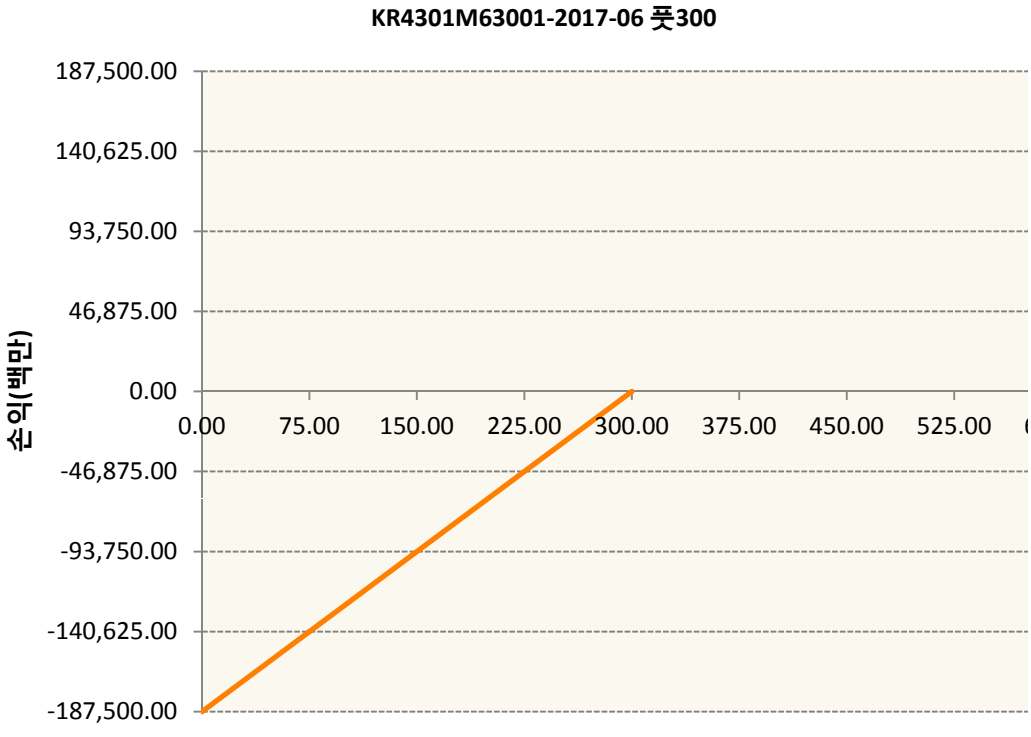
2. 만기시점의 손익구조






-137,287.50
-205,931.25
-274,575.00
가격


KR4301M62979-2017-06 풋297.5
16,734.38
11,156.25
5,578.13
0.00
-5,578.13
-11,156.25
-16,734.38
-22,312.50
0.00
74.38
148.75
223.13
297.50
371.88
446.25
520.63
손익(백만)
가격


KR4301M63001-2017-06 풋300
187,500.00
140,625.00
93,750.00
46,875.00
0.00
-46,875.00
-93,750.00
-140,625.00
-187,500.00
0.00
75.00
150.00
225.00
300.00
375.00
450.00
525.00
손익(백만)

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M62(	2017-06 콜297.5						1,917
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	424	424	423	421	418	415	410
-5.33%	418	413	406	397	386	373	359
-2.67%	358	336	313	289	264	237	210
0%	97	65	32	0	-32	-65	-97
2.67%	-446	-465	-486	-508	-532	-558	-584
5.33%	-1,152	-1,157	-1,164	-1,173	-1,183	-1,196	-1,211
8.00%	-1,900	-1,901	-1,902	-1,904	-1,907	-1,911	-1,917
KR4201M63(	2017-06 콜300						17,410
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,017	3,016	3,012	3,004	2,989	2,967	2,936
-5.33%	2,995	2,969	2,927	2,870	2,796	2,705	2,598
-2.67%	2,678	2,527	2,355	2,166	1,961	1,744	1,516
0%	927	619	310	0	-311	-622	-935
2.67%	-3,504	-3,747	-4,002	-4,267	-4,540	-4,819	-5,103
5.33%	-9,990	-10,070	-10,173	-10,297	-10,442	-10,603	-10,781
8.00%	-17,154	-17,166	-17,187	-17,221	-17,269	-17,332	-17,410
KR4301M62(	2017-06 풋297.5						1,463
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,452	-1,452	-1,453	-1,454	-1,456	-1,459	-1,463
-5.33%	-860	-864	-870	-877	-886	-896	-908
-2.67%	-313	-330	-348	-367	-387	-408	-429
0%	77	51	26	0	-26	-51	-77
2.67%	243	228	211	193	174	154	134
5.33%	279	276	270	263	255	245	233
8.00%	283	283	282	280	278	274	270
KR4301M63(	2017-06 풋300						12,889
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,833	-12,834	-12,837	-12,843	-12,853	-12,868	-12,889
-5.33%	-7,884	-7,902	-7,930	-7,969	-8,020	-8,082	-8,155
-2.67%	-3,136	-3,239	-3,356	-3,486	-3,626	-3,774	-3,930
0%	633	423	212	0	-212	-425	-638
2.67%	2,572	2,406	2,232	2,051	1,865	1,674	1,480

5.33%	3,107	3,053	2,982	2,897	2,799	2,689	2,567
8.00%	3,180	3,172	3,157	3,134	3,101	3,059	3,005

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

37,488

공시일	2017-05-15
기준일	2017-05-12

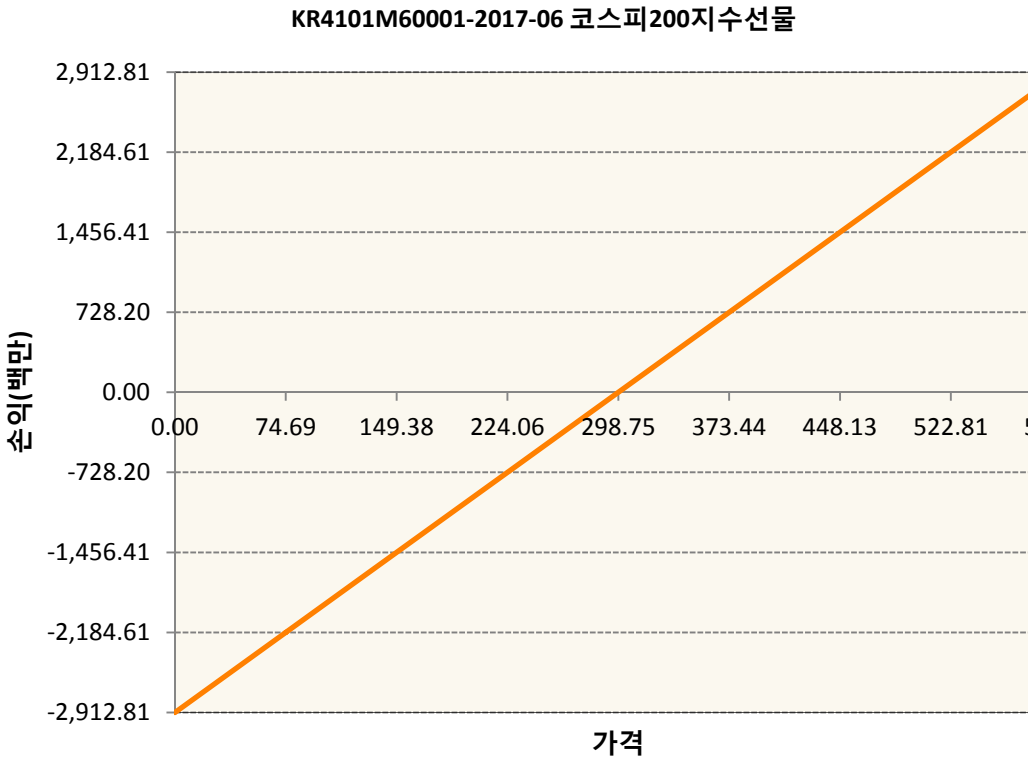
커버드콜목표전환형증권투자신탁

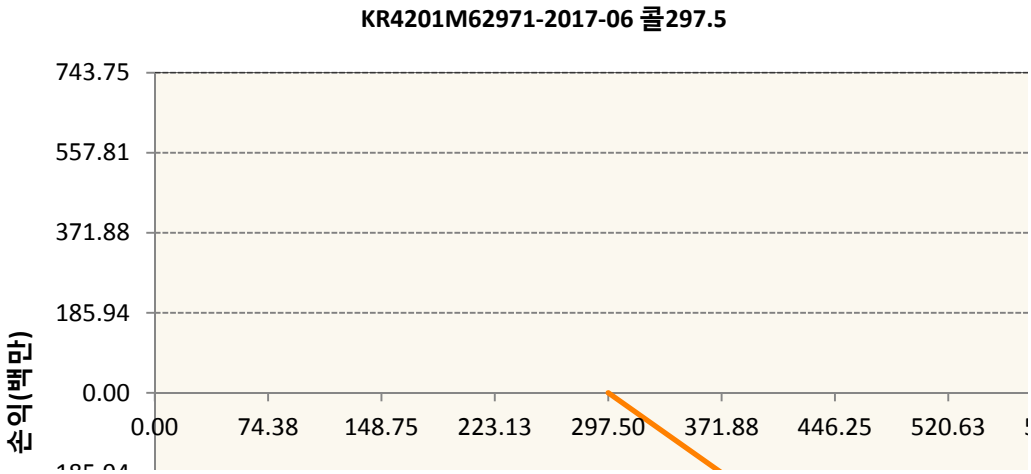
1. 계약금액

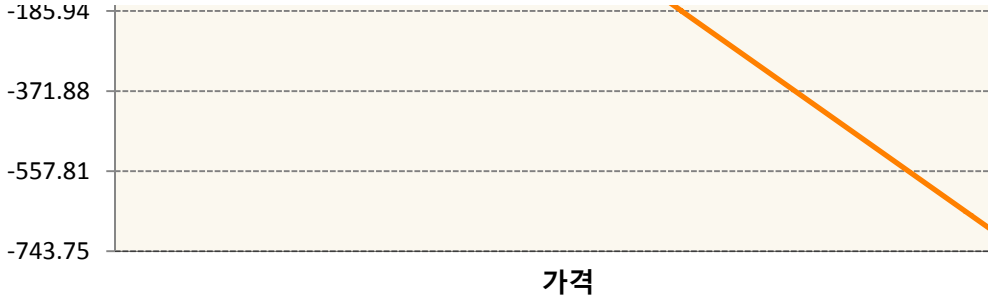
(단위:백만원)

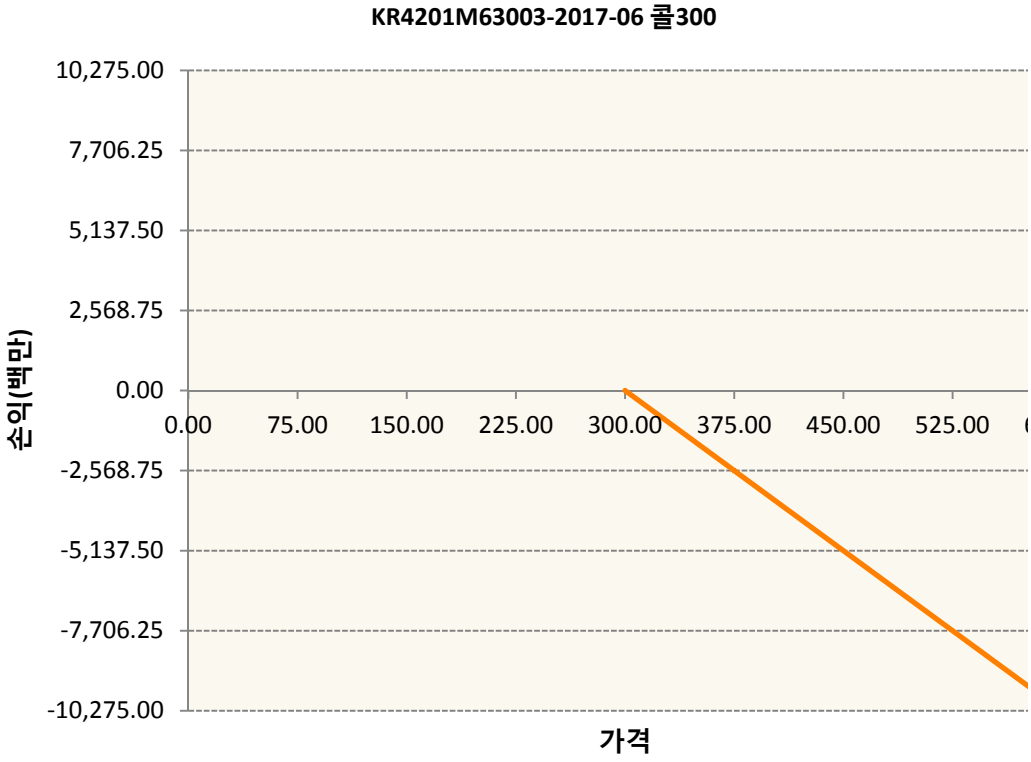
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	1,325	1,369	-44	장내
누계	유가증권	선물	2,913	0	2,913	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,889	-12,889	장내

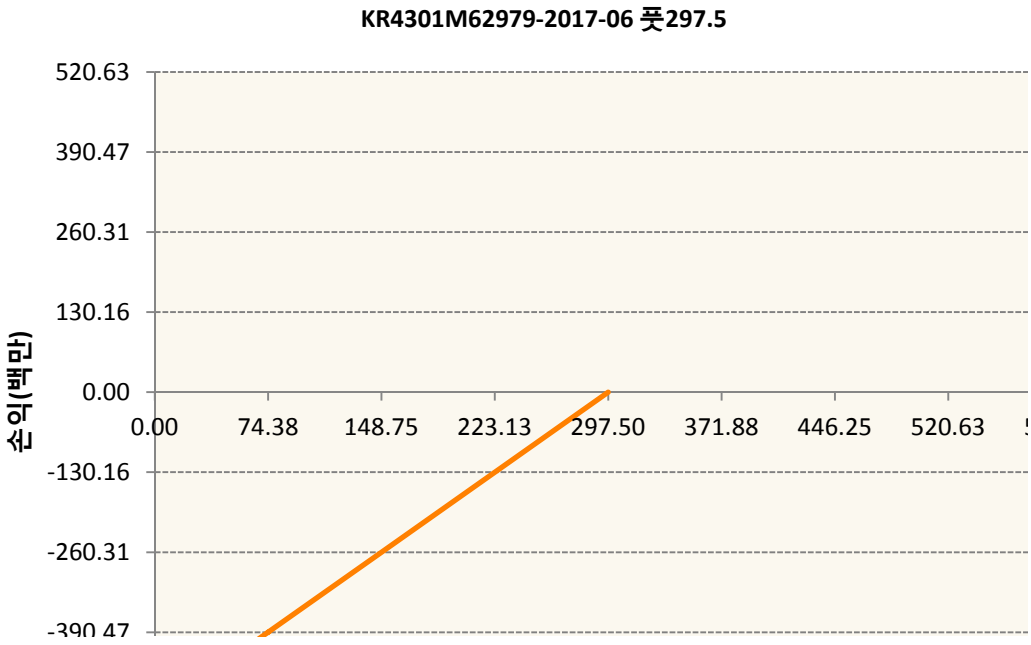
2. 만기시점의 손익구조



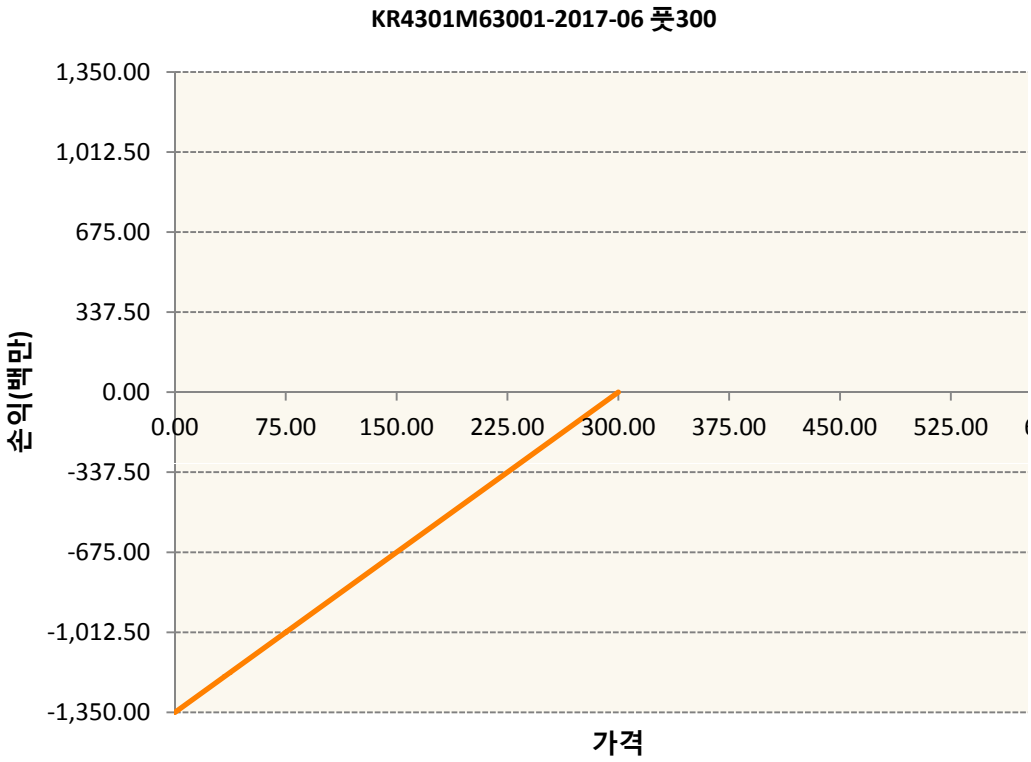



-185.94
-371.88
-557.81
-743.75
가격


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
520.63
390.47
260.31
130.16
0.00
-130.16
-260.31
-390.47
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							233
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-233	-233	-233	-233	-233	-233	-233
-5.33%	-155	-155	-155	-155	-155	-155	-155
-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%	155	155	155	155	155	155	155
8.00%	233	233	233	233	233	233	233
KR4201M62(2017-06 콜297.5							51
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11	11	11	11	11	11	11
-5.33%	11	11	11	10	10	10	9
-2.67%	9	9	8	8	7	6	6

0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-12	-12	-13	-13	-14	-15	-15
5.33%	-30	-31	-31	-31	-31	-32	-32
8.00%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-51
	KR4201M63(	2017-06 콜300					652
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	113	113	113	112	112	111	110
-5.33%	112	111	110	107	105	101	97
-2.67%	100	95	88	81	73	65	57
0%	35	23	12	0	-12	-23	-35
2.67%	-131	-140	-150	-160	-170	-180	-191
5.33%	-374	-377	-381	-385	-391	-397	-403
8.00%	-642	-642	-643	-644	-646	-649	-652
	KR4301M62(	2017-06 풋297.5					34
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
-5.33%	-20	-20	-20	-20	-21	-21	-21
-2.67%	-7	-8	-8	-9	-9	-10	-10
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	6	5	5	5	4	4	3
5.33%	7	6	6	6	6	6	5
8.00%	7	7	7	7	6	6	6
	KR4301M63(	2017-06 풋300					93
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-92	-92	-92	-92	-93	-93	-93
-5.33%	-57	-57	-57	-57	-58	-58	-59
-2.67%	-23	-23	-24	-25	-26	-27	-28
0%	5	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	19	17	16	15	13	12	11
5.33%	22	22	21	21	20	19	18
8.00%	23	23	23	23	22	22	22

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

1,067

공시일	2017-05-15
기준일	2017-05-12

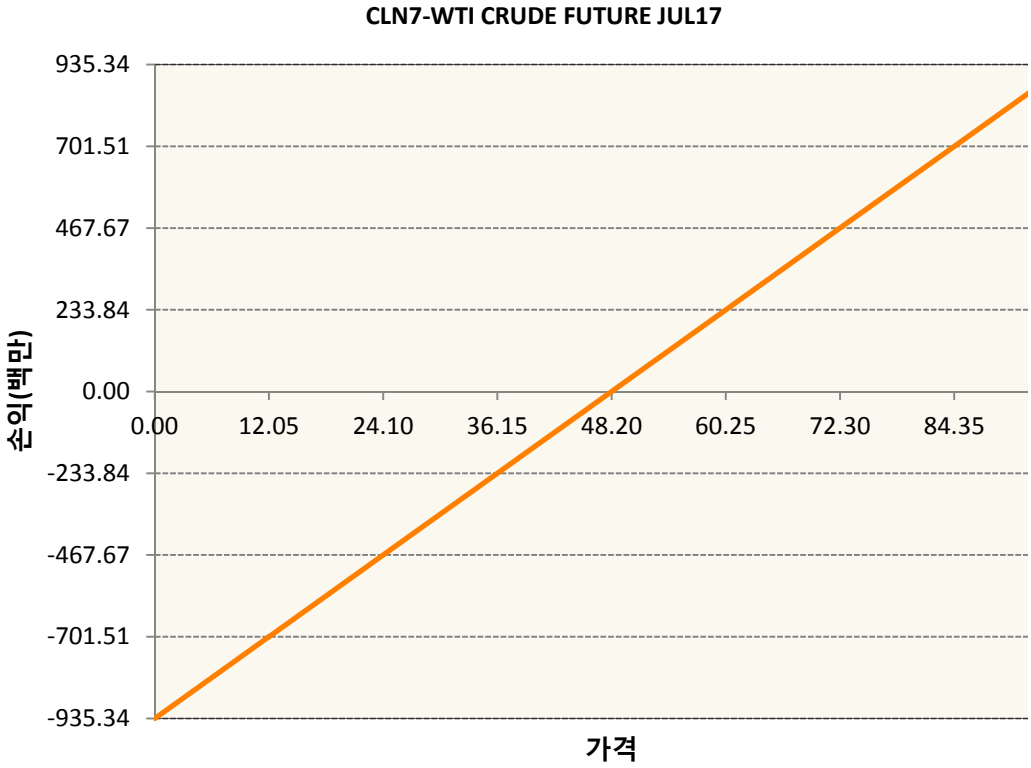
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

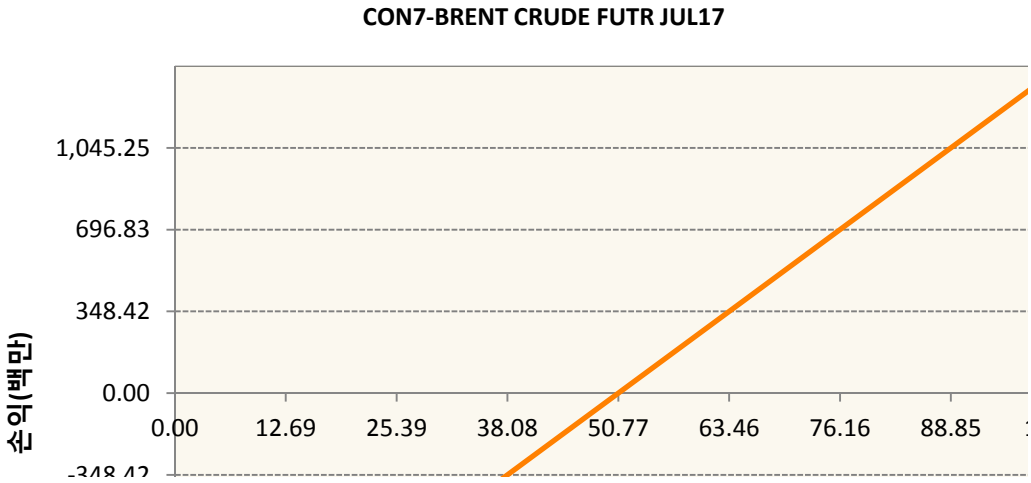
1. 계약금액

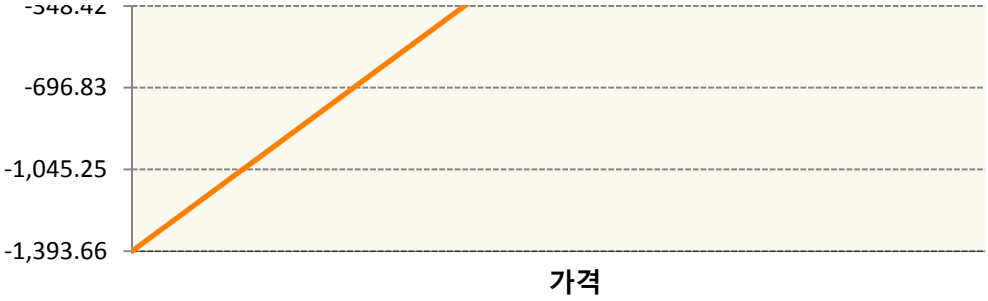
(단위:백만원)

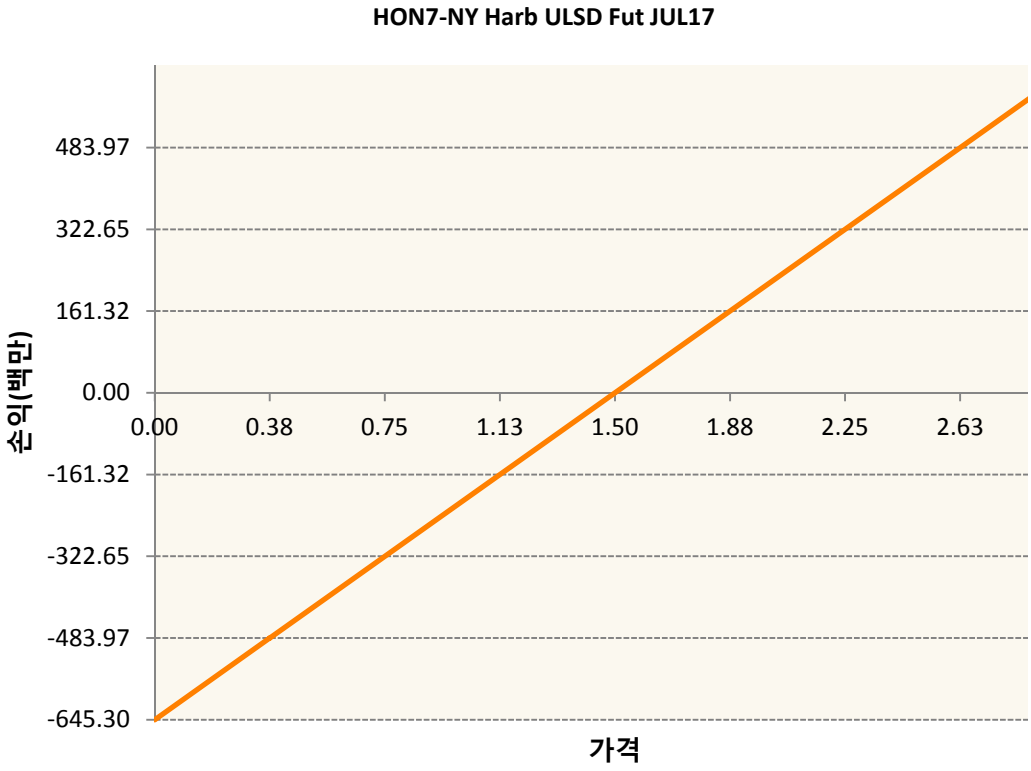
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	225	-225	장내
누계	유가증권	선물	5,266	0	5,266	
누계	통화	선물	0	225	-225	장내

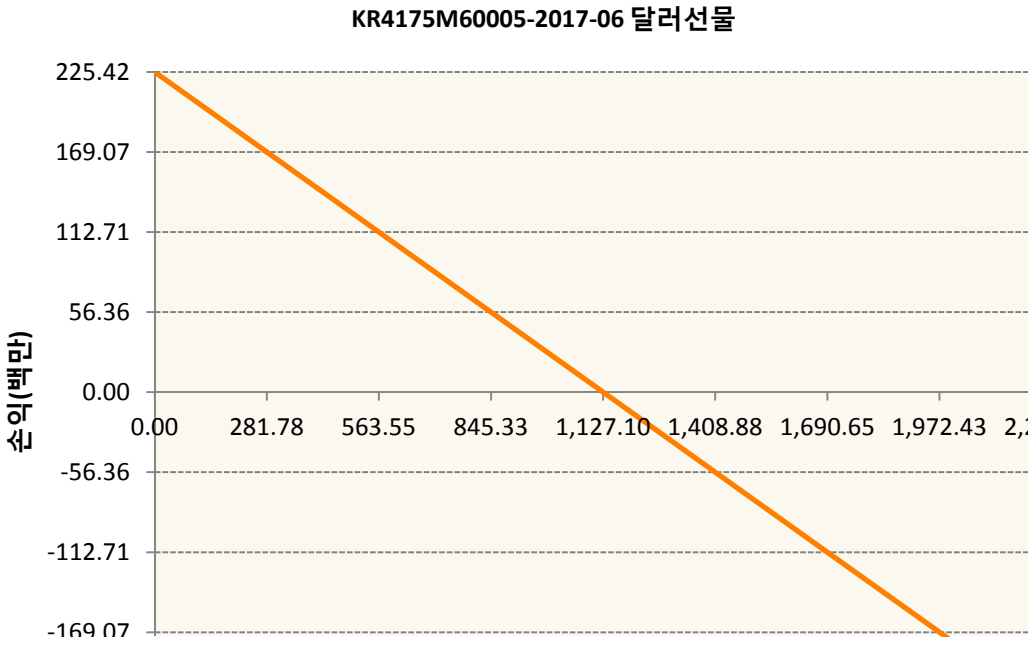
2. 만기시점의 손익구조

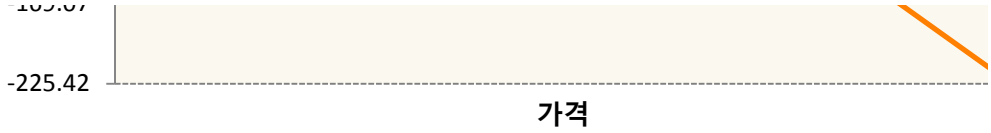


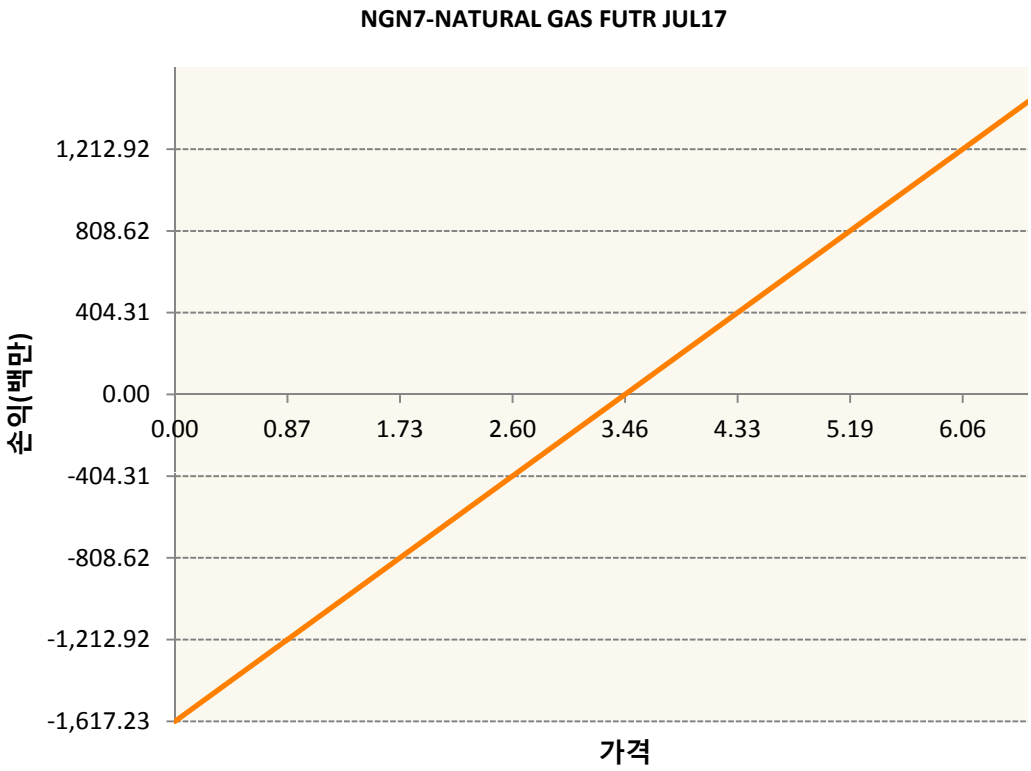


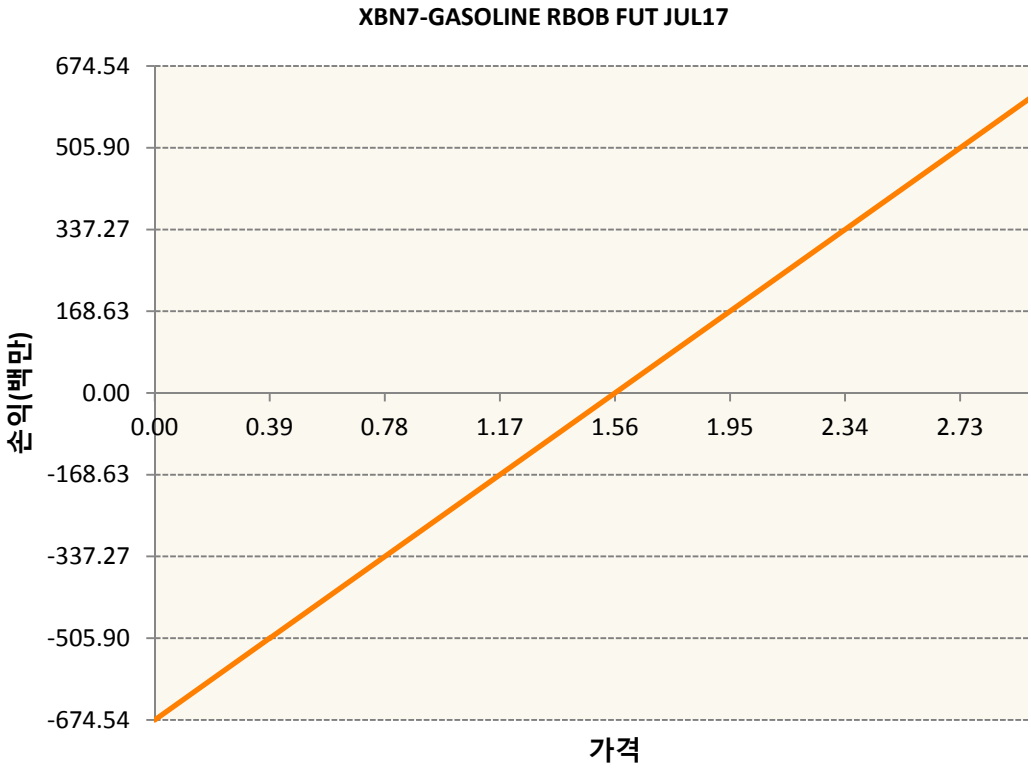

-696.83
-1,045.25
-1,393.66
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
483.97
322.65
161.32
0.00
-161.32
-322.65
-483.97
-645.30
0.00
0.38
0.75
1.13
1.50
1.88
2.25
2.63
순익(백만)
가격


KR4175M60005-2017-06 달러선물
225.42
169.07
112.71
56.36
0.00
-56.36
-112.71
-169.07
0.00
281.78
563.55
845.33
1,127.10
1,408.88
1,690.65
1,972.43
순익(백만)


-225.42
가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,212.92
808.62
404.31
0.00
-404.31
-808.62
-1,212.92
-1,617.23
0.00
0.87
1.73
2.60
3.46
4.33
5.19
6.06
순익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
674.54
505.90
337.27
168.63
0.00
-168.63
-337.27
-505.90
-674.54
0.00
0.39
0.78
1.17
1.56
1.95
2.34
2.73
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN7	WTI CRUDE FUTURE JUL17	75
CON7	BRENT CRUDE FUTR JUL17	111
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	52
KR4175M60(	2017-06 달러선물	18
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	129
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	54

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

905

공시일	2017-05-15
기준일	2017-05-12

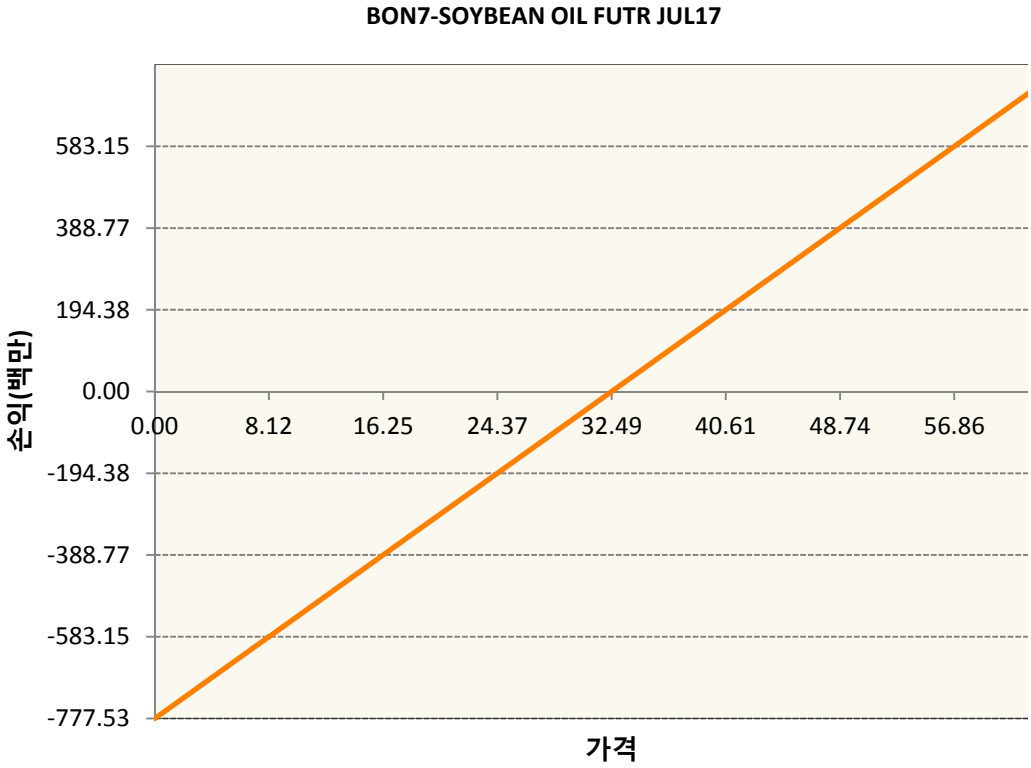
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

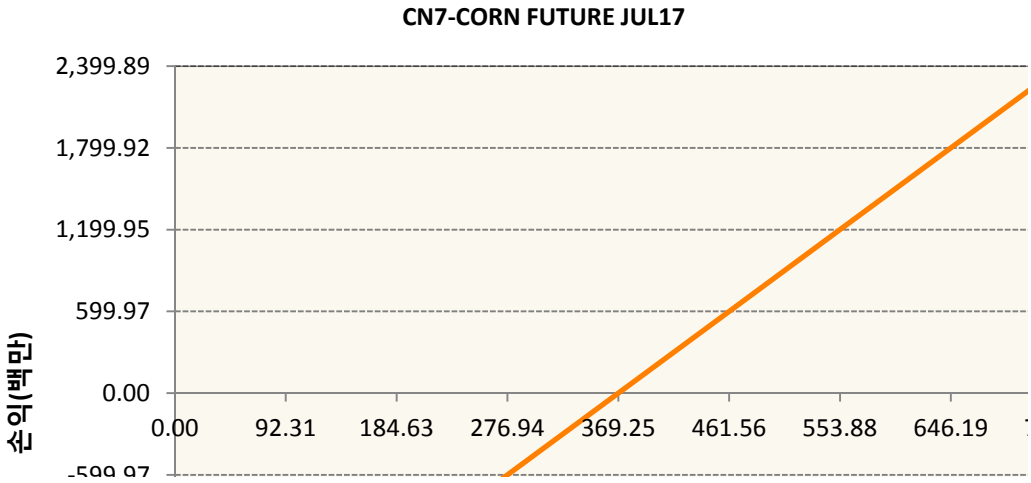
1. 계약금액

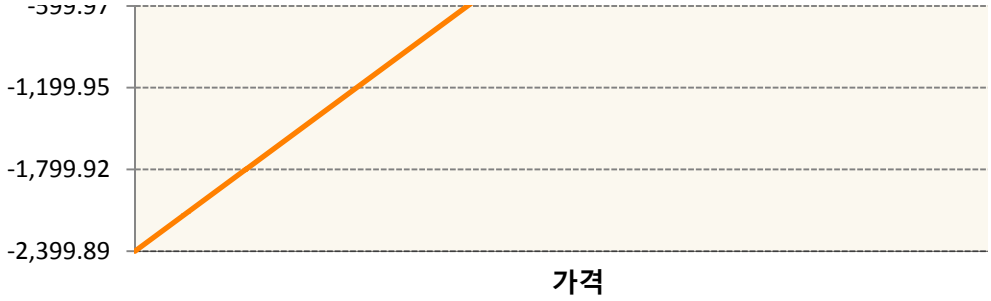
(단위:백만원)

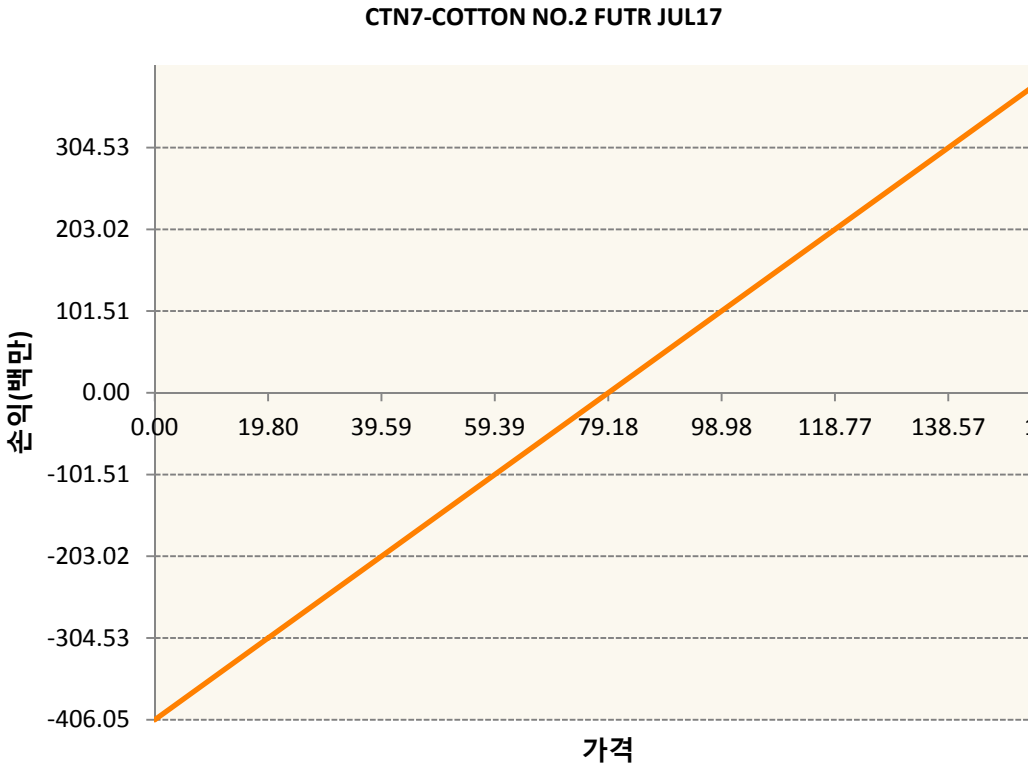
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	394	-394	장내
누계	유가증권	선물	8,898	0	8,898	
누계	통화	선물	0	394	-394	장내

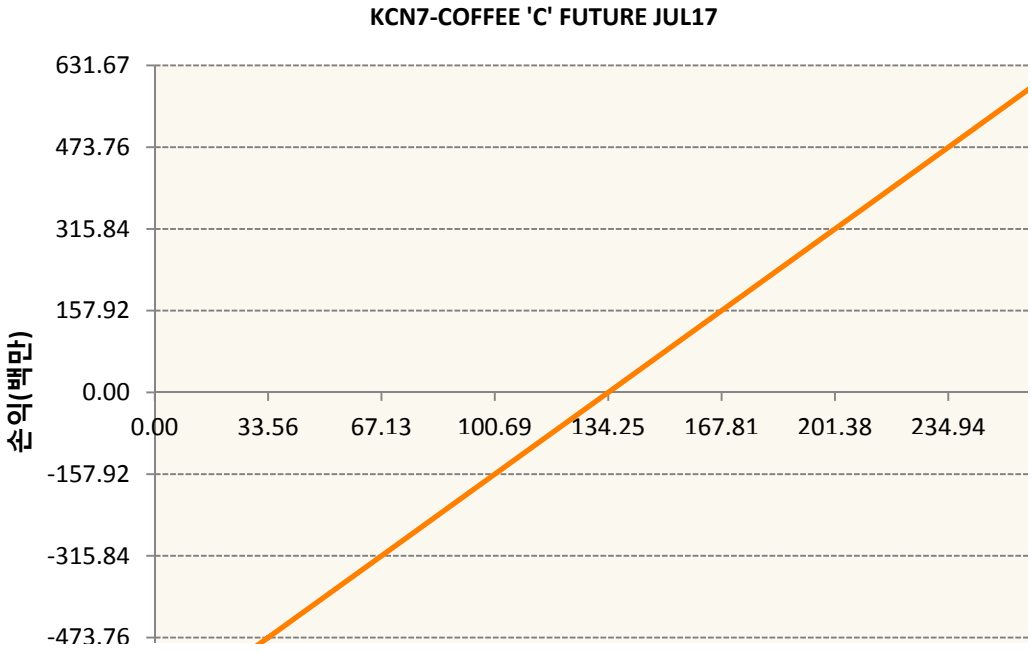
2. 만기시점의 손익구조

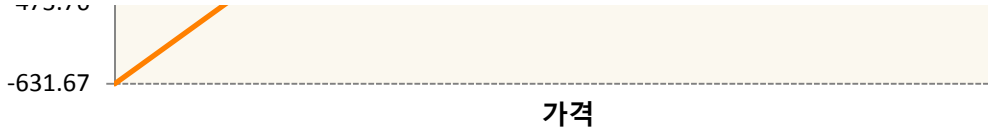


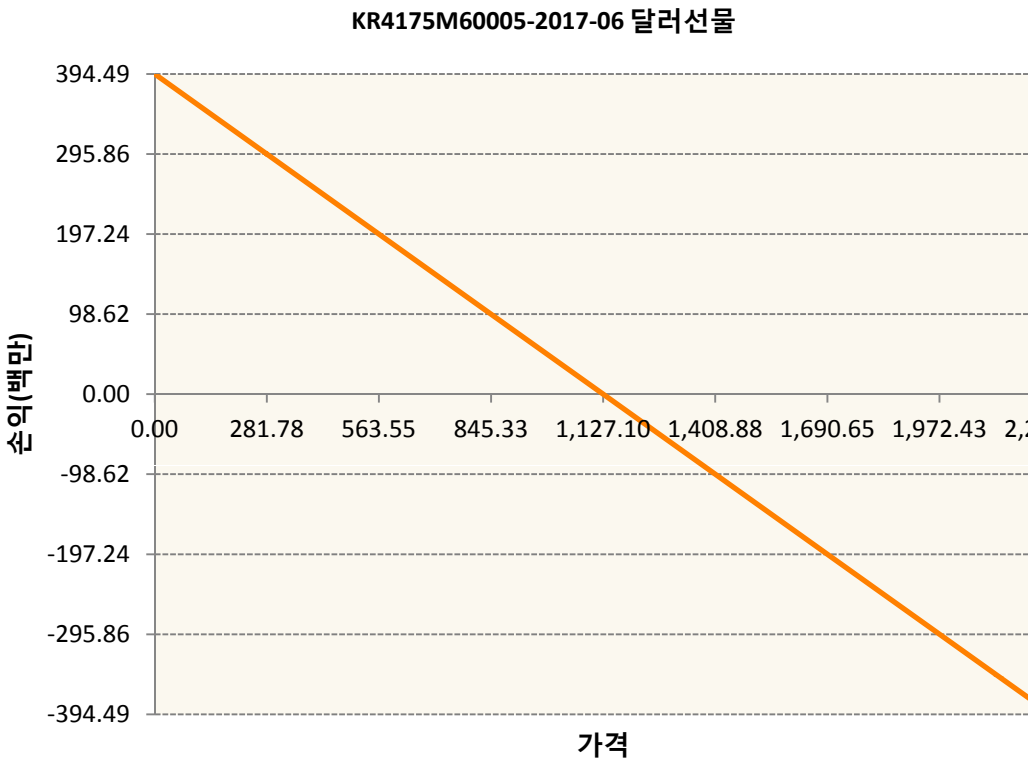


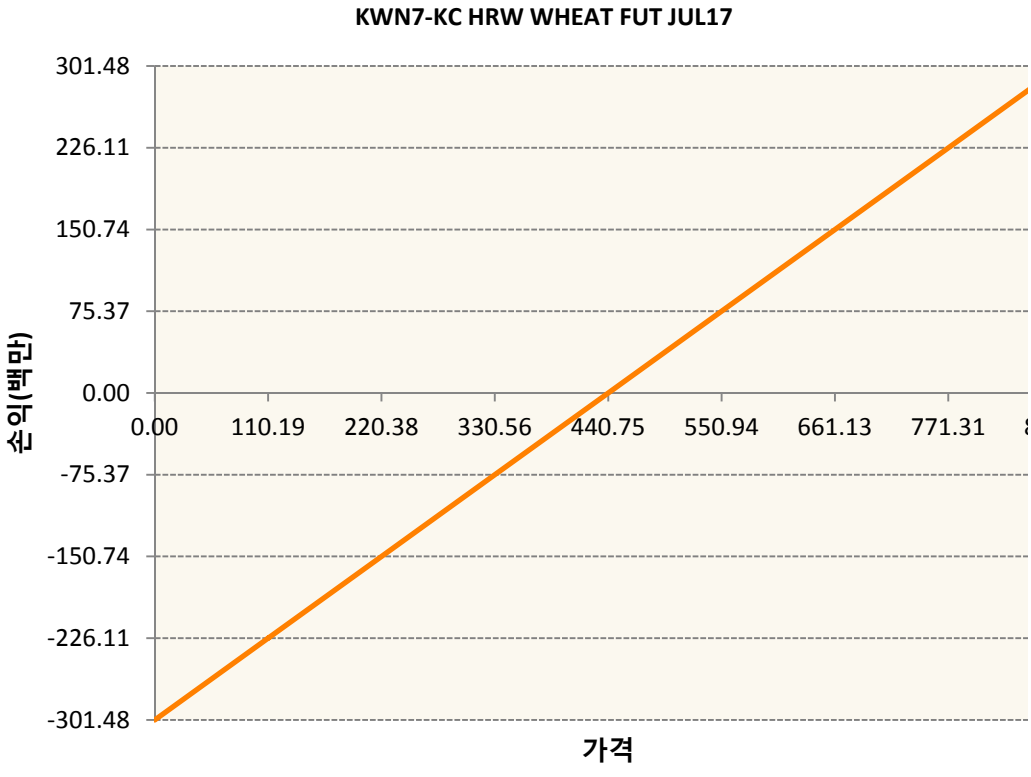

-1,199.95
-1,799.92
-2,399.89
가격

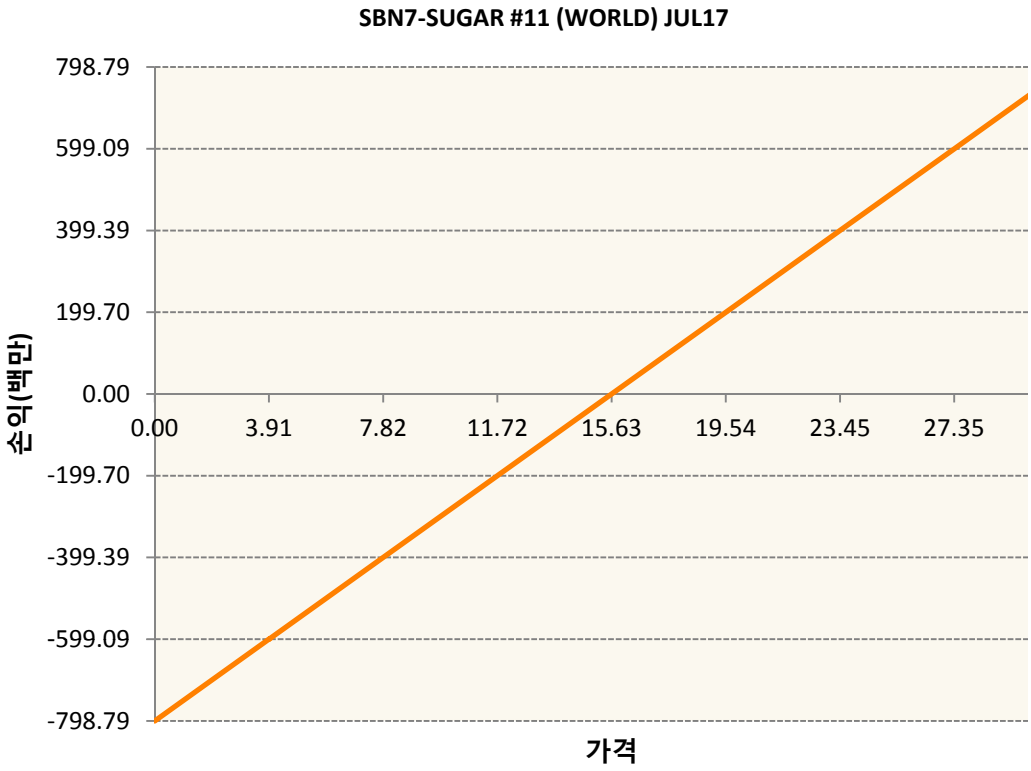

CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
304.53
203.02
101.51
0.00
-101.51
-203.02
-304.53
-406.05
0.00
19.80
39.59
59.39
79.18
98.98
118.77
138.57
순익(백만)
가격

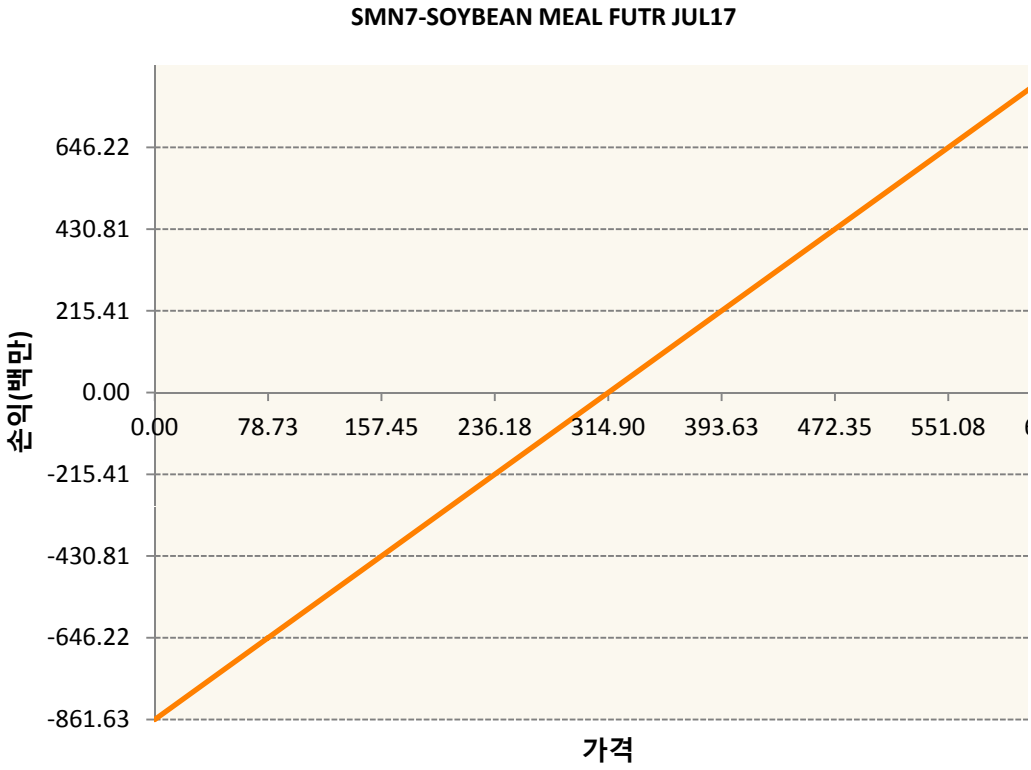

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
631.67
473.76
315.84
157.92
0.00
-157.92
-315.84
-473.76
0.00
33.56
67.13
100.69
134.25
167.81
201.38
234.94
순익(백만)


-631.67
가격

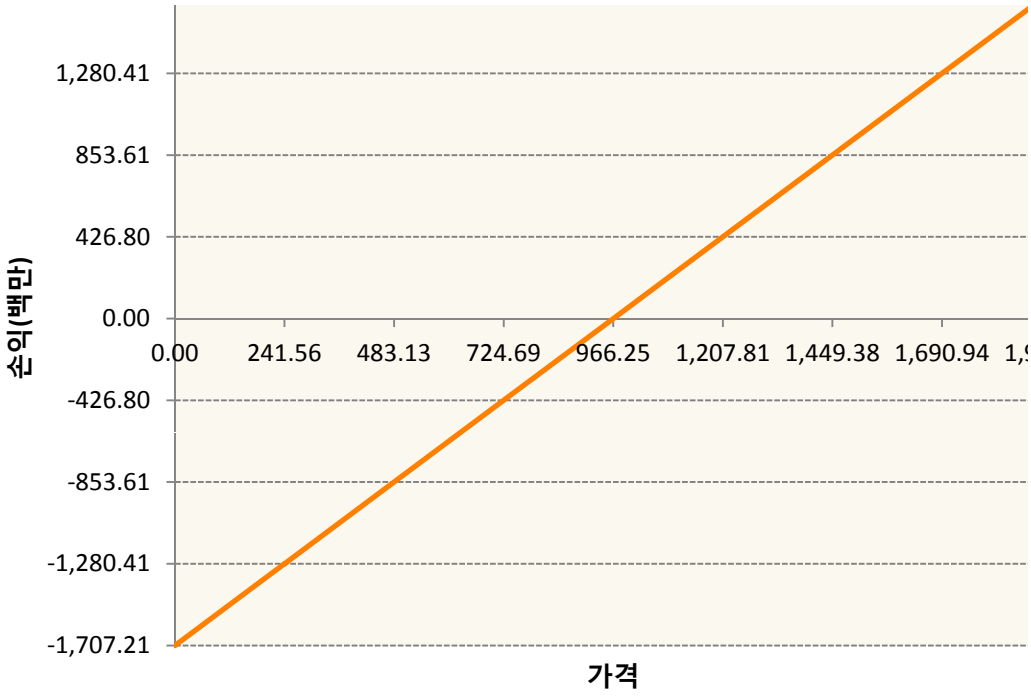

KR4175M60005-2017-06 달러선물
394.49
295.86
197.24
98.62
0.00
-98.62
-197.24
-295.86
-394.49
순익(백만)
0.00
281.78
563.55
845.33
1,127.10
1,408.88
1,690.65
1,972.43
가격


KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17
301.48
226.11
150.74
75.37
0.00
-75.37
-150.74
-226.11
-301.48
순익(백만)
0.00
110.19
220.38
330.56
440.75
550.94
661.13
771.31
가격

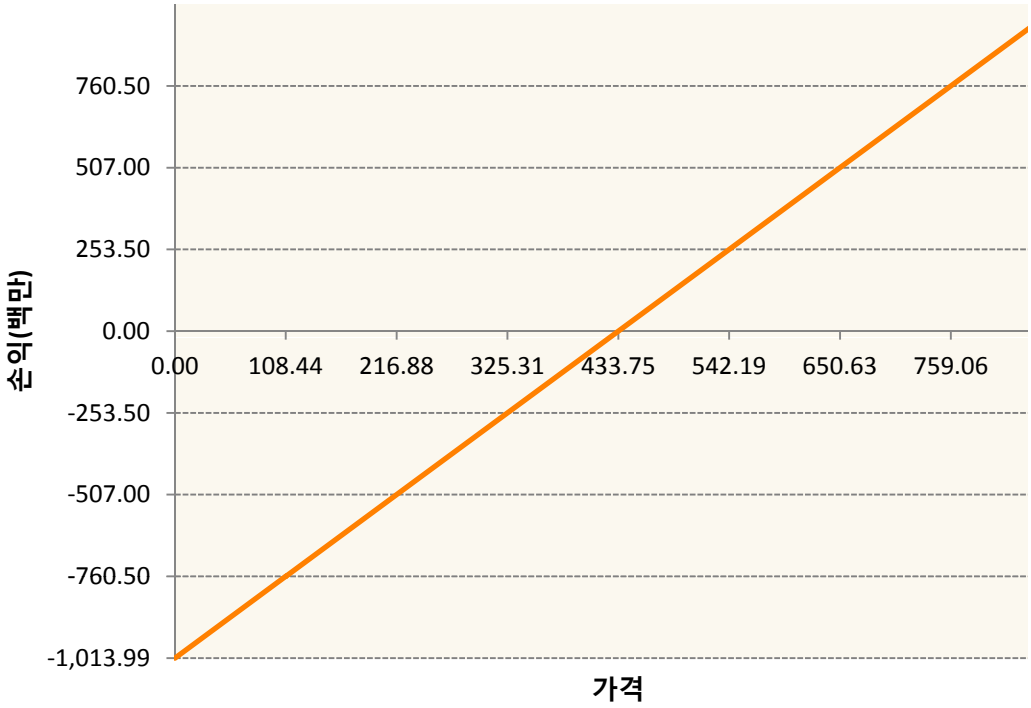

SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
798.79
599.09
399.39
199.70
0.00
-199.70
-399.39
-599.09
-798.79
0.00
3.91
7.82
11.72
15.63
19.54
23.45
27.35
순익(백만)
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
646.22
430.81
215.41
0.00
-215.41
-430.81
-646.22
-861.63
0.00
78.73
157.45
236.18
314.90
393.63
472.35
551.08
순익(백만)
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,707.21



WN7-WHEAT FUTURE(CBT) JUL17



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	62
CN7	CORN FUTURE JUL17	192
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	32

KCN7	COFFEE 'C' FUTURE JUL17	51
KR4175M60(	2017-06 달러선물	32
KWN7	KC HRW WHEAT FUT JUL17	24
SBN7	SUGAR #11 (WORLD) JUL17	64
SMN7	SOYBEAN MEAL FUTR JUL17	69
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	137
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	81

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

808