공시일	2017-05-16
기준일	2017-05-15

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	2017-05-16
기준일	2017-05-15

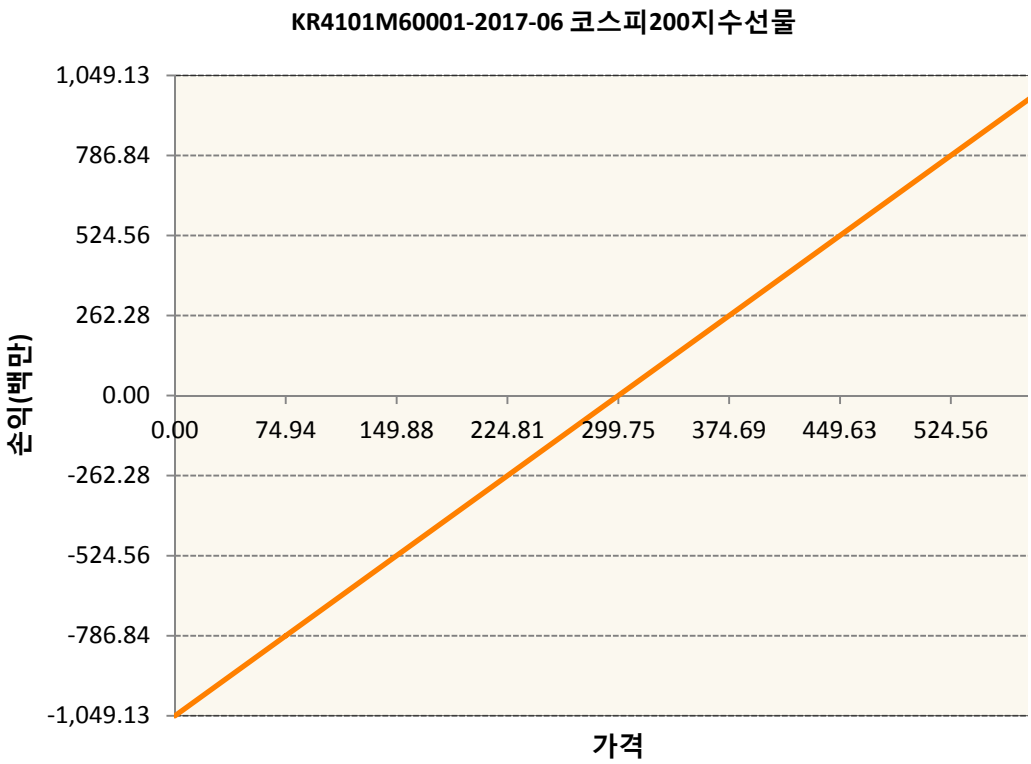
스마트인덱스모

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	1,049	0	1,049	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	2017-05-16
기준일	2017-05-15

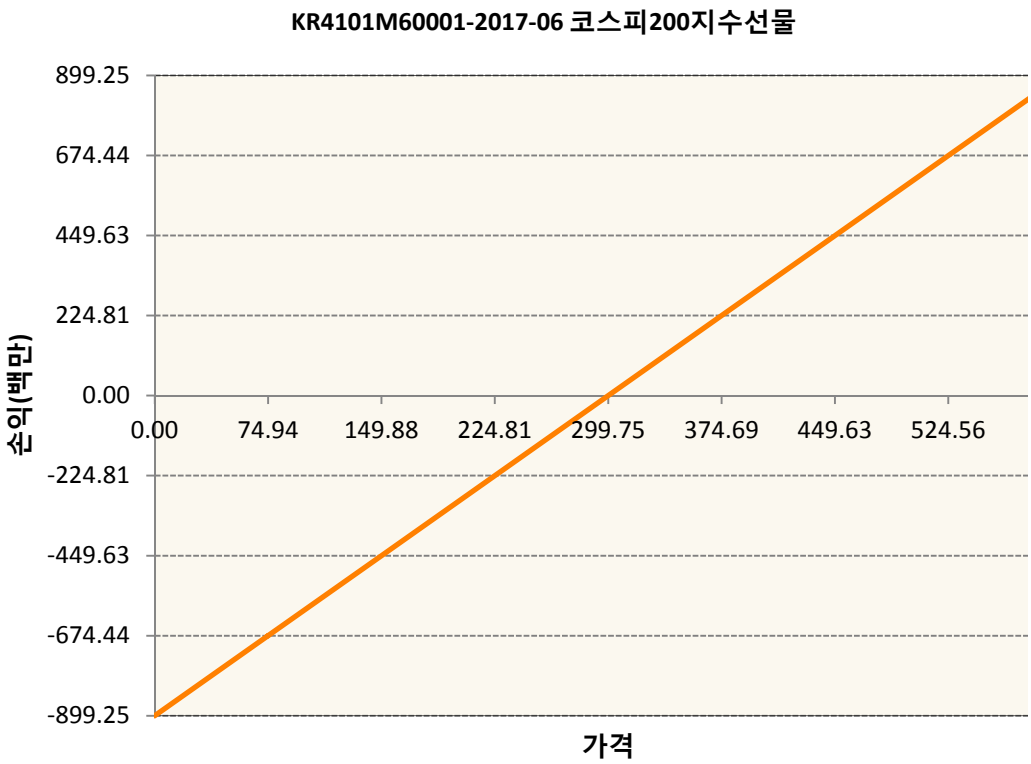
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	150	-150	장내
누계	유가증권	선물	899	0	899	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							72
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72
-5.33%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
-2.67%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	24	24	24	24	24	24	24
5.33%	48	48	48	48	48	48	48
8.00%	72	72	72	72	72	72	72

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

48

공시일	2017-05-16
기준일	2017-05-15

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	2017-05-16
기준일	2017-05-15

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	358

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

335

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-05-16
기준일	2017-05-15

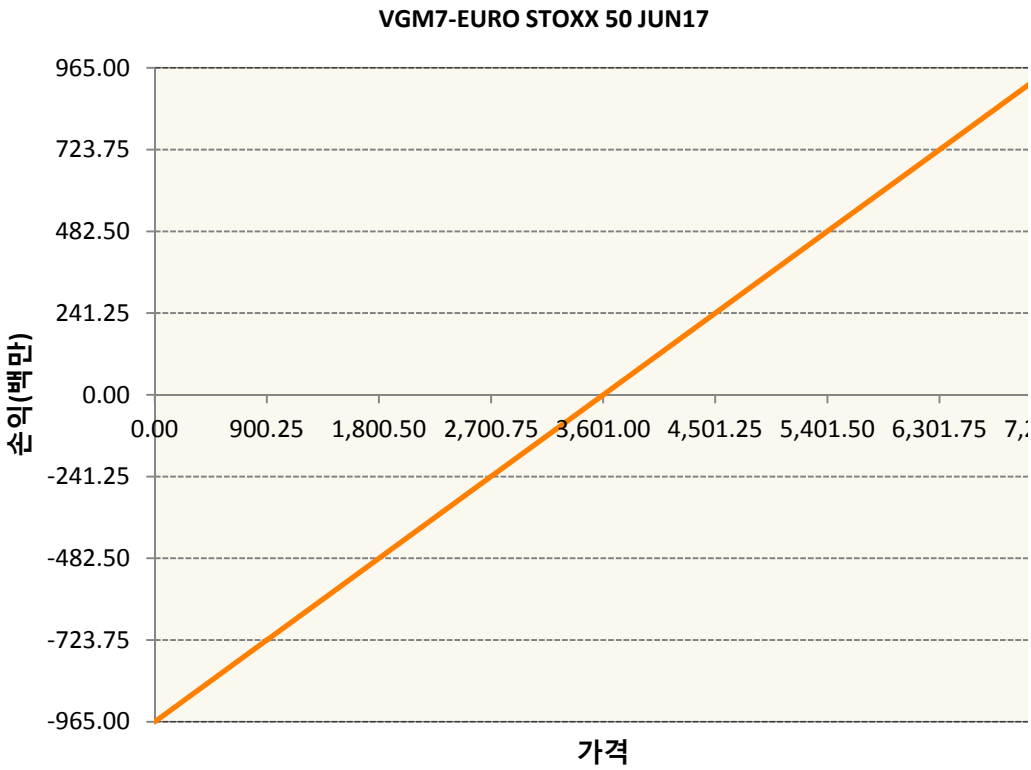
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	965	0	965	

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	2017-05-16
기준일	2017-05-15

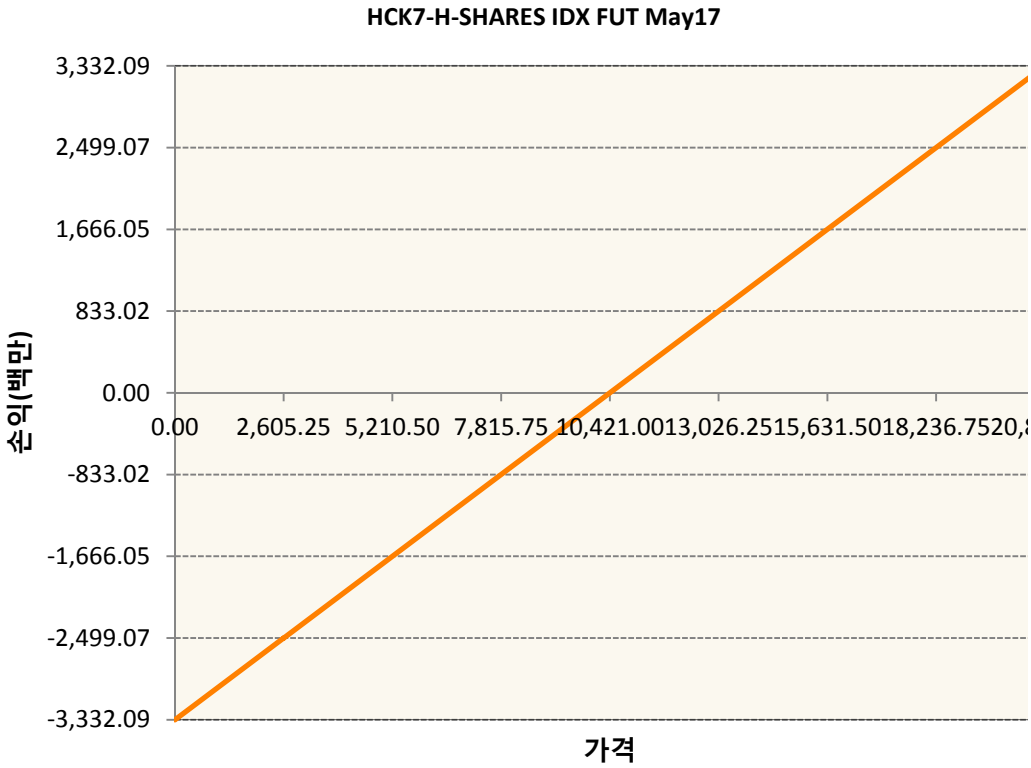
차이나인덱스모(주식-파생형)

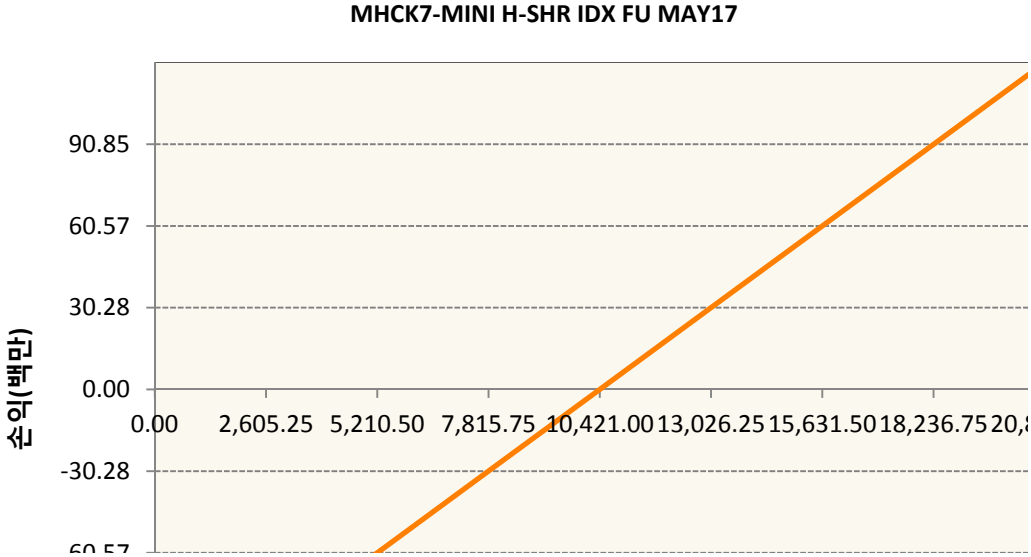
1. 계약금액

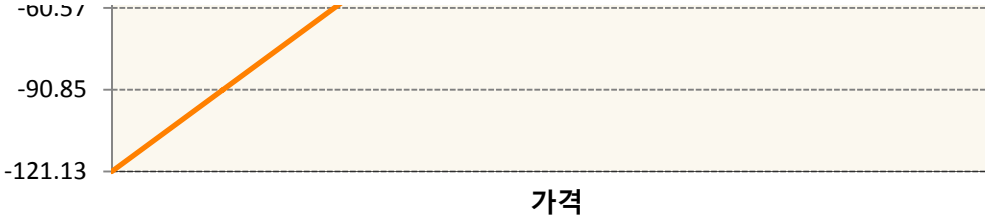
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,453	0	3,453	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCK7	H-SHARES IDX FUT May17	267
MHCK7	MINI H-SHR IDX FU MAY17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	293

공시일	2017-05-16
기준일	2017-05-15

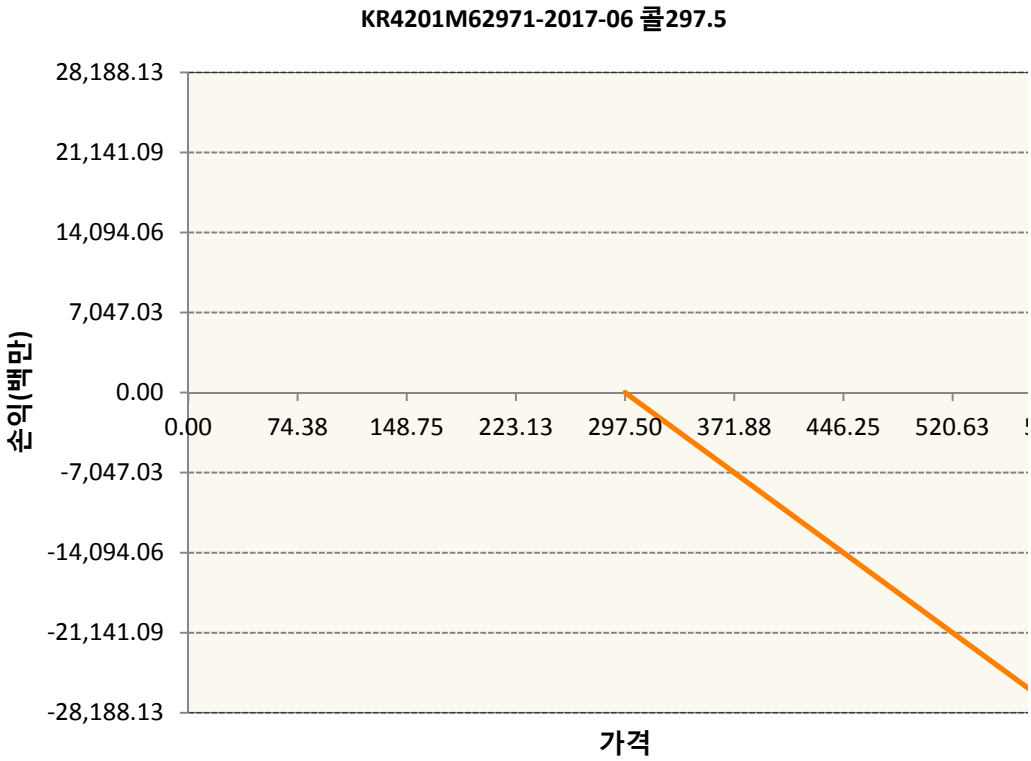
커버드콜모(주식혼합-파생형)

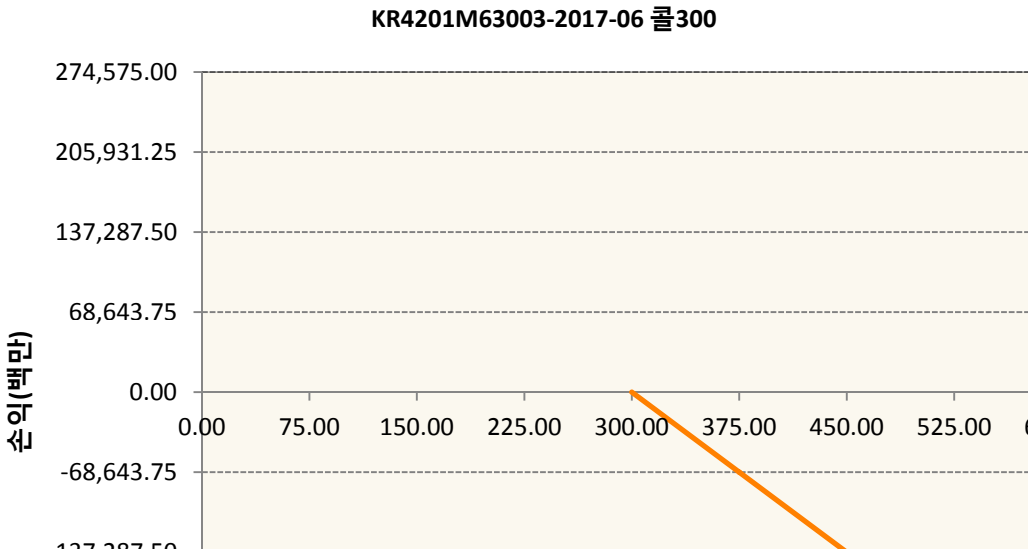
1. 계약금액

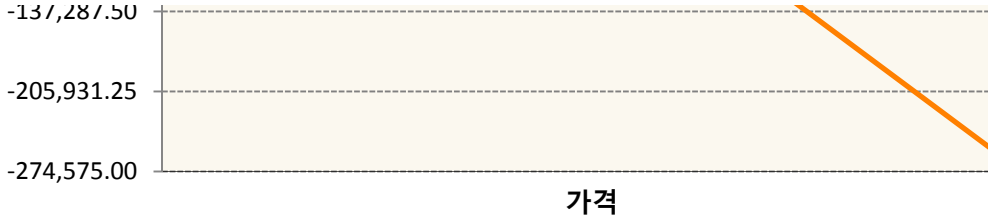
(단위:백만원)

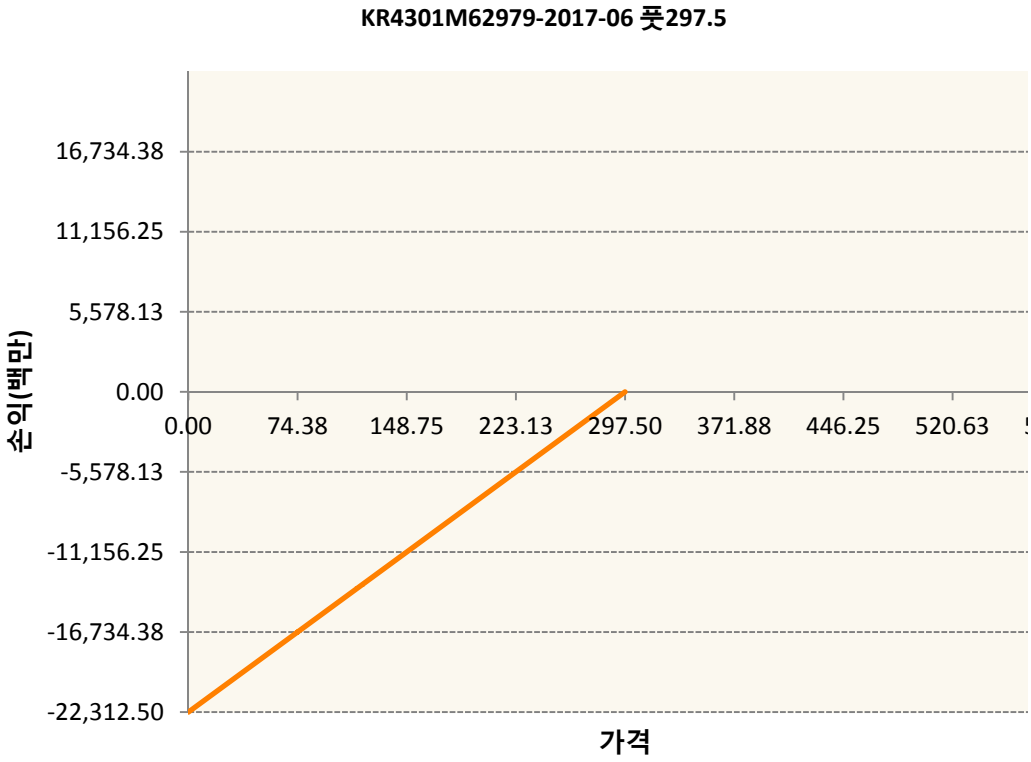
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	15,202	-15,202	장내
누계	유가증권	옵션	0	527,576	-527,576	장내

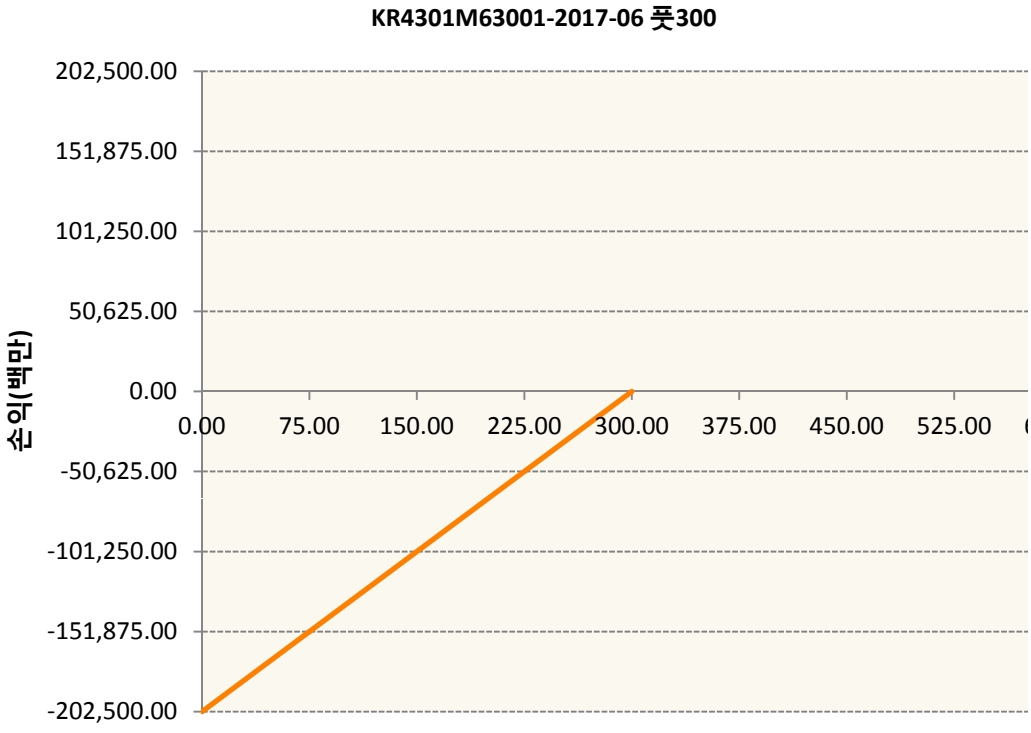
2. 만기시점의 손익구조






-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
202,500.00
151,875.00
101,250.00
50,625.00
0.00
-50,625.00
-101,250.00
-151,875.00
-202,500.00
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						1,954
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	449	448	447	446	443	439	435
-5.33%	442	437	430	420	409	396	382
-2.67%	376	354	330	305	280	253	226
0%	94	63	32	0	-32	-63	-95
2.67%	-472	-489	-508	-528	-550	-574	-598
5.33%	-1,190	-1,194	-1,199	-1,206	-1,215	-1,226	-1,239
8.00%	-1,941	-1,941	-1,942	-1,944	-1,946	-1,949	-1,954
KR4201M63(	2017-06 콜300						17,807
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,198	3,197	3,193	3,185	3,171	3,149	3,118
-5.33%	3,175	3,147	3,104	3,045	2,969	2,877	2,770
-2.67%	2,825	2,668	2,491	2,297	2,089	1,870	1,640
0%	918	613	307	0	-307	-614	-922
2.67%	-3,758	-3,979	-4,214	-4,460	-4,716	-4,979	-5,249
5.33%	-10,393	-10,456	-10,542	-10,648	-10,774	-10,917	-11,076
8.00%	-17,602	-17,610	-17,626	-17,652	-17,690	-17,741	-17,807
KR4301M62(	2017-06 풋297.5						1,447
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,436	-1,437	-1,437	-1,439	-1,441	-1,443	-1,447
-5.33%	-844	-848	-854	-861	-870	-881	-892
-2.67%	-300	-317	-336	-355	-376	-397	-418
0%	75	50	25	0	-25	-50	-75
2.67%	223	210	195	179	161	143	124
5.33%	252	249	245	239	232	224	214
8.00%	255	255	254	253	251	248	245
KR4301M63(	2017-06 풋300						13,822
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-13,763	-13,764	-13,767	-13,773	-13,783	-13,799	-13,822
-5.33%	-8,407	-8,427	-8,458	-8,502	-8,558	-8,626	-8,705
-2.67%	-3,291	-3,406	-3,537	-3,680	-3,833	-3,995	-4,164
0%	677	452	226	0	-226	-453	-680
2.67%	2,602	2,440	2,266	2,084	1,896	1,702	1,503

5.33%	3,083	3,036	2,973	2,895	2,802	2,696	2,579
8.00%	3,140	3,134	3,123	3,104	3,076	3,038	2,989

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

39,335

공시일	2017-05-16
기준일	2017-05-15

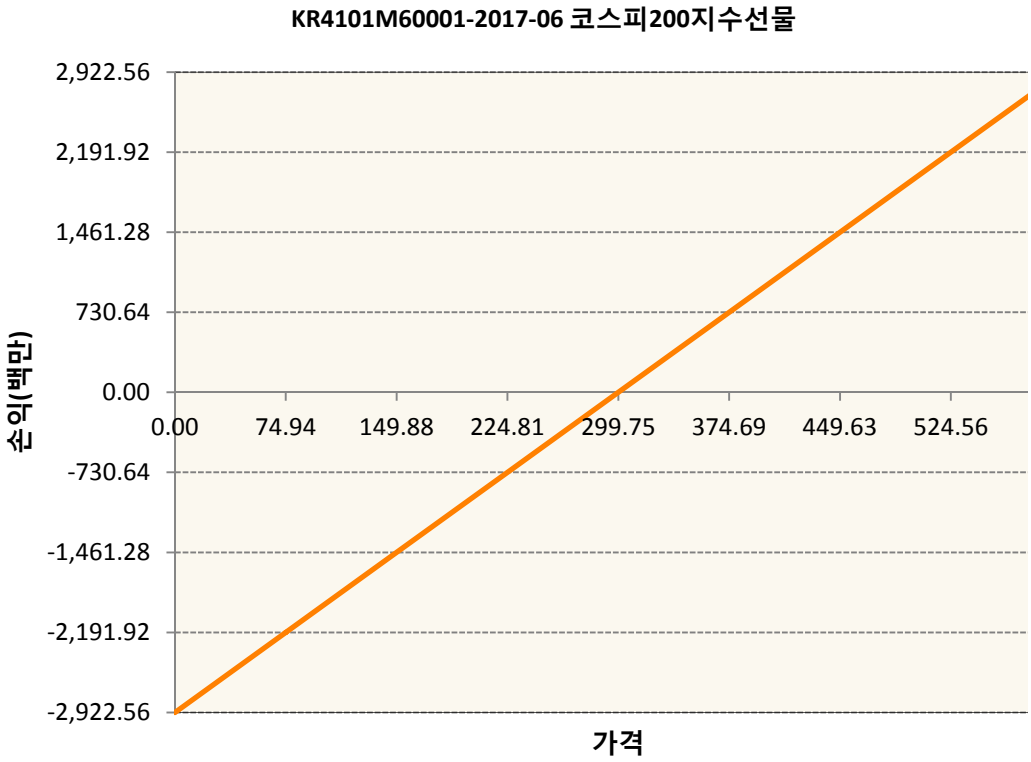
커버드콜목표전환형증권투자신탁

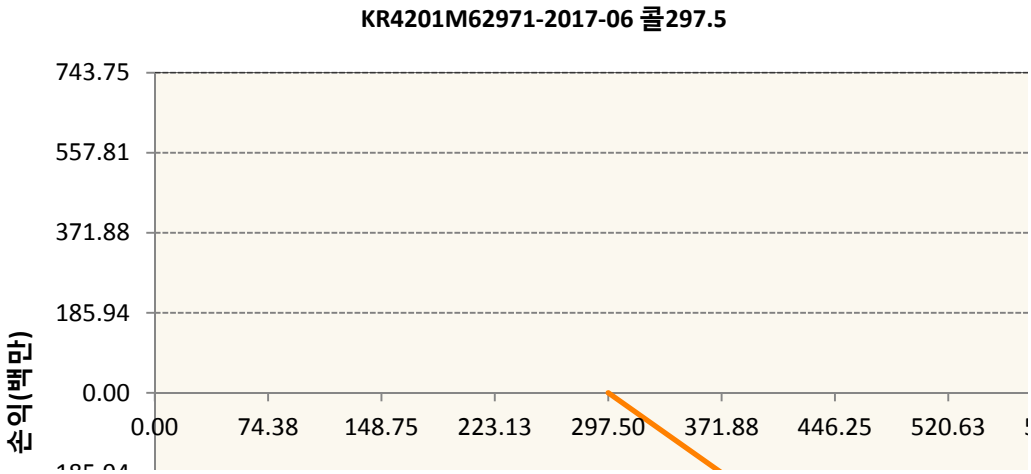
1. 계약금액

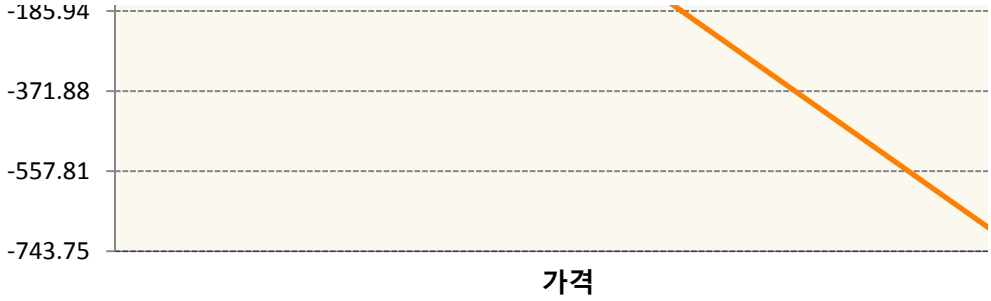
(단위:백만원)

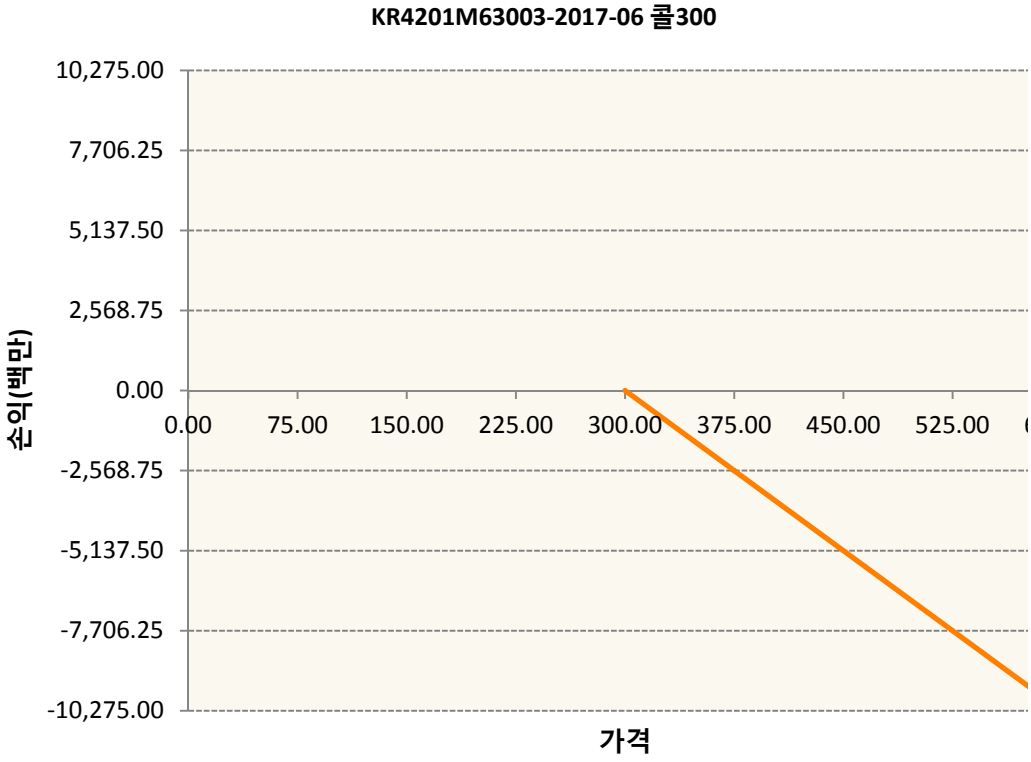
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,923	0	2,923	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,889	-12,889	장내

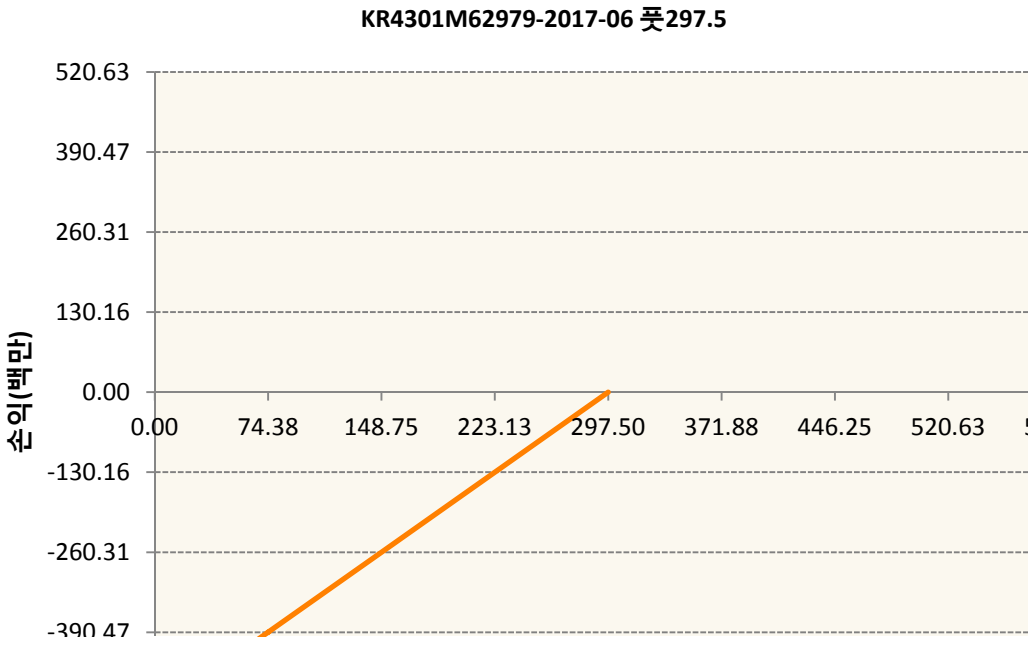
2. 만기시점의 손익구조



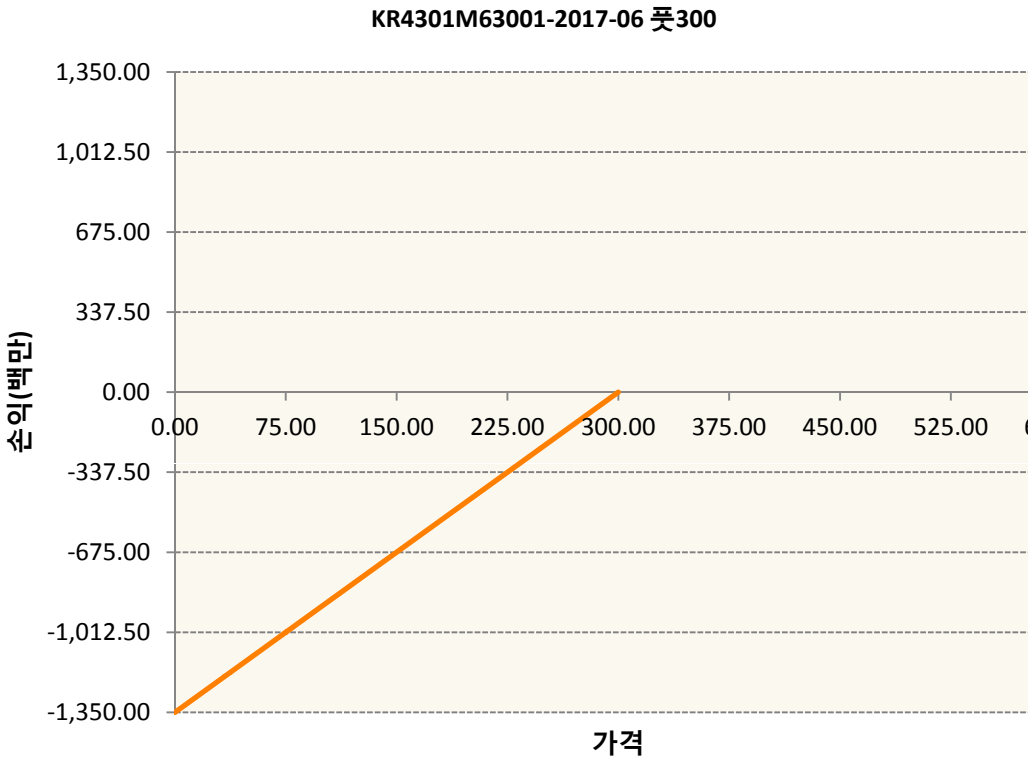



-185.94
-371.88
-557.81
-743.75
가격


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							52
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12	12	12	12	12	12	11
-5.33%	12	12	11	11	11	10	10
-2.67%	10	9	9	8	7	7	6

0%	2	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-12	-13	-13	-14	-15	-15	-16
5.33%	-31	-31	-32	-32	-32	-32	-33
8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-52
	KR4201M63(	2017-06 콜300					666
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	120	120	119	119	119	118	117
-5.33%	119	118	116	114	111	108	104
-2.67%	106	100	93	86	78	70	61
0%	34	23	11	0	-11	-23	-34
2.67%	-141	-149	-158	-167	-176	-186	-196
5.33%	-389	-391	-394	-398	-403	-409	-414
8.00%	-659	-659	-660	-661	-662	-664	-666
	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	-20	-21	-21
-2.67%	-7	-7	-8	-8	-9	-9	-10
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	5	5	5	4	4	3	3
5.33%	6	6	6	6	5	5	5
8.00%	6	6	6	6	6	6	6
	KR4301M63(	2017-06 풋300					92
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
-5.33%	-56	-56	-56	-57	-57	-58	-58
-2.67%	-22	-23	-24	-25	-26	-27	-28
0%	5	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	17	16	15	14	13	11	10
5.33%	21	20	20	19	19	18	17
8.00%	21	21	21	21	21	20	20

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

1,095

공시일	2017-05-16
기준일	2017-05-15

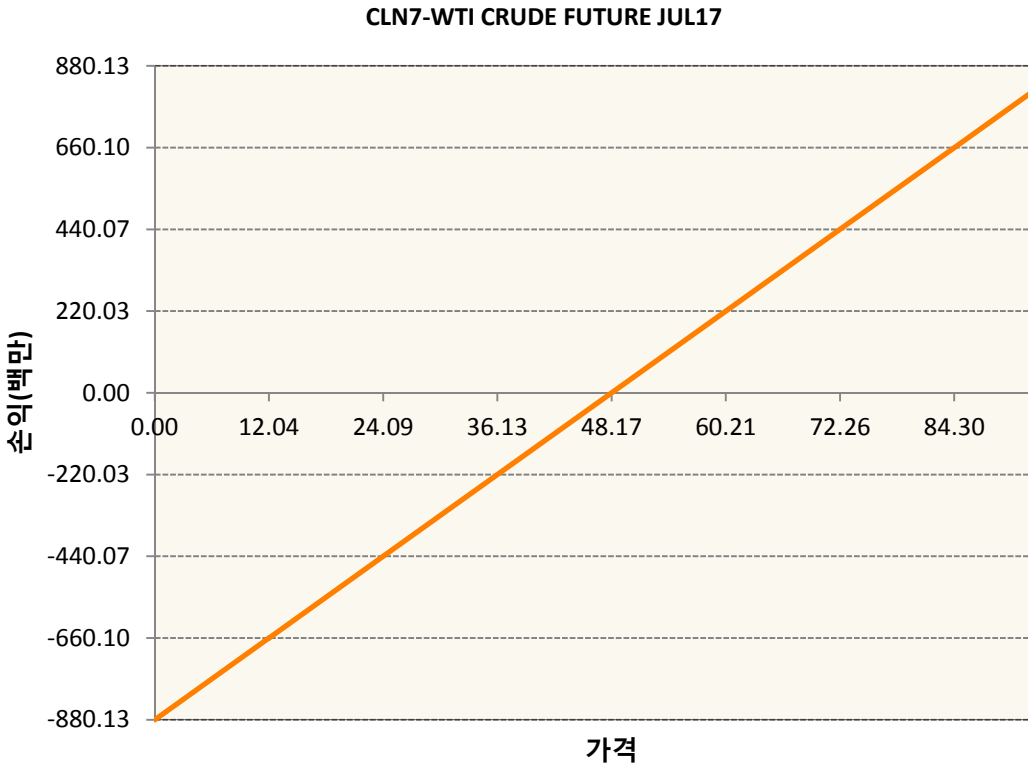
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

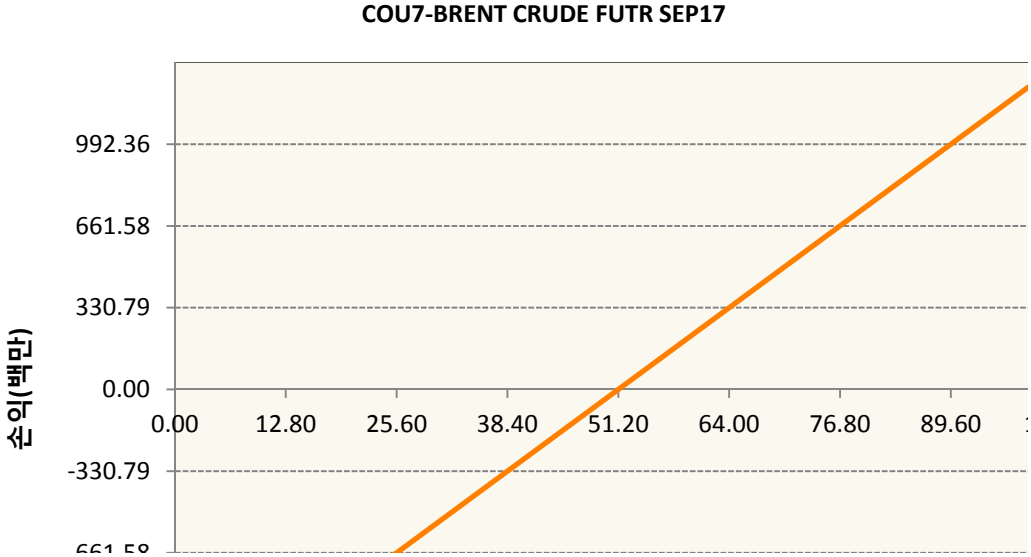
1. 계약금액

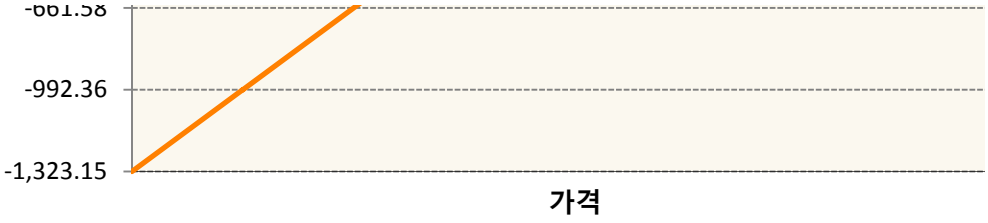
(단위:백만원)

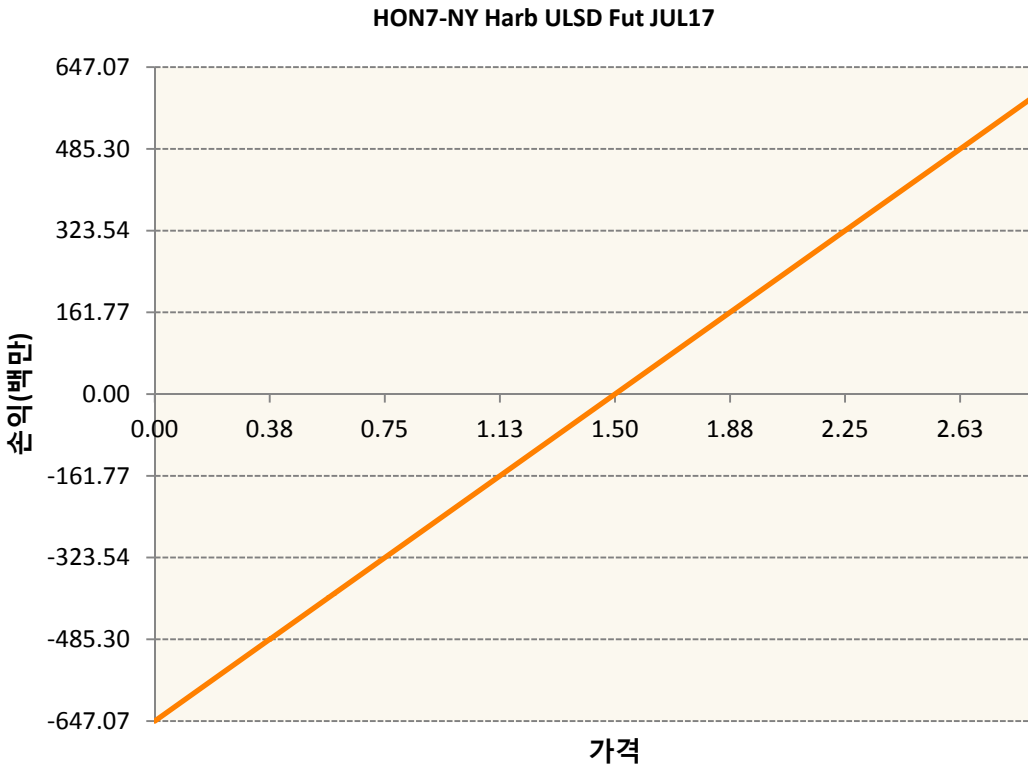
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,124	225	4,899	

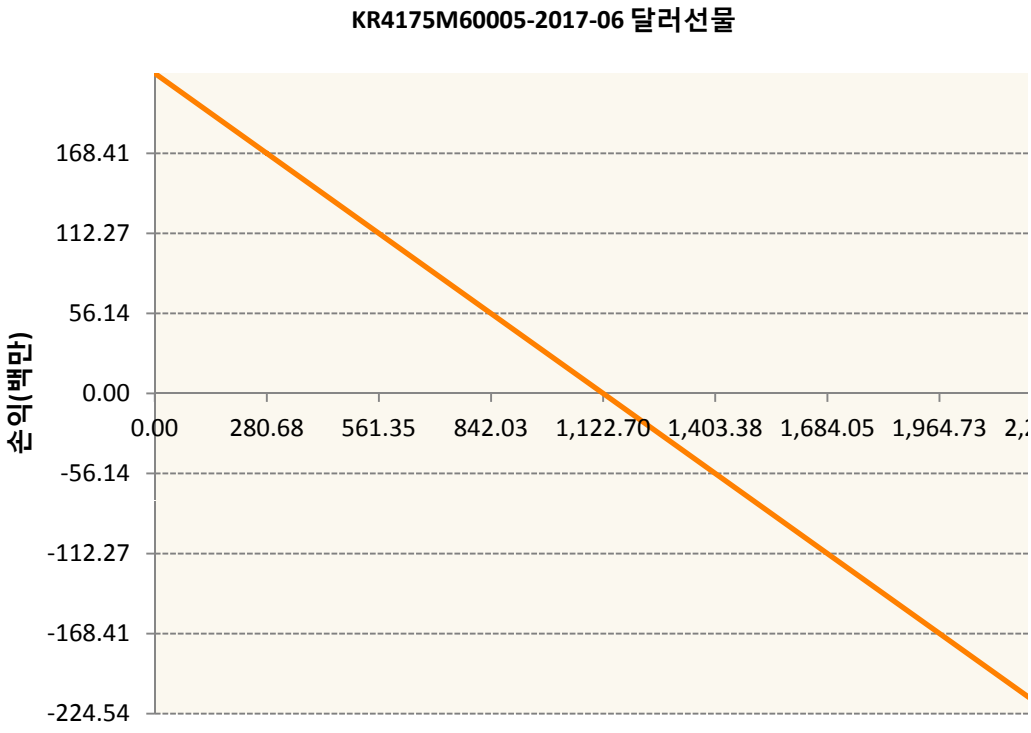
2. 만기시점의 손익구조



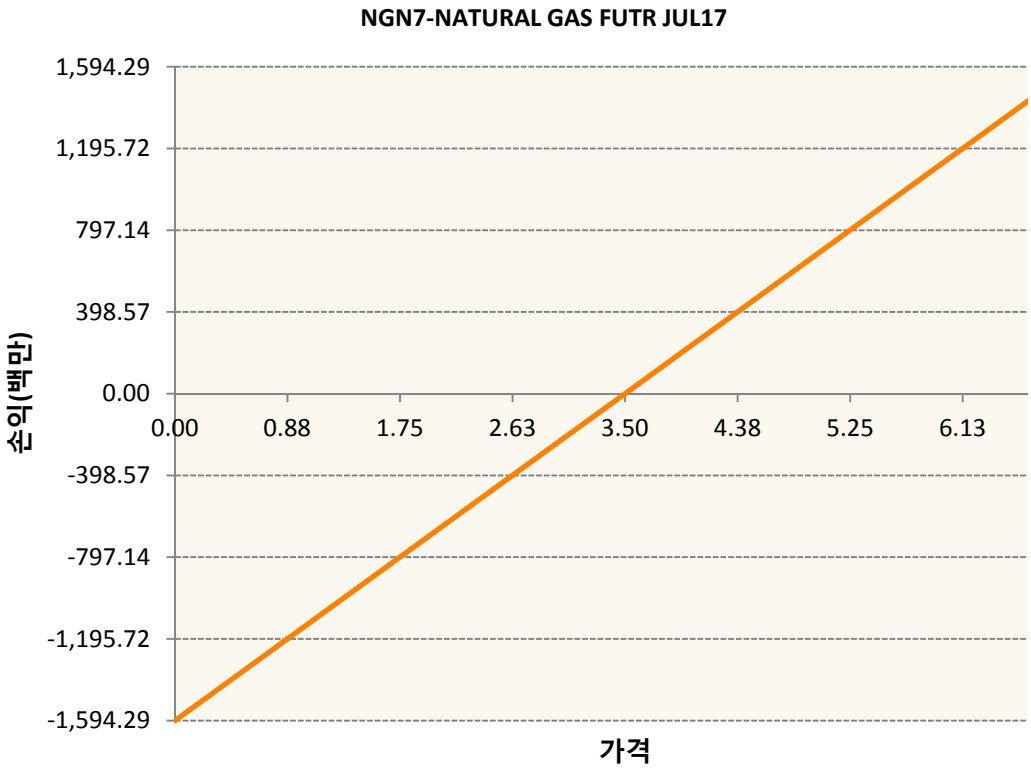


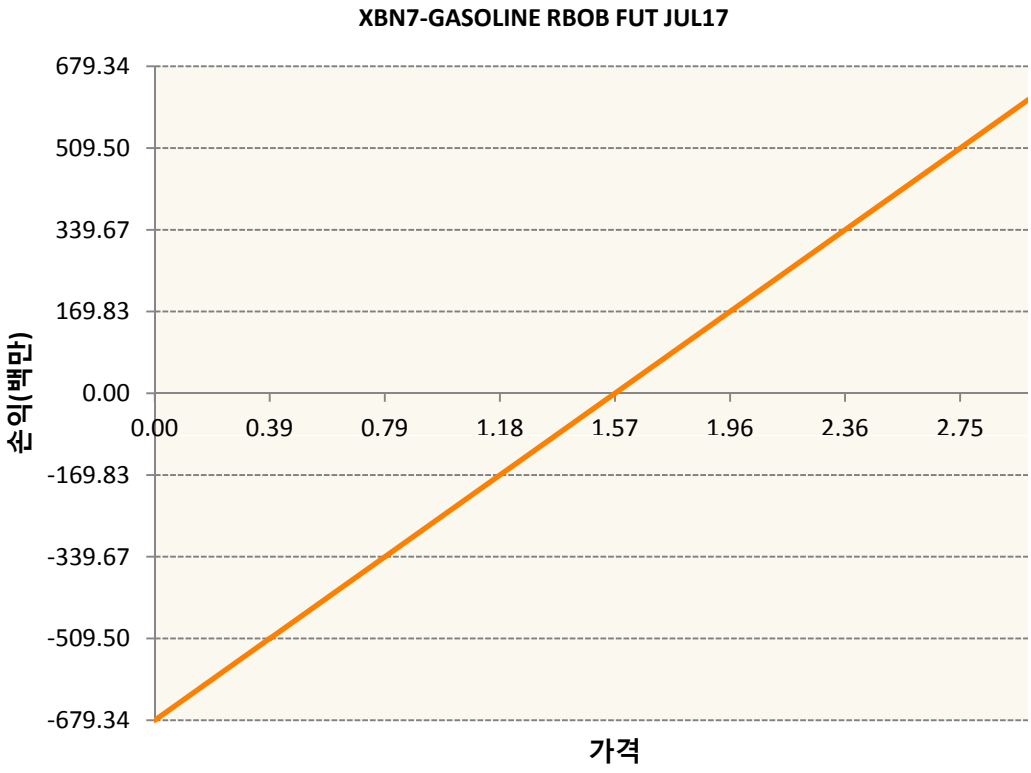

-661.58
-992.36
-1,323.15
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
647.07
485.30
323.54
161.77
0.00
-161.77
-323.54
-485.30
-647.07
0.00
0.38
0.75
1.13
1.50
1.88
2.25
2.63
순이익(백만)
가격


KR4175M60005-2017-06 달러선물
168.41
112.27
56.14
0.00
-56.14
-112.27
-168.41
-224.54
0.00
280.68
561.35
842.03
1,122.70
1,403.38
1,684.05
1,964.73
순이익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,594.29
1,195.72
797.14
398.57
0.00
-398.57
-797.14
-1,195.72
-1,594.29
0.00
0.88
1.75
2.63
3.50
4.38
5.25
6.13
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
679.34
509.50
339.67
169.83
0.00
-169.83
-339.67
-509.50
-679.34
0.00
0.39
0.79
1.18
1.57
1.96
2.36
2.75
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN7	WTI CRUDE FUTURE JUL17	70
COU7	BRENT CRUDE FUTR SEP17	106
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	52
KR4175M60(	2017-06 달러선물	18
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	128
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	54

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

881

공시일	2017-05-16
기준일	2017-05-15

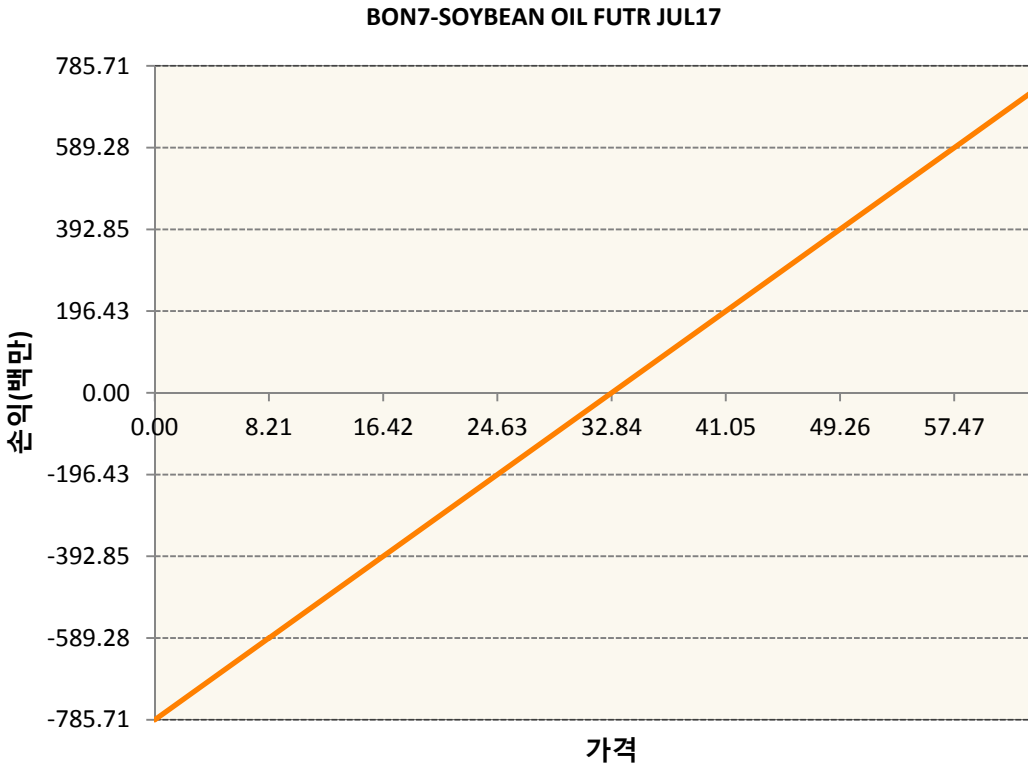
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

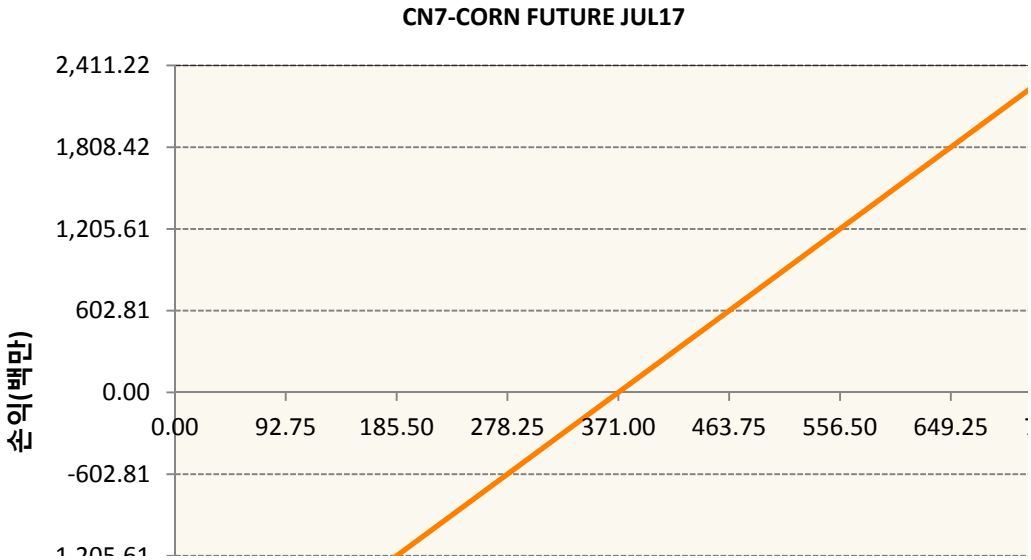
1. 계약금액

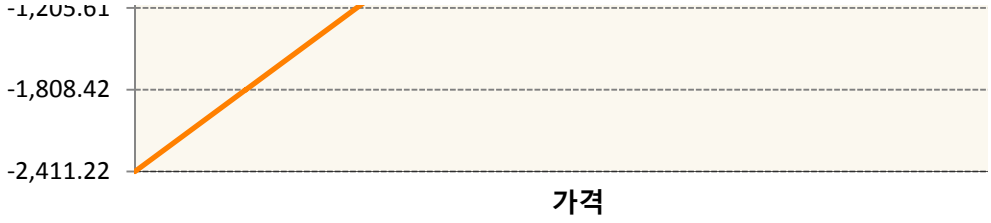
(단위:백만원)

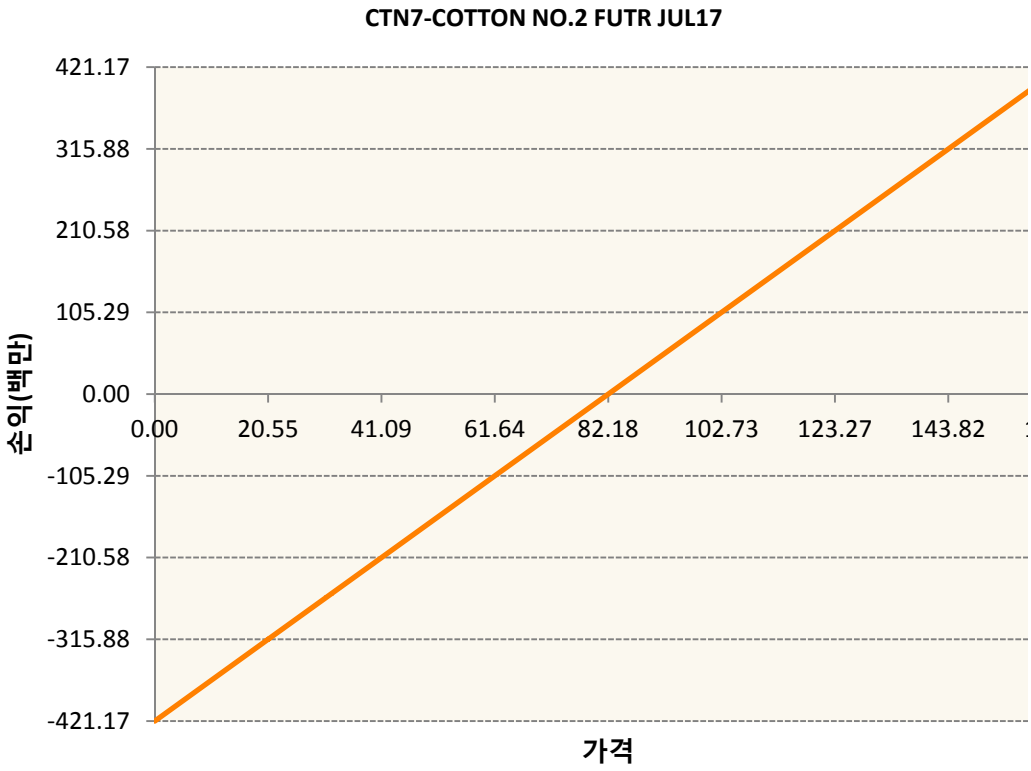
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,917	393	8,524	

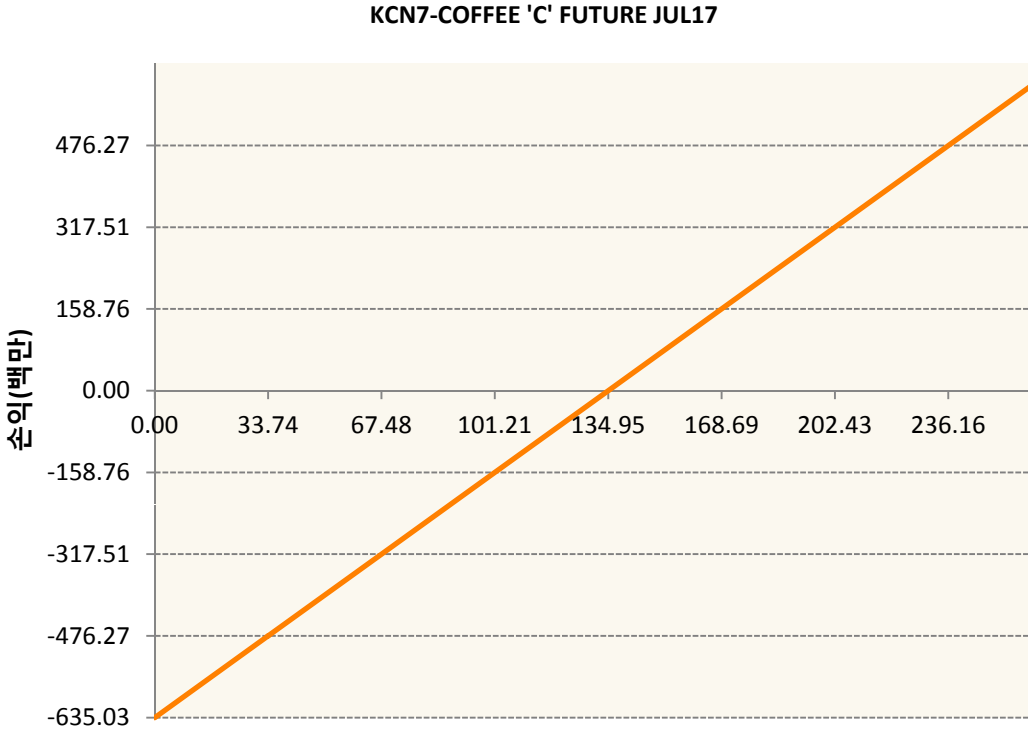
2. 만기시점의 손익구조





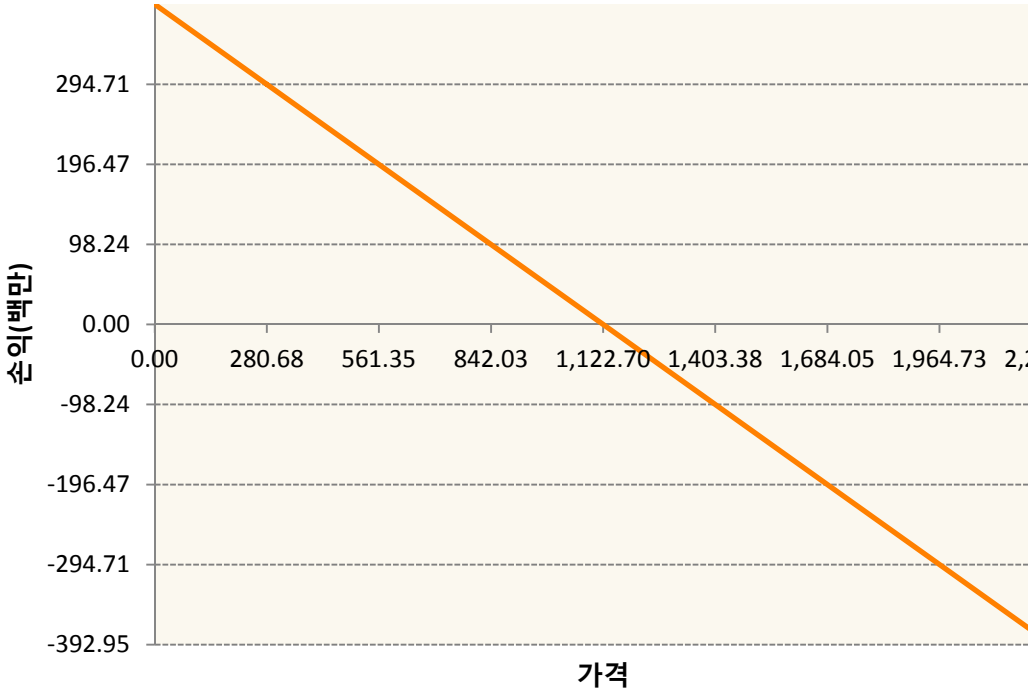

-1,808.42
-2,411.22
가격


CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
421.17
315.88
210.58
105.29
0.00
-105.29
-210.58
-315.88
-421.17
0.00
20.55
41.09
61.64
82.18
102.73
123.27
143.82
손익(백만)
가격

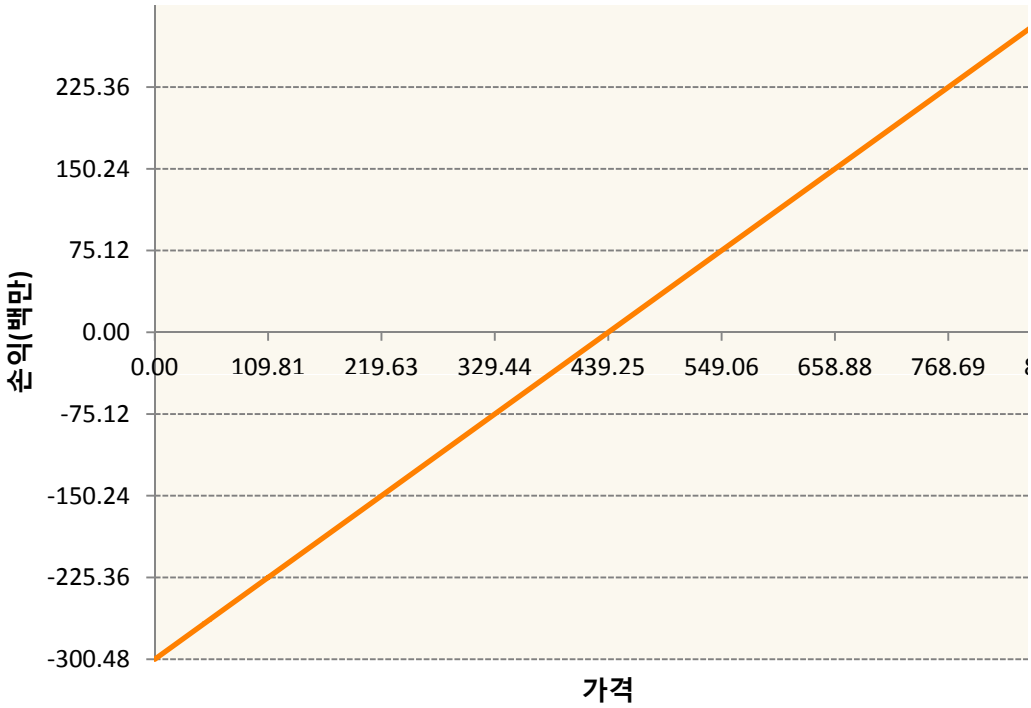

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
476.27
317.51
158.76
0.00
-158.76
-317.51
-476.27
-635.03
0.00
33.74
67.48
101.21
134.95
168.69
202.43
236.16
손익(백만)

가격

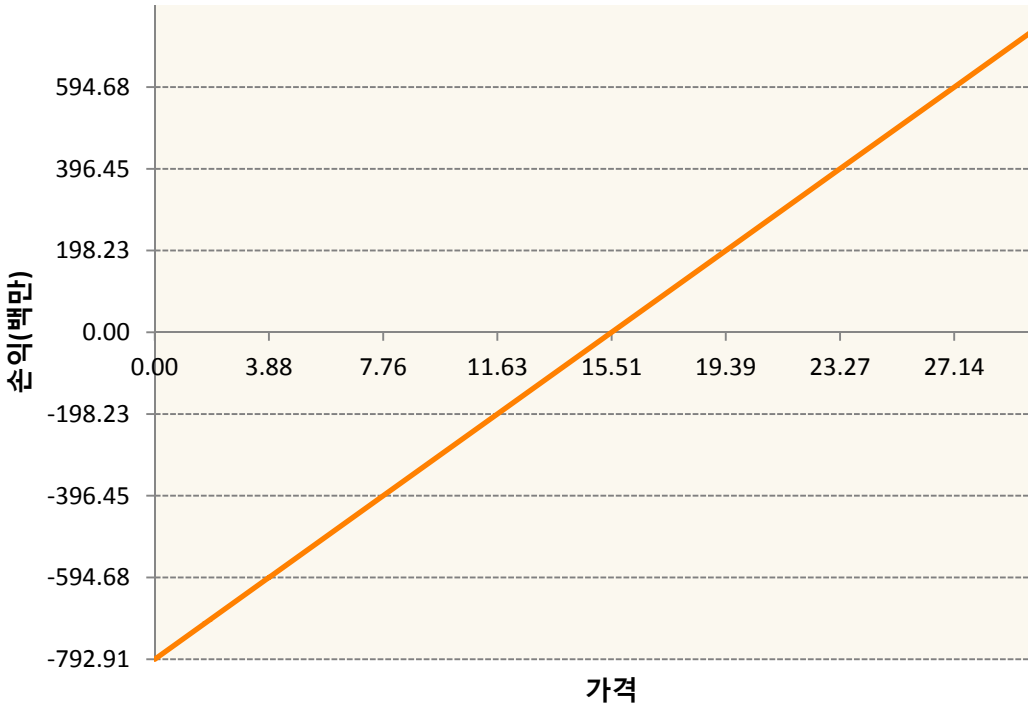
KR4175M60005-2017-06 달러선물



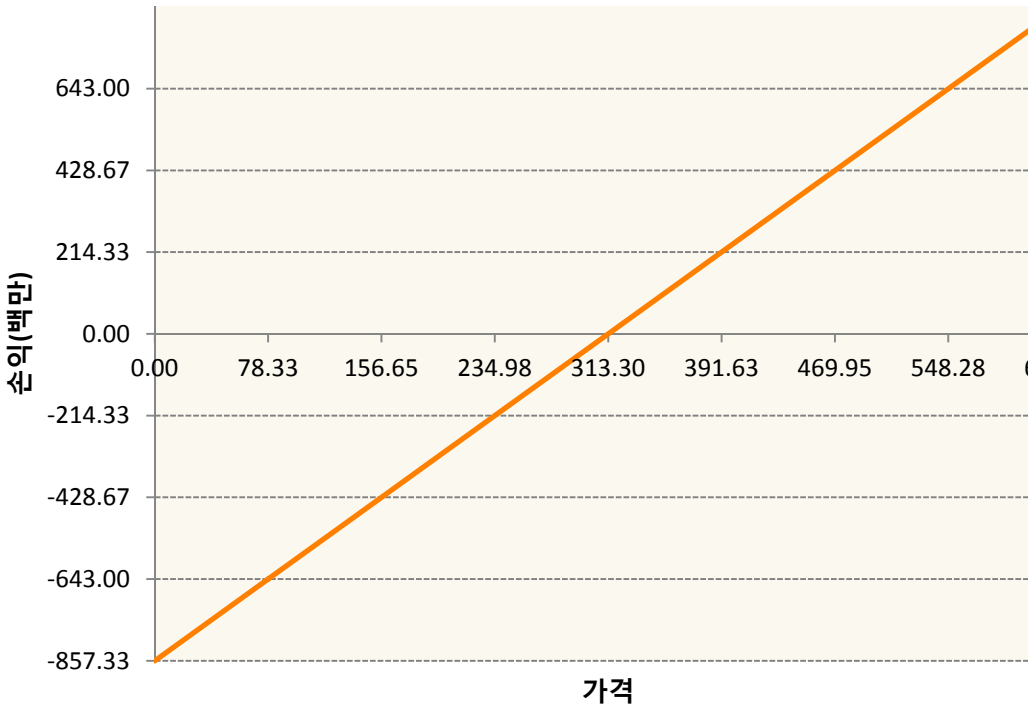
KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17



SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17

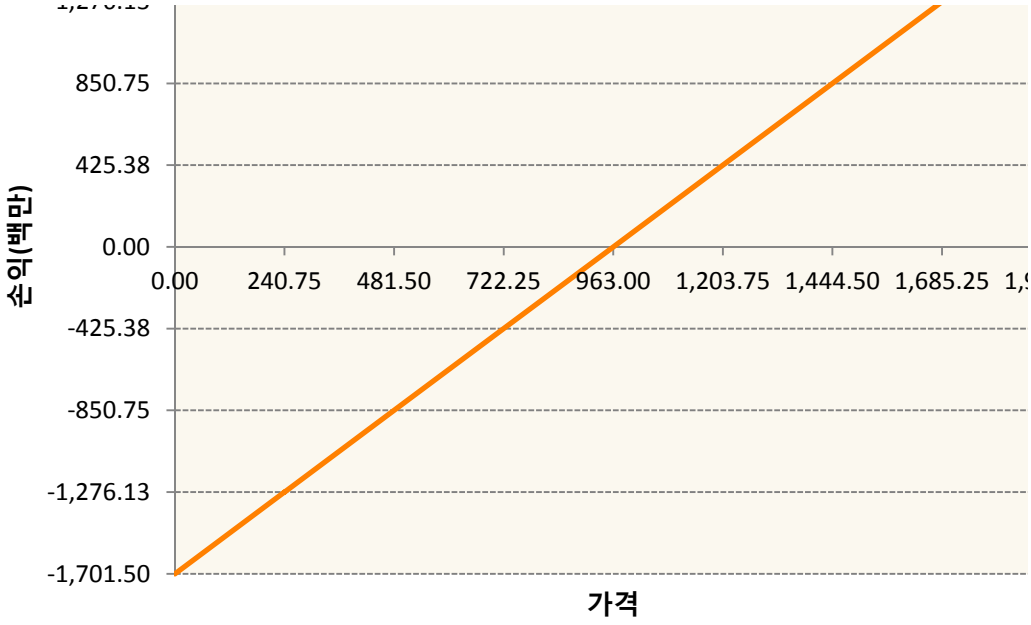


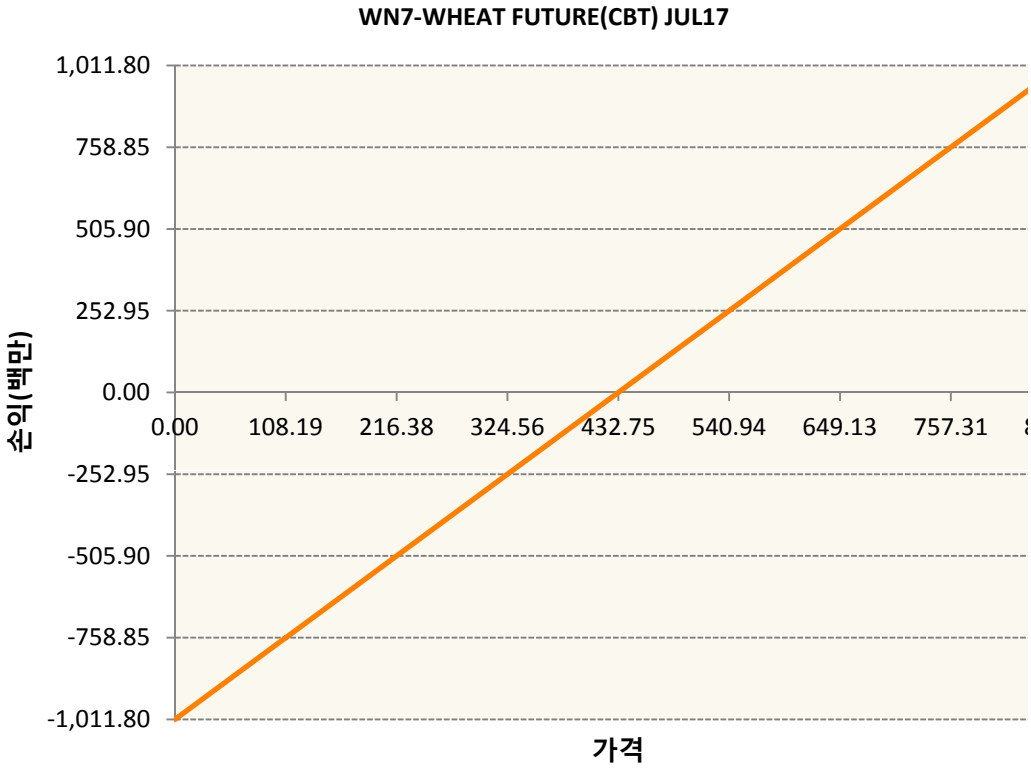
SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17



SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	63
CN7	CORN FUTURE JUL17	193
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	34
KCN7	COFFEE 'C' FUTURE JUL17	51
KR4175M60(	2017-06 달러선물	31

KWN7	KC HRW WHEAT FUT JUL17	24
SBN7	SUGAR #11 (WORLD) JUL17	63
SMN7	SOYBEAN MEAL FUTR JUL17	69
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	136
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	81

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

809