공시일	2017-05-17
기준일	2017-05-16

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	2017-05-17
기준일	2017-05-16

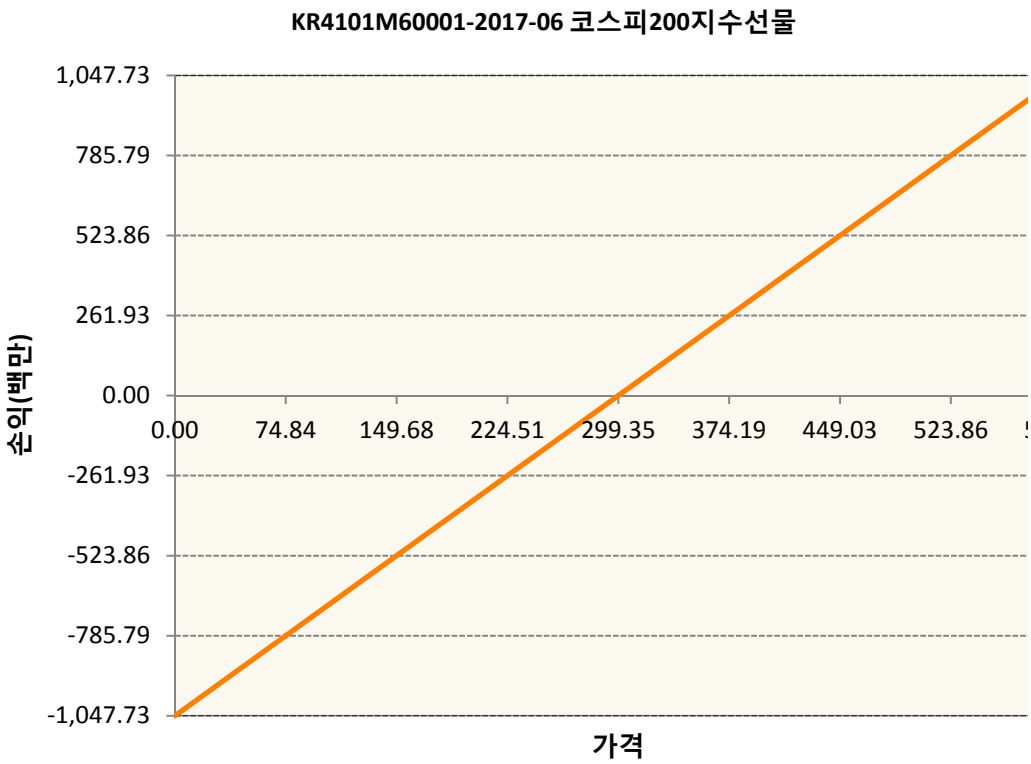
스마트인덱스모

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	1,048	0	1,048	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	2017-05-17
기준일	2017-05-16

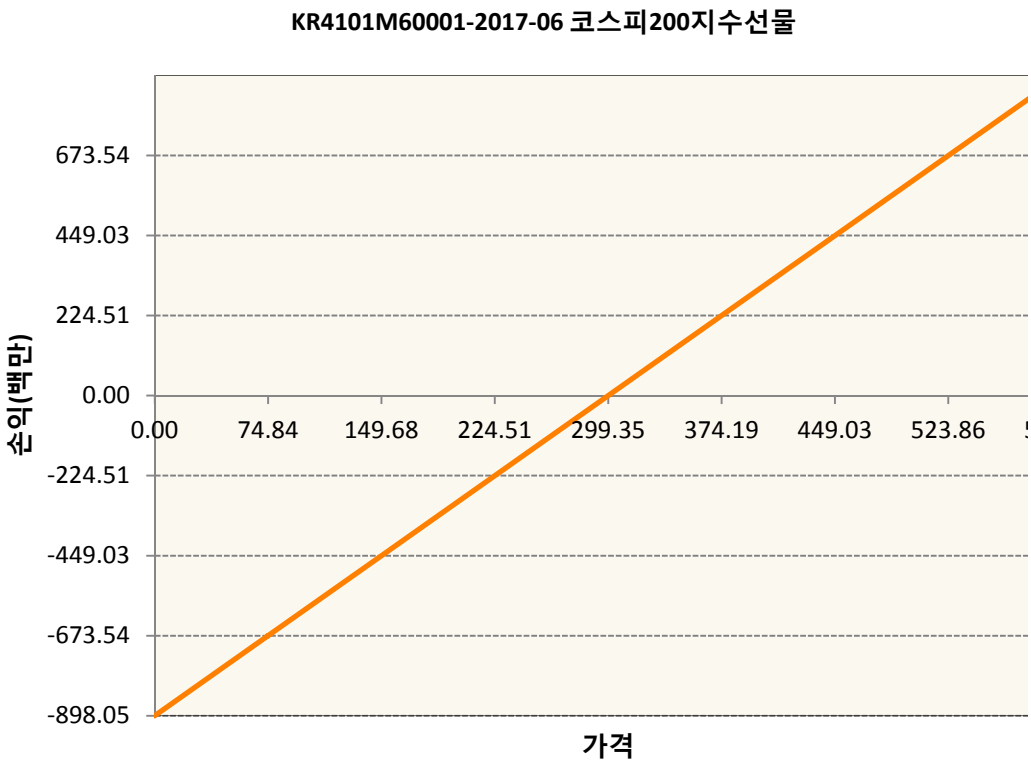
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	898	0	898	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	2017-05-17
기준일	2017-05-16

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	987

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

551

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-05-17
기준일	2017-05-16

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	366

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

343

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-05-17
기준일	2017-05-16

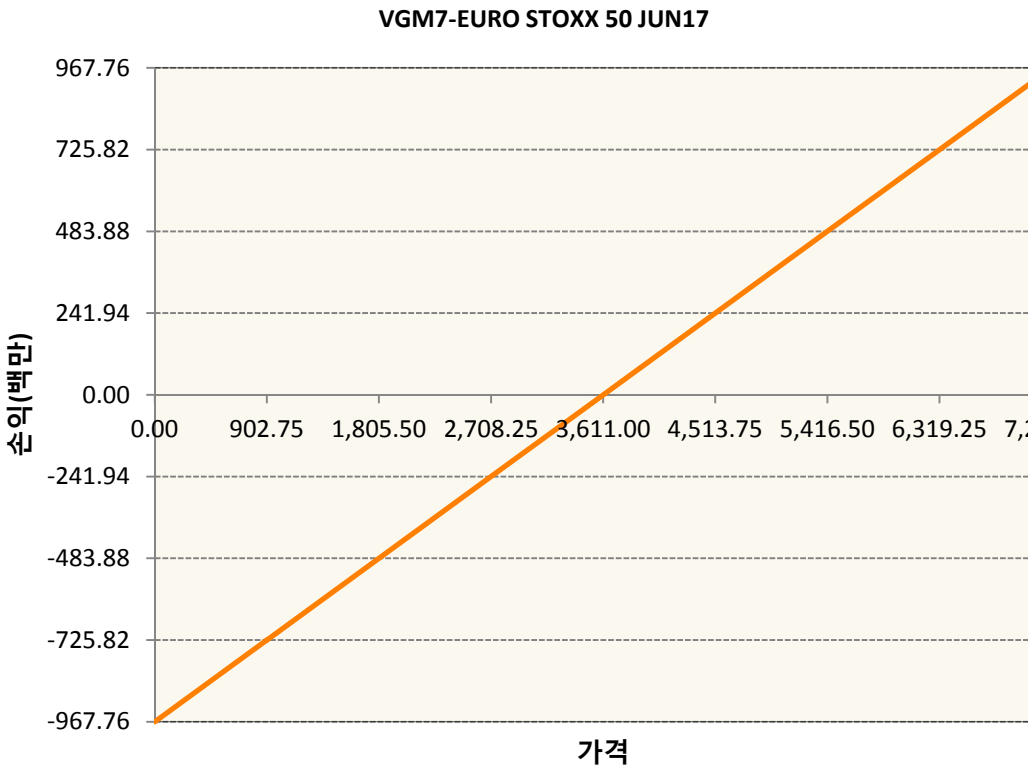
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	968	0	968	

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	2017-05-17
기준일	2017-05-16

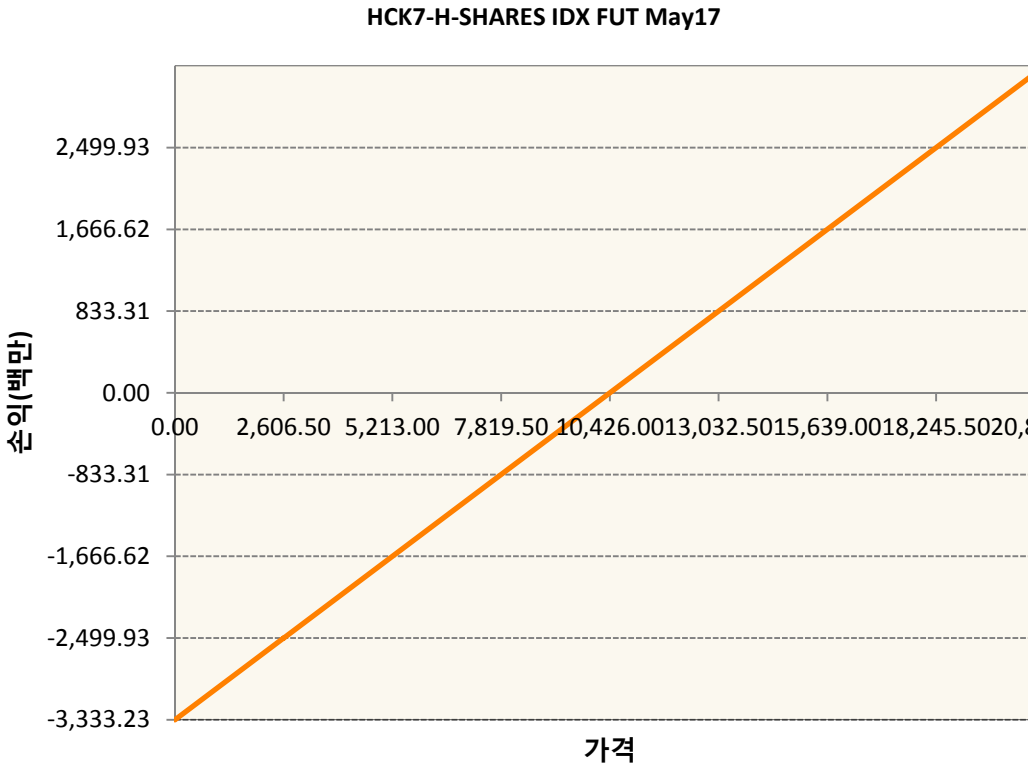
차이나인덱스모(주식-파생형)

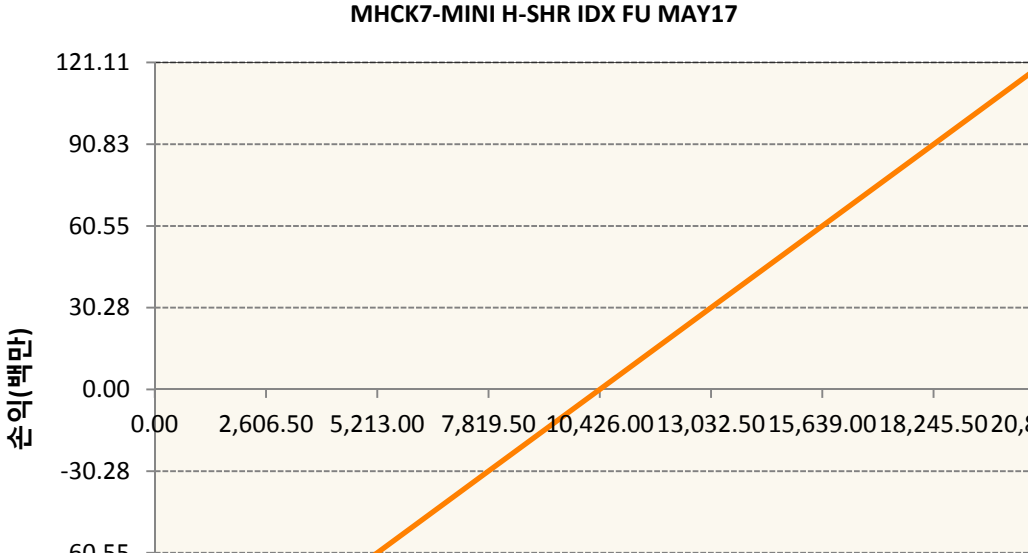
1. 계약금액

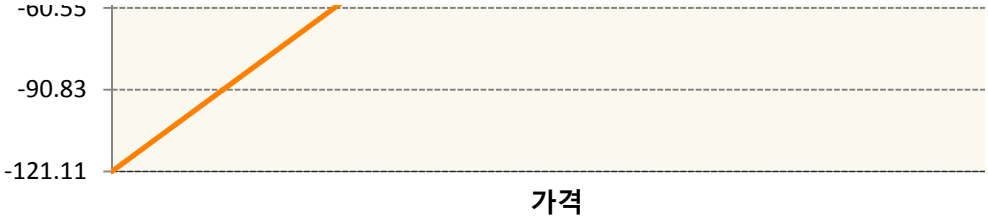
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,454	0	3,454	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	2017-05-17
기준일	2017-05-16

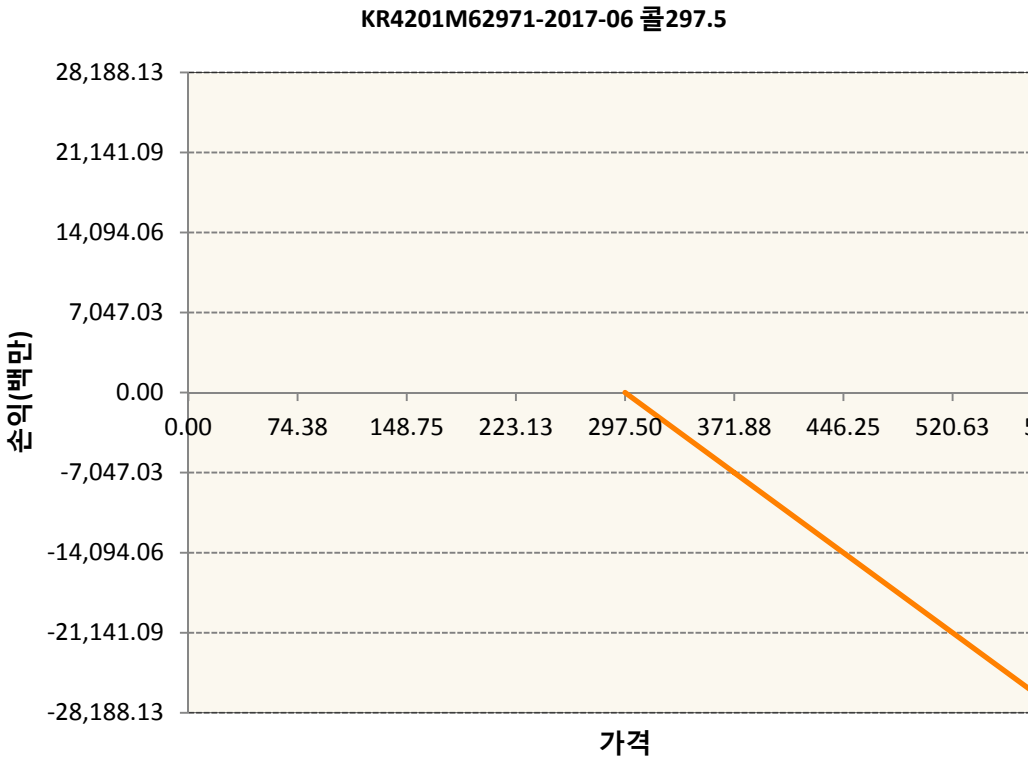
커버드콜모(주식혼합-파생형)

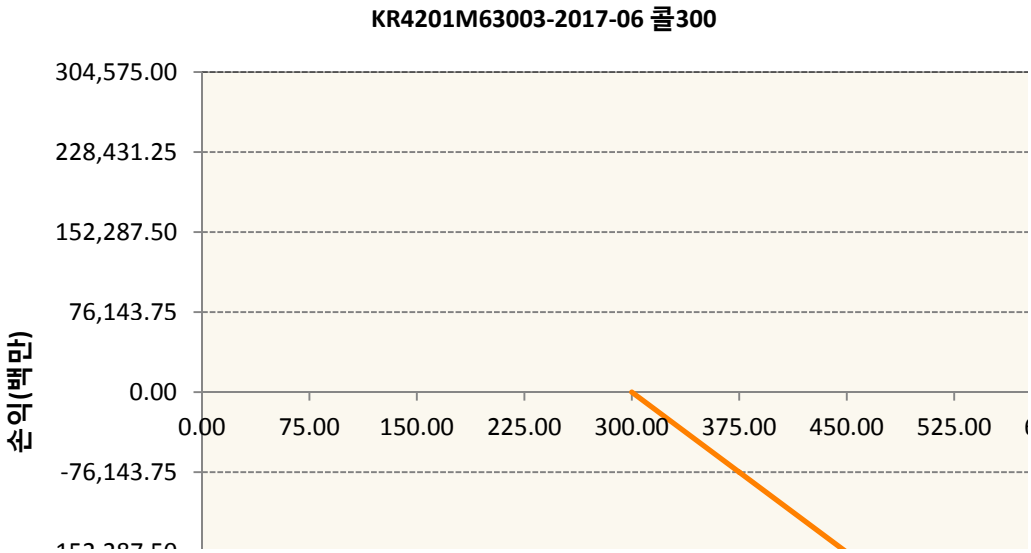
1. 계약금액

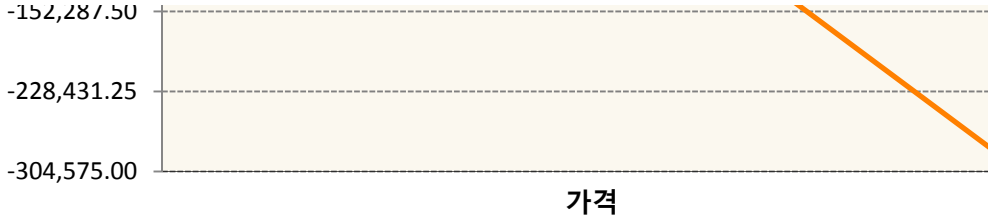
(단위:백만원)

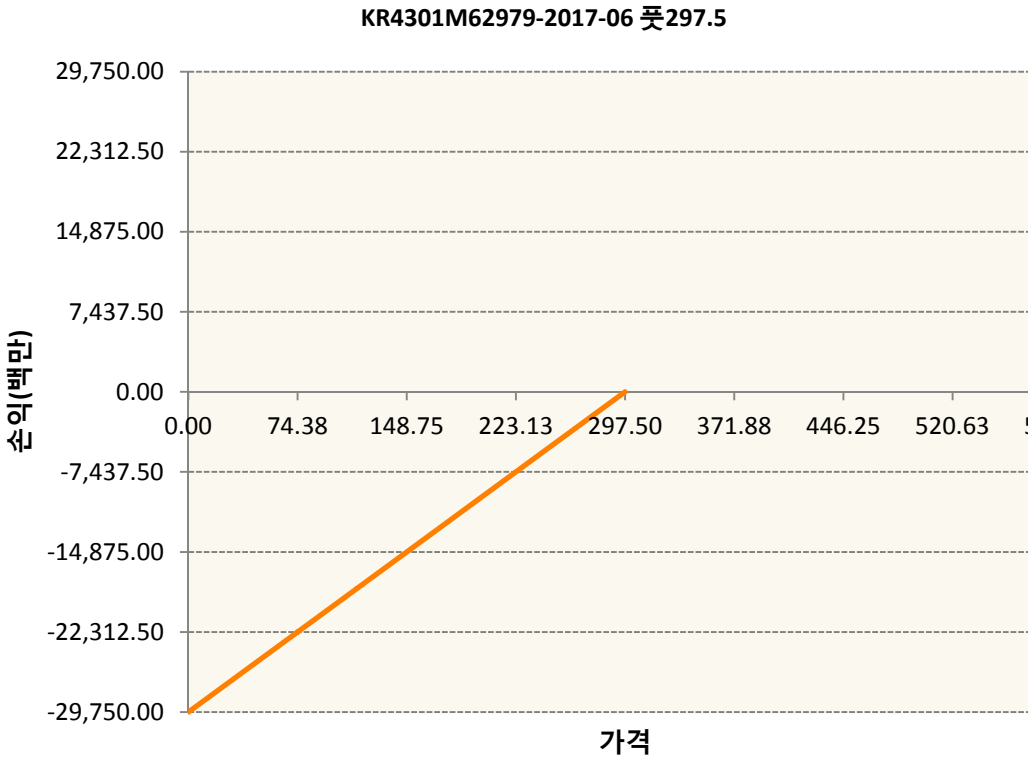
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	572,513	-572,513	장내

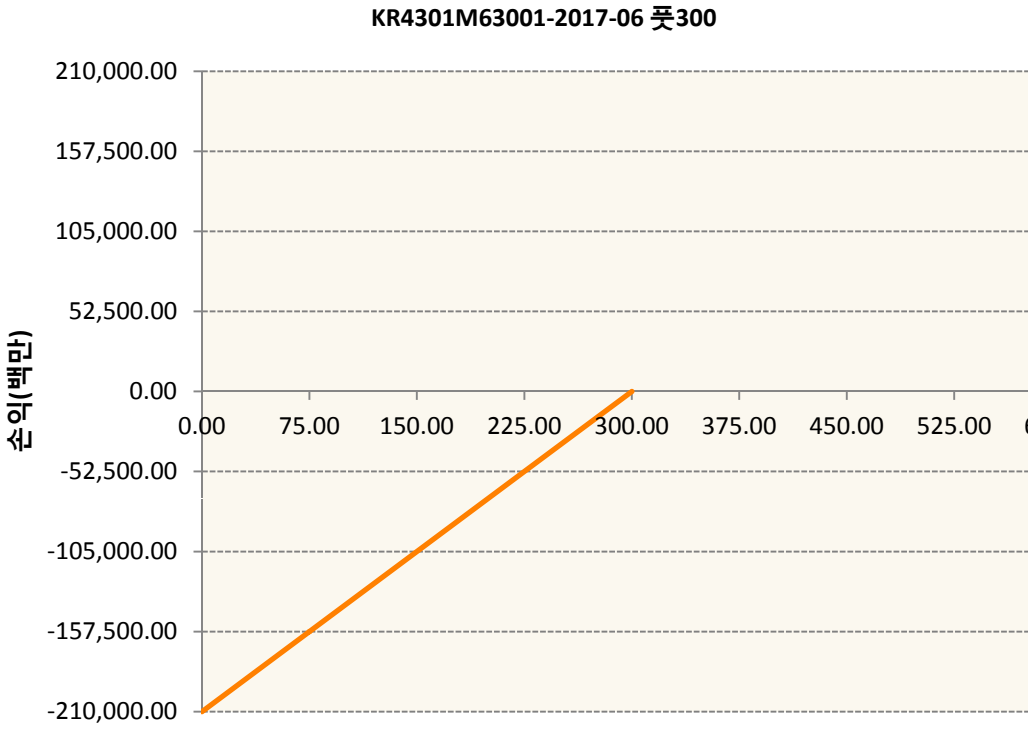
2. 만기시점의 손익구조






-152,287.50
-228,431.25
-304,575.00
가격


KR4301M62979-2017-06 풋297.5
29,750.00
22,312.50
14,875.00
7,437.50
0.00
-7,437.50
-14,875.00
-22,312.50
-29,750.00
0.00
74.38
148.75
223.13
297.50
371.88
446.25
520.63
손익(백만)
가격


KR4301M63001-2017-06 풋300
210,000.00
157,500.00
105,000.00
52,500.00
0.00
-52,500.00
-105,000.00
-157,500.00
-210,000.00
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						2,003
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	476	476	475	474	471	468	464
-5.33%	470	465	458	448	437	425	410
-2.67%	397	375	351	326	301	275	249
0%	89	59	30	0	-30	-60	-90
2.67%	-509	-523	-538	-556	-574	-595	-616
5.33%	-1,241	-1,243	-1,246	-1,252	-1,258	-1,267	-1,277
8.00%	-1,995	-1,995	-1,996	-1,997	-1,998	-2,000	-2,003
KR4201M63(	2017-06 콜300						20,341
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,762	3,761	3,757	3,749	3,735	3,713	3,682
-5.33%	3,736	3,706	3,660	3,597	3,515	3,417	3,301
-2.67%	3,316	3,139	2,941	2,726	2,497	2,257	2,006
0%	985	657	328	0	-328	-657	-985
2.67%	-4,567	-4,773	-4,999	-5,239	-5,492	-5,755	-6,026
5.33%	-12,133	-12,181	-12,249	-12,339	-12,448	-12,577	-12,723
8.00%	-20,188	-20,192	-20,202	-20,220	-20,248	-20,288	-20,341
KR4301M62(	2017-06 풋297.5						1,906
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,892	-1,892	-1,893	-1,895	-1,897	-1,901	-1,906
-5.33%	-1,100	-1,106	-1,114	-1,123	-1,135	-1,149	-1,164
-2.67%	-379	-403	-428	-454	-480	-508	-536
0%	94	63	31	0	-32	-63	-95
2.67%	261	247	230	212	192	171	148
5.33%	287	285	281	276	269	260	249
8.00%	289	289	289	288	286	284	280
KR4301M63(	2017-06 풋300						14,225
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,170	-14,171	-14,174	-14,179	-14,189	-14,204	-14,225
-5.33%	-8,600	-8,621	-8,653	-8,696	-8,752	-8,821	-8,900
-2.67%	-3,302	-3,424	-3,560	-3,709	-3,866	-4,032	-4,205
0%	679	453	226	0	-226	-453	-679
2.67%	2,439	2,297	2,142	1,976	1,802	1,620	1,433

5.33%	2,811	2,778	2,730	2,669	2,593	2,505	2,404
8.00%	2,845	2,842	2,835	2,823	2,804	2,776	2,739

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

43,752

공시일	2017-05-17
기준일	2017-05-16

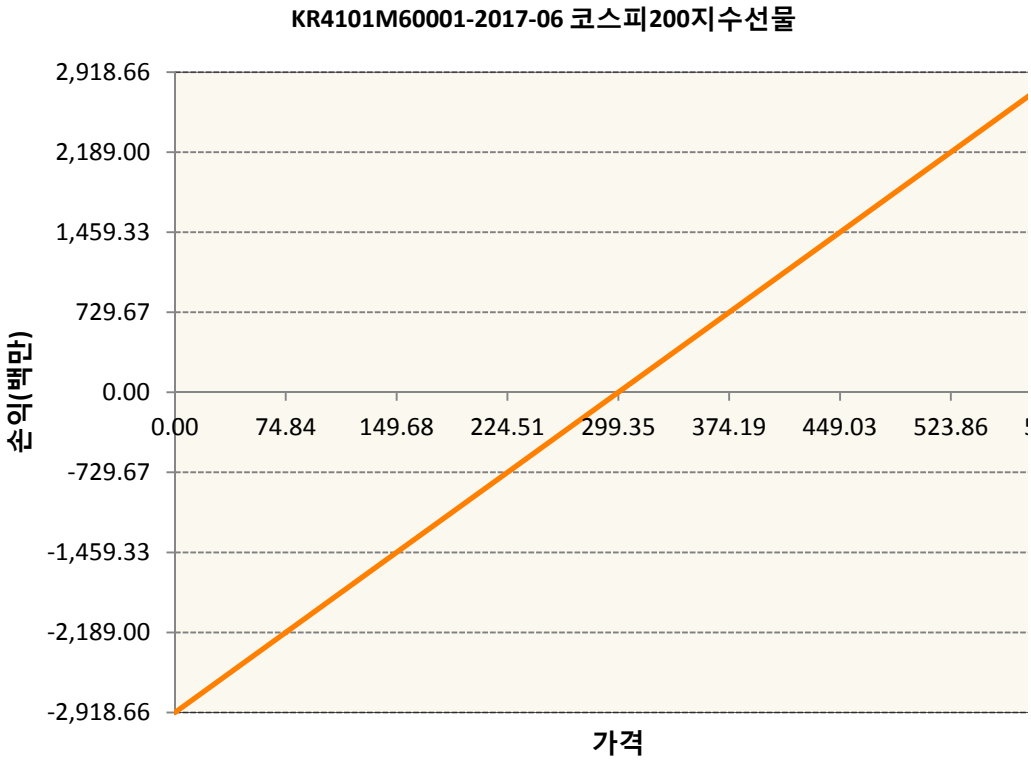
커버드콜목표전환형증권투자신탁

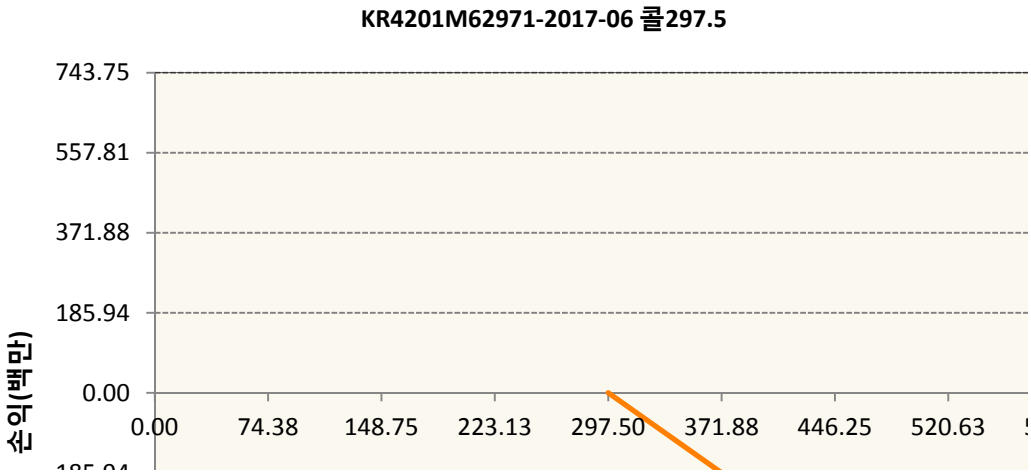
1. 계약금액

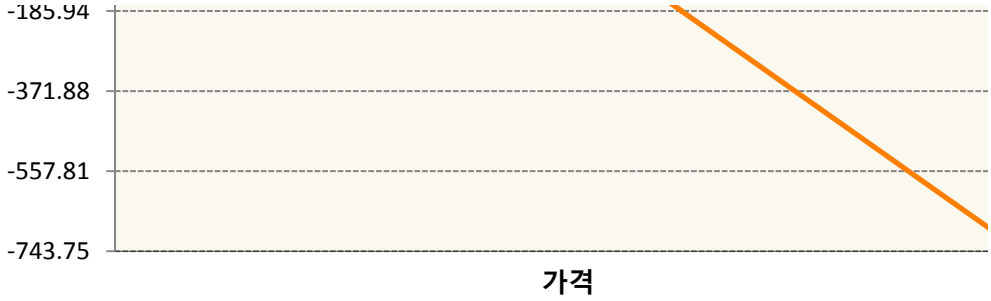
(단위:백만원)

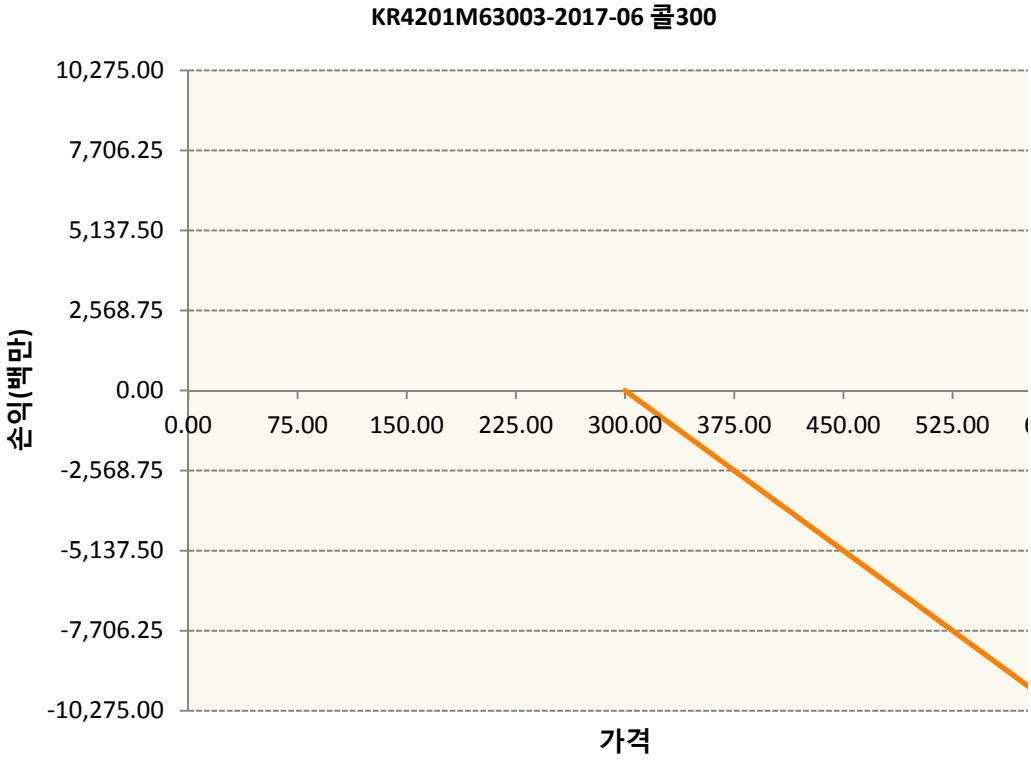
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,919	0	2,919	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,889	-12,889	장내

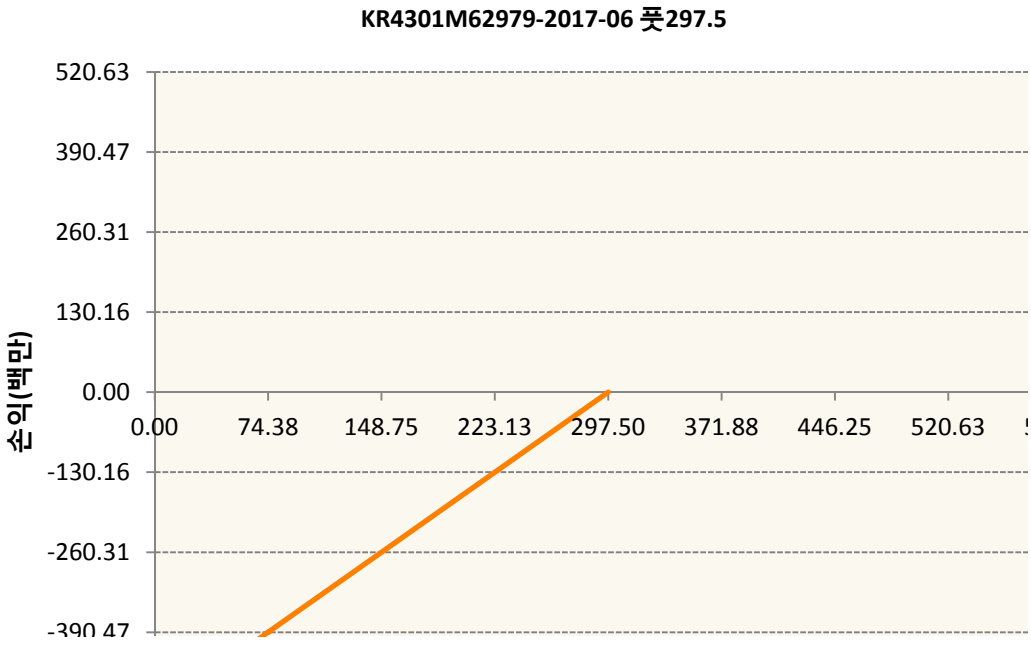
2. 만기시점의 손익구조



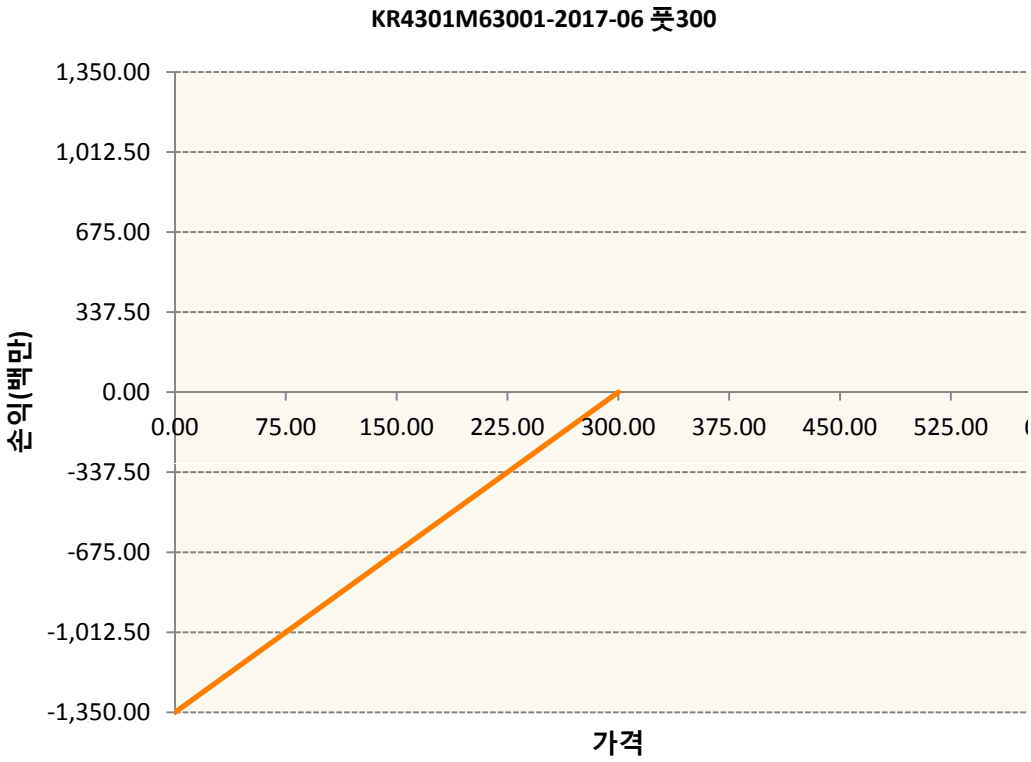



-185.94
-371.88
-557.81
-743.75
가격


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							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							53
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13	13	13	13	12	12	12
-5.33%	12	12	12	12	12	11	11
-2.67%	10	10	9	9	8	7	7

0%	2	2	1	0	-1	-2	-2
2.67%	-13	-14	-14	-15	-15	-16	-16
5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-34
8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
	KR4201M63(	2017-06 콜300					686
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	127	127	127	126	126	125	124
-5.33%	126	125	123	121	119	115	111
-2.67%	112	106	99	92	84	76	68
0%	33	22	11	0	-11	-22	-33
2.67%	-154	-161	-169	-177	-185	-194	-203
5.33%	-409	-411	-413	-416	-420	-424	-429
8.00%	-681	-681	-682	-682	-683	-684	-686
	KR4301M62(	2017-06 풋297.5					33
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-5.33%	-19	-19	-19	-20	-20	-20	-20
-2.67%	-7	-7	-7	-8	-8	-9	-9
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	5	4	4	4	3	3	3
5.33%	5	5	5	5	5	5	4
8.00%	5	5	5	5	5	5	5
	KR4301M63(	2017-06 풋300					91
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
-5.33%	-55	-55	-56	-56	-56	-57	-57
-2.67%	-21	-22	-23	-24	-25	-26	-27
0%	4	3	1	0	-1	-3	-4
2.67%	16	15	14	13	12	10	9
5.33%	18	18	18	17	17	16	15
8.00%	18	18	18	18	18	18	18

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

1,137

공시일	2017-05-17
기준일	2017-05-16

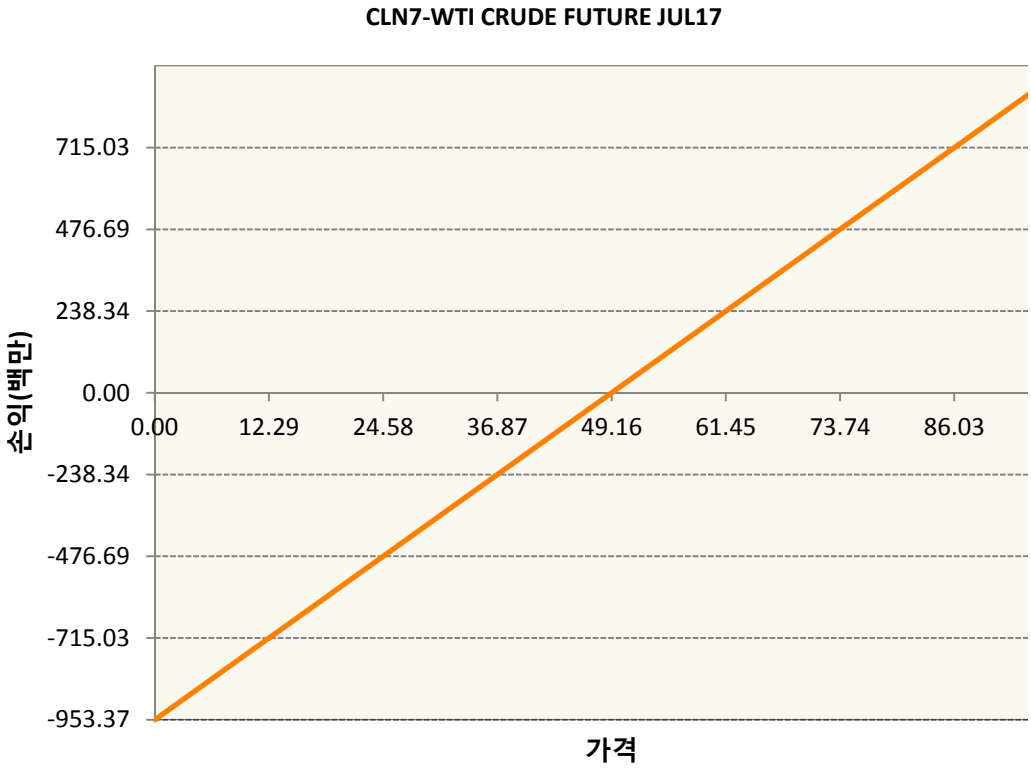
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

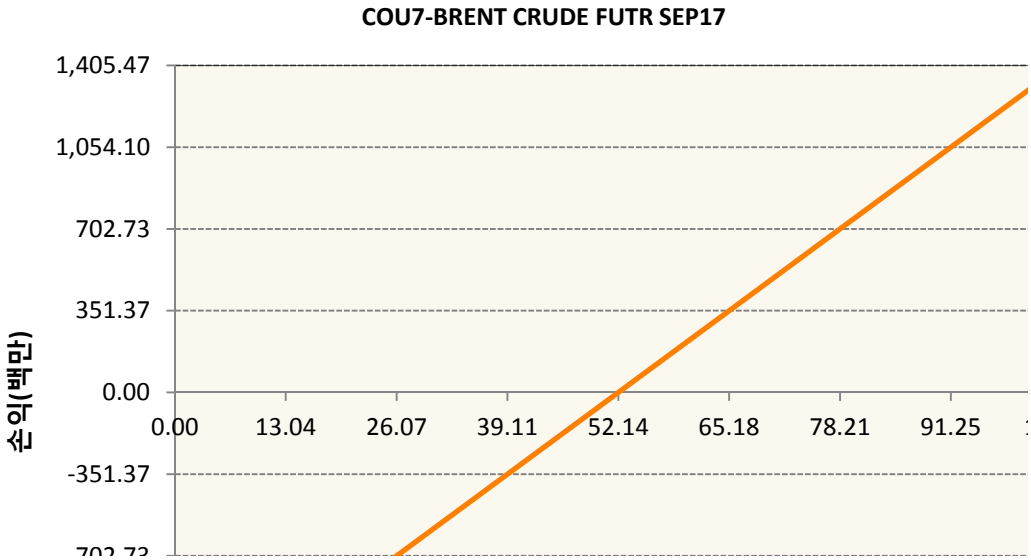
1. 계약금액

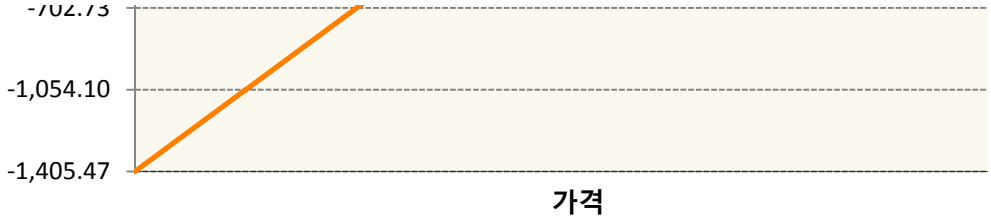
(단위:백만원)

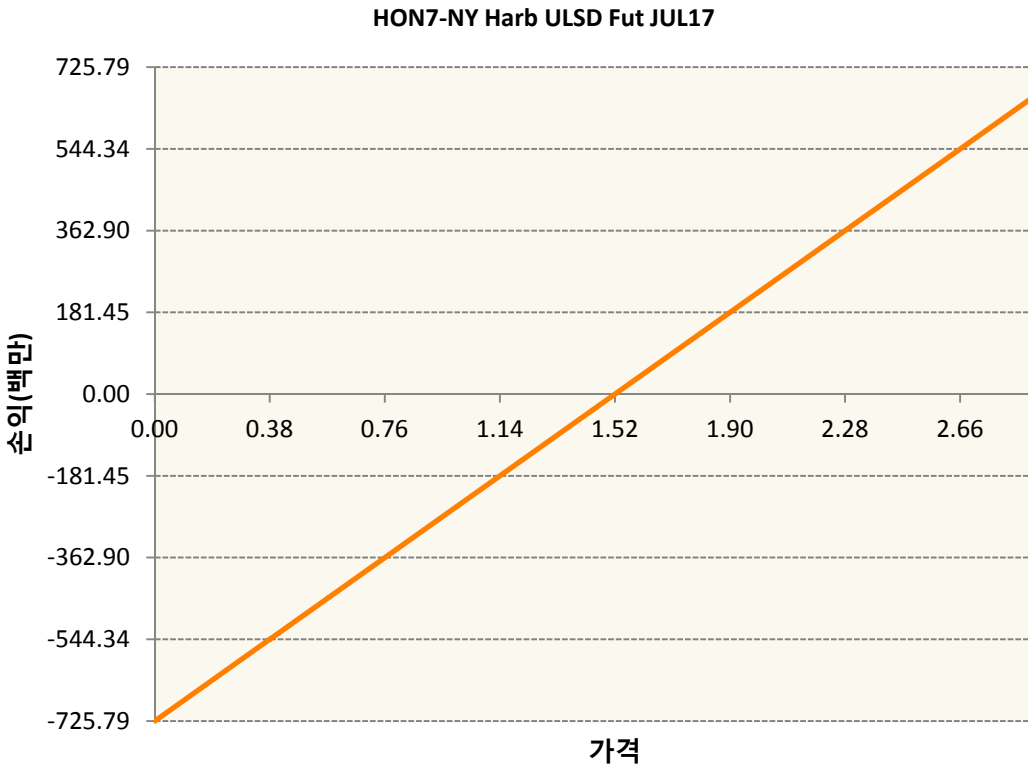
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,374	223	5,151	

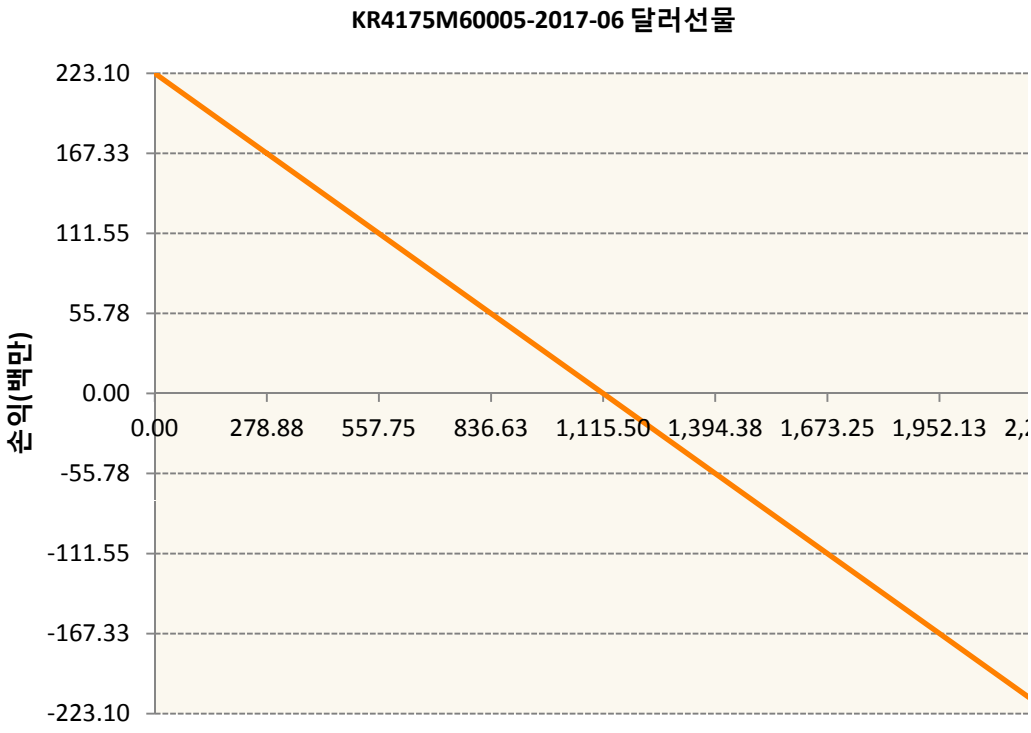
2. 만기시점의 손익구조



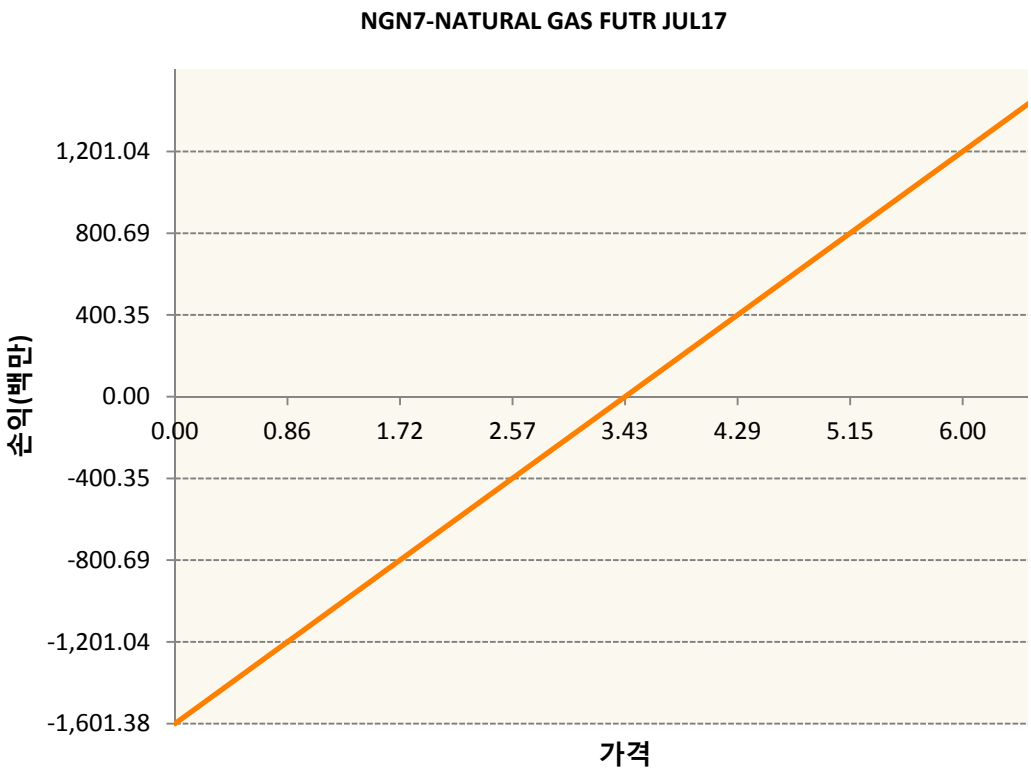


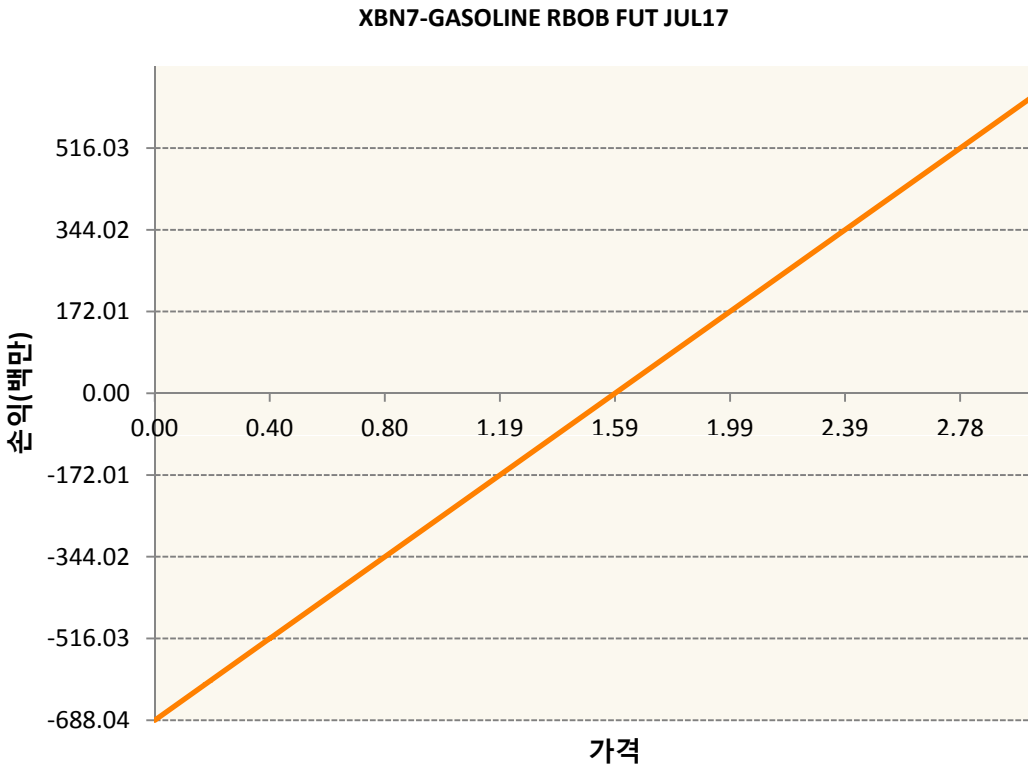

-1,054.10
-1,405.47
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
725.79
544.34
362.90
181.45
0.00
-181.45
-362.90
-544.34
-725.79
0.00
0.38
0.76
1.14
1.52
1.90
2.28
2.66
순이익(백만)
가격


KR4175M60005-2017-06 달러선물
223.10
167.33
111.55
55.78
0.00
-55.78
-111.55
-167.33
-223.10
0.00
278.88
557.75
836.63
1,115.50
1,394.38
1,673.25
1,952.13
순이익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,201.04
800.69
400.35
0.00
-400.35
-800.69
-1,201.04
-1,601.38
0.00
0.86
1.72
2.57
3.43
4.29
5.15
6.00
순익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
516.03
344.02
172.01
0.00
-172.01
-344.02
-516.03
-688.04
0.00
0.40
0.80
1.19
1.59
1.99
2.39
2.78
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN7	WTI CRUDE FUTURE JUL17	76
COU7	BRENT CRUDE FUTR SEP17	112
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	58
KR4175M60(	2017-06 달러선물	18
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	128
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	55

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

921

공시일	2017-05-17
기준일	2017-05-16

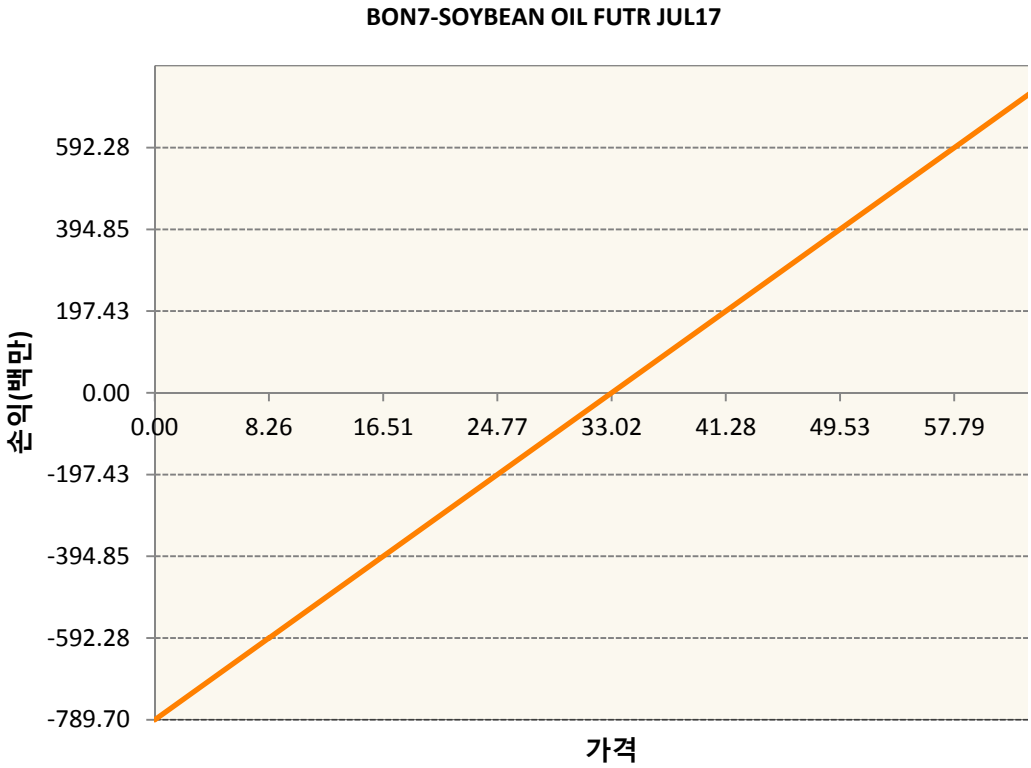
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

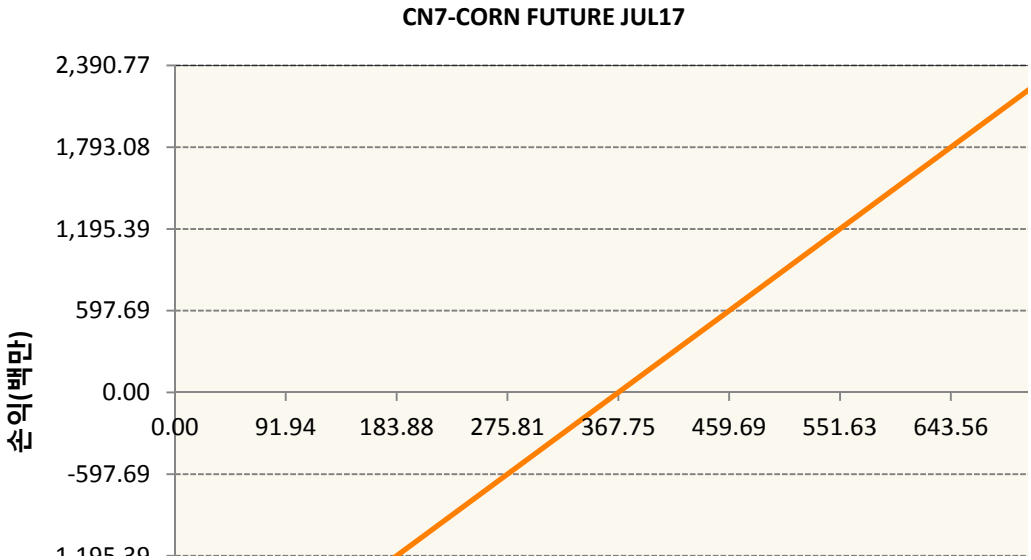
1. 계약금액

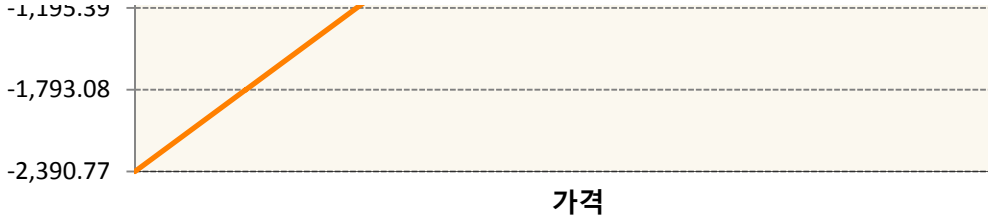
(단위:백만원)

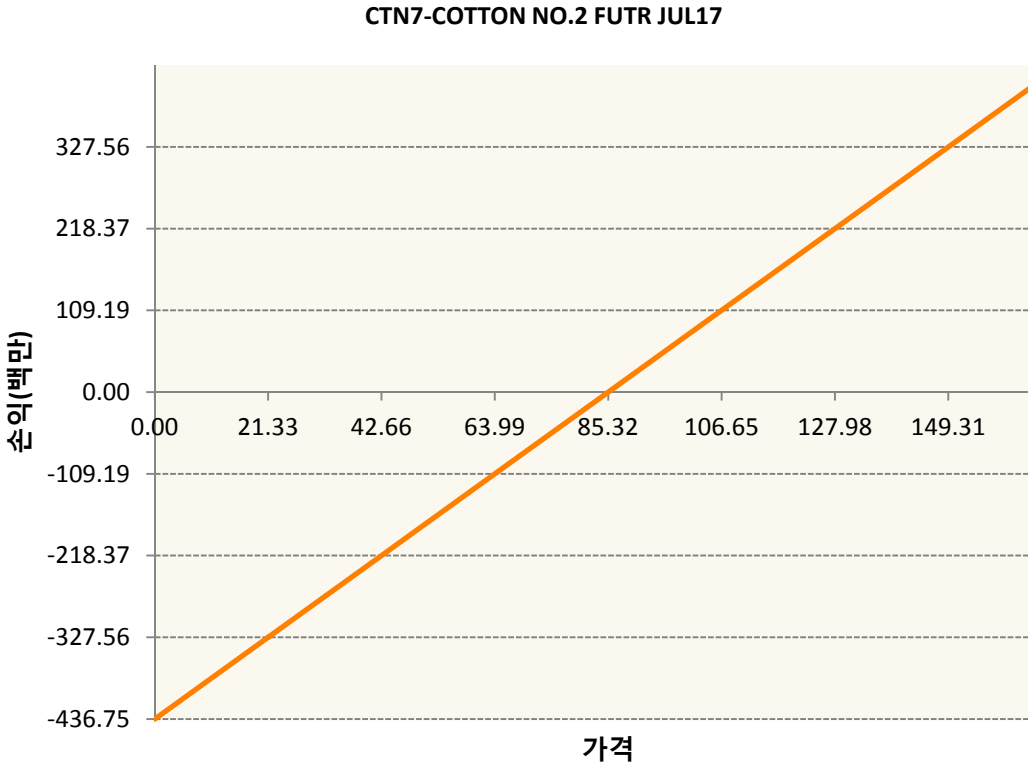
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,888	390	8,498	

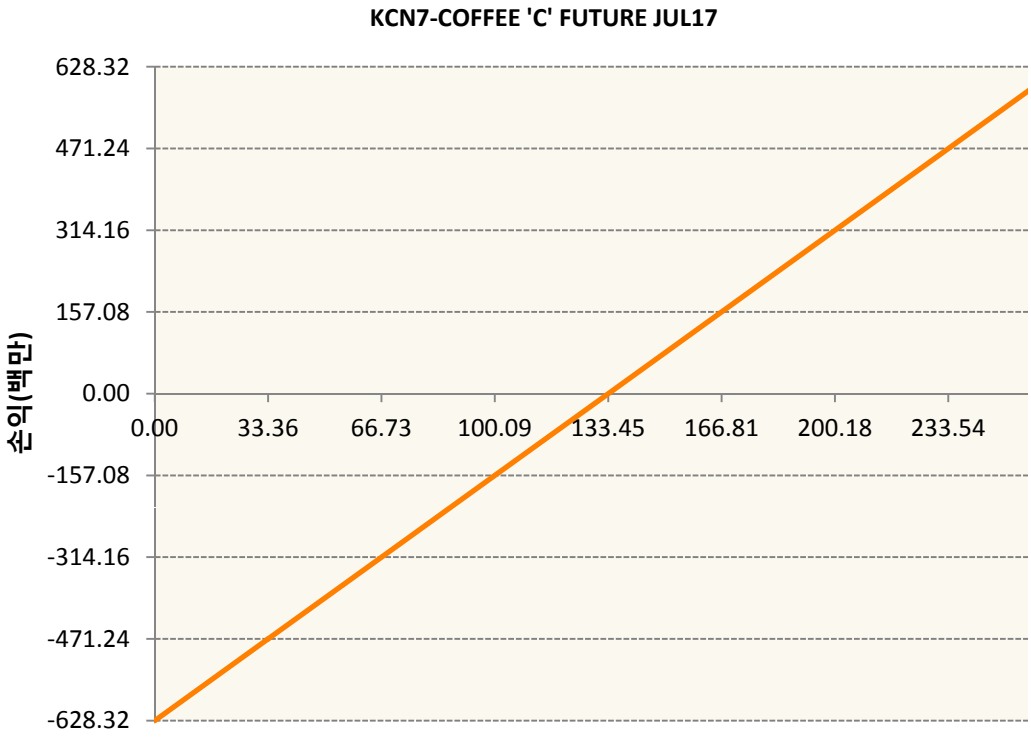
2. 만기시점의 손익구조





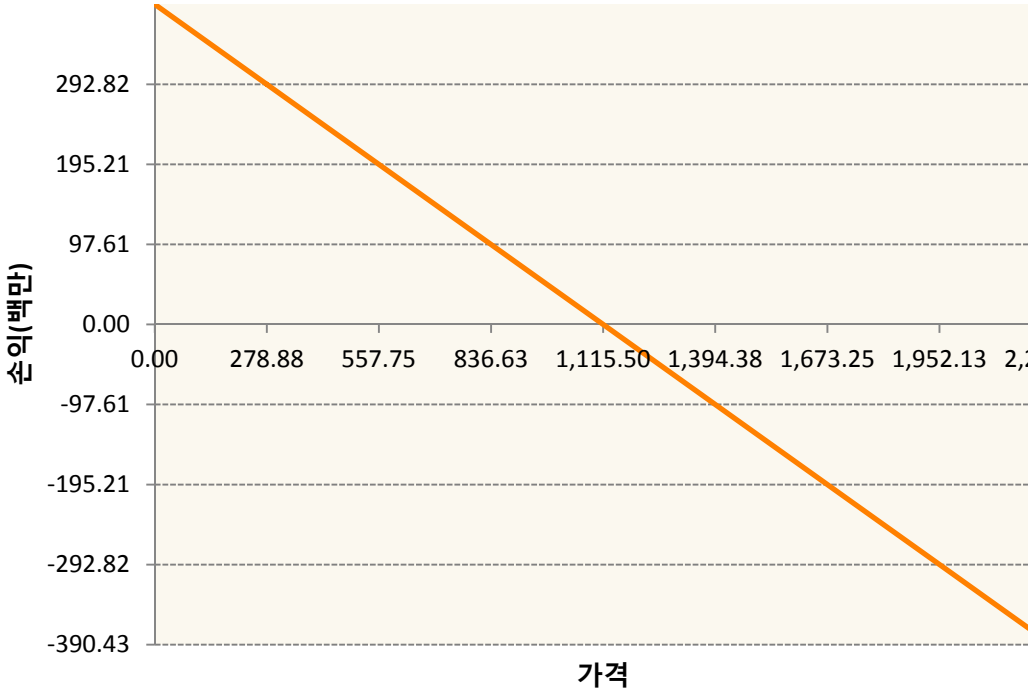

-1,793.08
-2,390.77
가격


CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
327.56
218.37
109.19
0.00
-109.19
-218.37
-327.56
-436.75
0.00
21.33
42.66
63.99
85.32
106.65
127.98
149.31
순익(백만)
가격

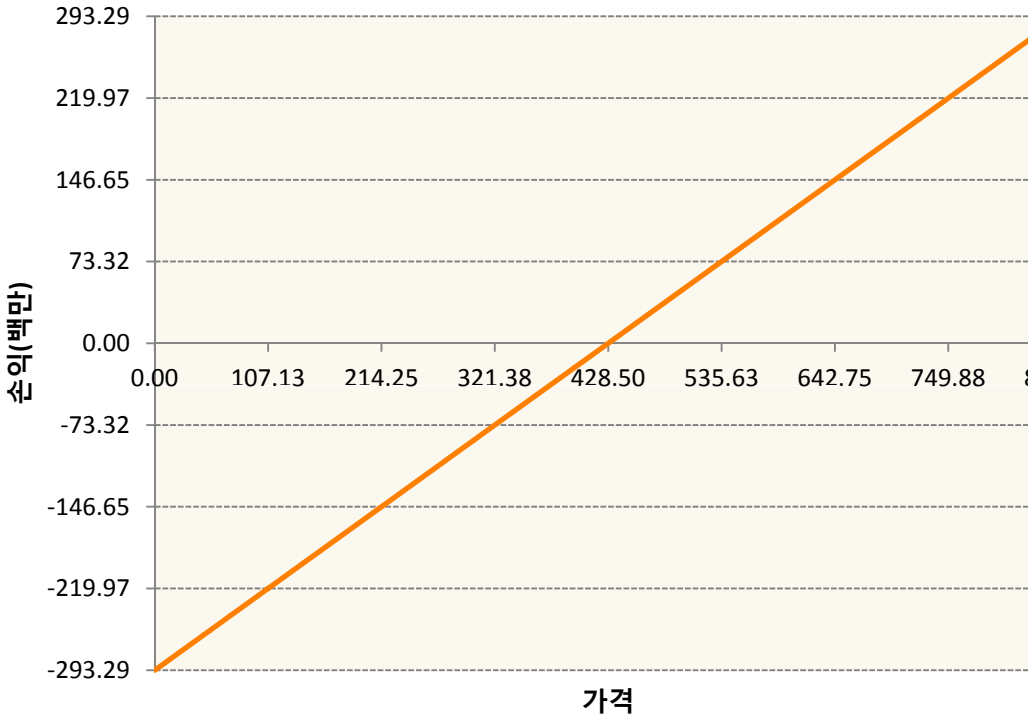

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
628.32
471.24
314.16
157.08
0.00
-157.08
-314.16
-471.24
-628.32
0.00
33.36
66.73
100.09
133.45
166.81
200.18
233.54
순익(백만)

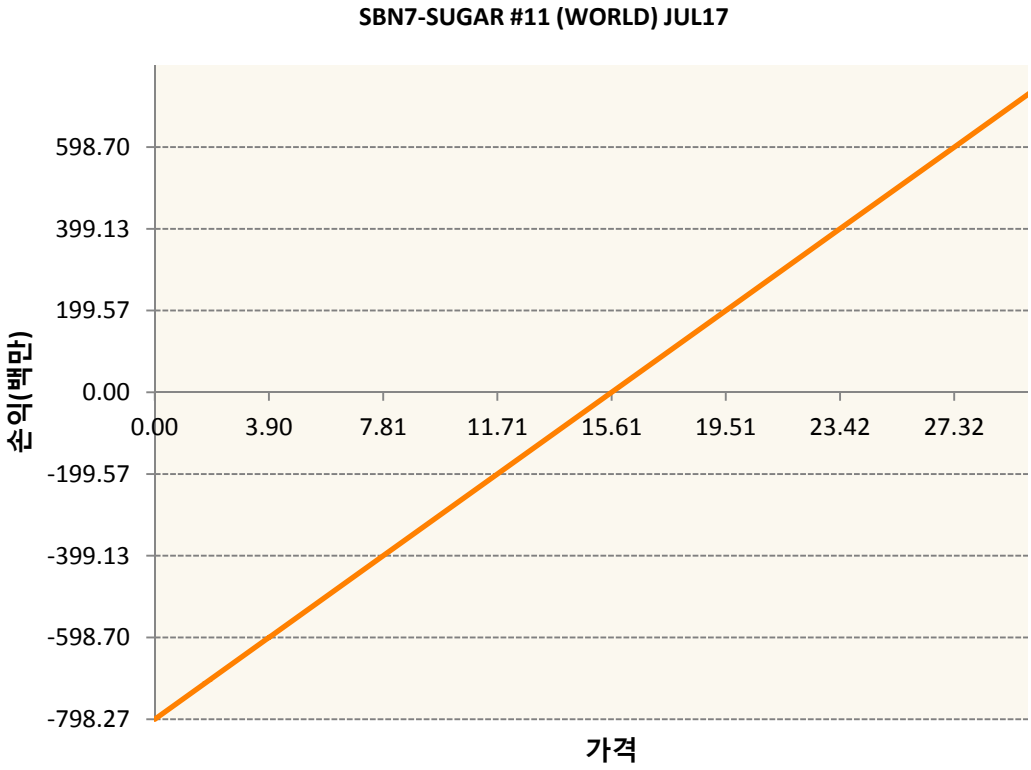
가격

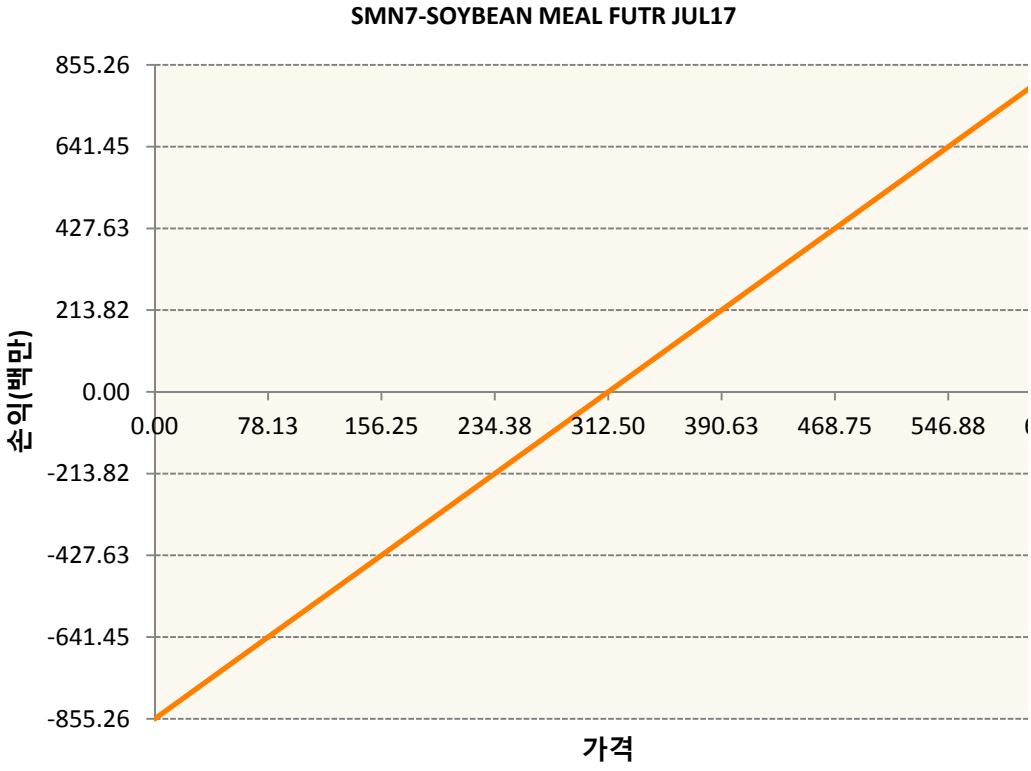
KR4175M60005-2017-06 달러선물

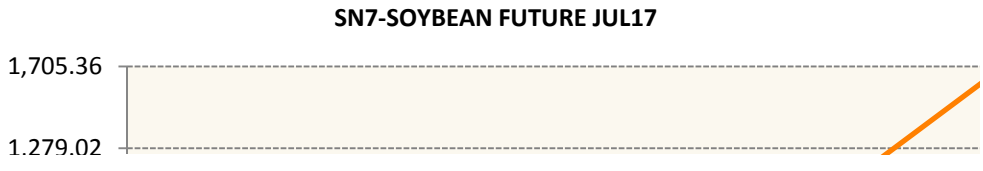


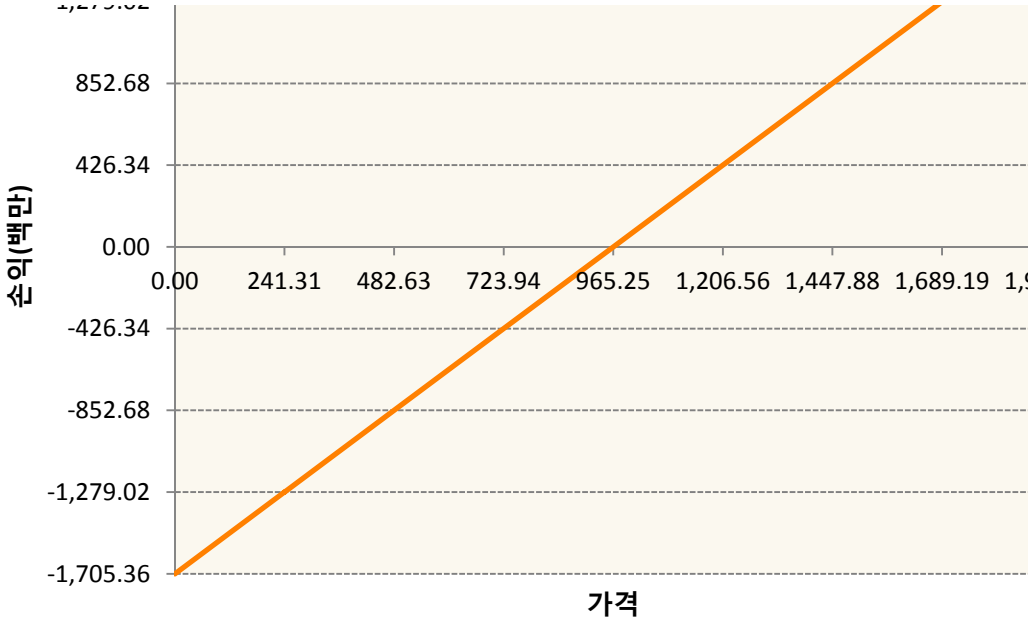
KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17

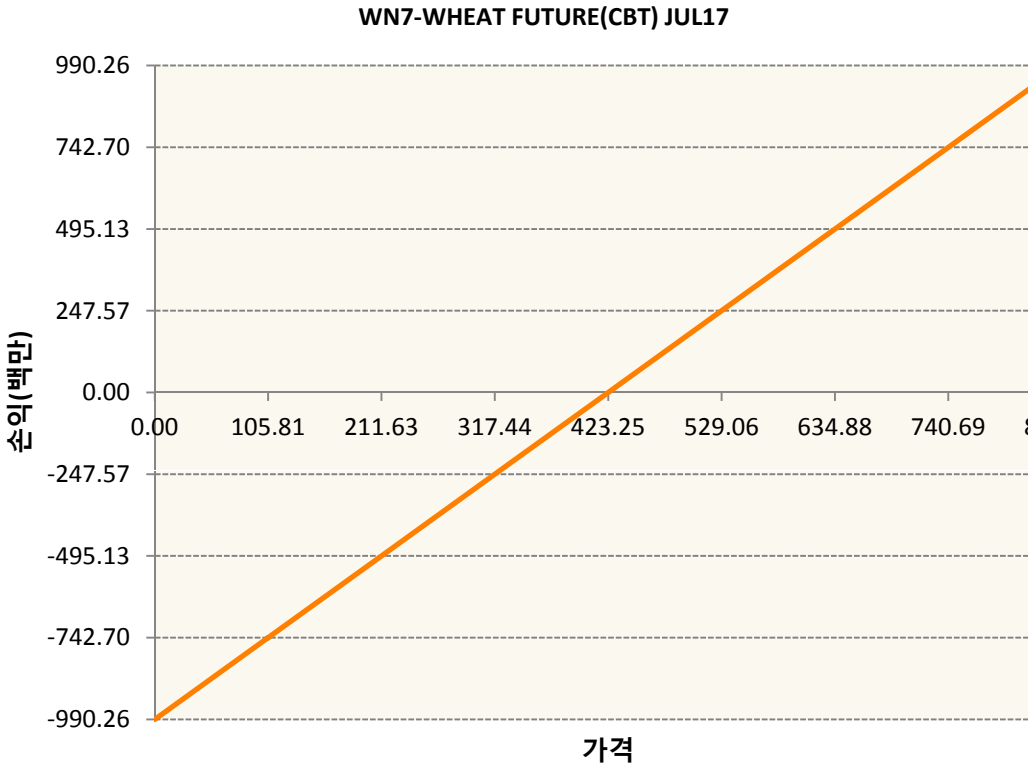



SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
598.70
399.13
199.57
0.00
-199.57
-399.13
-598.70
-798.27
손익(백만)
0.00
3.90
7.81
11.71
15.61
19.51
23.42
27.32
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
855.26
641.45
427.63
213.82
0.00
-213.82
-427.63
-641.45
-855.26
손익(백만)
0.00
78.13
156.25
234.38
312.50
390.63
468.75
546.88
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,705.36
1,279.02





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	63
CN7	CORN FUTURE JUL17	191
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	35
KCN7	COFFEE 'C' FUTURE JUL17	50
KR4175M60(	2017-06 달러선물	31

KWN7	KC HRW WHEAT FUT JUL17	23
SBN7	SUGAR #11 (WORLD) JUL17	64
SMN7	SOYBEAN MEAL FUTR JUL17	68
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	136
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	79

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

806