공시일	2017-05-18
기준일	2017-05-17

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	2017-05-18
기준일	2017-05-17

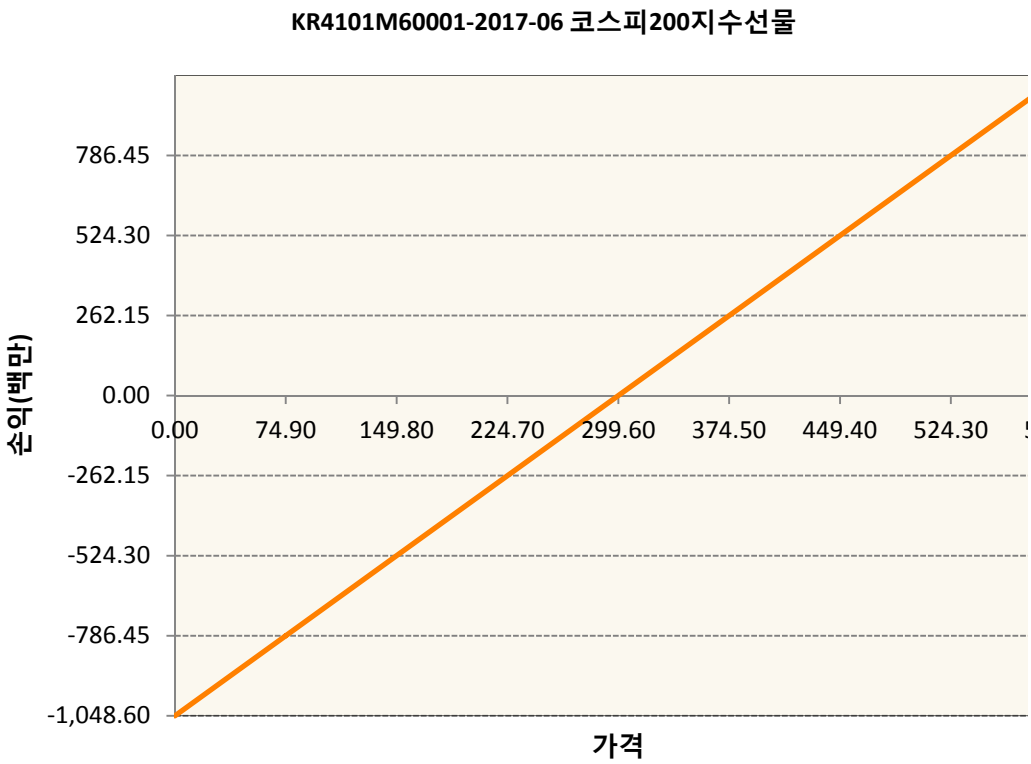
스마트인덱스모

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	2017-05-18
기준일	2017-05-17

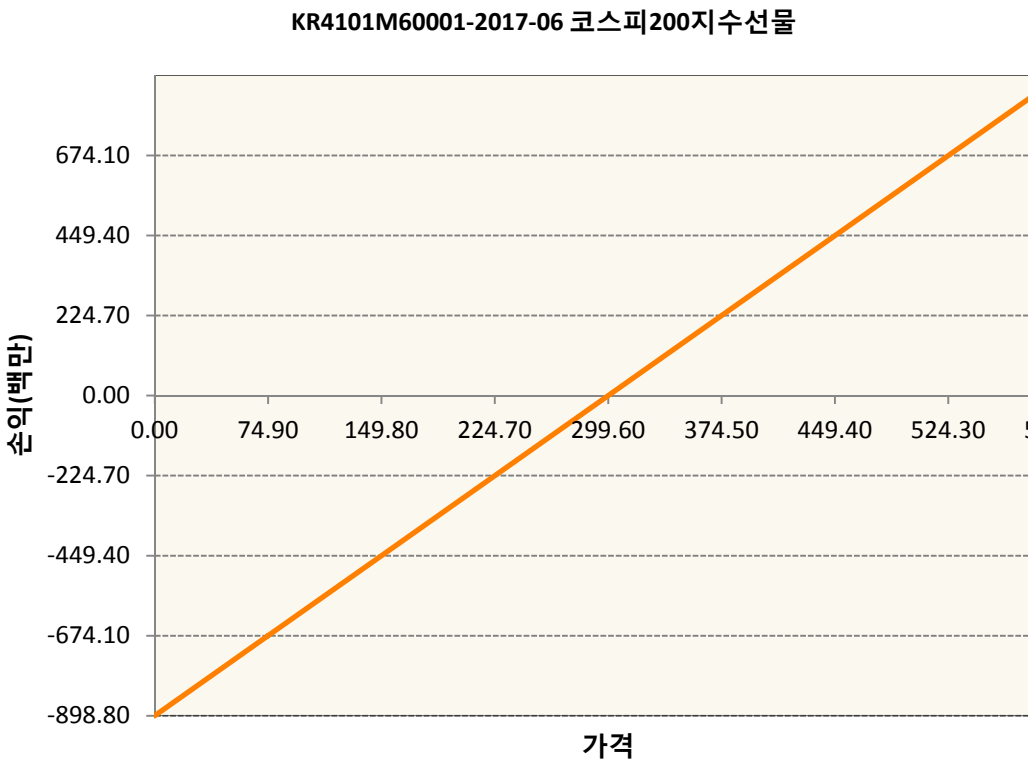
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	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)

47

공시일	2017-05-18
기준일	2017-05-17

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	989

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

552

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-05-18
기준일	2017-05-17

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)

346

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-05-18
기준일	2017-05-17

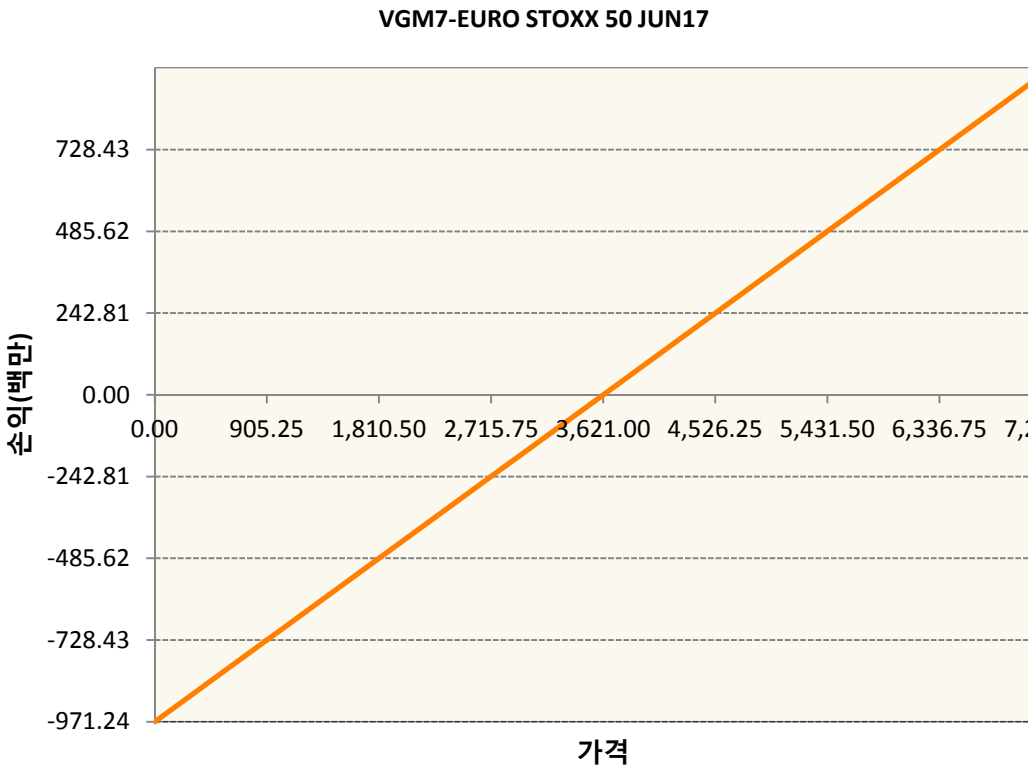
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	971	0	971	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM7	EURO STOXX 50 JUN17	78

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

(단위:백만원)

76

공시일	2017-05-18
기준일	2017-05-17

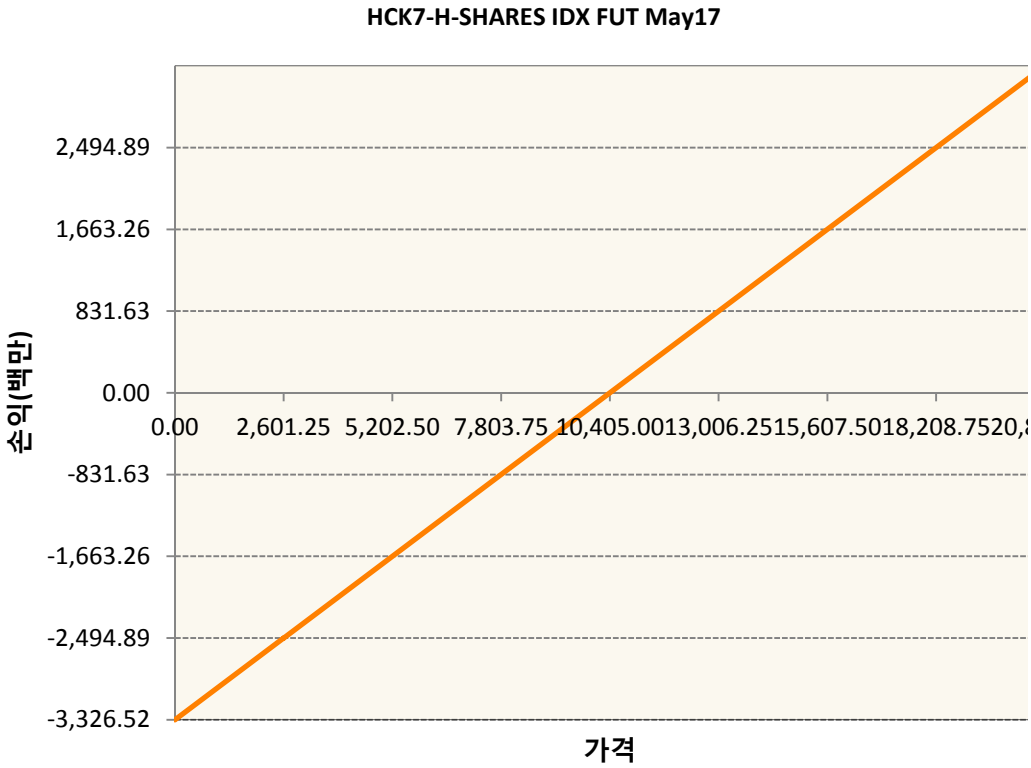
차이나인덱스모(주식-파생형)

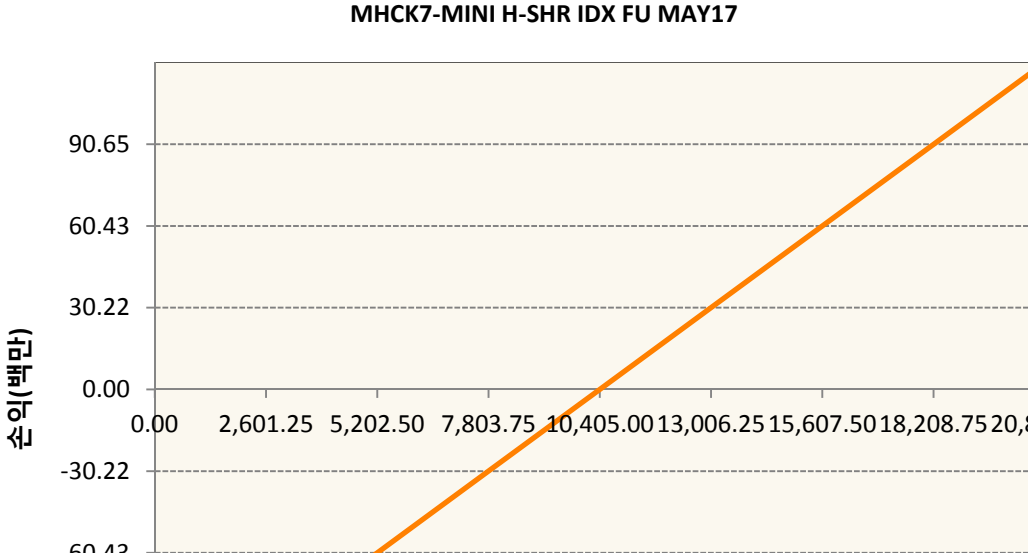
1. 계약금액

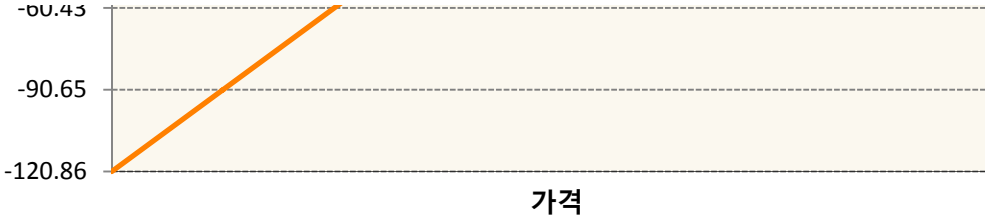
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,447	0	3,447	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCK7	H-SHARES IDX FUT May17	266
MHCK7	MINI H-SHR IDX FU MAY17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	291

공시일	2017-05-18
기준일	2017-05-17

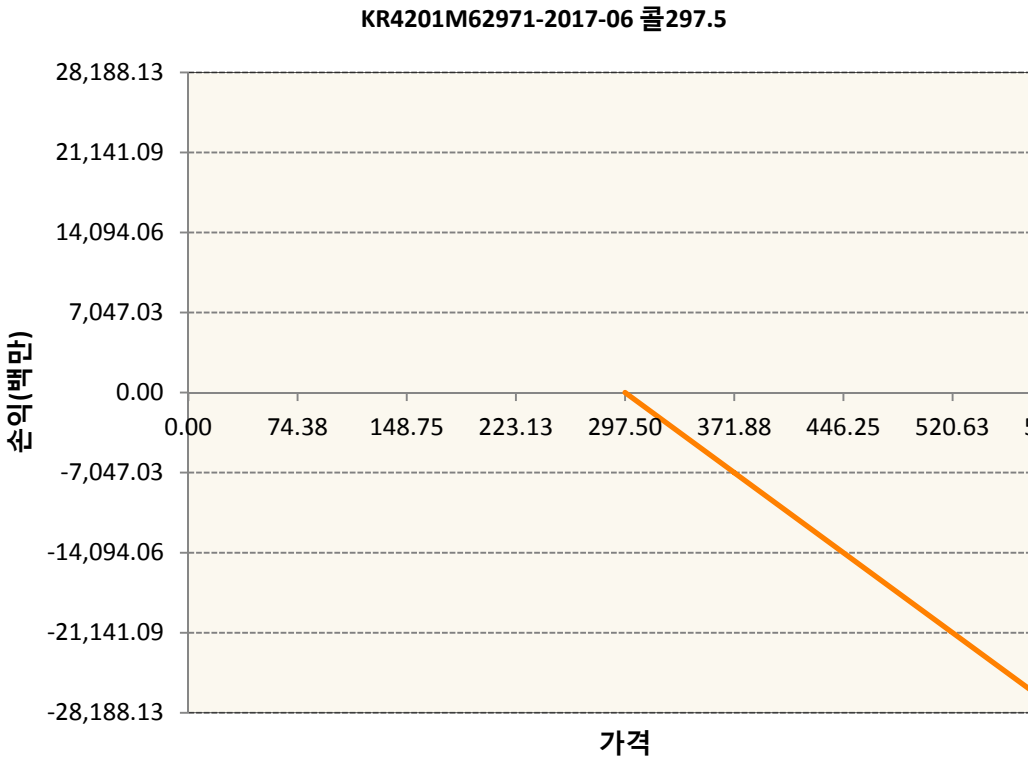
커버드콜모(주식혼합-파생형)

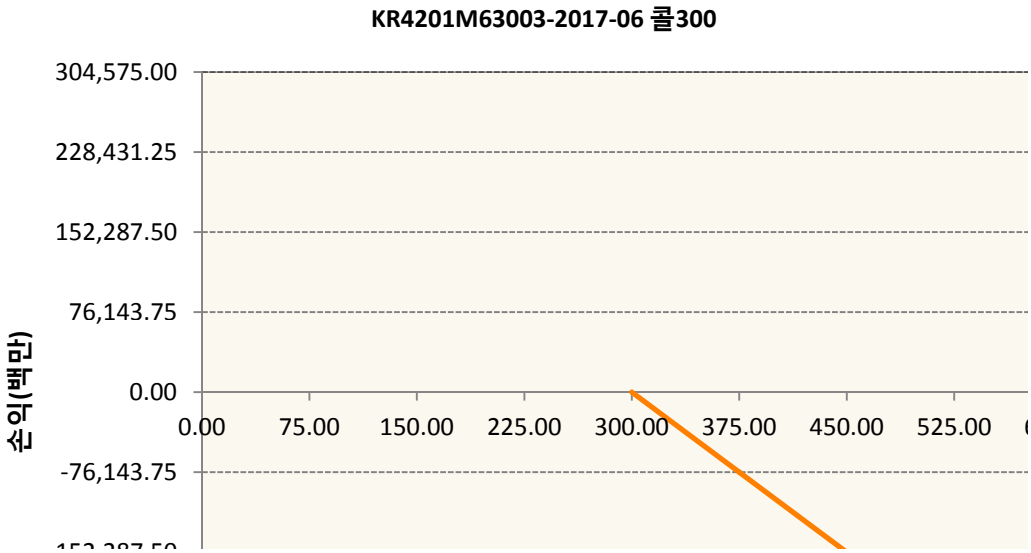
1. 계약금액

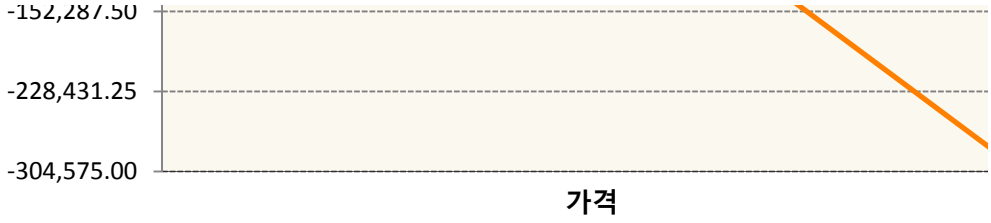
(단위:백만원)

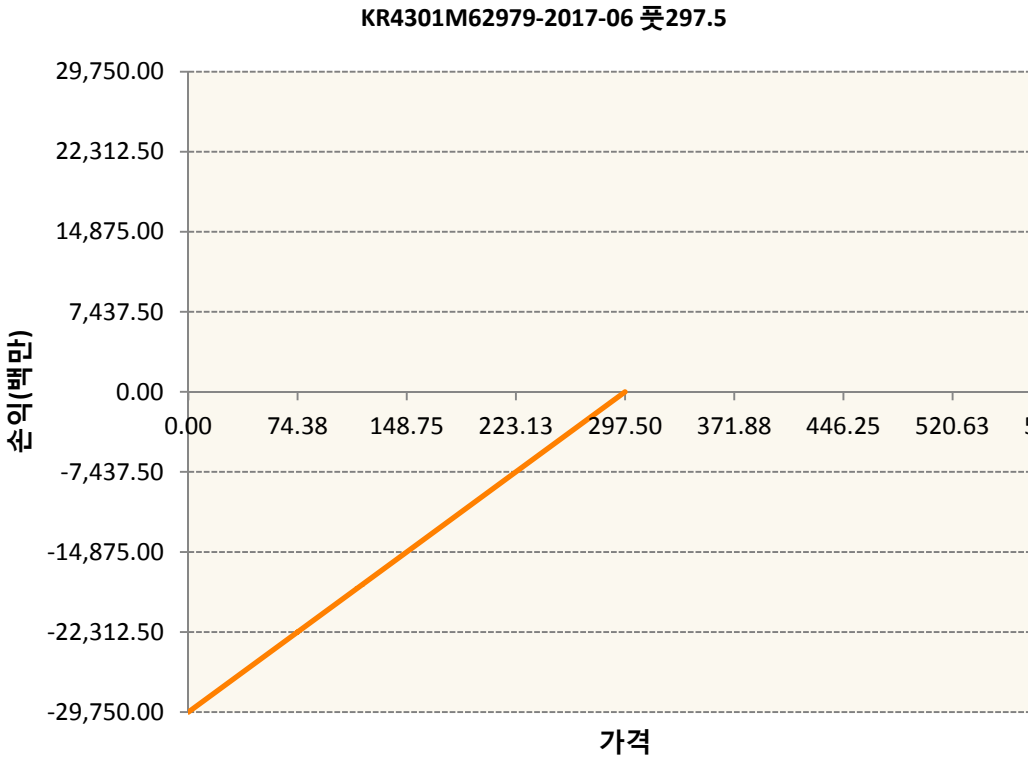
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	572,513	-572,513	장내

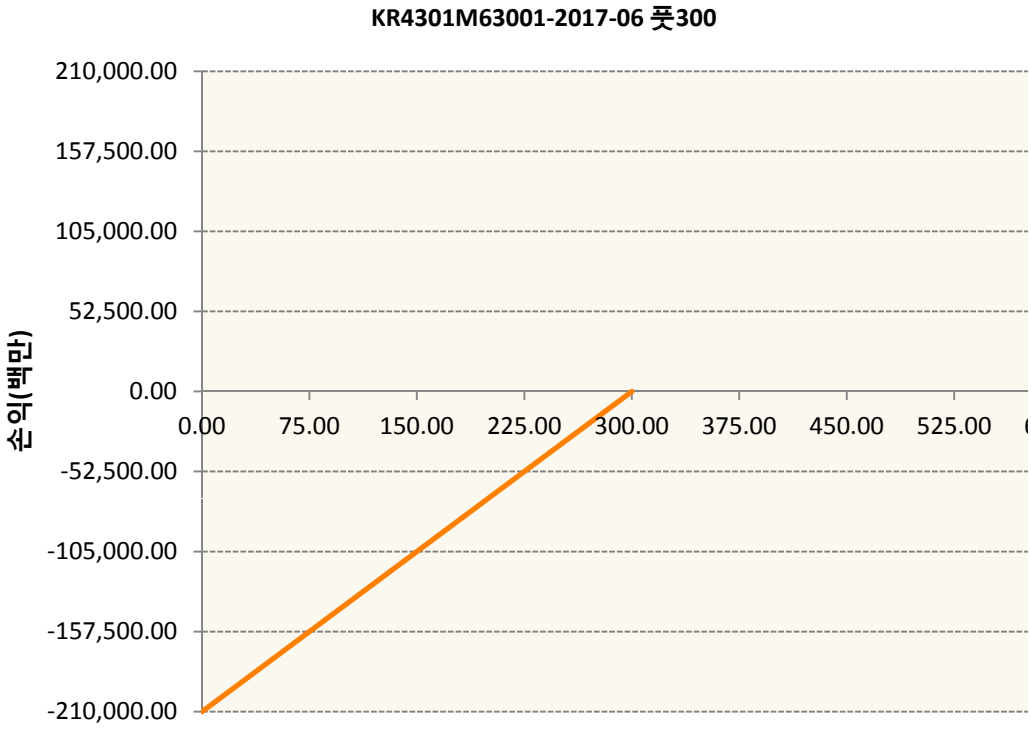
2. 만기시점의 손익구조






-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						2,001
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	444	444	443	442	441	438	435
-5.33%	440	436	430	422	413	402	390
-2.67%	378	358	336	314	290	266	241
0%	86	57	29	0	-29	-58	-87
2.67%	-508	-521	-536	-552	-570	-590	-610
5.33%	-1,240	-1,242	-1,245	-1,249	-1,256	-1,263	-1,273
8.00%	-1,994	-1,994	-1,994	-1,995	-1,996	-1,998	-2,001
KR4201M63(	2017-06 콜300						20,274
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,446	3,445	3,443	3,438	3,429	3,413	3,390
-5.33%	3,430	3,408	3,374	3,324	3,258	3,176	3,079
-2.67%	3,093	2,939	2,764	2,572	2,365	2,145	1,915
0%	943	629	315	0	-315	-630	-944
2.67%	-4,522	-4,721	-4,938	-5,170	-5,413	-5,666	-5,927
5.33%	-12,090	-12,134	-12,196	-12,277	-12,378	-12,497	-12,634
8.00%	-20,143	-20,147	-20,155	-20,170	-20,193	-20,227	-20,274
KR4301M62(	2017-06 풋297.5						1,934
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,924	-1,924	-1,924	-1,926	-1,927	-1,930	-1,934
-5.33%	-1,131	-1,135	-1,141	-1,149	-1,159	-1,170	-1,184
-2.67%	-398	-420	-443	-466	-491	-517	-543
0%	91	61	30	0	-30	-61	-91
2.67%	261	248	232	215	196	175	153
5.33%	286	284	281	276	270	262	252
8.00%	288	288	287	287	286	284	281
KR4301M63(	2017-06 풋300						14,409
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,370	-14,371	-14,373	-14,376	-14,383	-14,393	-14,409
-5.33%	-8,800	-8,814	-8,838	-8,873	-8,918	-8,974	-9,042
-2.67%	-3,450	-3,556	-3,676	-3,809	-3,952	-4,103	-4,262
0%	650	434	217	0	-217	-434	-651
2.67%	2,464	2,327	2,177	2,018	1,850	1,675	1,495

5.33%	2,828	2,798	2,756	2,699	2,630	2,548	2,454
8.00%	2,858	2,856	2,850	2,840	2,824	2,800	2,768

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

44,331

공시일	2017-05-18
기준일	2017-05-17

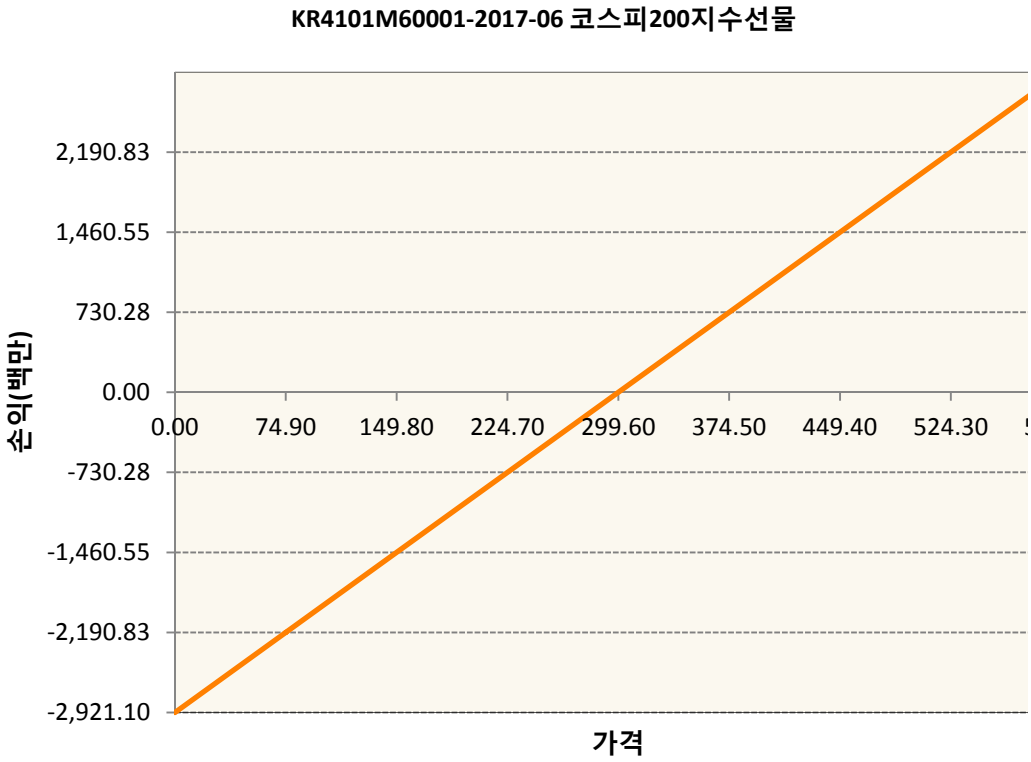
커버드콜목표전환형증권투자신탁

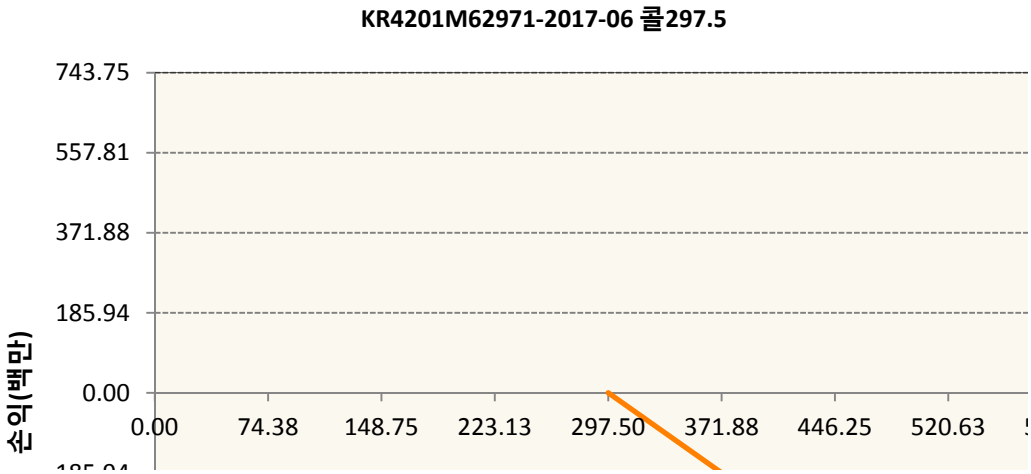
1. 계약금액

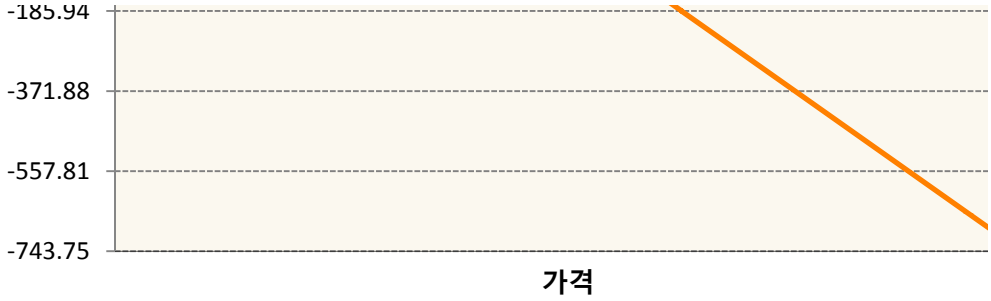
(단위:백만원)

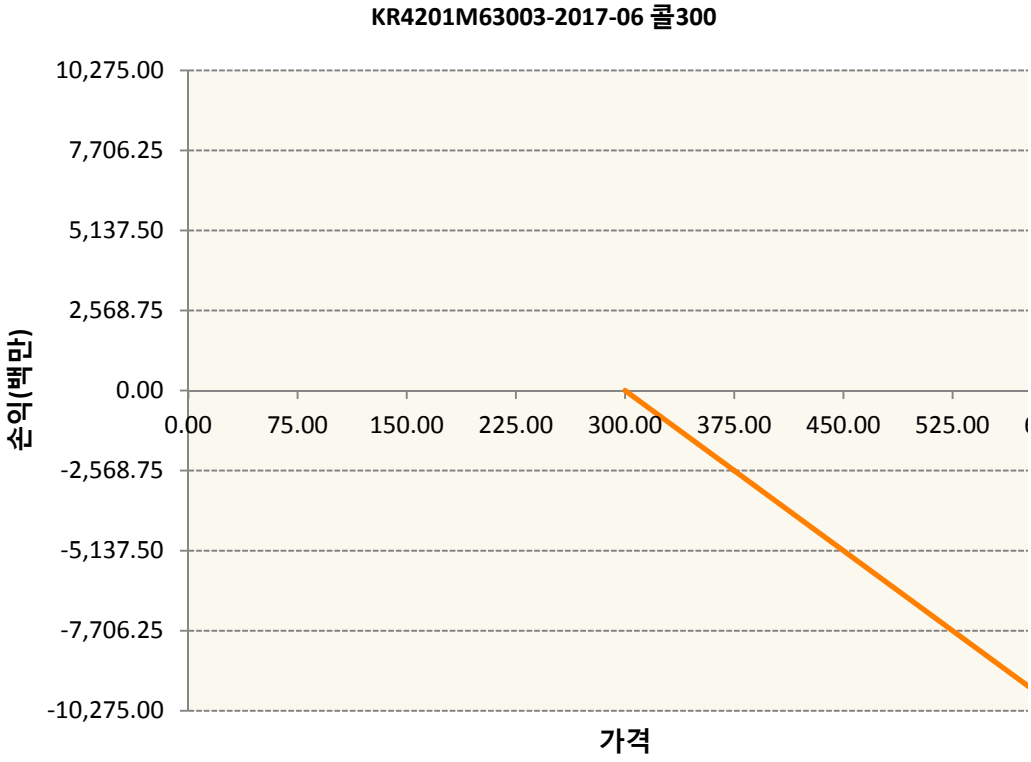
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,921	0	2,921	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,889	-12,889	장내

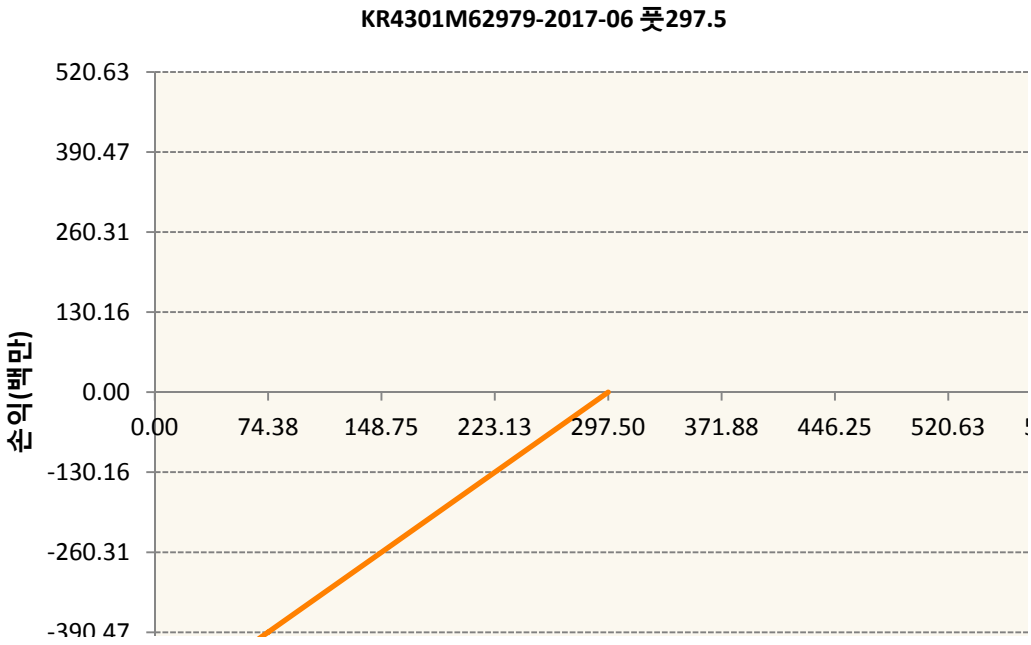
2. 만기시점의 손익구조



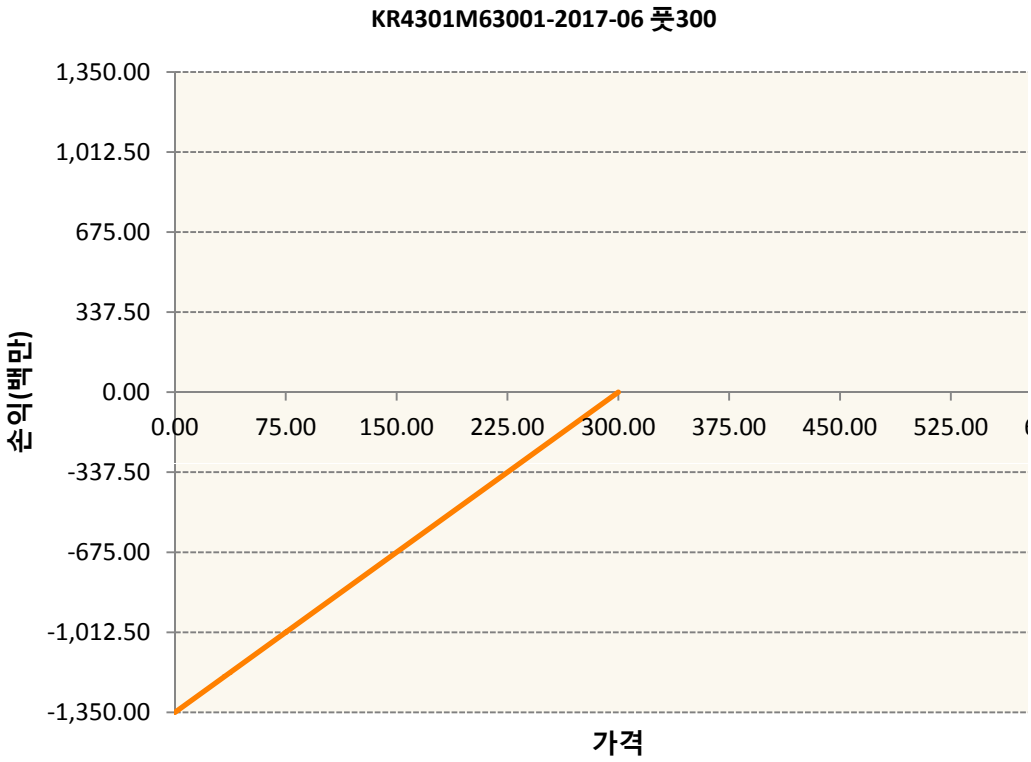



-185.94
-371.88
-557.81
-743.75
가격


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%	-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%	233	233	233	233	233	233	233
KR4201M62(2017-06 콜297.5							53
	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	11	11	11	11	11	10
-2.67%	10	9	9	8	8	7	6

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					684
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	116	116	116	116	116	115	114
-5.33%	116	115	114	112	110	107	104
-2.67%	104	99	93	87	80	72	65
0%	32	21	11	0	-11	-21	-32
2.67%	-153	-159	-167	-174	-183	-191	-200
5.33%	-408	-409	-411	-414	-418	-422	-426
8.00%	-680	-680	-680	-680	-681	-682	-684
	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	-20	-21
-2.67%	-7	-7	-8	-8	-9	-9	-10
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					93
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-92	-92	-92	-92	-92	-93	-93
-5.33%	-57	-57	-57	-57	-57	-58	-58
-2.67%	-22	-23	-24	-24	-25	-26	-27
0%	4	3	1	0	-1	-3	-4
2.67%	16	15	14	13	12	11	10
5.33%	18	18	18	17	17	16	16
8.00%	18	18	18	18	18	18	18

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

1,142

공시일	2017-05-18
기준일	2017-05-17

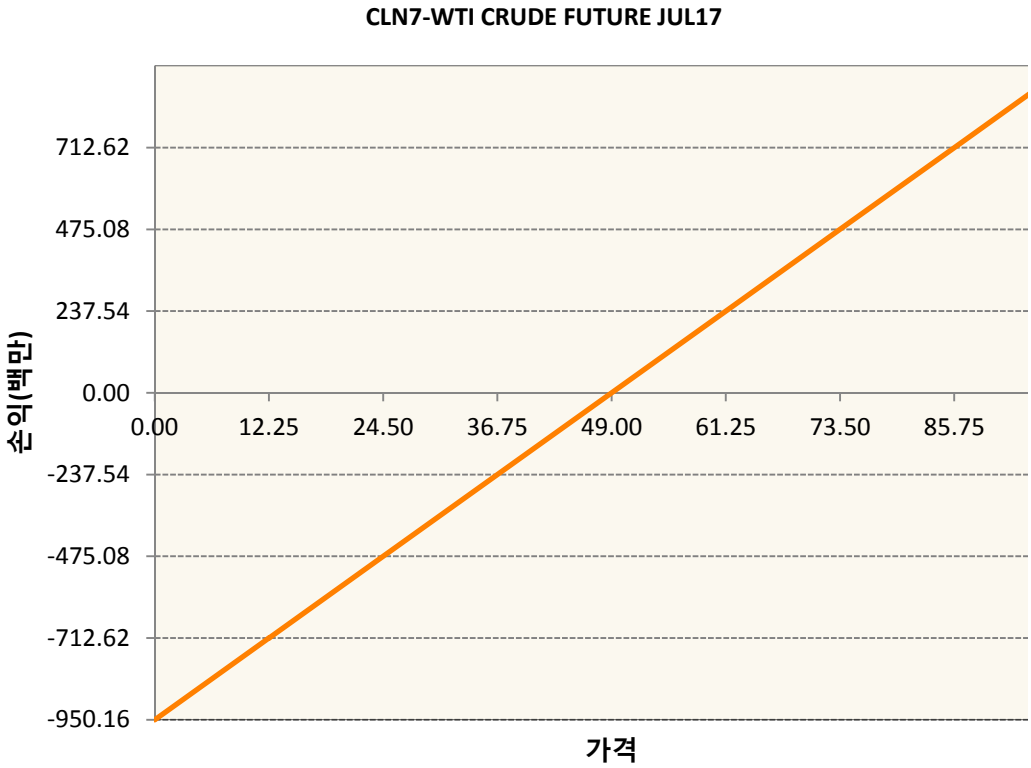
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

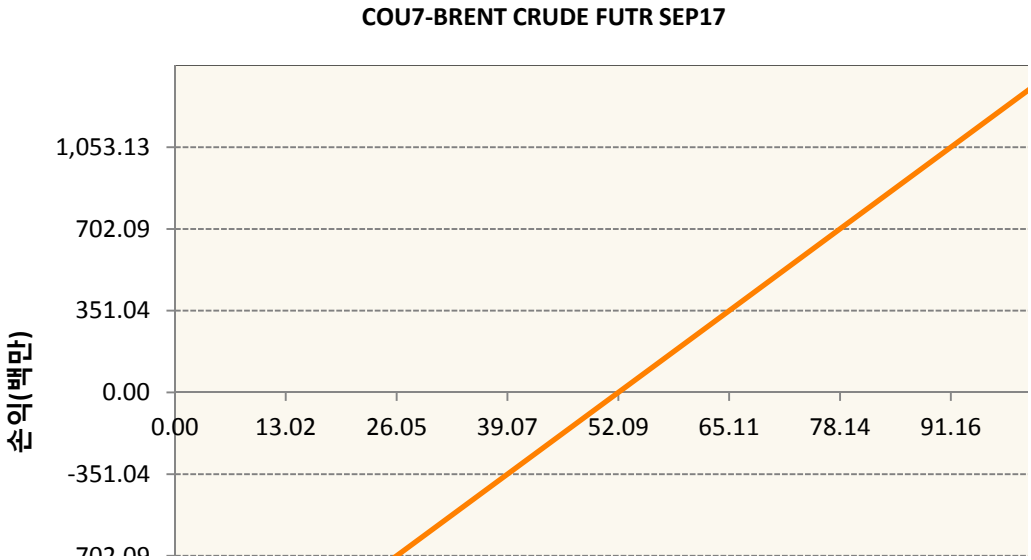
1. 계약금액

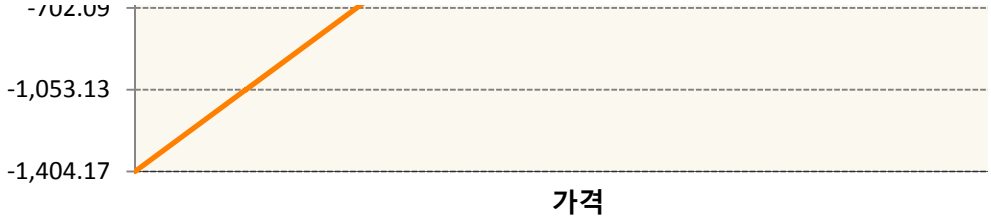
(단위:백만원)

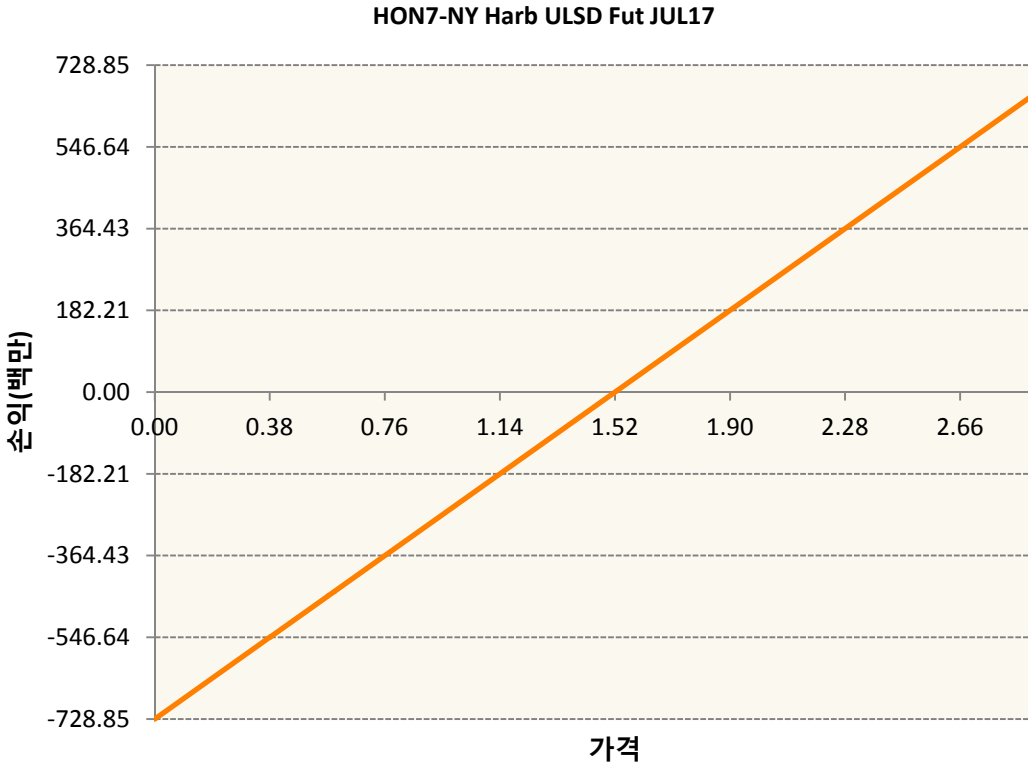
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,324	224	5,100	

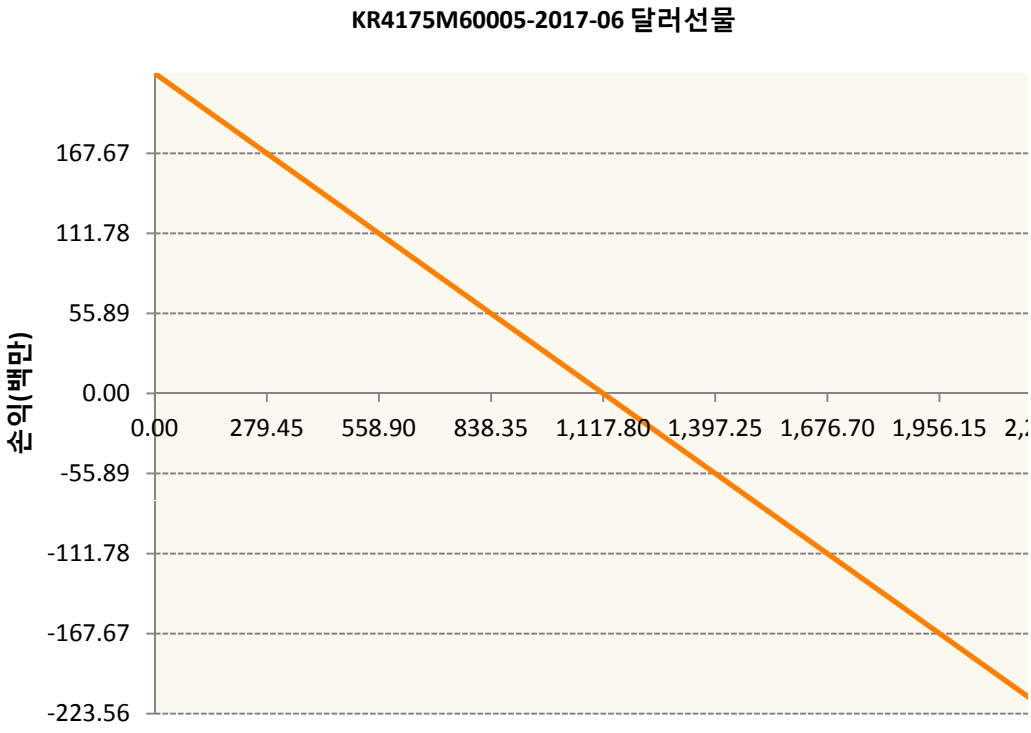
2. 만기시점의 손익구조



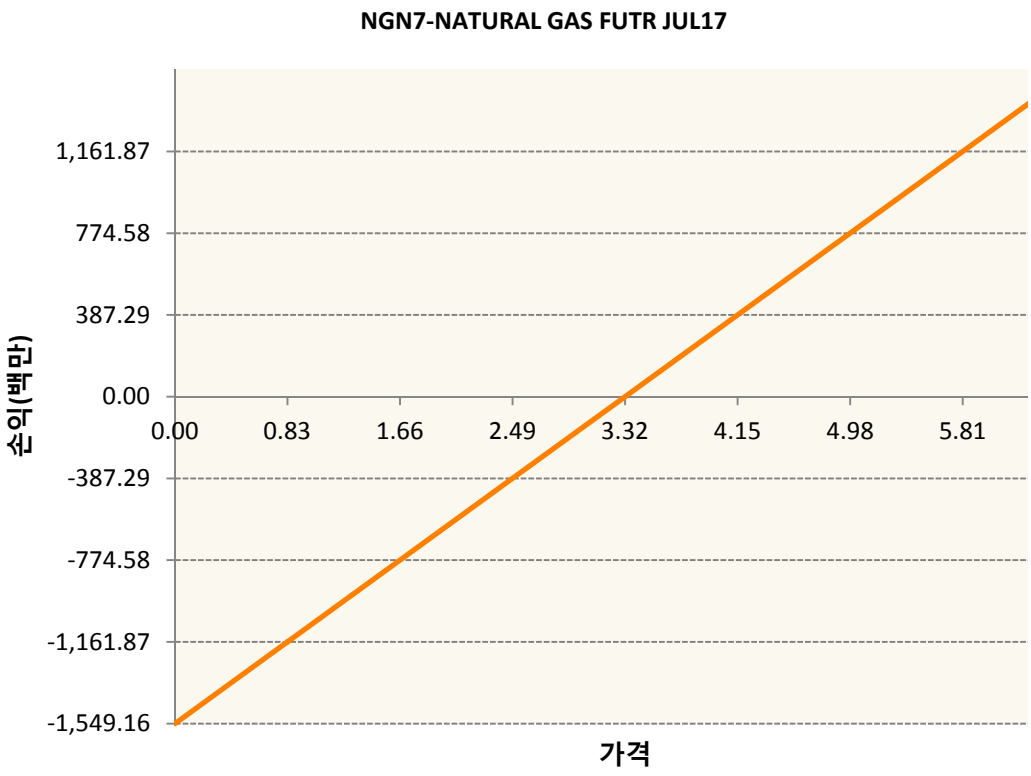


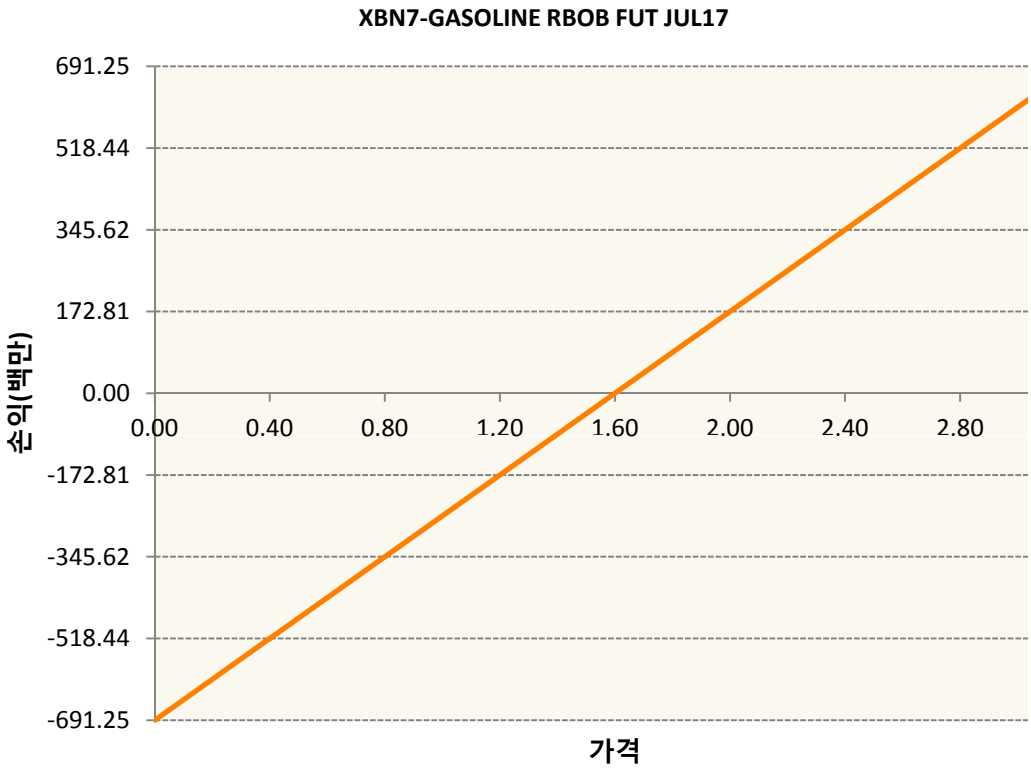

-1,053.13
-1,404.17
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
728.85
546.64
364.43
182.21
0.00
-182.21
-364.43
-546.64
-728.85
0.00
0.38
0.76
1.14
1.52
1.90
2.28
2.66
손익(백만)
가격


KR4175M60005-2017-06 달러선물
167.67
111.78
55.89
0.00
-55.89
-111.78
-167.67
-223.56
0.00
279.45
558.90
838.35
1,117.80
1,397.25
1,676.70
1,956.15
손익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,161.87
774.58
387.29
0.00
-387.29
-774.58
-1,161.87
-1,549.16
0.00
0.83
1.66
2.49
3.32
4.15
4.98
5.81
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
691.25
518.44
345.62
172.81
0.00
-172.81
-345.62
-518.44
-691.25
0.00
0.40
0.80
1.20
1.60
2.00
2.40
2.80
손익(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	124
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	55

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

911

공시일	2017-05-18
기준일	2017-05-17

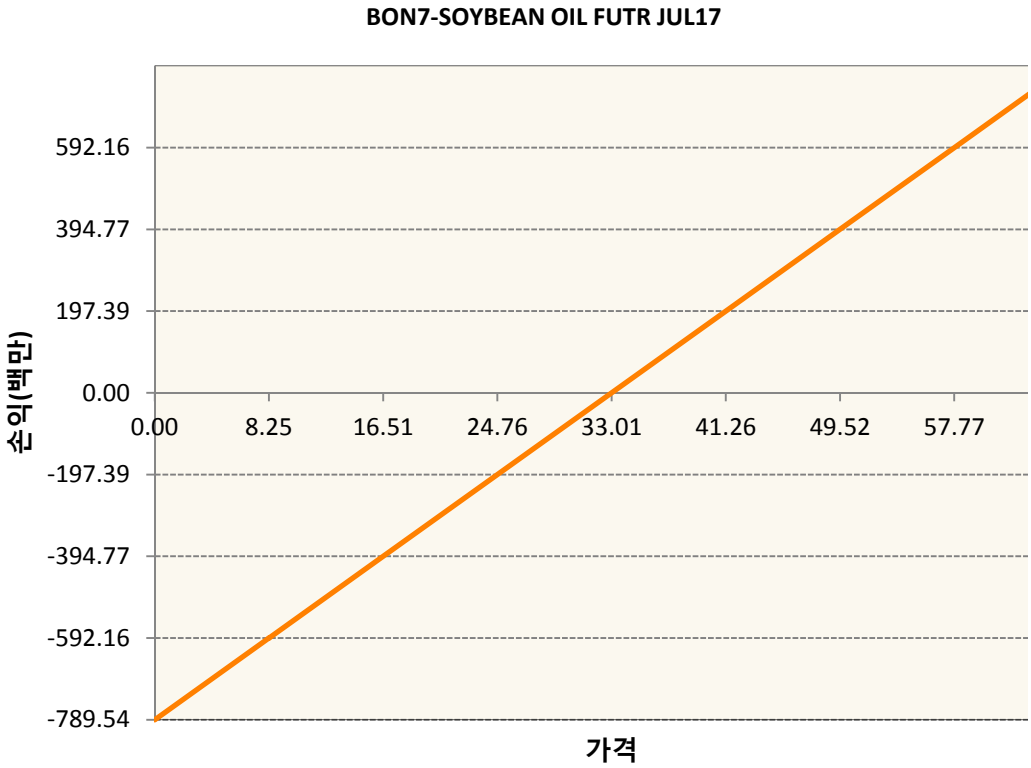
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

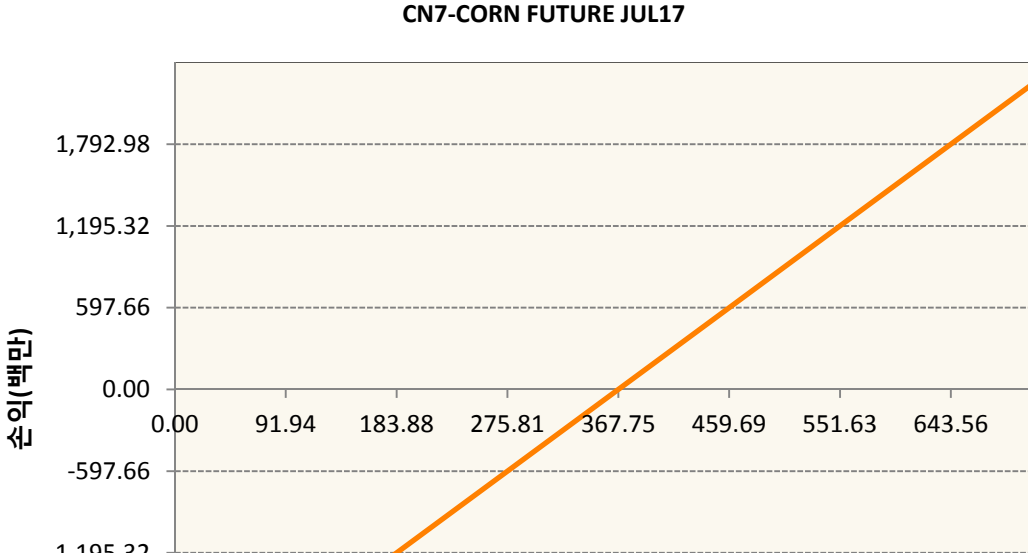
1. 계약금액

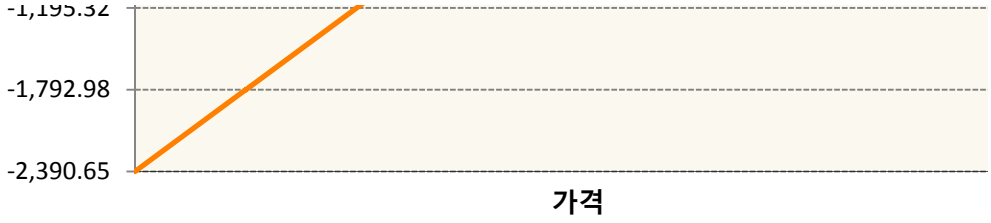
(단위:백만원)

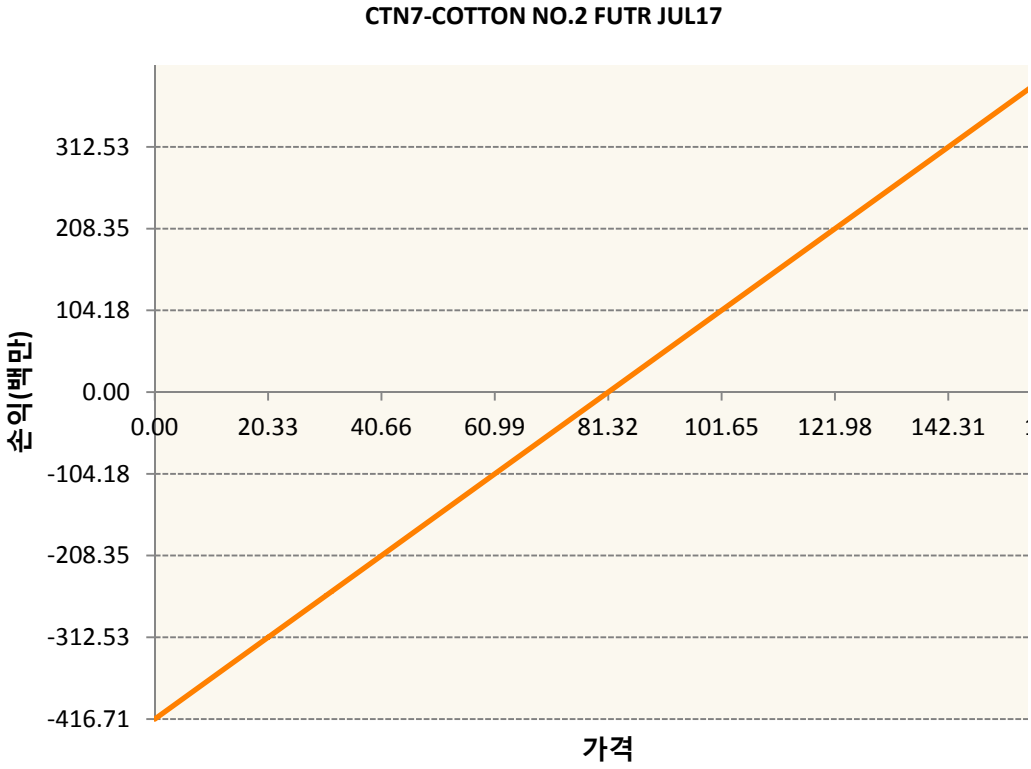
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,902	391	8,511	

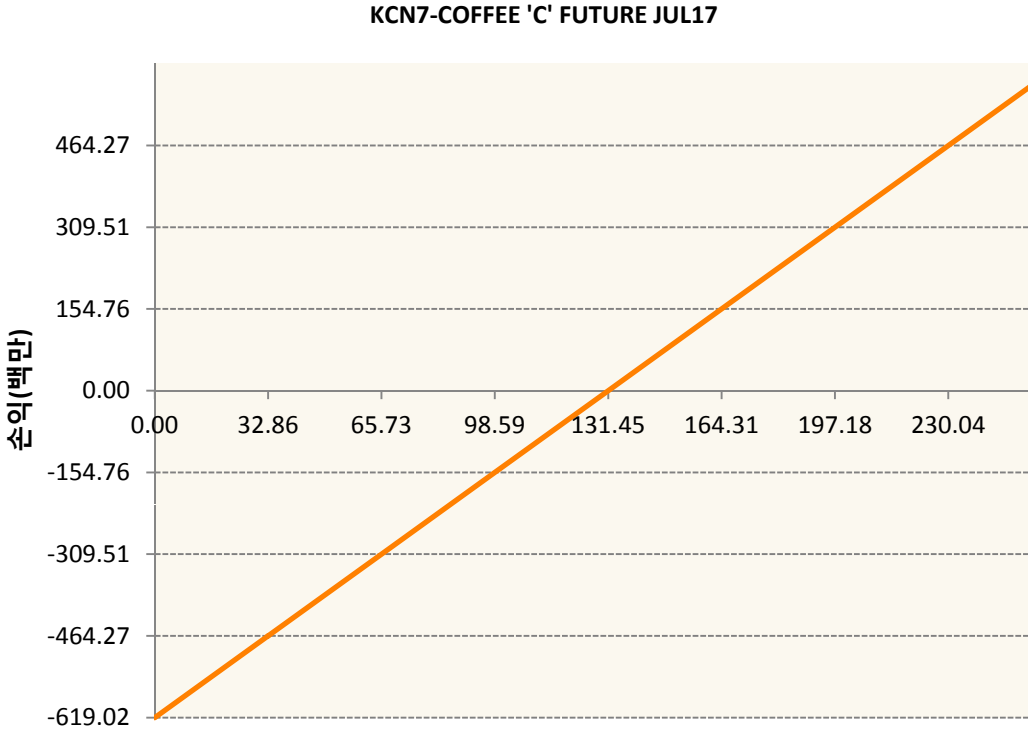
2. 만기시점의 손익구조





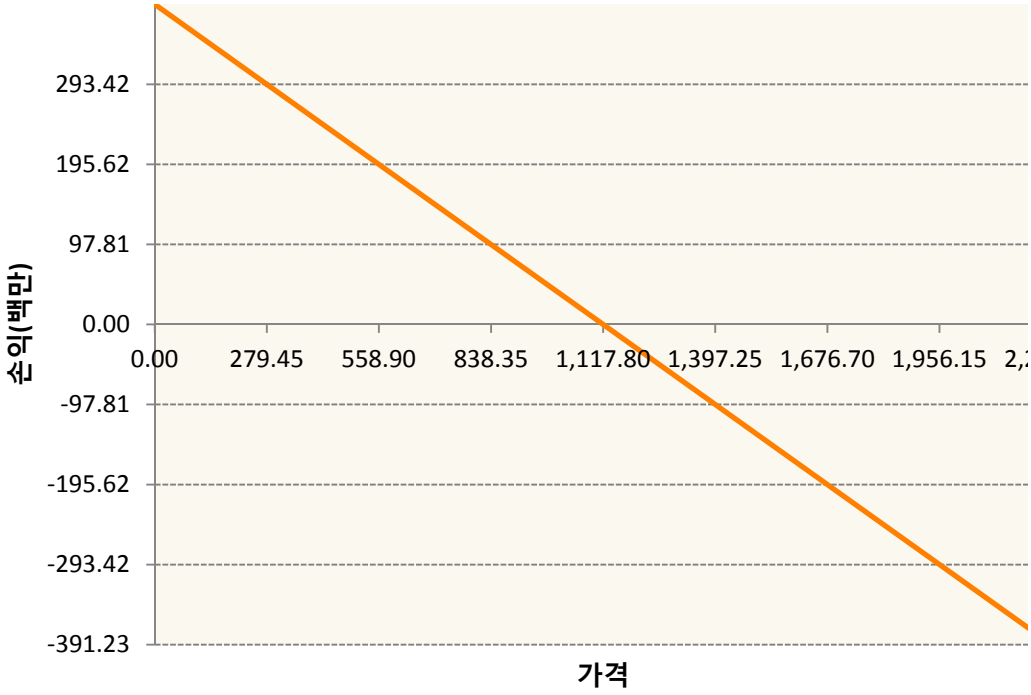

-1,792.98
-2,390.65
가격


CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
312.53
208.35
104.18
0.00
-104.18
-208.35
-312.53
-416.71
0.00
20.33
40.66
60.99
81.32
101.65
121.98
142.31
순익(백만)
가격

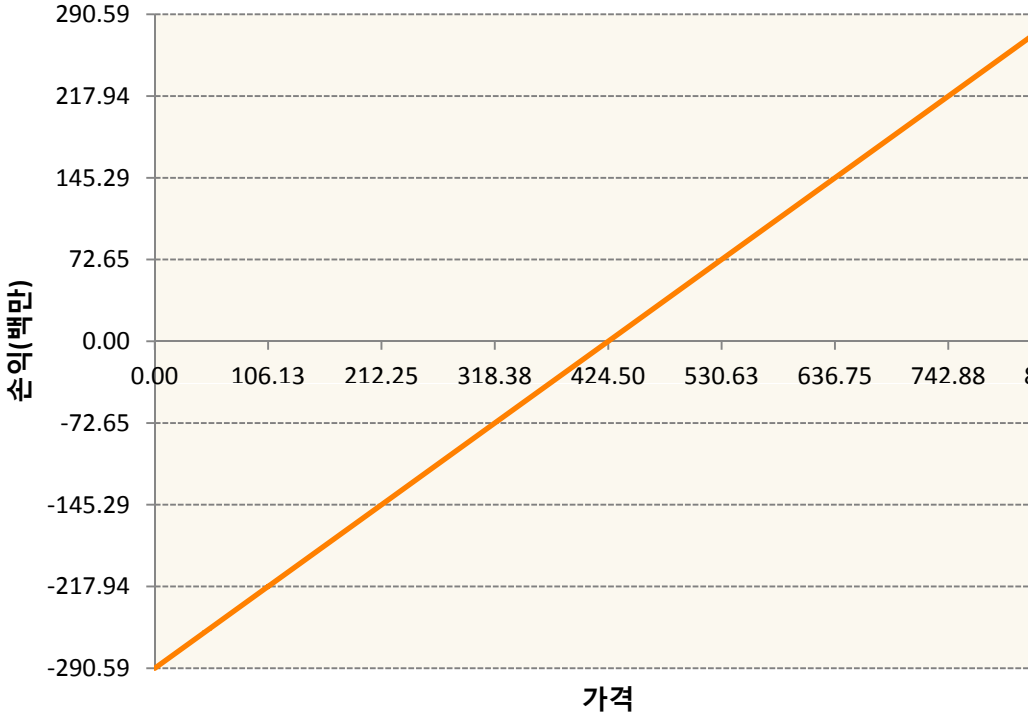

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
464.27
309.51
154.76
0.00
-154.76
-309.51
-464.27
-619.02
0.00
32.86
65.73
98.59
131.45
164.31
197.18
230.04
순익(백만)

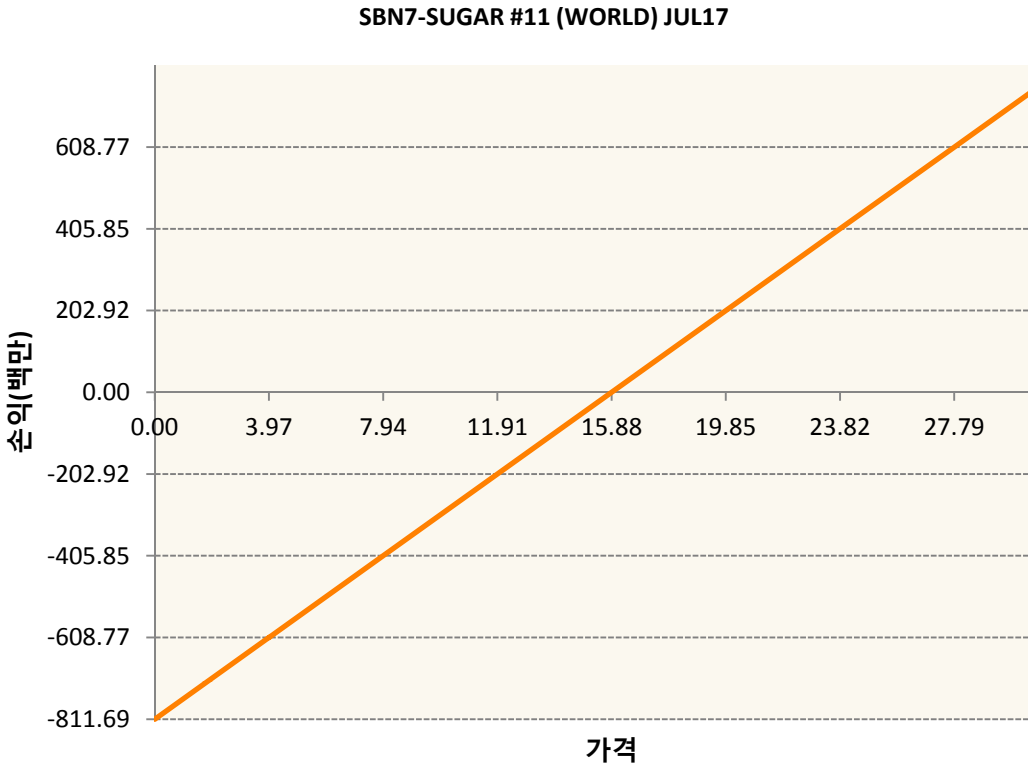
가격

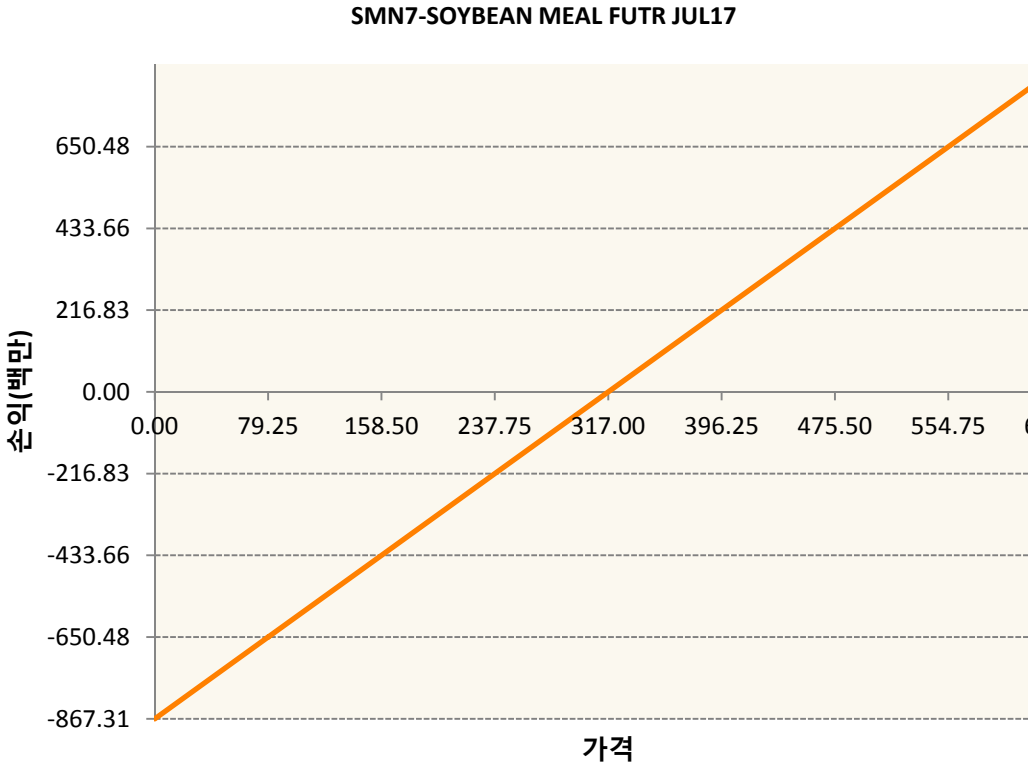
KR4175M60005-2017-06 달러선물

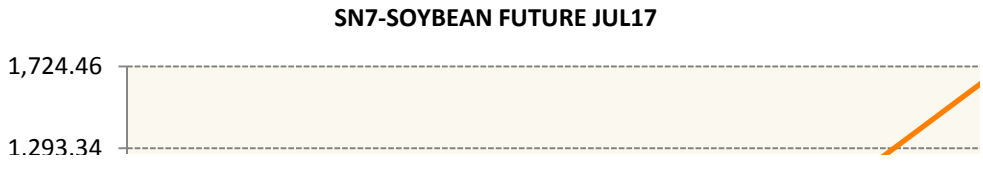


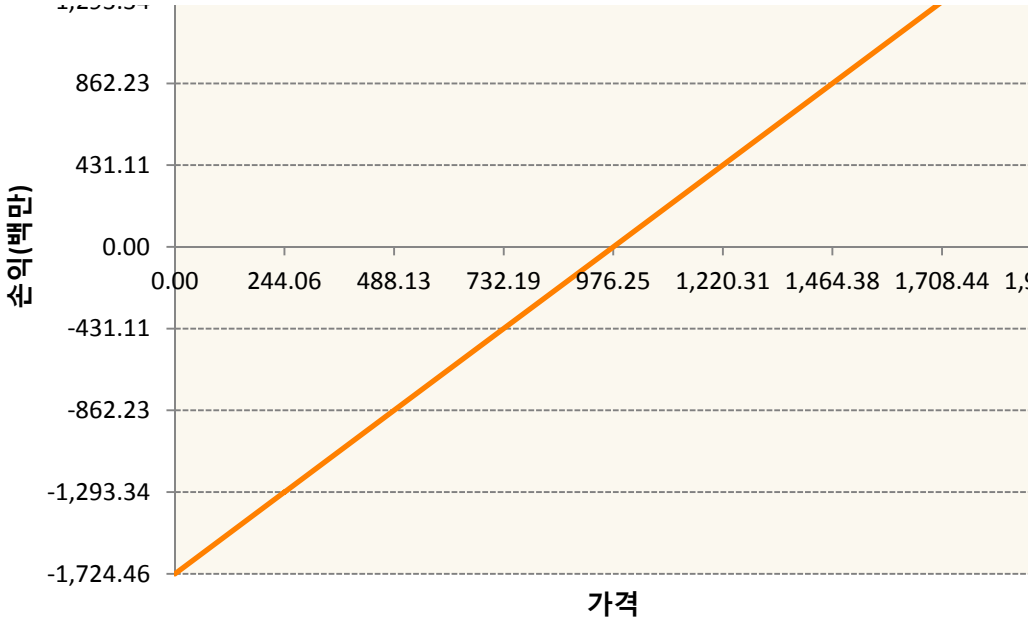
KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17

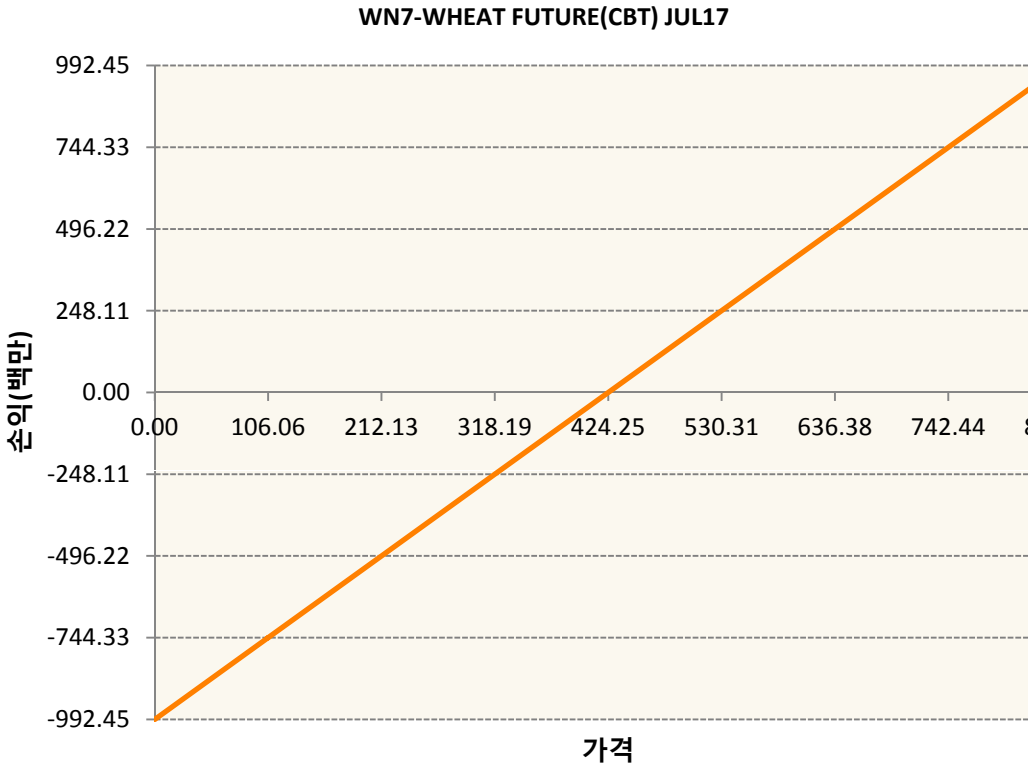



SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
608.77
405.85
202.92
0.00
-202.92
-405.85
-608.77
-811.69
손익(백만)
0.00
3.97
7.94
11.91
15.88
19.85
23.82
27.79
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
650.48
433.66
216.83
0.00
-216.83
-433.66
-650.48
-867.31
손익(백만)
0.00
79.25
158.50
237.75
317.00
396.25
475.50
554.75
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,724.46
1,293.34





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	63
CN7	CORN FUTURE JUL17	191
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	33
KCN7	COFFEE 'C' FUTURE JUL17	50
KR4175M60(	2017-06 달러선물	31

KWN7	KC HRW WHEAT FUT JUL17	23
SBN7	SUGAR #11 (WORLD) JUL17	65
SMN7	SOYBEAN MEAL FUTR JUL17	69
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	138
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	79

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

807