공시일	2017-05-22
기준일	2017-05-19

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	2017-05-22
기준일	2017-05-19

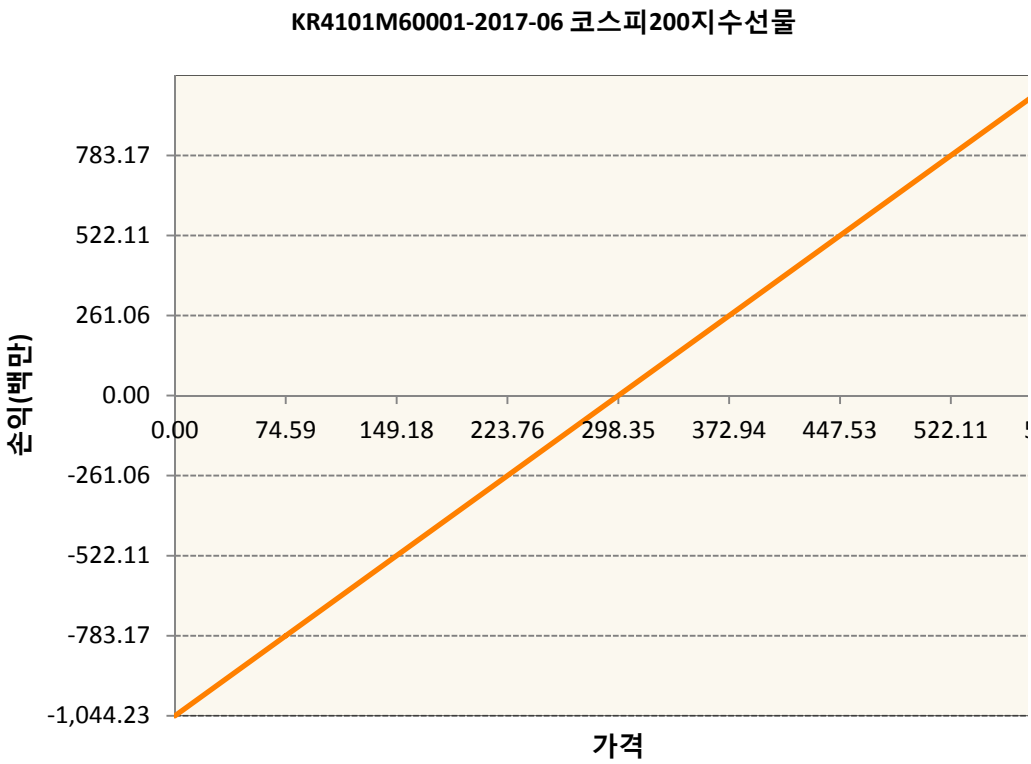
스마트인덱스모

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	1,044	0	1,044	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							83
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-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%	83	83	83	83	83	83	83

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

55

공시일	2017-05-22
기준일	2017-05-19

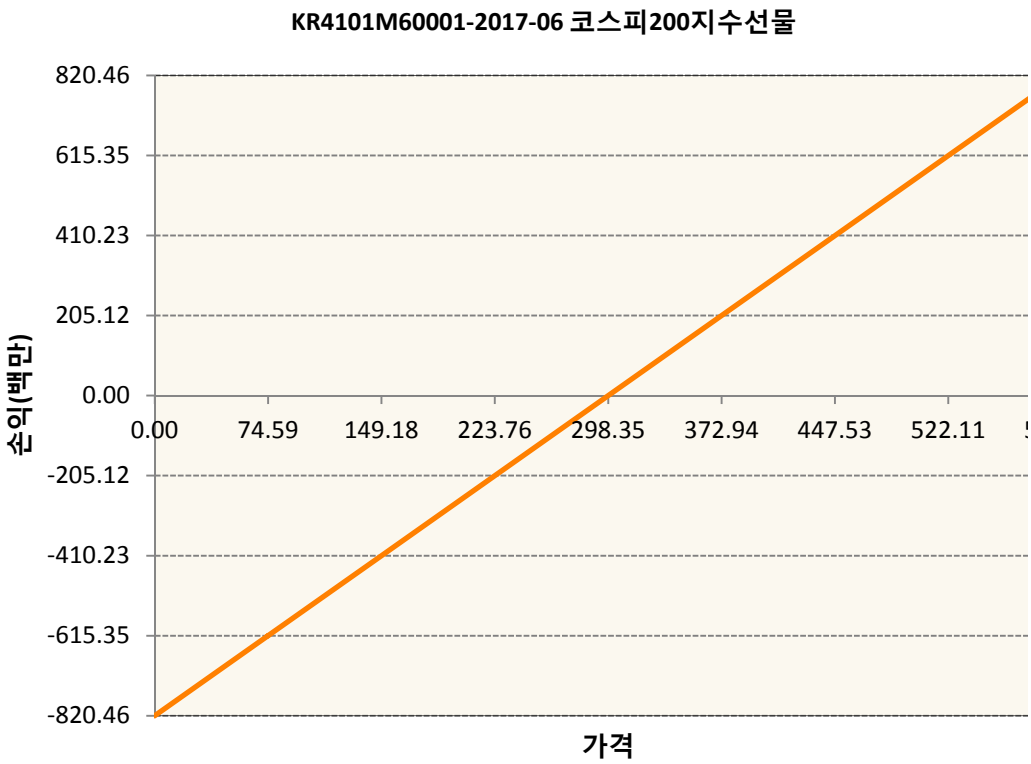
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	820	0	820	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							66
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
-5.33%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
-2.67%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	22	22	22	22	22	22	22
5.33%	44	44	44	44	44	44	44
8.00%	66	66	66	66	66	66	66

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

43

공시일	2017-05-22
기준일	2017-05-19

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	977

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

546

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-05-22
기준일	2017-05-19

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	363

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

342

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-05-22
기준일	2017-05-19

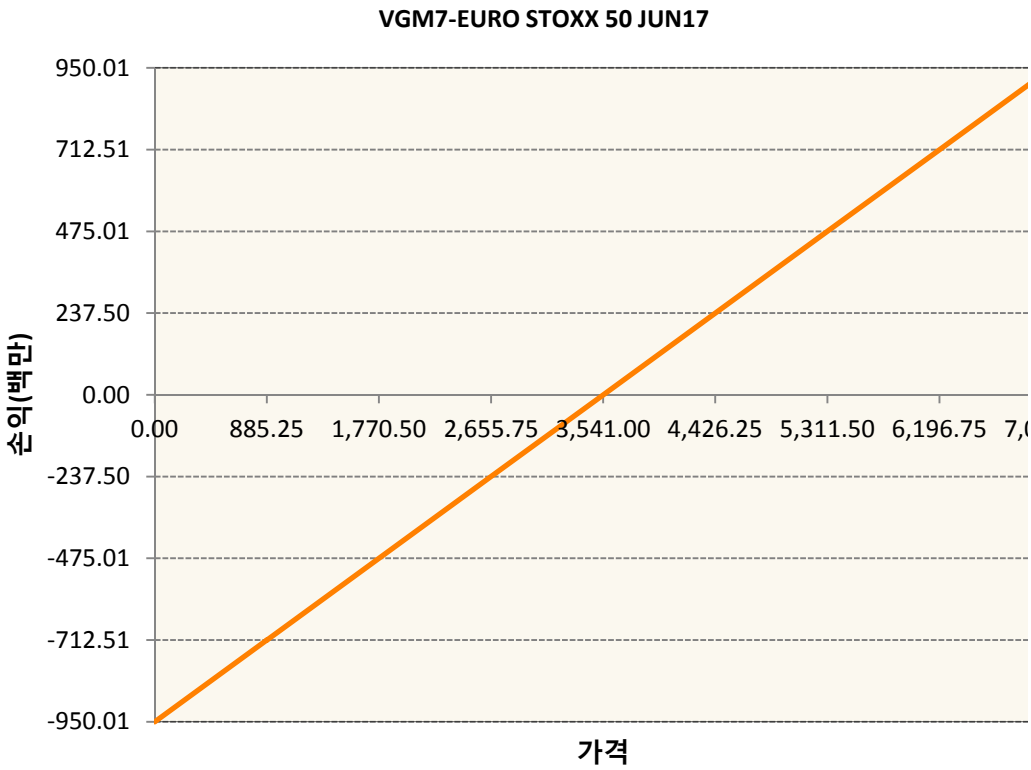
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	950	0	950	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM7	EURO STOXX 50 JUN17	76

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

(단위:백만원)

75

공시일	2017-05-22
기준일	2017-05-19

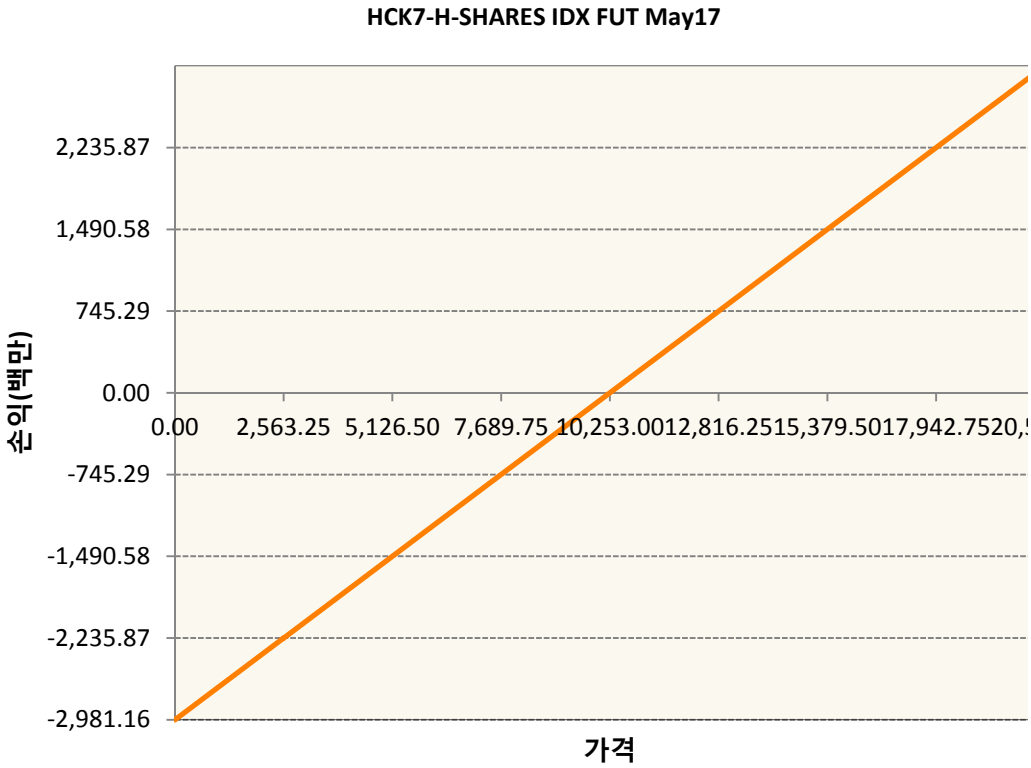
차이나인덱스모(주식-파생형)

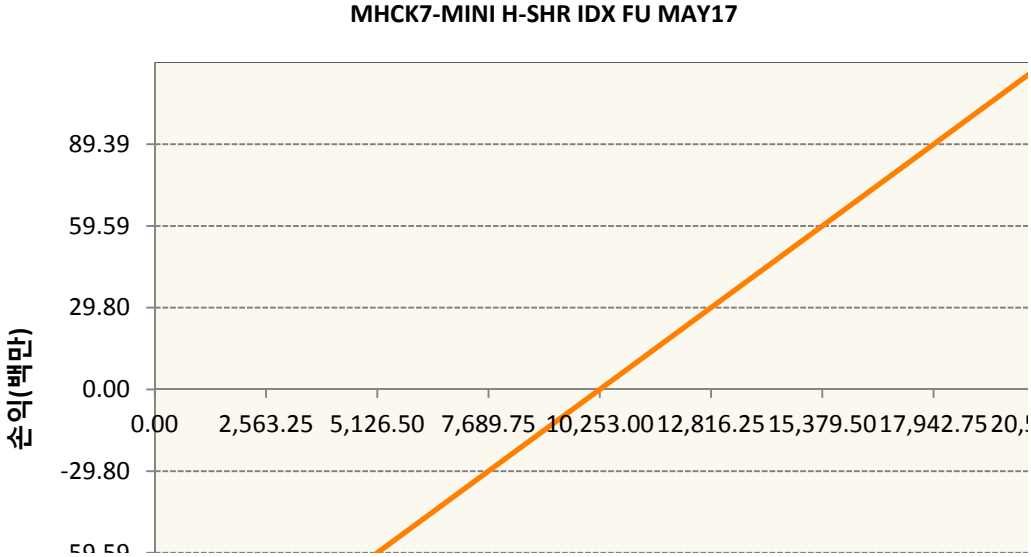
1. 계약금액

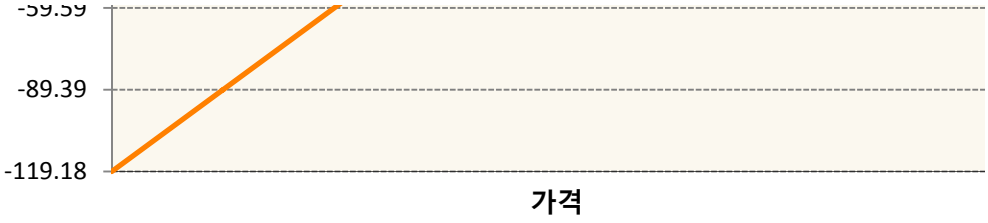
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,100	0	3,100	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCK7	H-SHARES IDX FUT May17	238
MHCK7	MINI H-SHR IDX FU MAY17	10

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

261

공시일	2017-05-22
기준일	2017-05-19

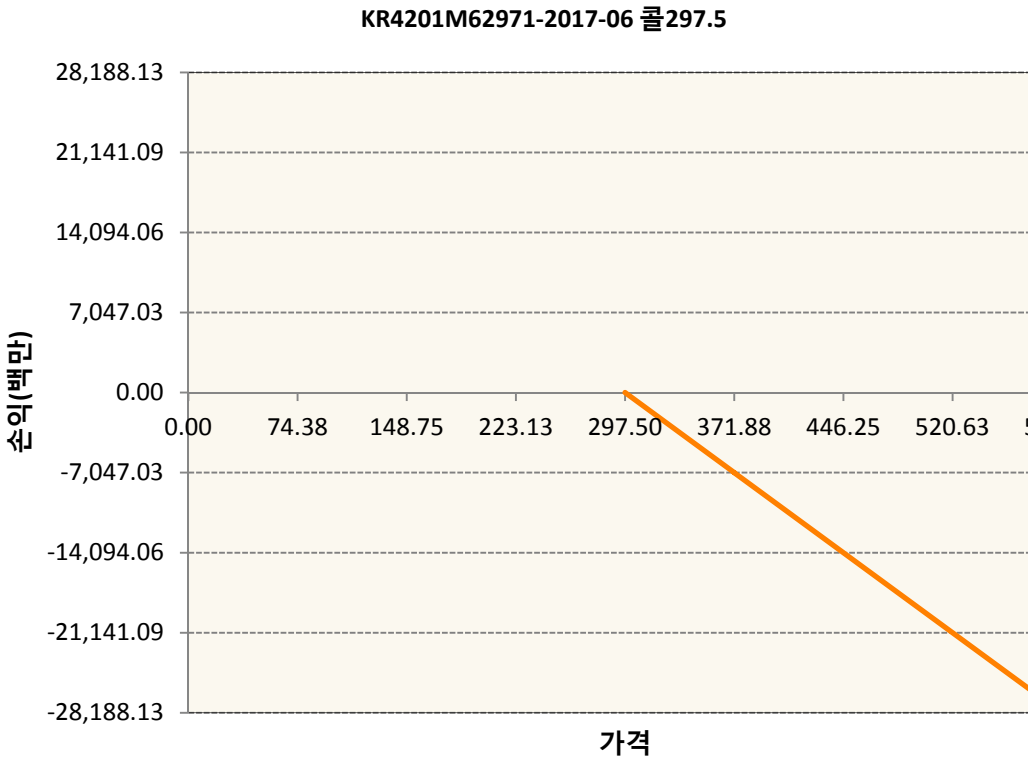
커버드콜모(주식혼합-파생형)

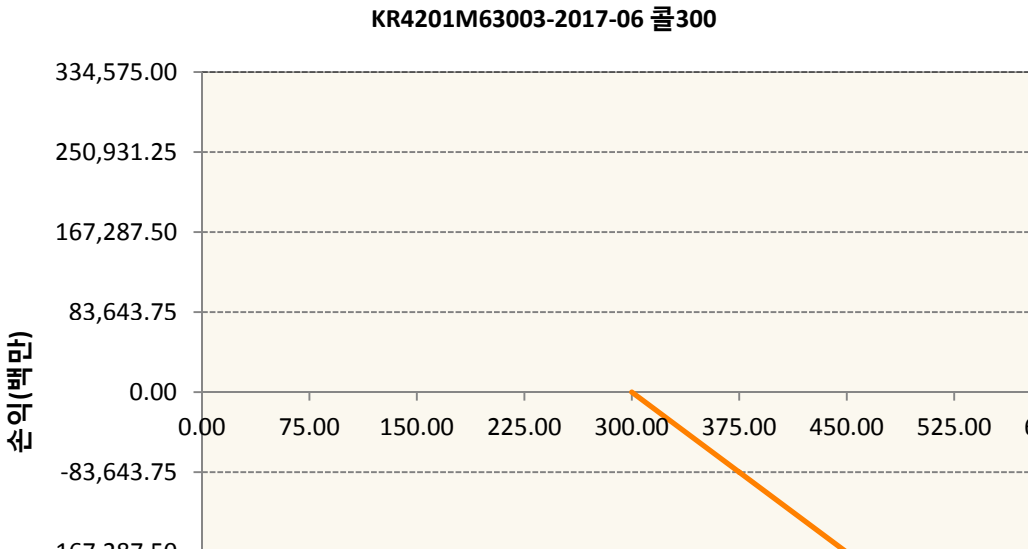
1. 계약금액

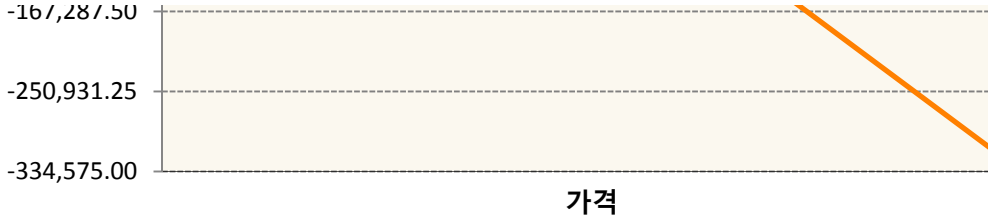
(단위:백만원)

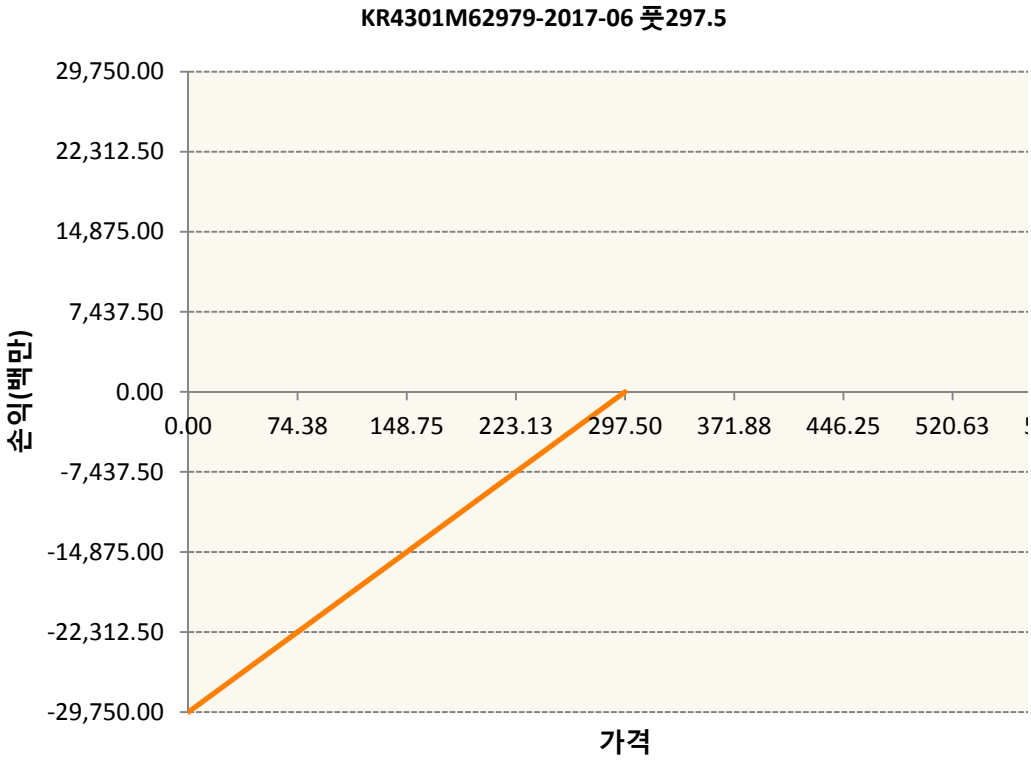
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	602,513	-602,513	장내

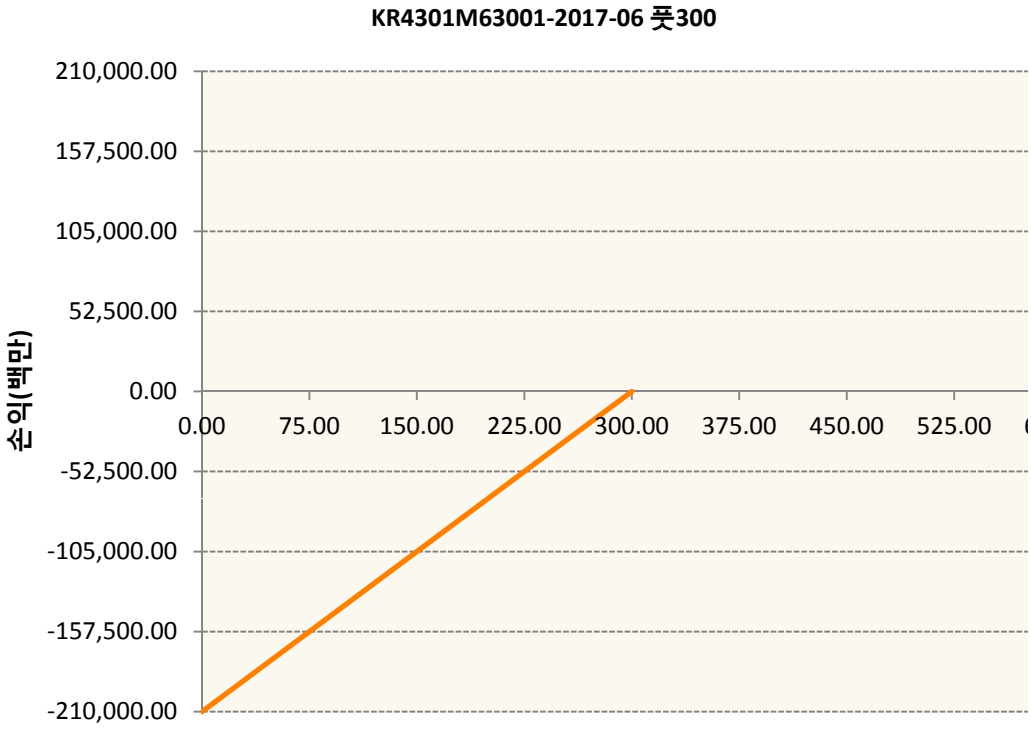
2. 만기시점의 손익구조






-167,287.50
-250,931.25
-334,575.00
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						1,950
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	367	367	367	367	366	364	362
-5.33%	365	363	359	354	347	339	329
-2.67%	325	309	291	272	251	230	208
0%	85	57	28	0	-28	-57	-85
2.67%	-471	-485	-502	-520	-539	-559	-581
5.33%	-1,192	-1,194	-1,198	-1,203	-1,210	-1,218	-1,228
8.00%	-1,942	-1,942	-1,943	-1,944	-1,945	-1,947	-1,950
KR4201M63(	2017-06 콜300						21,527
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,034	3,033	3,032	3,030	3,024	3,014	2,998
-5.33%	3,026	3,013	2,991	2,956	2,906	2,842	2,761
-2.67%	2,803	2,679	2,530	2,360	2,172	1,969	1,751
0%	976	653	327	0	-328	-658	-988
2.67%	-4,463	-4,705	-4,962	-5,231	-5,510	-5,797	-6,091
5.33%	-12,575	-12,632	-12,712	-12,813	-12,935	-13,076	-13,235
8.00%	-21,368	-21,373	-21,383	-21,402	-21,431	-21,472	-21,527
KR4301M62(	2017-06 풋297.5						2,001
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,995	-1,995	-1,995	-1,996	-1,997	-1,998	-2,001
-5.33%	-1,203	-1,205	-1,209	-1,215	-1,222	-1,231	-1,241
-2.67%	-451	-468	-487	-508	-529	-552	-575
0%	90	60	30	0	-30	-60	-90
2.67%	297	282	265	246	225	204	181
5.33%	331	328	324	319	311	303	292
8.00%	333	332	332	331	330	328	325
KR4301M63(	2017-06 풋300						14,796
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,773	-14,774	-14,774	-14,776	-14,780	-14,786	-14,796
-5.33%	-9,219	-9,227	-9,241	-9,263	-9,294	-9,335	-9,385
-2.67%	-3,800	-3,878	-3,971	-4,078	-4,196	-4,324	-4,460
0%	613	410	205	0	-206	-413	-620
2.67%	2,758	2,606	2,445	2,276	2,101	1,920	1,736

5.33%	3,225	3,190	3,140	3,076	3,000	2,911	2,811
8.00%	3,265	3,262	3,256	3,244	3,226	3,200	3,166

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

46,240

공시일	2017-05-22
기준일	2017-05-19

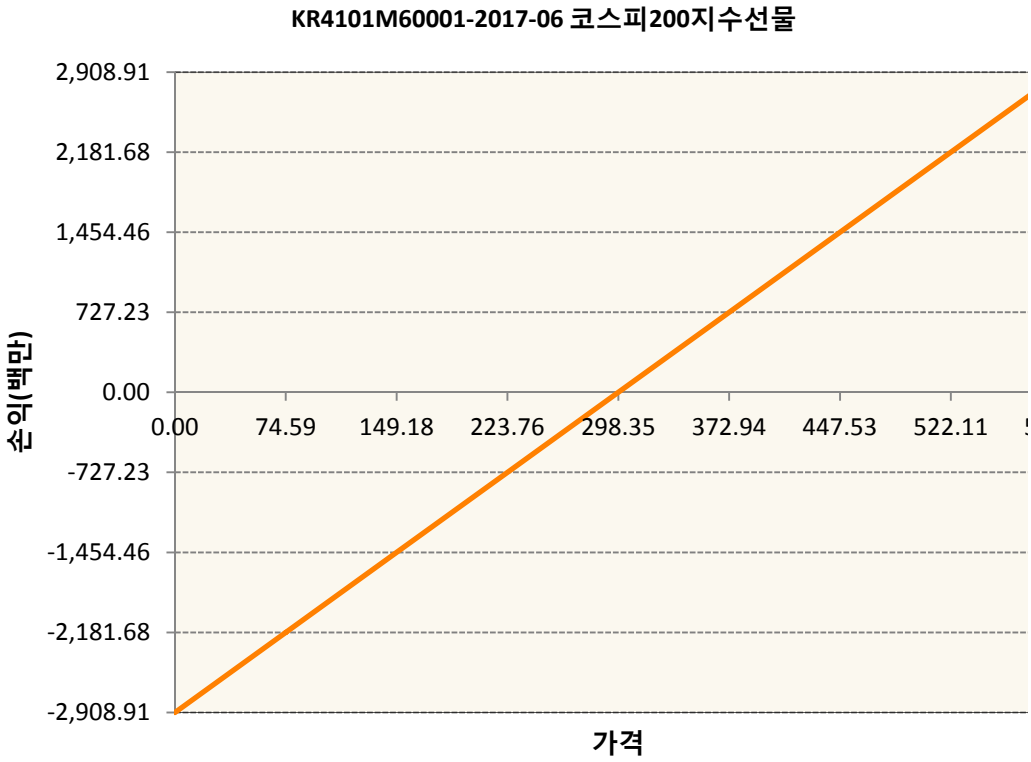
커버드콜목표전환형증권투자신탁

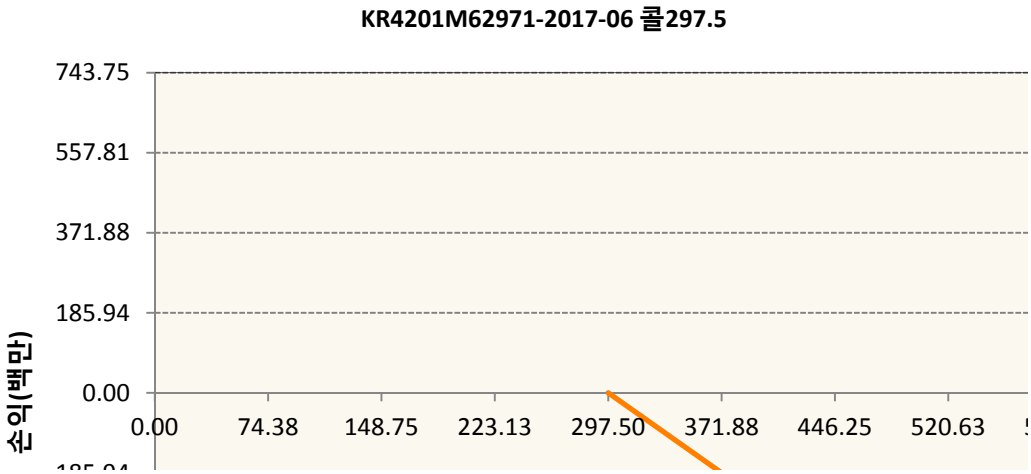
1. 계약금액

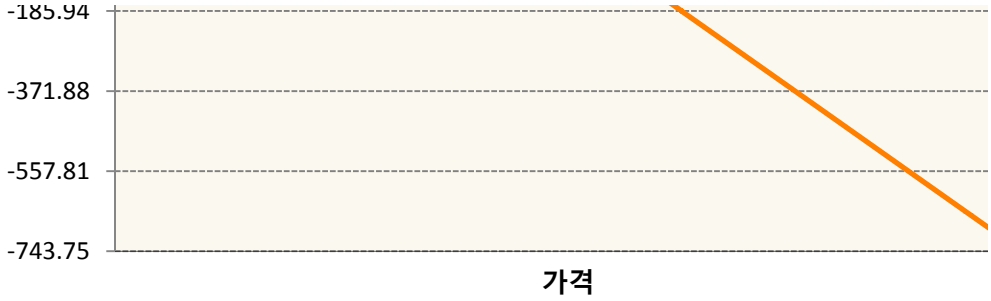
(단위:백만원)

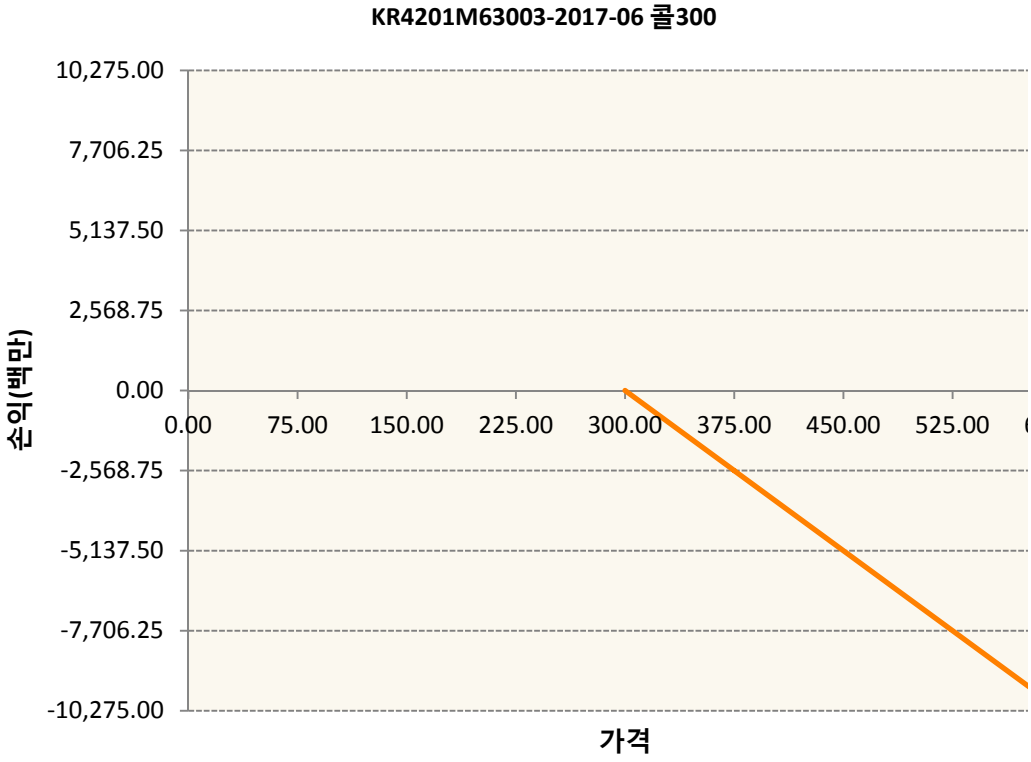
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,909	0	2,909	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,889	-12,889	장내

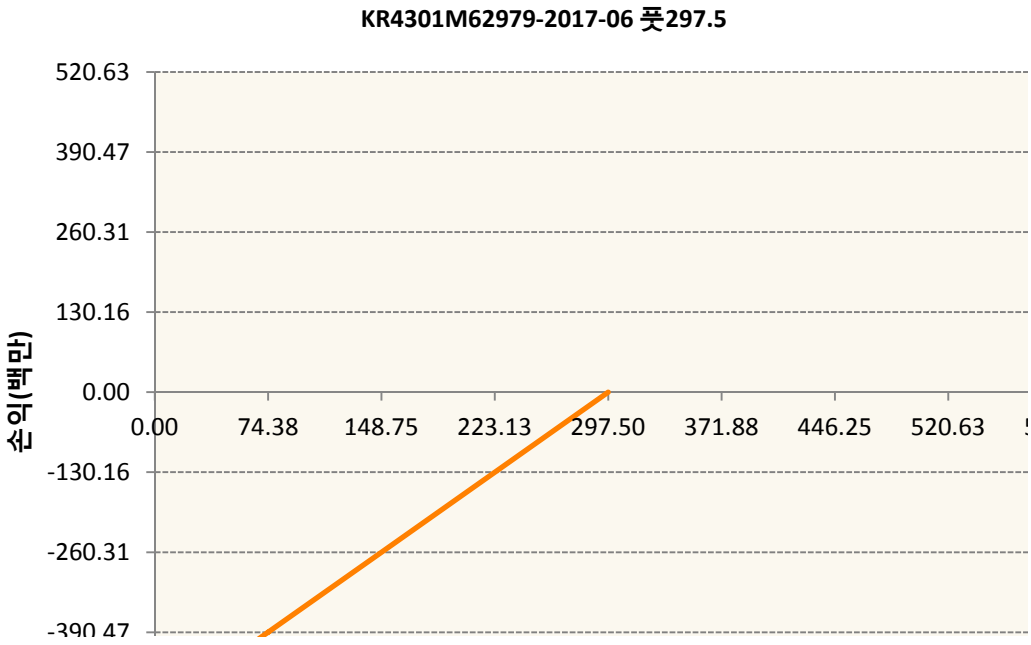
2. 만기시점의 손익구조



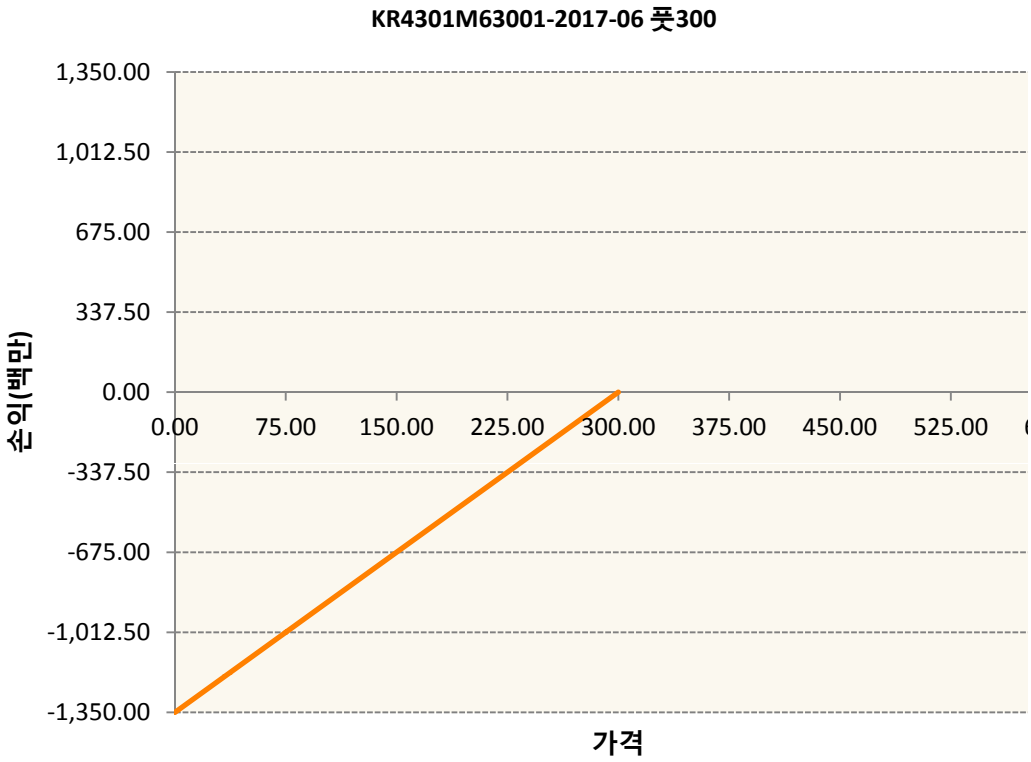



-185.94
-371.88
-557.81
-743.75
가격


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%	10	10	10	10	10	10	10
-5.33%	10	10	9	9	9	9	9
-2.67%	9	8	8	7	7	6	5

0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	-12	-13	-13	-14	-14	-15	-15
5.33%	-31	-32	-32	-32	-32	-32	-32
8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-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%	93	93	93	93	93	93	92
-5.33%	93	93	92	91	89	87	85
-2.67%	86	82	78	72	67	60	54
0%	30	20	10	0	-10	-20	-30
2.67%	-137	-144	-152	-161	-169	-178	-187
5.33%	-386	-388	-390	-393	-397	-402	-406
8.00%	-656	-656	-657	-657	-658	-659	-661
	KR4301M62(	2017-06 풋297.5					35
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-22	-22
-2.67%	-8	-8	-9	-9	-9	-10	-10
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	5	5	5	4	4	4	3
5.33%	6	6	6	6	5	5	5
8.00%	6	6	6	6	6	6	6
	KR4301M63(	2017-06 풋300					95
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-95	-95	-95	-95	-95	-95	-95
-5.33%	-59	-59	-59	-60	-60	-60	-60
-2.67%	-24	-25	-26	-26	-27	-28	-29
0%	4	3	1	0	-1	-3	-4
2.67%	18	17	16	15	14	12	11
5.33%	21	21	20	20	19	19	18
8.00%	21	21	21	21	21	21	20

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

1,109

공시일	2017-05-22
기준일	2017-05-19

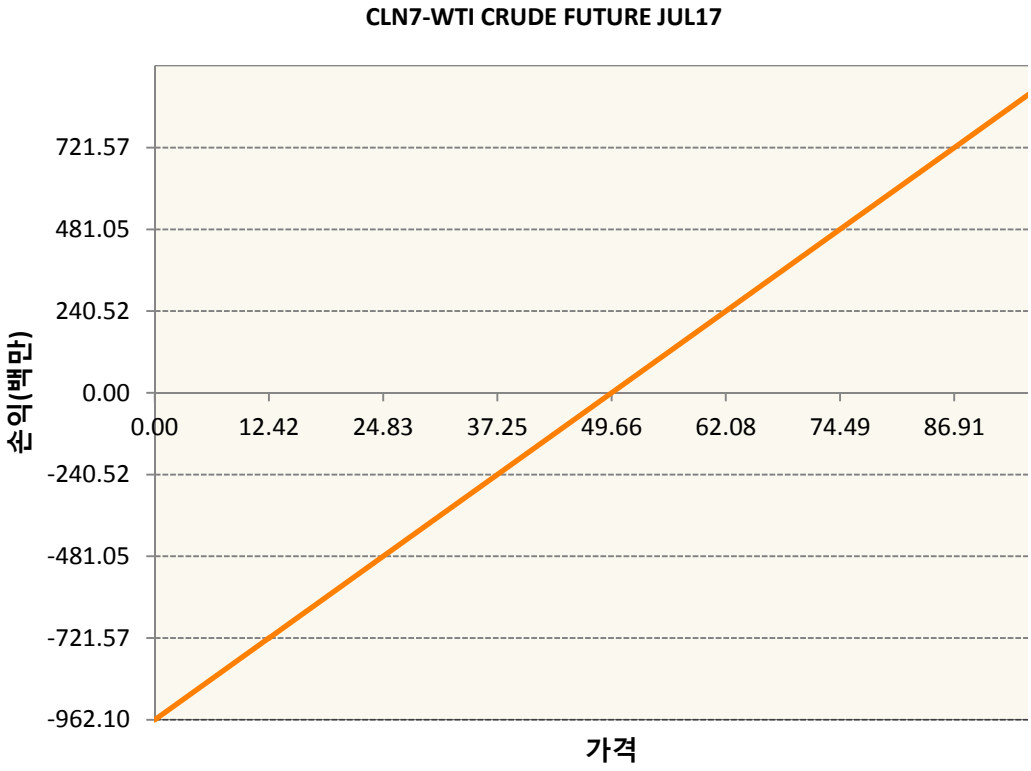
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

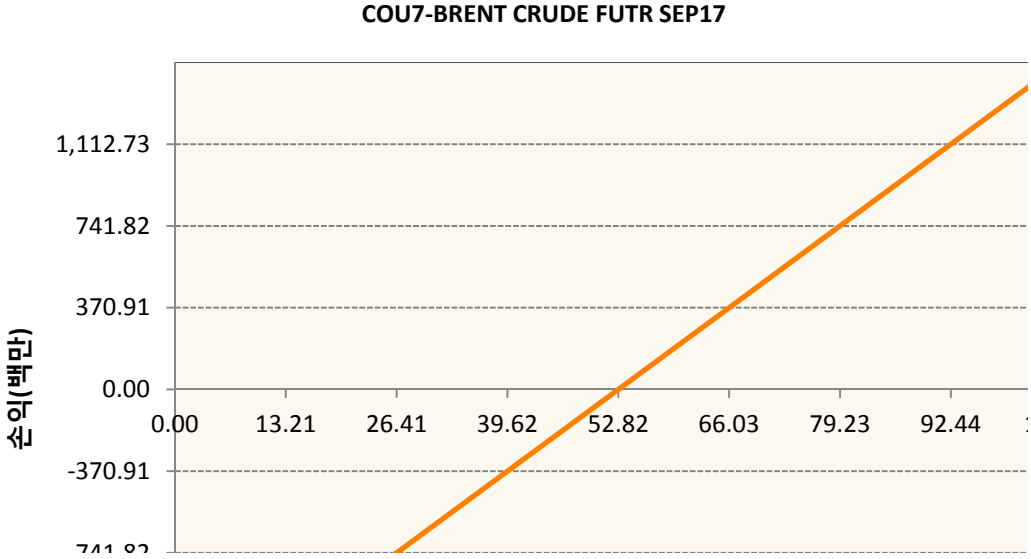
1. 계약금액

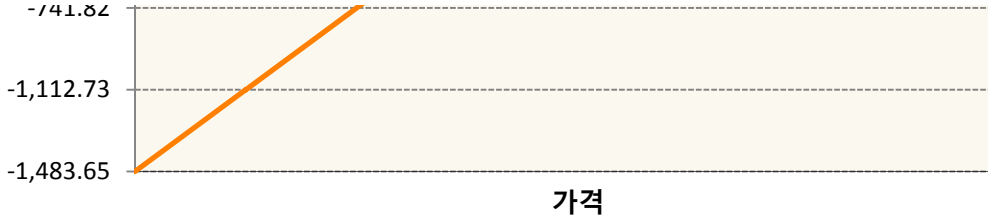
(단위:백만원)

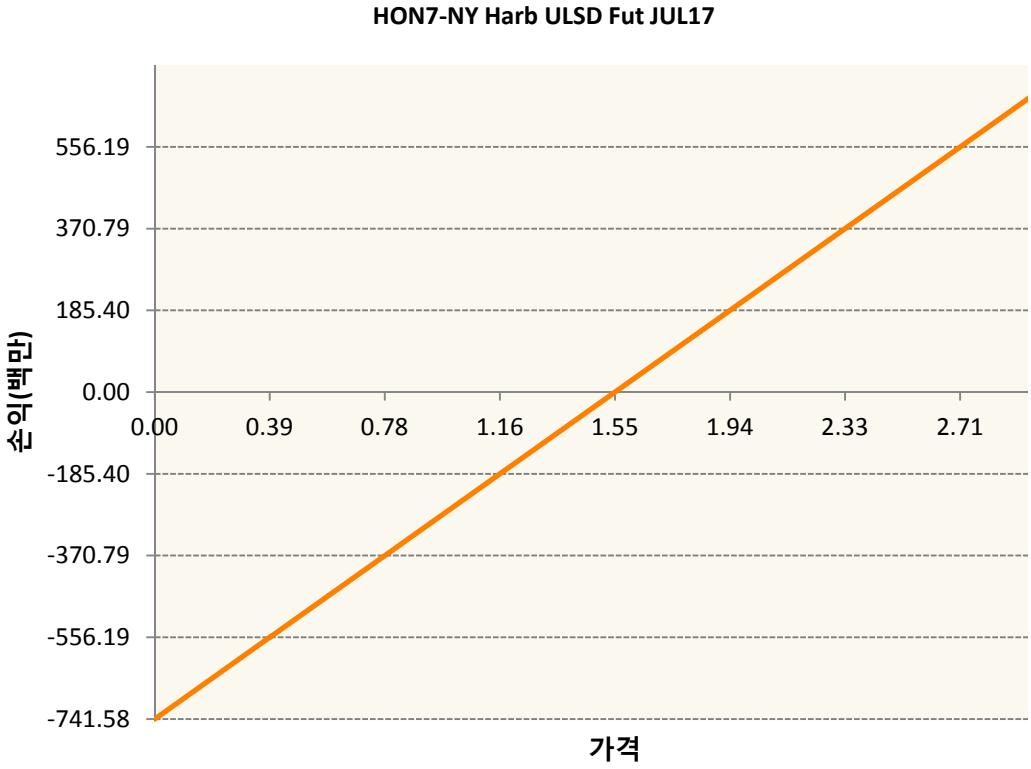
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,525	225	5,299	

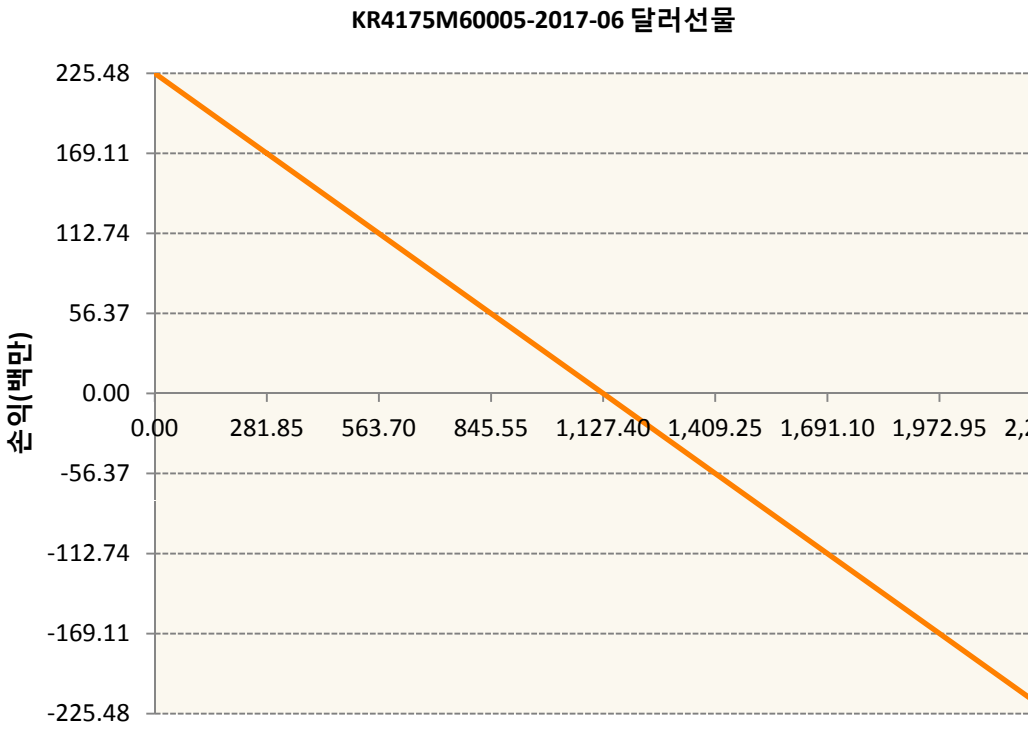
2. 만기시점의 손익구조



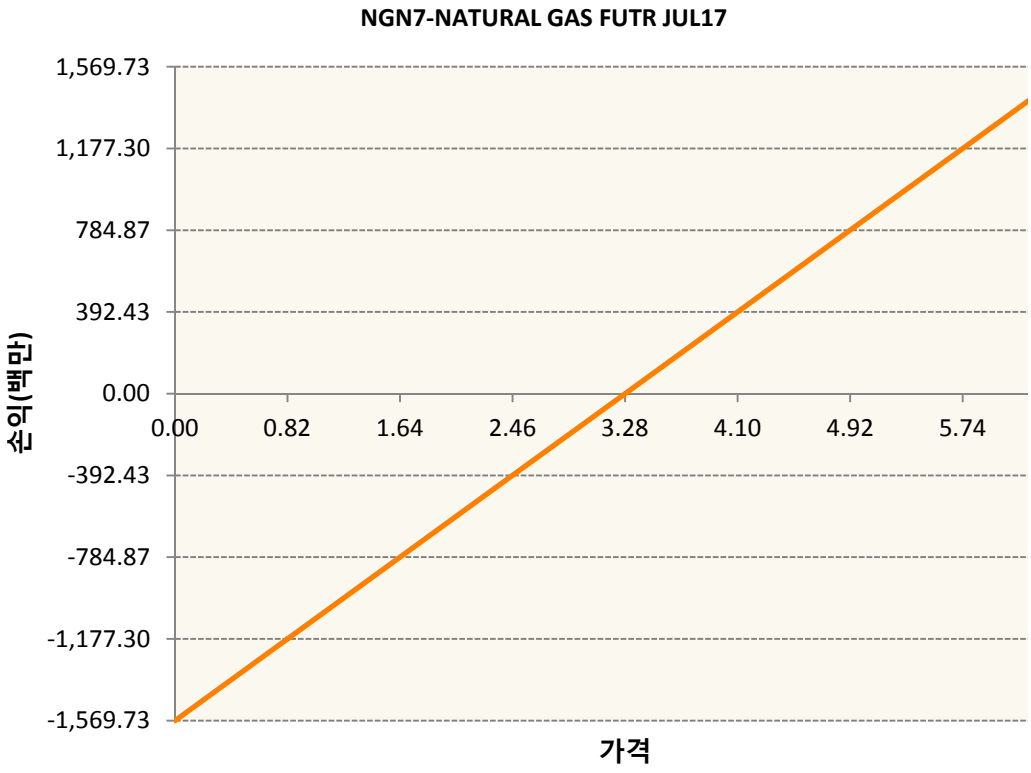


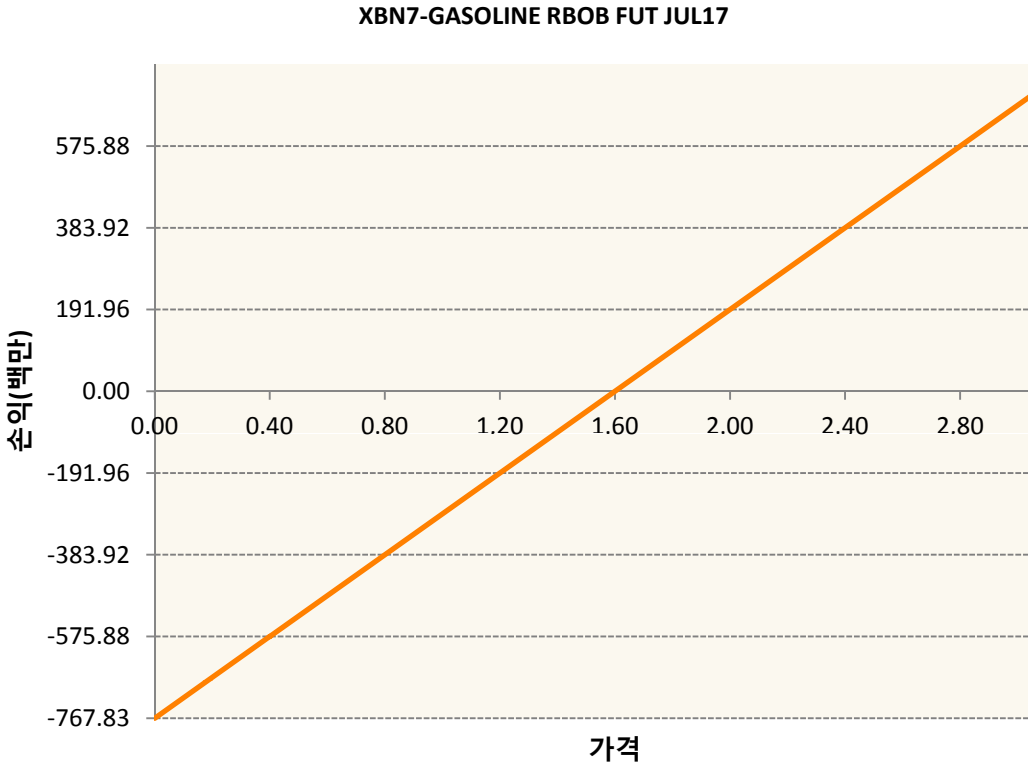

-1,112.73
-1,483.65
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
556.19
370.79
185.40
0.00
-185.40
-370.79
-556.19
-741.58
0.00
0.39
0.78
1.16
1.55
1.94
2.33
2.71
순이익(백만)
가격


KR4175M60005-2017-06 달러선물
225.48
169.11
112.74
56.37
0.00
-56.37
-112.74
-169.11
-225.48
0.00
281.85
563.70
845.55
1,127.40
1,409.25
1,691.10
1,972.95
순이익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,569.73
1,177.30
784.87
392.43
0.00
-392.43
-784.87
-1,177.30
-1,569.73
0.00
0.82
1.64
2.46
3.28
4.10
4.92
5.74
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
575.88
383.92
191.96
0.00
-191.96
-383.92
-575.88
-767.83
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	77
COU7	BRENT CRUDE FUTR SEP17	119
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	59
KR4175M60(	2017-06 달러선물	18
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	126
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	61

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

941

공시일	2017-05-22
기준일	2017-05-19

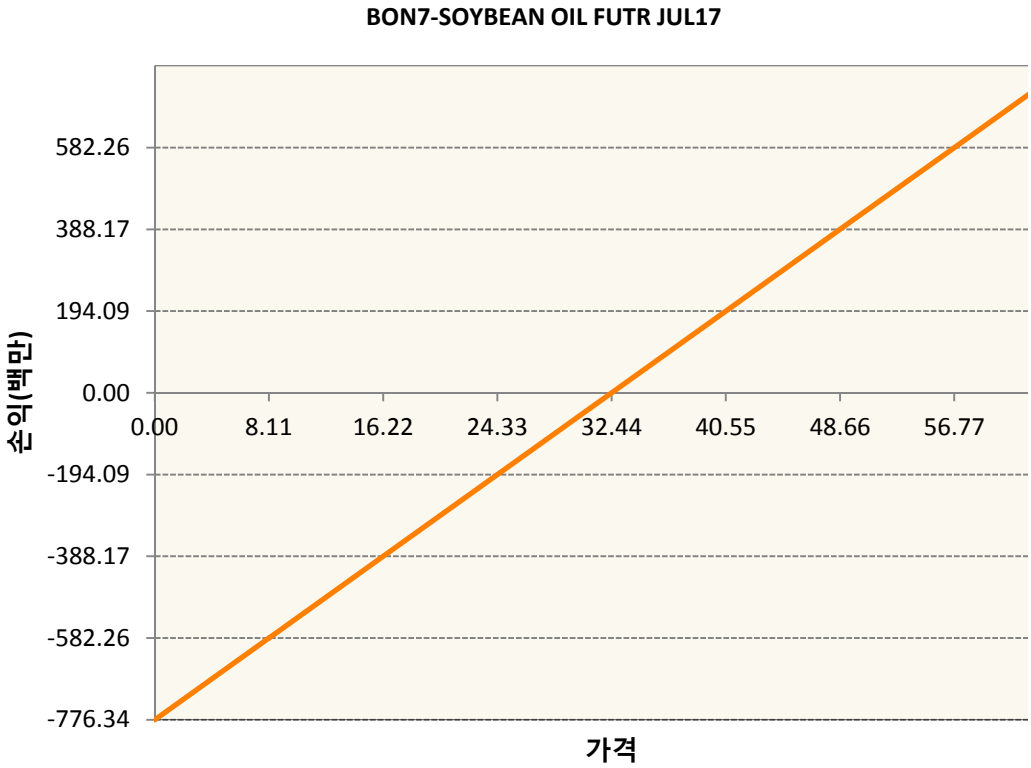
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

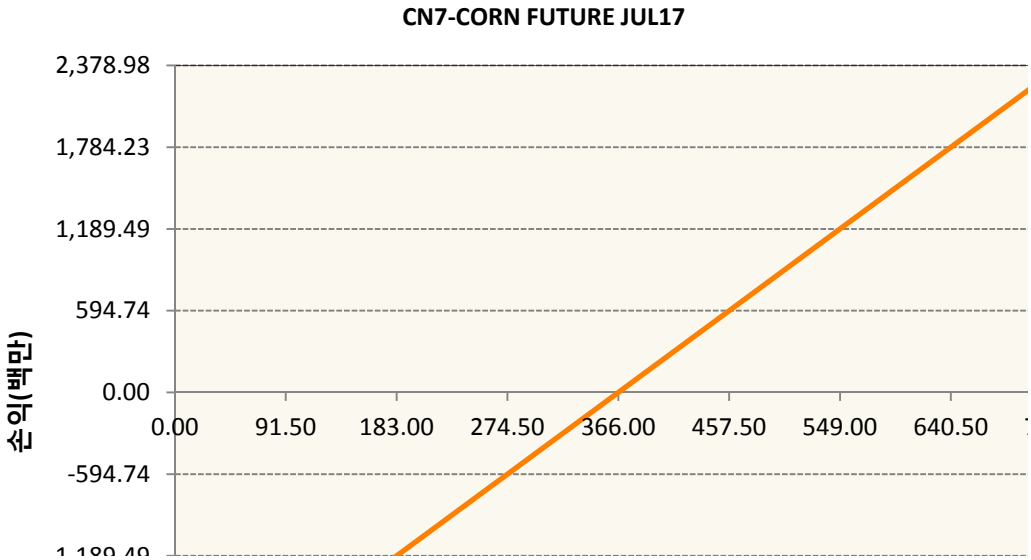
1. 계약금액

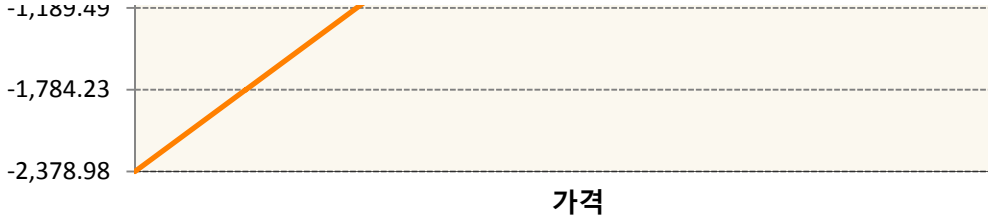
(단위:백만원)

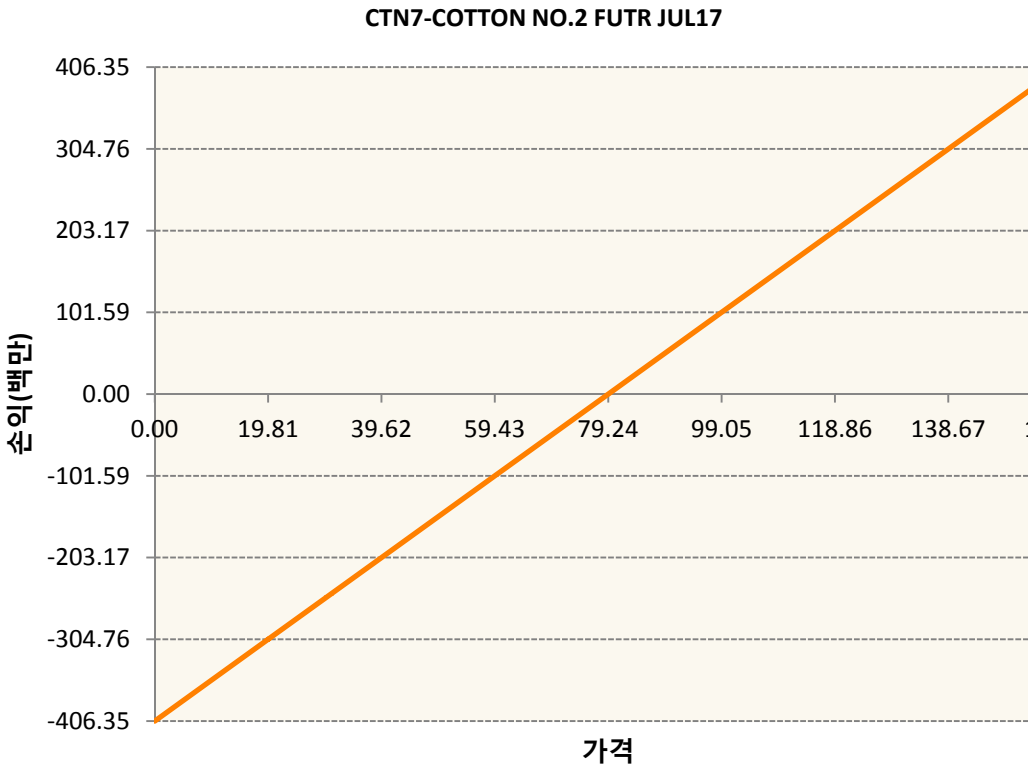
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,789	395	8,395	

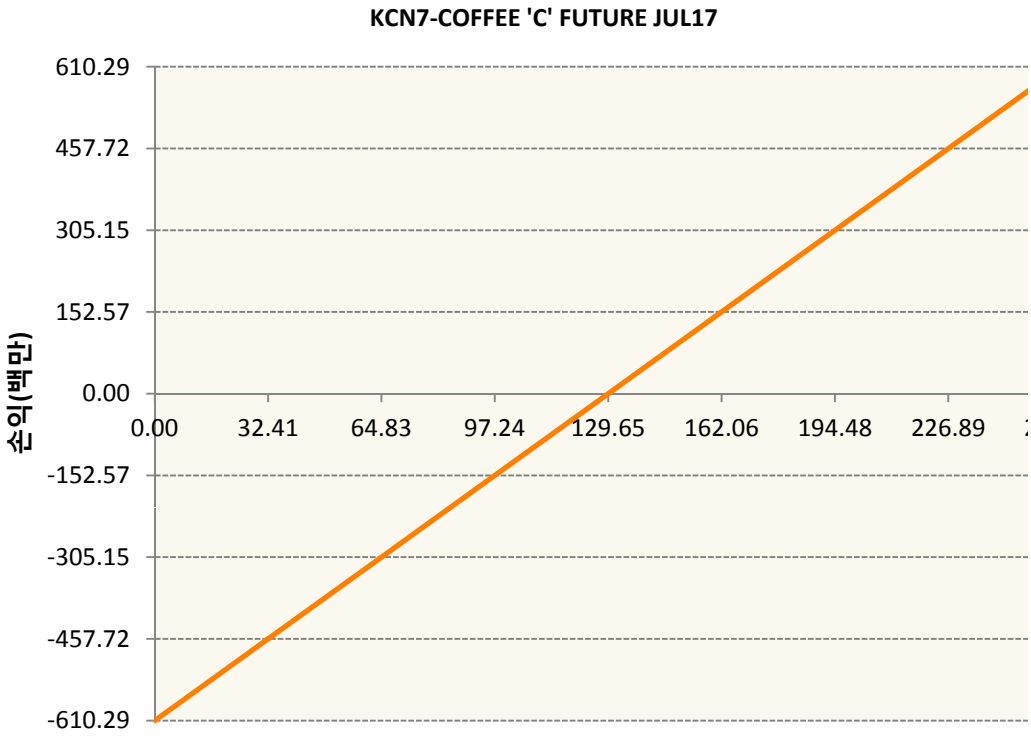
2. 만기시점의 손익구조



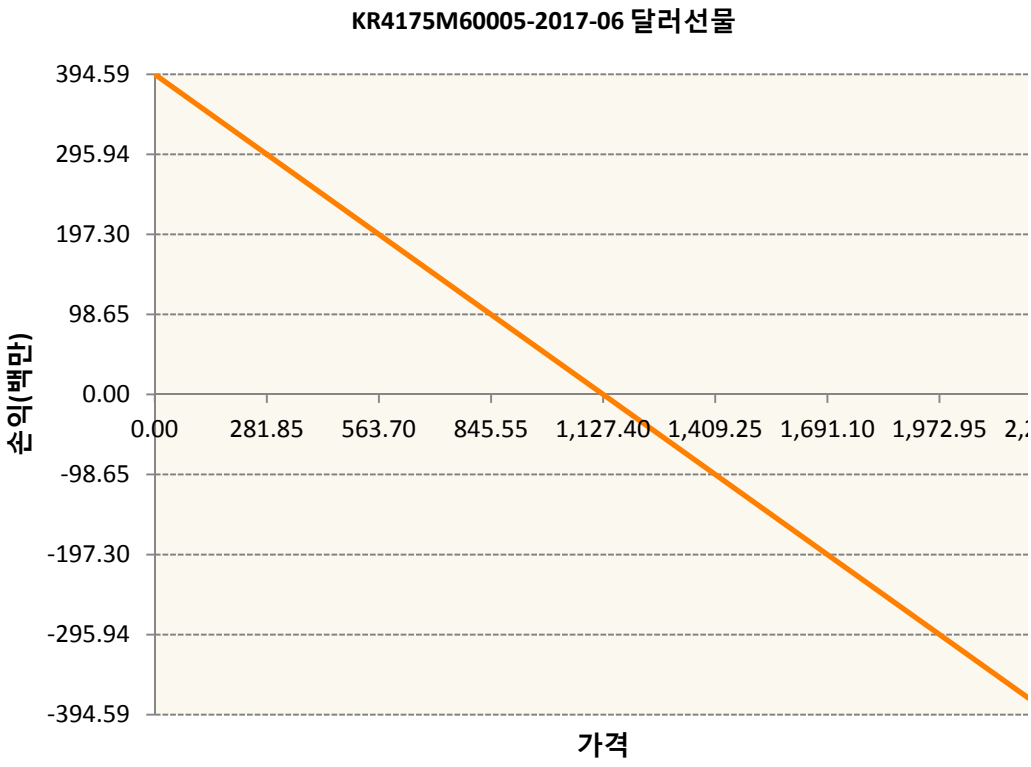


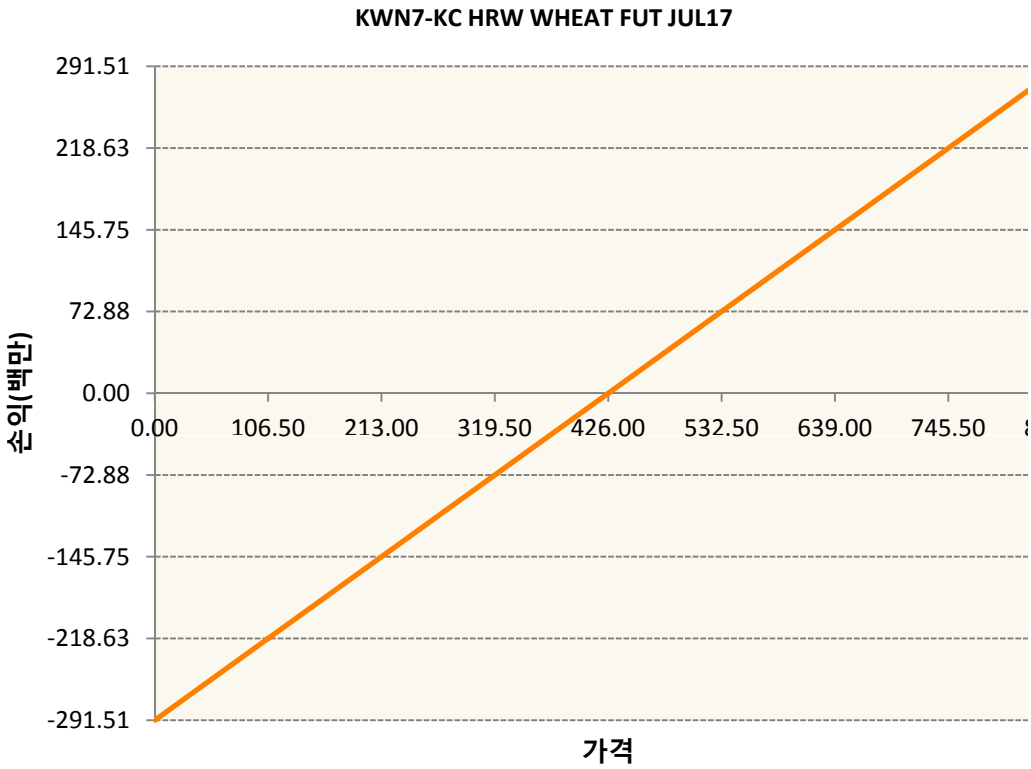

-1,784.23
-2,378.98
가격

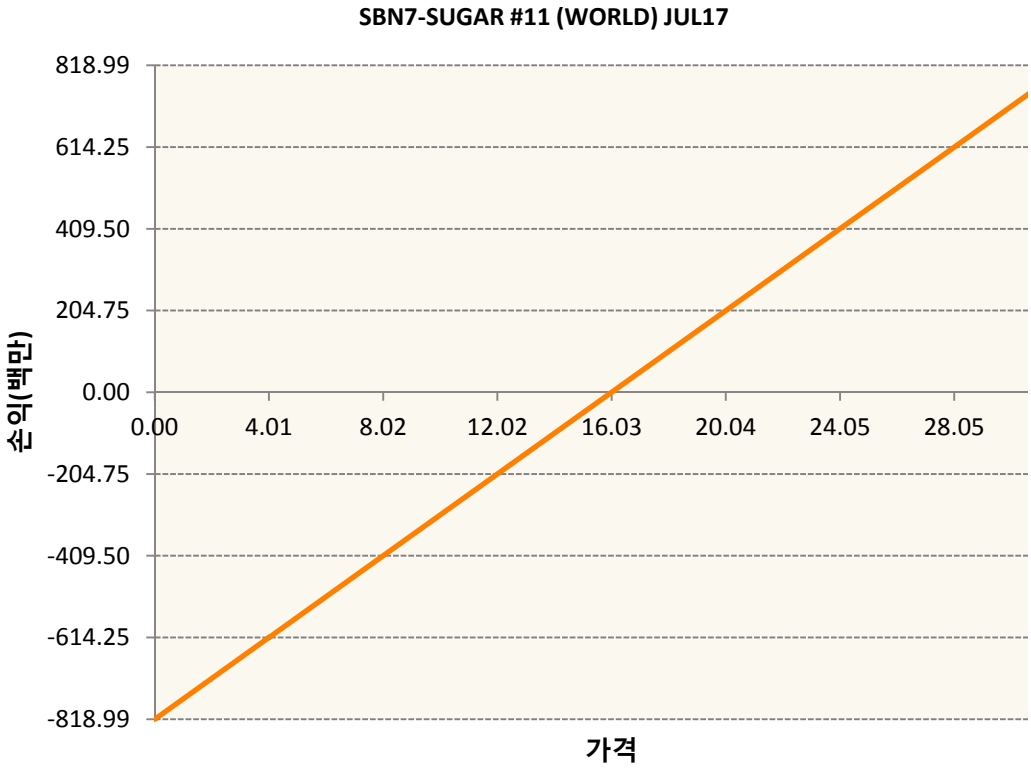

CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
406.35
304.76
203.17
101.59
0.00
-101.59
-203.17
-304.76
-406.35
0.00
19.81
39.62
59.43
79.24
99.05
118.86
138.67
순익(백만)
가격

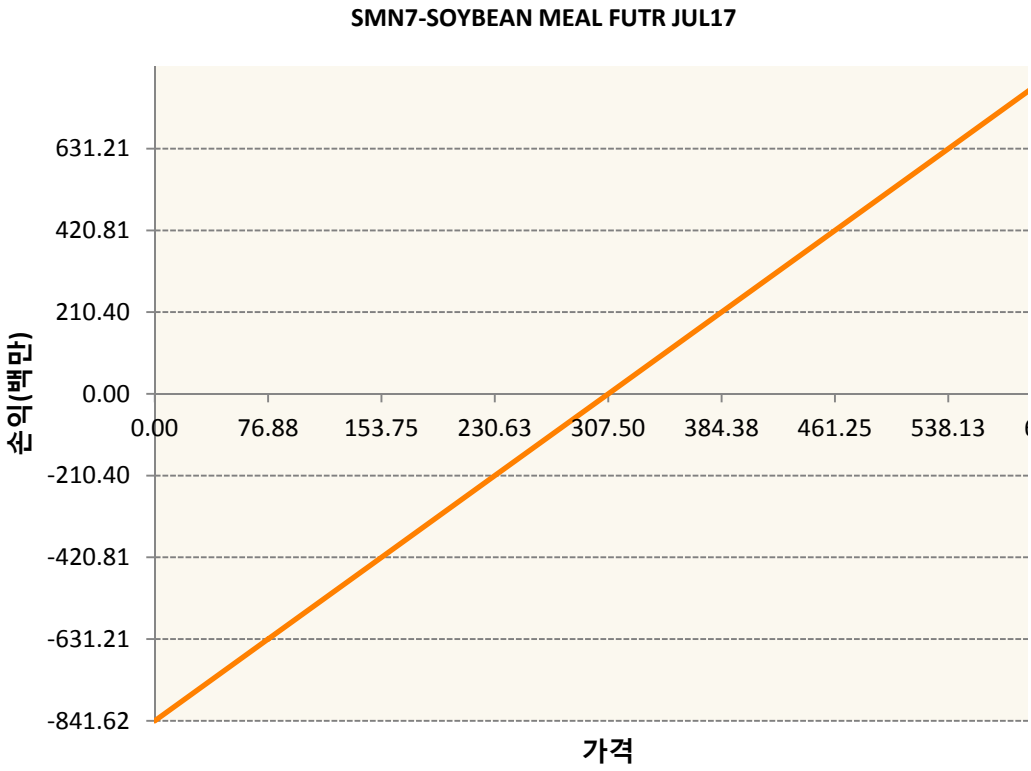

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
610.29
457.72
305.15
152.57
0.00
-152.57
-305.15
-457.72
-610.29
0.00
32.41
64.83
97.24
129.65
162.06
194.48
226.89
순익(백만)

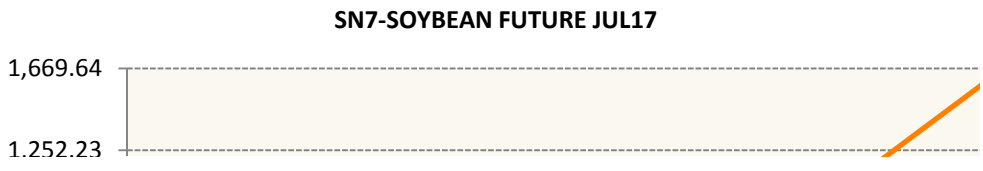
가격

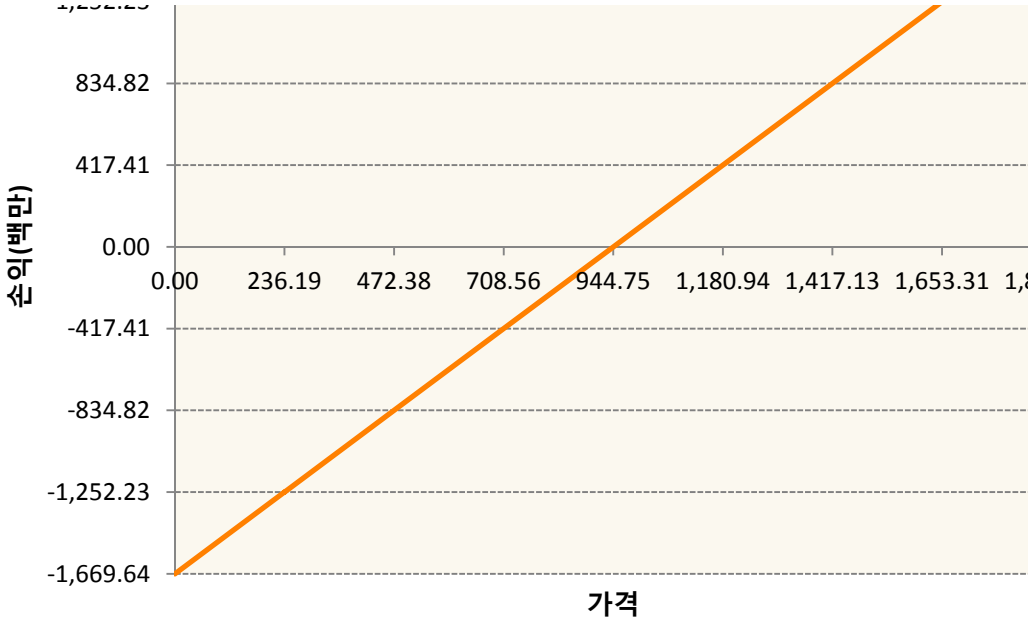

KR4175M60005-2017-06 달러선물
394.59
295.94
197.30
98.65
0.00
-98.65
-197.30
-295.94
-394.59
0.00
281.85
563.70
845.55
1,127.40
1,409.25
1,691.10
1,972.95
손익(백만)
가격

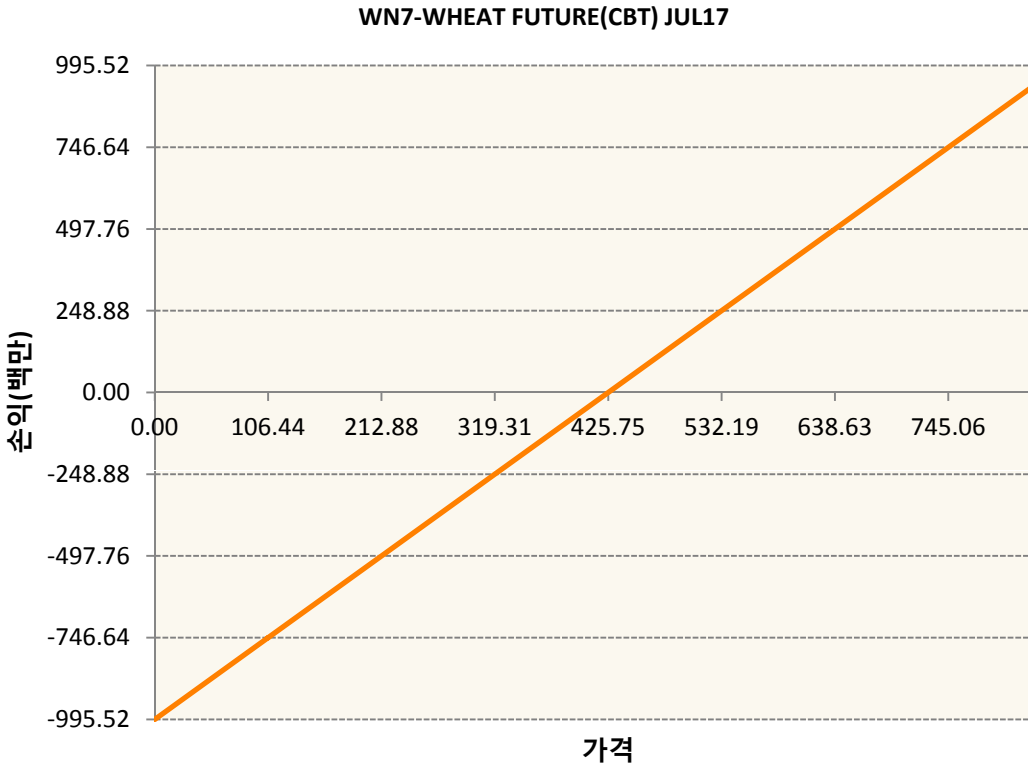

KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17
291.51
218.63
145.75
72.88
0.00
-72.88
-145.75
-218.63
-291.51
0.00
106.50
213.00
319.50
426.00
532.50
639.00
745.50
손익(백만)
가격


SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
818.99
614.25
409.50
204.75
0.00
-204.75
-409.50
-614.25
-818.99
0.00
4.01
8.02
12.02
16.03
20.04
24.05
28.05
손익(백만)
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
631.21
420.81
210.40
0.00
-210.40
-420.81
-631.21
-841.62
0.00
76.88
153.75
230.63
307.50
384.38
461.25
538.13
손익(백만)
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,669.64
1,252.23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	62
CN7	CORN FUTURE JUL17	190
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	33
KCN7	COFFEE 'C' FUTURE JUL17	49
KR4175M60(	2017-06 달러선물	32

KWN7	KC HRW WHEAT FUT JUL17	23
SBN7	SUGAR #11 (WORLD) JUL17	66
SMN7	SOYBEAN MEAL FUTR JUL17	67
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	134
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	80

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

800