공시일	2017-05-23
기준일	2017-05-22

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	2017-05-23
기준일	2017-05-22

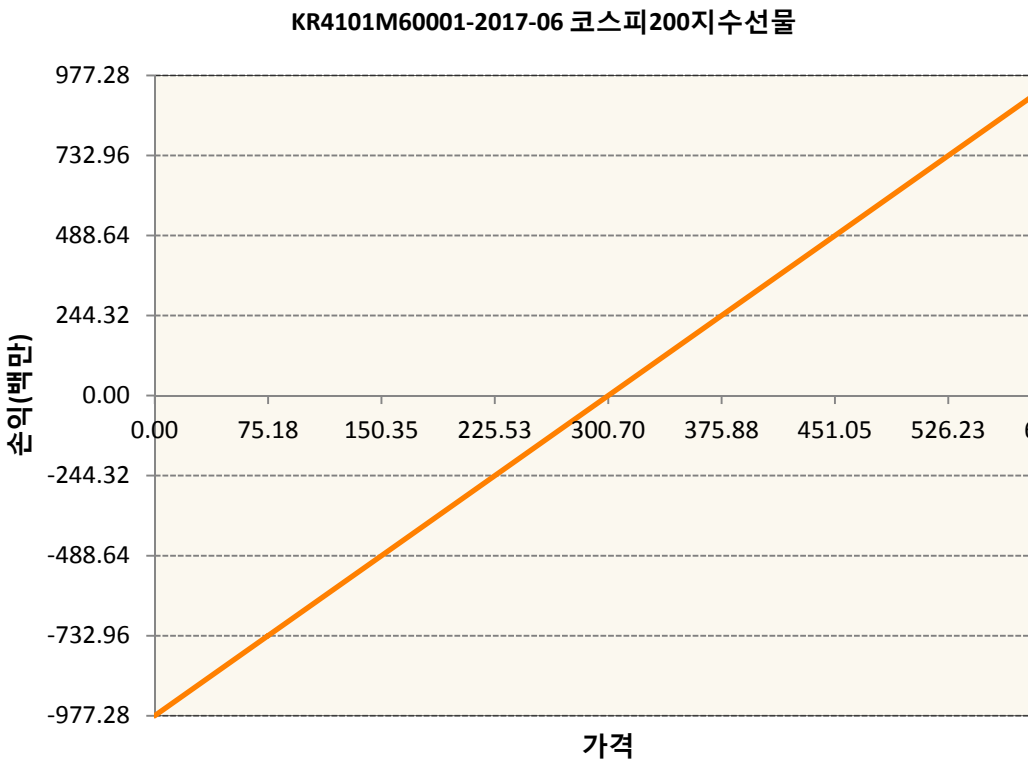
스마트인덱스모

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	977	0	977	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							78
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
-5.33%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
-2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	26	26	26	26	26	26	26
5.33%	52	52	52	52	52	52	52
8.00%	78	78	78	78	78	78	78

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

52

공시일	2017-05-23
기준일	2017-05-22

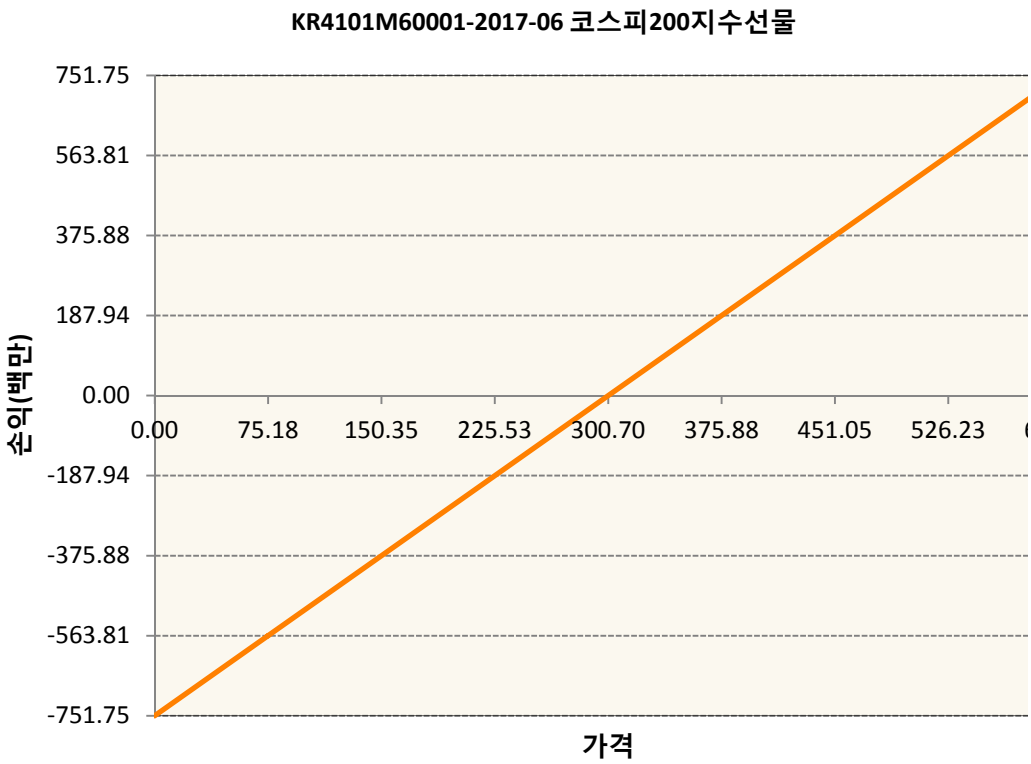
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	752	0	752	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							60
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
-5.33%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
-2.67%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	20	20	20	20	20	20	20
5.33%	40	40	40	40	40	40	40
8.00%	60	60	60	60	60	60	60

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

40

공시일	2017-05-23
기준일	2017-05-22

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	984

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

545

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-05-23
기준일	2017-05-22

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)

332

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-05-23
기준일	2017-05-22

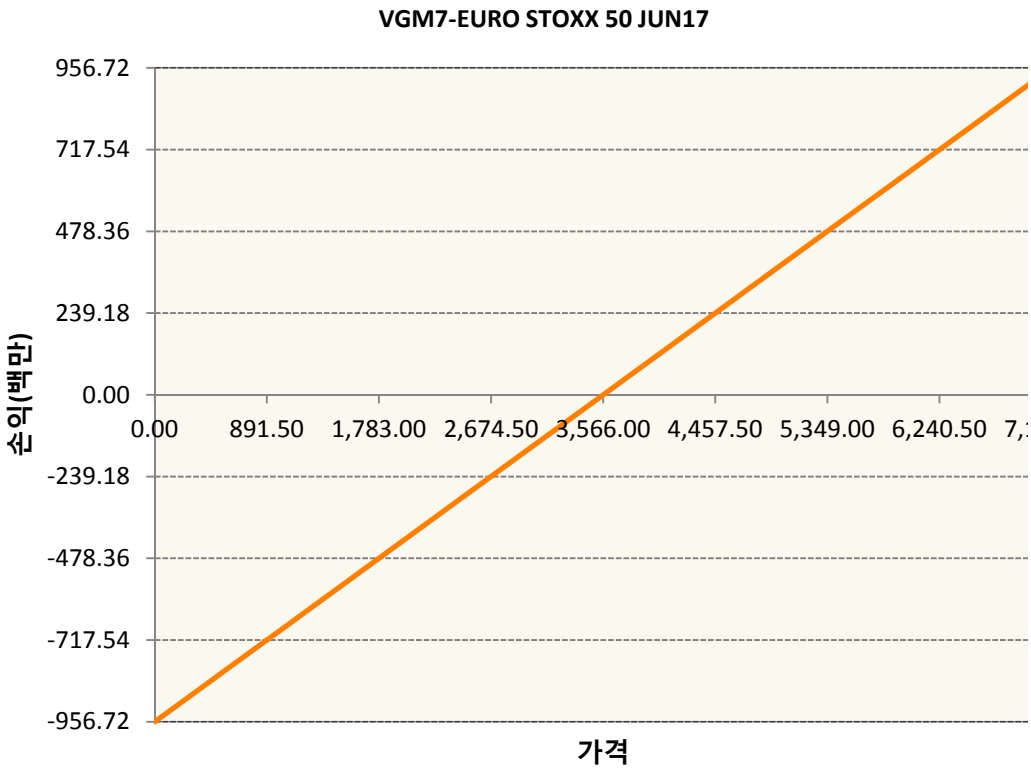
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	957	0	957	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM7	EURO STOXX 50 JUN17	77

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

(단위:백만원)

75

공시일	2017-05-23
기준일	2017-05-22

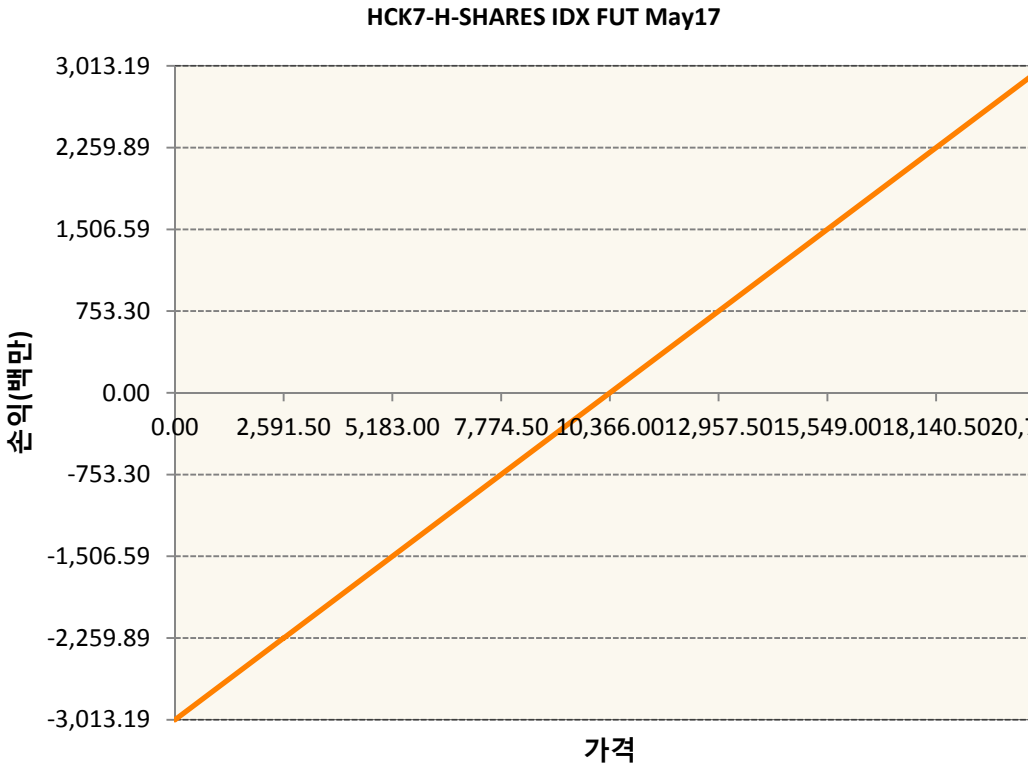
차이나인덱스모(주식-파생형)

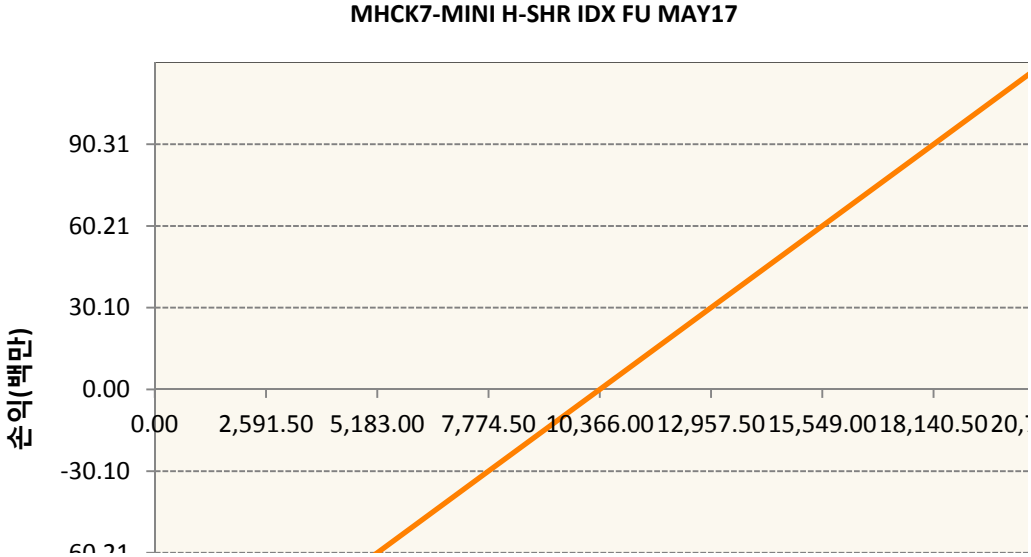
1. 계약금액

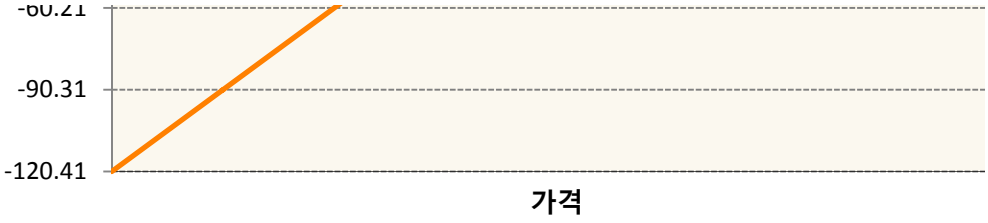
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,134	0	3,134	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCK7	H-SHARES IDX FUT May17	241
MHCK7	MINI H-SHR IDX FU MAY17	10

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

264

공시일	2017-05-23
기준일	2017-05-22

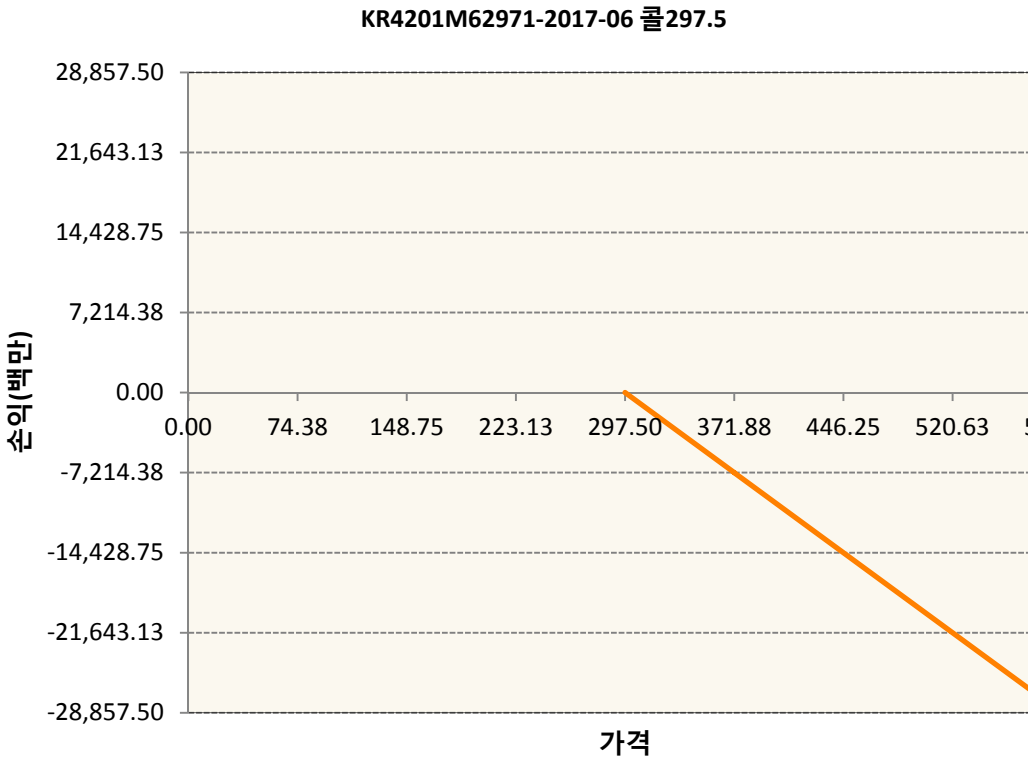
커버드콜모(주식혼합-파생형)

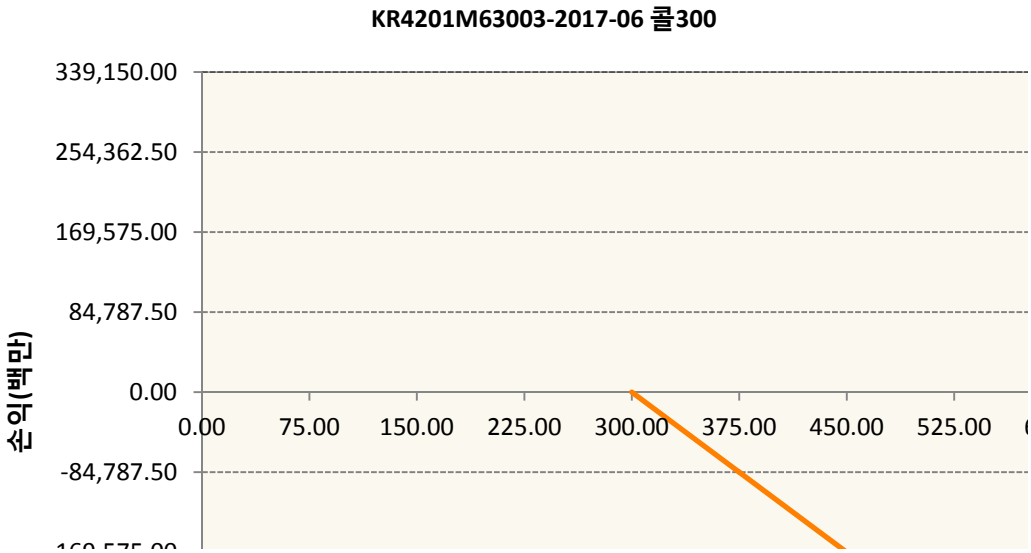
1. 계약금액

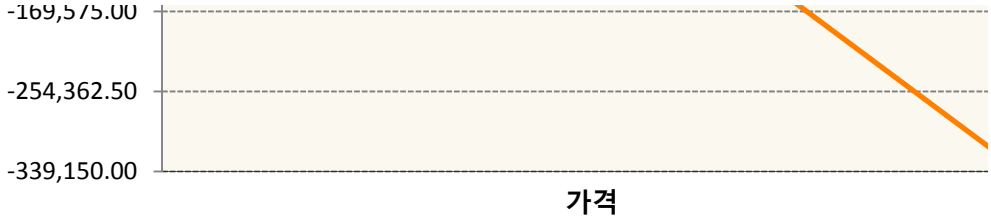
(단위:백만원)

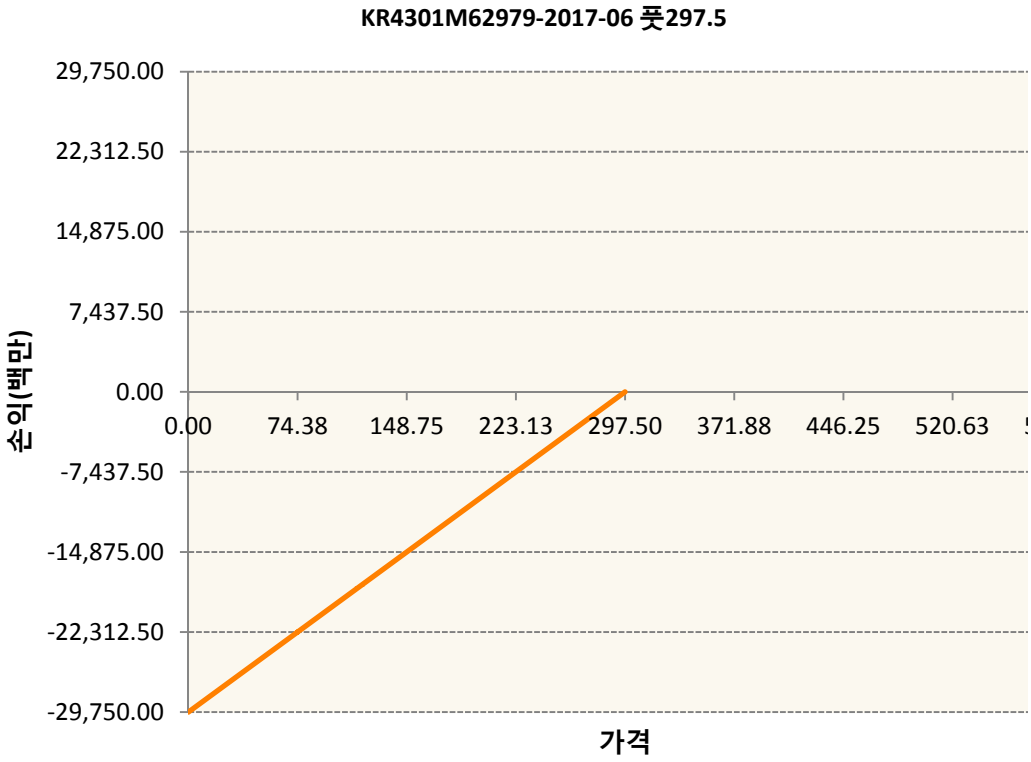
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	607,758	-607,758	장내

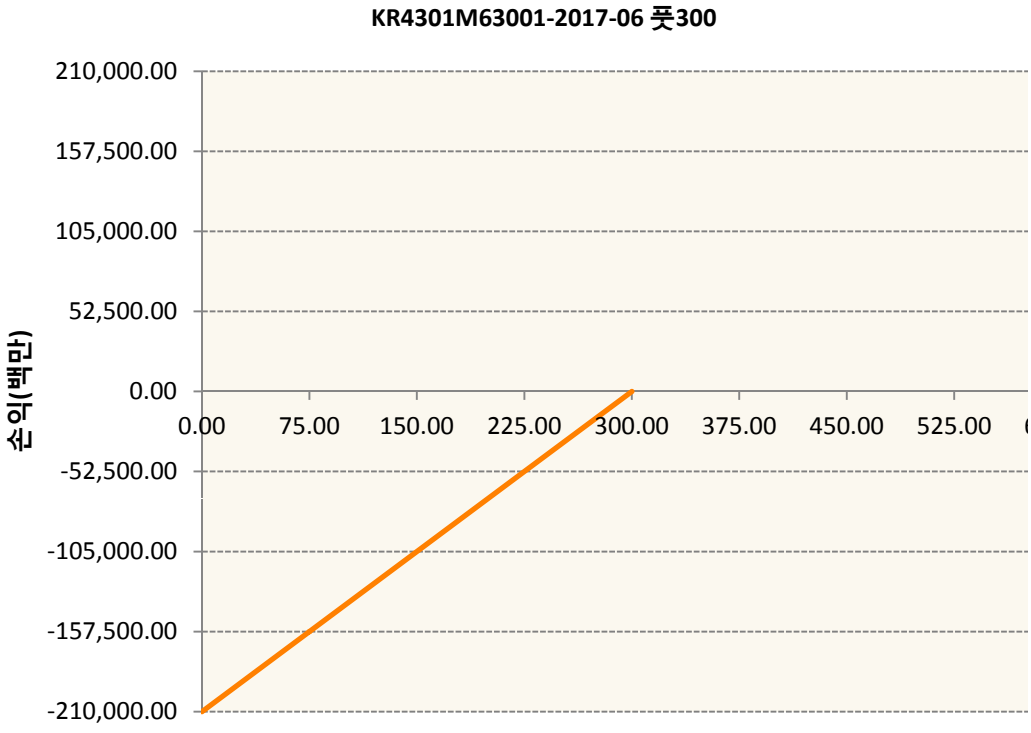
2. 만기시점의 손익구조






-169,575.00
-254,362.50
-339,150.00
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						2,137
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	498	497	497	496	495	494	491
-5.33%	494	490	485	478	470	460	449
-2.67%	424	404	382	360	338	314	291
0%	74	50	25	0	-25	-51	-77
2.67%	-591	-598	-607	-618	-630	-644	-660
5.33%	-1,358	-1,359	-1,360	-1,362	-1,365	-1,369	-1,374
8.00%	-2,135	-2,135	-2,135	-2,135	-2,136	-2,136	-2,137
KR4201M63(	2017-06 콜300						23,754
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,157	4,156	4,155	4,152	4,145	4,134	4,117
-5.33%	4,143	4,124	4,094	4,048	3,988	3,911	3,819
-2.67%	3,750	3,584	3,398	3,195	2,978	2,749	2,511
0%	947	632	316	0	-316	-632	-948
2.67%	-5,888	-6,030	-6,195	-6,380	-6,580	-6,795	-7,021
5.33%	-14,657	-14,675	-14,704	-14,747	-14,807	-14,882	-14,974
8.00%	-23,702	-23,702	-23,704	-23,709	-23,717	-23,732	-23,754
KR4301M62(	2017-06 풋297.5						1,897
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,890	-1,890	-1,891	-1,891	-1,893	-1,894	-1,897
-5.33%	-1,093	-1,097	-1,102	-1,109	-1,118	-1,128	-1,139
-2.67%	-364	-385	-407	-430	-453	-477	-501
0%	76	51	26	0	-26	-53	-79
2.67%	192	184	175	164	151	137	121
5.33%	202	201	200	198	195	191	186
8.00%	202	202	202	202	202	201	200
KR4301M63(	2017-06 풋300						14,273
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,249	-14,249	-14,250	-14,252	-14,256	-14,263	-14,273
-5.33%	-8,650	-8,661	-8,680	-8,708	-8,746	-8,793	-8,850
-2.67%	-3,286	-3,388	-3,504	-3,629	-3,764	-3,905	-4,053
0%	586	391	196	0	-196	-391	-587
2.67%	1,962	1,873	1,771	1,657	1,533	1,400	1,260

5.33%	2,139	2,129	2,110	2,084	2,047	2,000	1,943
8.00%	2,147	2,146	2,145	2,142	2,137	2,128	2,114

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

49,776

공시일	2017-05-23
기준일	2017-05-22

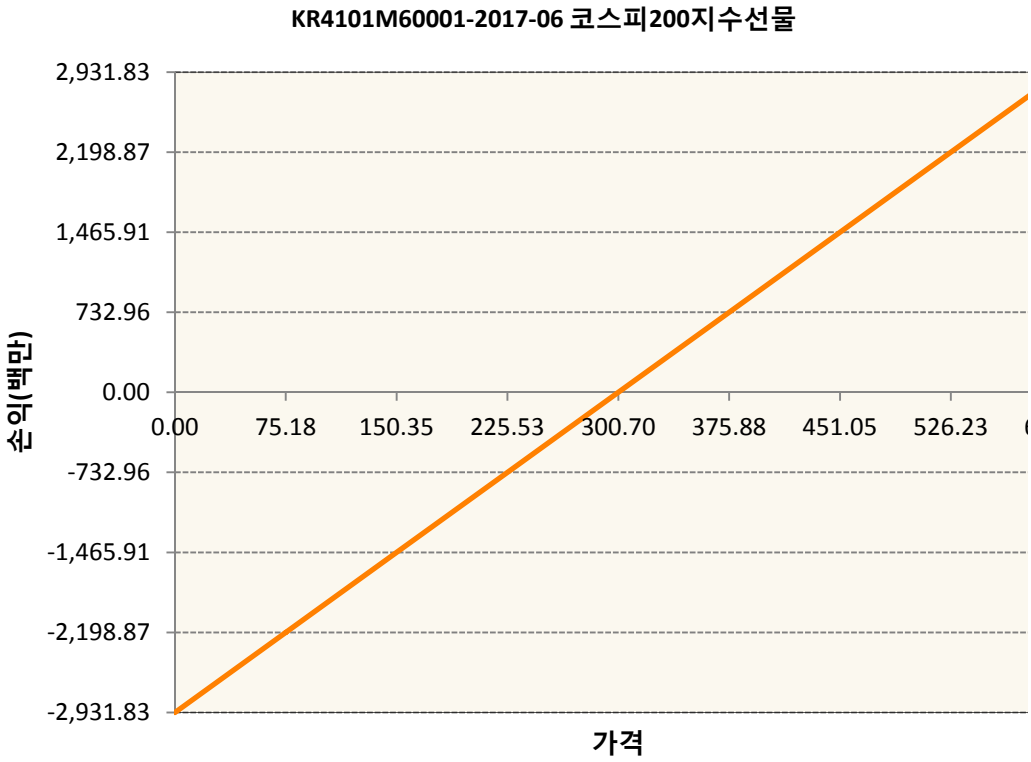
커버드콜목표전환형증권투자신탁

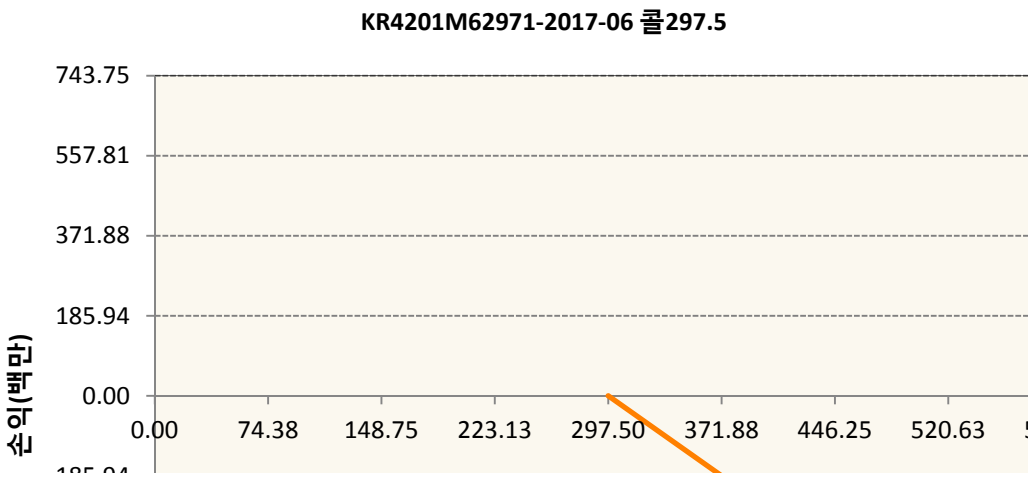
1. 계약금액

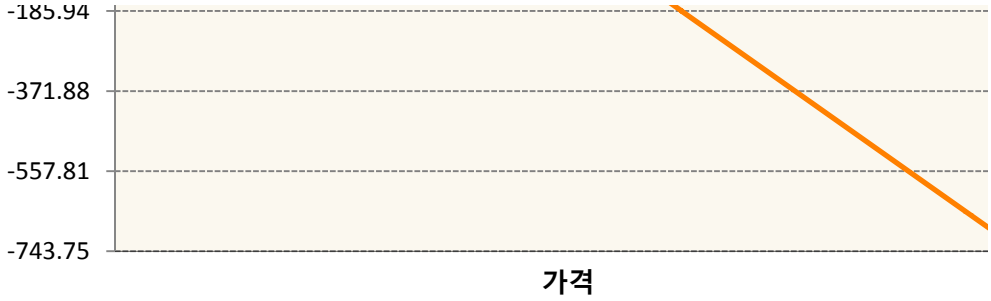
(단위:백만원)

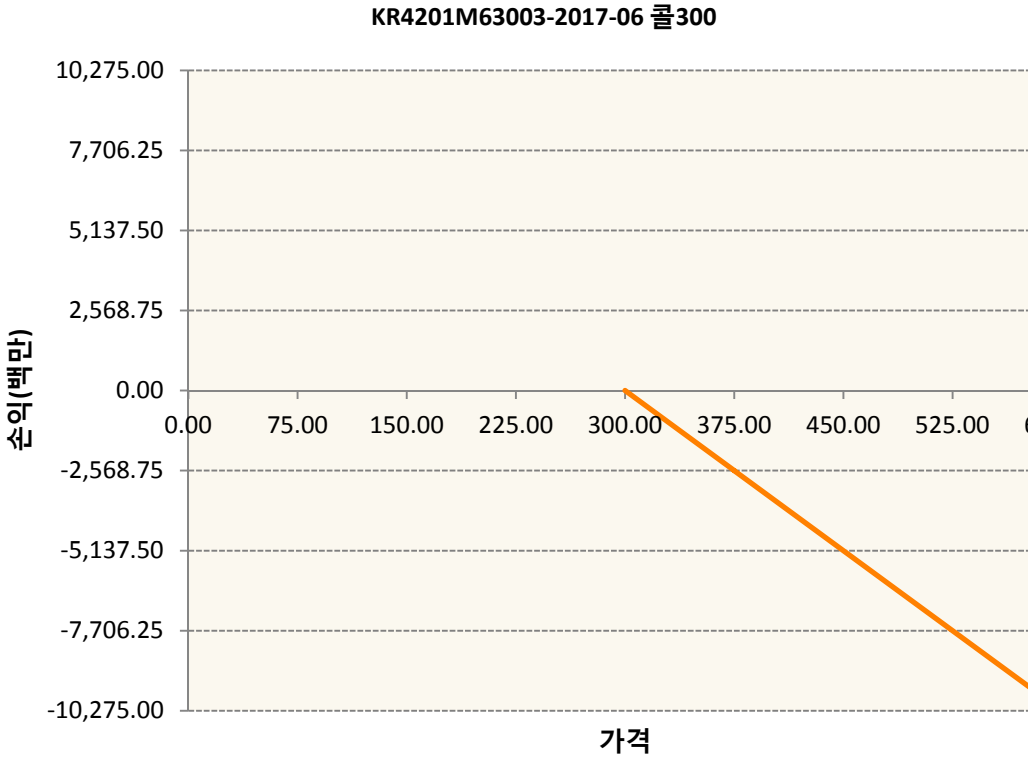
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,932	0	2,932	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,590	-12,590	장내

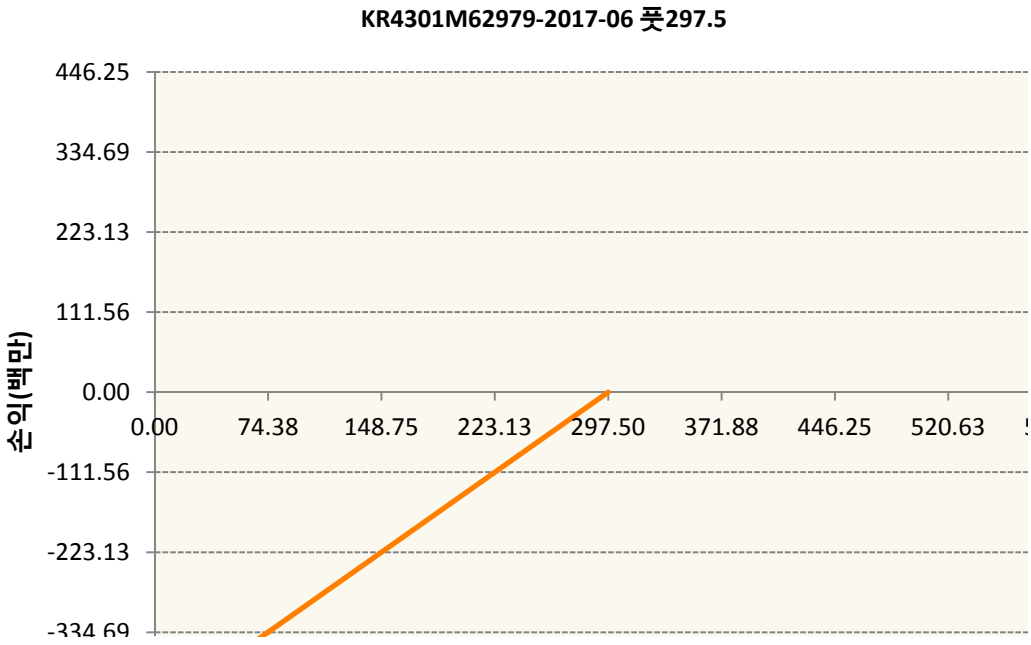
2. 만기시점의 손익구조



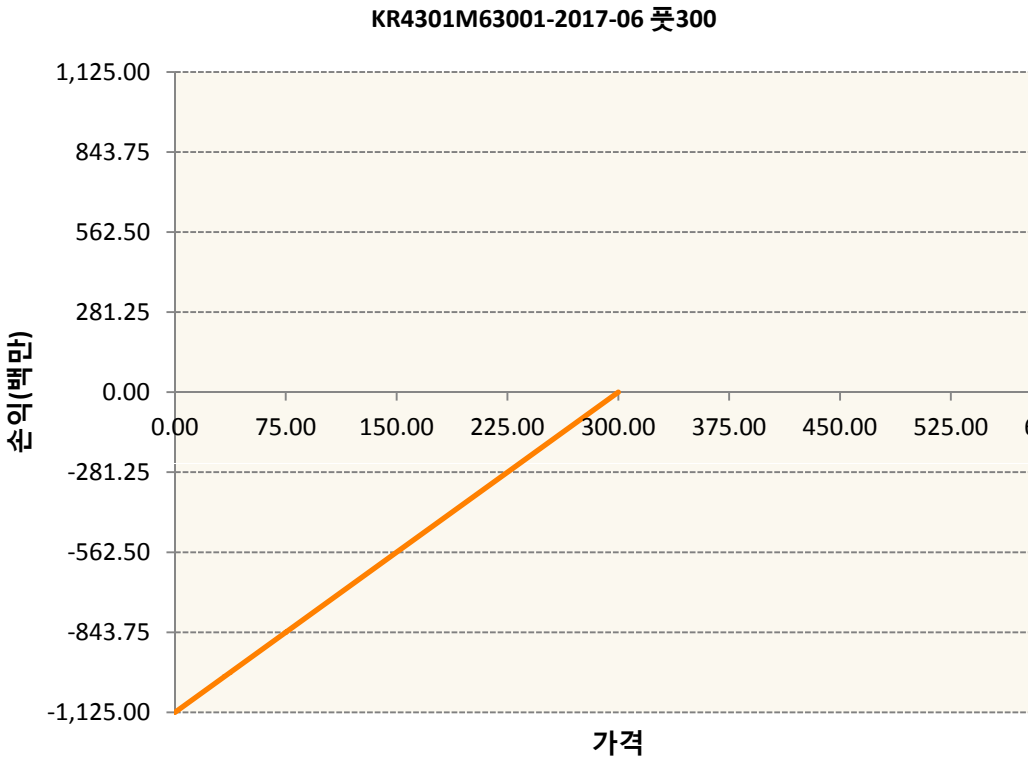



-185.94
-371.88
-557.81
-743.75
가격


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
446.25
334.69
223.13
111.56
0.00
-111.56
-223.13
-334.69
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							55
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13	13	13	13	13	13	13
-5.33%	13	13	13	12	12	12	12
-2.67%	11	10	10	9	9	8	7

0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	-15	-15	-16	-16	-16	-17	-17
5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
	KR4201M63(	2017-06 콜300					720
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	126	126	126	126	126	125	125
-5.33%	126	125	124	123	121	119	116
-2.67%	114	109	103	97	90	83	76
0%	29	19	10	0	-10	-19	-29
2.67%	-178	-183	-188	-193	-199	-206	-213
5.33%	-444	-445	-445	-447	-449	-451	-454
8.00%	-718	-718	-718	-718	-719	-719	-720
	KR4301M62(	2017-06 풋297.5					28
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
-5.33%	-16	-16	-17	-17	-17	-17	-17
-2.67%	-5	-6	-6	-6	-7	-7	-8
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	3	3	3	2	2	2	2
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3
	KR4301M63(	2017-06 풋300					76
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
-5.33%	-46	-46	-47	-47	-47	-47	-47
-2.67%	-18	-18	-19	-19	-20	-21	-22
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	11	10	9	9	8	8	7
5.33%	11	11	11	11	11	11	10
8.00%	11	11	11	11	11	11	11

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

1,204

공시일	2017-05-23
기준일	2017-05-22

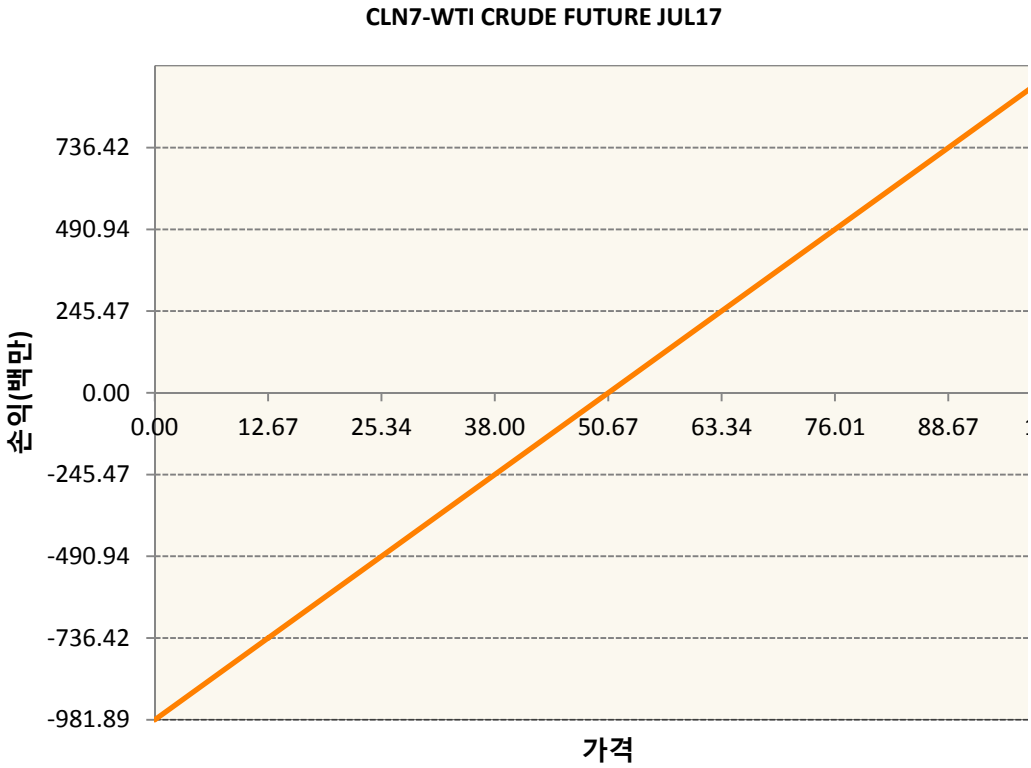
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

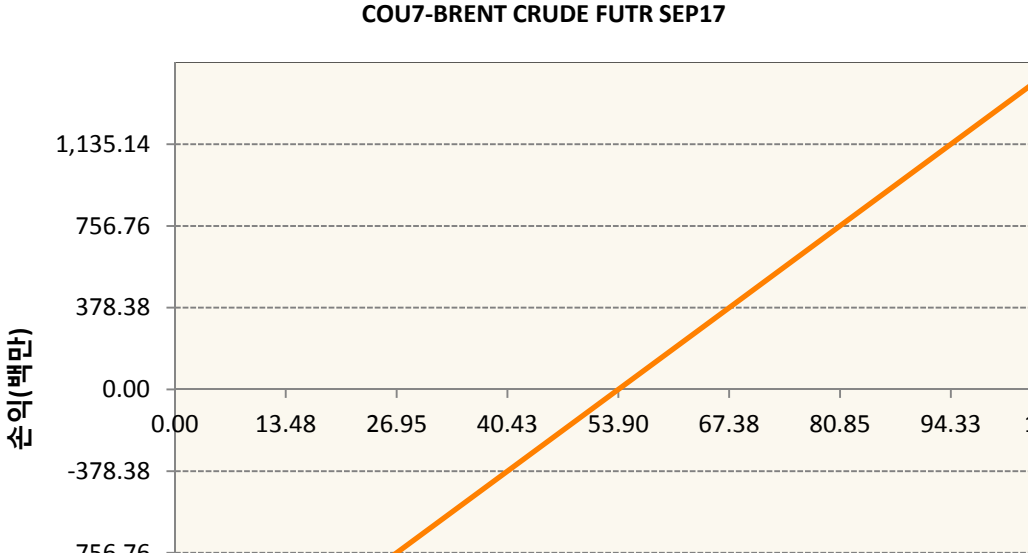
1. 계약금액

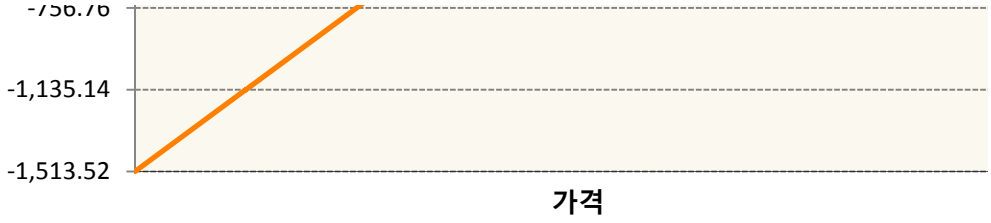
(단위:백만원)

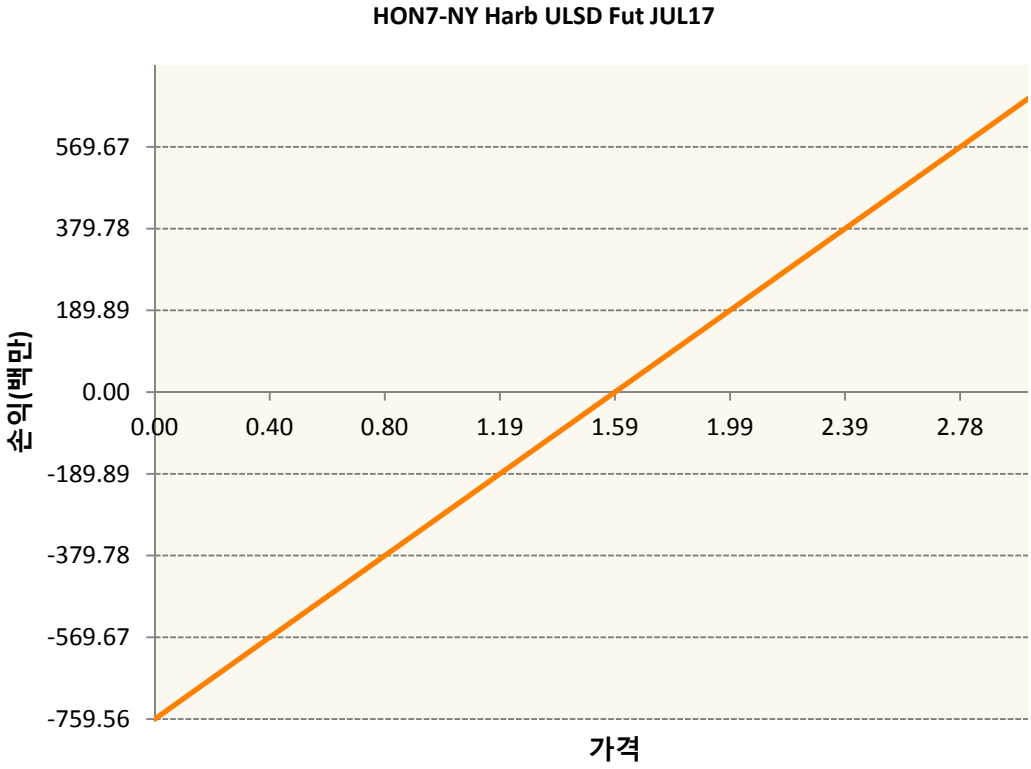
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,648	223	5,425	

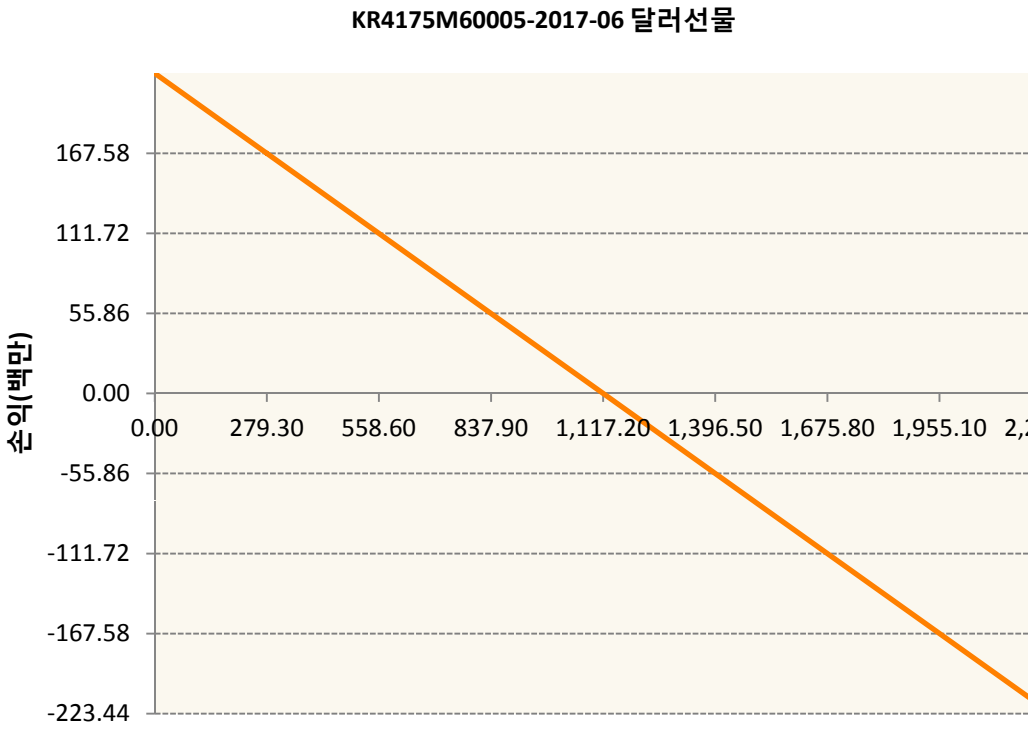
2. 만기시점의 손익구조



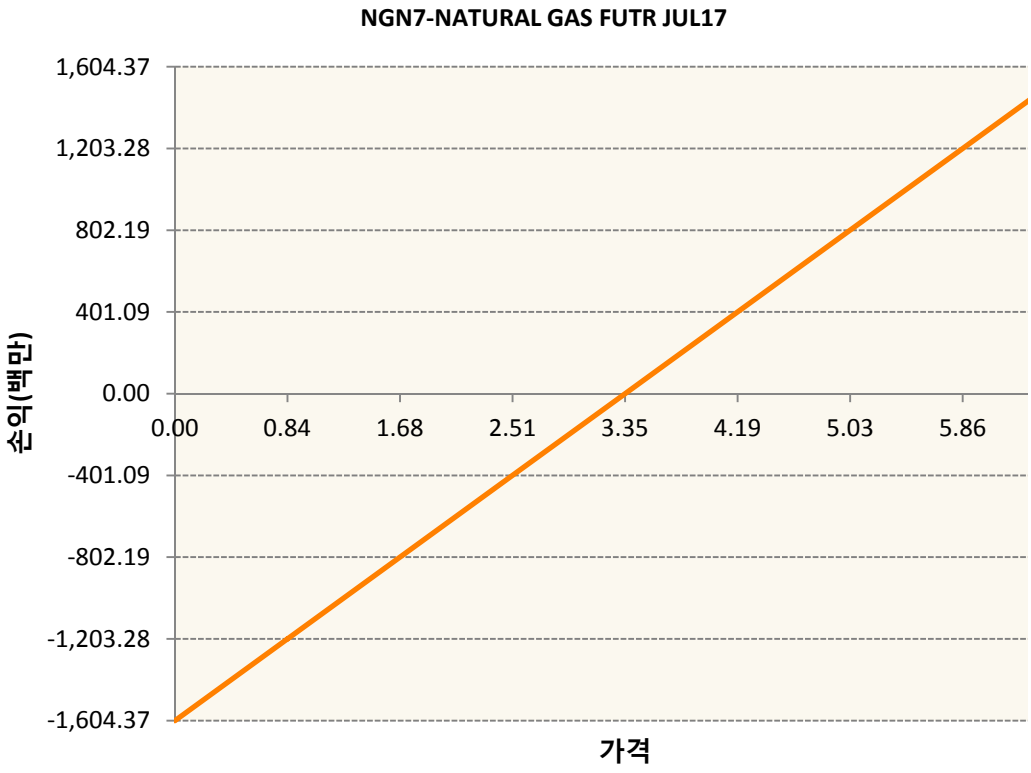


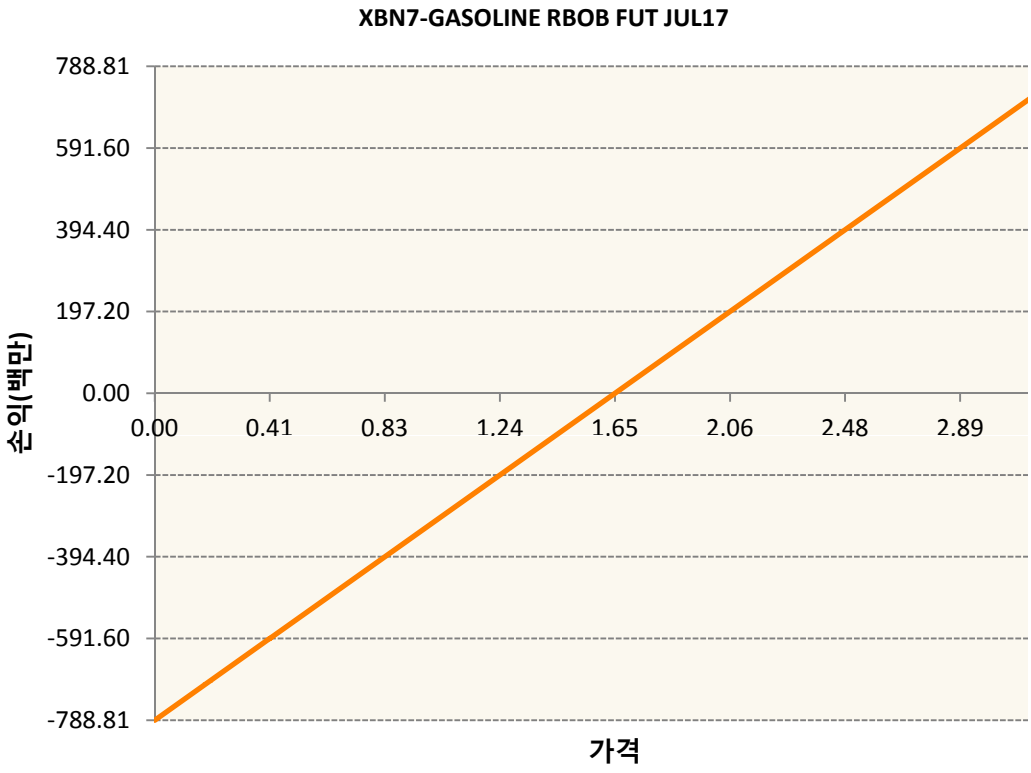

-1,135.14
-1,513.52
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
569.67
379.78
189.89
0.00
-189.89
-379.78
-569.67
-759.56
0.00
0.40
0.80
1.19
1.59
1.99
2.39
2.78
순이익(백만)
가격


KR4175M60005-2017-06 달러선물
167.58
111.72
55.86
0.00
-55.86
-111.72
-167.58
-223.44
0.00
279.30
558.60
837.90
1,117.20
1,396.50
1,675.80
1,955.10
순이익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,604.37
1,203.28
802.19
401.09
0.00
-401.09
-802.19
-1,203.28
-1,604.37
0.00
0.84
1.68
2.51
3.35
4.19
5.03
5.86
순익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
788.81
591.60
394.40
197.20
0.00
-197.20
-394.40
-591.60
-788.81
0.00
0.41
0.83
1.24
1.65
2.06
2.48
2.89
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN7	WTI CRUDE FUTURE JUL17	79
COU7	BRENT CRUDE FUTR SEP17	121
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	61
KR4175M60(	2017-06 달러선물	18
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	128
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	63

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

961

공시일	2017-05-23
기준일	2017-05-22

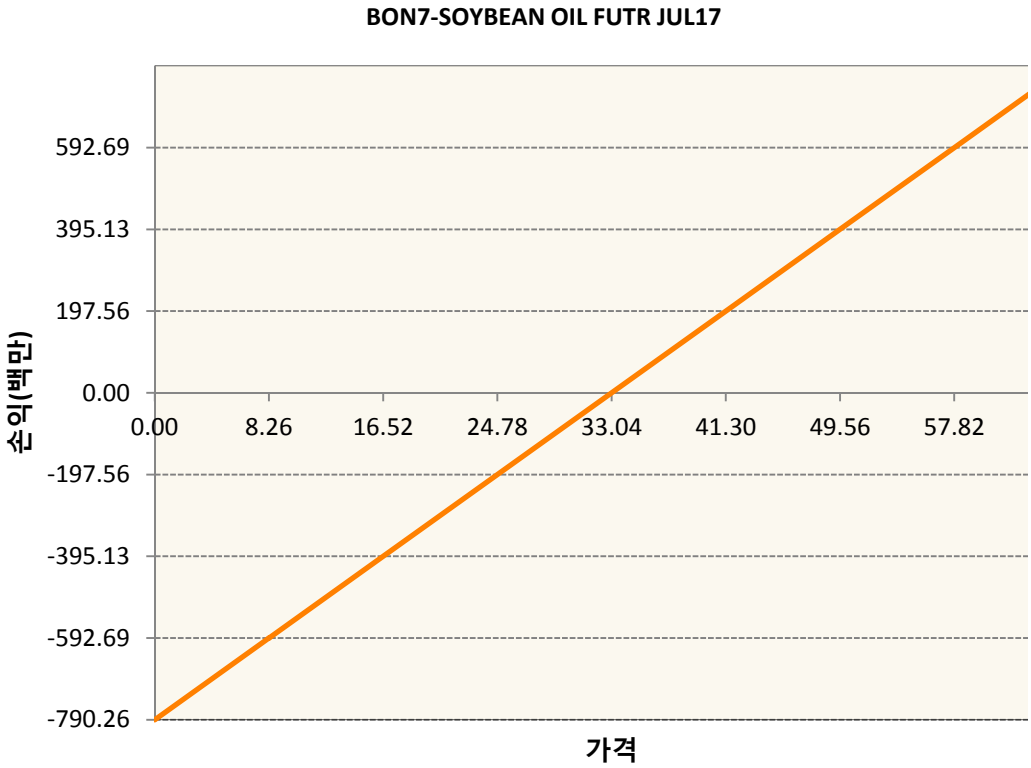
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

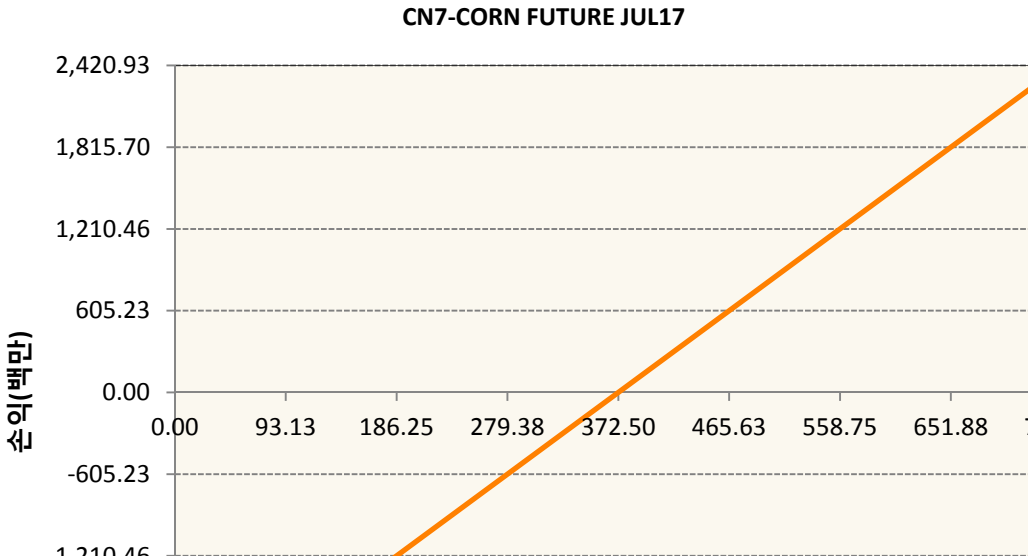
1. 계약금액

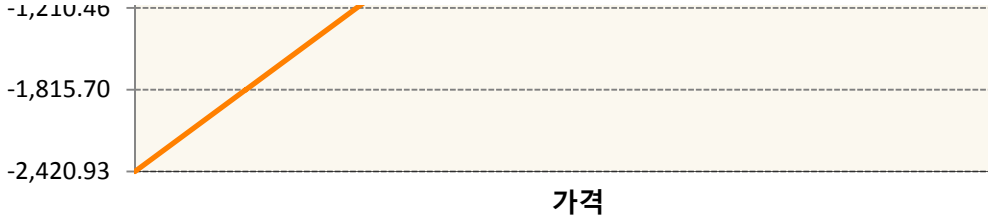
(단위:백만원)

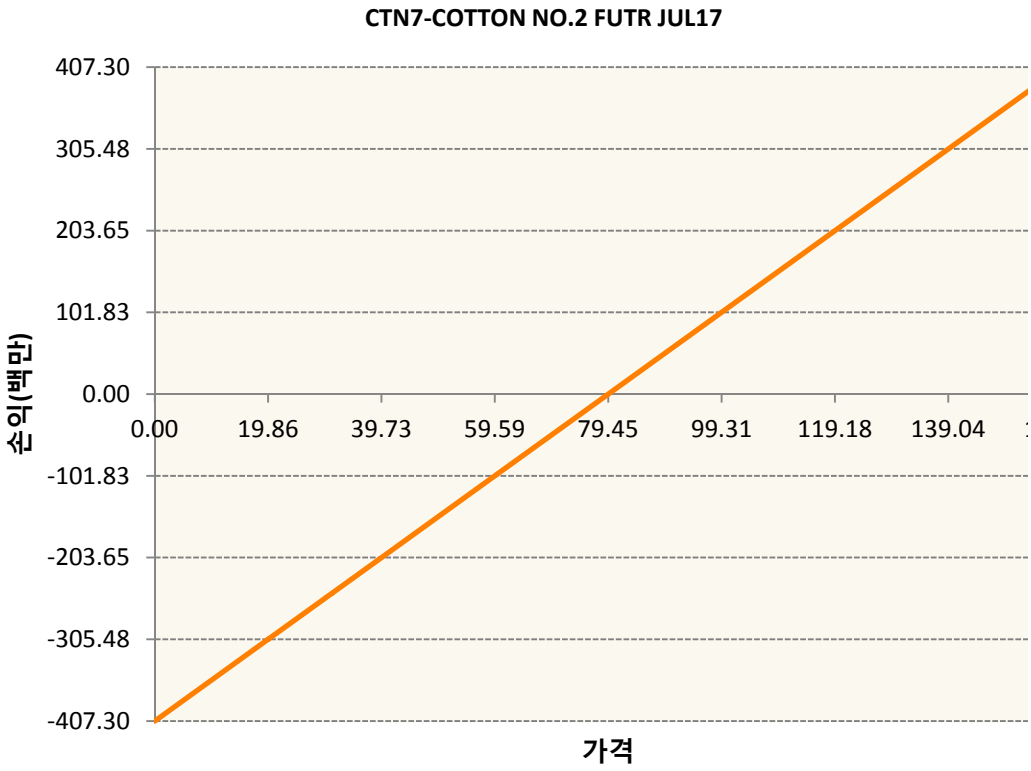
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,919	391	8,528	

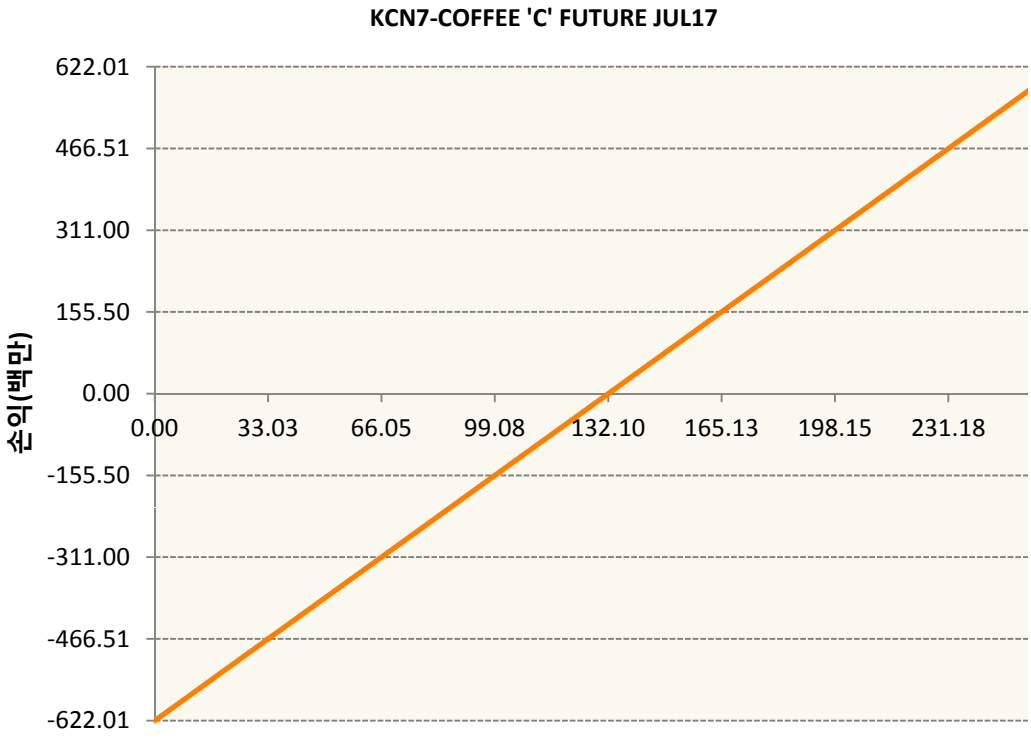
2. 만기시점의 손익구조



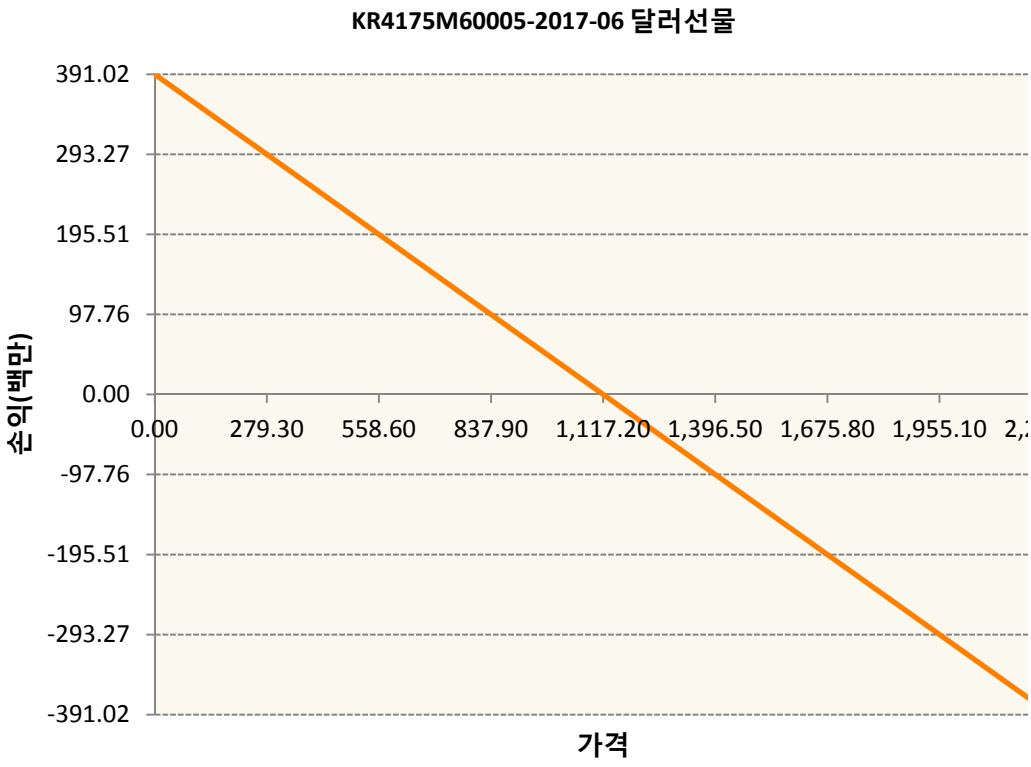


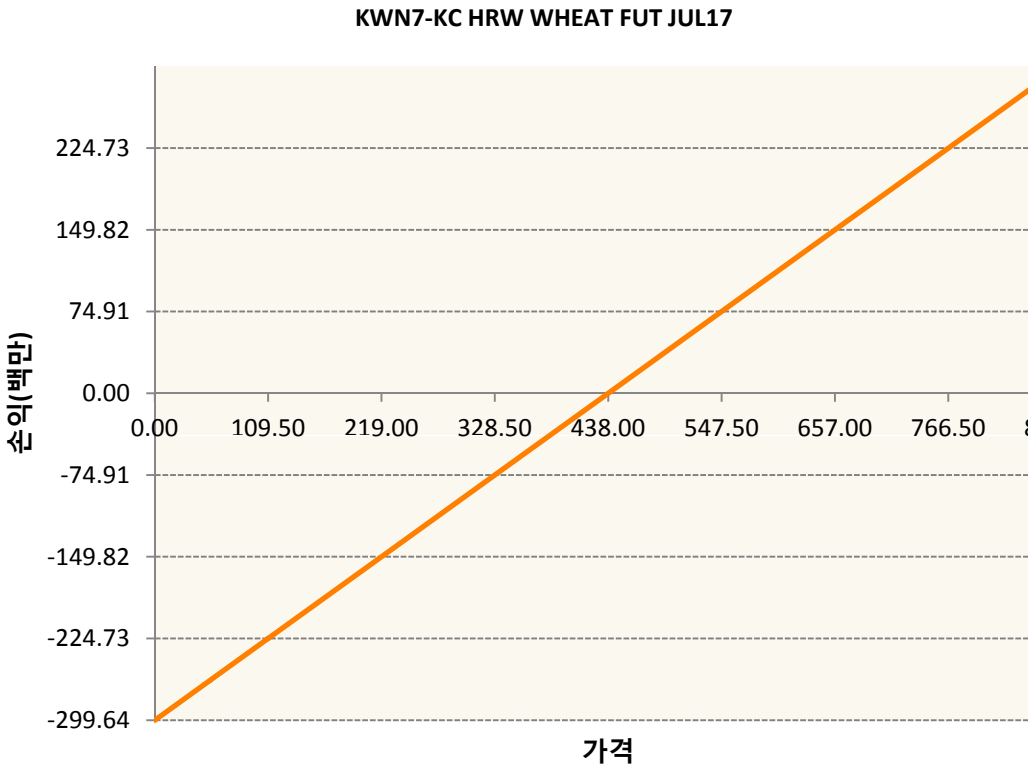

-1,815.70
-2,420.93
가격

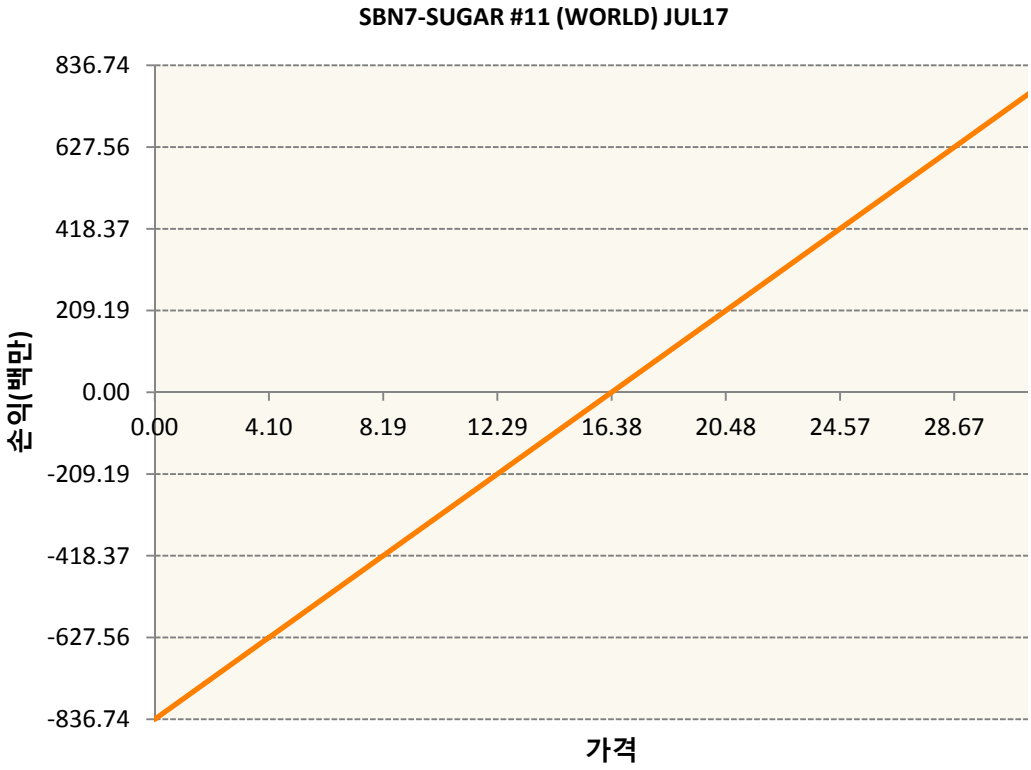

CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
407.30
305.48
203.65
101.83
0.00
-101.83
-203.65
-305.48
-407.30
0.00
19.86
39.73
59.59
79.45
99.31
119.18
139.04
순익(백만)
가격

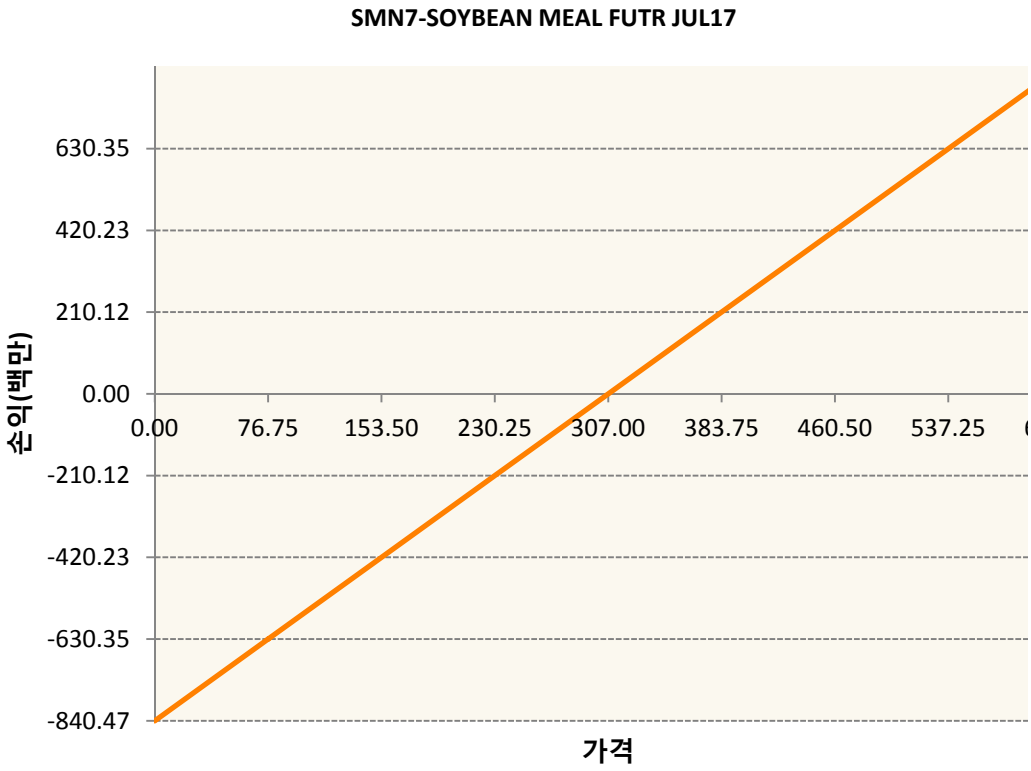

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
622.01
466.51
311.00
155.50
0.00
-155.50
-311.00
-466.51
-622.01
0.00
33.03
66.05
99.08
132.10
165.13
198.15
231.18
순익(백만)

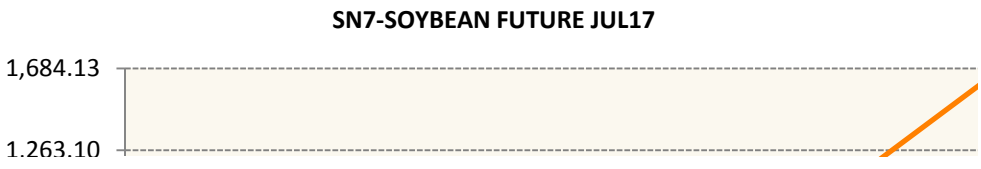
가격

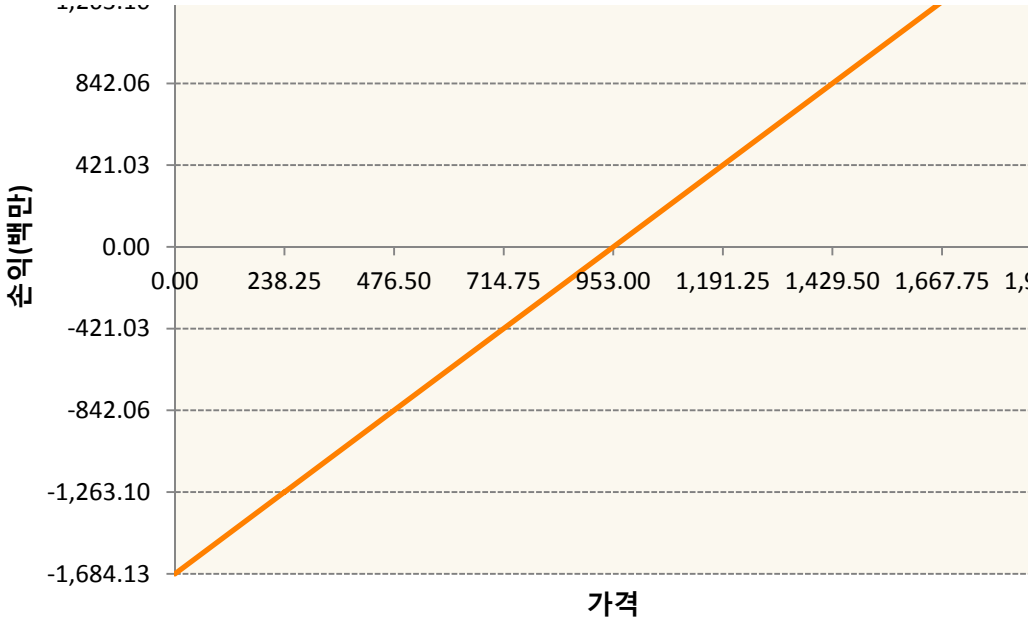

KR4175M60005-2017-06 달러선물
391.02
293.27
195.51
97.76
0.00
-97.76
-195.51
-293.27
-391.02
0.00
279.30
558.60
837.90
1,117.20
1,396.50
1,675.80
1,955.10
손익(백만)
가격

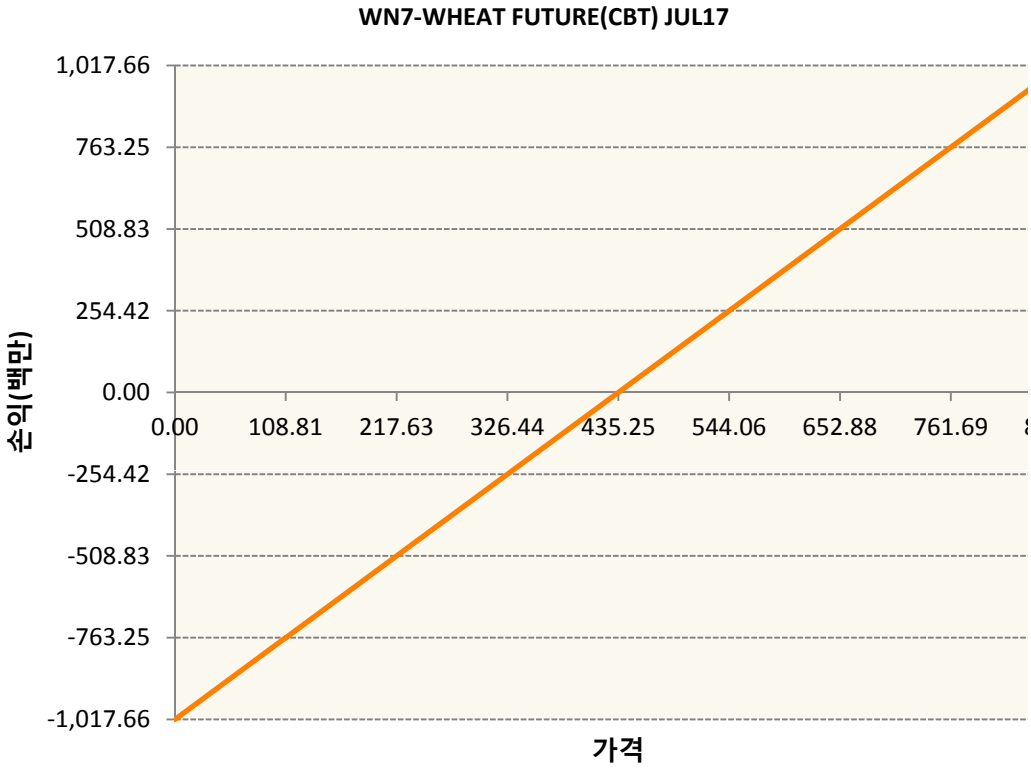

KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17
224.73
149.82
74.91
0.00
-74.91
-149.82
-224.73
-299.64
0.00
109.50
219.00
328.50
438.00
547.50
657.00
766.50
손익(백만)
가격


SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
836.74
627.56
418.37
209.19
0.00
-209.19
-418.37
-627.56
-836.74
0.00
4.10
8.19
12.29
16.38
20.48
24.57
28.67
손익(백만)
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
630.35
420.23
210.12
0.00
-210.12
-420.23
-630.35
-840.47
0.00
76.75
153.50
230.25
307.00
383.75
460.50
537.25
손익(백만)
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,684.13
1,263.10





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	63
CN7	CORN FUTURE JUL17	194
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	33
KCN7	COFFEE 'C' FUTURE JUL17	50
KR4175M60(	2017-06 달러선물	31

KWN7	KC HRW WHEAT FUT JUL17	24
SBN7	SUGAR #11 (WORLD) JUL17	67
SMN7	SOYBEAN MEAL FUTR JUL17	67
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	135
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	81

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

813