공시일	2017-05-24
기준일	2017-05-23

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	2017-05-24
기준일	2017-05-23

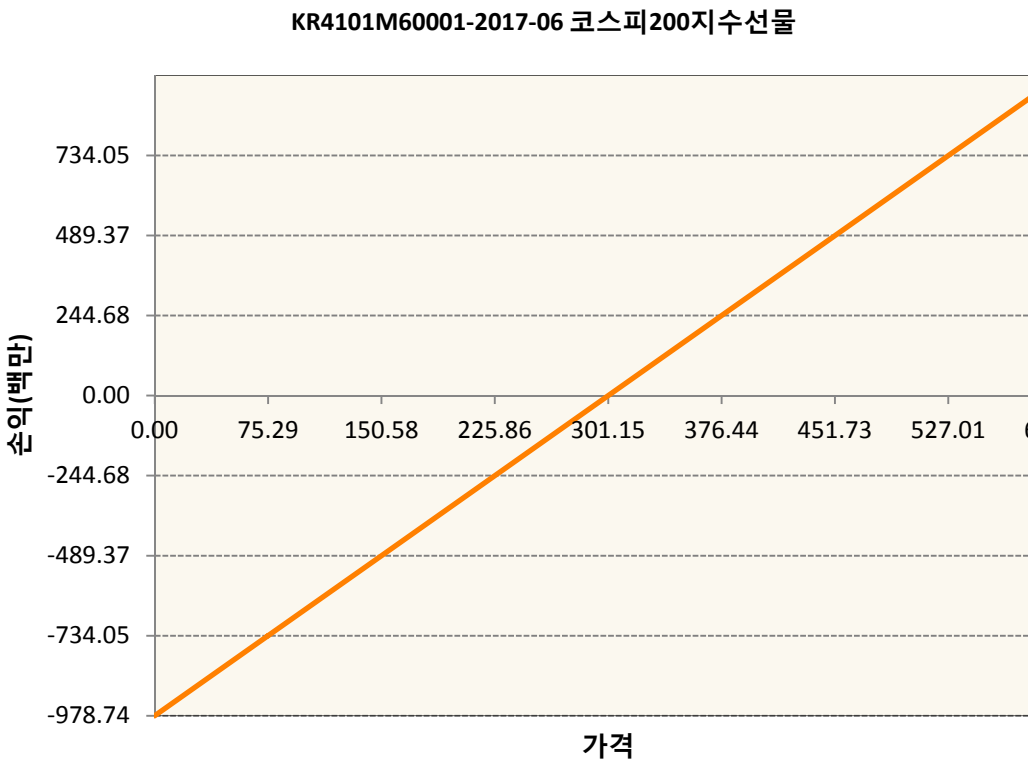
스마트인덱스모

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	979	0	979	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	2017-05-24
기준일	2017-05-23

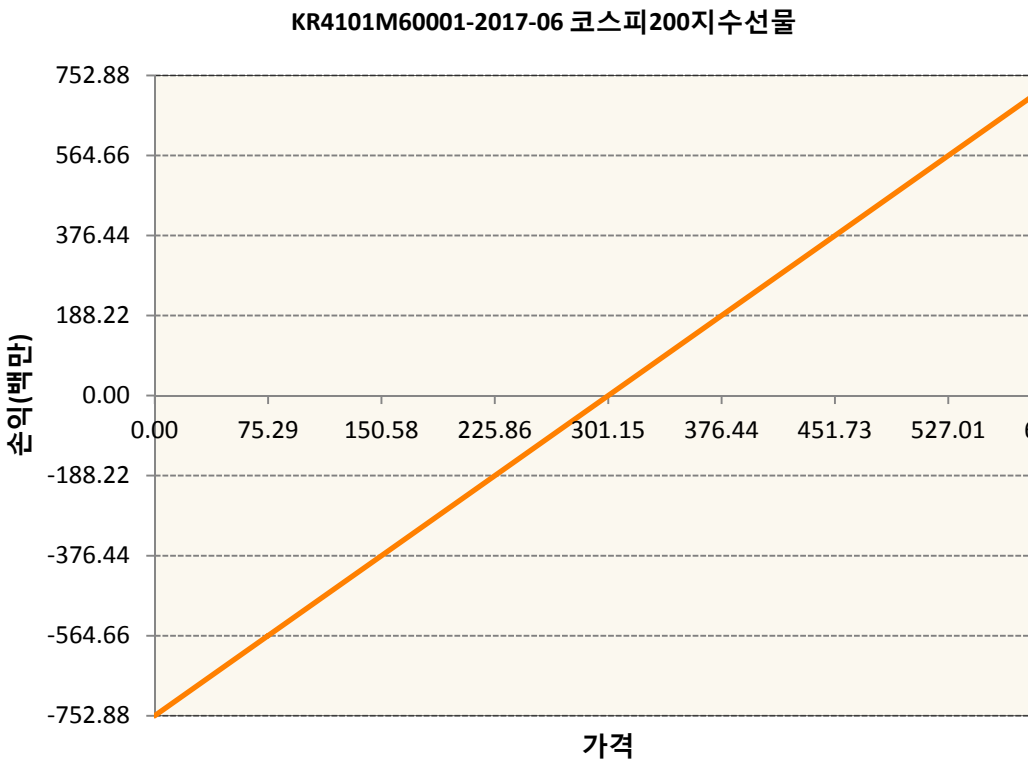
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	753	0	753	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	2017-05-24
기준일	2017-05-23

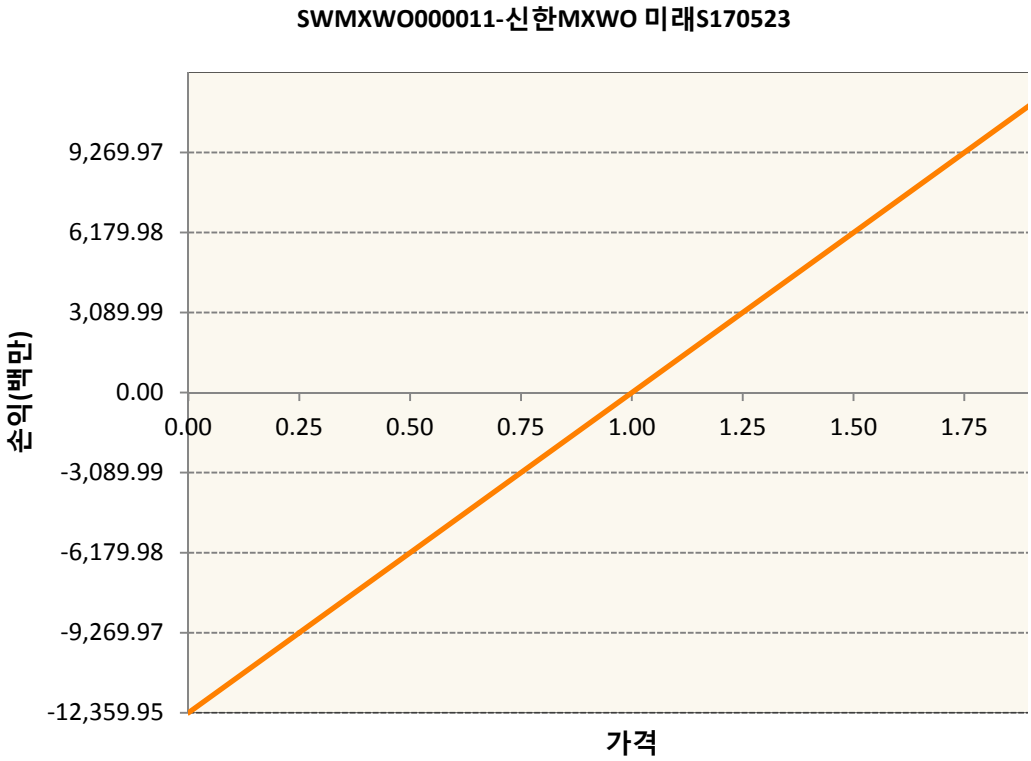
SMART합성-MSCI선진국증권상장지

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	12,360	0	12,360	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S170523	989

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

548

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-05-24
기준일	2017-05-23

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	351

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

326

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-05-24
기준일	2017-05-23

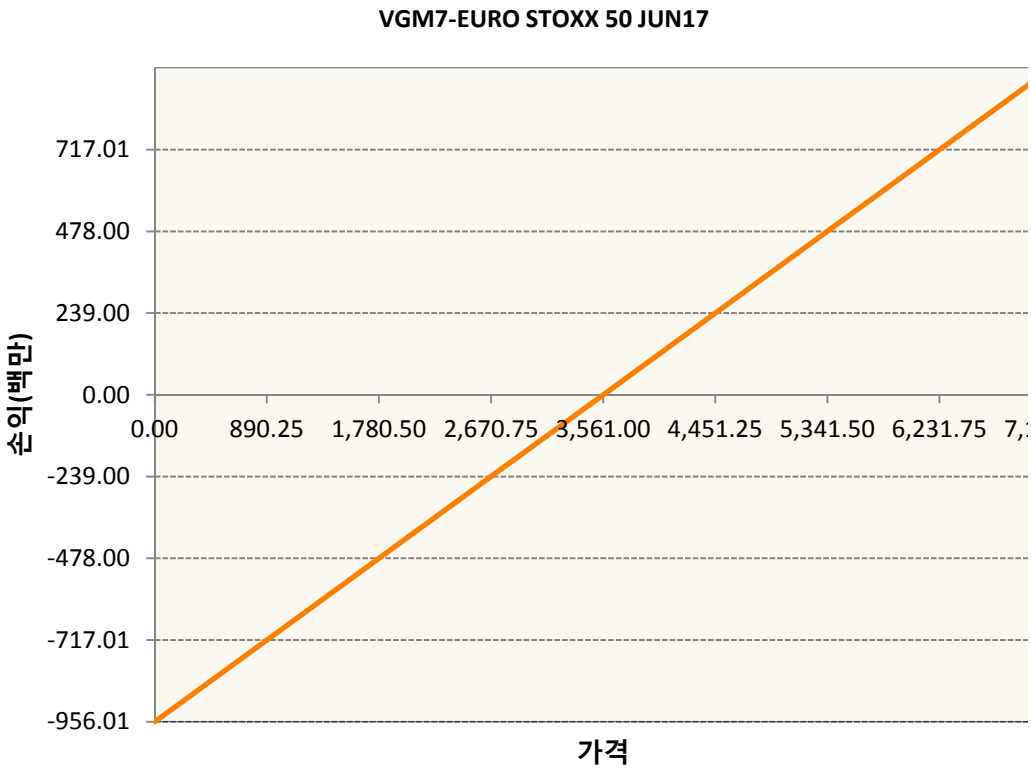
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	956	0	956	

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	2017-05-24
기준일	2017-05-23

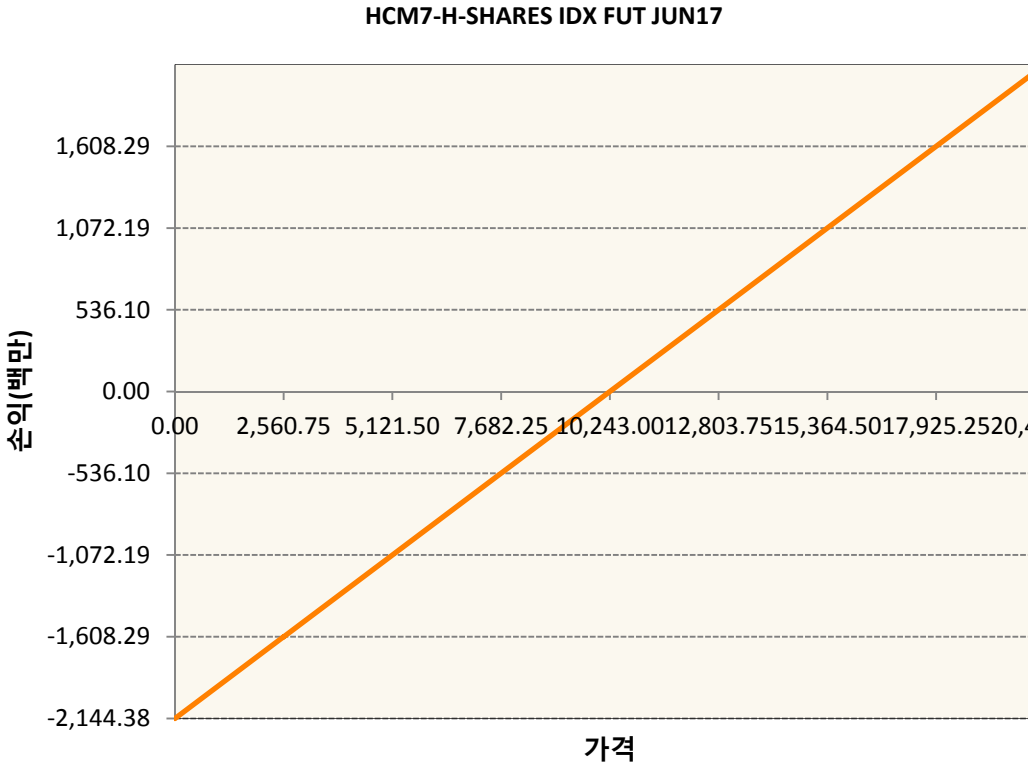
차이나인덱스모(주식-파생형)

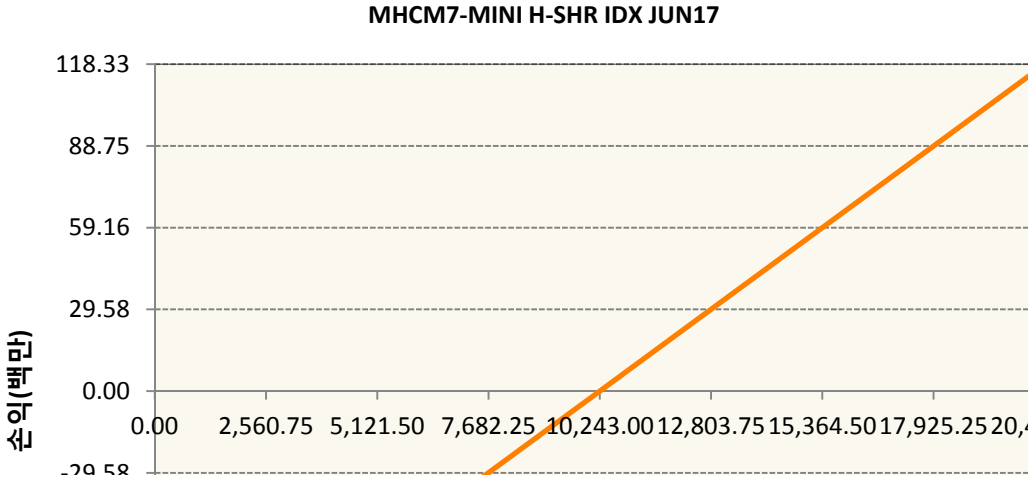
1. 계약금액

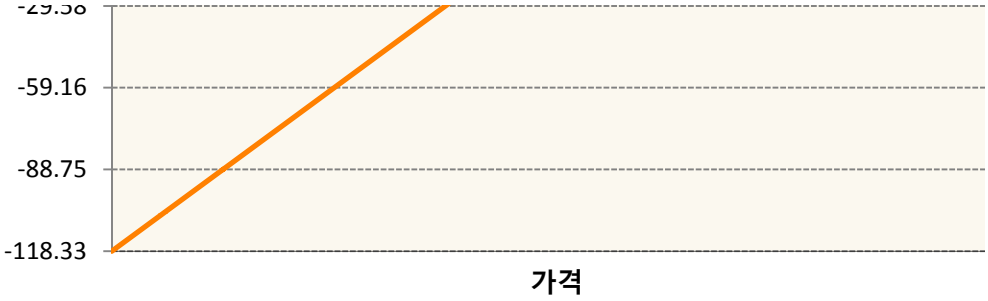
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계			2,144	0	2,144	
누계	유가증권	선물	118	0	118	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCM7	H-SHARES IDX FUT JUN17	172
MHCM7	MINI H-SHR IDX JUN17	9

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

126

공시일	2017-05-24
기준일	2017-05-23

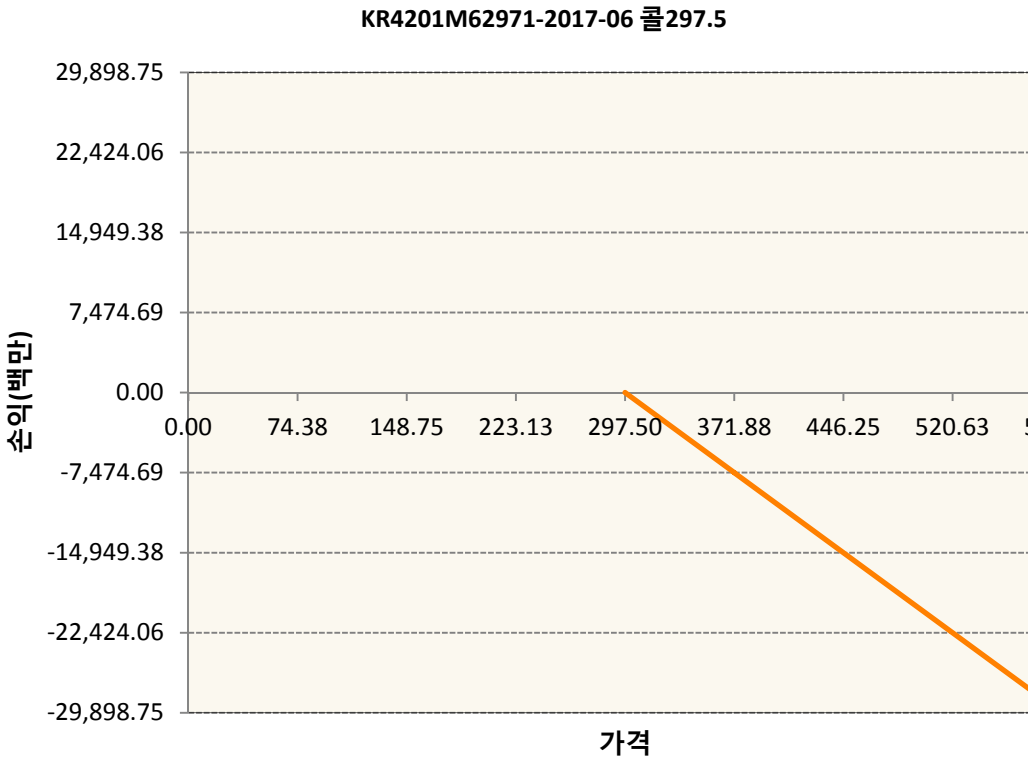
커버드콜모(주식혼합-파생형)

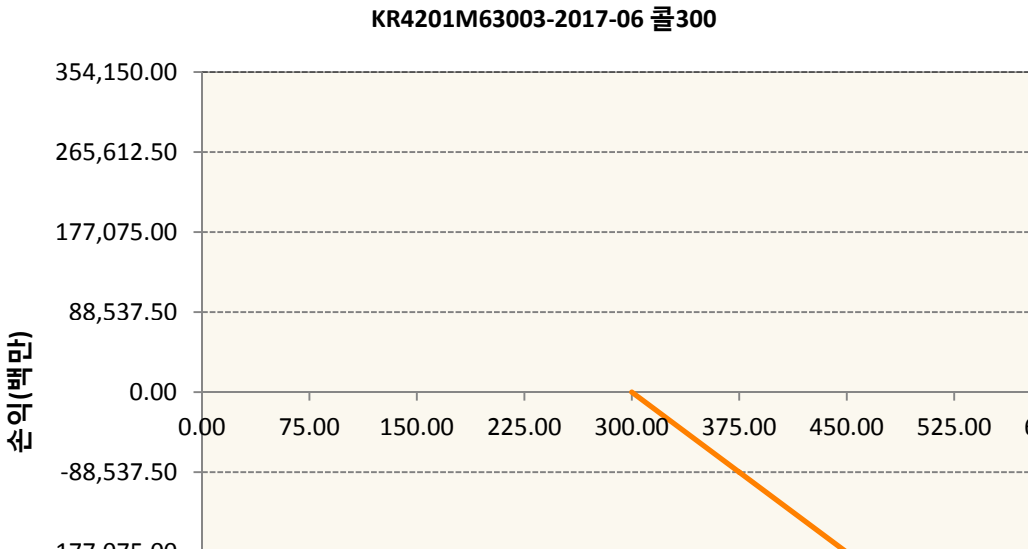
1. 계약금액

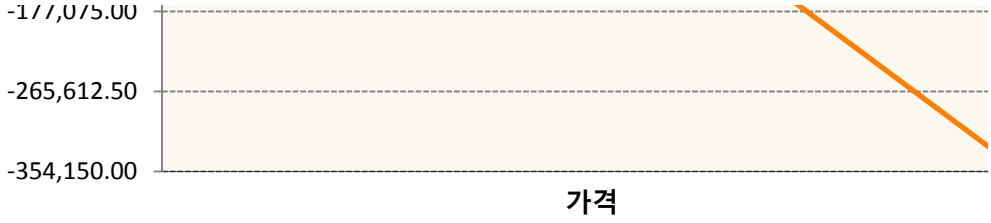
(단위:백만원)

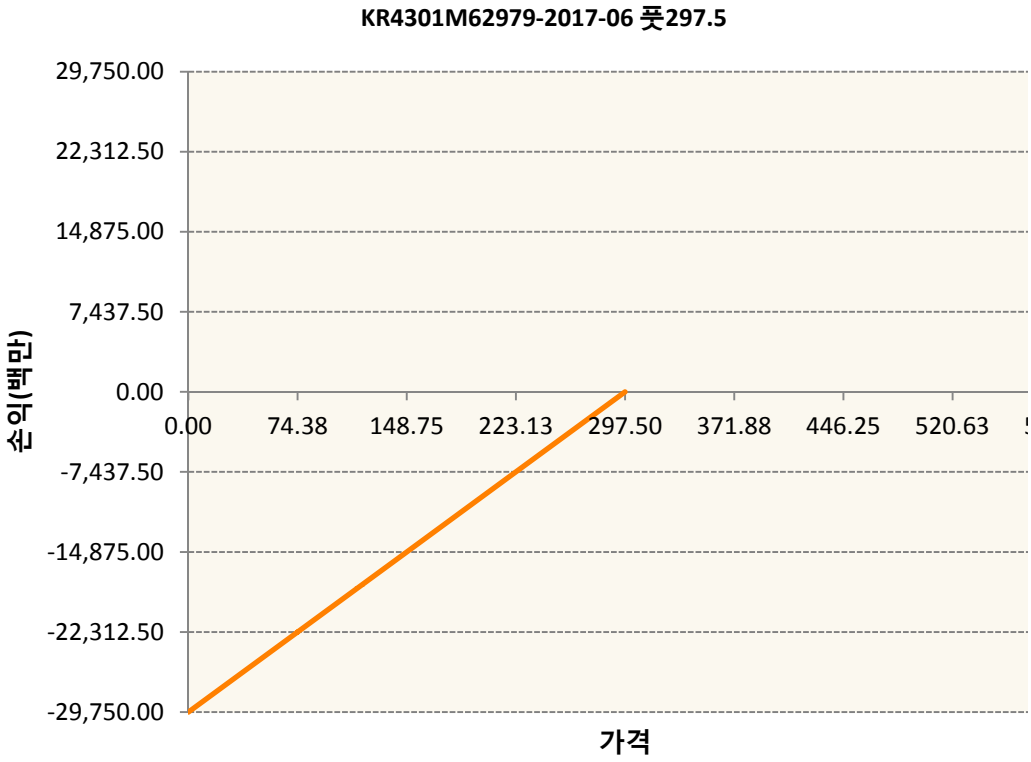
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	623,799	-623,799	장내

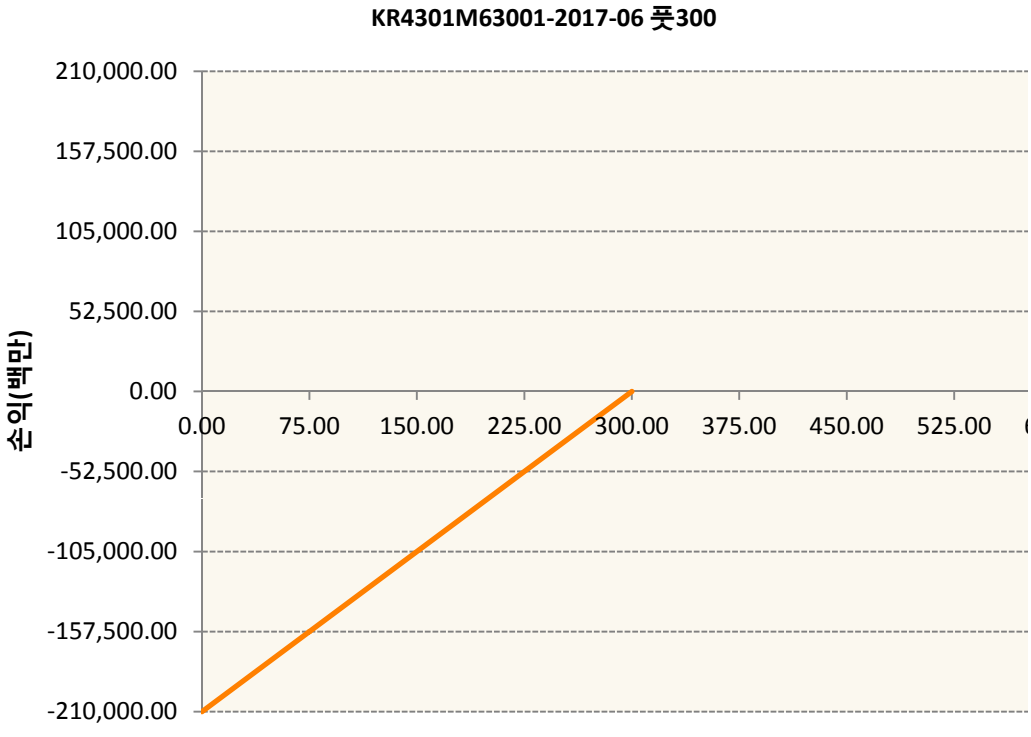
2. 만기시점의 손익구조






-177,075.00
-265,612.50
-354,150.00
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						2,253
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	555	555	555	554	553	551	548
-5.33%	551	547	541	534	525	515	503
-2.67%	468	446	424	401	377	353	328
0%	70	48	24	0	-25	-50	-75
2.67%	-644	-650	-657	-666	-676	-688	-702
5.33%	-1,445	-1,445	-1,446	-1,447	-1,449	-1,452	-1,456
8.00%	-2,252	-2,252	-2,252	-2,252	-2,252	-2,252	-2,253
KR4201M63(	2017-06 콜300						25,361
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,698	4,698	4,696	4,693	4,687	4,675	4,658
-5.33%	4,682	4,662	4,628	4,579	4,515	4,433	4,336
-2.67%	4,212	4,029	3,826	3,608	3,377	3,136	2,885
0%	947	632	317	0	-317	-635	-953
2.67%	-6,578	-6,695	-6,836	-6,998	-7,179	-7,375	-7,586
5.33%	-15,852	-15,863	-15,883	-15,915	-15,961	-16,021	-16,097
8.00%	-25,326	-25,326	-25,327	-25,330	-25,335	-25,345	-25,361
KR4301M62(	2017-06 풋297.5						1,863
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,857	-1,857	-1,857	-1,858	-1,859	-1,861	-1,863
-5.33%	-1,058	-1,062	-1,067	-1,075	-1,084	-1,094	-1,106
-2.67%	-337	-359	-381	-404	-428	-452	-476
0%	70	47	24	0	-24	-49	-74
2.67%	162	157	150	141	130	118	104
5.33%	168	168	167	166	164	161	157
8.00%	169	169	169	168	168	168	167
KR4301M63(	2017-06 풋300						14,102
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,078	-14,079	-14,079	-14,081	-14,085	-14,092	-14,102
-5.33%	-8,466	-8,479	-8,499	-8,527	-8,566	-8,614	-8,671
-2.67%	-3,124	-3,233	-3,352	-3,482	-3,619	-3,762	-3,910
0%	561	375	188	0	-188	-377	-565
2.67%	1,721	1,652	1,568	1,472	1,364	1,248	1,123

5.33%	1,843	1,837	1,825	1,806	1,779	1,743	1,698
8.00%	1,847	1,847	1,846	1,844	1,841	1,835	1,826

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

51,958

공시일	2017-05-24
기준일	2017-05-23

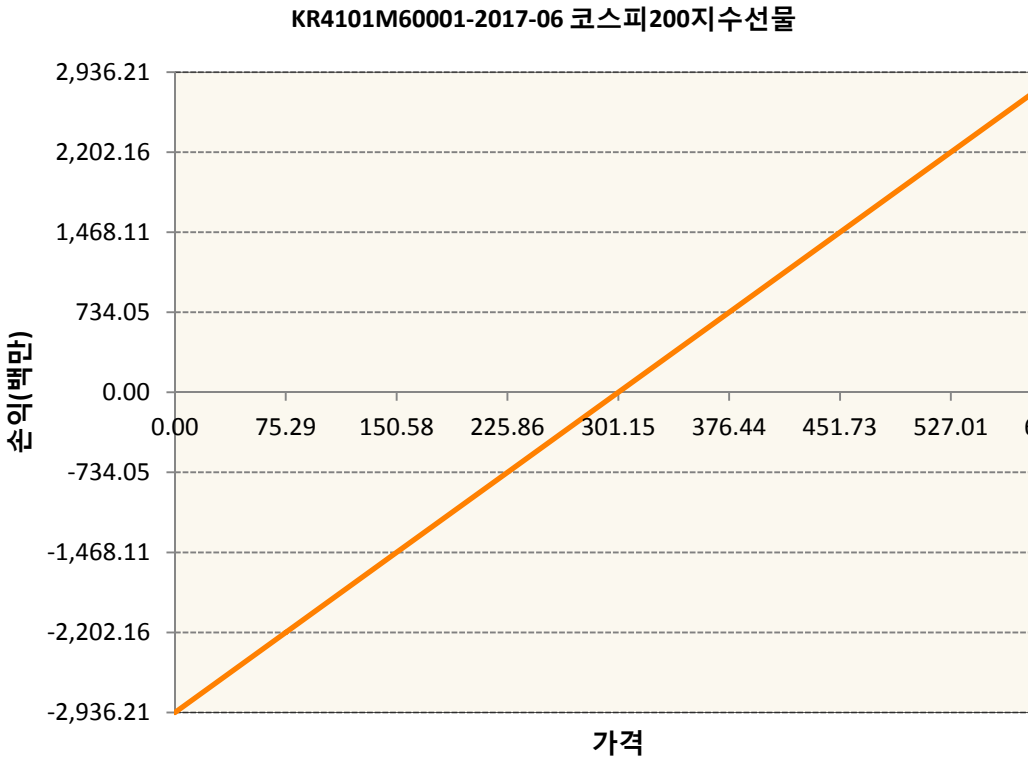
커버드콜목표전환형증권투자신탁

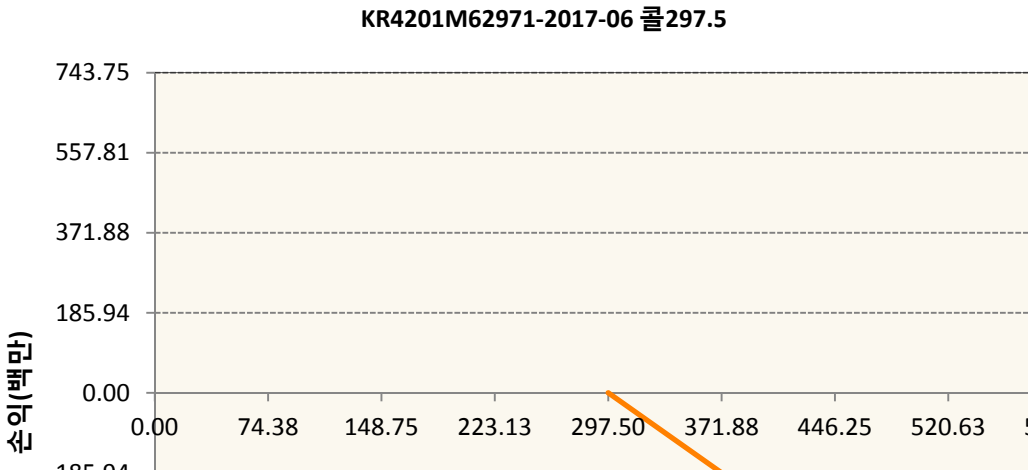
1. 계약금액

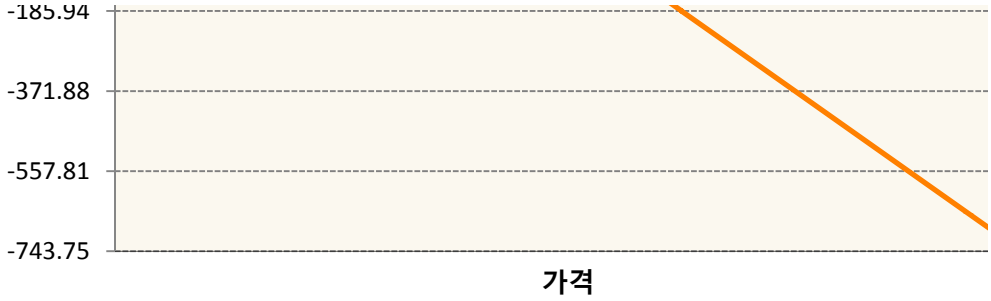
(단위:백만원)

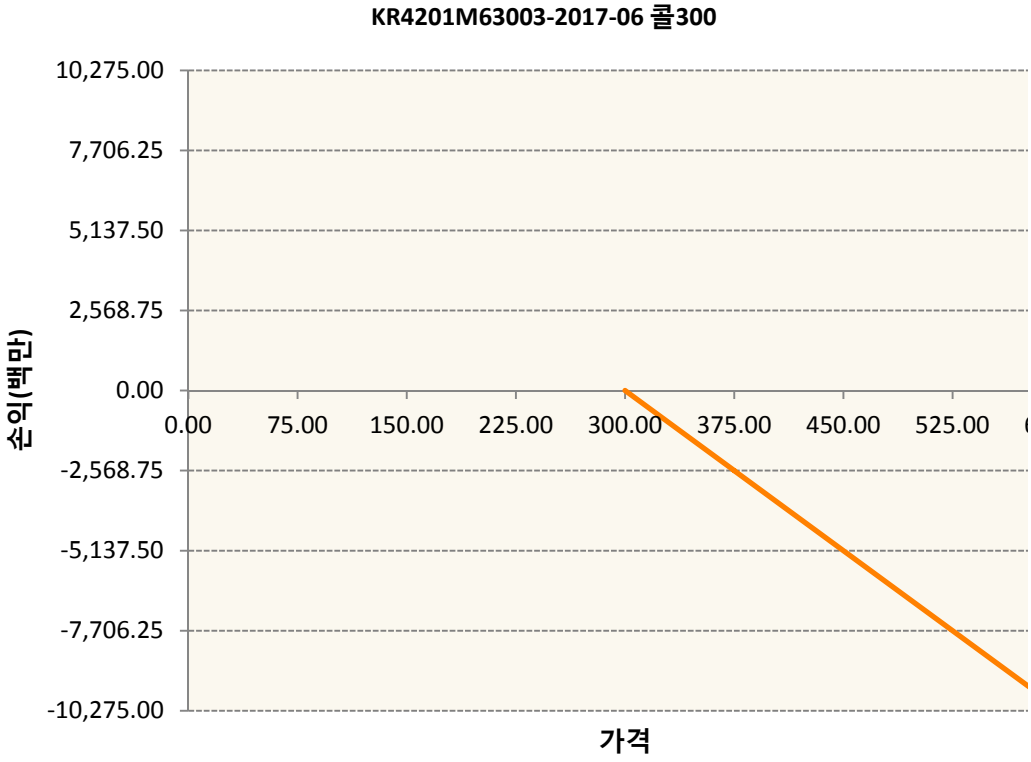
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,936	0	2,936	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,590	-12,590	장내

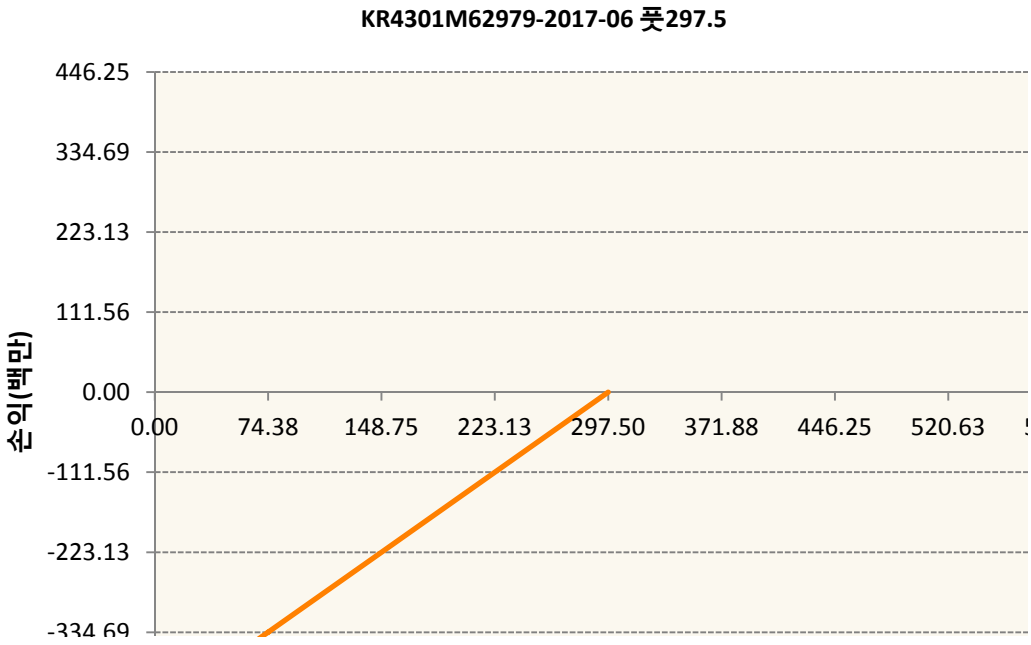
2. 만기시점의 손익구조



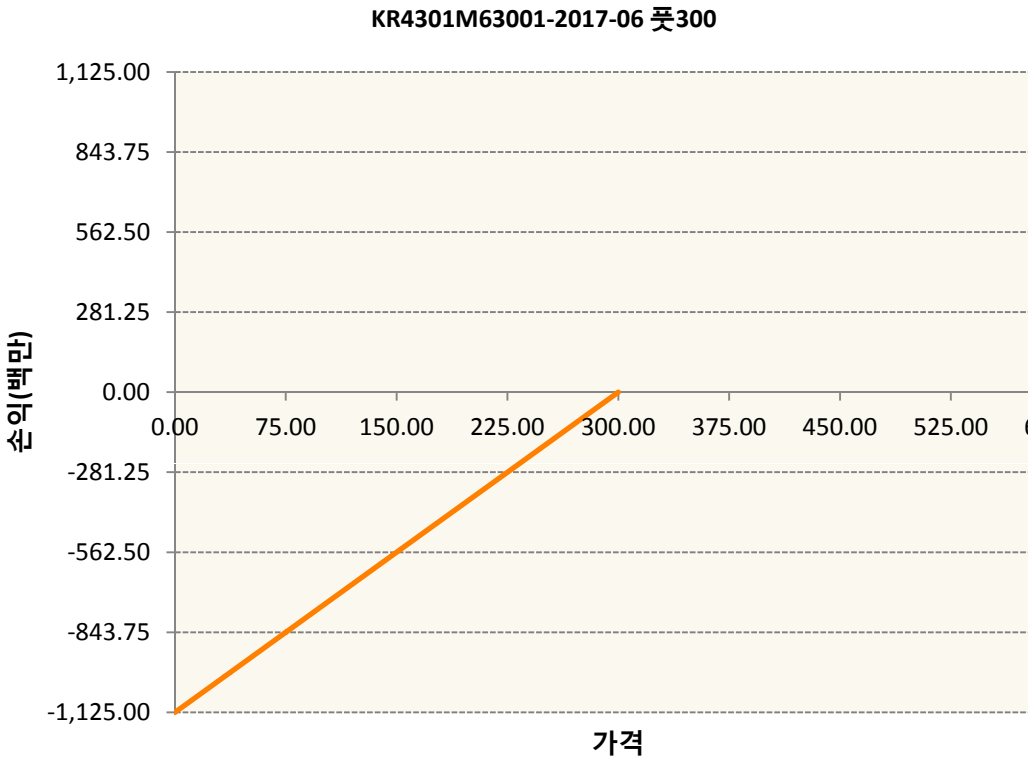



-185.94
-371.88
-557.81
-743.75
가격


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							235
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-235	-235	-235	-235	-235	-235	-235
-5.33%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-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%	157	157	157	157	157	157	157
8.00%	235	235	235	235	235	235	235
KR4201M62(2017-06 콜297.5							56
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	14	14	14	14	14	14	14
-5.33%	14	14	13	13	13	13	13
-2.67%	12	11	11	10	9	9	8

0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	-16	-16	-16	-17	-17	-17	-17
5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
8.00%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
	KR4201M63(	2017-06 콜300					736
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	136	136	136	136	136	136	135
-5.33%	136	135	134	133	131	129	126
-2.67%	122	117	111	105	98	91	84
0%	27	18	9	0	-9	-18	-28
2.67%	-191	-194	-198	-203	-208	-214	-220
5.33%	-460	-460	-461	-462	-463	-465	-467
8.00%	-735	-735	-735	-735	-735	-735	-736
	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	-16	-16	-16	-16	-17
-2.67%	-5	-5	-6	-6	-6	-7	-7
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	3	3	3	2	2	2	2
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%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-76
-5.33%	-45	-45	-46	-46	-46	-46	-46
-2.67%	-17	-17	-18	-19	-19	-20	-21
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	9	9	8	8	7	7	6
5.33%	10	10	10	10	10	9	9
8.00%	10	10	10	10	10	10	10

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

1,236

공시일	2017-05-24
기준일	2017-05-23

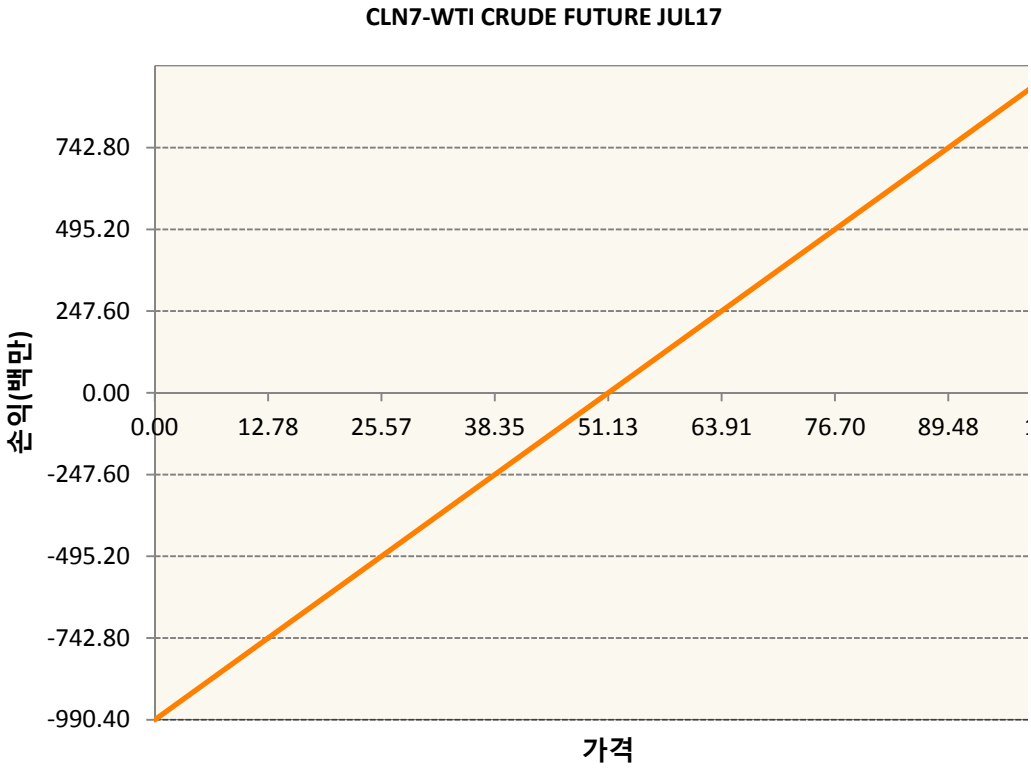
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

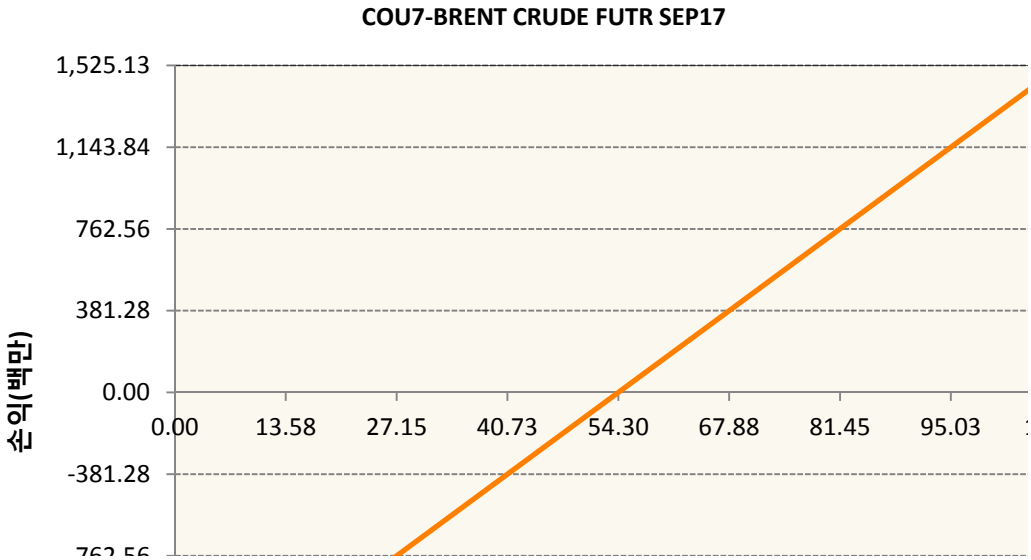
1. 계약금액

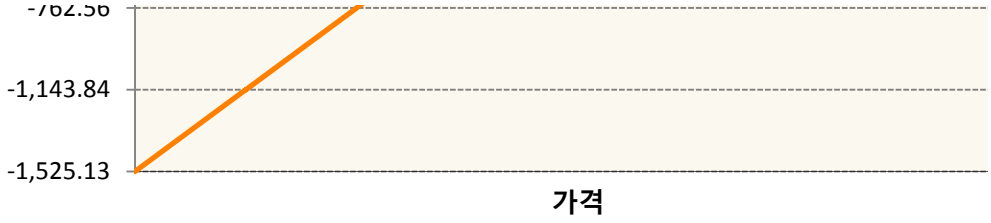
(단위:백만원)

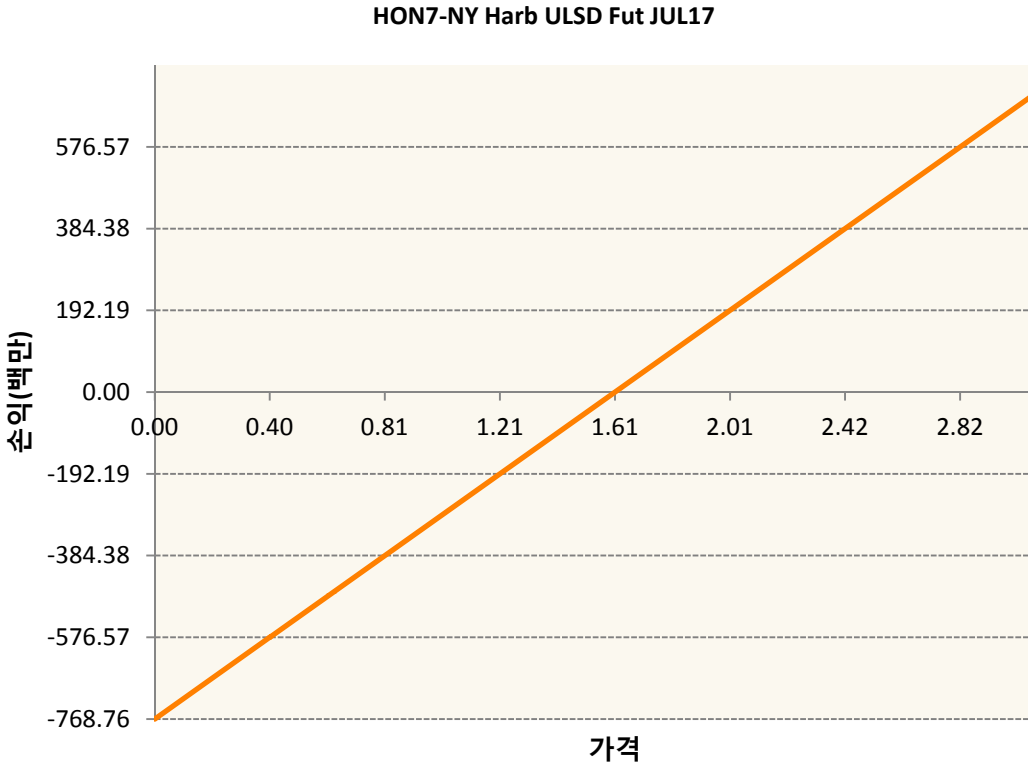
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,716	225	5,491	

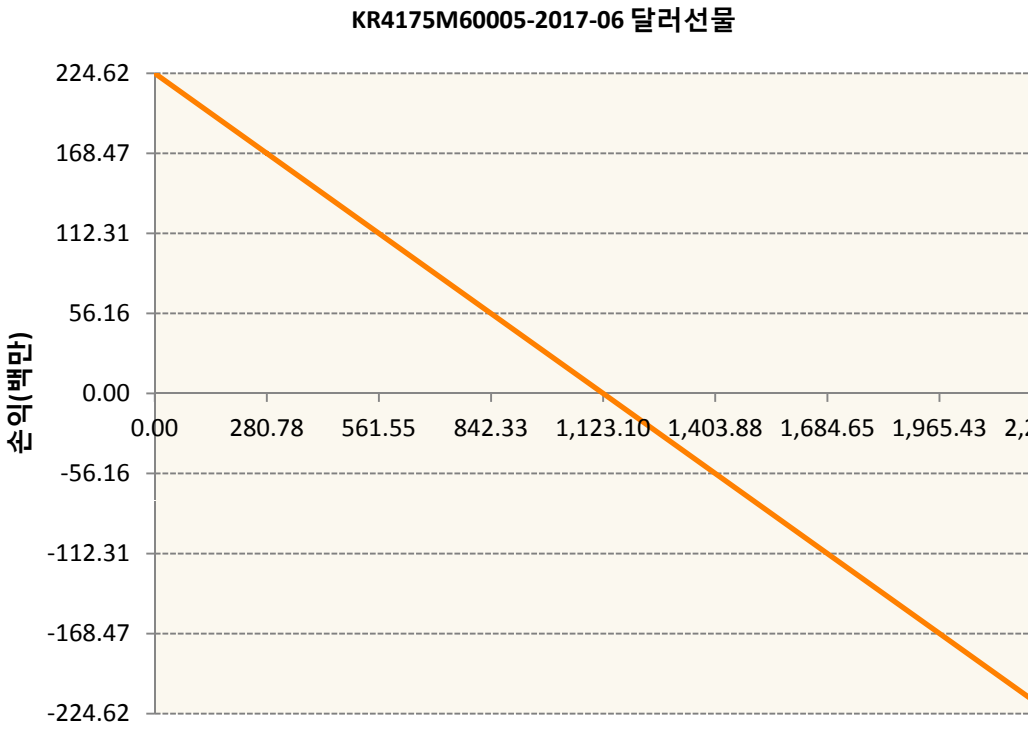
2. 만기시점의 손익구조





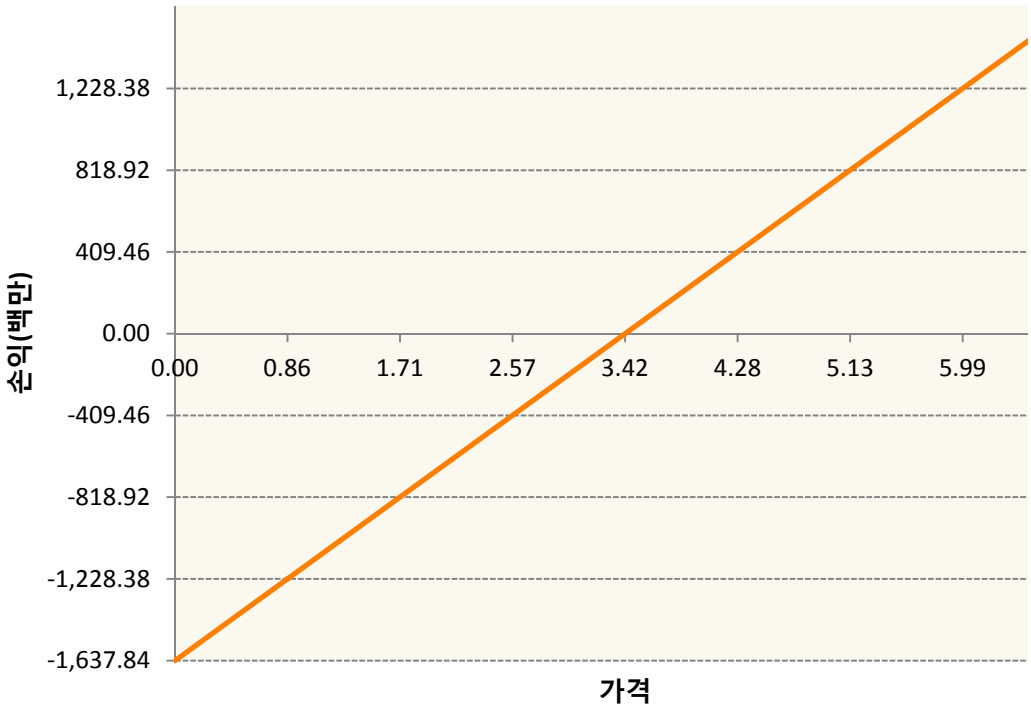

-1,143.84
-1,525.13
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
576.57
384.38
192.19
0.00
-192.19
-384.38
-576.57
-768.76
0.00
0.40
0.81
1.21
1.61
2.01
2.42
2.82
순이익(백만)
가격

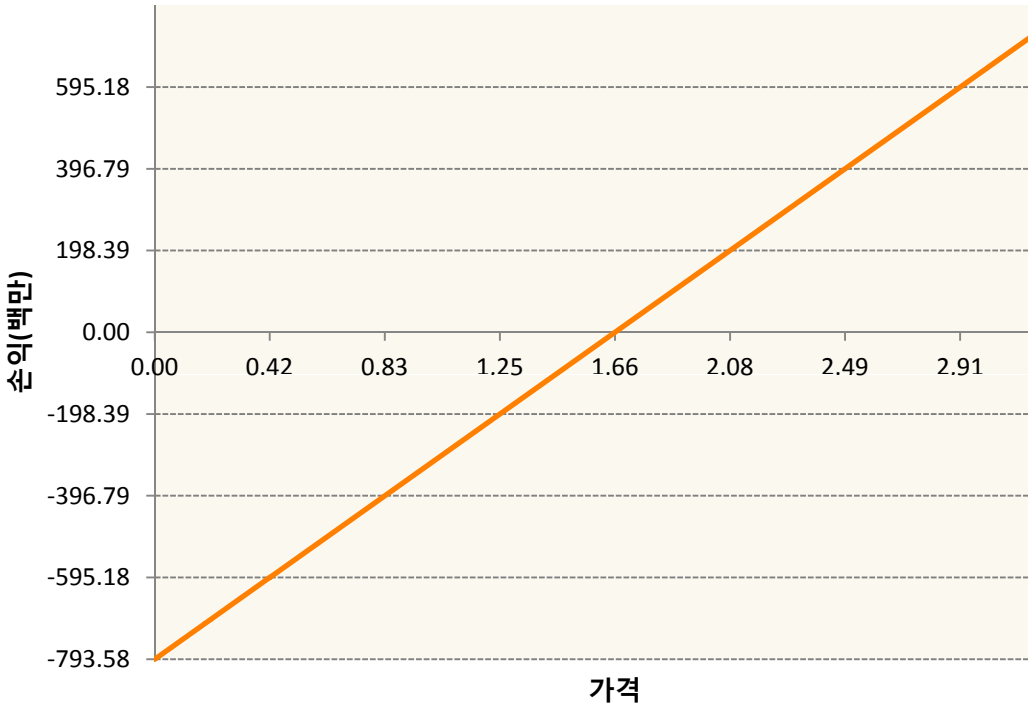

KR4175M60005-2017-06 달러선물
224.62
168.47
112.31
56.16
0.00
-56.16
-112.31
-168.47
-224.62
0.00
280.78
561.55
842.33
1,123.10
1,403.88
1,684.65
1,965.43
순이익(백만)

가격

NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17



XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN7	WTI CRUDE FUTURE JUL17	79
COU7	BRENT CRUDE FUTR SEP17	122
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	62
KR4175M60(	2017-06 달러선물	18
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	131
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	63

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

971

공시일	2017-05-24
기준일	2017-05-23

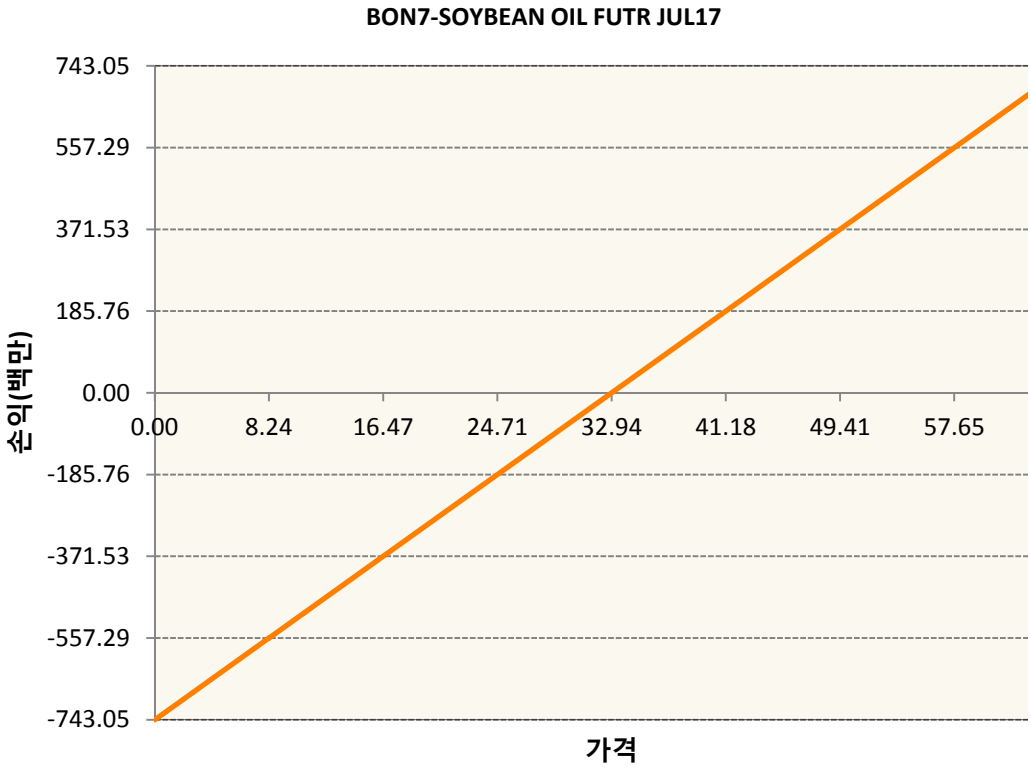
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

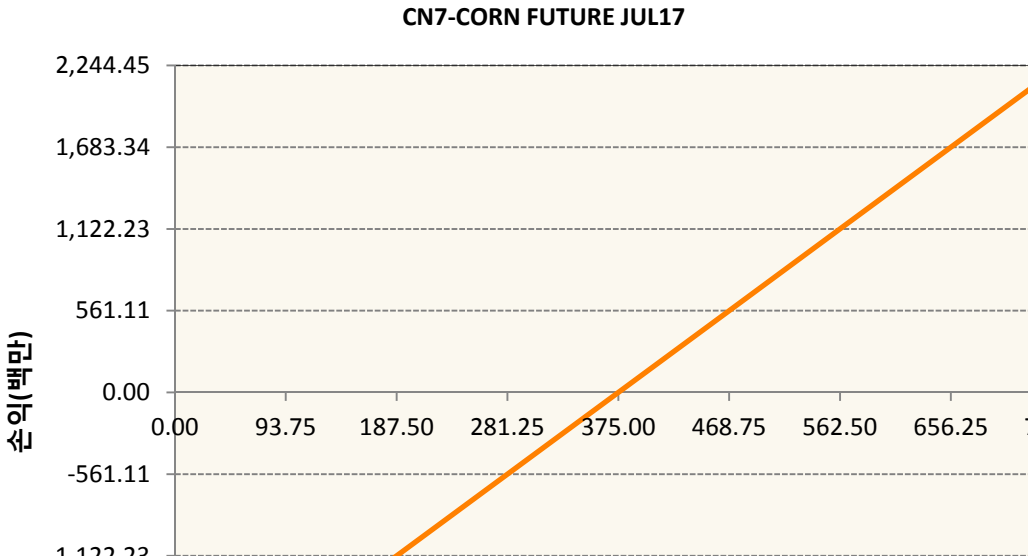
1. 계약금액

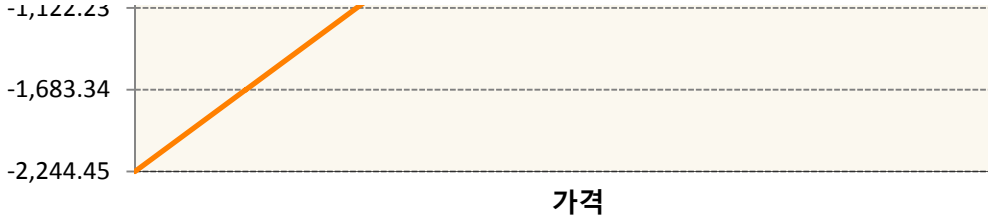
(단위:백만원)

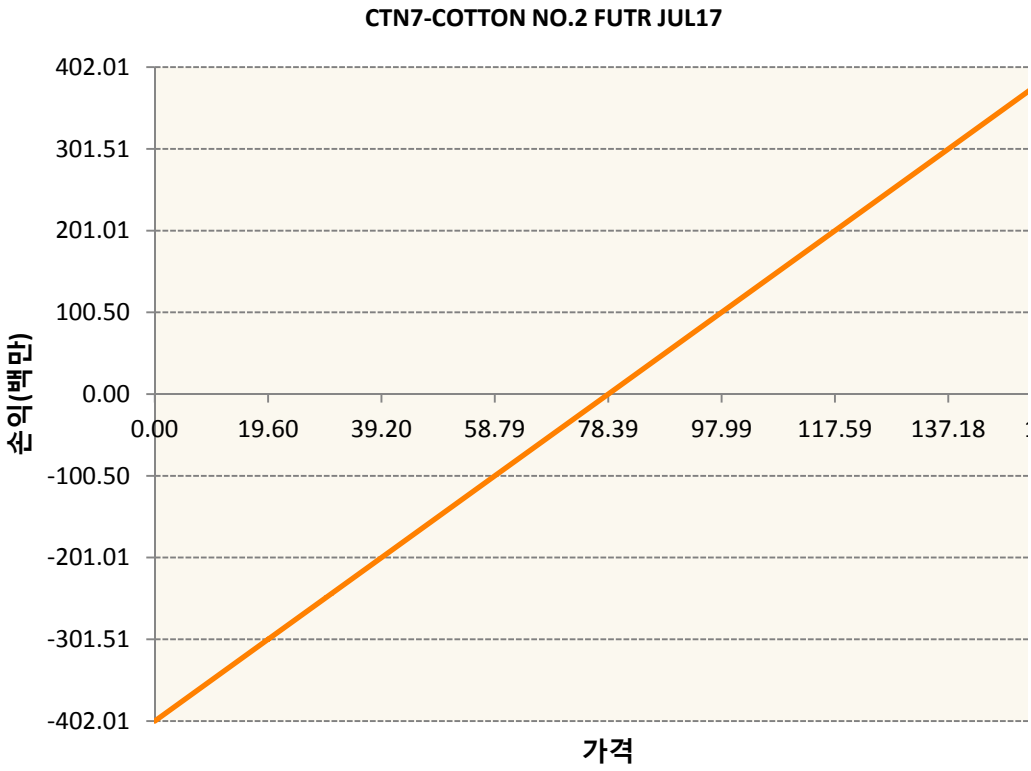
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,495	393	8,102	

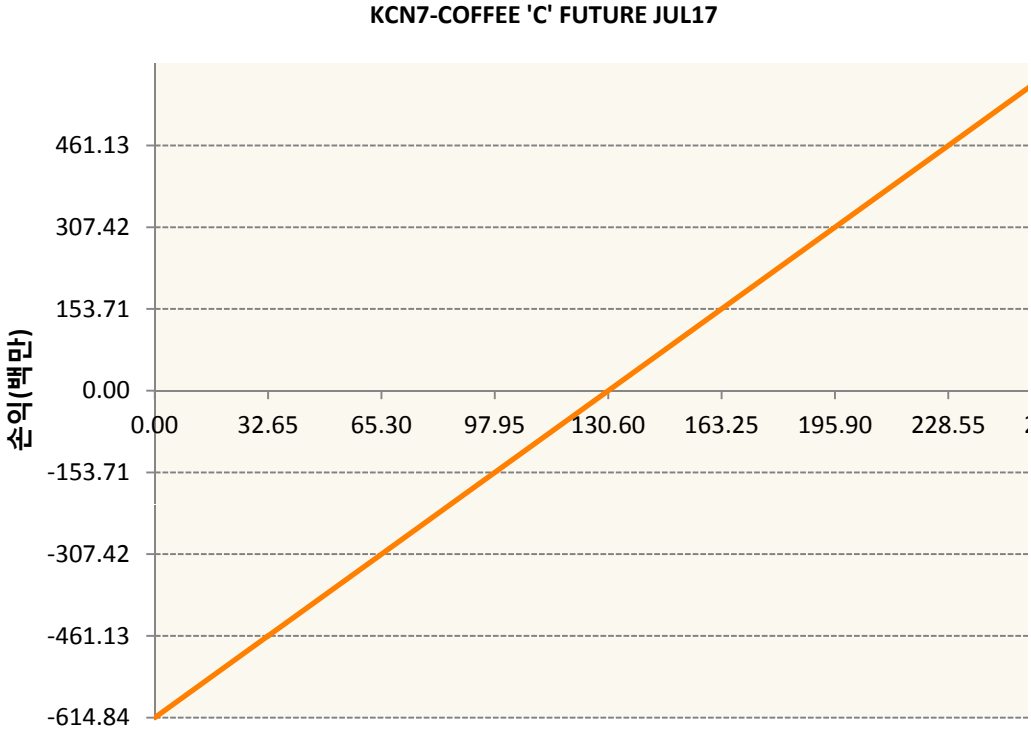
2. 만기시점의 손익구조





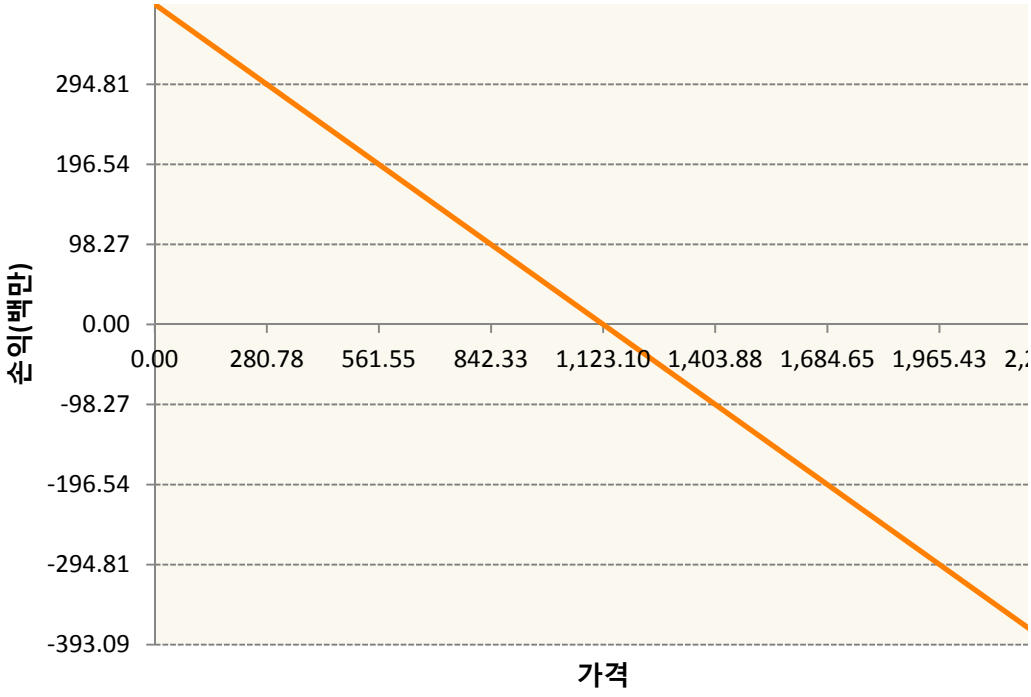

-1,683.34
-2,244.45
가격


CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
402.01
301.51
201.01
100.50
0.00
-100.50
-201.01
-301.51
-402.01
0.00
19.60
39.20
58.79
78.39
97.99
117.59
137.18
손익(백만)
가격

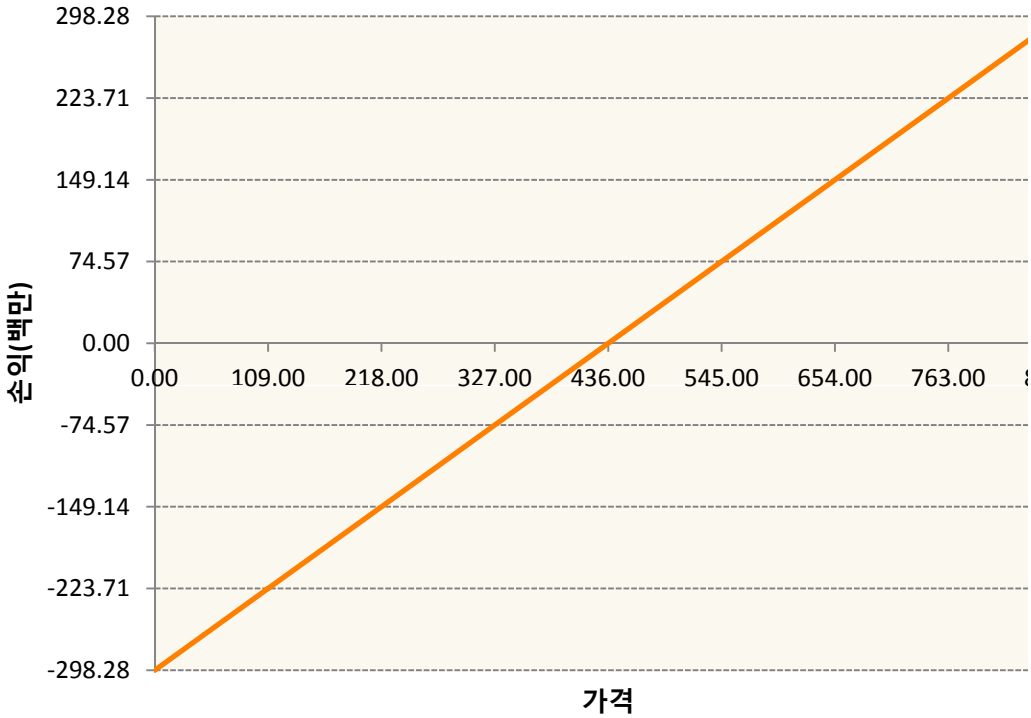

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
461.13
307.42
153.71
0.00
-153.71
-307.42
-461.13
-614.84
0.00
32.65
65.30
97.95
130.60
163.25
195.90
228.55
손익(백만)

가격

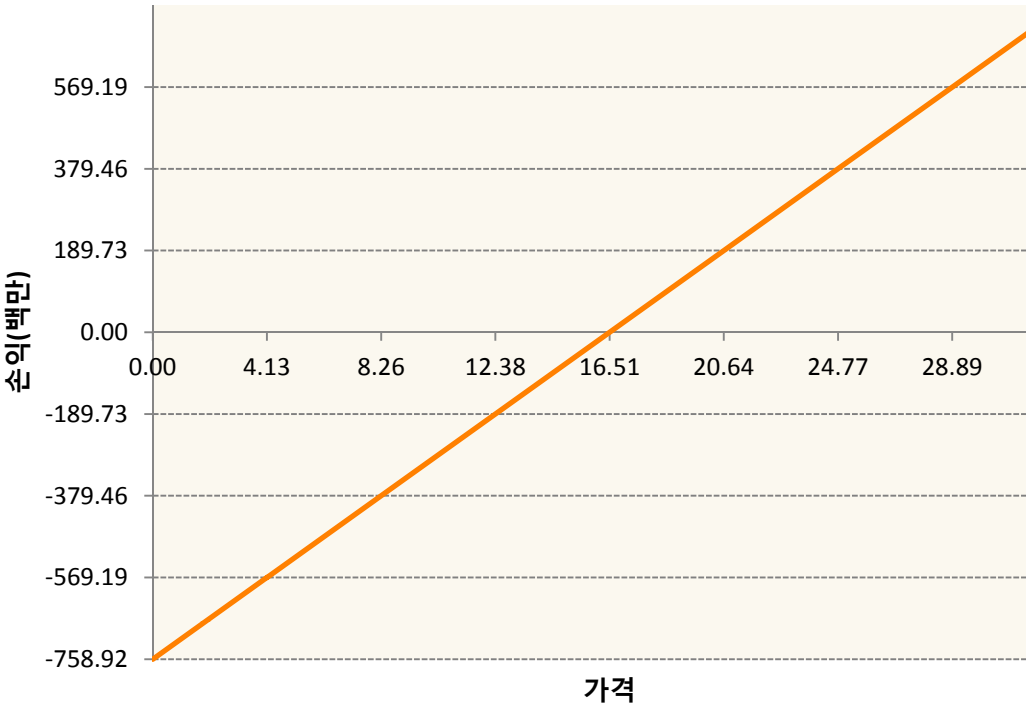
KR4175M60005-2017-06 달러선물



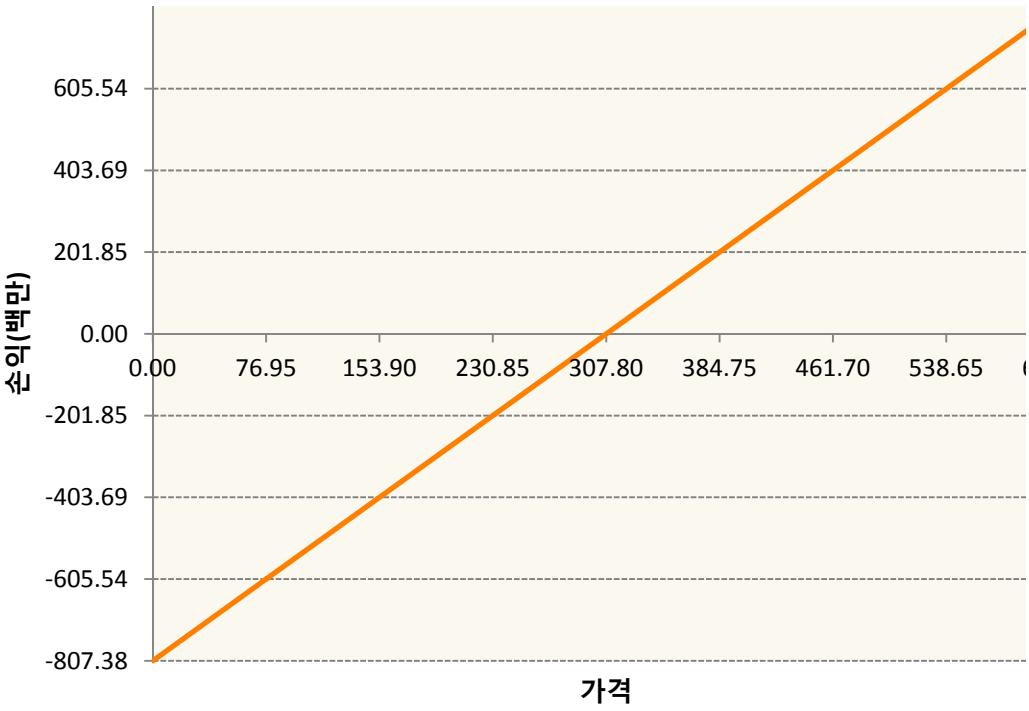
KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17



SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17

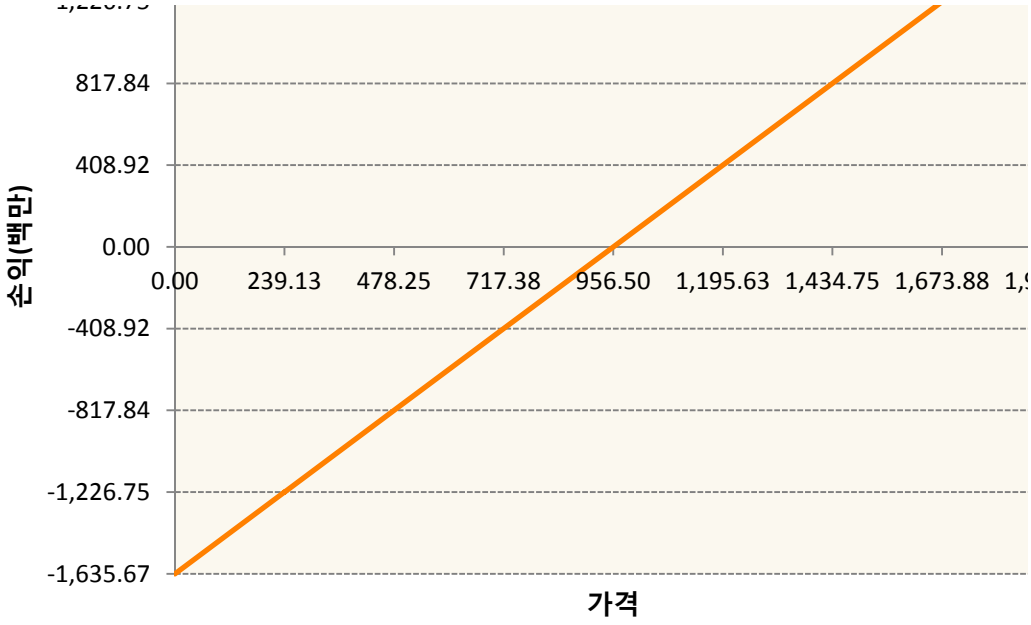


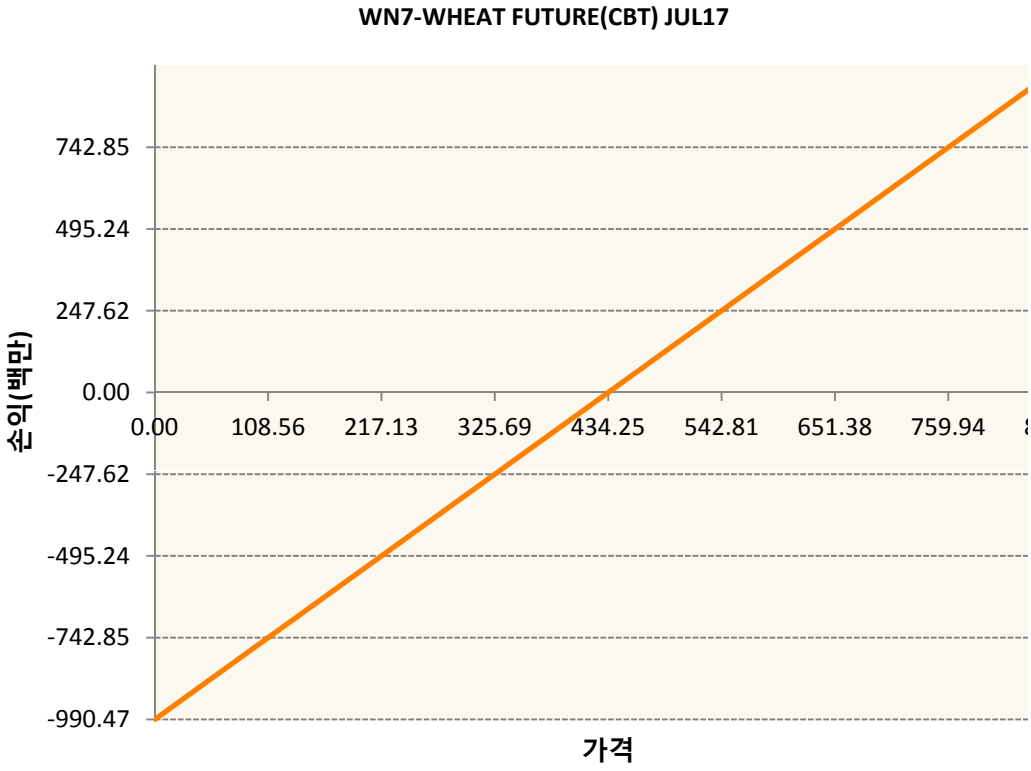
SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17



SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	59
CN7	CORN FUTURE JUL17	180
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	32
KCN7	COFFEE 'C' FUTURE JUL17	49
KR4175M60(	2017-06 달러선물	31

KWN7	KC HRW WHEAT FUT JUL17	24
SBN7	SUGAR #11 (WORLD) JUL17	61
SMN7	SOYBEAN MEAL FUTR JUL17	65
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	131
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	79

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

773