| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-05-25 |
| 기준일 | 2017-05-24 |

# 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 | 2017-05-25 |
| 기준일 | 2017-05-24 |

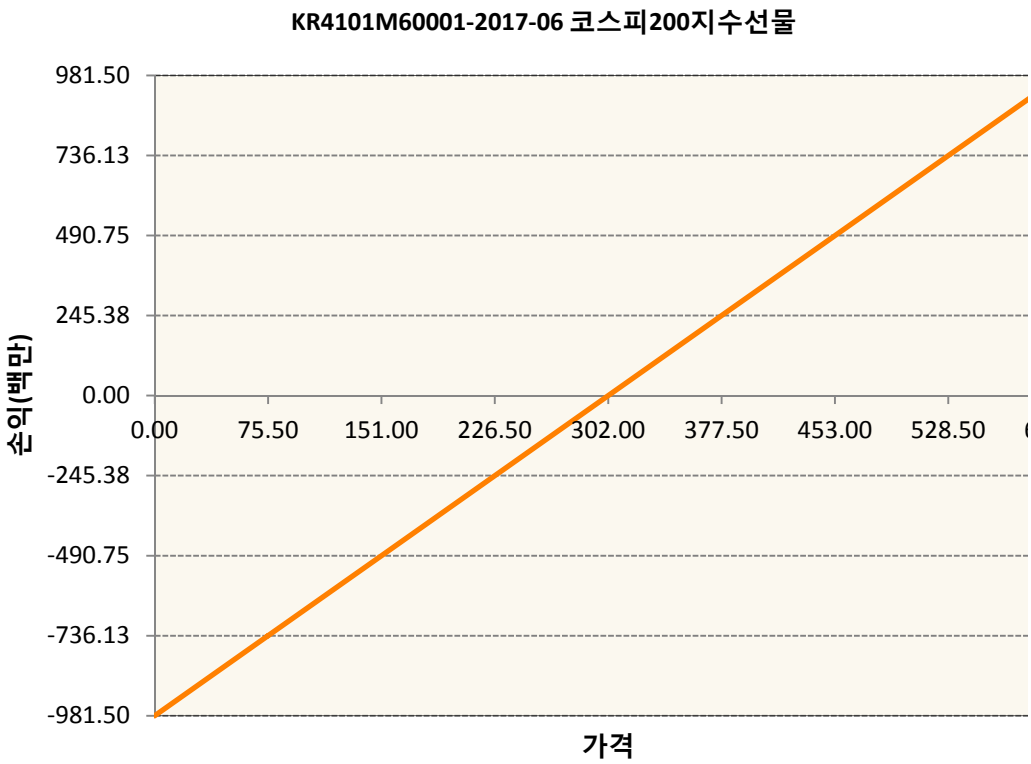
# 스마트인덱스모

## 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 | 982 | 0 | 982 | 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 | 2017-05-25 |
| 기준일 | 2017-05-24 |

# 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 | 990 |

* 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 | 2017-05-25 |
| 기준일 | 2017-05-24 |

# 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 | 353 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **330** |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-05-25 |
| 기준일 | 2017-05-24 |

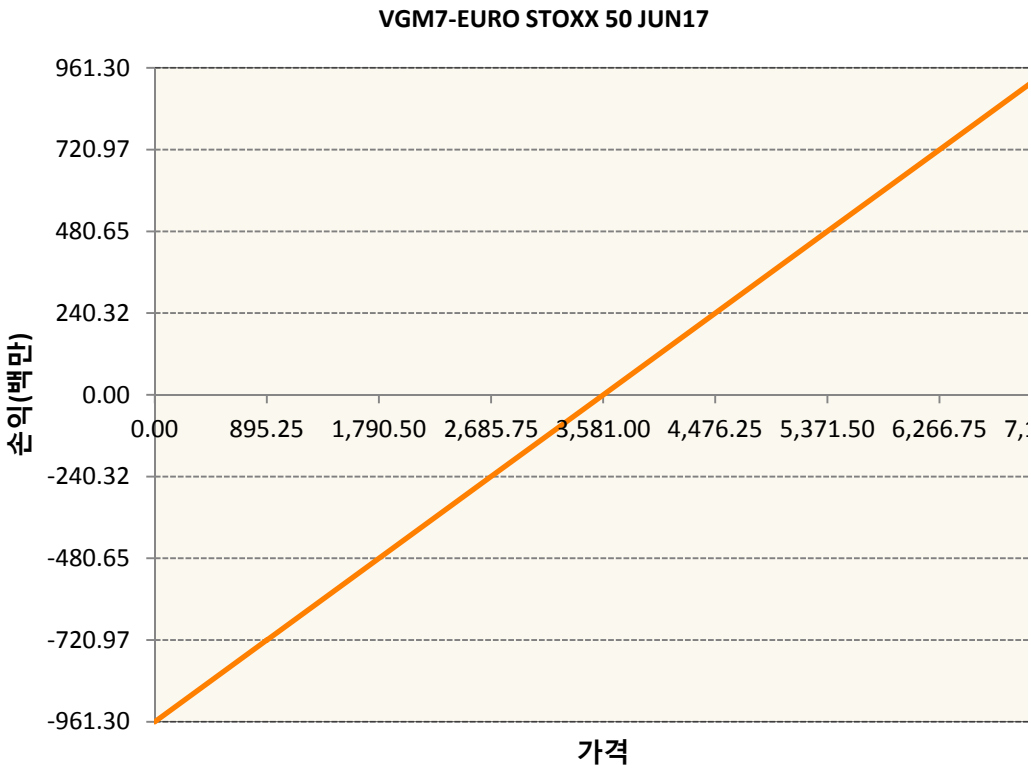
# 유로인덱스모(주식-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 961 | 0 | 961 | |

## 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 | 2017-05-25 |
| 기준일 | 2017-05-24 |

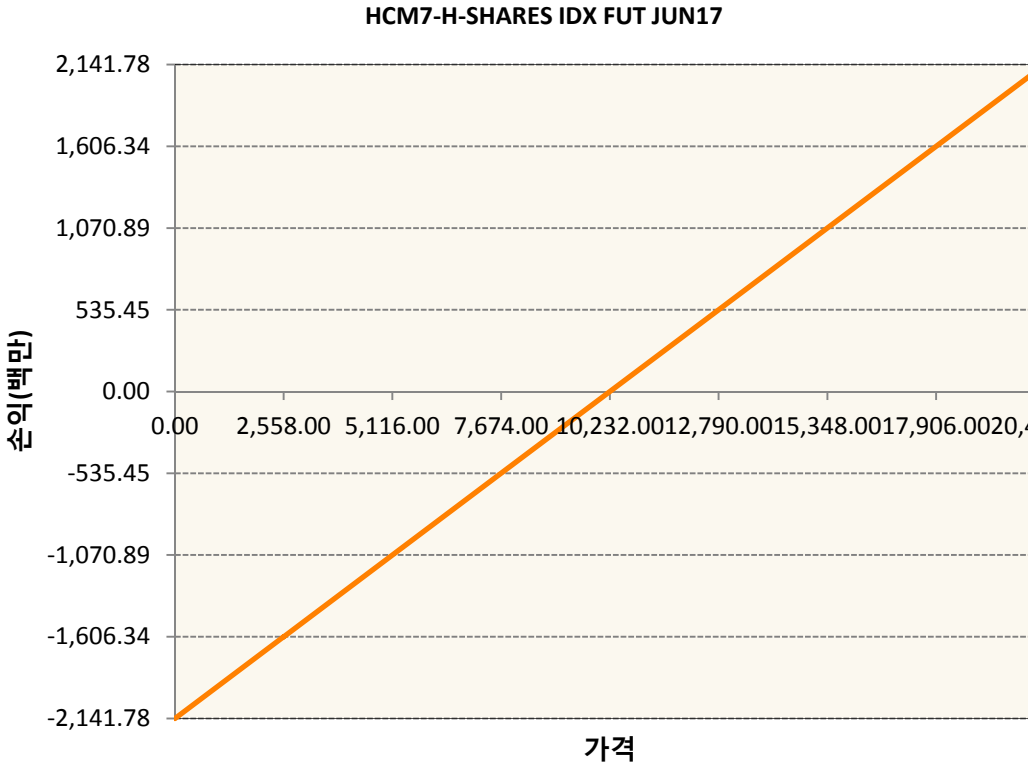
# 차이나인덱스모(주식-파생형)

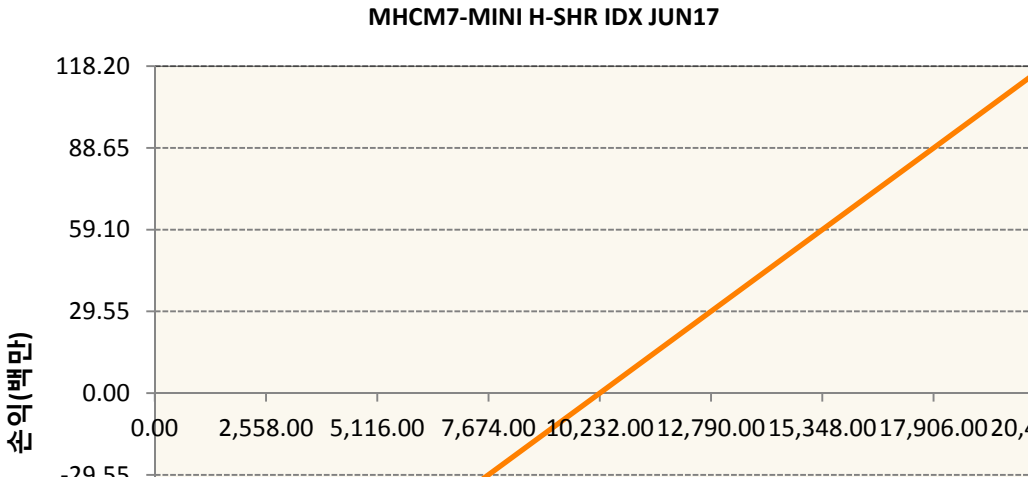
## 1. 계약금액

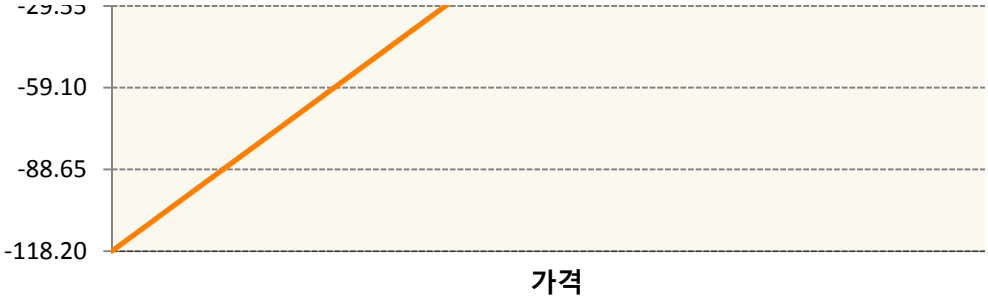
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | | | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | | | 2,142 | 0 | 2,142 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 118 | 0 | 118 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조






**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| HCM7 | H-SHARES IDX FUT JUN17 | 171 |
| MHCM7 | MINI H-SHR IDX JUN17 | 9 |

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

| |
|---|
| **126** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-05-25 |
| 기준일 | 2017-05-24 |

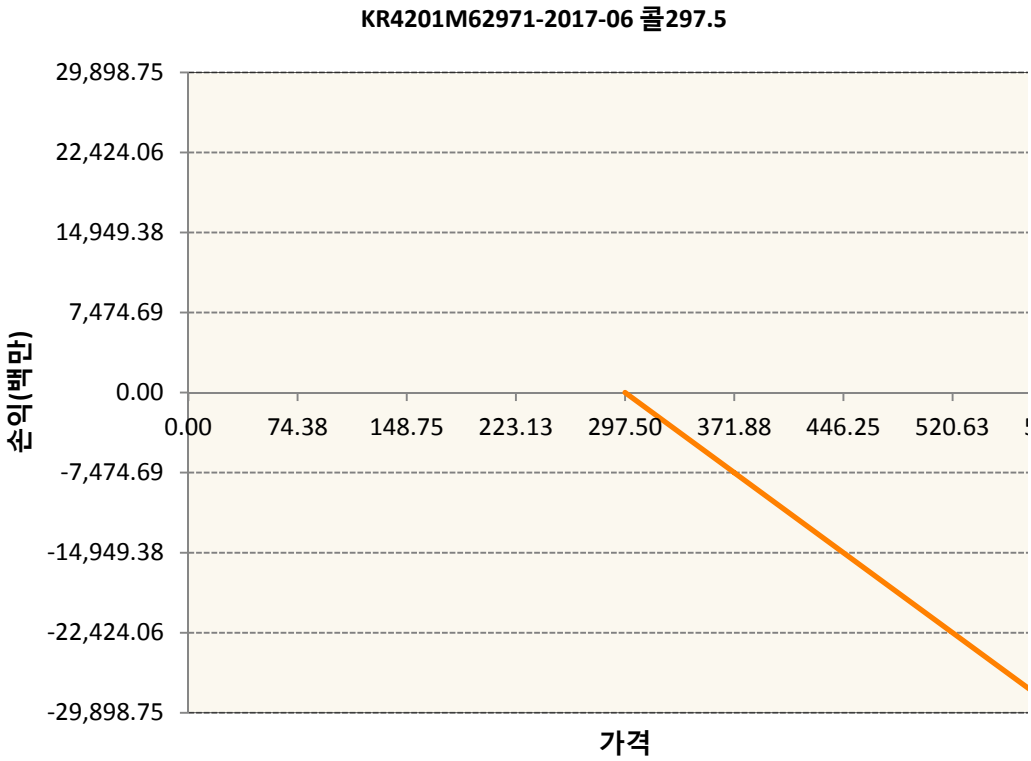
# 커버드콜모(주식혼합-파생형)

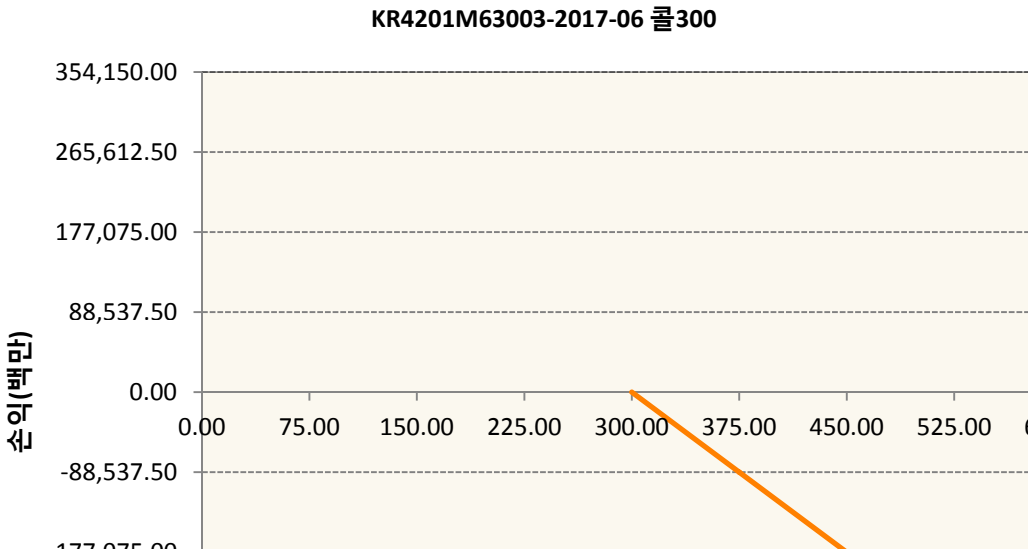
## 1. 계약금액

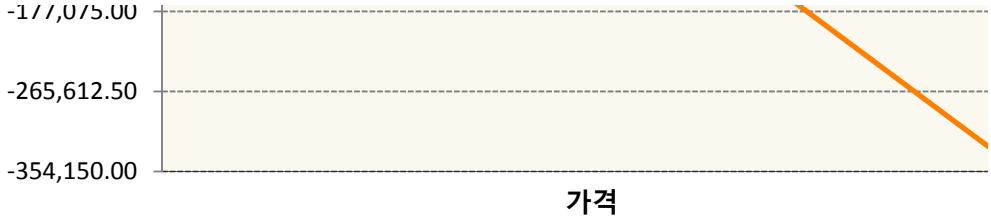
(단위:백만원)

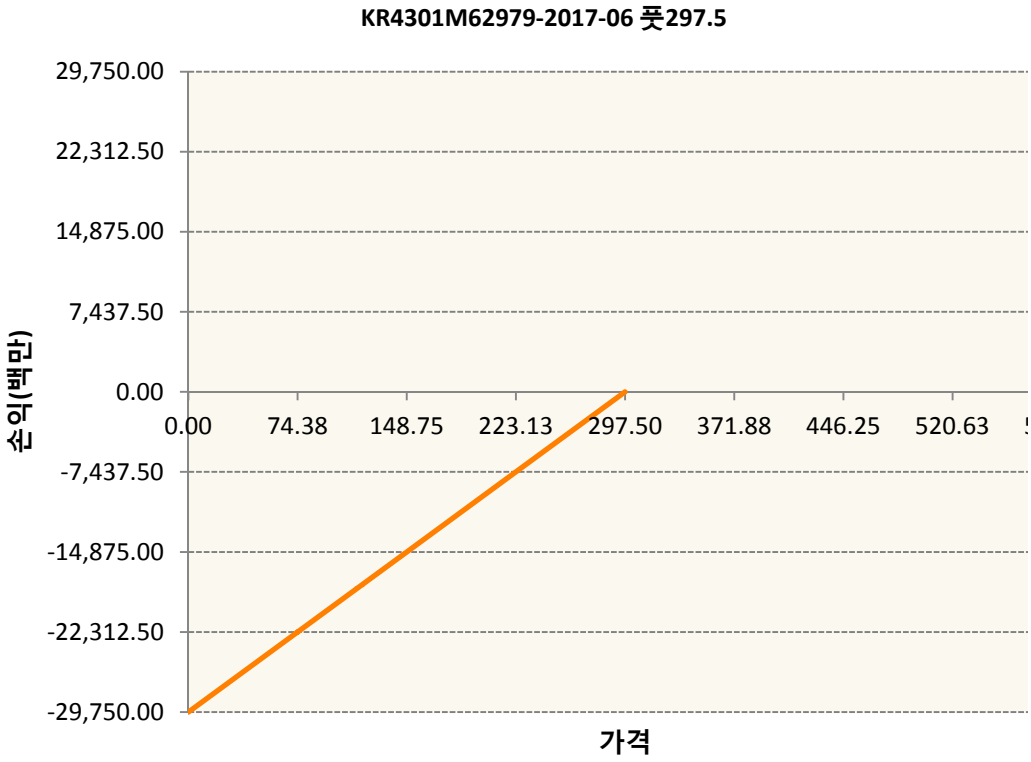
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 623,799 | -623,799 | 장내 |

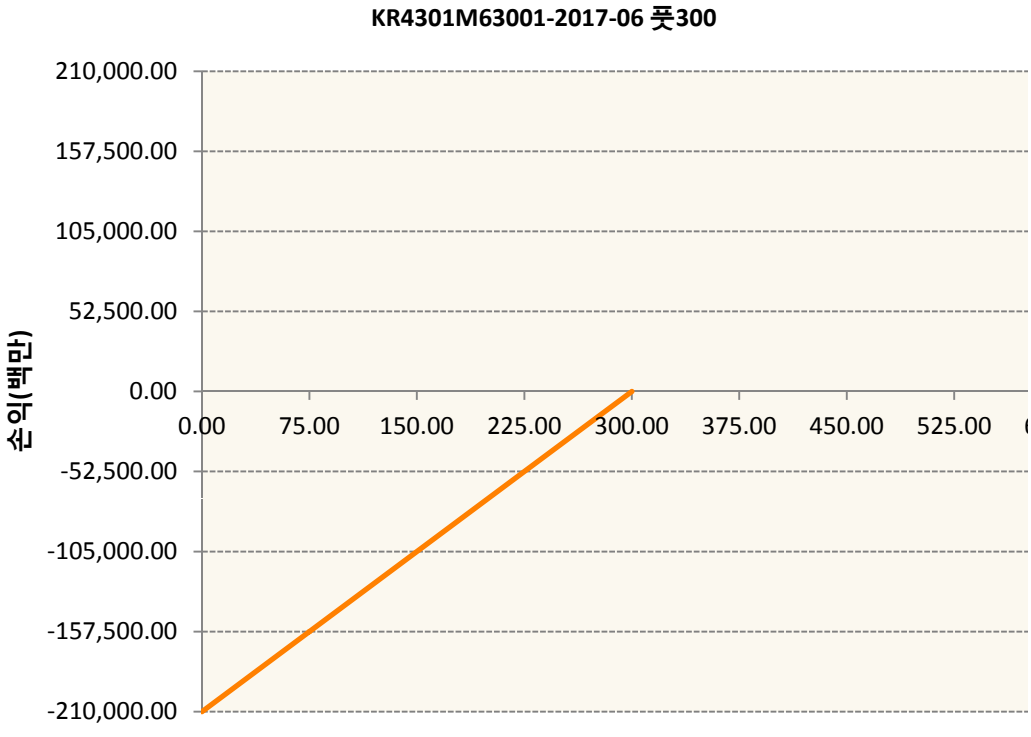
## 2. 만기시점의 손익구조




-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 | | | | | | 2,280 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 566 | 566 | 566 | 565 | 564 | 563 | 561 |
| -5.33% | 562 | 559 | 554 | 547 | 539 | 530 | 519 |
| -2.67% | 479 | 458 | 437 | 415 | 392 | 369 | 345 |
| 0% | 64 | 44 | 22 | 0 | -23 | -46 | -69 |
| 2.67% | -667 | -671 | -677 | -684 | -692 | -702 | -714 |
| 5.33% | -1,471 | -1,472 | -1,472 | -1,473 | -1,474 | -1,476 | -1,479 |
| 8.00% | -2,279 | -2,279 | -2,279 | -2,280 | -2,280 | -2,280 | -2,280 |
| KR4201M63( | 2017-06 콜300 | | | | | | 25,740 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 4,754 | 4,753 | 4,752 | 4,750 | 4,746 | 4,737 | 4,724 |
| -5.33% | 4,741 | 4,725 | 4,696 | 4,654 | 4,598 | 4,526 | 4,440 |
| -2.67% | 4,288 | 4,113 | 3,920 | 3,712 | 3,492 | 3,262 | 3,023 |
| 0% | 889 | 594 | 298 | 0 | -299 | -599 | -900 |
| 2.67% | -6,883 | -6,975 | -7,089 | -7,224 | -7,378 | -7,548 | -7,732 |
| 5.33% | -16,231 | -16,237 | -16,250 | -16,271 | -16,303 | -16,348 | -16,406 |
| 8.00% | -25,720 | -25,720 | -25,720 | -25,721 | -25,724 | -25,730 | -25,740 |
| KR4301M62( | 2017-06 풋297.5 | | | | | | 1,854 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,849 | -1,849 | -1,849 | -1,850 | -1,851 | -1,852 | -1,854 |
| -5.33% | -1,049 | -1,052 | -1,057 | -1,064 | -1,072 | -1,081 | -1,092 |
| -2.67% | -327 | -348 | -369 | -392 | -414 | -437 | -461 |
| 0% | 64 | 43 | 22 | 0 | -23 | -46 | -69 |
| 2.67% | 140 | 136 | 131 | 124 | 115 | 105 | 94 |
| 5.33% | 144 | 144 | 143 | 143 | 141 | 139 | 136 |
| 8.00% | 144 | 144 | 144 | 144 | 144 | 144 | 143 |
| KR4301M63( | 2017-06 풋300 | | | | | | 14,084 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -14,066 | -14,066 | -14,066 | -14,068 | -14,071 | -14,076 | -14,084 |
| -5.33% | -8,445 | -8,455 | -8,472 | -8,497 | -8,530 | -8,572 | -8,624 |
| -2.67% | -3,086 | -3,189 | -3,304 | -3,427 | -3,557 | -3,694 | -3,835 |
| 0% | 527 | 352 | 177 | 0 | -177 | -355 | -534 |
| 2.67% | 1,547 | 1,492 | 1,424 | 1,344 | 1,253 | 1,153 | 1,044 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 5.33% | 1,632 | 1,628 | 1,621 | 1,608 | 1,589 | 1,563 | 1,528 |
| 8.00% | 1,634 | 1,634 | 1,633 | 1,633 | 1,631 | 1,627 | 1,622 |

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

| |
|---|
| **53,037** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-05-25 |
| 기준일 | 2017-05-24 |

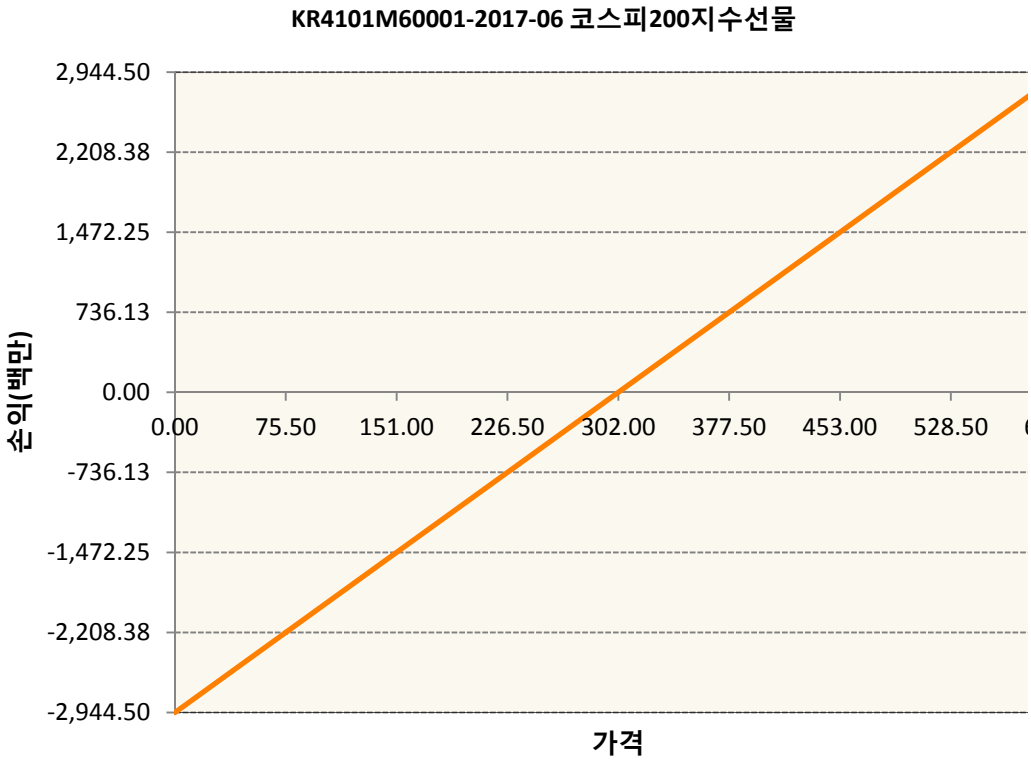
# 커버드콜목표전환형증권투자신탁

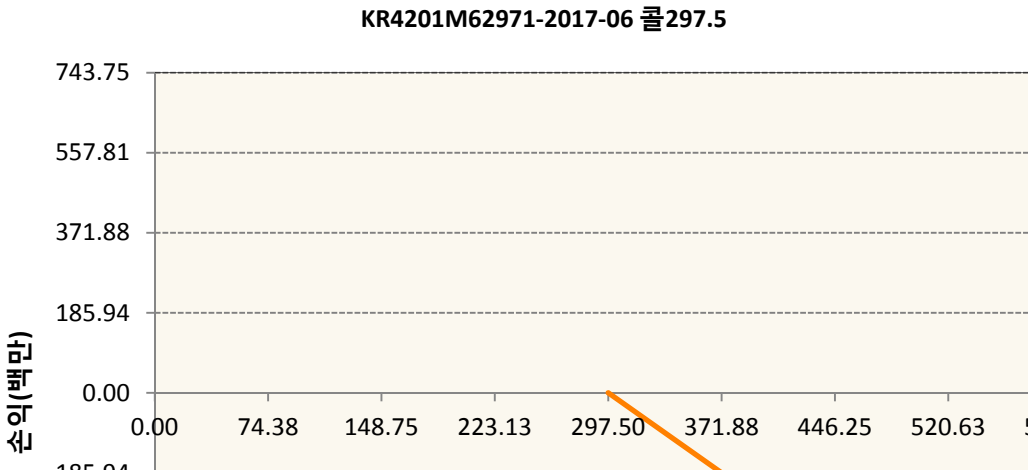
## 1. 계약금액

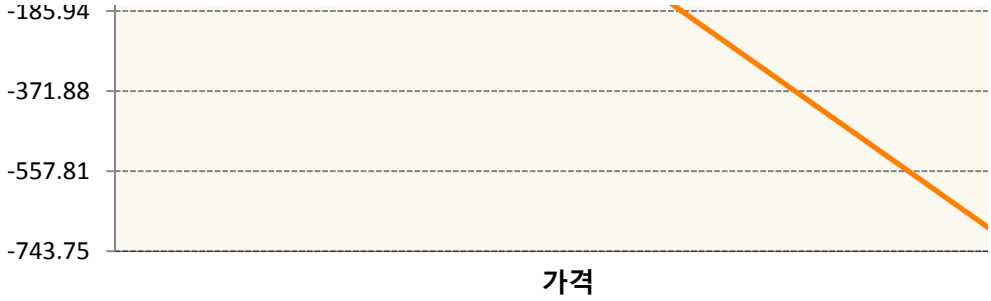
(단위:백만원)

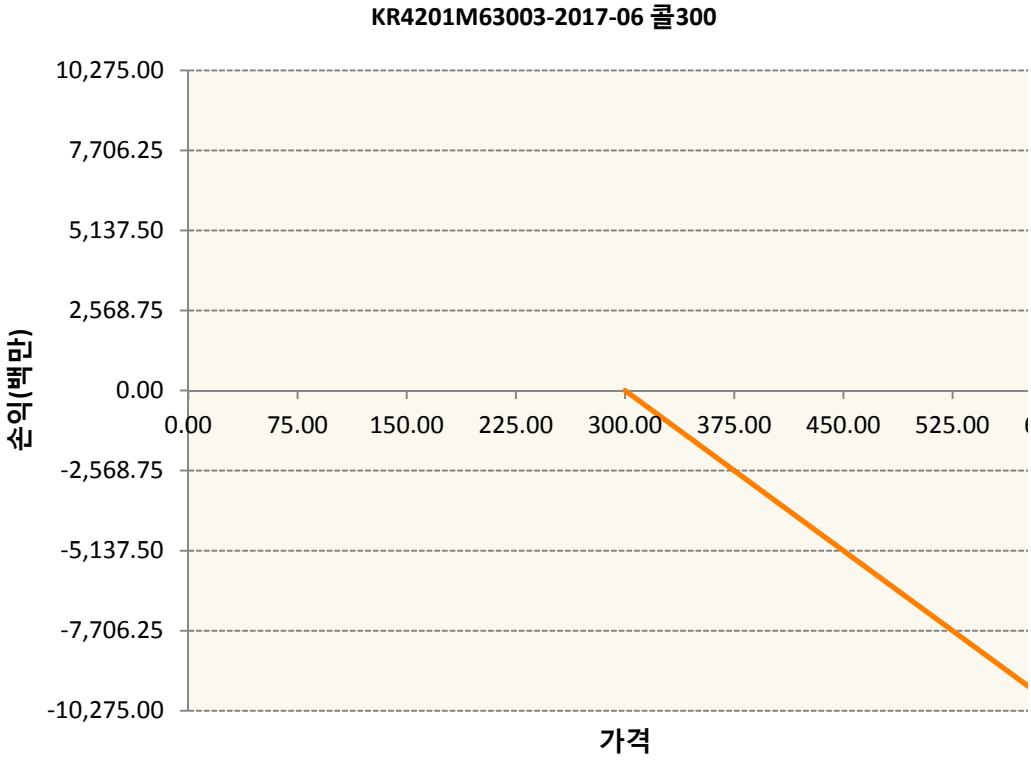
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,945 | 0 | 2,945 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 12,590 | -12,590 | 장내 |

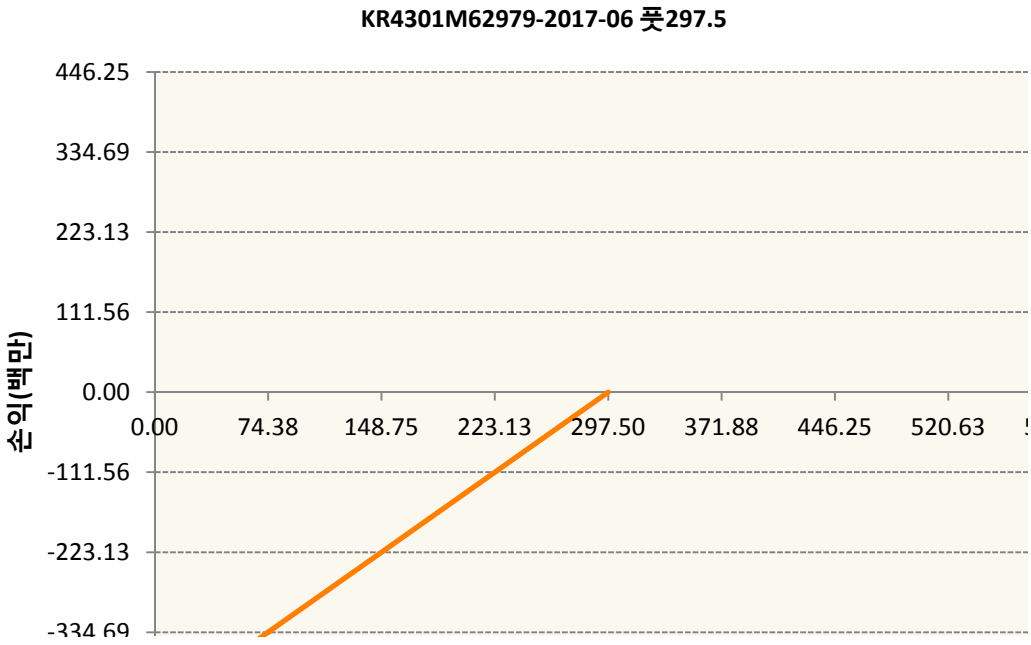
## 2. 만기시점의 손익구조



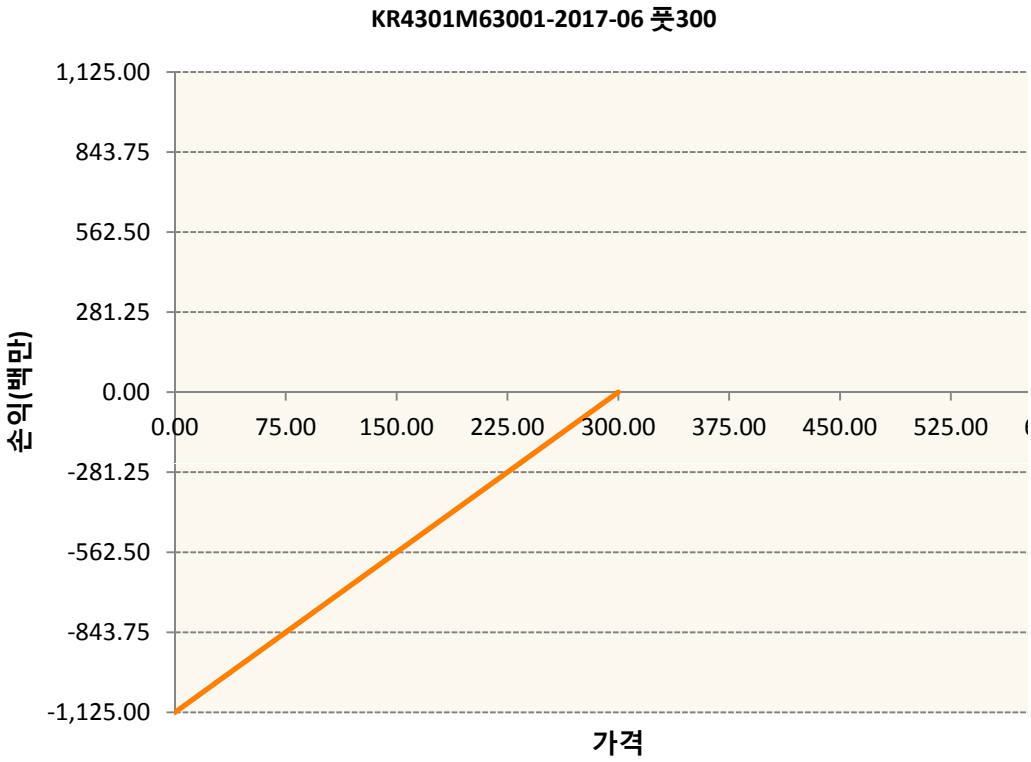




-185.94
-371.88
-557.81
-743.75
가격


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 | | | | | | | 57 |
| | 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 | 14 | 14 | 13 | 13 | 13 |
| -2.67% | 12 | 11 | 11 | 10 | 10 | 9 | 9 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 0% | 2 | 1 | 1 | 0 | -1 | -1 | -2 |
| 2.67% | -17 | -17 | -17 | -17 | -17 | -17 | -18 |
| 5.33% | -37 | -37 | -37 | -37 | -37 | -37 | -37 |
| 8.00% | -57 | -57 | -57 | -57 | -57 | -57 | -57 |
| | KR4201M63( | 2017-06 콜300 | | | | | 747 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 138 | 138 | 138 | 138 | 138 | 137 | 137 |
| -5.33% | 138 | 137 | 136 | 135 | 133 | 131 | 129 |
| -2.67% | 124 | 119 | 114 | 108 | 101 | 95 | 88 |
| 0% | 26 | 17 | 9 | 0 | -9 | -17 | -26 |
| 2.67% | -200 | -202 | -206 | -210 | -214 | -219 | -224 |
| 5.33% | -471 | -471 | -471 | -472 | -473 | -474 | -476 |
| 8.00% | -746 | -746 | -746 | -746 | -746 | -747 | -747 |
| | 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 | -16 |
| -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 | 1 |
| 5.33% | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 |
| 8.00% | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 |
| | KR4301M63( | 2017-06 풋300 | | | | | 75 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -75 | -75 | -75 | -75 | -75 | -75 | -75 |
| -5.33% | -45 | -45 | -45 | -46 | -46 | -46 | -46 |
| -2.67% | -17 | -17 | -18 | -18 | -19 | -20 | -21 |
| 0% | 3 | 2 | 1 | 0 | -1 | -2 | -3 |
| 2.67% | 8 | 8 | 8 | 7 | 7 | 6 | 6 |
| 5.33% | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 | 8 | 8 |
| 8.00% | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 |

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

| |
|---|
| **1,267** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-05-25 |
| 기준일 | 2017-05-24 |

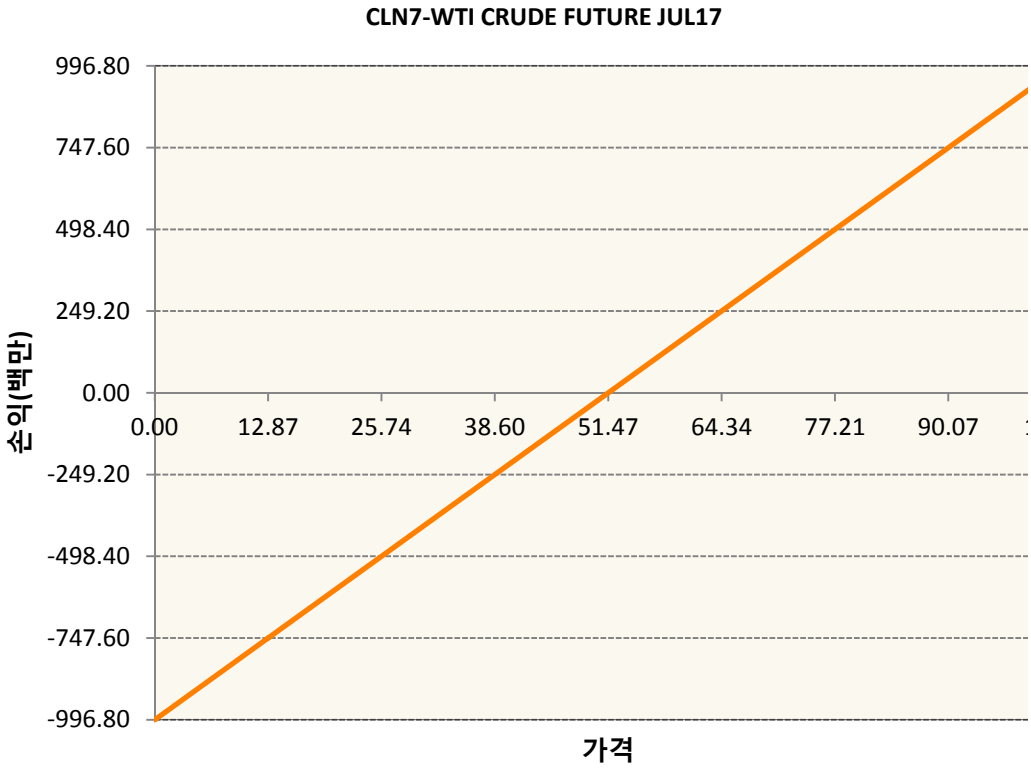
# 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

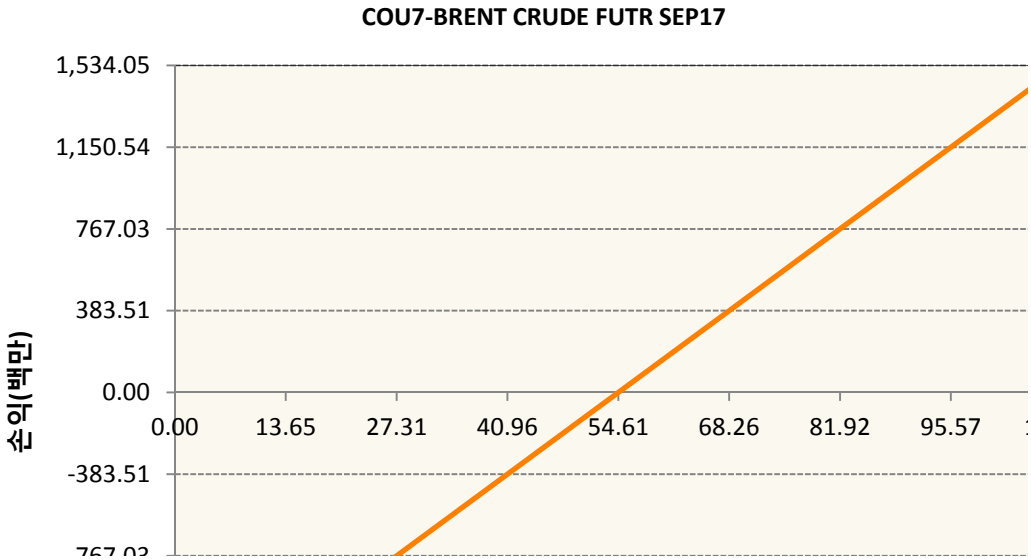
## 1. 계약금액

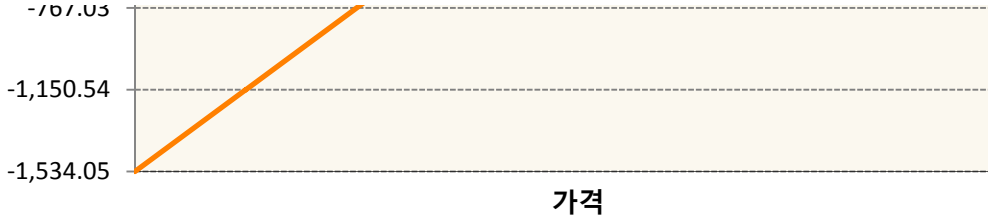
(단위:백만원)

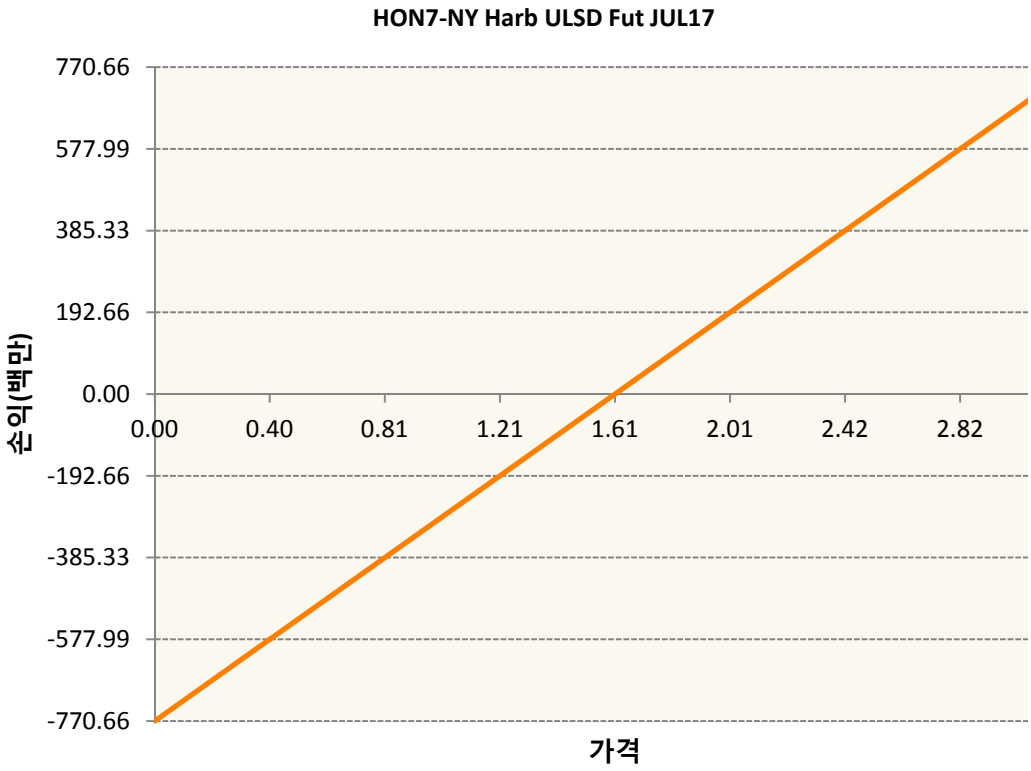
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 5,679 | 225 | 5,454 | |

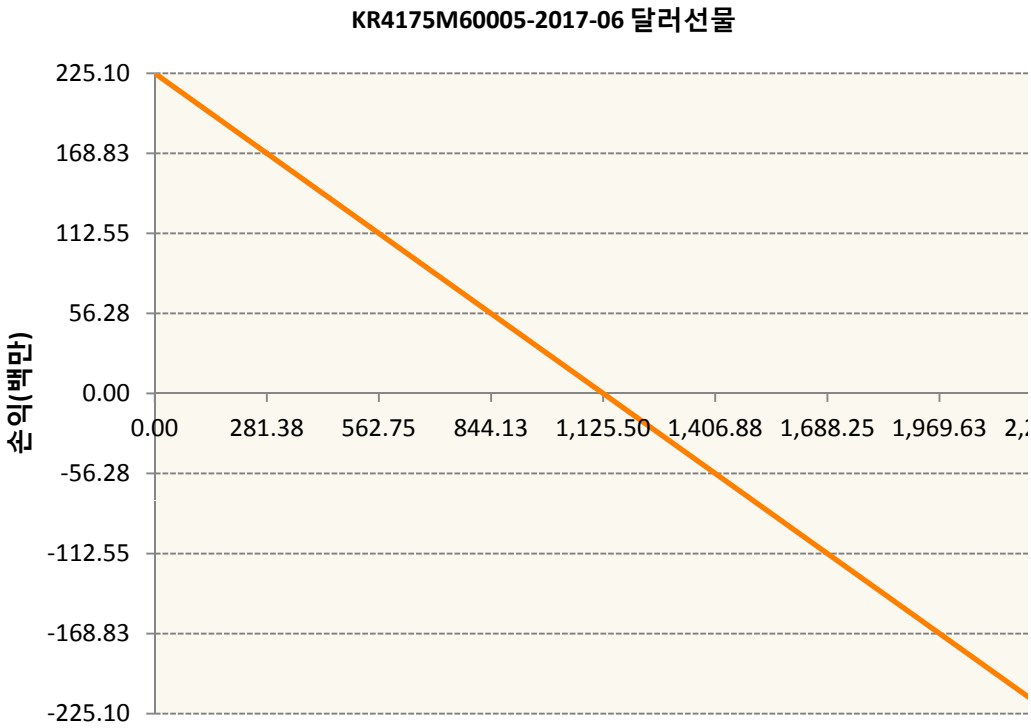
## 2. 만기시점의 손익구조



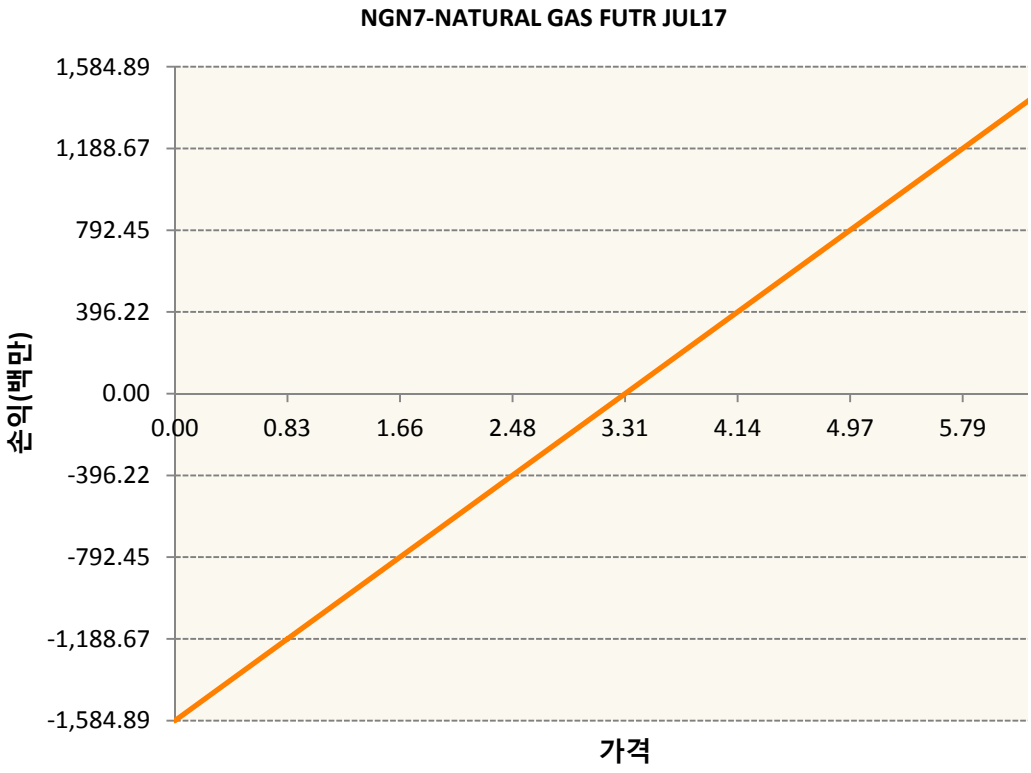



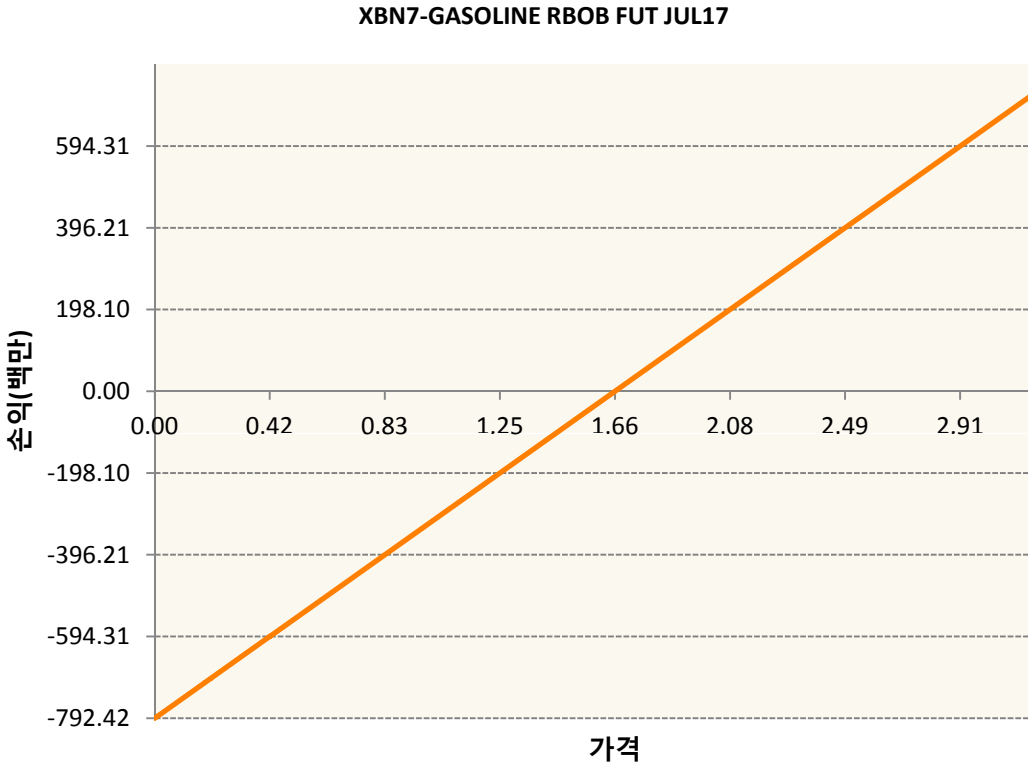

-1,150.54
-1,534.05
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
770.66
577.99
385.33
192.66
0.00
-192.66
-385.33
-577.99
-770.66
0.00
0.40
0.81
1.21
1.61
2.01
2.42
2.82
순이익(백만)
가격


KR4175M60005-2017-06 달러선물
225.10
168.83
112.55
56.28
0.00
-56.28
-112.55
-168.83
-225.10
0.00
281.38
562.75
844.13
1,125.50
1,406.88
1,688.25
1,969.63
순이익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,584.89
1,188.67
792.45
396.22
0.00
-396.22
-792.45
-1,188.67
-1,584.89
0.00
0.83
1.66
2.48
3.31
4.14
4.97
5.79
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
594.31
396.21
198.10
0.00
-198.10
-396.21
-594.31
-792.42
0.00
0.42
0.83
1.25
1.66
2.08
2.49
2.91
손익(백만)
가격

**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| CLN7 | WTI CRUDE FUTURE JUL17 | 80 |
| COU7 | BRENT CRUDE FUTR SEP17 | 123 |
| HON7 | NY Harb ULSD Fut JUL17 | 62 |
| KR4175M60( | 2017-06 달러선물 | 18 |
| NGN7 | NATURAL GAS FUTR JUL17 | 127 |
| XBN7 | GASOLINE RBOB FUT JUL17 | 63 |

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

| |
|---|
| **963** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-05-25 |
| 기준일 | 2017-05-24 |

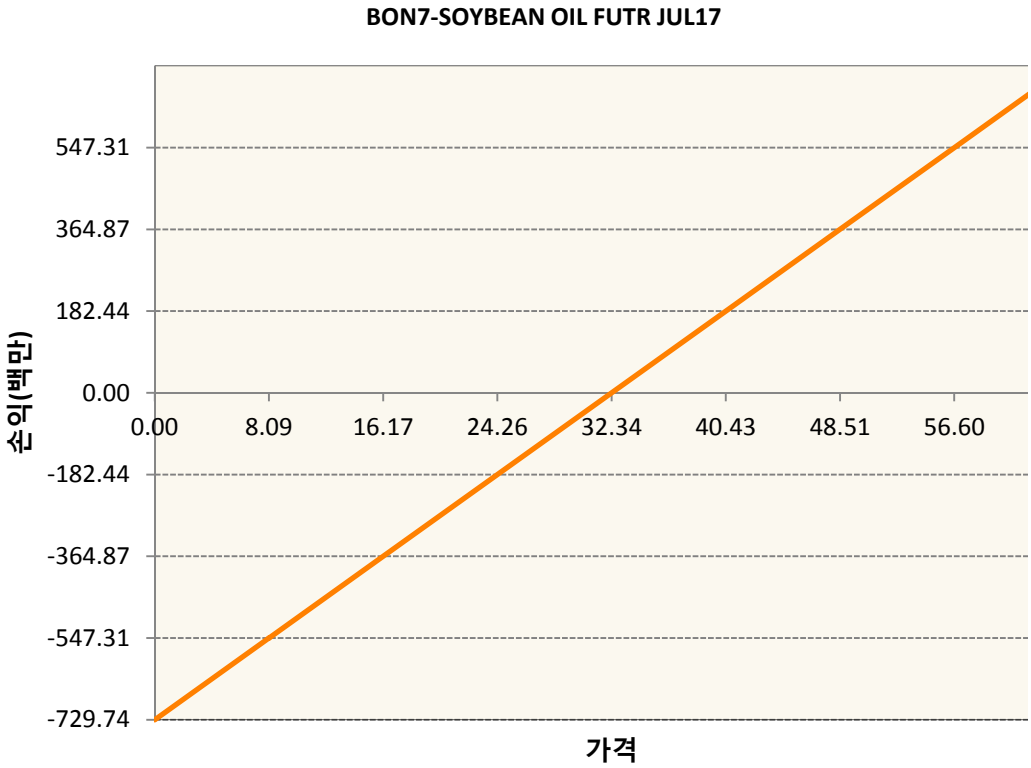
# 애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

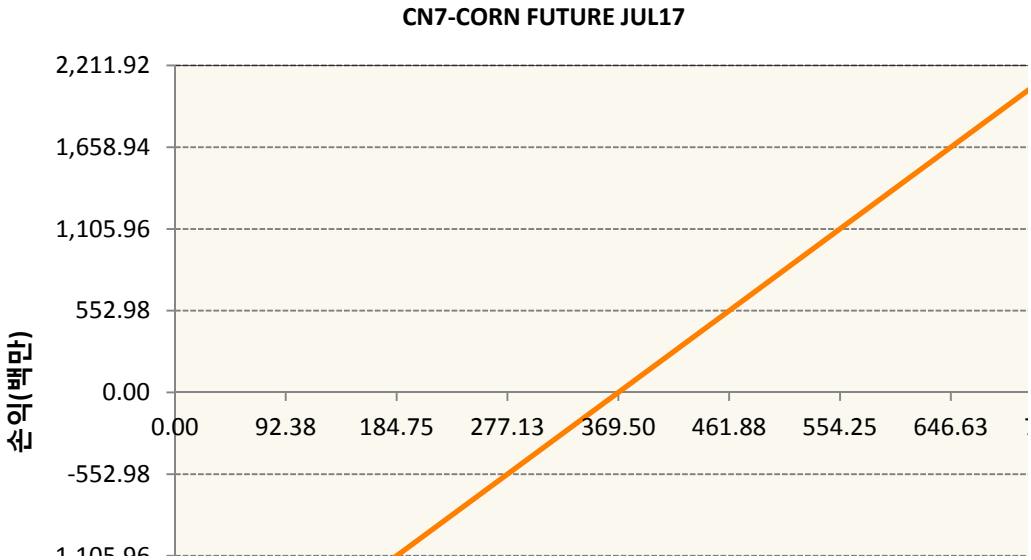
## 1. 계약금액

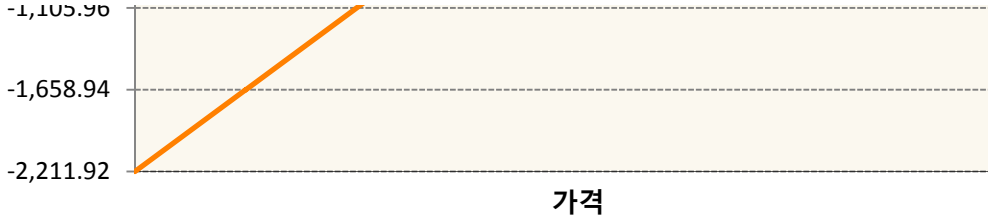
(단위:백만원)

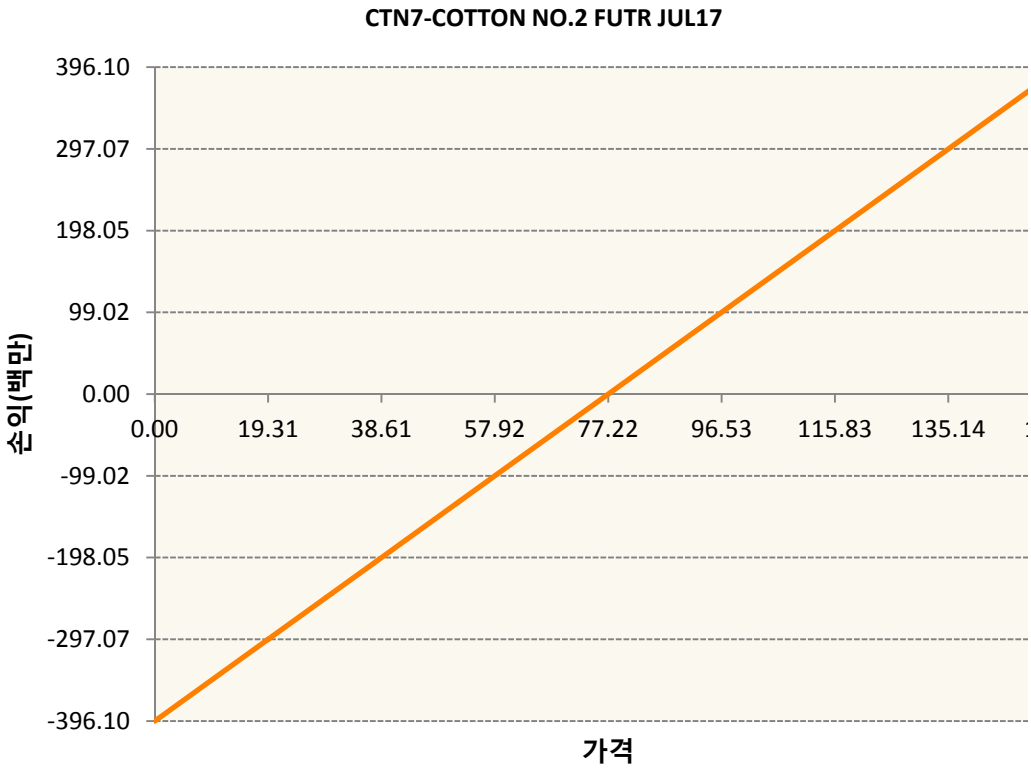
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 8,380 | 394 | 7,986 | |

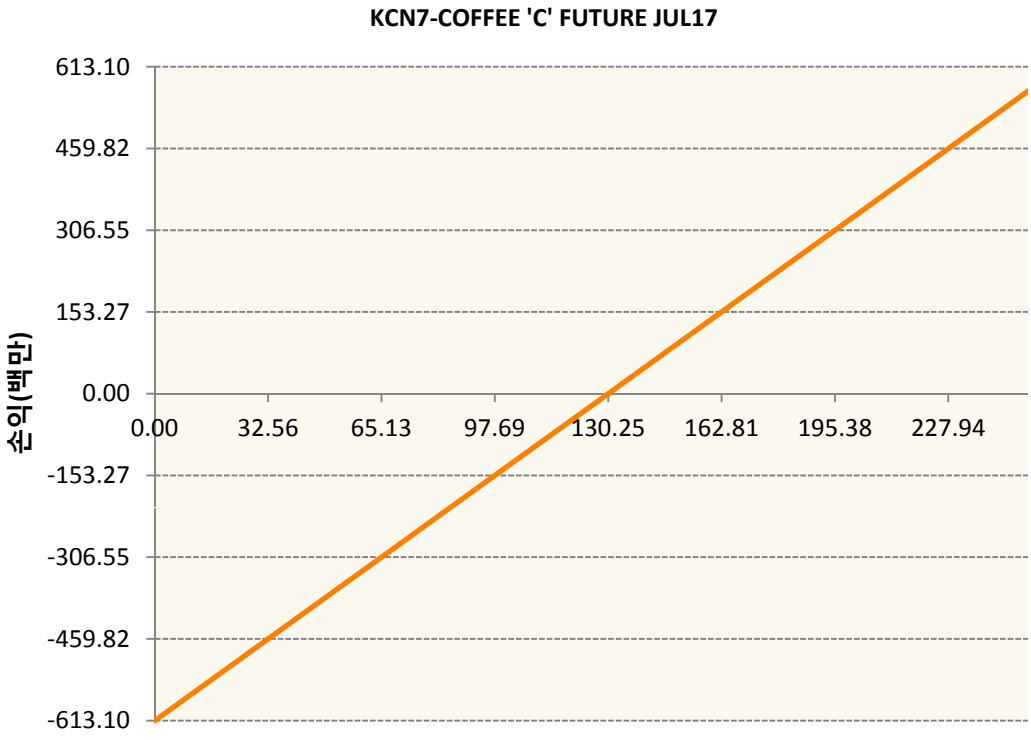
## 2. 만기시점의 손익구조



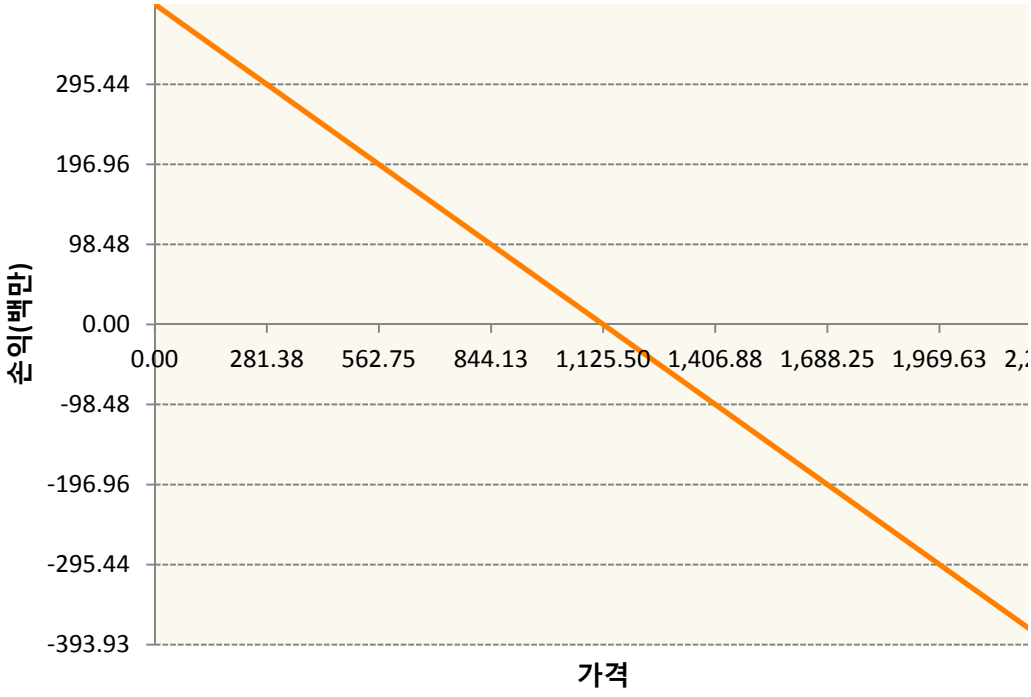

-1,658.94
-2,211.92
가격


CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
396.10
297.07
198.05
99.02
0.00
-99.02
-198.05
-297.07
-396.10
0.00
19.31
38.61
57.92
77.22
96.53
115.83
135.14
순익(백만)
가격

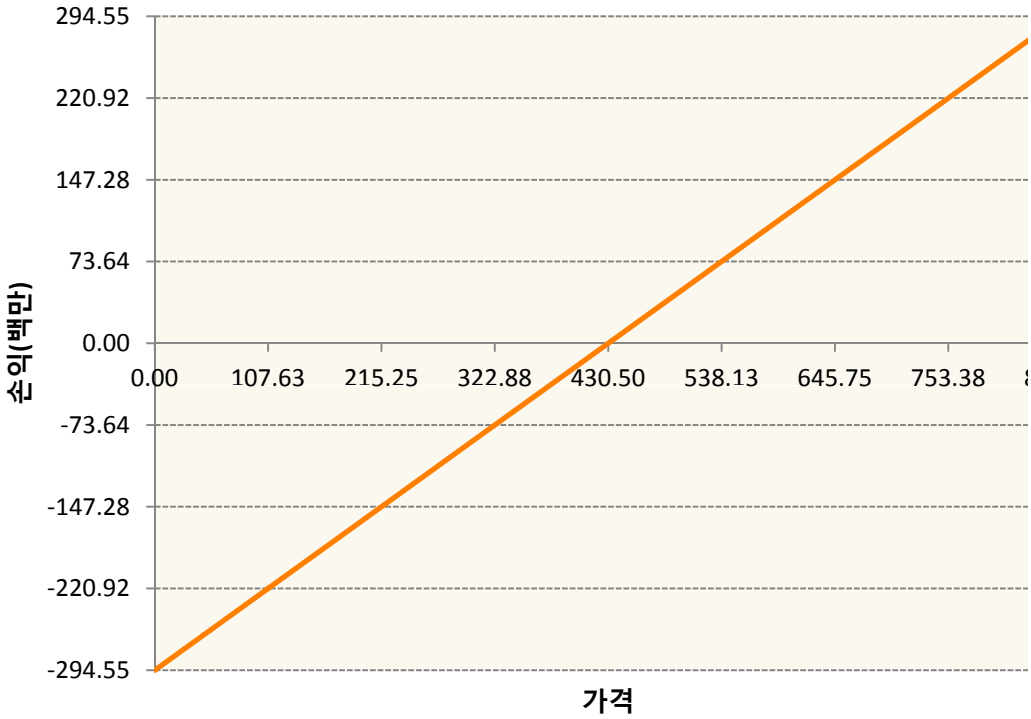

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
613.10
459.82
306.55
153.27
0.00
-153.27
-306.55
-459.82
-613.10
0.00
32.56
65.13
97.69
130.25
162.81
195.38
227.94
순익(백만)

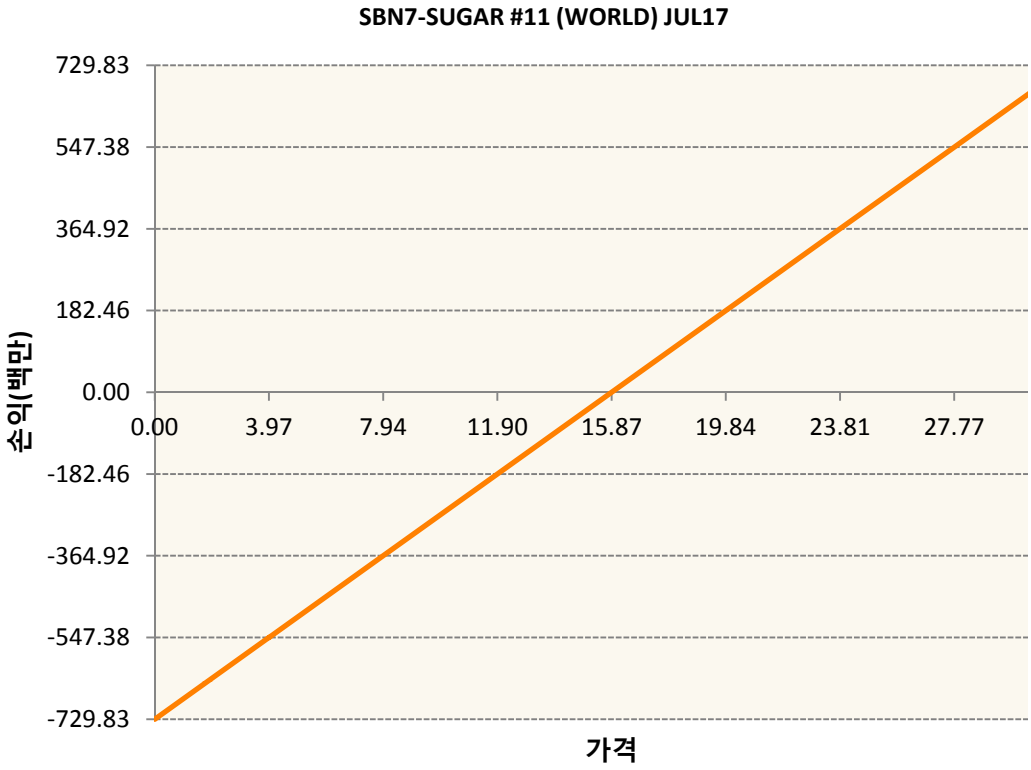
가격

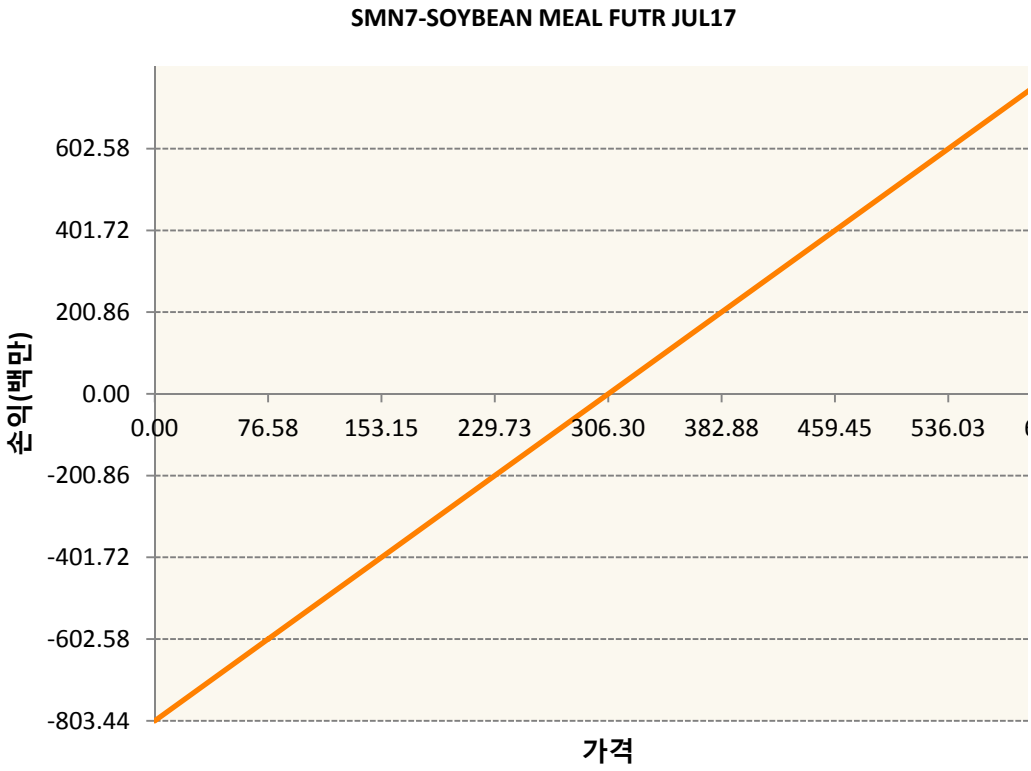
KR4175M60005-2017-06 달러선물

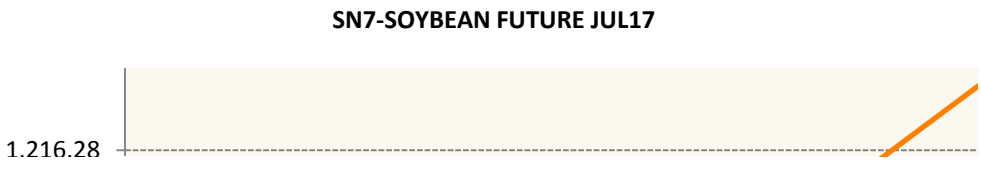


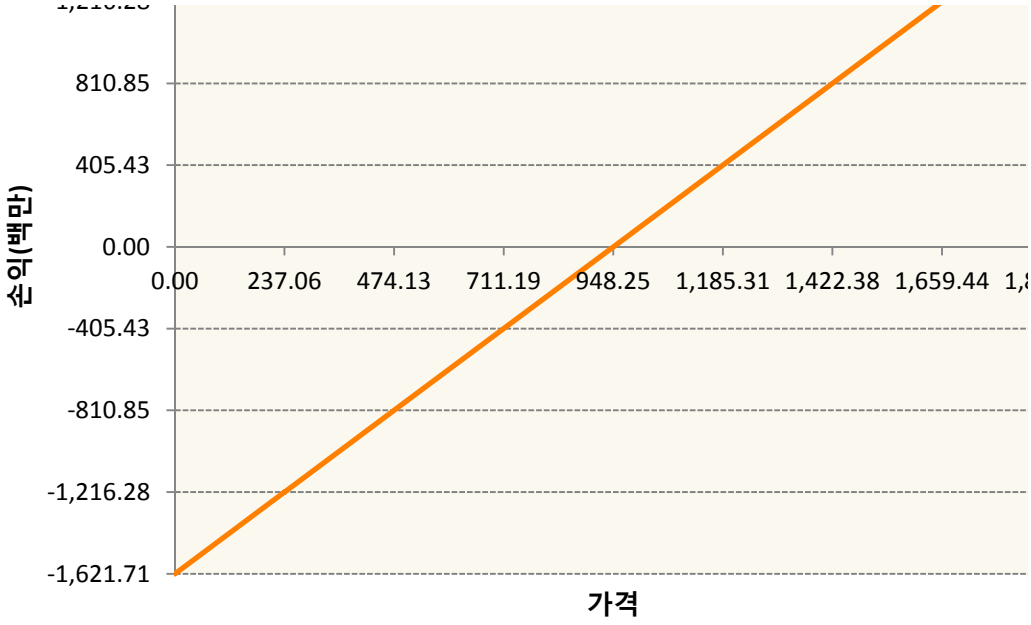

KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17

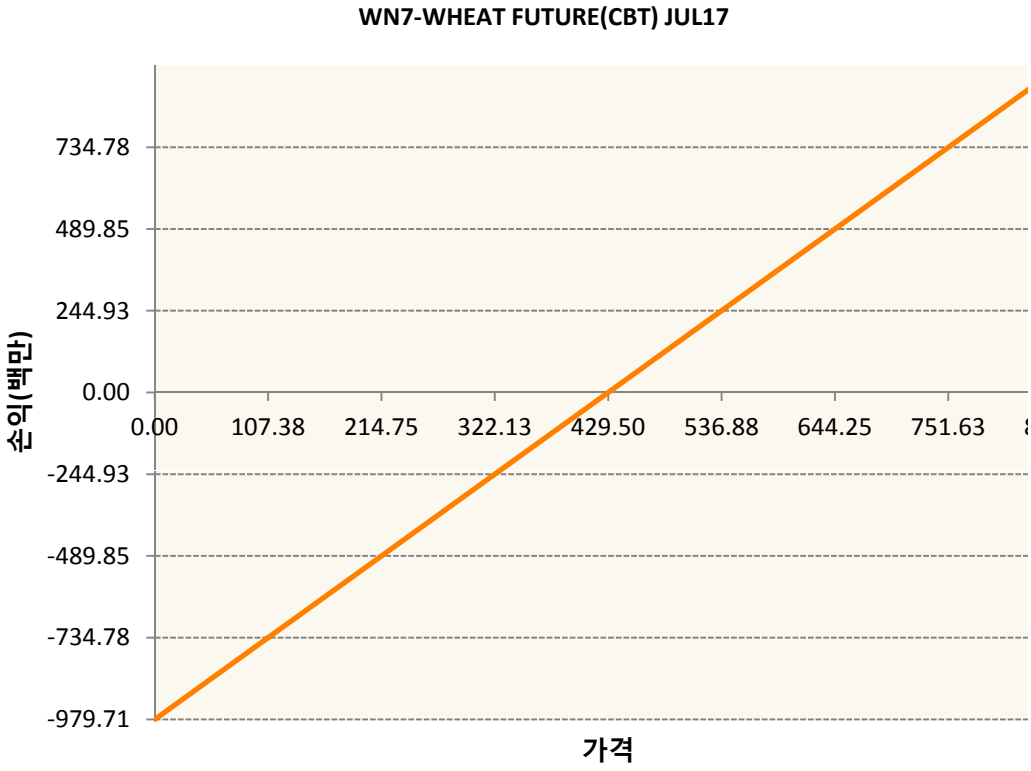



SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
729.83
547.38
364.92
182.46
0.00
-182.46
-364.92
-547.38
-729.83
0.00
3.97
7.94
11.90
15.87
19.84
23.81
27.77
손익(백만)
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
602.58
401.72
200.86
0.00
-200.86
-401.72
-602.58
-803.44
0.00
76.58
153.15
229.73
306.30
382.88
459.45
536.03
손익(백만)
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,216.28




| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---|---|
| BON7 | SOYBEAN OIL FUTR JUL17 | 58 |
| CN7 | CORN FUTURE JUL17 | 177 |
| CTN7 | COTTON NO.2 FUTR JUL17 | 32 |
| KCN7 | COFFEE 'C' FUTURE JUL17 | 49 |
| KR4175M60( | 2017-06 달러선물 | 32 |

| | | |
|---|---|---|
| KWN7 | KC HRW WHEAT FUT JUL17 | 24 |
| SBN7 | SUGAR #11 (WORLD) JUL17 | 58 |
| SMN7 | SOYBEAN MEAL FUTR JUL17 | 64 |
| SN7 | SOYBEAN FUTURE JUL17 | 130 |
| WN7 | WHEAT FUTURE(CBT) JUL17 | 78 |

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

| |
|---|
| **763** |