공시일	2017-05-26
기준일	2017-05-25

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	2017-05-26
기준일	2017-05-25

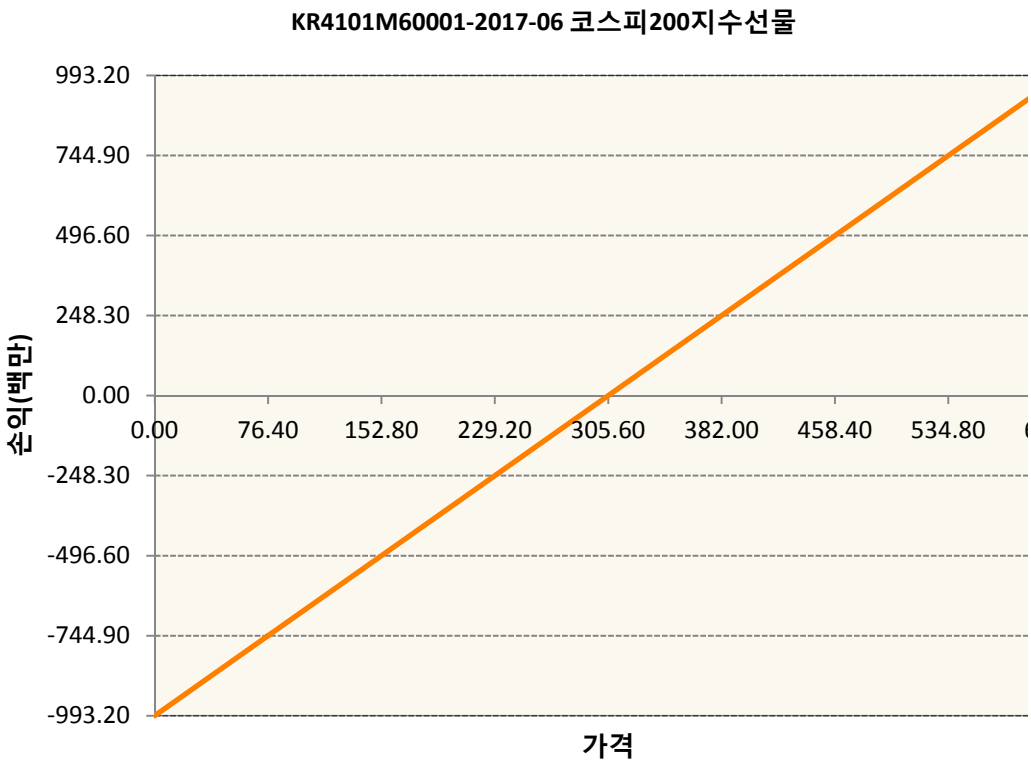
스마트인덱스모

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	993	0	993	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							79
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-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%	53	53	53	53	53	53	53
8.00%	79	79	79	79	79	79	79

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

53

공시일	2017-05-26
기준일	2017-05-25

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)

539

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-05-26
기준일	2017-05-25

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)

334

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-05-26
기준일	2017-05-25

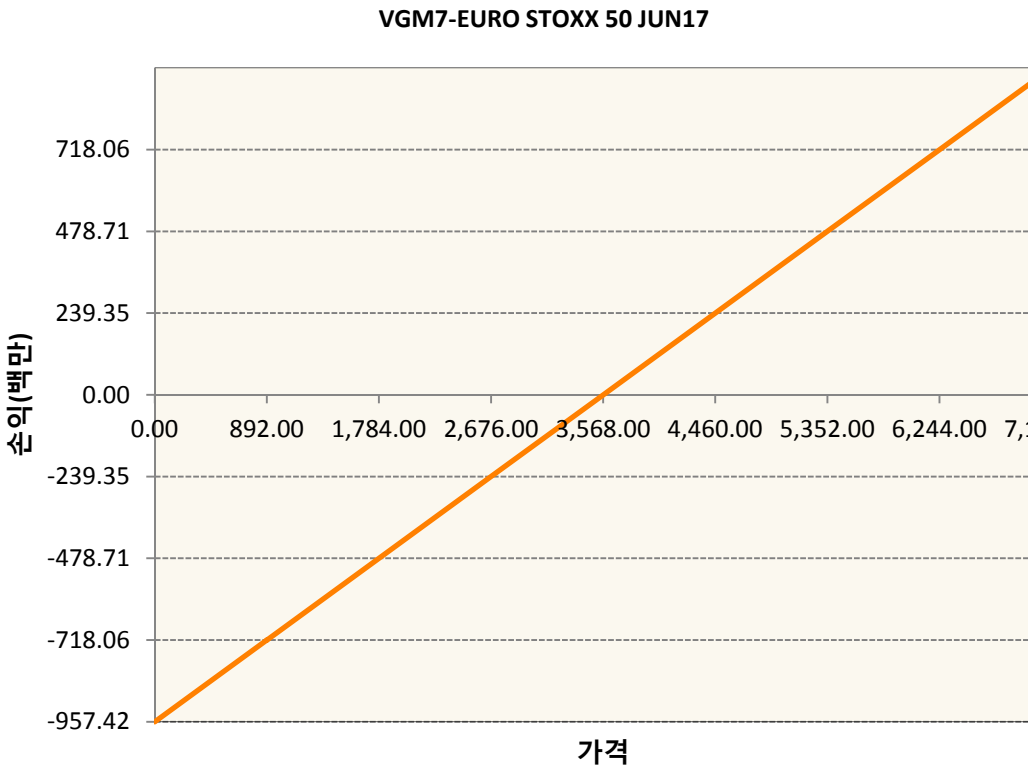
유로인덱스모(주식-파생형)

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)

74

공시일	2017-05-26
기준일	2017-05-25

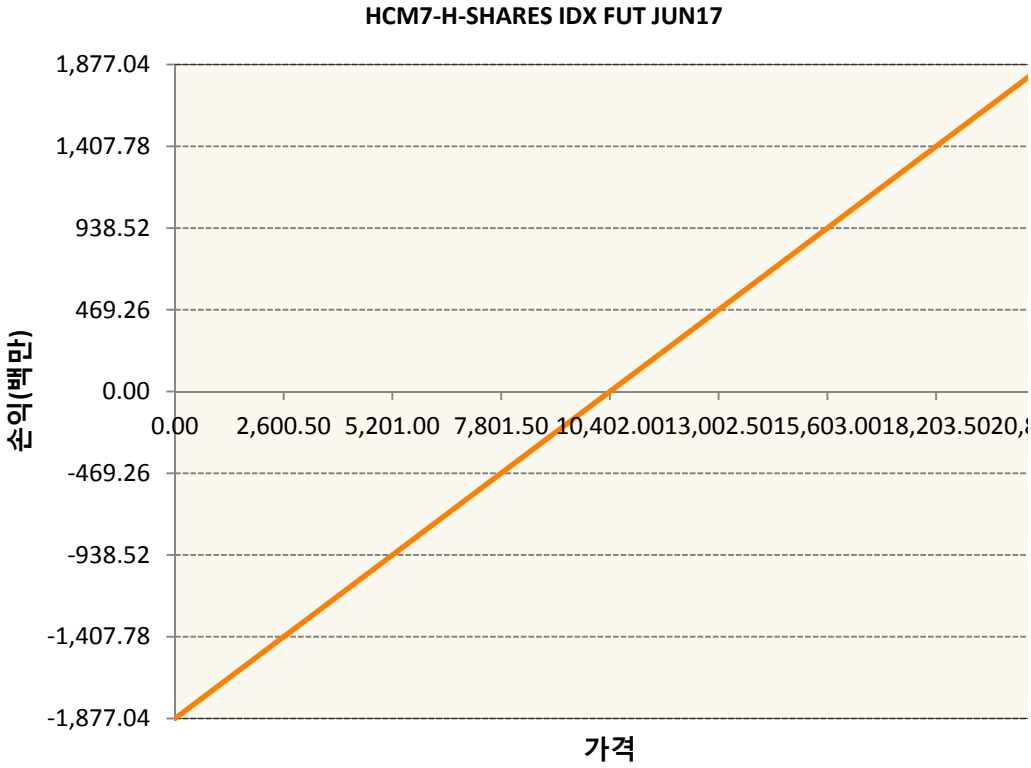
차이나인덱스모(주식-파생형)

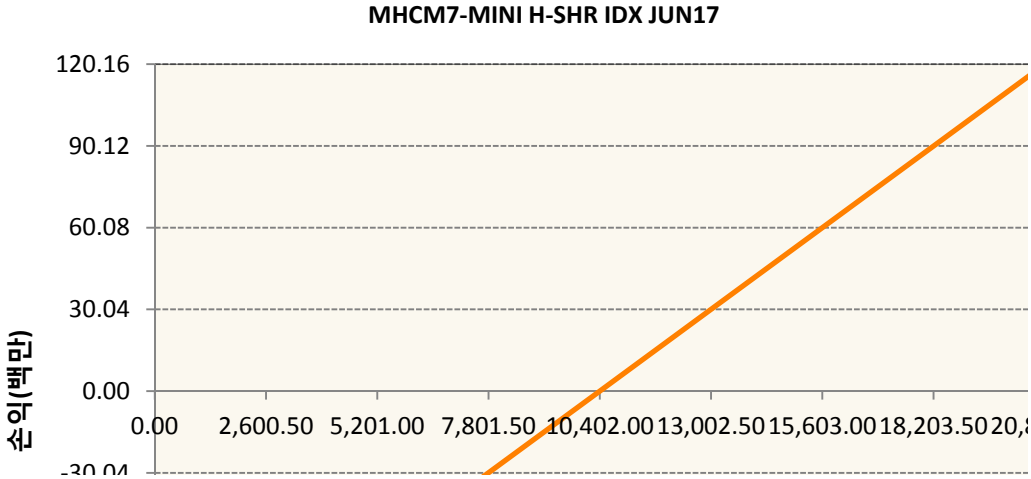
1. 계약금액

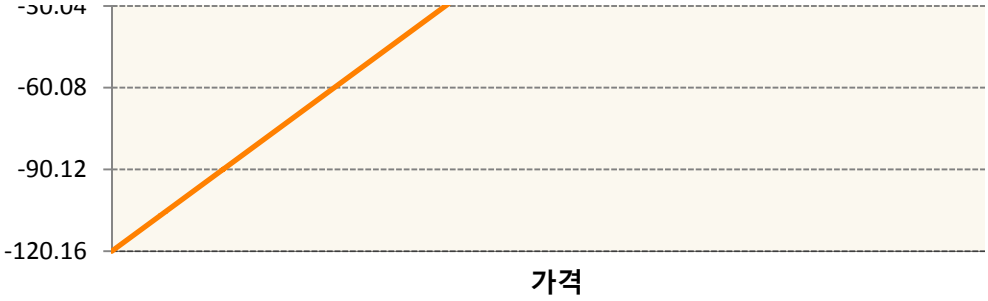
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계			1,877	0	1,877	
누계	유가증권	선물	120	0	120	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCM7	H-SHARES IDX FUT JUN17	150
MHCM7	MINI H-SHR IDX JUN17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	112

공시일	2017-05-26
기준일	2017-05-25

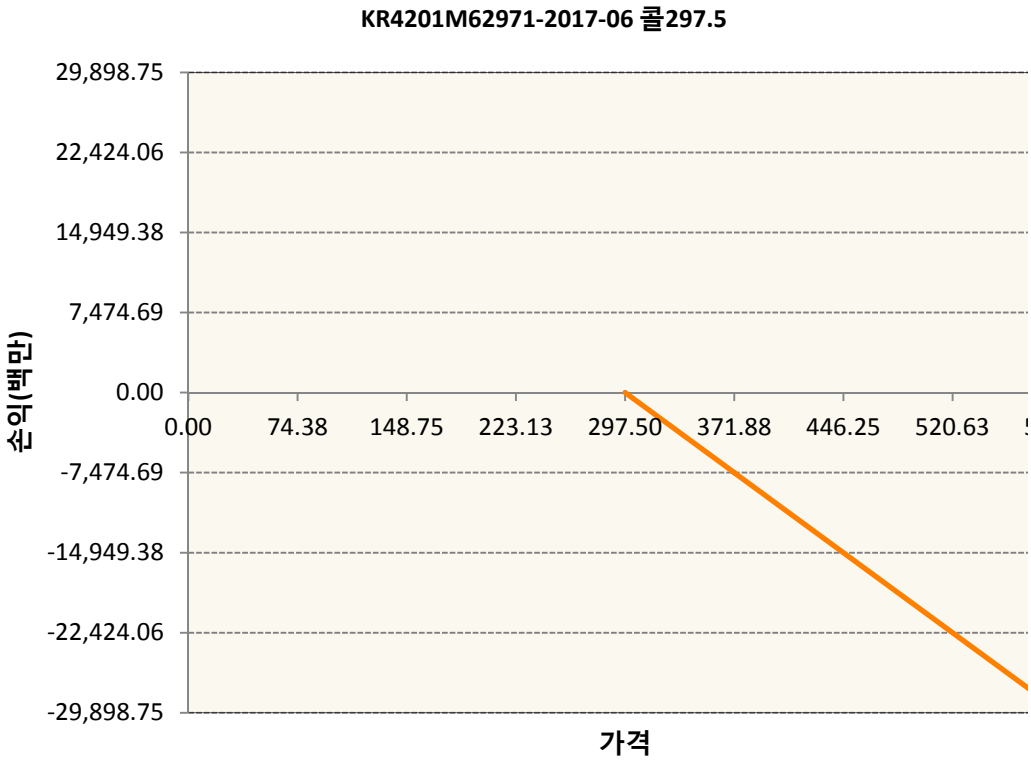
커버드콜모(주식혼합-파생형)

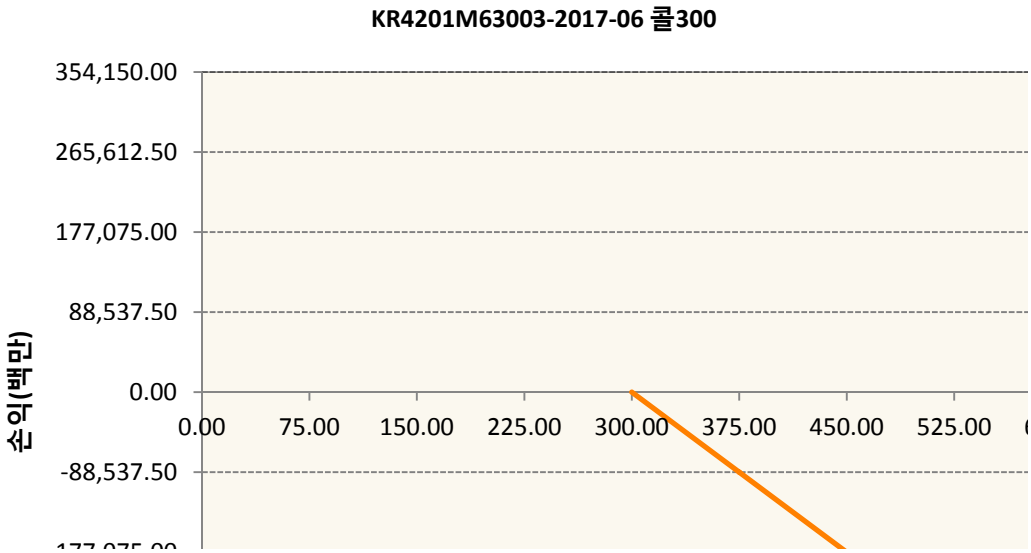
1. 계약금액

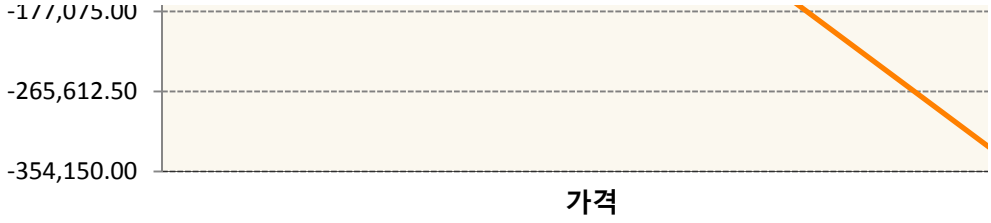
(단위:백만원)

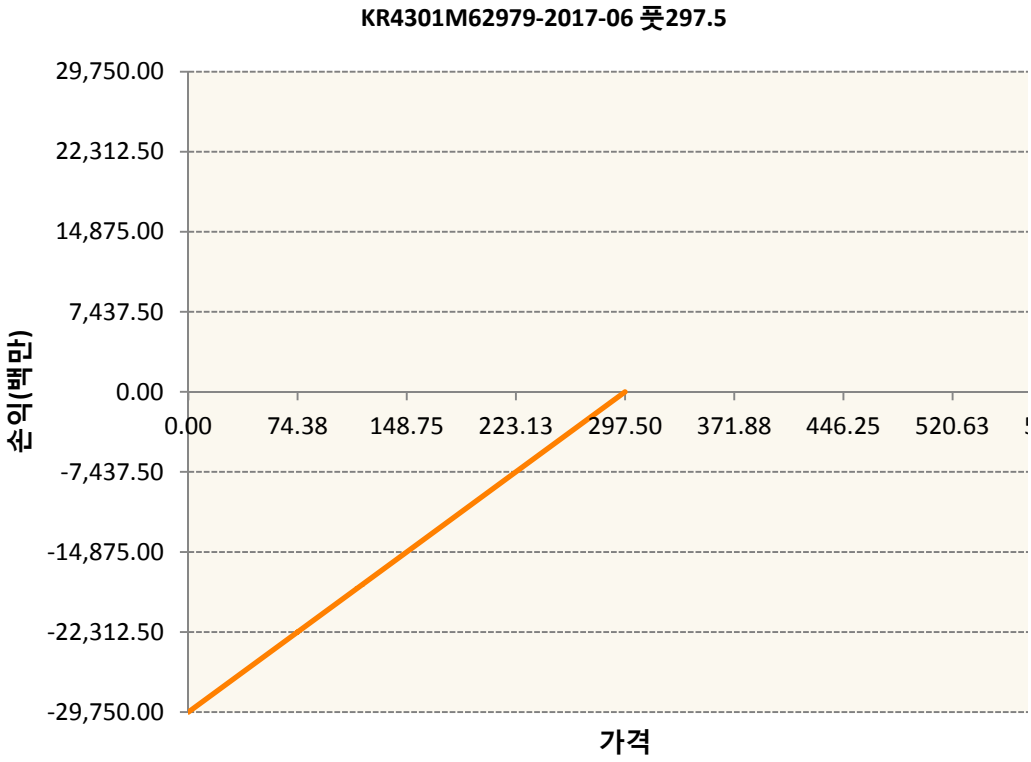
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	623,799	-623,799	장내

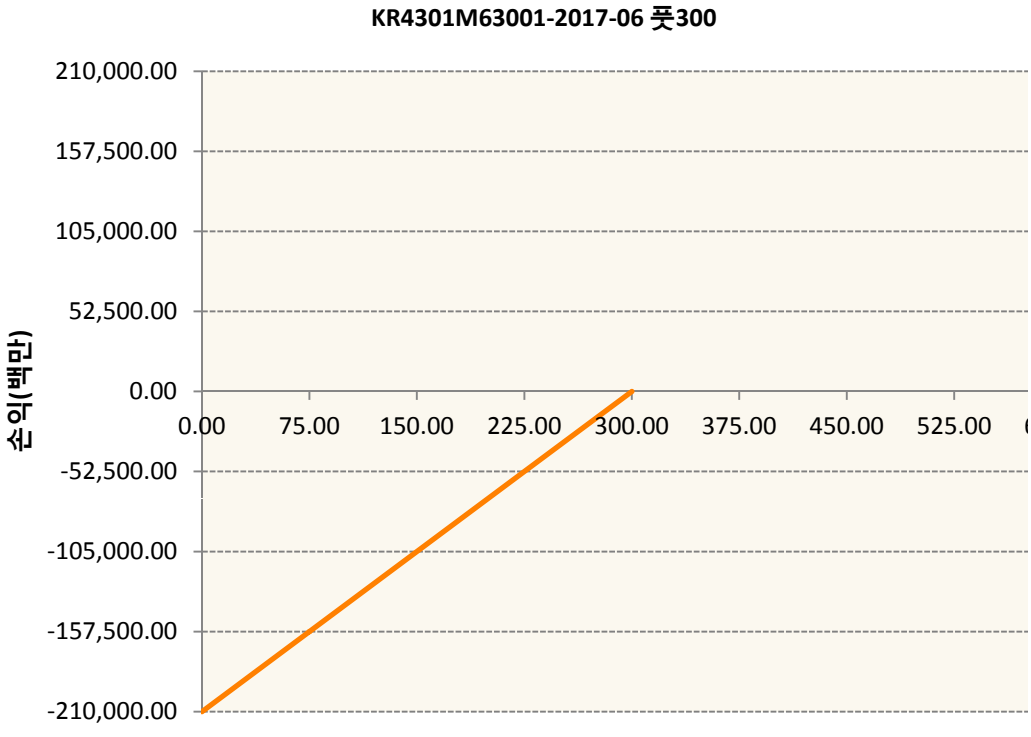
2. 만기시점의 손익구조






-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						2,379
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	848	847	846	844	841	837	831
-5.33%	829	819	806	793	777	761	744
-2.67%	629	603	576	550	523	496	470
0%	44	31	16	0	-18	-37	-56
2.67%	-744	-746	-748	-752	-757	-763	-771
5.33%	-1,561	-1,561	-1,561	-1,561	-1,562	-1,563	-1,565
8.00%	-2,378	-2,378	-2,378	-2,378	-2,378	-2,379	-2,379
KR4201M63(	2017-06 콜300						27,305
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,654	7,652	7,646	7,635	7,616	7,588	7,550
-5.33%	7,571	7,506	7,420	7,314	7,188	7,045	6,887
-2.67%	6,225	5,943	5,655	5,362	5,067	4,769	4,468
0%	728	498	255	0	-264	-535	-811
2.67%	-8,130	-8,170	-8,228	-8,305	-8,401	-8,516	-8,647
5.33%	-17,693	-17,695	-17,699	-17,708	-17,724	-17,748	-17,781
8.00%	-27,295	-27,295	-27,295	-27,296	-27,297	-27,300	-27,305
KR4301M62(	2017-06 풋297.5						1,613
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,597	-1,597	-1,599	-1,601	-1,604	-1,608	-1,613
-5.33%	-802	-812	-824	-838	-853	-870	-887
-2.67%	-187	-214	-240	-267	-293	-320	-346
0%	44	31	16	0	-18	-36	-56
2.67%	73	71	69	65	60	54	47
5.33%	74	74	74	73	73	72	70
8.00%	74	74	74	74	74	74	73
KR4301M63(	2017-06 풋300						12,605
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,543	-12,545	-12,548	-12,555	-12,566	-12,582	-12,605
-5.33%	-6,898	-6,937	-6,988	-7,051	-7,126	-7,210	-7,304
-2.67%	-2,003	-2,170	-2,341	-2,514	-2,689	-2,866	-3,044
0%	432	295	151	0	-156	-317	-481
2.67%	873	849	815	769	712	644	567

5.33%	896	895	893	887	878	864	844
8.00%	897	897	897	896	896	894	891

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

50,472

공시일	2017-05-26
기준일	2017-05-25

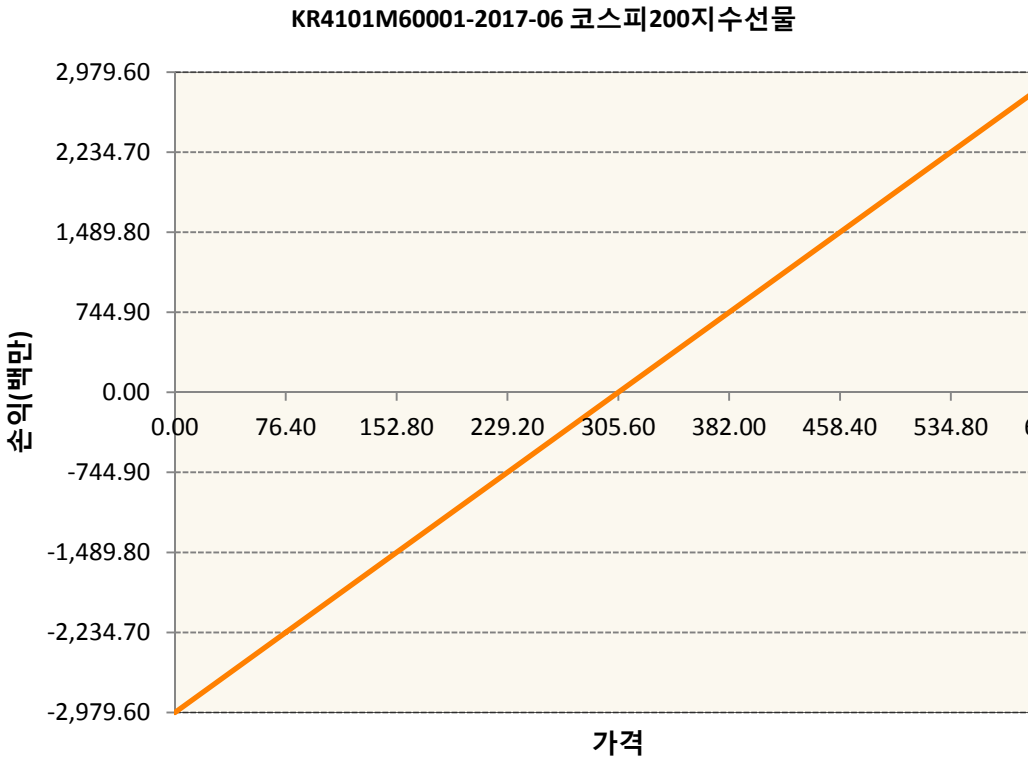
커버드콜목표전환형증권투자신탁

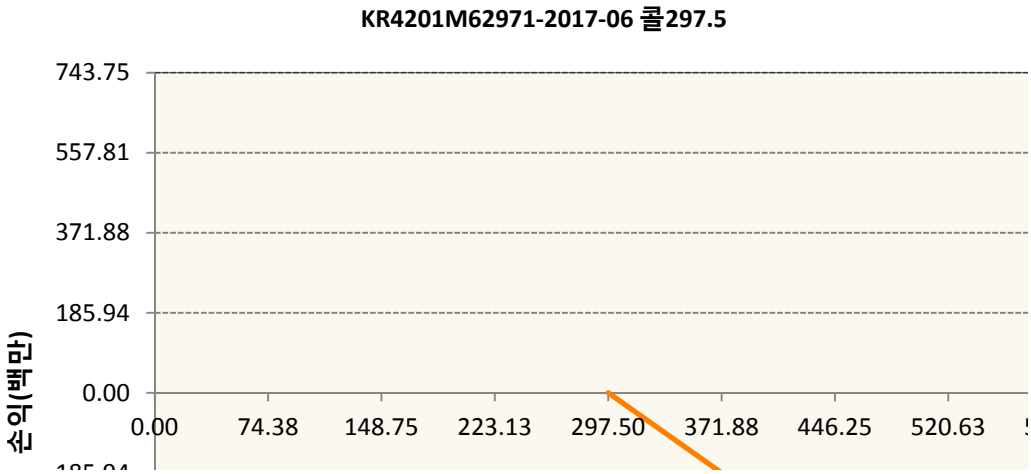
1. 계약금액

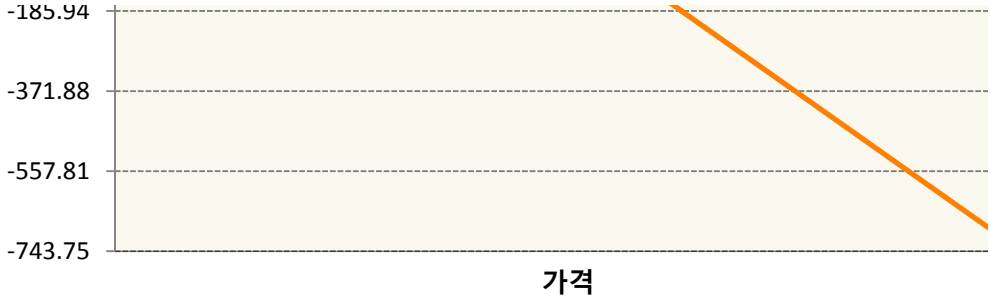
(단위:백만원)

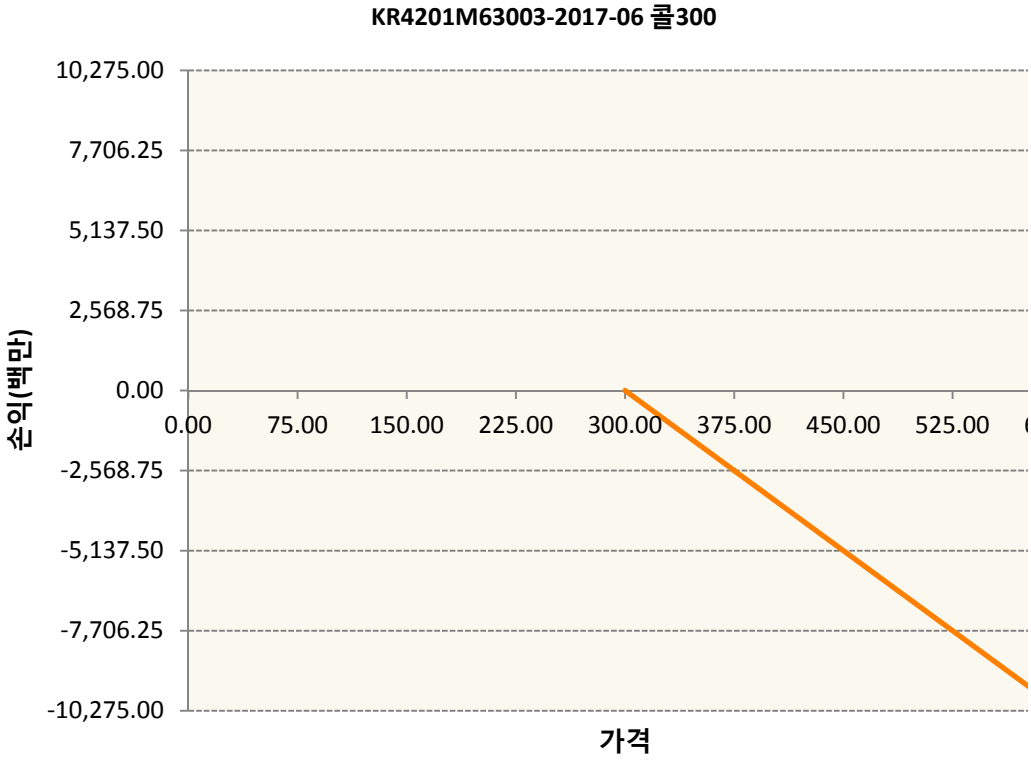
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,980	0	2,980	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,590	-12,590	장내

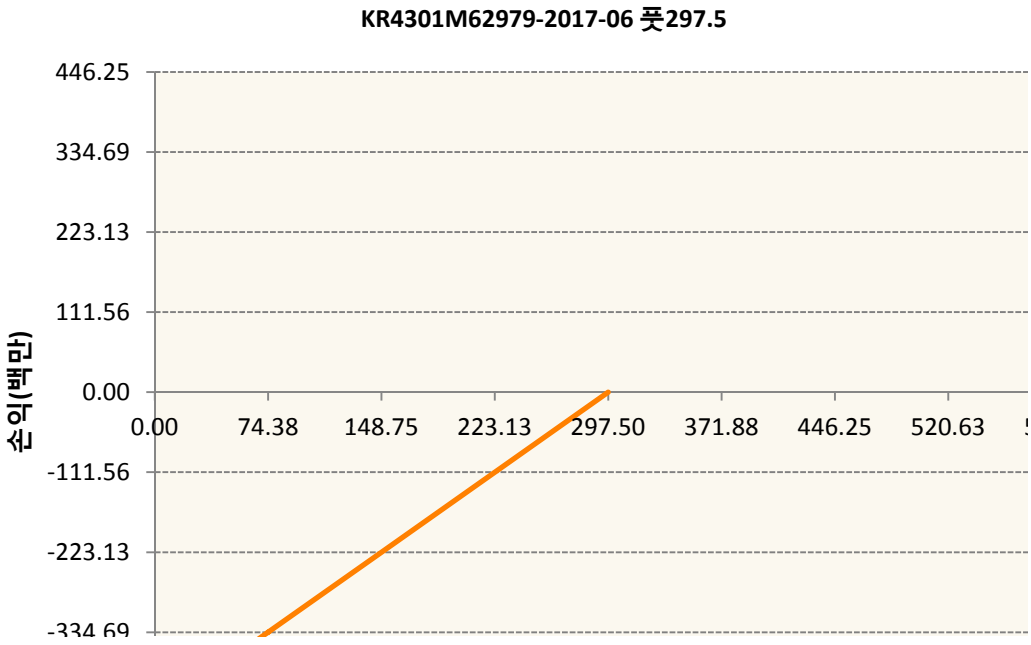
2. 만기시점의 손익구조



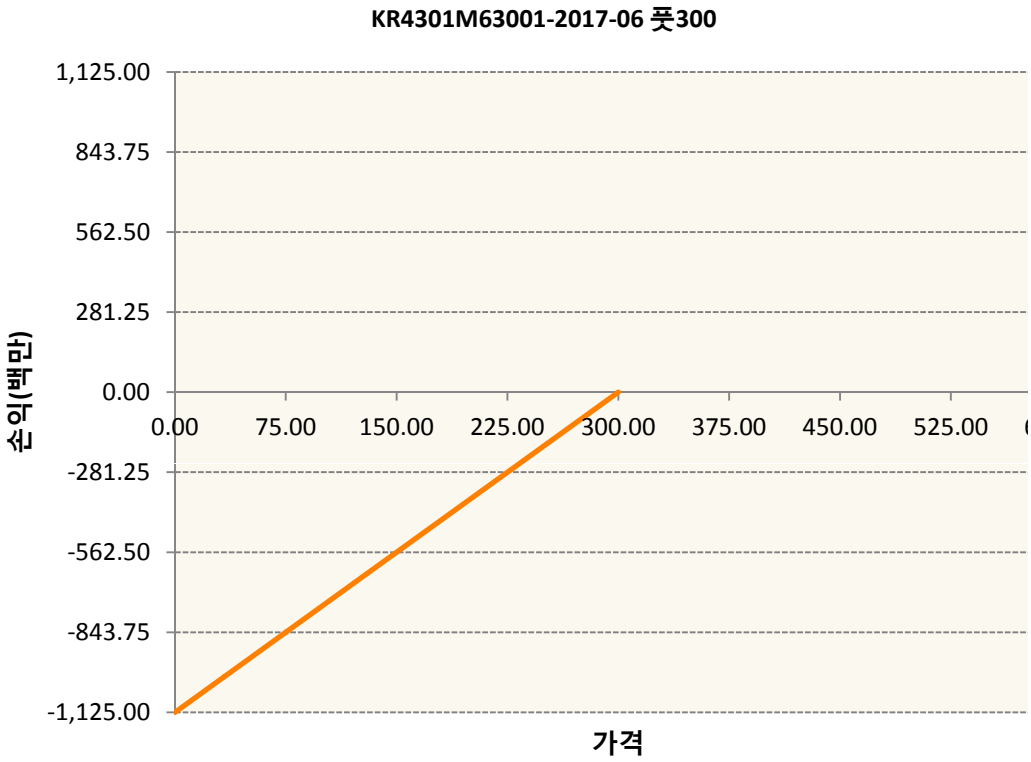



-185.94
-371.88
-557.81
-743.75
가격


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							238
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-238	-238	-238	-238	-238	-238	-238
-5.33%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
-2.67%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	79	79	79	79	79	79	79
5.33%	159	159	159	159	159	159	159
8.00%	238	238	238	238	238	238	238
KR4201M62(2017-06 콜297.5							59
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	21	21	21	21	21	21	21
-5.33%	21	20	20	20	19	19	18
-2.67%	16	15	14	14	13	12	12

0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
8.00%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
	KR4201M63(	2017-06 콜300					792
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	222	222	222	222	221	220	219
-5.33%	220	218	215	212	209	204	200
-2.67%	181	172	164	156	147	138	130
0%	21	14	7	0	-8	-16	-24
2.67%	-236	-237	-239	-241	-244	-247	-251
5.33%	-513	-513	-514	-514	-514	-515	-516
8.00%	-792	-792	-792	-792	-792	-792	-792
	KR4301M62(	2017-06 풋297.5					24
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
-5.33%	-12	-12	-12	-13	-13	-13	-13
-2.67%	-3	-3	-4	-4	-4	-5	-5
0%	1	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1
	KR4301M63(	2017-06 풋300					68
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-68
-5.33%	-37	-37	-37	-38	-38	-39	-39
-2.67%	-11	-12	-13	-13	-14	-15	-16
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	5	5	4	4	4	3	3
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

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

1,287

공시일	2017-05-26
기준일	2017-05-25

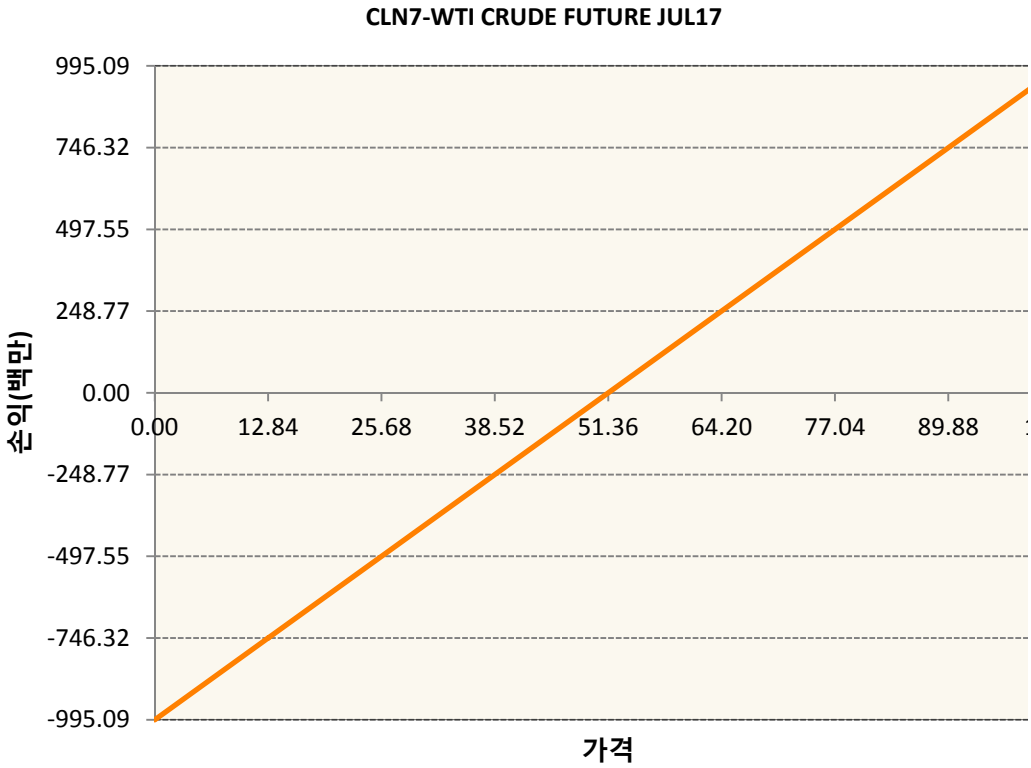
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

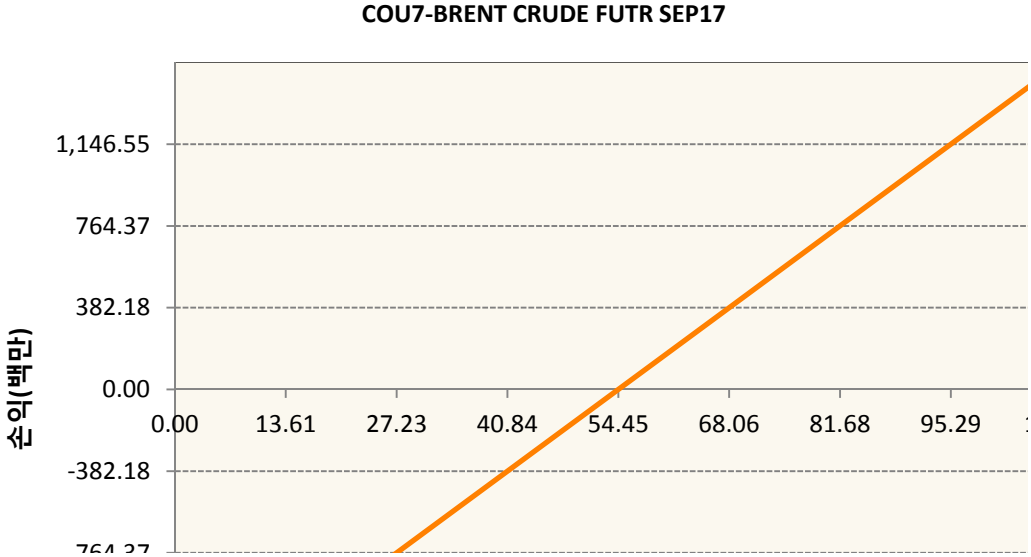
1. 계약금액

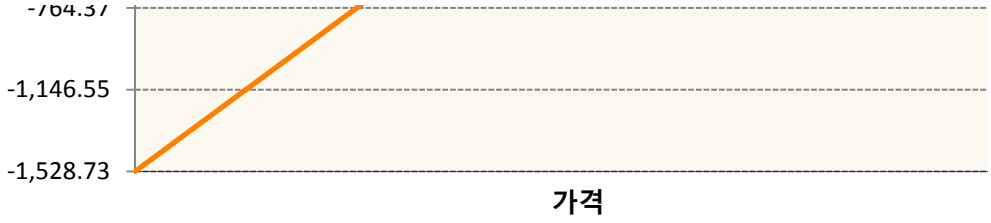
(단위:백만원)

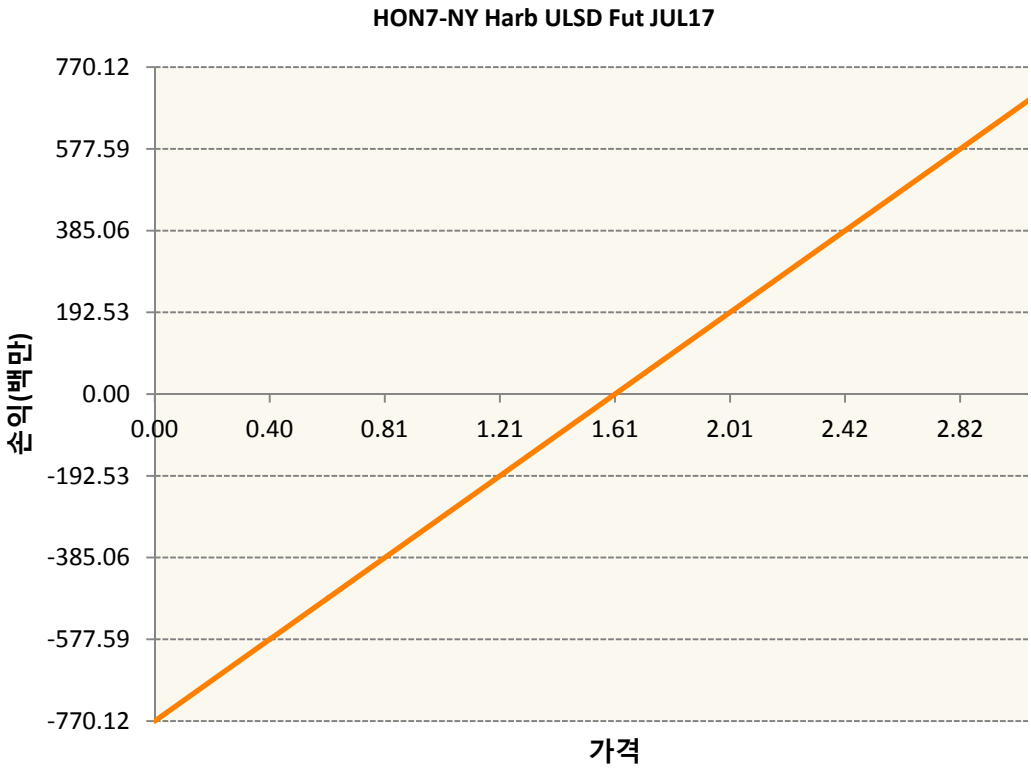
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,662	223	5,439	

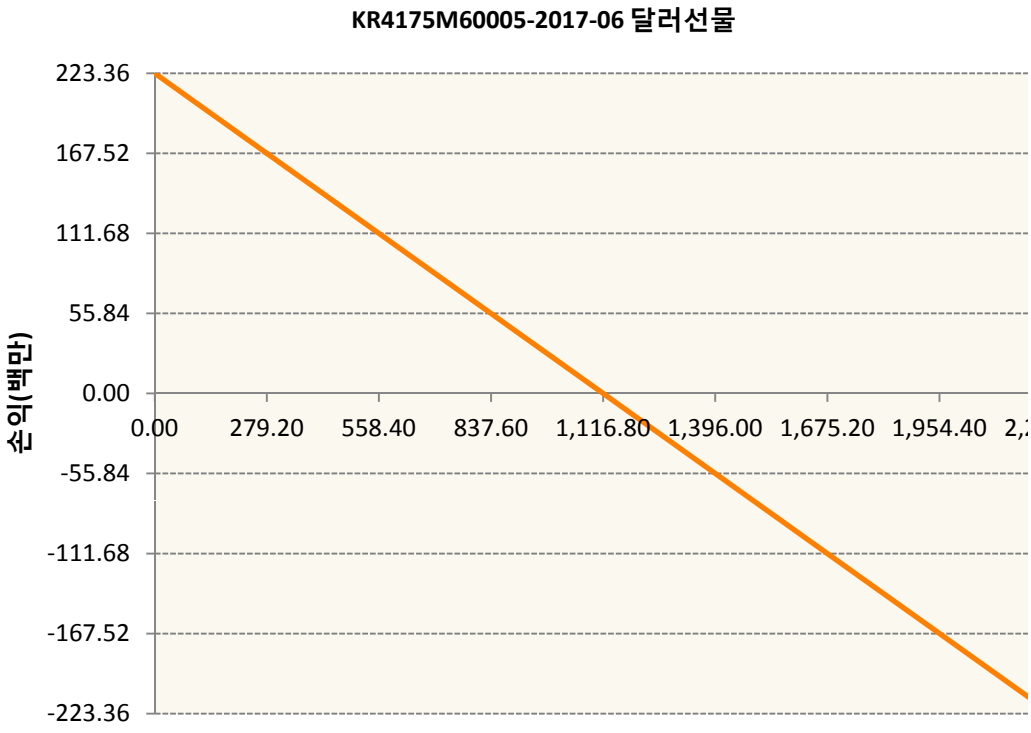
2. 만기시점의 손익구조





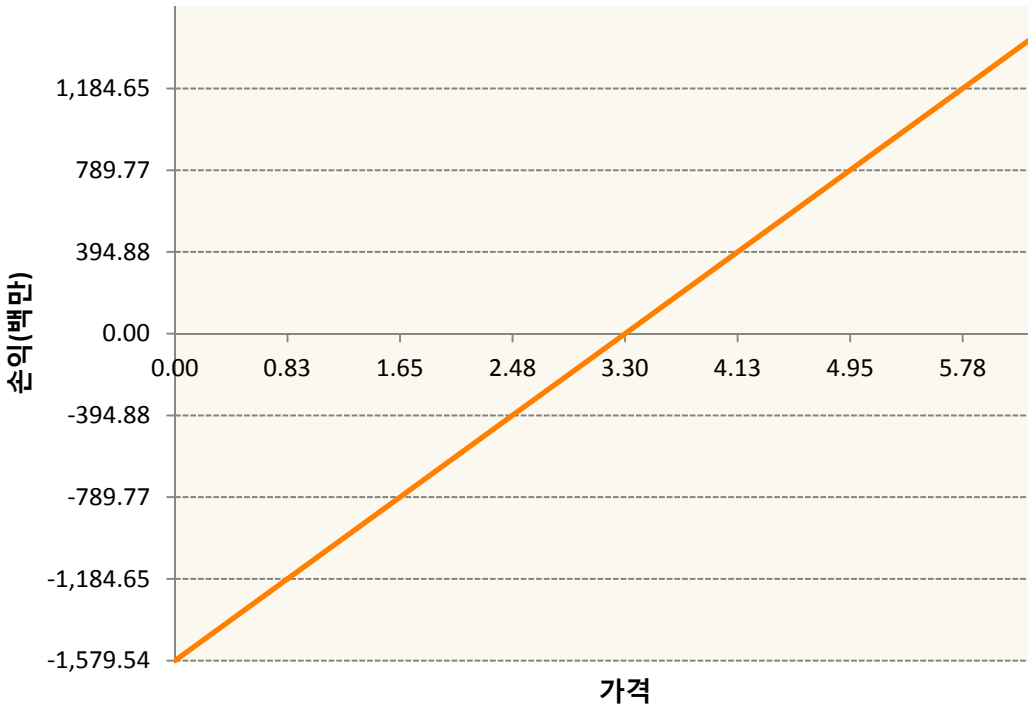

-1,146.55
-1,528.73
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
770.12
577.59
385.06
192.53
0.00
-192.53
-385.06
-577.59
-770.12
0.00
0.40
0.81
1.21
1.61
2.01
2.42
2.82
순이익(백만)
가격

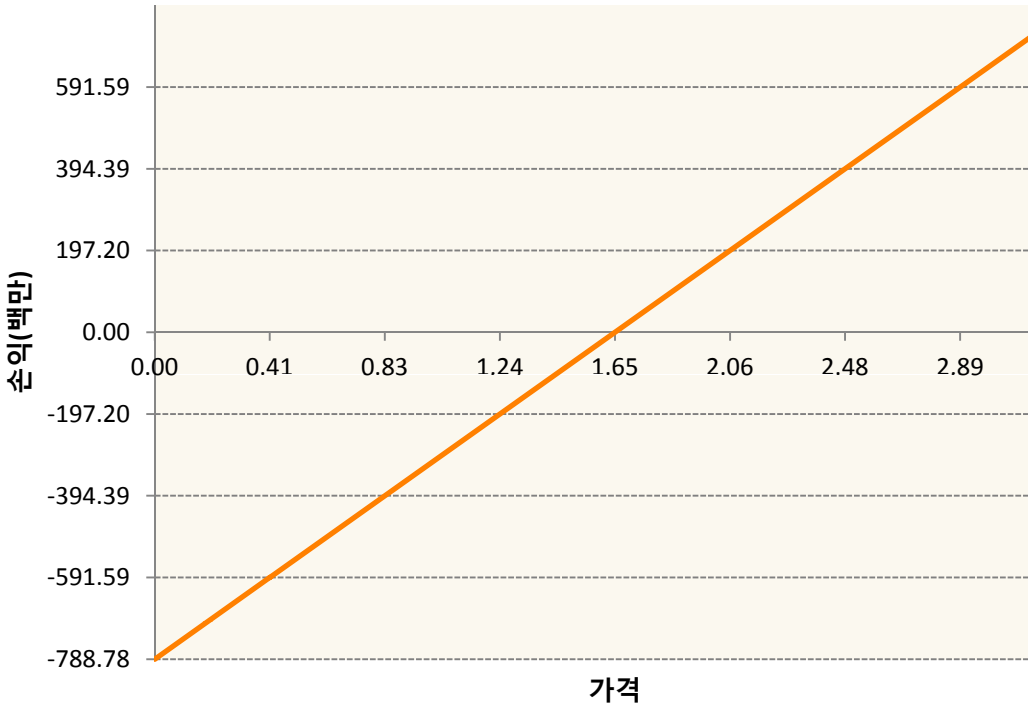

KR4175M60005-2017-06 달러선물
223.36
167.52
111.68
55.84
0.00
-55.84
-111.68
-167.52
-223.36
0.00
279.20
558.40
837.60
1,116.80
1,396.00
1,675.20
1,954.40
순이익(백만)

가격

NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17



XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN7	WTI CRUDE FUTURE JUL17	80
COU7	BRENT CRUDE FUTR SEP17	122
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	62
KR4175M60(	2017-06 달러선물	18
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	126
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	63

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

960

공시일	2017-05-26
기준일	2017-05-25

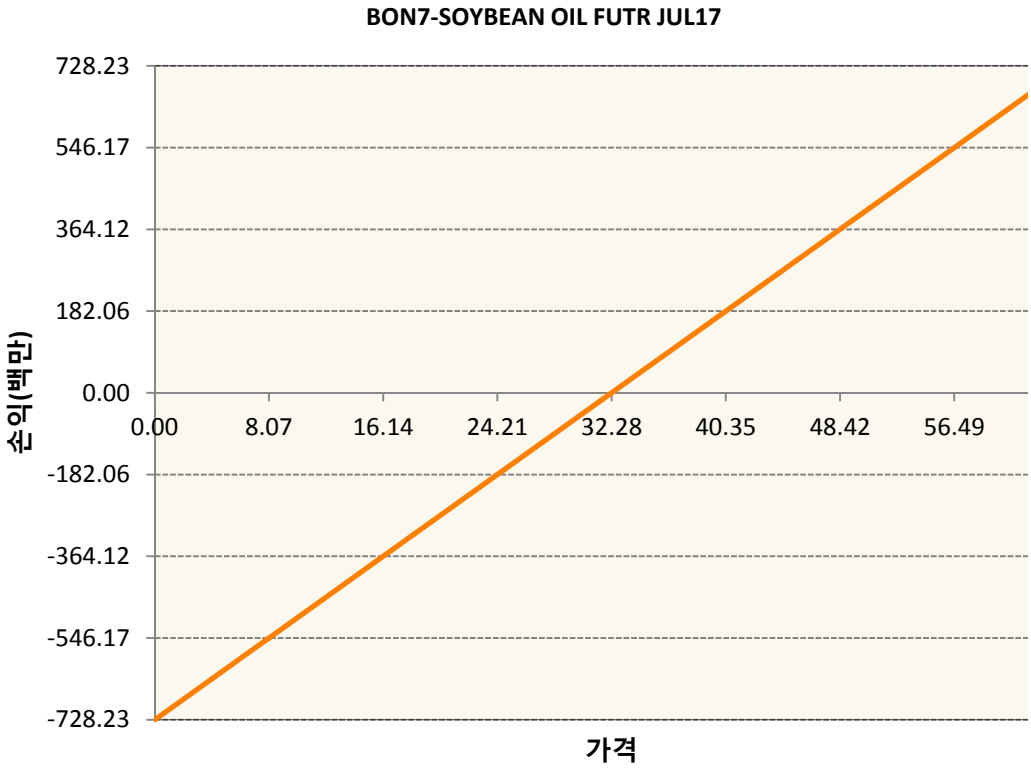
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

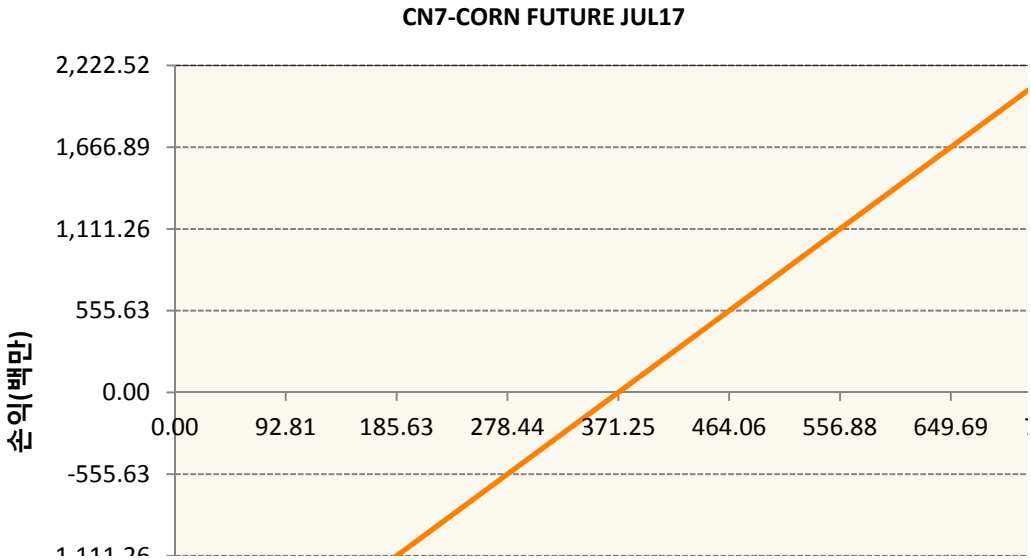
1. 계약금액

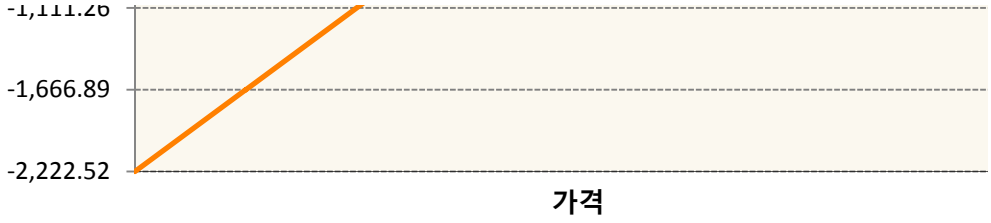
(단위:백만원)

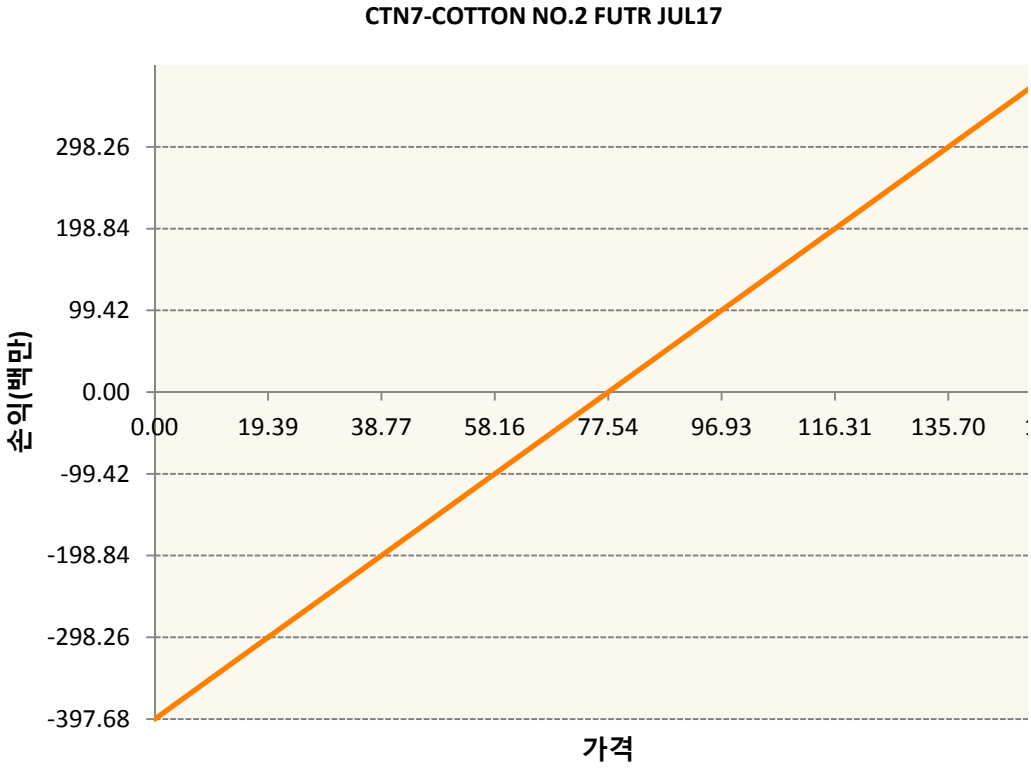
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,384	391	7,993	

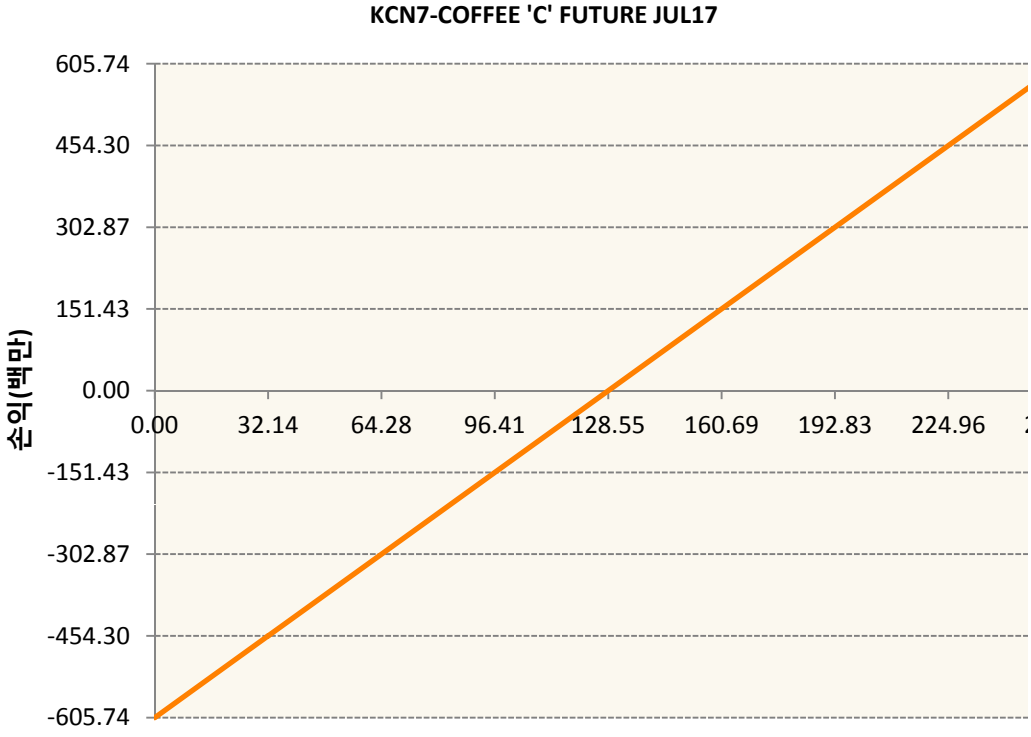
2. 만기시점의 손익구조





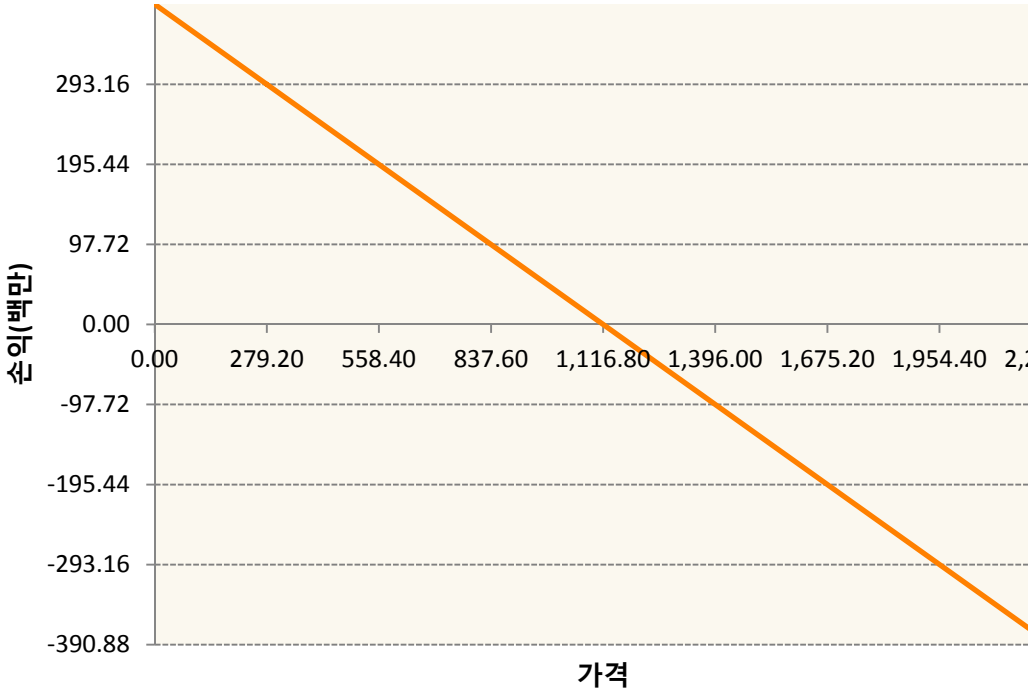

-1,666.89
-2,222.52
가격


CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
298.26
198.84
99.42
0.00
-99.42
-198.84
-298.26
-397.68
0.00
19.39
38.77
58.16
77.54
96.93
116.31
135.70
순익(백만)
가격

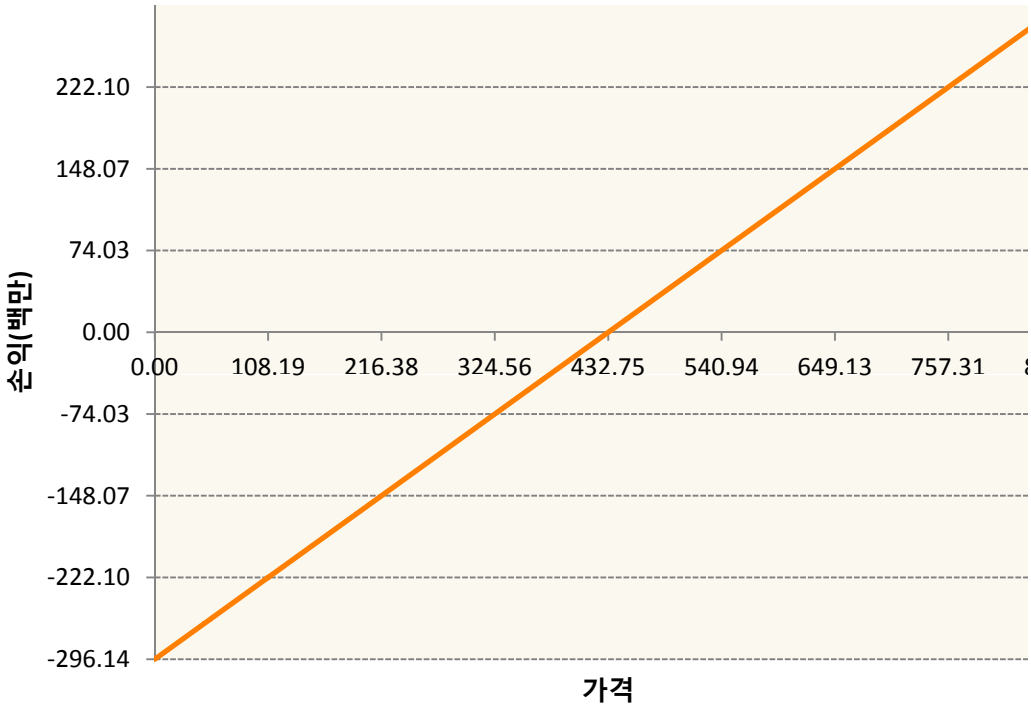

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
605.74
454.30
302.87
151.43
0.00
-151.43
-302.87
-454.30
-605.74
0.00
32.14
64.28
96.41
128.55
160.69
192.83
224.96
순익(백만)

가격

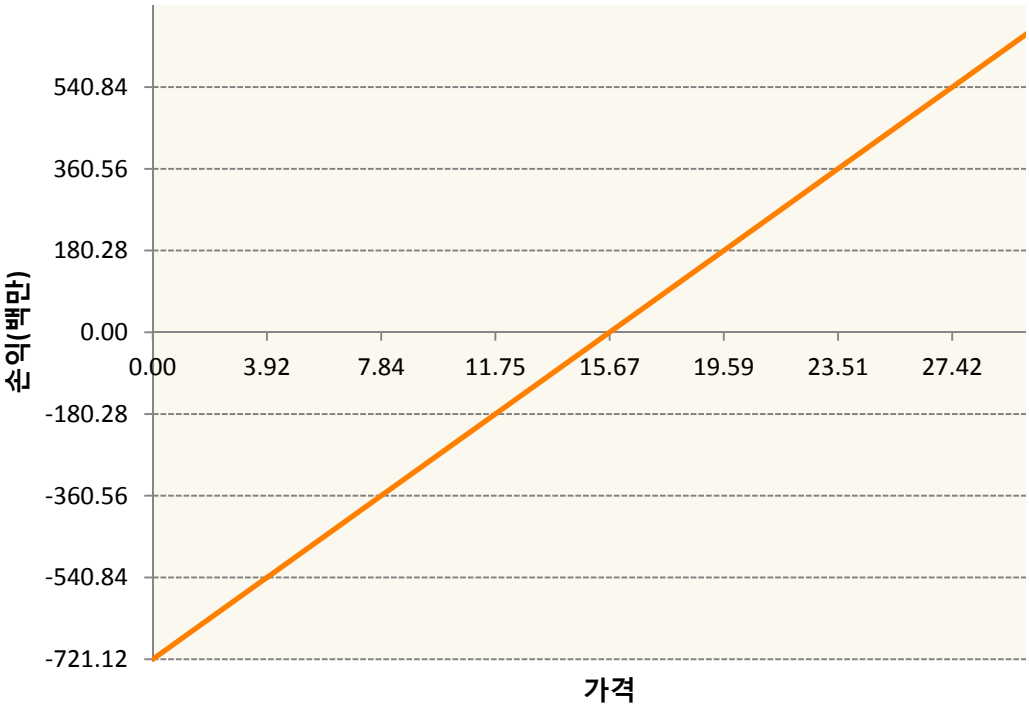
KR4175M60005-2017-06 달러선물



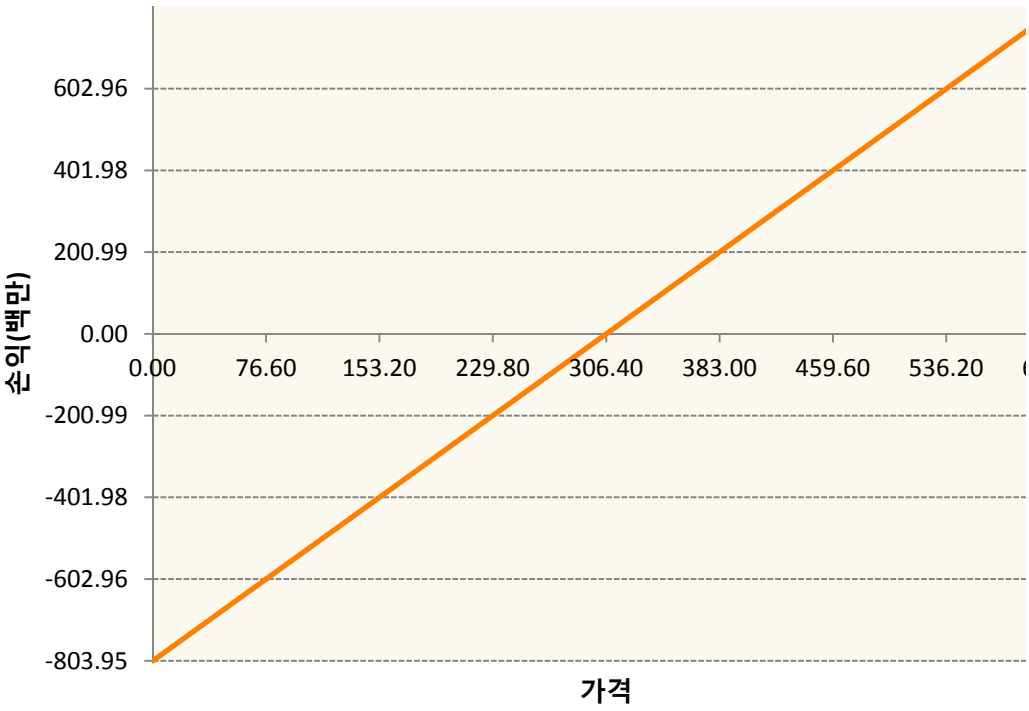
KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17



SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17

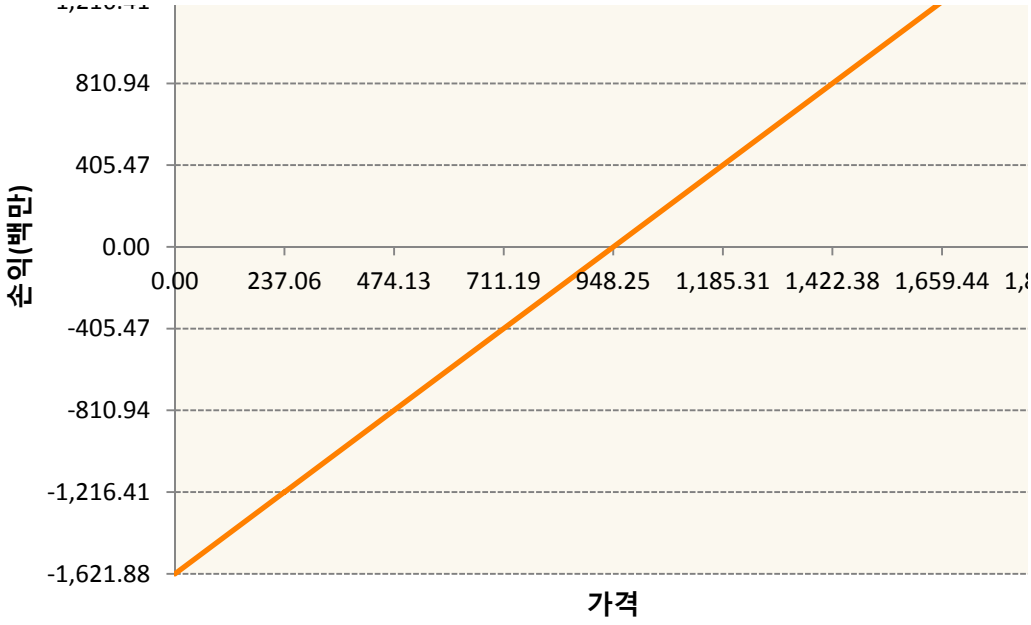


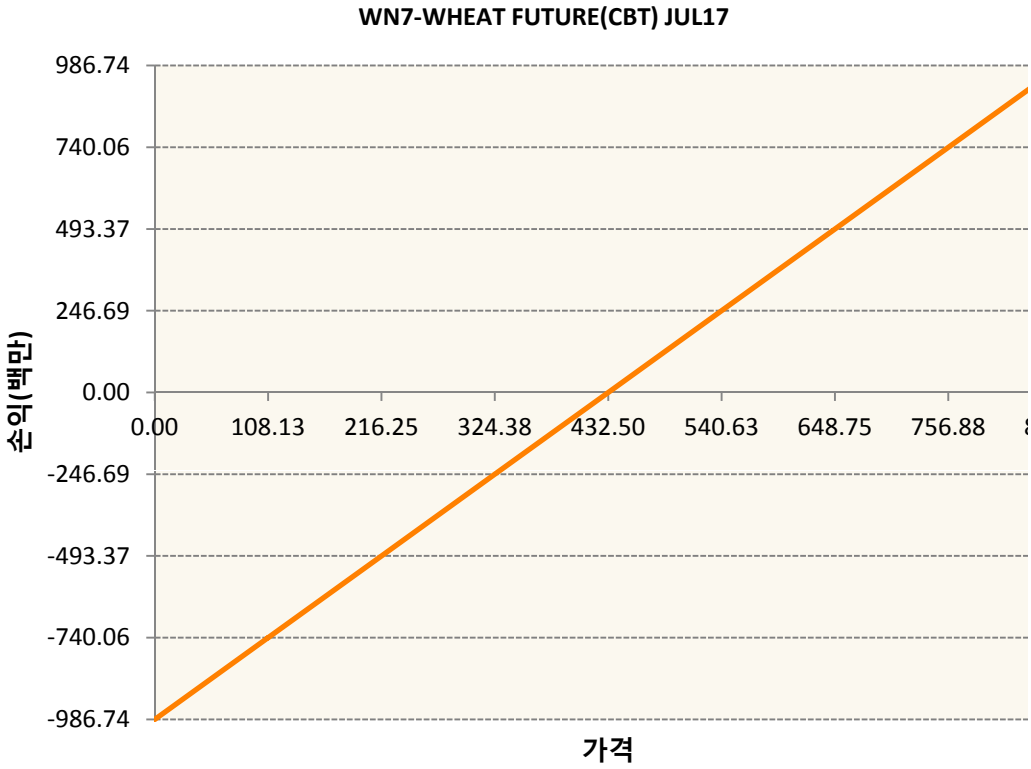
SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17



SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	58
CN7	CORN FUTURE JUL17	178
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	32
KCN7	COFFEE 'C' FUTURE JUL17	48
KR4175M60(	2017-06 달러선물	31

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	79

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

762