공시일	2017-05-29
기준일	2017-05-26

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	2017-05-29
기준일	2017-05-26

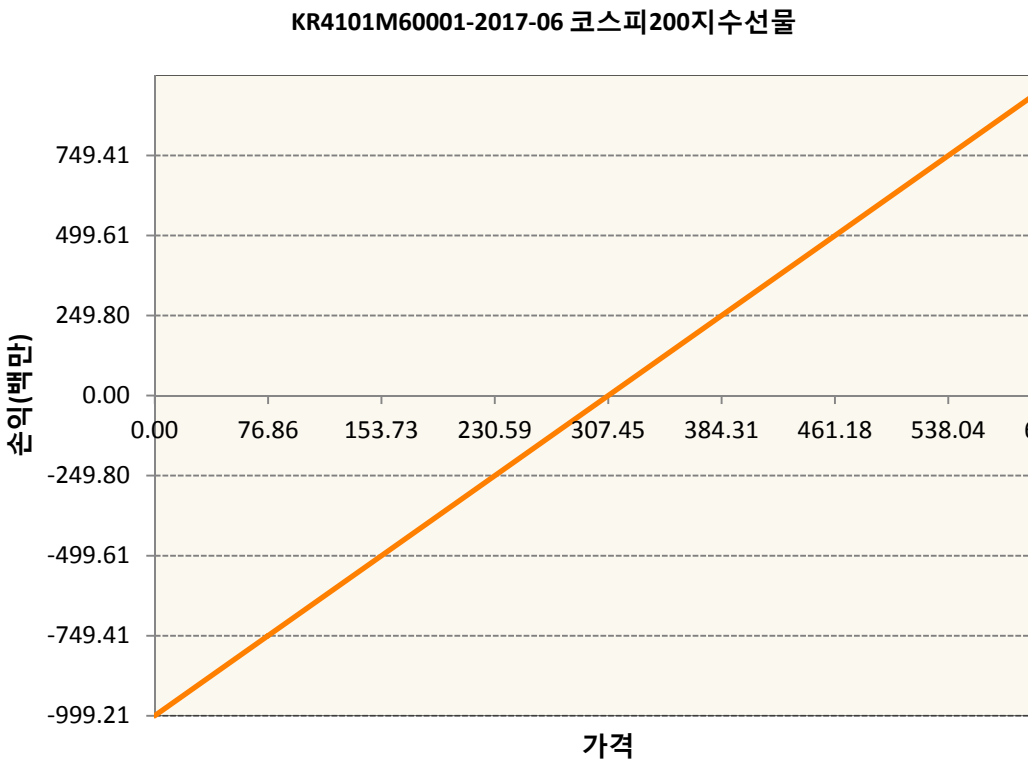
스마트인덱스모

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	999	0	999	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							80
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
-5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	27	27	27	27	27	27	27
5.33%	53	53	53	53	53	53	53
8.00%	80	80	80	80	80	80	80

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

53

공시일	2017-05-29
기준일	2017-05-26

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	994

* 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	2017-05-29
기준일	2017-05-26

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	357

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

333

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-05-29
기준일	2017-05-26

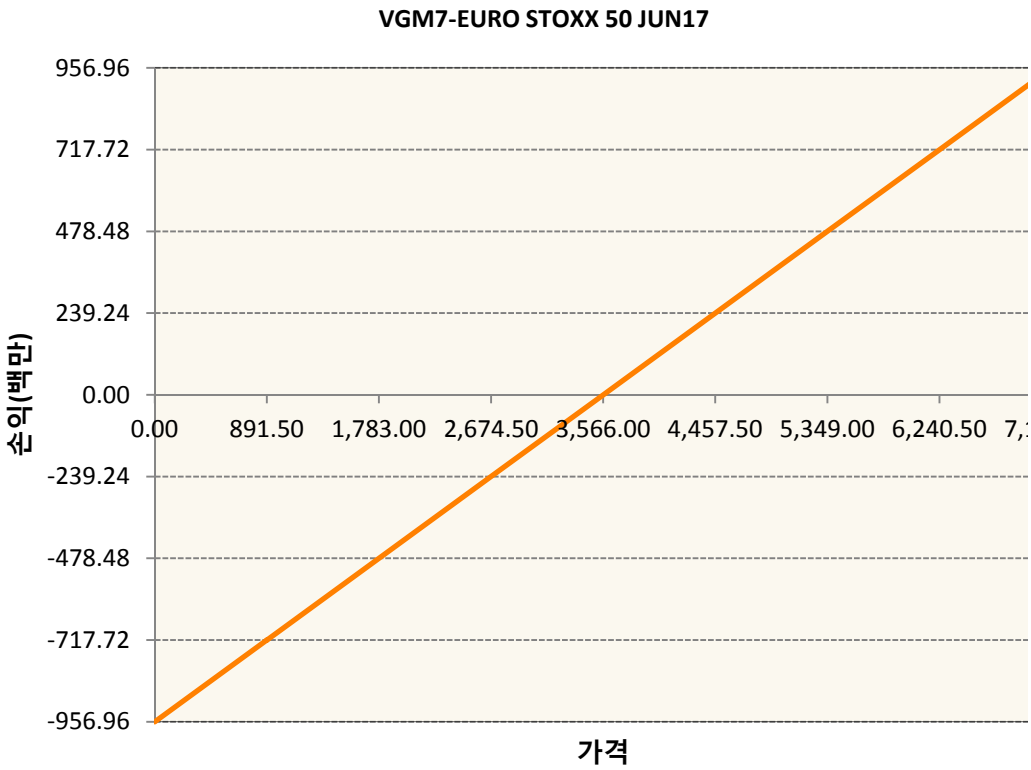
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2017-05-29
기준일	2017-05-26

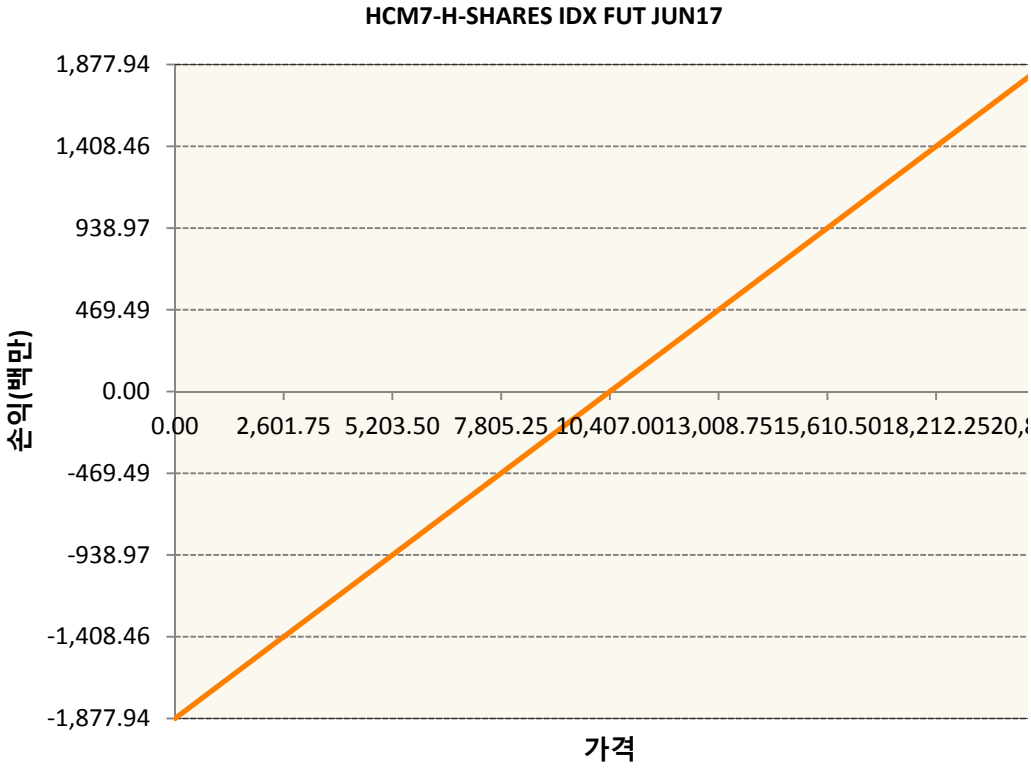
차이나인덱스모(주식-파생형)

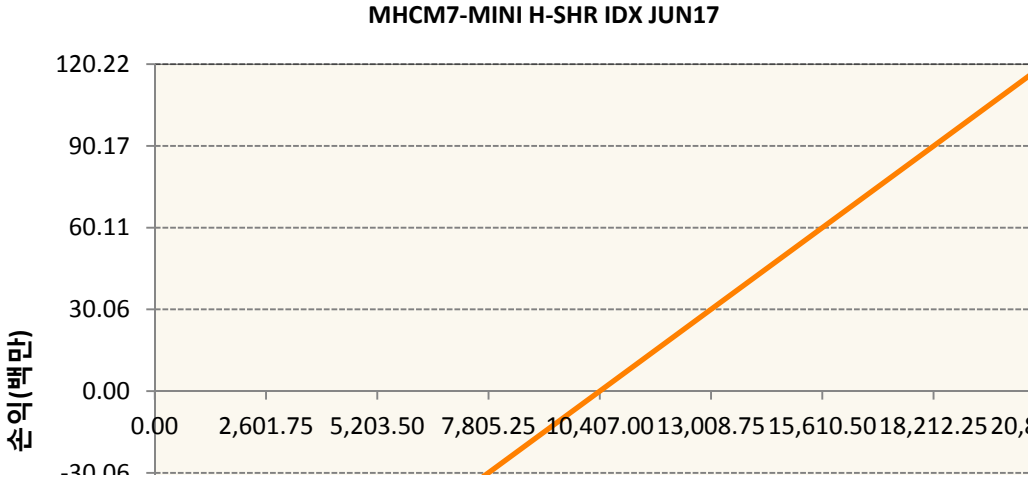
1. 계약금액

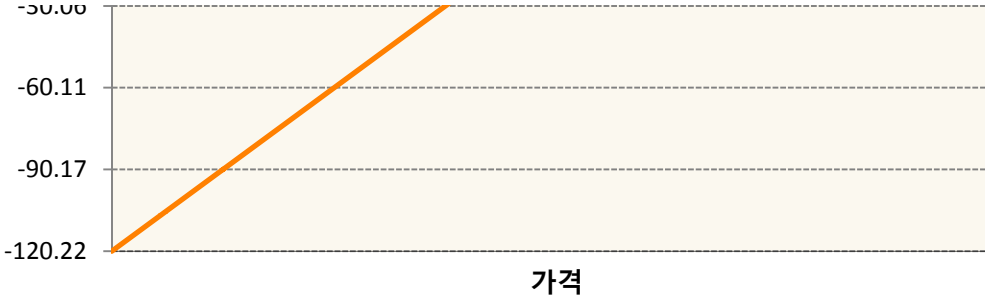
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계			1,878	0	1,878	
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)
	113

공시일	2017-05-29
기준일	2017-05-26

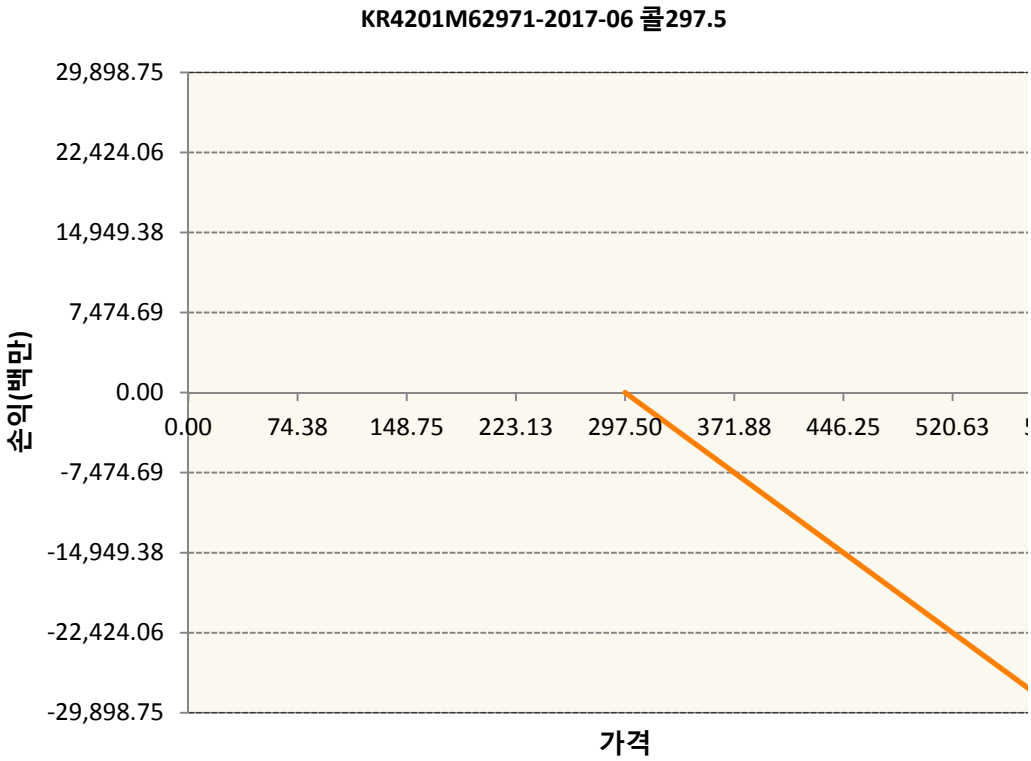
커버드콜모(주식혼합-파생형)

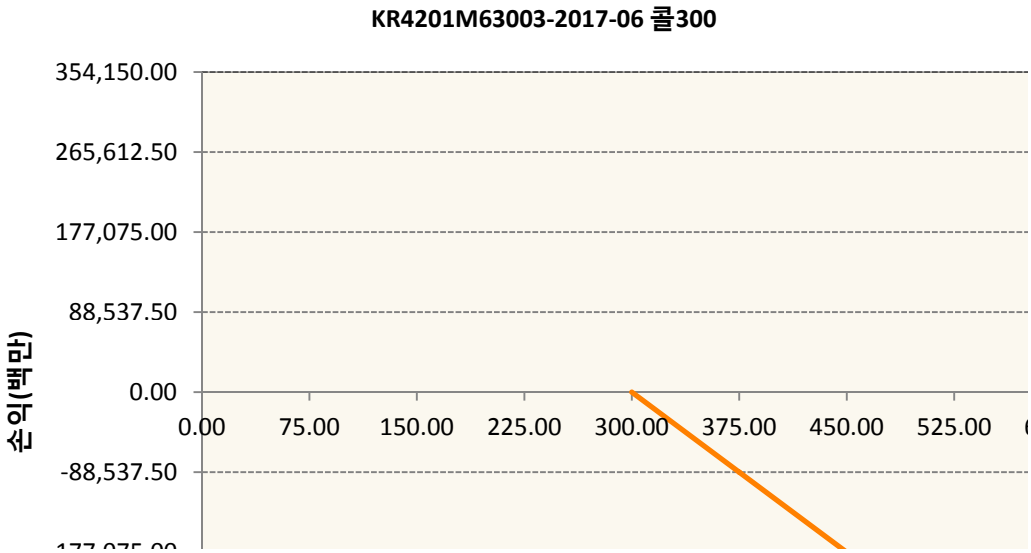
1. 계약금액

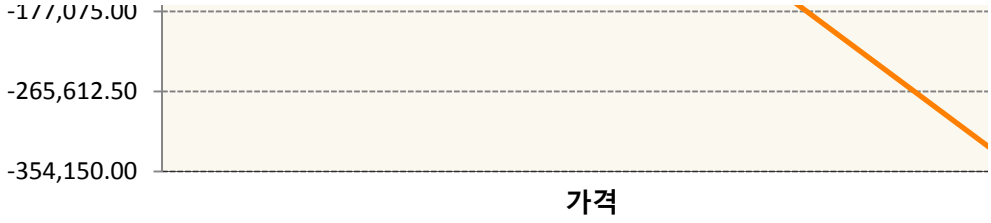
(단위:백만원)

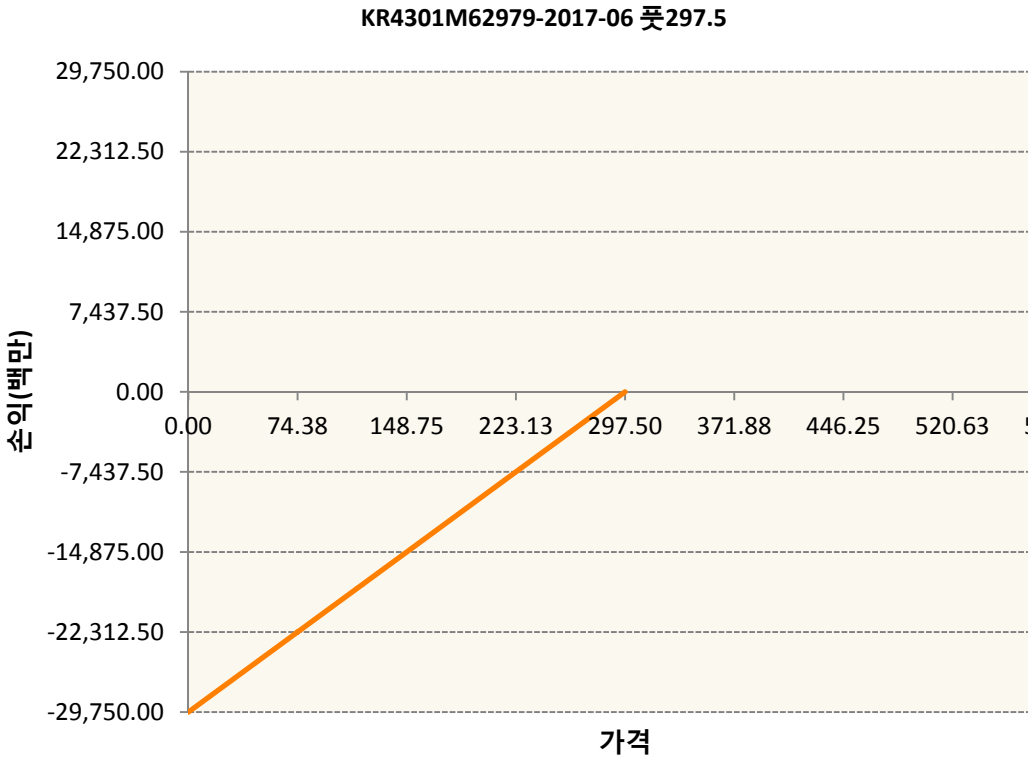
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	623,799	-623,799	장내

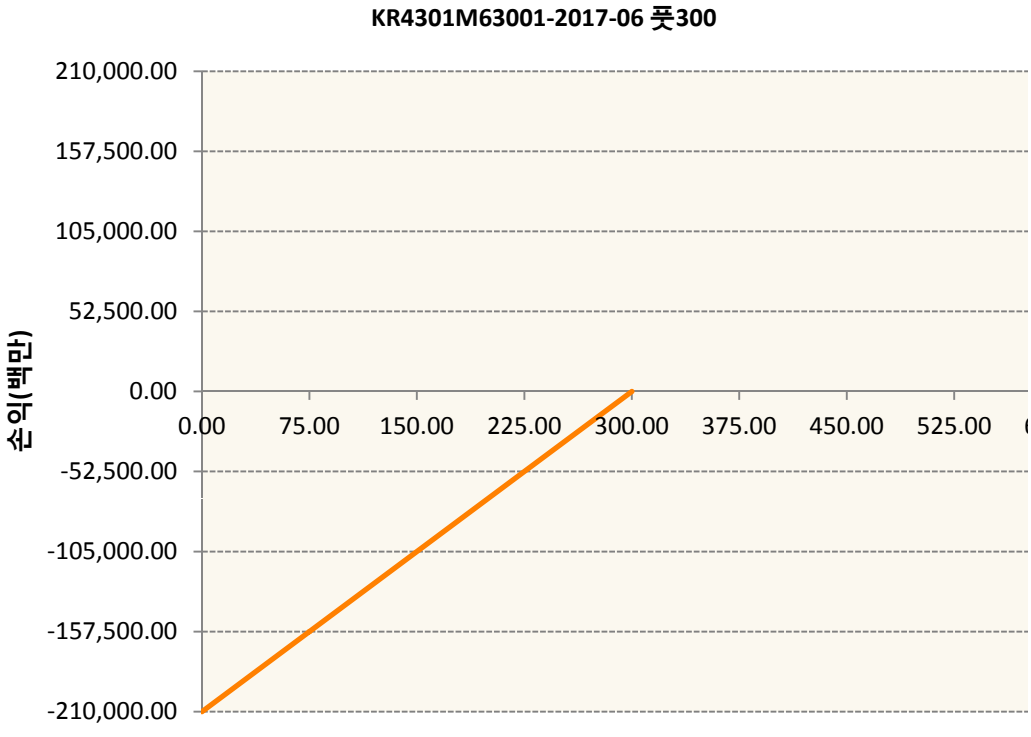
2. 만기시점의 손익구조






-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						2,427
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	988	987	986	983	980	975	970
-5.33%	960	948	934	918	902	884	866
-2.67%	694	669	644	620	595	570	545
0%	28	20	11	0	-13	-26	-41
2.67%	-783	-783	-784	-786	-788	-791	-796
5.33%	-1,605	-1,605	-1,605	-1,605	-1,605	-1,605	-1,606
8.00%	-2,427	-2,427	-2,427	-2,427	-2,427	-2,427	-2,427
KR4201M63(	2017-06 콜300						28,081
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,090	9,087	9,080	9,068	9,047	9,018	8,977
-5.33%	8,967	8,886	8,783	8,661	8,522	8,366	8,198
-2.67%	7,093	6,803	6,512	6,220	5,928	5,635	5,341
0%	522	367	192	0	-205	-422	-648
2.67%	-8,774	-8,788	-8,814	-8,852	-8,905	-8,972	-9,055
5.33%	-18,421	-18,422	-18,423	-18,425	-18,431	-18,440	-18,455
8.00%	-28,079	-28,079	-28,079	-28,079	-28,079	-28,080	-28,081
KR4301M62(	2017-06 풋297.5						1,489
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,471	-1,472	-1,473	-1,476	-1,479	-1,484	-1,489
-5.33%	-681	-693	-707	-722	-739	-756	-775
-2.67%	-128	-152	-177	-202	-226	-251	-276
0%	28	20	11	0	-12	-26	-41
2.67%	39	39	38	36	34	31	26
5.33%	39	39	39	39	39	39	38
8.00%	39	39	39	39	39	39	39
KR4301M63(	2017-06 풋300						11,857
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11,790	-11,792	-11,796	-11,803	-11,815	-11,833	-11,857
-5.33%	-6,136	-6,184	-6,245	-6,318	-6,400	-6,492	-6,592
-2.67%	-1,521	-1,693	-1,865	-2,038	-2,212	-2,386	-2,560
0%	310	217	114	0	-122	-250	-384
2.67%	524	515	500	478	446	406	357

5.33%	530	530	529	528	524	519	510
8.00%	530	530	530	530	530	529	529

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

49,023

공시일	2017-05-29
기준일	2017-05-26

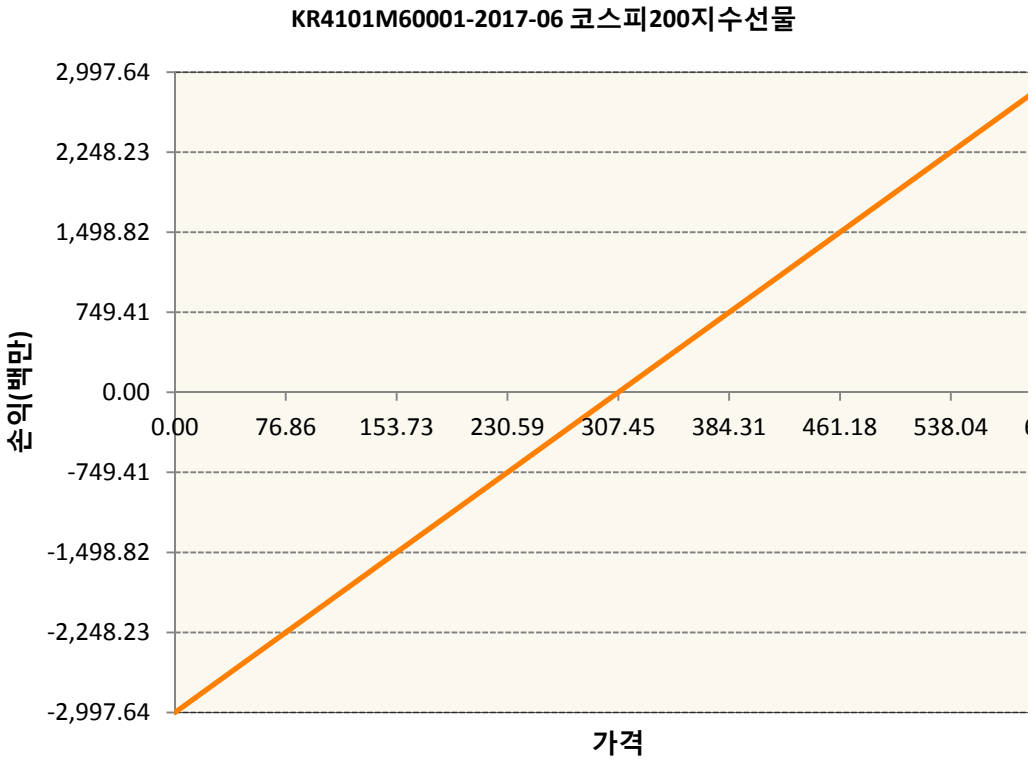
커버드콜목표전환형증권투자신탁

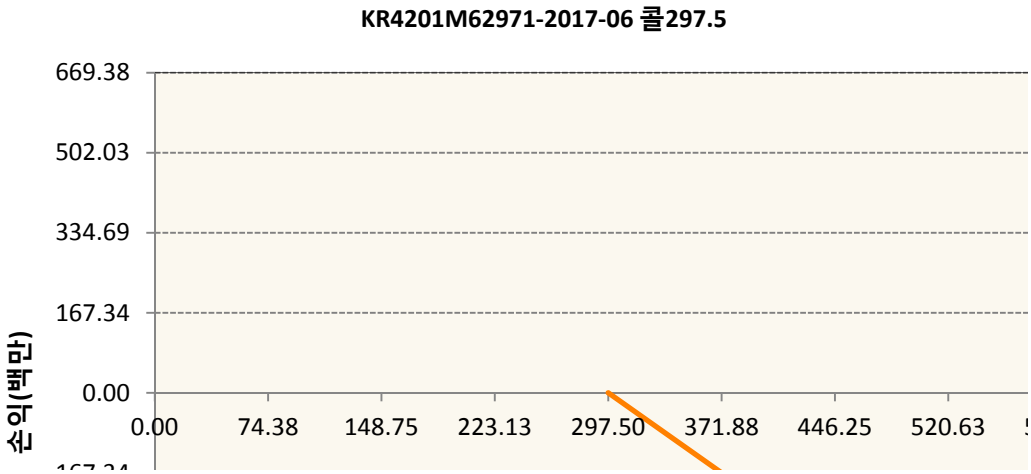
1. 계약금액

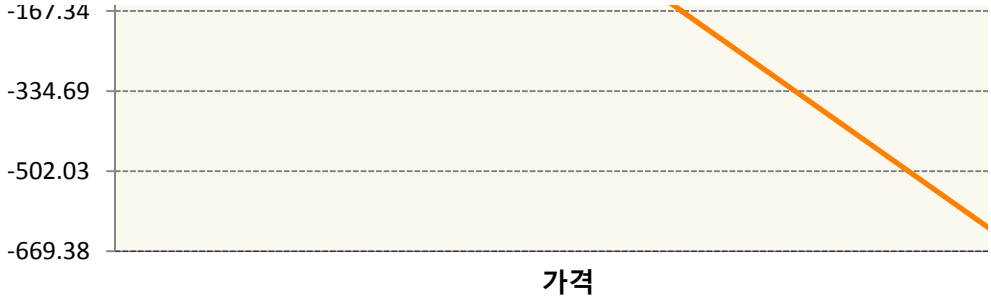
(단위:백만원)

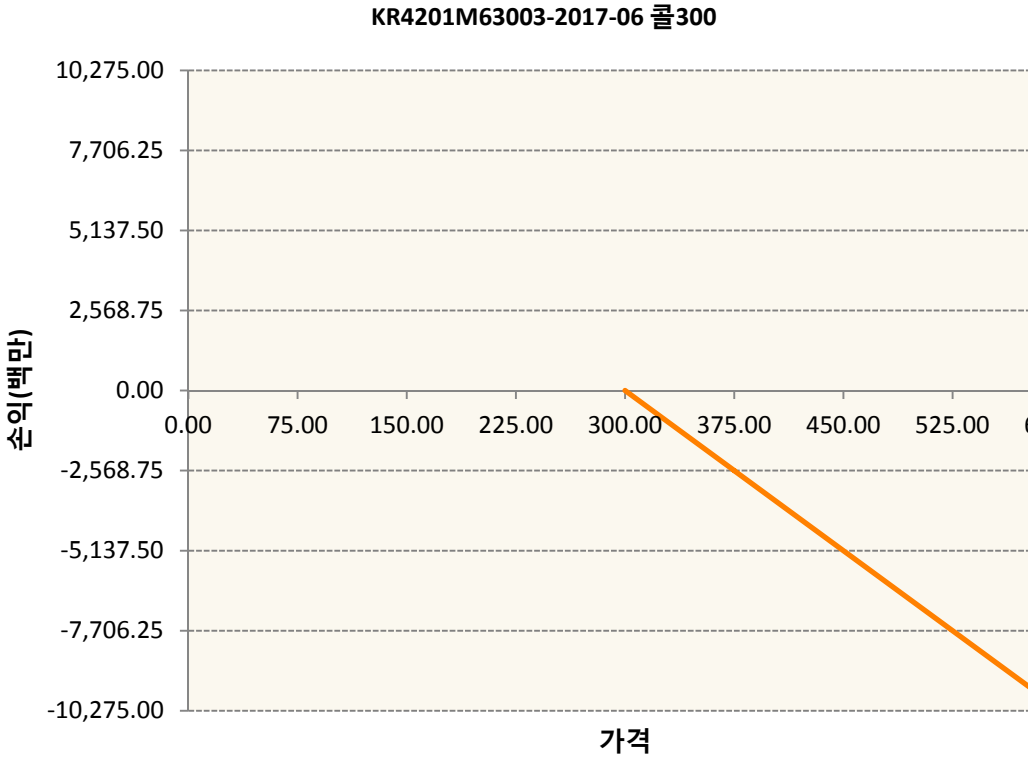
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	146	0	146	장내
누계	유가증권	선물	2,998	0	2,998	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,441	-12,441	장내

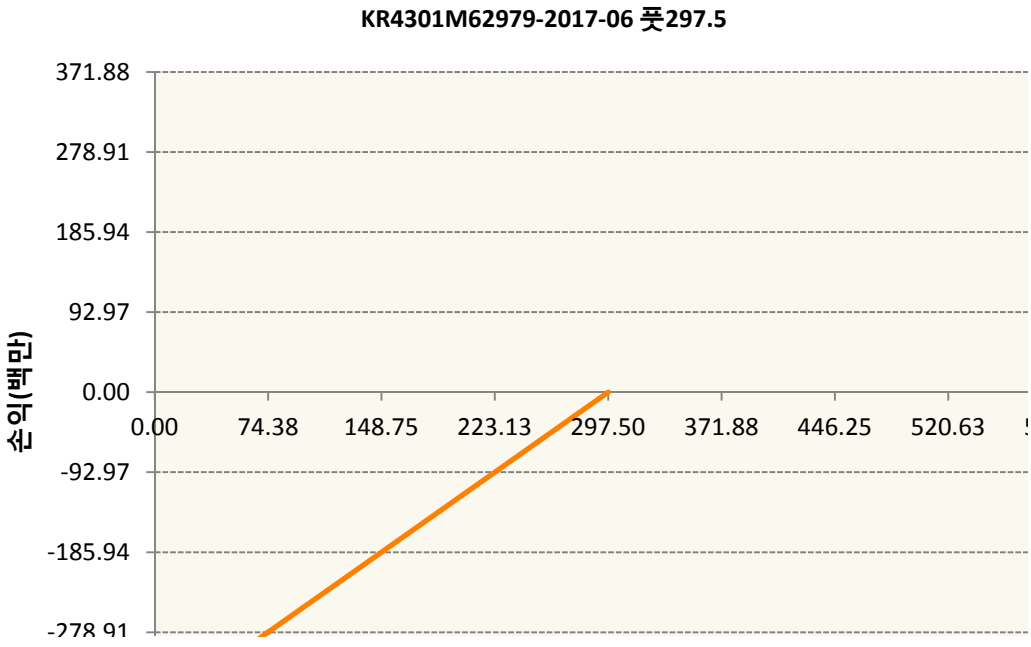
2. 만기시점의 손익구조



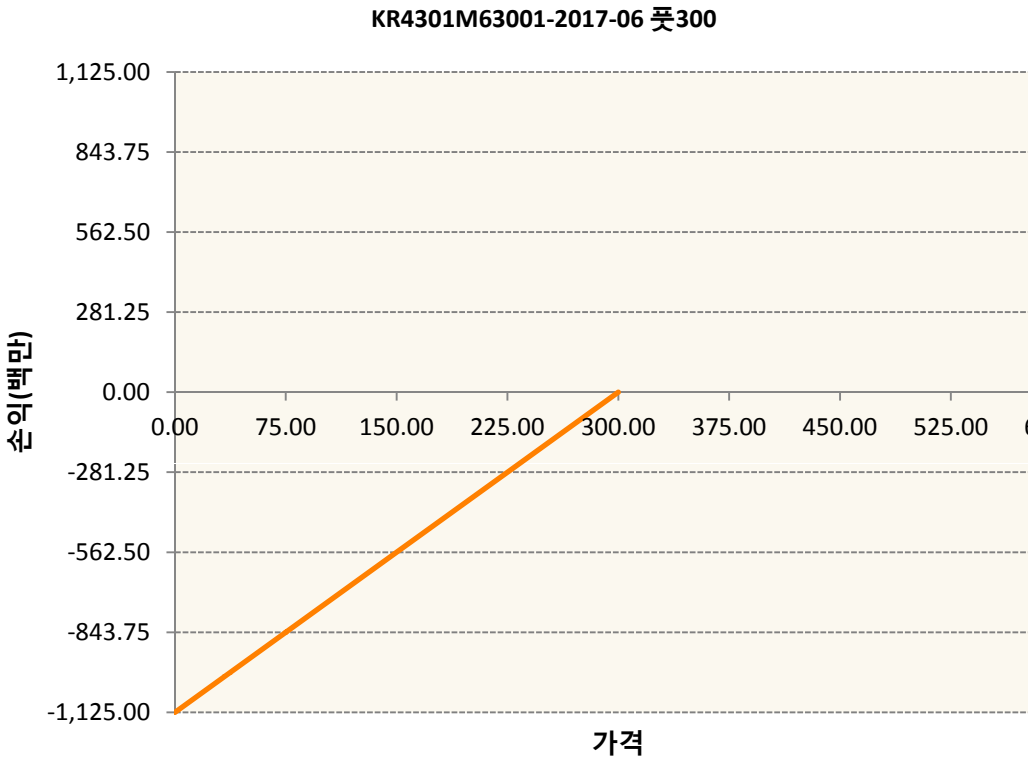



-167.34
-334.69
-502.03
-669.38
가격


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
371.88
278.91
185.94
92.97
0.00
-92.97
-185.94
-278.91
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							239
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-239	-239	-239	-239	-239	-239	-239
-5.33%	-160	-160	-160	-160	-160	-160	-160
-2.67%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	80	80	80	80	80	80	80
5.33%	160	160	160	160	160	160	160
8.00%	239	239	239	239	239	239	239
KR4201M62(2017-06 콜297.5							54
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	22	22	22	22	22	22	22
-5.33%	21	21	21	21	20	20	19
-2.67%	16	15	14	14	13	13	12

0%	1	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
	KR4201M63(	2017-06 콜300					815
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	264	264	263	263	262	262	260
-5.33%	260	258	255	251	247	243	238
-2.67%	206	197	189	180	172	163	155
0%	15	11	6	0	-6	-12	-19
2.67%	-255	-255	-256	-257	-258	-260	-263
5.33%	-534	-534	-535	-535	-535	-535	-535
8.00%	-815	-815	-815	-815	-815	-815	-815
	KR4301M62(	2017-06 풋297.5					19
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-18	-18	-18	-18	-18	-19	-19
-5.33%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-10
-2.67%	-2	-2	-2	-3	-3	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0
	KR4301M63(	2017-06 풋300					64
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-64
-5.33%	-33	-33	-33	-34	-34	-35	-35
-2.67%	-8	-9	-10	-11	-12	-13	-14
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	3	3	3	3	2	2	2
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

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

1,285

공시일	2017-05-29
기준일	2017-05-26

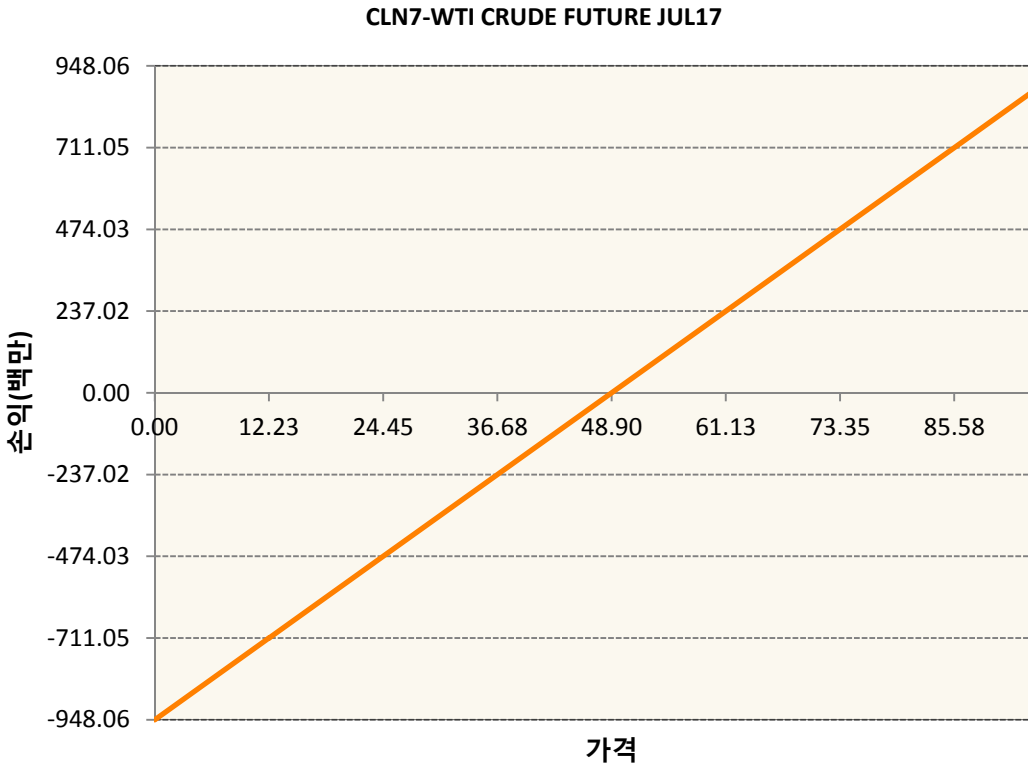
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

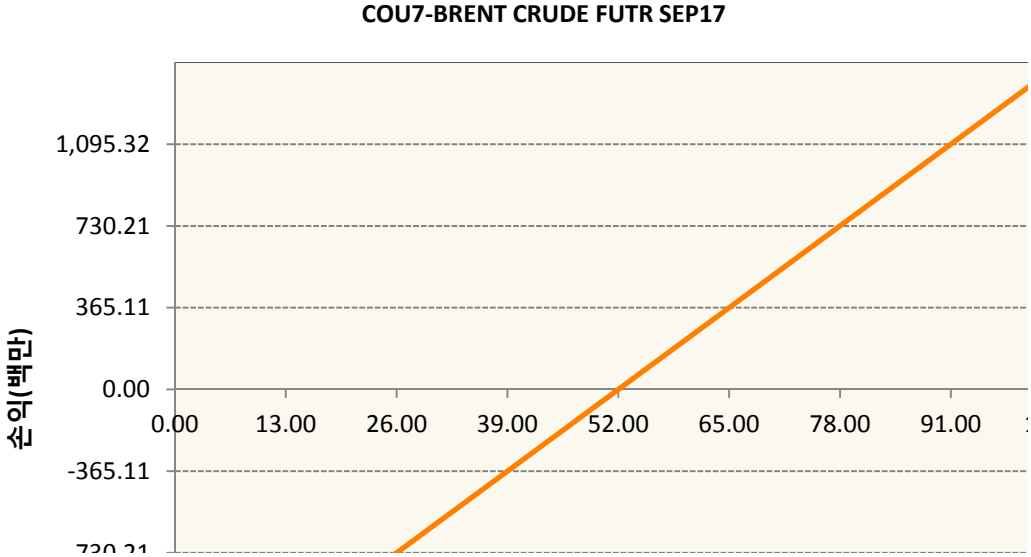
1. 계약금액

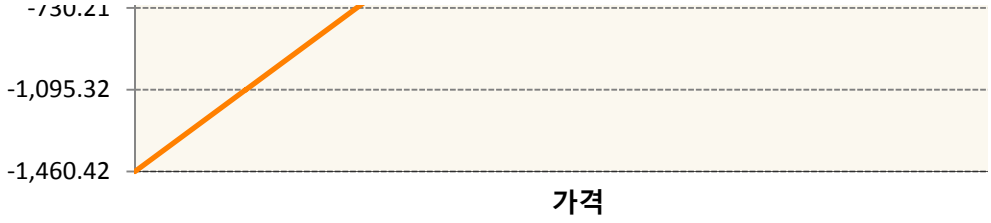
(단위:백만원)

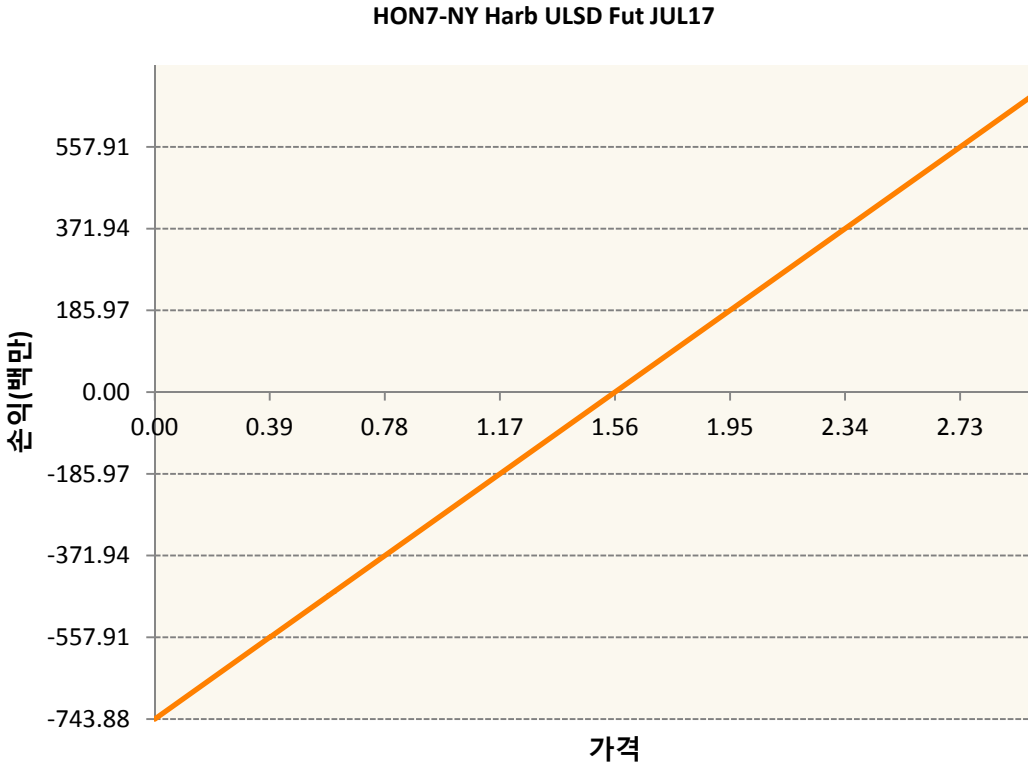
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,487	224	5,263	

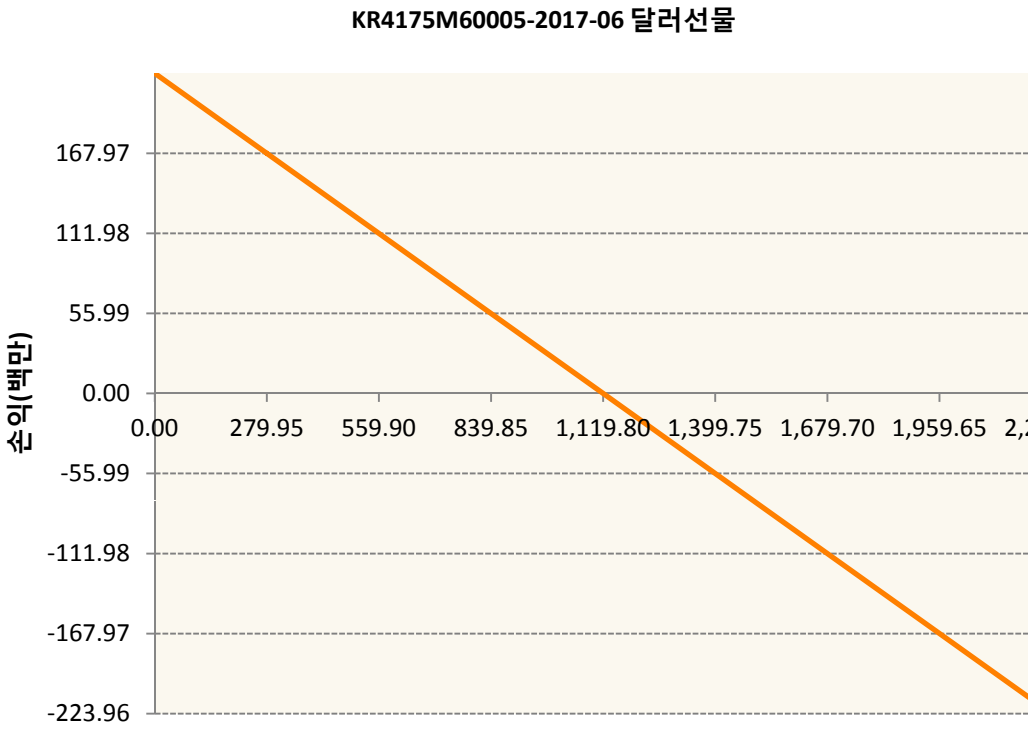
2. 만기시점의 손익구조



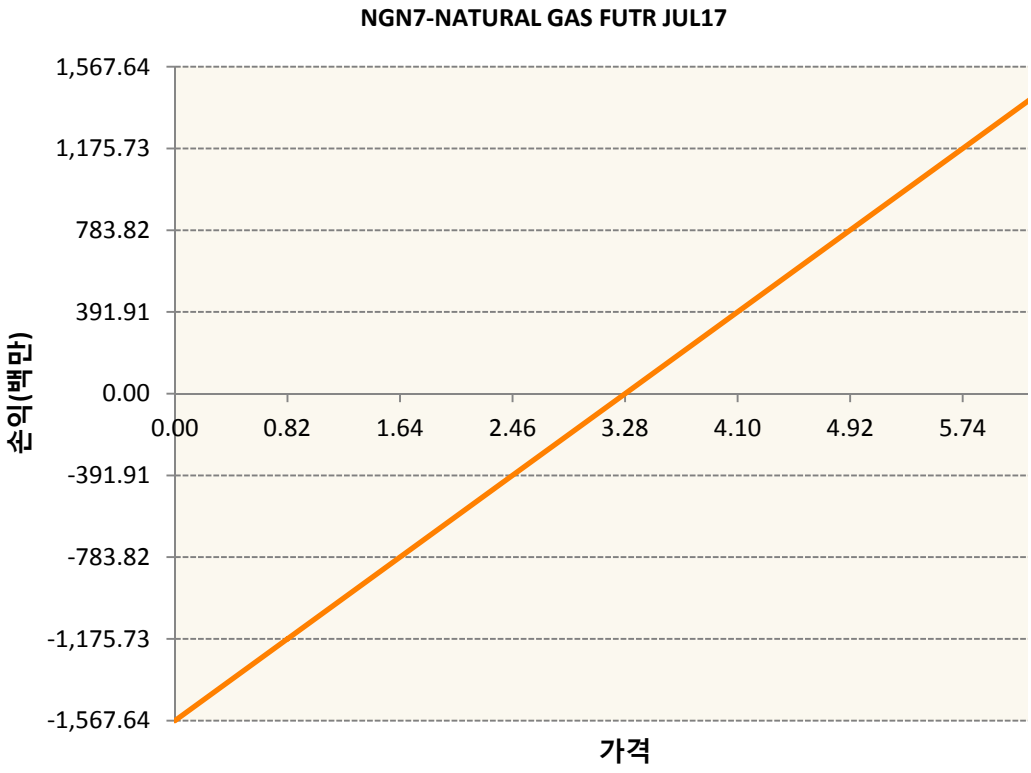


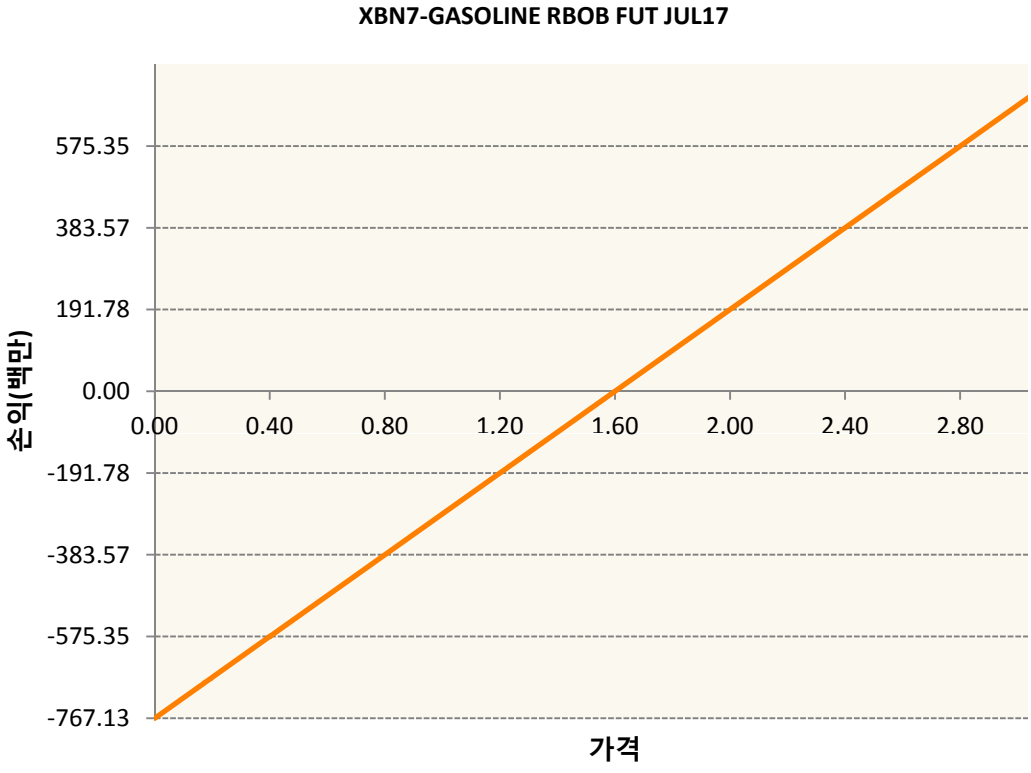

-730.21
-1,095.32
-1,460.42
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
557.91
371.94
185.97
0.00
-185.97
-371.94
-557.91
-743.88
0.00
0.39
0.78
1.17
1.56
1.95
2.34
2.73
순이익(백만)
가격


KR4175M60005-2017-06 달러선물
167.97
111.98
55.99
0.00
-55.99
-111.98
-167.97
-223.96
0.00
279.95
559.90
839.85
1,119.80
1,399.75
1,679.70
1,959.65
순이익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,567.64
1,175.73
783.82
391.91
0.00
-391.91
-783.82
-1,175.73
-1,567.64
0.00
0.82
1.64
2.46
3.28
4.10
4.92
5.74
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
575.35
383.57
191.78
0.00
-191.78
-383.57
-575.35
-767.13
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	76
COU7	BRENT CRUDE FUTR SEP17	117
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	60
KR4175M60(	2017-06 달러선물	18
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	125
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	61

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

931

공시일	2017-05-29
기준일	2017-05-26

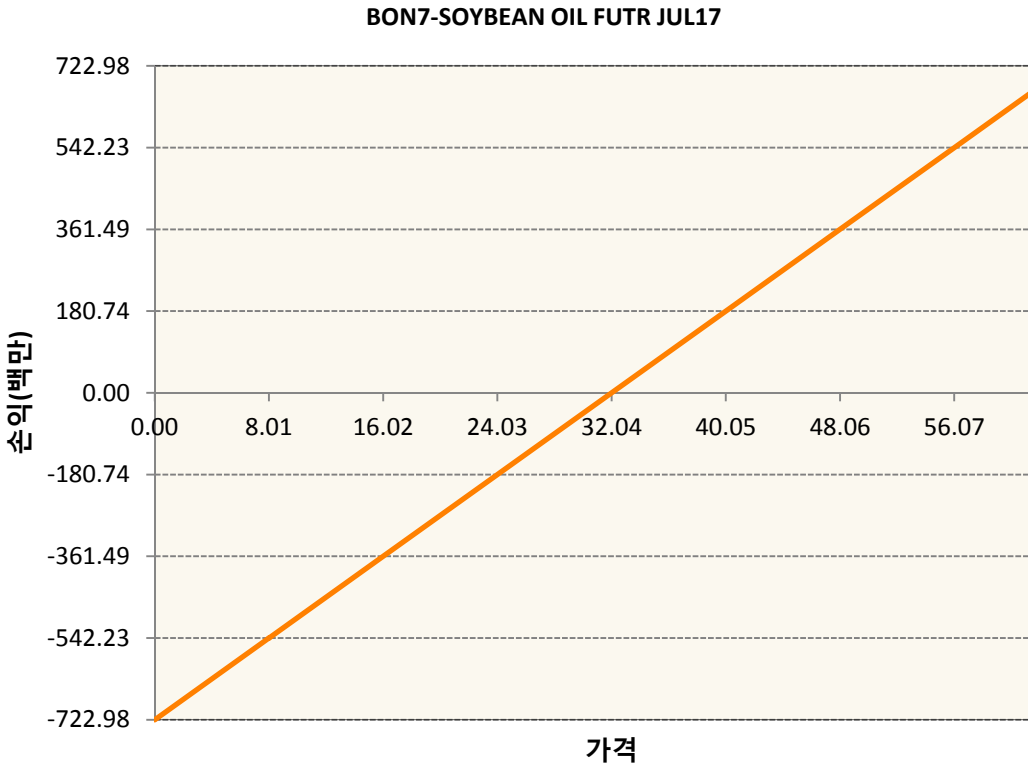
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

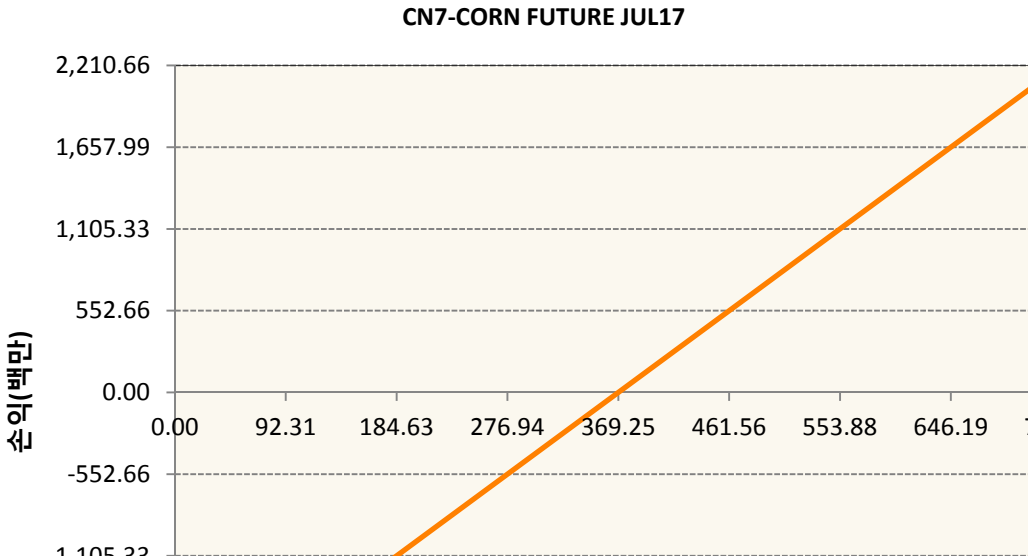
1. 계약금액

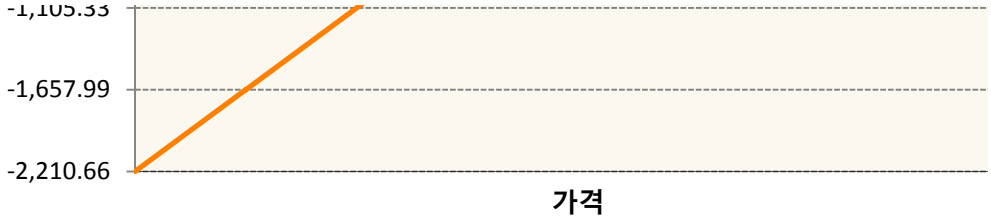
(단위:백만원)

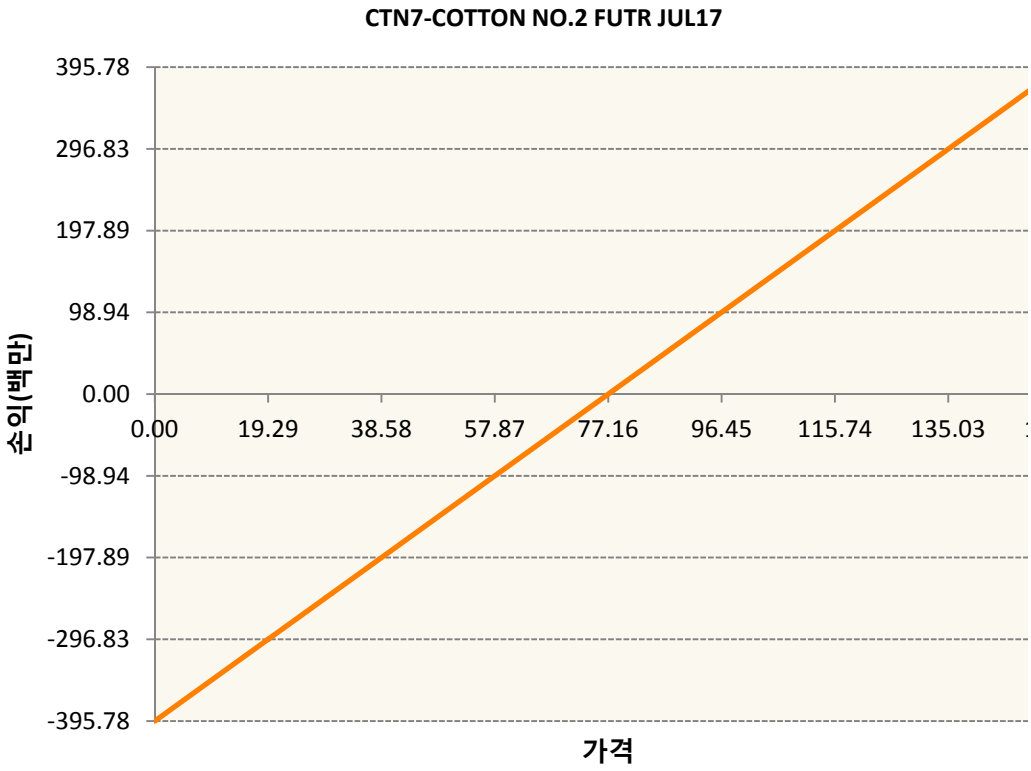
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,343	392	7,951	

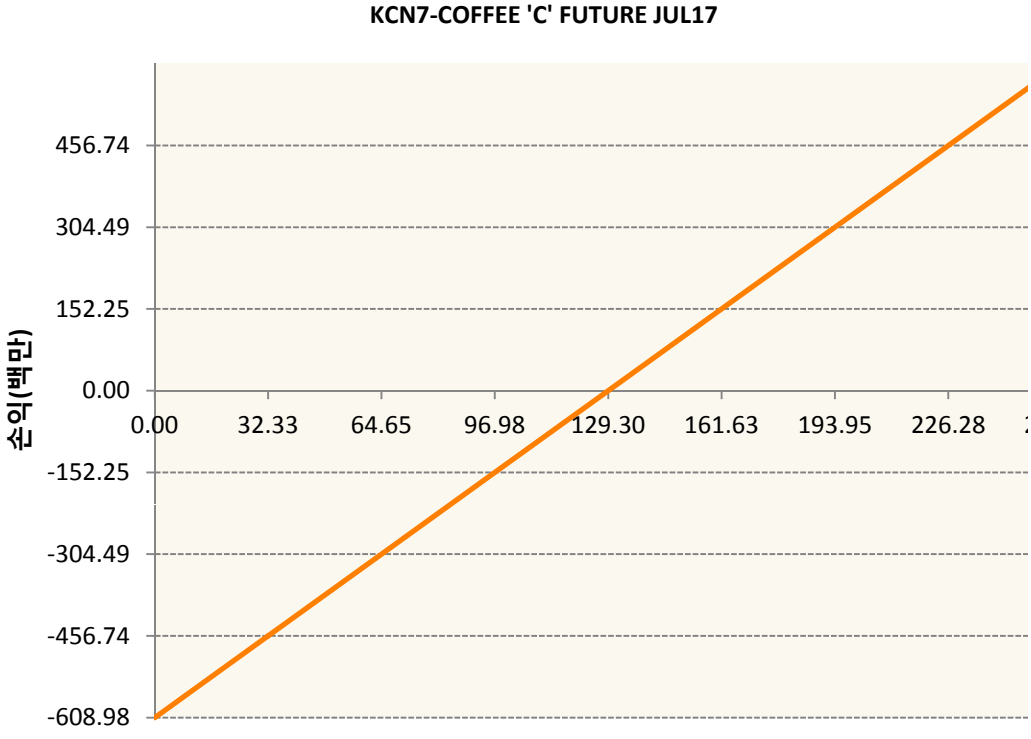
2. 만기시점의 손익구조





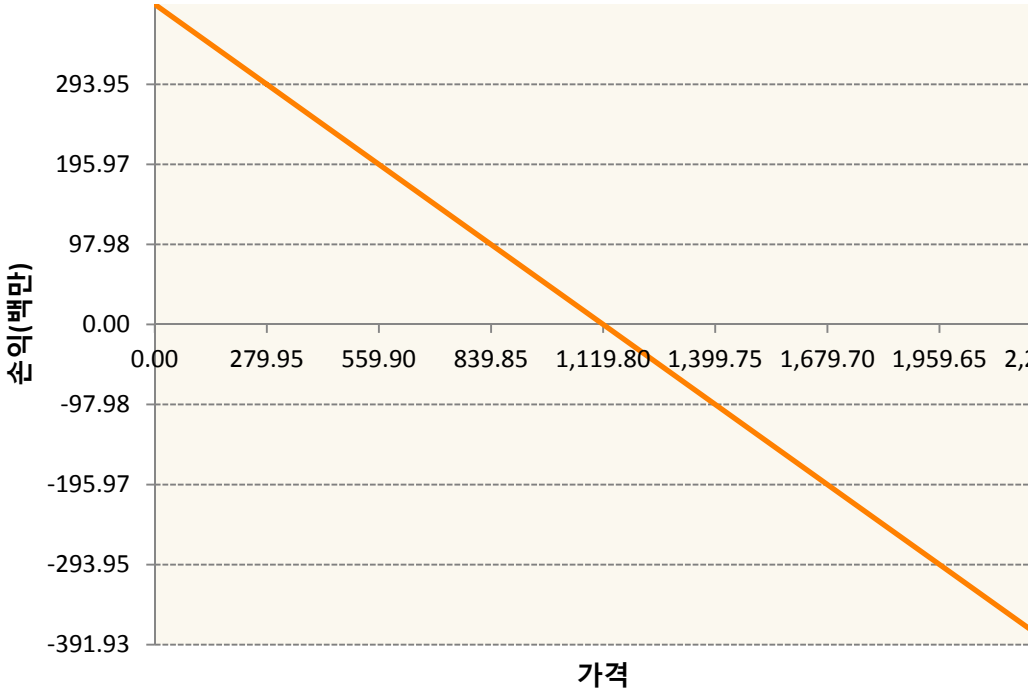

-1,657.99
-2,210.66
가격


CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
395.78
296.83
197.89
98.94
0.00
-98.94
-197.89
-296.83
-395.78
0.00
19.29
38.58
57.87
77.16
96.45
115.74
135.03
순익(백만)
가격

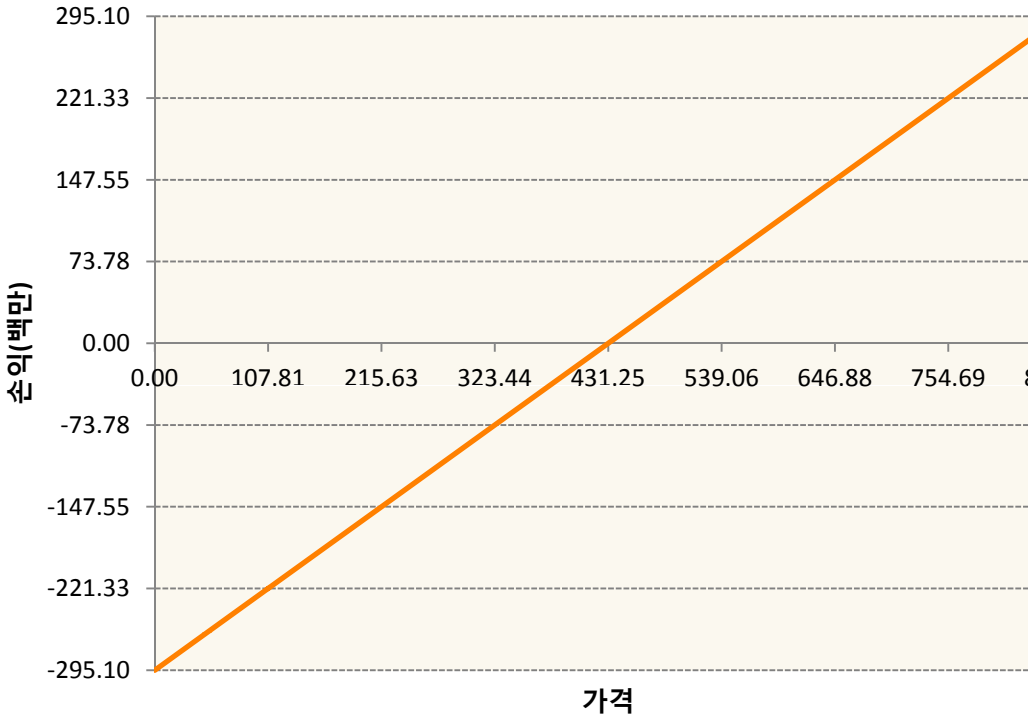

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
456.74
304.49
152.25
0.00
-152.25
-304.49
-456.74
-608.98
0.00
32.33
64.65
96.98
129.30
161.63
193.95
226.28
순익(백만)

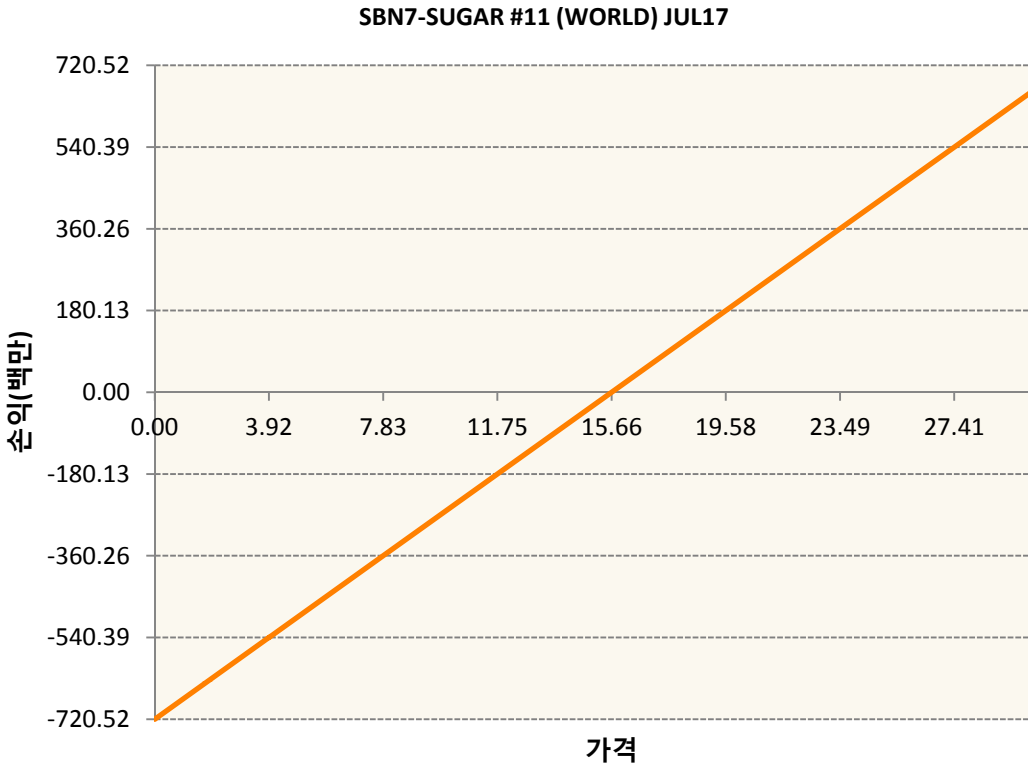
가격

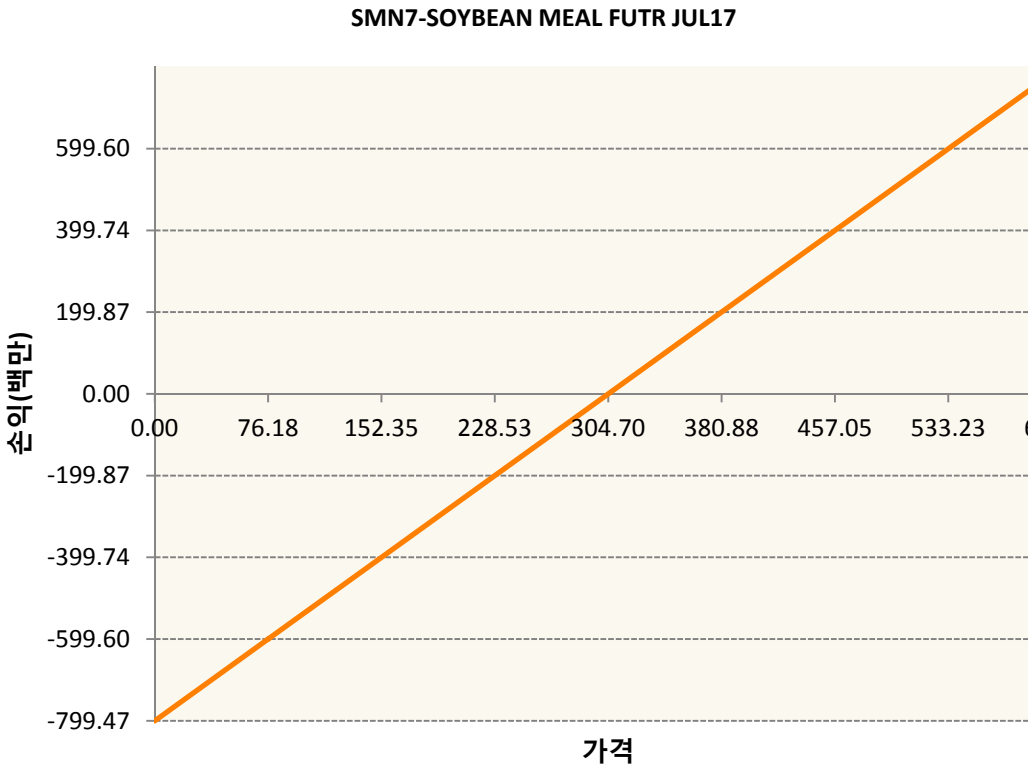
KR4175M60005-2017-06 달러선물

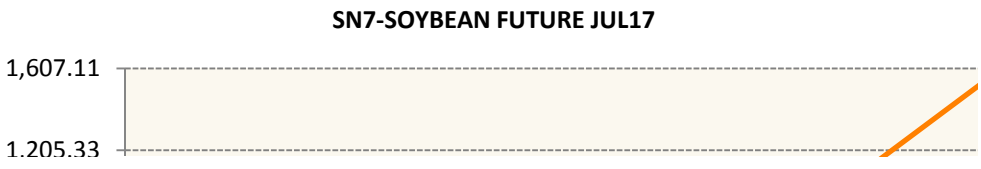


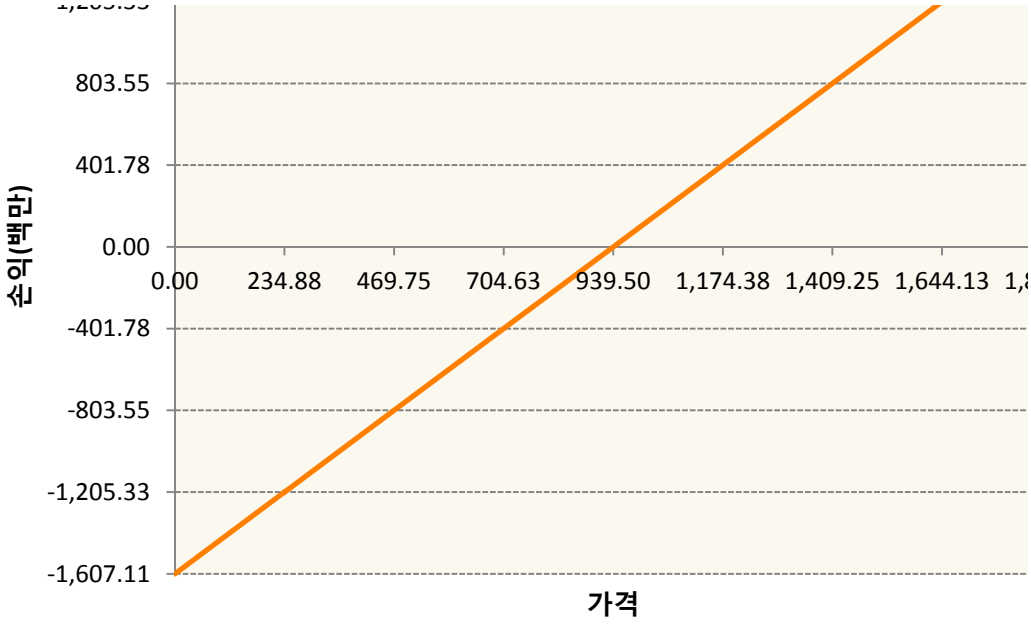
KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17



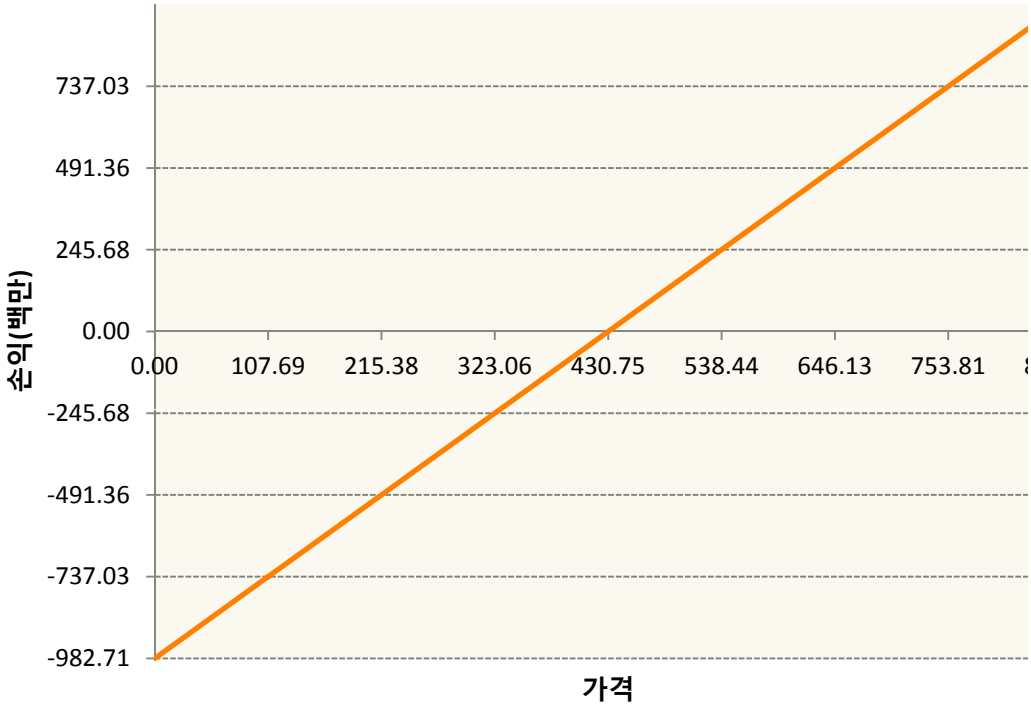

SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
720.52
540.39
360.26
180.13
0.00
-180.13
-360.26
-540.39
-720.52
0.00
3.92
7.83
11.75
15.66
19.58
23.49
27.41
손익(백만)
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
599.60
399.74
199.87
0.00
-199.87
-399.74
-599.60
-799.47
0.00
76.18
152.35
228.53
304.70
380.88
457.05
533.23
손익(백만)
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,607.11
1,205.33



WN7-WHEAT FUTURE(CBT) JUL17



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	31

KWN7	KC HRW WHEAT FUT JUL17	24
SBN7	SUGAR #11 (WORLD) JUL17	58
SMN7	SOYBEAN MEAL FUTR JUL17	64
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	129
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	79

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

759