공시일	2017-05-30
기준일	2017-05-29

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	2017-05-30
기준일	2017-05-29

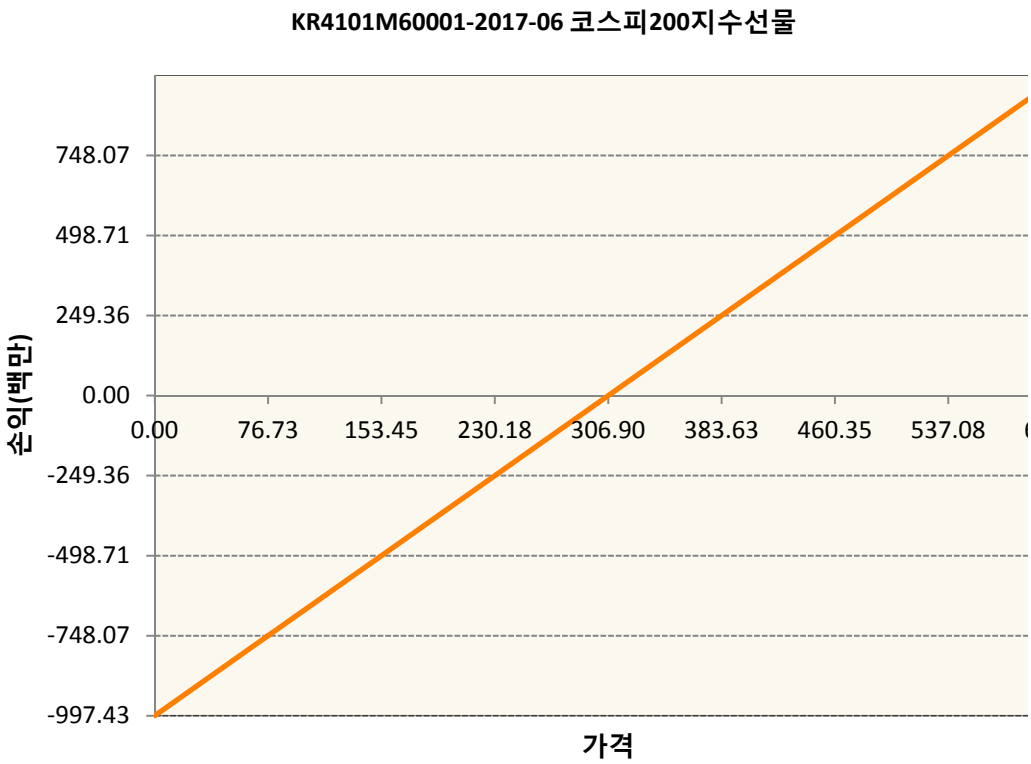
스마트인덱스모

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	997	0	997	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)

52

공시일	2017-05-30
기준일	2017-05-29

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	993

* 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	2017-05-30
기준일	2017-05-29

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	2017-05-30
기준일	2017-05-29

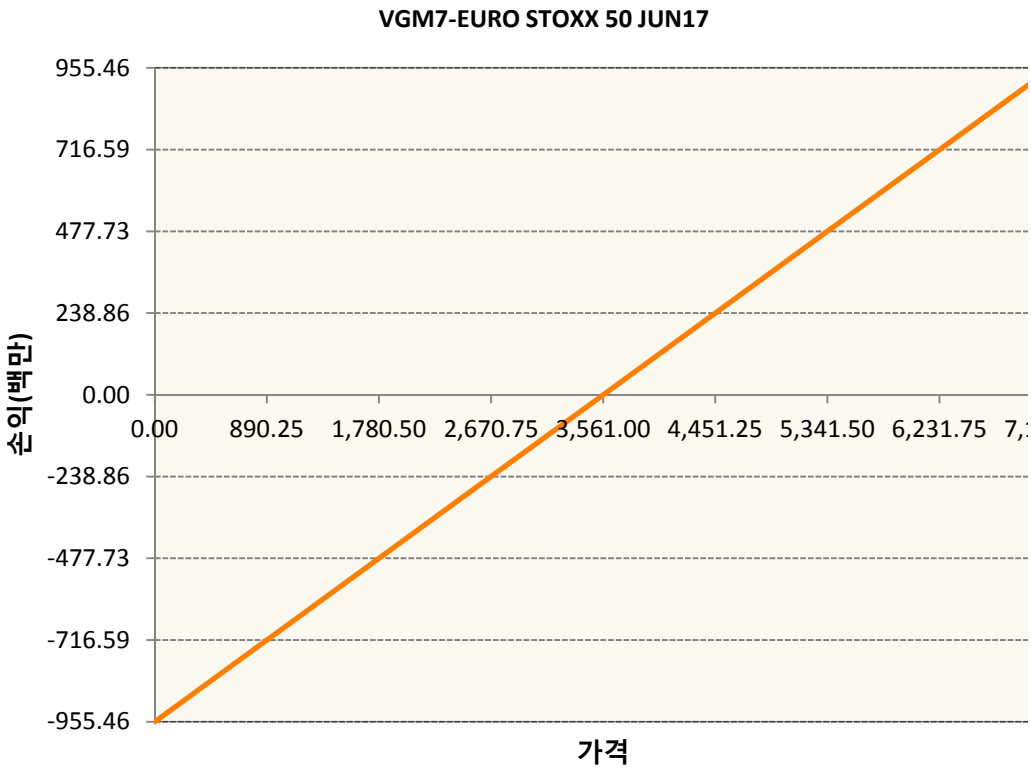
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	955	0	955	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM7	EURO STOXX 50 JUN17	76

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

(단위:백만원)

73

공시일	2017-05-30
기준일	2017-05-29

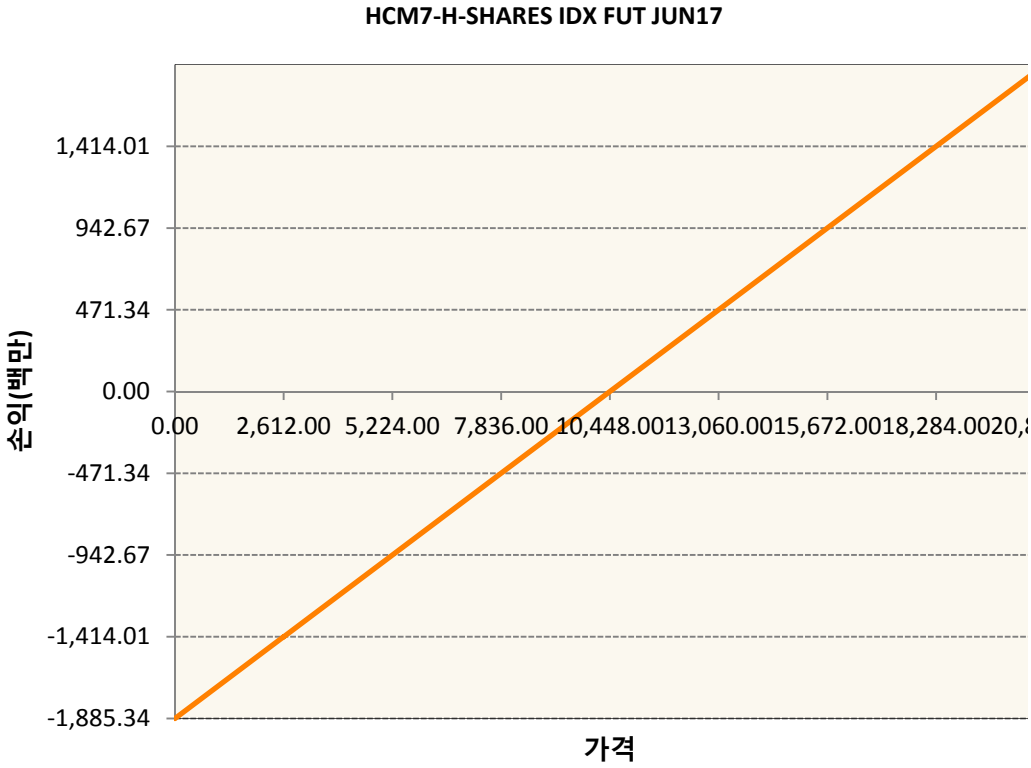
차이나인덱스모(주식-파생형)

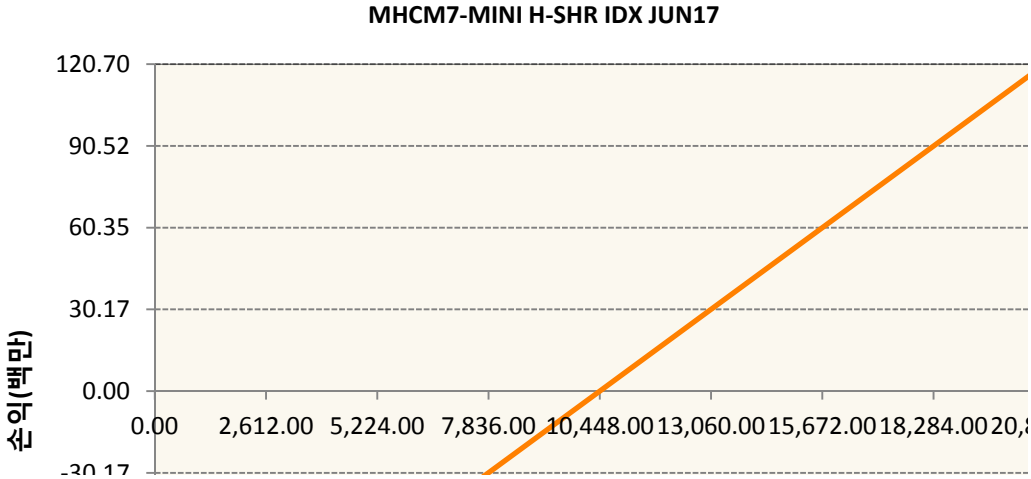
1. 계약금액

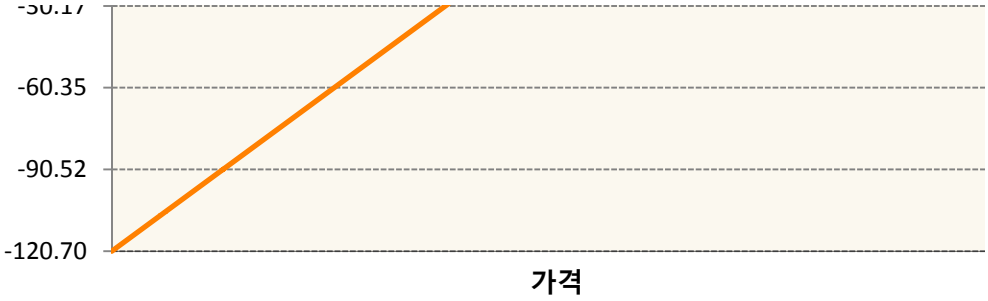
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계			1,885	0	1,885	
누계	유가증권	선물	121	0	121	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCM7	H-SHARES IDX FUT JUN17	151
MHCM7	MINI H-SHR IDX JUN17	10

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

113

공시일	2017-05-30
기준일	2017-05-29

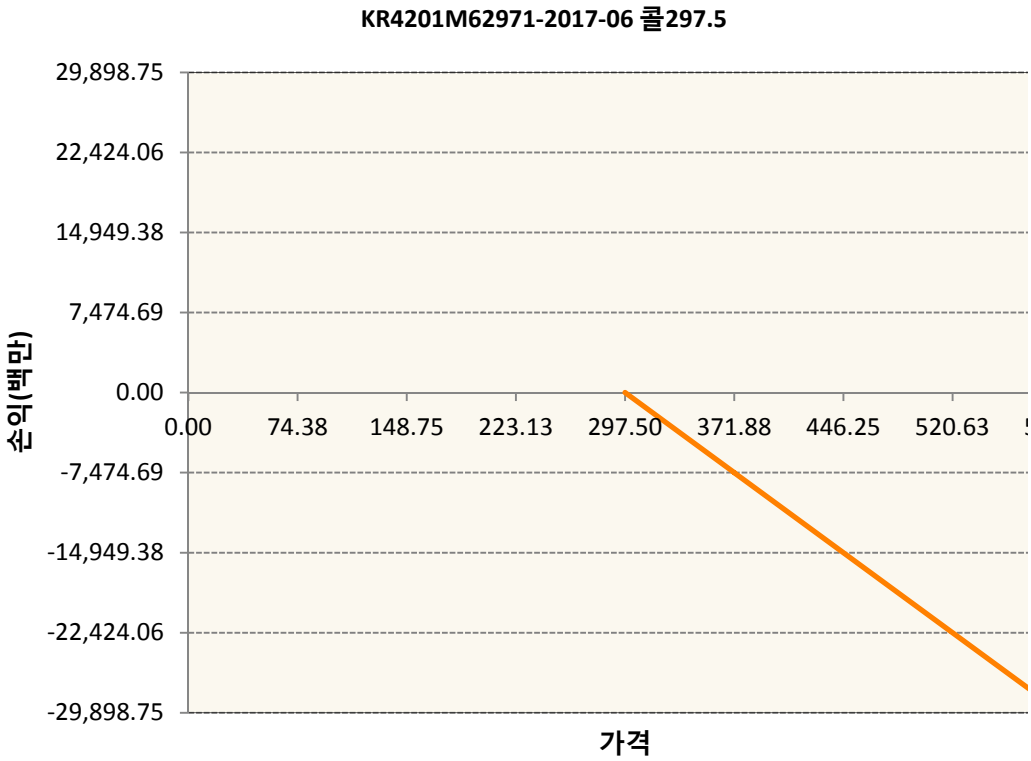
커버드콜모(주식혼합-파생형)

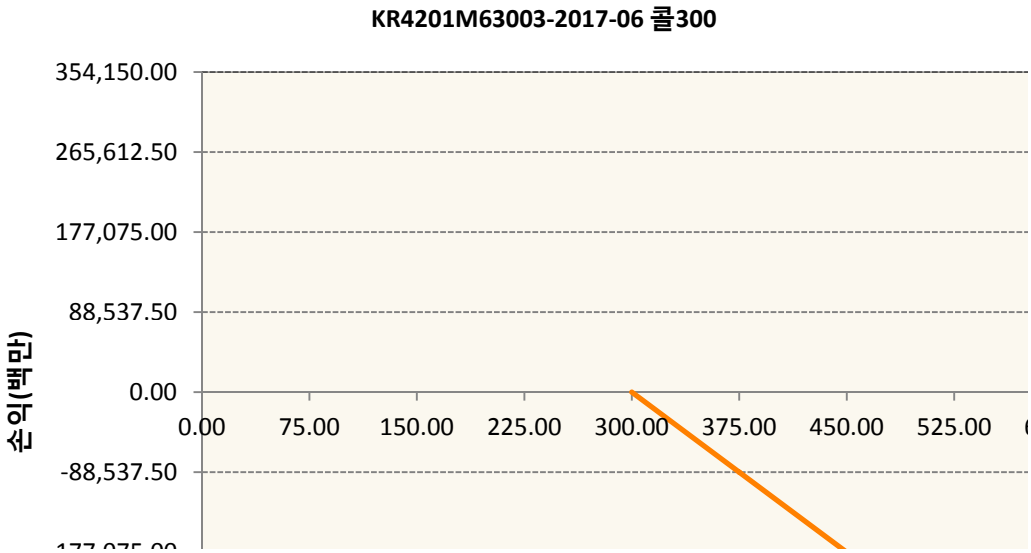
1. 계약금액

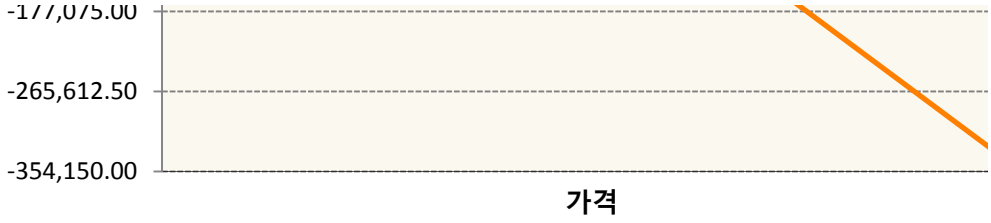
(단위:백만원)

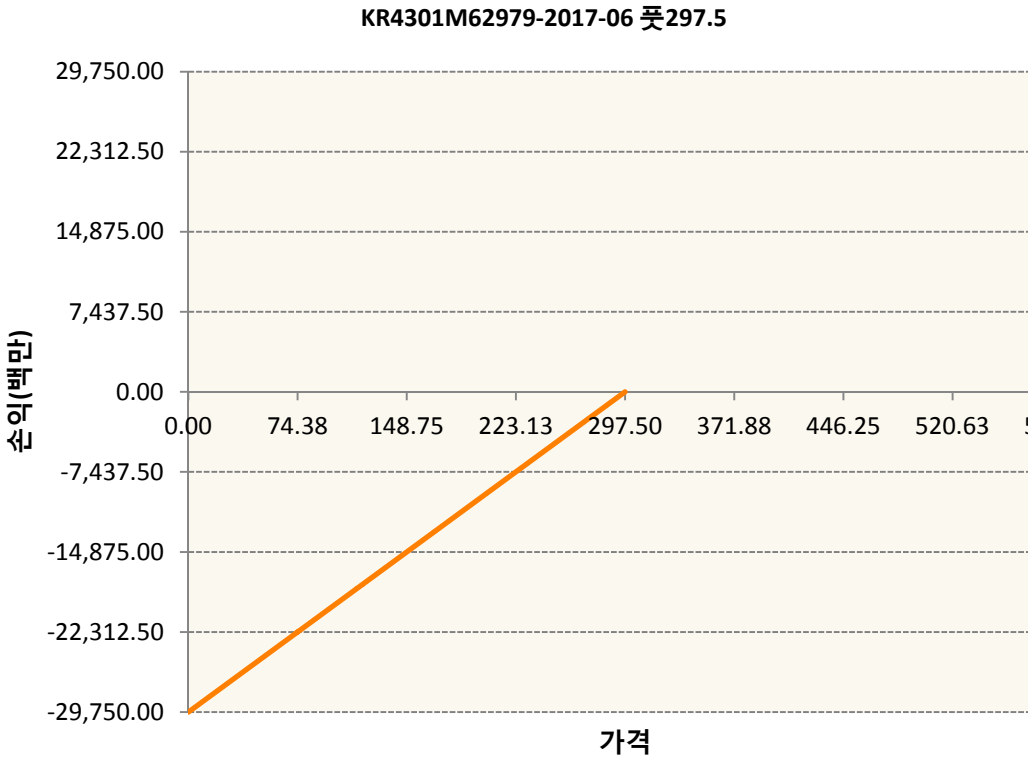
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	623,799	-623,799	장내

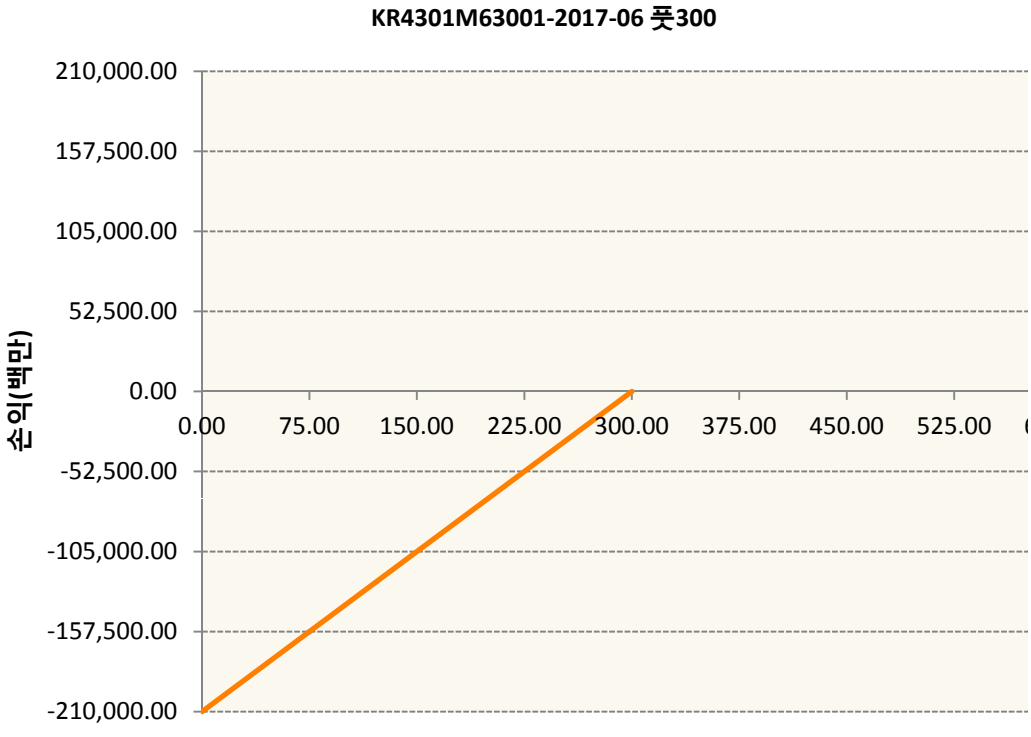
2. 만기시점의 손익구조






-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						2,430
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	938	938	937	936	934	931	927
-5.33%	921	912	901	889	876	861	846
-2.67%	686	663	640	617	594	571	548
0%	24	17	10	0	-11	-23	-36
2.67%	-788	-788	-789	-790	-791	-794	-797
5.33%	-1,609	-1,609	-1,609	-1,609	-1,609	-1,609	-1,610
8.00%	-2,430	-2,430	-2,430	-2,430	-2,430	-2,430	-2,430
KR4201M63(	2017-06 콜300						28,139
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,479	8,478	8,476	8,470	8,460	8,444	8,421
-5.33%	8,415	8,363	8,293	8,206	8,102	7,983	7,850
-2.67%	6,885	6,624	6,362	6,098	5,832	5,566	5,299
0%	471	331	173	0	-186	-383	-589
2.67%	-8,854	-8,863	-8,881	-8,909	-8,949	-9,001	-9,067
5.33%	-18,493	-18,493	-18,493	-18,495	-18,498	-18,503	-18,512
8.00%	-28,138	-28,138	-28,138	-28,138	-28,138	-28,138	-28,139
KR4301M62(	2017-06 풋297.5						1,528
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,518	-1,518	-1,519	-1,520	-1,522	-1,525	-1,528
-5.33%	-718	-727	-738	-750	-763	-777	-792
-2.67%	-135	-158	-180	-203	-226	-249	-272
0%	24	17	9	0	-11	-23	-36
2.67%	33	33	32	31	30	27	24
5.33%	33	33	33	33	33	33	32
8.00%	33	33	33	33	33	33	33
KR4301M63(	2017-06 풋300						12,164
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,130	-12,130	-12,132	-12,135	-12,141	-12,151	-12,164
-5.33%	-6,449	-6,479	-6,521	-6,573	-6,634	-6,705	-6,783
-2.67%	-1,637	-1,791	-1,947	-2,103	-2,261	-2,419	-2,577
0%	279	196	103	0	-110	-227	-349
2.67%	469	464	453	437	413	382	343

5.33%	473	473	472	472	470	467	461
8.00%	473	473	473	473	473	473	472

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

50,268

공시일	2017-05-30
기준일	2017-05-29

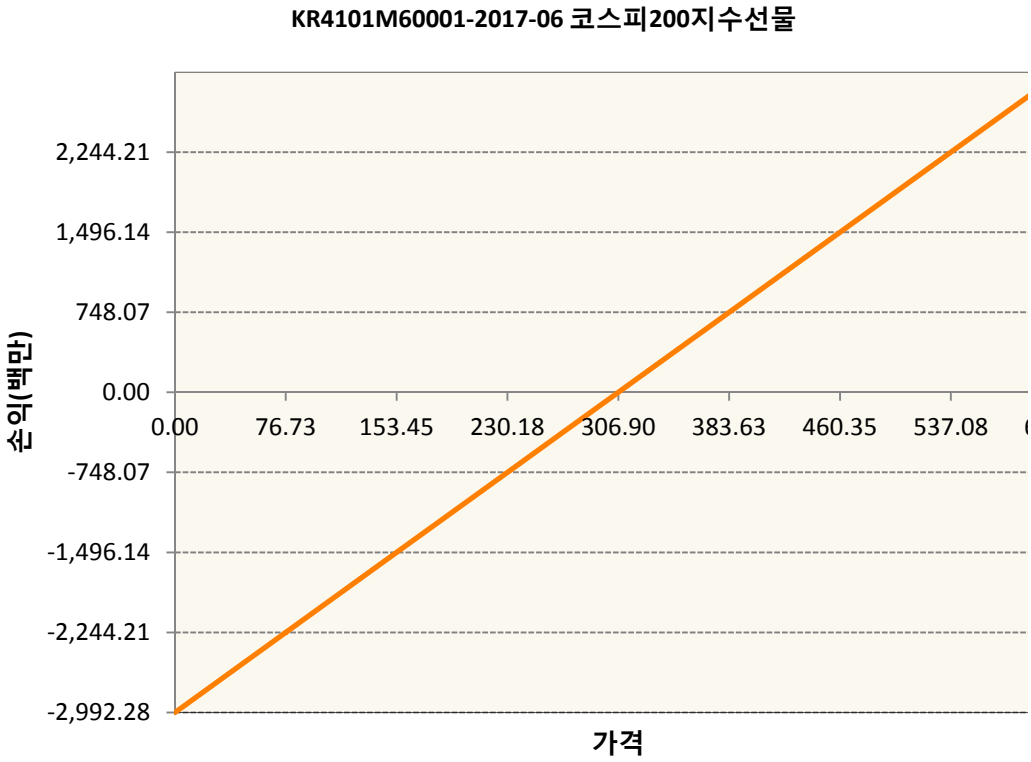
커버드콜목표전환형증권투자신탁

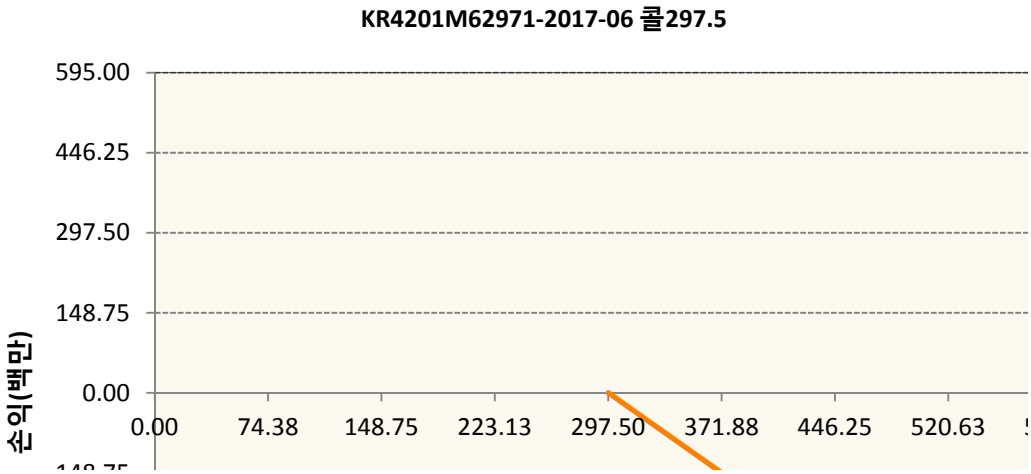
1. 계약금액

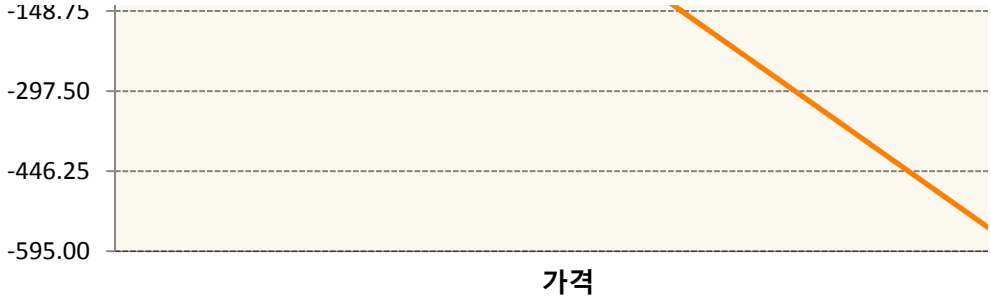
(단위:백만원)

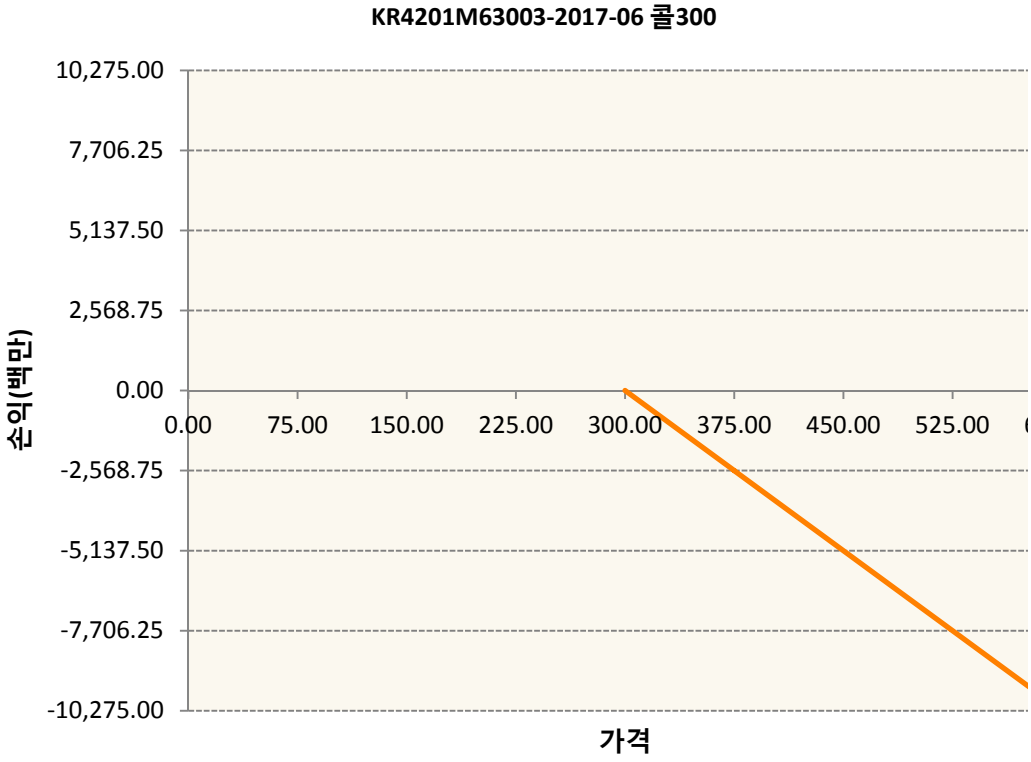
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	72	0	72	장내
누계	유가증권	선물	2,992	0	2,992	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,367	-12,367	장내

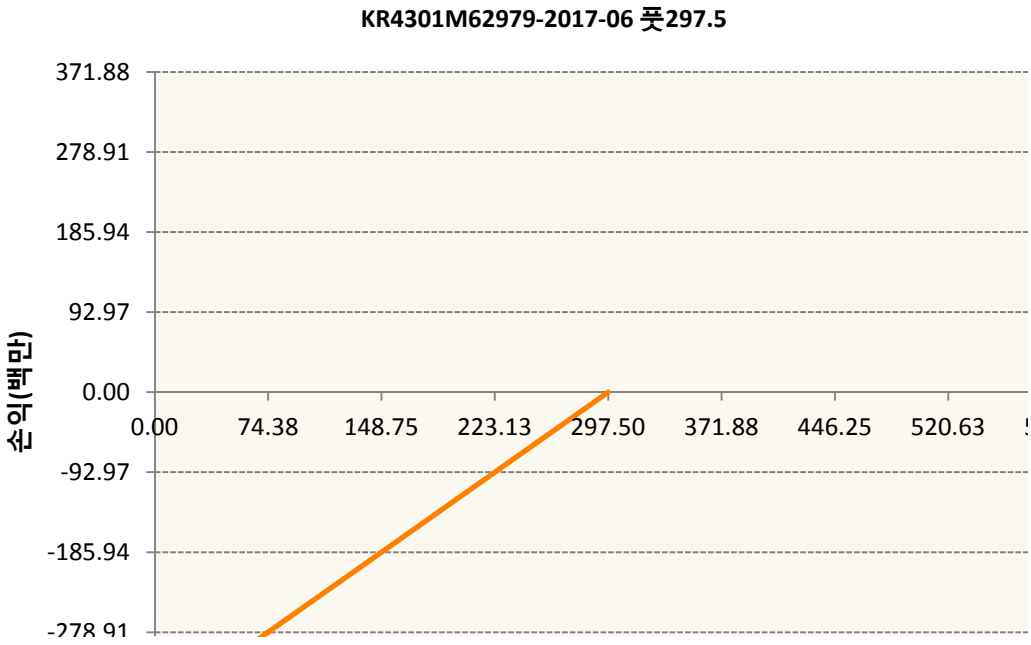
2. 만기시점의 손익구조



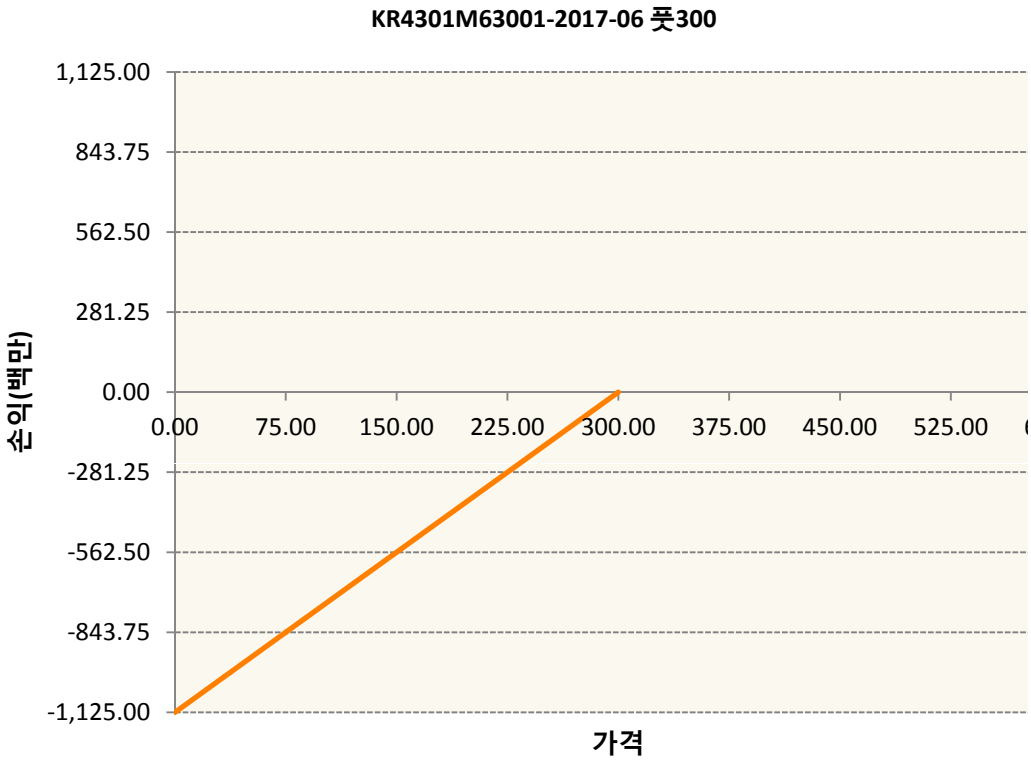



-148.75
-297.50
-446.25
-595.00
가격


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%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
-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%	159	159	159	159	159	159	159
8.00%	239	239	239	239	239	239	239
KR4201M62(2017-06 콜297.5							48
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19	19	19	19	19	19	18
-5.33%	18	18	18	18	17	17	17
-2.67%	14	13	13	12	12	11	11

0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
	KR4201M63(	2017-06 콜300					816
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	246	246	246	246	245	245	244
-5.33%	244	243	241	238	235	232	228
-2.67%	200	192	185	177	169	161	154
0%	14	10	5	0	-5	-11	-17
2.67%	-257	-257	-258	-258	-260	-261	-263
5.33%	-537	-537	-537	-537	-537	-537	-537
8.00%	-816	-816	-816	-816	-816	-816	-816
	KR4301M62(	2017-06 풋297.5					19
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
-5.33%	-9	-9	-9	-9	-10	-10	-10
-2.67%	-2	-2	-2	-3	-3	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
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					65
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-36	-36	-36
-2.67%	-9	-10	-10	-11	-12	-13	-14
0%	1	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	3	2	2	2	2	2	2
5.33%	3	3	3	3	3	3	2
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

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

1,299

공시일	2017-05-30
기준일	2017-05-29

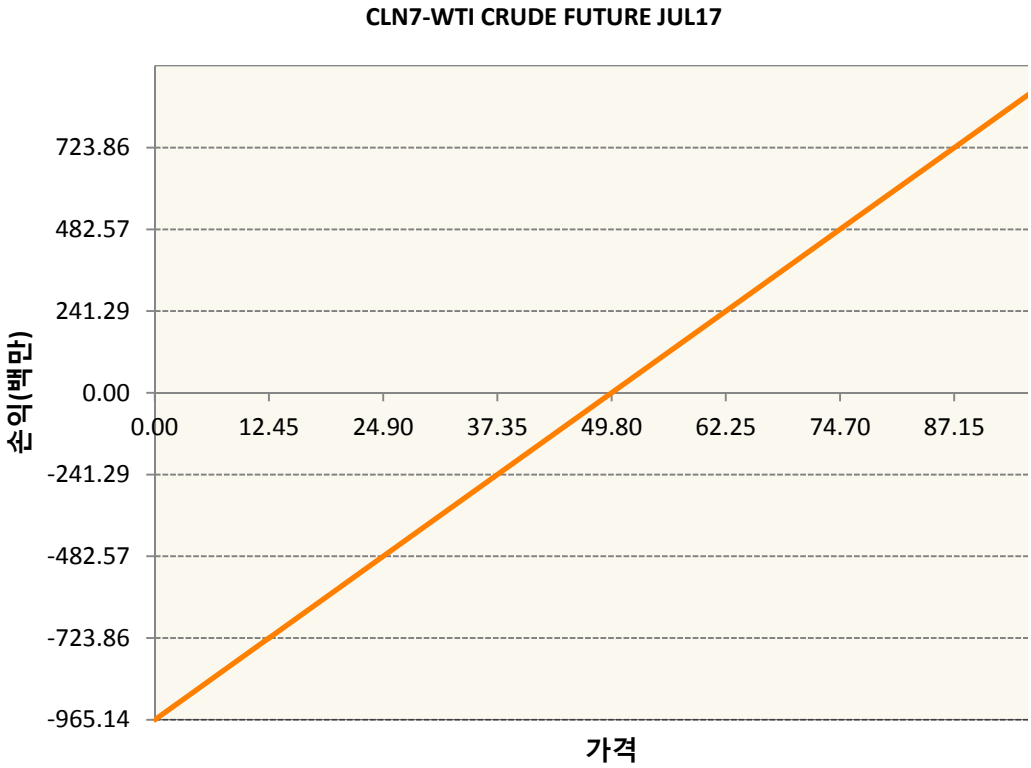
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

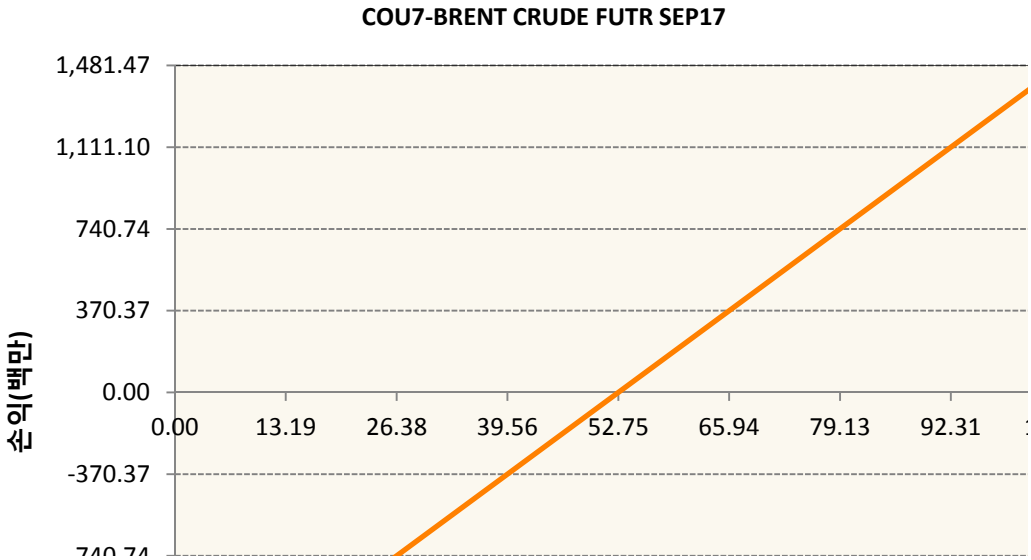
1. 계약금액

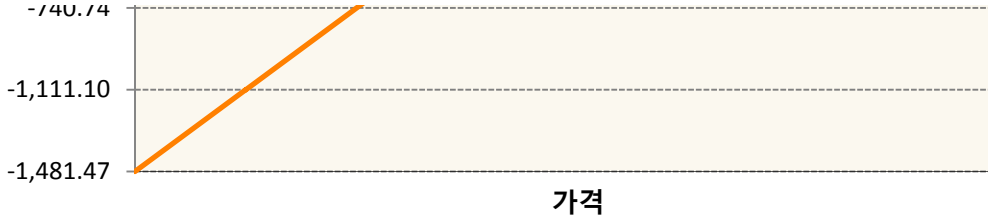
(단위:백만원)

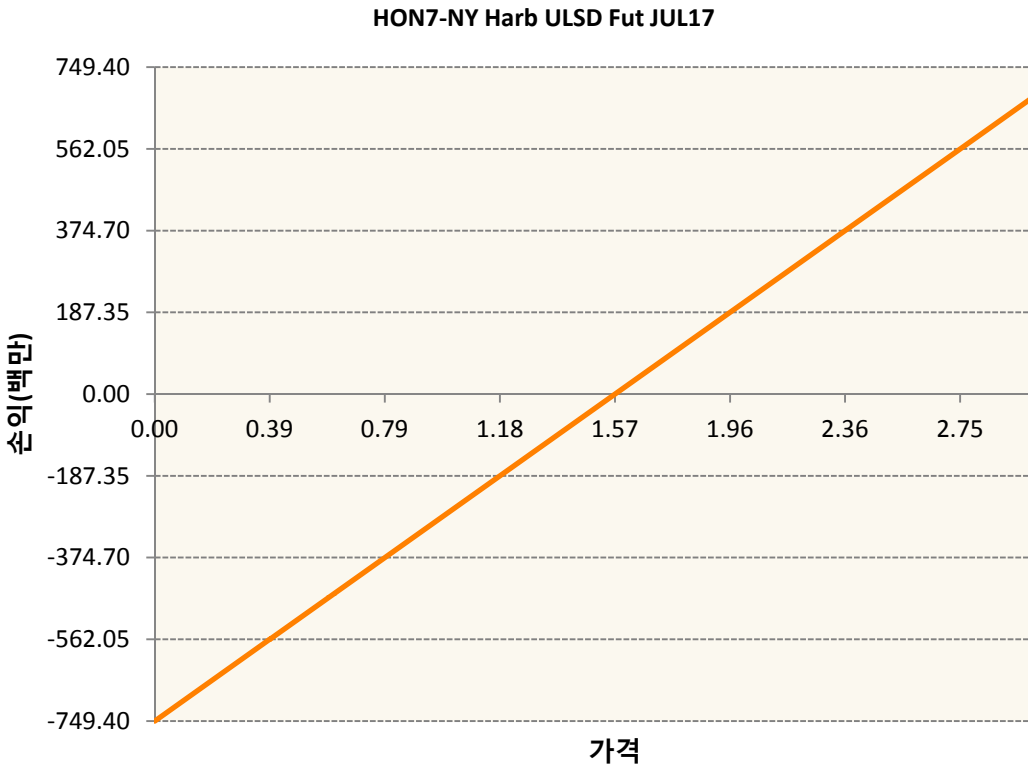
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,559	224	5,334	

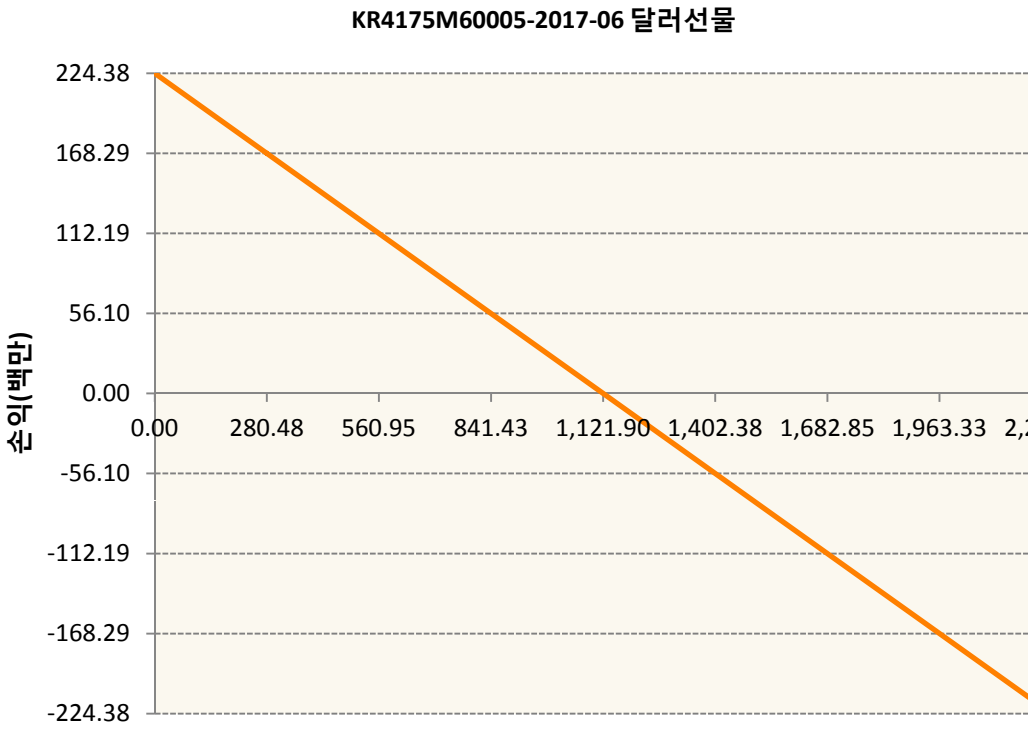
2. 만기시점의 손익구조



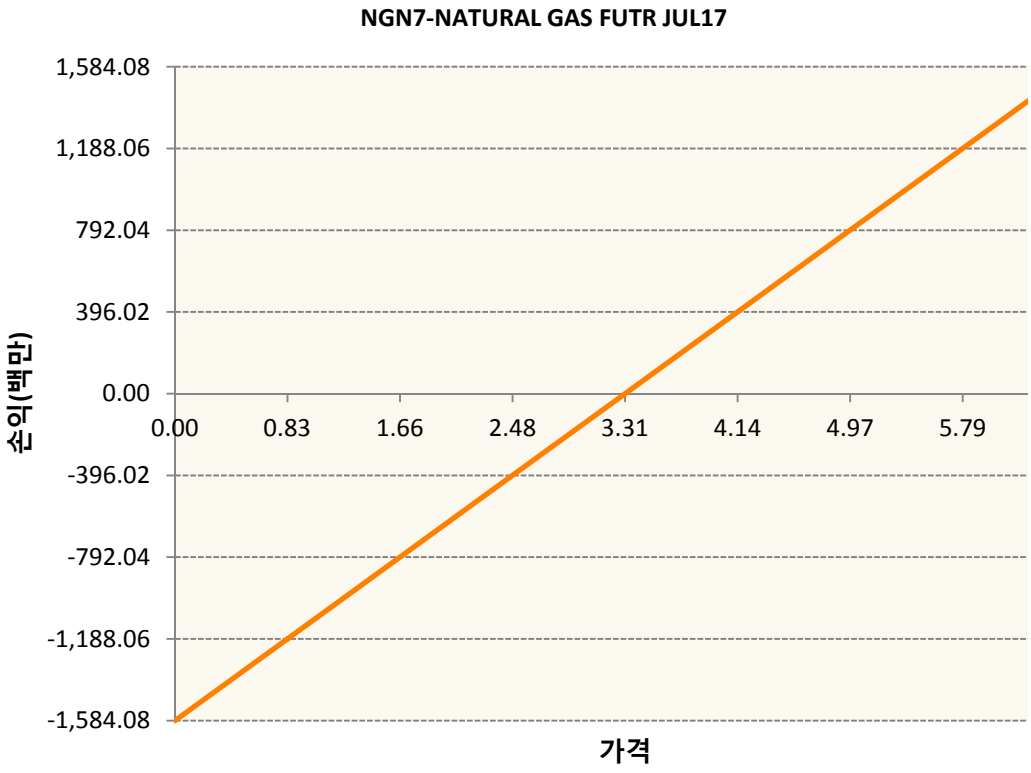


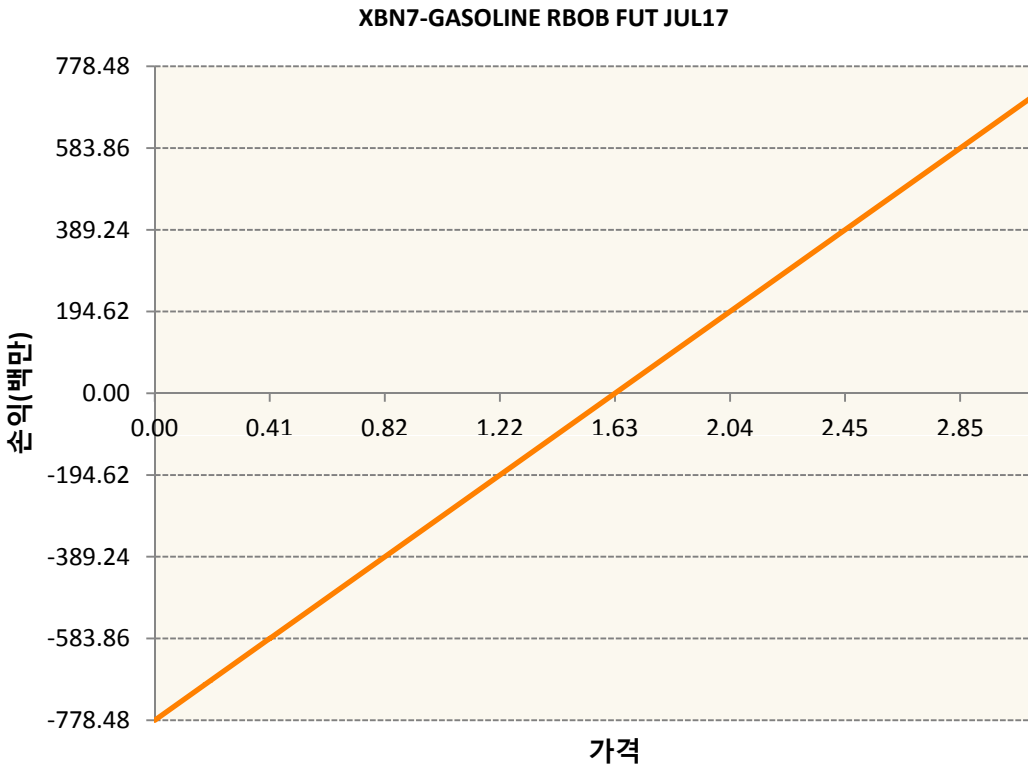

-1,111.10
-1,481.47
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
749.40
562.05
374.70
187.35
0.00
-187.35
-374.70
-562.05
-749.40
0.00
0.39
0.79
1.18
1.57
1.96
2.36
2.75
순이익(백만)
가격


KR4175M60005-2017-06 달러선물
224.38
168.29
112.19
56.10
0.00
-56.10
-112.19
-168.29
-224.38
0.00
280.48
560.95
841.43
1,121.90
1,402.38
1,682.85
1,963.33
순이익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,584.08
1,188.06
792.04
396.02
0.00
-396.02
-792.04
-1,188.06
-1,584.08
0.00
0.83
1.66
2.48
3.31
4.14
4.97
5.79
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
778.48
583.86
389.24
194.62
0.00
-194.62
-389.24
-583.86
-778.48
0.00
0.41
0.82
1.22
1.63
2.04
2.45
2.85
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN7	WTI CRUDE FUTURE JUL17	77
COU7	BRENT CRUDE FUTR SEP17	119
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	60
KR4175M60(	2017-06 달러선물	18
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	127
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	62

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

940

공시일	2017-05-30
기준일	2017-05-29

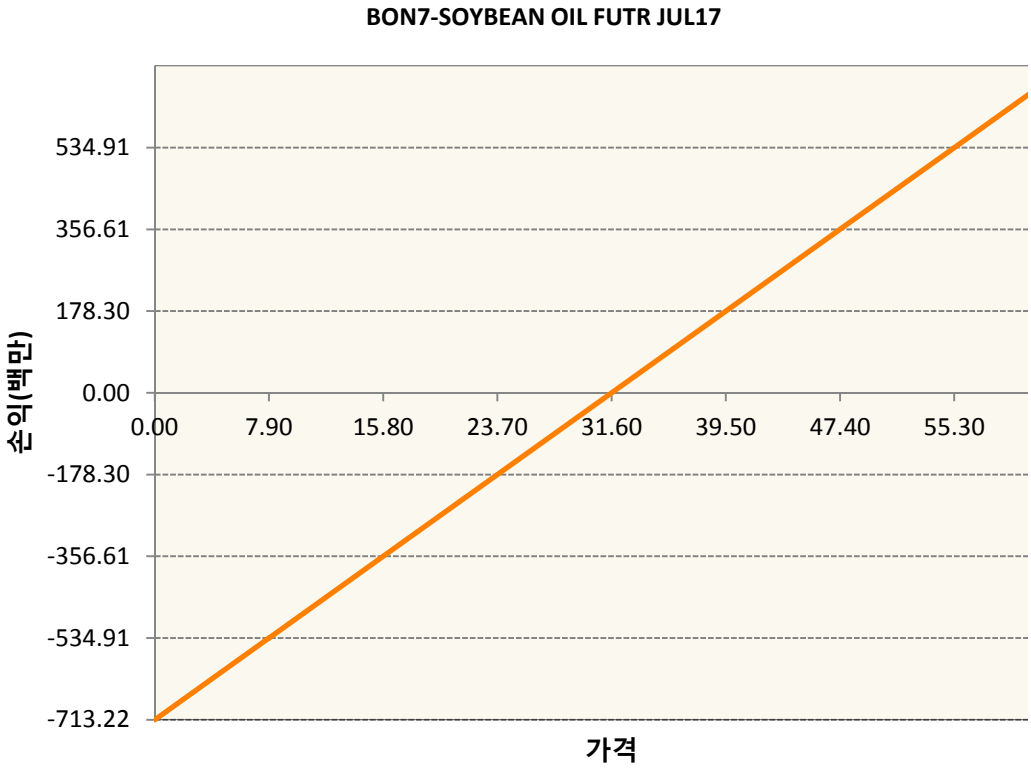
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

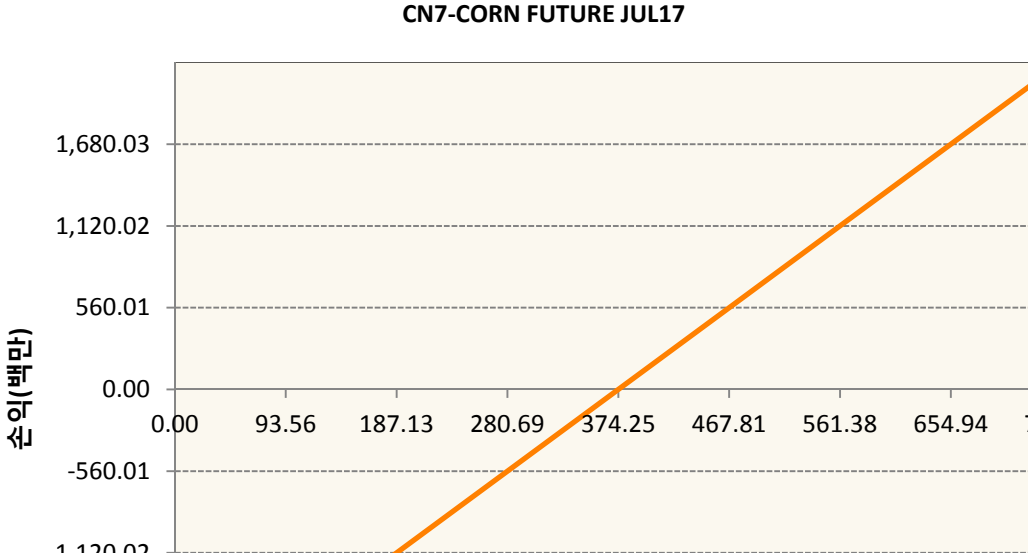
1. 계약금액

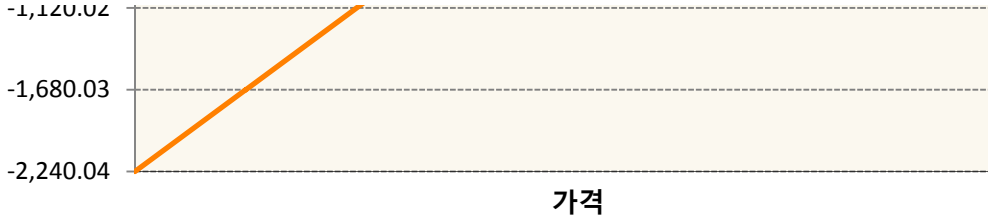
(단위:백만원)

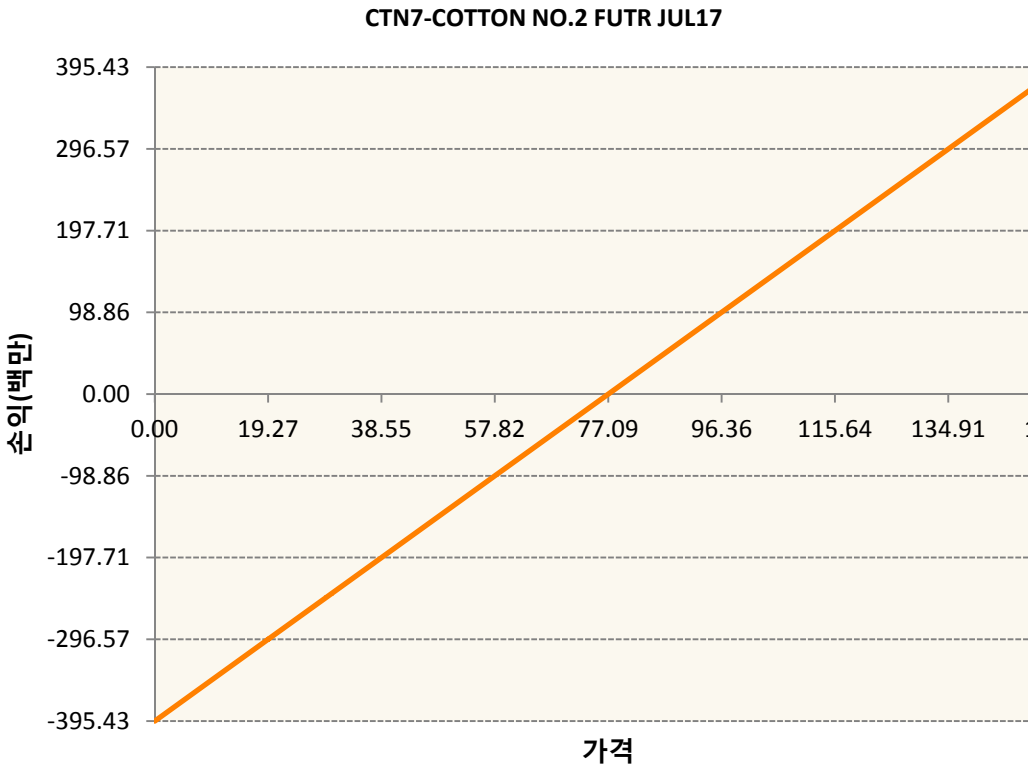
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,335	393	7,943	

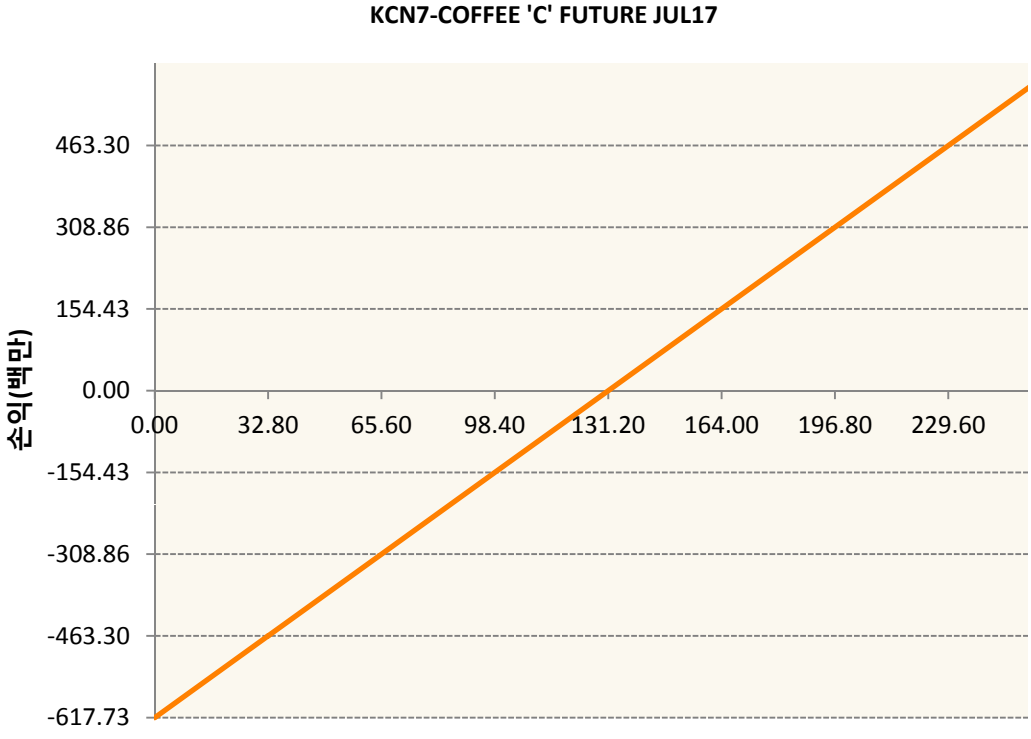
2. 만기시점의 손익구조



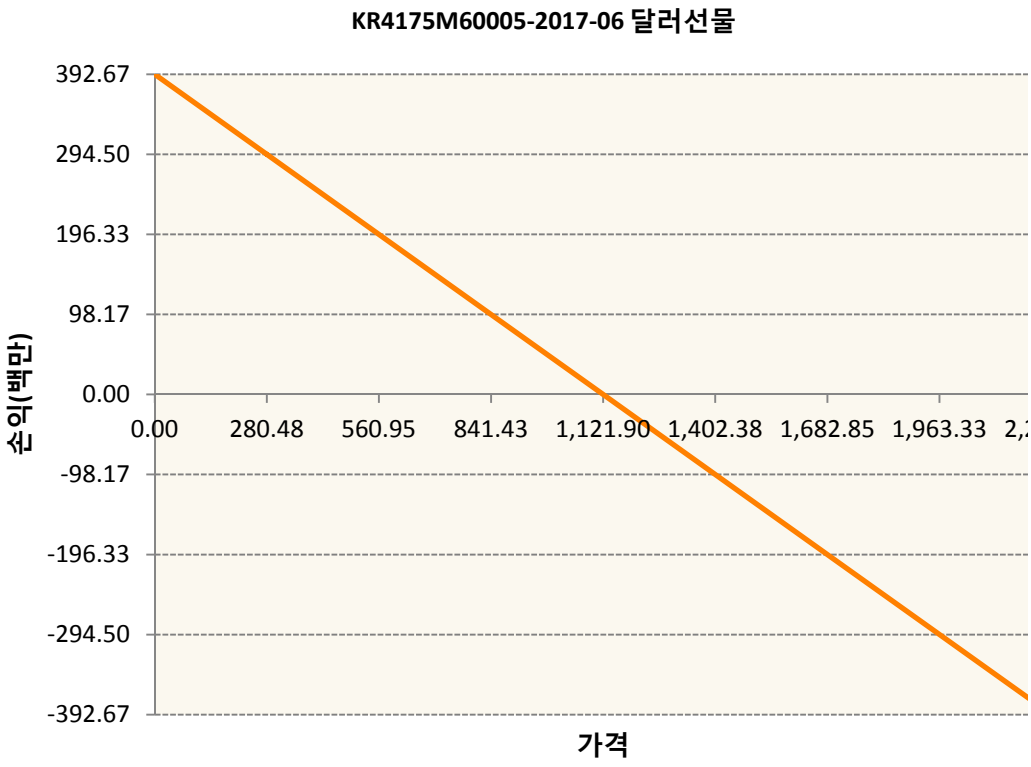


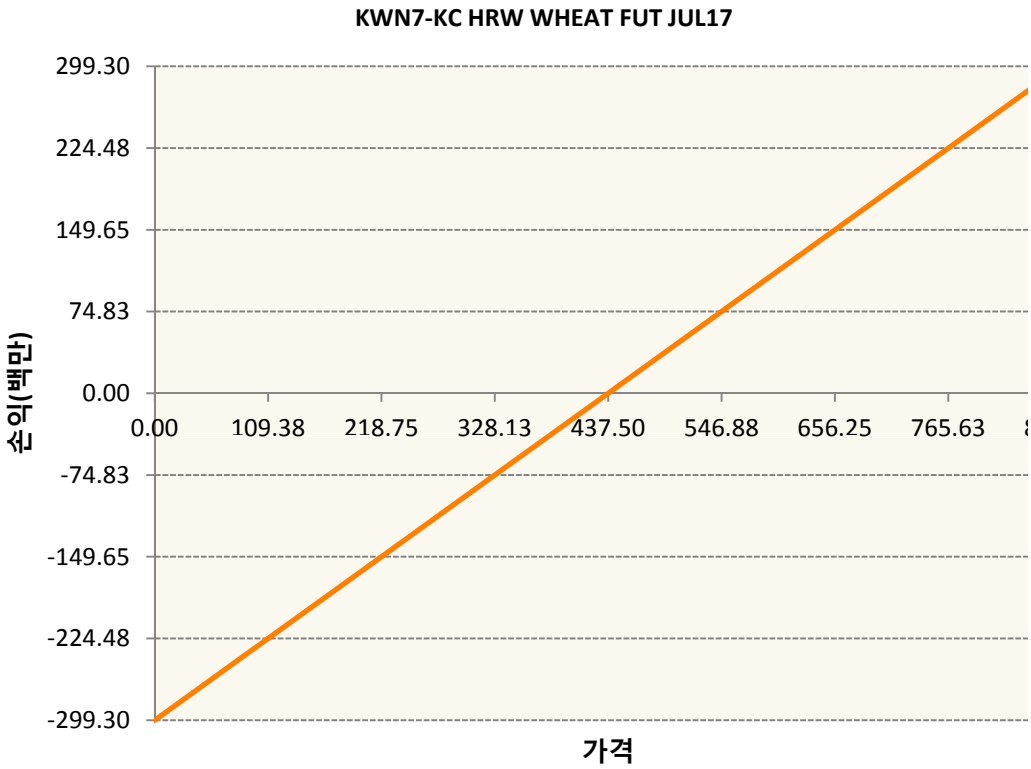

-1,680.03
-2,240.04
가격

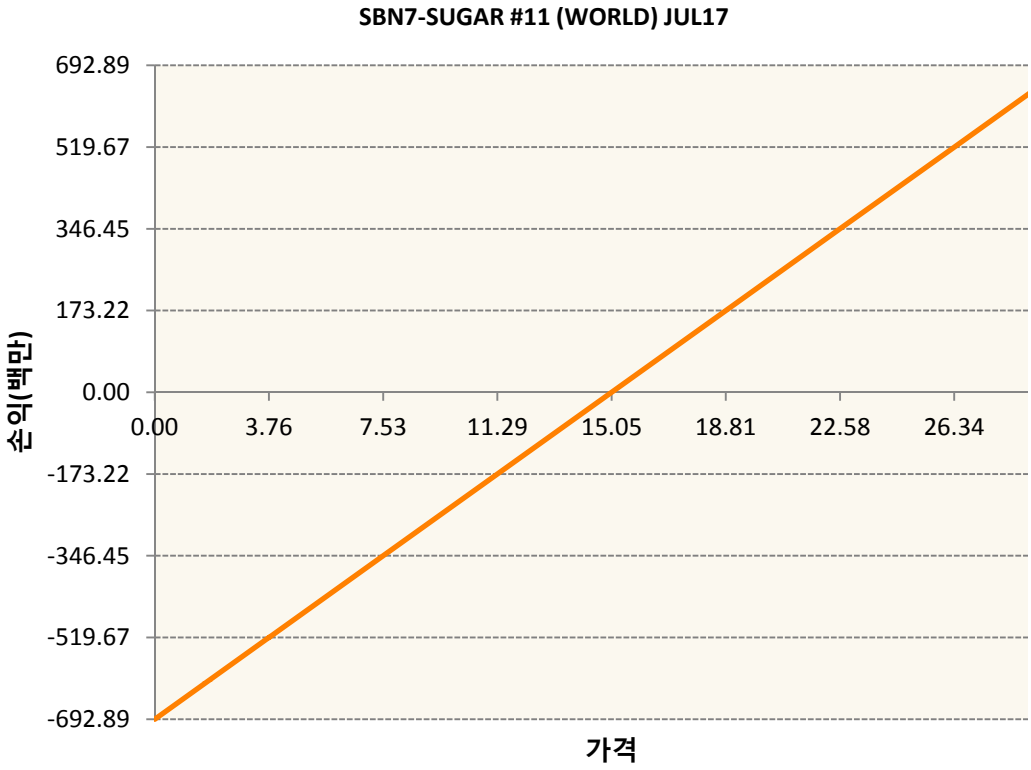

CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
395.43
296.57
197.71
98.86
0.00
-98.86
-197.71
-296.57
-395.43
0.00
19.27
38.55
57.82
77.09
96.36
115.64
134.91
순익(백만)
가격

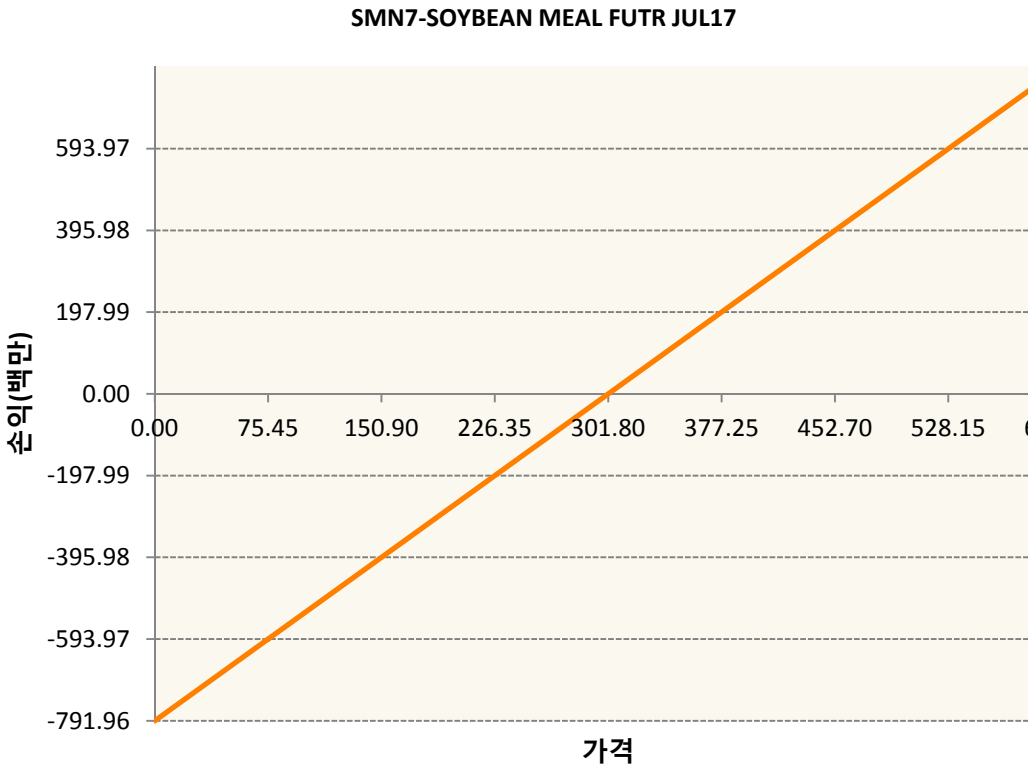

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
463.30
308.86
154.43
0.00
-154.43
-308.86
-463.30
-617.73
0.00
32.80
65.60
98.40
131.20
164.00
196.80
229.60
순익(백만)

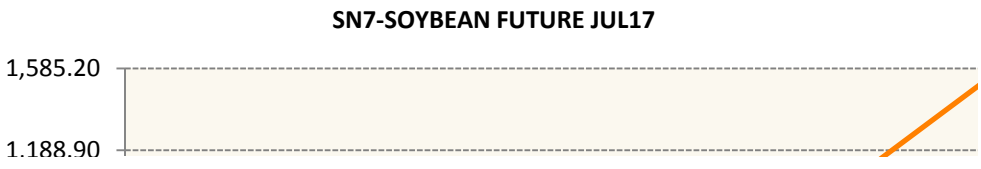
가격

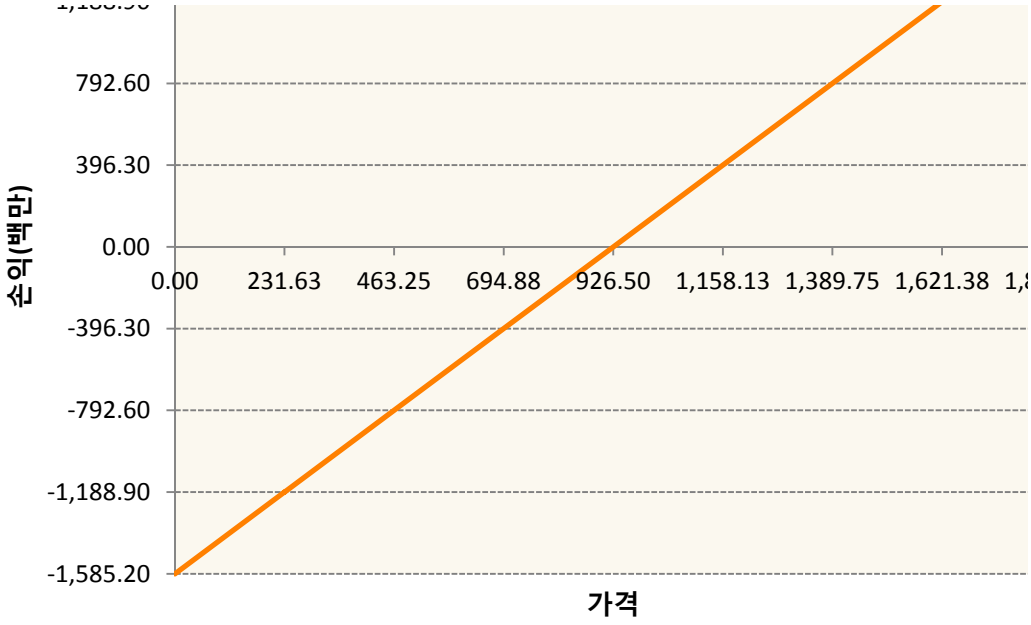

KR4175M60005-2017-06 달러선물
392.67
294.50
196.33
98.17
0.00
-98.17
-196.33
-294.50
-392.67
0.00
280.48
560.95
841.43
1,121.90
1,402.38
1,682.85
1,963.33
손익(백만)
가격

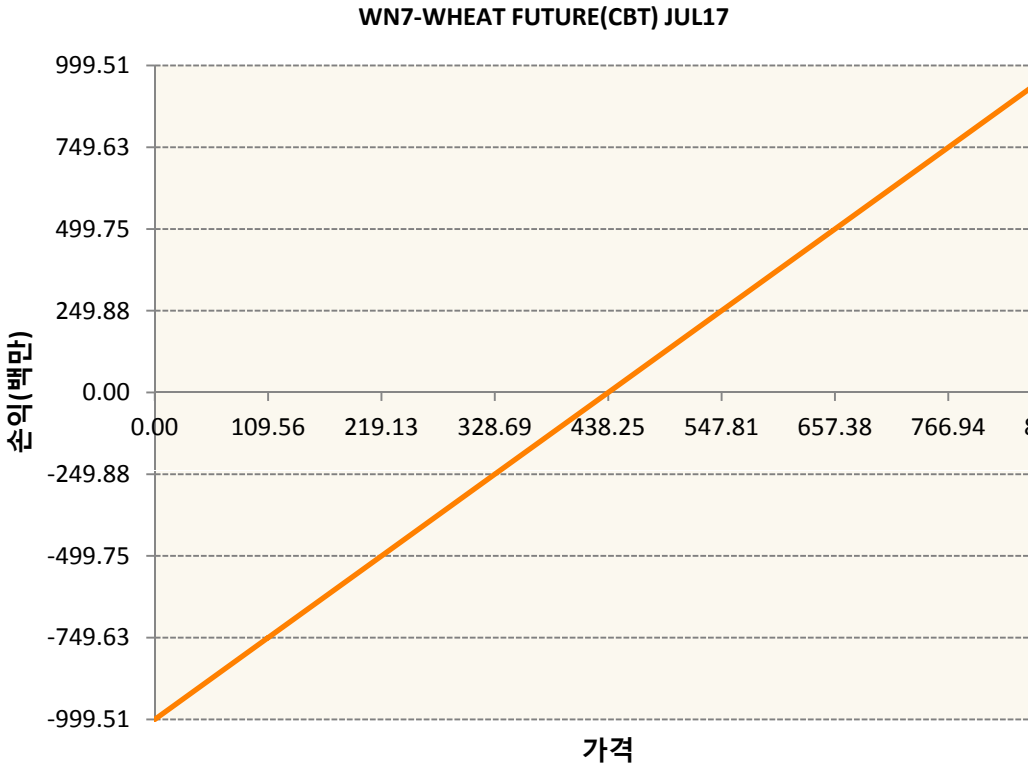

KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17
299.30
224.48
149.65
74.83
0.00
-74.83
-149.65
-224.48
-299.30
0.00
109.38
218.75
328.13
437.50
546.88
656.25
765.63
손익(백만)
가격


SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
692.89
519.67
346.45
173.22
0.00
-173.22
-346.45
-519.67
-692.89
0.00
3.76
7.53
11.29
15.05
18.81
22.58
26.34
손익(백만)
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
593.97
395.98
197.99
0.00
-197.99
-395.98
-593.97
-791.96
0.00
75.45
150.90
226.35
301.80
377.25
452.70
528.15
손익(백만)
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,585.20
1,188.90





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	57
CN7	CORN FUTURE JUL17	179
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	55
SMN7	SOYBEAN MEAL FUTR JUL17	63
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	127
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	80

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

758