공시일	2017-05-31
기준일	2017-05-30

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	2017-05-31
기준일	2017-05-30

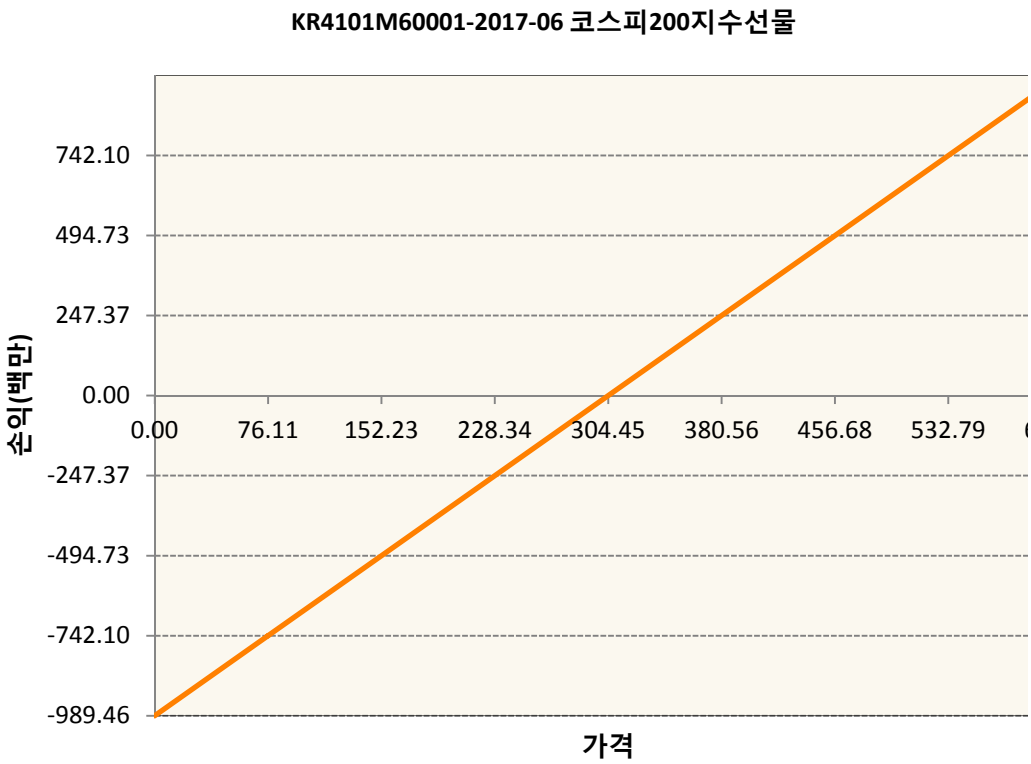
스마트인덱스모

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	989	0	989	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)

52

공시일	2017-05-31
기준일	2017-05-30

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	2017-05-31
기준일	2017-05-30

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	2017-05-31
기준일	2017-05-30

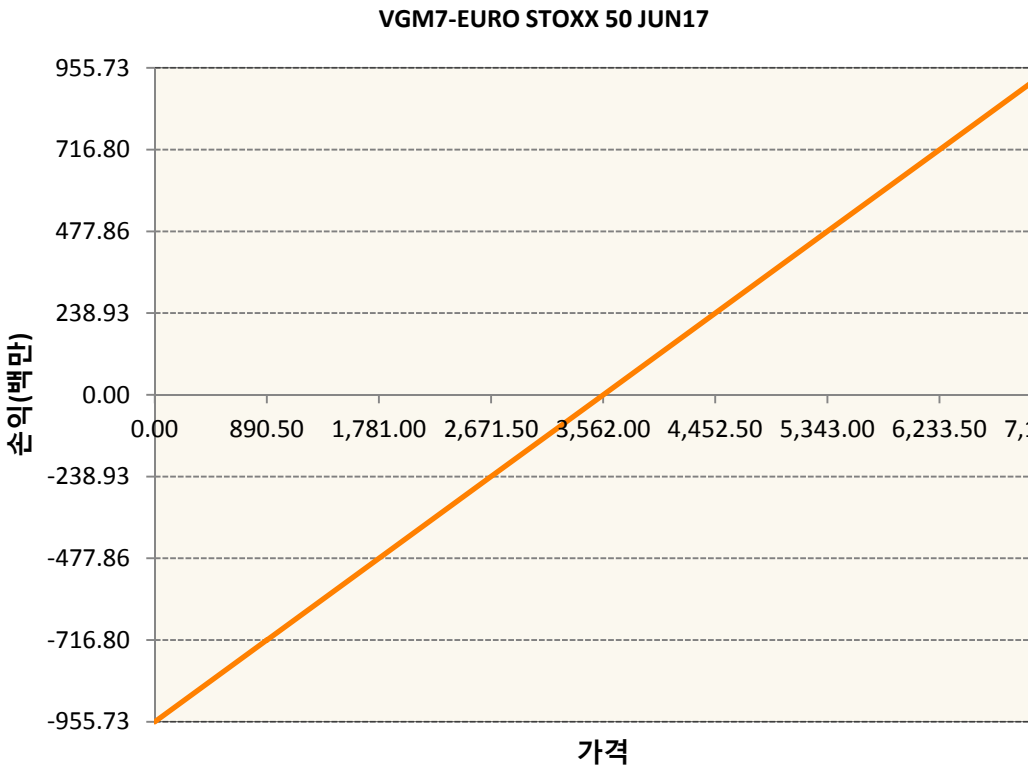
유로인덱스모(주식-파생형)

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)

73

공시일	2017-05-31
기준일	2017-05-30

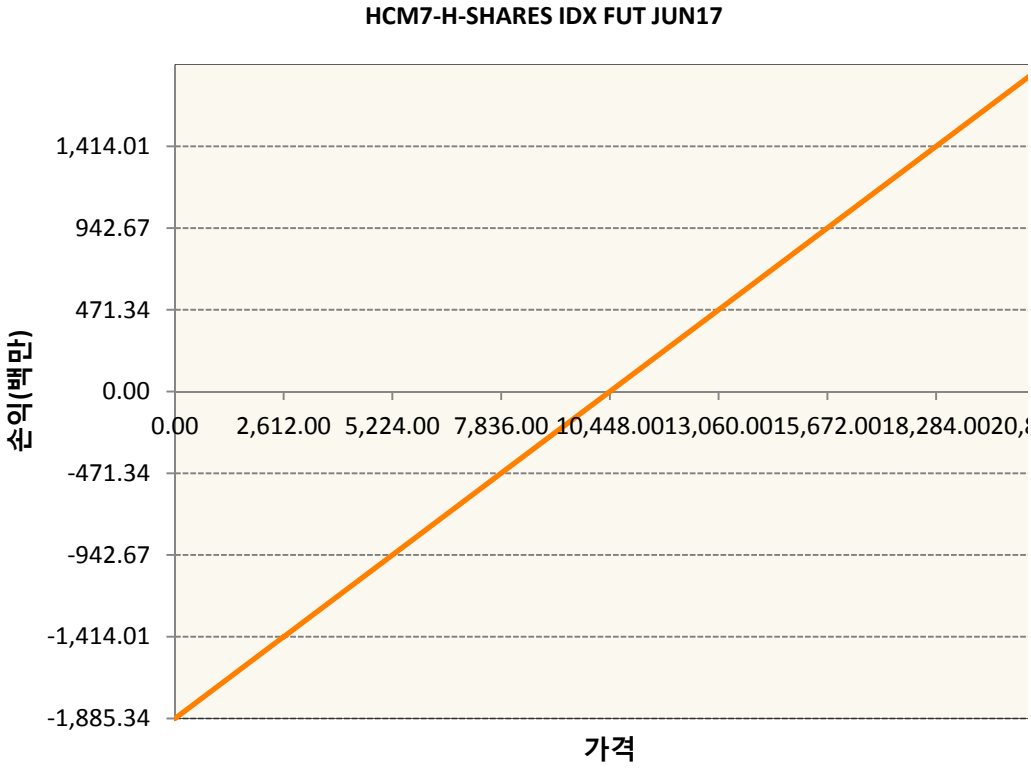
차이나인덱스모(주식-파생형)

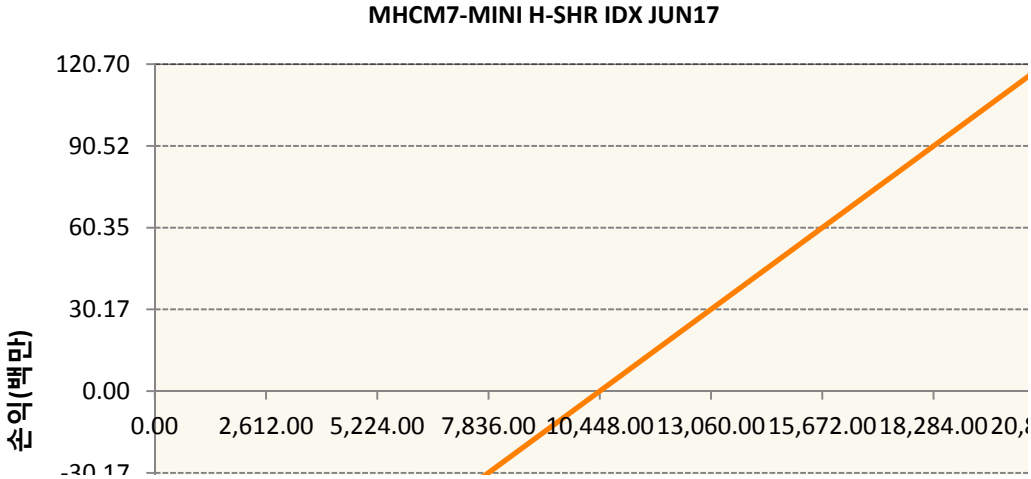
1. 계약금액

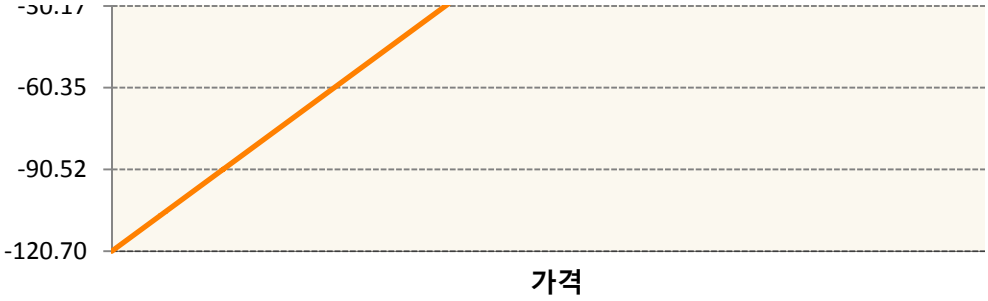
(단위:백만원)

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	2017-05-31
기준일	2017-05-30

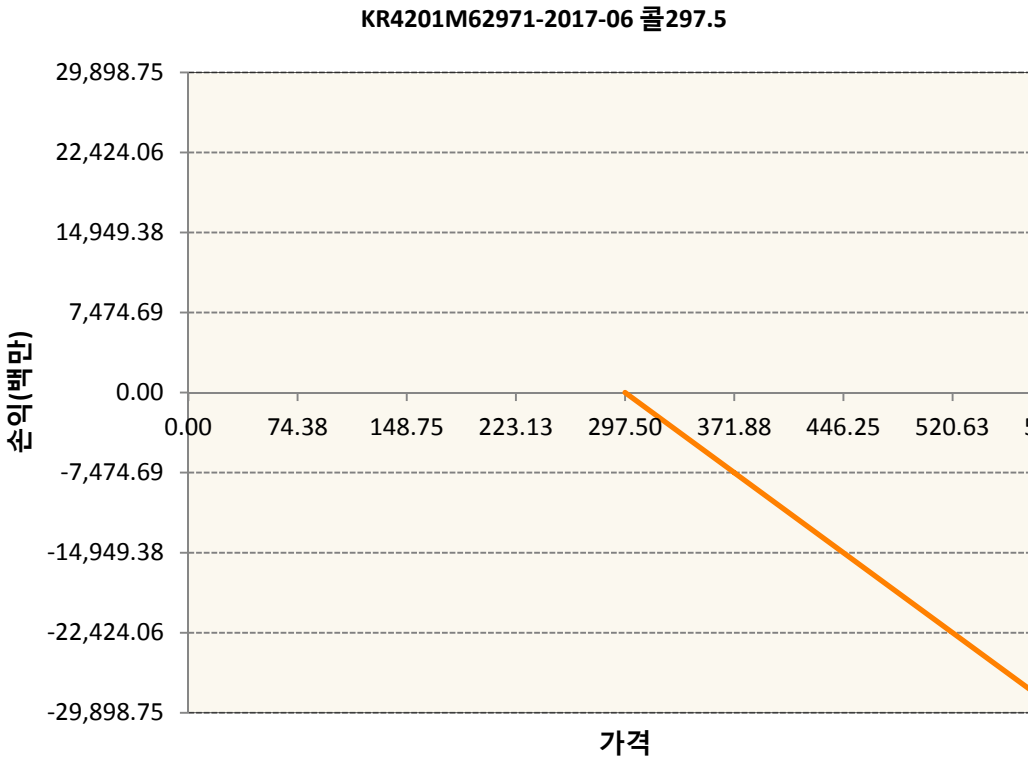
커버드콜모(주식혼합-파생형)

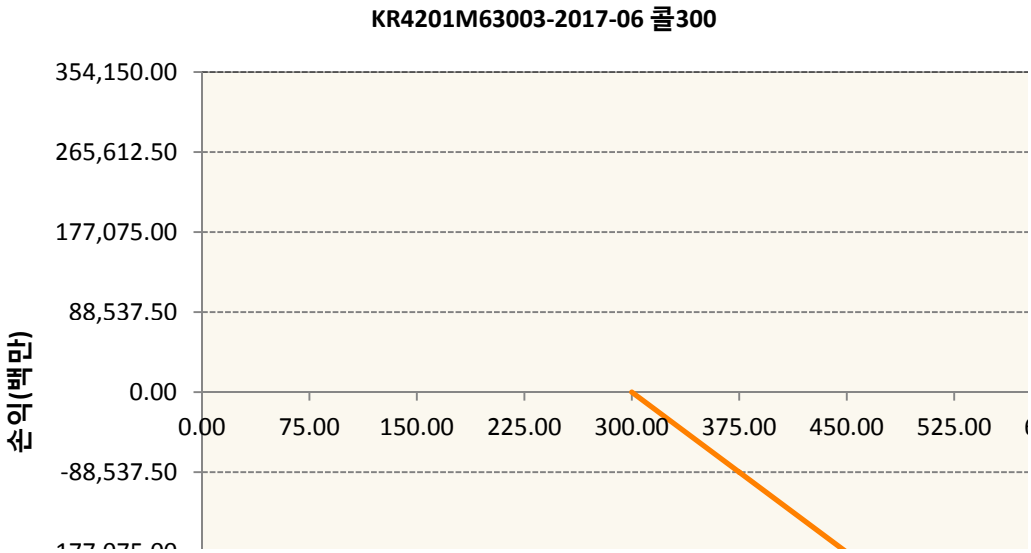
1. 계약금액

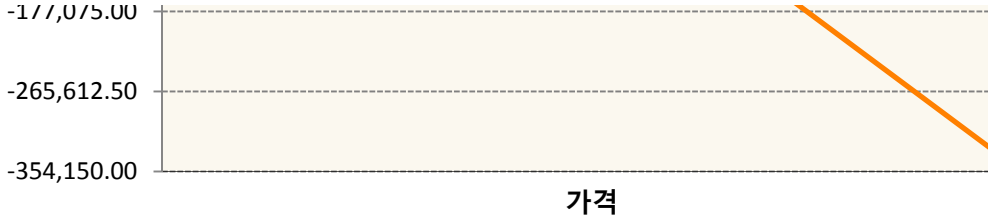
(단위:백만원)

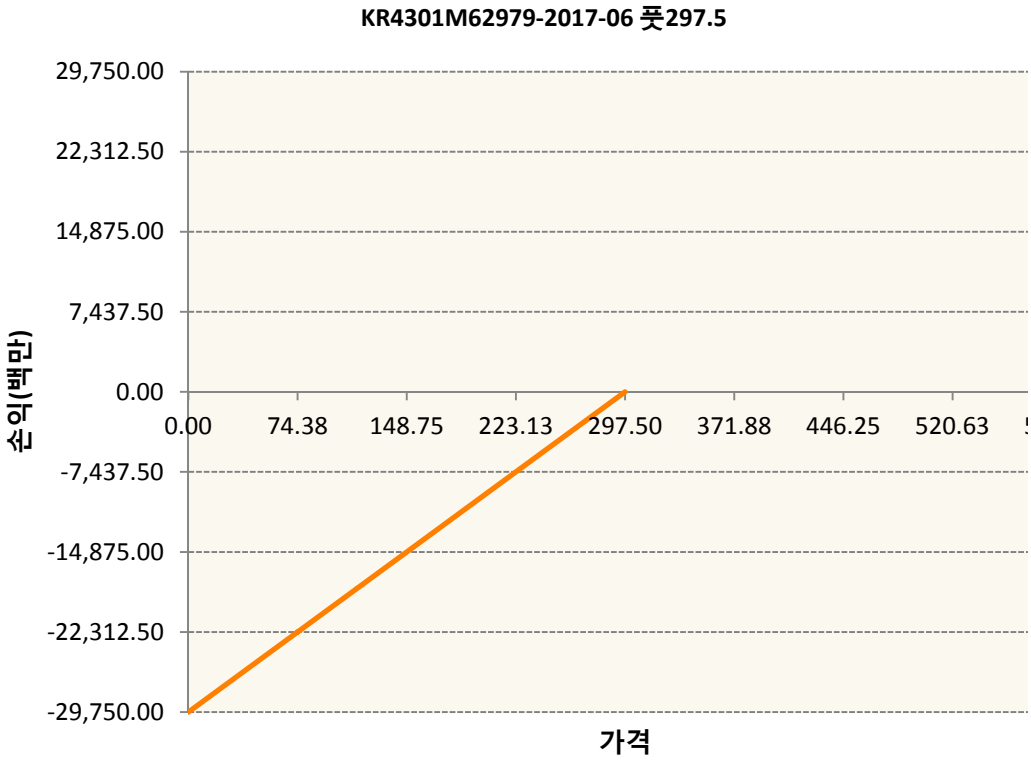
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	75,196	-75,196	장내
누계	유가증권	옵션	0	698,799	-698,799	장내

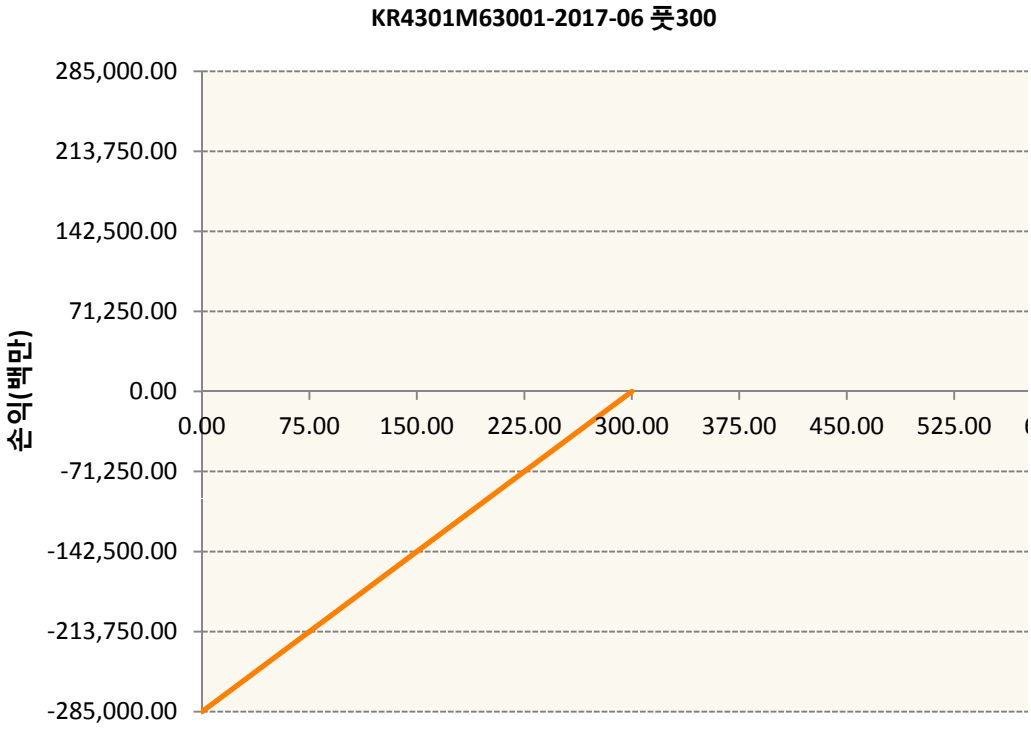
2. 만기시점의 손익구조






-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
285,000.00
213,750.00
142,500.00
71,250.00
0.00
-71,250.00
-142,500.00
-213,750.00
-285,000.00
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						2,400
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	759	759	759	759	758	757	755
-5.33%	754	750	744	737	729	719	708
-2.67%	611	590	569	547	526	504	483
0%	31	22	12	0	-13	-27	-42
2.67%	-768	-769	-769	-771	-773	-776	-779
5.33%	-1,584	-1,584	-1,584	-1,584	-1,584	-1,584	-1,585
8.00%	-2,400	-2,400	-2,400	-2,400	-2,400	-2,400	-2,400
KR4201M63(	2017-06 콜300						27,621
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,539	6,539	6,538	6,537	6,534	6,528	6,519
-5.33%	6,524	6,505	6,475	6,433	6,377	6,307	6,225
-2.67%	5,743	5,540	5,328	5,110	4,886	4,658	4,426
0%	568	391	200	0	-209	-424	-644
2.67%	-8,461	-8,477	-8,502	-8,540	-8,591	-8,655	-8,732
5.33%	-18,035	-18,035	-18,036	-18,038	-18,041	-18,048	-18,059
8.00%	-27,620	-27,620	-27,620	-27,620	-27,620	-27,620	-27,621
KR4301M62(	2017-06 풋297.5						1,684
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,680	-1,680	-1,681	-1,681	-1,682	-1,683	-1,684
-5.33%	-874	-878	-883	-891	-899	-908	-919
-2.67%	-203	-225	-246	-267	-289	-310	-332
0%	31	22	12	0	-13	-27	-42
2.67%	48	47	46	45	43	40	36
5.33%	48	48	48	48	48	47	47
8.00%	48	48	48	48	48	48	48
KR4301M63(	2017-06 풋300						17,893
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-17,878	-17,878	-17,878	-17,879	-17,882	-17,886	-17,893
-5.33%	-10,176	-10,191	-10,216	-10,250	-10,295	-10,351	-10,417
-2.67%	-3,092	-3,255	-3,425	-3,601	-3,781	-3,965	-4,152
0%	457	314	161	0	-168	-341	-519
2.67%	904	892	871	841	800	748	686

5.33%	913	913	912	911	908	903	894
8.00%	913	913	913	913	913	913	912

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

58,969

공시일	2017-05-31
기준일	2017-05-30

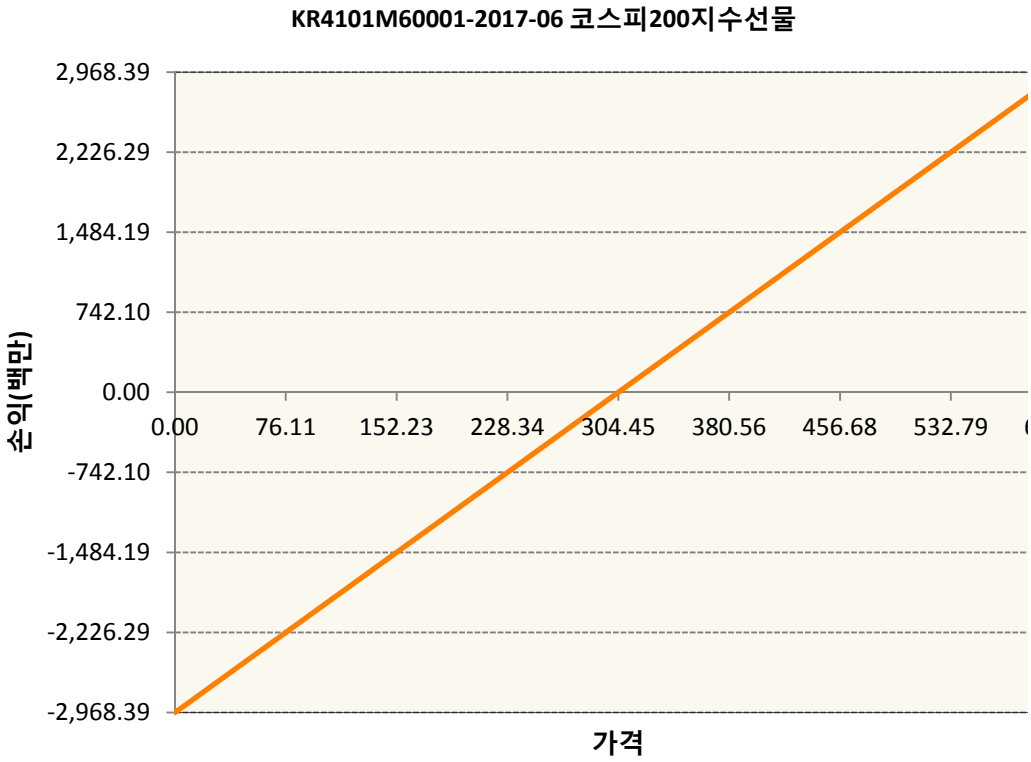
커버드콜목표전환형증권투자신탁

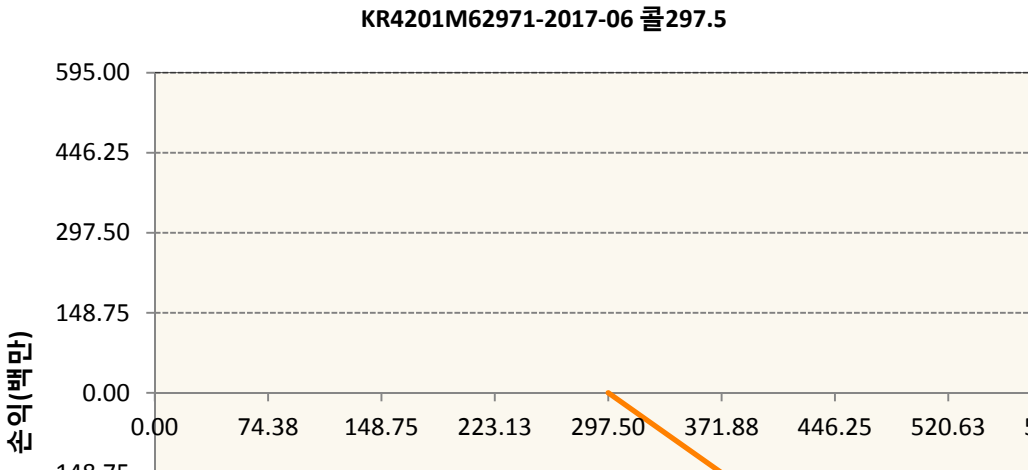
1. 계약금액

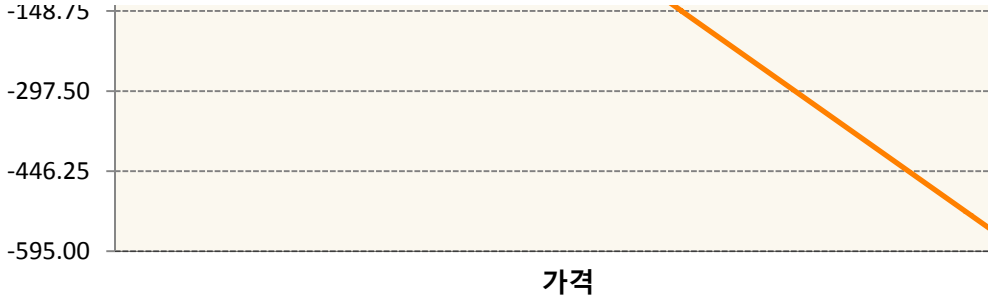
(단위:백만원)

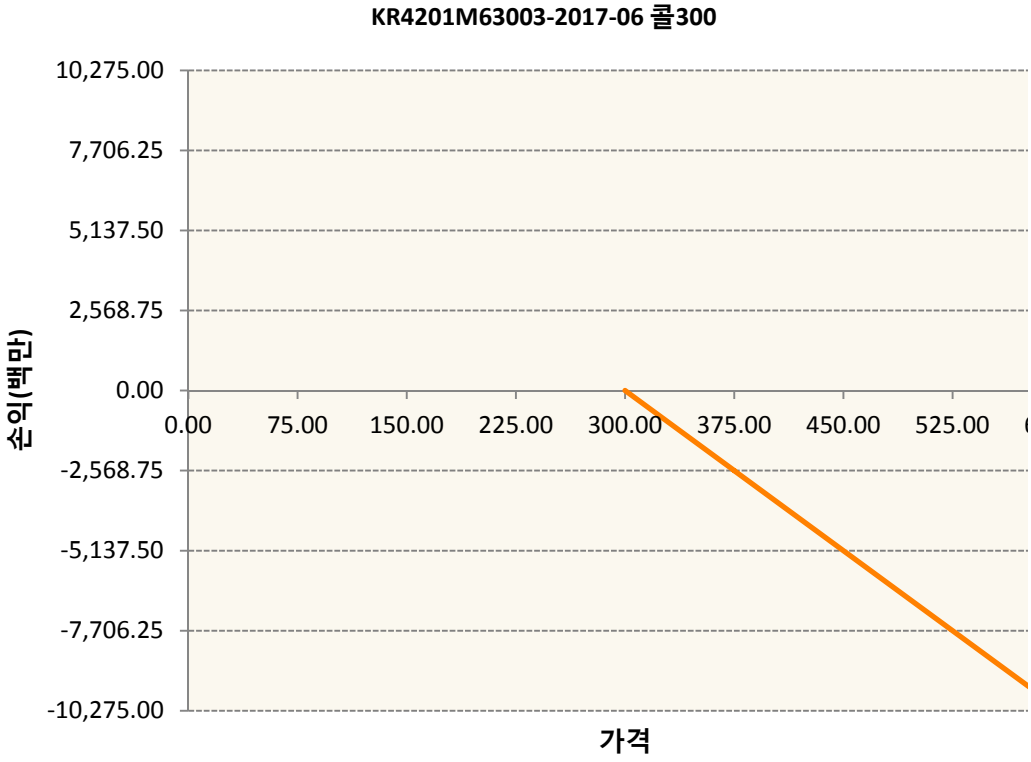
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,968	0	2,968	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,367	-12,367	장내

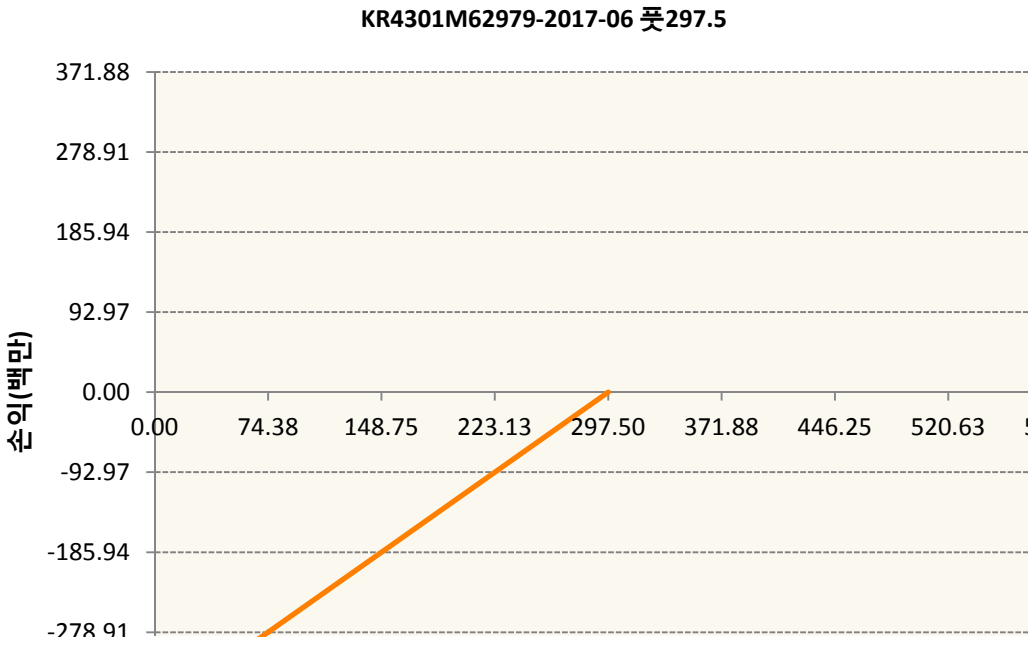
2. 만기시점의 손익구조



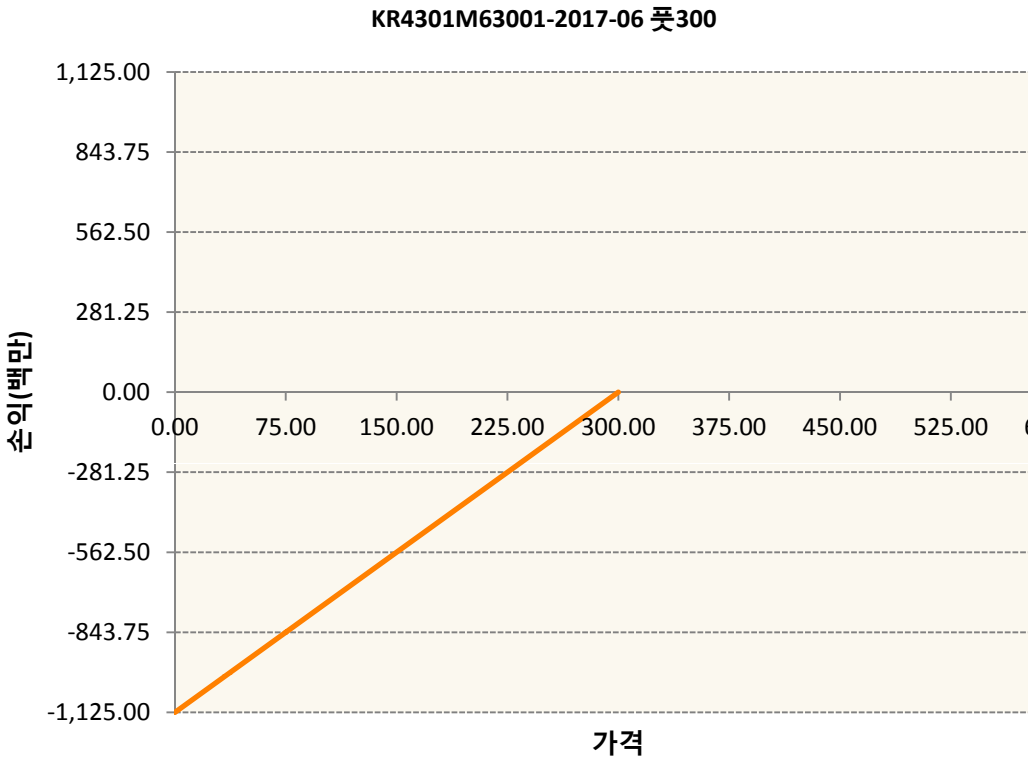



-148.75
-297.50
-446.25
-595.00
가격


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							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%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
-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%	158	158	158	158	158	158	158
8.00%	238	238	238	238	238	238	238
KR4201M62(2017-06 콜297.5							48
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15	15	15	15	15	15	15
-5.33%	15	15	15	15	14	14	14
-2.67%	12	12	11	11	10	10	10

0%	1	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-16
5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
	KR4201M63(	2017-06 콜300					801
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	190	190	190	190	190	189	189
-5.33%	189	189	188	187	185	183	181
-2.67%	167	161	155	148	142	135	128
0%	16	11	6	0	-6	-12	-19
2.67%	-245	-246	-247	-248	-249	-251	-253
5.33%	-523	-523	-523	-523	-523	-524	-524
8.00%	-801	-801	-801	-801	-801	-801	-801
	KR4301M62(	2017-06 풋297.5					21
	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%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-4	-4	-4
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	1	1	1	1	1	1	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1
	KR4301M63(	2017-06 풋300					71
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71
-5.33%	-40	-40	-40	-40	-41	-41	-41
-2.67%	-12	-13	-14	-14	-15	-16	-16
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	4	4	3	3	3	3	3
5.33%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

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

1,336

공시일	2017-05-31
기준일	2017-05-30

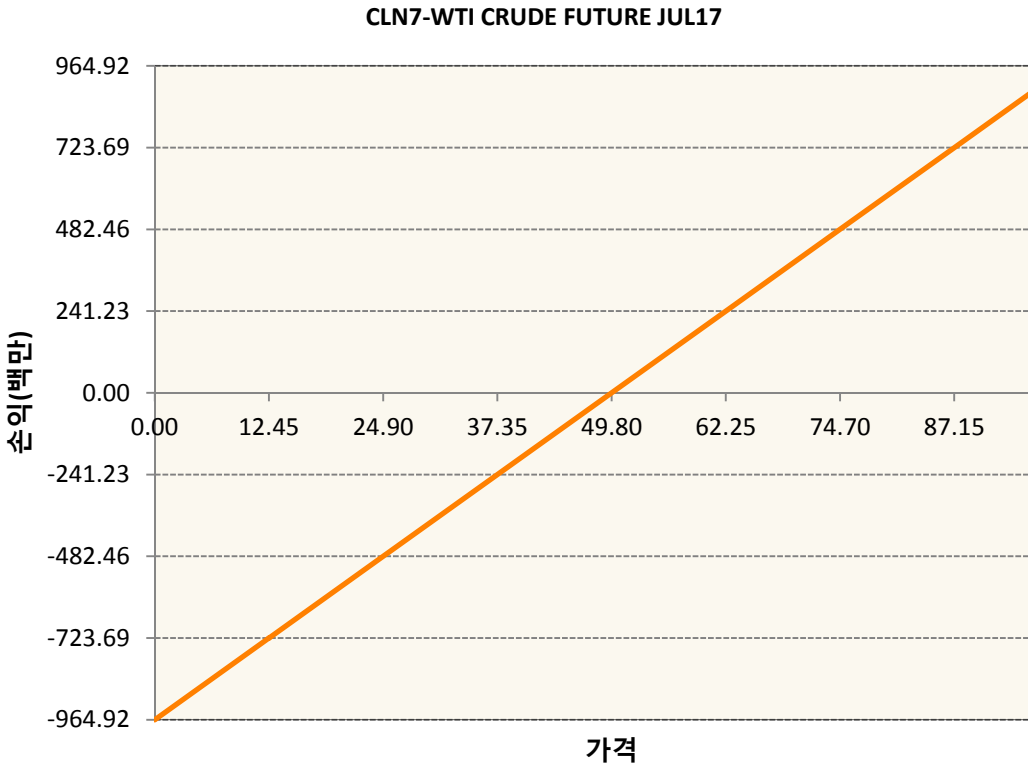
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

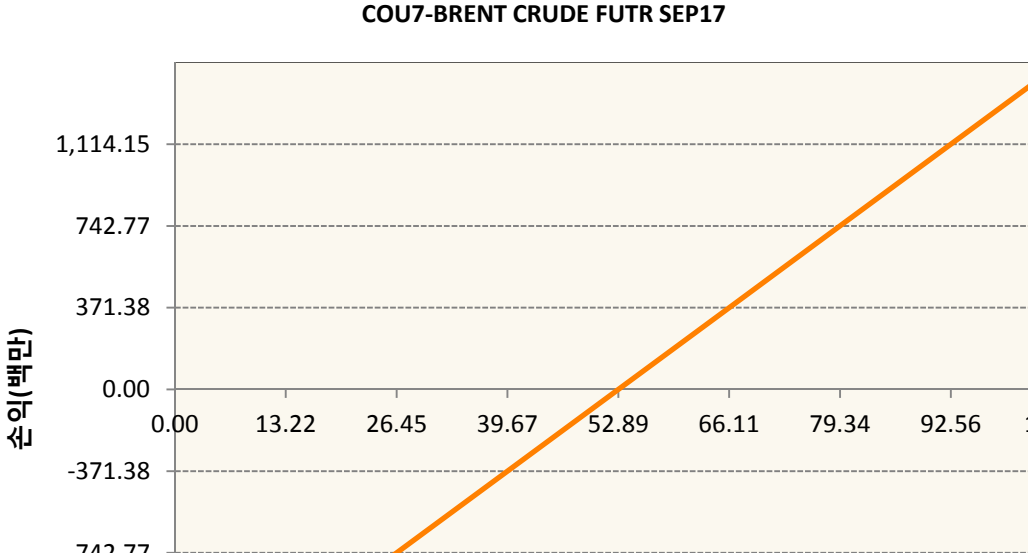
1. 계약금액

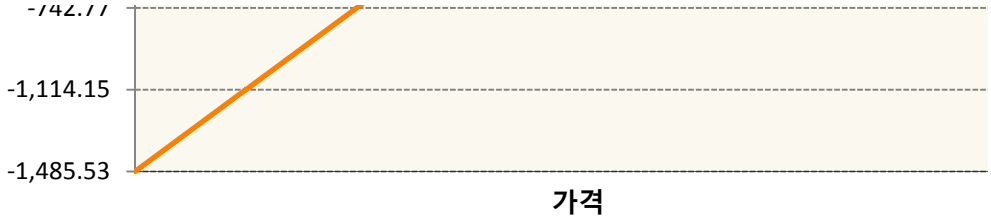
(단위:백만원)

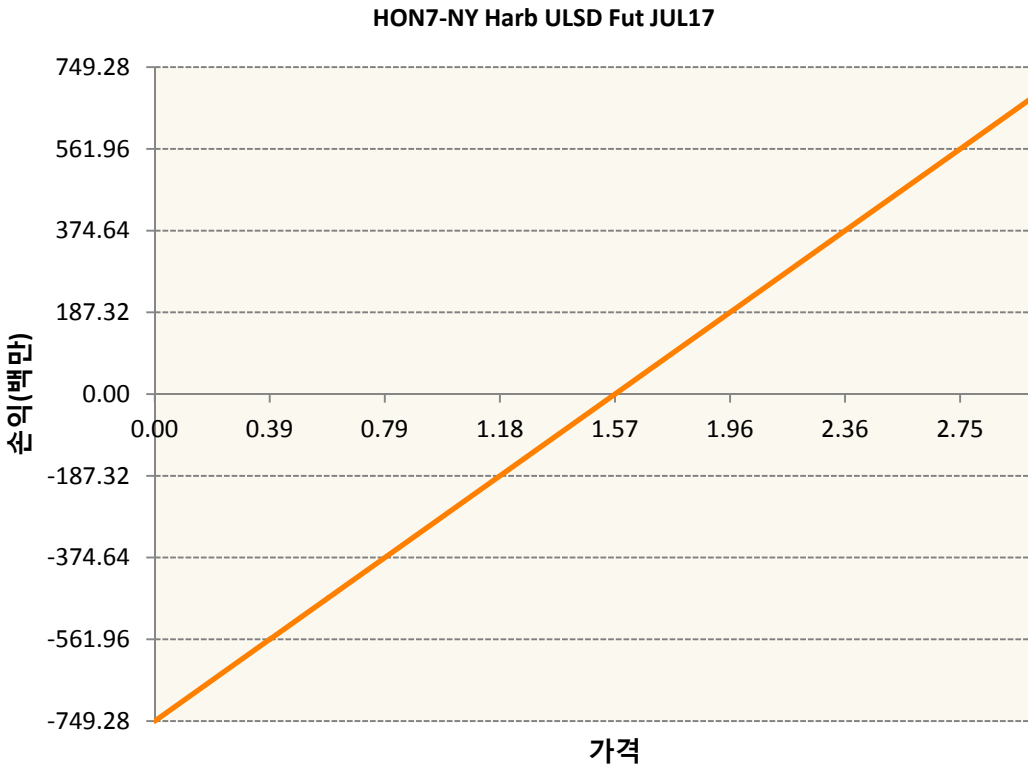
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,562	225	5,337	

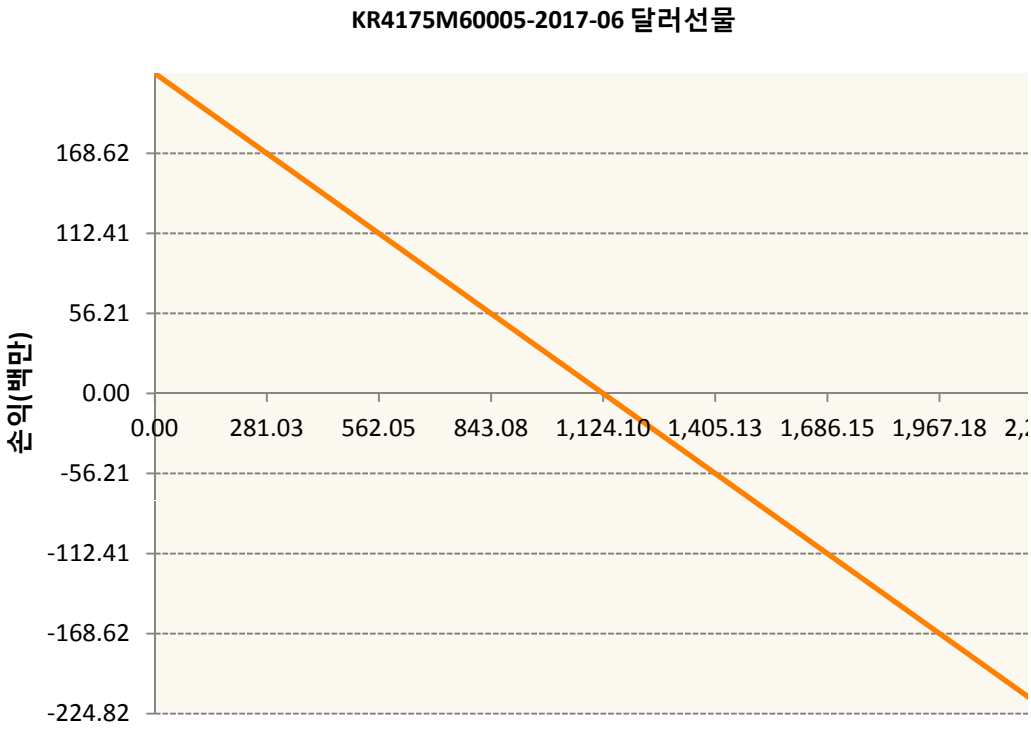
2. 만기시점의 손익구조



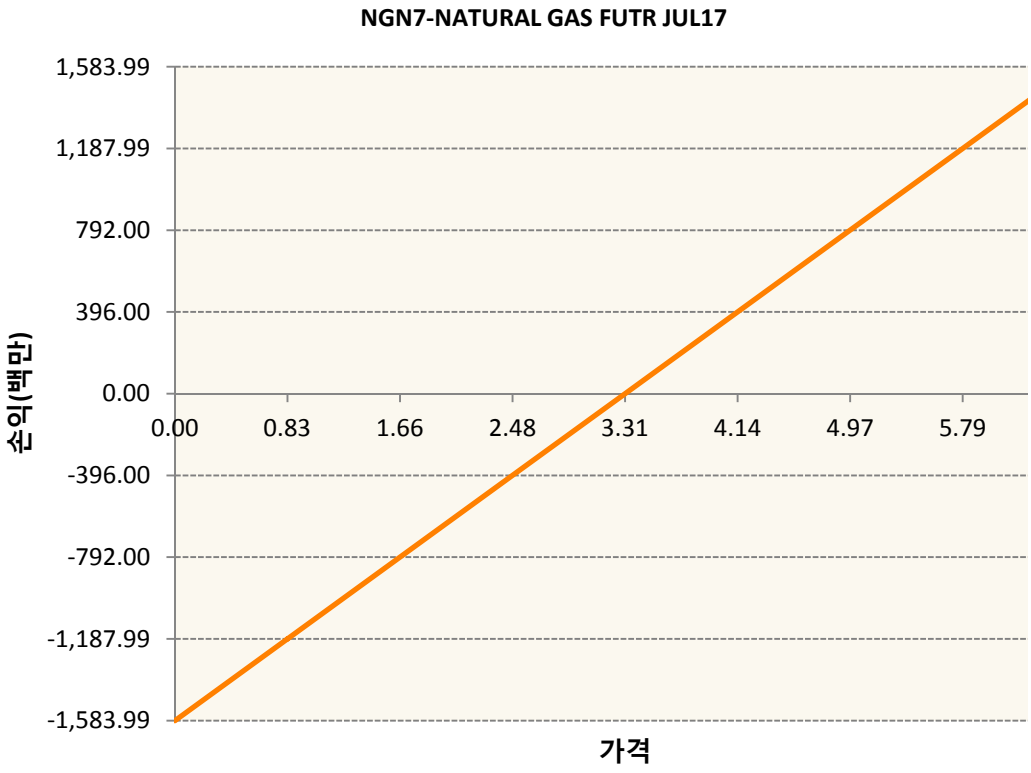


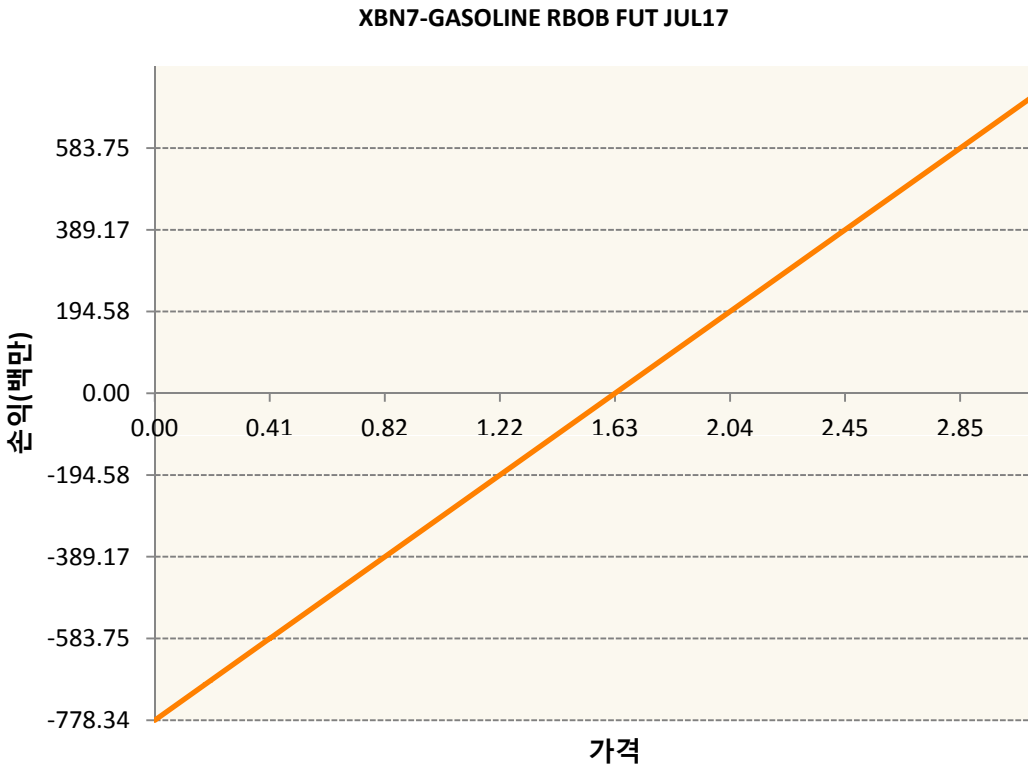

-1,114.15
-1,485.53
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
749.28
561.96
374.64
187.32
0.00
-187.32
-374.64
-561.96
-749.28
0.00
0.39
0.79
1.18
1.57
1.96
2.36
2.75
순이익(백만)
가격


KR4175M60005-2017-06 달러선물
168.62
112.41
56.21
0.00
-56.21
-112.41
-168.62
-224.82
0.00
281.03
562.05
843.08
1,124.10
1,405.13
1,686.15
1,967.18
순이익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,583.99
1,187.99
792.00
396.00
0.00
-396.00
-792.00
-1,187.99
-1,583.99
0.00
0.83
1.66
2.48
3.31
4.14
4.97
5.79
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
583.75
389.17
194.58
0.00
-194.58
-389.17
-583.75
-778.34
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)

923

공시일	2017-05-31
기준일	2017-05-30

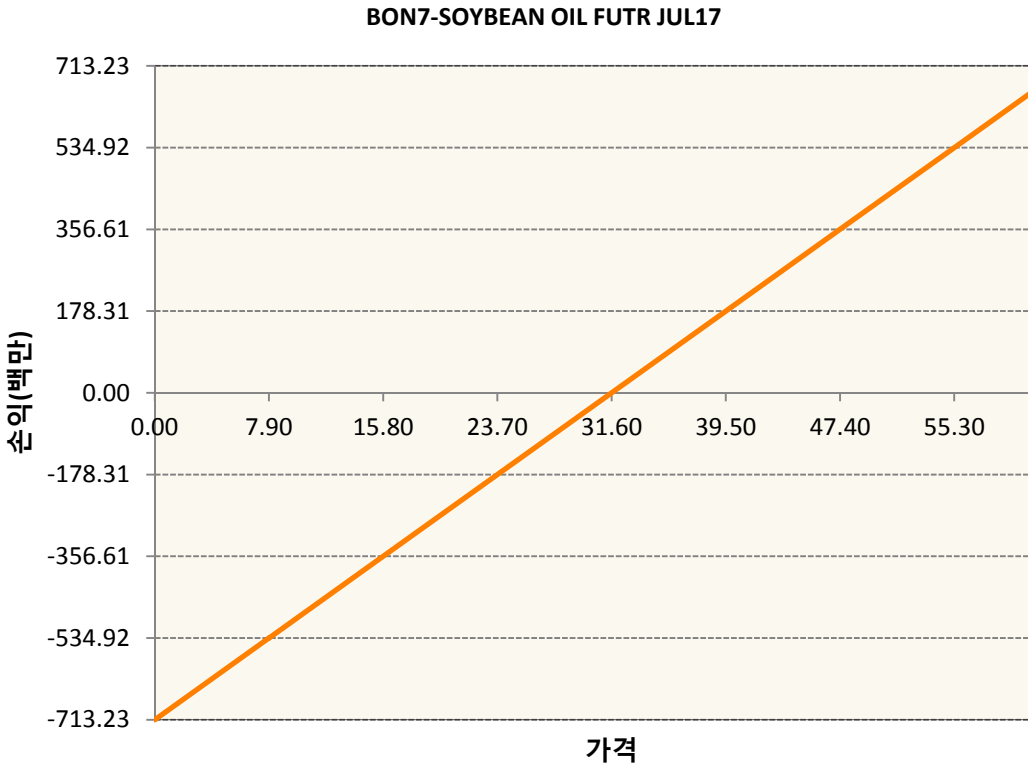
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

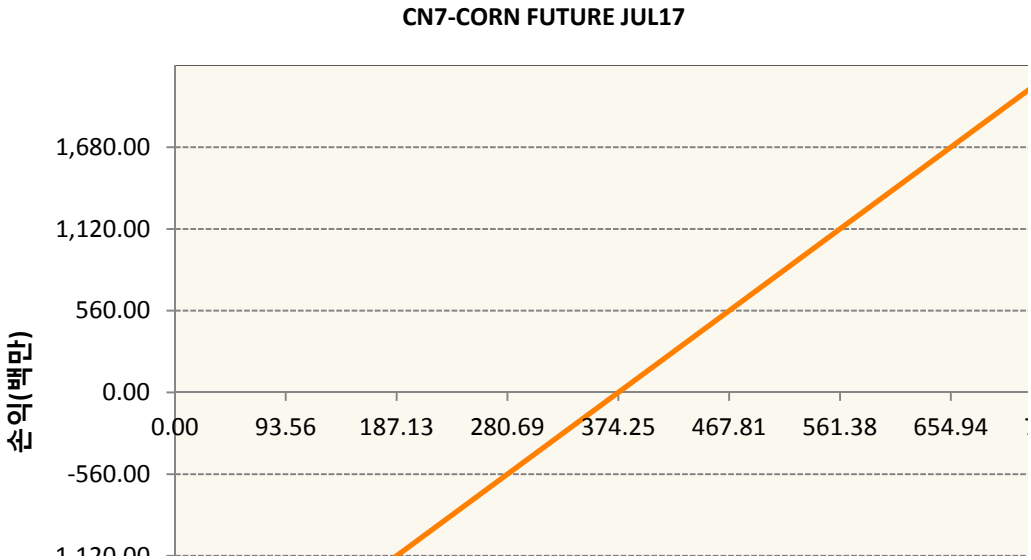
1. 계약금액

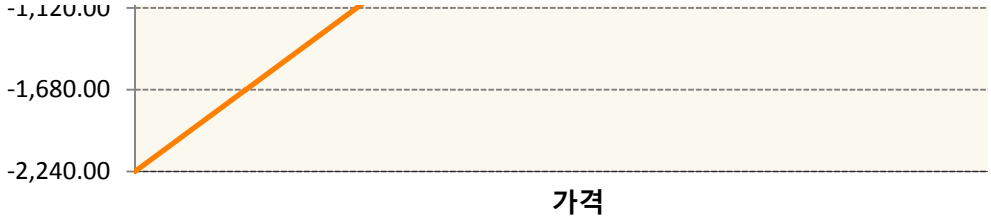
(단위:백만원)

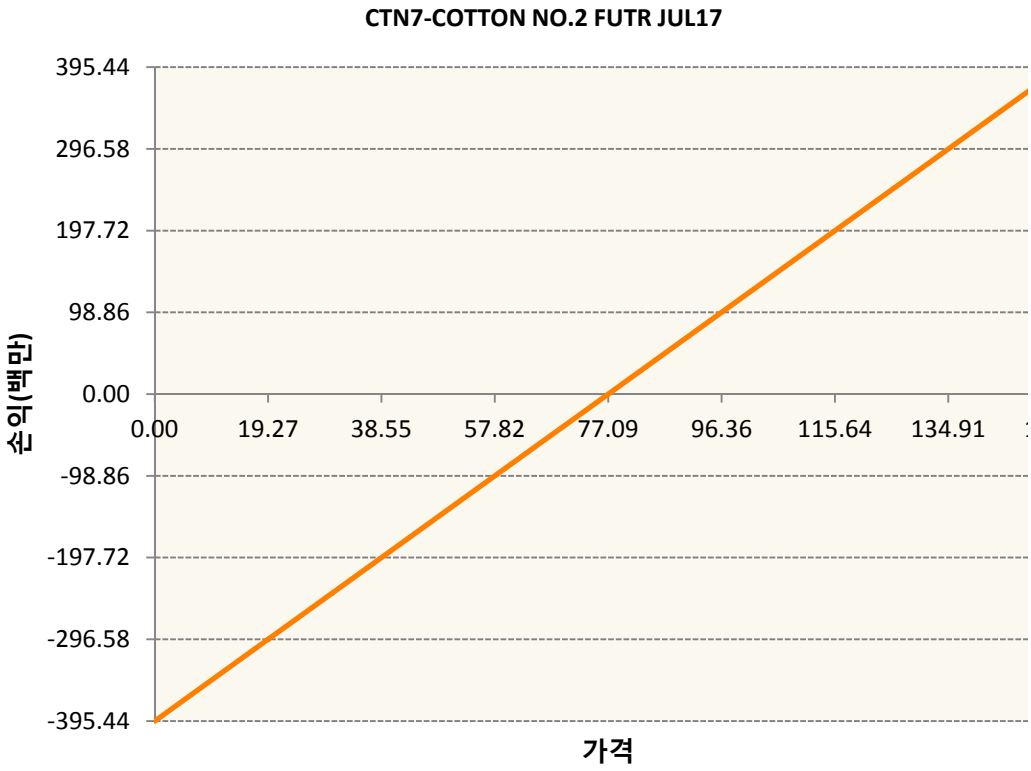
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,335	393	7,941	

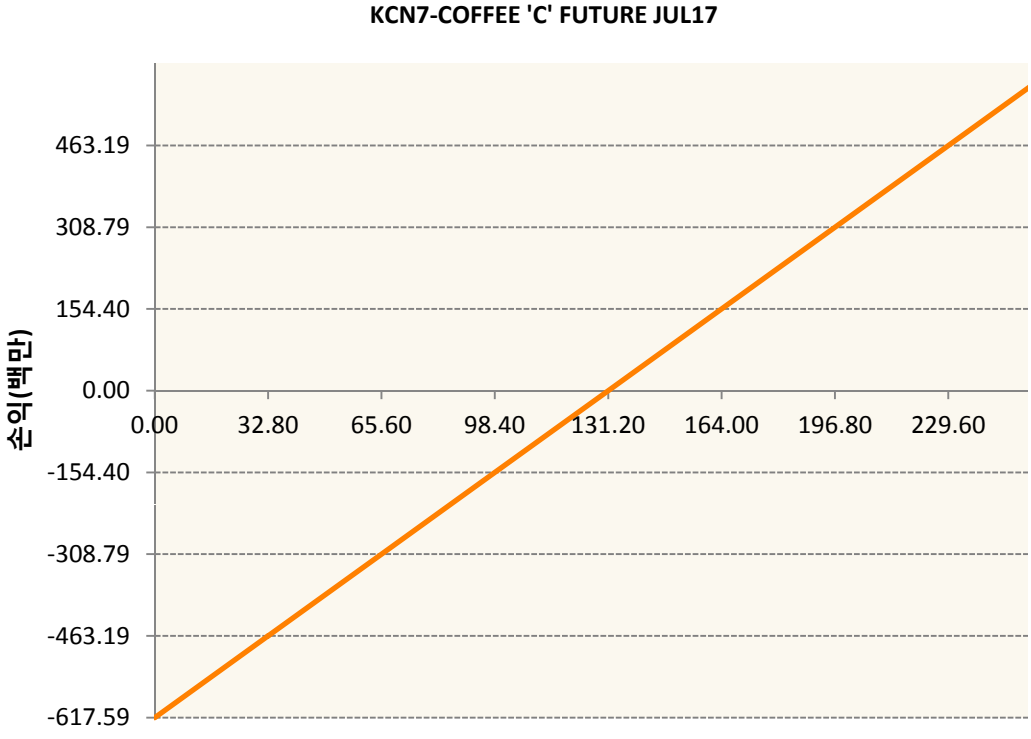
2. 만기시점의 손익구조





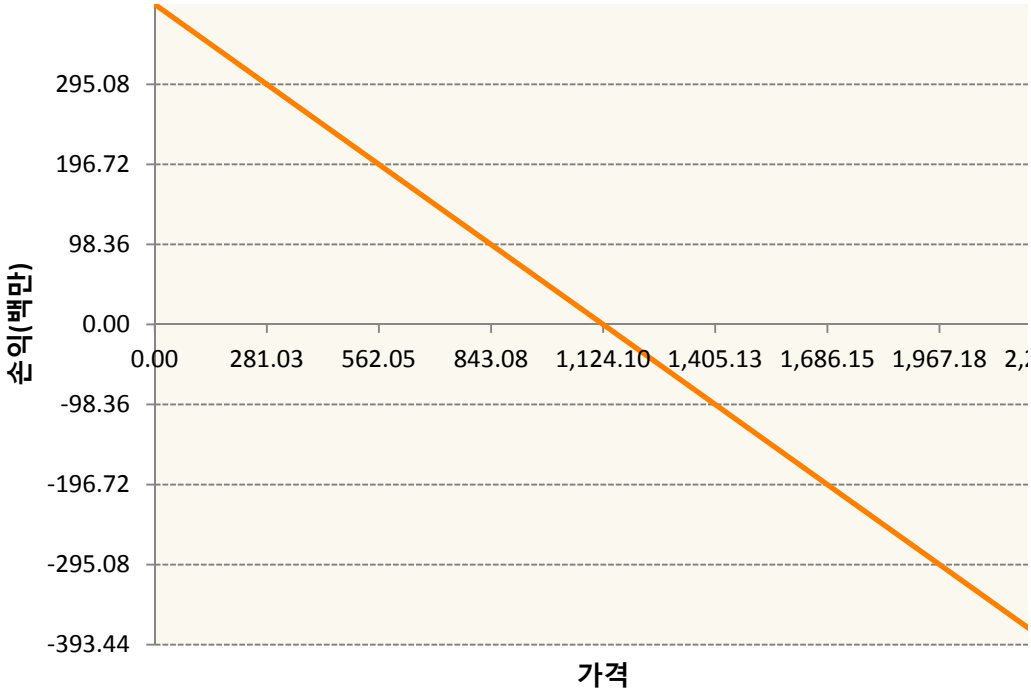

-1,120.00
-1,680.00
-2,240.00
가격


CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
395.44
296.58
197.72
98.86
0.00
-98.86
-197.72
-296.58
-395.44
0.00
19.27
38.55
57.82
77.09
96.36
115.64
134.91
순익(백만)
가격

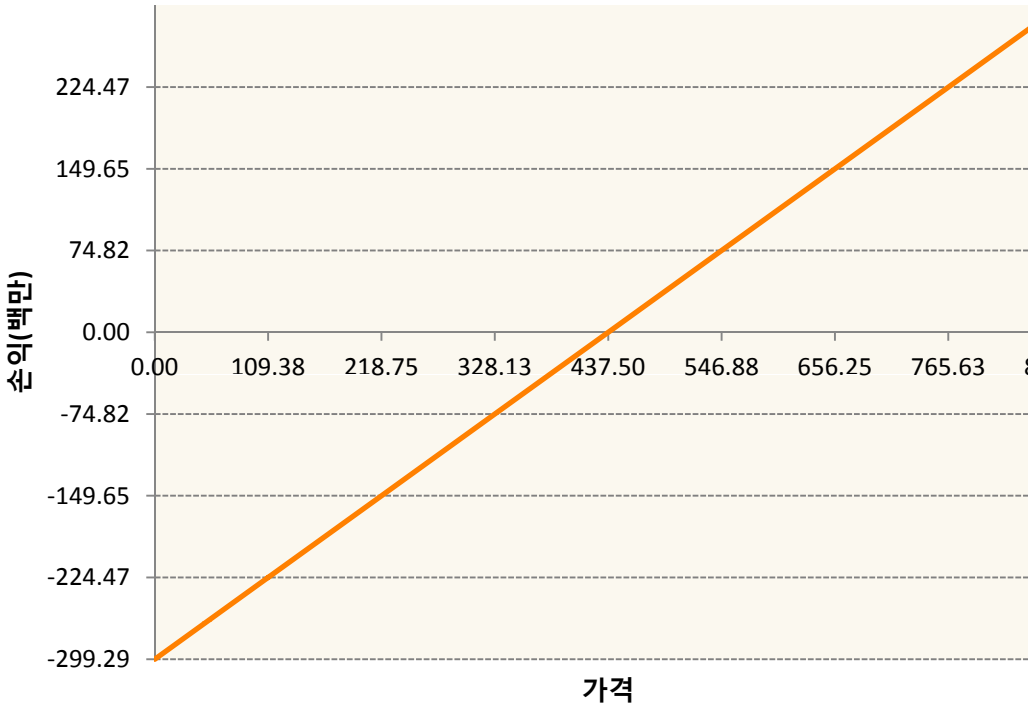

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
463.19
308.79
154.40
0.00
-154.40
-308.79
-463.19
-617.59
0.00
32.80
65.60
98.40
131.20
164.00
196.80
229.60
순익(백만)

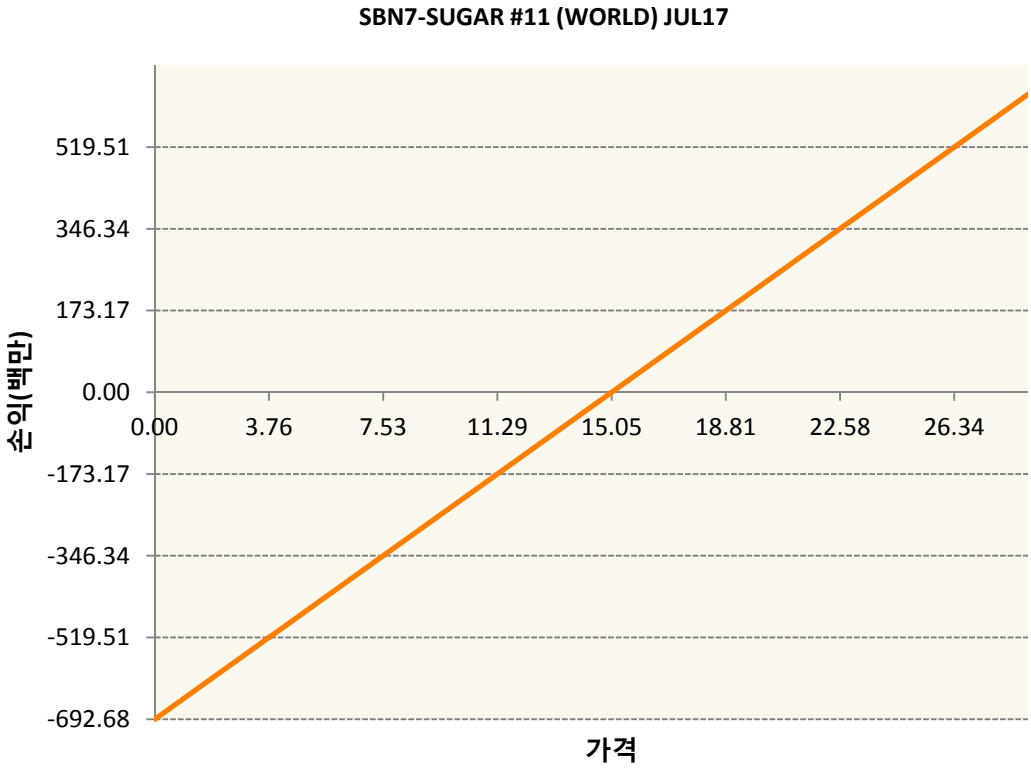
가격

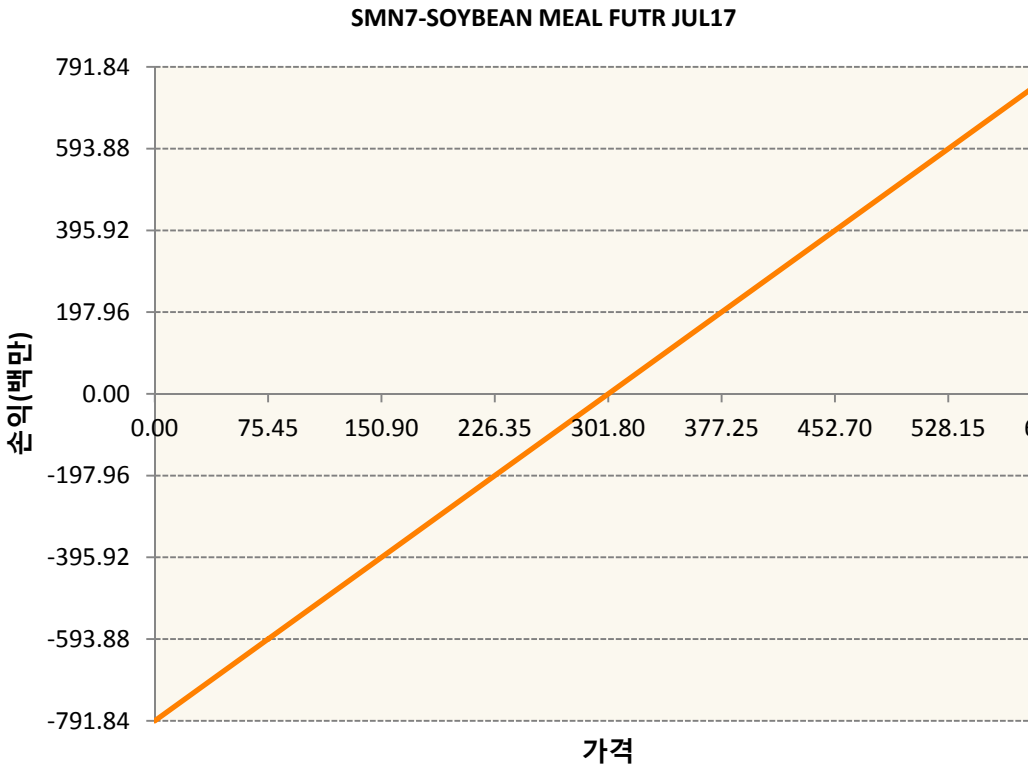
KR4175M60005-2017-06 달러선물

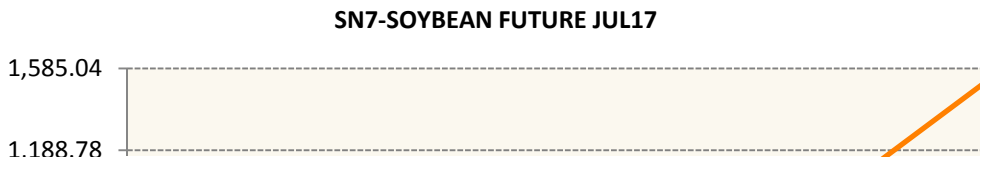


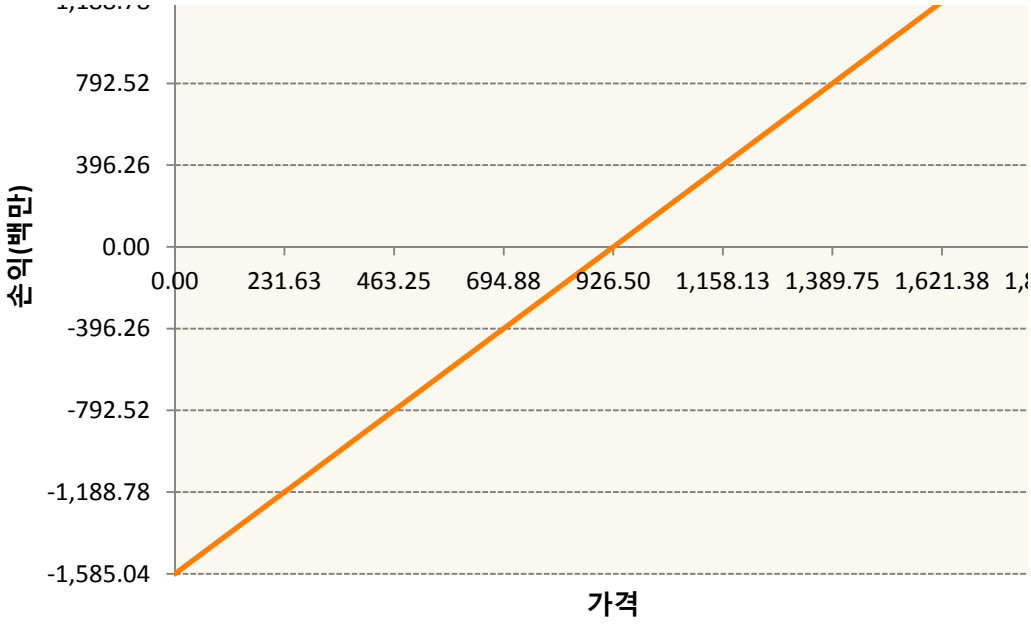
KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17

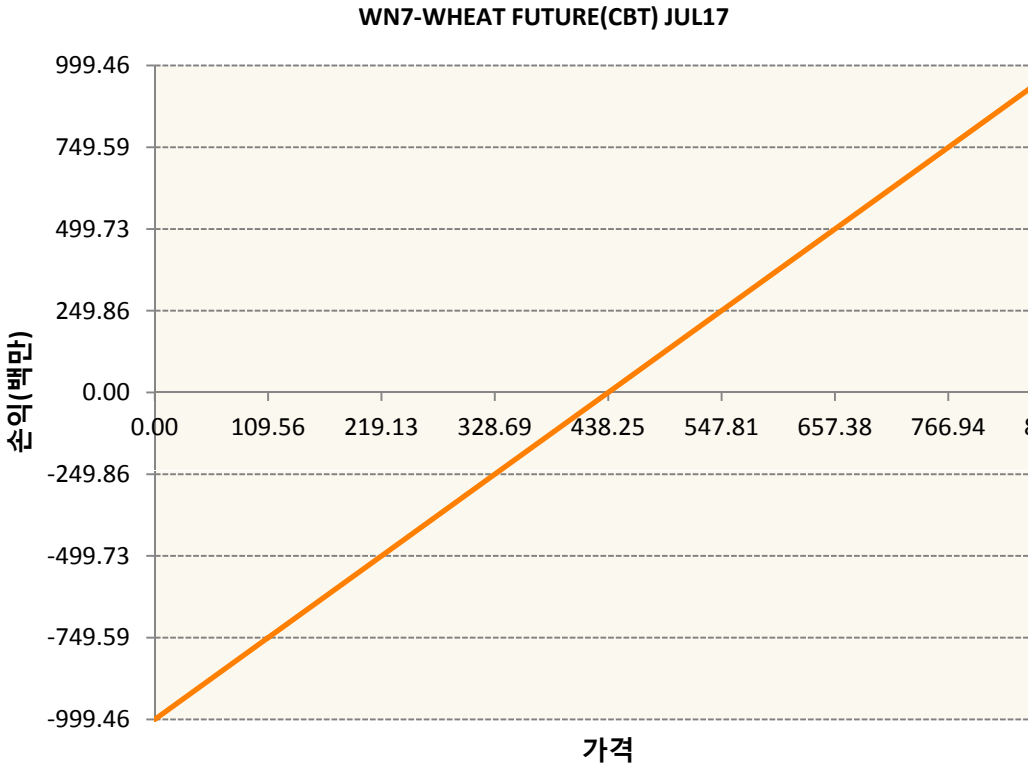



SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
519.51
346.34
173.17
0.00
-173.17
-346.34
-519.51
-692.68
손익(백만)
0.00
3.76
7.53
11.29
15.05
18.81
22.58
26.34
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
791.84
593.88
395.92
197.96
0.00
-197.96
-395.92
-593.88
-791.84
손익(백만)
0.00
75.45
150.90
226.35
301.80
377.25
452.70
528.15
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,585.04
1,188.78





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