| 공시일 | 2017-06-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2017-05-31 |

# 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 | 2017-06-01 |
| 기준일 | 2017-05-31 |

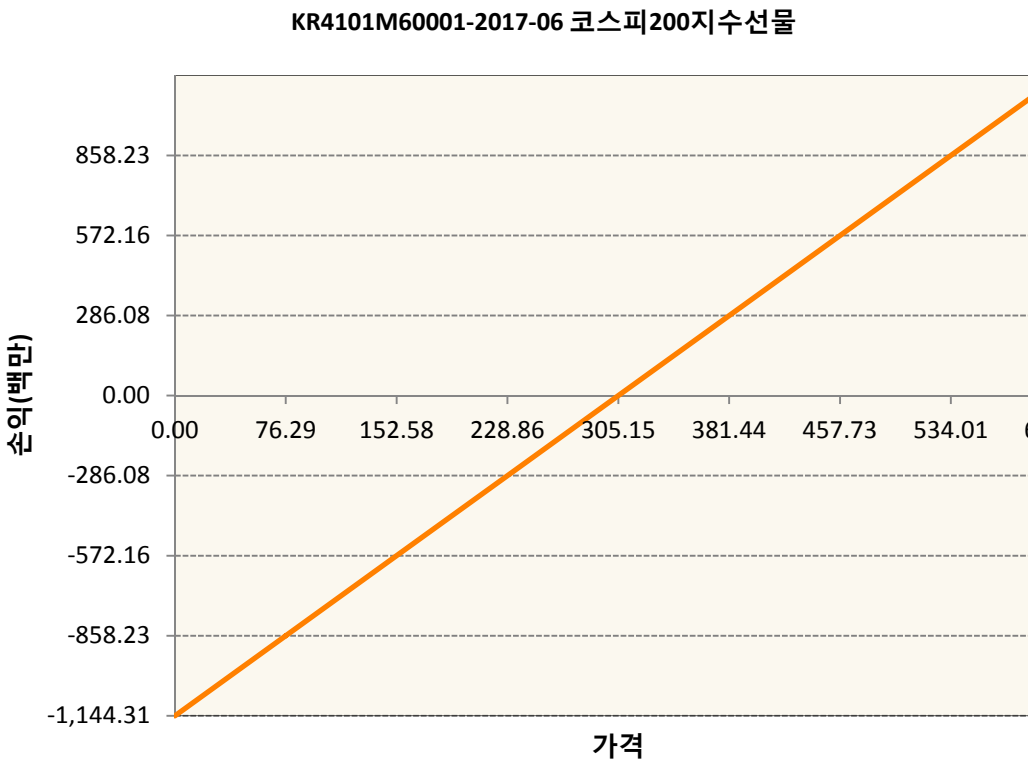
# 스마트인덱스모

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 153 | 0 | 153 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,144 | 0 | 1,144 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101M60( 2017-06 코스피200지수선물 | | | | | | | 91 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -91 | -91 | -91 | -91 | -91 | -91 | -91 |
| -5.33% | -61 | -61 | -61 | -61 | -61 | -61 | -61 |
| -2.67% | -30 | -30 | -30 | -30 | -30 | -30 | -30 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 |
| 5.33% | 61 | 61 | 61 | 61 | 61 | 61 | 61 |
| 8.00% | 91 | 91 | 91 | 91 | 91 | 91 | 91 |

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

| 60 |
|---|

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-06-01 |
| 기준일 | 2017-05-31 |

# 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 | 992 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **536** |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| 공시일 | 2017-06-01 |
|---|---|
| 기준일 | 2017-05-31 |

# 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 | 2017-06-01 |
| 기준일 | 2017-05-31 |

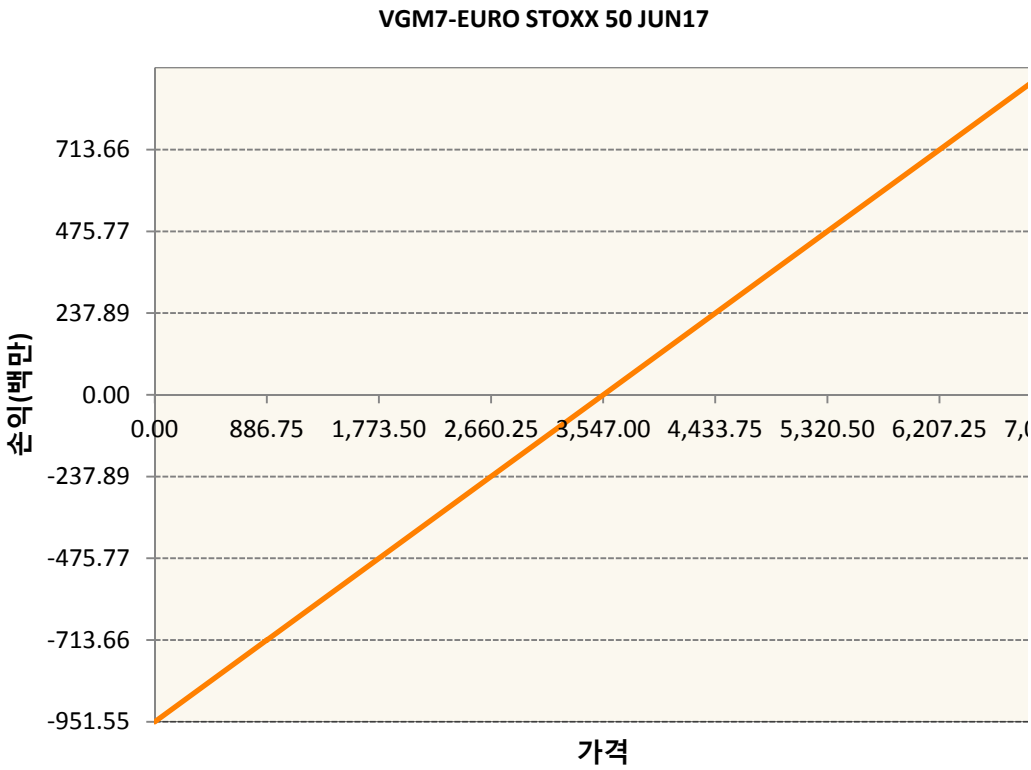
# 유로인덱스모(주식-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 952 | 0 | 952 | |

## 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 | 2017-06-01 |
| 기준일 | 2017-05-31 |

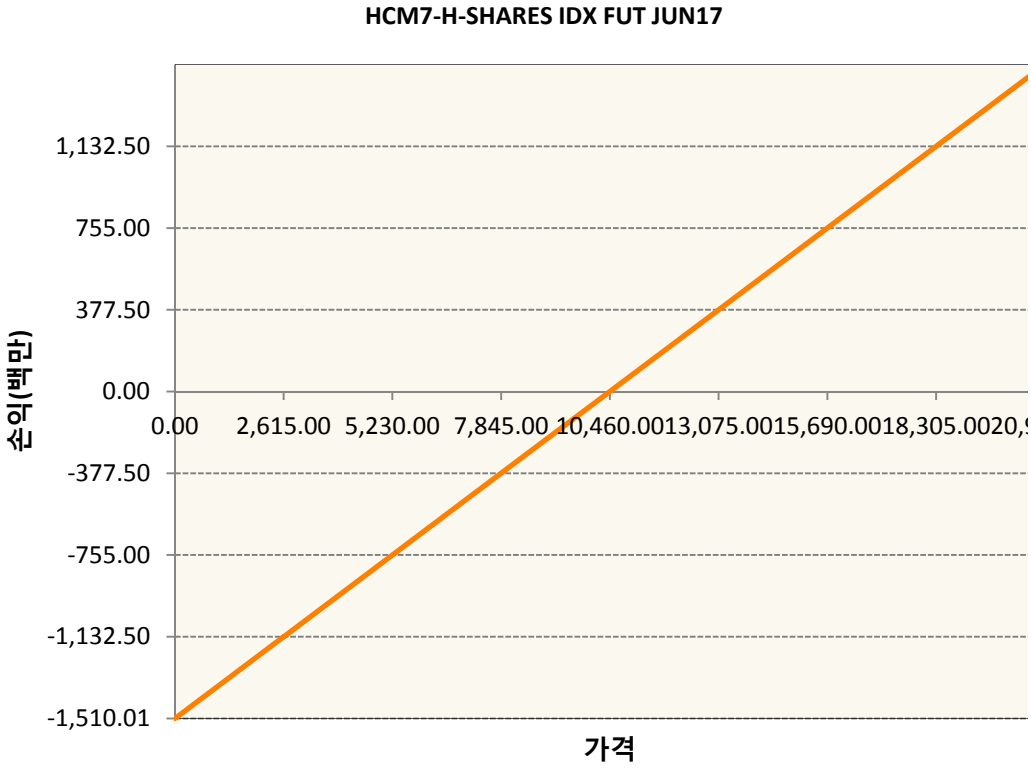
# 차이나인덱스모(주식-파생형)

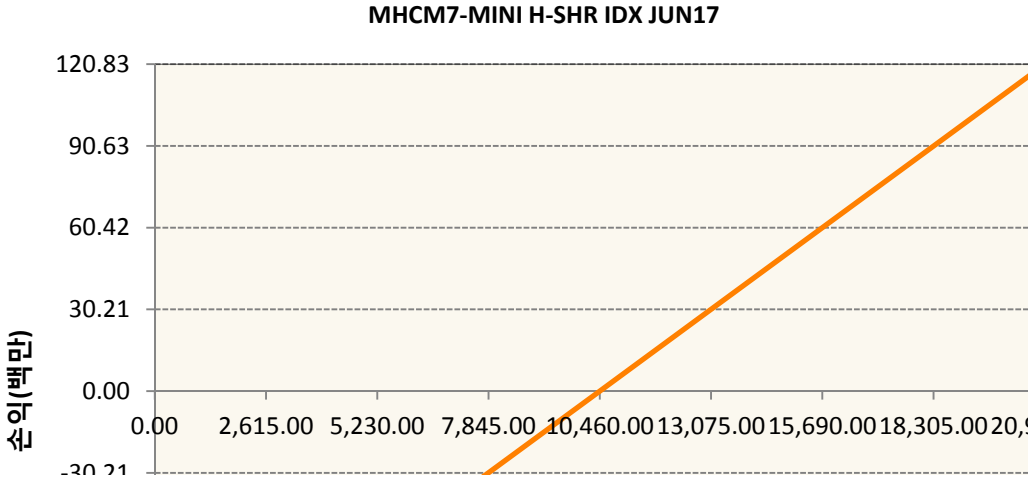
## 1. 계약금액

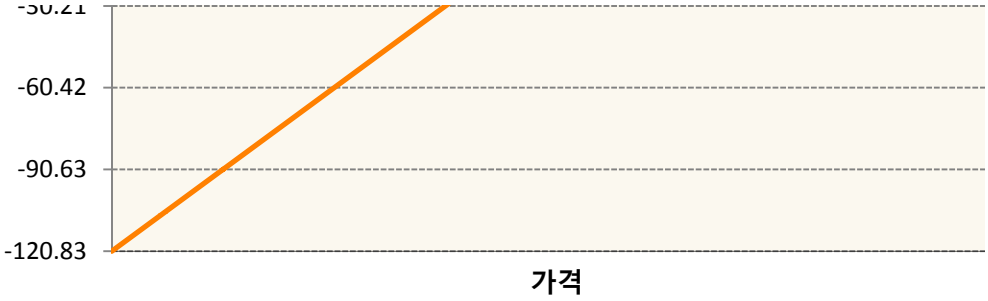
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | | | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | | | 1,510 | 0 | 1,510 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 121 | 0 | 121 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조






| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---|---|
| HCM7 | H-SHARES IDX FUT JUN17 | 121 |
| MHCM7 | MINI H-SHR IDX JUN17 | 10 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|---|---|
| | **93** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-06-01 |
| 기준일 | 2017-05-31 |

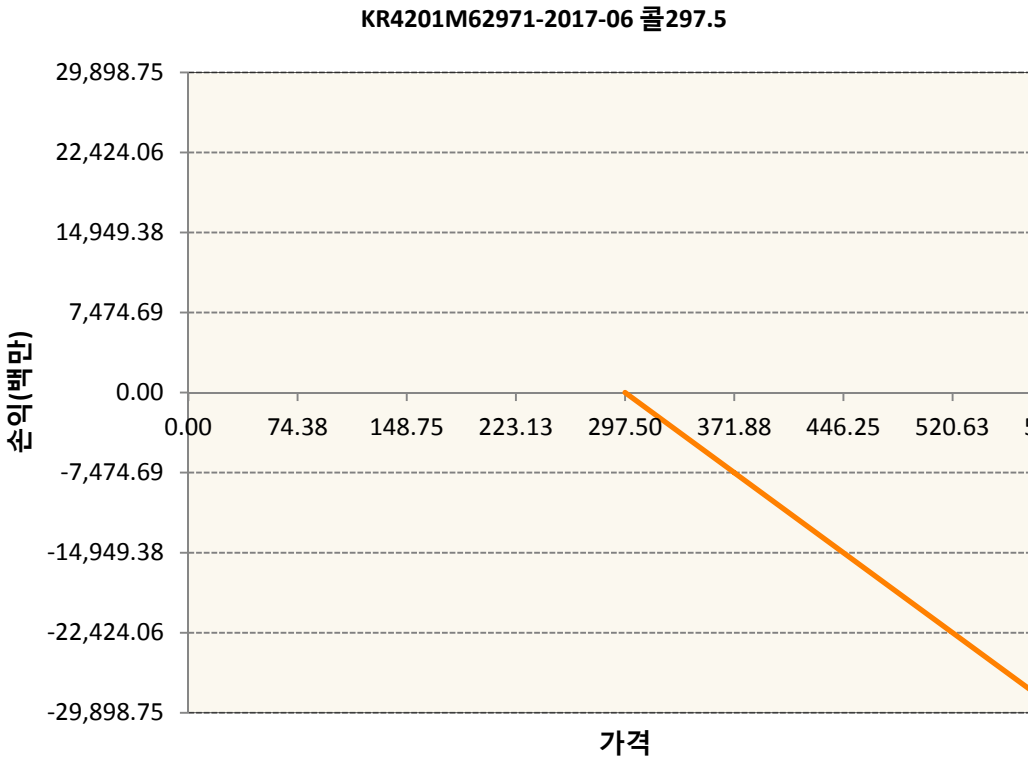
# 커버드콜모(주식혼합-파생형)

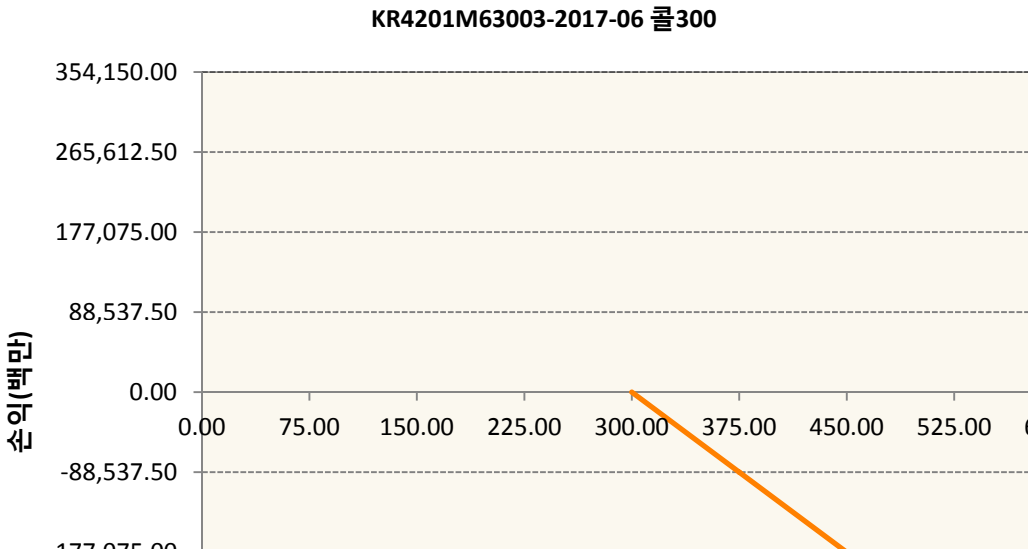
## 1. 계약금액

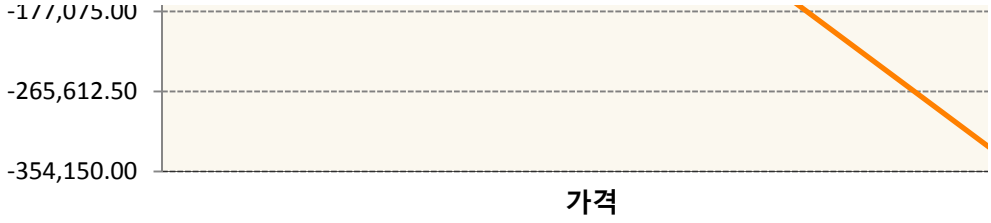
(단위:백만원)

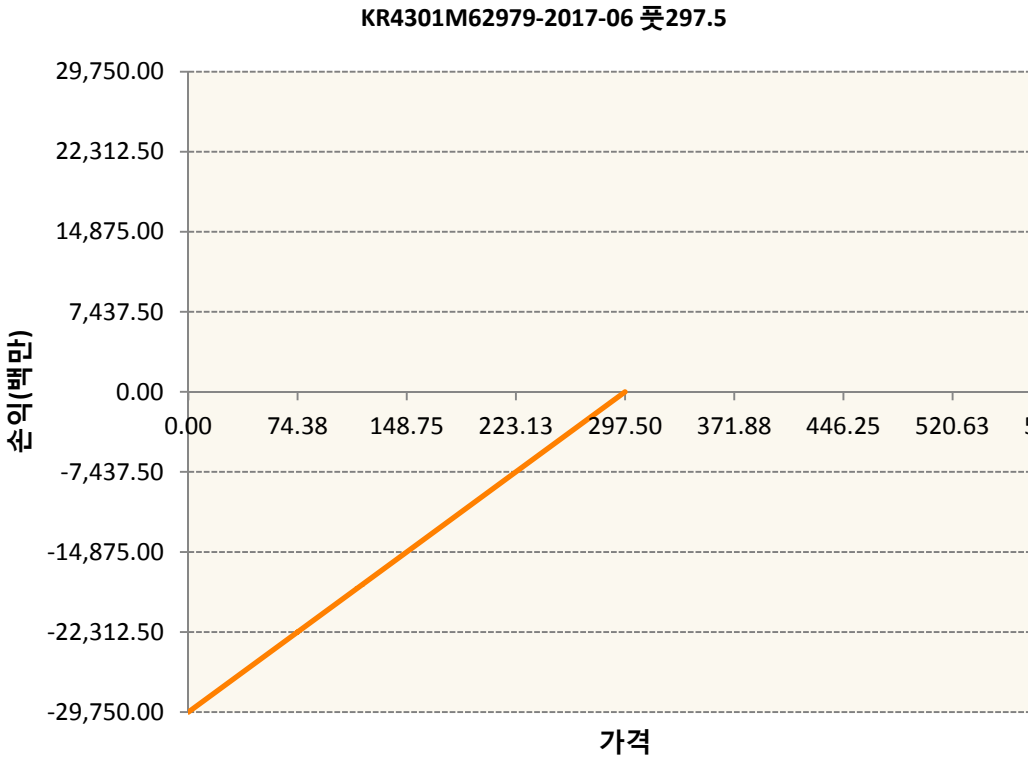
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 698,799 | -698,799 | 장내 |

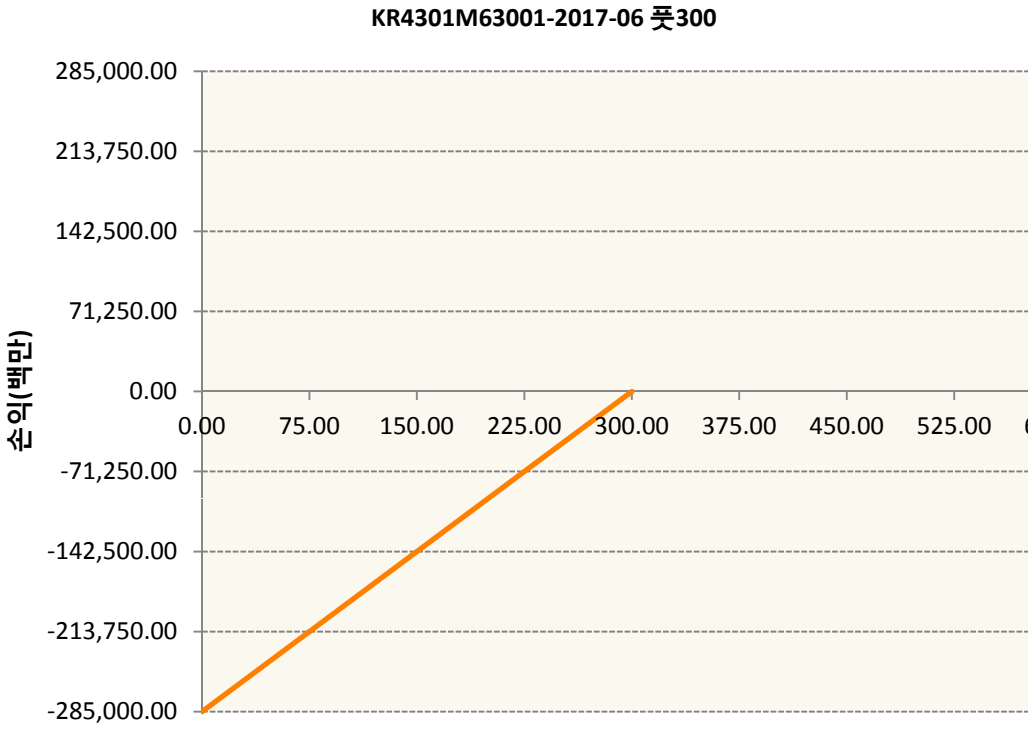
## 2. 만기시점의 손익구조




-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 | | | | | | 2,413 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 755 | 755 | 755 | 755 | 754 | 754 | 753 |
| -5.33% | 752 | 749 | 744 | 739 | 733 | 725 | 716 |
| -2.67% | 619 | 600 | 580 | 561 | 541 | 521 | 501 |
| 0% | 24 | 18 | 9 | 0 | -11 | -22 | -35 |
| 2.67% | -781 | -781 | -781 | -782 | -783 | -785 | -787 |
| 5.33% | -1,597 | -1,597 | -1,597 | -1,597 | -1,597 | -1,597 | -1,597 |
| 8.00% | -2,413 | -2,413 | -2,413 | -2,413 | -2,413 | -2,413 | -2,413 |
| KR4201M63( | 2017-06 콜300 | | | | | | 27,848 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 6,416 | 6,416 | 6,416 | 6,415 | 6,414 | 6,412 | 6,407 |
| -5.33% | 6,409 | 6,398 | 6,379 | 6,350 | 6,310 | 6,259 | 6,196 |
| -2.67% | 5,742 | 5,562 | 5,373 | 5,176 | 4,974 | 4,768 | 4,558 |
| 0% | 485 | 336 | 173 | 0 | -182 | -371 | -566 |
| 2.67% | -8,677 | -8,685 | -8,699 | -8,723 | -8,756 | -8,800 | -8,856 |
| 5.33% | -18,260 | -18,260 | -18,260 | -18,260 | -18,262 | -18,265 | -18,270 |
| 8.00% | -27,847 | -27,847 | -27,847 | -27,847 | -27,847 | -27,847 | -27,848 |
| KR4301M62( | 2017-06 풋297.5 | | | | | | 1,688 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,685 | -1,685 | -1,685 | -1,686 | -1,686 | -1,687 | -1,688 |
| -5.33% | -876 | -879 | -884 | -889 | -895 | -903 | -912 |
| -2.67% | -196 | -215 | -235 | -254 | -274 | -294 | -313 |
| 0% | 24 | 17 | 9 | 0 | -11 | -22 | -35 |
| 2.67% | 35 | 35 | 35 | 34 | 33 | 31 | 29 |
| 5.33% | 35 | 35 | 35 | 35 | 35 | 35 | 35 |
| 8.00% | 35 | 35 | 35 | 35 | 35 | 35 | 35 |
| KR4301M63( | 2017-06 풋300 | | | | | | 17,991 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -17,983 | -17,983 | -17,984 | -17,984 | -17,985 | -17,987 | -17,991 |
| -5.33% | -10,274 | -10,283 | -10,298 | -10,321 | -10,353 | -10,394 | -10,445 |
| -2.67% | -3,094 | -3,240 | -3,392 | -3,550 | -3,713 | -3,879 | -4,048 |
| 0% | 390 | 270 | 139 | 0 | -146 | -299 | -456 |
| 2.67% | 733 | 727 | 715 | 696 | 669 | 634 | 589 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 5.33% | 737 | 737 | 737 | 736 | 735 | 733 | 728 |
| 8.00% | 737 | 737 | 737 | 737 | 737 | 737 | 737 |

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

| |
|---|
| **59,955** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-06-01 |
| 기준일 | 2017-05-31 |

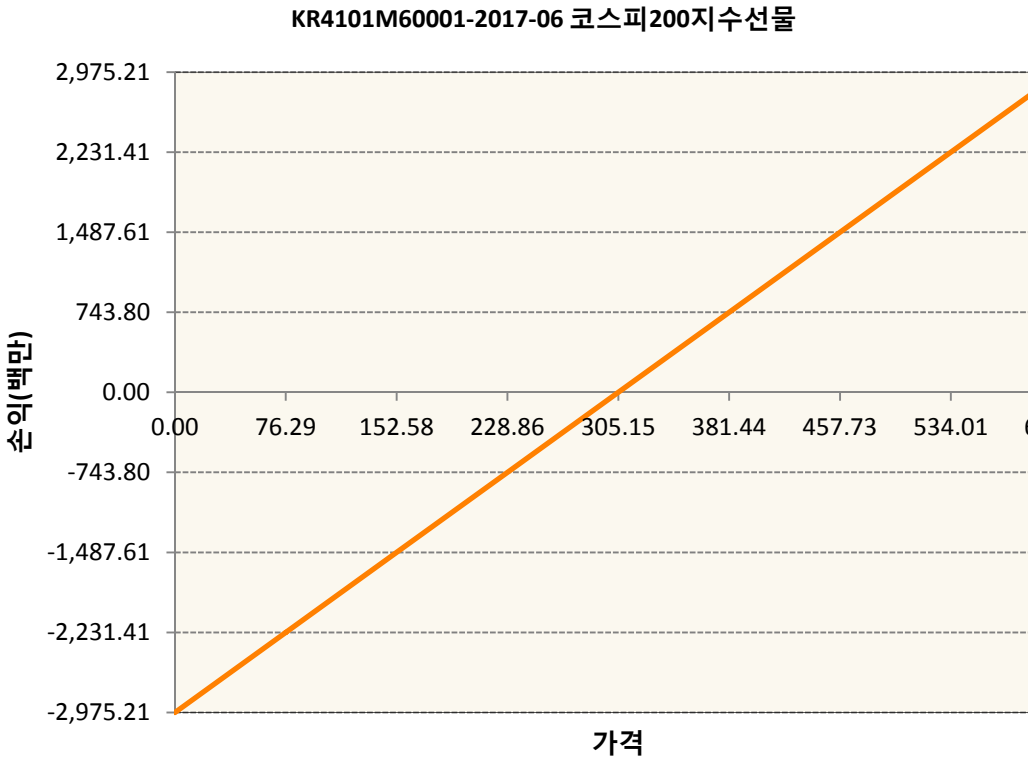
# 커버드콜목표전환형증권투자신탁

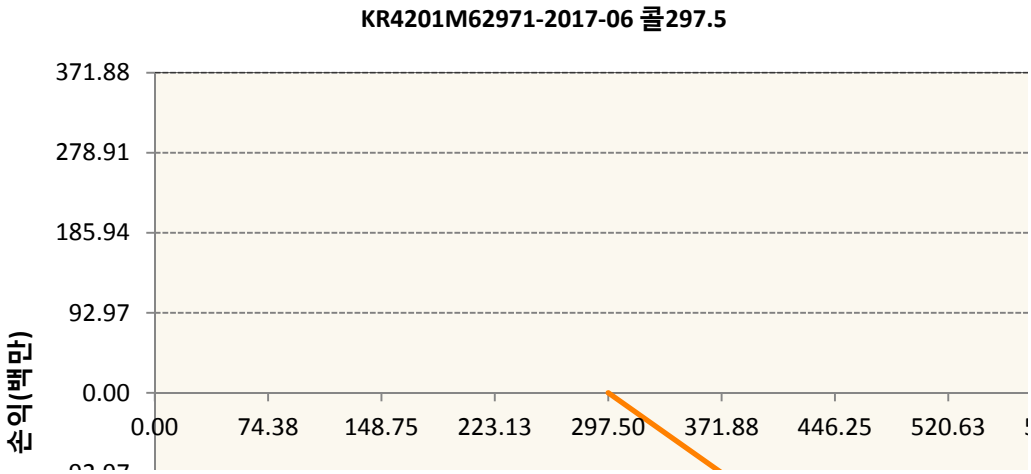
## 1. 계약금액

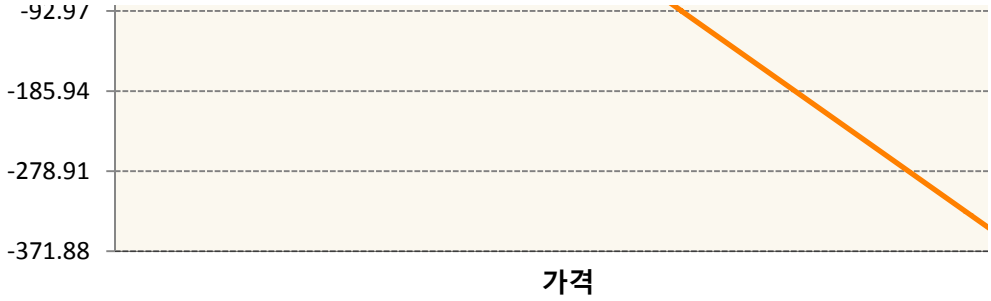
(단위:백만원)

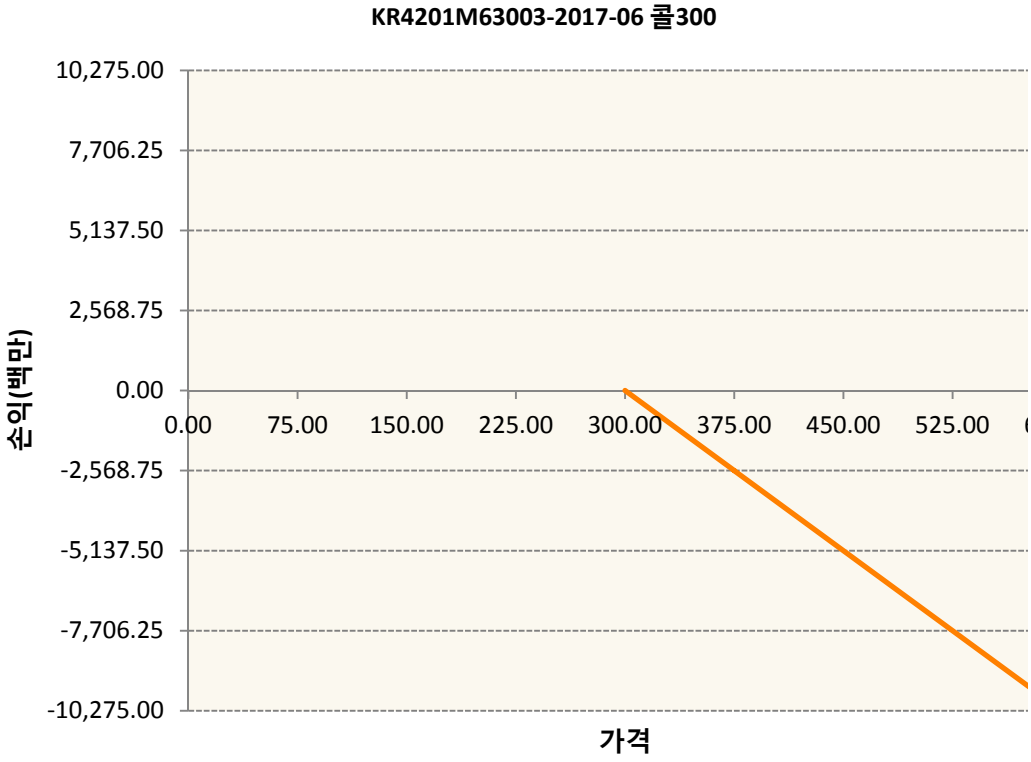
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 216 | 0 | 216 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,975 | 0 | 2,975 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 12,144 | -12,144 | 장내 |

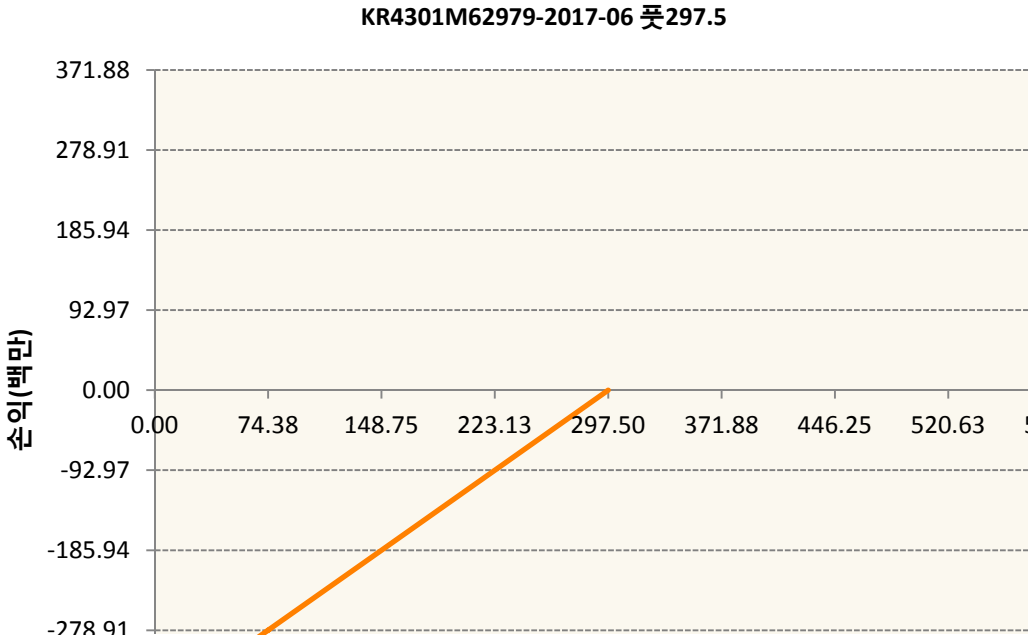
## 2. 만기시점의 손익구조

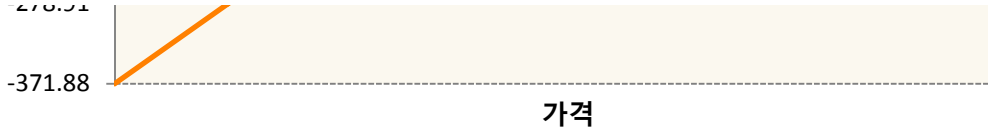


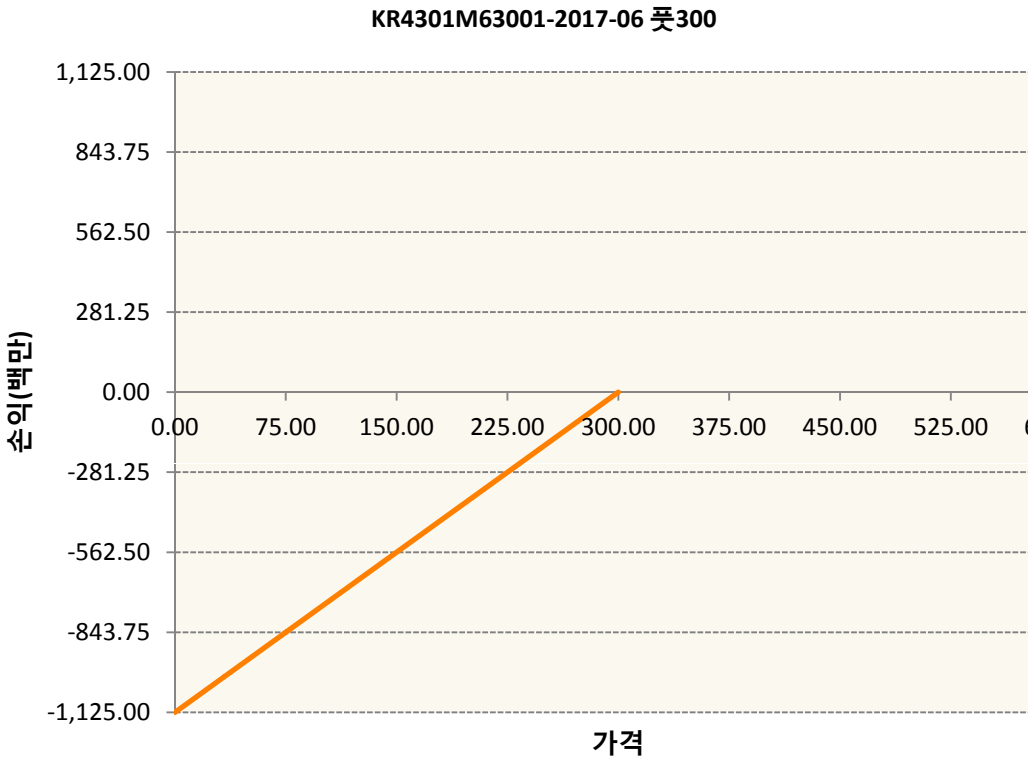




-92.97
-185.94
-278.91
-371.88
가격


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 | | | | | | | 30 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 |
| -5.33% | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 |
| -2.67% | 8 | 7 | 7 | 7 | 7 | 6 | 6 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | -10 | -10 | -10 | -10 | -10 | -10 | -10 |
| 5.33% | -20 | -20 | -20 | -20 | -20 | -20 | -20 |
| 8.00% | -30 | -30 | -30 | -30 | -30 | -30 | -30 |
| | KR4201M63( | 2017-06 콜300 | | | | | 808 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 186 | 186 | 186 | 186 | 186 | 186 | 186 |
| -5.33% | 186 | 186 | 185 | 184 | 183 | 182 | 180 |
| -2.67% | 167 | 161 | 156 | 150 | 144 | 138 | 132 |
| 0% | 14 | 10 | 5 | 0 | -5 | -11 | -16 |
| 2.67% | -252 | -252 | -252 | -253 | -254 | -255 | -257 |
| 5.33% | -530 | -530 | -530 | -530 | -530 | -530 | -530 |
| 8.00% | -808 | -808 | -808 | -808 | -808 | -808 | -808 |
| | 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% | -2 | -3 | -3 | -3 | -3 | -4 | -4 |
| 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 | | | | | 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% | -41 | -41 | -41 | -41 | -41 | -41 | -41 |
| -2.67% | -12 | -13 | -13 | -14 | -15 | -15 | -16 |
| 0% | 2 | 1 | 1 | 0 | -1 | -1 | -2 |
| 2.67% | 3 | 3 | 3 | 3 | 3 | 3 | 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)

| |
|---|
| **1,339** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-06-01 |
| 기준일 | 2017-05-31 |

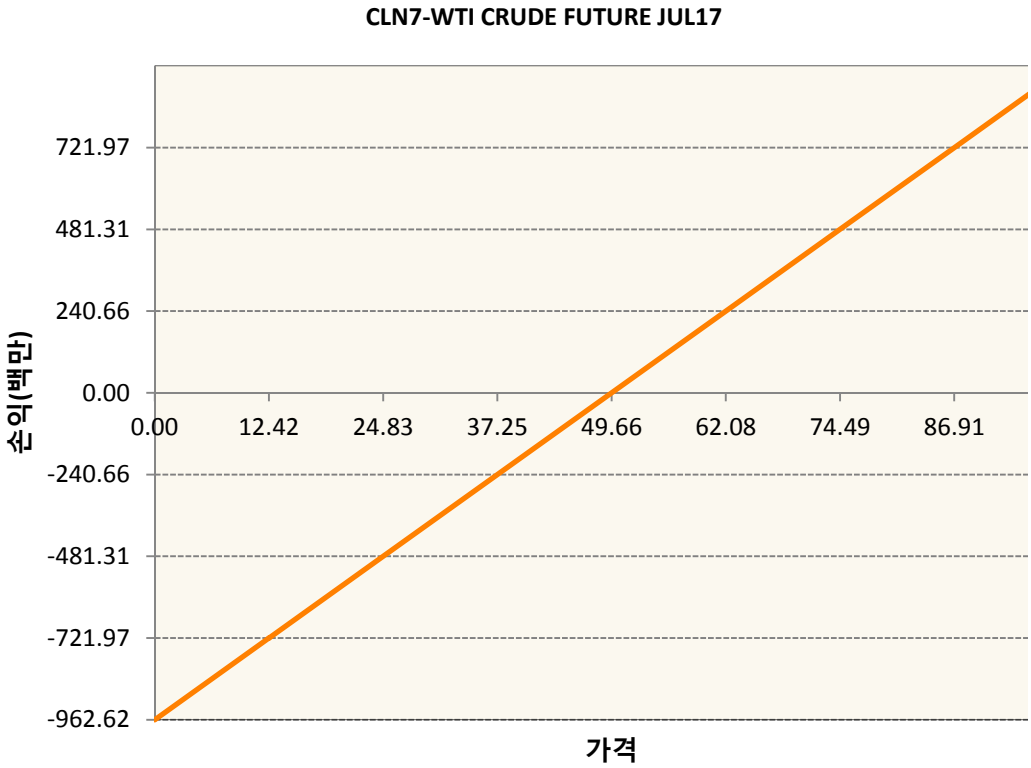
# 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

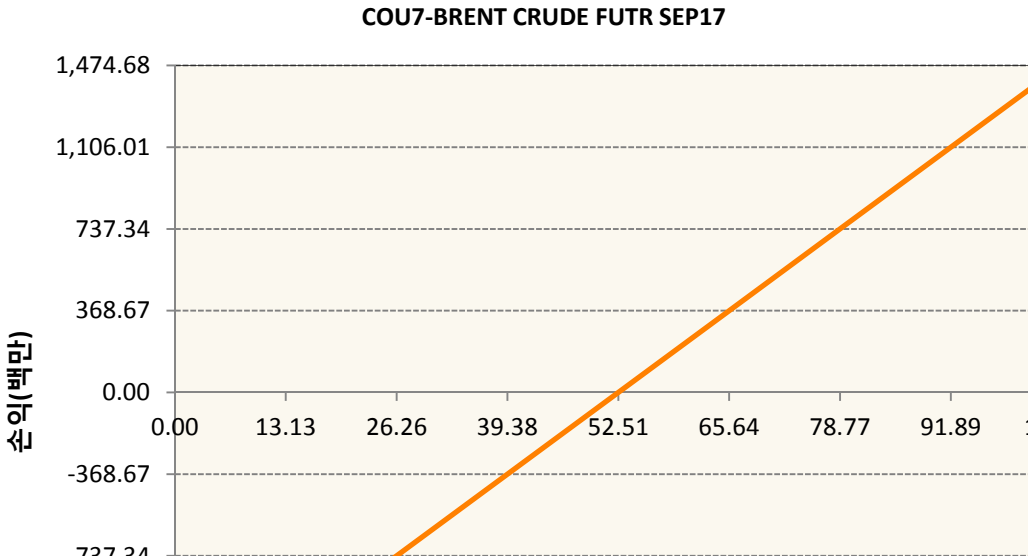
## 1. 계약금액

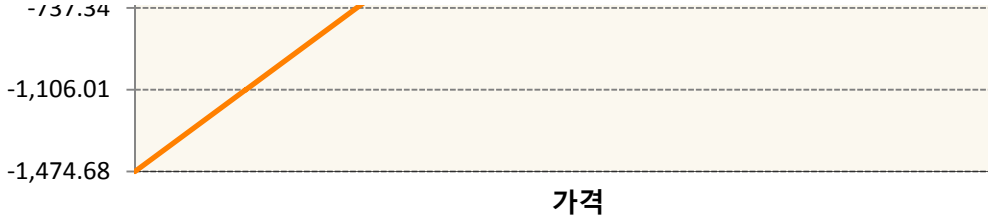
(단위:백만원)

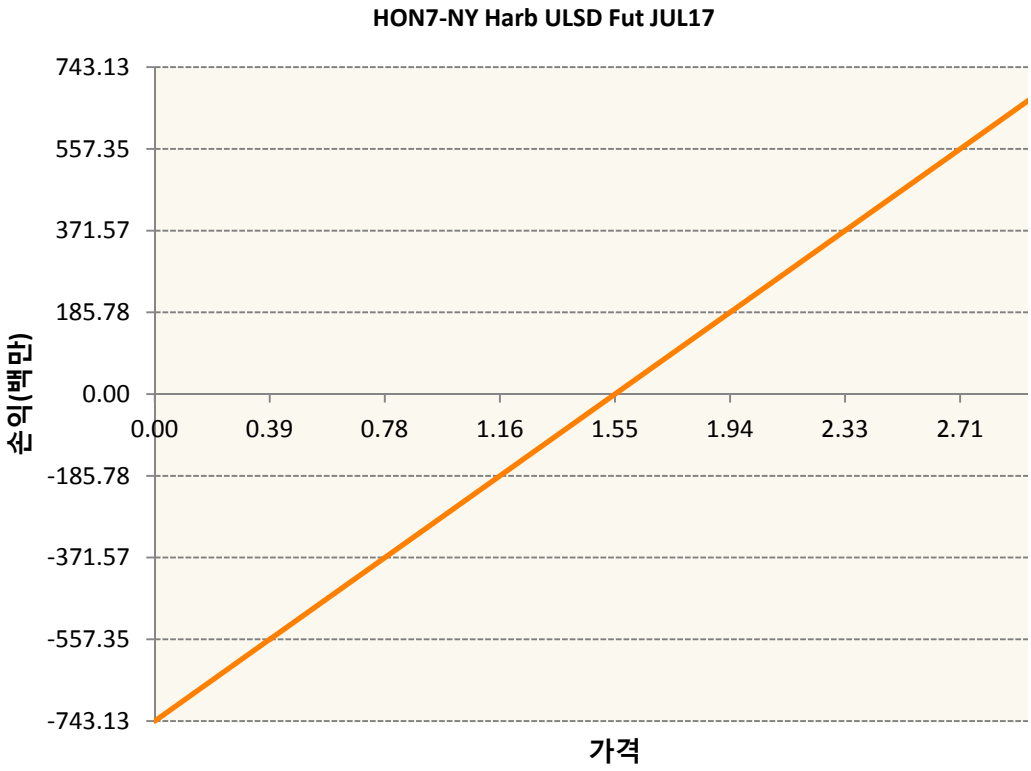
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 5,465 | 224 | 5,241 | |

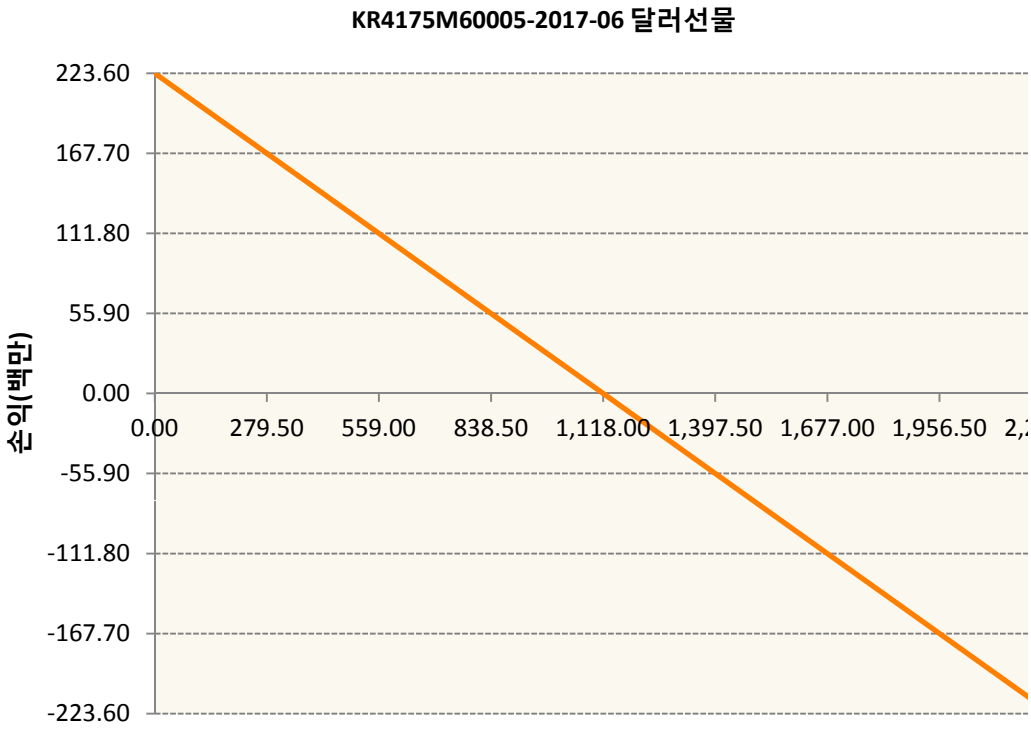
## 2. 만기시점의 손익구조



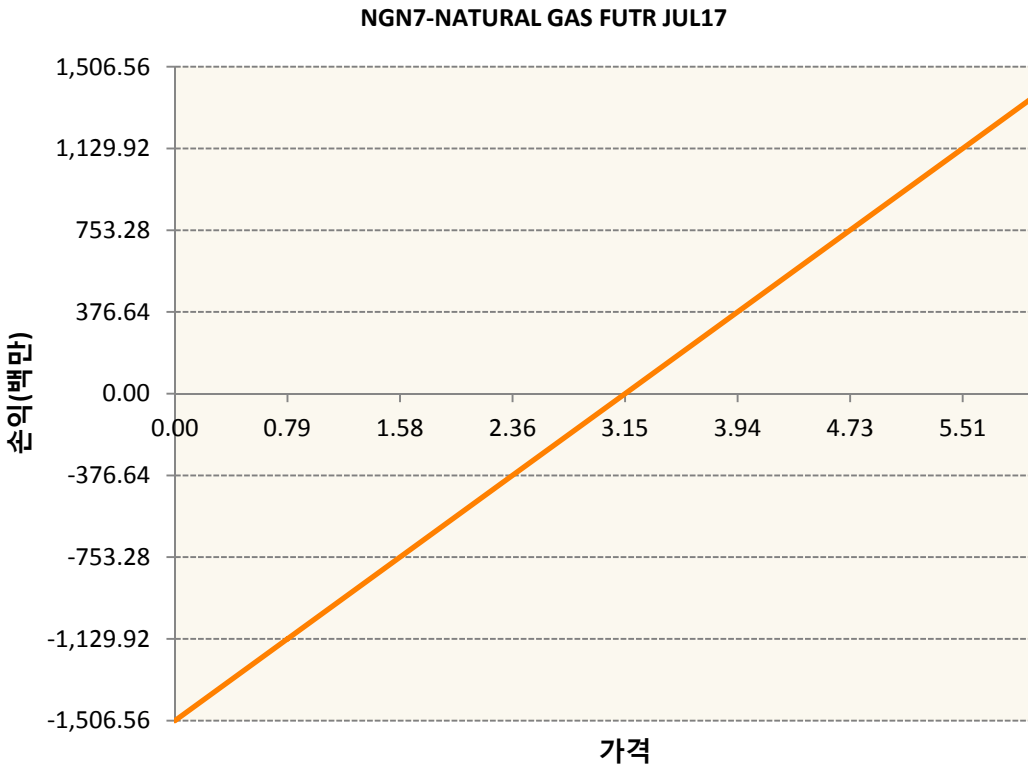



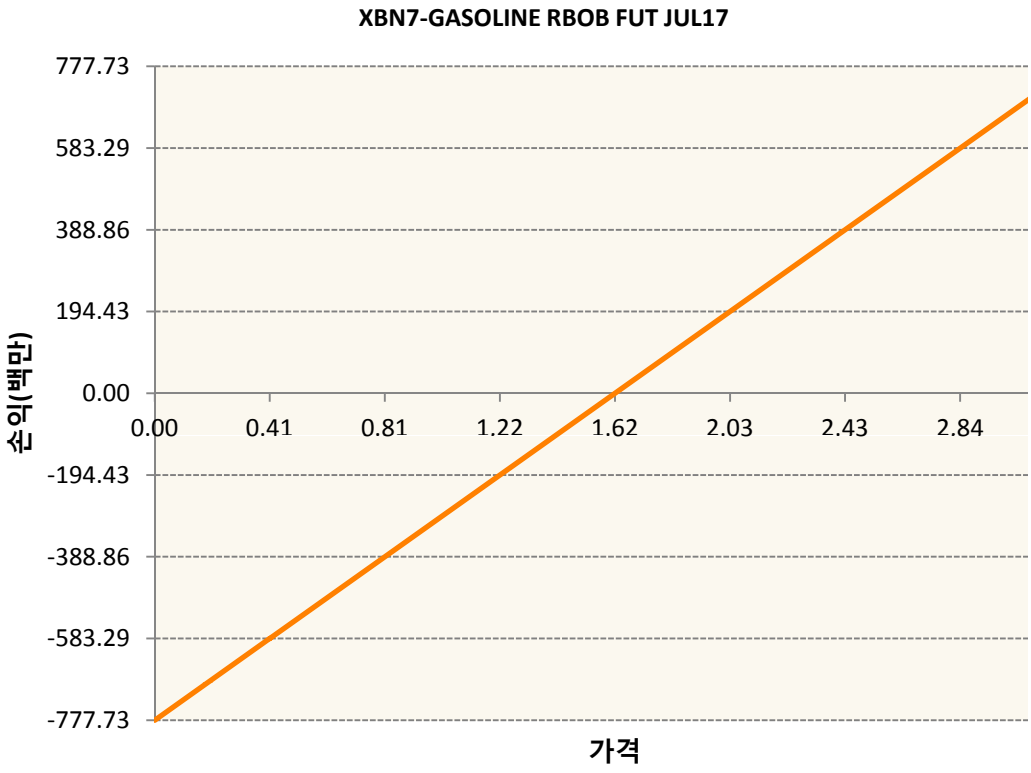

-1,106.01
-1,474.68
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
743.13
557.35
371.57
185.78
0.00
-185.78
-371.57
-557.35
-743.13
0.00
0.39
0.78
1.16
1.55
1.94
2.33
2.71
순이익(백만)
가격


KR4175M60005-2017-06 달러선물
223.60
167.70
111.80
55.90
0.00
-55.90
-111.80
-167.70
-223.60
0.00
279.50
559.00
838.50
1,118.00
1,397.50
1,677.00
1,956.50
순이익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,506.56
1,129.92
753.28
376.64
0.00
-376.64
-753.28
-1,129.92
-1,506.56
0.00
0.79
1.58
2.36
3.15
3.94
4.73
5.51
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
777.73
583.29
388.86
194.43
0.00
-194.43
-388.86
-583.29
-777.73
0.00
0.41
0.81
1.22
1.62
2.03
2.43
2.84
손익(백만)
가격

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

| | | |
|---|---|---|
| CLN7 | WTI CRUDE FUTURE JUL17 | 77 |
| COU7 | BRENT CRUDE FUTR SEP17 | 118 |
| HON7 | NY Harb ULSD Fut JUL17 | 59 |
| KR4175M60( | 2017-06 달러선물 | 18 |
| NGN7 | NATURAL GAS FUTR JUL17 | 121 |
| XBN7 | GASOLINE RBOB FUT JUL17 | 62 |

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

| |
|---|
| **921** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-06-01 |
| 기준일 | 2017-05-31 |

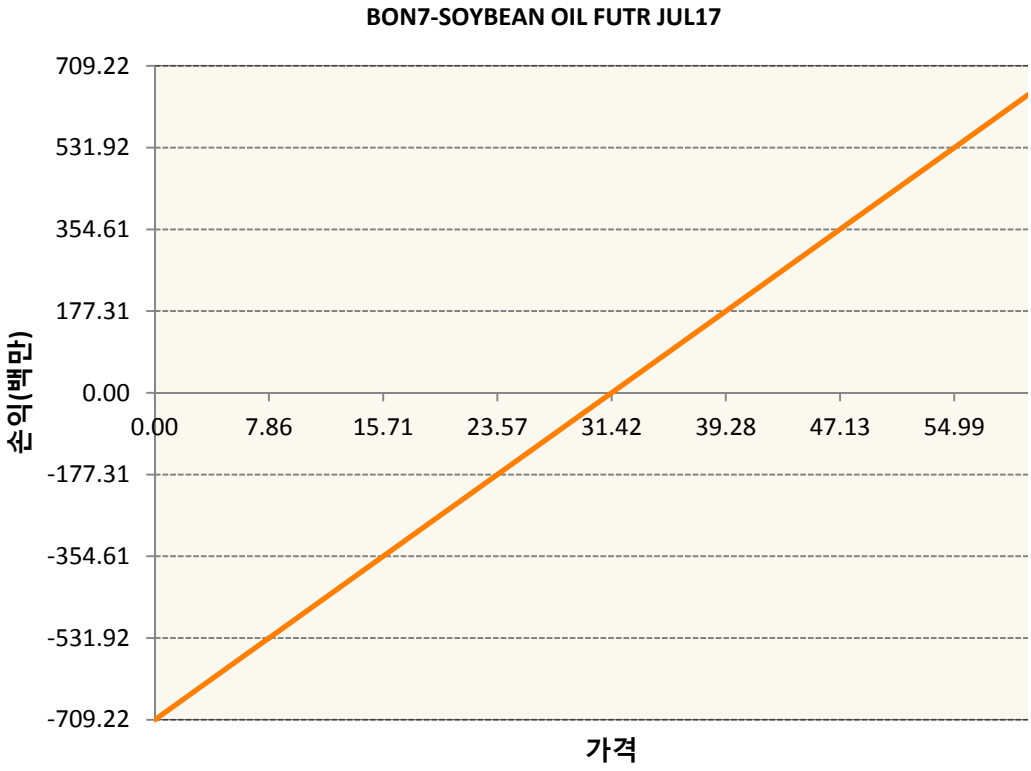
# 애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

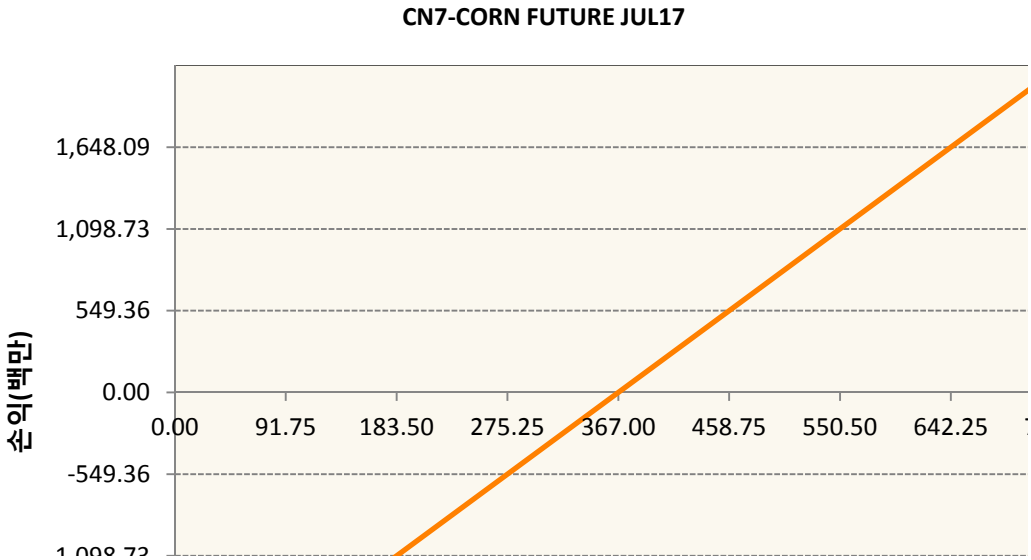
## 1. 계약금액

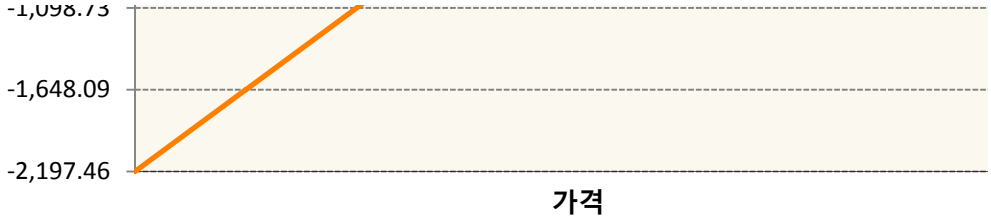
(단위:백만원)

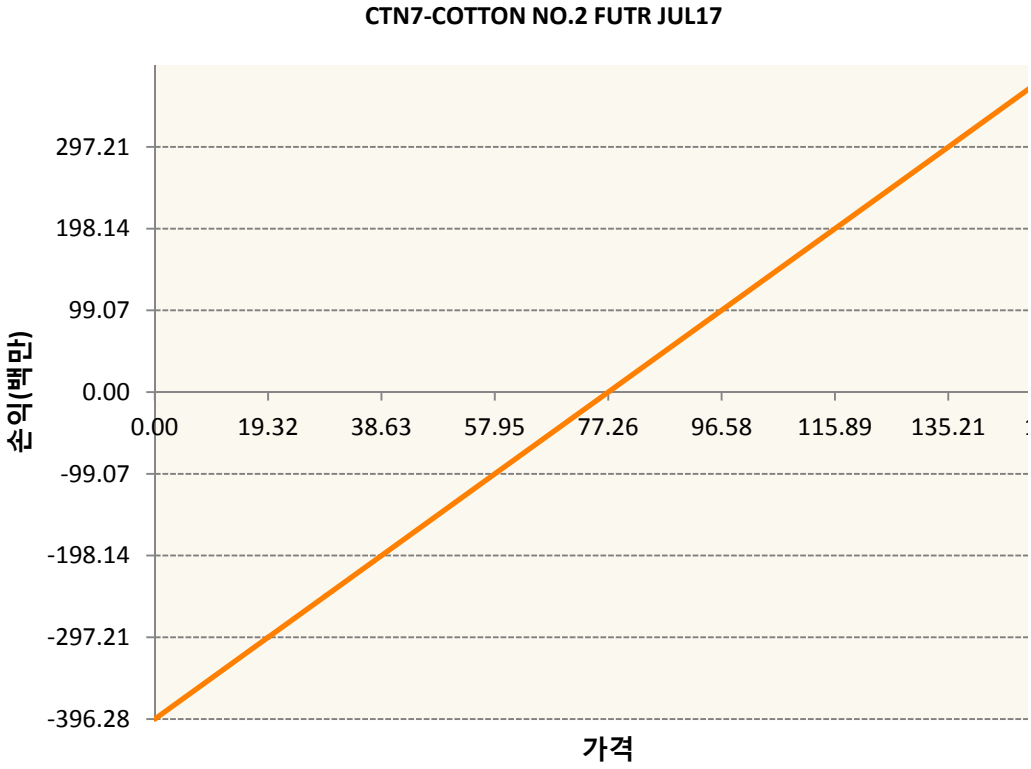
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 8,236 | 391 | 7,845 | |

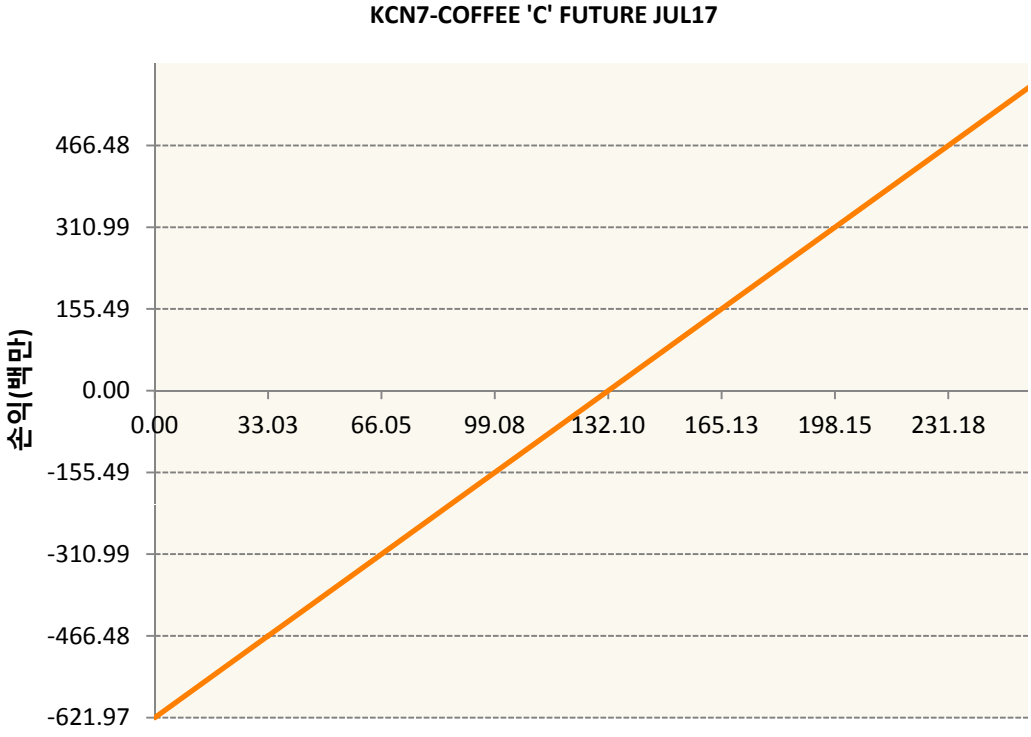
## 2. 만기시점의 손익구조



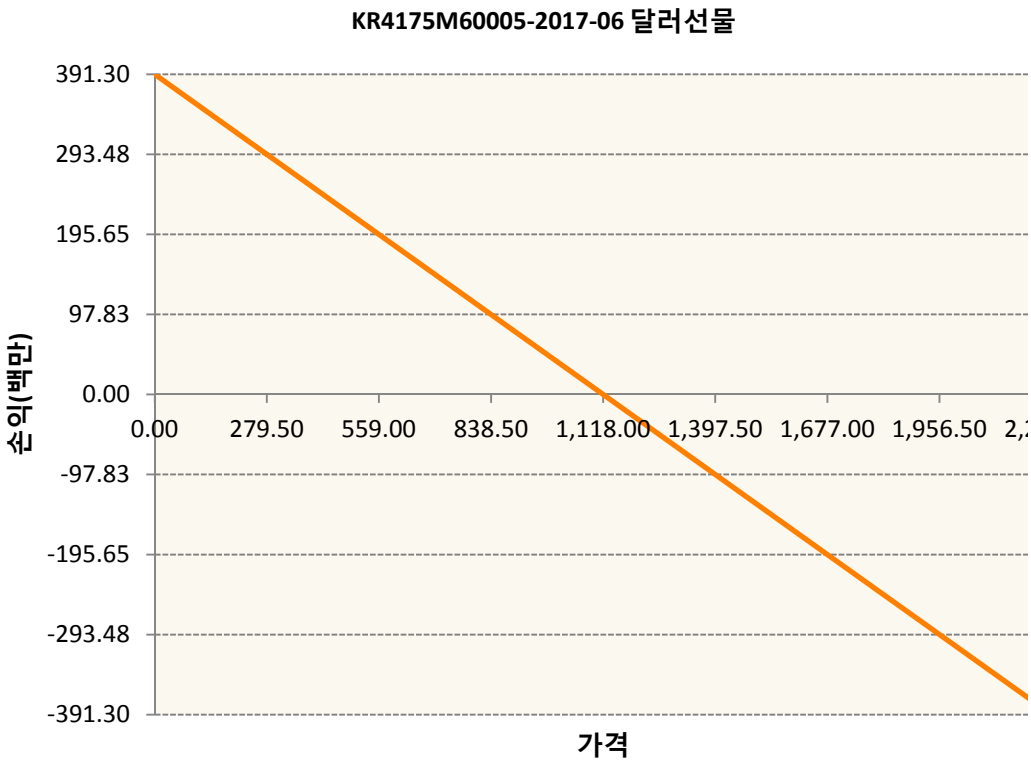



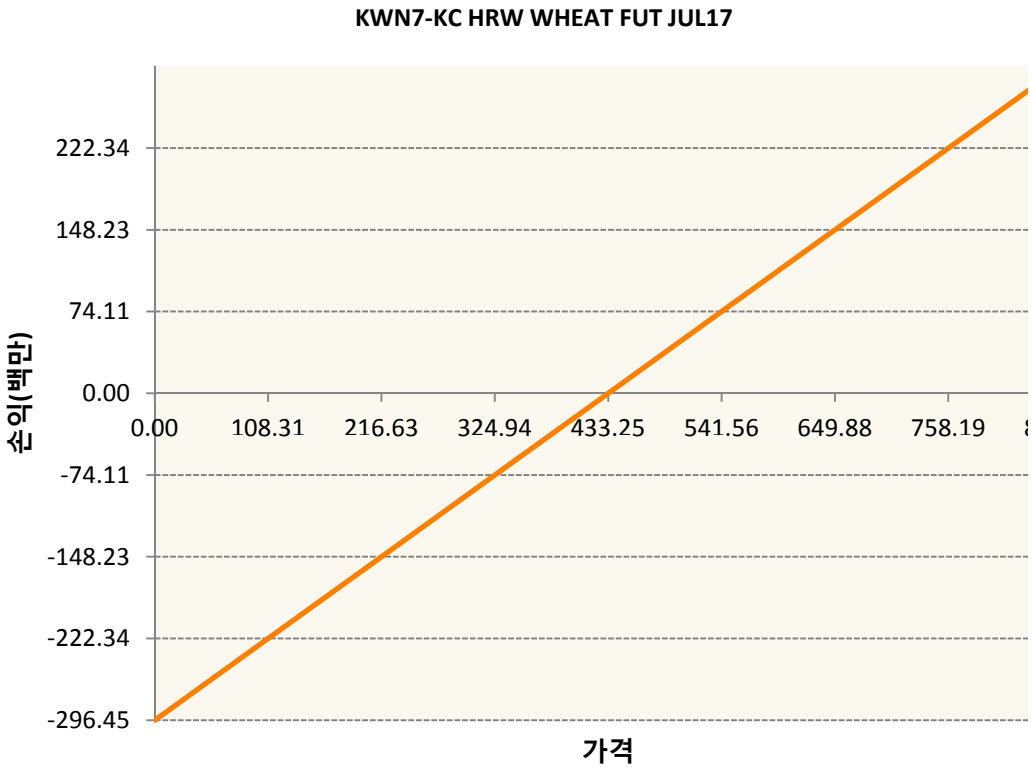

-1,648.09
-2,197.46
가격


CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
297.21
198.14
99.07
0.00
-99.07
-198.14
-297.21
-396.28
0.00
19.32
38.63
57.95
77.26
96.58
115.89
135.21
순익(백만)
가격

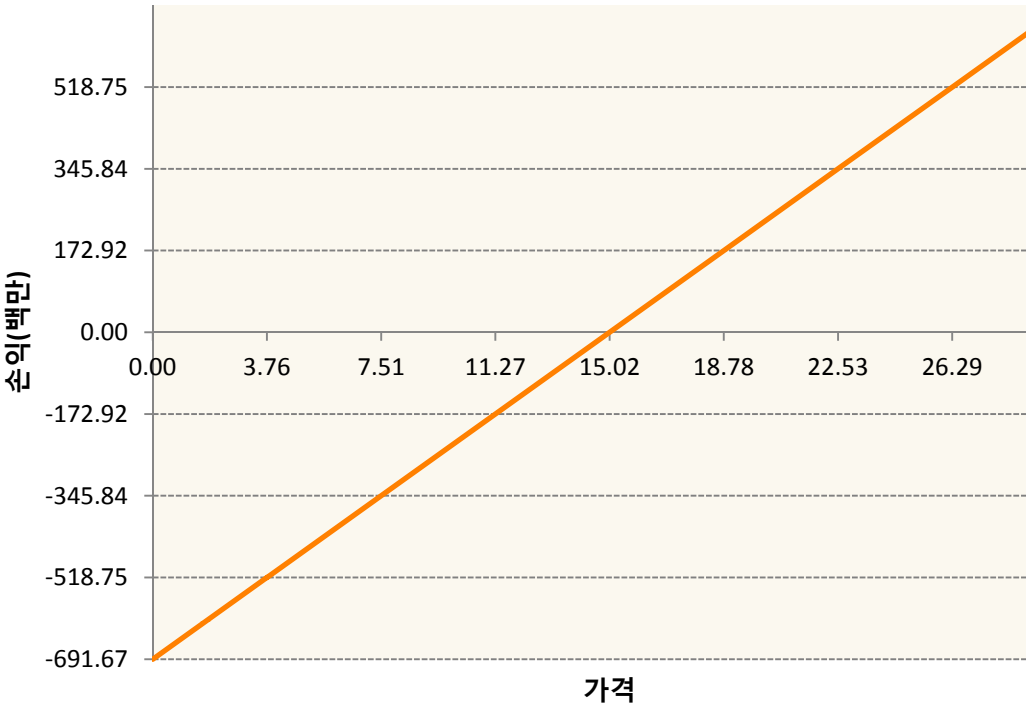

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
466.48
310.99
155.49
0.00
-155.49
-310.99
-466.48
-621.97
0.00
33.03
66.05
99.08
132.10
165.13
198.15
231.18
순익(백만)

가격

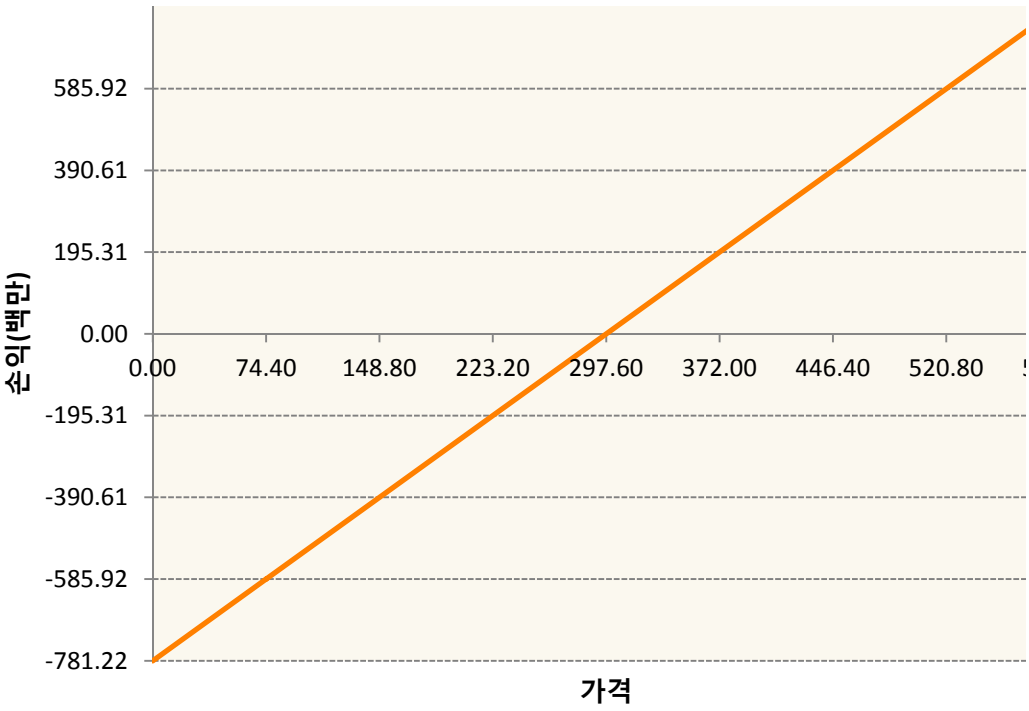

KR4175M60005-2017-06 달러선물
391.30
293.48
195.65
97.83
0.00
-97.83
-195.65
-293.48
-391.30
0.00
279.50
559.00
838.50
1,118.00
1,397.50
1,677.00
1,956.50
손익(백만)
가격


KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17
222.34
148.23
74.11
0.00
-74.11
-148.23
-222.34
-296.45
0.00
108.31
216.63
324.94
433.25
541.56
649.88
758.19
손익(백만)
가격

SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17

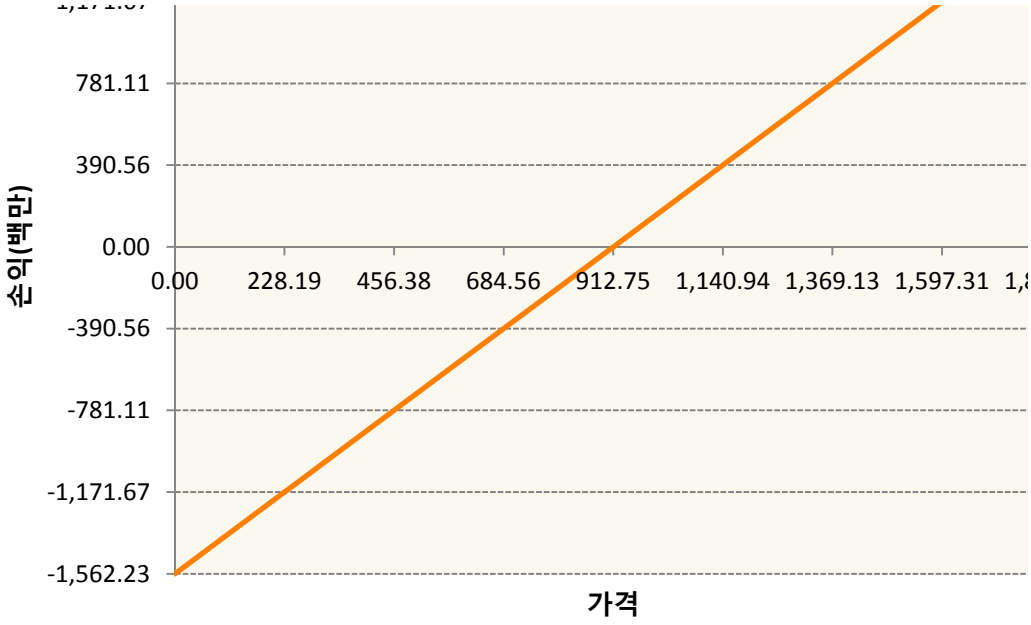


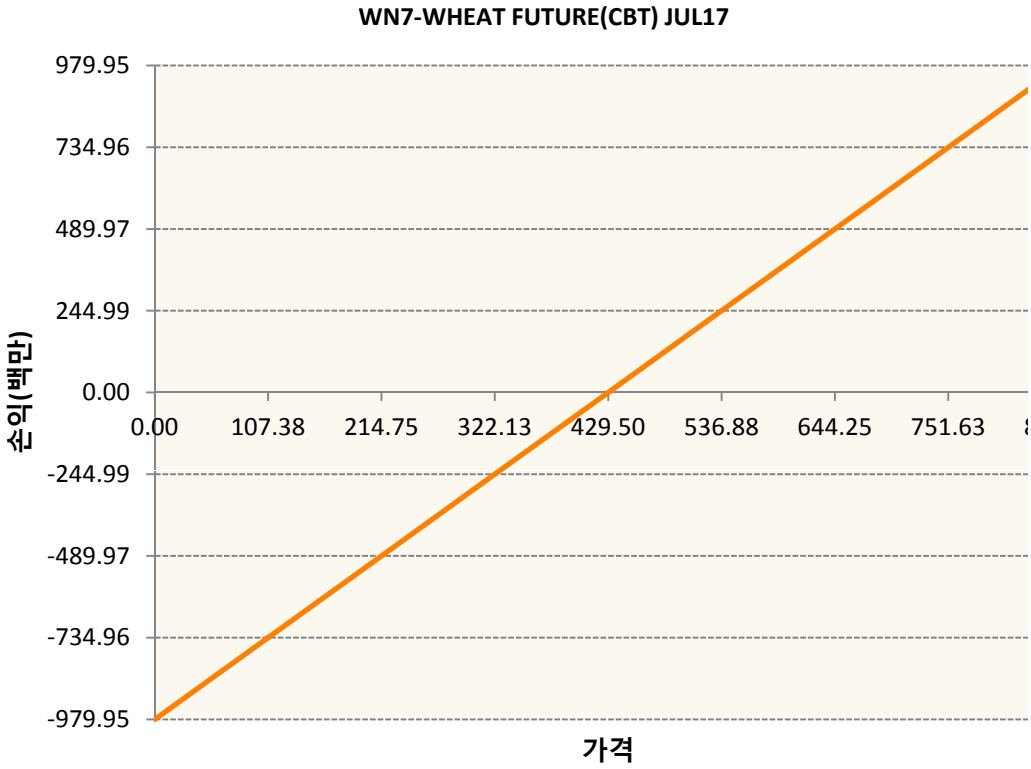

SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17




SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17






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

| | | |
|---|---|---|
| BON7 | SOYBEAN OIL FUTR JUL17 | 57 |
| CN7 | CORN FUTURE JUL17 | 176 |
| CTN7 | COTTON NO.2 FUTR JUL17 | 32 |
| KCN7 | COFFEE 'C' FUTURE JUL17 | 50 |
| KR4175M60( | 2017-06 달러선물 | 31 |

| | | |
|---|---|---|
| KWN7 | KC HRW WHEAT FUT JUL17 | 24 |
| SBN7 | SUGAR #11 (WORLD) JUL17 | 55 |
| SMN7 | SOYBEAN MEAL FUTR JUL17 | 62 |
| SN7 | SOYBEAN FUTURE JUL17 | 125 |
| WN7 | WHEAT FUTURE(CBT) JUL17 | 78 |

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

| |
|---|
| **750** |