공시일	2017-06-02
기준일	2017-06-01

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	2017-06-02
기준일	2017-06-01

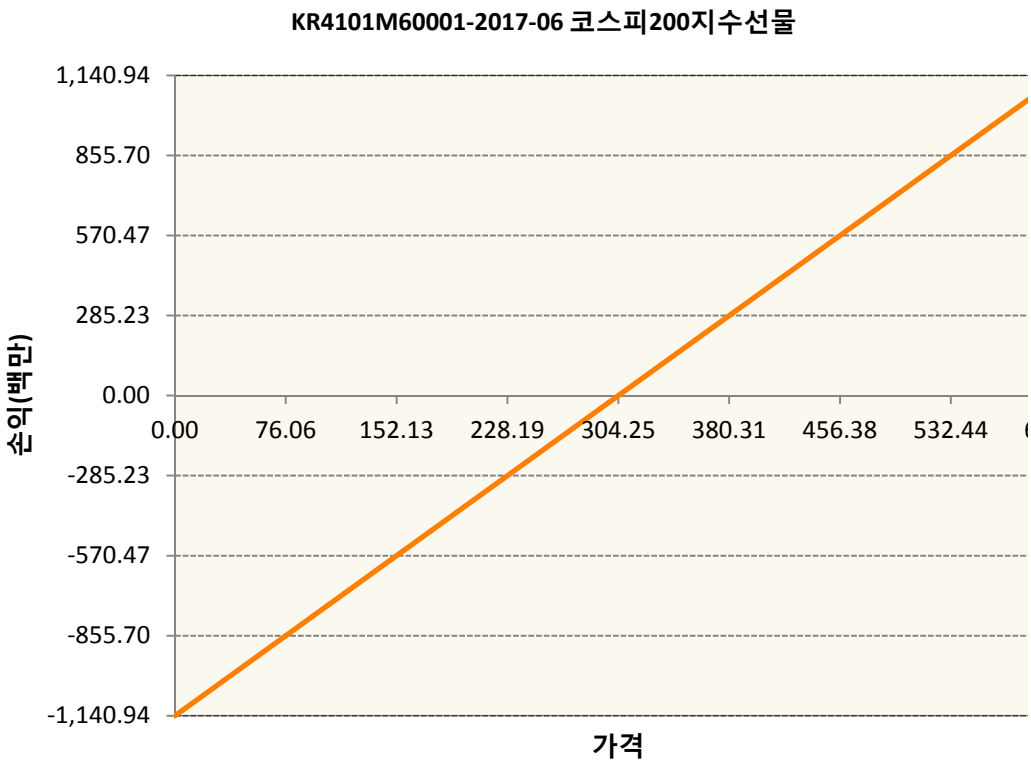
스마트인덱스모

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	1,141	0	1,141	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	2017-06-02
기준일	2017-06-01

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)

536

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-02
기준일	2017-06-01

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	352

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

328

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-02
기준일	2017-06-01

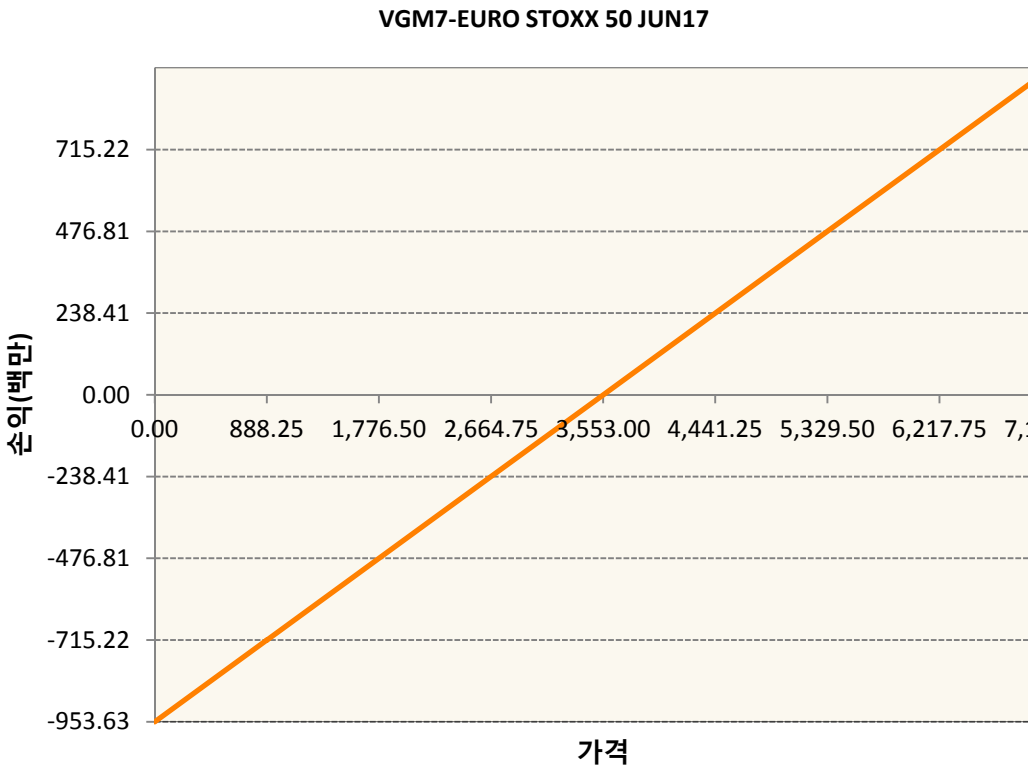
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	954	0	954	

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	2017-06-02
기준일	2017-06-01

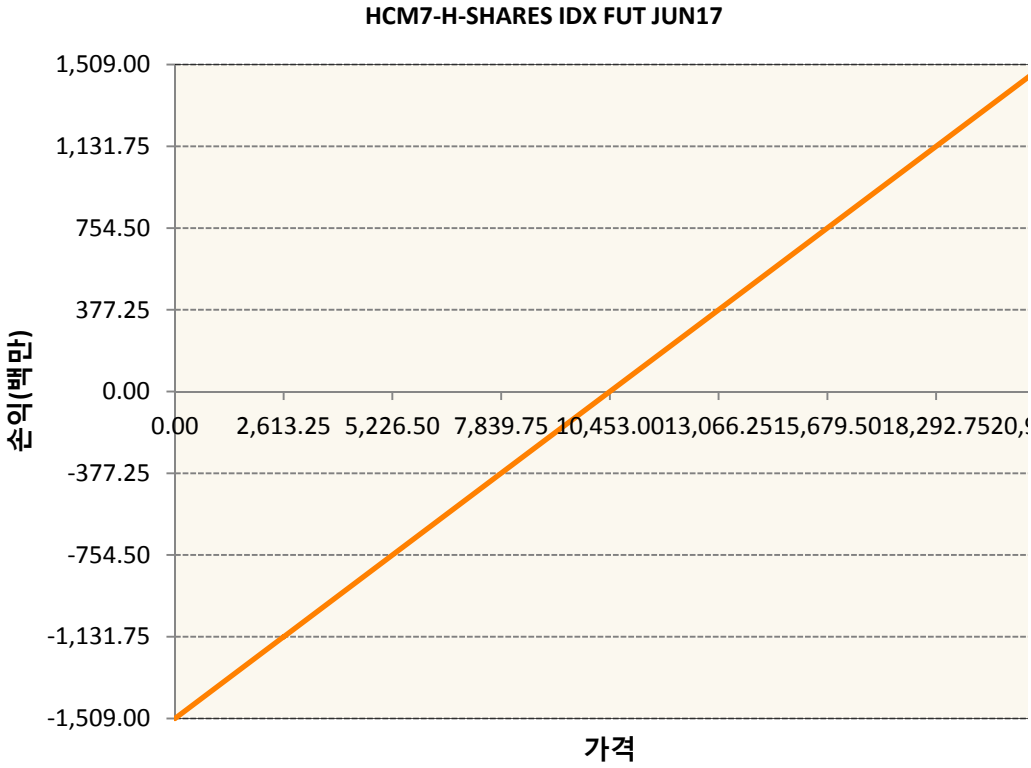
차이나인덱스모(주식-파생형)

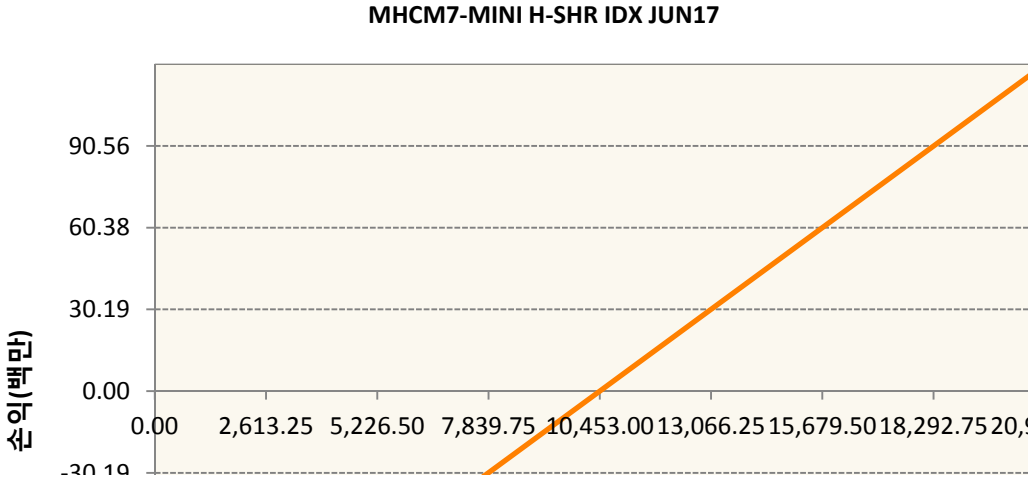
1. 계약금액

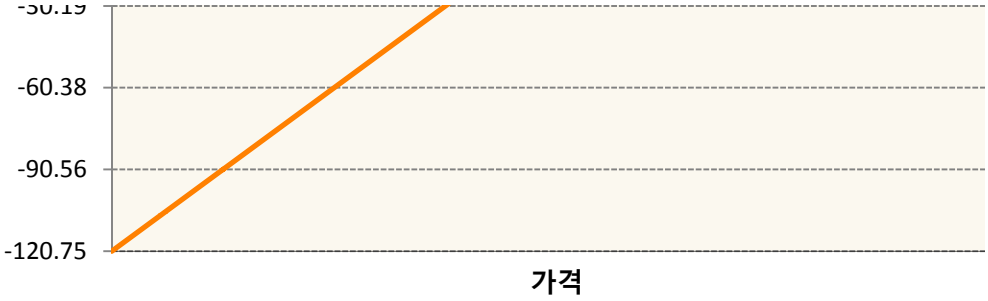
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계			1,509	0	1,509	
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)
	92

공시일	2017-06-02
기준일	2017-06-01

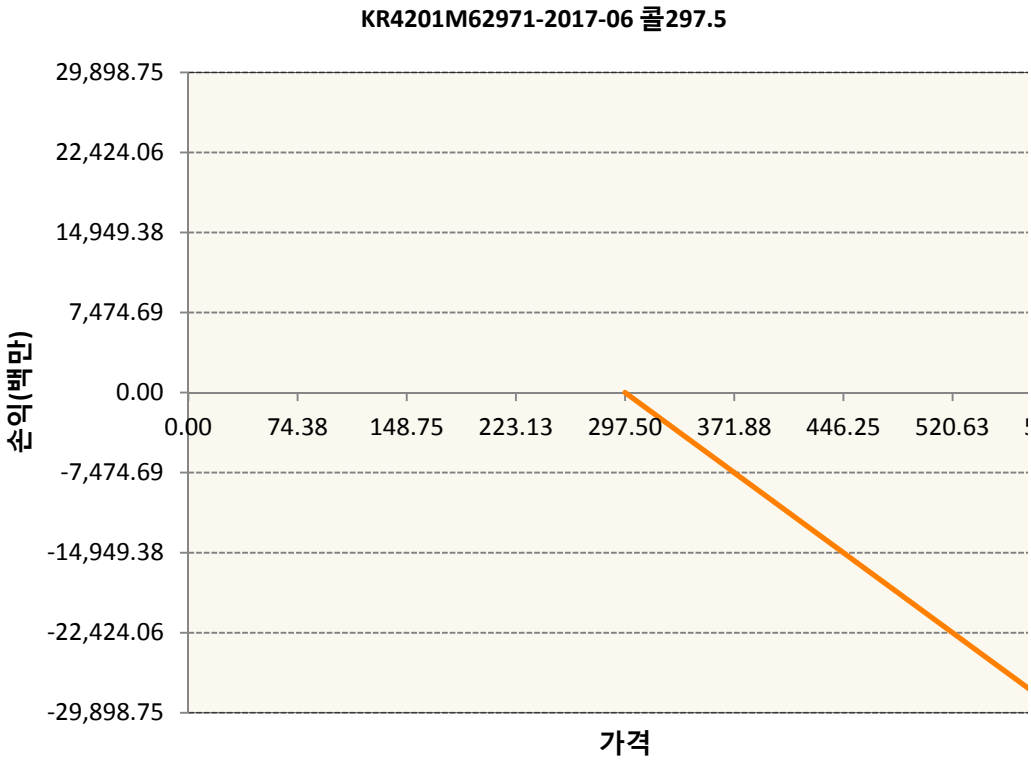
커버드콜모(주식혼합-파생형)

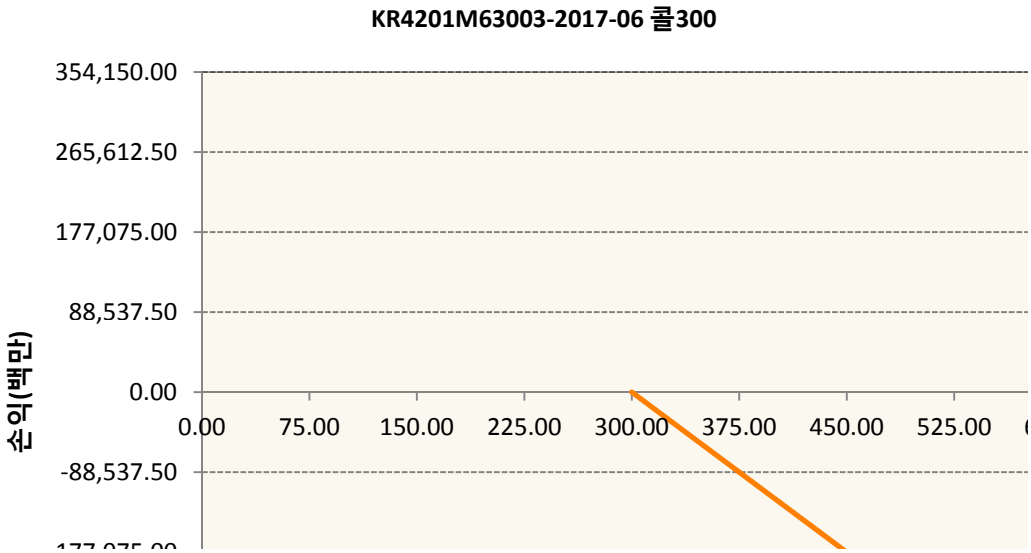
1. 계약금액

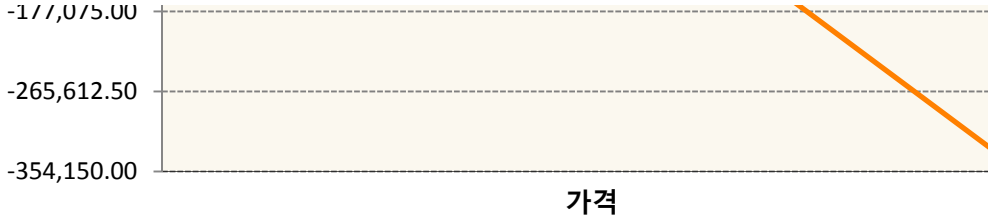
(단위:백만원)

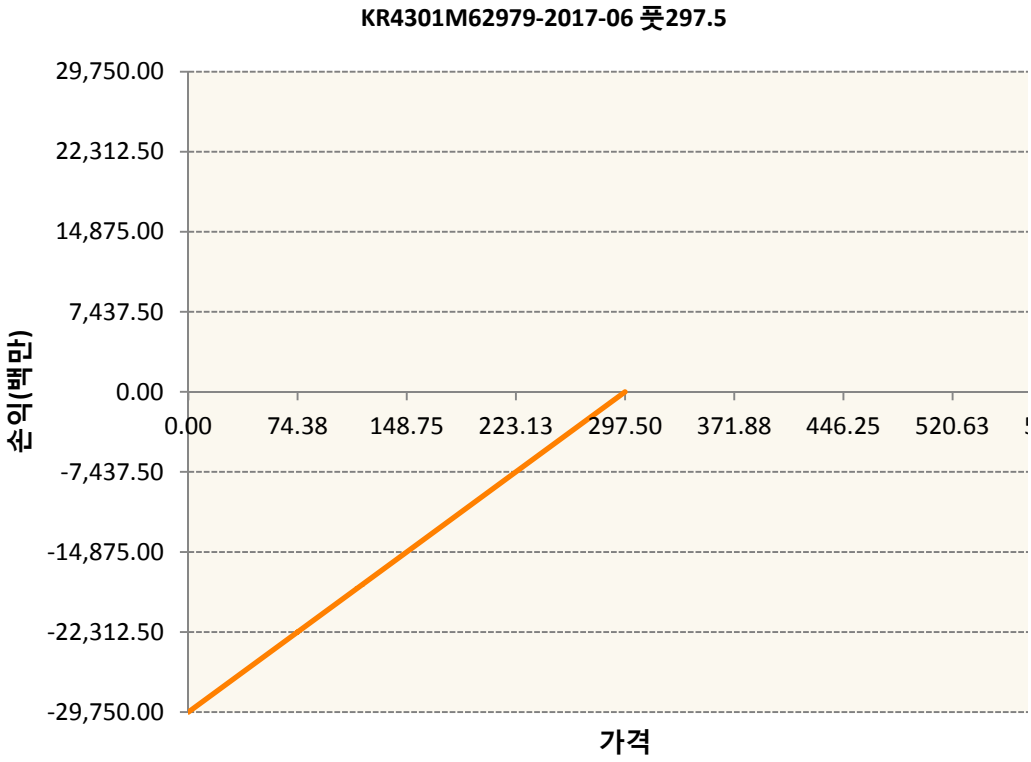
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	15,027	-15,027	장내
누계	유가증권	옵션	0	713,799	-713,799	장내

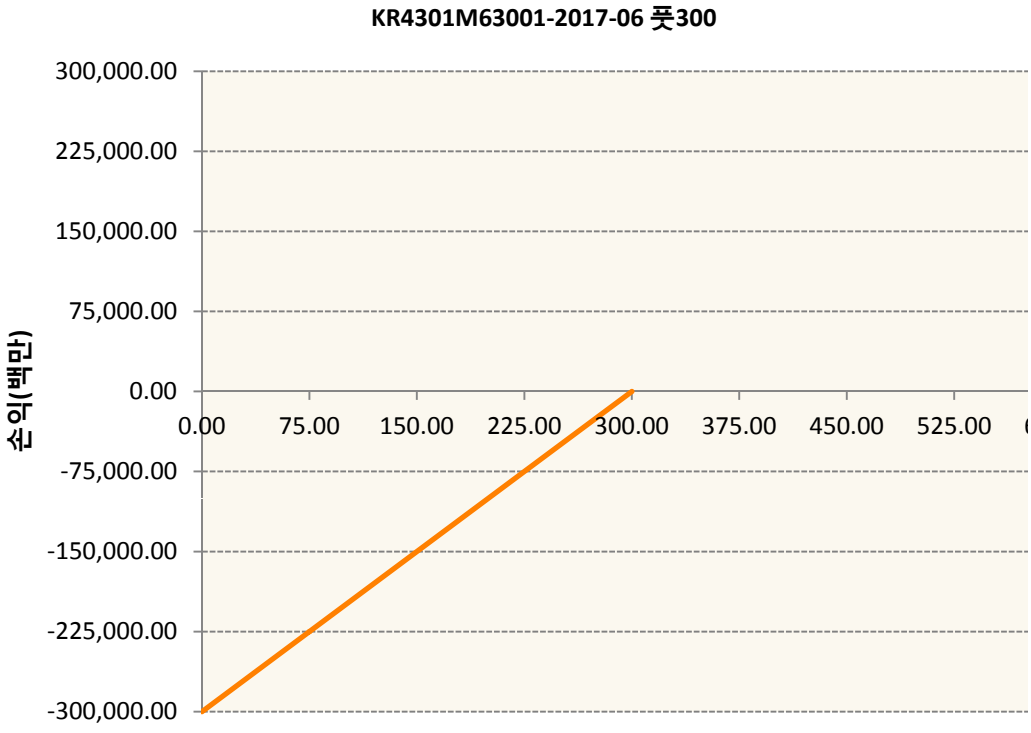
2. 만기시점의 손익구조






-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
300,000.00
225,000.00
150,000.00
75,000.00
0.00
-75,000.00
-150,000.00
-225,000.00
-300,000.00
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						2,415
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	684	684	684	684	684	684	683
-5.33%	683	682	680	678	674	670	665
-2.67%	593	576	560	543	526	509	492
0%	20	15	8	0	-9	-19	-30
2.67%	-786	-786	-786	-786	-787	-788	-789
5.33%	-1,600	-1,600	-1,600	-1,600	-1,600	-1,600	-1,600
8.00%	-2,415	-2,415	-2,415	-2,415	-2,415	-2,415	-2,415
KR4201M63(	2017-06 콜300						27,874
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,575	5,575	5,575	5,575	5,575	5,574	5,573
-5.33%	5,574	5,571	5,565	5,555	5,538	5,515	5,483
-2.67%	5,207	5,078	4,938	4,788	4,630	4,467	4,297
0%	434	300	155	0	-162	-331	-504
2.67%	-8,740	-8,744	-8,753	-8,767	-8,788	-8,818	-8,857
5.33%	-18,306	-18,306	-18,306	-18,306	-18,307	-18,308	-18,310
8.00%	-27,874	-27,874	-27,874	-27,874	-27,874	-27,874	-27,874
KR4301M62(	2017-06 풋297.5						1,751
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,751	-1,751	-1,751	-1,751	-1,751	-1,751	-1,751
-5.33%	-941	-942	-944	-947	-950	-955	-960
-2.67%	-221	-237	-253	-270	-287	-304	-321
0%	20	15	8	0	-9	-19	-29
2.67%	29	29	28	28	27	26	25
5.33%	29	29	29	29	29	29	29
8.00%	29	29	29	29	29	29	29
KR4301M63(	2017-06 풋300						19,594
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19,592	-19,592	-19,592	-19,592	-19,592	-19,593	-19,594
-5.33%	-11,488	-11,491	-11,495	-11,504	-11,518	-11,538	-11,565
-2.67%	-3,694	-3,803	-3,922	-4,049	-4,183	-4,321	-4,465
0%	368	254	131	0	-137	-280	-427
2.67%	701	698	691	679	660	635	603

5.33%	703	703	703	703	702	701	700
8.00%	703	703	703	703	703	703	703

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

64,386

공시일	2017-06-02
기준일	2017-06-01

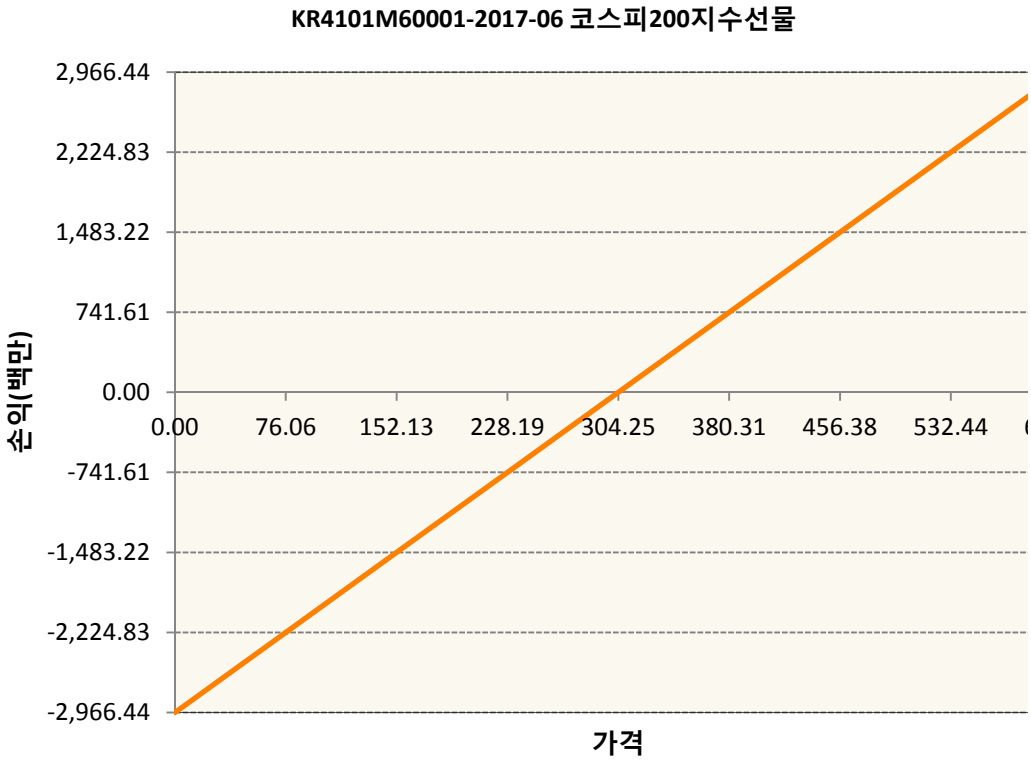
커버드콜목표전환형증권투자신탁

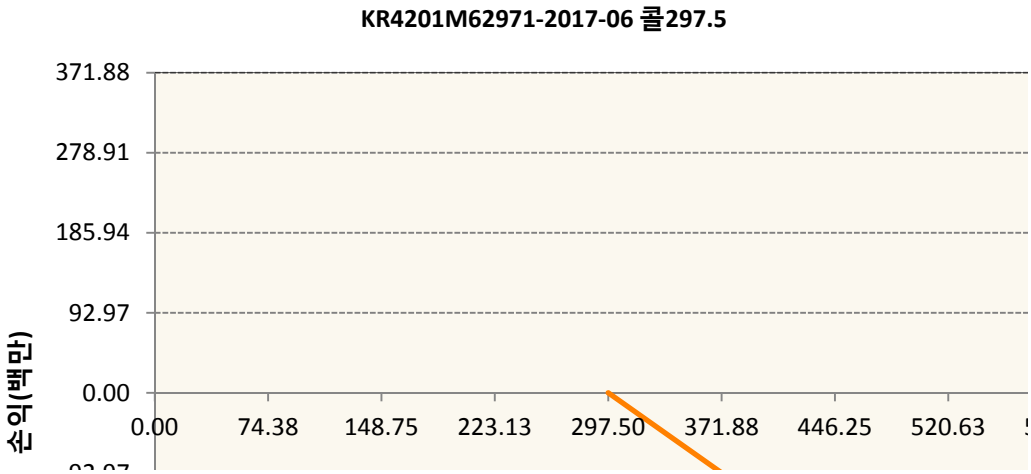
1. 계약금액

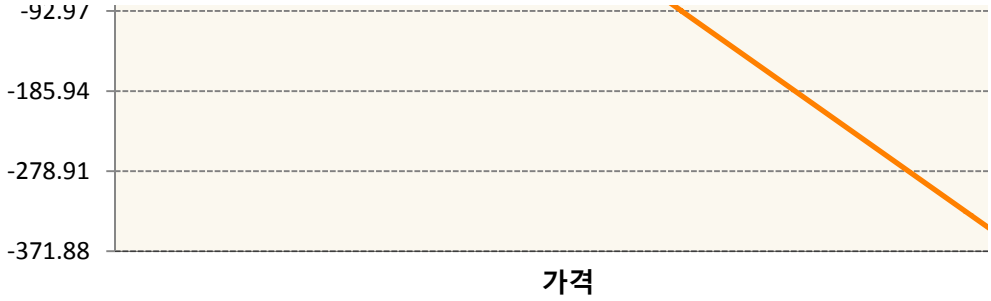
(단위:백만원)

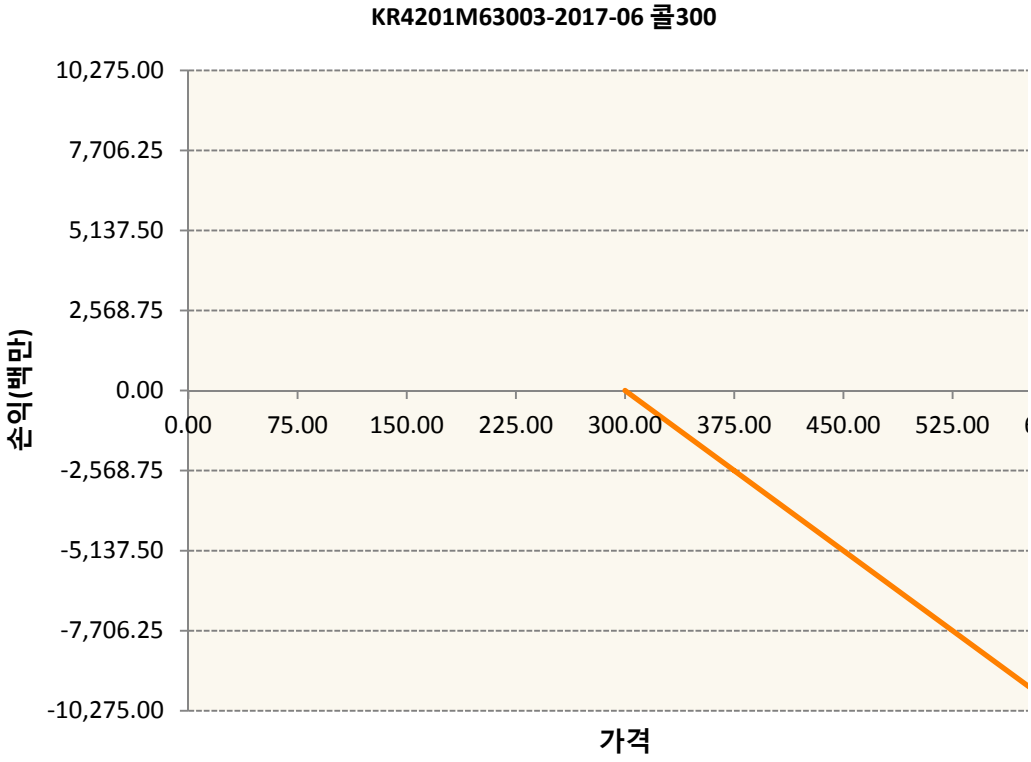
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,966	0	2,966	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,144	-12,144	장내

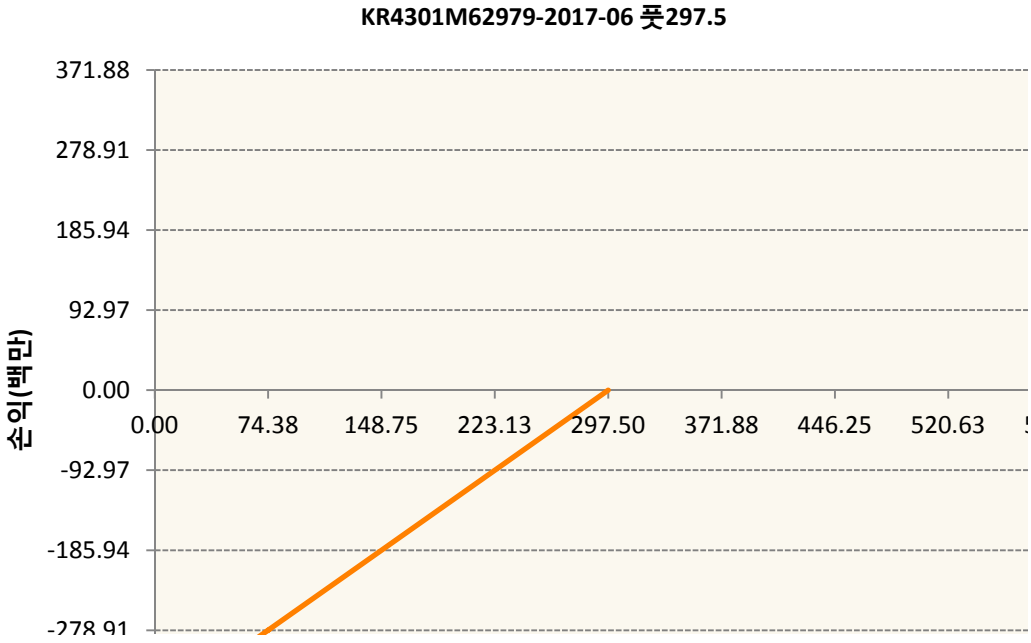
2. 만기시점의 손익구조



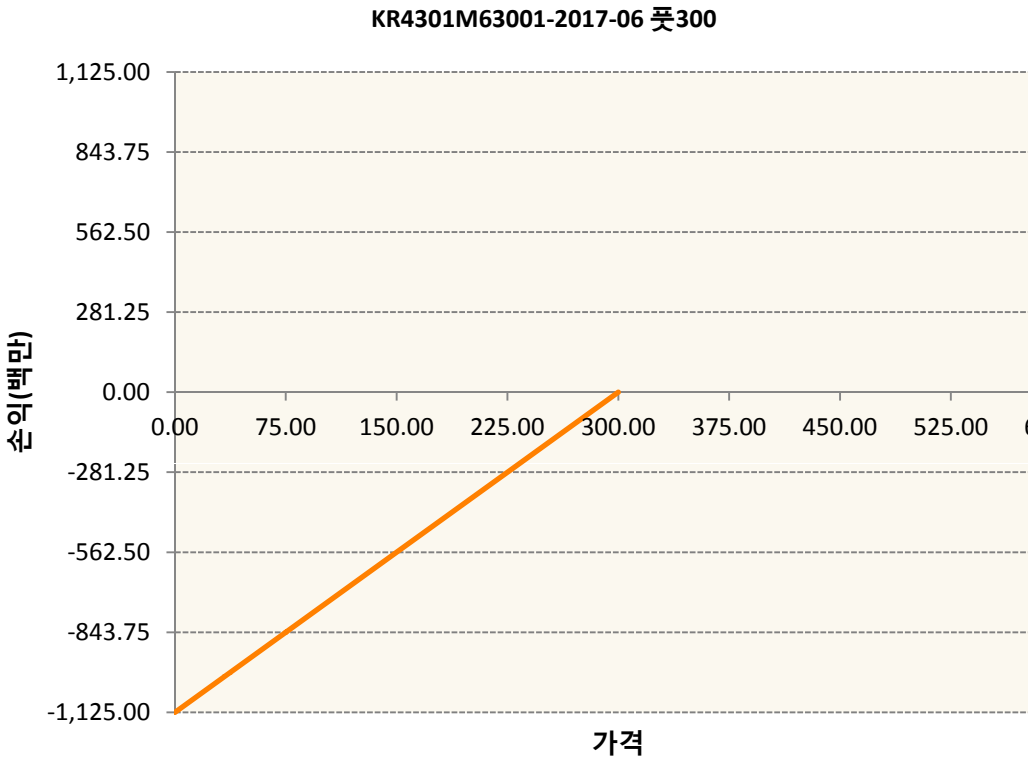



-92.97
-185.94
-278.91
-371.88
가격


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							237
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-237	-237	-237	-237	-237	-237	-237
-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%	237	237	237	237	237	237	237
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%	8	8	8	8	8	8	8
-2.67%	7	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					809
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	162	162	162	162	162	162	162
-5.33%	162	162	161	161	161	160	159
-2.67%	151	147	143	139	134	130	125
0%	13	9	4	0	-5	-10	-15
2.67%	-254	-254	-254	-254	-255	-256	-257
5.33%	-531	-531	-531	-531	-531	-531	-531
8.00%	-809	-809	-809	-809	-809	-809	-809
	KR4301M62(	2017-06 풋297.5					22
	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%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-4	-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					73
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73
-5.33%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
-2.67%	-14	-14	-15	-15	-16	-16	-17
0%	1	1	0	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)

1,385

공시일	2017-06-02
기준일	2017-06-01

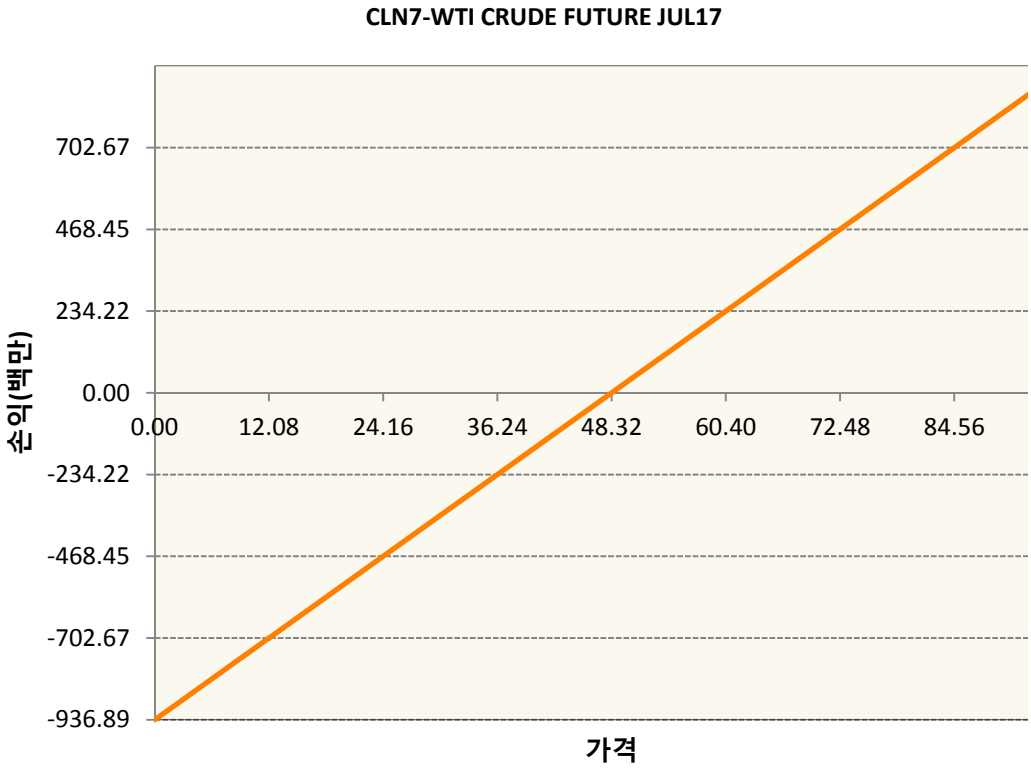
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

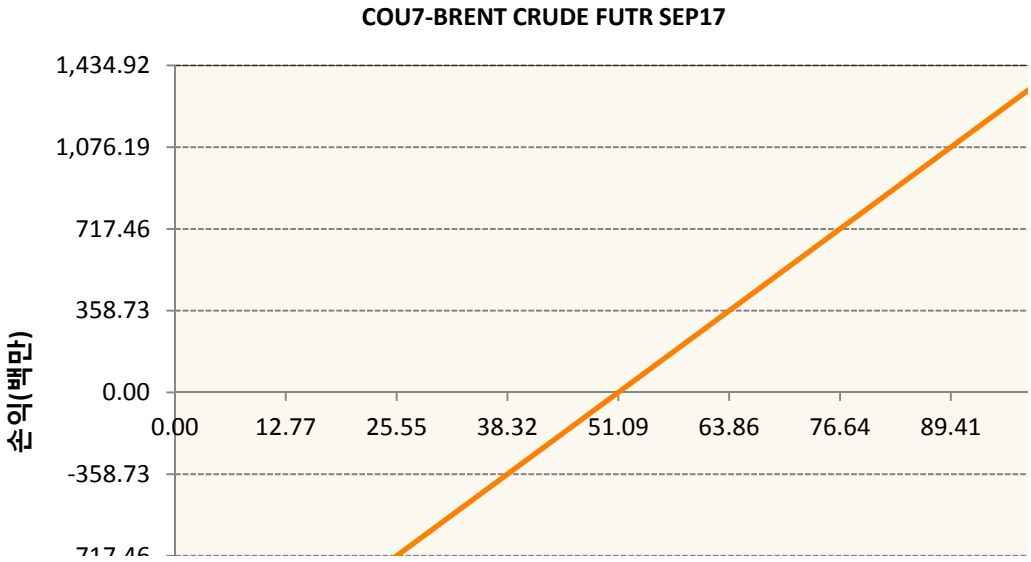
1. 계약금액

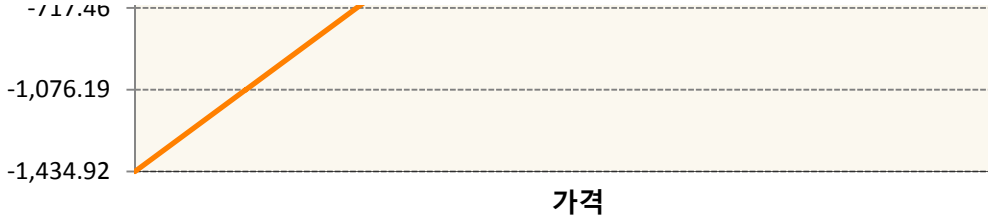
(단위:백만원)

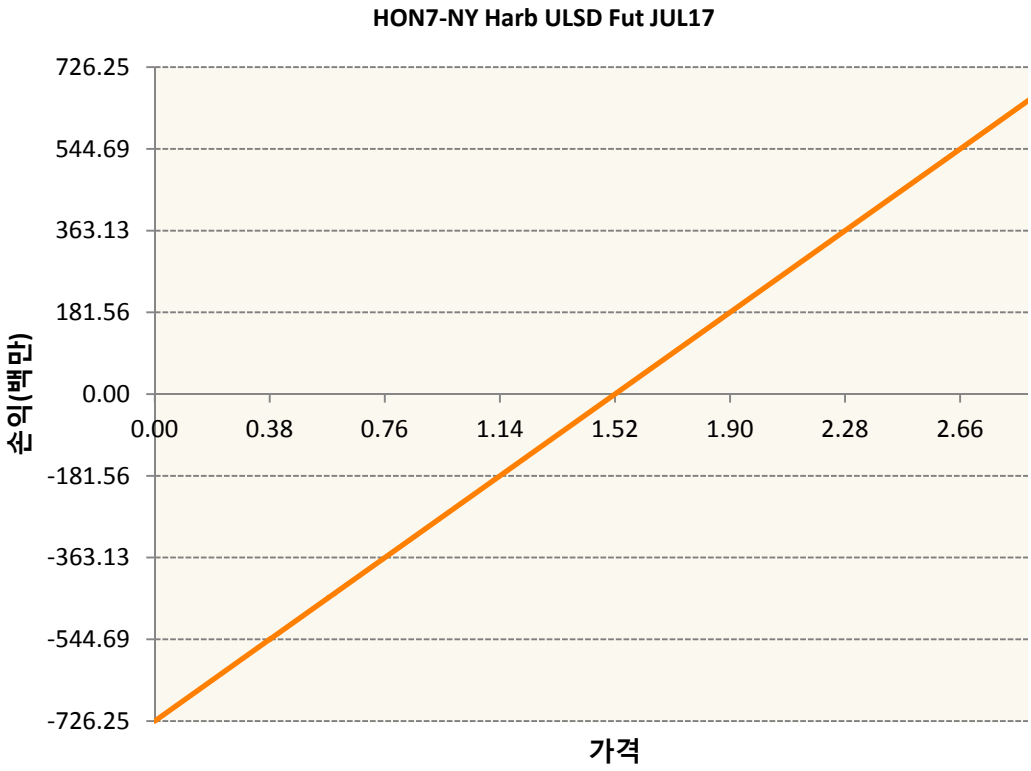
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,334	224	5,110	

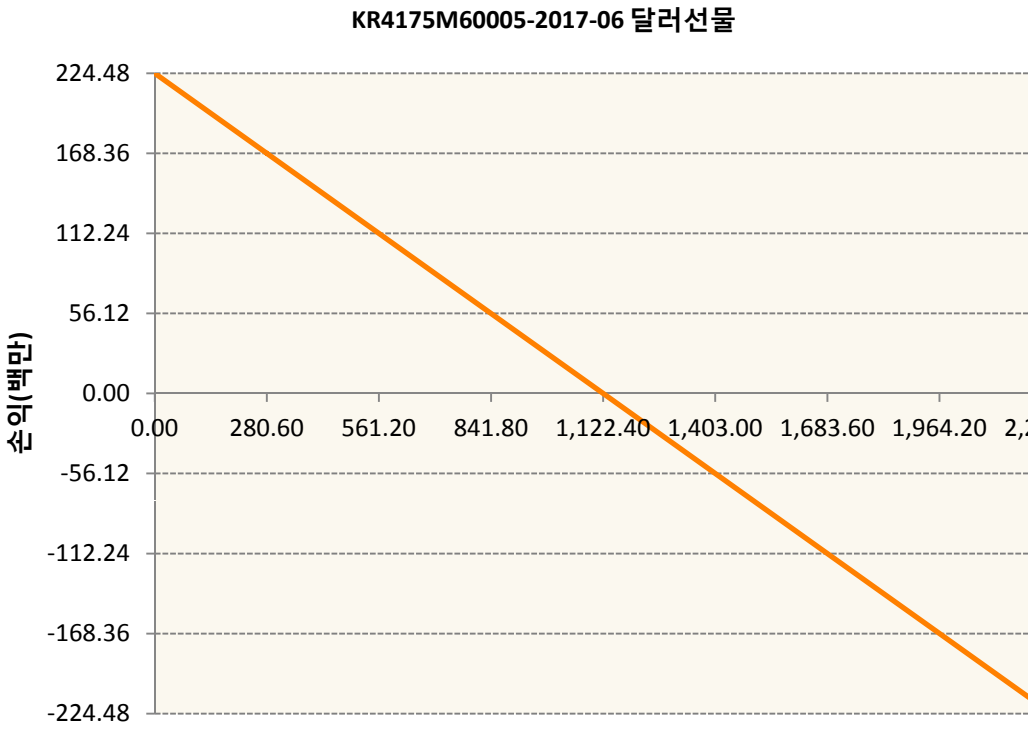
2. 만기시점의 손익구조



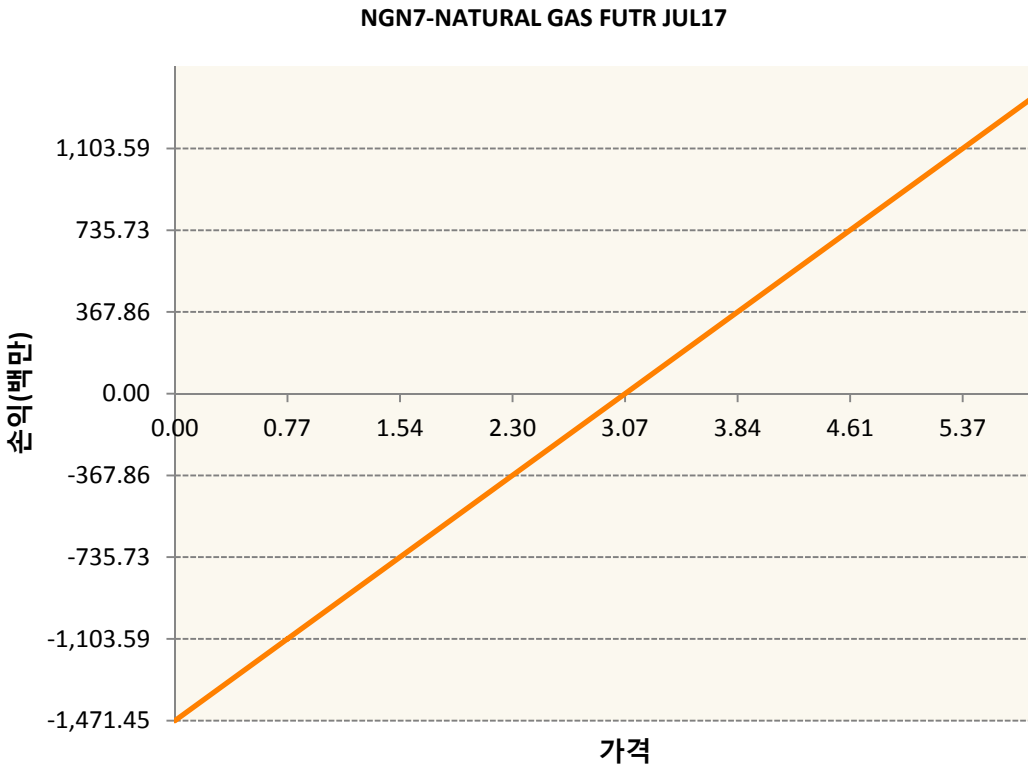


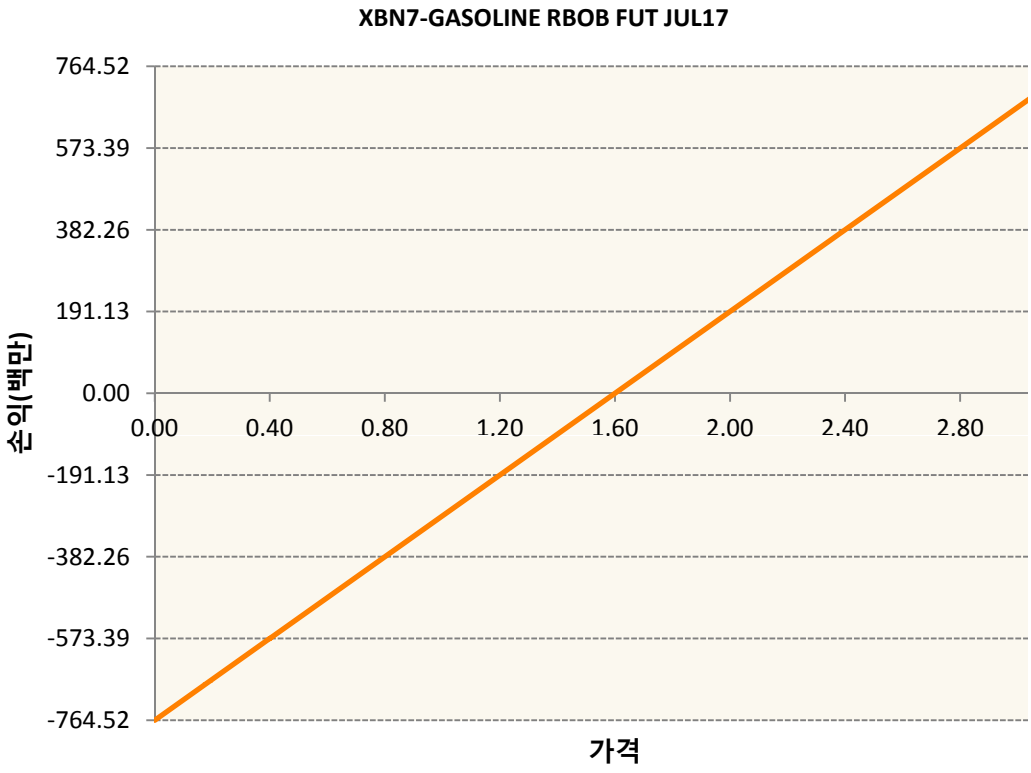

-1,076.19
-1,434.92
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
726.25
544.69
363.13
181.56
0.00
-181.56
-363.13
-544.69
-726.25
0.00
0.38
0.76
1.14
1.52
1.90
2.28
2.66
순이익(백만)
가격


KR4175M60005-2017-06 달러선물
224.48
168.36
112.24
56.12
0.00
-56.12
-112.24
-168.36
-224.48
0.00
280.60
561.20
841.80
1,122.40
1,403.00
1,683.60
1,964.20
순이익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,103.59
735.73
367.86
0.00
-367.86
-735.73
-1,103.59
-1,471.45
0.00
0.77
1.54
2.30
3.07
3.84
4.61
5.37
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
764.52
573.39
382.26
191.13
0.00
-191.13
-382.26
-573.39
-764.52
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	75
COU7	BRENT CRUDE FUTR SEP17	115
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	58
KR4175M60(	2017-06 달러선물	18
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	118
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	61

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

898

공시일	2017-06-02
기준일	2017-06-01

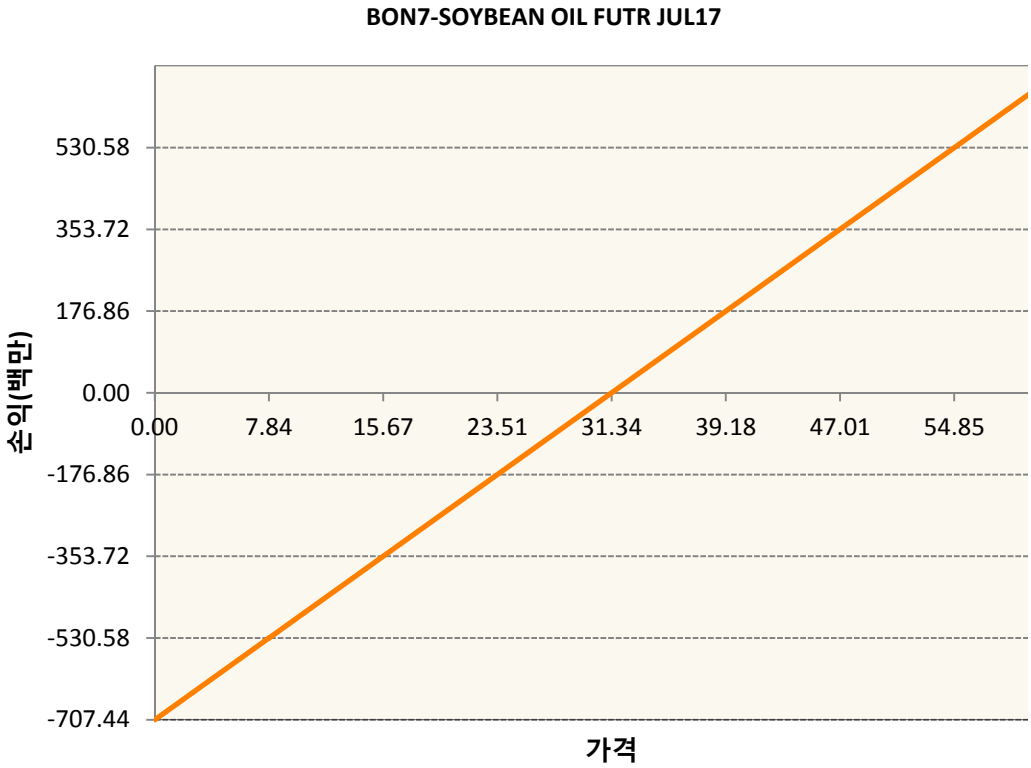
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

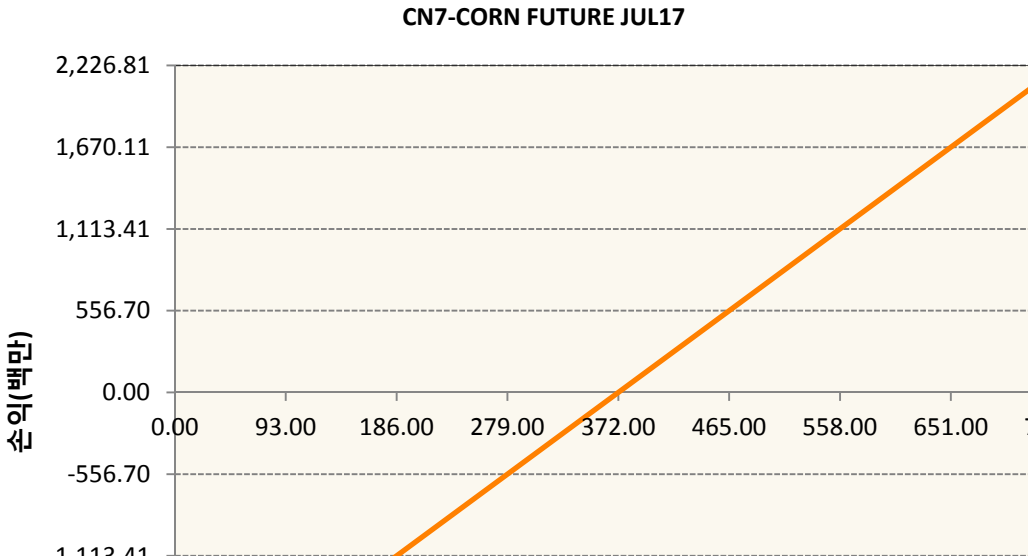
1. 계약금액

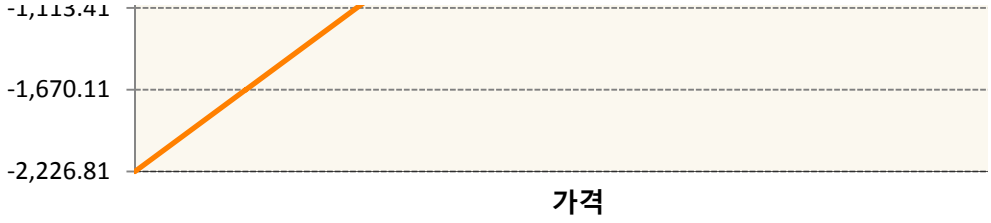
(단위:백만원)

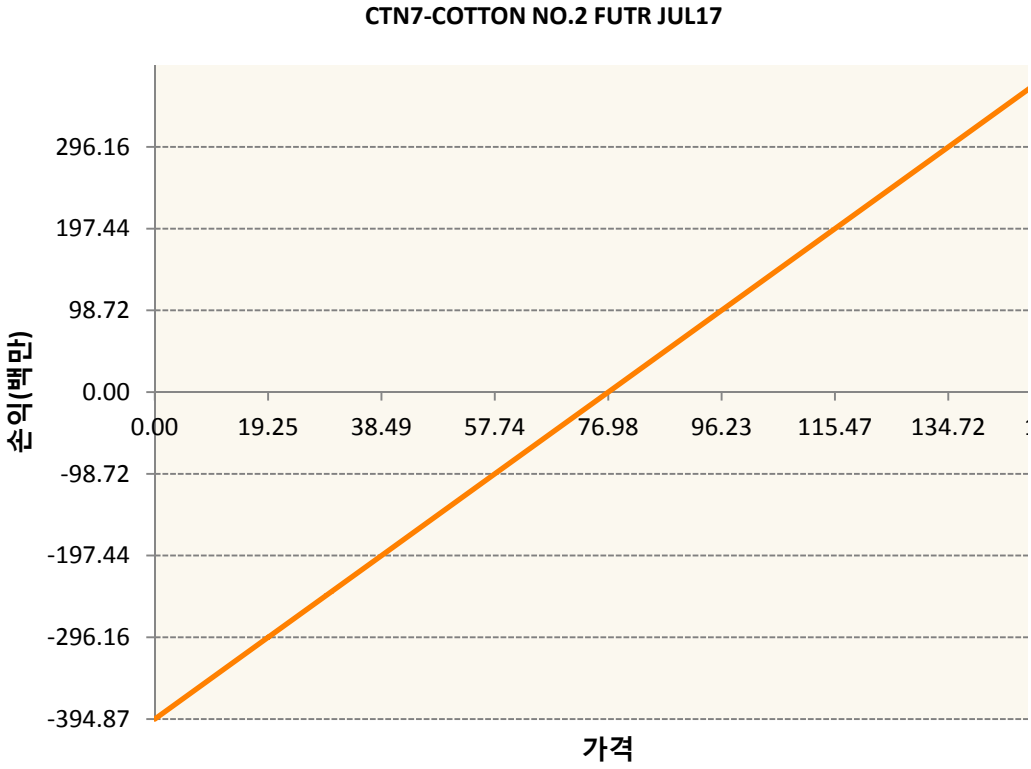
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,248	393	7,855	

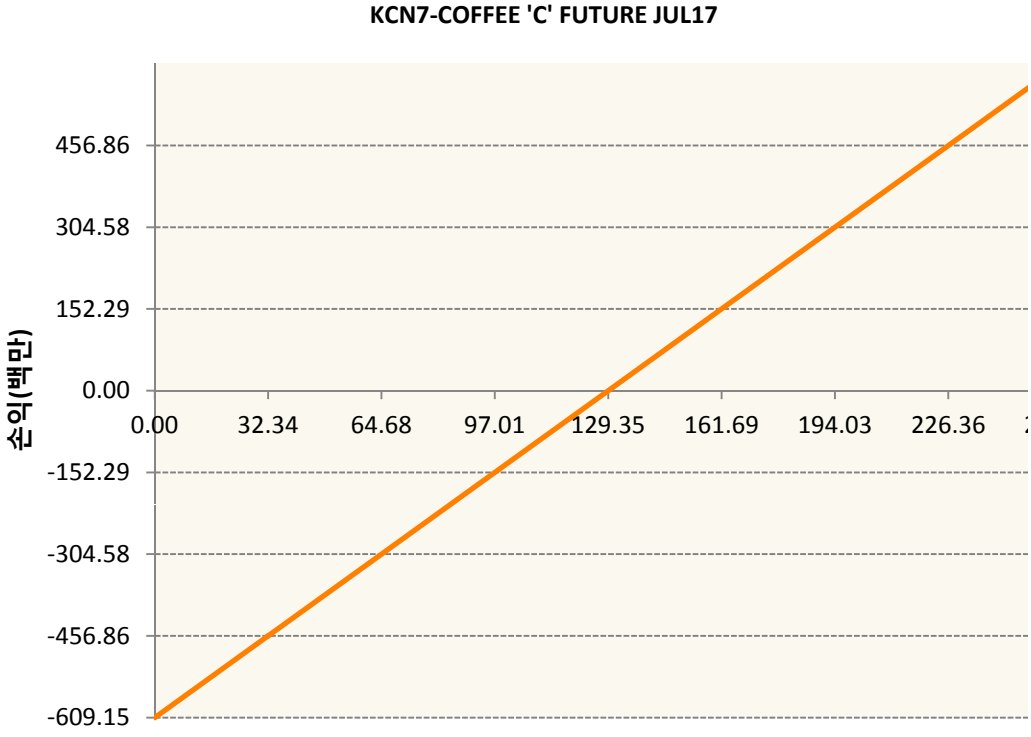
2. 만기시점의 손익구조



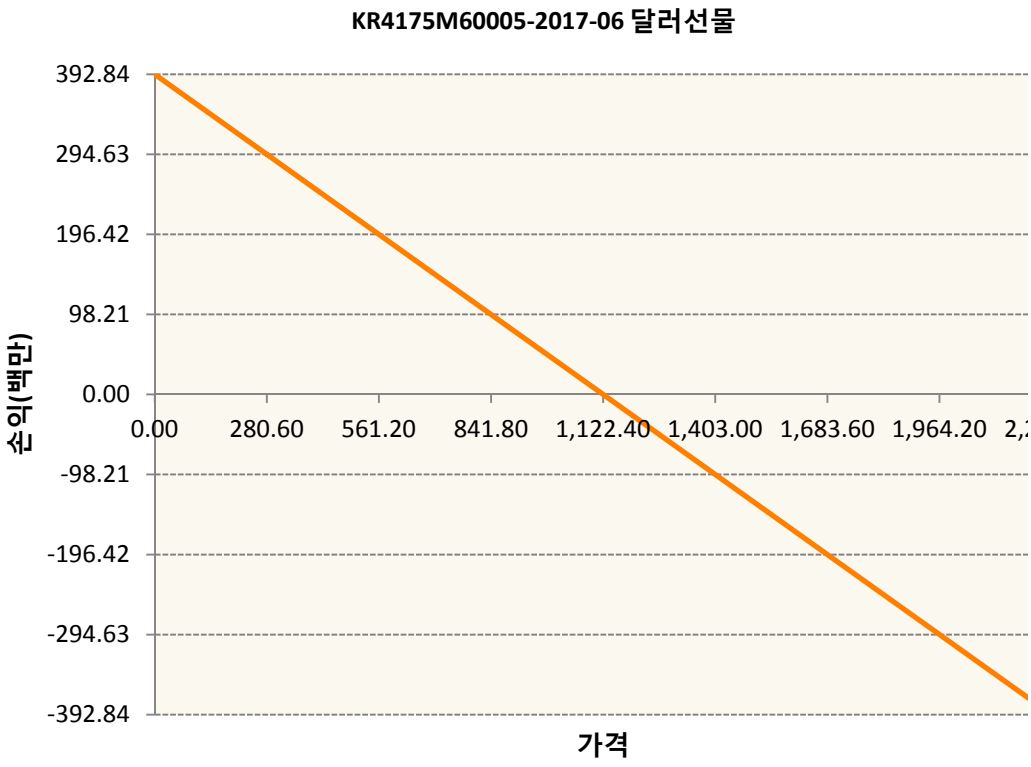


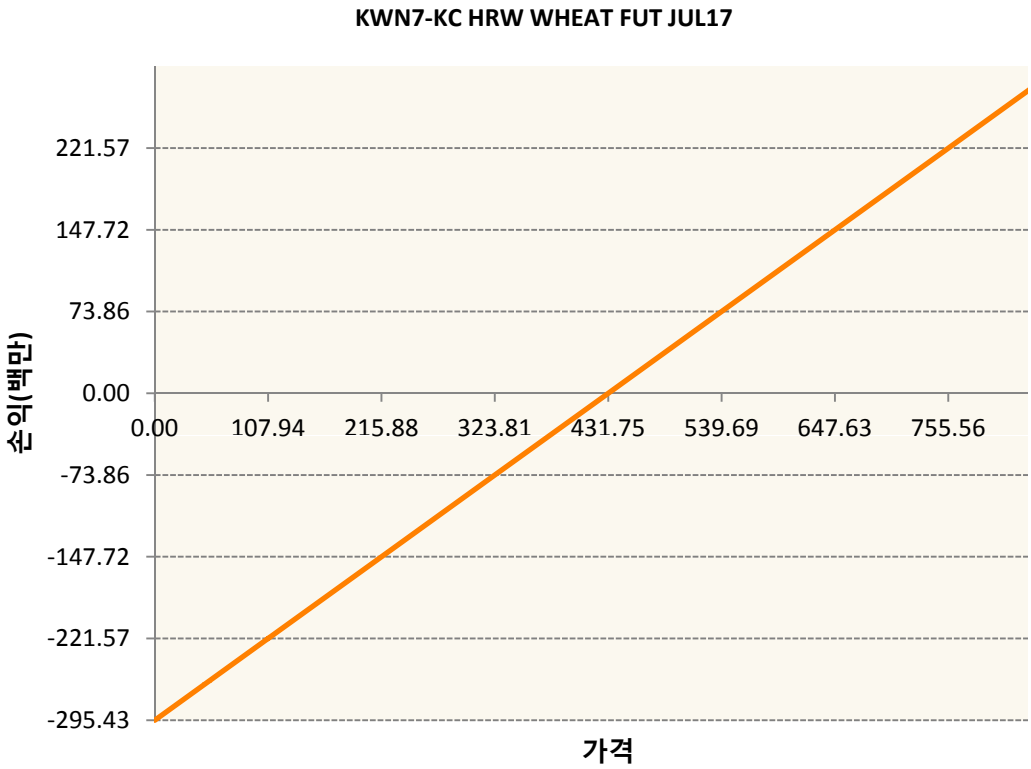

-1,670.11
-2,226.81
가격

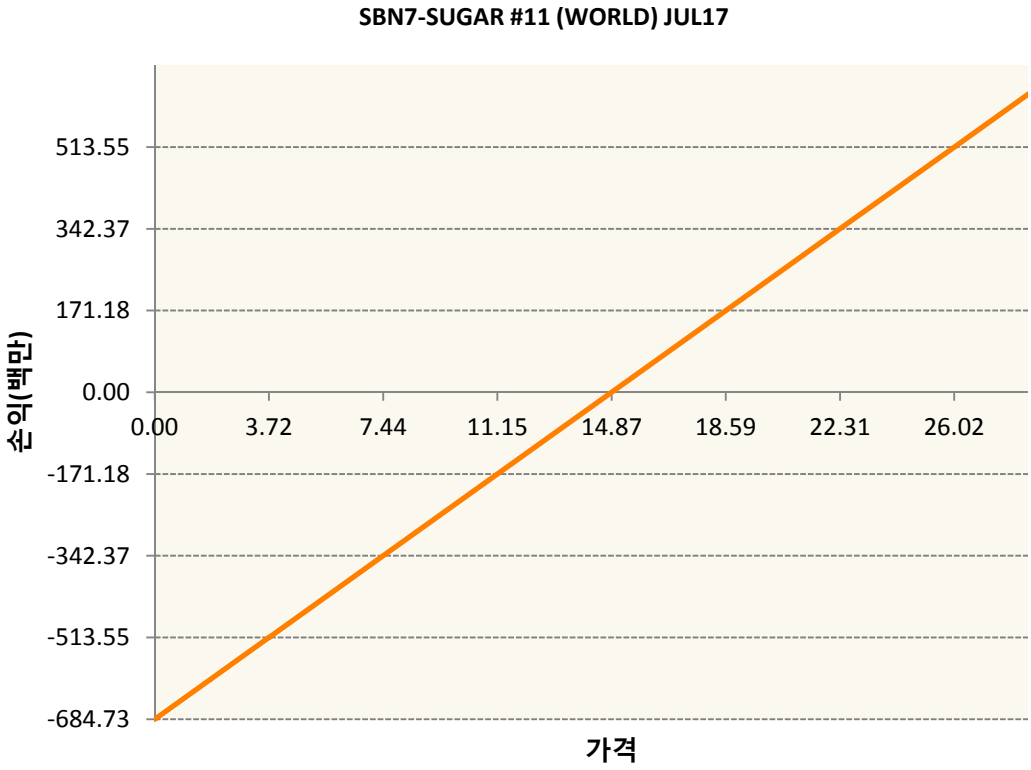

CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
296.16
197.44
98.72
0.00
-98.72
-197.44
-296.16
-394.87
0.00
19.25
38.49
57.74
76.98
96.23
115.47
134.72
순익(백만)
가격

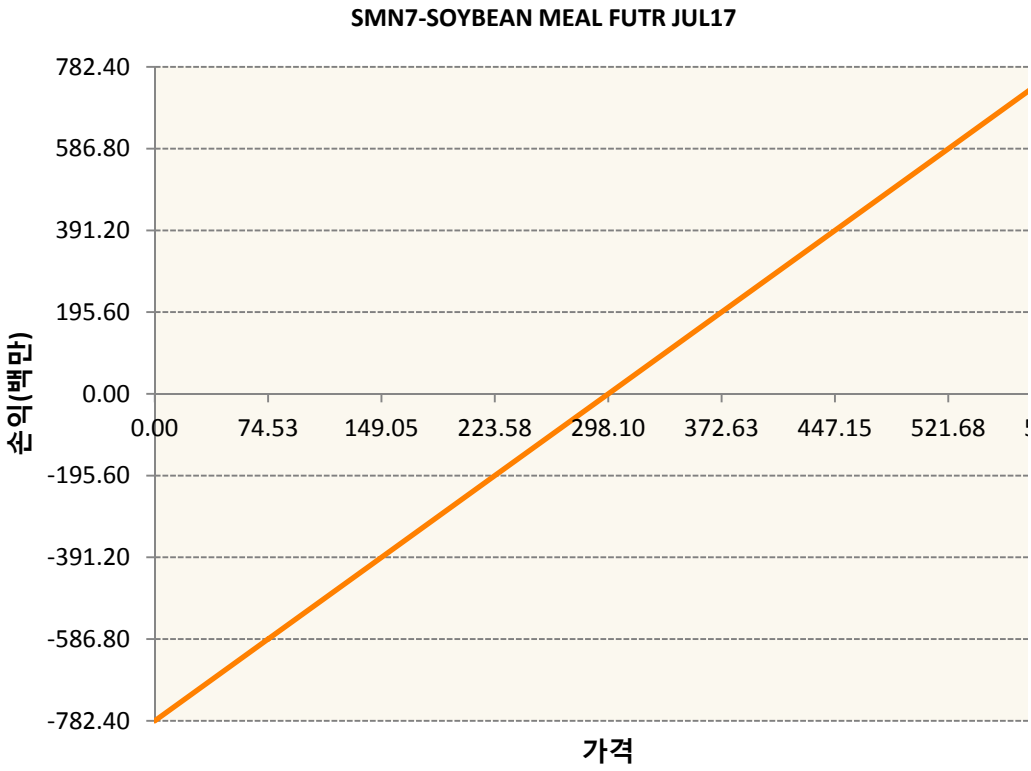

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
456.86
304.58
152.29
0.00
-152.29
-304.58
-456.86
-609.15
0.00
32.34
64.68
97.01
129.35
161.69
194.03
226.36
순익(백만)

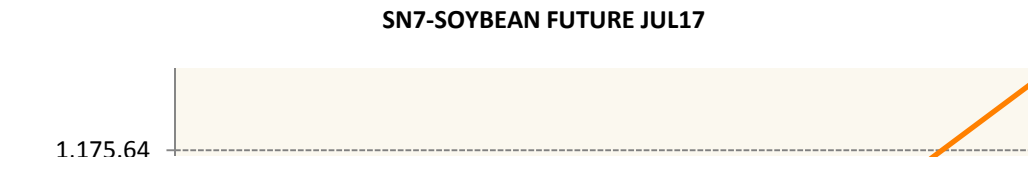
가격

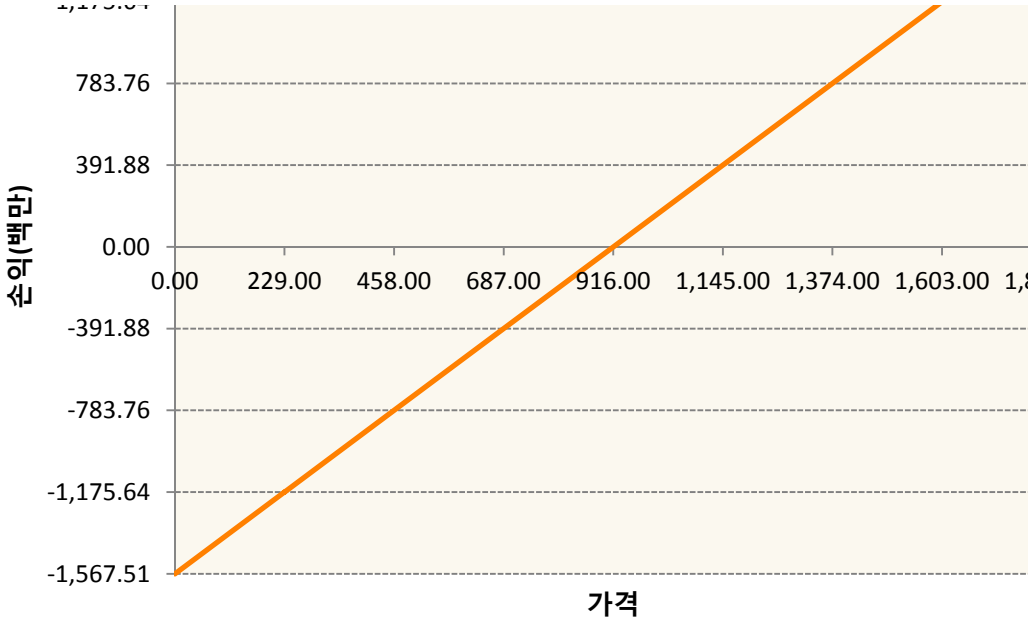

KR4175M60005-2017-06 달러선물
392.84
294.63
196.42
98.21
0.00
-98.21
-196.42
-294.63
-392.84
0.00
280.60
561.20
841.80
1,122.40
1,403.00
1,683.60
1,964.20
손익(백만)
가격

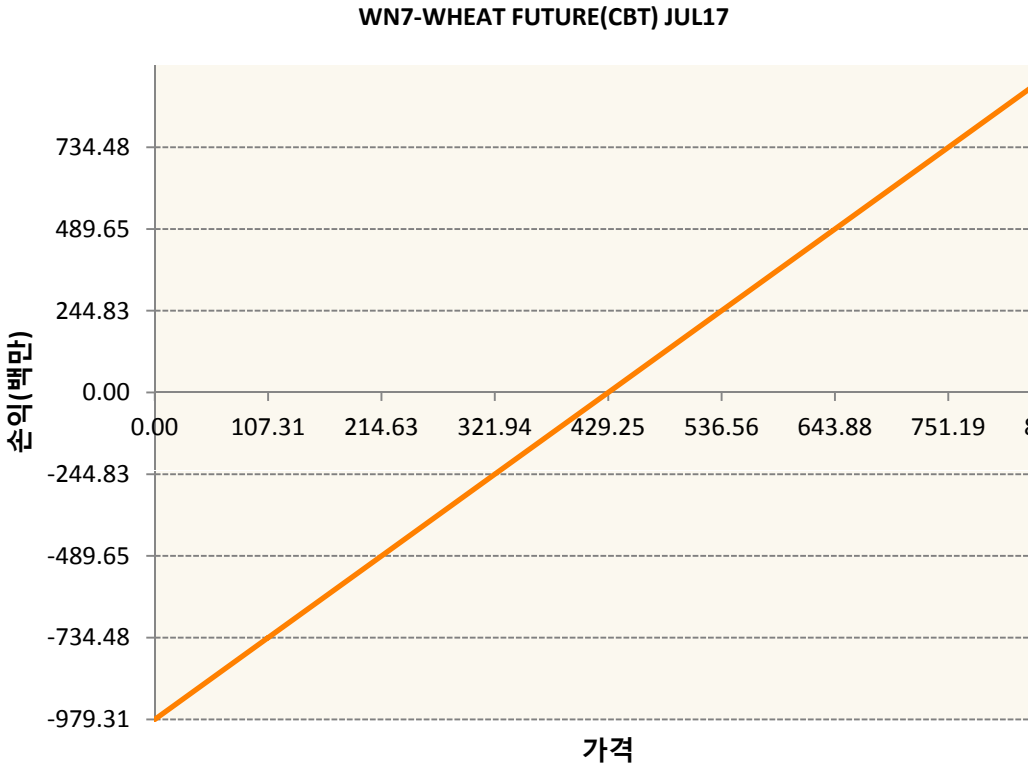

KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17
221.57
147.72
73.86
0.00
-73.86
-147.72
-221.57
-295.43
0.00
107.94
215.88
323.81
431.75
539.69
647.63
755.56
손익(백만)
가격


SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
513.55
342.37
171.18
0.00
-171.18
-342.37
-513.55
-684.73
손익(백만)
0.00
3.72
7.44
11.15
14.87
18.59
22.31
26.02
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
782.40
586.80
391.20
195.60
0.00
-195.60
-391.20
-586.80
-782.40
손익(백만)
0.00
74.53
149.05
223.58
298.10
372.63
447.15
521.68
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,175.64





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	57
CN7	CORN FUTURE JUL17	178
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	125
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	78

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

751