공시일	2017-06-05
기준일	2017-06-02

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	2017-06-05
기준일	2017-06-02

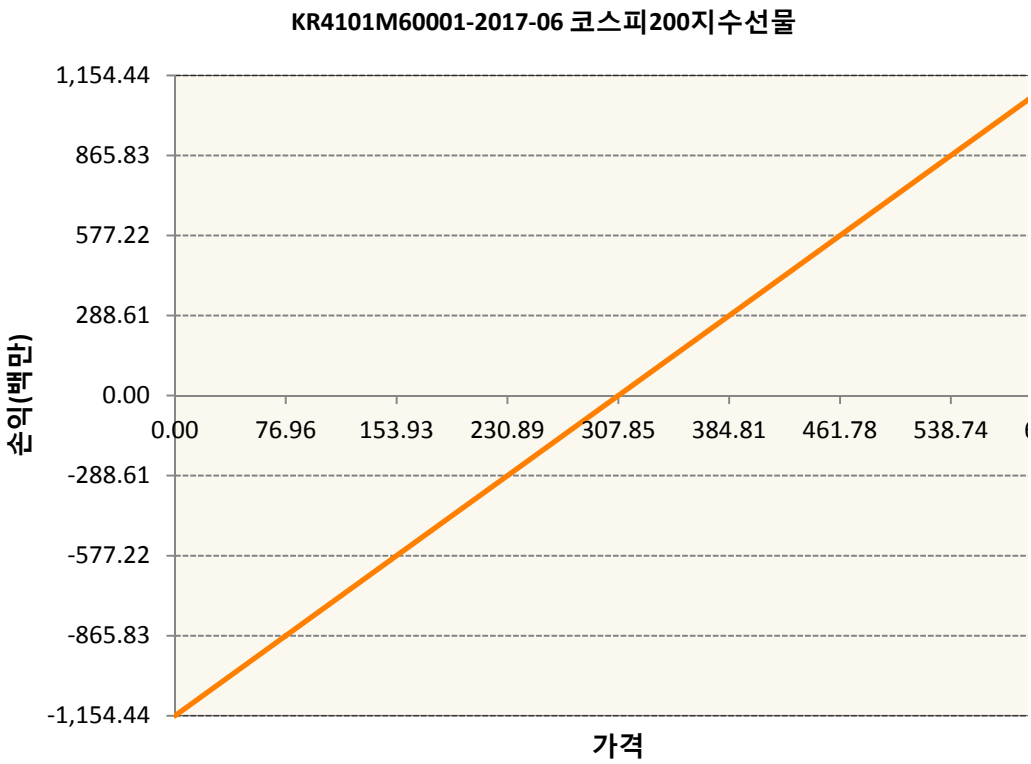
스마트인덱스모

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	1,154	0	1,154	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							92
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
-5.33%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
-2.67%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	31	31	31	31	31	31	31
5.33%	62	62	62	62	62	62	62
8.00%	92	92	92	92	92	92	92

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

61

공시일	2017-06-05
기준일	2017-06-02

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	999

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

534

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-05
기준일	2017-06-02

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	356

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

322

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-05
기준일	2017-06-02

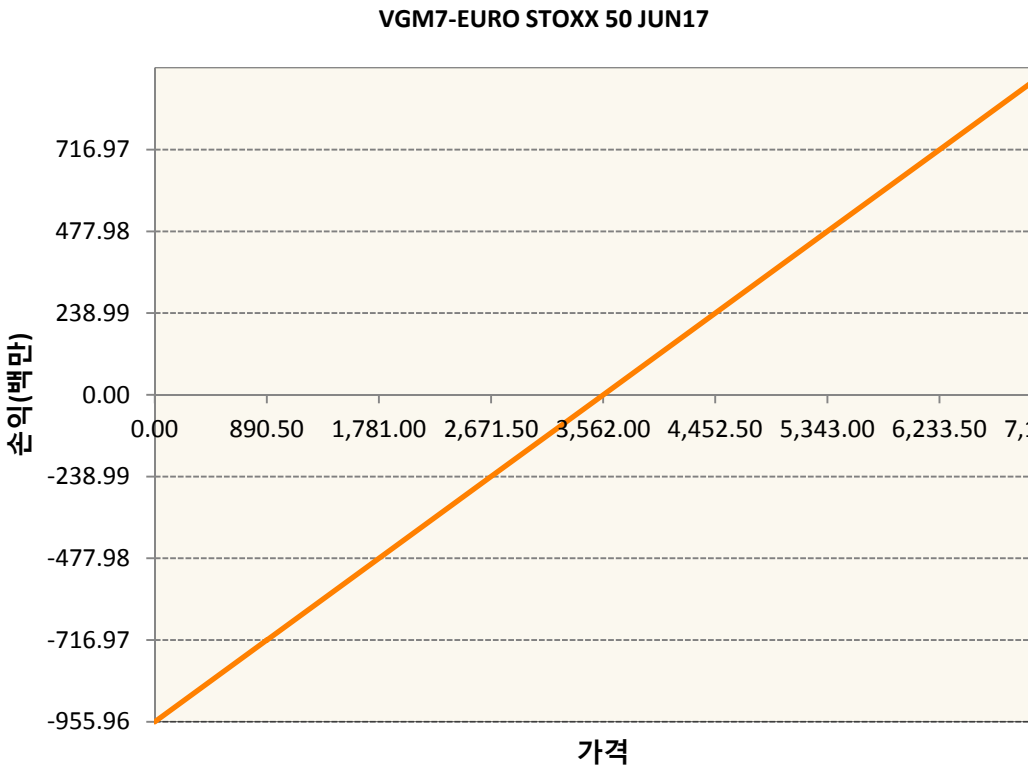
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2017-06-05
기준일	2017-06-02

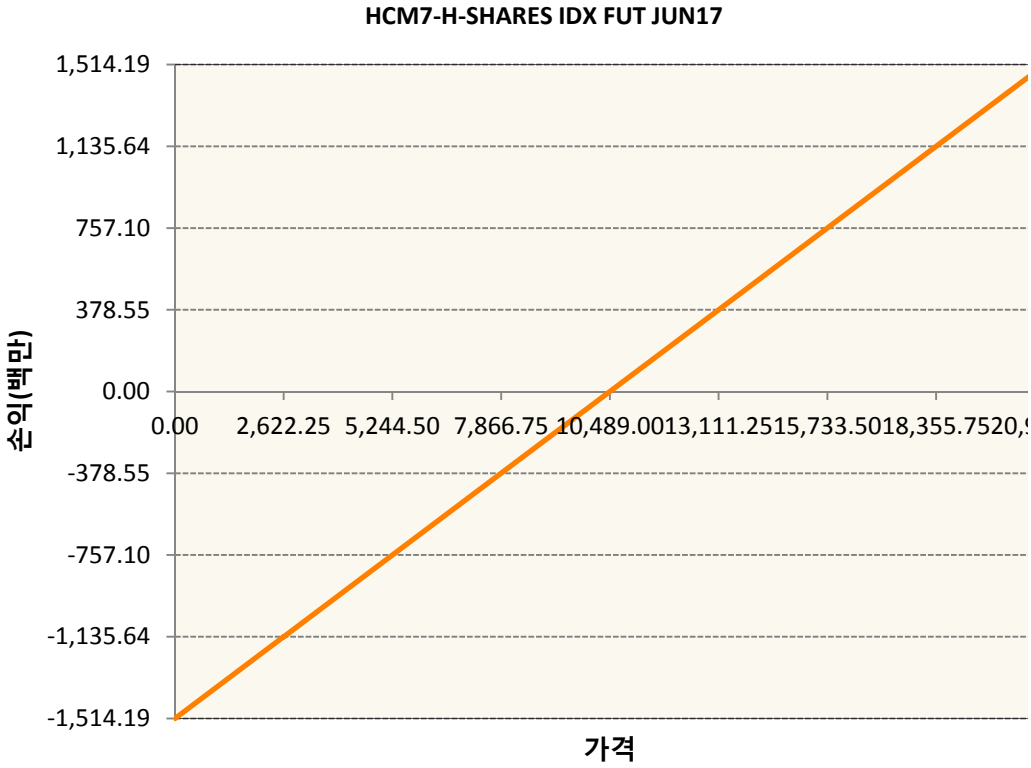
차이나인덱스모(주식-파생형)

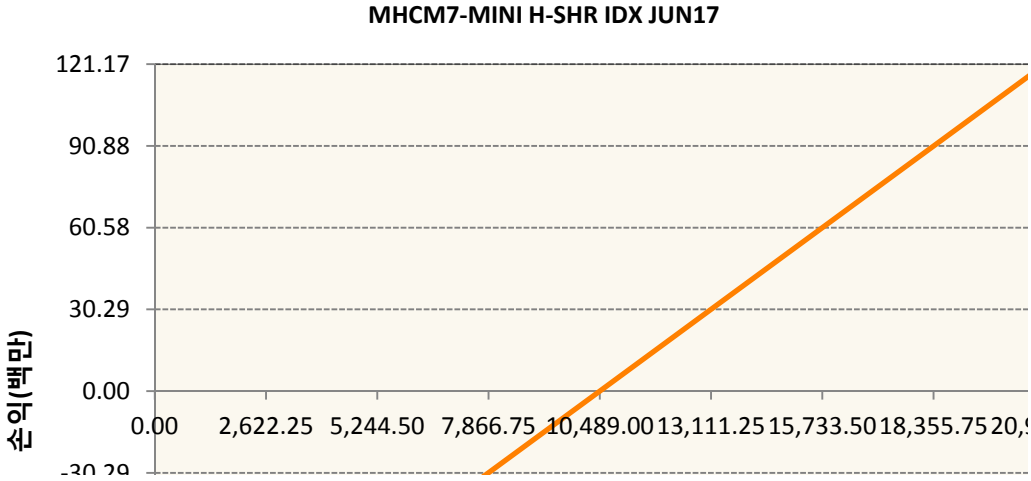
1. 계약금액

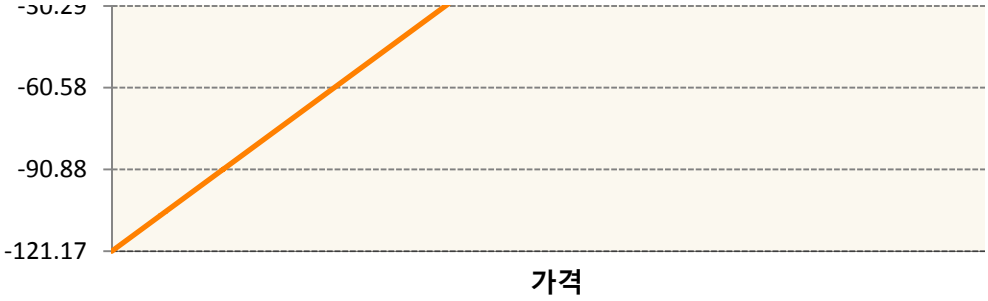
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계			1,514	0	1,514	
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	2017-06-05
기준일	2017-06-02

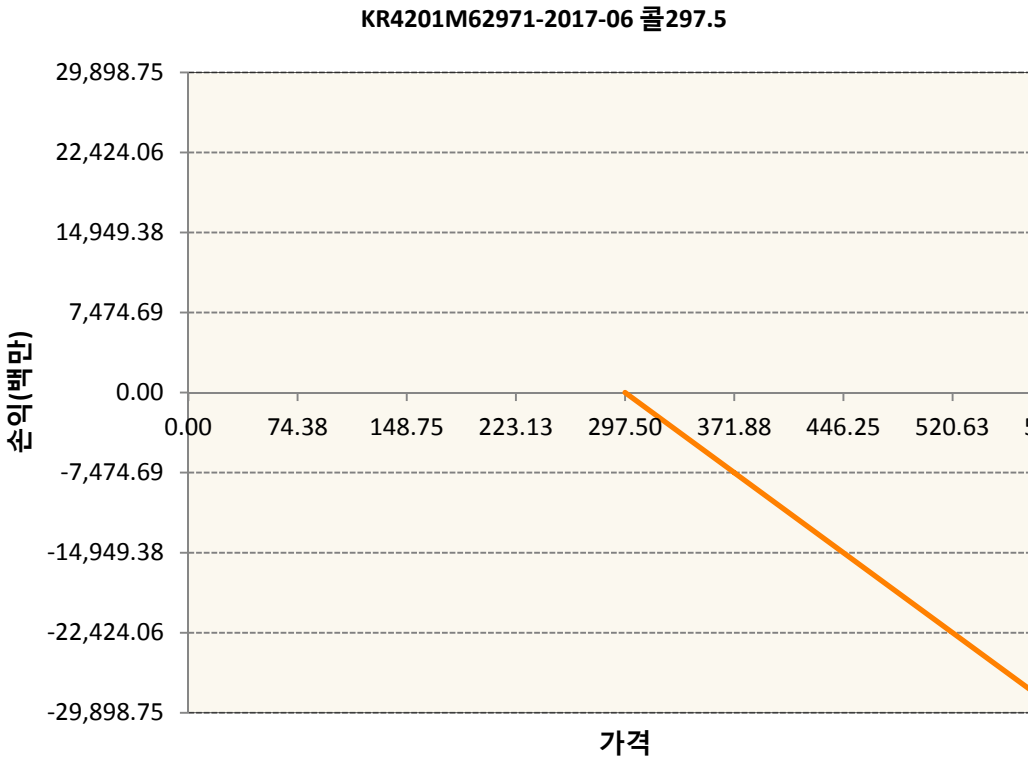
커버드콜모(주식혼합-파생형)

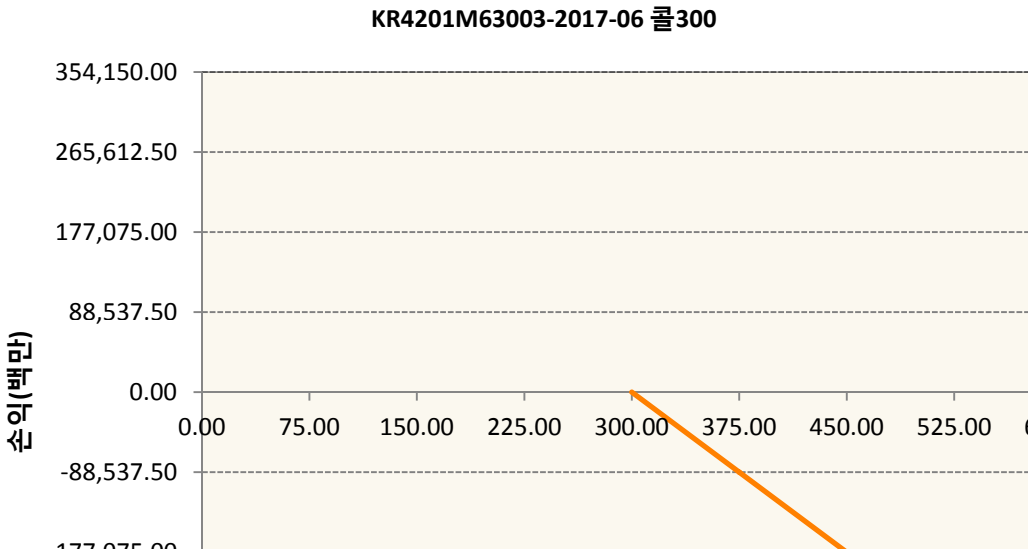
1. 계약금액

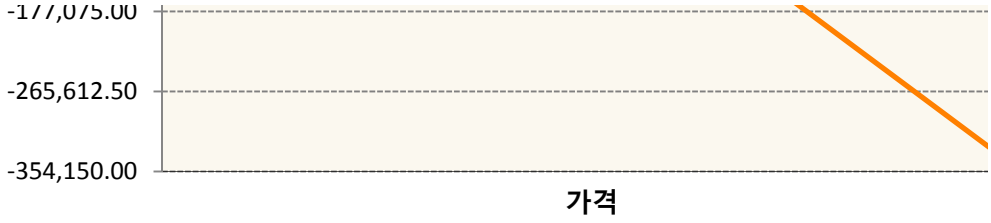
(단위:백만원)

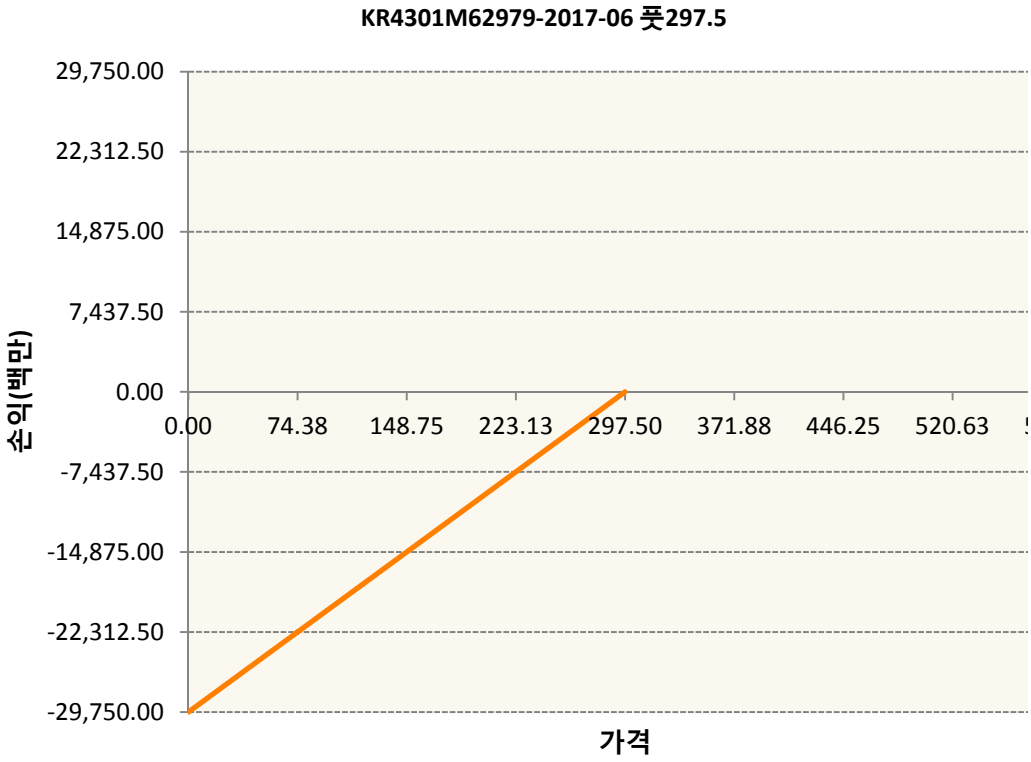
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	713,799	-713,799	장내

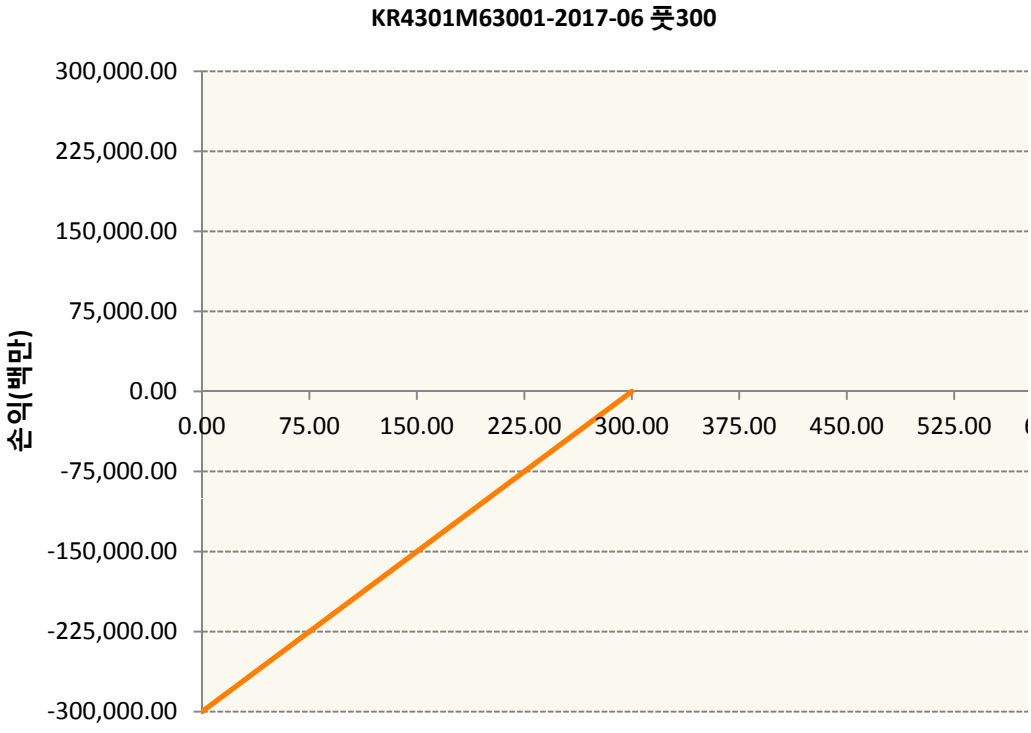
2. 만기시점의 손익구조






-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						2,471
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,041	1,041	1,041	1,040	1,040	1,040	1,039
-5.33%	1,034	1,029	1,023	1,016	1,009	1,000	990
-2.67%	763	749	734	719	704	689	674
0%	3	3	2	0	-2	-5	-9
2.67%	-821	-821	-821	-821	-821	-821	-822
5.33%	-1,646	-1,646	-1,646	-1,646	-1,646	-1,646	-1,646
8.00%	-2,471	-2,471	-2,471	-2,471	-2,471	-2,471	-2,471
KR4201M63(	2017-06 콜300						28,914
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,382	9,382	9,382	9,382	9,381	9,380	9,377
-5.33%	9,369	9,353	9,328	9,292	9,247	9,191	9,125
-2.67%	7,856	7,663	7,470	7,277	7,084	6,891	6,697
0%	120	92	52	0	-64	-139	-224
2.67%	-9,538	-9,538	-9,538	-9,539	-9,541	-9,545	-9,552
5.33%	-19,226	-19,226	-19,226	-19,226	-19,226	-19,226	-19,226
8.00%	-28,914	-28,914	-28,914	-28,914	-28,914	-28,914	-28,914
KR4301M62(	2017-06 풋297.5						1,428
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,427	-1,427	-1,427	-1,427	-1,427	-1,427	-1,428
-5.33%	-613	-617	-623	-630	-638	-646	-656
-2.67%	-61	-76	-90	-105	-120	-135	-150
0%	3	3	2	0	-2	-5	-9
2.67%	3	3	3	3	3	3	3
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3
KR4301M63(	2017-06 풋300						16,677
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-16,672	-16,672	-16,672	-16,673	-16,673	-16,674	-16,677
-5.33%	-8,477	-8,491	-8,512	-8,542	-8,580	-8,628	-8,683
-2.67%	-1,552	-1,715	-1,878	-2,042	-2,206	-2,370	-2,533
0%	102	78	44	0	-54	-117	-190
2.67%	127	127	127	126	124	121	115

5.33%	127	127	127	127	127	127	127
8.00%	127	127	127	127	127	127	127

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

51,247

공시일	2017-06-05
기준일	2017-06-02

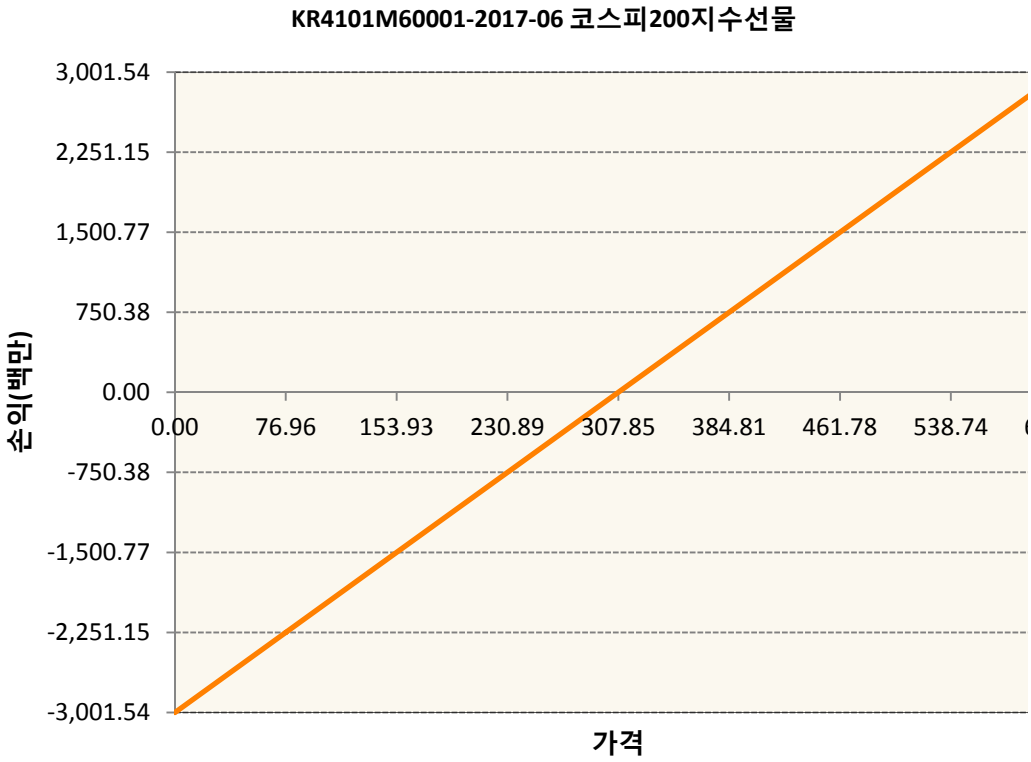
커버드콜목표전환형증권투자신탁

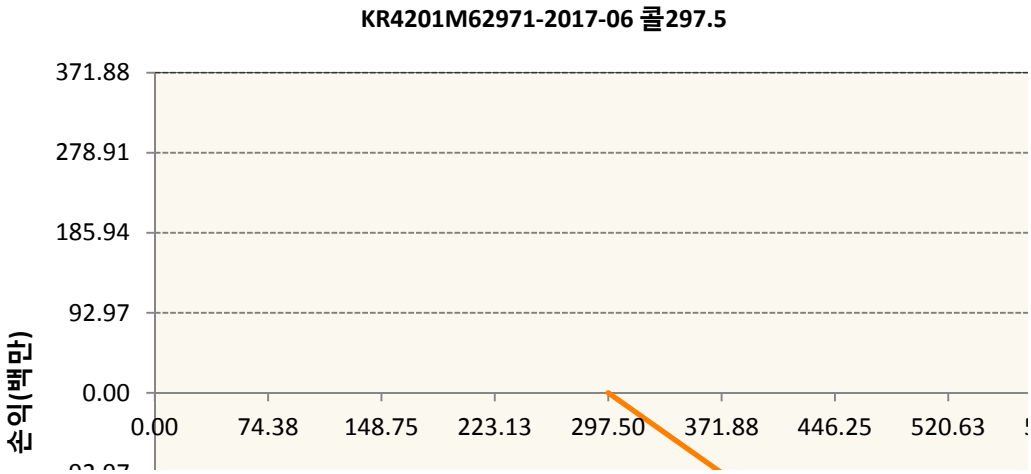
1. 계약금액

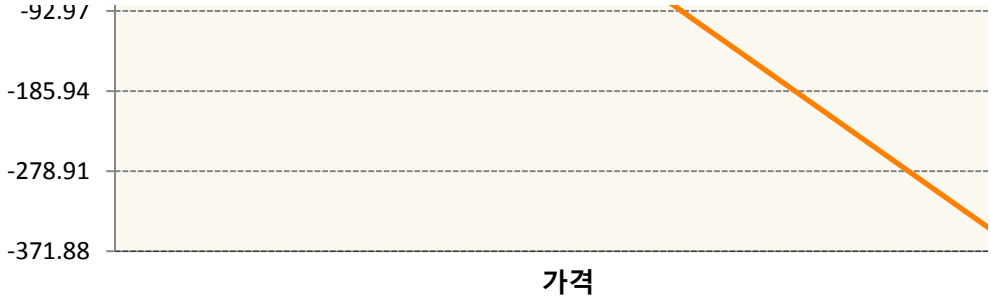
(단위:백만원)

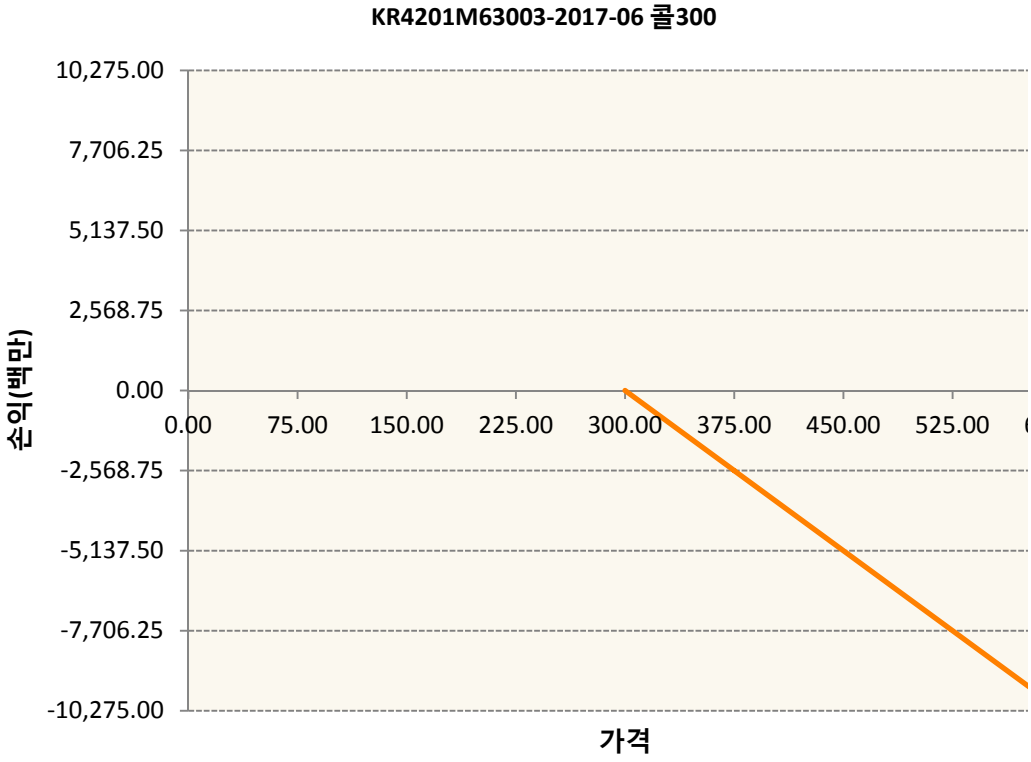
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,002	0	3,002	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,144	-12,144	장내

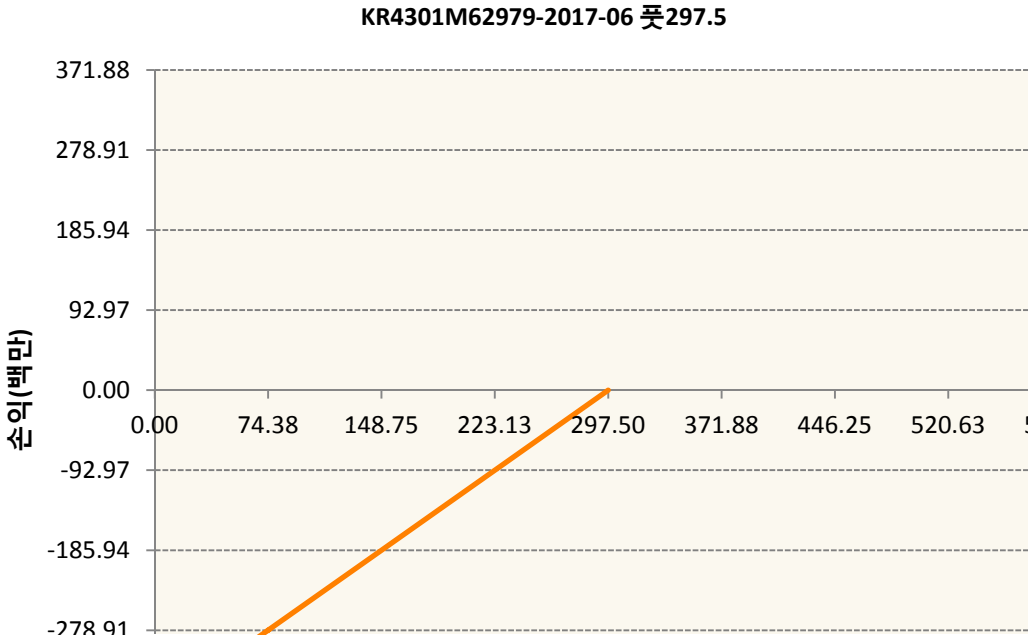
2. 만기시점의 손익구조



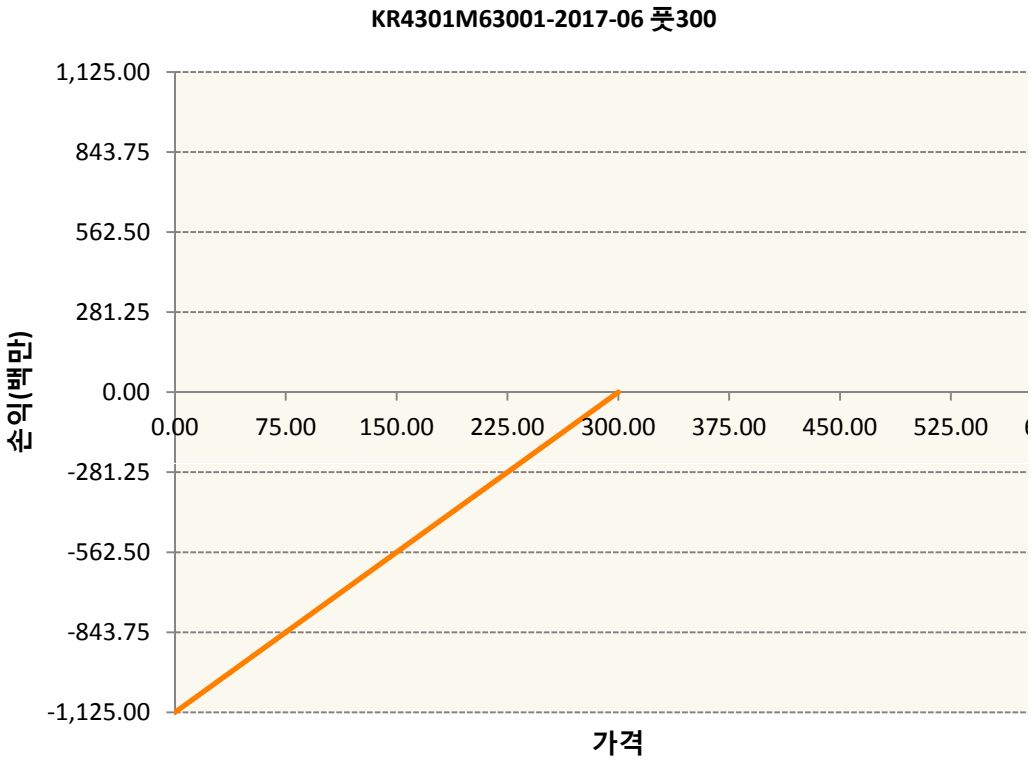



-92.97
-185.94
-278.91
-371.88
가격


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							240
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-240	-240	-240	-240	-240	-240	-240
-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%	240	240	240	240	240	240	240
KR4201M62(2017-06 콜297.5							31
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13	13	13	13	13	13	13
-5.33%	13	13	13	13	13	12	12
-2.67%	9	9	9	9	9	9	8

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%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
	KR4201M63(	2017-06 콜300					839
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	272	272	272	272	272	272	272
-5.33%	272	271	271	270	268	267	265
-2.67%	228	222	217	211	206	200	194
0%	3	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	-277	-277	-277	-277	-277	-277	-277
5.33%	-558	-558	-558	-558	-558	-558	-558
8.00%	-839	-839	-839	-839	-839	-839	-839
	KR4301M62(	2017-06 풋297.5					18
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
-5.33%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-2	-2
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					63
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-33
-2.67%	-6	-6	-7	-8	-8	-9	-10
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

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

1,271

공시일	2017-06-05
기준일	2017-06-02

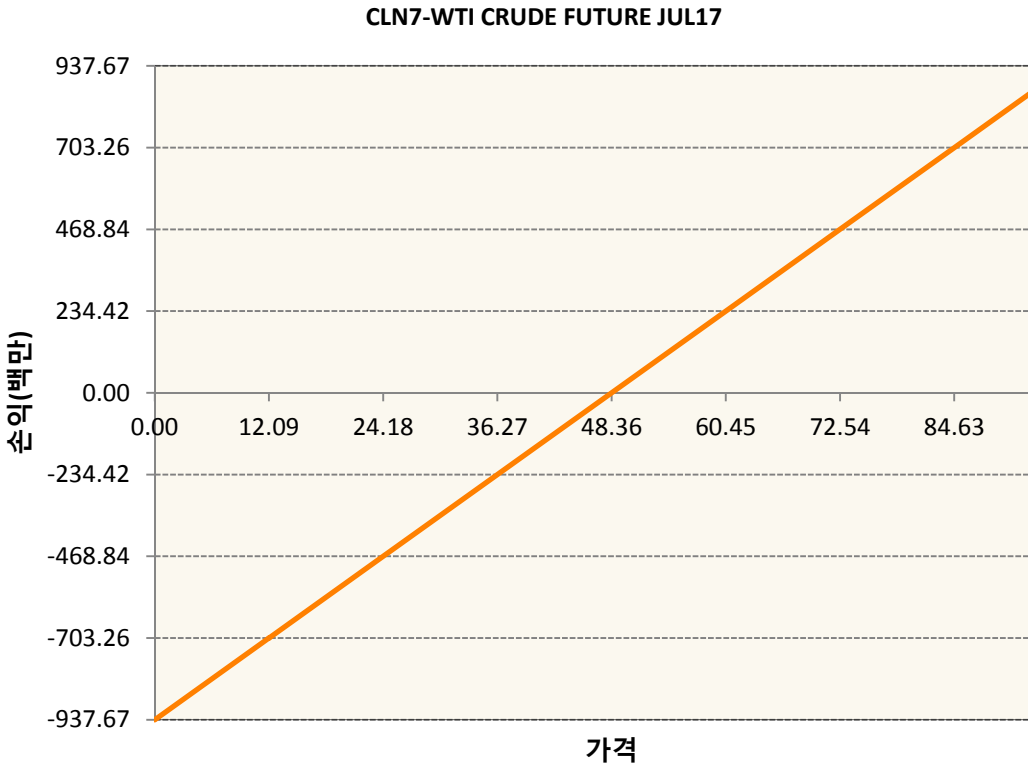
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

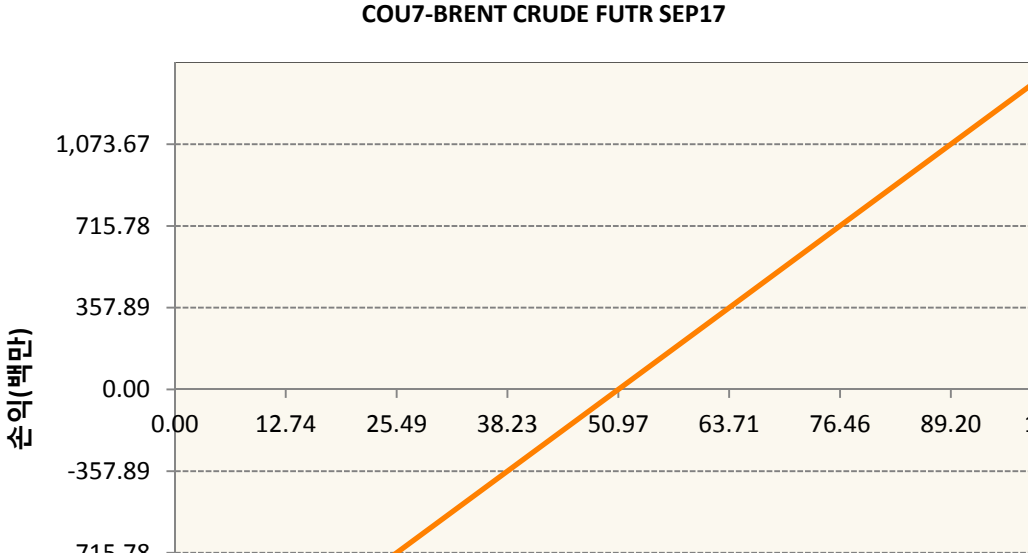
1. 계약금액

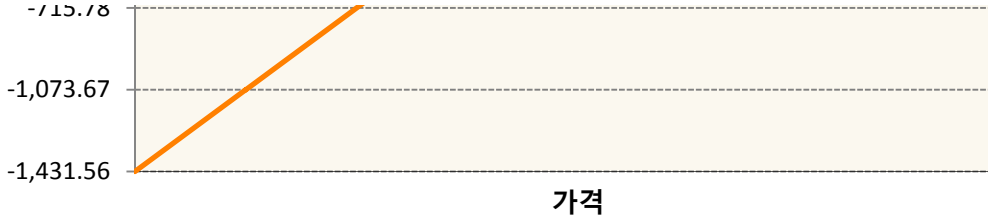
(단위:백만원)

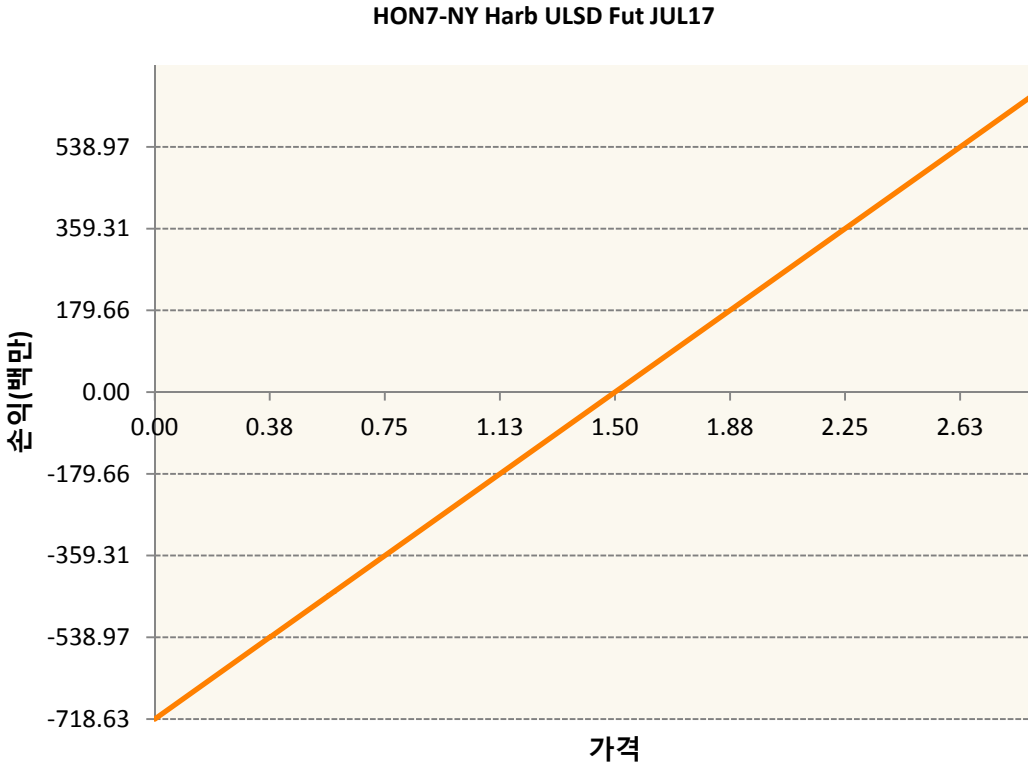
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,296	224	5,072	

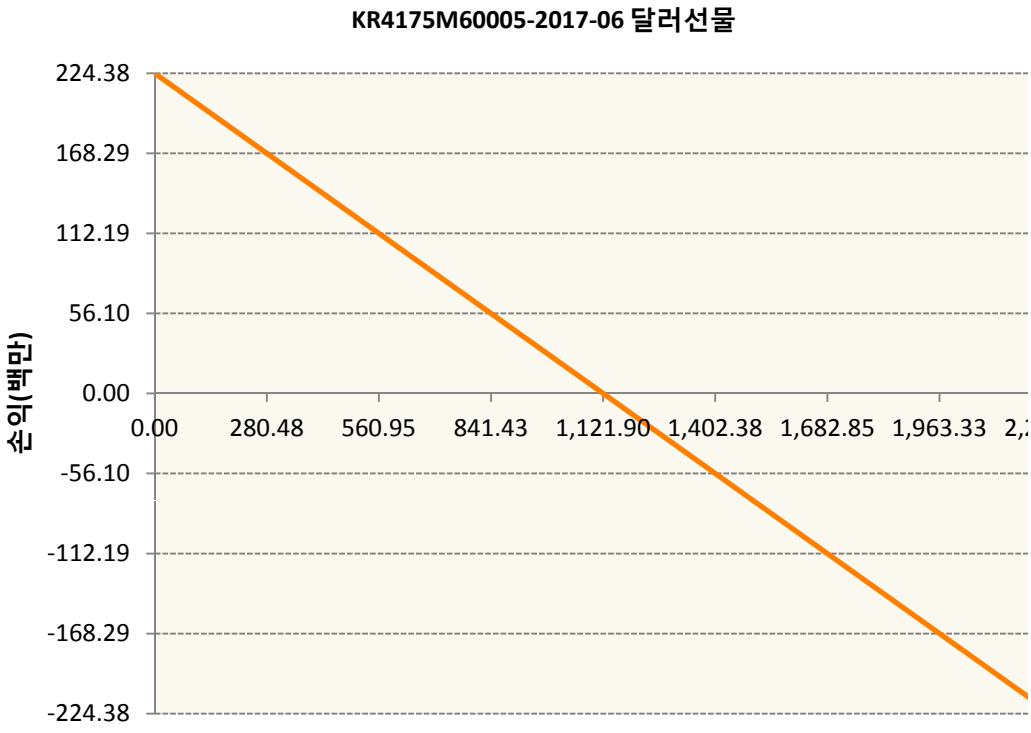
2. 만기시점의 손익구조



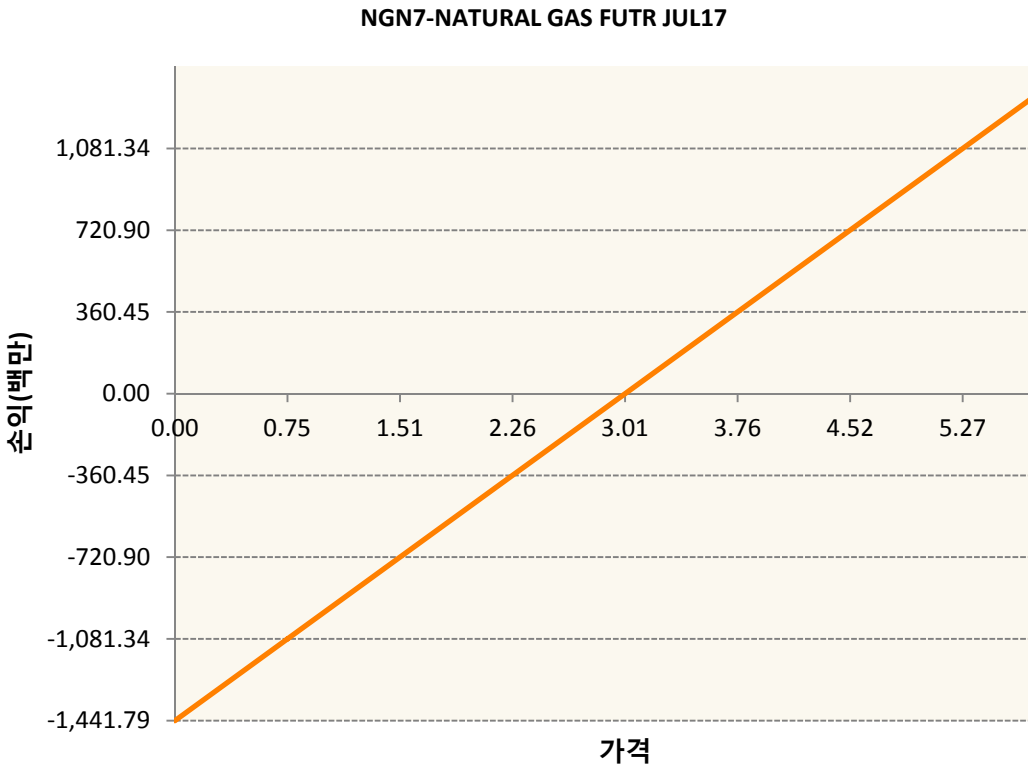


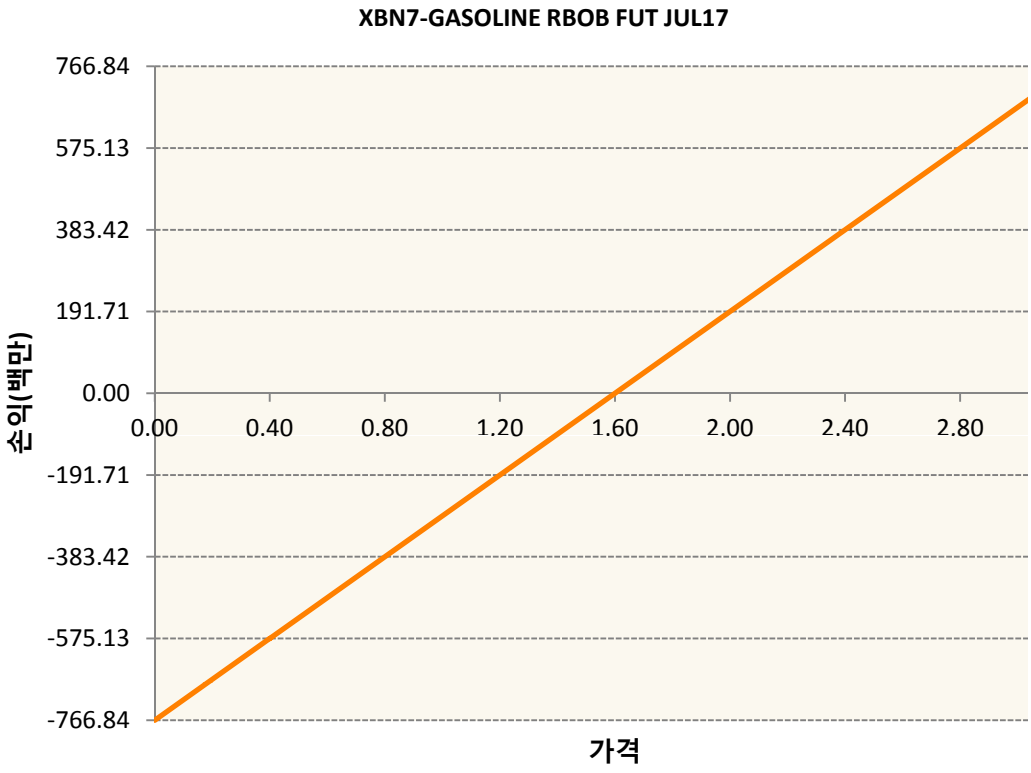

-1,073.67
-1,431.56
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
538.97
359.31
179.66
0.00
-179.66
-359.31
-538.97
-718.63
0.00
0.38
0.75
1.13
1.50
1.88
2.25
2.63
손익(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
손익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,081.34
720.90
360.45
0.00
-360.45
-720.90
-1,081.34
-1,441.79
0.00
0.75
1.51
2.26
3.01
3.76
4.52
5.27
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
766.84
575.13
383.42
191.71
0.00
-191.71
-383.42
-575.13
-766.84
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	57
KR4175M60(	2017-06 달러선물	18
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	115
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	61

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

887

공시일	2017-06-05
기준일	2017-06-02

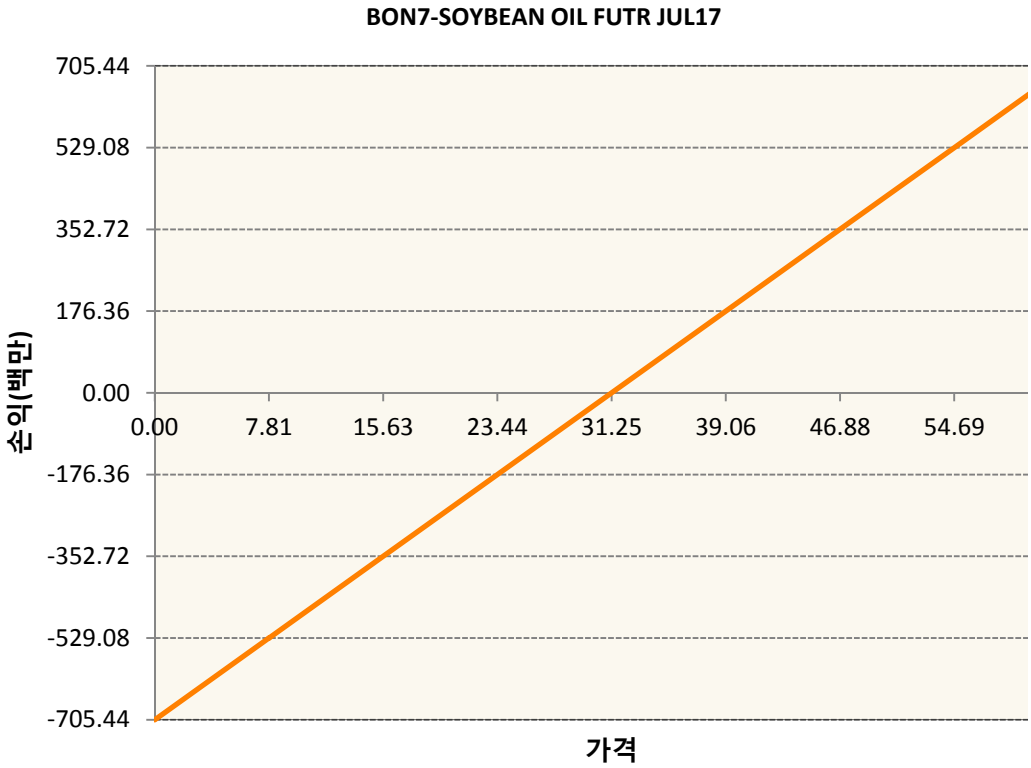
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

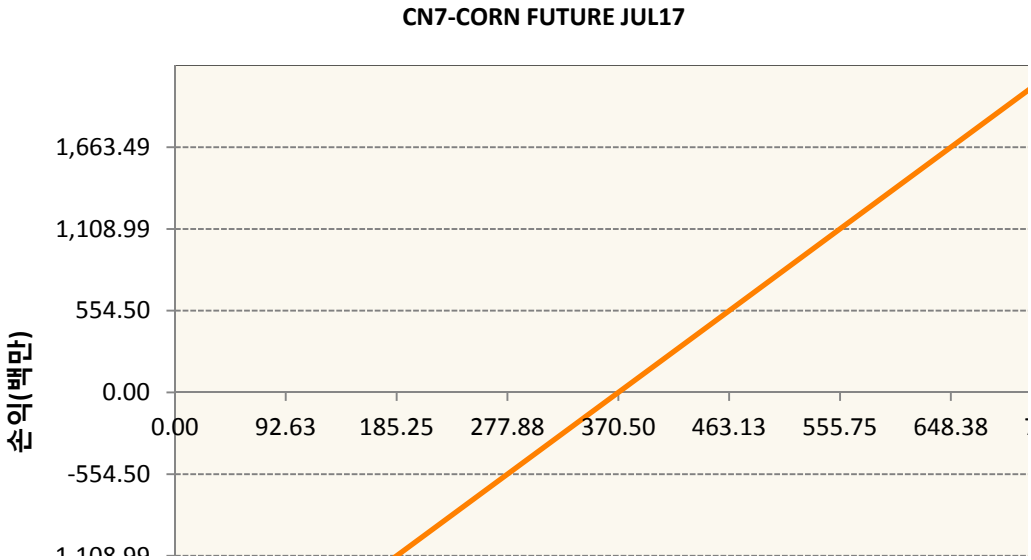
1. 계약금액

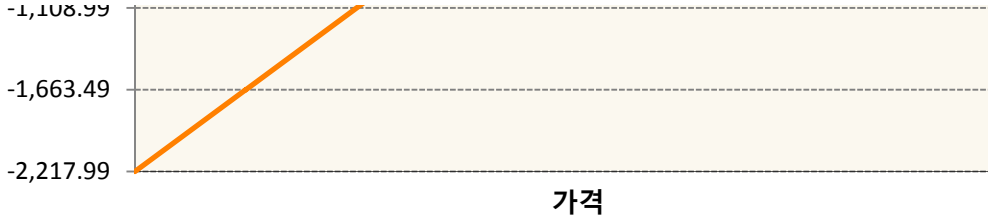
(단위:백만원)

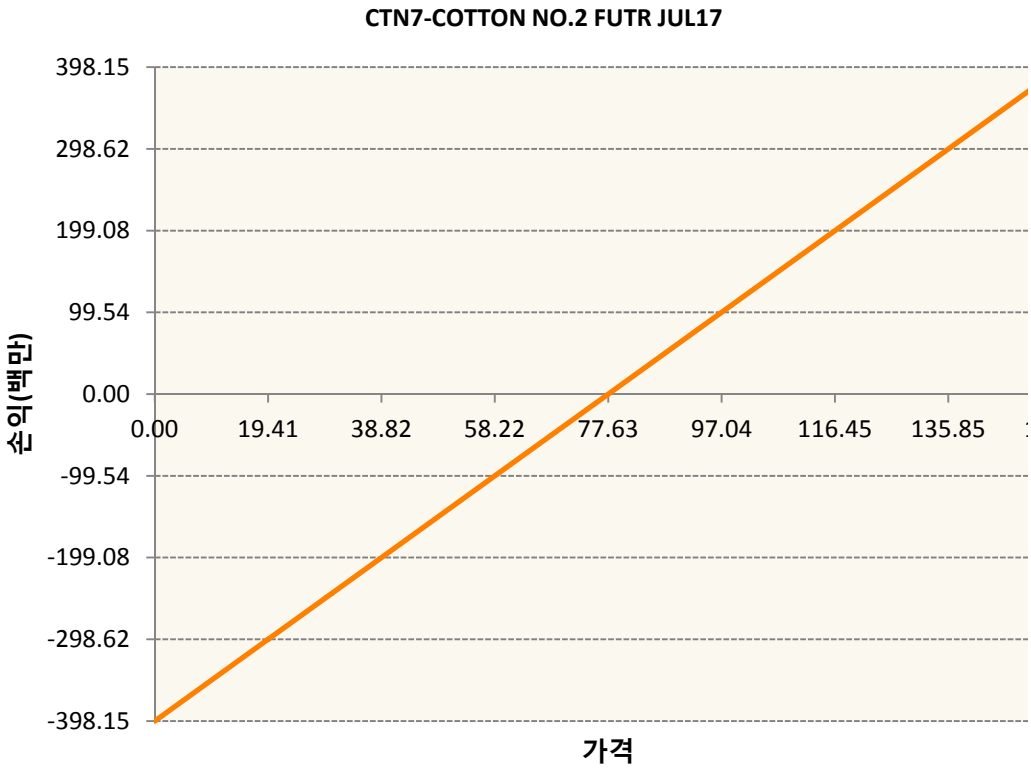
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,194	393	7,802	

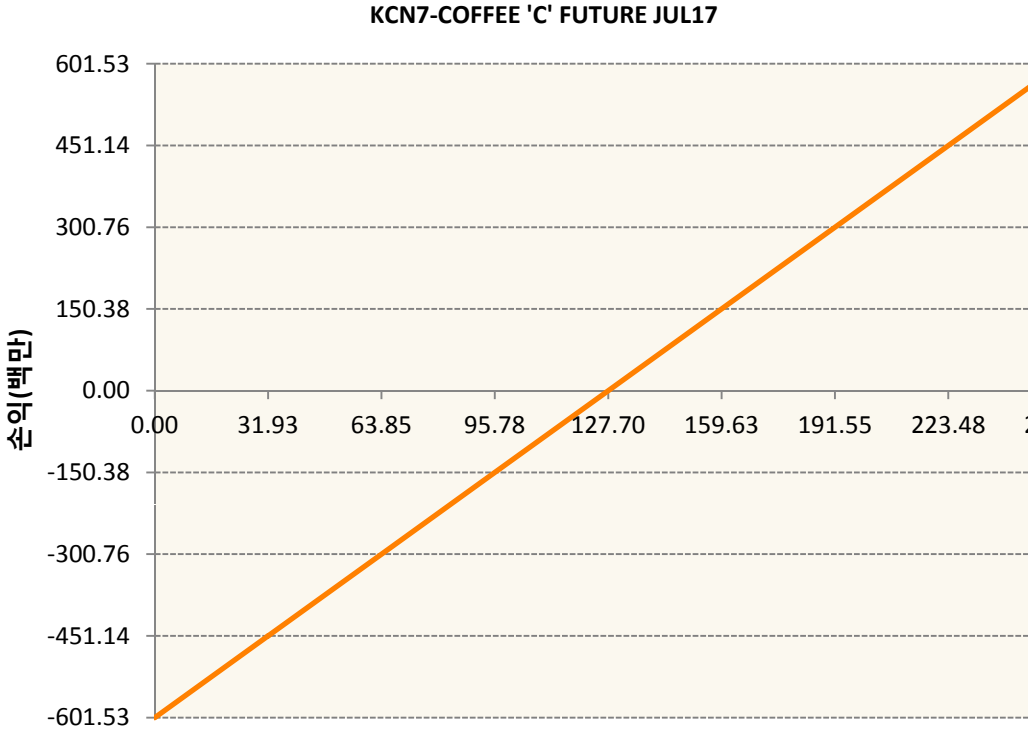
2. 만기시점의 손익구조





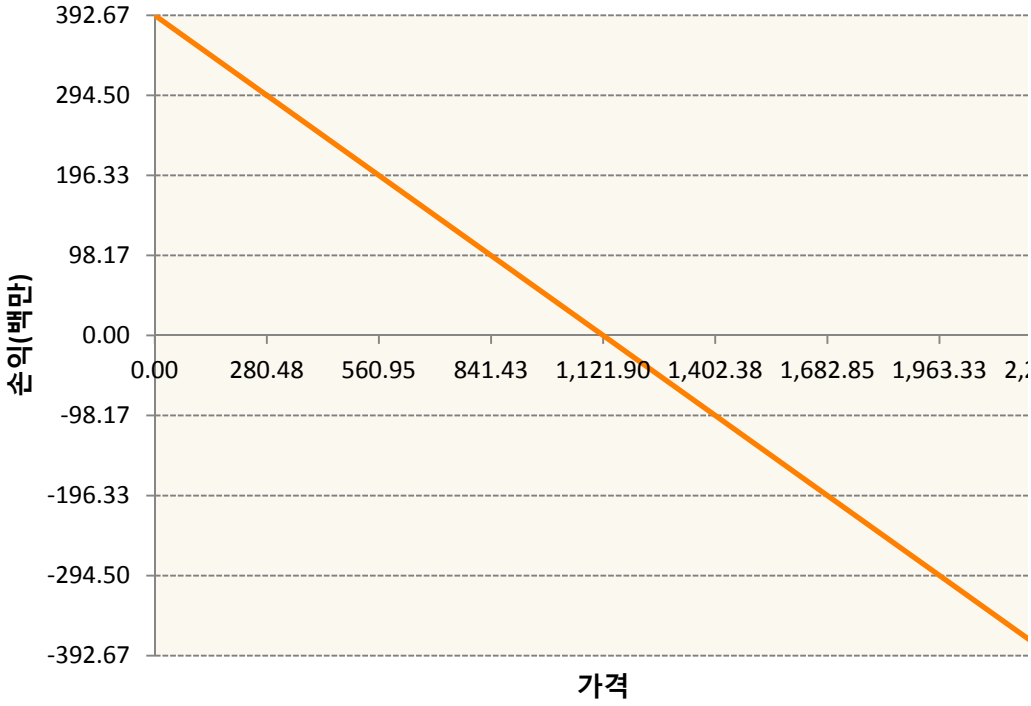

-1,663.49
-2,217.99
가격


CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
398.15
298.62
199.08
99.54
0.00
-99.54
-199.08
-298.62
-398.15
0.00
19.41
38.82
58.22
77.63
97.04
116.45
135.85
순익(백만)
가격

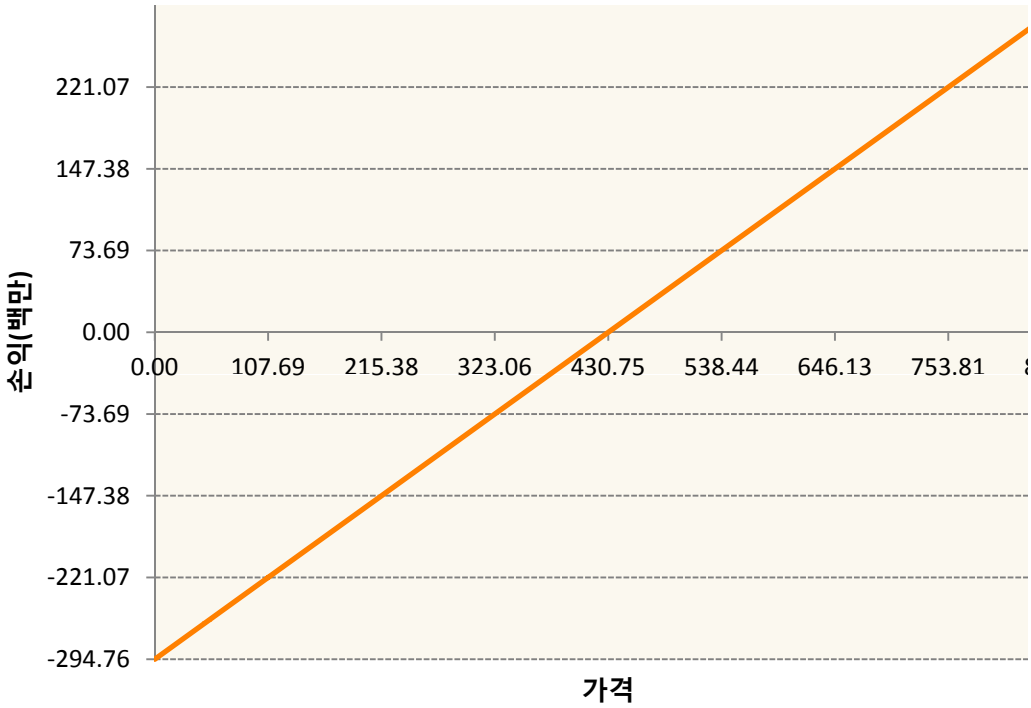

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
601.53
451.14
300.76
150.38
0.00
-150.38
-300.76
-451.14
-601.53
0.00
31.93
63.85
95.78
127.70
159.63
191.55
223.48
순익(백만)

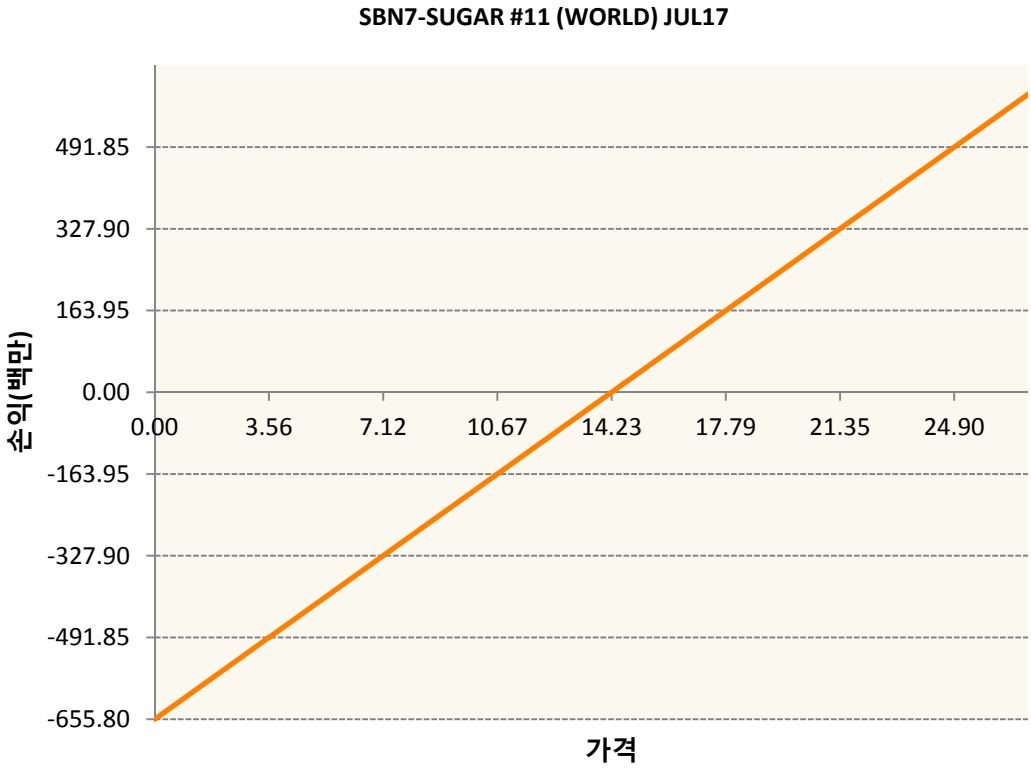
가격

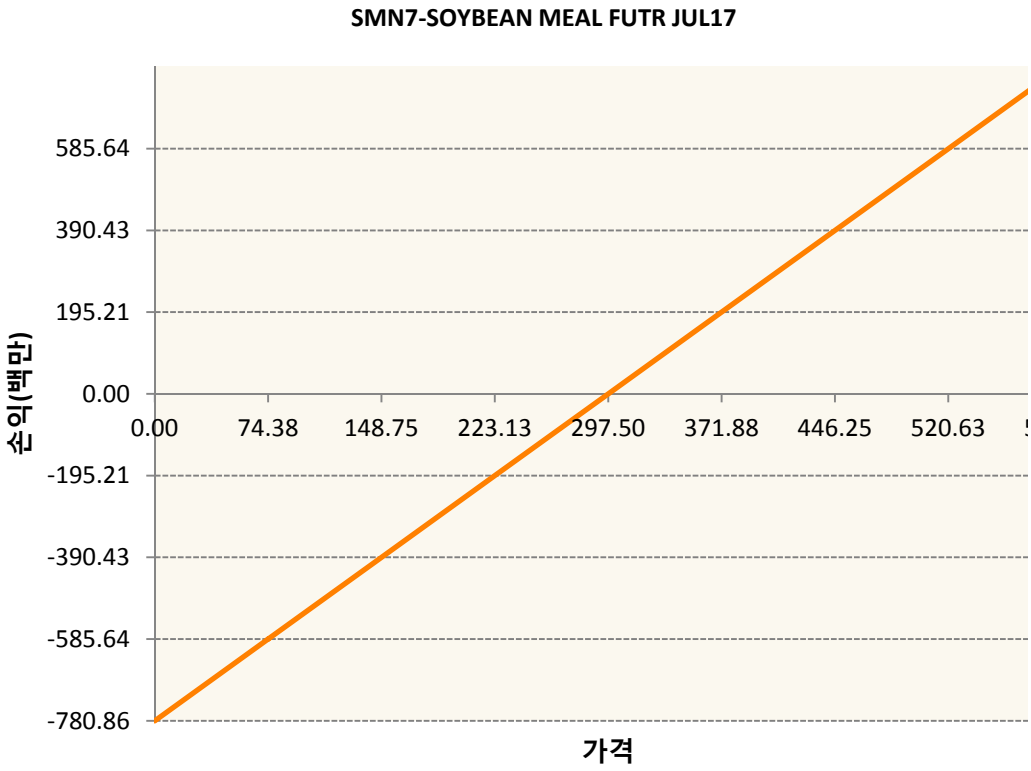
KR4175M60005-2017-06 달러선물

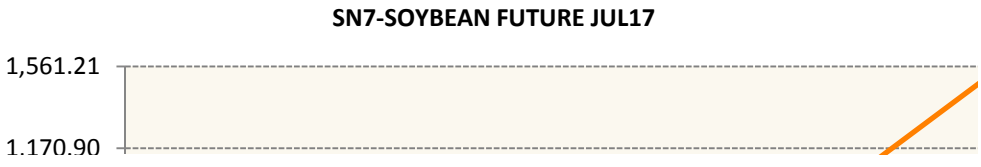


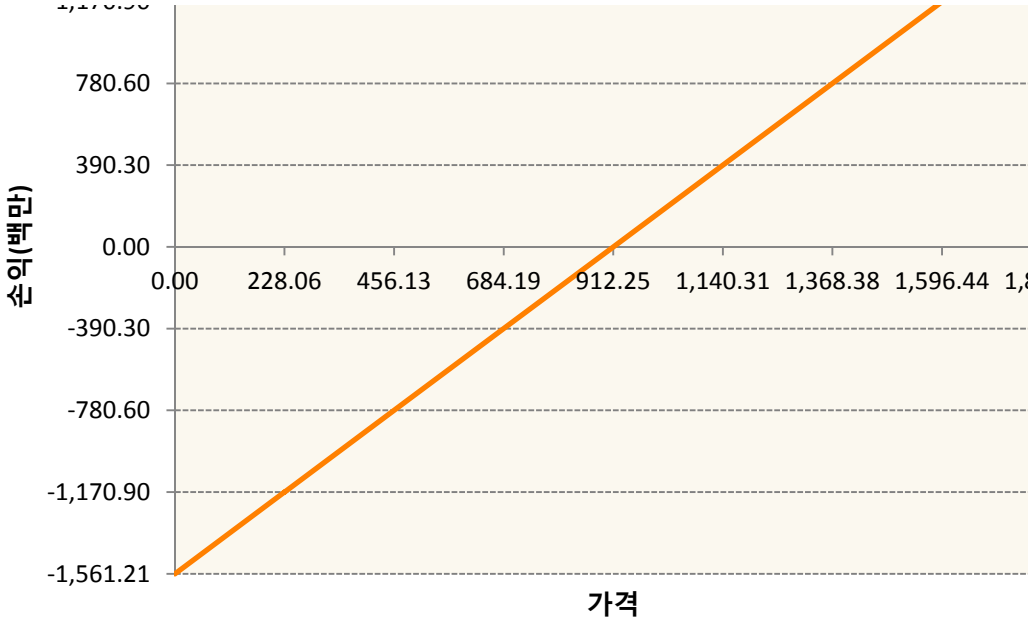
KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17

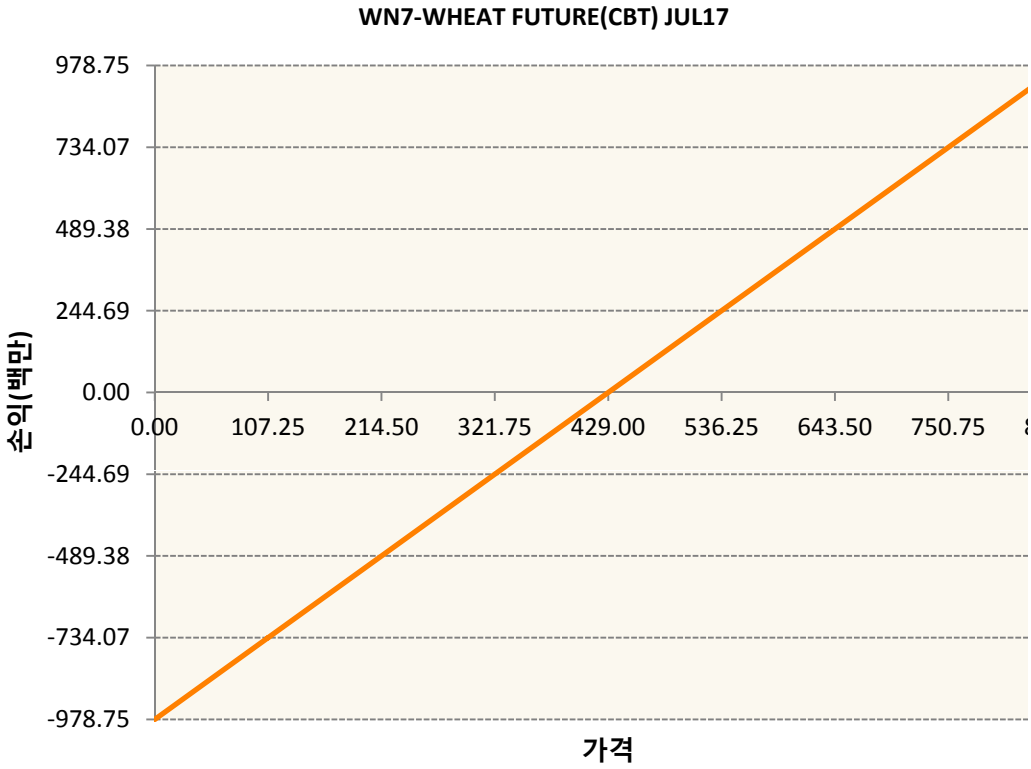



SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
491.85
327.90
163.95
0.00
-163.95
-327.90
-491.85
-655.80
손익(백만)
0.00
3.56
7.12
10.67
14.23
17.79
21.35
24.90
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
585.64
390.43
195.21
0.00
-195.21
-390.43
-585.64
-780.86
손익(백만)
0.00
74.38
148.75
223.13
297.50
371.88
446.25
520.63
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,561.21
1,170.90





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	56
CN7	CORN FUTURE JUL17	177
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	32
KCN7	COFFEE 'C' FUTURE JUL17	48
KR4175M60(	2017-06 달러선물	31

KWN7	KC HRW WHEAT FUT JUL17	24
SBN7	SUGAR #11 (WORLD) JUL17	52
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)

745