공시일	2017-06-07
기준일	2017-06-05

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	2017-06-07
기준일	2017-06-05

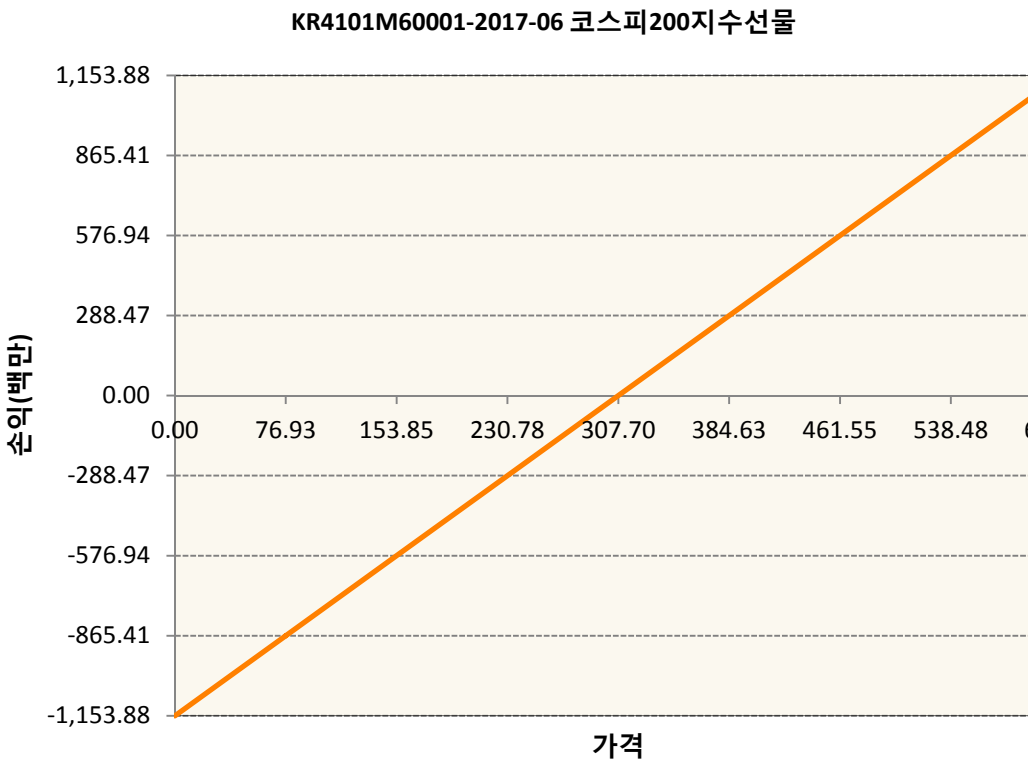
스마트인덱스모

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%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61
-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%	61	61	61	61	61	61	61
8.00%	92	92	92	92	92	92	92

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

61

공시일	2017-06-07
기준일	2017-06-05

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	1,005

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

538

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-07
기준일	2017-06-05

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	359

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

325

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-07
기준일	2017-06-05

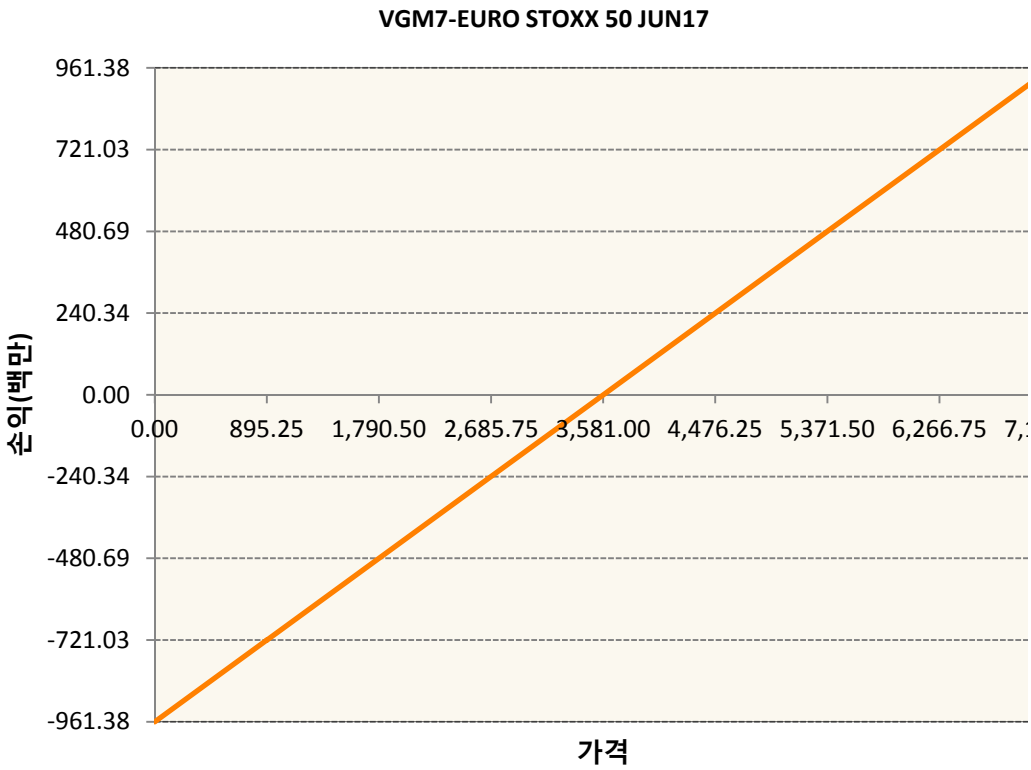
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	961	0	961	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM7	EURO STOXX 50 JUN17	77

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

(단위:백만원)

73

공시일	2017-06-07
기준일	2017-06-05

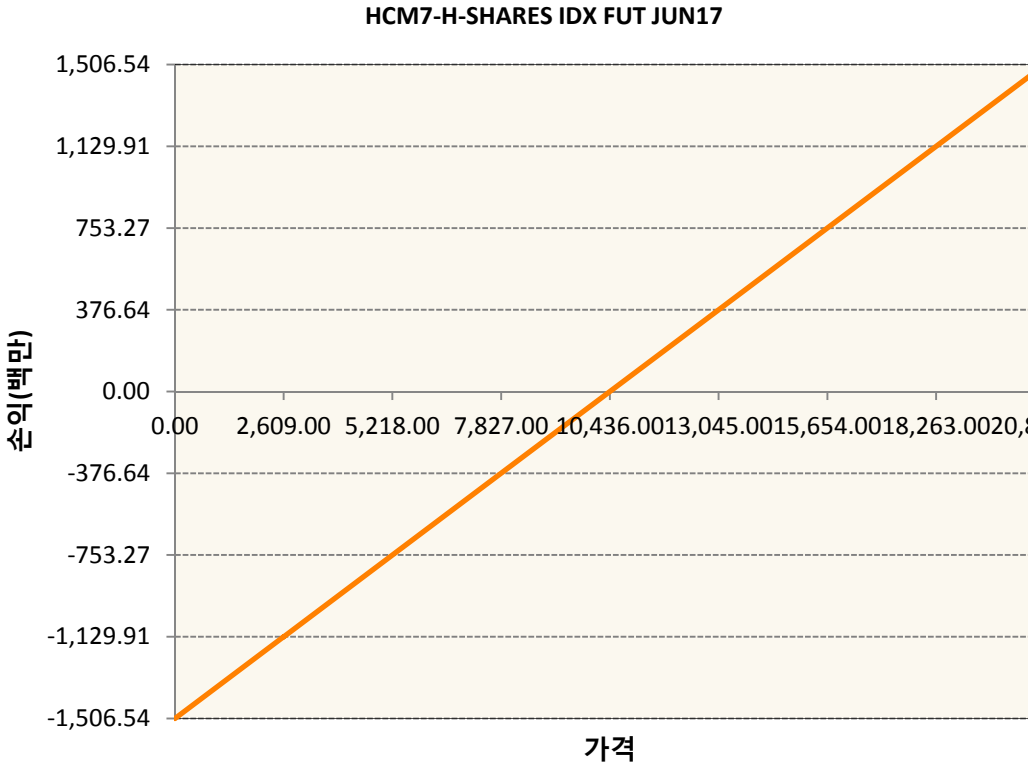
차이나인덱스모(주식-파생형)

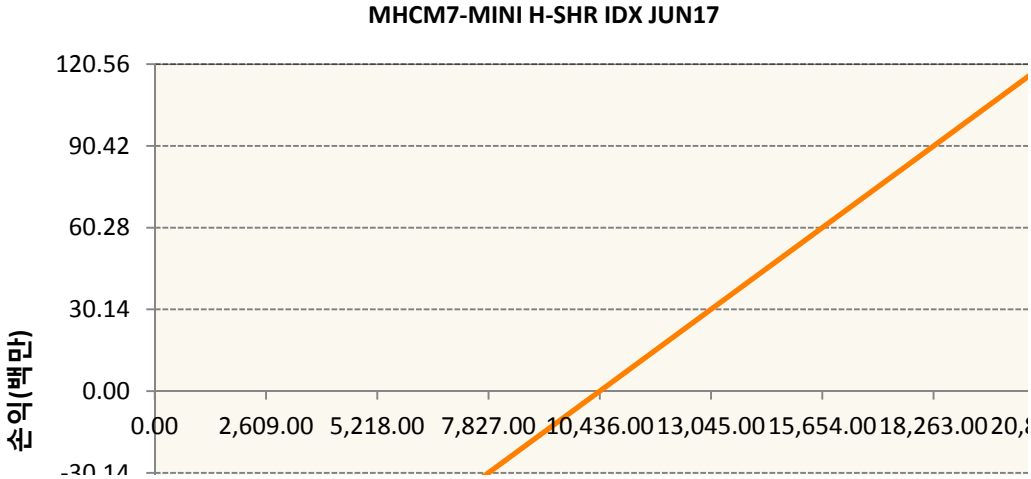
1. 계약금액

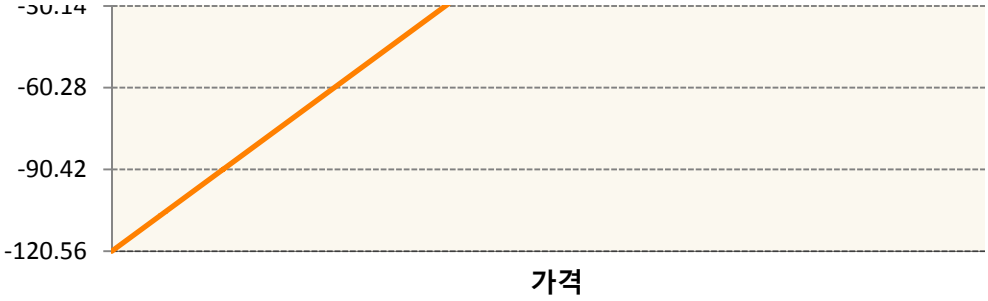
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계			1,507	0	1,507	
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	2017-06-07
기준일	2017-06-05

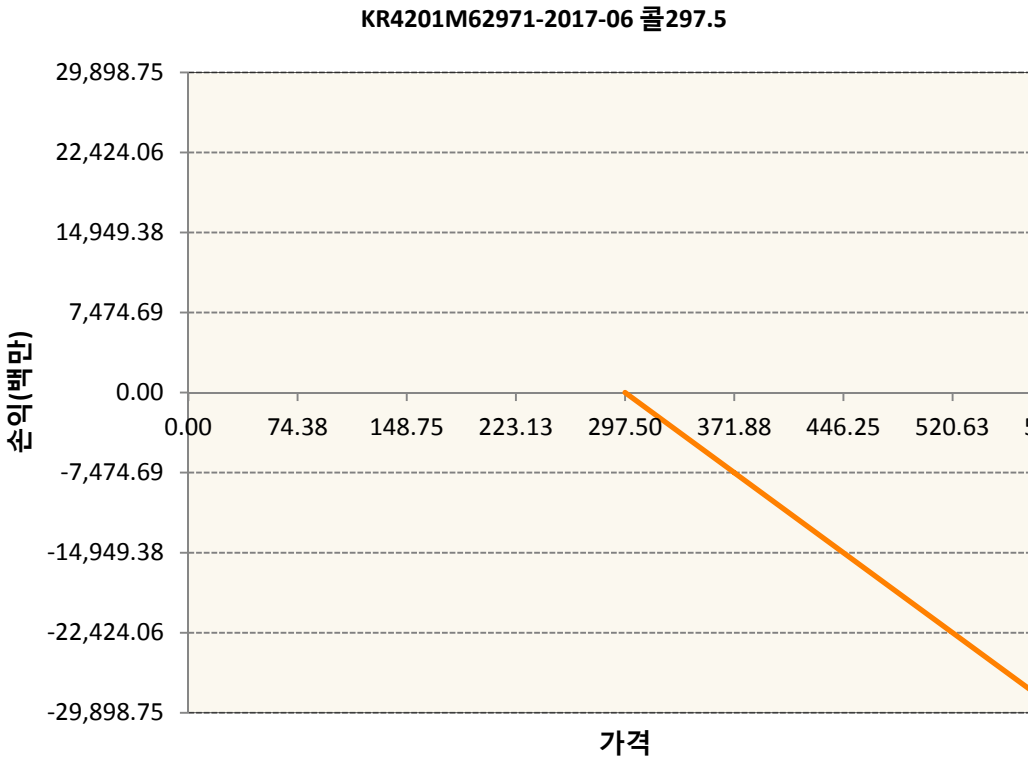
커버드콜모(주식혼합-파생형)

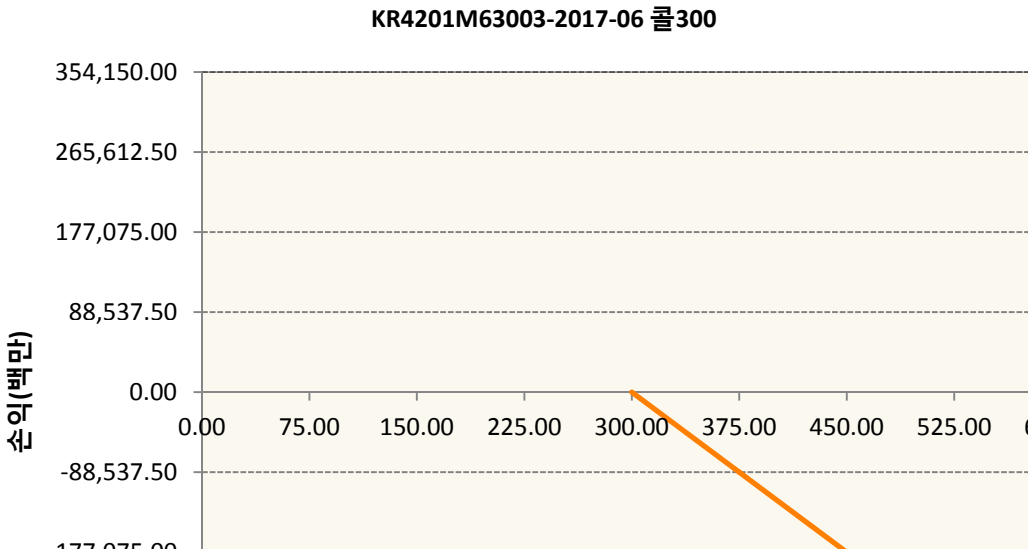
1. 계약금액

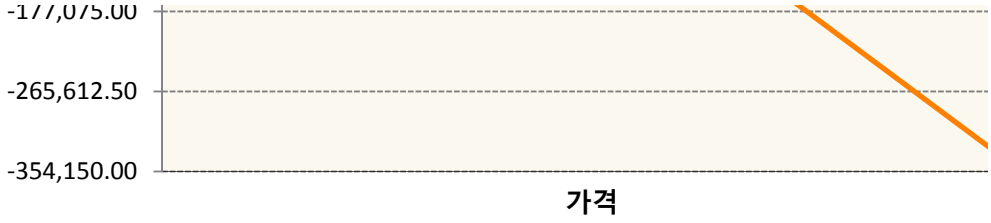
(단위:백만원)

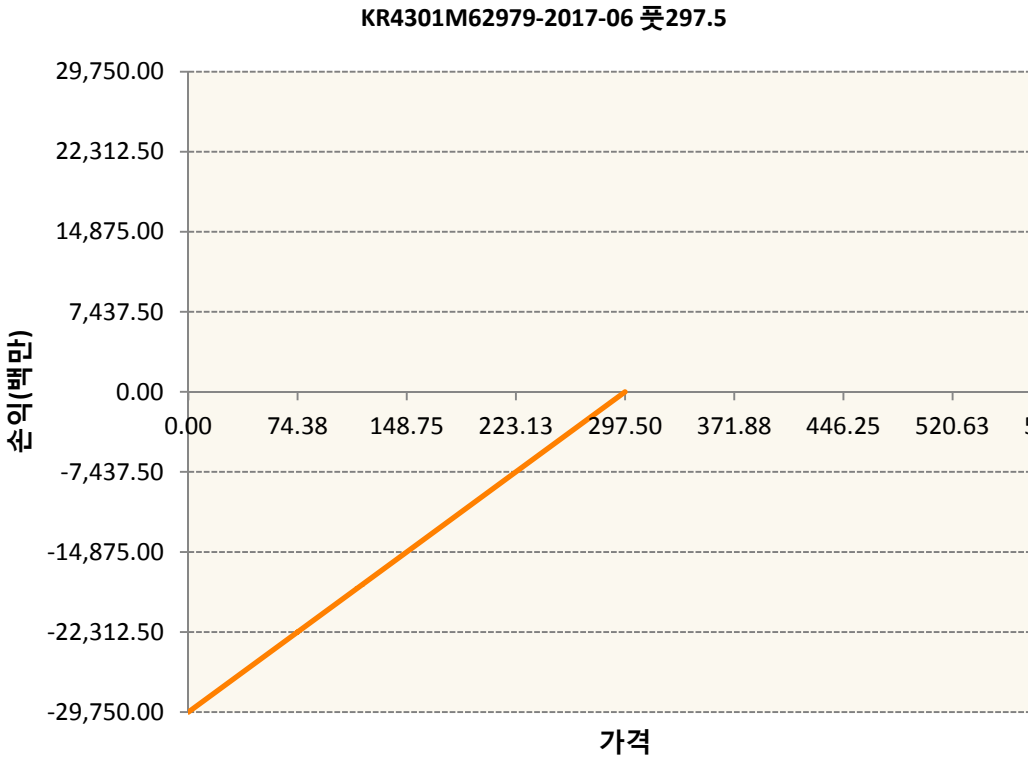
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	713,799	-713,799	장내

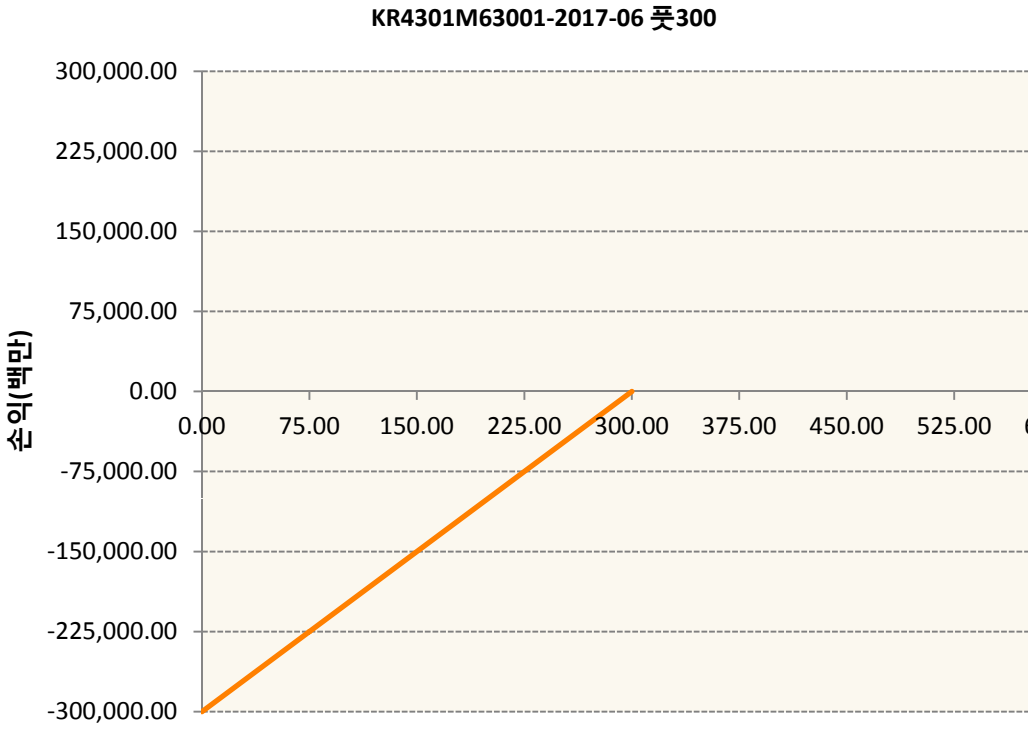
2. 만기시점의 손익구조






-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						2,470
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	988	988	988	988	988	988	988
-5.33%	987	987	986	984	982	979	976
-2.67%	781	771	761	751	740	730	719
0%	0	0	0	0	0	-1	-2
2.67%	-823	-823	-823	-823	-823	-823	-823
5.33%	-1,647	-1,647	-1,647	-1,647	-1,647	-1,647	-1,647
8.00%	-2,470	-2,470	-2,470	-2,470	-2,470	-2,470	-2,470
KR4201M63(	2017-06 콜300						28,990
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,677	8,677	8,677	8,677	8,677	8,677	8,677
-5.33%	8,677	8,677	8,675	8,672	8,666	8,657	8,644
-2.67%	7,886	7,755	7,623	7,490	7,356	7,222	7,087
0%	27	23	14	0	-20	-46	-78
2.67%	-9,643	-9,643	-9,643	-9,643	-9,643	-9,644	-9,644
5.33%	-19,317	-19,317	-19,317	-19,317	-19,317	-19,317	-19,317
8.00%	-28,990	-28,990	-28,990	-28,990	-28,990	-28,990	-28,990
KR4301M62(	2017-06 풋297.5						1,476
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,476	-1,476	-1,476	-1,476	-1,476	-1,476	-1,476
-5.33%	-657	-657	-658	-660	-662	-665	-668
-2.67%	-42	-52	-62	-72	-83	-93	-104
0%	0	0	0	0	0	-1	-2
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						17,233
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-17,233	-17,233	-17,233	-17,233	-17,233	-17,233	-17,233
-5.33%	-9,038	-9,039	-9,040	-9,043	-9,048	-9,055	-9,066
-2.67%	-1,514	-1,625	-1,737	-1,850	-1,963	-2,077	-2,191
0%	23	19	12	0	-17	-39	-66
2.67%	25	25	25	25	25	25	25

5.33%	25	25	25	25	25	25	25
8.00%	25	25	25	25	25	25	25

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

50,977

공시일	2017-06-07
기준일	2017-06-05

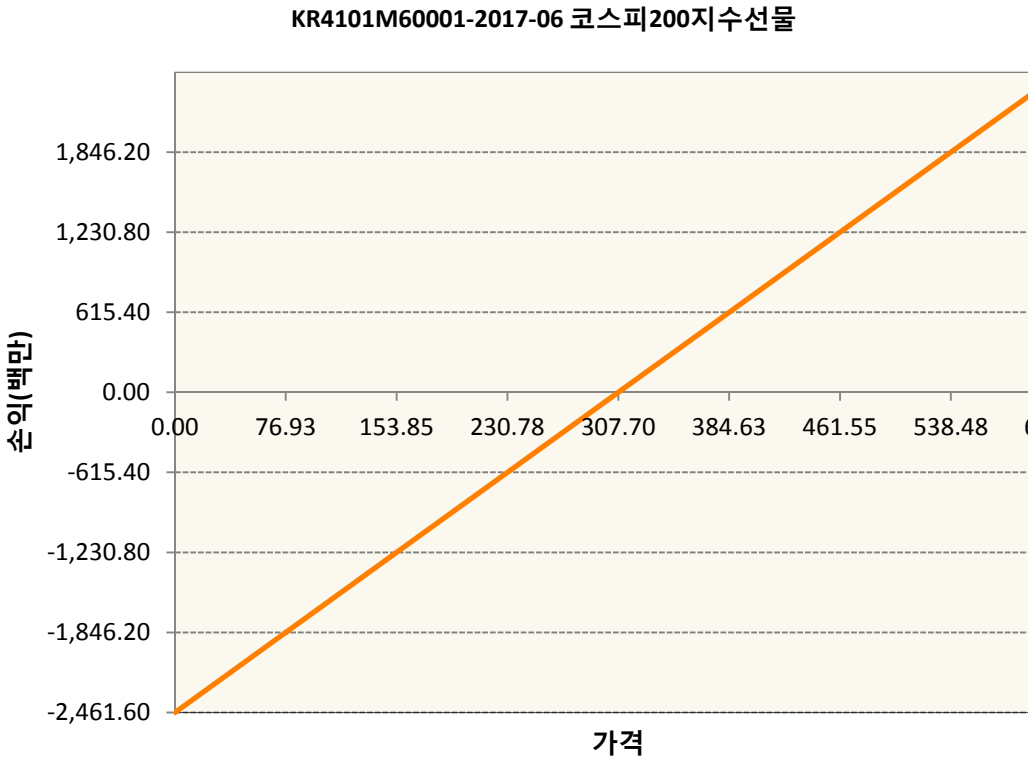
커버드콜목표전환형증권투자신탁

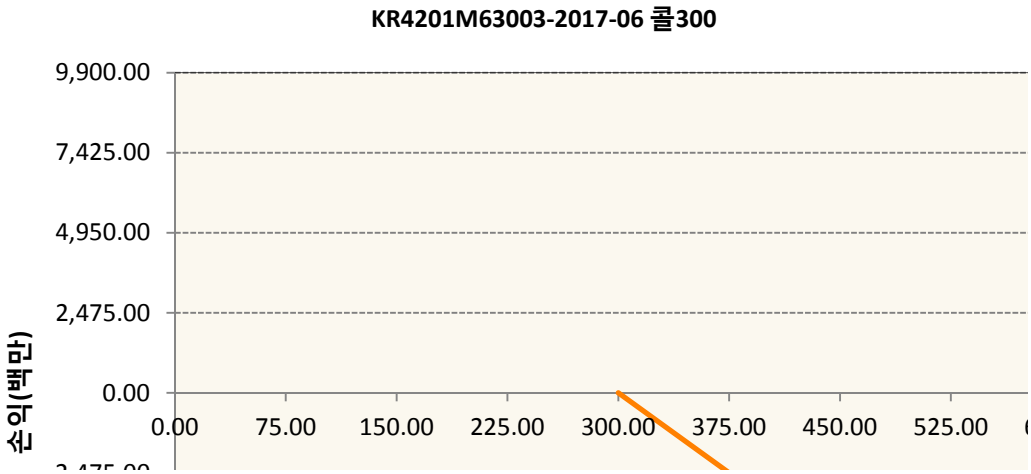
1. 계약금액

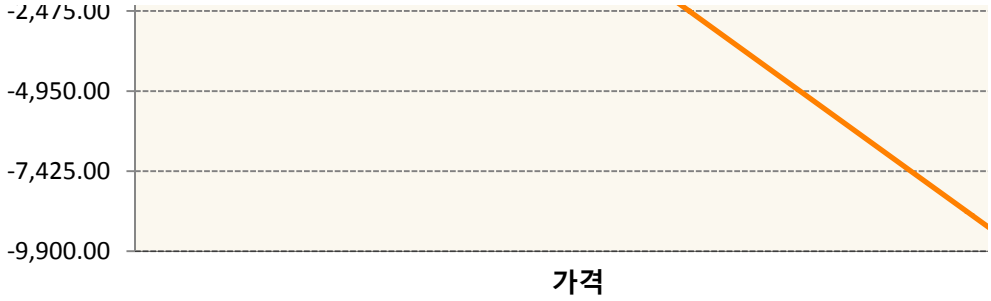
(단위:백만원)

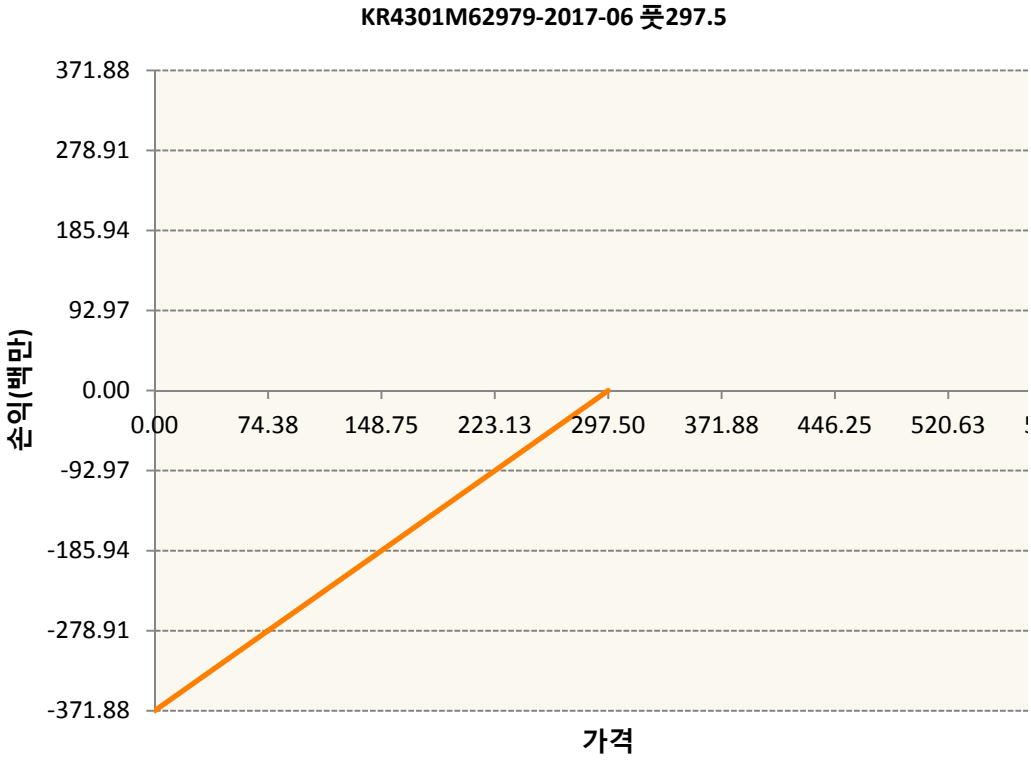
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	539	-539	장내
신규	유가증권	옵션	365	0	365	장내
누계	유가증권	선물	2,462	0	2,462	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,397	-11,397	장내

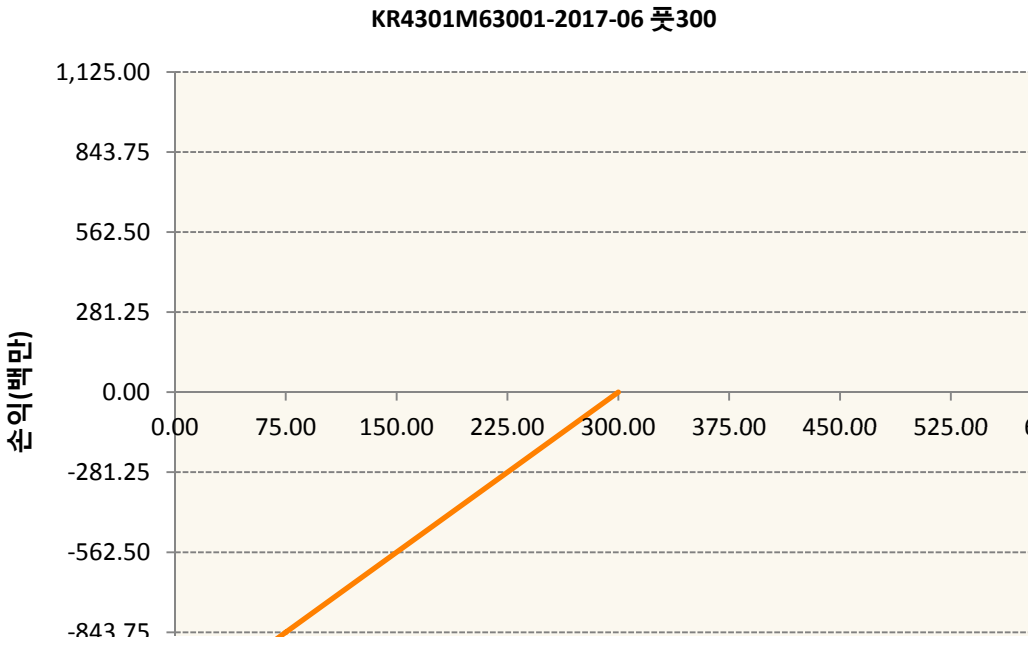
2. 만기시점의 손익구조

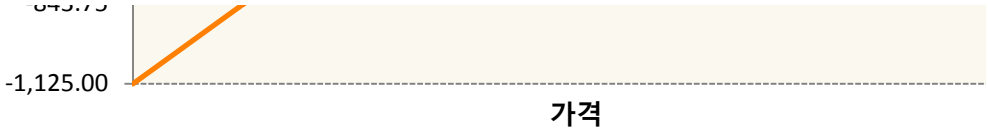





-2,475.00
-4,950.00
-7,425.00
-9,900.00
가격


KR4301M62979-2017-06 풋297.5
371.88
278.91
185.94
92.97
0.00
-92.97
-185.94
-278.91
-371.88
0.00
74.38
148.75
223.13
297.50
371.88
446.25
520.63
순익(백만)
가격


KR4301M63001-2017-06 풋300
1,125.00
843.75
562.50
281.25
0.00
-281.25
-562.50
-843.75
0.00
75.00
150.00
225.00
300.00
375.00
450.00
525.00
순익(백만)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							197
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197
-5.33%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-2.67%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	66	66	66	66	66	66	66
5.33%	131	131	131	131	131	131	131
8.00%	197	197	197	197	197	197	197
KR4201M63(2017-06 콜300							810
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	243	243	243	243	243	243	243
-5.33%	243	243	243	242	242	242	242
-2.67%	220	217	213	209	206	202	198
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	-270	-270	-270	-270	-270	-270	-270
5.33%	-540	-540	-540	-540	-540	-540	-540
8.00%	-810	-810	-810	-810	-810	-810	-810
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	-1	-1
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%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
-2.67%	-6	-6	-7	-7	-7	-8	-8

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

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

1,174

공시일	2017-06-07
기준일	2017-06-05

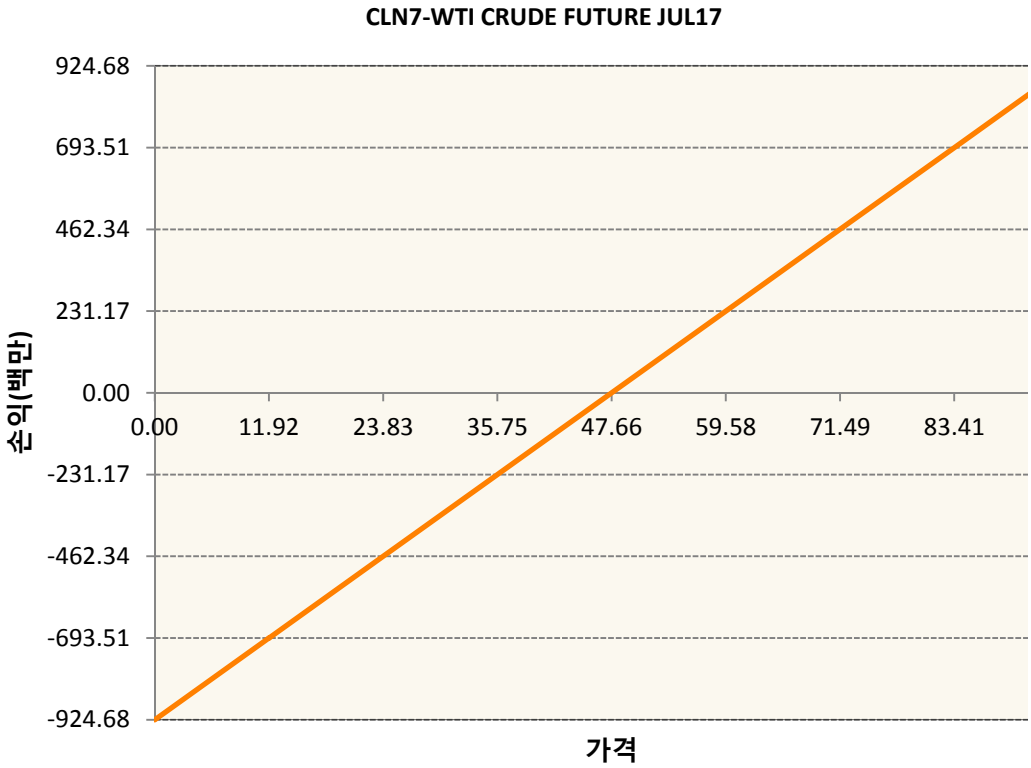
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

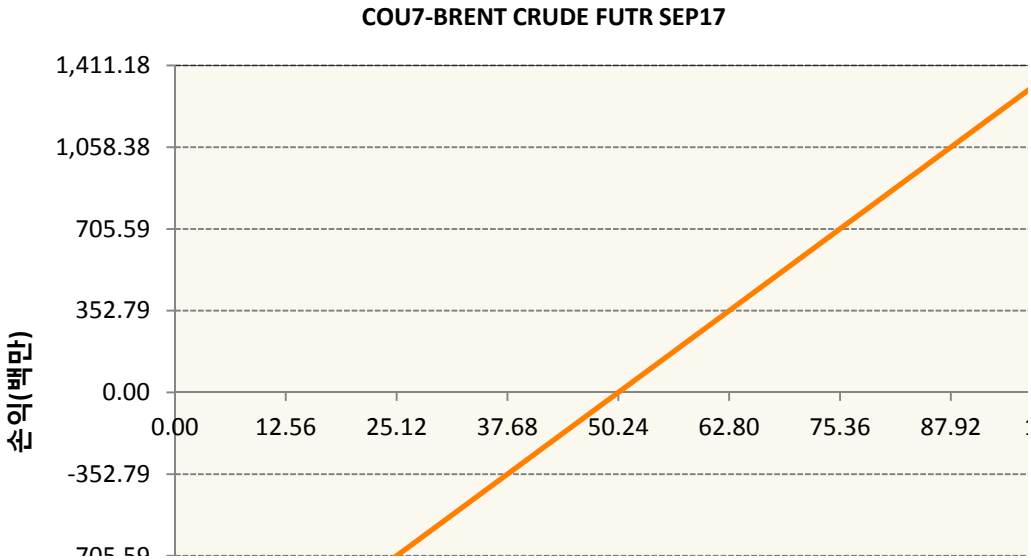
1. 계약금액

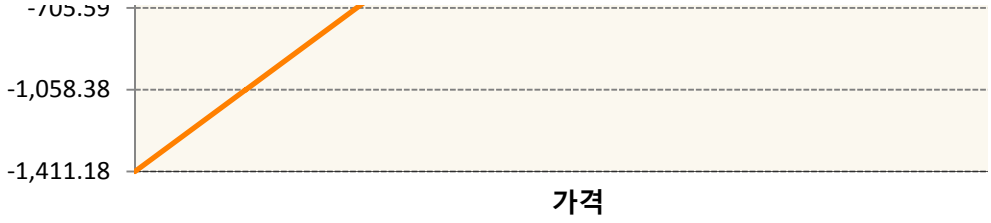
(단위:백만원)

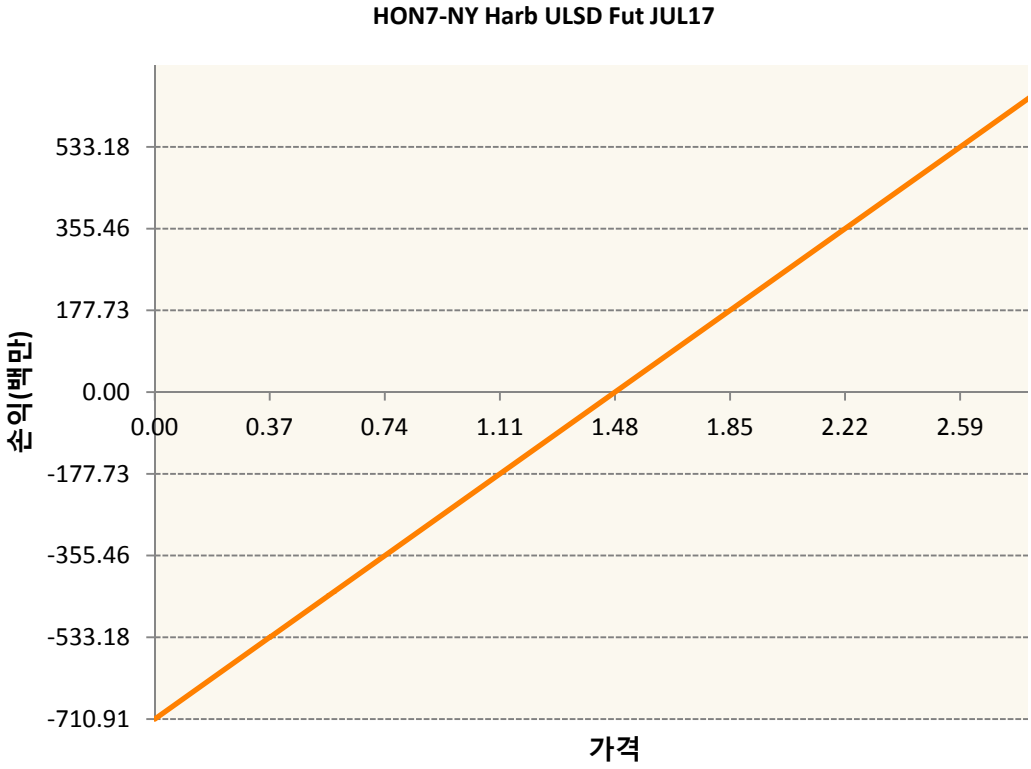
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,240	224	5,017	

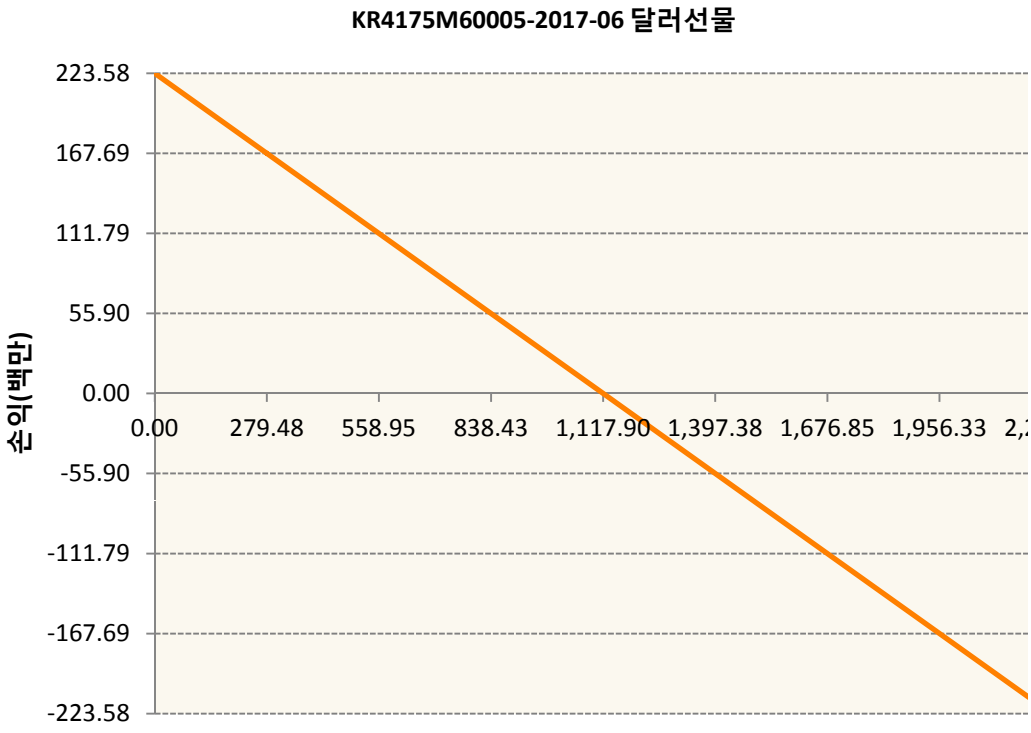
2. 만기시점의 손익구조



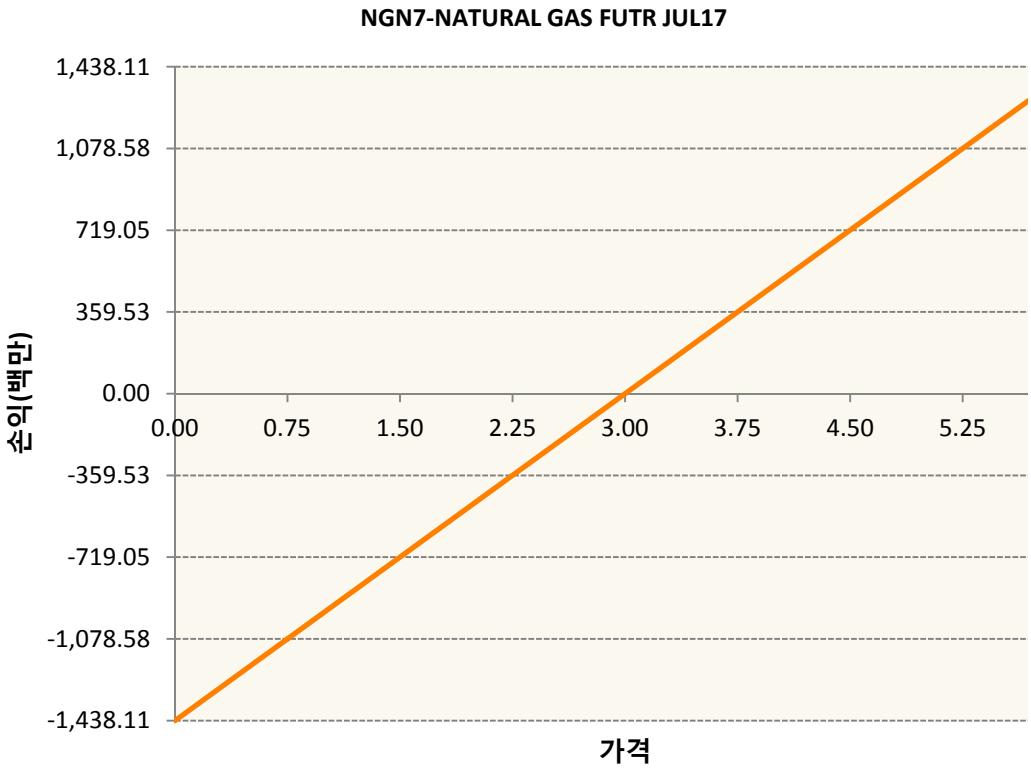


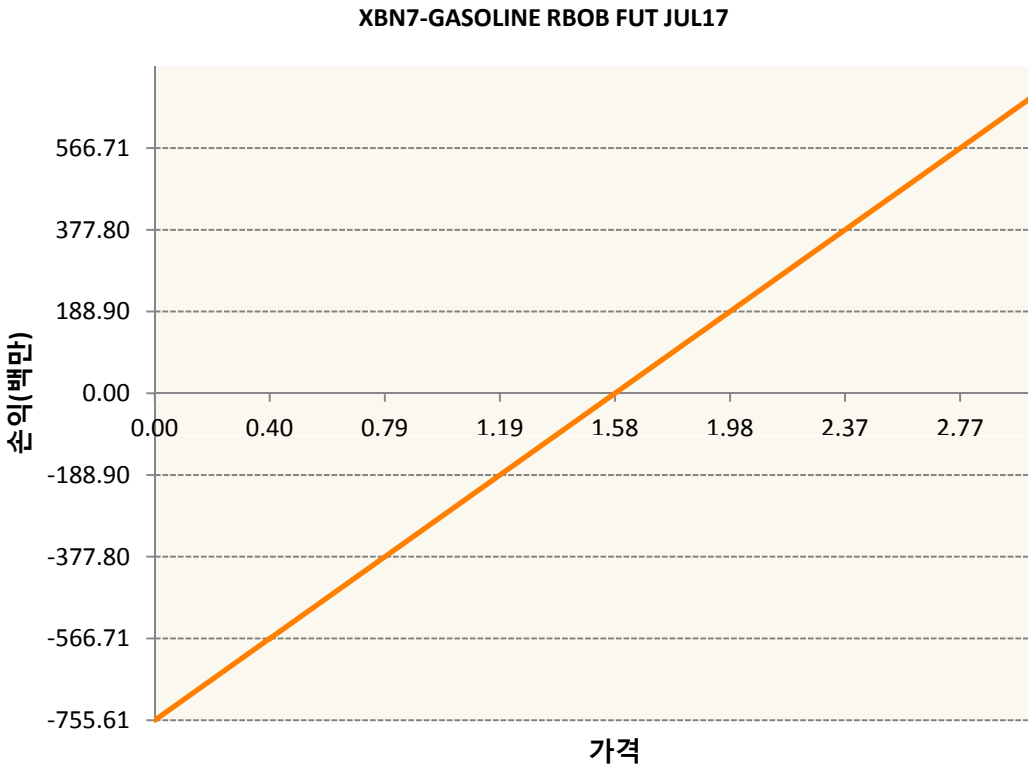

-1,058.38
-1,411.18
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
533.18
355.46
177.73
0.00
-177.73
-355.46
-533.18
-710.91
0.00
0.37
0.74
1.11
1.48
1.85
2.22
2.59
순이익(백만)
가격


KR4175M60005-2017-06 달러선물
223.58
167.69
111.79
55.90
0.00
-55.90
-111.79
-167.69
-223.58
0.00
279.48
558.95
838.43
1,117.90
1,397.38
1,676.85
1,956.33
순이익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,438.11
1,078.58
719.05
359.53
0.00
-359.53
-719.05
-1,078.58
-1,438.11
0.00
0.75
1.50
2.25
3.00
3.75
4.50
5.25
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
566.71
377.80
188.90
0.00
-188.90
-377.80
-566.71
-755.61
0.00
0.40
0.79
1.19
1.58
1.98
2.37
2.77
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN7	WTI CRUDE FUTURE JUL17	74
COU7	BRENT CRUDE FUTR SEP17	113
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	57
KR4175M60(	2017-06 달러선물	18
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	115
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	60

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

876

공시일	2017-06-07
기준일	2017-06-05

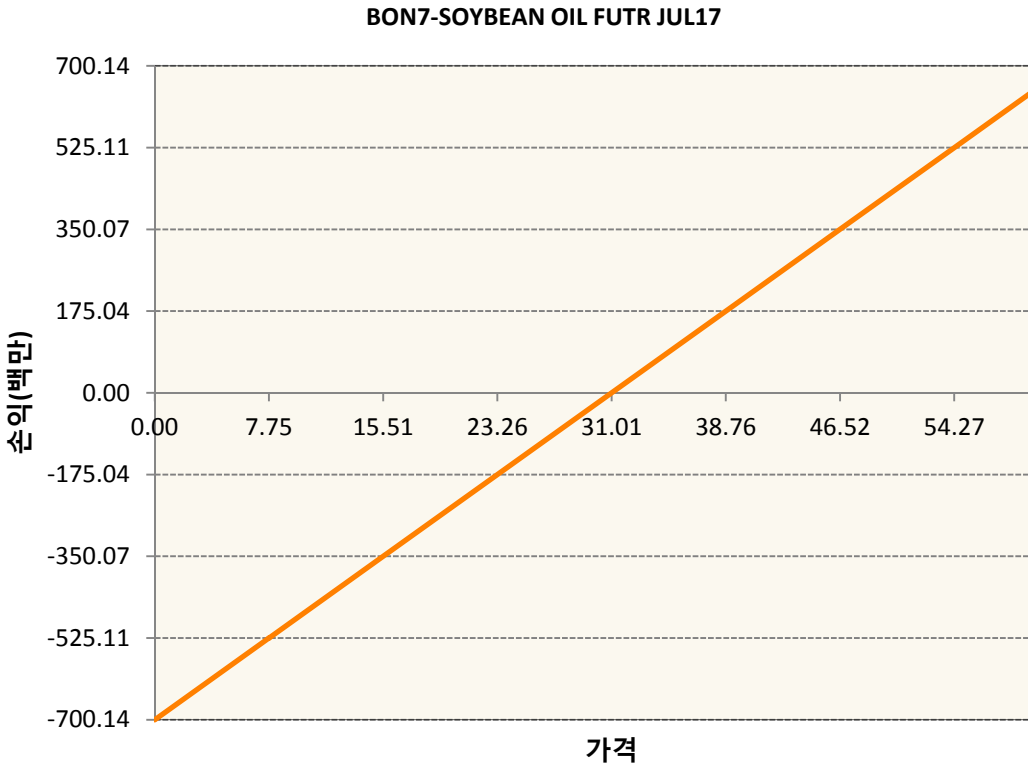
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

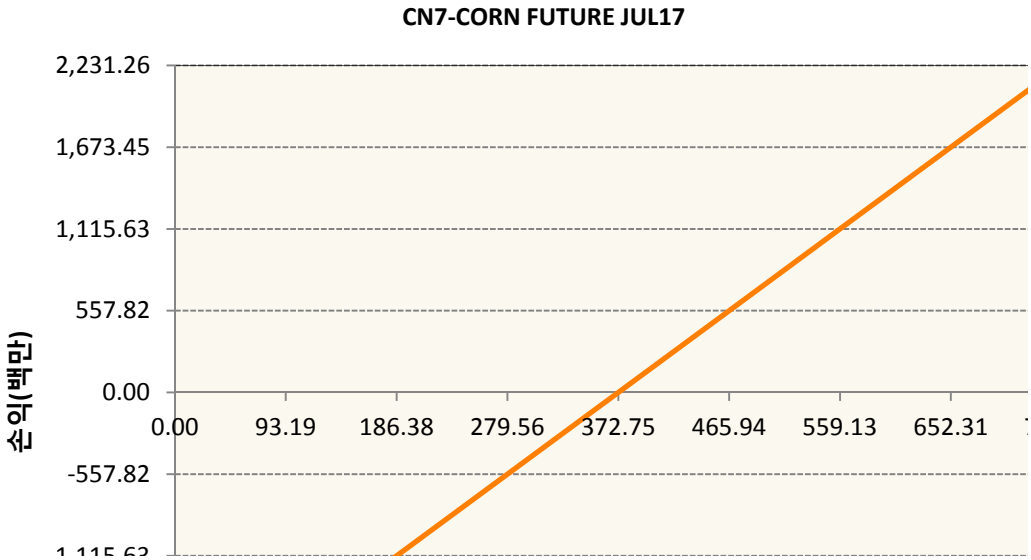
1. 계약금액

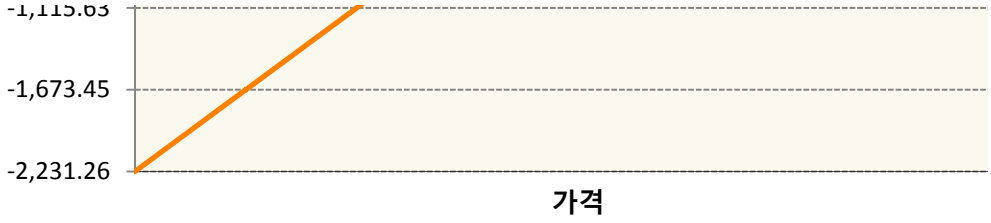
(단위:백만원)

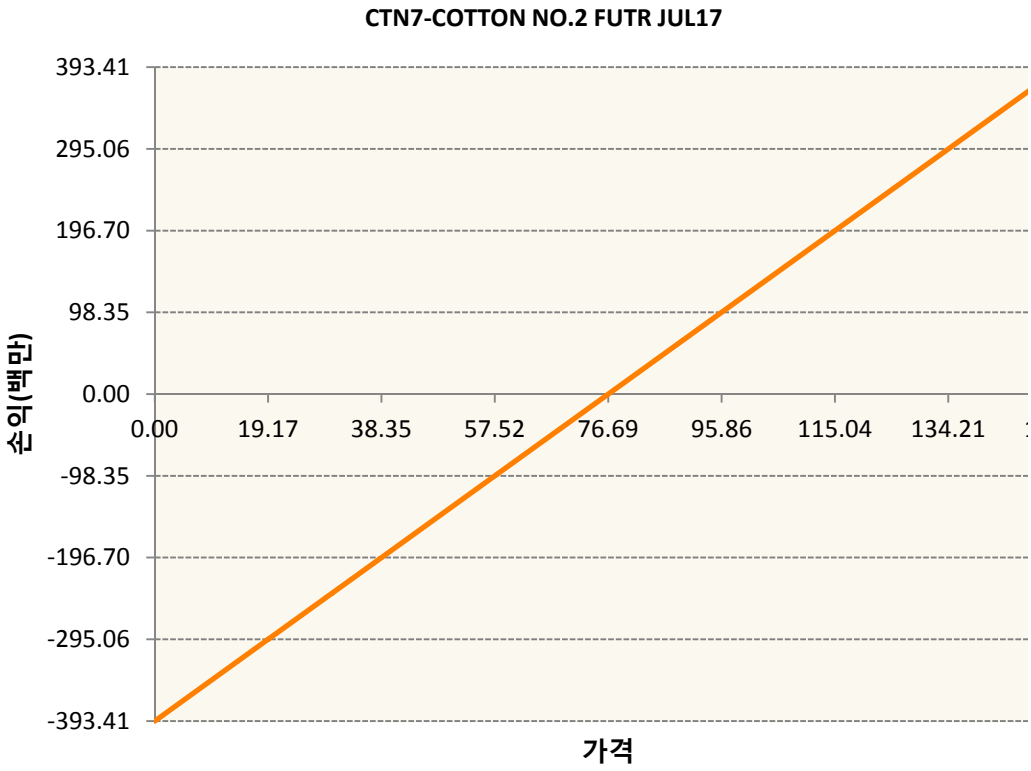
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,196	391	7,805	

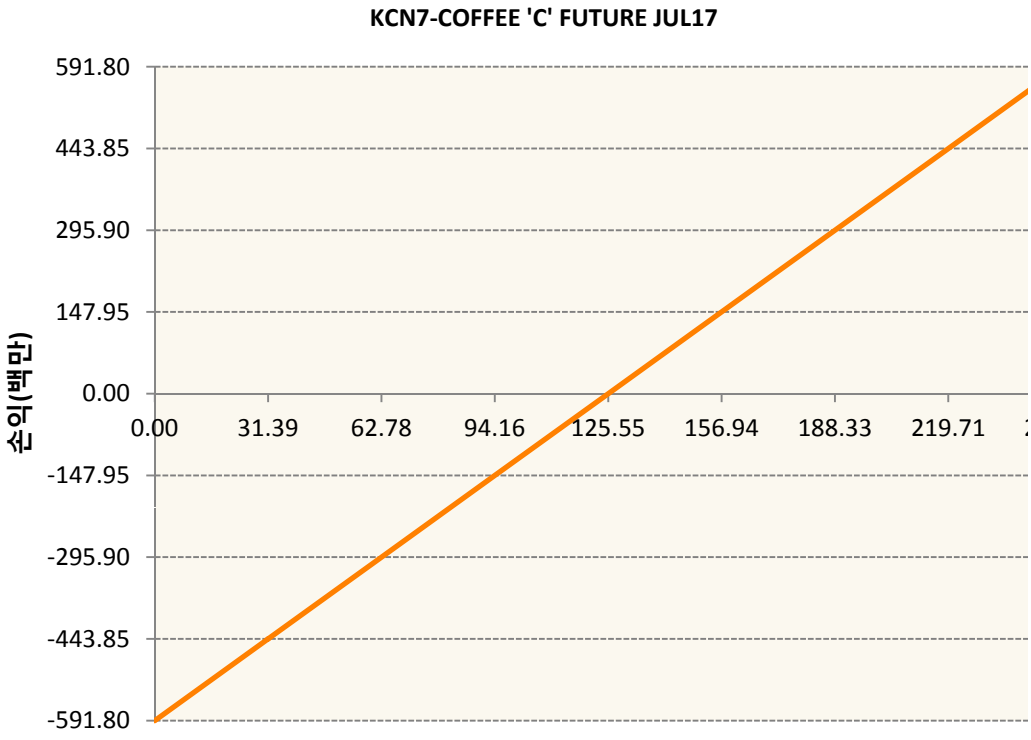
2. 만기시점의 손익구조





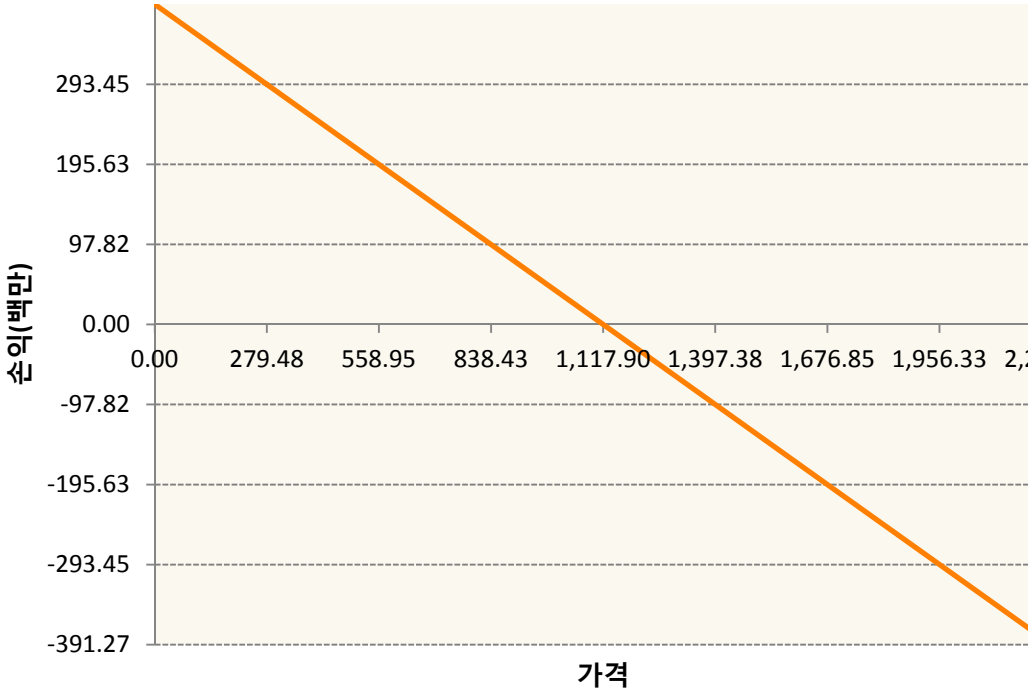

-1,673.45
-2,231.26
가격


CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
393.41
295.06
196.70
98.35
0.00
-98.35
-196.70
-295.06
-393.41
0.00
19.17
38.35
57.52
76.69
95.86
115.04
134.21
순익(백만)
가격

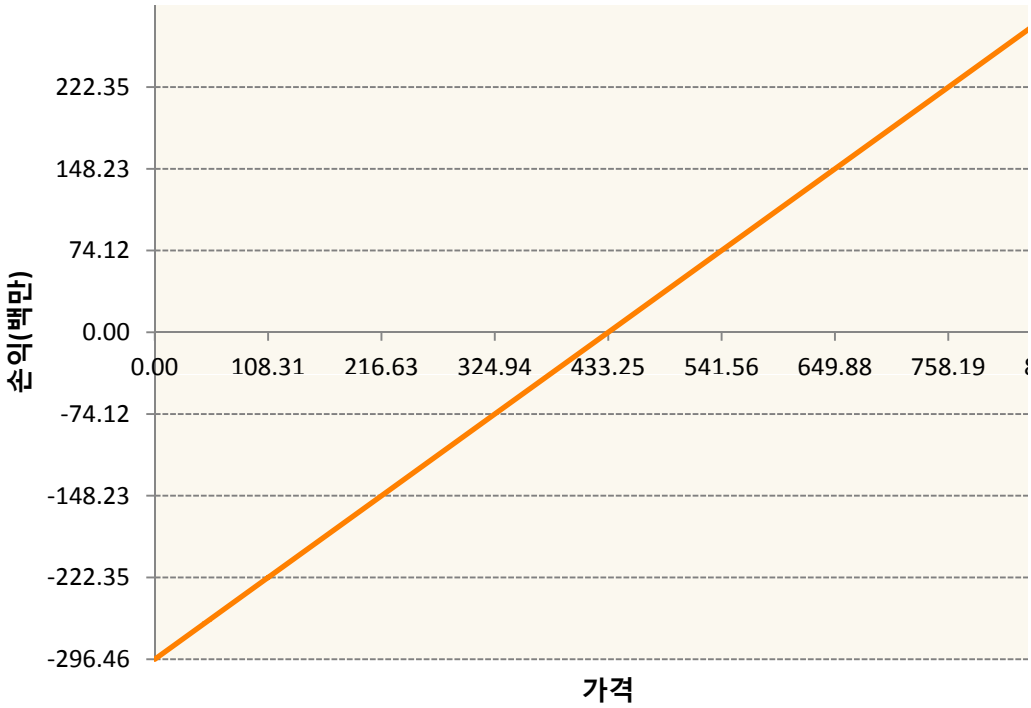

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
591.80
443.85
295.90
147.95
0.00
-147.95
-295.90
-443.85
-591.80
0.00
31.39
62.78
94.16
125.55
156.94
188.33
219.71
순익(백만)

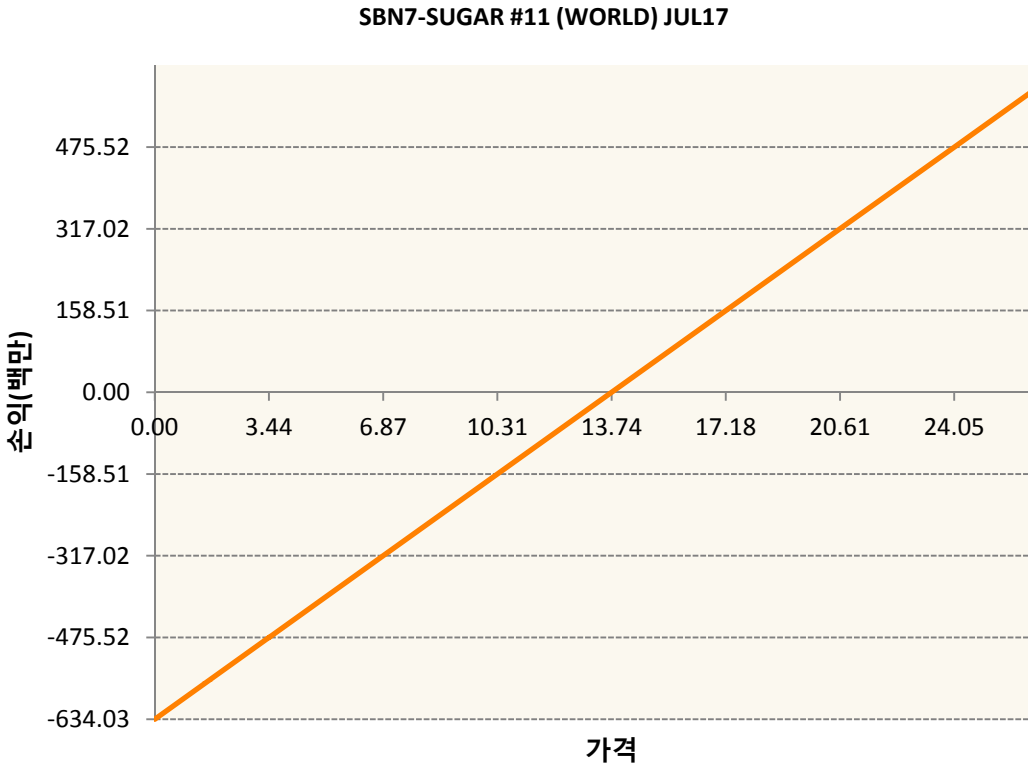
가격

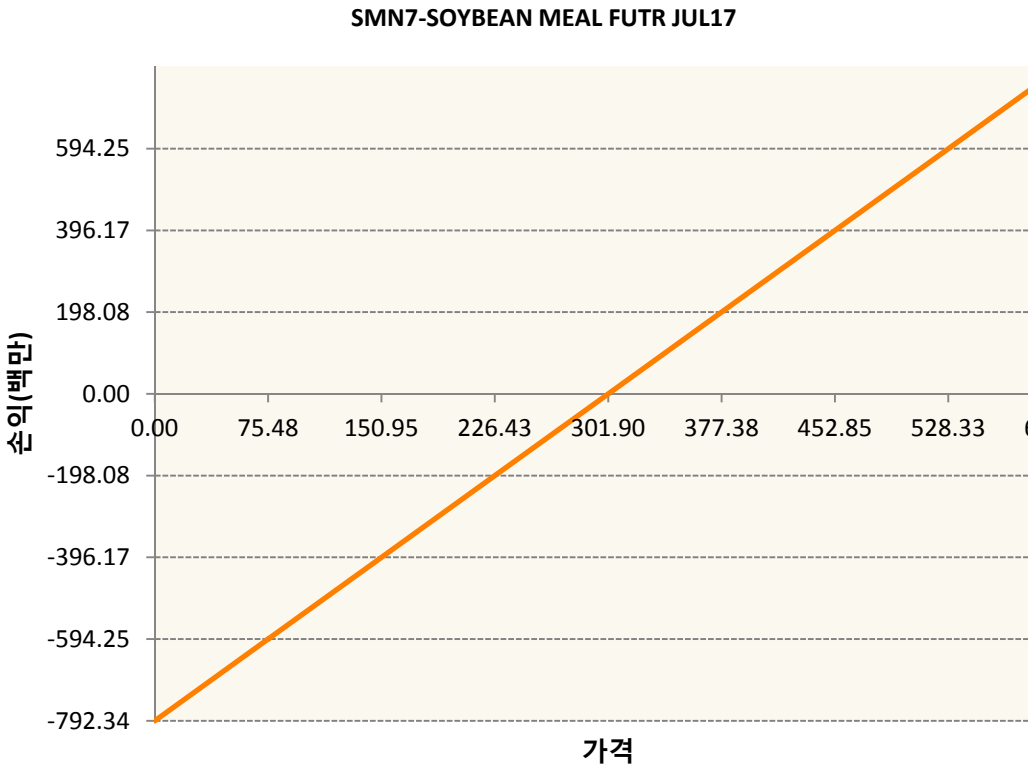
KR4175M60005-2017-06 달러선물

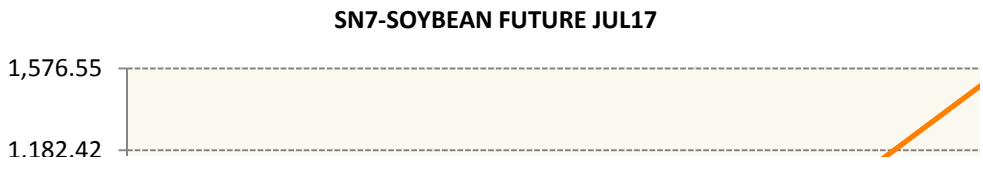


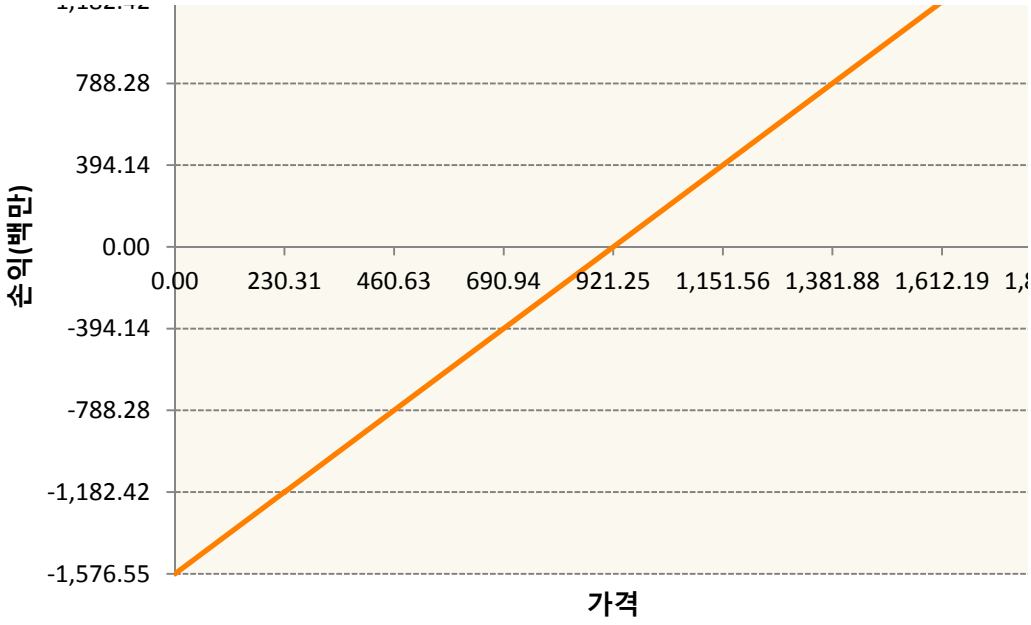
KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17

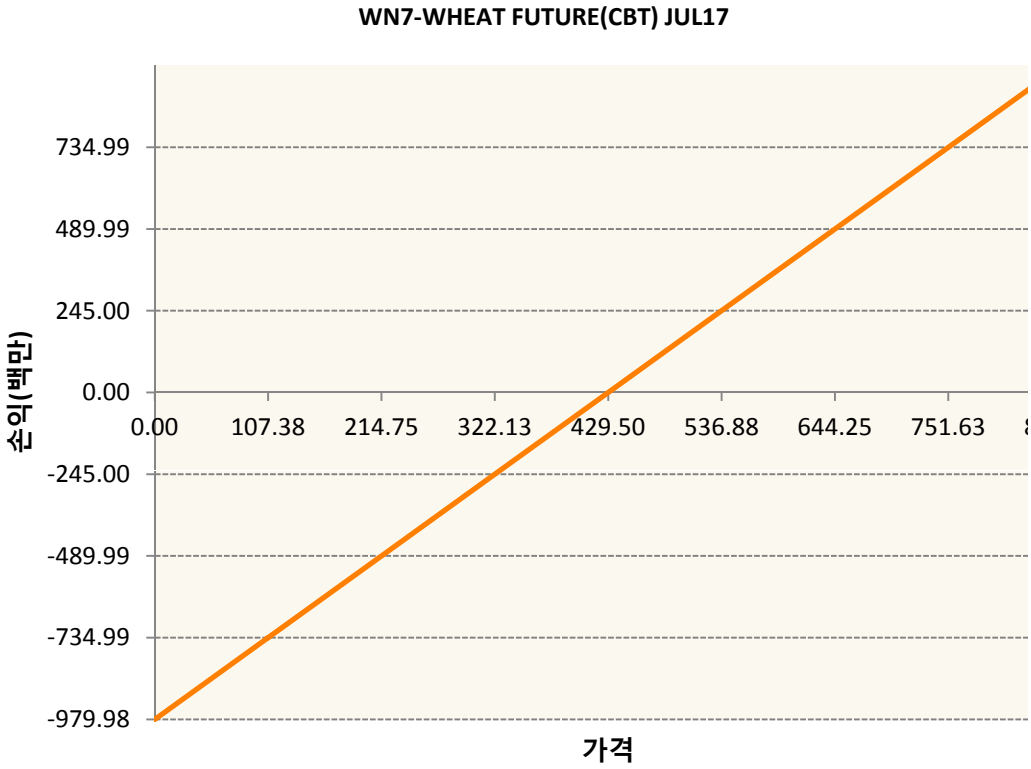



SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
475.52
317.02
158.51
0.00
-158.51
-317.02
-475.52
-634.03
0.00
3.44
6.87
10.31
13.74
17.18
20.61
24.05
손익(백만)
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
594.25
396.17
198.08
0.00
-198.08
-396.17
-594.25
-792.34
0.00
75.48
150.95
226.43
301.90
377.38
452.85
528.33
손익(백만)
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,576.55
1,182.42





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	56
CN7	CORN FUTURE JUL17	179
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	31
KCN7	COFFEE 'C' FUTURE JUL17	47
KR4175M60(	2017-06 달러선물	31

KWN7	KC HRW WHEAT FUT JUL17	24
SBN7	SUGAR #11 (WORLD) JUL17	51
SMN7	SOYBEAN MEAL FUTR JUL17	63
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	126
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	78

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

744