공시일	2017-06-08
기준일	2017-06-07

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	2017-06-08
기준일	2017-06-07

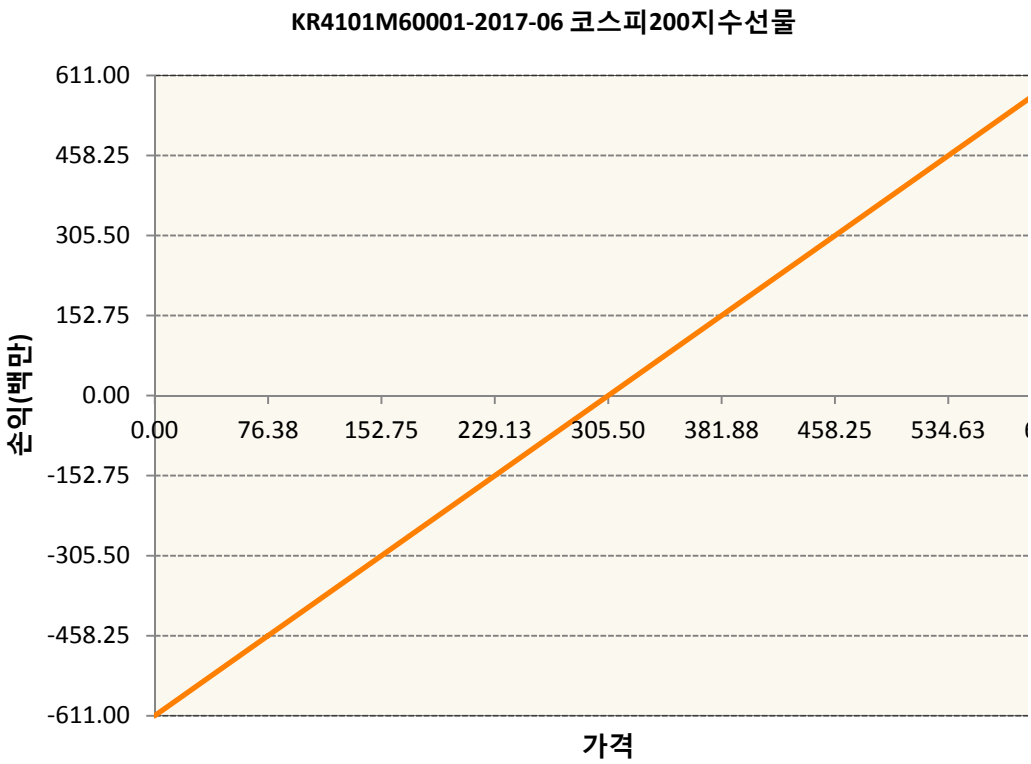
스마트인덱스모

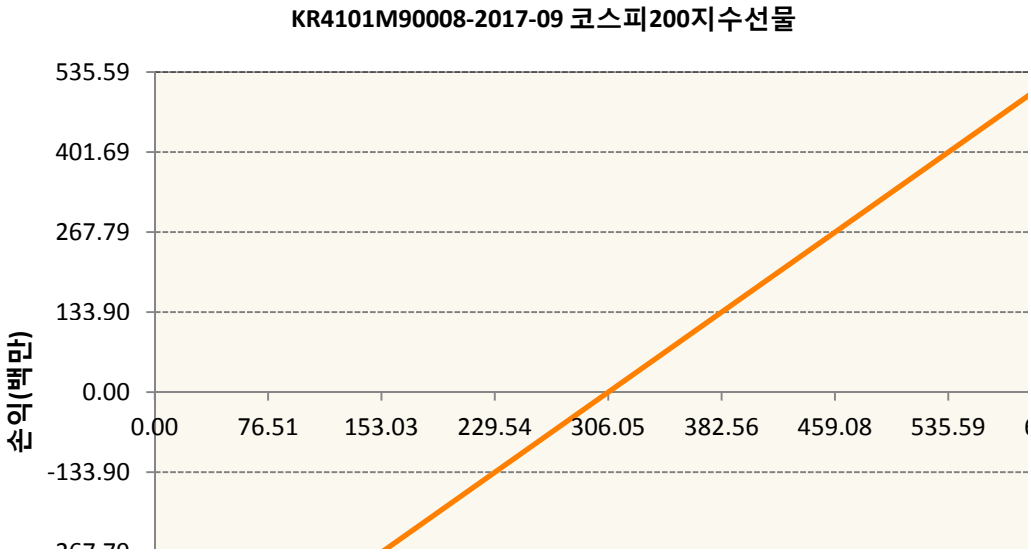
1. 계약금액

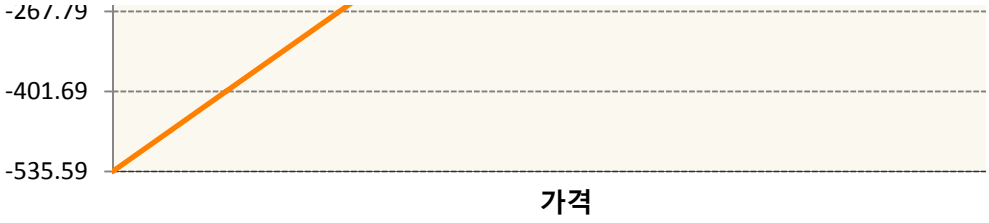
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	538	537	1	장내
누계	유가증권	선물	1,147	0	1,147	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							49
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	16	16	16	16	16	16	16
5.33%	33	33	33	33	33	33	33
8.00%	49	49	49	49	49	49	49
KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							43
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
-5.33%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
-2.67%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	14	14	14	14	14	14	14
5.33%	29	29	29	29	29	29	29
8.00%	43	43	43	43	43	43	43

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

61

공시일	2017-06-08
기준일	2017-06-07

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	1,001

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

530

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-08
기준일	2017-06-07

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	368

* 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	2017-06-08
기준일	2017-06-07

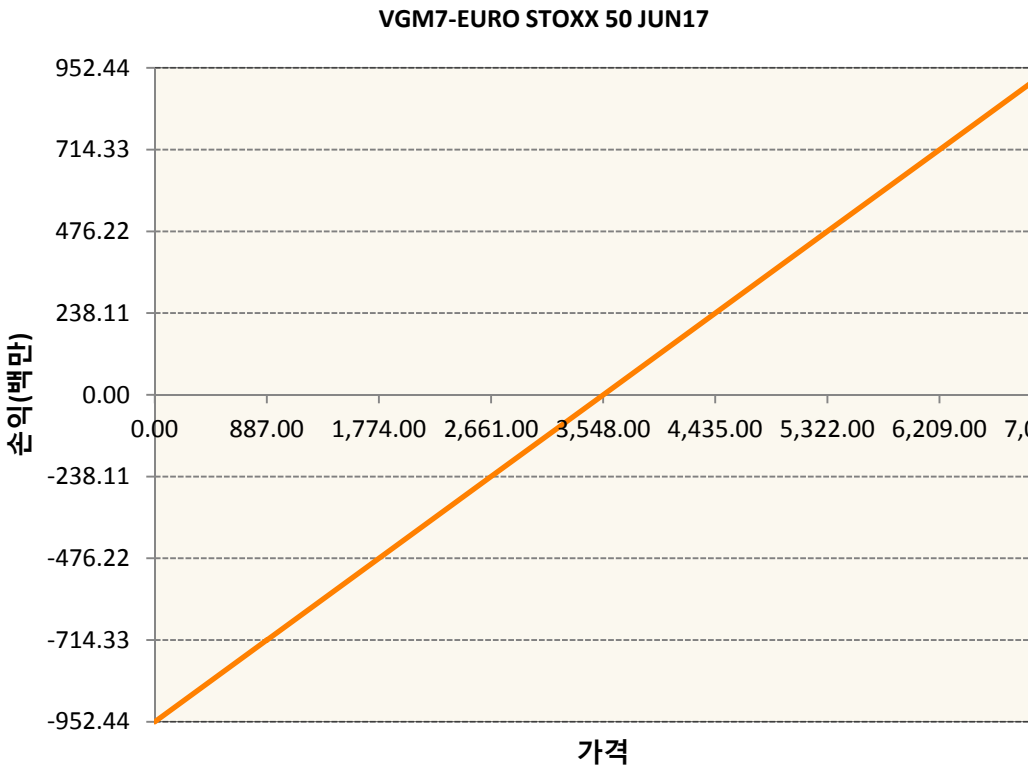
유로인덱스모(주식-파생형)

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)

72

공시일	2017-06-08
기준일	2017-06-07

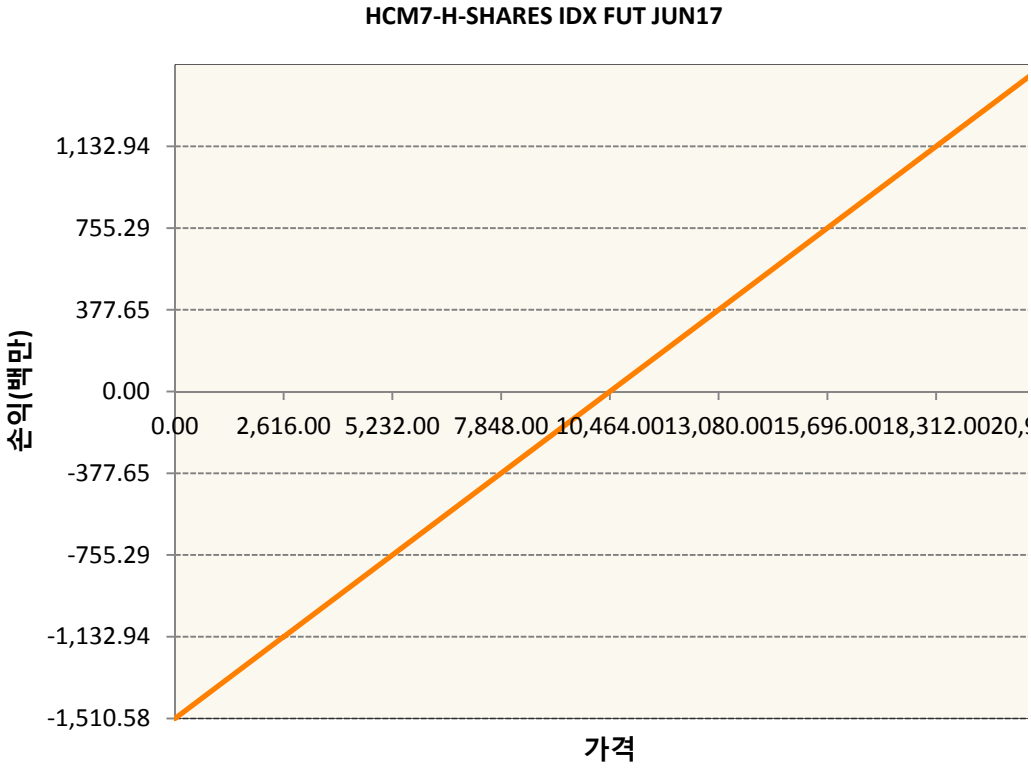
차이나인덱스모(주식-파생형)

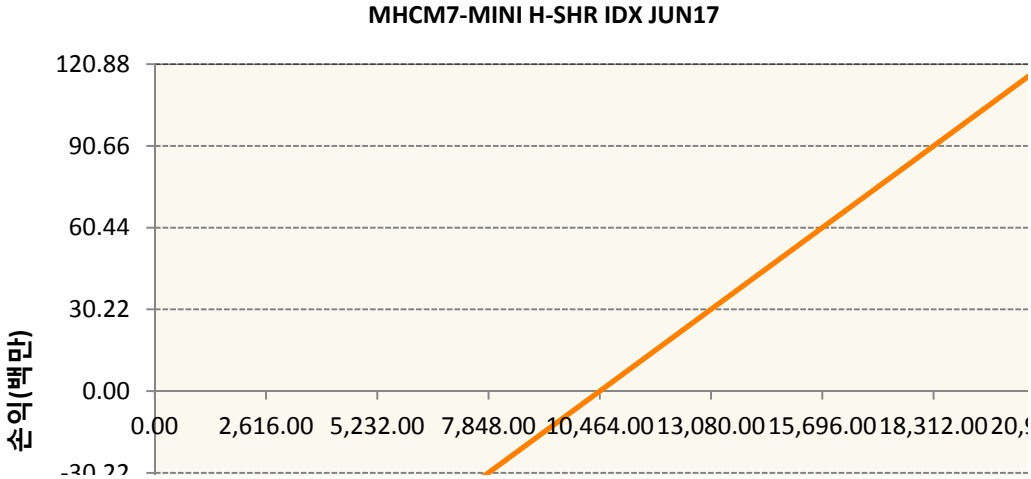
1. 계약금액

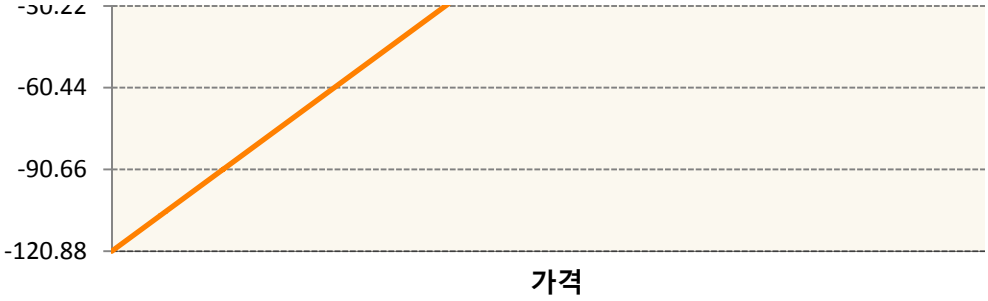
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계			1,511	0	1,511	
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	2017-06-08
기준일	2017-06-07

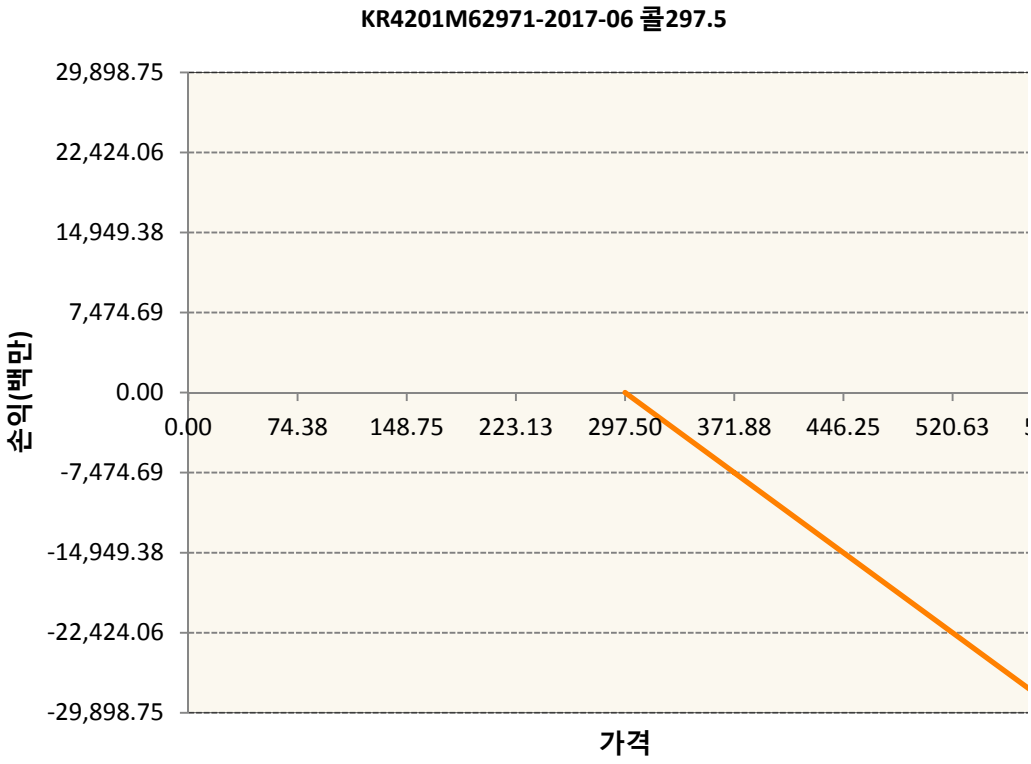
커버드콜모(주식혼합-파생형)

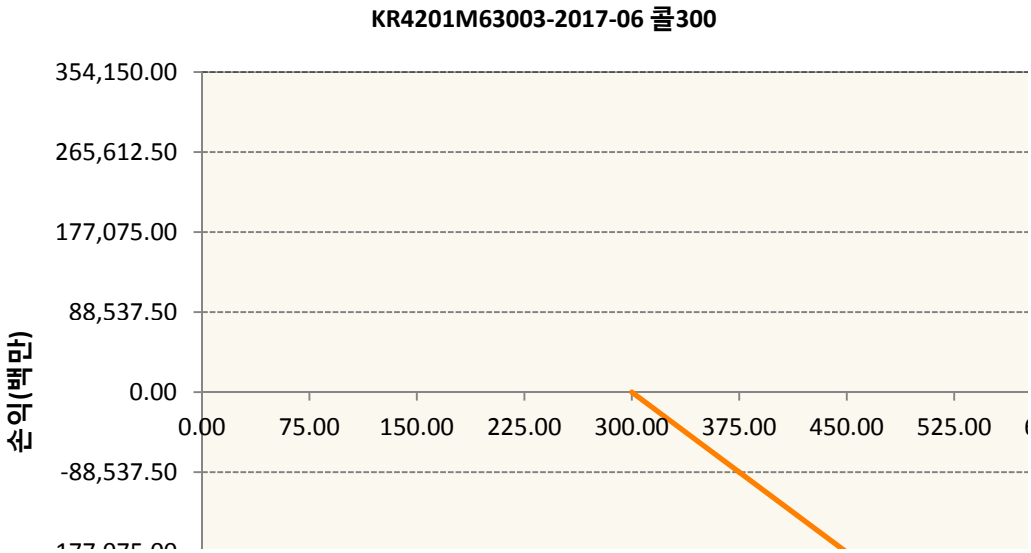
1. 계약금액

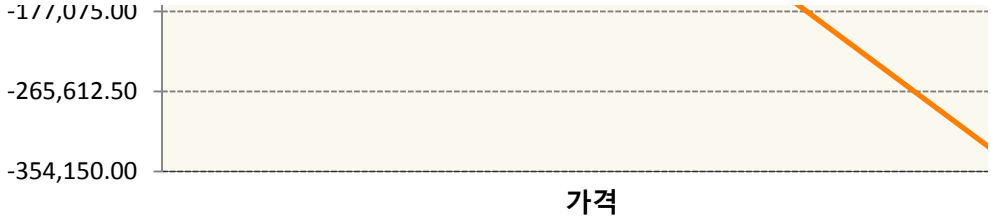
(단위:백만원)

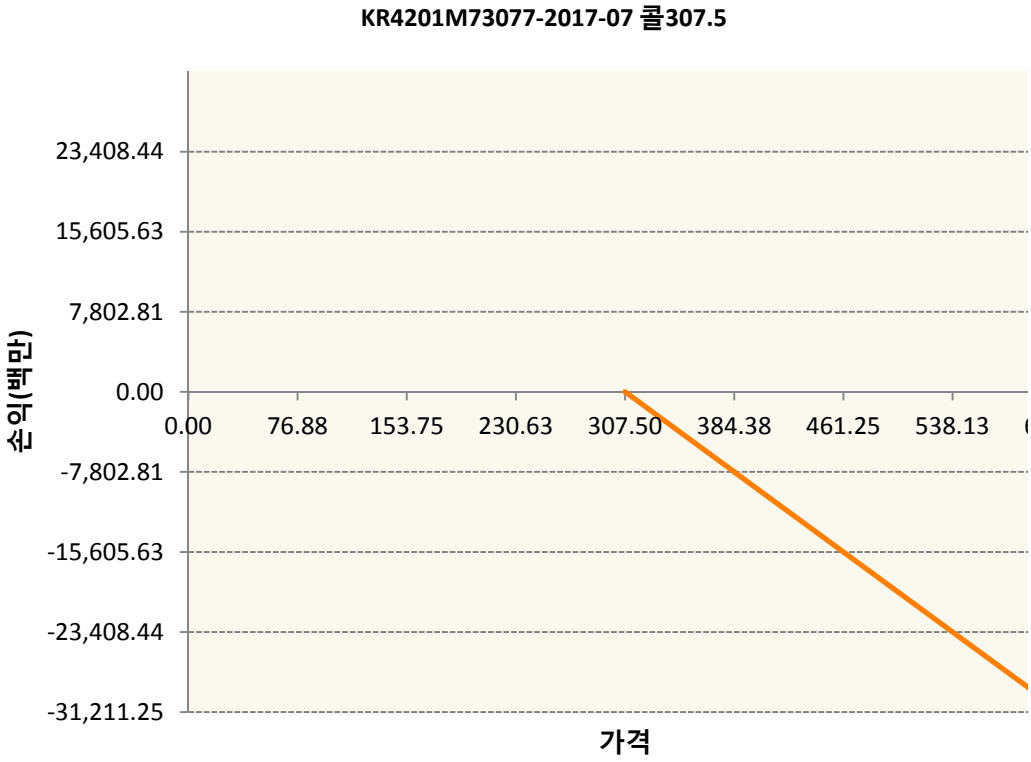
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	31,647	-31,647	장내
누계	유가증권	옵션	0	745,010	-745,010	장내

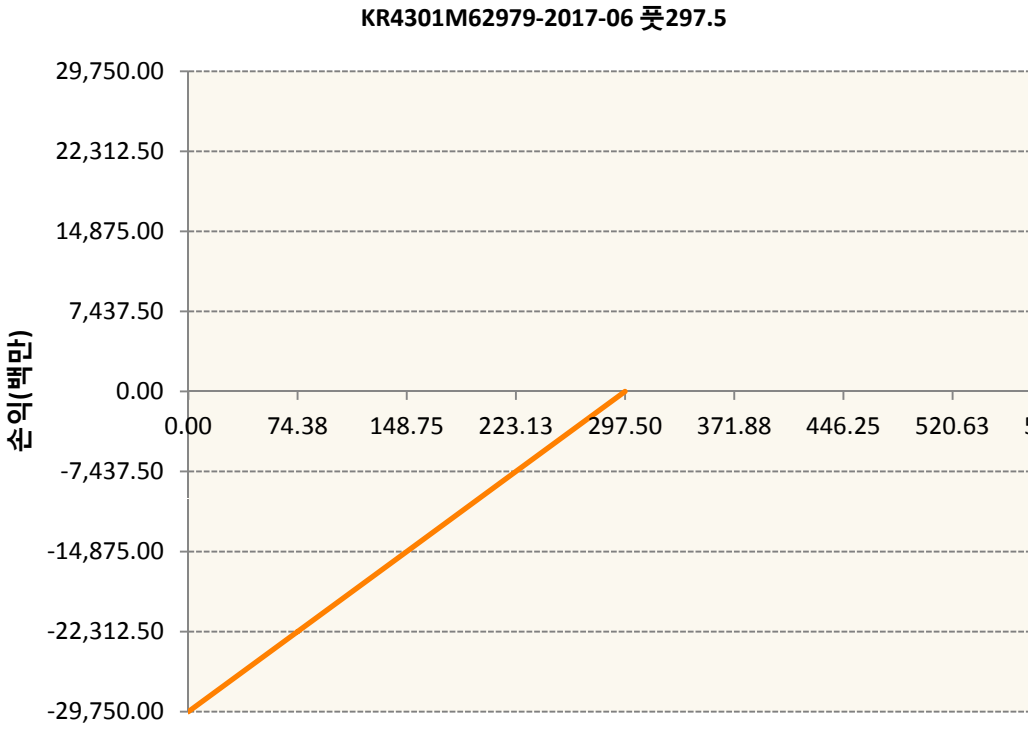
2. 만기시점의 손익구조



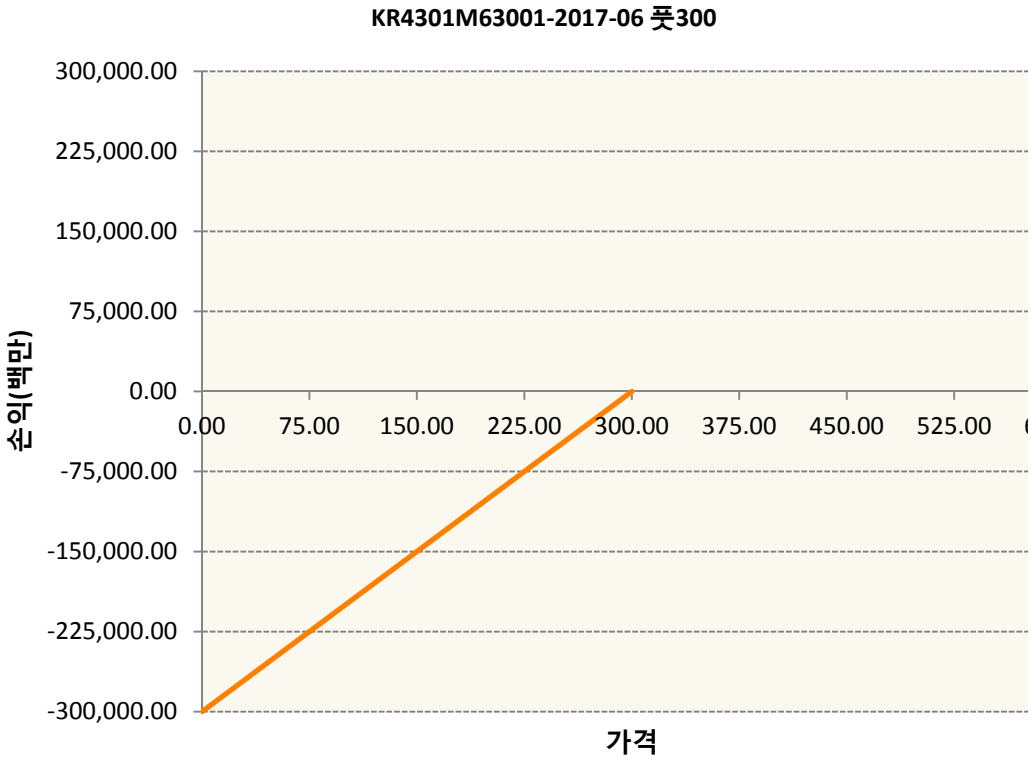



-177,075.00
-265,612.50
-354,150.00
가격


KR4201M73077-2017-07 콜307.5
23,408.44
15,605.63
7,802.81
0.00
-7,802.81
-15,605.63
-23,408.44
-31,211.25
0.00
76.88
153.75
230.63
307.50
384.38
461.25
538.13
손익(백만)
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



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M62(2017-06 콜297.5							2,458
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	822	822	822	822	822	822	822
-5.33%	822	822	822	822	822	822	822
-2.67%	760	754	747	740	734	727	720
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-819	-819	-819	-819	-819	-819	-819
5.33%	-1,638	-1,638	-1,638	-1,638	-1,638	-1,638	-1,638
8.00%	-2,458	-2,458	-2,458	-2,458	-2,458	-2,458	-2,458
KR4201M63(2017-06 콜300							28,865
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,705	6,705	6,705	6,705	6,705	6,705	6,705
-5.33%	6,705	6,705	6,705	6,705	6,705	6,705	6,705
-2.67%	6,668	6,644	6,615	6,580	6,541	6,498	6,451
0%	2	2	1	0	-2	-6	-12
2.67%	-9,620	-9,620	-9,620	-9,620	-9,620	-9,620	-9,620

5.33%	-19,243	-19,243	-19,243	-19,243	-19,243	-19,243	-19,243
8.00%	-28,865	-28,865	-28,865	-28,865	-28,865	-28,865	-28,865
	KR4201M73(	2017-07 콜307.5					1,934
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	416	415	413	410	406	400	392
-5.33%	408	401	392	380	365	348	329
-2.67%	350	325	298	269	239	207	174
0%	124	83	42	0	-42	-83	-125
2.67%	-367	-402	-438	-476	-514	-553	-592
5.33%	-1,075	-1,091	-1,109	-1,131	-1,155	-1,181	-1,210
8.00%	-1,876	-1,880	-1,886	-1,894	-1,905	-1,918	-1,934
	KR4301M62(	2017-06 풋297.5					1,628
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,628	-1,628	-1,628	-1,628	-1,628	-1,628	-1,628
-5.33%	-812	-812	-812	-812	-812	-812	-812
-2.67%	-59	-65	-72	-78	-85	-92	-98
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					18,773
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-18,773	-18,773	-18,773	-18,773	-18,773	-18,773	-18,773
-5.33%	-10,622	-10,622	-10,622	-10,622	-10,622	-10,622	-10,622
-2.67%	-2,503	-2,523	-2,548	-2,577	-2,610	-2,647	-2,687
0%	2	1	1	0	-2	-5	-10
2.67%	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

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

60,810

공시일	2017-06-08
기준일	2017-06-07

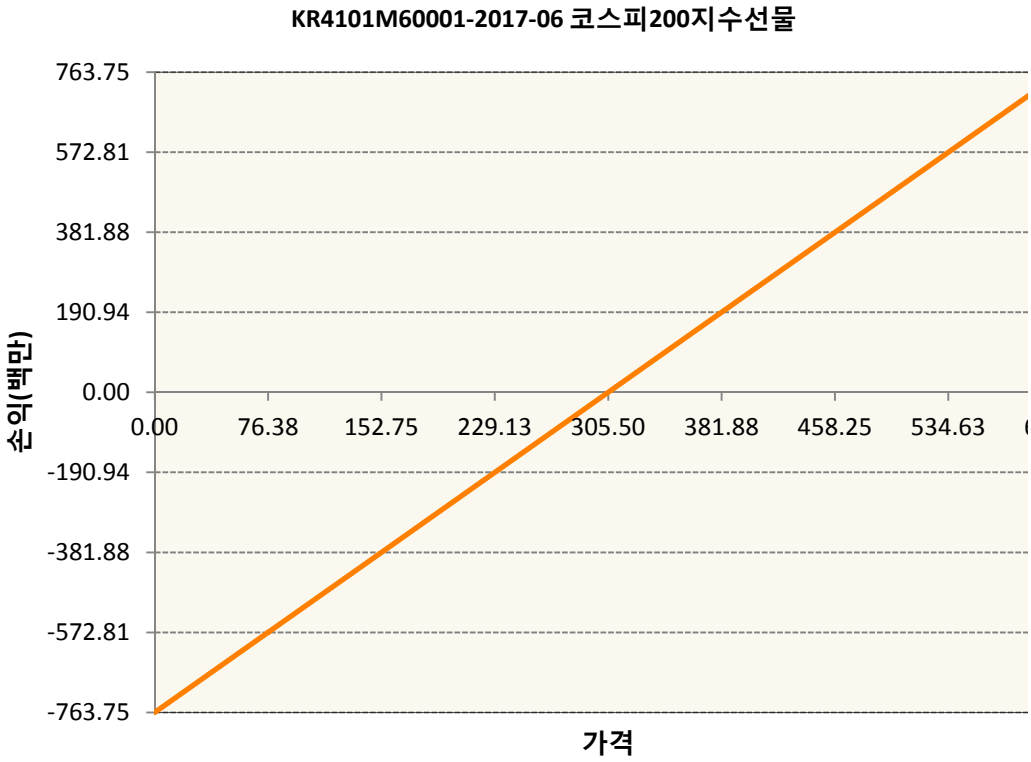
커버드콜목표전환형증권투자신탁

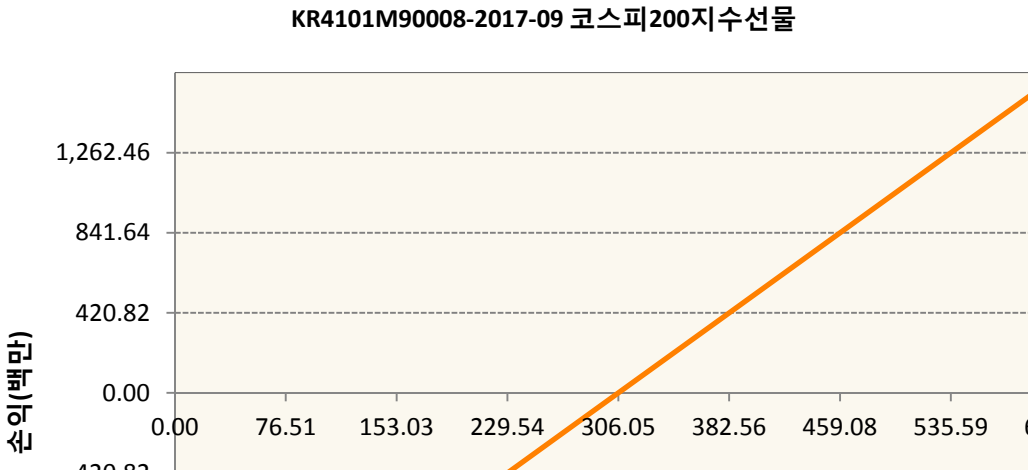
1. 계약금액

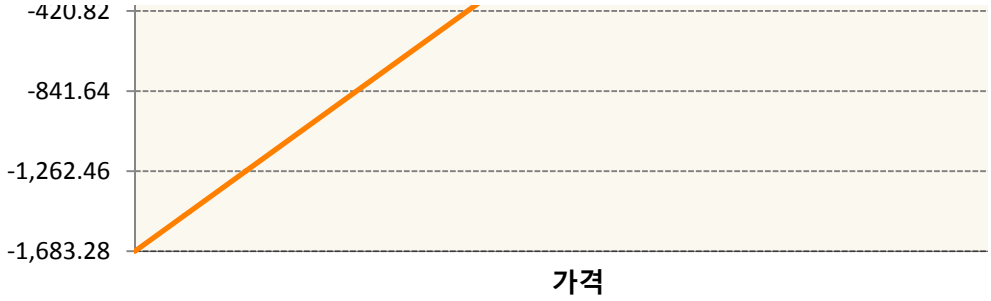
(단위:백만원)

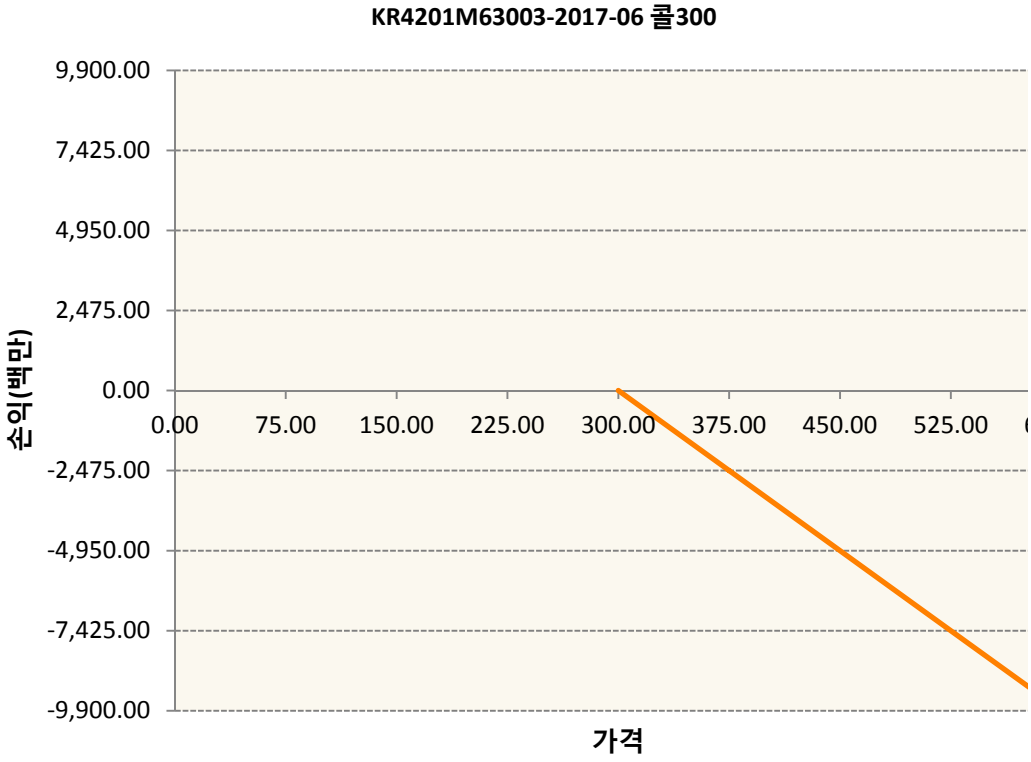
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,692	1,688	4	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,447	0	2,447	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,397	-11,397	장내

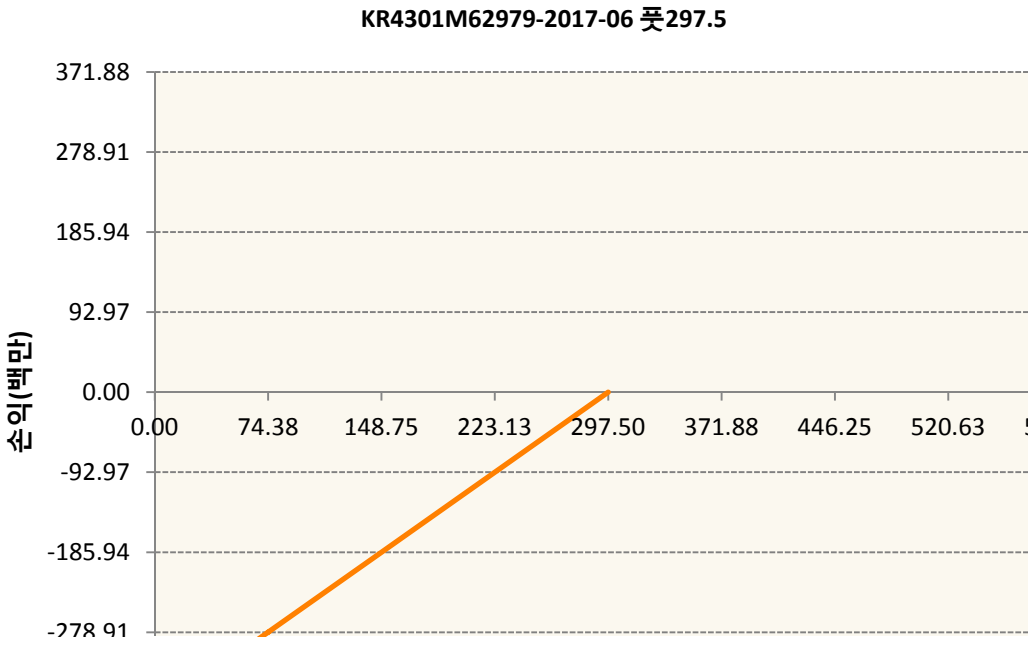
2. 만기시점의 손익구조



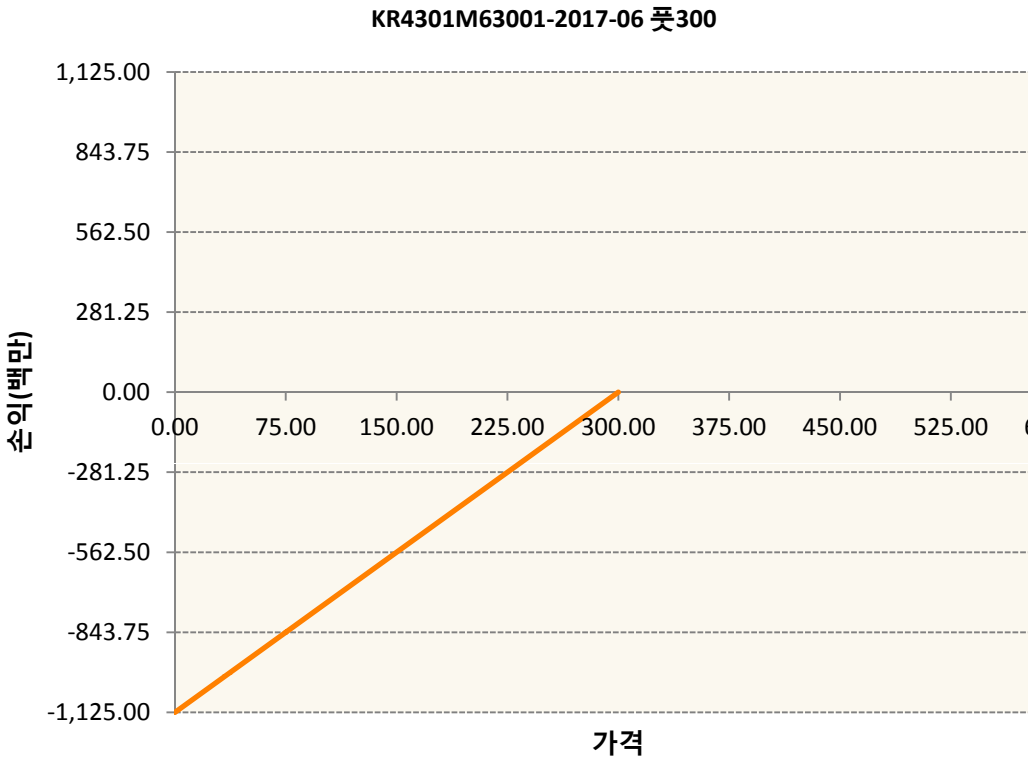



-420.82
-841.64
-1,262.46
-1,683.28
가격


KR4201M63003-2017-06 콜300
9,900.00
7,425.00
4,950.00
2,475.00
0.00
-2,475.00
-4,950.00
-7,425.00
-9,900.00
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							61
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61
-5.33%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
-2.67%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	20	20	20	20	20	20	20
5.33%	41	41	41	41	41	41	41
8.00%	61	61	61	61	61	61	61
KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							134
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-134	-134	-134	-134	-134	-134	-134
-5.33%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90
-2.67%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45

0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	45	45	45	45	45	45	45
5.33%	90	90	90	90	90	90	90
8.00%	134	134	134	134	134	134	134
	KR4201M63(	2017-06 콜300					807
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	187	187	187	187	187	187	187
-5.33%	187	187	187	187	187	187	187
-2.67%	186	186	185	184	183	182	180
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-269	-269	-269	-269	-269	-269	-269
5.33%	-538	-538	-538	-538	-538	-538	-538
8.00%	-807	-807	-807	-807	-807	-807	-807
	KR4301M62(	2017-06 풋297.5					20
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
-5.33%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
-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					70
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70
-5.33%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
-2.67%	-9	-9	-10	-10	-10	-10	-10
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)

1,268

공시일	2017-06-08
기준일	2017-06-07

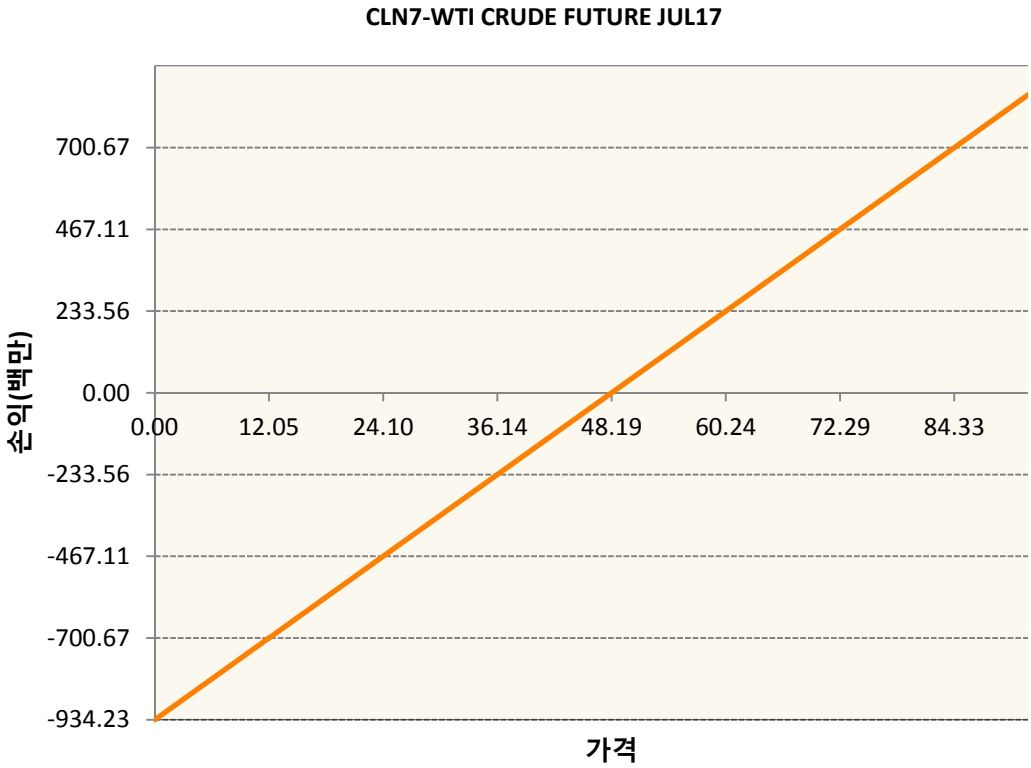
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

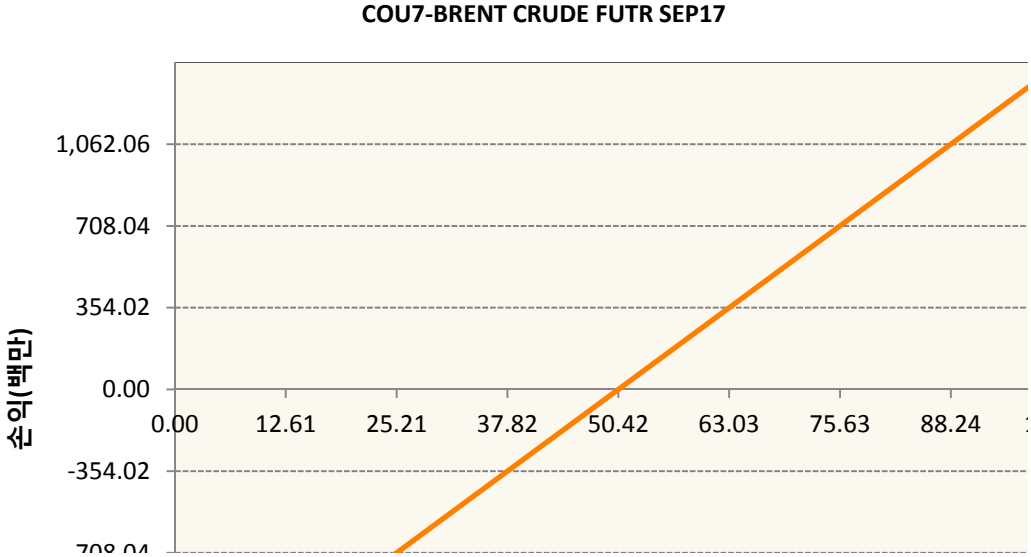
1. 계약금액

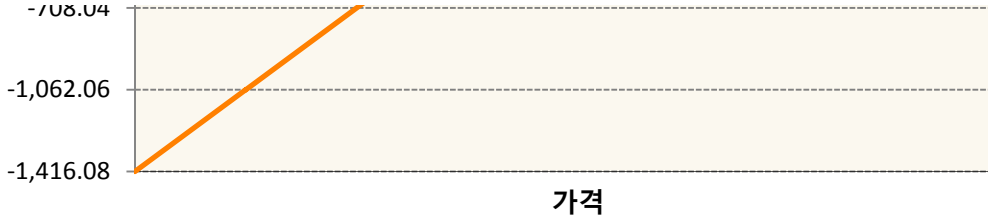
(단위:백만원)

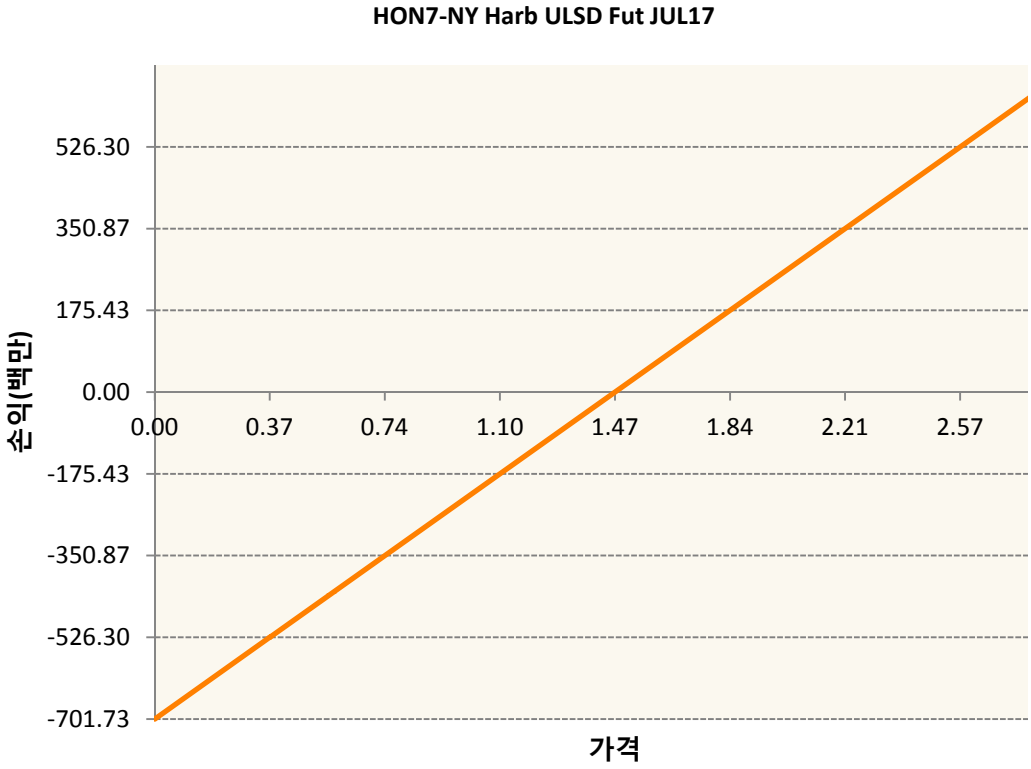
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,254	225	5,030	

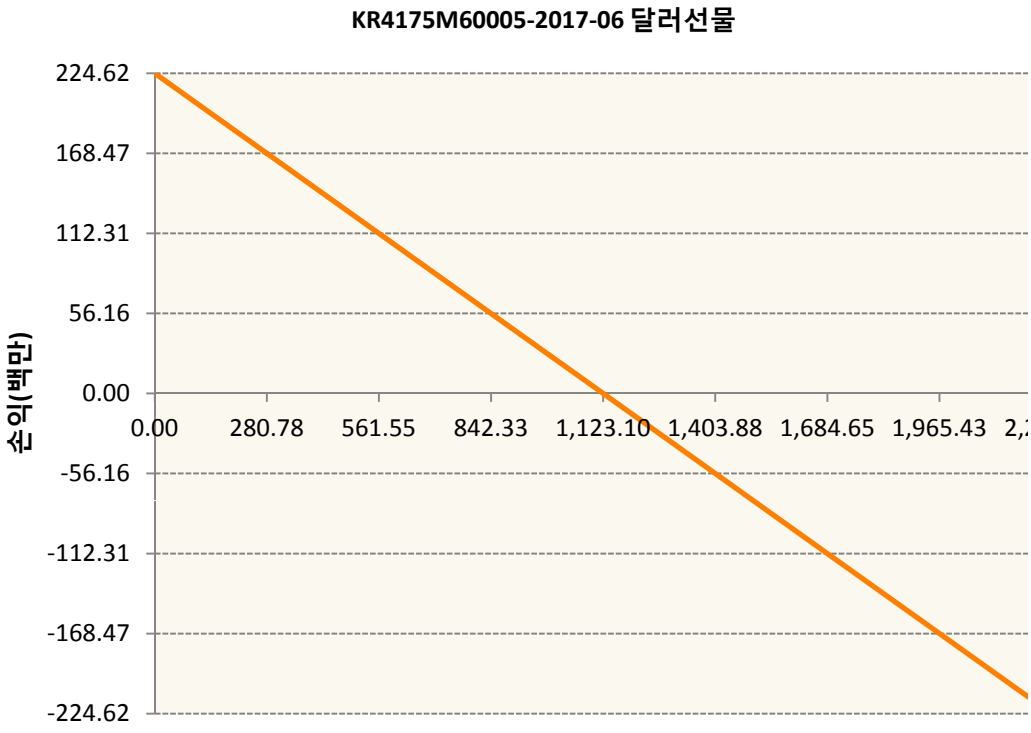
2. 만기시점의 손익구조



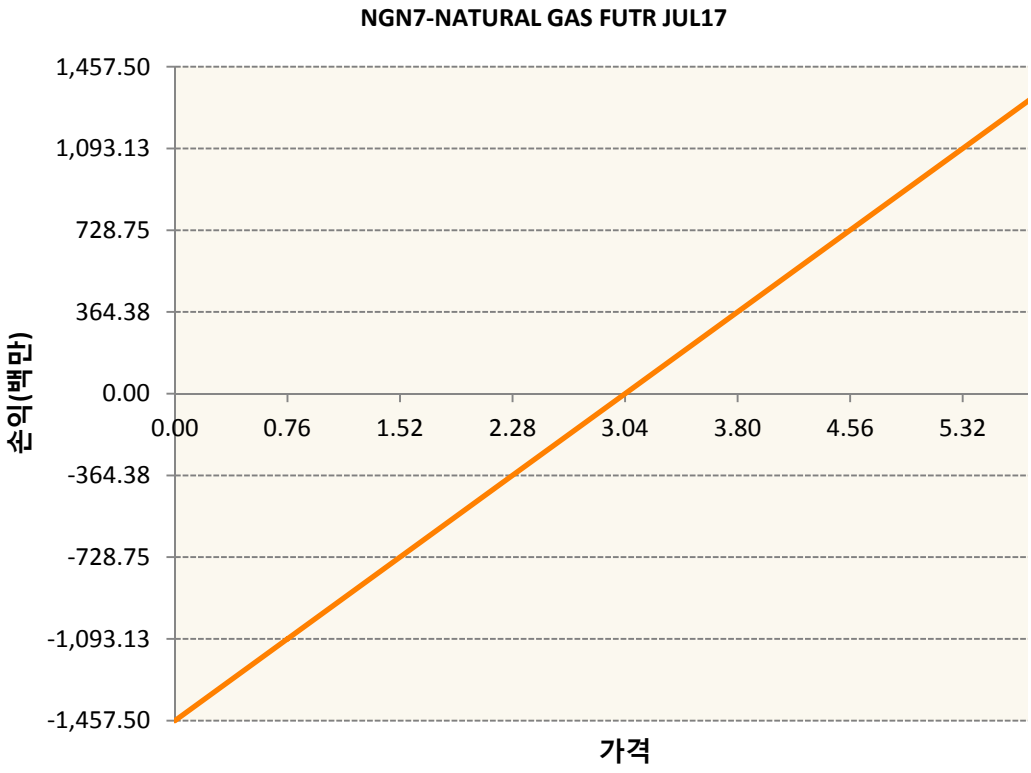


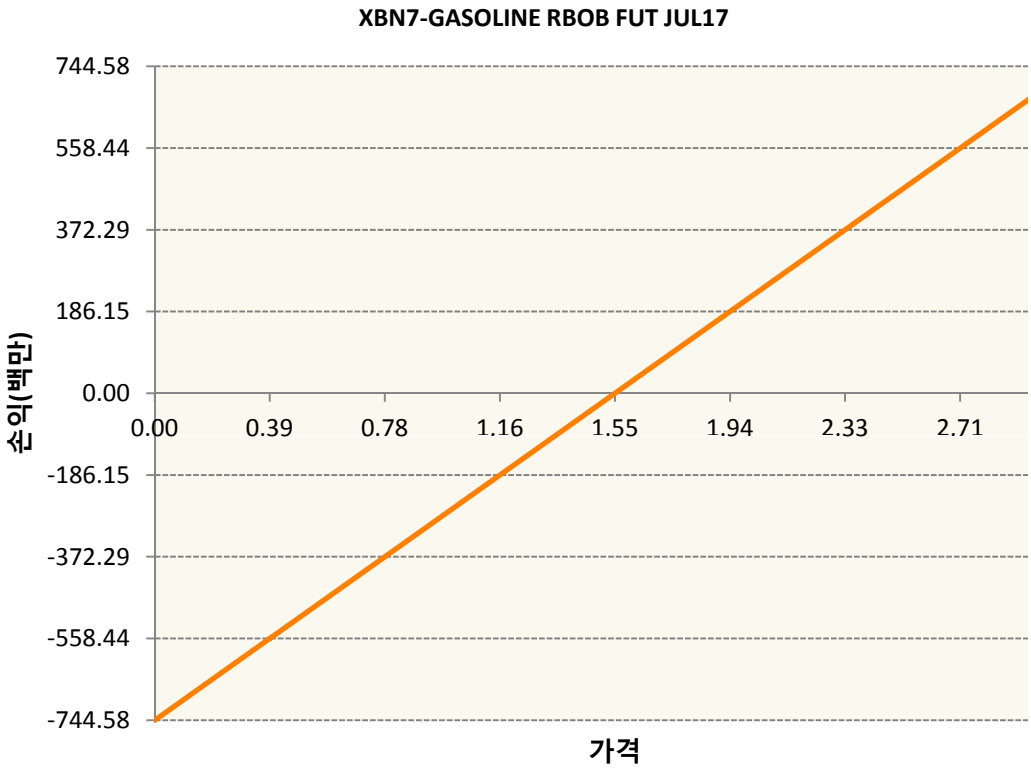

-1,062.06
-1,416.08
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
526.30
350.87
175.43
0.00
-175.43
-350.87
-526.30
-701.73
0.00
0.37
0.74
1.10
1.47
1.84
2.21
2.57
순이익(백만)
가격


KR4175M60005-2017-06 달러선물
224.62
168.47
112.31
56.16
0.00
-56.16
-112.31
-168.47
-224.62
0.00
280.78
561.55
842.33
1,123.10
1,403.88
1,684.65
1,965.43
순이익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,457.50
1,093.13
728.75
364.38
0.00
-364.38
-728.75
-1,093.13
-1,457.50
0.00
0.76
1.52
2.28
3.04
3.80
4.56
5.32
순익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
744.58
558.44
372.29
186.15
0.00
-186.15
-372.29
-558.44
-744.58
0.00
0.39
0.78
1.16
1.55
1.94
2.33
2.71
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN7	WTI CRUDE FUTURE JUL17	75
COU7	BRENT CRUDE FUTR SEP17	113
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	56
KR4175M60(	2017-06 달러선물	18
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	117
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	60

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

872

공시일	2017-06-08
기준일	2017-06-07

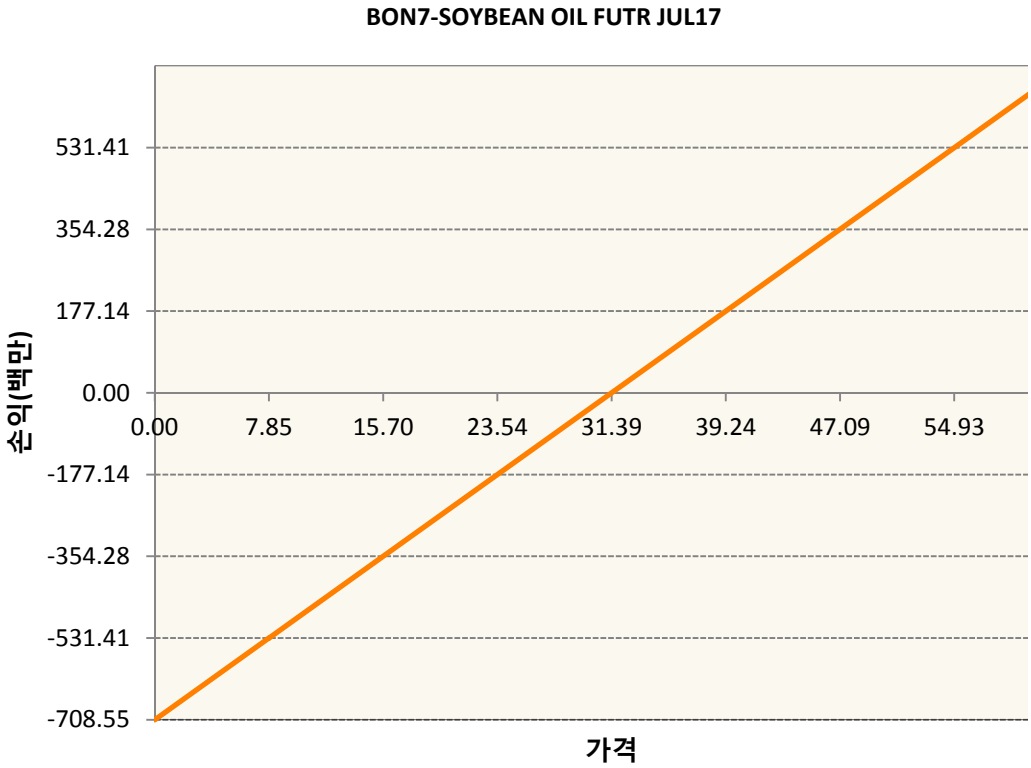
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

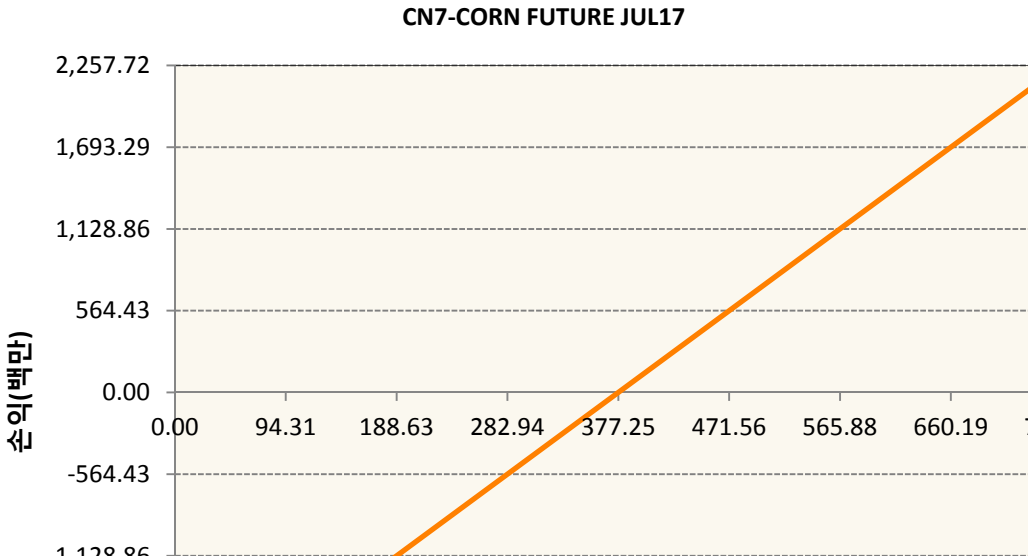
1. 계약금액

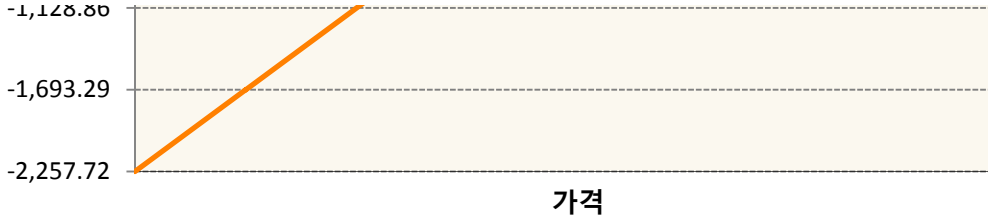
(단위:백만원)

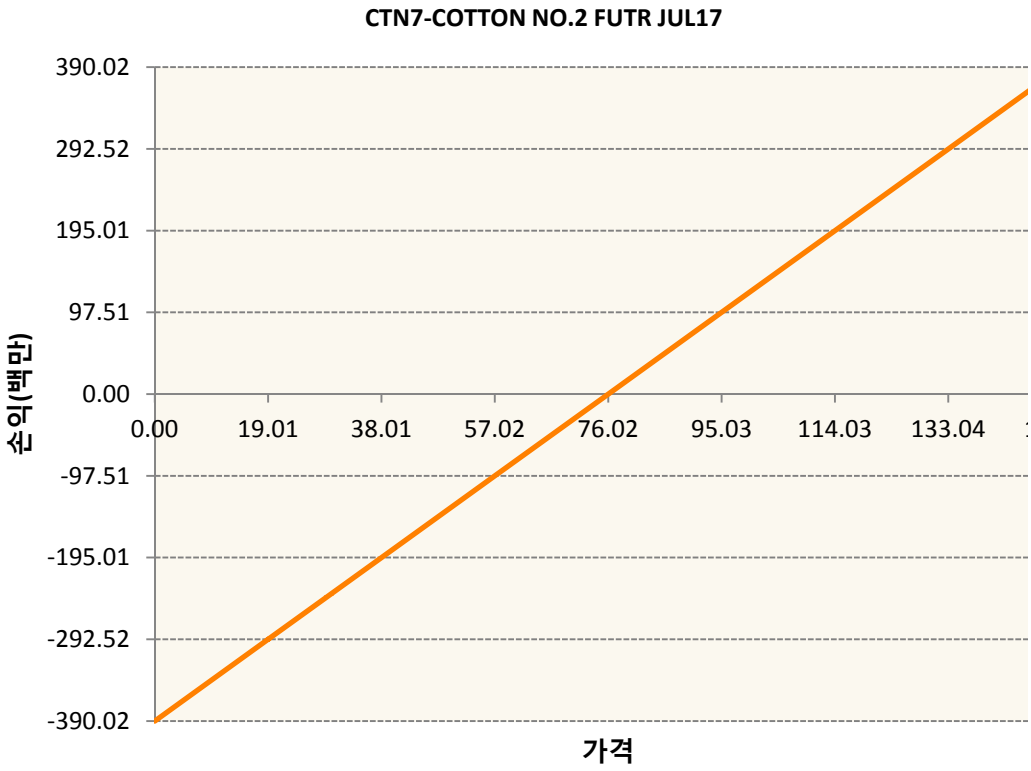
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,256	393	7,862	

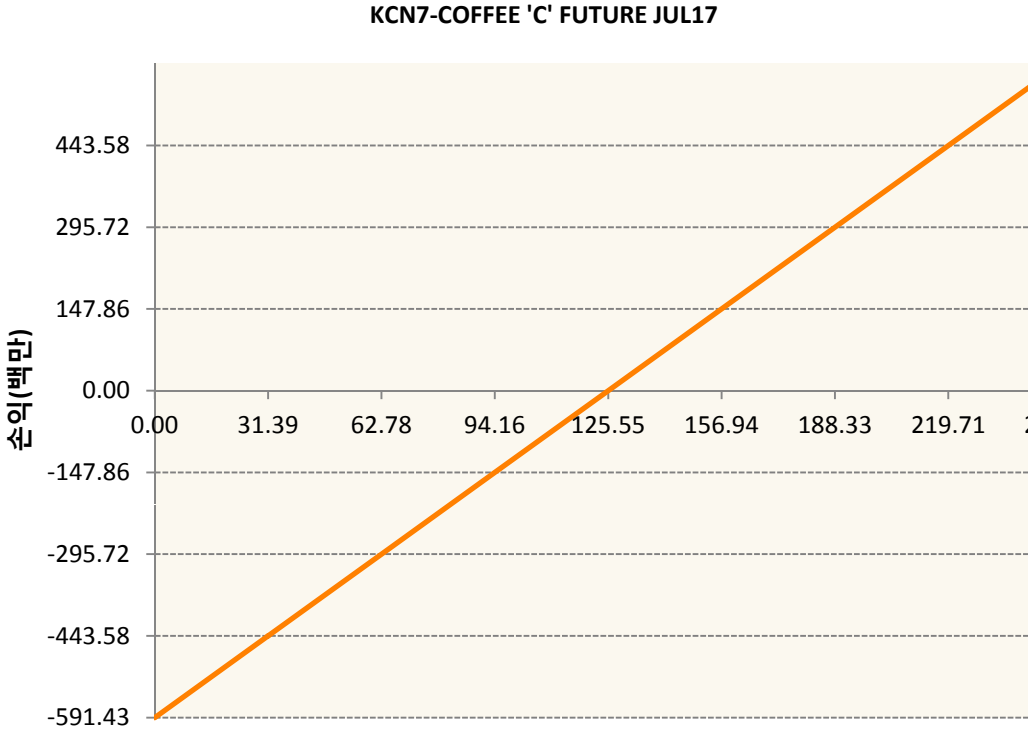
2. 만기시점의 손익구조



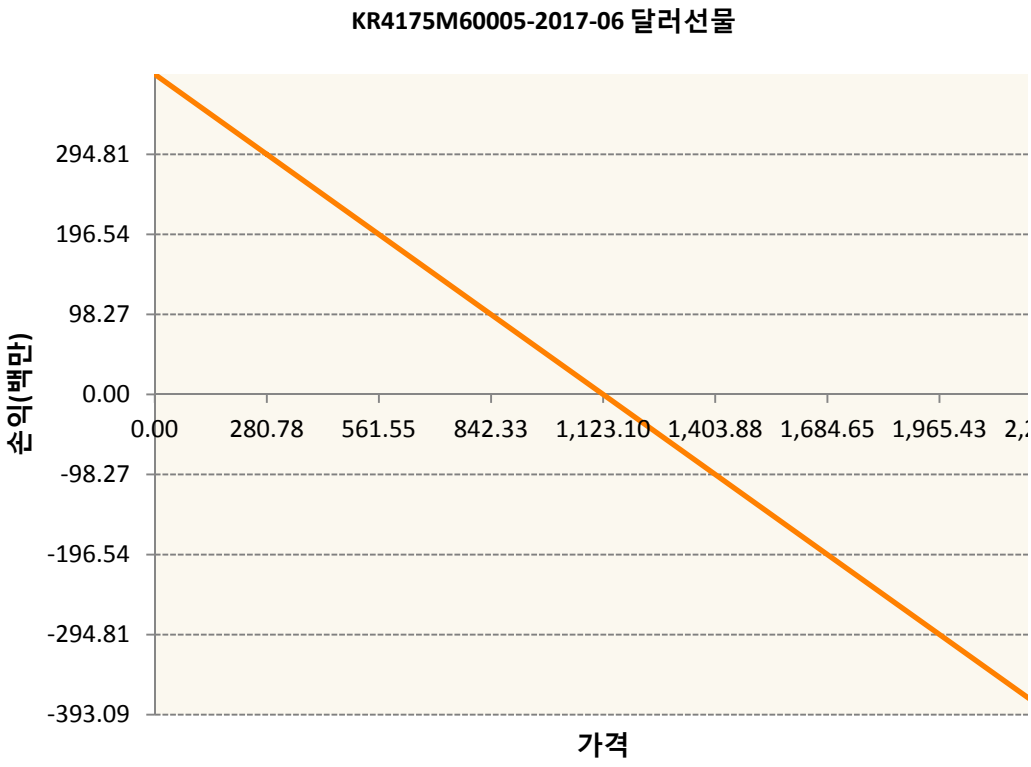


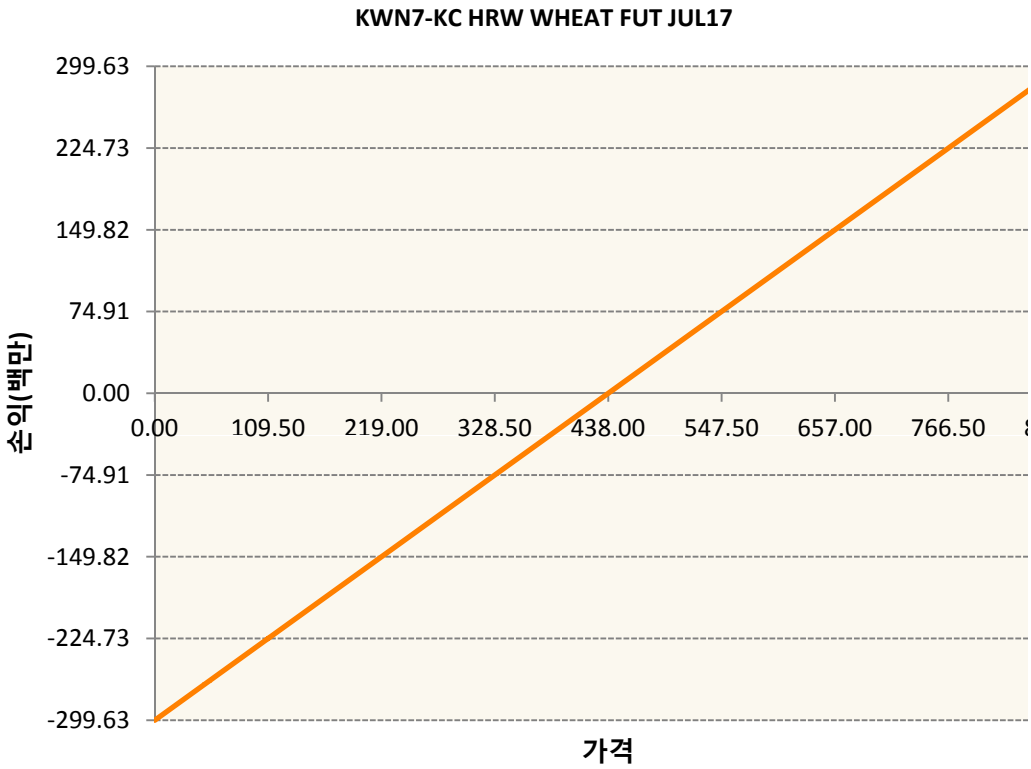

-1,693.29
-2,257.72
가격

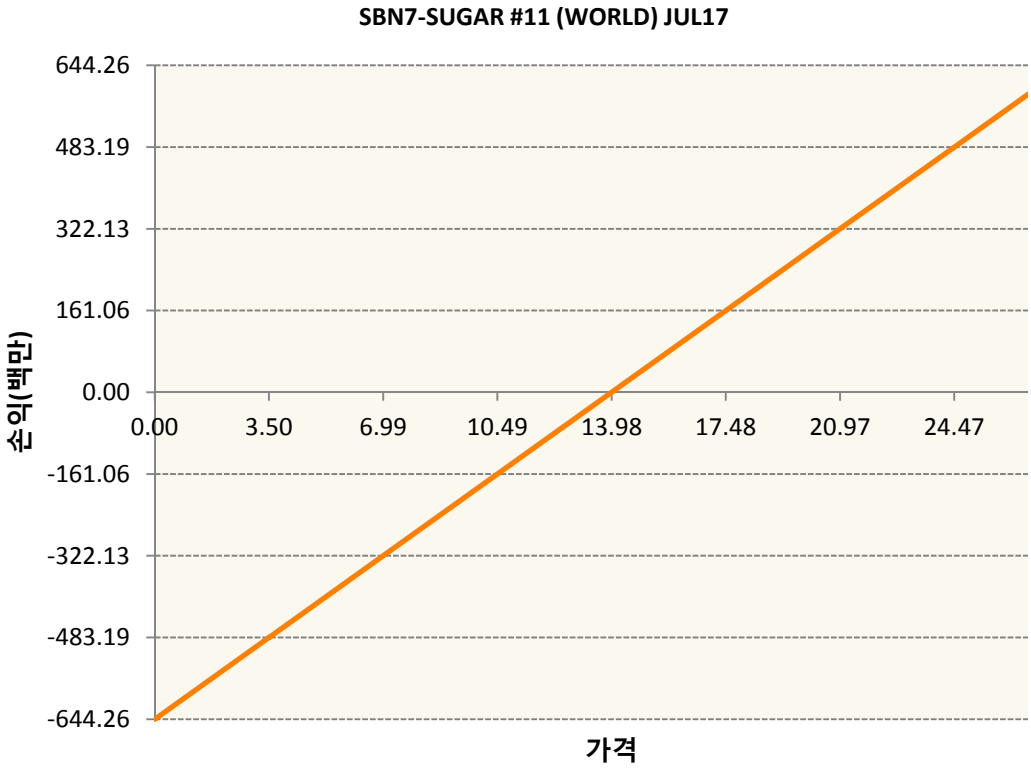

CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
390.02
292.52
195.01
97.51
0.00
-97.51
-195.01
-292.52
-390.02
0.00
19.01
38.01
57.02
76.02
95.03
114.03
133.04
순익(백만)
가격

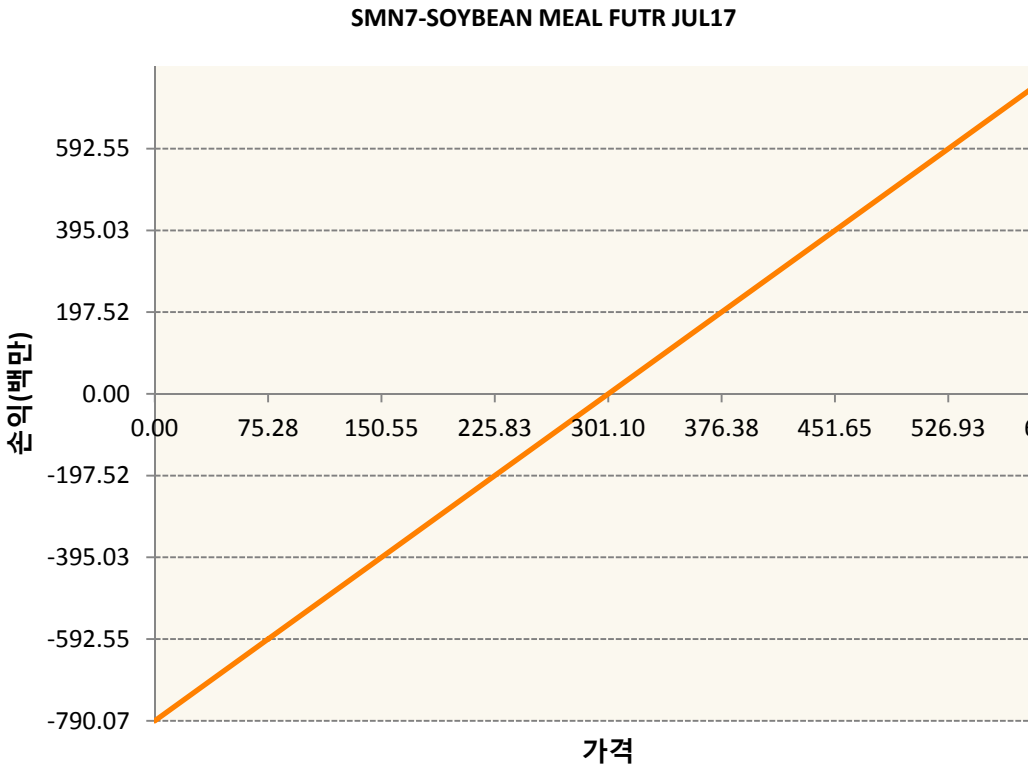

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
443.58
295.72
147.86
0.00
-147.86
-295.72
-443.58
-591.43
0.00
31.39
62.78
94.16
125.55
156.94
188.33
219.71
순익(백만)

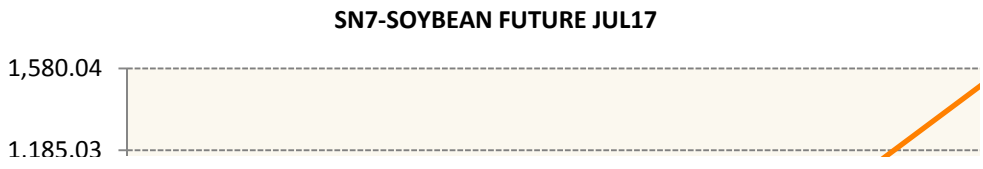
가격

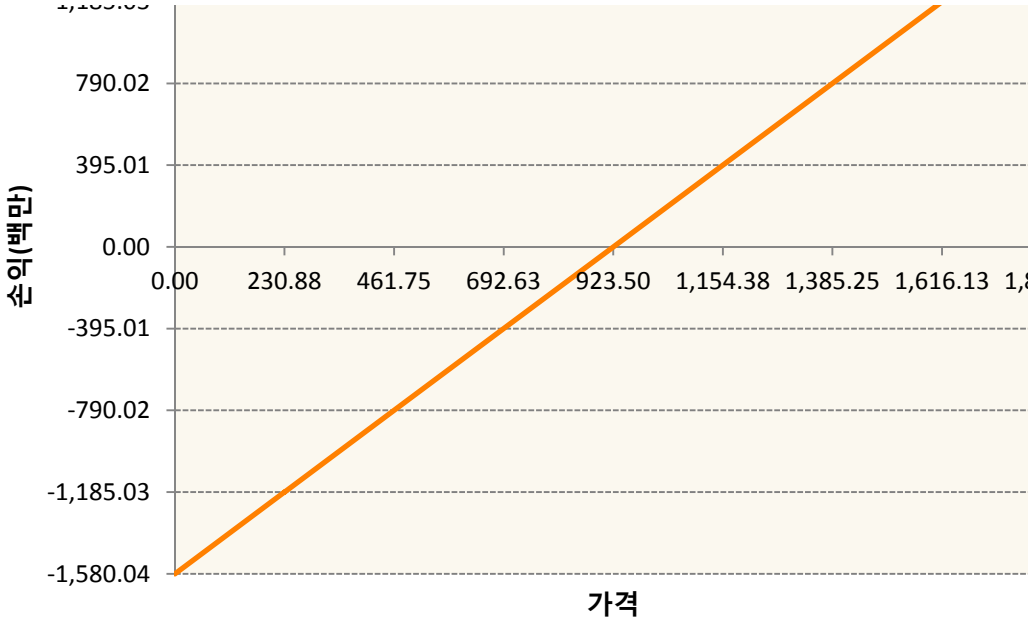

KR4175M60005-2017-06 달러선물
294.81
196.54
98.27
0.00
-98.27
-196.54
-294.81
-393.09
0.00
280.78
561.55
842.33
1,123.10
1,403.88
1,684.65
1,965.43
손익(백만)
가격

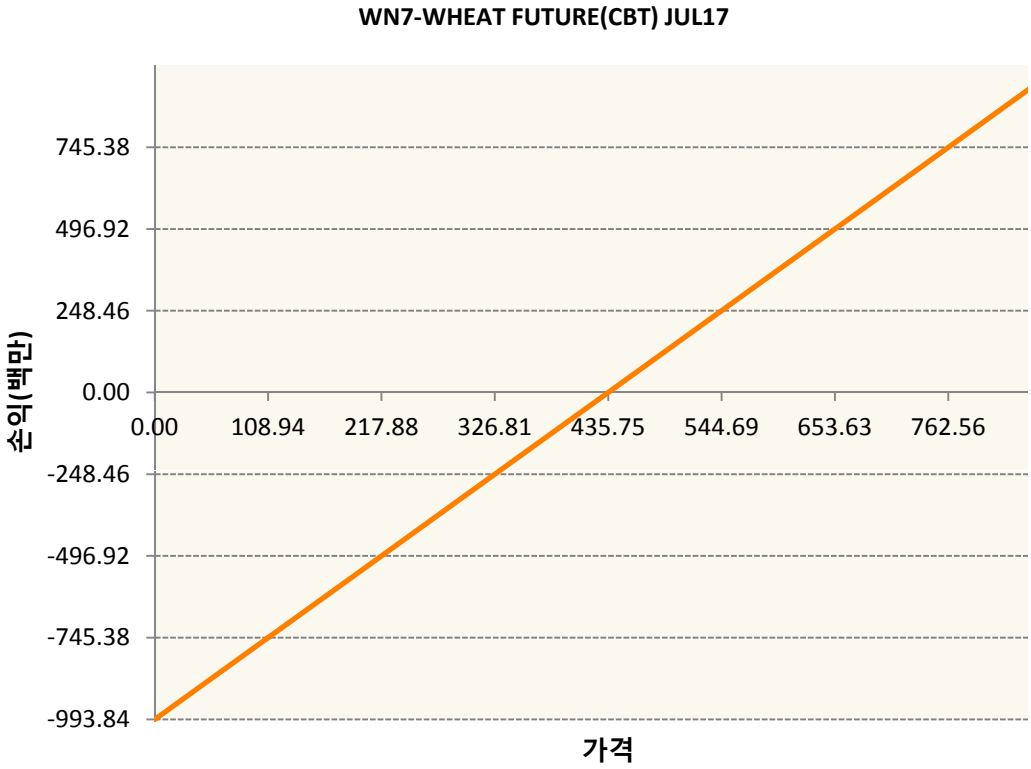

KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17
299.63
224.73
149.82
74.91
0.00
-74.91
-149.82
-224.73
-299.63
0.00
109.50
219.00
328.50
438.00
547.50
657.00
766.50
손익(백만)
가격


SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
644.26
483.19
322.13
161.06
0.00
-161.06
-322.13
-483.19
-644.26
0.00
3.50
6.99
10.49
13.98
17.48
20.97
24.47
손익(백만)
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
592.55
395.03
197.52
0.00
-197.52
-395.03
-592.55
-790.07
0.00
75.28
150.55
225.83
301.10
376.38
451.65
526.93
손익(백만)
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,580.04
1,185.03





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	57
CN7	CORN FUTURE JUL17	181
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	52
SMN7	SOYBEAN MEAL FUTR JUL17	63
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	126
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	80

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

749