공시일	2017-06-09
기준일	2017-06-08

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	2017-06-09
기준일	2017-06-08

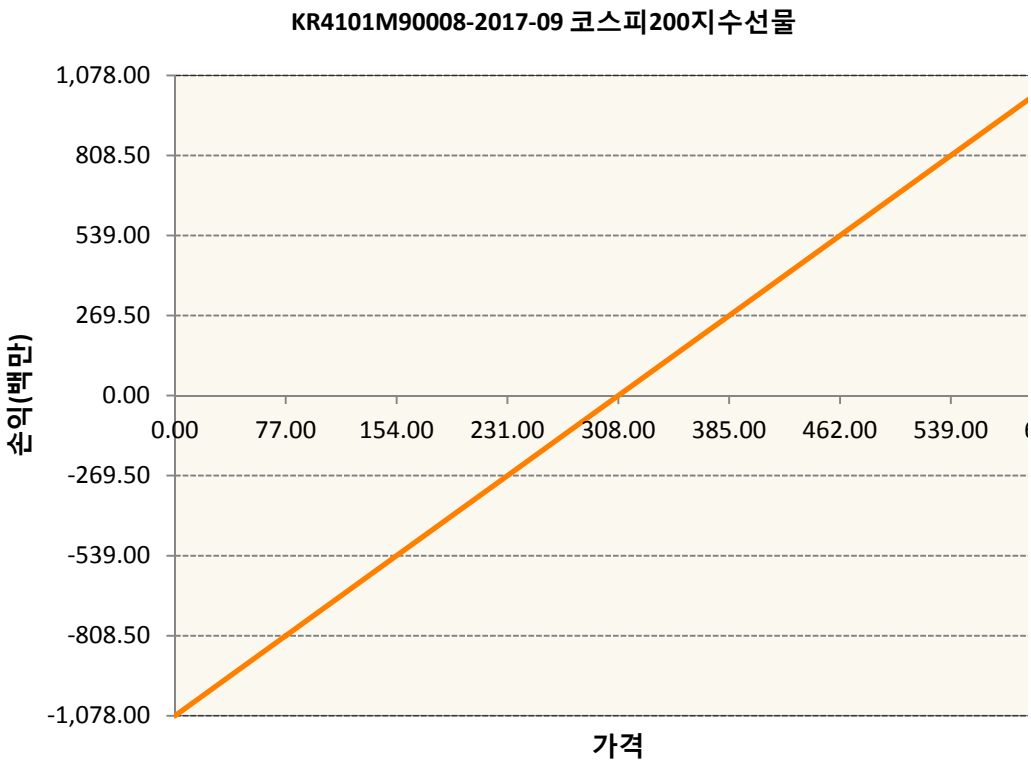
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	535	0	535	장내
누계	유가증권	선물	1,078	0	1,078	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							86
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
-5.33%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
-2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	29	29	29	29	29	29	29
5.33%	57	57	57	57	57	57	57
8.00%	86	86	86	86	86	86	86

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

57

공시일	2017-06-09
기준일	2017-06-08

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)

529

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-09
기준일	2017-06-08

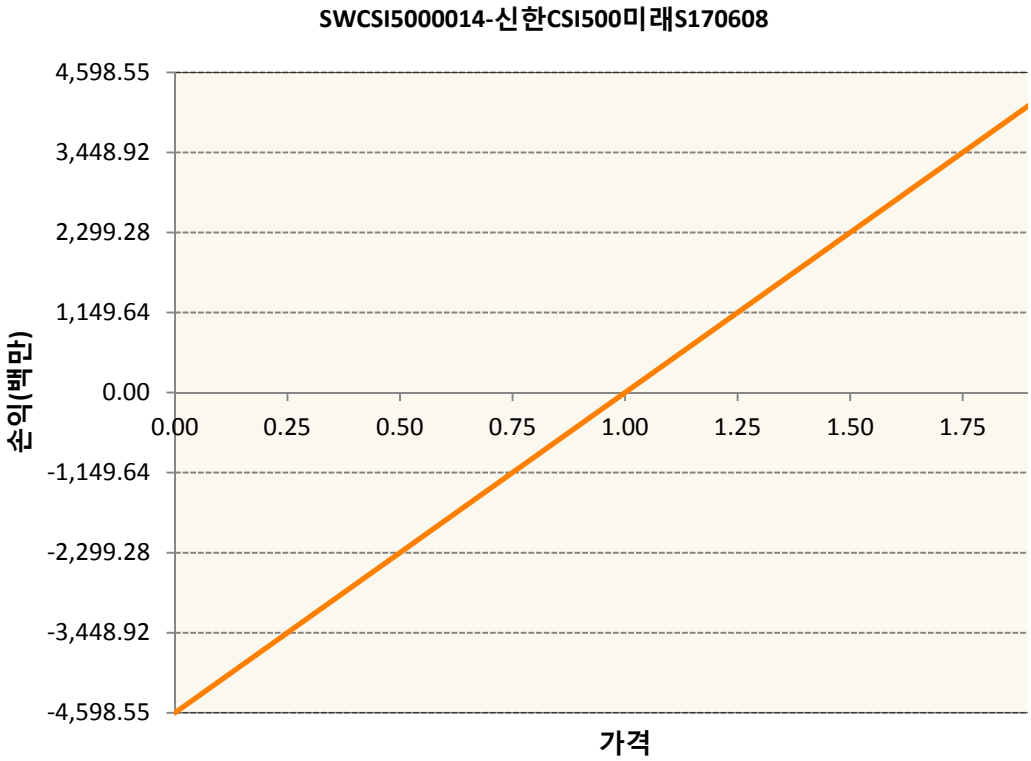
SMART중국본토중소형CSI500상장

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	4,599	0	4,599	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S170608	368

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

338

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-09
기준일	2017-06-08

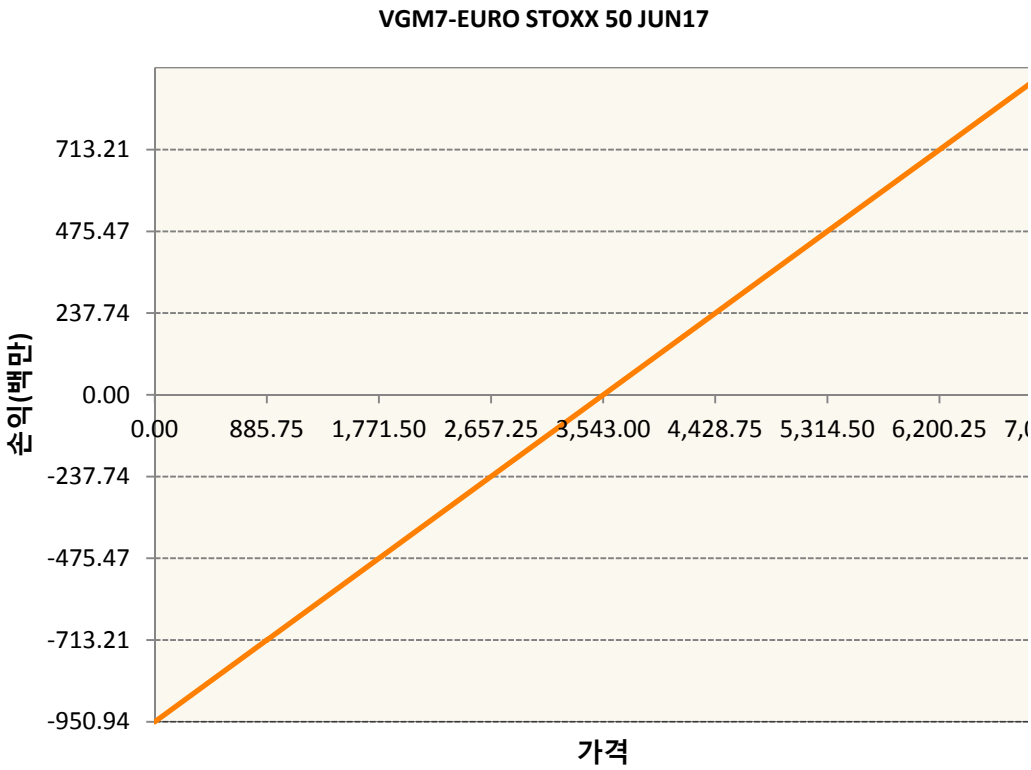
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	951	0	951	

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	2017-06-09
기준일	2017-06-08

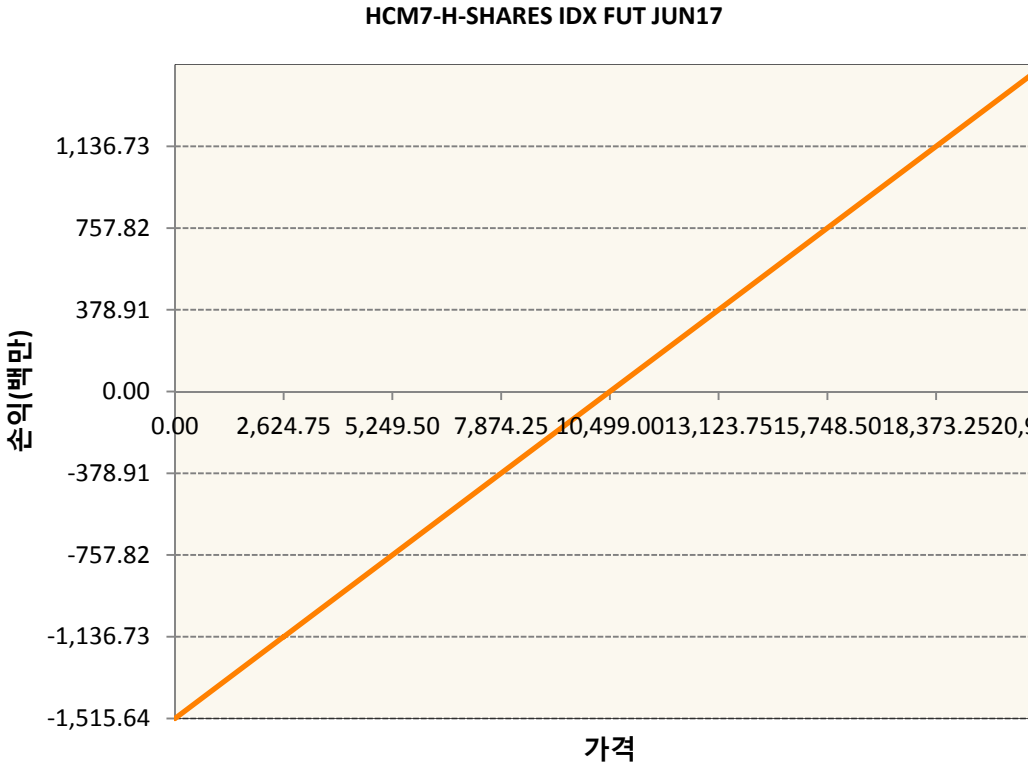
차이나인덱스모(주식-파생형)

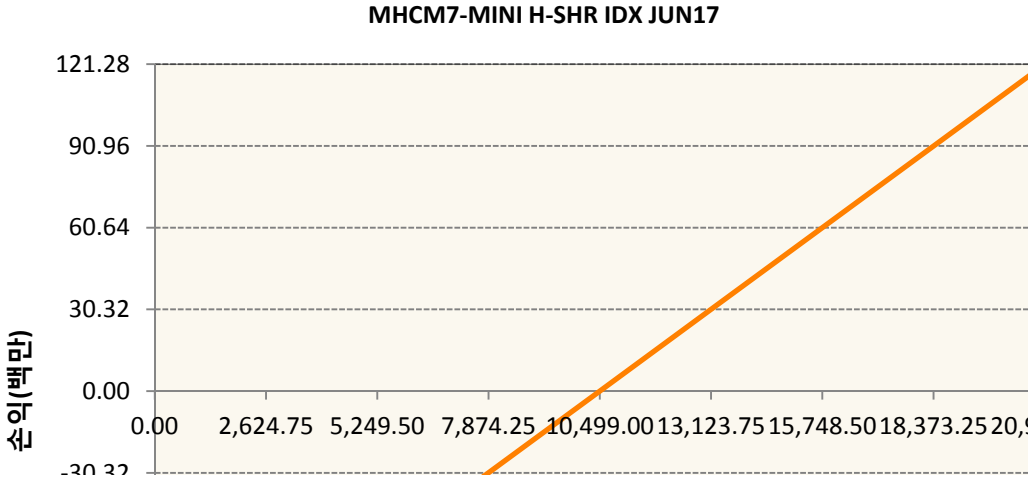
1. 계약금액

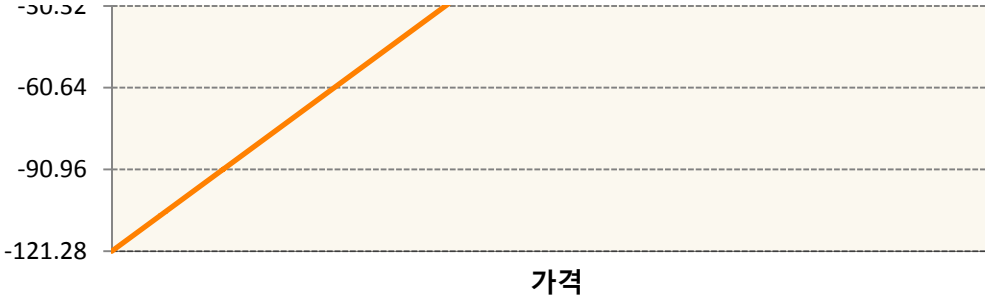
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계			1,516	0	1,516	
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	2017-06-09
기준일	2017-06-08

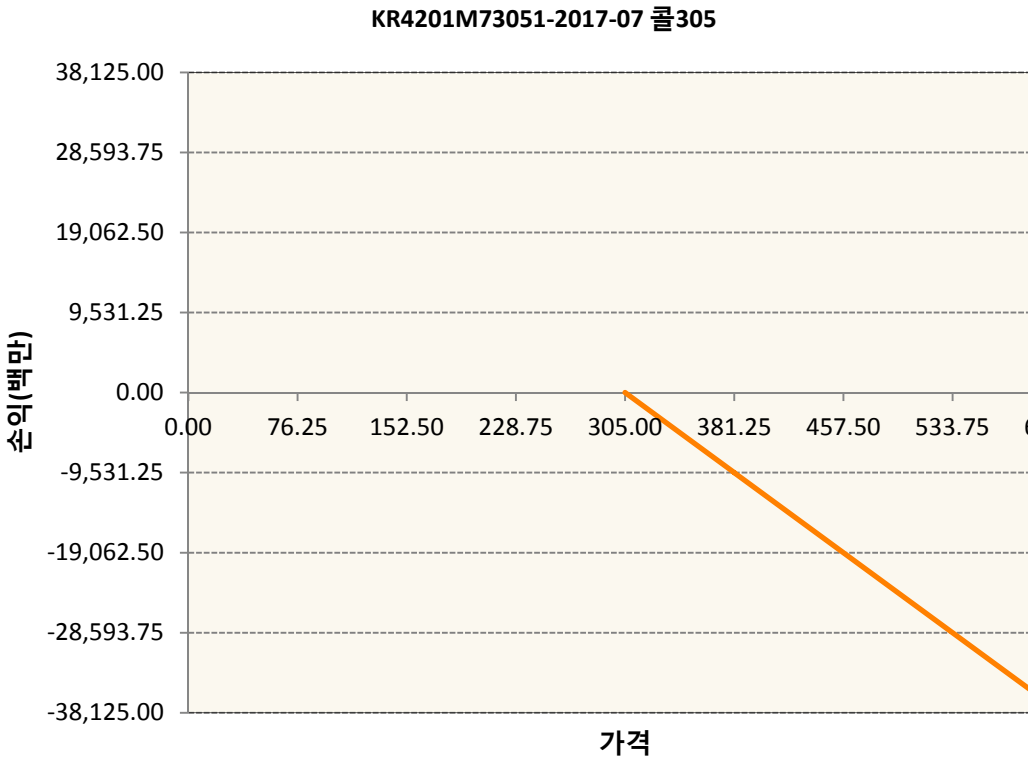
커버드콜모(주식혼합-파생형)

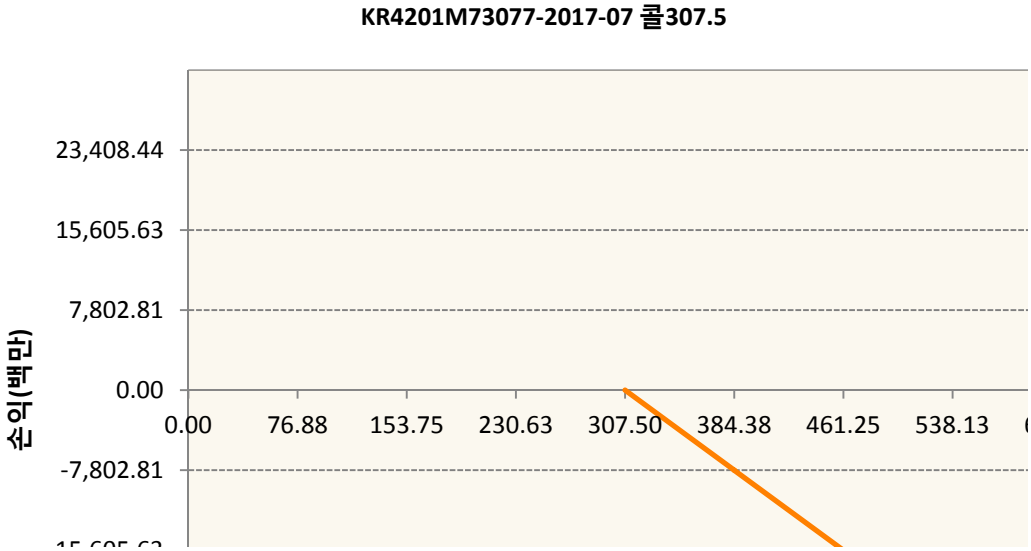
1. 계약금액

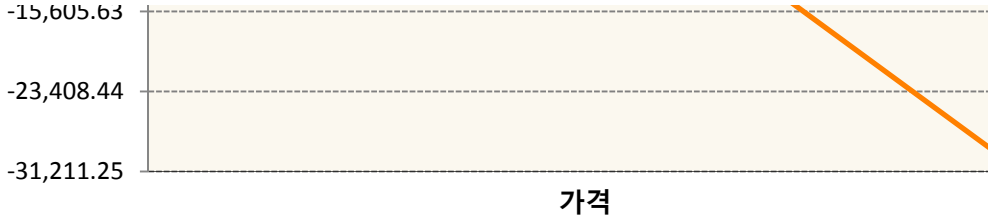
(단위:백만원)

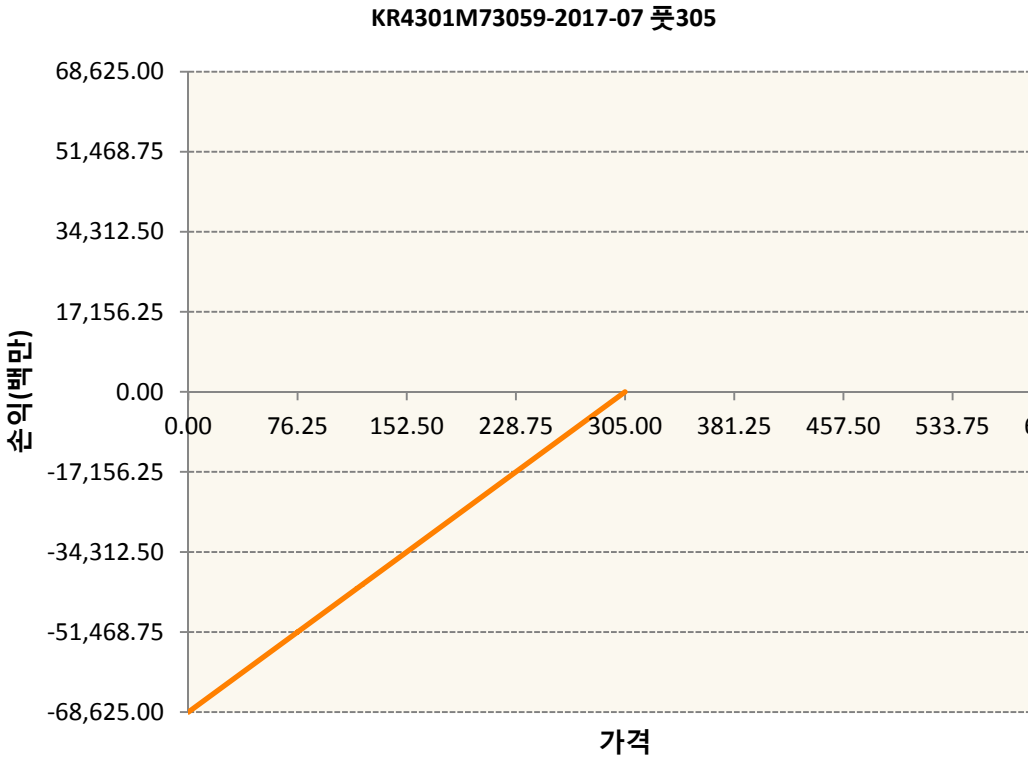
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	108,266	-108,266	장내
누계	유가증권	옵션	0	137,961	-137,961	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M73(2017-07 콜305							2,577
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	668	666	663	658	651	642	631
-5.33%	651	639	623	605	583	559	532
-2.67%	535	499	460	420	379	337	294
0%	147	98	49	0	-49	-98	-147
2.67%	-587	-618	-652	-687	-725	-764	-805
5.33%	-1,531	-1,541	-1,554	-1,571	-1,590	-1,612	-1,637
8.00%	-2,540	-2,541	-2,544	-2,549	-2,556	-2,565	-2,577
KR4201M73(2017-07 콜307.5							1,978
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	418	418	416	414	410	405	398

-5.33%	412	406	397	386	372	357	339
-2.67%	354	331	305	277	247	217	185
0%	119	80	40	0	-40	-80	-120
2.67%	-396	-427	-460	-494	-529	-565	-601
5.33%	-1,124	-1,137	-1,152	-1,170	-1,191	-1,213	-1,238
8.00%	-1,934	-1,937	-1,941	-1,947	-1,956	-1,966	-1,978
KR4301M73(	2017-07 풋305						4,368

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,302	-4,305	-4,311	-4,319	-4,332	-4,348	-4,368
-5.33%	-2,497	-2,519	-2,547	-2,581	-2,620	-2,664	-2,712
-2.67%	-871	-937	-1,006	-1,078	-1,152	-1,228	-1,306
0%	264	176	88	0	-88	-176	-265
2.67%	778	722	662	597	529	459	386
5.33%	913	895	872	842	807	767	723
8.00%	933	930	924	916	903	887	866

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

9,643

공시일	2017-06-09
기준일	2017-06-08

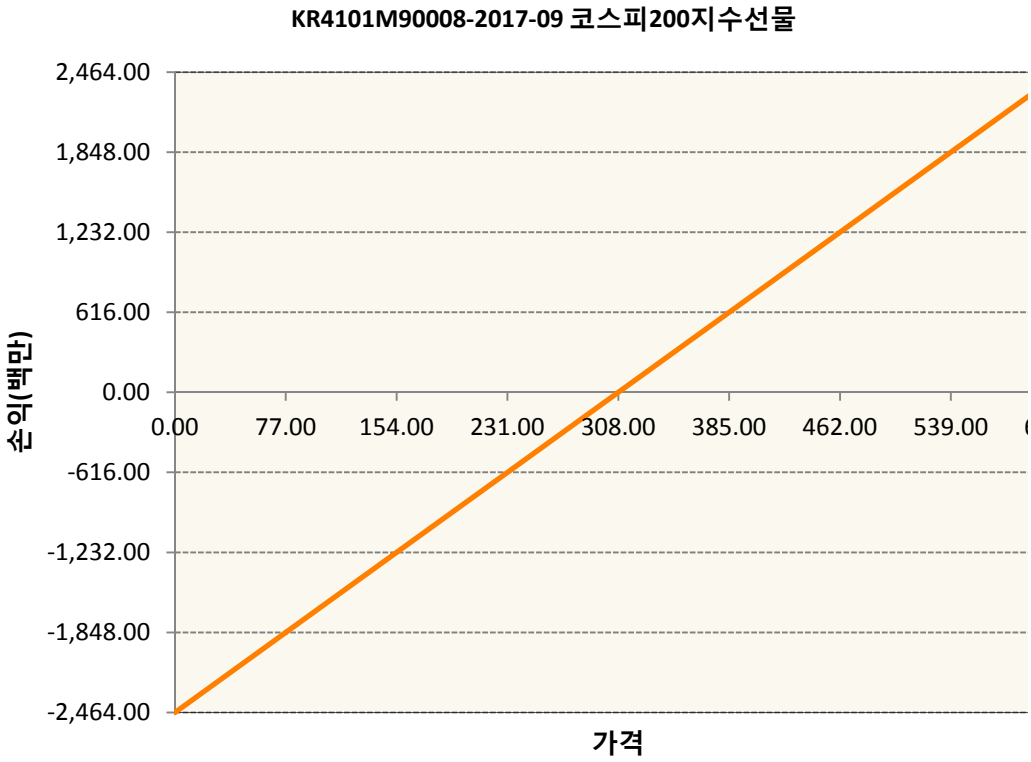
커버드콜목표전환형증권투자신탁

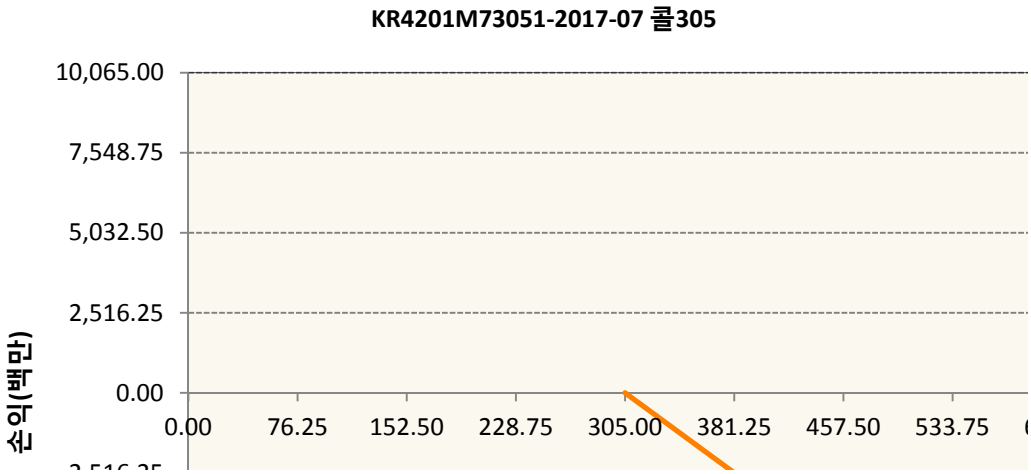
1. 계약금액

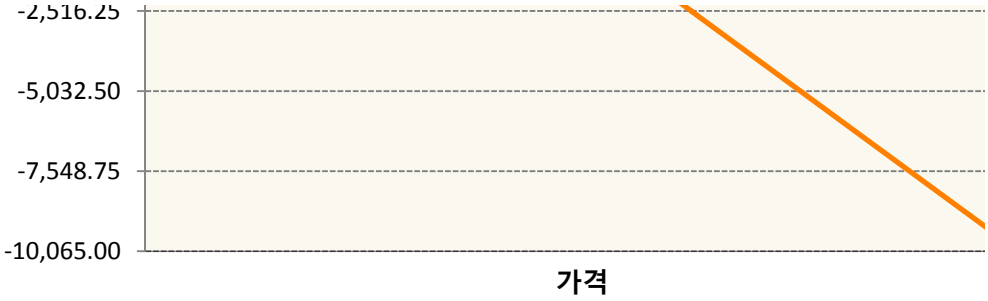
(단위:백만원)

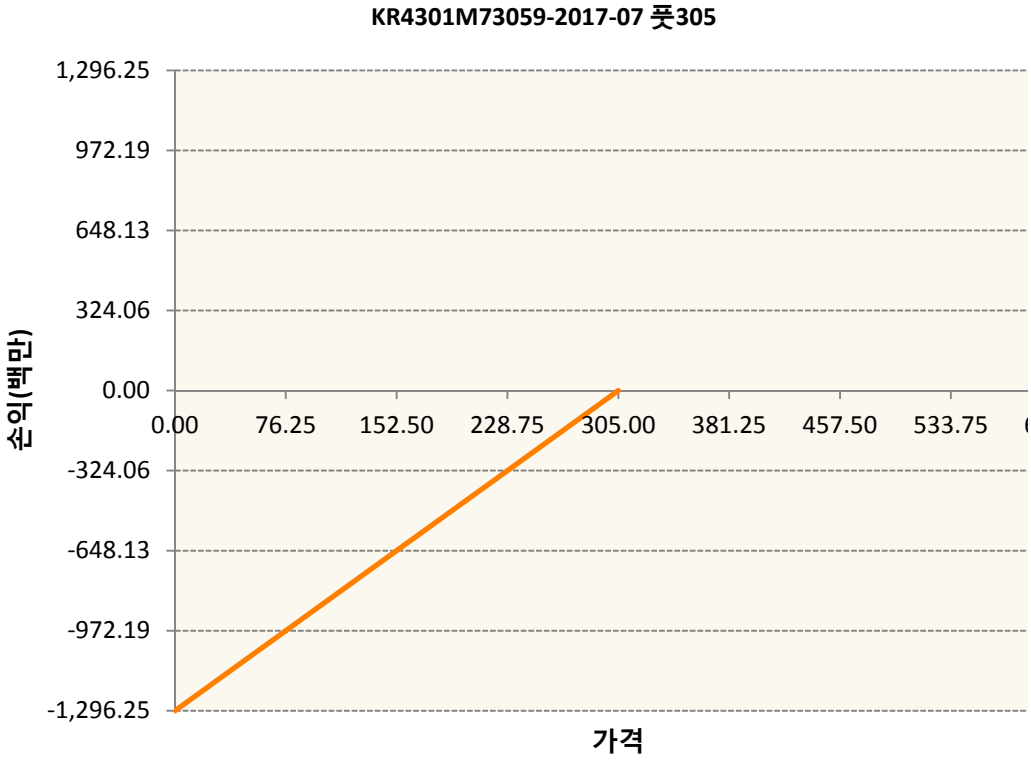
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	765	0	765	장내
신규	유가증권	옵션	0	11,525	-11,525	장내
누계	유가증권	선물	2,464	0	2,464	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,361	-11,361	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							196
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-196	-196	-196	-196	-196	-196	-196
-5.33%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-2.67%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	65	65	65	65	65	65	65
5.33%	131	131	131	131	131	131	131
8.00%	196	196	196	196	196	196	196
KR4201M73(2017-07 콜305							680
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	176	176	175	174	172	170	167
-5.33%	172	169	165	160	154	147	140
-2.67%	141	132	122	111	100	89	78
0%	39	26	13	0	-13	-26	-39
2.67%	-155	-163	-172	-181	-191	-202	-212
5.33%	-404	-407	-410	-415	-420	-426	-432
8.00%	-670	-671	-672	-673	-675	-677	-680
KR4301M73(2017-07 풋305							83
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-81	-81	-81	-82	-82	-82	-83
-5.33%	-47	-48	-48	-49	-49	-50	-51
-2.67%	-16	-18	-19	-20	-22	-23	-25
0%	5	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	15	14	13	11	10	9	7
5.33%	17	17	16	16	15	14	14
8.00%	18	18	17	17	17	17	16

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

970

공시일	2017-06-09
기준일	2017-06-08

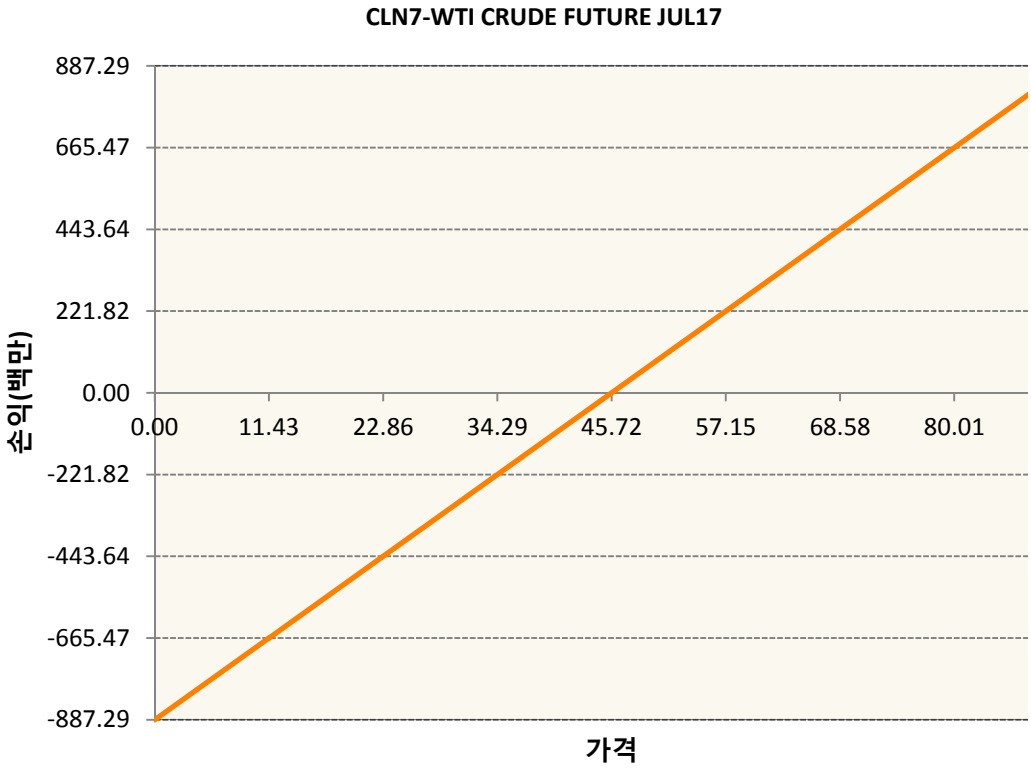
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

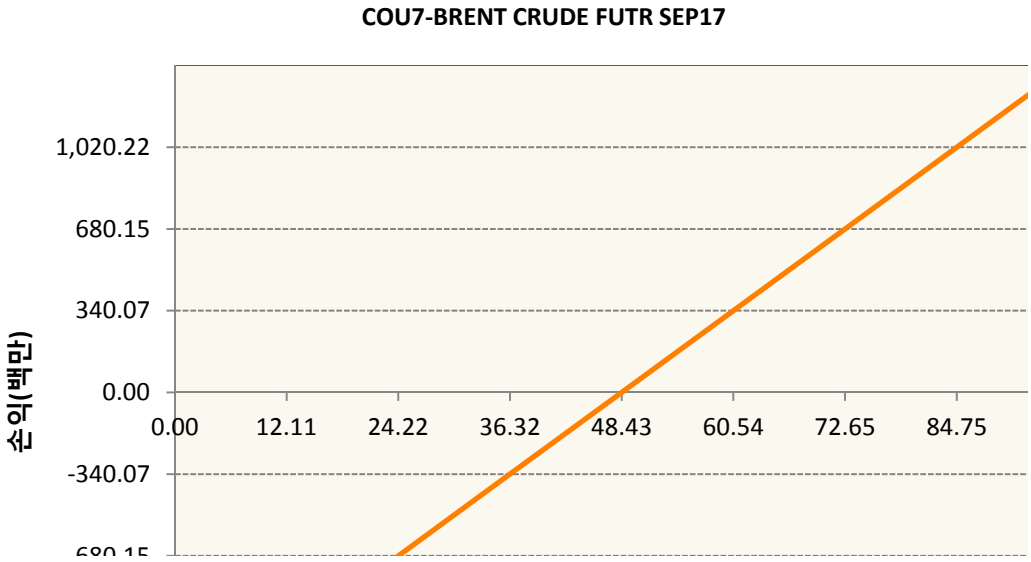
1. 계약금액

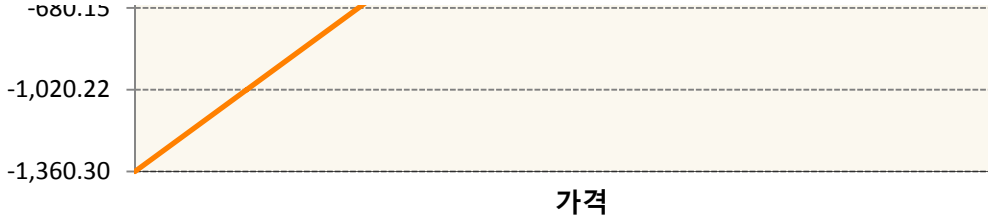
(단위:백만원)

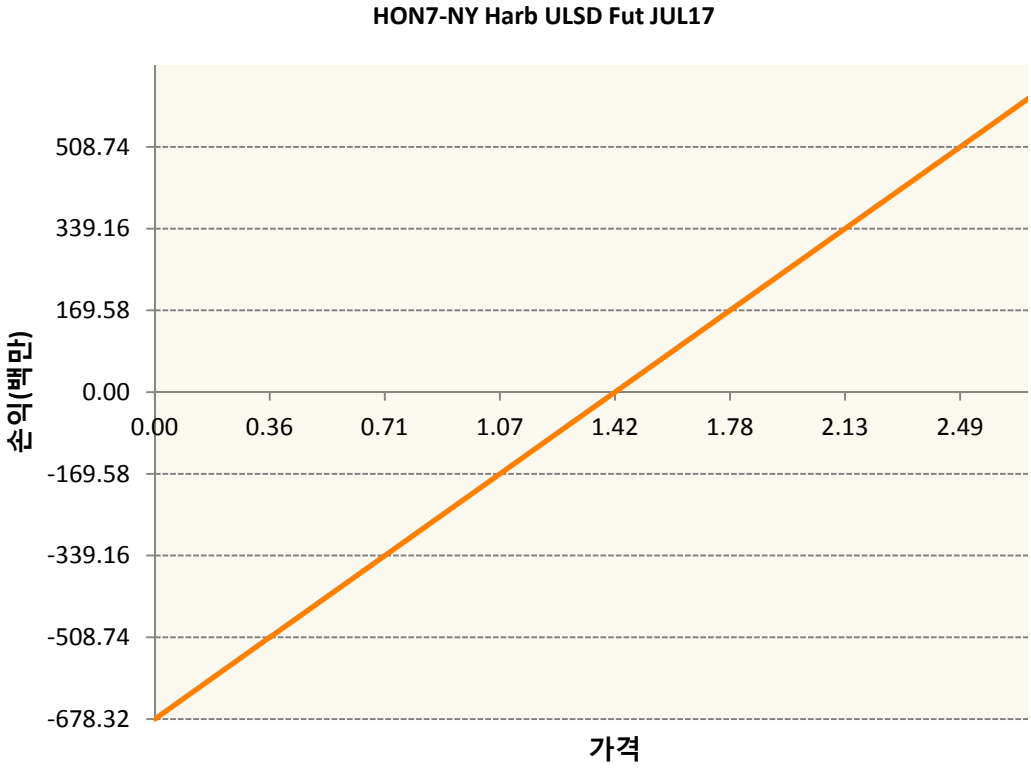
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,088	224	4,864	

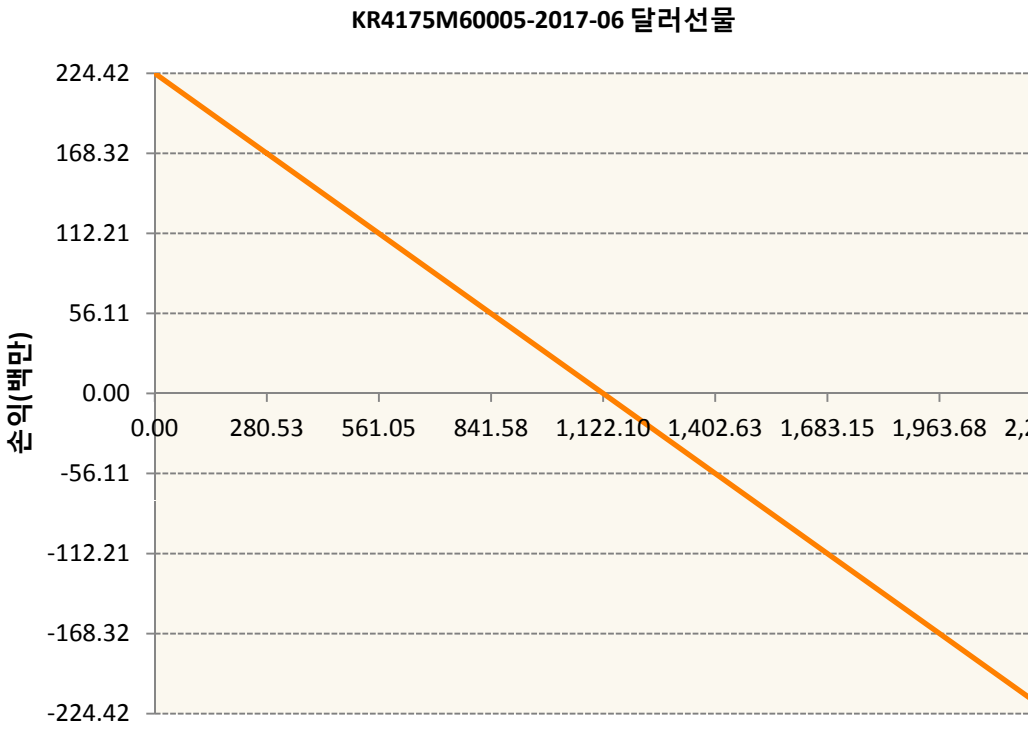
2. 만기시점의 손익구조



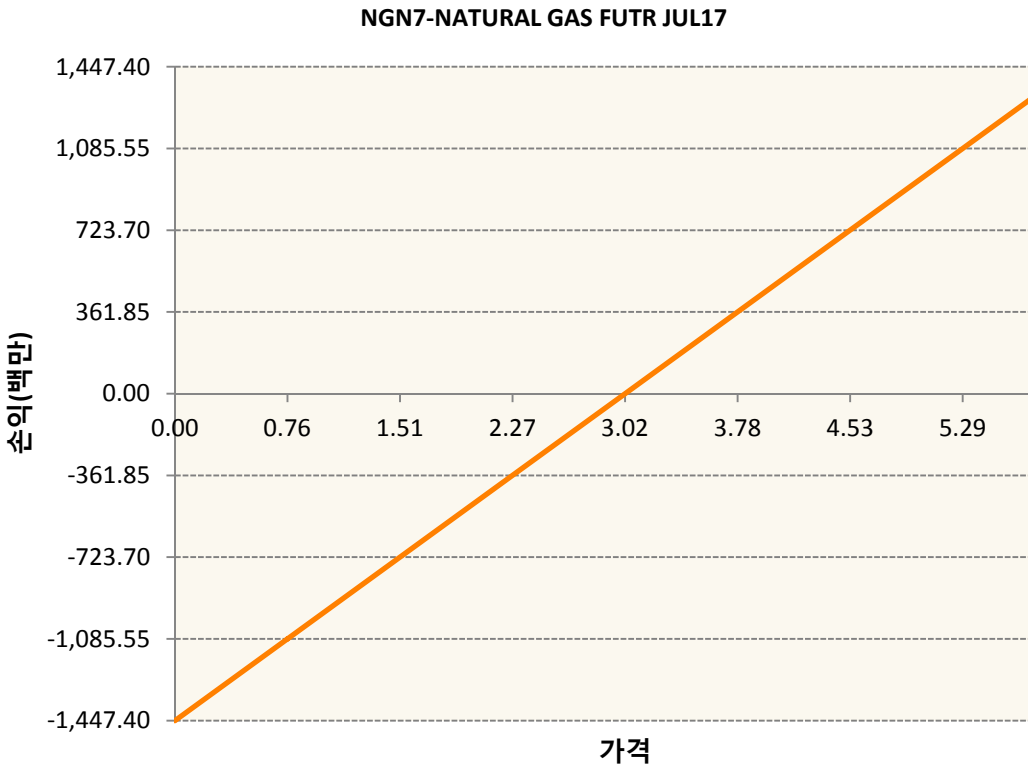


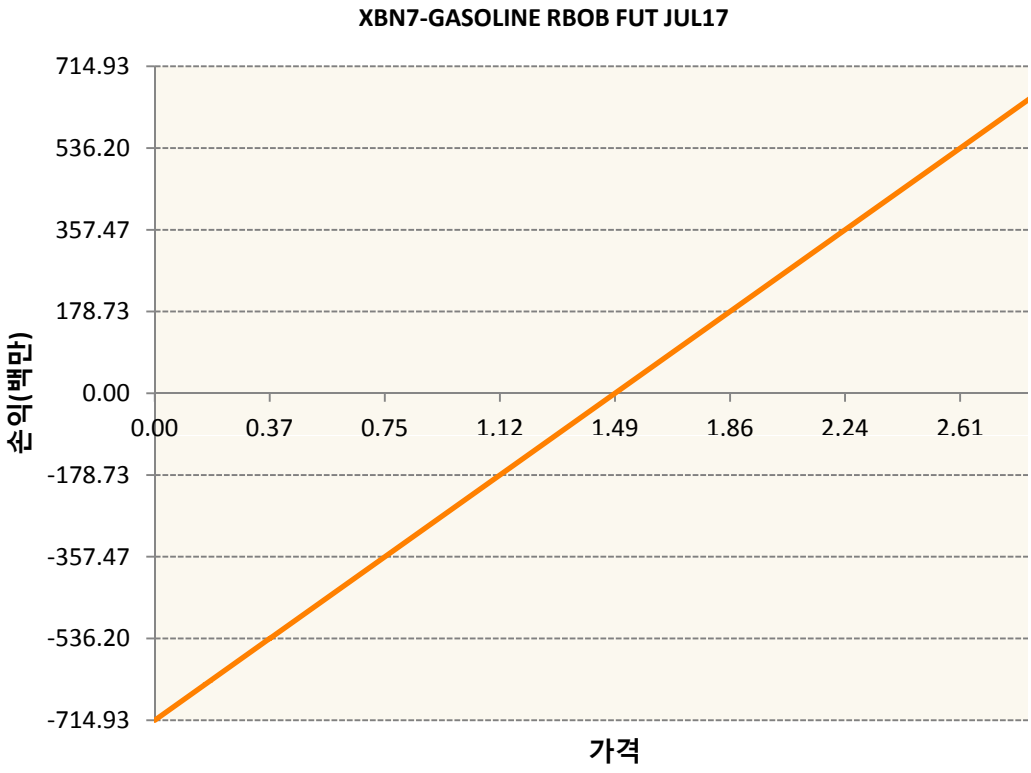

-1,020.22
-1,360.30
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
508.74
339.16
169.58
0.00
-169.58
-339.16
-508.74
-678.32
0.00
0.36
0.71
1.07
1.42
1.78
2.13
2.49
순이익(백만)
가격


KR4175M60005-2017-06 달러선물
224.42
168.32
112.21
56.11
0.00
-56.11
-112.21
-168.32
-224.42
0.00
280.53
561.05
841.58
1,122.10
1,402.63
1,683.15
1,963.68
순이익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,447.40
1,085.55
723.70
361.85
0.00
-361.85
-723.70
-1,085.55
-1,447.40
0.00
0.76
1.51
2.27
3.02
3.78
4.53
5.29
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
714.93
536.20
357.47
178.73
0.00
-178.73
-357.47
-536.20
-714.93
0.00
0.37
0.75
1.12
1.49
1.86
2.24
2.61
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN7	WTI CRUDE FUTURE JUL17	71
COU7	BRENT CRUDE FUTR SEP17	109
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	54
KR4175M60(	2017-06 달러선물	18
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	116
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	57

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

847

공시일	2017-06-09
기준일	2017-06-08

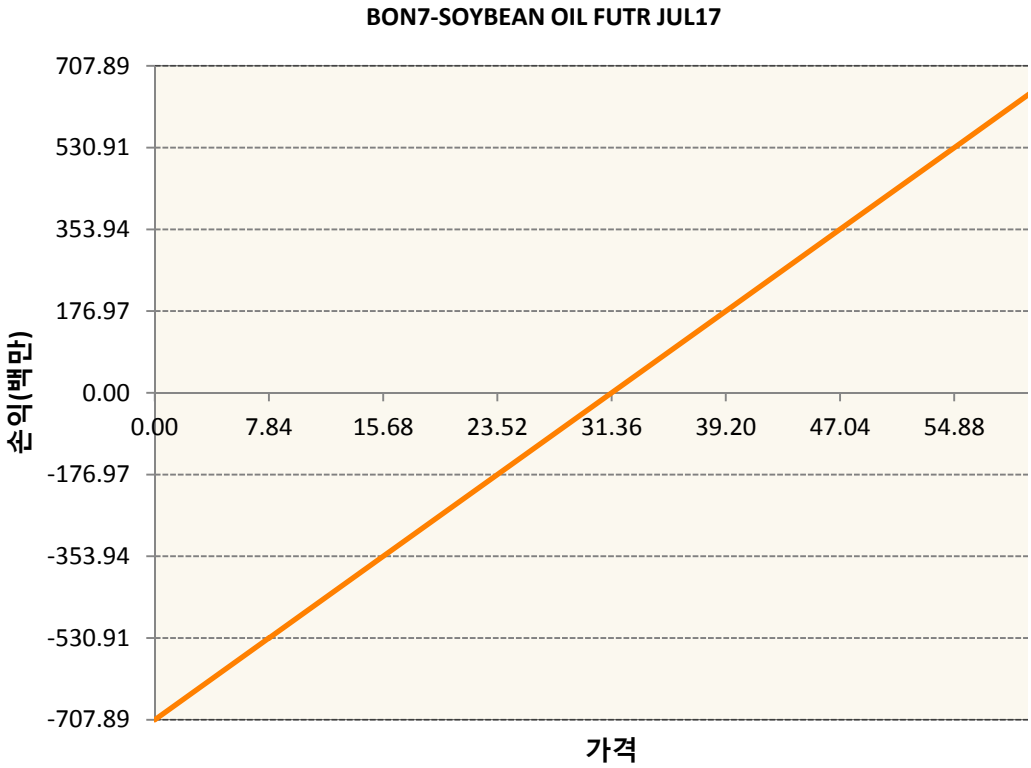
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

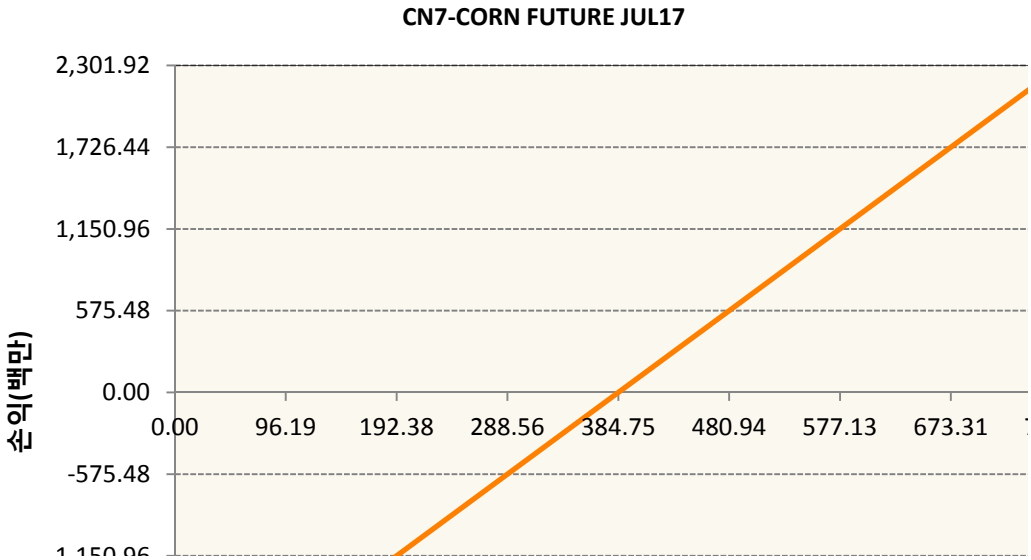
1. 계약금액

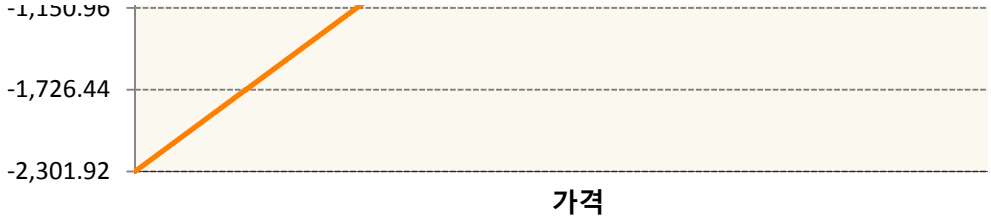
(단위:백만원)

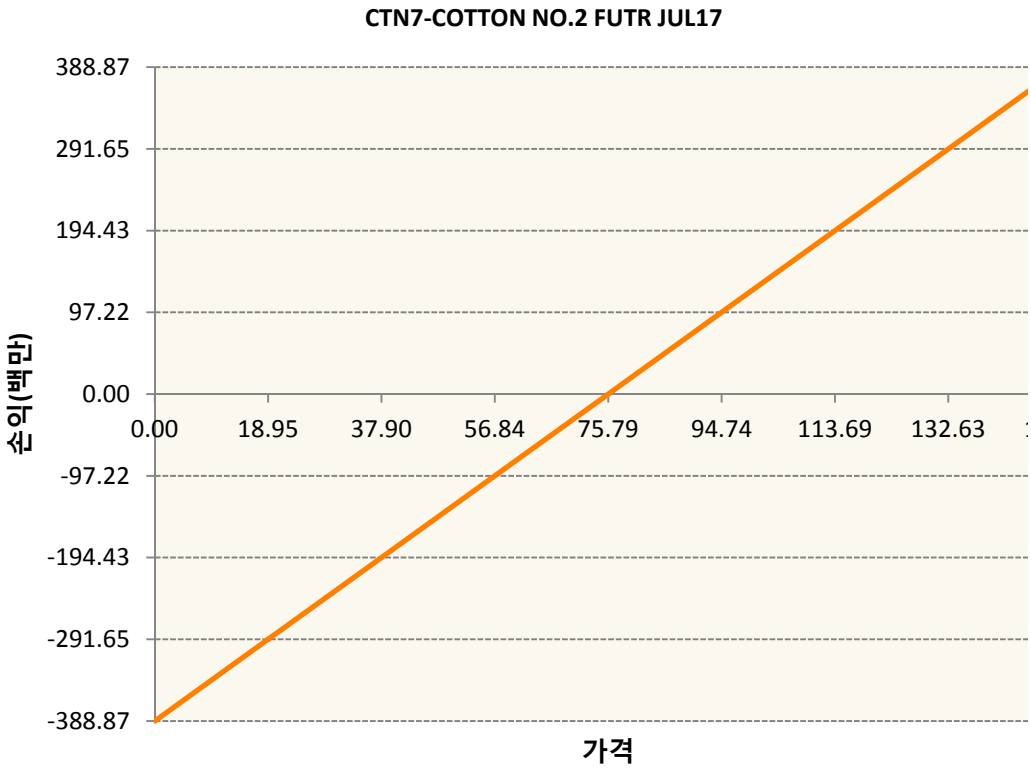
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,354	393	7,962	

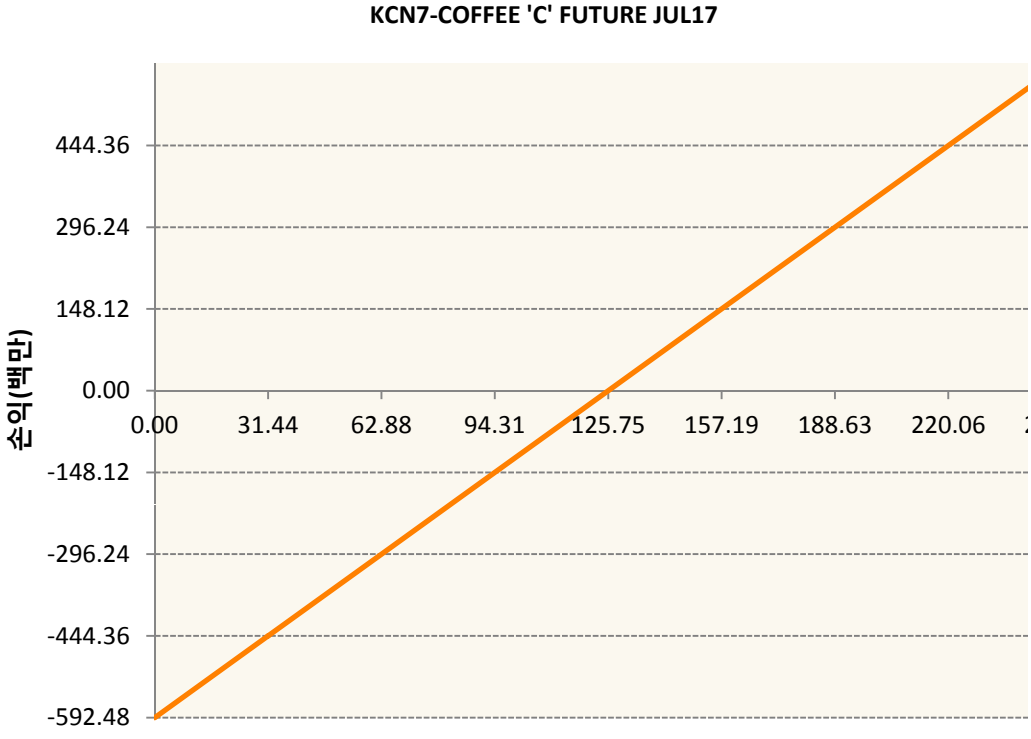
2. 만기시점의 손익구조



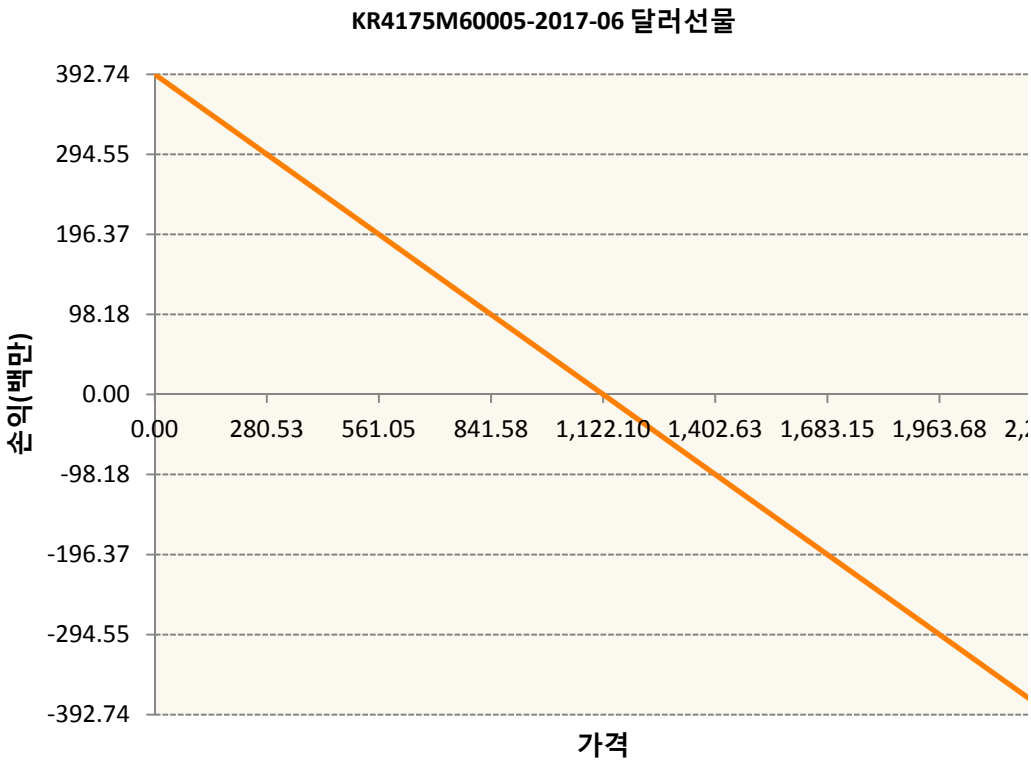


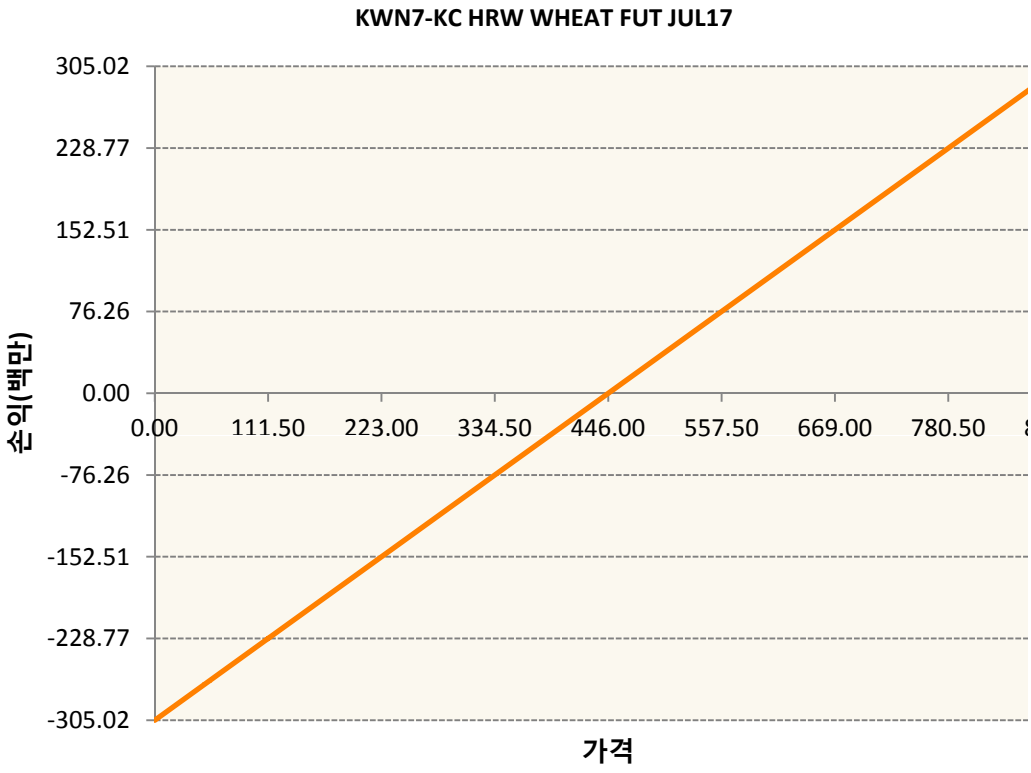

-1,150.96
-1,726.44
-2,301.92
가격

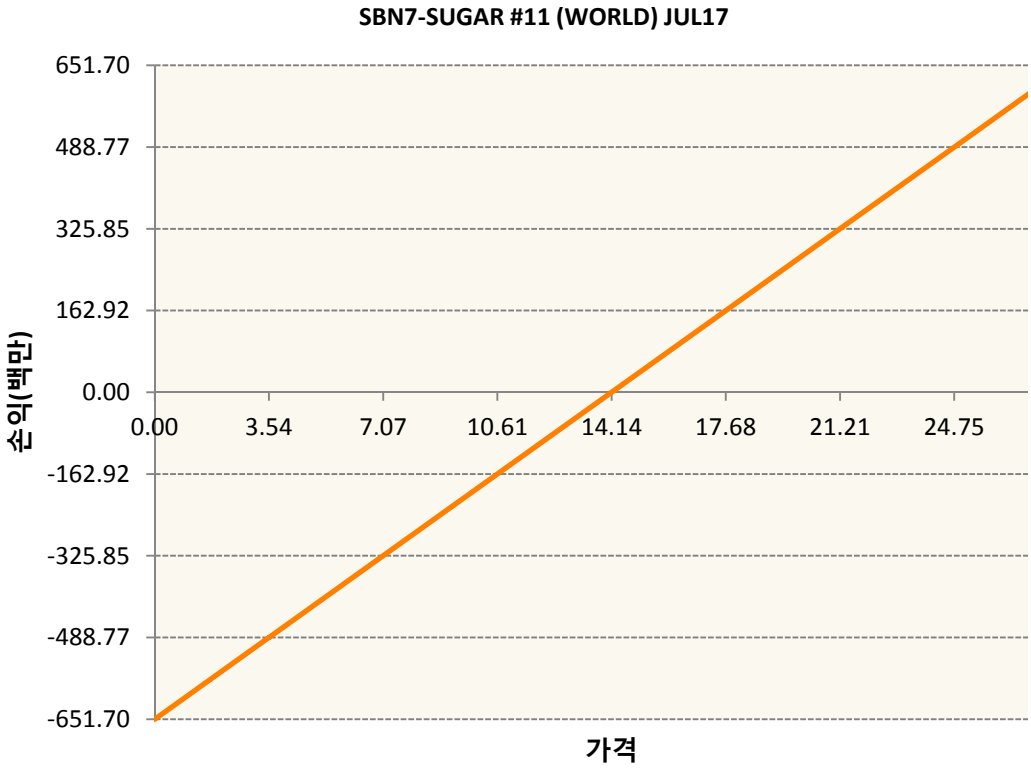

CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
388.87
291.65
194.43
97.22
0.00
-97.22
-194.43
-291.65
-388.87
0.00
18.95
37.90
56.84
75.79
94.74
113.69
132.63
순익(백만)
가격

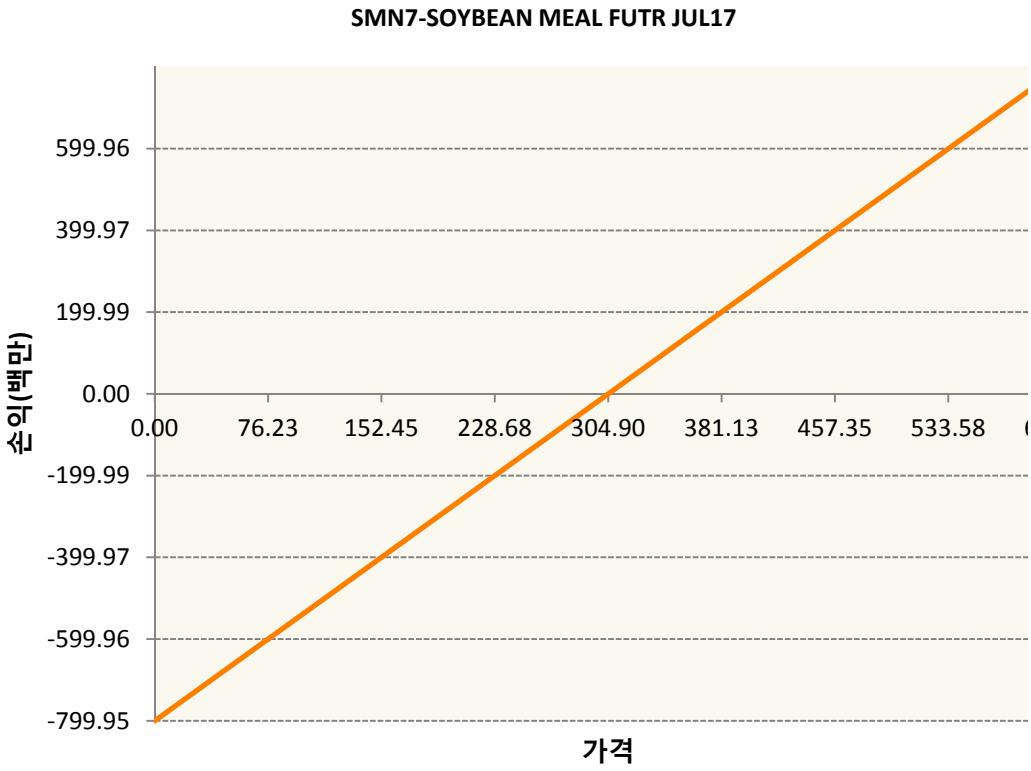

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
444.36
296.24
148.12
0.00
-148.12
-296.24
-444.36
-592.48
0.00
31.44
62.88
94.31
125.75
157.19
188.63
220.06
순익(백만)

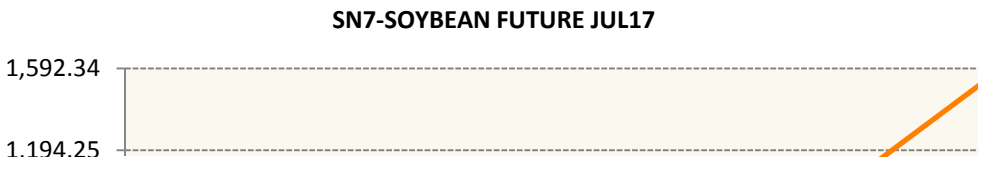
가격

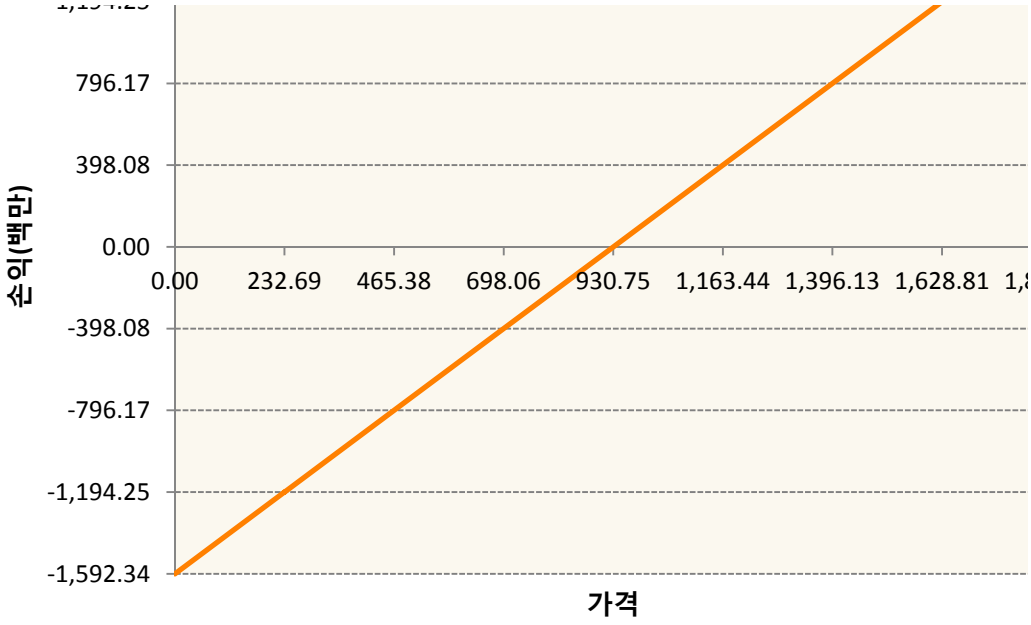

KR4175M60005-2017-06 달러선물
392.74
294.55
196.37
98.18
0.00
-98.18
-196.37
-294.55
-392.74
0.00
280.53
561.05
841.58
1,122.10
1,402.63
1,683.15
1,963.68
순이(백만)
가격

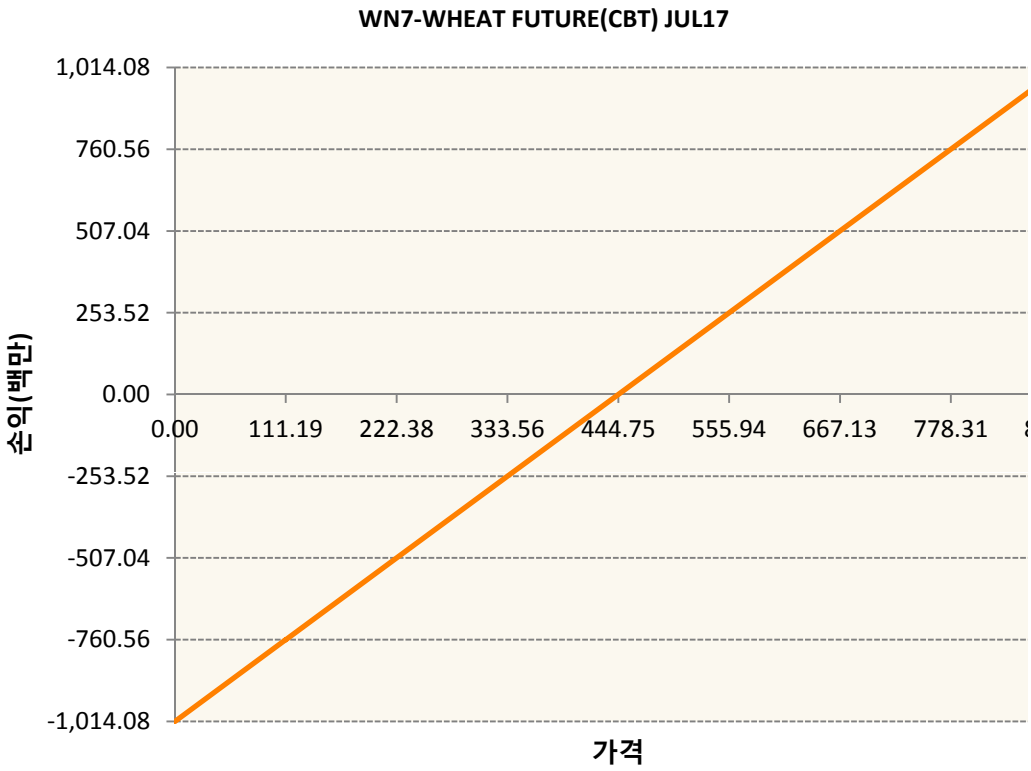

KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17
305.02
228.77
152.51
76.26
0.00
-76.26
-152.51
-228.77
-305.02
0.00
111.50
223.00
334.50
446.00
557.50
669.00
780.50
순이(백만)
가격


SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
651.70
488.77
325.85
162.92
0.00
-162.92
-325.85
-488.77
-651.70
0.00
3.54
7.07
10.61
14.14
17.68
21.21
24.75
손익(백만)
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
599.96
399.97
199.99
0.00
-199.99
-399.97
-599.96
-799.95
0.00
76.23
152.45
228.68
304.90
381.13
457.35
533.58
손익(백만)
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,592.34
1,194.25





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	57
CN7	CORN FUTURE JUL17	184
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	64
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	127
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	81

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

758