공시일	2017-06-12
기준일	2017-06-09

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	2017-06-12
기준일	2017-06-09

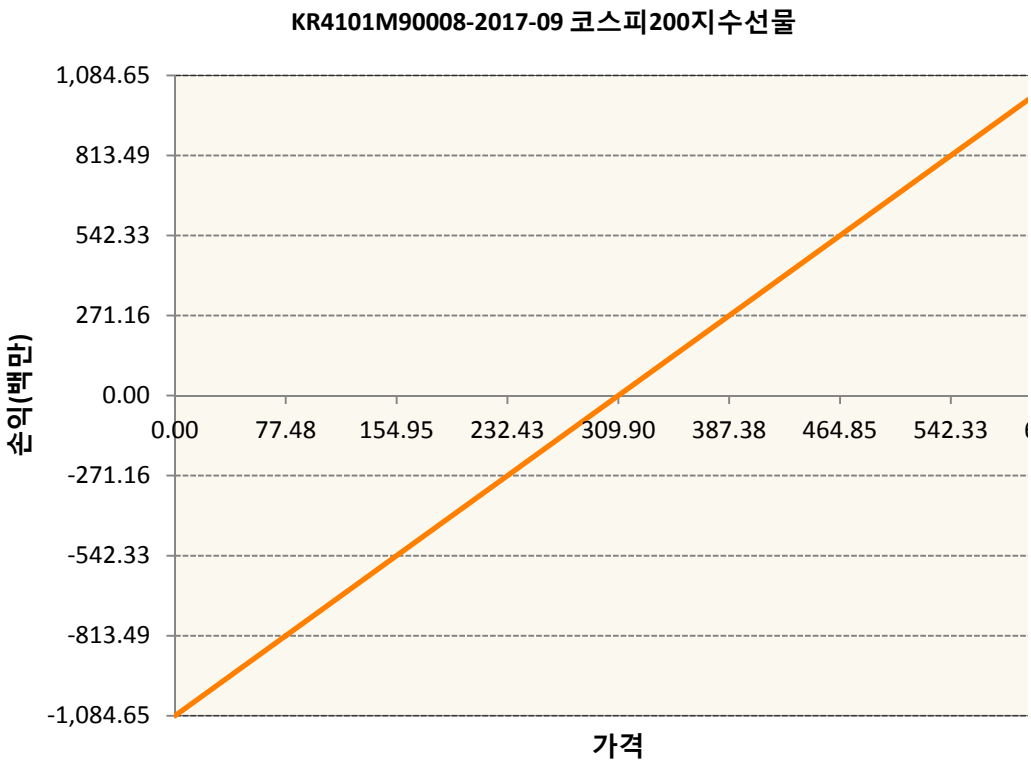
스마트인덱스모

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	1,085	0	1,085	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							87
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-5.33%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-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%	58	58	58	58	58	58	58
8.00%	87	87	87	87	87	87	87

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

57

공시일	2017-06-12
기준일	2017-06-09

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	1,000

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

519

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-12
기준일	2017-06-09

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	369

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

339

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-12
기준일	2017-06-09

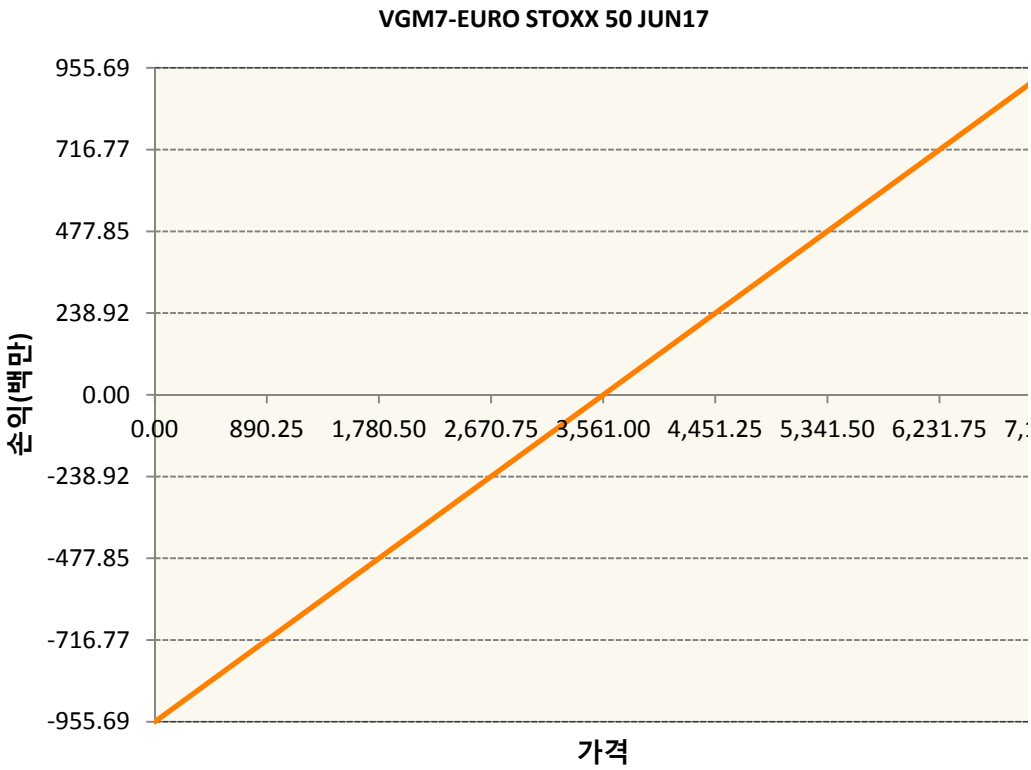
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2017-06-12
기준일	2017-06-09

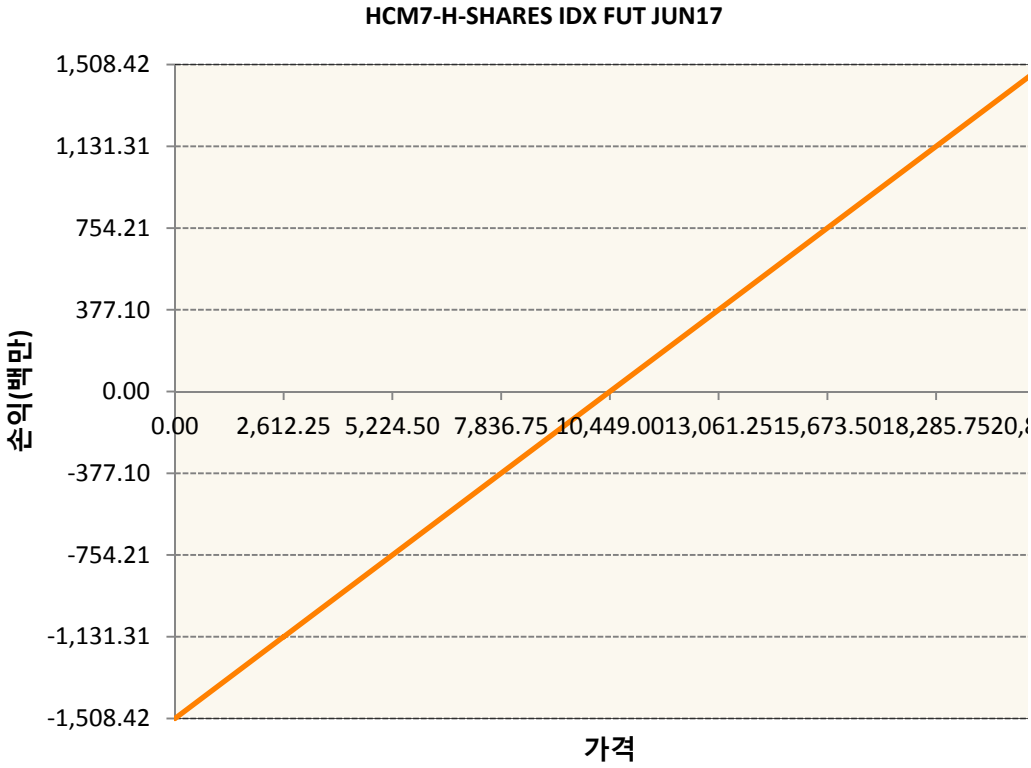
차이나인덱스모(주식-파생형)

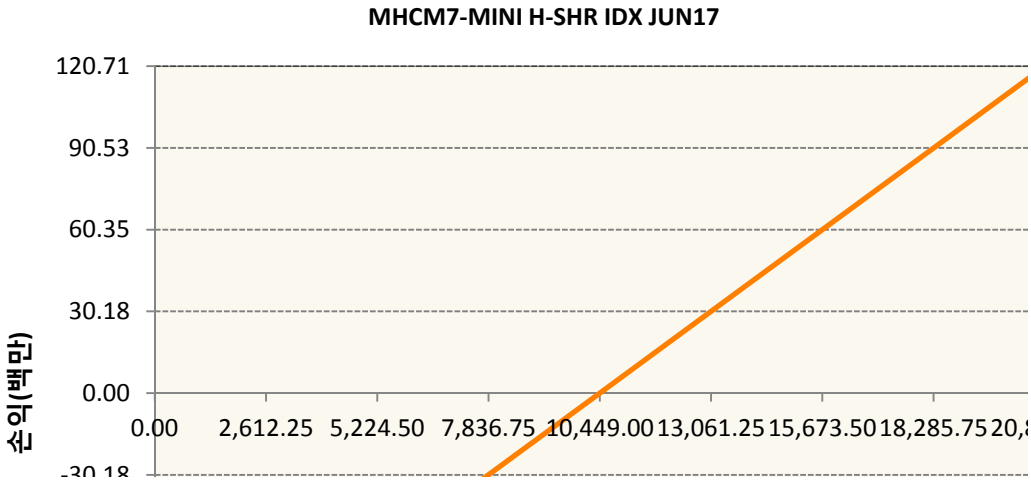
1. 계약금액

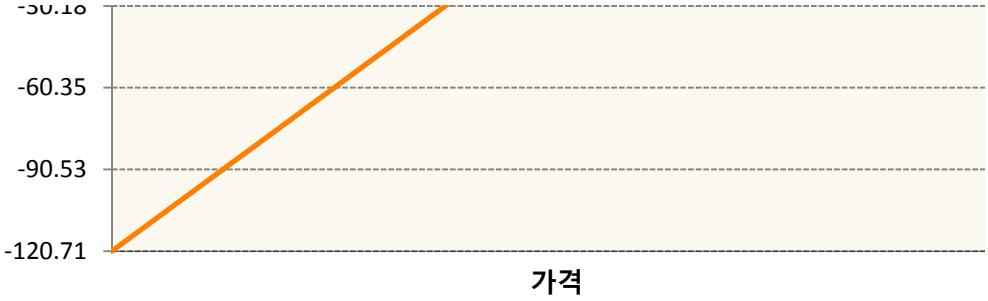
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계			1,508	0	1,508	
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	2017-06-12
기준일	2017-06-09

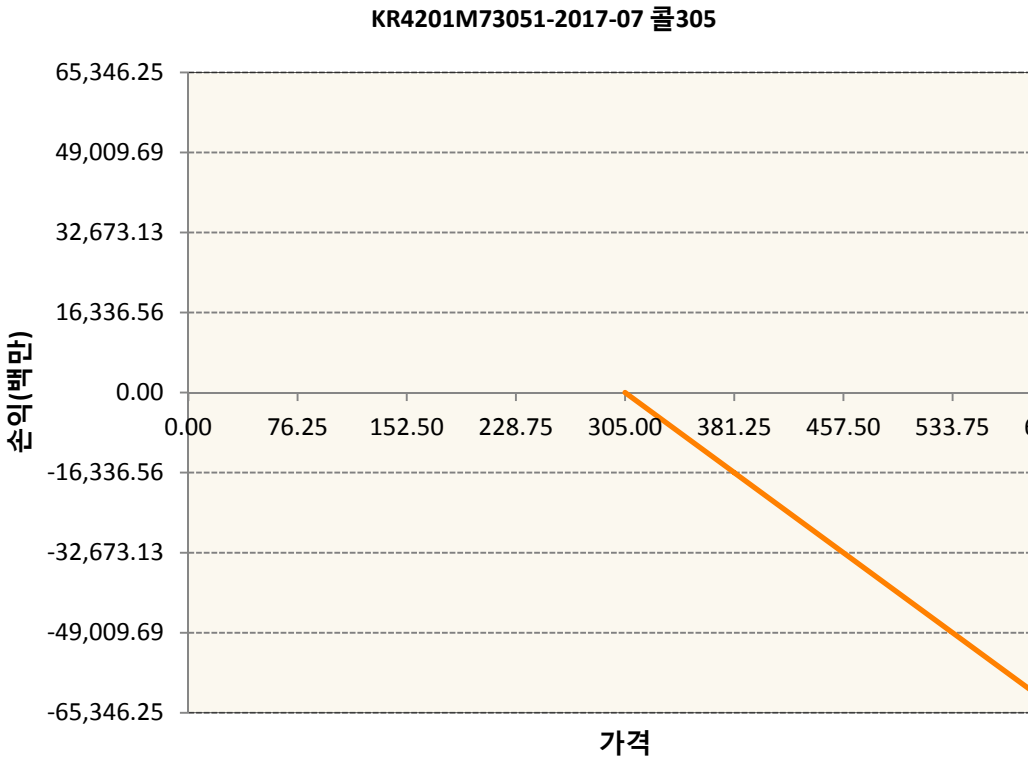
커버드콜모(주식혼합-파생형)

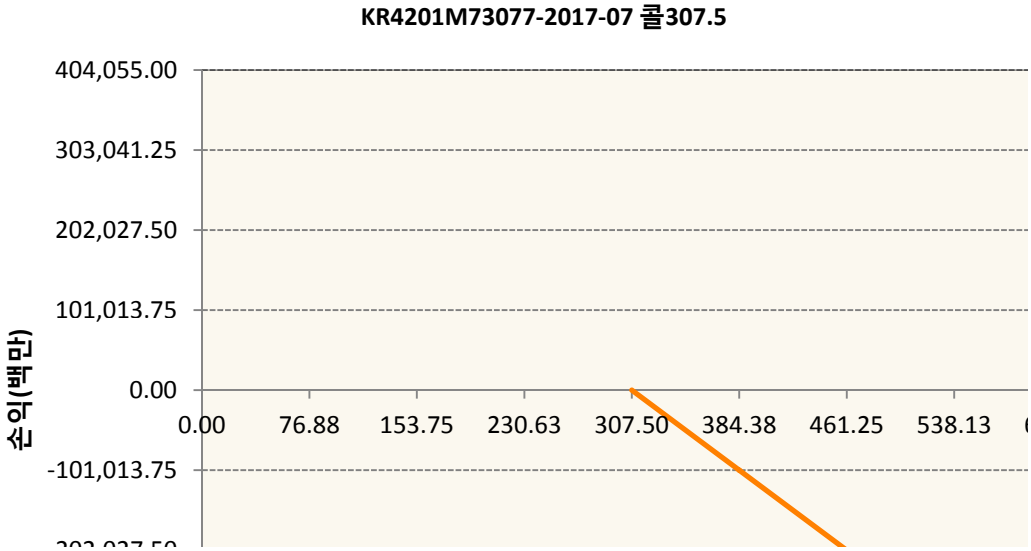
1. 계약금액

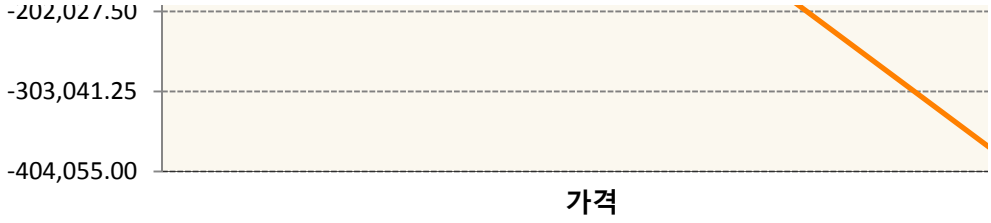
(단위:백만원)

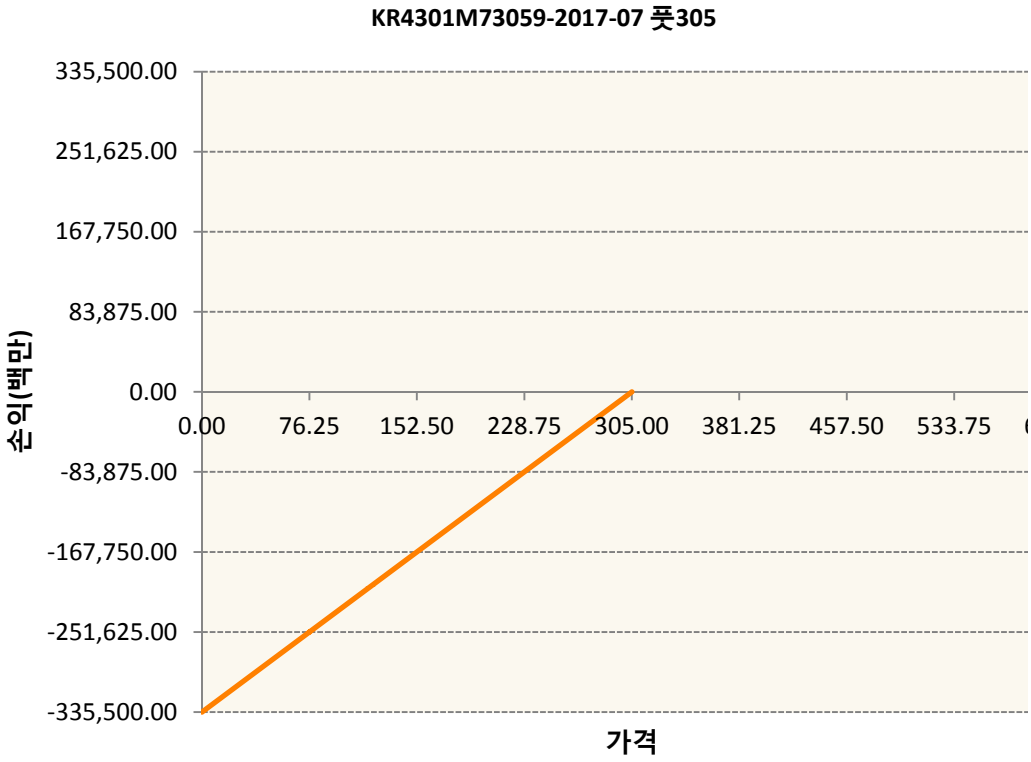
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	675,578	-675,578	장내
누계	유가증권	옵션	0	804,901	-804,901	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M73(2017-07 콜305							4,773
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,470	1,466	1,460	1,450	1,437	1,420	1,399
-5.33%	1,425	1,398	1,365	1,328	1,286	1,240	1,192
-2.67%	1,119	1,050	979	907	835	762	688
0%	211	142	72	0	-73	-146	-220
2.67%	-1,271	-1,299	-1,333	-1,373	-1,417	-1,464	-1,516
5.33%	-2,988	-2,994	-3,002	-3,015	-3,031	-3,052	-3,077
8.00%	-4,749	-4,750	-4,751	-4,753	-4,758	-4,764	-4,773
KR4201M73(2017-07 콜307.5							28,059
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,048	7,036	7,015	6,979	6,926	6,853	6,761

-5.33%	6,911	6,806	6,668	6,499	6,301	6,077	5,831
-2.67%	5,736	5,377	4,999	4,606	4,202	3,789	3,368
0%	1,416	946	474	0	-475	-950	-1,427
2.67%	-6,789	-7,043	-7,329	-7,642	-7,976	-8,329	-8,698
5.33%	-17,062	-17,123	-17,212	-17,330	-17,477	-17,652	-17,853
8.00%	-27,829	-27,836	-27,851	-27,877	-27,919	-27,979	-28,059
KR4301M73(	2017-07 풋305						20,001

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19,637	-19,657	-19,690	-19,740	-19,808	-19,895	-20,001
-5.33%	-10,810	-10,948	-11,115	-11,308	-11,522	-11,756	-12,006
-2.67%	-3,316	-3,672	-4,035	-4,403	-4,776	-5,151	-5,530
0%	1,084	730	368	0	-373	-750	-1,130
2.67%	2,538	2,392	2,216	2,013	1,788	1,543	1,281
5.33%	2,781	2,754	2,710	2,646	2,560	2,454	2,326
8.00%	2,801	2,799	2,793	2,780	2,759	2,727	2,682

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

57,706

공시일	2017-06-12
기준일	2017-06-09

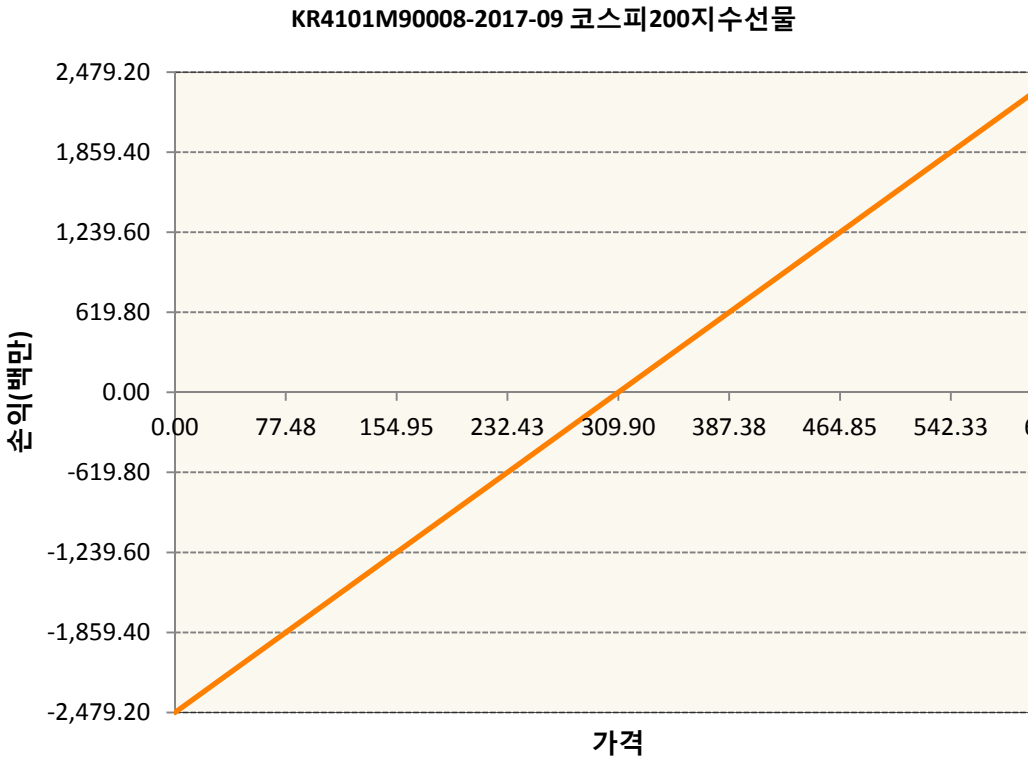
커버드콜목표전환형증권투자신탁

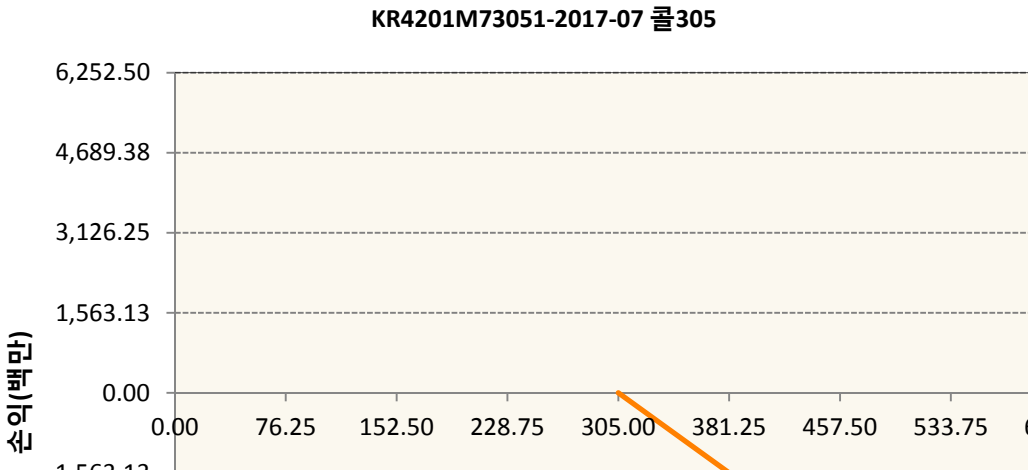
1. 계약금액

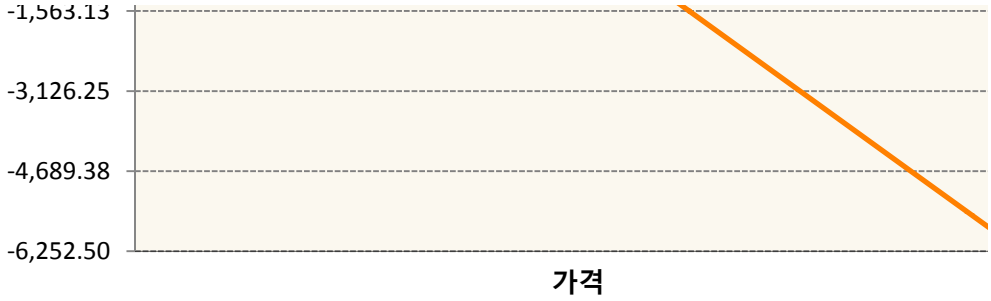
(단위:백만원)

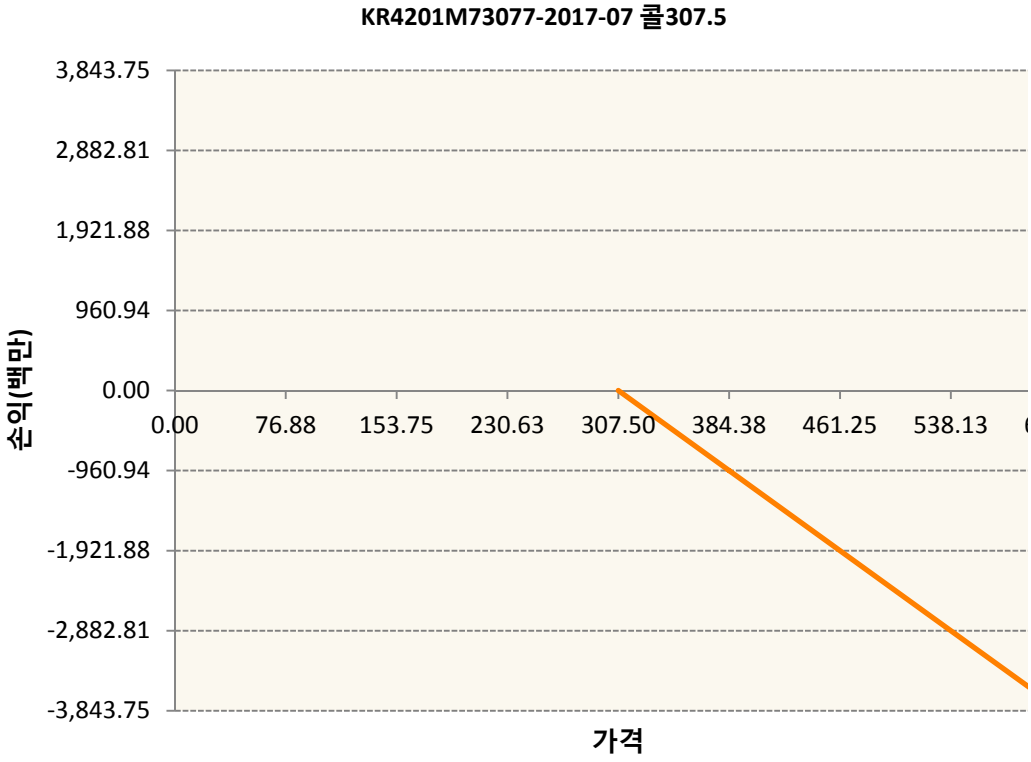
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	3,730	5,459	-1,729	장내
누계	유가증권	선물	2,479	0	2,479	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,634	-11,634	장내

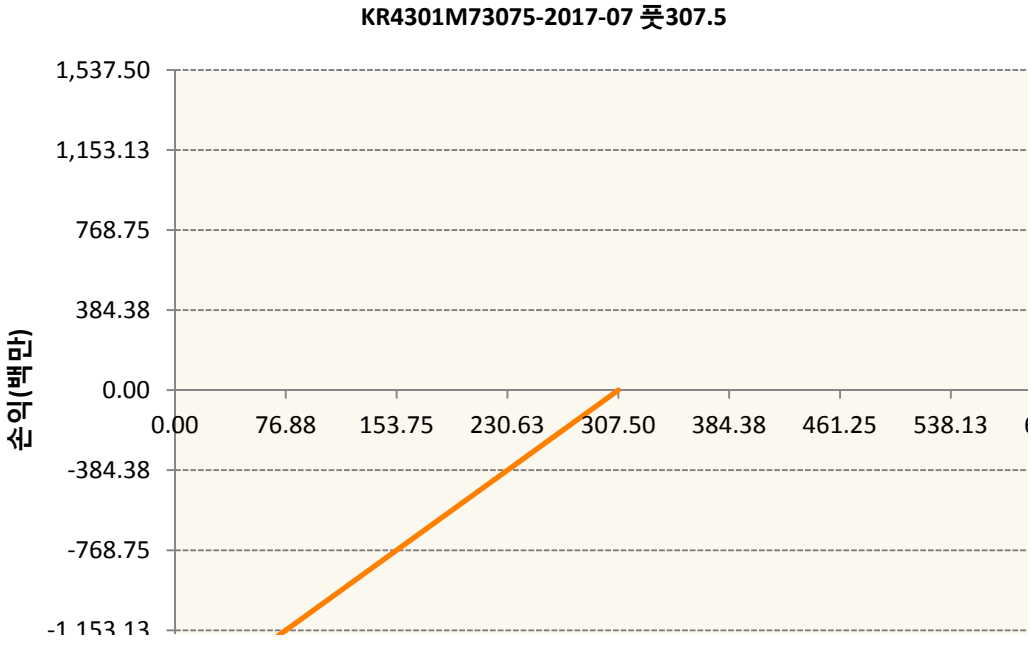
2. 만기시점의 손익구조

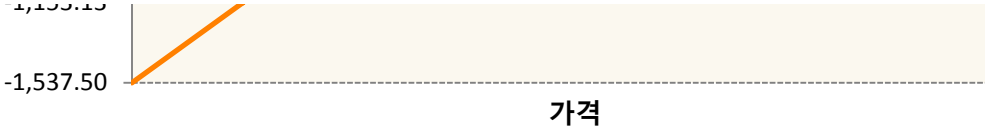





-1,563.13
-3,126.25
-4,689.38
-6,252.50
가격


KR4201M73077-2017-07 콜307.5
3,843.75
2,882.81
1,921.88
960.94
0.00
-960.94
-1,921.88
-2,882.81
-3,843.75
0.00
76.88
153.75
230.63
307.50
384.38
461.25
538.13
순익(백만)
가격


KR4301M73075-2017-07 풋307.5
1,537.50
1,153.13
768.75
384.38
0.00
-384.38
-768.75
-1,153.13
0.00
76.88
153.75
230.63
307.50
384.38
461.25
538.13
순익(백만)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							198
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198
-5.33%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-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%	132	132	132	132	132	132	132
8.00%	198	198	198	198	198	198	198
KR4201M73(2017-07 콜305							457
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	141	140	140	139	137	136	134
-5.33%	136	134	131	127	123	119	114
-2.67%	107	100	94	87	80	73	66
0%	20	14	7	0	-7	-14	-21
2.67%	-122	-124	-128	-131	-136	-140	-145
5.33%	-286	-286	-287	-288	-290	-292	-294
8.00%	-454	-454	-455	-455	-455	-456	-457
KR4201M73(2017-07 콜307.5							267
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	67	67	67	66	66	65	64
-5.33%	66	65	63	62	60	58	55
-2.67%	55	51	48	44	40	36	32
0%	13	9	5	0	-5	-9	-14
2.67%	-65	-67	-70	-73	-76	-79	-83
5.33%	-162	-163	-164	-165	-166	-168	-170
8.00%	-265	-265	-265	-265	-266	-266	-267
KR4301M73(2017-07 풋307.5							98
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-98
-5.33%	-56	-56	-57	-58	-58	-59	-60
-2.67%	-19	-21	-22	-24	-25	-27	-28

0%	5	4	2	0	-2	-4	-5
2.67%	15	14	13	12	11	9	8
5.33%	17	17	17	16	16	15	14
8.00%	18	18	18	17	17	17	17

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

1,063

공시일	2017-06-12
기준일	2017-06-09

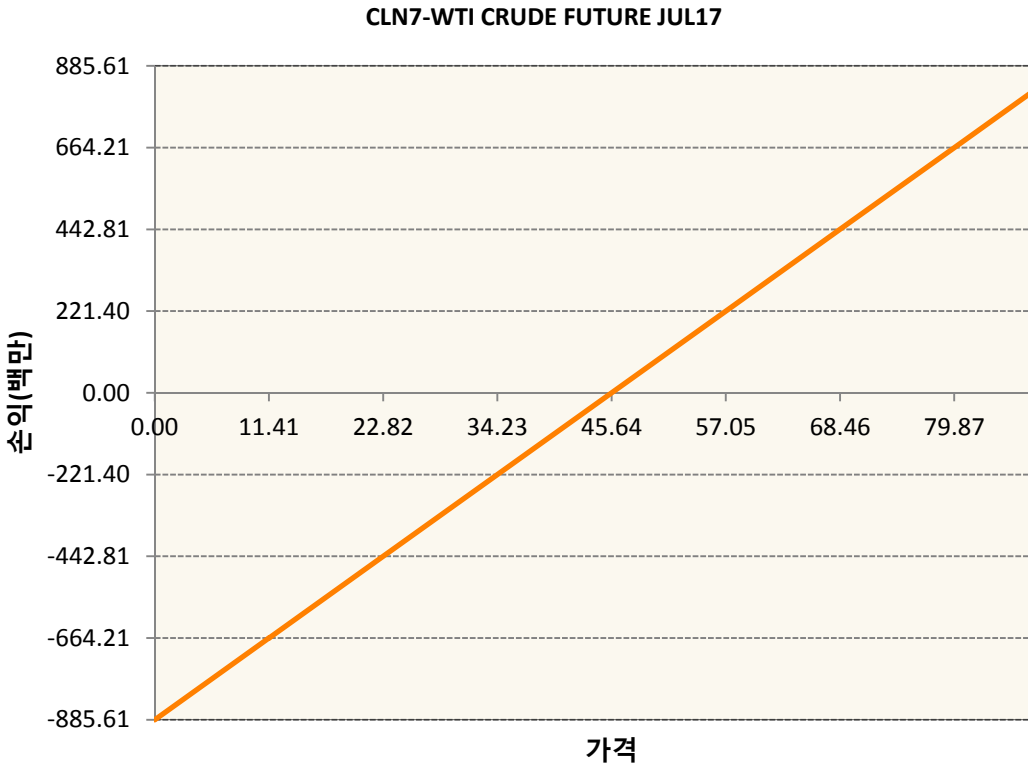
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

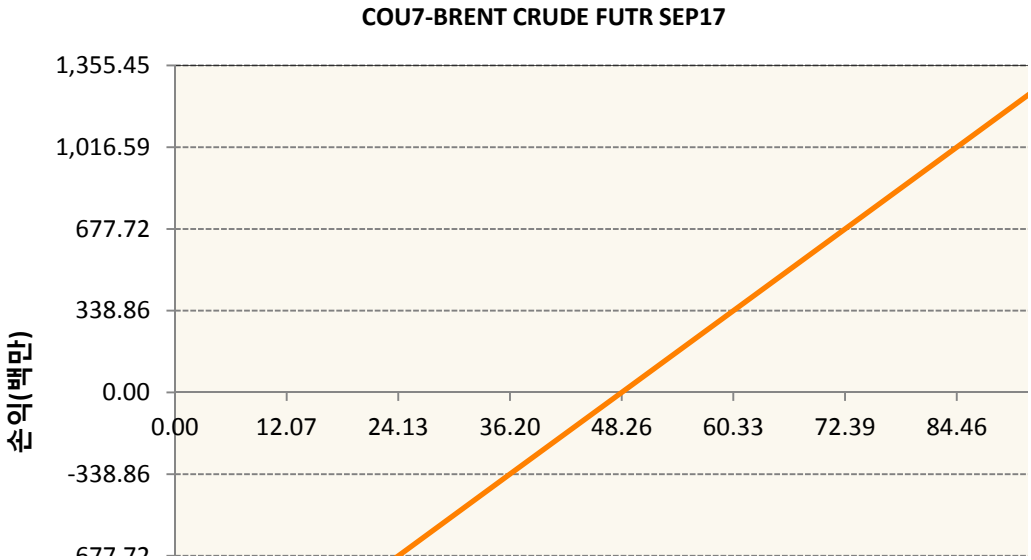
1. 계약금액

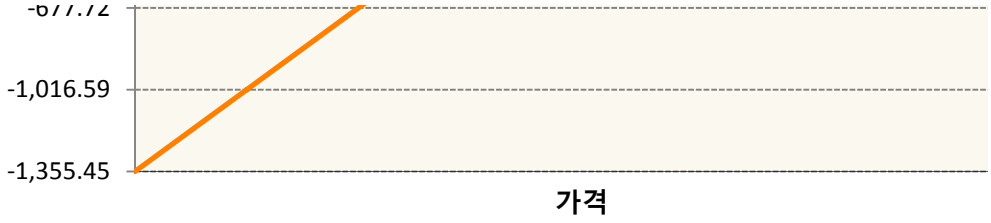
(단위:백만원)

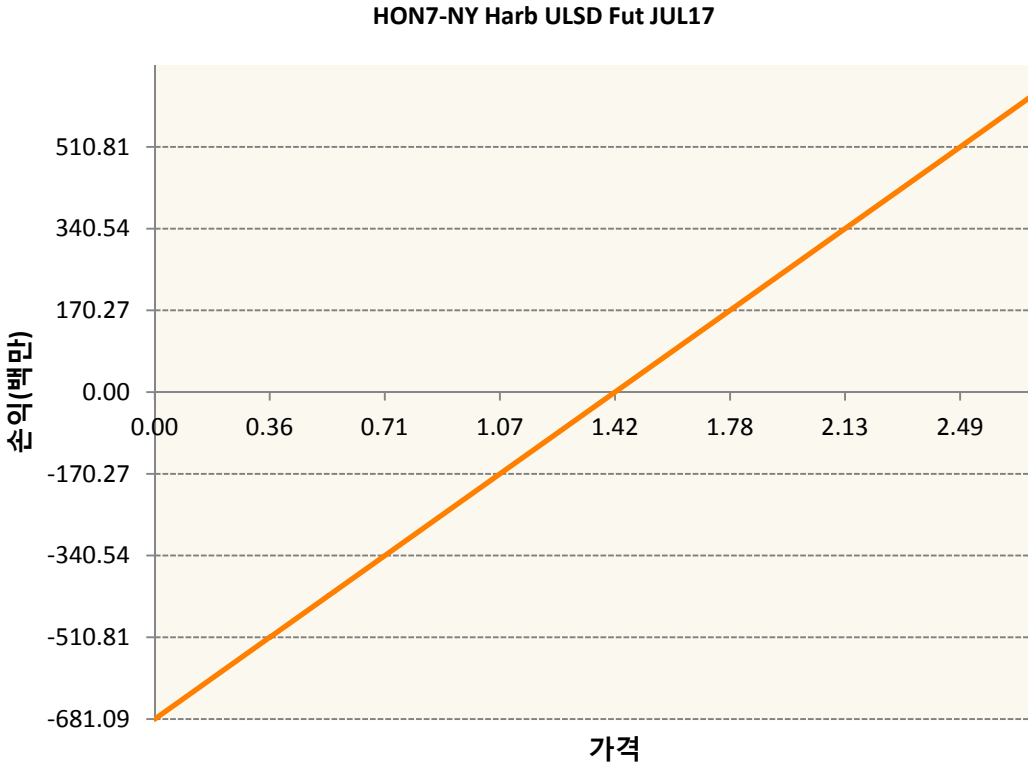
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,088	225	4,864	

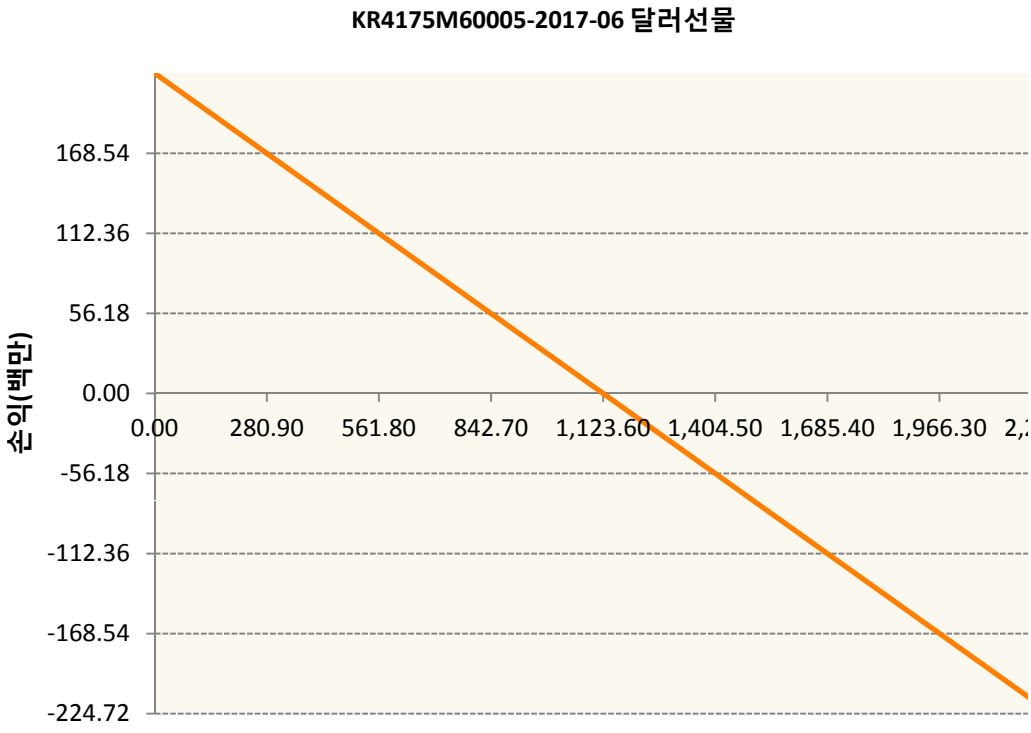
2. 만기시점의 손익구조





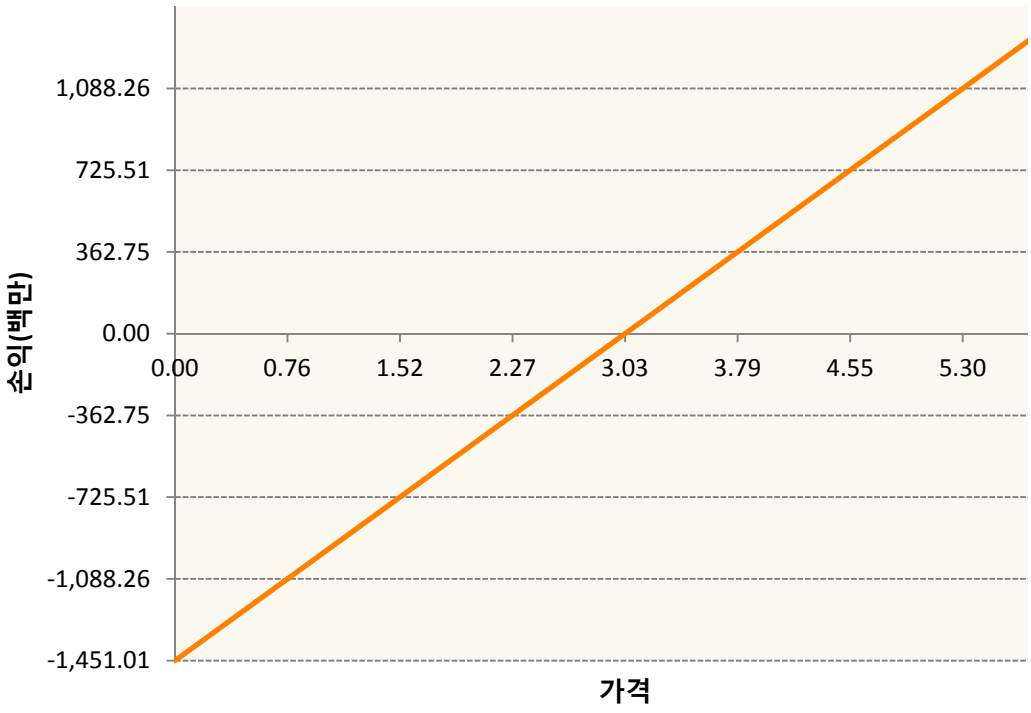

-1,016.59
-1,355.45
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
510.81
340.54
170.27
0.00
-170.27
-340.54
-510.81
-681.09
0.00
0.36
0.71
1.07
1.42
1.78
2.13
2.49
순이익(백만)
가격

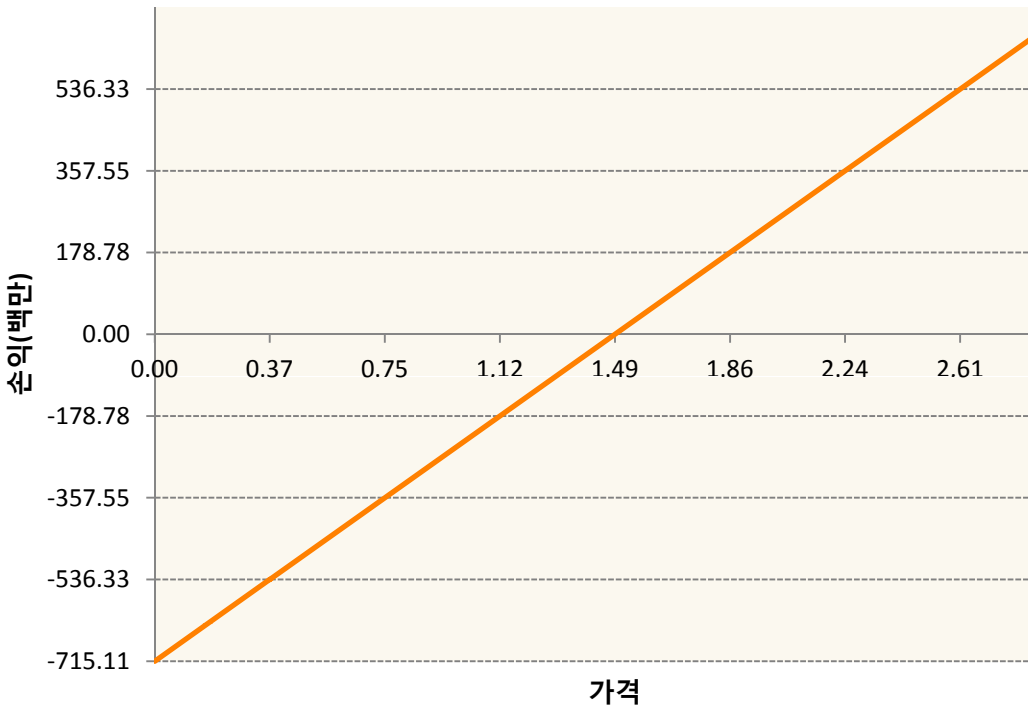

KR4175M60005-2017-06 달러선물
168.54
112.36
56.18
0.00
-56.18
-112.36
-168.54
-224.72
0.00
280.90
561.80
842.70
1,123.60
1,404.50
1,685.40
1,966.30
순이익(백만)

가격

NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17



XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN7	WTI CRUDE FUTURE JUL17	71
COU7	BRENT CRUDE FUTR SEP17	108
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	2017-06-12
기준일	2017-06-09

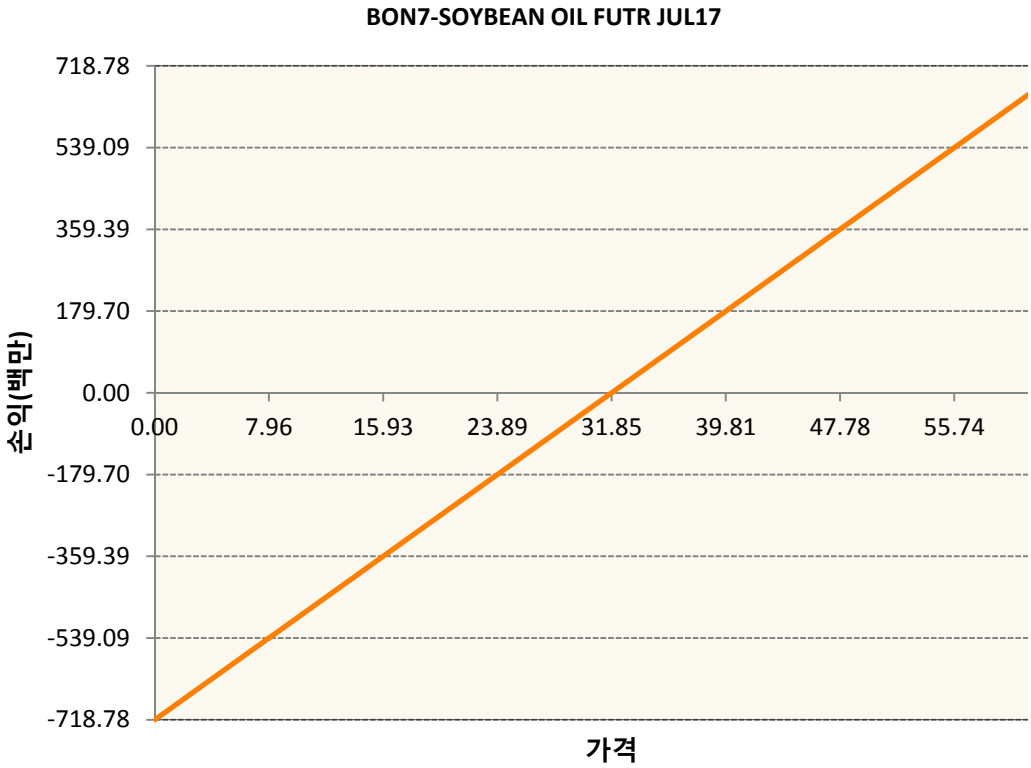
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

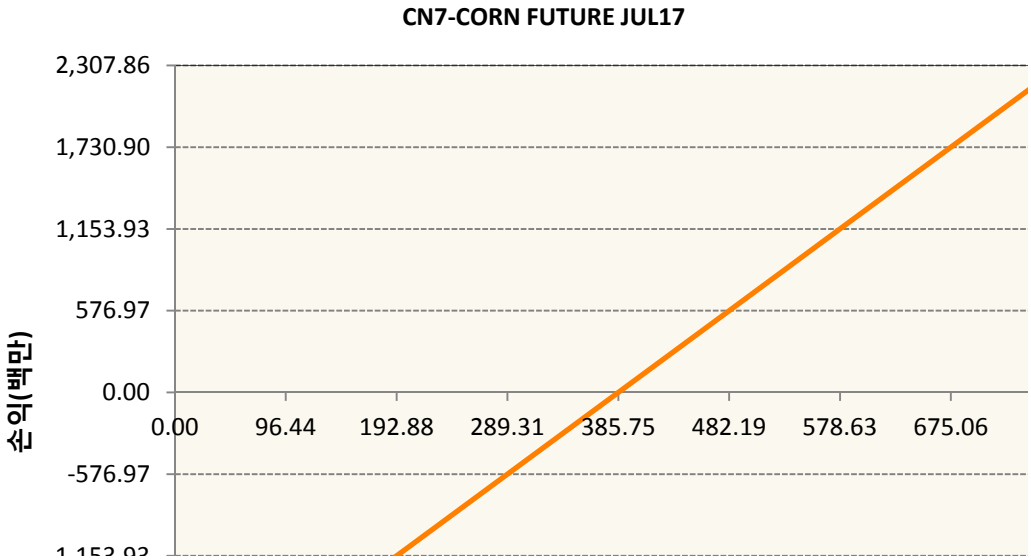
1. 계약금액

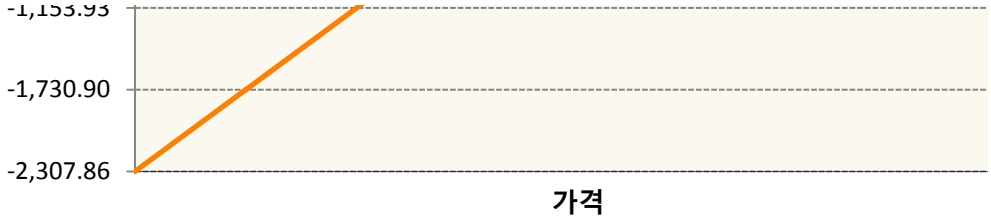
(단위:백만원)

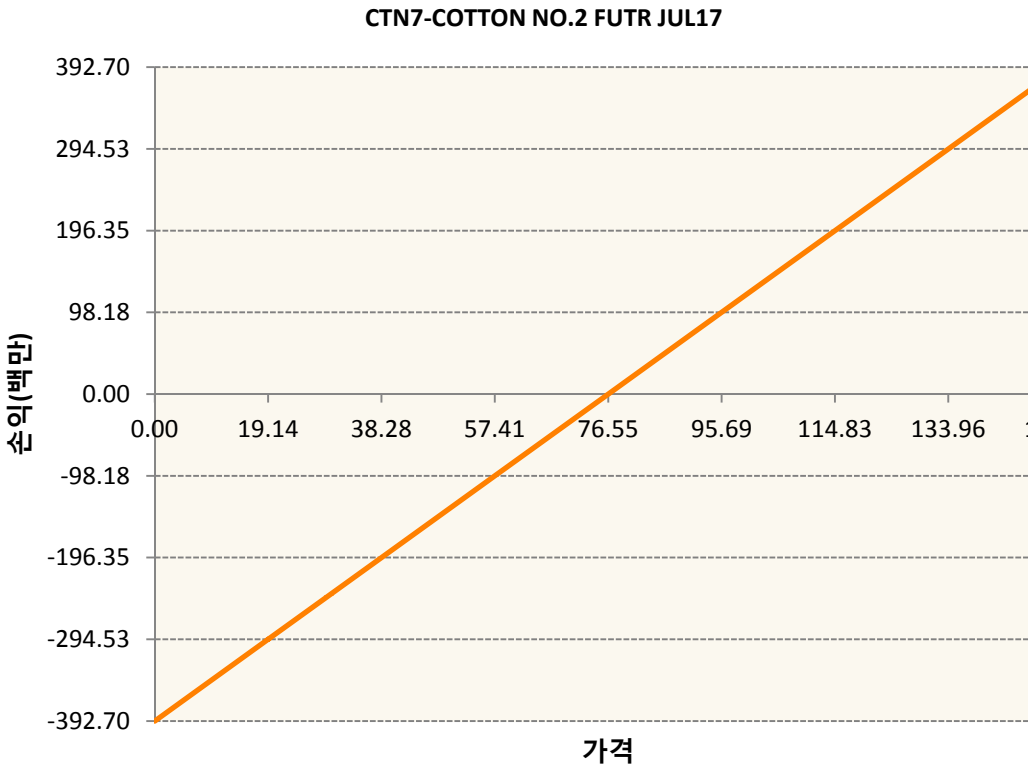
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,417	393	8,024	

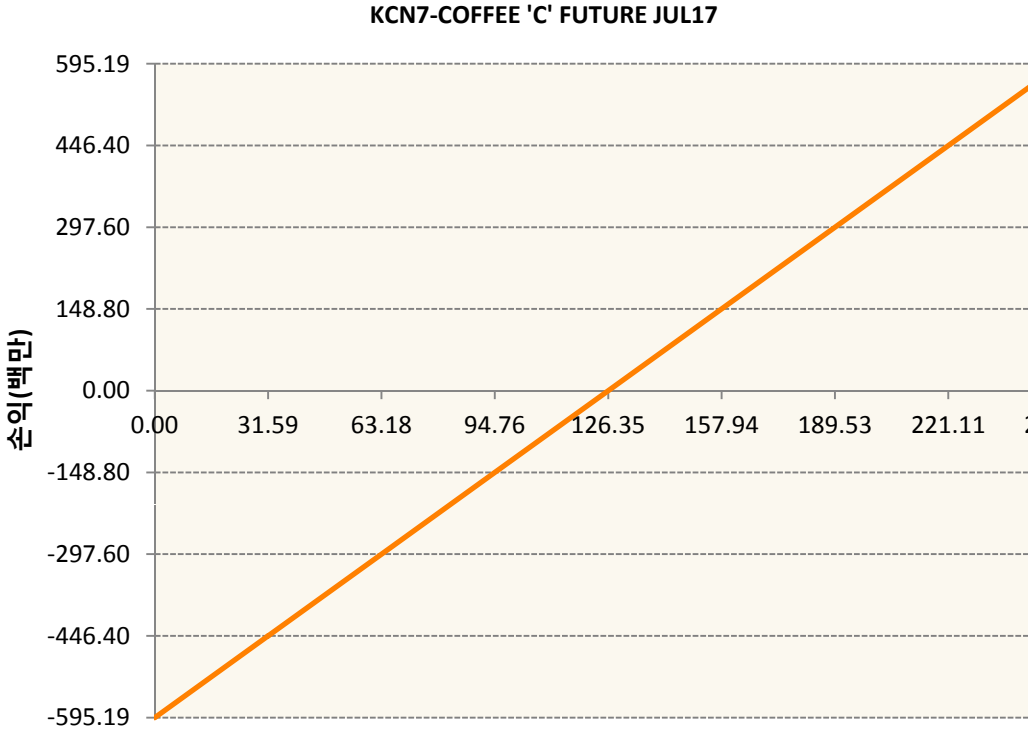
2. 만기시점의 손익구조





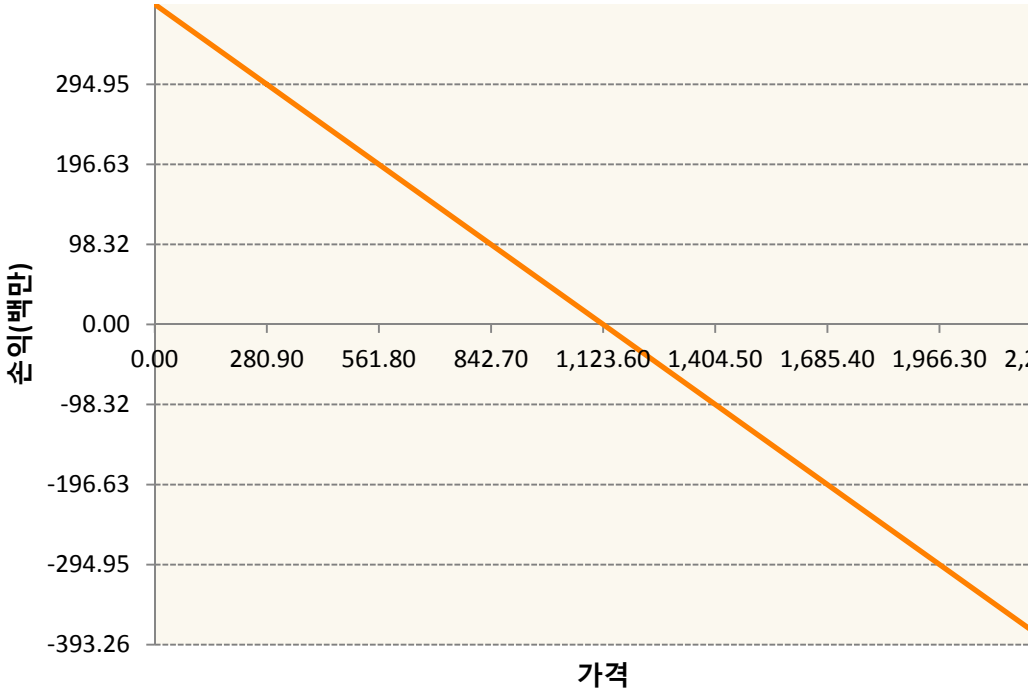

-1,730.90
-2,307.86
가격


CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
392.70
294.53
196.35
98.18
0.00
-98.18
-196.35
-294.53
-392.70
0.00
19.14
38.28
57.41
76.55
95.69
114.83
133.96
순익(백만)
가격

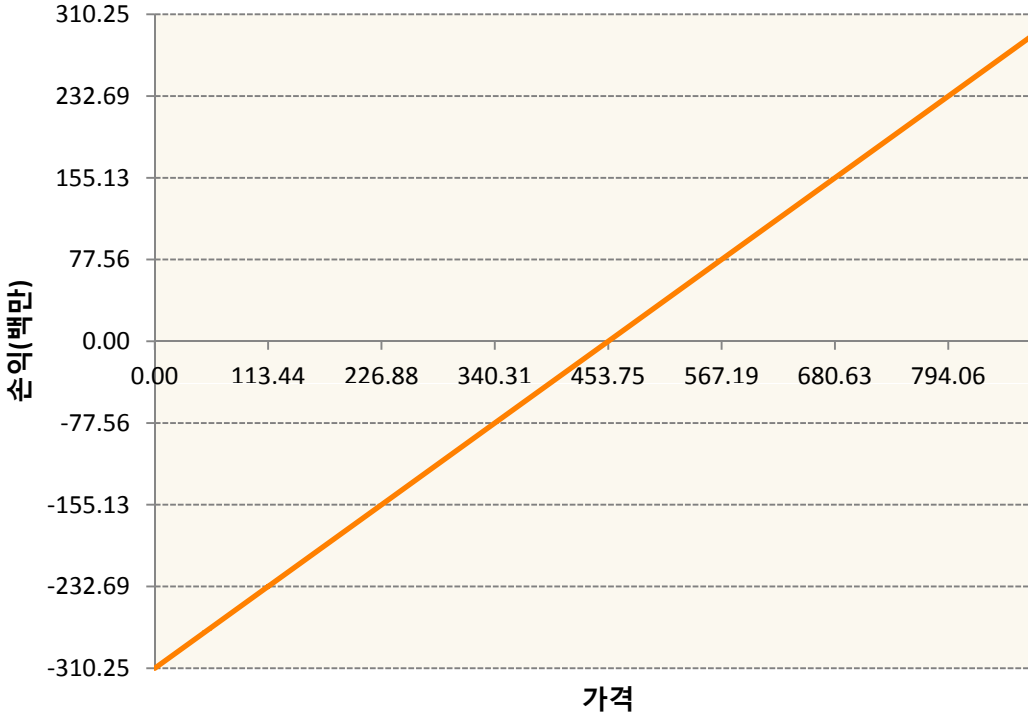

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
595.19
446.40
297.60
148.80
0.00
-148.80
-297.60
-446.40
-595.19
0.00
31.59
63.18
94.76
126.35
157.94
189.53
221.11
순익(백만)

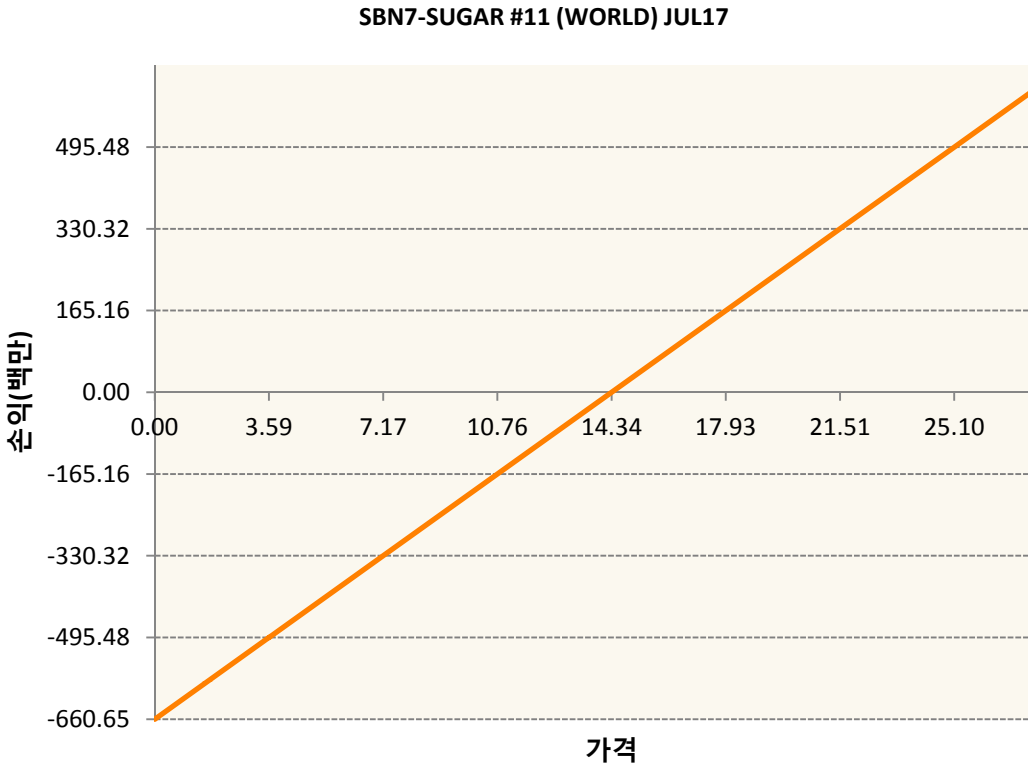
가격

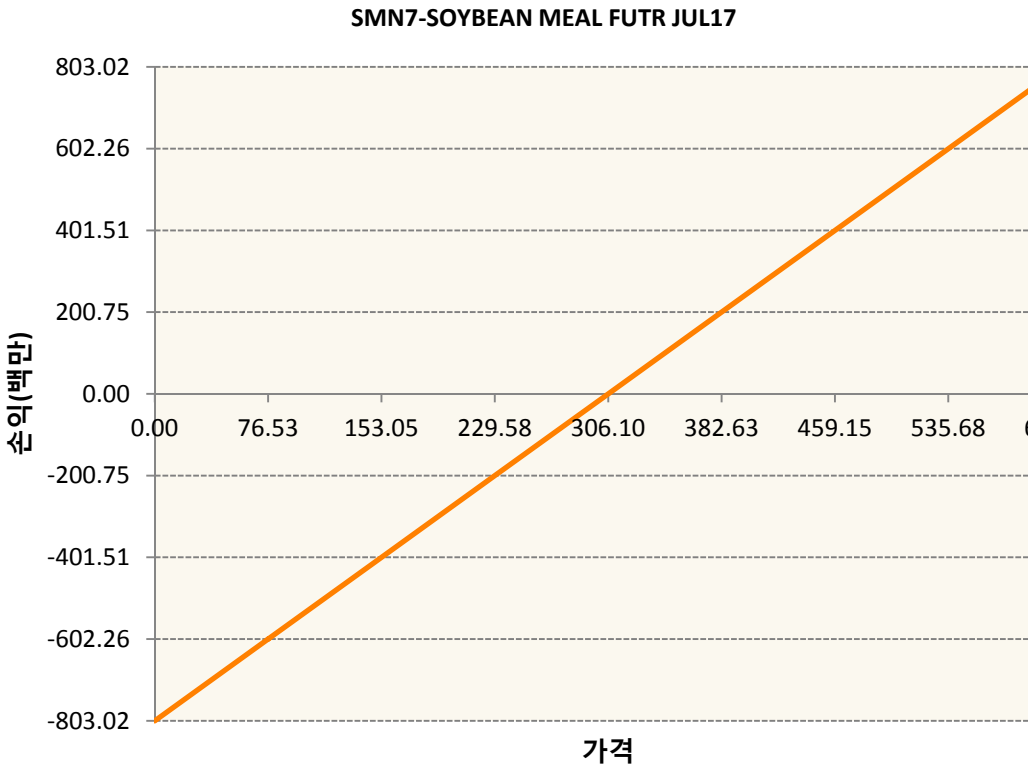
KR4175M60005-2017-06 달러선물

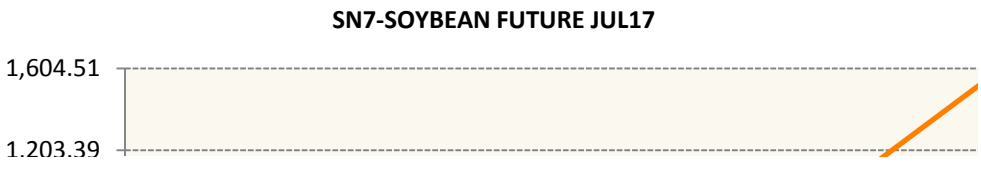


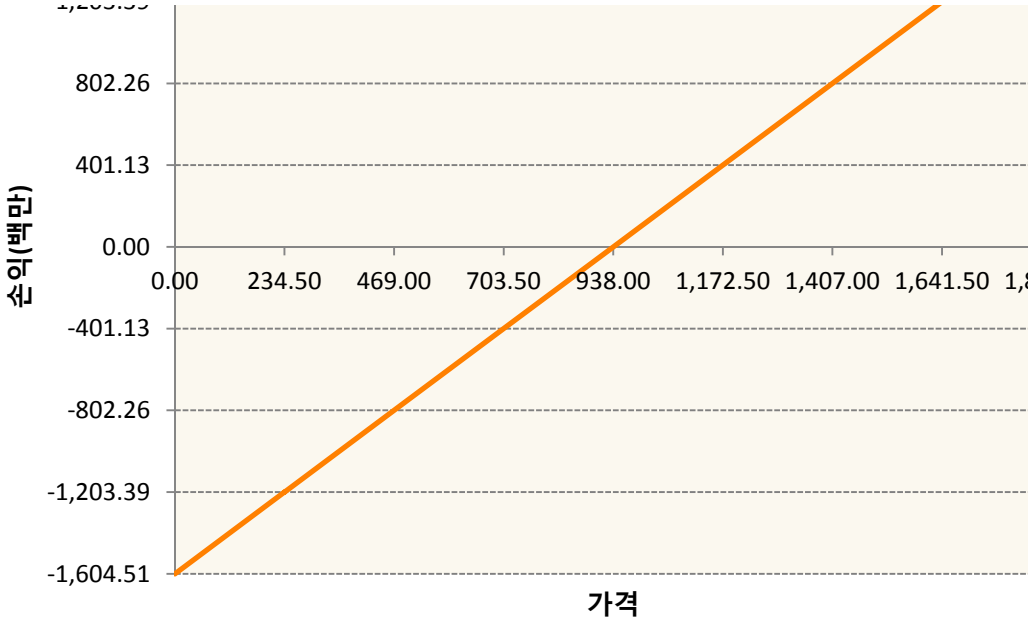
KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17

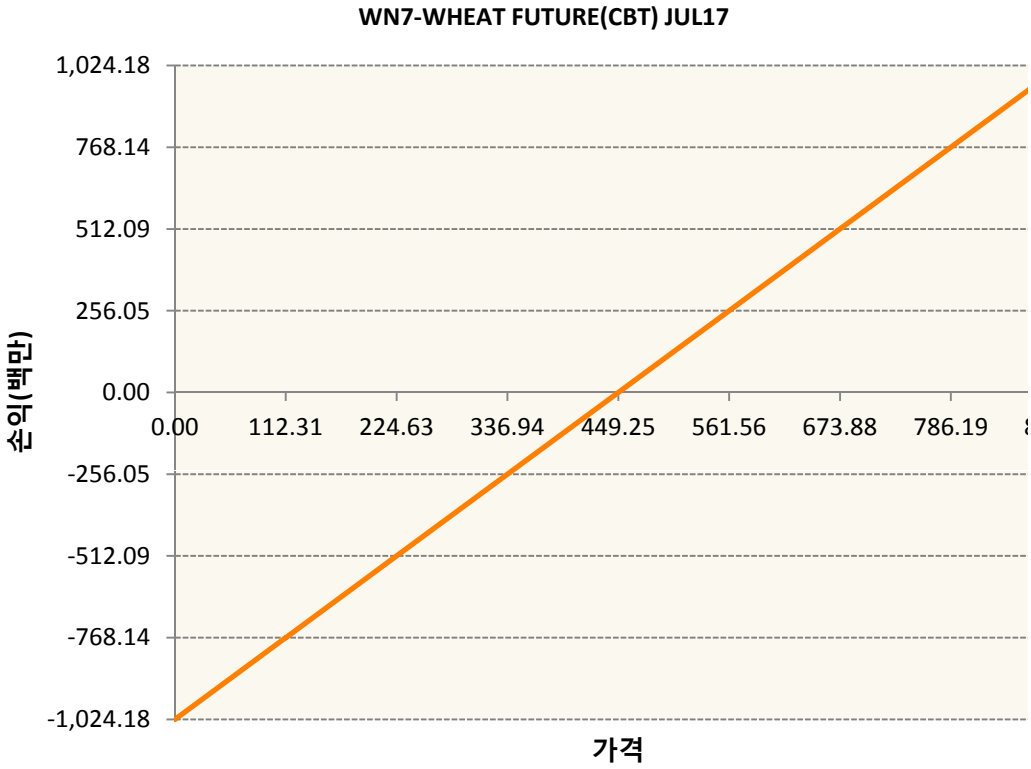



SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
495.48
330.32
165.16
0.00
-165.16
-330.32
-495.48
-660.65
손익(백만)
0.00
3.59
7.17
10.76
14.34
17.93
21.51
25.10
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
803.02
602.26
401.51
200.75
0.00
-200.75
-401.51
-602.26
-803.02
손익(백만)
0.00
76.53
153.05
229.58
306.10
382.63
459.15
535.68
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,604.51
1,203.39





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	58
CN7	CORN FUTURE JUL17	185
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	31
KCN7	COFFEE 'C' FUTURE JUL17	48
KR4175M60(	2017-06 달러선물	31

KWN7	KC HRW WHEAT FUT JUL17	25
SBN7	SUGAR #11 (WORLD) JUL17	53
SMN7	SOYBEAN MEAL FUTR JUL17	64
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	128
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	82

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

763