공시일	2017-06-13
기준일	2017-06-12

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	2017-06-13
기준일	2017-06-12

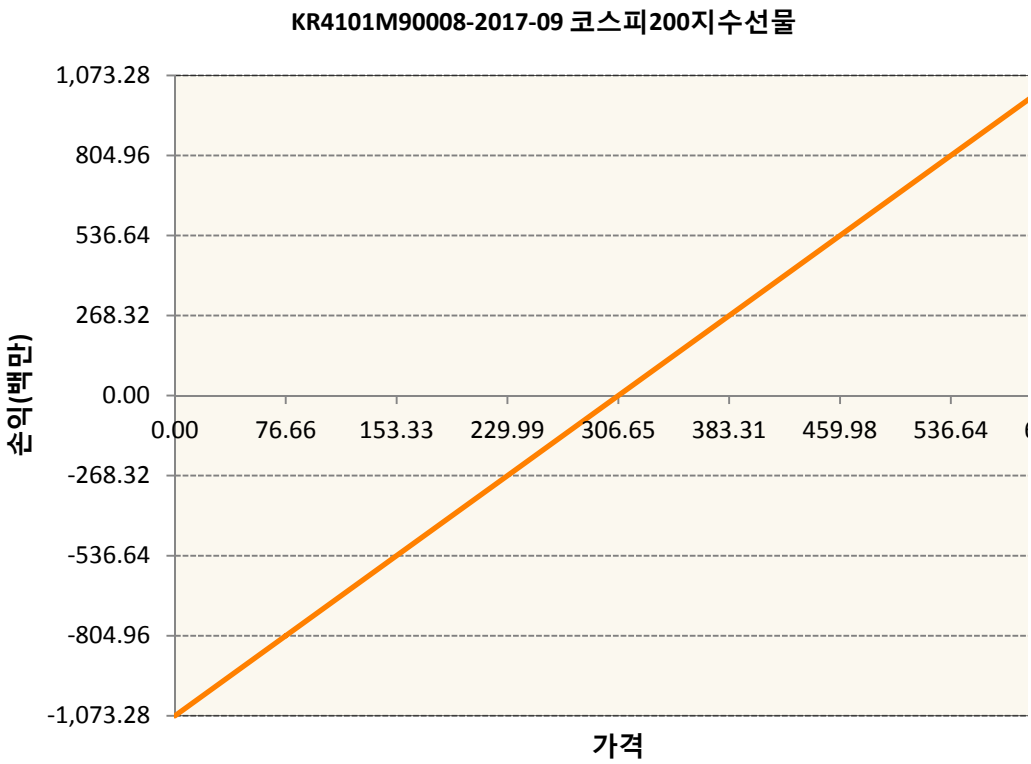
스마트인덱스모

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	1,073	0	1,073	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	2017-06-13
기준일	2017-06-12

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)

517

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-13
기준일	2017-06-12

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	365

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

335

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-13
기준일	2017-06-12

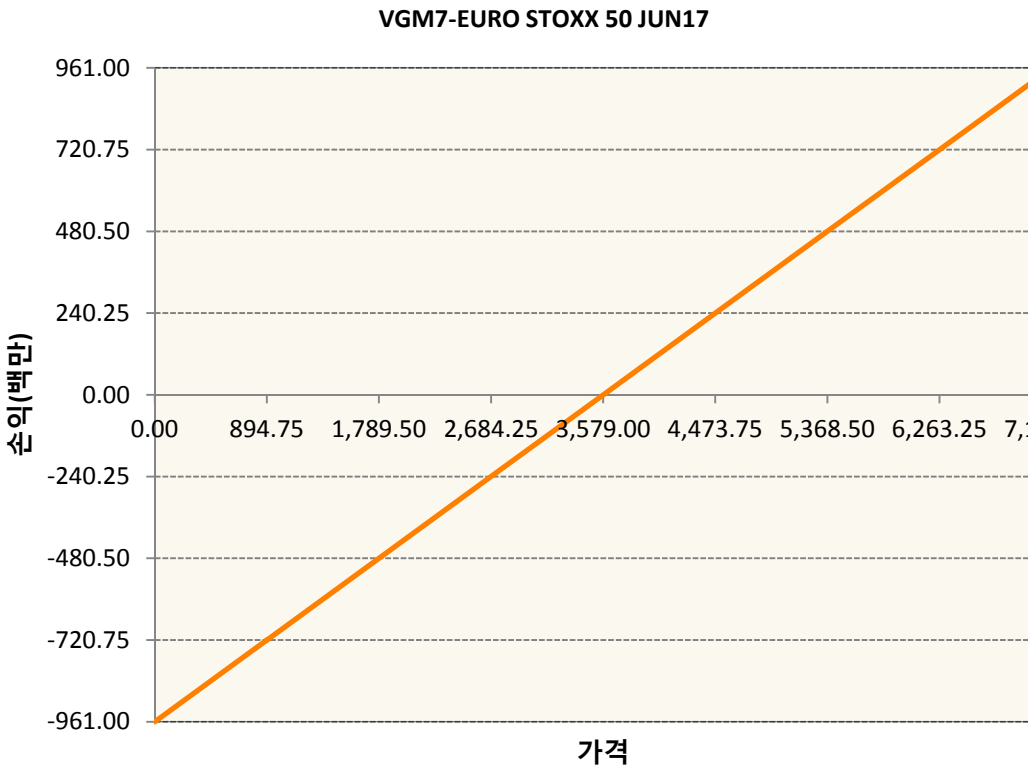
유로인덱스모(주식-파생형)

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)

72

공시일	2017-06-13
기준일	2017-06-12

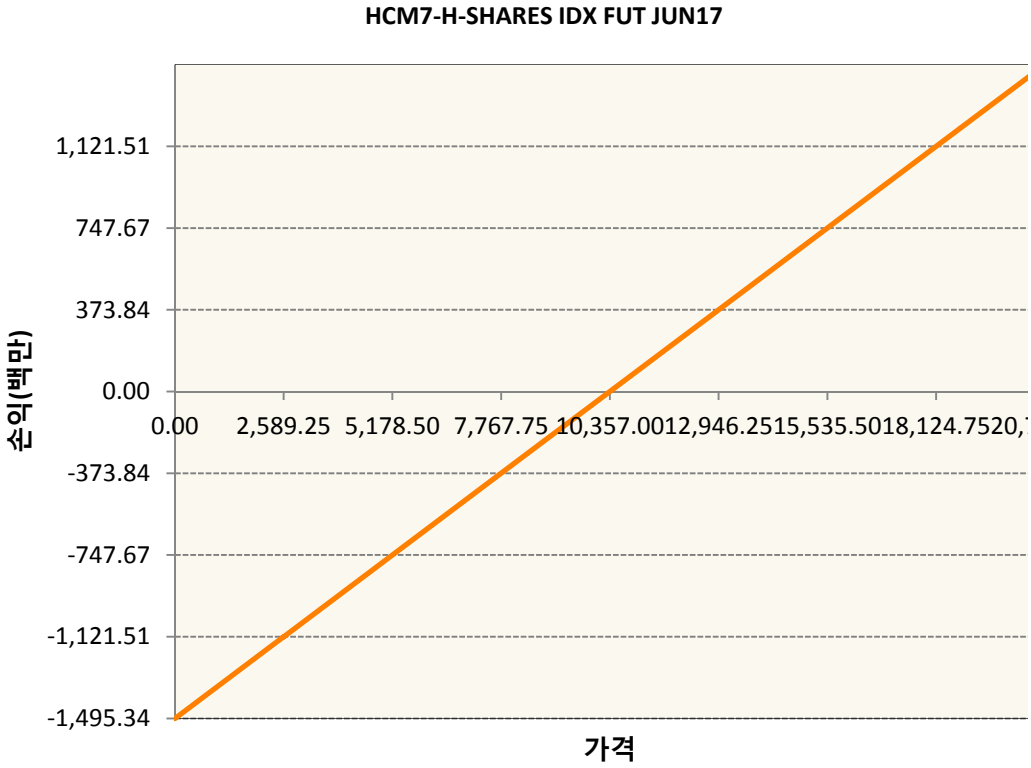
차이나인덱스모(주식-파생형)

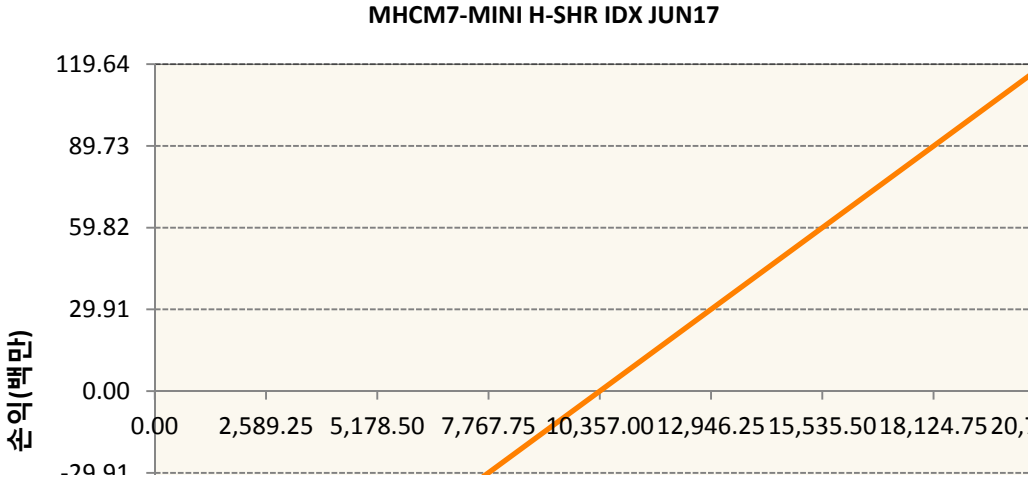
1. 계약금액

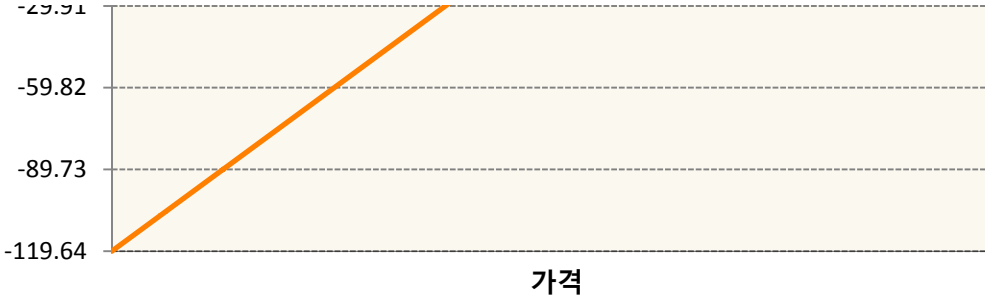
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계			1,495	0	1,495	
누계	유가증권	선물	120	0	120	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCM7	H-SHARES IDX FUT JUN17	120
MHCM7	MINI H-SHR IDX JUN17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	92

공시일	2017-06-13
기준일	2017-06-12

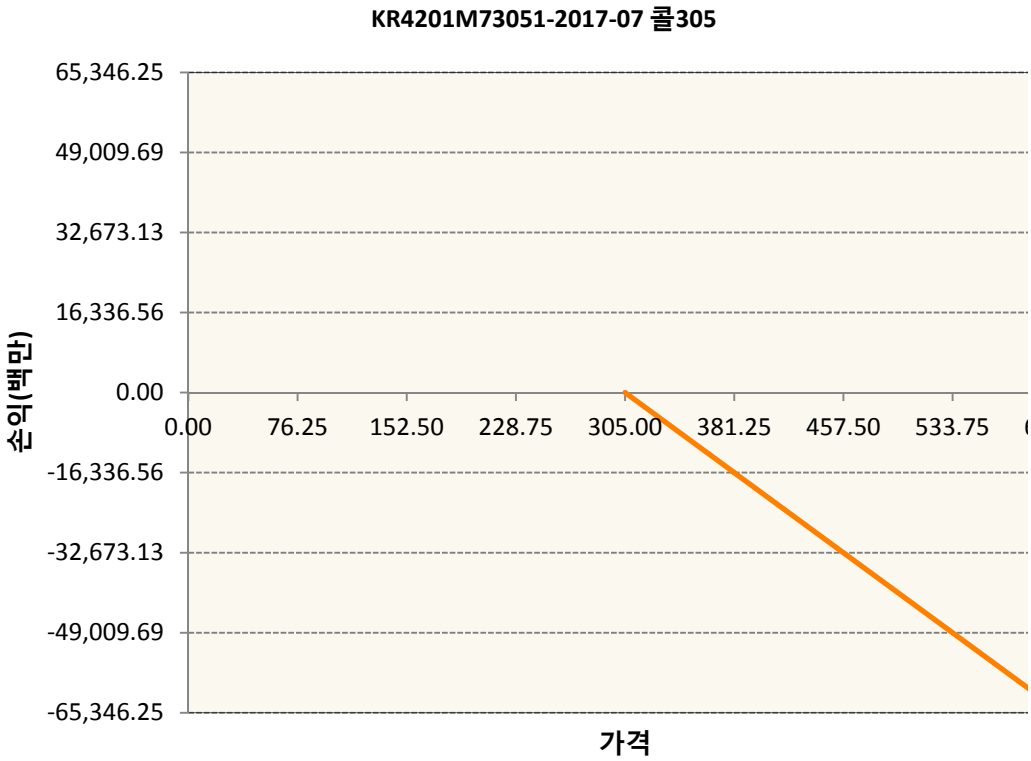
커버드콜모(주식혼합-파생형)

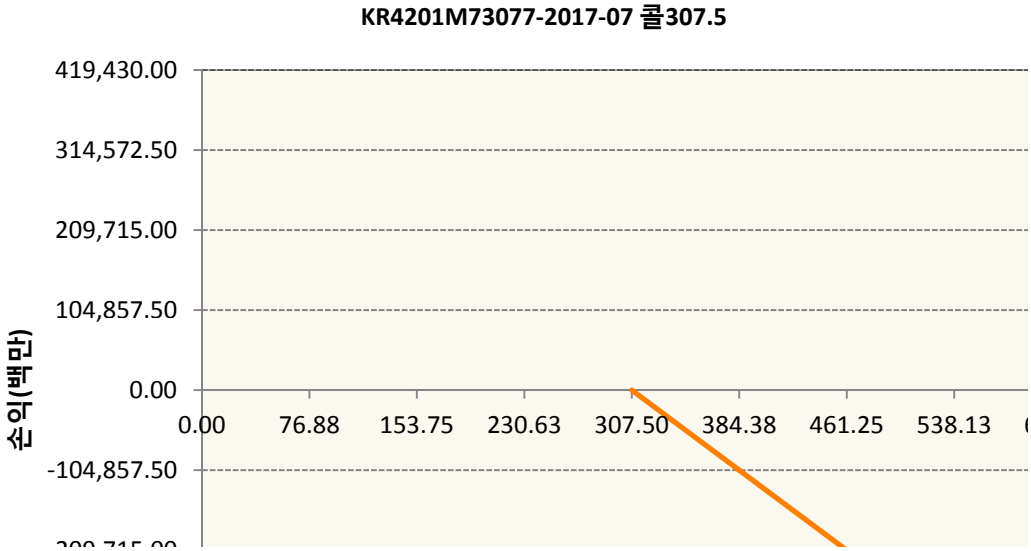
1. 계약금액

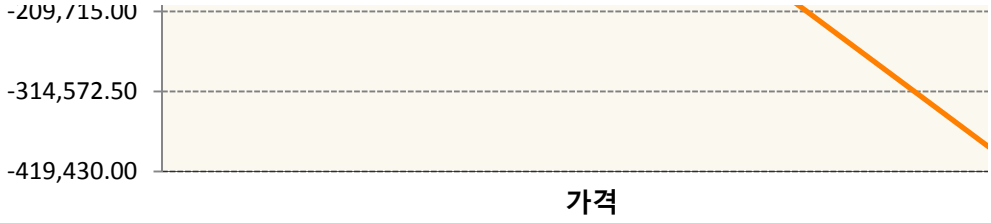
(단위:백만원)

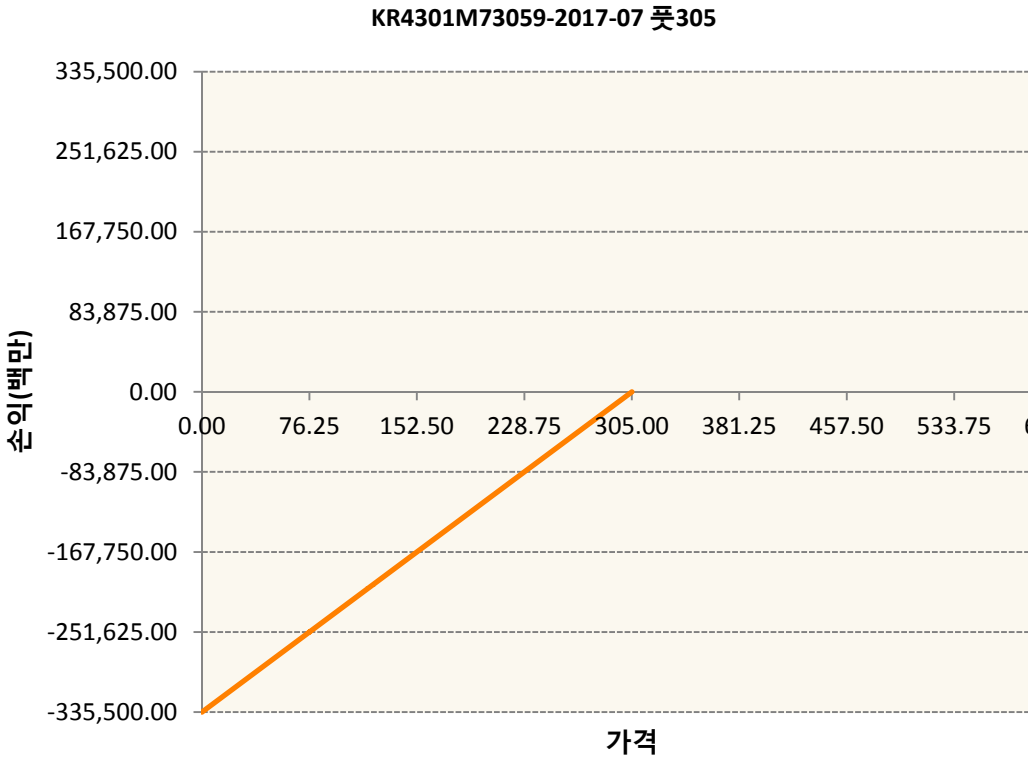
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	15,541	-15,541	장내
누계	유가증권	옵션	0	820,276	-820,276	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M73(2017-07 콜305							4,473
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,071	1,069	1,066	1,061	1,053	1,042	1,028
-5.33%	1,052	1,037	1,016	991	961	926	888
-2.67%	883	828	769	707	644	578	512
0%	232	155	78	0	-78	-155	-233
2.67%	-1,051	-1,096	-1,146	-1,199	-1,256	-1,316	-1,378
5.33%	-2,695	-2,706	-2,723	-2,744	-2,770	-2,801	-2,836
8.00%	-4,430	-4,432	-4,435	-4,440	-4,447	-4,458	-4,473
KR4201M73(2017-07 콜307.5							26,898
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,146	5,142	5,132	5,113	5,082	5,037	4,974

-5.33%	5,093	5,037	4,954	4,842	4,703	4,536	4,344
-2.67%	4,472	4,204	3,904	3,578	3,231	2,867	2,487
0%	1,483	989	495	0	-496	-992	-1,488
2.67%	-5,539	-5,912	-6,306	-6,717	-7,141	-7,576	-8,019
5.33%	-15,519	-15,644	-15,805	-16,000	-16,226	-16,481	-16,760
8.00%	-26,480	-26,500	-26,535	-26,591	-26,669	-26,771	-26,898
KR4301M73(2017-07 풋305							21,634
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21,416	-21,424	-21,440	-21,467	-21,507	-21,563	-21,634
-5.33%	-12,541	-12,620	-12,725	-12,855	-13,010	-13,186	-13,382
-2.67%	-4,438	-4,722	-5,024	-5,339	-5,666	-6,002	-6,344
0%	1,192	795	398	0	-398	-797	-1,196
2.67%	3,573	3,344	3,089	2,813	2,521	2,215	1,897
5.33%	4,108	4,048	3,964	3,855	3,720	3,563	3,384
8.00%	4,168	4,161	4,146	4,119	4,079	4,023	3,950

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

58,002

공시일	2017-06-13
기준일	2017-06-12

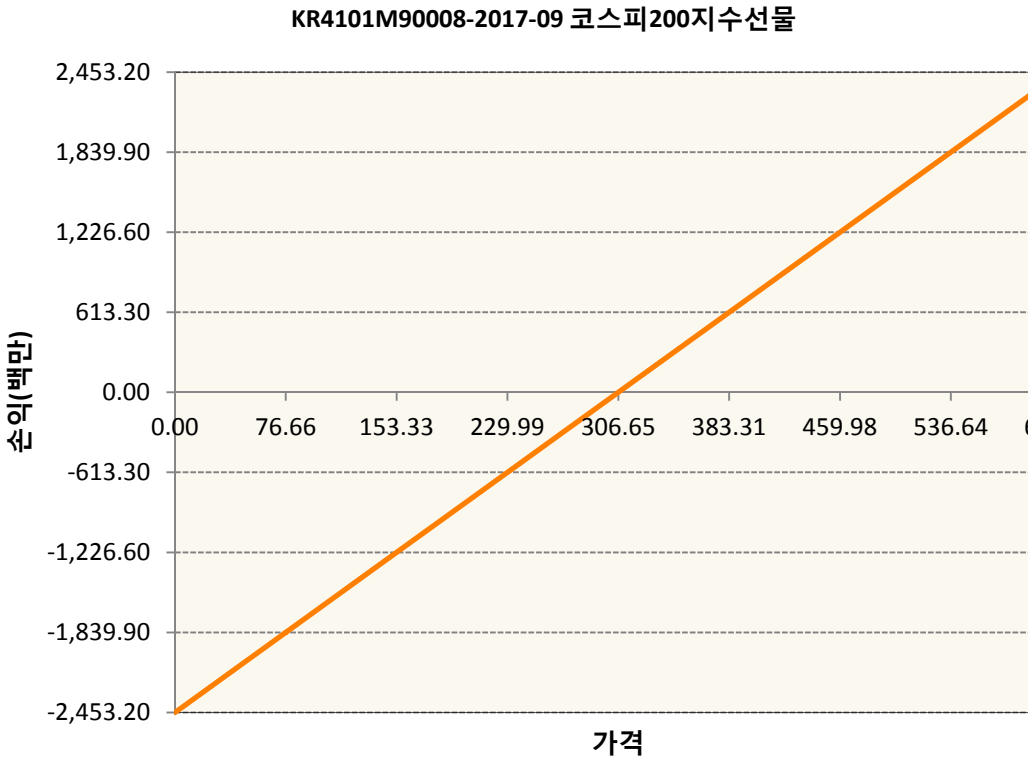
커버드콜목표전환형증권투자신탁

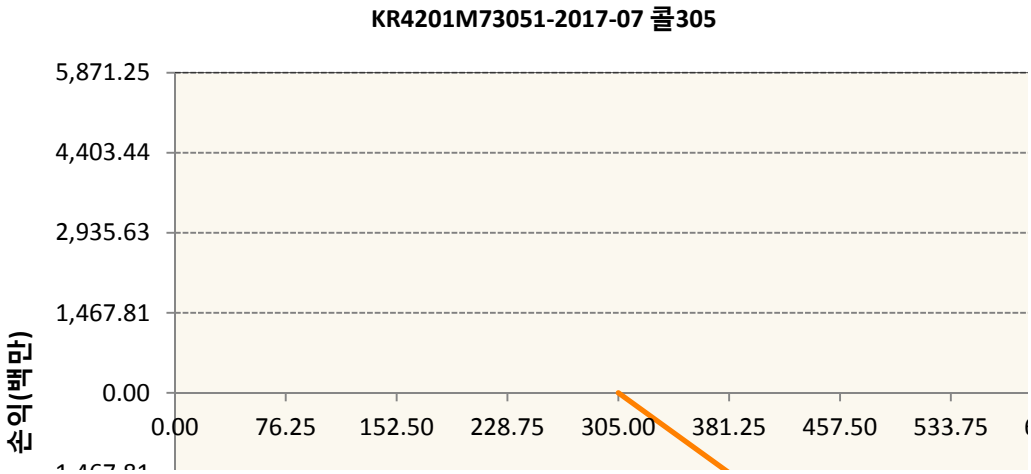
1. 계약금액

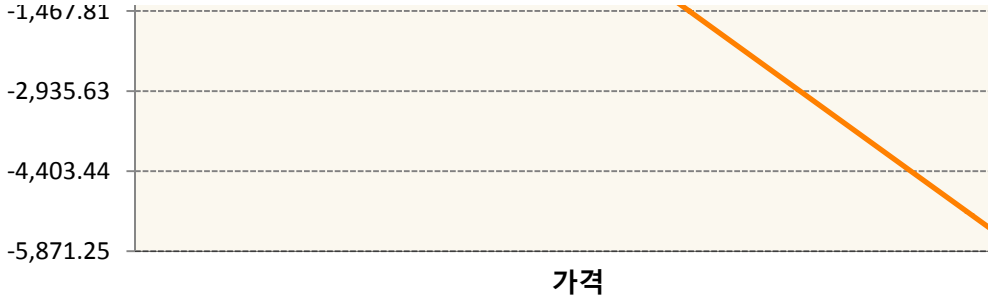
(단위:백만원)

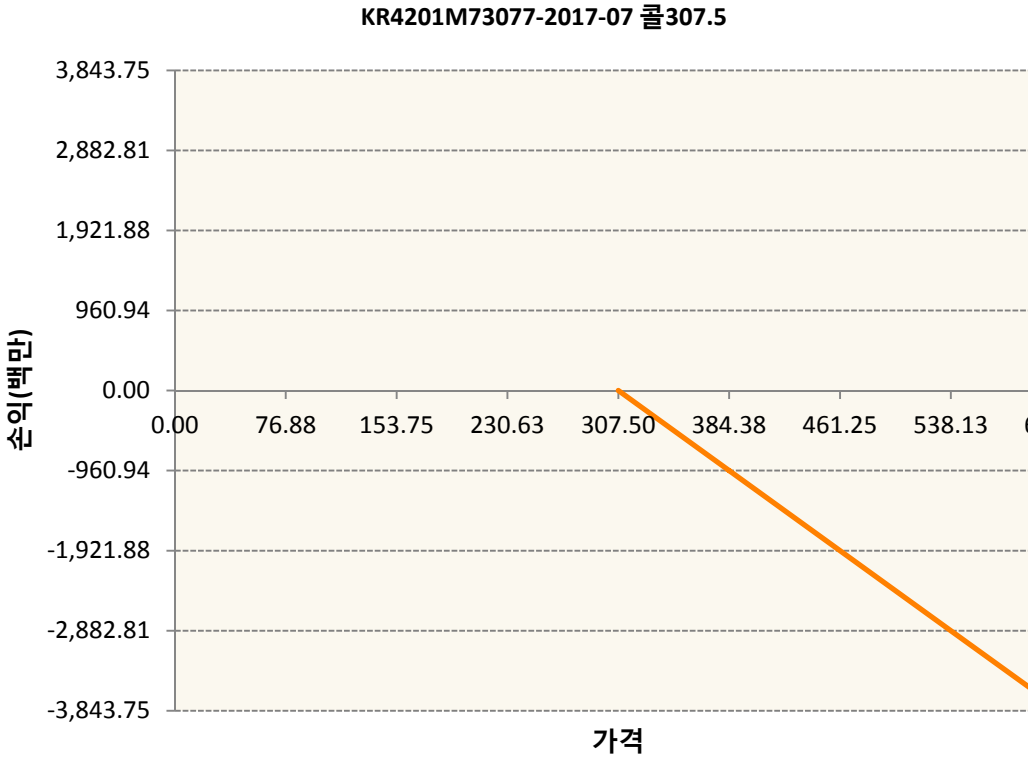
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	376	0	376	장내
누계	유가증권	선물	2,453	0	2,453	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,253	-11,253	장내

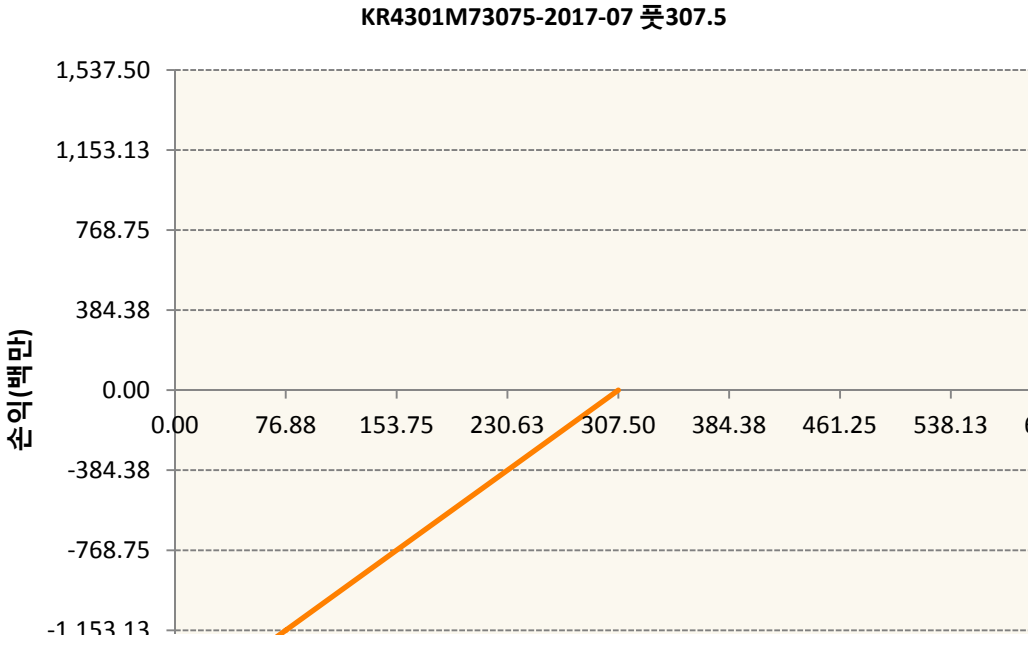
2. 만기시점의 손익구조

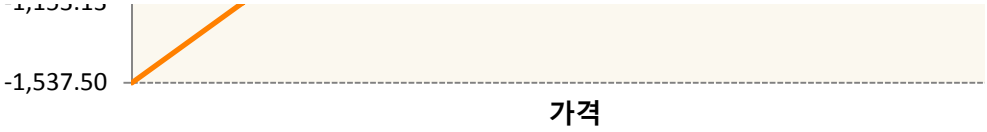





-1,467.81
-2,935.63
-4,403.44
-5,871.25
가격


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							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							402
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	96	96	96	95	95	94	92
-5.33%	95	93	91	89	86	83	80
-2.67%	79	74	69	64	58	52	46
0%	21	14	7	0	-7	-14	-21
2.67%	-94	-98	-103	-108	-113	-118	-124
5.33%	-242	-243	-245	-247	-249	-252	-255
8.00%	-398	-398	-398	-399	-400	-401	-402
KR4201M73(2017-07 콜307.5							246
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	47	47	47	47	47	46	46
-5.33%	47	46	45	44	43	42	40
-2.67%	41	39	36	33	30	26	23
0%	14	9	5	0	-5	-9	-14
2.67%	-51	-54	-58	-62	-65	-69	-73
5.33%	-142	-143	-145	-147	-149	-151	-154
8.00%	-243	-243	-243	-244	-244	-245	-246
KR4301M73(2017-07 풋307.5							104
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-103	-103	-104	-104	-104	-104	-104
-5.33%	-63	-63	-63	-64	-64	-65	-66
-2.67%	-24	-25	-26	-28	-29	-30	-32

0%	5	4	2	0	-2	-4	-5
2.67%	20	19	18	16	15	13	11
5.33%	25	24	24	23	22	21	20
8.00%	25	25	25	25	25	24	24

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

970

공시일	2017-06-13
기준일	2017-06-12

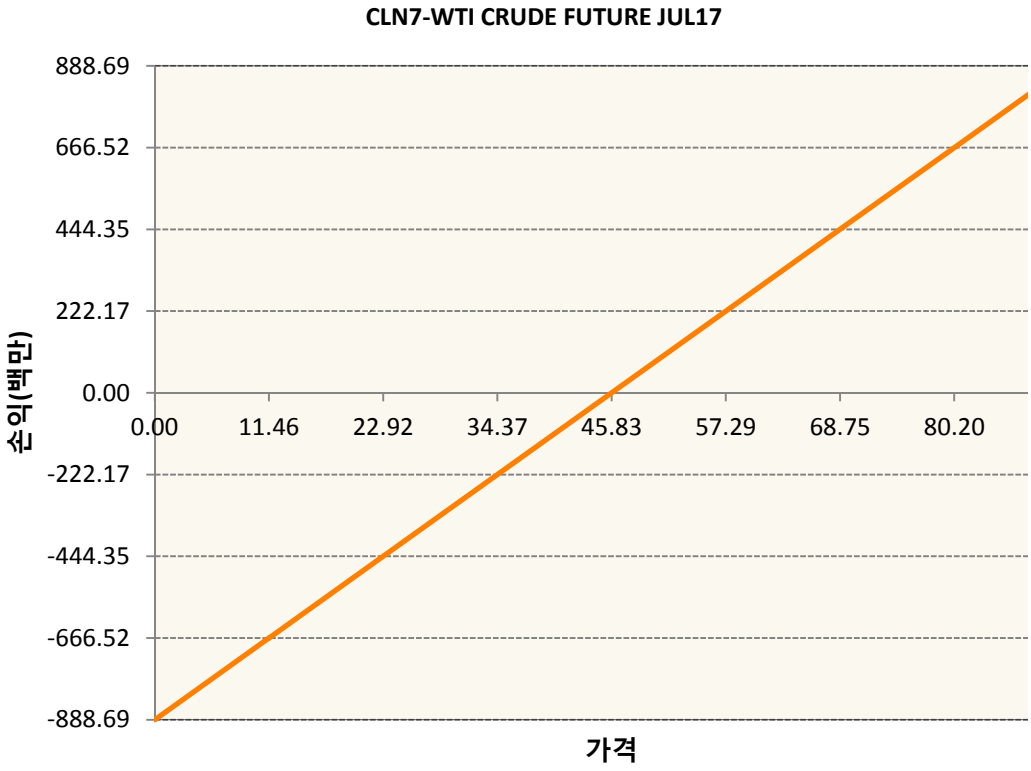
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

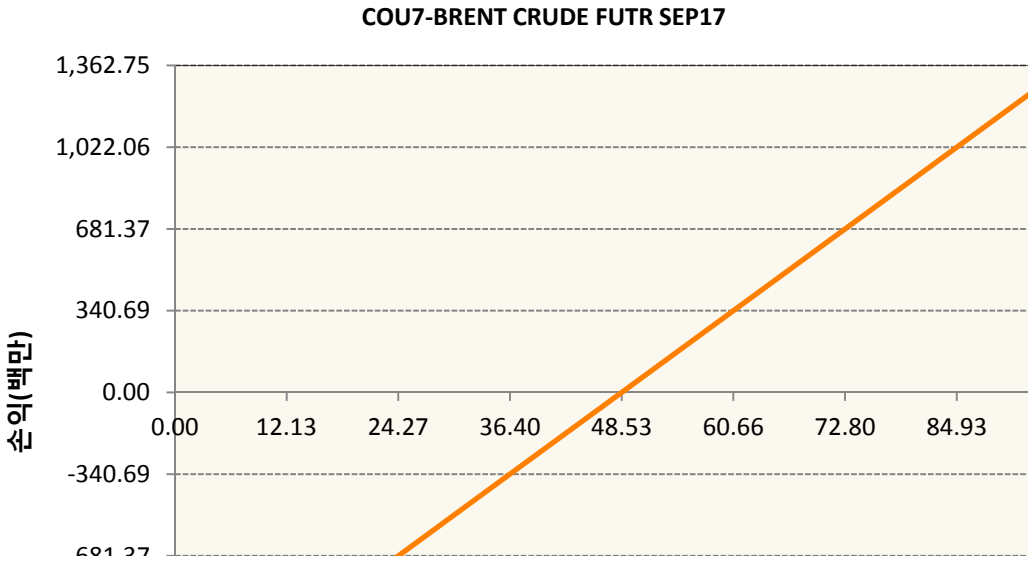
1. 계약금액

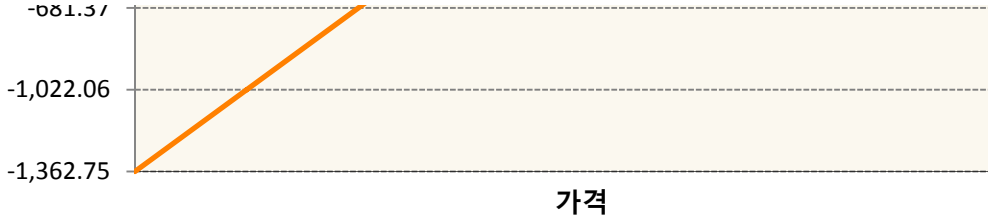
(단위:백만원)

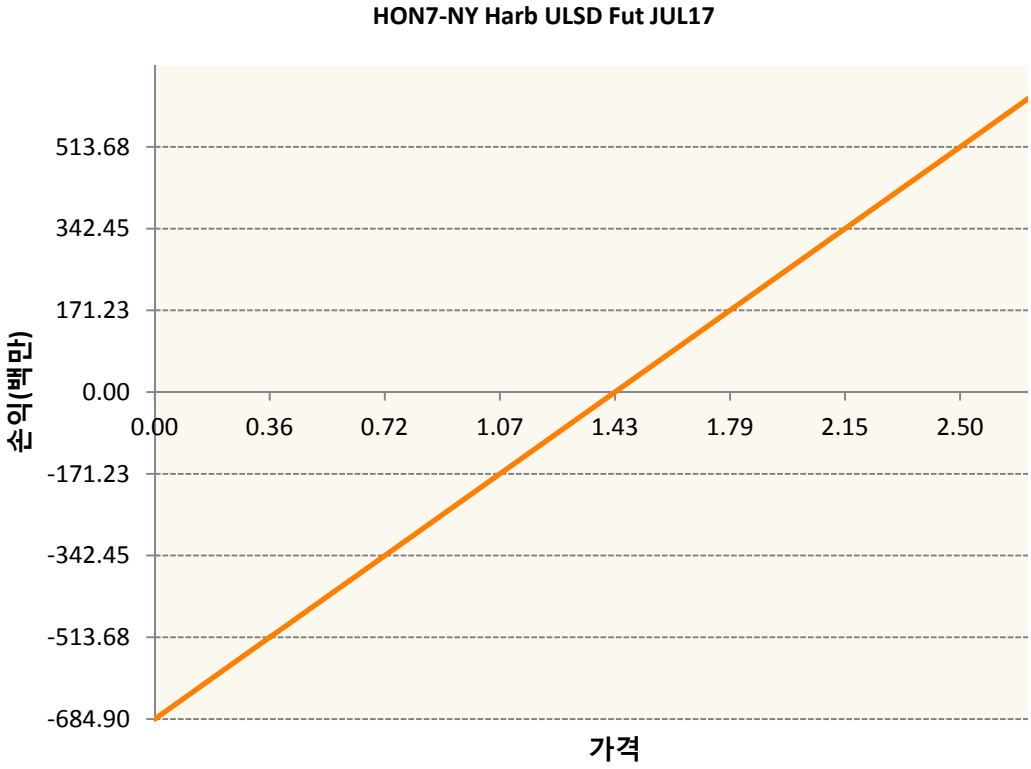
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,111	226	4,886	

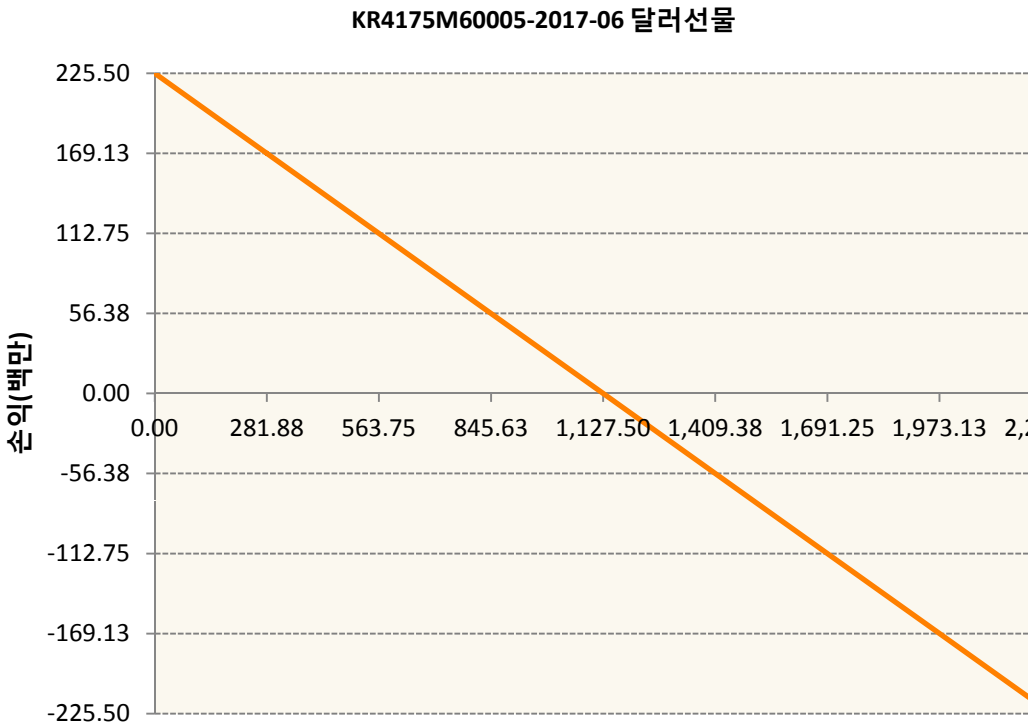
2. 만기시점의 손익구조



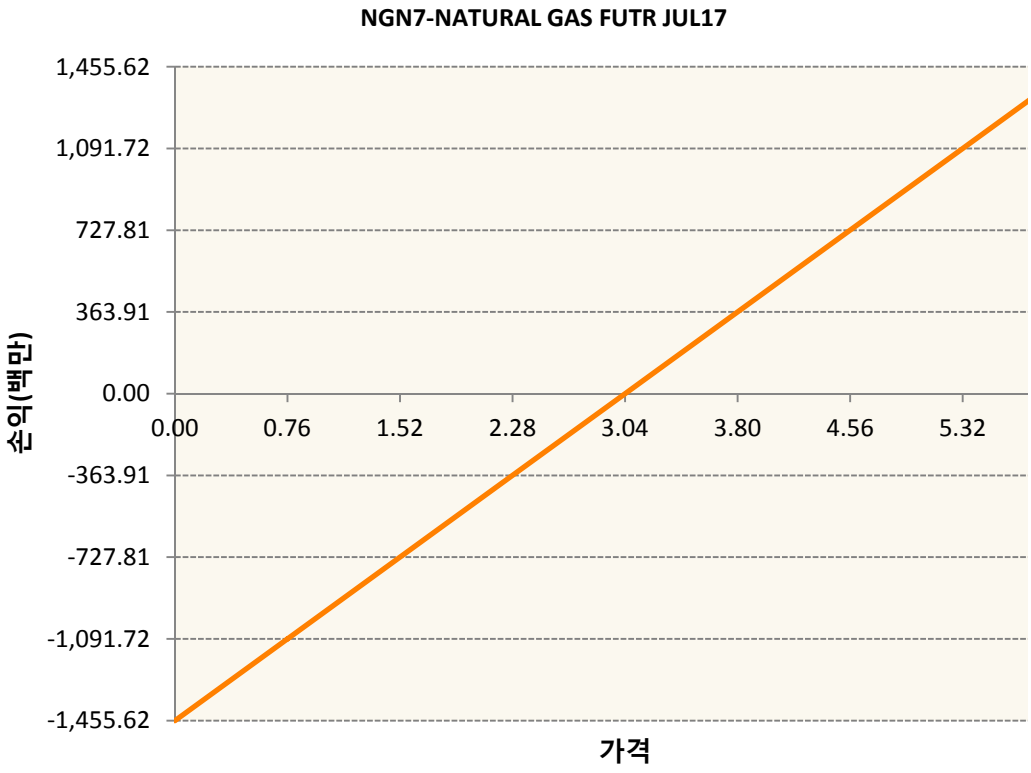


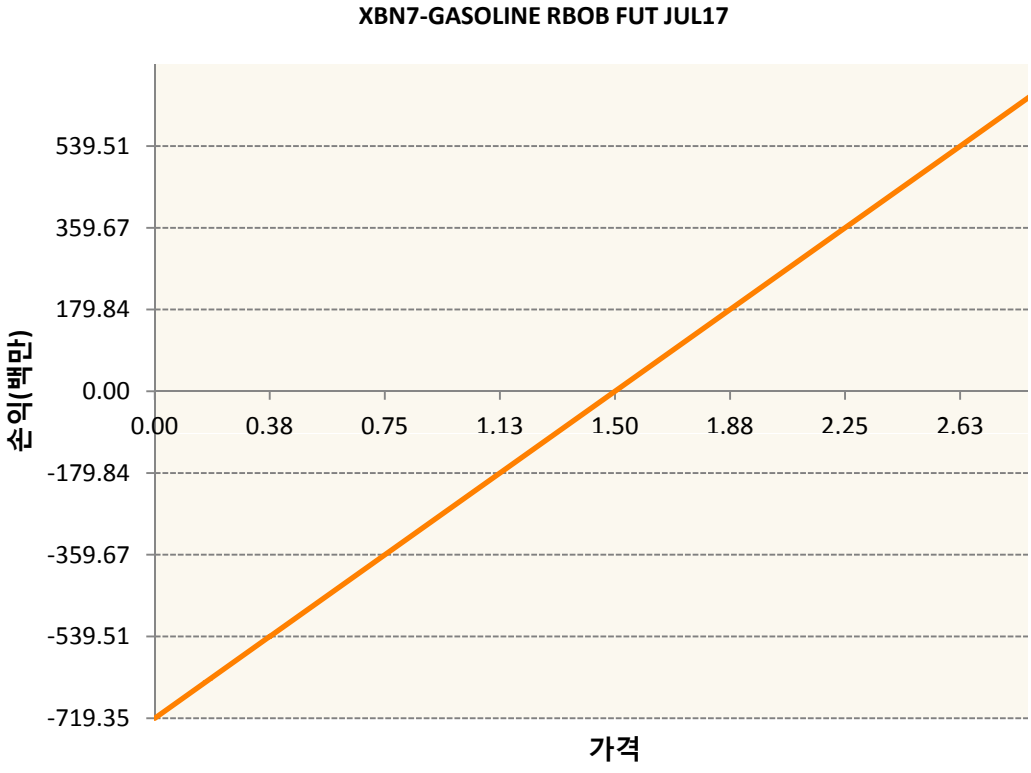

-1,022.06
-1,362.75
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
513.68
342.45
171.23
0.00
-171.23
-342.45
-513.68
-684.90
0.00
0.36
0.72
1.07
1.43
1.79
2.15
2.50
순이익(백만)
가격


KR4175M60005-2017-06 달러선물
225.50
169.13
112.75
56.38
0.00
-56.38
-112.75
-169.13
-225.50
0.00
281.88
563.75
845.63
1,127.50
1,409.38
1,691.25
1,973.13
순이익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,455.62
1,091.72
727.81
363.91
0.00
-363.91
-727.81
-1,091.72
-1,455.62
0.00
0.76
1.52
2.28
3.04
3.80
4.56
5.32
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
539.51
359.67
179.84
0.00
-179.84
-359.67
-539.51
-719.35
0.00
0.38
0.75
1.13
1.50
1.88
2.25
2.63
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	55
KR4175M60(	2017-06 달러선물	18
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	116
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	58

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

847

공시일	2017-06-13
기준일	2017-06-12

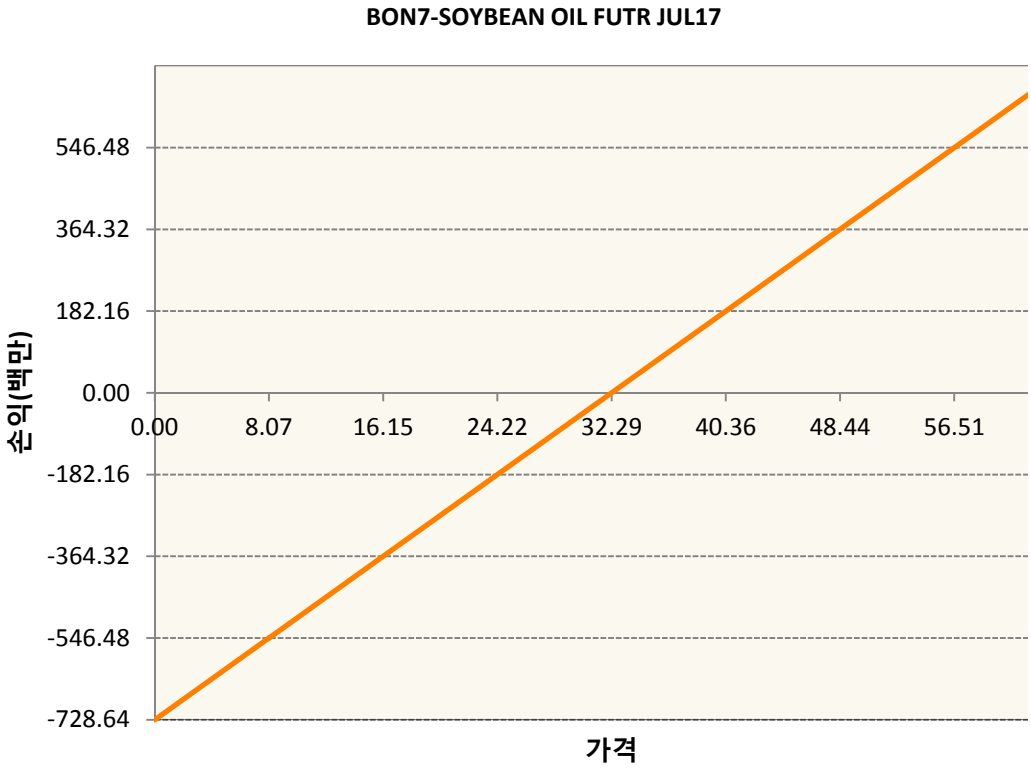
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

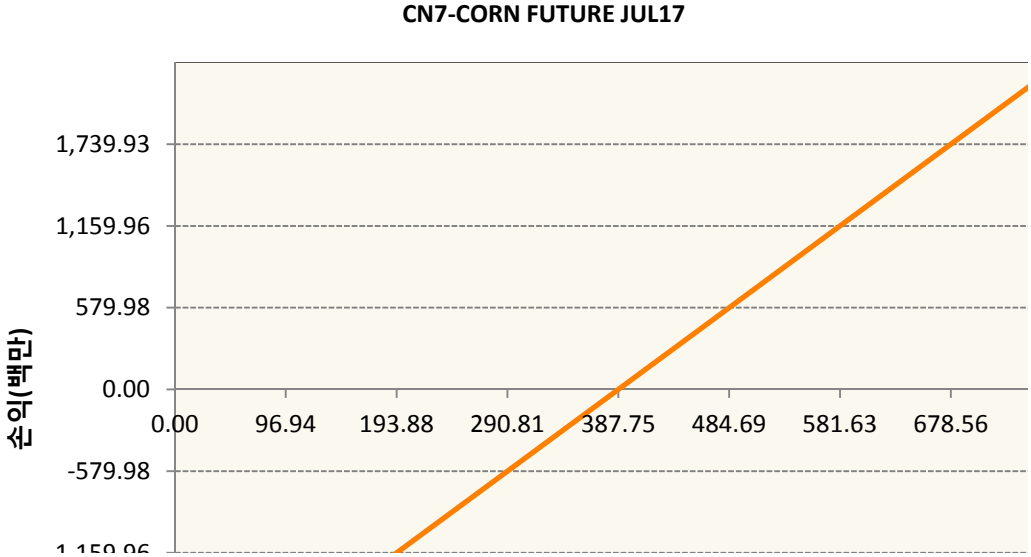
1. 계약금액

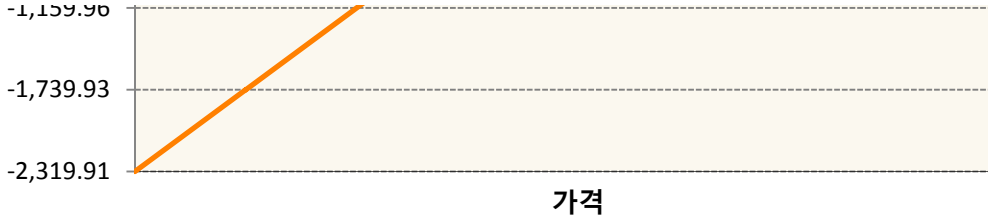
(단위:백만원)

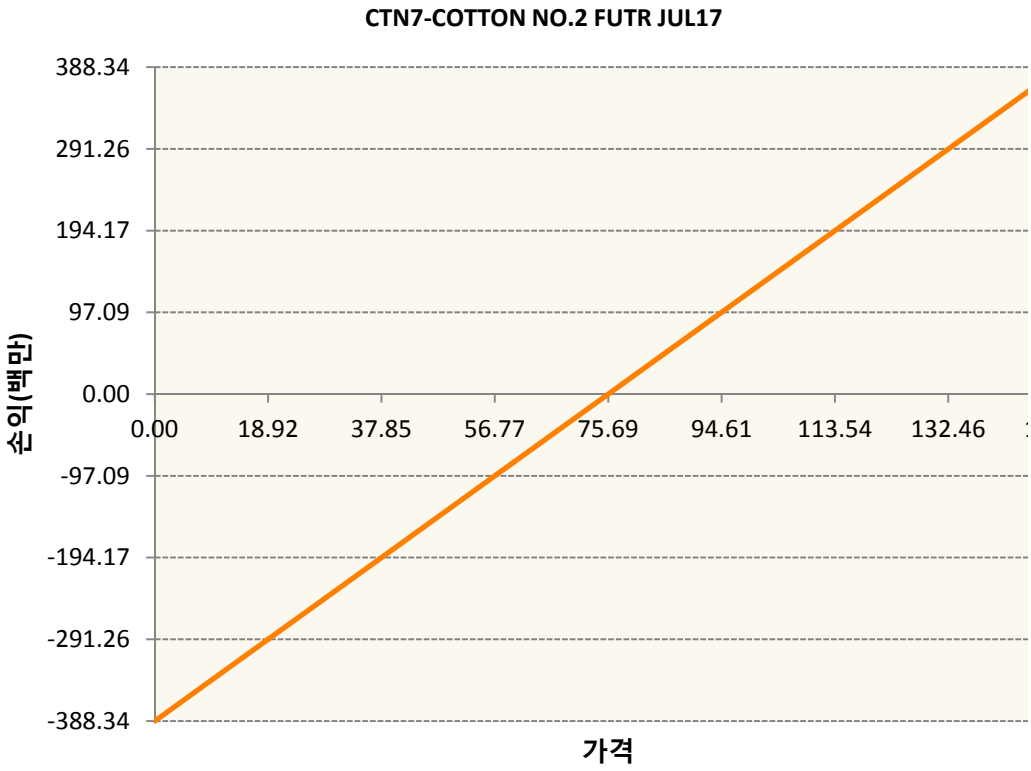
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,428	395	8,033	

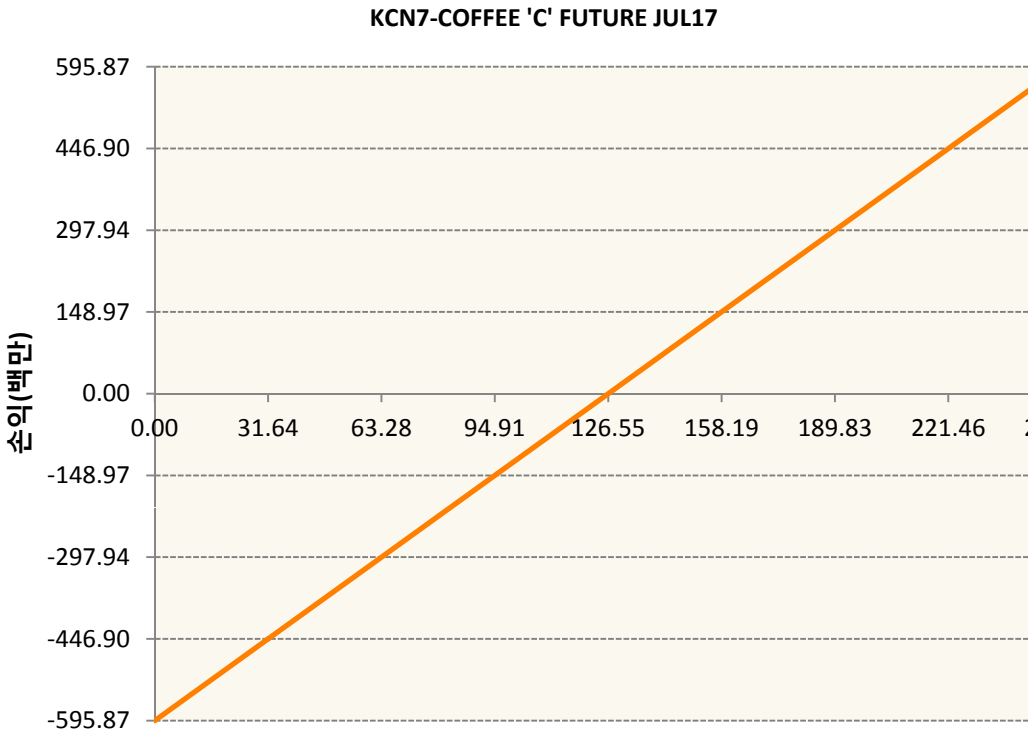
2. 만기시점의 손익구조



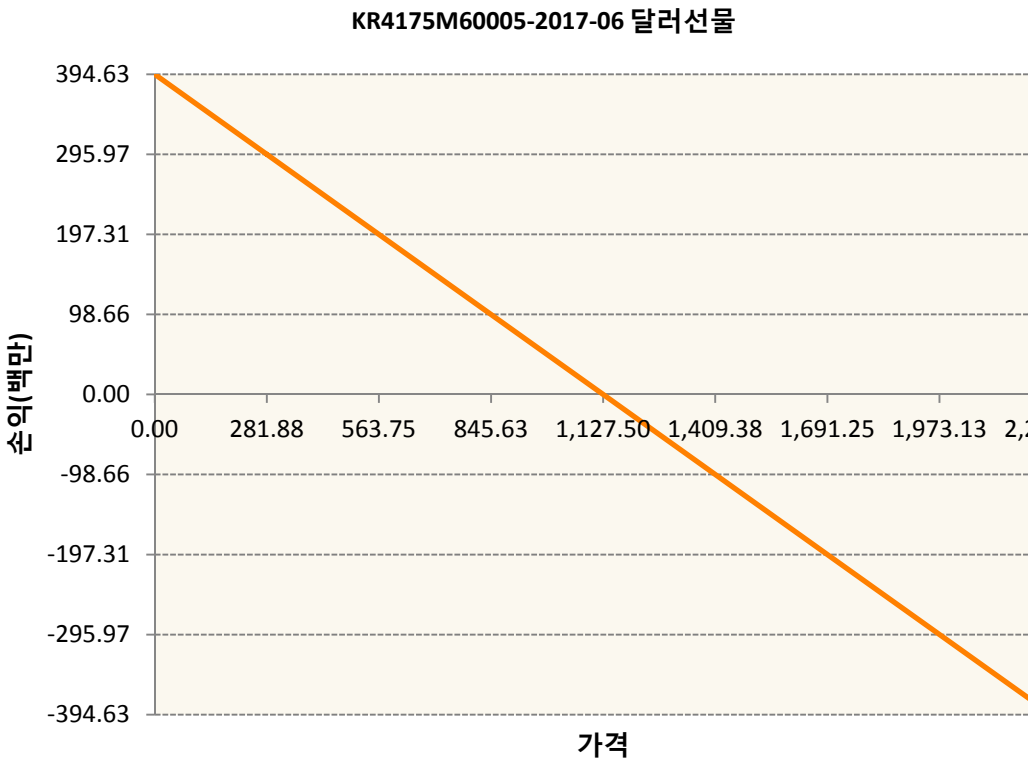


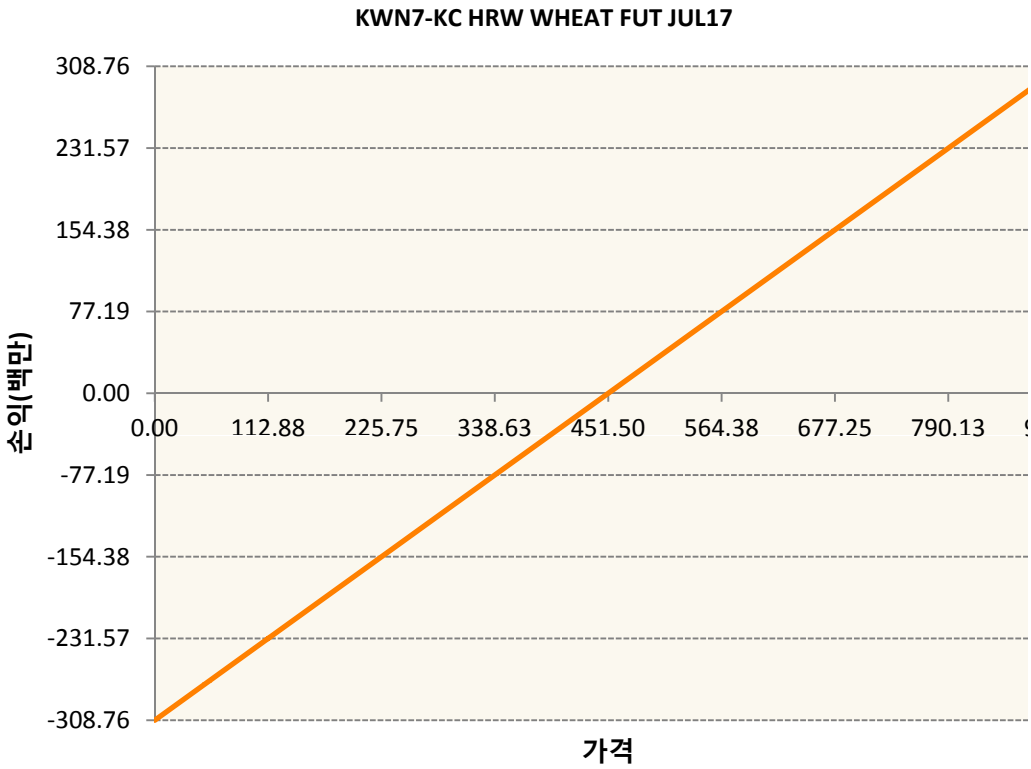

-1,159.96
-1,739.93
-2,319.91
가격

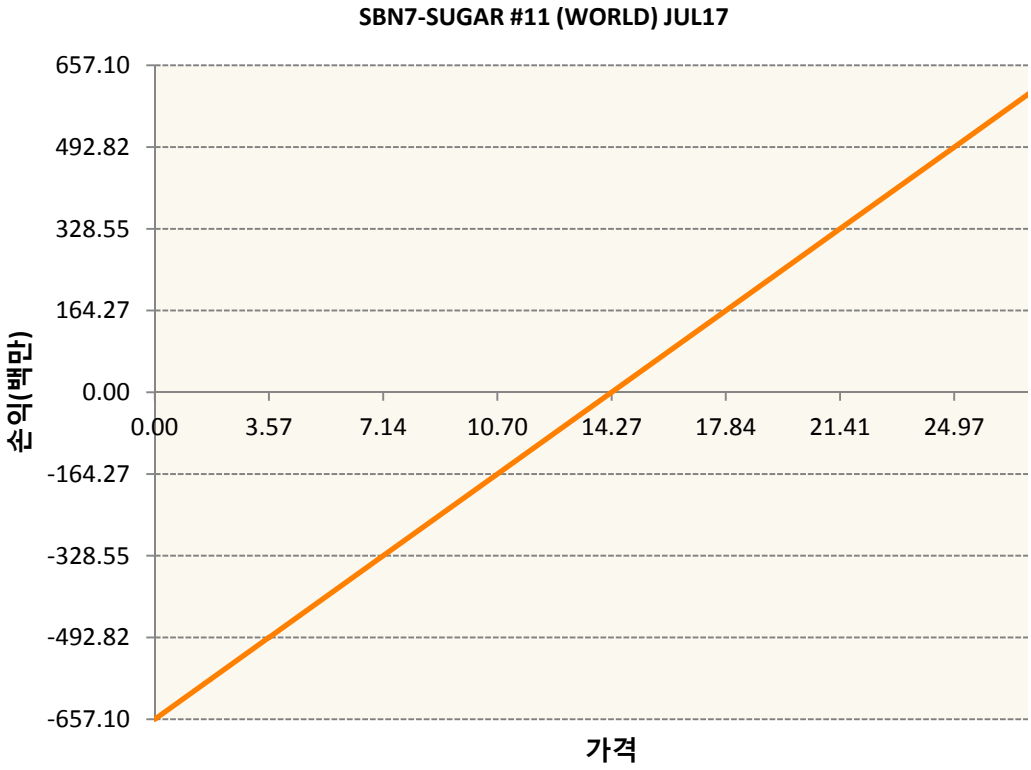

CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
388.34
291.26
194.17
97.09
0.00
-97.09
-194.17
-291.26
-388.34
0.00
18.92
37.85
56.77
75.69
94.61
113.54
132.46
순익(백만)
가격

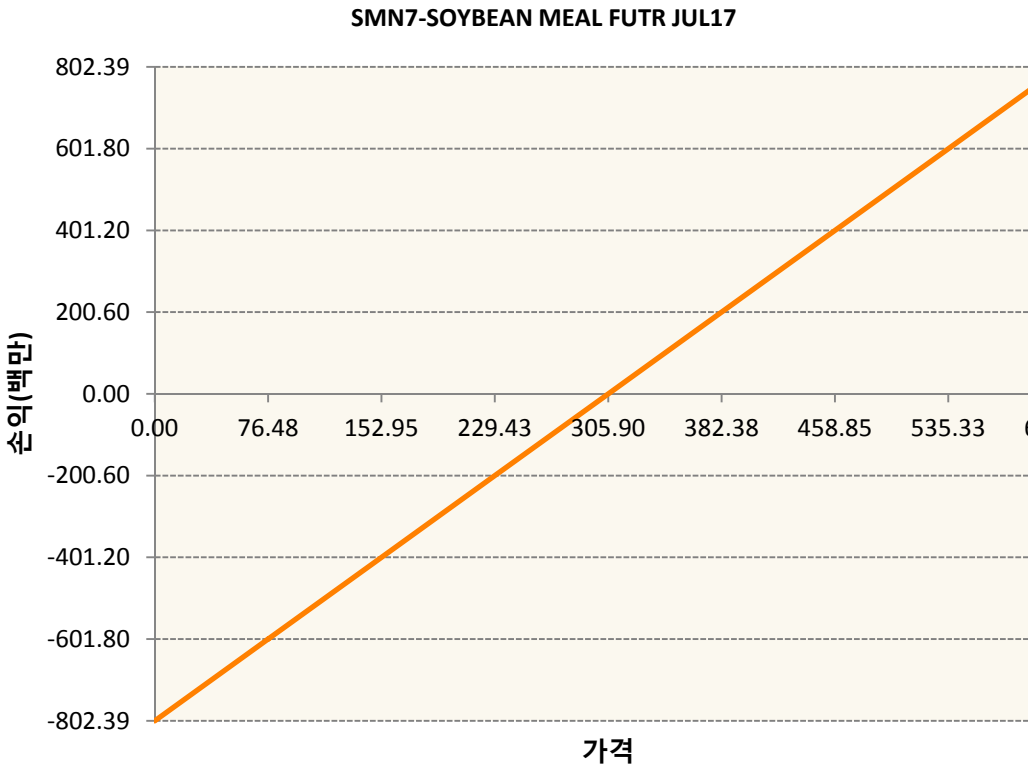

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
595.87
446.90
297.94
148.97
0.00
-148.97
-297.94
-446.90
-595.87
0.00
31.64
63.28
94.91
126.55
158.19
189.83
221.46
순익(백만)

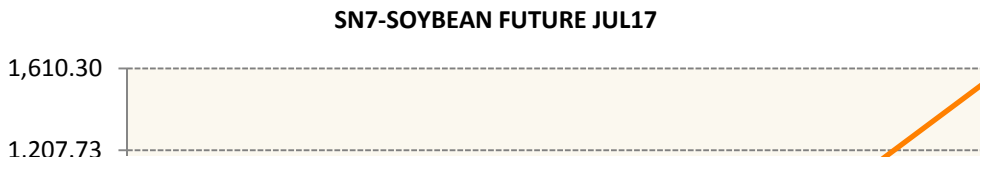
가격

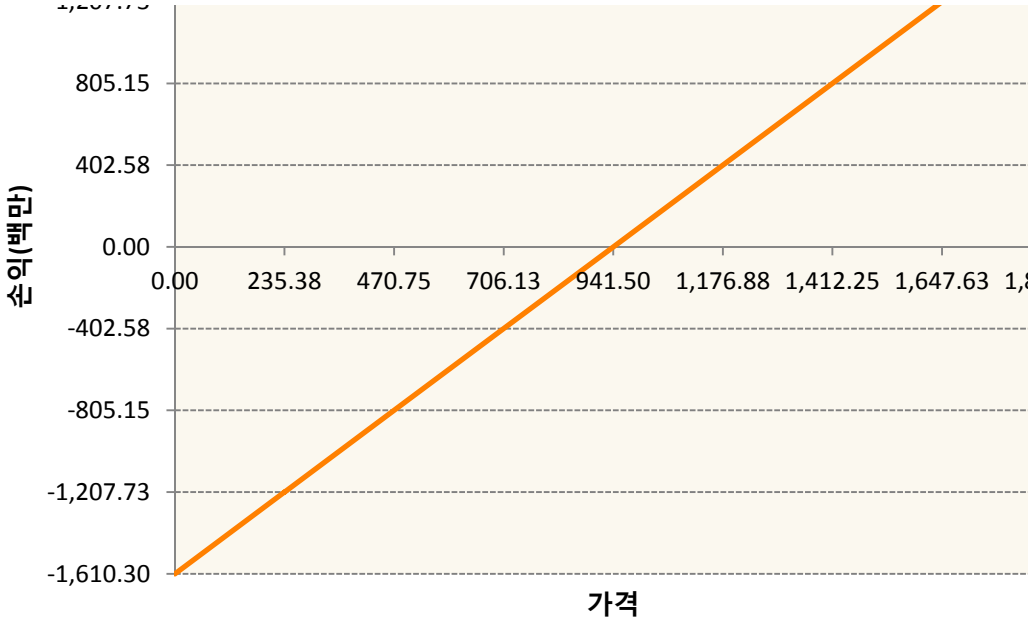

KR4175M60005-2017-06 달러선물
394.63
295.97
197.31
98.66
0.00
-98.66
-197.31
-295.97
-394.63
0.00
281.88
563.75
845.63
1,127.50
1,409.38
1,691.25
1,973.13
손익(백만)
가격

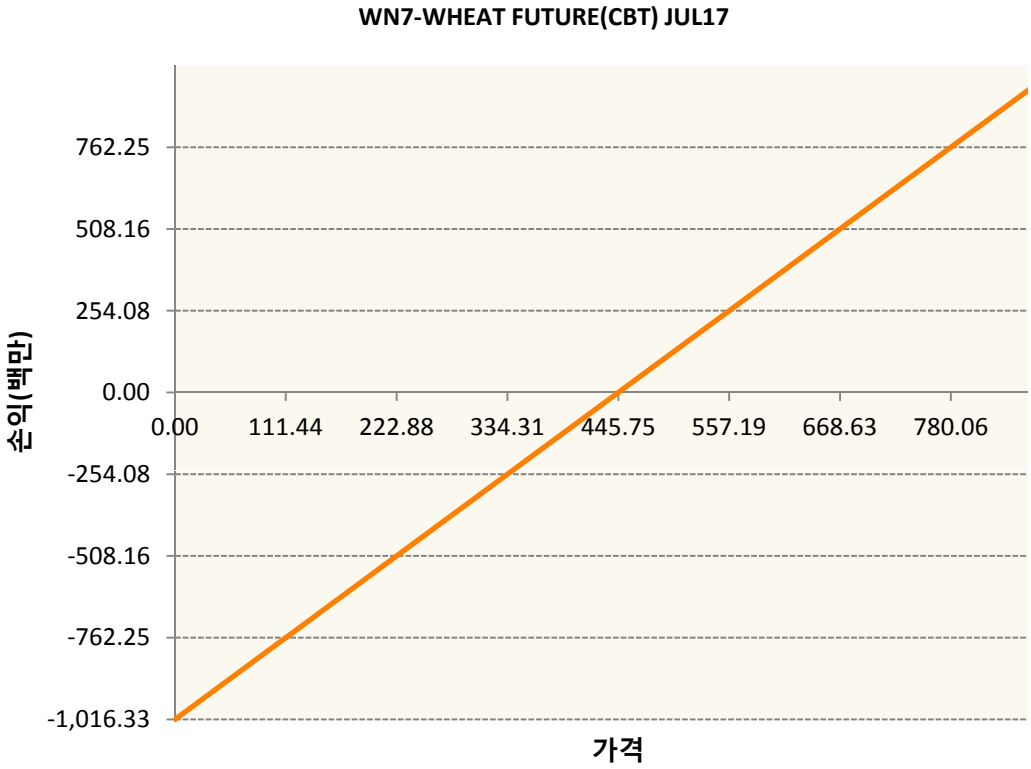

KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17
308.76
231.57
154.38
77.19
0.00
-77.19
-154.38
-231.57
-308.76
0.00
112.88
225.75
338.63
451.50
564.38
677.25
790.13
손익(백만)
가격


SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
657.10
492.82
328.55
164.27
0.00
-164.27
-328.55
-492.82
-657.10
0.00
3.57
7.14
10.70
14.27
17.84
21.41
24.97
손익(백만)
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
802.39
601.80
401.20
200.60
0.00
-200.60
-401.20
-601.80
-802.39
0.00
76.48
152.95
229.43
305.90
382.38
458.85
535.33
손익(백만)
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,610.30
1,207.73





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	58
CN7	CORN FUTURE JUL17	186
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	31
KCN7	COFFEE 'C' FUTURE JUL17	48
KR4175M60(	2017-06 달러선물	32

KWN7	KC HRW WHEAT FUT JUL17	25
SBN7	SUGAR #11 (WORLD) JUL17	53
SMN7	SOYBEAN MEAL FUTR JUL17	64
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	129
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	81

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

763