공시일	2017-06-14
기준일	2017-06-13

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	2017-06-14
기준일	2017-06-13

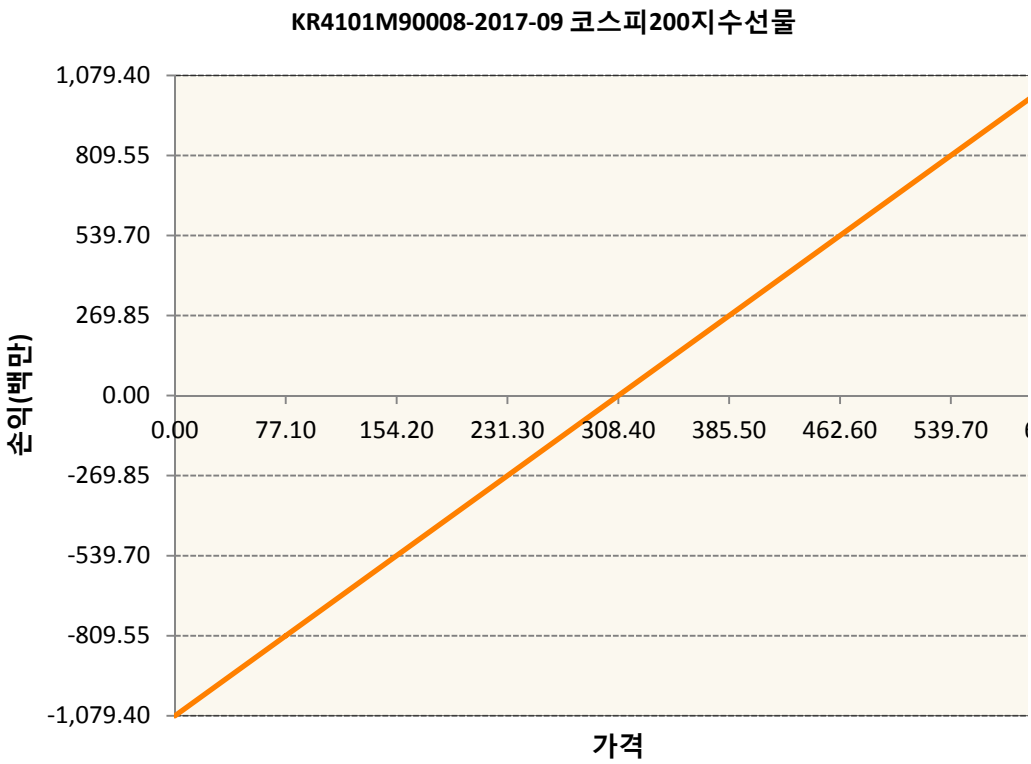
스마트인덱스모

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	1,079	0	1,079	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	2017-06-14
기준일	2017-06-13

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	997

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

514

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-14
기준일	2017-06-13

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)

340

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-14
기준일	2017-06-13

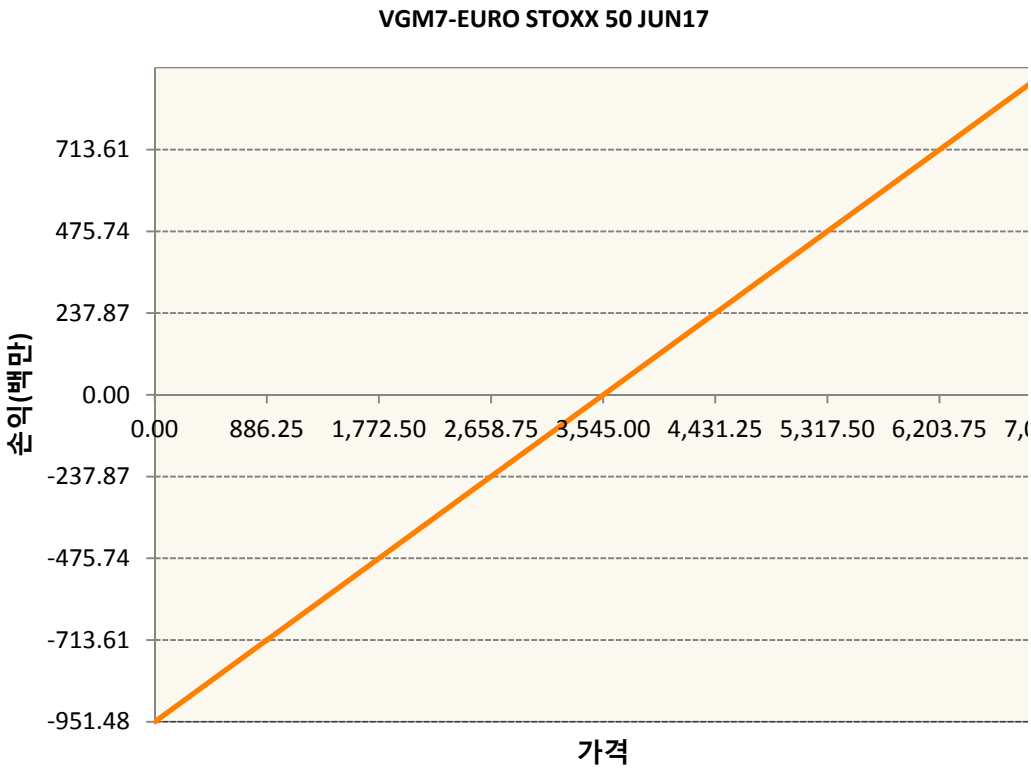
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2017-06-14
기준일	2017-06-13

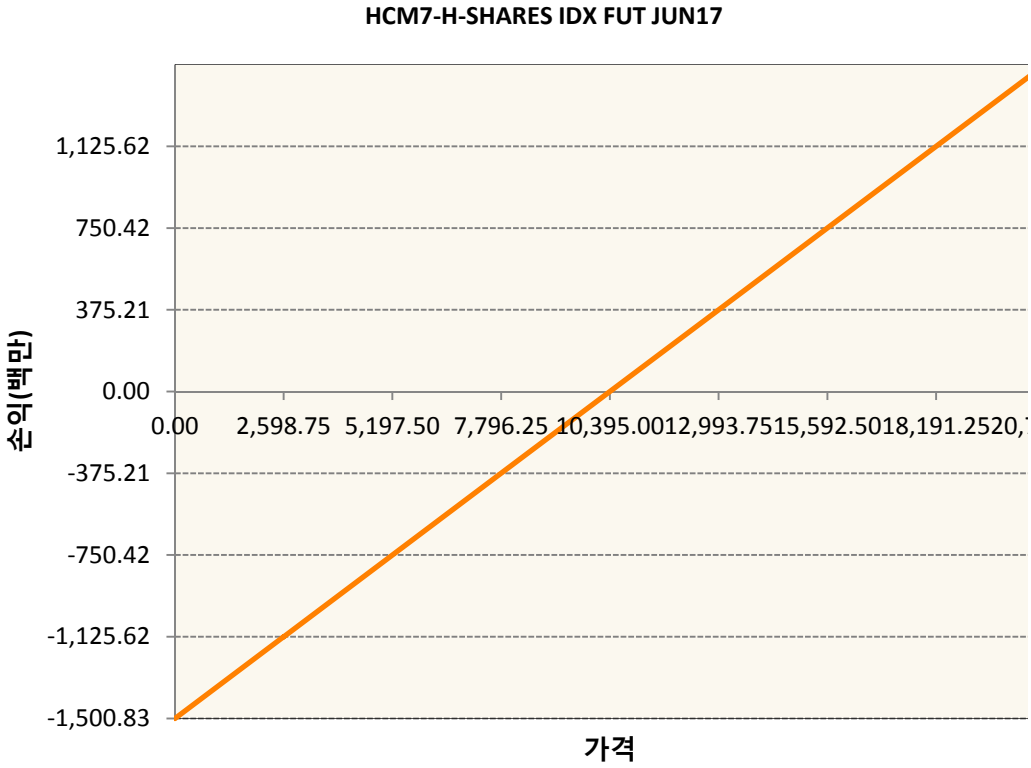
차이나인덱스모(주식-파생형)

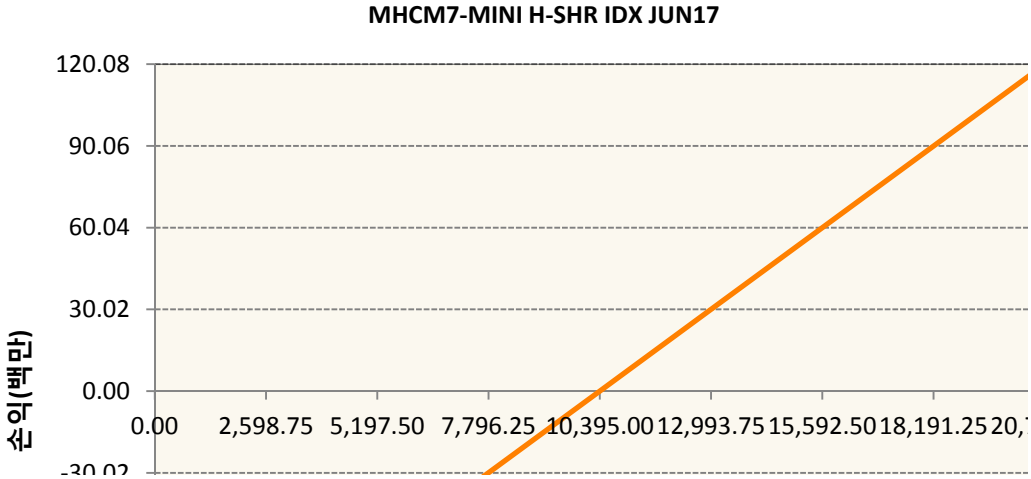
1. 계약금액

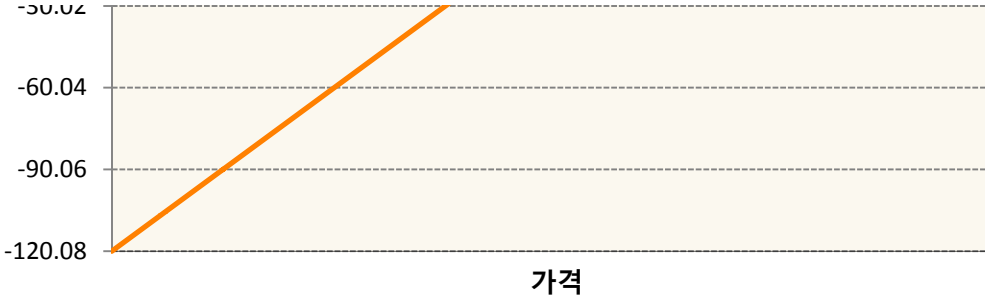
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계			1,501	0	1,501	
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	2017-06-14
기준일	2017-06-13

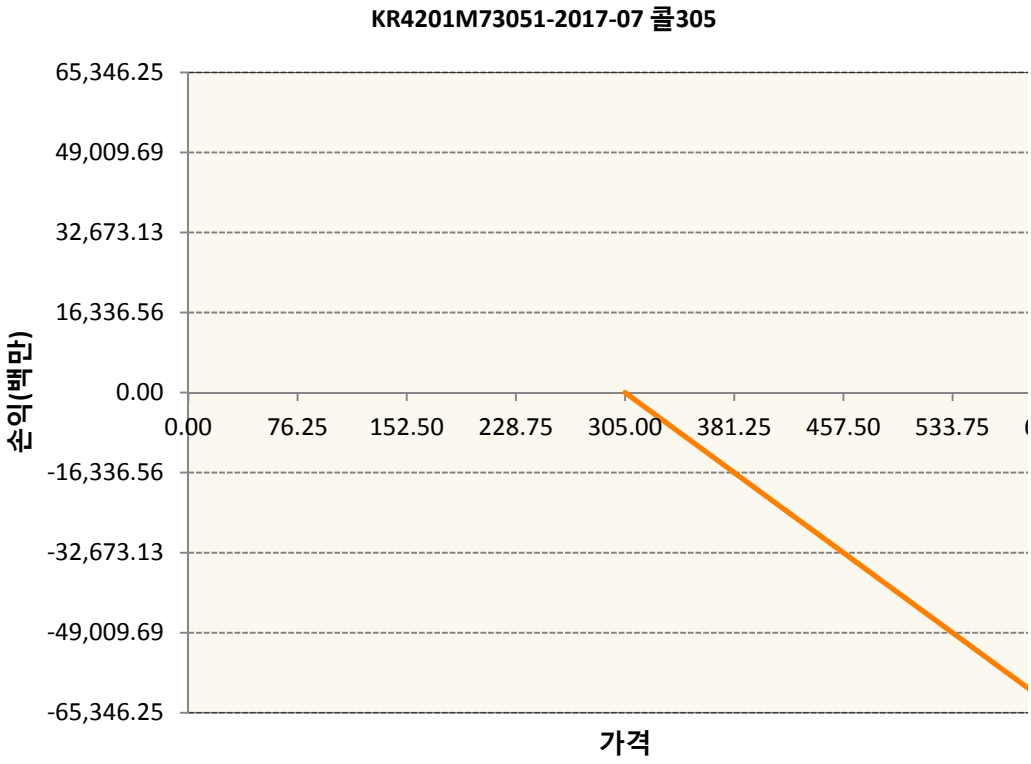
커버드콜모(주식혼합-파생형)

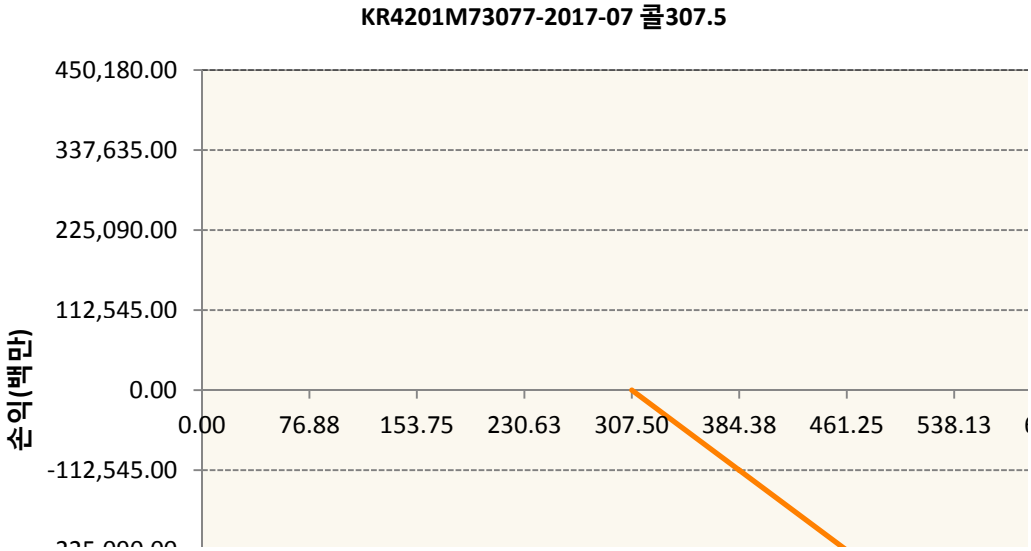
1. 계약금액

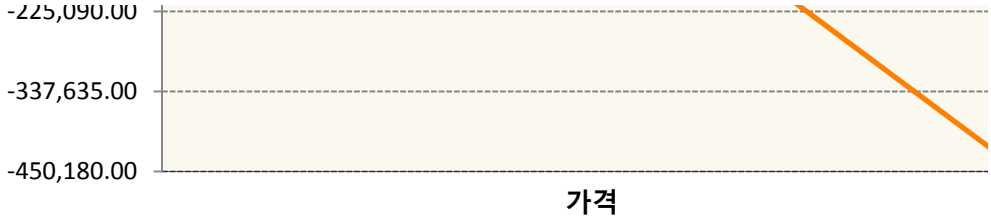
(단위:백만원)

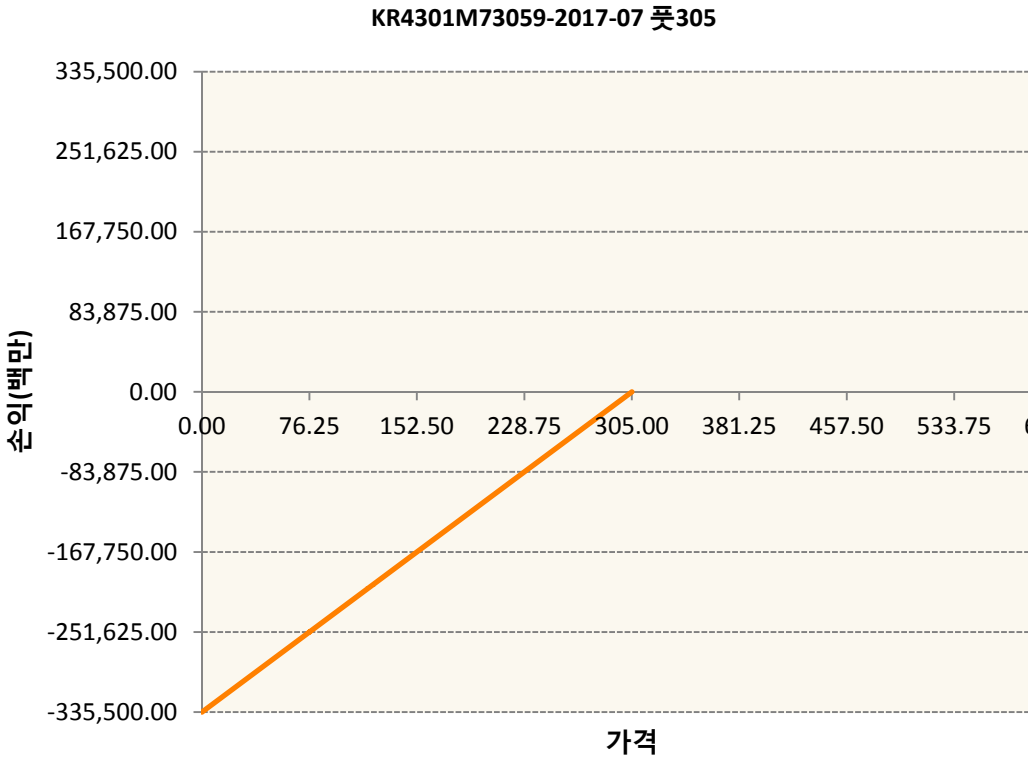
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	31,129	-31,129	장내
누계	유가증권	옵션	0	851,026	-851,026	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M73(2017-07 콜305							4,708
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,223	1,222	1,219	1,214	1,207	1,197	1,184
-5.33%	1,202	1,186	1,165	1,139	1,109	1,076	1,038
-2.67%	992	935	875	814	751	687	622
0%	204	137	69	0	-69	-139	-209
2.67%	-1,228	-1,256	-1,290	-1,328	-1,370	-1,416	-1,465
5.33%	-2,935	-2,940	-2,947	-2,959	-2,973	-2,992	-3,015
8.00%	-4,689	-4,690	-4,690	-4,692	-4,695	-4,700	-4,708
KR4201M73(2017-07 콜307.5							30,653
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,308	6,304	6,295	6,278	6,249	6,207	6,148

-5.33%	6,247	6,186	6,096	5,978	5,832	5,658	5,459
-2.67%	5,433	5,128	4,796	4,441	4,069	3,682	3,283
0%	1,484	989	495	0	-495	-990	-1,484
2.67%	-7,159	-7,443	-7,758	-8,099	-8,460	-8,839	-9,233
5.33%	-18,491	-18,554	-18,646	-18,769	-18,921	-19,102	-19,309
8.00%	-30,440	-30,446	-30,459	-30,483	-30,522	-30,578	-30,653
	KR4301M73(	2017-07 풋305					20,990

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20,792	-20,799	-20,813	-20,838	-20,874	-20,924	-20,990
-5.33%	-11,877	-11,959	-12,067	-12,198	-12,352	-12,525	-12,717
-2.67%	-3,929	-4,223	-4,529	-4,844	-5,167	-5,495	-5,828
0%	1,049	704	353	0	-356	-714	-1,074
2.67%	2,720	2,575	2,402	2,205	1,988	1,753	1,503
5.33%	2,979	2,955	2,915	2,858	2,781	2,685	2,569
8.00%	2,996	2,994	2,990	2,981	2,964	2,939	2,902

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

62,929

공시일	2017-06-14
기준일	2017-06-13

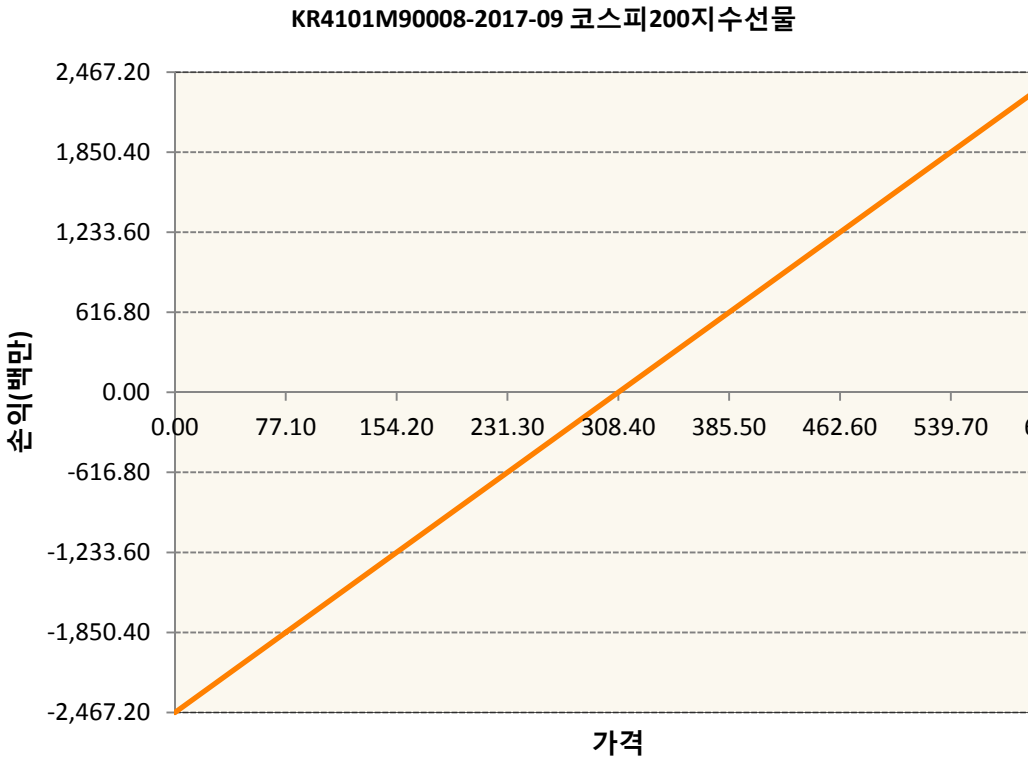
커버드콜목표전환형증권투자신탁

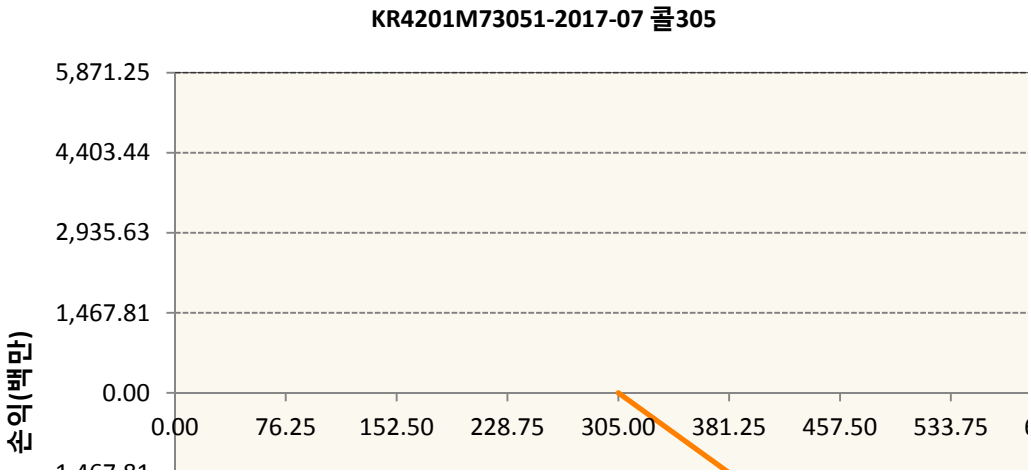
1. 계약금액

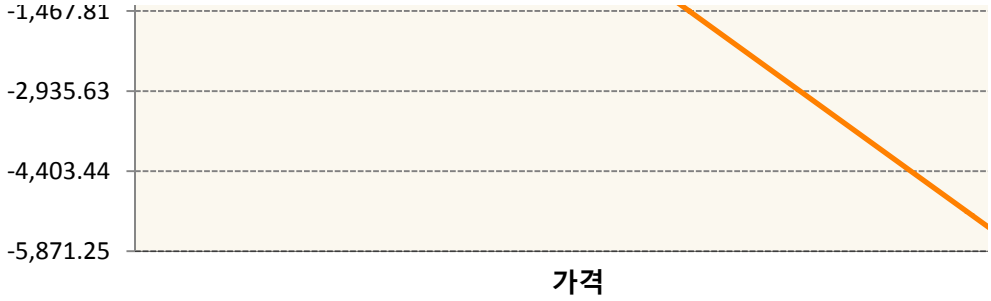
(단위:백만원)

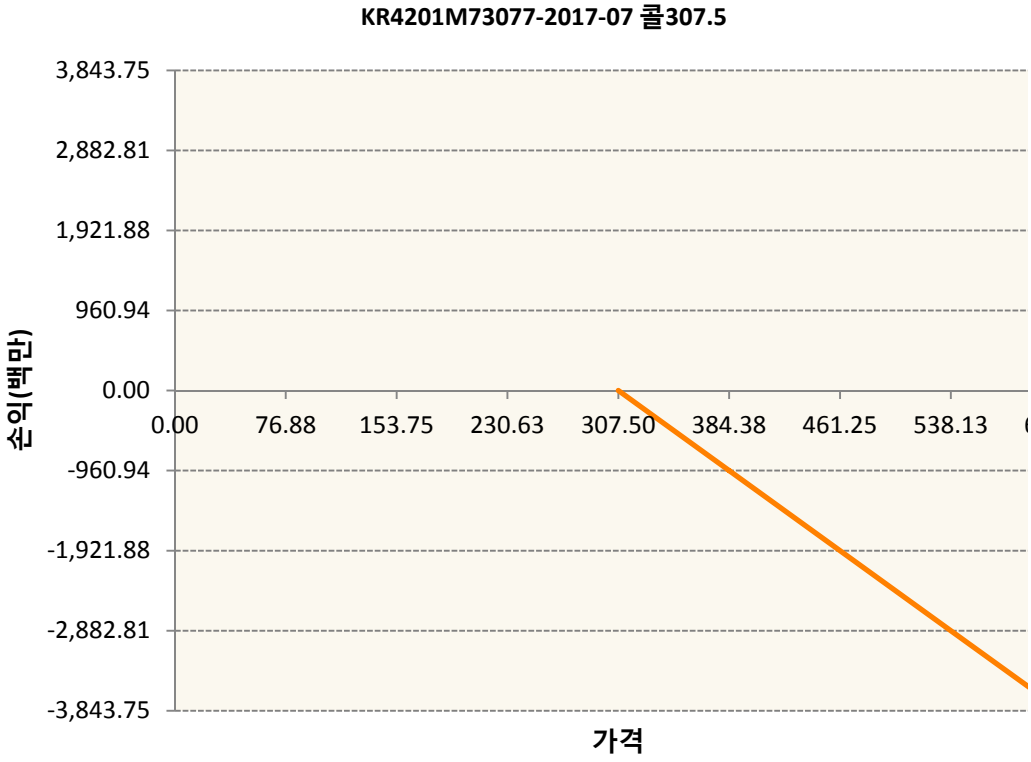
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,467	0	2,467	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,253	-11,253	장내

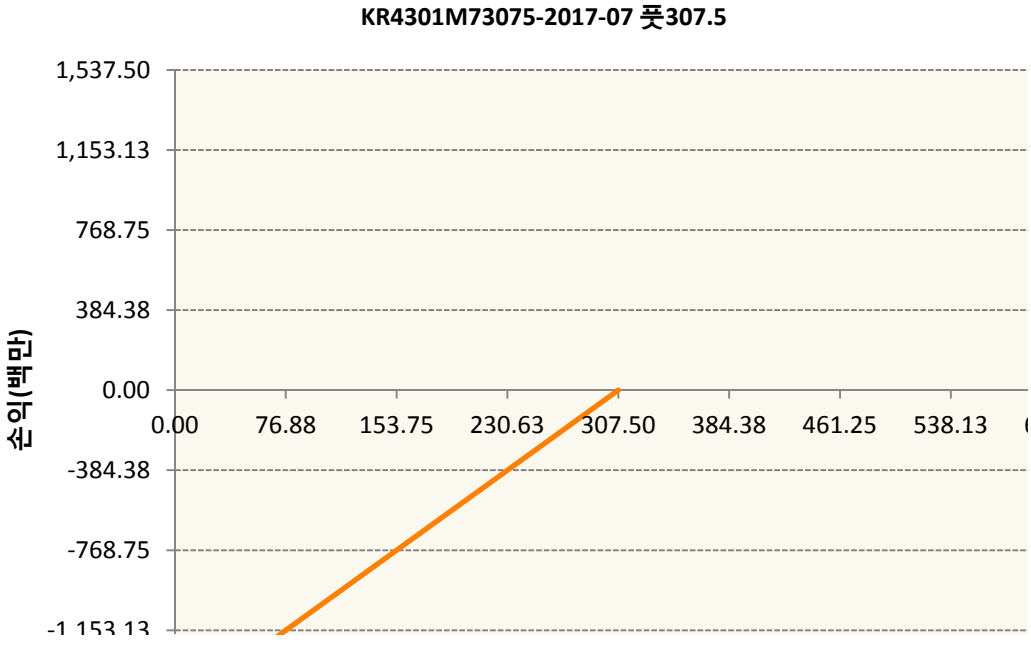
2. 만기시점의 손익구조

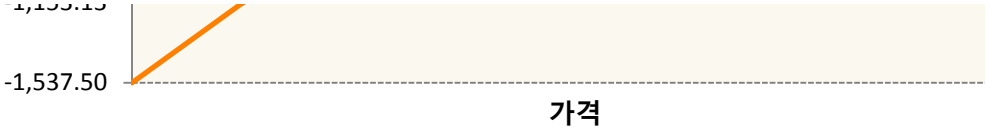





-1,467.81
-2,935.63
-4,403.44
-5,871.25
가격


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							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
KR4201M73(2017-07 콜305							423
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	110	110	110	109	108	108	106
-5.33%	108	107	105	102	100	97	93
-2.67%	89	84	79	73	67	62	56
0%	18	12	6	0	-6	-12	-19
2.67%	-110	-113	-116	-119	-123	-127	-132
5.33%	-264	-264	-265	-266	-267	-269	-271
8.00%	-421	-421	-421	-422	-422	-422	-423
KR4201M73(2017-07 콜307.5							262
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	54	54	54	54	53	53	52
-5.33%	53	53	52	51	50	48	47
-2.67%	46	44	41	38	35	31	28
0%	13	8	4	0	-4	-8	-13
2.67%	-61	-64	-66	-69	-72	-75	-79
5.33%	-158	-158	-159	-160	-162	-163	-165
8.00%	-260	-260	-260	-260	-261	-261	-262
KR4301M73(2017-07 풋307.5							102
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-102	-102	-102	-102	-102	-102	-102
-5.33%	-61	-61	-61	-62	-62	-63	-63
-2.67%	-22	-24	-25	-26	-27	-28	-30

0%	5	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	17	16	15	13	12	11	9
5.33%	19	19	18	18	17	17	16
8.00%	19	19	19	19	19	19	18

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

1,037

공시일	2017-06-14
기준일	2017-06-13

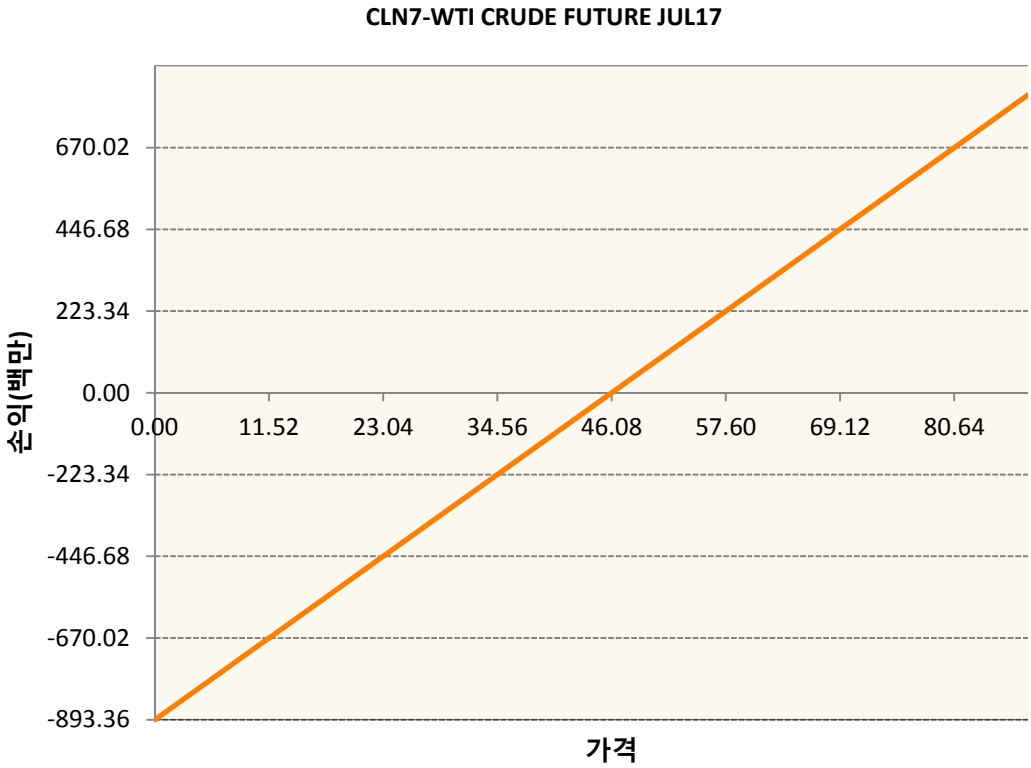
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

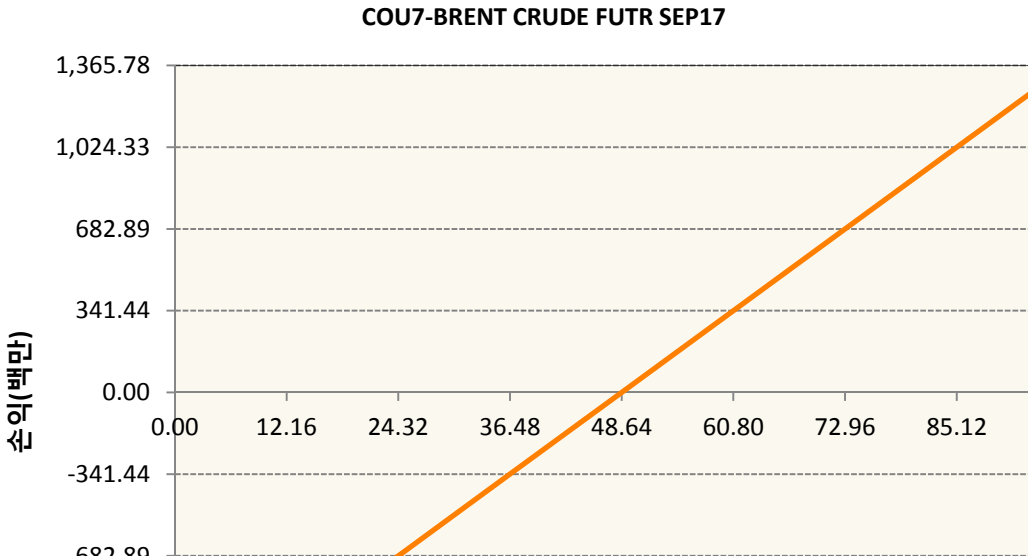
1. 계약금액

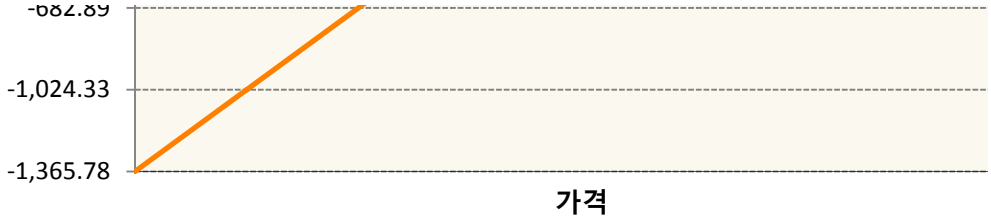
(단위:백만원)

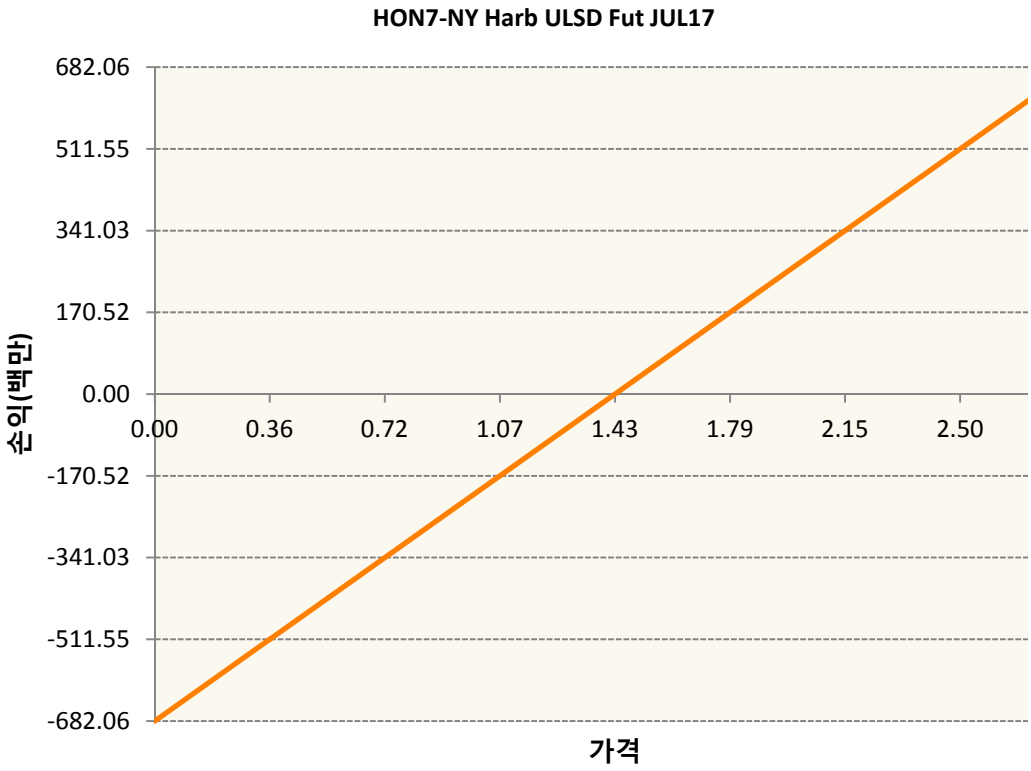
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,102	226	4,877	

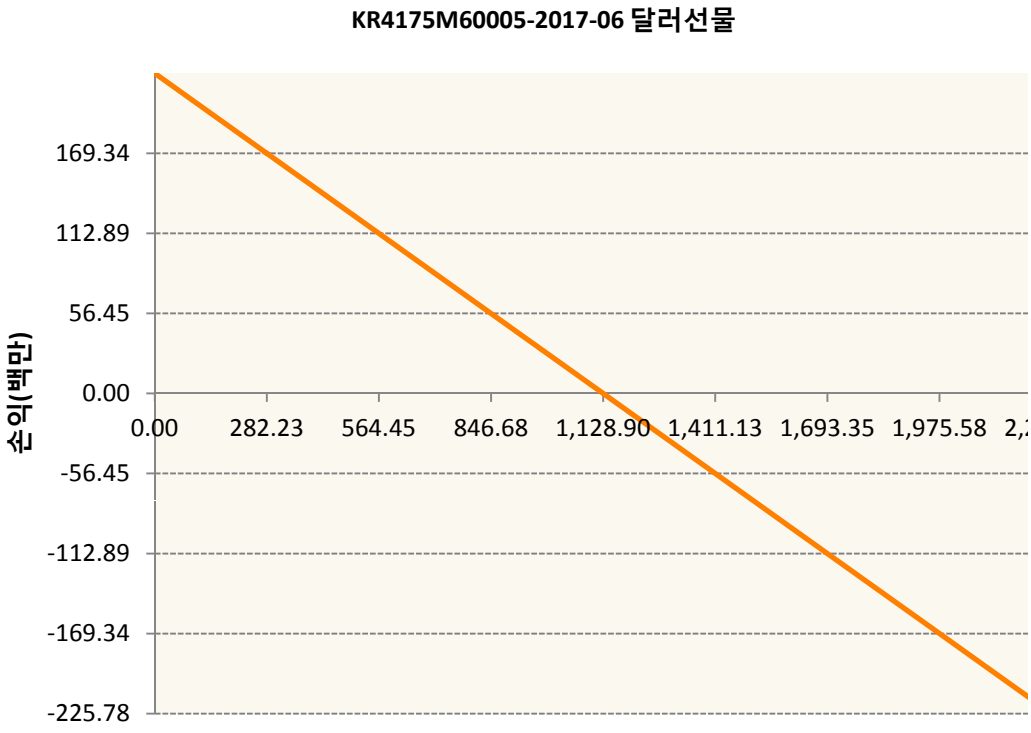
2. 만기시점의 손익구조



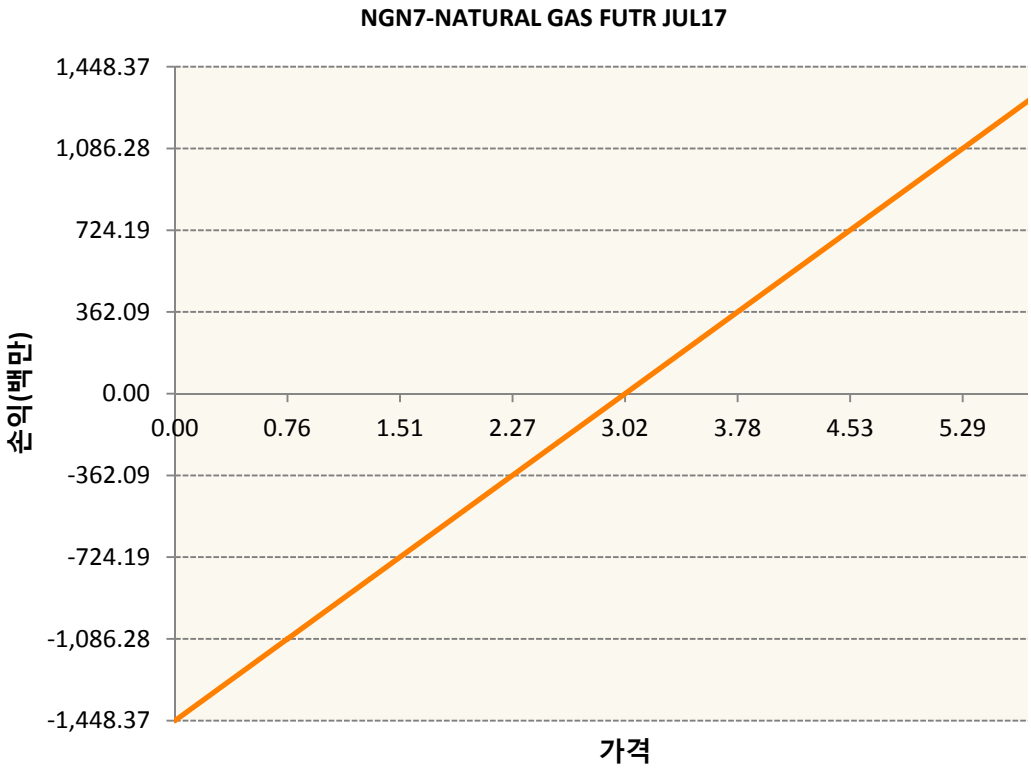


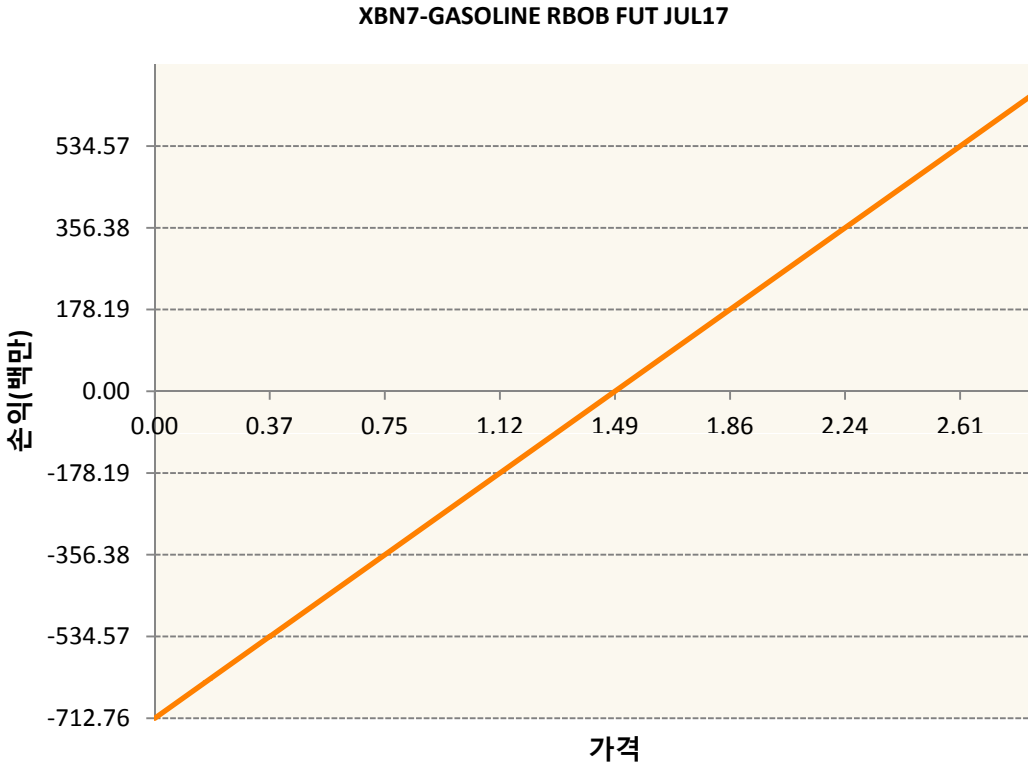

-682.89
-1,024.33
-1,365.78
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
682.06
511.55
341.03
170.52
0.00
-170.52
-341.03
-511.55
-682.06
0.00
0.36
0.72
1.07
1.43
1.79
2.15
2.50
손익(백만)
가격


KR4175M60005-2017-06 달러선물
169.34
112.89
56.45
0.00
-56.45
-112.89
-169.34
-225.78
0.00
282.23
564.45
846.68
1,128.90
1,411.13
1,693.35
1,975.58
손익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,448.37
1,086.28
724.19
362.09
0.00
-362.09
-724.19
-1,086.28
-1,448.37
0.00
0.76
1.51
2.27
3.02
3.78
4.53
5.29
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
534.57
356.38
178.19
0.00
-178.19
-356.38
-534.57
-712.76
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	55
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)

843

공시일	2017-06-14
기준일	2017-06-13

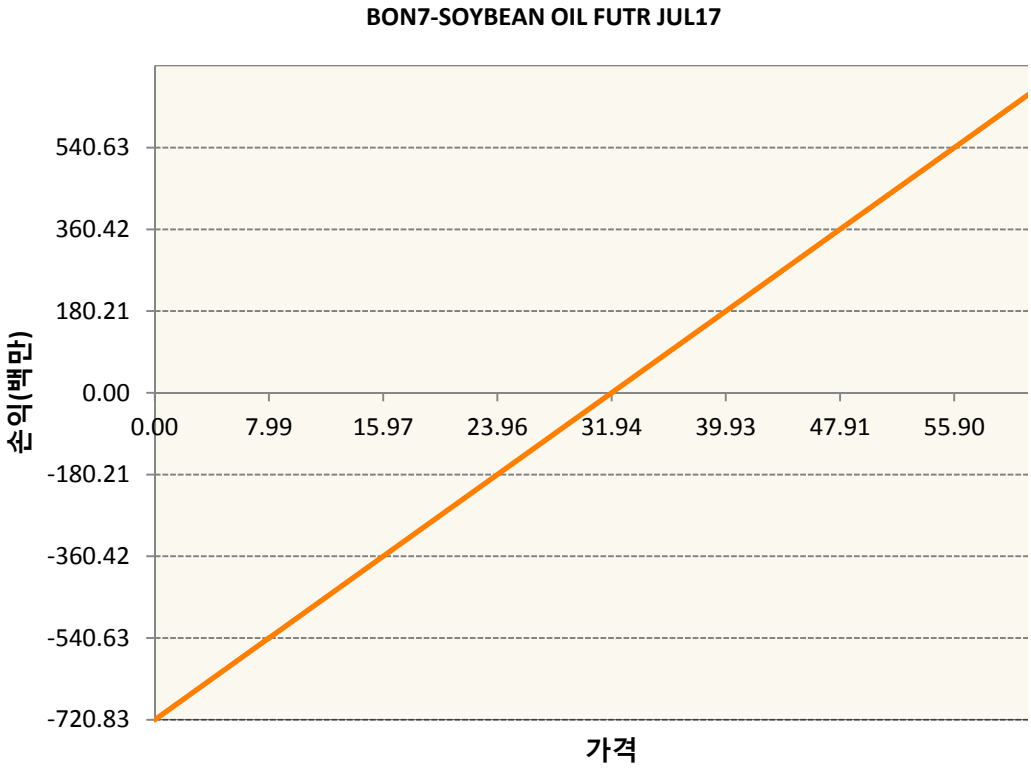
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

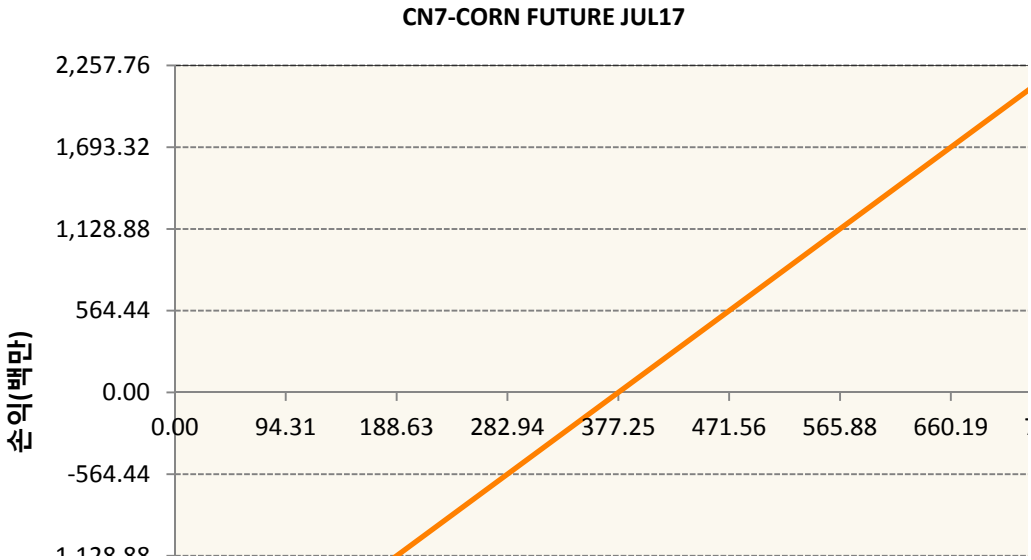
1. 계약금액

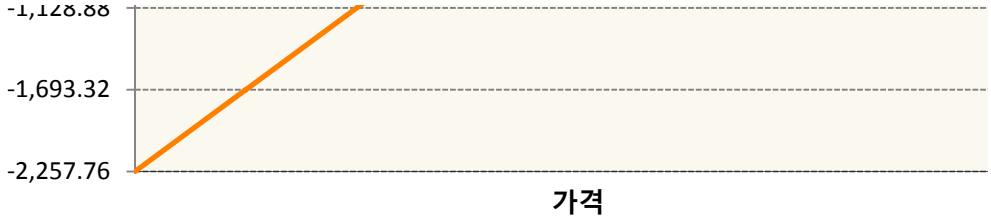
(단위:백만원)

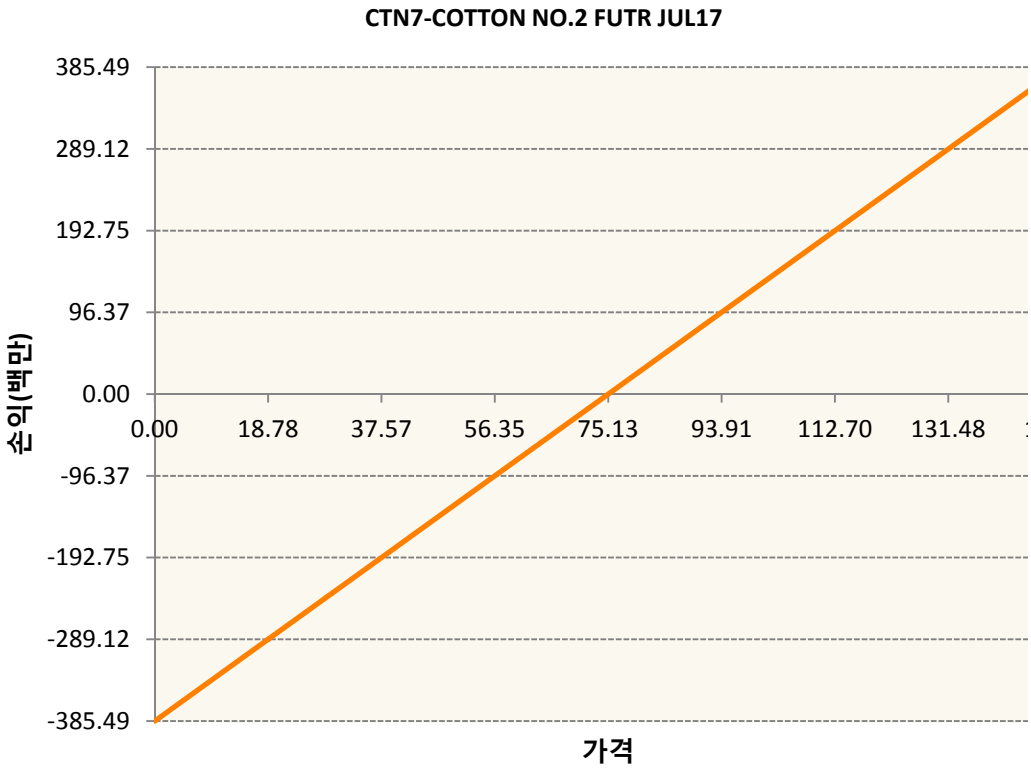
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,288	395	7,893	

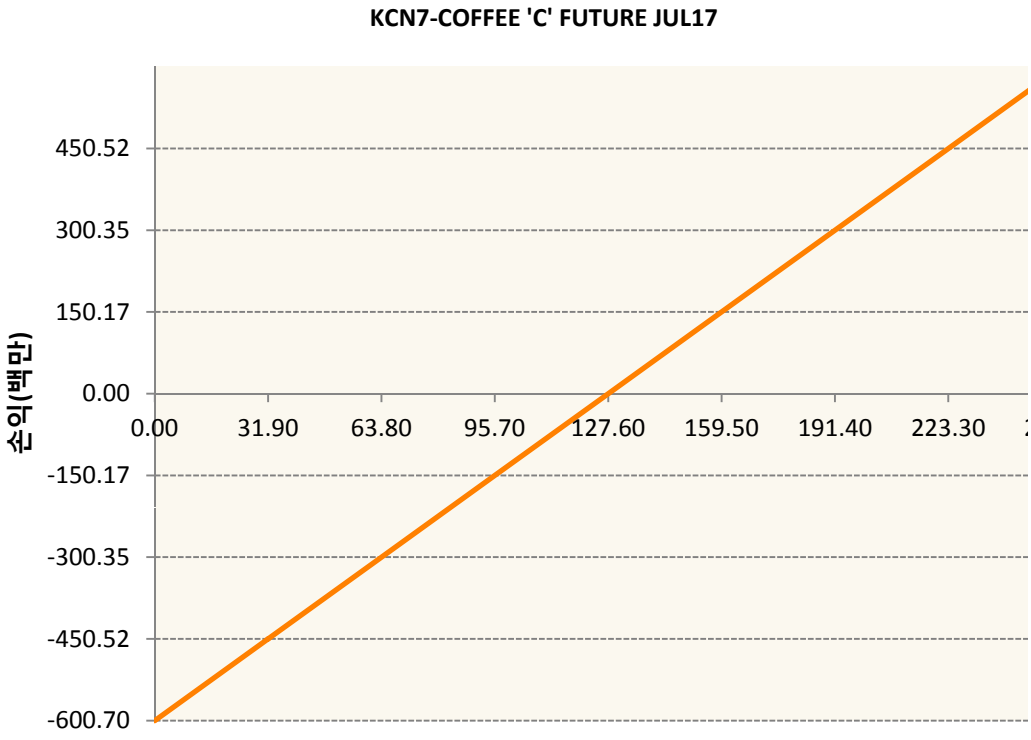
2. 만기시점의 손익구조





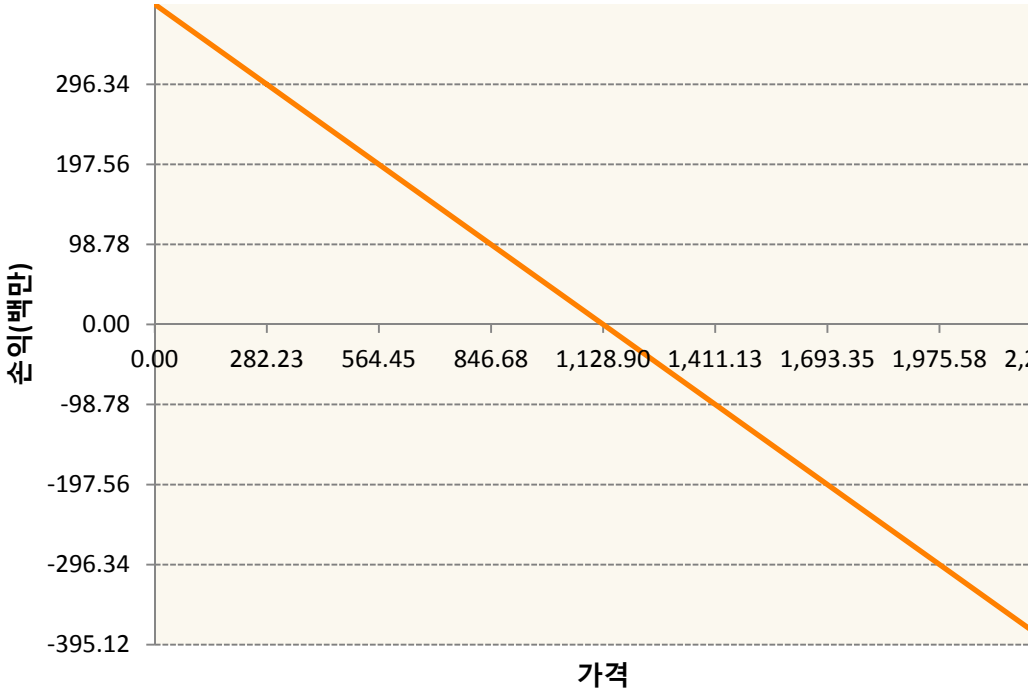

-1,693.32
-2,257.76
가격


CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
385.49
289.12
192.75
96.37
0.00
-96.37
-192.75
-289.12
-385.49
0.00
18.78
37.57
56.35
75.13
93.91
112.70
131.48
순익(백만)
가격

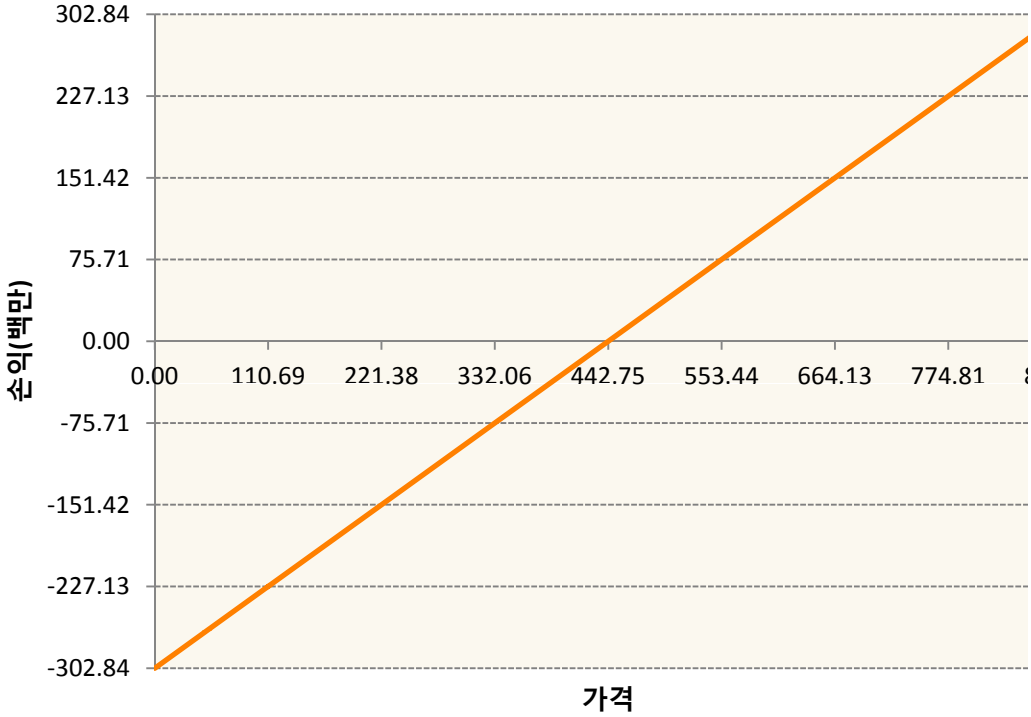

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
450.52
300.35
150.17
0.00
-150.17
-300.35
-450.52
-600.70
0.00
31.90
63.80
95.70
127.60
159.50
191.40
223.30
순익(백만)

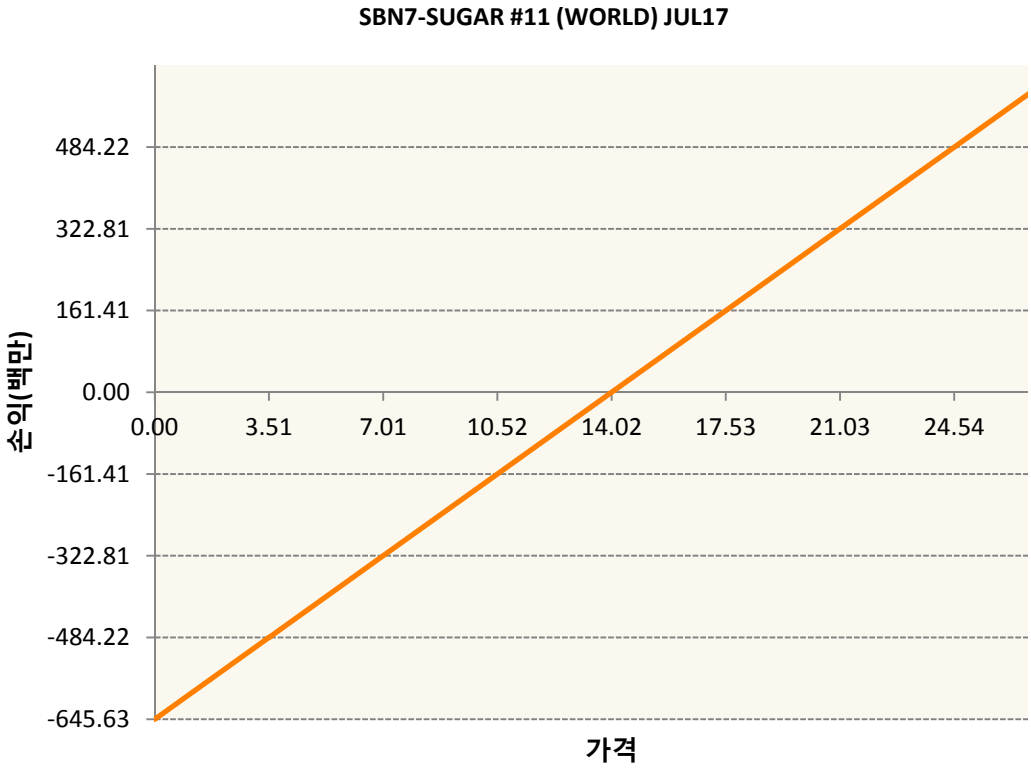
가격

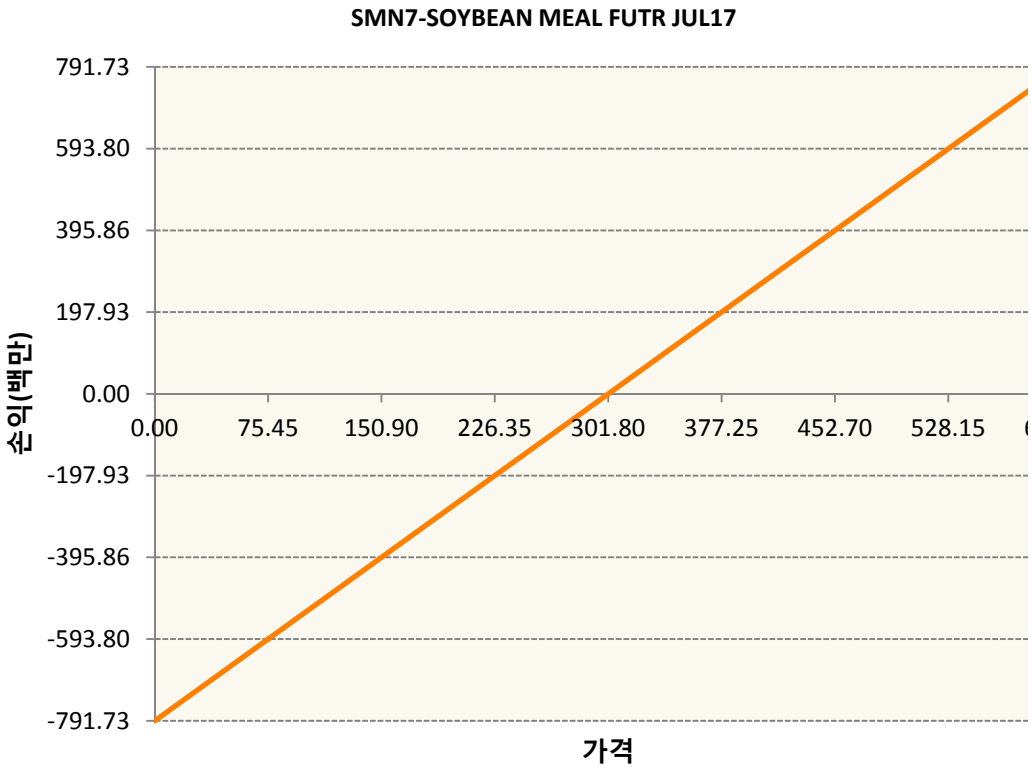
KR4175M60005-2017-06 달러선물

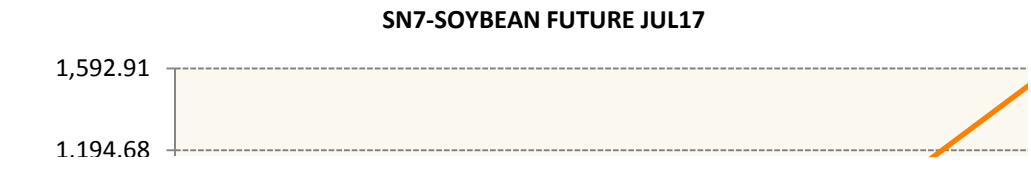


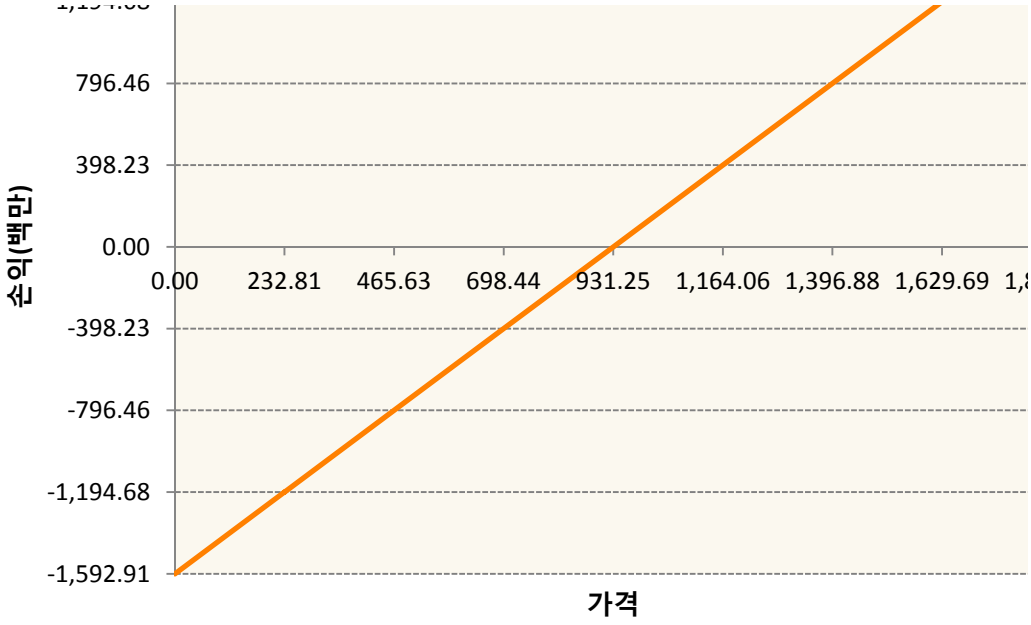
KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17



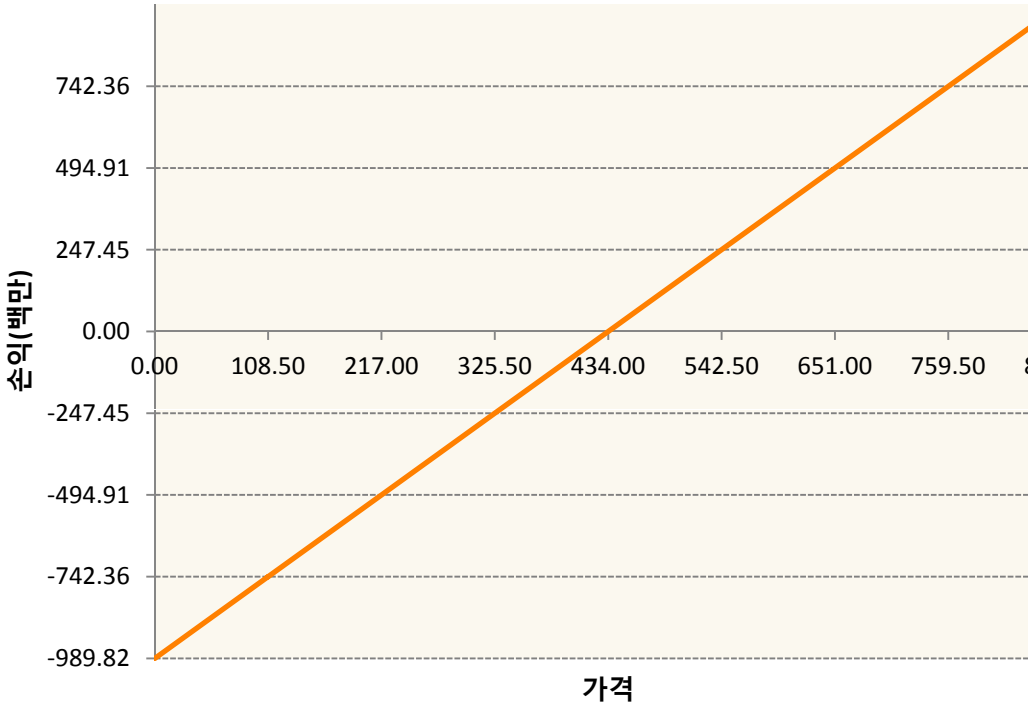

SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
484.22
322.81
161.41
0.00
-161.41
-322.81
-484.22
-645.63
손익(백만)
0.00
3.51
7.01
10.52
14.02
17.53
21.03
24.54
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
791.73
593.80
395.86
197.93
0.00
-197.93
-395.86
-593.80
-791.73
손익(백만)
0.00
75.45
150.90
226.35
301.80
377.25
452.70
528.15
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,592.91
1,194.68



WN7-WHEAT FUTURE(CBT) JUL17



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	58
CN7	CORN FUTURE JUL17	181
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	31
KCN7	COFFEE 'C' FUTURE JUL17	48
KR4175M60(	2017-06 달러선물	32

KWN7	KC HRW WHEAT FUT JUL17	24
SBN7	SUGAR #11 (WORLD) JUL17	52
SMN7	SOYBEAN MEAL FUTR JUL17	63
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	127
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	79

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

752