공시일	2017-06-15
기준일	2017-06-14

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	2017-06-15
기준일	2017-06-14

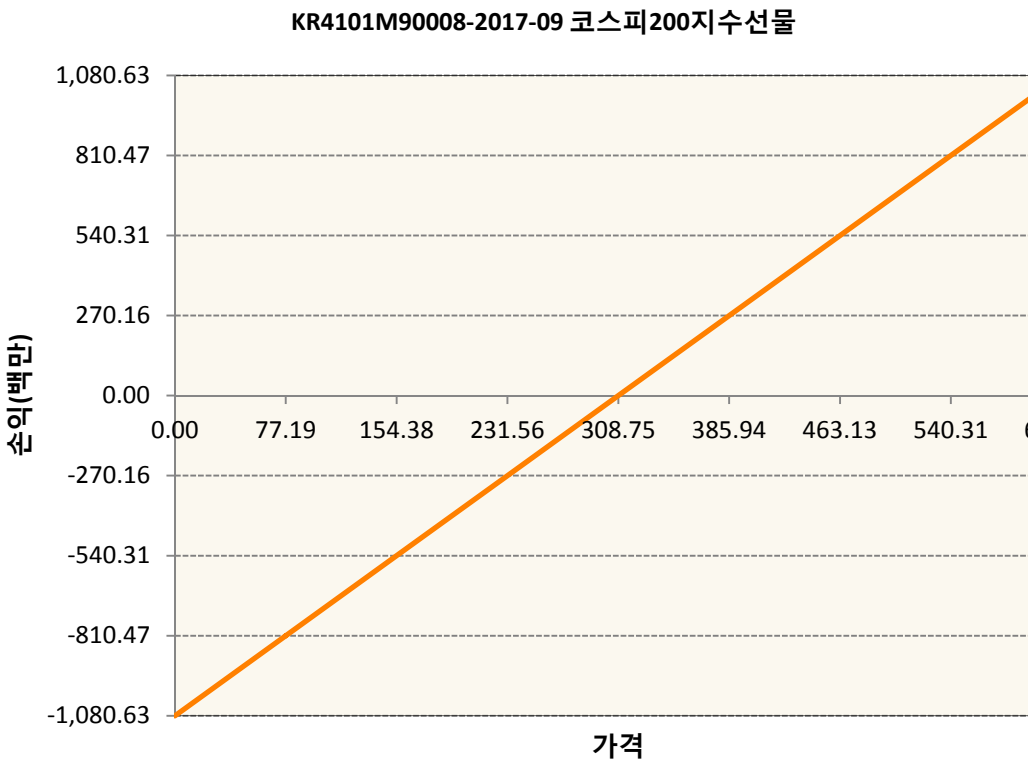
스마트인덱스모

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	1,081	0	1,081	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	2017-06-15
기준일	2017-06-14

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	1,003

* 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	2017-06-15
기준일	2017-06-14

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)

341

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-15
기준일	2017-06-14

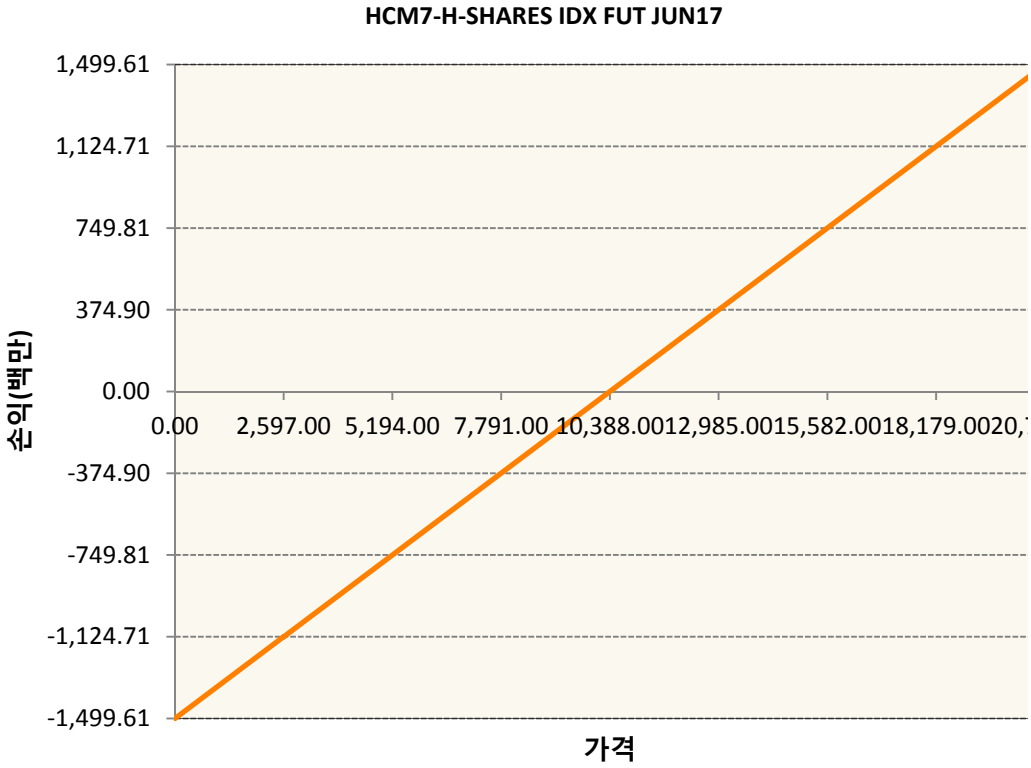
차이나인덱스모(주식-파생형)

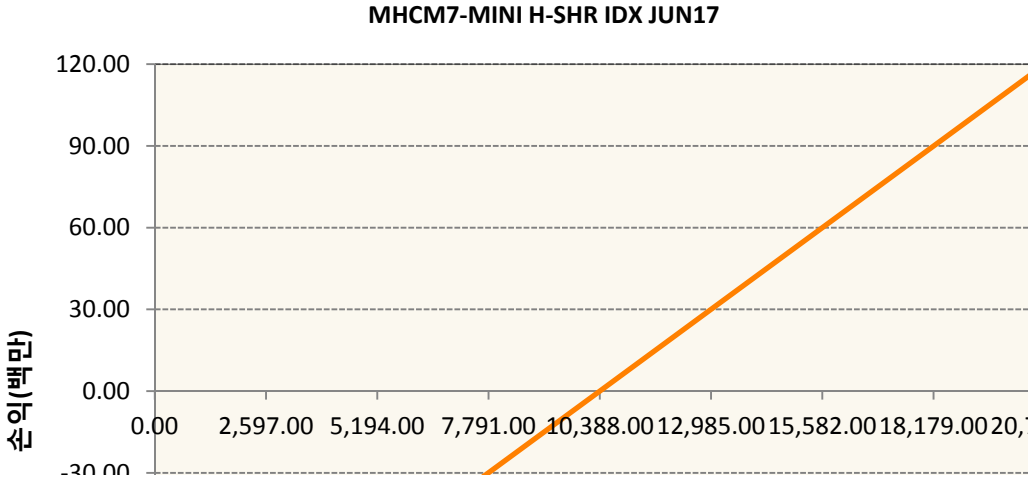
1. 계약금액

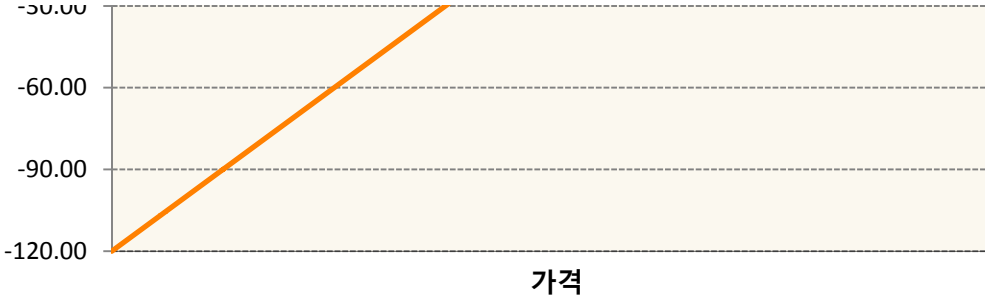
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계			1,500	0	1,500	
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	2017-06-15
기준일	2017-06-14

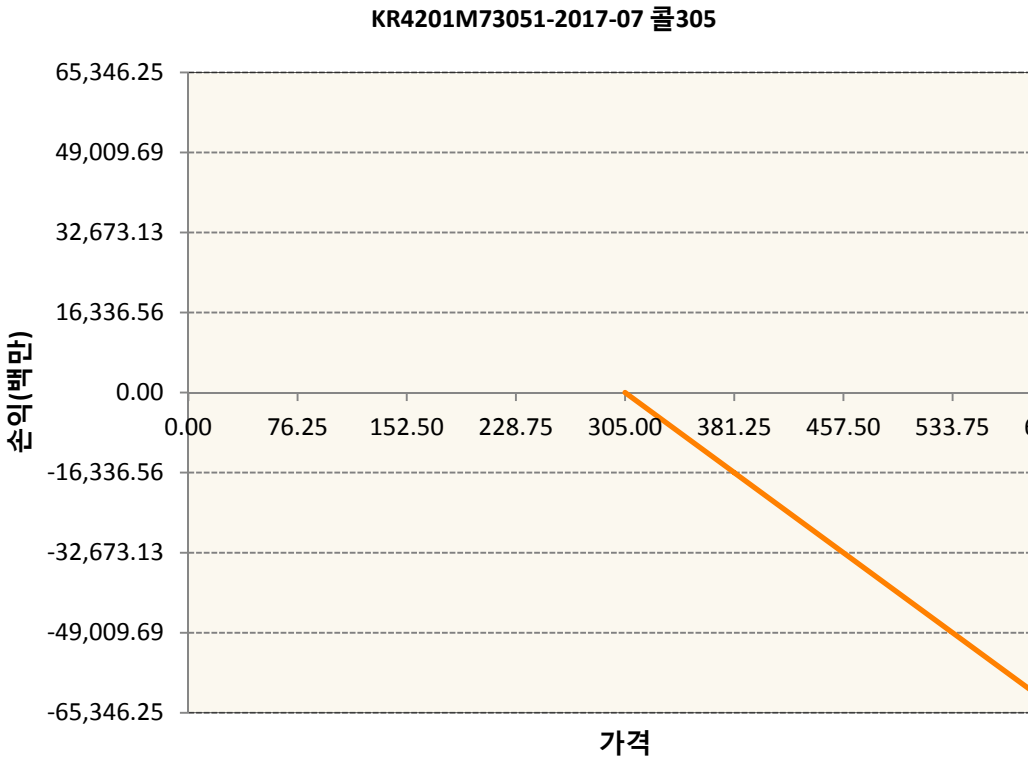
커버드콜모(주식혼합-파생형)

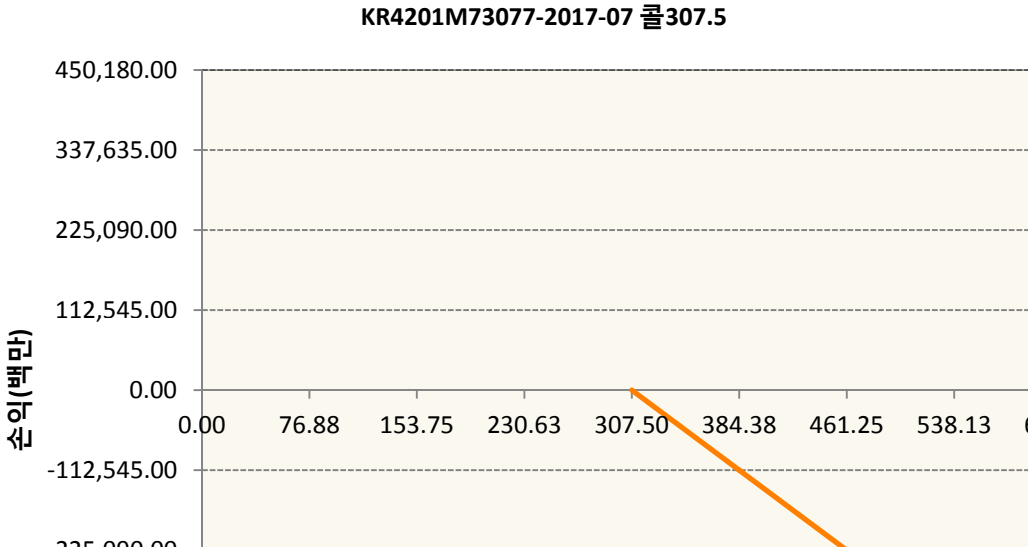
1. 계약금액

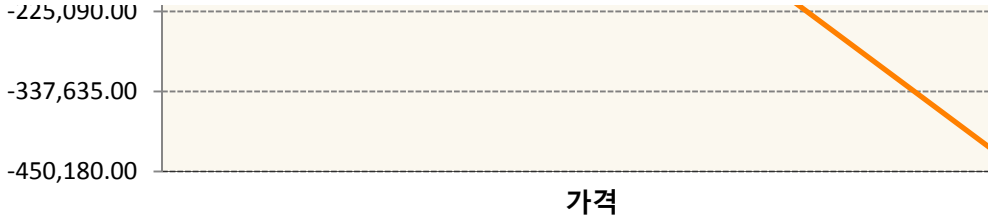
(단위:백만원)

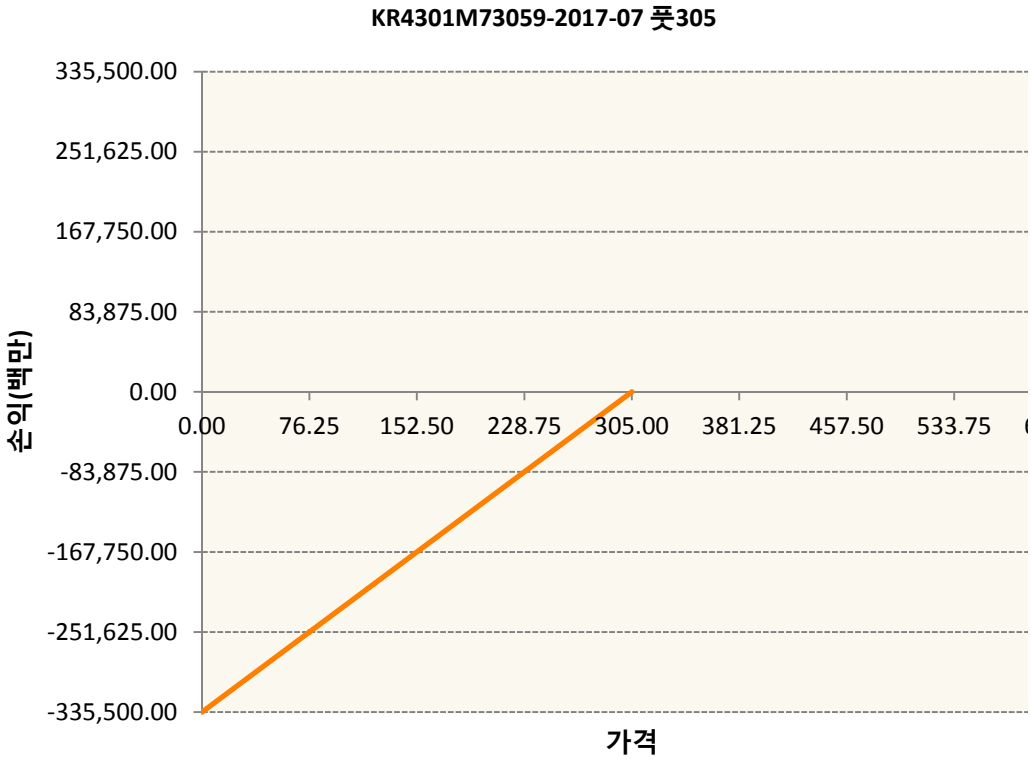
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	15,560	-15,560	장내
누계	유가증권	옵션	0	866,401	-866,401	장내

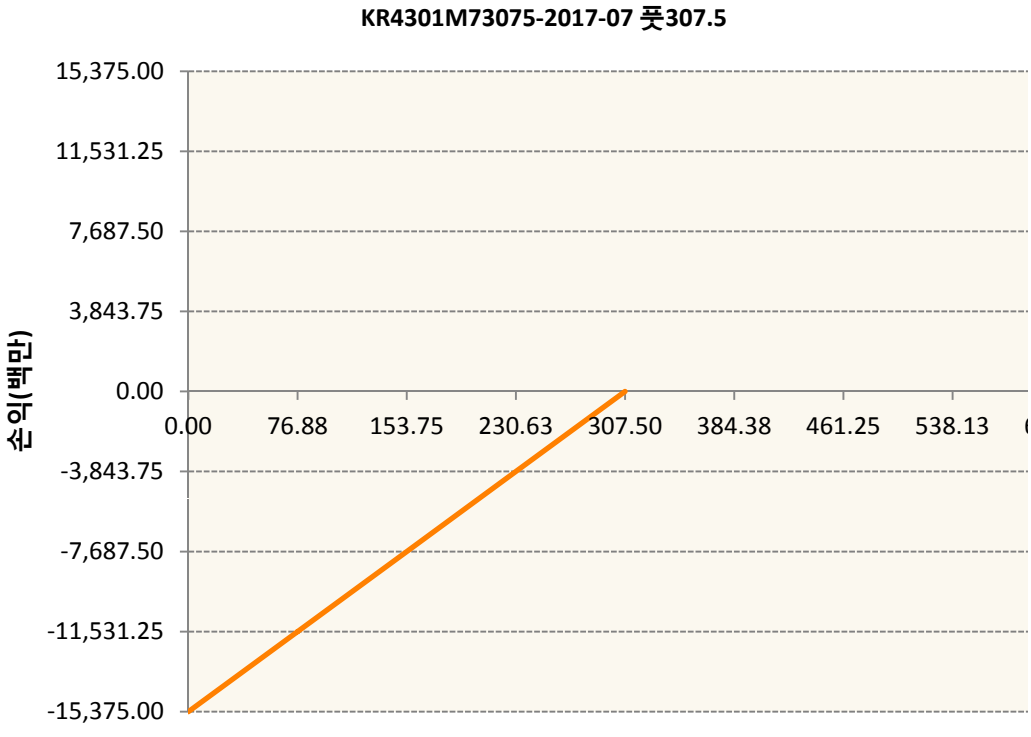
2. 만기시점의 손익구조






-225,090.00
-337,635.00
-450,180.00
가격


KR4301M73059-2017-07 풋305
335,500.00
251,625.00
167,750.00
83,875.00
0.00
-83,875.00
-167,750.00
-251,625.00
-335,500.00
0.00
76.25
152.50
228.75
305.00
381.25
457.50
533.75
손익(백만)
가격


KR4301M73075-2017-07 풋307.5
15,375.00
11,531.25
7,687.50
3,843.75
0.00
-3,843.75
-7,687.50
-11,531.25
-15,375.00
0.00
76.88
153.75
230.63
307.50
384.38
461.25
538.13
손익(백만)

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M73(2017-07 콜305							4,704
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,211	1,209	1,207	1,202	1,195	1,186	1,173
-5.33%	1,190	1,175	1,154	1,129	1,100	1,067	1,030
-2.67%	985	929	870	809	747	683	619
0%	204	137	69	0	-69	-139	-209
2.67%	-1,225	-1,254	-1,287	-1,326	-1,368	-1,413	-1,462
5.33%	-2,932	-2,937	-2,945	-2,956	-2,971	-2,989	-3,012
8.00%	-4,686	-4,687	-4,687	-4,689	-4,692	-4,697	-4,704
KR4201M73(2017-07 콜307.5							30,621
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,232	6,228	6,220	6,203	6,176	6,135	6,078
-5.33%	6,174	6,115	6,028	5,914	5,771	5,601	5,405
-2.67%	5,382	5,082	4,754	4,405	4,037	3,654	3,258
0%	1,478	985	493	0	-493	-986	-1,478
2.67%	-7,137	-7,421	-7,736	-8,077	-8,437	-8,815	-9,208
5.33%	-18,464	-18,527	-18,619	-18,740	-18,892	-19,072	-19,278
8.00%	-30,411	-30,417	-30,430	-30,454	-30,492	-30,547	-30,621
KR4301M73(2017-07 풋305							21,041
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20,851	-20,857	-20,871	-20,894	-20,929	-20,978	-21,041
-5.33%	-11,932	-12,012	-12,117	-12,246	-12,396	-12,566	-12,755
-2.67%	-3,962	-4,253	-4,556	-4,868	-5,188	-5,514	-5,844
0%	1,047	702	353	0	-355	-712	-1,071
2.67%	2,730	2,585	2,412	2,216	1,999	1,765	1,516
5.33%	2,989	2,965	2,926	2,869	2,793	2,697	2,582
8.00%	3,006	3,005	3,000	2,991	2,975	2,950	2,913
KR4301M73(2017-07 풋307.5							1,023
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,017	-1,018	-1,018	-1,018	-1,019	-1,021	-1,023
-5.33%	-609	-611	-614	-618	-623	-629	-636
-2.67%	-226	-237	-248	-260	-272	-285	-299
0%	50	34	17	0	-17	-34	-50
2.67%	166	157	146	134	122	109	96

5.33%	190	187	184	180	175	169	162
8.00%	192	191	191	190	189	187	184

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

64,164

공시일	2017-06-15
기준일	2017-06-14

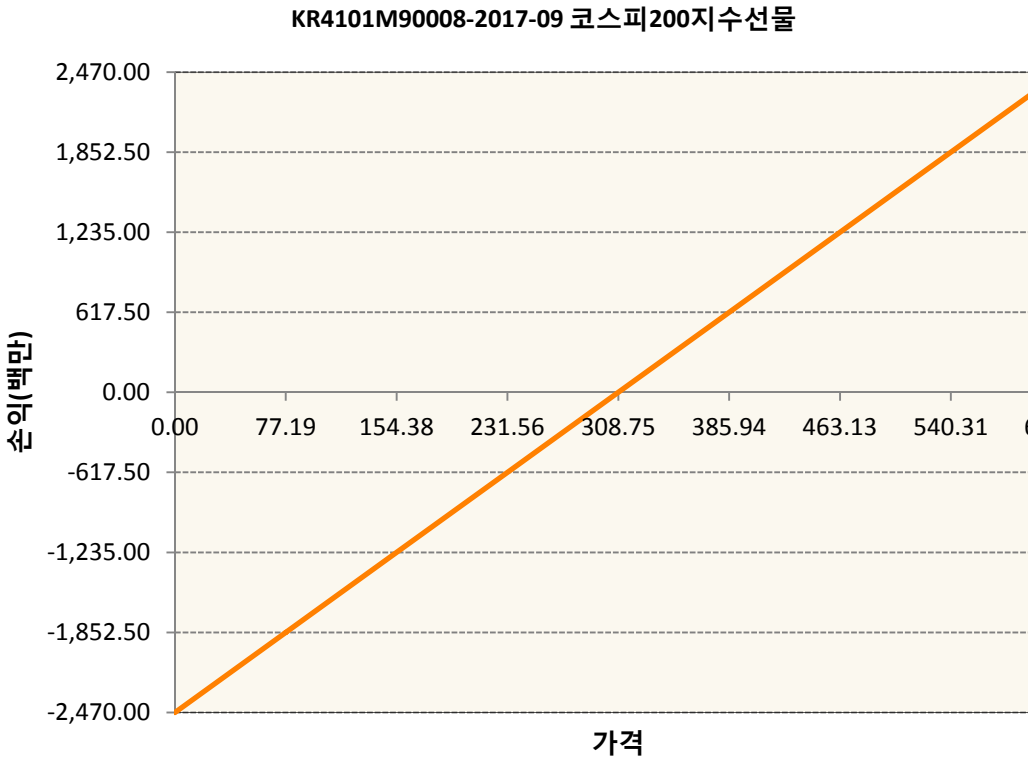
커버드콜목표전환형증권투자신탁

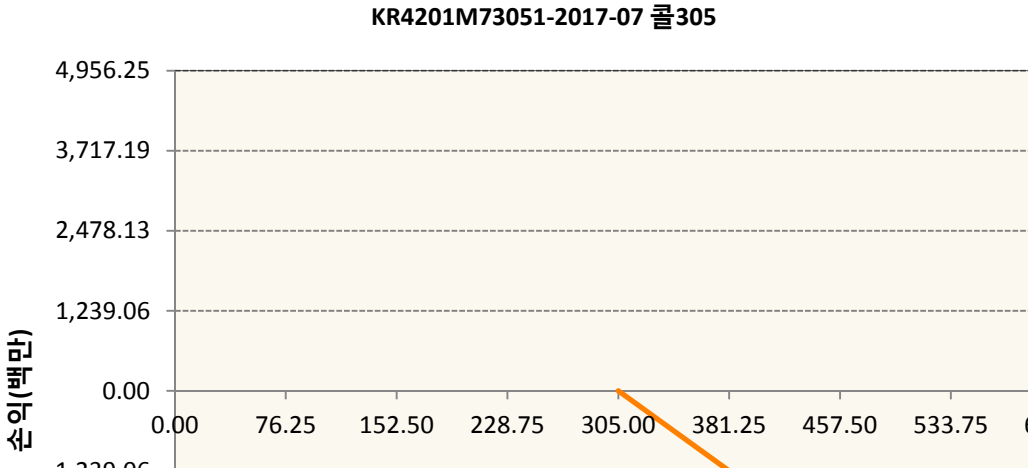
1. 계약금액

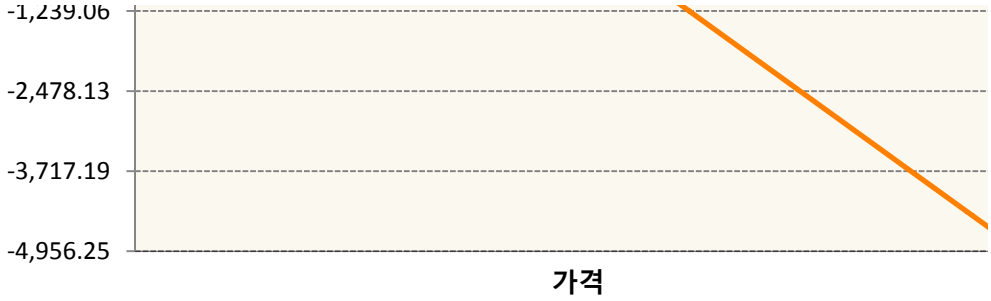
(단위:백만원)

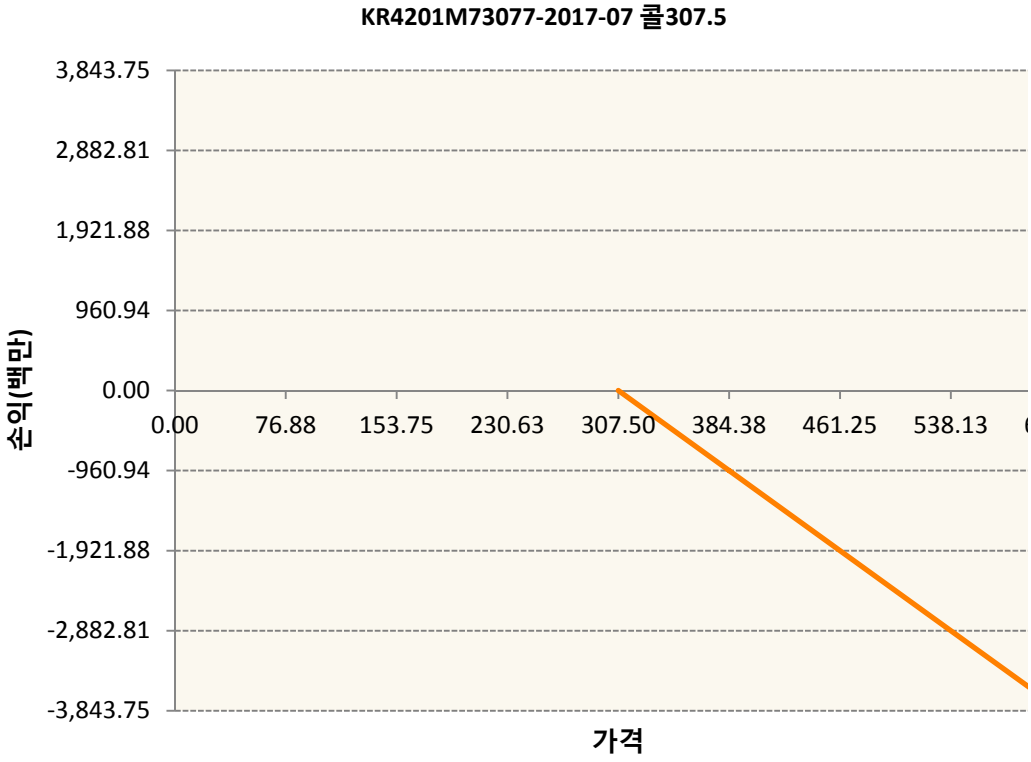
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	899	0	899	장내
누계	유가증권	선물	2,470	0	2,470	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,338	-10,338	장내

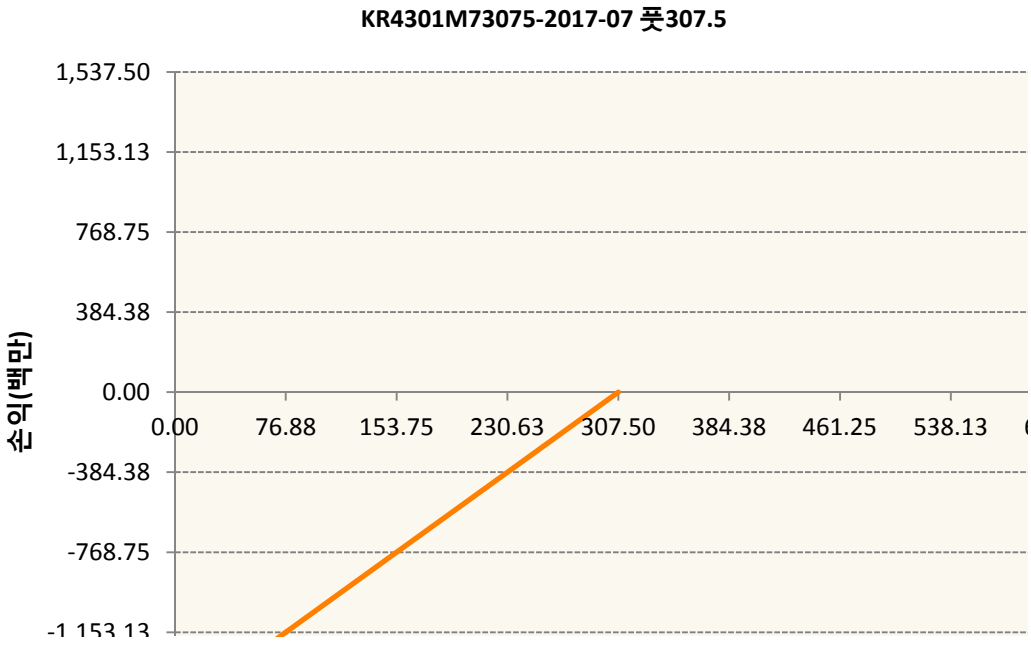
2. 만기시점의 손익구조

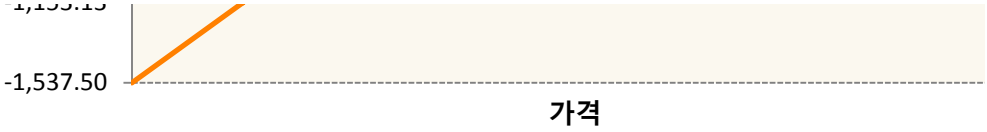





-1,239.06
-2,478.13
-3,717.19
-4,956.25
가격


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							357
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	92	92	92	91	91	90	89
-5.33%	90	89	88	86	83	81	78
-2.67%	75	70	66	61	57	52	47
0%	15	10	5	0	-5	-11	-16
2.67%	-93	-95	-98	-101	-104	-107	-111
5.33%	-222	-223	-223	-224	-225	-227	-228
8.00%	-355	-355	-356	-356	-356	-356	-357
KR4201M73(2017-07 콜307.5							261
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	53	53	53	53	53	52	52
-5.33%	53	52	51	50	49	48	46
-2.67%	46	43	41	38	34	31	28
0%	13	8	4	0	-4	-8	-13
2.67%	-61	-63	-66	-69	-72	-75	-79
5.33%	-158	-158	-159	-160	-161	-163	-165
8.00%	-260	-260	-260	-260	-260	-261	-261
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	-64
-2.67%	-23	-24	-25	-26	-27	-29	-30

0%	5	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	17	16	15	13	12	11	10
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)

960

공시일	2017-06-15
기준일	2017-06-14

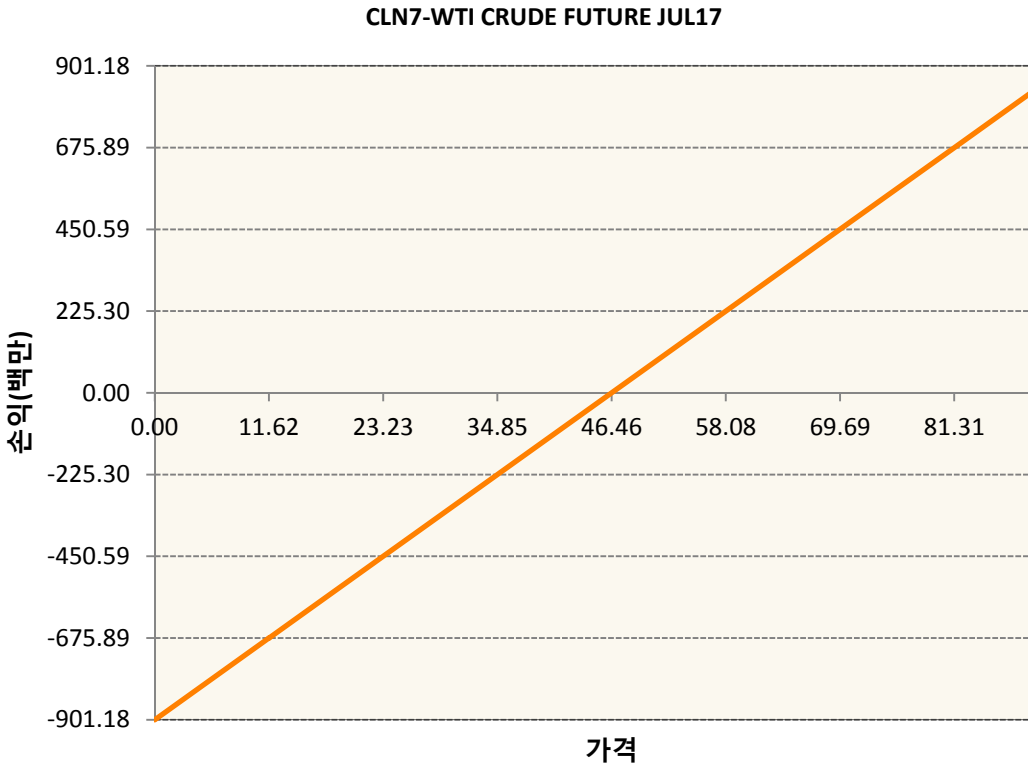
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

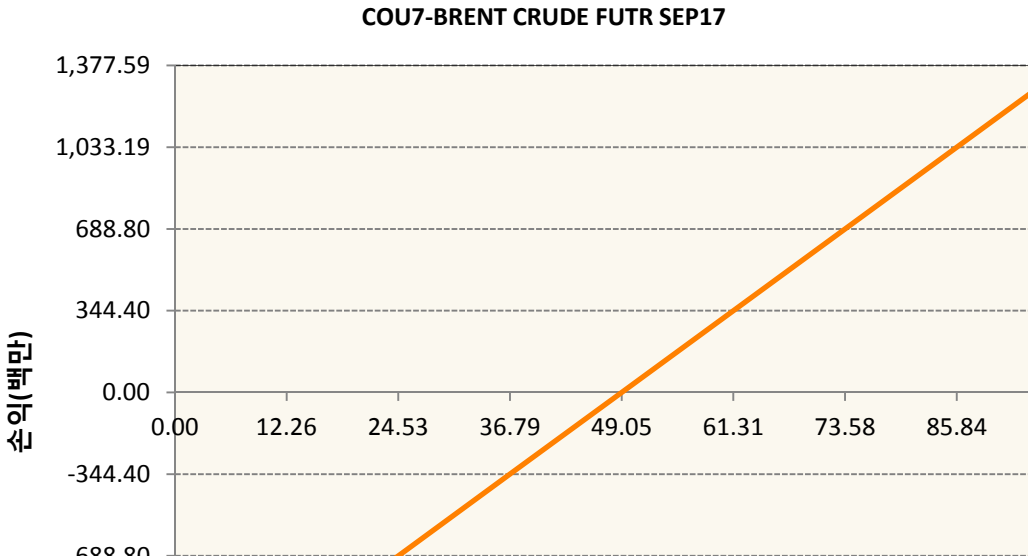
1. 계약금액

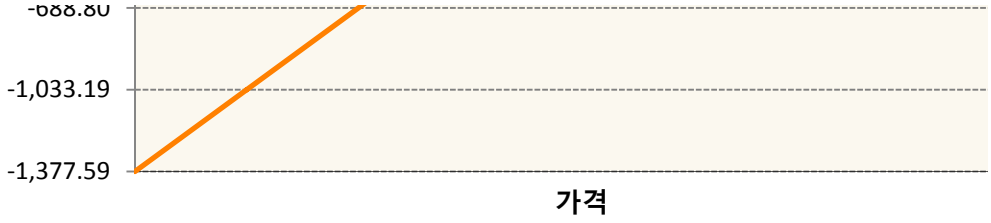
(단위:백만원)

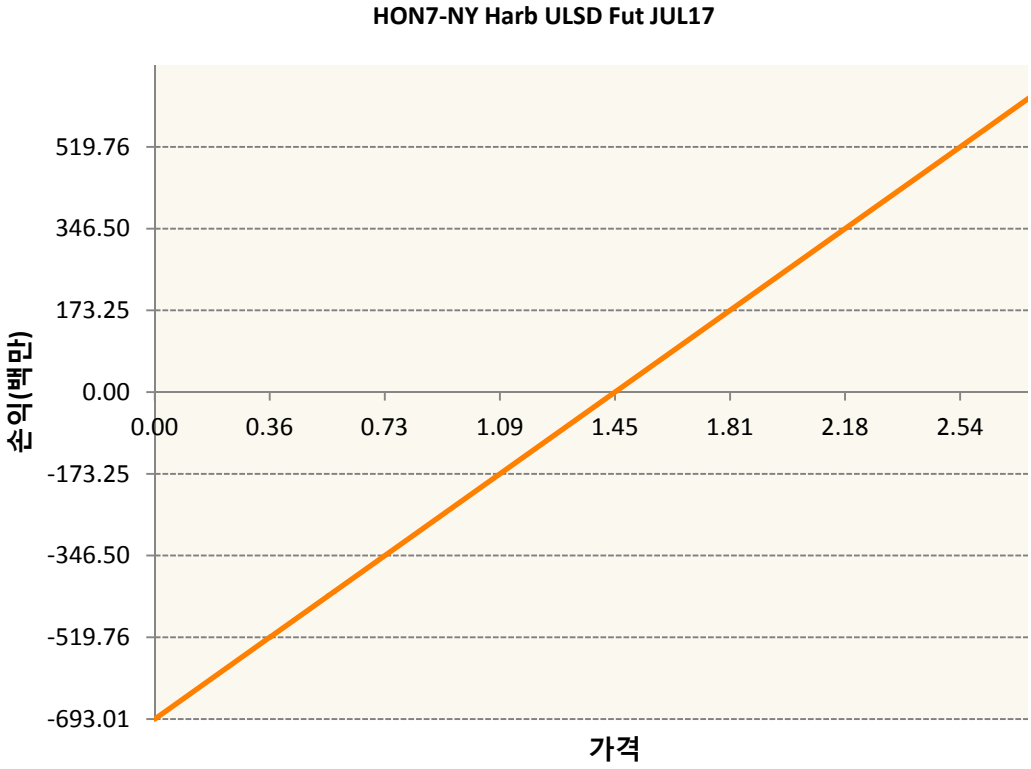
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,112	225	4,887	

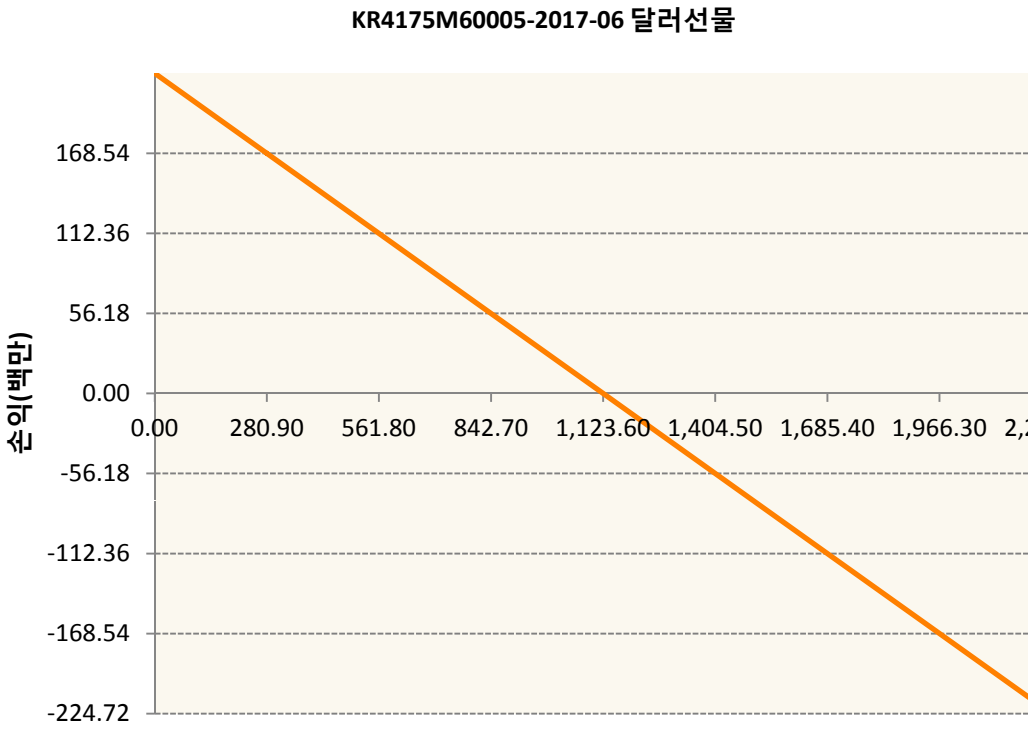
2. 만기시점의 손익구조



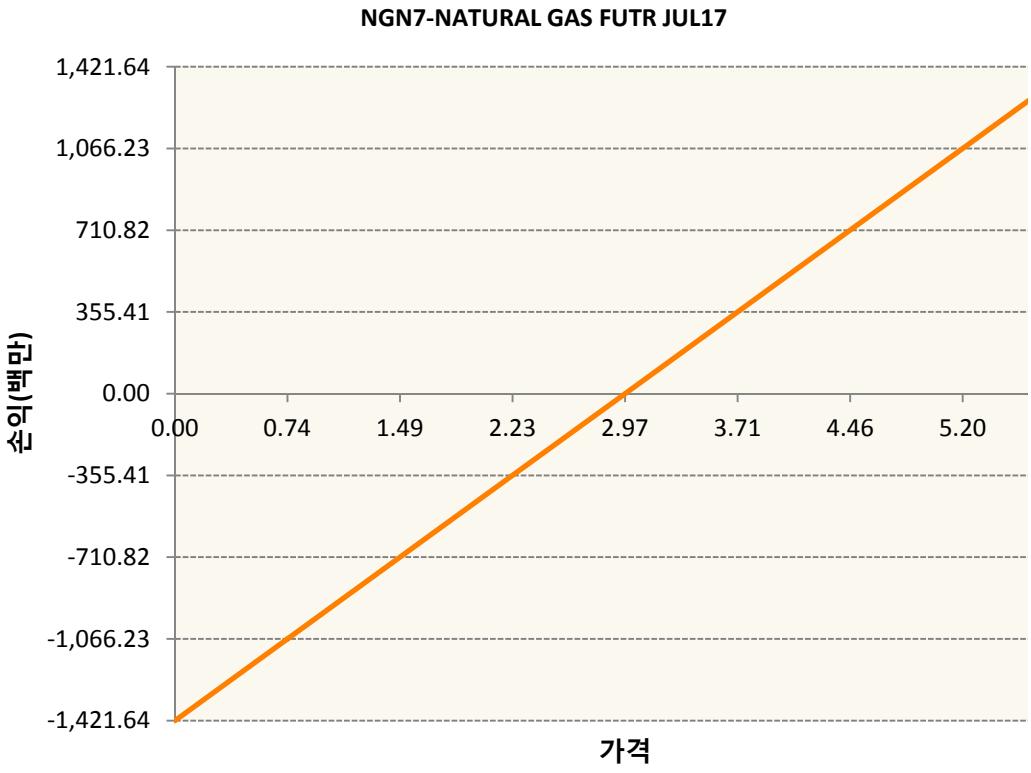


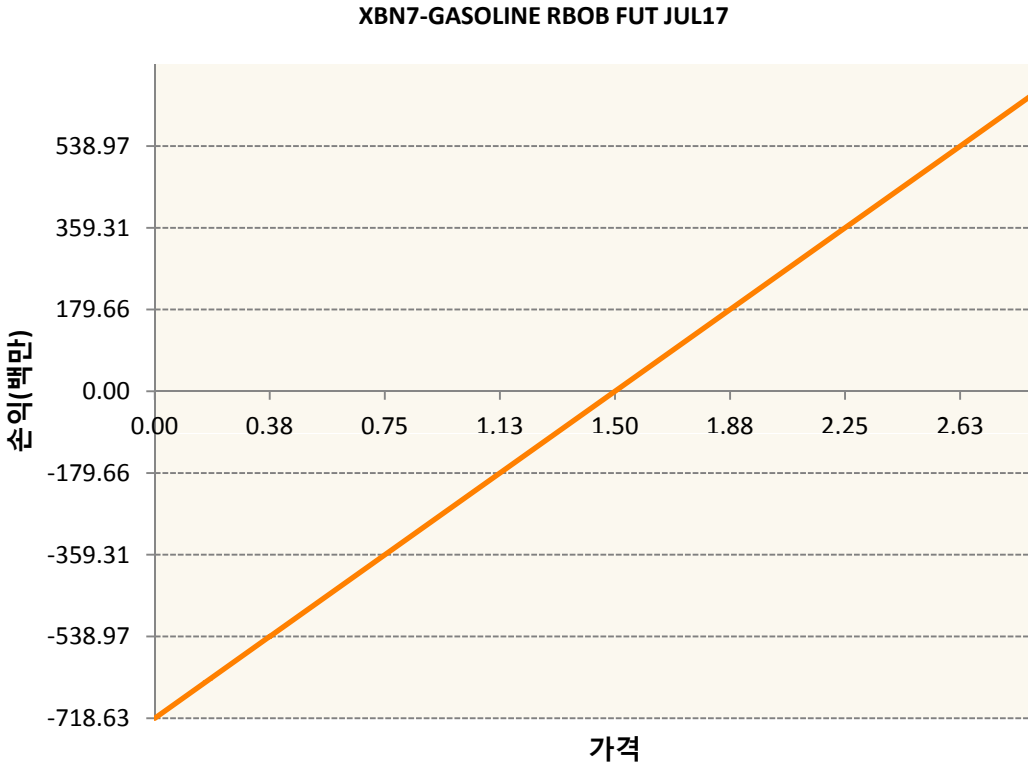

-1,033.19
-1,377.59
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
519.76
346.50
173.25
0.00
-173.25
-346.50
-519.76
-693.01
0.00
0.36
0.73
1.09
1.45
1.81
2.18
2.54
손익(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
손익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,421.64
1,066.23
710.82
355.41
0.00
-355.41
-710.82
-1,066.23
-1,421.64
0.00
0.74
1.49
2.23
2.97
3.71
4.46
5.20
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
538.97
359.31
179.66
0.00
-179.66
-359.31
-538.97
-718.63
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	72
COU7	BRENT CRUDE FUTR SEP17	110
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	55
KR4175M60(	2017-06 달러선물	18
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	114
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	57

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

839

공시일	2017-06-15
기준일	2017-06-14

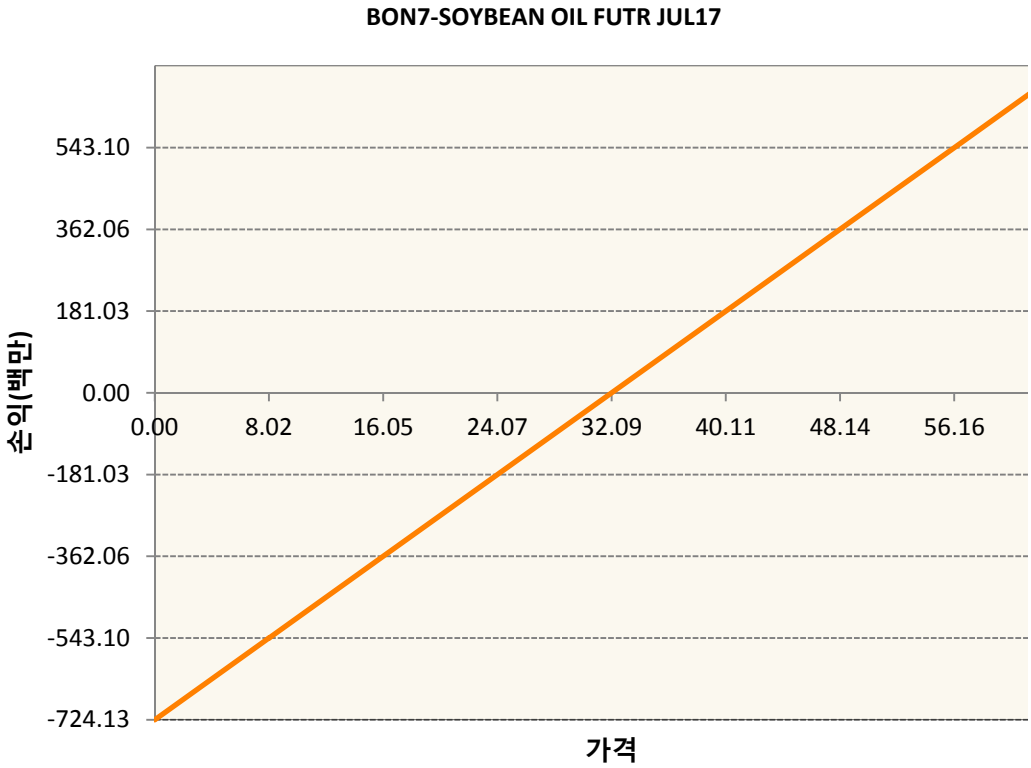
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

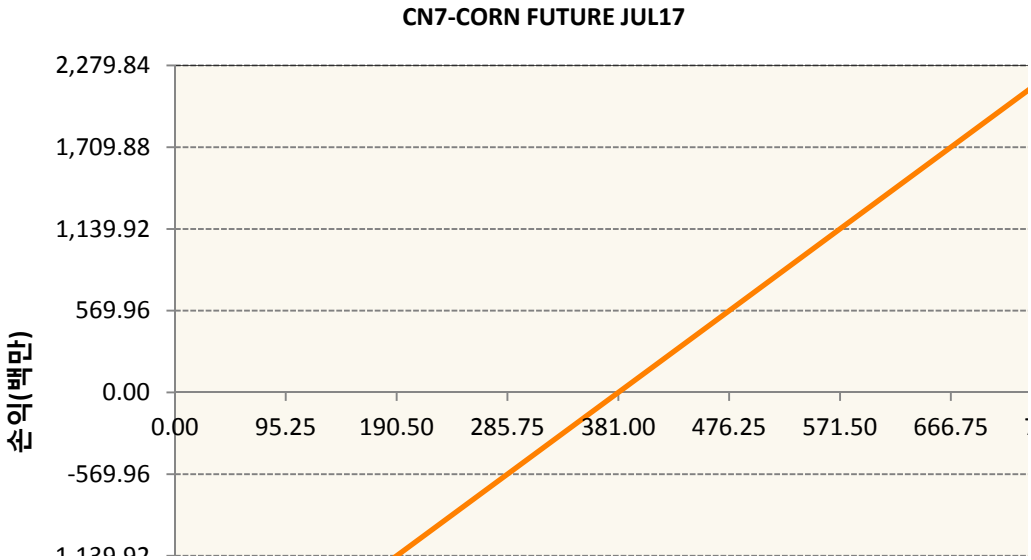
1. 계약금액

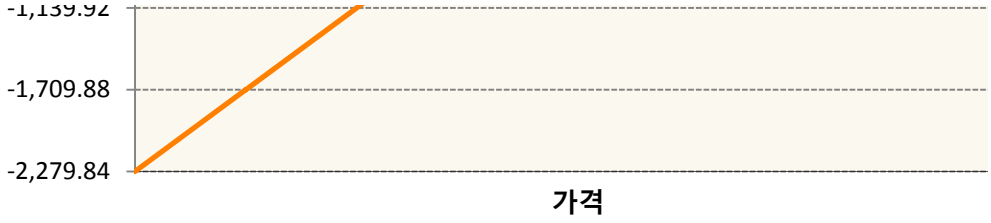
(단위:백만원)

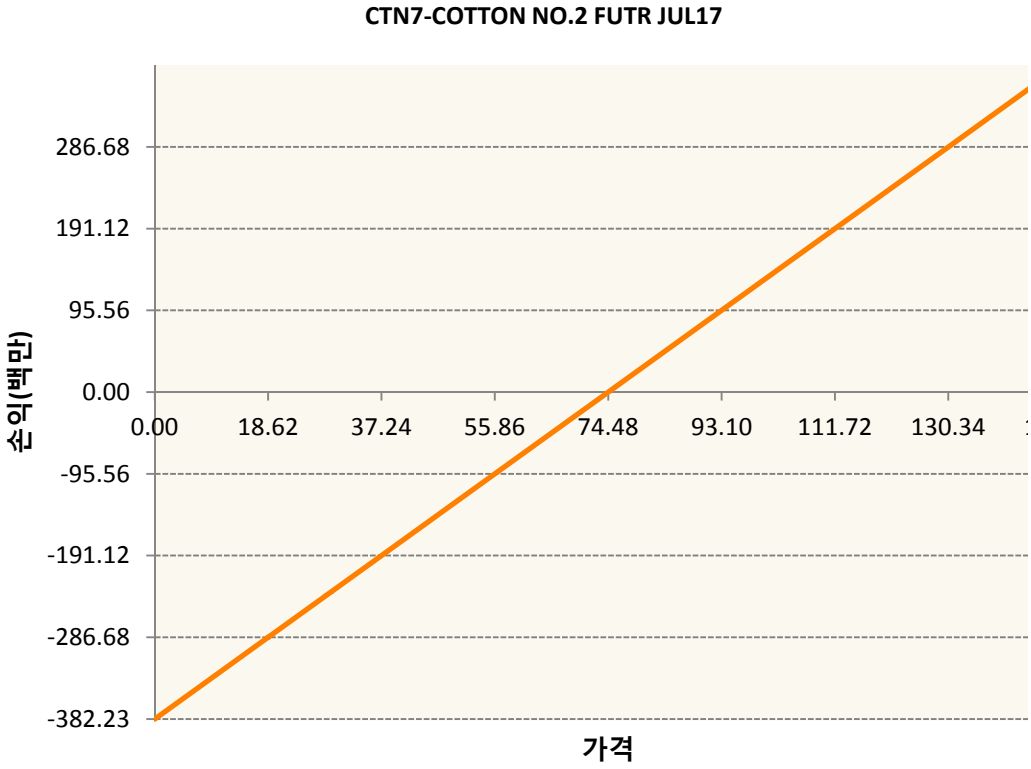
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,331	393	7,937	

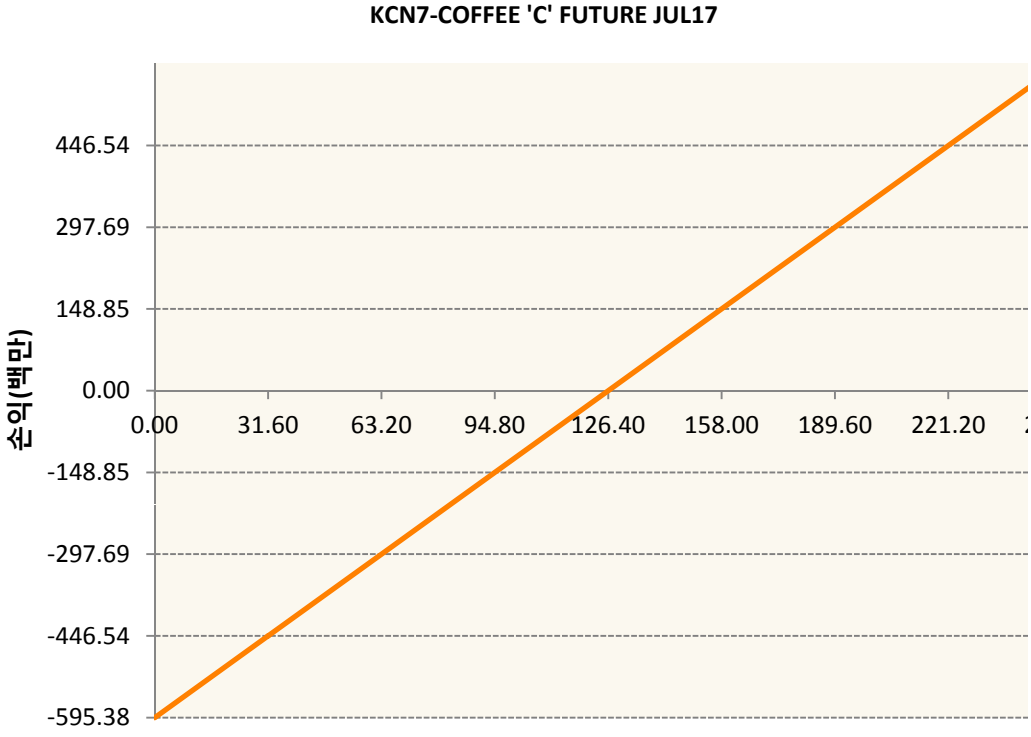
2. 만기시점의 손익구조





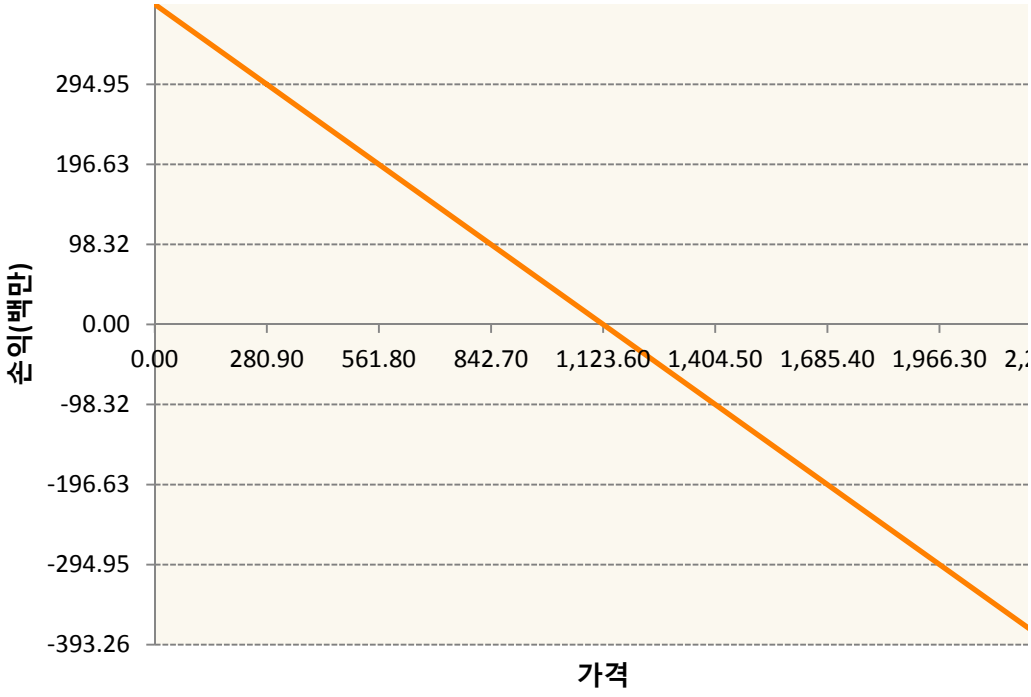

-1,709.88
-2,279.84
가격


CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
286.68
191.12
95.56
0.00
-95.56
-191.12
-286.68
-382.23
0.00
18.62
37.24
55.86
74.48
93.10
111.72
130.34
순익(백만)
가격

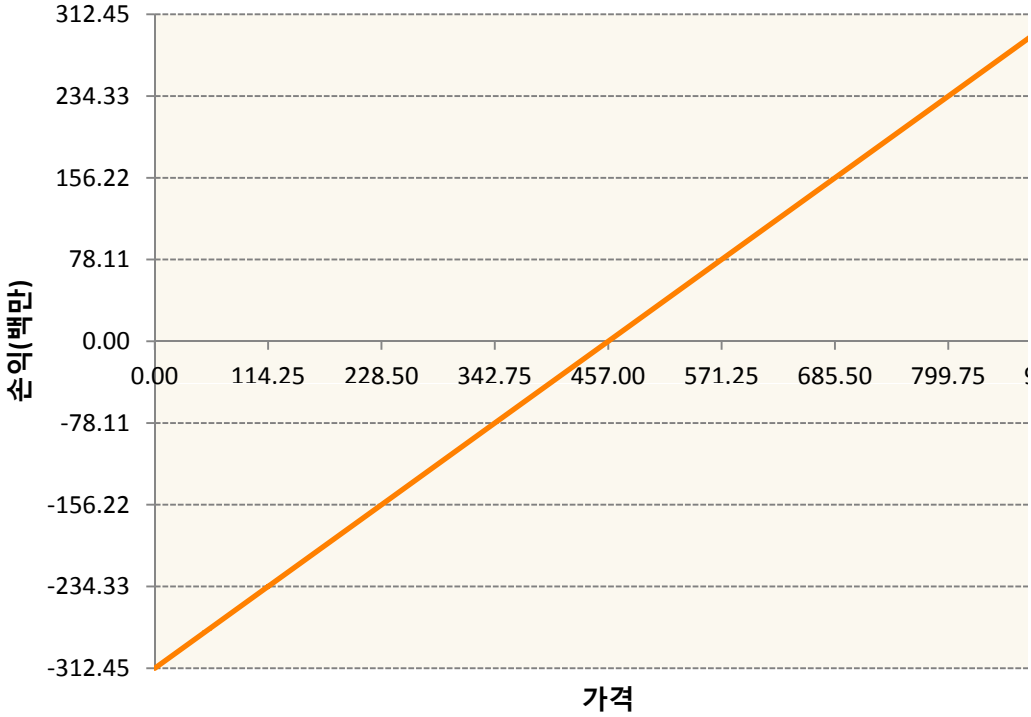

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
446.54
297.69
148.85
0.00
-148.85
-297.69
-446.54
-595.38
0.00
31.60
63.20
94.80
126.40
158.00
189.60
221.20
순익(백만)

가격

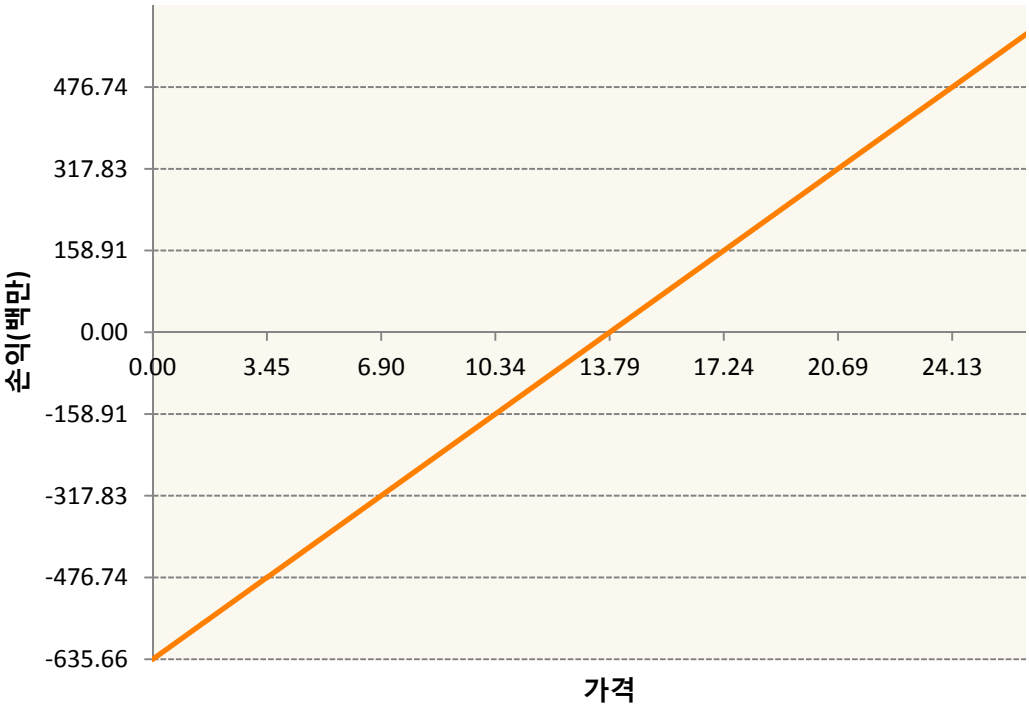
KR4175M60005-2017-06 달러선물



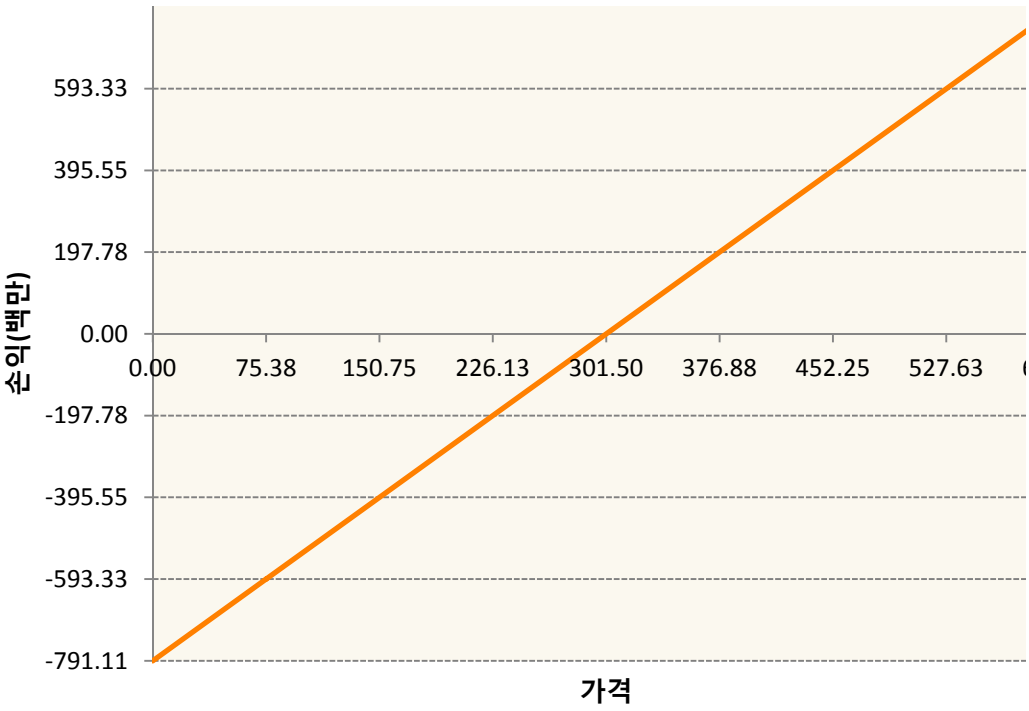
KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17



SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17

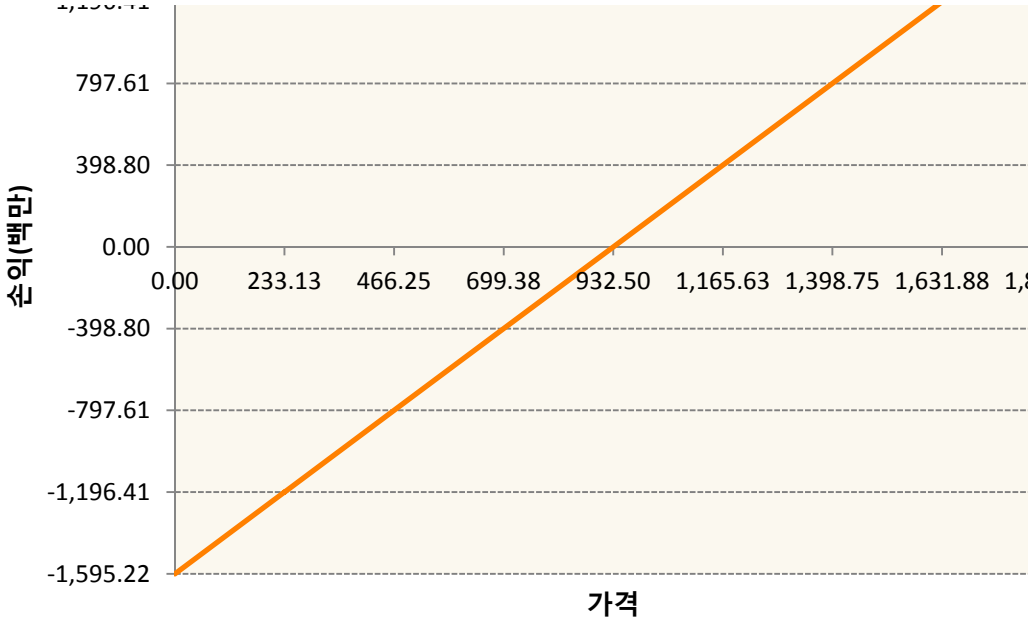


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17

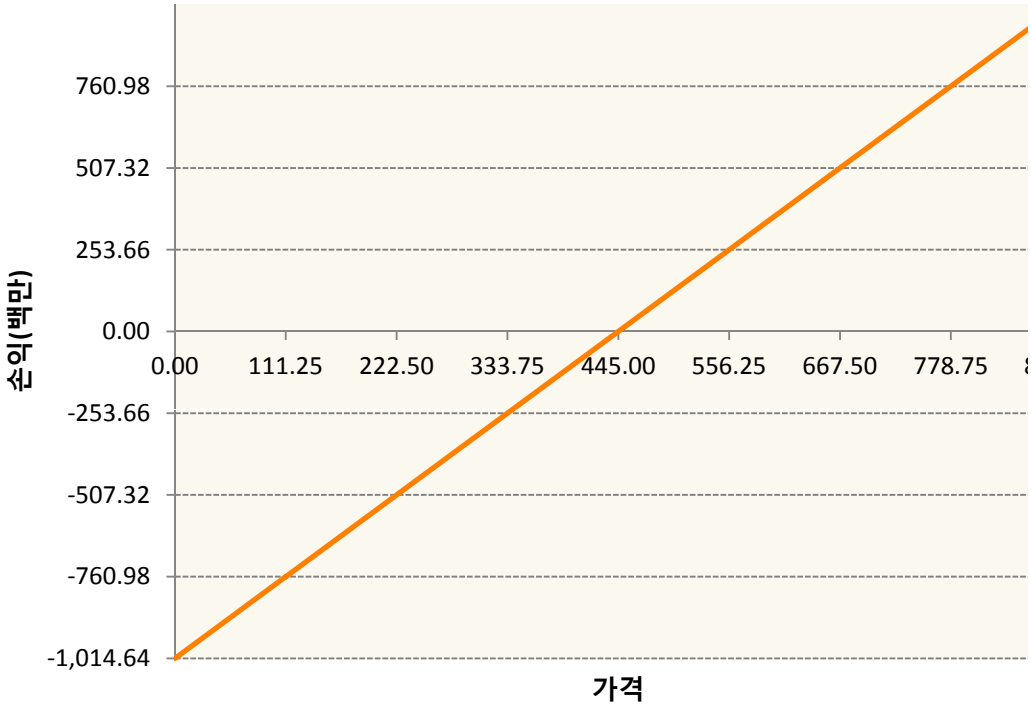


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17





WN7-WHEAT FUTURE(CBT) JUL17



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	58
CN7	CORN FUTURE JUL17	182
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	51
SMN7	SOYBEAN MEAL FUTR JUL17	63
SN7	SOYBEAN FUTURE JUL17	128
WN7	WHEAT FUTURE(CBT) JUL17	81

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

756