공시일	2017-06-16
기준일	2017-06-15

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	2017-06-16
기준일	2017-06-15

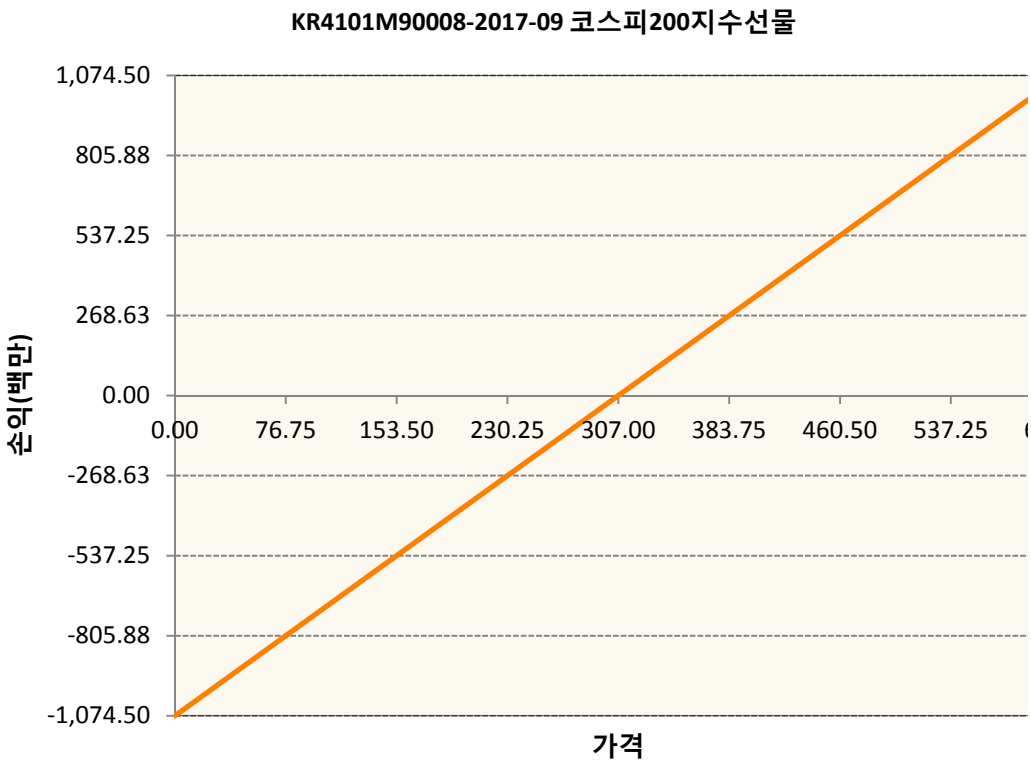
스마트인덱스모

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	1,075	0	1,075	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)

56

공시일	2017-06-16
기준일	2017-06-15

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	1,004

* 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	2017-06-16
기준일	2017-06-15

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	372

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

326

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-16
기준일	2017-06-15

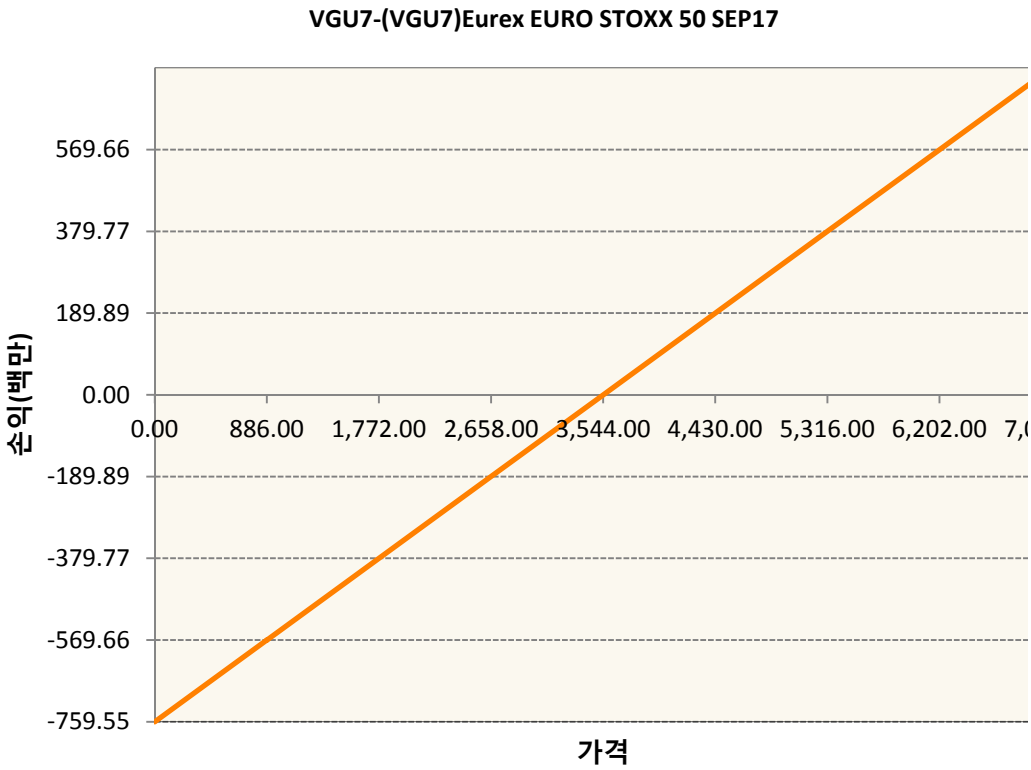
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	760	0	760	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	61

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

(단위:백만원)

56

공시일	2017-06-16
기준일	2017-06-15

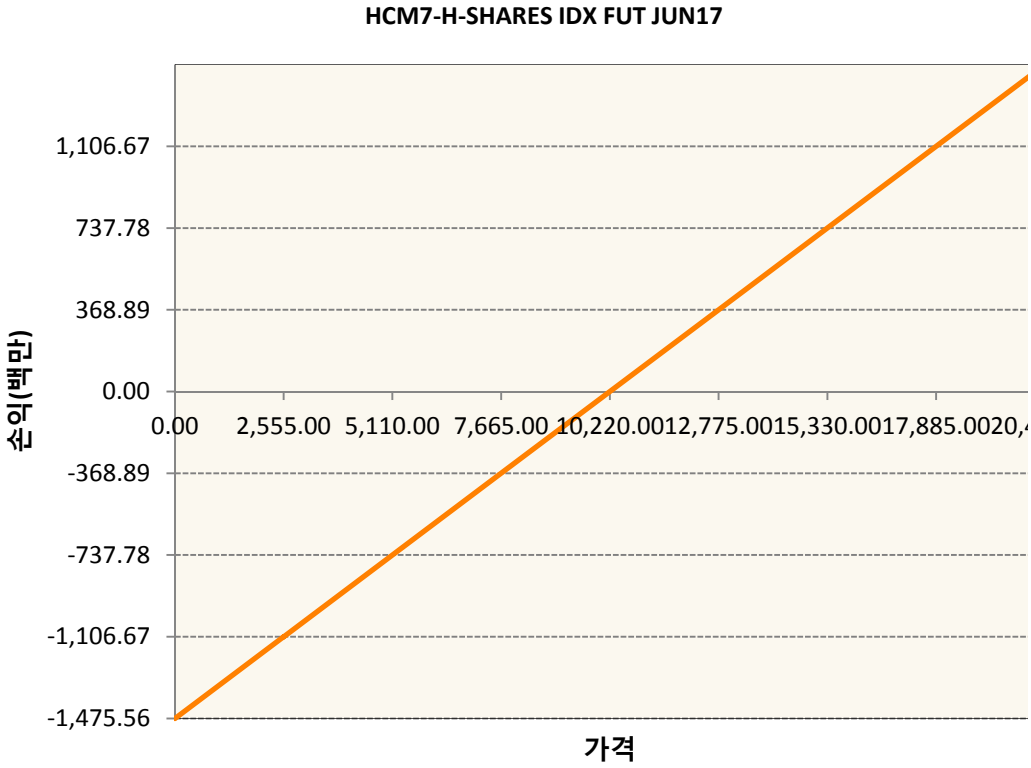
차이나인덱스모(주식-파생형)

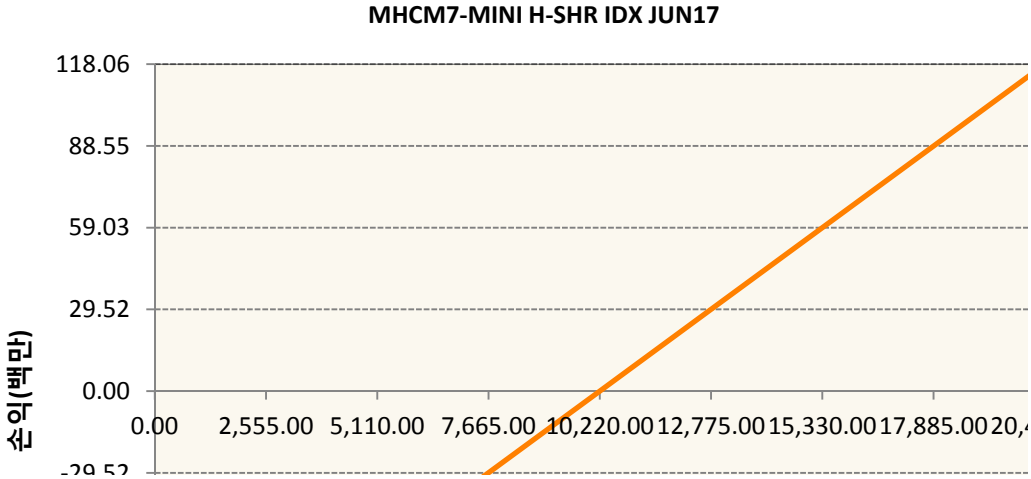
1. 계약금액

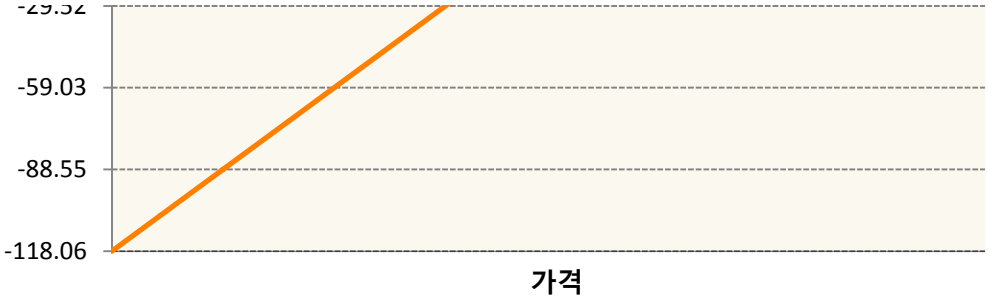
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계			1,476	0	1,476	
누계	유가증권	선물	118	0	118	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCM7	H-SHARES IDX FUT JUN17	118
MHCM7	MINI H-SHR IDX JUN17	9

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

91

공시일	2017-06-16
기준일	2017-06-15

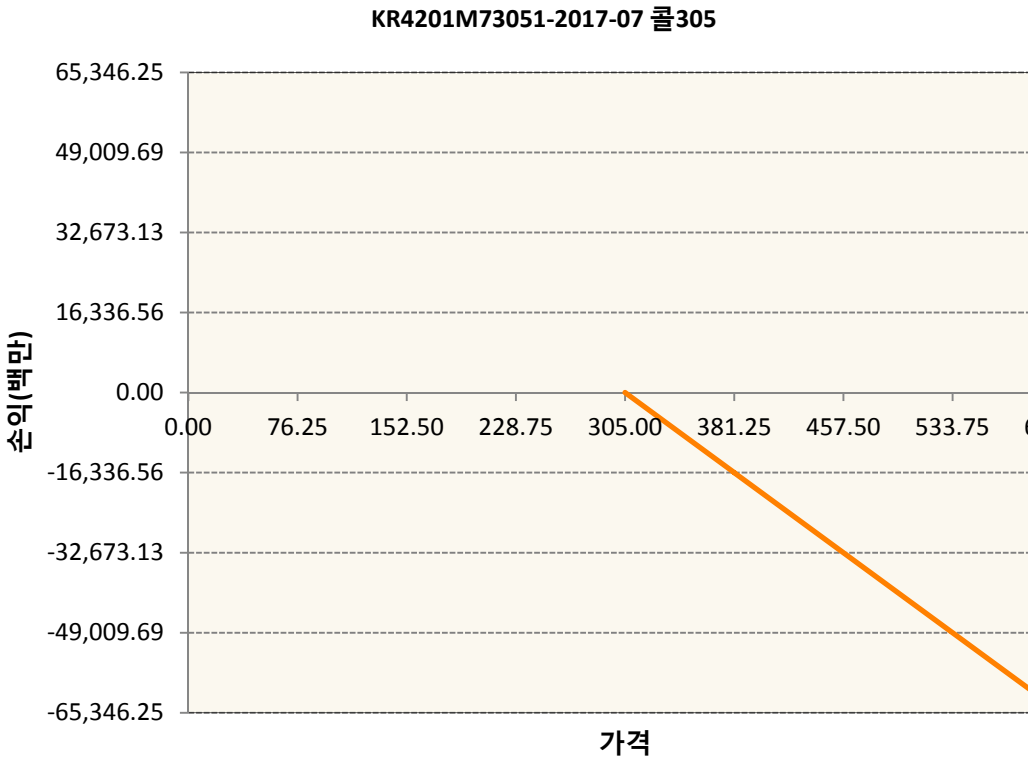
커버드콜모(주식혼합-파생형)

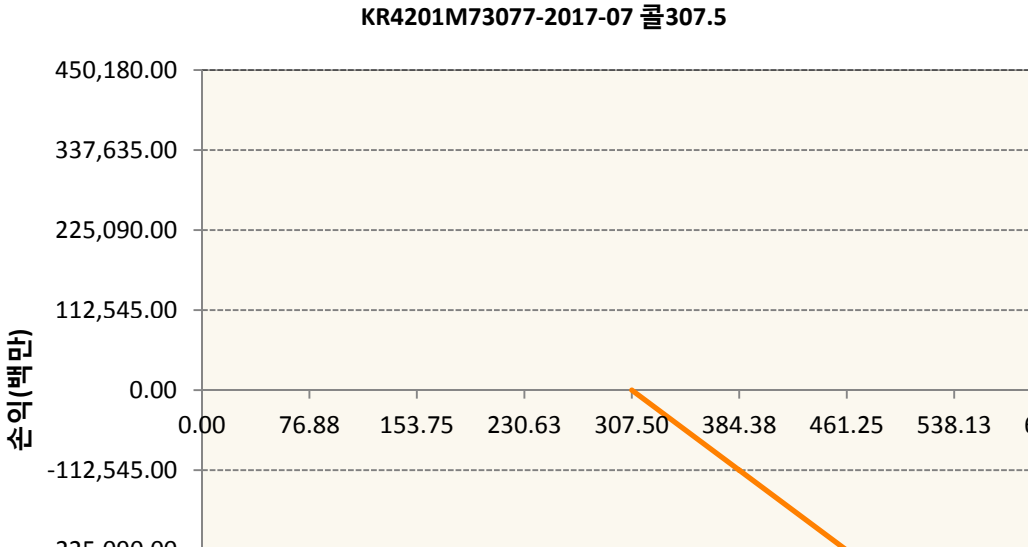
1. 계약금액

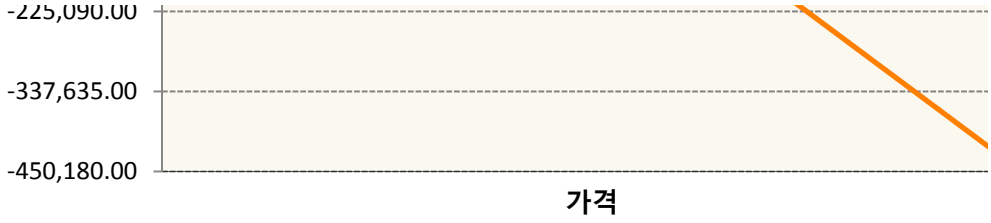
(단위:백만원)

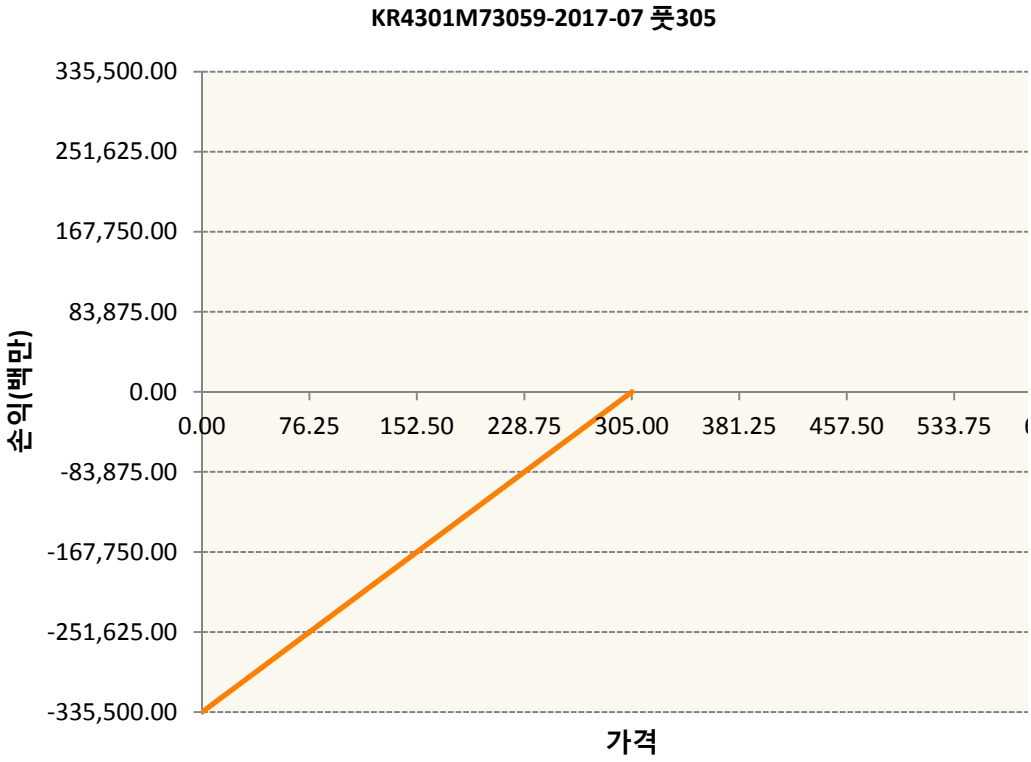
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	866,401	-866,401	장내

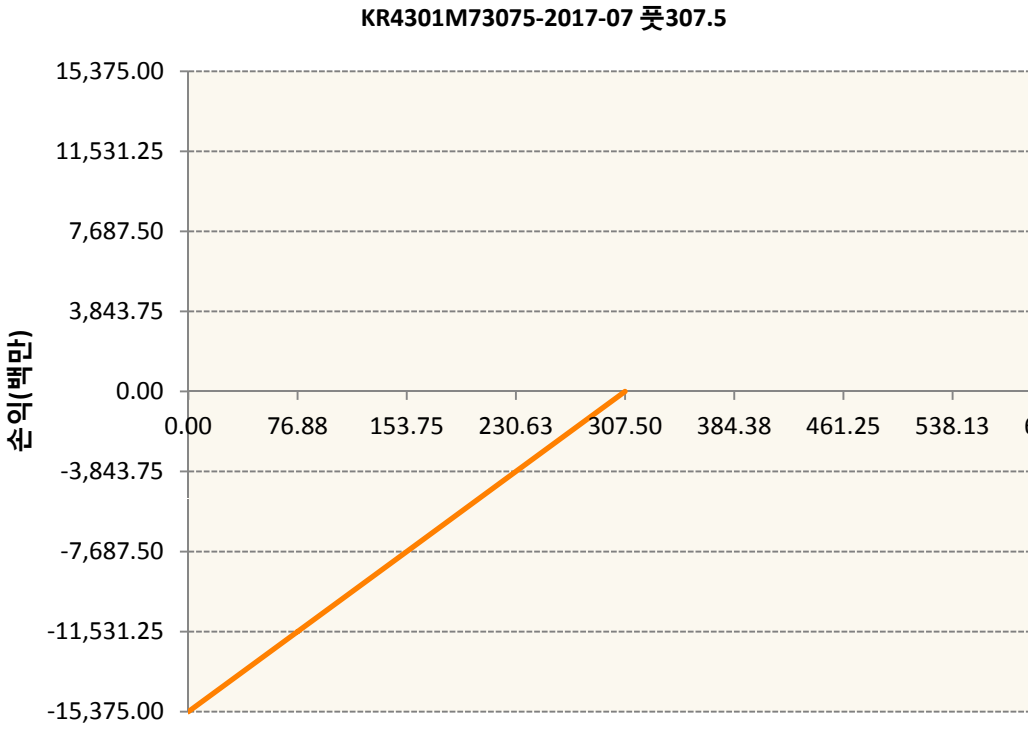
2. 만기시점의 손익구조






-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							4,596
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,030	1,030	1,028	1,025	1,021	1,014	1,005
-5.33%	1,019	1,009	994	975	952	925	895
-2.67%	872	824	773	719	662	605	545
0%	206	138	69	0	-69	-138	-208
2.67%	-1,146	-1,179	-1,216	-1,258	-1,303	-1,352	-1,403
5.33%	-2,830	-2,836	-2,845	-2,858	-2,875	-2,895	-2,919
8.00%	-4,576	-4,576	-4,577	-4,579	-4,583	-4,589	-4,596
KR4201M73(2017-07 콜307.5							29,716
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,176	5,174	5,170	5,160	5,143	5,116	5,076
-5.33%	5,146	5,109	5,051	4,969	4,862	4,729	4,573
-2.67%	4,615	4,375	4,104	3,806	3,487	3,148	2,795
0%	1,435	957	479	0	-479	-958	-1,438
2.67%	-6,515	-6,832	-7,175	-7,538	-7,918	-8,312	-8,717
5.33%	-17,603	-17,680	-17,787	-17,925	-18,093	-18,288	-18,509
8.00%	-29,480	-29,488	-29,503	-29,531	-29,574	-29,636	-29,716
KR4301M73(2017-07 풋305							21,796
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21,667	-21,670	-21,678	-21,692	-21,715	-21,749	-21,796
-5.33%	-12,739	-12,793	-12,868	-12,965	-13,084	-13,222	-13,378
-2.67%	-4,507	-4,755	-5,019	-5,297	-5,585	-5,882	-6,186
0%	1,059	707	354	0	-355	-710	-1,067
2.67%	3,101	2,933	2,741	2,526	2,294	2,046	1,785
5.33%	3,439	3,410	3,363	3,298	3,213	3,107	2,983
8.00%	3,463	3,460	3,455	3,445	3,426	3,398	3,358
KR4301M73(2017-07 풋307.5							1,052
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,049	-1,049	-1,049	-1,049	-1,050	-1,051	-1,052
-5.33%	-641	-642	-644	-647	-651	-655	-661
-2.67%	-251	-259	-268	-278	-289	-301	-313
0%	49	33	16	0	-16	-33	-49
2.67%	186	175	163	151	138	125	111

5.33%	216	213	209	205	199	192	185
8.00%	218	218	218	217	215	213	210

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

64,271

공시일	2017-06-16
기준일	2017-06-15

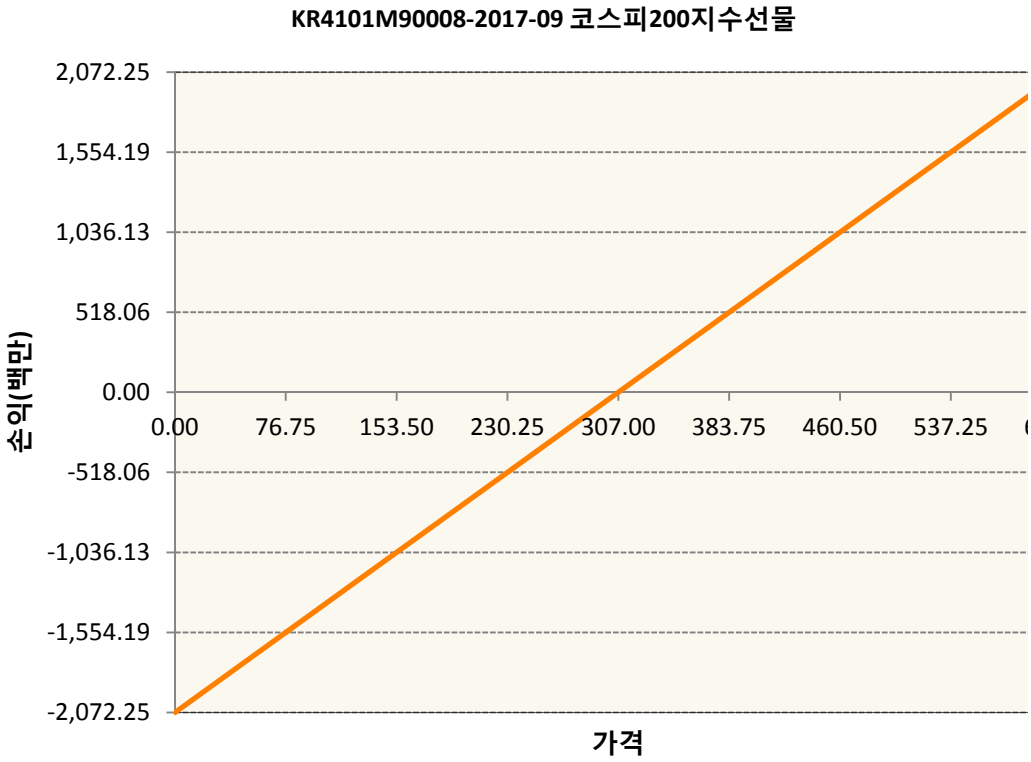
커버드콜목표전환형증권투자신탁

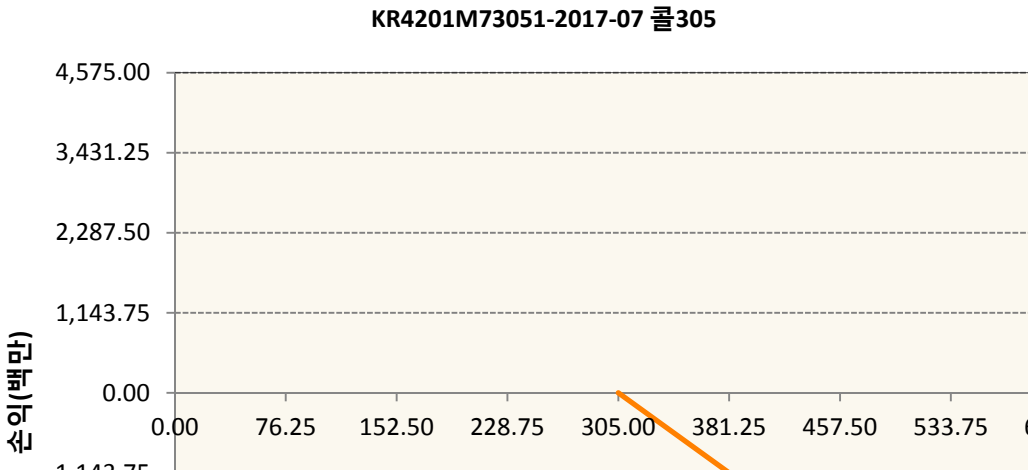
1. 계약금액

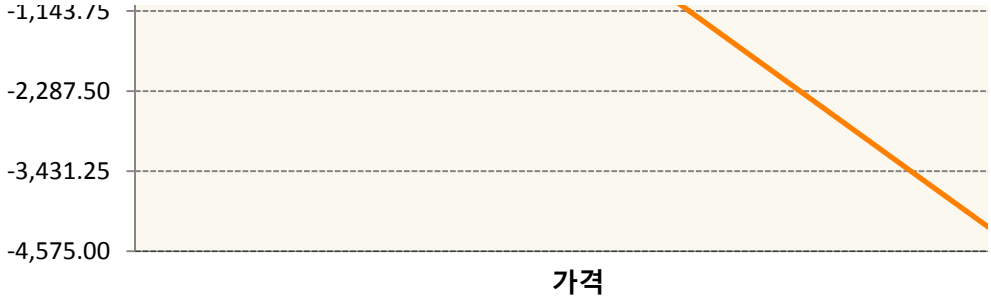
(단위:백만원)

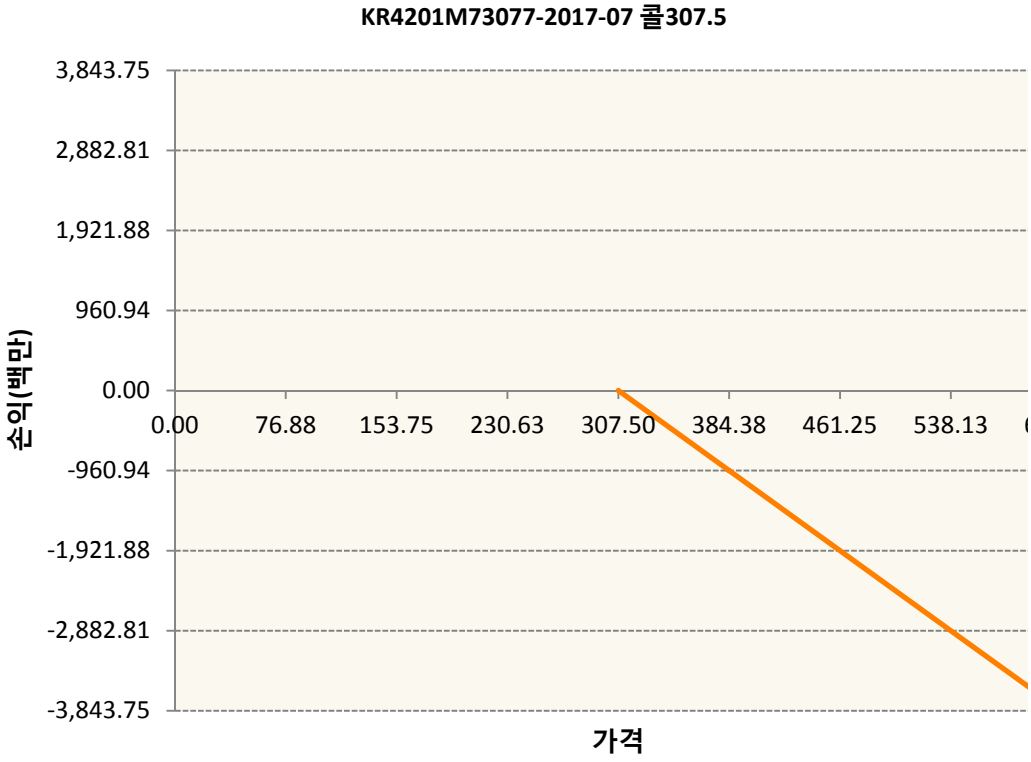
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	383	-383	장내
신규	유가증권	옵션	376	0	376	장내
누계	유가증권	선물	2,072	0	2,072	장내
누계	유가증권	옵션	0	9,956	-9,956	장내

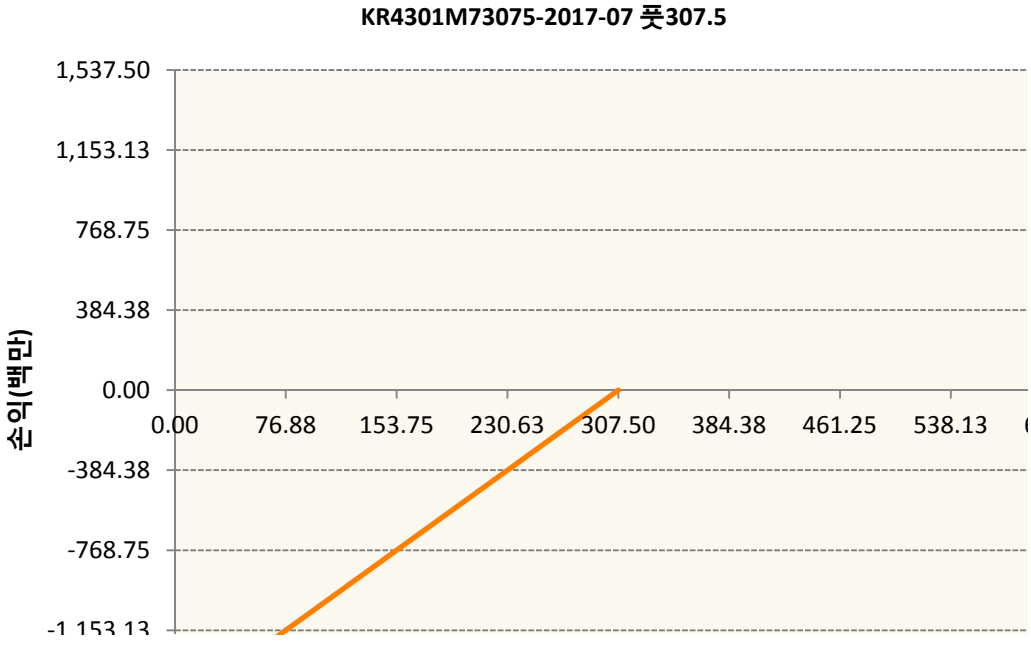
2. 만기시점의 손익구조

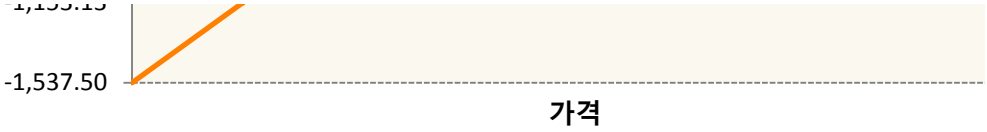





-1,143.75
-2,287.50
-3,431.25
-4,575.00
가격


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							166
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-166	-166	-166	-166	-166	-166	-166
-5.33%	-110	-110	-110	-110	-110	-110	-110
-2.67%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	55	55	55	55	55	55	55
5.33%	110	110	110	110	110	110	110
8.00%	166	166	166	166	166	166	166
KR4201M73(2017-07 콜305							322
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	72	72	72	72	71	71	70
-5.33%	71	71	70	68	67	65	63
-2.67%	61	58	54	50	46	42	38
0%	14	10	5	0	-5	-10	-15
2.67%	-80	-83	-85	-88	-91	-95	-98
5.33%	-198	-199	-199	-200	-201	-203	-204
8.00%	-320	-320	-320	-321	-321	-321	-322
KR4201M73(2017-07 콜307.5							254
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	44	44	44	44	44	44	43
-5.33%	44	44	43	42	42	40	39
-2.67%	39	37	35	33	30	27	24
0%	12	8	4	0	-4	-8	-12
2.67%	-56	-58	-61	-64	-68	-71	-74
5.33%	-150	-151	-152	-153	-154	-156	-158
8.00%	-252	-252	-252	-252	-253	-253	-254
KR4301M73(2017-07 풋307.5							105
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-5.33%	-64	-64	-64	-65	-65	-66	-66
-2.67%	-25	-26	-27	-28	-29	-30	-31

0%	5	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	19	18	16	15	14	12	11
5.33%	22	21	21	20	20	19	18
8.00%	22	22	22	22	22	21	21

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

890

공시일	2017-06-16
기준일	2017-06-15

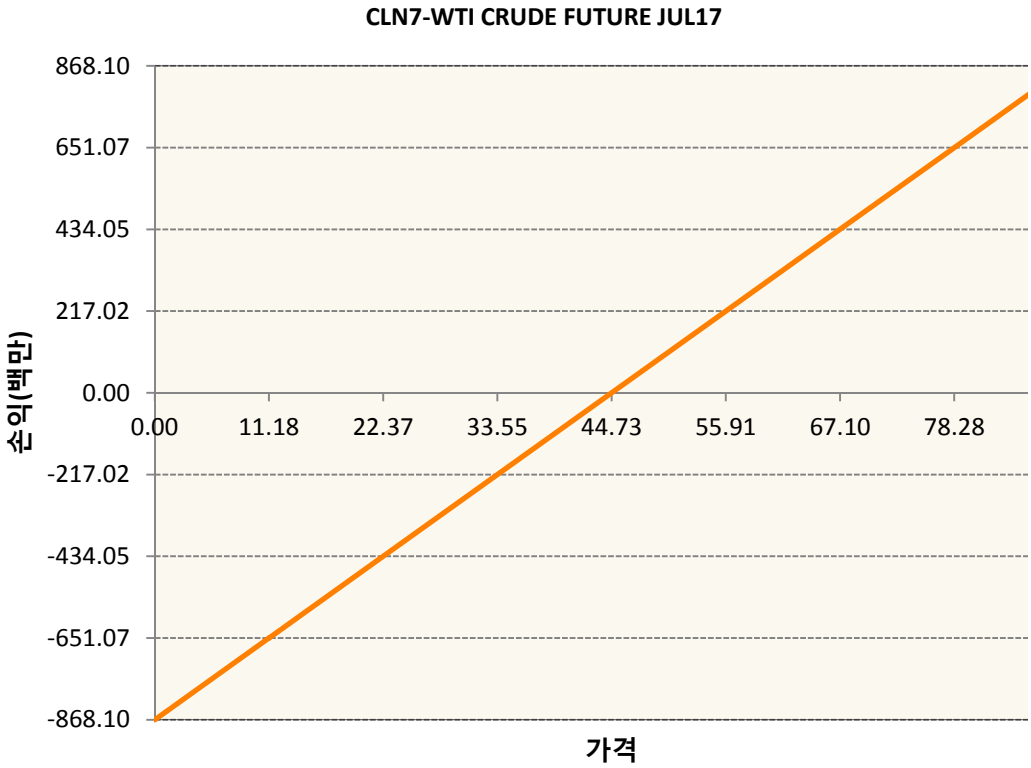
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

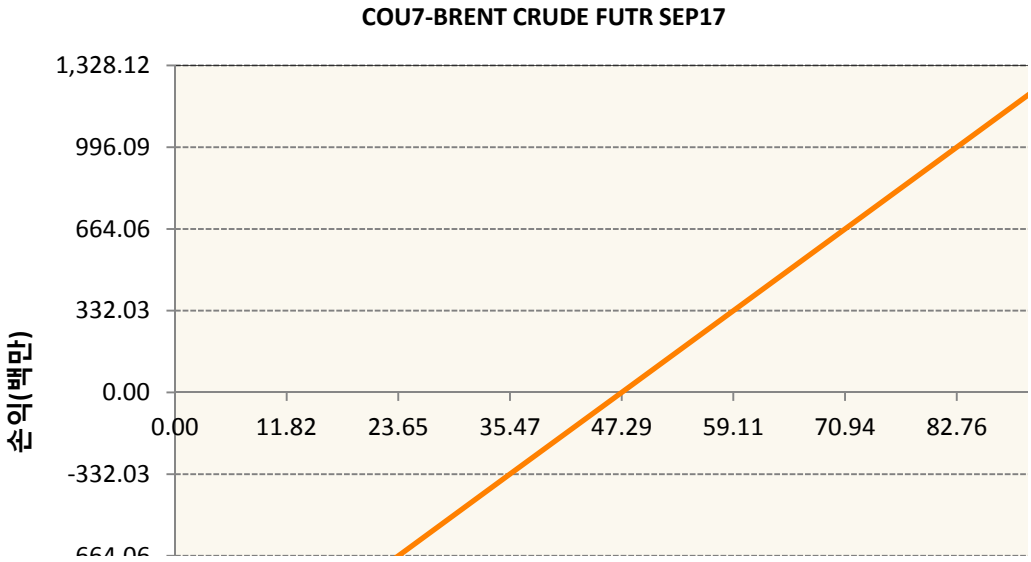
1. 계약금액

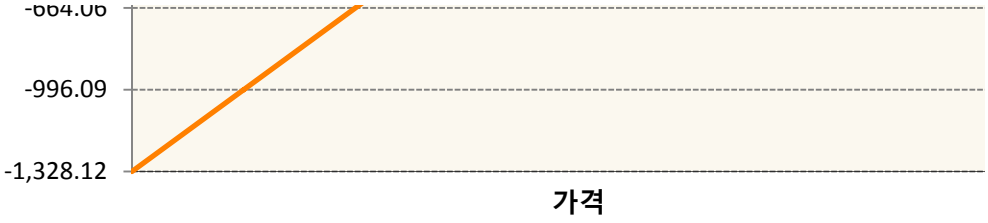
(단위:백만원)

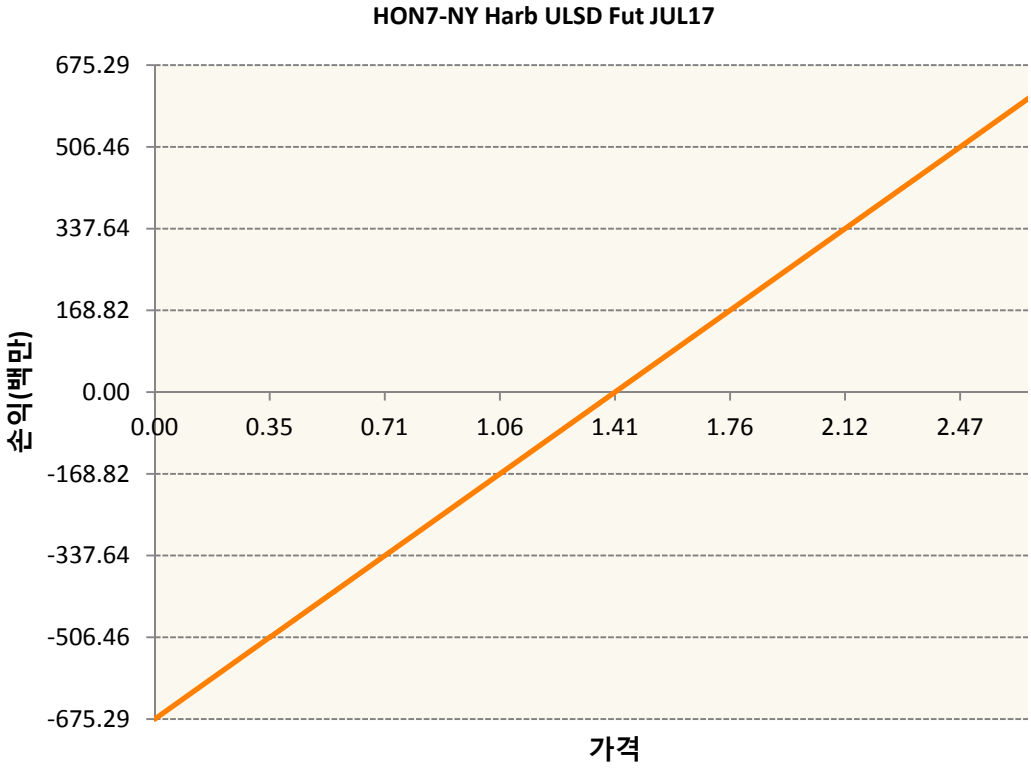
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,965	225	4,740	

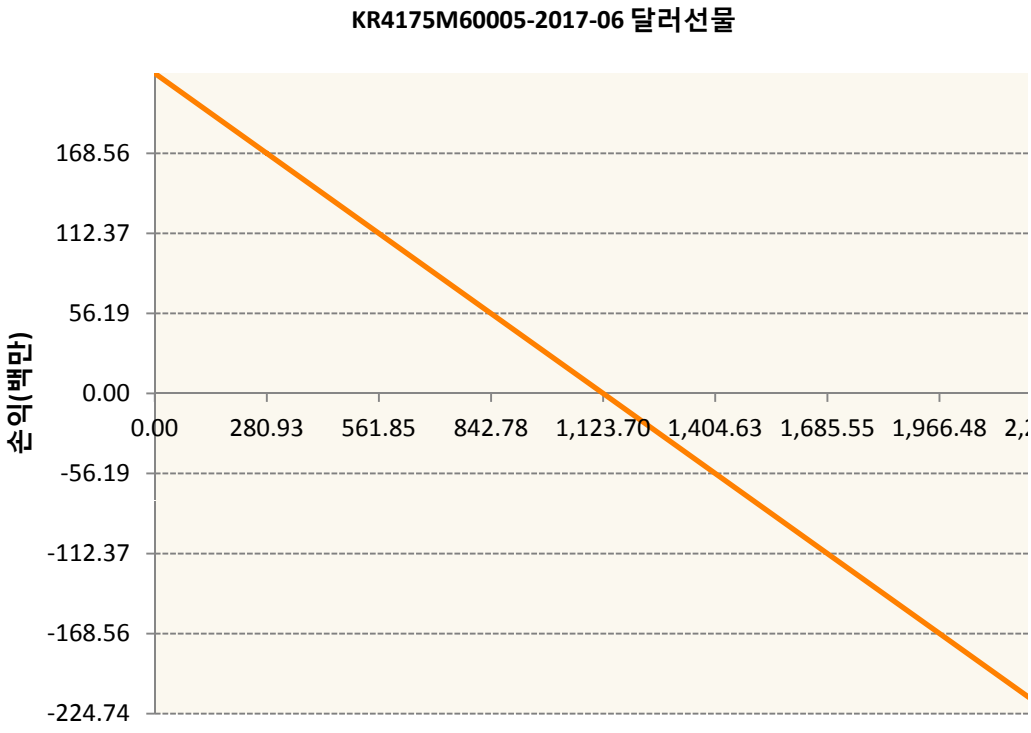
2. 만기시점의 손익구조



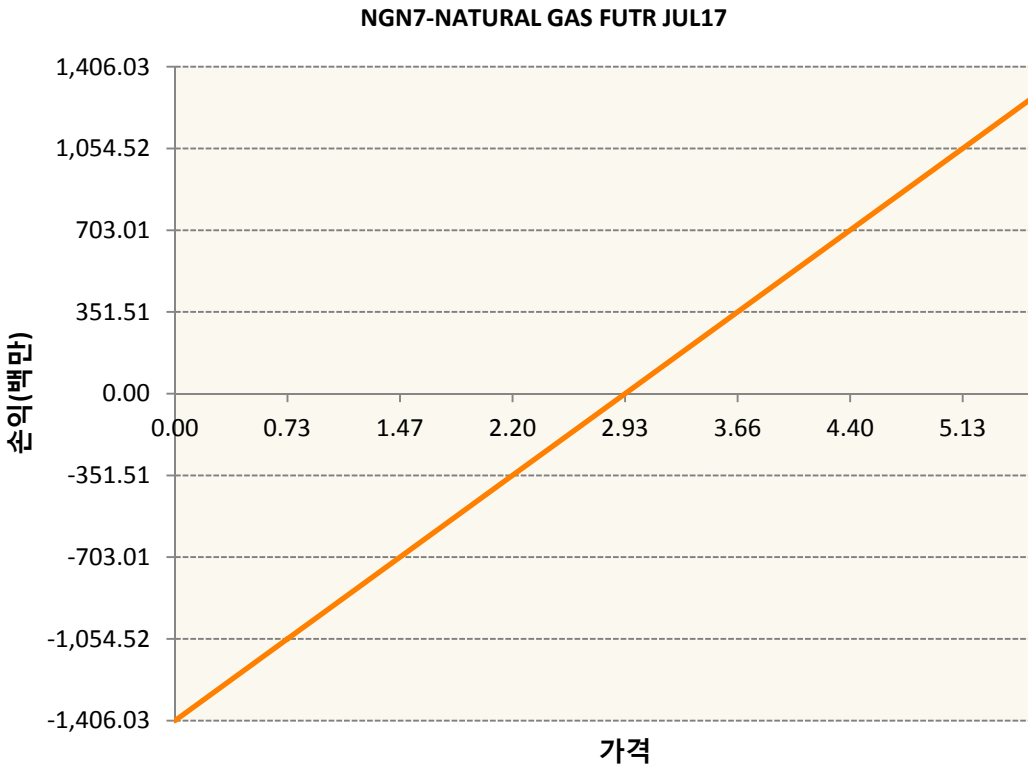


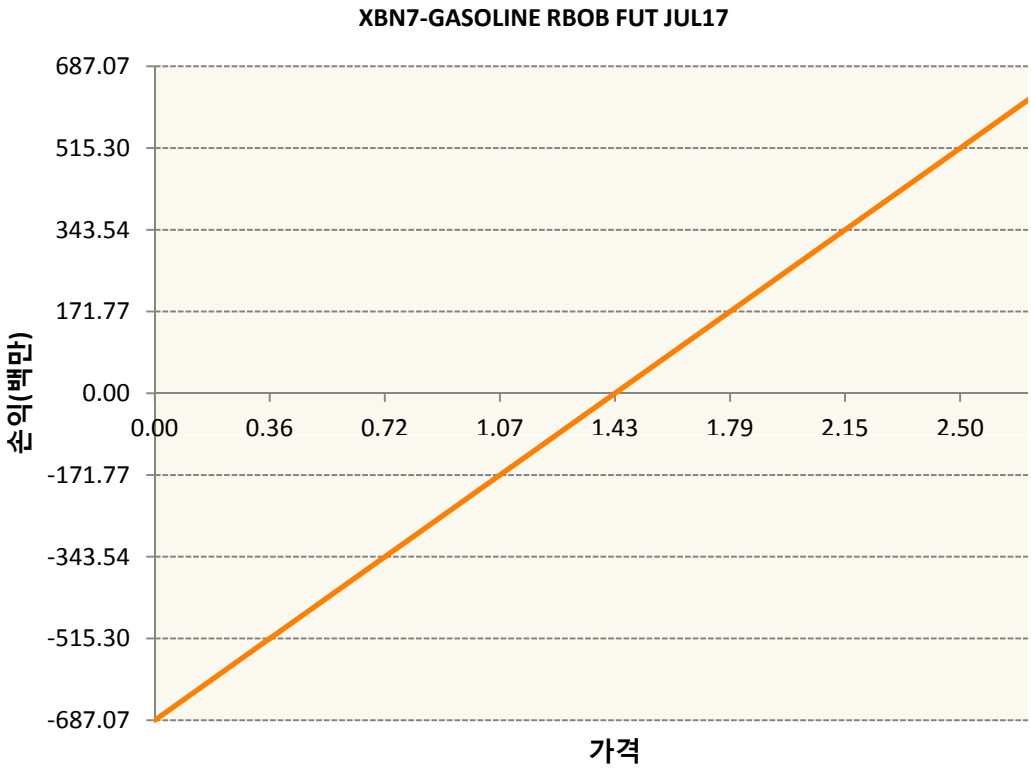

-664.06
-996.09
-1,328.12
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
675.29
506.46
337.64
168.82
0.00
-168.82
-337.64
-506.46
-675.29
0.00
0.35
0.71
1.06
1.41
1.76
2.12
2.47
손익(백만)
가격


KR4175M60005-2017-06 달러선물
168.56
112.37
56.19
0.00
-56.19
-112.37
-168.56
-224.74
0.00
280.93
561.85
842.78
1,123.70
1,404.63
1,685.55
1,966.48
손익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,406.03
1,054.52
703.01
351.51
0.00
-351.51
-703.01
-1,054.52
-1,406.03
0.00
0.73
1.47
2.20
2.93
3.66
4.40
5.13
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
687.07
515.30
343.54
171.77
0.00
-171.77
-343.54
-515.30
-687.07
0.00
0.36
0.72
1.07
1.43
1.79
2.15
2.50
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN7	WTI CRUDE FUTURE JUL17	69
COU7	BRENT CRUDE FUTR SEP17	106
HON7	NY Harb ULSD Fut JUL17	54
KR4175M60(	2017-06 달러선물	18
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	112
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	55

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

814

공시일	2017-06-16
기준일	2017-06-15

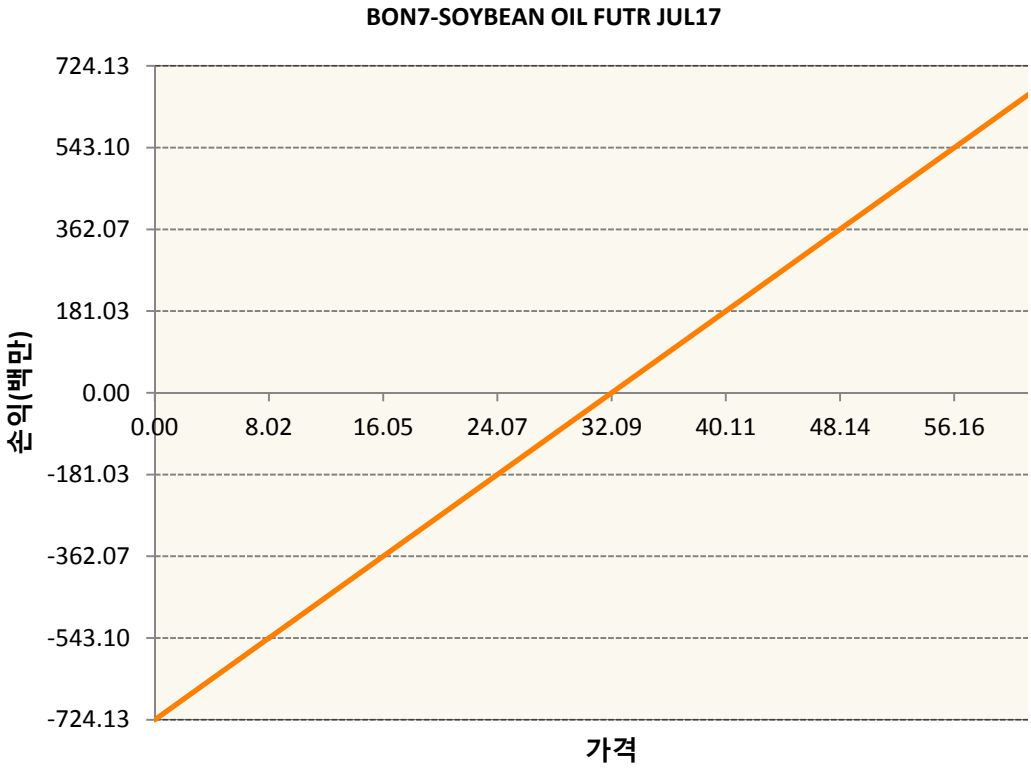
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

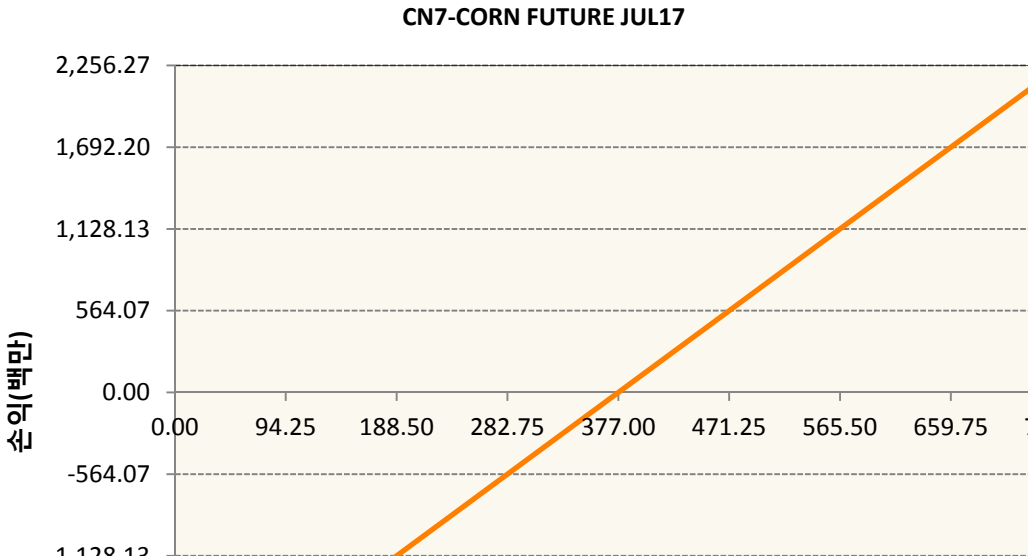
1. 계약금액

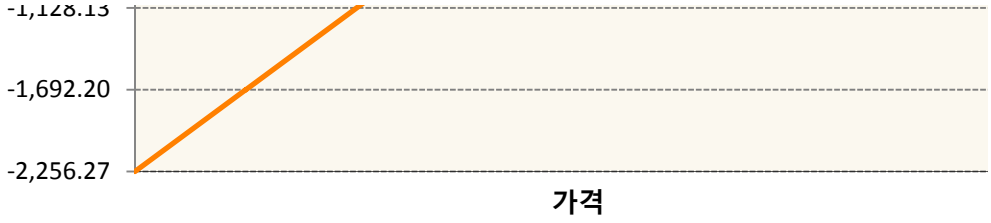
(단위:백만원)

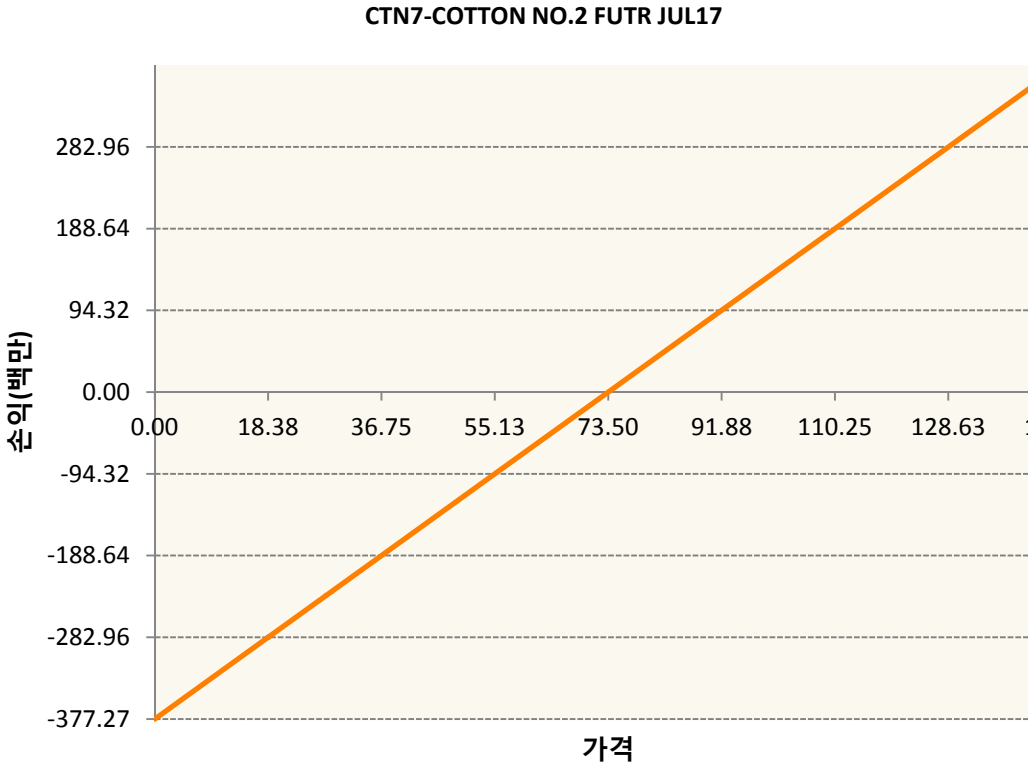
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,286	393	7,892	

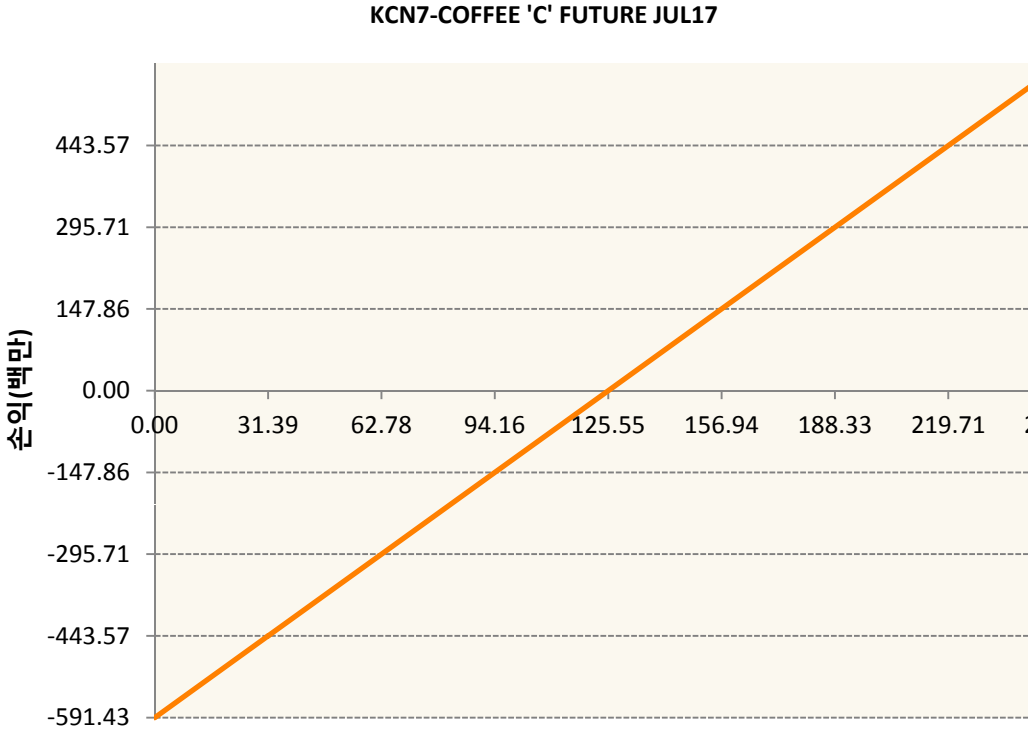
2. 만기시점의 손익구조





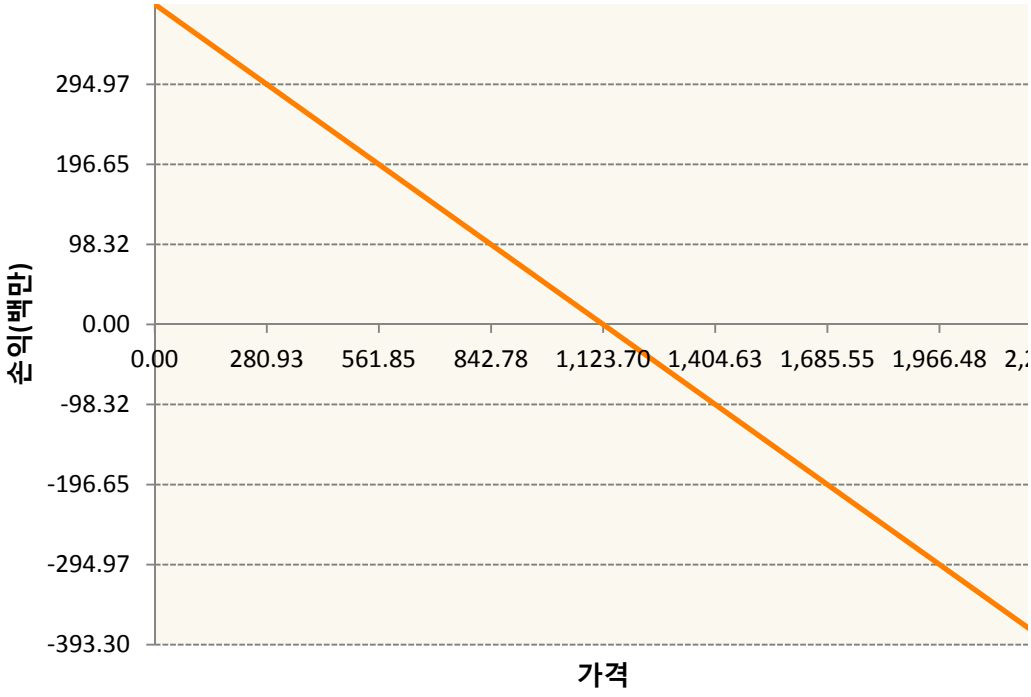

-1,692.20
-2,256.27
가격


CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
282.96
188.64
94.32
0.00
-94.32
-188.64
-282.96
-377.27
0.00
18.38
36.75
55.13
73.50
91.88
110.25
128.63
순익(백만)
가격

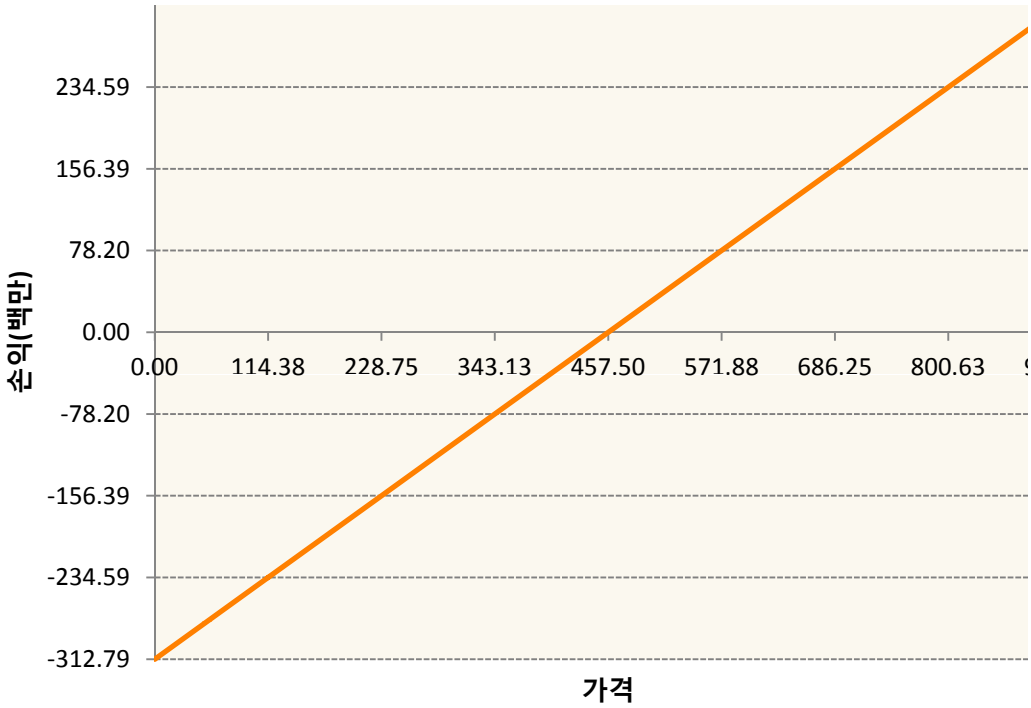

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
443.57
295.71
147.86
0.00
-147.86
-295.71
-443.57
-591.43
0.00
31.39
62.78
94.16
125.55
156.94
188.33
219.71
순익(백만)

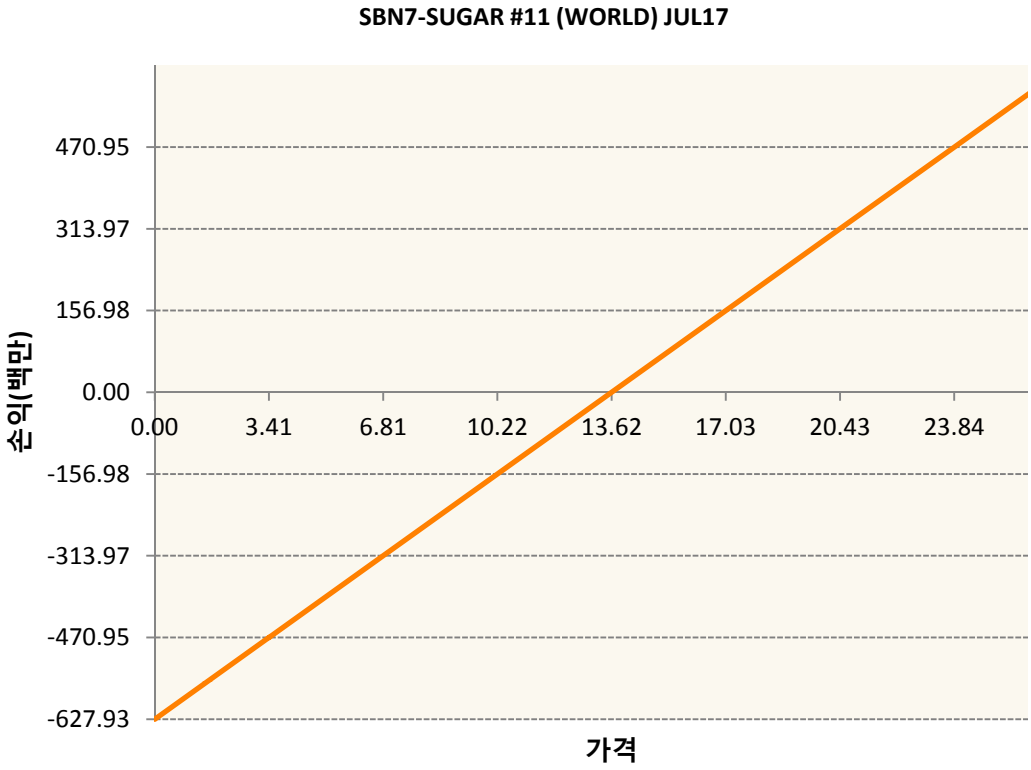
가격

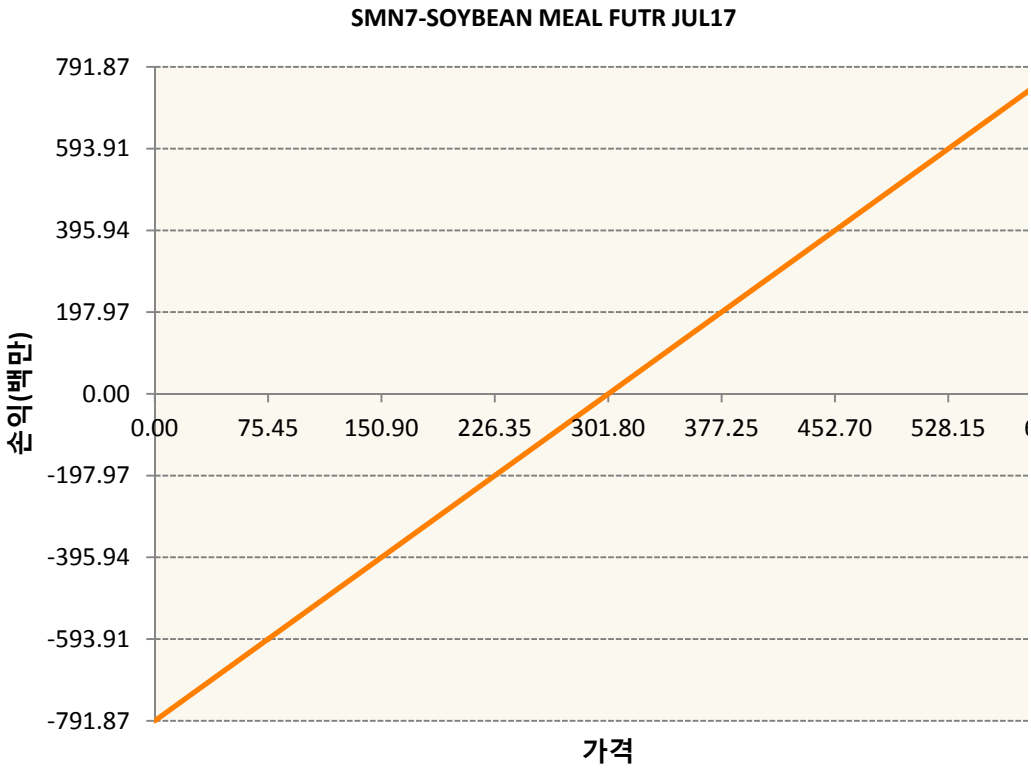
KR4175M60005-2017-06 달러선물

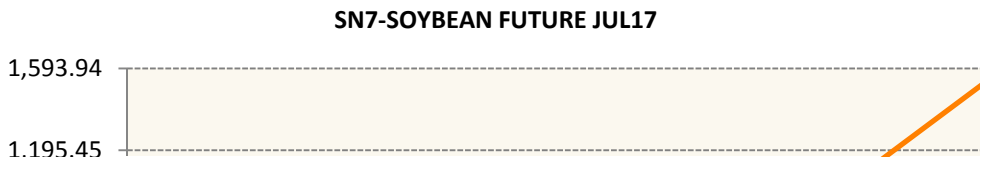


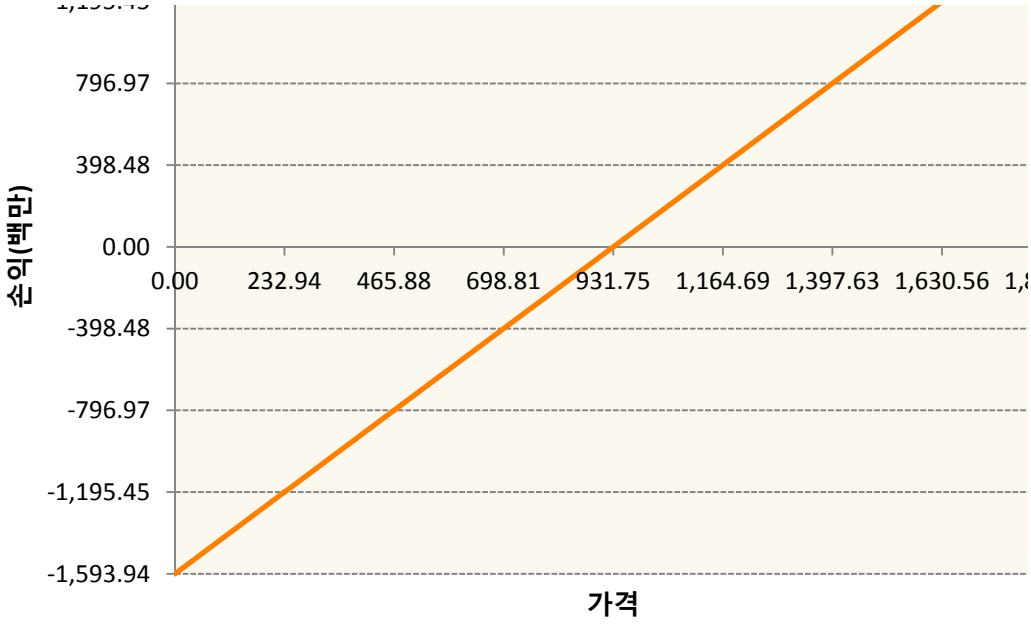
KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17



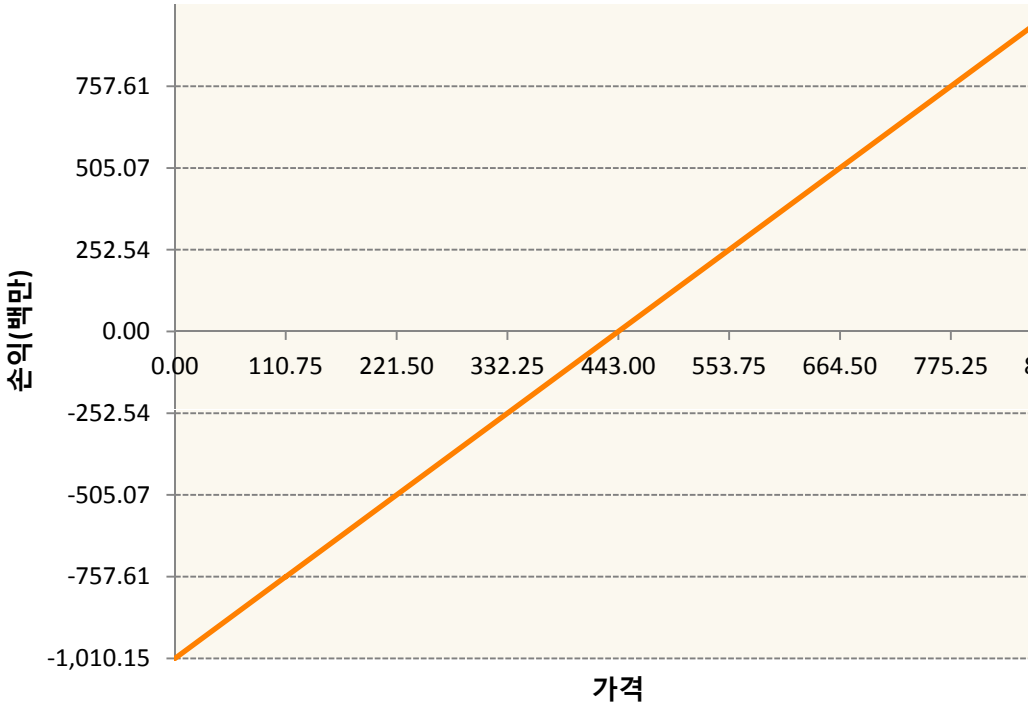

SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
470.95
313.97
156.98
0.00
-156.98
-313.97
-470.95
-627.93
손익(백만)
0.00
3.41
6.81
10.22
13.62
17.03
20.43
23.84
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
791.87
593.91
395.94
197.97
0.00
-197.97
-395.94
-593.91
-791.87
손익(백만)
0.00
75.45
150.90
226.35
301.80
377.25
452.70
528.15
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,593.94
1,195.45



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	30
KCN7	COFFEE 'C' FUTURE JUL17	47
KR4175M60(	2017-06 달러선물	31

KWN7	KC HRW WHEAT FUT JUL17	25
SBN7	SUGAR #11 (WORLD) JUL17	50
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)

750