공시일	2017-06-19
기준일	2017-06-16

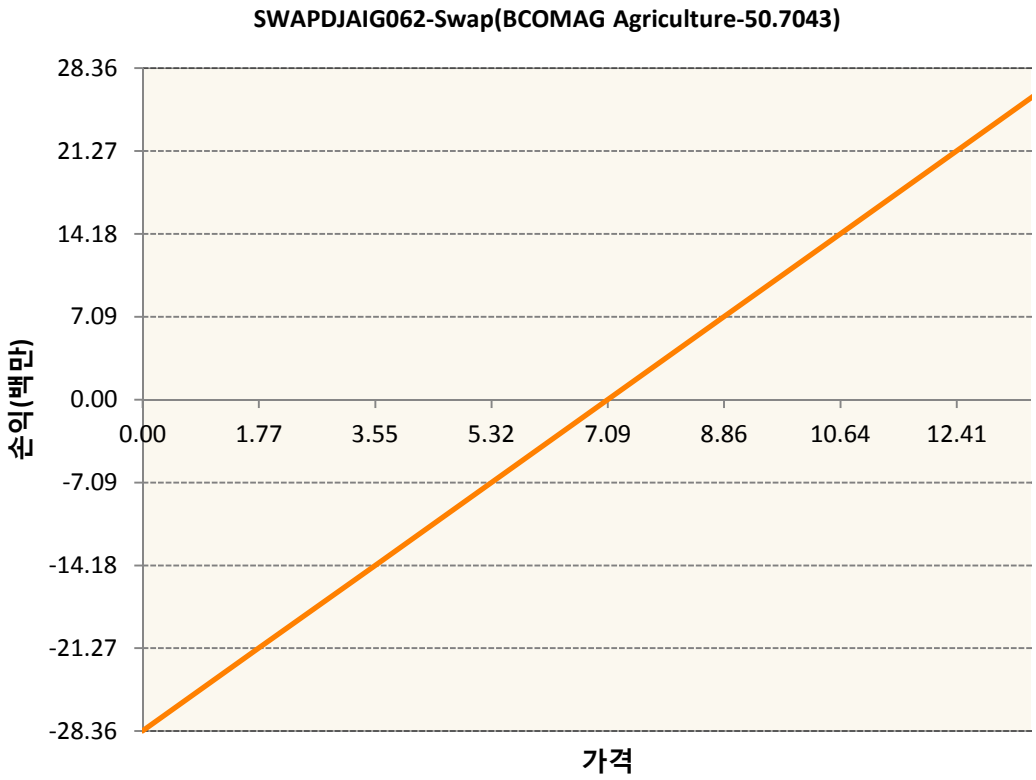
포커스농산물모(채권-파생평)

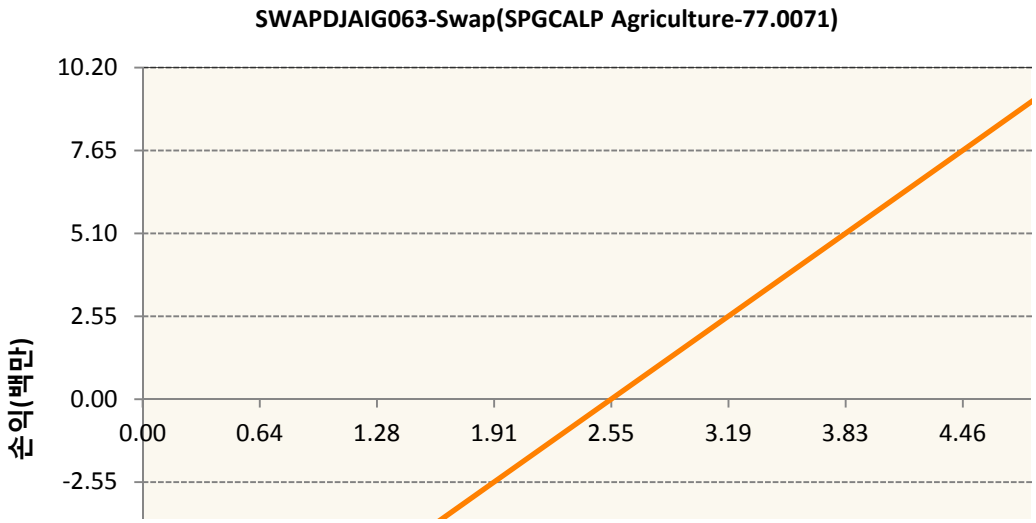
1. 계약금액

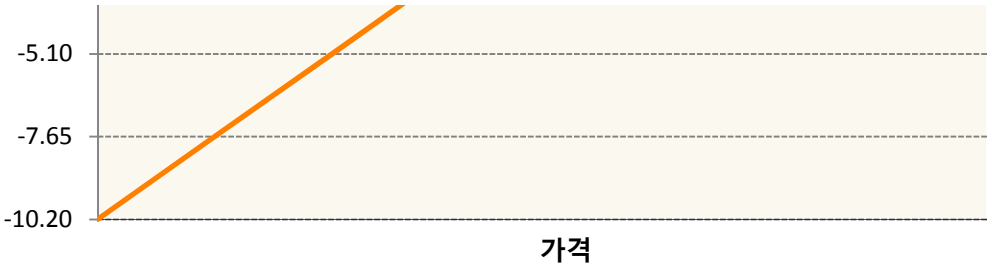
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	39	0	39	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	2017-06-19
기준일	2017-06-16

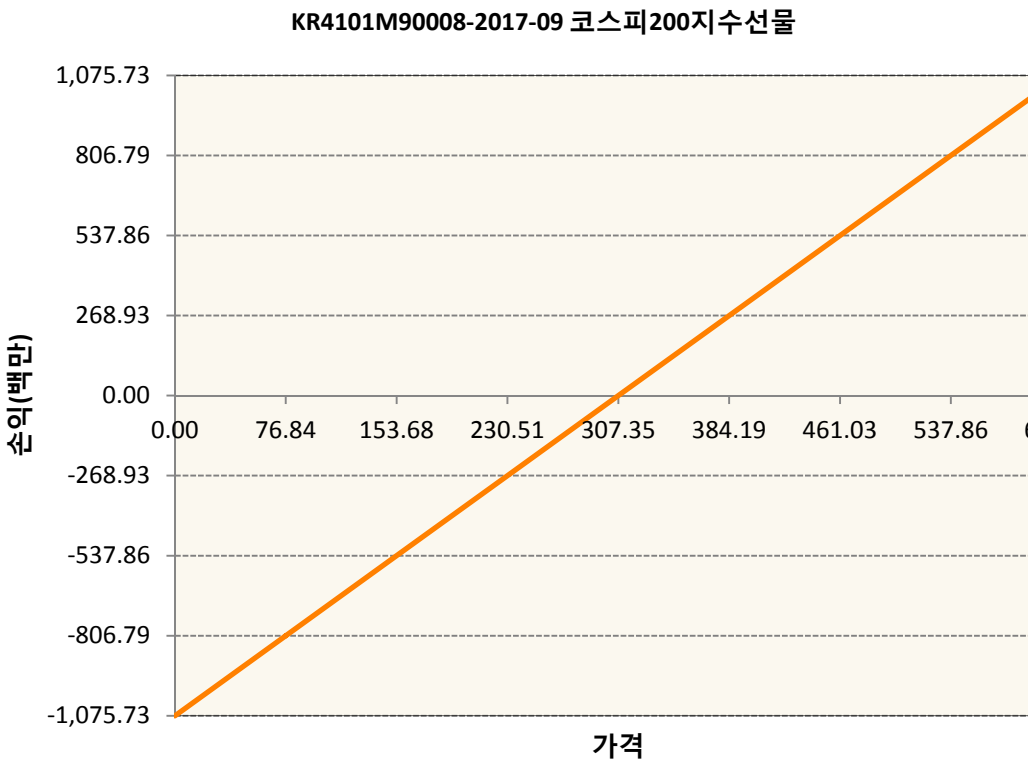
스마트인덱스모

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	1,076	0	1,076	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	2017-06-19
기준일	2017-06-16

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)

509

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-19
기준일	2017-06-16

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)

327

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-19
기준일	2017-06-16

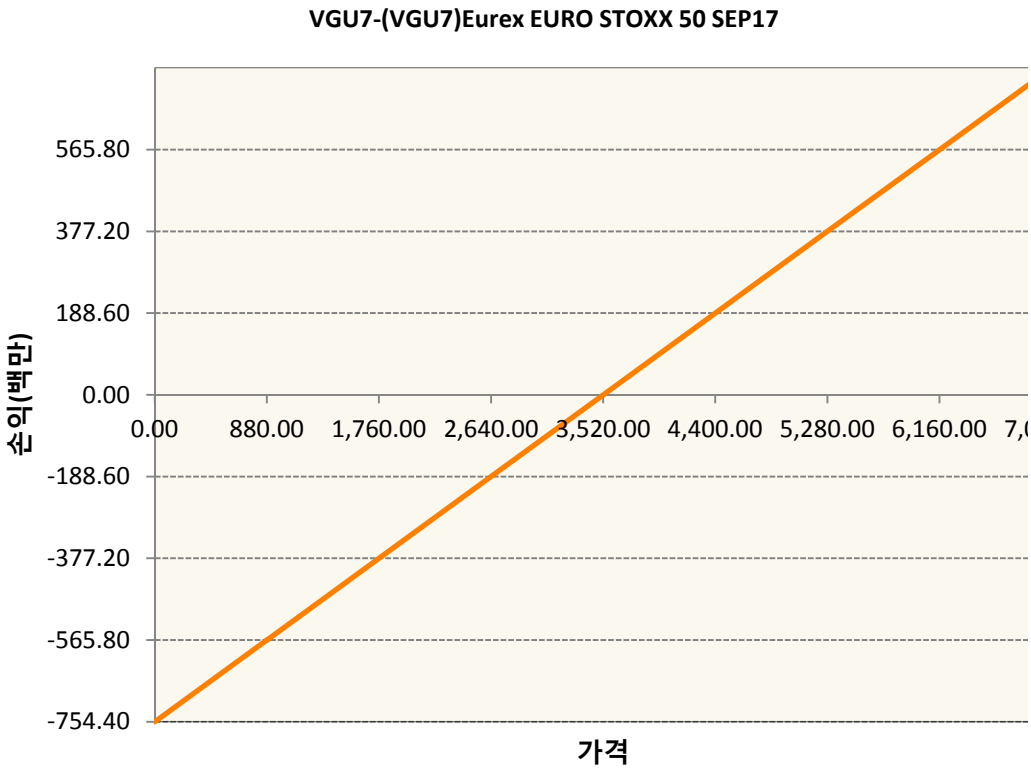
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	754	0	754	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	60

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

(단위:백만원)

56

공시일	2017-06-19
기준일	2017-06-16

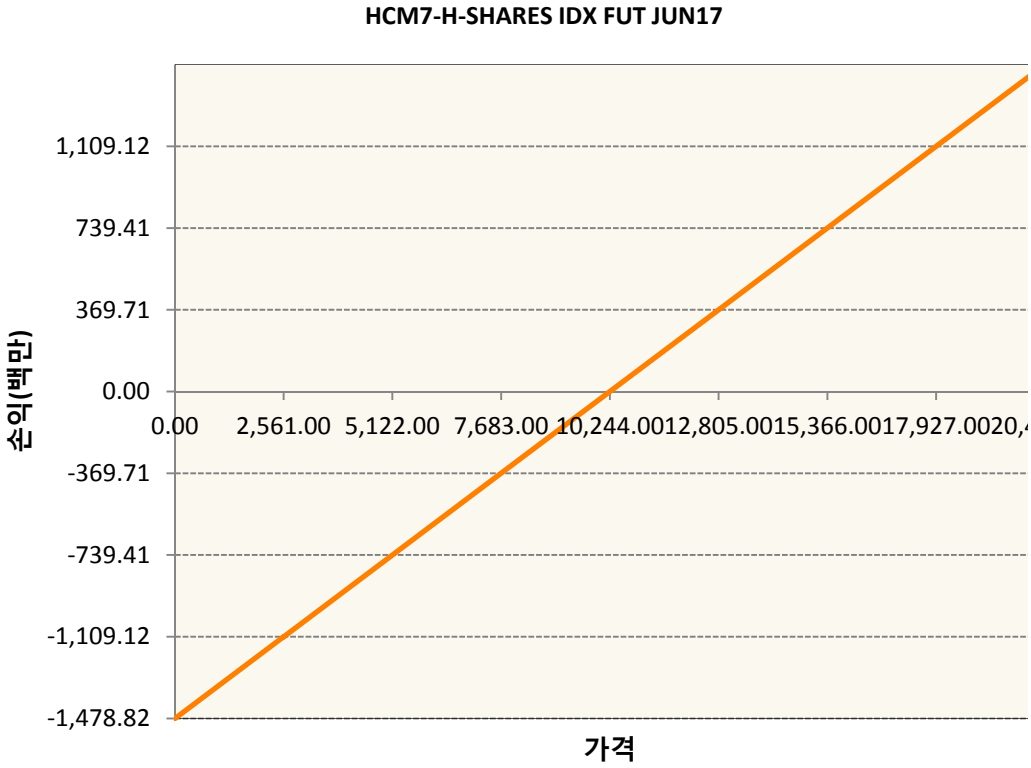
차이나인덱스모(주식-파생형)

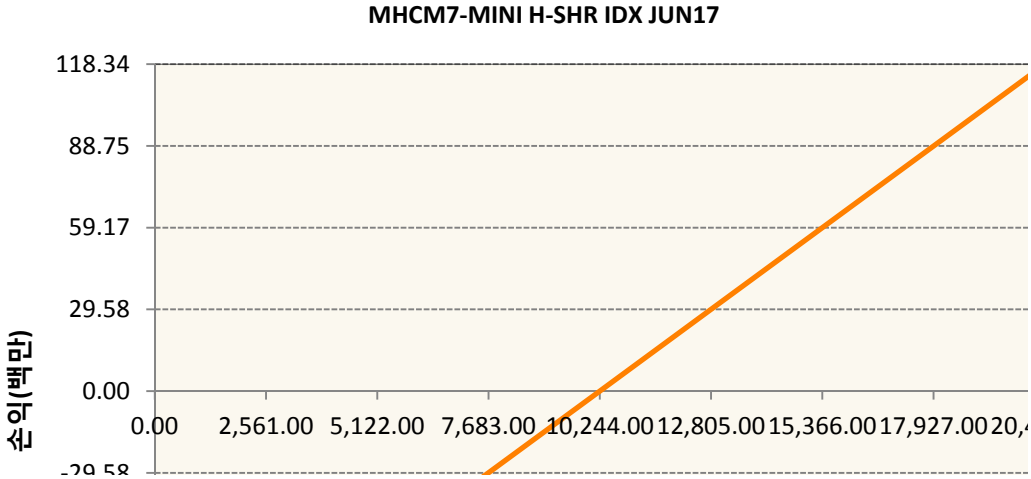
1. 계약금액

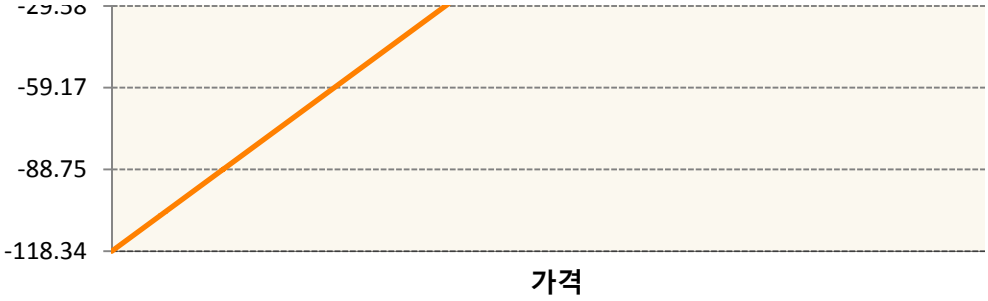
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계			1,479	0	1,479	
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)

92

공시일	2017-06-19
기준일	2017-06-16

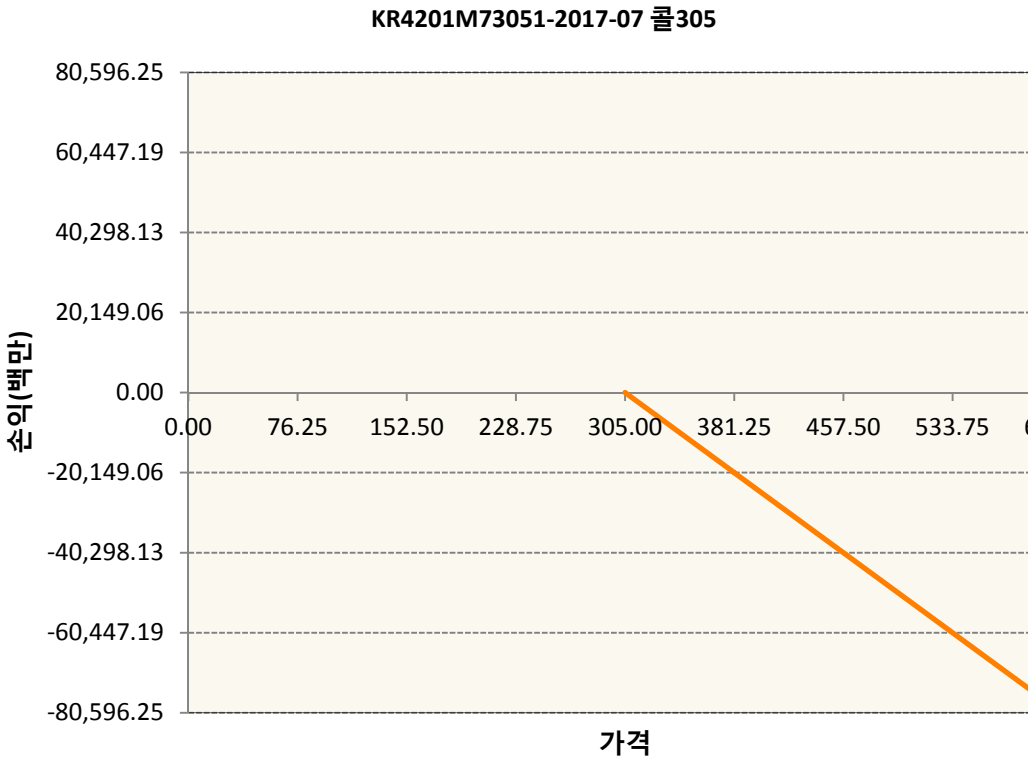
커버드콜모(주식혼합-파생형)

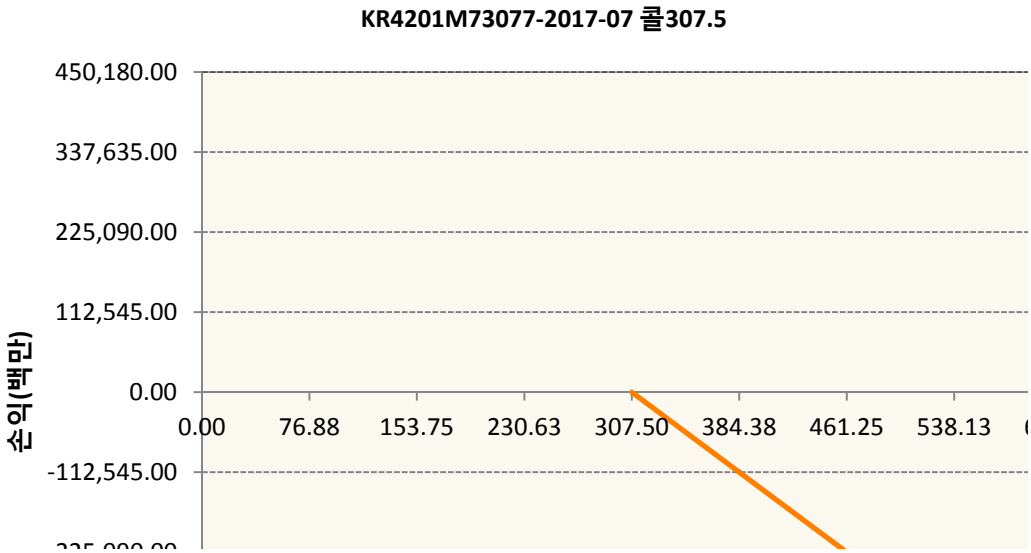
1. 계약금액

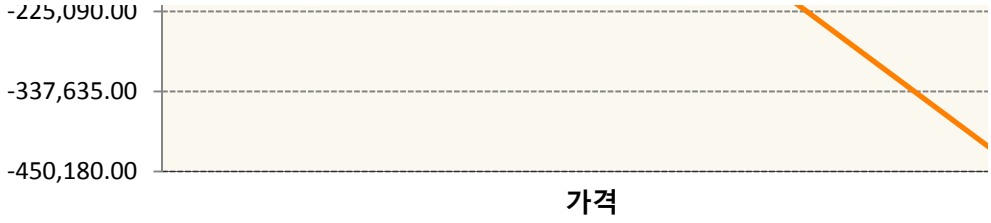
(단위:백만원)

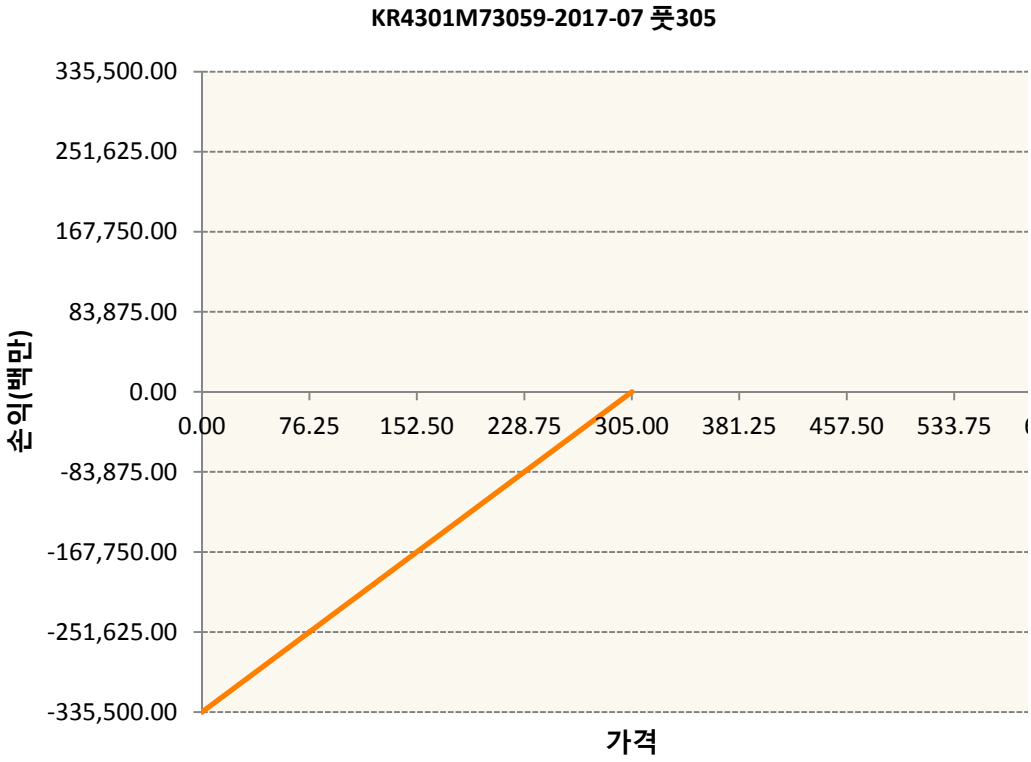
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	15,464	-15,464	장내
누계	유가증권	옵션	0	881,651	-881,651	장내

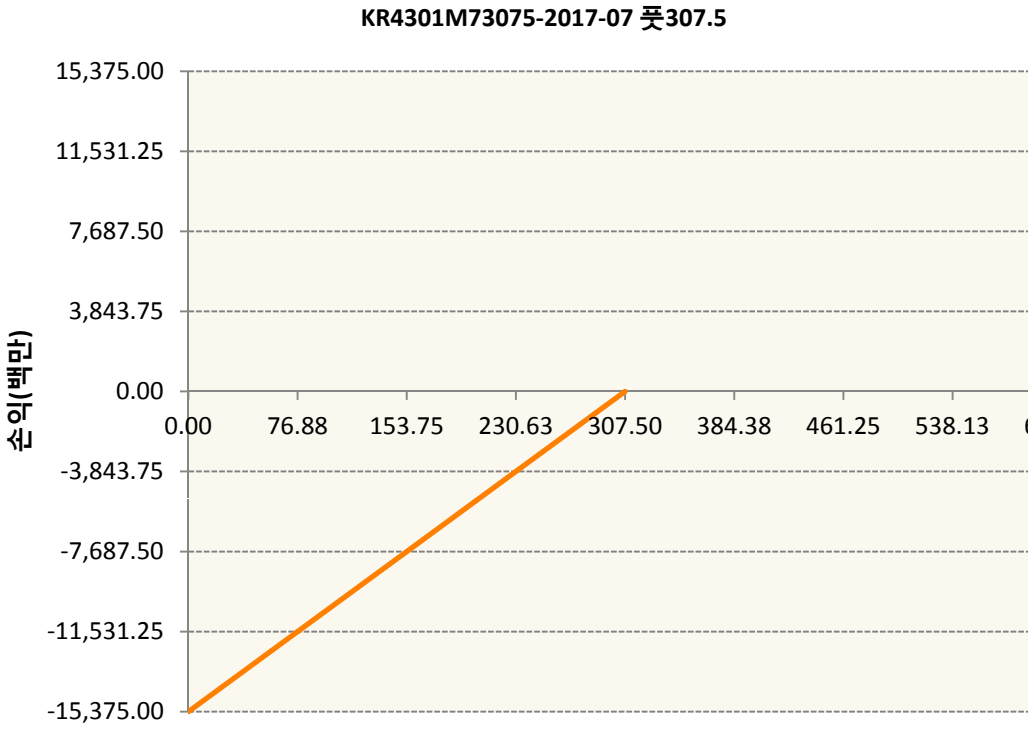
2. 만기시점의 손익구조






-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							5,698
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,268	1,267	1,266	1,262	1,257	1,250	1,240
-5.33%	1,255	1,243	1,226	1,203	1,176	1,144	1,108
-2.67%	1,077	1,019	957	891	823	754	682
0%	249	166	83	0	-84	-167	-251
2.67%	-1,436	-1,474	-1,518	-1,567	-1,620	-1,677	-1,738
5.33%	-3,522	-3,528	-3,538	-3,552	-3,571	-3,594	-3,622
8.00%	-5,677	-5,677	-5,678	-5,680	-5,684	-5,690	-5,698
KR4201M73(2017-07 콜307.5							29,886
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,142	5,141	5,137	5,129	5,114	5,089	5,053
-5.33%	5,116	5,082	5,028	4,950	4,849	4,723	4,574
-2.67%	4,601	4,369	4,104	3,814	3,502	3,172	2,826
0%	1,410	940	470	0	-471	-941	-1,412
2.67%	-6,631	-6,934	-7,262	-7,612	-7,979	-8,360	-8,752
5.33%	-17,785	-17,853	-17,950	-18,077	-18,233	-18,416	-18,624
8.00%	-29,678	-29,684	-29,697	-29,721	-29,759	-29,813	-29,886
KR4301M73(2017-07 풋305							21,806
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21,689	-21,692	-21,698	-21,711	-21,732	-21,763	-21,806
-5.33%	-12,753	-12,804	-12,875	-12,968	-13,081	-13,214	-13,364
-2.67%	-4,504	-4,747	-5,006	-5,278	-5,561	-5,852	-6,150
0%	1,036	692	347	0	-348	-696	-1,045
2.67%	3,010	2,853	2,670	2,466	2,244	2,006	1,755
5.33%	3,317	3,291	3,250	3,191	3,114	3,017	2,901
8.00%	3,336	3,334	3,330	3,321	3,306	3,281	3,246
KR4301M73(2017-07 풋307.5							1,053
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,050	-1,050	-1,050	-1,051	-1,051	-1,052	-1,053
-5.33%	-642	-644	-645	-648	-652	-656	-661
-2.67%	-251	-259	-268	-278	-289	-300	-312
0%	48	32	16	0	-16	-32	-48
2.67%	182	172	161	149	136	123	110

5.33%	210	207	204	200	194	188	181
8.00%	212	212	211	211	209	208	205

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

66,069

공시일	2017-06-19
기준일	2017-06-16

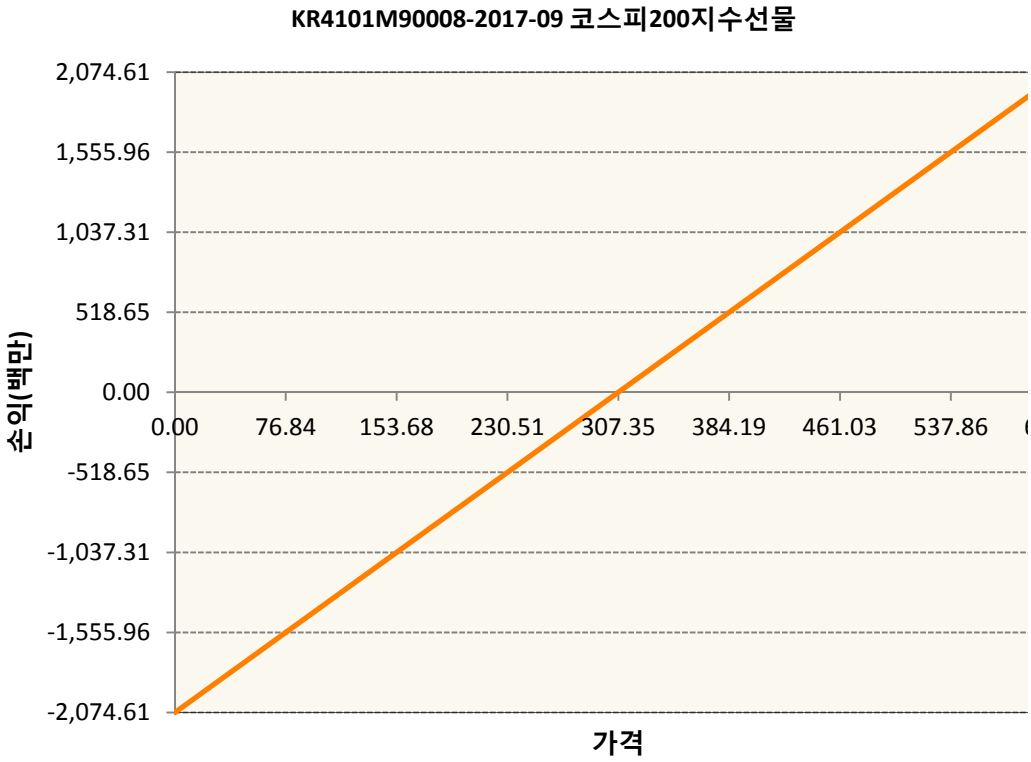
커버드콜목표전환형증권투자신탁

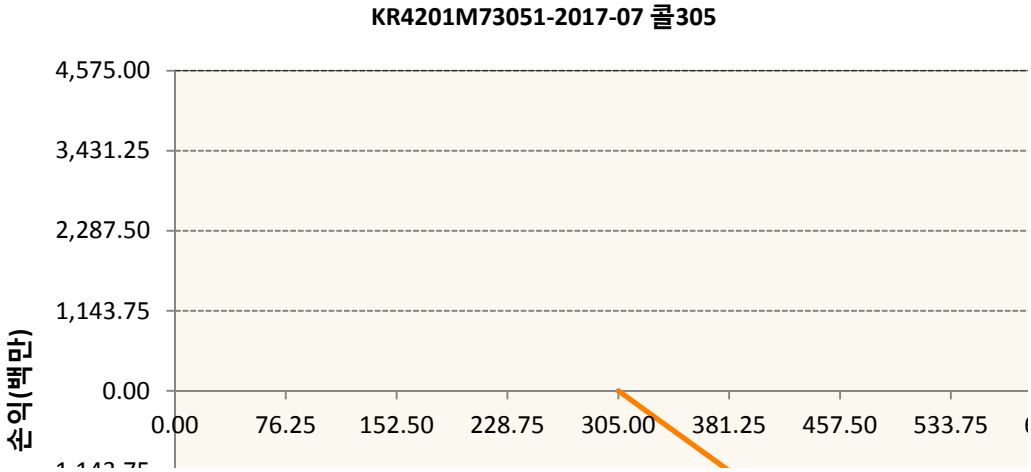
1. 계약금액

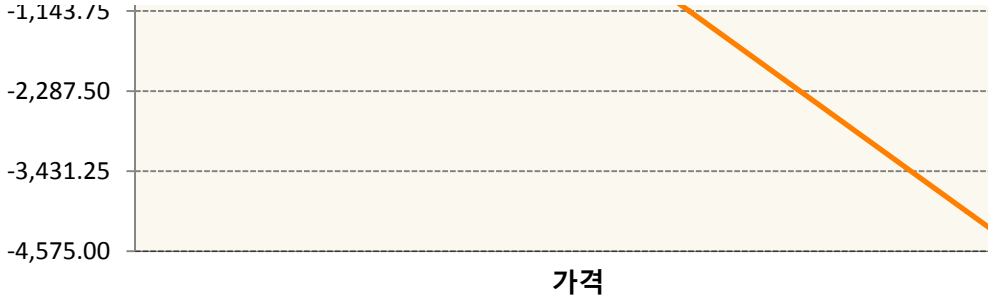
(단위:백만원)

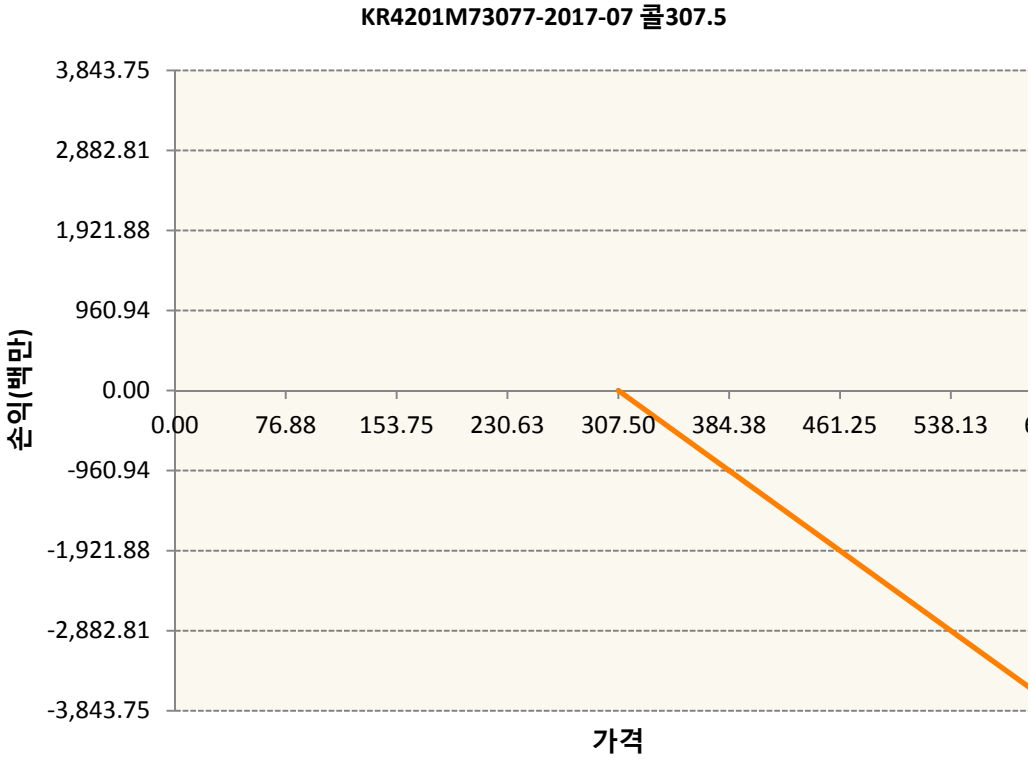
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	76	0	76	장내
누계	유가증권	선물	2,075	0	2,075	장내
누계	유가증권	옵션	0	9,879	-9,879	장내

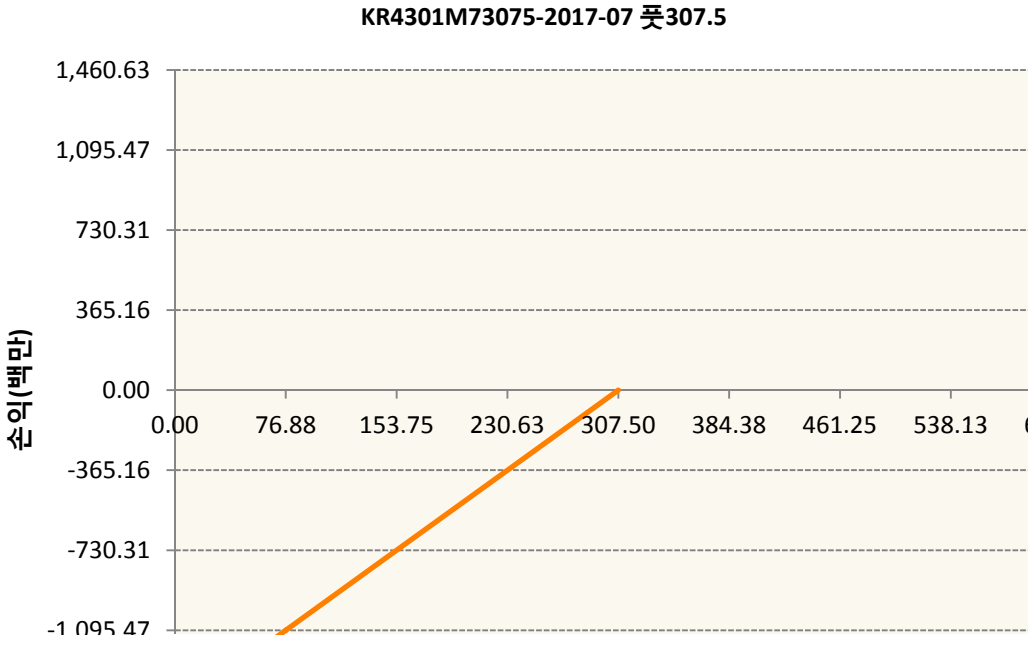
2. 만기시점의 손익구조

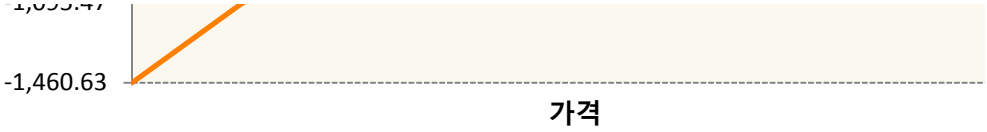





-1,143.75
-2,287.50
-3,431.25
-4,575.00
가격


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
1,460.63
1,095.47
730.31
365.16
0.00
-365.16
-730.31
-1,095.47
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							323
	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	51	47	43	39
0%	14	9	5	0	-5	-9	-14
2.67%	-82	-84	-86	-89	-92	-95	-99
5.33%	-200	-200	-201	-202	-203	-204	-206
8.00%	-322	-322	-322	-322	-323	-323	-323
KR4201M73(2017-07 콜307.5							255
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	44	44	44	44	44	43	43
-5.33%	44	43	43	42	41	40	39
-2.67%	39	37	35	33	30	27	24
0%	12	8	4	0	-4	-8	-12
2.67%	-57	-59	-62	-65	-68	-71	-75
5.33%	-152	-152	-153	-154	-156	-157	-159
8.00%	-253	-253	-254	-254	-254	-255	-255
KR4301M73(2017-07 풋307.5							100
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-100	-100	-100	-100	-100	-100	-100
-5.33%	-61	-61	-61	-62	-62	-62	-63
-2.67%	-24	-25	-25	-26	-27	-29	-30

0%	5	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	17	16	15	14	13	12	10
5.33%	20	20	19	19	18	18	17
8.00%	20	20	20	20	20	20	19

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

892

공시일	2017-06-19
기준일	2017-06-16

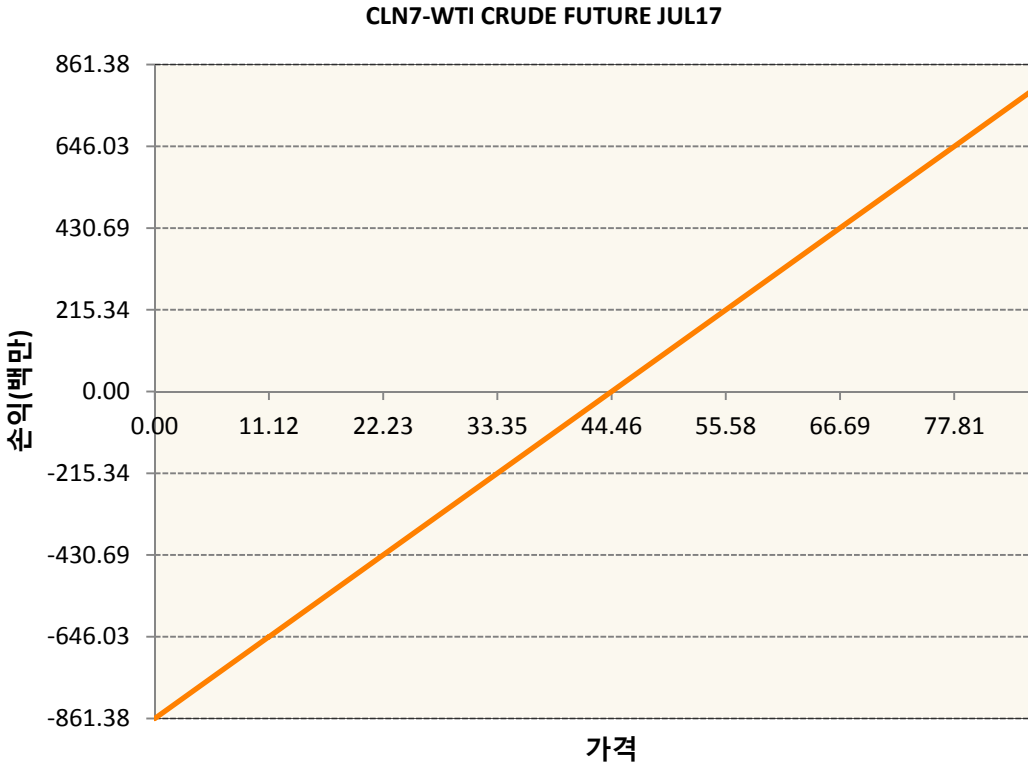
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

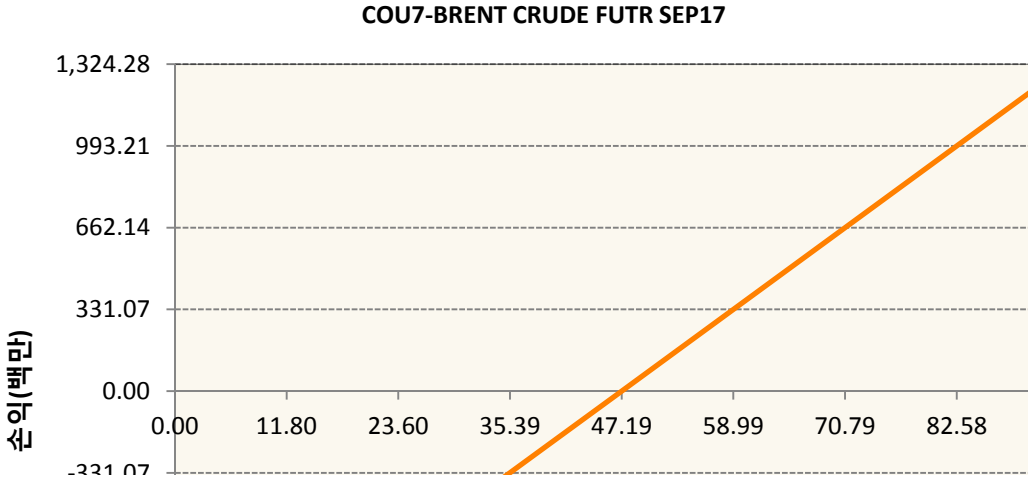
1. 계약금액

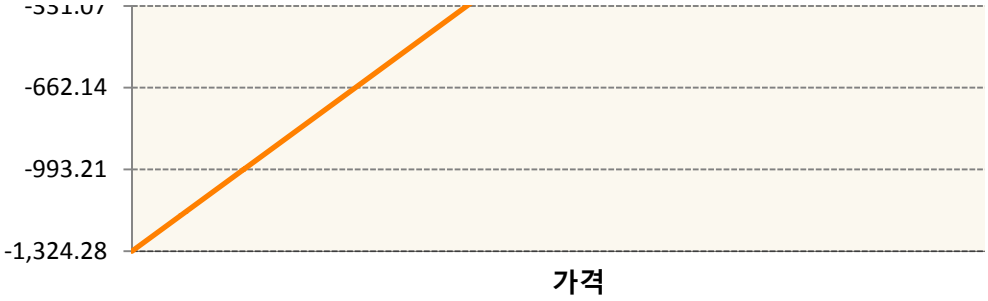
(단위:백만원)

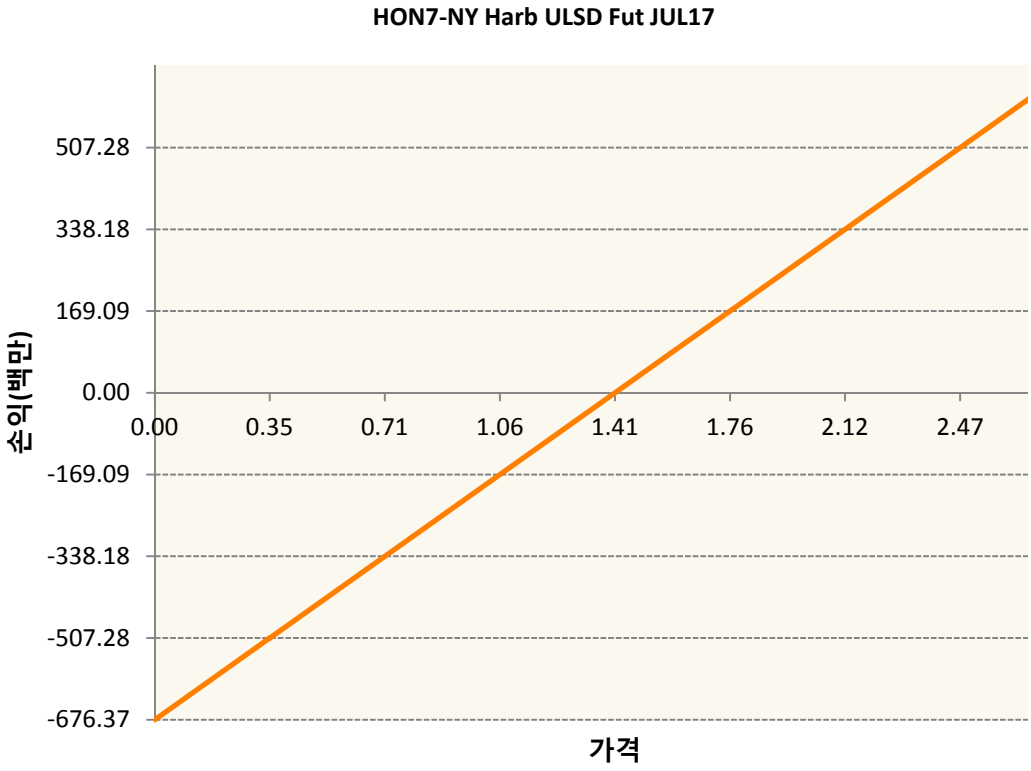
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	226	-226	장내
누계	유가증권	선물	5,012	0	5,012	
누계	통화	선물	0	227	-227	장내

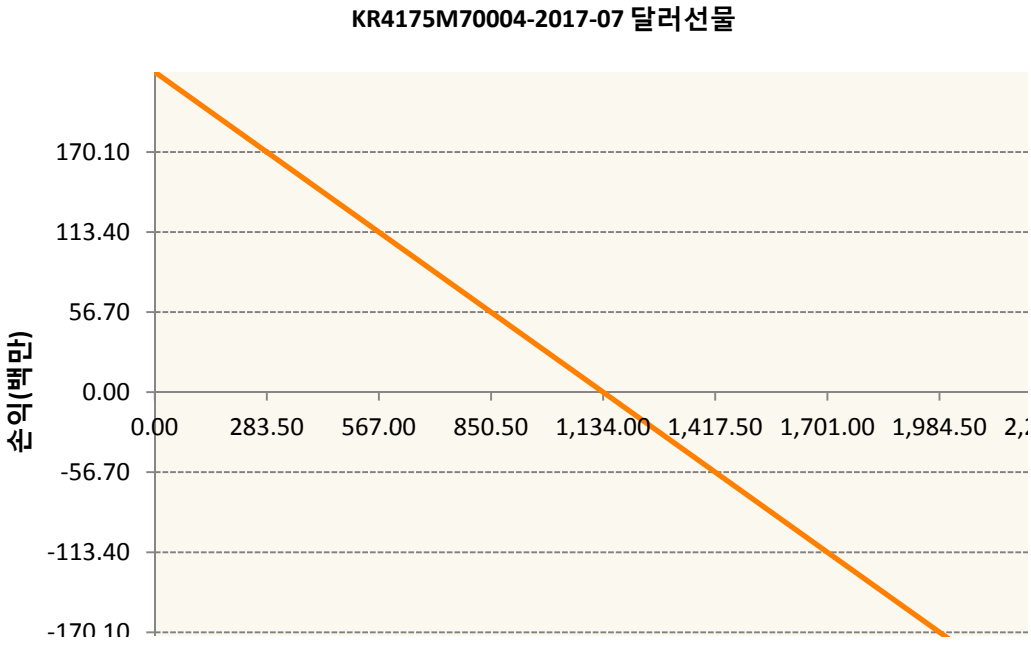
2. 만기시점의 손익구조

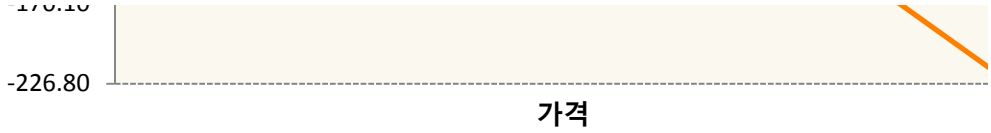


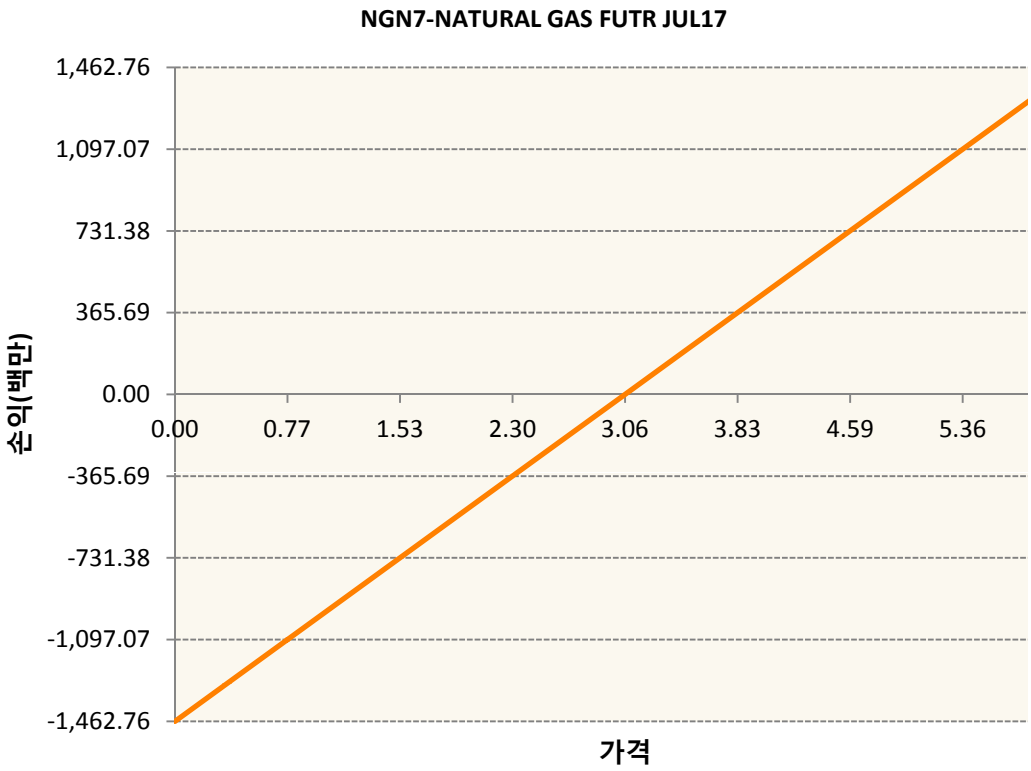


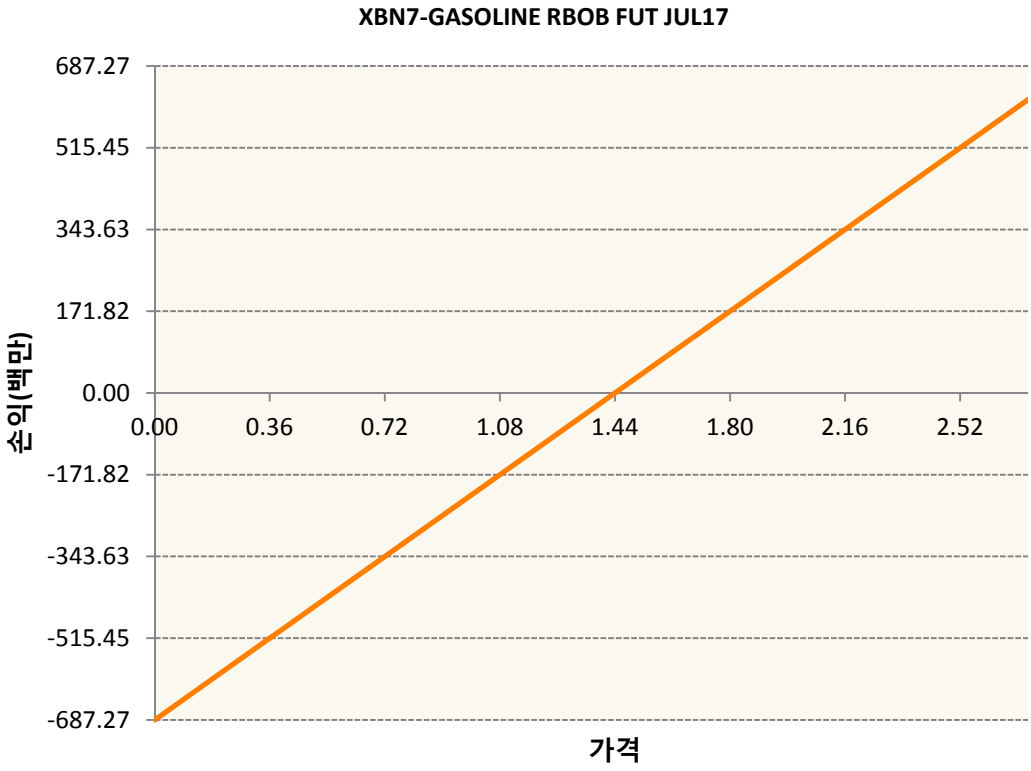

-662.14
-993.21
-1,324.28
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
507.28
338.18
169.09
0.00
-169.09
-338.18
-507.28
-676.37
0.00
0.35
0.71
1.06
1.41
1.76
2.12
2.47
순익(백만)
가격


KR4175M70004-2017-07 달러선물
170.10
113.40
56.70
0.00
-56.70
-113.40
-170.10
0.00
283.50
567.00
850.50
1,134.00
1,417.50
1,701.00
1,984.50
순익(백만)


-226.80
가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,462.76
1,097.07
731.38
365.69
0.00
-365.69
-731.38
-1,097.07
-1,462.76
0.00
0.77
1.53
2.30
3.06
3.83
4.59
5.36
순익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
687.27
515.45
343.63
171.82
0.00
-171.82
-343.63
-515.45
-687.27
0.00
0.36
0.72
1.08
1.44
1.80
2.16
2.52
순익(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
KR4175M70(	2017-07 달러선물	18
NGN7	NATURAL GAS FUTR JUL17	117
XBN7	GASOLINE RBOB FUT JUL17	55

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

821

공시일	2017-06-19
기준일	2017-06-16

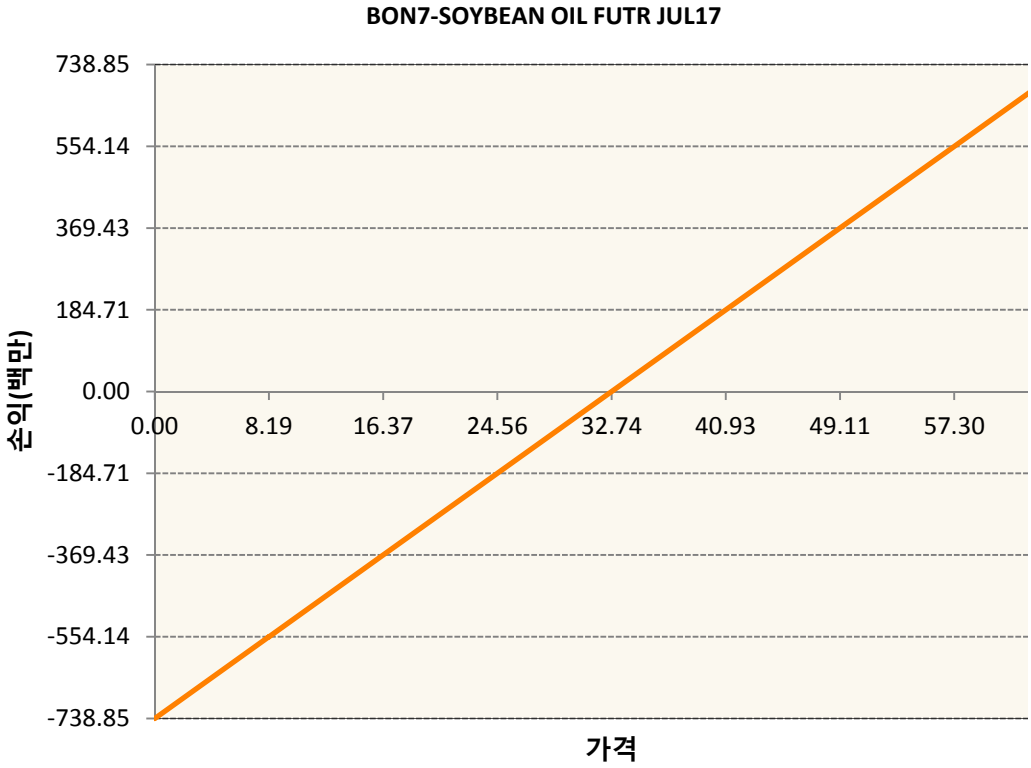
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

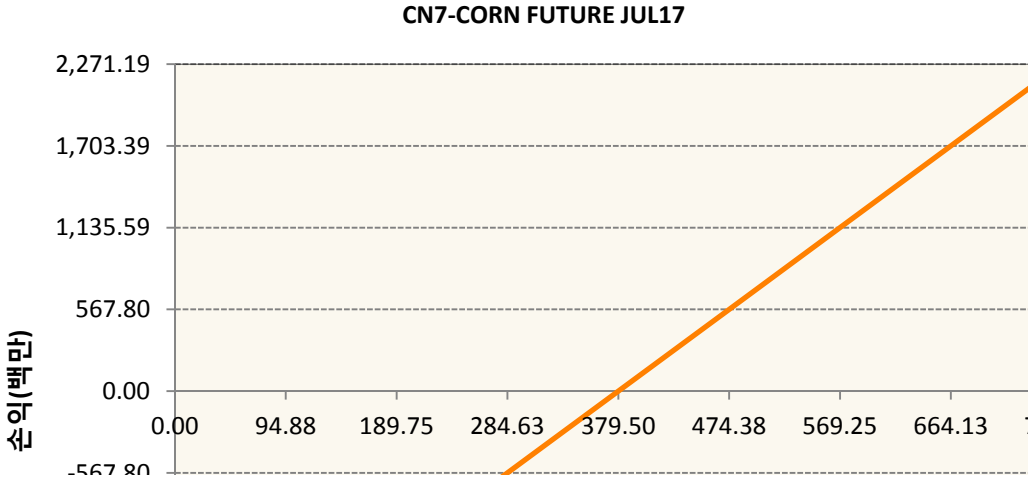
1. 계약금액

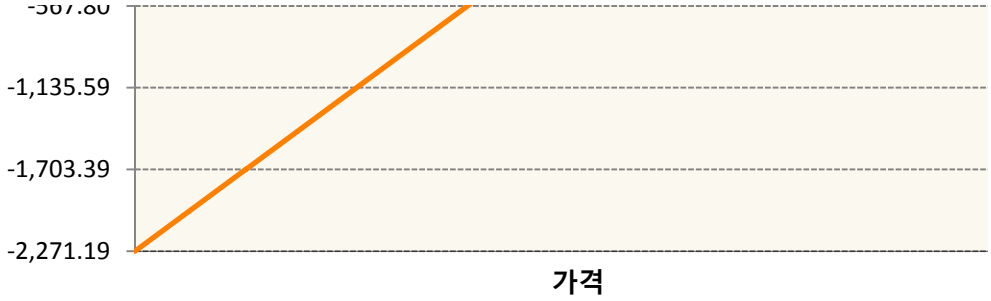
(단위:백만원)

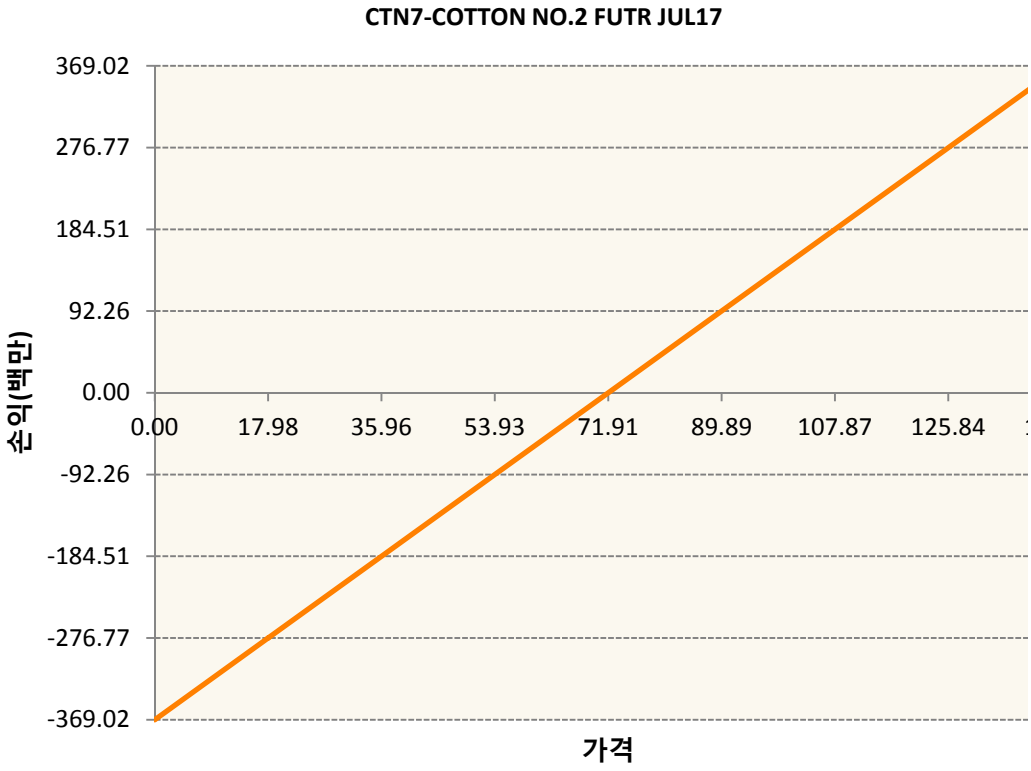
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	395	-395	장내
누계	유가증권	선물	8,331	0	8,331	
누계	통화	선물	0	397	-397	장내

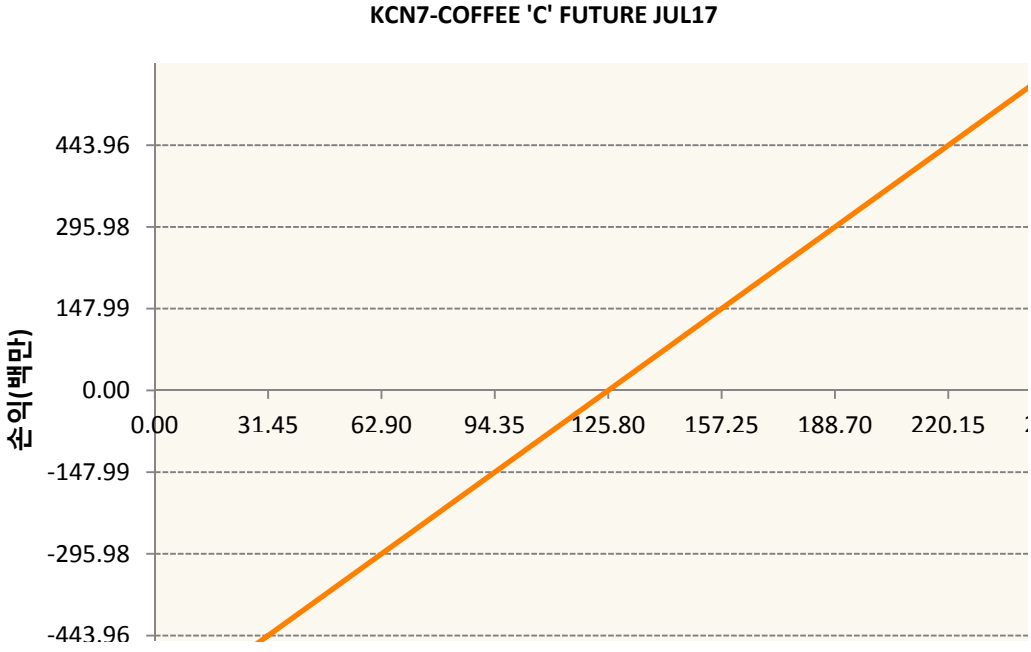
2. 만기시점의 손익구조

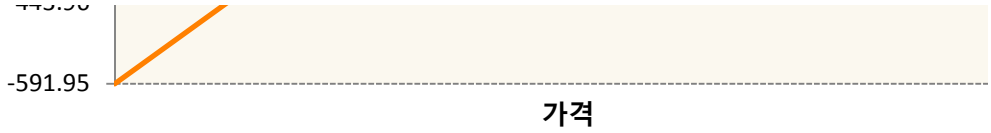


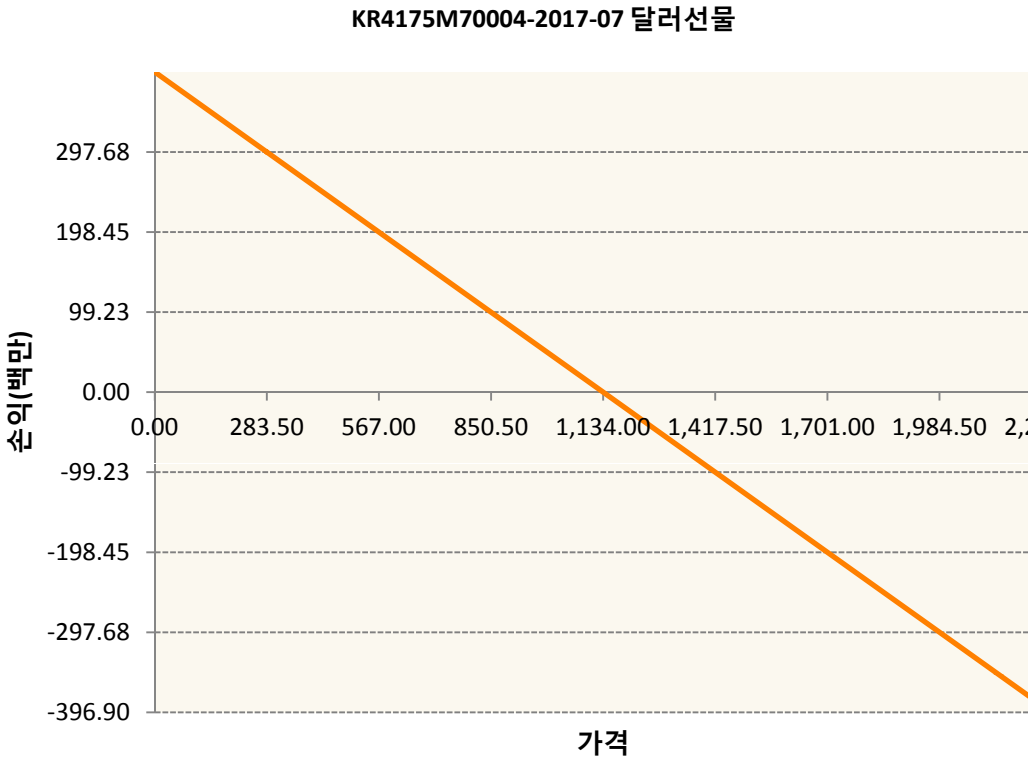


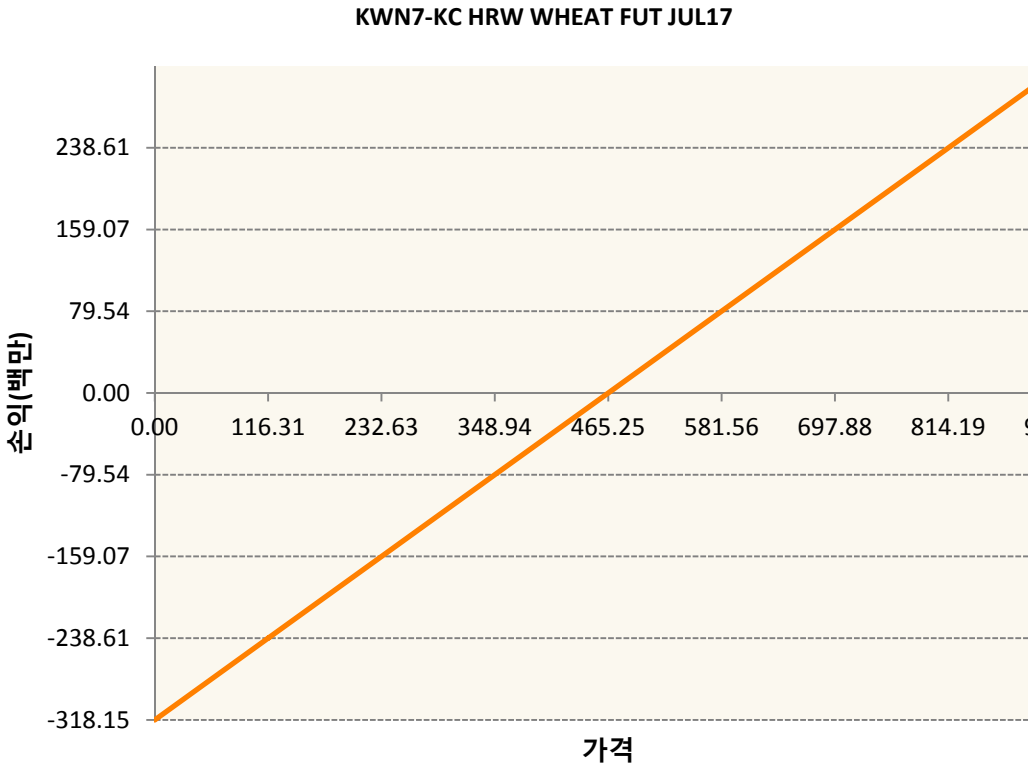

-1,135.59
-1,703.39
-2,271.19
가격

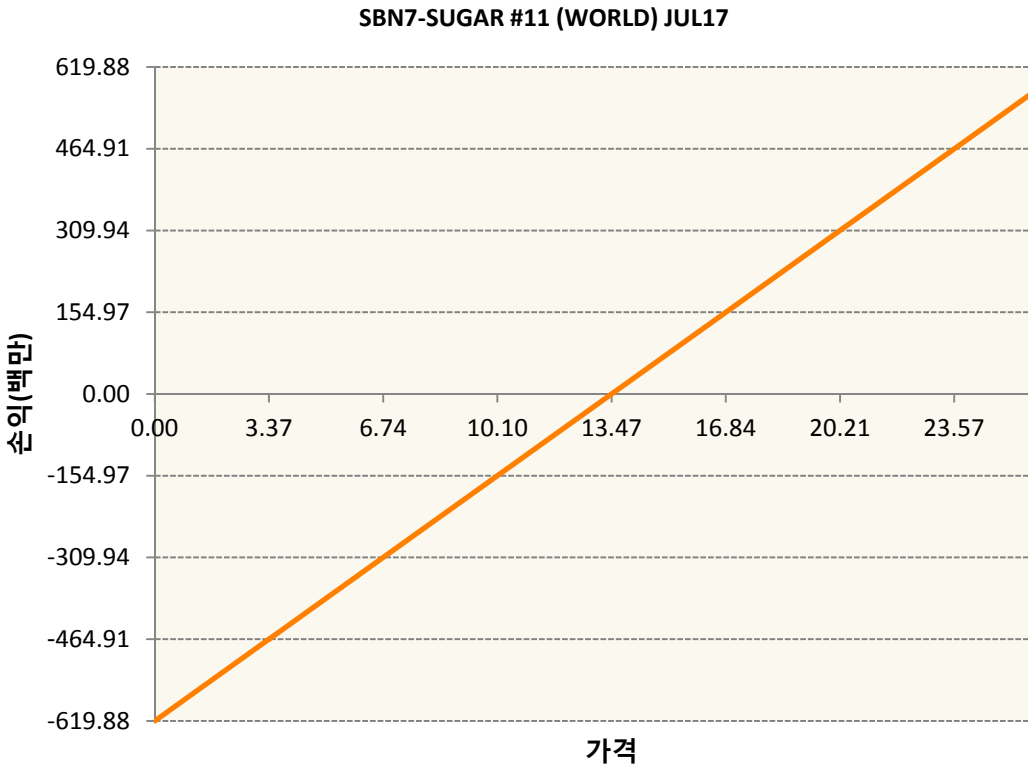

CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
369.02
276.77
184.51
92.26
0.00
-92.26
-184.51
-276.77
-369.02
0.00
17.98
35.96
53.93
71.91
89.89
107.87
125.84
순익(백만)
가격

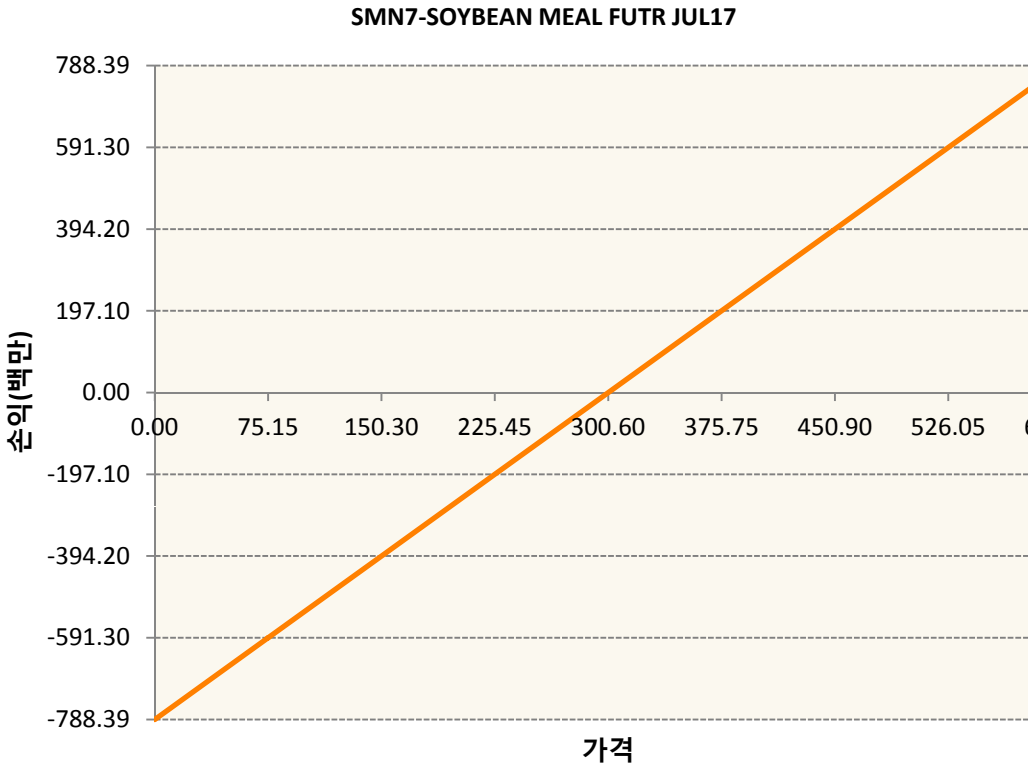

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
443.96
295.98
147.99
0.00
-147.99
-295.98
-443.96
0.00
31.45
62.90
94.35
125.80
157.25
188.70
220.15
순익(백만)

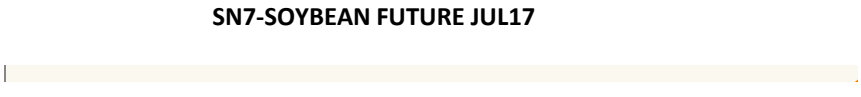

-591.95
가격

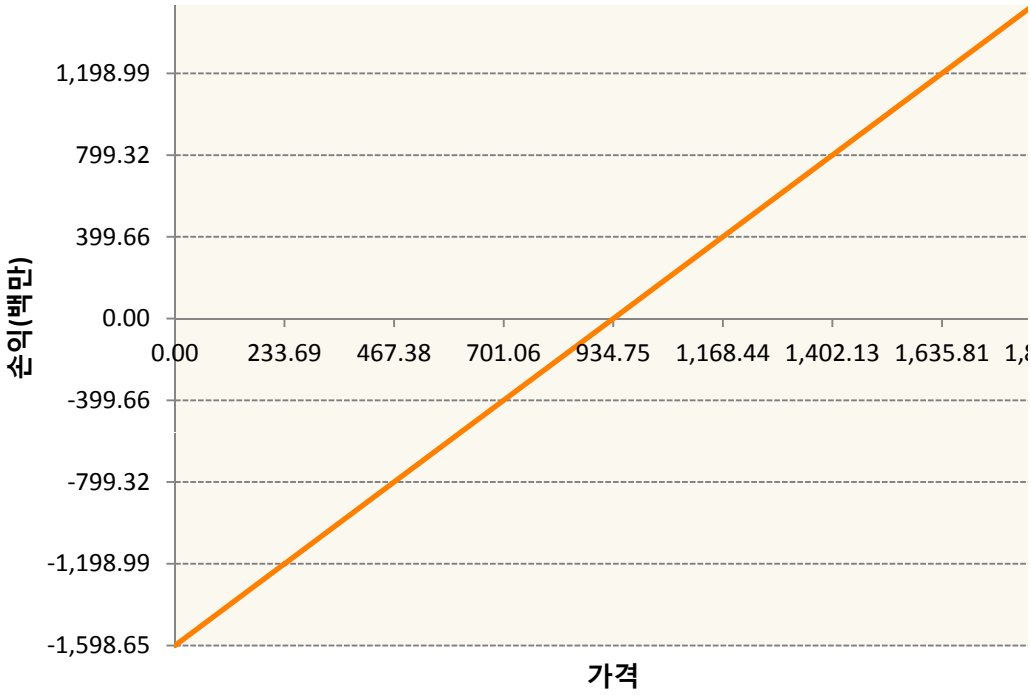

KR4175M70004-2017-07 달러선물
297.68
198.45
99.23
0.00
-99.23
-198.45
-297.68
-396.90
0.00
283.50
567.00
850.50
1,134.00
1,417.50
1,701.00
1,984.50
순익(백만)
가격

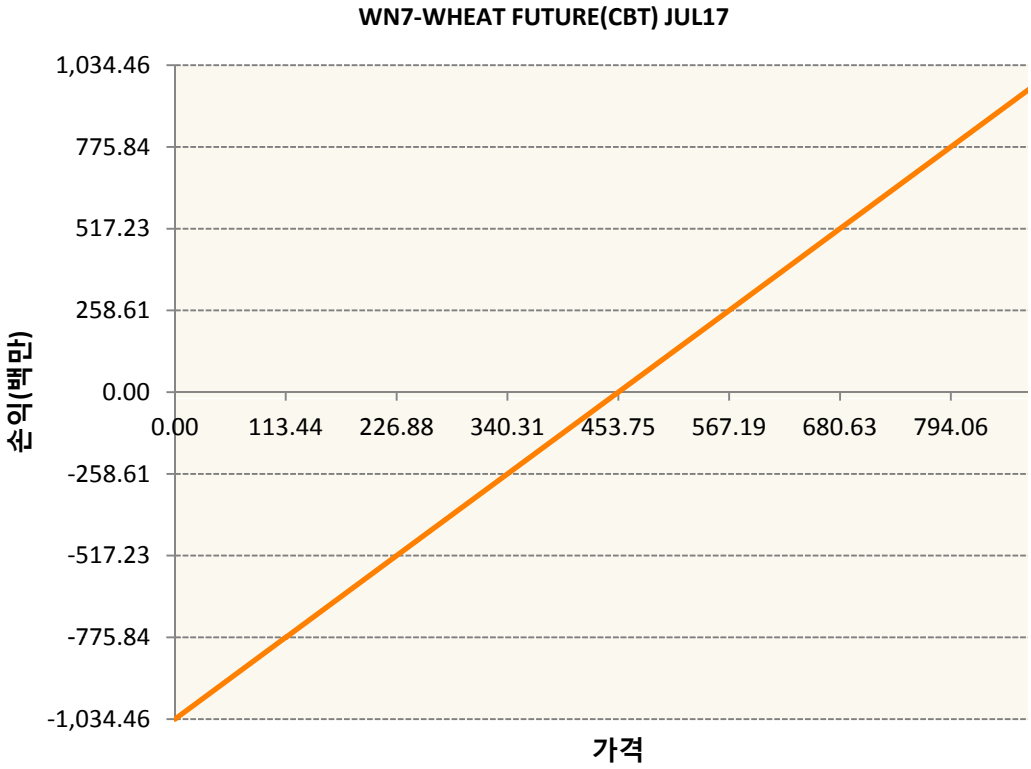

KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17
238.61
159.07
79.54
0.00
-79.54
-159.07
-238.61
-318.15
0.00
116.31
232.63
348.94
465.25
581.56
697.88
814.19
순익(백만)
가격


SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
619.88
464.91
309.94
154.97
0.00
-154.97
-309.94
-464.91
-619.88
0.00
3.37
6.74
10.10
13.47
16.84
20.21
23.57
손익(백만)
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
788.39
591.30
394.20
197.10
0.00
-197.10
-394.20
-591.30
-788.39
0.00
75.15
150.30
225.45
300.60
375.75
450.90
526.05
손익(백만)
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON7	SOYBEAN OIL FUTR JUL17	59
CN7	CORN FUTURE JUL17	182
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	30

KCN7	COFFEE 'C' FUTURE JUL17	47
KR4175M70(	2017-07 달러선물	32
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	83

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

754