

공시일	2018-05-11
기준일	2018-05-10

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	8	0	8	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

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

(단위:백만원)

84

공시일	2018-05-11
기준일	2018-05-10

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	13,869	0	13,869	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S180222

1,112

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

454

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-05-11
기준일	2018-05-10

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	5,081	0	5,081	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S180308

400

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

436

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-05-11
기준일	2018-05-10

유로인덱스모(주식-파생형)

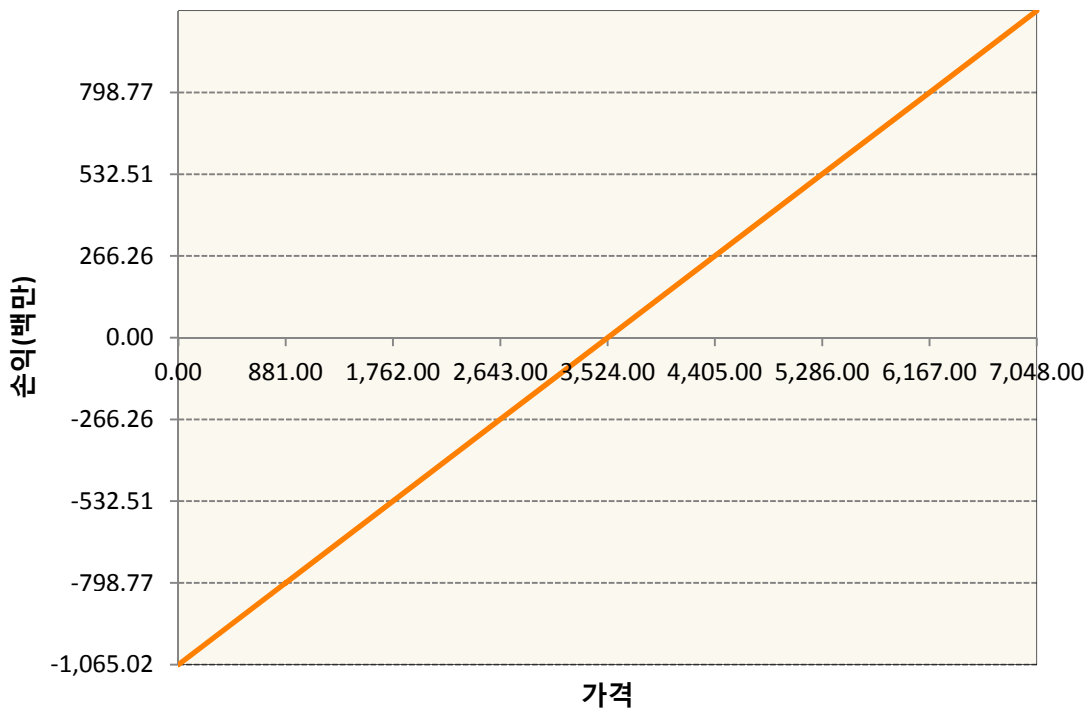
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,065	0	1,065	

2. 만기시점의 손익구조

VGM8-EURO STOXX 50 JUN18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	85
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

51

공시일	2018-05-11
기준일	2018-05-10

차이나인덱스모(주식-파생형)

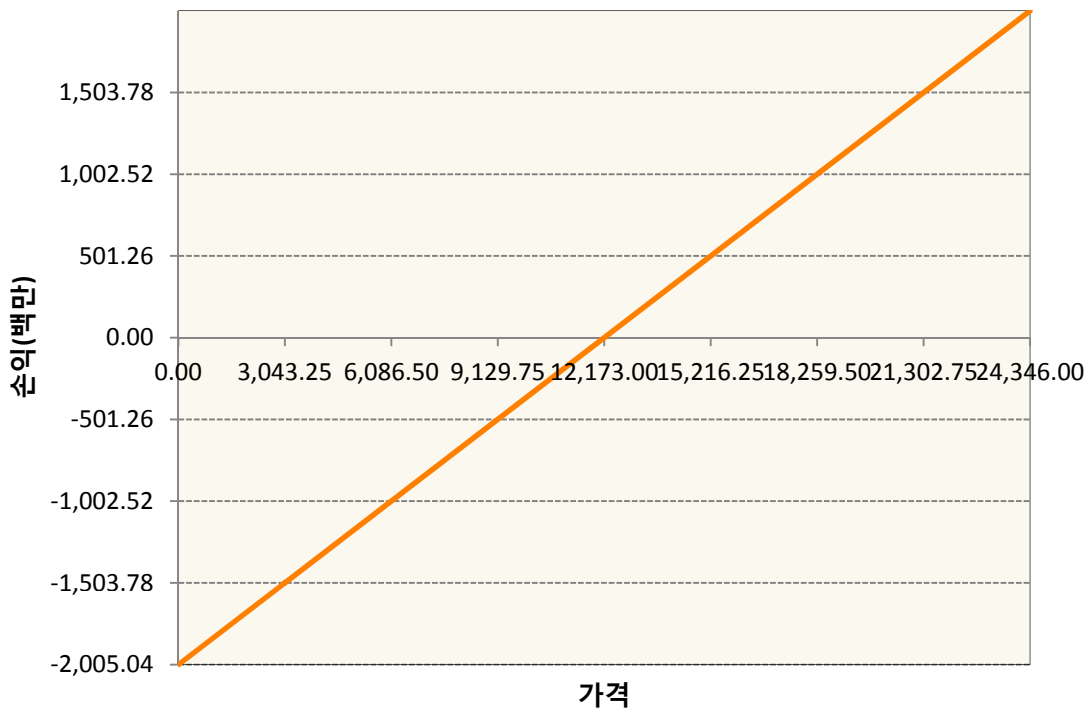
1. 계약금액

(단위:백만원)

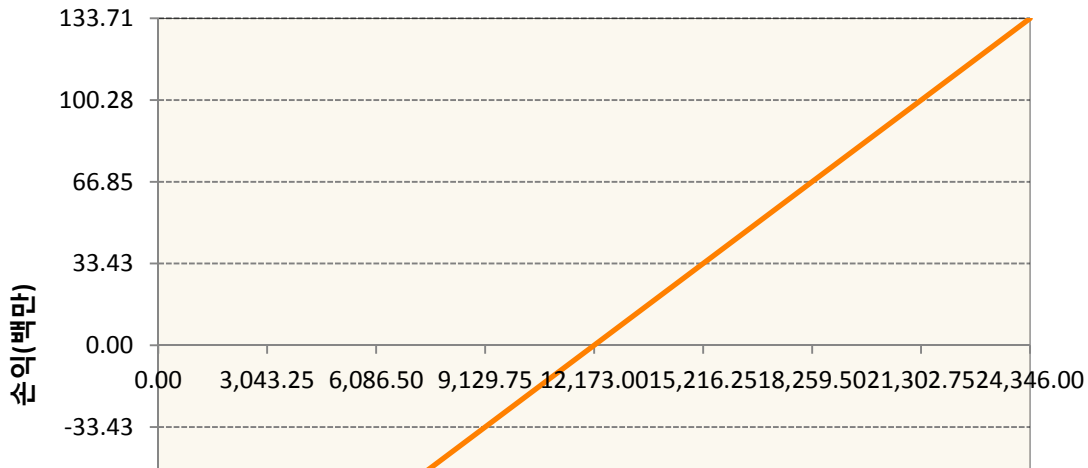
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,139	0	2,139	장내

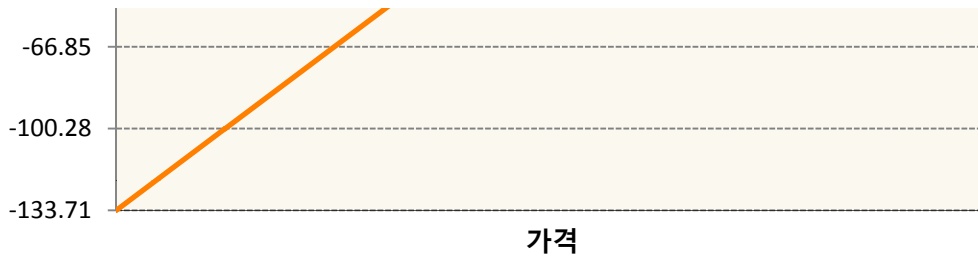
2. 만기시점의 손익구조

HCK8-H-SHARES FUT May18



MHCK8-MINI H-SHR IDX FU May18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCK8	H-SHARES FUT May18	160
MHCK8	MINI H-SHR IDX FU May18	11

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

150

공시일	2018-05-11
기준일	2018-05-10

커버드콜모(주식혼합-파생형)

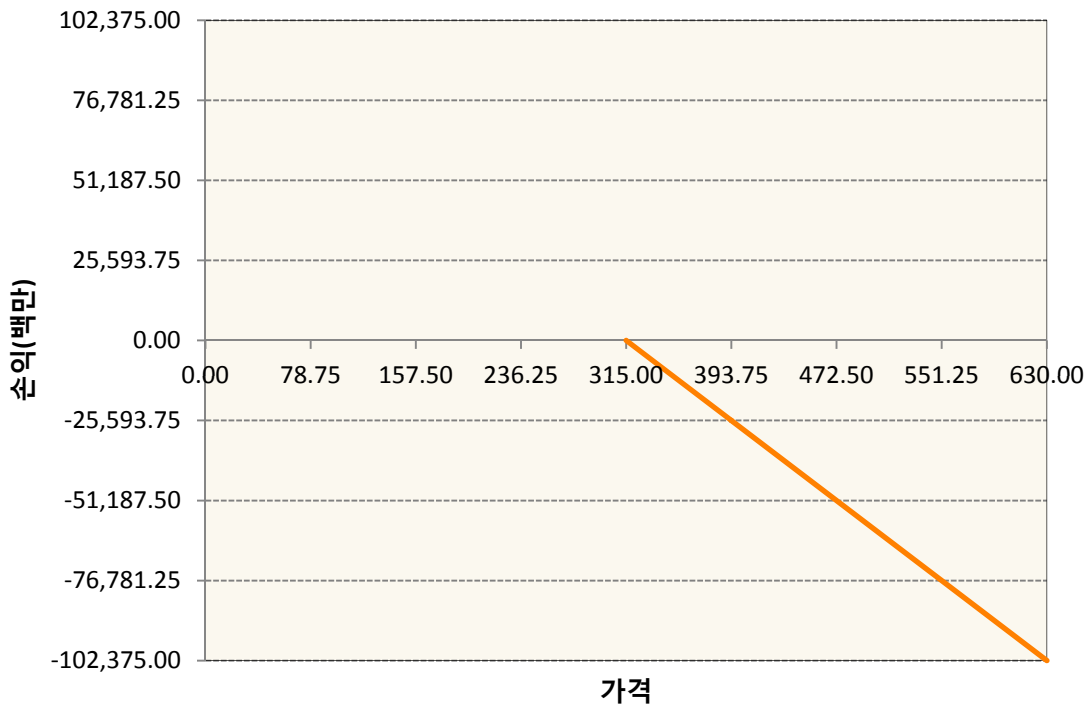
1. 계약금액

(단위:백만원)

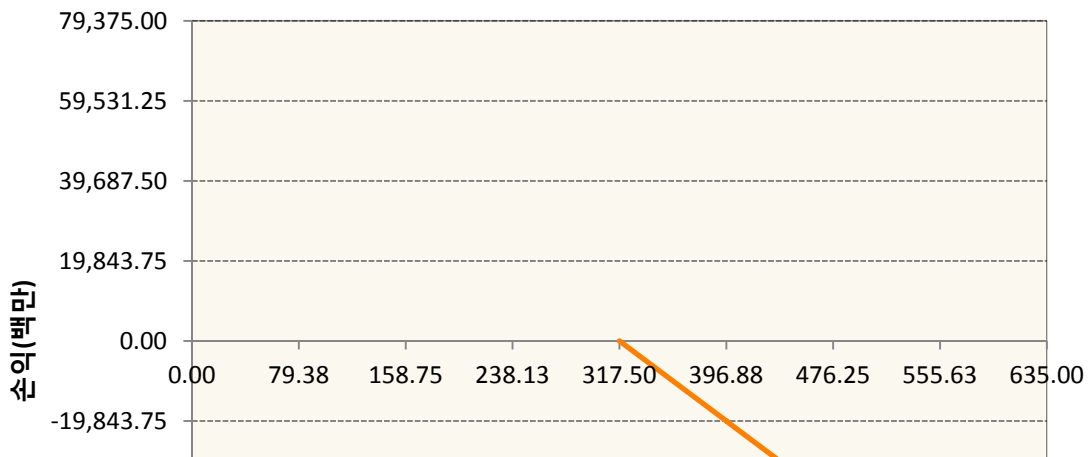
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	160,275	-160,275	장내
누계	유가증권	옵션	0	181,750	-181,750	장내

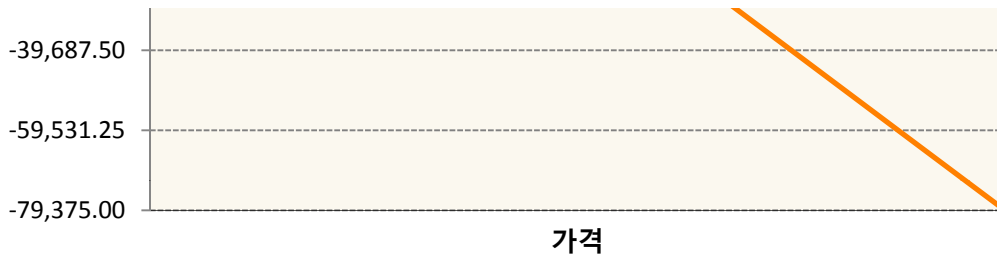
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63159-2018-06 콜315



KR4201N63175-2018-06 콜317.5





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N6312018-06 콜315 6,500

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,515	3,368	3,203	3,023	2,830	2,627	2,416
-5.33%	3,028	2,808	2,578	2,340	2,095	1,846	1,592
-2.67%	2,170	1,896	1,619	1,342	1,063	783	502
0%	865	577	289	0	-289	-578	-867
2.67%	-886	-1,145	-1,410	-1,679	-1,952	-2,228	-2,507
5.33%	-3,015	-3,216	-3,433	-3,661	-3,898	-4,144	-4,395
8.00%	-5,417	-5,555	-5,713	-5,889	-6,081	-6,285	-6,500

KR4201N6312018-06 콜317.5 4,838

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,454	2,356	2,242	2,115	1,978	1,832	1,678
-5.33%	2,144	1,988	1,823	1,650	1,471	1,287	1,098
-2.67%	1,572	1,369	1,163	954	744	532	319
0%	672	448	224	0	-224	-448	-671
2.67%	-576	-787	-1,000	-1,216	-1,433	-1,652	-1,872
5.33%	-2,132	-2,304	-2,485	-2,673	-2,867	-3,066	-3,268
8.00%	-3,923	-4,045	-4,183	-4,332	-4,493	-4,662	-4,838

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

10,490

공시일	2018-05-11
기준일	2018-05-10

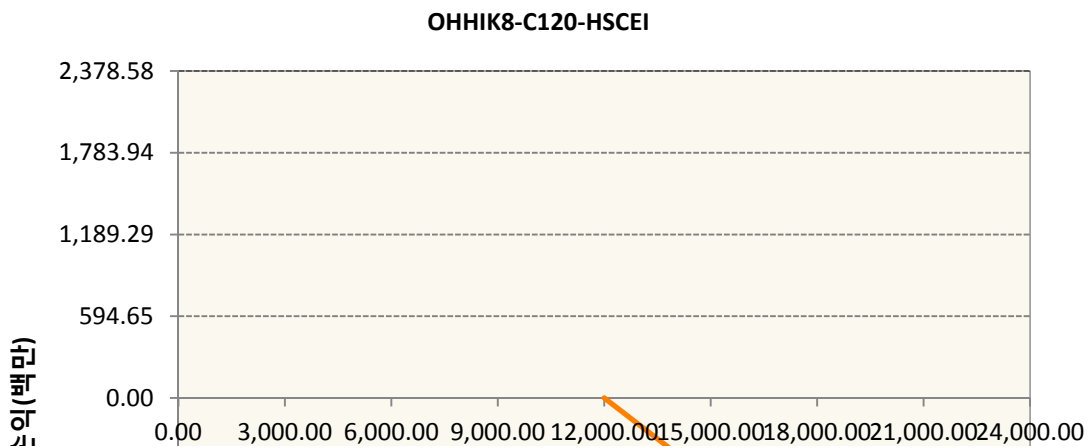
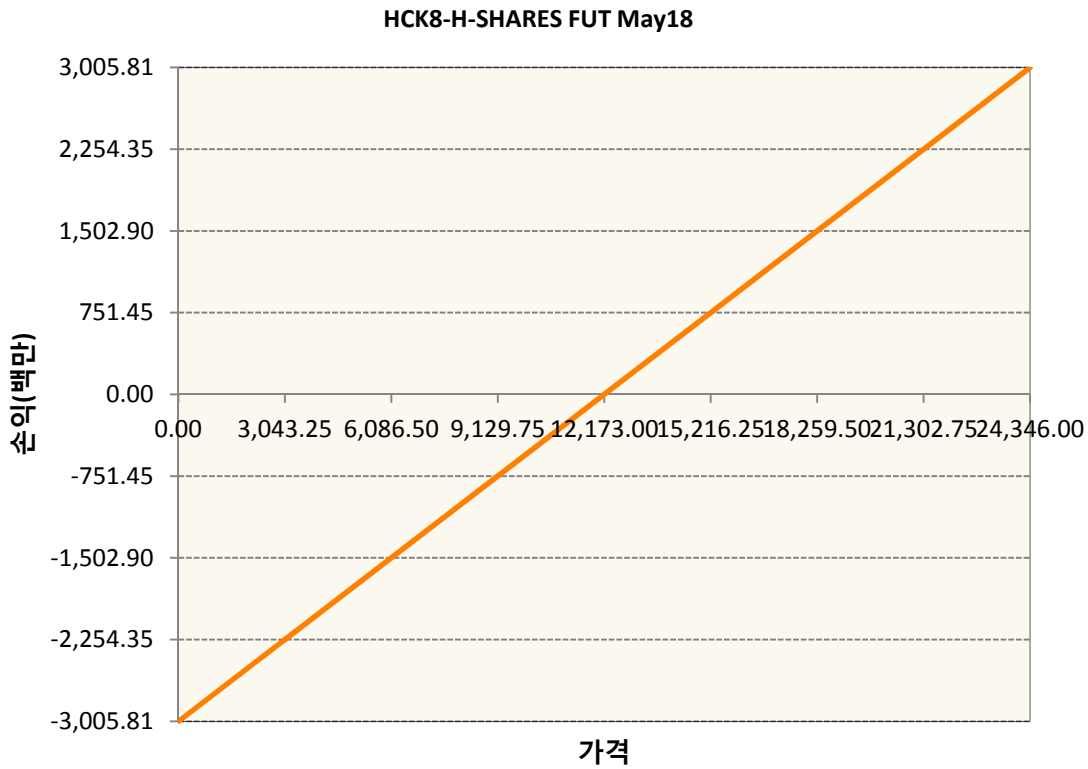
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

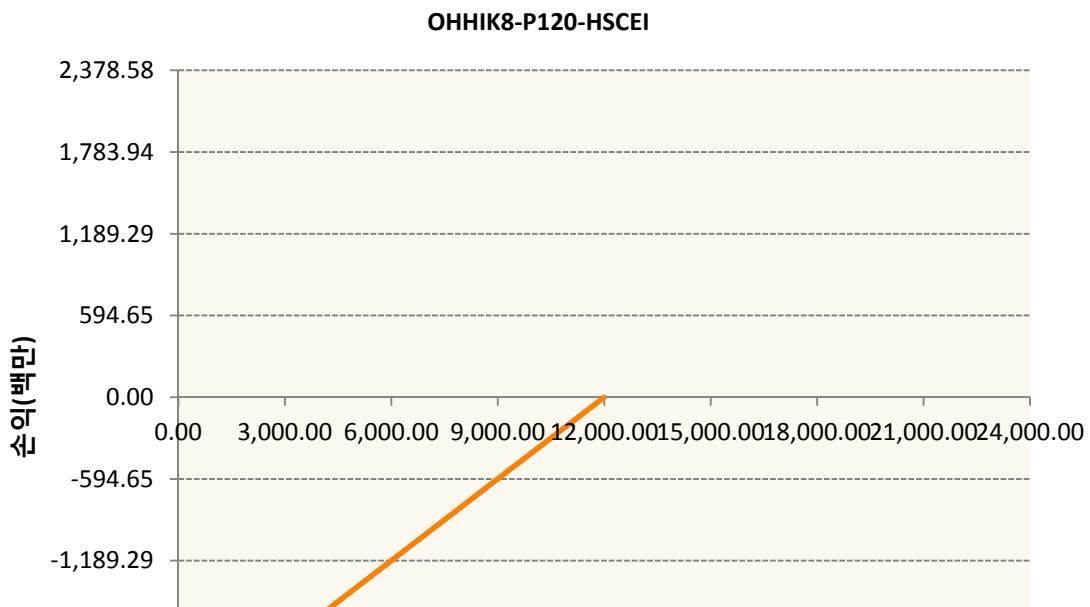
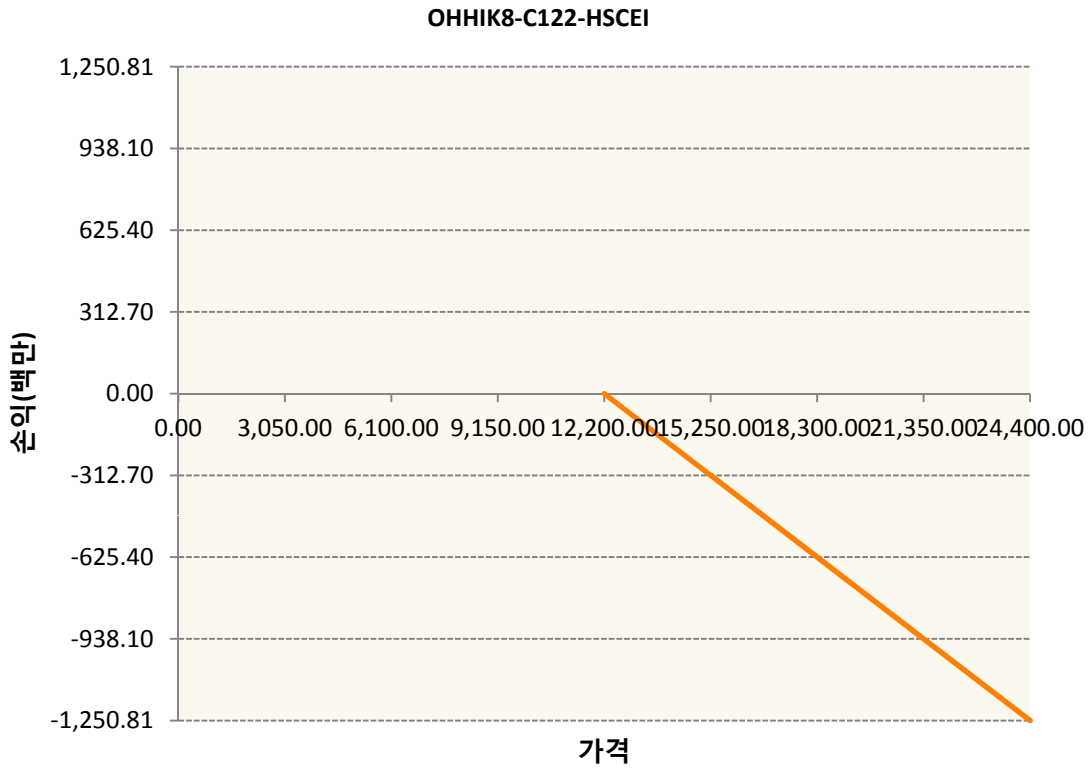
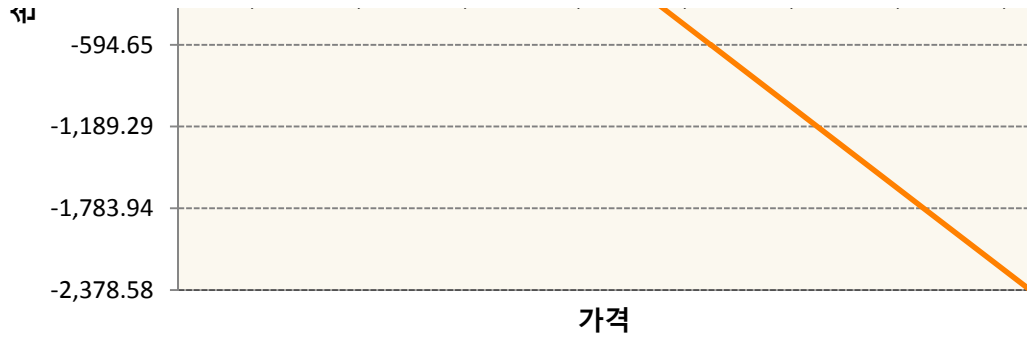
1. 계약금액

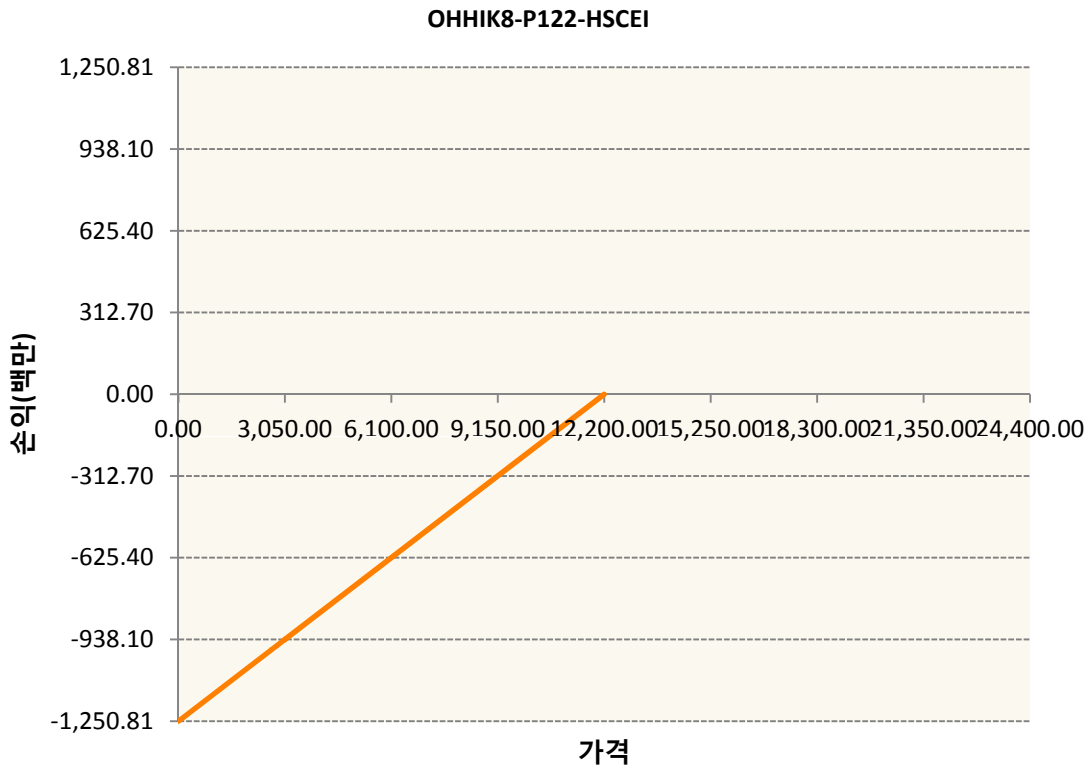
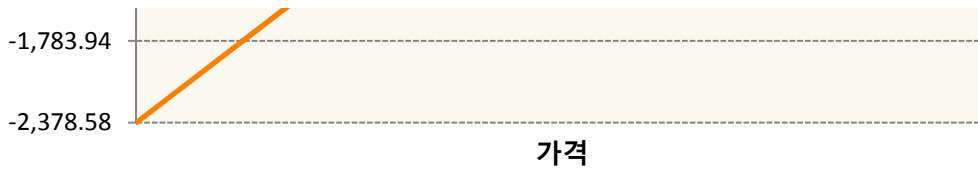
(단위:백만원)

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	3,006	0	3,006	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,259	-7,259	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCK8	H-SHARES FUT May18	240
OHHIK8-C12	HSCEI	190
OHHIK8-C12	HSCEI	100
OHHIK8-P12	HSCEI	190
OHHIK8-P12	HSCEI	100

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	719

5.33%	983	983	983	983	983	983	983
8.00%	1,474	1,474	1,474	1,474	1,474	1,474	1,474

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3 279

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-279	-279	-279	-279	-279	-279	-279
-5.33%	-186	-186	-186	-186	-186	-186	-186
-2.67%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	93	93	93	93	93	93	93
5.33%	186	186	186	186	186	186	186
8.00%	279	279	279	279	279	279	279

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5 239

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-239	-239	-239	-239	-239	-239	-239
-5.33%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
-2.67%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	80	80	80	80	80	80	80
5.33%	159	159	159	159	159	159	159
8.00%	239	239	239	239	239	239	239

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7 255

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-255	-255	-255	-255	-255	-255	-255
-5.33%	-170	-170	-170	-170	-170	-170	-170
-2.67%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	85	85	85	85	85	85	85
5.33%	170	170	170	170	170	170	170
8.00%	255	255	255	255	255	255	255

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8 472

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-472	-472	-472	-472	-472	-472	-472
-5.33%	-314	-314	-314	-314	-314	-314	-314
-2.67%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	157	157	157	157	157	157	157
5.33%	314	314	314	314	314	314	314
8.00%	472	472	472	472	472	472	472

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11 638

기초자산의 변동성							
-----------	--	--	--	--	--	--	--

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-638	-638	-638	-638	-638	-638	-638
-5.33%	-425	-425	-425	-425	-425	-425	-425
-2.67%	-213	-213	-213	-213	-213	-213	-213
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	213	213	213	213	213	213	213
5.33%	425	425	425	425	425	425	425
8.00%	638	638	638	638	638	638	638
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12							478

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-478	-478	-478	-478	-478	-478	-478
-5.33%	-319	-319	-319	-319	-319	-319	-319
-2.67%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	159	159	159	159	159	159	159
5.33%	319	319	319	319	319	319	319
8.00%	478	478	478	478	478	478	478
KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물							159

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
-5.33%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106
-2.67%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	53	53	53	53	53	53	53
5.33%	106	106	106	106	106	106	106
8.00%	159	159	159	159	159	159	159

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

(단위:백만원)

3,953

공시일	2018-05-11
기준일	2018-05-10

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

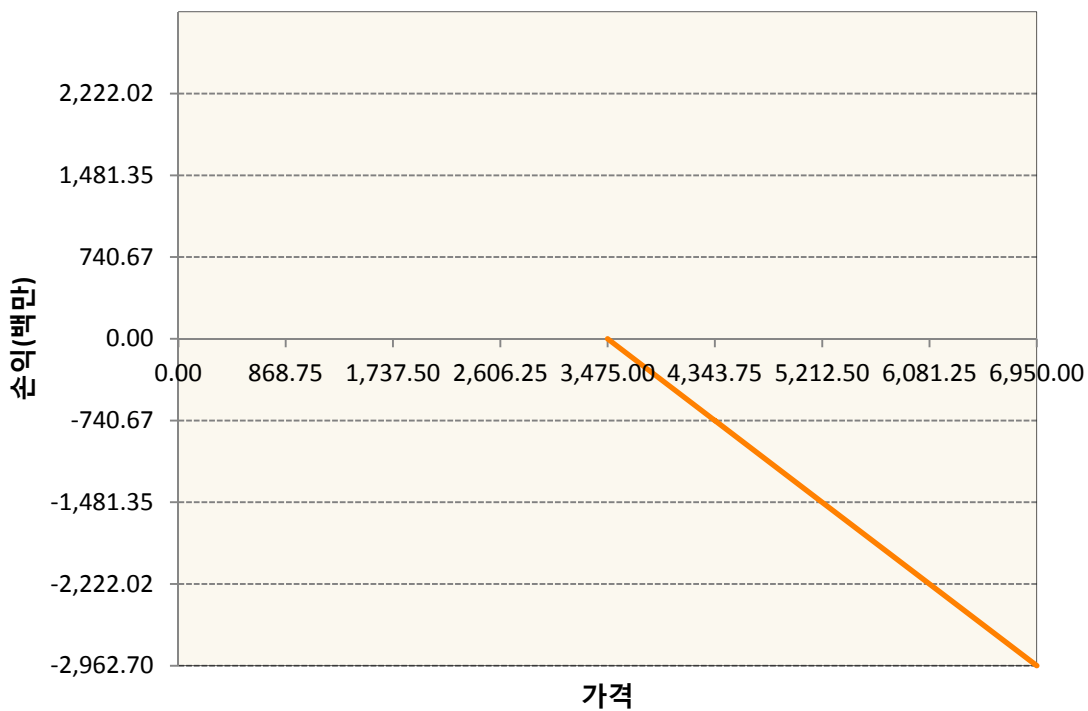
1. 계약금액

(단위:백만원)

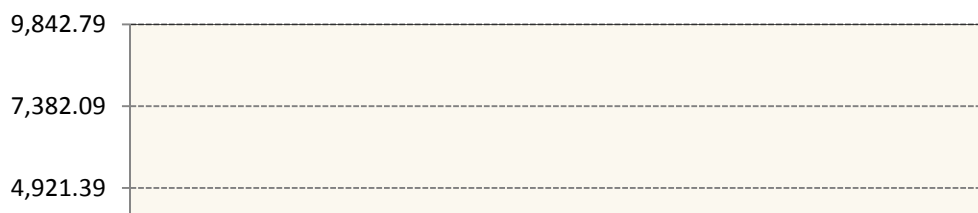
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,973	0	4,973	
누계	유가증권	스왑	73,500	0	73,500	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,611	-25,611	장내
누계	지수	스왑	50,900	0	50,900	장외

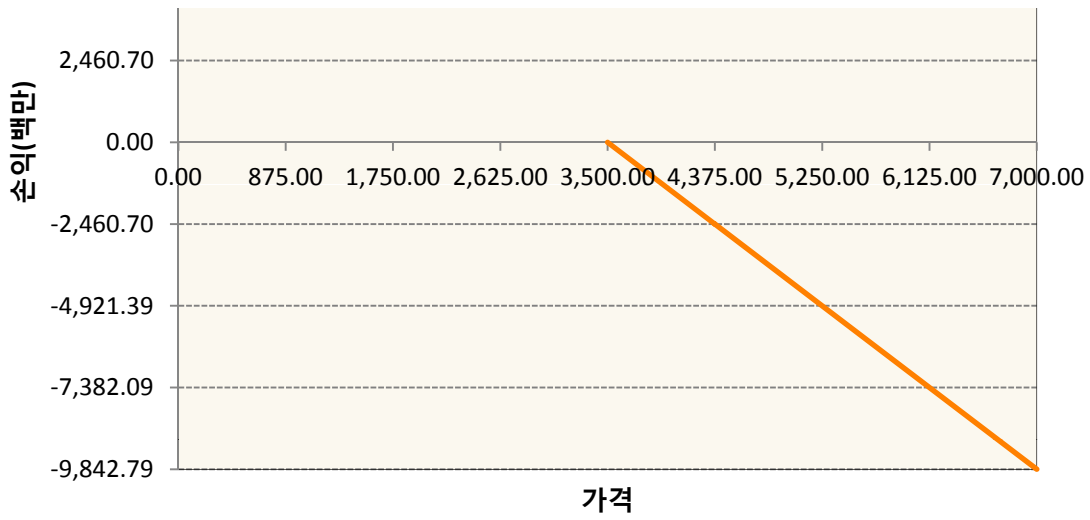
2. 만기시점의 손익구조

OESXK8-C3475-EURO STOXX 50

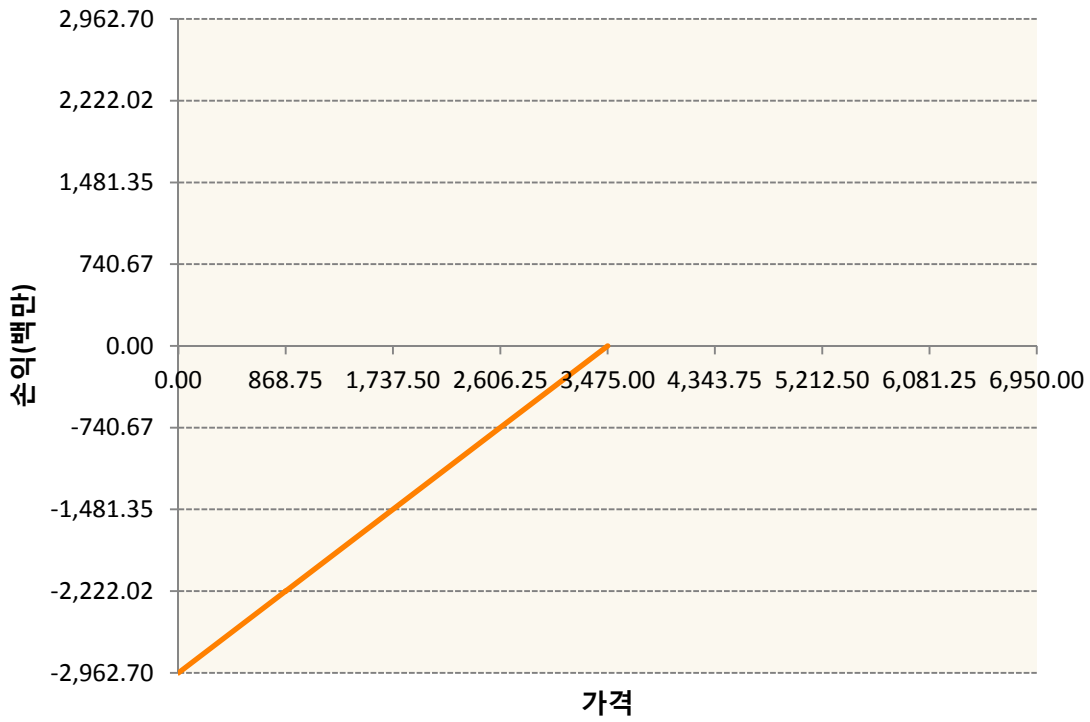


OESXK8-C3500-EURO STOXX 50

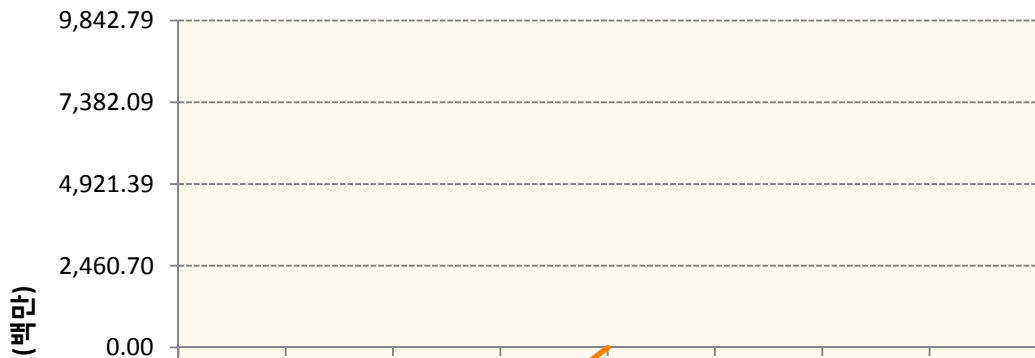


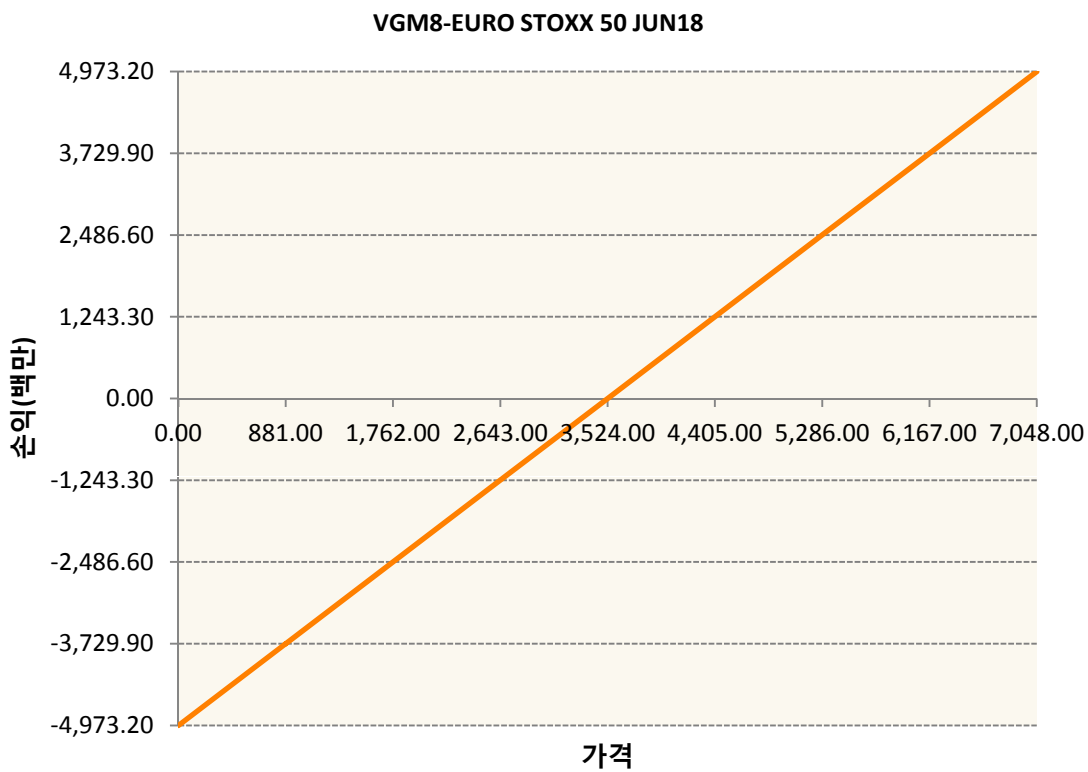
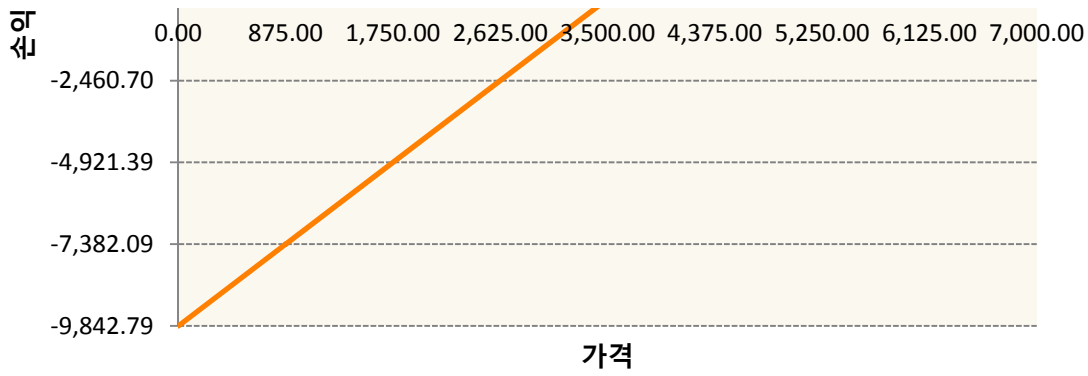


OESXK8-P3475-EURO STOXX 50



OESXK8-P3500-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		62
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		90
OESXK8-C34 EURO STOXX 50		237
OESXK8-C35 EURO STOXX 50		787
OESXK8-P34 EURO STOXX 50		237
OESXK8-P35 EURO STOXX 50		787
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18		398

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

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

(단위:백만원)

1,204

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

(단위:백만원)

61

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

(단위:백만원)

98

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

(단위:백만원)

223

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

(단위:백만원)

42

공시일	2018-05-11
기준일	2018-05-10

리디파인K200(주식혼합-파생재간

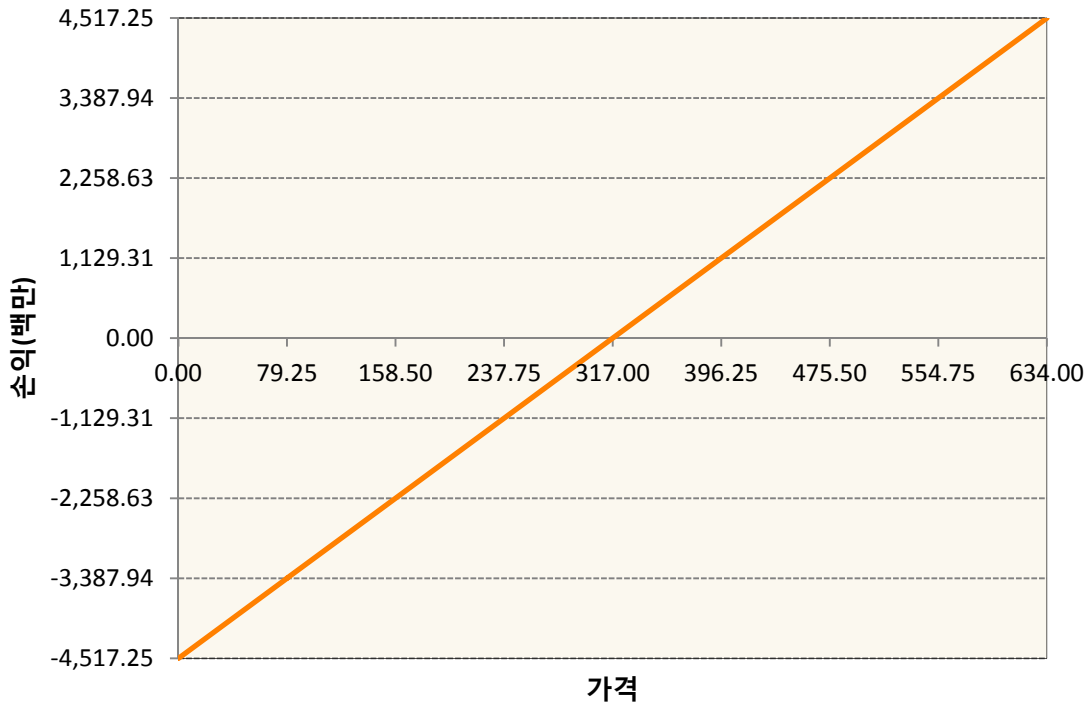
1. 계약금액

(단위:백만원)

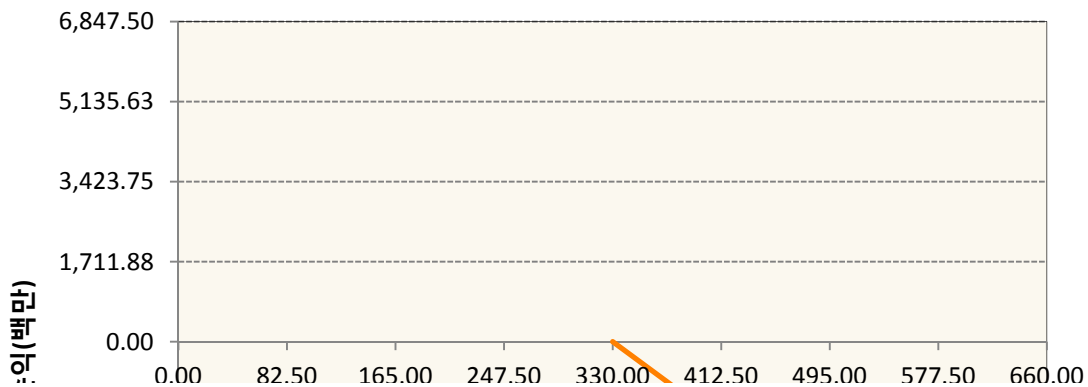
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,345	0	1,345	장내
신규	유가증권	옵션	778	6,859	-6,081	장내
누계	유가증권	선물	4,517	0	4,517	장내
누계	유가증권	옵션	788	6,848	-6,060	장내

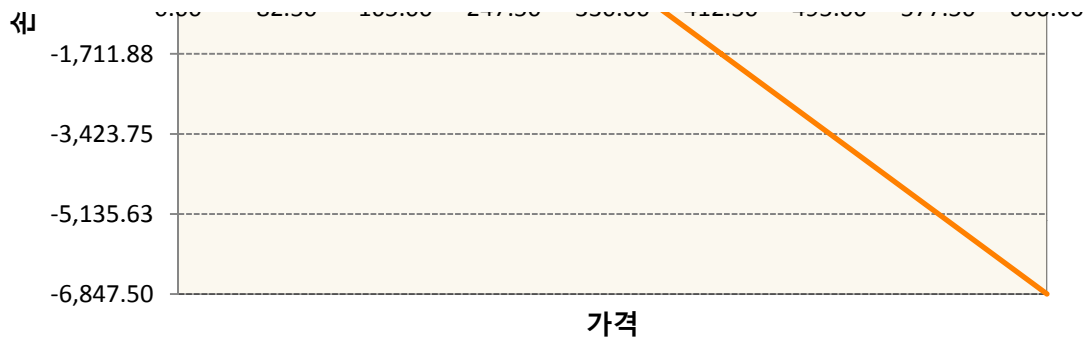
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

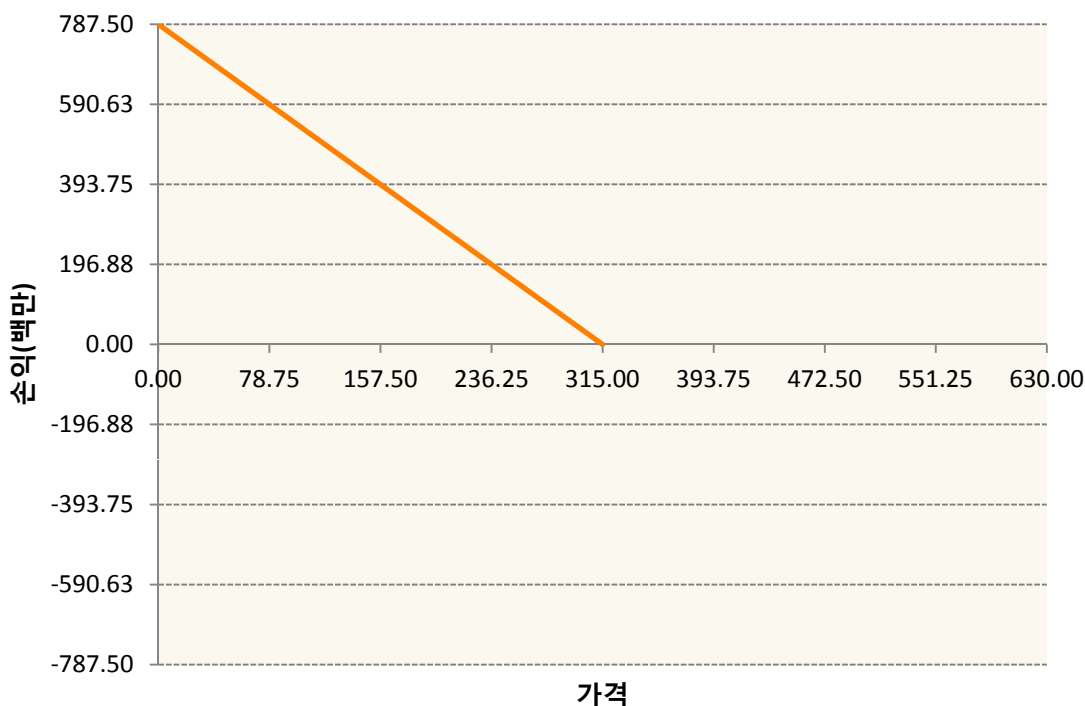


KR4201N63308-2018-06 콜330





KR4301N63157-2018-06 풋315



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물							362
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-362	-362	-362	-362	-362	-362	-362
-5.33%	-241	-241	-241	-241	-241	-241	-241
-2.67%	-121	-121	-121	-121	-121	-121	-121
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	121	121	121	121	121	121	121
5.33%	241	241	241	241	241	241	241
8.00%	362	362	362	362	362	362	362
KR4201N63E 2018-06 콜330							326
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	116	112	108	102	95	87	78
-5.33%	107	100	92	82	72	60	48
-2.67%	87	76	63	50	36	21	6
0%	49	33	17	0	-17	-35	-52
2.67%	-13	-32	-51	-70	-89	-108	-127
5.33%	-103	-122	-141	-160	-180	-199	-218
8.00%	-219	-236	-254	-271	-289	-307	-326

KR4301N6312018-06 풋315

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	49	49	49	49	49	49	49
-5.33%	28	28	28	29	29	30	30
-2.67%	9	10	11	12	13	13	14
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-8	-7	-7	-6	-5	-5	-4
5.33%	-9	-9	-8	-8	-8	-8	-7
8.00%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-8

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

(단위:백만원)

563

공시일	2018-05-11
기준일	2018-05-10

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

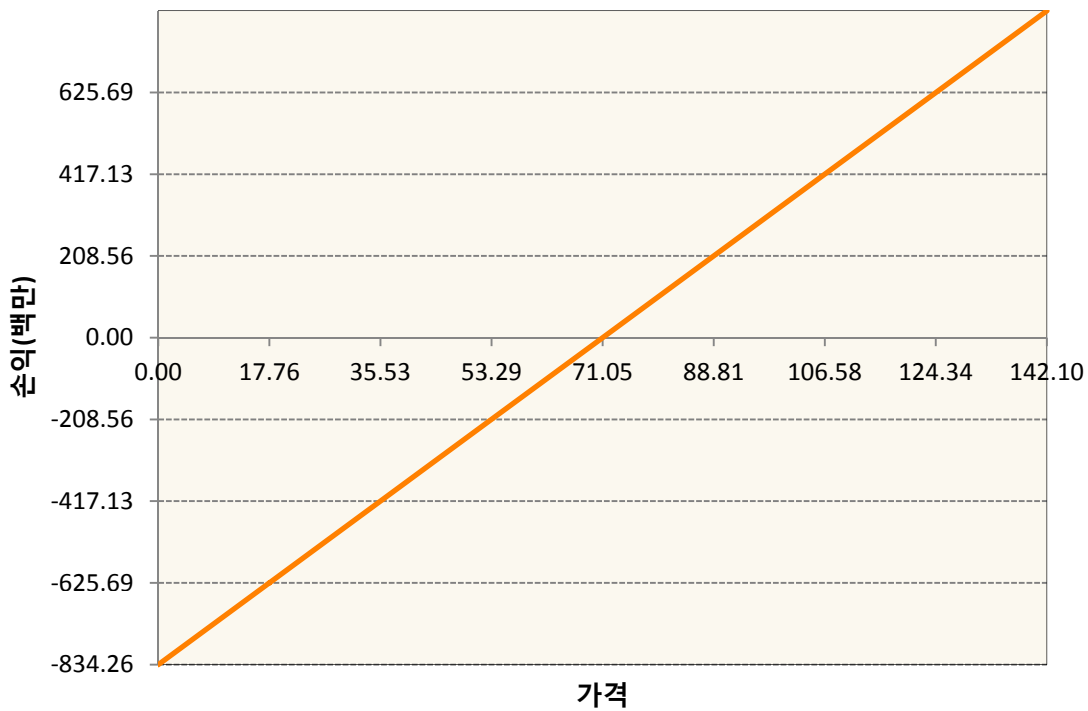
1. 계약금액

(단위:백만원)

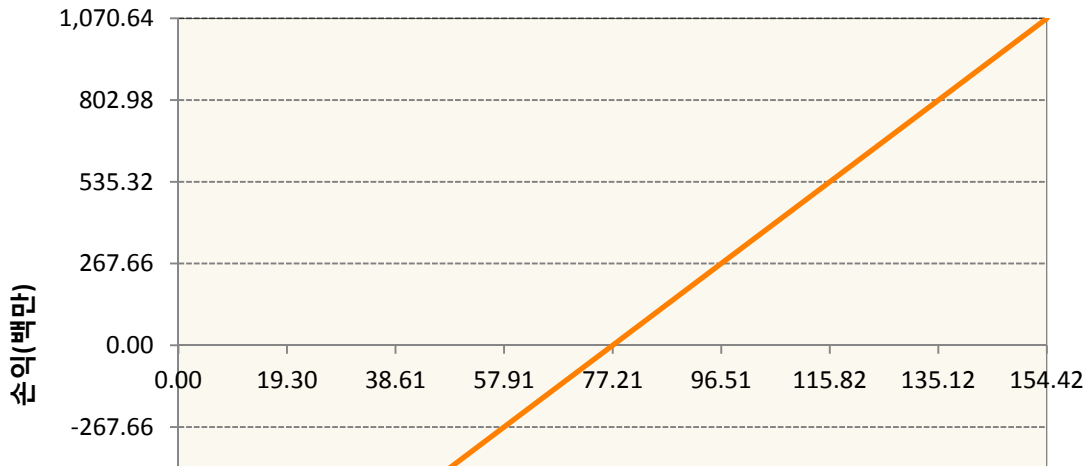
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,014	590	3,425	

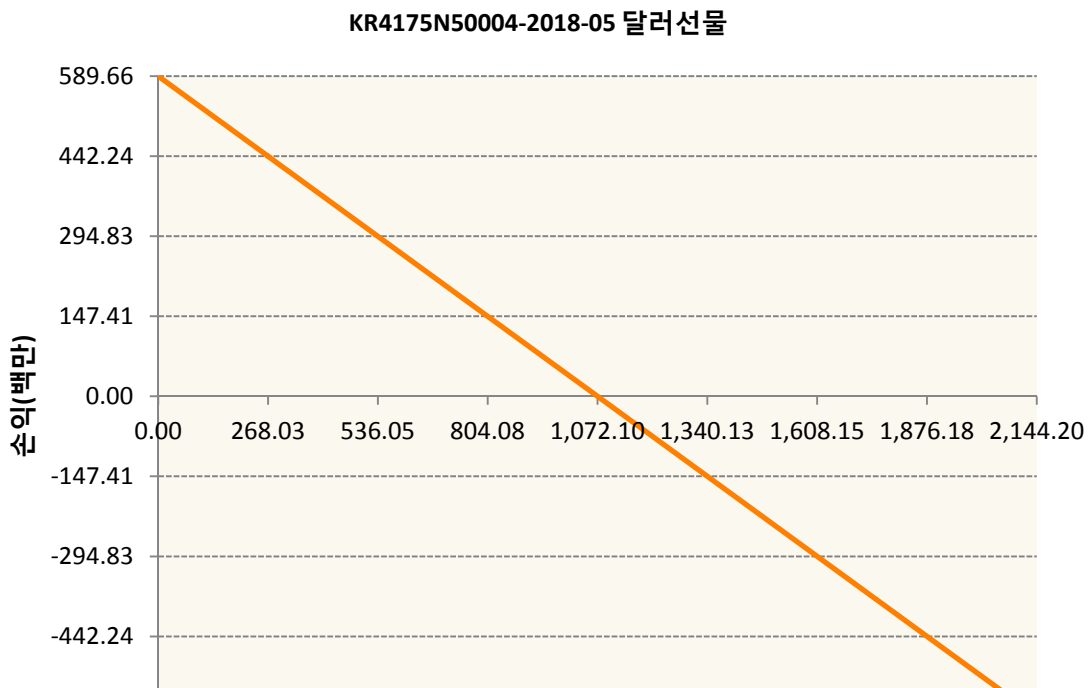
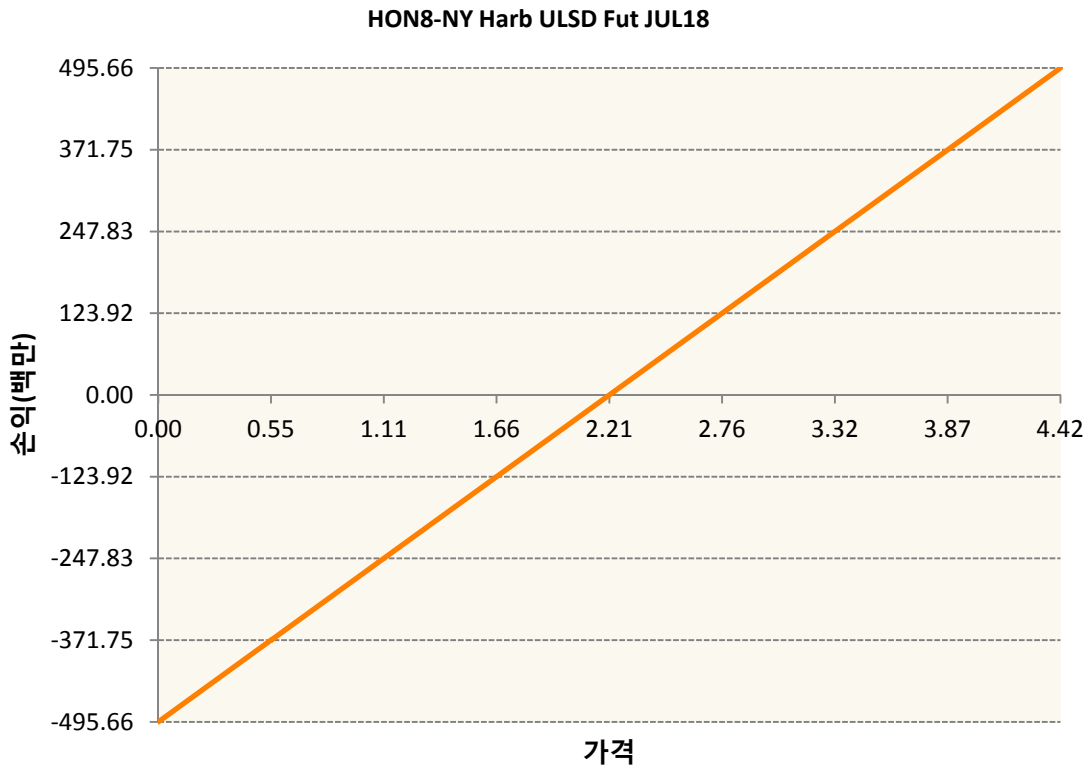
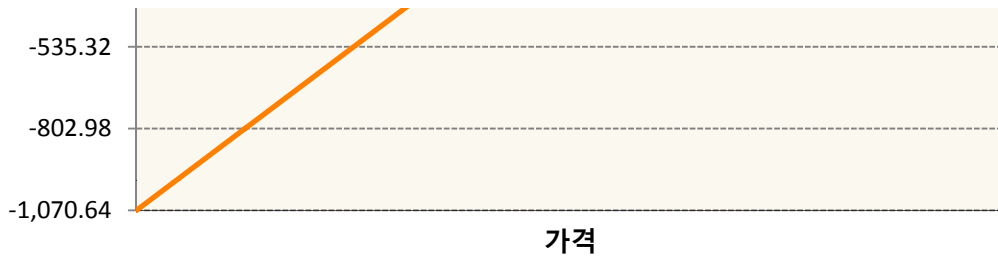
2. 만기시점의 손익구조

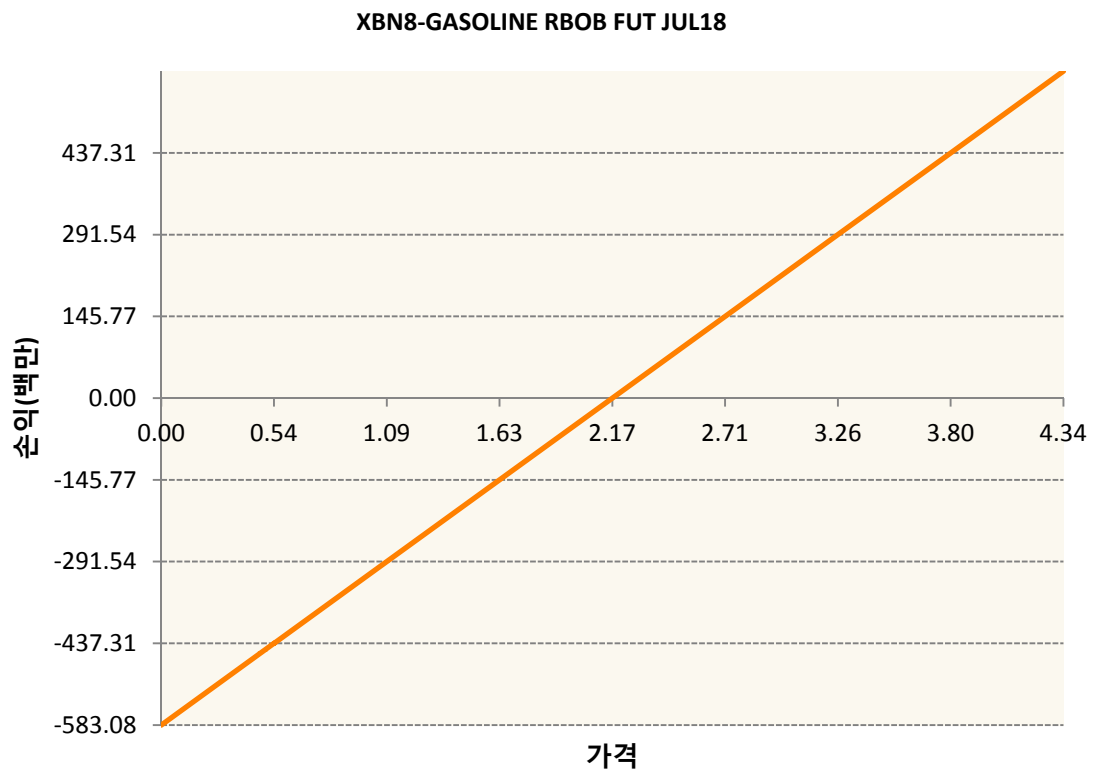
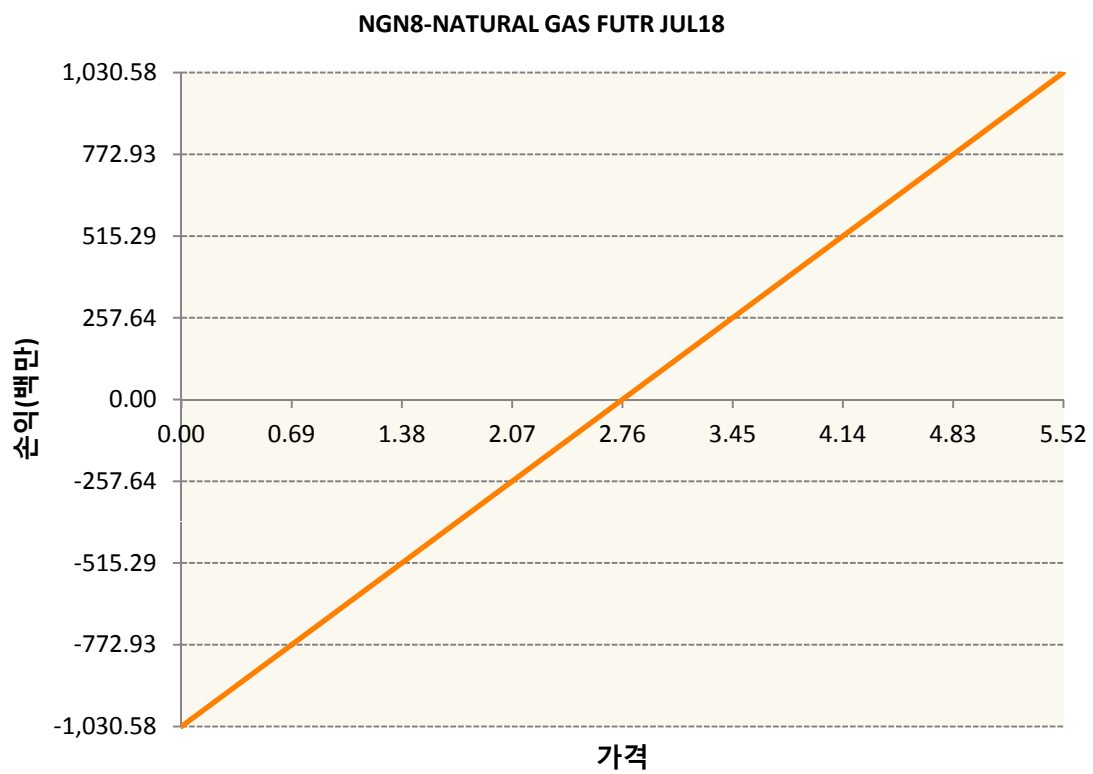
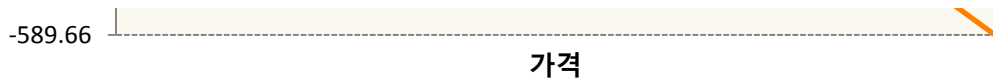
CLN8-WTI CRUDE FUTURE JUL18



CON8-BRENT CRUDE FUTR JUL18







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN8	WTI CRUDE FUTURE JUL18	67
CON8	BRENT CRUDE FUTR JUL18	86
HON8	NY Harb ULSD Fut JUL18	40
KR4175N50C	2018-05 달러선물	47
NGN8	NATURAL GAS FUTR JUL18	82
XBN8	GASOLINE RBOB FUT JUL18	47

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

483

공시일	2018-05-11
기준일	2018-05-10

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

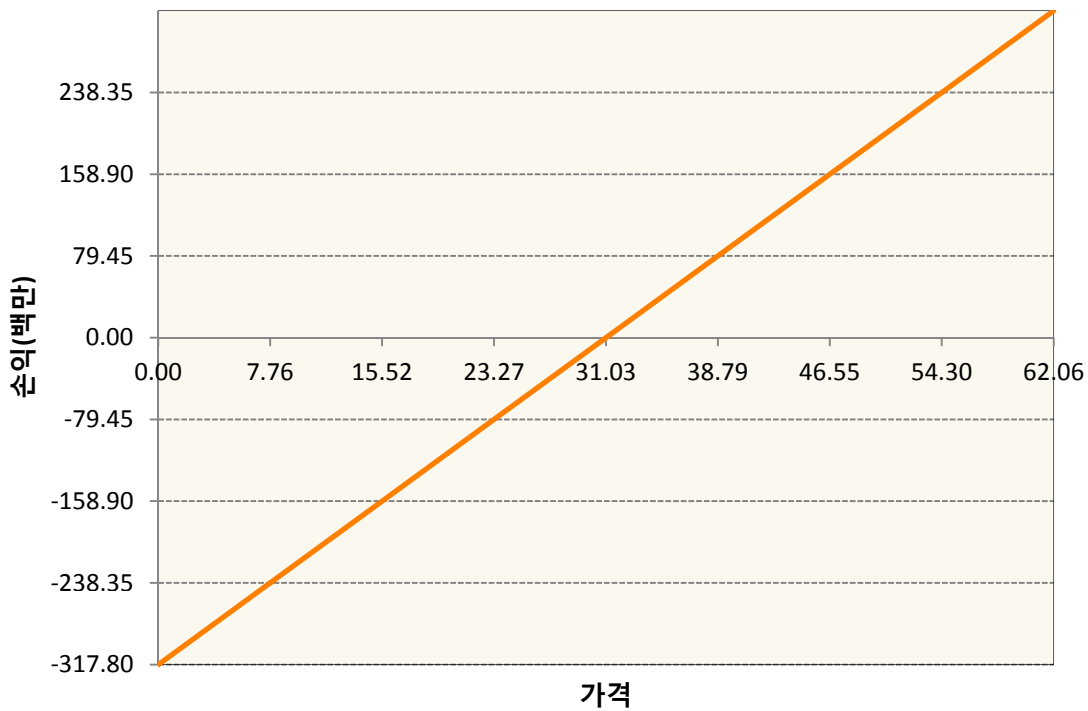
1. 계약금액

(단위:백만원)

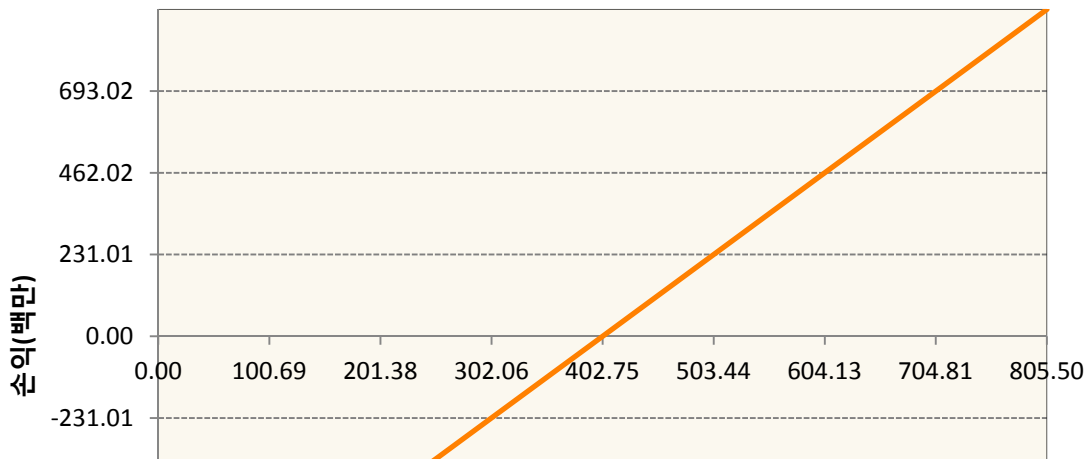
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,082	322	3,760	

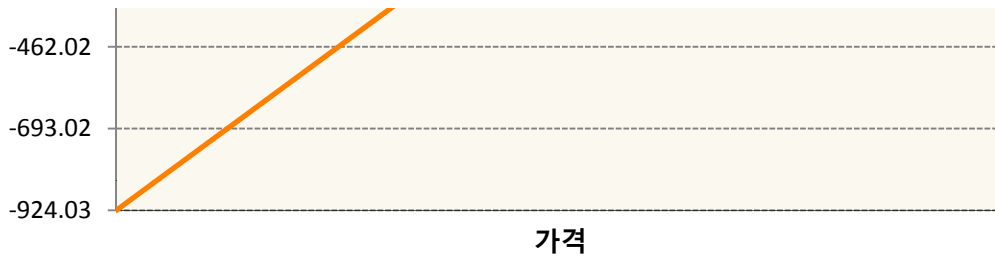
2. 만기시점의 손익구조

BON8-SOYBEAN OIL FUTR JUL18

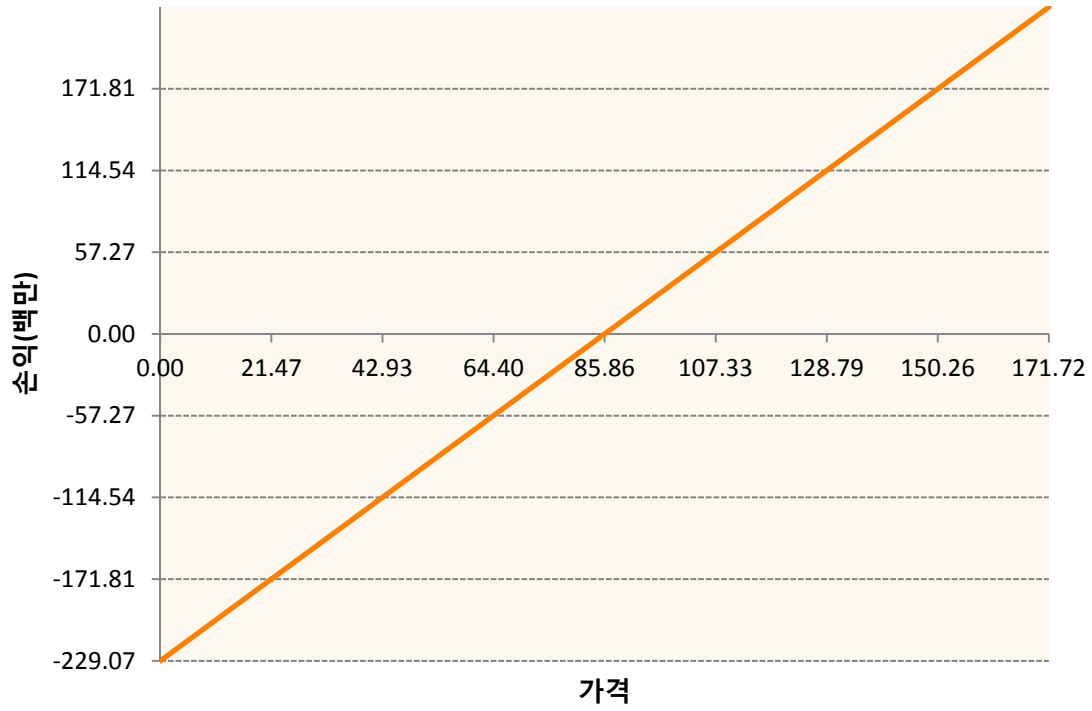


CN8-CORN FUTURE JUL18

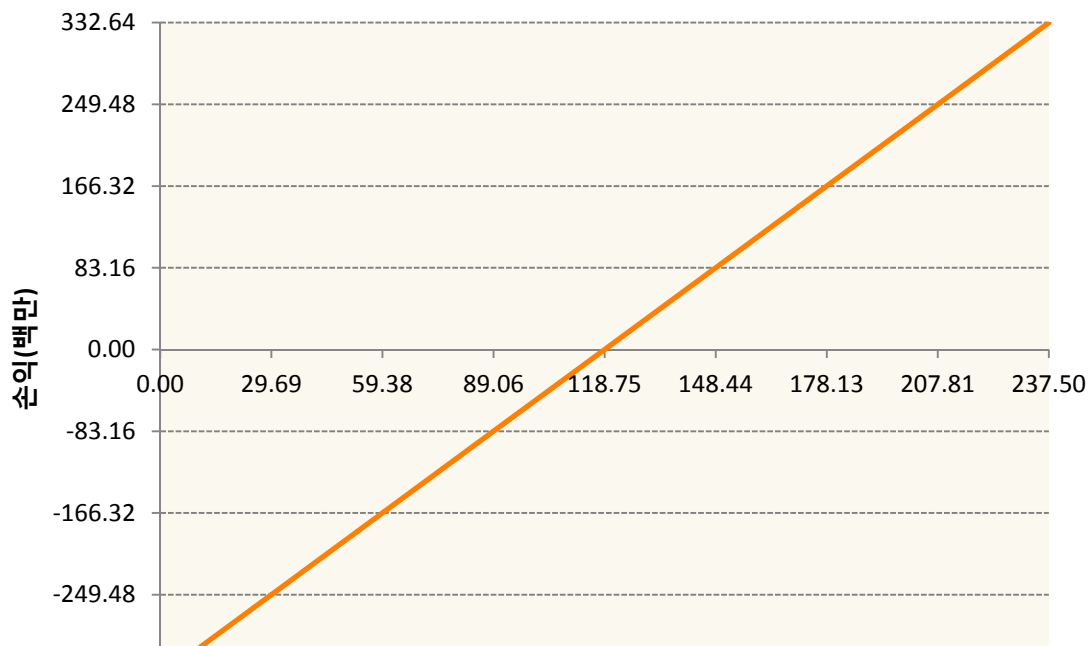


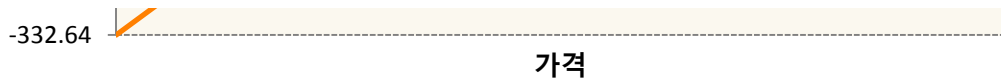


CTN8-COTTON NO.2 FUTR JUL18

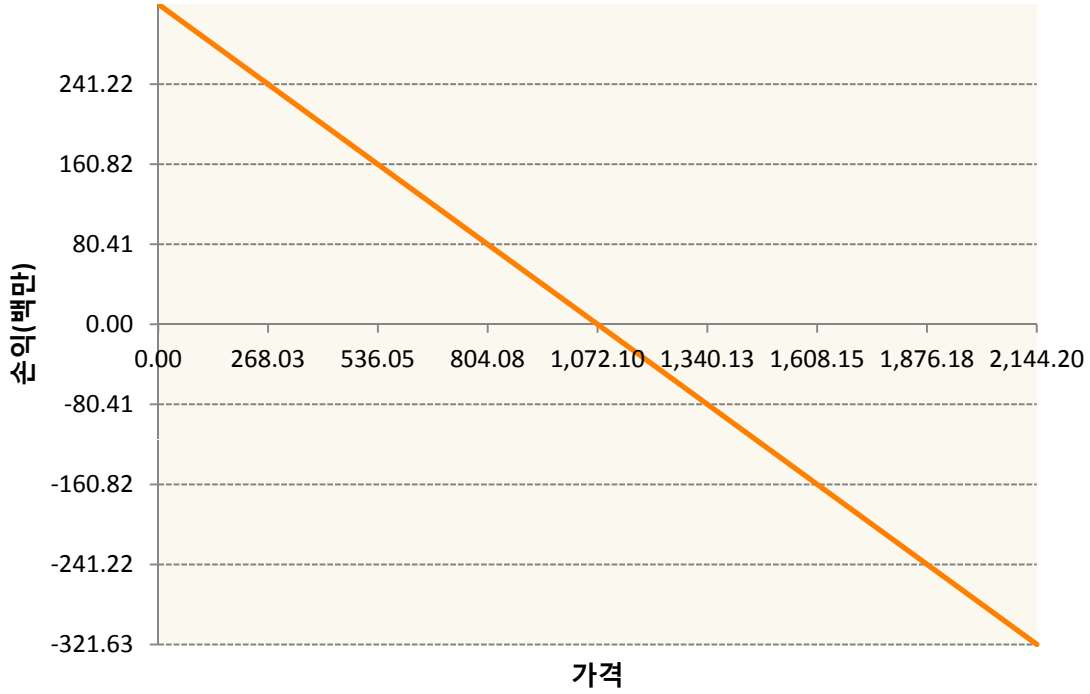


KCN8-COFFEE 'C' FUTURE JUL18

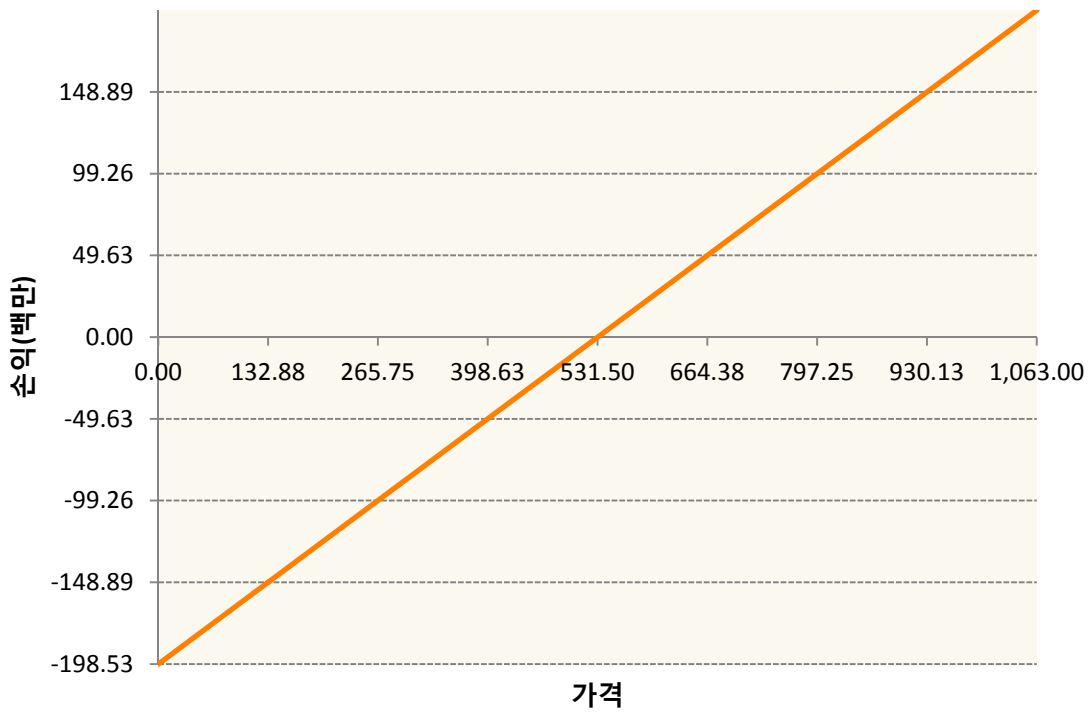




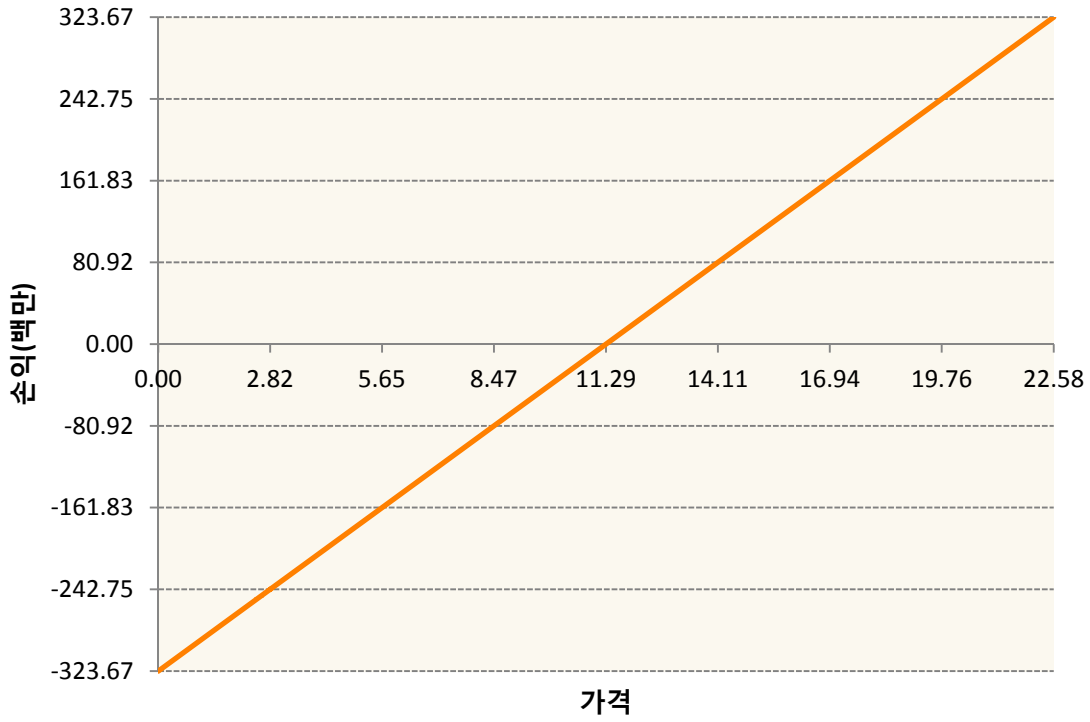
KR4175N50004-2018-05 달러선물



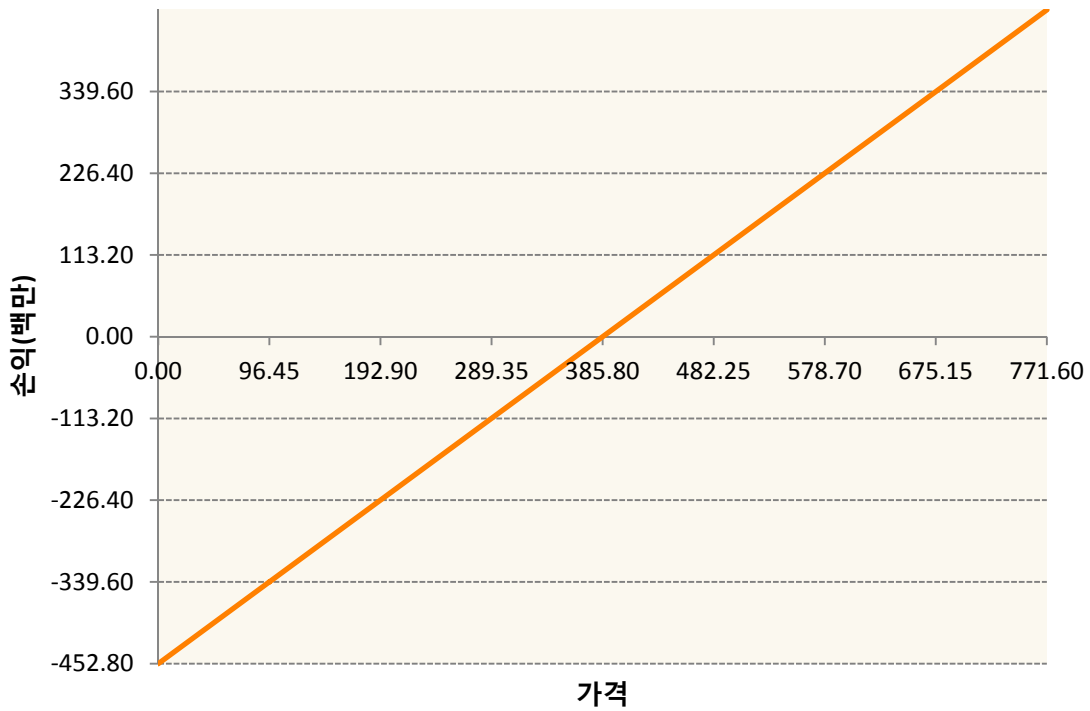
KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18



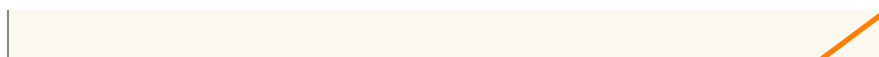
SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18

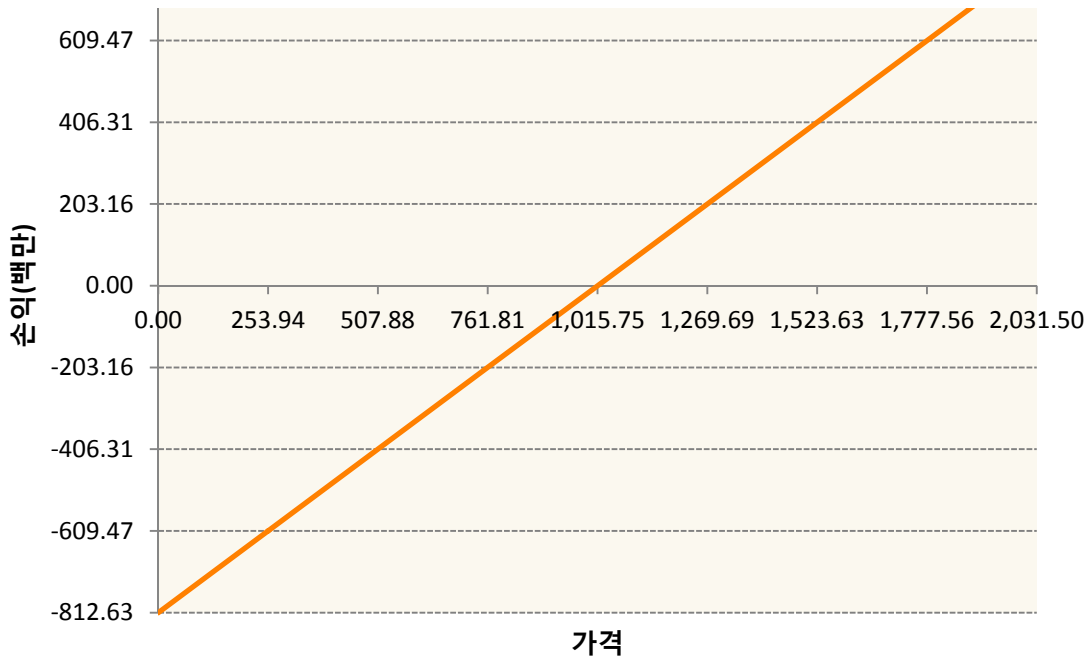


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18

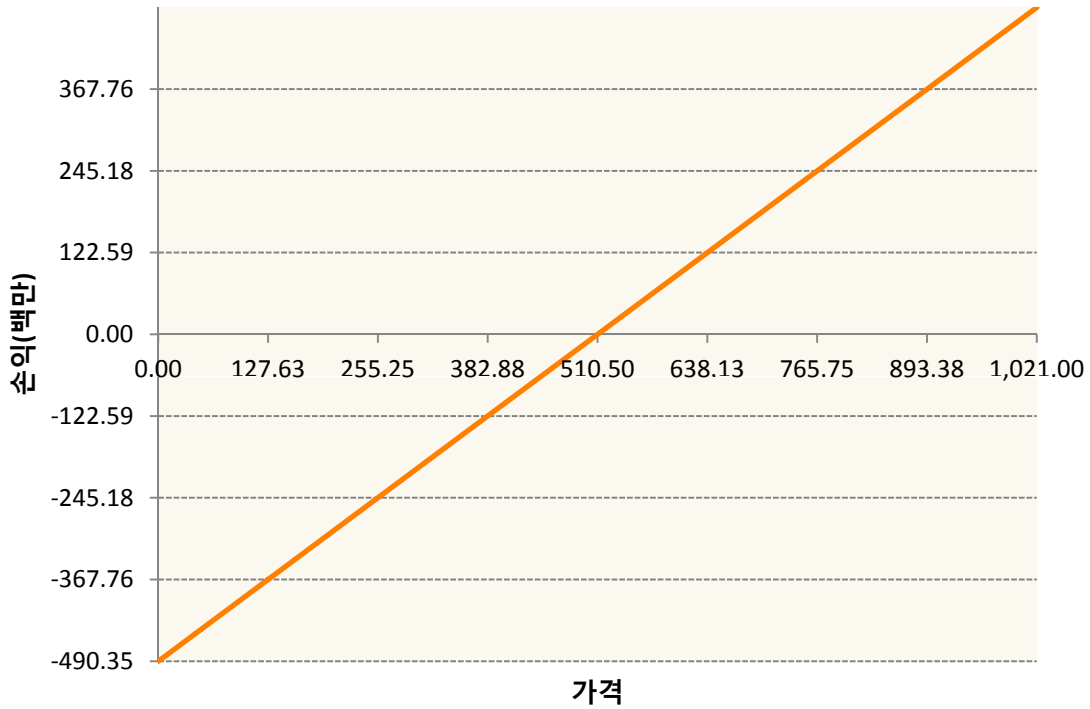


SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18





WN8-WHEAT FUTURE(CBT) JUL18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON8	SOYBEAN OIL FUTR JUL18	25
CN8	CORN FUTURE JUL18	74
CTN8	COTTON NO.2 FUTR JUL18	18
KCN8	COFFEE 'C' FUTURE JUL18	27
KR4175N50C	2018-05 달러선물	26

KWN8	KC HRW WHEAT FUT JUL18	16
SBN8	SUGAR #11 (WORLD) JUL18	26
SMN8	SOYBEAN MEAL FUTR JUL18	36
SN8	SOYBEAN FUTURE JUL18	65
WN8	WHEAT FUTURE(CBT) JUL18	39

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

(단위:백만원)

328