

공시일	2018-05-16
기준일	2018-05-15

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	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)

82

공시일	2018-05-16
기준일	2018-05-15

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	13,869	0	13,869	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S180222

1,127

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

461

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-05-16
기준일	2018-05-15

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	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)

428

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-05-16
기준일	2018-05-15

유로인덱스모(주식-파생형)

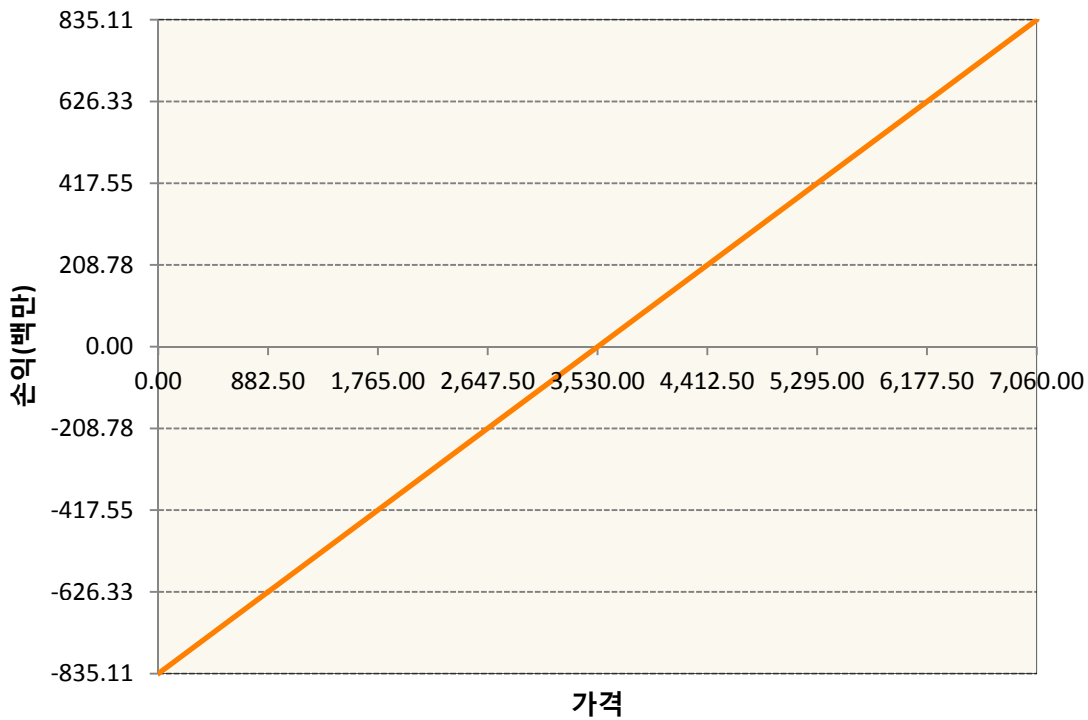
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	835	0	835	

2. 만기시점의 손익구조

VGM8-EURO STOXX 50 JUN18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	67
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-05-16
기준일	2018-05-15

차이나인덱스모(주식-파생형)

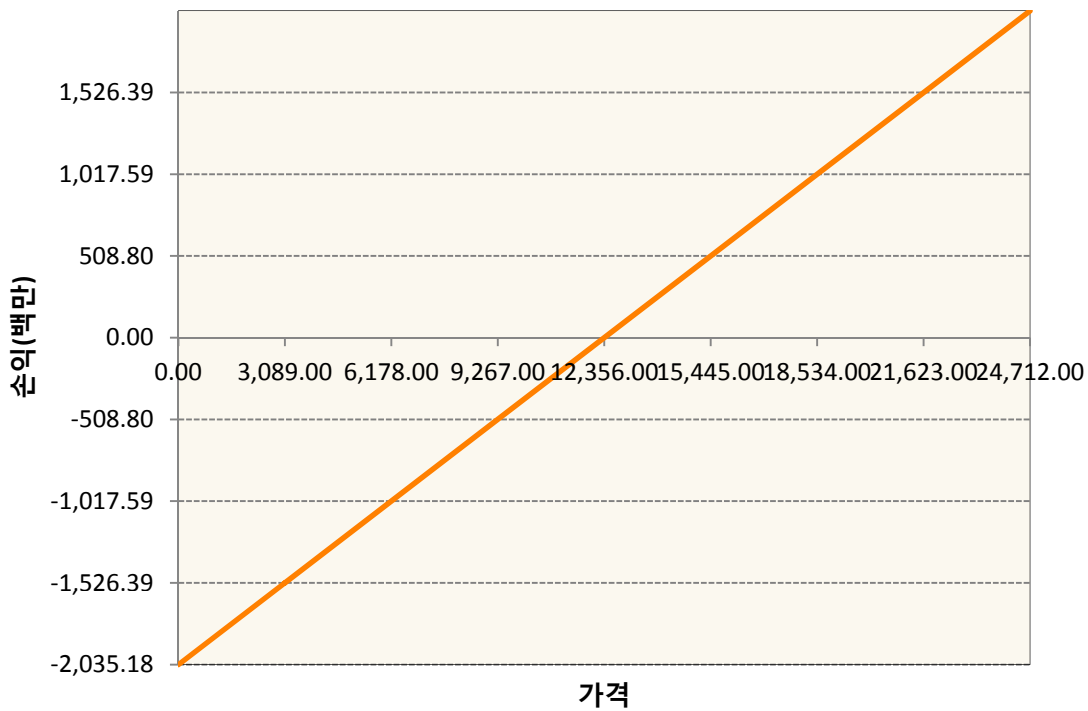
1. 계약금액

(단위:백만원)

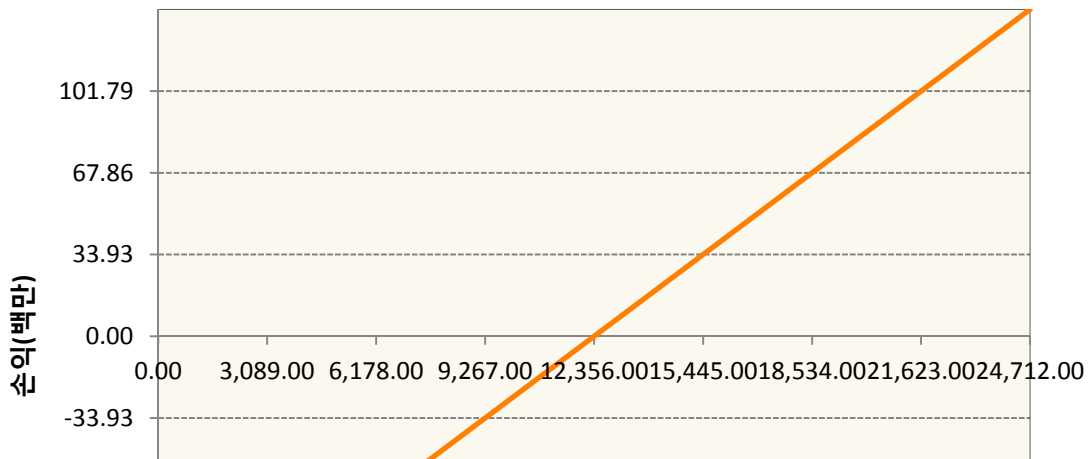
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,171	0	2,171	장내

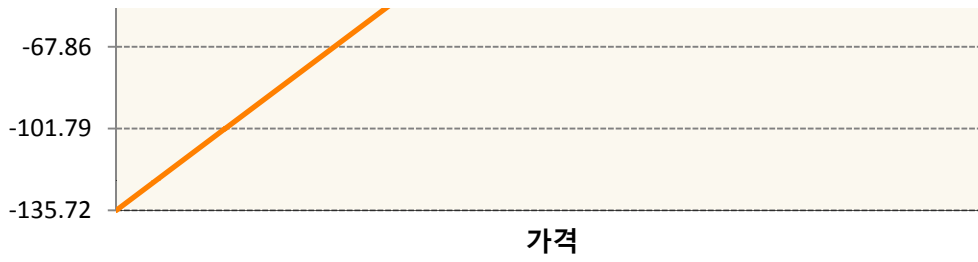
2. 만기시점의 손익구조

HCK8-H-SHARES FUT May18



MHCK8-MINI H-SHR IDX FU May18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCK8	H-SHARES FUT May18	163
MHCK8	MINI H-SHR IDX FU May18	11

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

152

공시일	2018-05-16
기준일	2018-05-15

커버드콜모(주식혼합-파생형)

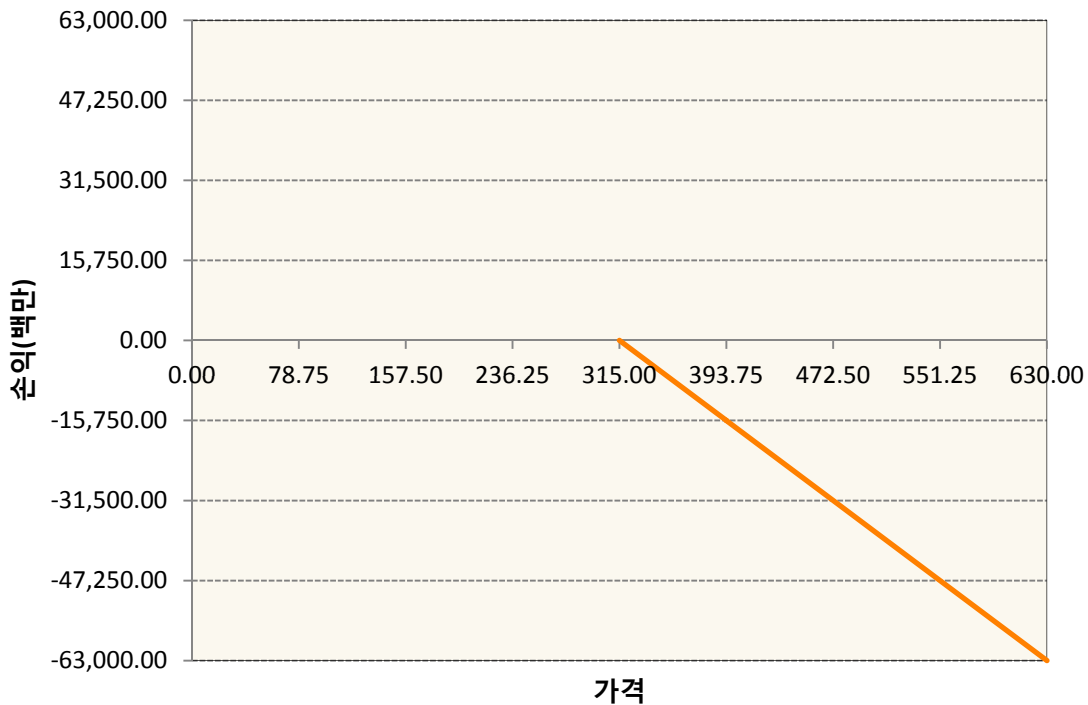
1. 계약금액

(단위:백만원)

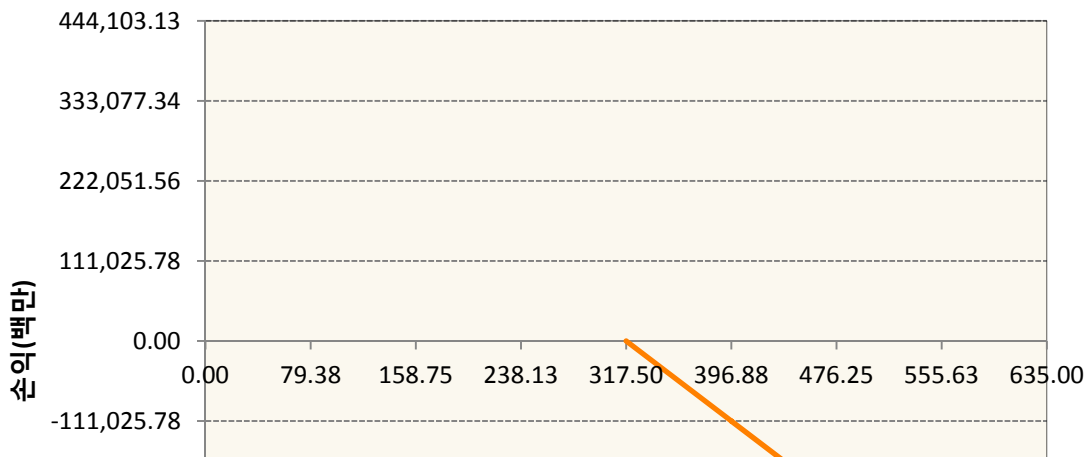
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	8,232	0	8,232	장내
누계	유가증권	옵션	0	816,666	-816,666	장내

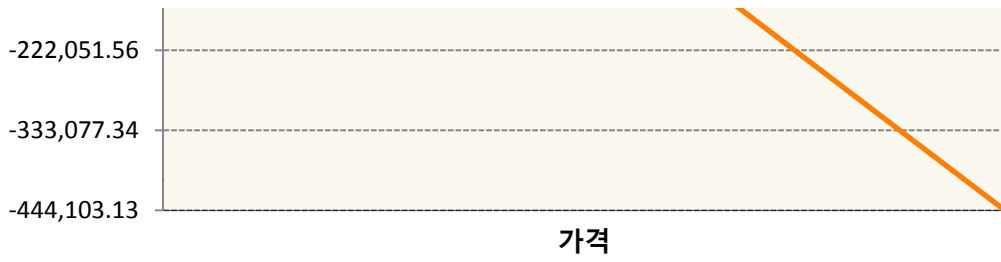
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63159-2018-06 콜315

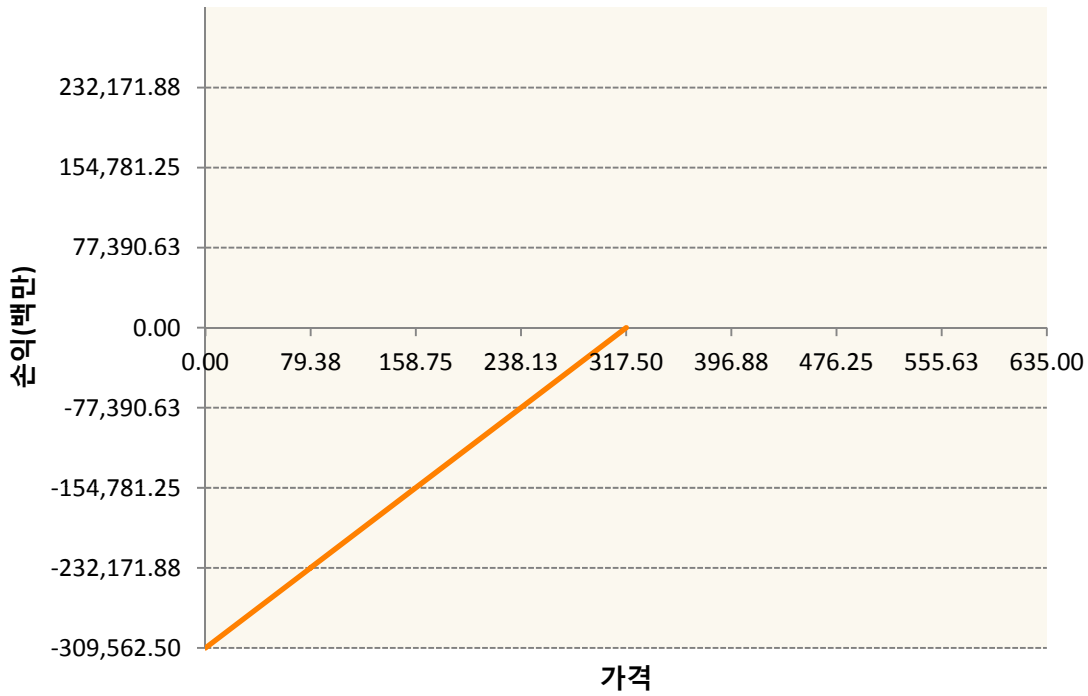


KR4201N63175-2018-06 콜317.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N6312018-06 콜315

3,852

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,848	1,783	1,707	1,621	1,527	1,425	1,318
-5.33%	1,630	1,521	1,405	1,281	1,153	1,021	885
-2.67%	1,201	1,054	903	751	597	442	286
0%	494	330	165	0	-165	-330	-494
2.67%	-509	-662	-817	-975	-1,133	-1,293	-1,454
5.33%	-1,772	-1,892	-2,020	-2,153	-2,292	-2,434	-2,580
8.00%	-3,226	-3,306	-3,398	-3,500	-3,611	-3,728	-3,852

KR4201N6312018-06 풋317.5

25,923

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,533	11,153	10,691	10,157	9,560	8,907	8,207

-5.33%	10,316	9,638	8,894	8,097	7,257	6,381	5,476
-2.67%	7,794	6,819	5,816	4,791	3,748	2,693	1,626
0%	3,448	2,300	1,151	0	-1,152	-2,304	-3,456
2.67%	-2,961	-4,084	-5,216	-6,355	-7,498	-8,646	-9,796
5.33%	-11,285	-12,211	-13,181	-14,184	-15,212	-16,263	-17,330
8.00%	-21,088	-21,742	-22,471	-23,264	-24,109	-24,998	-25,923
KR4301N6312018-06 풋317.5							21,515
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21,441	-21,442	-21,446	-21,453	-21,465	-21,486	-21,515
-5.33%	-13,283	-13,306	-13,344	-13,399	-13,471	-13,562	-13,669
-2.67%	-5,398	-5,548	-5,722	-5,918	-6,131	-6,360	-6,601
0%	1,014	678	340	0	-342	-685	-1,029
2.67%	4,433	4,151	3,856	3,552	3,241	2,924	2,602
5.33%	5,410	5,313	5,190	5,043	4,875	4,688	4,483
8.00%	5,545	5,530	5,504	5,464	5,408	5,334	5,244

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

(단위:백만원)

52,063

공시일	2018-05-16
기준일	2018-05-15

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

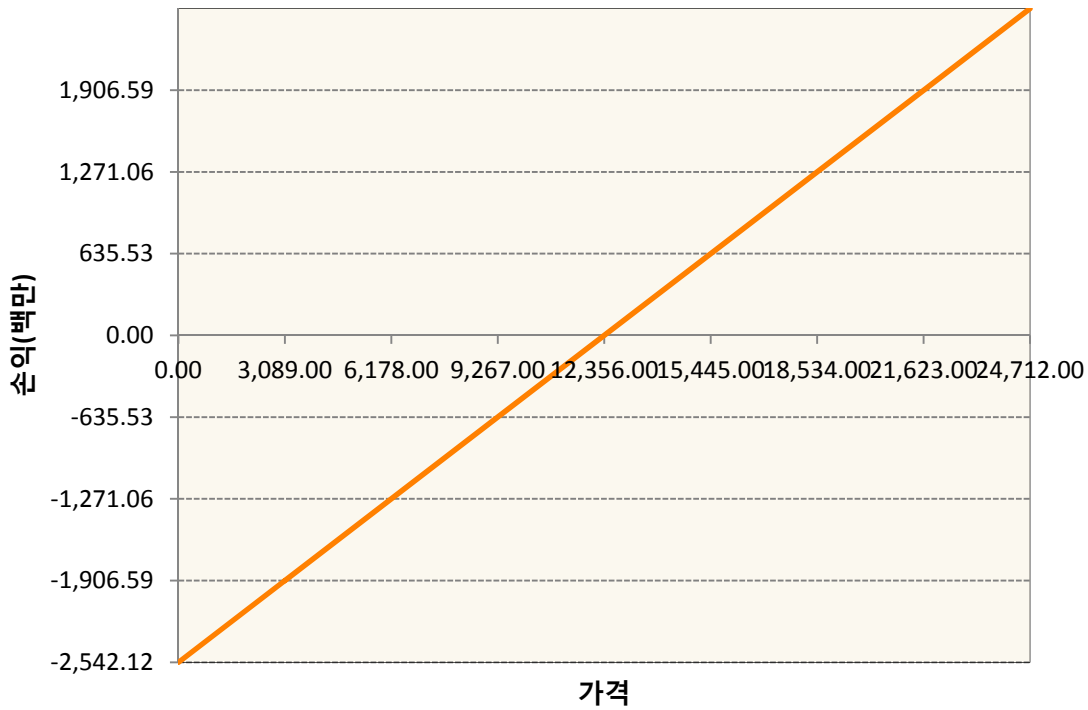
1. 계약금액

(단위:백만원)

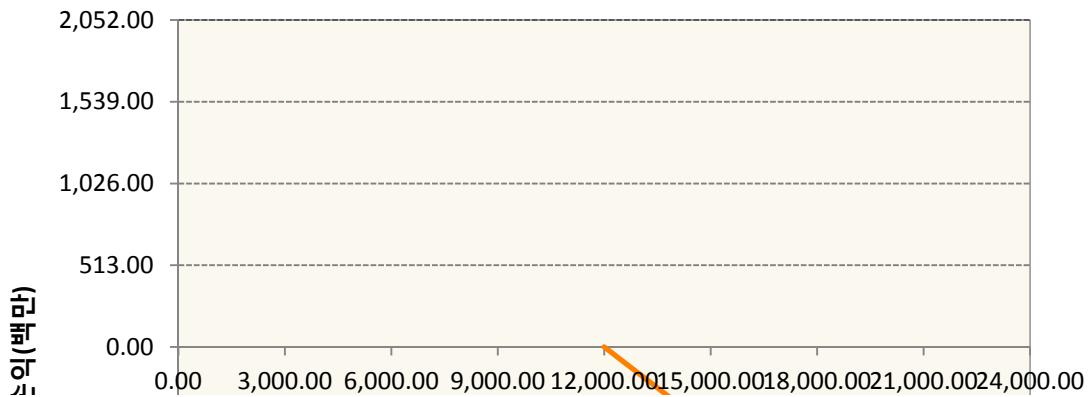
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,542	0	2,542	장내
누계	유가증권	옵션	0	6,274	-6,274	장내

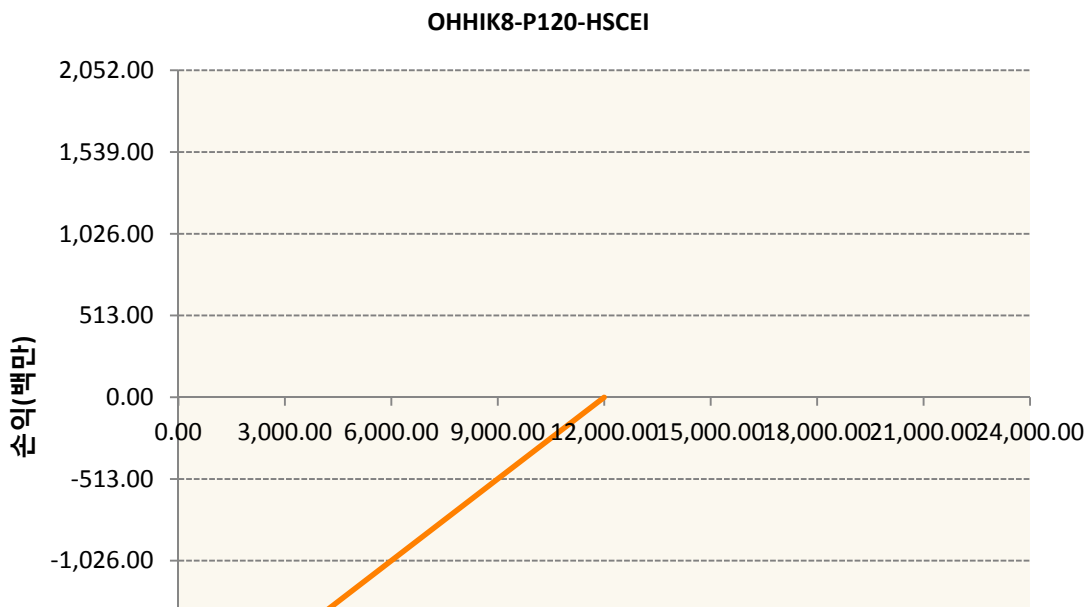
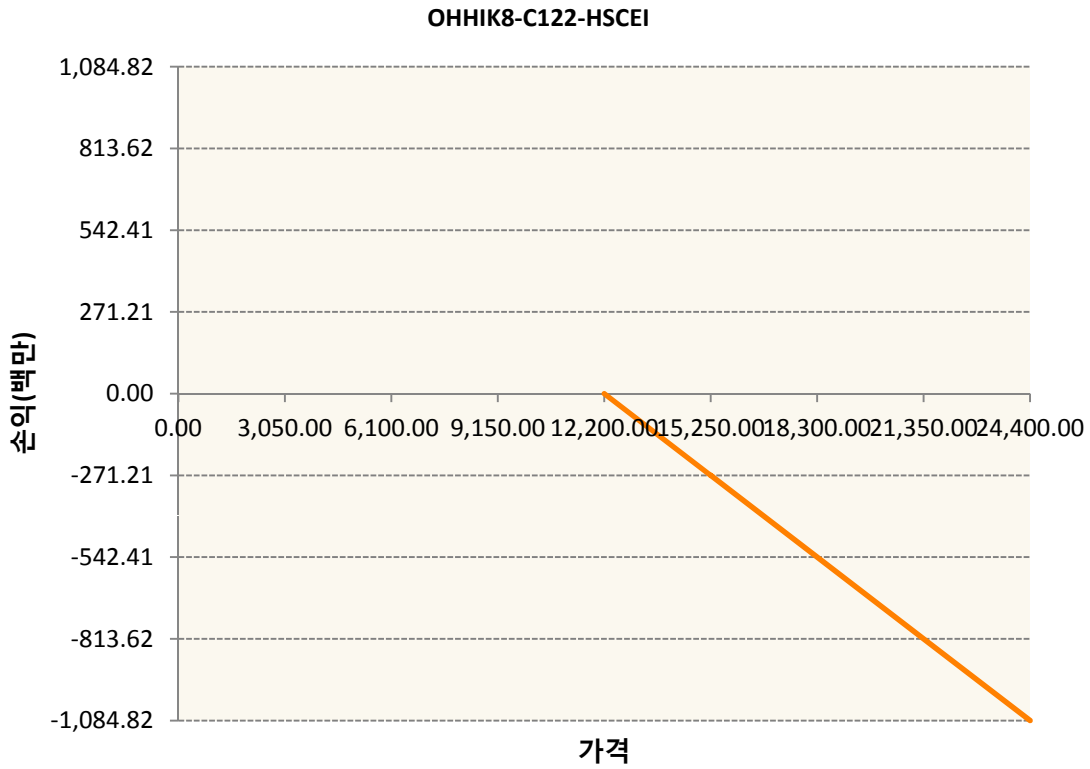
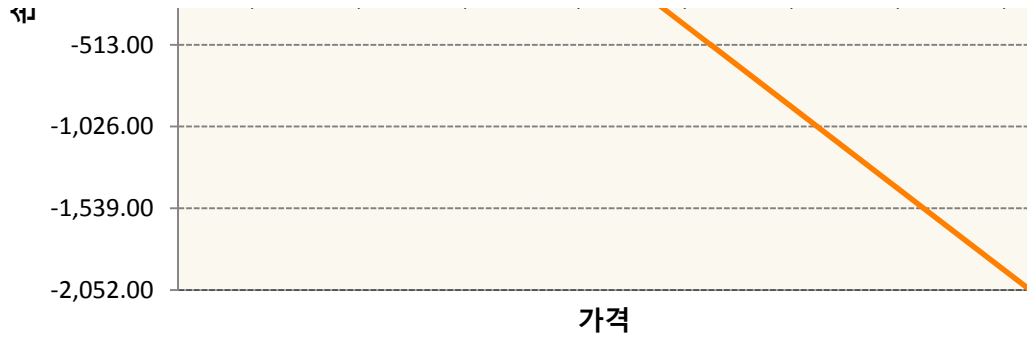
2. 만기시점의 손익구조

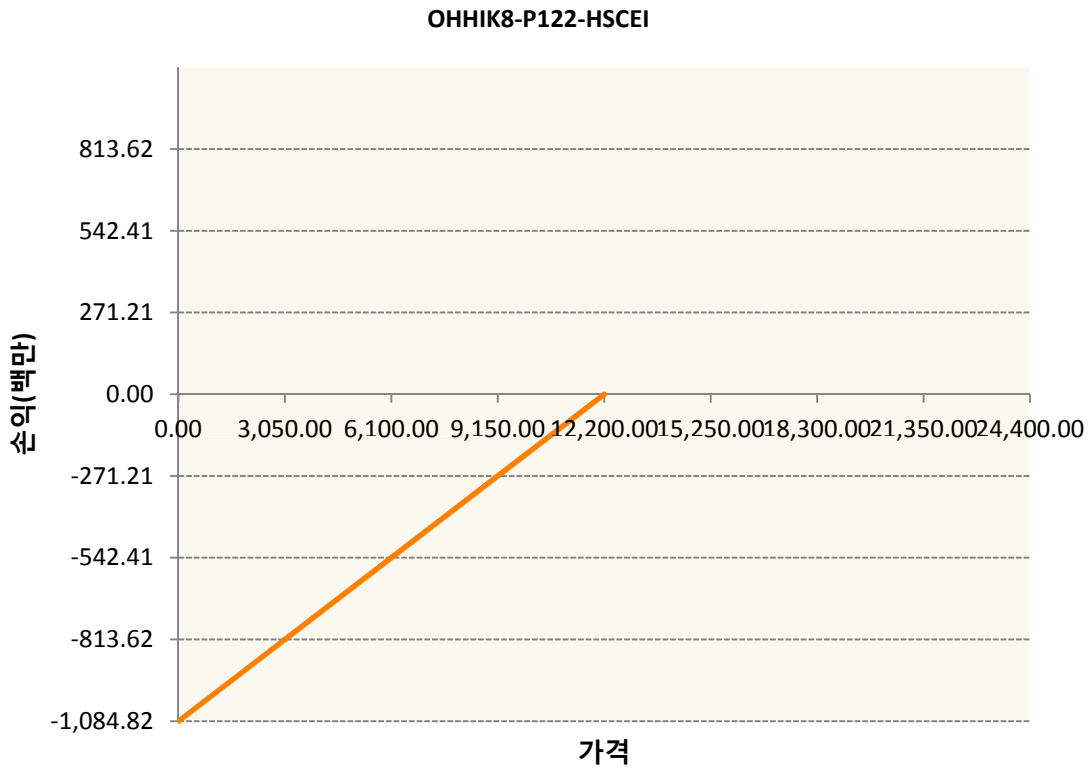
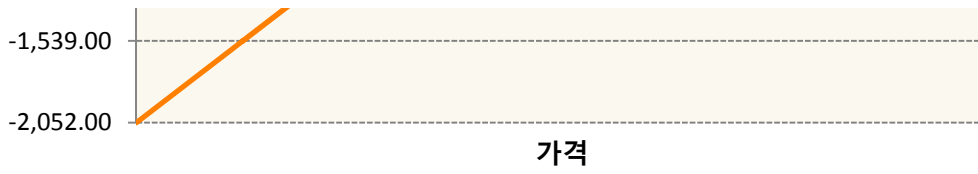
HCK8-H-SHARES FUT May18



OHHIK8-C120-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCK8	H-SHARES FUT May18	203
OHHIK8-C12	HSCEI	164
OHHIK8-C12	HSCEI	87
OHHIK8-P12	HSCEI	164
OHHIK8-P12	HSCEI	87

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	619

공시일	2018-05-16
기준일	2018-05-15

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

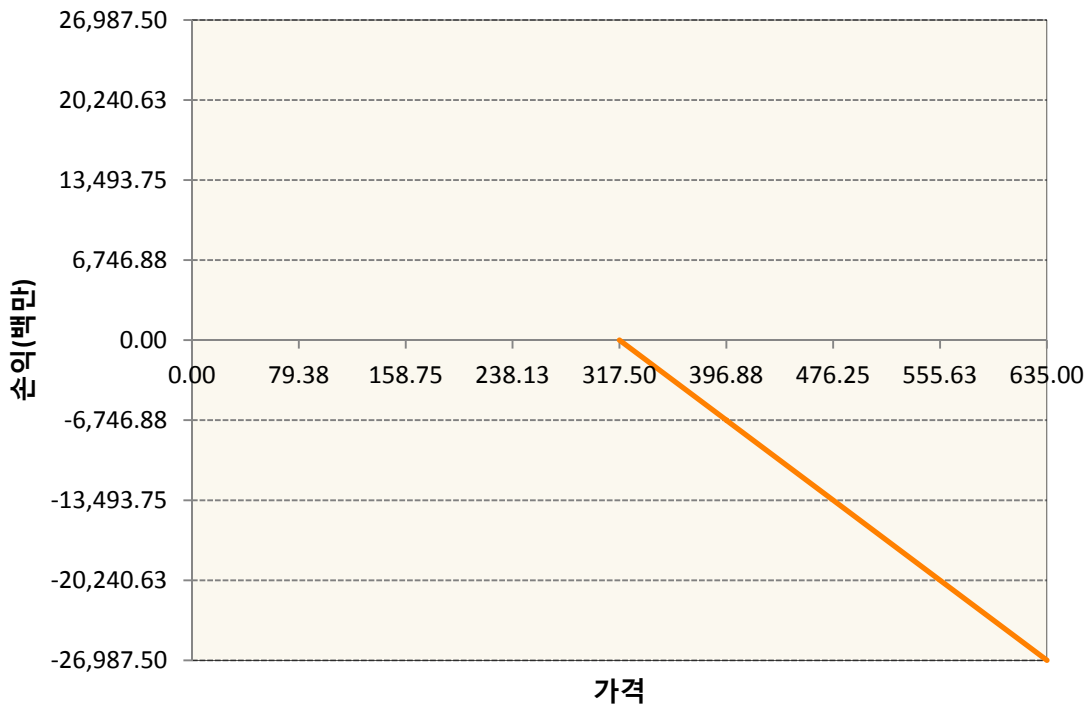
1. 계약금액

(단위:백만원)

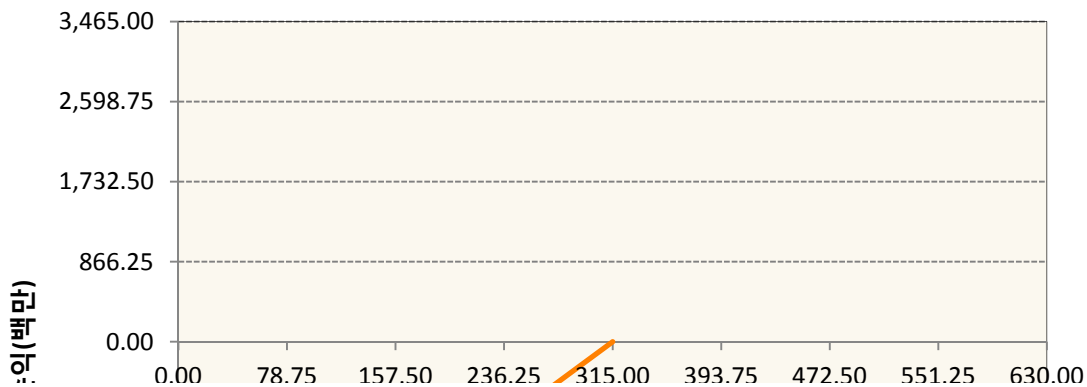
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	46,804	-46,804	장내

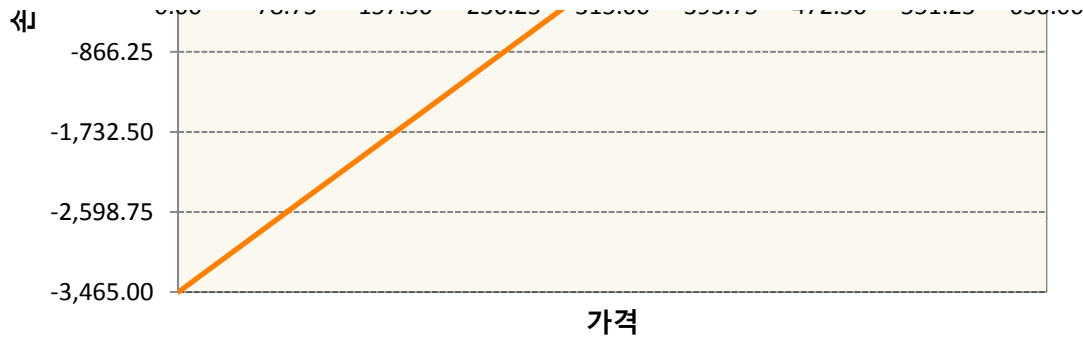
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63175-2018-06 콜317.5

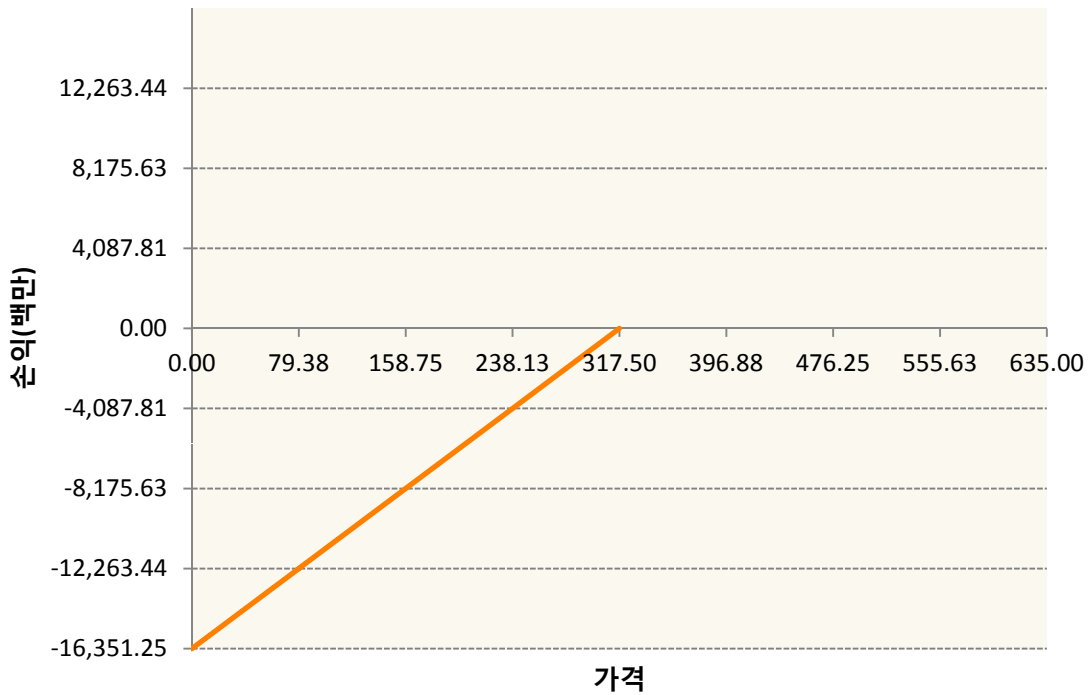


KR4301N63157-2018-06 풋315





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_2							1,474
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,474	-1,474	-1,474	-1,474	-1,474	-1,474	-1,474
-5.33%	-982	-982	-982	-982	-982	-982	-982
-2.67%	-491	-491	-491	-491	-491	-491	-491
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	491	491	491	491	491	491	491
5.33%	982	982	982	982	982	982	982
8.00%	1,474	1,474	1,474	1,474	1,474	1,474	1,474
2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_3							279
	기초자산의 변동성						

0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	212	212	212	212	212	212	212
5.33%	425	425	425	425	425	425	425
8.00%	637	637	637	637	637	637	637

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

KR4201N6312018-06 콜317.5 1,575

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	701	678	650	617	581	541	499
-5.33%	627	586	540	492	441	388	333
-2.67%	474	414	353	291	228	164	99
0%	210	140	70	0	-70	-140	-210
2.67%	-180	-248	-317	-386	-456	-525	-595
5.33%	-686	-742	-801	-862	-924	-988	-1,053
8.00%	-1,282	-1,321	-1,366	-1,414	-1,465	-1,519	-1,575

KR4301N6312018-06 풋315 231

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-230	-230	-230	-230	-230	-231	-231
-5.33%	-138	-138	-139	-140	-141	-143	-144
-2.67%	-52	-54	-57	-59	-62	-65	-68
0%	12	8	4	0	-4	-8	-12
2.67%	40	38	35	32	29	26	23
5.33%	47	46	45	44	43	41	39
8.00%	47	47	47	47	47	46	45

KR4301N6312018-06 풋317.5 1,136

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,133	-1,133	-1,133	-1,133	-1,134	-1,135	-1,136
-5.33%	-702	-703	-705	-708	-712	-716	-722
-2.67%	-285	-293	-302	-313	-324	-336	-349
0%	54	36	18	0	-18	-36	-54
2.67%	234	219	204	188	171	154	137
5.33%	286	281	274	266	258	248	237
8.00%	293	292	291	289	286	282	277

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

(단위:백만원)

6,842

공시일	2018-05-16
기준일	2018-05-15

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

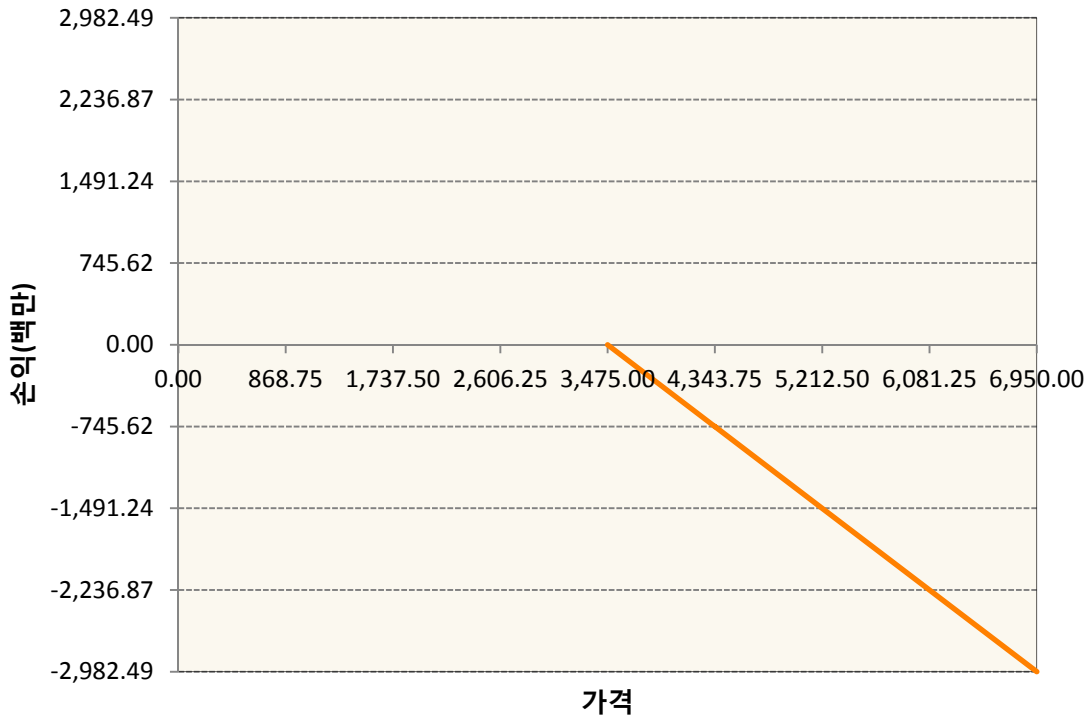
1. 계약금액

(단위:백만원)

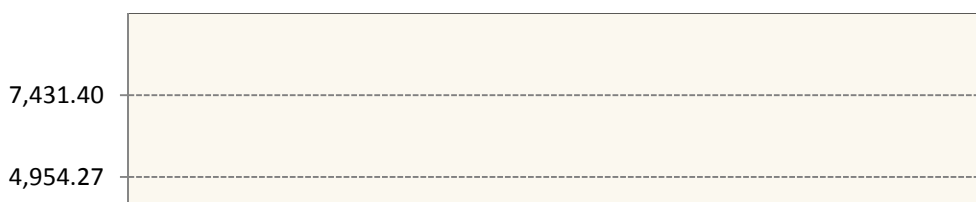
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,984	0	4,984	
누계	유가증권	스왑	64,000	0	64,000	장외
누계	유가증권	옵션	0	33,749	-33,749	장내
누계	지수	스왑	51,240	0	51,240	장외

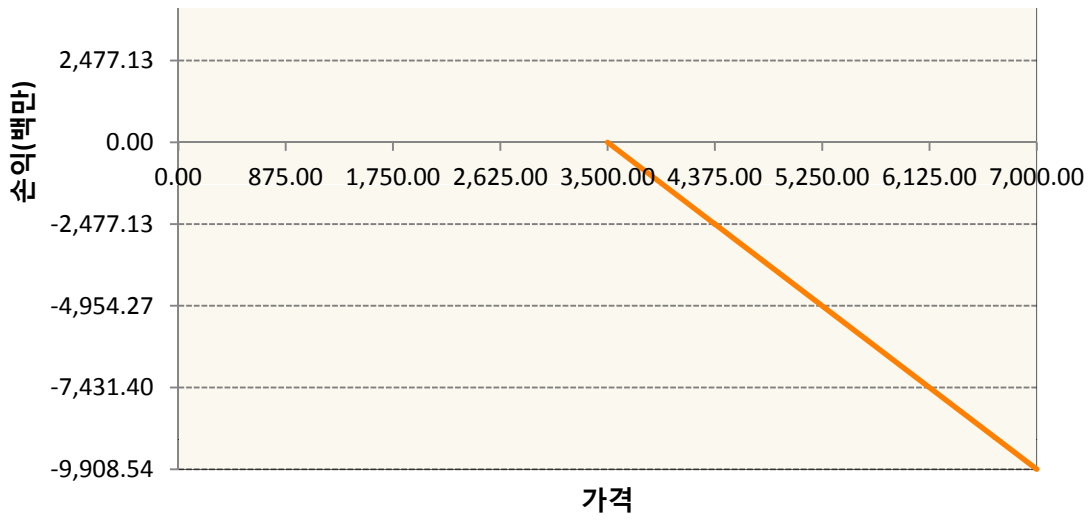
2. 만기시점의 손익구조

OESXK8-C3475-EURO STOXX 50

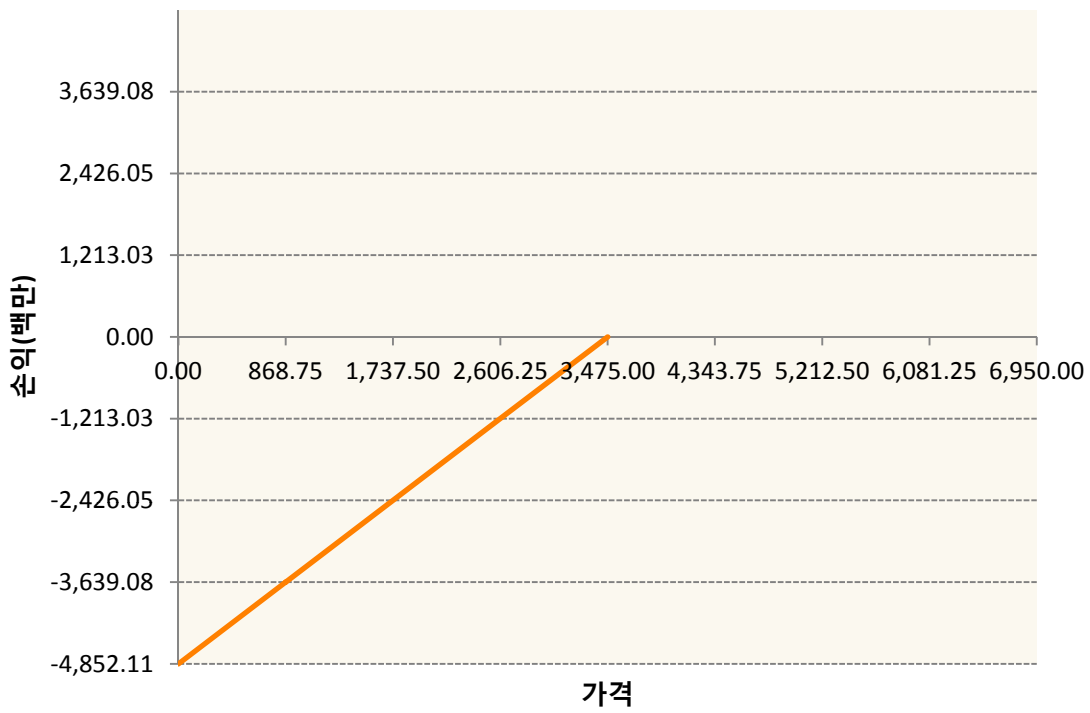


OESXK8-C3500-EURO STOXX 50

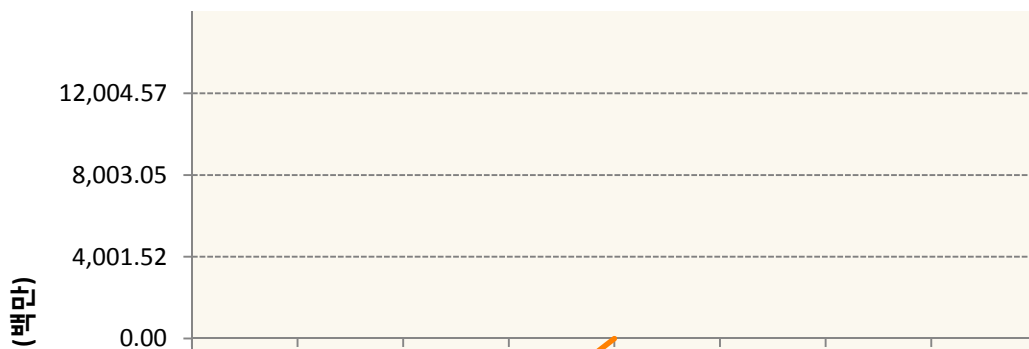


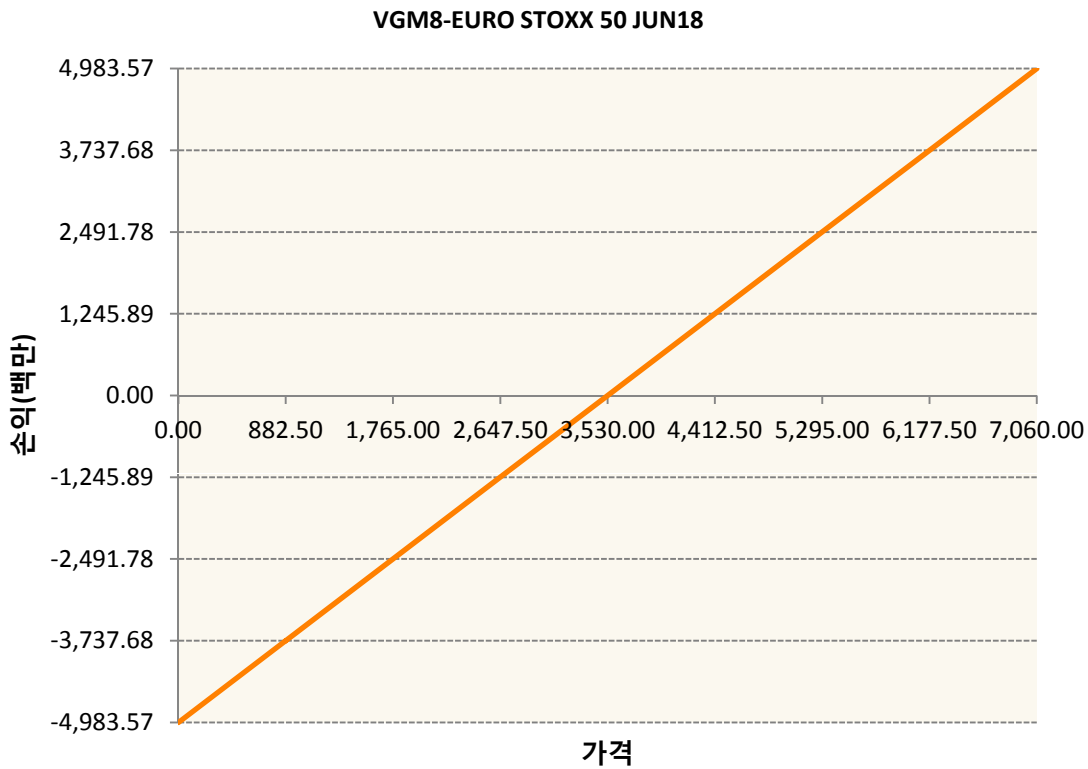
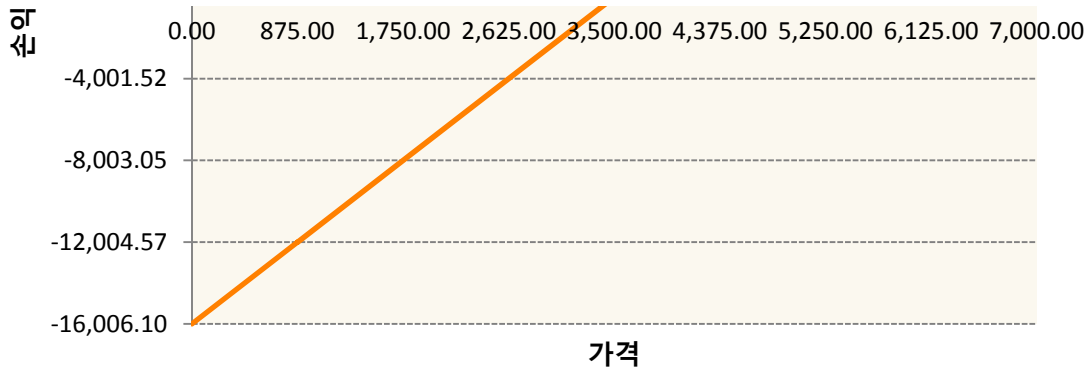


OESXK8-P3475-EURO STOXX 50



OESXK8-P3500-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		64
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		80
OESXK8-C34 EURO STOXX 50		239
OESXK8-C35 EURO STOXX 50		793
OESXK8-P34 EURO STOXX 50		388
OESXK8-P35 EURO STOXX 50		1,280
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18		399

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

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

(단위:백만원)

1,170

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

(단위:백만원)

59

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

(단위:백만원)

96

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

(단위:백만원)

207

공시일	2018-05-16
기준일	2018-05-15

스마트KRX300인덱스목표전환형1

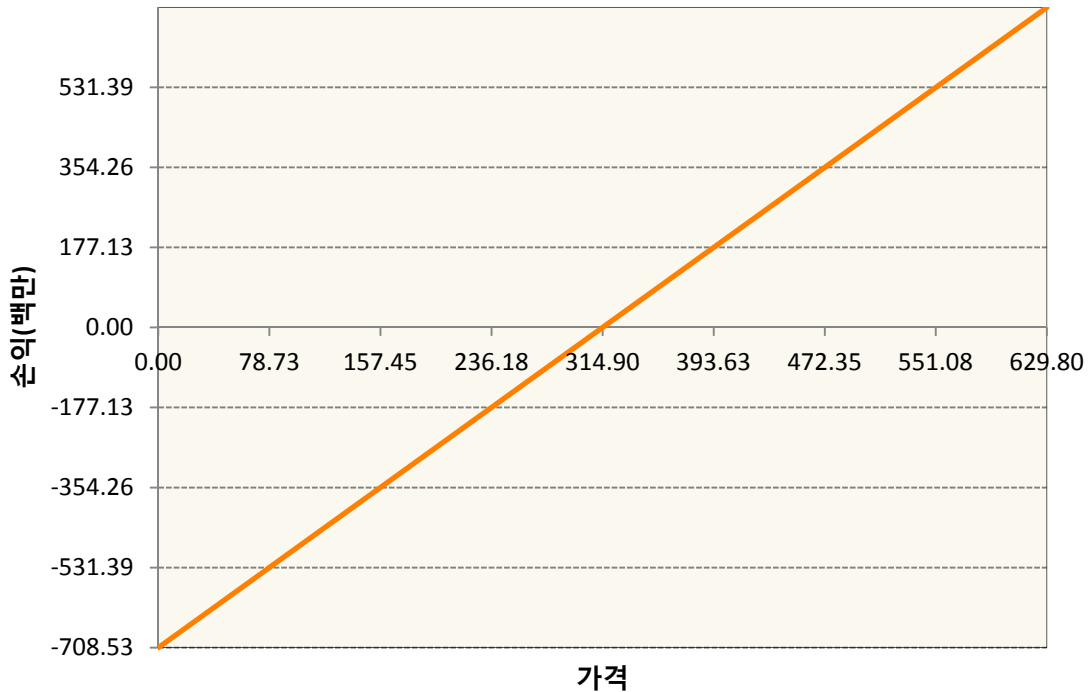
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	709	0	709	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물

57

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
-5.33%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
-2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	19	19	19	19	19	19	19
5.33%	38	38	38	38	38	38	38
8.00%	57	57	57	57	57	57	57

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

(단위:백만원)

41

공시일	2018-05-16
기준일	2018-05-15

리디파인K200(주식혼합-파생재간

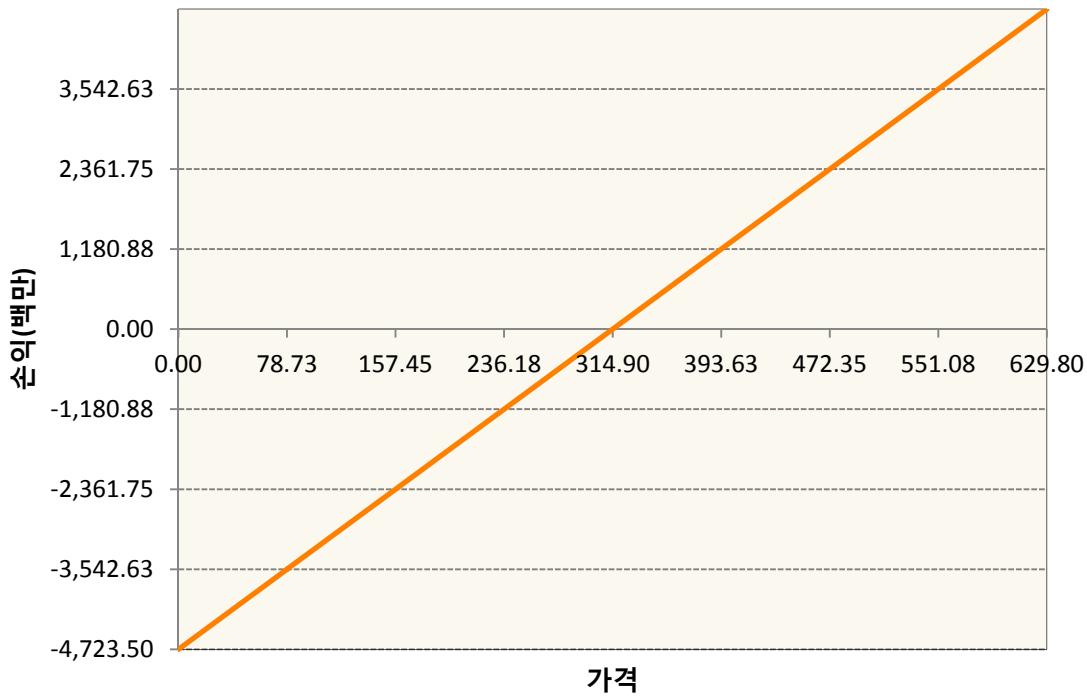
1. 계약금액

(단위:백만원)

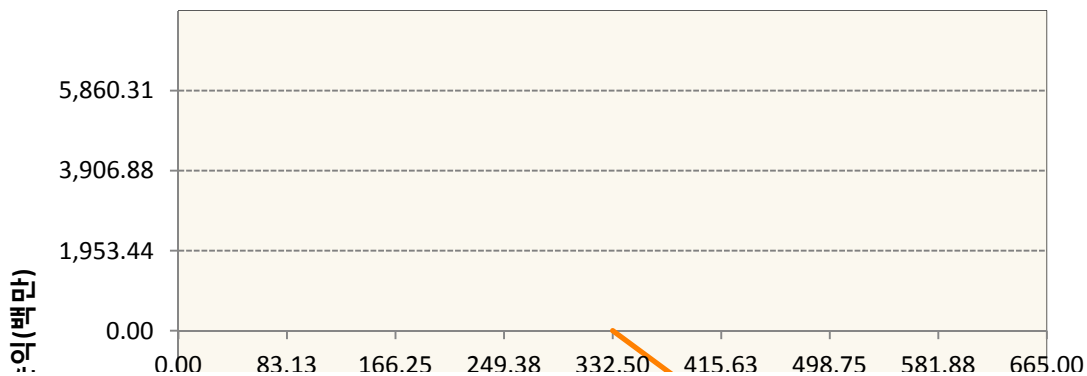
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	238	0	238	장내
신규	유가증권	옵션	78	250	-171	장내
누계	유가증권	선물	4,724	0	4,724	장내
누계	유가증권	옵션	1,032	7,814	-6,782	장내

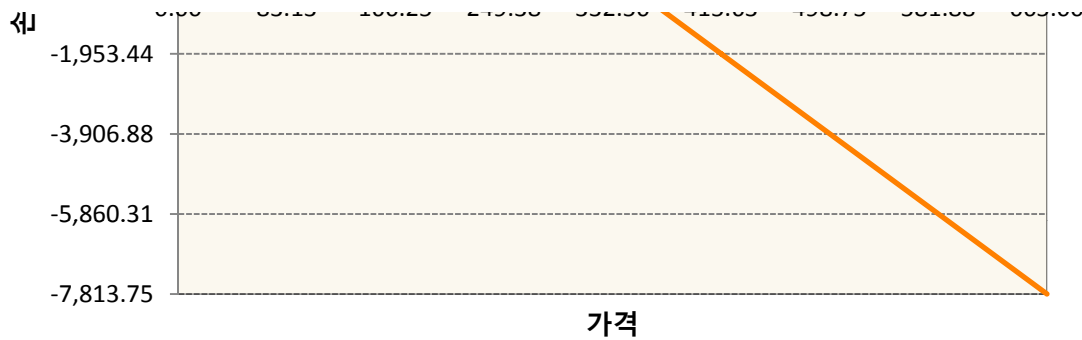
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

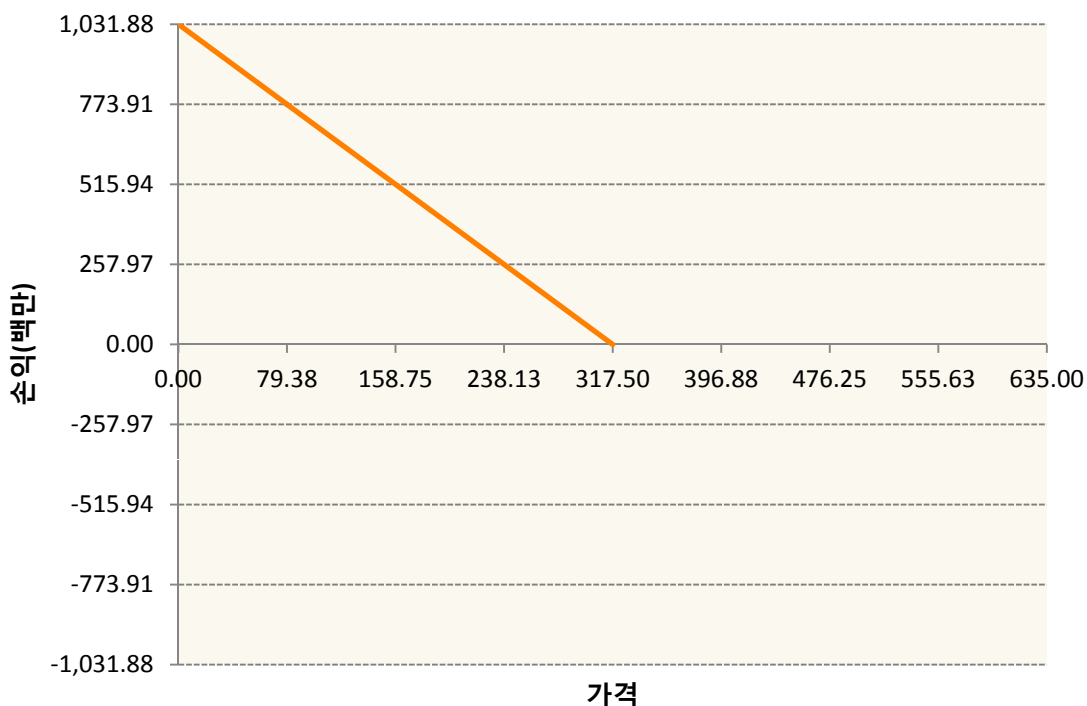


KR4201N63324-2018-06 콜332.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물							378
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-378	-378	-378	-378	-378	-378	-378
-5.33%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252
-2.67%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	126	126	126	126	126	126	126
5.33%	252	252	252	252	252	252	252
8.00%	378	378	378	378	378	378	378
KR4201N63E 2018-06 콜332.5							321
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	86	84	82	78	73	68	61
-5.33%	82	78	72	65	57	48	38
-2.67%	70	62	52	41	29	16	2
0%	44	30	15	0	-16	-33	-49
2.67%	-7	-25	-44	-62	-81	-101	-120
5.33%	-88	-108	-129	-149	-170	-190	-210
8.00%	-202	-222	-241	-261	-281	-301	-321

KR4301N6312018-06 풋317.5

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	71	71	71	72	72	72	72
-5.33%	44	44	44	45	45	45	46
-2.67%	18	18	19	20	20	21	22
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-15	-14	-13	-12	-11	-10	-9
5.33%	-18	-18	-17	-17	-16	-16	-15
8.00%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-17

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

(단위:백만원)

573

공시일	2018-05-16
기준일	2018-05-15

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

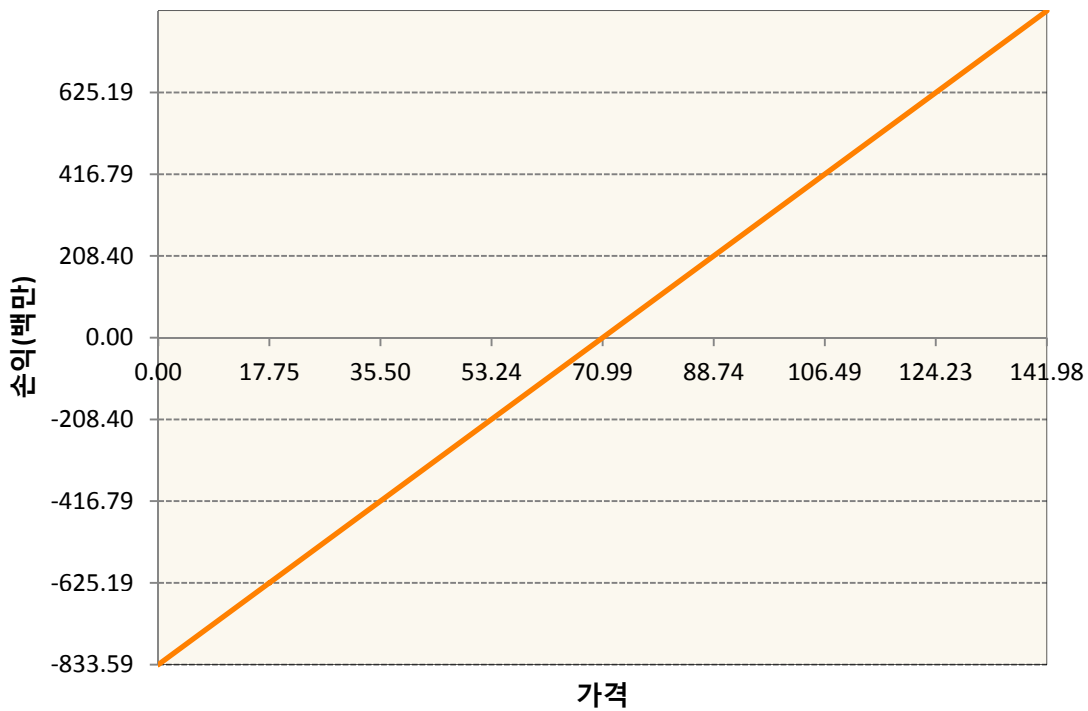
1. 계약금액

(단위:백만원)

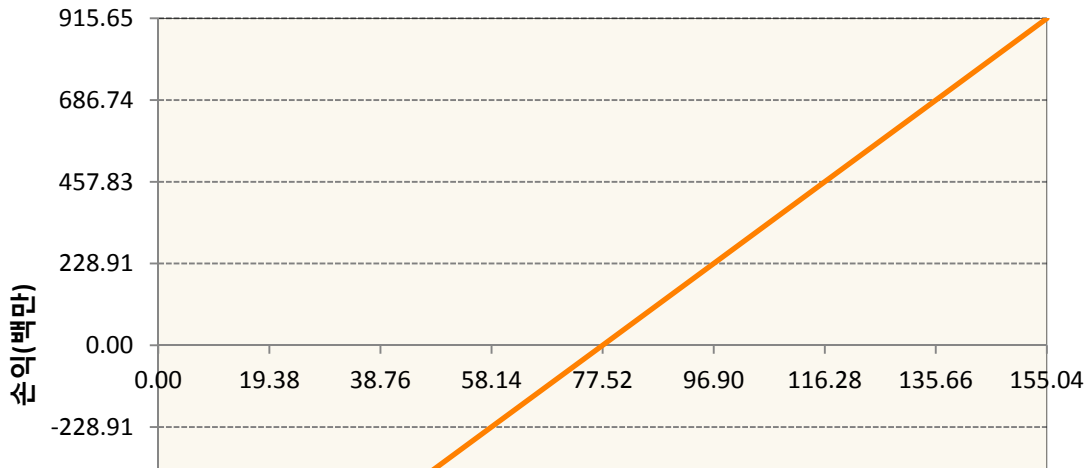
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,911	591	3,321	

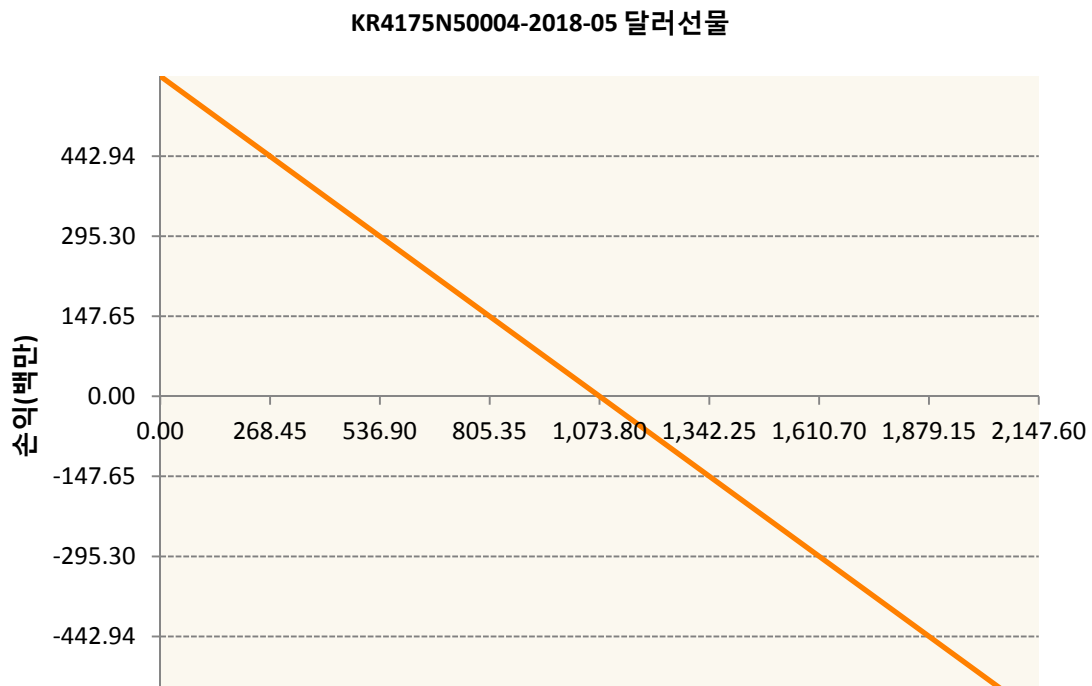
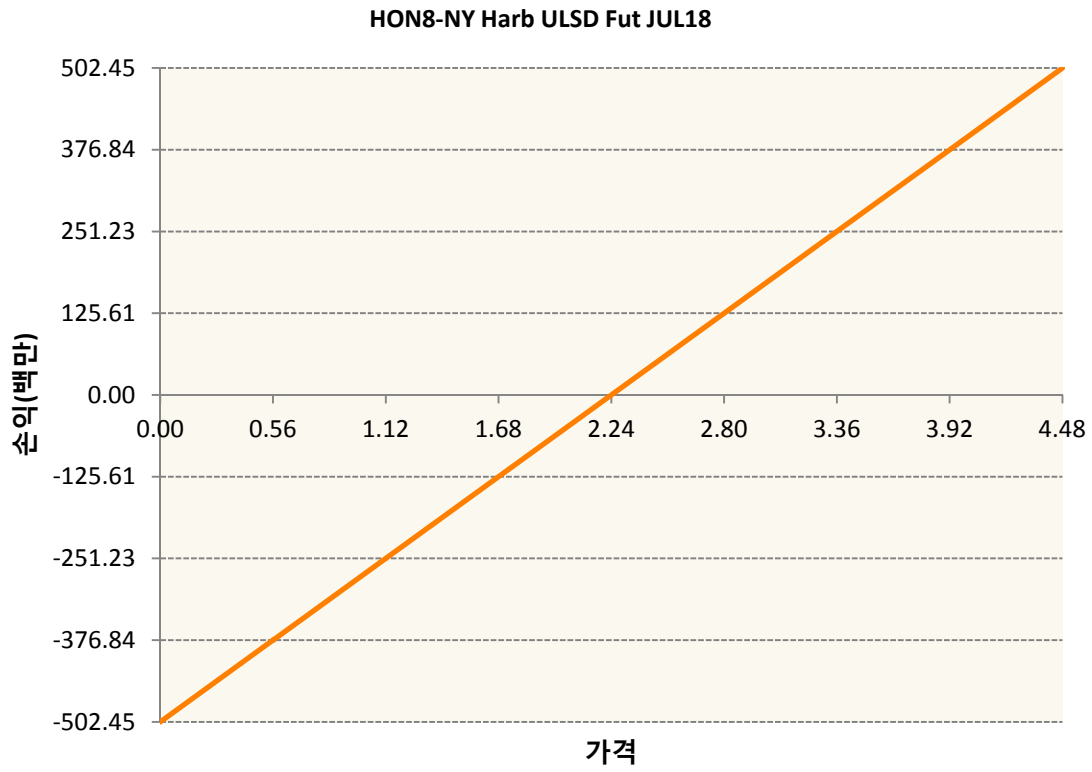
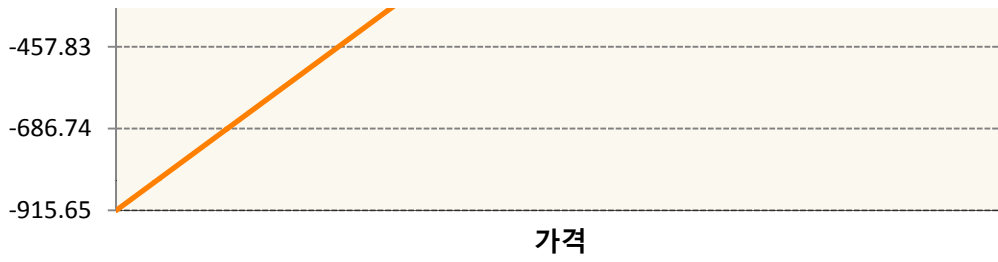
2. 만기시점의 손익구조

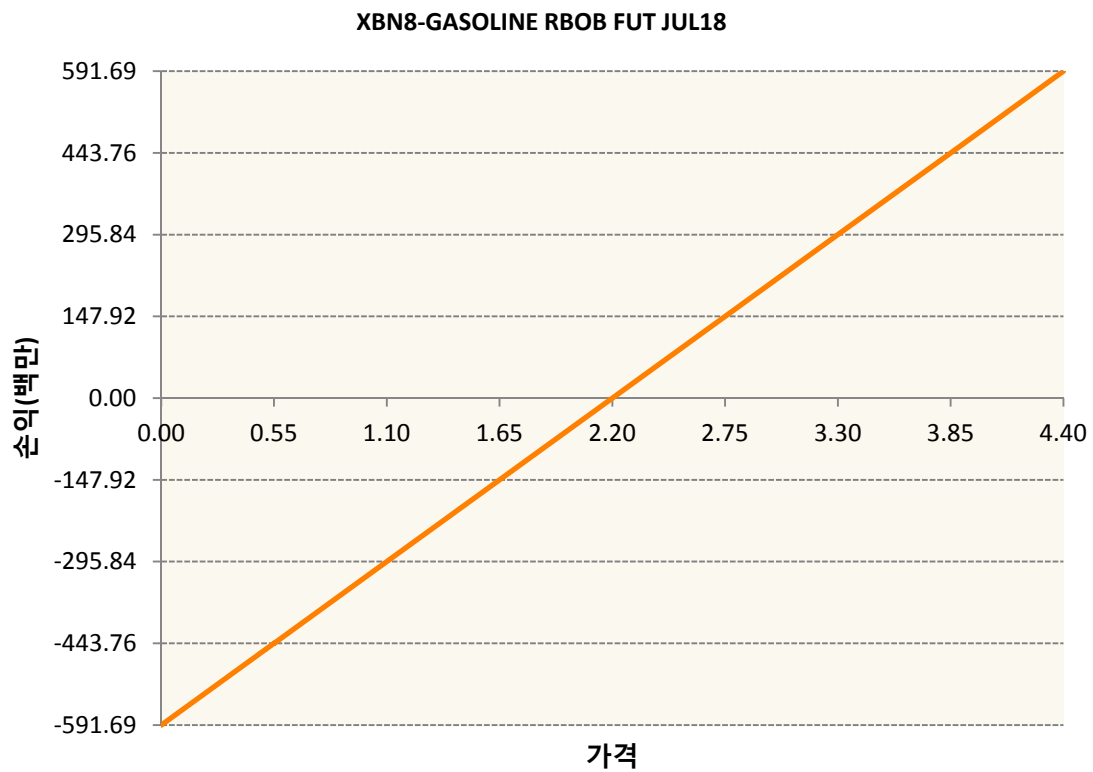
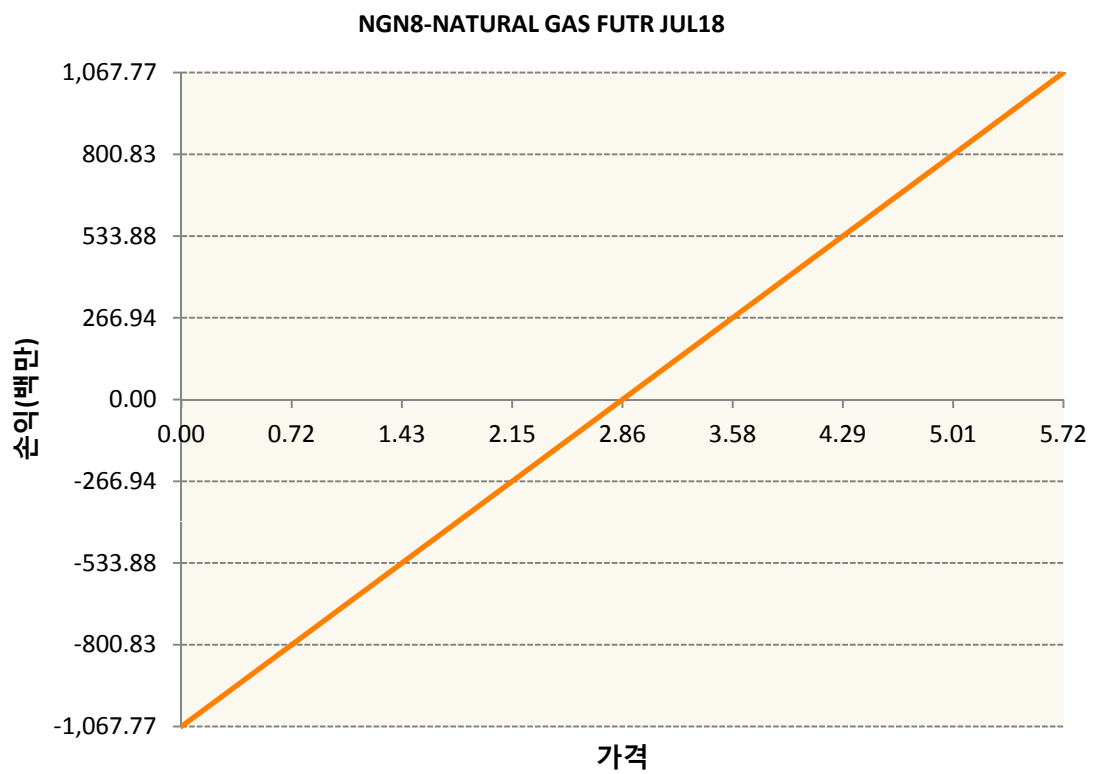
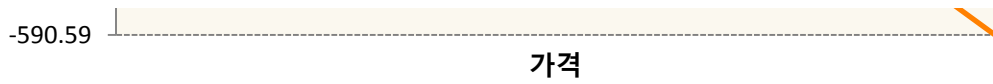
CLN8-WTI CRUDE FUTURE JUL18



COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN8	WTI CRUDE FUTURE JUL18	67
COU8	BRENT CRUDE FUTR SEP18	73
HON8	NY Harb ULSD Fut JUL18	40
KR4175N50C	2018-05 달러선물	47
NGN8	NATURAL GAS FUTR JUL18	85
XBN8	GASOLINE RBOB FUT JUL18	47

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

475

공시일	2018-05-16
기준일	2018-05-15

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

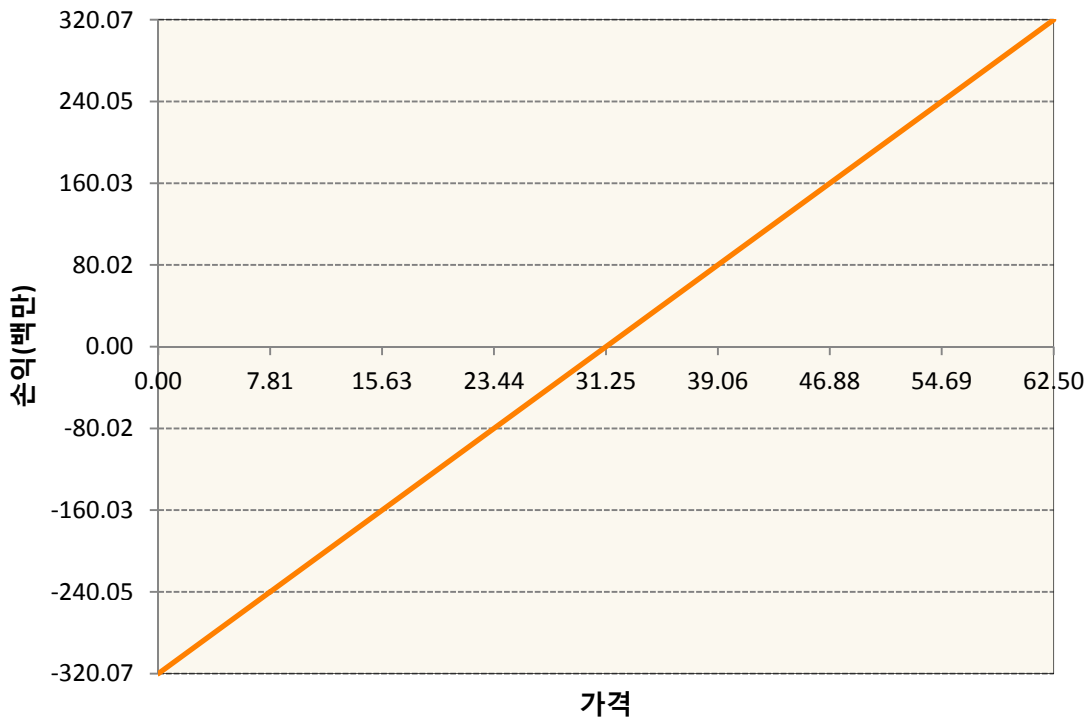
1. 계약금액

(단위:백만원)

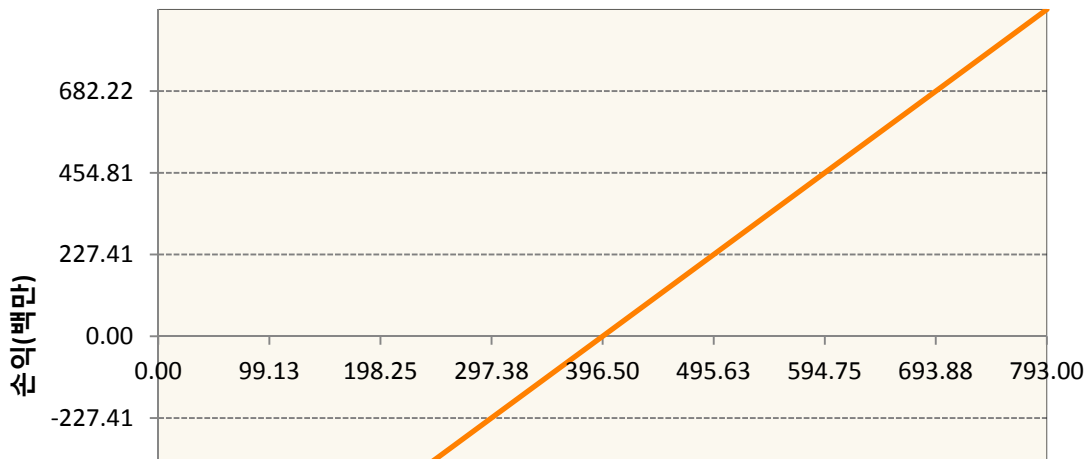
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,036	322	3,714	

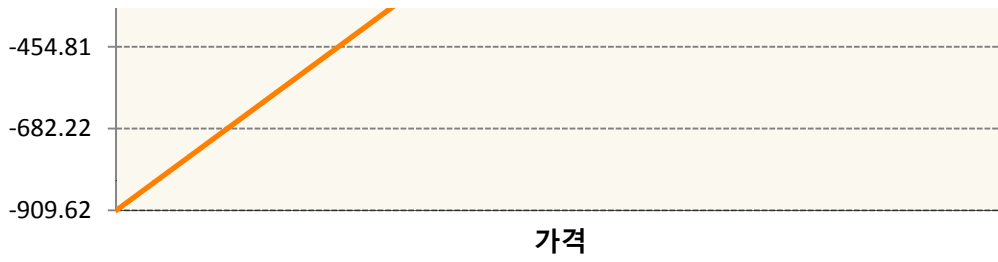
2. 만기시점의 손익구조

BON8-SOYBEAN OIL FUTR JUL18

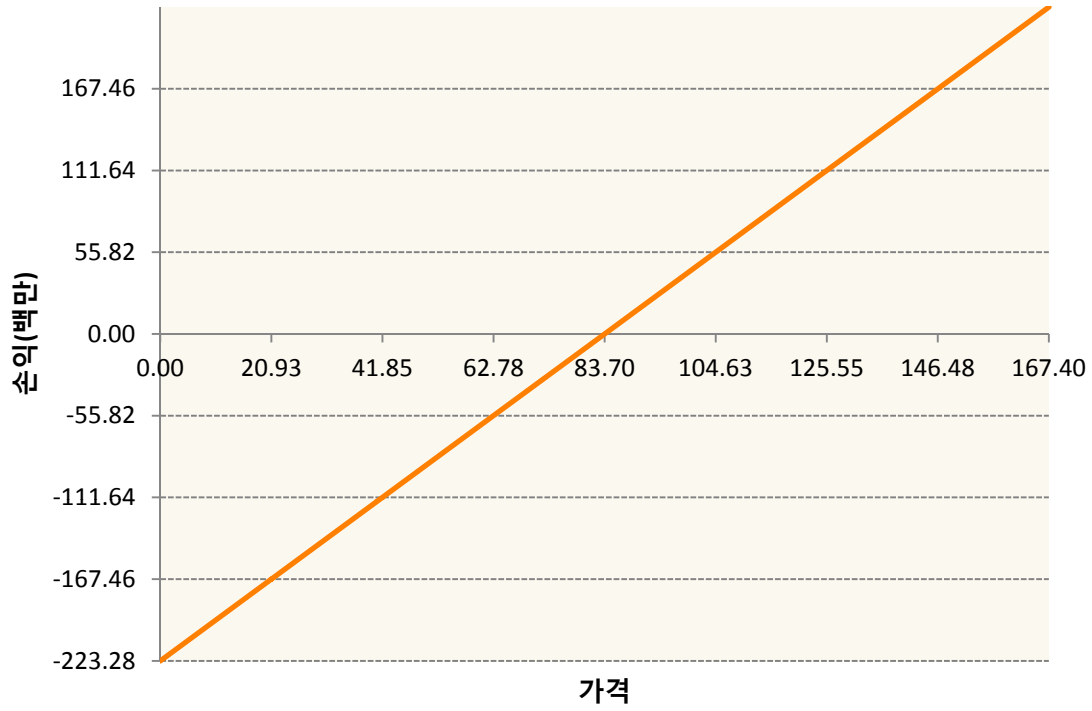


CN8-CORN FUTURE JUL18

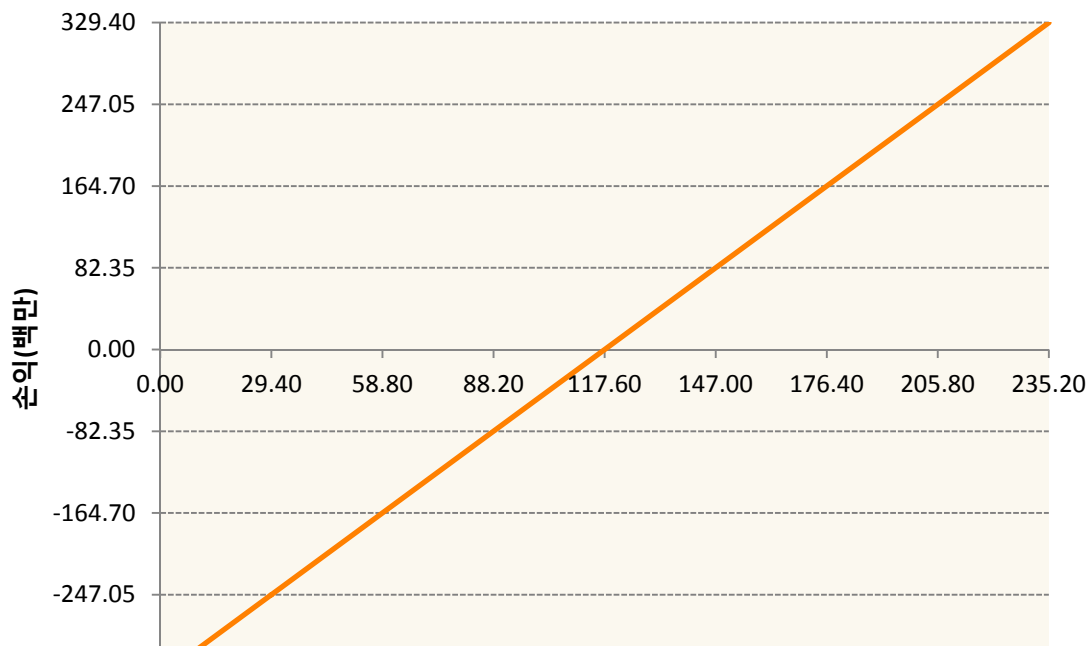


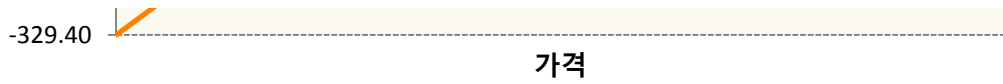


CTN8-COTTON NO.2 FUTR JUL18

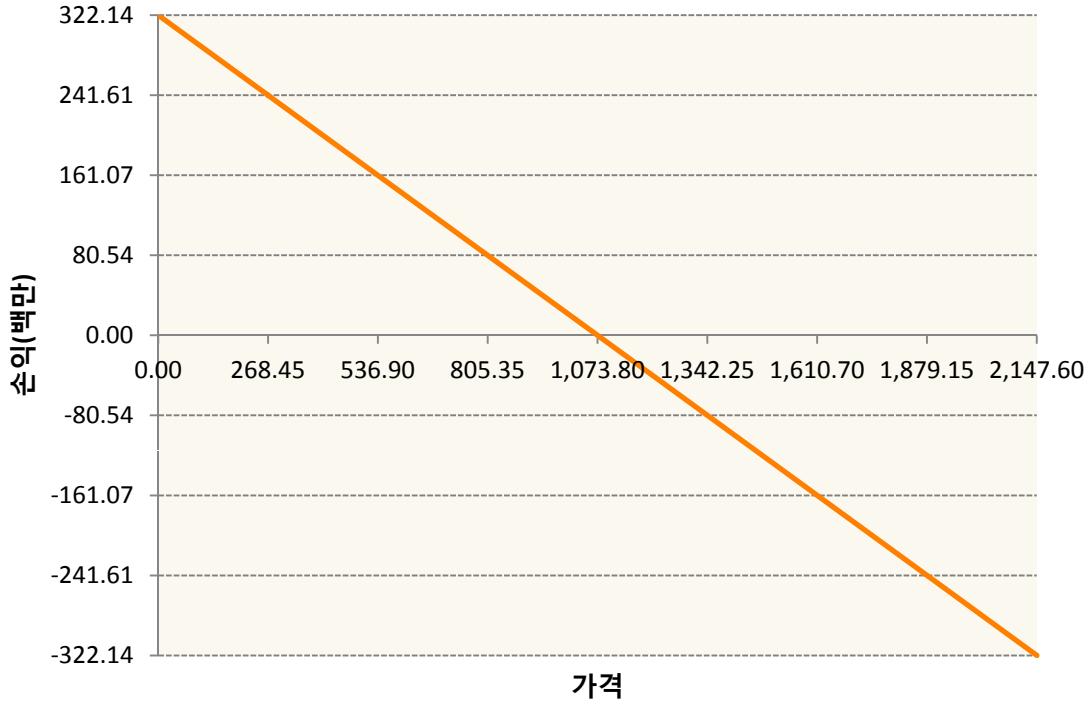


KCN8-COFFEE 'C' FUTURE JUL18

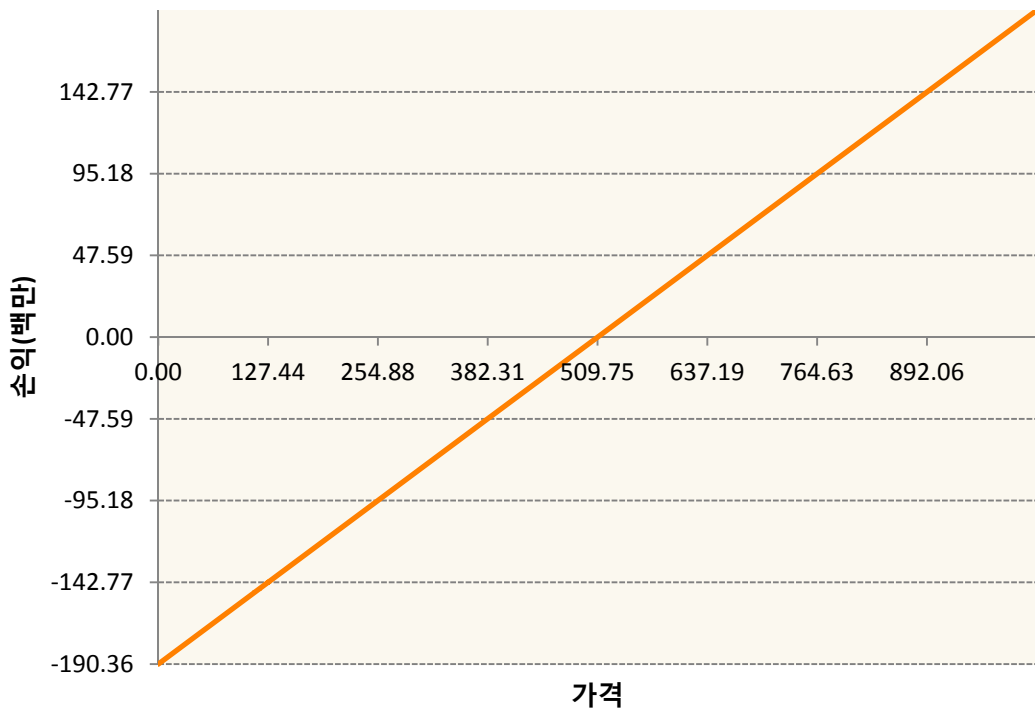




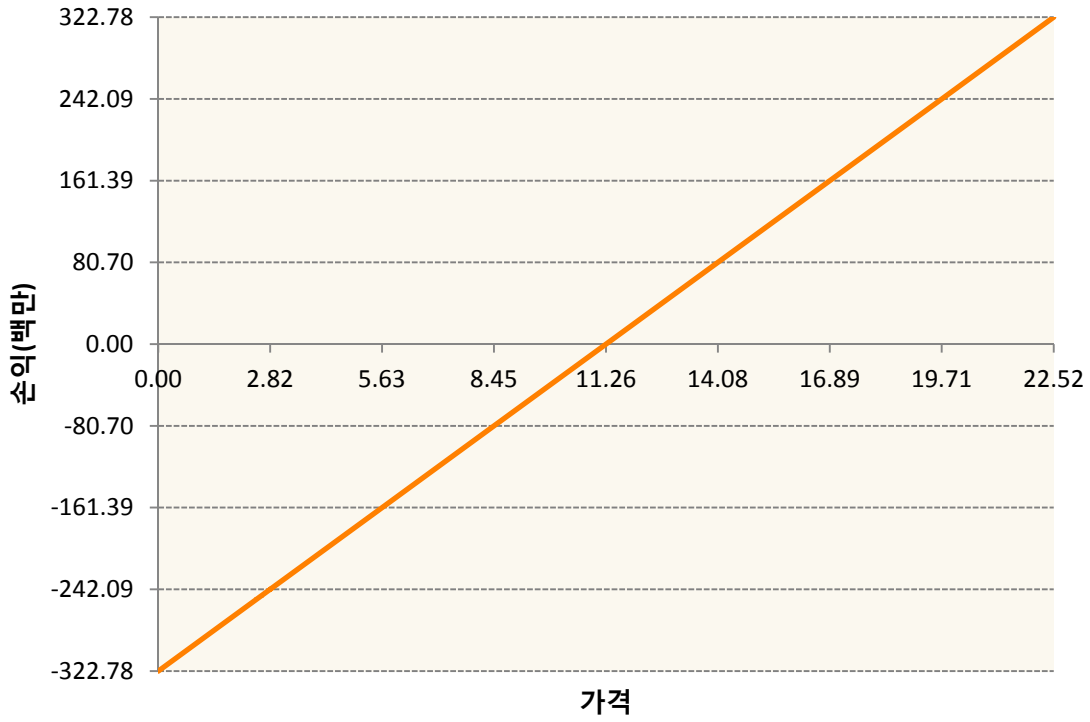
KR4175N50004-2018-05 달러선물



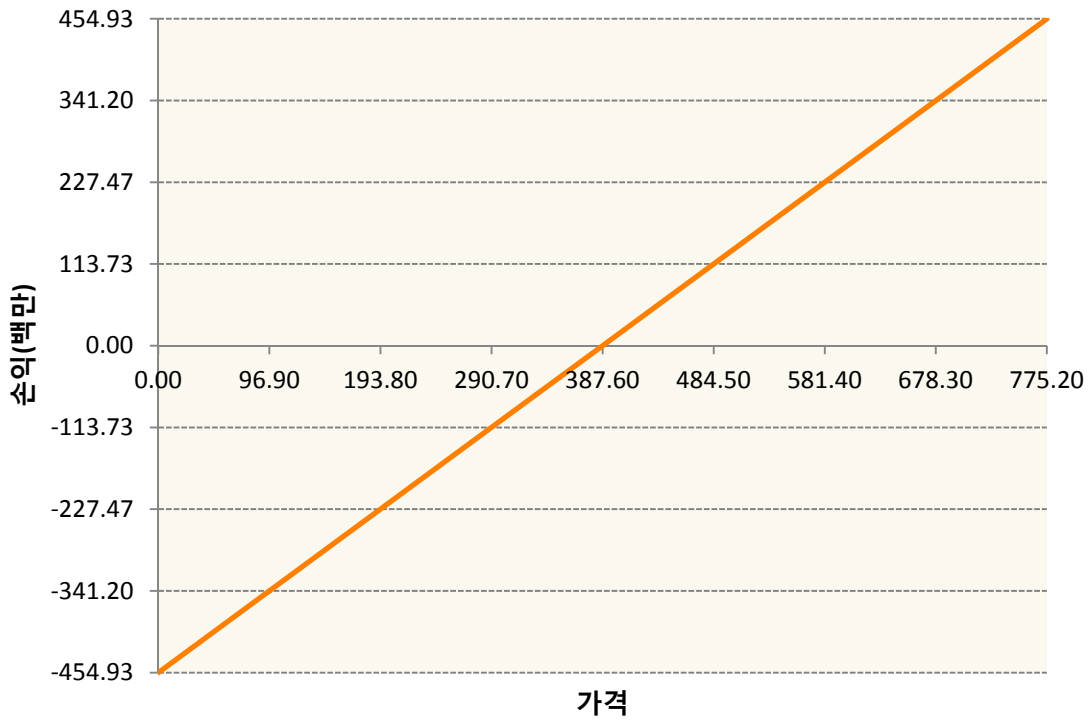
KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18



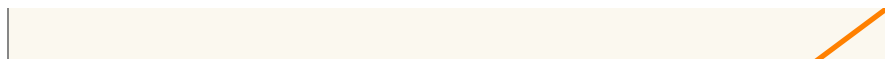
SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18

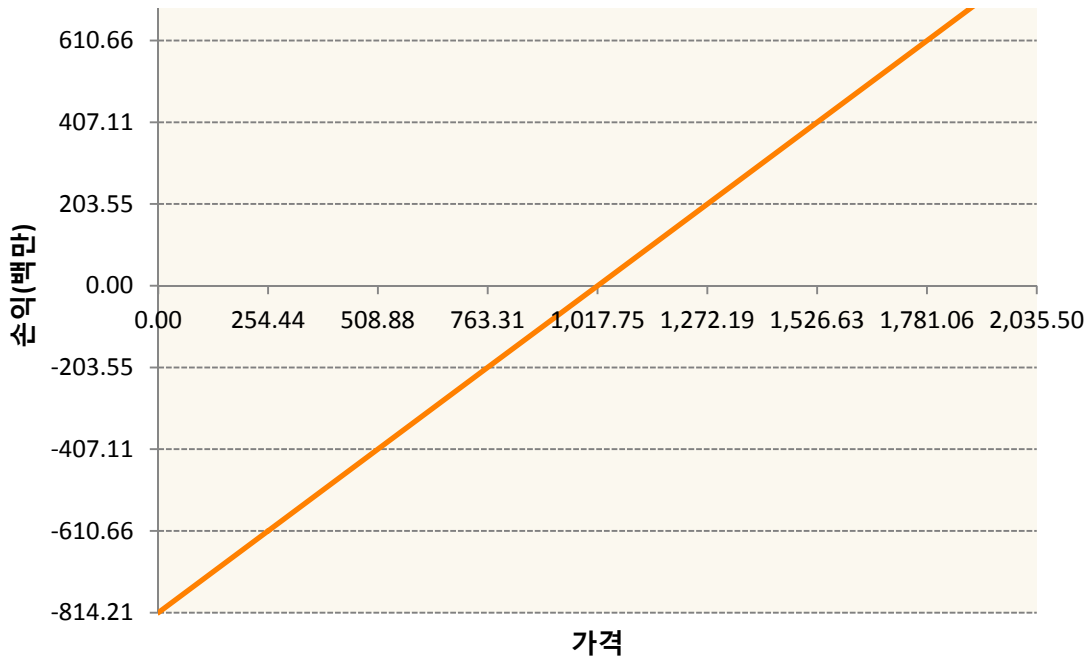


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18

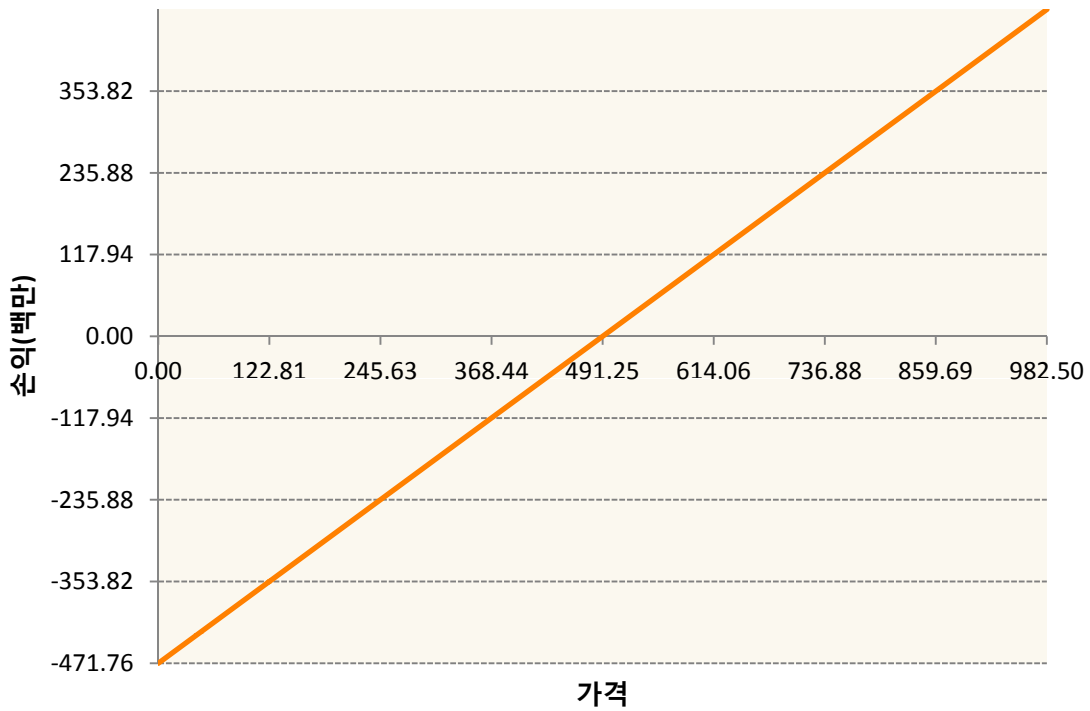


SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18





WN8-WHEAT FUTURE(CBT) JUL18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON8	SOYBEAN OIL FUTR JUL18	26
CN8	CORN FUTURE JUL18	73
CTN8	COTTON NO.2 FUTR JUL18	18
KCN8	COFFEE 'C' FUTURE JUL18	26
KR4175N50C	2018-05 달러선물	26

KWN8	KC HRW WHEAT FUT JUL18	15
SBN8	SUGAR #11 (WORLD) JUL18	26
SMN8	SOYBEAN MEAL FUTR JUL18	36
SN8	SOYBEAN FUTURE JUL18	65
WN8	WHEAT FUTURE(CBT) JUL18	38

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

(단위:백만원)

323