

공시일	2018-05-17
기준일	2018-05-16

## 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	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	2018-05-17
기준일	2018-05-16

## 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	13,869	0	13,869	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0( 신한MXWO 미래S180222

1,119

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

**459**

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-05-17
기준일	2018-05-16

## 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	5,081	0	5,081	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

#### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI500000 신한CSI500미래S180308

400

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

427

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-05-17
기준일	2018-05-16

## 유로인덱스모(주식-파생형)

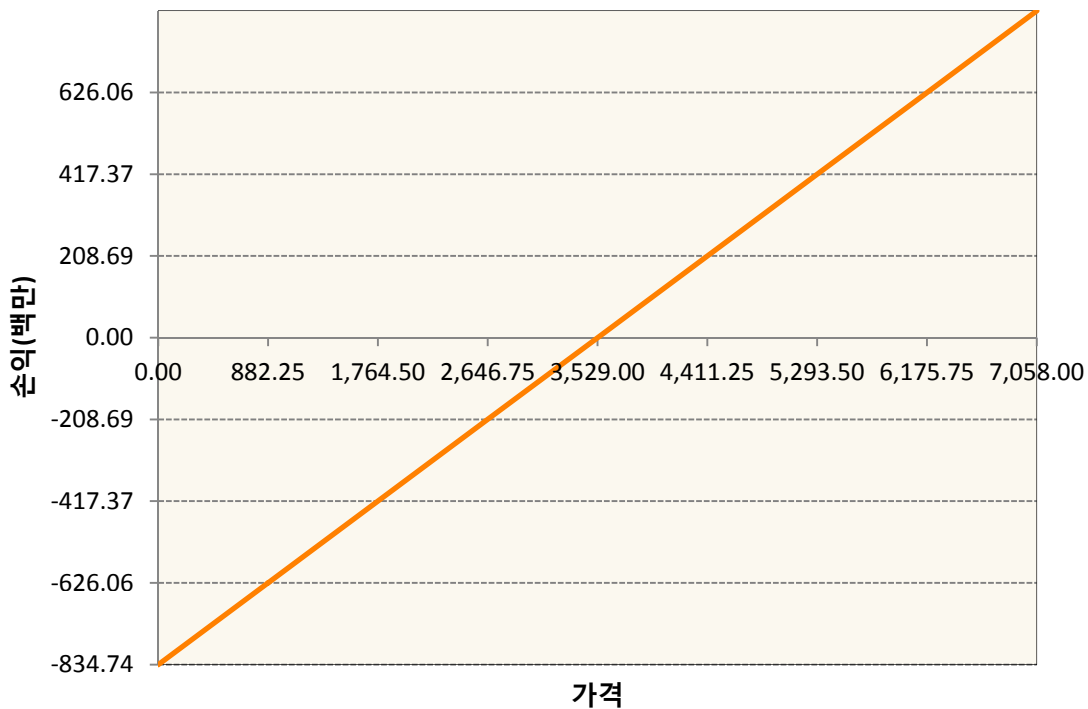
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	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	2018-05-17
기준일	2018-05-16

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

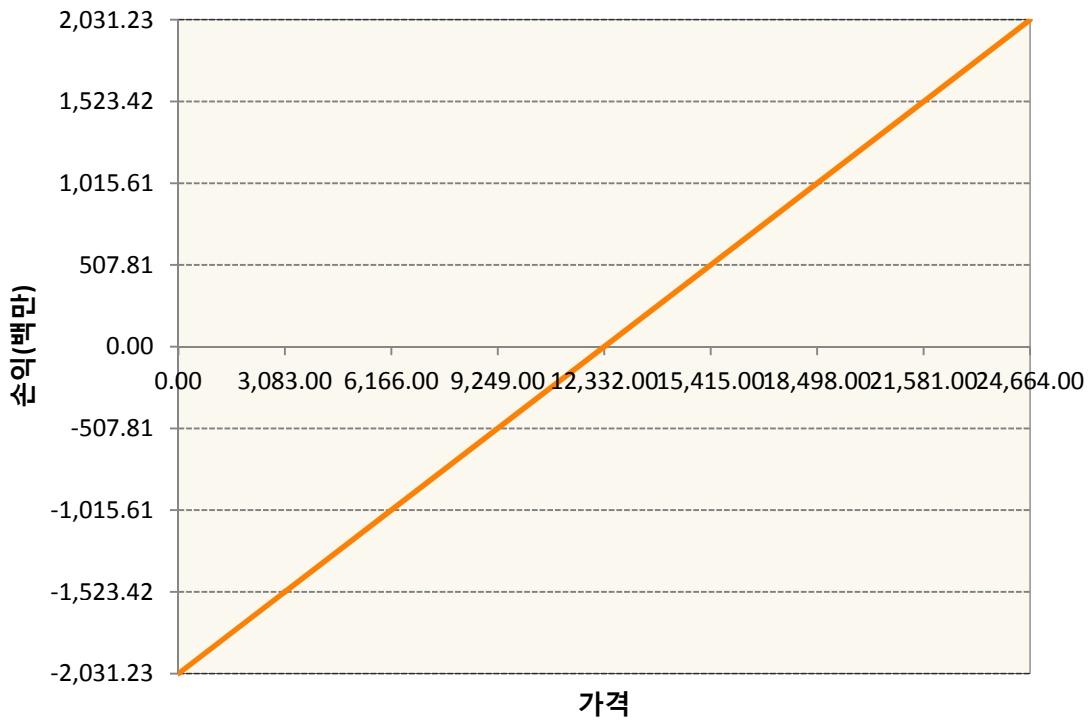
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

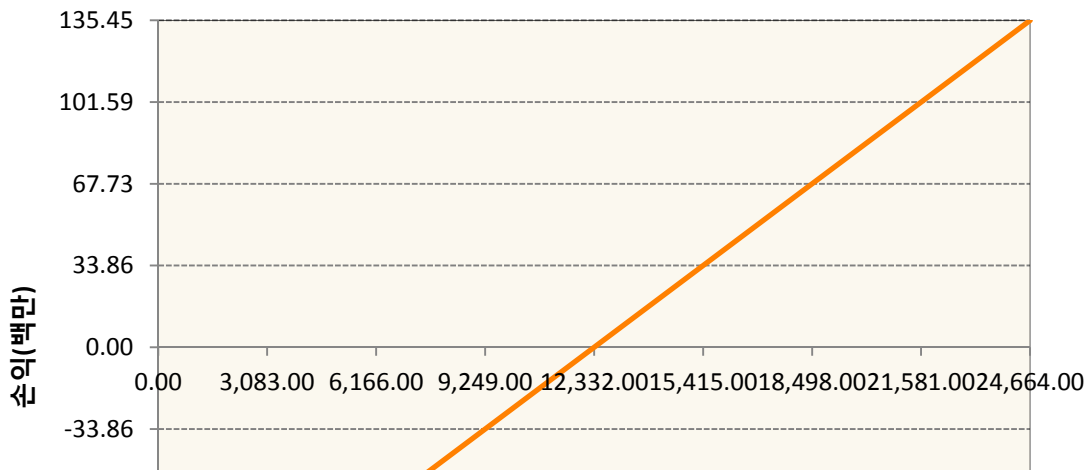
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,167	0	2,167	장내

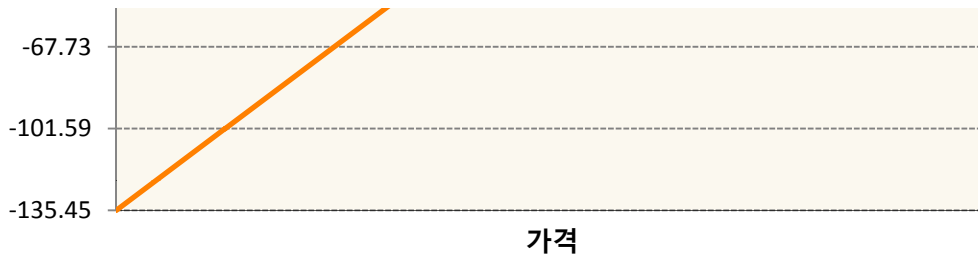
### 2. 만기시점의 손익구조

**HCK8-H-SHARES FUT May18**



**MHCK8-MINI H-SHR IDX FU May18**





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

HCK8	H-SHARES FUT May18	162
MHCK8	MINI H-SHR IDX FU May18	11

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

<b>152</b>
------------

공시일	2018-05-17
기준일	2018-05-16

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

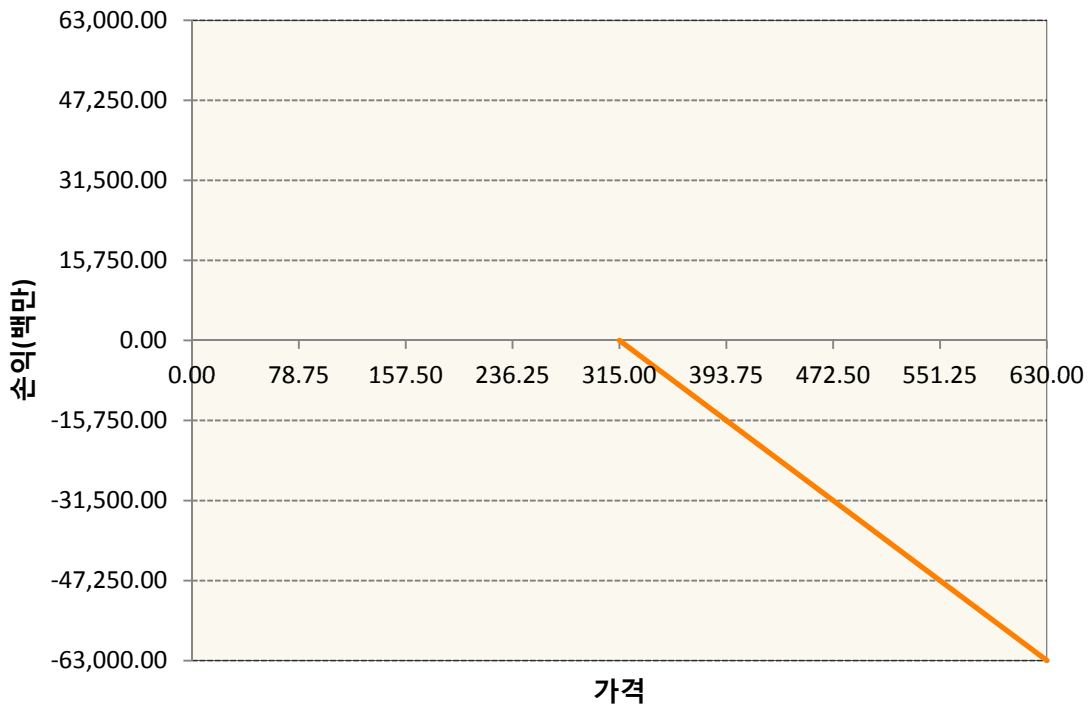
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

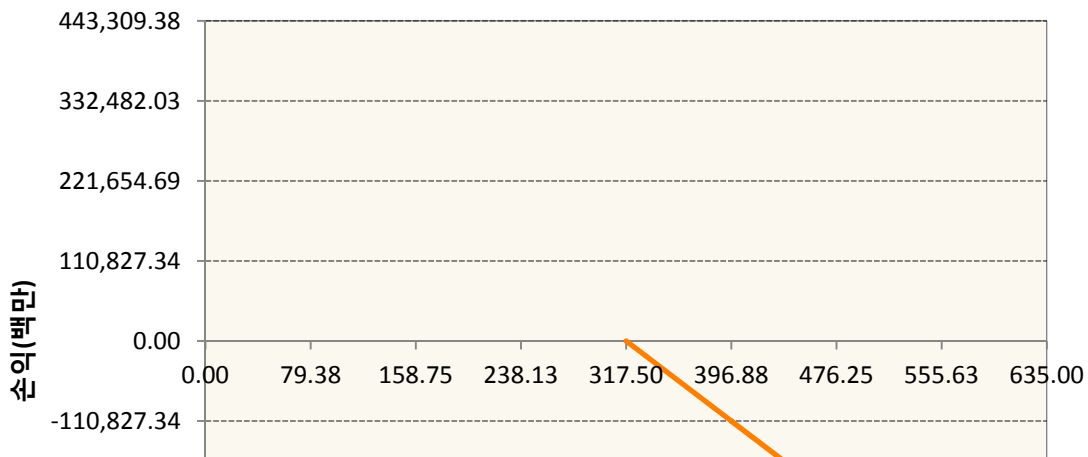
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	1,567	0	1,567	장내
누계	유가증권	옵션	0	815,078	-815,078	장내

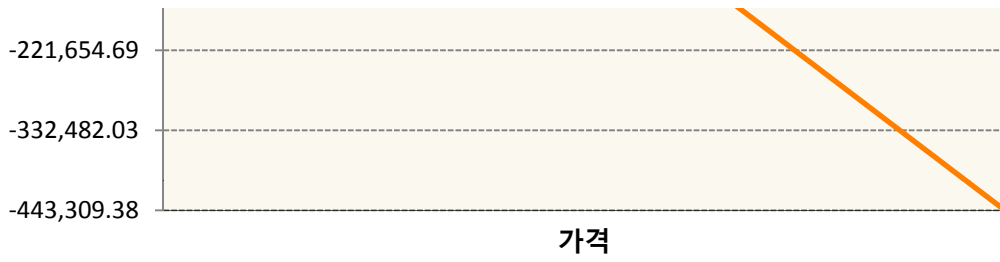
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201N63159-2018-06 콜315**

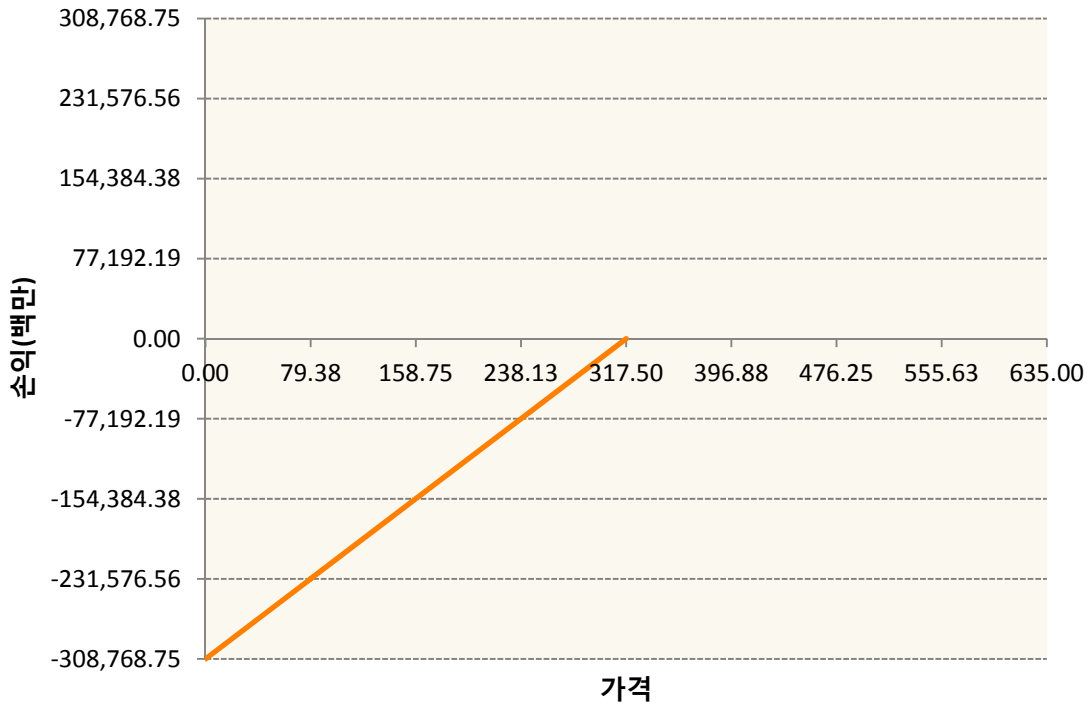


**KR4201N63175-2018-06 콜317.5**





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N6312018-06 콜315

3,924

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,923	1,856	1,777	1,689	1,593	1,490	1,381
-5.33%	1,690	1,578	1,458	1,333	1,203	1,070	933
-2.67%	1,233	1,084	932	779	625	470	314
0%	489	326	163	0	-163	-326	-489
2.67%	-554	-702	-853	-1,006	-1,161	-1,317	-1,475
5.33%	-1,854	-1,967	-2,088	-2,215	-2,348	-2,486	-2,627
8.00%	-3,335	-3,409	-3,494	-3,589	-3,694	-3,805	-3,924

KR4201N6312018-06 풋317.5

26,390

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,999	11,603	11,126	10,579	9,970	9,307	8,599

-5.33%	10,692	9,993	9,232	8,422	7,571	6,687	5,776
-2.67%	8,006	7,017	6,004	4,973	3,927	2,870	1,803
0%	3,426	2,284	1,142	0	-1,142	-2,285	-3,428
2.67%	-3,252	-4,343	-5,446	-6,559	-7,678	-8,803	-9,932
5.33%	-11,827	-12,704	-13,629	-14,591	-15,583	-16,599	-17,635
8.00%	-21,829	-22,429	-23,108	-23,854	-24,655	-25,503	-26,390
KR4301N6312018-06 풋317.5							21,080
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20,981	-20,983	-20,988	-20,998	-21,016	-21,043	-21,080
-5.33%	-12,828	-12,861	-12,911	-12,981	-13,069	-13,177	-13,303
-2.67%	-5,040	-5,219	-5,421	-5,643	-5,881	-6,132	-6,395
0%	1,051	702	351	0	-352	-704	-1,057
2.67%	4,103	3,839	3,560	3,268	2,967	2,659	2,344
5.33%	4,917	4,834	4,725	4,592	4,437	4,262	4,069
8.00%	5,024	5,012	4,990	4,955	4,905	4,838	4,754

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

(단위:백만원)

52,062

공시일	2018-05-17
기준일	2018-05-16

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

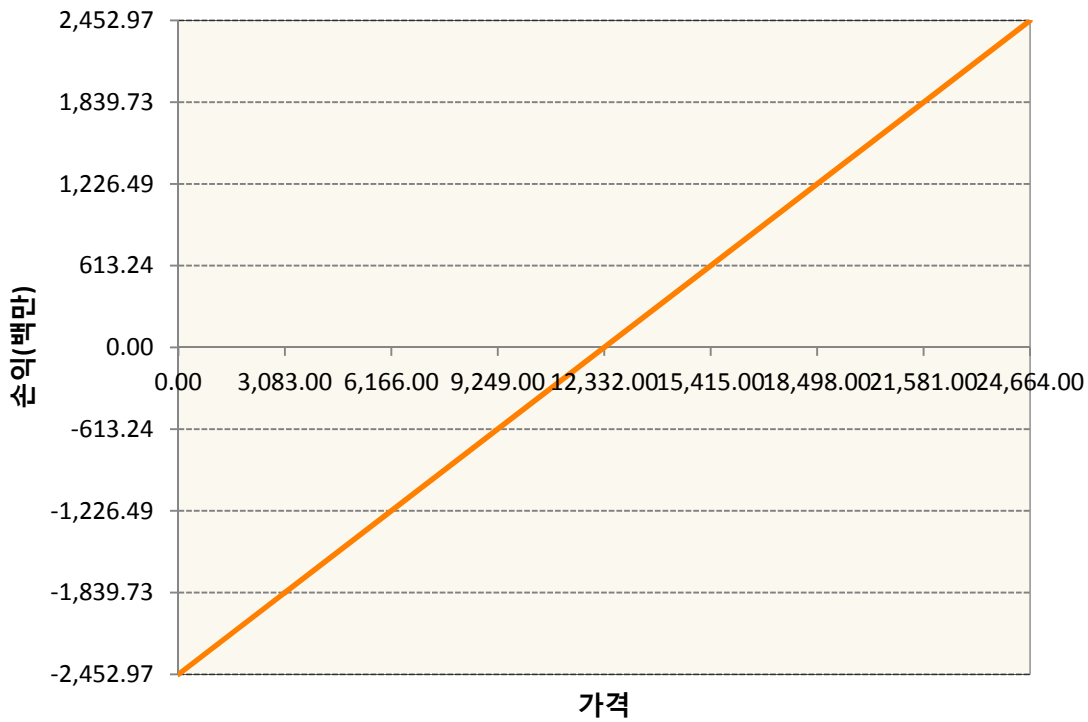
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

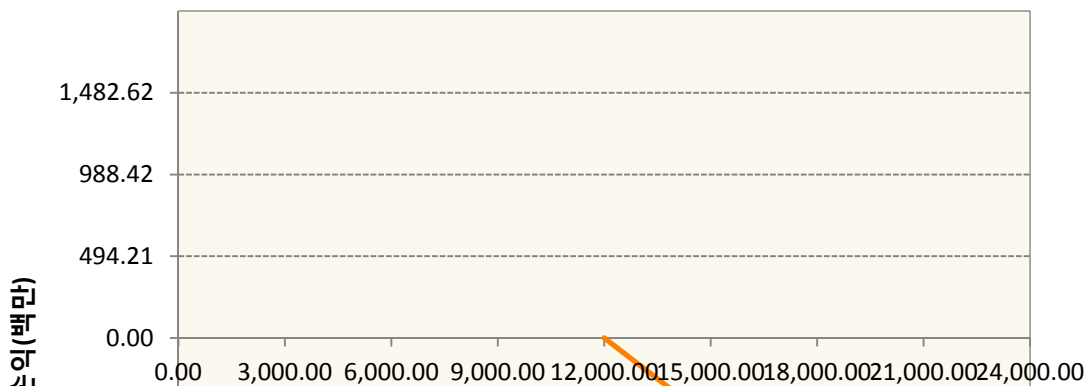
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,453	0	2,453	장내
누계	유가증권	옵션	0	6,131	-6,131	장내

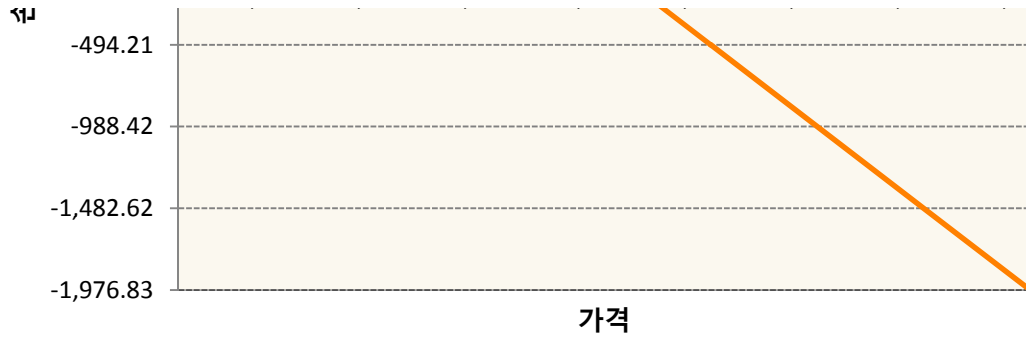
### 2. 만기시점의 손익구조

HCK8-H-SHARES FUT May18

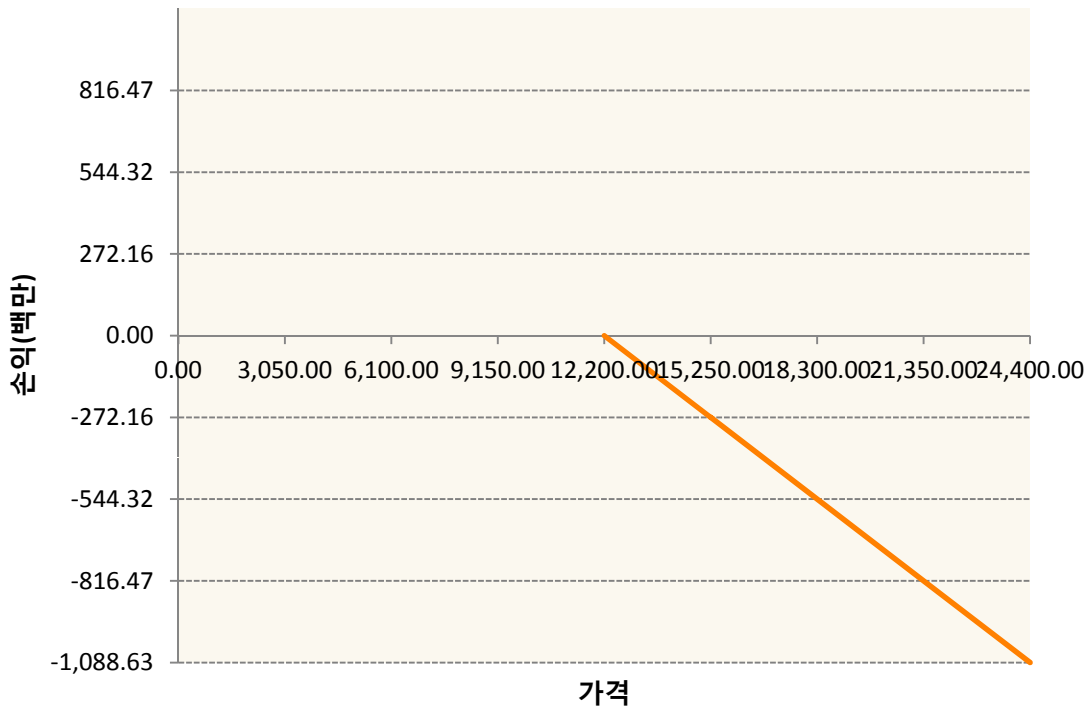


OHHK8-C120-HSCEI



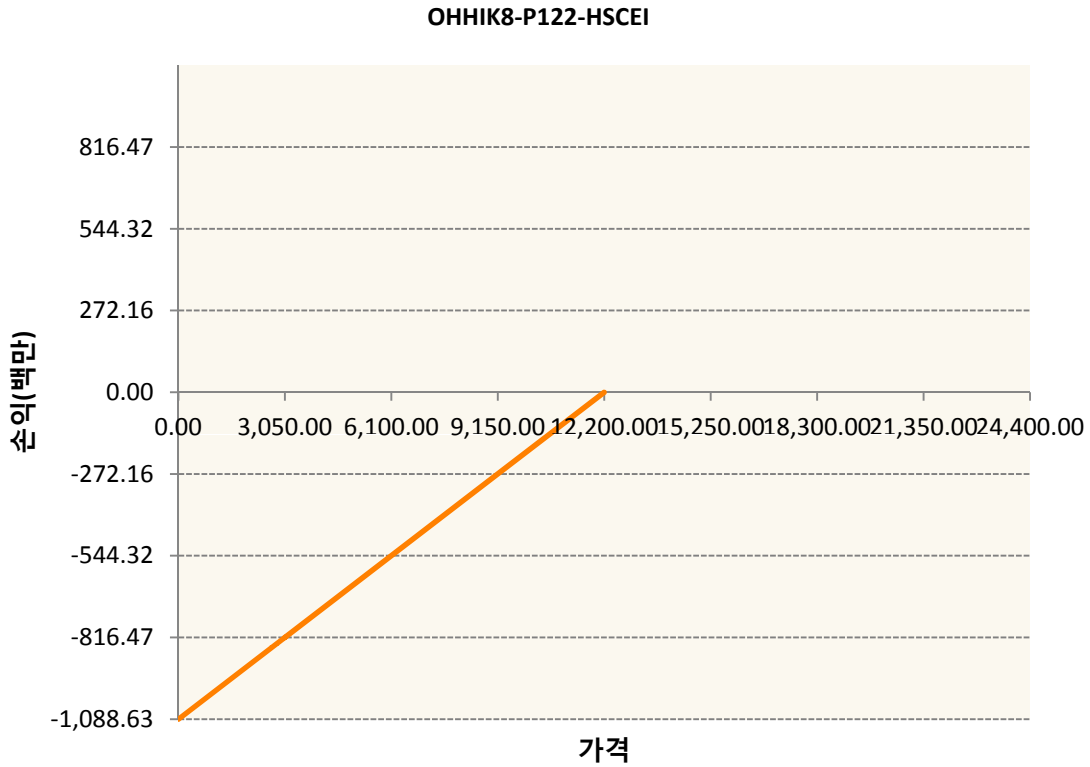
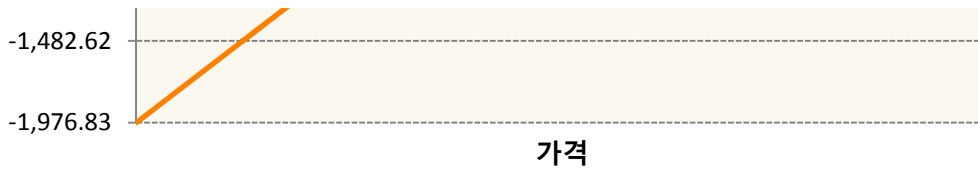


OHHIK8-C122-HSCEI



OHHIK8-P120-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCK8	H-SHARES FUT May18	196
OHHIK8-C12	HSCEI	158
OHHIK8-C12	HSCEI	87
OHHIK8-P12	HSCEI	158
OHHIK8-P12	HSCEI	87

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	<b>603</b>

공시일	2018-05-17
기준일	2018-05-16

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

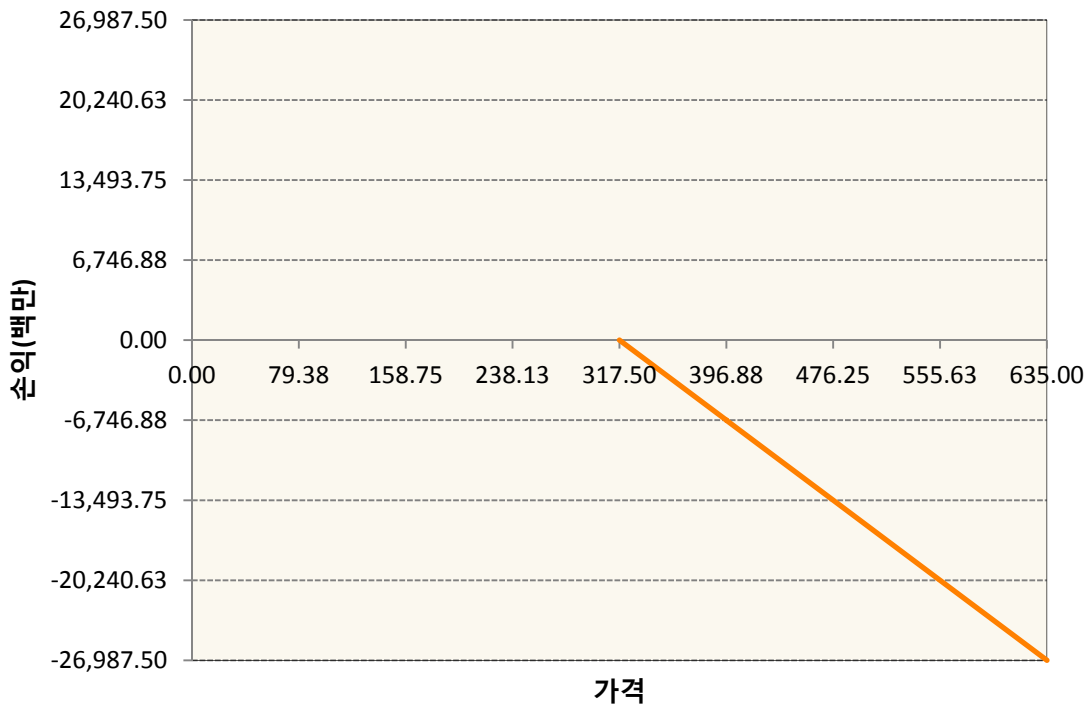
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

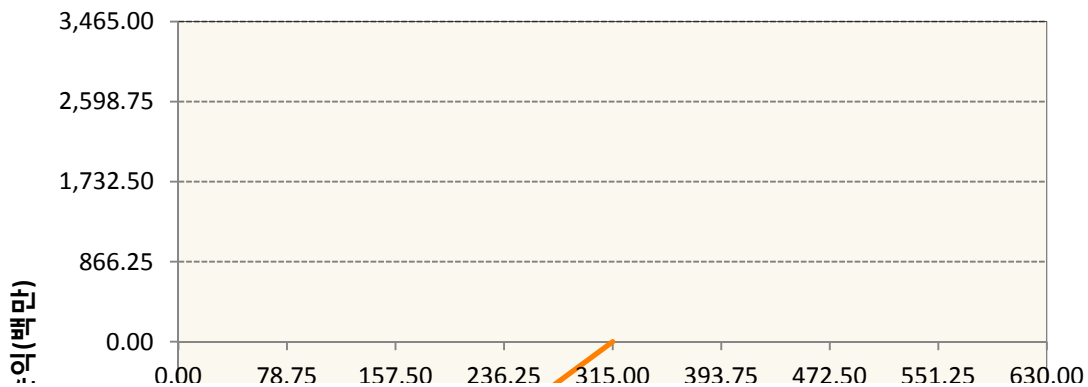
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	46,804	-46,804	장내

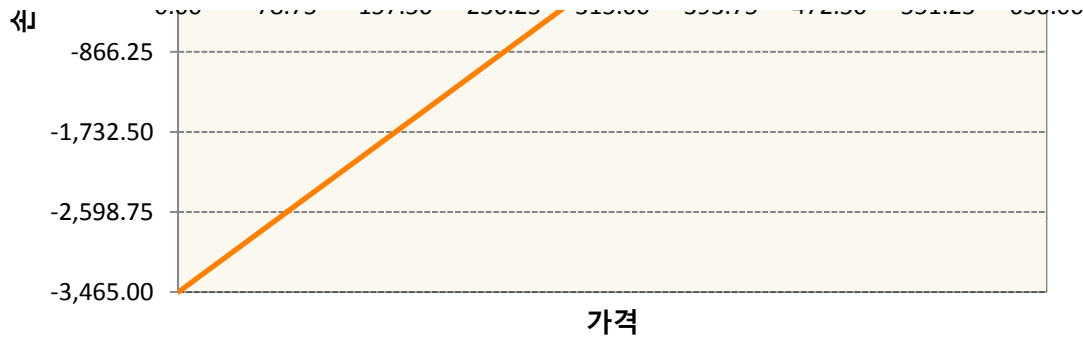
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63175-2018-06 콜317.5

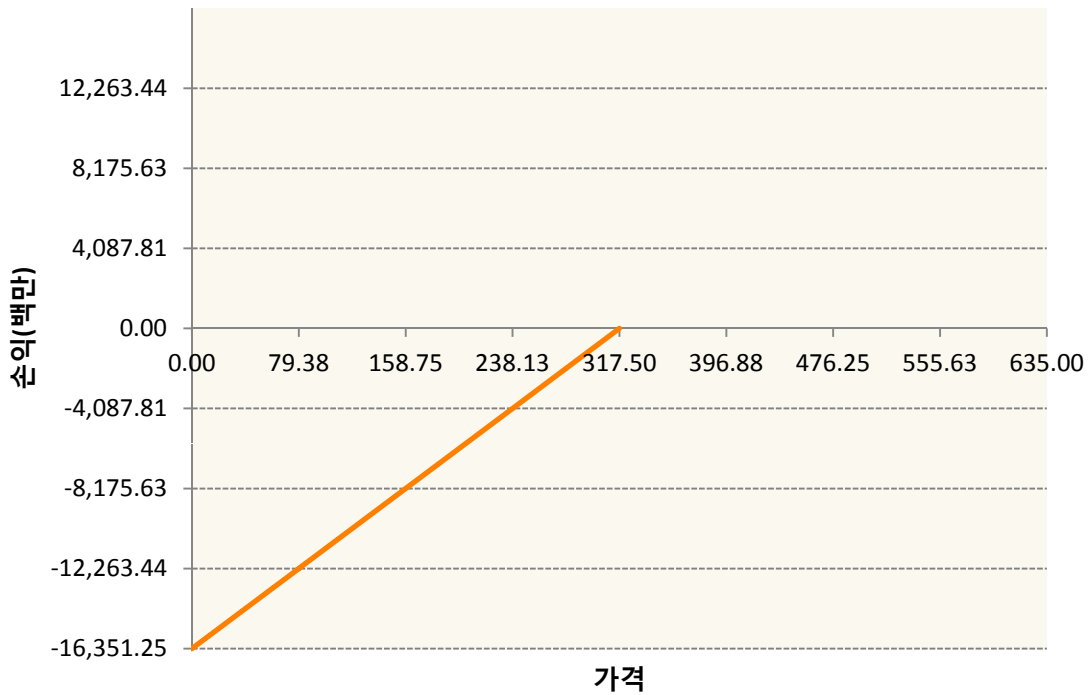


KR4301N63157-2018-06 풋315





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 1,607

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	730	706	677	644	607	567	523
-5.33%	651	608	562	513	461	407	352
-2.67%	487	427	366	303	239	175	110
0%	209	139	70	0	-70	-139	-209
2.67%	-198	-264	-332	-399	-467	-536	-605
5.33%	-720	-773	-830	-888	-949	-1,011	-1,074
8.00%	-1,329	-1,365	-1,407	-1,452	-1,501	-1,553	-1,607

KR4301N6312018-06 풋315 226

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-224	-224	-224	-224	-225	-225	-226
-5.33%	-132	-133	-134	-135	-136	-138	-140
-2.67%	-48	-50	-53	-56	-59	-63	-66
0%	12	8	4	0	-4	-8	-12
2.67%	37	35	32	29	26	23	20
5.33%	42	42	41	40	38	37	35
8.00%	43	43	43	42	42	41	41

KR4301N6312018-06 풋317.5 1,116

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,111	-1,111	-1,111	-1,112	-1,113	-1,114	-1,116
-5.33%	-679	-681	-684	-687	-692	-698	-704
-2.67%	-267	-276	-287	-299	-311	-325	-339
0%	56	37	19	0	-19	-37	-56
2.67%	217	203	189	173	157	141	124
5.33%	260	256	250	243	235	226	215
8.00%	266	265	264	262	260	256	252

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

(단위:백만원)

6,838

공시일	2018-05-17
기준일	2018-05-16

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

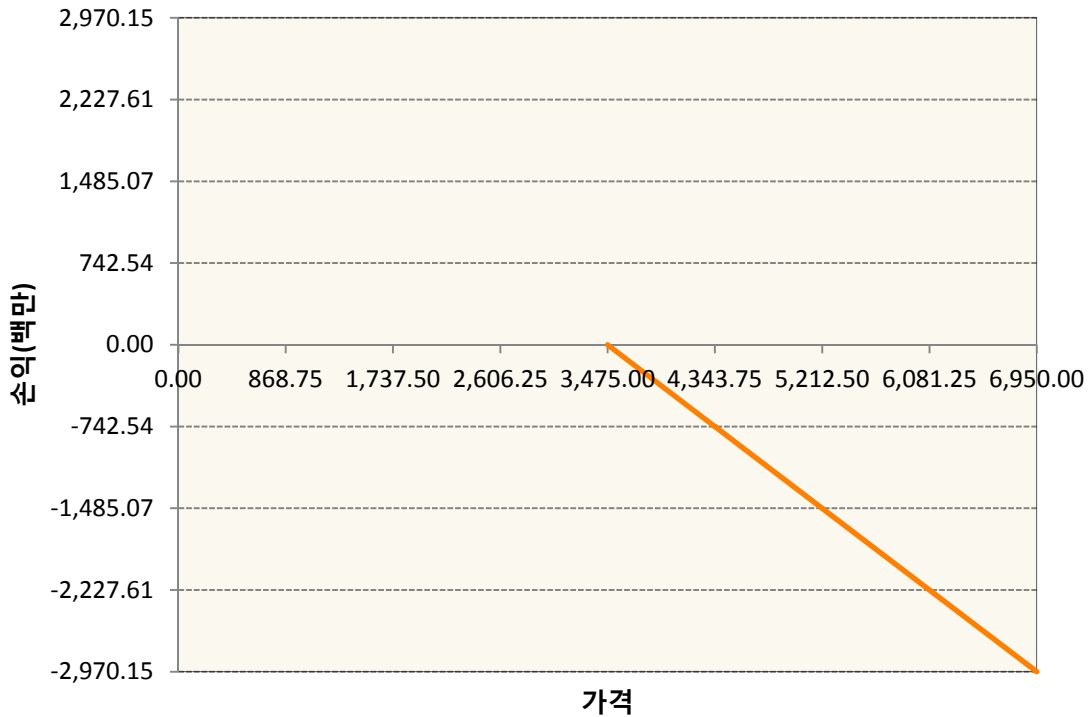
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

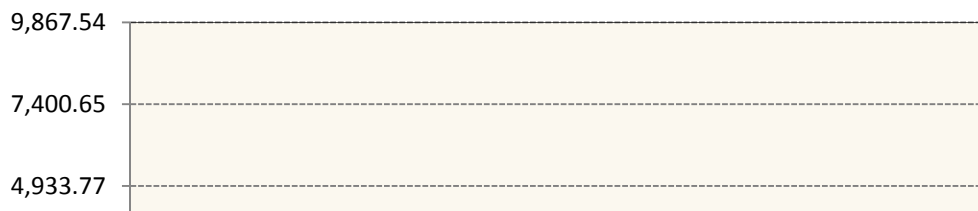
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,981	0	4,981	
누계	유가증권	스왑	63,733	0	63,733	장외
누계	유가증권	옵션	0	33,610	-33,610	장내
누계	지수	스왑	51,027	0	51,027	장외

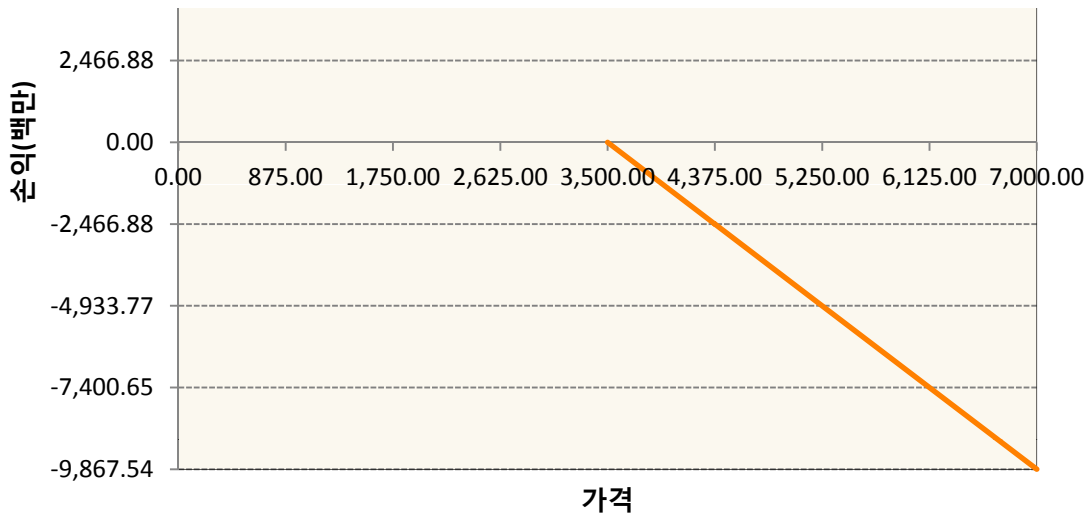
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXK8-C3475-EURO STOXX 50**

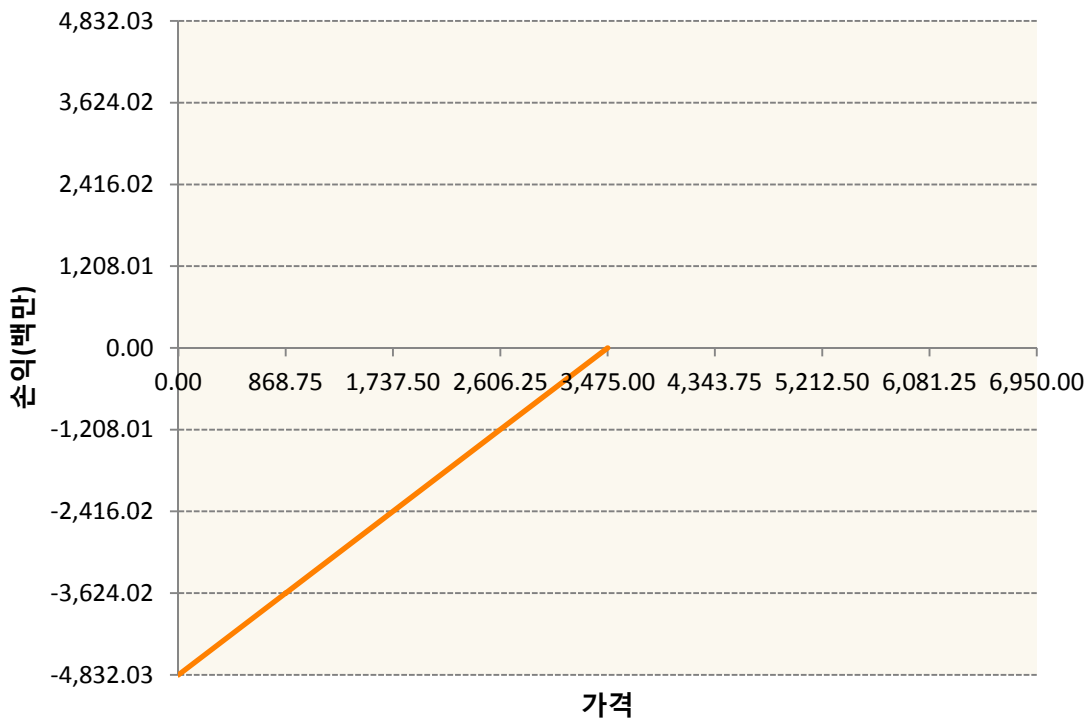


**OESXK8-C3500-EURO STOXX 50**

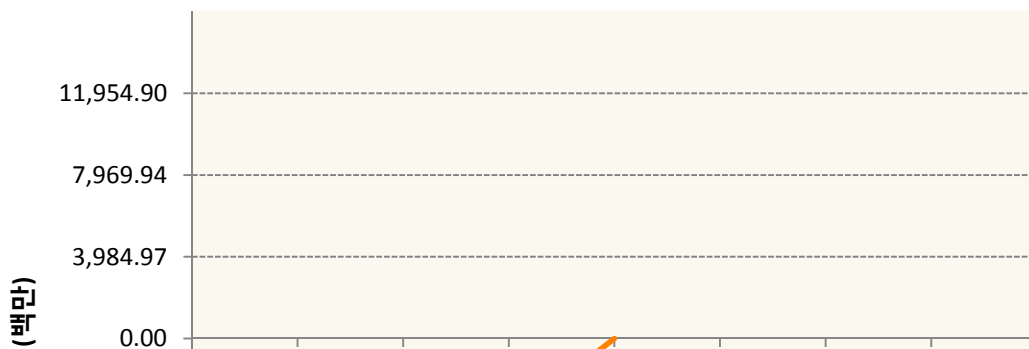


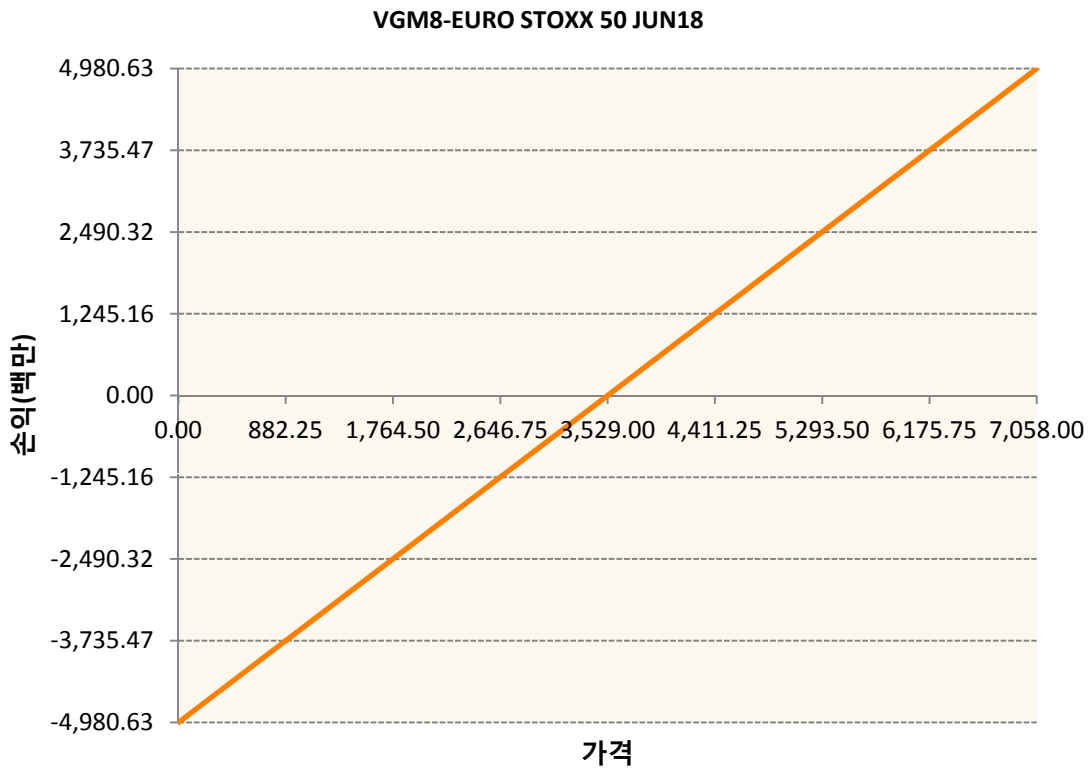
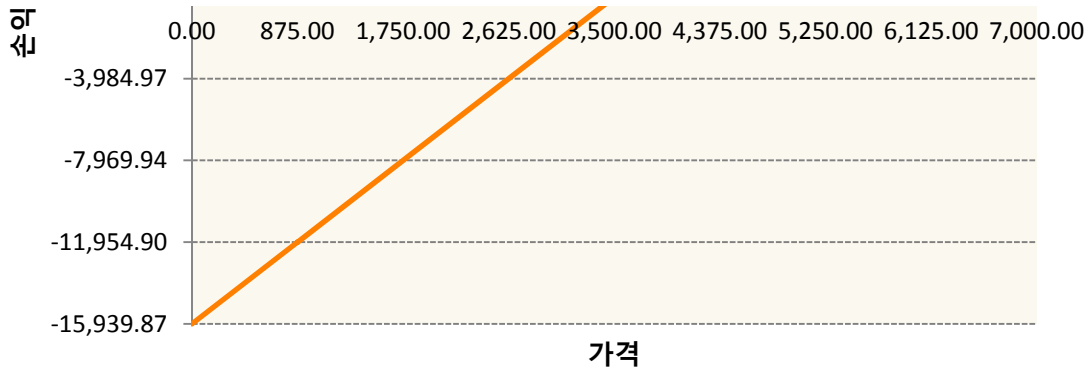


OESXK8-P3475-EURO STOXX 50



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		238
OESXK8-C35 EURO STOXX 50		789
OESXK8-P34 EURO STOXX 50		387
OESXK8-P35 EURO STOXX 50		1,275
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18		398

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





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

(단위:백만원)

1,168



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

(단위:백만원)

59



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

(단위:백만원)

95



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

(단위:백만원)

209

공시일	2018-05-17
기준일	2018-05-16

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1

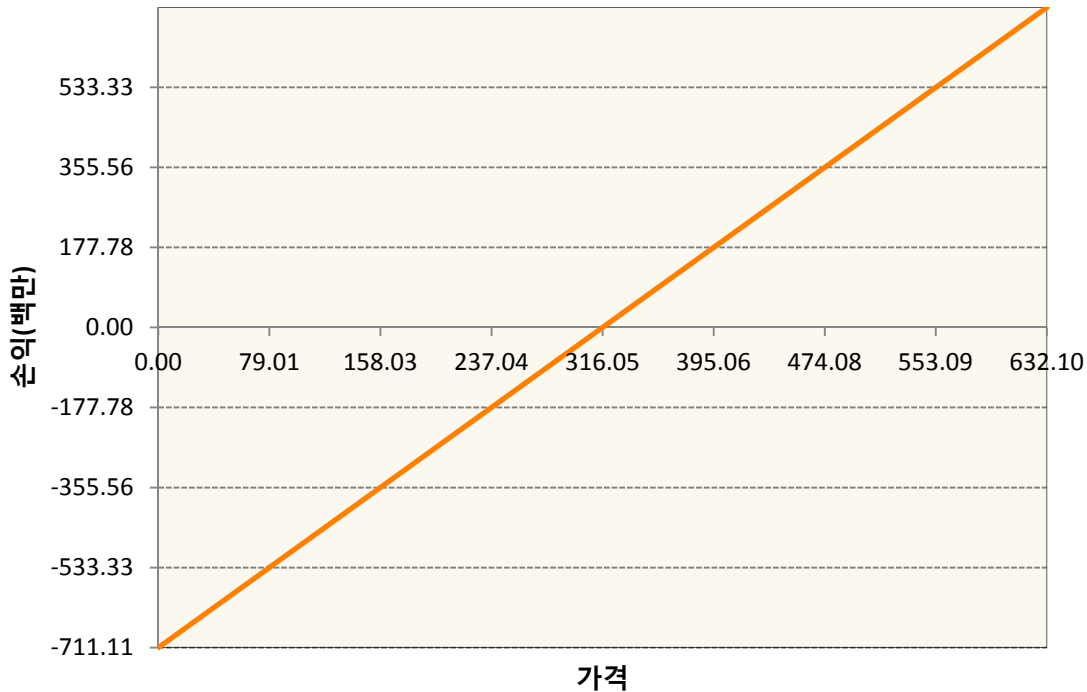
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	711	0	711	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	2018-05-17
기준일	2018-05-16

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

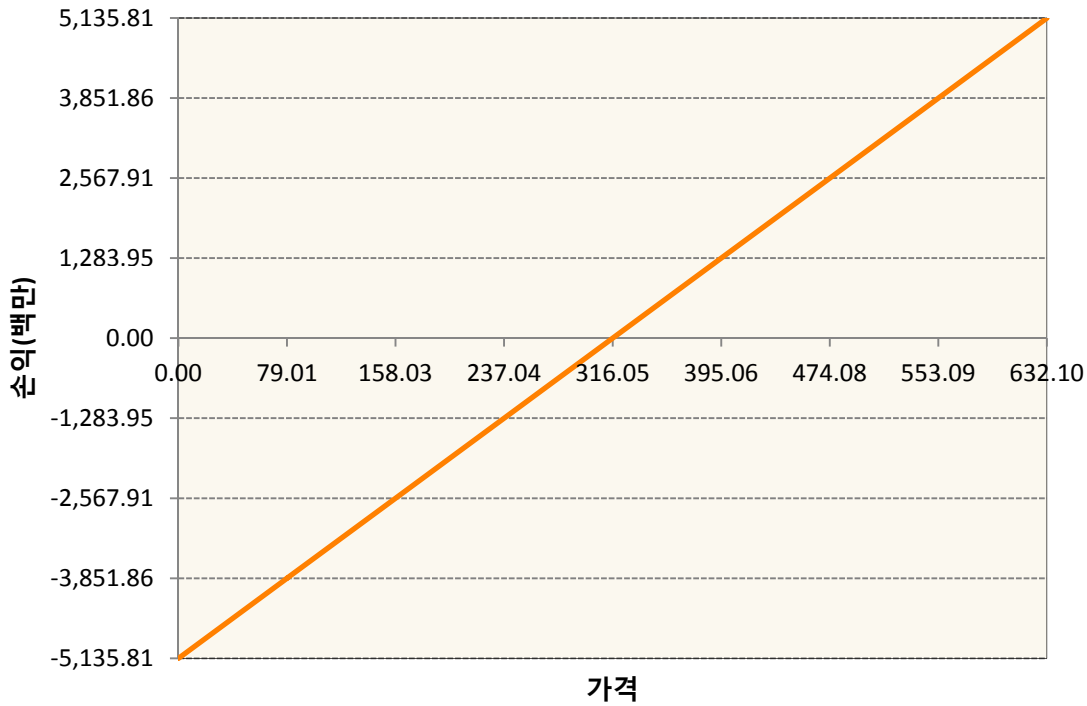
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

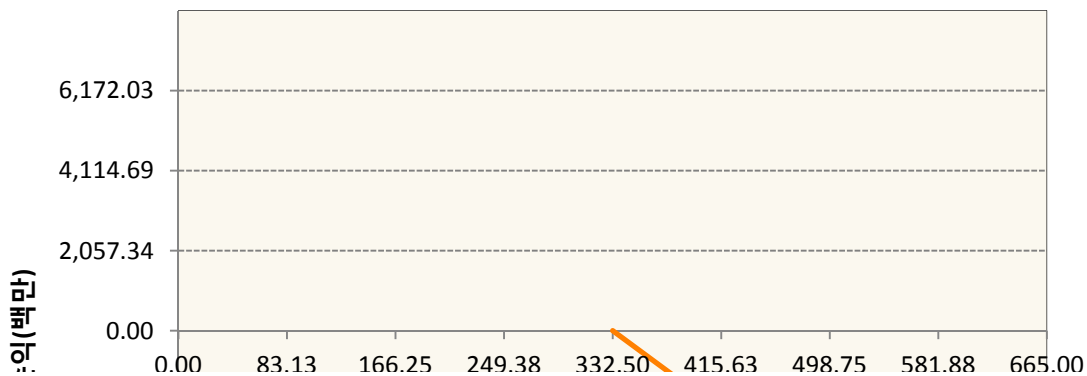
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	395	0	395	장내
신규	유가증권	옵션	78	416	-338	장내
누계	유가증권	선물	5,136	0	5,136	장내
누계	유가증권	옵션	1,111	8,229	-7,118	장내

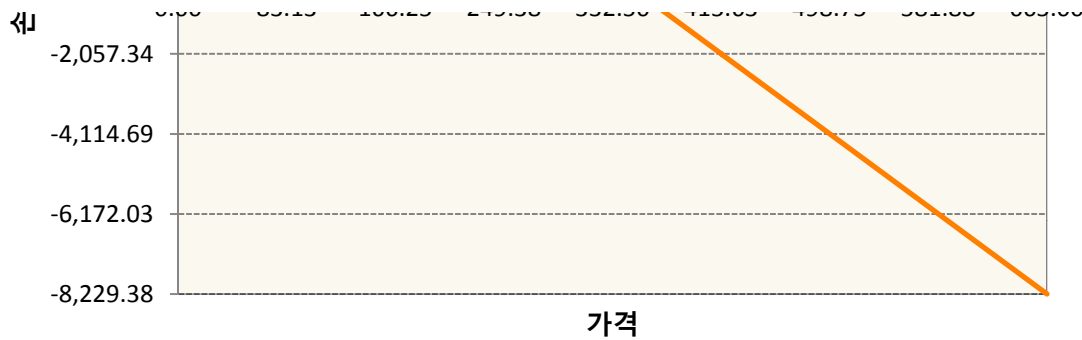
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

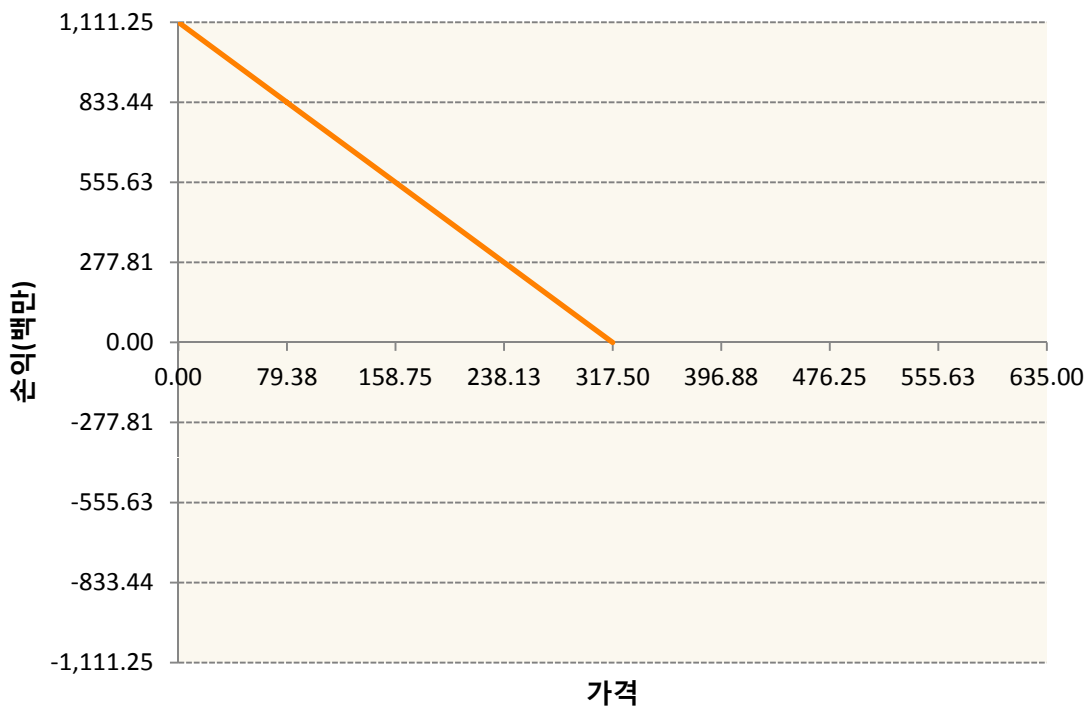


KR4201N63324-2018-06 콜332.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물							411
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-411	-411	-411	-411	-411	-411	-411
-5.33%	-274	-274	-274	-274	-274	-274	-274
-2.67%	-137	-137	-137	-137	-137	-137	-137
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	137	137	137	137	137	137	137
5.33%	274	274	274	274	274	274	274
8.00%	411	411	411	411	411	411	411
KR4201N63E 2018-06 콜332.5							347
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	95	93	90	86	81	75	68
-5.33%	90	86	79	72	63	54	43
-2.67%	77	68	57	45	32	18	4
0%	47	32	16	0	-17	-35	-53
2.67%	-9	-29	-49	-69	-89	-109	-129
5.33%	-100	-121	-142	-163	-185	-206	-227
8.00%	-225	-245	-265	-285	-306	-326	-347

KR4301N6312018-06 풋317.5

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	76	76	76	76	76	76	76
-5.33%	46	46	46	47	47	47	48
-2.67%	18	19	20	20	21	22	23
0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-15	-14	-13	-12	-11	-10	-8
5.33%	-18	-17	-17	-17	-16	-15	-15
8.00%	-18	-18	-18	-18	-18	-17	-17

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

(단위:백만원)

620

공시일	2018-05-17
기준일	2018-05-16

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

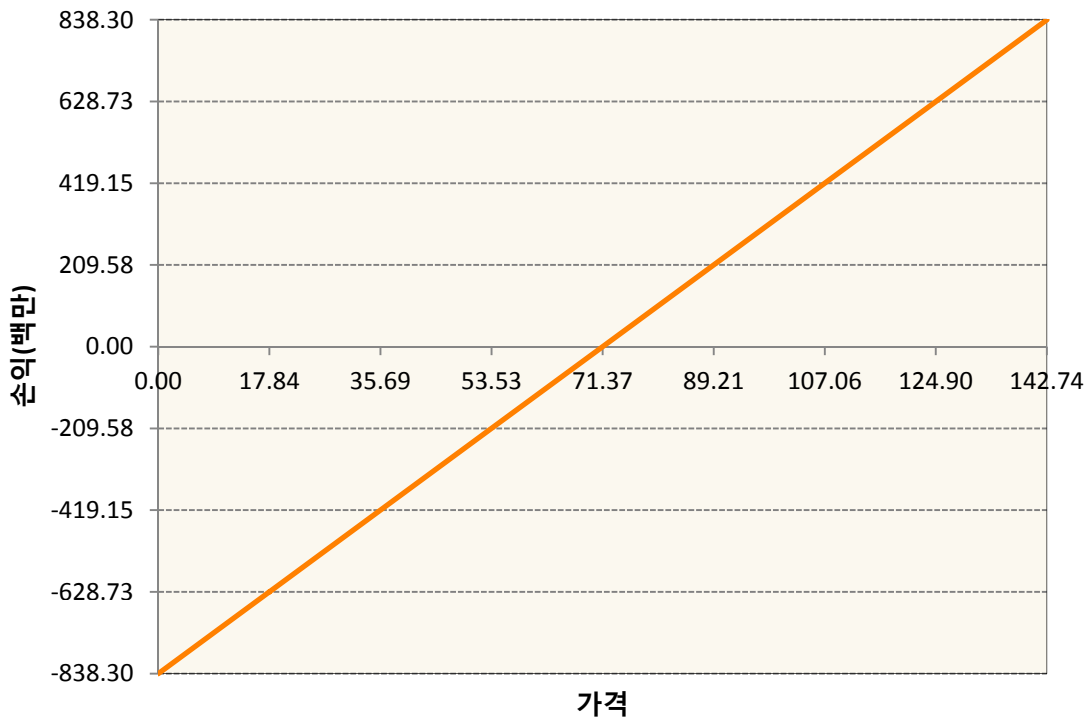
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

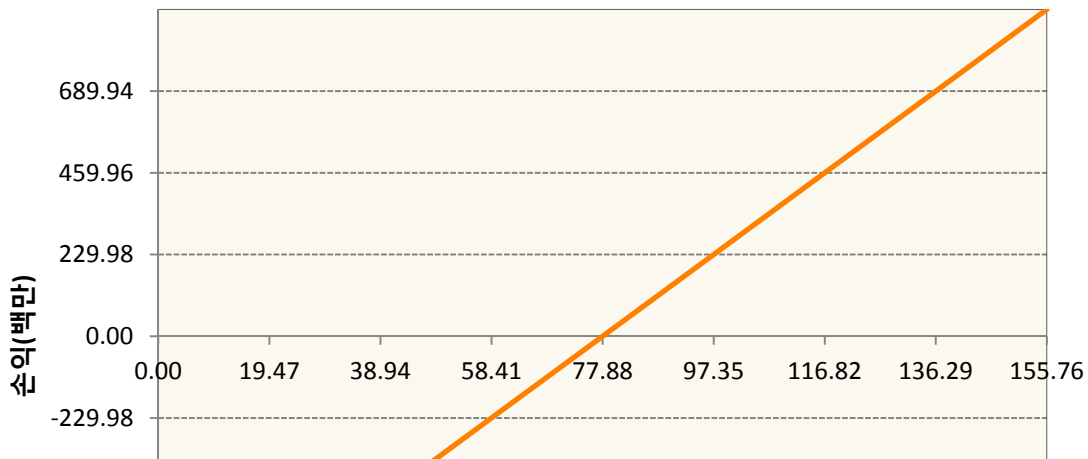
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,920	593	3,328	

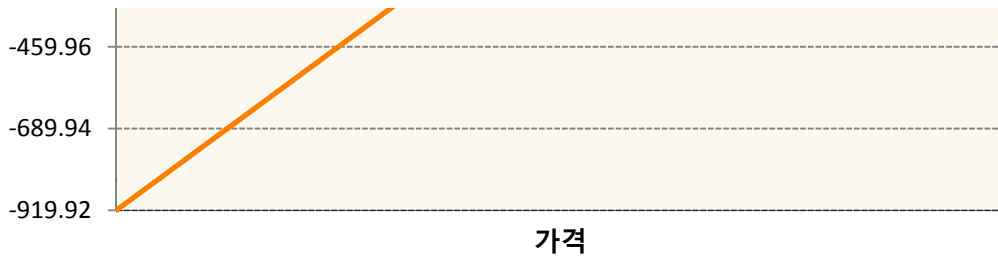
### 2. 만기시점의 손익구조

**CLN8-WTI CRUDE FUTURE JUL18**

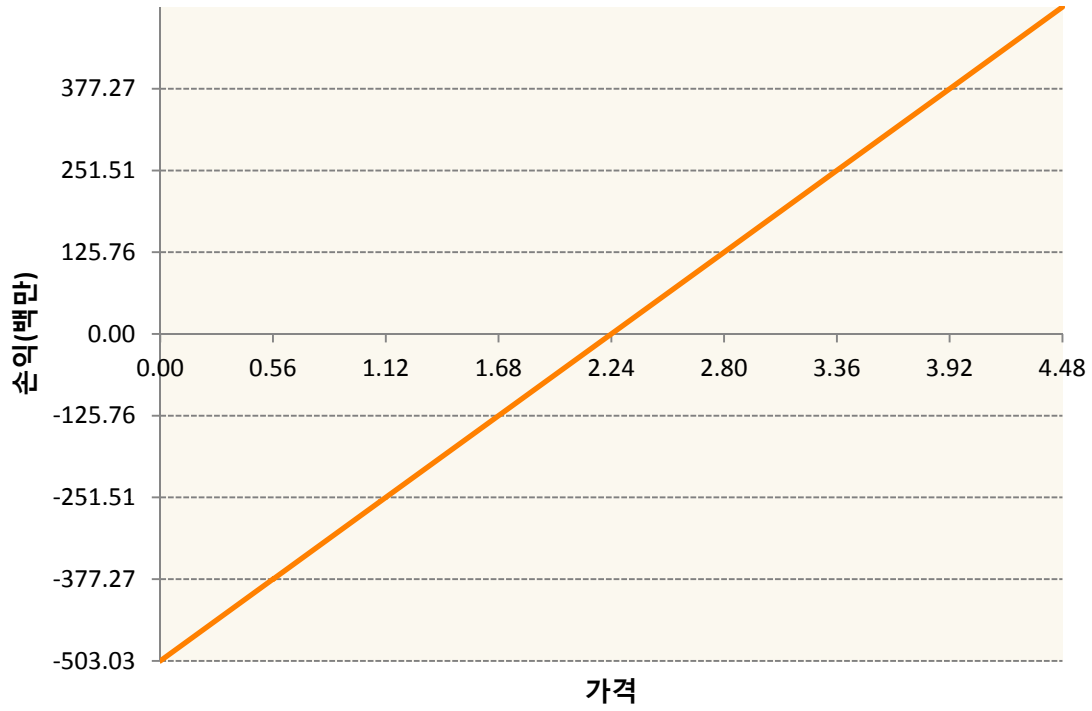


**COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18**

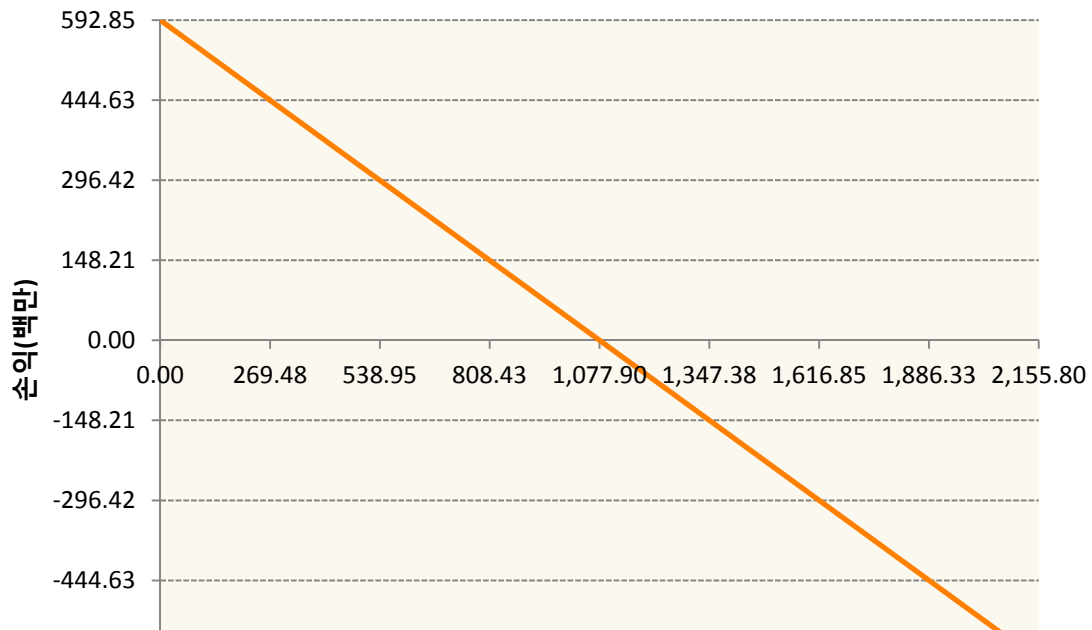


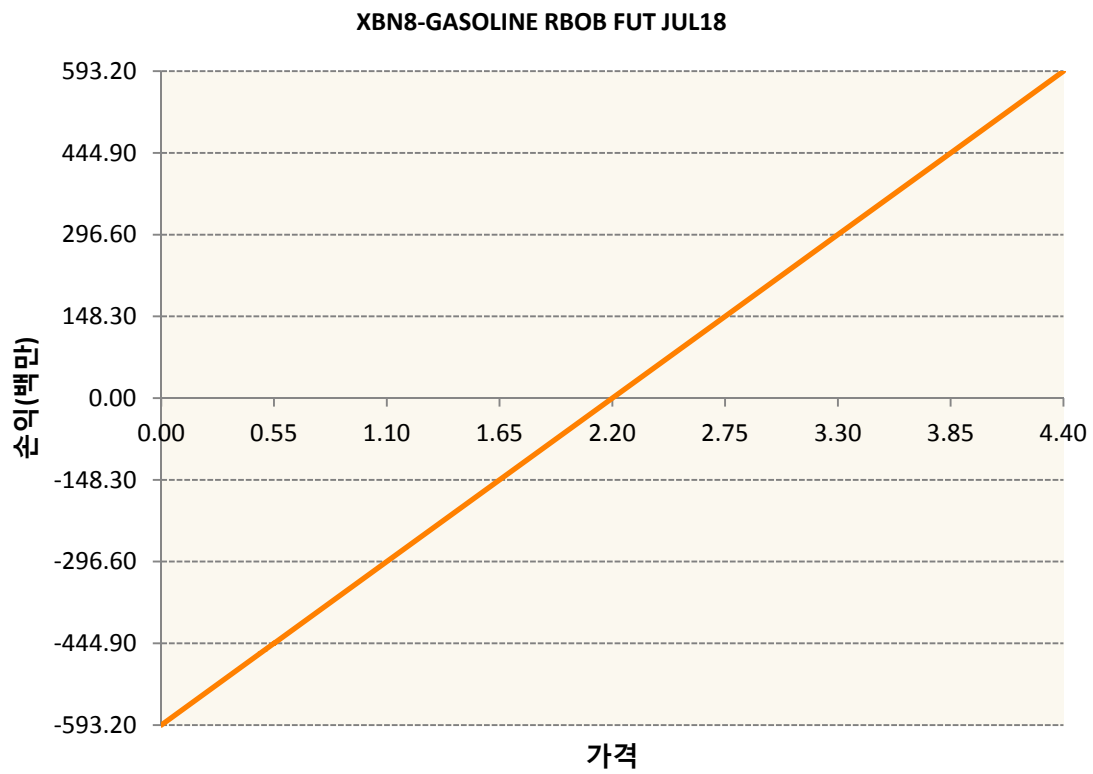
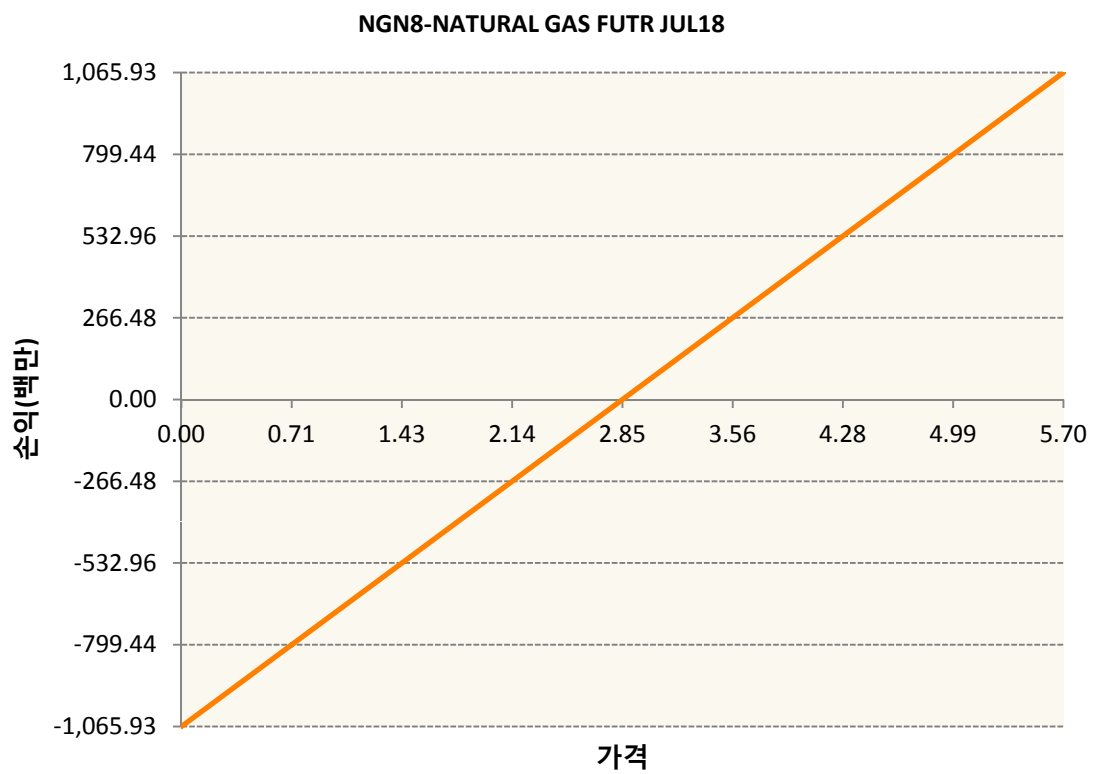
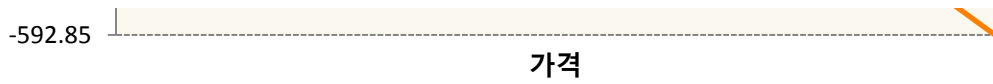


HON8-NY Harb ULSD Fut JUL18



KR4175N50004-2018-05 달러선물





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

CLN8	WTI CRUDE FUTURE JUL18	67
COU8	BRENT CRUDE FUTR SEP18	74
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	2018-05-17
기준일	2018-05-16

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

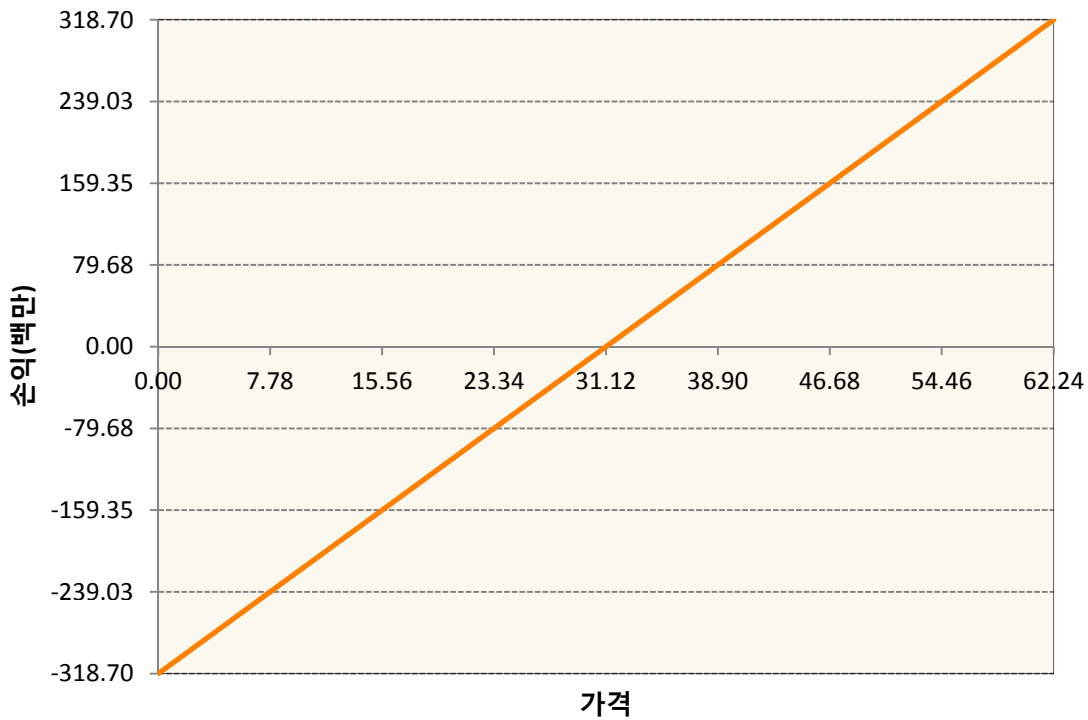
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

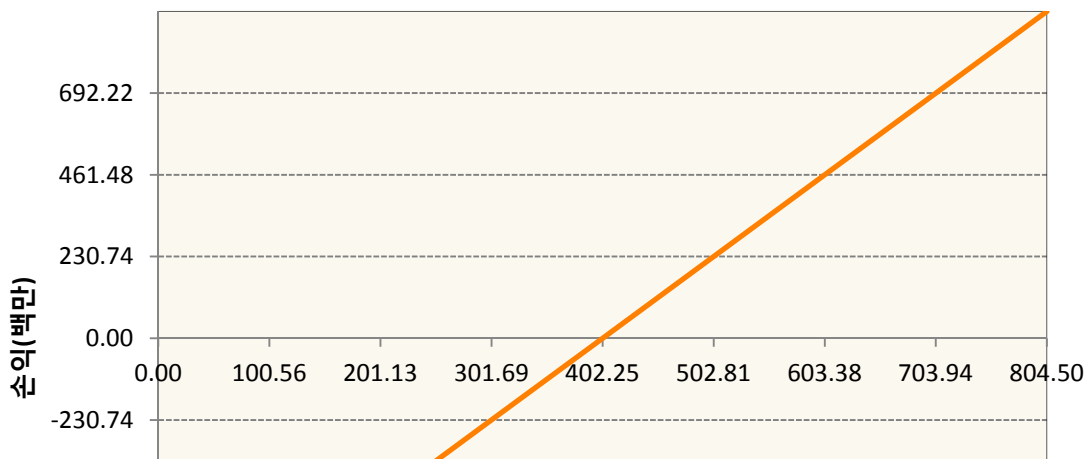
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,051	323	3,727	

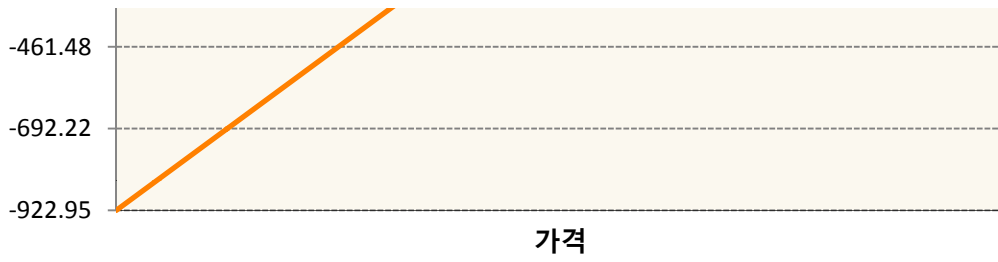
### 2. 만기시점의 손익구조

**BON8-SOYBEAN OIL FUTR JUL18**

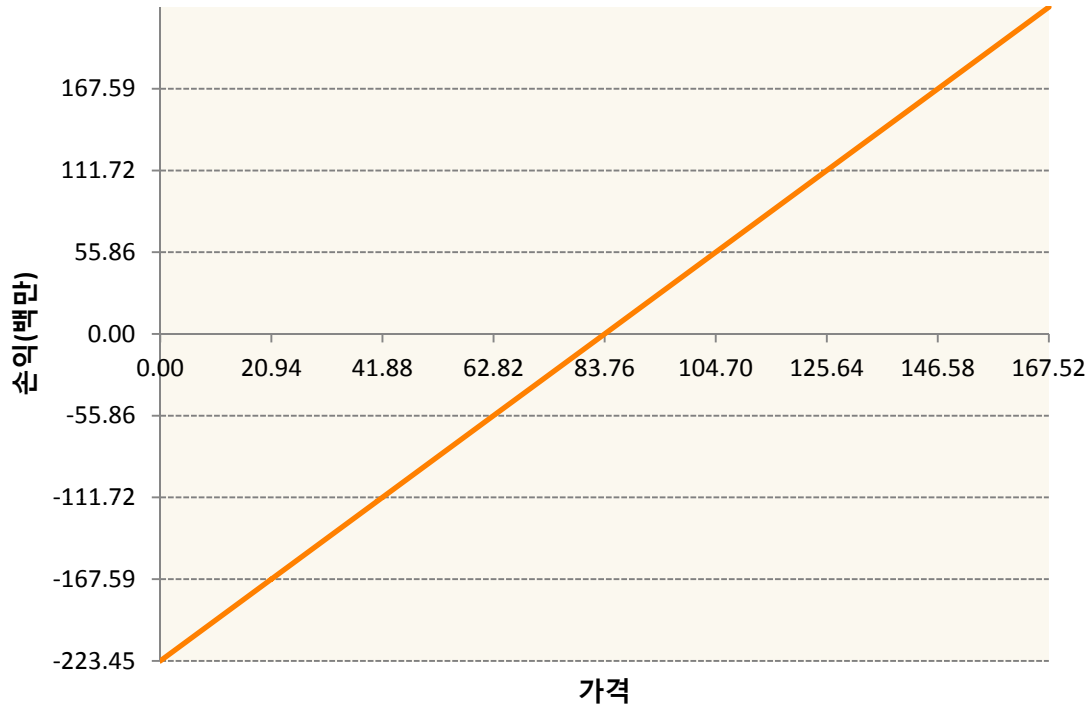


**CN8-CORN FUTURE JUL18**

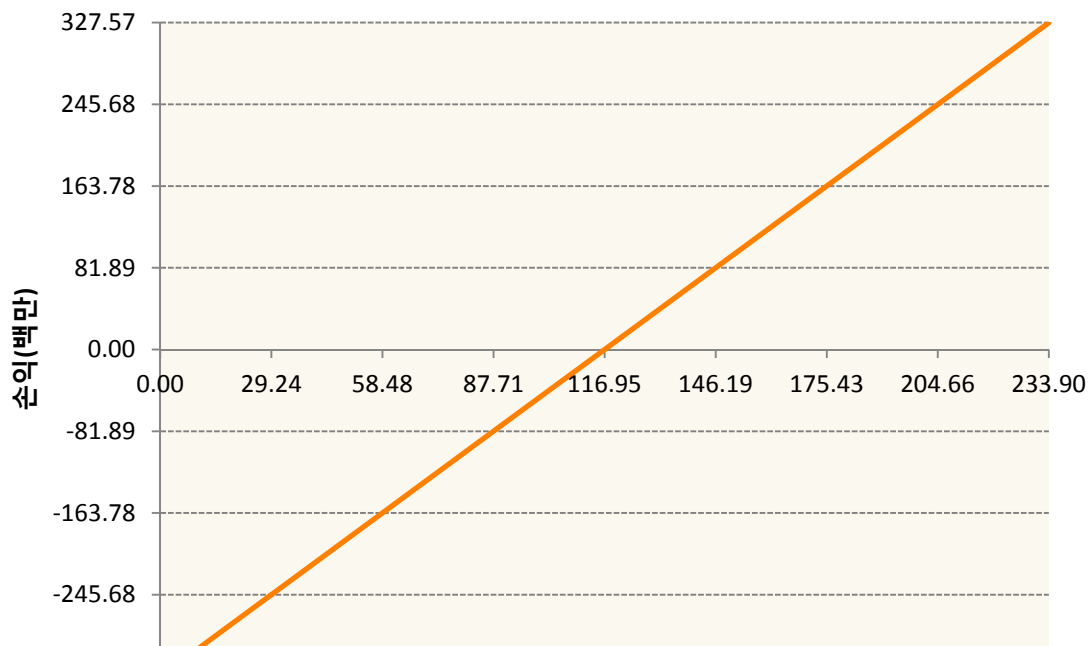


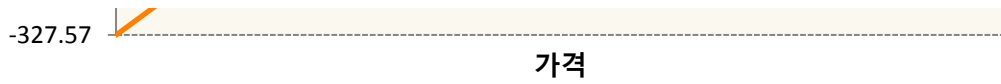


CTN8-COTTON NO.2 FUTR JUL18



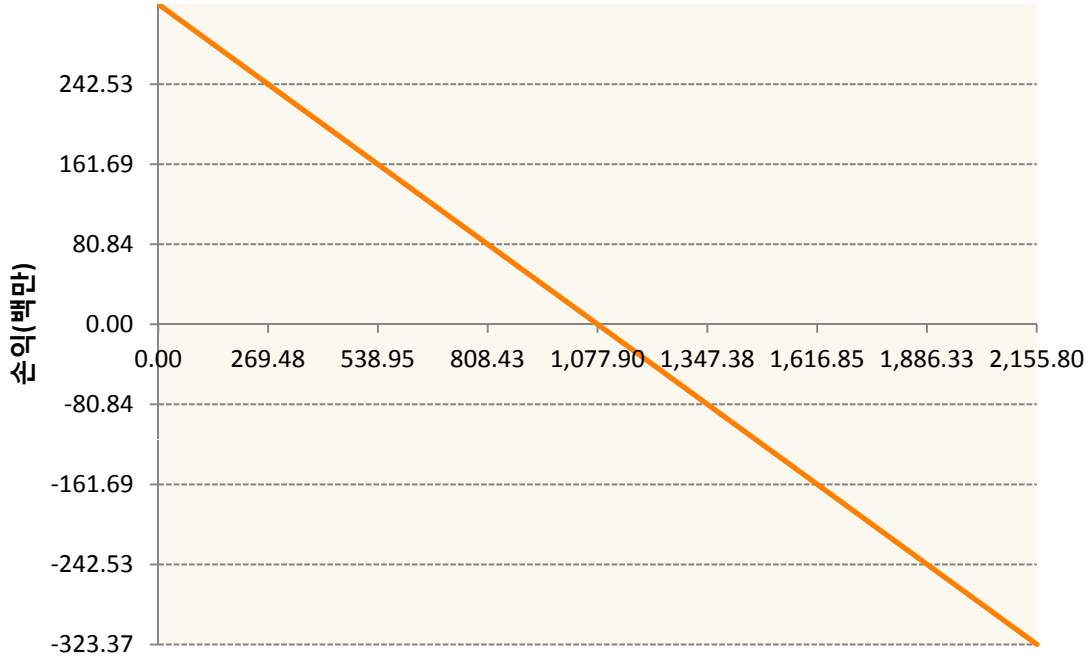
KCN8-COFFEE 'C' FUTURE JUL18





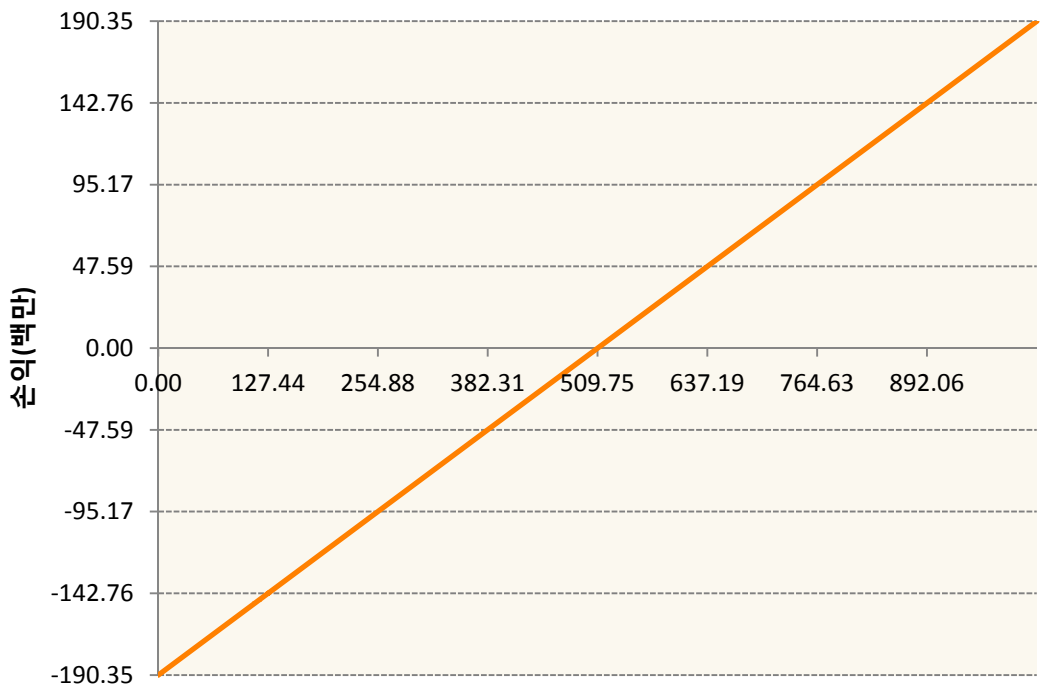
가격

**KR4175N50004-2018-05 달러선물**



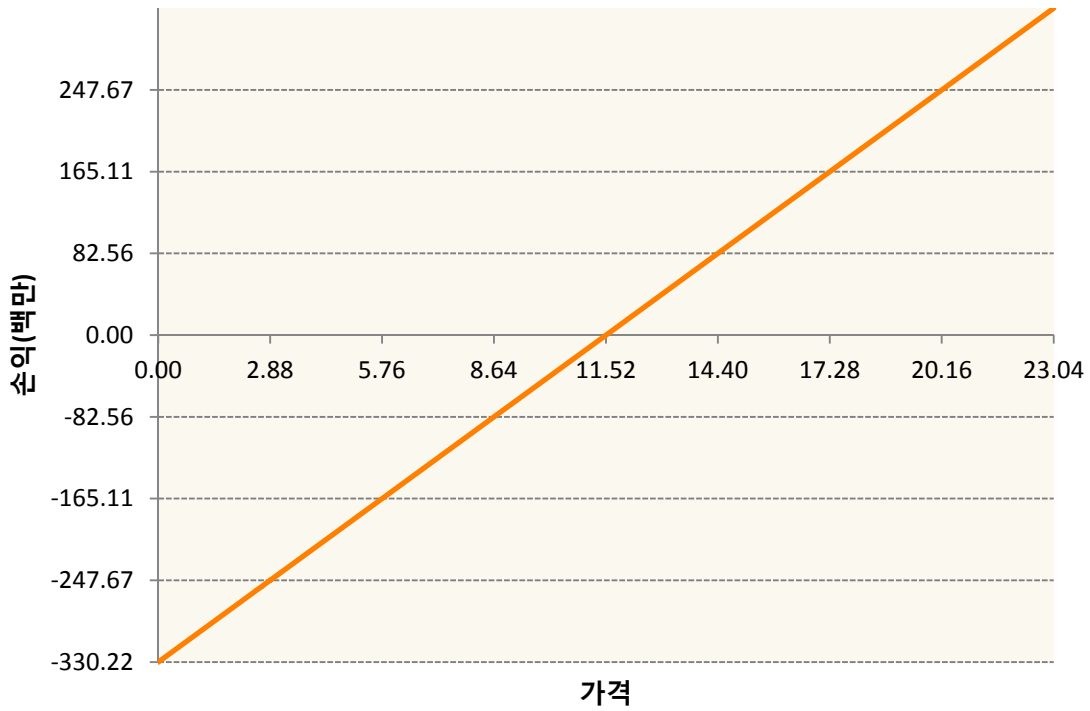
가격

**KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18**

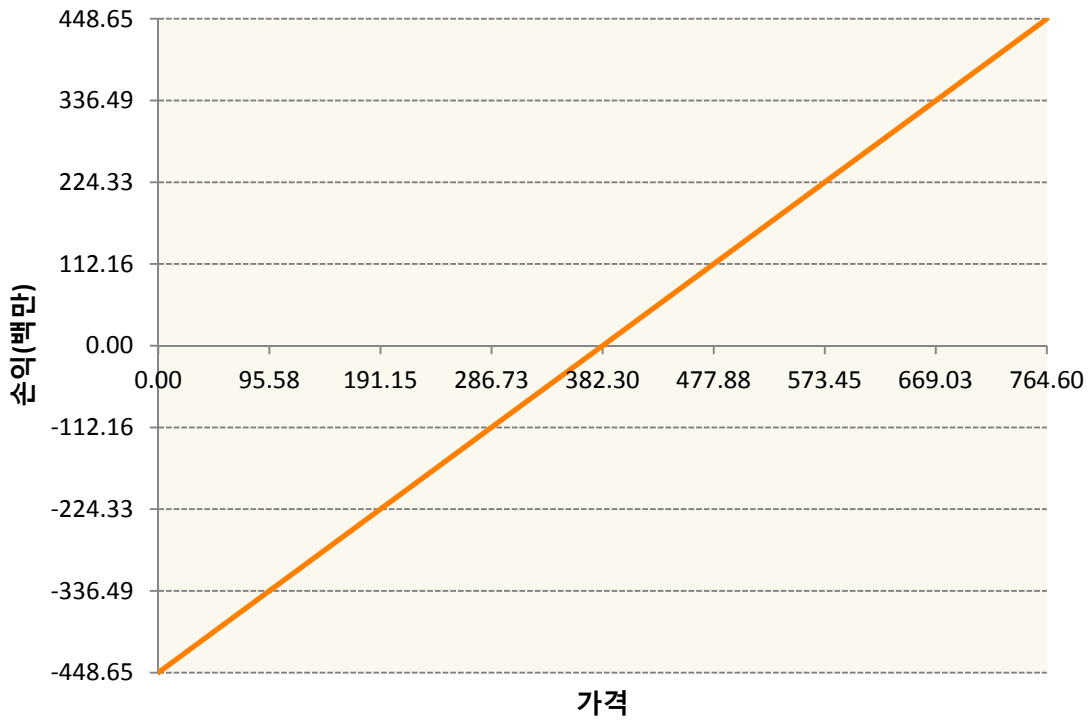


가격

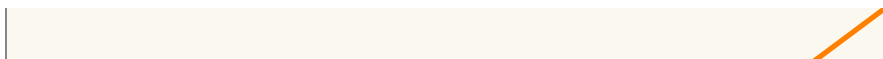
SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18

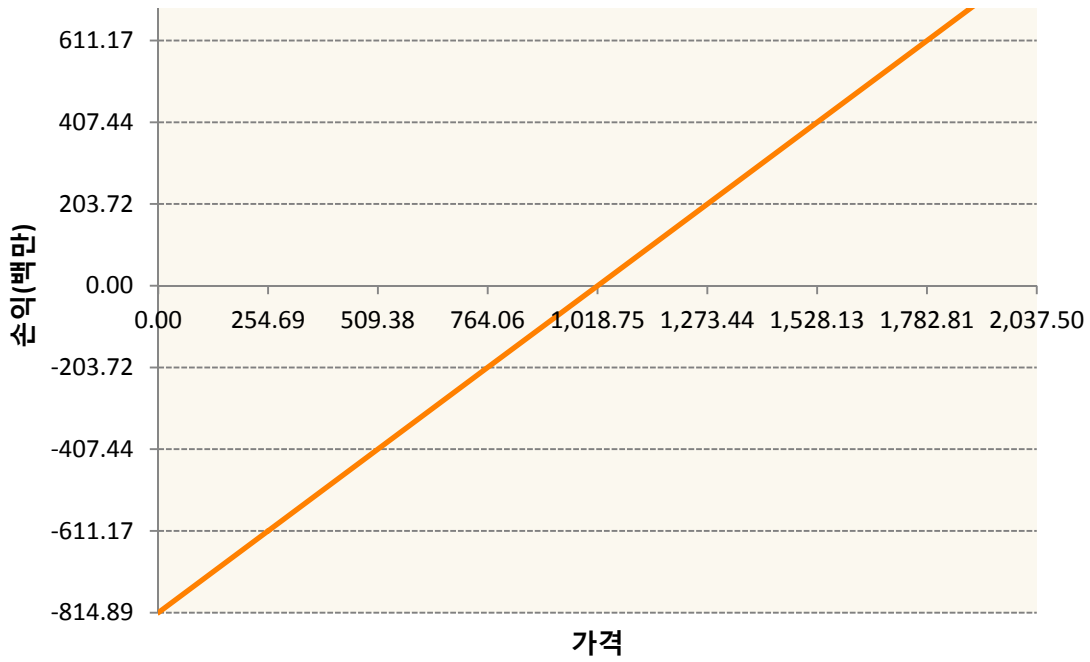


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18

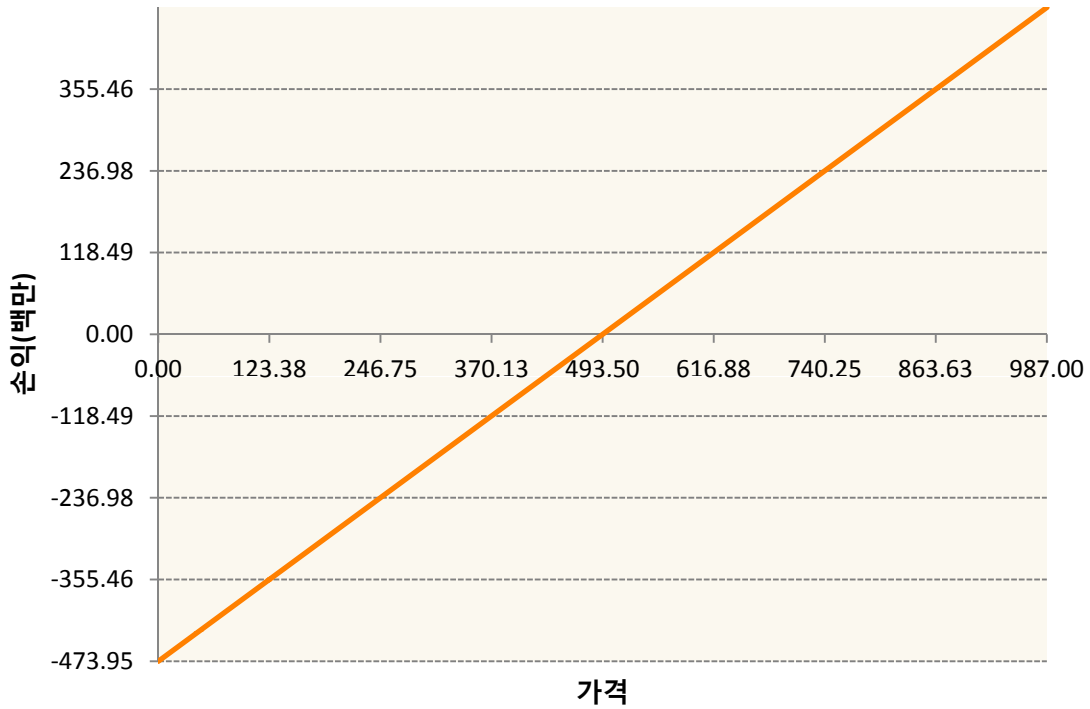


SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18





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	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)

**325**