

공시일	2018-05-21
기준일	2018-05-18

## 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)

81

공시일	2018-05-21
기준일	2018-05-18

## 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

1,122

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

460

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-05-21
기준일	2018-05-18

## 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

398
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

425
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-05-21
기준일	2018-05-18

## 유로인덱스모(주식-파생형)

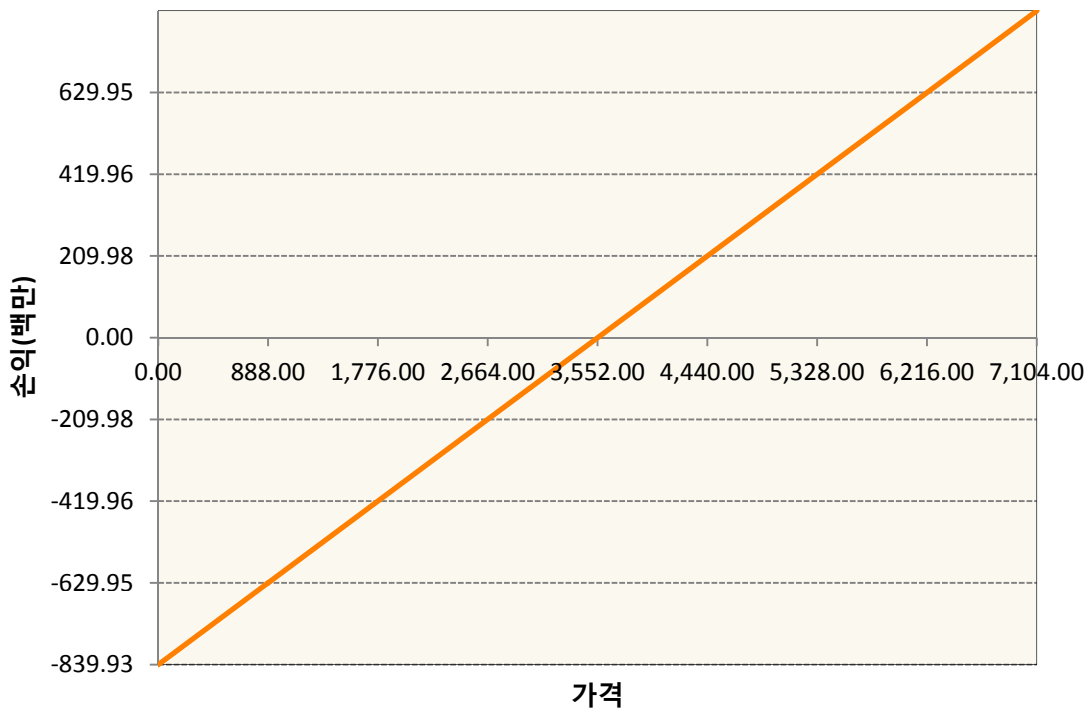
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	840	0	840	

### 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	2018-05-21
기준일	2018-05-18

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

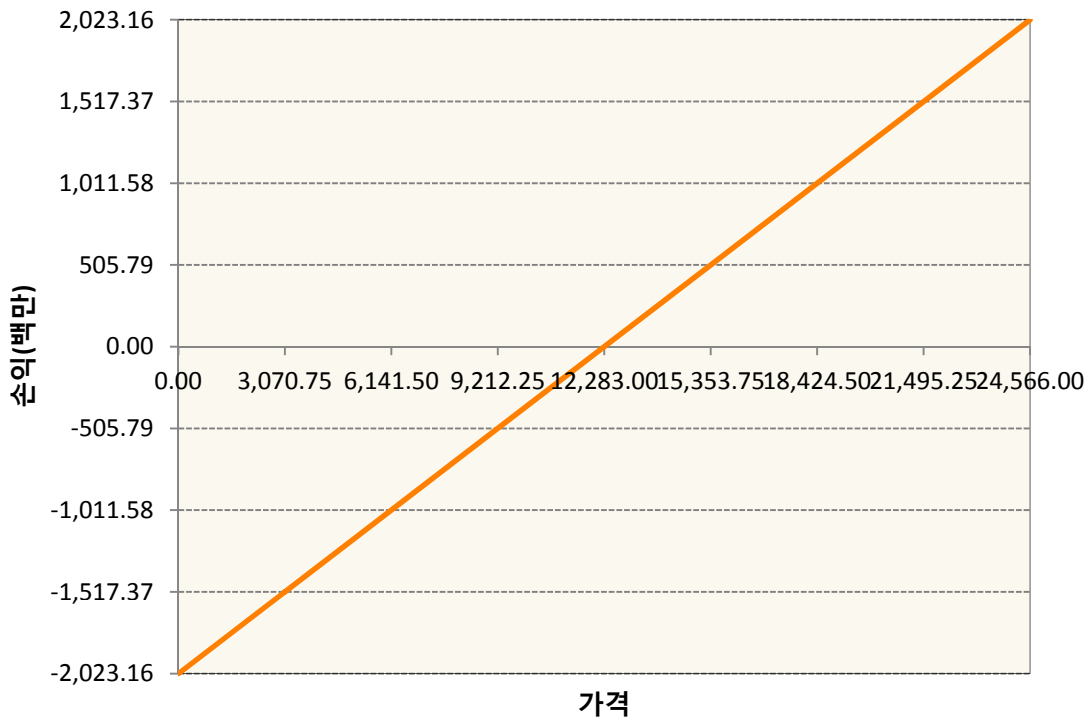
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

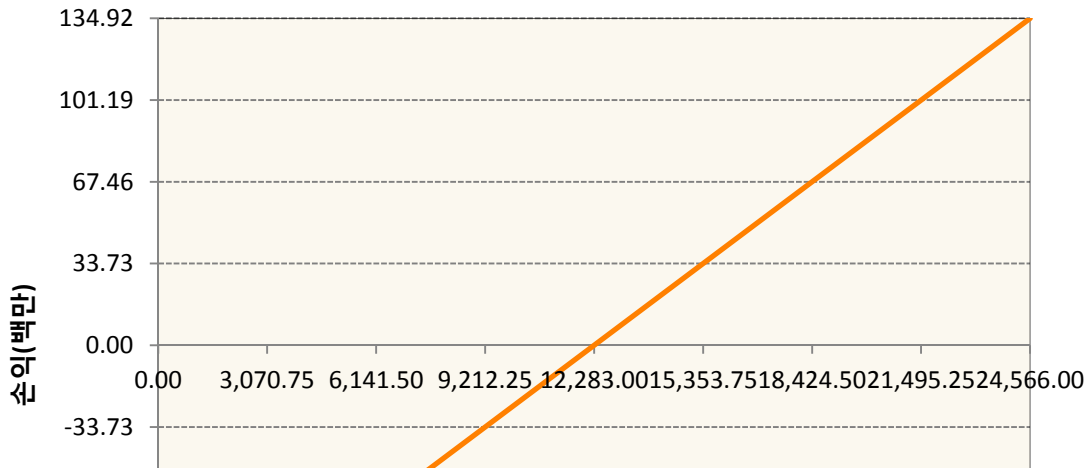
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,158	0	2,158	장내

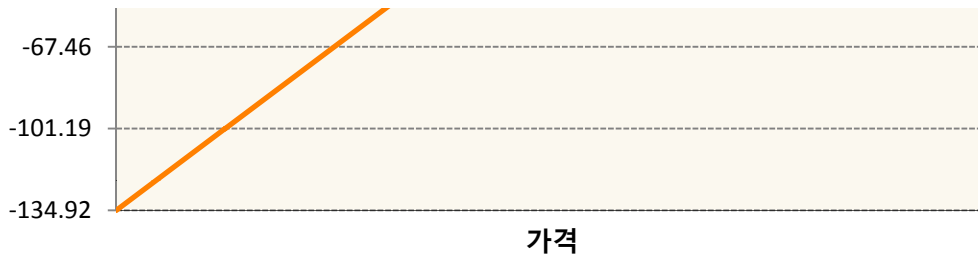
### 2. 만기시점의 손익구조

**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	2018-05-21
기준일	2018-05-18

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

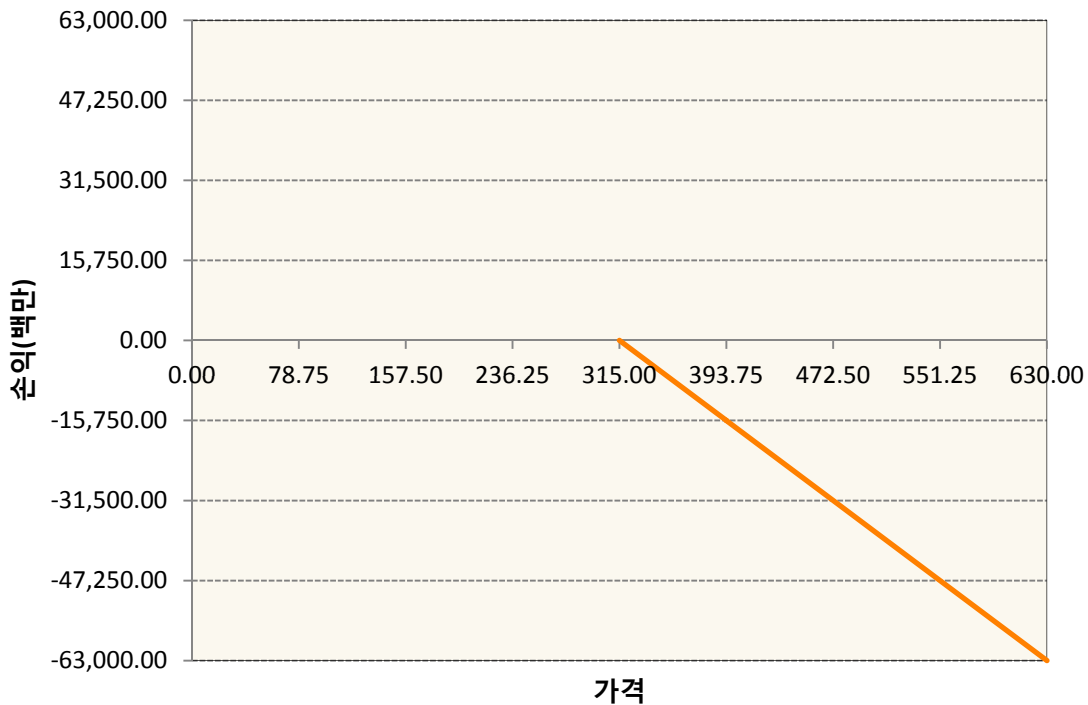
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

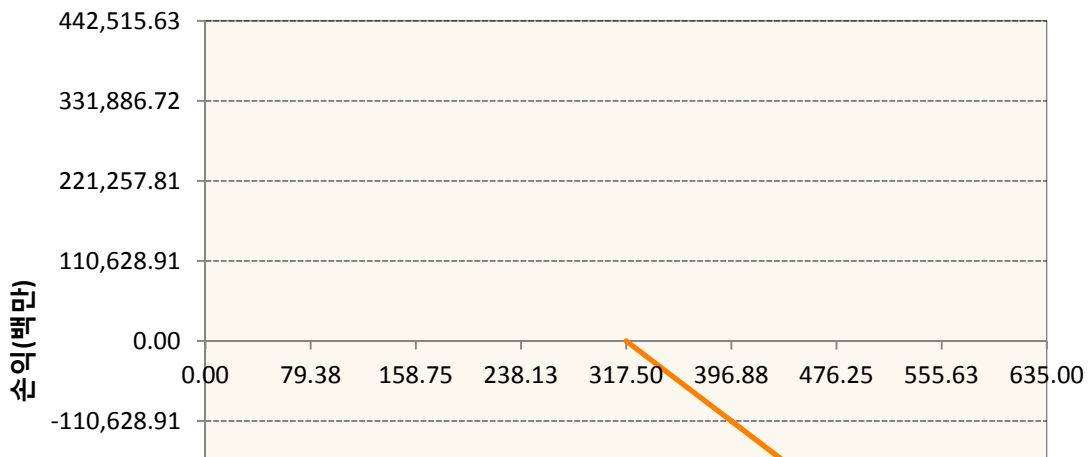
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	813,491	-813,491	장내

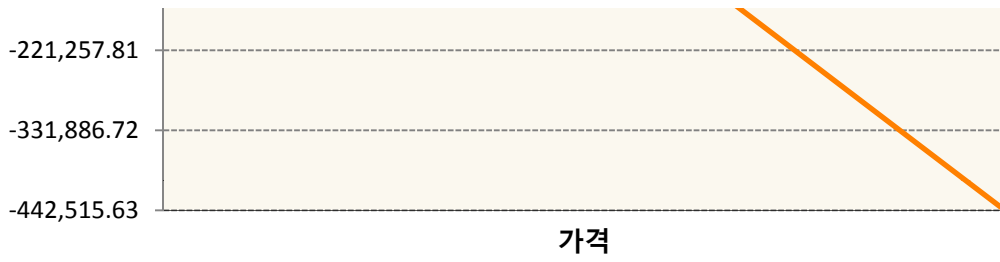
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201N63159-2018-06 콜315**

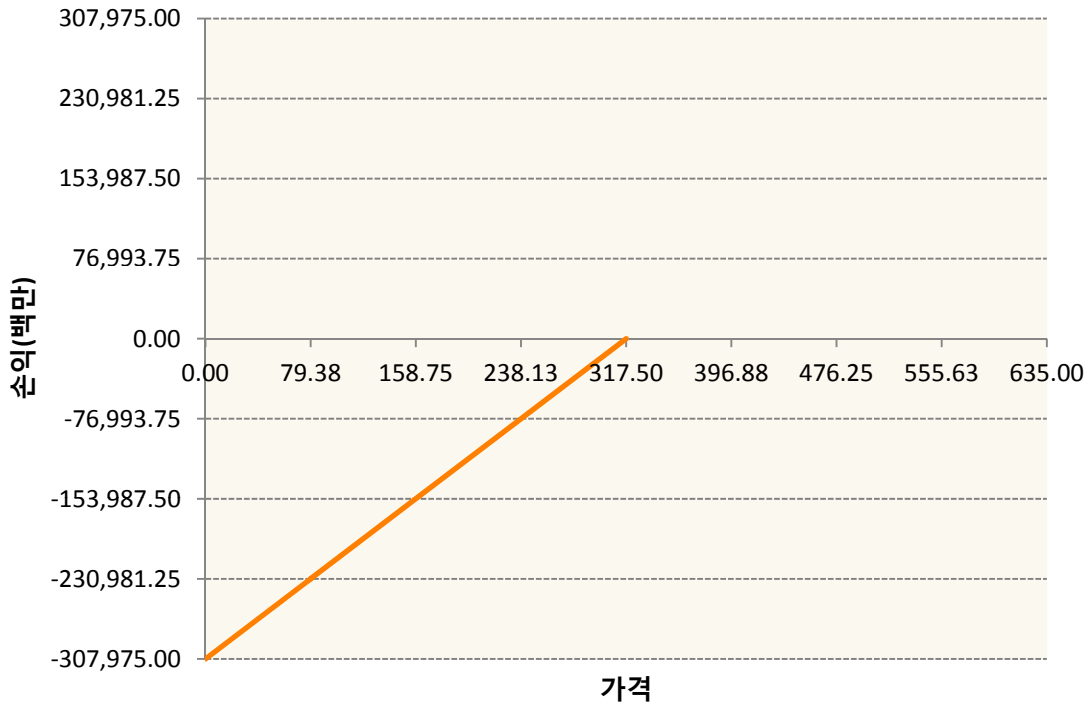


**KR4201N63175-2018-06 콜317.5**





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N6312018-06 콜315

3,886

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,823	1,764	1,694	1,614	1,526	1,432	1,331
-5.33%	1,615	1,512	1,401	1,285	1,163	1,037	907
-2.67%	1,190	1,048	903	757	609	460	311
0%	474	316	158	0	-158	-316	-474
2.67%	-551	-695	-842	-991	-1,141	-1,293	-1,446
5.33%	-1,842	-1,951	-2,069	-2,193	-2,322	-2,455	-2,592
8.00%	-3,321	-3,391	-3,473	-3,564	-3,665	-3,772	-3,886

KR4201N6312018-06 풋317.5

26,039

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,277	10,936	10,517	10,029	9,478	8,874	8,223

-5.33%	10,133	9,500	8,802	8,053	7,260	6,433	5,576
-2.67%	7,663	6,733	5,776	4,797	3,802	2,795	1,776
0%	3,300	2,201	1,101	0	-1,102	-2,204	-3,306
2.67%	-3,212	-4,274	-5,346	-6,426	-7,512	-8,603	-9,697
5.33%	-11,693	-12,545	-13,443	-14,376	-15,338	-16,322	-17,325
8.00%	-21,651	-22,227	-22,880	-23,598	-24,369	-25,185	-26,039

KR4301N6312018-06 풋317.5

21,332

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21,260	-21,261	-21,264	-21,271	-21,283	-21,303	-21,332
-5.33%	-13,132	-13,155	-13,194	-13,249	-13,321	-13,411	-13,519
-2.67%	-5,291	-5,444	-5,621	-5,818	-6,032	-6,260	-6,501
0%	1,005	672	337	0	-338	-676	-1,016
2.67%	4,250	3,984	3,704	3,414	3,116	2,811	2,500
5.33%	5,122	5,038	4,928	4,796	4,641	4,468	4,277
8.00%	5,233	5,221	5,200	5,166	5,117	5,053	4,972

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

(단위:백만원)

**52,357**

공시일	2018-05-21
기준일	2018-05-18

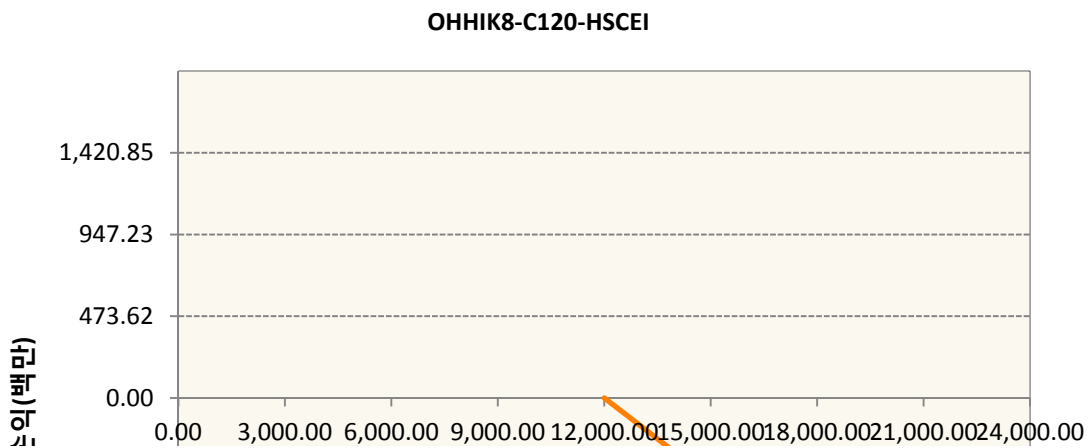
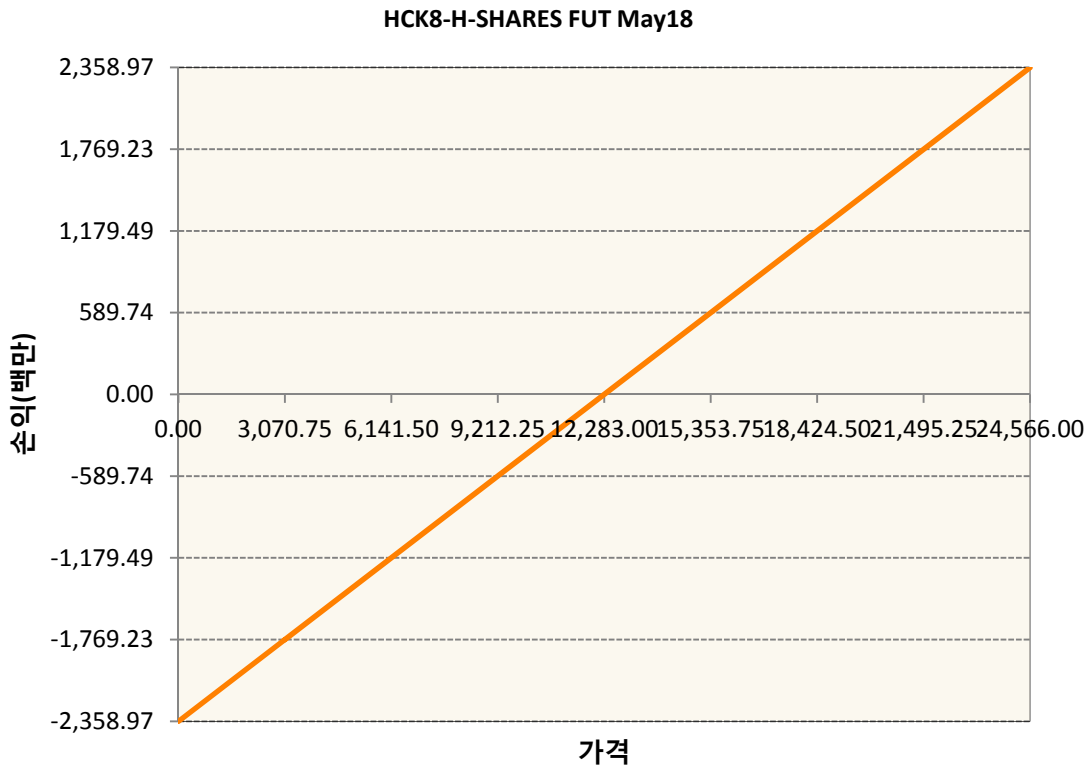
## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

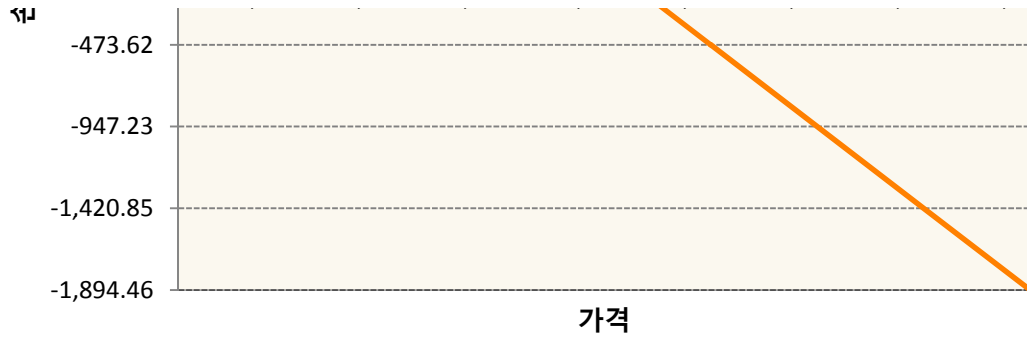
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

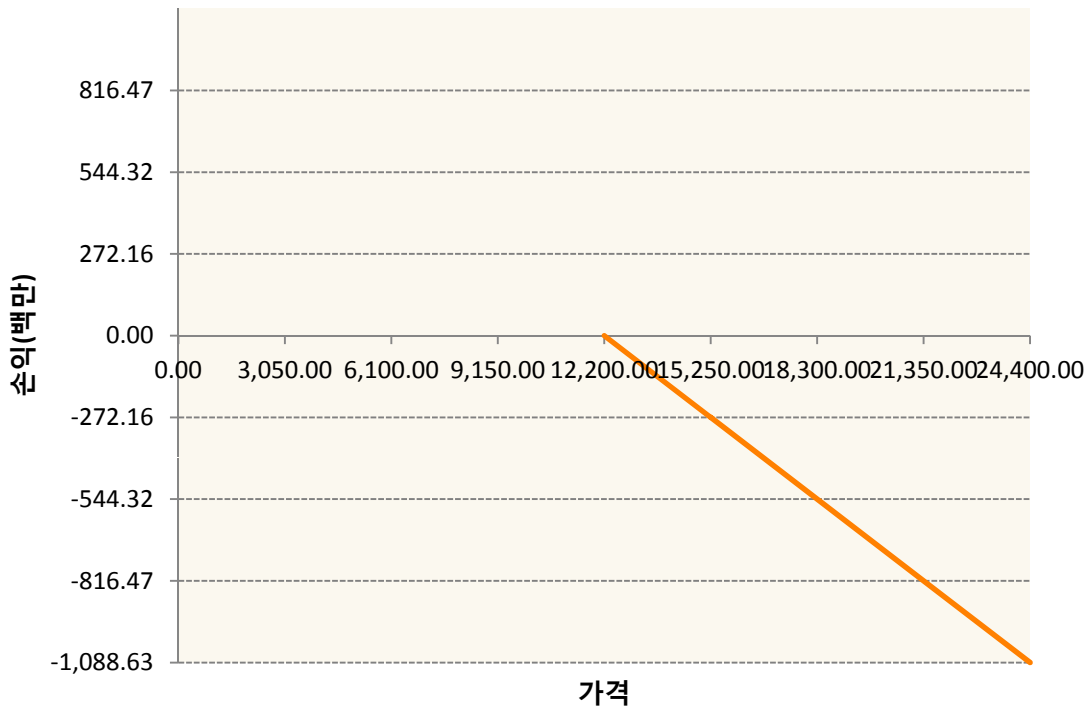
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,359	0	2,359	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,966	-5,966	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

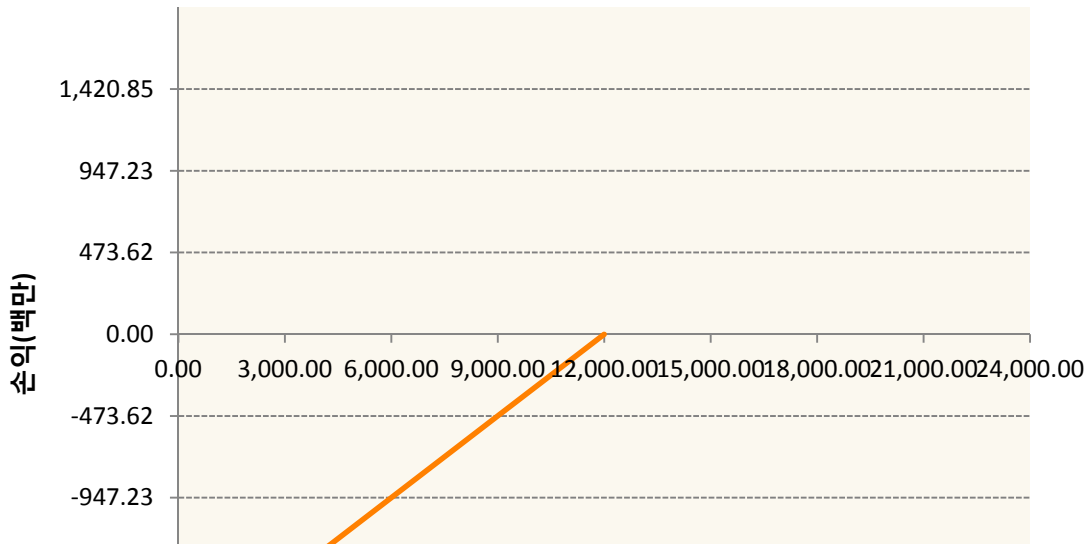


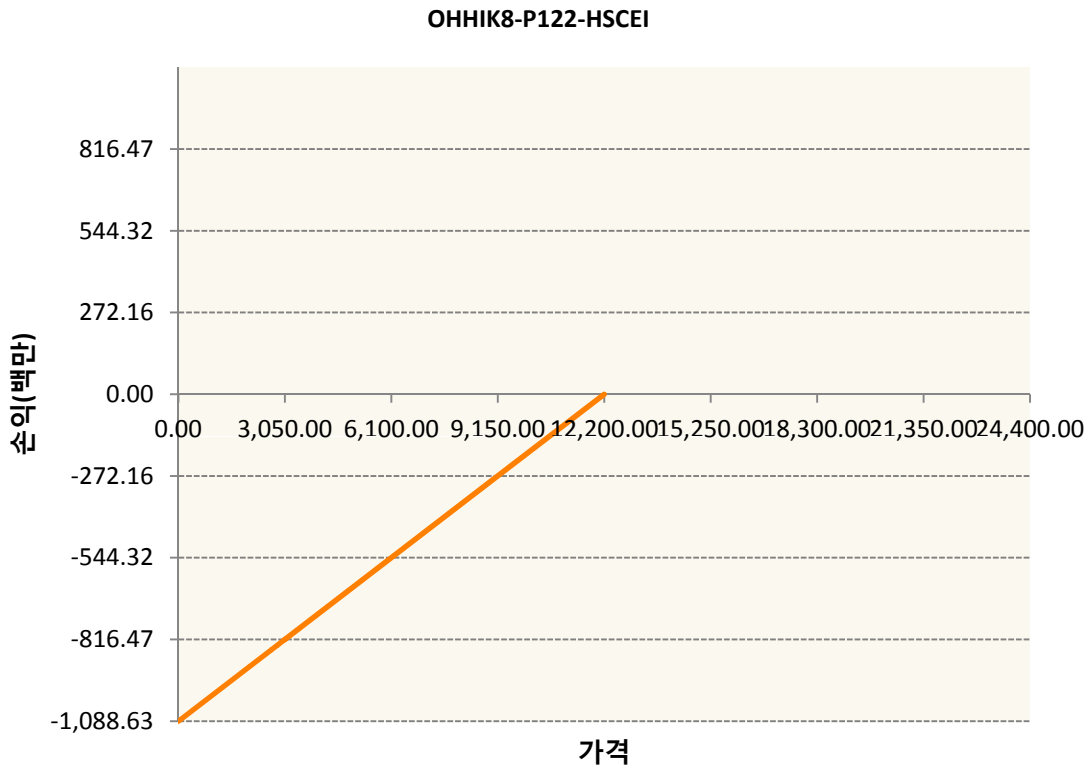
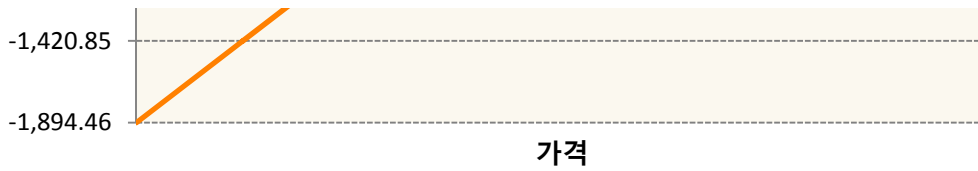


OHHIK8-C122-HSCEI



OHHIK8-P120-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCK8	H-SHARES FUT May18	189
OHHIK8-C12	HSCEI	152
OHHIK8-C12	HSCEI	87
OHHIK8-P12	HSCEI	152
OHHIK8-P12	HSCEI	87

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	585

공시일	2018-05-21
기준일	2018-05-18

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

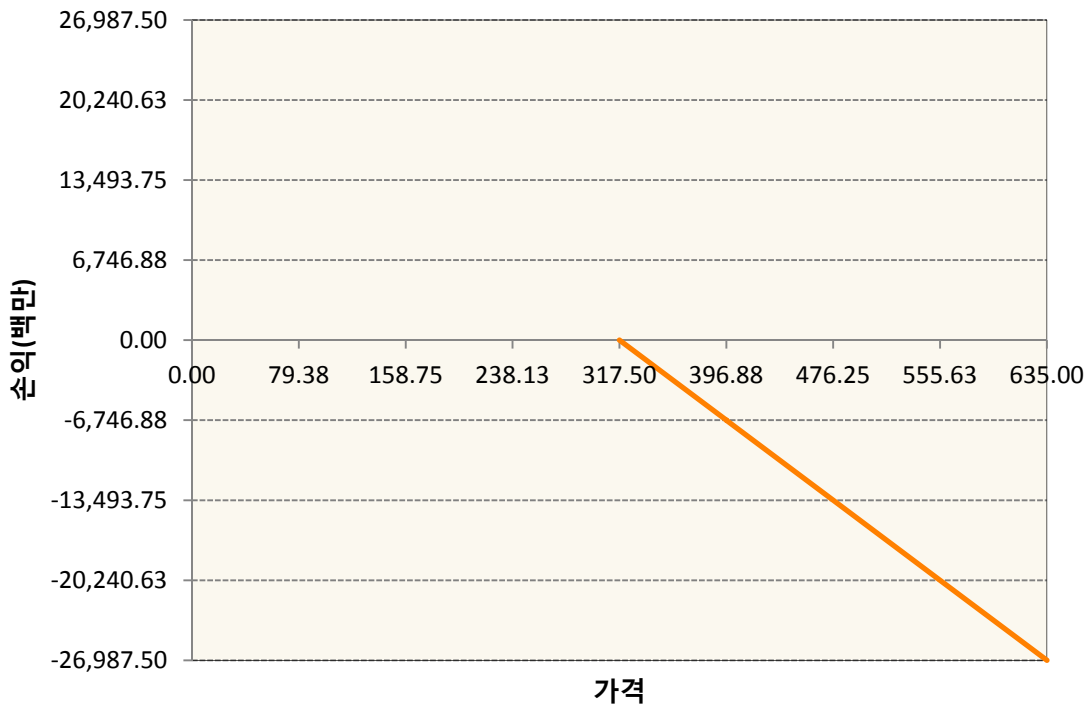
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

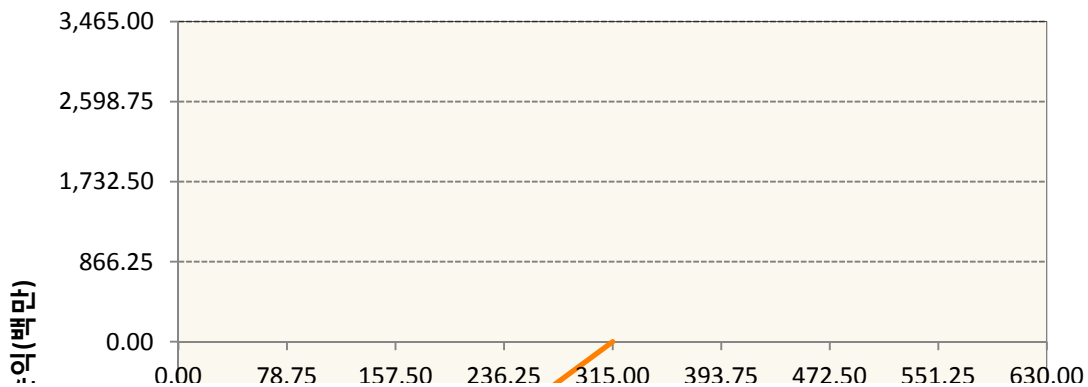
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	46,804	-46,804	장내

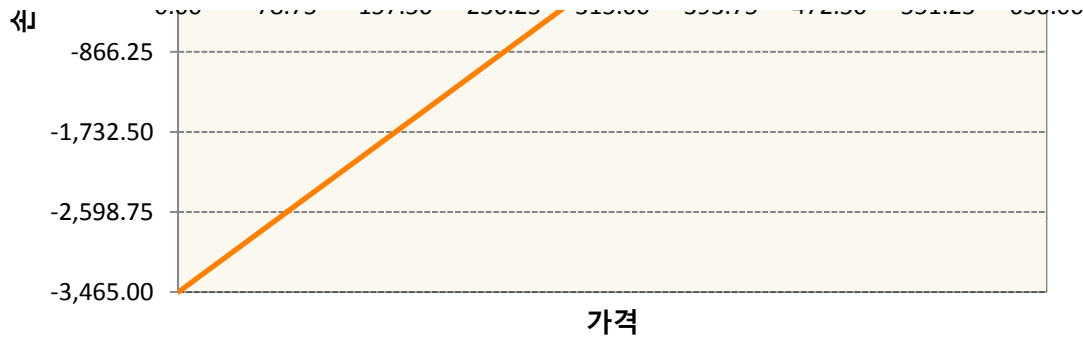
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63175-2018-06 콜317.5

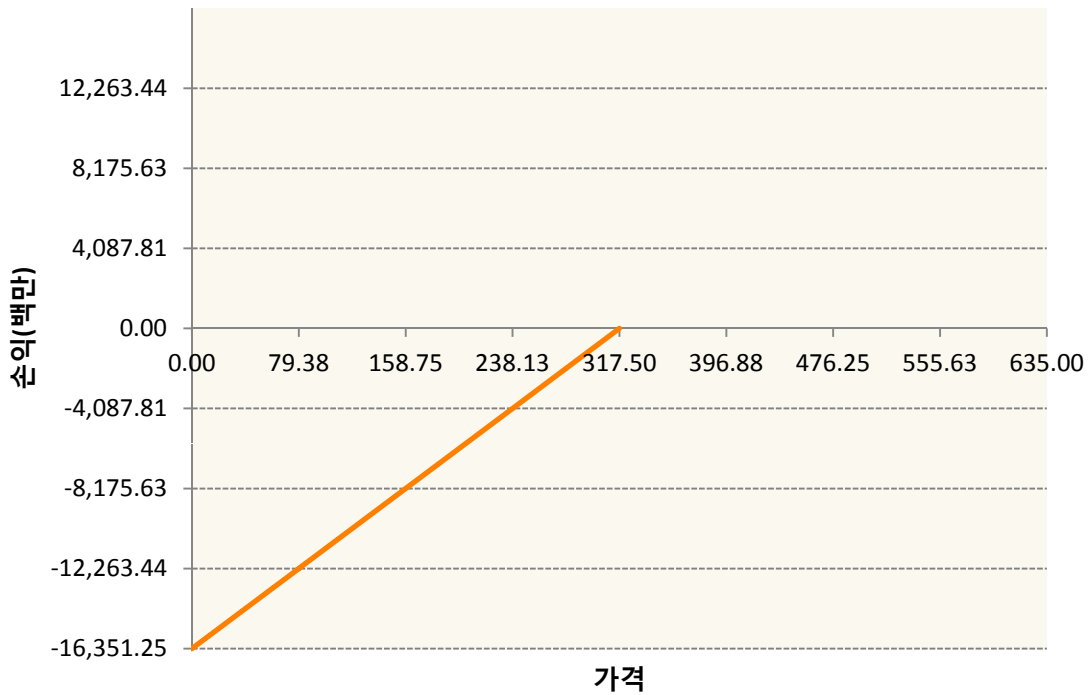


KR4301N63157-2018-06 풋315





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_2							1,478
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,478	-1,478	-1,478	-1,478	-1,478	-1,478	-1,478
-5.33%	-986	-986	-986	-986	-986	-986	-986
-2.67%	-493	-493	-493	-493	-493	-493	-493
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	493	493	493	493	493	493	493
5.33%	986	986	986	986	986	986	986
8.00%	1,478	1,478	1,478	1,478	1,478	1,478	1,478
2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_3							280
	기초자산의 변동성						



0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	213	213	213	213	213	213	213
5.33%	426	426	426	426	426	426	426
8.00%	639	639	639	639	639	639	639

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX\_12 479

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-479	-479	-479	-479	-479	-479	-479
-5.33%	-320	-320	-320	-320	-320	-320	-320
-2.67%	-160	-160	-160	-160	-160	-160	-160
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	160	160	160	160	160	160	160
5.33%	320	320	320	320	320	320	320
8.00%	479	479	479	479	479	479	479

KR4201N6312018-06 콜317.5 1,588

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	688	667	641	612	578	541	501
-5.33%	618	579	537	491	443	392	340
-2.67%	467	411	352	293	232	170	108
0%	201	134	67	0	-67	-134	-202
2.67%	-196	-261	-326	-392	-458	-525	-591
5.33%	-713	-765	-820	-877	-935	-995	-1,057
8.00%	-1,320	-1,356	-1,395	-1,439	-1,486	-1,536	-1,588

KR4301N6312018-06 풋315 230

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-228	-228	-229	-229	-229	-229	-230
-5.33%	-137	-137	-138	-139	-140	-141	-143
-2.67%	-51	-53	-56	-58	-61	-64	-67
0%	12	8	4	0	-4	-8	-12
2.67%	38	36	33	31	28	25	22
5.33%	44	43	43	42	40	39	37
8.00%	45	45	44	44	44	43	43

KR4301N6312018-06 풋317.5 1,133

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,129	-1,129	-1,129	-1,129	-1,130	-1,131	-1,133
-5.33%	-697	-698	-700	-703	-707	-712	-718
-2.67%	-281	-289	-298	-309	-320	-332	-345
0%	53	36	18	0	-18	-36	-54
2.67%	226	212	197	181	165	149	133
5.33%	272	267	262	255	246	237	227
8.00%	278	277	276	274	272	268	264

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

(단위:백만원)

6,879

공시일	2018-05-21
기준일	2018-05-18

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

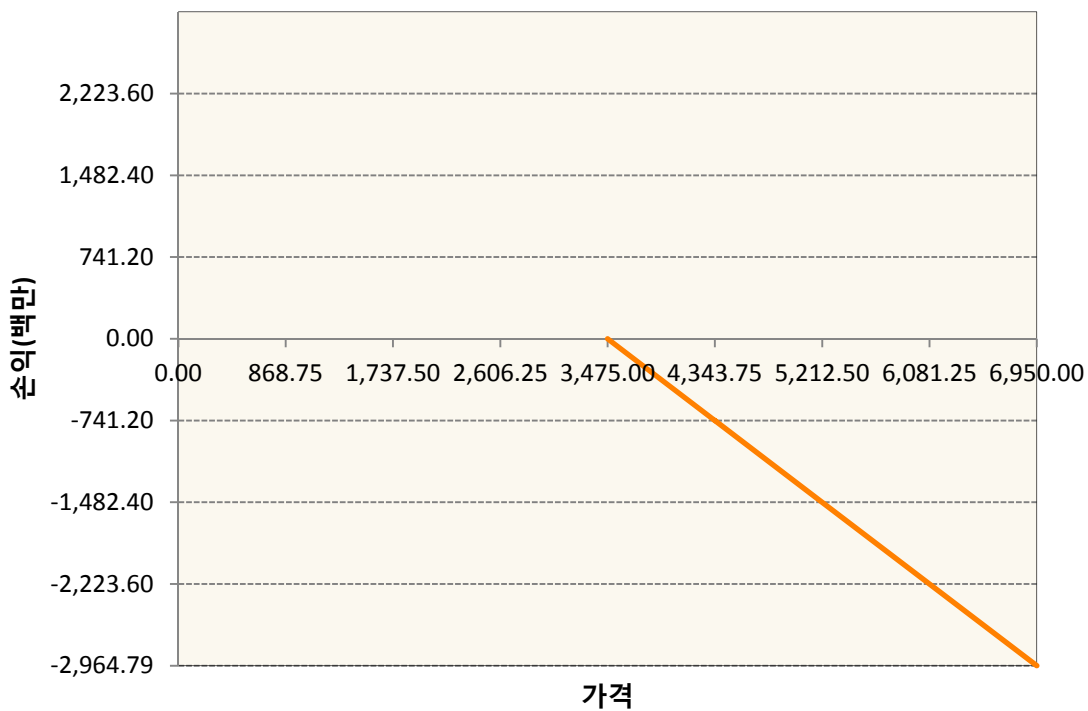
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

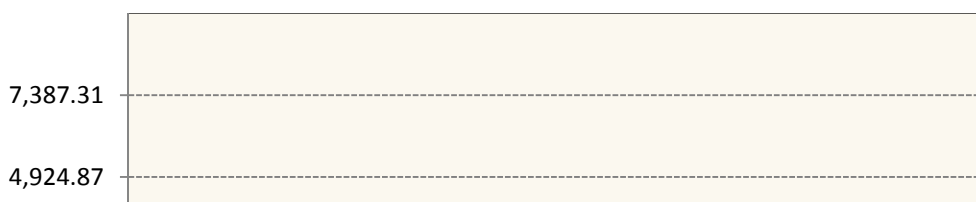
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,012	0	5,012	
누계	유가증권	스왑	63,620	0	63,620	장외
누계	유가증권	옵션	0	33,549	-33,549	장내
누계	지수	스왑	50,937	0	50,937	장외

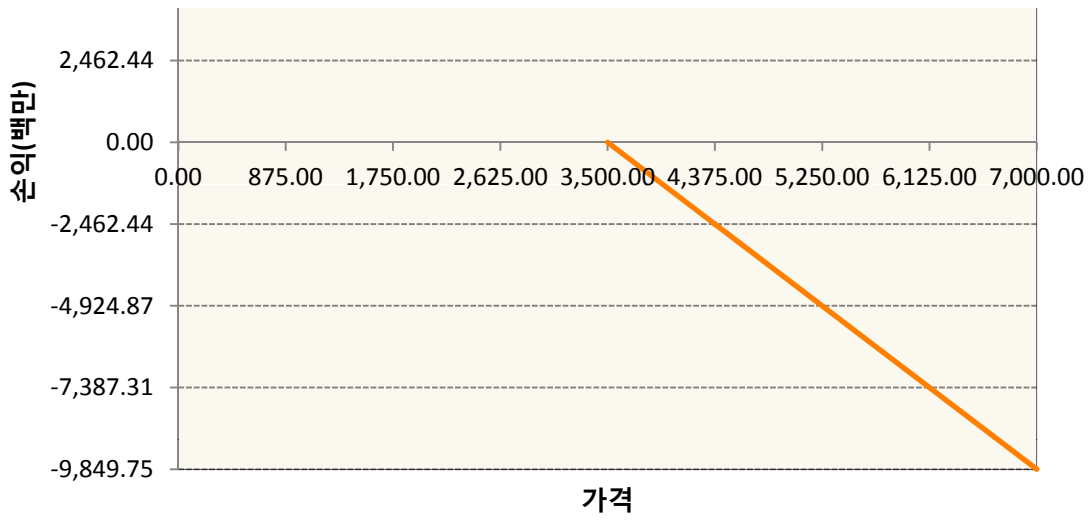
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXK8-C3475-EURO STOXX 50**

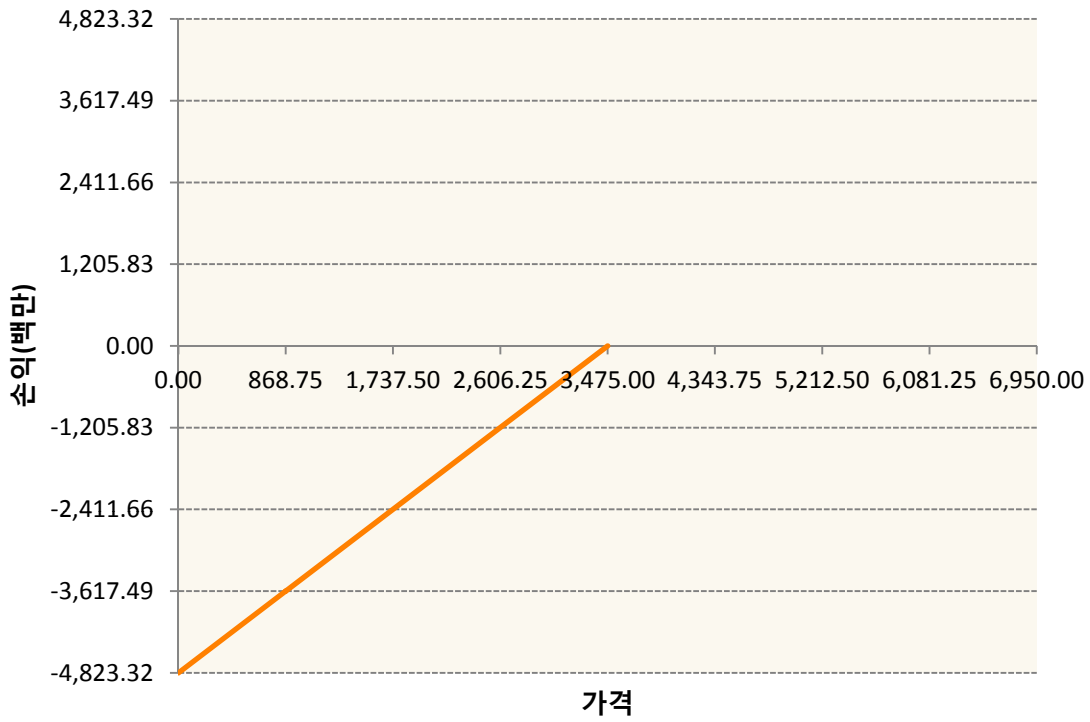


**OESXK8-C3500-EURO STOXX 50**



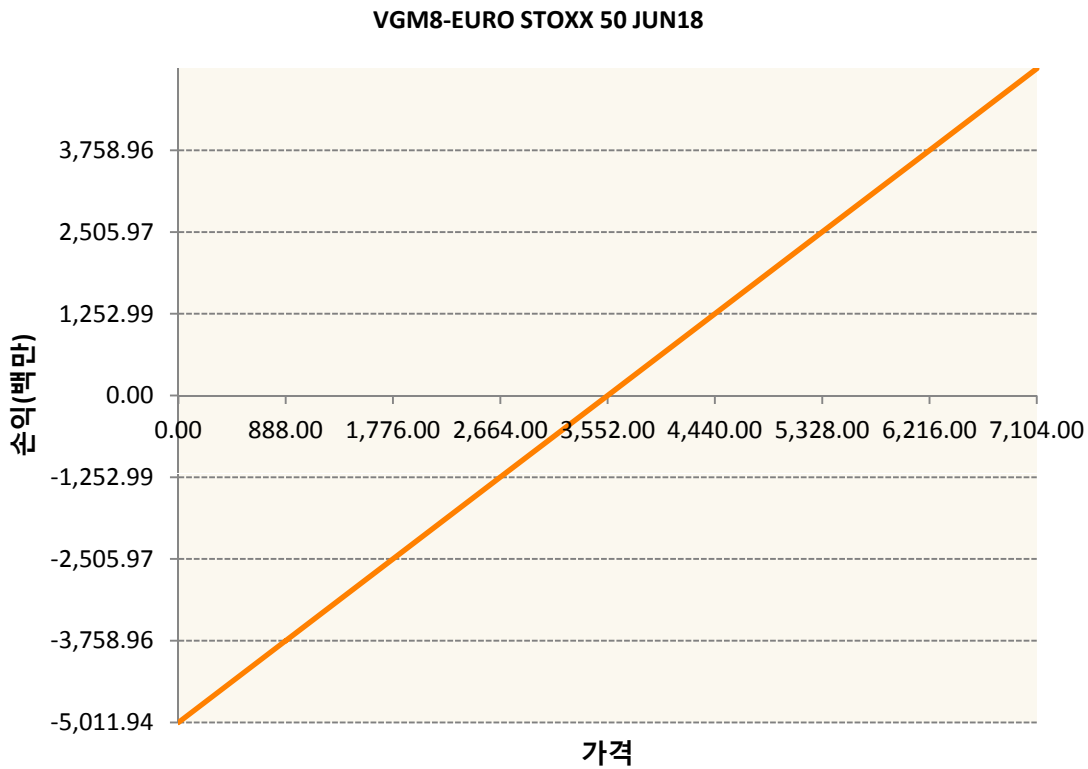
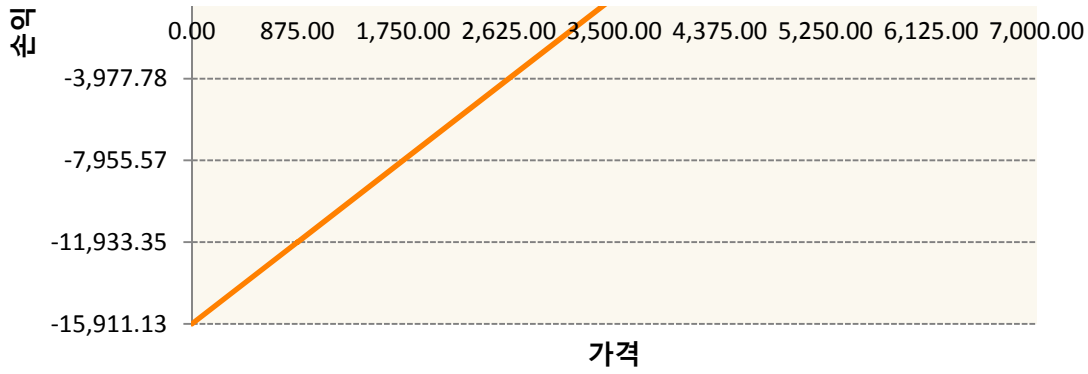


OESXK8-P3475-EURO STOXX 50



OESXK8-P3500-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		66
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		82
OESXK8-C34 EURO STOXX 50		237
OESXK8-C35 EURO STOXX 50		788
OESXK8-P34 EURO STOXX 50		386
OESXK8-P35 EURO STOXX 50		1,273
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18		401

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





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

(단위:백만원)

1,161



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)

207



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

(단위:백만원)

41

공시일	2018-05-21
기준일	2018-05-18

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

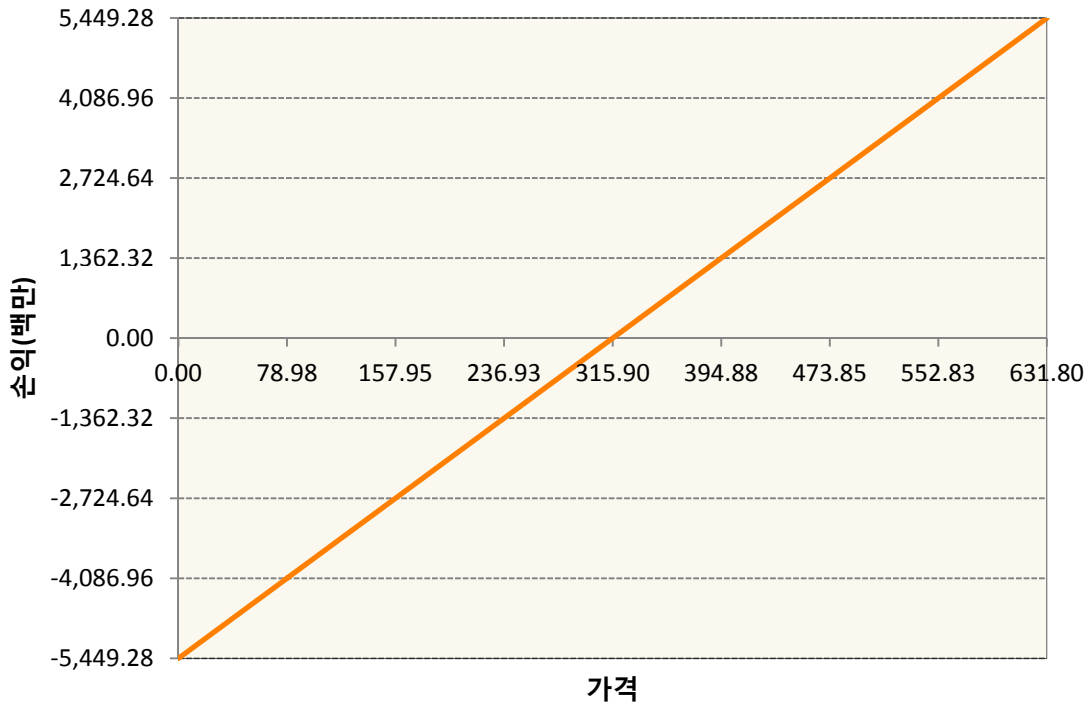
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

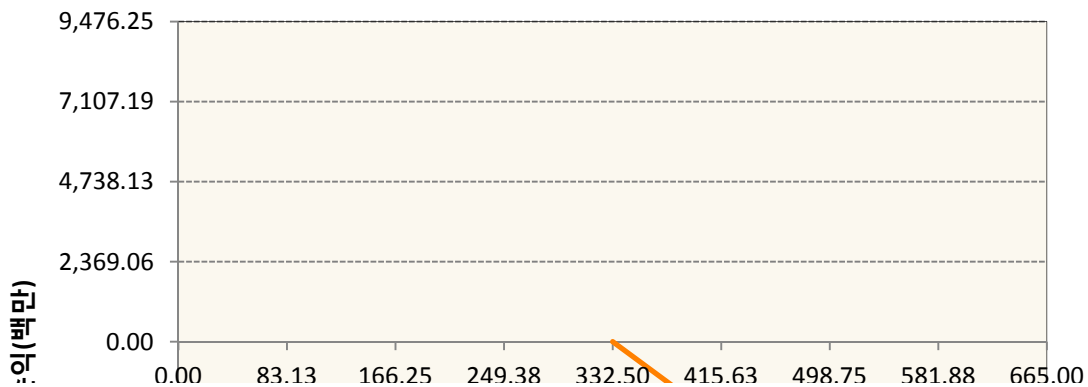
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	156	915	-758	장내
누계	유가증권	선물	5,449	0	5,449	장내
누계	유가증권	옵션	1,270	9,476	-8,206	장내

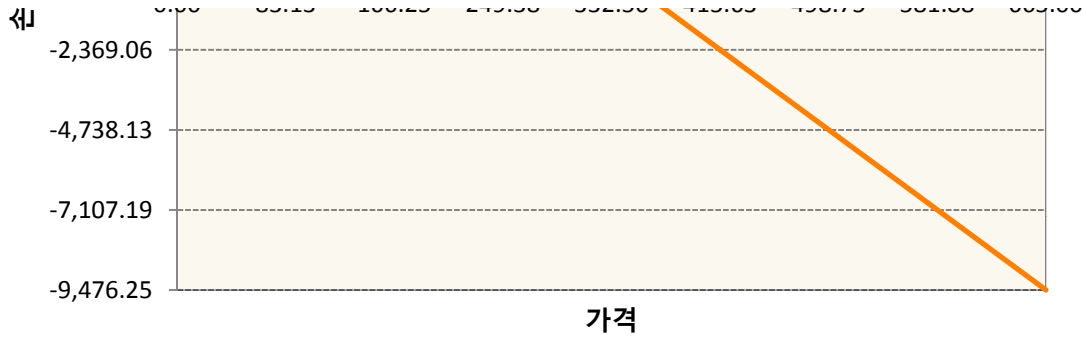
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

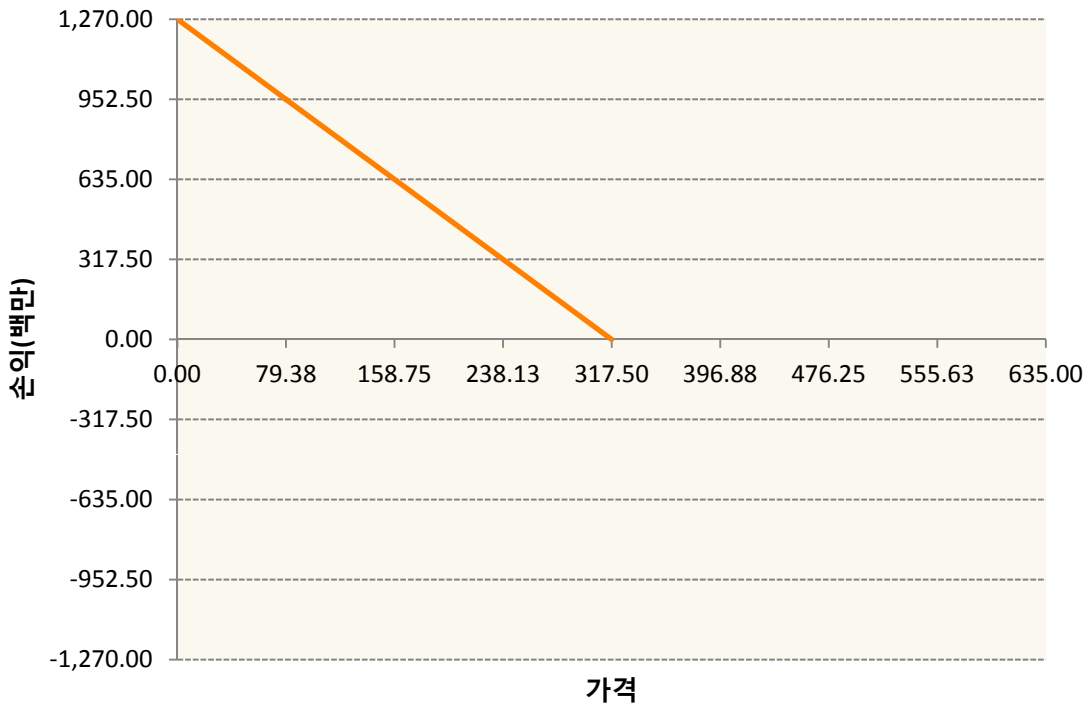


KR4201N63324-2018-06 콜332.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물							435
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-435	-435	-435	-435	-435	-435	-435
-5.33%	-290	-290	-290	-290	-290	-290	-290
-2.67%	-145	-145	-145	-145	-145	-145	-145
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	145	145	145	145	145	145	145
5.33%	290	290	290	290	290	290	290
8.00%	435	435	435	435	435	435	435
KR4201N63E 2018-06 콜332.5							388
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	98	96	94	90	85	79	72
-5.33%	94	89	83	76	67	57	46
-2.67%	81	72	61	48	35	20	4
0%	50	35	18	0	-18	-38	-57
2.67%	-10	-32	-53	-75	-97	-120	-142
5.33%	-110	-134	-158	-181	-205	-229	-252
8.00%	-252	-274	-296	-319	-342	-365	-388

KR4301N6312018-06 풋317.5

88

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	88	88	88	88	88	88	88
-5.33%	54	54	54	55	55	55	56
-2.67%	22	22	23	24	25	26	27
0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-18	-16	-15	-14	-13	-12	-10
5.33%	-21	-21	-20	-20	-19	-18	-18
8.00%	-22	-22	-21	-21	-21	-21	-21

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

(단위:백만원)

676

공시일	2018-05-21
기준일	2018-05-18

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

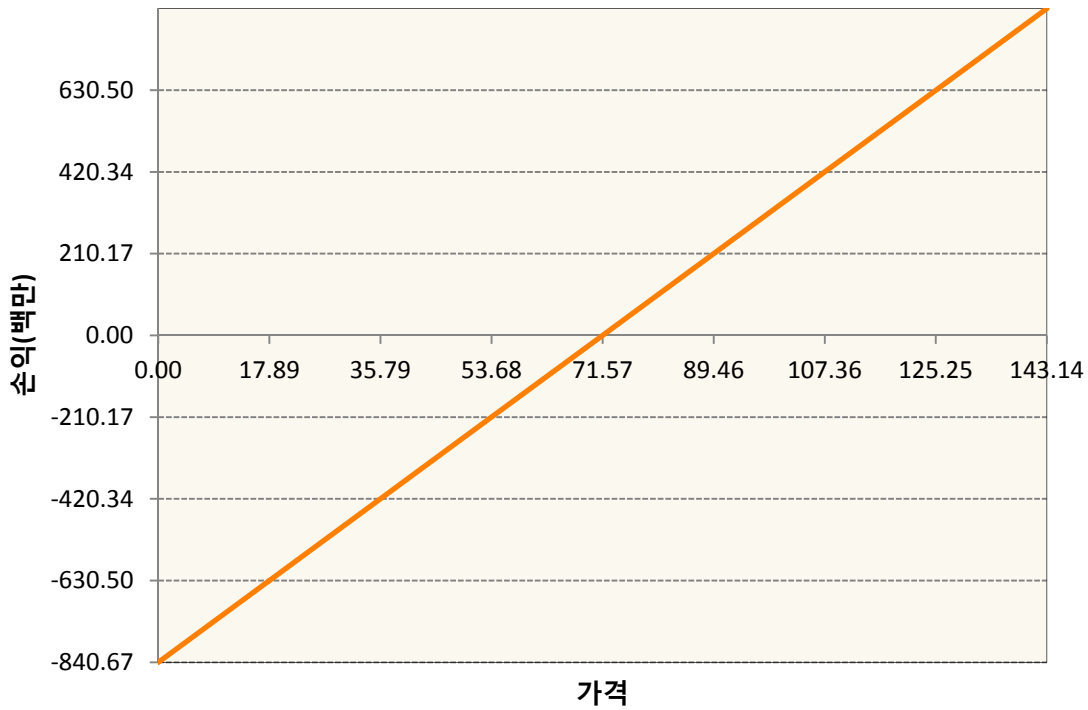
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

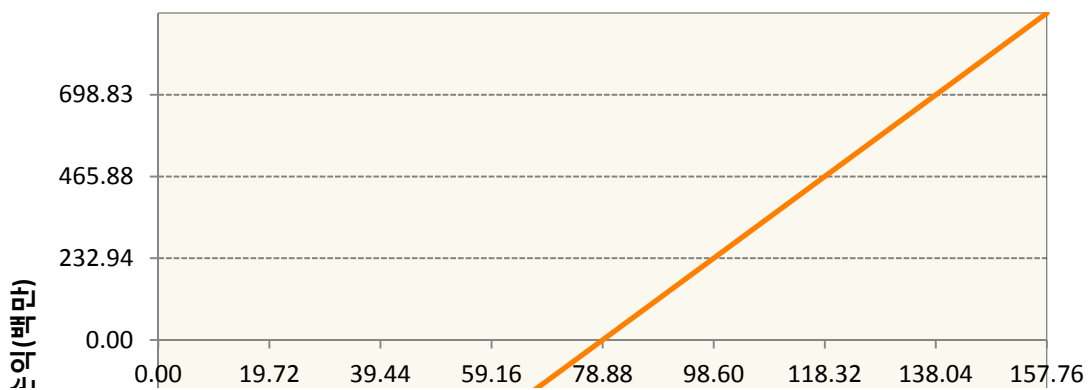
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	593	-593	장내
누계	유가증권	선물	3,963	0	3,963	
누계	통화	선물	0	592	-592	장내

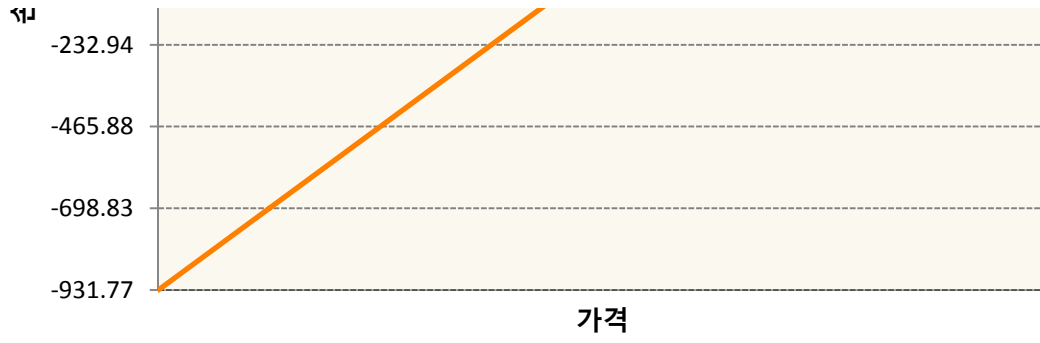
### 2. 만기시점의 손익구조

CLN8-WTI CRUDE FUTURE JUL18

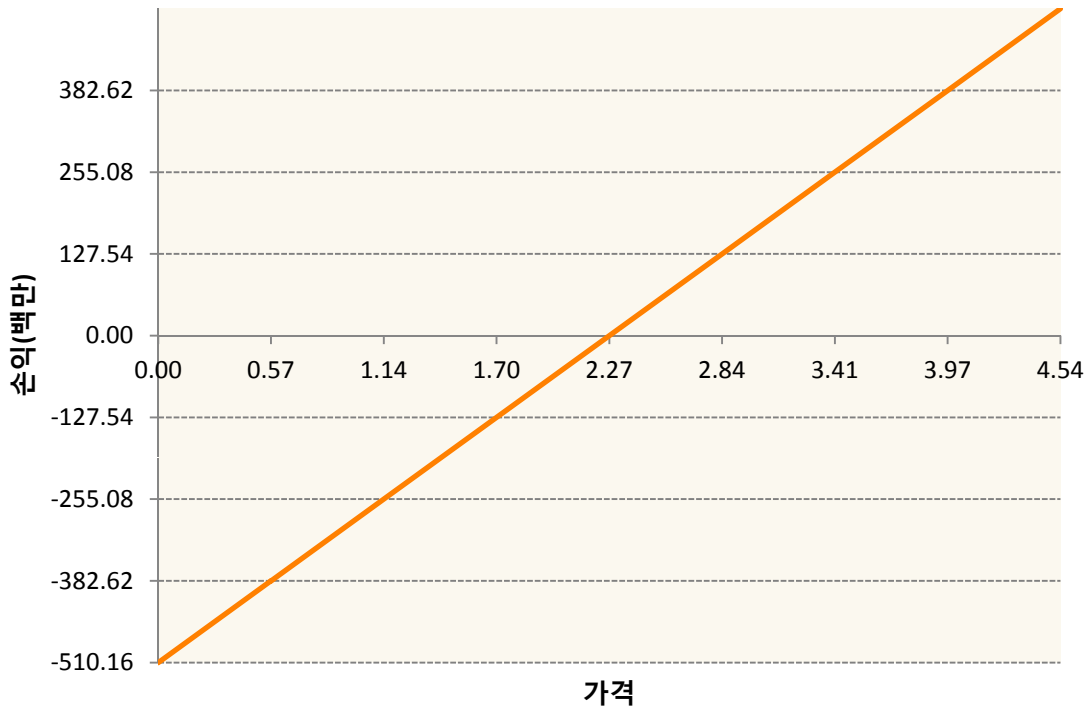


COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18

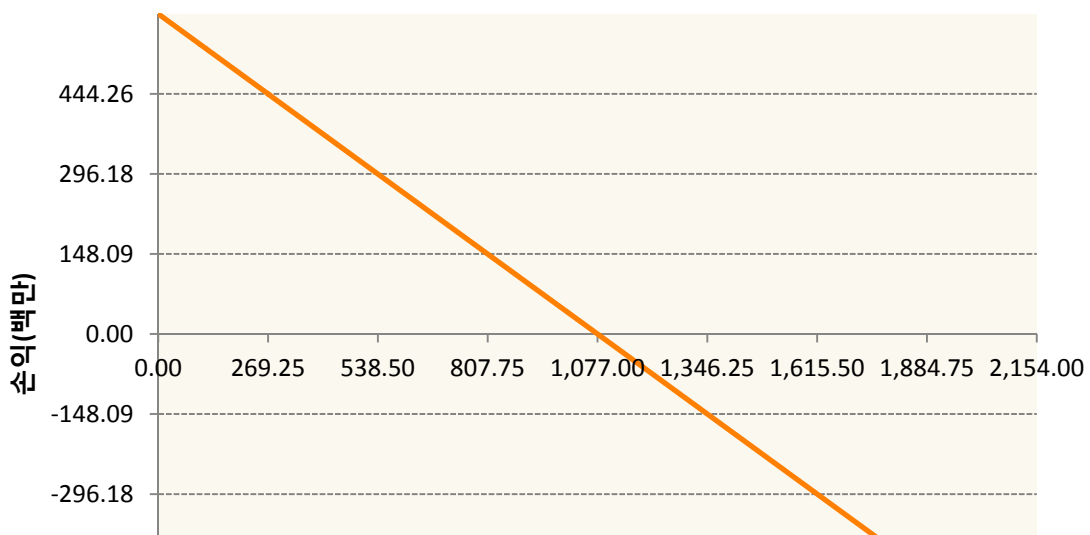


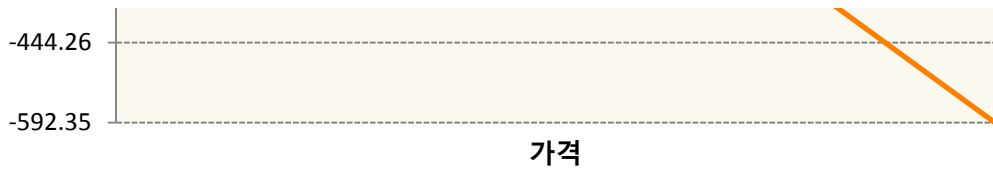


HON8-NY Harb ULSD Fut JUL18

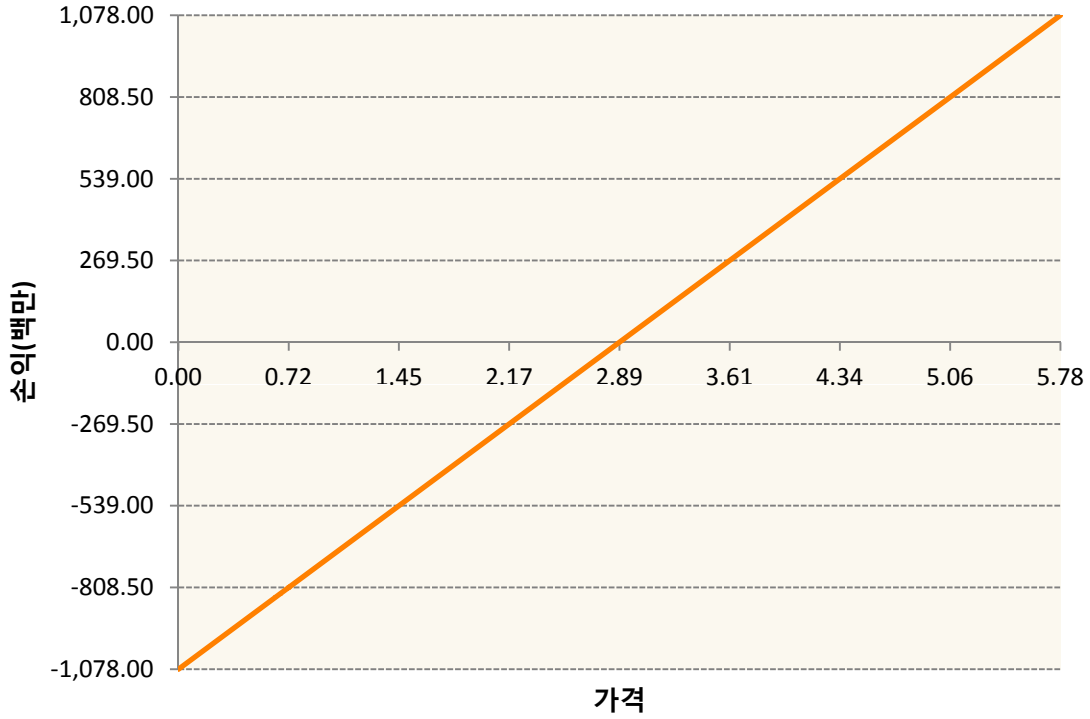


KR4175N60003-2018-06 달러선물

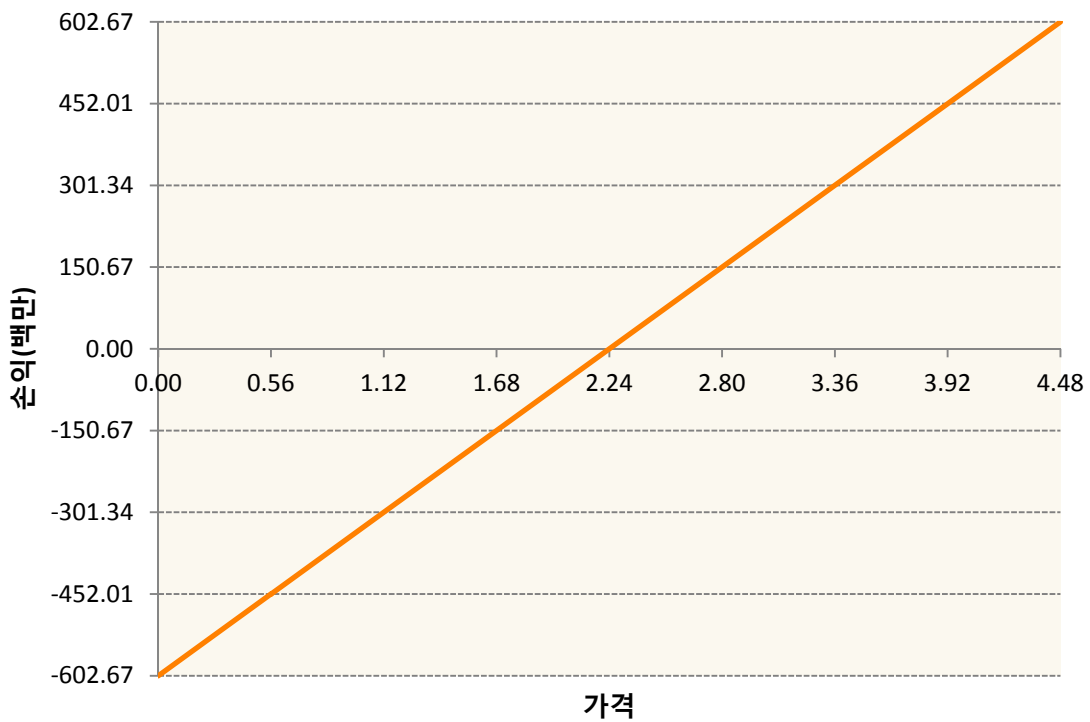




**NGN8-NATURAL GAS FUTR JUL18**



**XBN8-GASOLINE RBOB FUT JUL18**



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLN8	WTI CRUDE FUTURE JUL18	67
COU8	BRENT CRUDE FUTR SEP18	75
HON8	NY Harb ULSD Fut JUL18	41
	KR4175N60C 2018-06 달러선물	47
NGN8	NATURAL GAS FUTR JUL18	86
XBN8	GASOLINE RBOB FUT JUL18	48

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	478

공시일	2018-05-21
기준일	2018-05-18

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

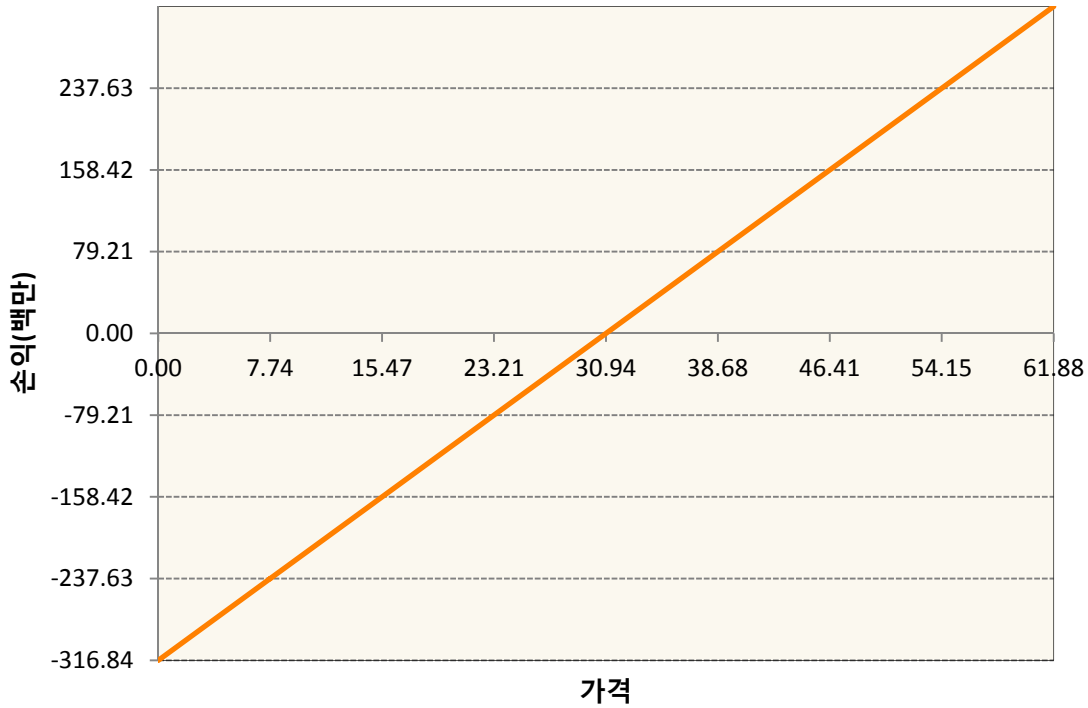
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

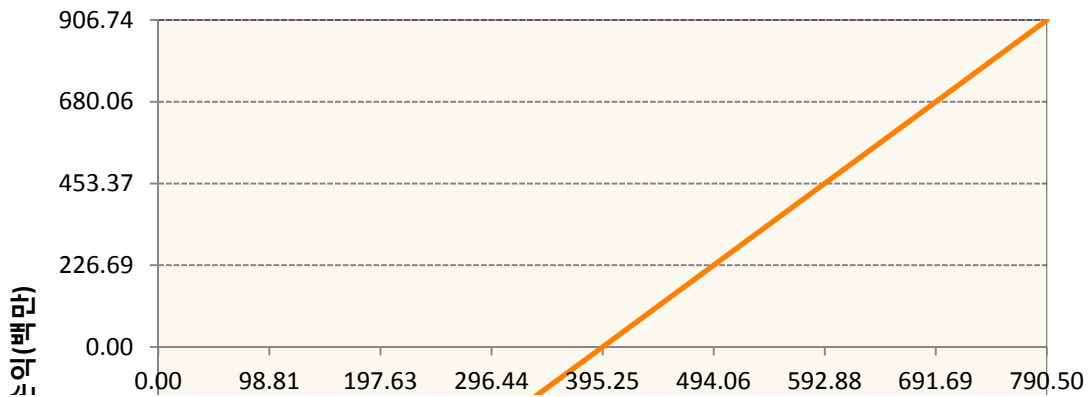
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	324	-324	장내
누계	유가증권	선물	4,020	0	4,020	
누계	통화	선물	0	323	-323	장내

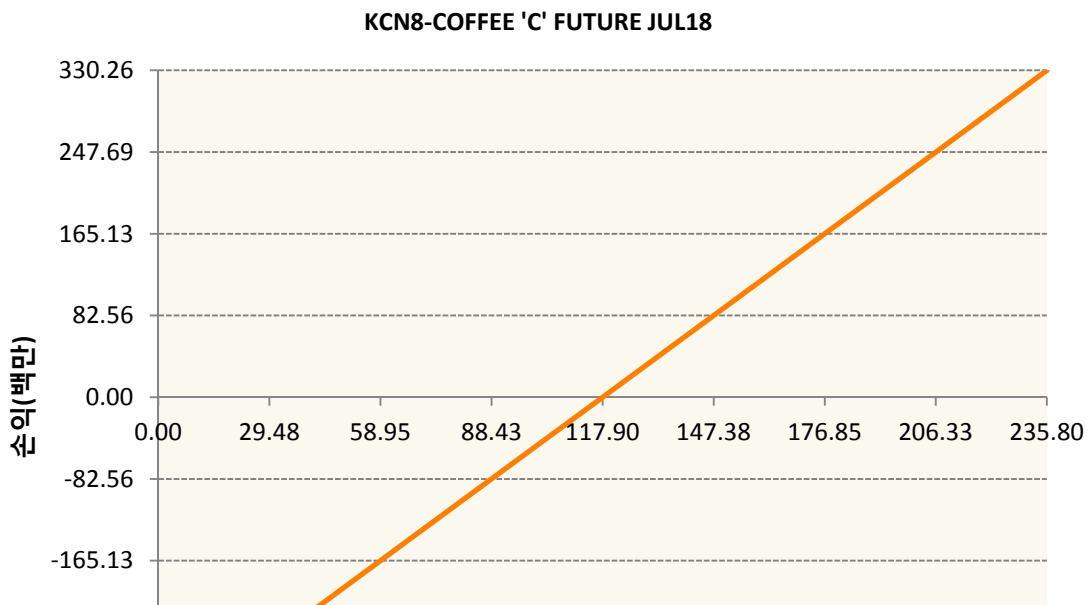
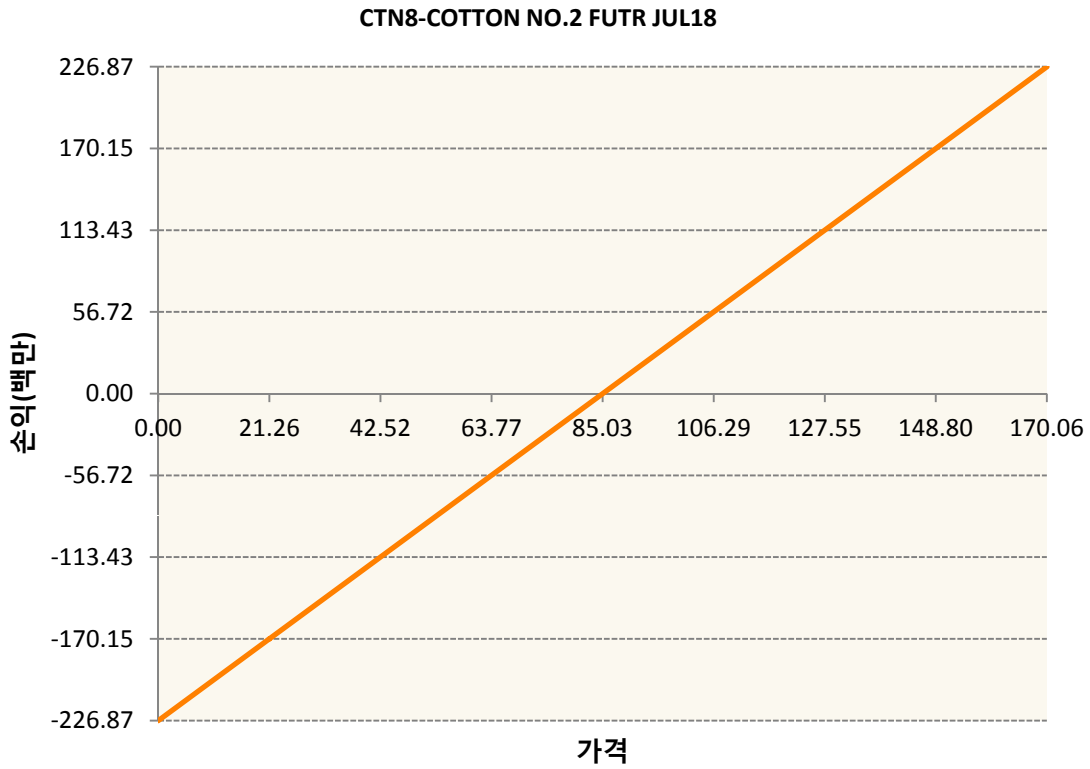
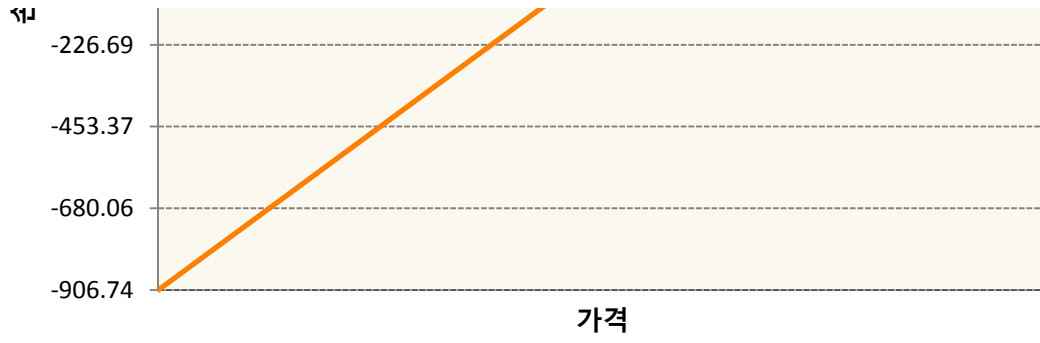
### 2. 만기시점의 손익구조

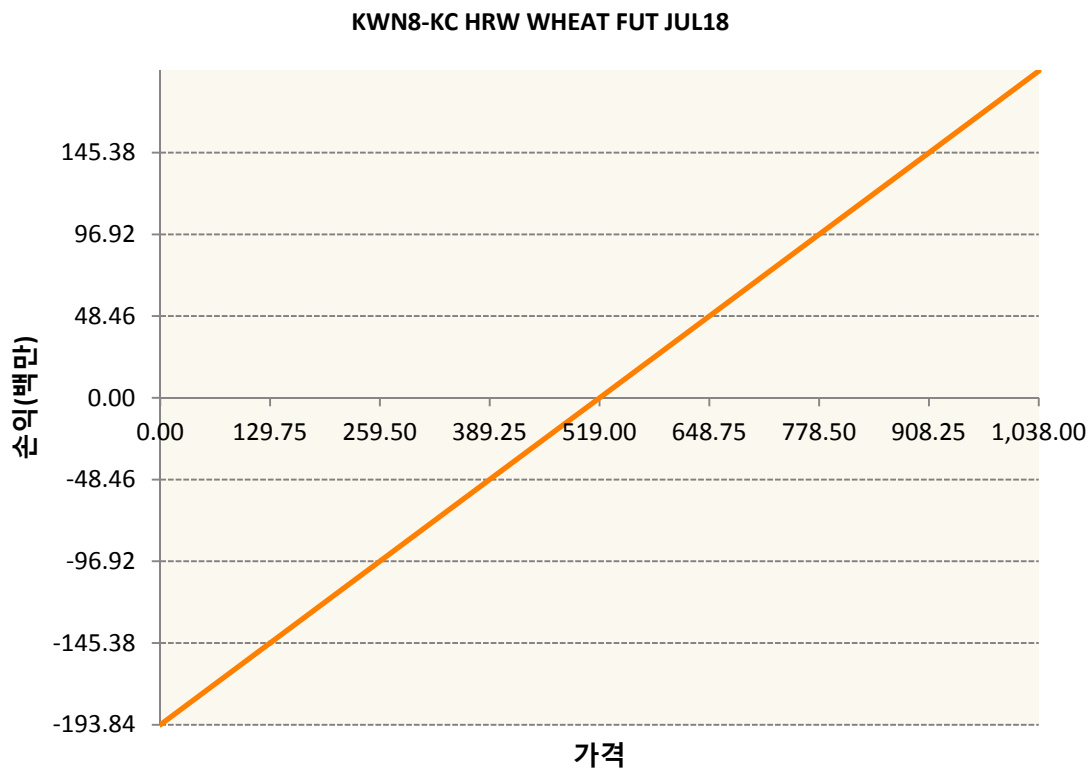
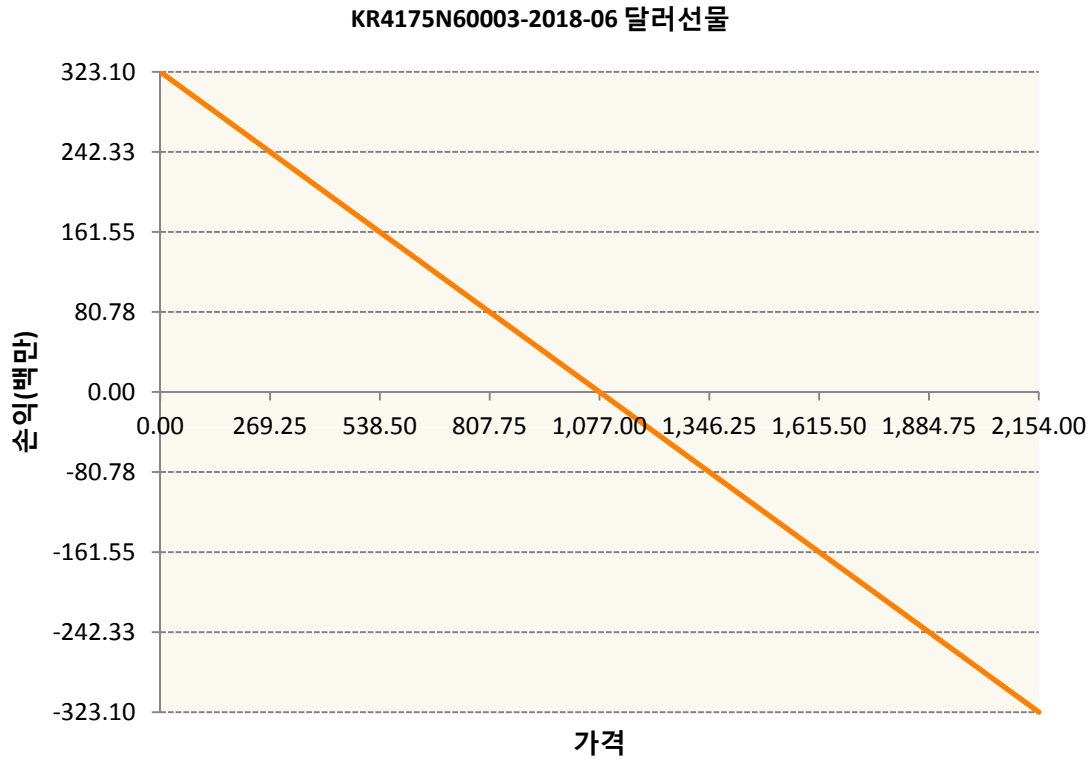
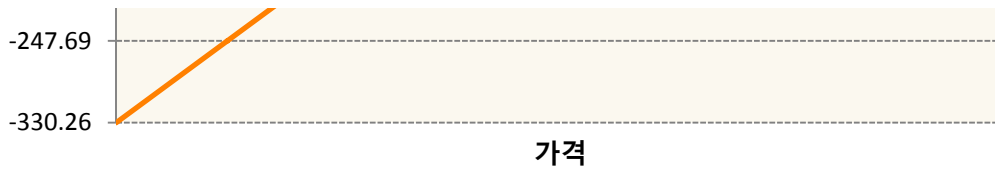
**BON8-SOYBEAN OIL FUTR JUL18**



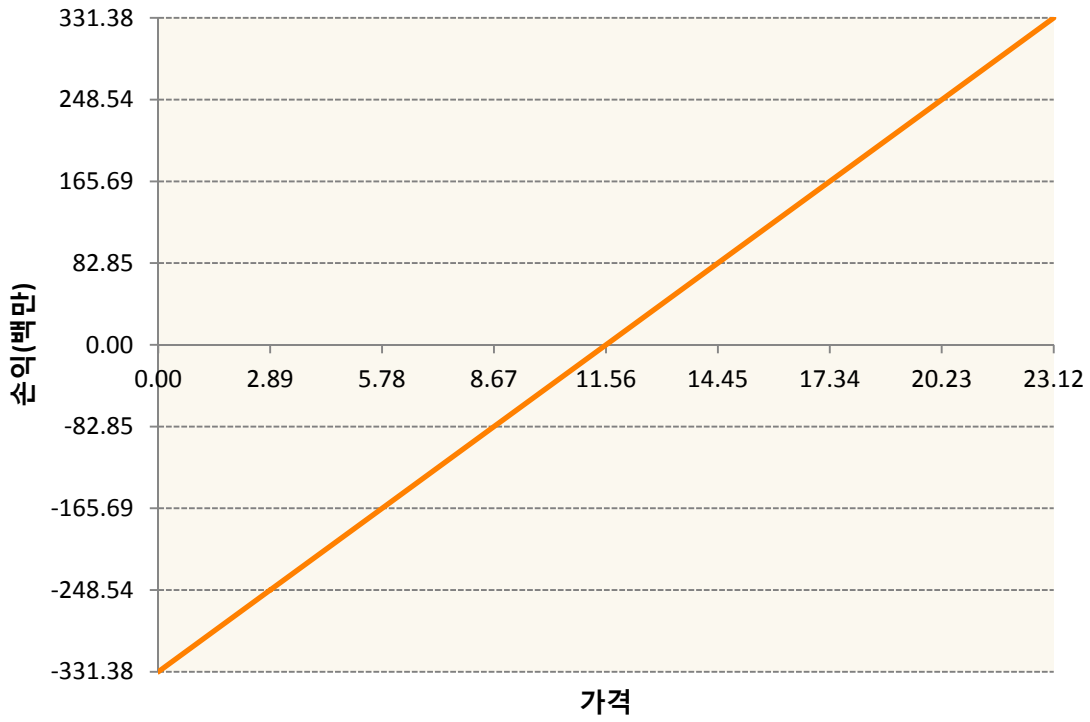
**CN8-CORN FUTURE JUL18**



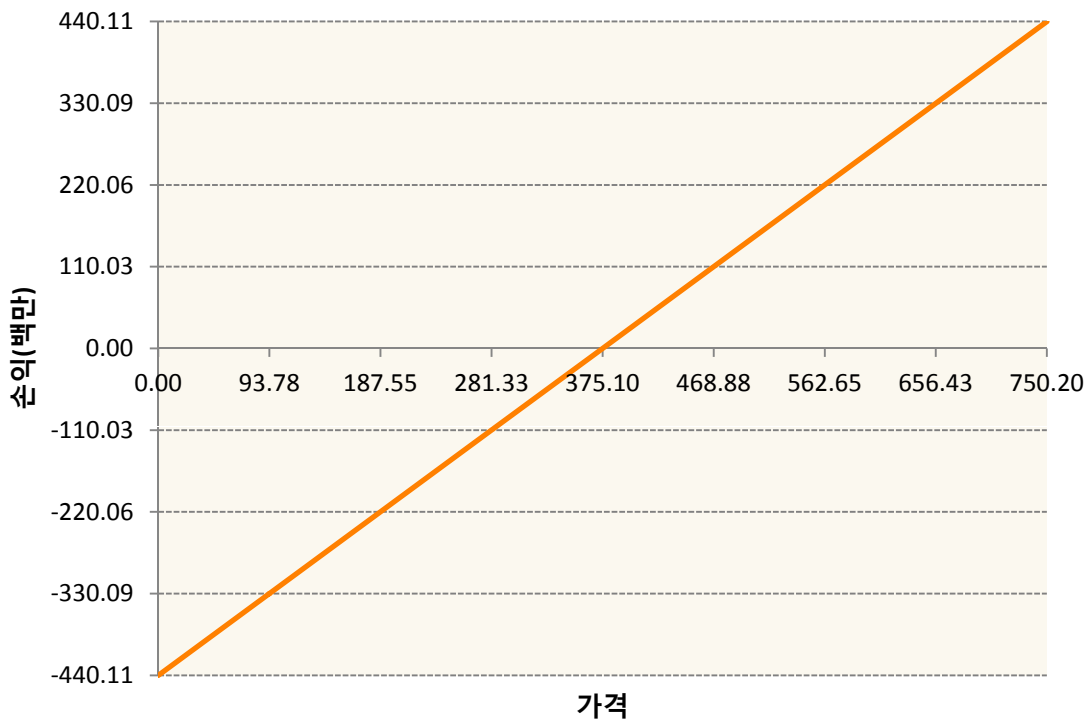




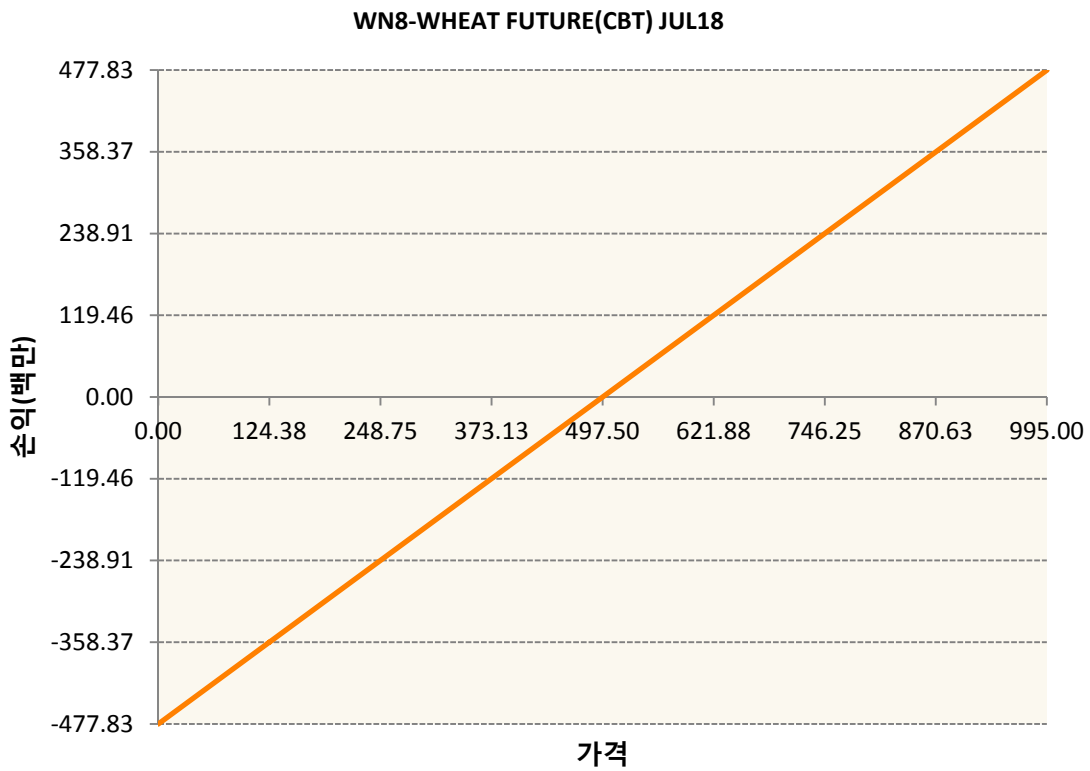
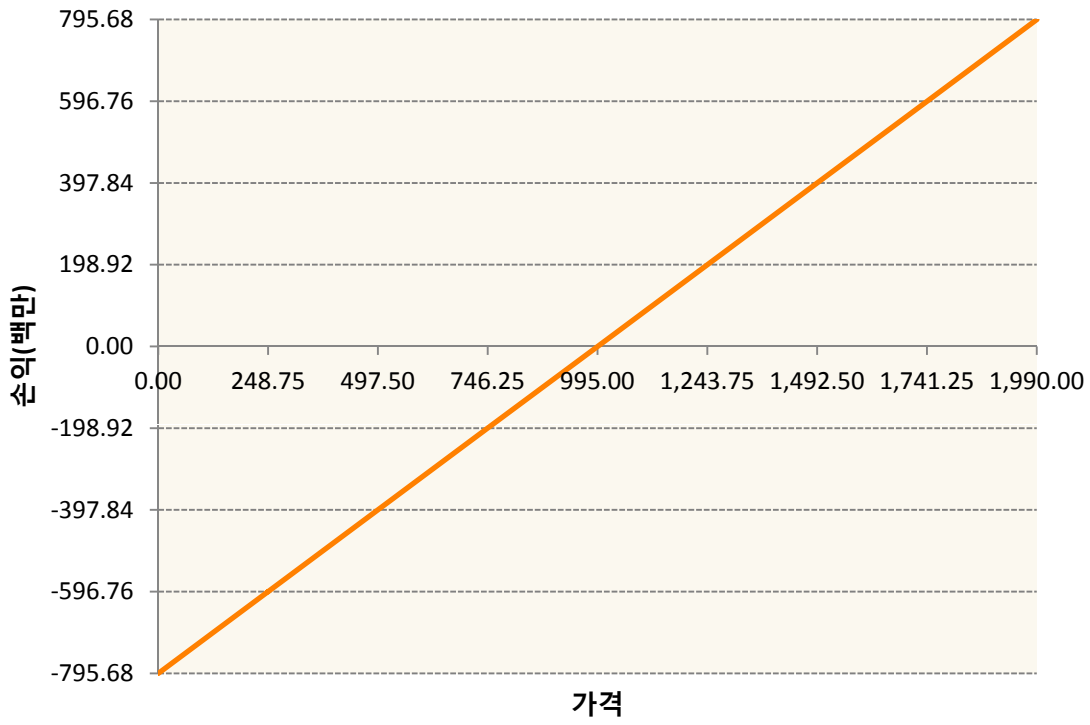
SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18



SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18



SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BON8	SOYBEAN OIL FUTR JUL18	25
CN8	CORN FUTURE JUL18	73
CTN8	COTTON NO.2 FUTR JUL18	18

KCN8	COFFEE 'C' FUTURE JUL18	26
KR4175N60C	2018-06 달러선물	26
KWN8	KC HRW WHEAT FUT JUL18	16
SBN8	SUGAR #11 (WORLD) JUL18	27
SMN8	SOYBEAN MEAL FUTR JUL18	35
SN8	SOYBEAN FUTURE JUL18	64
WN8	WHEAT FUTURE(CBT) JUL18	38

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

(단위:백만원)

**324**