

공시일	2018-05-23
기준일	2018-05-21

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	2018-05-23
기준일	2018-05-21

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

1,120

* 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	2018-05-23
기준일	2018-05-21

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

403

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

429

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-05-23
기준일	2018-05-21

유로인덱스모(주식-파생형)

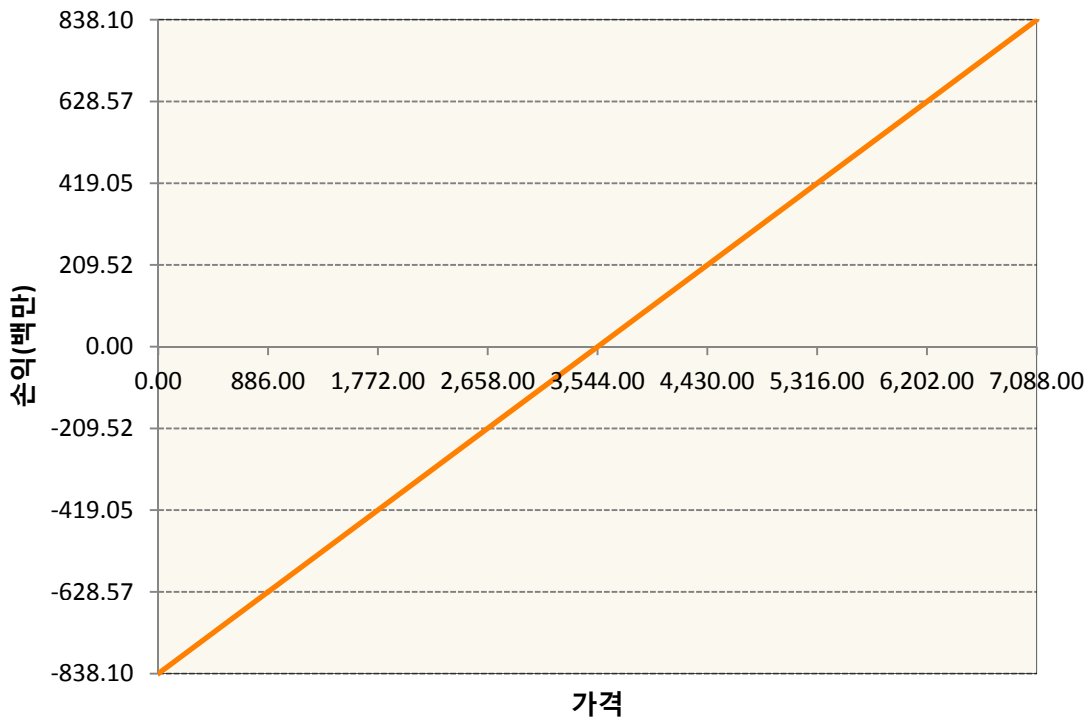
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	838	0	838	

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	2018-05-23
기준일	2018-05-21

차이나인덱스모(주식-파생형)

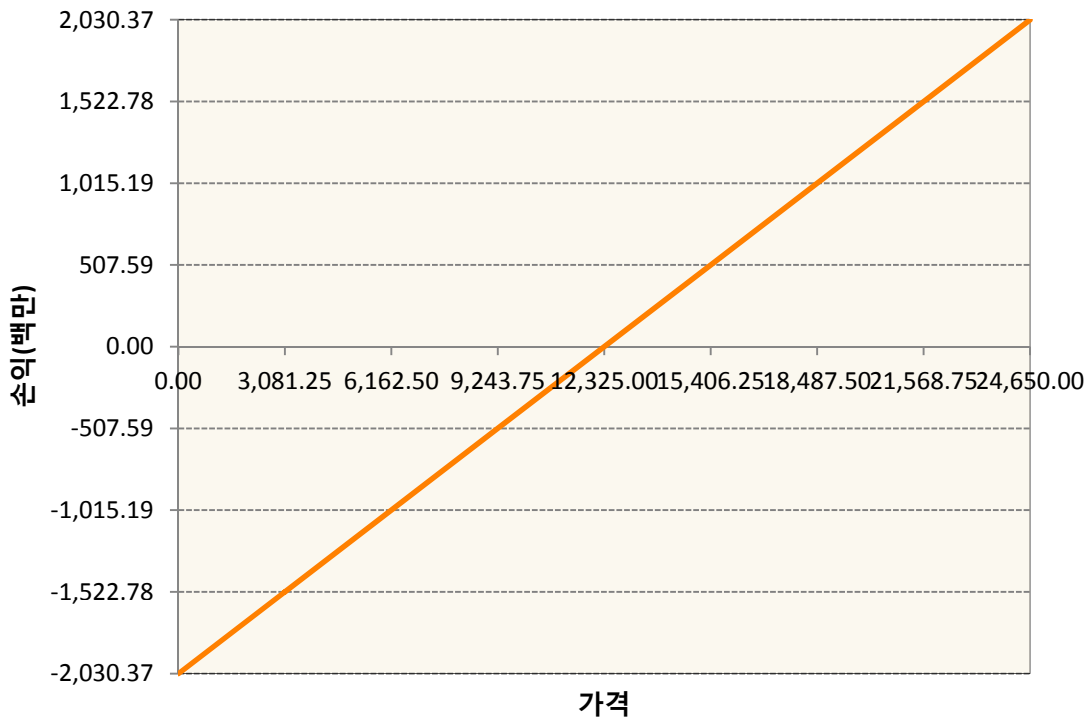
1. 계약금액

(단위:백만원)

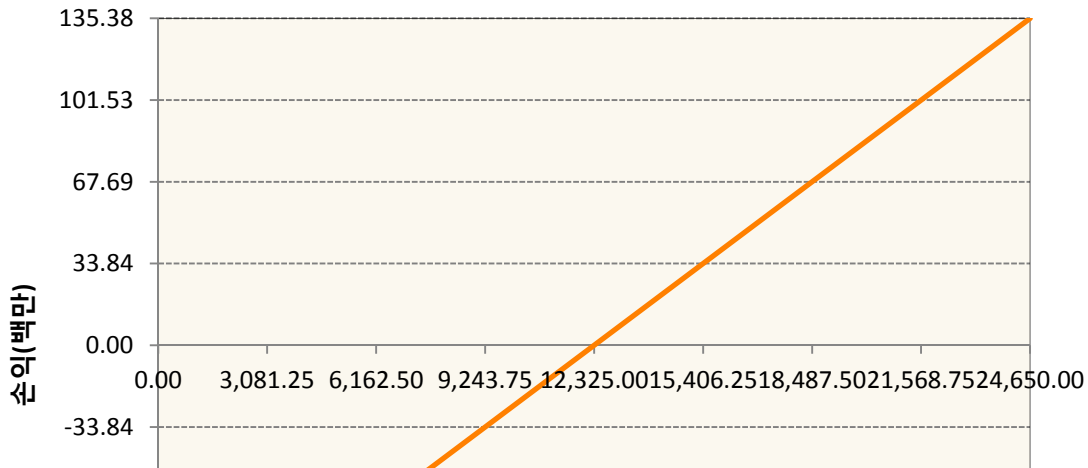
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,166	0	2,166	장내

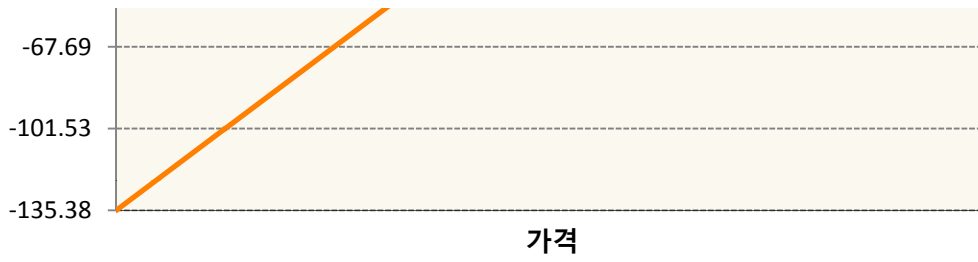
2. 만기시점의 손익구조

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)

152

공시일	2018-05-23
기준일	2018-05-21

커버드콜모(주식혼합-파생형)

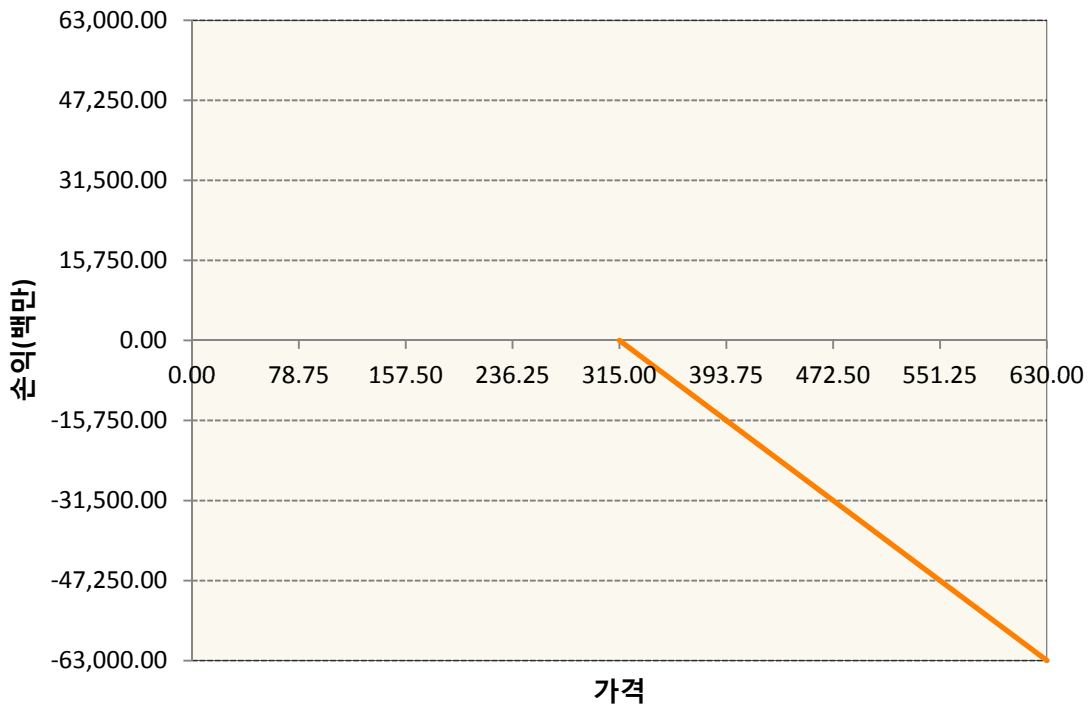
1. 계약금액

(단위:백만원)

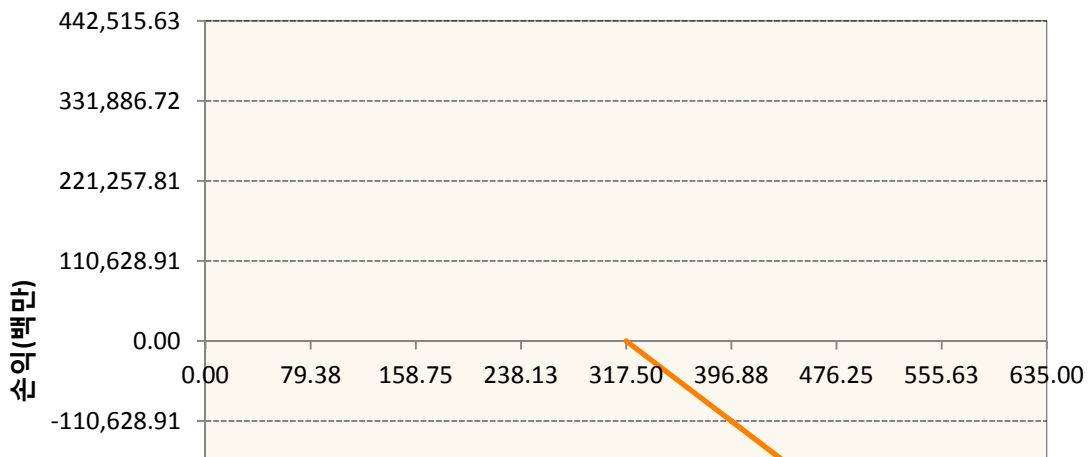
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	813,491	-813,491	장내

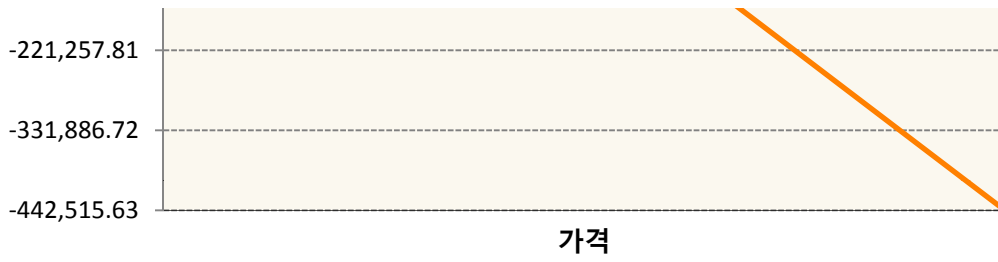
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63159-2018-06 콜315

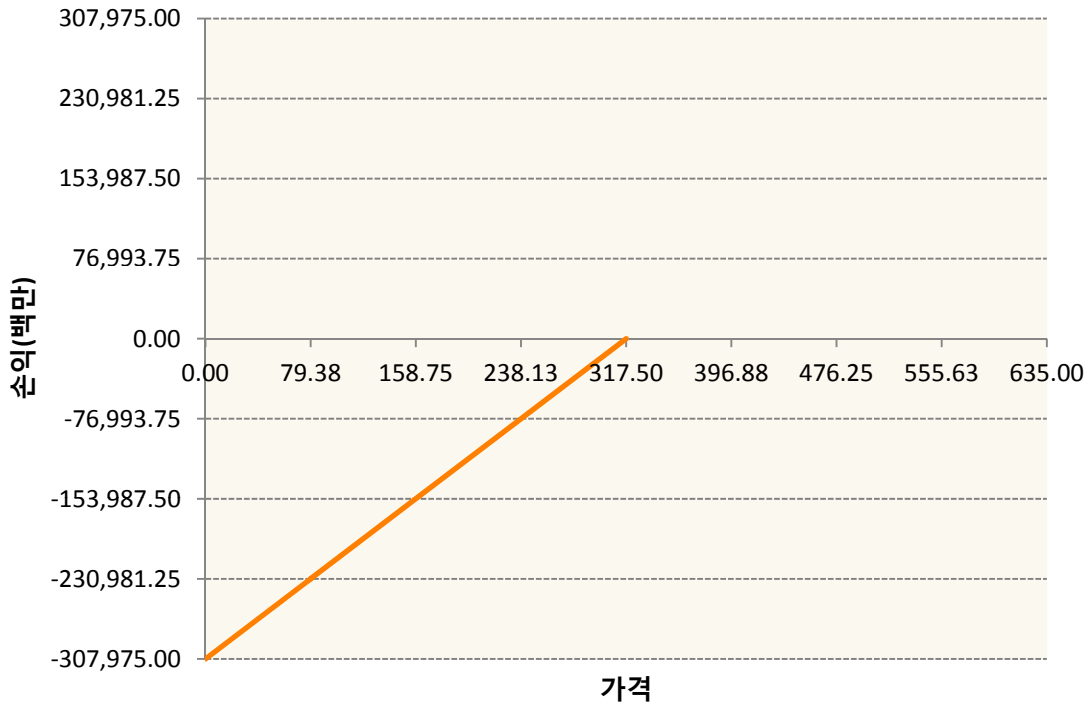


KR4201N63175-2018-06 콜317.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N6312018-06 콜315

3,958

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,842	1,786	1,720	1,645	1,562	1,472	1,376
-5.33%	1,634	1,535	1,428	1,316	1,199	1,078	953
-2.67%	1,198	1,060	920	779	636	493	349
0%	453	302	151	0	-151	-302	-454
2.67%	-614	-747	-884	-1,023	-1,165	-1,308	-1,452
5.33%	-1,949	-2,045	-2,151	-2,263	-2,380	-2,503	-2,630
8.00%	-3,465	-3,522	-3,592	-3,671	-3,759	-3,855	-3,958

KR4201N6312018-06 콜317.5

26,521

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,349	11,032	10,641	10,182	9,664	9,093	8,477

-5.33%	10,220	9,612	8,943	8,224	7,464	6,670	5,849
-2.67%	7,700	6,798	5,871	4,925	3,965	2,993	2,012
0%	3,172	2,115	1,058	0	-1,058	-2,116	-3,173
2.67%	-3,613	-4,607	-5,615	-6,633	-7,660	-8,693	-9,731
5.33%	-12,406	-13,170	-13,984	-14,839	-15,725	-16,638	-17,572
8.00%	-22,640	-23,127	-23,692	-24,323	-25,010	-25,745	-26,521

KR4301N6312018-06 풋317.5

21,170

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21,103	-21,104	-21,107	-21,113	-21,125	-21,143	-21,170
-5.33%	-12,951	-12,975	-13,014	-13,068	-13,140	-13,229	-13,335
-2.67%	-5,120	-5,279	-5,460	-5,660	-5,876	-6,104	-6,344
0%	986	658	329	0	-330	-660	-990
2.67%	3,877	3,647	3,401	3,141	2,871	2,592	2,306
5.33%	4,544	4,484	4,402	4,298	4,174	4,030	3,868
8.00%	4,611	4,605	4,592	4,570	4,536	4,489	4,428

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

(단위:백만원)

53,209

공시일	2018-05-23
기준일	2018-05-21

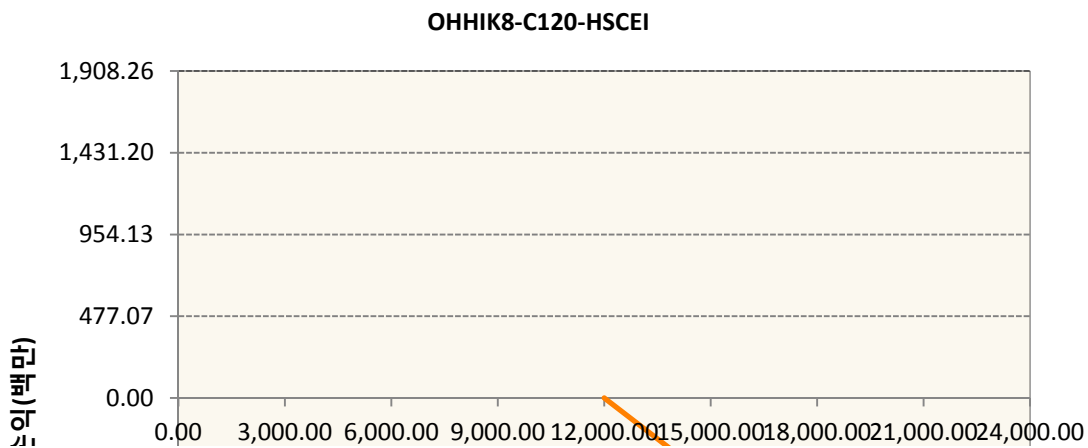
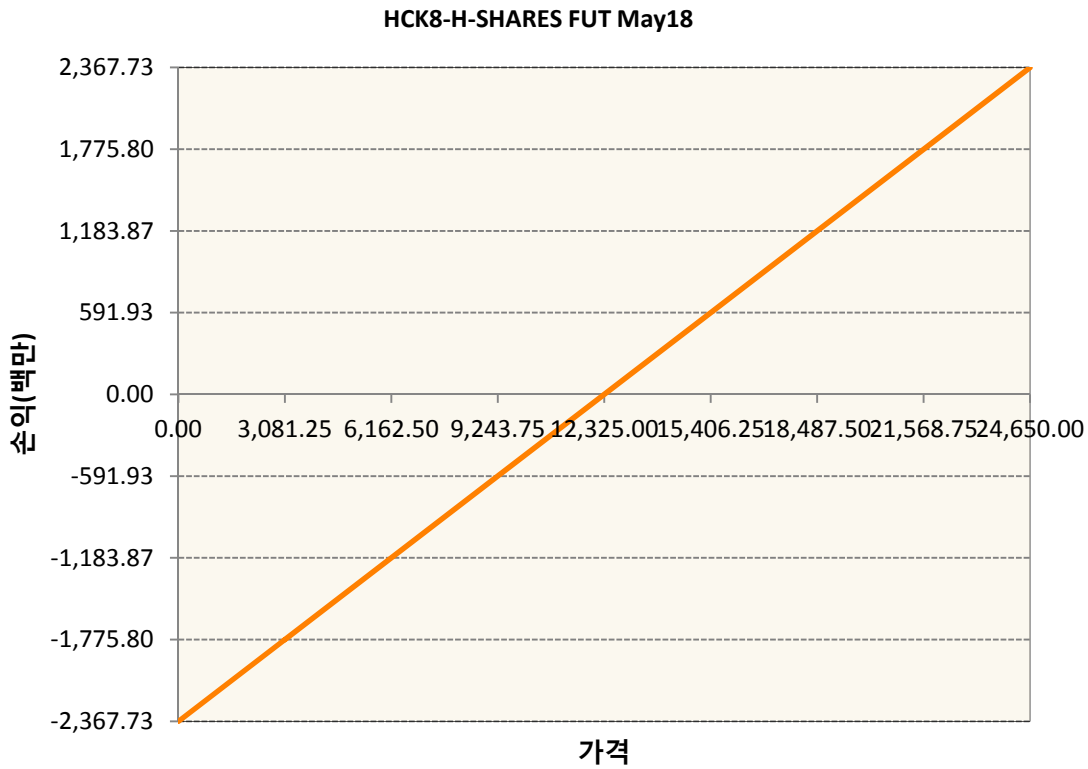
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

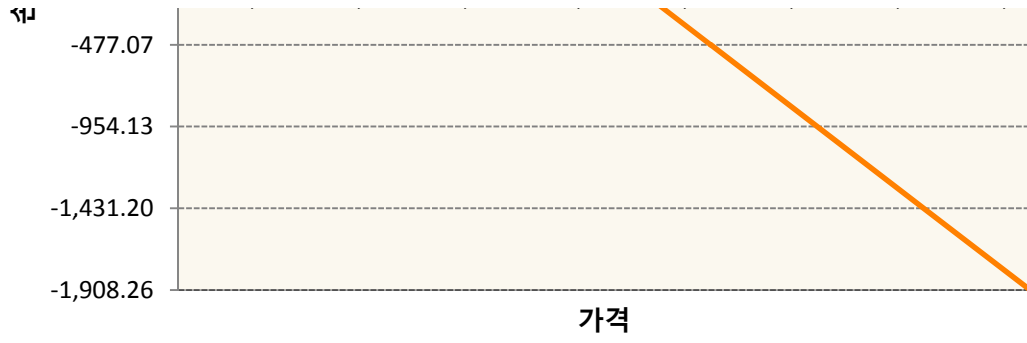
1. 계약금액

(단위:백만원)

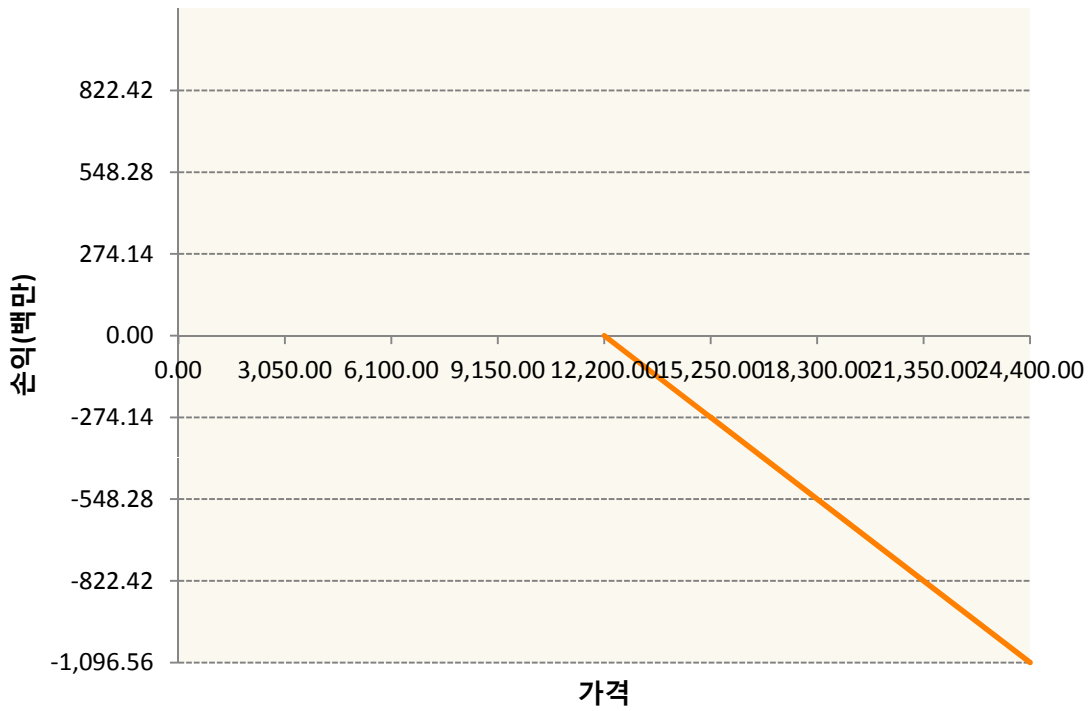
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,368	0	2,368	장내
누계	유가증권	옵션	0	6,010	-6,010	장내

2. 만기시점의 손익구조

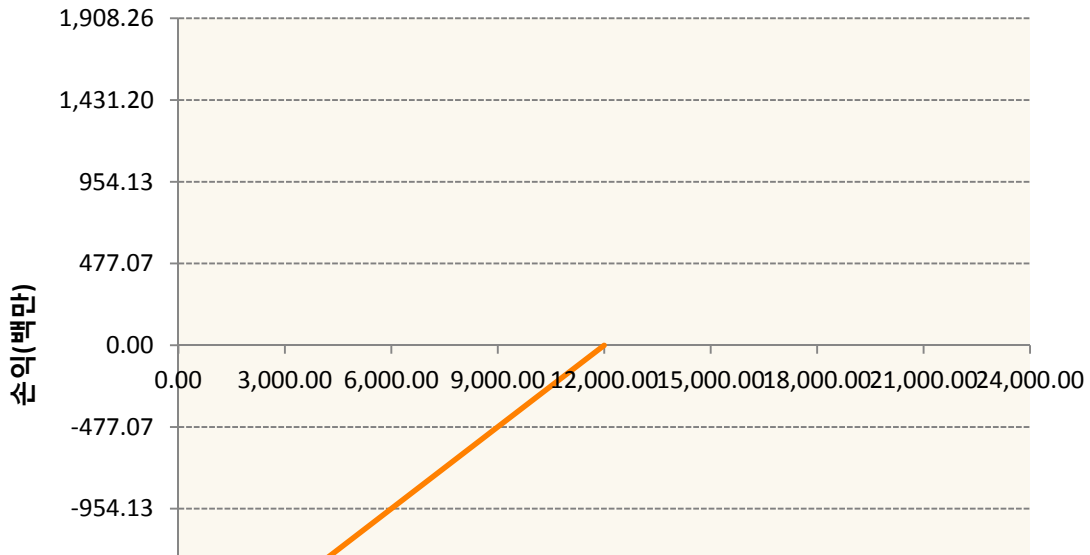


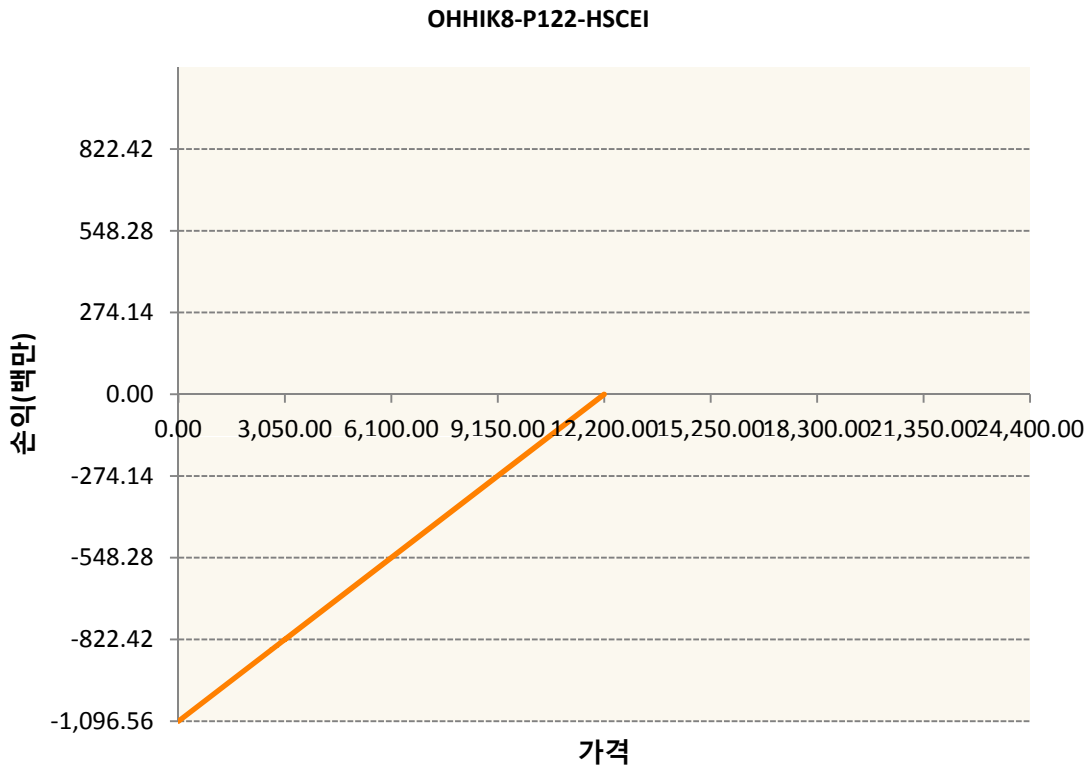
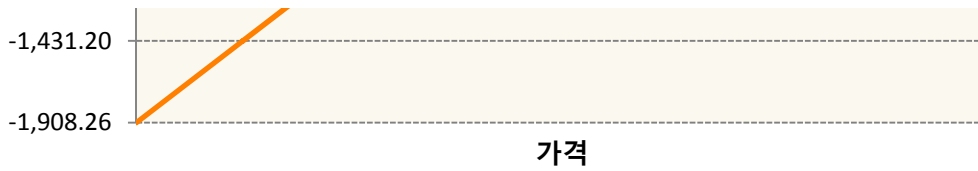


OHHIK8-C122-HSCEI



OHHIK8-P120-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCK8	H-SHARES FUT May18	189
OHHIK8-C12	HSCEI	153
OHHIK8-C12	HSCEI	88
OHHIK8-P12	HSCEI	153
OHHIK8-P12	HSCEI	88

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	589

공시일	2018-05-23
기준일	2018-05-21

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

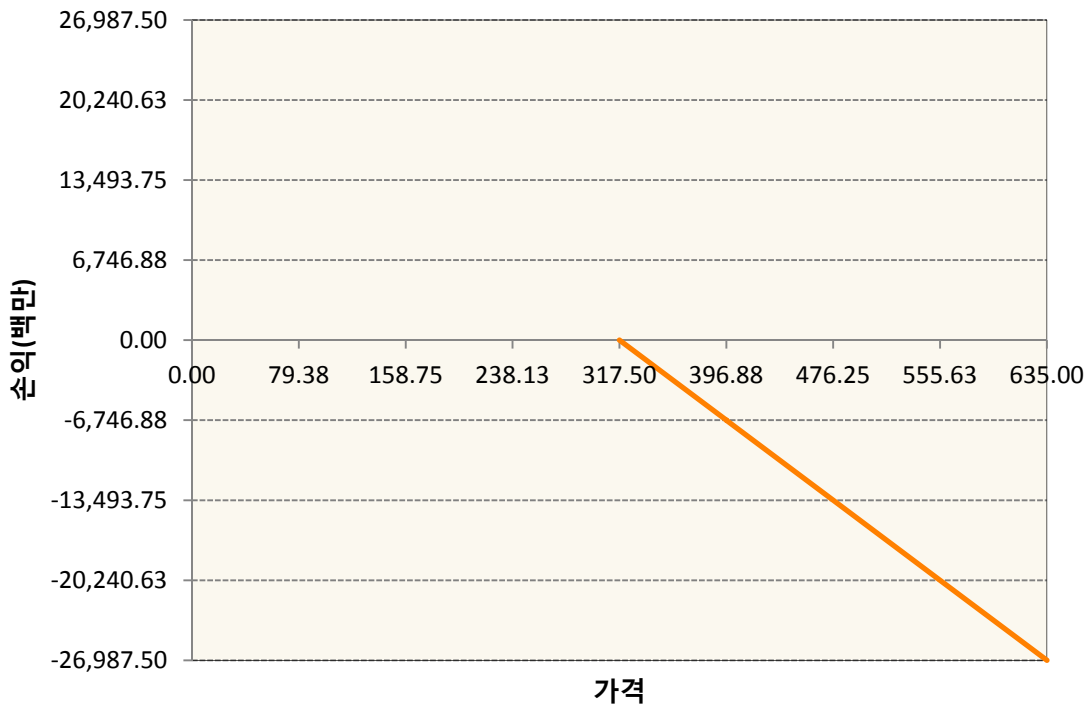
1. 계약금액

(단위:백만원)

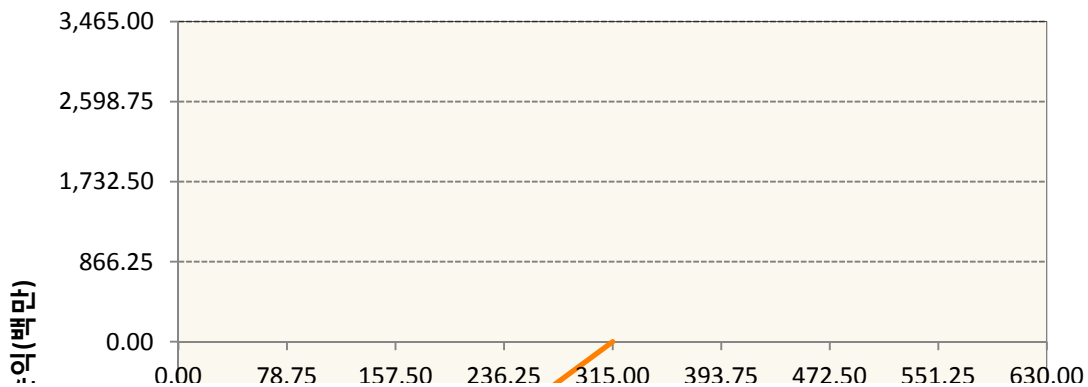
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	46,804	-46,804	장내

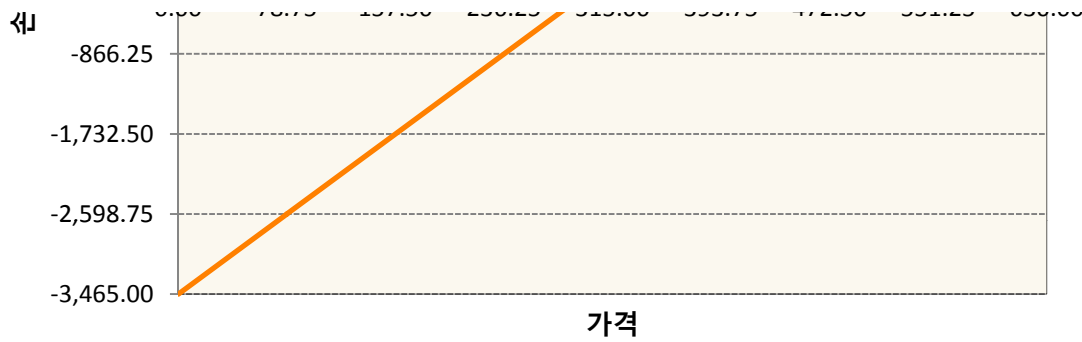
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63175-2018-06 콜317.5

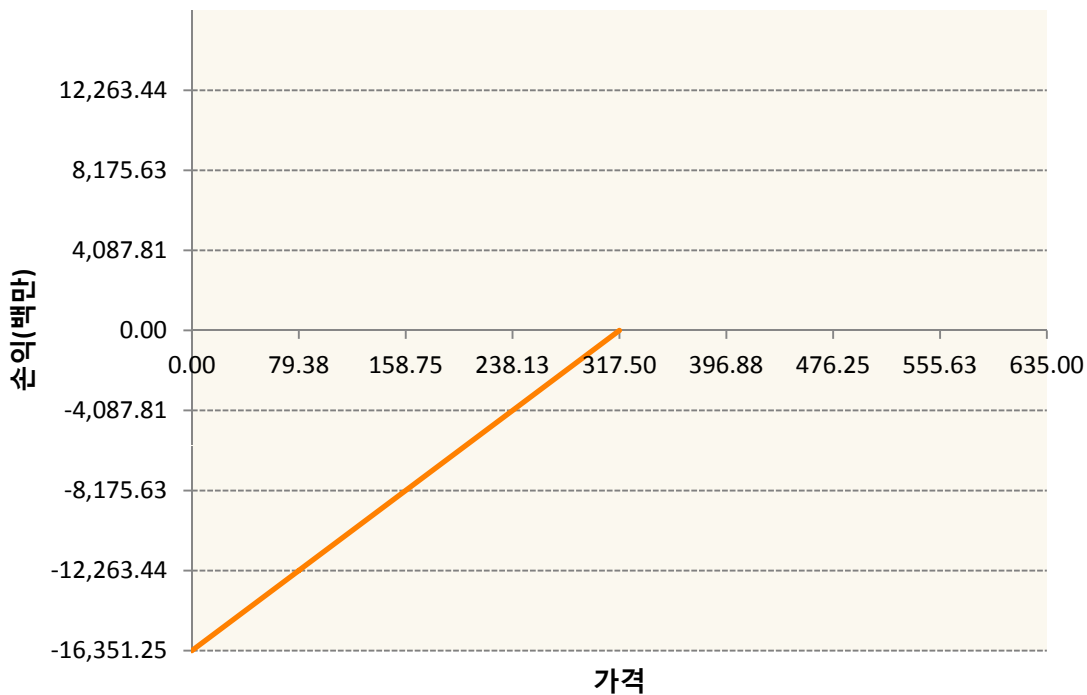


KR4301N63157-2018-06 풋315





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,481	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,481	-1,481	-1,481	-1,481	-1,481	-1,481	-1,481	
-5.33%	-987	-987	-987	-987	-987	-987	-987	
-2.67%	-494	-494	-494	-494	-494	-494	-494	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	494	494	494	494	494	494	494	
5.33%	987	987	987	987	987	987	987	
8.00%	1,481	1,481	1,481	1,481	1,481	1,481	1,481	
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							280	
	기초자산의 변동성							

0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	214	214	214	214	214	214	214
5.33%	427	427	427	427	427	427	427
8.00%	641	641	641	641	641	641	641

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12 480

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-480	-480	-480	-480	-480	-480	-480
-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%	480	480	480	480	480	480	480

KR4201N6312018-06 콜317.5 1,617

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	692	673	649	621	589	555	517
-5.33%	623	586	545	502	455	407	357
-2.67%	470	415	358	300	242	183	123
0%	193	129	64	0	-65	-129	-194
2.67%	-220	-281	-342	-405	-467	-530	-593
5.33%	-757	-803	-853	-905	-959	-1,015	-1,072
8.00%	-1,381	-1,410	-1,445	-1,483	-1,525	-1,570	-1,617

KR4301N6312018-06 풋315 227

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-226	-226	-226	-226	-226	-227	-227
-5.33%	-134	-134	-135	-136	-137	-138	-140
-2.67%	-48	-51	-53	-56	-59	-62	-65
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	34	32	30	28	25	22	20
5.33%	38	38	37	36	35	34	33
8.00%	38	38	38	38	38	38	37

KR4301N6312018-06 풋317.5 1,124

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,120	-1,120	-1,121	-1,121	-1,122	-1,123	-1,124
-5.33%	-688	-689	-691	-694	-698	-702	-708
-2.67%	-272	-280	-290	-301	-312	-324	-337
0%	52	35	17	0	-18	-35	-53
2.67%	206	194	181	167	152	138	122
5.33%	241	238	234	228	222	214	205
8.00%	245	244	244	243	241	238	235

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

(단위:백만원)

6,928

공시일	2018-05-23
기준일	2018-05-21

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

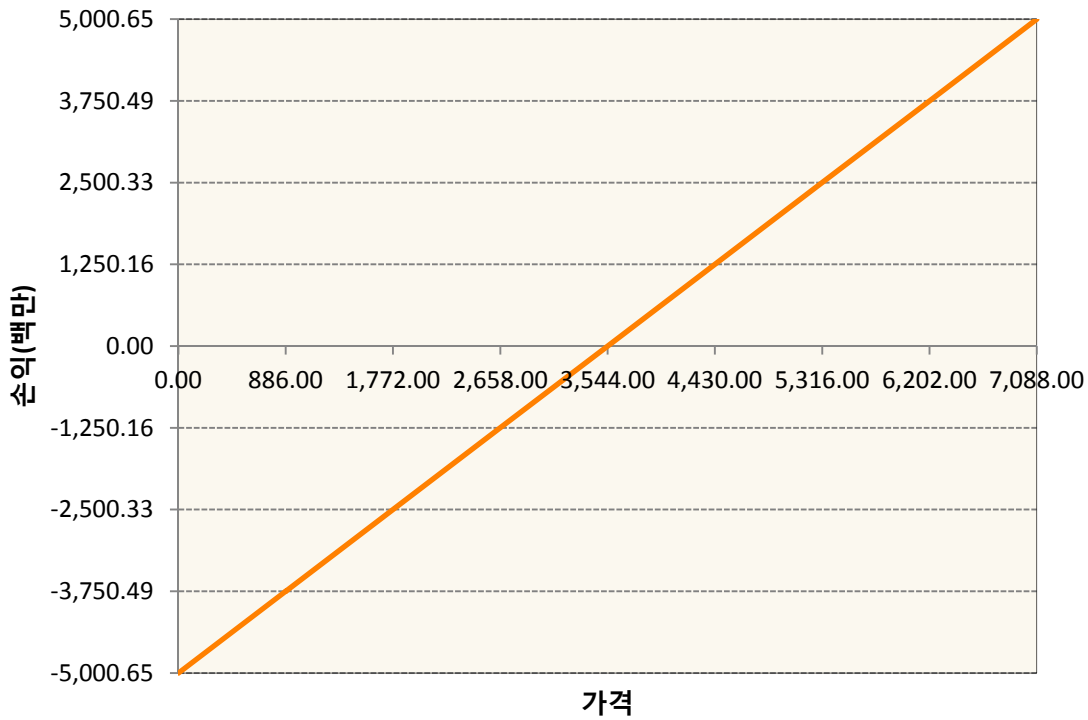
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	8	-8	장외
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,001	0	5,001	
누계	유가증권	스왑	53,665	0	53,665	장외
누계	지수	스왑	50,915	0	50,915	장외

2. 만기시점의 손익구조

VGM8-EURO STOXX 50 JUN18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	66
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	69
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18	400

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

(단위:백만원)

1,165

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	2018-05-23
기준일	2018-05-21

스마트KRX300인덱스목표전환형1

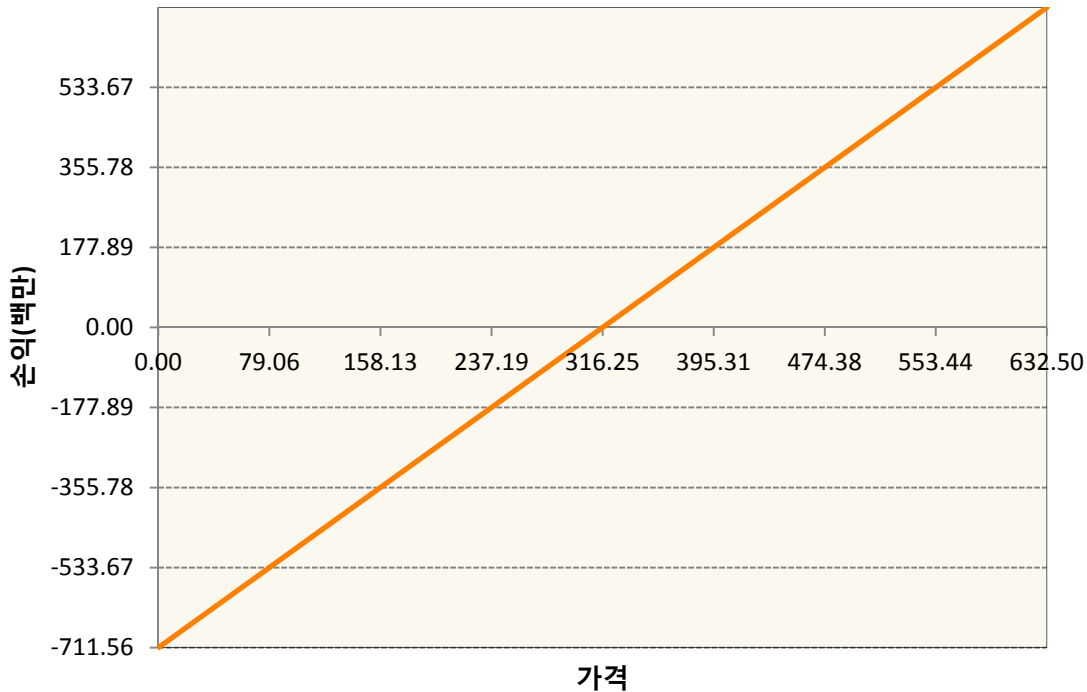
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	712	0	712	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	2018-05-23
기준일	2018-05-21

리디파인K200(주식혼합-파생재간

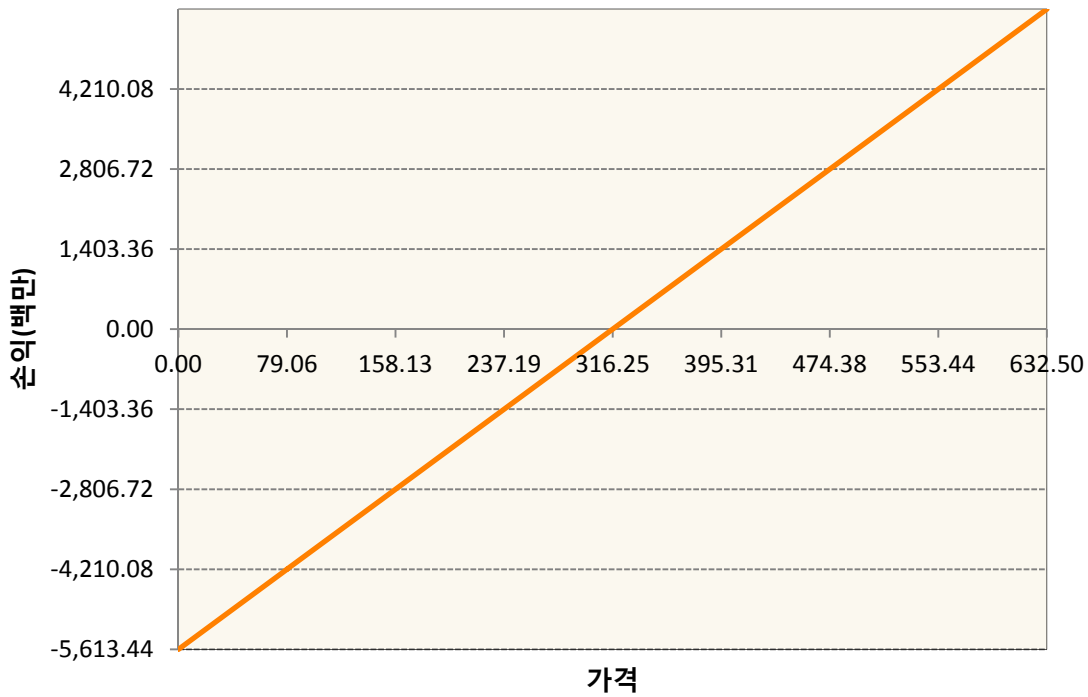
1. 계약금액

(단위:백만원)

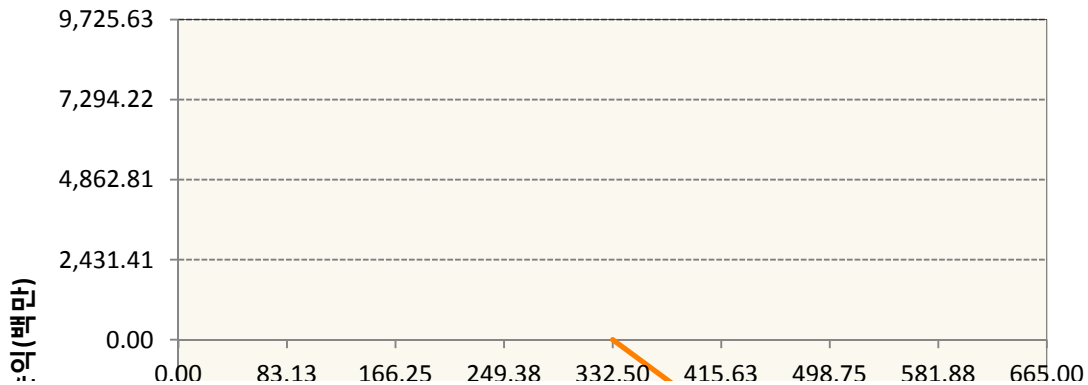
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	158	0	158	장내
신규	유가증권	옵션	0	250	-250	장내
누계	유가증권	선물	5,613	0	5,613	장내
누계	유가증권	옵션	1,270	9,726	-8,456	장내

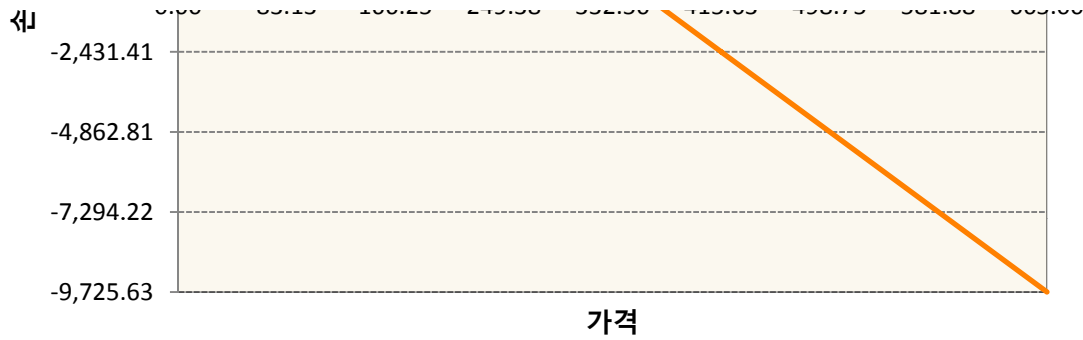
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물



KR4201N63324-2018-06 콜332.5





가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	98	96	94	91	86	80	74
-5.33%	94	90	84	77	69	59	48
-2.67%	81	72	62	50	36	22	7
0%	50	34	18	0	-18	-37	-56
2.67%	-14	-35	-57	-79	-100	-123	-145
5.33%	-121	-144	-167	-191	-214	-237	-261
8.00%	-272	-293	-315	-337	-359	-381	-404

KR4301N6312018-06 풋317.5

87

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	87	87	87	87	87	87	87
-5.33%	53	54	54	54	54	55	55
-2.67%	21	22	23	23	24	25	26
0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-16	-15	-14	-13	-12	-11	-10
5.33%	-19	-18	-18	-18	-17	-17	-16
8.00%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-18

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

(단위:백만원)

700

공시일	2018-05-23
기준일	2018-05-21

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

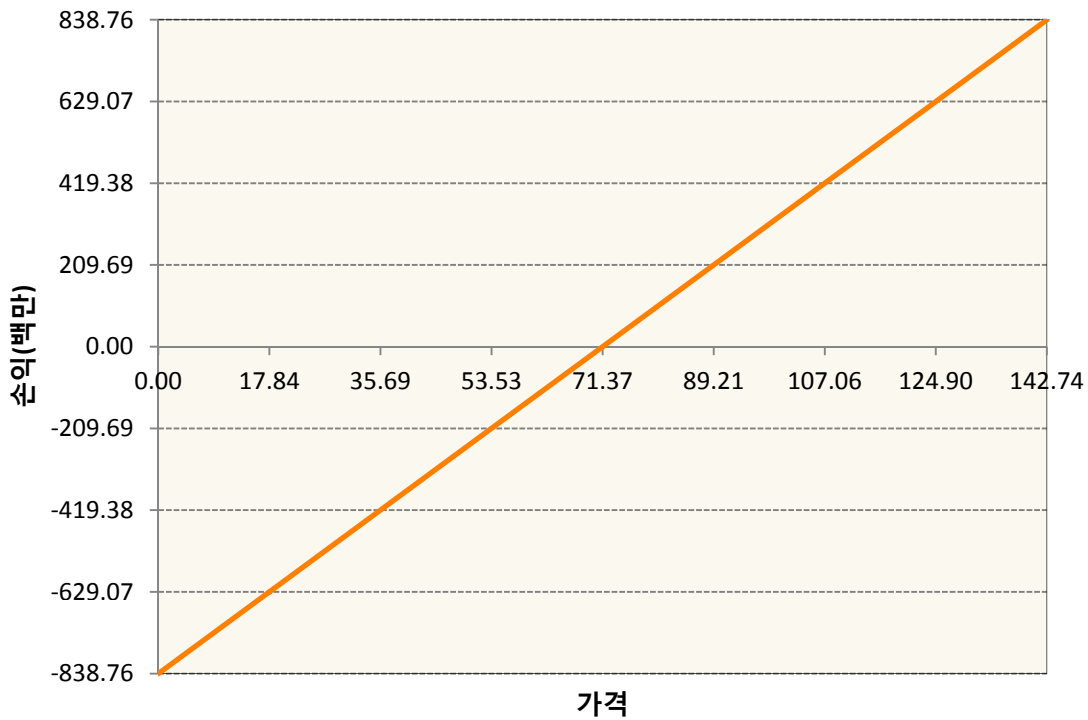
1. 계약금액

(단위:백만원)

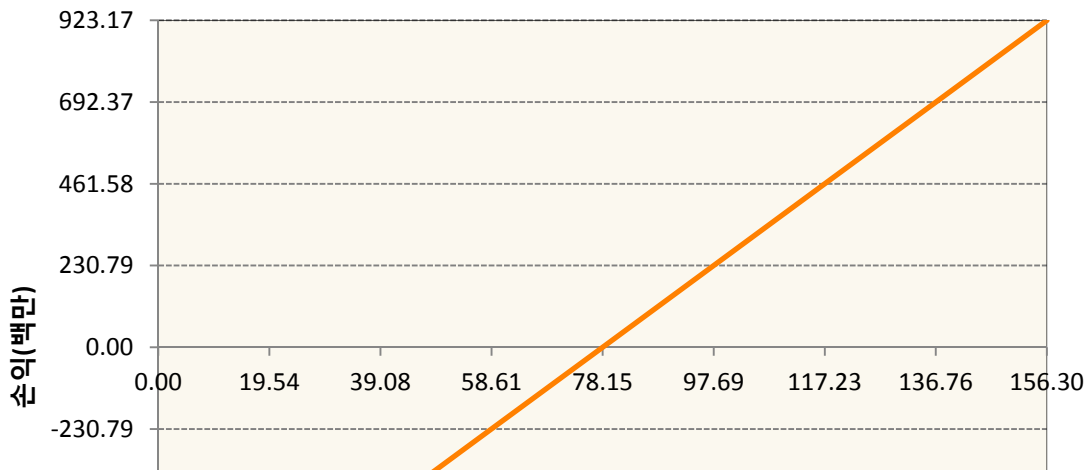
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,945	596	3,349	

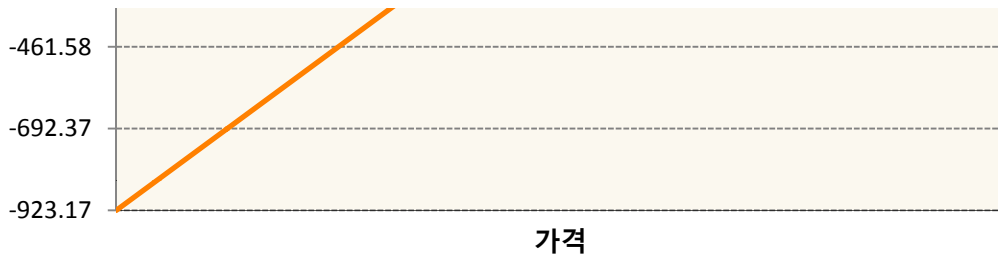
2. 만기시점의 손익구조

CLN8-WTI CRUDE FUTURE JUL18

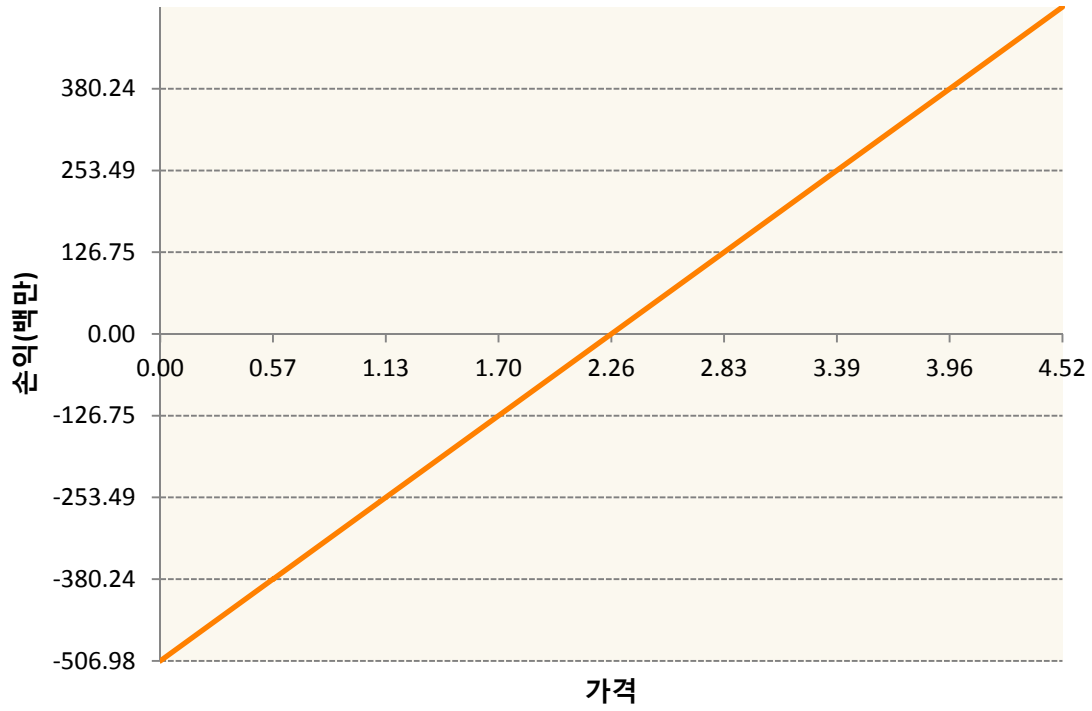


COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18

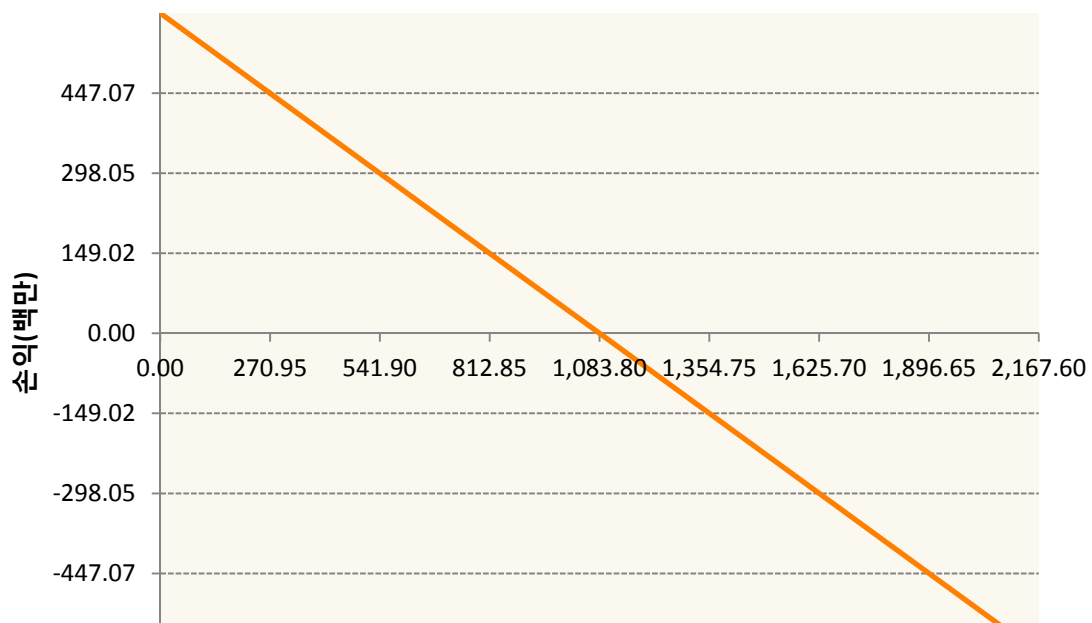


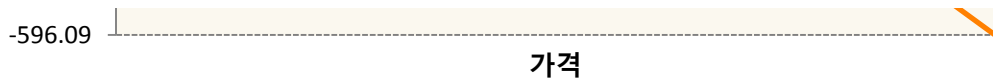


HON8-NY Harb ULSD Fut JUL18

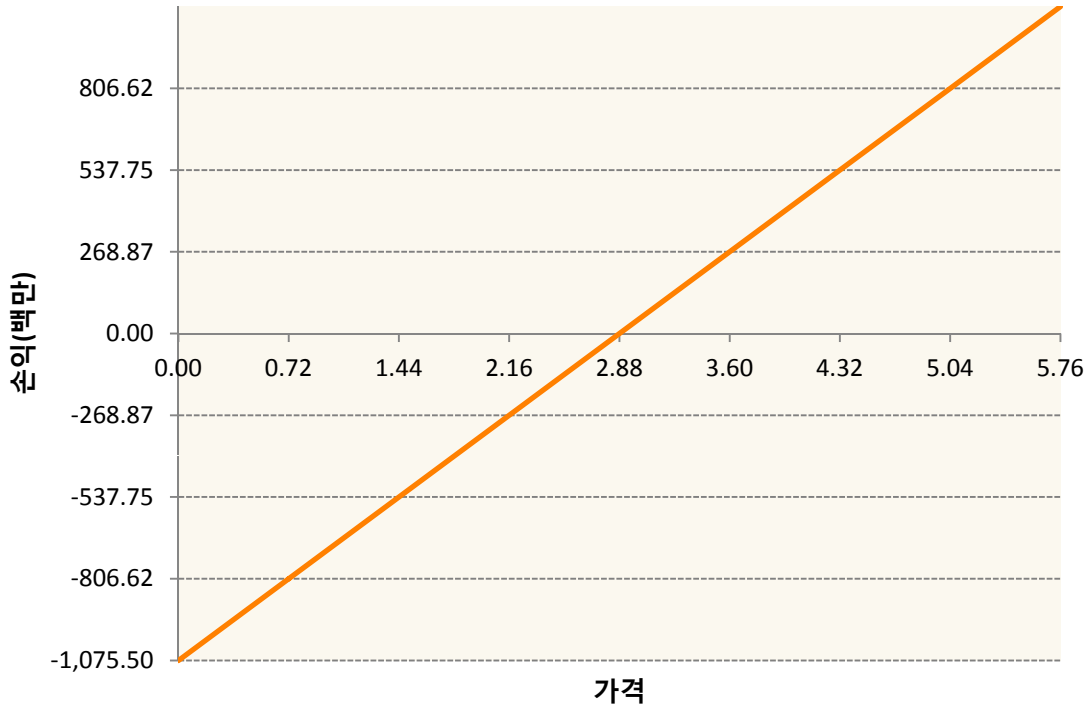


KR4175N60003-2018-06 달러선물

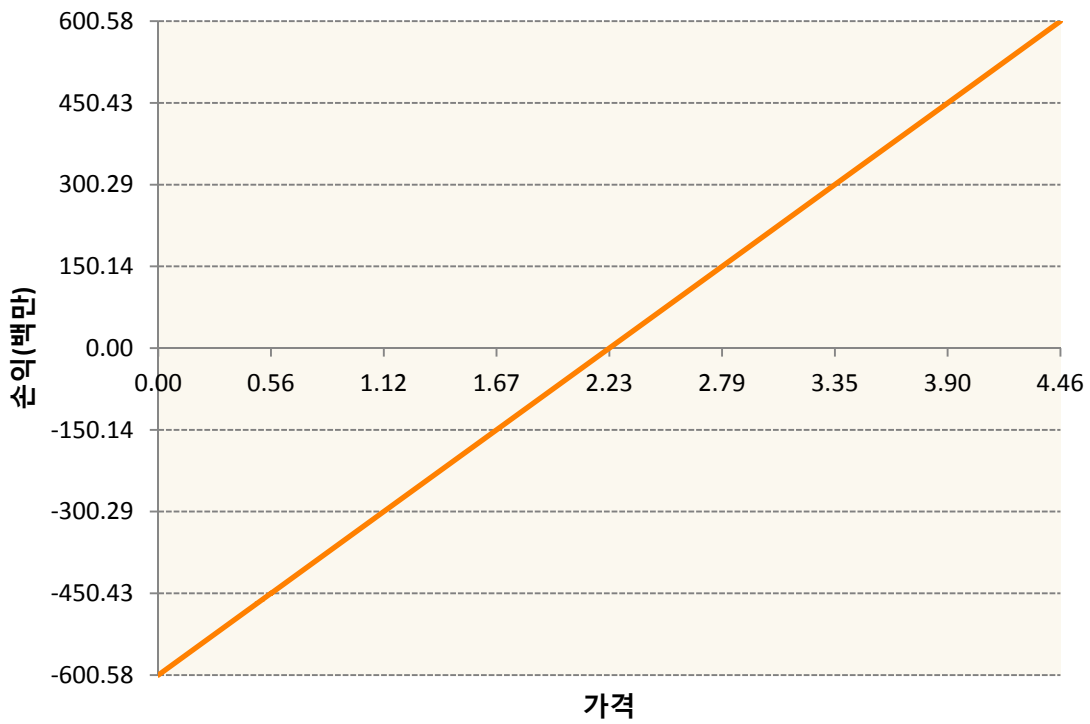




NGN8-NATURAL GAS FUTR JUL18



XBN8-GASOLINE RBOB FUT JUL18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN8	WTI CRUDE FUTURE JUL18	67
COU8	BRENT CRUDE FUTR SEP18	74
HON8	NY Harb ULSD Fut JUL18	41
KR4175N60C	2018-06 달러선물	48
NGN8	NATURAL GAS FUTR JUL18	86
XBN8	GASOLINE RBOB FUT JUL18	48

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

476

공시일	2018-05-23
기준일	2018-05-21

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

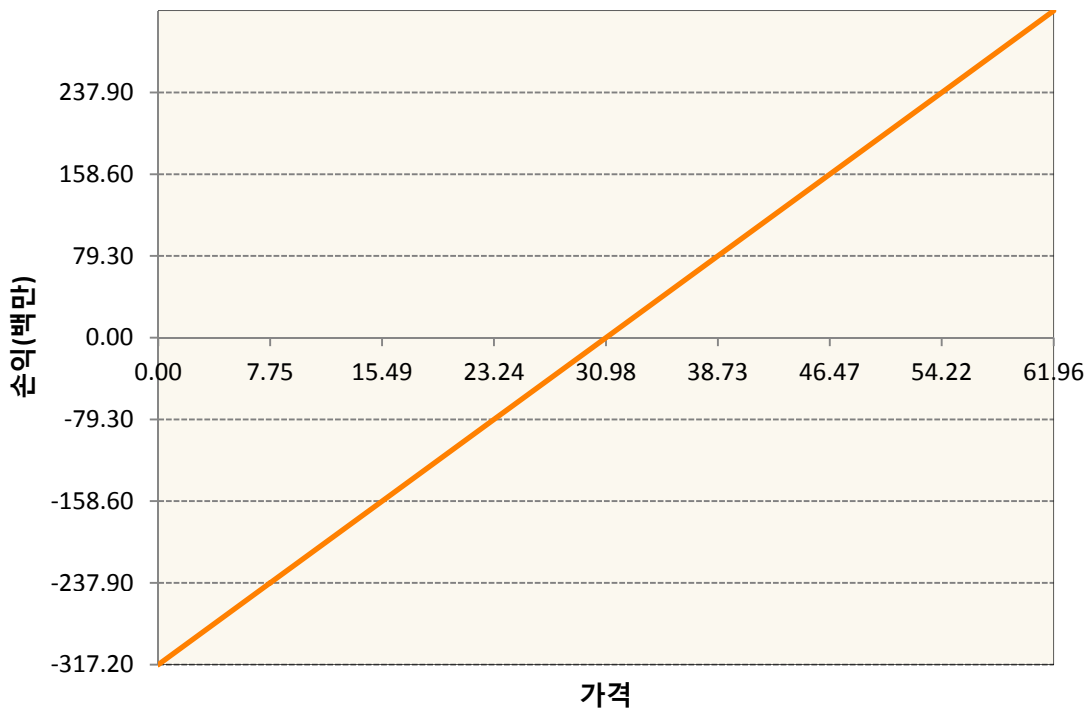
1. 계약금액

(단위:백만원)

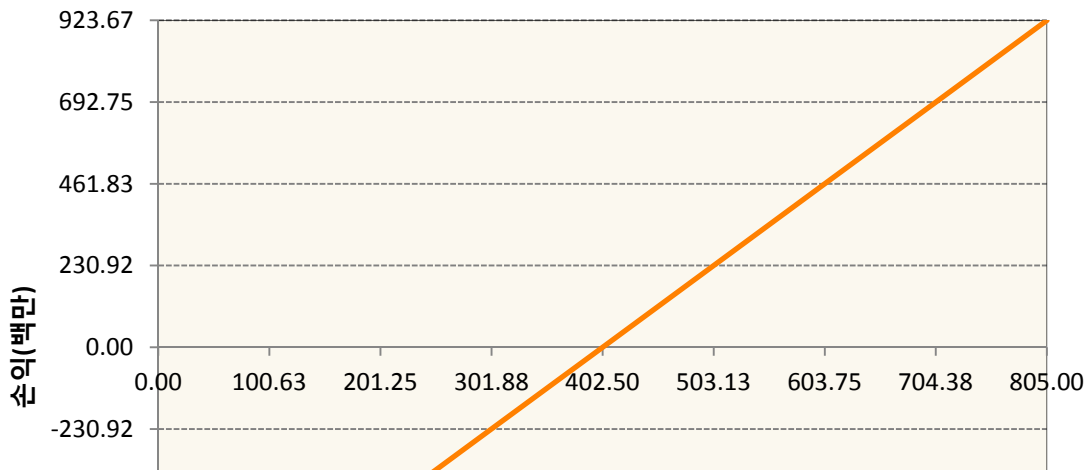
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,076	325	3,751	

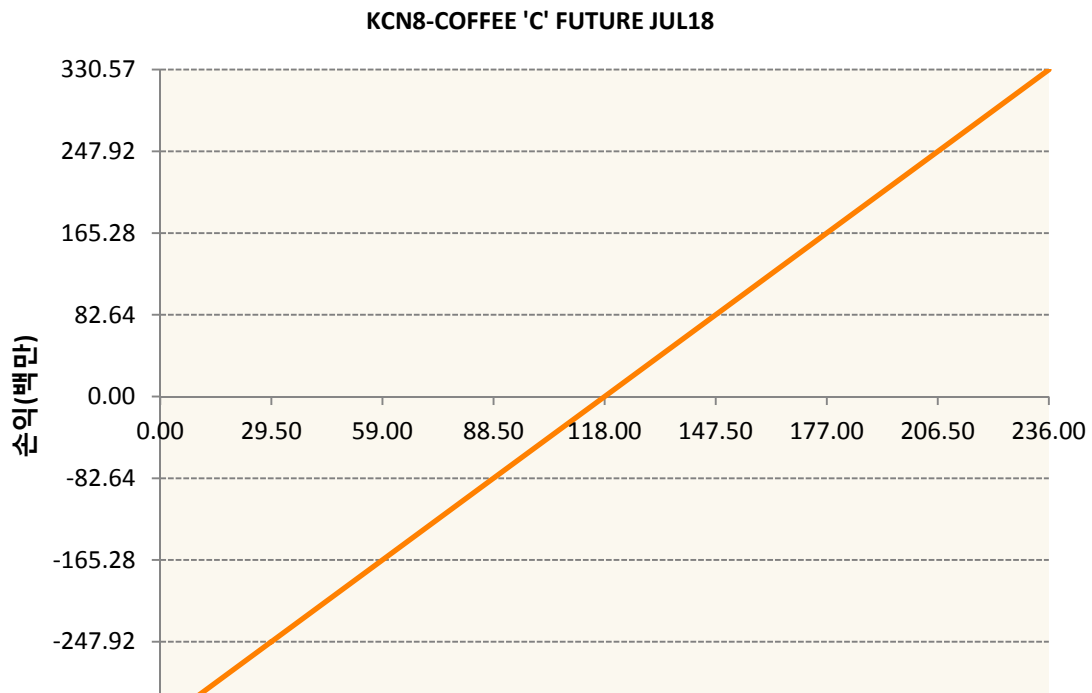
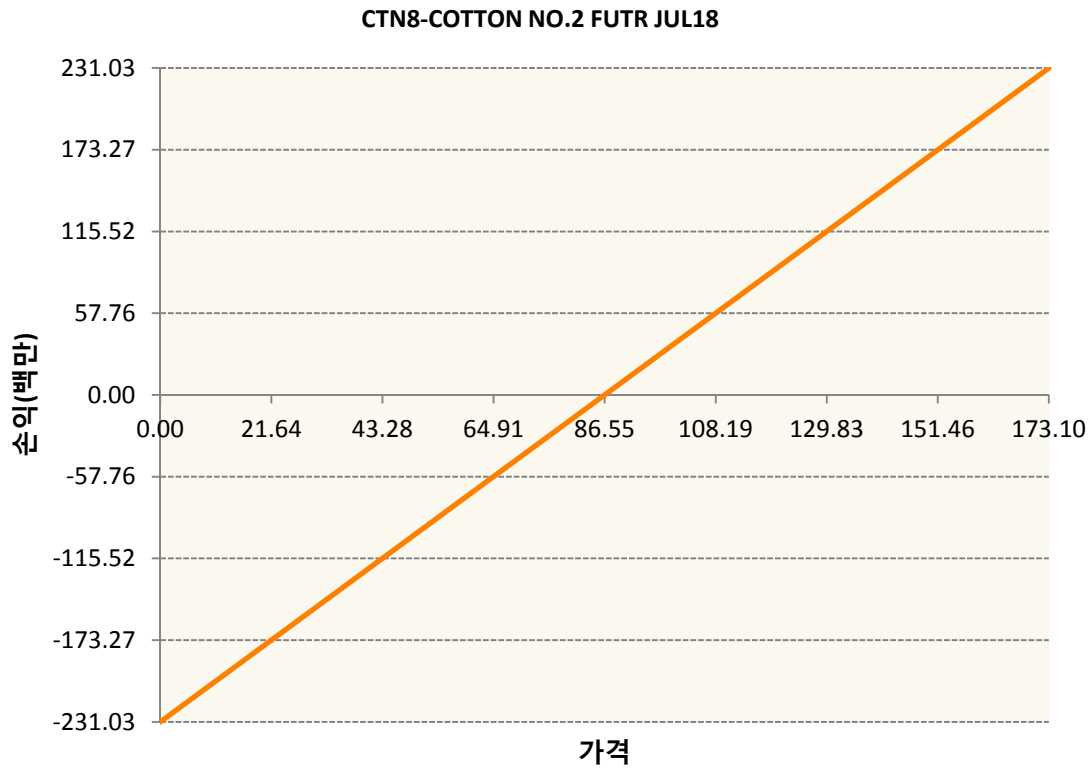
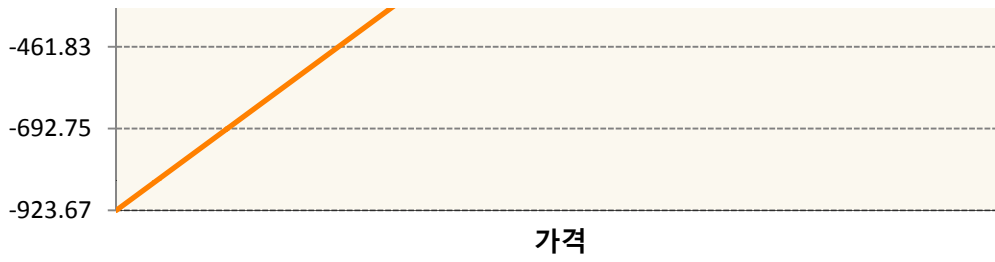
2. 만기시점의 손익구조

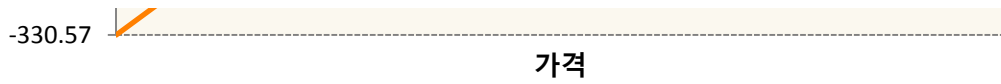
BON8-SOYBEAN OIL FUTR JUL18



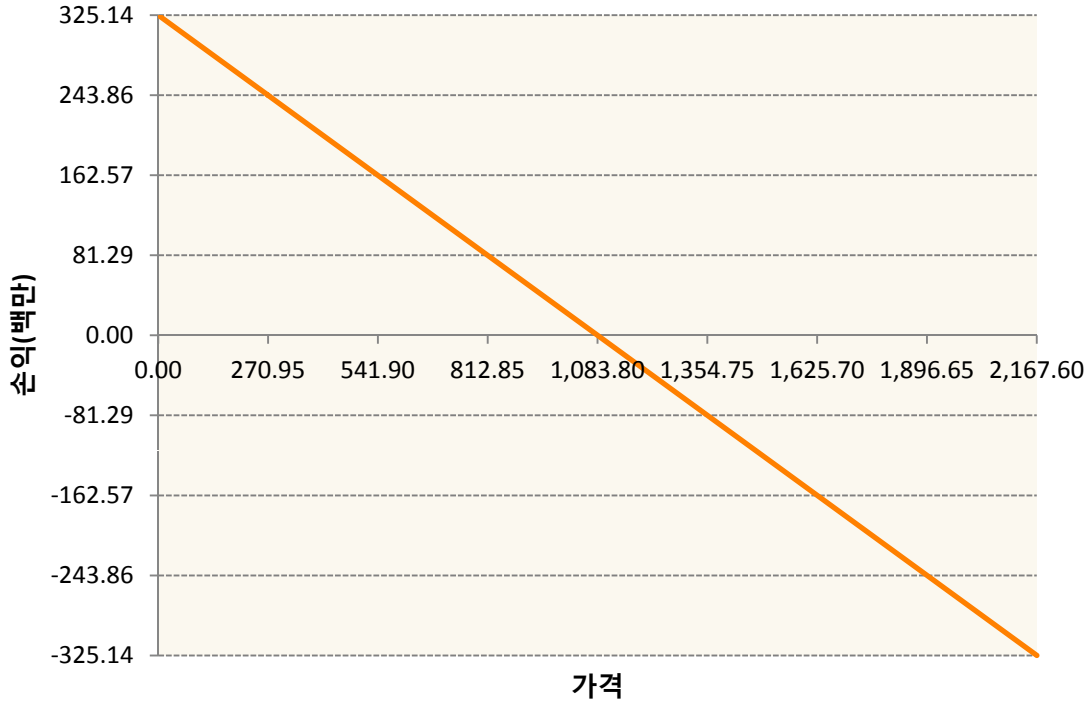
CN8-CORN FUTURE JUL18



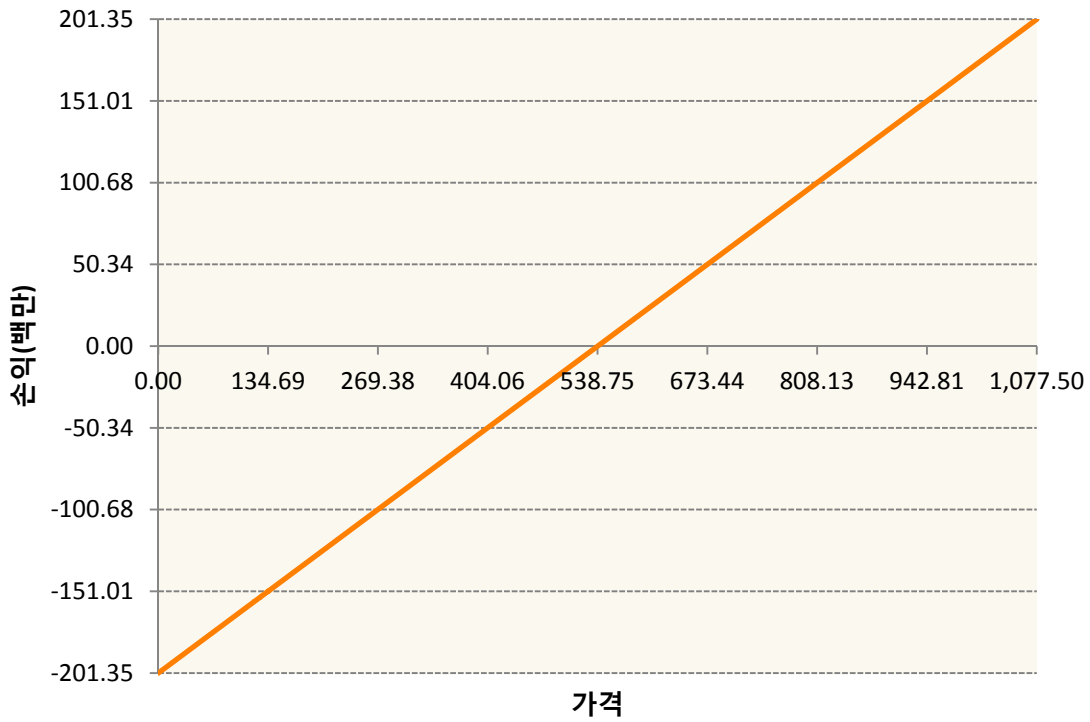




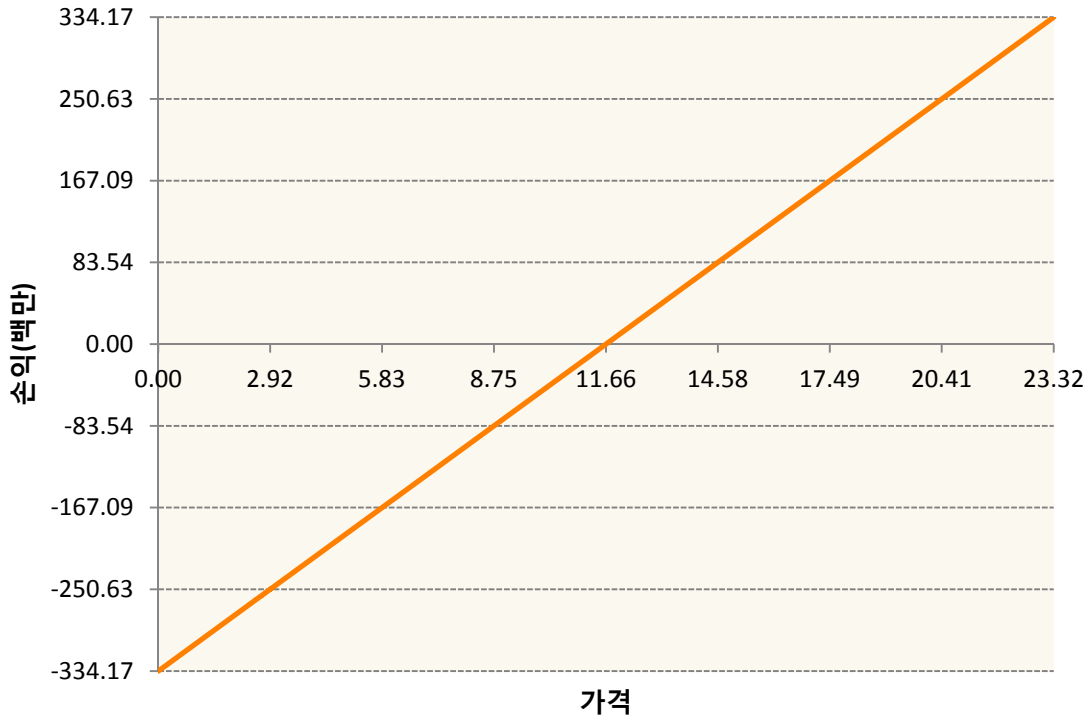
KR4175N60003-2018-06 달러선물



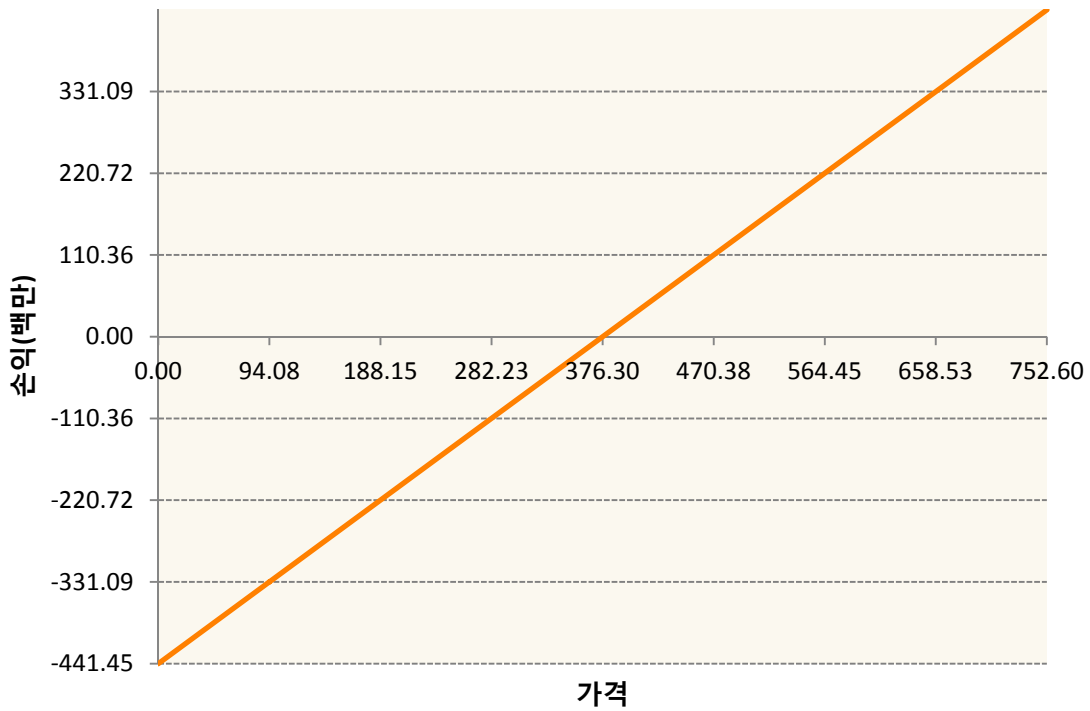
KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18



SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18

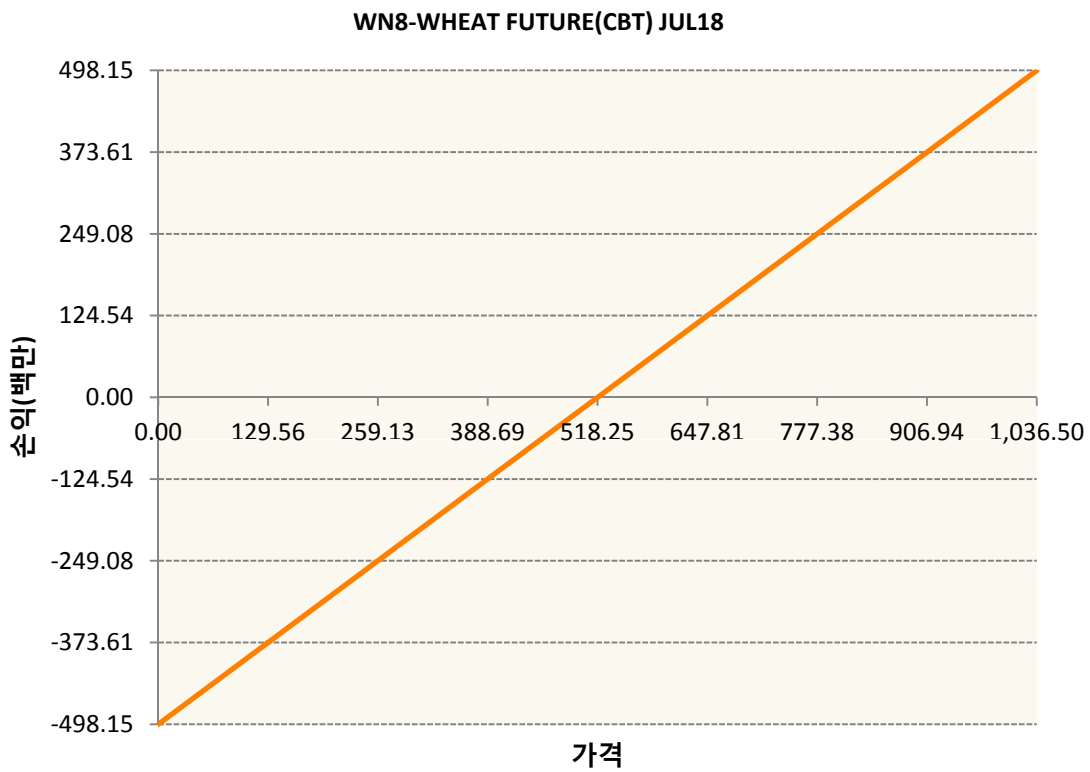
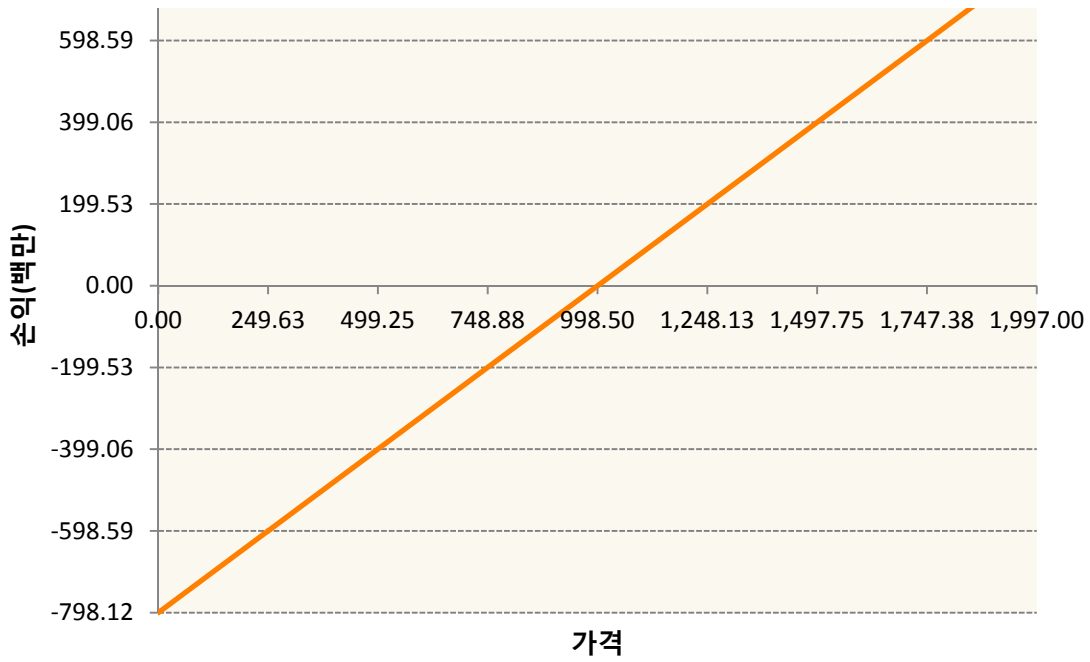


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18



SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON8	SOYBEAN OIL FUTR JUL18	25
CN8	CORN FUTURE JUL18	74
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	40

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

(단위:백만원)

329