

공시일	2018-05-24
기준일	2018-05-23

## 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	2018-05-24
기준일	2018-05-23

## SMART합성-MSCI선진국증권상장지

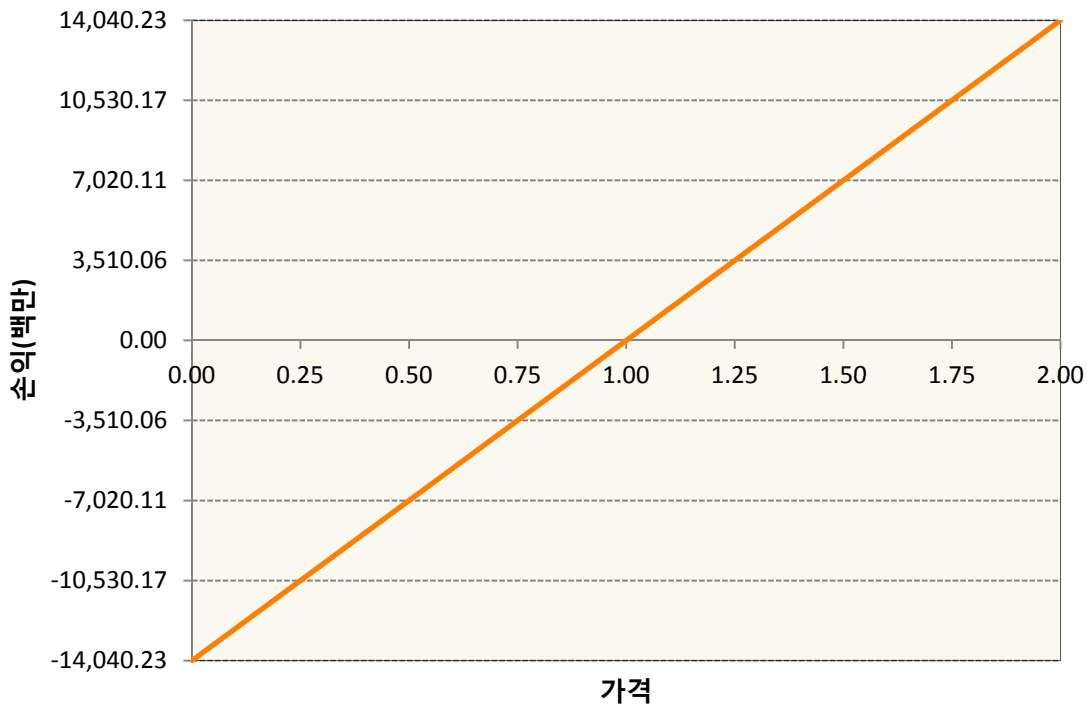
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	14,040	0	14,040	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

SWMXWO000015-신한MXWO 미래S180523



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0( 신한MXWO 미래S180523

1,123

\* 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	2018-05-24
기준일	2018-05-23

## 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)

422

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-05-24
기준일	2018-05-23

## 유로인덱스모(주식-파생형)

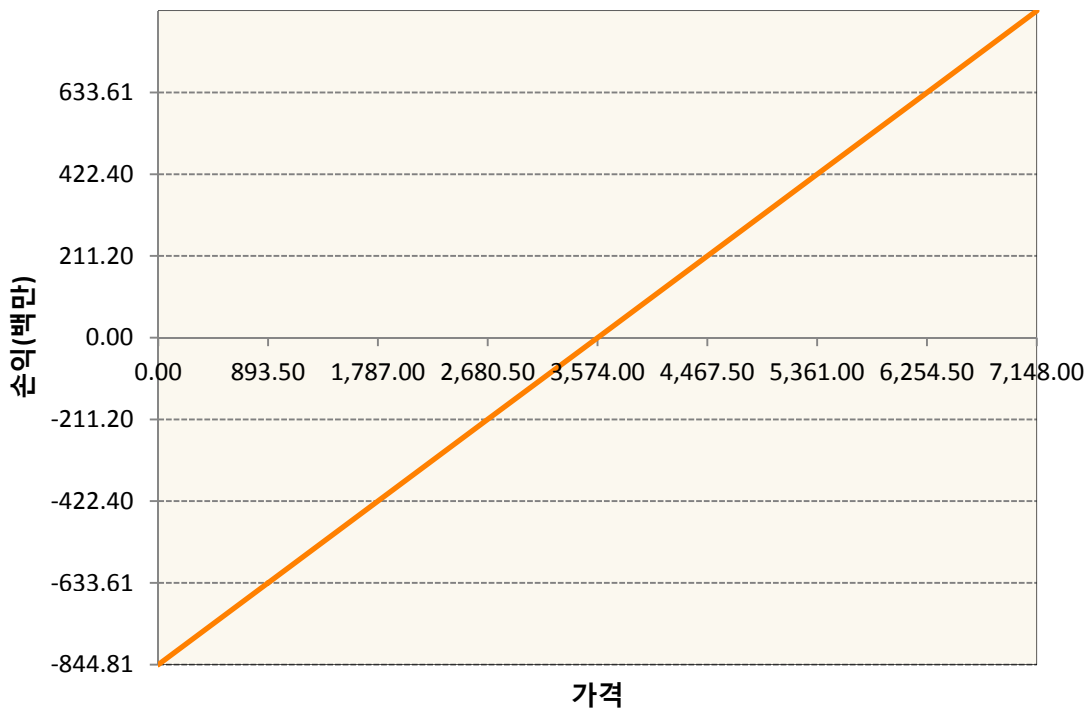
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	845	0	845	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGM8-EURO STOXX 50 JUN18



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	68
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

40
----

공시일	2018-05-24
기준일	2018-05-23

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

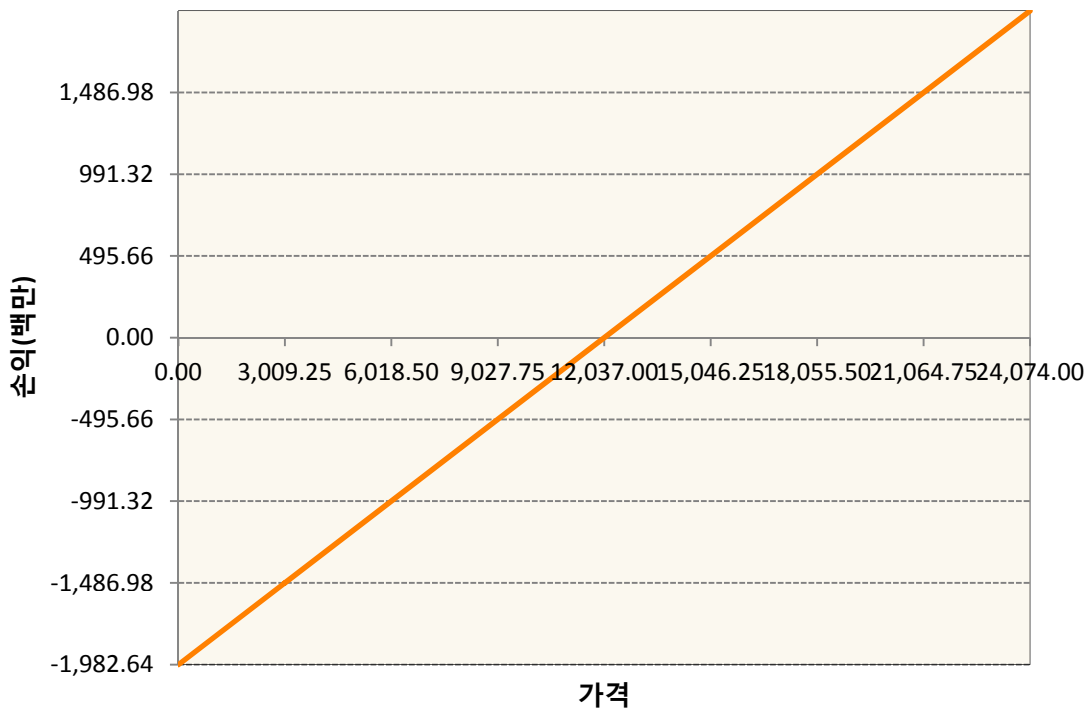
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

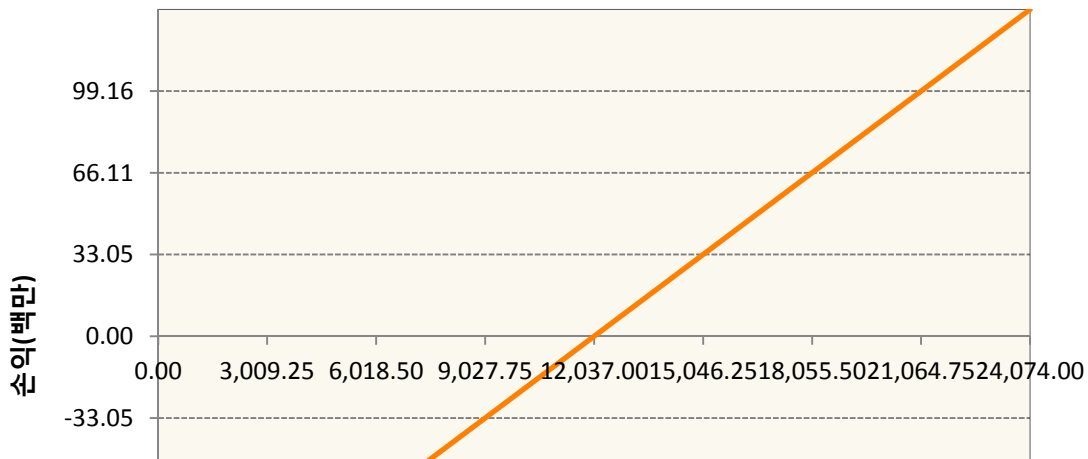
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,115	0	2,115	장내

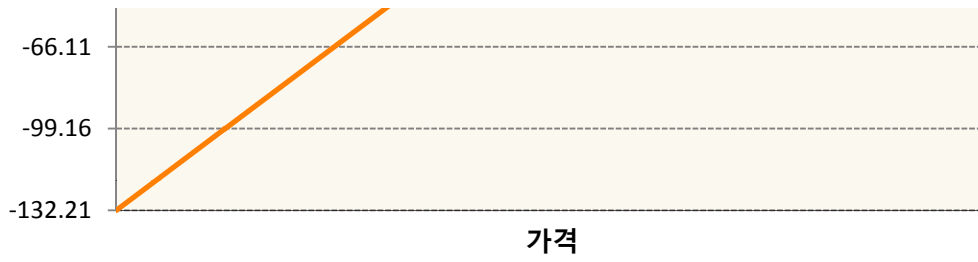
### 2. 만기시점의 손익구조

HCK8-H-SHARES FUT May18



MHCK8-MINI H-SHR IDX FU May18





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

HCK8	H-SHARES FUT May18	159
MHCK8	MINI H-SHR IDX FU May18	11

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

<b>9</b>
----------

공시일	2018-05-24
기준일	2018-05-23

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

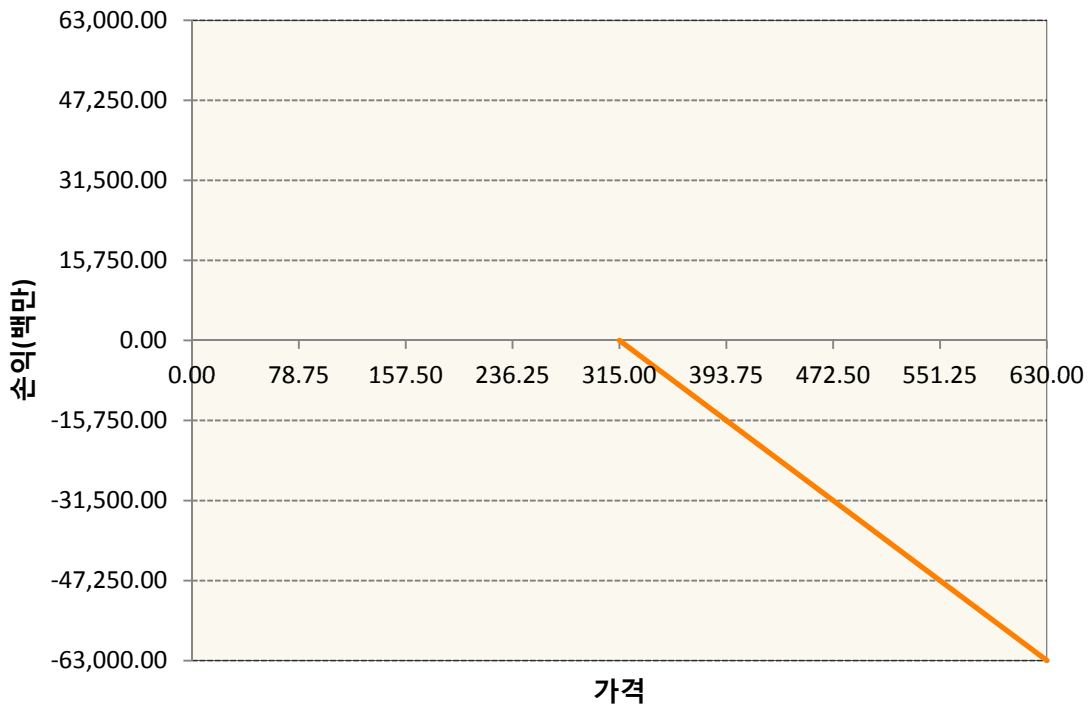
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

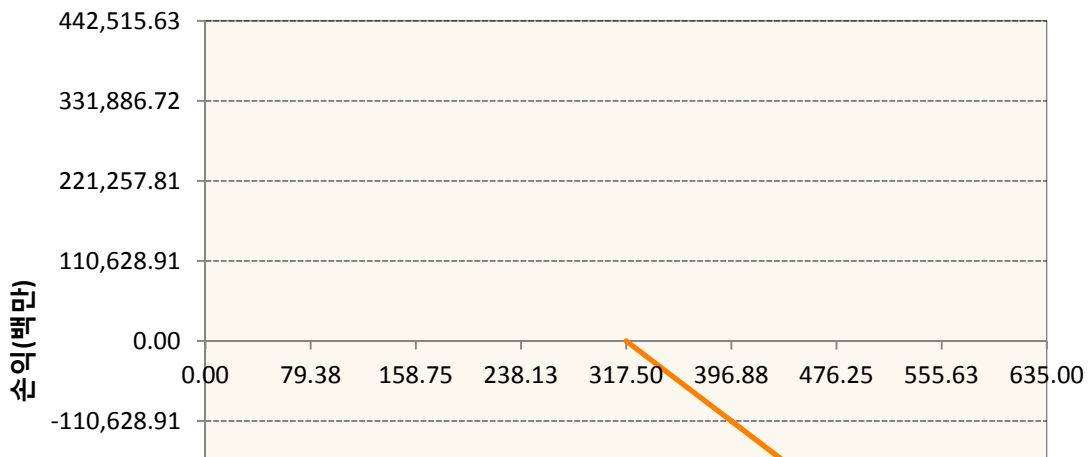
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	813,491	-813,491	장내

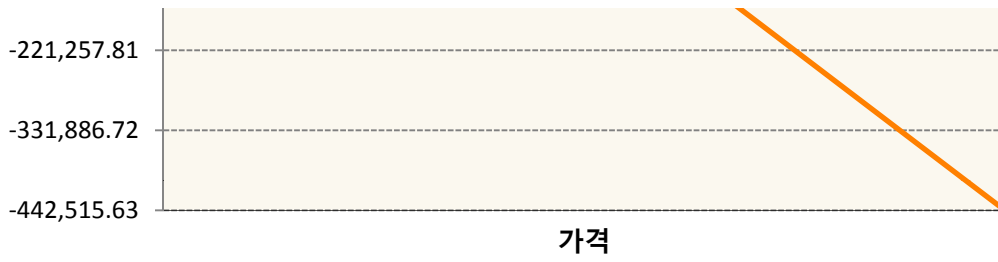
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201N63159-2018-06 콜315**

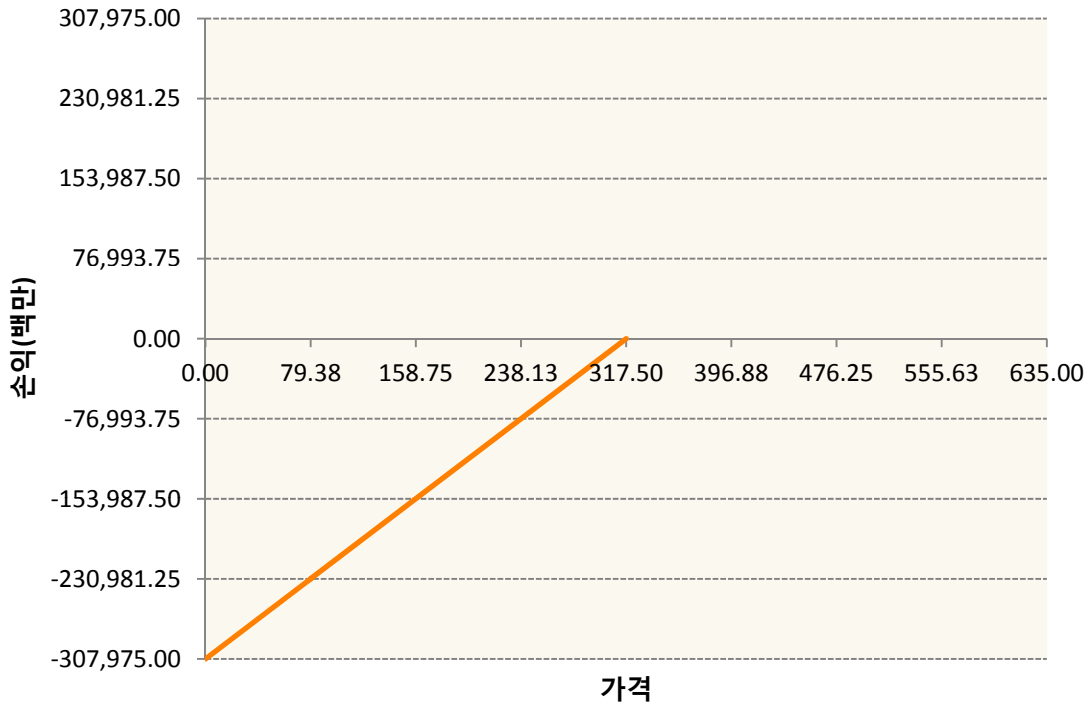


**KR4201N63175-2018-06 콜317.5**





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N6312018-06 콜315

4,117

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,981	1,924	1,857	1,781	1,698	1,608	1,513
-5.33%	1,748	1,646	1,538	1,425	1,308	1,188	1,065
-2.67%	1,256	1,119	981	842	703	563	422
0%	429	287	143	0	-144	-288	-432
2.67%	-730	-848	-970	-1,096	-1,225	-1,357	-1,490
5.33%	-2,146	-2,224	-2,311	-2,407	-2,509	-2,617	-2,730
8.00%	-3,719	-3,762	-3,815	-3,878	-3,950	-4,030	-4,117

KR4201N6312018-06 콜317.5

27,653

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12,214	11,887	11,488	11,026	10,507	9,939	9,330

-5.33%	10,945	10,319	9,639	8,914	8,155	7,366	6,554
-2.67%	8,102	7,195	6,271	5,334	4,388	3,434	2,474
0%	3,046	2,031	1,015	0	-1,015	-2,031	-3,046
2.67%	-4,378	-5,273	-6,191	-7,128	-8,077	-9,038	-10,007
5.33%	-13,771	-14,405	-15,099	-15,842	-16,624	-17,439	-18,281
8.00%	-24,460	-24,827	-25,271	-25,784	-26,357	-26,982	-27,653
KR4301N6312018-06 풋317.5							20,544
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20,469	-20,471	-20,474	-20,482	-20,495	-20,515	-20,544
-5.33%	-12,273	-12,305	-12,352	-12,417	-12,500	-12,599	-12,714
-2.67%	-4,547	-4,736	-4,943	-5,164	-5,398	-5,642	-5,893
0%	944	630	315	0	-315	-631	-946
2.67%	3,044	2,885	2,704	2,505	2,291	2,065	1,827
5.33%	3,389	3,362	3,320	3,260	3,183	3,088	2,977
8.00%	3,412	3,410	3,406	3,397	3,381	3,357	3,323

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

(단위:백만원)

54,137

공시일	2018-05-24
기준일	2018-05-23

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

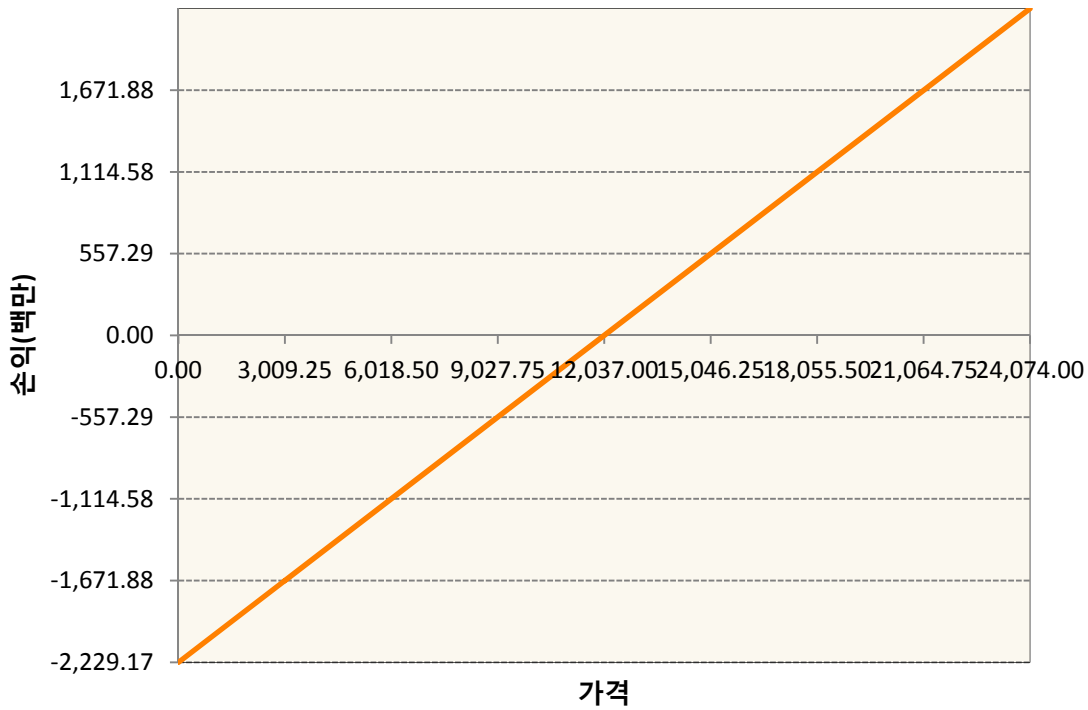
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

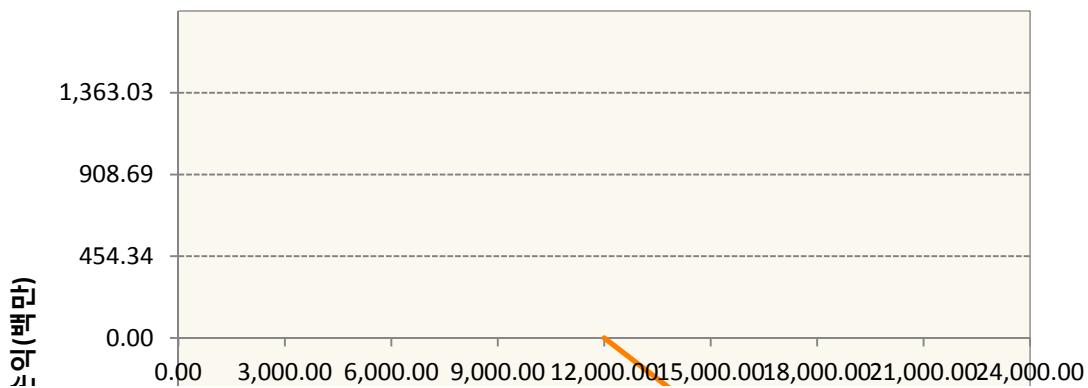
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,229	0	2,229	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,818	-5,818	장내

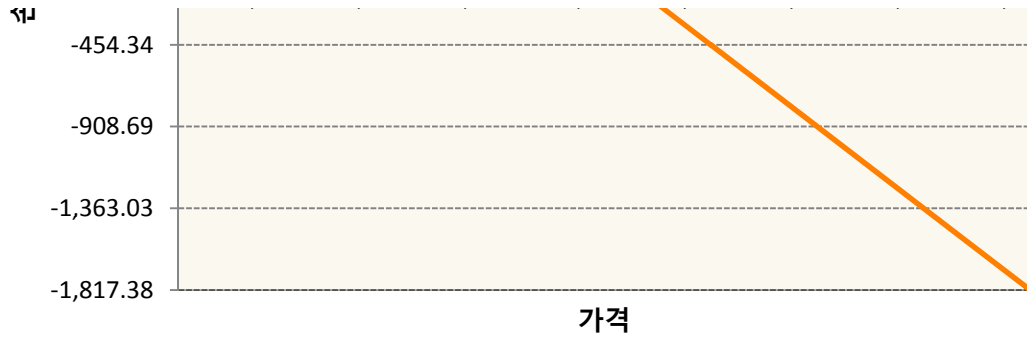
### 2. 만기시점의 손익구조

HCK8-H-SHARES FUT May18

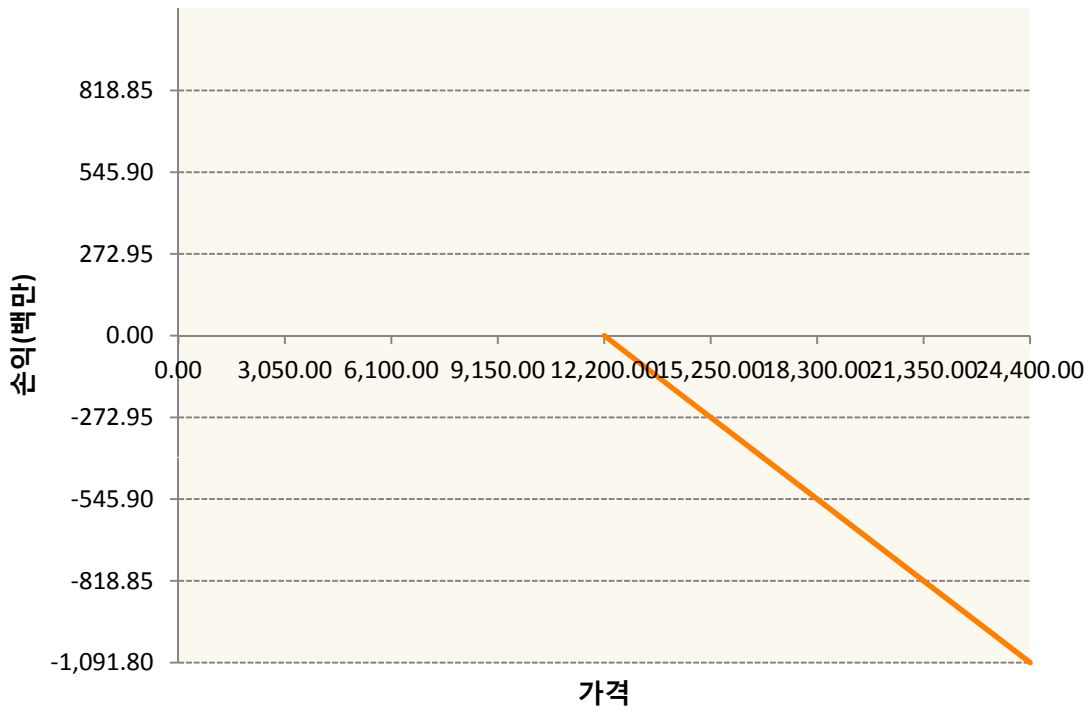


OHHIK8-C120-HSCEI



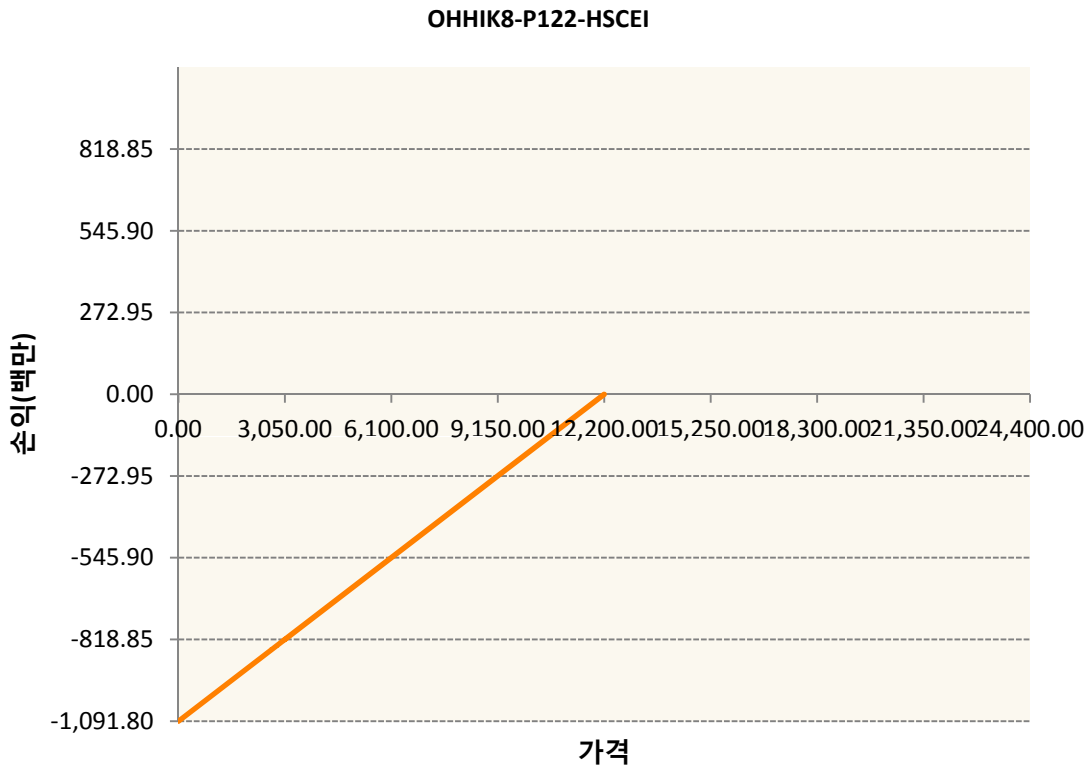
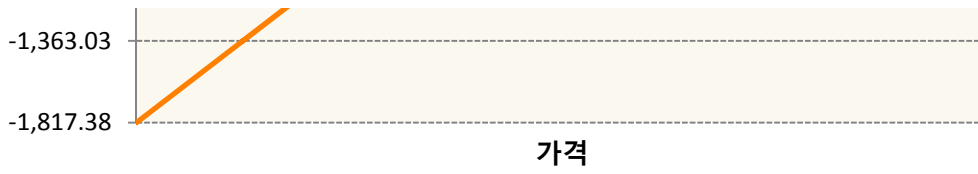


OHHIK8-C122-HSCEI



OHHIK8-P120-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCK8	H-SHARES FUT May18	178
OHHIK8-C12	HSCEI	145
OHHIK8-C12	HSCEI	87
OHHIK8-P12	HSCEI	145
OHHIK8-P12	HSCEI	87

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	0

공시일	2018-05-24
기준일	2018-05-23

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

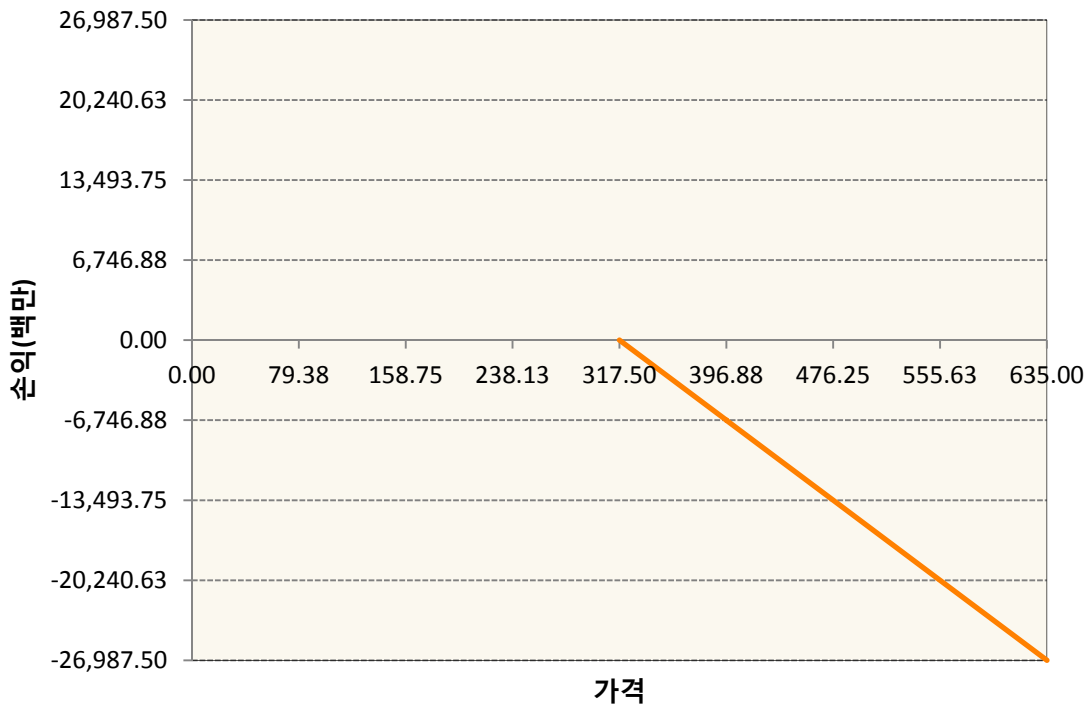
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

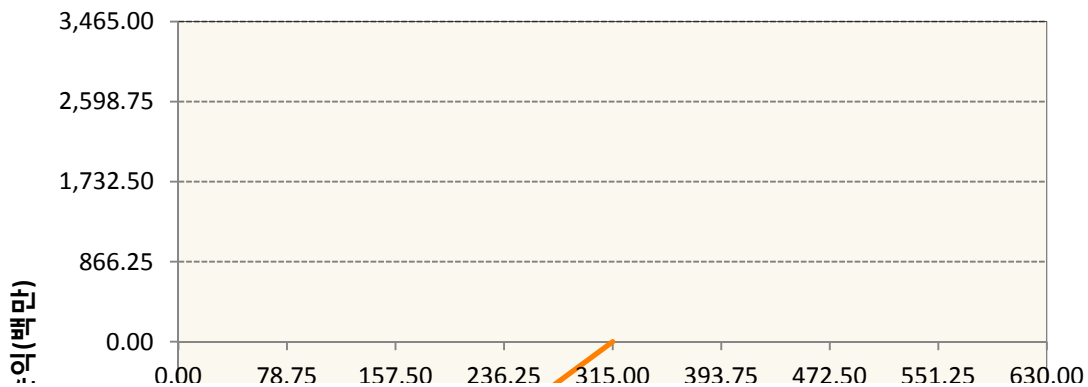
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	46,804	-46,804	장내

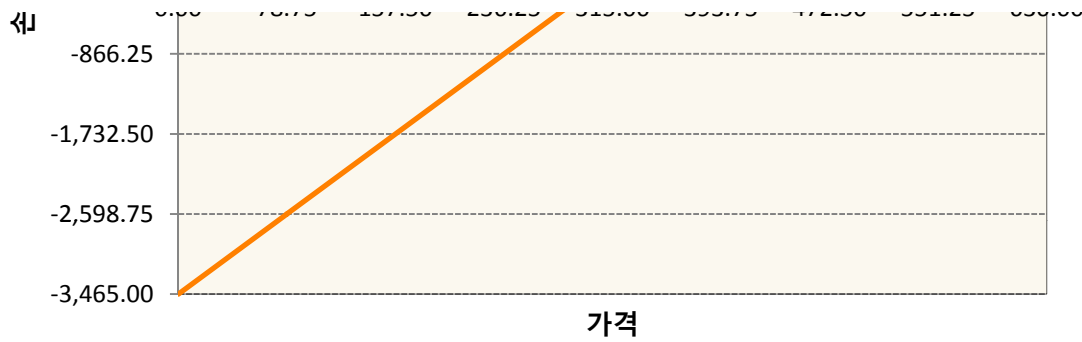
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63175-2018-06 콜317.5

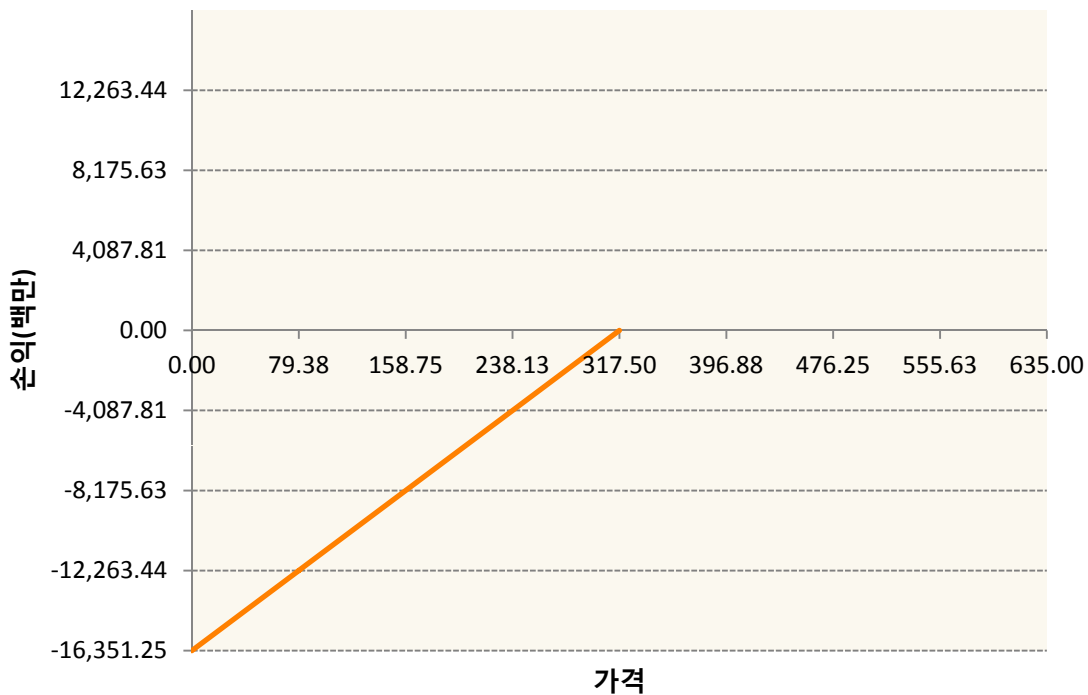


KR4301N63157-2018-06 풋315





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 1,686

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	745	725	701	672	641	606	569
-5.33%	668	629	588	544	497	449	400
-2.67%	494	439	382	325	268	209	151
0%	186	124	62	0	-62	-124	-186
2.67%	-267	-322	-378	-435	-493	-551	-610
5.33%	-840	-879	-921	-966	-1,014	-1,064	-1,115
8.00%	-1,492	-1,514	-1,541	-1,572	-1,607	-1,646	-1,686

KR4301N6312018-06 풋315 218

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-216	-216	-216	-217	-217	-217	-218
-5.33%	-124	-125	-125	-127	-128	-129	-131
-2.67%	-41	-44	-47	-50	-53	-56	-59
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	25	24	23	21	19	17	15
5.33%	27	27	27	26	26	25	24
8.00%	27	27	27	27	27	27	27

KR4301N6312018-06 풋317.5 1,091

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,087	-1,087	-1,087	-1,087	-1,088	-1,089	-1,091
-5.33%	-652	-653	-656	-659	-664	-669	-675
-2.67%	-241	-251	-262	-274	-287	-300	-313
0%	50	33	17	0	-17	-33	-50
2.67%	162	153	144	133	122	110	97
5.33%	180	179	176	173	169	164	158
8.00%	181	181	181	180	180	178	176

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

(단위:백만원)

6,959

공시일	2018-05-24
기준일	2018-05-23

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

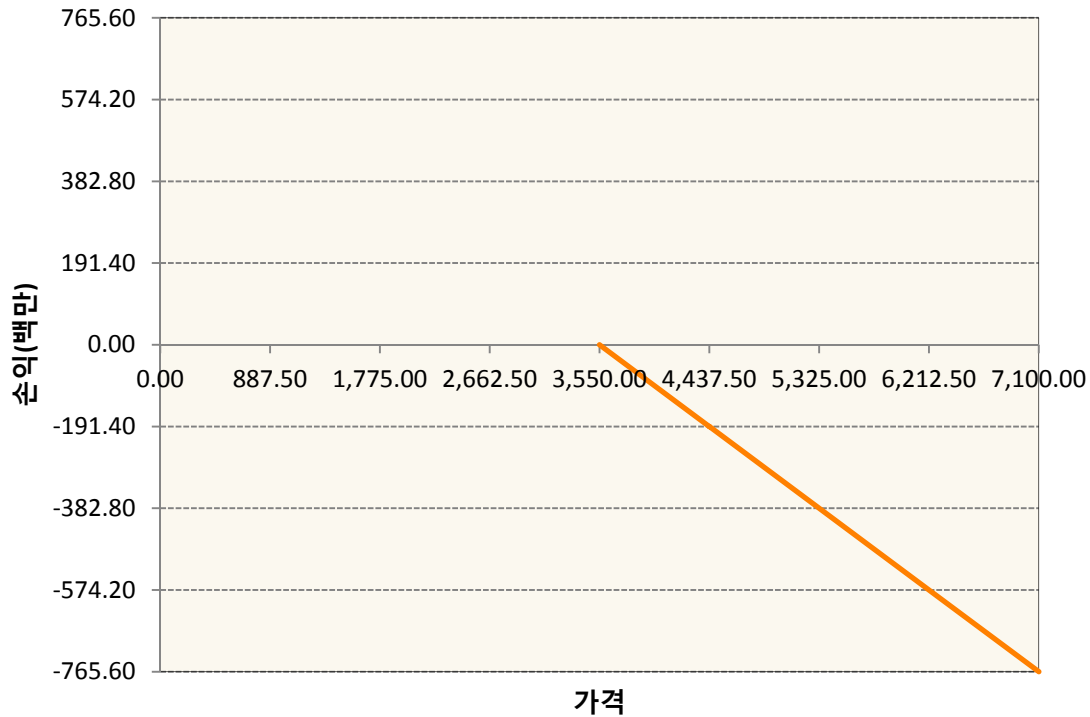
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

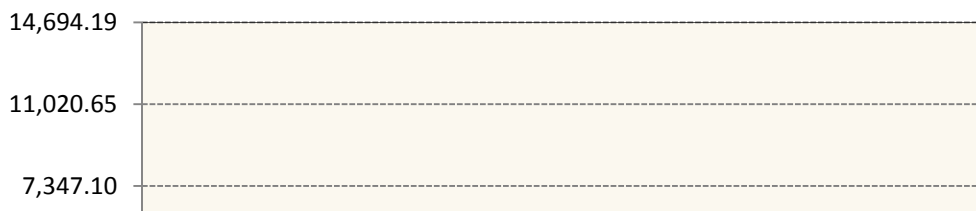
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,444	0	7,444	
누계	유가증권	스왑	53,487	0	53,487	장외
누계	유가증권	옵션	0	30,920	-30,920	장내
누계	지수	스왑	50,746	0	50,746	장외

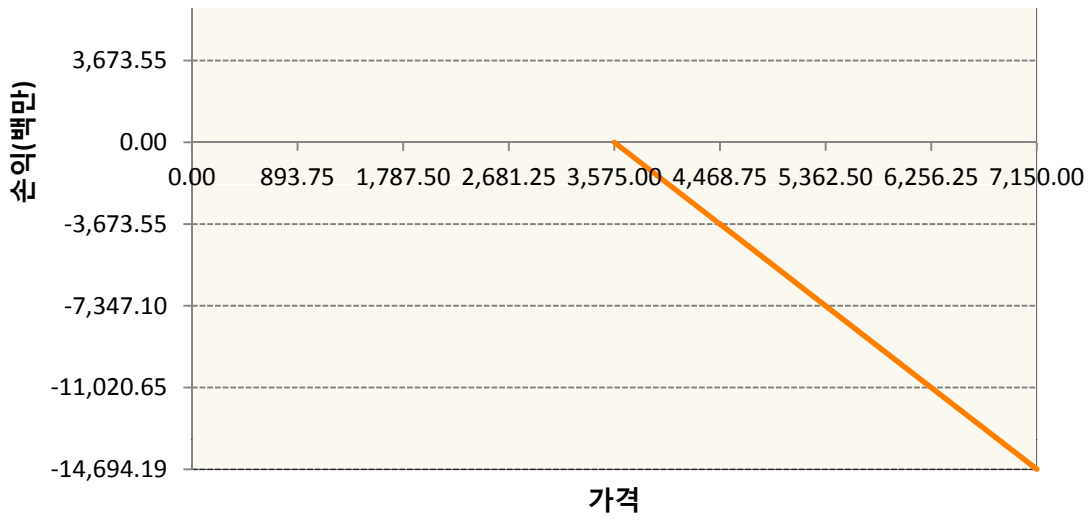
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXM8-C3550-SX5E 06/15/18 C3550 EURO STOXX 50 Price

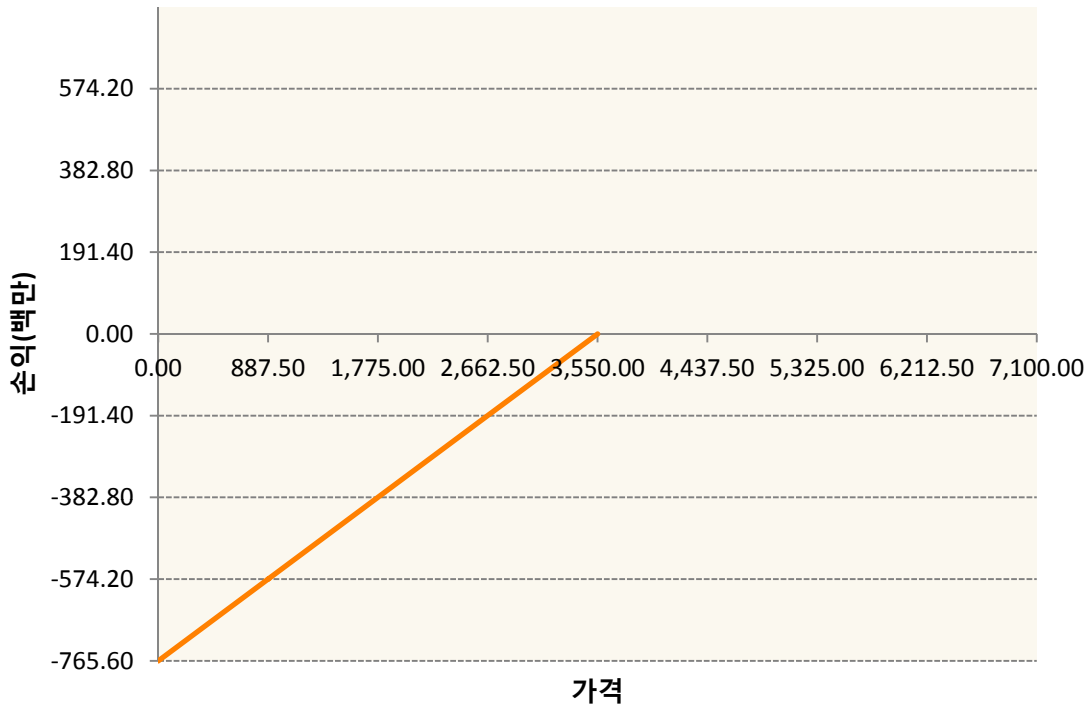


OESXM8-C3575-SX5E 06/15/18 C3575 EURO STOXX 50 Price



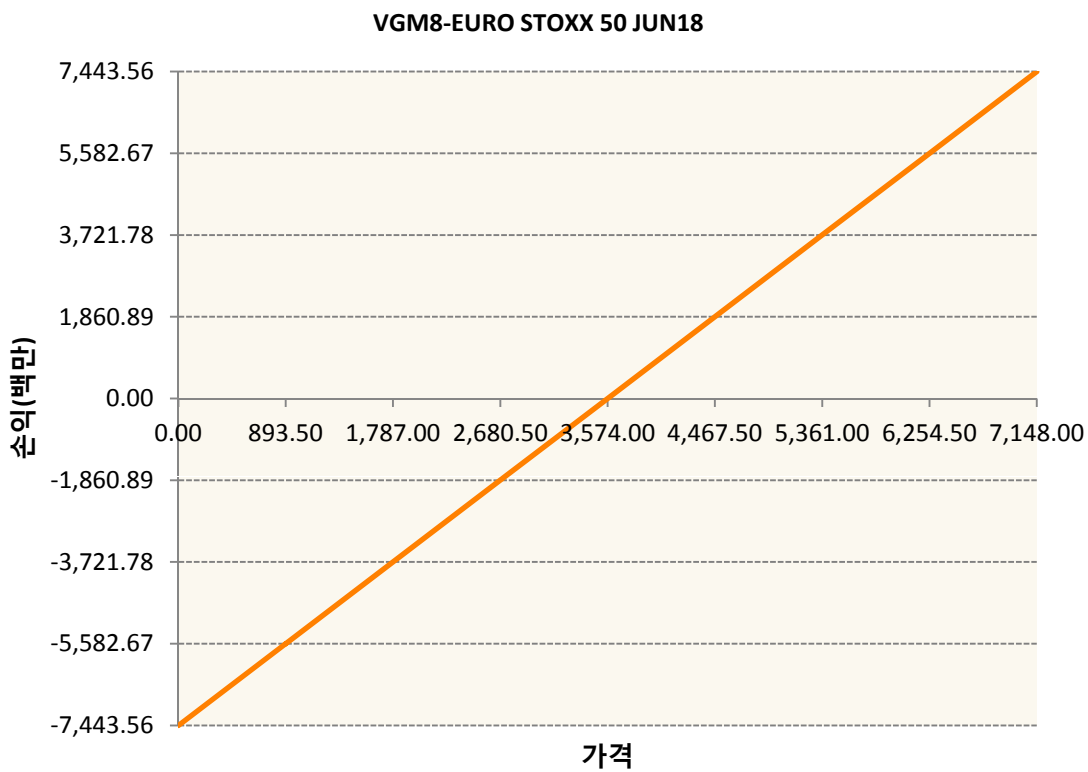
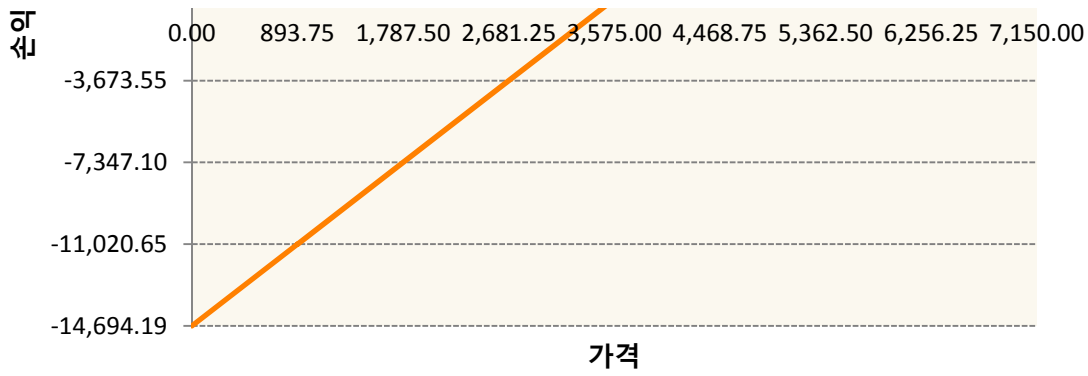


OESXM8-P3550-SX5E 06/15/18 P3550 EURO STOXX 50 Price



OESXM8-P3575-SX5E 06/15/18 P3575 EURO STOXX 50 Price





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	67
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	71
OESXM8-C3 SX5E 06/15/18 C3550 EURO STOXX 50 Price	61
OESXM8-C3 SX5E 06/15/18 C3575 EURO STOXX 50 Price	1,176
OESXM8-P3 SX5E 06/15/18 P3550 EURO STOXX 50 Price	61
OESXM8-P3 SX5E 06/15/18 P3575 EURO STOXX 50 Price	1,176
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18	596

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





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

(단위:백만원)

1,174



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)

219

공시일	2018-05-24
기준일	2018-05-23

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1

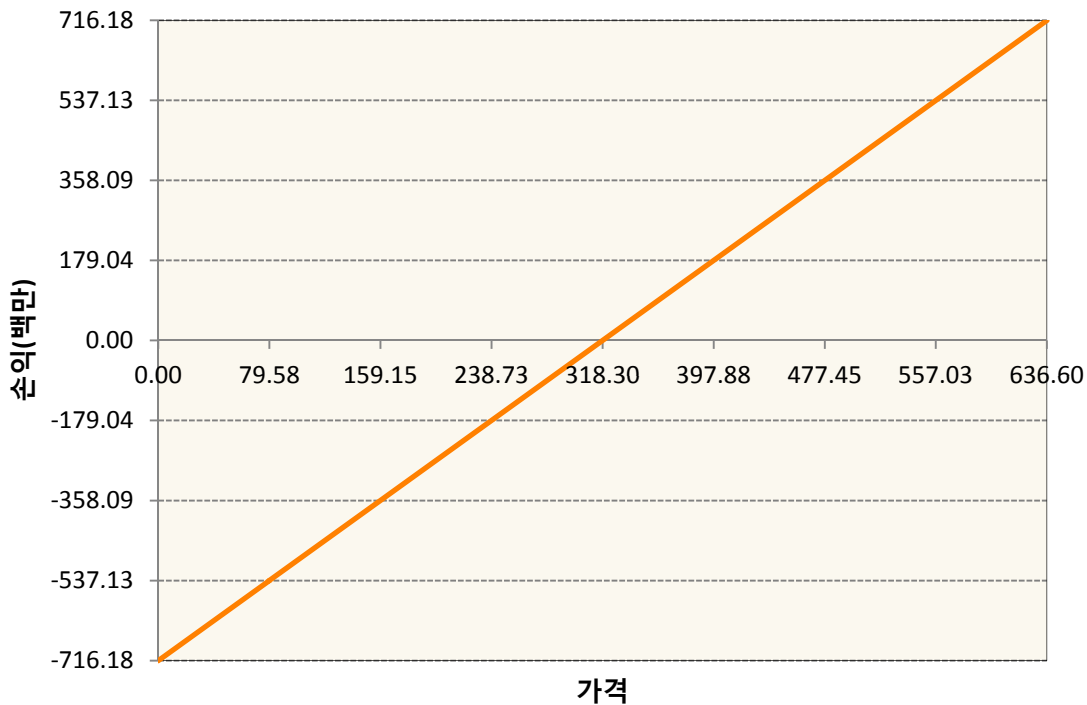
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	716	0	716	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	2018-05-24
기준일	2018-05-23

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

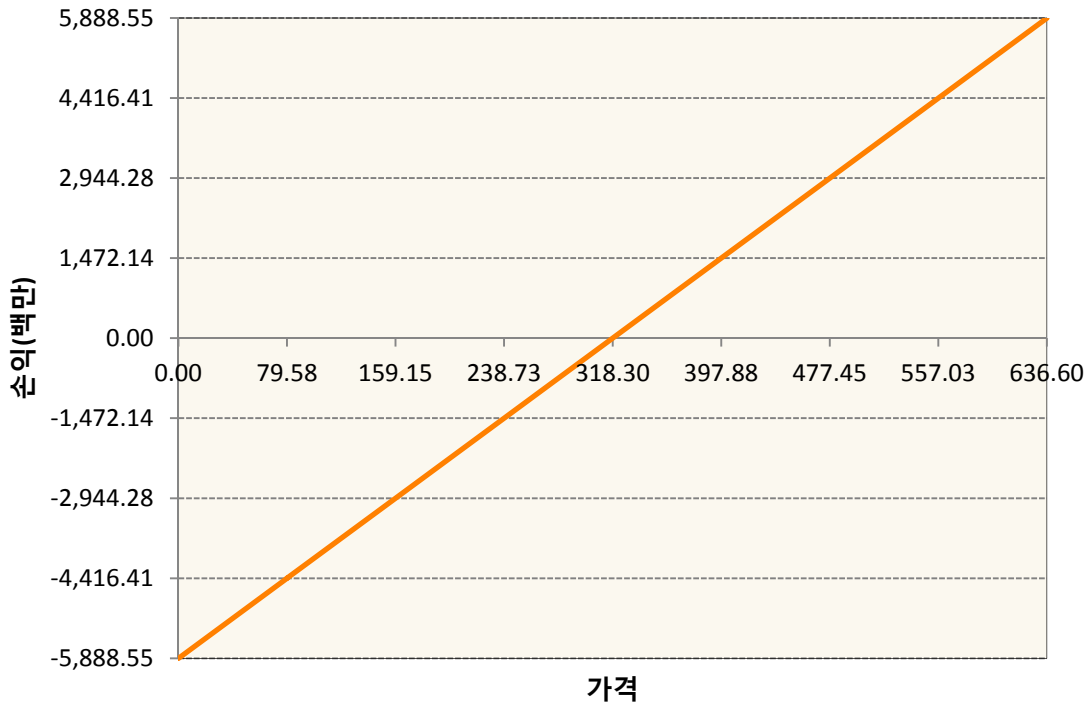
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

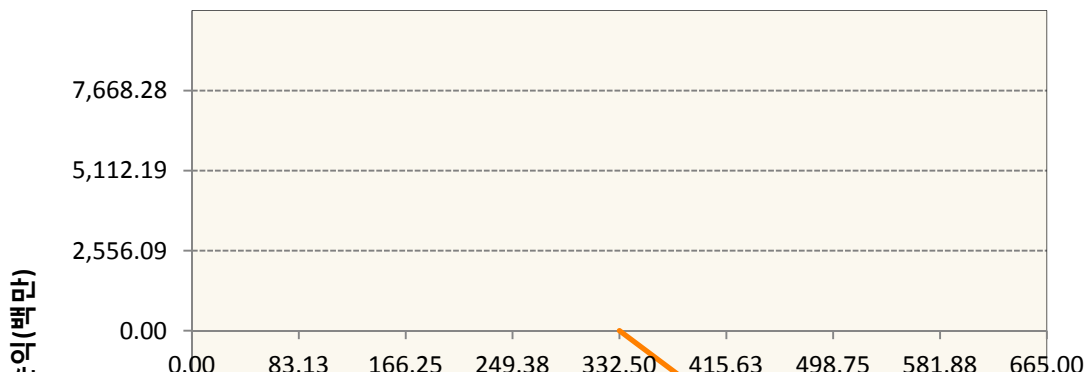
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	238	0	238	장내
신규	유가증권	옵션	0	499	-499	장내
누계	유가증권	선물	5,889	0	5,889	장내
누계	유가증권	옵션	1,270	10,224	-8,954	장내

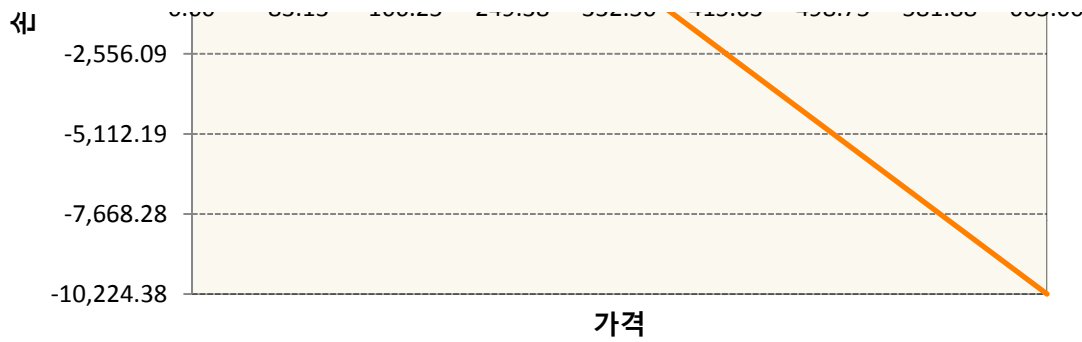
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

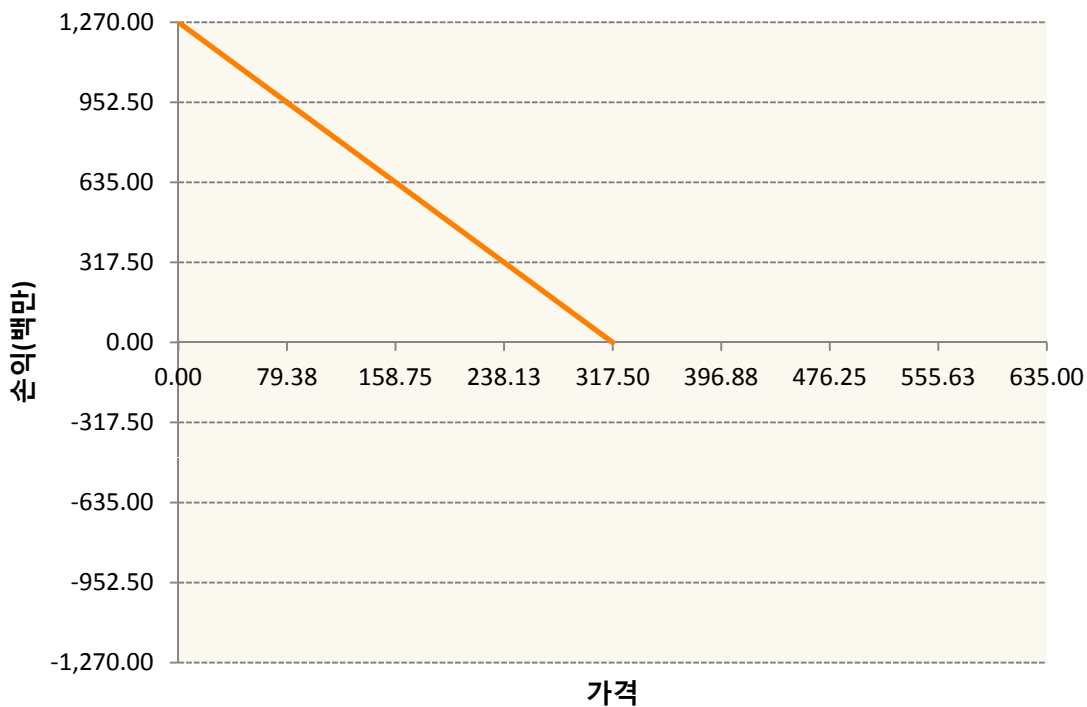


KR4201N63324-2018-06 콜332.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물							471
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-471	-471	-471	-471	-471	-471	-471
-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%	471	471	471	471	471	471	471
KR4201N63E 2018-06 콜332.5							447
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	110	108	106	102	97	92	85
-5.33%	105	101	95	87	79	69	57
-2.67%	90	81	69	56	42	27	12
0%	53	36	18	0	-19	-39	-59
2.67%	-23	-45	-67	-90	-112	-135	-158
5.33%	-147	-170	-194	-217	-240	-264	-287
8.00%	-320	-340	-361	-382	-403	-425	-447

KR4301N6312018-06 풋317.5

85

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	84	84	84	84	85	85	85
-5.33%	51	51	51	51	52	52	52
-2.67%	19	20	20	21	22	23	24
0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-13	-12	-11	-10	-9	-9	-8
5.33%	-14	-14	-14	-13	-13	-13	-12
8.00%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14

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

(단위:백만원)

755

공시일	2018-05-24
기준일	2018-05-23

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

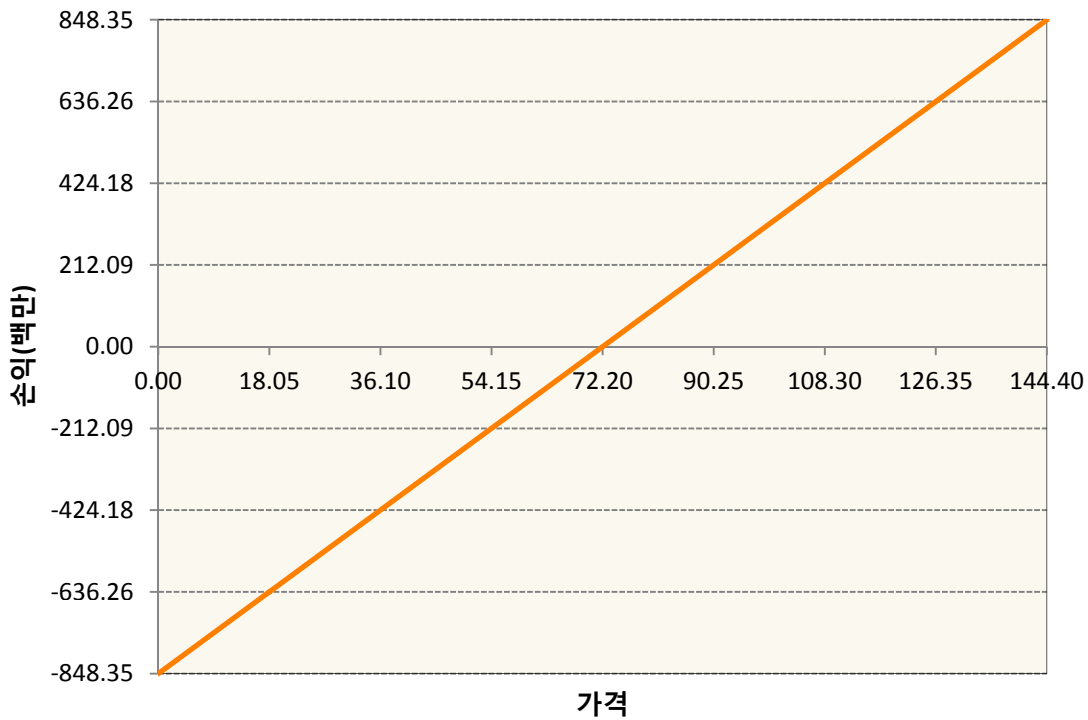
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

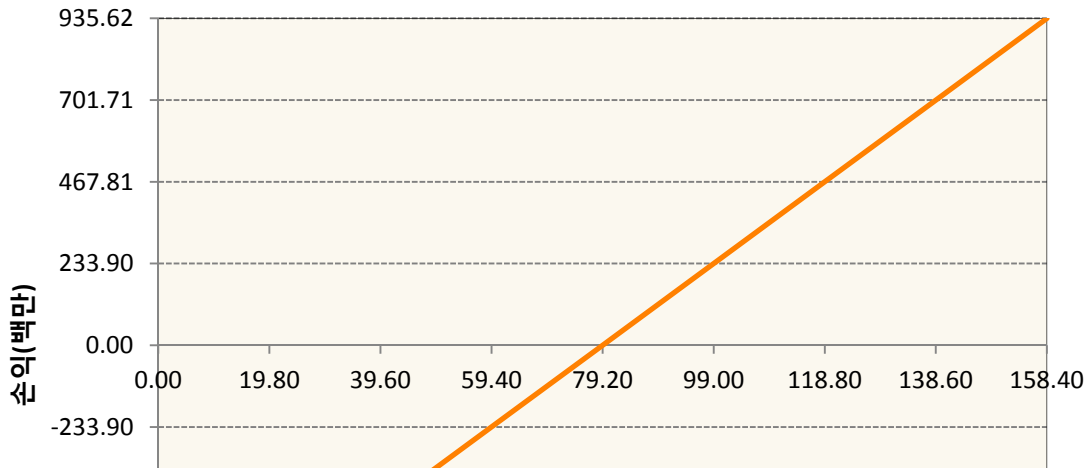
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,001	593	3,408	

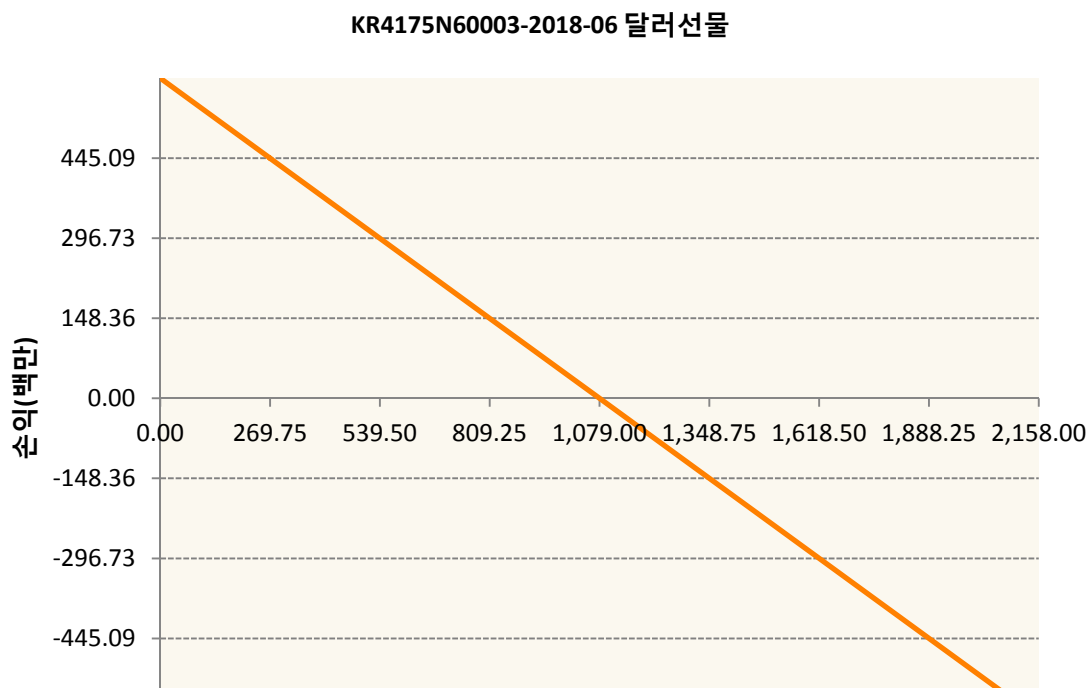
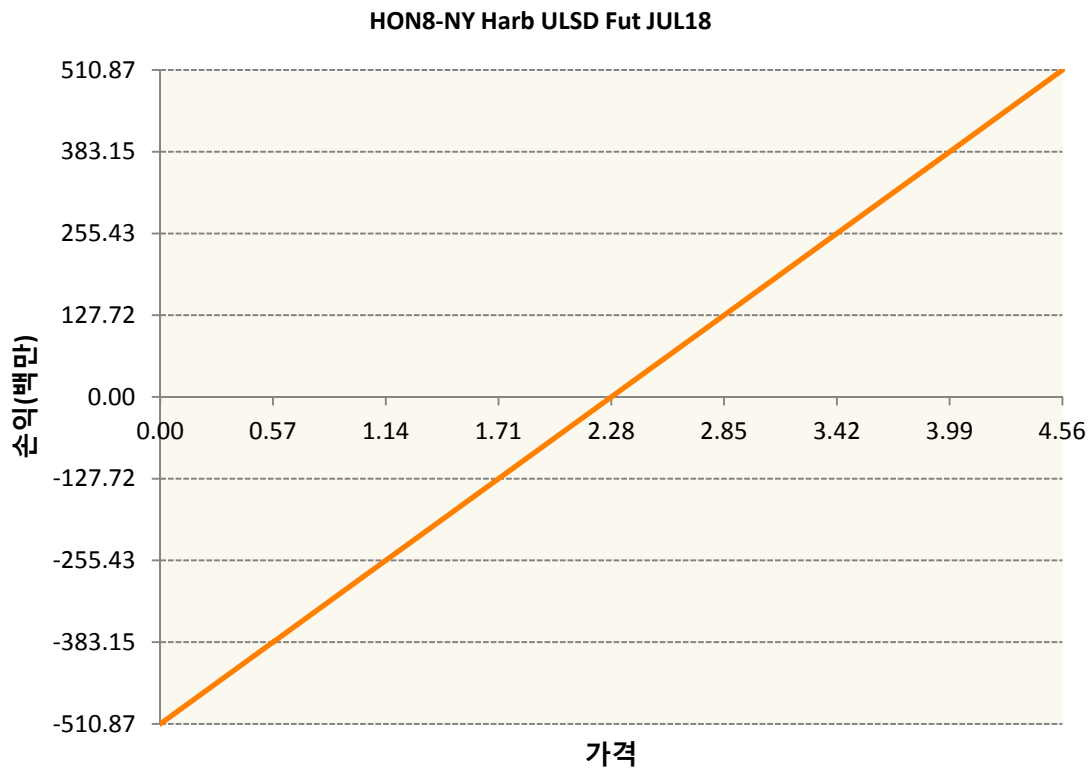
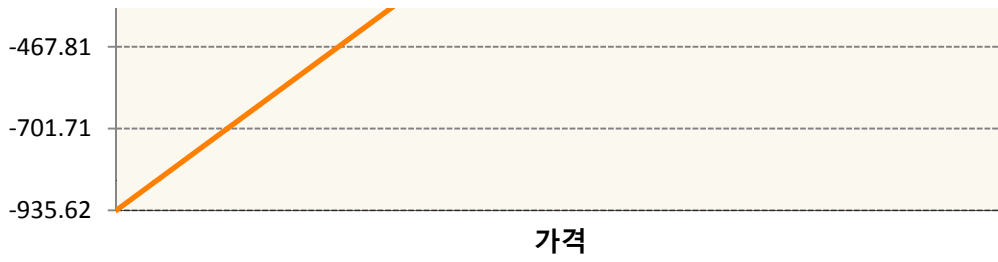
### 2. 만기시점의 손익구조

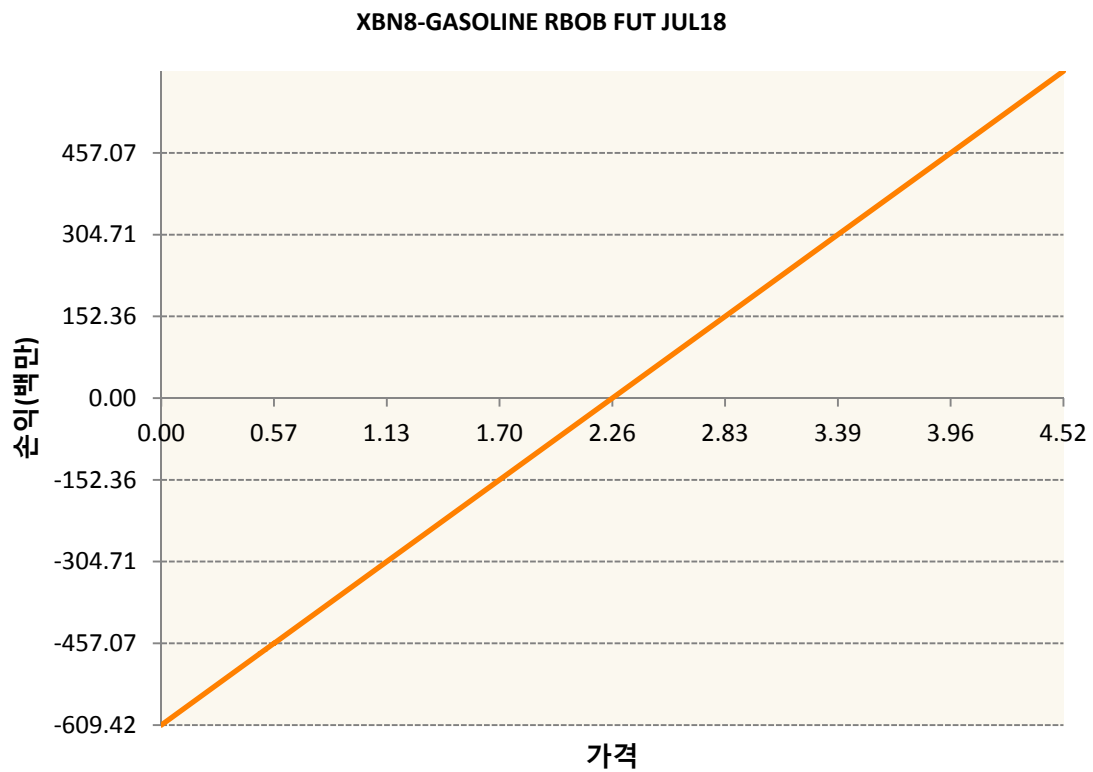
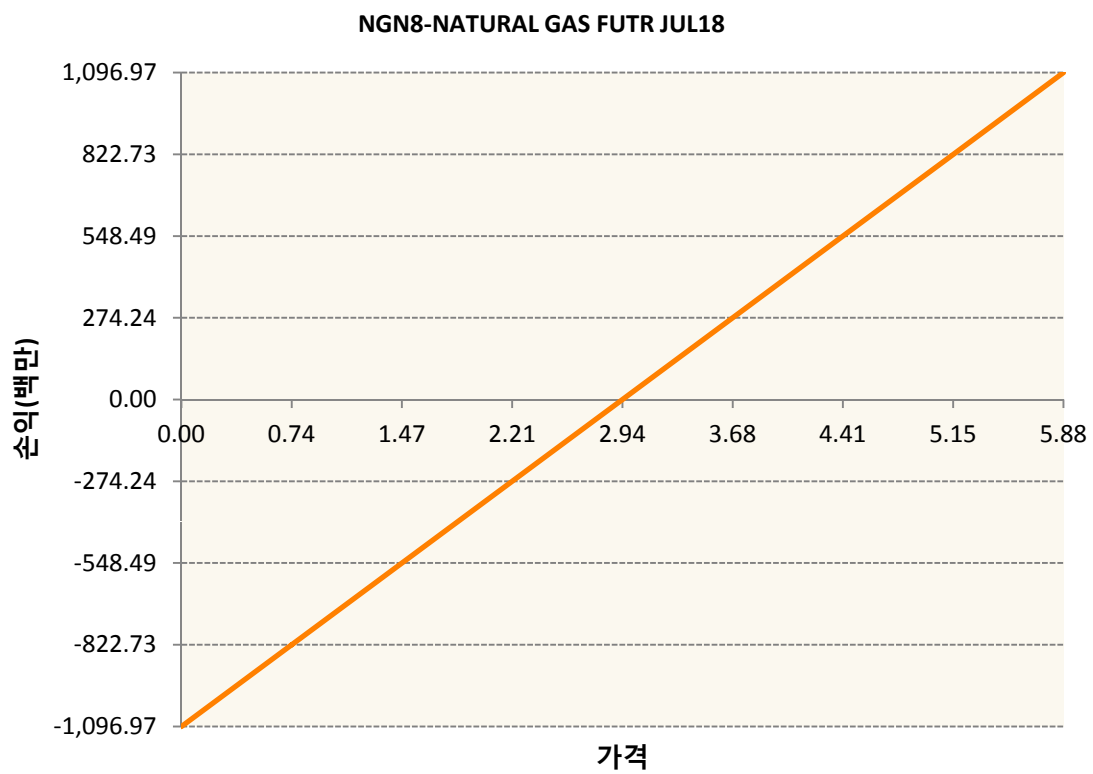
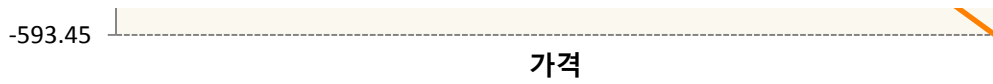
**CLN8-WTI CRUDE FUTURE JUL18**



**COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18**







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

CLN8	WTI CRUDE FUTURE JUL18	68
COU8	BRENT CRUDE FUTR SEP18	75
HON8	NY Harb ULSD Fut JUL18	41
KR4175N60C	2018-06 달러선물	47
NGN8	NATURAL GAS FUTR JUL18	88
XBN8	GASOLINE RBOB FUT JUL18	49

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

**464**

공시일	2018-05-24
기준일	2018-05-23

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

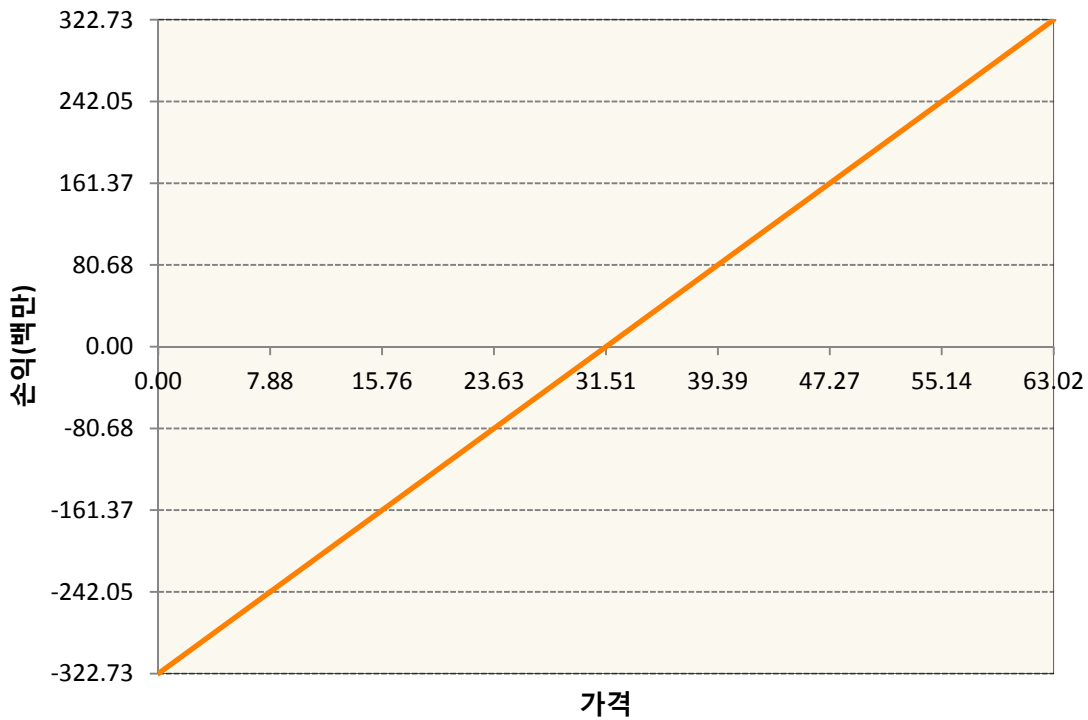
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

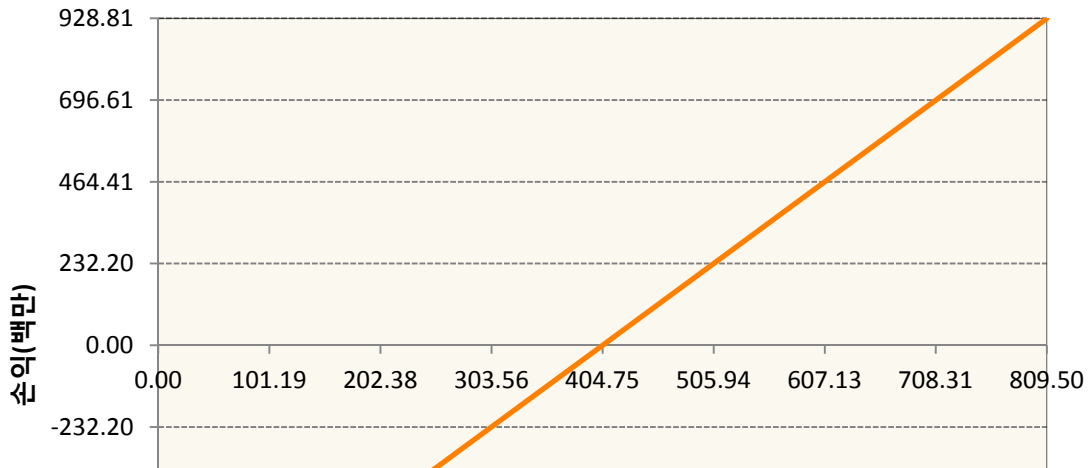
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,142	324	3,818	

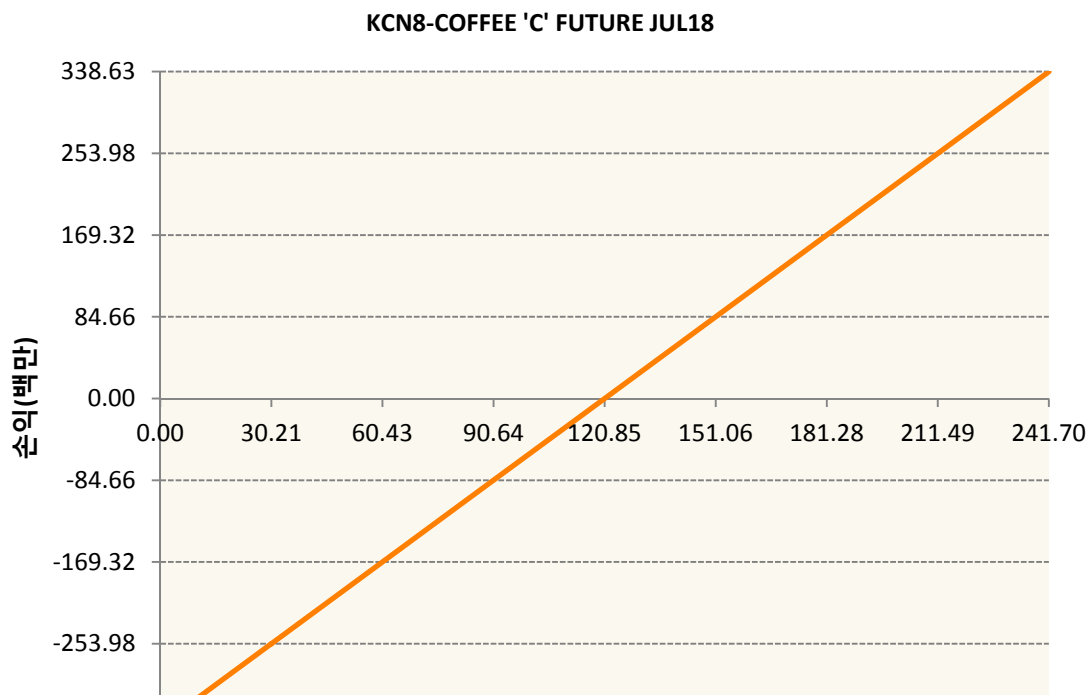
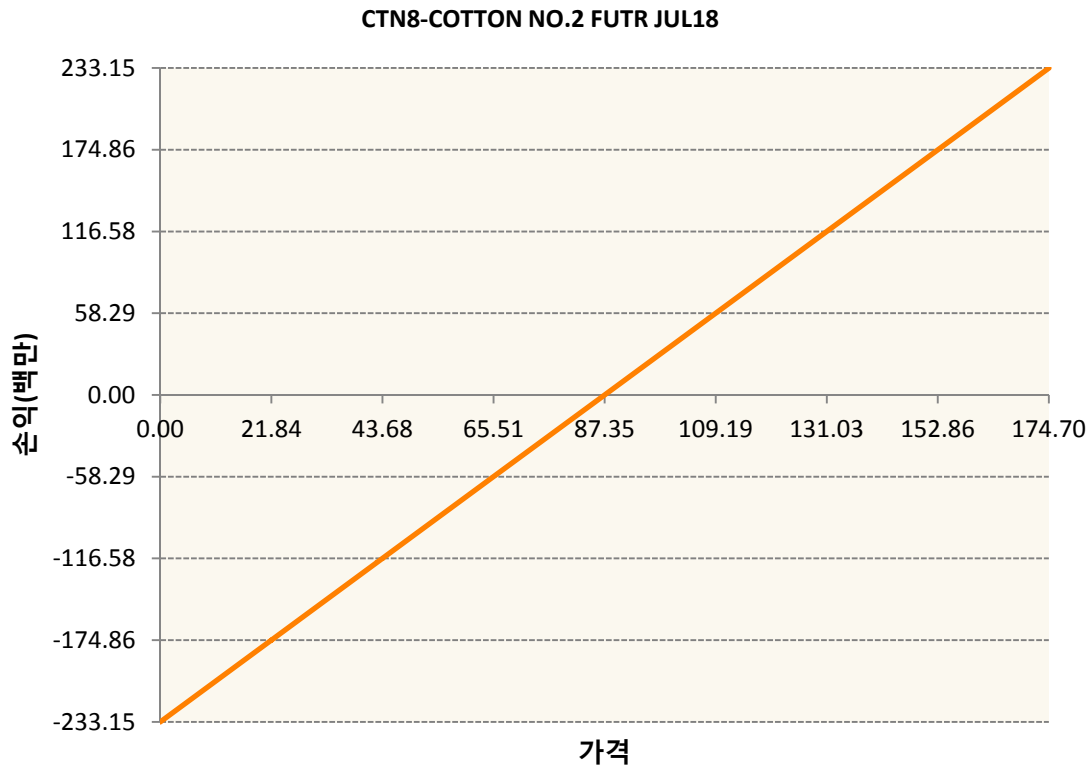
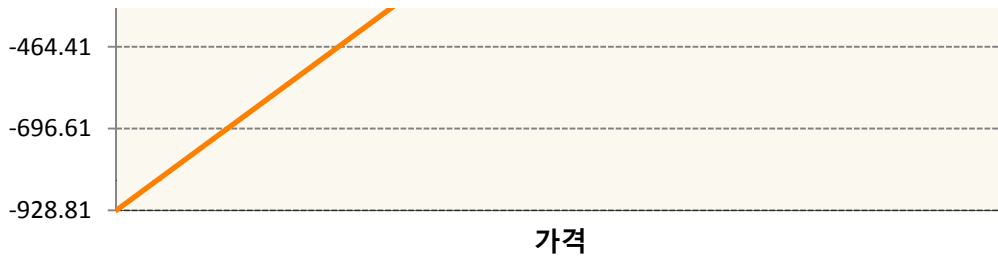
### 2. 만기시점의 손익구조

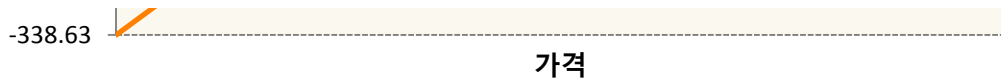
**BON8-SOYBEAN OIL FUTR JUL18**



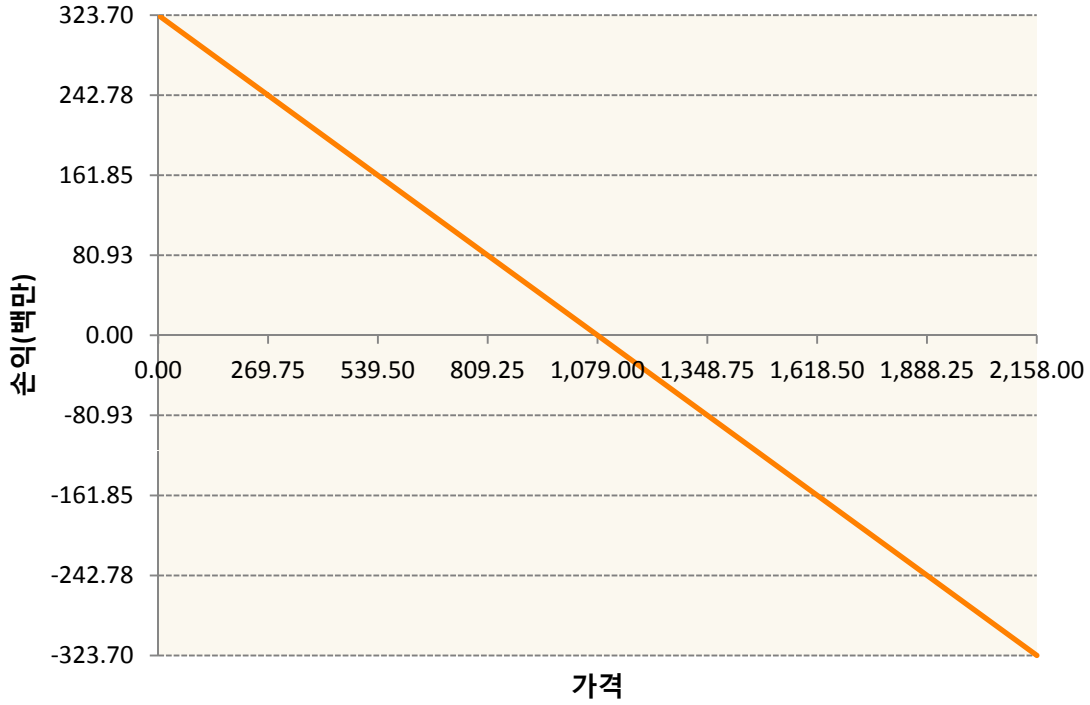
**CN8-CORN FUTURE JUL18**



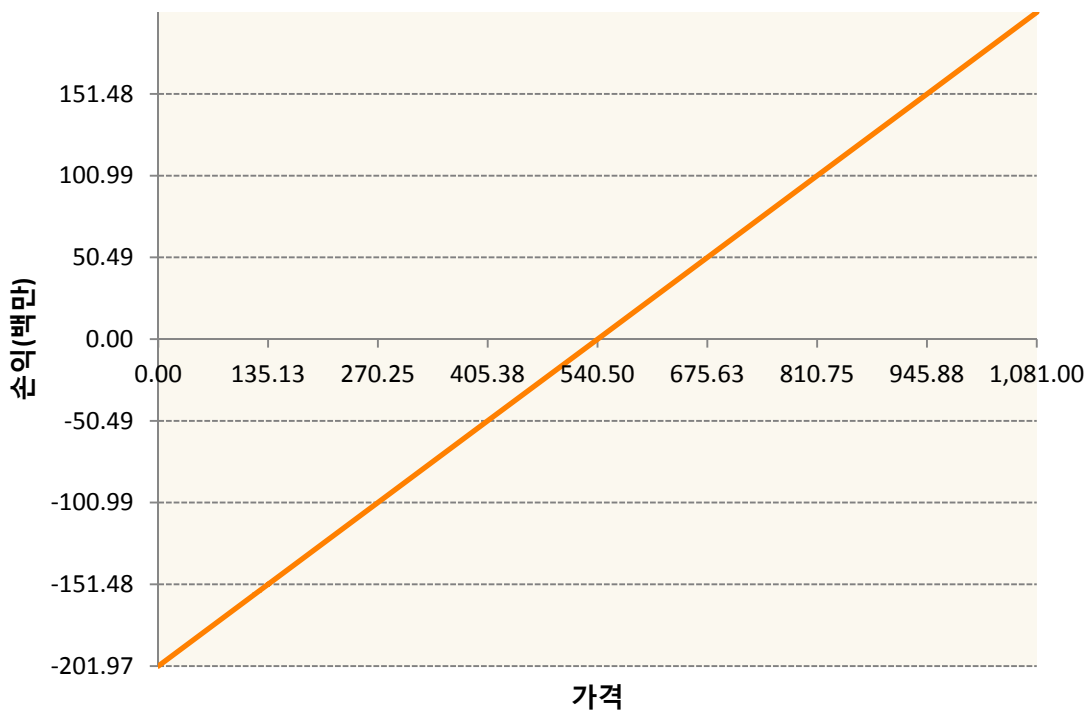




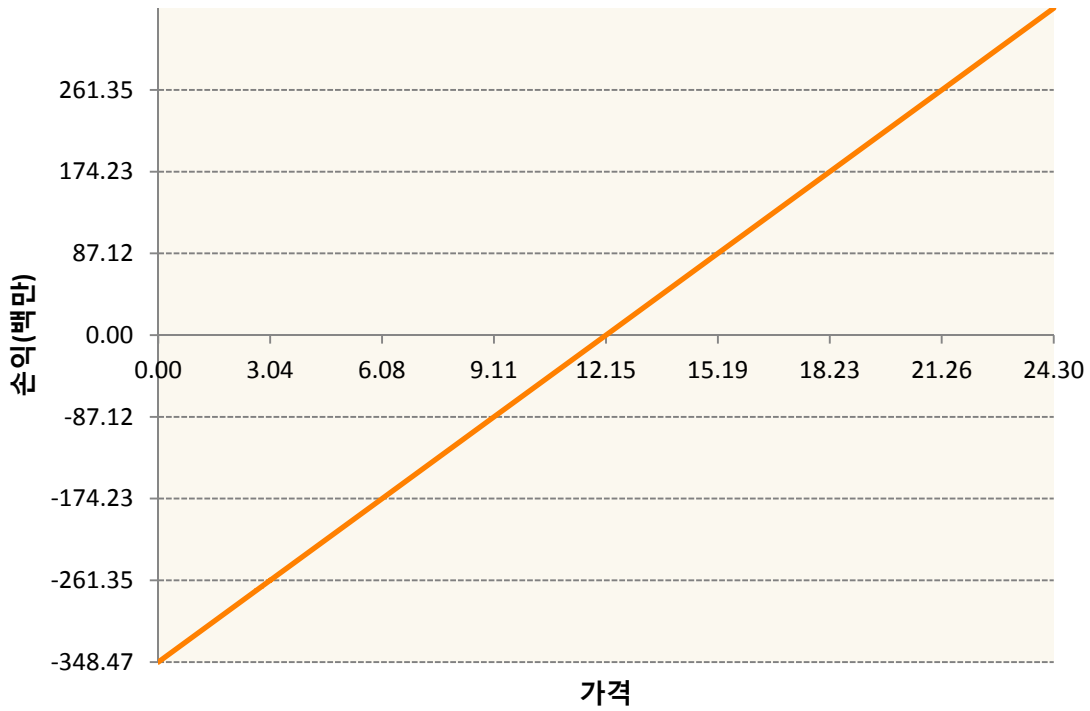
**KR4175N60003-2018-06 달러선물**



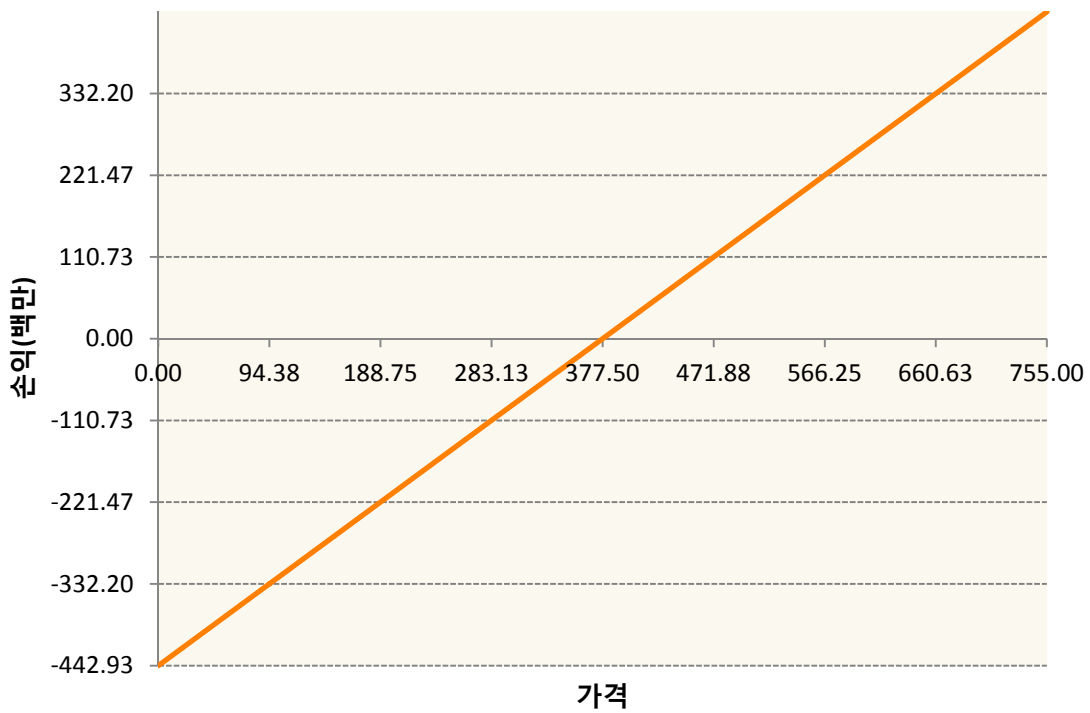
**KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18**



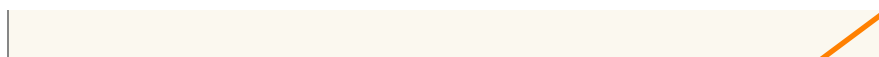
SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18

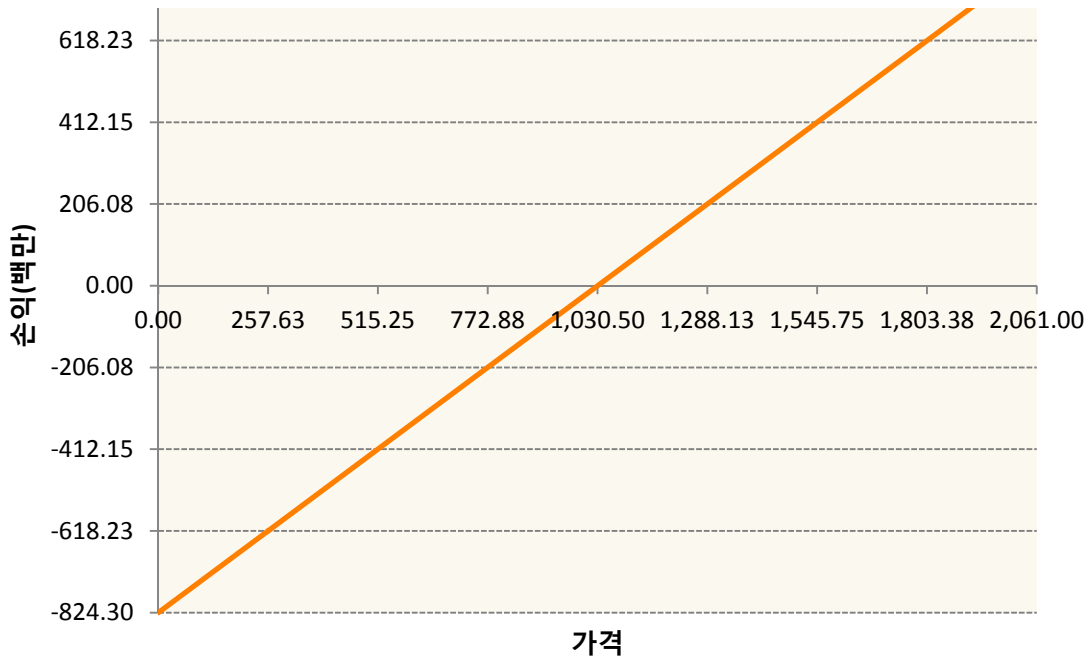


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18

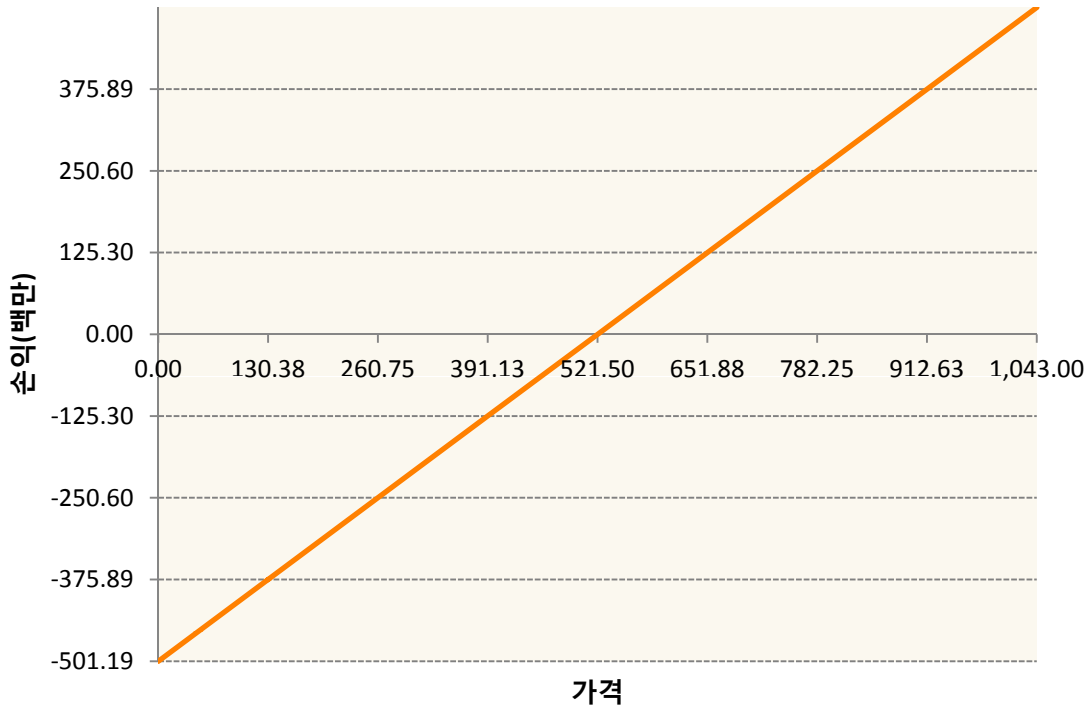


SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18





WN8-WHEAT FUTURE(CBT) JUL18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON8	SOYBEAN OIL FUTR JUL18	26
CN8	CORN FUTURE JUL18	74
CTN8	COTTON NO.2 FUTR JUL18	19
KCN8	COFFEE 'C' FUTURE JUL18	27
KR4175N60C	2018-06 달러선물	26

KWN8	KC HRW WHEAT FUT JUL18	16
SBN8	SUGAR #11 (WORLD) JUL18	28
SMN8	SOYBEAN MEAL FUTR JUL18	35
SN8	SOYBEAN FUTURE JUL18	66
WN8	WHEAT FUTURE(CBT) JUL18	40

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

(단위:백만원)

**326**