

공시일	2018-05-25
기준일	2018-05-24

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	2018-05-25
기준일	2018-05-24

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

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S180523

1,120

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

458

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-05-25
기준일	2018-05-24

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

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	2018-05-25
기준일	2018-05-24

유로인덱스모(주식-파생형)

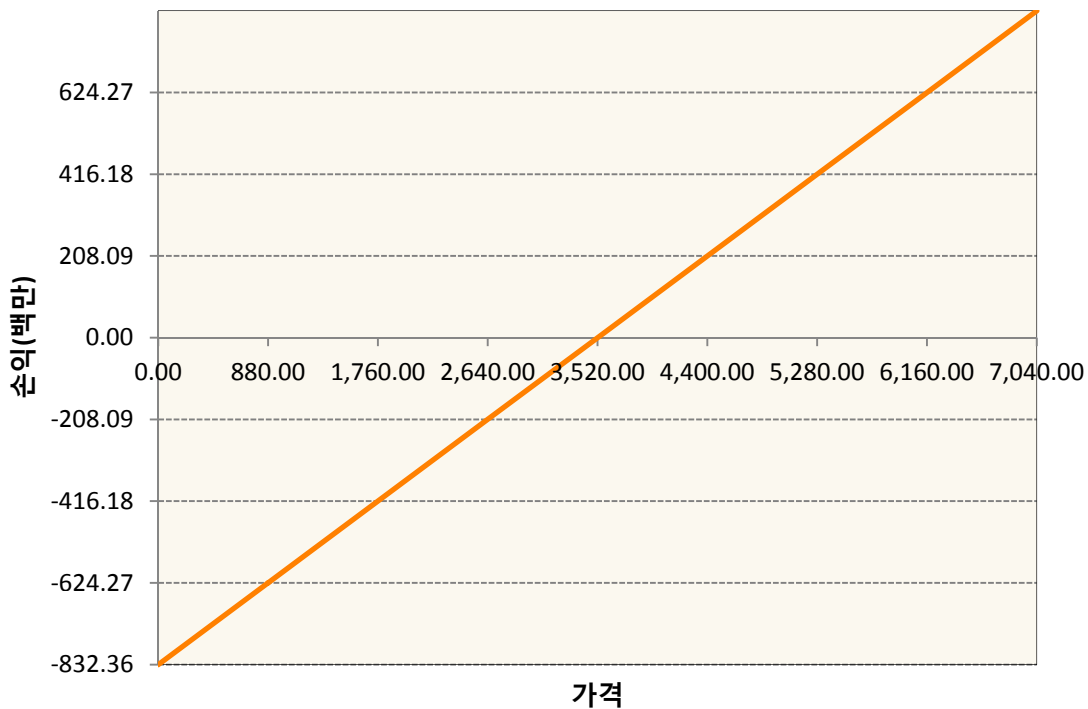
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	832	0	832	

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	2018-05-25
기준일	2018-05-24

차이나인덱스모(주식-파생형)

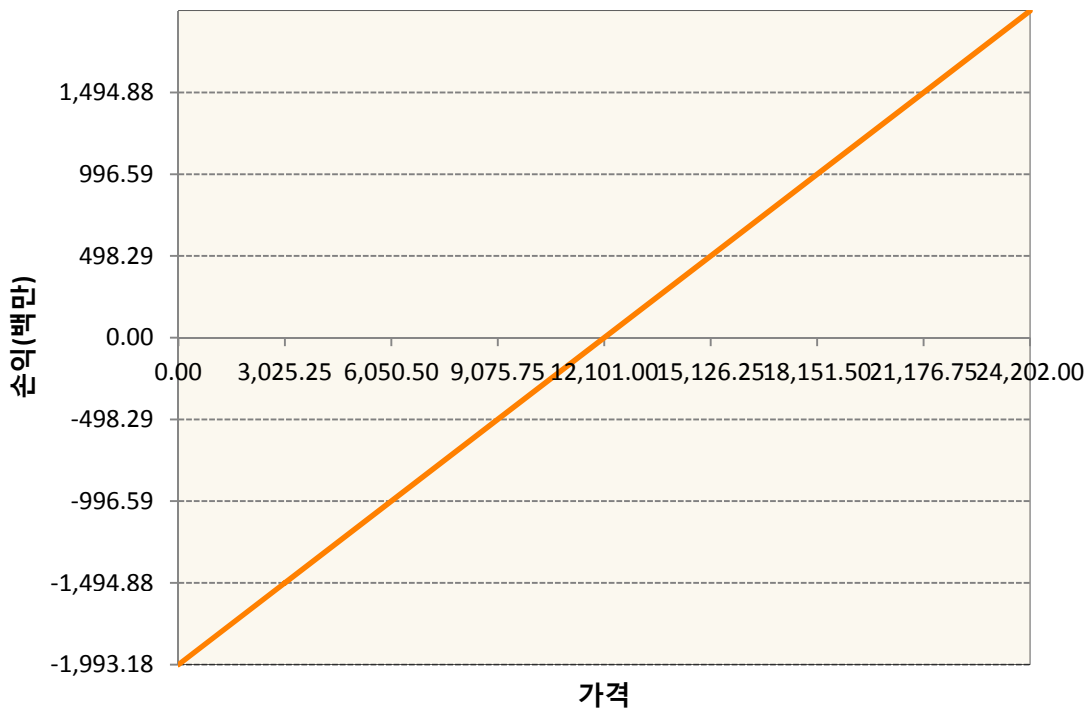
1. 계약금액

(단위:백만원)

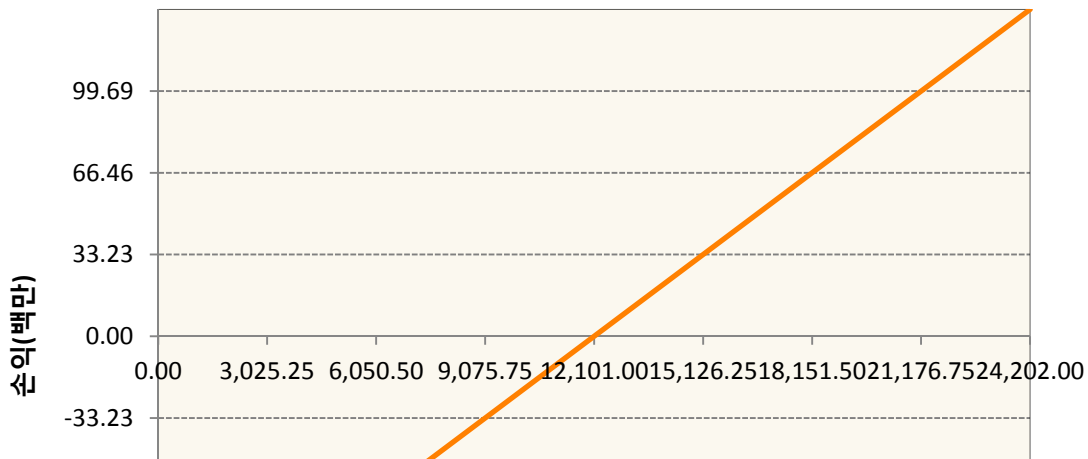
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,126	0	2,126	장내

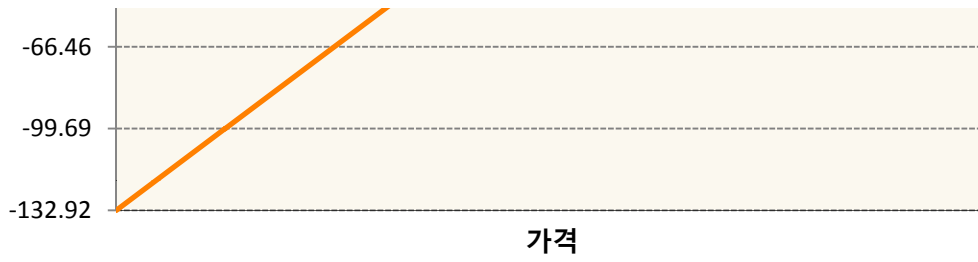
2. 만기시점의 손익구조

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)

150

공시일	2018-05-25
기준일	2018-05-24

커버드콜모(주식혼합-파생형)

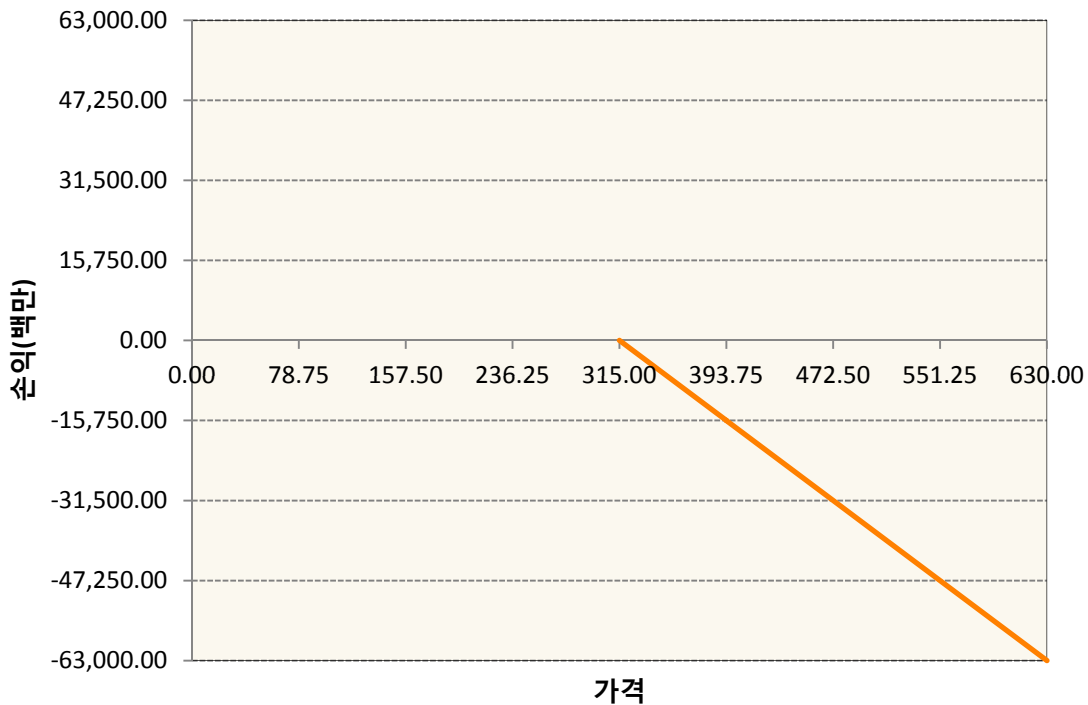
1. 계약금액

(단위:백만원)

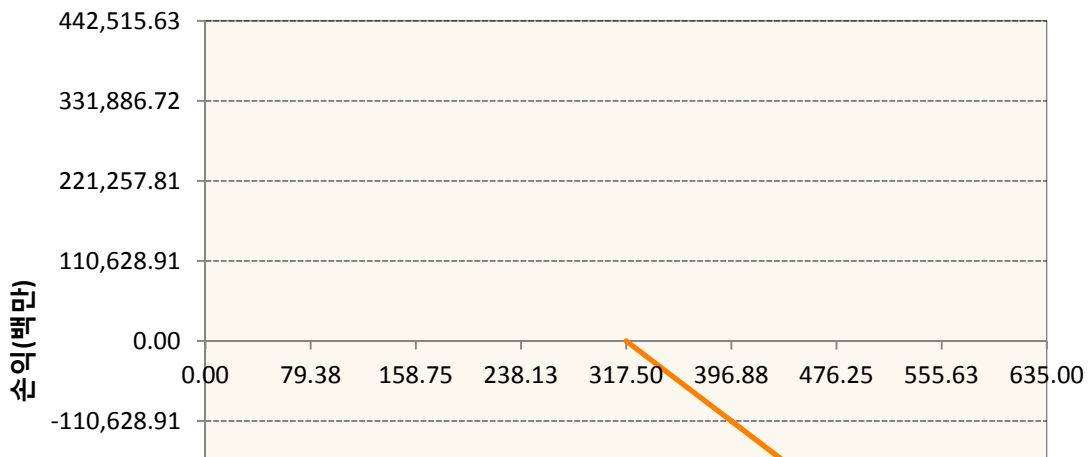
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	813,491	-813,491	장내

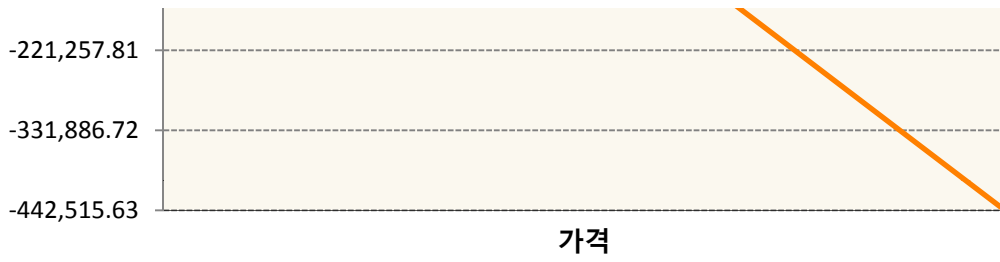
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63159-2018-06 콜315

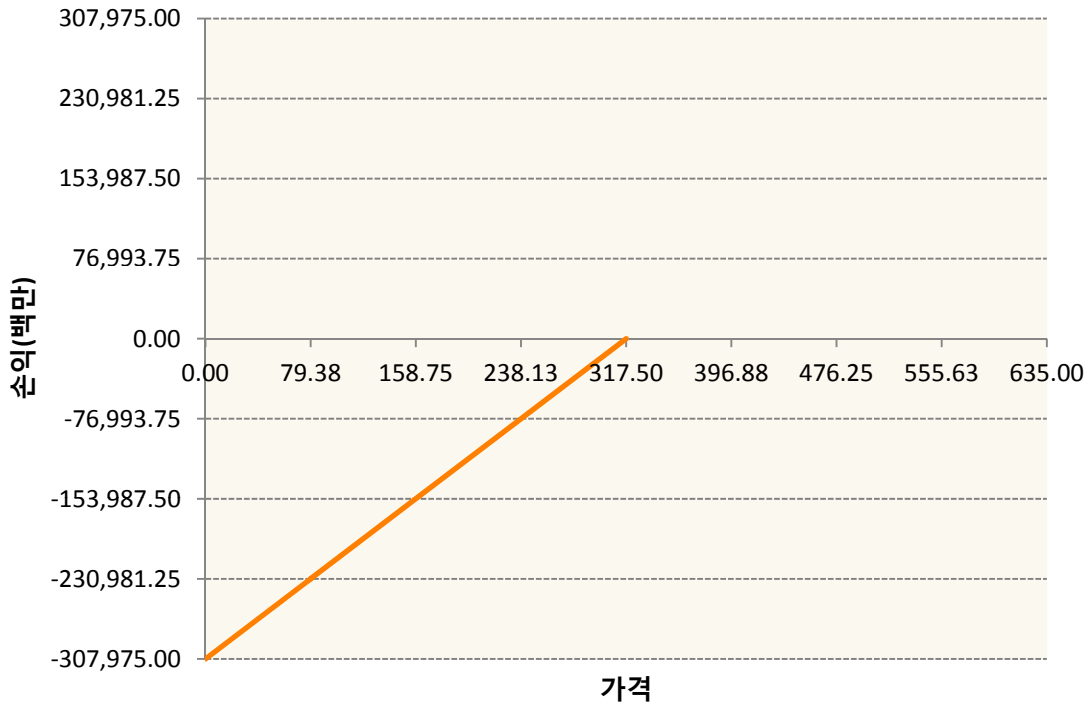


KR4201N63175-2018-06 콜317.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N6312018-06 콜315

4,068

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,864	1,814	1,755	1,687	1,611	1,529	1,442
-5.33%	1,660	1,567	1,467	1,362	1,252	1,139	1,023
-2.67%	1,208	1,078	946	812	678	544	408
0%	420	280	140	0	-140	-281	-421
2.67%	-713	-829	-950	-1,074	-1,201	-1,330	-1,461
5.33%	-2,114	-2,191	-2,277	-2,371	-2,472	-2,578	-2,688
8.00%	-3,680	-3,721	-3,773	-3,834	-3,905	-3,983	-4,068

KR4201N6312018-06 풋317.5

27,265

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,406	11,129	10,783	10,373	9,908	9,393	8,834

-5.33%	10,319	9,754	9,133	8,464	7,758	7,020	6,255
-2.67%	7,740	6,884	6,008	5,116	4,212	3,299	2,377
0%	2,963	1,975	987	0	-987	-1,975	-2,962
2.67%	-4,244	-5,130	-6,036	-6,956	-7,889	-8,831	-9,780
5.33%	-13,510	-14,140	-14,826	-15,558	-16,328	-17,128	-17,954
8.00%	-24,137	-24,498	-24,934	-25,437	-25,998	-26,610	-27,265

KR4301N6312018-06 풋317.5

20,946

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20,891	-20,892	-20,894	-20,899	-20,908	-20,923	-20,946
-5.33%	-12,705	-12,728	-12,764	-12,815	-12,882	-12,966	-13,064
-2.67%	-4,881	-5,043	-5,225	-5,424	-5,636	-5,860	-6,094
0%	932	621	311	0	-311	-621	-932
2.67%	3,297	3,124	2,931	2,722	2,499	2,265	2,021
5.33%	3,708	3,677	3,629	3,564	3,481	3,381	3,264
8.00%	3,735	3,733	3,728	3,718	3,701	3,676	3,640

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

(단위:백만원)

54,598

공시일	2018-05-25
기준일	2018-05-24

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

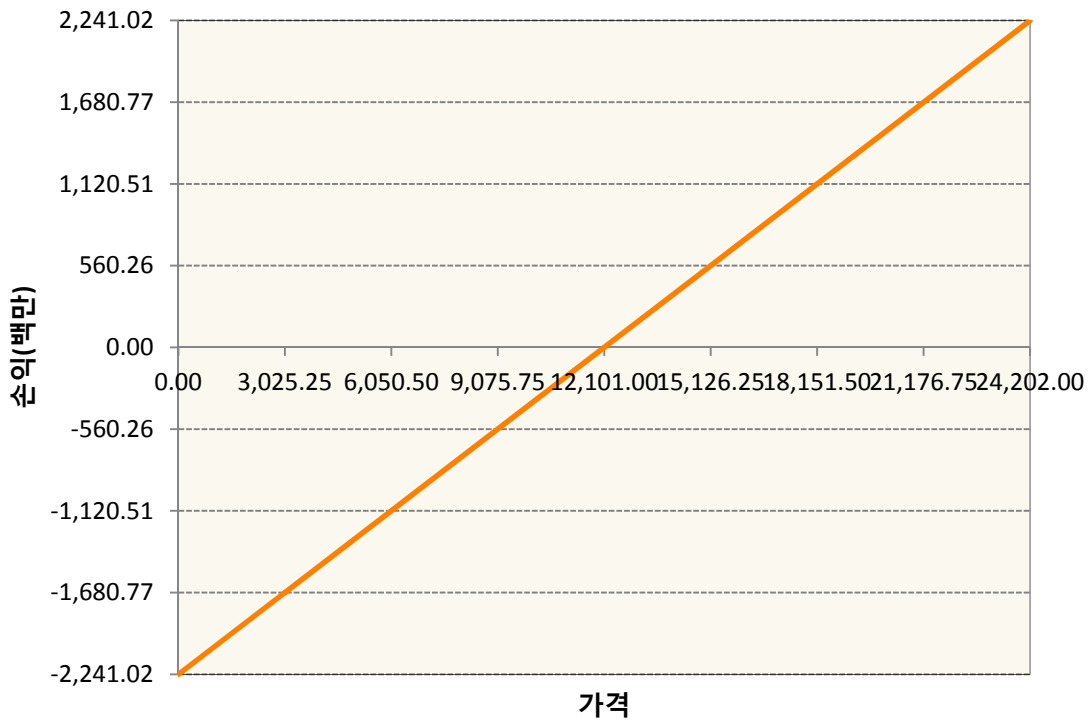
1. 계약금액

(단위:백만원)

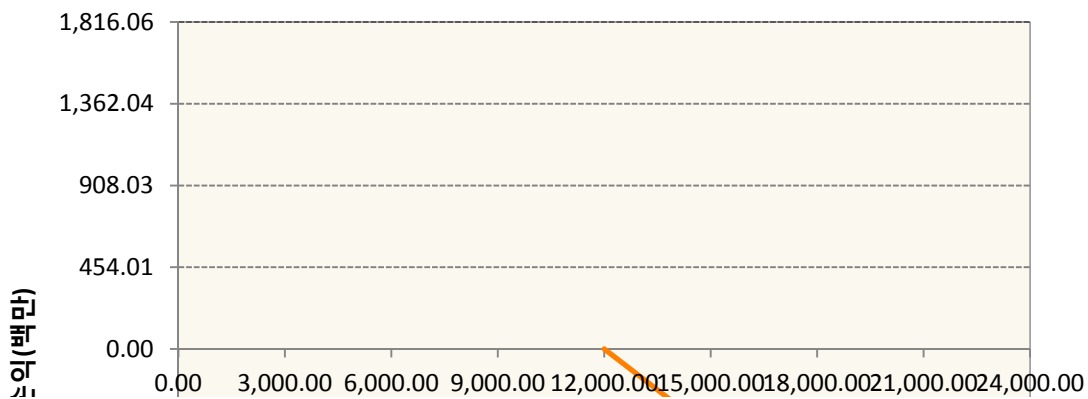
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,241	0	2,241	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,814	-5,814	장내

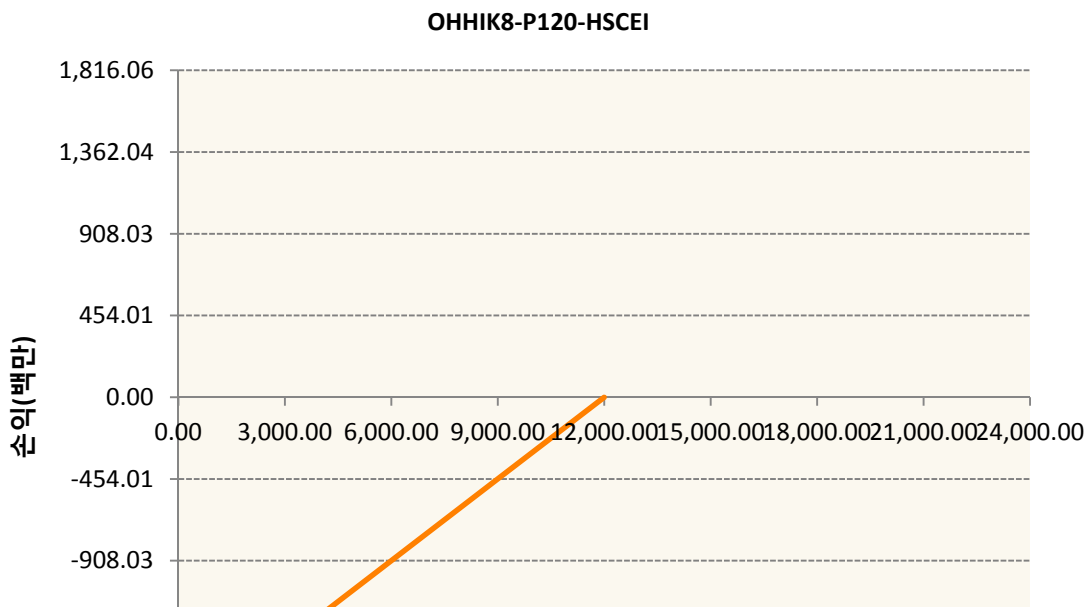
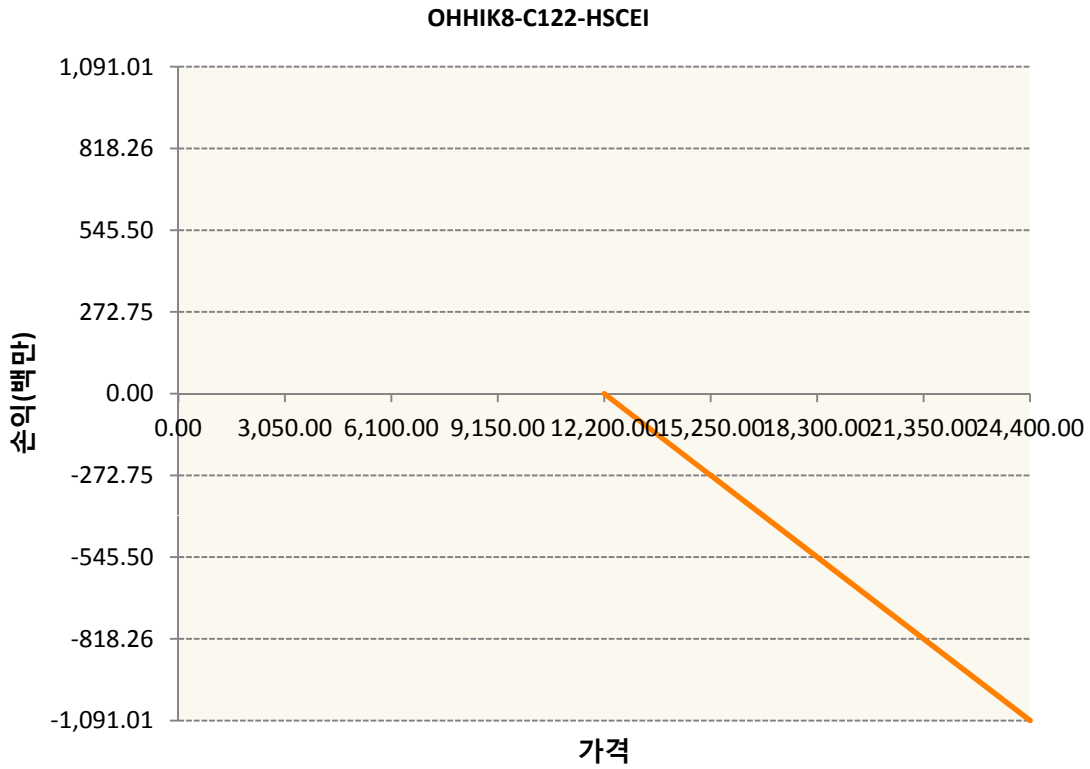
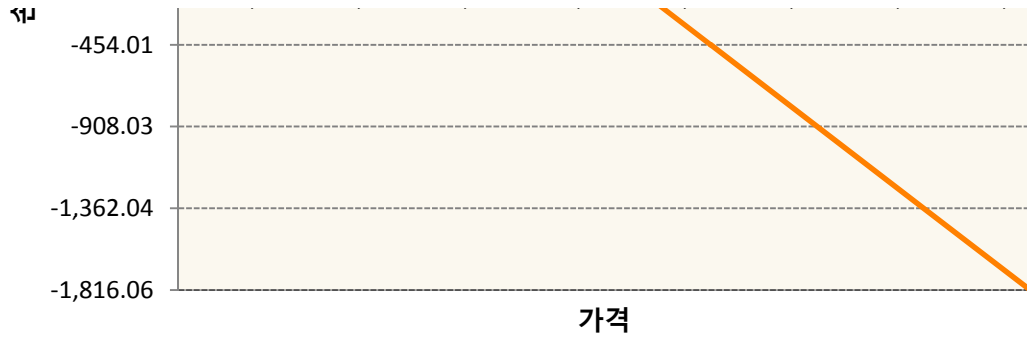
2. 만기시점의 손익구조

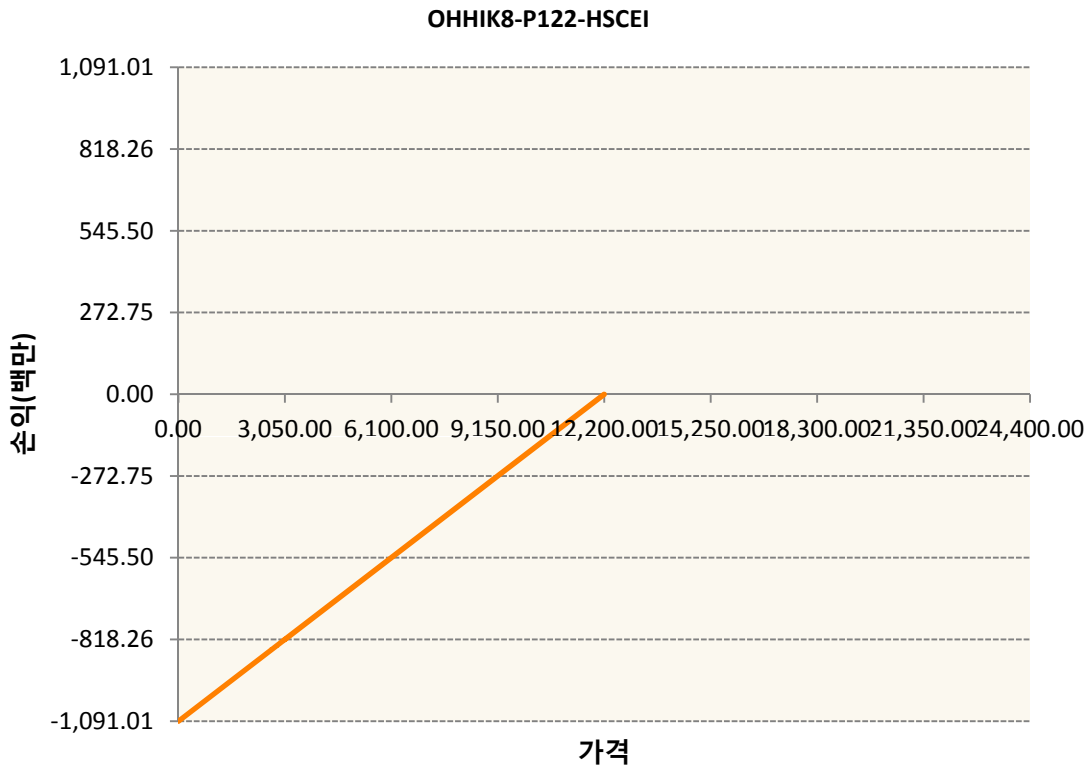
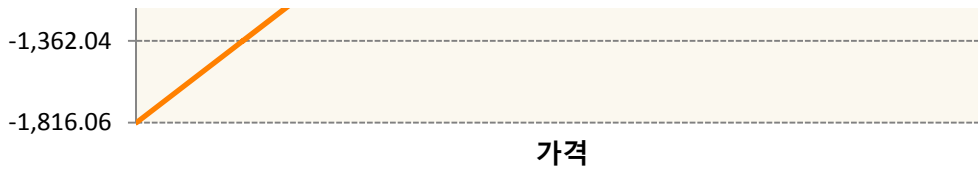
HCK8-H-SHARES FUT May18



OHHK8-C120-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCK8	H-SHARES FUT May18	179
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)
	569

공시일	2018-05-25
기준일	2018-05-24

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

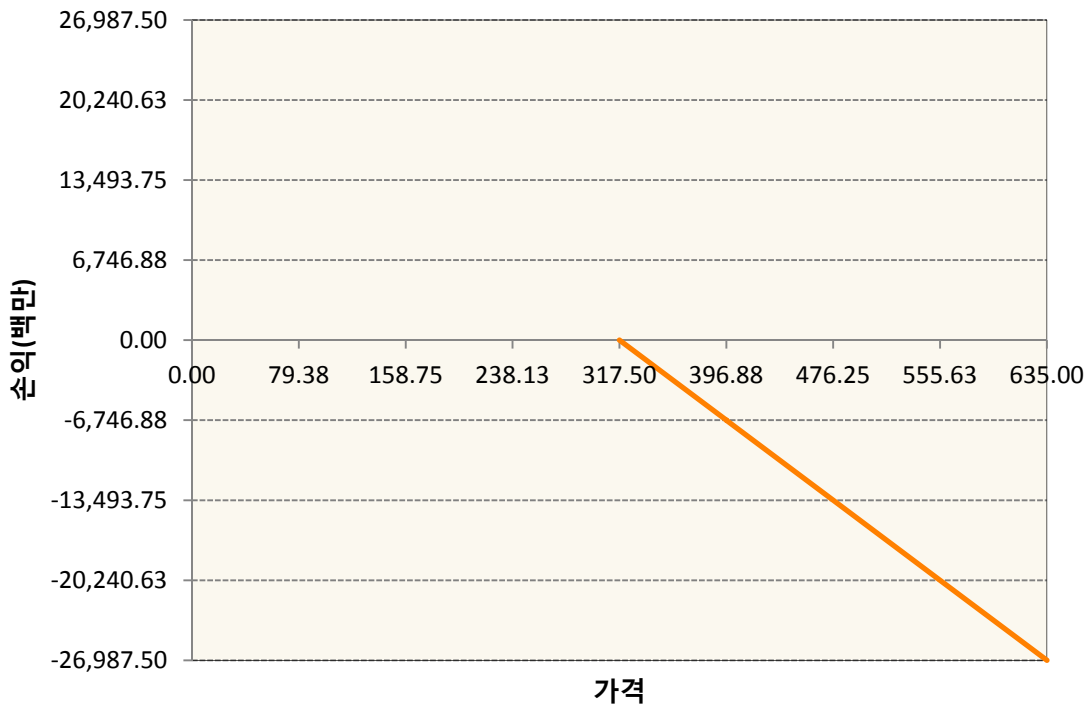
1. 계약금액

(단위:백만원)

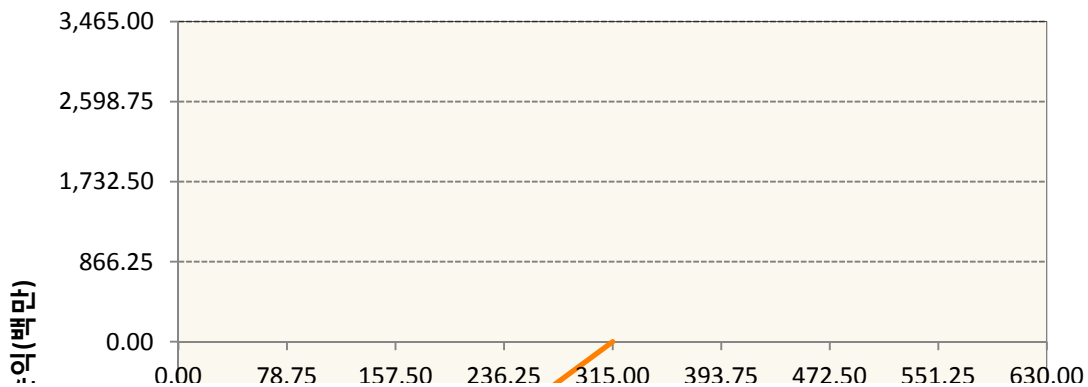
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	46,804	-46,804	장내

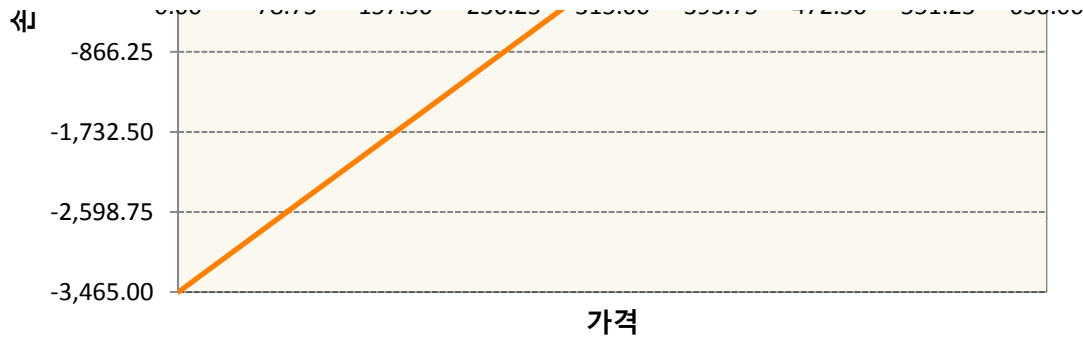
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63175-2018-06 콜317.5

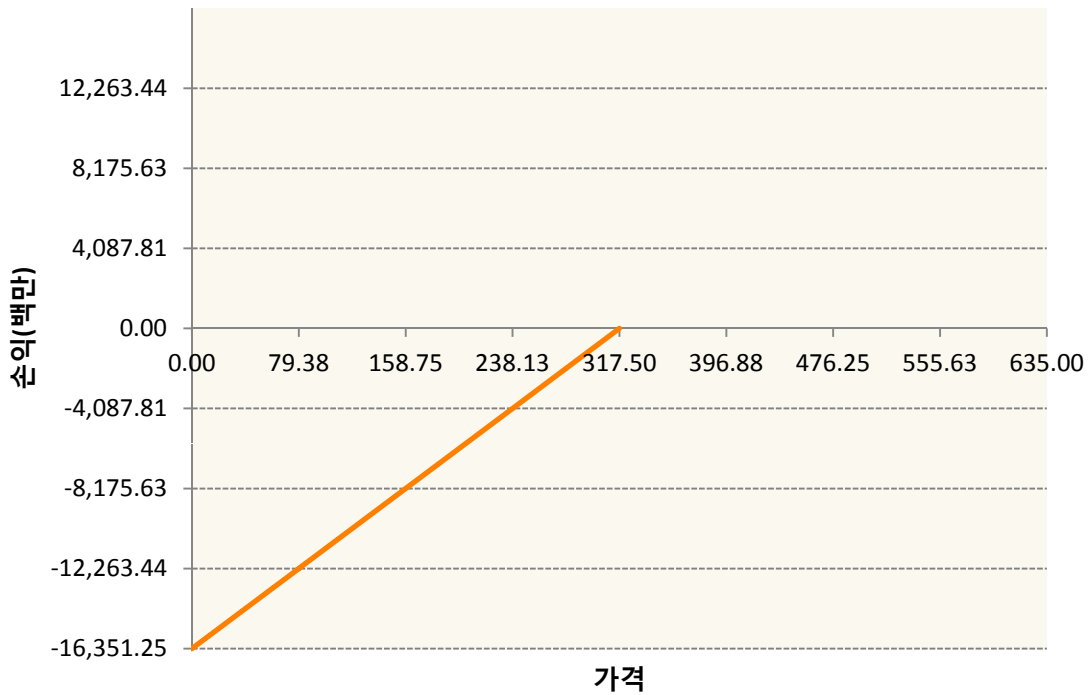


KR4301N63157-2018-06 풋315





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_2							1,477
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,477	-1,477	-1,477	-1,477	-1,477	-1,477	-1,477
-5.33%	-985	-985	-985	-985	-985	-985	-985
-2.67%	-492	-492	-492	-492	-492	-492	-492
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	492	492	492	492	492	492	492
5.33%	985	985	985	985	985	985	985
8.00%	1,477	1,477	1,477	1,477	1,477	1,477	1,477
2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_3							279
	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%	-319	-319	-319	-319	-319	-319	-319
-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%	319	319	319	319	319	319	319
8.00%	479	479	479	479	479	479	479

KR4201N6312018-06 콜317.5

1,663

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	696	679	658	633	604	573	539
-5.33%	629	595	557	516	473	428	381
-2.67%	472	420	366	312	257	201	145
0%	181	120	60	0	-60	-120	-181
2.67%	-259	-313	-368	-424	-481	-539	-596
5.33%	-824	-862	-904	-949	-996	-1,045	-1,095
8.00%	-1,472	-1,494	-1,521	-1,551	-1,586	-1,623	-1,663

KR4301N6312018-06 풋315

223

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-222	-222	-222	-222	-222	-223	-223
-5.33%	-129	-130	-131	-132	-133	-134	-136
-2.67%	-45	-47	-50	-53	-55	-58	-61
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	28	26	25	23	21	19	16
5.33%	30	30	29	29	28	27	27
8.00%	30	30	30	30	30	30	29

KR4301N6312018-06 풋317.5

1,112

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,109	-1,109	-1,109	-1,110	-1,110	-1,111	-1,112
-5.33%	-675	-676	-678	-680	-684	-688	-694
-2.67%	-259	-268	-277	-288	-299	-311	-324
0%	49	33	16	0	-16	-33	-49
2.67%	175	166	156	145	133	120	107
5.33%	197	195	193	189	185	179	173
8.00%	198	198	198	197	197	195	193

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

(단위:백만원)

6,984

공시일	2018-05-25
기준일	2018-05-24

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

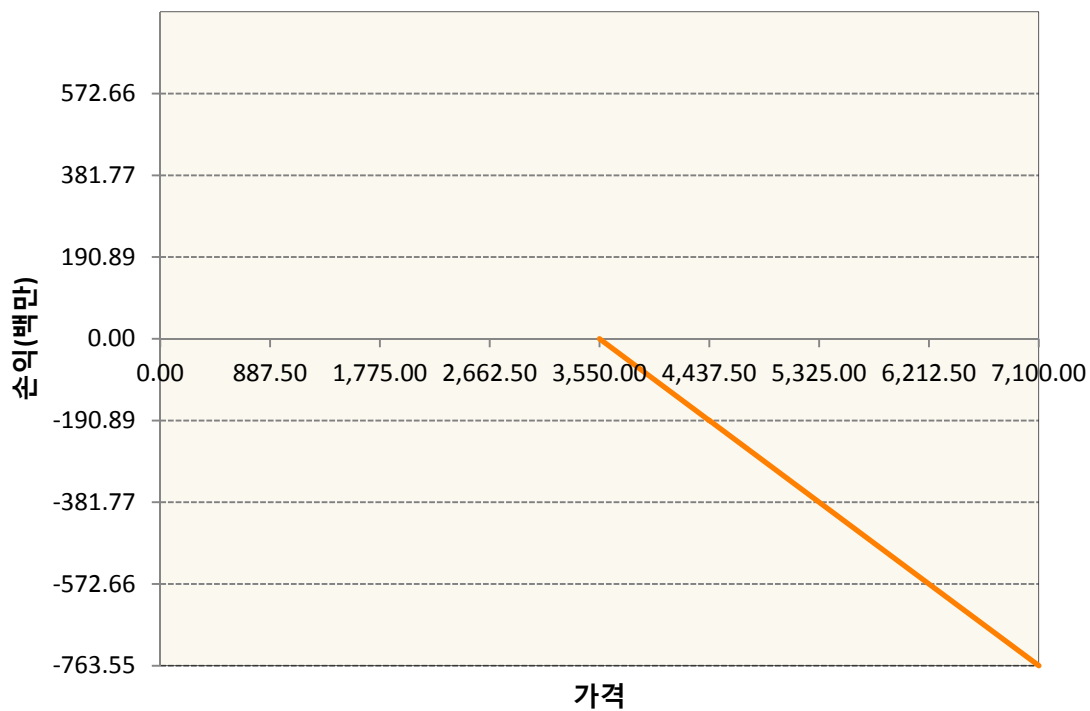
1. 계약금액

(단위:백만원)

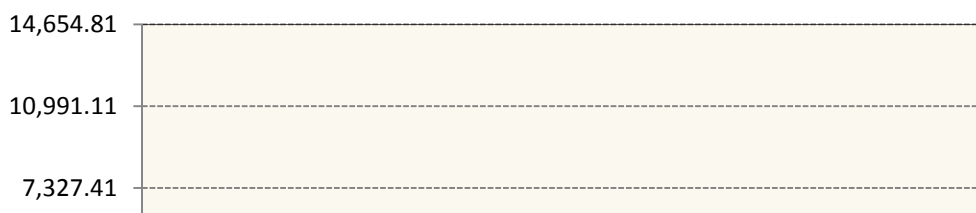
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,333	0	7,333	
누계	유가증권	스왑	53,344	0	53,344	장외
누계	유가증권	옵션	0	30,837	-30,837	장내
누계	지수	스왑	50,610	0	50,610	장외

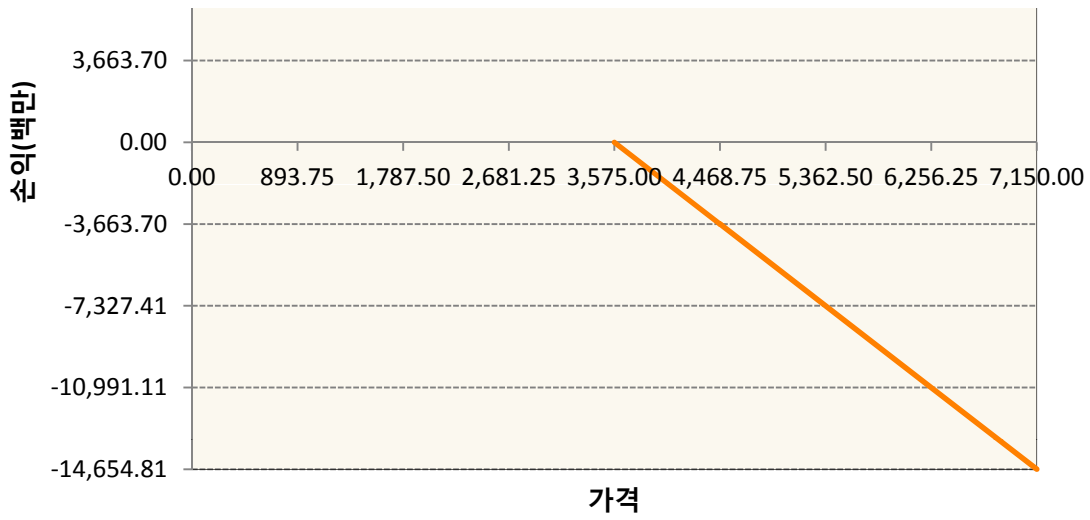
2. 만기시점의 손익구조

OESXM8-C3550-EURO STOXX 50

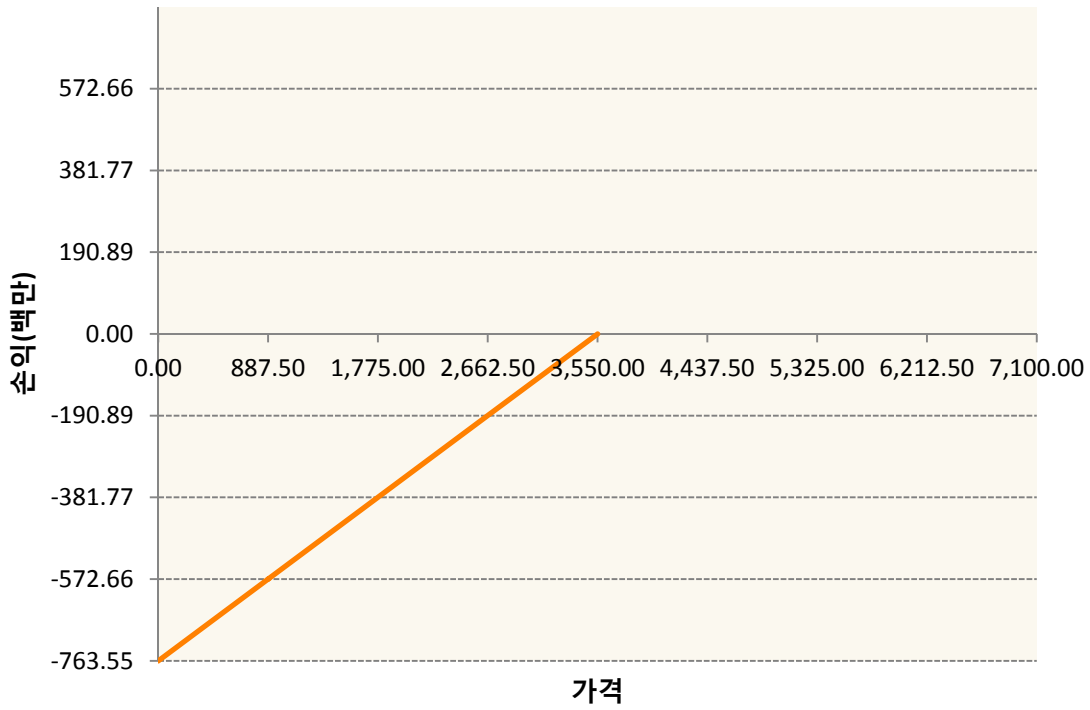


OESXM8-C3575-EURO STOXX 50



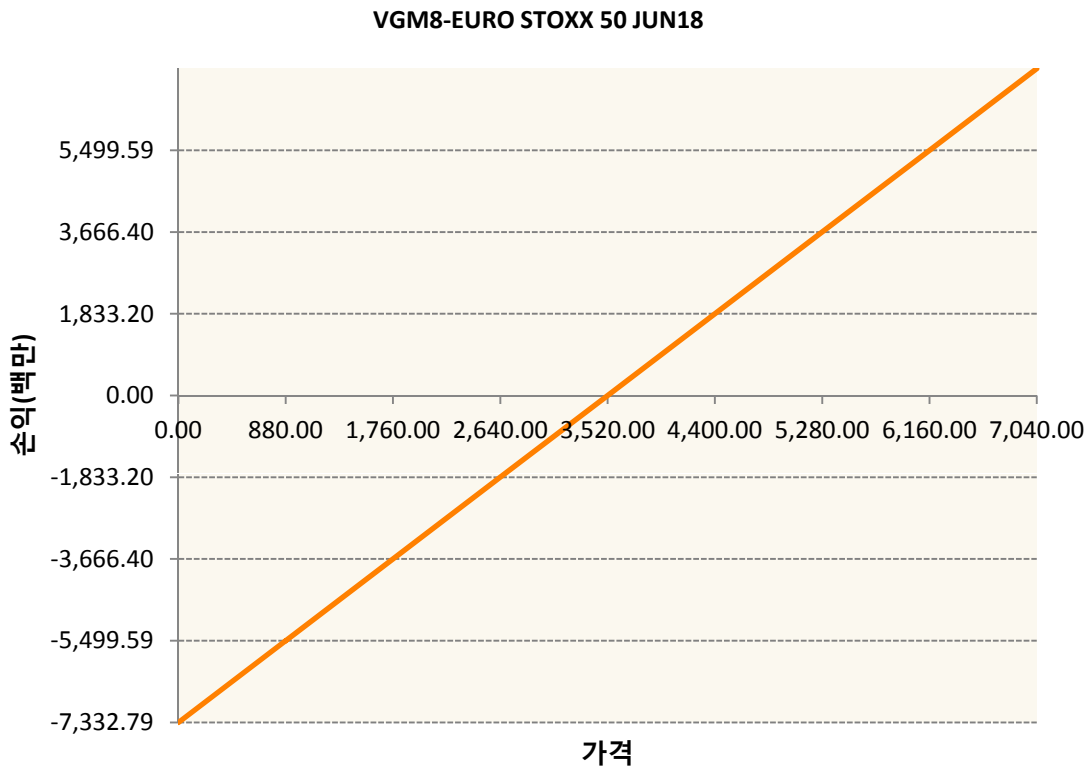
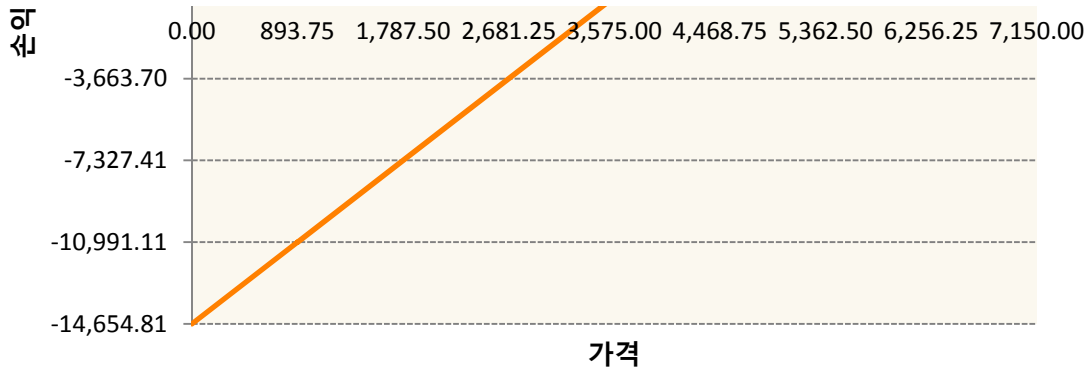


OESXM8-P3550-EURO STOXX 50



OESXM8-P3575-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		78
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		82
OESXM8-C3 EURO STOXX 50		61
OESXM8-C3 EURO STOXX 50		1,172
OESXM8-P3! EURO STOXX 50		61
OESXM8-P3! EURO STOXX 50		1,172
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18		587

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

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

(단위:백만원)

1,171

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)

217

공시일	2018-05-25
기준일	2018-05-24

스마트KRX300인덱스목표전환형1

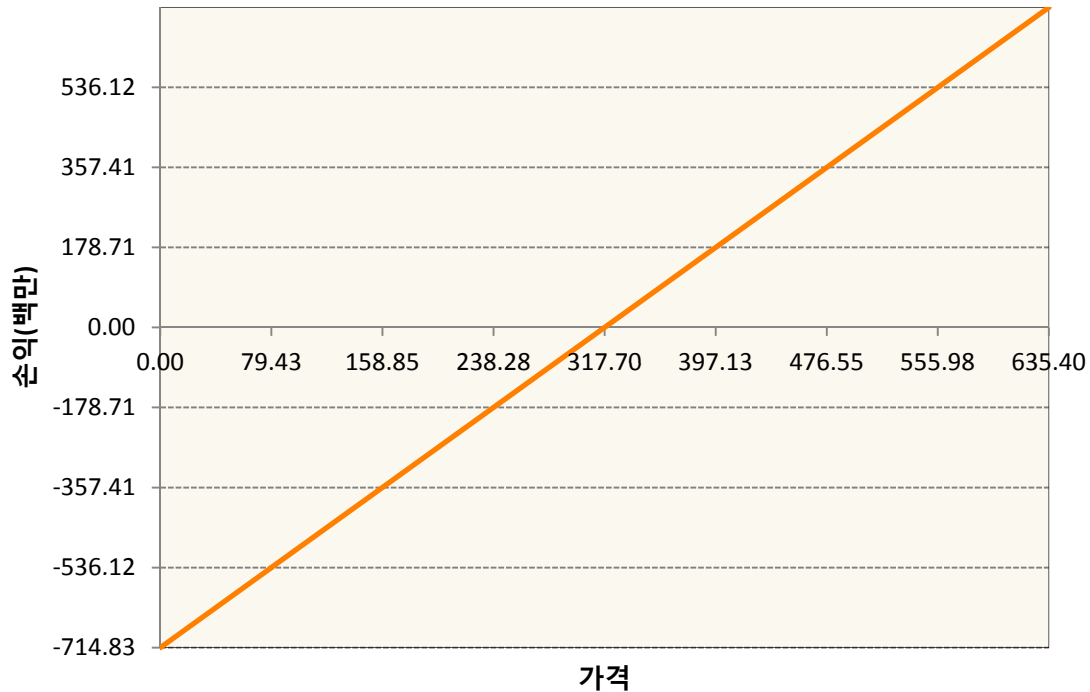
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	715	0	715	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	2018-05-25
기준일	2018-05-24

리디파인K200(주식혼합-파생재간

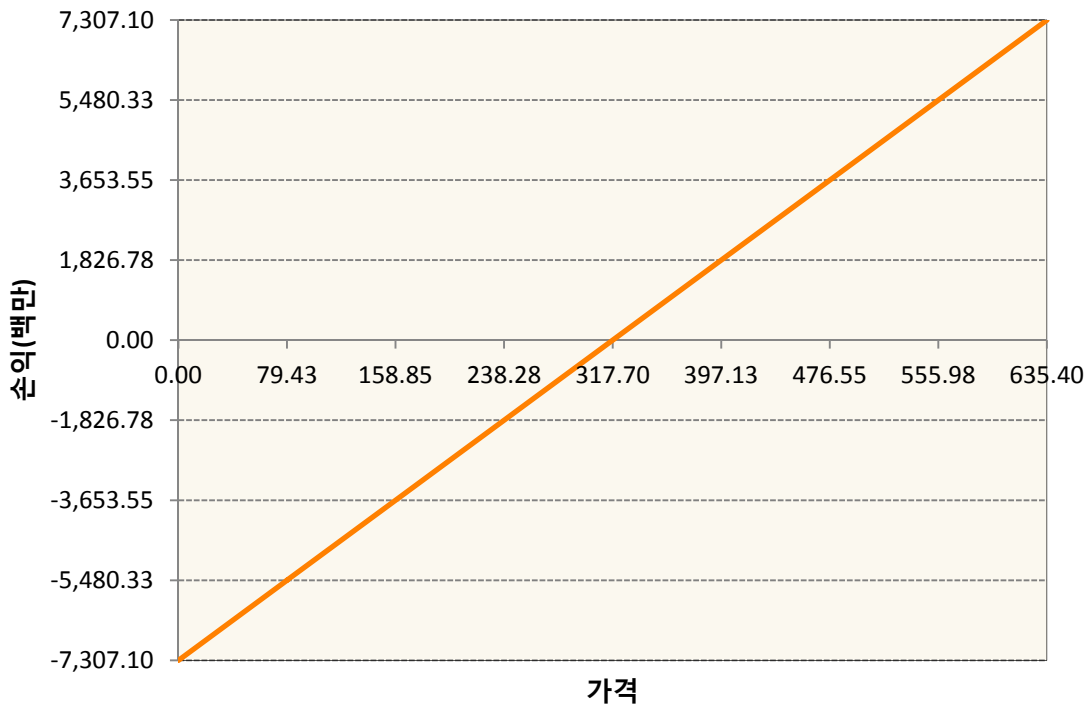
1. 계약금액

(단위:백만원)

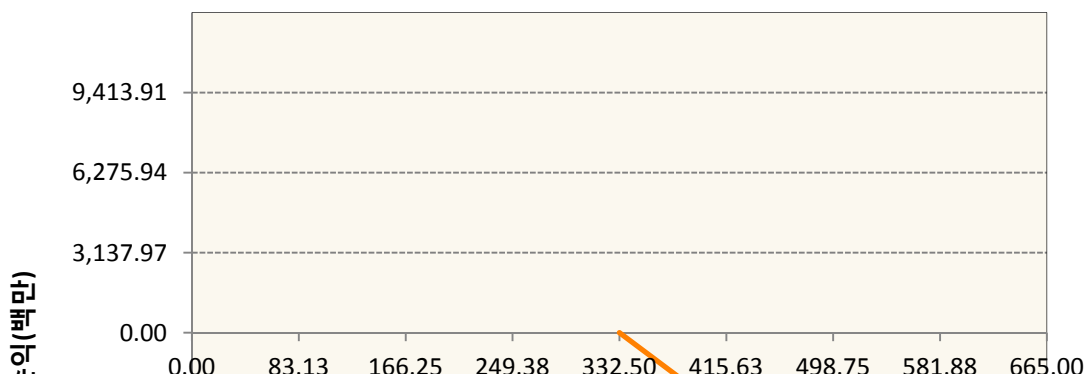
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,428	0	1,428	장내
신규	유가증권	옵션	236	2,329	-2,093	장내
누계	유가증권	선물	7,307	0	7,307	장내
누계	유가증권	옵션	1,508	12,552	-11,044	장내

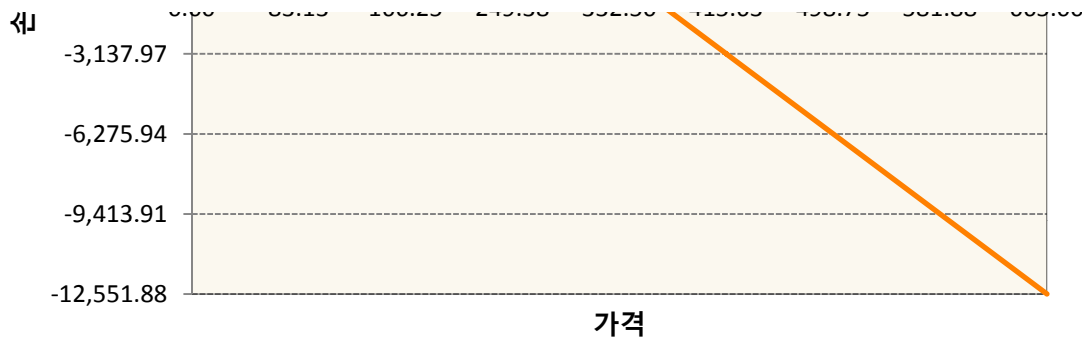
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

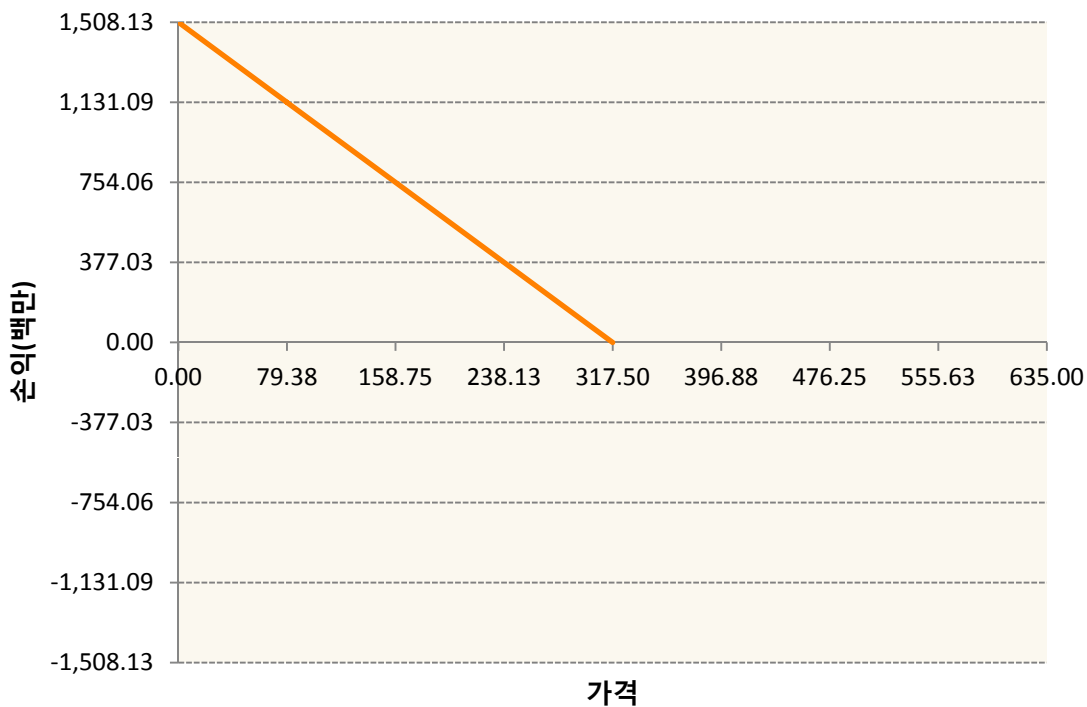


KR4201N63324-2018-06 콜332.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물							584
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-584	-584	-584	-584	-584	-584	-584
-5.33%	-389	-389	-389	-389	-389	-389	-389
-2.67%	-195	-195	-195	-195	-195	-195	-195
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	195	195	195	195	195	195	195
5.33%	389	389	389	389	389	389	389
8.00%	584	584	584	584	584	584	584
KR4201N63E 2018-06 콜332.5							531
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	119	118	116	112	107	101	94
-5.33%	115	111	105	97	87	77	64
-2.67%	100	90	77	63	48	31	13
0%	60	41	21	0	-22	-45	-68
2.67%	-25	-51	-77	-104	-130	-157	-184
5.33%	-170	-198	-226	-254	-282	-310	-338
8.00%	-378	-402	-427	-452	-478	-504	-531

KR4301N6312018-06 풋317.5

103

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	102	102	102	102	102	102	103
-5.33%	62	62	63	63	63	63	64
-2.67%	24	25	26	27	28	29	30
0%	-5	-3	-2	0	2	3	5
2.67%	-16	-15	-14	-13	-12	-11	-10
5.33%	-18	-18	-18	-17	-17	-17	-16
8.00%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18

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

(단위:백만원)

913

공시일	2018-05-25
기준일	2018-05-24

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

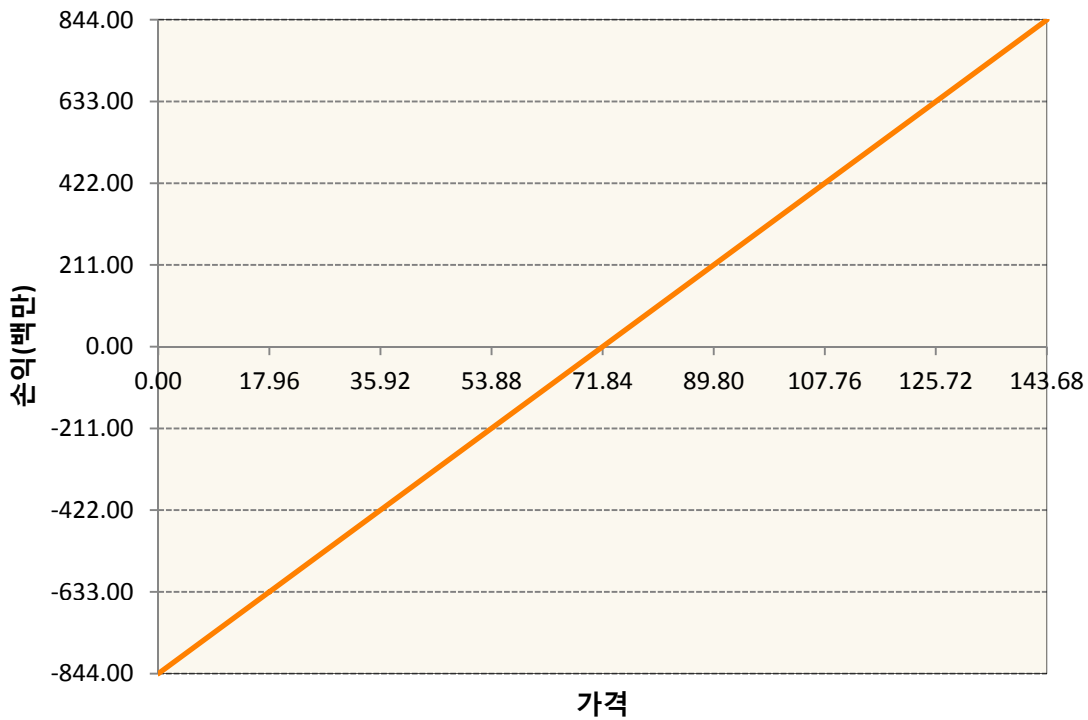
1. 계약금액

(단위:백만원)

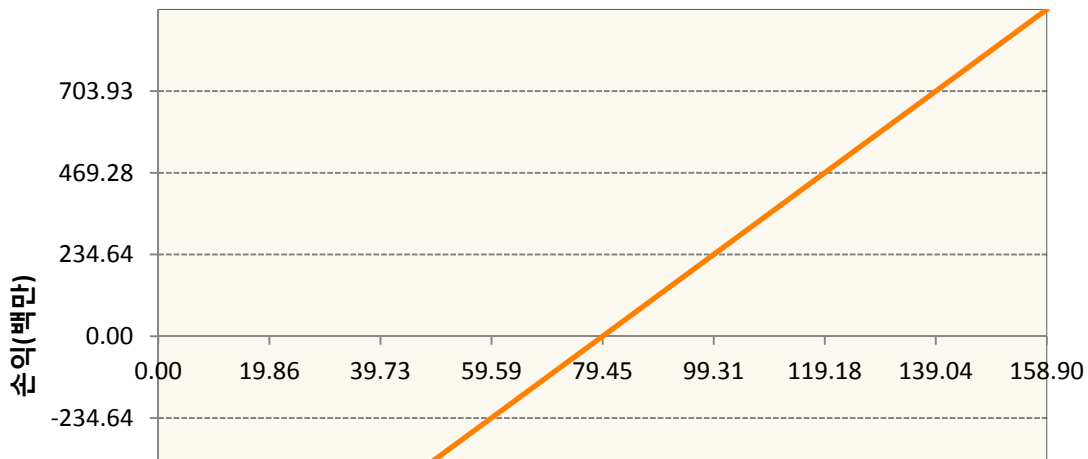
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,006	593	3,413	

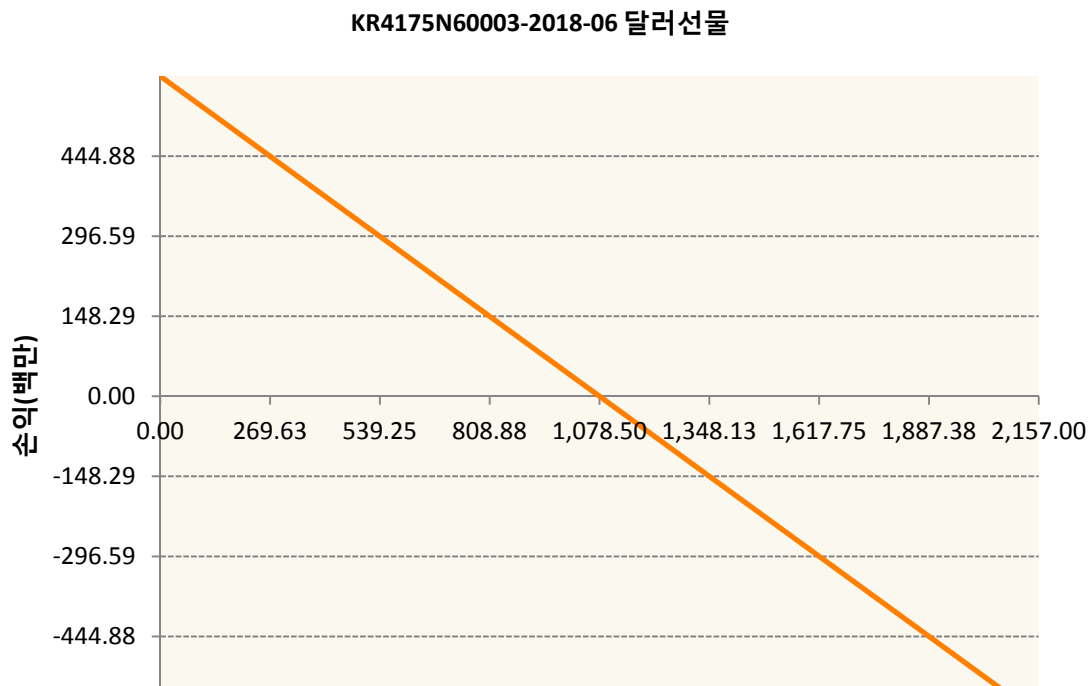
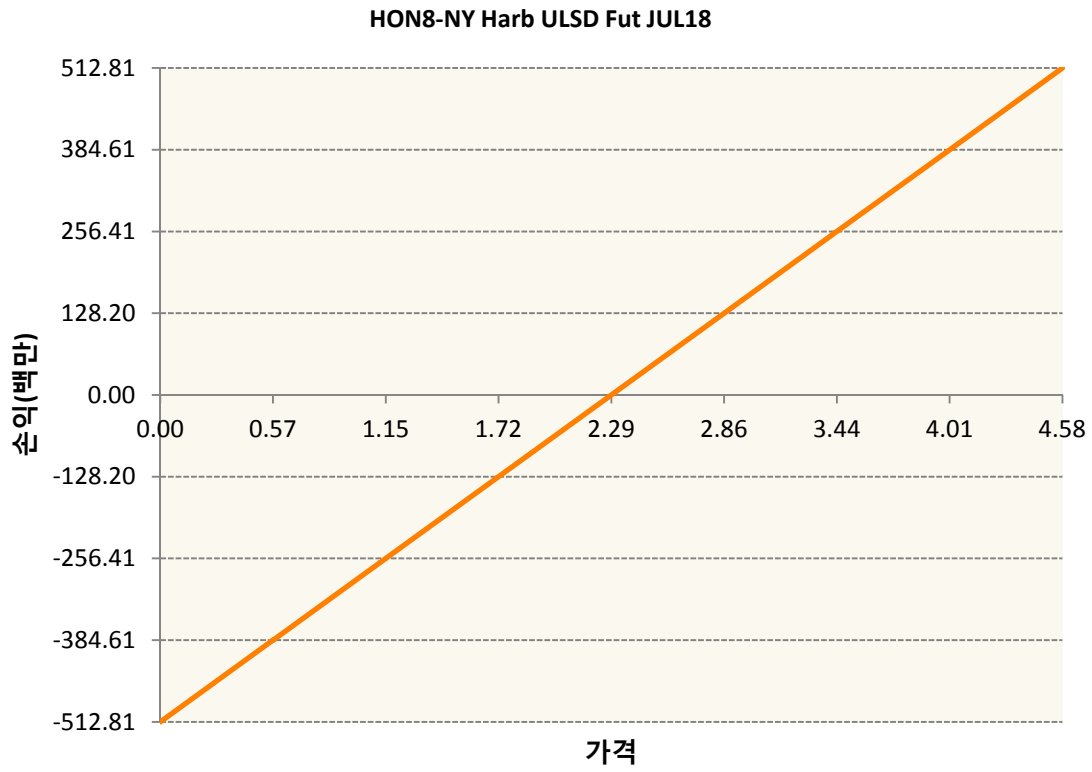
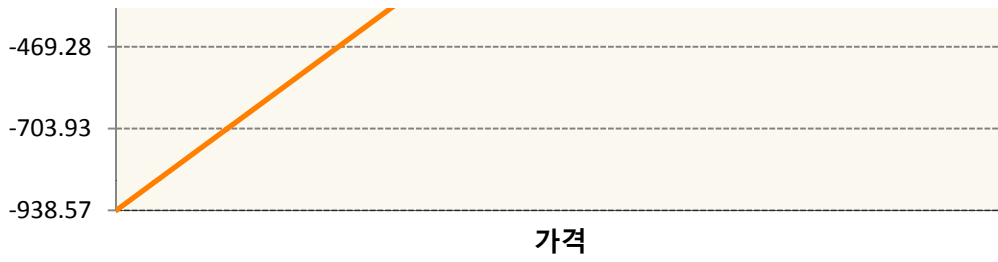
2. 만기시점의 손익구조

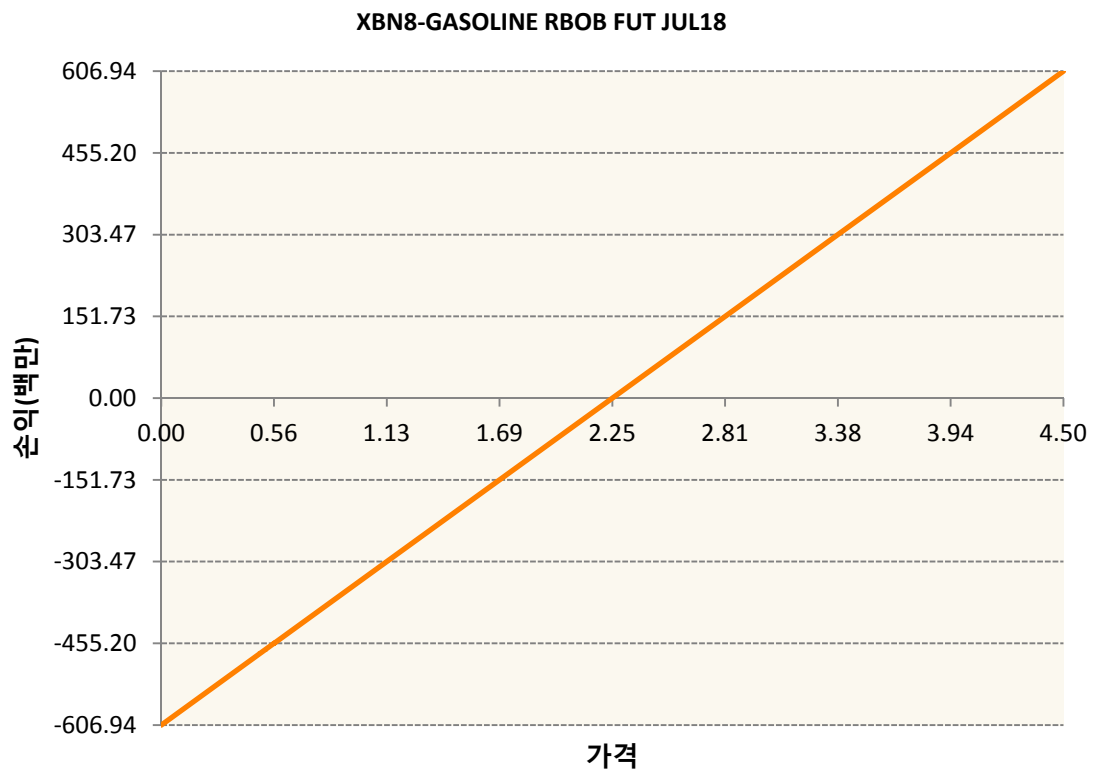
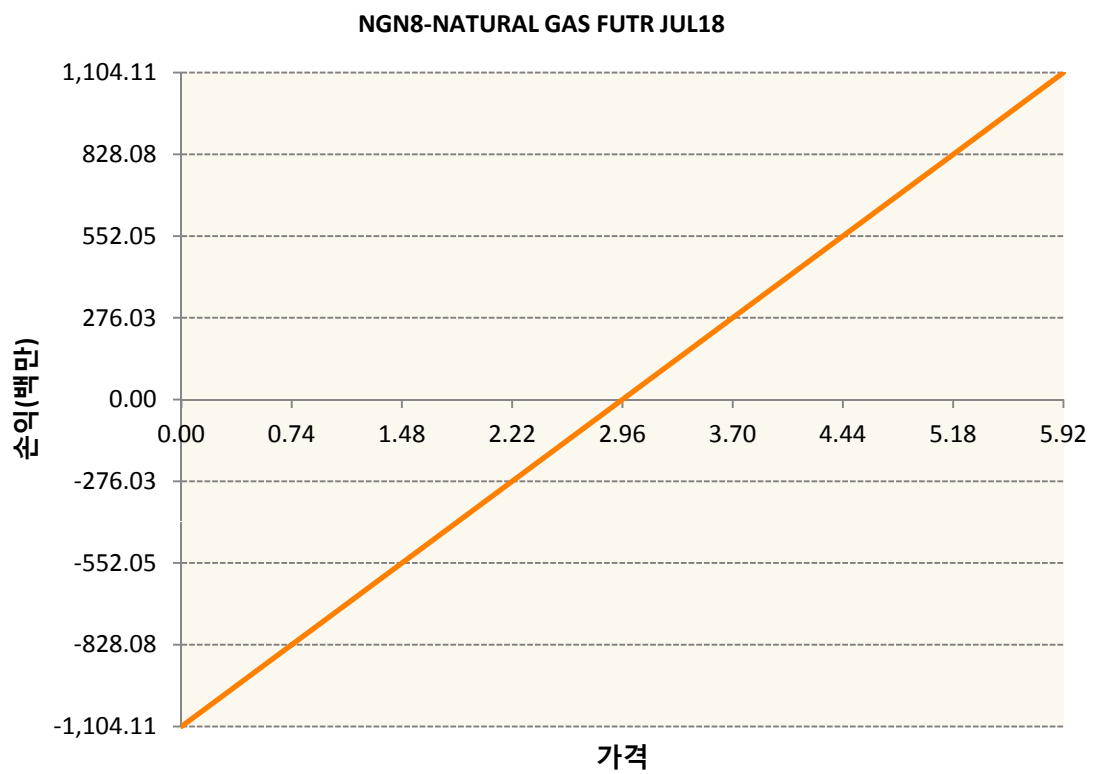
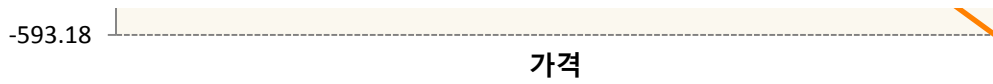
CLN8-WTI CRUDE FUTURE JUL18



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)

483

공시일	2018-05-25
기준일	2018-05-24

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

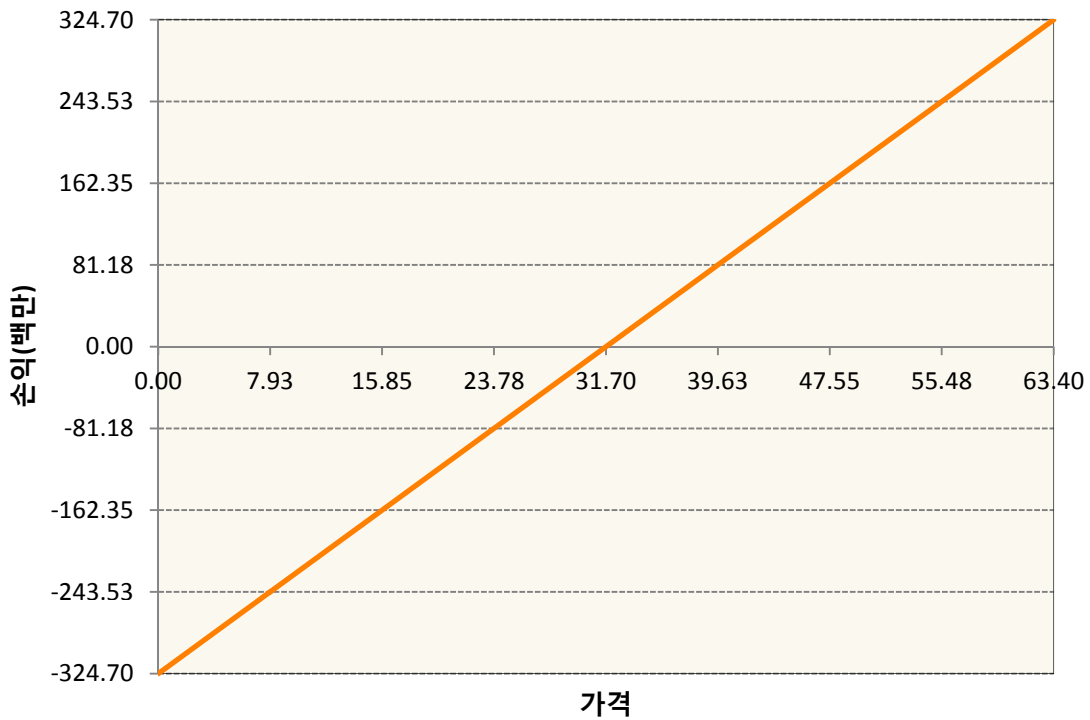
1. 계약금액

(단위:백만원)

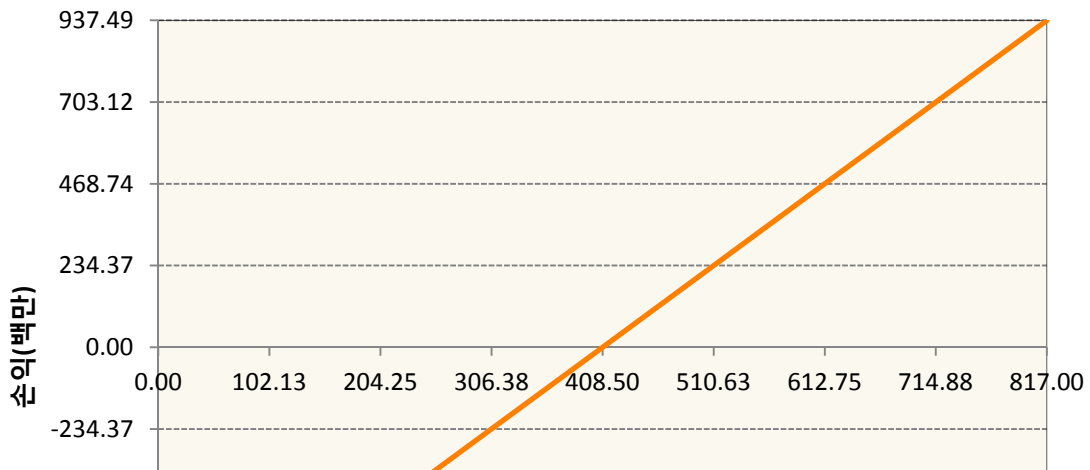
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,178	324	3,854	

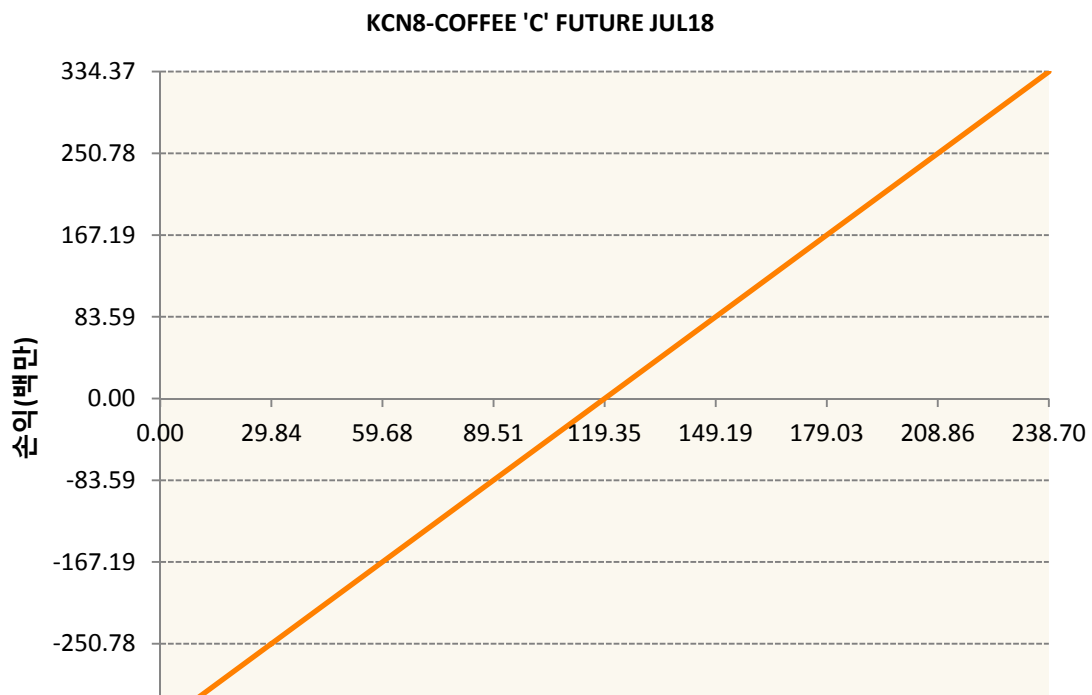
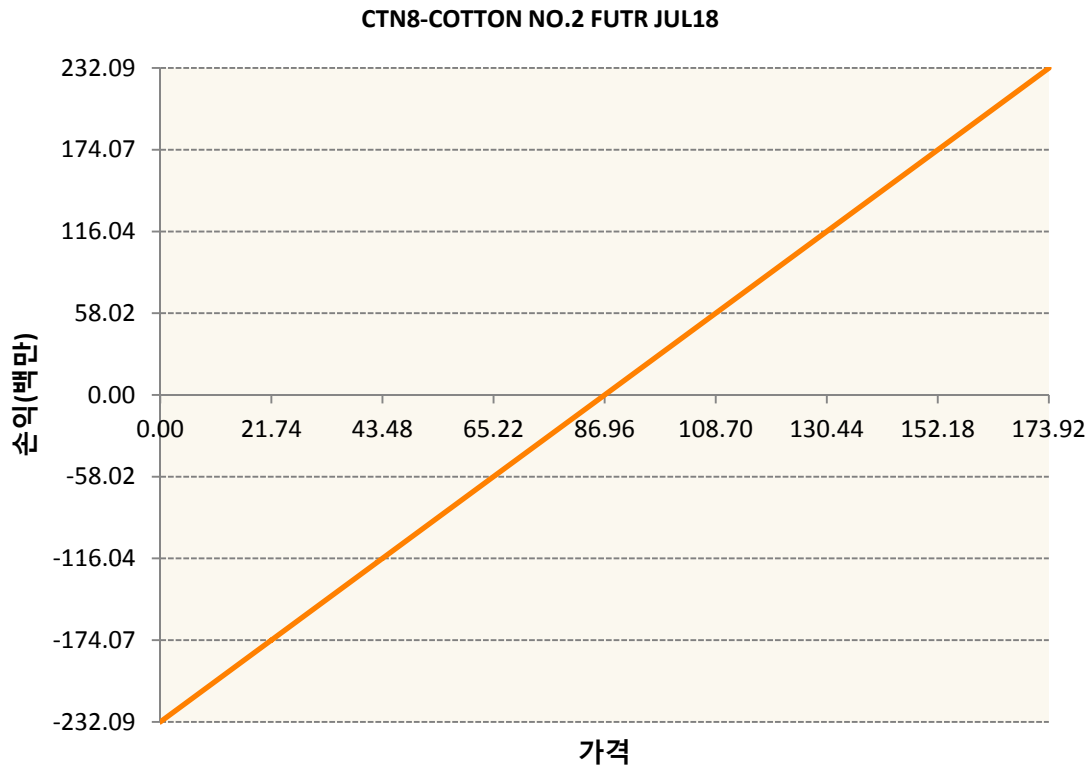
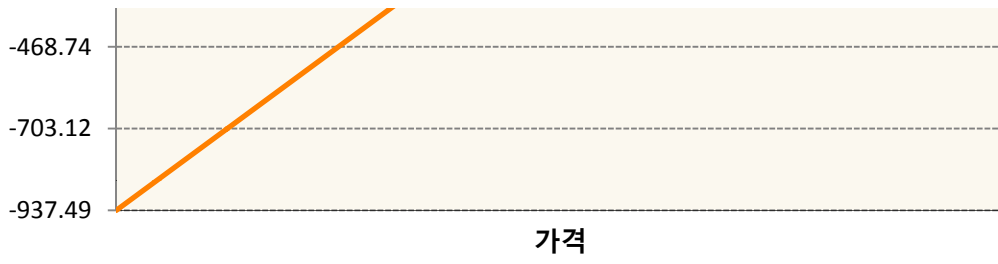
2. 만기시점의 손익구조

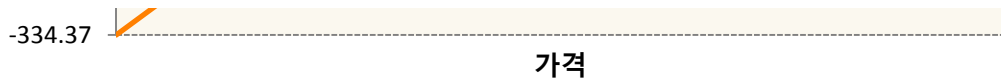
BON8-SOYBEAN OIL FUTR JUL18



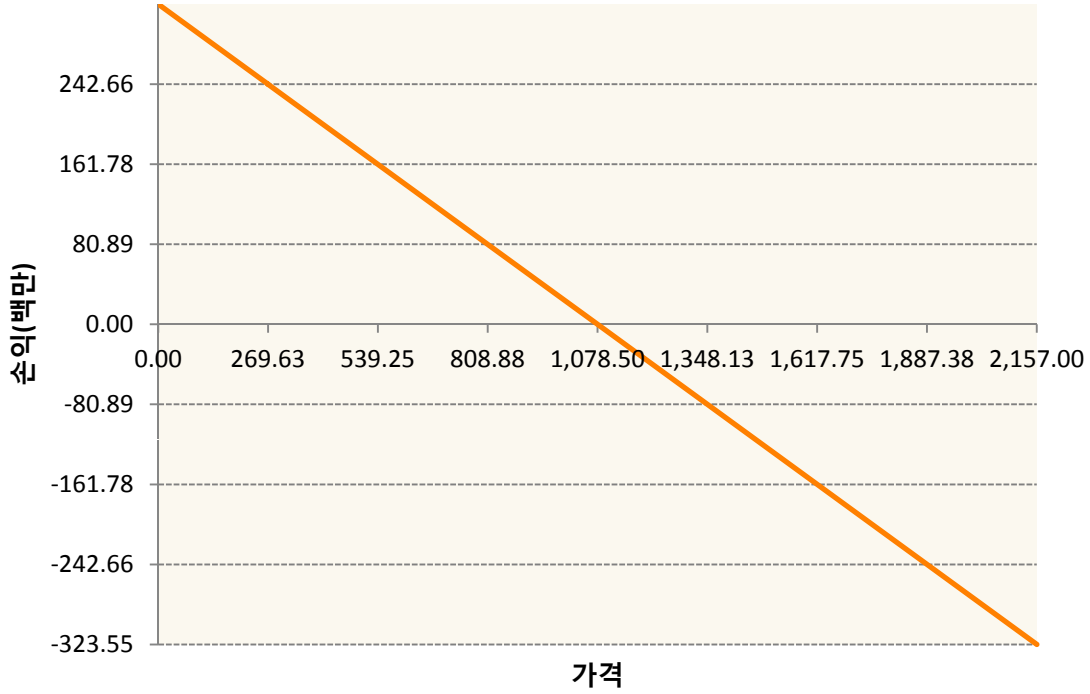
CN8-CORN FUTURE JUL18



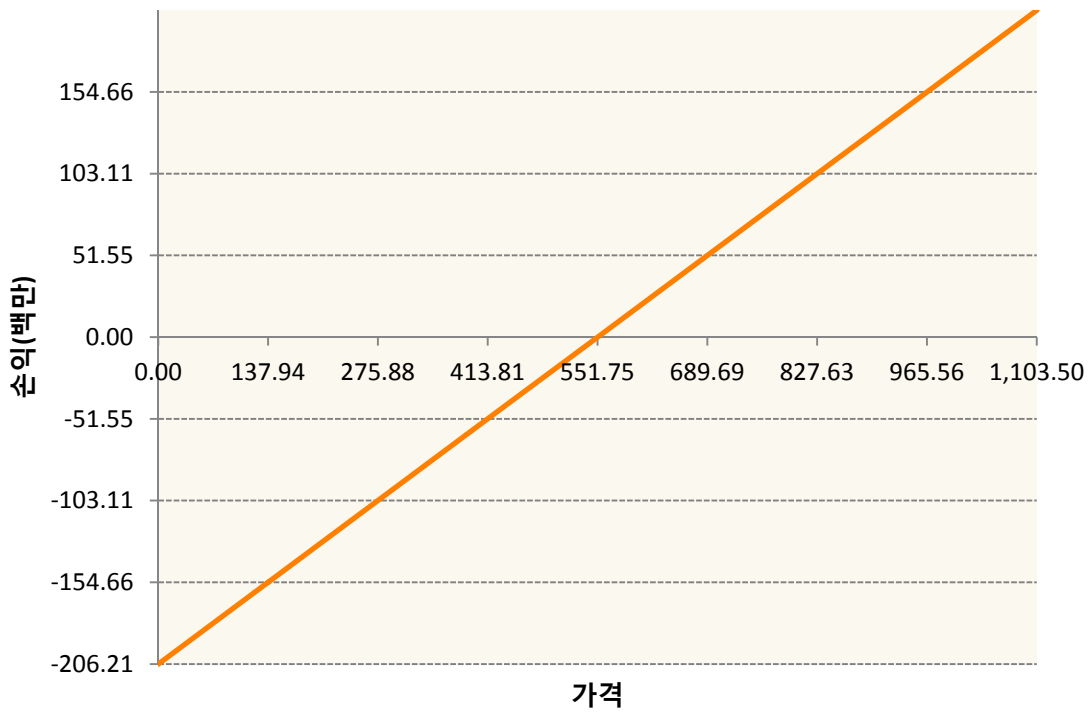




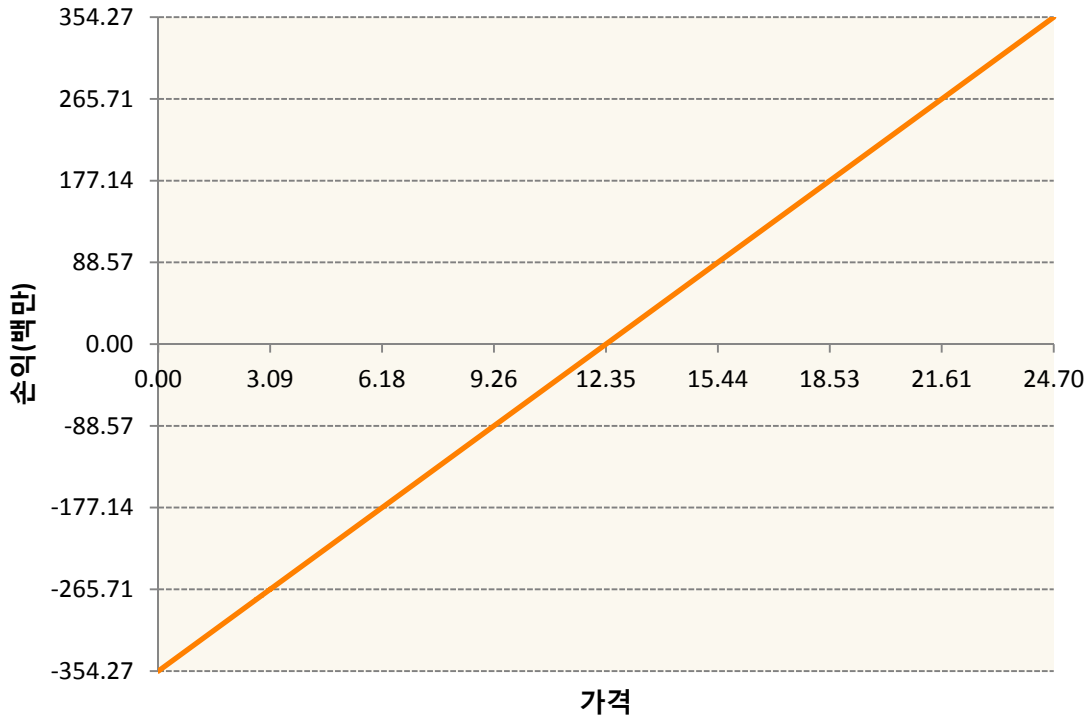
KR4175N60003-2018-06 달러선물



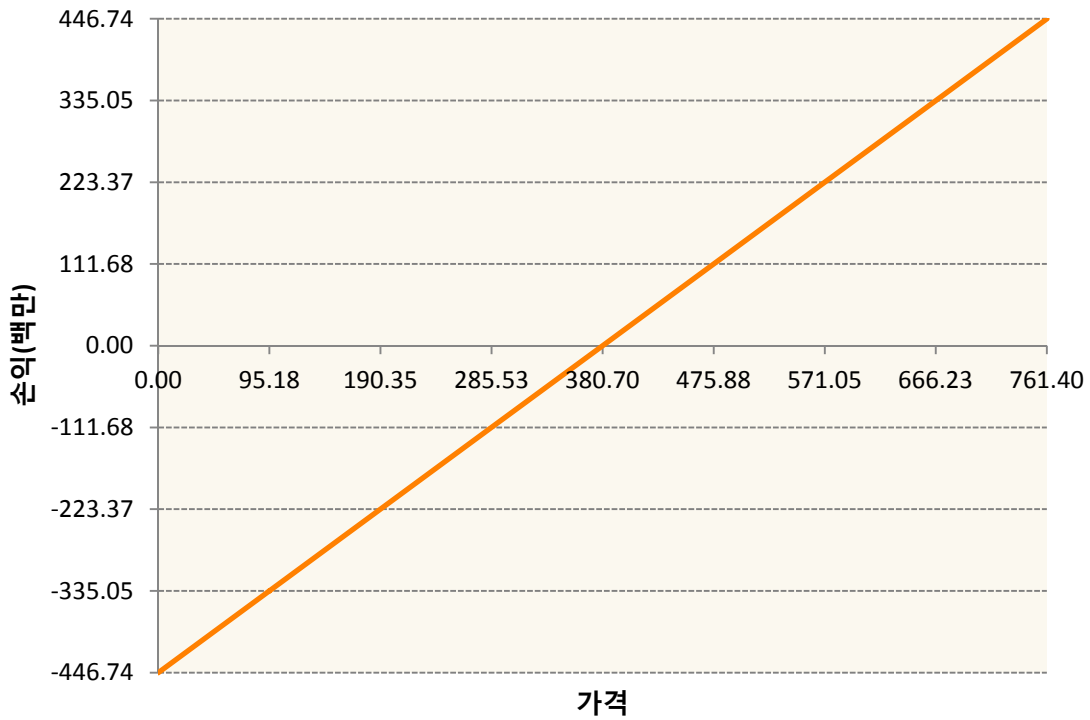
KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18



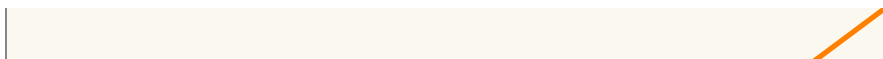
SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18

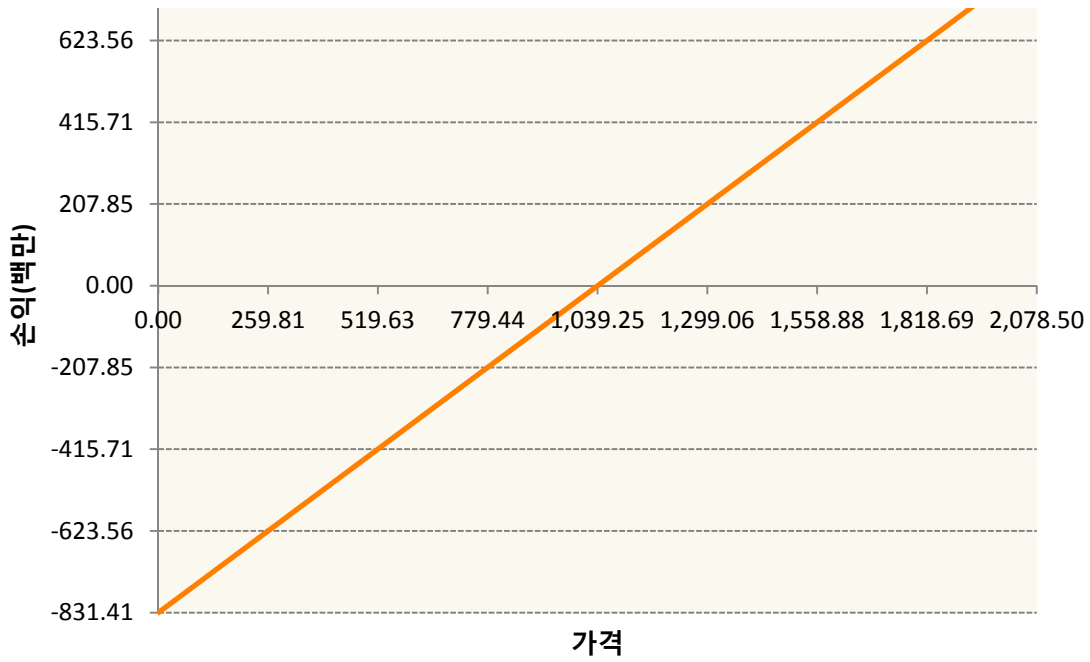


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18

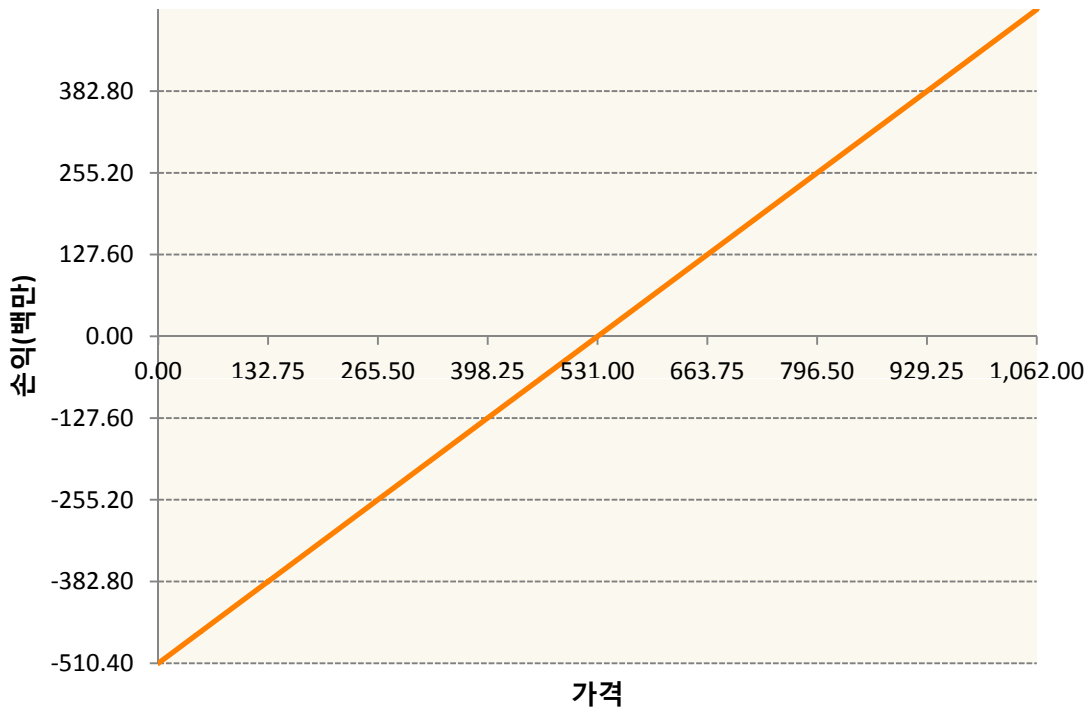


SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18





WN8-WHEAT FUTURE(CBT) JUL18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON8	SOYBEAN OIL FUTR JUL18	26
CN8	CORN FUTURE JUL18	75
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	36
SN8	SOYBEAN FUTURE JUL18	67
WN8	WHEAT FUTURE(CBT) JUL18	41

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

(단위:백만원)

339