

공시일	2018-05-28
기준일	2018-05-25

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	2018-05-28
기준일	2018-05-25

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

1,118

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

457

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-05-28
기준일	2018-05-25

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

391

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

415

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-05-28
기준일	2018-05-25

유로인덱스모(주식-파생형)

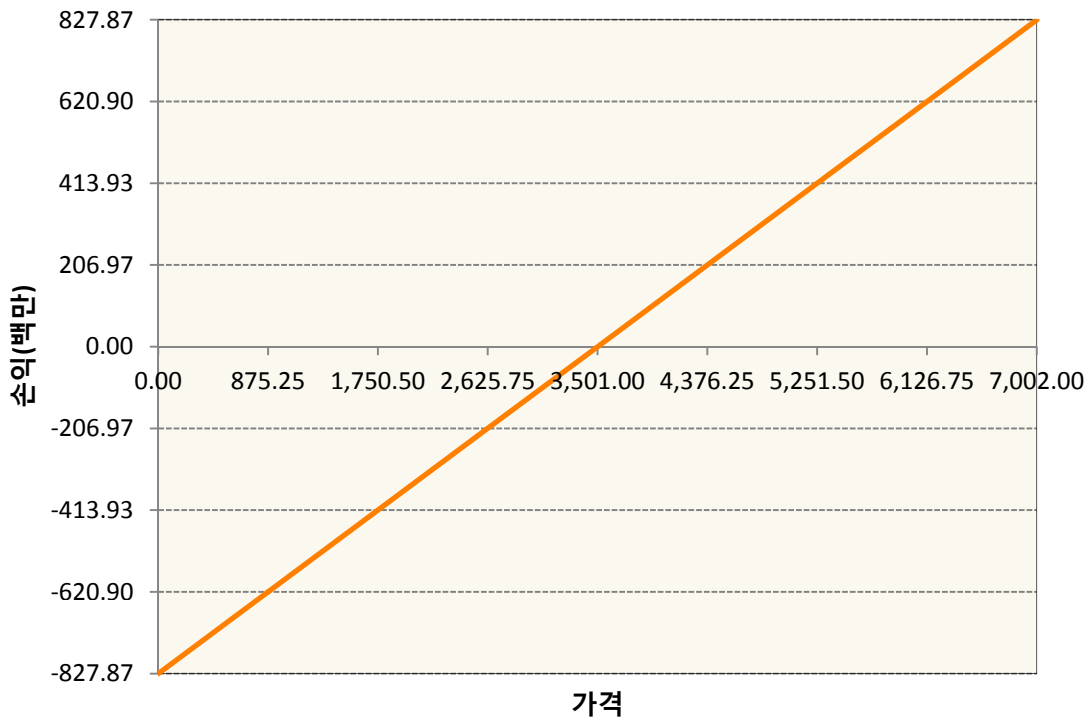
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	828	0	828	

2. 만기시점의 손익구조

VGM8-EURO STOXX 50 JUN18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	66
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-05-28
기준일	2018-05-25

차이나인덱스모(주식-파생형)

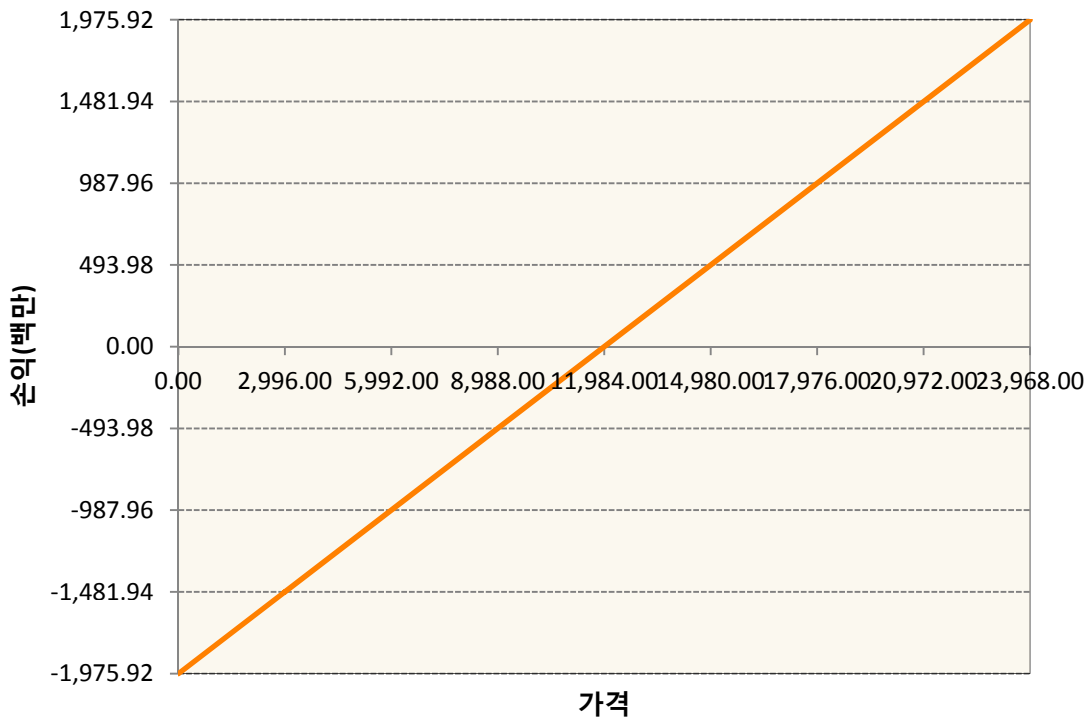
1. 계약금액

(단위:백만원)

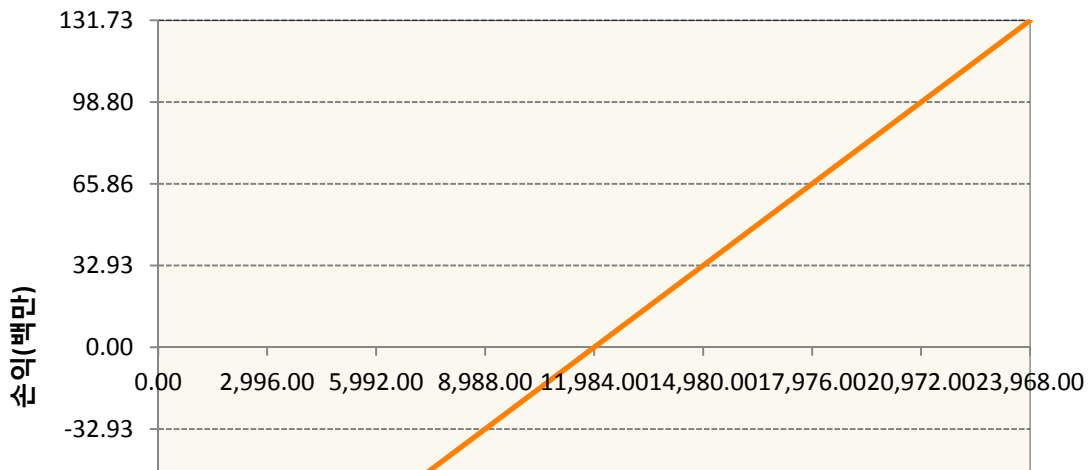
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,108	0	2,108	장내

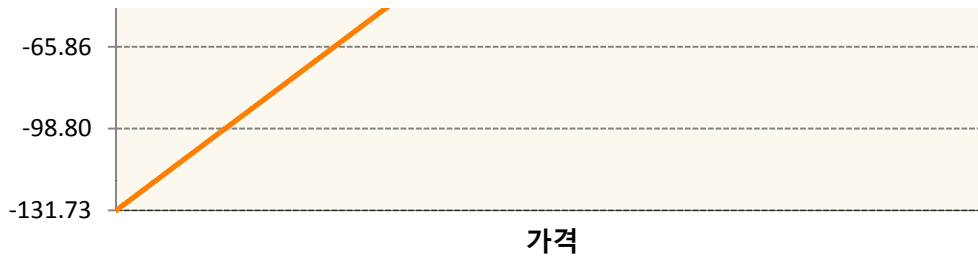
2. 만기시점의 손익구조

HCM8-HSCEI Futures Jun18



MHCM8-MINI H-SHR IDX FU Jun18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCM8	HSCEI Futures Jun18	158
MHCM8	MINI H-SHR IDX FU Jun18	11

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

149

공시일	2018-05-28
기준일	2018-05-25

커버드콜모(주식혼합-파생형)

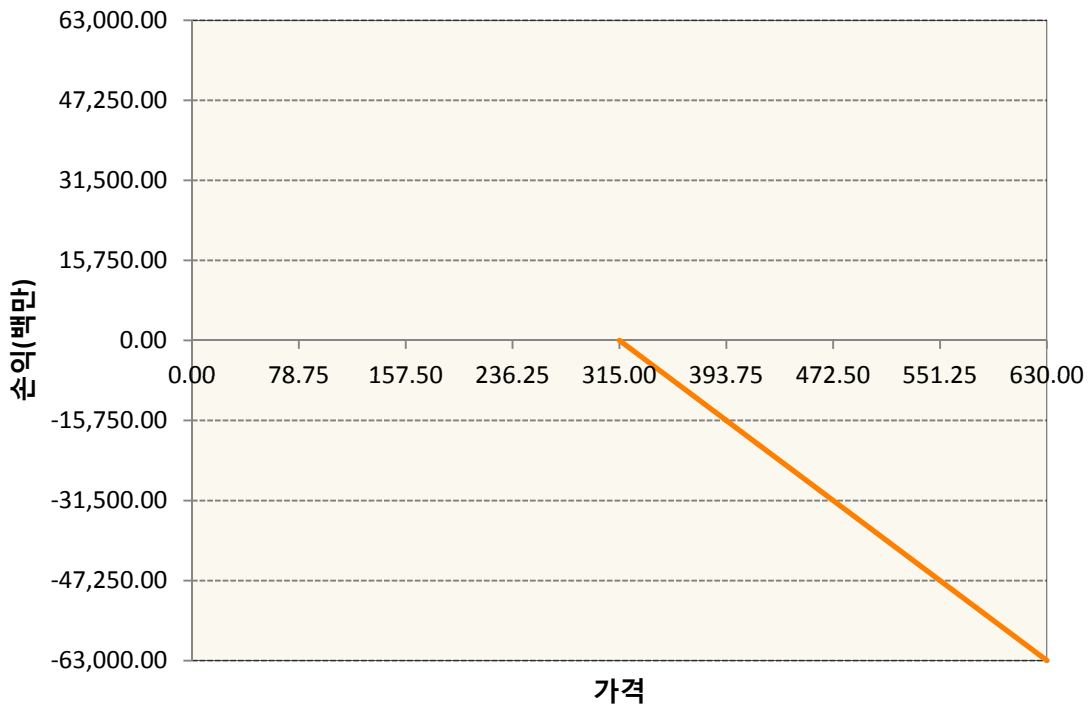
1. 계약금액

(단위:백만원)

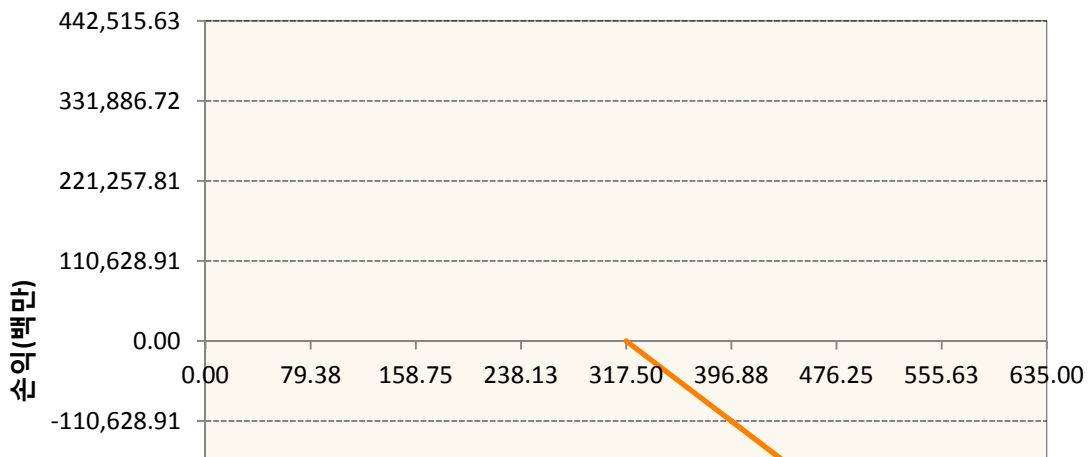
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	813,491	-813,491	장내

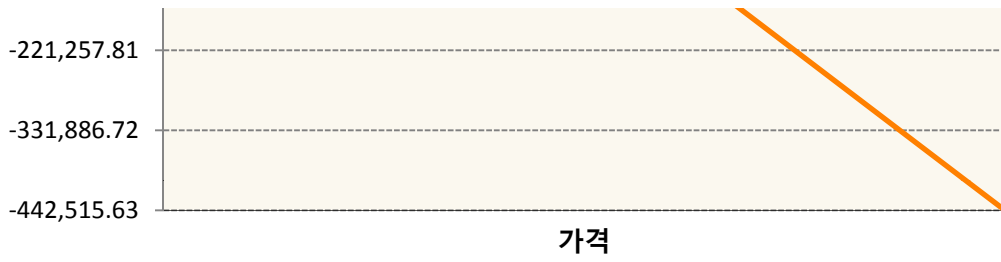
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63159-2018-06 콜315

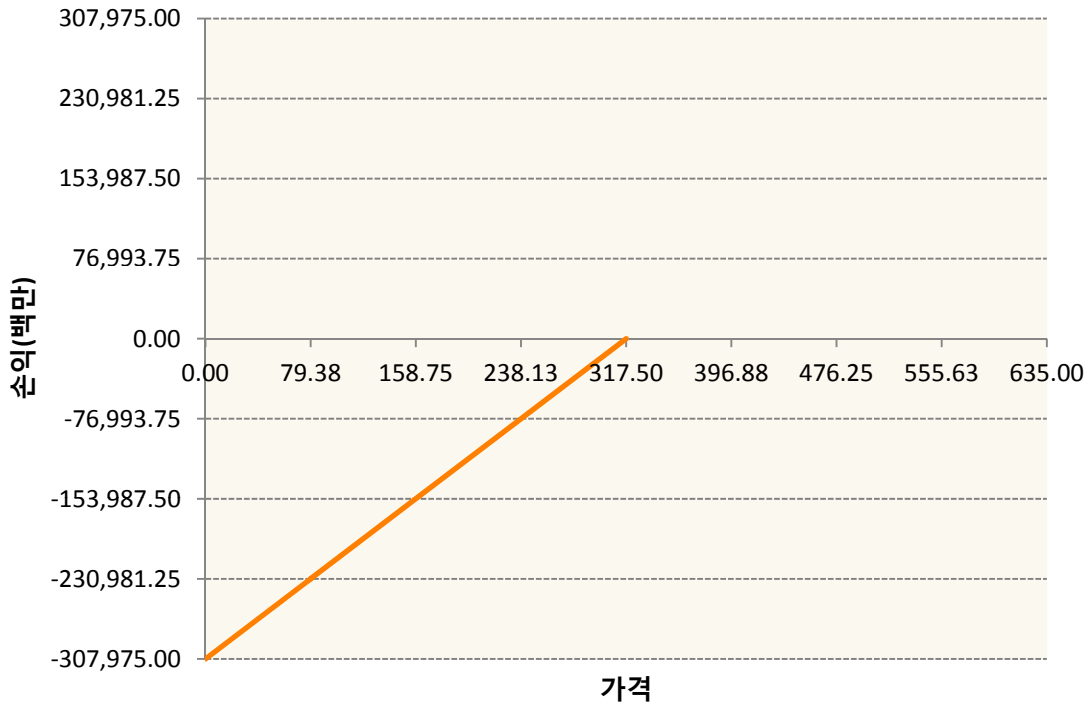


KR4201N63175-2018-06 콜317.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N6312018-06 콜315

4,121

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,885	1,837	1,780	1,714	1,641	1,561	1,476
-5.33%	1,680	1,589	1,491	1,388	1,281	1,171	1,057
-2.67%	1,218	1,090	960	830	699	567	435
0%	406	271	136	0	-136	-272	-408
2.67%	-757	-866	-980	-1,098	-1,219	-1,342	-1,468
5.33%	-2,187	-2,256	-2,335	-2,422	-2,515	-2,614	-2,718
8.00%	-3,773	-3,808	-3,853	-3,908	-3,971	-4,043	-4,121

KR4201N6312018-06 콜317.5

27,628

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,507	11,242	10,910	10,516	10,068	9,571	9,032

-5.33%	10,423	9,871	9,264	8,612	7,923	7,203	6,458
-2.67%	7,795	6,954	6,095	5,221	4,337	3,444	2,544
0%	2,880	1,920	960	0	-960	-1,920	-2,880
2.67%	-4,533	-5,373	-6,235	-7,115	-8,009	-8,914	-9,827
5.33%	-14,009	-14,583	-15,217	-15,899	-16,620	-17,375	-18,157
8.00%	-24,795	-25,108	-25,495	-25,948	-26,459	-27,021	-27,628

KR4301N6312018-06 풋317.5

20,894

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20,852	-20,853	-20,854	-20,858	-20,864	-20,876	-20,894
-5.33%	-12,648	-12,667	-12,698	-12,742	-12,802	-12,876	-12,965
-2.67%	-4,802	-4,958	-5,133	-5,323	-5,526	-5,740	-5,962
0%	880	587	293	0	-294	-587	-881
2.67%	2,962	2,823	2,664	2,487	2,295	2,091	1,876
5.33%	3,253	3,234	3,203	3,158	3,098	3,022	2,931
8.00%	3,267	3,266	3,264	3,258	3,249	3,233	3,209

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

(단위:백만원)

55,413

공시일	2018-05-28
기준일	2018-05-25

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

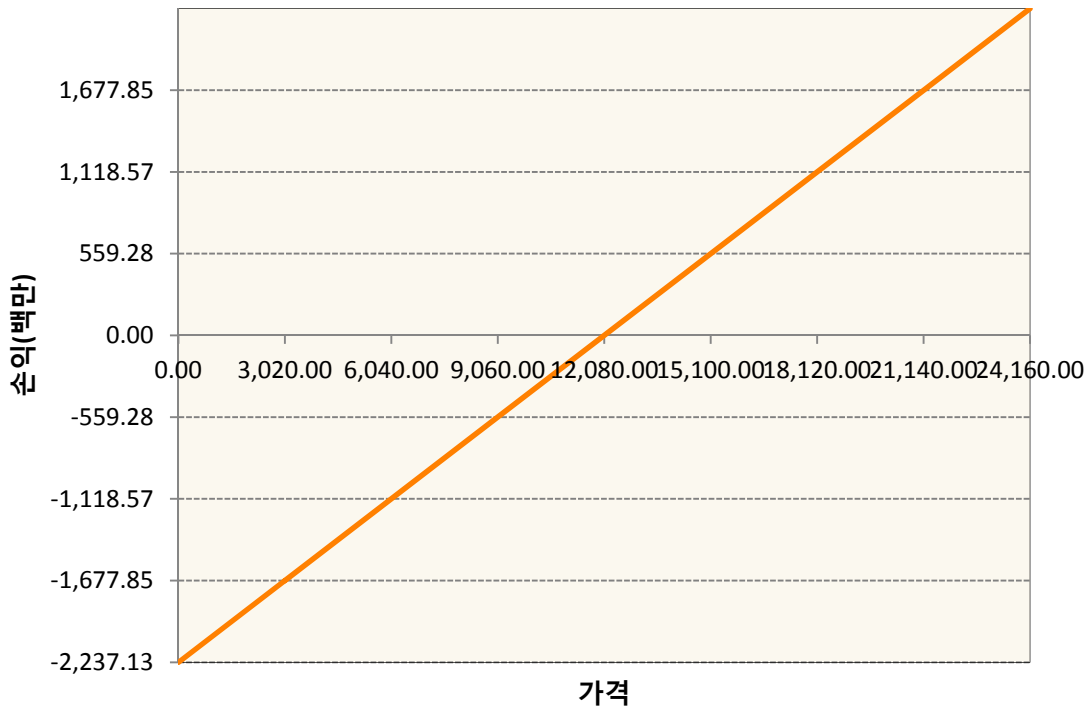
1. 계약금액

(단위:백만원)

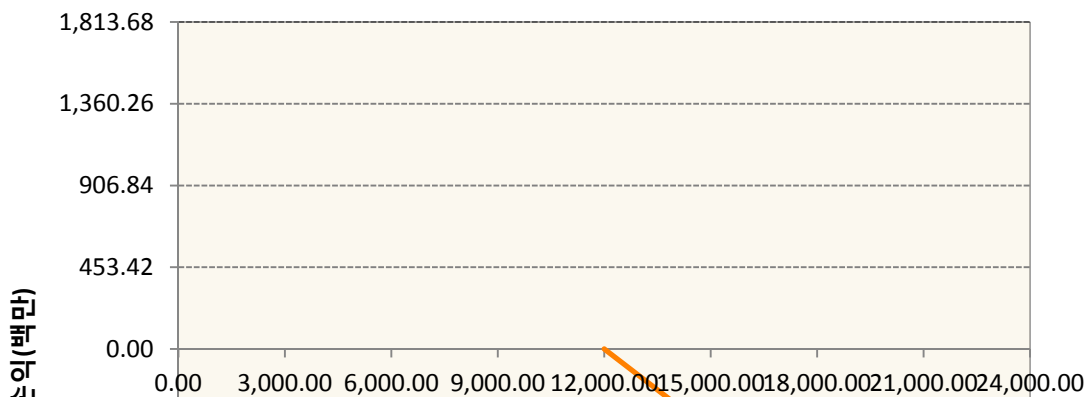
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,237	0	2,237	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,807	-5,807	장내

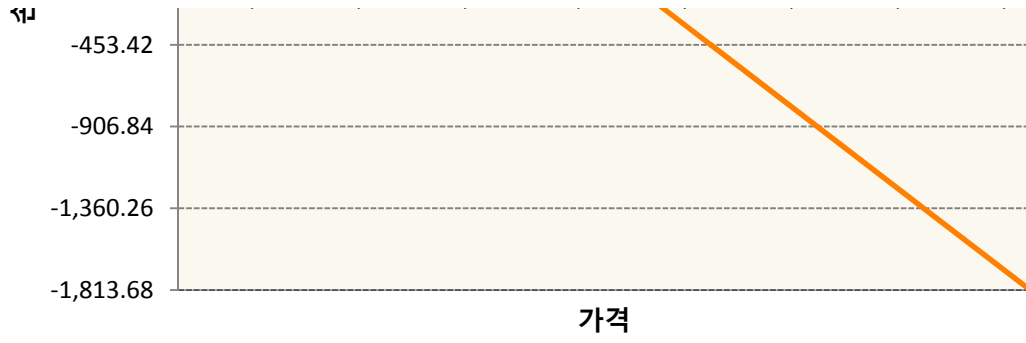
2. 만기시점의 손익구조

HCK8-H-SHARES FUT May18

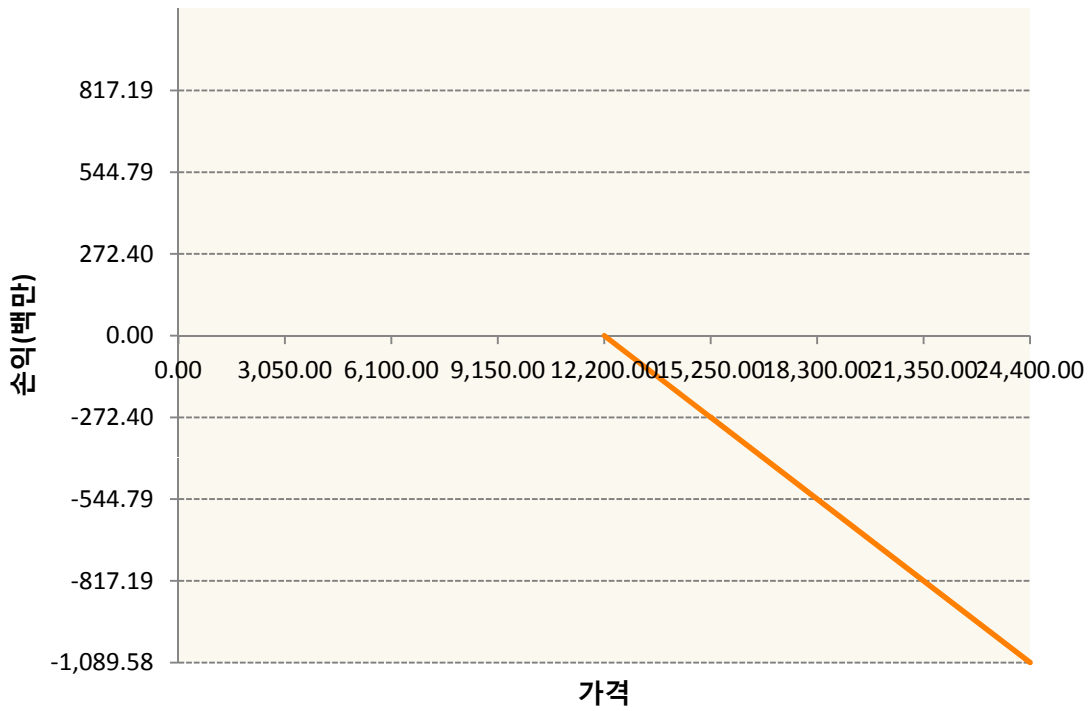


OHHIK8-C120-HSCEI

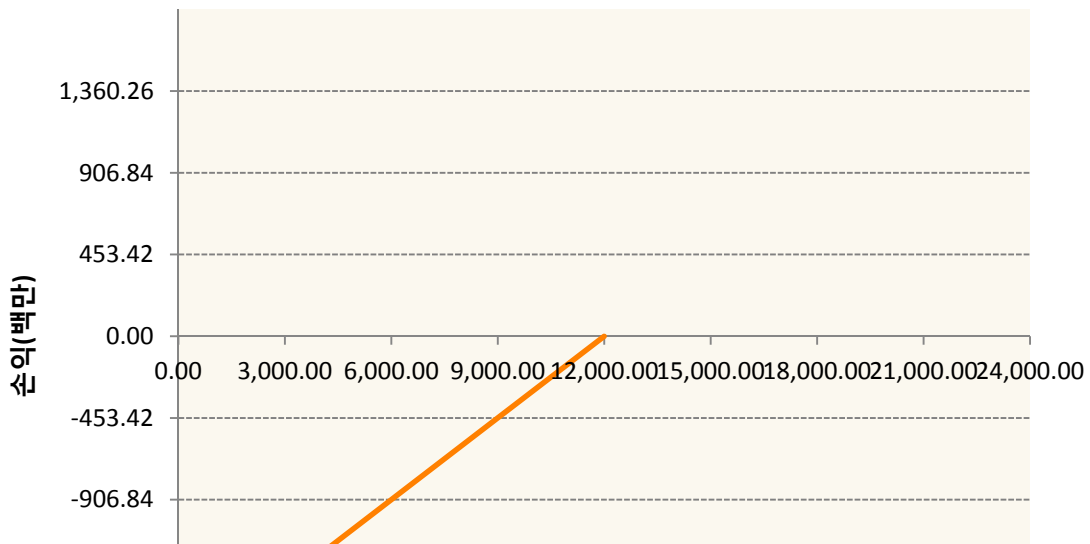


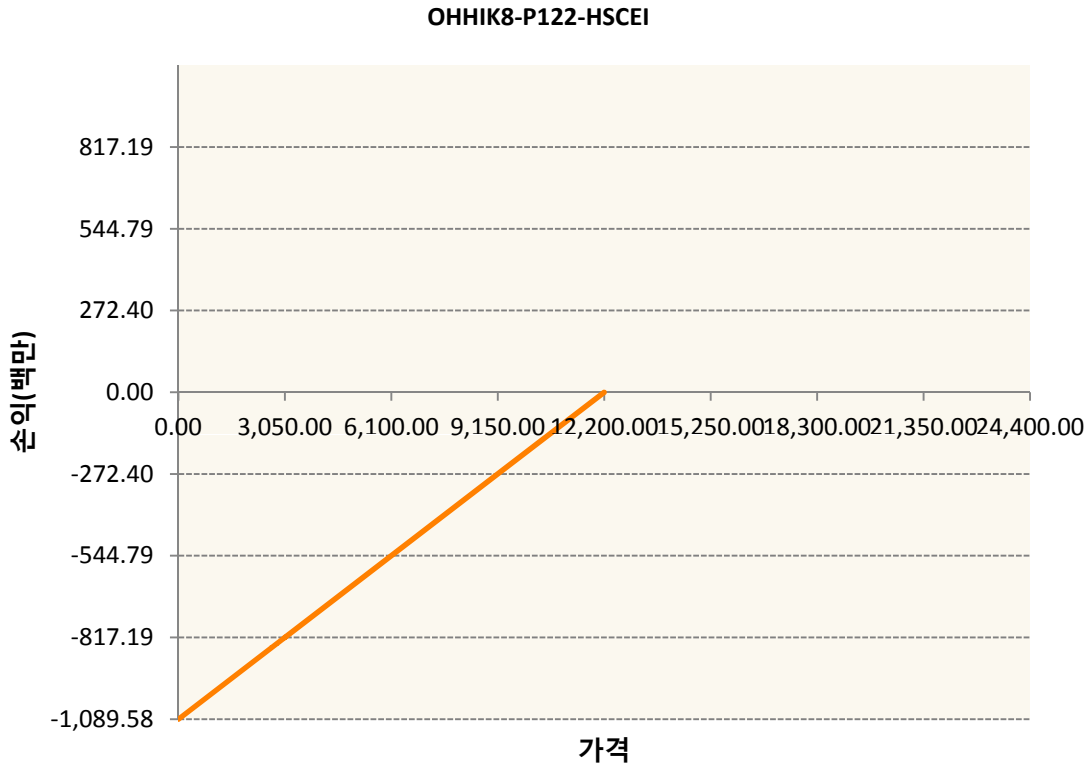
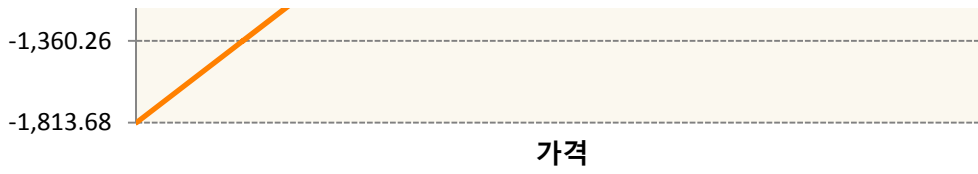


OHHIK8-C122-HSCEI



OHHIK8-P120-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCK8	H-SHARES FUT May18	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	2018-05-28
기준일	2018-05-25

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

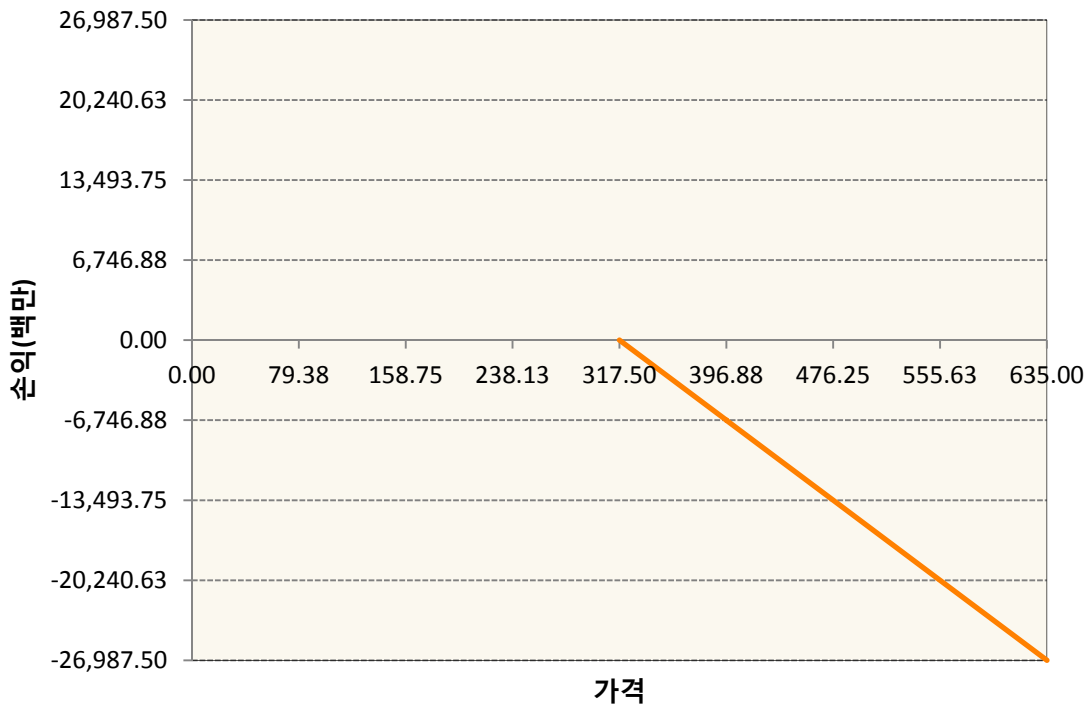
1. 계약금액

(단위:백만원)

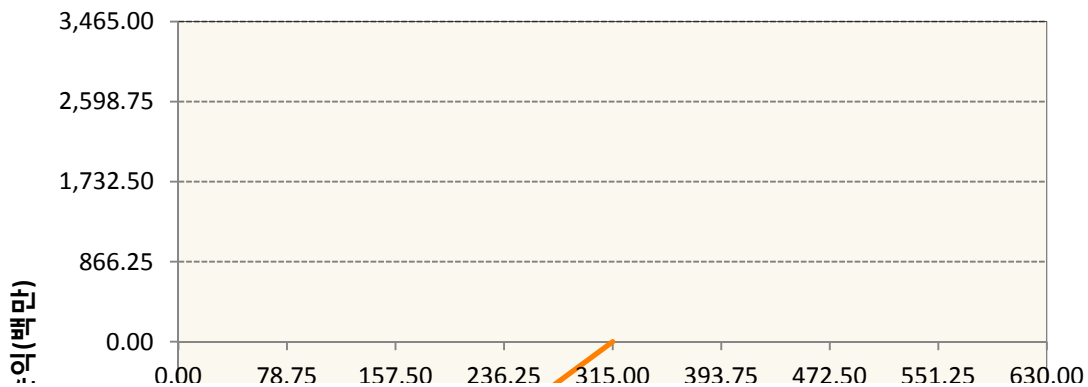
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	46,804	-46,804	장내

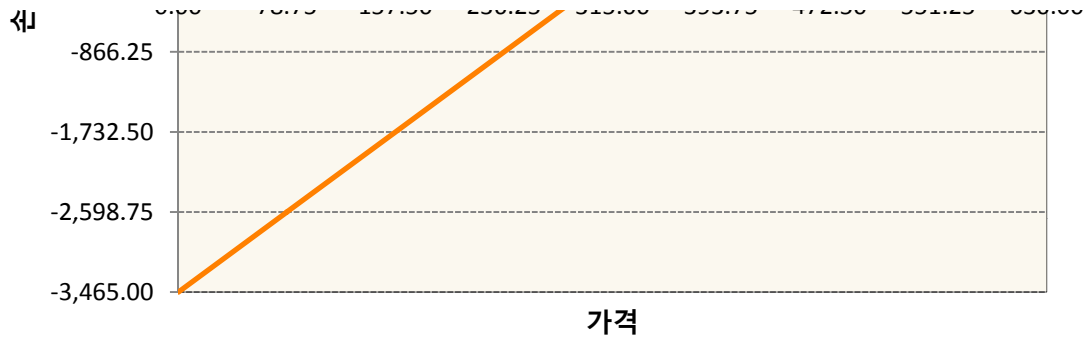
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63175-2018-06 콜317.5

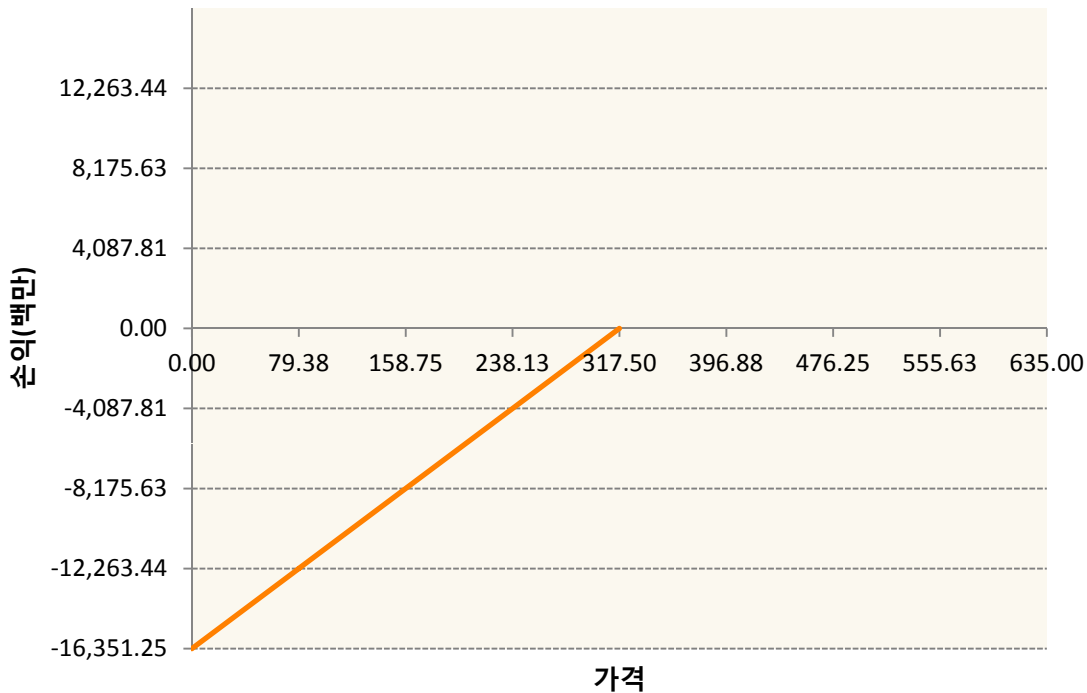


KR4301N63157-2018-06 풋315





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_2							1,479
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,479	-1,479	-1,479	-1,479	-1,479	-1,479	-1,479
-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%	1,479	1,479	1,479	1,479	1,479	1,479	1,479
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%	640	640	640	640	640	640	640

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

1,685

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	702	686	665	641	614	584	551
-5.33%	636	602	565	525	483	439	394
-2.67%	475	424	372	318	265	210	155
0%	176	117	59	0	-59	-117	-176
2.67%	-276	-328	-380	-434	-488	-544	-599
5.33%	-854	-889	-928	-970	-1,014	-1,060	-1,107
8.00%	-1,512	-1,531	-1,555	-1,582	-1,614	-1,648	-1,685

KR4301N6312018-06 풋315

222

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-221	-221	-221	-221	-221	-221	-222
-5.33%	-128	-128	-129	-130	-131	-132	-134
-2.67%	-43	-46	-48	-51	-54	-56	-59
0%	9	6	3	0	-3	-6	-10
2.67%	24	23	22	20	19	17	15
5.33%	25	25	25	25	24	24	23
8.00%	25	25	25	25	25	25	25

KR4301N6312018-06 풋317.5

1,109

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,107	-1,107	-1,107	-1,107	-1,108	-1,108	-1,109
-5.33%	-672	-673	-674	-677	-680	-684	-688
-2.67%	-255	-263	-273	-283	-293	-305	-317
0%	47	31	16	0	-16	-31	-47
2.67%	157	150	141	132	122	111	100
5.33%	173	172	170	168	164	160	156
8.00%	173	173	173	173	172	172	170

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

(단위:백만원)

7,030

공시일	2018-05-28
기준일	2018-05-25

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

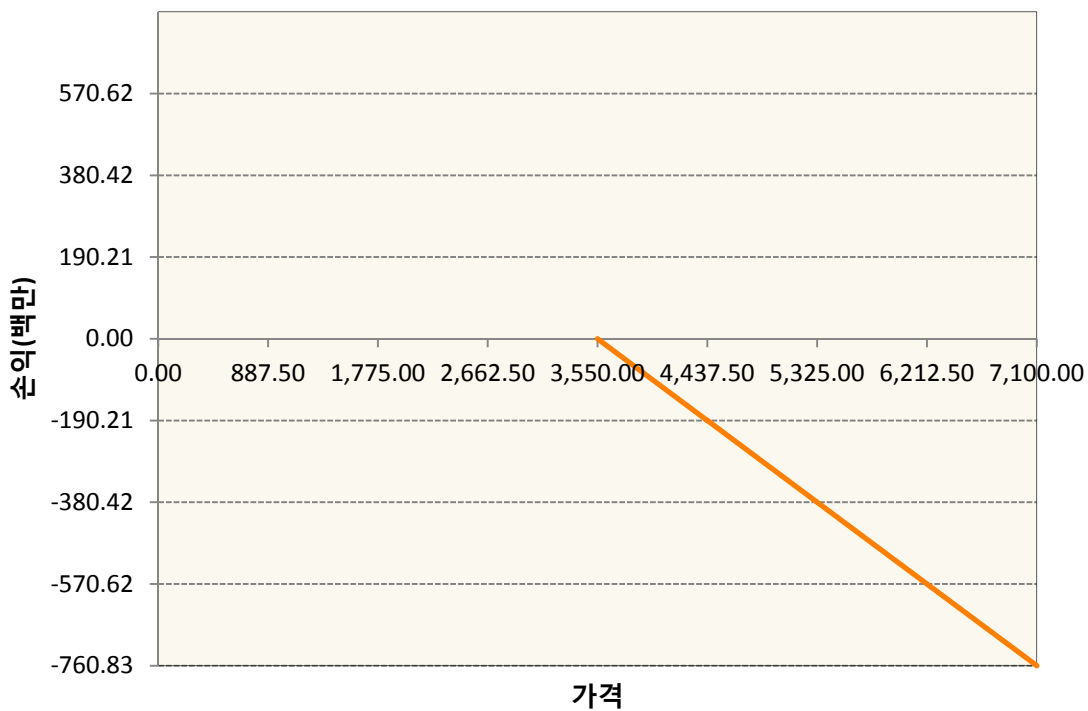
1. 계약금액

(단위:백만원)

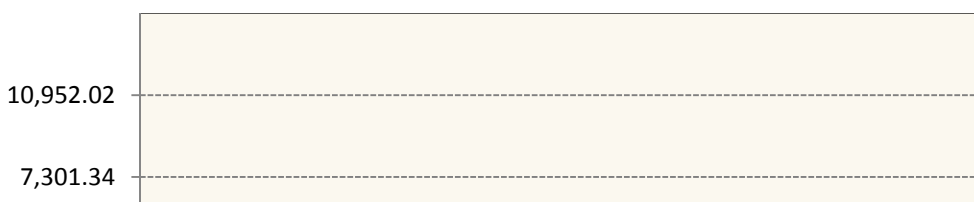
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,293	0	7,293	
누계	유가증권	스왑	53,153	0	53,153	장외
누계	유가증권	옵션	0	30,727	-30,727	장내
누계	지수	스왑	50,430	0	50,430	장외

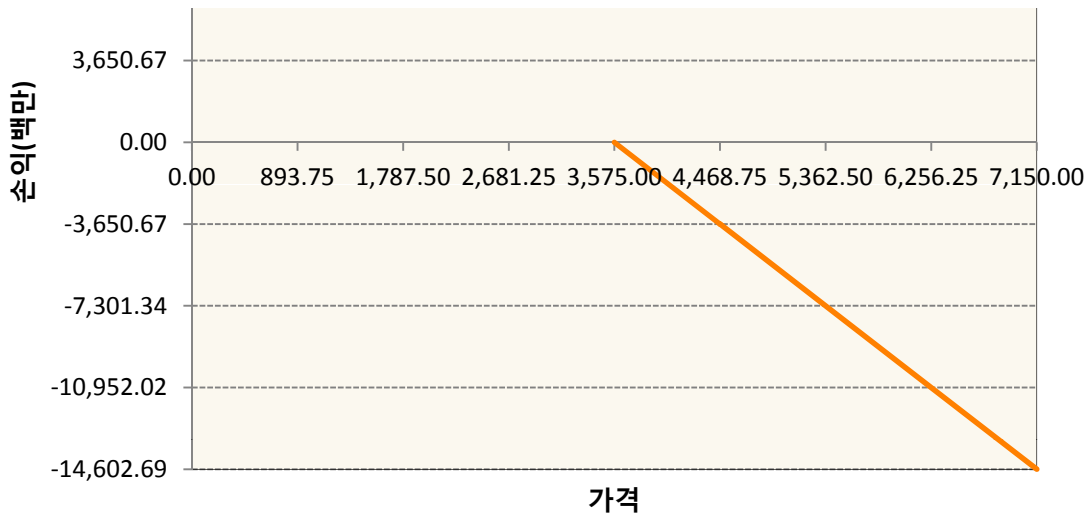
2. 만기시점의 손익구조

OESXM8-C3550-EURO STOXX 50

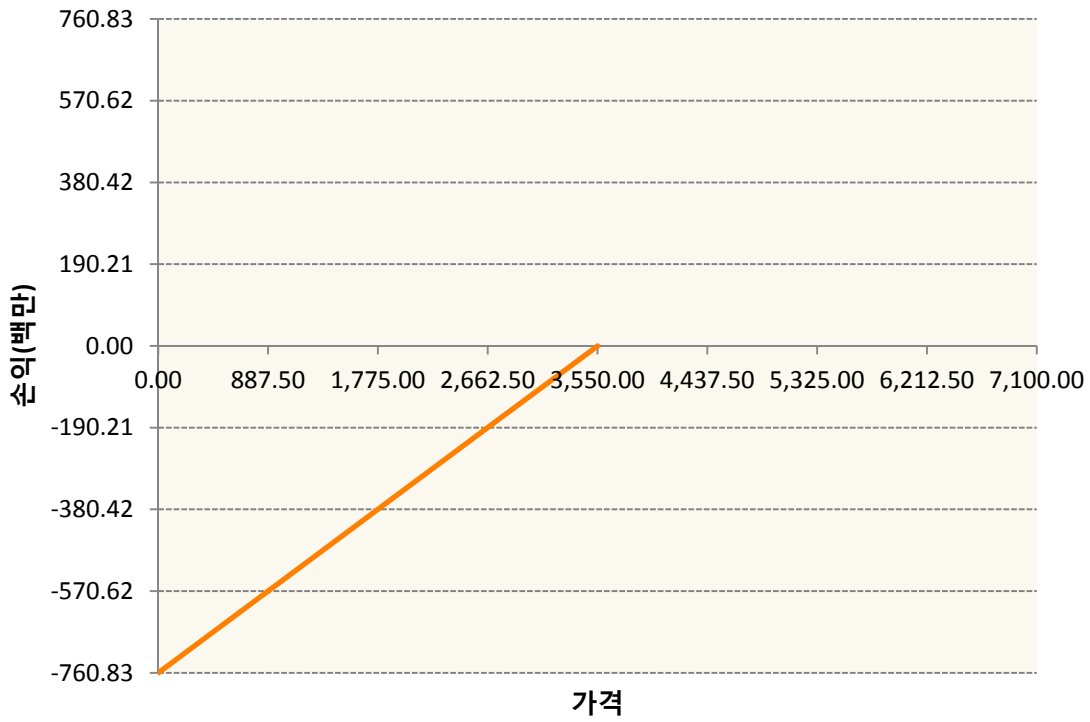


OESXM8-C3575-EURO STOXX 50

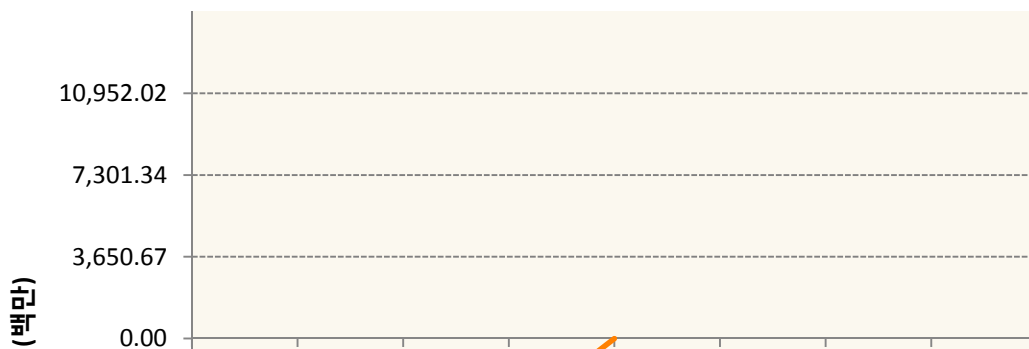


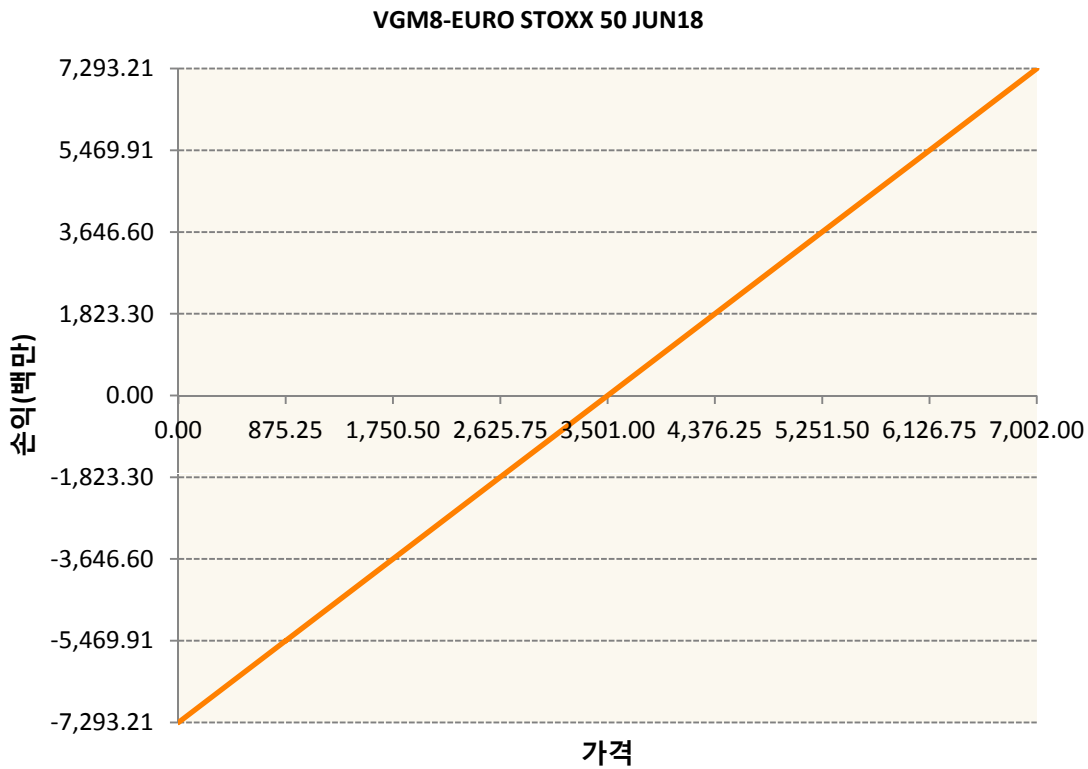
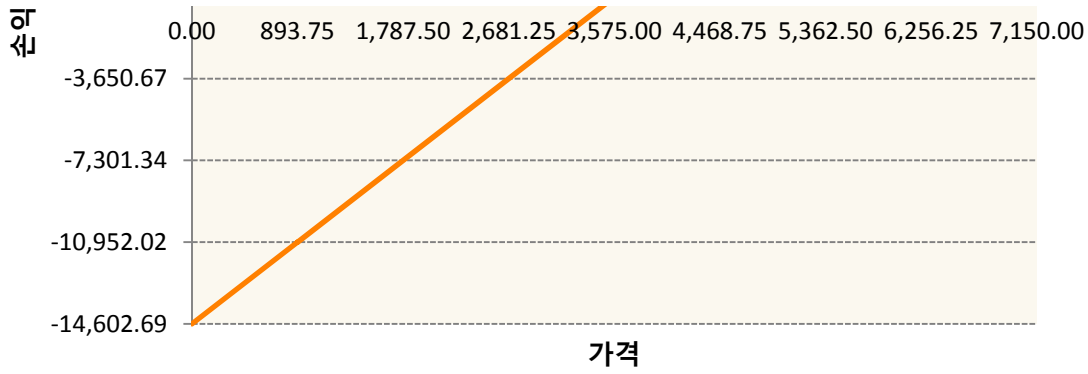


OESXM8-P3550-EURO STOXX 50



OESXM8-P3575-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		34
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		36
OESXM8-C3: EURO STOXX 50		61
OESXM8-C3: EURO STOXX 50		1,168
OESXM8-P3! EURO STOXX 50		61
OESXM8-P3! EURO STOXX 50		1,168
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18		583

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

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

(단위:백만원)

1,173

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)

222

공시일	2018-05-28
기준일	2018-05-25

스마트KRX300인덱스목표전환형1

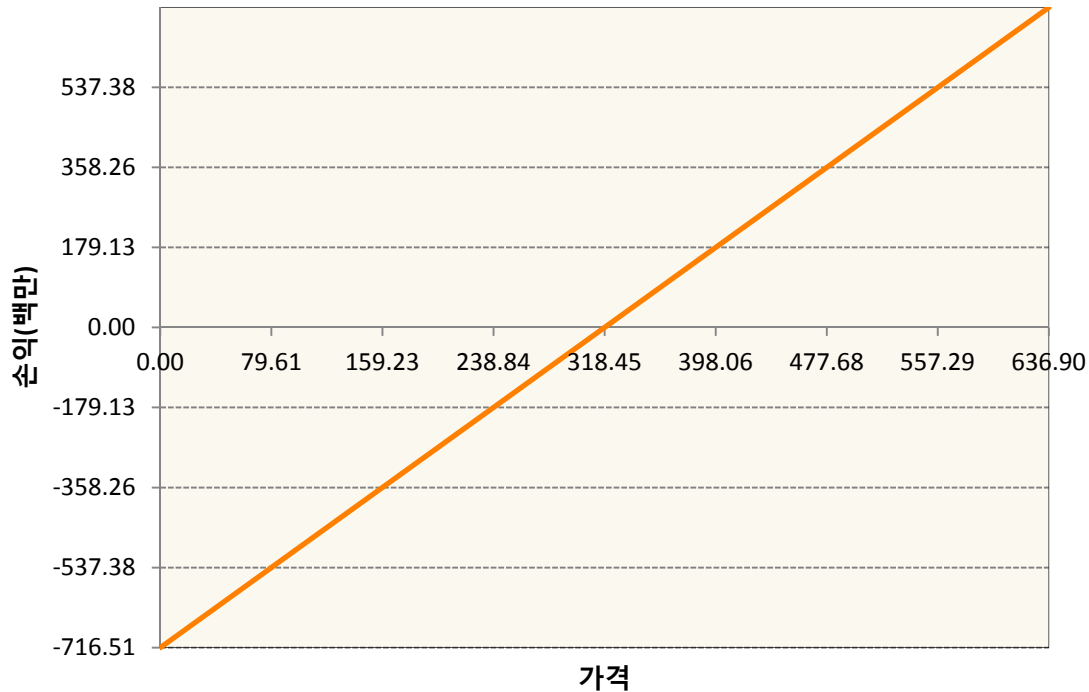
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	717	0	717	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	2018-05-28
기준일	2018-05-25

리디파인K200(주식혼합-파생재간

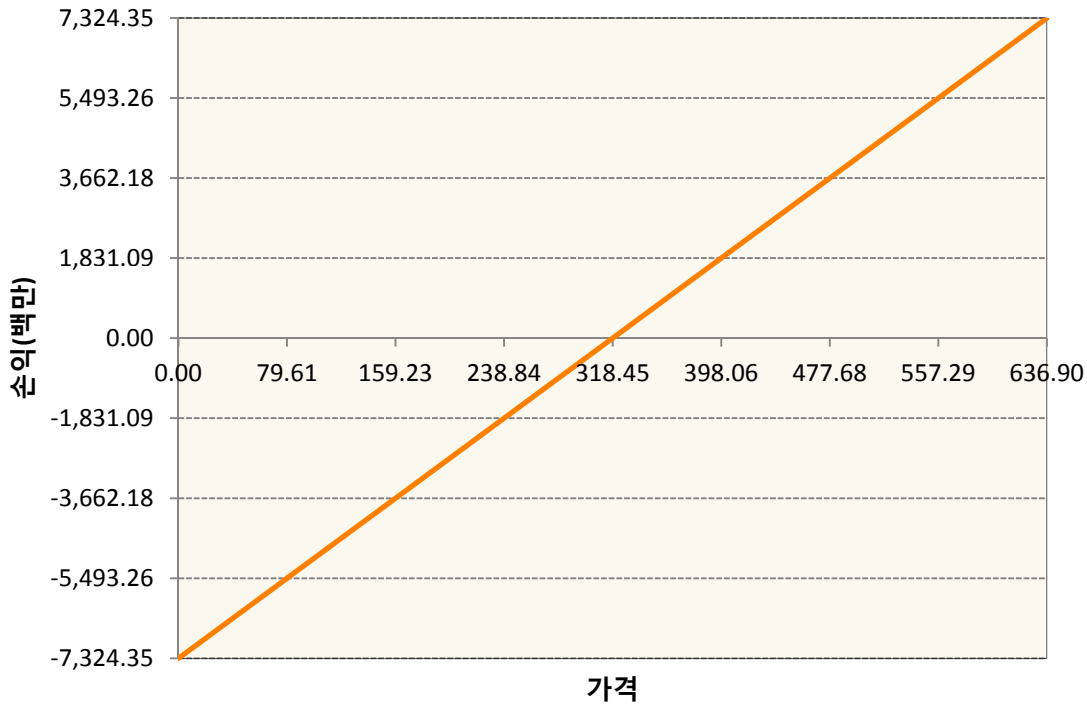
1. 계약금액

(단위:백만원)

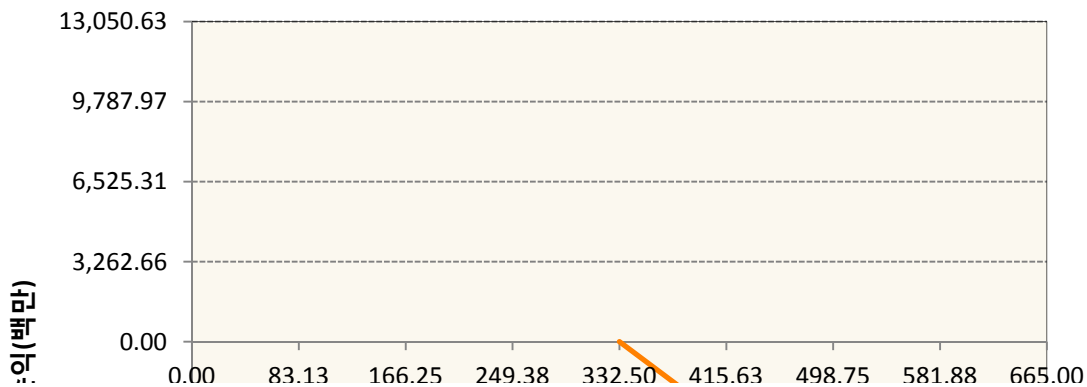
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	499	-499	장내
누계	유가증권	선물	7,324	0	7,324	장내
누계	유가증권	옵션	1,508	13,051	-11,543	장내

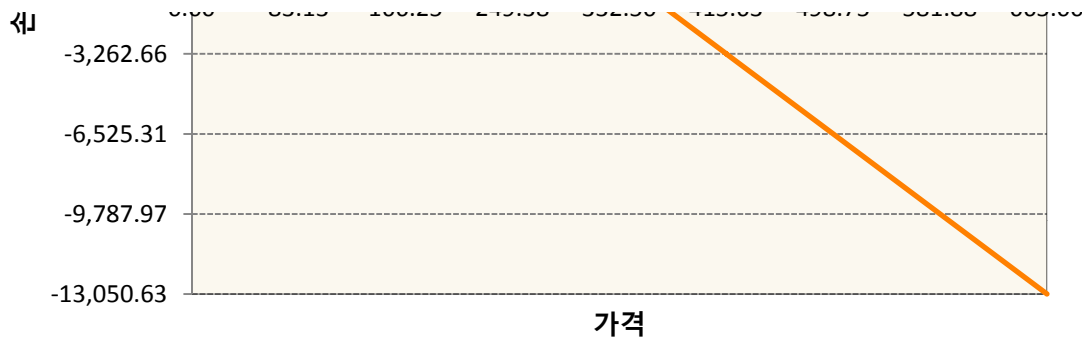
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

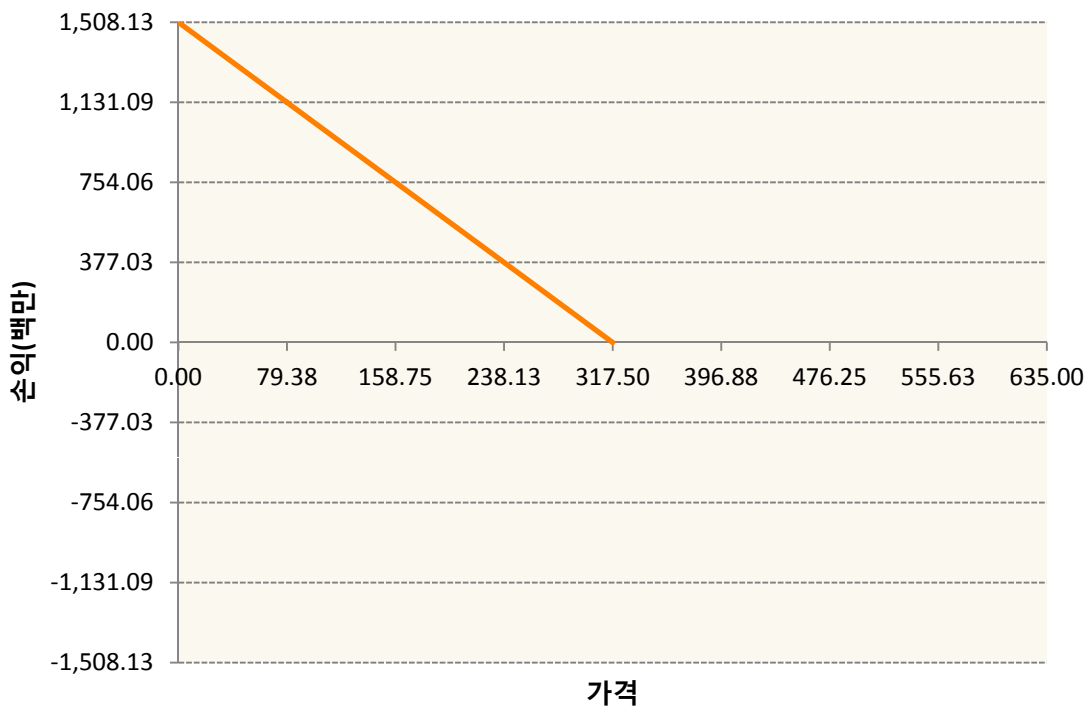


KR4201N63324-2018-06 콜332.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물							585
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-585	-585	-585	-585	-585	-585	-585
-5.33%	-390	-390	-390	-390	-390	-390	-390
-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%	390	390	390	390	390	390	390
8.00%	585	585	585	585	585	585	585
KR4201N63E 2018-06 콜332.5							558
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	122	121	119	115	111	105	98
-5.33%	118	114	108	100	91	80	68
-2.67%	103	93	80	66	50	33	15
0%	61	42	22	0	-22	-45	-69
2.67%	-30	-56	-83	-109	-137	-164	-191
5.33%	-185	-213	-241	-270	-298	-326	-354
8.00%	-407	-430	-455	-480	-506	-532	-558

KR4301N6312018-06 풋317.5

102

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	102	102	102	102	102	102	102
-5.33%	62	62	62	62	63	63	63
-2.67%	24	24	25	26	27	28	29
0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-15	-14	-13	-12	-11	-10	-9
5.33%	-16	-16	-16	-15	-15	-15	-14
8.00%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16

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

(단위:백만원)

938

공시일	2018-05-28
기준일	2018-05-25

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

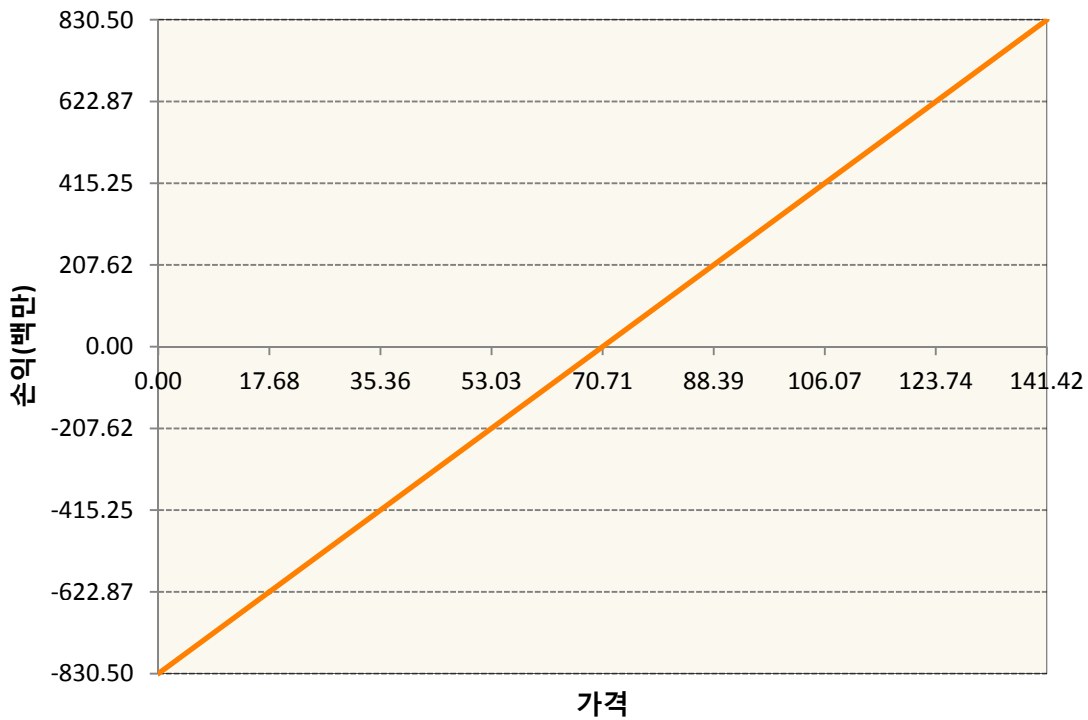
1. 계약금액

(단위:백만원)

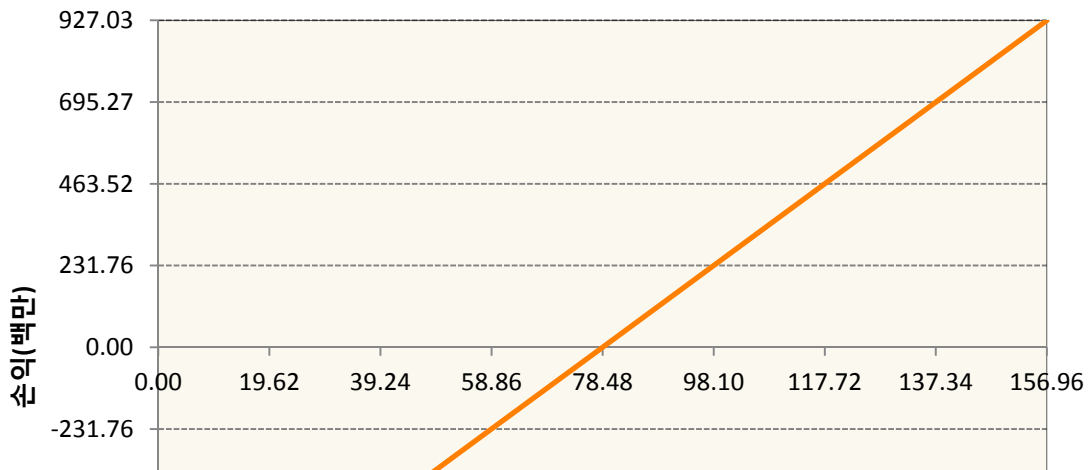
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,975	592	3,382	

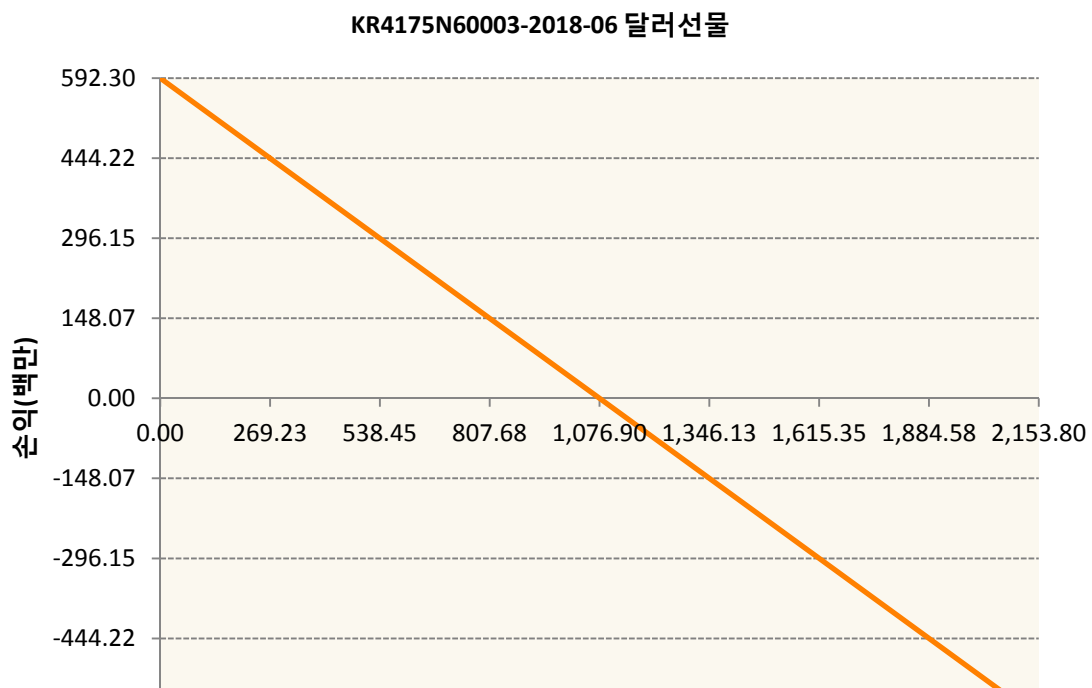
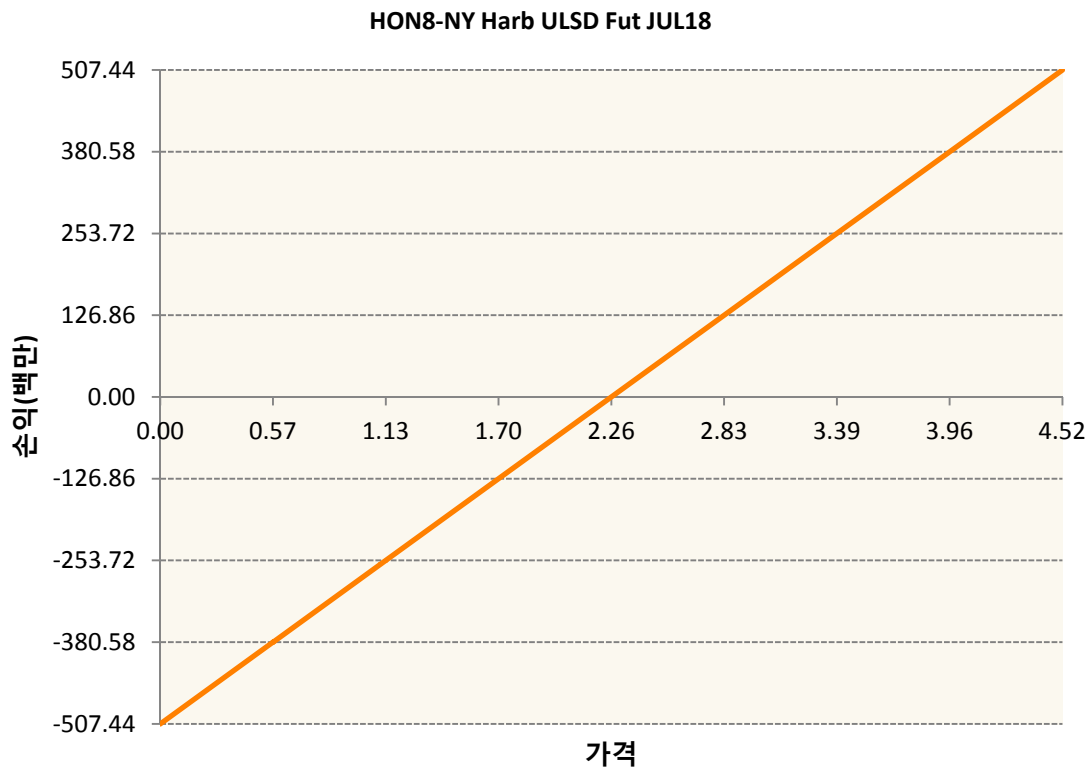
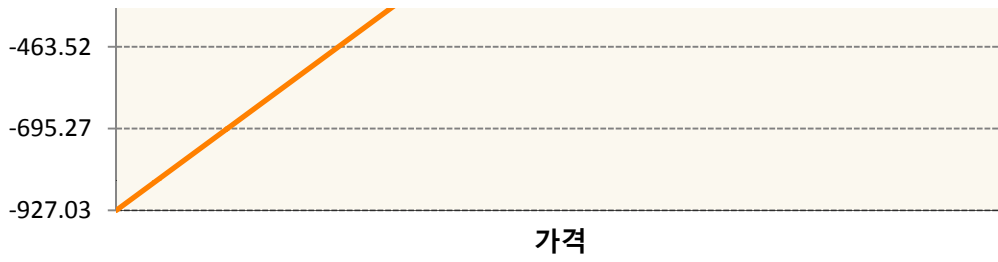
2. 만기시점의 손익구조

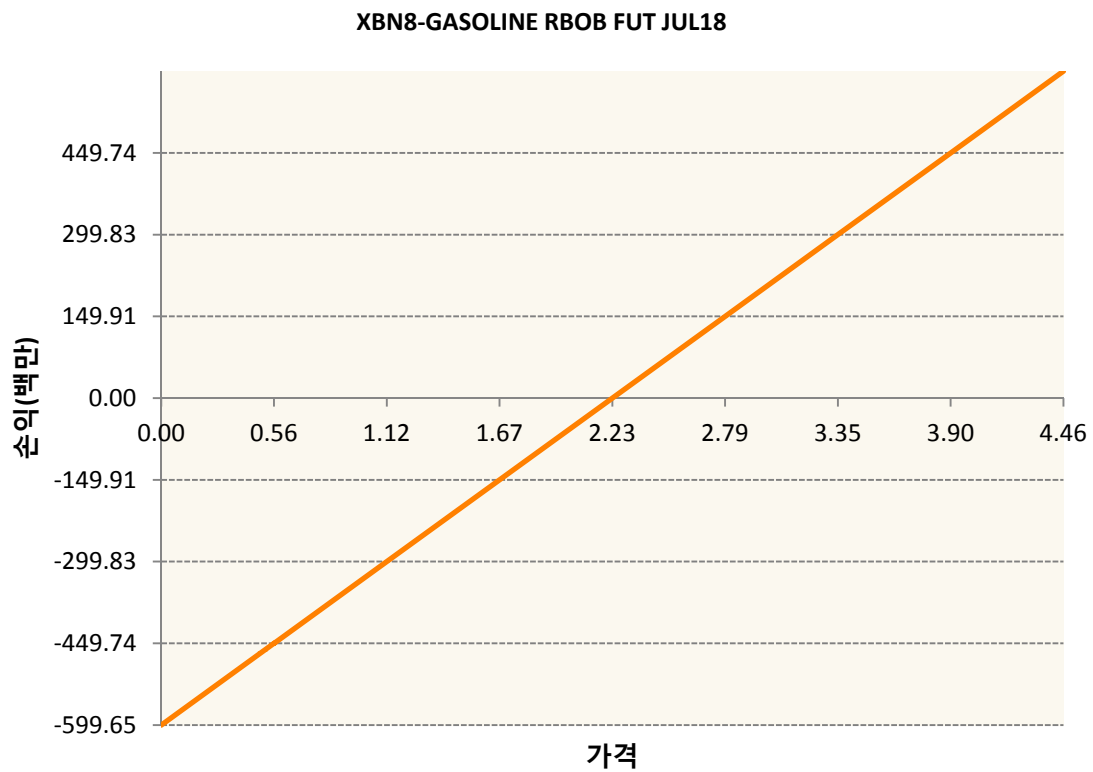
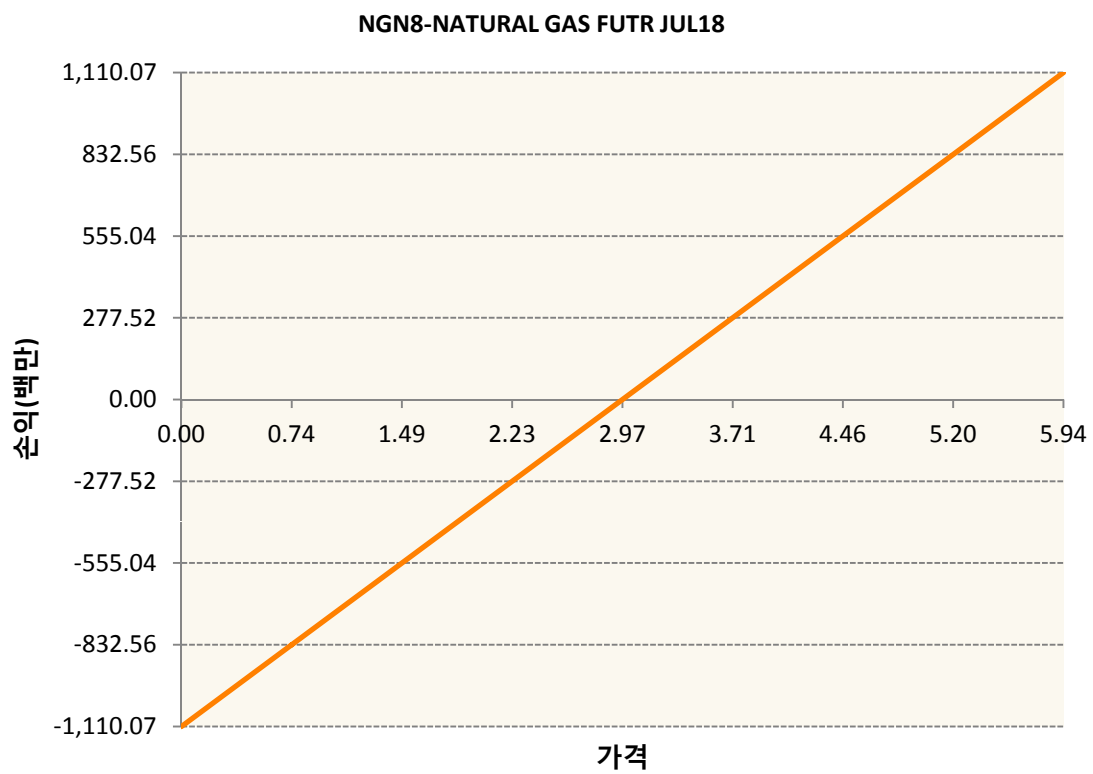
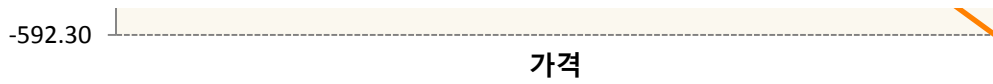
CLN8-WTI CRUDE FUTURE JUL18



COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN8	WTI CRUDE FUTURE JUL18	66
COU8	BRENT CRUDE FUTR SEP18	74
HON8	NY Harb ULSD Fut JUL18	41
KR4175N60C	2018-06 달러선물	47
NGN8	NATURAL GAS FUTR JUL18	89
XBN8	GASOLINE RBOB FUT JUL18	48

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

480

공시일	2018-05-28
기준일	2018-05-25

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

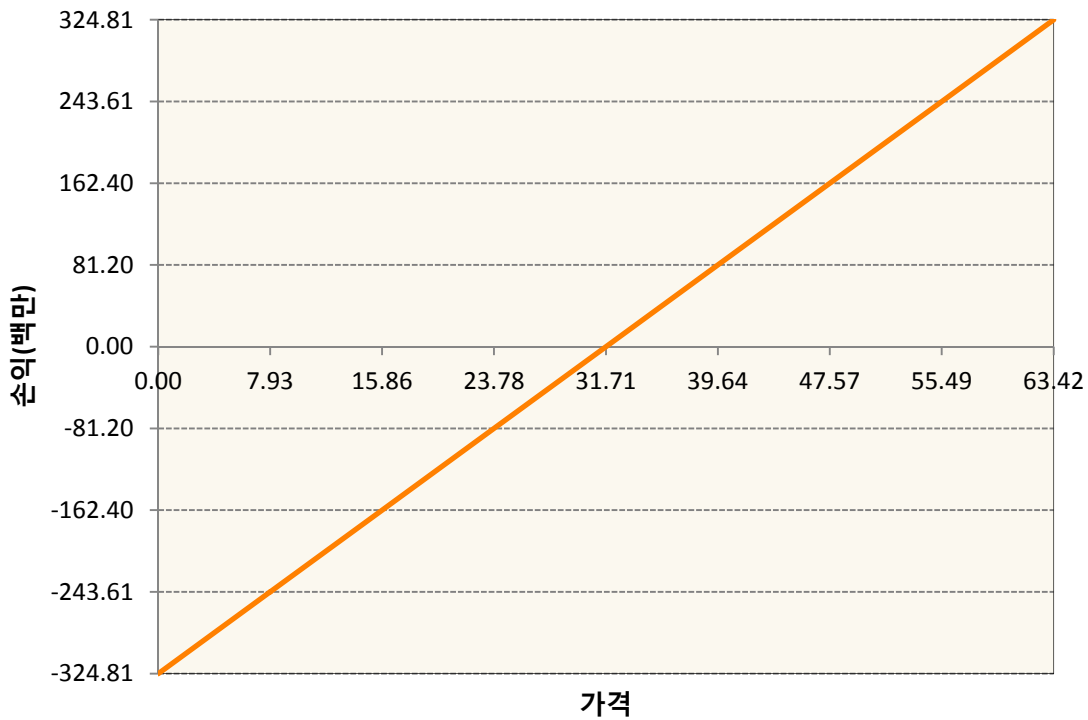
1. 계약금액

(단위:백만원)

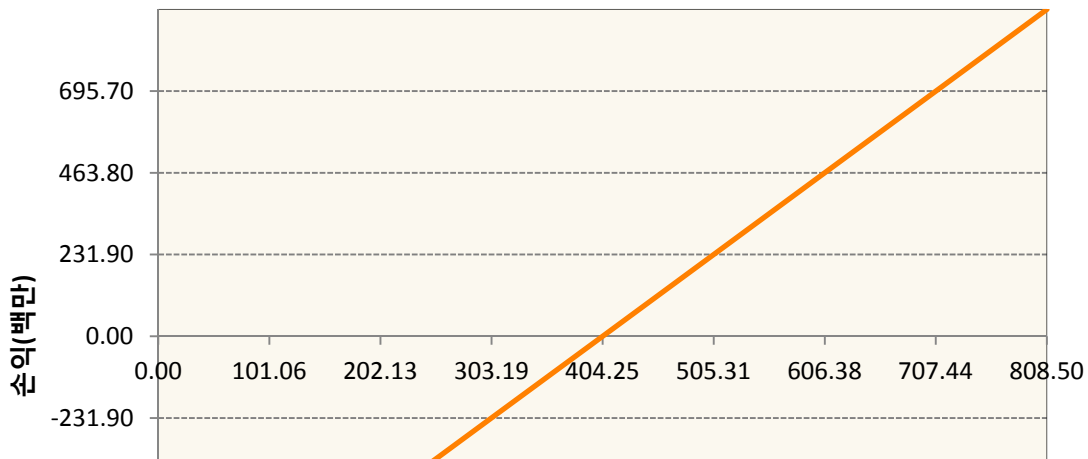
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,165	323	3,842	

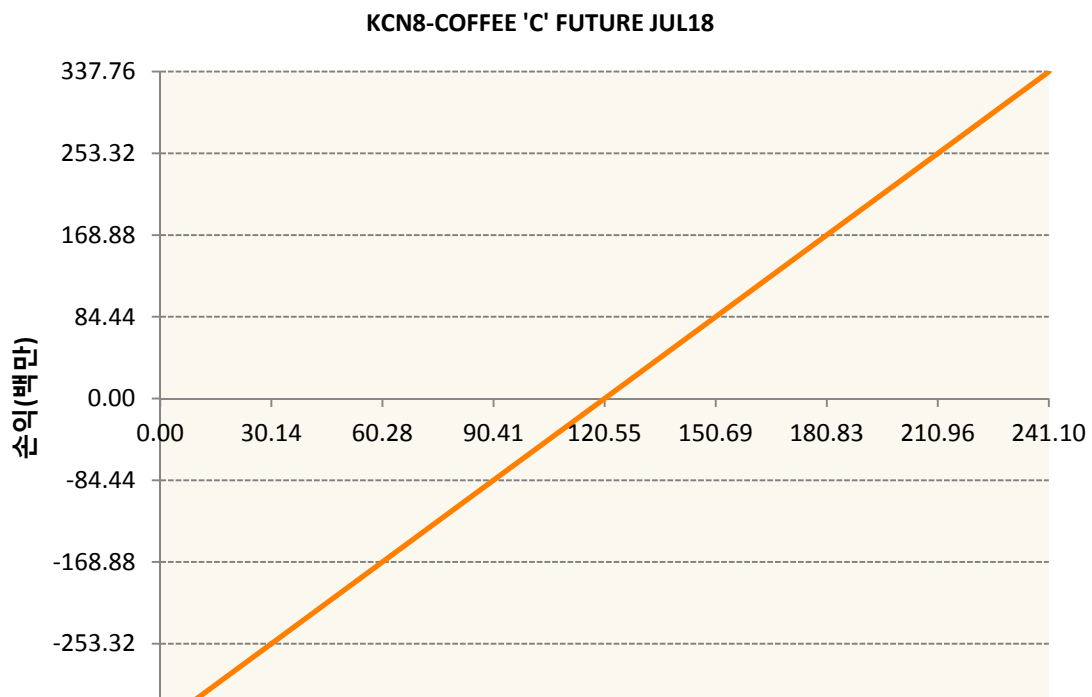
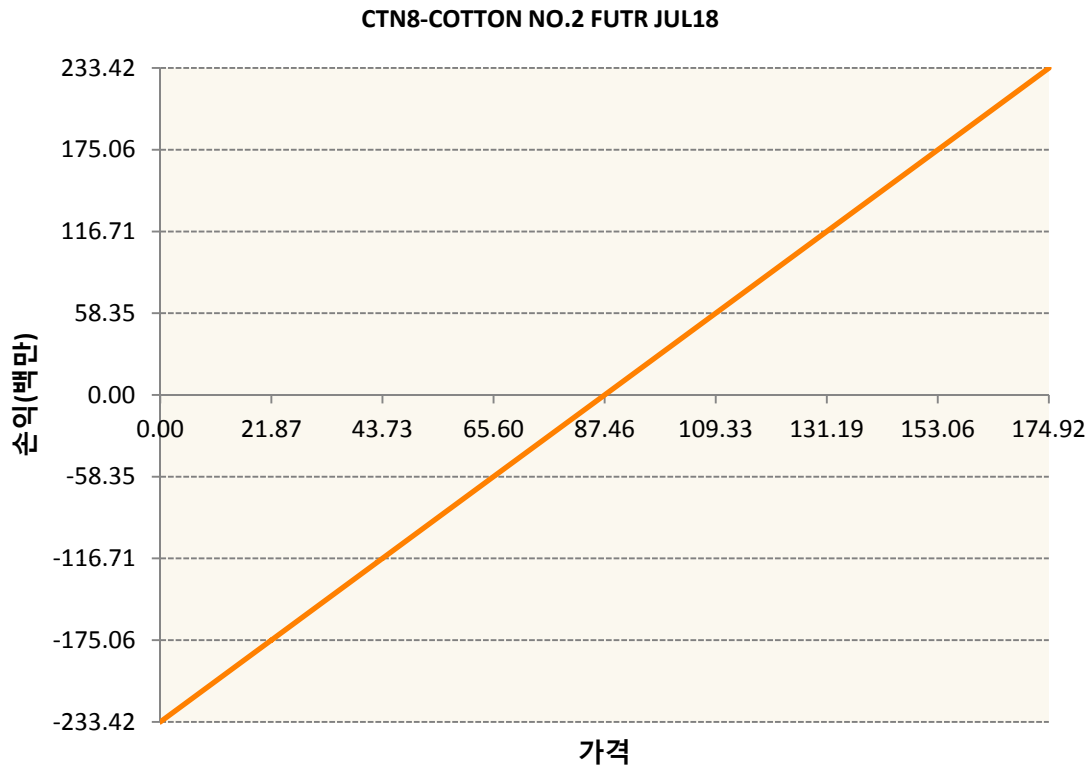
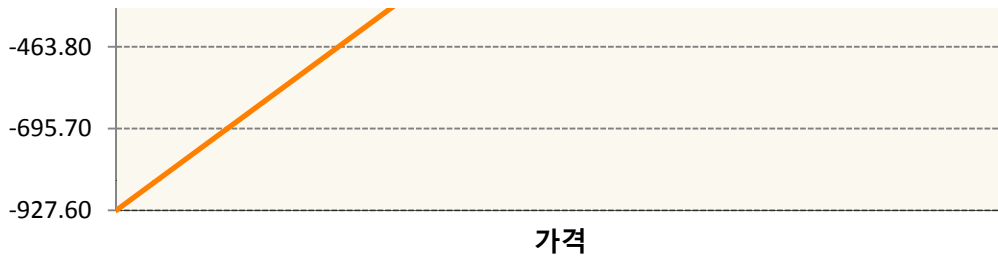
2. 만기시점의 손익구조

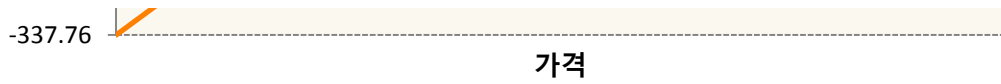
BON8-SOYBEAN OIL FUTR JUL18



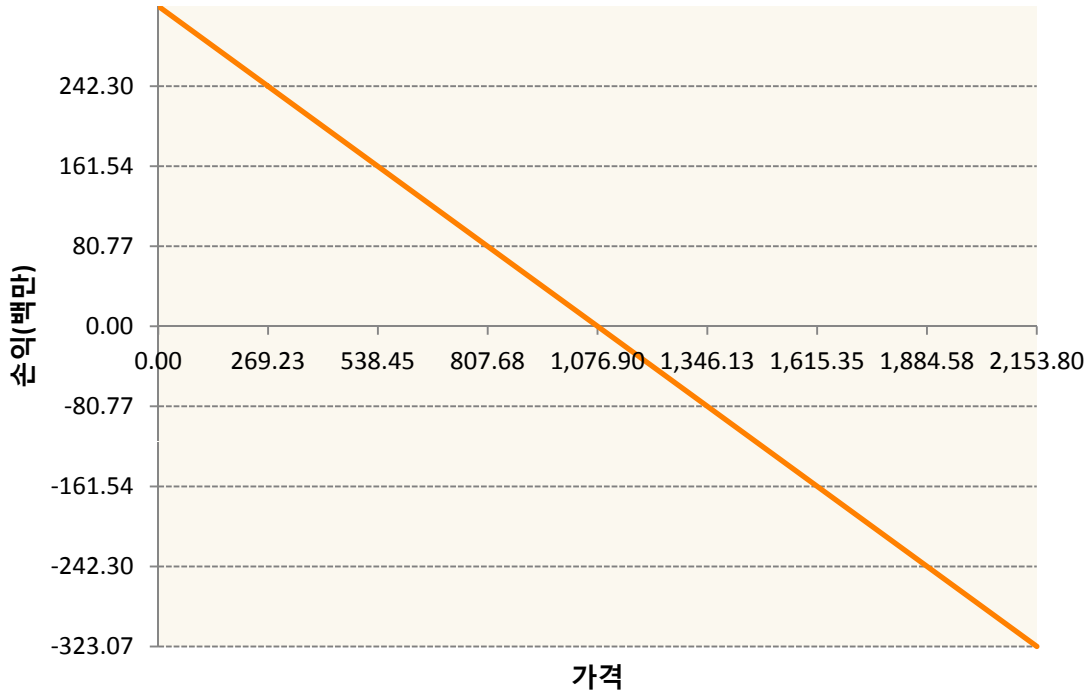
CN8-CORN FUTURE JUL18



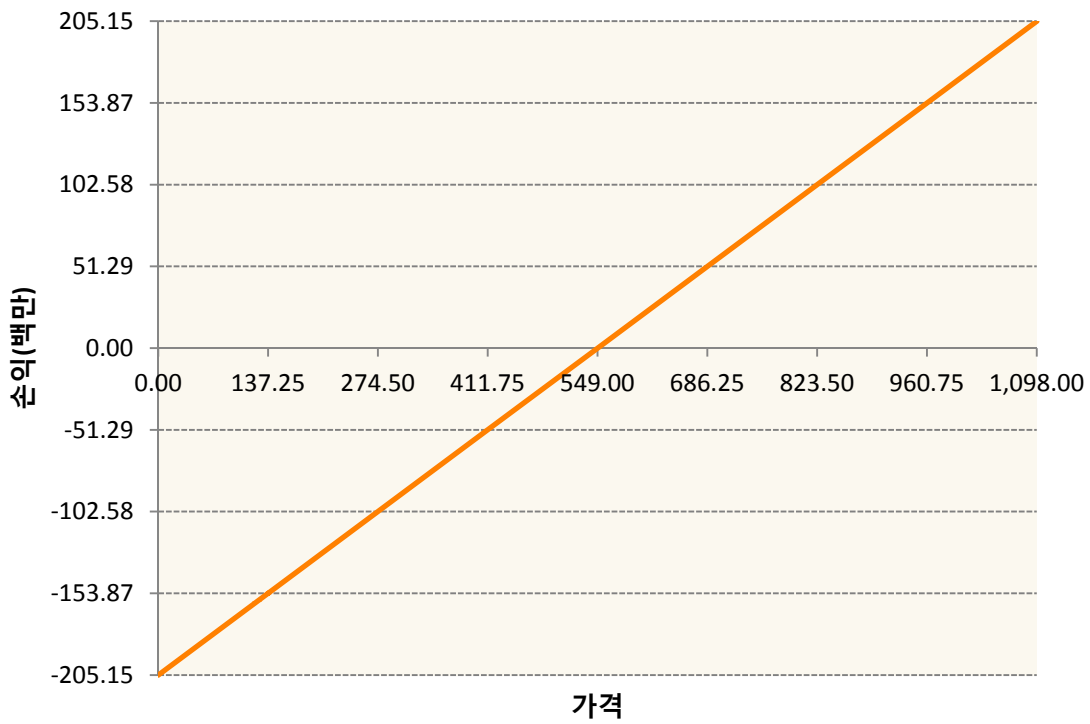




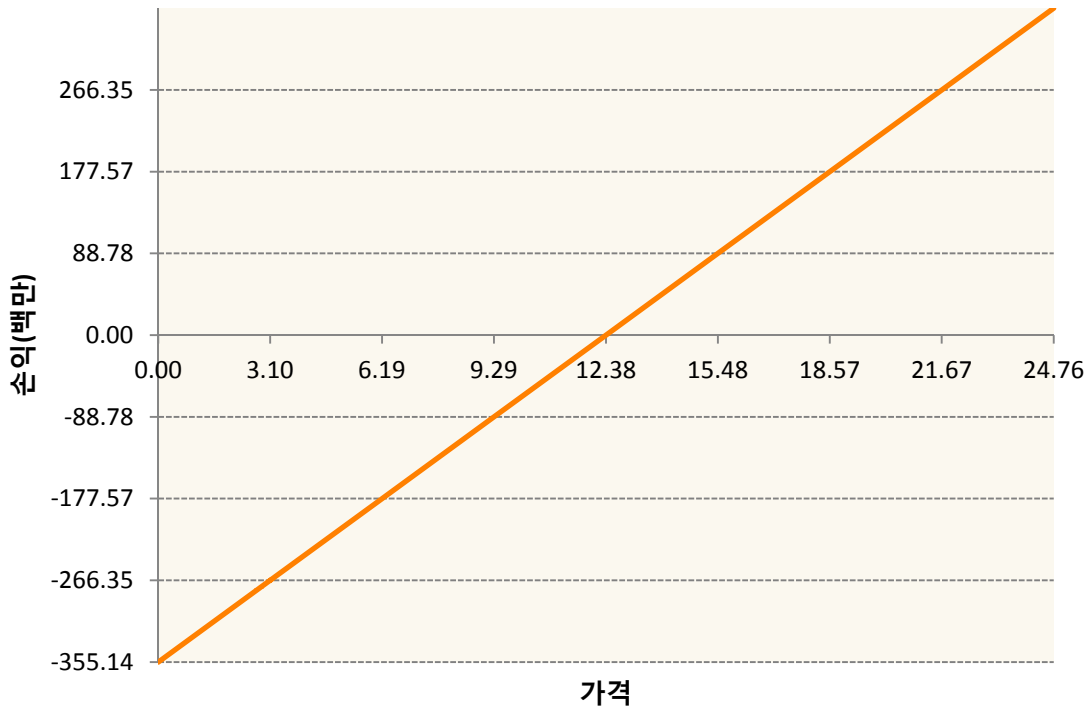
KR4175N60003-2018-06 달러선물



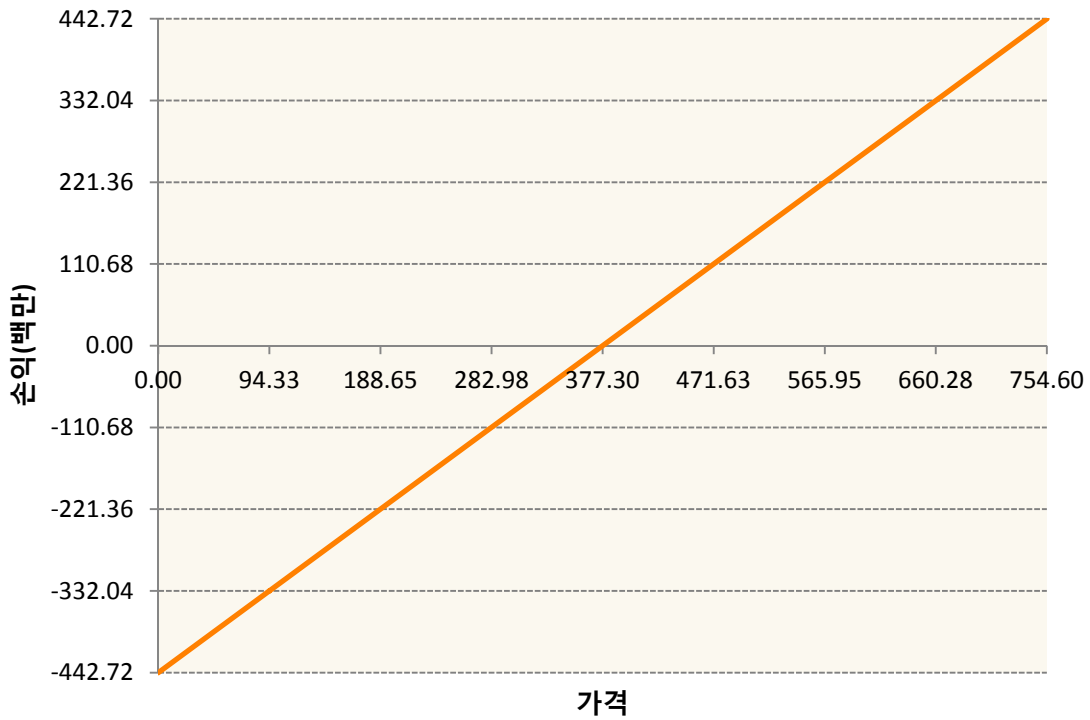
KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18



SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18

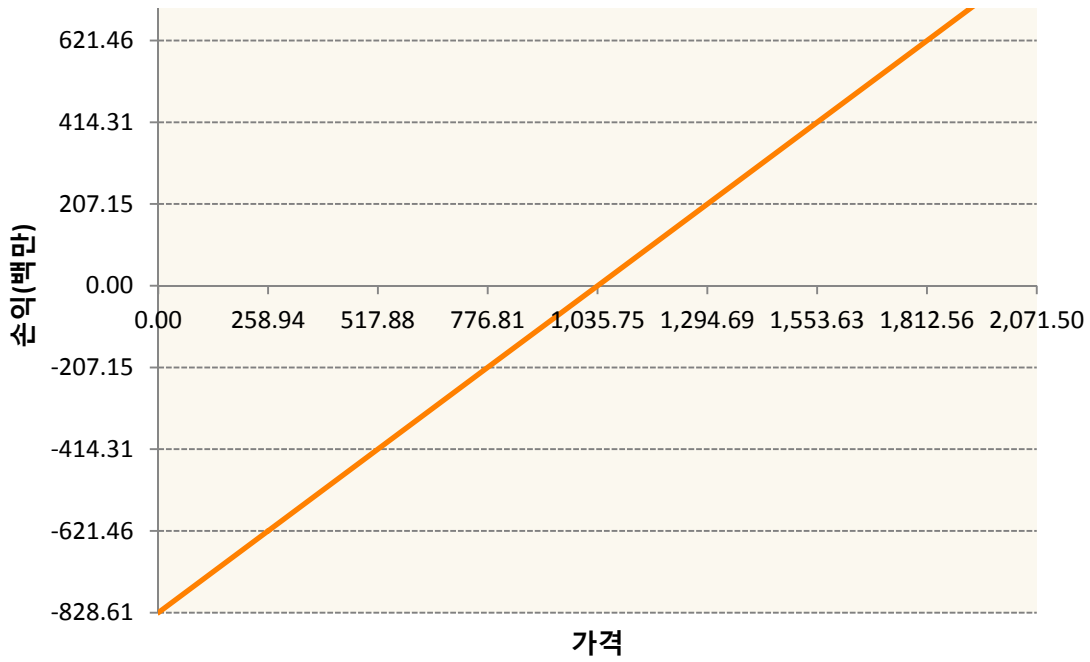


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18

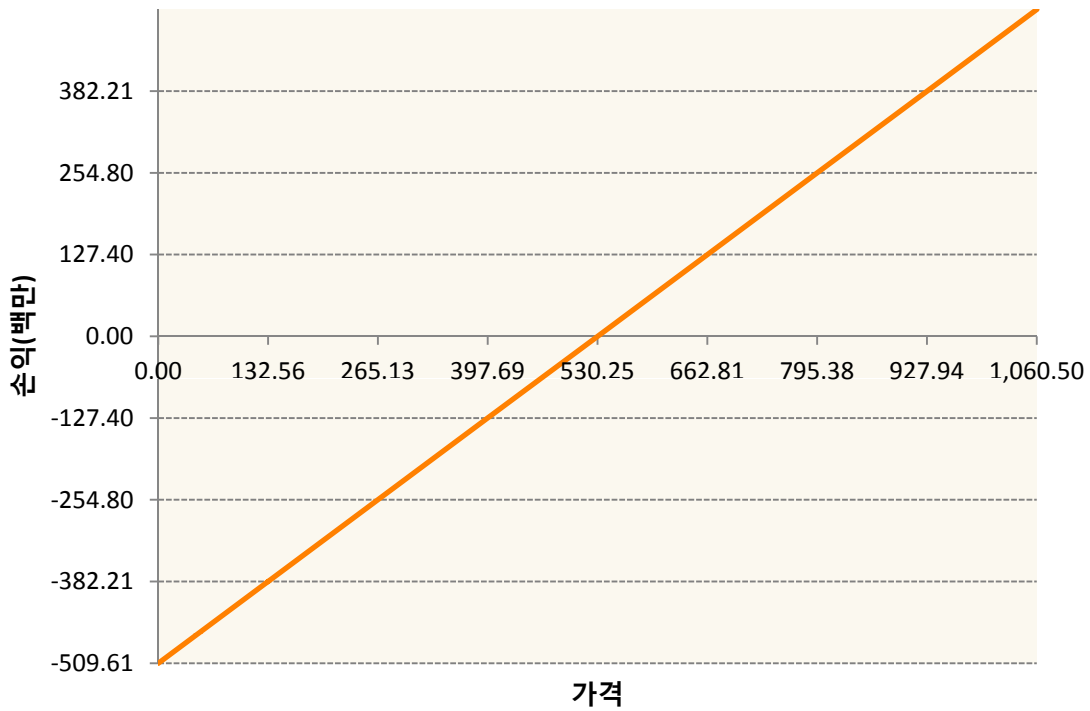


SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18





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	41

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

(단위:백만원)

338