

공시일	2018-05-29
기준일	2018-05-28

## 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	2018-05-29
기준일	2018-05-28

## 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

1,114

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

455

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-05-29
기준일	2018-05-28

## 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

390

\* 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	2018-05-29
기준일	2018-05-28

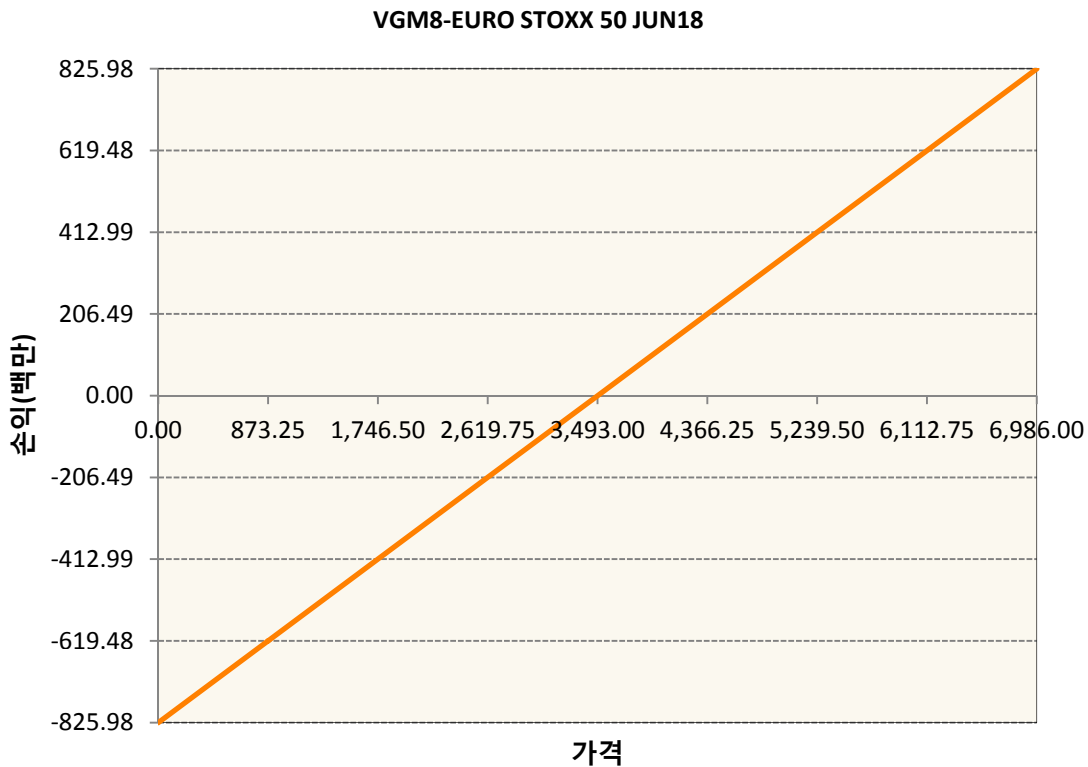
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	826	0	826	

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

40
----

공시일	2018-05-29
기준일	2018-05-28

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

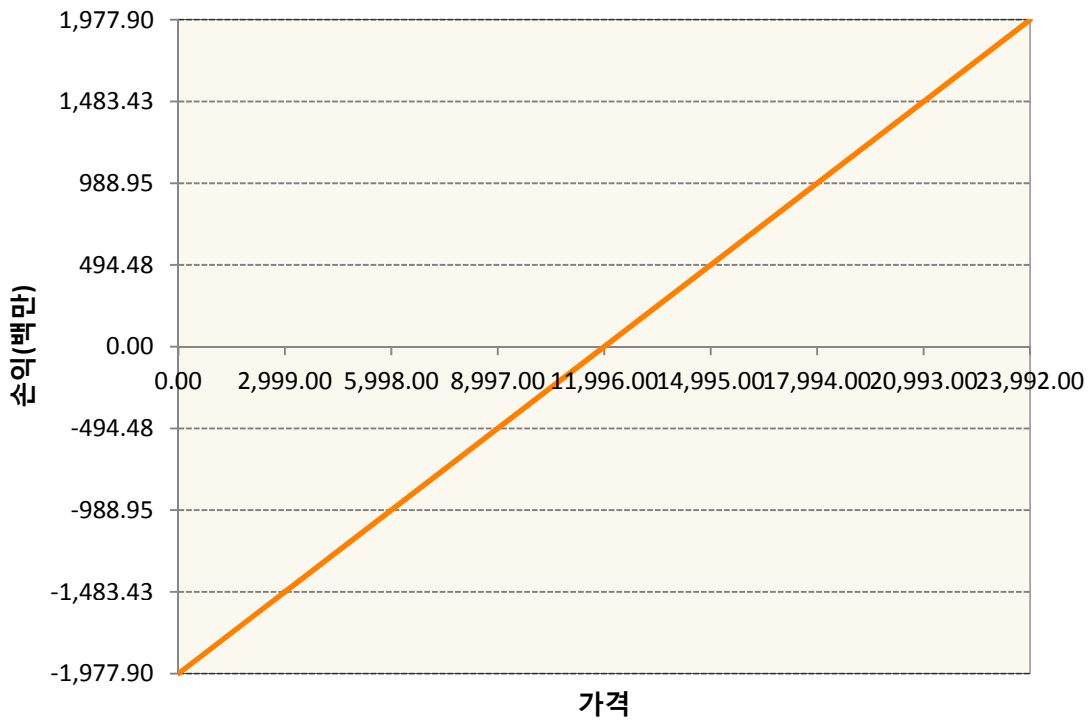
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

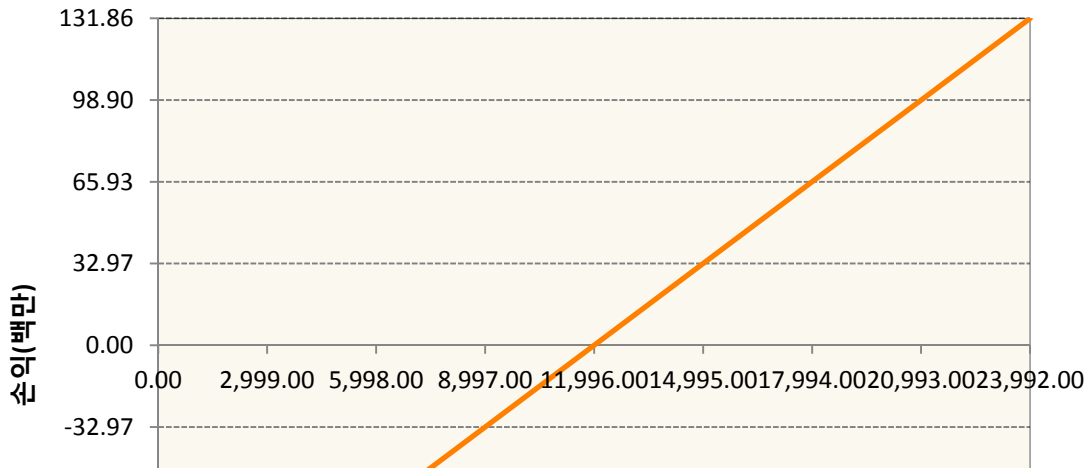
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,110	0	2,110	장내

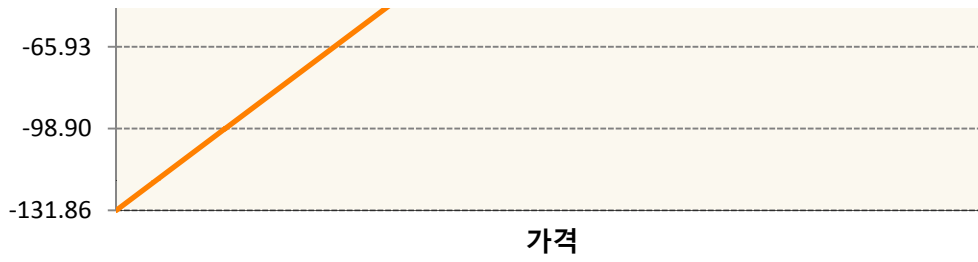
### 2. 만기시점의 손익구조

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)

<b>149</b>
------------

공시일	2018-05-29
기준일	2018-05-28

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

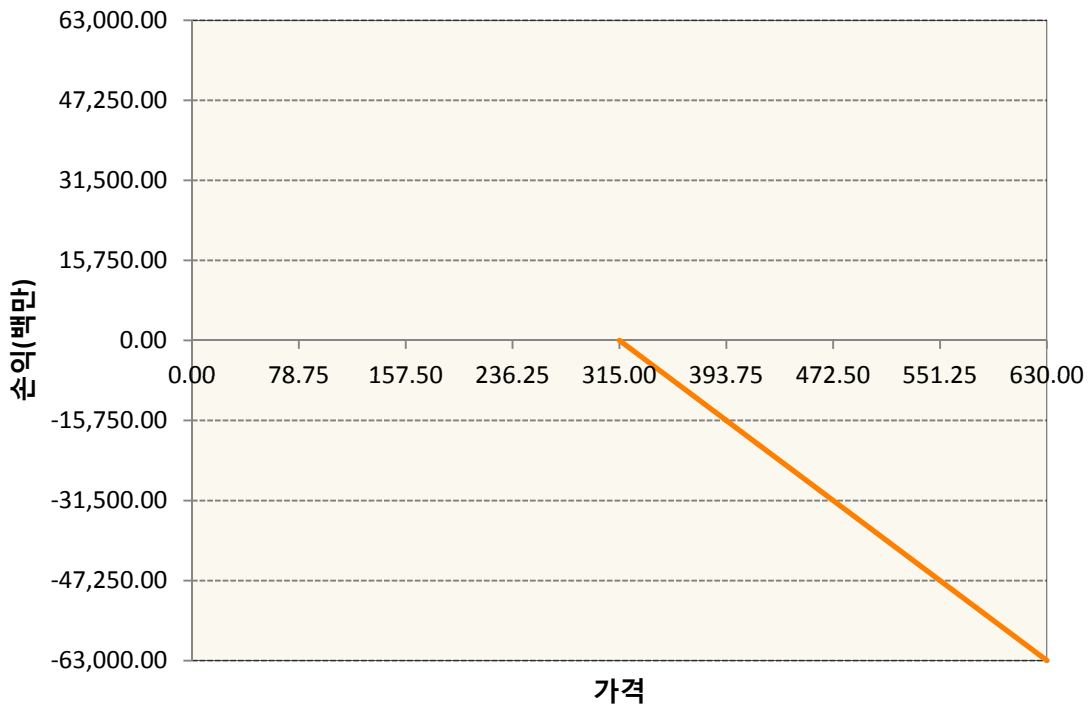
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

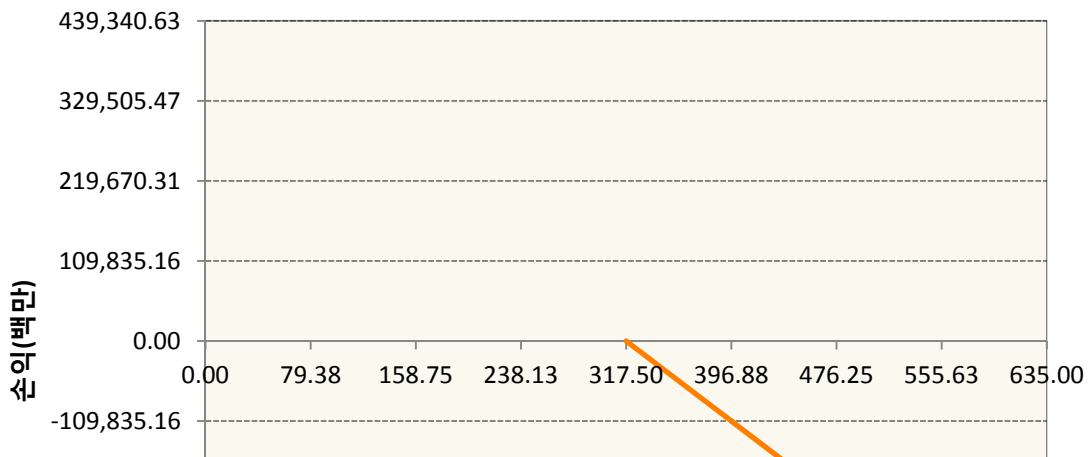
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	3,133	0	3,133	장내
누계	유가증권	옵션	0	810,316	-810,316	장내

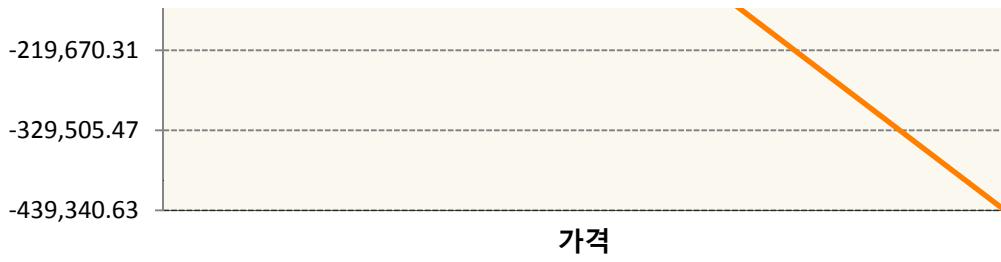
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201N63159-2018-06 콜315**

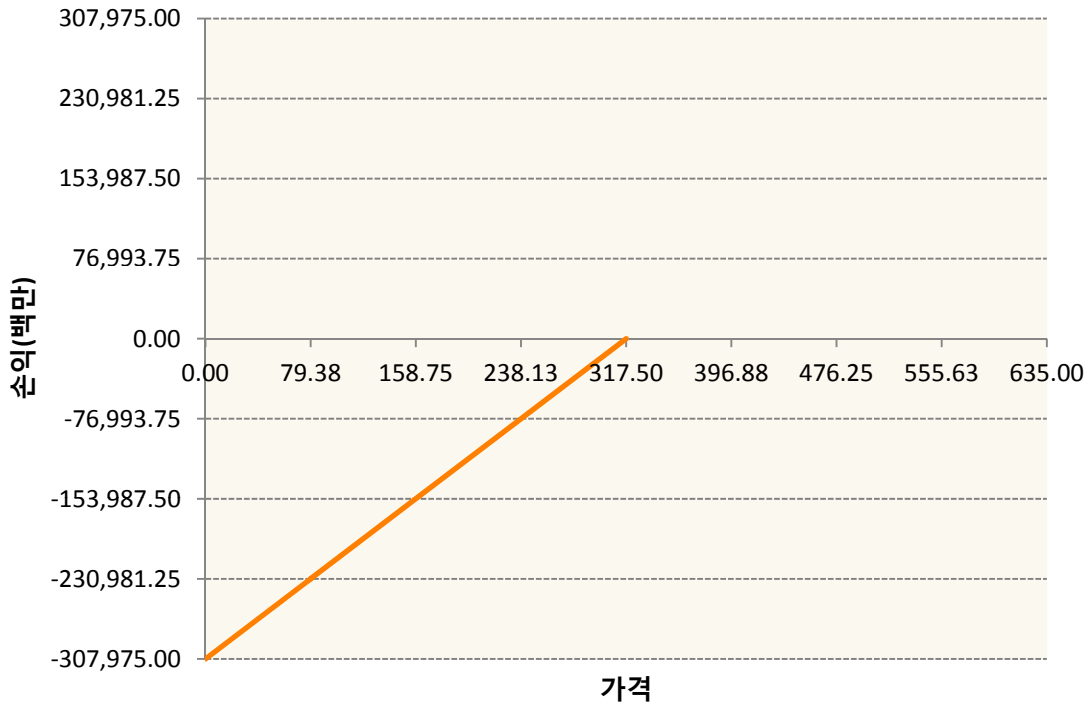


**KR4201N63175-2018-06 콜317.5**





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N6312018-06 콜315

4,226

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,889	1,848	1,799	1,741	1,676	1,605	1,529
-5.33%	1,694	1,611	1,521	1,426	1,327	1,225	1,120
-2.67%	1,223	1,103	982	861	739	616	493
0%	371	248	124	0	-125	-250	-375
2.67%	-854	-946	-1,045	-1,147	-1,254	-1,363	-1,475
5.33%	-2,341	-2,394	-2,455	-2,526	-2,603	-2,686	-2,774
8.00%	-3,966	-3,989	-4,020	-4,060	-4,108	-4,164	-4,226

KR4201N6312018-06 풋317.5

28,137

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,352	11,133	10,853	10,516	10,128	9,695	9,221

-5.33%	10,355	9,859	9,311	8,720	8,094	7,439	6,760
-2.67%	7,736	6,955	6,157	5,348	4,530	3,704	2,872
0%	2,640	1,761	881	0	-881	-1,763	-2,644
2.67%	-5,120	-5,845	-6,599	-7,375	-8,168	-8,974	-9,792
5.33%	-14,951	-15,401	-15,911	-16,473	-17,078	-17,718	-18,389
8.00%	-25,972	-26,186	-26,464	-26,804	-27,200	-27,646	-28,137

KR4301N6312018-06 풋317.5

20,675

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20,643	-20,643	-20,644	-20,647	-20,652	-20,661	-20,675
-5.33%	-12,411	-12,429	-12,457	-12,498	-12,552	-12,621	-12,703
-2.67%	-4,572	-4,729	-4,903	-5,091	-5,289	-5,497	-5,712
0%	812	543	272	0	-272	-545	-819
2.67%	2,470	2,373	2,255	2,119	1,967	1,802	1,624
5.33%	2,636	2,628	2,612	2,586	2,549	2,500	2,438
8.00%	2,641	2,641	2,640	2,638	2,634	2,626	2,614

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

(단위:백만원)

**56,487**

공시일	2018-05-29
기준일	2018-05-28

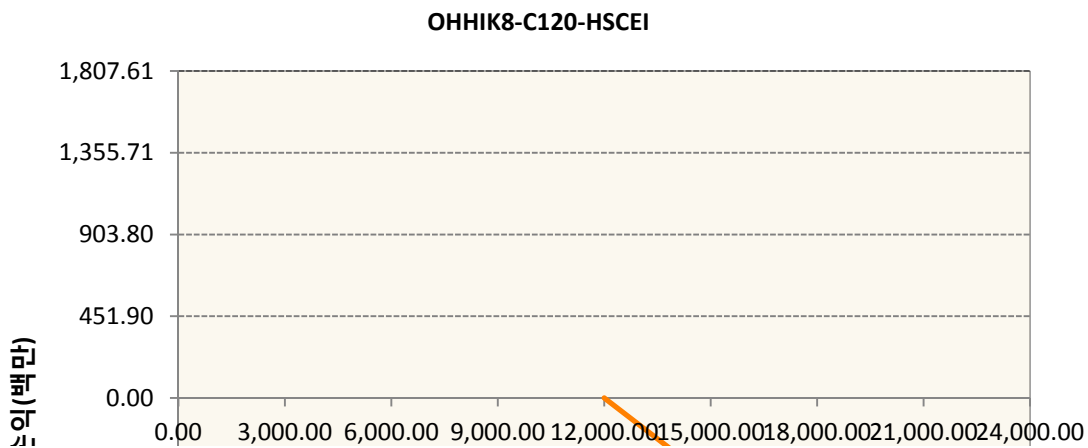
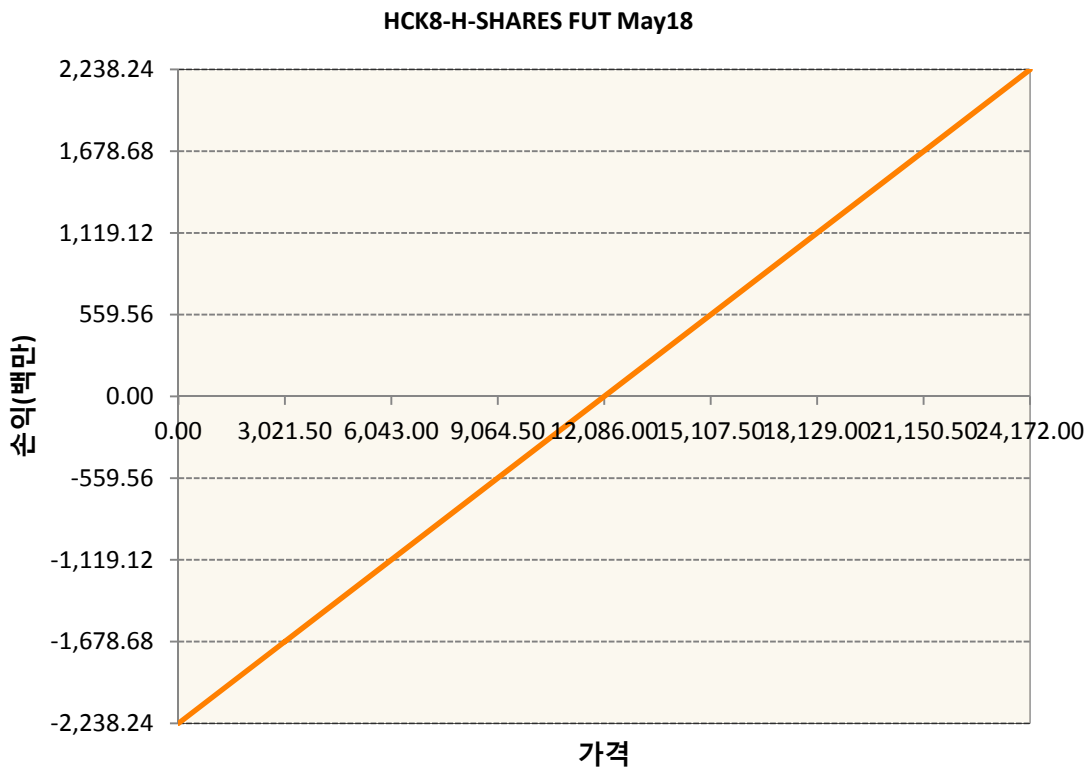
## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

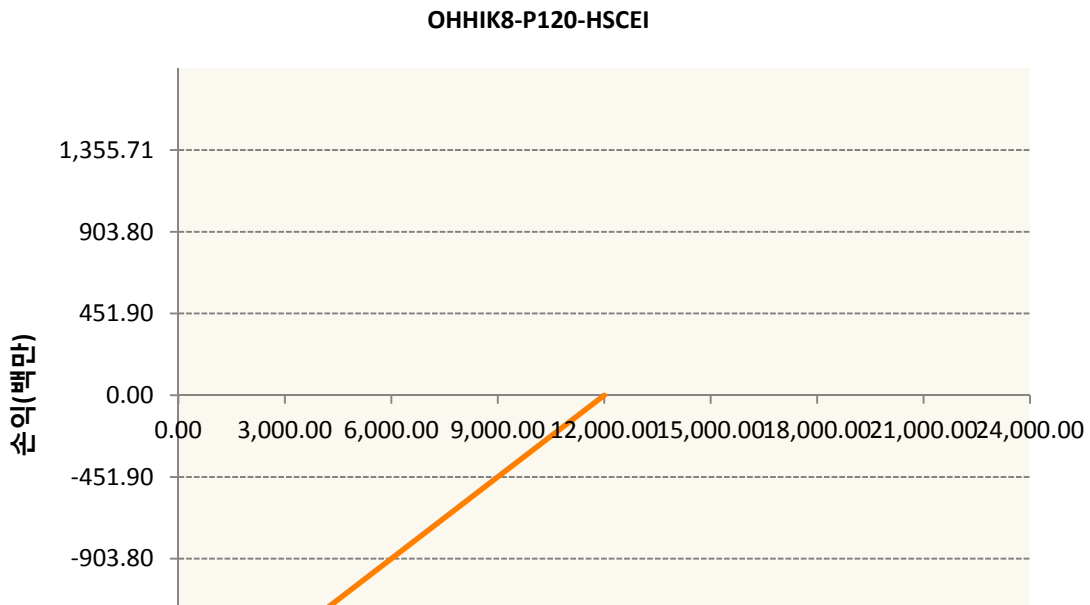
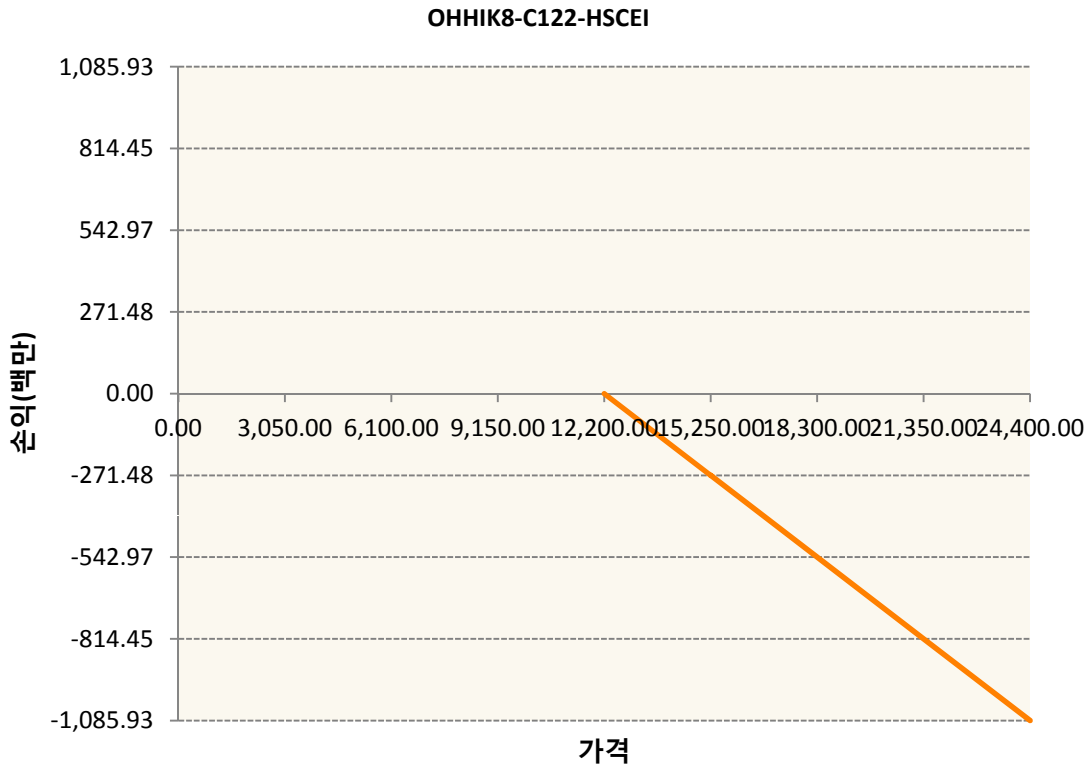
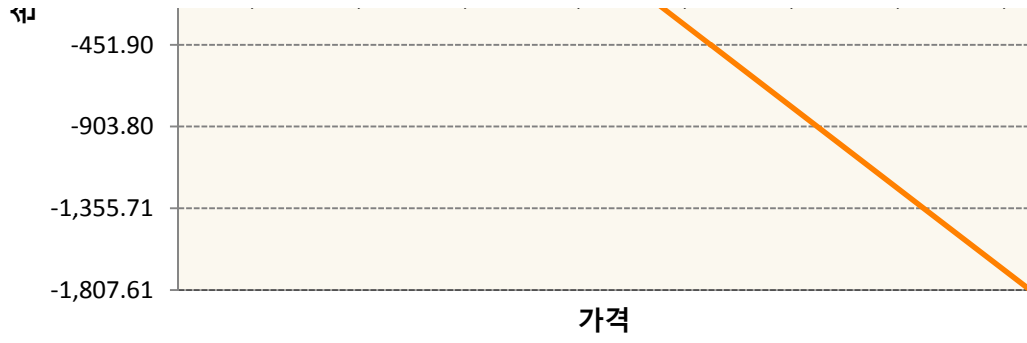
### 1. 계약금액

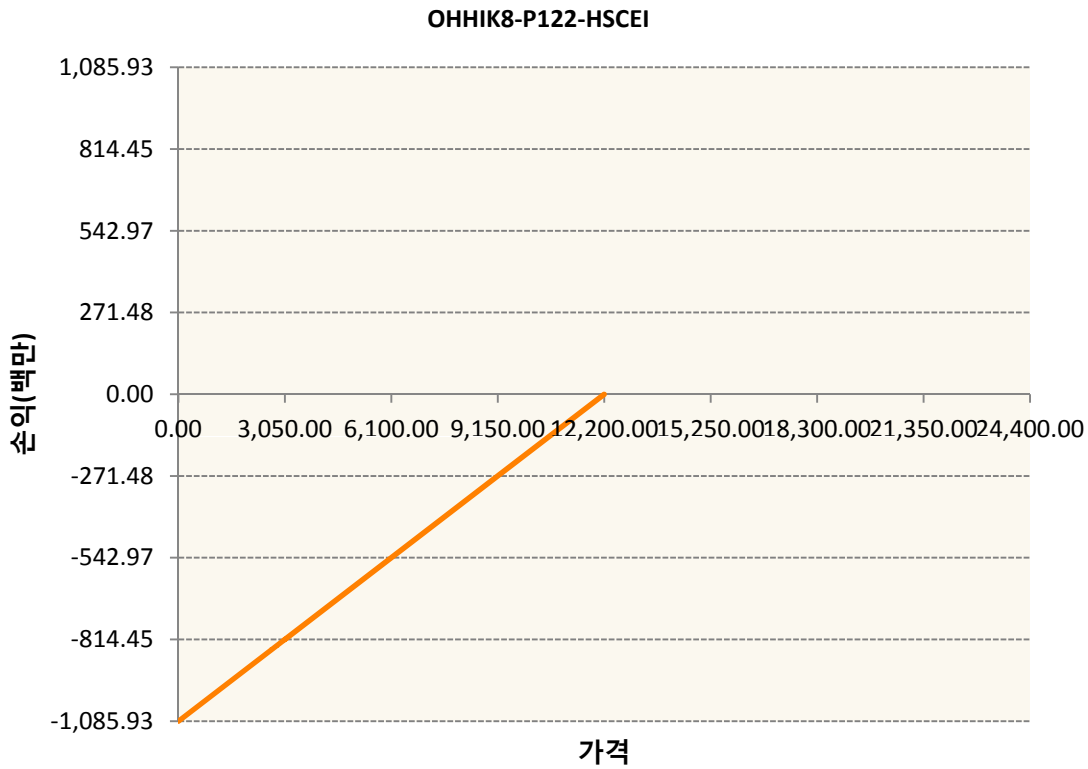
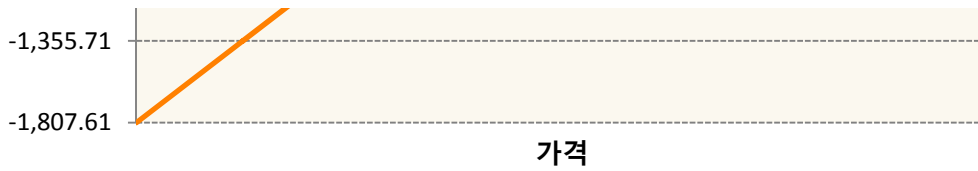
(단위:백만원)

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	2,238	0	2,238	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,787	-5,787	장내

### 2. 만기시점의 손익구조







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)
	567

공시일	2018-05-29
기준일	2018-05-28

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

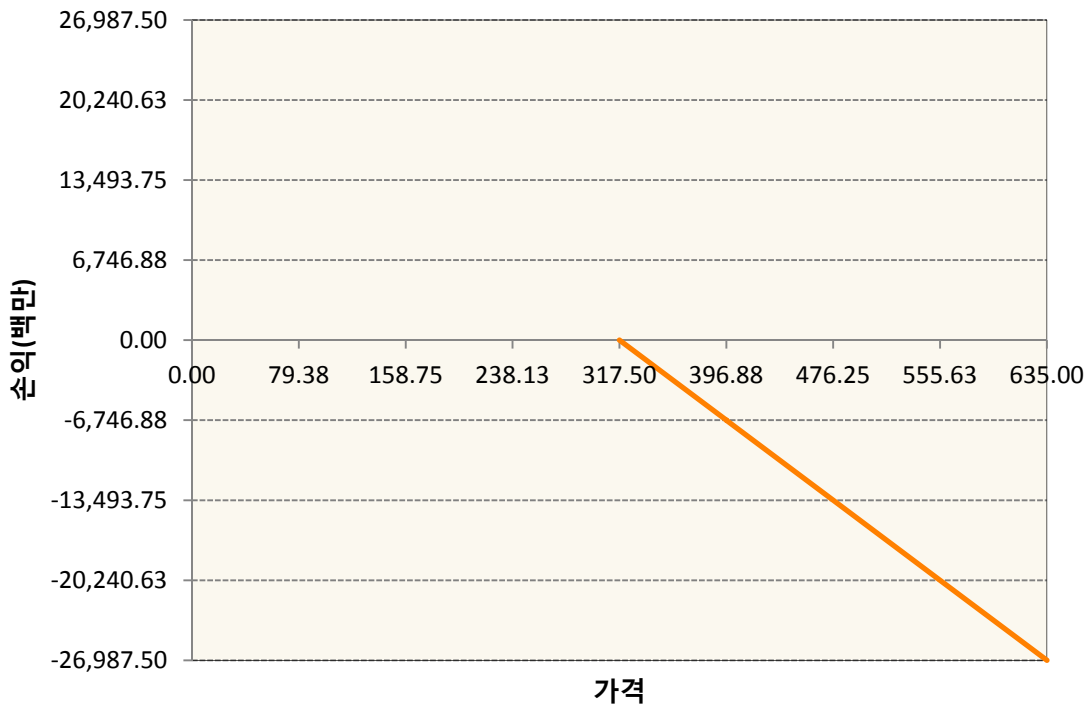
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

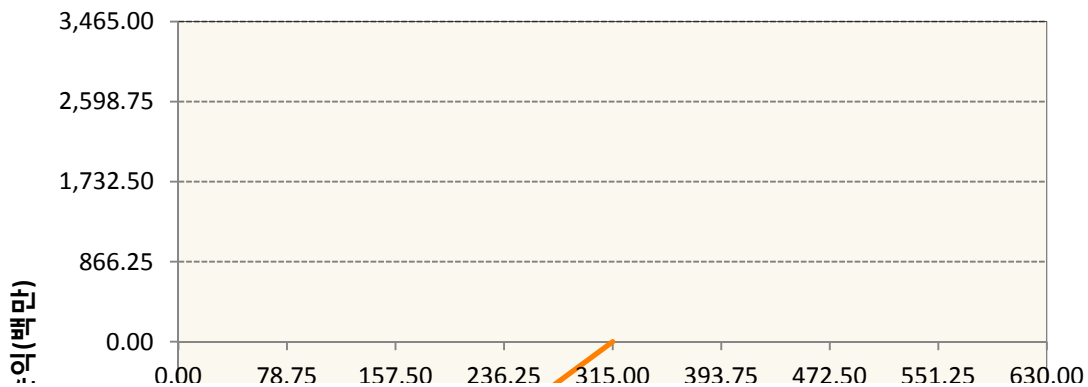
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	46,804	-46,804	장내

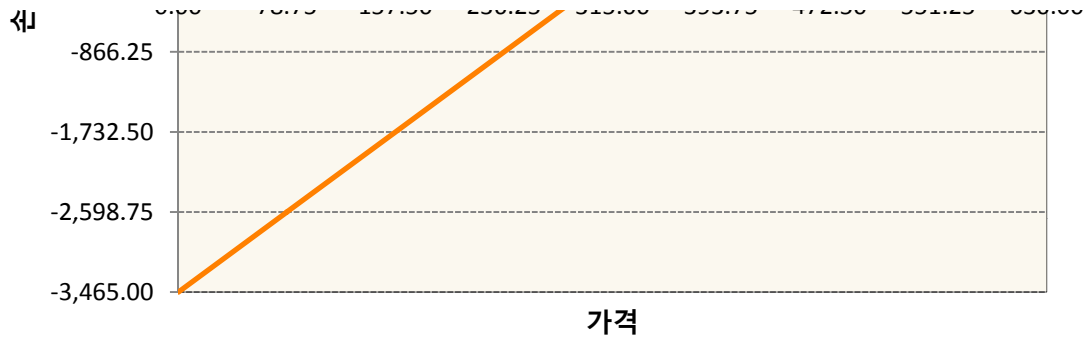
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63175-2018-06 콜317.5

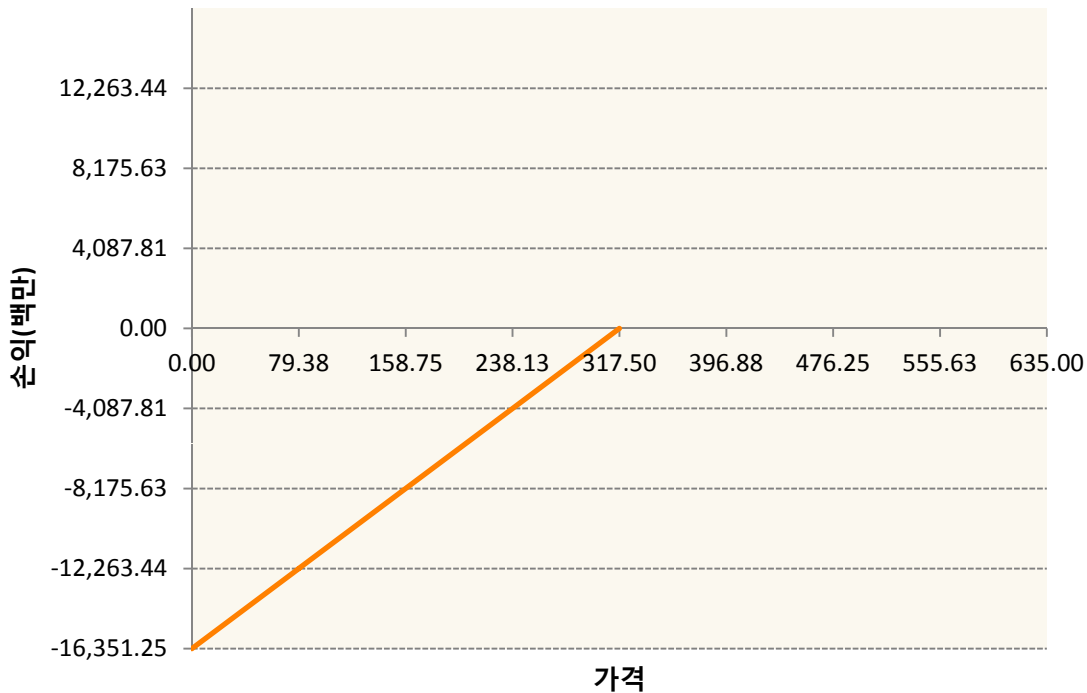


KR4301N63157-2018-06 풋315





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 1,728

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	697	684	667	646	622	596	566
-5.33%	636	606	572	536	497	457	415
-2.67%	475	427	378	329	278	228	176
0%	162	108	54	0	-54	-108	-162
2.67%	-315	-359	-405	-453	-502	-551	-601
5.33%	-918	-946	-977	-1,012	-1,049	-1,088	-1,130
8.00%	-1,595	-1,609	-1,626	-1,646	-1,671	-1,698	-1,728

KR4301N6312018-06 풋315 218

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-217	-217	-217	-217	-217	-217	-218
-5.33%	-124	-124	-125	-126	-127	-128	-129
-2.67%	-40	-42	-45	-47	-50	-53	-56
0%	8	5	3	0	-3	-6	-9
2.67%	19	18	17	16	15	14	12
5.33%	20	19	19	19	19	19	18
8.00%	20	20	20	20	19	19	19

KR4301N6312018-06 풋317.5 1,098

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,096	-1,096	-1,096	-1,096	-1,096	-1,097	-1,098
-5.33%	-659	-660	-661	-664	-666	-670	-674
-2.67%	-243	-251	-260	-270	-281	-292	-303
0%	43	29	14	0	-14	-29	-43
2.67%	131	126	120	113	104	96	86
5.33%	140	140	139	137	135	133	129
8.00%	140	140	140	140	140	139	139

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

(단위:백만원)

7,089

공시일	2018-05-29
기준일	2018-05-28

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

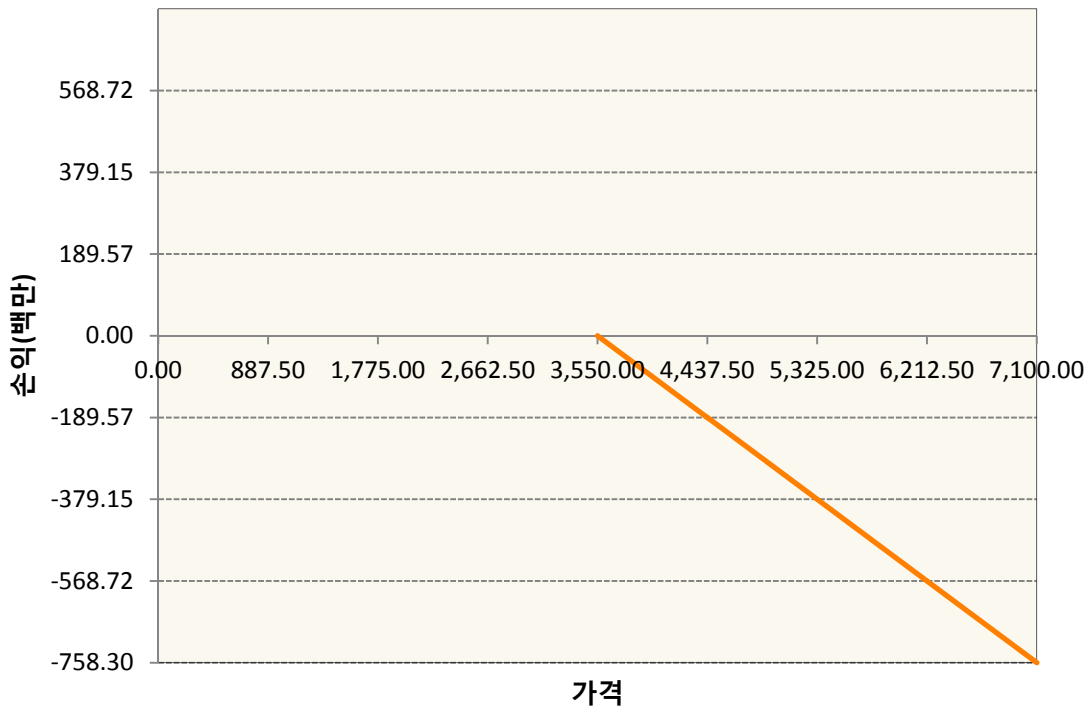
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

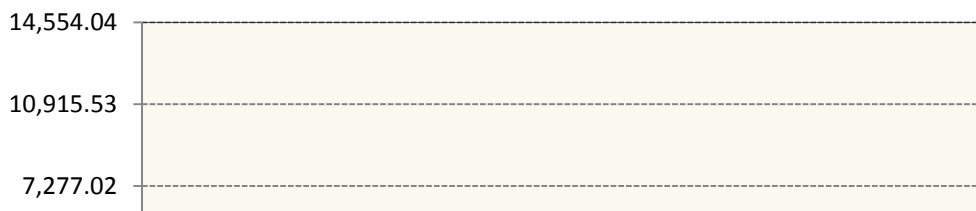
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,277	0	7,277	
누계	유가증권	스왑	52,977	0	52,977	장외
누계	유가증권	옵션	0	30,625	-30,625	장내
누계	지수	스왑	50,263	0	50,263	장외

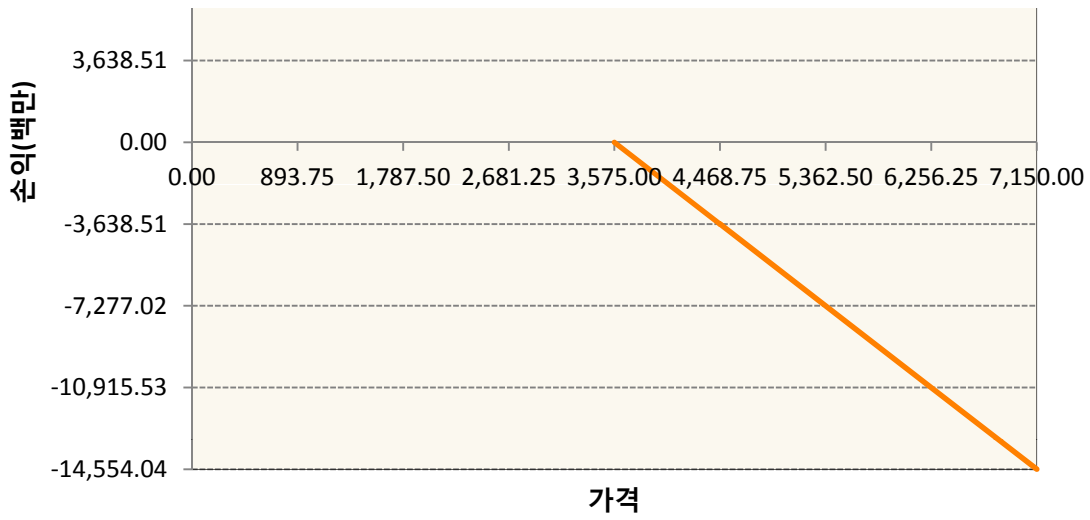
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXM8-C3550-EURO STOXX 50**

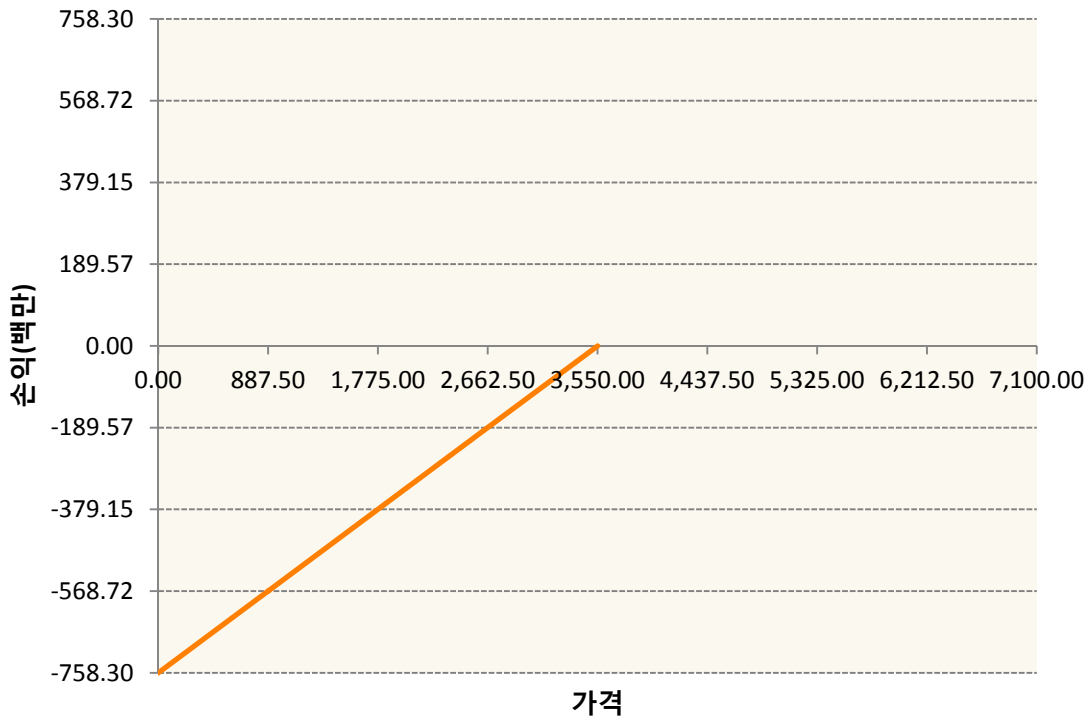


**OESXM8-C3575-EURO STOXX 50**

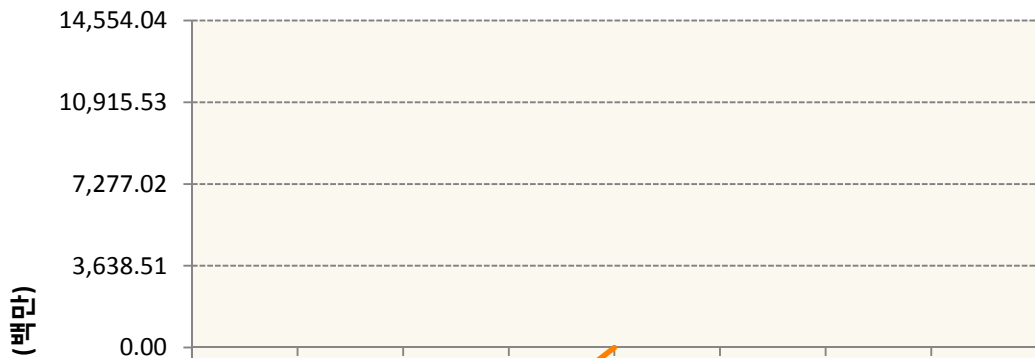


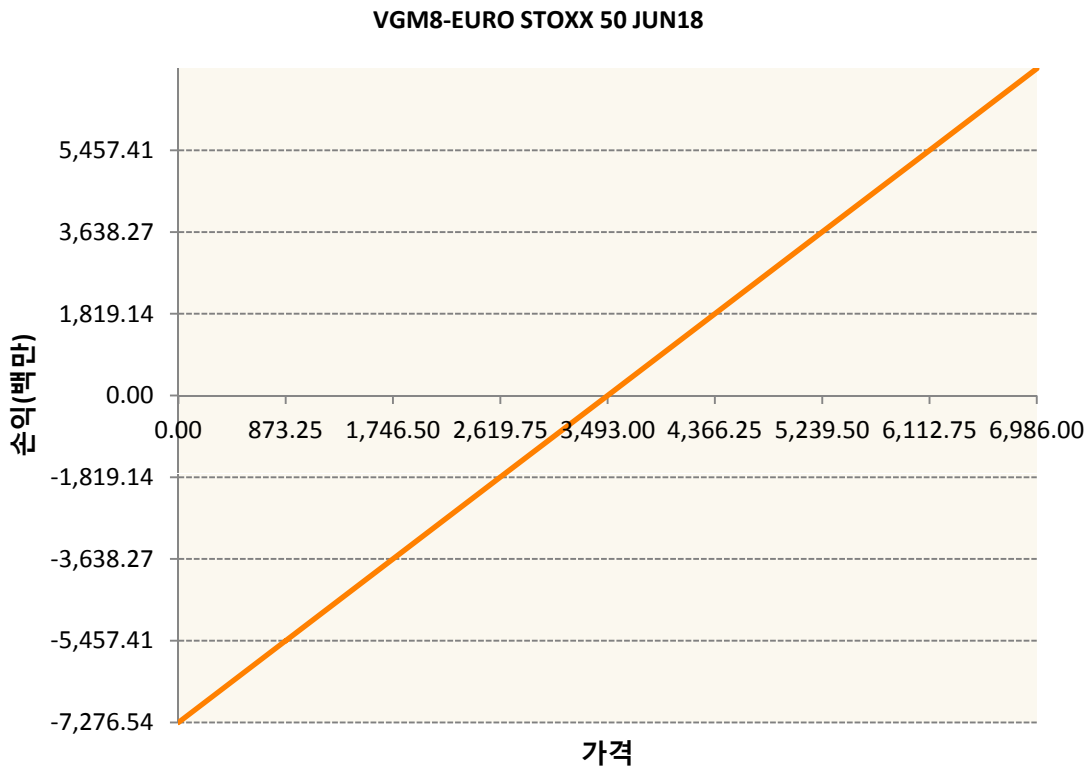
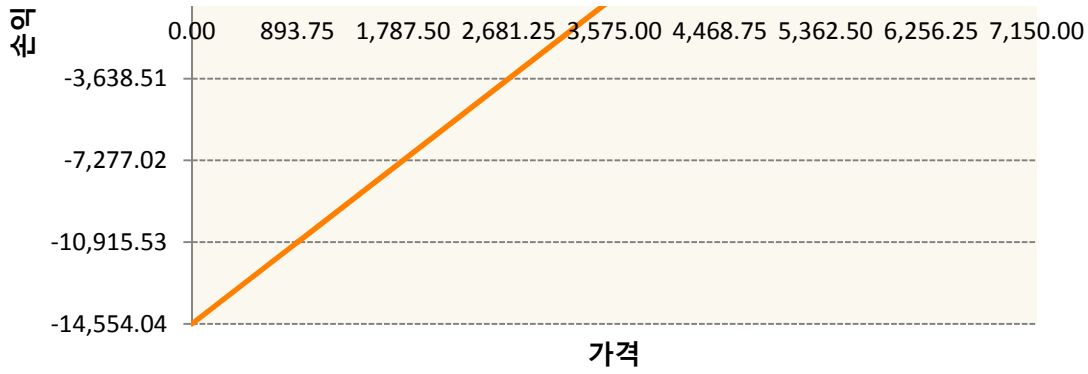


OESXM8-P3550-EURO STOXX 50



OESXM8-P3575-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		23
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		25
OESXM8-C3: EURO STOXX 50		61
OESXM8-C3: EURO STOXX 50		1,164
OESXM8-P3! EURO STOXX 50		61
OESXM8-P3! EURO STOXX 50		1,164
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18		582

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





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

(단위:백만원)

1,176



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

(단위:백만원)

60



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

(단위:백만원)

96



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

(단위:백만원)

220

공시일	2018-05-29
기준일	2018-05-28

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1

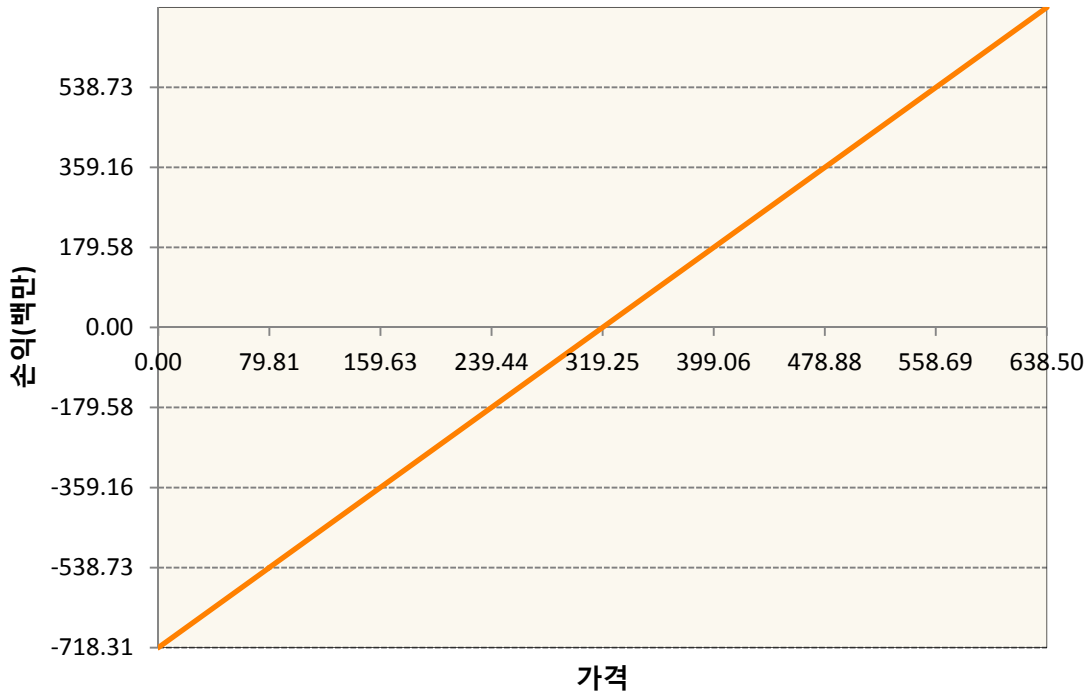
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	718	0	718	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	2018-05-29
기준일	2018-05-28

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

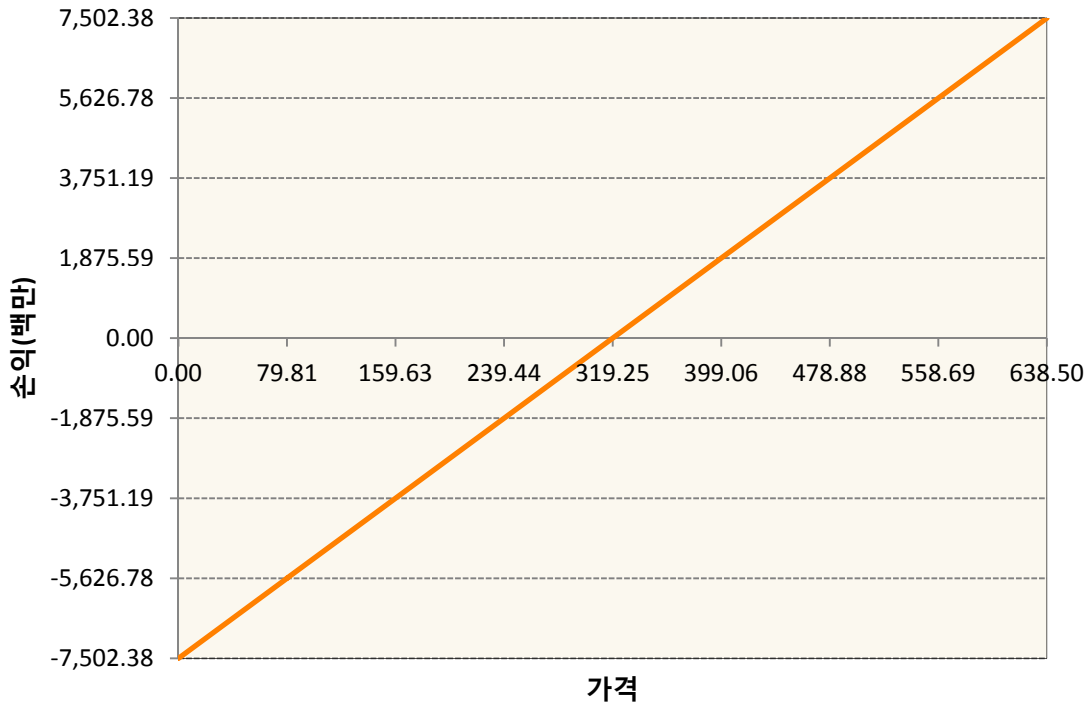
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

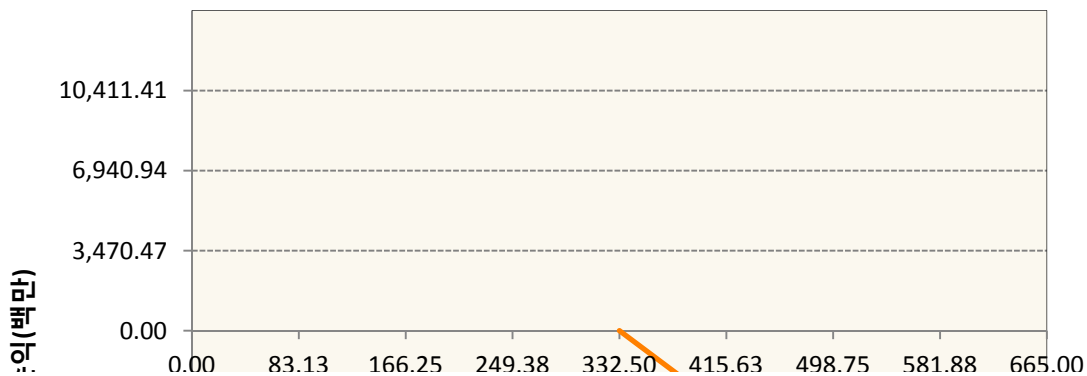
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	160	0	160	장내
신규	유가증권	옵션	0	832	-832	장내
누계	유가증권	선물	7,502	0	7,502	장내
누계	유가증권	옵션	1,508	13,882	-12,374	장내

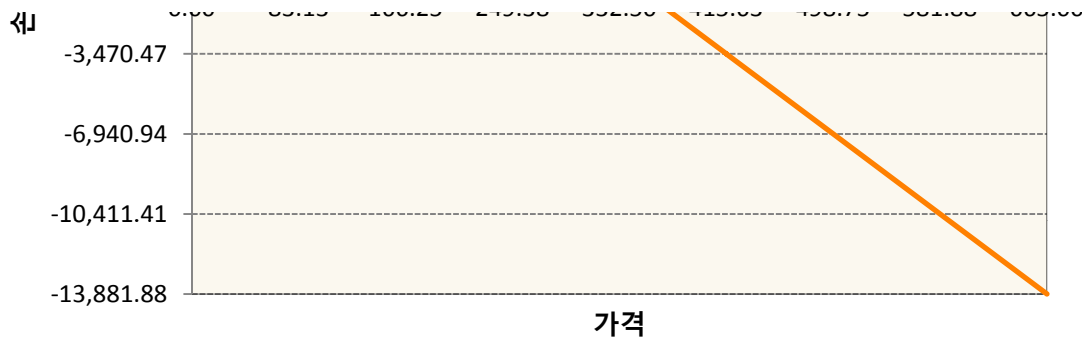
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

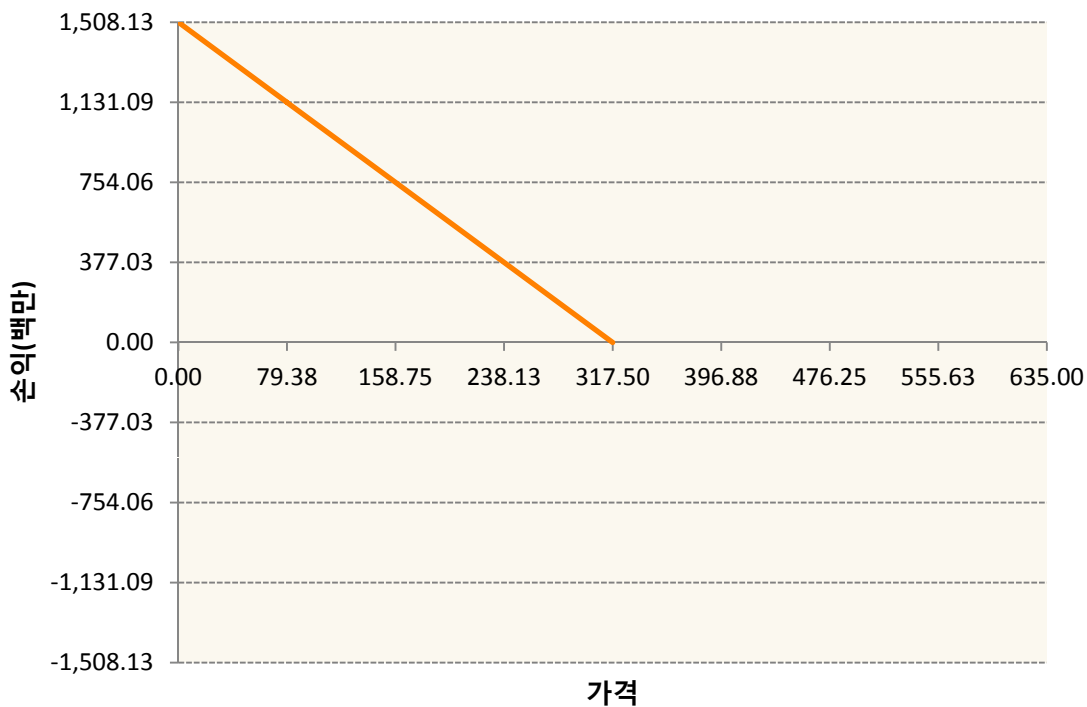


KR4201N63324-2018-06 콜332.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물							600
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-600	-600	-600	-600	-600	-600	-600
-5.33%	-400	-400	-400	-400	-400	-400	-400
-2.67%	-200	-200	-200	-200	-200	-200	-200
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	200	200	200	200	200	200	200
5.33%	400	400	400	400	400	400	400
8.00%	600	600	600	600	600	600	600
KR4201N63E 2018-06 콜332.5							602
기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	120	119	117	114	111	106	100
-5.33%	116	113	108	101	93	83	72
-2.67%	103	93	81	68	53	37	20
0%	60	41	21	0	-22	-45	-68
2.67%	-38	-65	-91	-118	-145	-172	-199
5.33%	-212	-239	-267	-294	-322	-350	-377
8.00%	-460	-482	-504	-528	-552	-577	-602

KR4301N6312018-06 풋317.5

101

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	101	101	101	101	101	101	101
-5.33%	61	61	61	61	61	62	62
-2.67%	22	23	24	25	26	27	28
0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-12	-12	-11	-10	-10	-9	-8
5.33%	-13	-13	-13	-13	-12	-12	-12
8.00%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13

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

(단위:백만원)

988

공시일	2018-05-29
기준일	2018-05-28

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

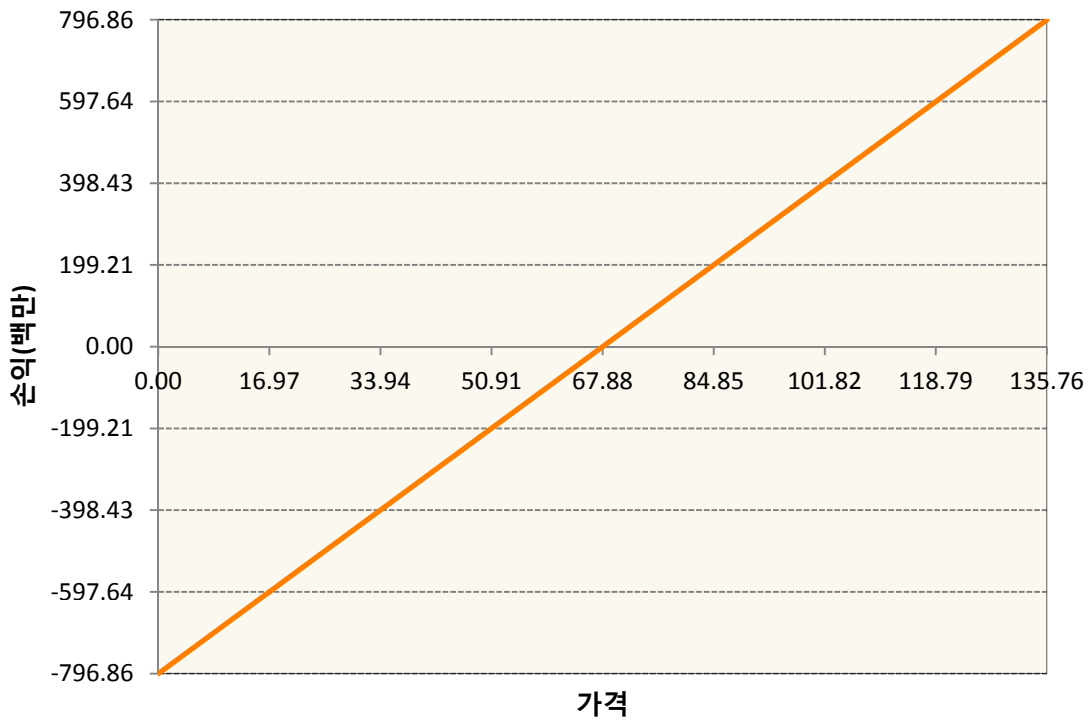
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

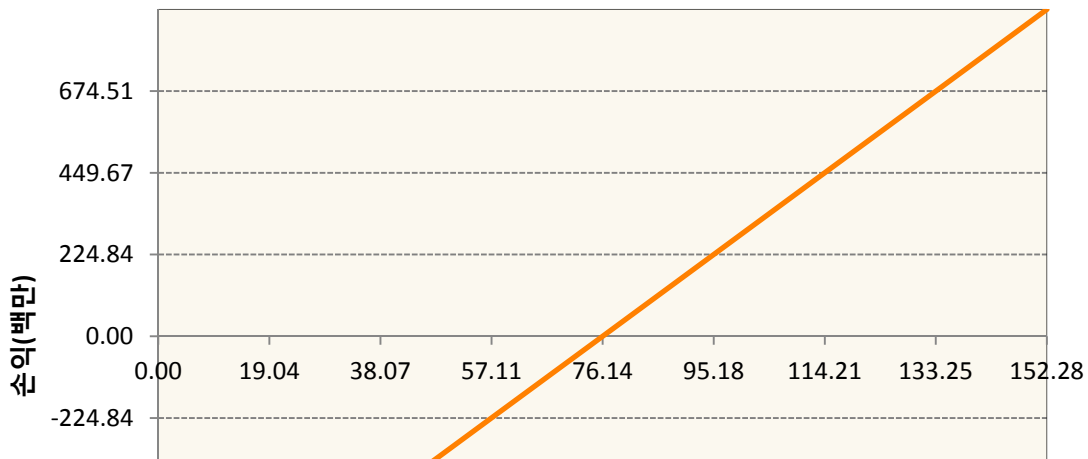
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,882	590	3,292	

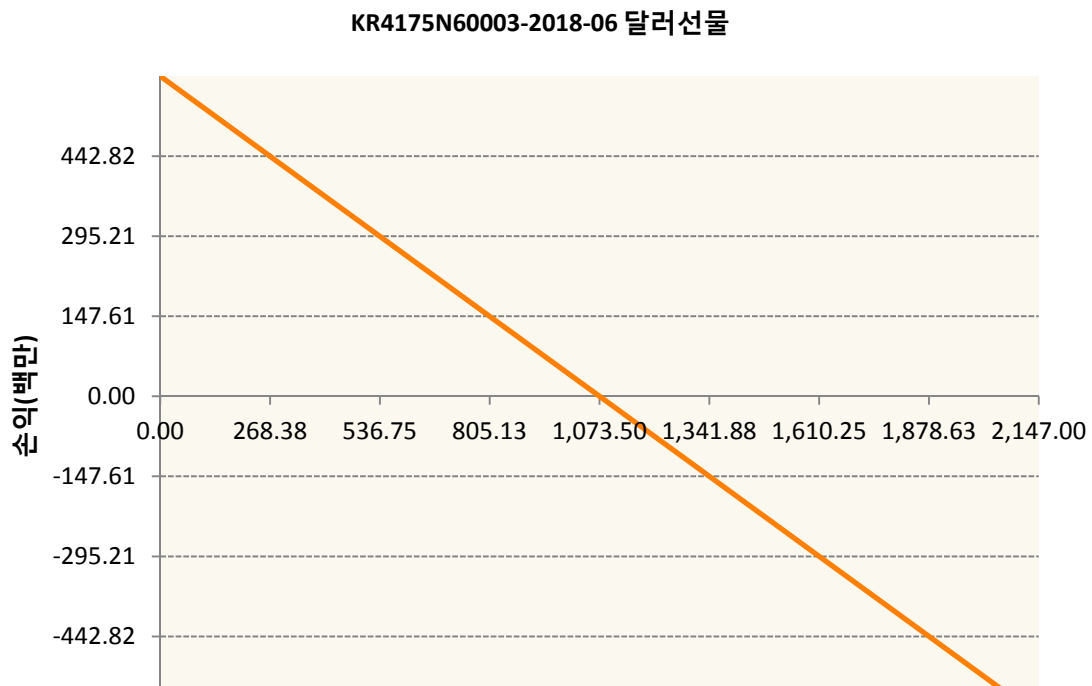
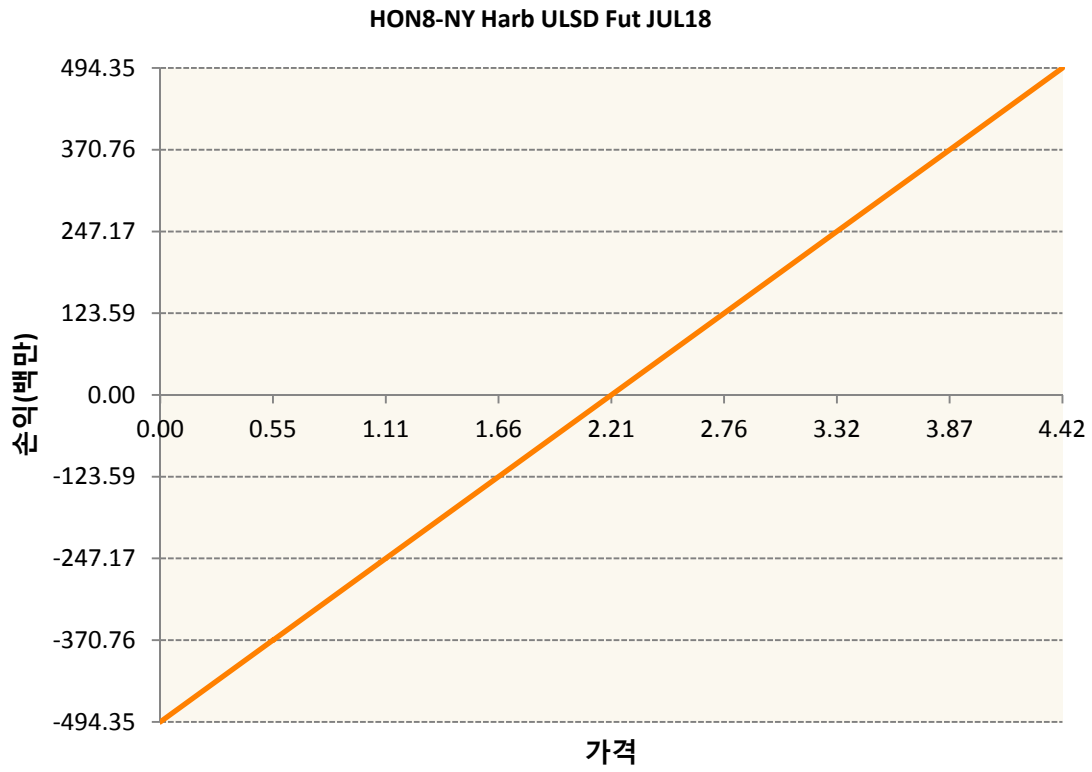
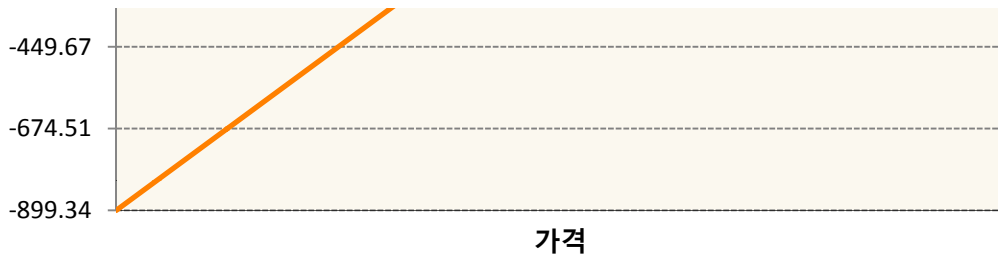
### 2. 만기시점의 손익구조

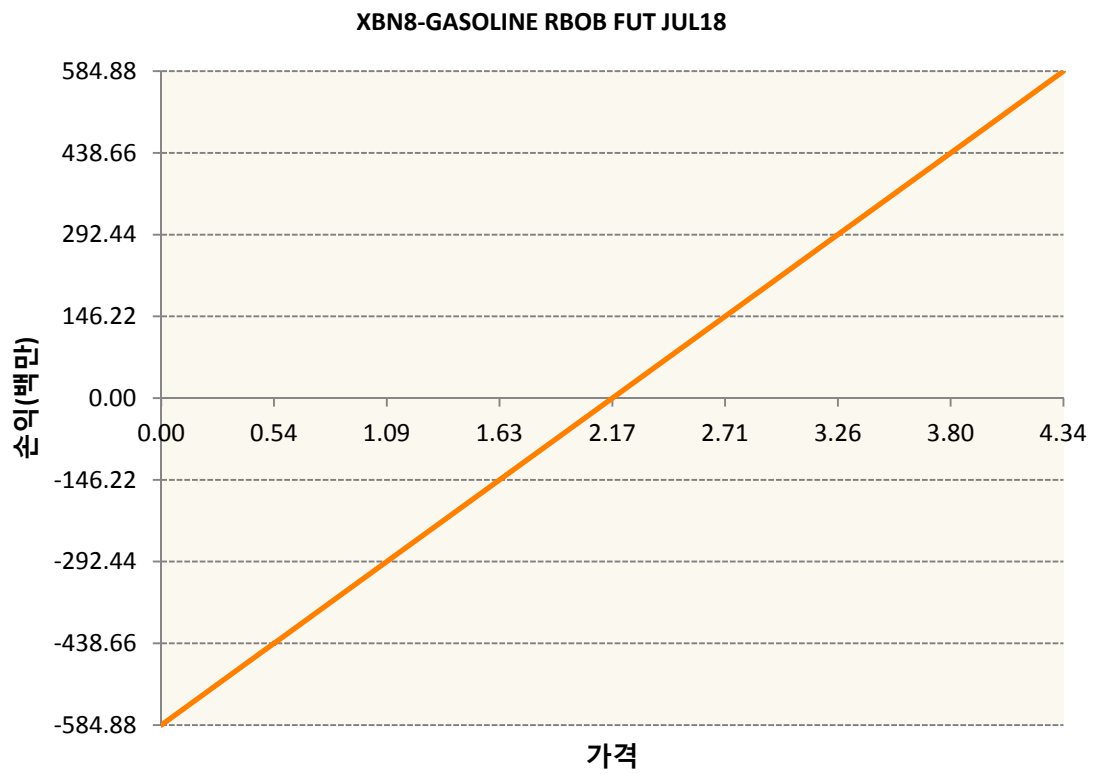
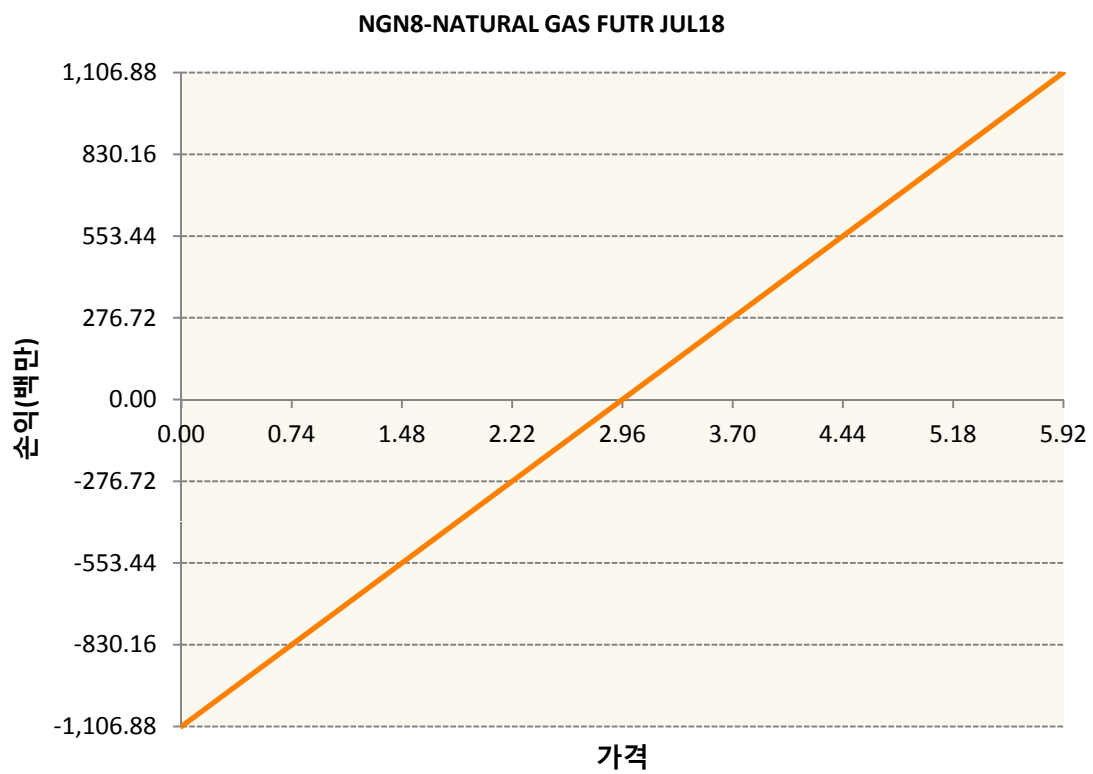
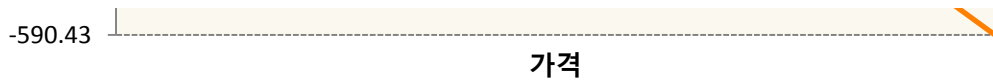
**CLN8-WTI CRUDE FUTURE JUL18**



**COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18**







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

CLN8	WTI CRUDE FUTURE JUL18	64
COU8	BRENT CRUDE FUTR SEP18	72
HON8	NY Harb ULSD Fut JUL18	40
KR4175N60C	2018-06 달러선물	47
NGN8	NATURAL GAS FUTR JUL18	89
XBN8	GASOLINE RBOB FUT JUL18	47

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

472

공시일	2018-05-29
기준일	2018-05-28

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

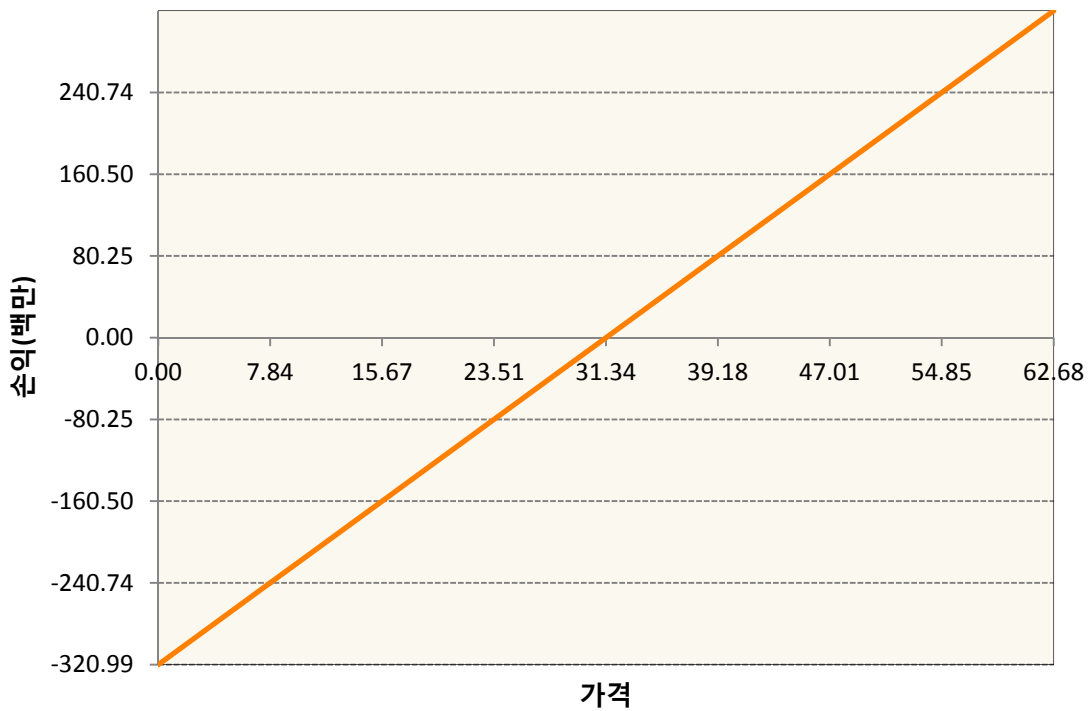
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

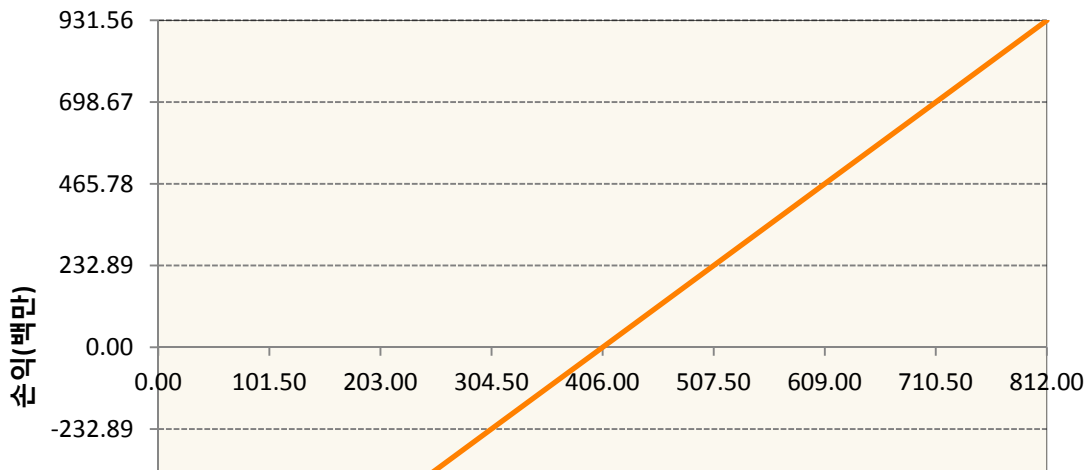
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,198	322	3,875	

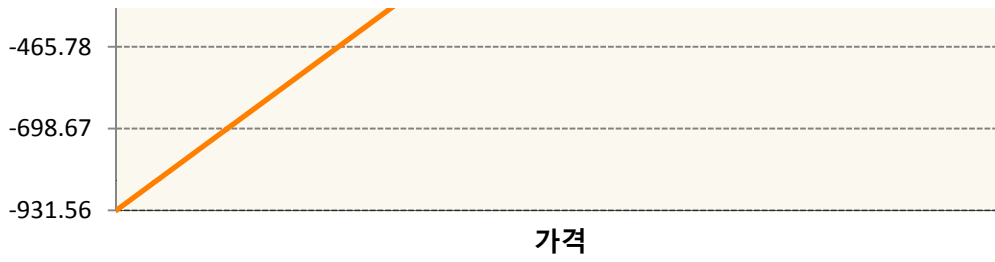
### 2. 만기시점의 손익구조

**BON8-SOYBEAN OIL FUTR JUL18**

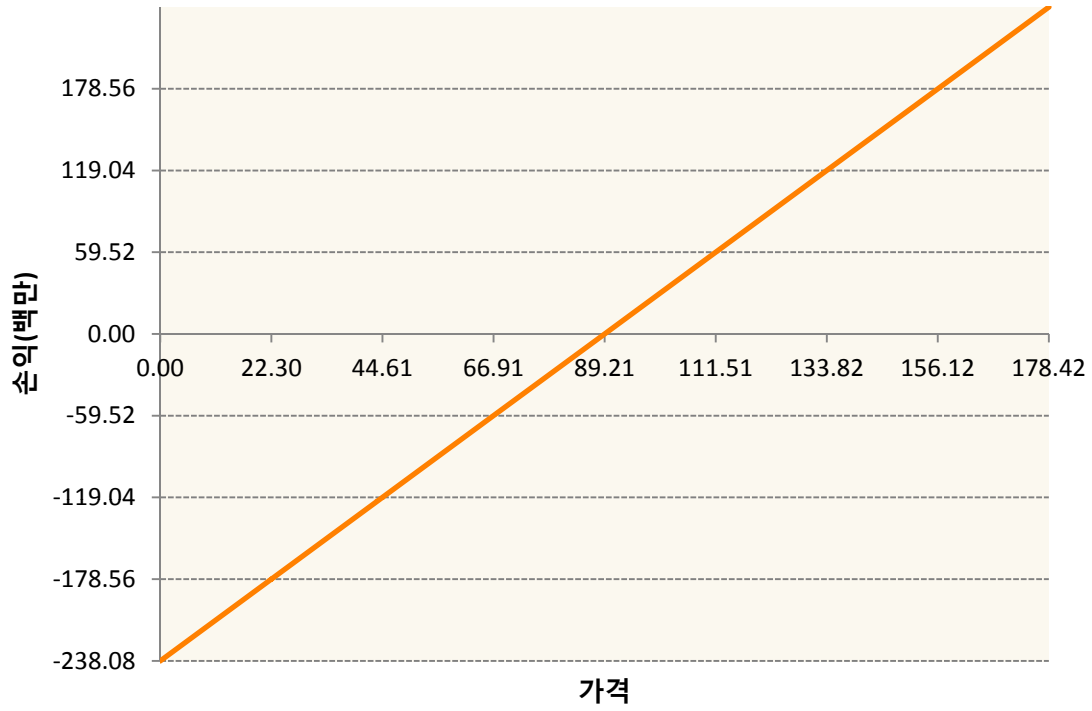


**CN8-CORN FUTURE JUL18**

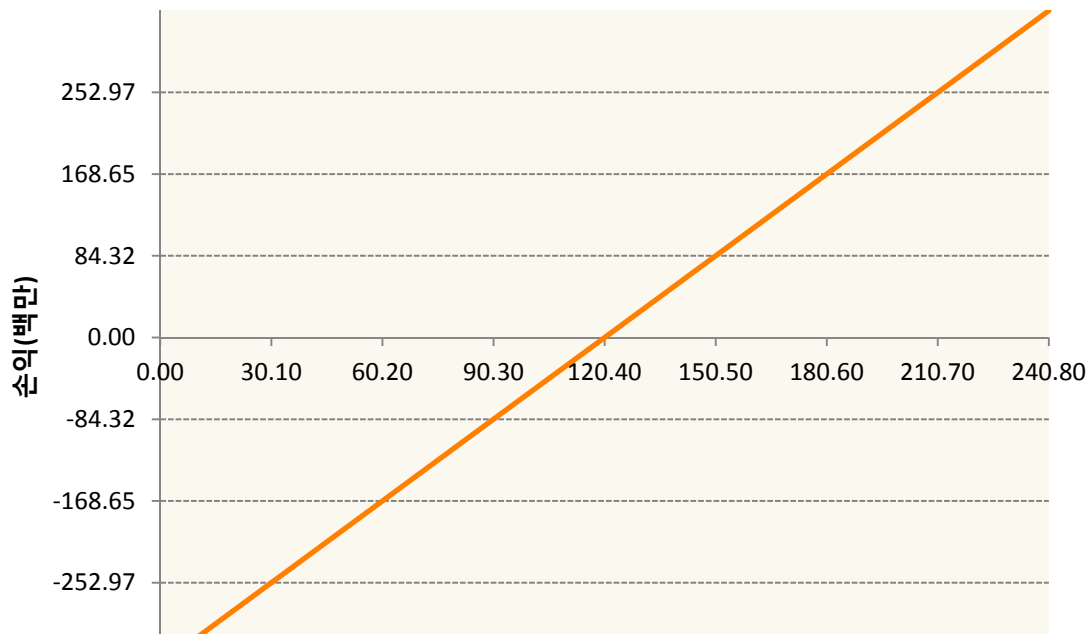


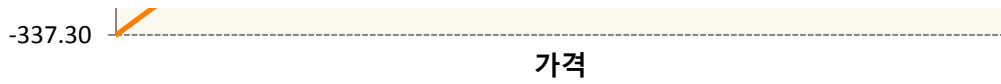


**CTN8-COTTON NO.2 FUTR JUL18**

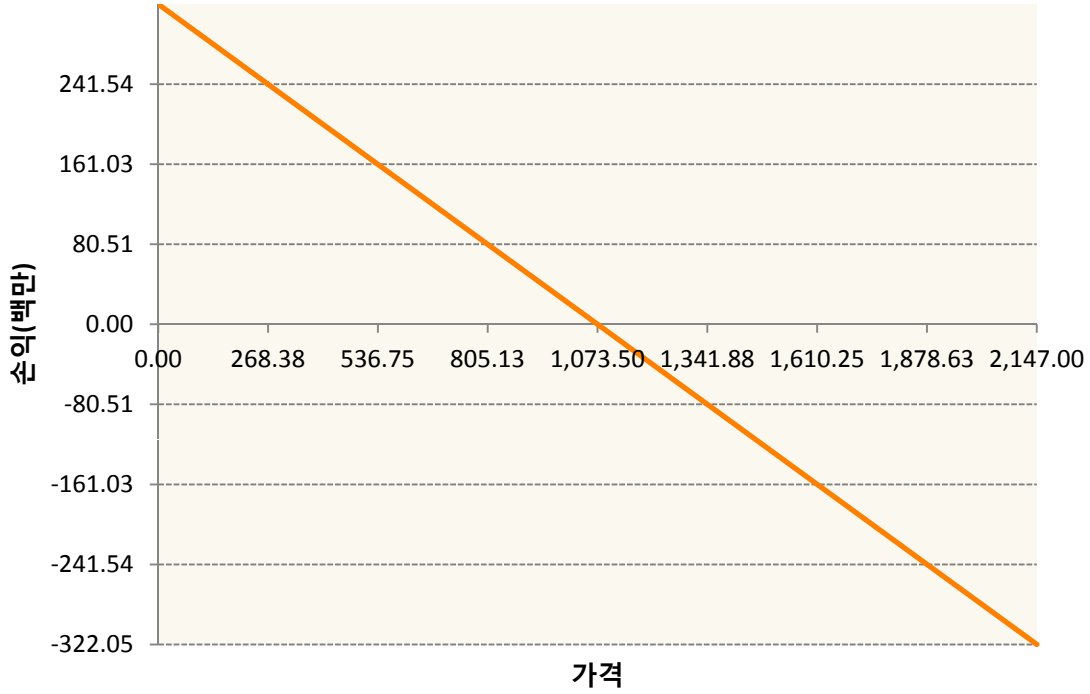


**KCN8-COFFEE 'C' FUTURE JUL18**

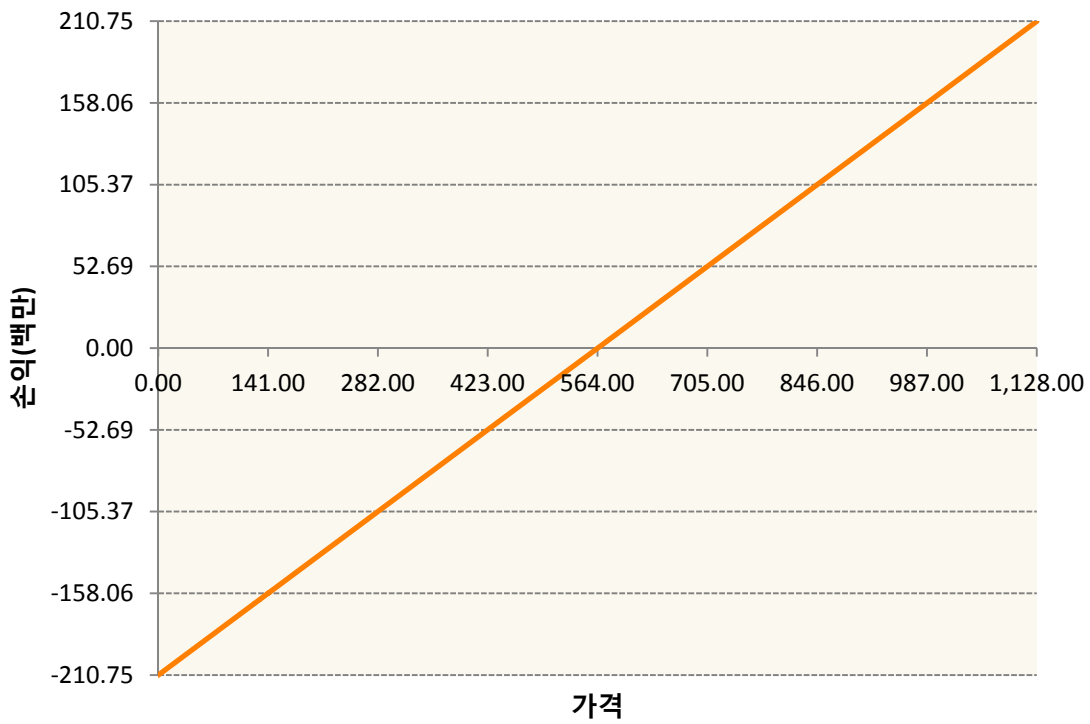




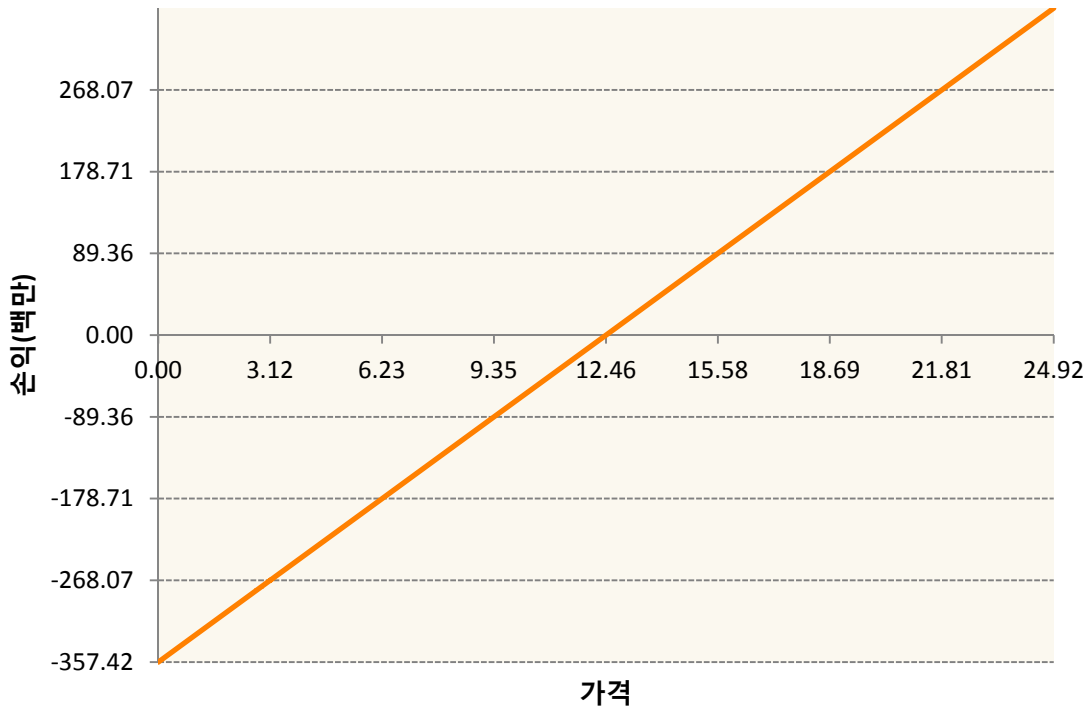
KR4175N60003-2018-06 달러선물



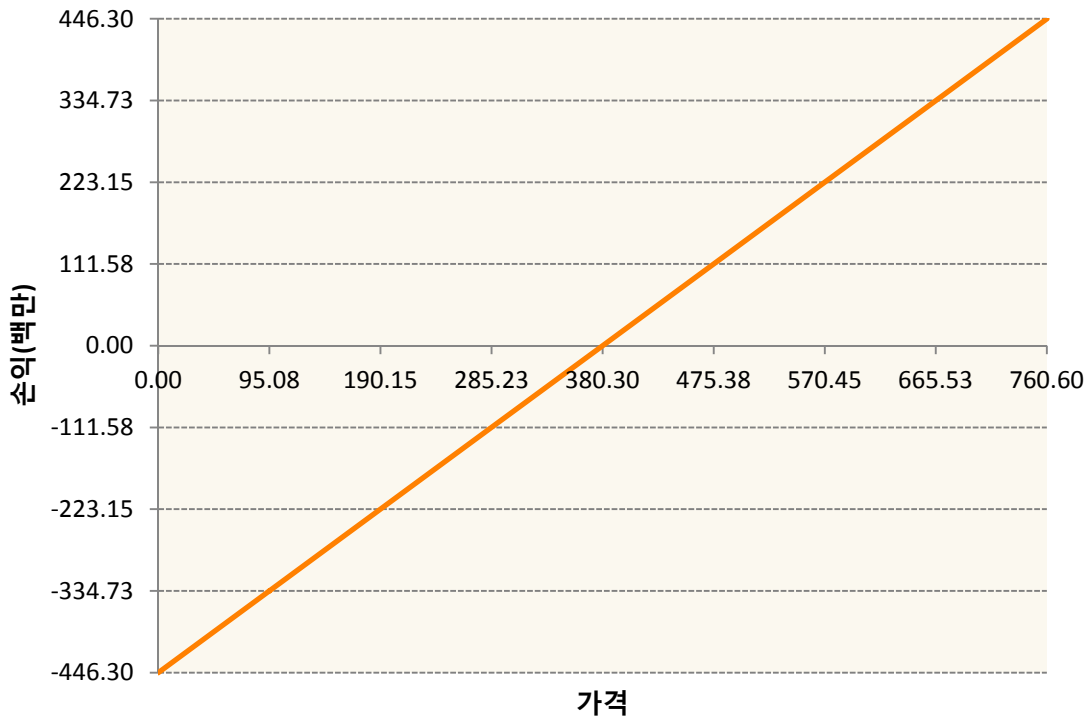
KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18



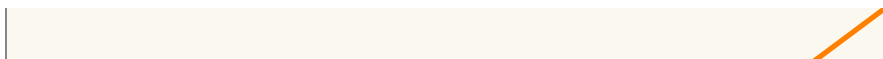
SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18

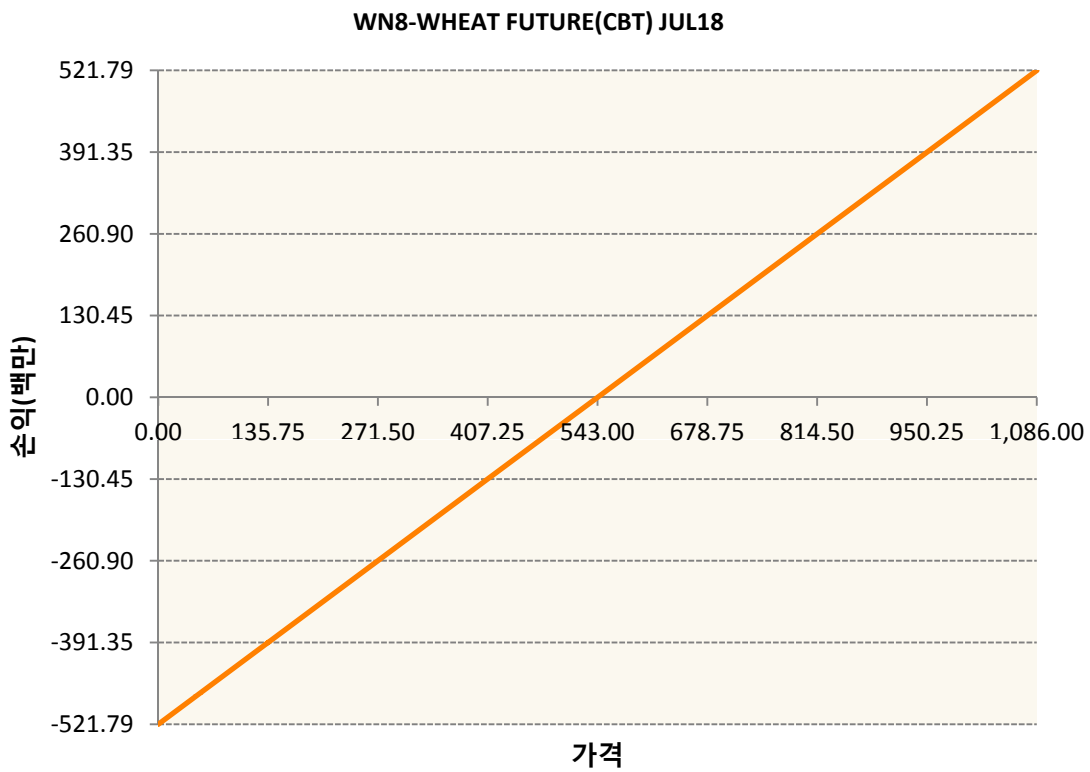
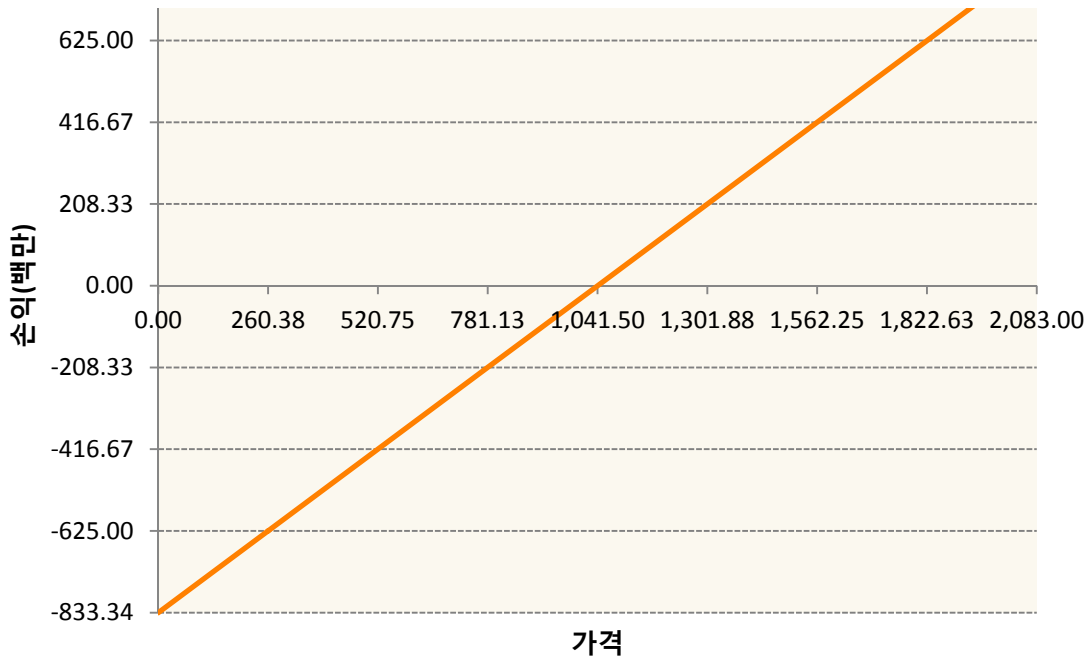


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18



SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON8	SOYBEAN OIL FUTR JUL18	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	17
SBN8	SUGAR #11 (WORLD) JUL18	29
SMN8	SOYBEAN MEAL FUTR JUL18	36
SN8	SOYBEAN FUTURE JUL18	67
WN8	WHEAT FUTURE(CBT) JUL18	42

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

(단위:백만원)

**341**