

공시일	2018-05-30
기준일	2018-05-29

## 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	2018-05-30
기준일	2018-05-29

## 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

1,112

\* 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	2018-05-30
기준일	2018-05-29

## 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

385

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

409

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-05-30
기준일	2018-05-29

## 유로인덱스모(주식-파생형)

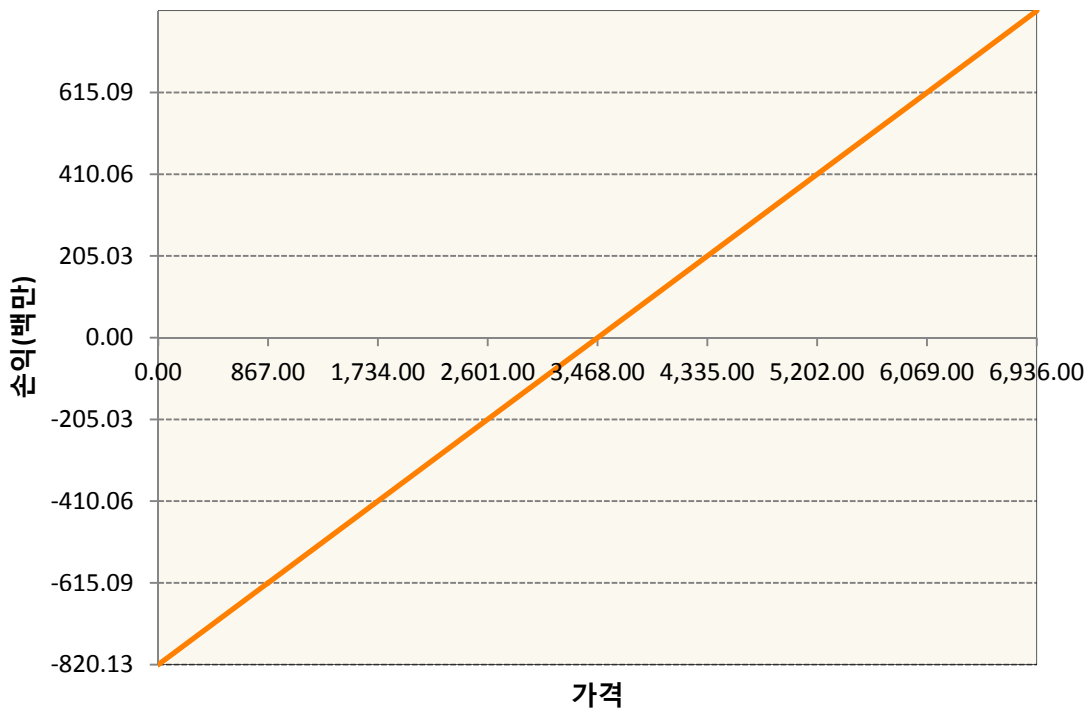
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	820	0	820	

### 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	2018-05-30
기준일	2018-05-29

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

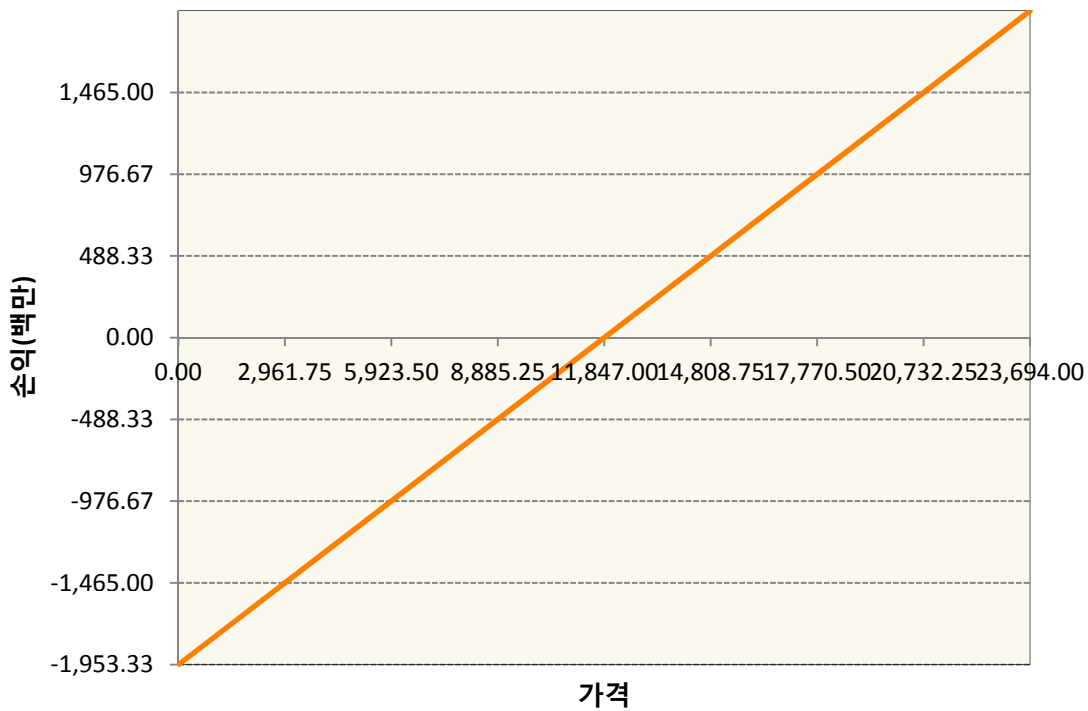
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

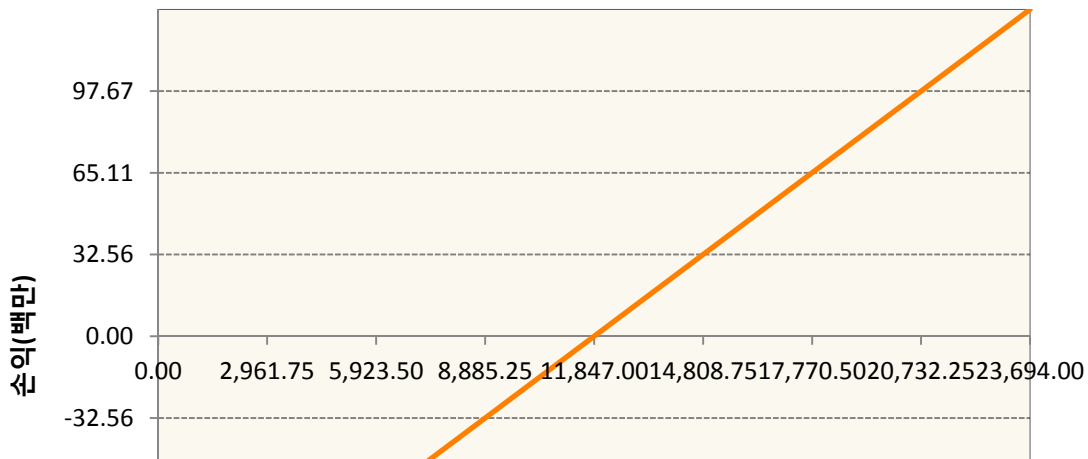
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,084	0	2,084	장내

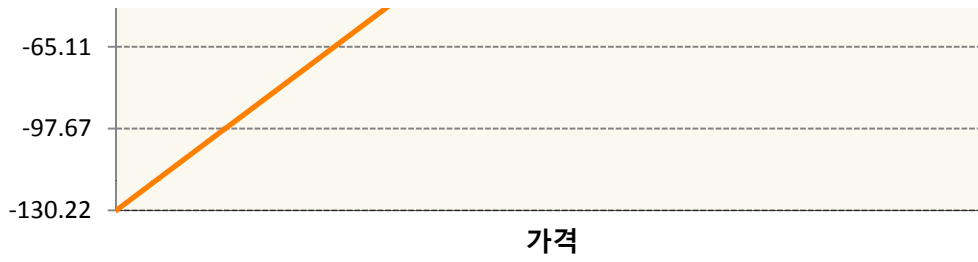
### 2. 만기시점의 손익구조

HCM8-HSCEI Futures Jun18



MHCM8-MINI H-SHR IDX FU Jun18





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

HCM8	HSCEI Futures Jun18	156
MHCM8	MINI H-SHR IDX FU Jun18	10

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

<b>147</b>
------------

공시일	2018-05-30
기준일	2018-05-29

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

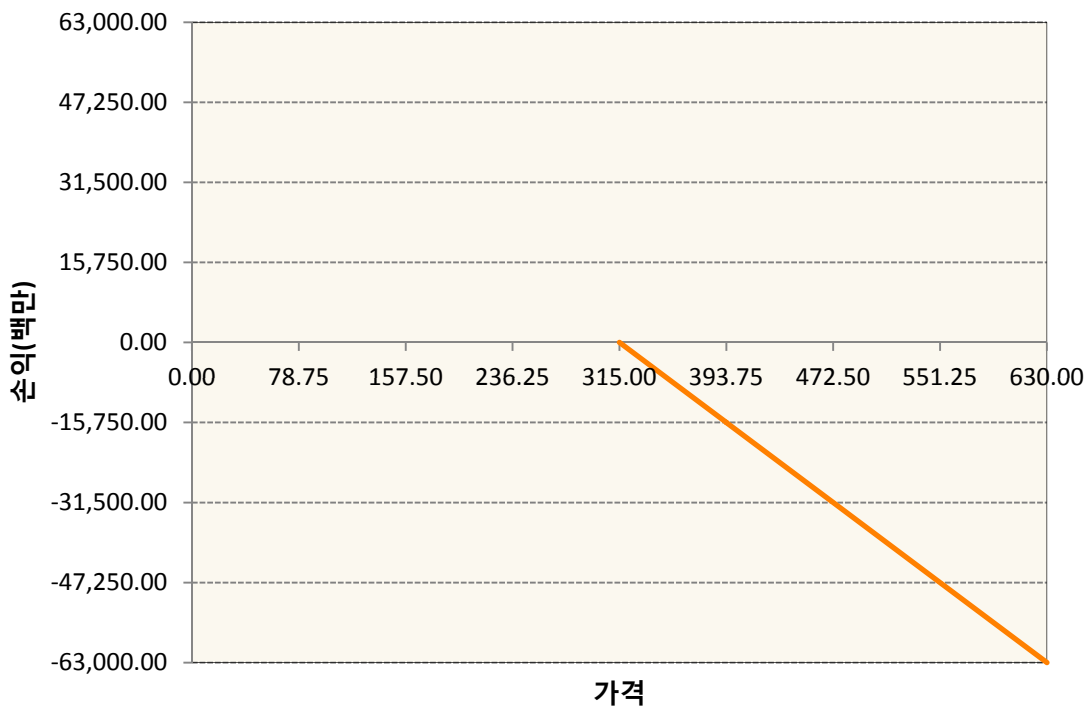
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

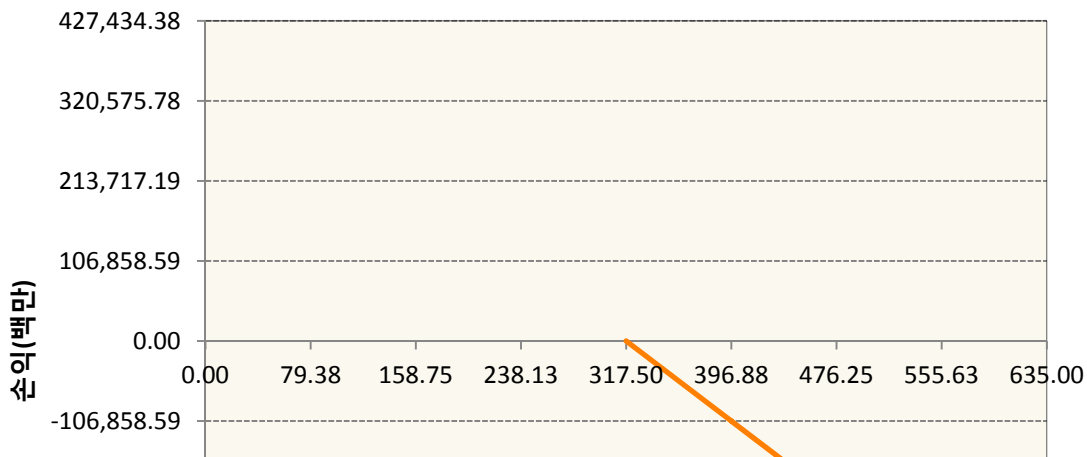
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	11,801	0	11,801	장내
누계	유가증권	옵션	0	798,409	-798,409	장내

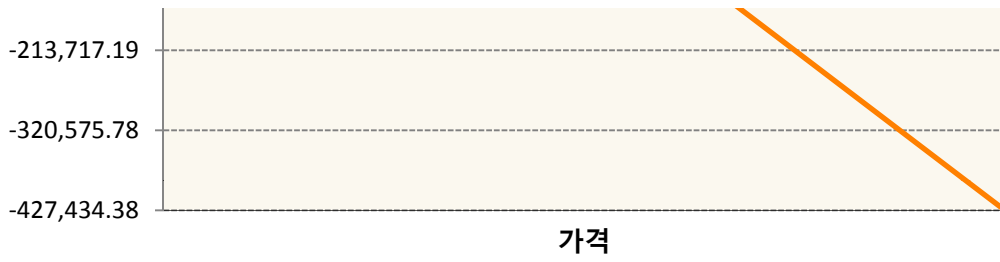
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63159-2018-06 콜315

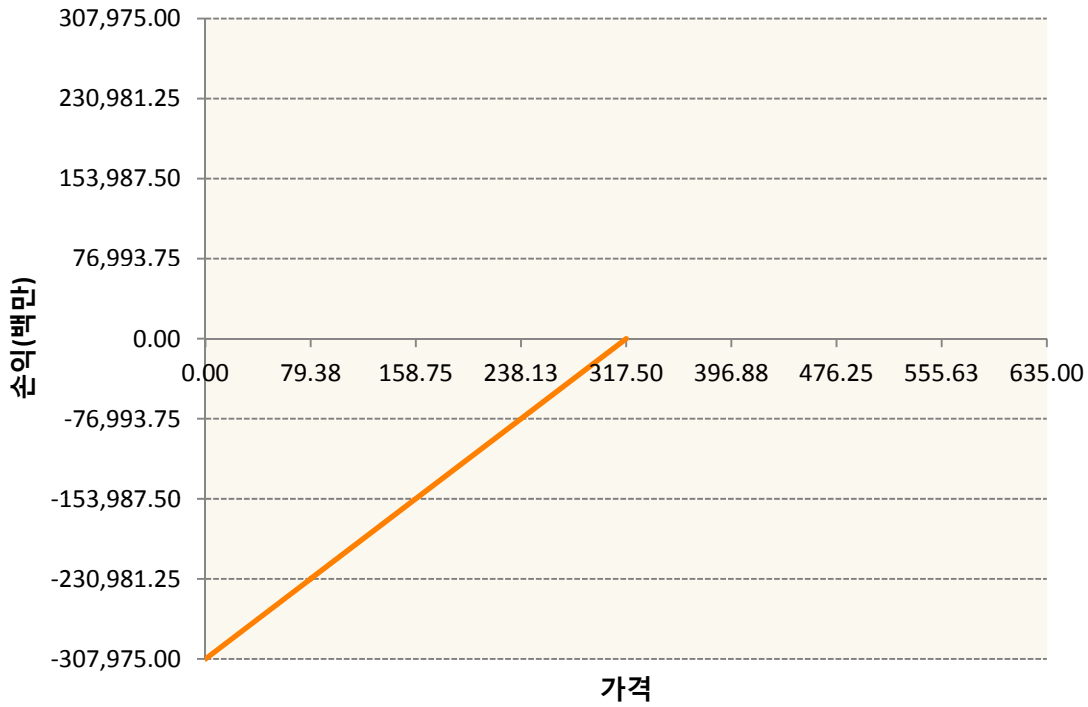


KR4201N63175-2018-06 콜317.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N6312018-06 콜315

4,024

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,564	1,536	1,501	1,457	1,407	1,349	1,286
-5.33%	1,436	1,370	1,297	1,218	1,133	1,044	952
-2.67%	1,081	974	865	753	640	526	411
0%	368	246	123	0	-123	-246	-369
2.67%	-737	-839	-944	-1,052	-1,162	-1,275	-1,389
5.33%	-2,149	-2,210	-2,280	-2,358	-2,441	-2,529	-2,622
8.00%	-3,732	-3,760	-3,798	-3,843	-3,897	-3,957	-4,024

KR4201N6312018-06 콜317.5

25,891

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,981	8,845	8,657	8,418	8,131	7,799	7,425

-5.33%	8,371	8,008	7,589	7,121	6,611	6,067	5,494
-2.67%	6,521	5,865	5,182	4,477	3,756	3,021	2,276
0%	2,489	1,660	830	0	-830	-1,661	-2,491
2.67%	-4,195	-4,947	-5,715	-6,495	-7,284	-8,081	-8,884
5.33%	-13,158	-13,660	-14,214	-14,808	-15,437	-16,094	-16,774
8.00%	-23,540	-23,794	-24,110	-24,484	-24,910	-25,381	-25,891

KR4301N6312018-06 풋317.5

21,872

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21,860	-21,860	-21,860	-21,861	-21,862	-21,866	-21,872
-5.33%	-13,690	-13,695	-13,705	-13,723	-13,751	-13,788	-13,837
-2.67%	-5,667	-5,755	-5,864	-5,990	-6,131	-6,286	-6,453
0%	799	534	267	0	-268	-536	-804
2.67%	3,506	3,349	3,176	2,989	2,791	2,583	2,368
5.33%	3,899	3,879	3,845	3,798	3,736	3,660	3,569
8.00%	3,916	3,915	3,913	3,908	3,900	3,885	3,864

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

(단위:백만원)

**56,249**

공시일	2018-05-30
기준일	2018-05-29

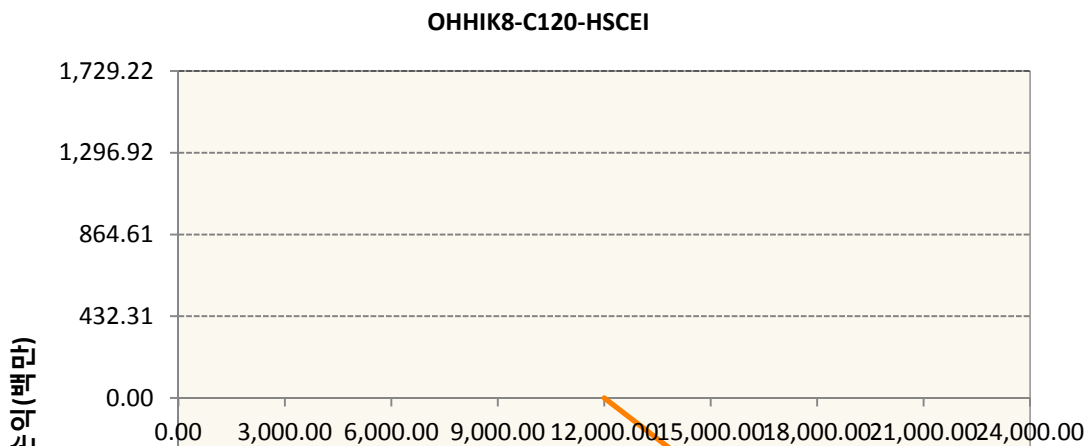
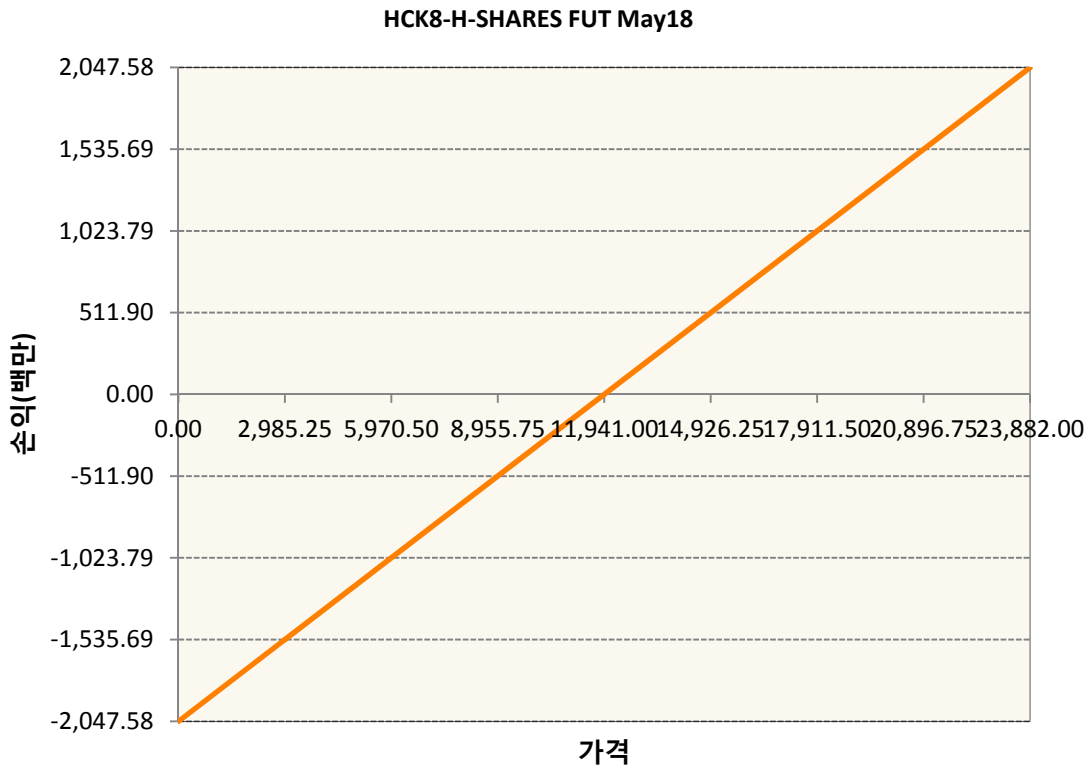
## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

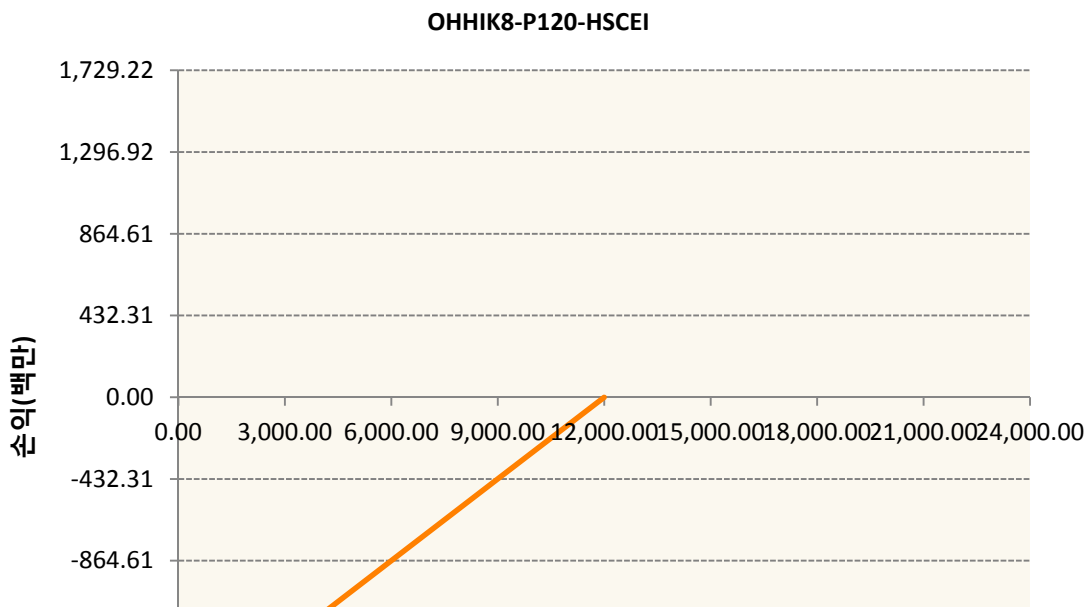
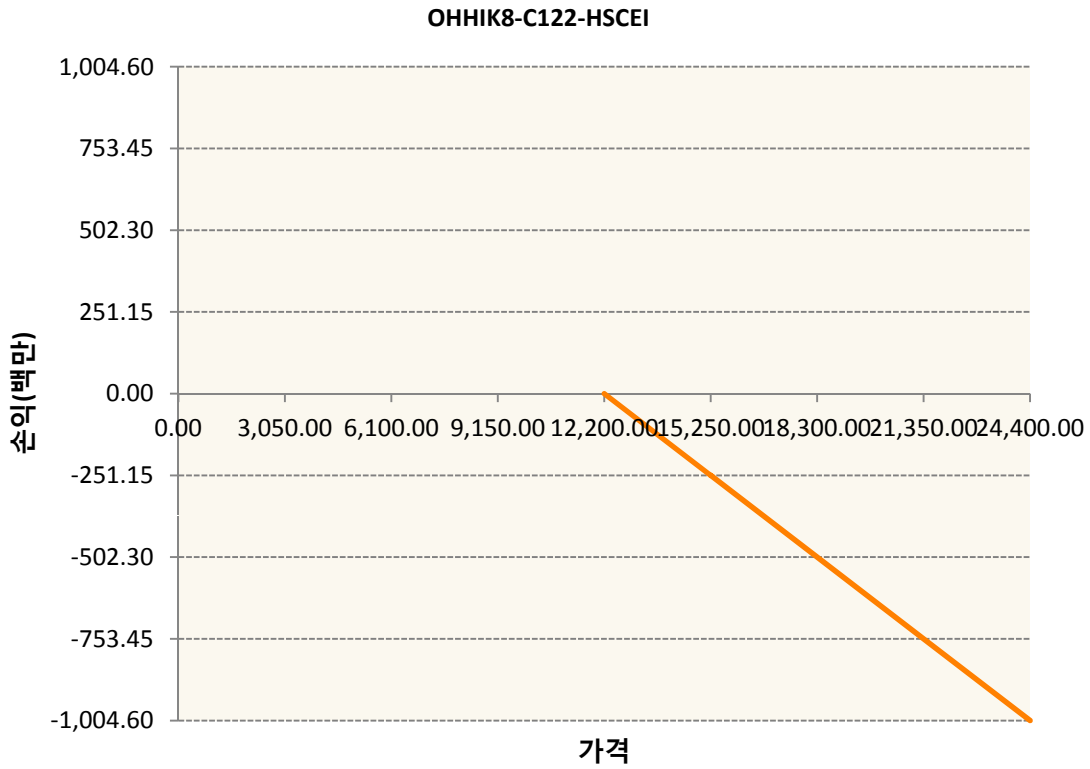
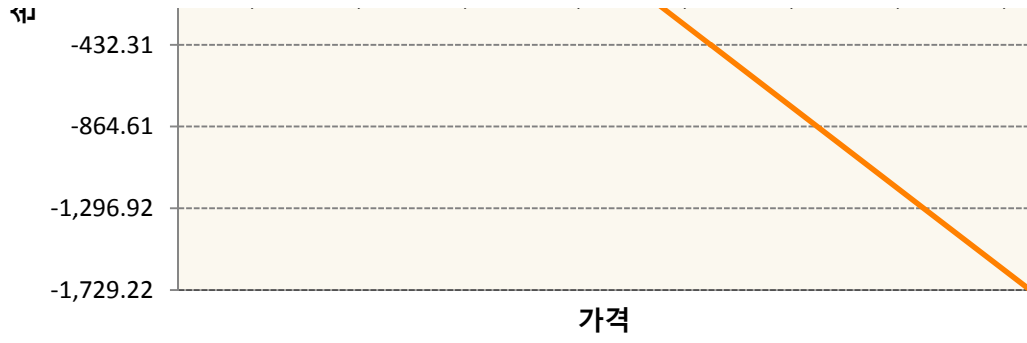
### 1. 계약금액

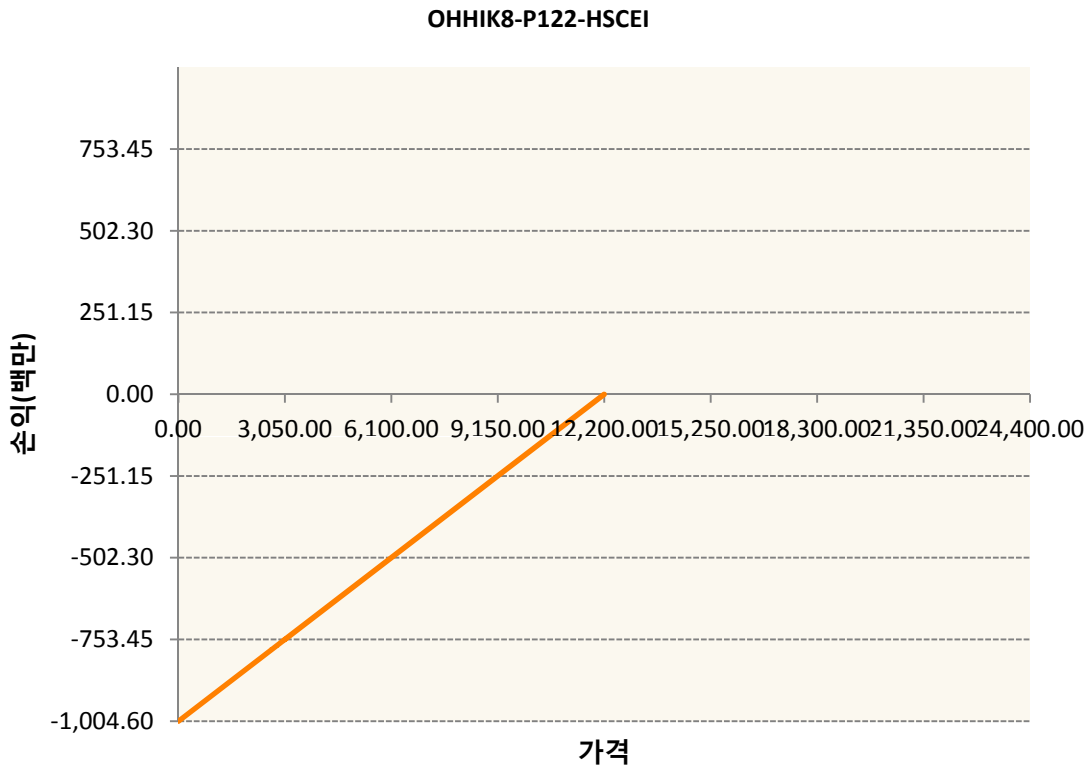
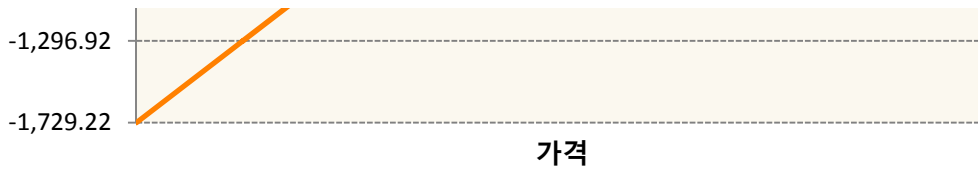
(단위:백만원)

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	2,048	0	2,048	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,468	-5,468	장내

### 2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCK8	H-SHARES FUT May18	164
OHHIK8-C12	HSCEI	138
OHHIK8-C12	HSCEI	80
OHHIK8-P12	HSCEI	138
OHHIK8-P12	HSCEI	80

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	531

공시일	2018-05-30
기준일	2018-05-29

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

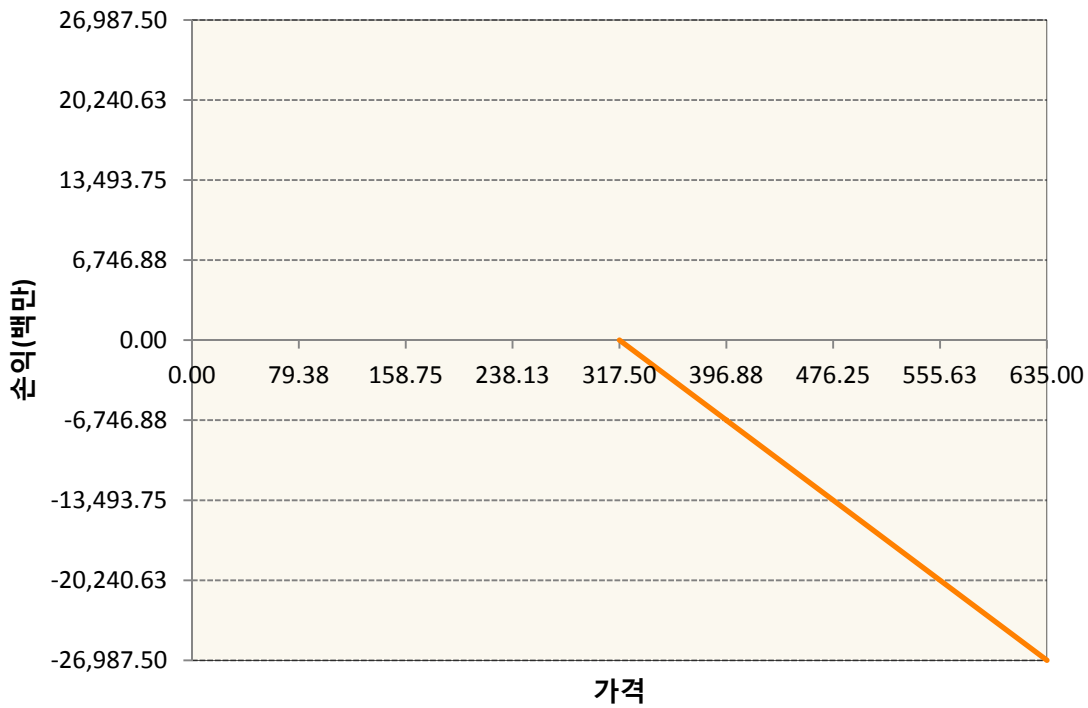
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

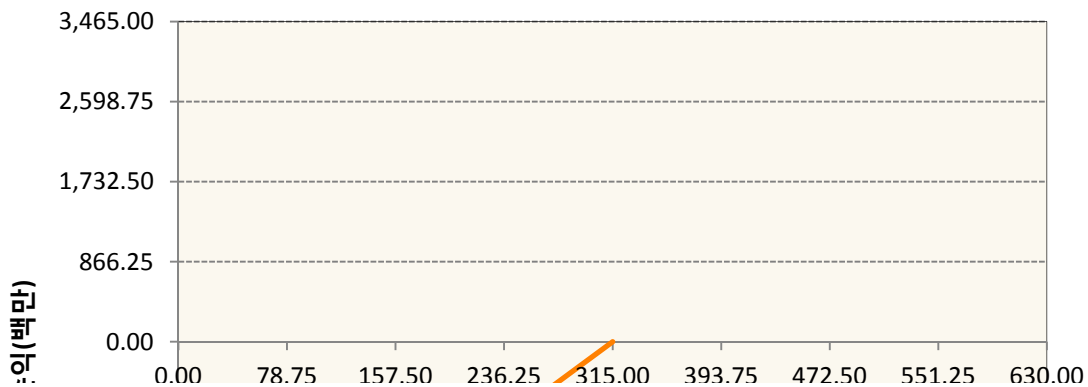
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	46,804	-46,804	장내

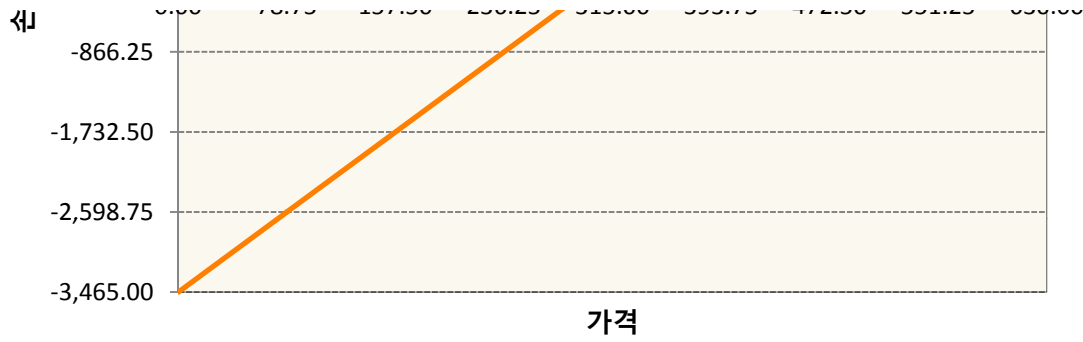
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63175-2018-06 콜317.5

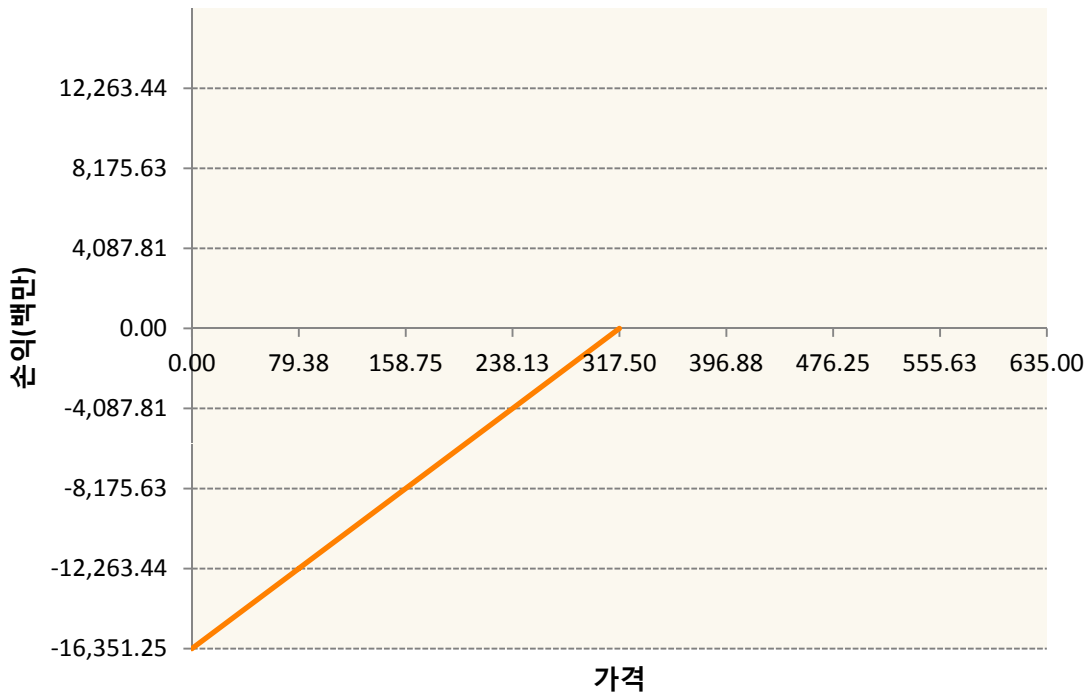


KR4301N63157-2018-06 풋315





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%	639	639	639	639	639	639	639

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 1,635

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	567	558	547	532	513	492	469
-5.33%	529	506	479	450	417	383	347
-2.67%	412	370	327	283	237	191	144
0%	157	105	52	0	-52	-105	-157
2.67%	-265	-312	-361	-410	-460	-510	-561
5.33%	-831	-862	-897	-935	-975	-1,016	-1,059
8.00%	-1,486	-1,502	-1,522	-1,546	-1,573	-1,602	-1,635

KR4301N6312018-06 풋315 235

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-234	-234	-234	-234	-234	-235	-235
-5.33%	-142	-142	-142	-143	-143	-144	-145
-2.67%	-53	-55	-57	-59	-61	-63	-65
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	28	27	26	25	23	21	19
5.33%	30	30	30	30	29	29	28
8.00%	30	30	30	30	30	30	30

KR4301N6312018-06 풋317.5 1,161

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,161	-1,161	-1,161	-1,161	-1,161	-1,161	-1,161
-5.33%	-727	-727	-728	-729	-730	-732	-735
-2.67%	-301	-306	-311	-318	-326	-334	-343
0%	42	28	14	0	-14	-28	-43
2.67%	186	178	169	159	148	137	126
5.33%	207	206	204	202	198	194	189
8.00%	208	208	208	208	207	206	205

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

(단위:백만원)

7,151

공시일	2018-05-30
기준일	2018-05-29

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

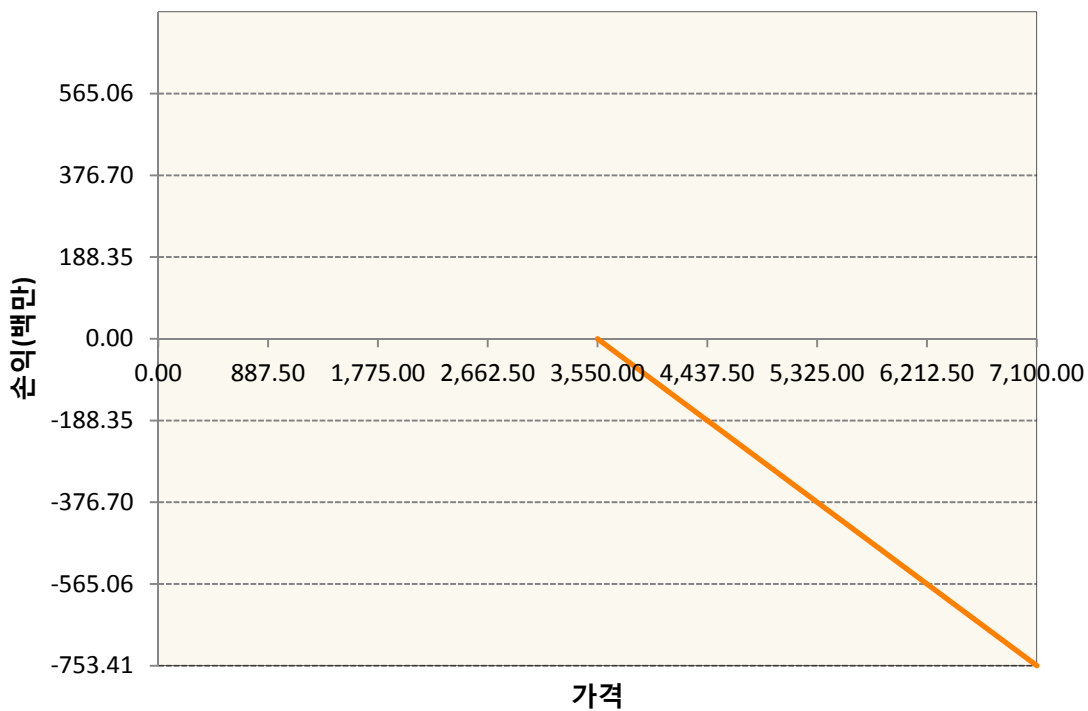
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

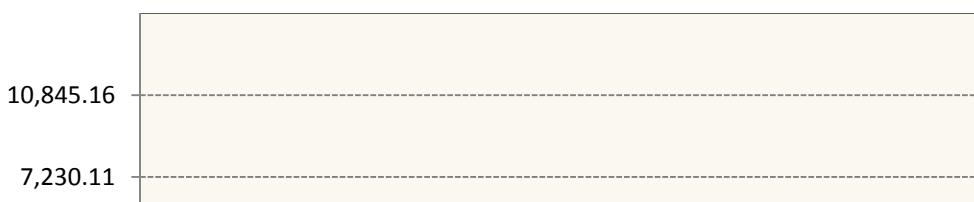
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,225	0	7,225	
누계	유가증권	스왑	52,636	0	52,636	장외
누계	유가증권	옵션	0	30,427	-30,427	장내
누계	지수	스왑	49,938	0	49,938	장외

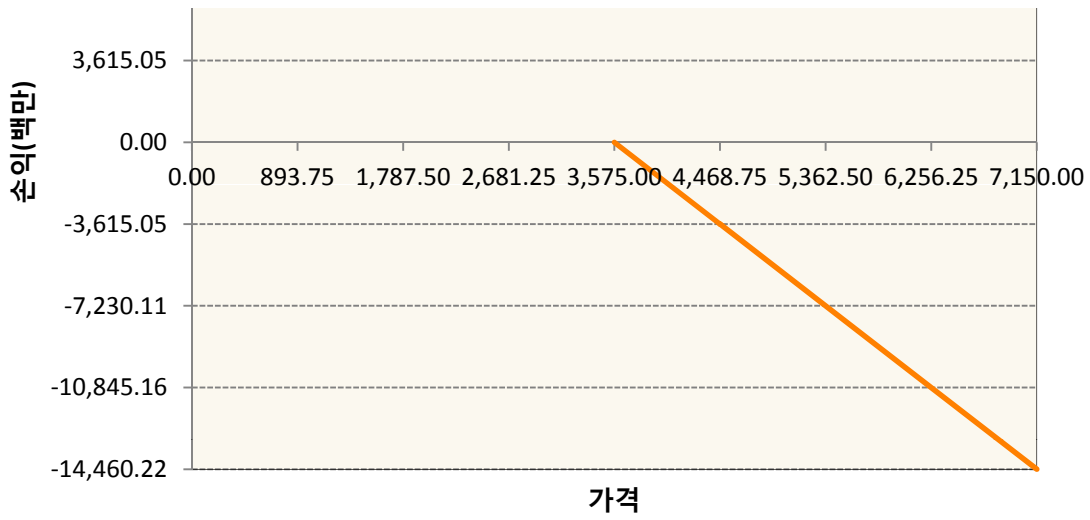
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXM8-C3550-EURO STOXX 50**

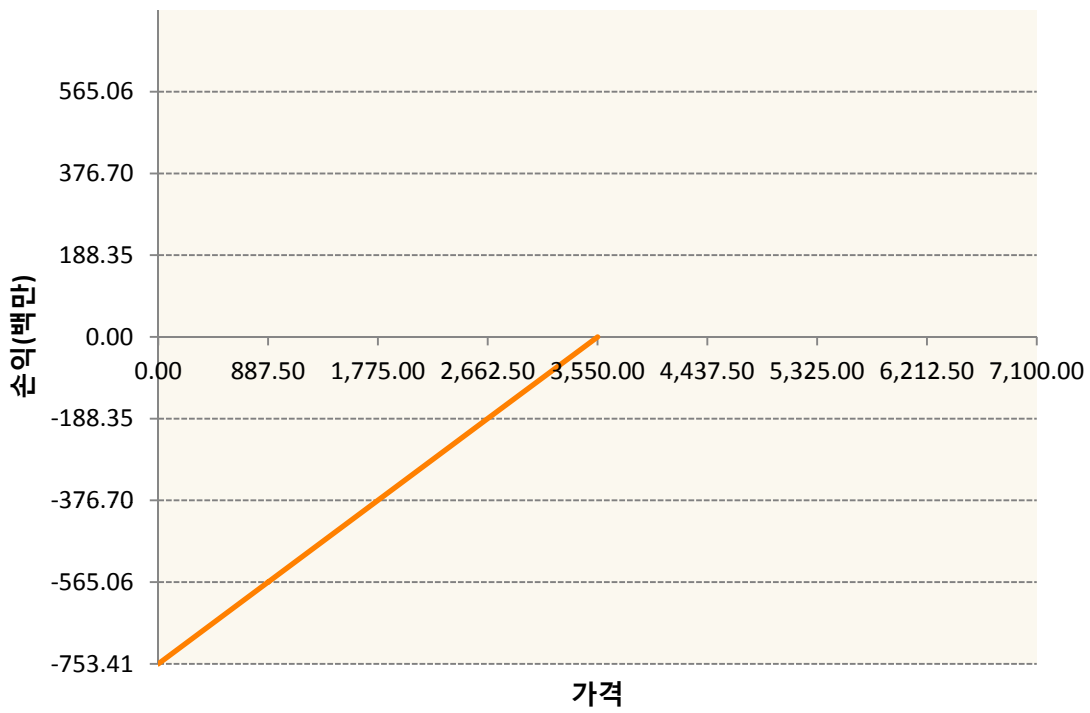


**OESXM8-C3575-EURO STOXX 50**

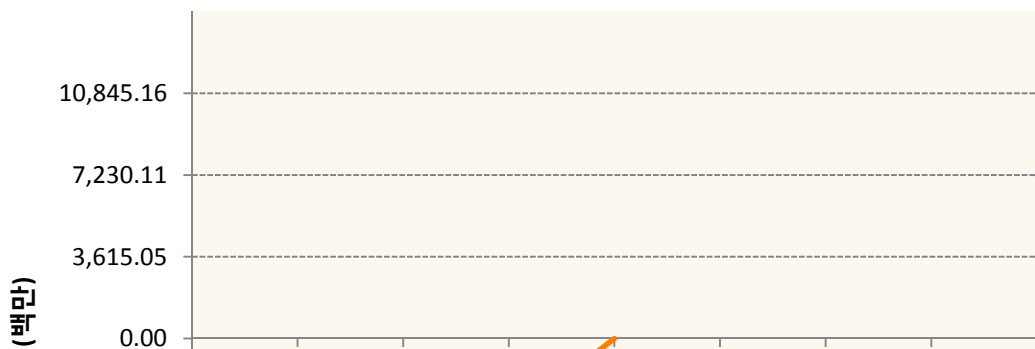


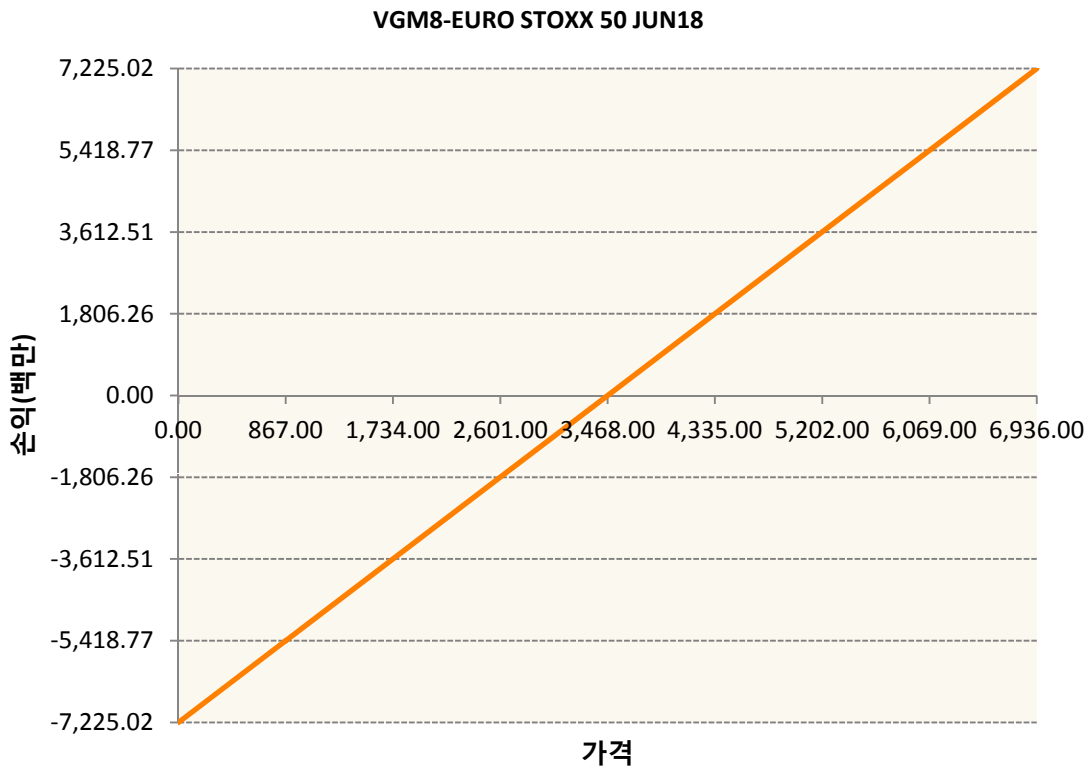
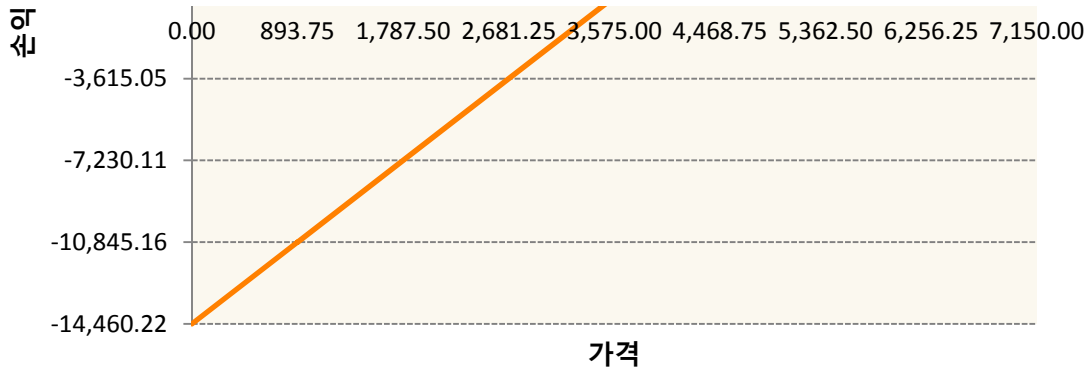


OESXM8-P3550-EURO STOXX 50



OESXM8-P3575-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		5
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		6
OESXM8-C3: EURO STOXX 50		60
OESXM8-C3: EURO STOXX 50		1,157
OESXM8-P3! EURO STOXX 50		60
OESXM8-P3! EURO STOXX 50		1,157
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18		578

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





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

(단위:백만원)

1,167



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)

217

공시일	2018-05-30
기준일	2018-05-29

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1

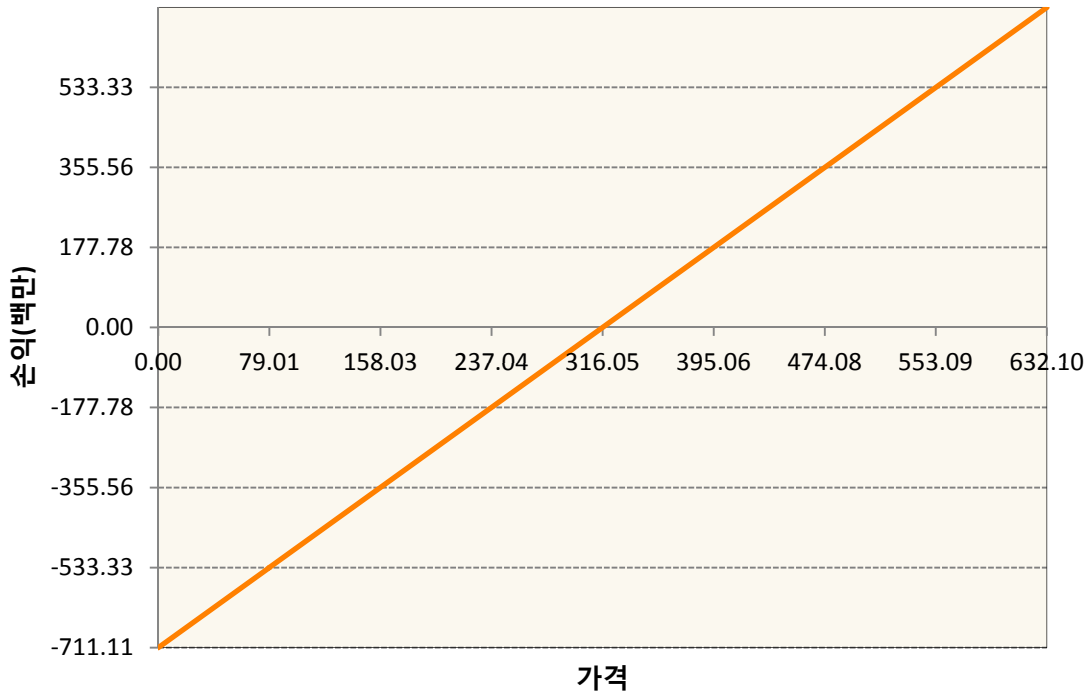
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	711	0	711	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	2018-05-30
기준일	2018-05-29

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

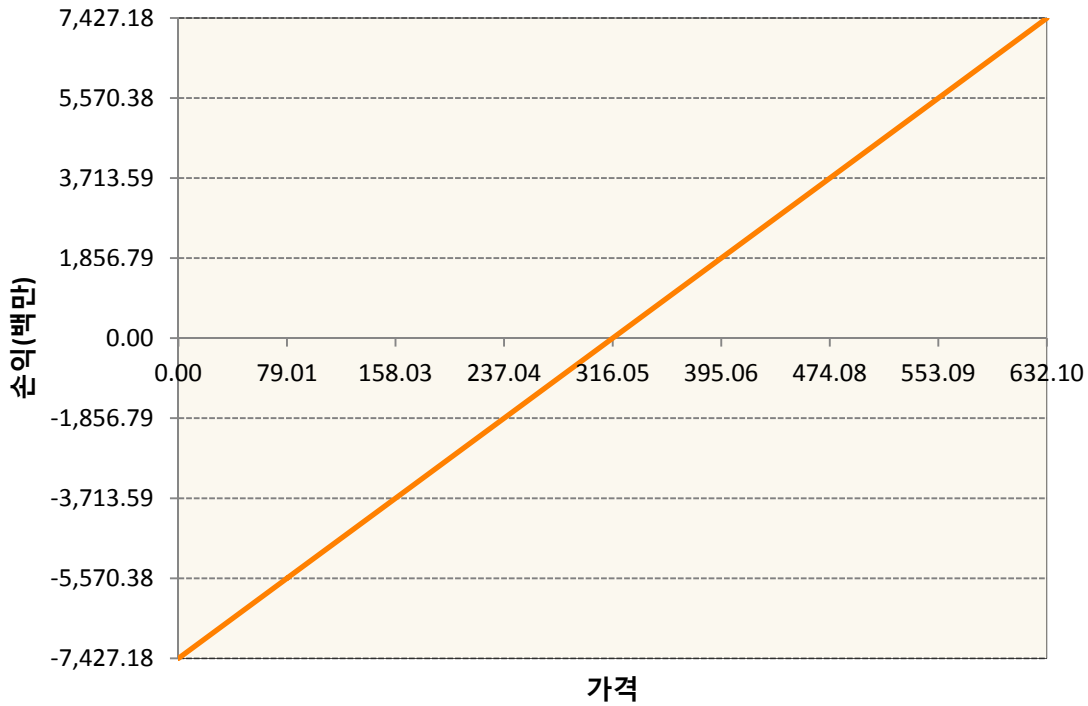
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

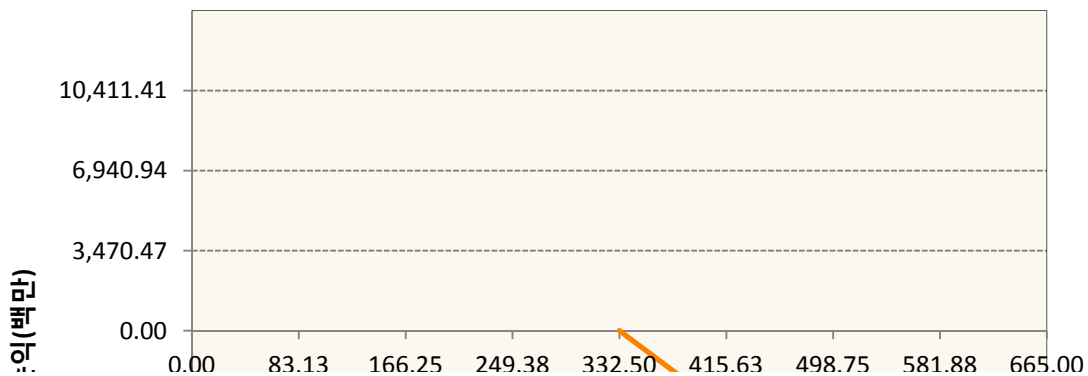
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,427	0	7,427	장내
누계	유가증권	옵션	1,508	13,882	-12,374	장내

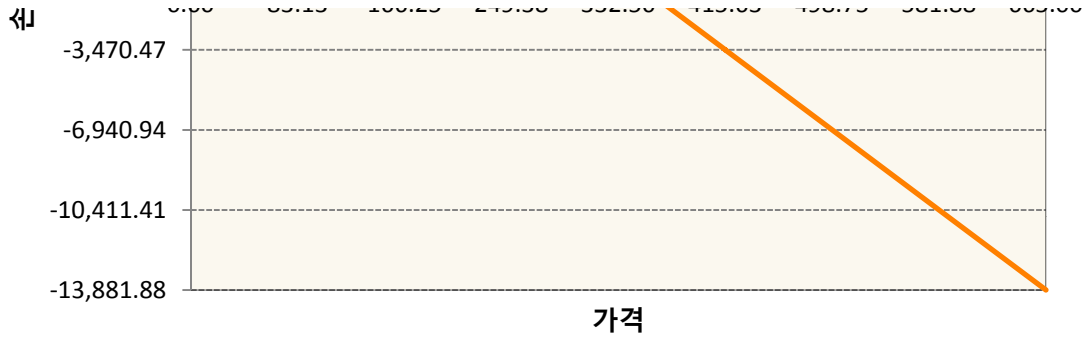
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

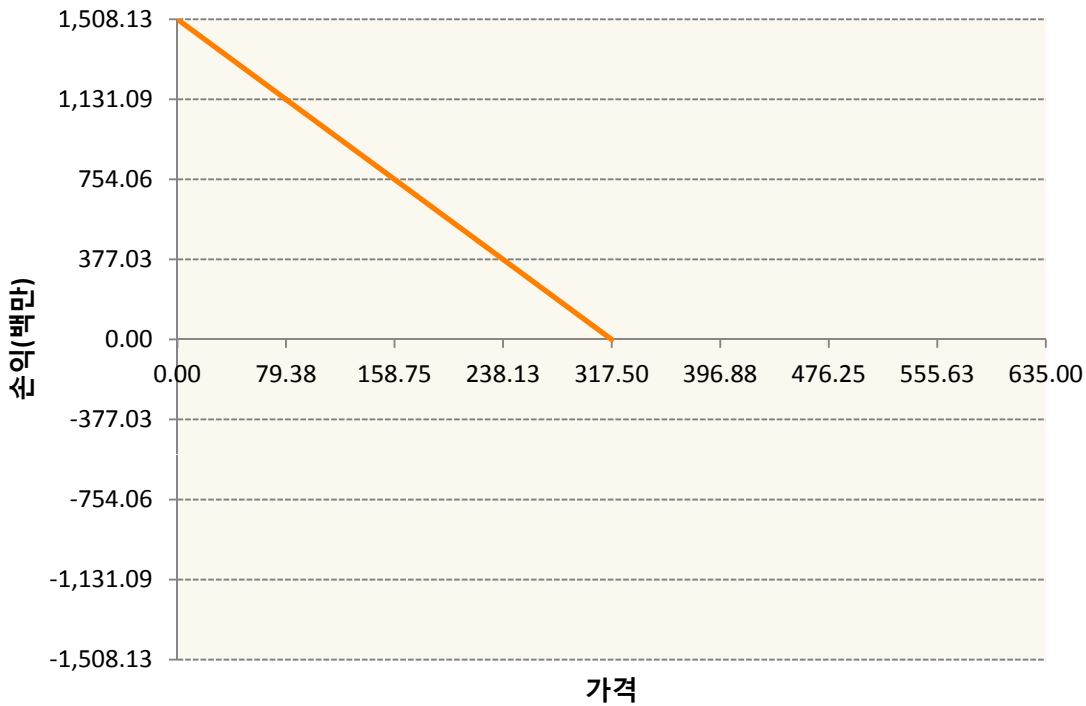


KR4201N63324-2018-06 콜332.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물							594
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-594	-594	-594	-594	-594	-594	-594
-5.33%	-396	-396	-396	-396	-396	-396	-396
-2.67%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	198	198	198	198	198	198	198
5.33%	396	396	396	396	396	396	396
8.00%	594	594	594	594	594	594	594
KR4201N63E 2018-06 콜332.5							540
기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	86	86	85	84	81	78	74
-5.33%	85	83	80	75	69	62	53
-2.67%	77	71	62	52	40	27	13
0%	49	34	18	0	-19	-39	-59
2.67%	-25	-48	-72	-97	-122	-147	-172
5.33%	-169	-197	-224	-251	-278	-305	-332
8.00%	-392	-416	-440	-464	-489	-514	-540

KR4301N6312018-06 풋317.5

107

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	107	107	107	107	107	107	107
-5.33%	67	67	67	67	67	68	68
-2.67%	28	28	29	29	30	31	32
0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-17	-16	-16	-15	-14	-13	-12
5.33%	-19	-19	-19	-19	-18	-18	-17
8.00%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19

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

(단위:백만원)

920

공시일	2018-05-30
기준일	2018-05-29

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

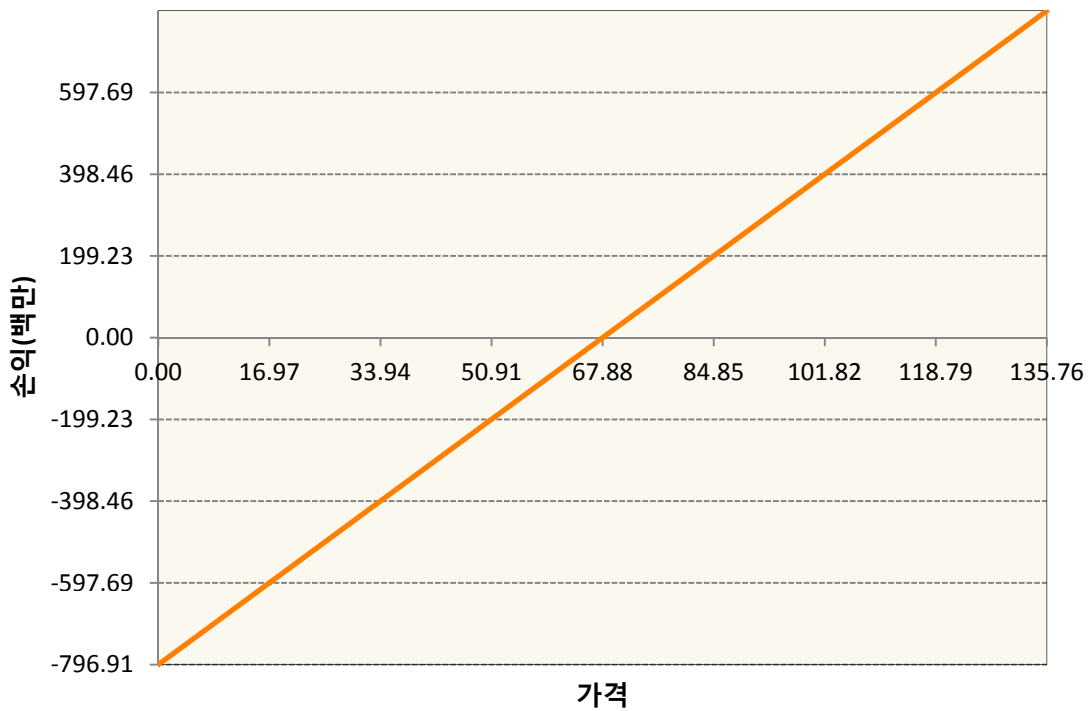
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

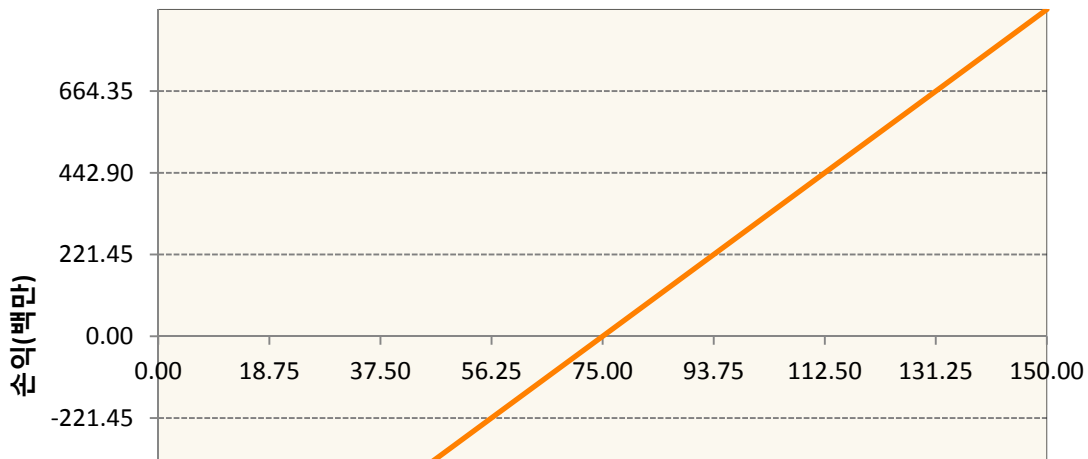
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,869	592	3,277	

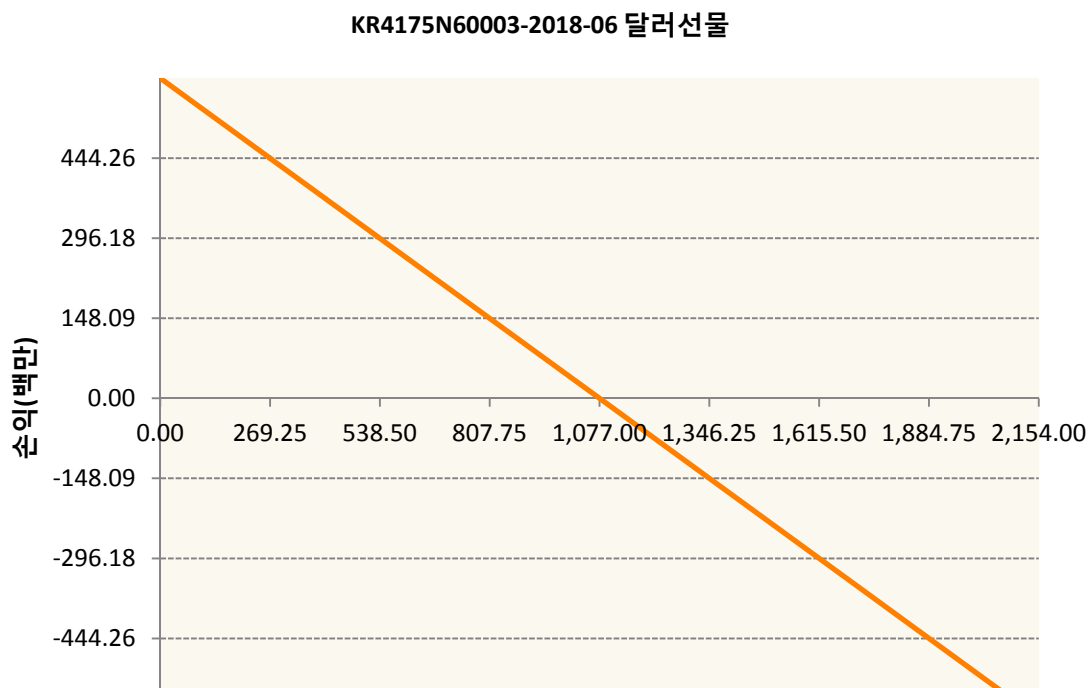
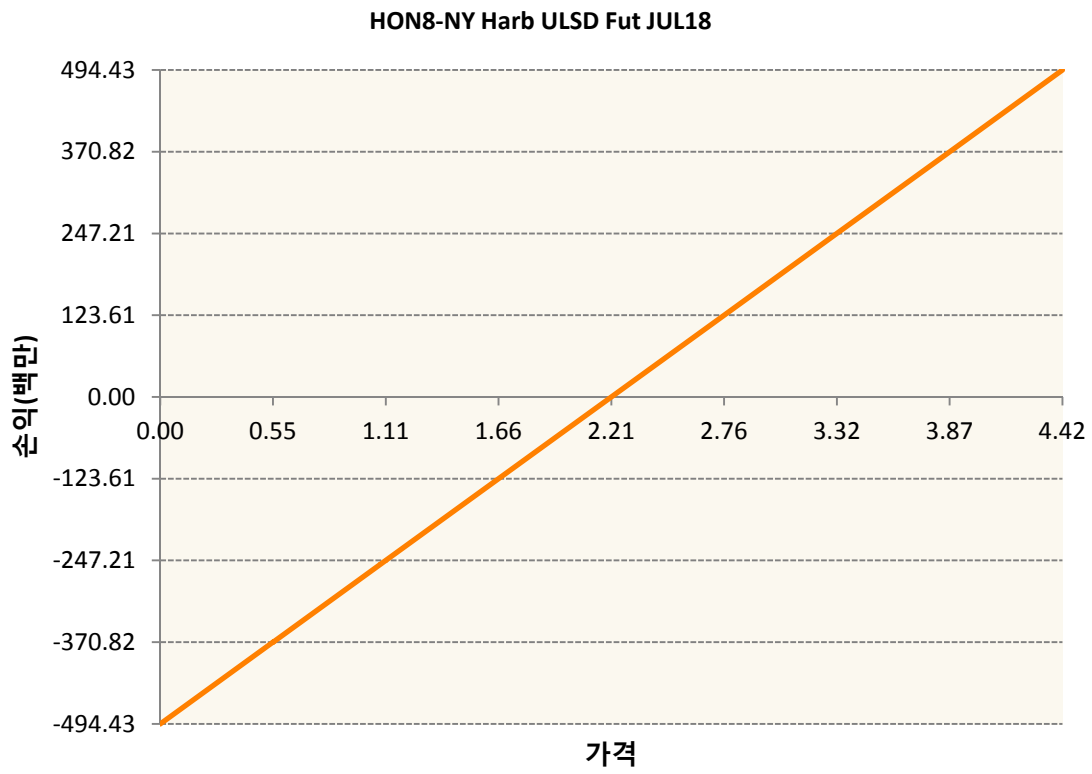
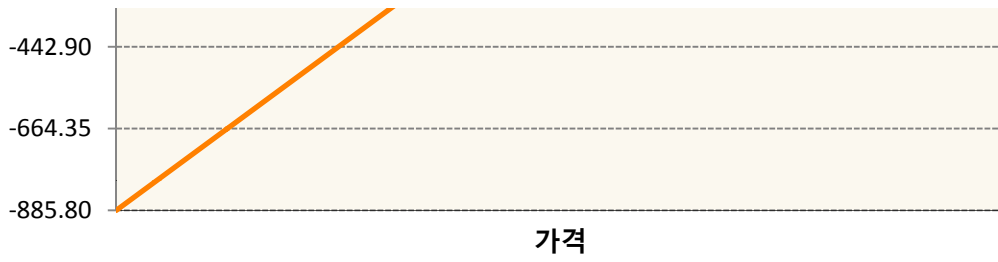
### 2. 만기시점의 손익구조

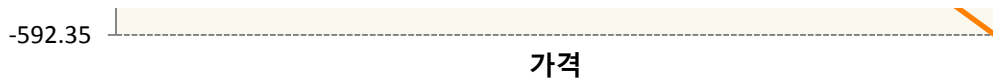
**CLN8-WTI CRUDE FUTURE JUL18**



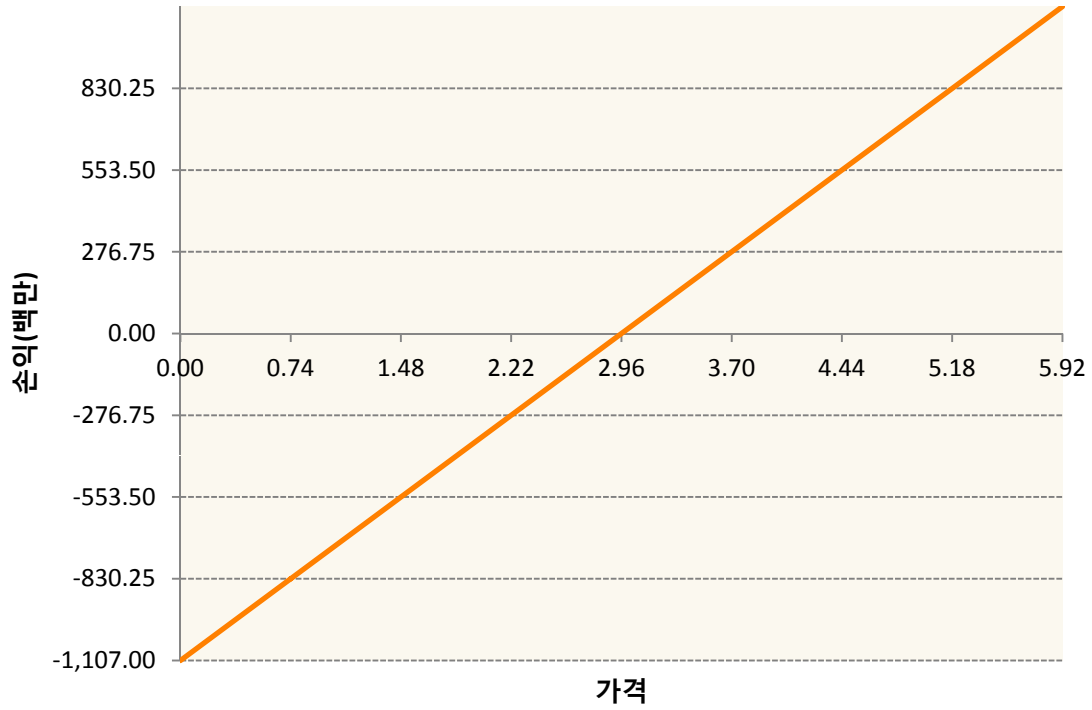
**COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18**



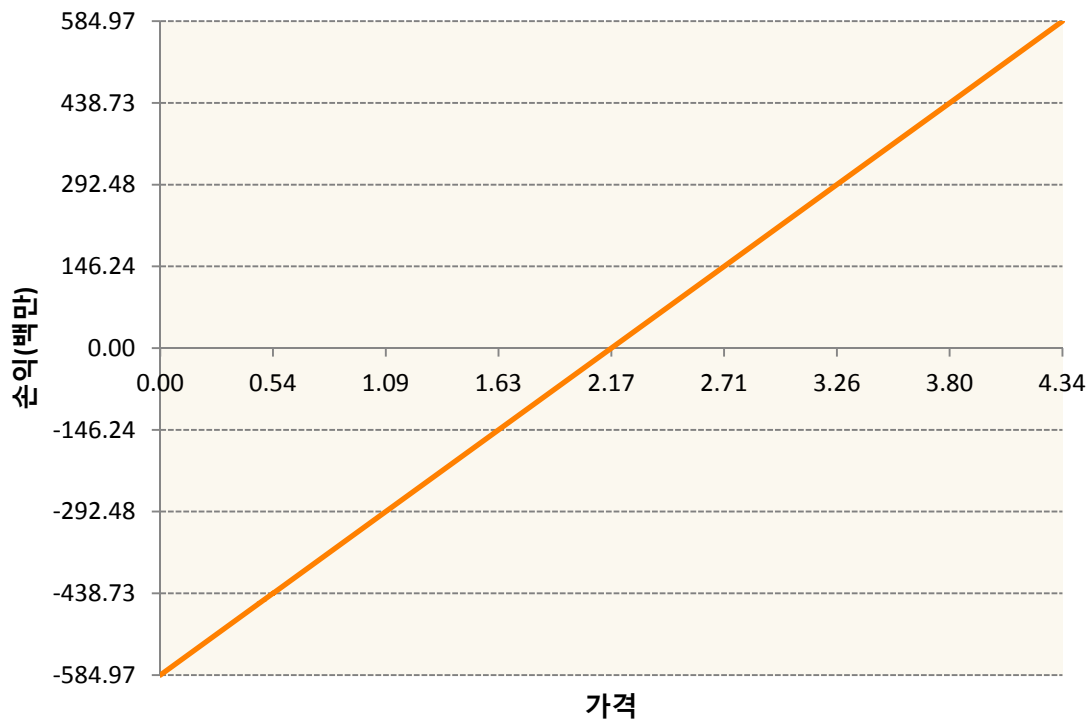




NGN8-NATURAL GAS FUTR JUL18



XBN8-GASOLINE RBOB FUT JUL18



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

CLN8	WTI CRUDE FUTURE JUL18	64
COU8	BRENT CRUDE FUTR SEP18	71
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)

**471**

공시일	2018-05-30
기준일	2018-05-29

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

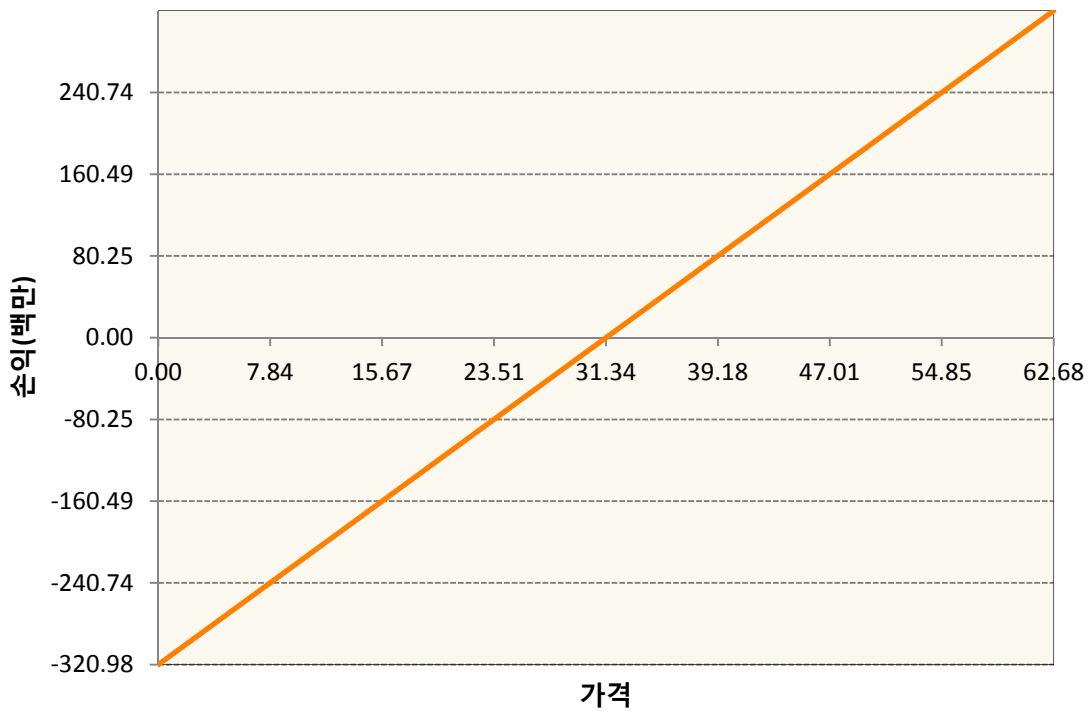
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

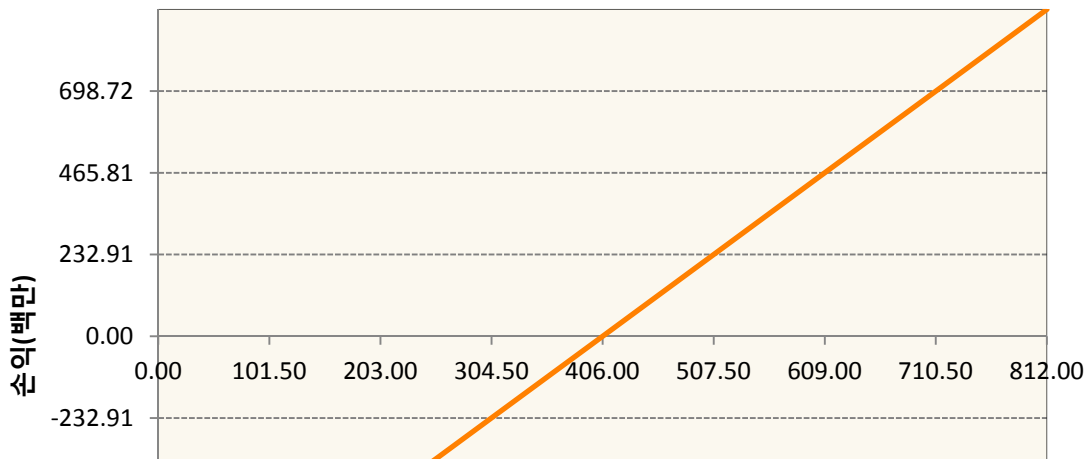
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,198	323	3,875	

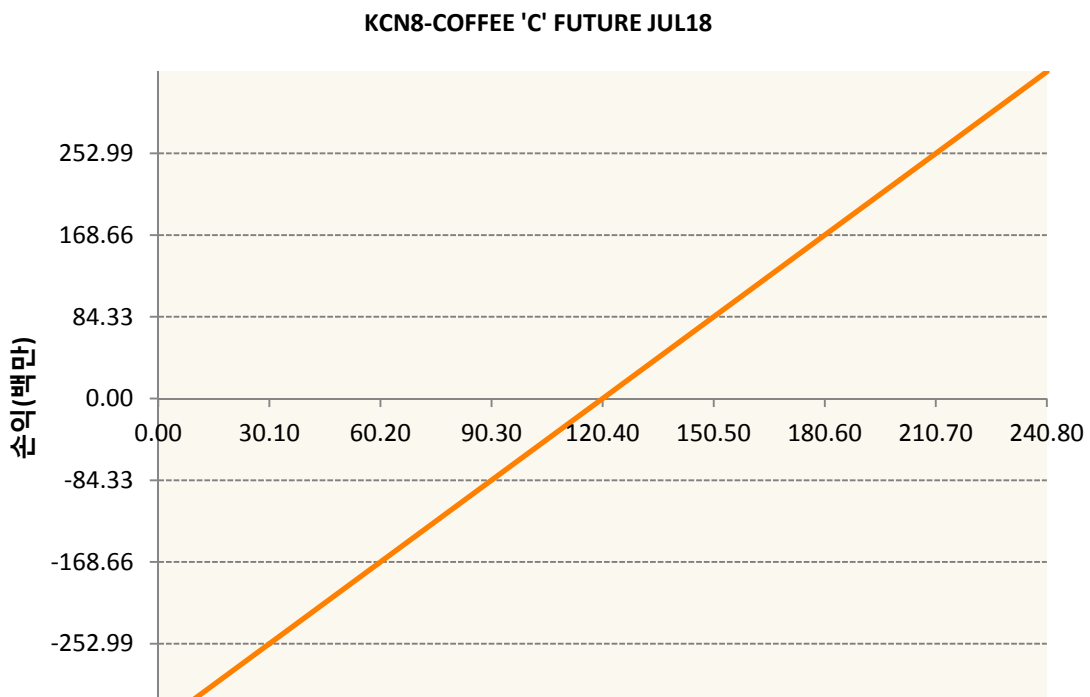
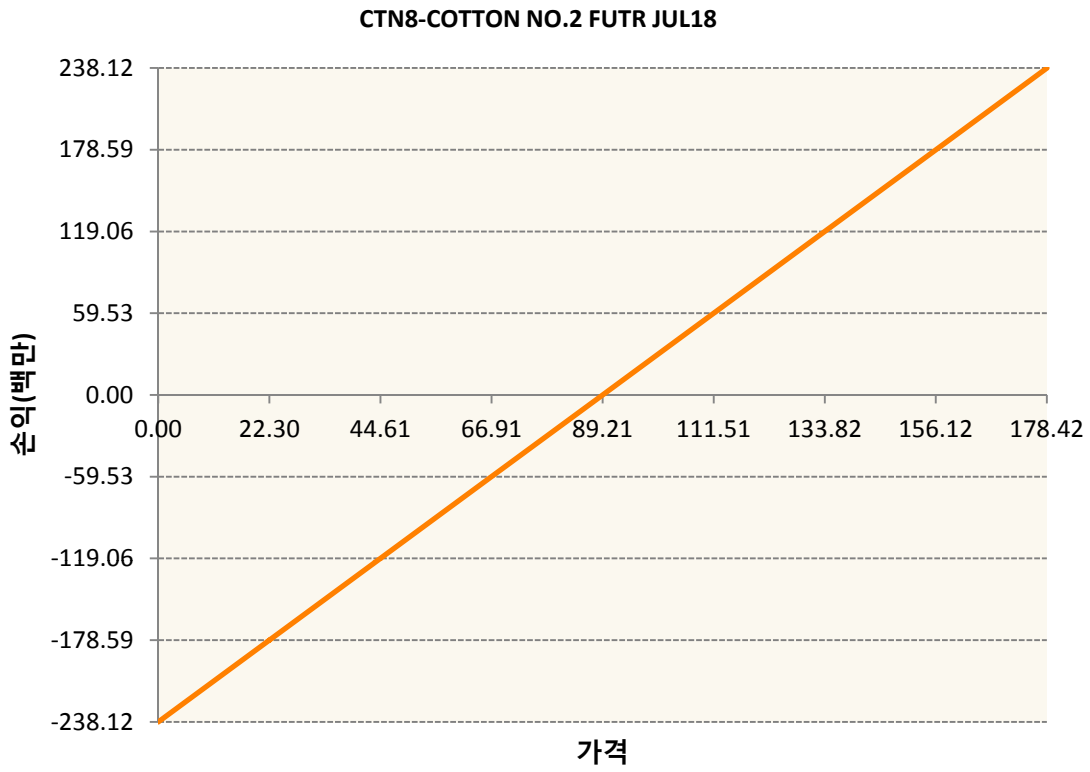
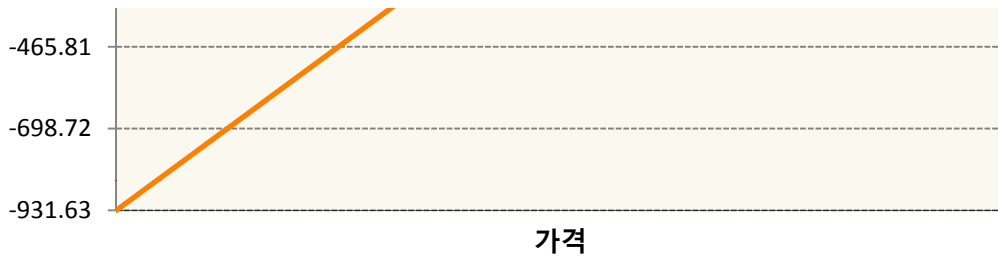
### 2. 만기시점의 손익구조

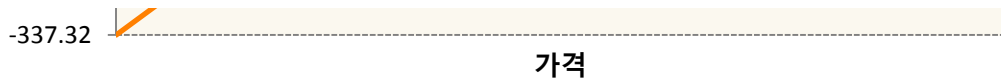
**BON8-SOYBEAN OIL FUTR JUL18**



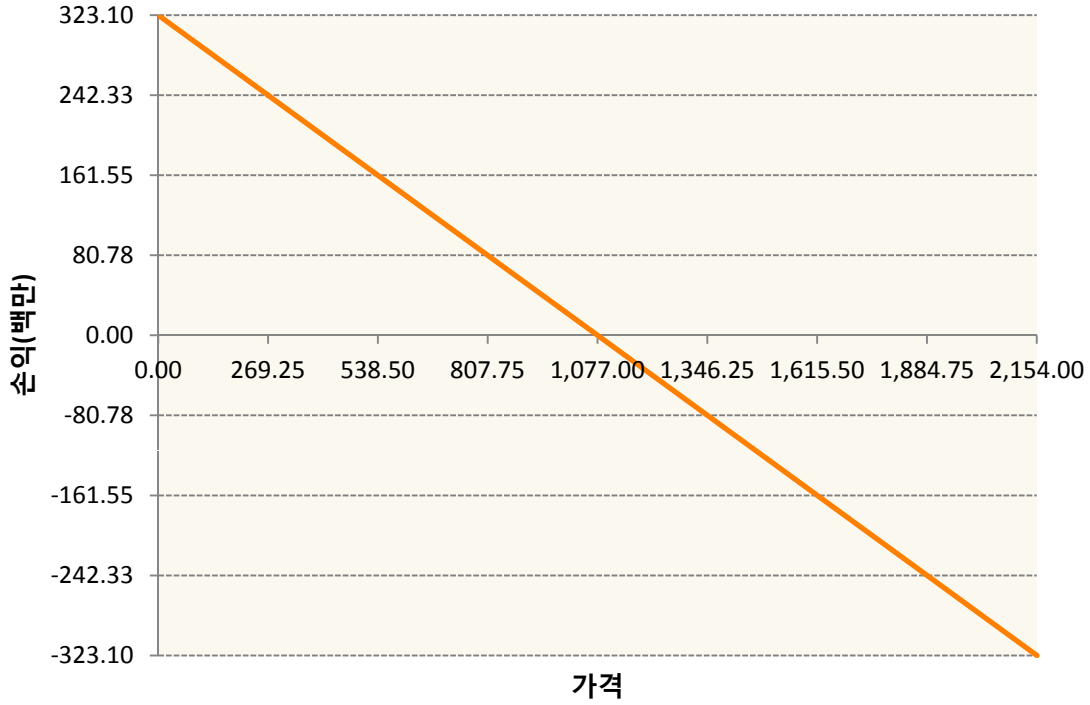
**CN8-CORN FUTURE JUL18**



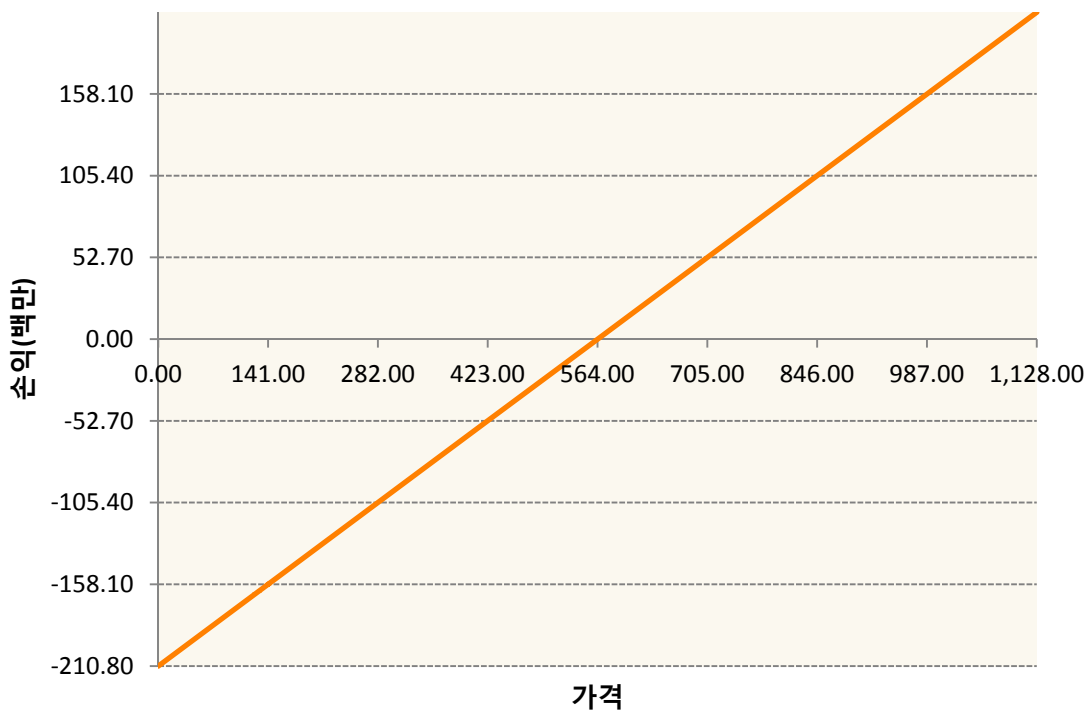




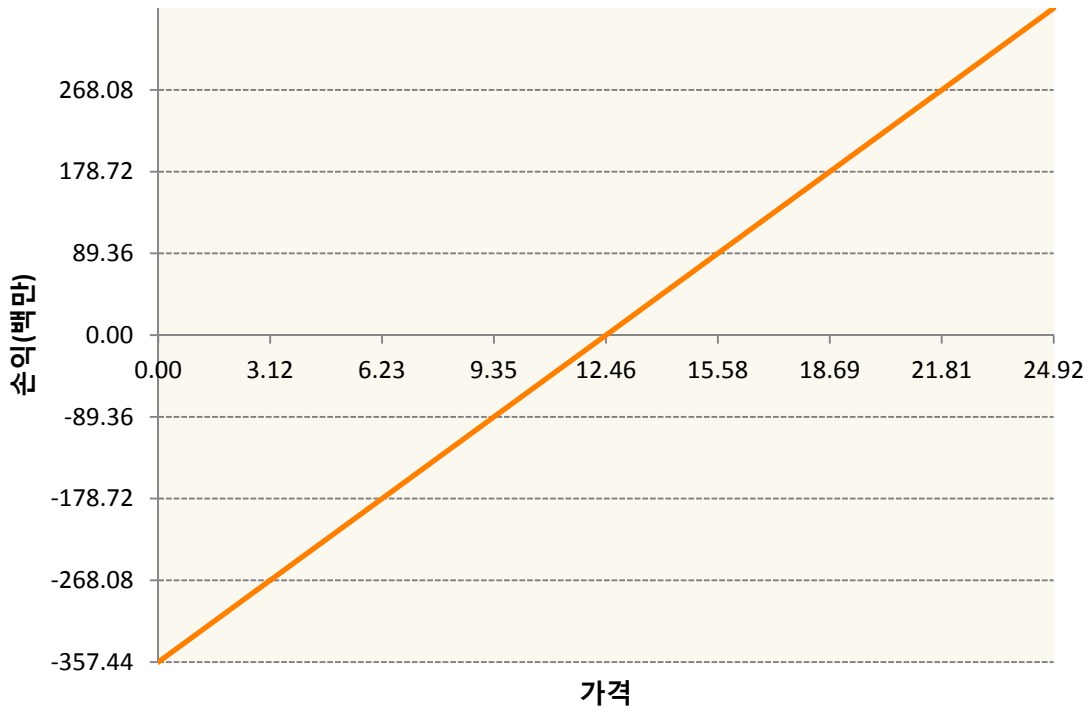
**KR4175N60003-2018-06 달러선물**



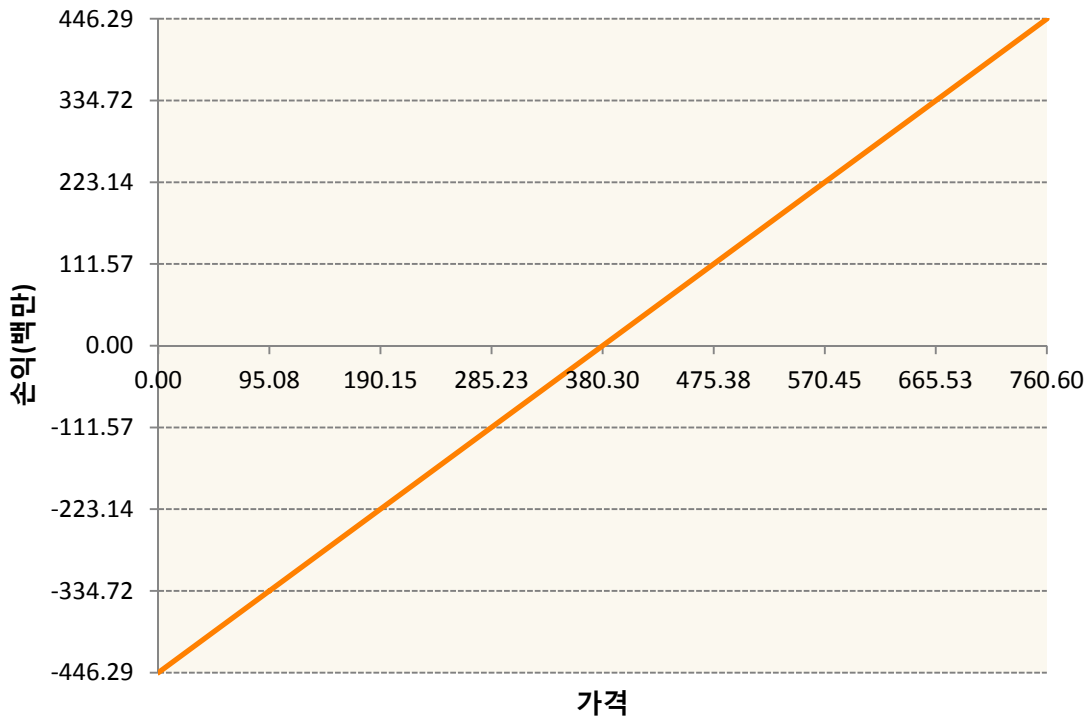
**KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18**



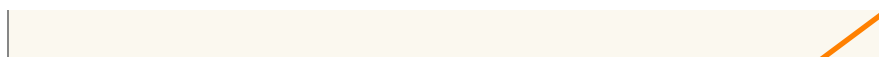
SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18

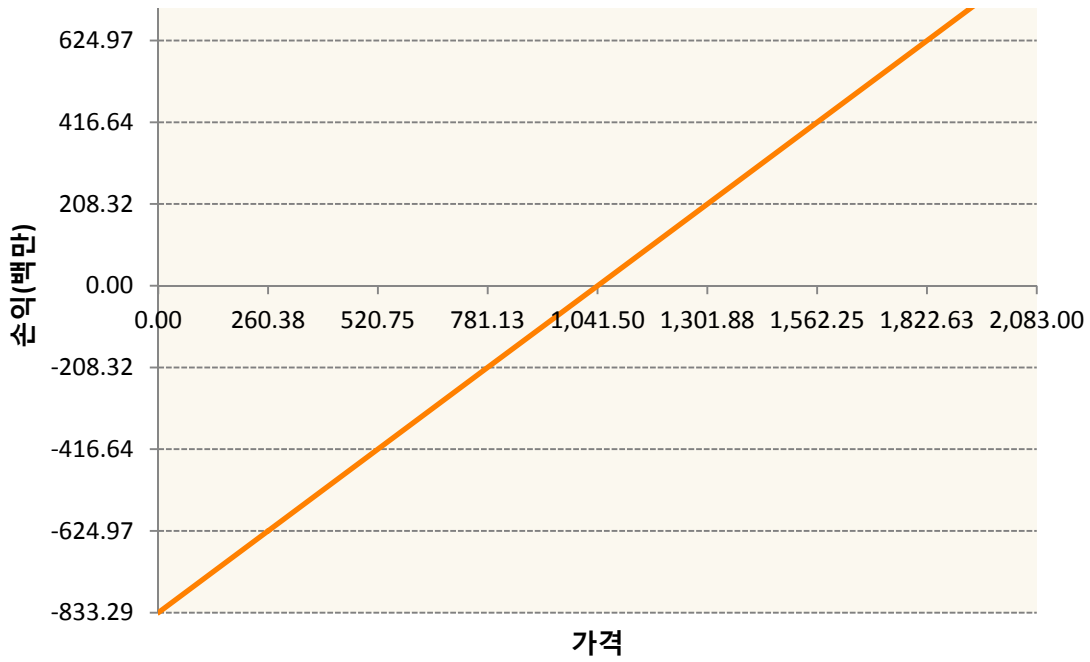


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18

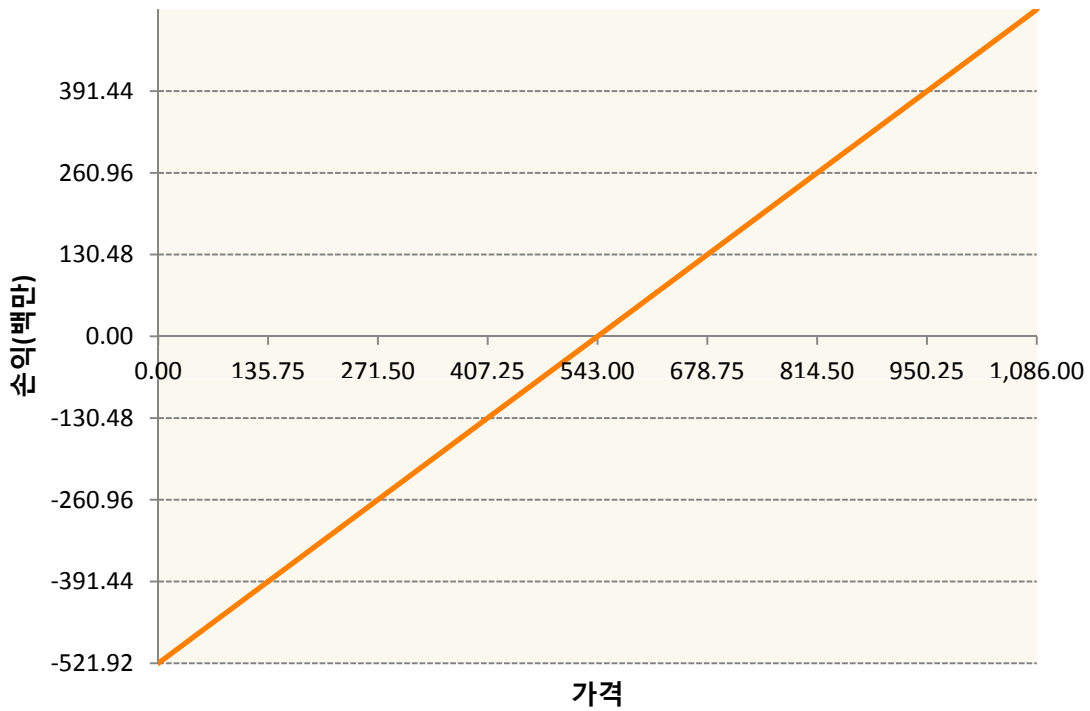


SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18





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	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**