

공시일	2018-05-31
기준일	2018-05-30

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)

81

공시일	2018-05-31
기준일	2018-05-30

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

1,100

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

453

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-05-31
기준일	2018-05-30

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

374

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

395

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-05-31
기준일	2018-05-30

유로인덱스모(주식-파생형)

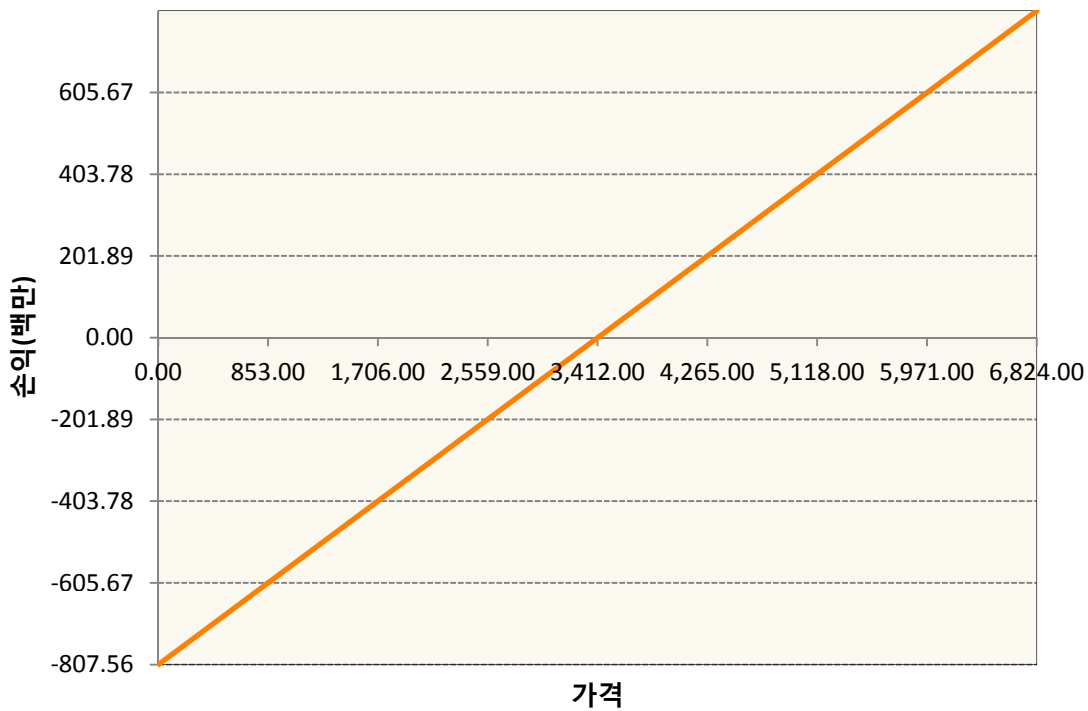
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	808	0	808	

2. 만기시점의 손익구조

VGM8-EURO STOXX 50 JUN18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	65
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

39

공시일	2018-05-31
기준일	2018-05-30

차이나인덱스모(주식-파생형)

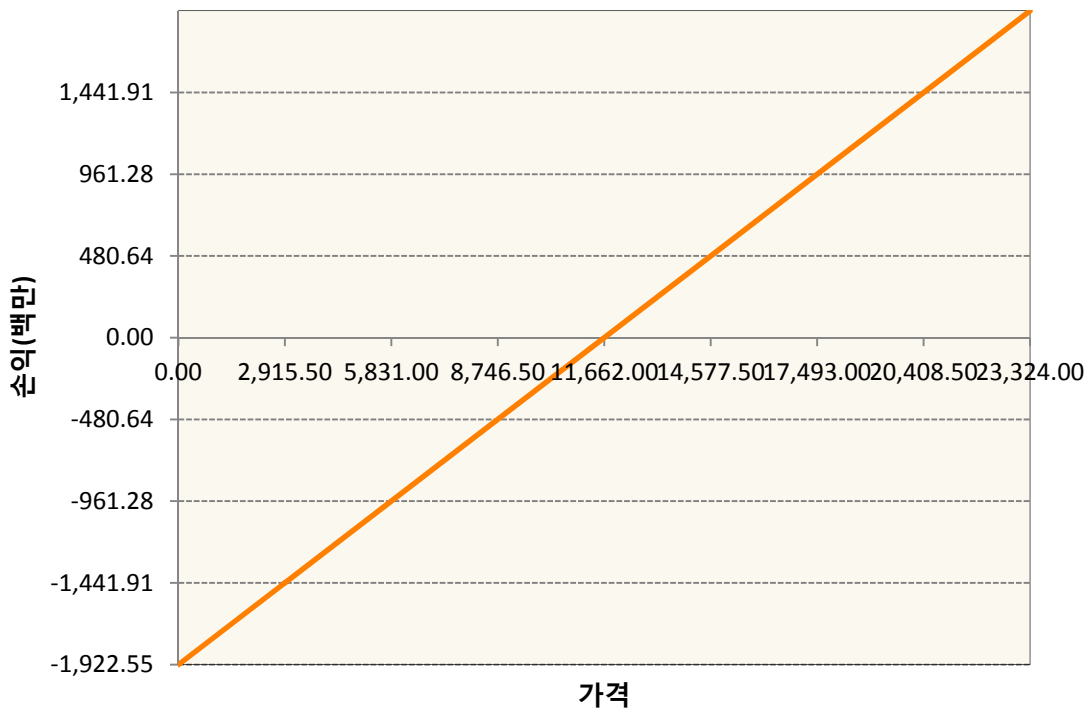
1. 계약금액

(단위:백만원)

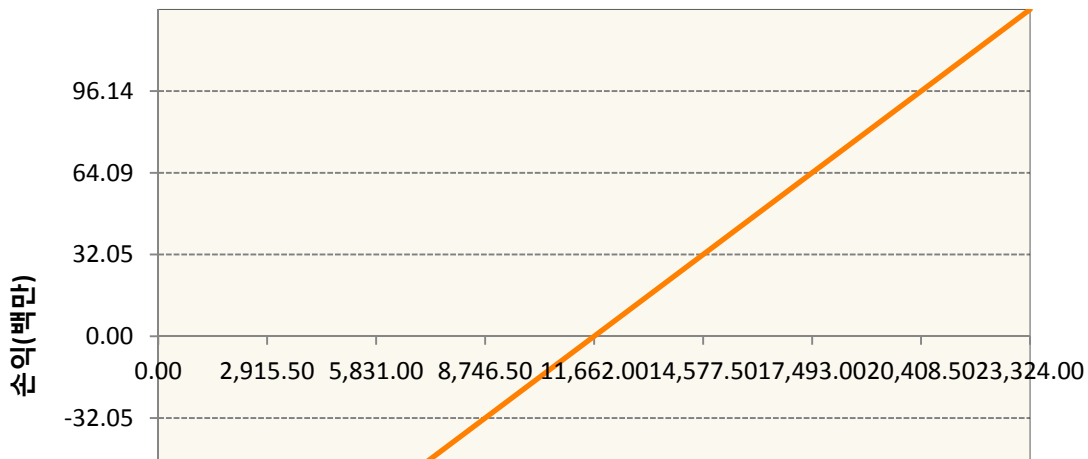
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,051	0	2,051	장내

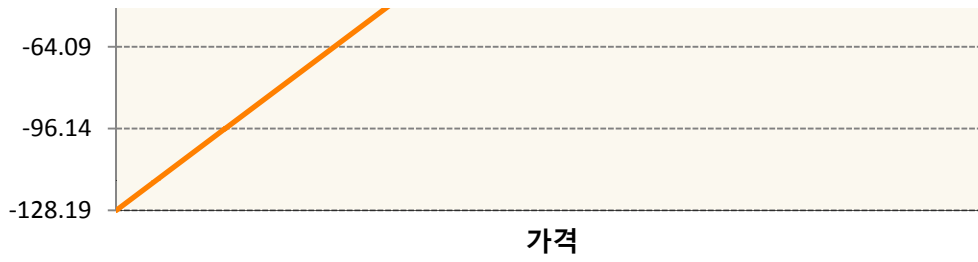
2. 만기시점의 손익구조

HCM8-HSCEI Futures Jun18



MHCM8-MINI H-SHR IDX FU Jun18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCM8	HSCEI Futures Jun18	154
MHCM8	MINI H-SHR IDX FU Jun18	10

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

145

공시일	2018-05-31
기준일	2018-05-30

커버드콜모(주식혼합-파생형)

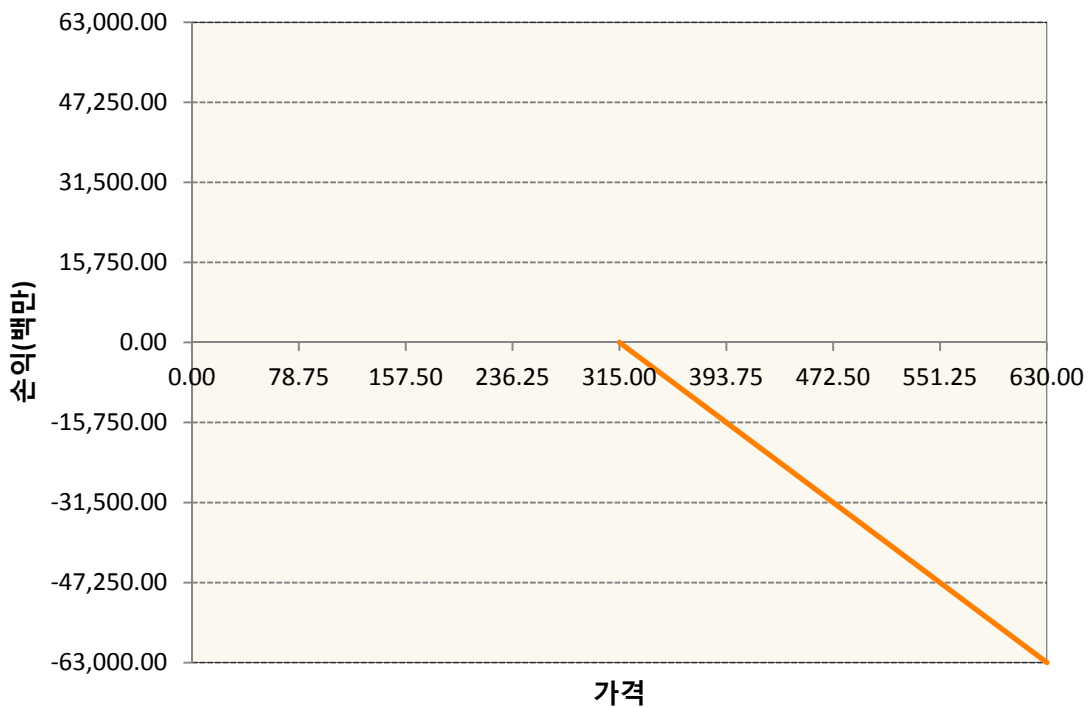
1. 계약금액

(단위:백만원)

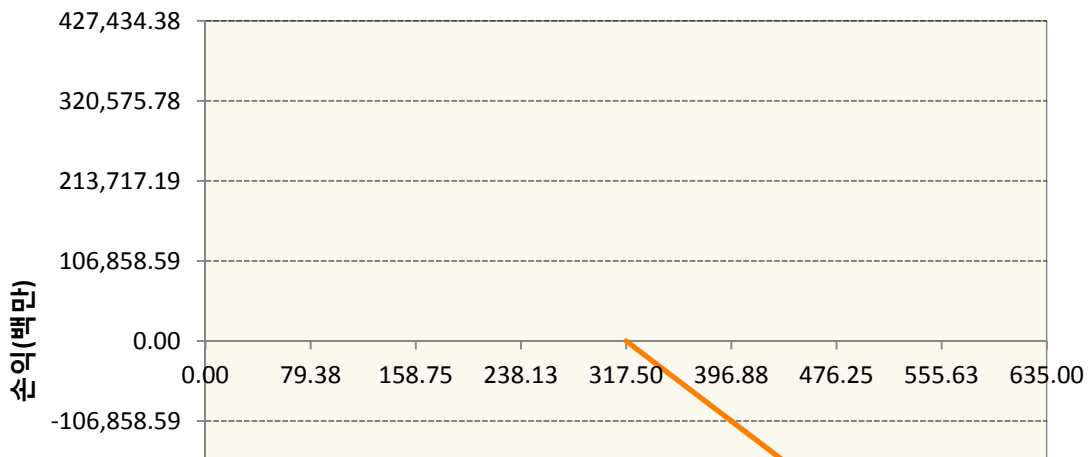
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	798,409	-798,409	장내

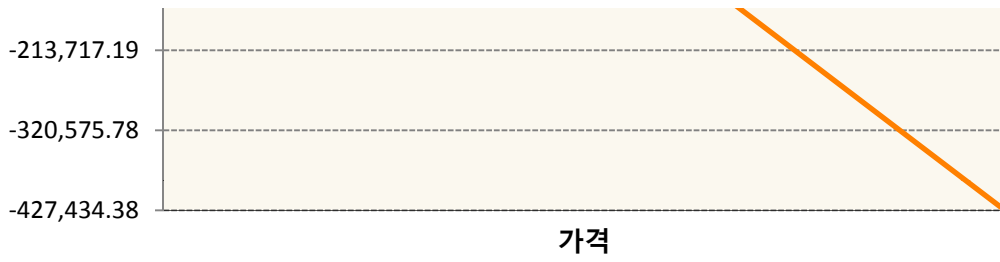
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63159-2018-06 콜315

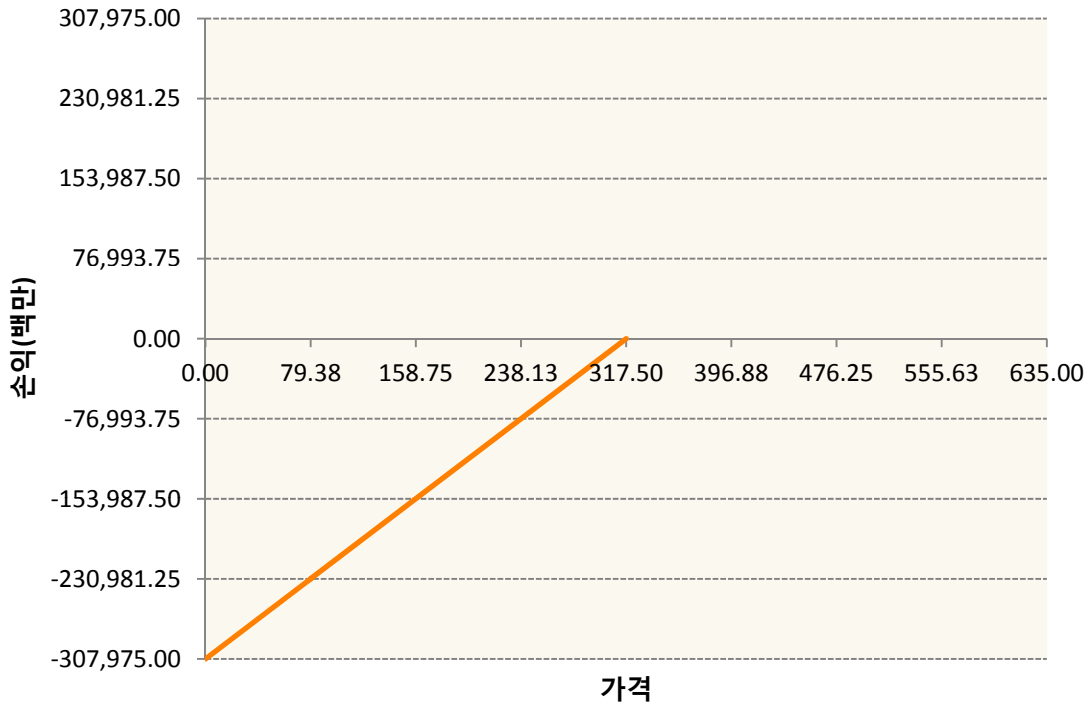


KR4201N63175-2018-06 콜317.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N6312018-06 콜315

3,412

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	945	935	918	896	867	832	790
-5.33%	902	868	825	775	717	654	585
-2.67%	744	670	589	503	412	318	220
0%	341	229	115	0	-116	-233	-350
2.67%	-421	-542	-664	-785	-907	-1,029	-1,152
5.33%	-1,554	-1,650	-1,750	-1,854	-1,961	-2,071	-2,182
8.00%	-2,963	-3,020	-3,085	-3,158	-3,238	-3,323	-3,412

KR4201N6312018-06 콜317.5

21,555

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,242	5,194	5,115	4,998	4,842	4,645	4,409

-5.33%	5,050	4,877	4,650	4,369	4,040	3,666	3,253
-2.67%	4,284	3,867	3,397	2,882	2,330	1,747	1,139
0%	2,152	1,453	735	0	-747	-1,504	-2,270
2.67%	-2,206	-3,037	-3,868	-4,700	-5,531	-6,361	-7,192
5.33%	-9,108	-9,830	-10,572	-11,330	-12,101	-12,881	-13,669
8.00%	-18,100	-18,569	-19,091	-19,658	-20,262	-20,896	-21,555
KR4301N6312018-06 풋317.5							23,013
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-23,007	-23,007	-23,008	-23,008	-23,008	-23,010	-23,013
-5.33%	-15,014	-15,015	-15,018	-15,024	-15,035	-15,052	-15,077
-2.67%	-7,042	-7,067	-7,107	-7,162	-7,234	-7,321	-7,425
0%	554	388	202	0	-215	-441	-676
2.67%	6,182	5,873	5,563	5,254	4,945	4,636	4,327
5.33%	8,508	8,332	8,136	7,925	7,700	7,465	7,220
8.00%	8,931	8,897	8,847	8,778	8,691	8,587	8,466

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

(단위:백만원)

49,792

공시일	2018-05-31
기준일	2018-05-30

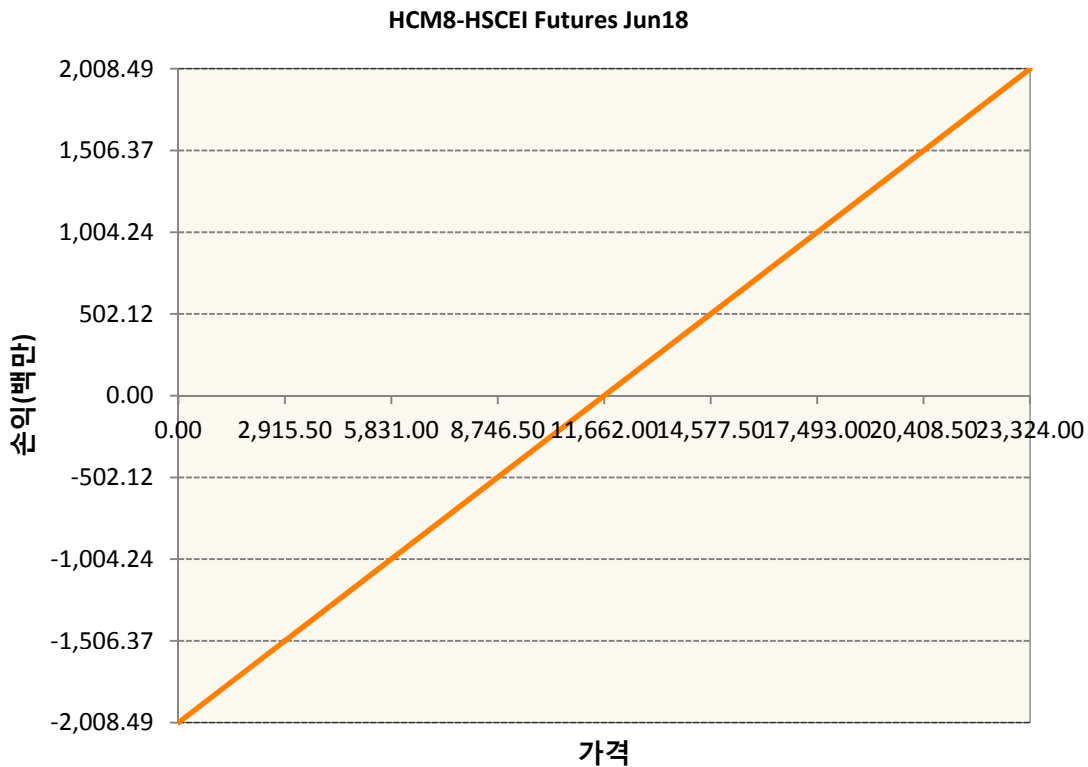
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,008	0	2,008	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM8	HSCEI Futures Jun18	161
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

142

공시일	2018-05-31
기준일	2018-05-30

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

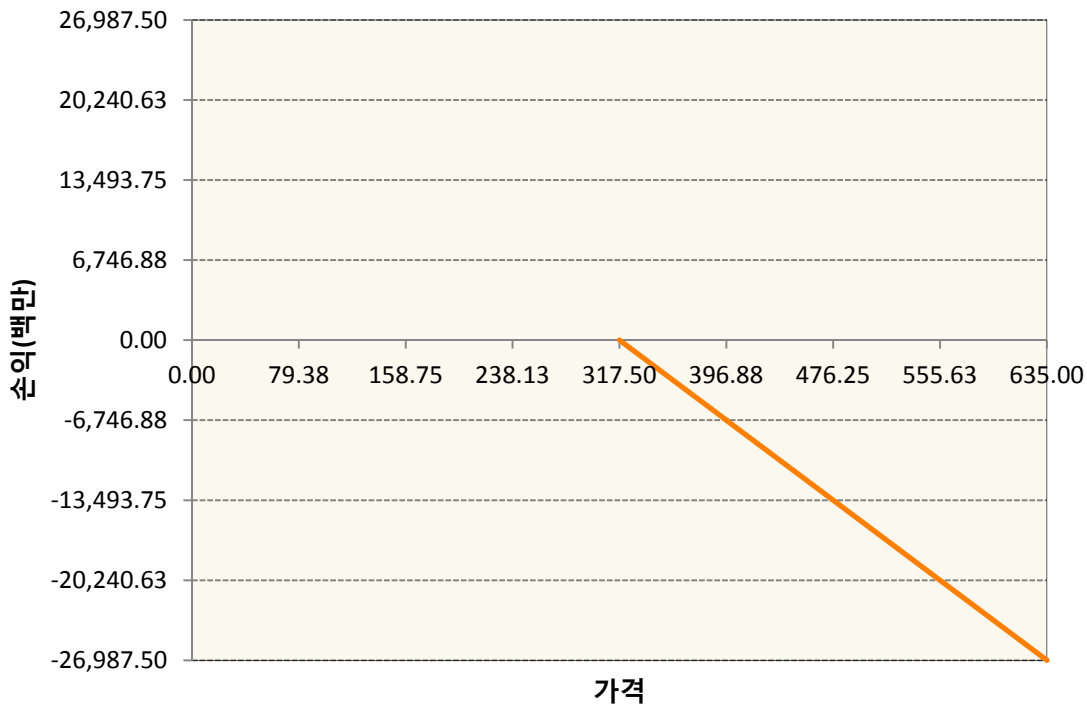
1. 계약금액

(단위:백만원)

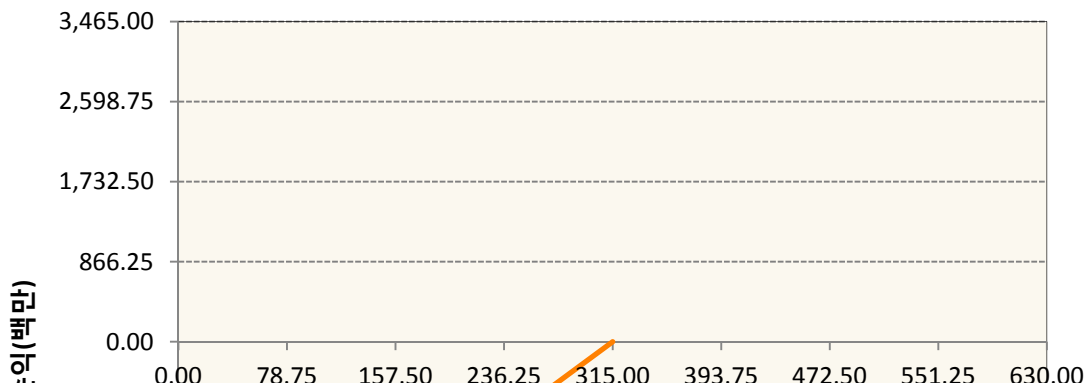
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	46,804	-46,804	장내

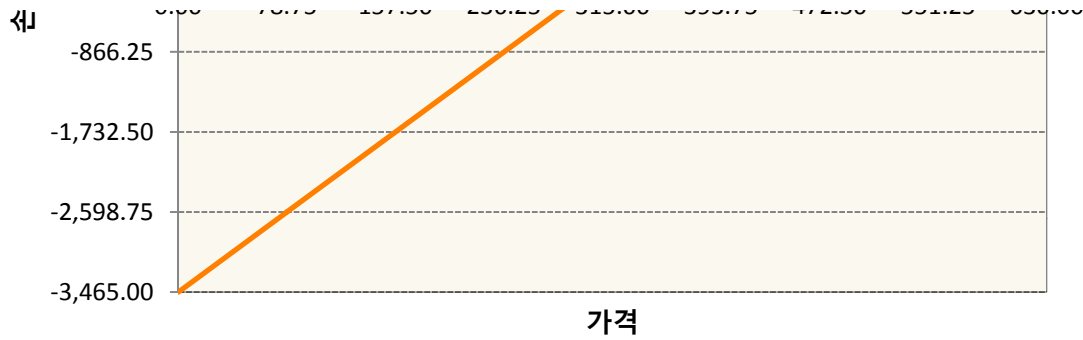
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63175-2018-06 콜317.5

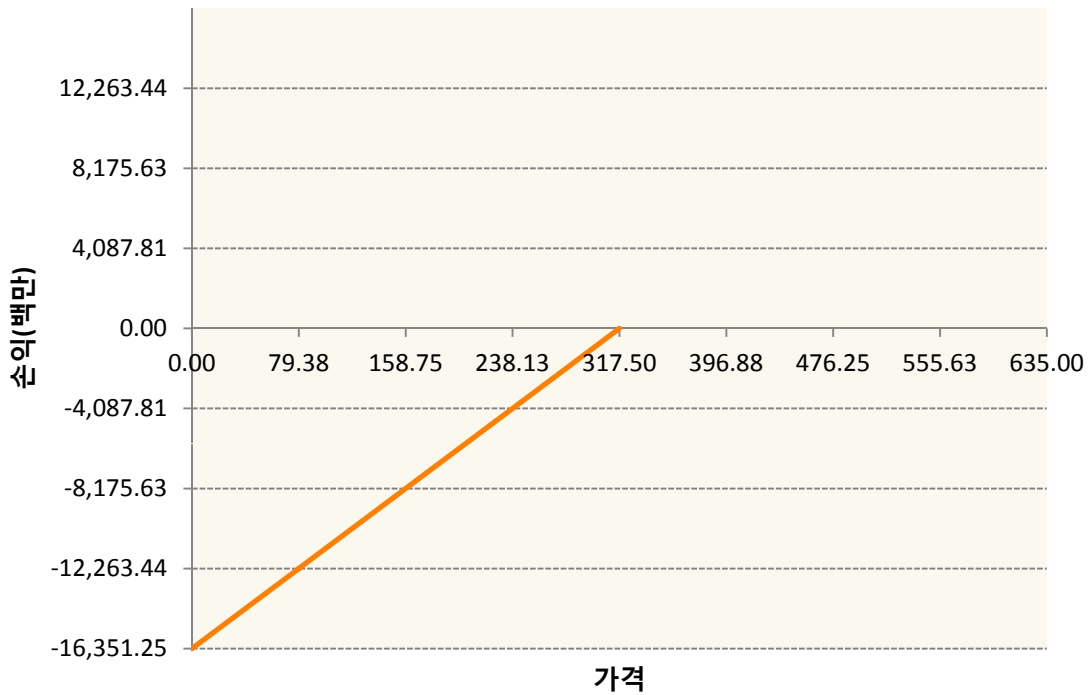


KR4301N63157-2018-06 풋315





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,482
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,482	-1,482	-1,482	-1,482	-1,482	-1,482	-1,482
-5.33%	-988	-988	-988	-988	-988	-988	-988
-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%	988	988	988	988	988	988	988
8.00%	1,482	1,482	1,482	1,482	1,482	1,482	1,482
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_12 481

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-481	-481	-481	-481	-481	-481	-481
-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%	481	481	481	481	481	481	481

KR4201N6312018-06 콜317.5 1,361

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	331	328	323	316	306	293	278
-5.33%	319	308	294	276	255	231	205
-2.67%	270	244	214	182	147	110	72
0%	136	92	46	0	-47	-95	-143
2.67%	-139	-192	-244	-297	-349	-402	-454
5.33%	-575	-621	-668	-715	-764	-813	-863
8.00%	-1,143	-1,172	-1,205	-1,241	-1,279	-1,319	-1,361

KR4301N6312018-06 풋315 255

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-255	-255	-255	-255	-255	-255	-255
-5.33%	-164	-164	-164	-164	-165	-165	-165
-2.67%	-74	-75	-75	-76	-78	-79	-81
0%	8	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	61	57	54	51	47	44	41
5.33%	78	77	75	73	71	69	67
8.00%	80	80	80	79	79	78	77

KR4301N6312018-06 풋317.5 1,222

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,222	-1,222	-1,222	-1,222	-1,222	-1,222	-1,222
-5.33%	-797	-797	-797	-798	-798	-799	-800
-2.67%	-374	-375	-377	-380	-384	-389	-394
0%	29	21	11	0	-11	-23	-36
2.67%	328	312	295	279	263	246	230
5.33%	452	442	432	421	409	396	383
8.00%	474	472	470	466	461	456	449

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

(단위:백만원)

6,830

공시일	2018-05-31
기준일	2018-05-30

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

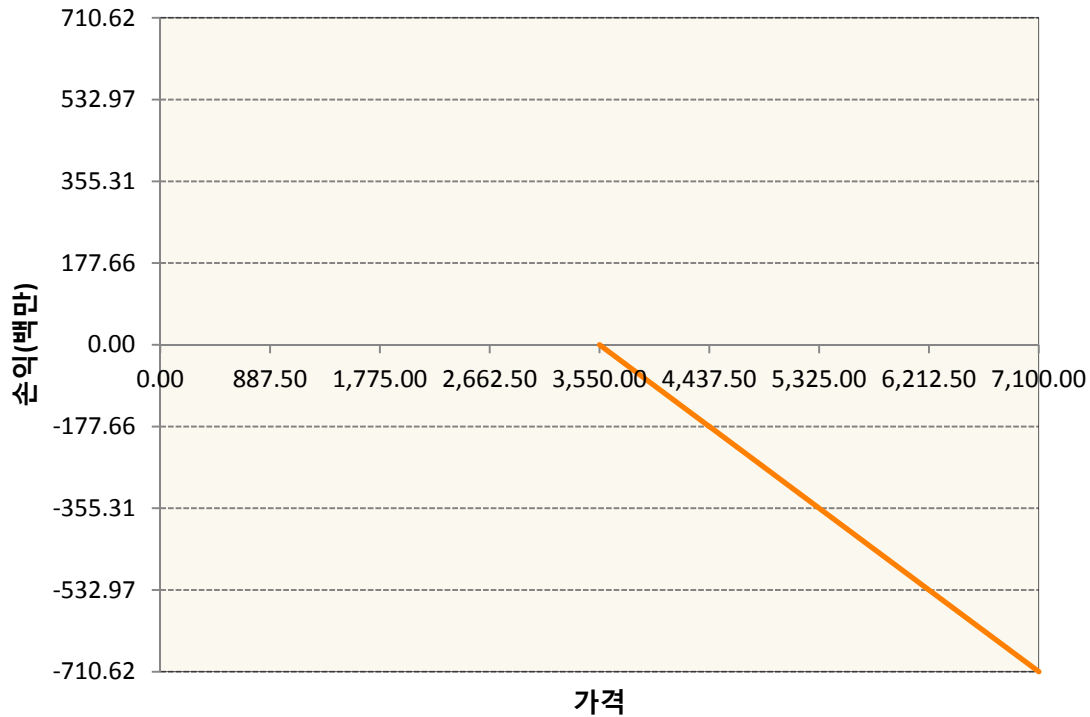
1. 계약금액

(단위:백만원)

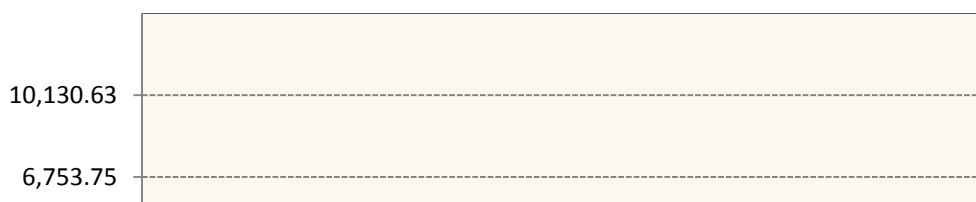
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,082	0	6,082	
누계	유가증권	스왑	52,747	0	52,747	장외
누계	유가증권	옵션	0	28,436	-28,436	장내
누계	지수	스왑	50,044	0	50,044	장외

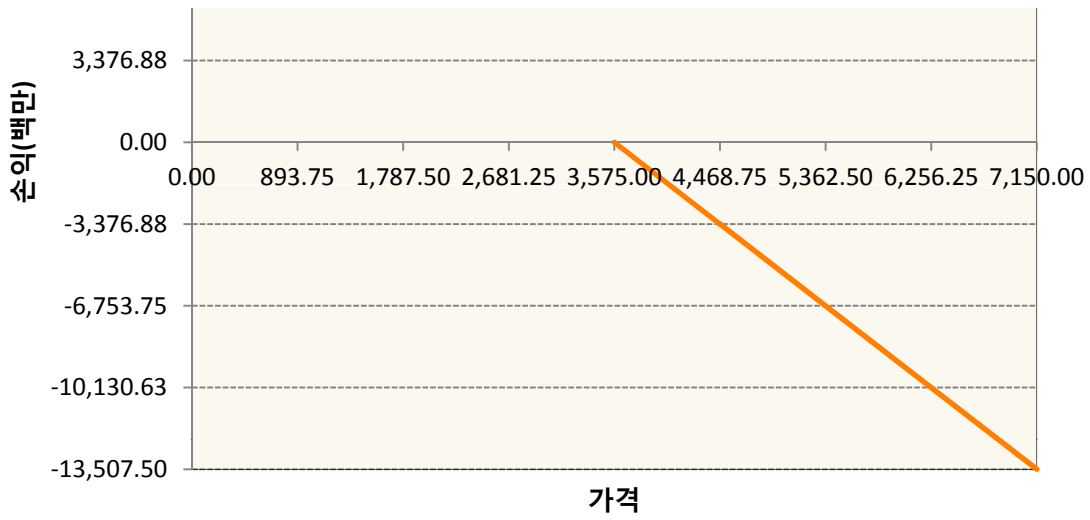
2. 만기시점의 손익구조

OESXM8-C3550-EURO STOXX 50

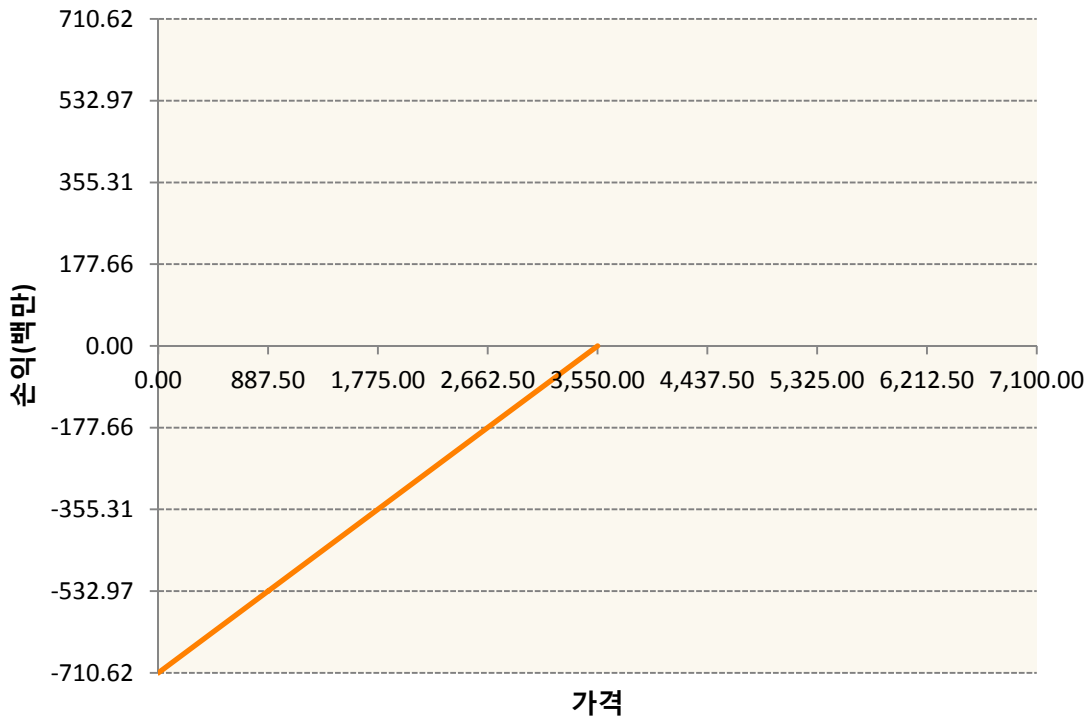


OESXM8-C3575-EURO STOXX 50

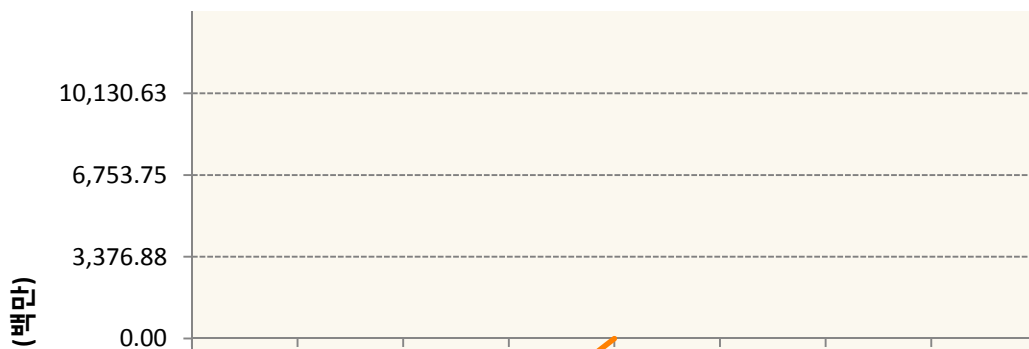


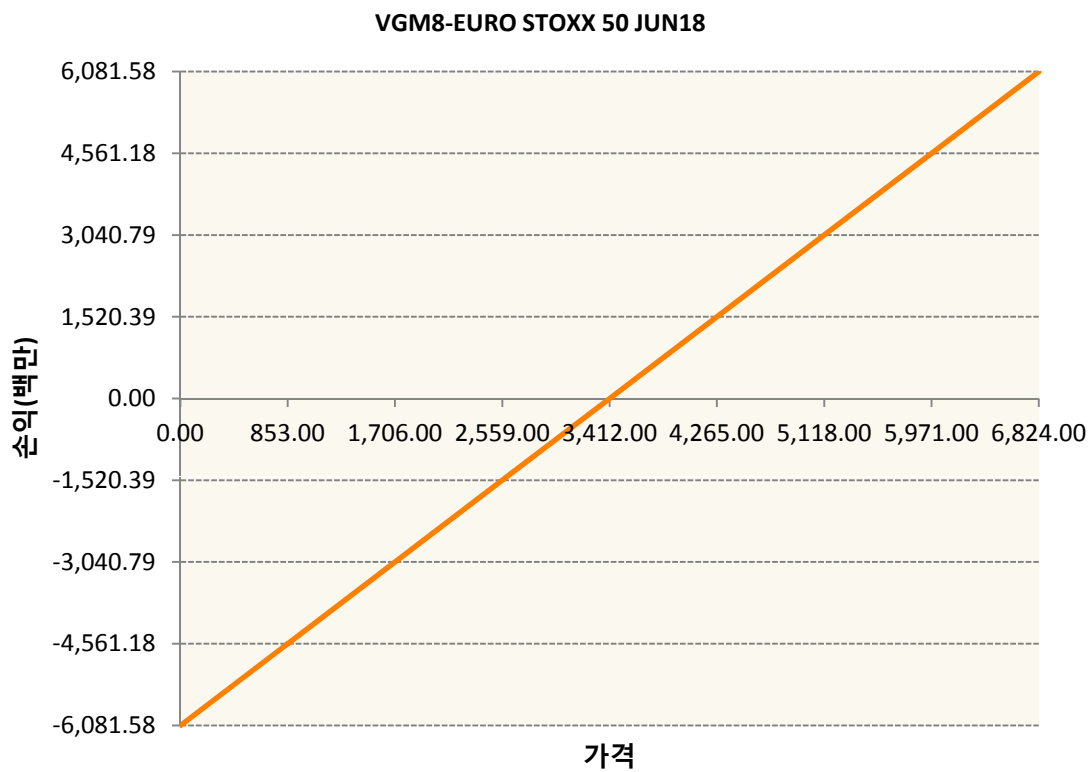
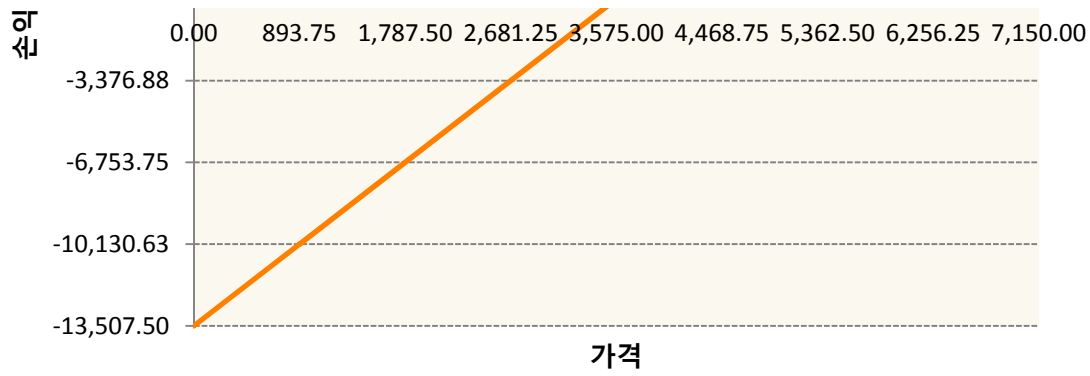


OESXM8-P3550-EURO STOXX 50



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		57
OESXM8-C3 EURO STOXX 50		1,081
OESXM8-P3! EURO STOXX 50		57
OESXM8-P3! EURO STOXX 50		1,081
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18		487

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

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

(단위:백만원)

1,159

공시일	2018-05-31
기준일	2018-05-30

ETF스마트레버리지목표전환형9호

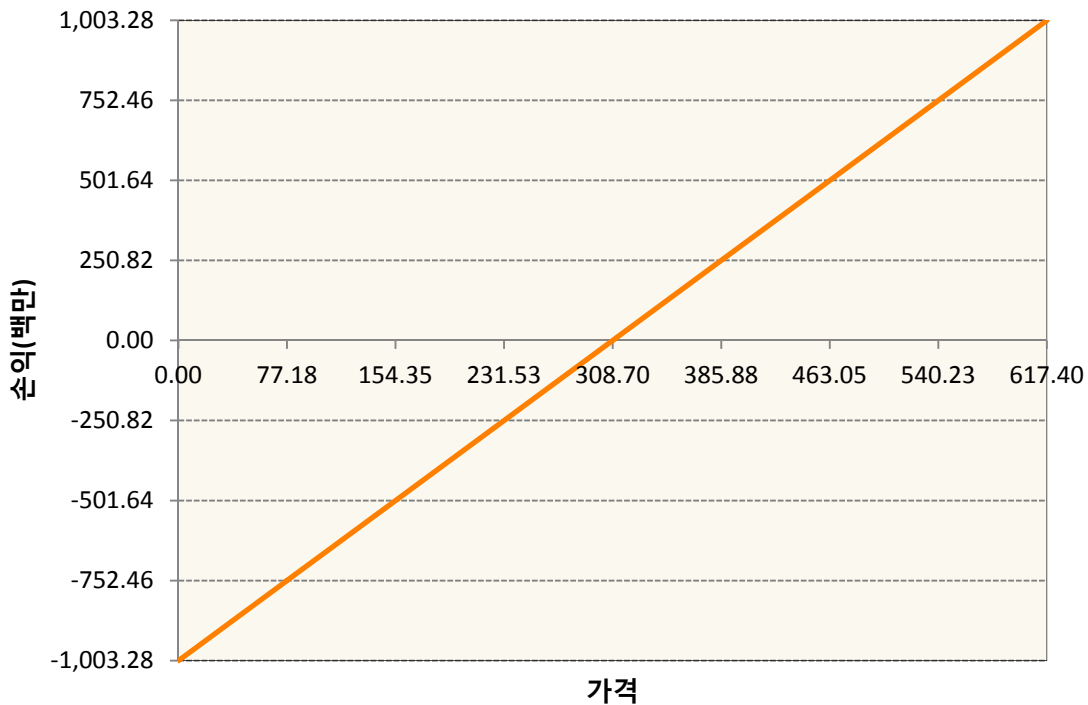
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,003	0	1,003	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물

80

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
-5.33%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	27	27	27	27	27	27	27
5.33%	54	54	54	54	54	54	54
8.00%	80	80	80	80	80	80	80

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)

213

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

(단위:백만원)

41

공시일	2018-05-31
기준일	2018-05-30

리디파인K200(주식혼합-파생재간

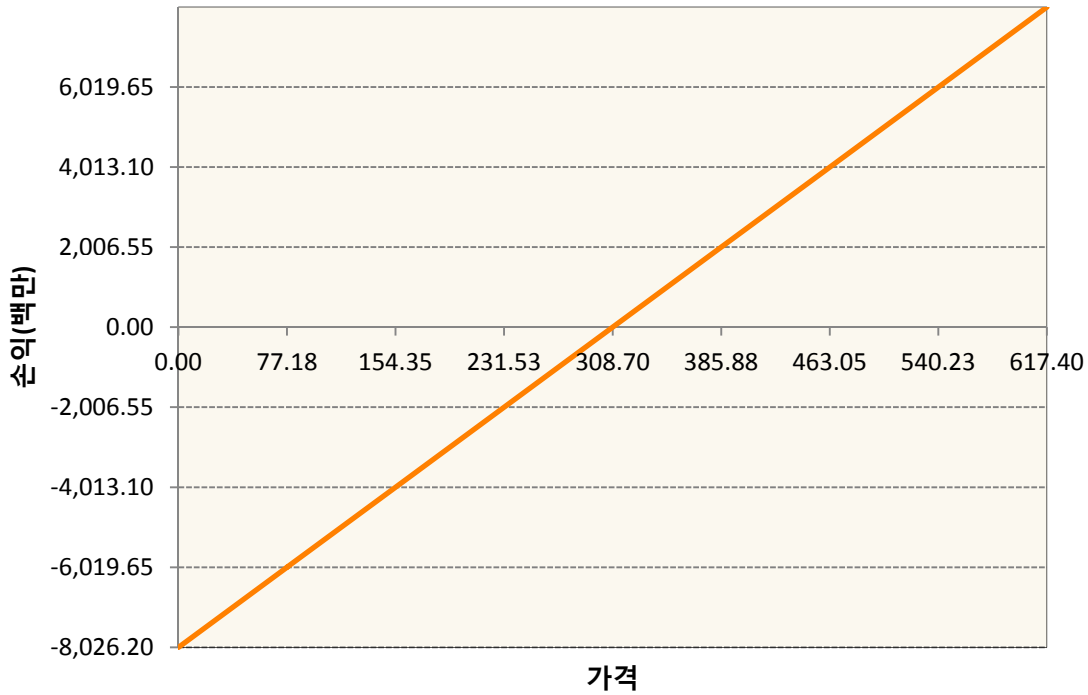
1. 계약금액

(단위:백만원)

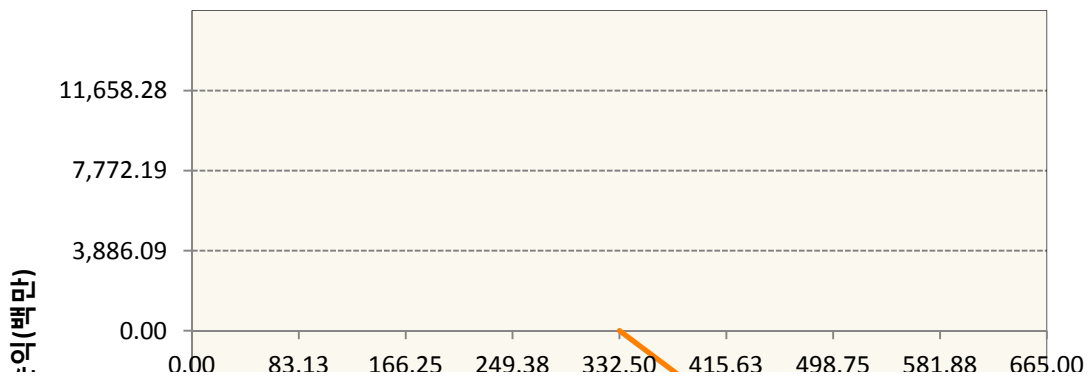
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	774	0	774	장내
신규	유가증권	옵션	232	1,663	-1,431	장내
누계	유가증권	선물	8,026	0	8,026	장내
누계	유가증권	옵션	1,746	15,544	-13,798	장내

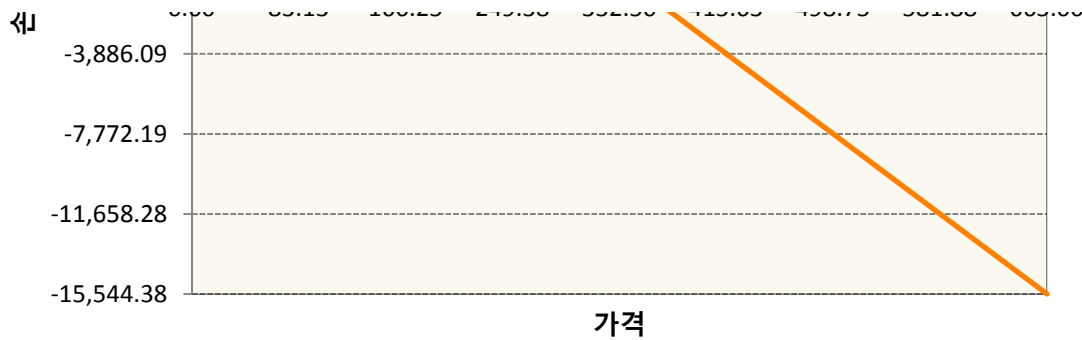
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

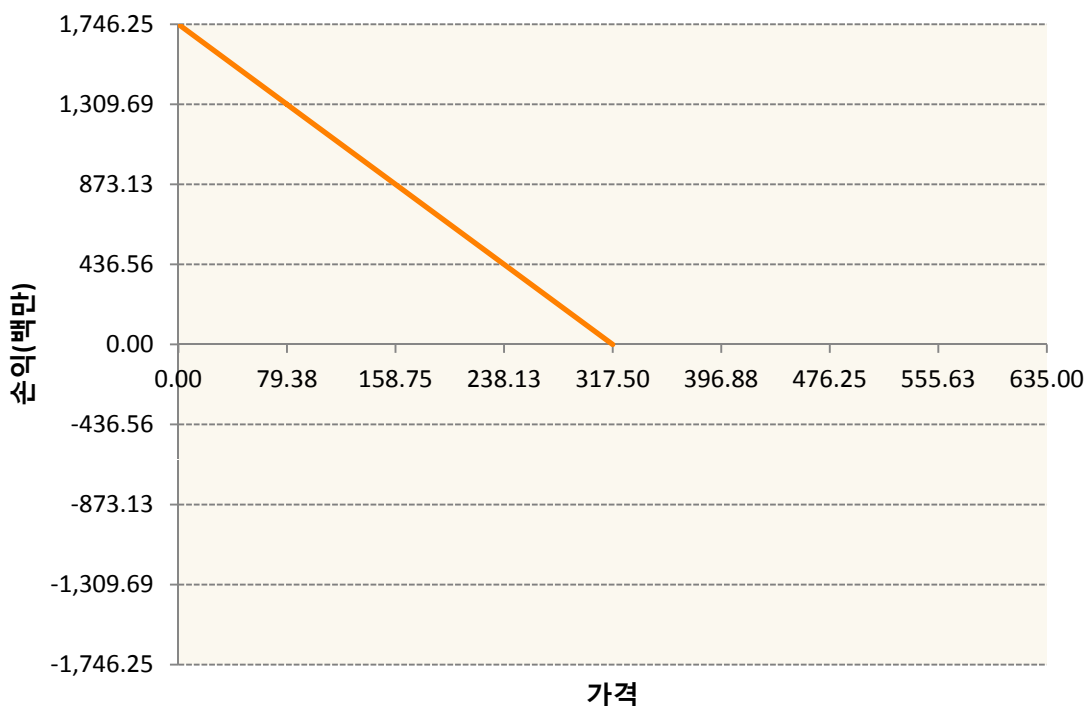


KR4201N63324-2018-06 콜332.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물							643
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-643	-643	-643	-643	-643	-643	-643
-5.33%	-429	-429	-429	-429	-429	-429	-429
-2.67%	-214	-214	-214	-214	-214	-214	-214
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	214	214	214	214	214	214	214
5.33%	429	429	429	429	429	429	429
8.00%	643	643	643	643	643	643	643
KR4201N63E 2018-06 콜332.5							445
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	45	45	45	45	43	42	39
-5.33%	45	44	43	41	38	33	28
-2.67%	43	40	36	30	22	13	2
0%	32	23	13	0	-14	-30	-48
2.67%	-5	-23	-42	-64	-86	-109	-133
5.33%	-95	-122	-150	-178	-206	-234	-263
8.00%	-264	-294	-324	-354	-384	-415	-445

KR4301N6312018-06 풋317.5

130

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	130	130	130	130	130	130	130
-5.33%	85	85	85	85	85	85	85
-2.67%	40	40	40	41	41	42	42
0%	-3	-2	-1	0	1	3	4
2.67%	-35	-33	-32	-30	-28	-26	-25
5.33%	-48	-47	-46	-45	-44	-42	-41
8.00%	-51	-50	-50	-50	-49	-49	-48

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

(단위:백만원)

869

공시일	2018-05-31
기준일	2018-05-30

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

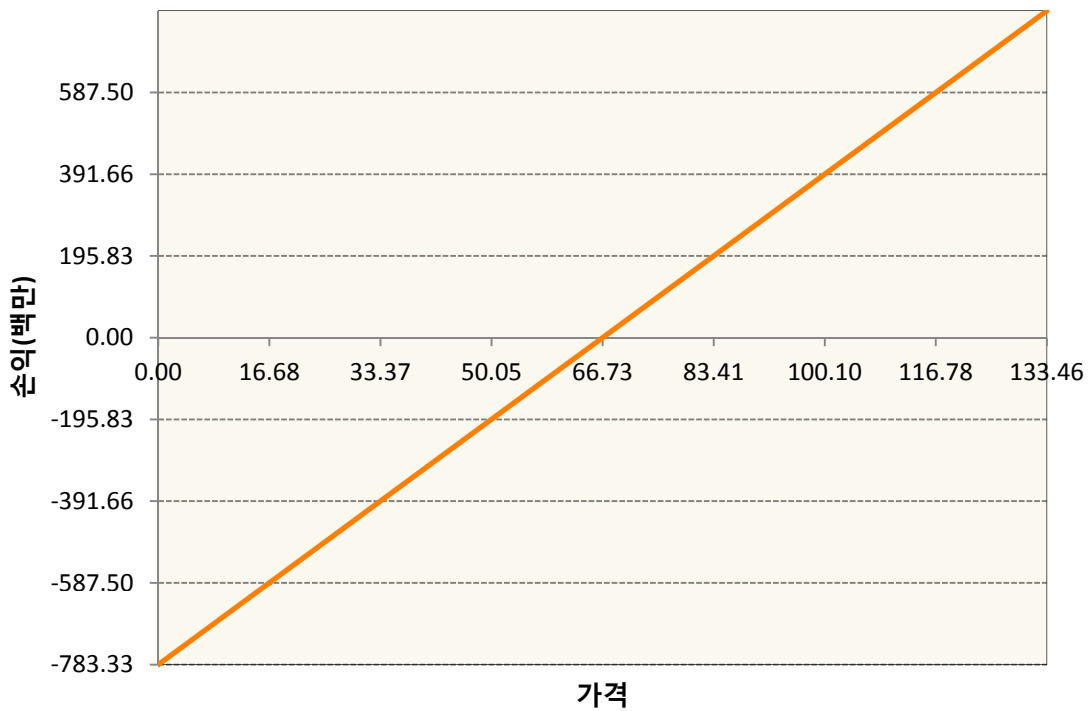
1. 계약금액

(단위:백만원)

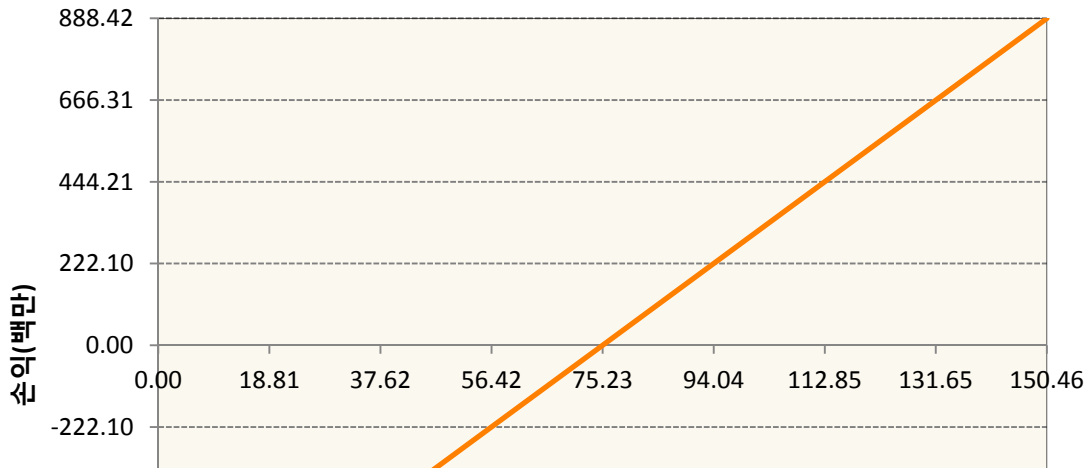
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,820	594	3,226	

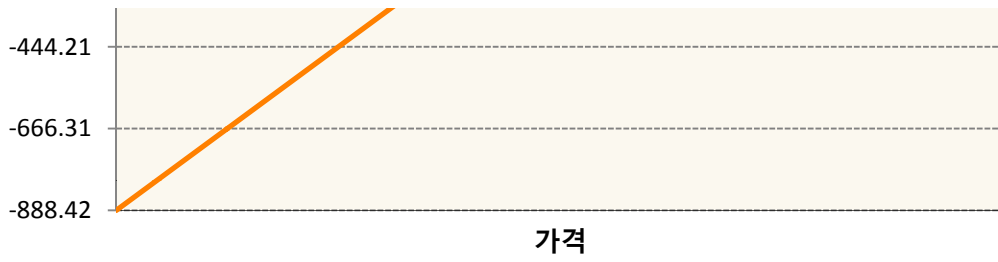
2. 만기시점의 손익구조

CLN8-WTI CRUDE FUTURE JUL18

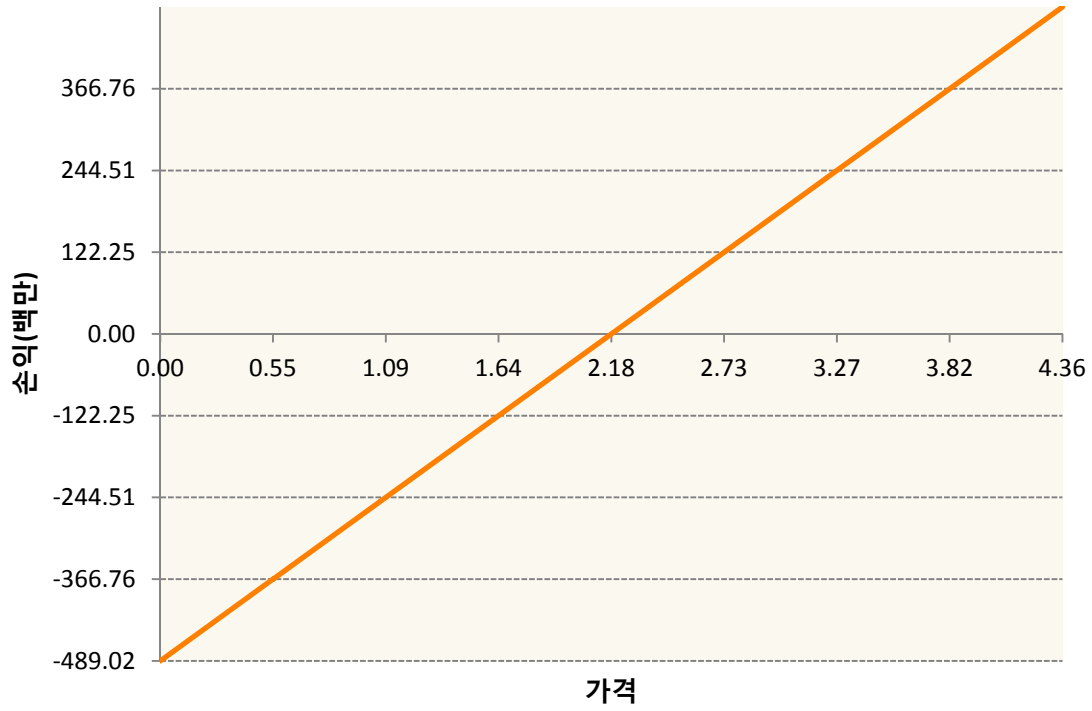


COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18

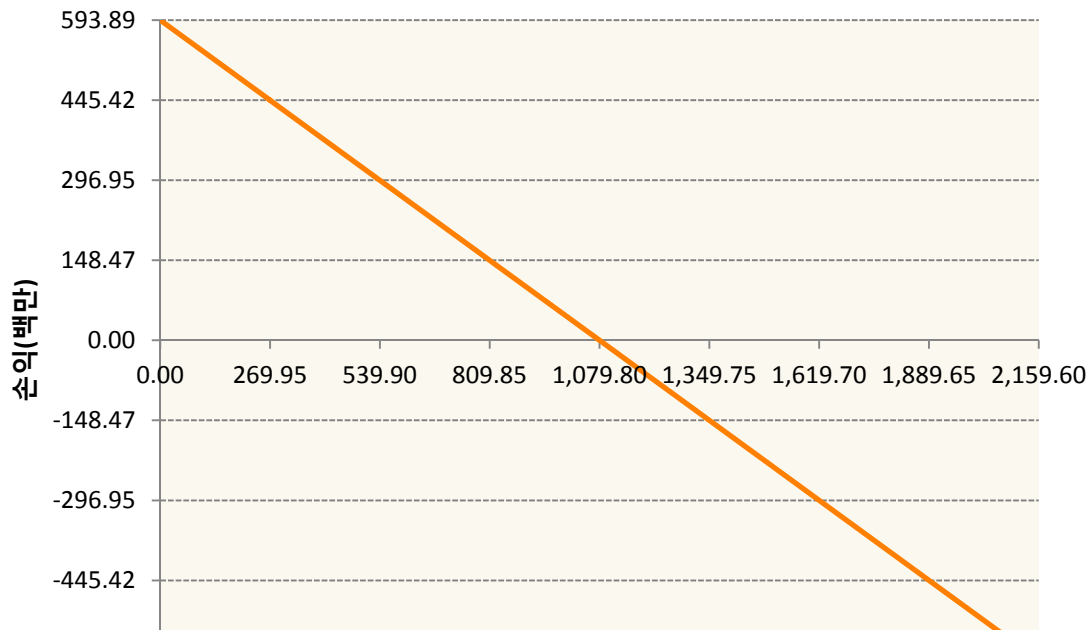


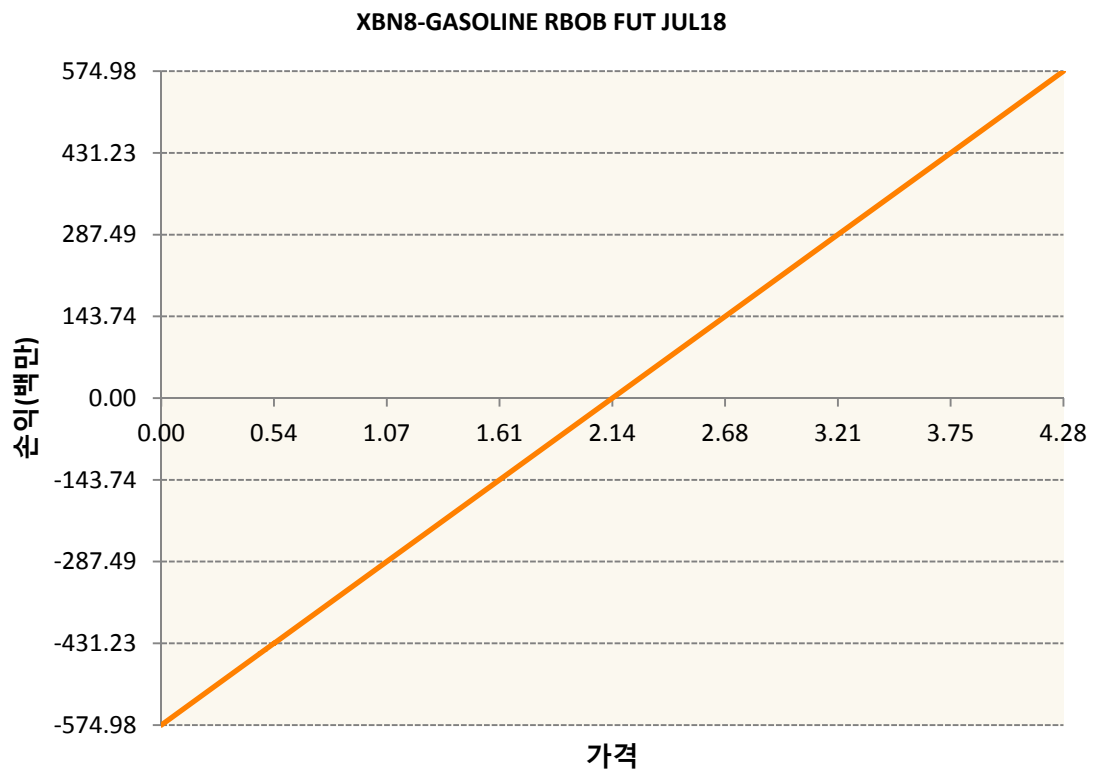
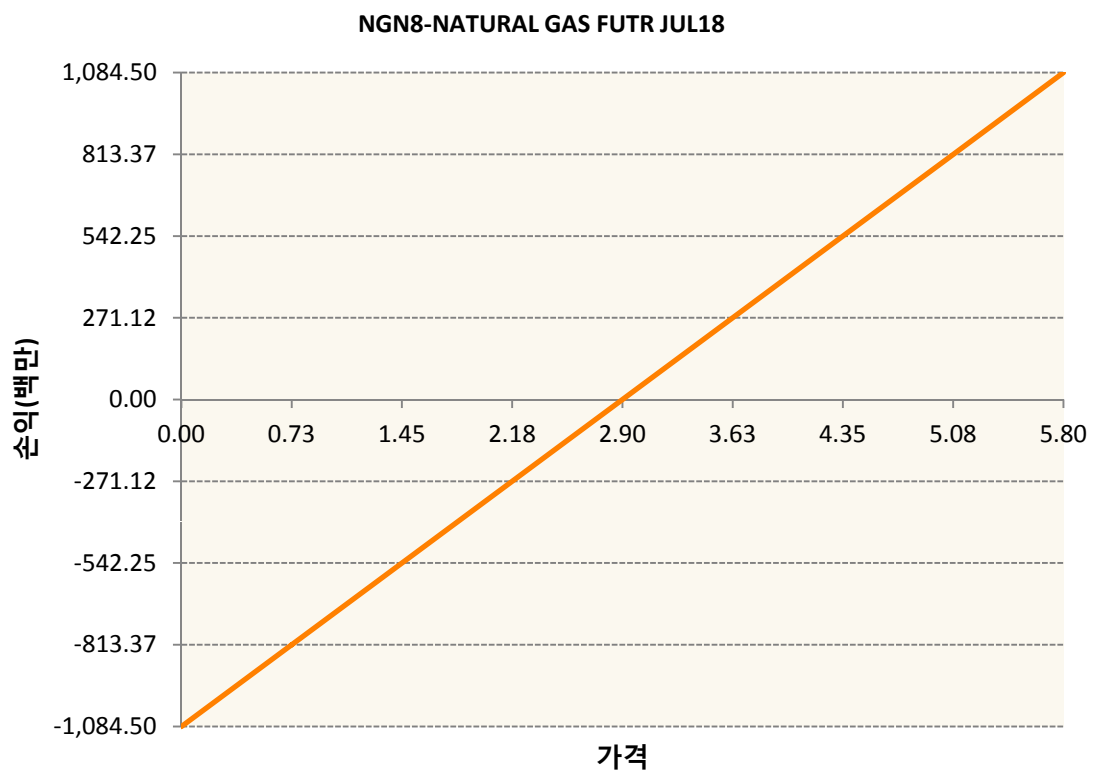
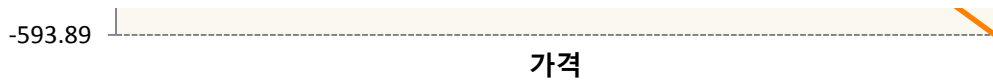


HON8-NY Harb ULSD Fut JUL18



KR4175N60003-2018-06 달러선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN8	WTI CRUDE FUTURE JUL18	63
COU8	BRENT CRUDE FUTR SEP18	71
HON8	NY Harb ULSD Fut JUL18	39
KR4175N60C	2018-06 달러선물	48
NGN8	NATURAL GAS FUTR JUL18	87
XBN8	GASOLINE RBOB FUT JUL18	46

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

462

공시일	2018-05-31
기준일	2018-05-30

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

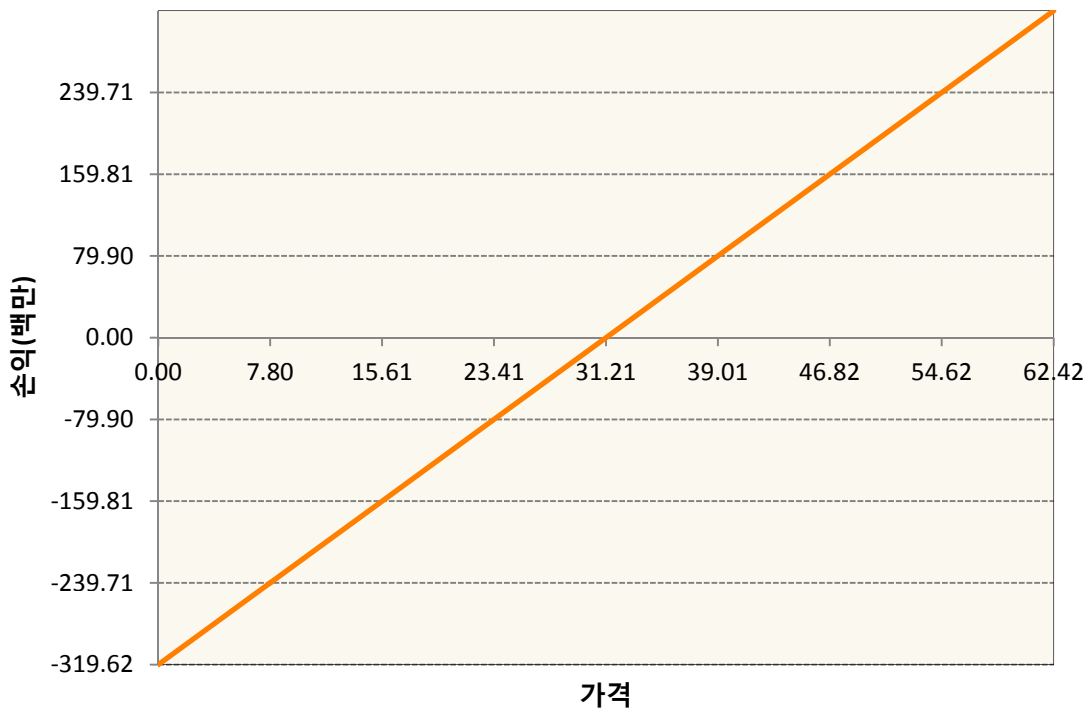
1. 계약금액

(단위:백만원)

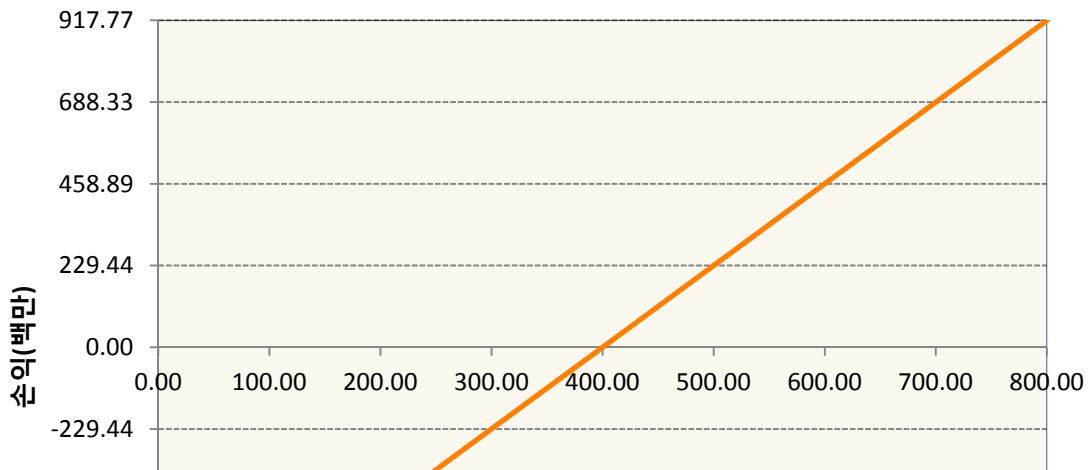
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,175	324	3,851	

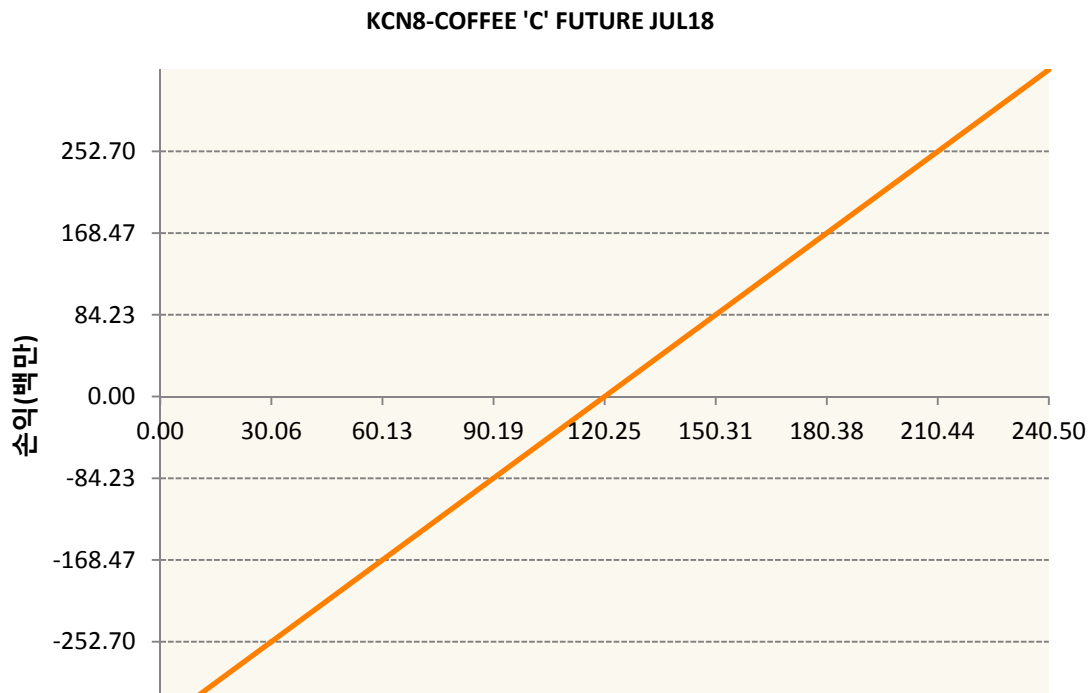
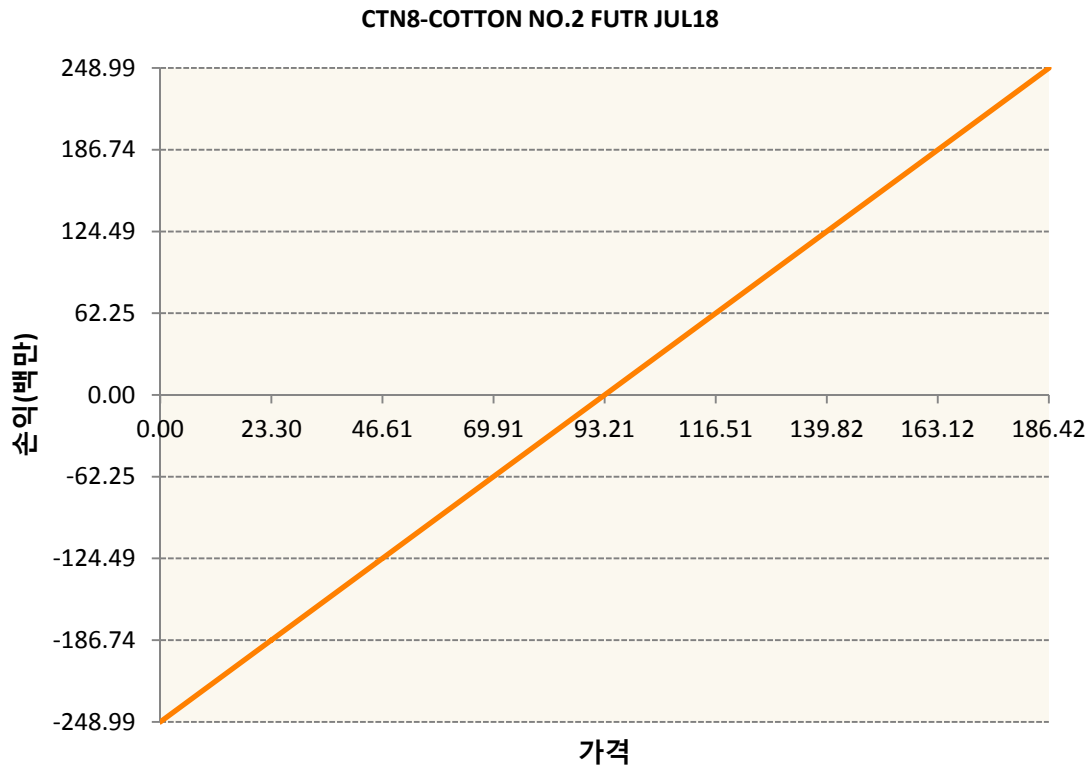
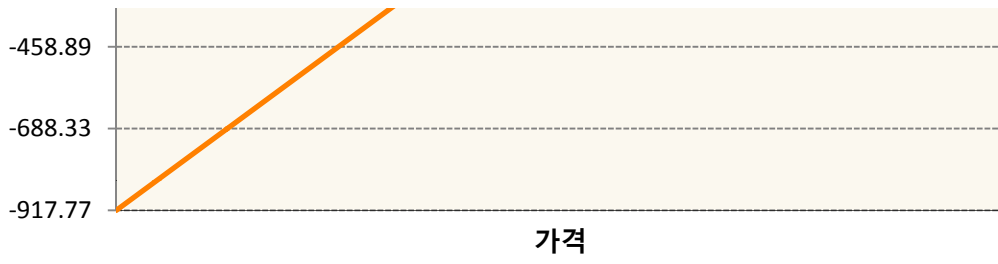
2. 만기시점의 손익구조

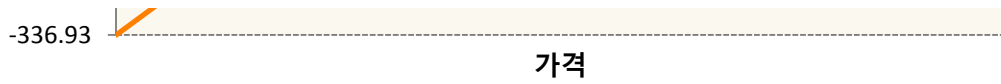
BON8-SOYBEAN OIL FUTR JUL18



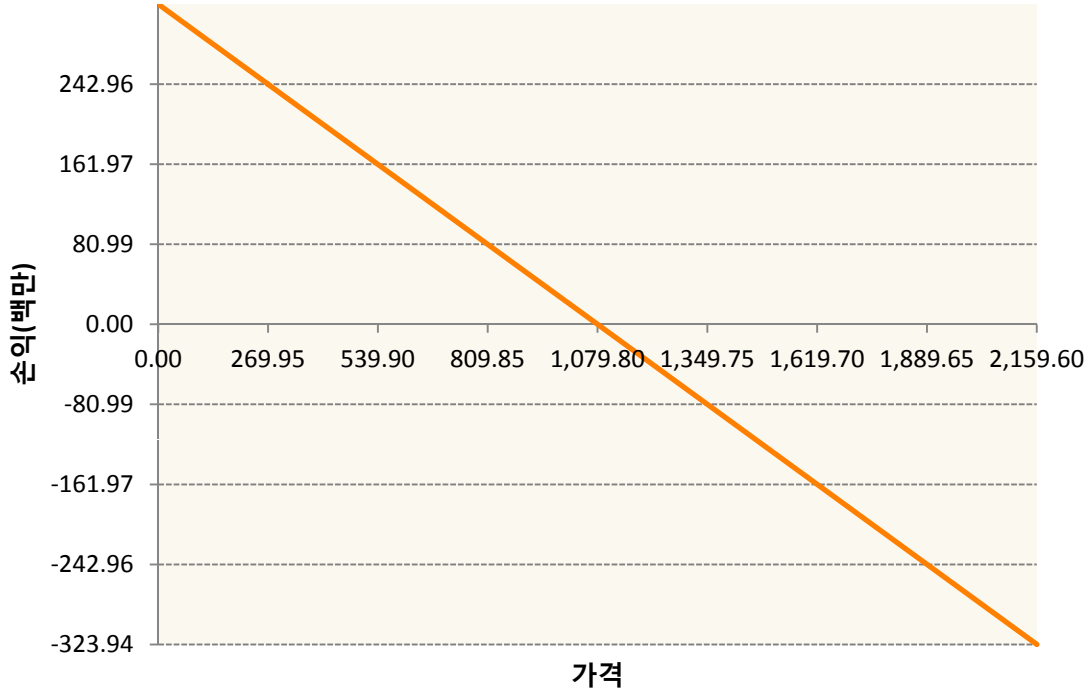
CN8-CORN FUTURE JUL18



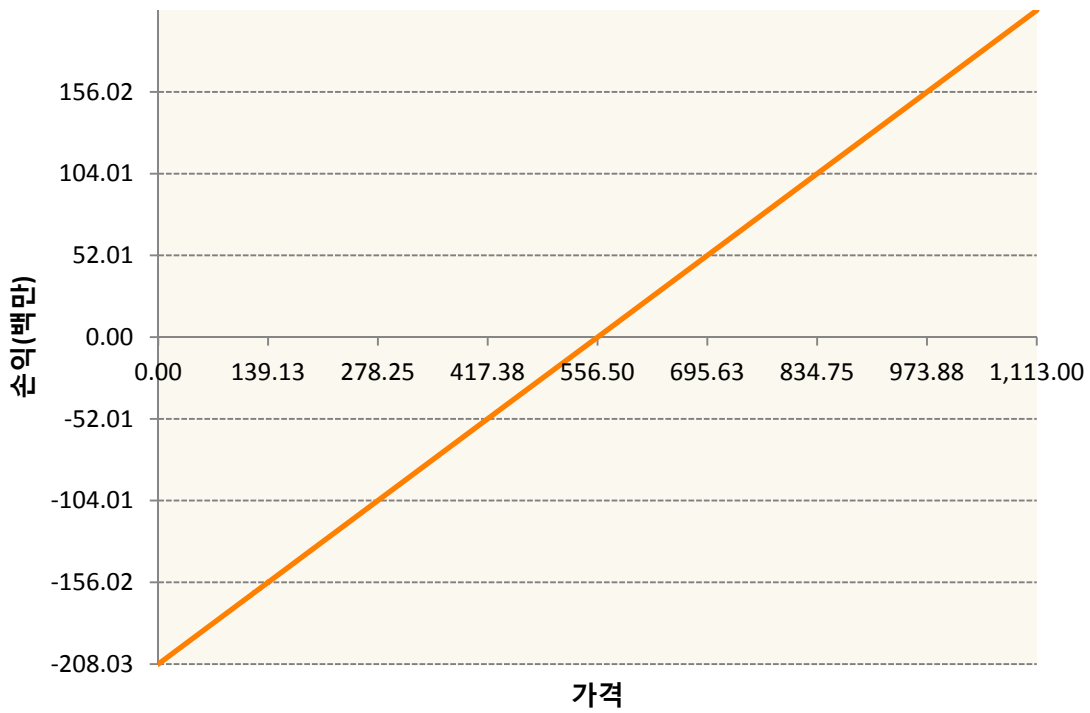




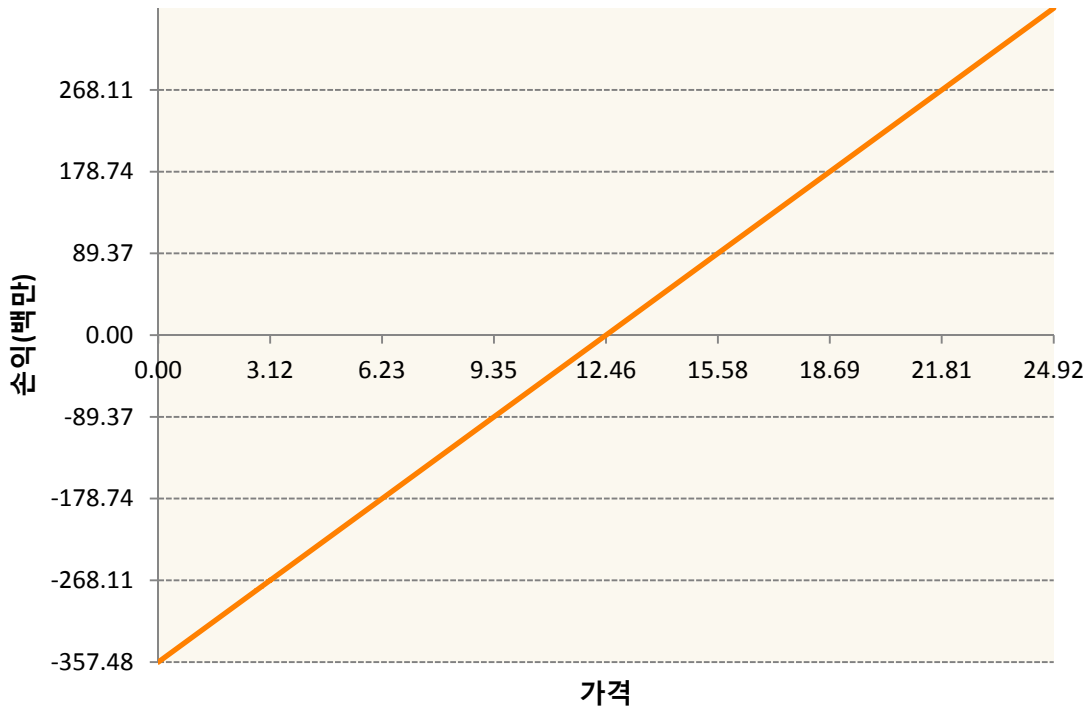
KR4175N60003-2018-06 달러선물



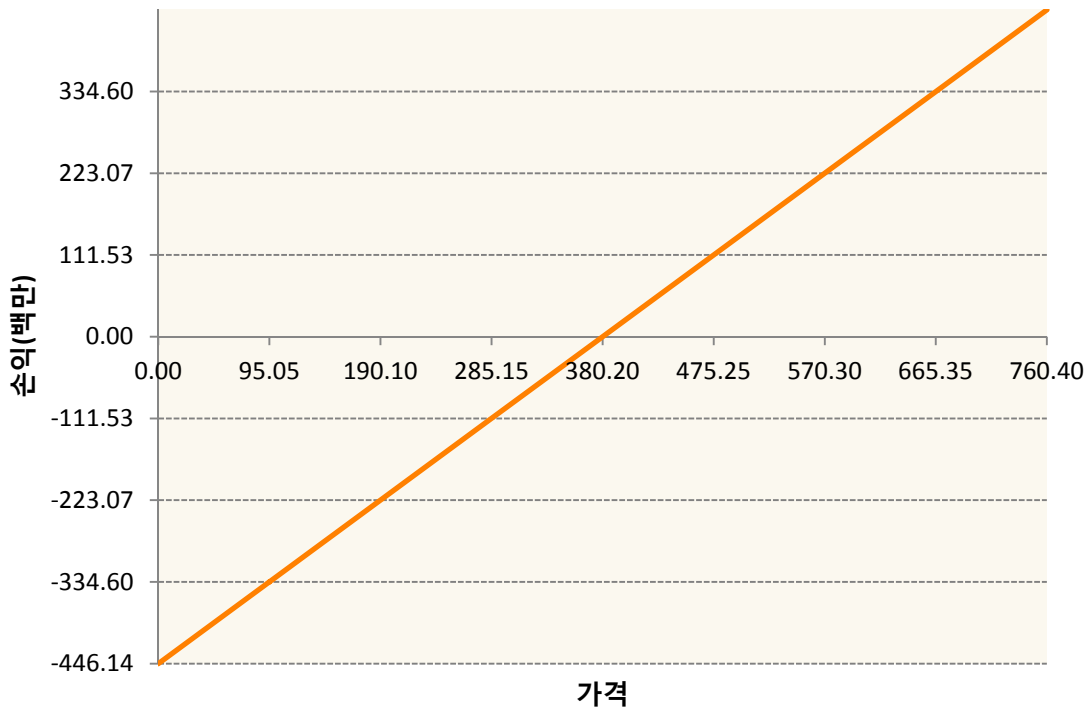
KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18



SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18

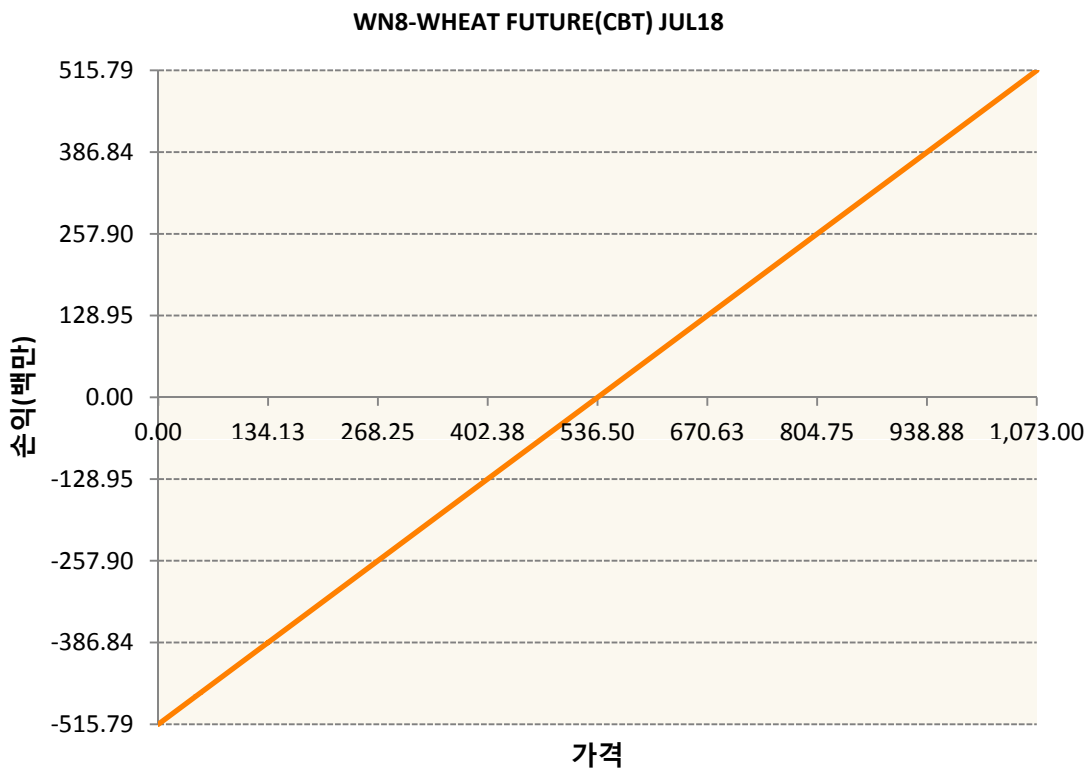
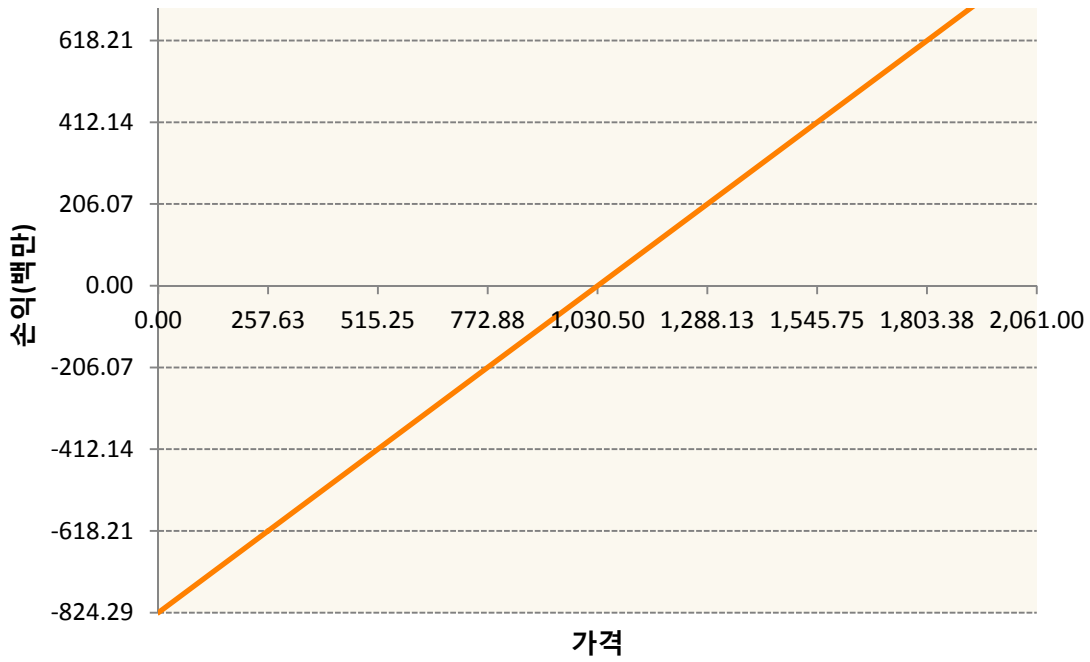


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18



SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON8	SOYBEAN OIL FUTR JUL18	26
CN8	CORN FUTURE JUL18	73
CTN8	COTTON NO.2 FUTR JUL18	20
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	66
WN8	WHEAT FUTURE(CBT) JUL18	41

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

(단위:백만원)

340