

공시일	2018-06-01
기준일	2018-05-31

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	2018-06-01
기준일	2018-05-31

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

1,109

* 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	2018-06-01
기준일	2018-05-31

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

380

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

406

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-06-01
기준일	2018-05-31

유로인덱스모(주식-파생형)

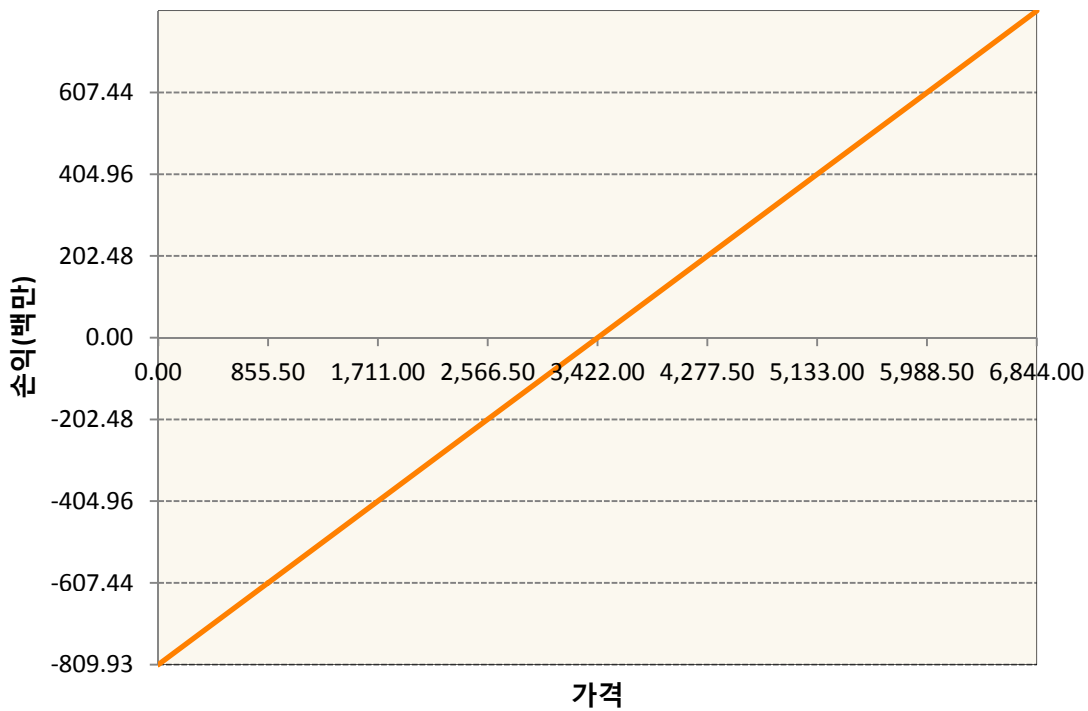
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	810	0	810	

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	2018-06-01
기준일	2018-05-31

차이나인덱스모(주식-파생형)

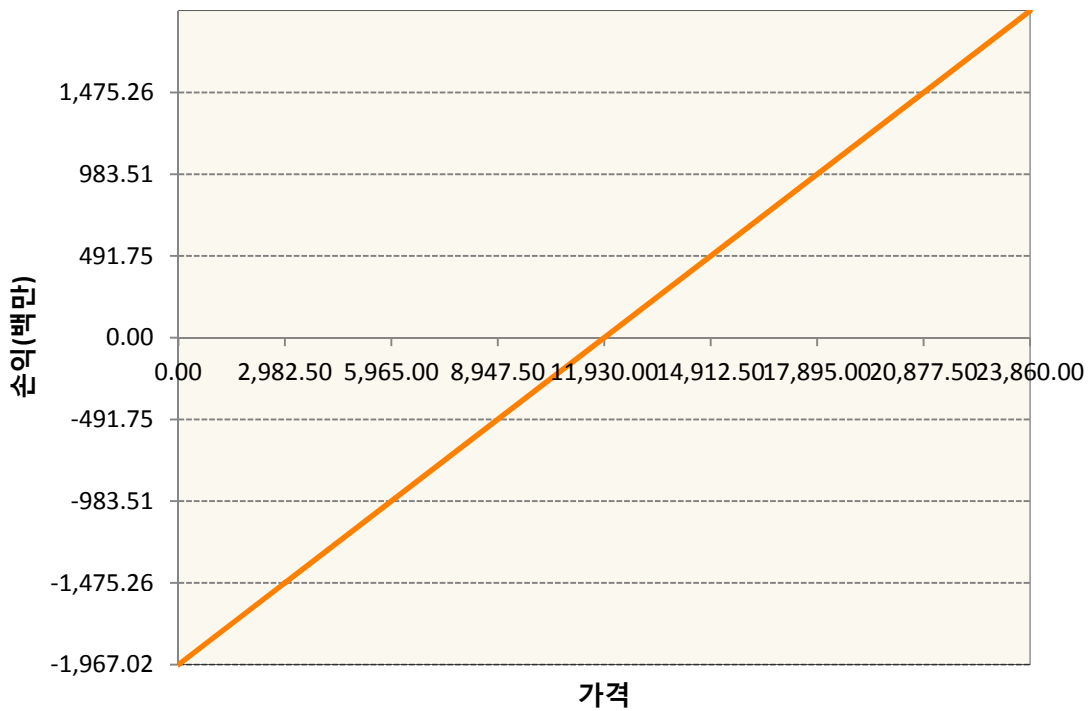
1. 계약금액

(단위:백만원)

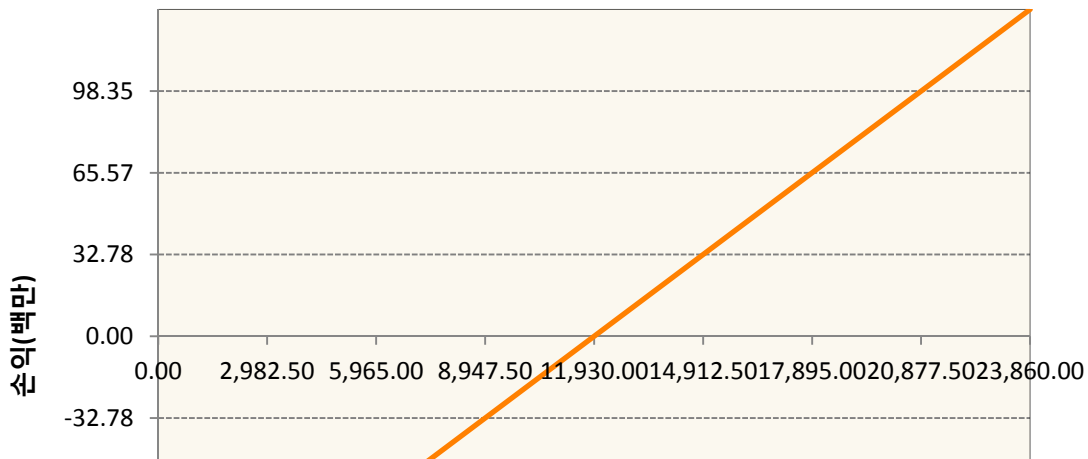
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,098	0	2,098	장내

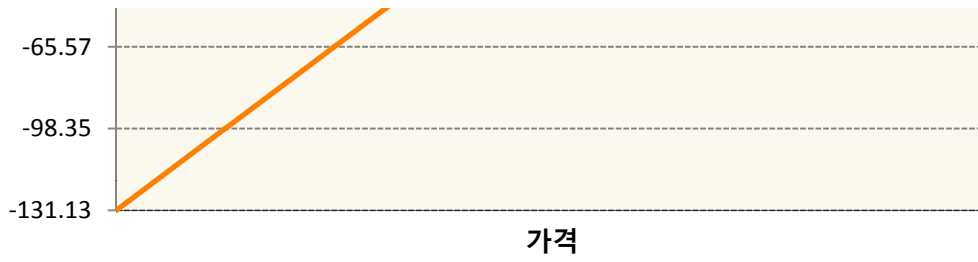
2. 만기시점의 손익구조

HCM8-HSCEI Futures Jun18



MHCM8-MINI H-SHR IDX FU Jun18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCM8	HSCEI Futures Jun18	157
MHCM8	MINI H-SHR IDX FU Jun18	10

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

148

공시일	2018-06-01
기준일	2018-05-31

커버드콜모(주식혼합-파생형)

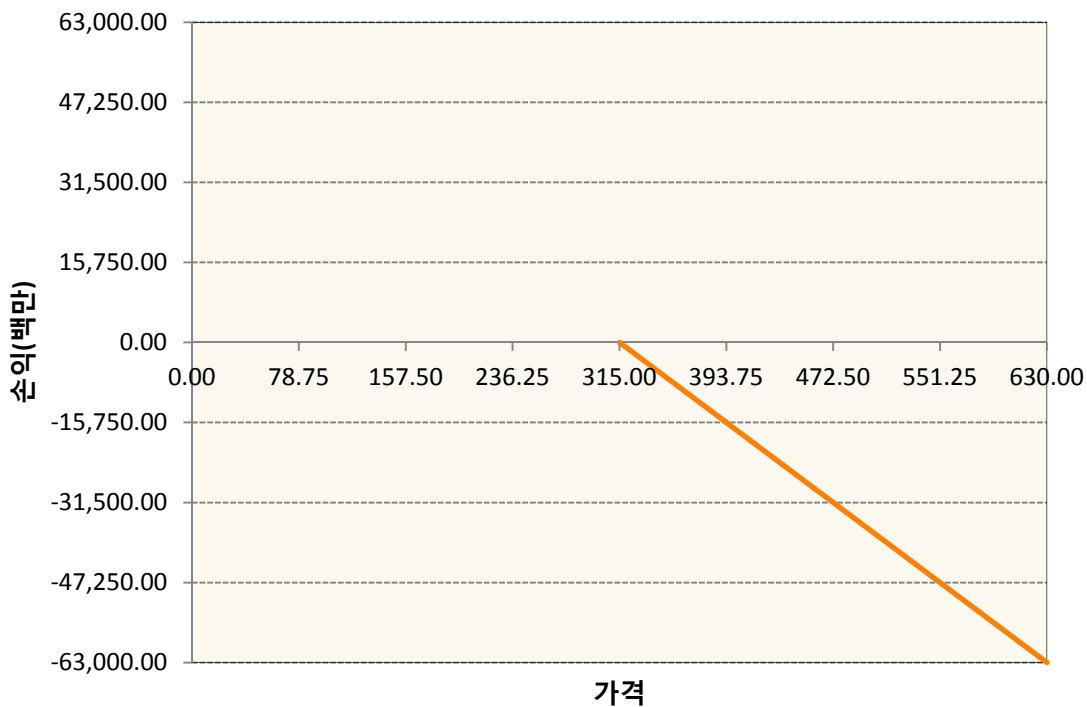
1. 계약금액

(단위:백만원)

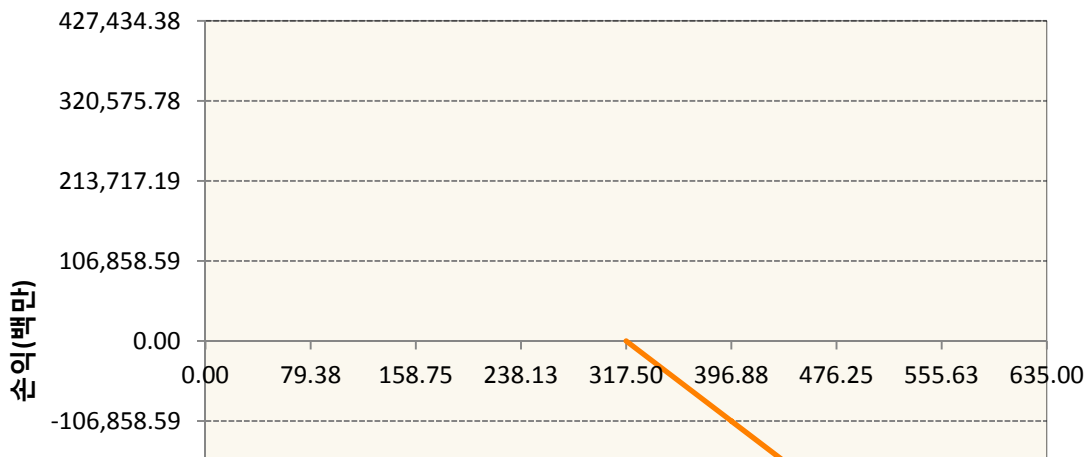
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	798,409	-798,409	장내

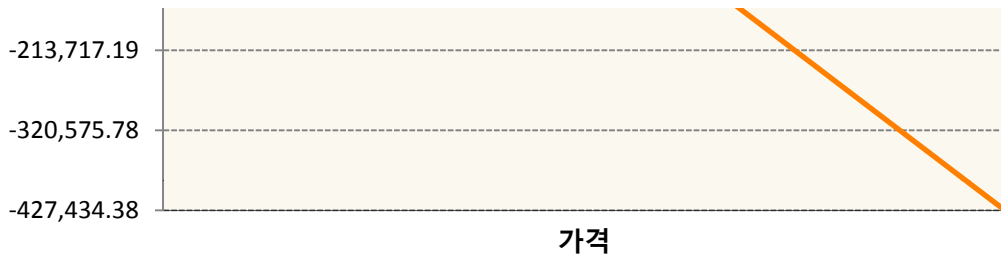
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63159-2018-06 콜315

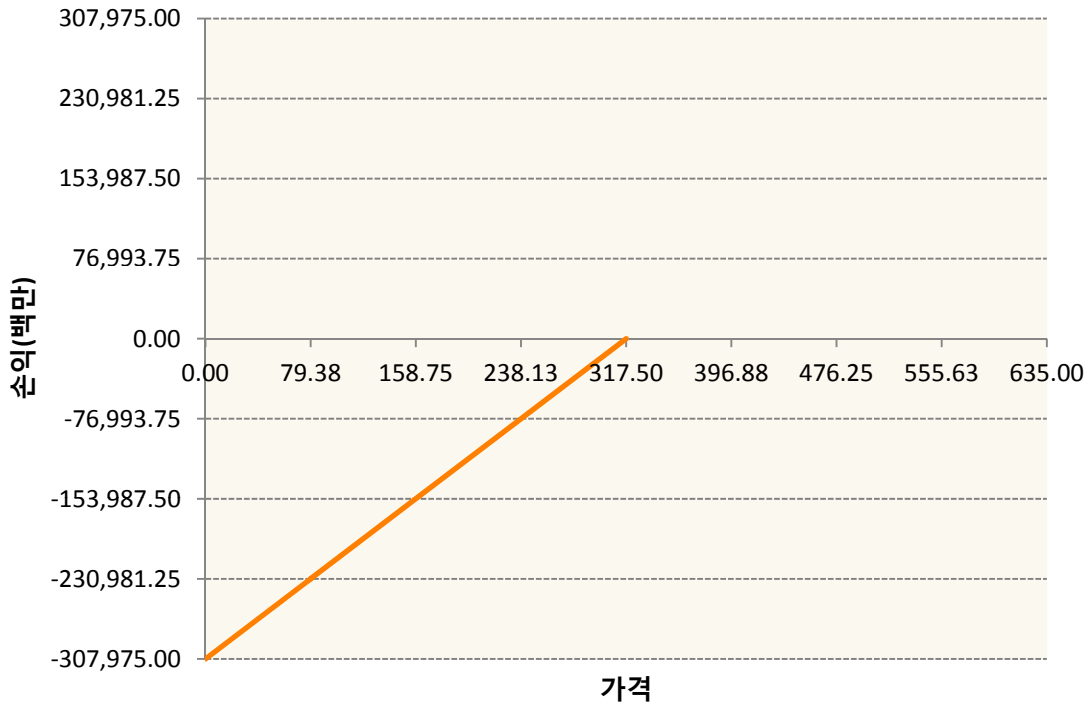


KR4201N63175-2018-06 콜317.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N6312018-06 콜315

3,573

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,028	1,017	1,000	977	948	912	871
-5.33%	978	942	898	846	787	723	653
-2.67%	797	720	637	549	457	362	265
0%	340	227	114	0	-114	-229	-345
2.67%	-505	-619	-734	-849	-965	-1,081	-1,198
5.33%	-1,724	-1,806	-1,894	-1,987	-2,084	-2,184	-2,286
8.00%	-3,196	-3,240	-3,293	-3,353	-3,421	-3,494	-3,573

KR4201N6312018-06 풋317.5

22,634

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,700	5,650	5,568	5,450	5,292	5,095	4,859

-5.33%	5,483	5,300	5,062	4,773	4,437	4,058	3,642
-2.67%	4,605	4,165	3,678	3,150	2,589	2,002	1,391
0%	2,171	1,460	736	0	-744	-1,495	-2,251
2.67%	-2,702	-3,500	-4,299	-5,098	-5,898	-6,699	-7,500
5.33%	-10,197	-10,836	-11,505	-12,195	-12,903	-13,625	-14,359
8.00%	-19,674	-20,050	-20,483	-20,965	-21,488	-22,046	-22,634
KR4301N6312018-06 풋317.5							22,917
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,912	-22,912	-22,912	-22,912	-22,913	-22,914	-22,917
-5.33%	-14,875	-14,877	-14,880	-14,886	-14,898	-14,917	-14,944
-2.67%	-6,868	-6,900	-6,947	-7,011	-7,091	-7,188	-7,299
0%	617	425	219	0	-229	-466	-709
2.67%	5,664	5,376	5,087	4,797	4,506	4,214	3,922
5.33%	7,349	7,230	7,090	6,930	6,755	6,565	6,364
8.00%	7,568	7,553	7,528	7,489	7,435	7,367	7,284

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

(단위:백만원)

52,033

공시일	2018-06-01
기준일	2018-05-31

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

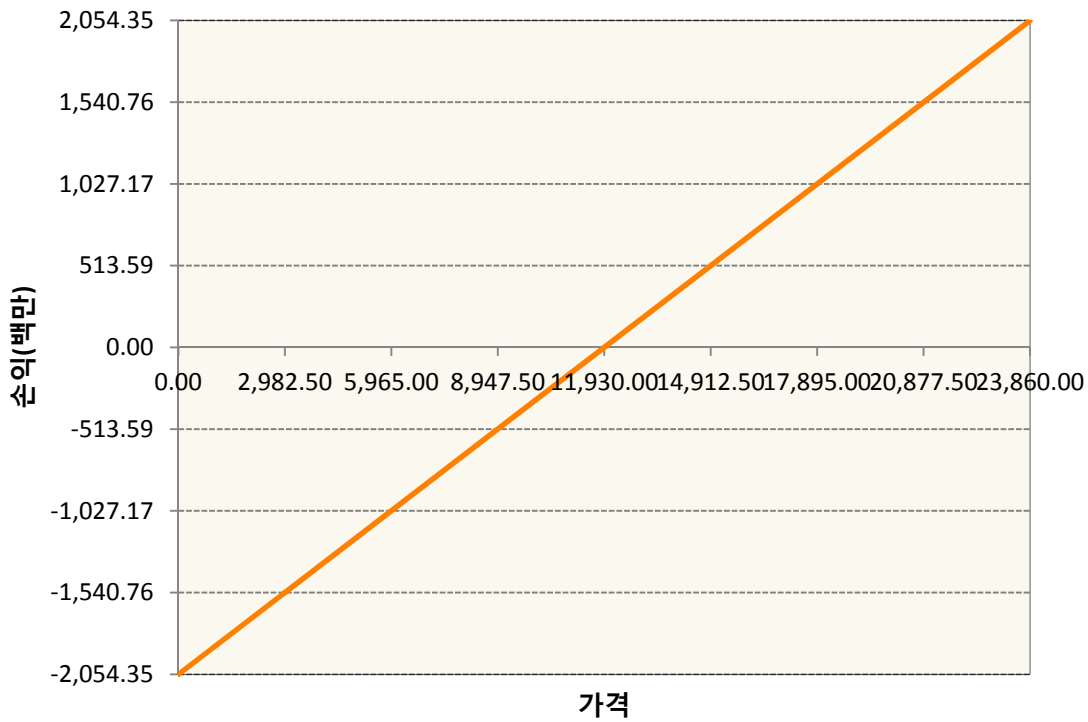
1. 계약금액

(단위:백만원)

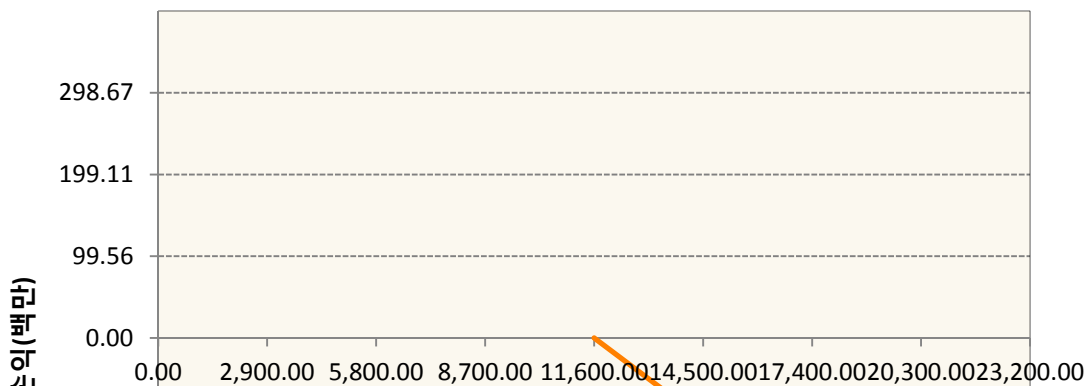
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,054	0	2,054	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,334	-5,334	장내

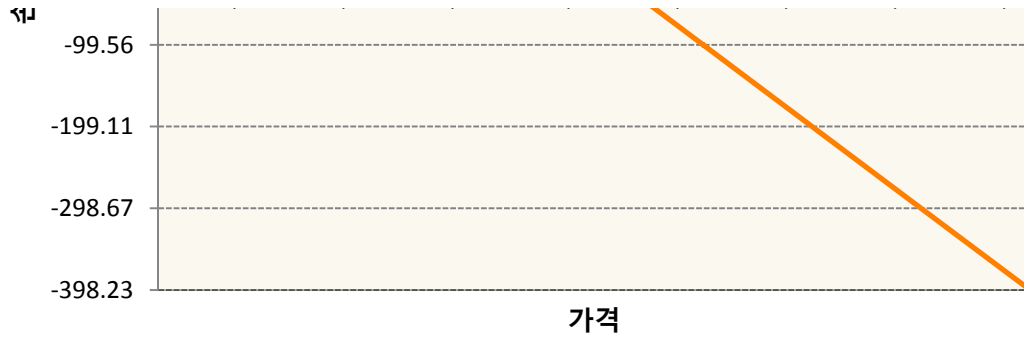
2. 만기시점의 손익구조

HCM8-HSCEI Futures Jun18

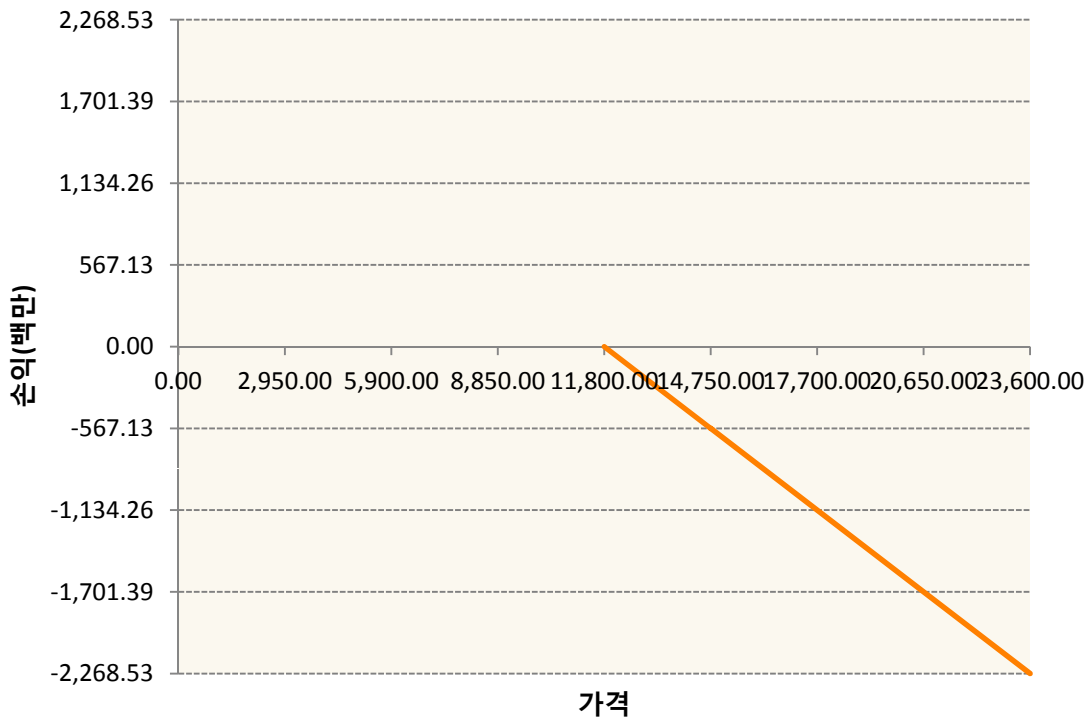


OHHIM8-C116-HSCEI 06/28/18 C11600 Hong Kong Stock Ex

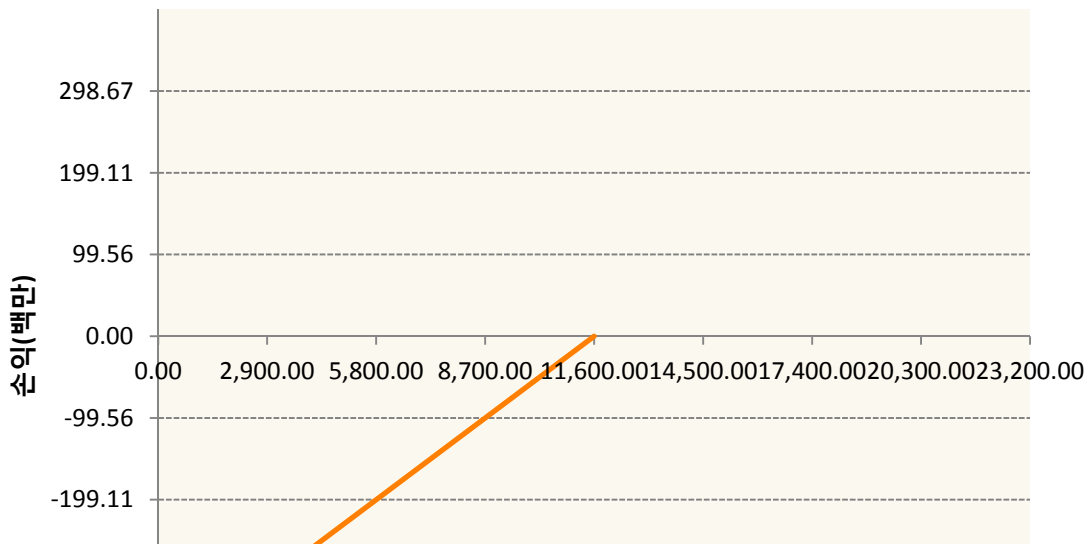


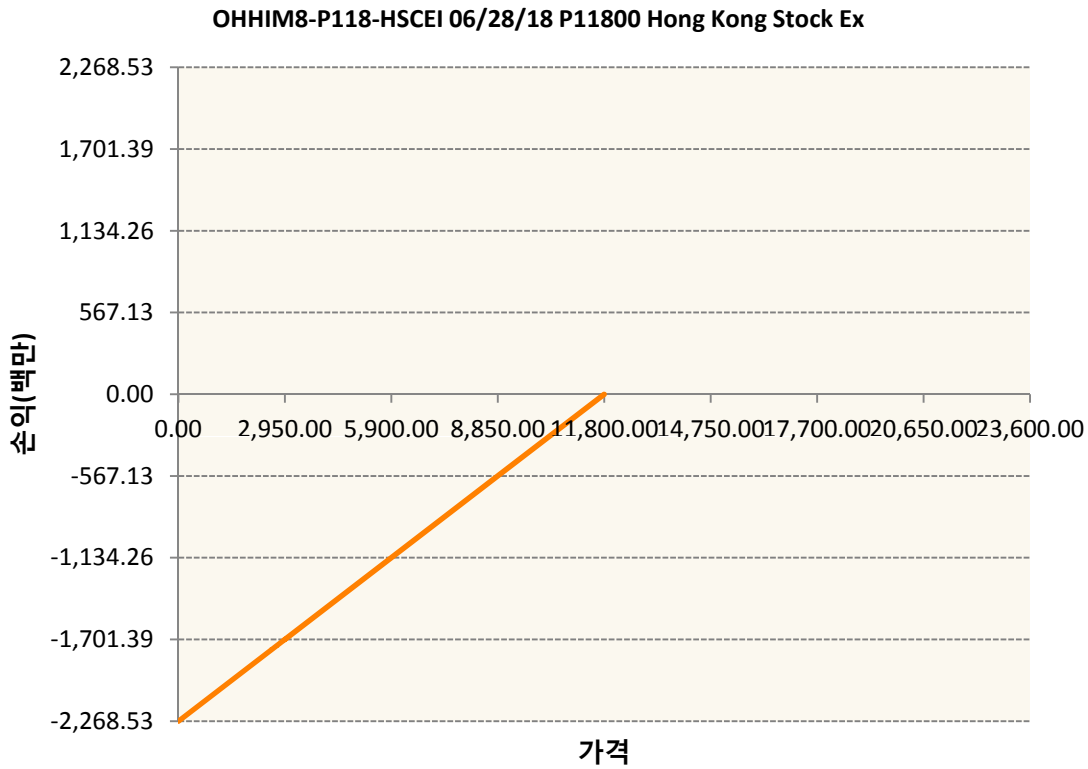
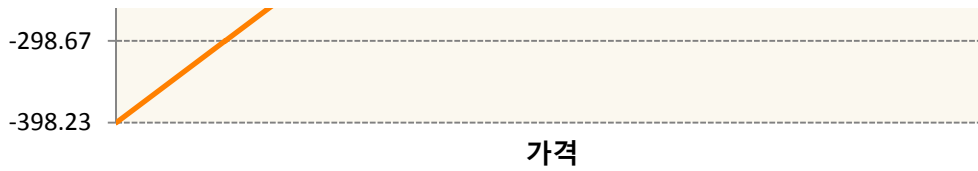


OHHIM8-C118-HSCEI 06/28/18 C11800 Hong Kong Stock Ex



OHHIM8-P116-HSCEI 06/28/18 P11600 Hong Kong Stock Ex





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCM8	HSCEI Futures Jun18	164
OHHIM8-C1	HSCEI 06/28/18 C11600 Hong Kong Stock Ex	32
OHHIM8-C1	HSCEI 06/28/18 C11800 Hong Kong Stock Ex	181
OHHIM8-P1	HSCEI 06/28/18 P11600 Hong Kong Stock Ex	32
OHHIM8-P1	HSCEI 06/28/18 P11800 Hong Kong Stock Ex	181

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	523

공시일	2018-06-01
기준일	2018-05-31

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

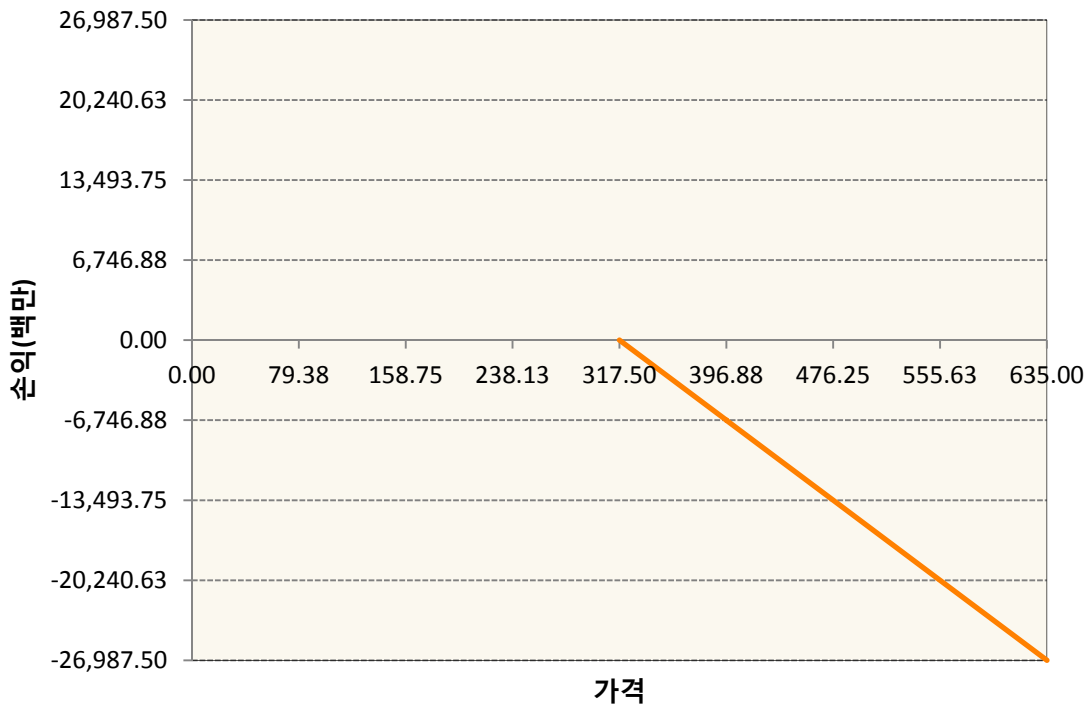
1. 계약금액

(단위:백만원)

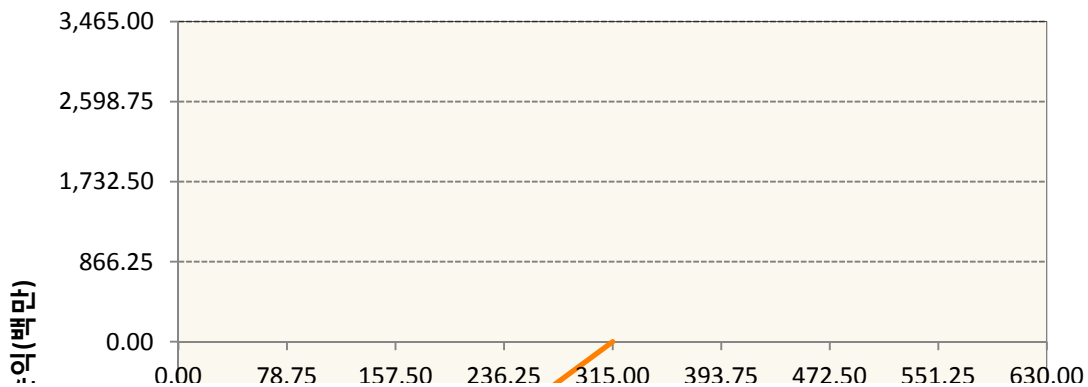
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	46,804	-46,804	장내

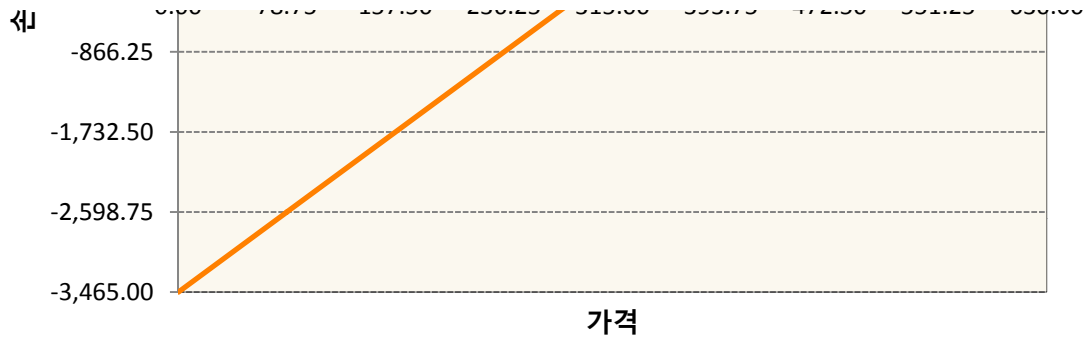
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63175-2018-06 콜317.5

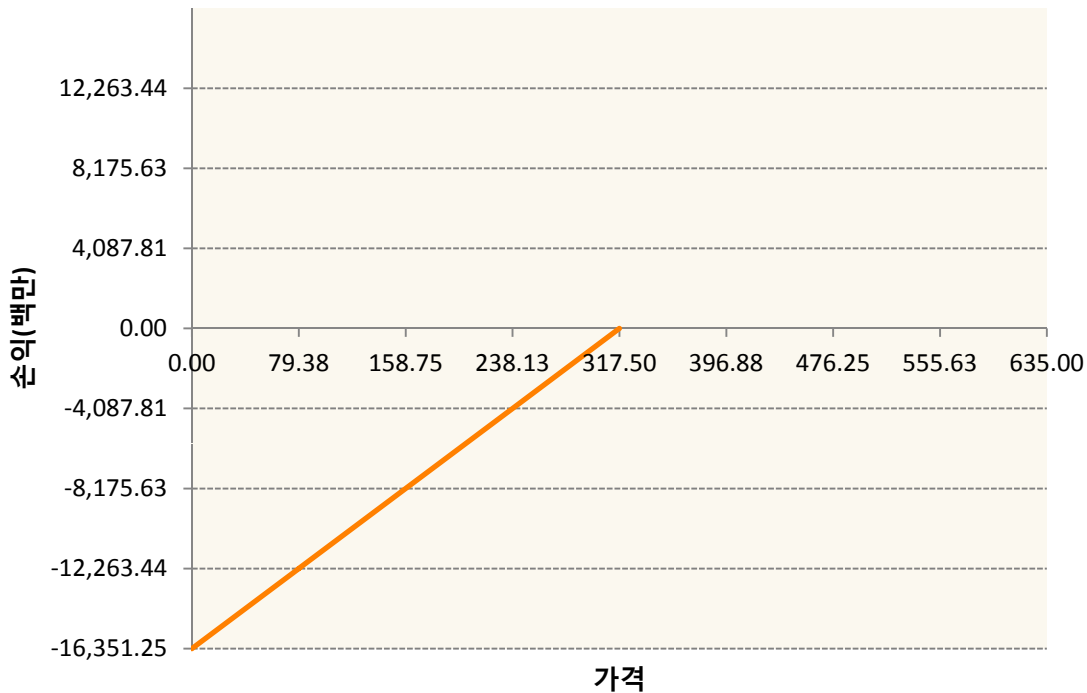


KR4301N63157-2018-06 풋315





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_2							1,480
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,480	-1,480	-1,480	-1,480	-1,480	-1,480	-1,480
-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%	1,480	1,480	1,480	1,480	1,480	1,480	1,480
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%	427	427	427	427	427	427	427
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 1,429

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	360	357	352	344	334	322	307
-5.33%	346	335	320	301	280	256	230
-2.67%	291	263	232	199	163	126	88
0%	137	92	46	0	-47	-94	-142
2.67%	-171	-221	-271	-322	-372	-423	-474
5.33%	-644	-684	-726	-770	-815	-860	-907
8.00%	-1,242	-1,266	-1,293	-1,324	-1,357	-1,392	-1,429

KR4301N6312018-06 풋315 252

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252
-5.33%	-161	-161	-161	-161	-162	-162	-163
-2.67%	-71	-72	-73	-74	-75	-77	-78
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	54	51	48	45	42	39	36
5.33%	65	64	63	62	60	59	57
8.00%	66	66	66	66	65	65	64

KR4301N6312018-06 풋317.5 1,217

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,216	-1,216	-1,216	-1,216	-1,216	-1,217	-1,217
-5.33%	-790	-790	-790	-790	-791	-792	-793
-2.67%	-365	-366	-369	-372	-376	-382	-388
0%	33	23	12	0	-12	-25	-38
2.67%	301	285	270	255	239	224	208
5.33%	390	384	376	368	359	349	338
8.00%	402	401	400	398	395	391	387

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

(단위:백만원)

6,947

공시일	2018-06-01
기준일	2018-05-31

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

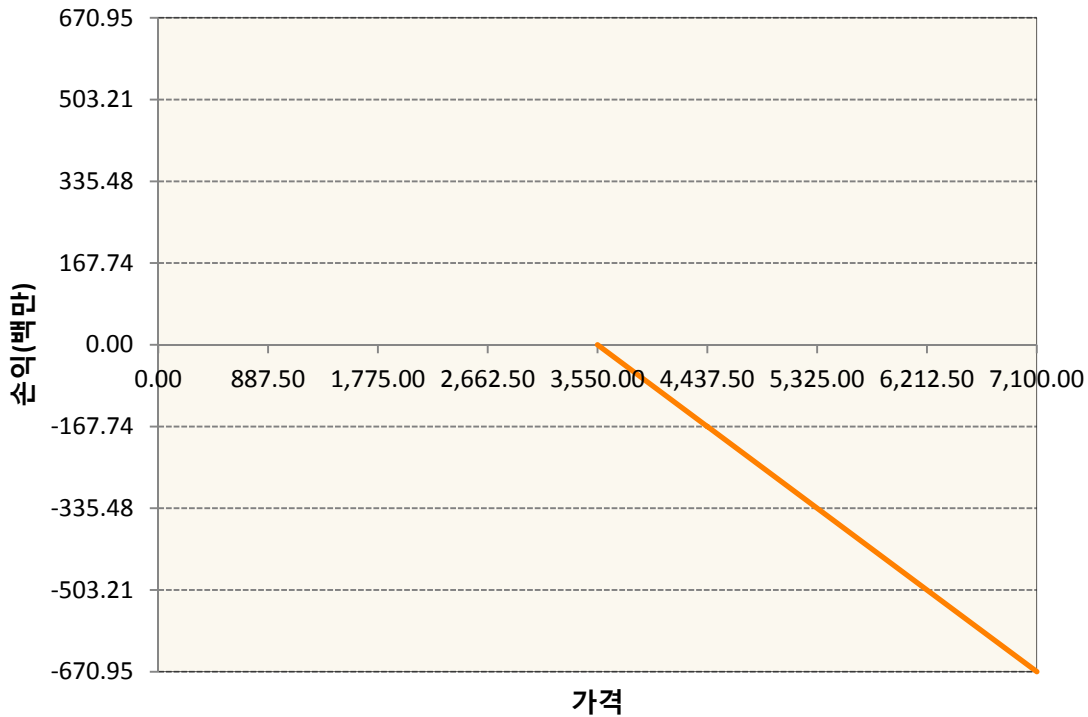
1. 계약금액

(단위:백만원)

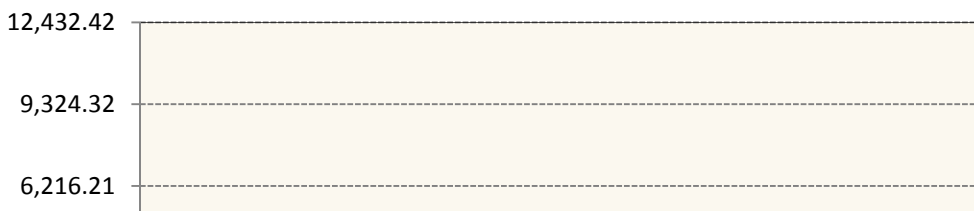
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,885	0	4,885	
누계	유가증권	스왑	53,123	0	53,123	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,207	-26,207	장내
누계	지수	스왑	50,400	0	50,400	장외

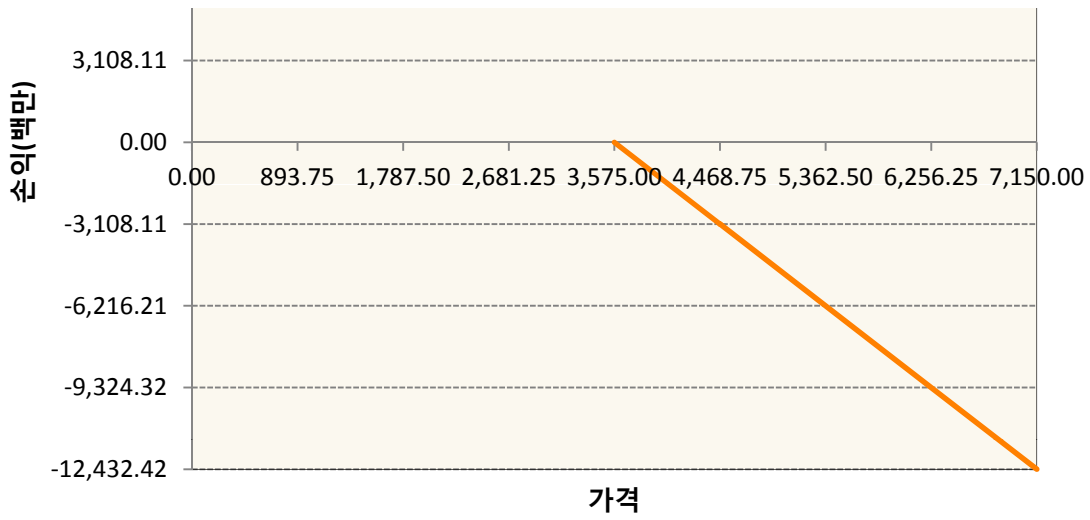
2. 만기시점의 손익구조

OESXM8-C3550-EURO STOXX 50

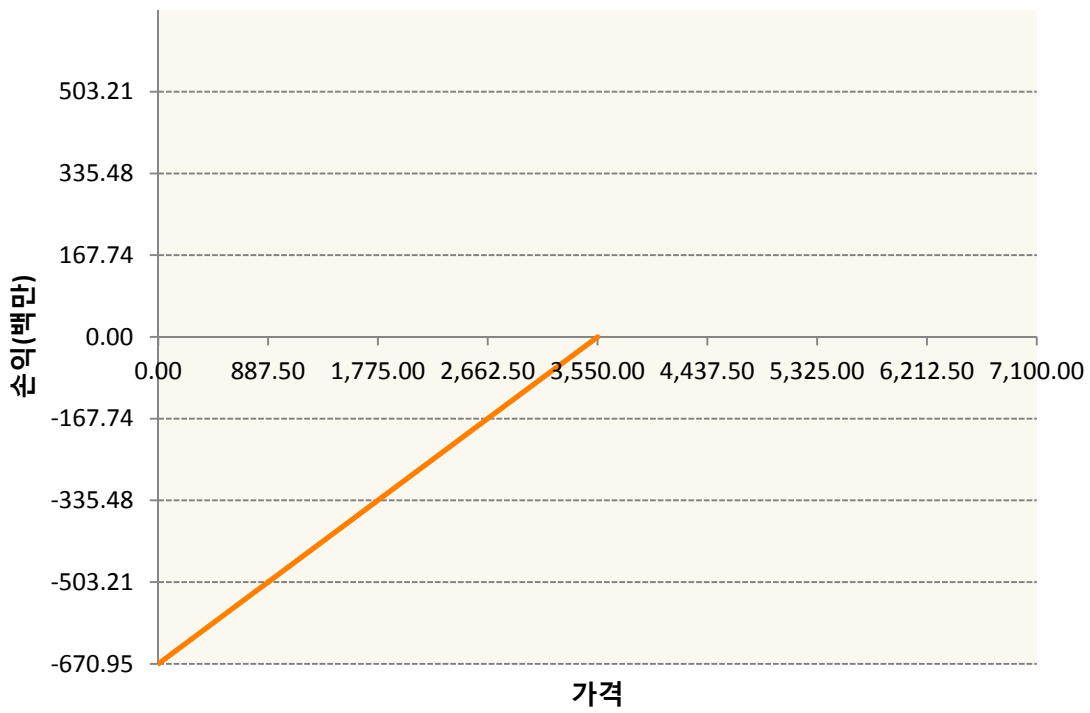


OESXM8-C3575-EURO STOXX 50



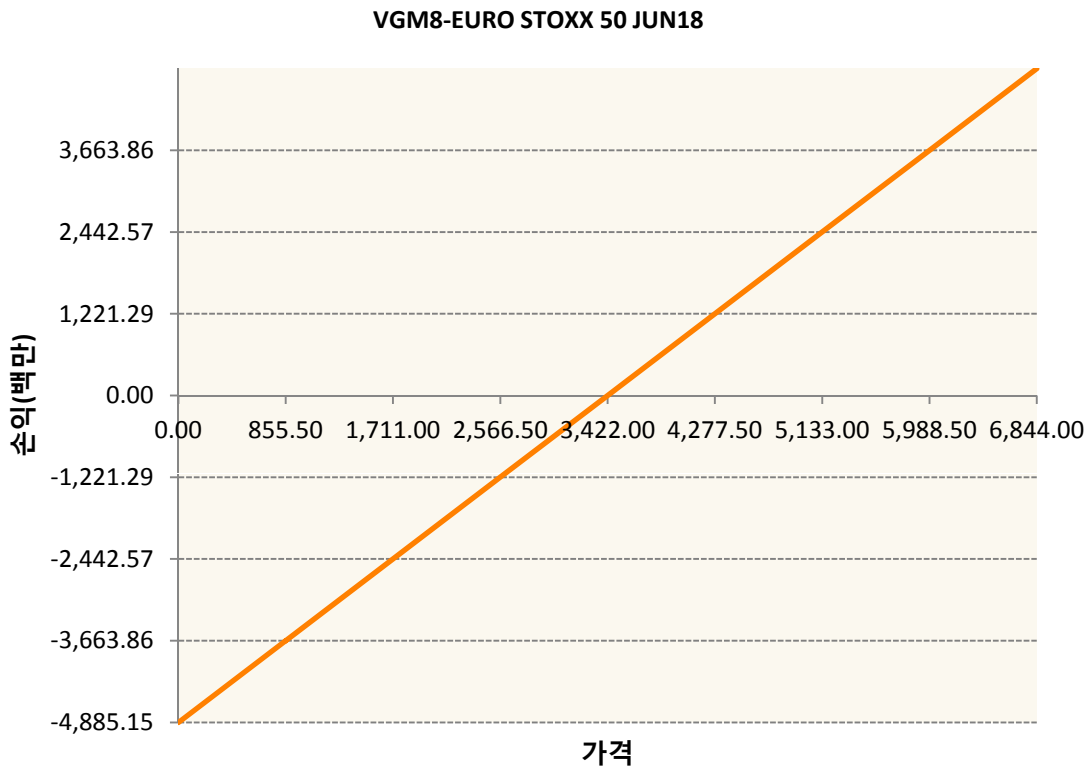
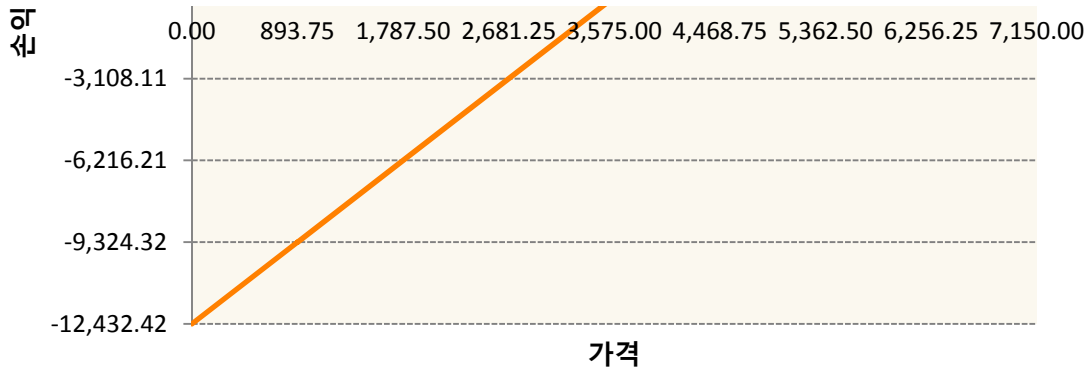


OESXM8-P3550-EURO STOXX 50



OESXM8-P3575-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		62
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		66
OESXM8-C3 EURO STOXX 50		54
OESXM8-C3 EURO STOXX 50		995
OESXM8-P3! EURO STOXX 50		54
OESXM8-P3! EURO STOXX 50		995
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18		391

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)

219

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

(단위:백만원)

41

공시일	2018-06-01
기준일	2018-05-31

리디파인K200(주식혼합-파생재간

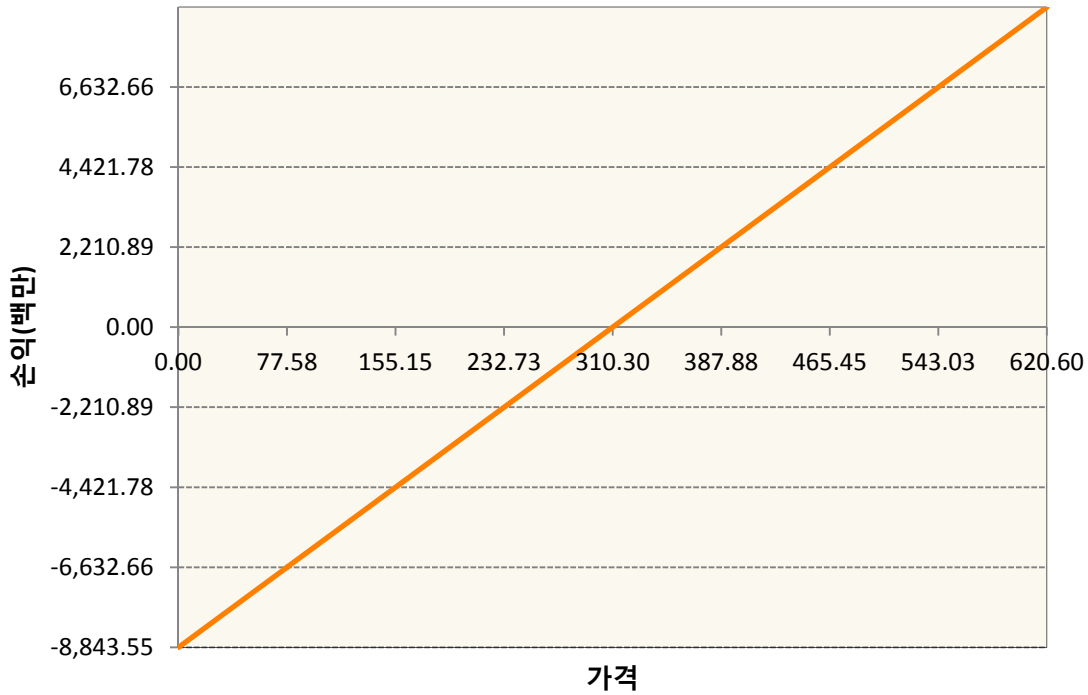
1. 계약금액

(단위:백만원)

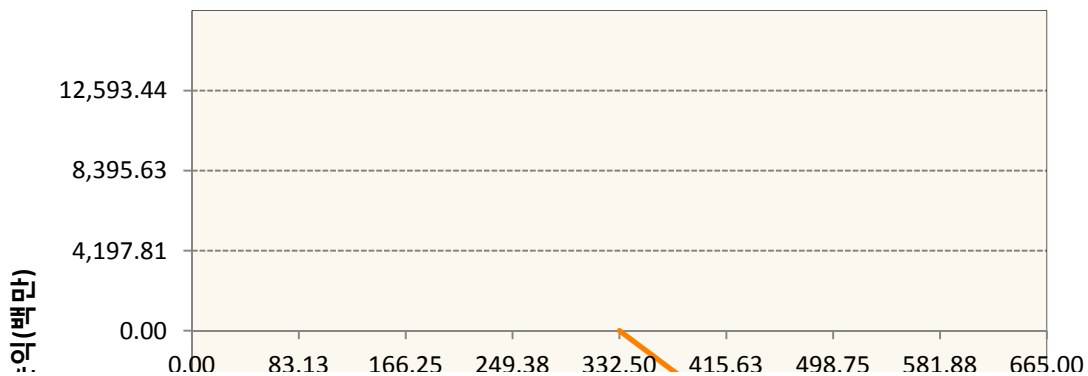
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	776	0	776	장내
신규	유가증권	옵션	77	1,247	-1,170	장내
누계	유가증권	선물	8,844	0	8,844	장내
누계	유가증권	옵션	1,826	16,791	-14,966	장내

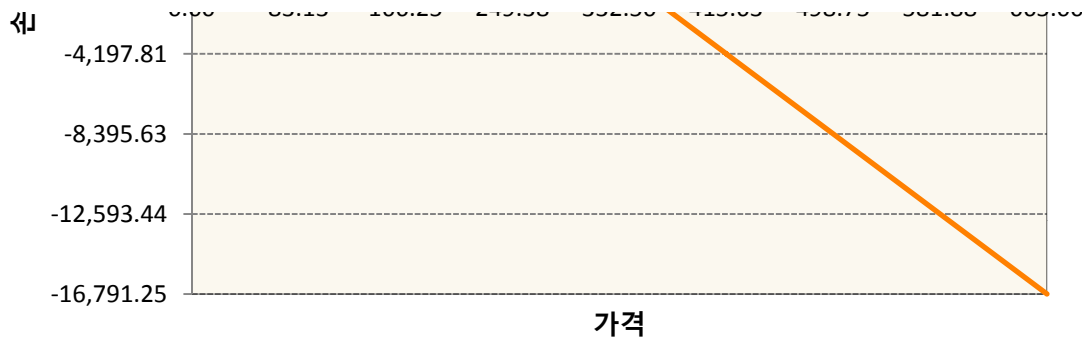
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

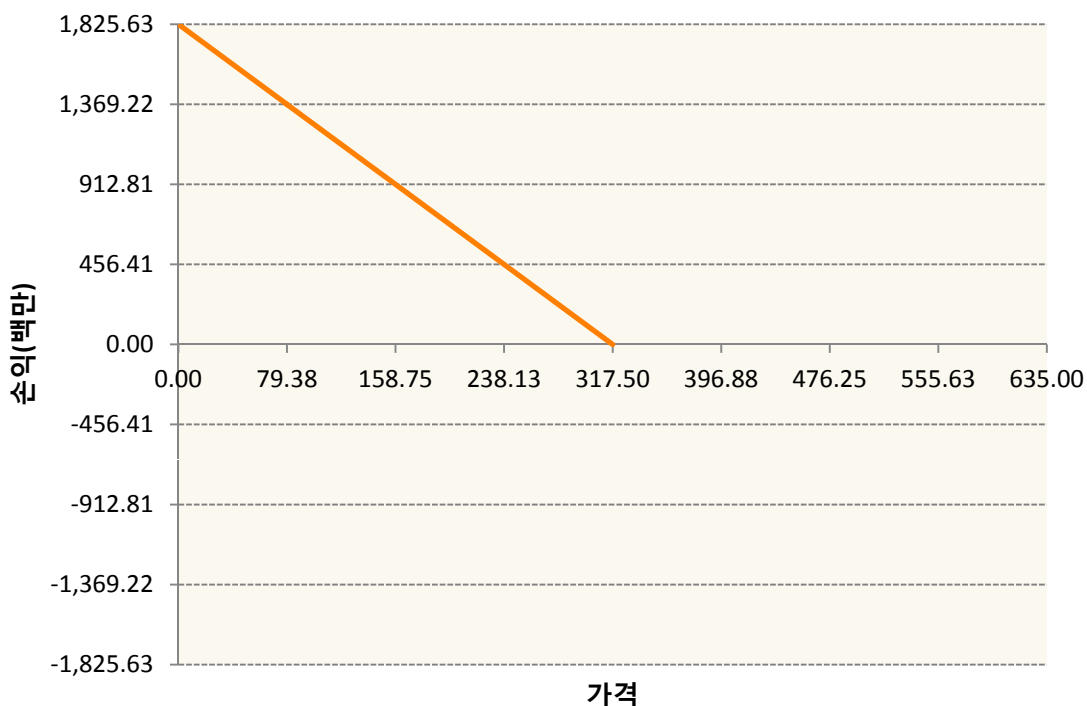


KR4201N63324-2018-06 콜332.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물							709
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-709	-709	-709	-709	-709	-709	-709
-5.33%	-473	-473	-473	-473	-473	-473	-473
-2.67%	-236	-236	-236	-236	-236	-236	-236
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	236	236	236	236	236	236	236
5.33%	473	473	473	473	473	473	473
8.00%	709	709	709	709	709	709	709
KR4201N63E 2018-06 콜332.5							510
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	53	52	52	52	50	49	46
-5.33%	52	51	50	48	44	40	34
-2.67%	49	46	41	35	26	16	5
0%	36	26	14	0	-16	-33	-52
2.67%	-10	-30	-52	-75	-99	-124	-150
5.33%	-120	-150	-180	-210	-240	-270	-301
8.00%	-323	-354	-385	-416	-447	-478	-510

KR4301N6312018-06 풋317.5

136

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	136	136	136	136	136	136	136
-5.33%	88	88	88	88	88	88	89
-2.67%	41	41	41	42	42	43	43
0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-34	-32	-30	-28	-27	-25	-23
5.33%	-44	-43	-42	-41	-40	-39	-38
8.00%	-45	-45	-45	-44	-44	-44	-43

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

(단위:백만원)

971

공시일	2018-06-01
기준일	2018-05-31

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

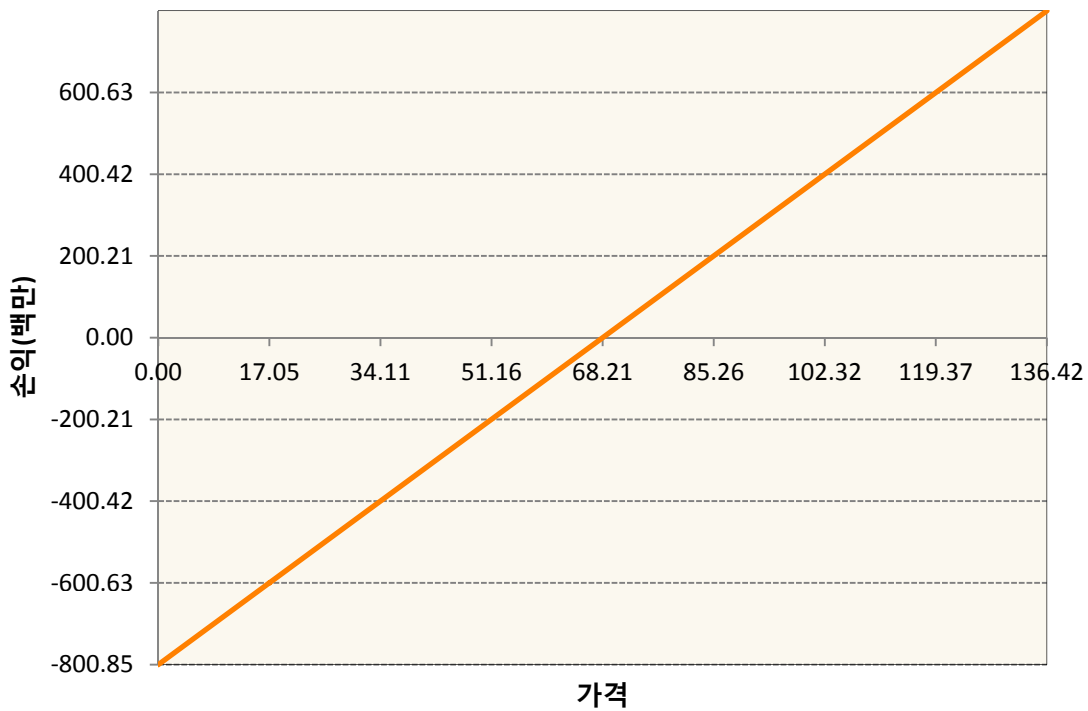
1. 계약금액

(단위:백만원)

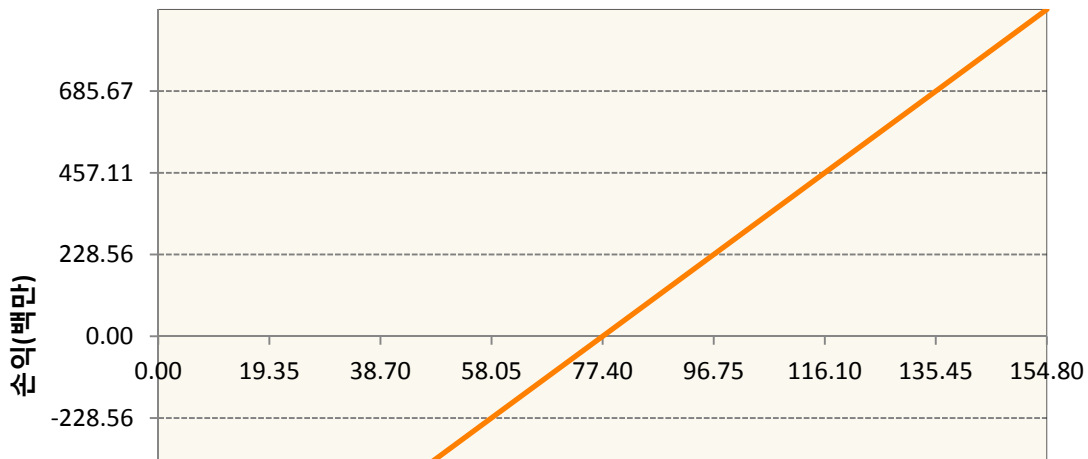
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,876	592	3,284	

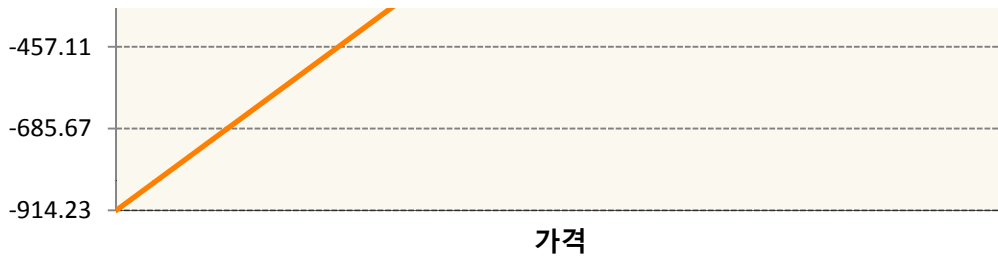
2. 만기시점의 손익구조

CLN8-WTI CRUDE FUTURE JUL18

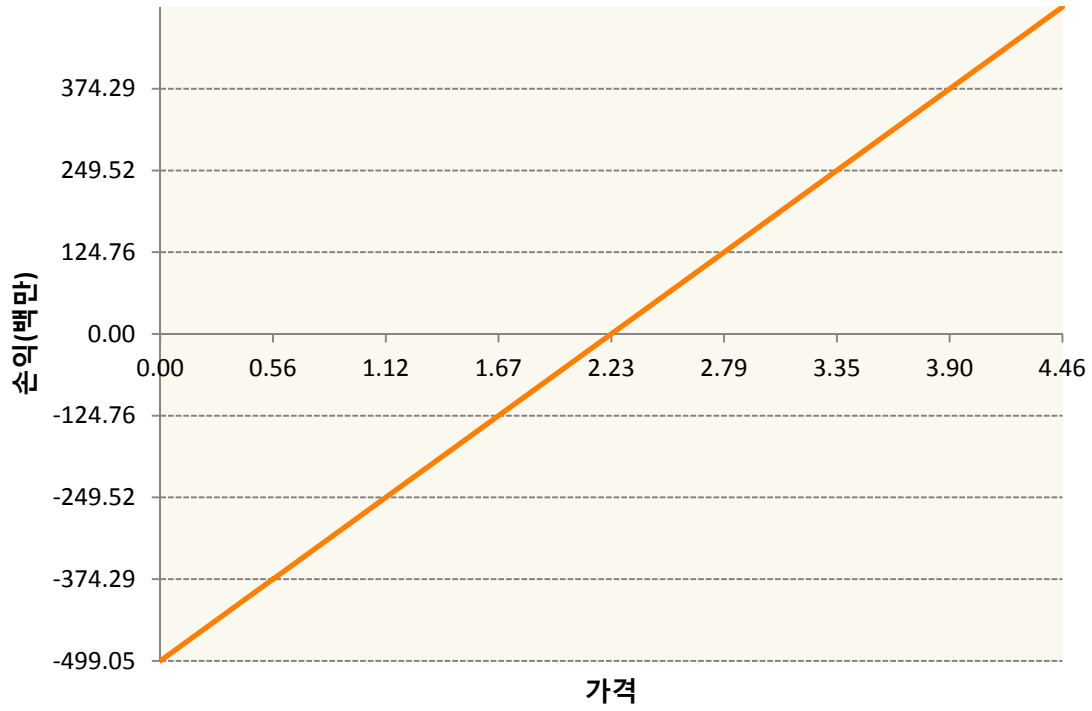


COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18

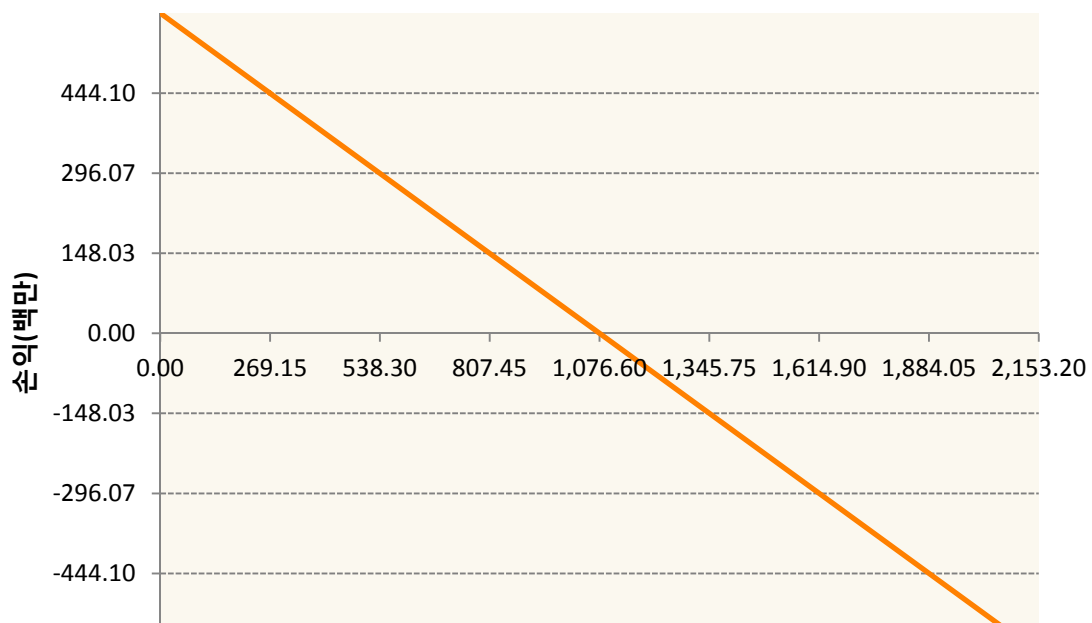


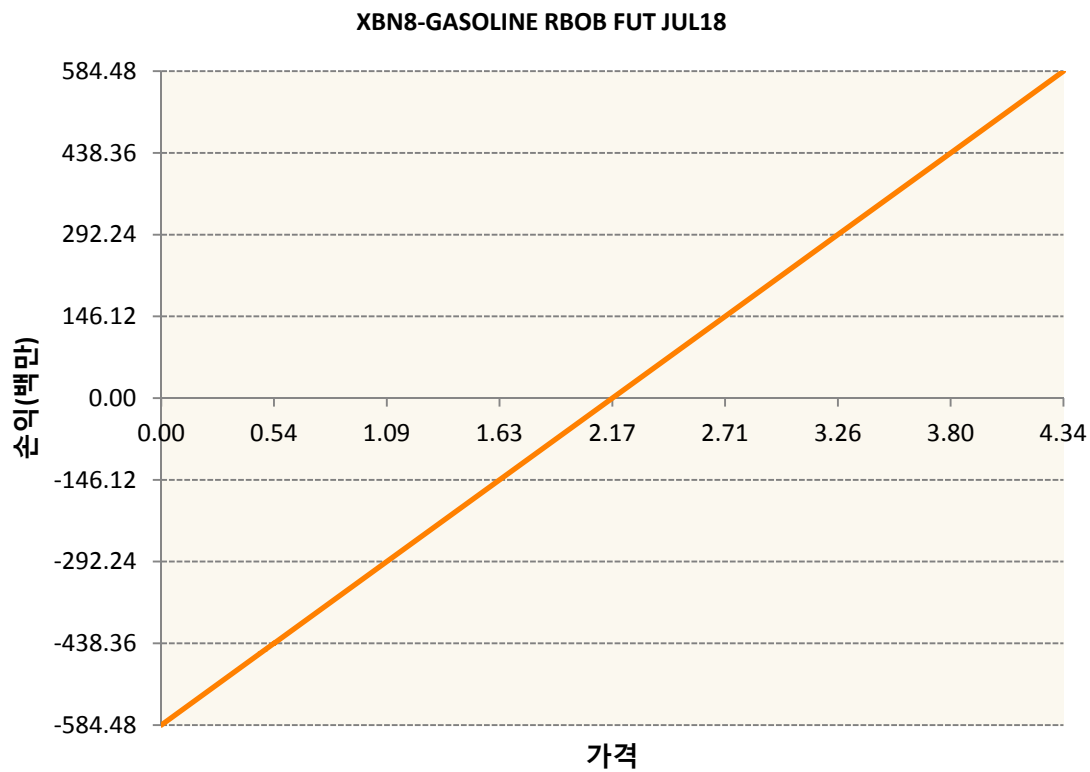
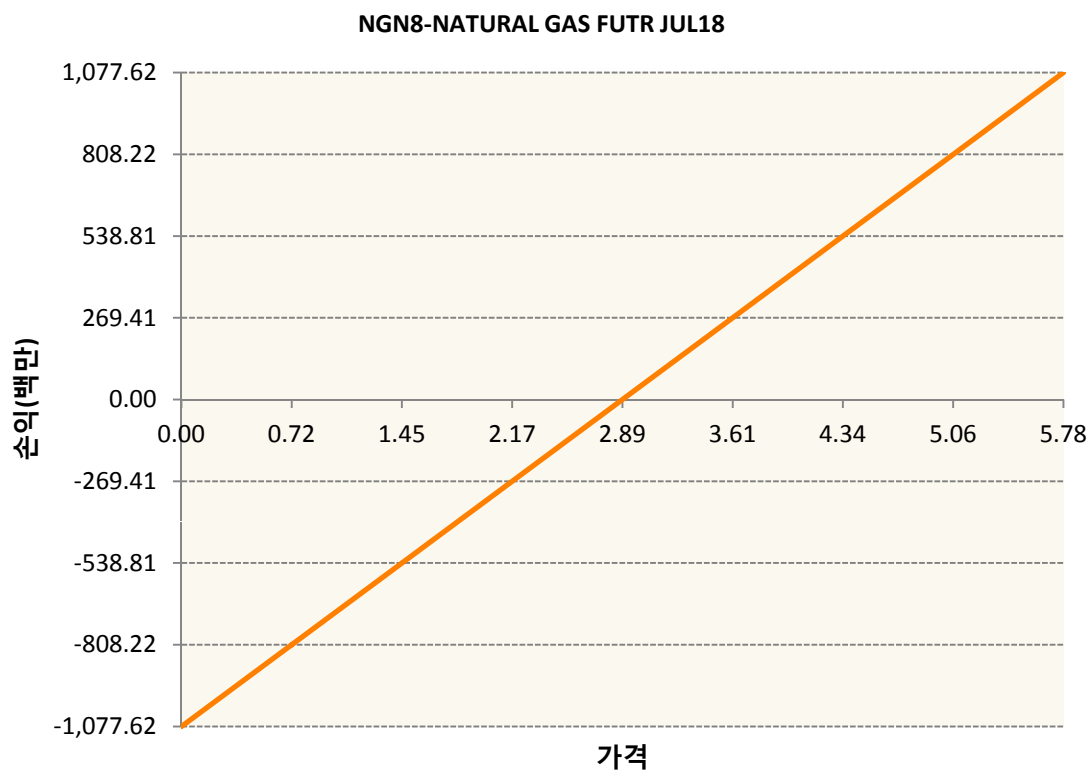
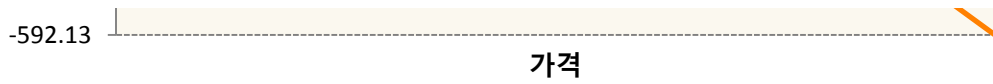


HON8-NY Harb ULSD Fut JUL18



KR4175N60003-2018-06 달러선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN8	WTI CRUDE FUTURE JUL18	64
COU8	BRENT CRUDE FUTR SEP18	73
HON8	NY Harb ULSD Fut JUL18	40
KR4175N60C	2018-06 달러선물	47
NGN8	NATURAL GAS FUTR JUL18	86
XBN8	GASOLINE RBOB FUT JUL18	47

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

468

공시일	2018-06-01
기준일	2018-05-31

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

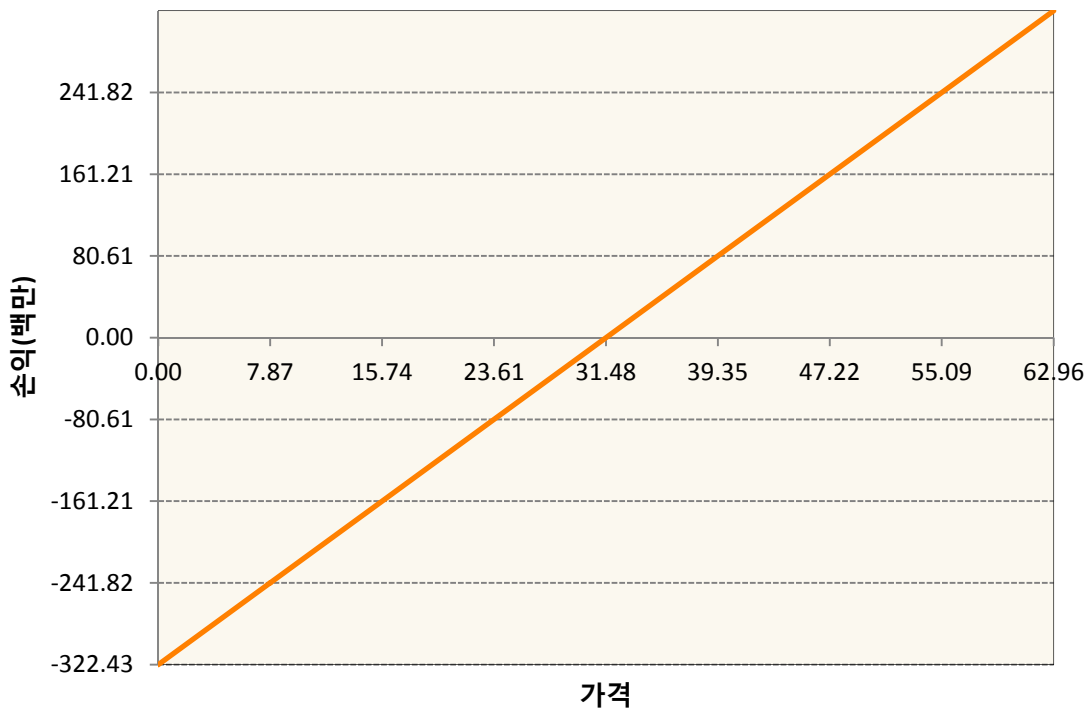
1. 계약금액

(단위:백만원)

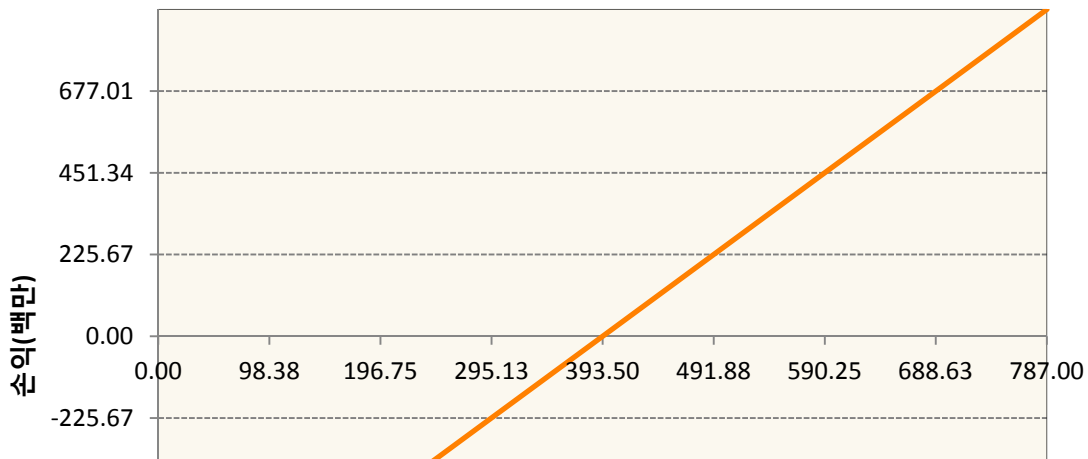
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,135	323	3,812	

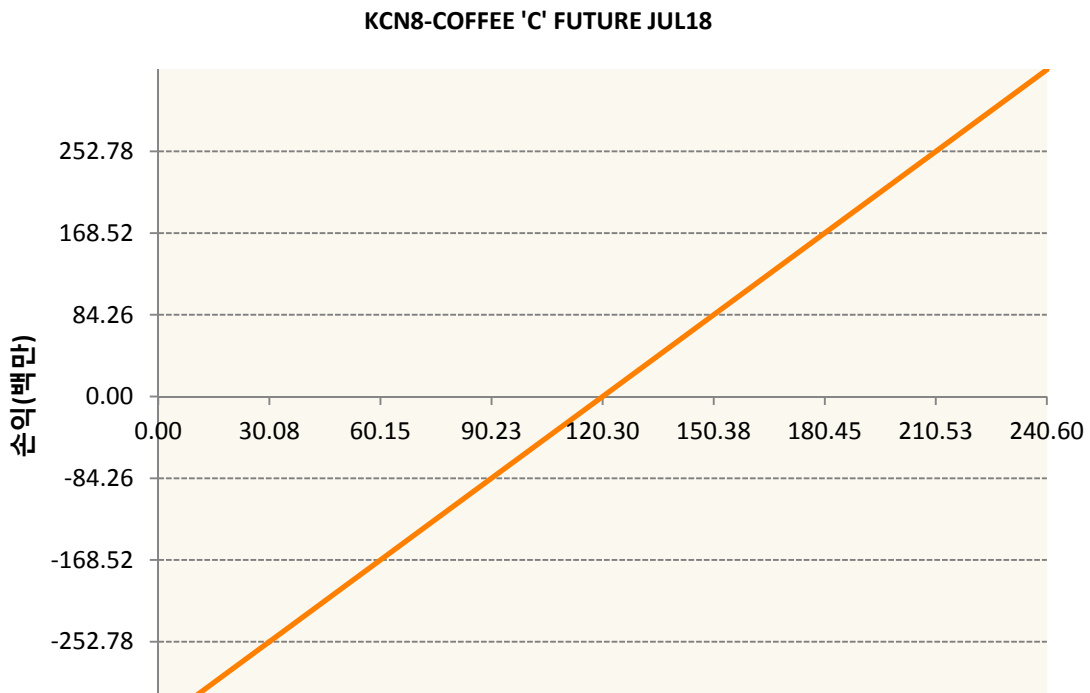
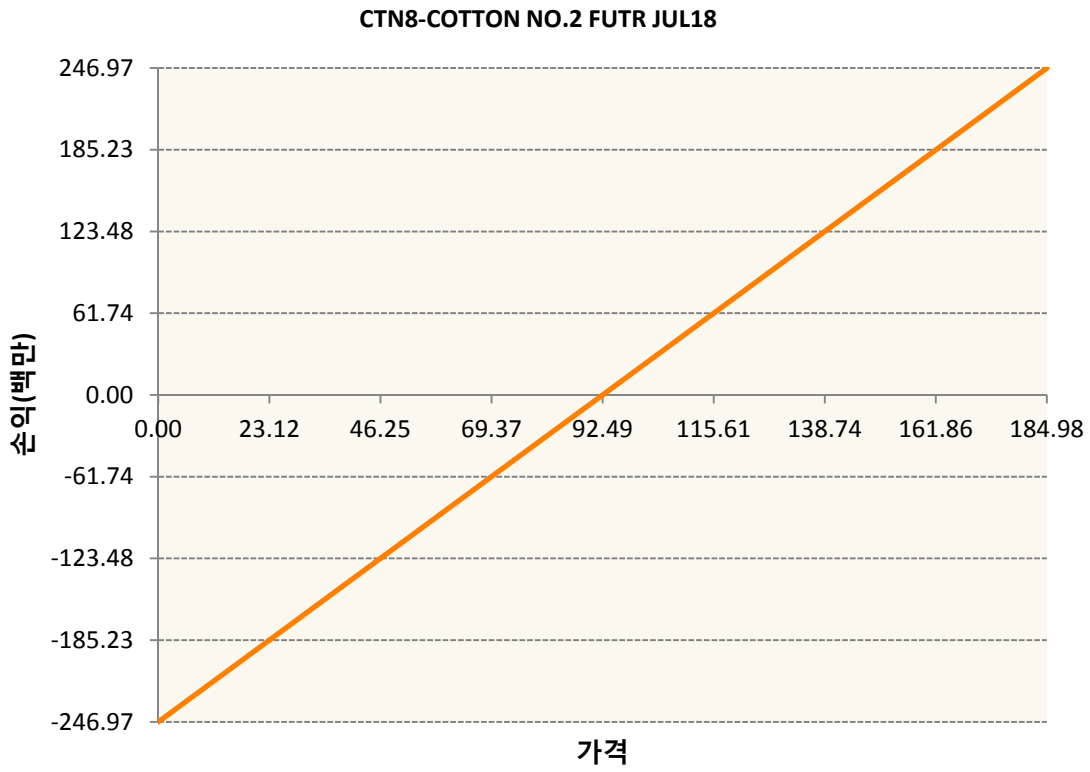
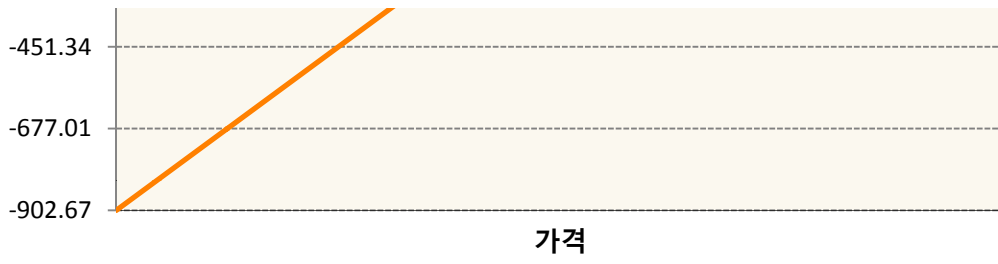
2. 만기시점의 손익구조

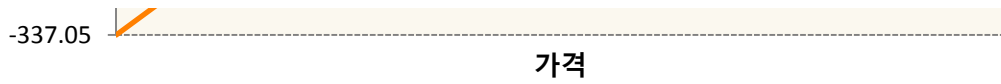
BON8-SOYBEAN OIL FUTR JUL18



CN8-CORN FUTURE JUL18

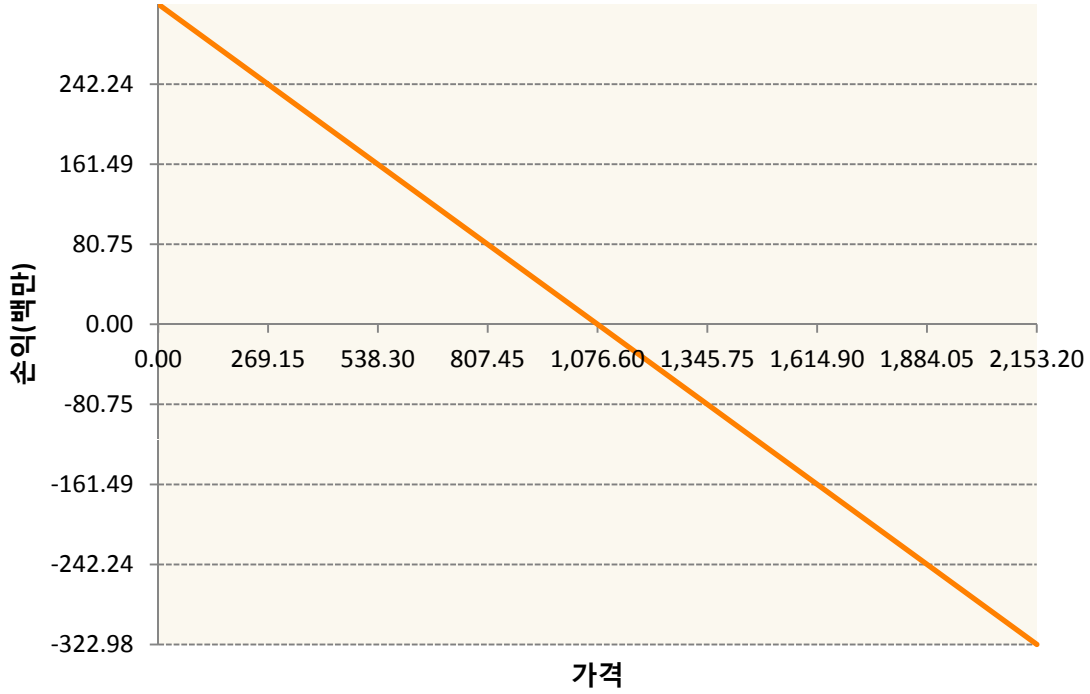






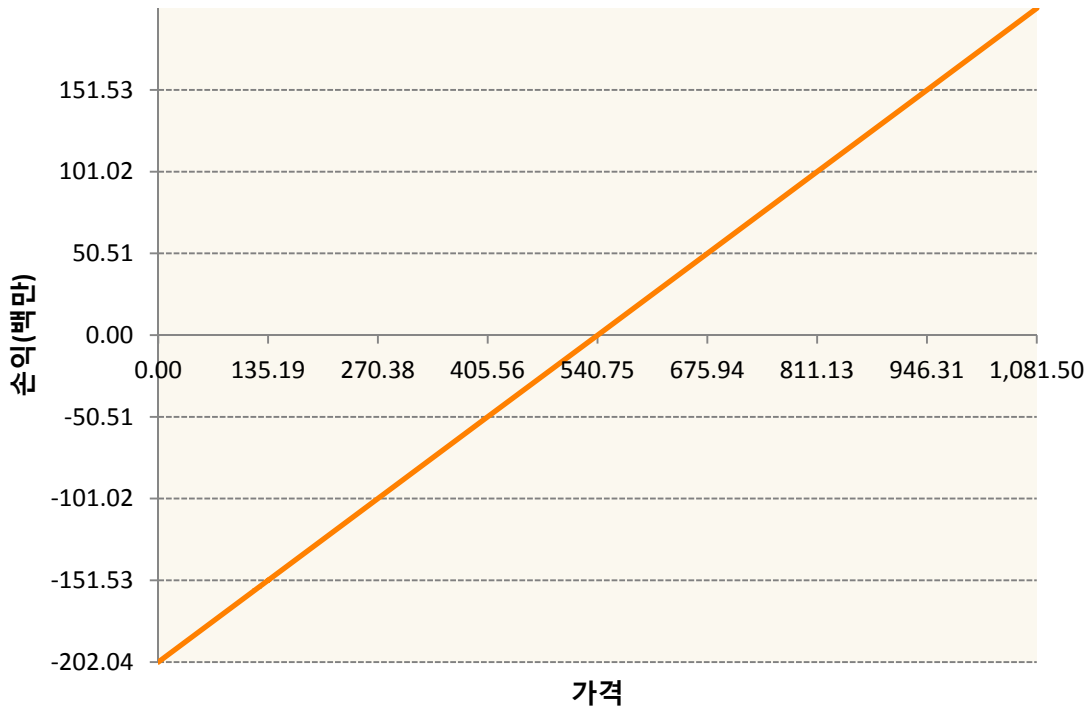
가격

KR4175N60003-2018-06 달러선물



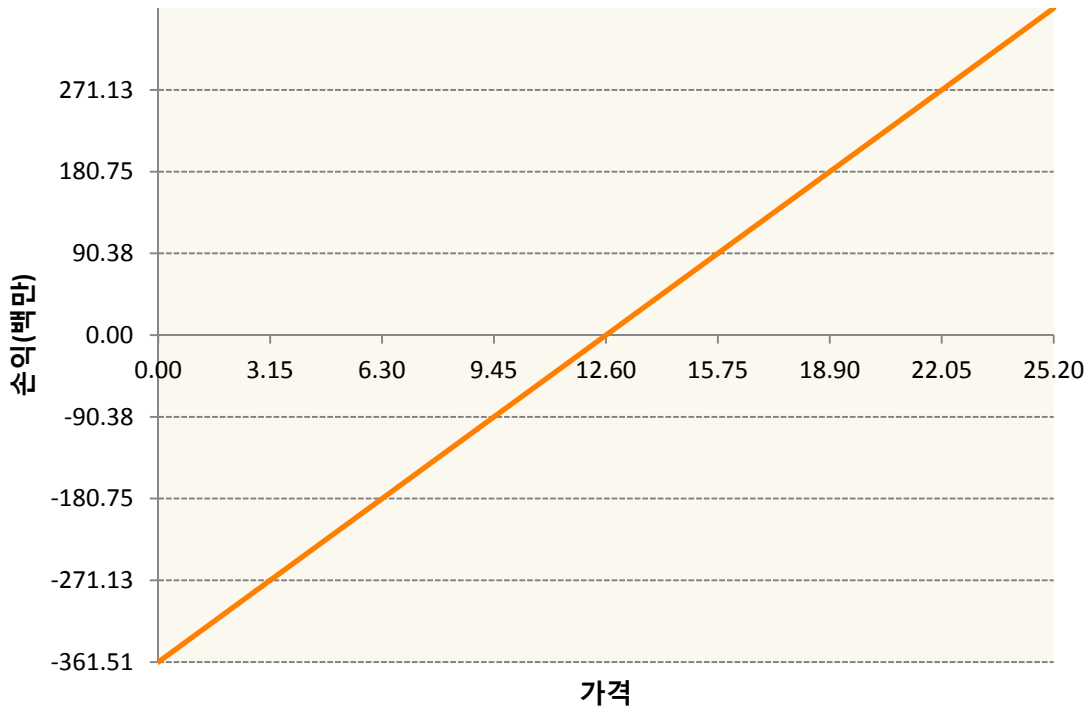
가격

KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18

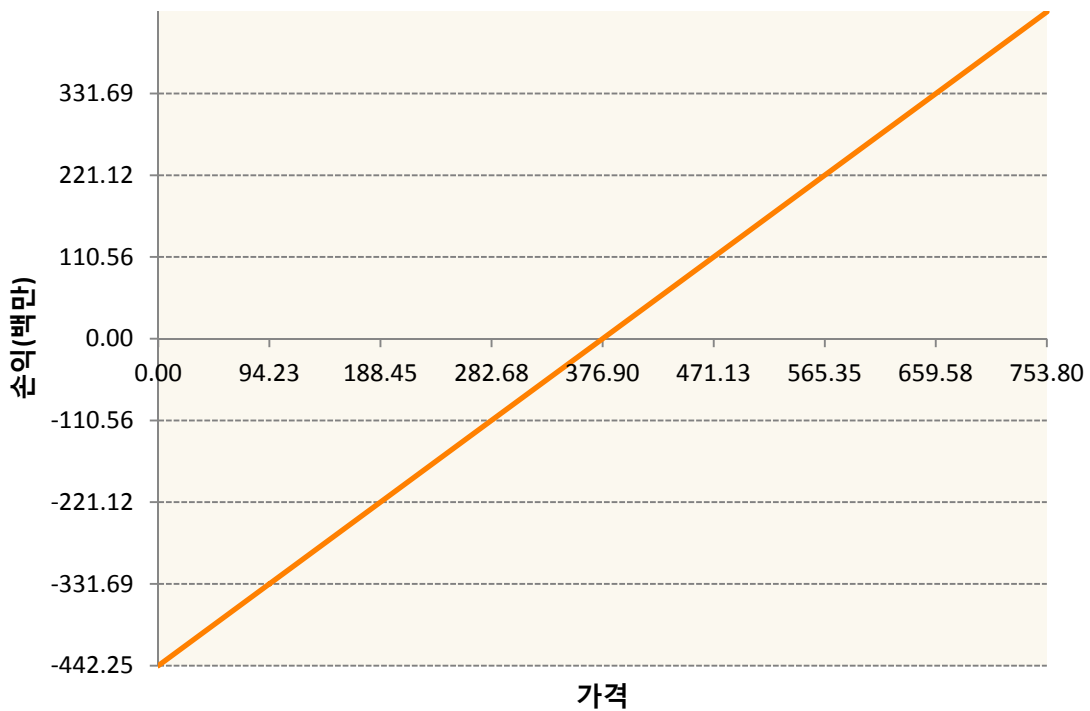


가격

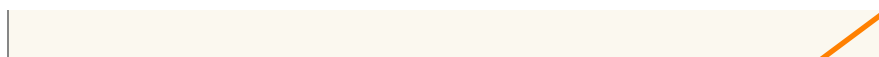
SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18

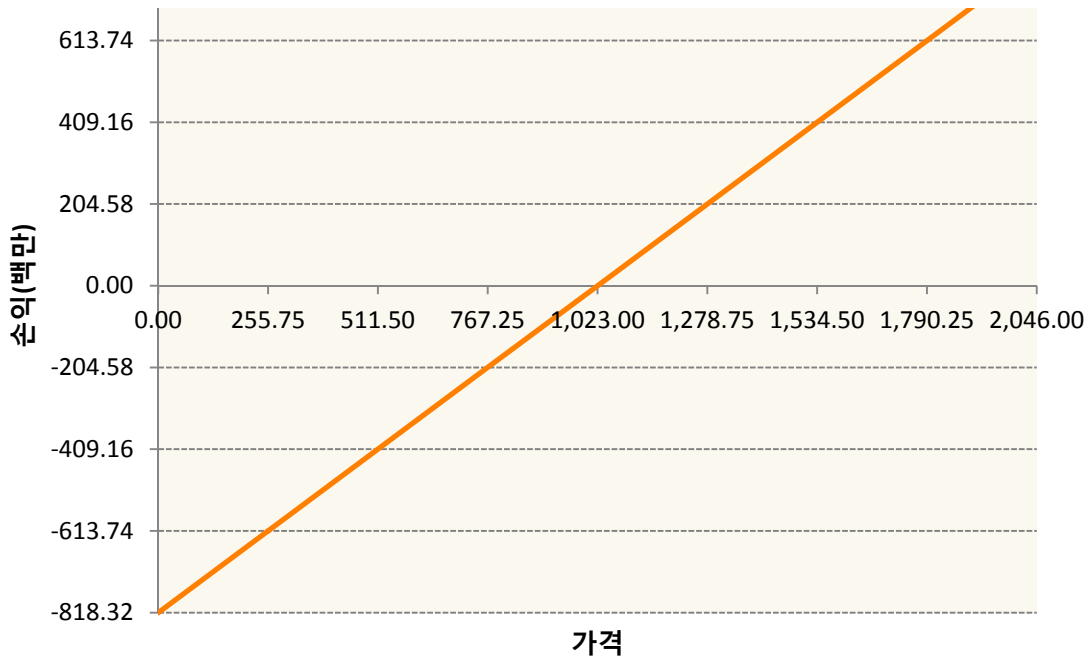


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18

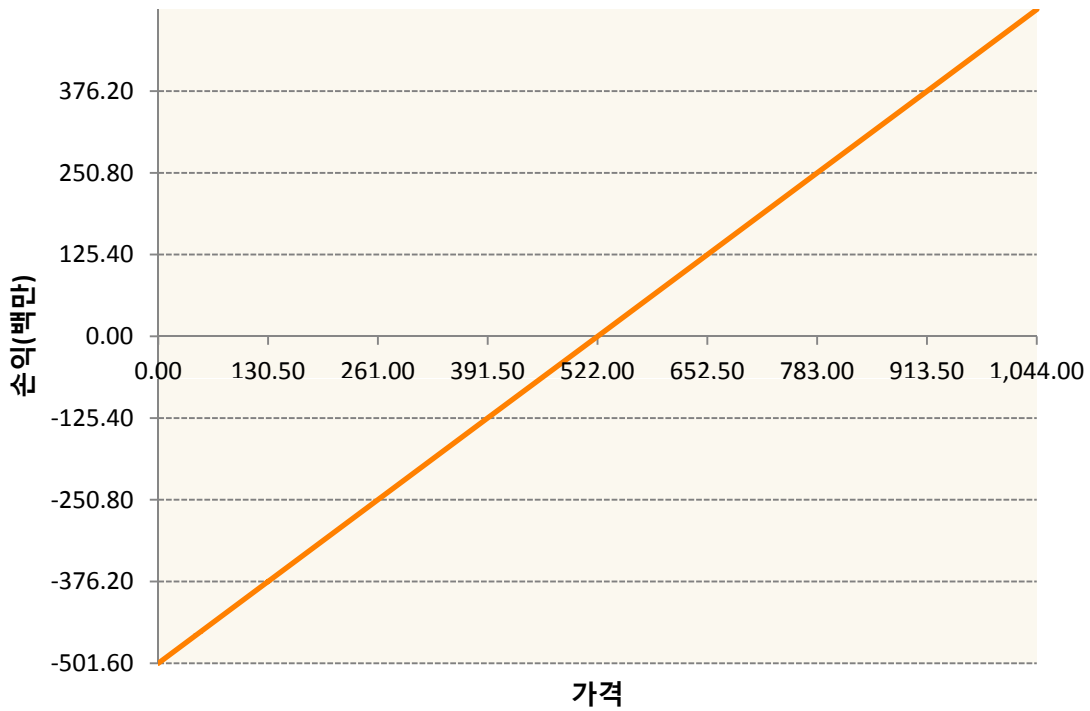


SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18





WN8-WHEAT FUTURE(CBT) JUL18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON8	SOYBEAN OIL FUTR JUL18	26
CN8	CORN FUTURE JUL18	72
CTN8	COTTON NO.2 FUTR JUL18	20
KCN8	COFFEE 'C' FUTURE JUL18	27
KR4175N60C	2018-06 달러선물	26

KWN8	KC HRW WHEAT FUT JUL18	16
SBN8	SUGAR #11 (WORLD) JUL18	29
SMN8	SOYBEAN MEAL FUTR JUL18	35
SN8	SOYBEAN FUTURE JUL18	65
WN8	WHEAT FUTURE(CBT) JUL18	40

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

(단위:백만원)

336