

공시일	2018-06-04
기준일	2018-06-01

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	2018-06-04
기준일	2018-06-01

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

1,105

* 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	2018-06-04
기준일	2018-06-01

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

375

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

402

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-06-04
기준일	2018-06-01

유로인덱스모(주식-파생형)

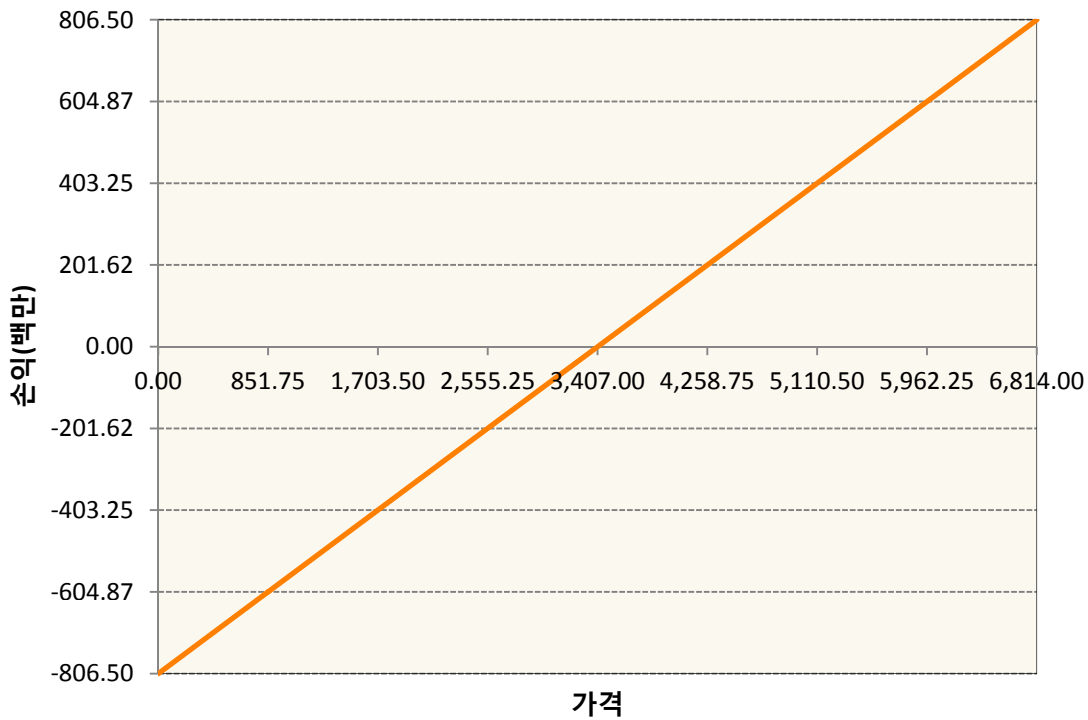
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	806	0	806	

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	2018-06-04
기준일	2018-06-01

차이나인덱스모(주식-파생형)

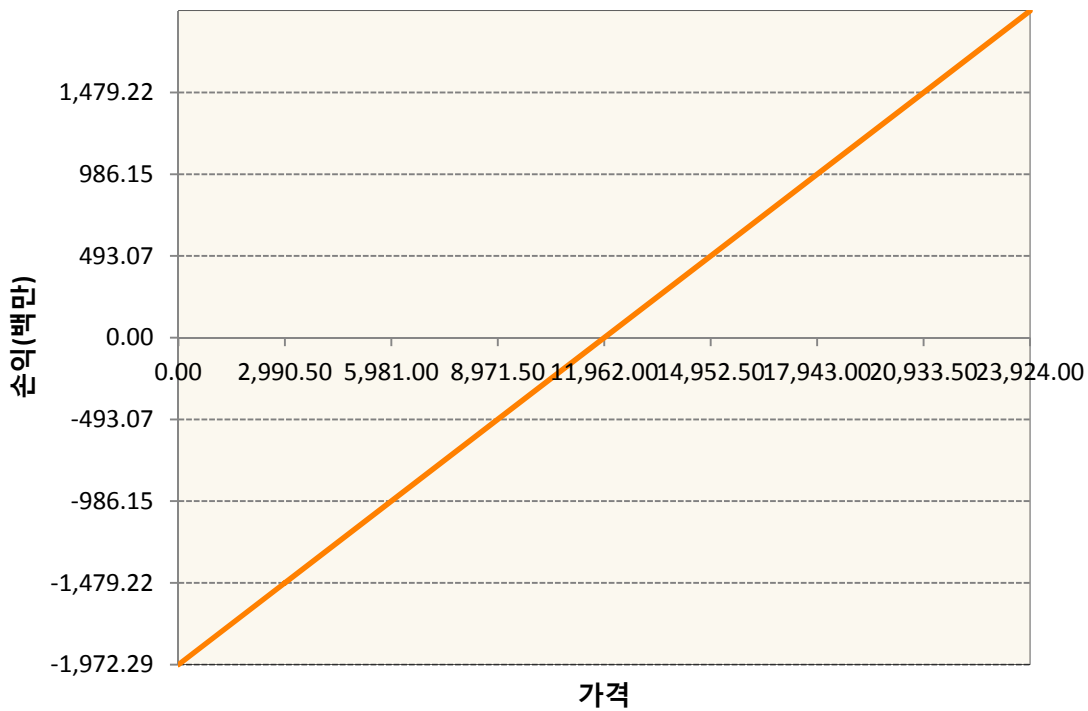
1. 계약금액

(단위:백만원)

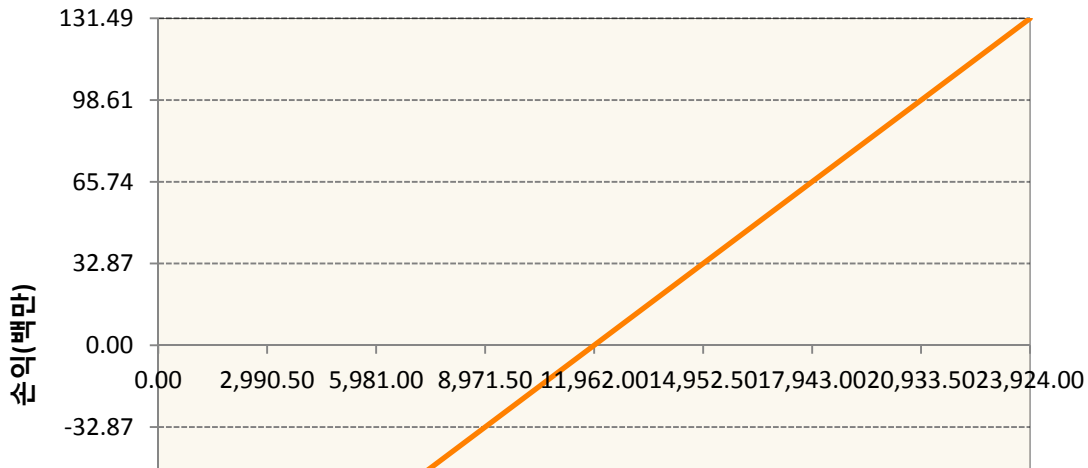
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,104	0	2,104	장내

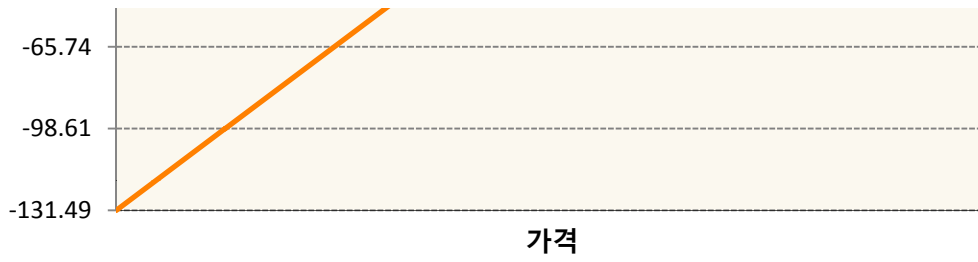
2. 만기시점의 손익구조

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	2018-06-04
기준일	2018-06-01

커버드콜모(주식혼합-파생형)

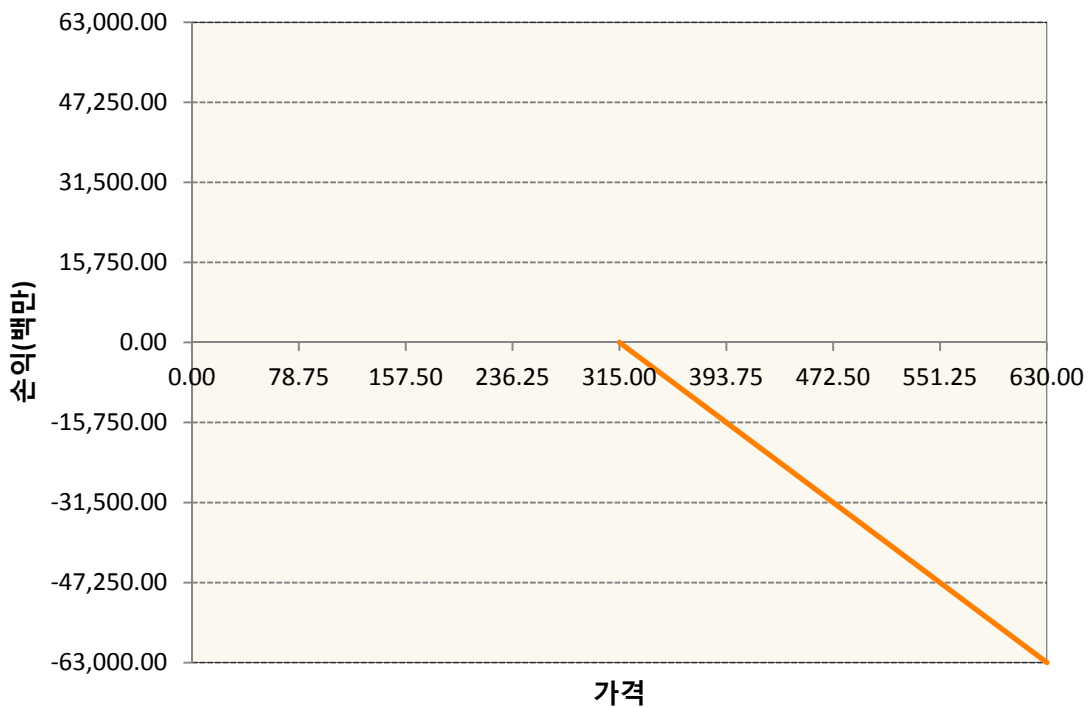
1. 계약금액

(단위:백만원)

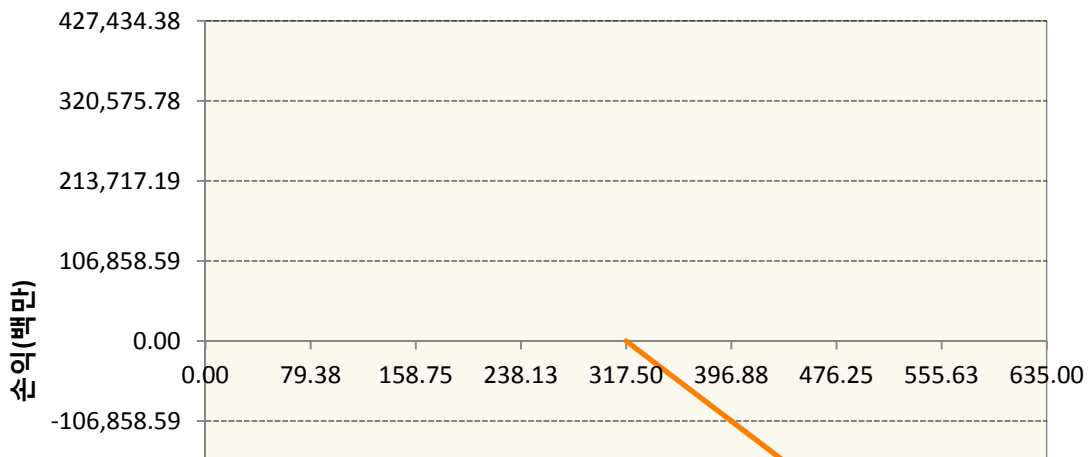
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	798,409	-798,409	장내

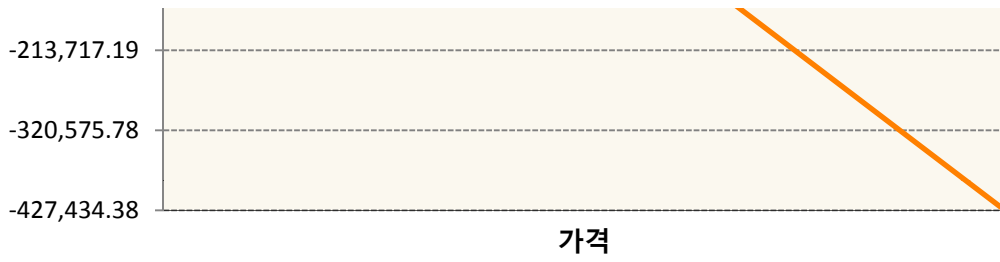
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63159-2018-06 콜315

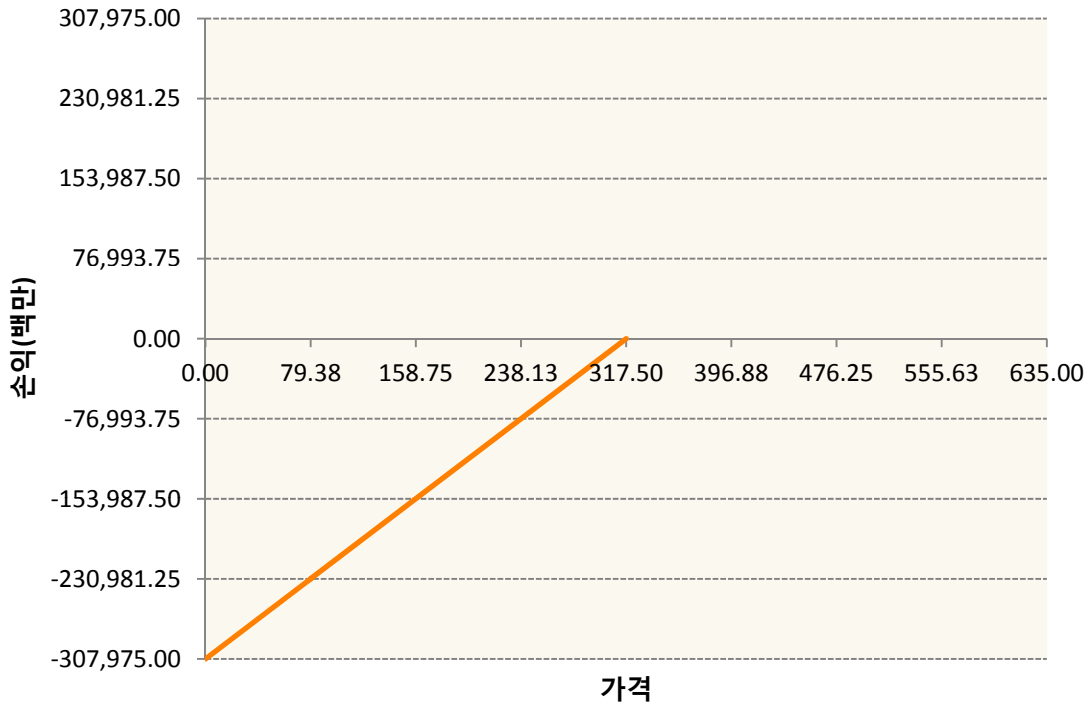


KR4201N63175-2018-06 콜317.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N6312018-06 콜315

3,804

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,154	1,142	1,125	1,101	1,072	1,037	996
-5.33%	1,095	1,056	1,010	956	896	831	762
-2.67%	876	795	709	620	527	433	337
0%	331	221	111	0	-111	-221	-332
2.67%	-639	-739	-841	-945	-1,050	-1,156	-1,263
5.33%	-1,976	-2,038	-2,108	-2,184	-2,264	-2,349	-2,437
8.00%	-3,526	-3,554	-3,590	-3,634	-3,684	-3,741	-3,804

KR4201N6312018-06 콜317.5

24,201

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,392	6,340	6,257	6,138	5,981	5,786	5,553

-5.33%	6,139	5,942	5,692	5,394	5,052	4,670	4,254
-2.67%	5,080	4,613	4,106	3,565	2,998	2,409	1,801
0%	2,160	1,446	726	0	-729	-1,462	-2,197
2.67%	-3,507	-4,235	-4,969	-5,707	-6,449	-7,193	-7,940
5.33%	-11,845	-12,355	-12,905	-13,486	-14,093	-14,722	-15,368
8.00%	-21,942	-22,195	-22,505	-22,867	-23,274	-23,720	-24,201
KR4301N6312018-06 풋317.5							22,793
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,789	-22,789	-22,789	-22,789	-22,790	-22,791	-22,793
-5.33%	-14,693	-14,694	-14,697	-14,702	-14,712	-14,728	-14,752
-2.67%	-6,634	-6,670	-6,722	-6,789	-6,872	-6,970	-7,081
0%	655	445	226	0	-231	-466	-705
2.67%	4,730	4,511	4,284	4,051	3,814	3,572	3,327
5.33%	5,597	5,551	5,487	5,406	5,308	5,196	5,069
8.00%	5,650	5,648	5,643	5,632	5,615	5,590	5,555

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

(단위:백만원)

55,593

공시일	2018-06-04
기준일	2018-06-01

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

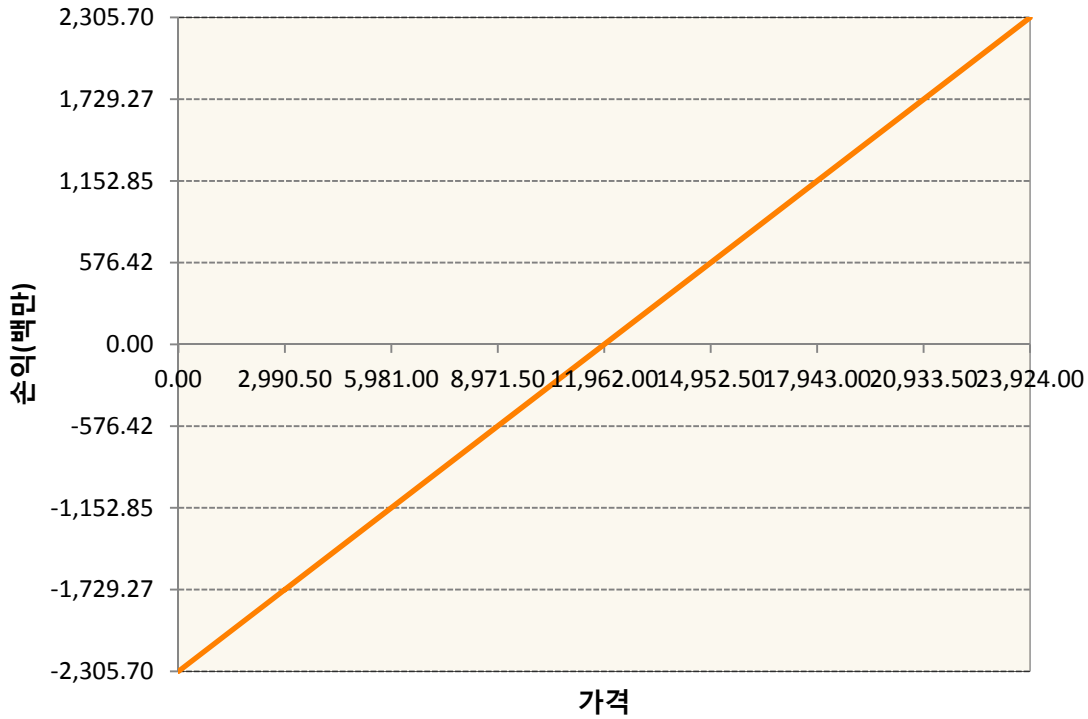
1. 계약금액

(단위:백만원)

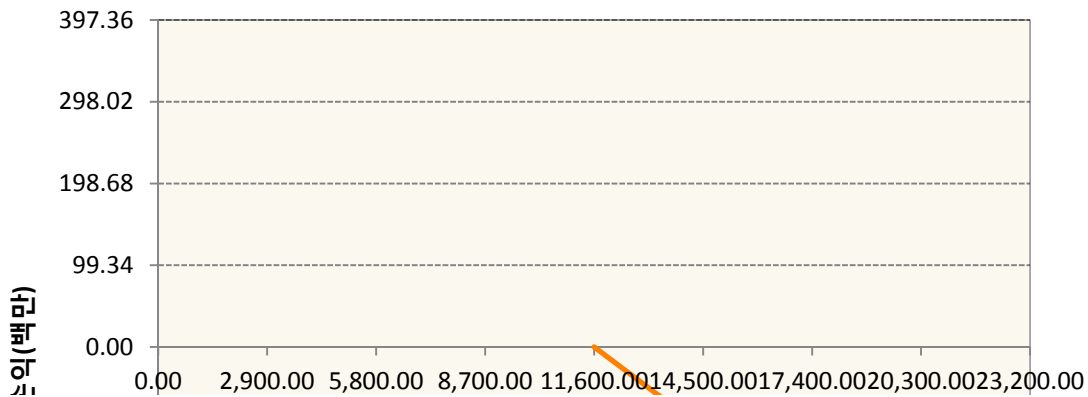
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,306	0	2,306	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,807	-5,807	장내

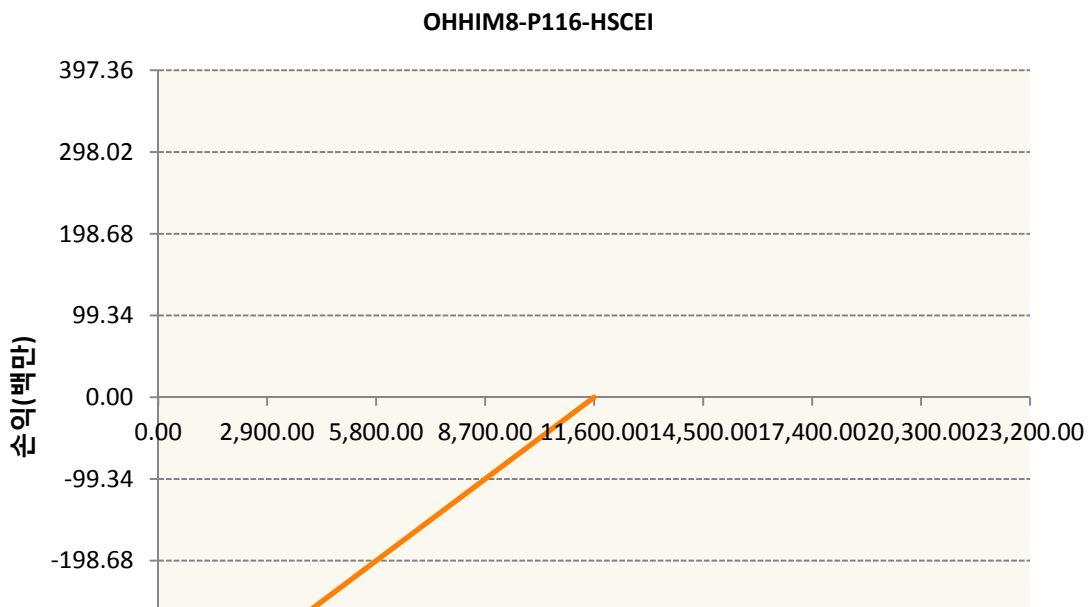
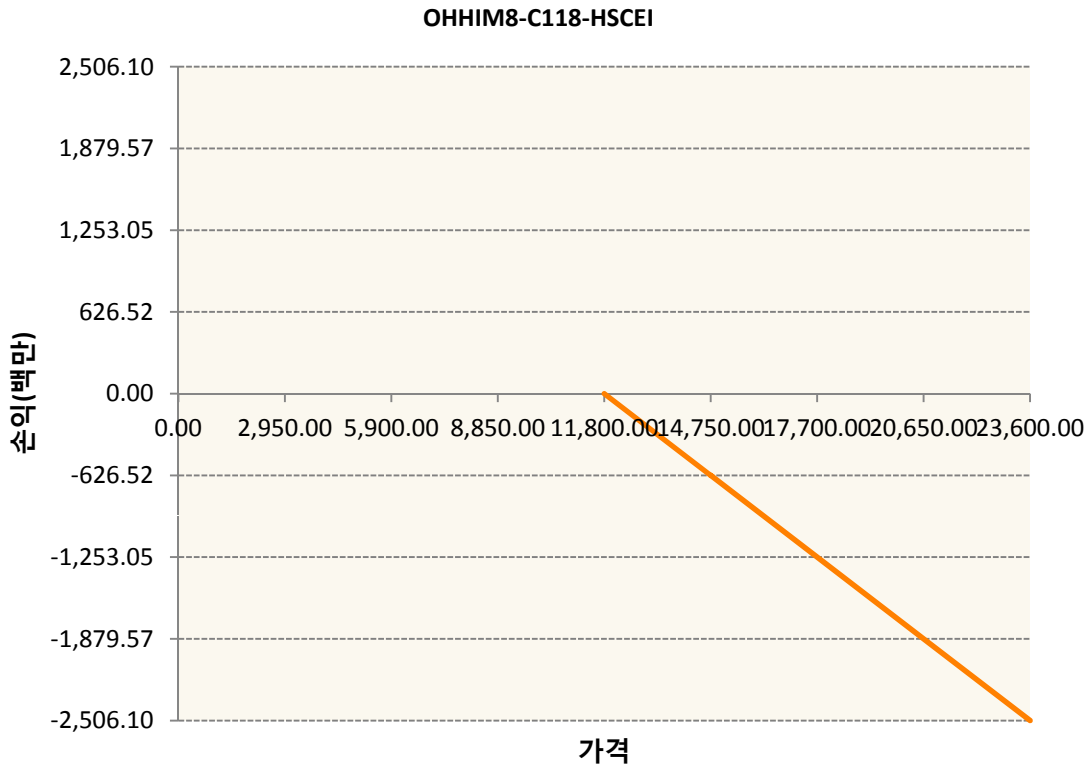
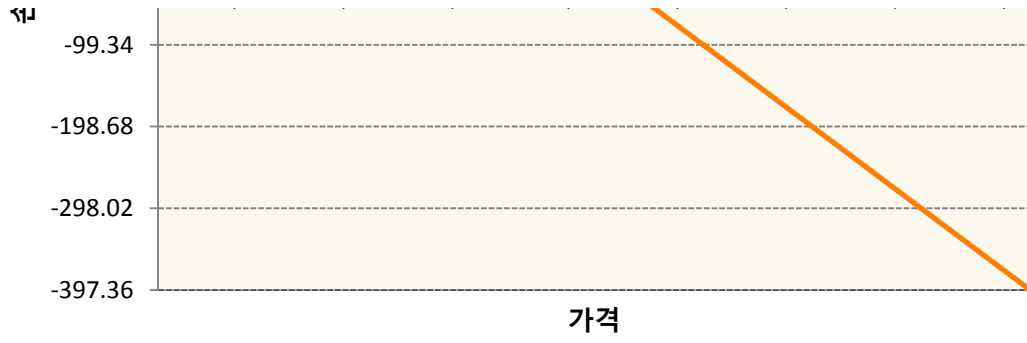
2. 만기시점의 손익구조

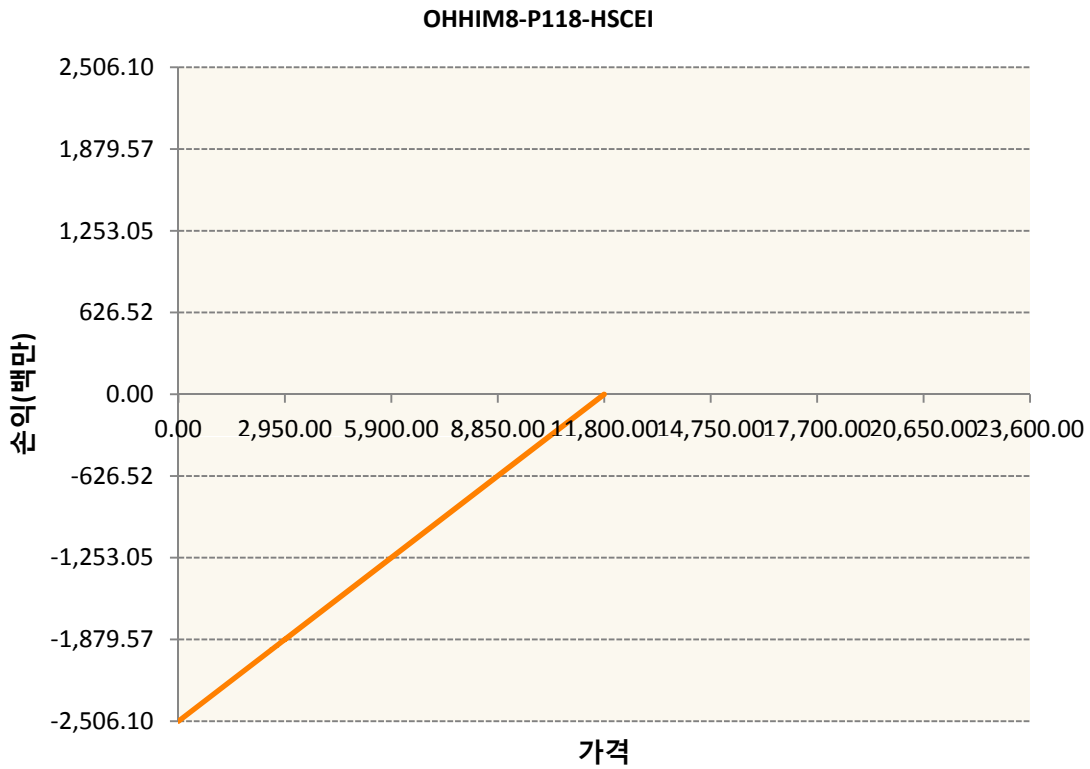
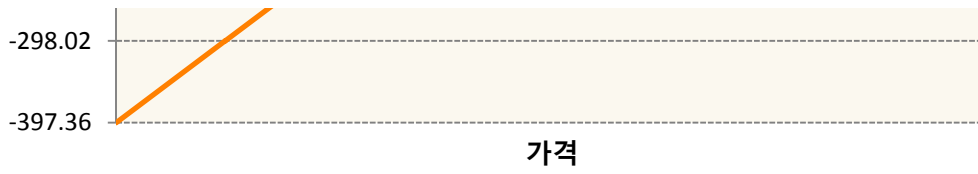
HCM8-HSCEI Futures Jun18



OHHIM8-C116-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCM8	HSCEI Futures Jun18	184
OHHIM8-C1	HSCEI	32
OHHIM8-C1	HSCEI	200
OHHIM8-P1	HSCEI	32
OHHIM8-P1	HSCEI	200

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	575

공시일	2018-06-04
기준일	2018-06-01

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

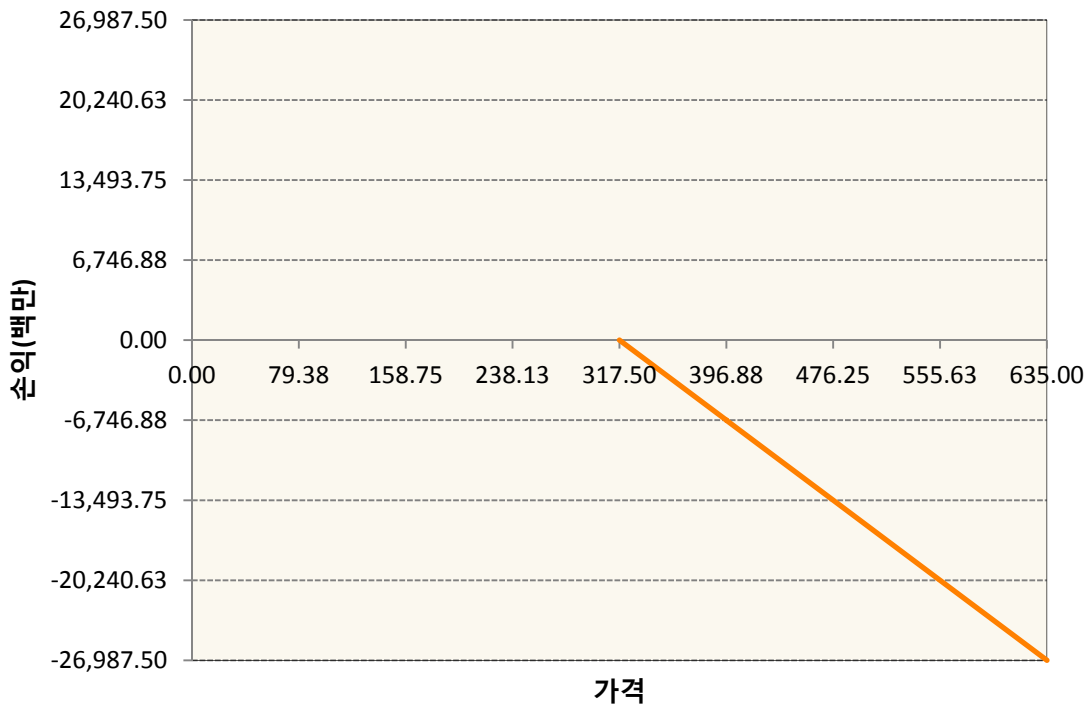
1. 계약금액

(단위:백만원)

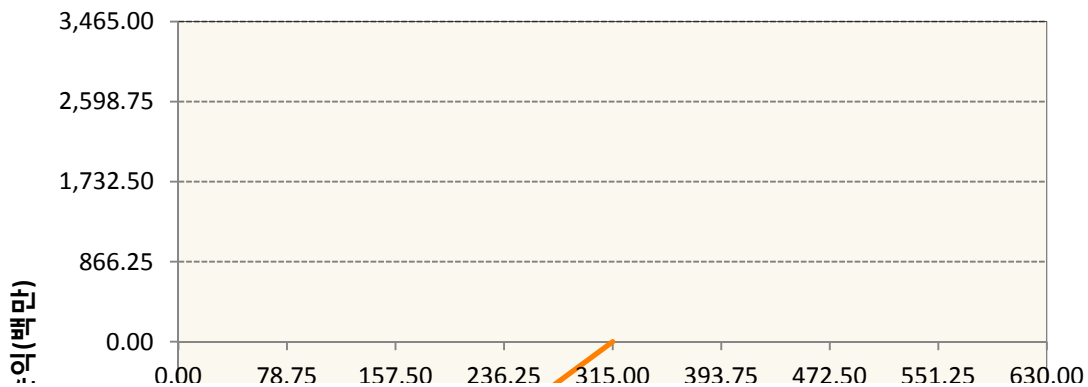
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	46,804	-46,804	장내

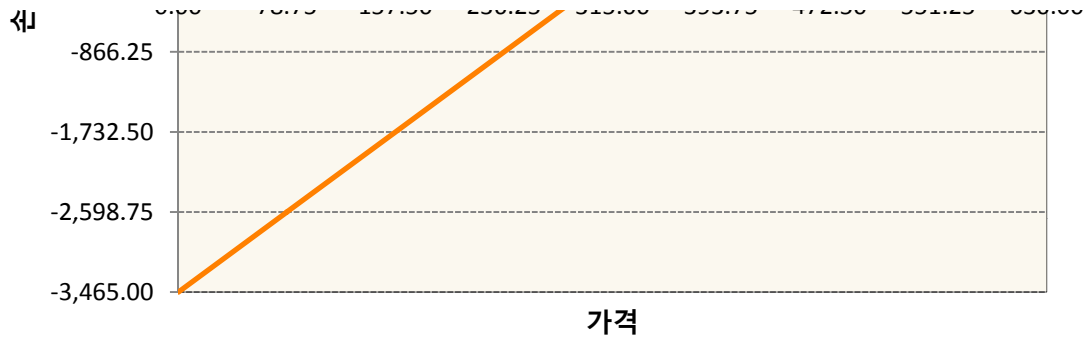
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63175-2018-06 콜317.5

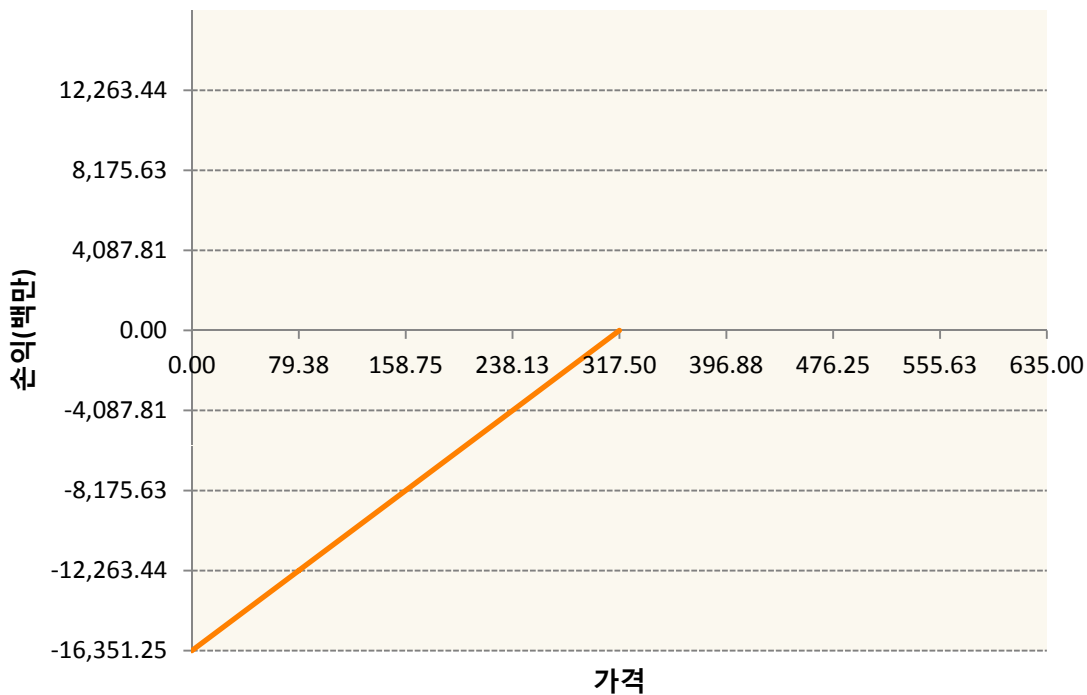


KR4301N63157-2018-06 풋315





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 1,528

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	404	400	395	388	378	365	351
-5.33%	388	375	359	341	319	295	269
-2.67%	321	291	259	225	189	152	114
0%	136	91	46	0	-46	-92	-139
2.67%	-221	-267	-314	-360	-407	-454	-501
5.33%	-748	-780	-815	-851	-890	-930	-970
8.00%	-1,385	-1,401	-1,421	-1,444	-1,469	-1,498	-1,528

KR4301N6312018-06 풋315 249

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-249	-249	-249	-249	-249	-249	-249
-5.33%	-157	-157	-157	-157	-157	-158	-158
-2.67%	-66	-67	-68	-69	-71	-72	-74
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	41	39	37	35	33	31	28
5.33%	46	46	45	45	44	43	42
8.00%	46	46	46	46	46	46	46

KR4301N6312018-06 풋317.5 1,210

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,210	-1,210	-1,210	-1,210	-1,210	-1,210	-1,210
-5.33%	-780	-780	-780	-781	-781	-782	-783
-2.67%	-352	-354	-357	-360	-365	-370	-376
0%	35	24	12	0	-12	-25	-37
2.67%	251	240	227	215	202	190	177
5.33%	297	295	291	287	282	276	269
8.00%	300	300	300	299	298	297	295

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

(단위:백만원)

7,142

공시일	2018-06-04
기준일	2018-06-01

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

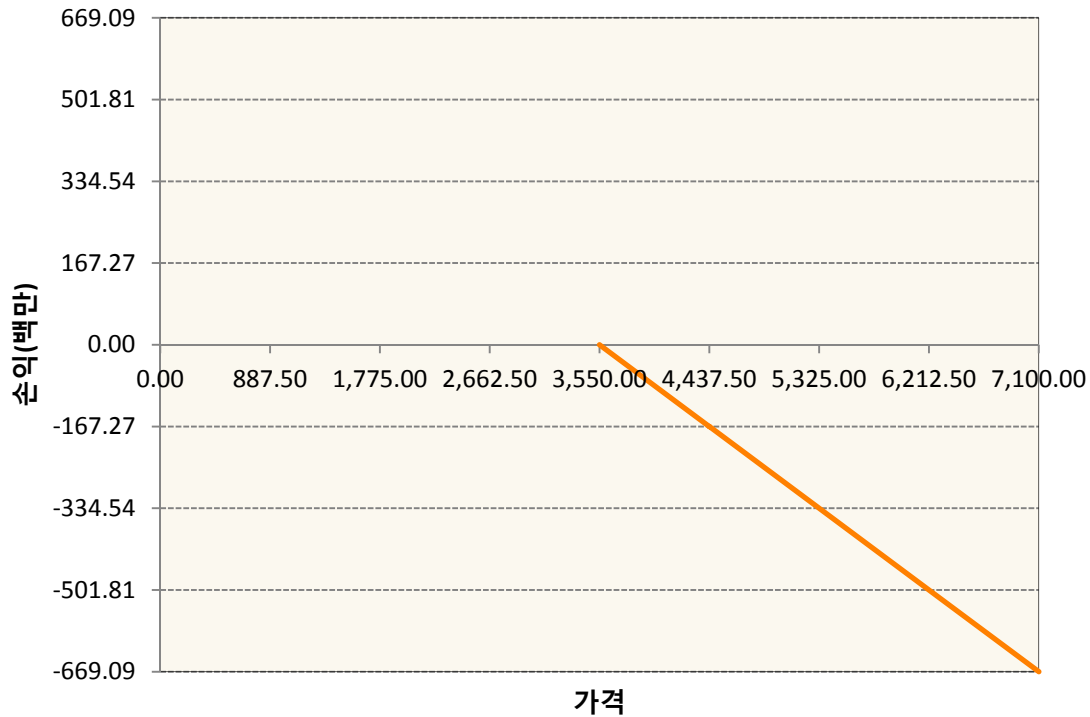
1. 계약금액

(단위:백만원)

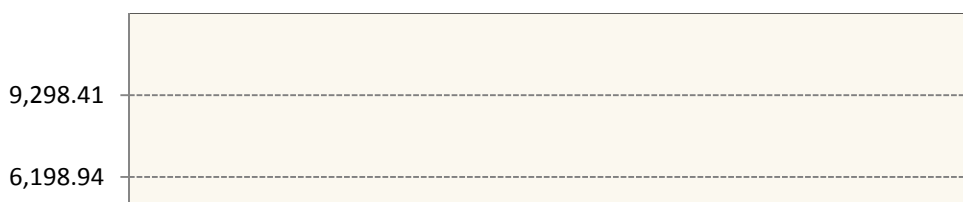
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,864	0	4,864	
누계	유가증권	스왑	52,974	0	52,974	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,134	-26,134	장내
누계	지수	스왑	50,259	0	50,259	장외

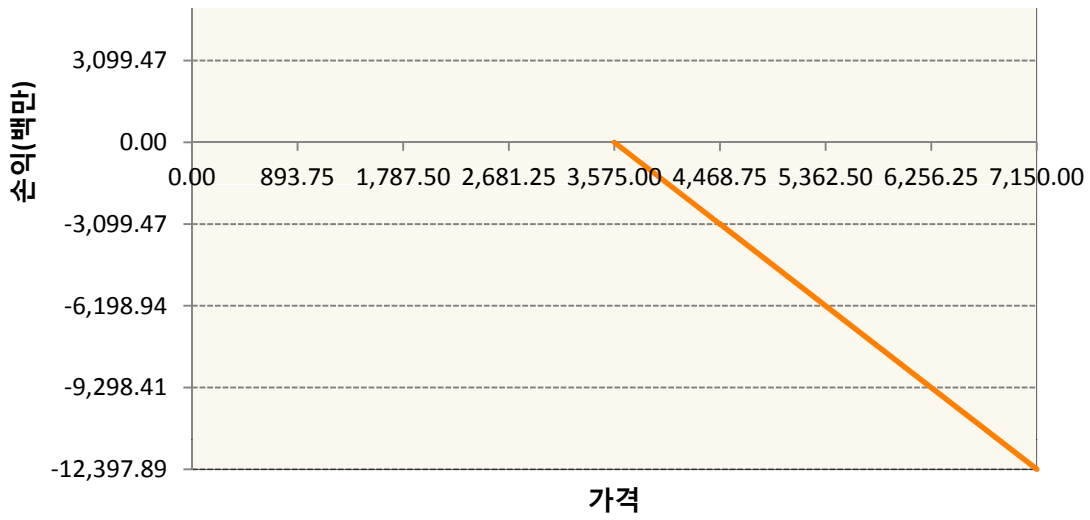
2. 만기시점의 손익구조

OESXM8-C3550-EURO STOXX 50

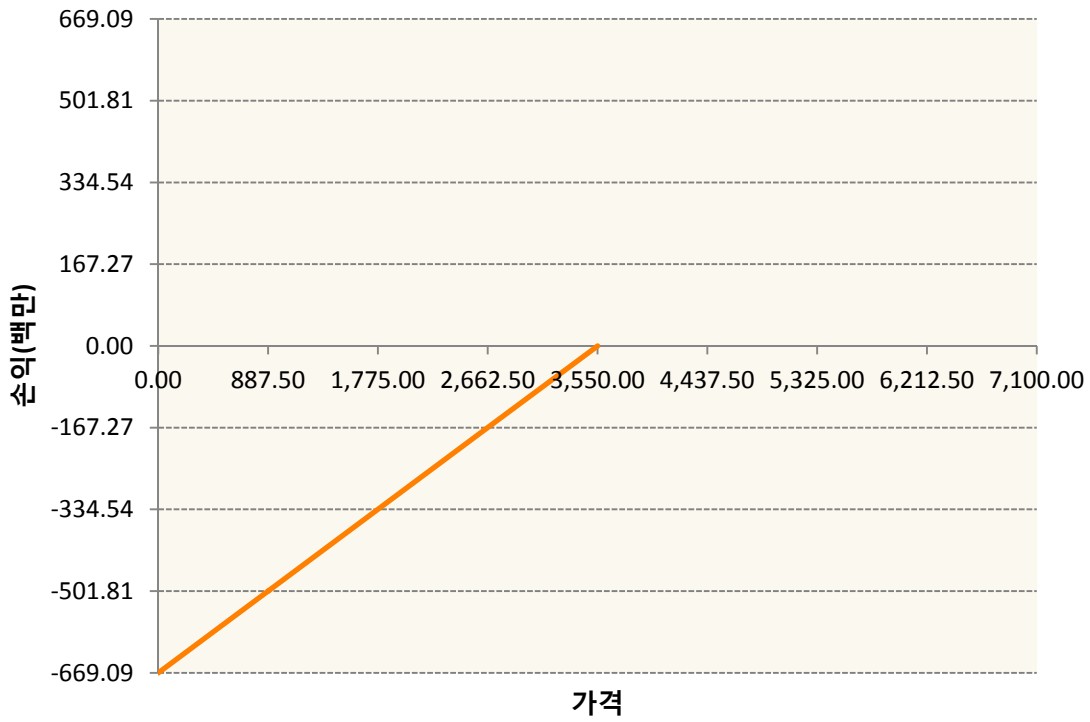


OESXM8-C3575-EURO STOXX 50

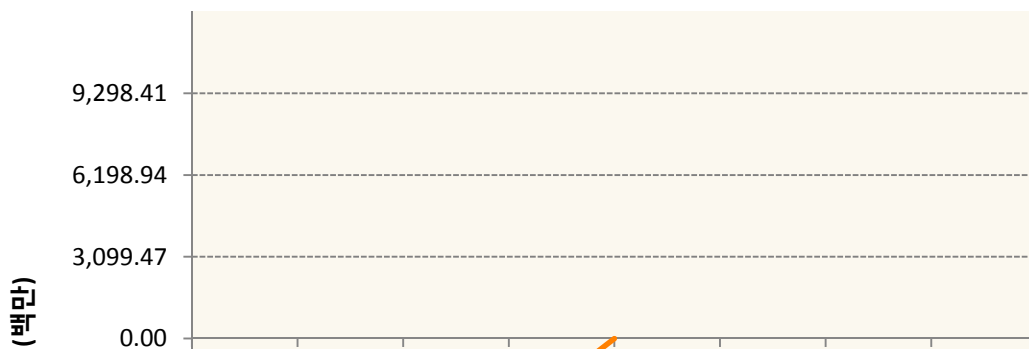


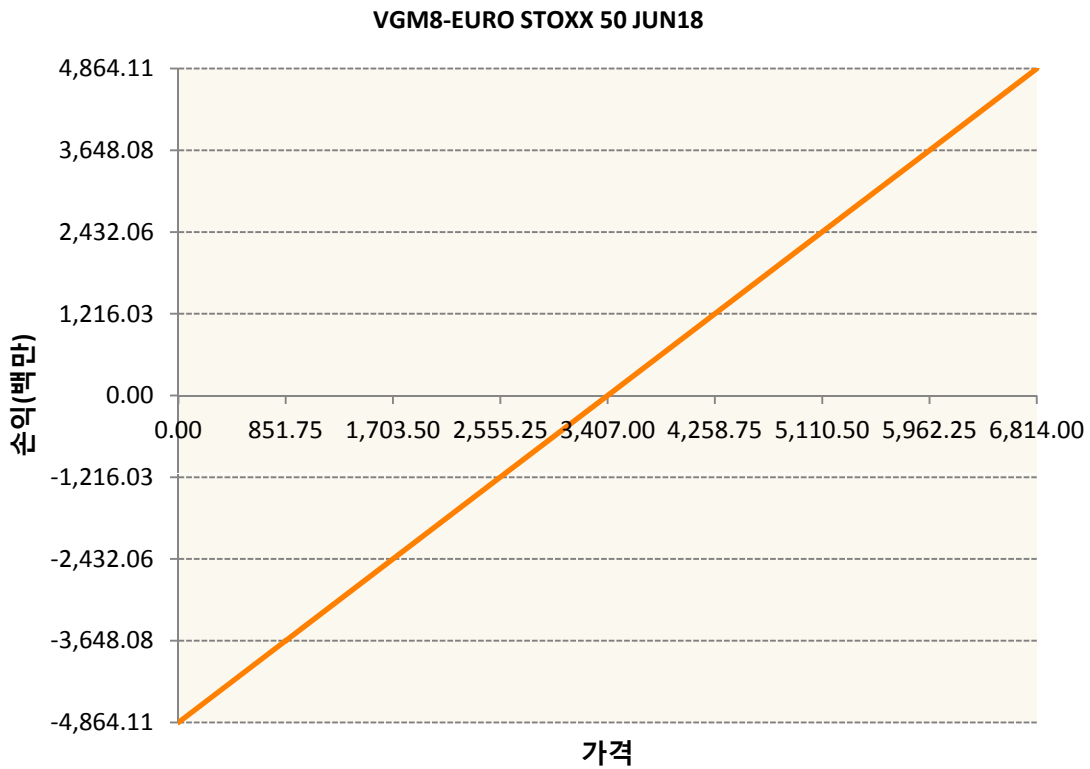
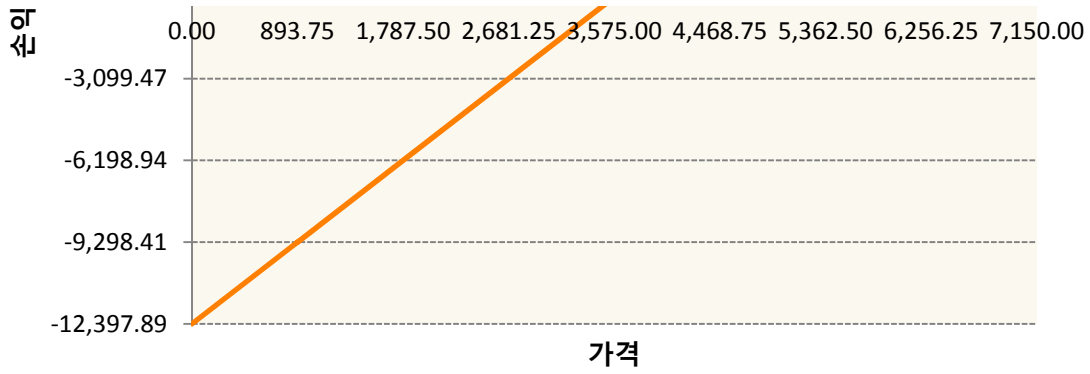


OESXM8-P3550-EURO STOXX 50



OESXM8-P3575-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		41
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		43
OESXM8-C3: EURO STOXX 50		54
OESXM8-C3: EURO STOXX 50		992
OESXM8-P3! EURO STOXX 50		54
OESXM8-P3! EURO STOXX 50		992
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18		389

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

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

(단위:백만원)

1,172

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

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

(단위:백만원)

41

공시일	2018-06-04
기준일	2018-06-01

리디파인K200(주식혼합-파생재간

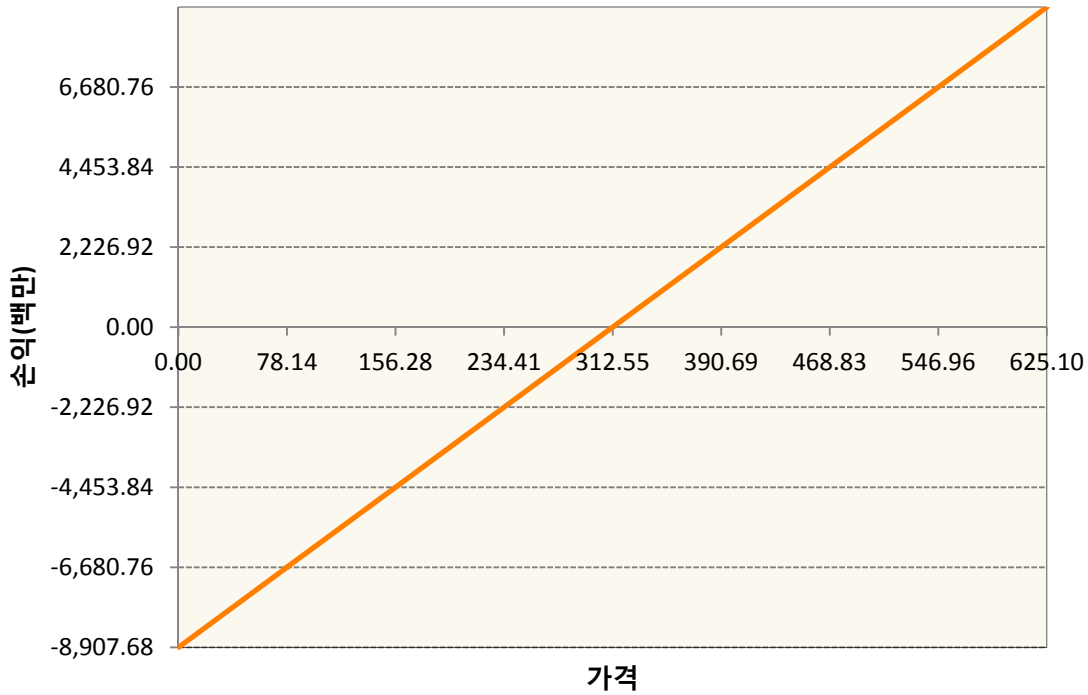
1. 계약금액

(단위:백만원)

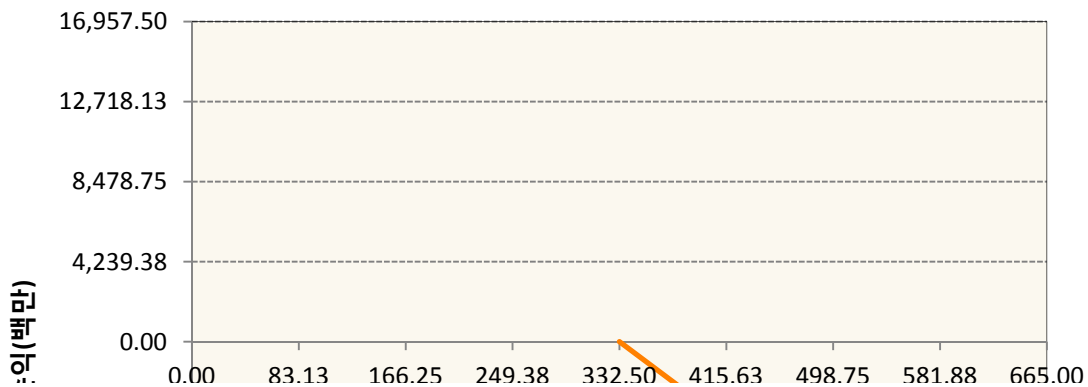
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	166	-166	장내
누계	유가증권	선물	8,908	0	8,908	장내
누계	유가증권	옵션	1,826	16,958	-15,132	장내

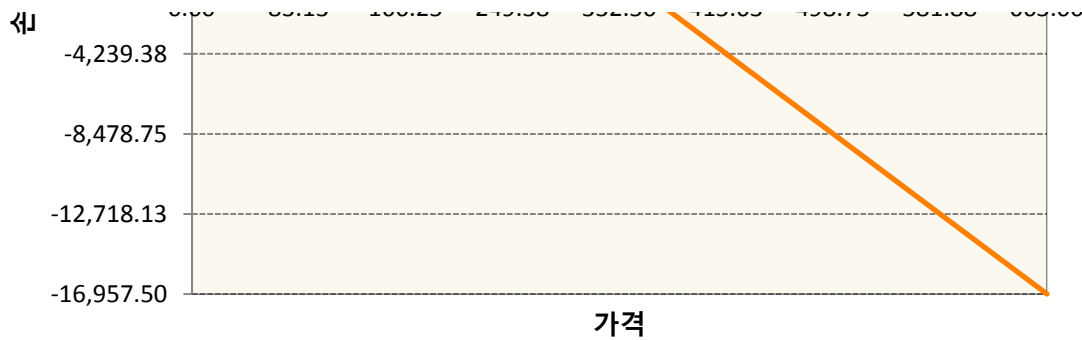
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

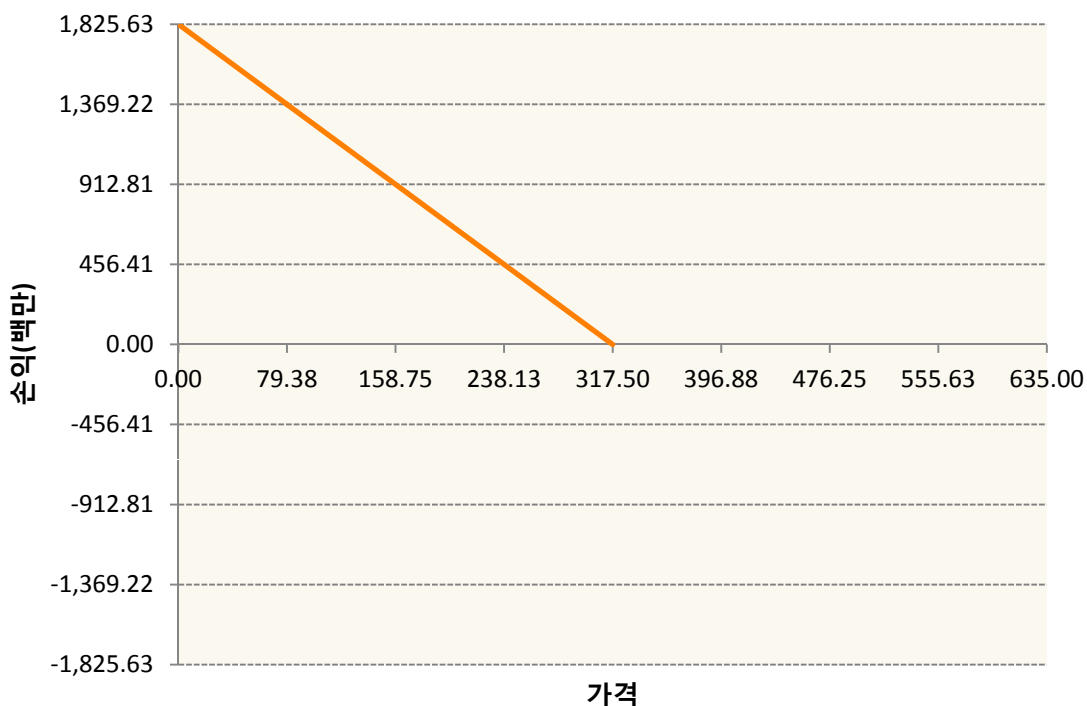


KR4201N63324-2018-06 콜332.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물							714
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-714	-714	-714	-714	-714	-714	-714
-5.33%	-476	-476	-476	-476	-476	-476	-476
-2.67%	-238	-238	-238	-238	-238	-238	-238
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	238	238	238	238	238	238	238
5.33%	476	476	476	476	476	476	476
8.00%	714	714	714	714	714	714	714
KR4201N63E 2018-06 콜332.5							559
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	58	58	57	57	56	54	52
-5.33%	57	57	55	53	50	45	39
-2.67%	54	51	46	39	30	20	9
0%	38	28	15	0	-16	-34	-53
2.67%	-17	-39	-62	-86	-110	-136	-161
5.33%	-151	-180	-210	-239	-269	-299	-328
8.00%	-387	-415	-443	-472	-501	-530	-559

KR4301N6312018-06 풋317.5

135

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	135	135	135	135	135	135	135
-5.33%	87	87	87	87	87	87	87
-2.67%	39	40	40	40	41	41	42
0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-28	-27	-25	-24	-23	-21	-20
5.33%	-33	-33	-33	-32	-31	-31	-30
8.00%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33

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

(단위:백만원)

1,016

공시일	2018-06-04
기준일	2018-06-01

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

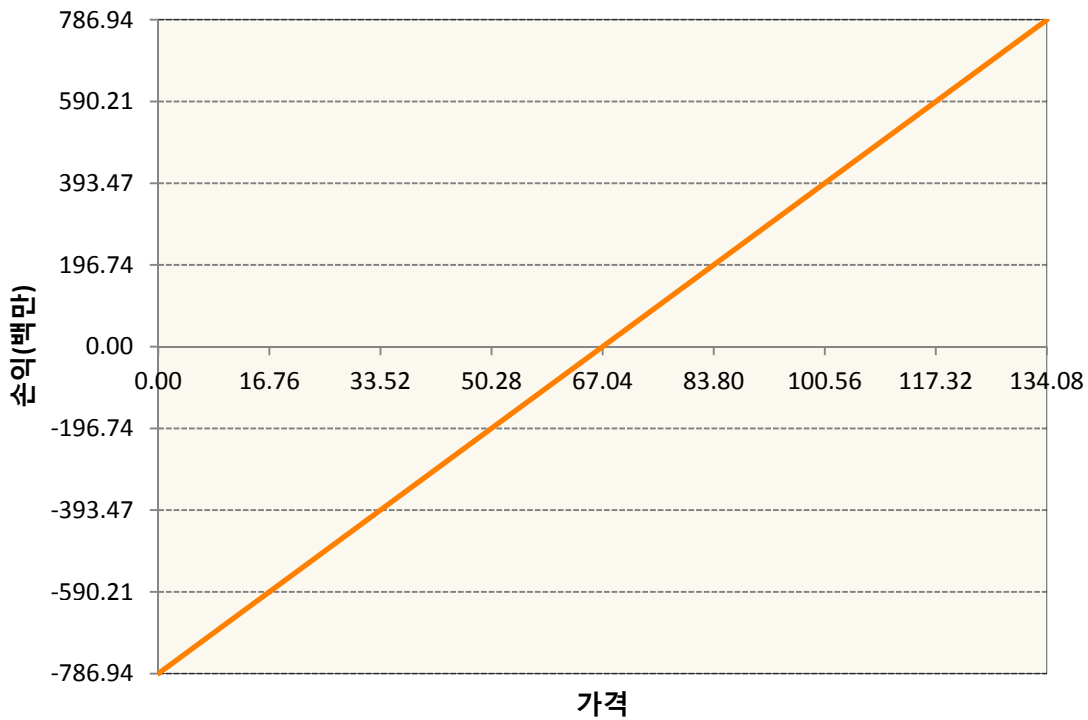
1. 계약금액

(단위:백만원)

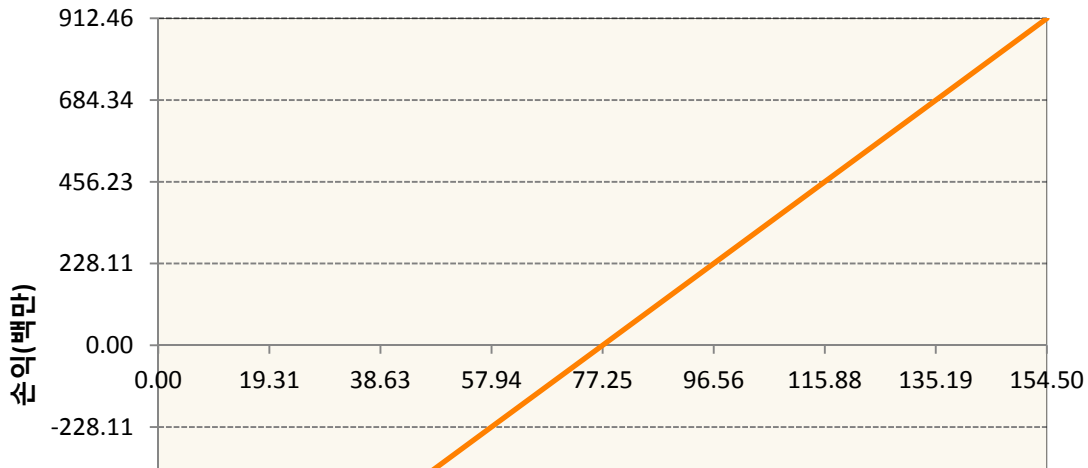
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,878	591	3,286	

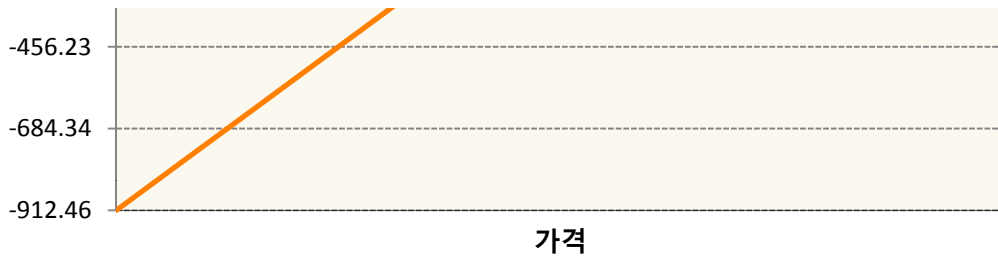
2. 만기시점의 손익구조

CLN8-WTI CRUDE FUTURE JUL18

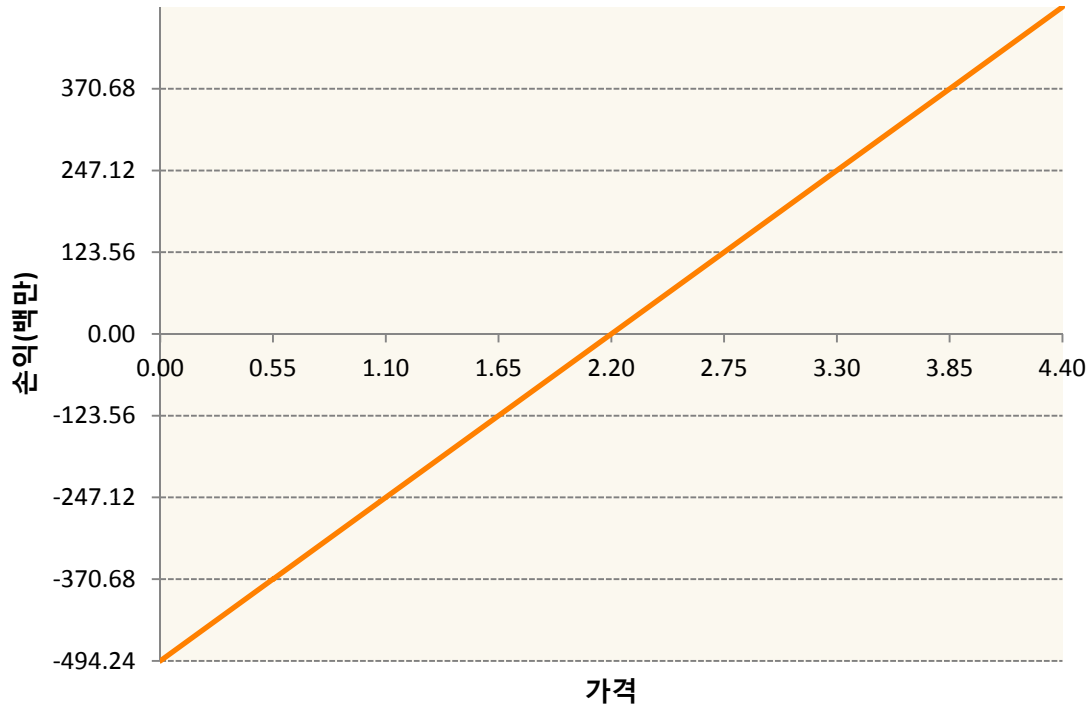


COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18

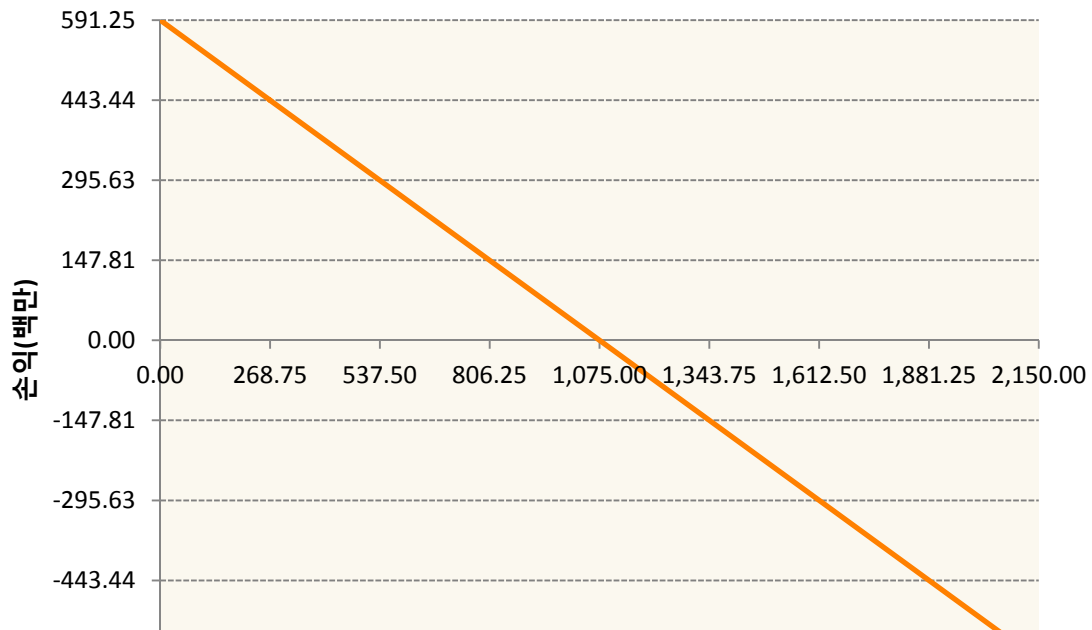


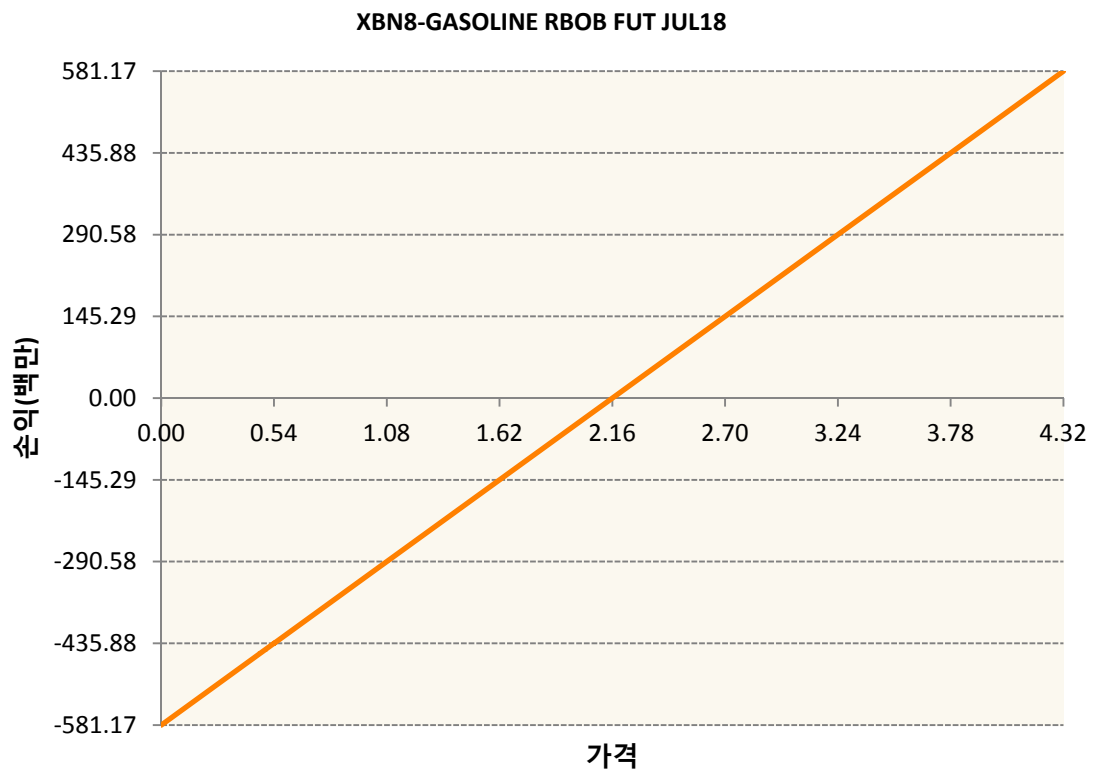
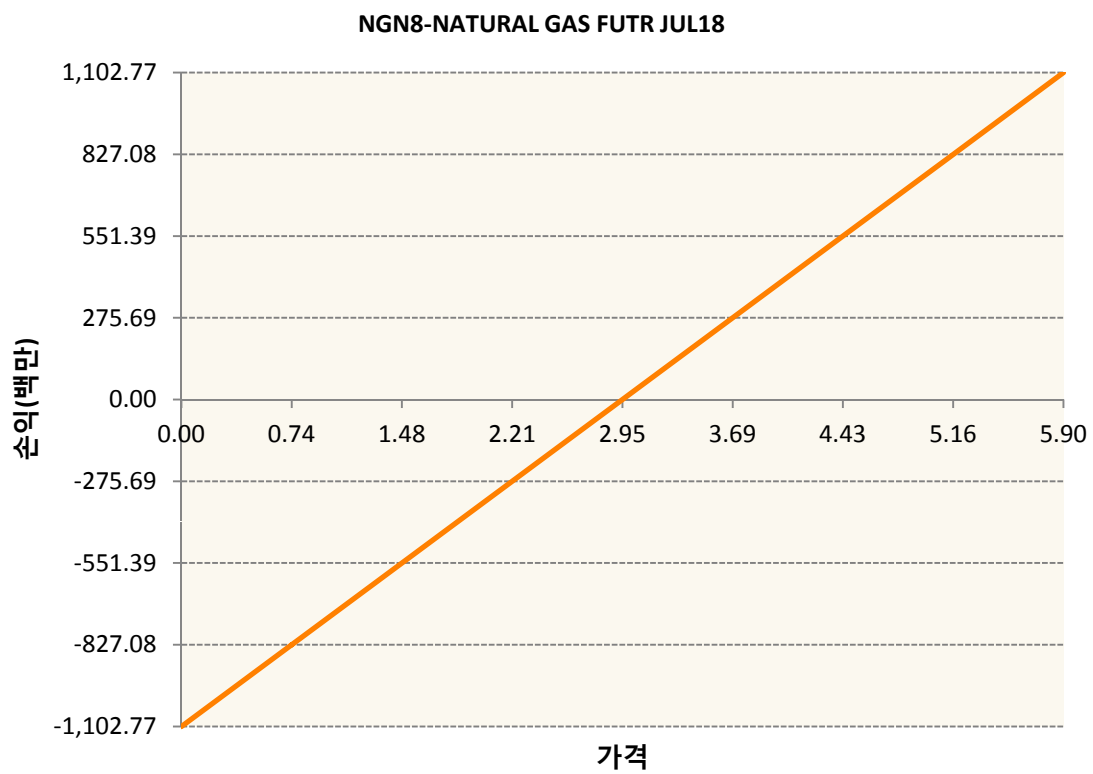
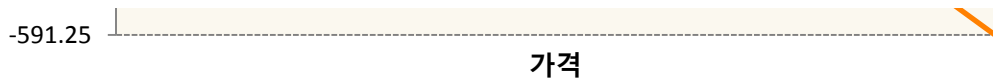


HON8-NY Harb ULSD Fut JUL18



KR4175N60003-2018-06 달러선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN8	WTI CRUDE FUTURE JUL18	63
COU8	BRENT CRUDE FUTR SEP18	73
HON8	NY Harb ULSD Fut JUL18	40
KR4175N60C	2018-06 달러선물	47
NGN8	NATURAL GAS FUTR JUL18	88
XBN8	GASOLINE RBOB FUT JUL18	46

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

468

공시일	2018-06-04
기준일	2018-06-01

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

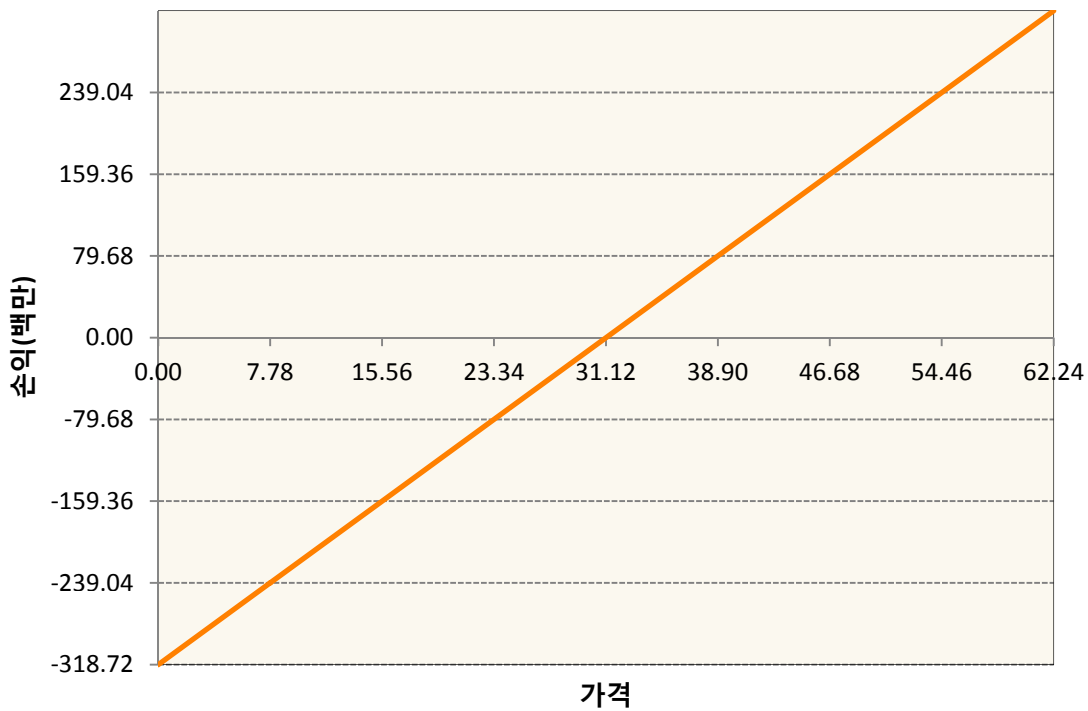
1. 계약금액

(단위:백만원)

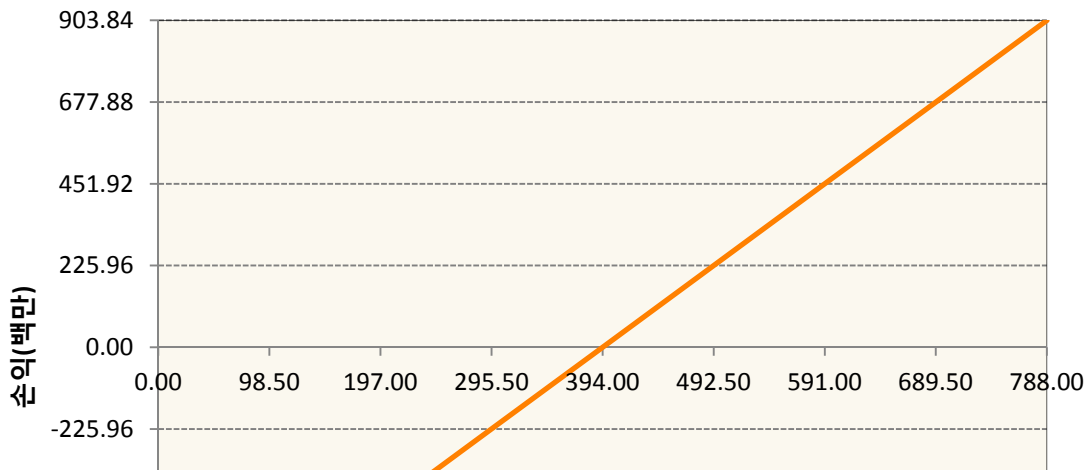
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,148	323	3,826	

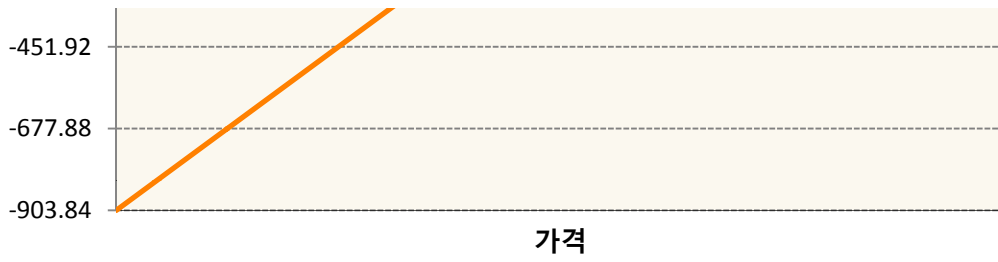
2. 만기시점의 손익구조

BON8-SOYBEAN OIL FUTR JUL18

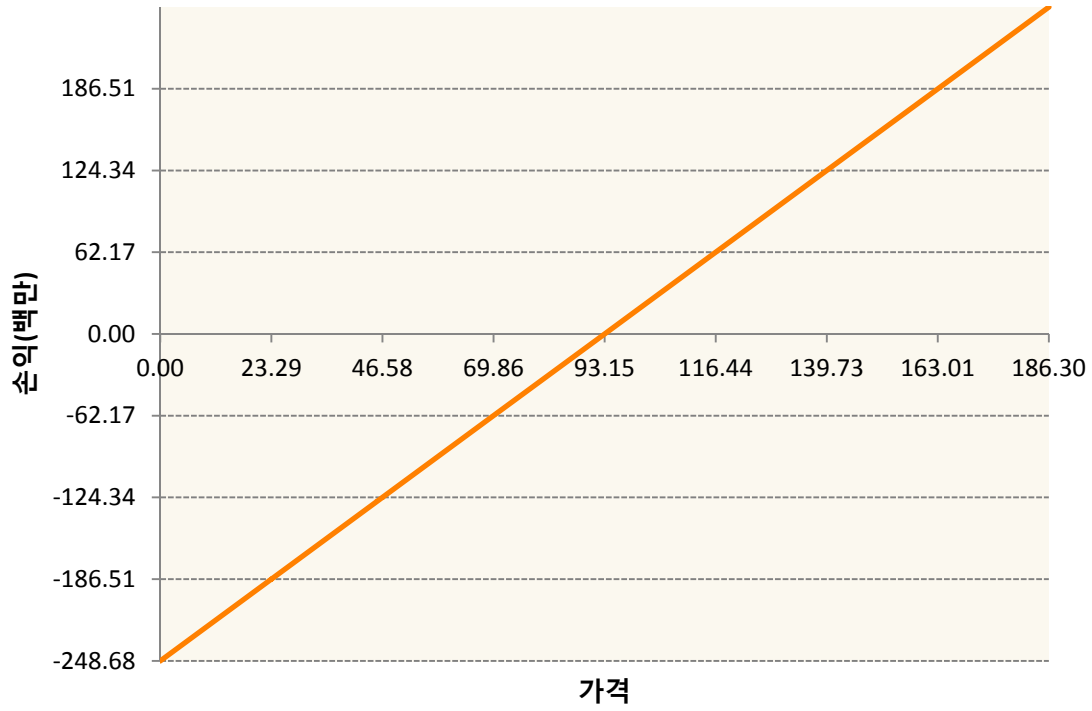


CN8-CORN FUTURE JUL18

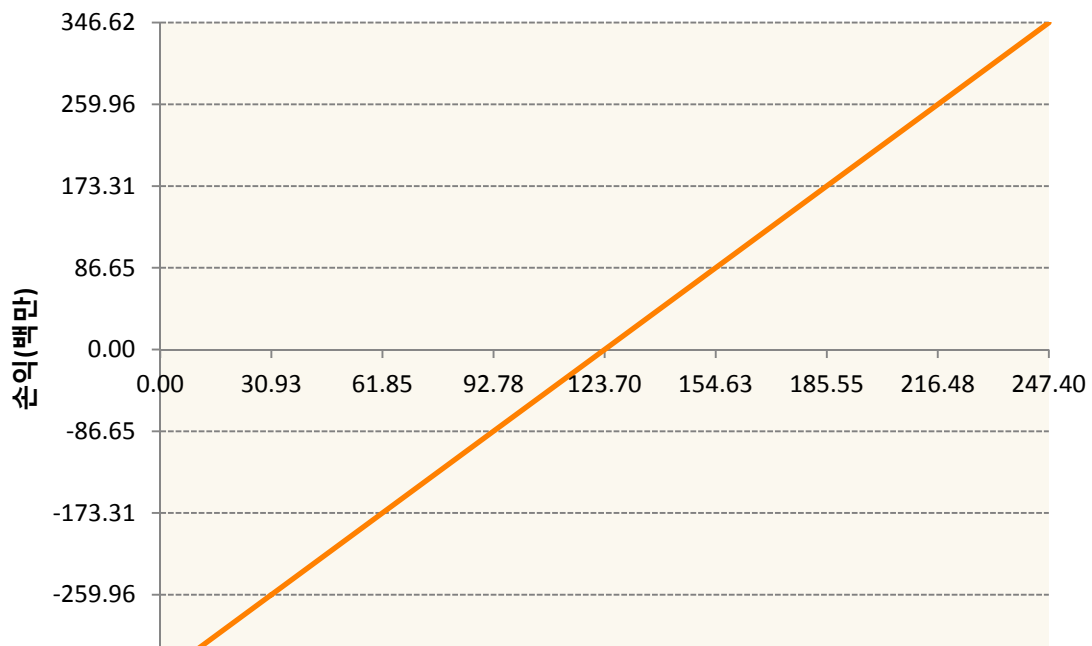


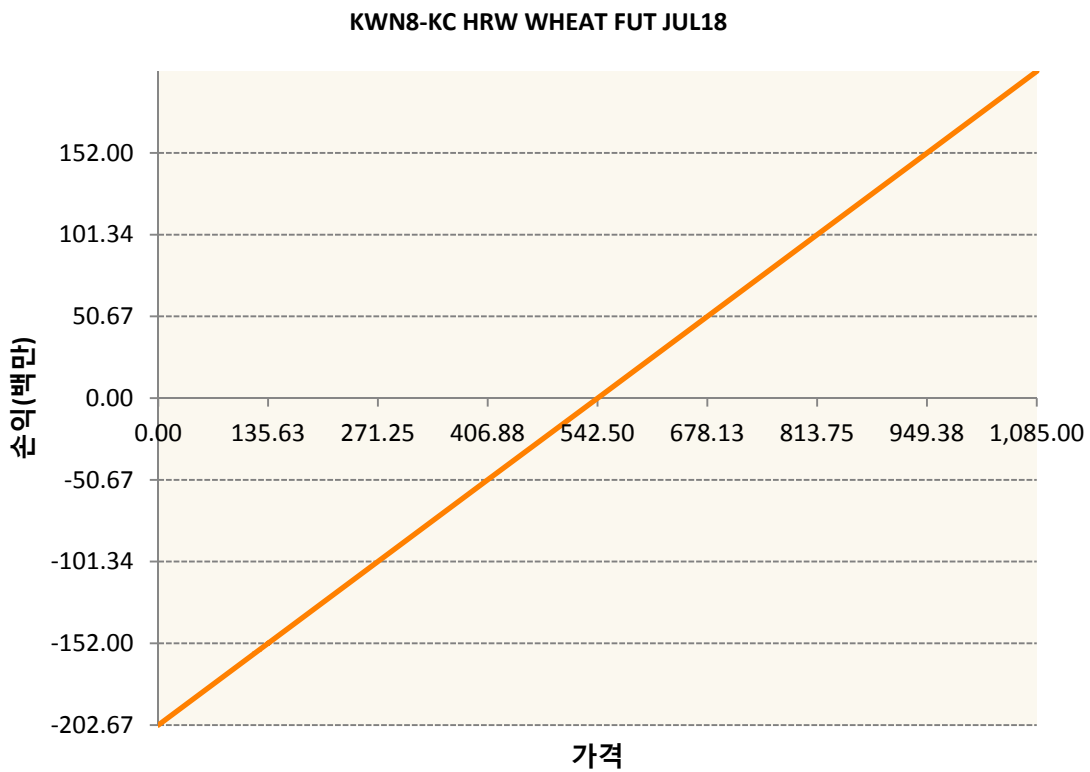
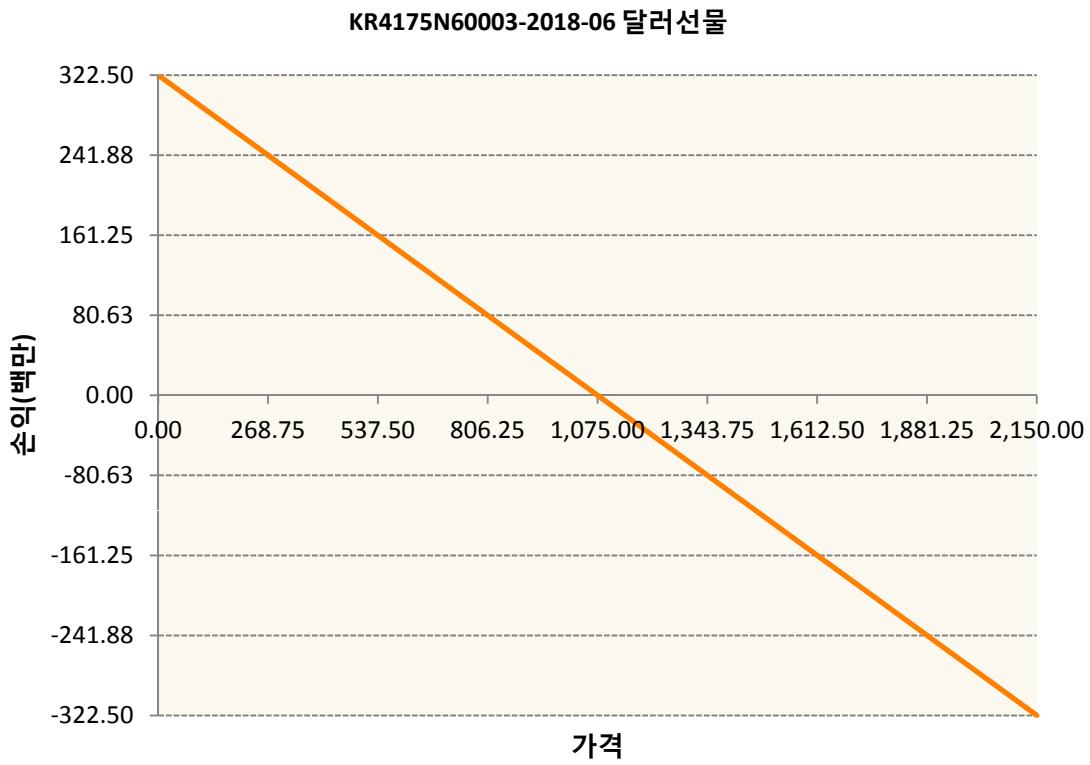
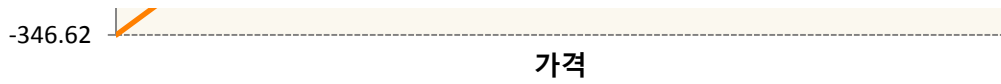


CTN8-COTTON NO.2 FUTR JUL18

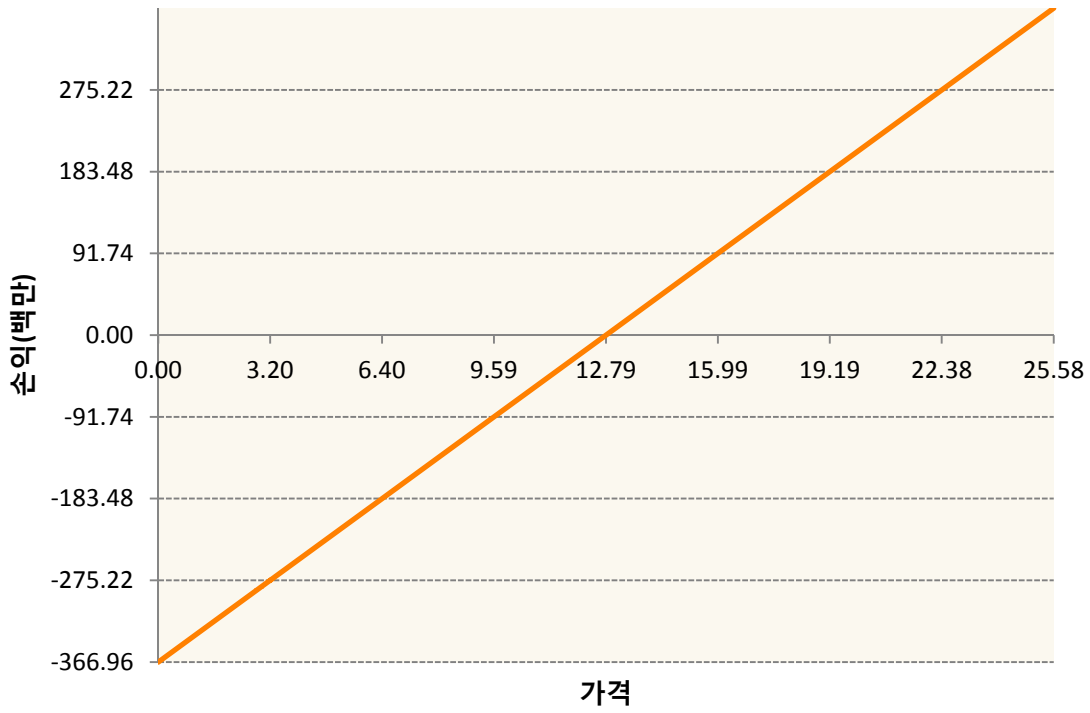


KCN8-COFFEE 'C' FUTURE JUL18

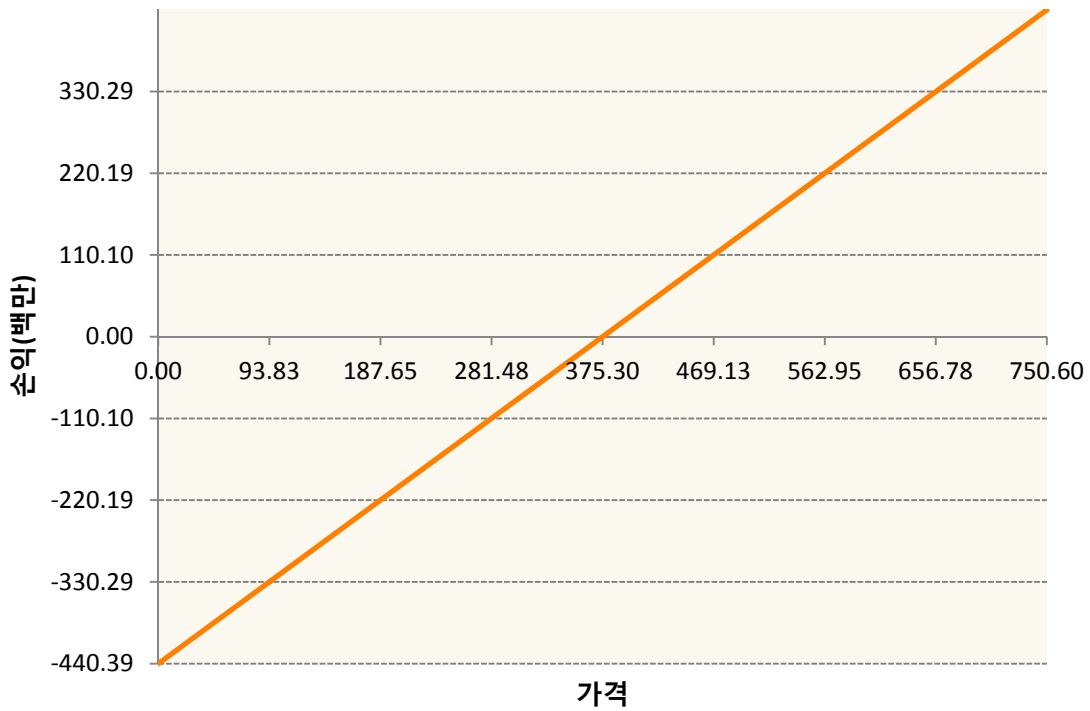




SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18

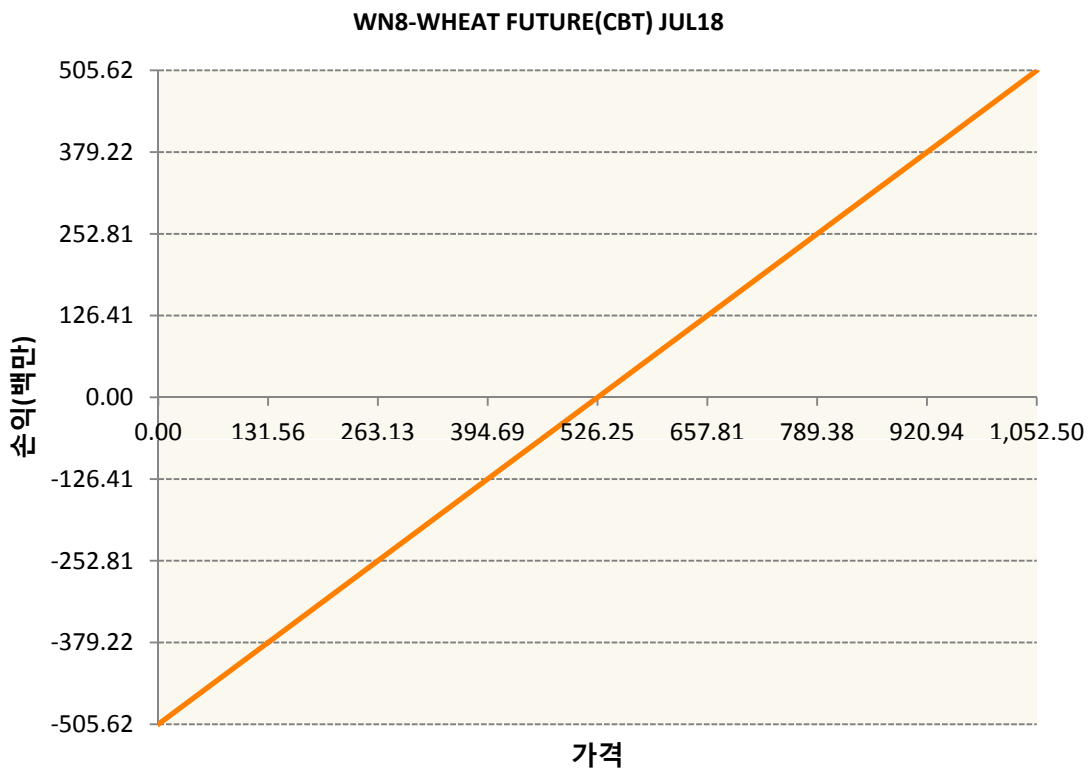
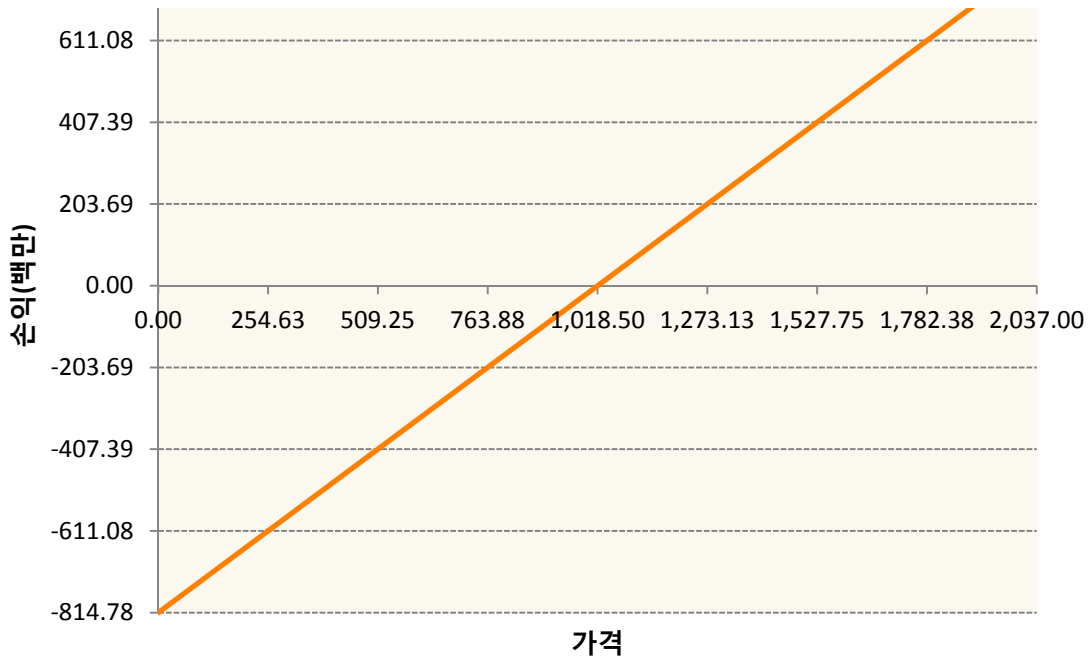


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18



SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BON8	SOYBEAN OIL FUTR JUL18	25
CN8	CORN FUTURE JUL18	72
CTN8	COTTON NO.2 FUTR JUL18	20
KCN8	COFFEE 'C' FUTURE JUL18	28
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)

338