

공시일	2018-06-05
기준일	2018-06-04

## 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)

83

공시일	2018-06-05
기준일	2018-06-04

## 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)

461

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-06-05
기준일	2018-06-04

## 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

376
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

404
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-06-05
기준일	2018-06-04

## 유로인덱스모(주식-파생형)

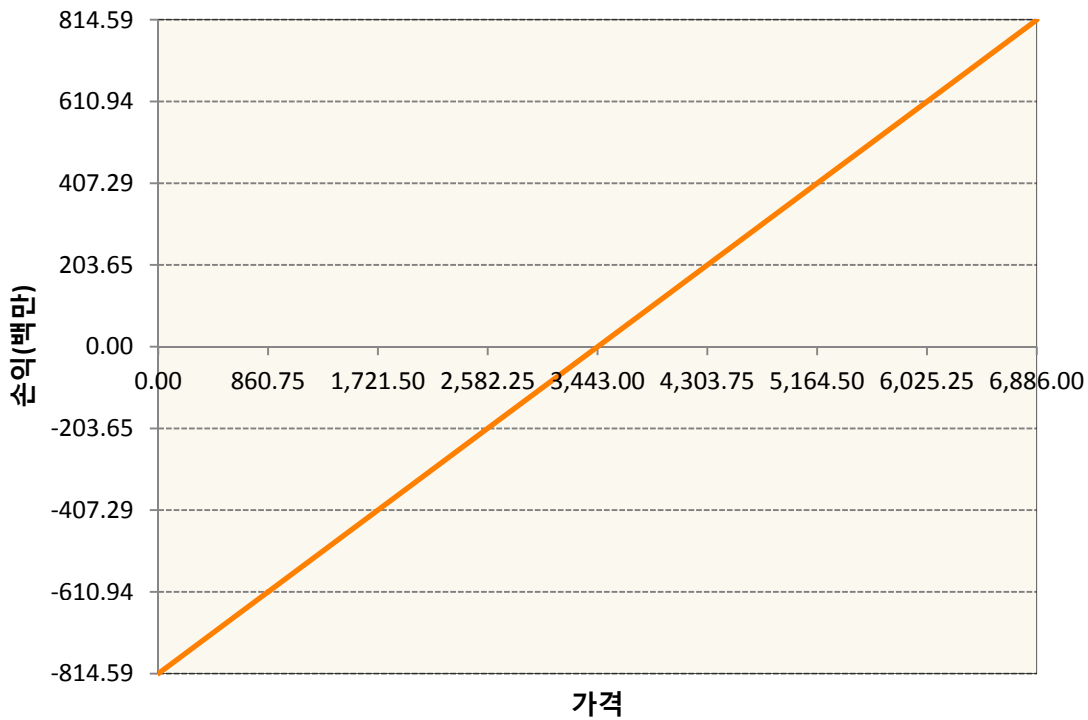
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	815	0	815	

### 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)

40
----

공시일	2018-06-05
기준일	2018-06-04

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

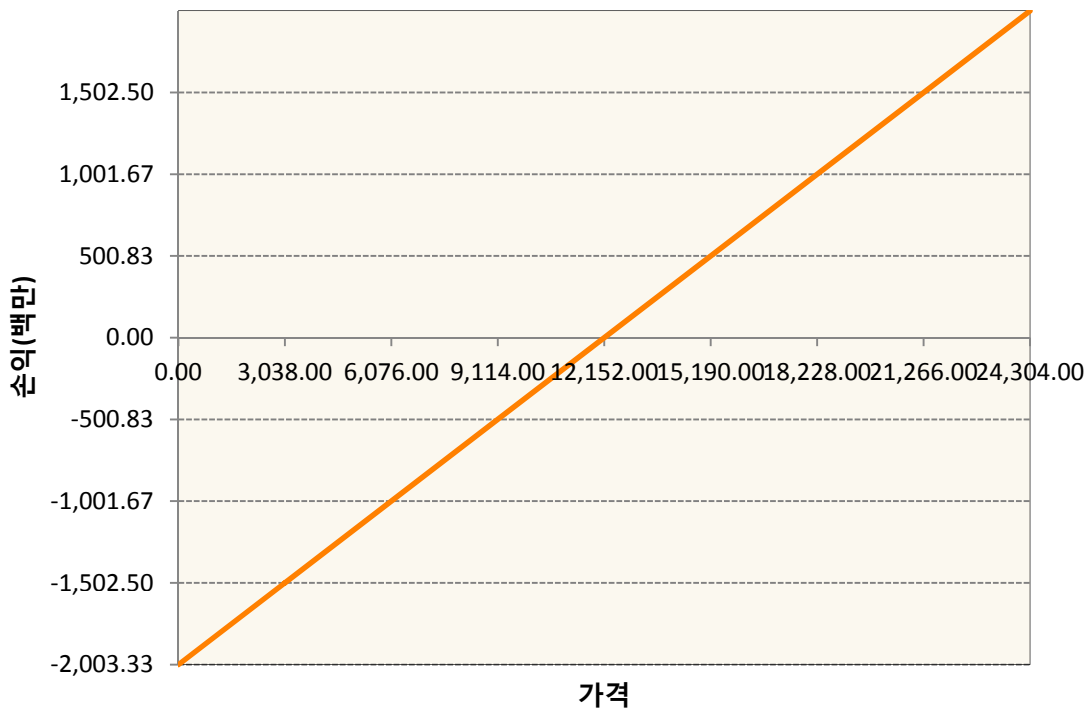
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

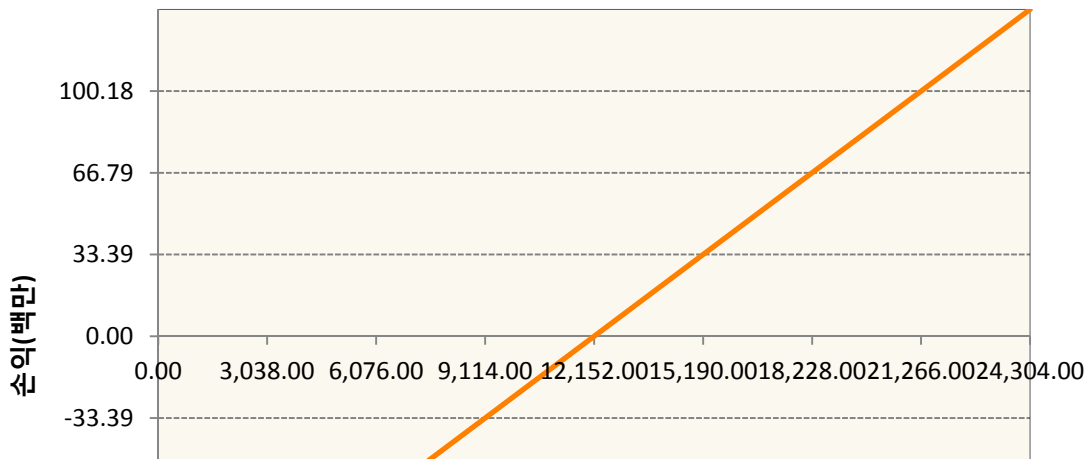
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,137	0	2,137	장내

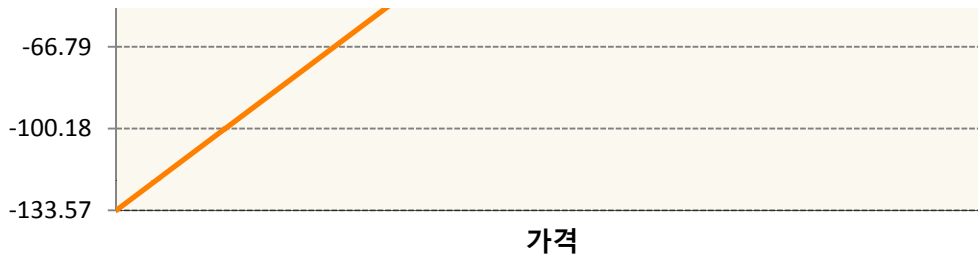
### 2. 만기시점의 손익구조

HCM8-HSCEI Futures Jun18



MHCM8-MINI H-SHR IDX FU Jun18





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

HCM8	HSCEI Futures Jun18	160
MHCM8	MINI H-SHR IDX FU Jun18	11

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

<b>151</b>
------------

공시일	2018-06-05
기준일	2018-06-04

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

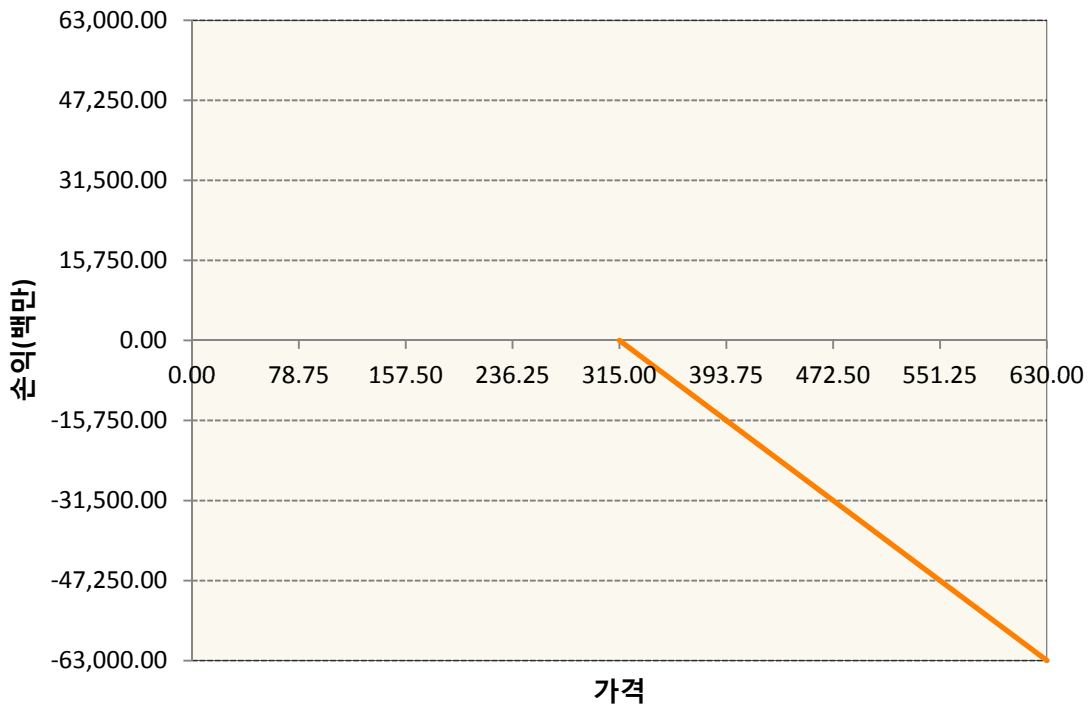
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

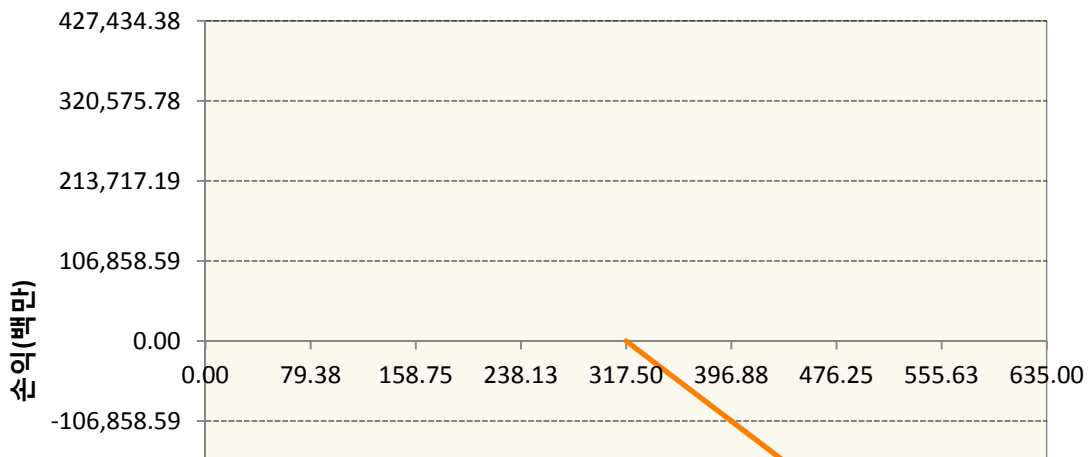
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	798,409	-798,409	장내

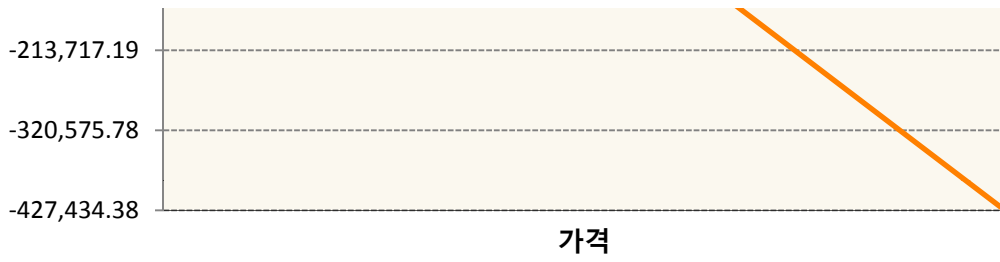
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63159-2018-06 콜315

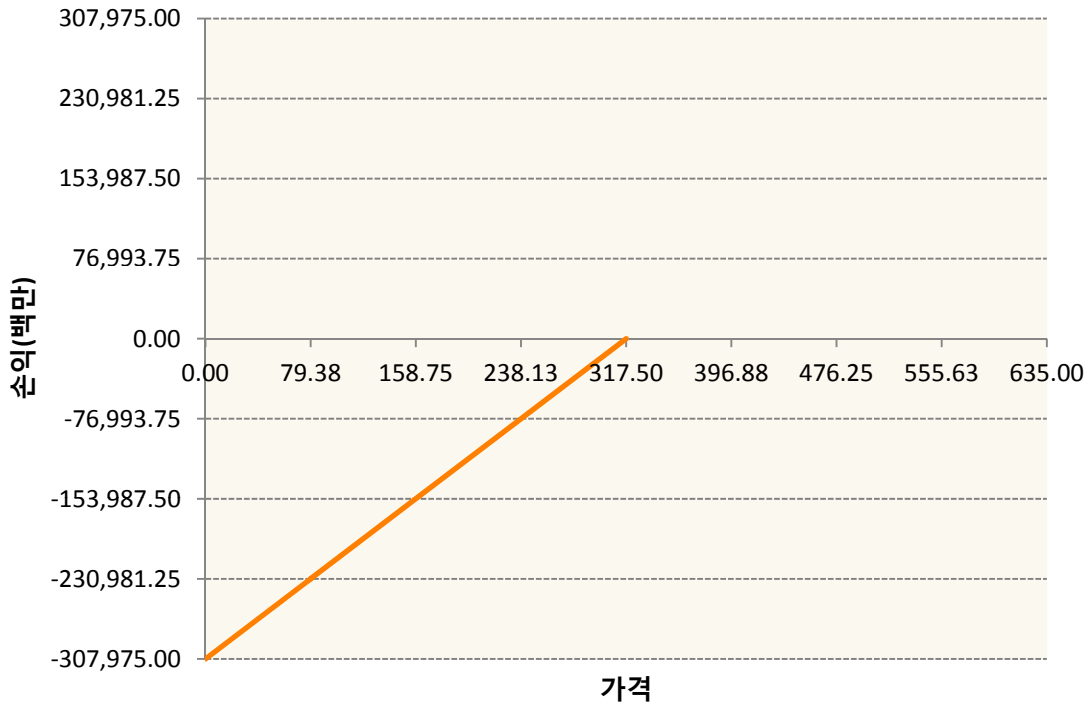


KR4201N63175-2018-06 콜317.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N6312018-06 콜315

4,026

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,130	1,123	1,113	1,098	1,078	1,054	1,025
-5.33%	1,087	1,058	1,022	980	932	880	823
-2.67%	879	808	733	656	575	493	410
0%	288	192	96	0	-96	-192	-288
2.67%	-799	-874	-953	-1,035	-1,118	-1,204	-1,291
5.33%	-2,255	-2,291	-2,334	-2,384	-2,439	-2,499	-2,563
8.00%	-3,878	-3,889	-3,905	-3,927	-3,955	-3,988	-4,026

KR4201N6312018-06 콜317.5

25,624

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,100	6,075	6,029	5,959	5,861	5,734	5,577

-5.33%	5,933	5,795	5,613	5,390	5,128	4,831	4,503
-2.67%	4,985	4,589	4,157	3,695	3,211	2,706	2,186
0%	1,900	1,270	636	0	-638	-1,277	-1,917
2.67%	-4,436	-5,017	-5,611	-6,215	-6,827	-7,444	-8,067
5.33%	-13,630	-13,953	-14,321	-14,728	-15,166	-15,631	-16,119
8.00%	-24,326	-24,439	-24,595	-24,794	-25,034	-25,311	-25,624

KR4301N6312018-06 풋317.5

22,935

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,935	-22,935	-22,935	-22,935	-22,935	-22,935	-22,935
-5.33%	-14,795	-14,795	-14,796	-14,798	-14,801	-14,807	-14,816
-2.67%	-6,676	-6,698	-6,731	-6,776	-6,833	-6,902	-6,981
0%	578	389	196	0	-199	-400	-603
2.67%	3,751	3,629	3,494	3,348	3,192	3,029	2,860
5.33%	4,059	4,052	4,039	4,017	3,987	3,947	3,896
8.00%	4,064	4,064	4,063	4,063	4,061	4,058	4,052

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

(단위:백만원)

**60,469**

공시일	2018-06-05
기준일	2018-06-04

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

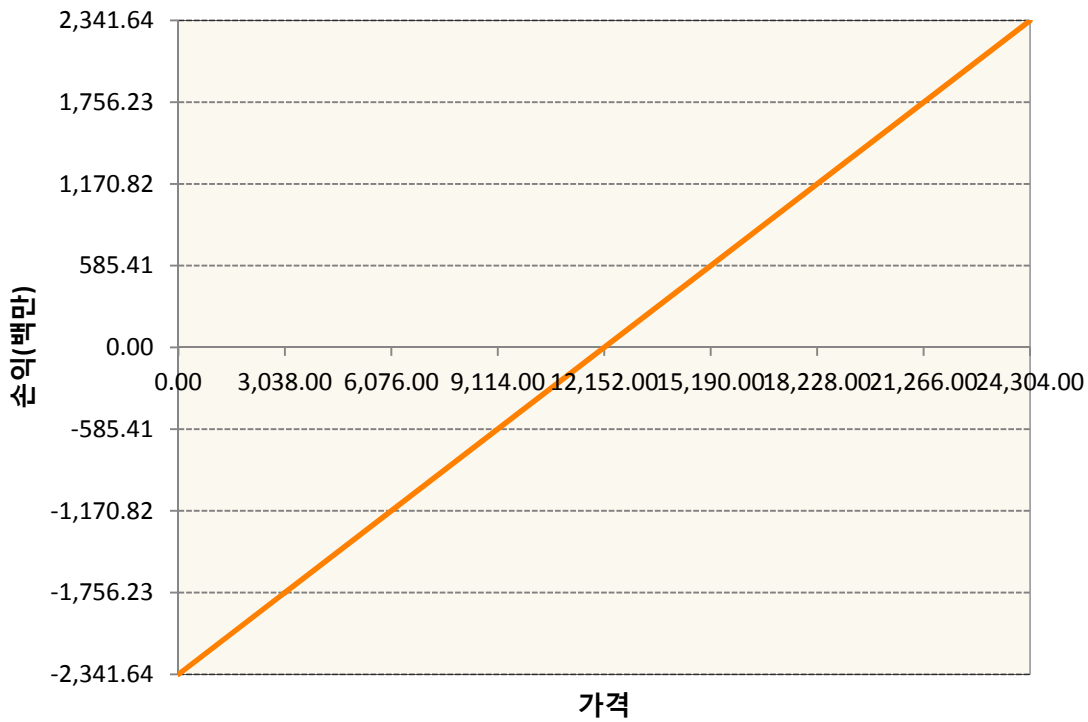
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

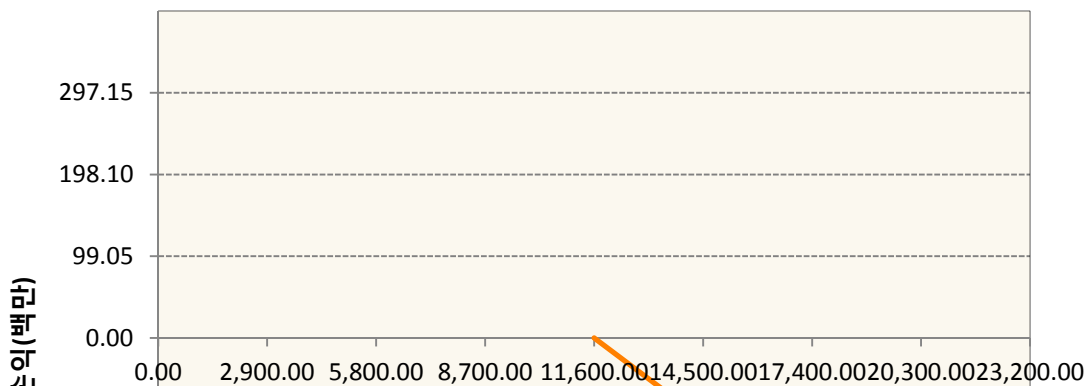
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,342	0	2,342	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,790	-5,790	장내

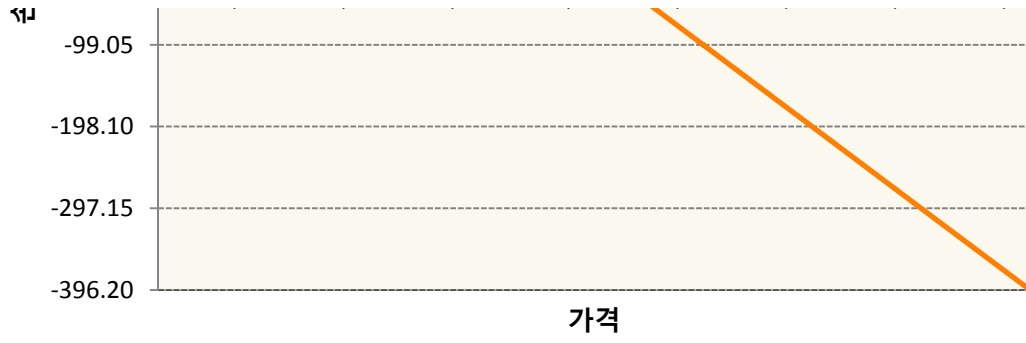
### 2. 만기시점의 손익구조

HCM8-HSCEI Futures Jun18

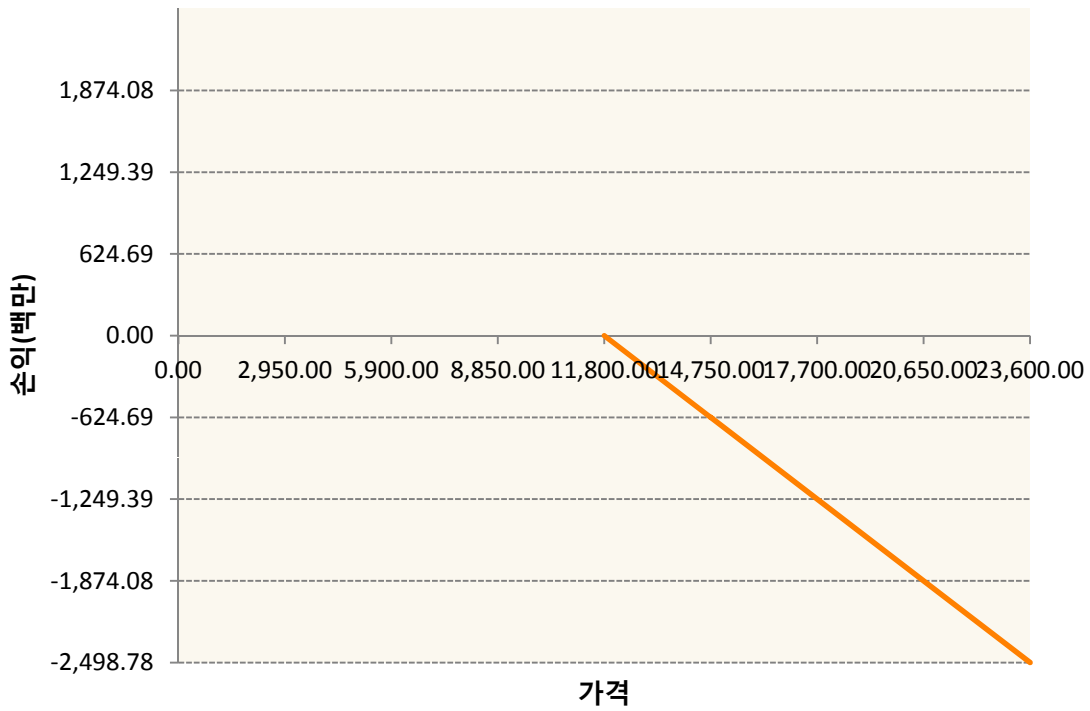


OHHIM8-C116-HSCEI

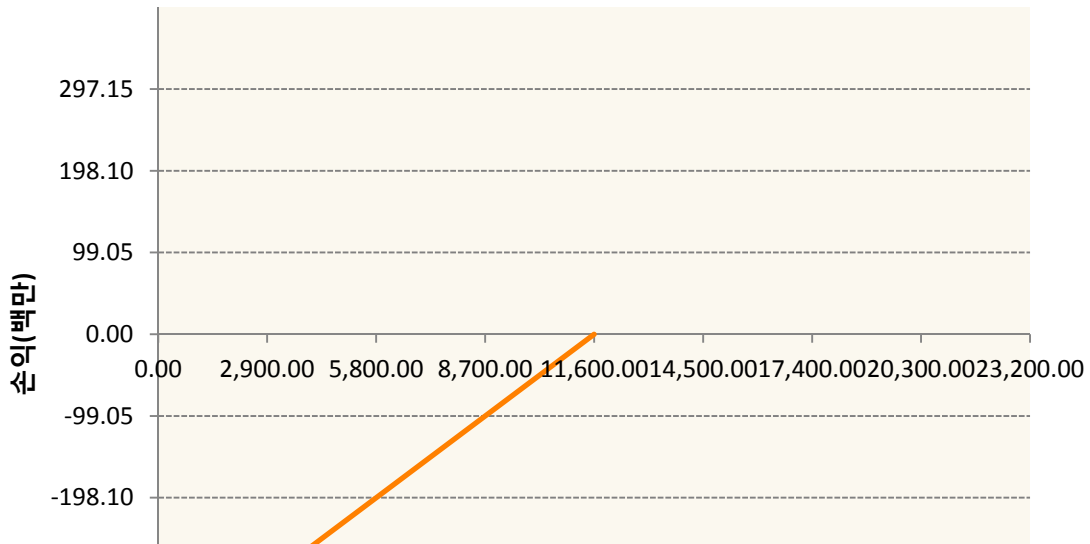


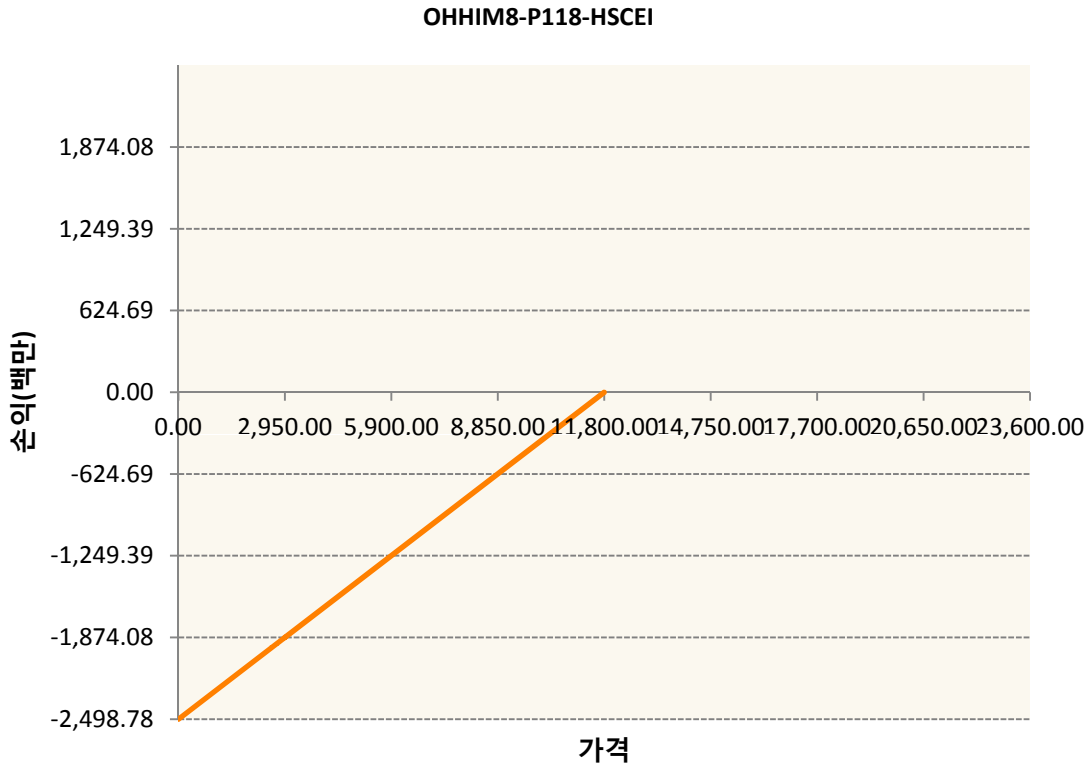
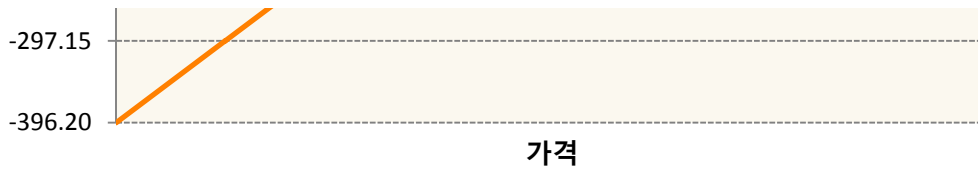


OHHIM8-C118-HSCEI



OHHIM8-P116-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCM8	HSCEI Futures Jun18	187
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)
	576

공시일	2018-06-05
기준일	2018-06-04

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

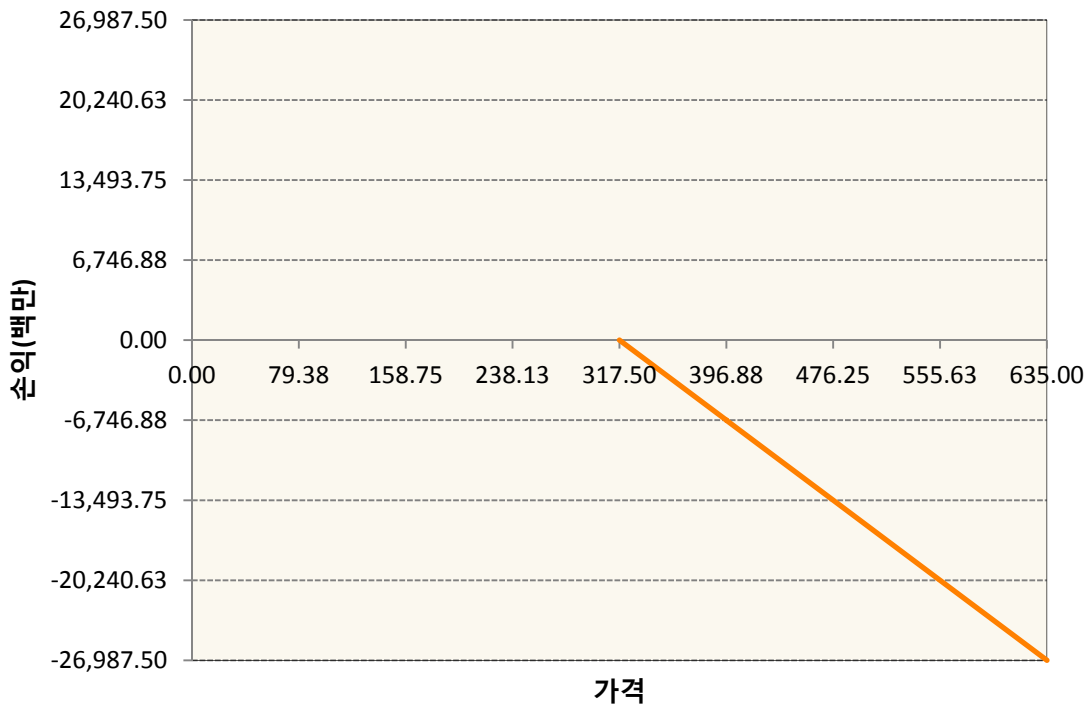
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

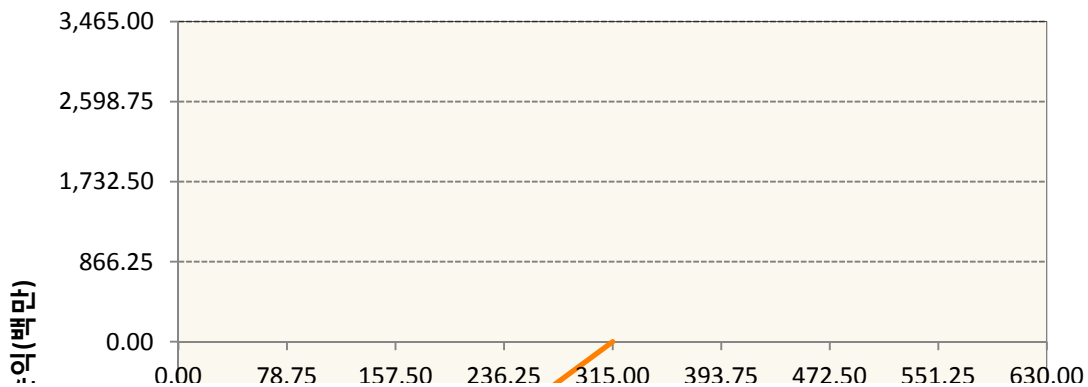
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	46,804	-46,804	장내

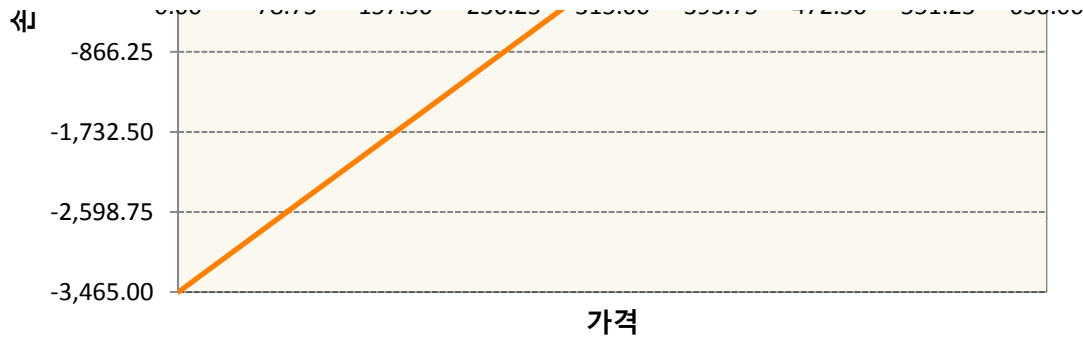
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63175-2018-06 콜317.5

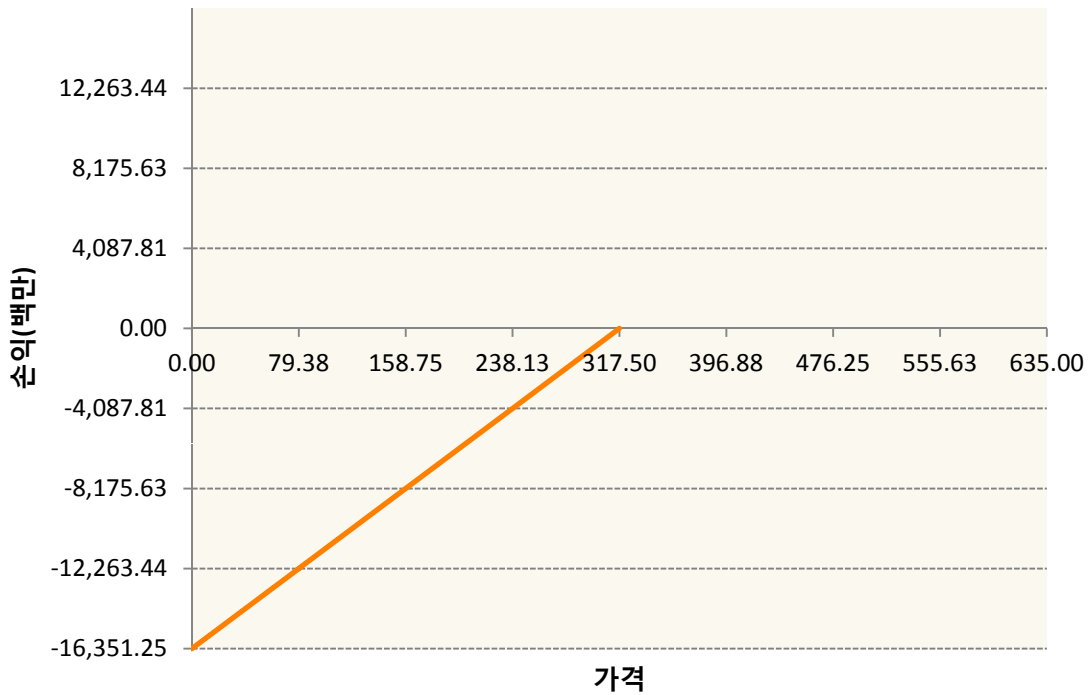


KR4301N63157-2018-06 풋315





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_2							1,476
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,476	-1,476	-1,476	-1,476	-1,476	-1,476	-1,476
-5.33%	-984	-984	-984	-984	-984	-984	-984
-2.67%	-492	-492	-492	-492	-492	-492	-492
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	492	492	492	492	492	492	492
5.33%	984	984	984	984	984	984	984
8.00%	1,476	1,476	1,476	1,476	1,476	1,476	1,476
2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_3							279
	기초자산의 변동성						



0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	213	213	213	213	213	213	213
5.33%	425	425	425	425	425	425	425
8.00%	638	638	638	638	638	638	638

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX\_12

479

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-479	-479	-479	-479	-479	-479	-479
-5.33%	-319	-319	-319	-319	-319	-319	-319
-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%	319	319	319	319	319	319	319
8.00%	479	479	479	479	479	479	479

KR4201N6312018-06 콜317.5

1,618

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	385	384	381	376	370	362	352
-5.33%	375	366	354	340	324	305	284
-2.67%	315	290	262	233	203	171	138
0%	120	80	40	0	-40	-81	-121
2.67%	-280	-317	-354	-392	-431	-470	-509
5.33%	-861	-881	-904	-930	-958	-987	-1,018
8.00%	-1,536	-1,543	-1,553	-1,565	-1,581	-1,598	-1,618

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%	-156	-156	-156	-157	-157	-157	-157
-2.67%	-65	-66	-66	-67	-68	-70	-71
0%	7	5	2	0	-2	-5	-7
2.67%	29	28	27	26	25	23	22
5.33%	30	30	30	30	30	29	29
8.00%	30	30	30	30	30	30	30

KR4301N6312018-06 풋317.5

1,218

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,218	-1,218	-1,218	-1,218	-1,218	-1,218	-1,218
-5.33%	-786	-786	-786	-786	-786	-786	-787
-2.67%	-354	-356	-357	-360	-363	-366	-371
0%	31	21	10	0	-11	-21	-32
2.67%	199	193	186	178	169	161	152
5.33%	216	215	214	213	212	210	207
8.00%	216	216	216	216	216	215	215

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

(단위:백만원)

7,409

공시일	2018-06-05
기준일	2018-06-04

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

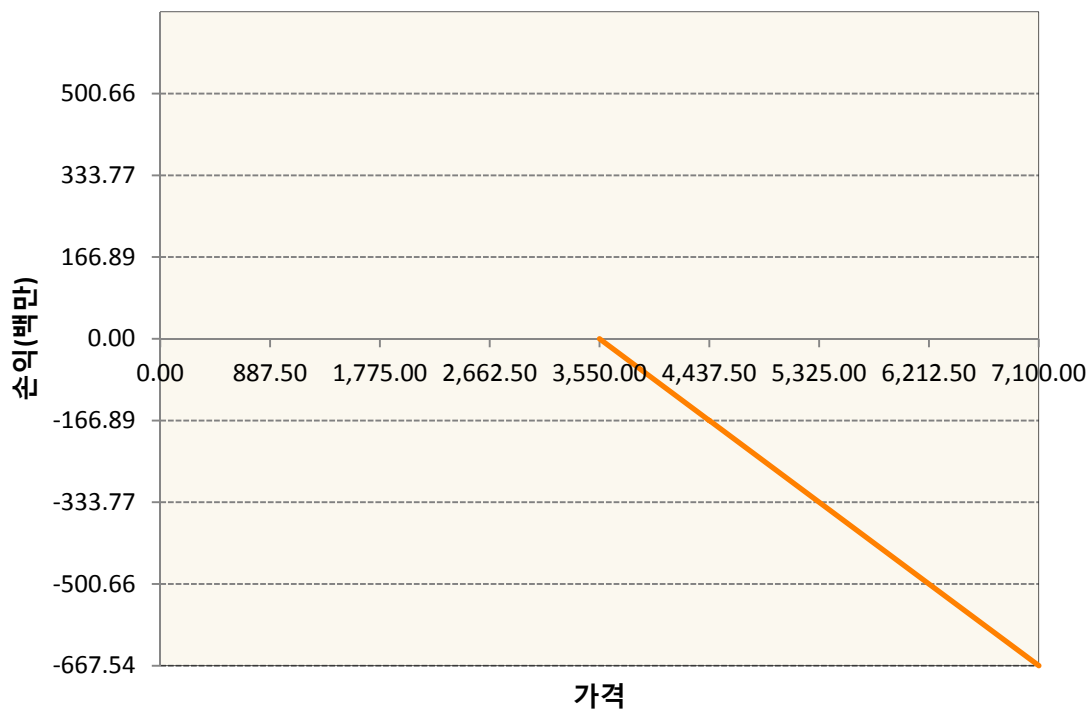
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

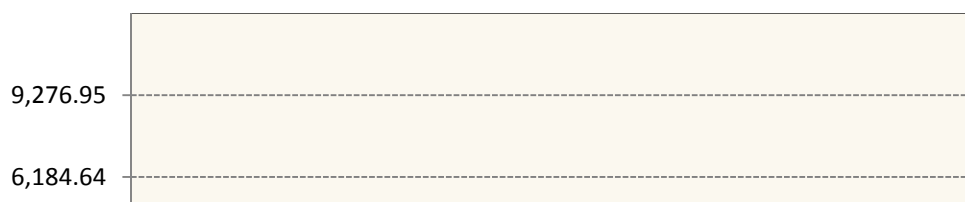
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,914	0	4,914	
누계	유가증권	스왑	52,855	0	52,855	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,074	-26,074	장내
누계	지수	스왑	50,146	0	50,146	장외

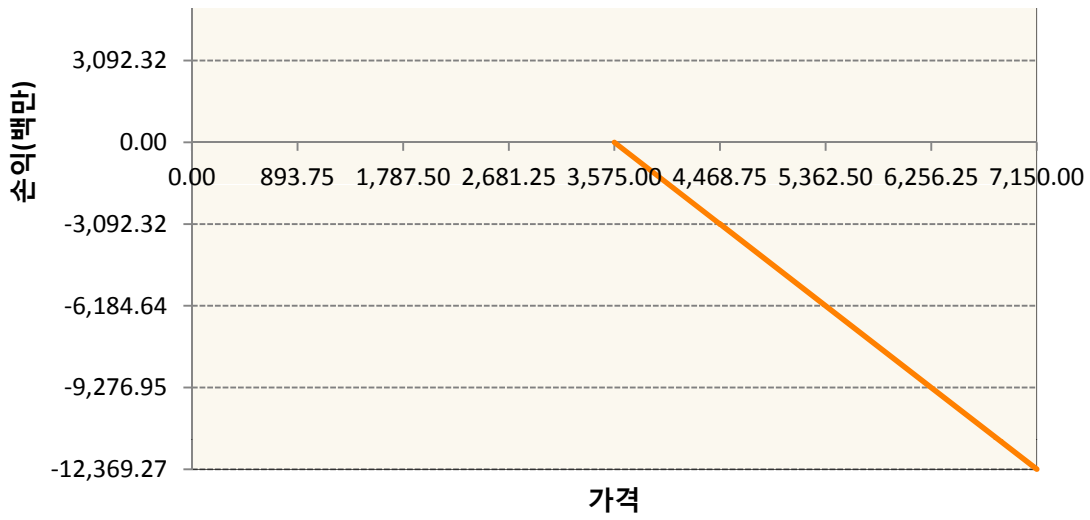
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXM8-C3550-EURO STOXX 50**

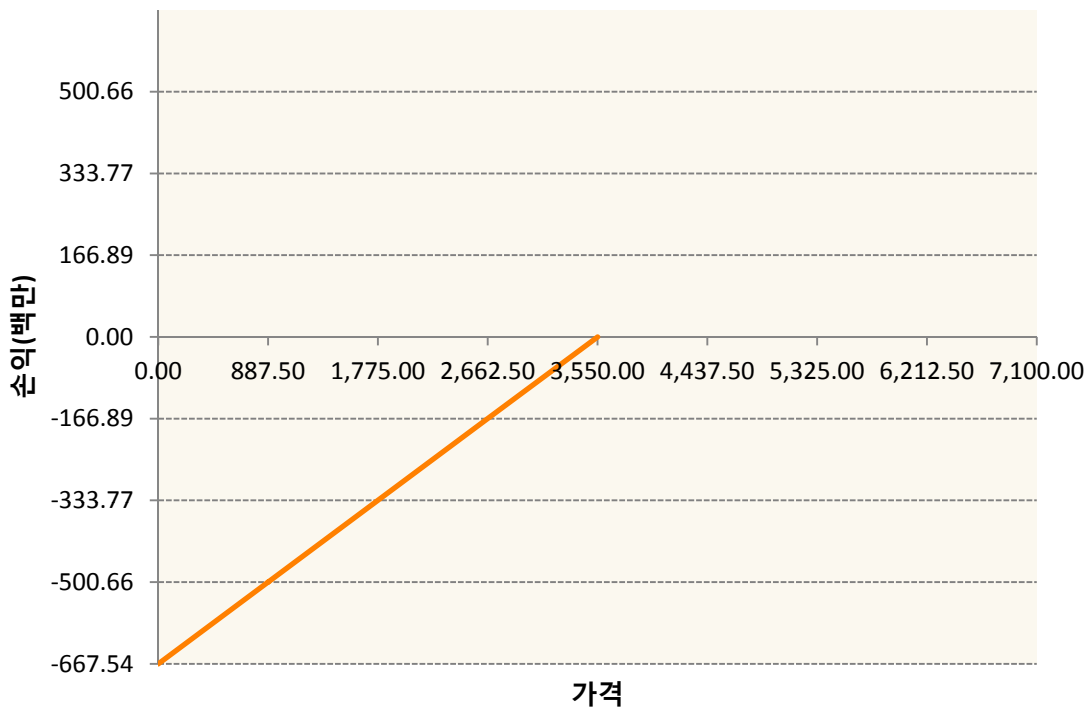


**OESXM8-C3575-EURO STOXX 50**

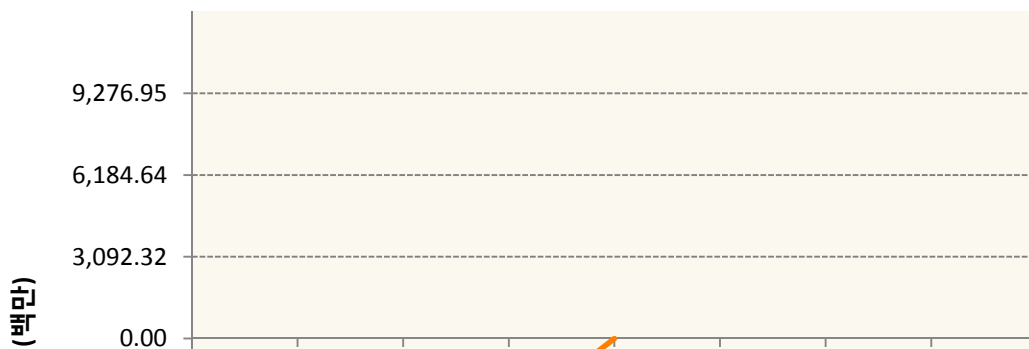


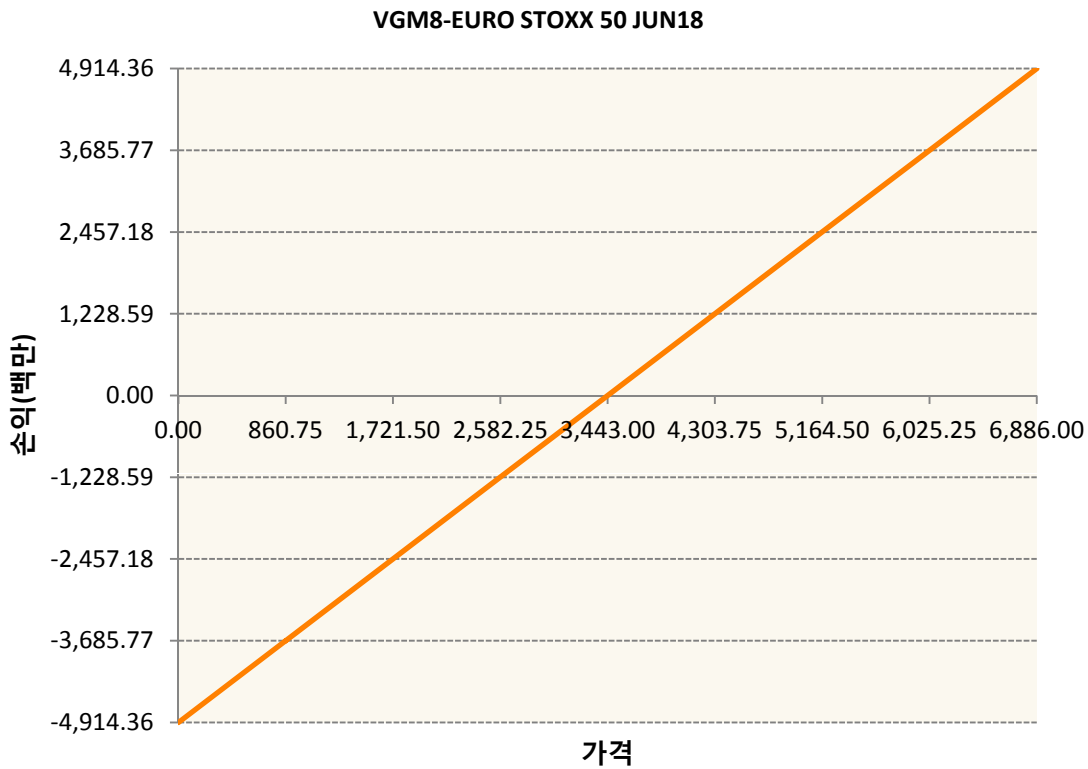
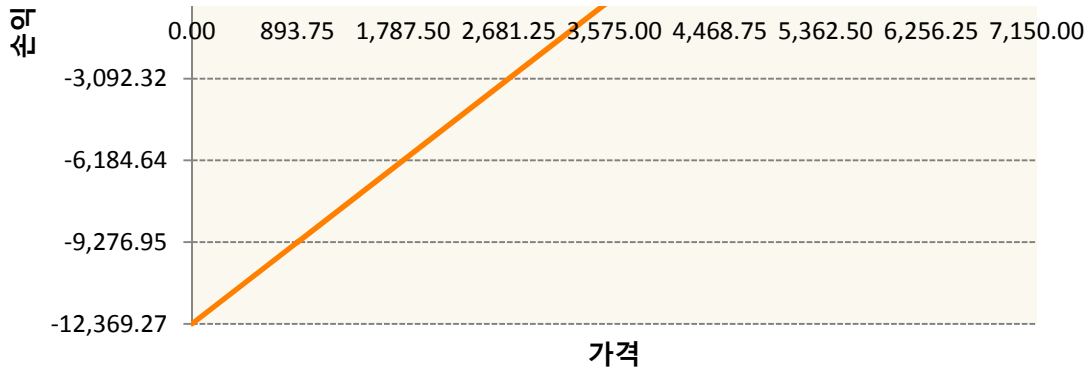


OESXM8-P3550-EURO STOXX 50



OESXM8-P3575-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		24
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		26
OESXM8-C3 EURO STOXX 50		53
OESXM8-C3 EURO STOXX 50		990
OESXM8-P3! EURO STOXX 50		53
OESXM8-P3! EURO STOXX 50		990
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18		393

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





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

(단위:백만원)

1,178



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



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

(단위:백만원)

41

공시일	2018-06-05
기준일	2018-06-04

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

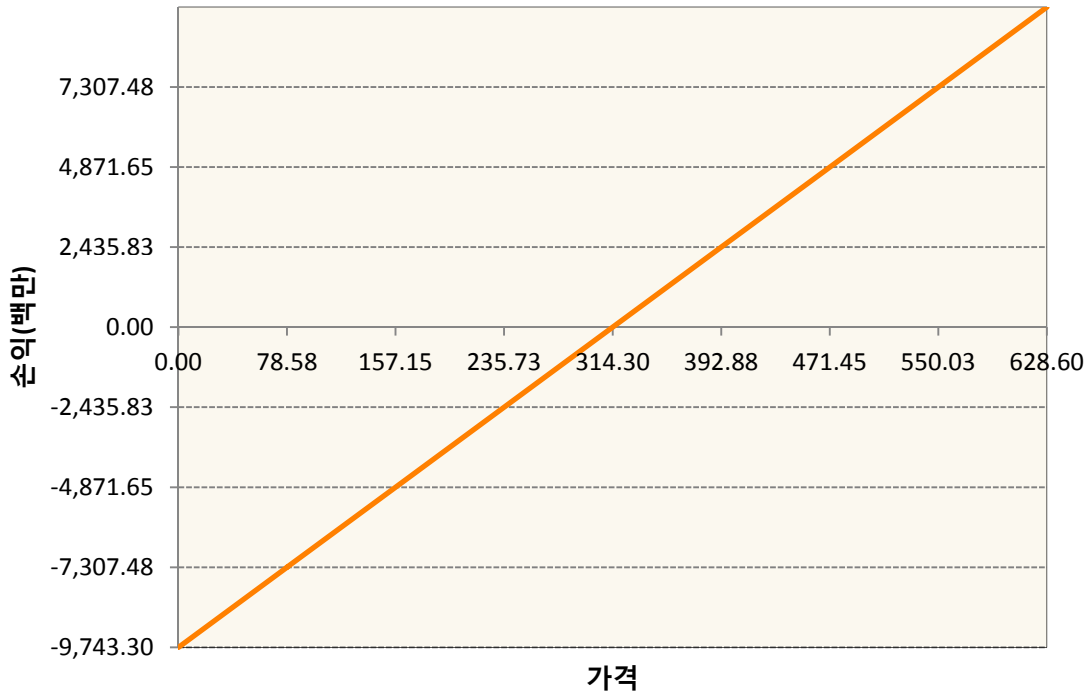
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

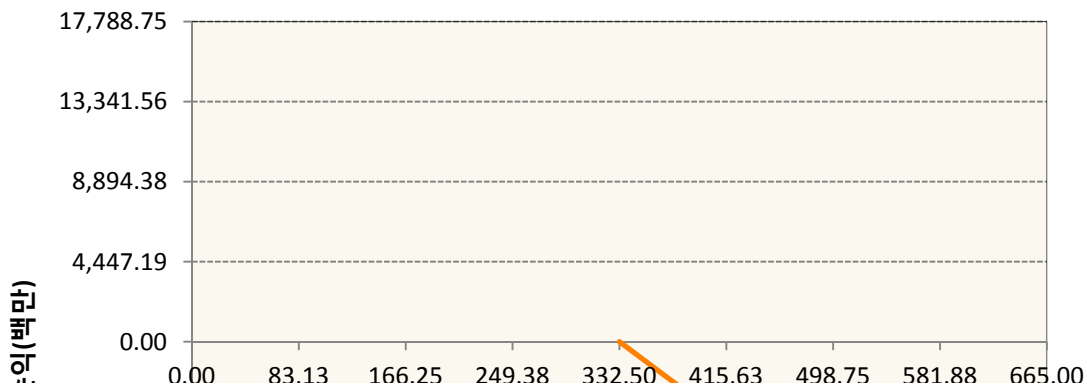
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	785	0	785	장내
신규	유가증권	옵션	78	831	-753	장내
누계	유가증권	선물	9,743	0	9,743	장내
누계	유가증권	옵션	1,905	17,789	-15,884	장내

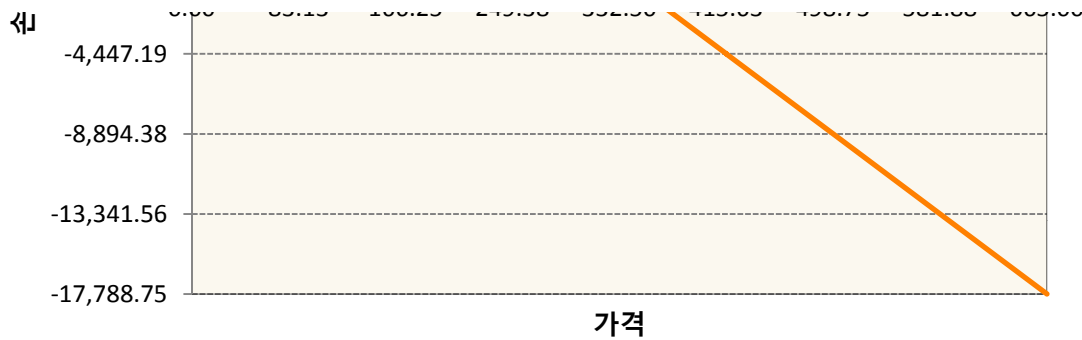
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

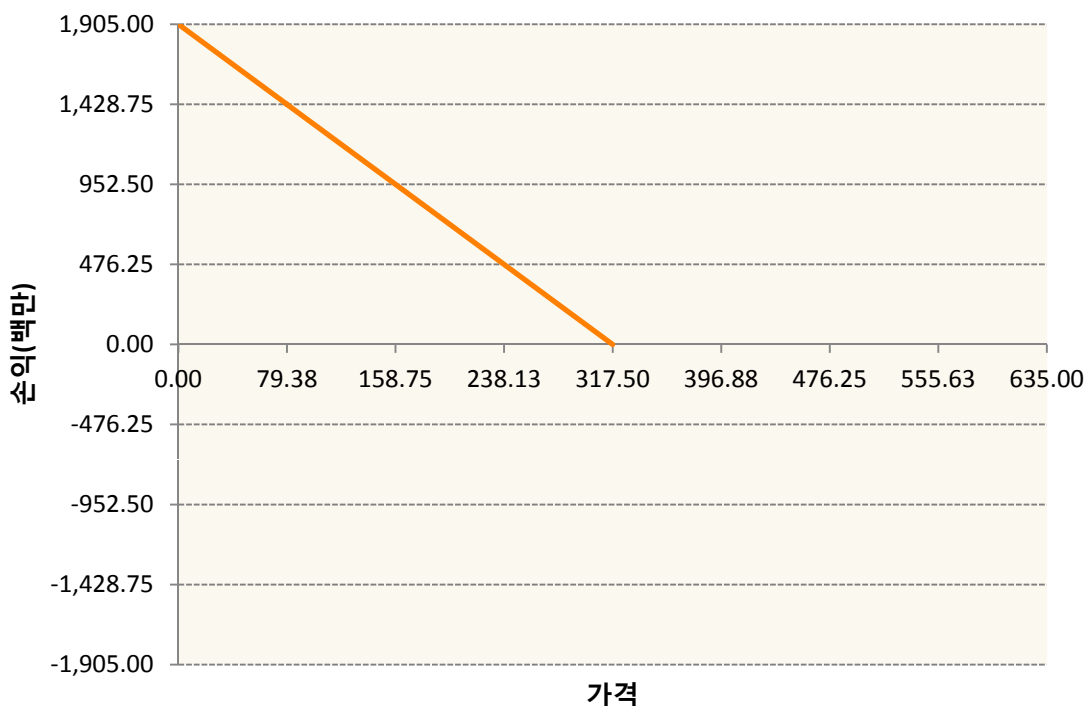


KR4201N63324-2018-06 콜332.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물							781
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-781	-781	-781	-781	-781	-781	-781
-5.33%	-521	-521	-521	-521	-521	-521	-521
-2.67%	-260	-260	-260	-260	-260	-260	-260
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	260	260	260	260	260	260	260
5.33%	521	521	521	521	521	521	521
8.00%	781	781	781	781	781	781	781
KR4201N63E 2018-06 콜332.5							598
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	45	45	45	45	45	44	43
-5.33%	45	45	44	43	41	39	35
-2.67%	44	41	38	34	28	20	11
0%	31	23	12	0	-14	-29	-45
2.67%	-24	-44	-65	-87	-109	-132	-155
5.33%	-176	-203	-230	-257	-284	-311	-338
8.00%	-453	-476	-499	-523	-548	-572	-598

KR4301N6312018-06 풋317.5

142

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	142	142	142	142	142	142	142
-5.33%	92	92	92	92	92	92	92
-2.67%	41	41	42	42	42	43	43
0%	-4	-2	-1	0	1	2	4
2.67%	-23	-22	-22	-21	-20	-19	-18
5.33%	-25	-25	-25	-25	-25	-24	-24
8.00%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25

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

(단위:백만원)

**1,085**

공시일	2018-06-05
기준일	2018-06-04

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

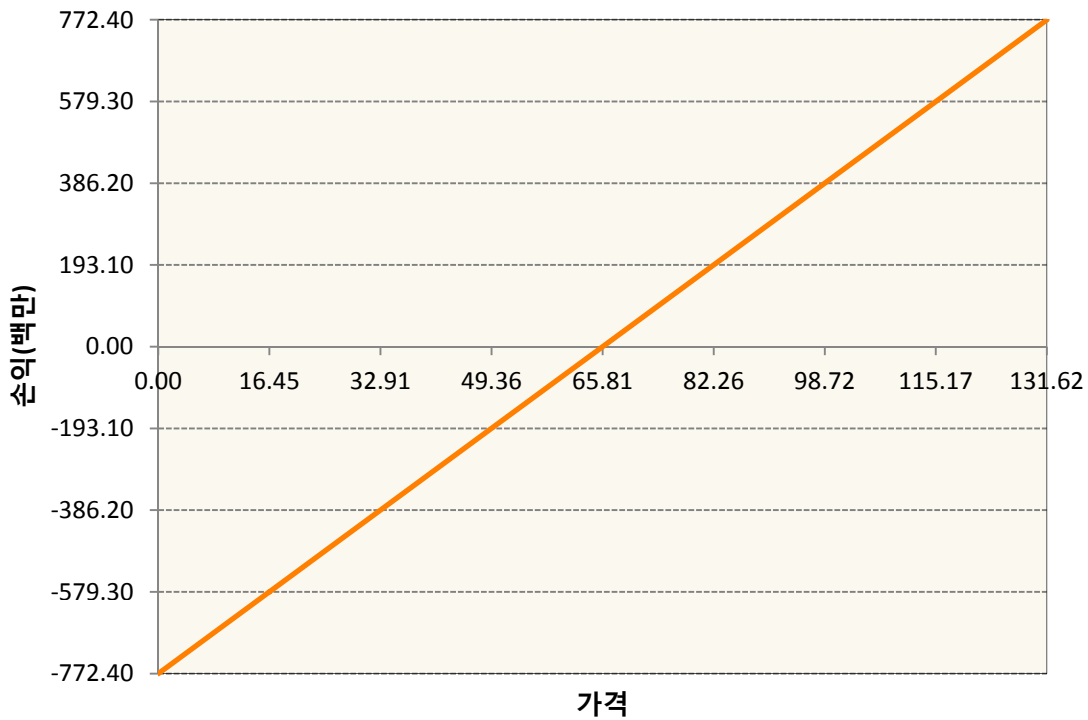
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

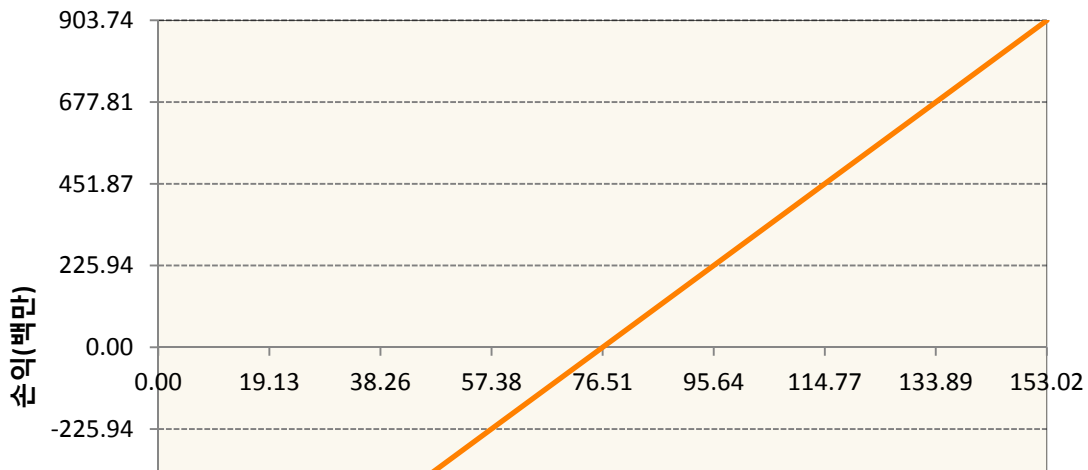
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,847	589	3,257	

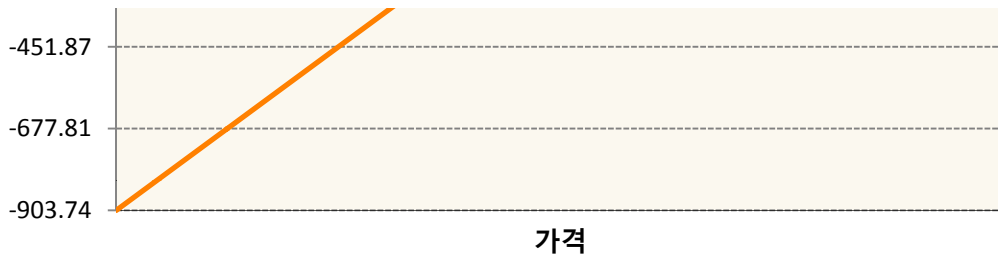
### 2. 만기시점의 손익구조

**CLN8-WTI CRUDE FUTURE JUL18**

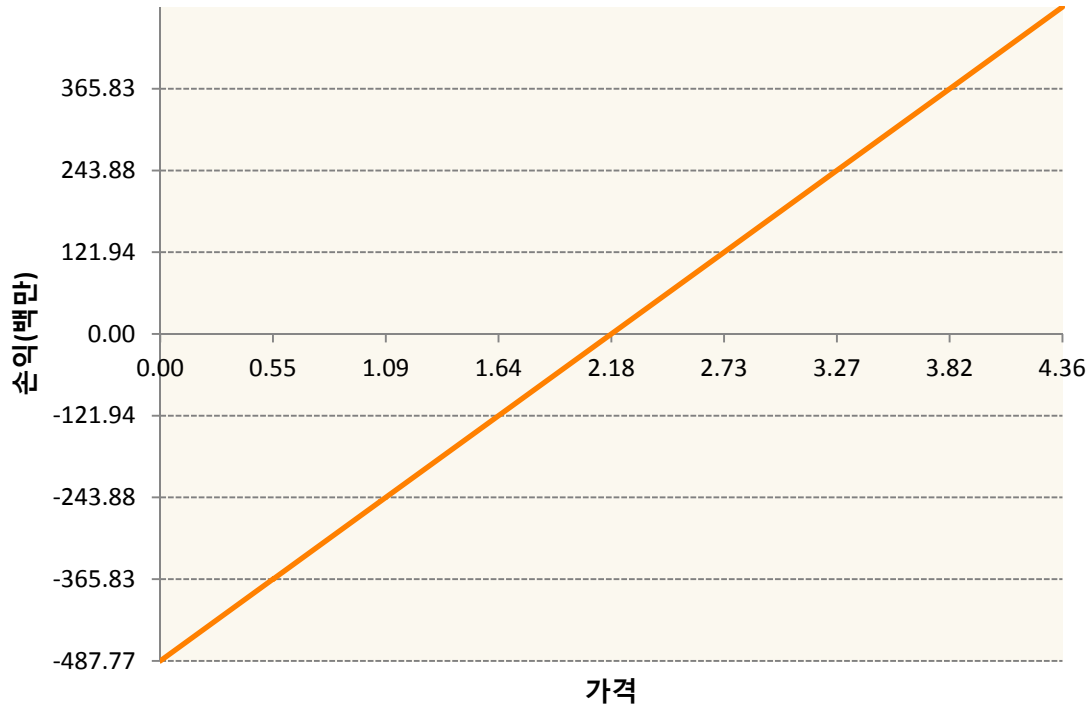


**COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18**

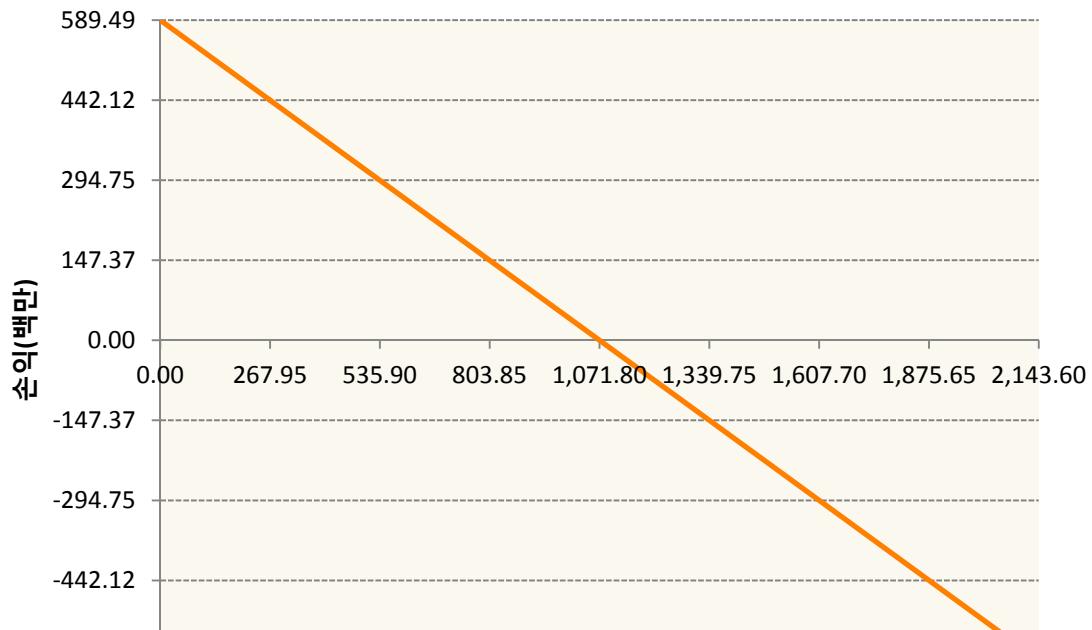


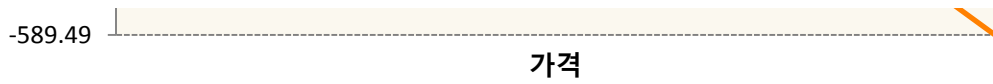


HON8-NY Harb ULSD Fut JUL18

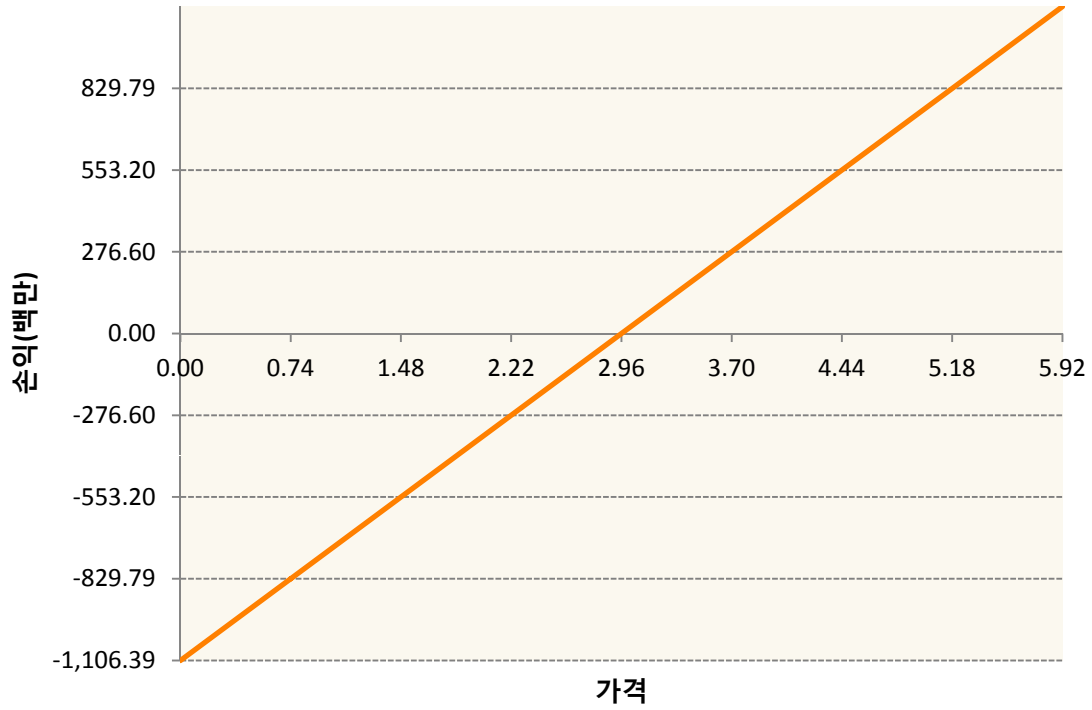


KR4175N60003-2018-06 달러선물

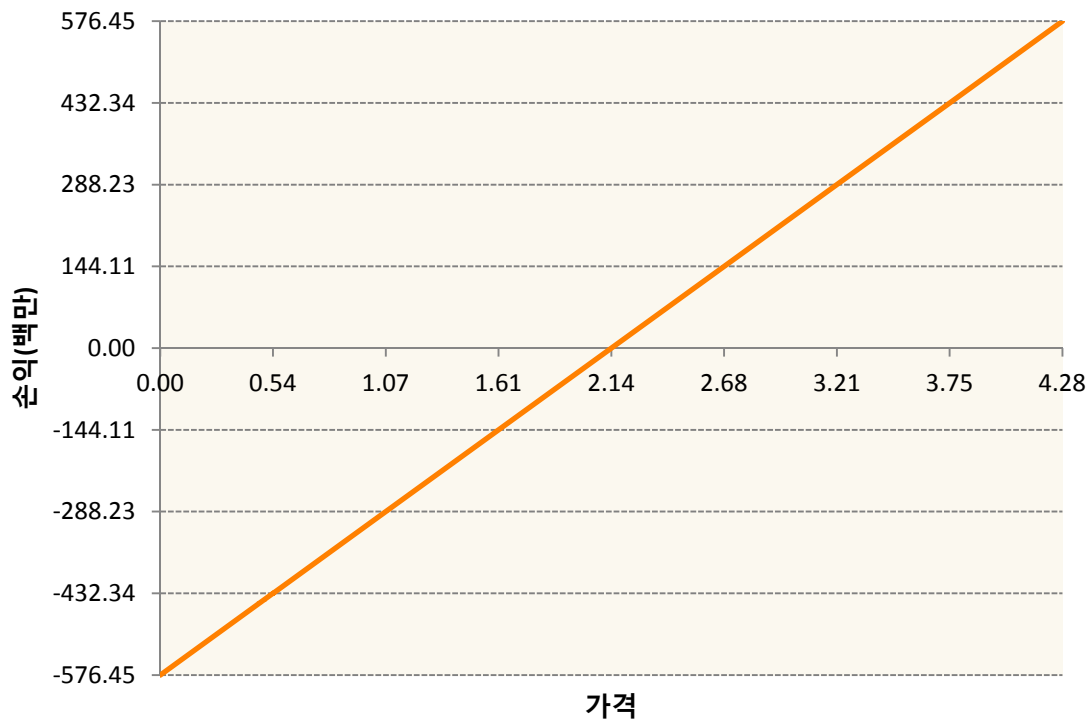




NGN8-NATURAL GAS FUTR JUL18



XBN8-GASOLINE RBOB FUT JUL18



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

CLN8	WTI CRUDE FUTURE JUL18	62
COU8	BRENT CRUDE FUTR SEP18	72
HON8	NY Harb ULSD Fut JUL18	39
KR4175N60C	2018-06 달러선물	47
NGN8	NATURAL GAS FUTR JUL18	89
XBN8	GASOLINE RBOB FUT JUL18	46

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

465

공시일	2018-06-05
기준일	2018-06-04

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

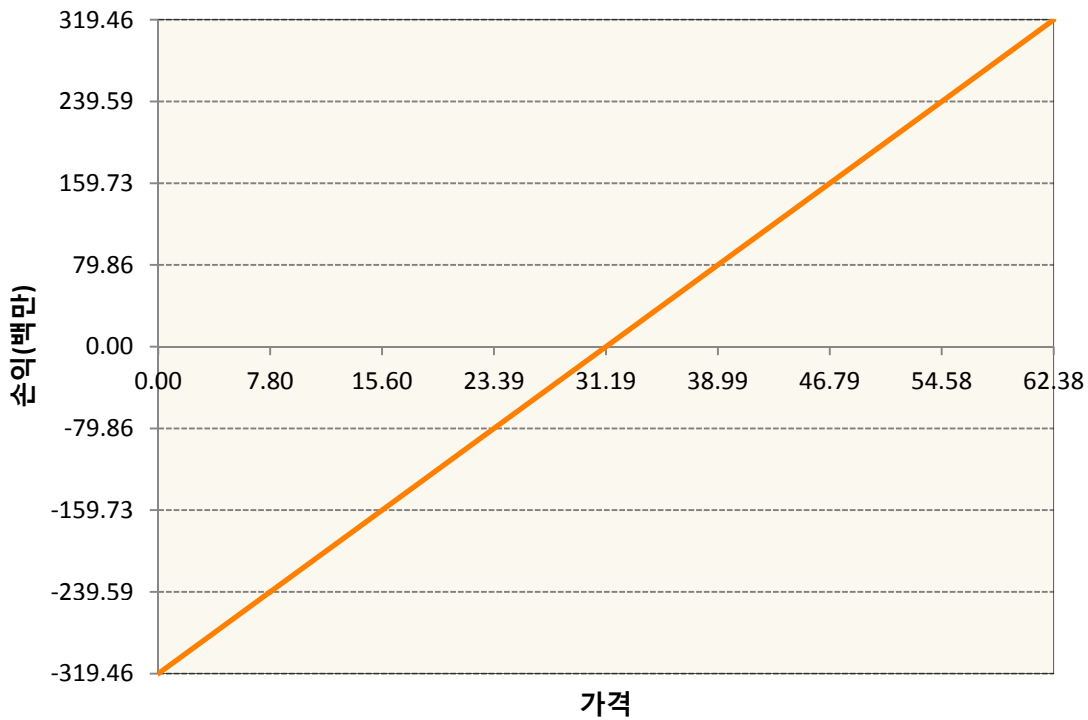
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

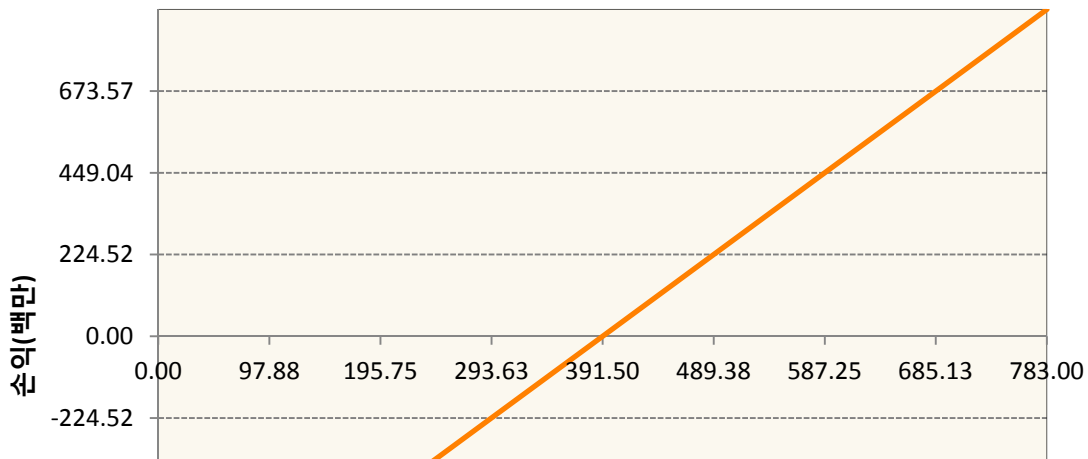
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,130	322	3,809	

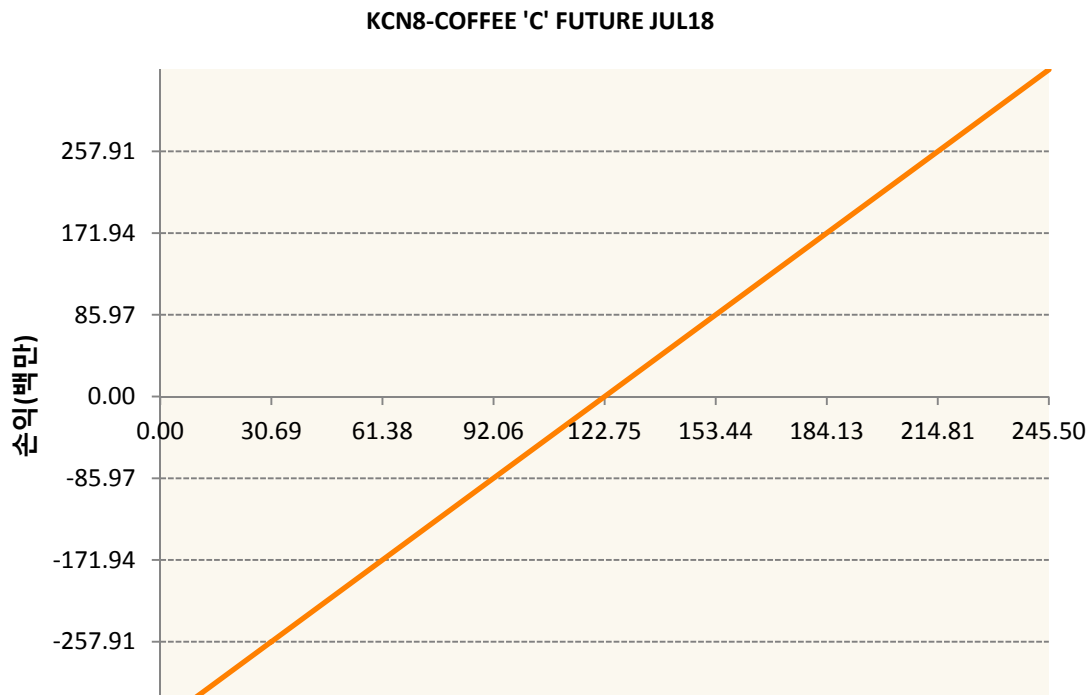
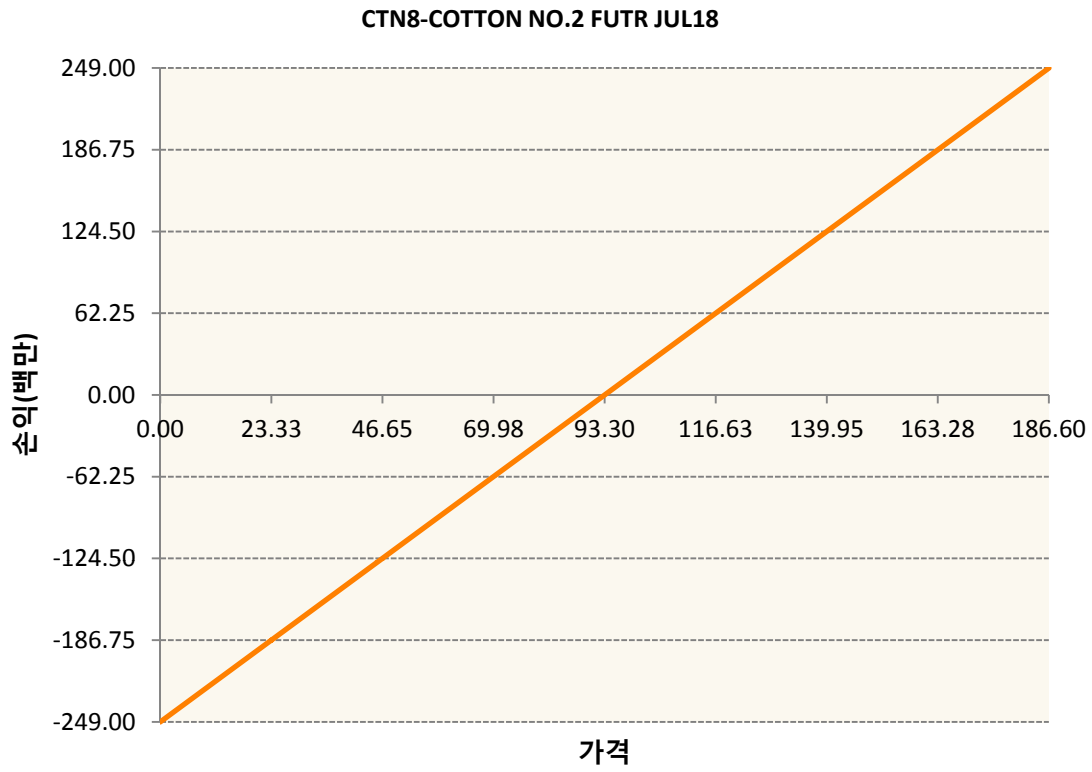
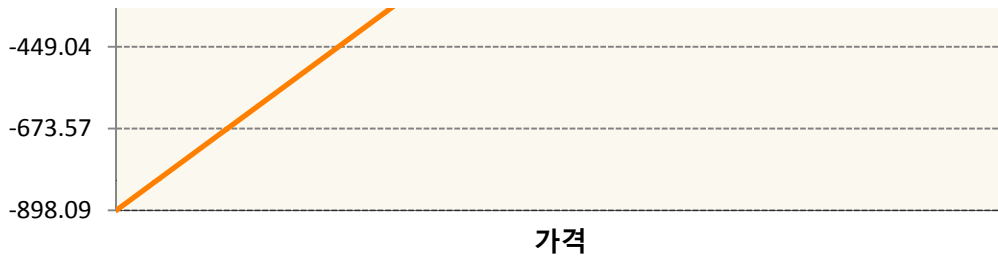
### 2. 만기시점의 손익구조

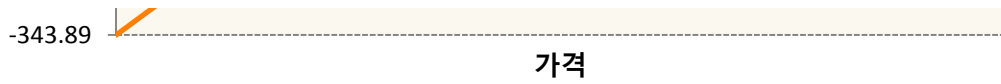
**BON8-SOYBEAN OIL FUTR JUL18**



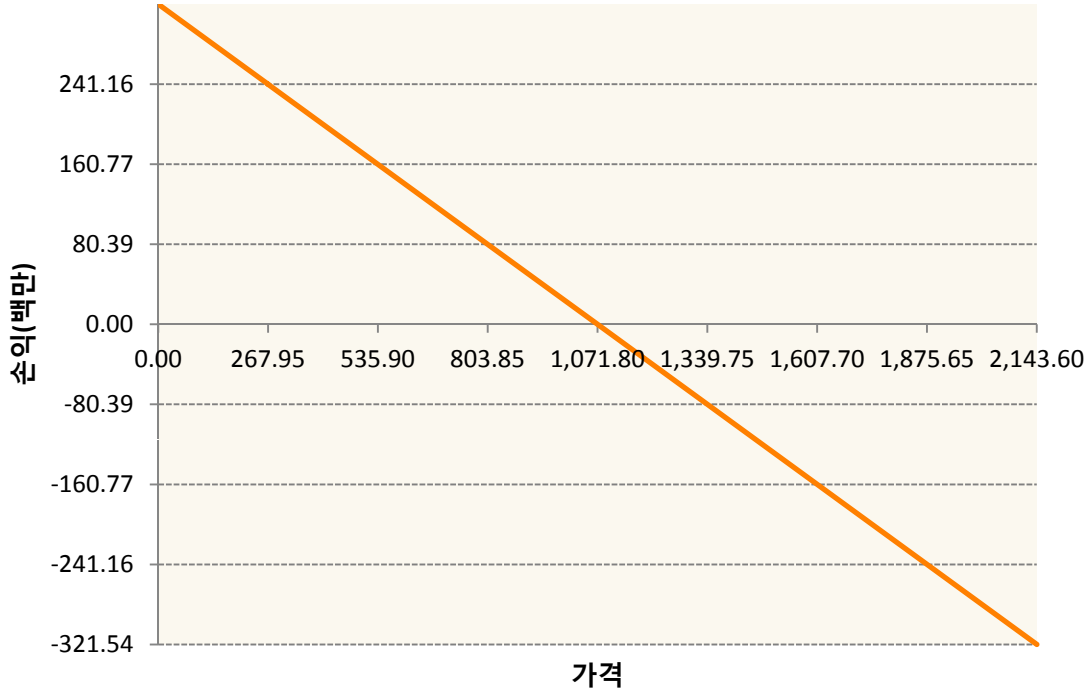
**CN8-CORN FUTURE JUL18**



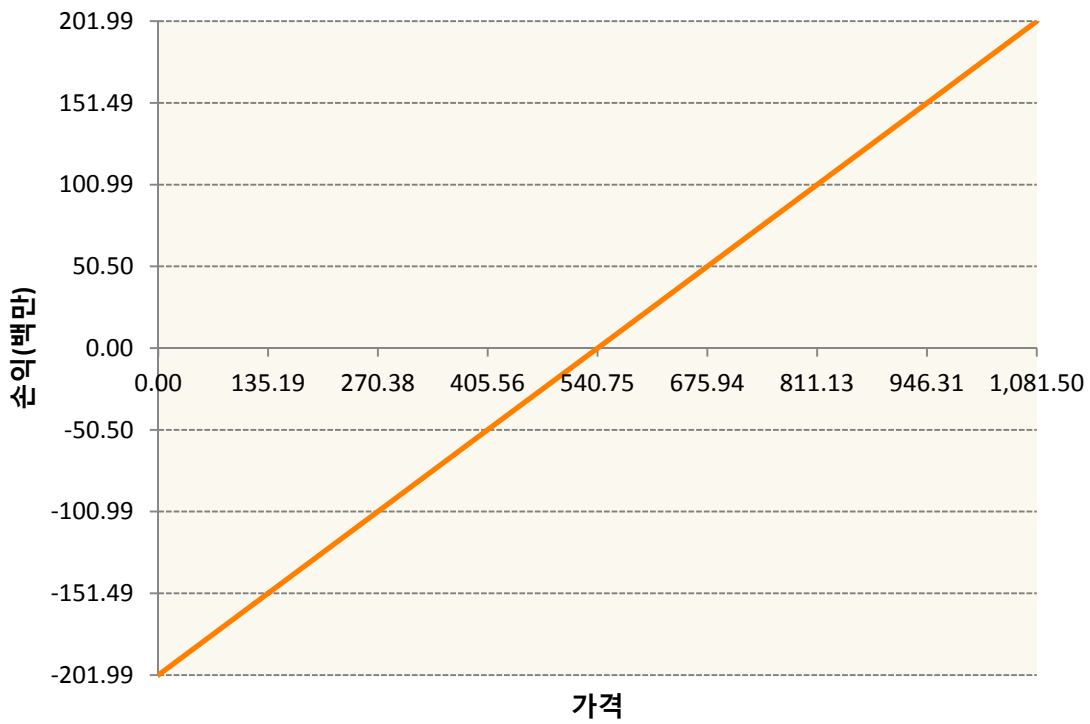




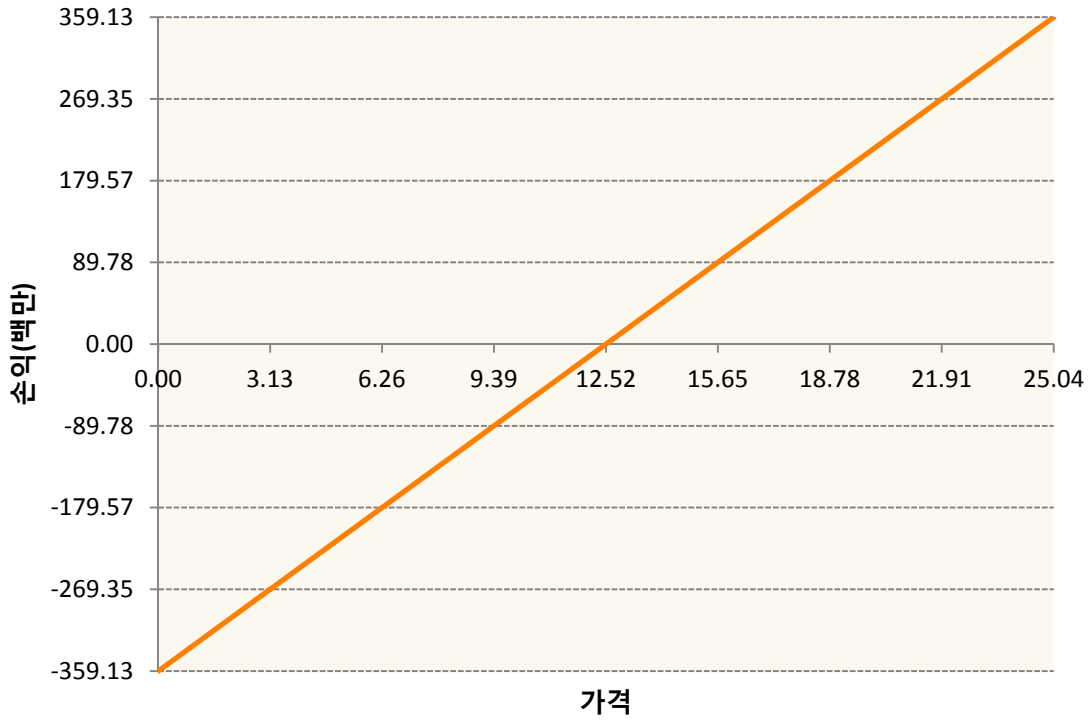
KR4175N60003-2018-06 달러선물



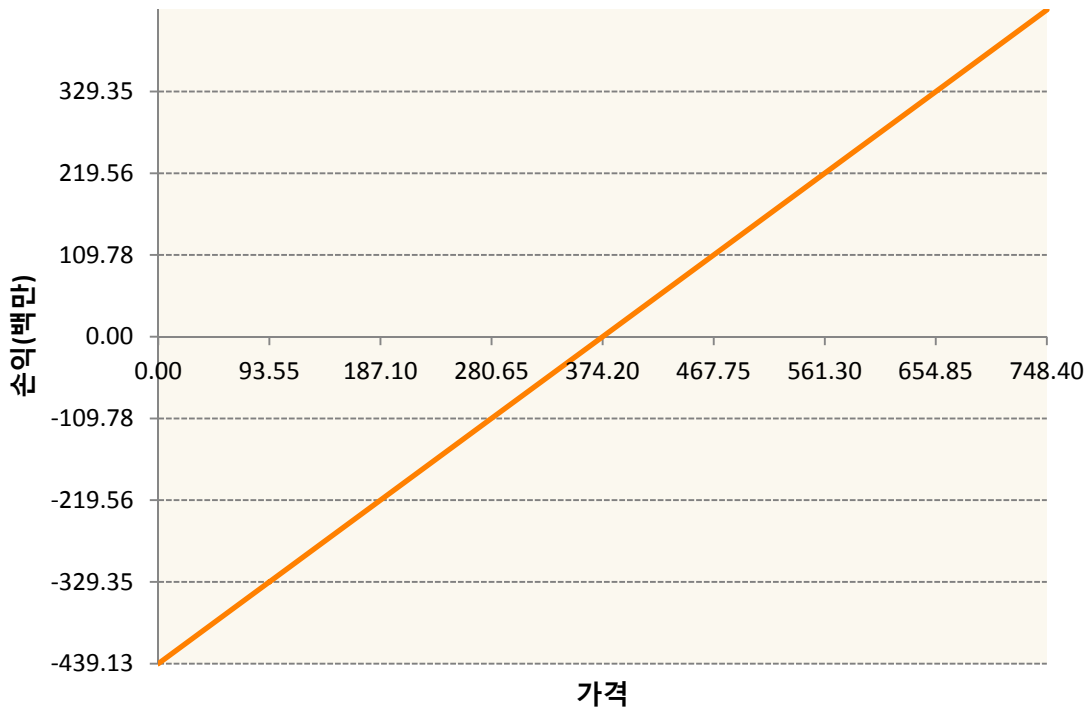
KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18



SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18

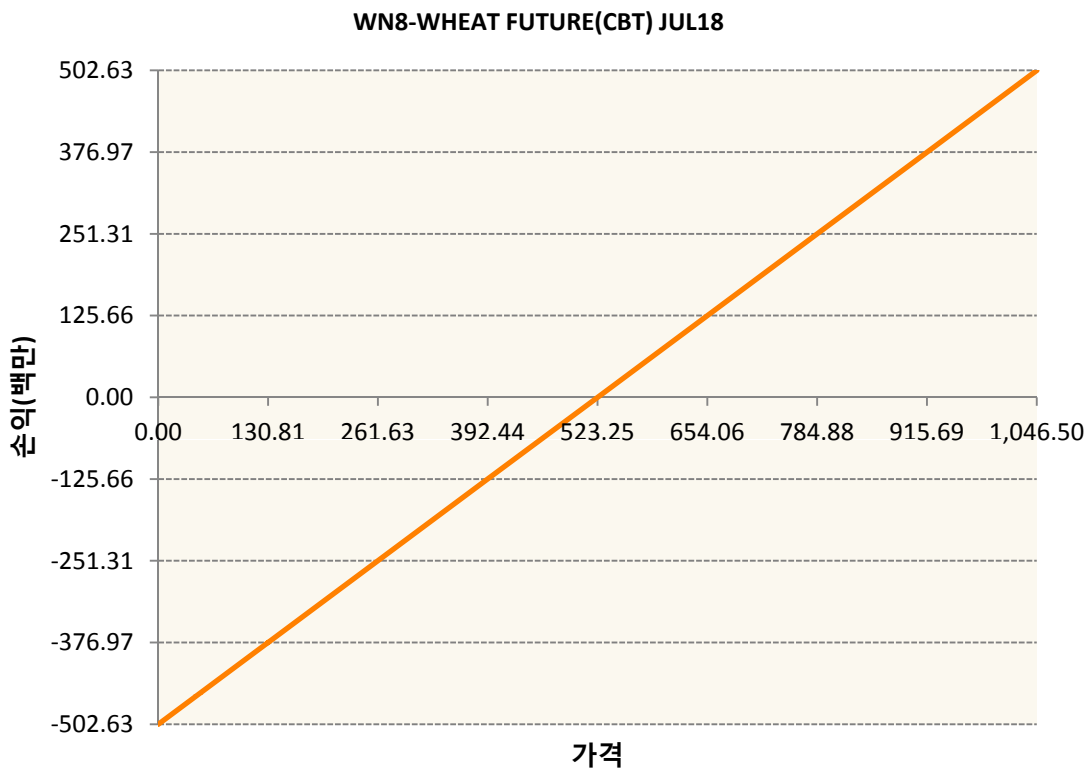
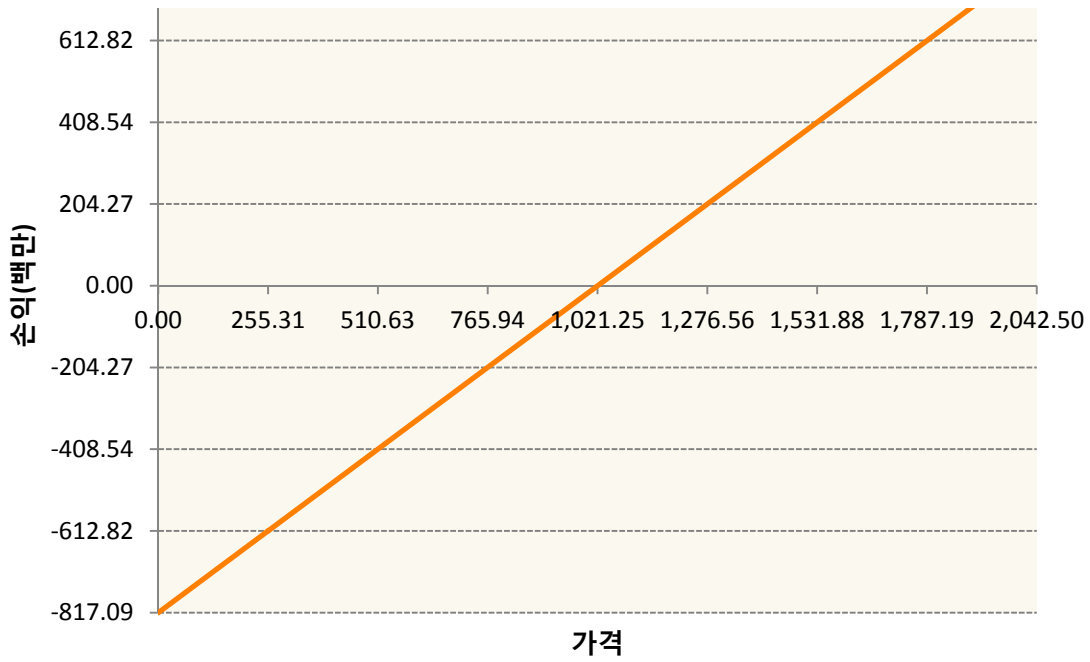


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18



SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BON8	SOYBEAN OIL FUTR JUL18	26
CN8	CORN FUTURE JUL18	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)

**335**