

공시일	2018-06-08
기준일	2018-06-07

## 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	2018-06-08
기준일	2018-06-07

## 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

1,129

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

468

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-06-08
기준일	2018-06-07

## 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

380

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

411

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-06-08
기준일	2018-06-07

## 유로인덱스모(주식-파생형)

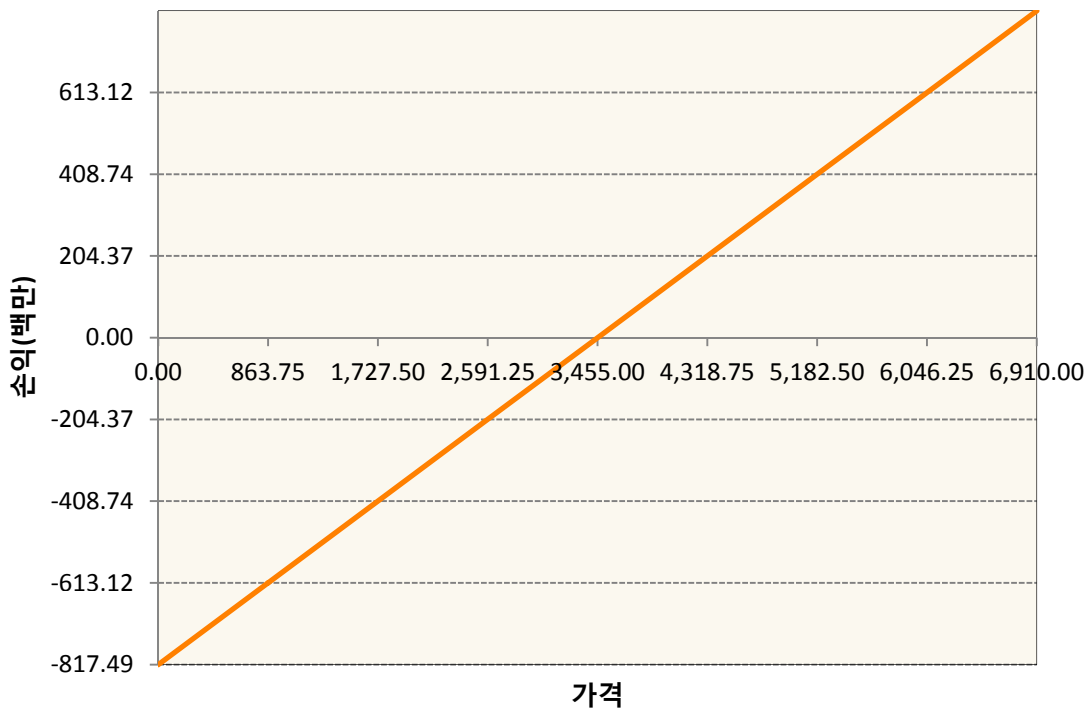
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	817	0	817	

### 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	2018-06-08
기준일	2018-06-07

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

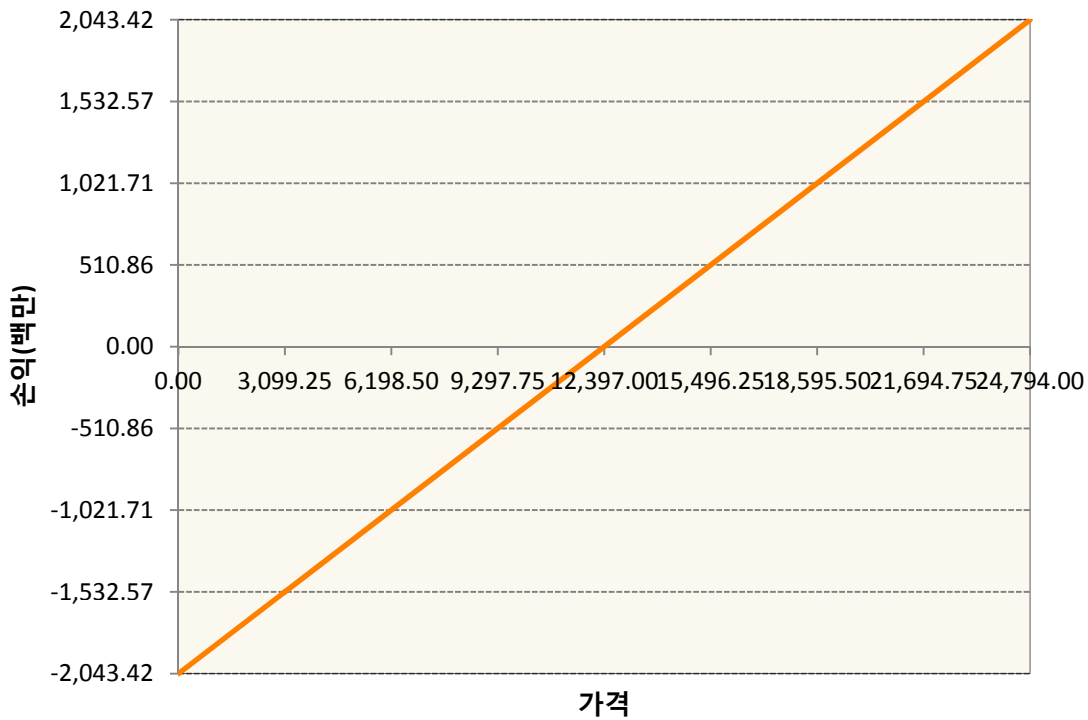
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

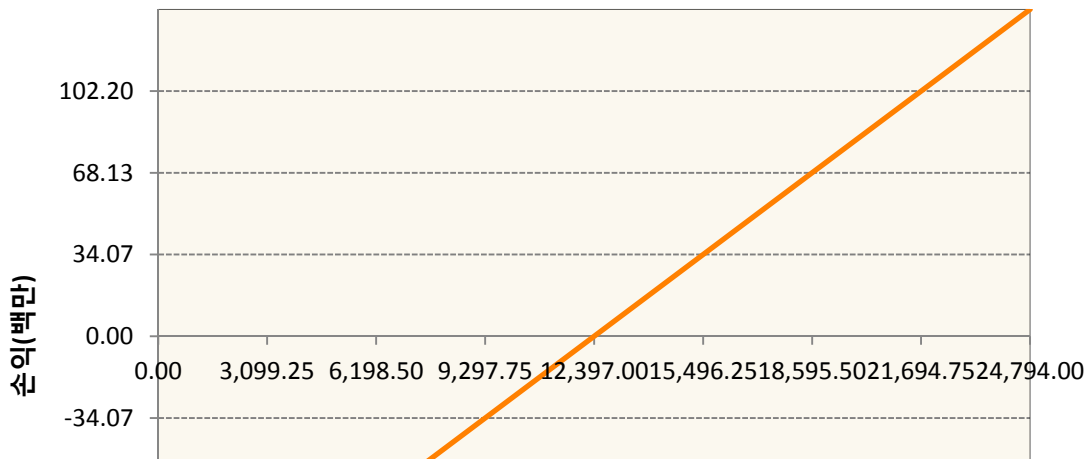
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,180	0	2,180	장내

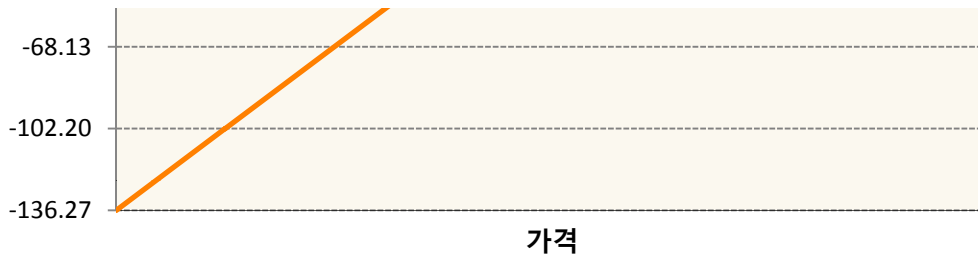
### 2. 만기시점의 손익구조

HCM8-HSCEI Futures Jun18



MHCM8-MINI H-SHR IDX FU Jun18





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

HCM8	HSCEI Futures Jun18	163
MHCM8	MINI H-SHR IDX FU Jun18	11

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

<b>154</b>
------------

공시일	2018-06-08
기준일	2018-06-07

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

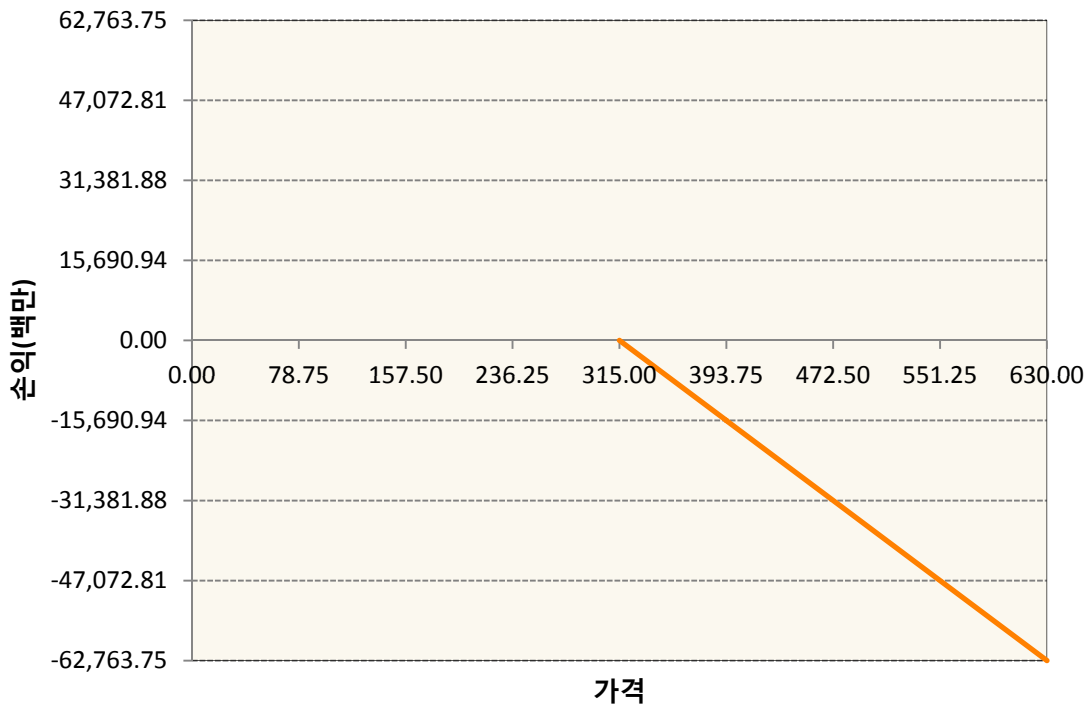
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

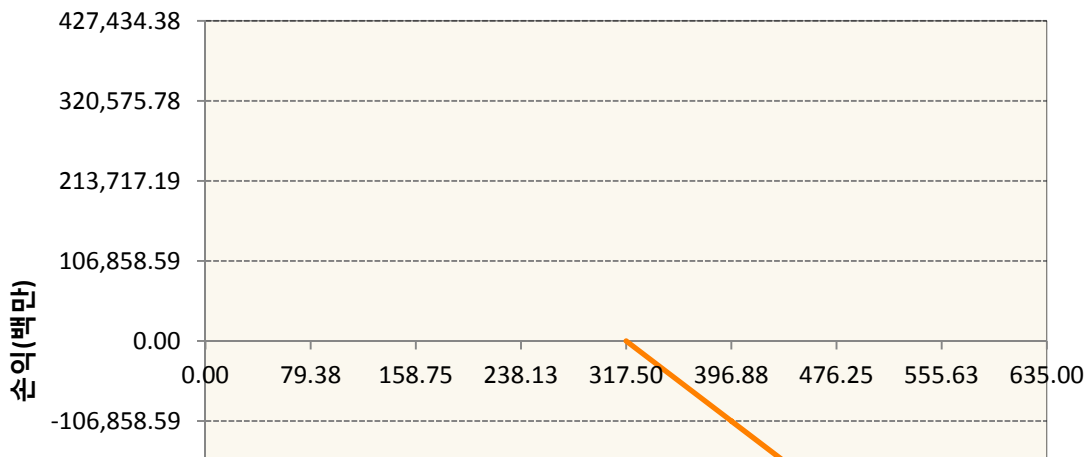
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	233	0	233	장내
누계	유가증권	옵션	0	798,173	-798,173	장내

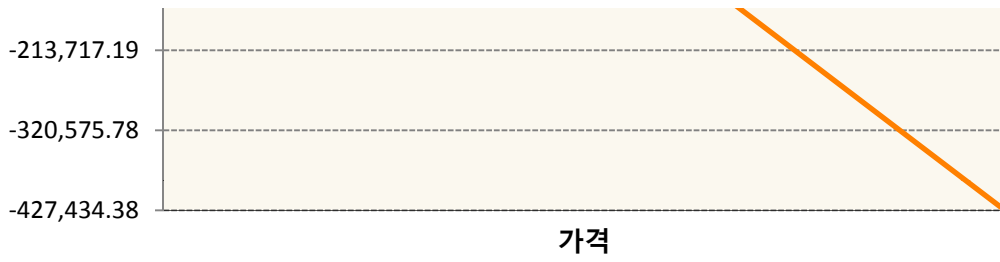
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201N63159-2018-06 콜315**

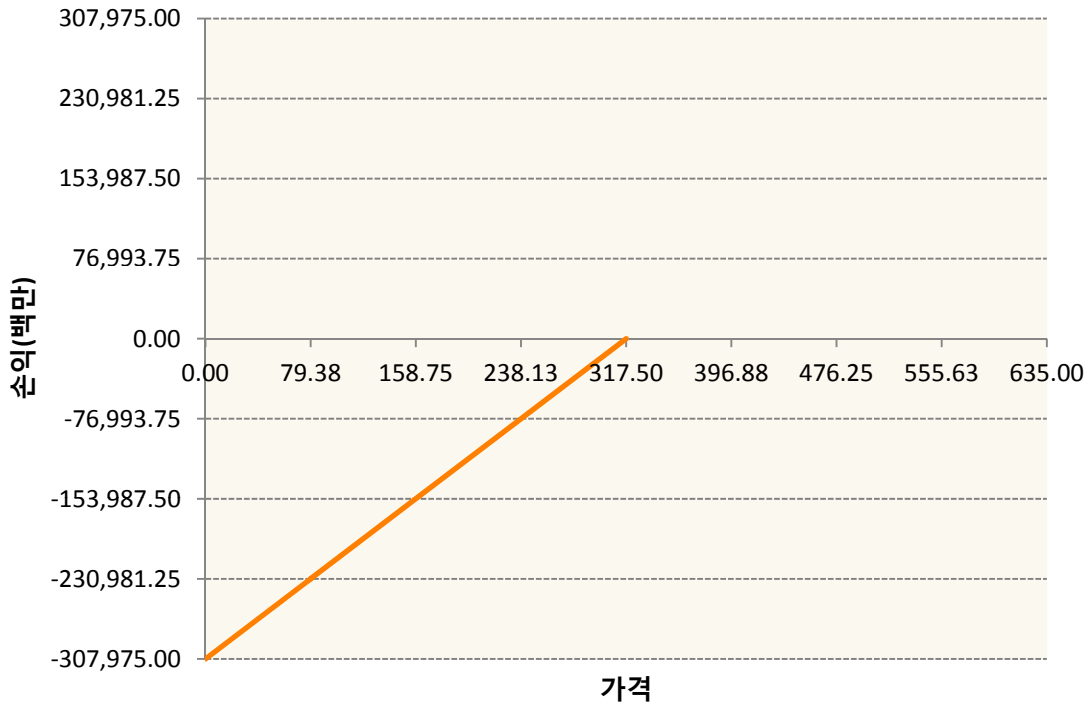


**KR4201N63175-2018-06 콜317.5**





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N6312018-06 콜315

4,387

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,251	1,247	1,241	1,231	1,218	1,201	1,180
-5.33%	1,214	1,189	1,159	1,124	1,084	1,040	993
-2.67%	974	908	840	770	699	627	554
0%	233	156	78	0	-79	-157	-236
2.67%	-1,067	-1,109	-1,157	-1,209	-1,265	-1,324	-1,385
5.33%	-2,665	-2,676	-2,693	-2,714	-2,740	-2,771	-2,807
8.00%	-4,341	-4,343	-4,346	-4,352	-4,360	-4,372	-4,387

KR4201N6312018-06 콜317.5

28,250

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,649	6,636	6,611	6,570	6,509	6,426	6,320

-5.33%	6,519	6,411	6,268	6,090	5,879	5,639	5,371
-2.67%	5,483	5,116	4,722	4,308	3,876	3,431	2,974
0%	1,635	1,090	545	0	-545	-1,090	-1,635
2.67%	-6,150	-6,523	-6,924	-7,347	-7,787	-8,242	-8,709
5.33%	-16,542	-16,668	-16,833	-17,034	-17,270	-17,537	-17,832
8.00%	-27,787	-27,809	-27,849	-27,910	-27,997	-28,110	-28,250
KR4301N6312018-06 풋317.5							22,446
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,446	-22,446	-22,446	-22,446	-22,446	-22,446	-22,446
-5.33%	-14,231	-14,231	-14,232	-14,232	-14,234	-14,238	-14,243
-2.67%	-6,046	-6,072	-6,109	-6,157	-6,215	-6,283	-6,360
0%	528	352	176	0	-176	-352	-528
2.67%	2,005	1,979	1,943	1,896	1,838	1,769	1,692
5.33%	2,033	2,032	2,032	2,031	2,028	2,024	2,016
8.00%	2,033	2,033	2,033	2,033	2,033	2,032	2,032

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

(단위:백만원)

66,482

공시일	2018-06-08
기준일	2018-06-07

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

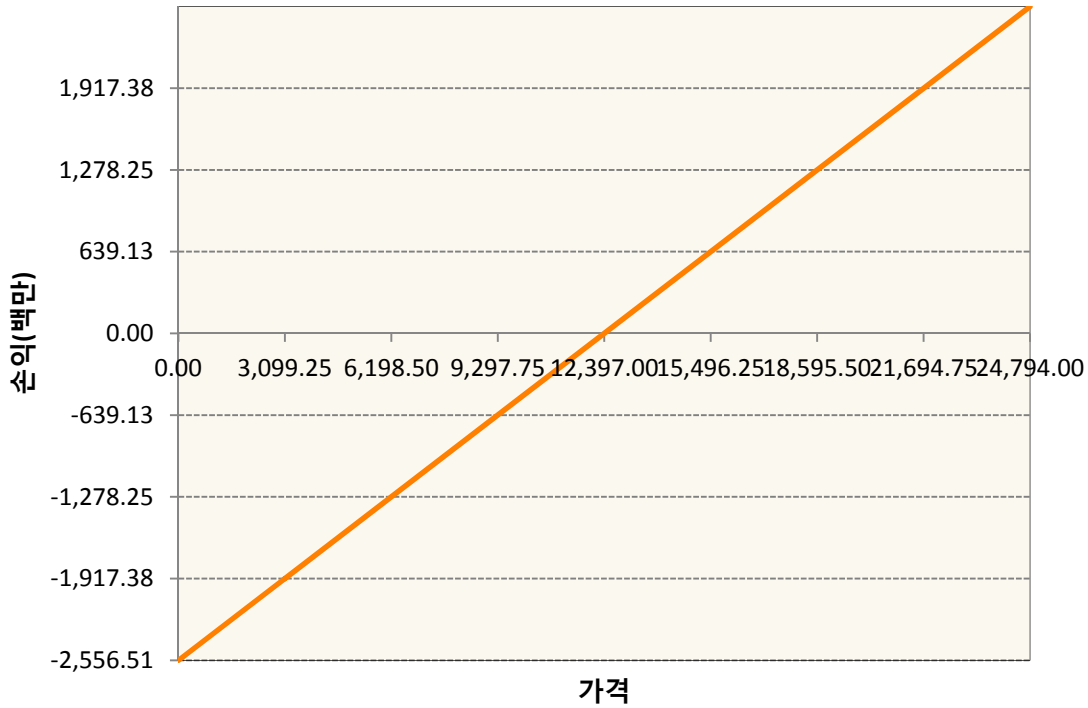
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

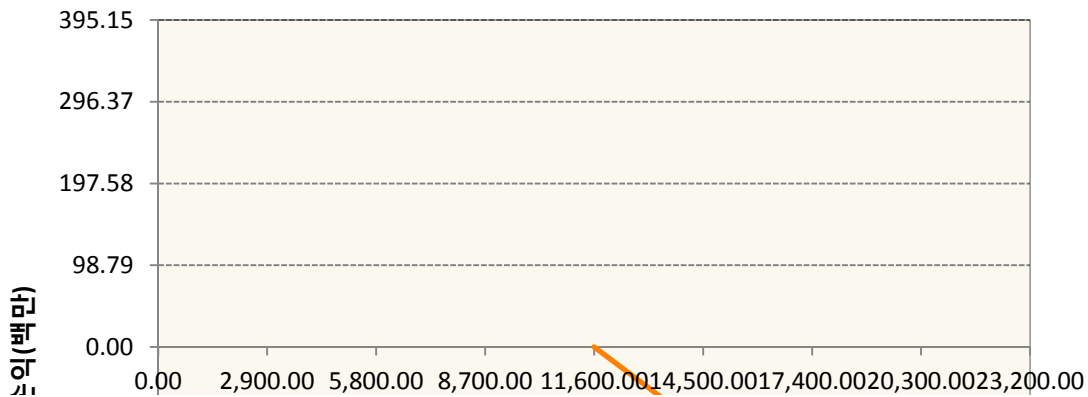
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,557	0	2,557	장내
누계	유가증권	옵션	0	6,096	-6,096	장내

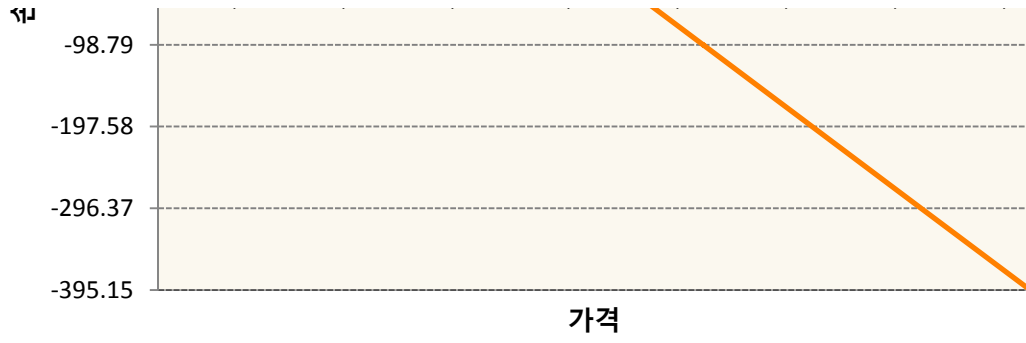
### 2. 만기시점의 손익구조

HCM8-HSCEI Futures Jun18

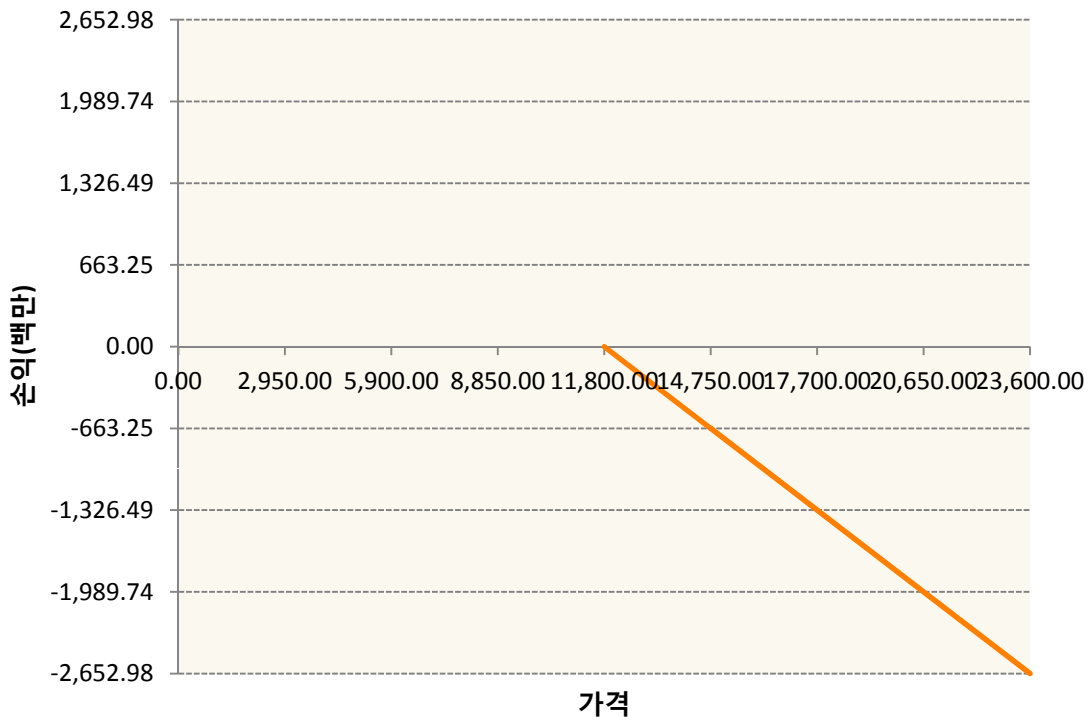


OHHIM8-C116-HSCEI

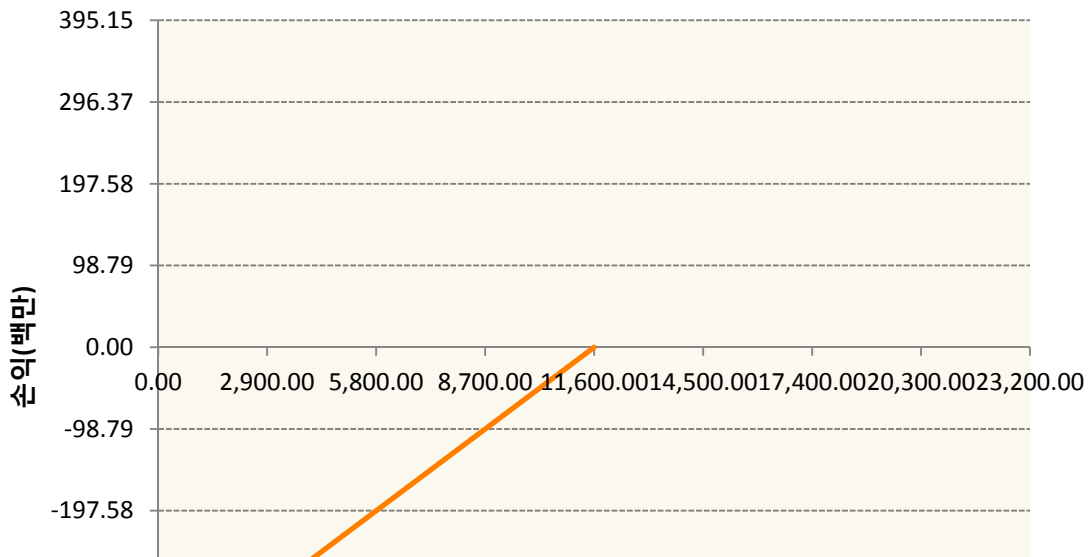


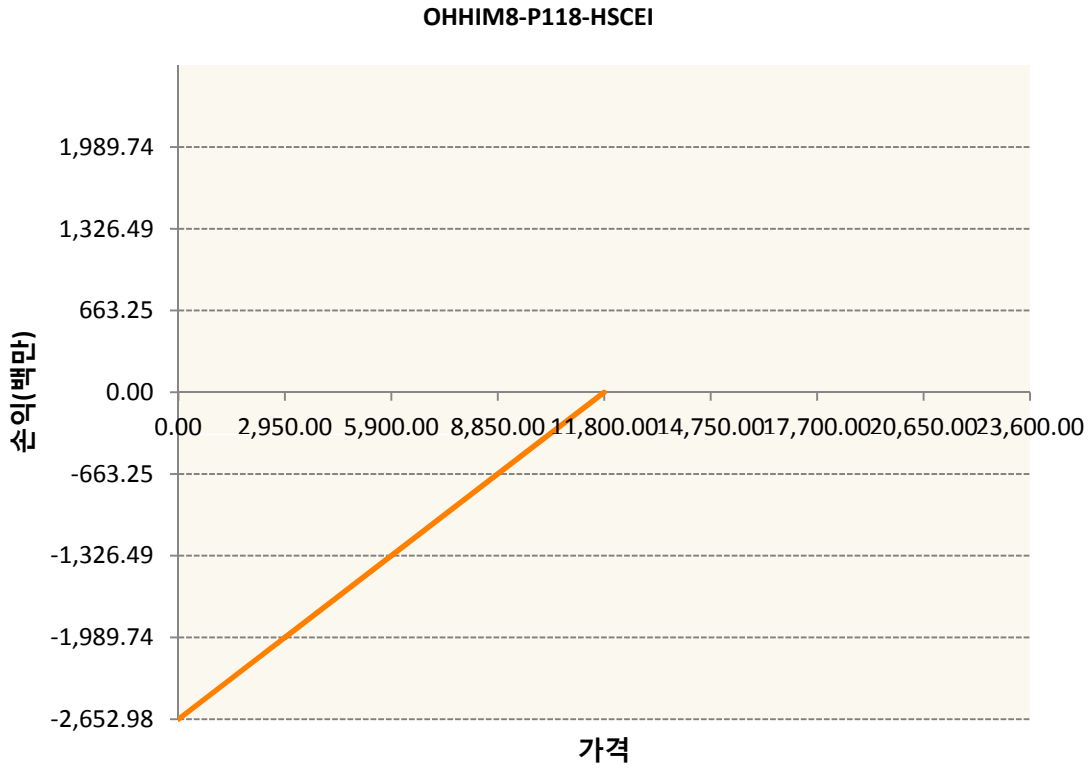
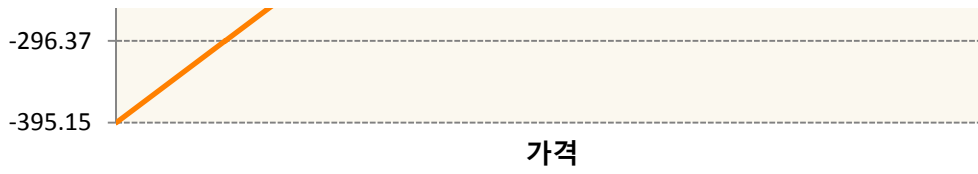


OHHIM8-C118-HSCEI



OHHIM8-P116-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCM8	HSCEI Futures Jun18	205
OHHIM8-C1	HSCEI	32
OHHIM8-C1	HSCEI	212
OHHIM8-P1	HSCEI	32
OHHIM8-P1	HSCEI	212

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	611

공시일	2018-06-08
기준일	2018-06-07

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

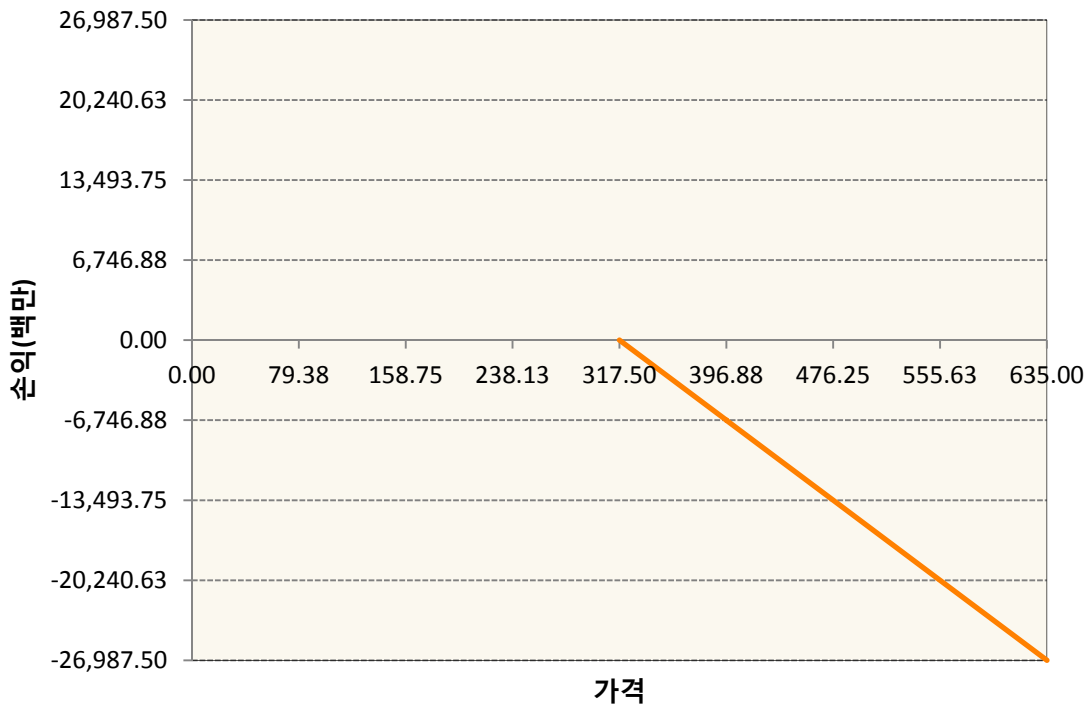
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

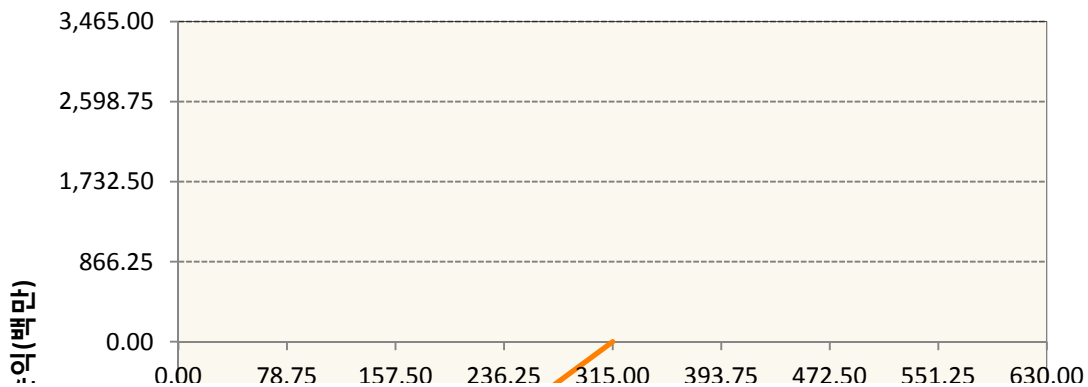
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	46,804	-46,804	장내

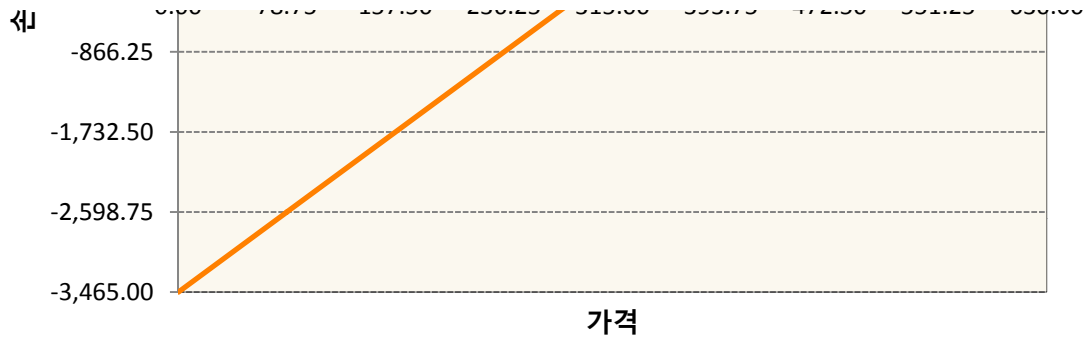
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63175-2018-06 콜317.5

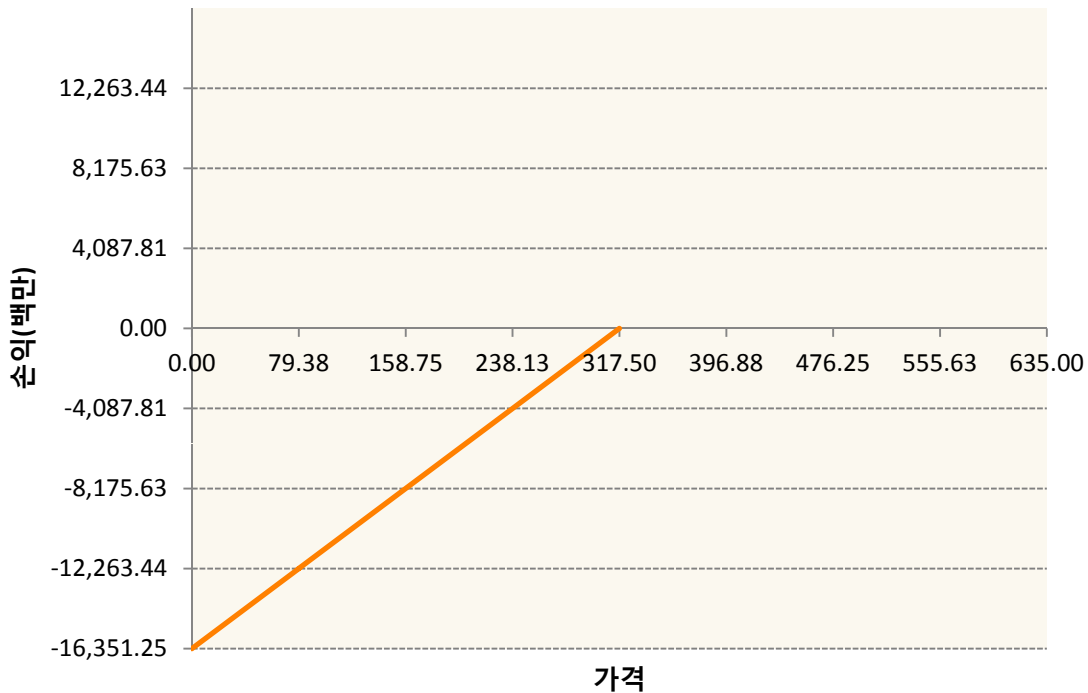


KR4301N63157-2018-06 풋315





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_2							1,475
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,475	-1,475	-1,475	-1,475	-1,475	-1,475	-1,475
-5.33%	-983	-983	-983	-983	-983	-983	-983
-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%	983	983	983	983	983	983	983
8.00%	1,475	1,475	1,475	1,475	1,475	1,475	1,475
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

478

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-478	-478	-478	-478	-478	-478	-478
-5.33%	-319	-319	-319	-319	-319	-319	-319
-2.67%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	159	159	159	159	159	159	159
5.33%	319	319	319	319	319	319	319
8.00%	478	478	478	478	478	478	478

KR4201N6312018-06 콜317.5

1,784

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	420	419	417	415	411	406	399
-5.33%	412	405	396	384	371	356	339
-2.67%	346	323	298	272	245	217	188
0%	103	69	34	0	-34	-69	-103
2.67%	-388	-412	-437	-464	-492	-520	-550
5.33%	-1,044	-1,052	-1,063	-1,076	-1,090	-1,107	-1,126
8.00%	-1,754	-1,756	-1,758	-1,762	-1,768	-1,775	-1,784

KR4301N6312018-06 풋315

238

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-238	-238	-238	-238	-238	-238	-238
-5.33%	-145	-145	-145	-145	-145	-145	-145
-2.67%	-53	-54	-55	-56	-57	-58	-60
0%	5	3	2	0	-2	-4	-5
2.67%	12	12	12	12	11	11	10
5.33%	12	12	12	12	12	12	12
8.00%	12	12	12	12	12	12	12

KR4301N6312018-06 풋317.5

1,192

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,192	-1,192	-1,192	-1,192	-1,192	-1,192	-1,192
-5.33%	-756	-756	-756	-756	-756	-756	-756
-2.67%	-321	-322	-324	-327	-330	-334	-338
0%	28	19	9	0	-9	-19	-28
2.67%	106	105	103	101	98	94	90
5.33%	108	108	108	108	108	107	107
8.00%	108	108	108	108	108	108	108

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

(단위:백만원)

7,715

공시일	2018-06-08
기준일	2018-06-07

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

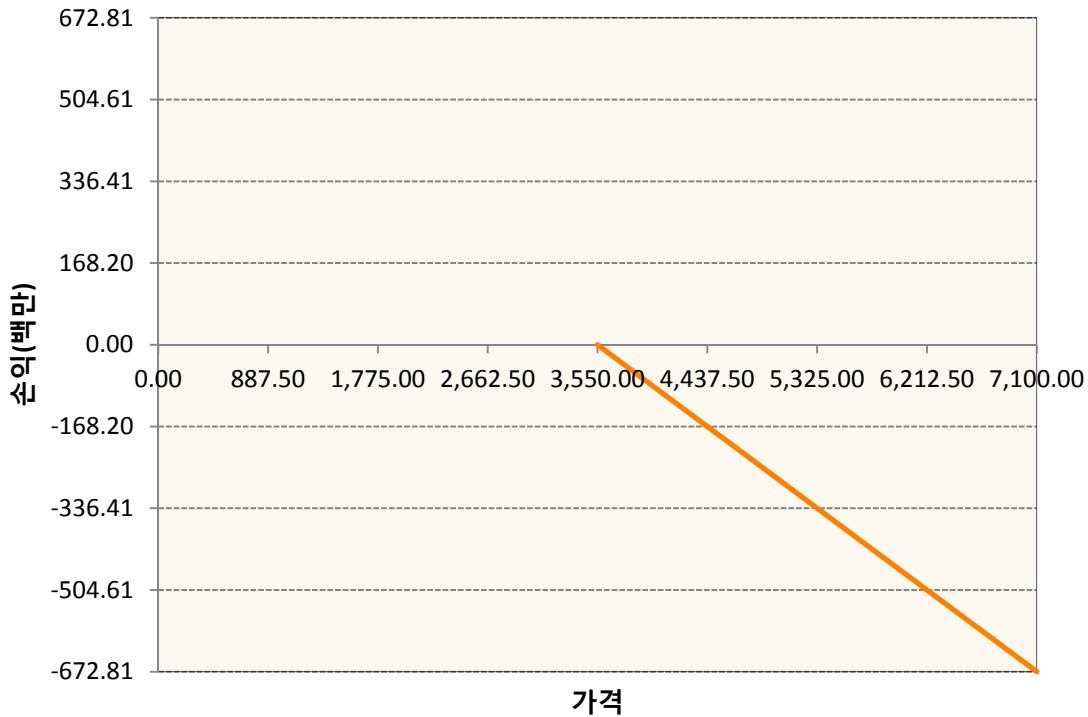
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

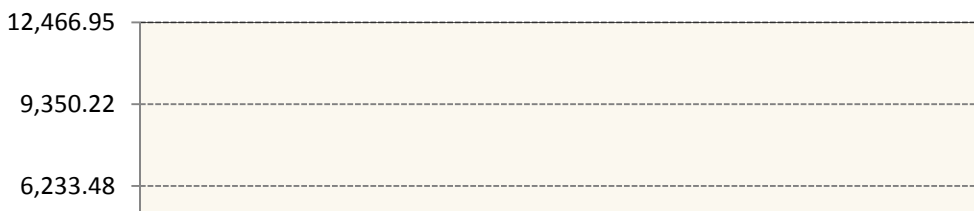
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,931	0	4,931	
누계	유가증권	스왑	53,271	0	53,271	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,280	-26,280	장내
누계	지수	스왑	50,541	0	50,541	장외

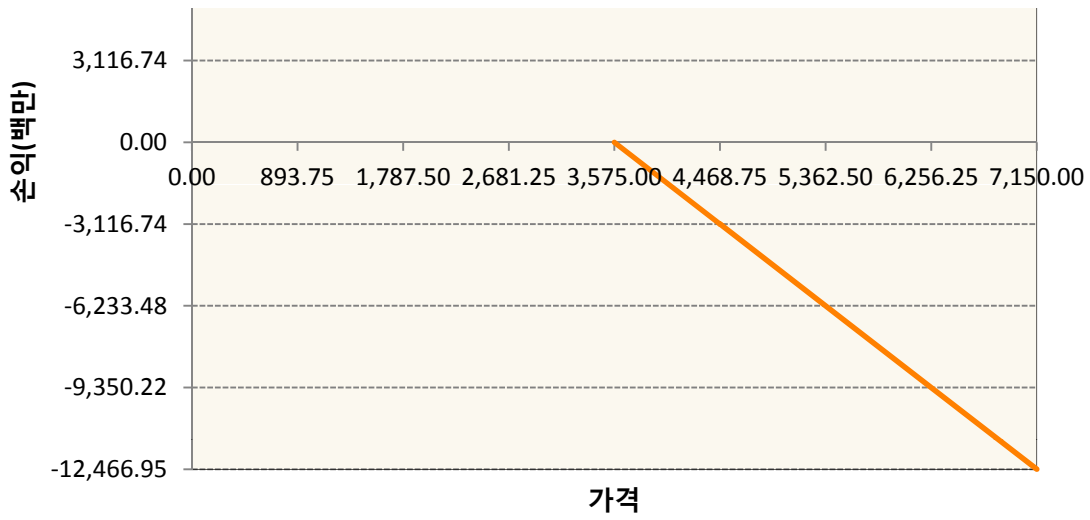
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXM8-C3550-EURO STOXX 50**

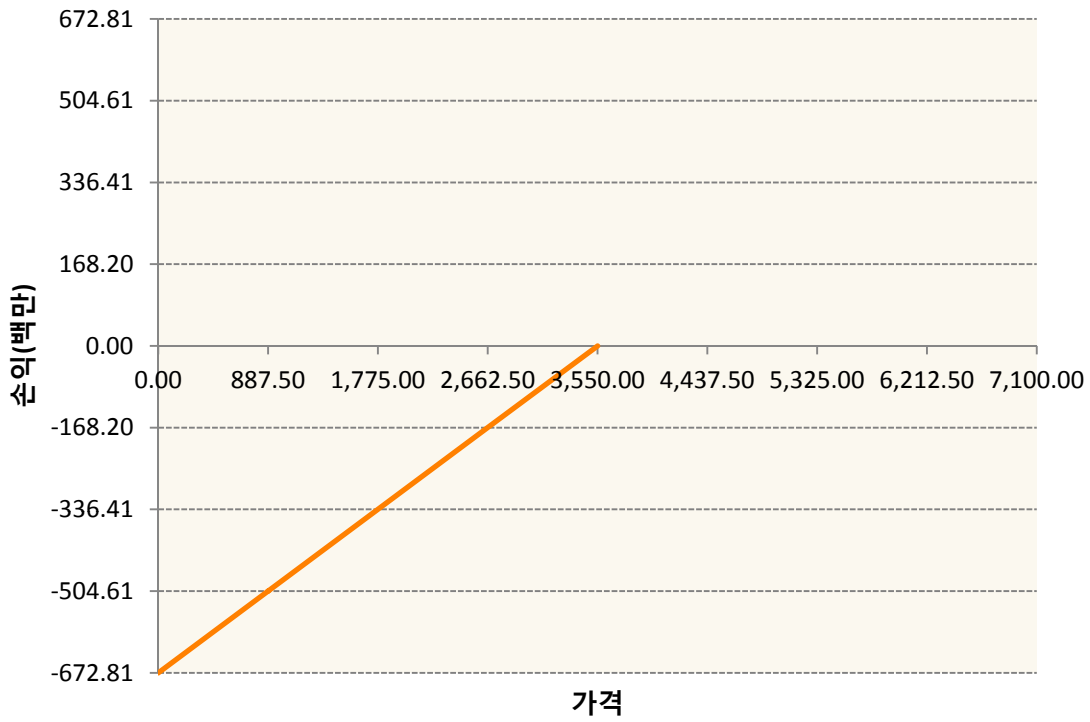


**OESXM8-C3575-EURO STOXX 50**



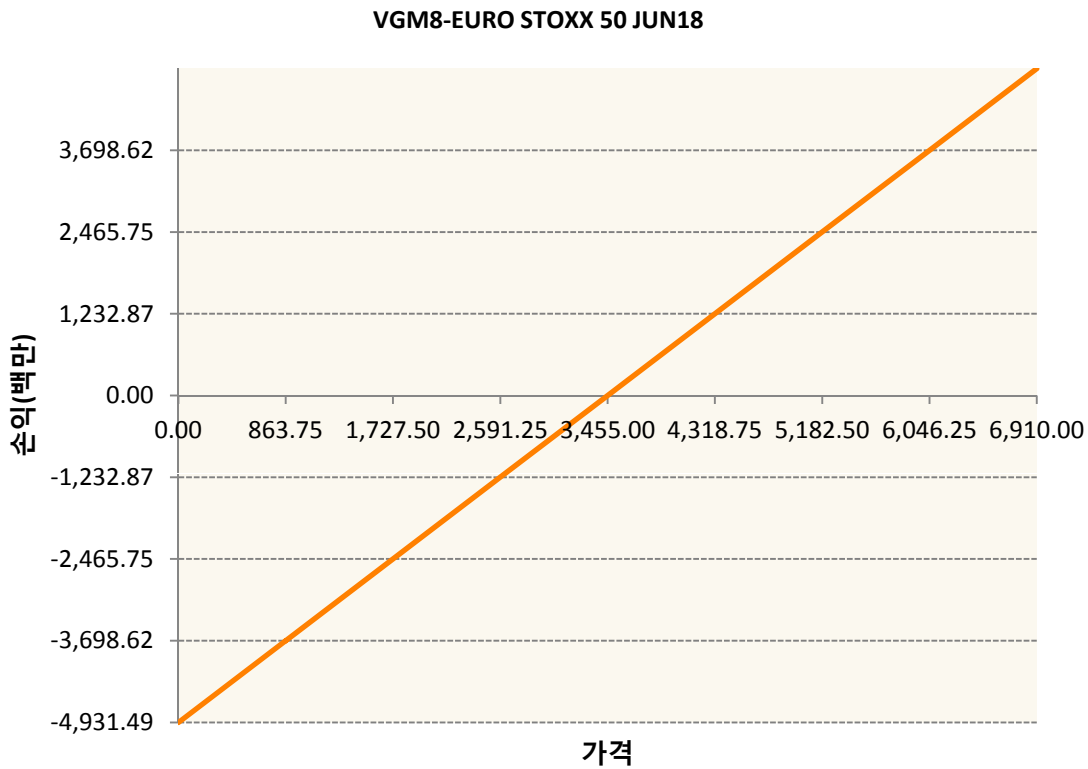
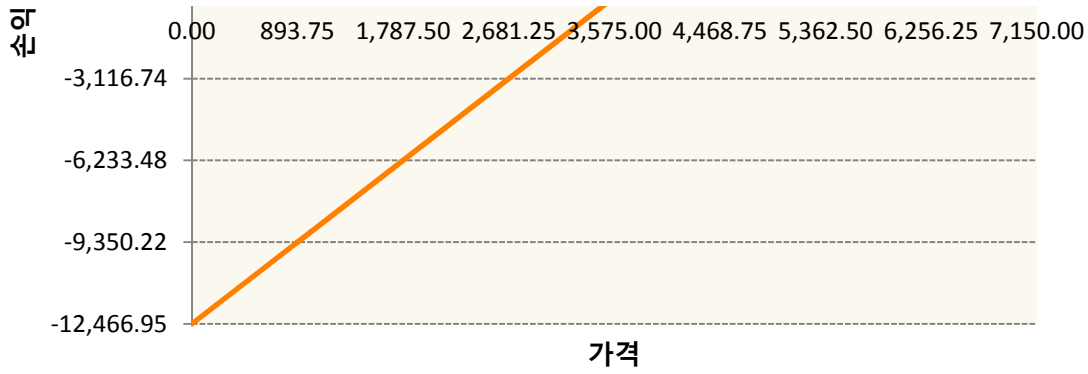


OESXM8-P3550-EURO STOXX 50



OESXM8-P3575-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		6
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		6
OESXM8-C3 EURO STOXX 50		54
OESXM8-C3 EURO STOXX 50		997
OESXM8-P3! EURO STOXX 50		54
OESXM8-P3! EURO STOXX 50		997
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18		395

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





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

(단위:백만원)

1,189

공시일	2018-06-08
기준일	2018-06-07

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

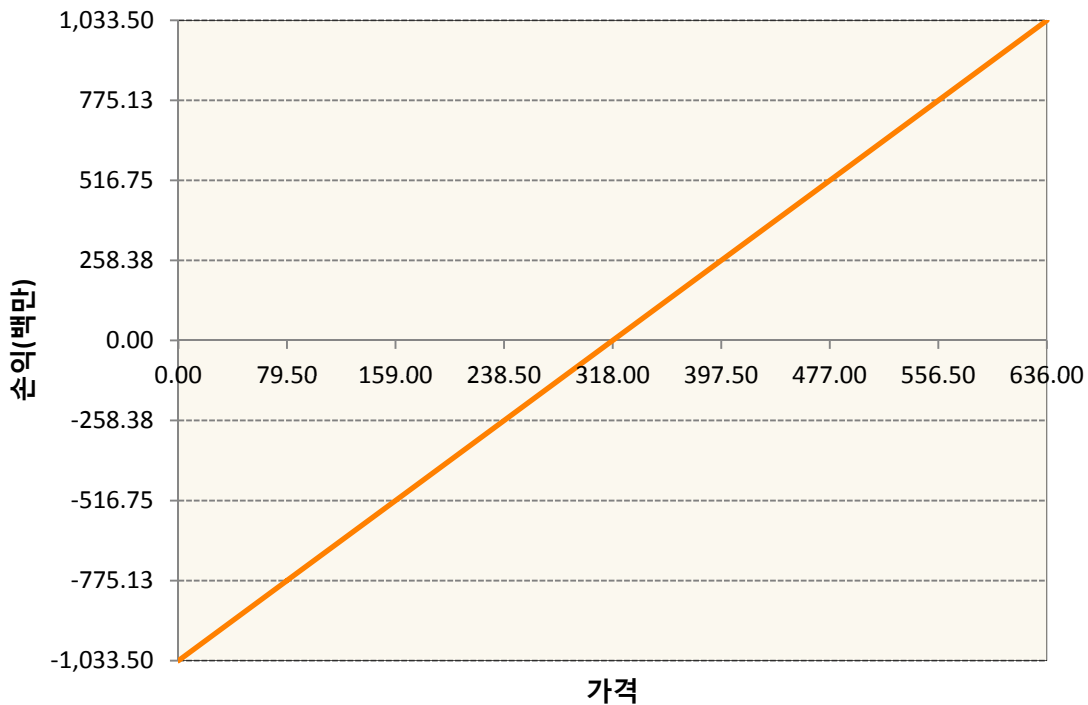
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,034	0	1,034	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물

83

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-5.33%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-2.67%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	28	28	28	28	28	28	28
5.33%	55	55	55	55	55	55	55
8.00%	83	83	83	83	83	83	83

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

(단위:백만원)

60



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

(단위:백만원)

97



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

(단위:백만원)

217



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

(단위:백만원)

42

공시일	2018-06-08
기준일	2018-06-07

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

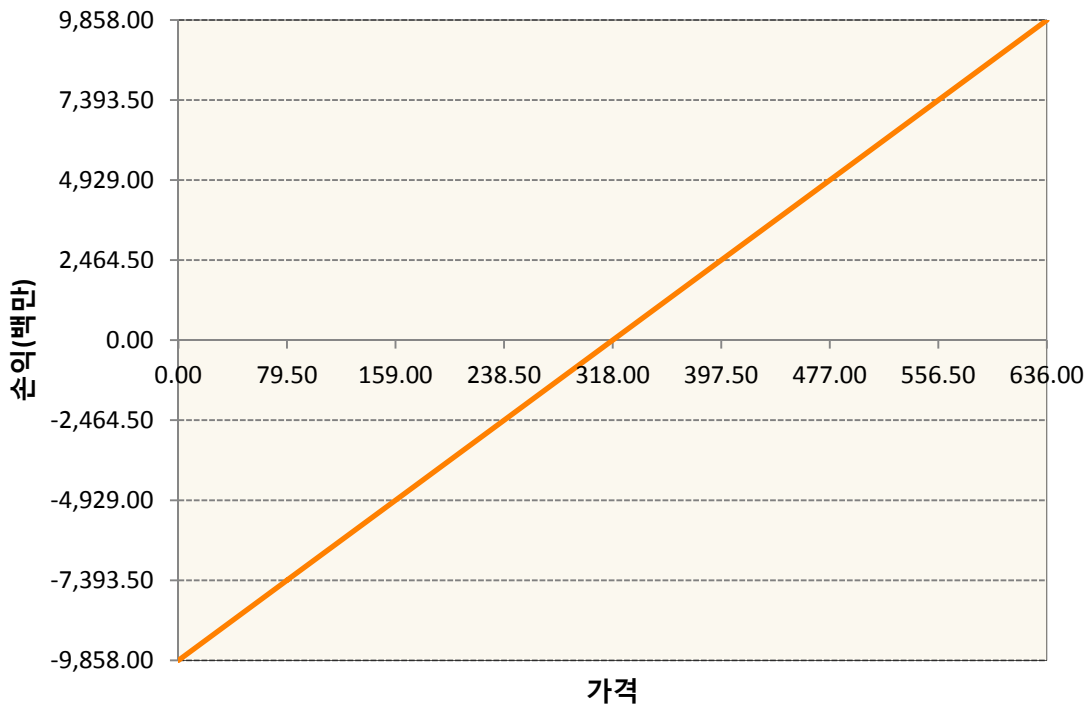
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

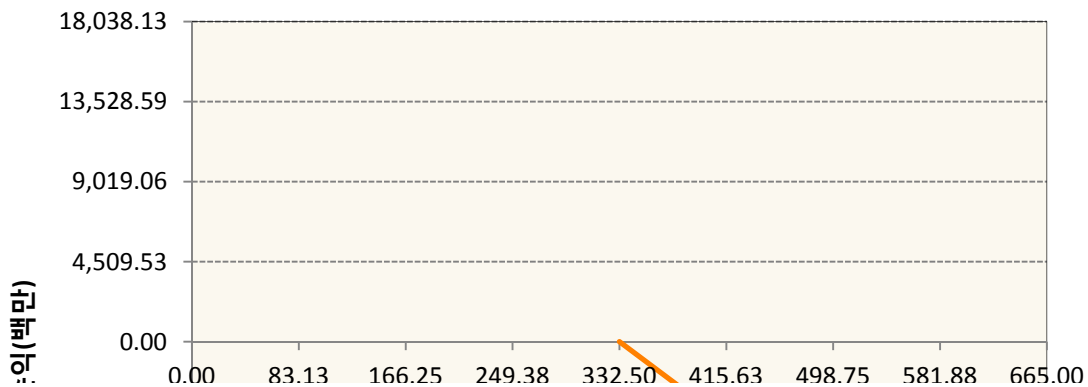
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	166	-166	장내
누계	유가증권	선물	9,858	0	9,858	장내
누계	유가증권	옵션	1,905	18,038	-16,133	장내

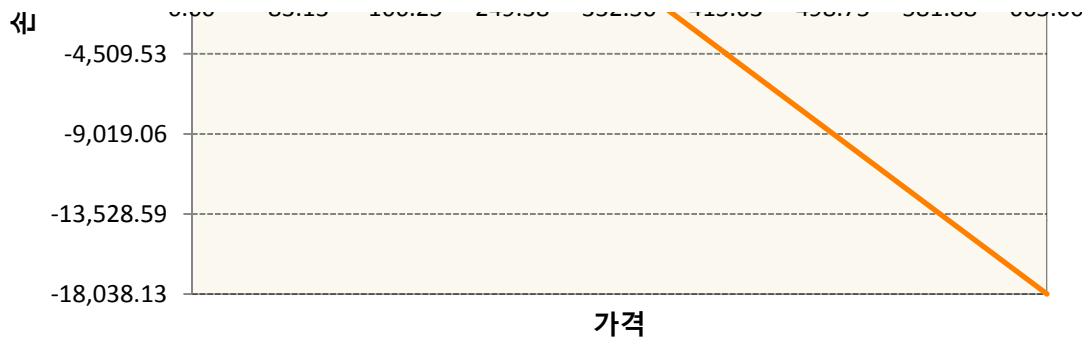
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

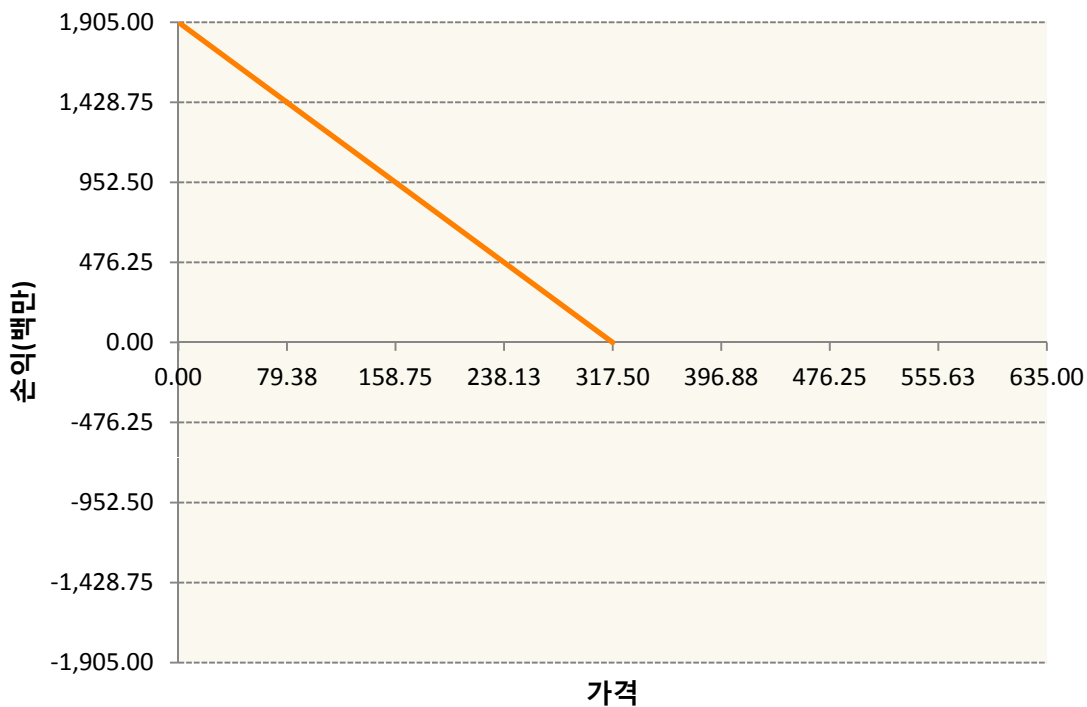


KR4201N63324-2018-06 콜332.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물							788
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-788	-788	-788	-788	-788	-788	-788
-5.33%	-525	-525	-525	-525	-525	-525	-525
-2.67%	-263	-263	-263	-263	-263	-263	-263
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	263	263	263	263	263	263	263
5.33%	525	525	525	525	525	525	525
8.00%	788	788	788	788	788	788	788
KR4201N63E 2018-06 콜332.5							671
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	39	39	39	39	39	38	38
-5.33%	39	39	38	38	37	35	33
-2.67%	38	37	34	31	27	22	15
0%	27	19	10	0	-12	-25	-38
2.67%	-38	-57	-76	-96	-116	-137	-158
5.33%	-231	-254	-276	-299	-322	-345	-368
8.00%	-572	-586	-601	-617	-634	-652	-671

KR4301N6312018-06 풋317.5

139

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	139	139	139	139	139	139	139
-5.33%	88	88	88	88	88	88	88
-2.67%	37	38	38	38	38	39	39
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-12	-12	-12	-12	-11	-11	-10
5.33%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-12
8.00%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13

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

(단위:백만원)

1,138

공시일	2018-06-08
기준일	2018-06-07

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

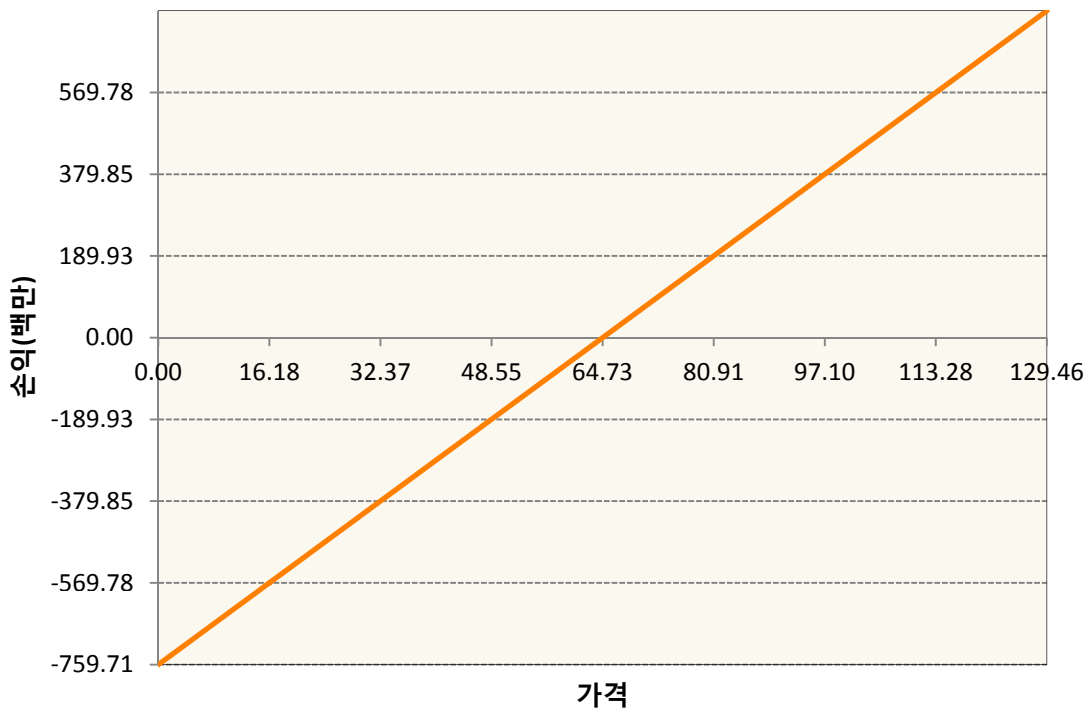
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

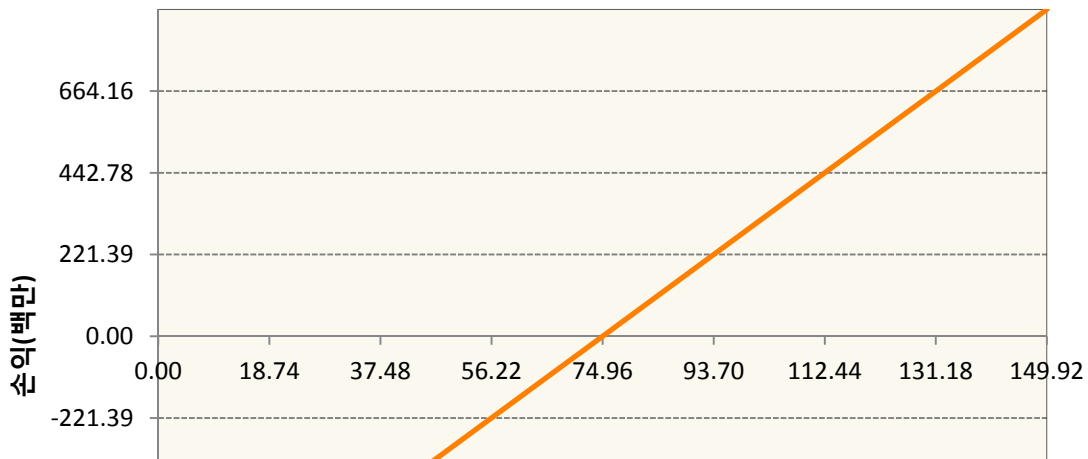
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,760	588	3,172	

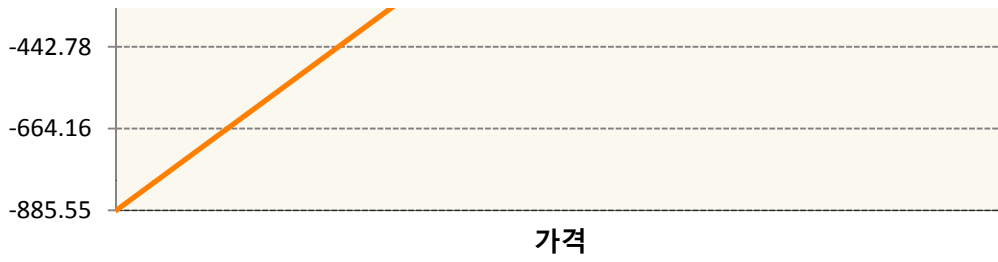
### 2. 만기시점의 손익구조

**CLN8-WTI CRUDE FUTURE JUL18**

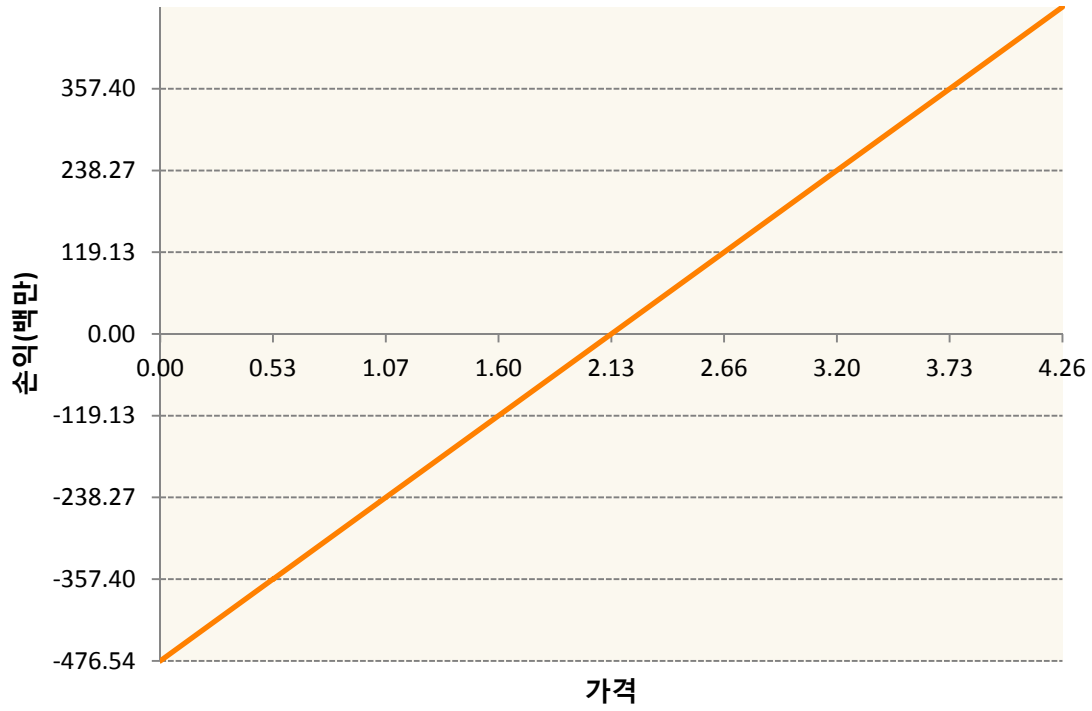


**COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18**

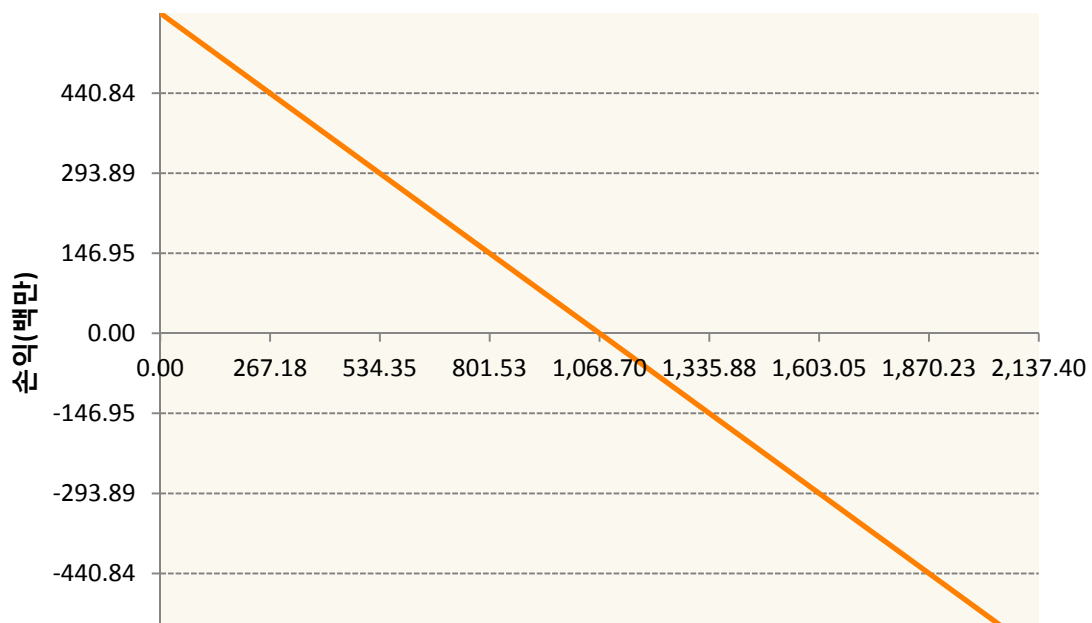


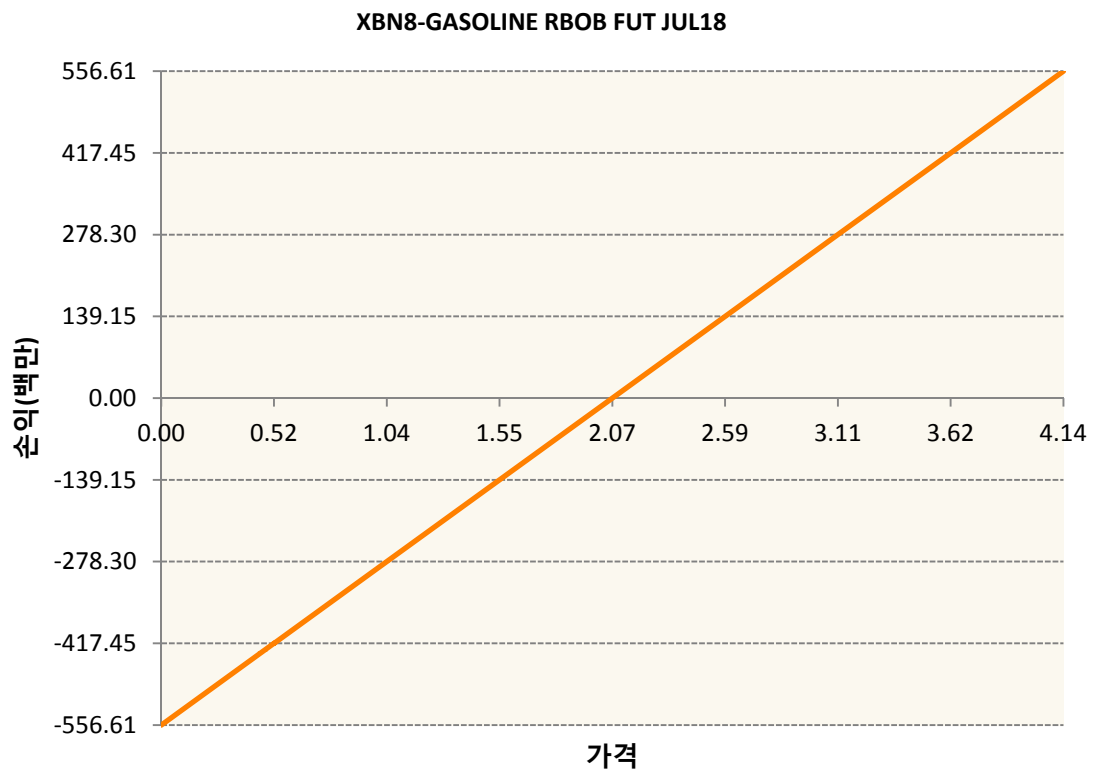
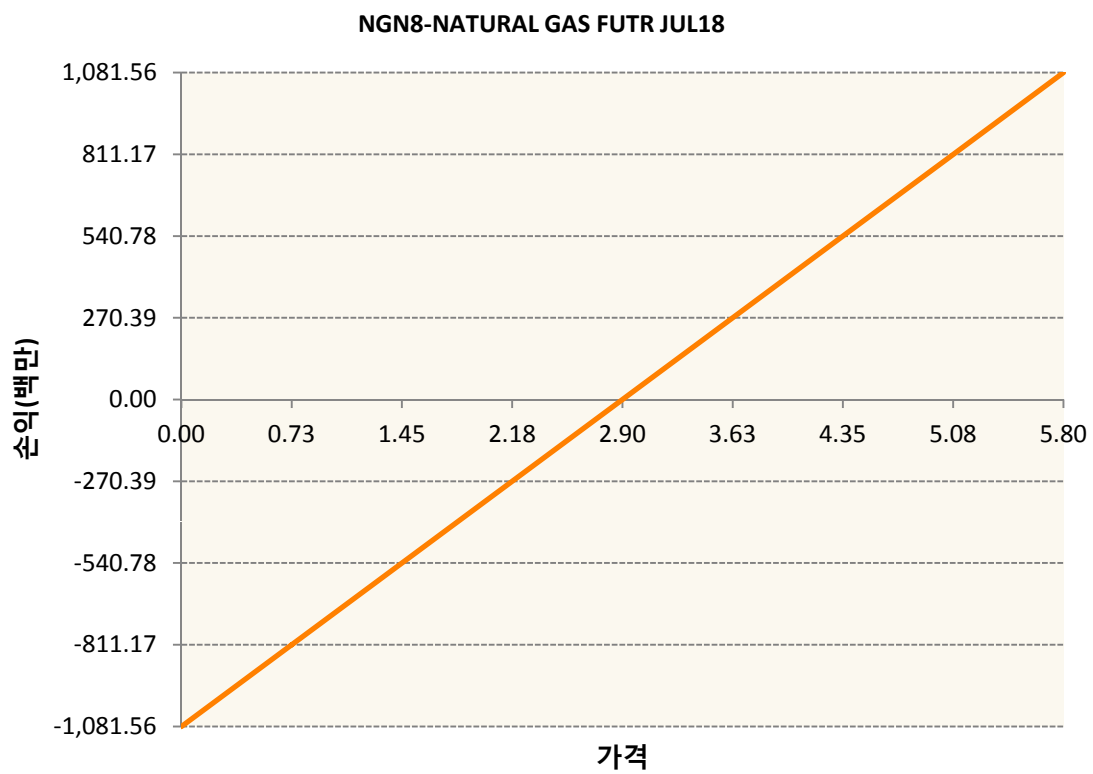
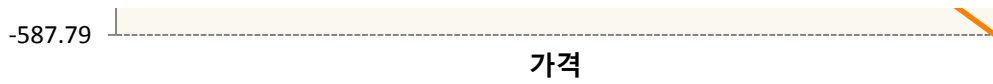


HON8-NY Harb ULSD Fut JUL18



KR4175N60003-2018-06 달러선물





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

CLN8	WTI CRUDE FUTURE JUL18	61
COU8	BRENT CRUDE FUTR SEP18	71
HON8	NY Harb ULSD Fut JUL18	38
KR4175N60C	2018-06 달러선물	47
NGN8	NATURAL GAS FUTR JUL18	87
XBN8	GASOLINE RBOB FUT JUL18	45

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

**453**

공시일	2018-06-08
기준일	2018-06-07

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

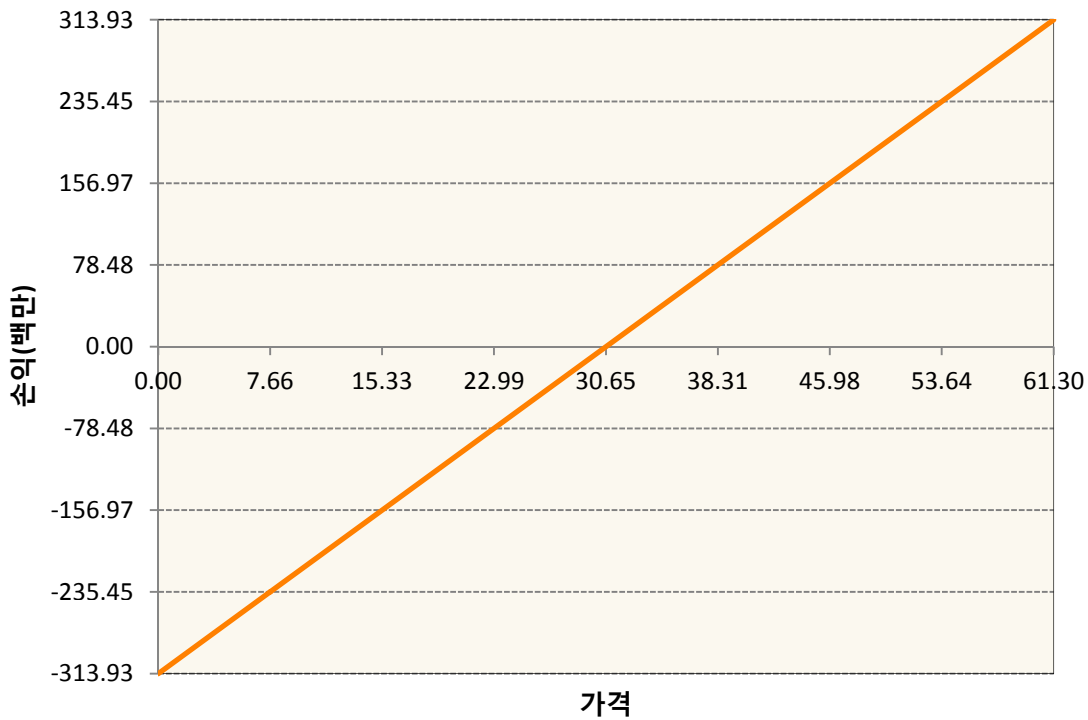
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

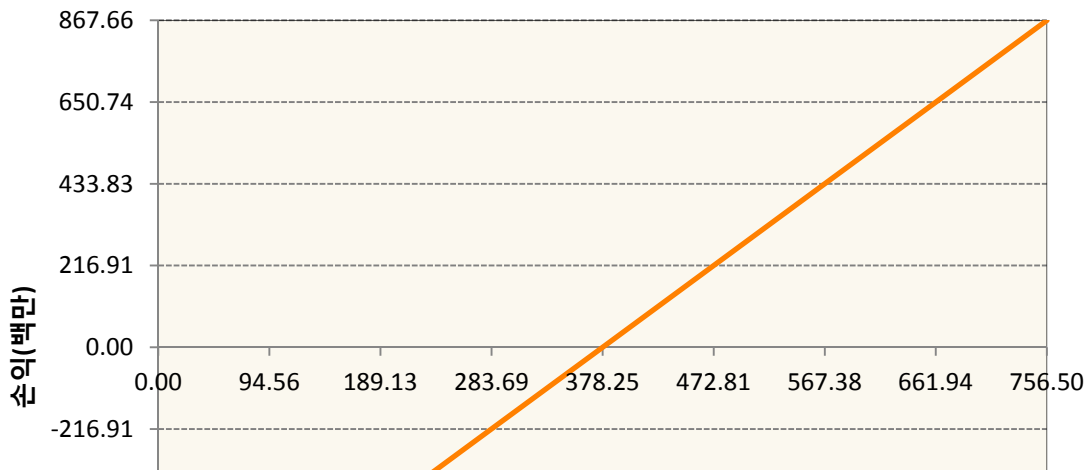
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,030	321	3,709	

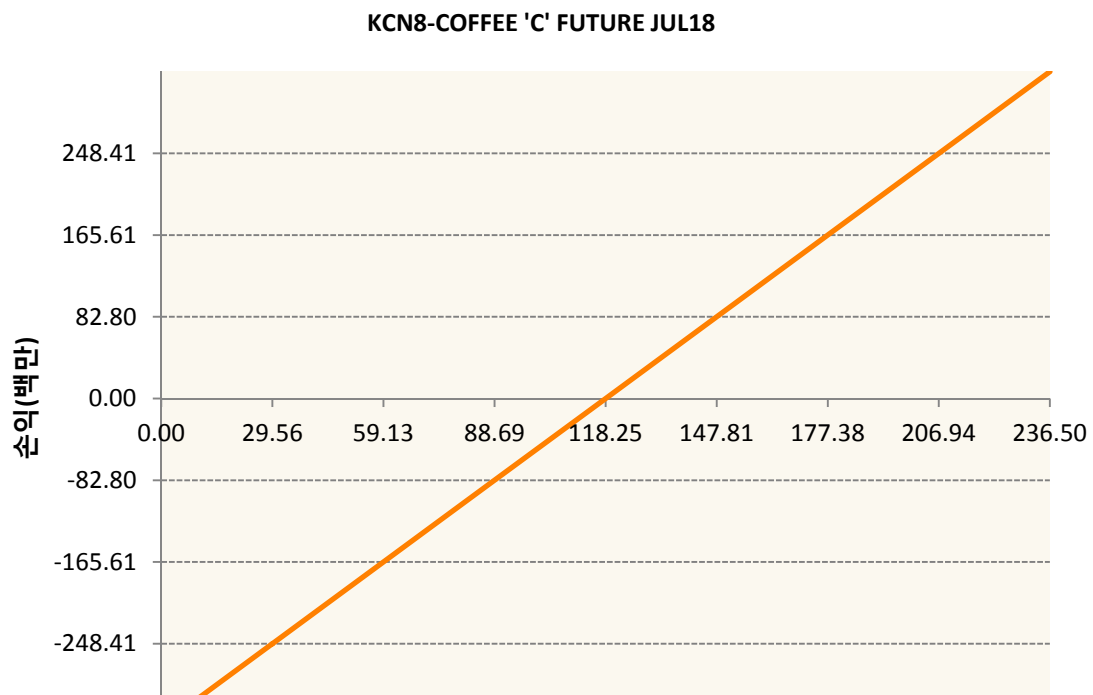
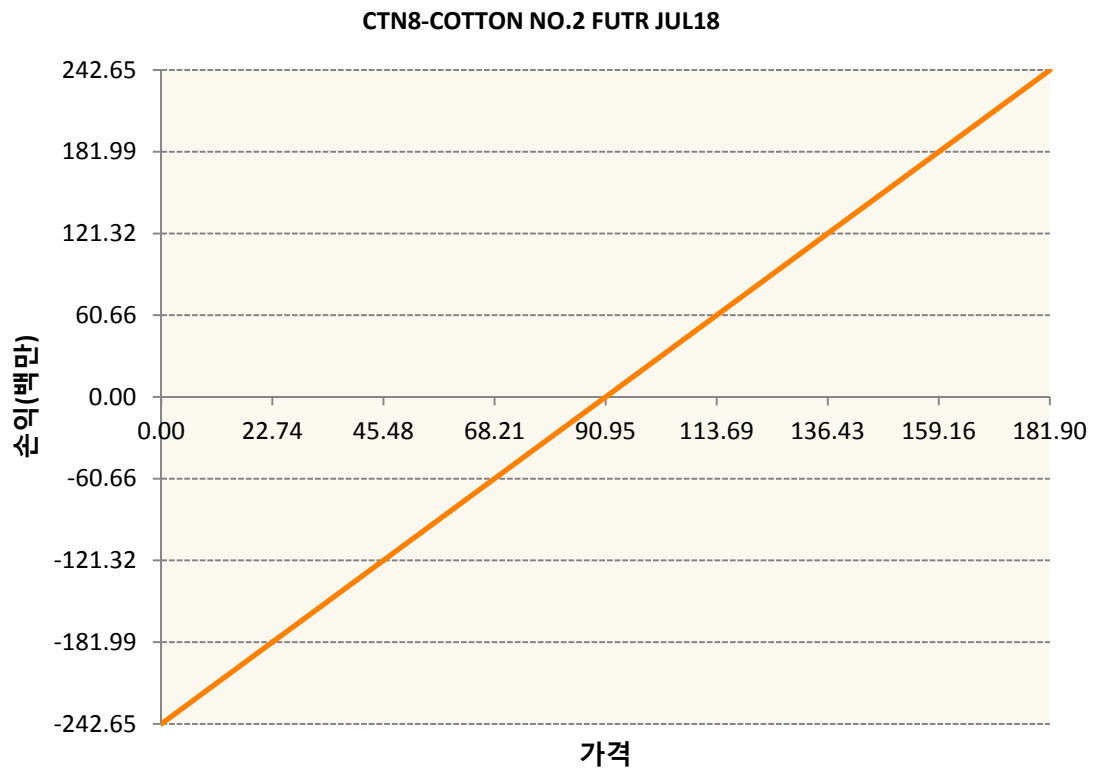
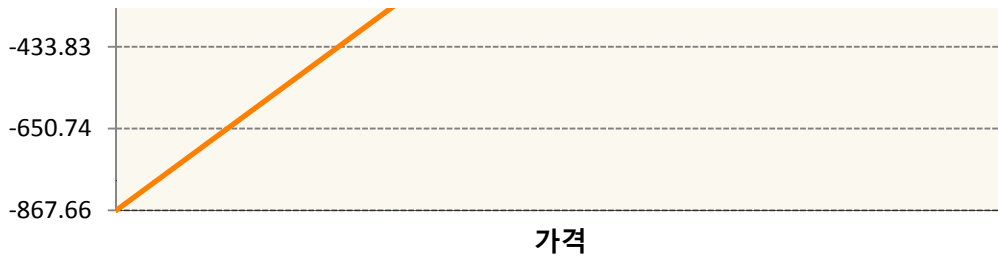
### 2. 만기시점의 손익구조

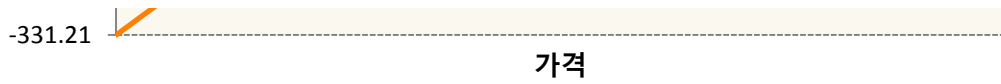
**BON8-SOYBEAN OIL FUTR JUL18**



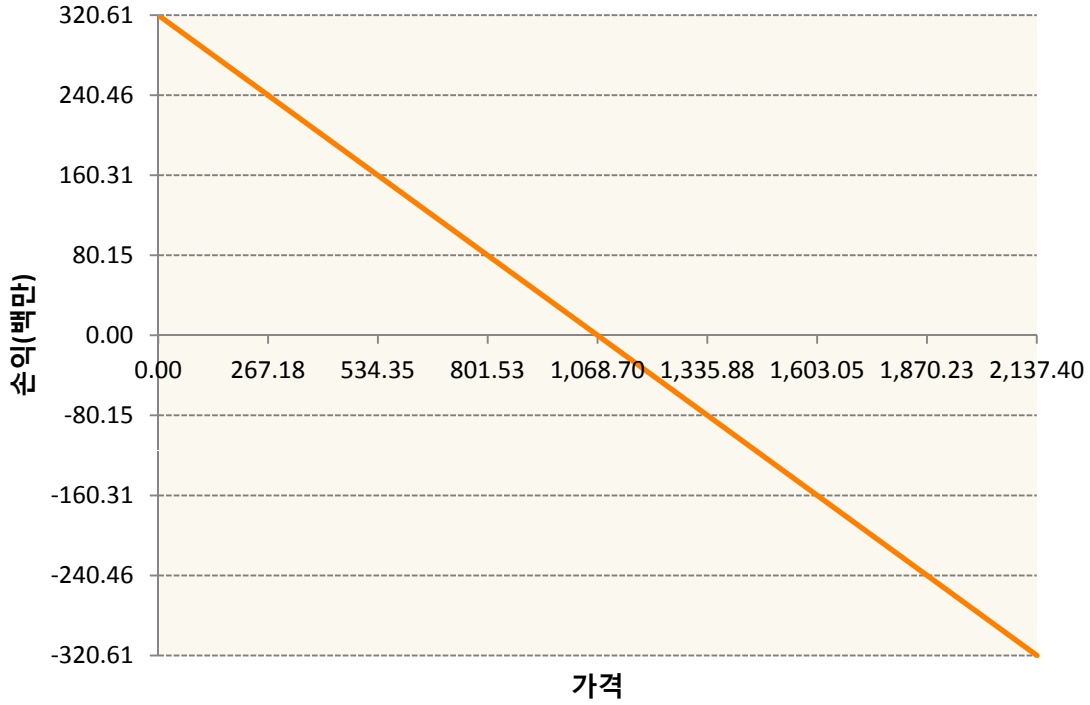
**CN8-CORN FUTURE JUL18**



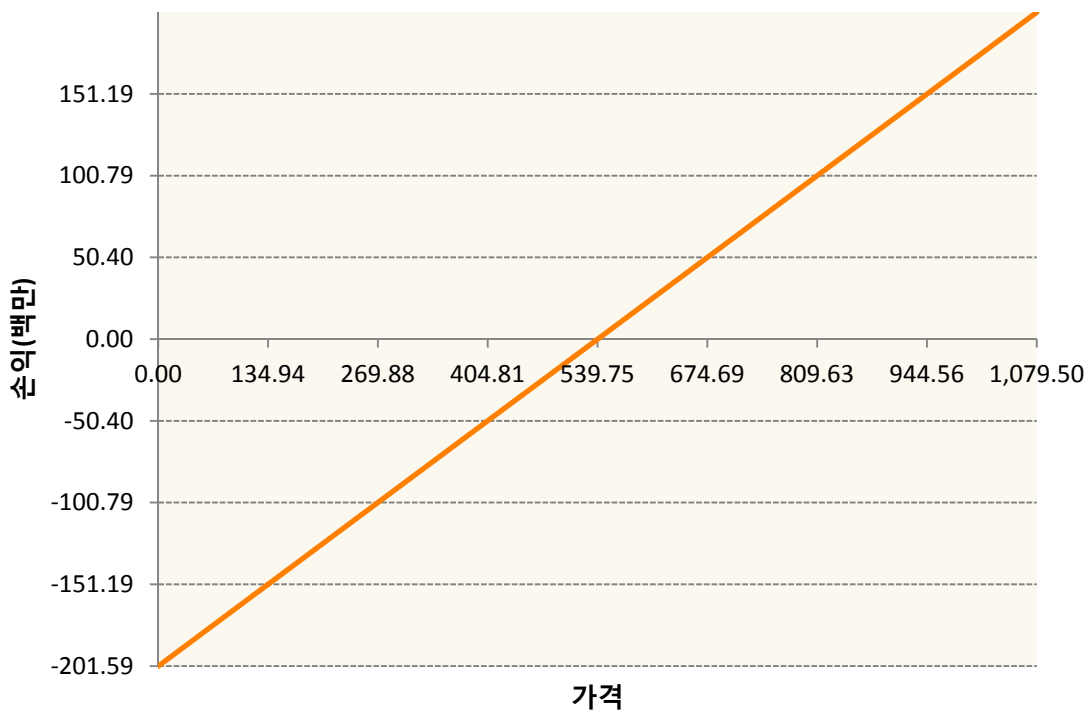




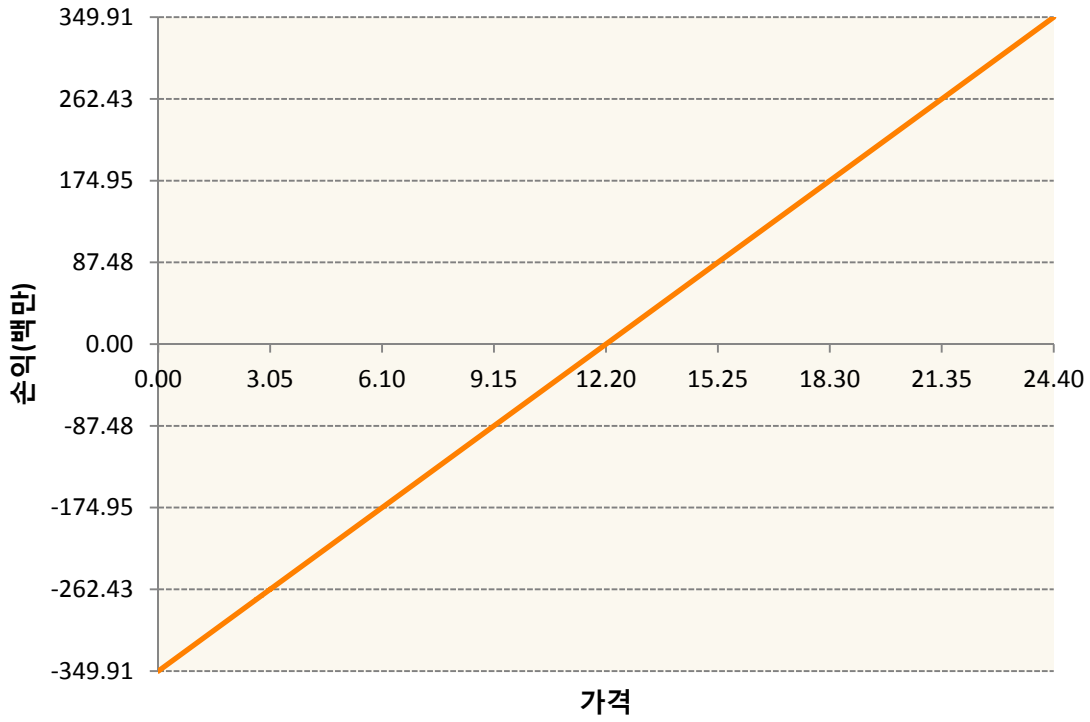
KR4175N60003-2018-06 달러선물



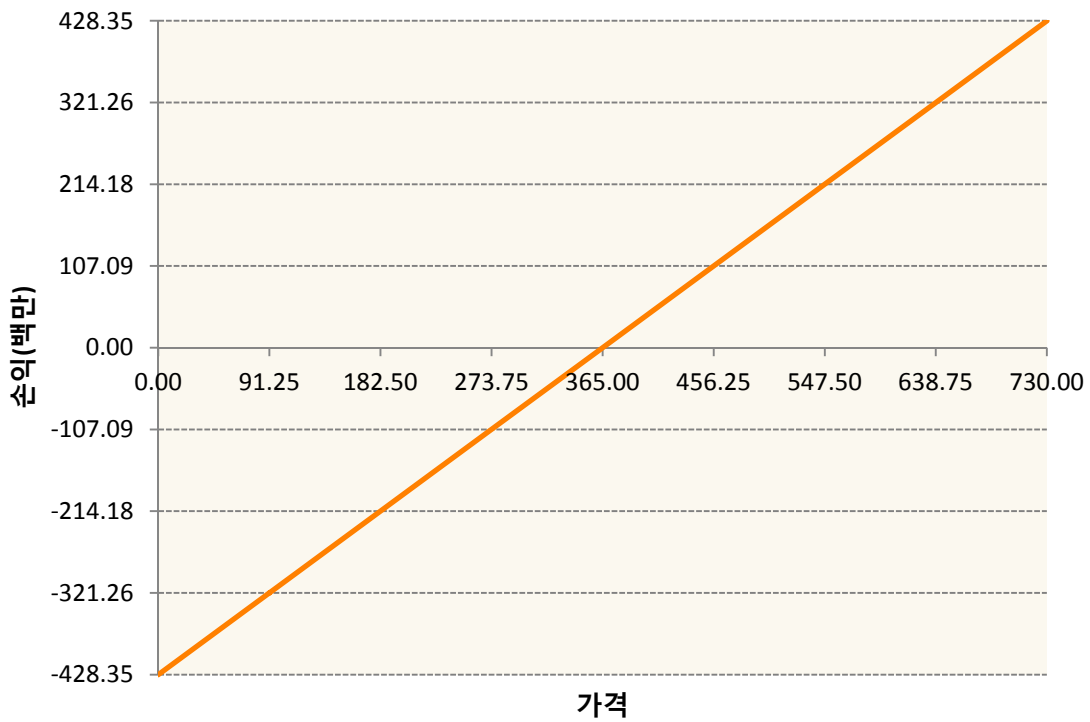
KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18



SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18

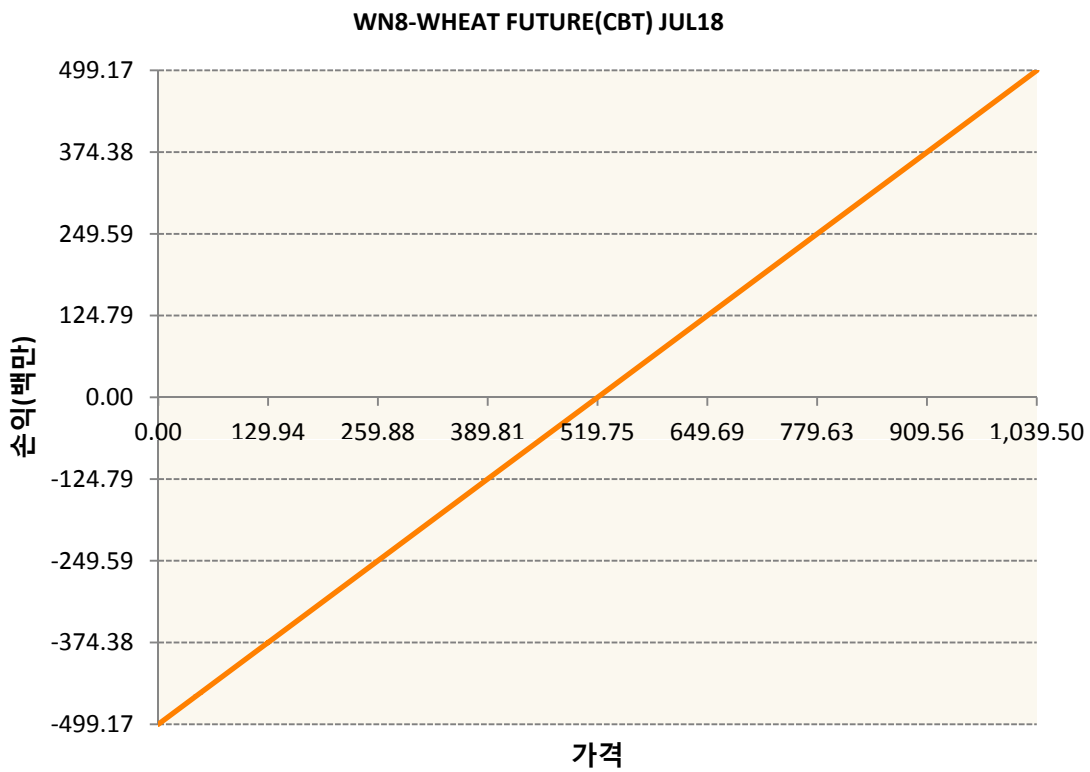
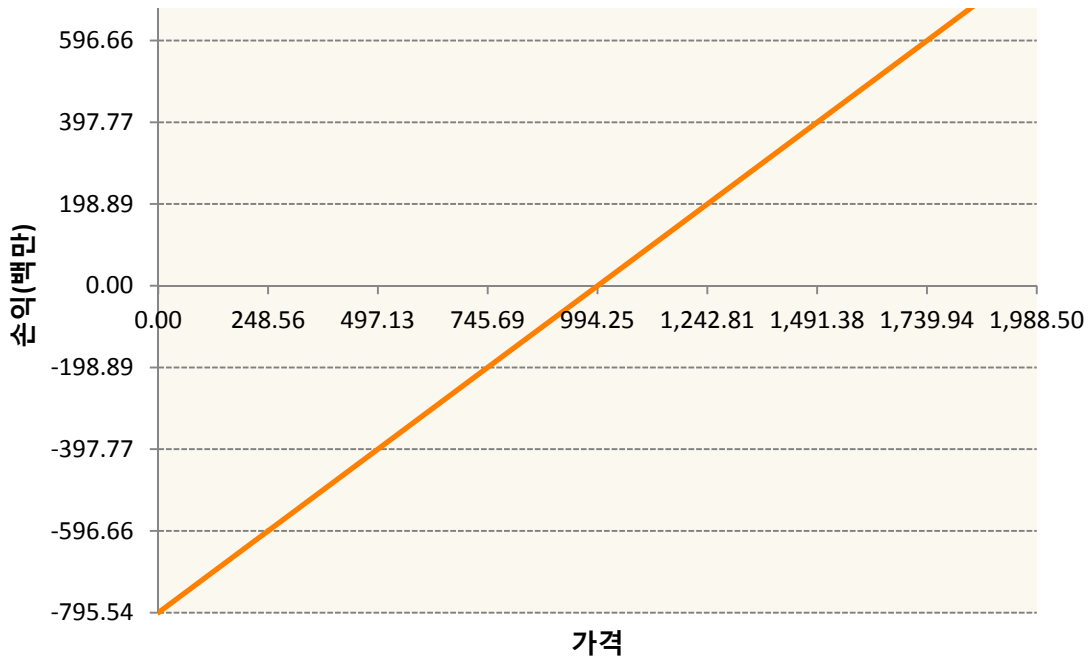


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18



SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BON8	SOYBEAN OIL FUTR JUL18	25
CN8	CORN FUTURE JUL18	69
CTN8	COTTON NO.2 FUTR JUL18	19
KCN8	COFFEE 'C' FUTURE JUL18	26
KR4175N60C	2018-06 달러선물	26

KWN8	KC HRW WHEAT FUT JUL18	16
SBN8	SUGAR #11 (WORLD) JUL18	28
SMN8	SOYBEAN MEAL FUTR JUL18	34
SN8	SOYBEAN FUTURE JUL18	64
WN8	WHEAT FUTURE(CBT) JUL18	40

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

(단위:백만원)

**329**