

공시일	2018-06-11
기준일	2018-06-08

## 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	2018-06-11
기준일	2018-06-08

## 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)

469

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-06-11
기준일	2018-06-08

## SMART중국본토중소형CSI500상장

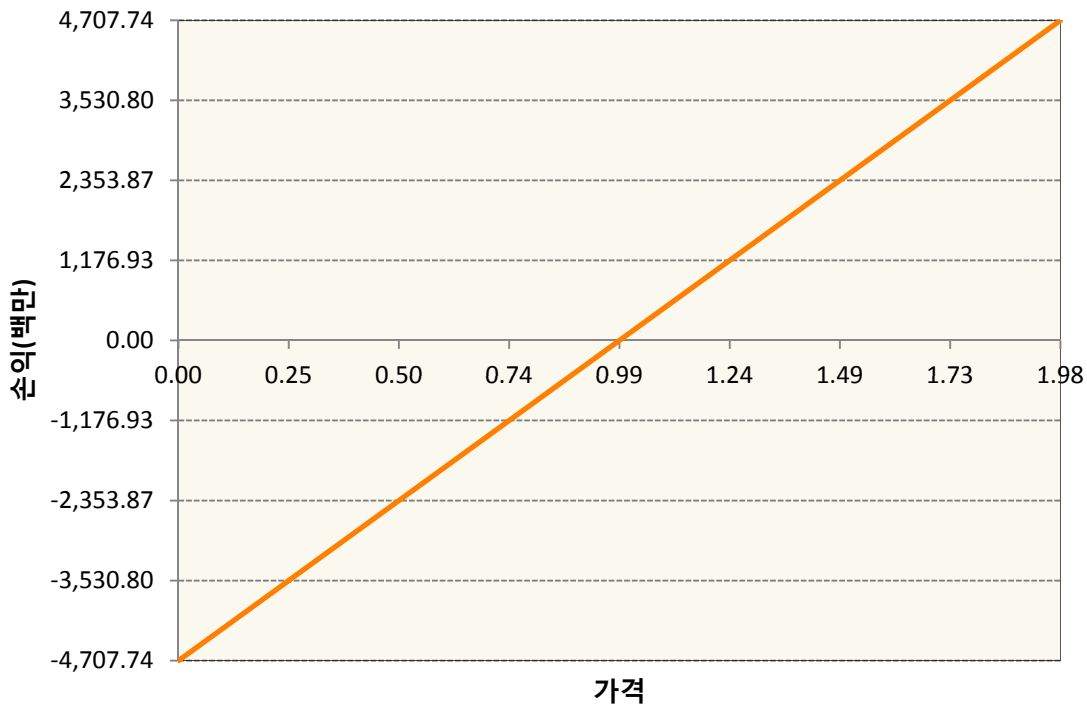
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	4,708	0	4,708	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

SWCSI5000018-신한CSI500미래S180608



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S180608

375

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

405

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-06-11
기준일	2018-06-08

## 유로인덱스모(주식-파생형)

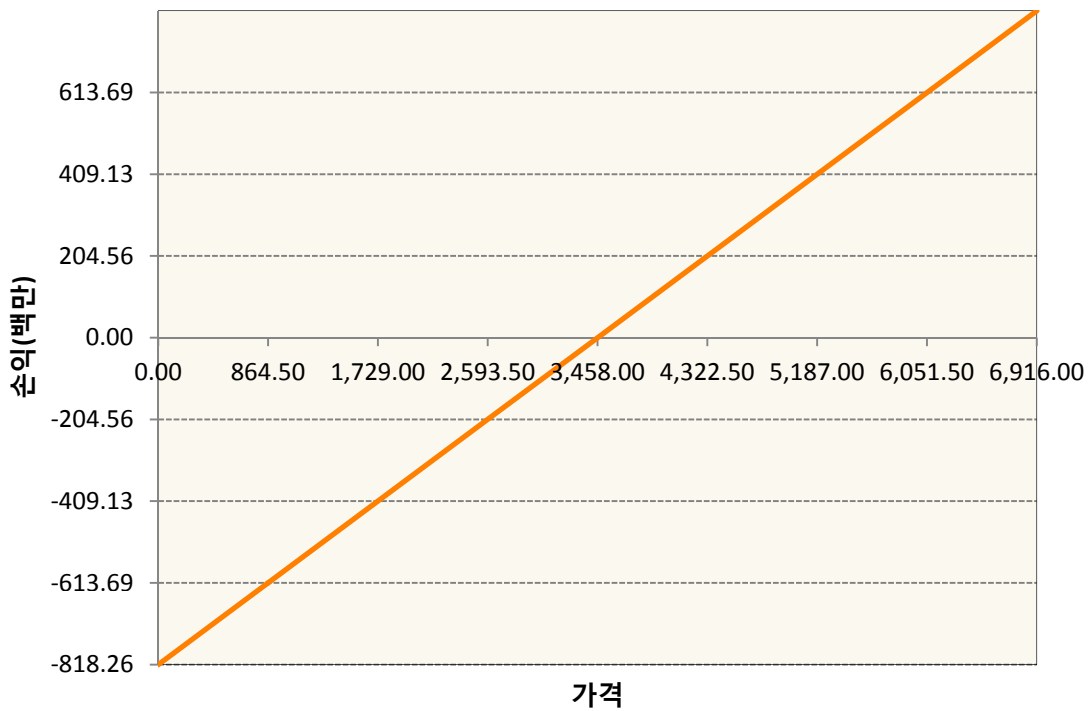
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	818	0	818	

### 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	2018-06-11
기준일	2018-06-08

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

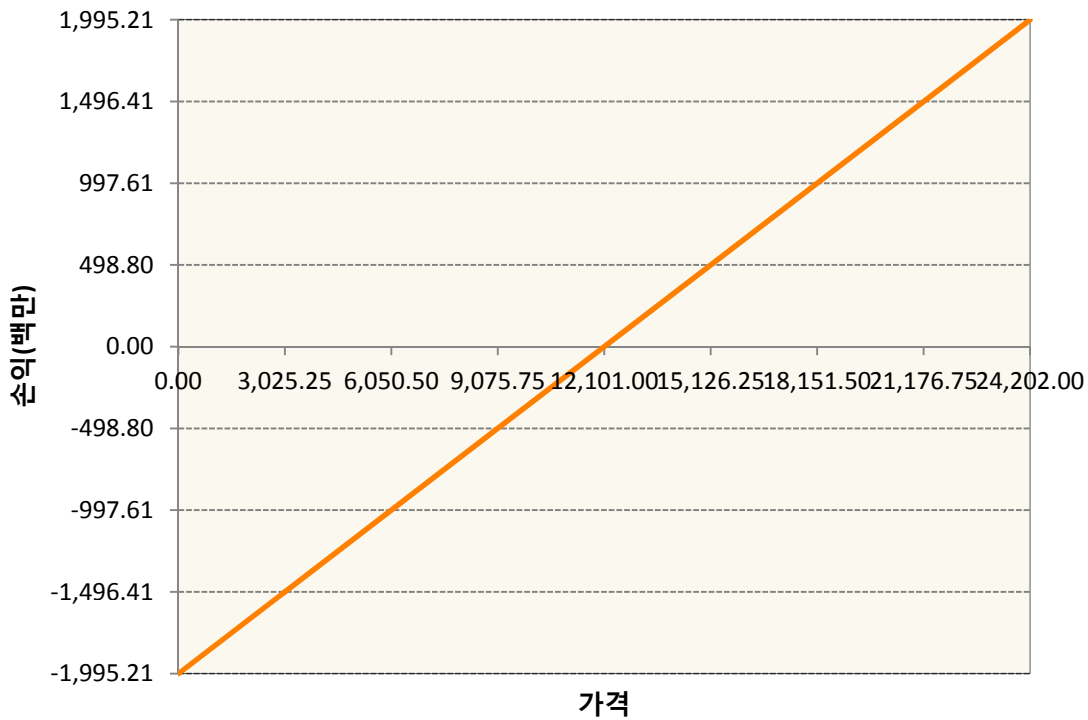
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

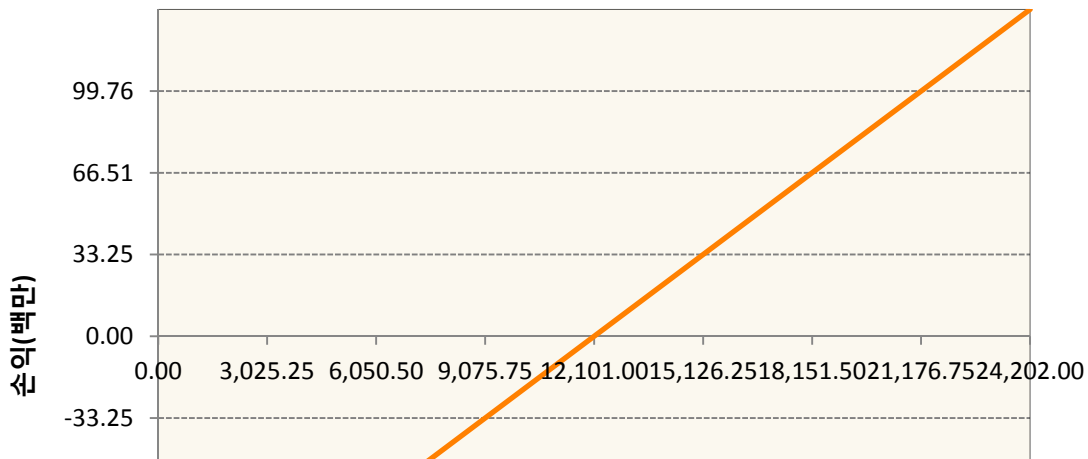
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,128	0	2,128	장내

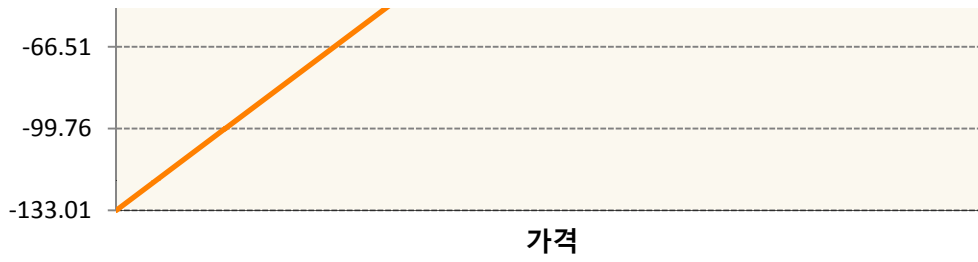
### 2. 만기시점의 손익구조

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>150</b>
------------

공시일	2018-06-11
기준일	2018-06-08

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

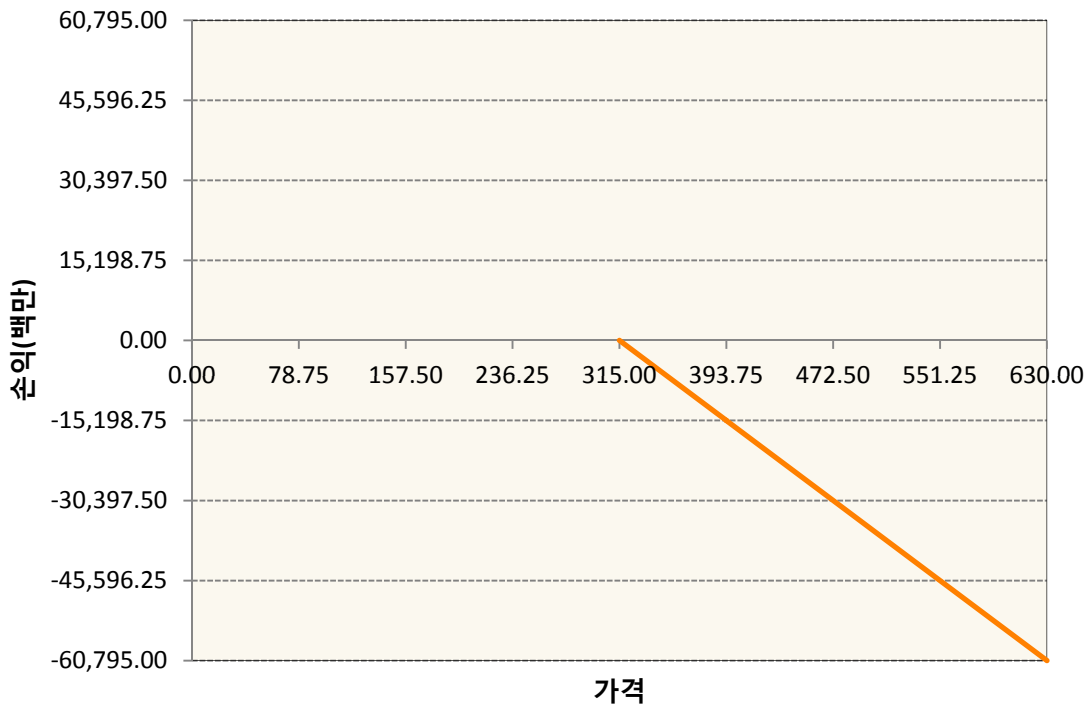
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

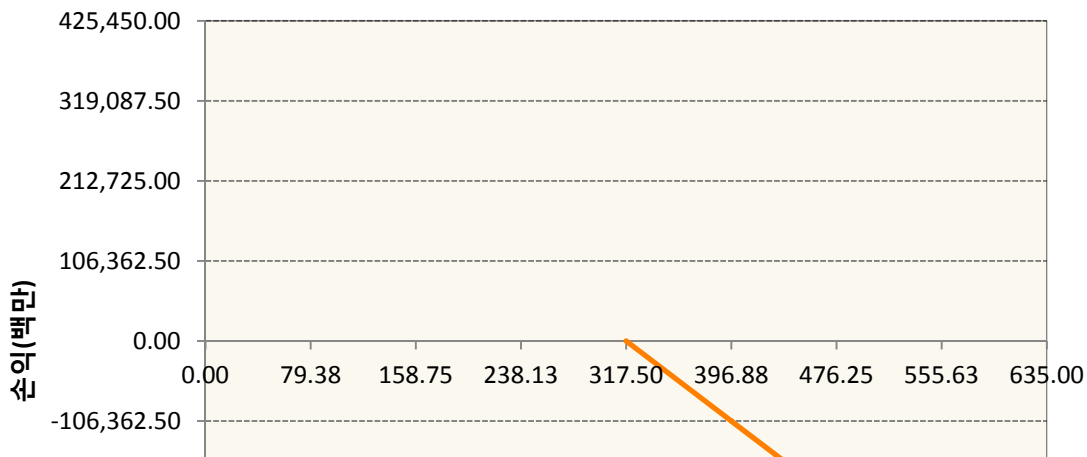
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	3,930	0	3,930	장내
누계	유가증권	옵션	0	794,220	-794,220	장내

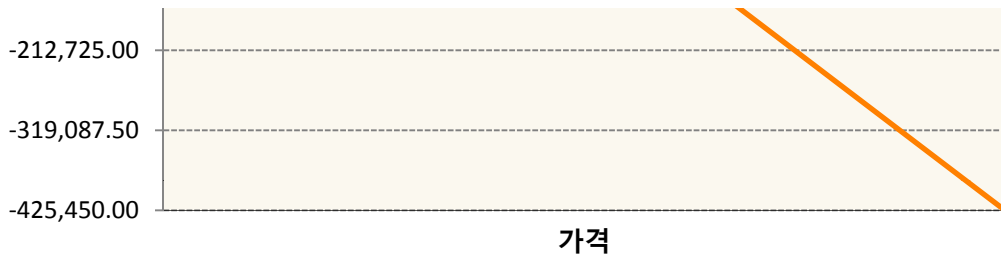
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201N63159-2018-06 콜315**

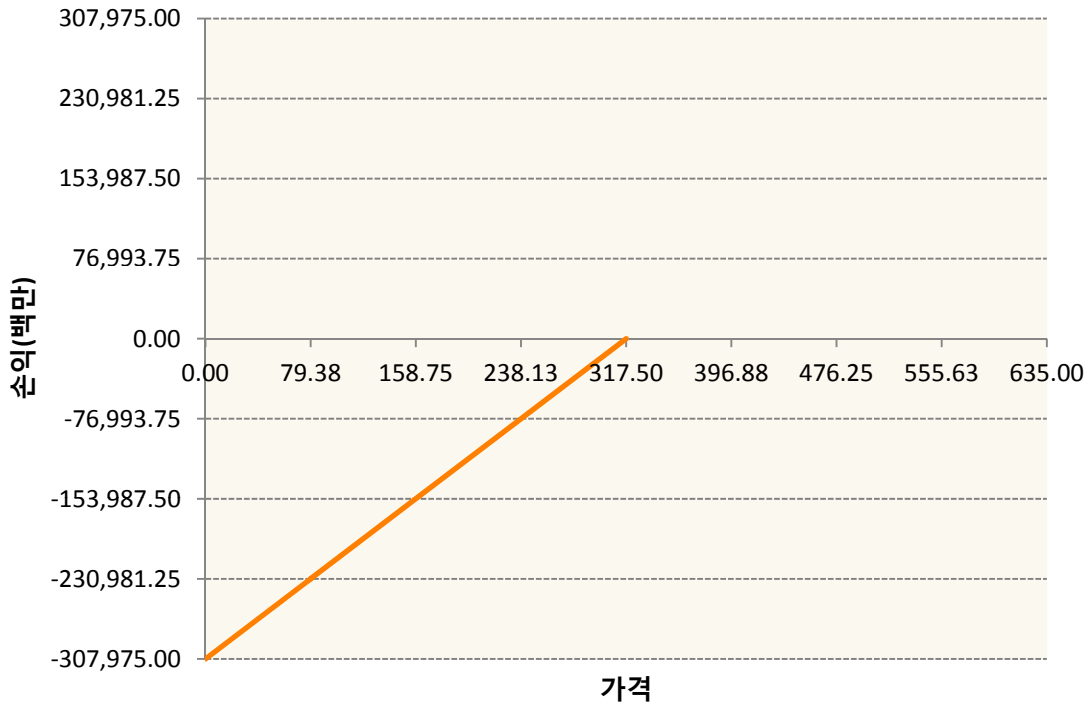


**KR4201N63175-2018-06 콜317.5**





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N6312018-06 콜315

4,044

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	860	859	857	853	848	840	830
-5.33%	849	838	823	804	781	753	722
-2.67%	731	686	638	586	532	475	417
0%	216	144	72	0	-72	-144	-216
2.67%	-896	-943	-995	-1,049	-1,105	-1,164	-1,225
5.33%	-2,391	-2,405	-2,423	-2,447	-2,474	-2,506	-2,542
8.00%	-3,996	-3,998	-4,002	-4,008	-4,017	-4,028	-4,044

KR4201N6312018-06 콜317.5

26,403

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,472	4,469	4,463	4,449	4,426	4,390	4,340

-5.33%	4,438	4,397	4,333	4,244	4,127	3,985	3,817
-2.67%	3,977	3,749	3,487	3,195	2,878	2,541	2,186
0%	1,454	973	488	0	-490	-981	-1,474
2.67%	-5,065	-5,476	-5,904	-6,343	-6,793	-7,250	-7,714
5.33%	-14,881	-15,034	-15,224	-15,448	-15,703	-15,984	-16,289
8.00%	-25,909	-25,935	-25,981	-26,048	-26,141	-26,259	-26,403

KR4301N6312018-06 풋317.5

23,415

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-23,415	-23,415	-23,415	-23,415	-23,415	-23,415	-23,415
-5.33%	-15,270	-15,270	-15,270	-15,270	-15,271	-15,271	-15,272
-2.67%	-7,128	-7,133	-7,141	-7,155	-7,176	-7,203	-7,238
0%	430	291	147	0	-150	-303	-458
2.67%	3,357	3,294	3,218	3,132	3,036	2,932	2,821
5.33%	3,474	3,473	3,471	3,468	3,461	3,451	3,436
8.00%	3,474	3,474	3,474	3,474	3,474	3,474	3,473

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

(단위:백만원)

65,576

공시일	2018-06-11
기준일	2018-06-08

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

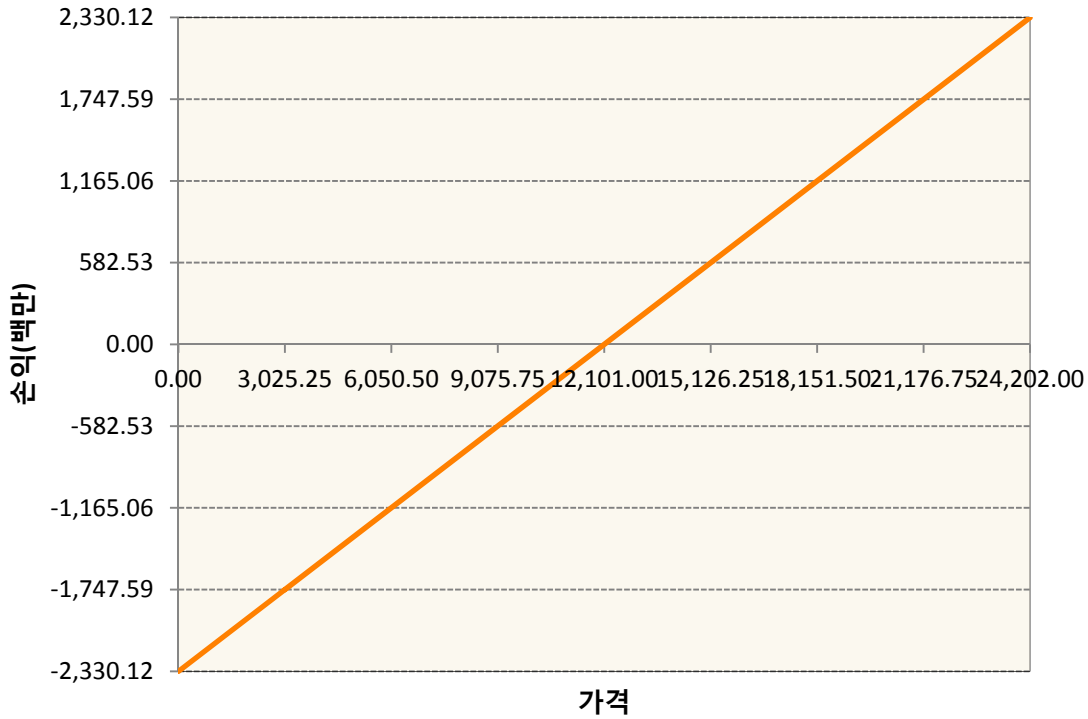
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

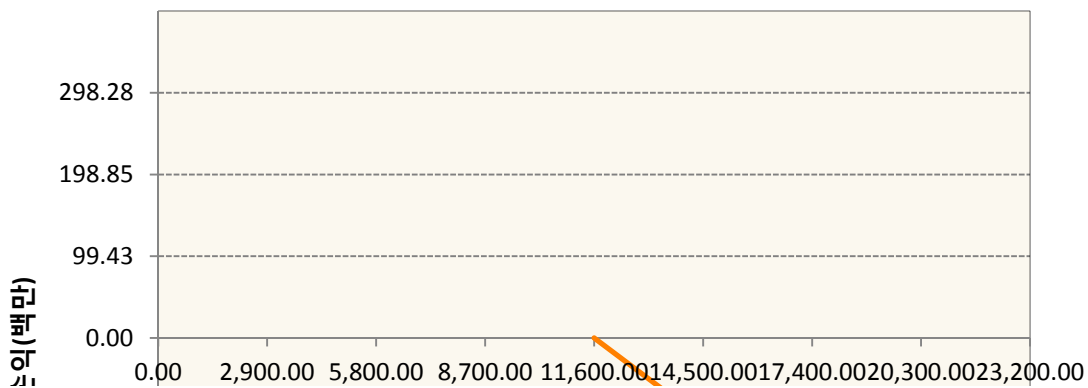
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,330	0	2,330	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,812	-5,812	장내

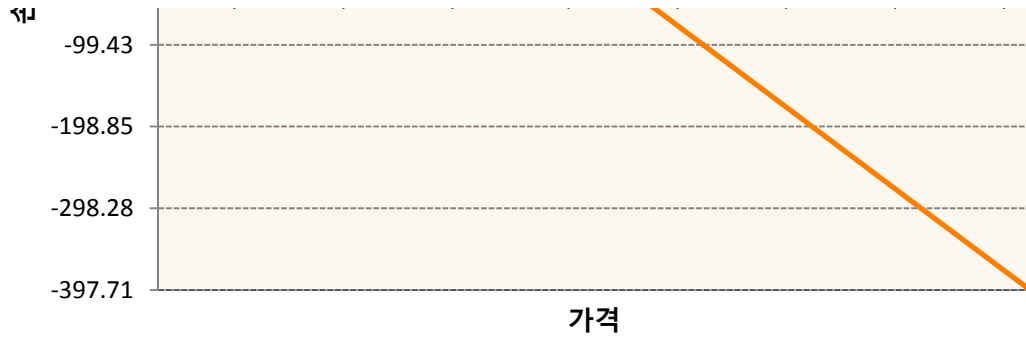
### 2. 만기시점의 손익구조

HCM8-HSCEI Futures Jun18

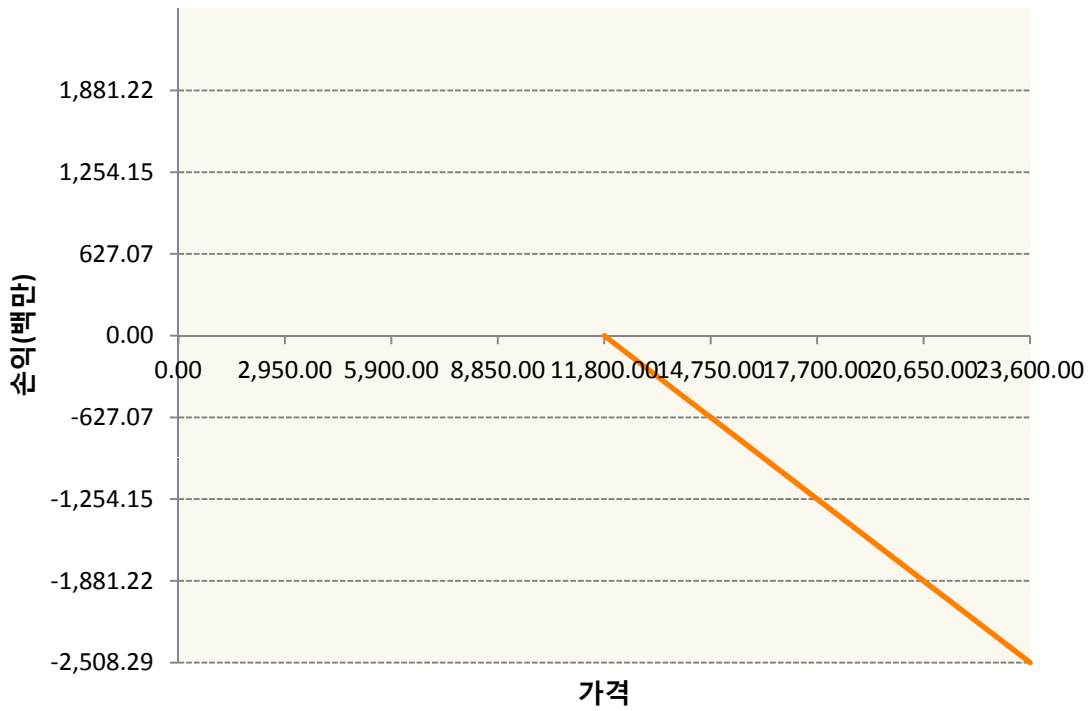


OHHIM8-C116-HSCEI

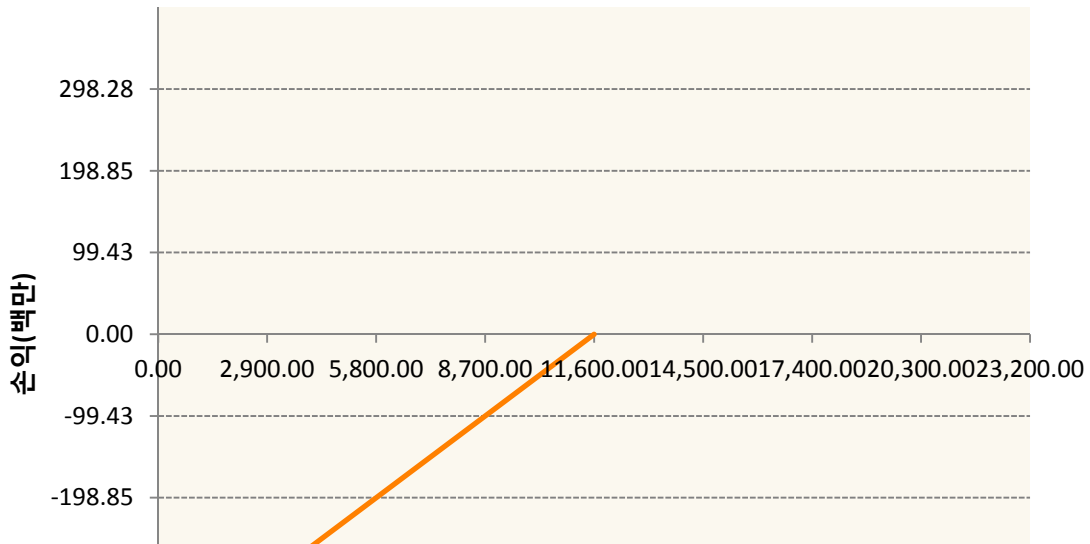


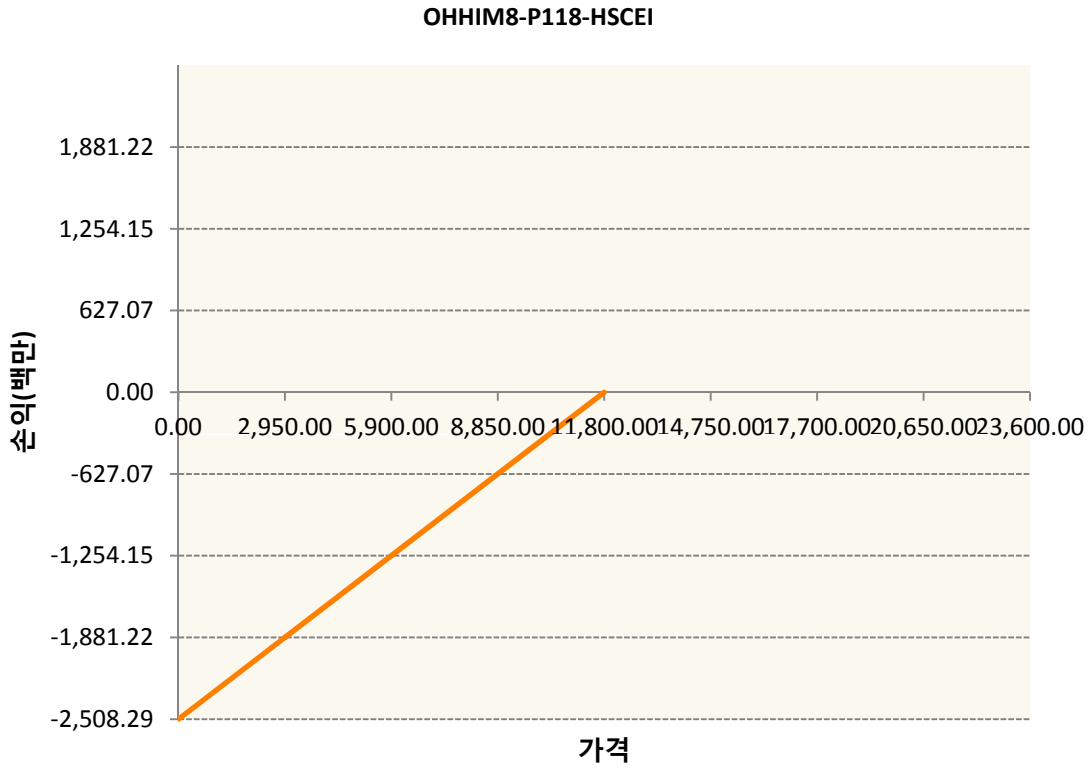
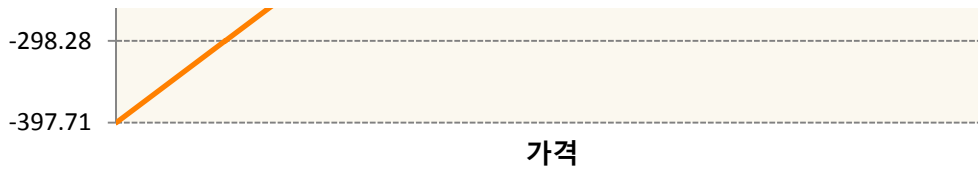


OHHIM8-C118-HSCEI



OHHIM8-P116-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCM8	HSCEI Futures Jun18	186
OHHIM8-C1	HSCEI	32
OHHIM8-C1	HSCEI	201
OHHIM8-P1	HSCEI	32
OHHIM8-P1	HSCEI	201

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

공시일	2018-06-11
기준일	2018-06-08

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

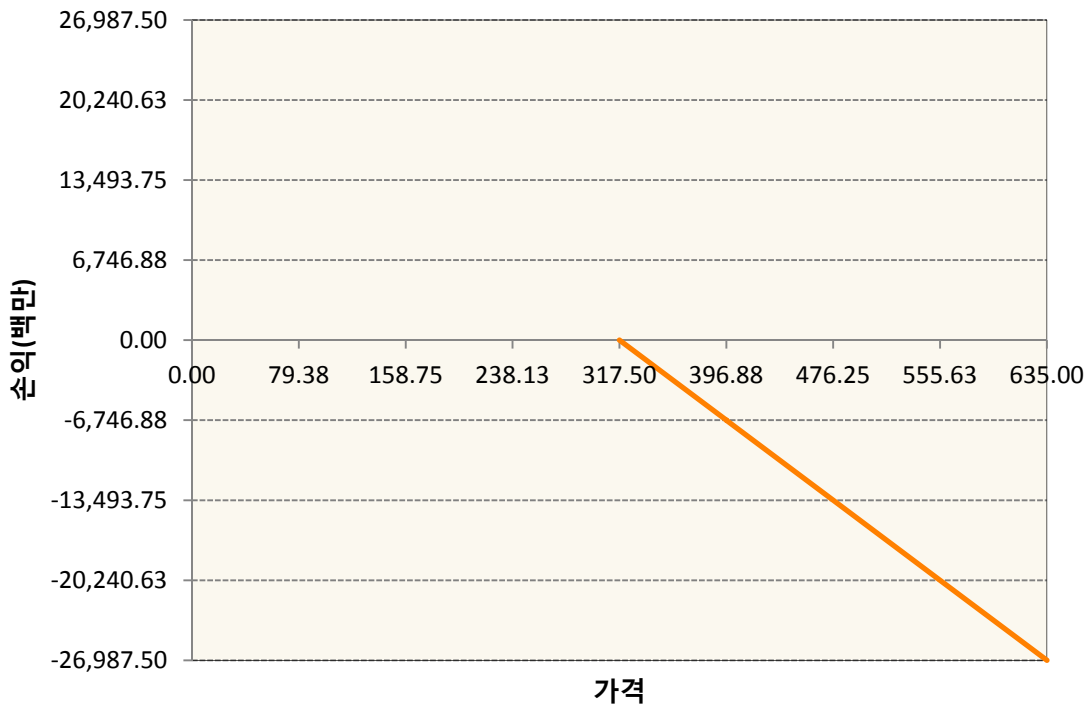
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

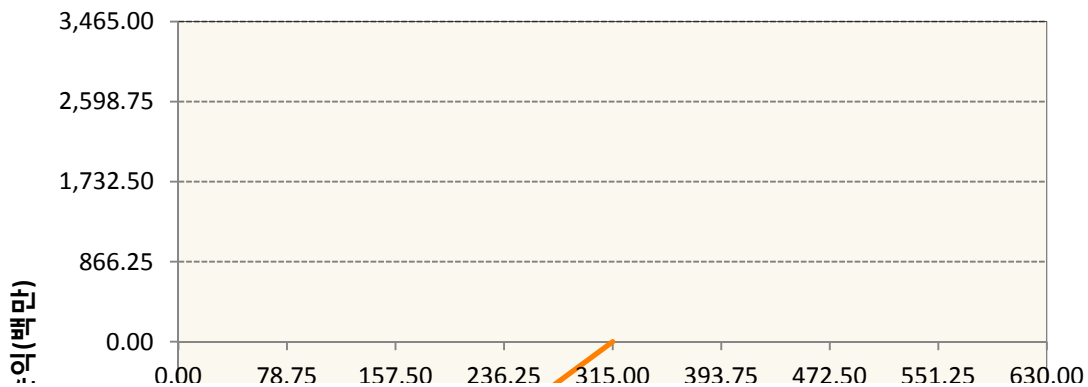
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	46,804	-46,804	장내

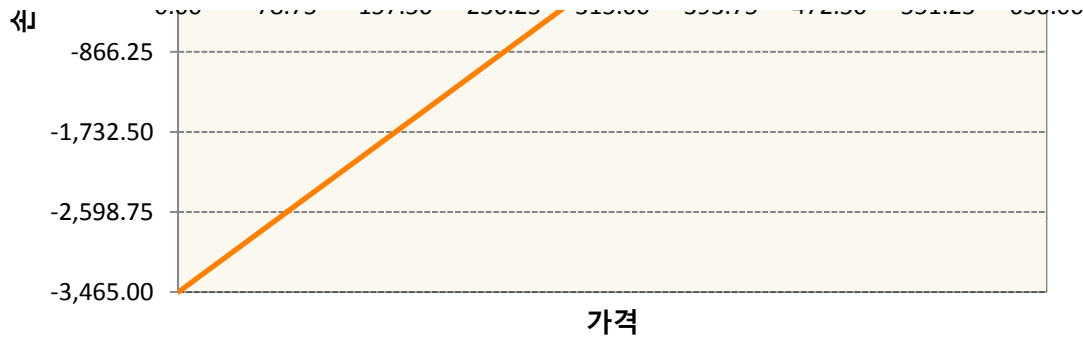
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63175-2018-06 콜317.5

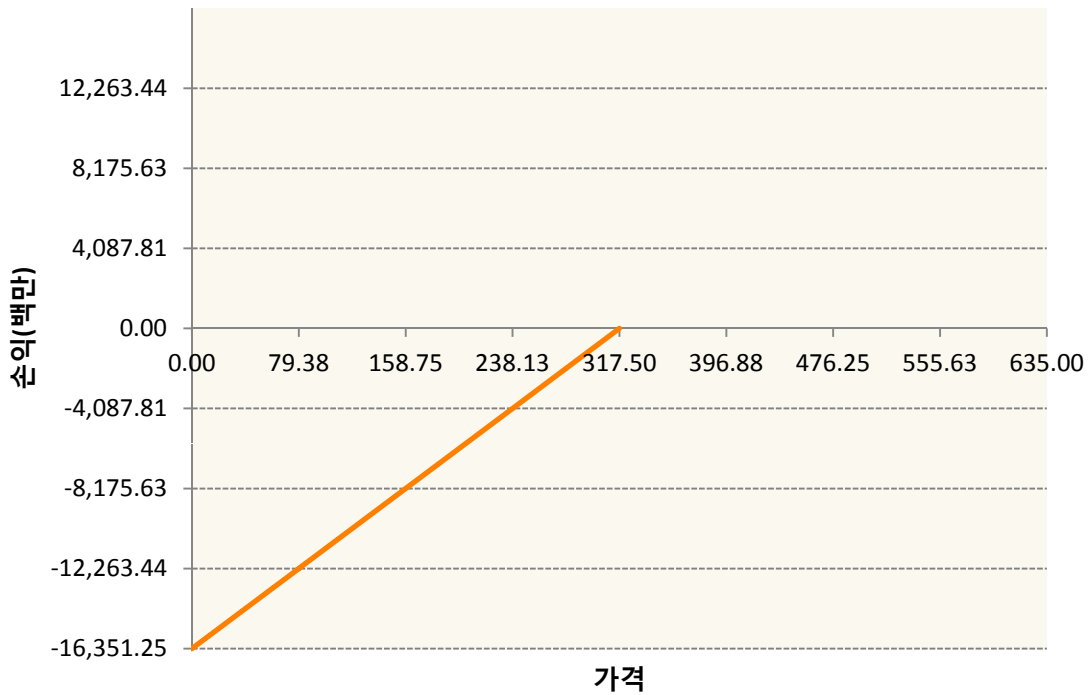


KR4301N63157-2018-06 풋315





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

1,675

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	284	283	283	282	281	278	275
-5.33%	282	279	275	269	262	253	242
-2.67%	252	238	221	203	183	161	139
0%	92	62	31	0	-31	-62	-93
2.67%	-321	-347	-374	-402	-431	-460	-489
5.33%	-944	-954	-966	-980	-996	-1,014	-1,033
8.00%	-1,643	-1,645	-1,648	-1,652	-1,658	-1,666	-1,675

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%	-162	-162	-162	-162	-162	-162	-162
-2.67%	-70	-70	-71	-71	-71	-72	-73
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	23	22	22	22	21	20	19
5.33%	23	23	23	23	23	23	23
8.00%	23	23	23	23	23	23	23

KR4301N6312018-06 풋317.5

1,243

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,243	-1,243	-1,243	-1,243	-1,243	-1,243	-1,243
-5.33%	-811	-811	-811	-811	-811	-811	-811
-2.67%	-378	-379	-379	-380	-381	-382	-384
0%	23	15	8	0	-8	-16	-24
2.67%	178	175	171	166	161	156	150
5.33%	184	184	184	184	184	183	182
8.00%	184	184	184	184	184	184	184

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

(단위:백만원)

7,738

공시일	2018-06-11
기준일	2018-06-08

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

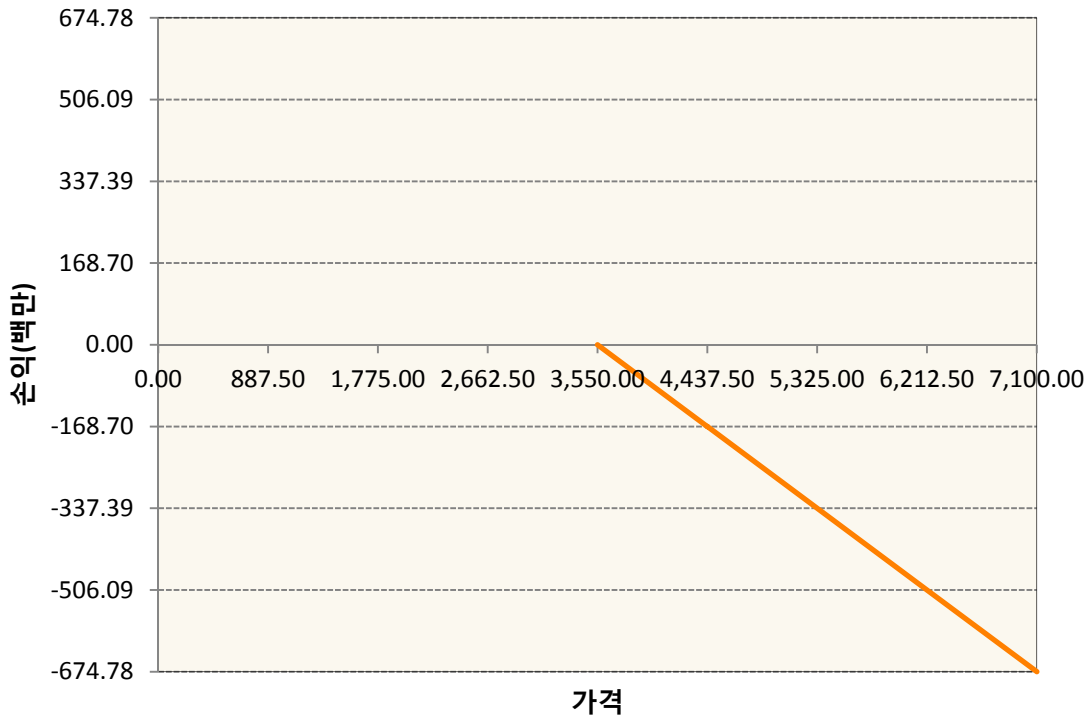
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

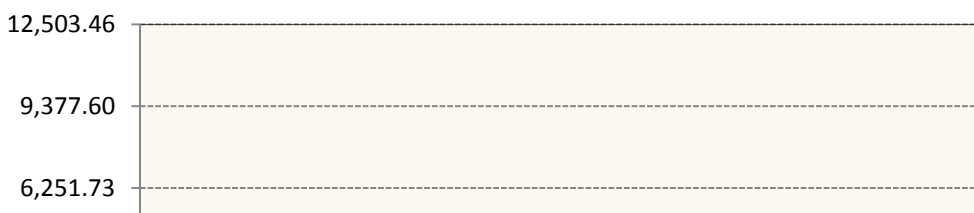
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,936	0	4,936	
누계	유가증권	스왑	53,426	0	53,426	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,356	-26,356	장내
누계	지수	스왑	50,689	0	50,689	장외

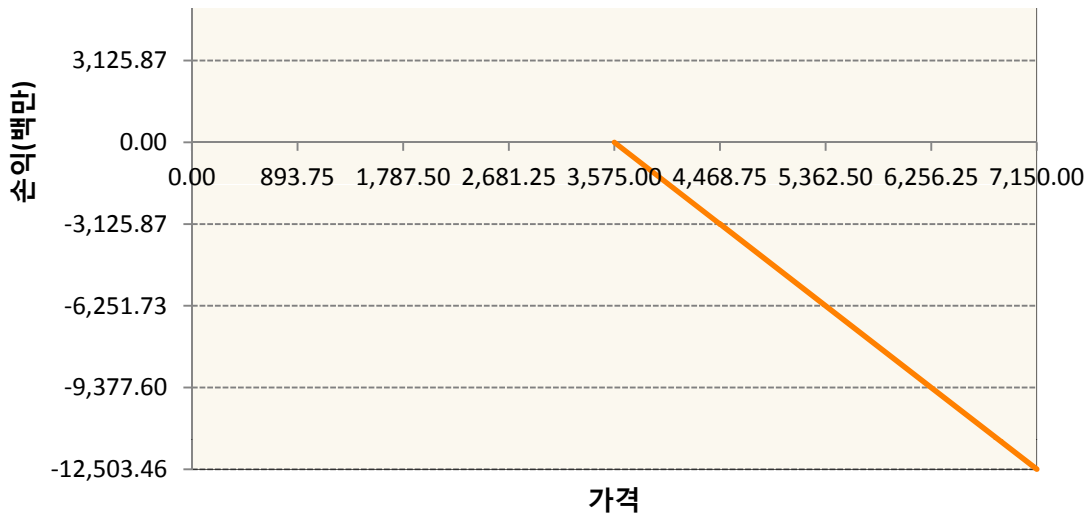
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXM8-C3550-EURO STOXX 50**

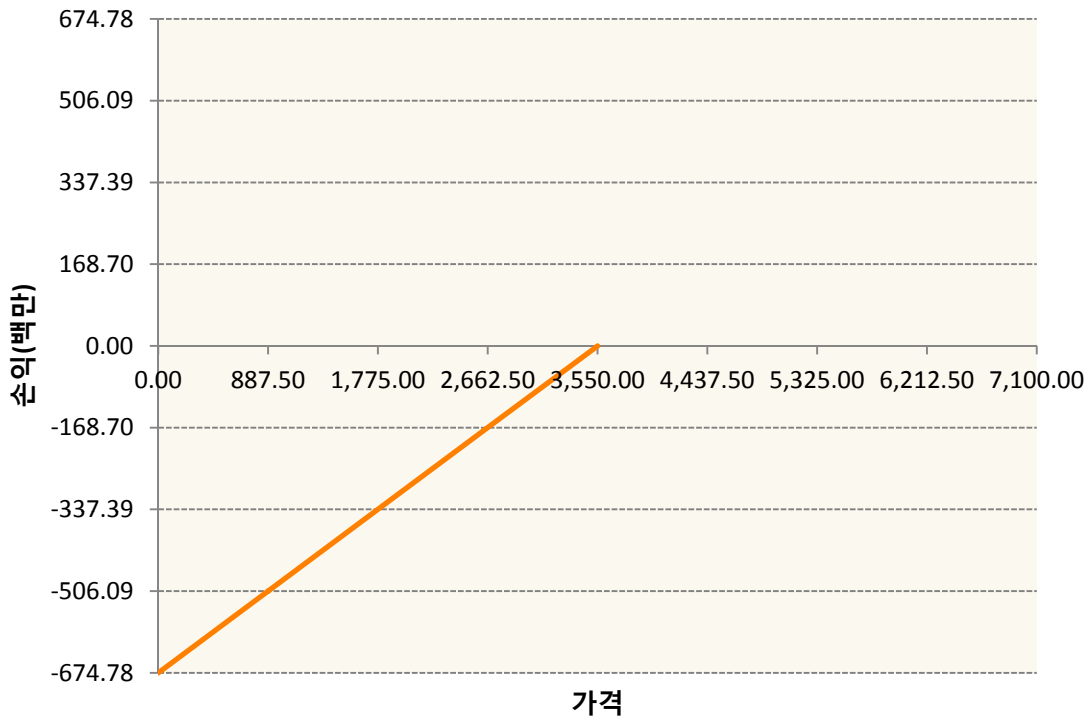


**OESXM8-C3575-EURO STOXX 50**

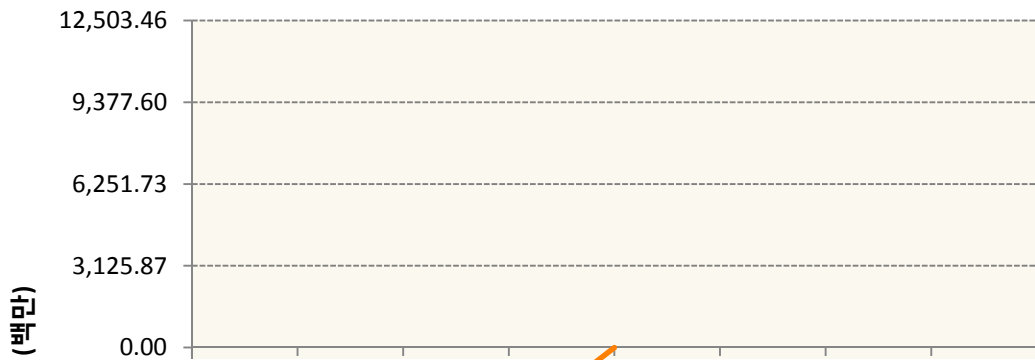


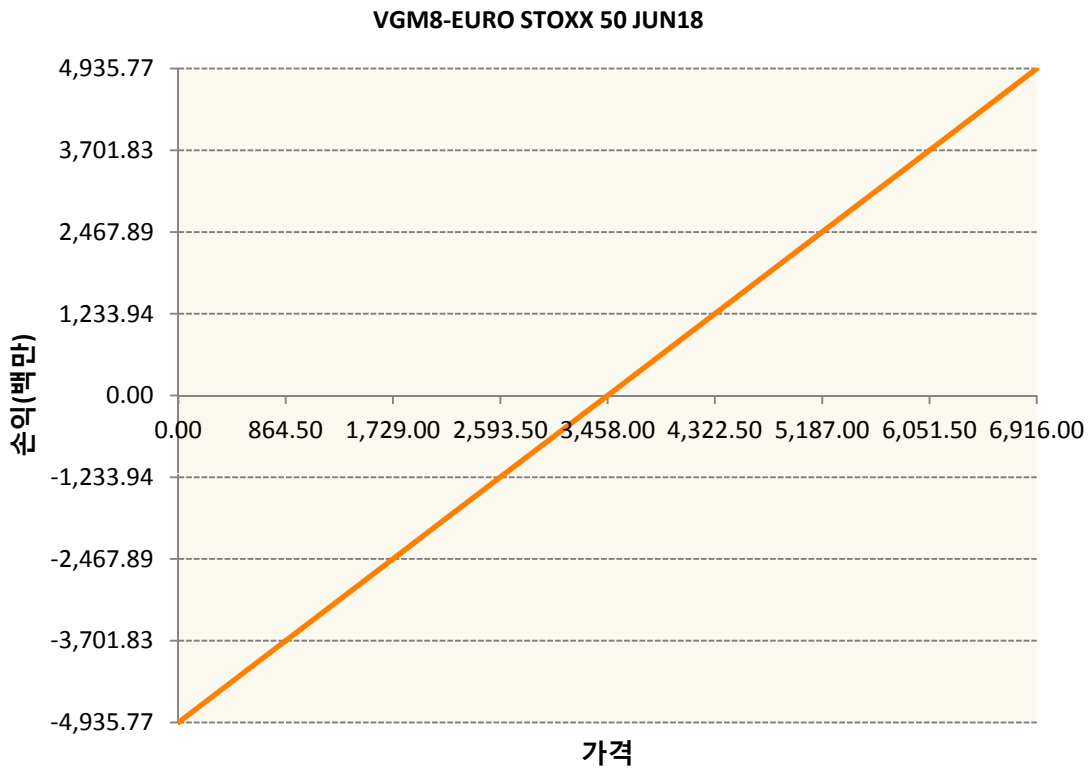
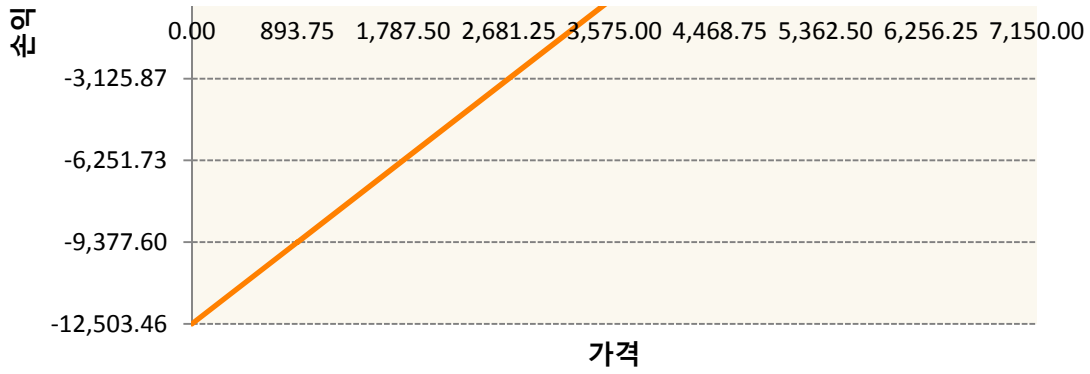


OESXM8-P3550-EURO STOXX 50



OESXM8-P3575-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		15
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		16
OESXM8-C3: EURO STOXX 50		54
OESXM8-C3: EURO STOXX 50		1,000
OESXM8-P3! EURO STOXX 50		54
OESXM8-P3! EURO STOXX 50		1,000
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18		395

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





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

(단위:백만원)

1,181

공시일	2018-06-11
기준일	2018-06-08

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

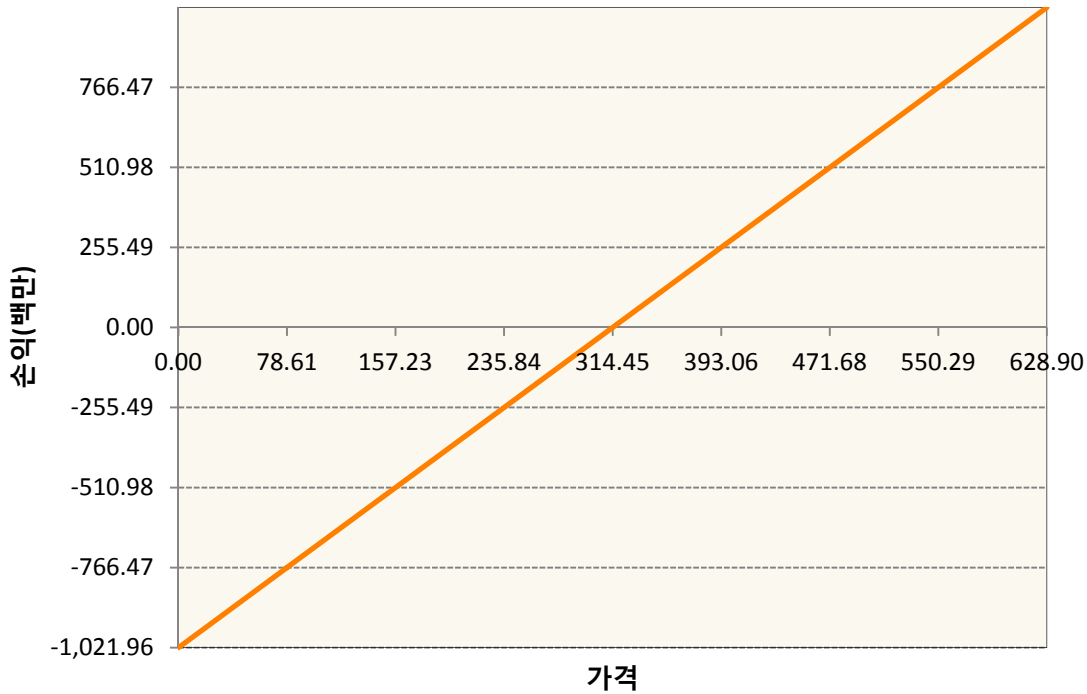
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,022	0	1,022	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물

82

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-5.33%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-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%	55	55	55	55	55	55	55
8.00%	82	82	82	82	82	82	82

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)

213

공시일	2018-06-11
기준일	2018-06-08

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1

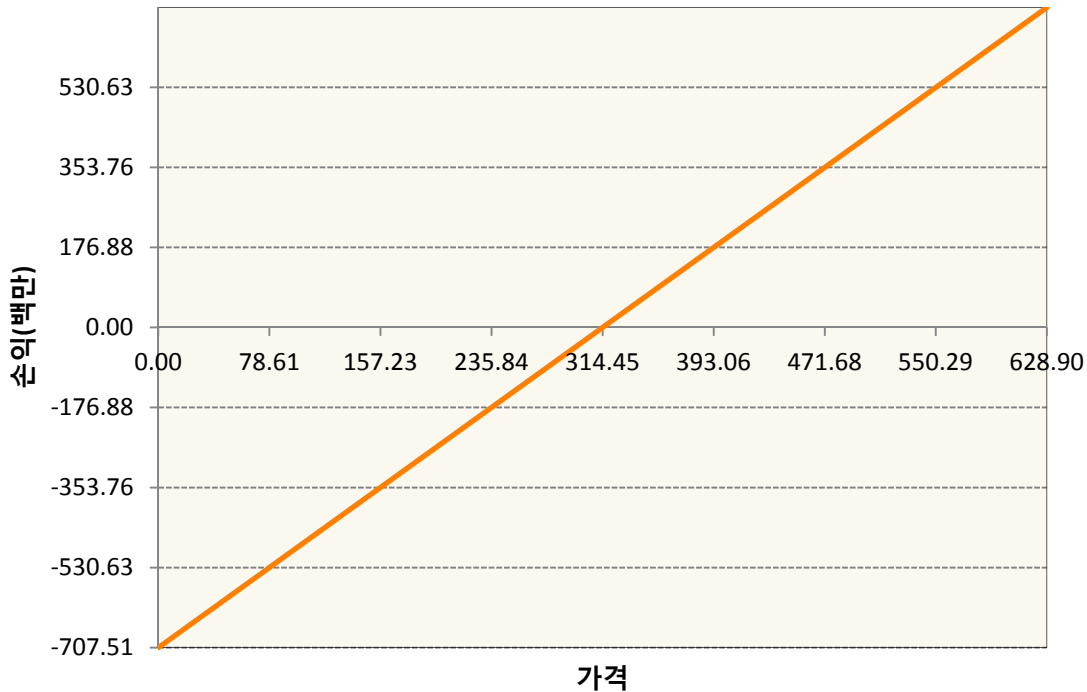
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	708	0	708	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물

57

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
-5.33%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
-2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	19	19	19	19	19	19	19
5.33%	38	38	38	38	38	38	38
8.00%	57	57	57	57	57	57	57

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

(단위:백만원)

41

공시일	2018-06-11
기준일	2018-06-08

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

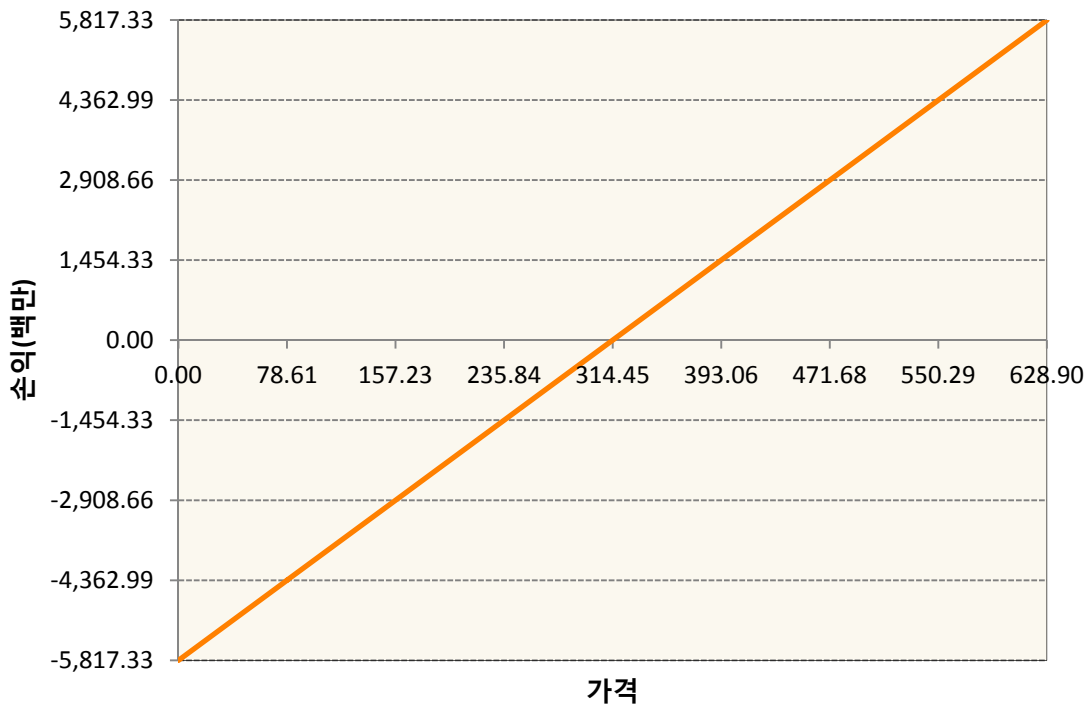
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

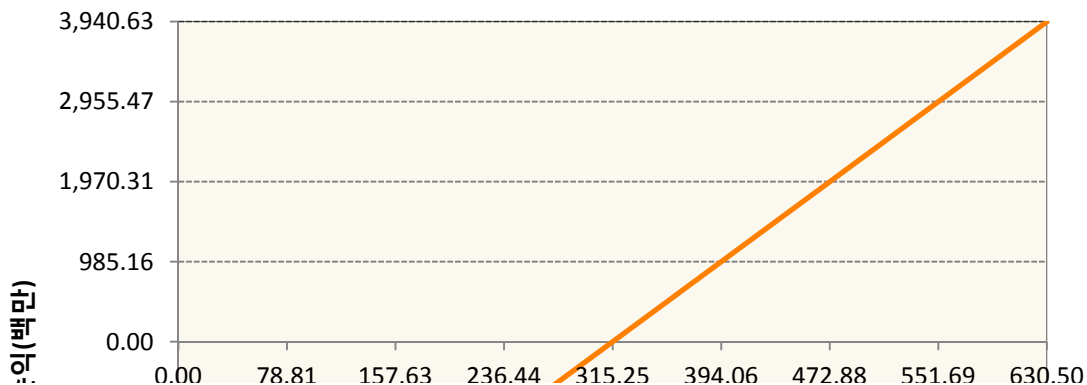
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3,955	3,952	3	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,758	0	9,758	장내
누계	유가증권	옵션	1,905	18,038	-16,133	장내

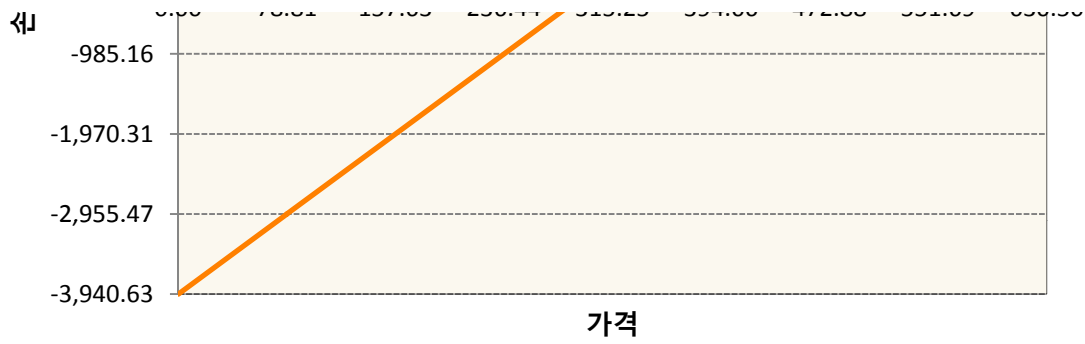
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

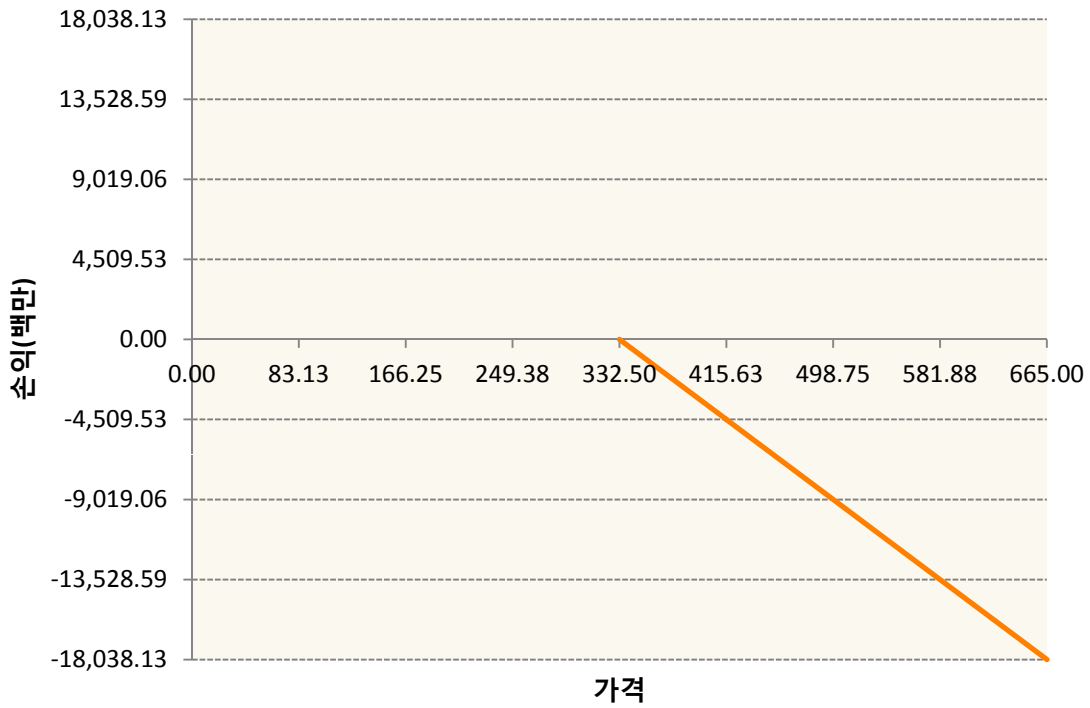


KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

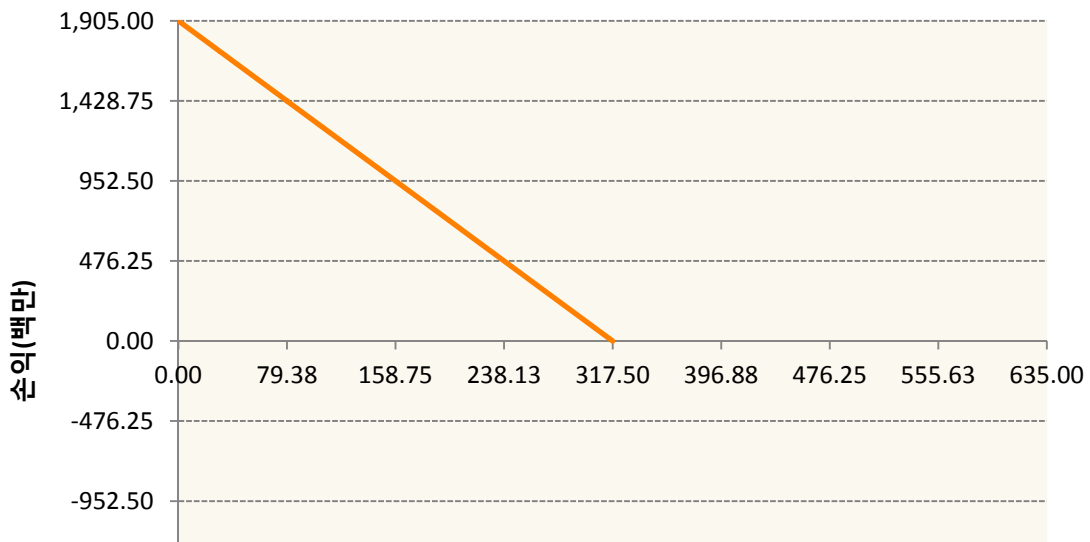


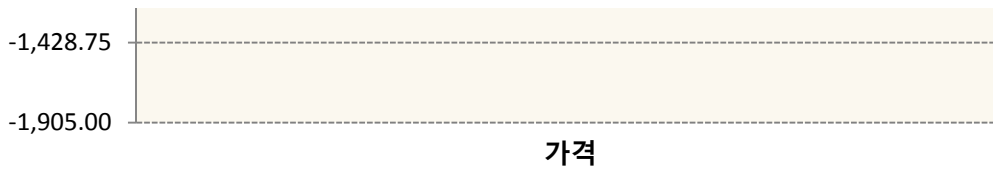


**KR4201N63324-2018-06 콜332.5**



**KR4301N63173-2018-06 풋317.5**





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

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물								466
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-466	-466	-466	-466	-466	-466	-466	-466
-5.33%	-311	-311	-311	-311	-311	-311	-311	-311
-2.67%	-155	-155	-155	-155	-155	-155	-155	-155
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	155	155	155	155	155	155	155	155
5.33%	311	311	311	311	311	311	311	311
8.00%	466	466	466	466	466	466	466	466
KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물								315
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-315	-315	-315	-315	-315	-315	-315	-315
-5.33%	-210	-210	-210	-210	-210	-210	-210	-210
-2.67%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	105	105	105	105	105	105	105	105
5.33%	210	210	210	210	210	210	210	210
8.00%	315	315	315	315	315	315	315	315
KR4201N63E 2018-06 콜332.5								556
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	17	17	17	17	17	17	17	17
-5.33%	17	17	17	17	17	16	16	16
-2.67%	17	17	16	15	13	11	7	7
0%	14	10	6	0	-7	-15	-25	-25
2.67%	-19	-32	-46	-61	-77	-93	-111	-111
5.33%	-155	-176	-198	-219	-240	-262	-283	-283
8.00%	-452	-467	-484	-501	-519	-537	-556	-556
KR4301N631 2018-06 풋317.5								145
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	145	145	145	145	145	145	145	145
-5.33%	94	94	94	94	94	94	94	94
-2.67%	44	44	44	44	44	45	45	45

0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-21	-20	-20	-19	-19	-18	-17
5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
8.00%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21

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

(단위:백만원)

**994**

공시일	2018-06-11
기준일	2018-06-08

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

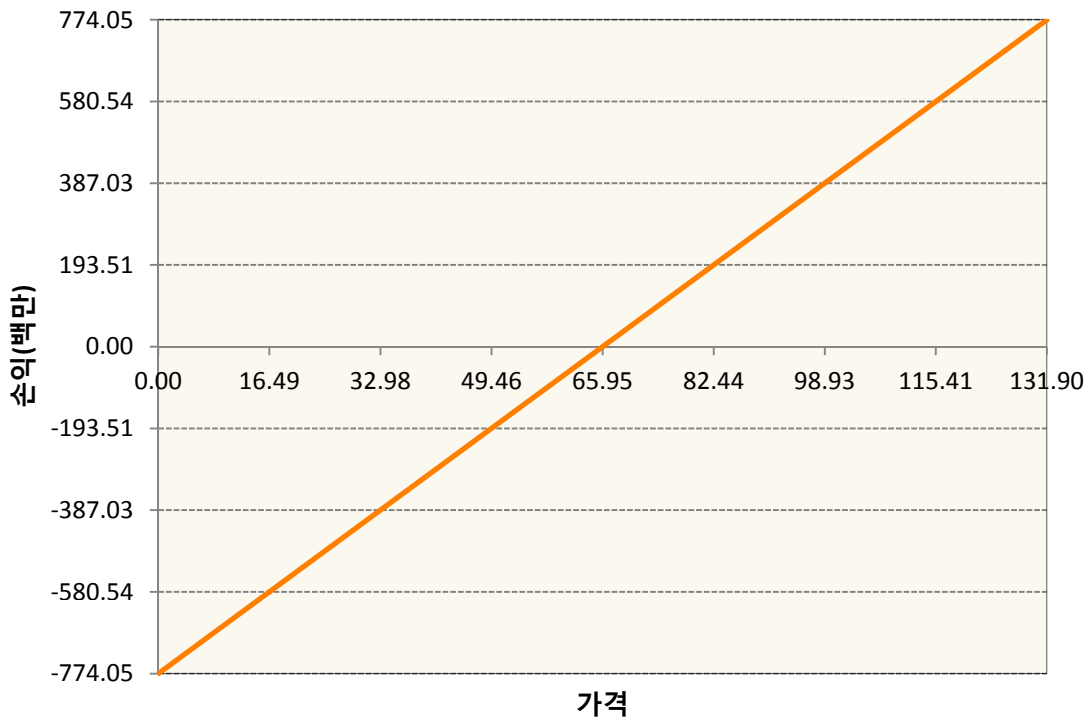
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

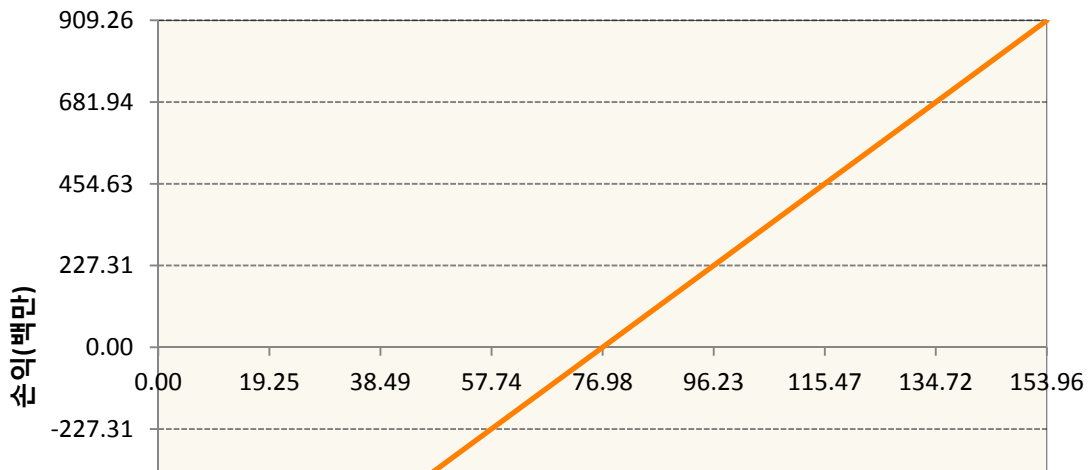
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,835	591	3,244	

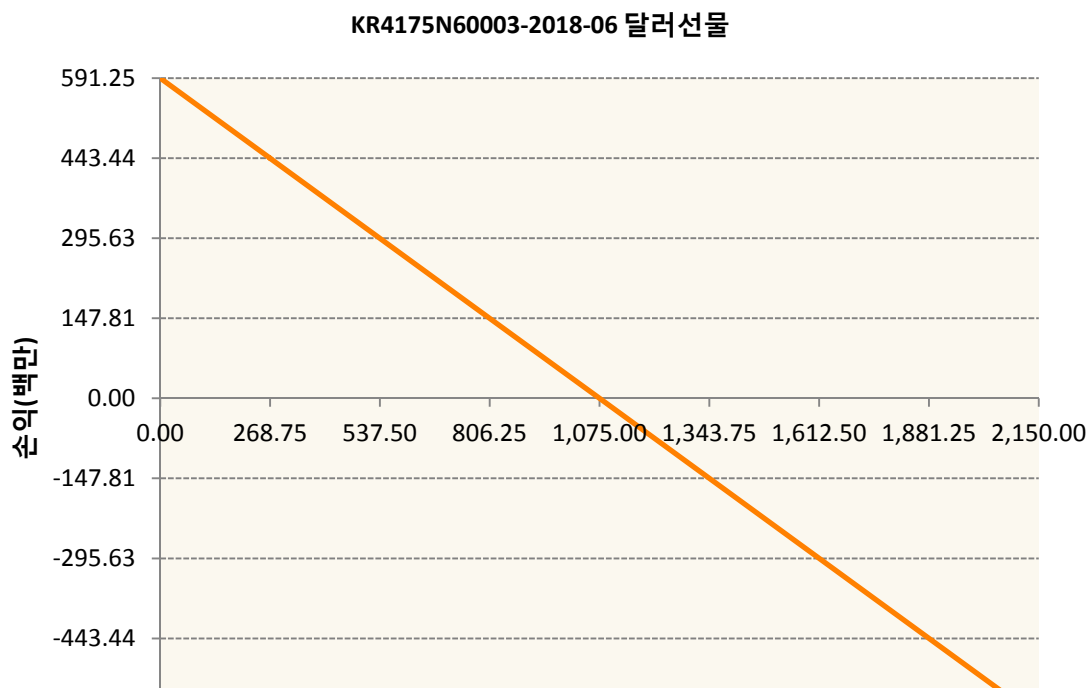
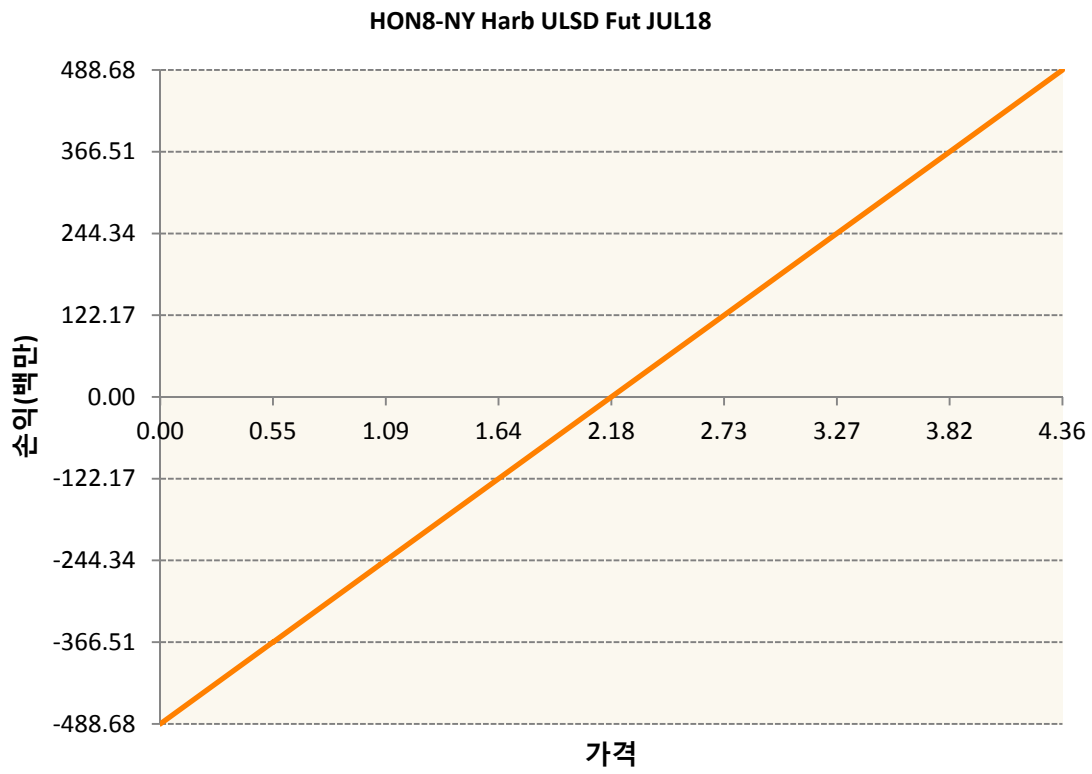
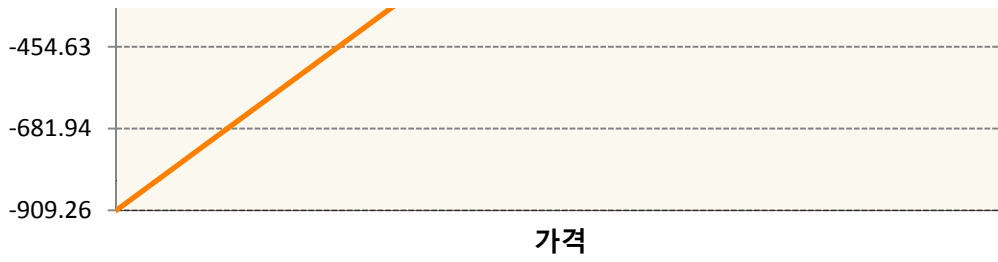
### 2. 만기시점의 손익구조

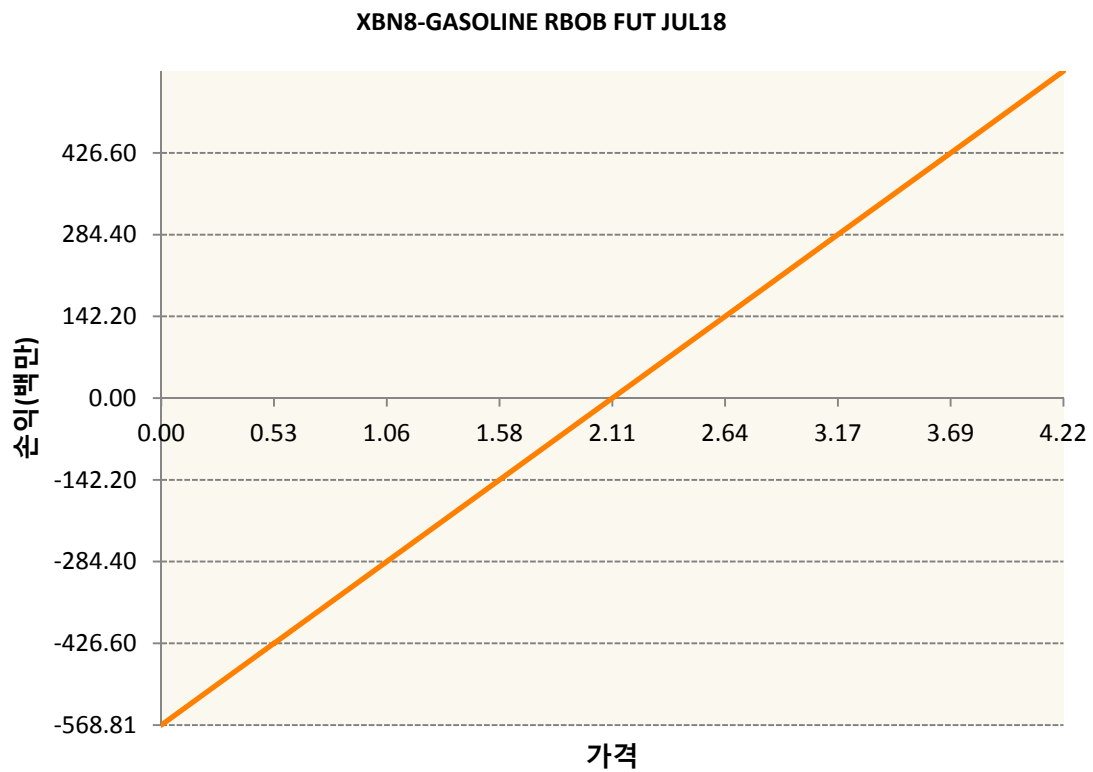
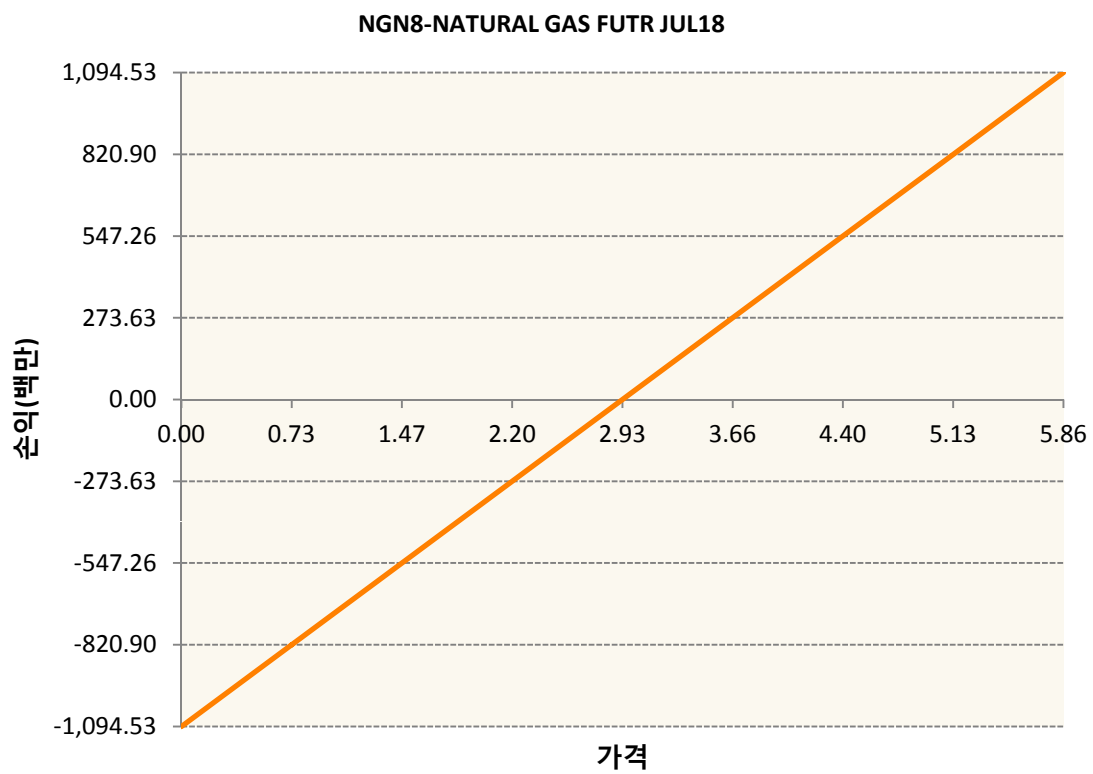
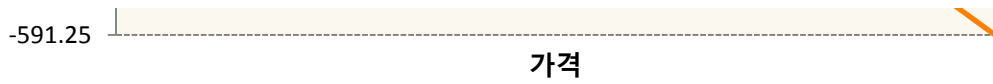
**CLN8-WTI CRUDE FUTURE JUL18**



**COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18**







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

CLN8	WTI CRUDE FUTURE JUL18	62
COU8	BRENT CRUDE FUTR SEP18	73
HON8	NY Harb ULSD Fut JUL18	39
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)

457

공시일	2018-06-11
기준일	2018-06-08

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

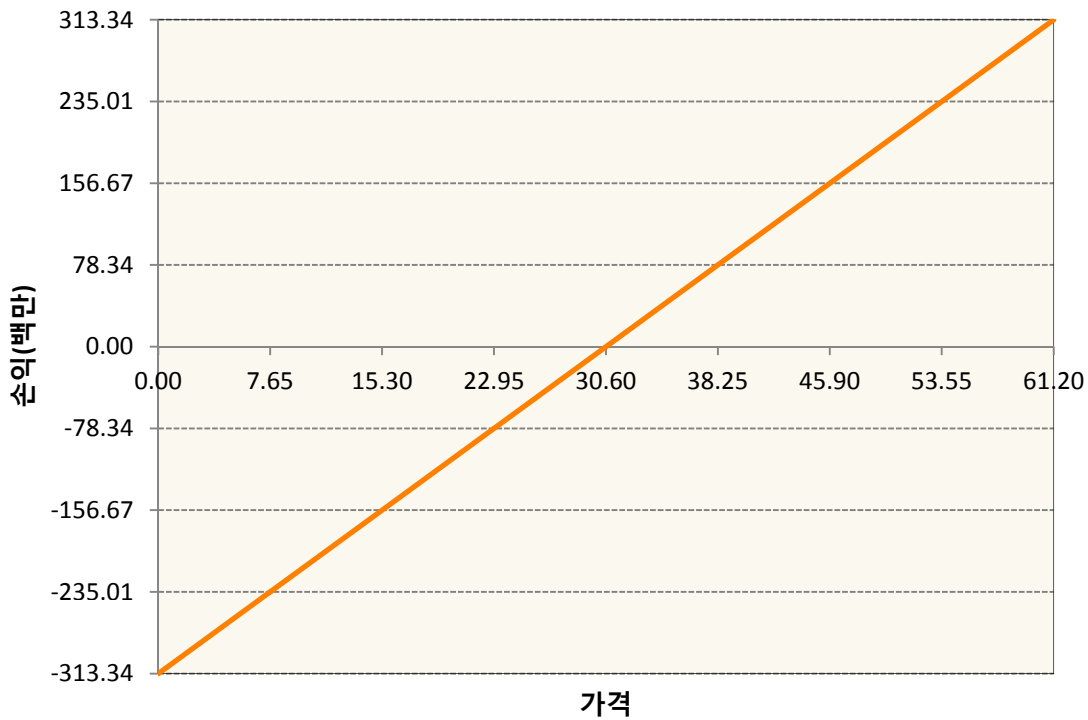
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

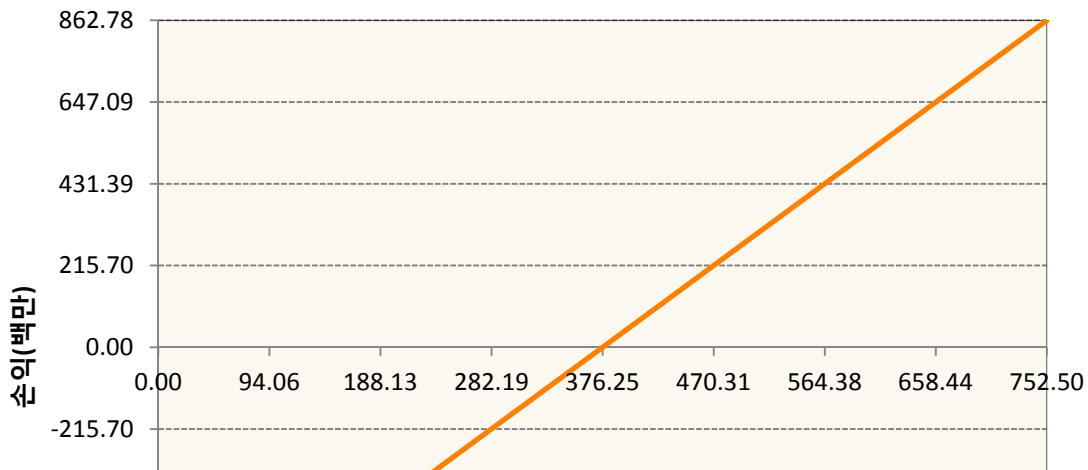
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,996	323	3,673	

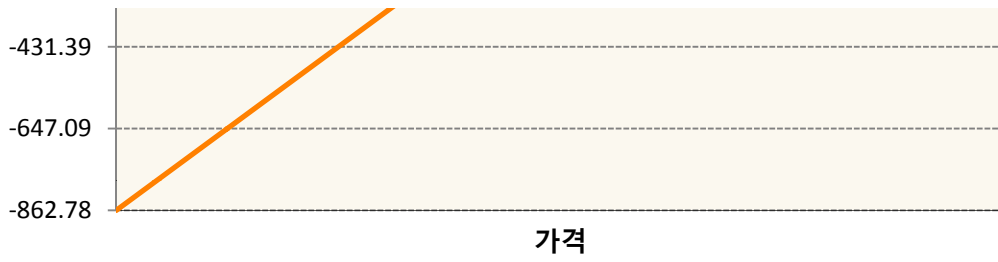
### 2. 만기시점의 손익구조

**BON8-SOYBEAN OIL FUTR JUL18**

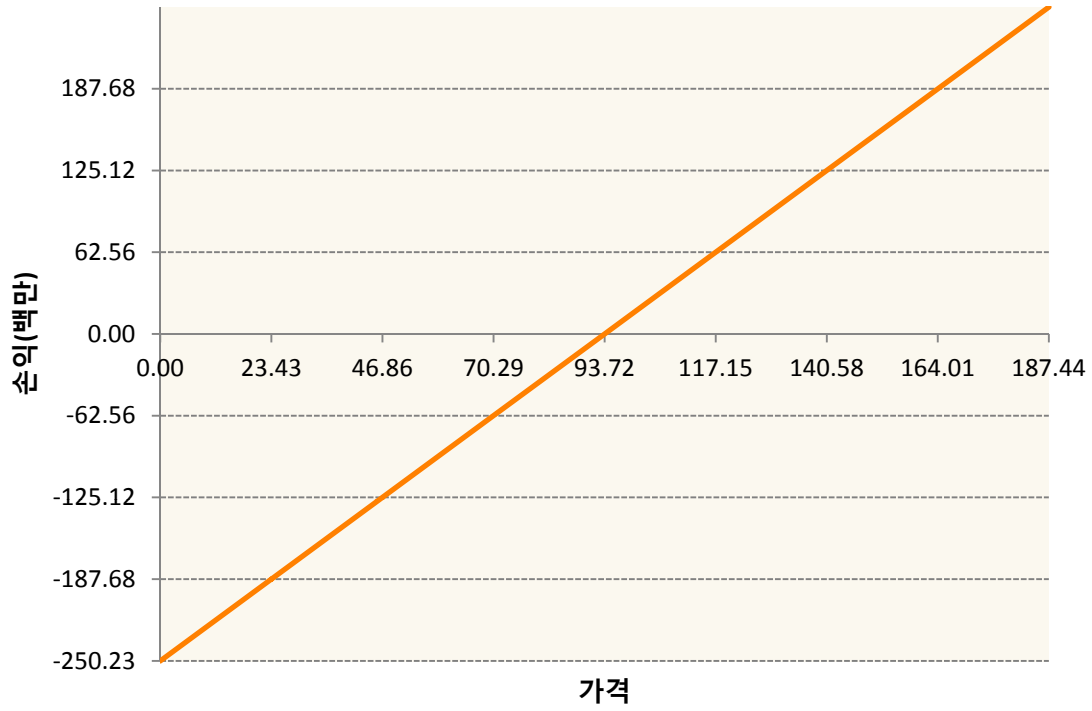


**CN8-CORN FUTURE JUL18**

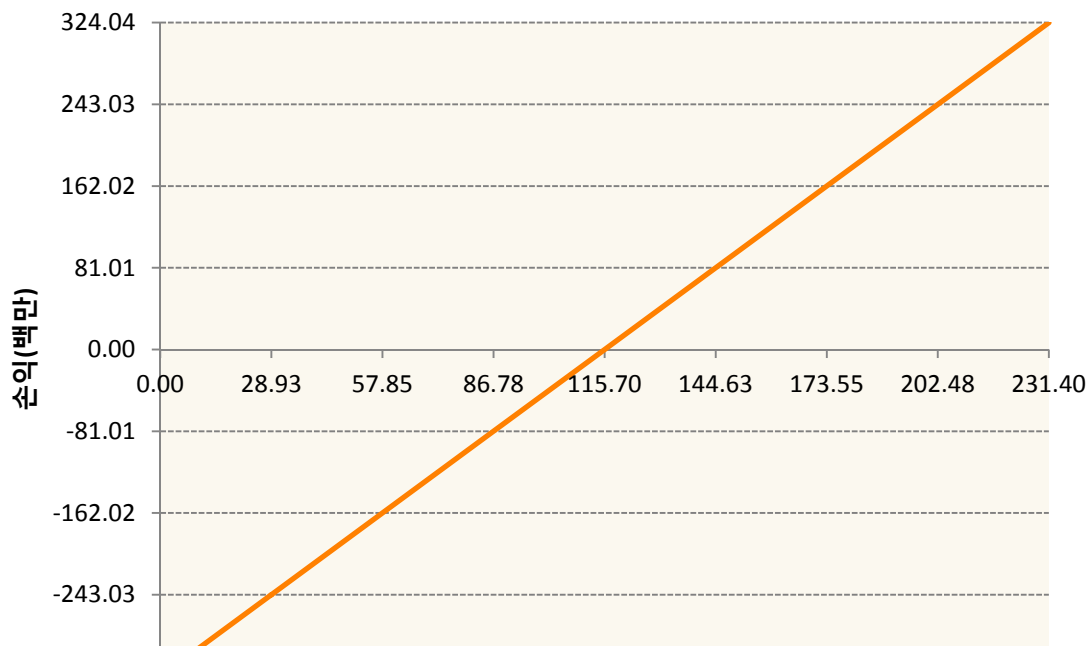


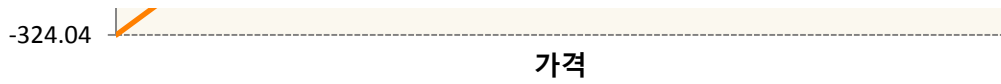


**CTN8-COTTON NO.2 FUTR JUL18**

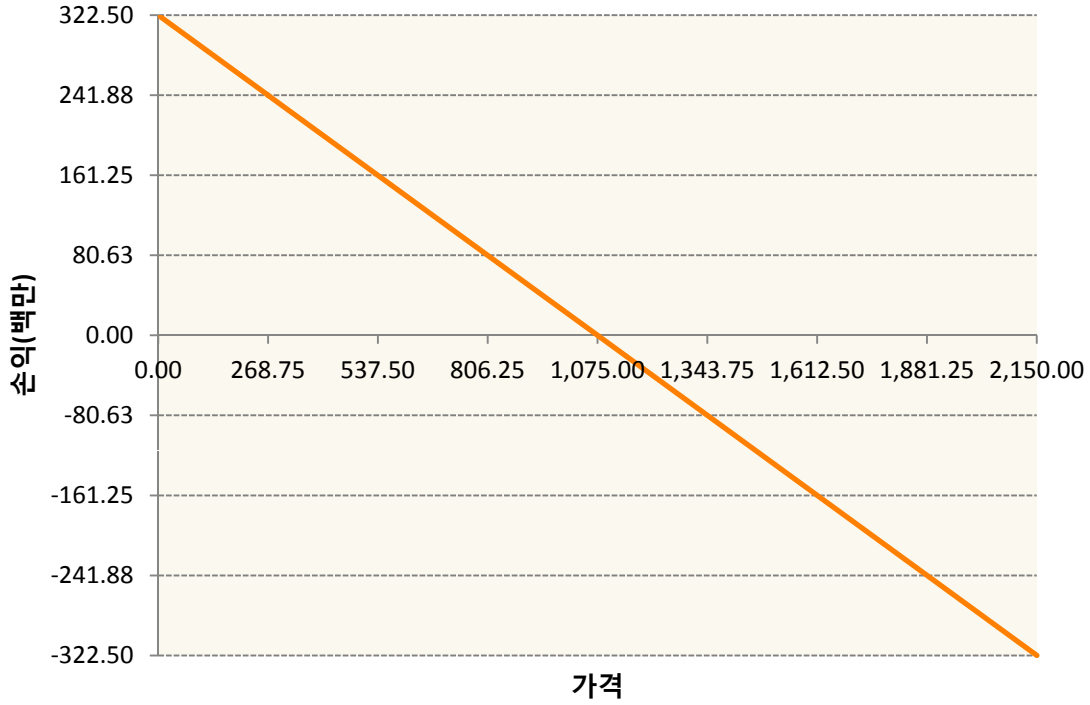


**KCN8-COFFEE 'C' FUTURE JUL18**

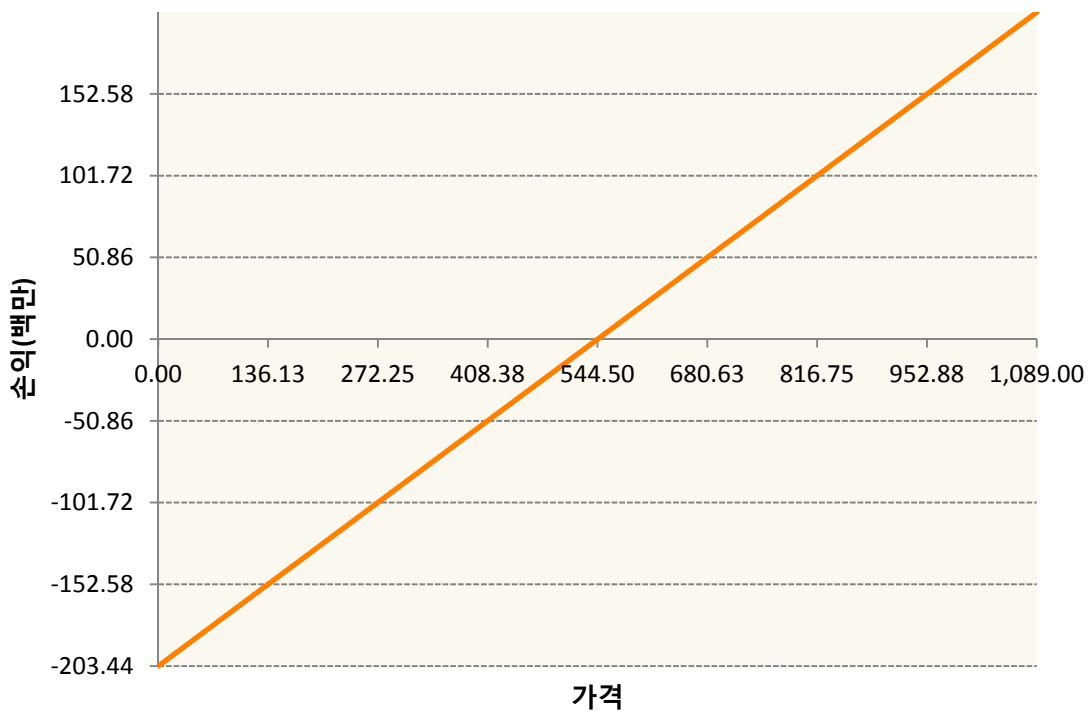




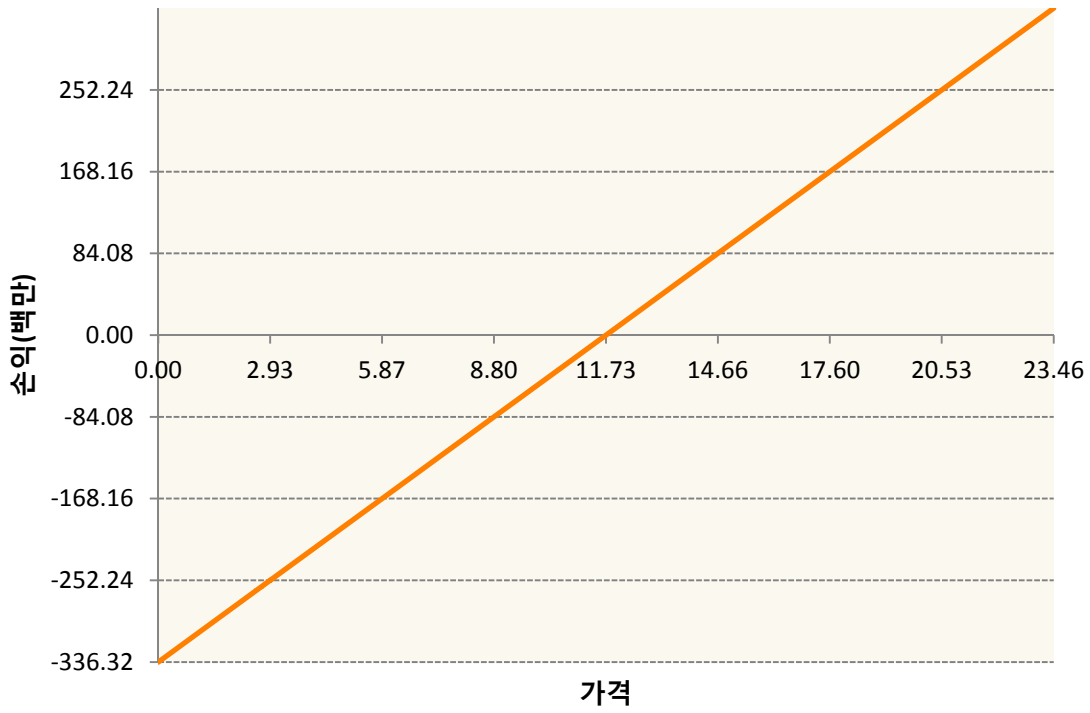
**KR4175N60003-2018-06 달러선물**



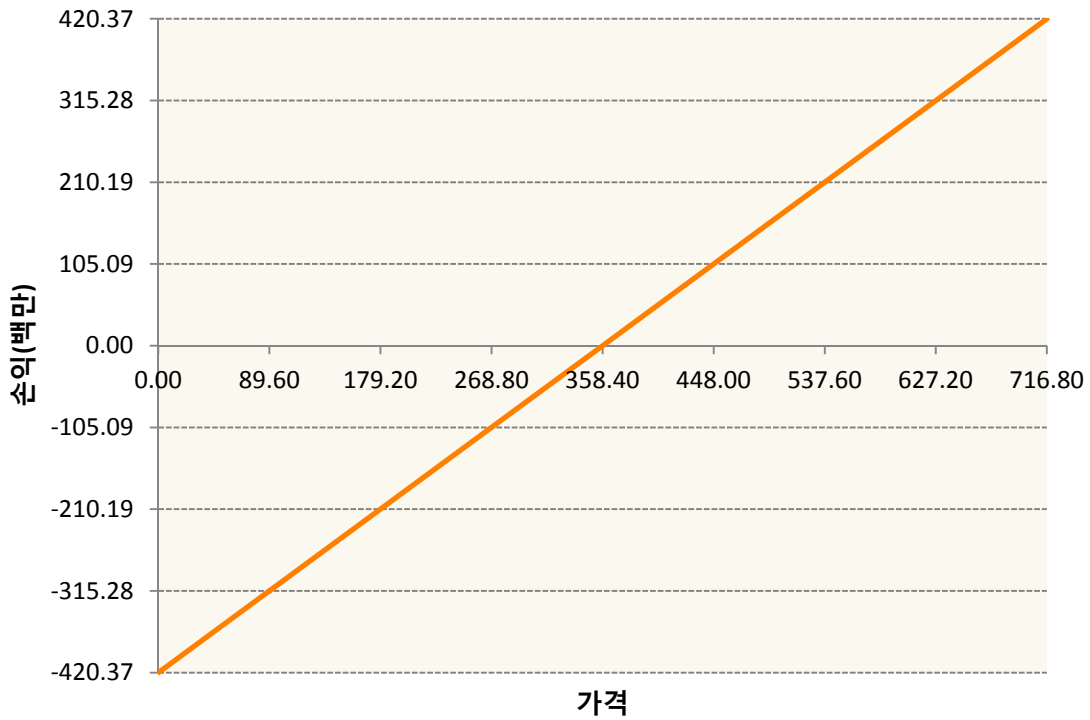
**KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18**



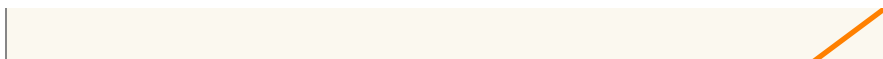
SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18

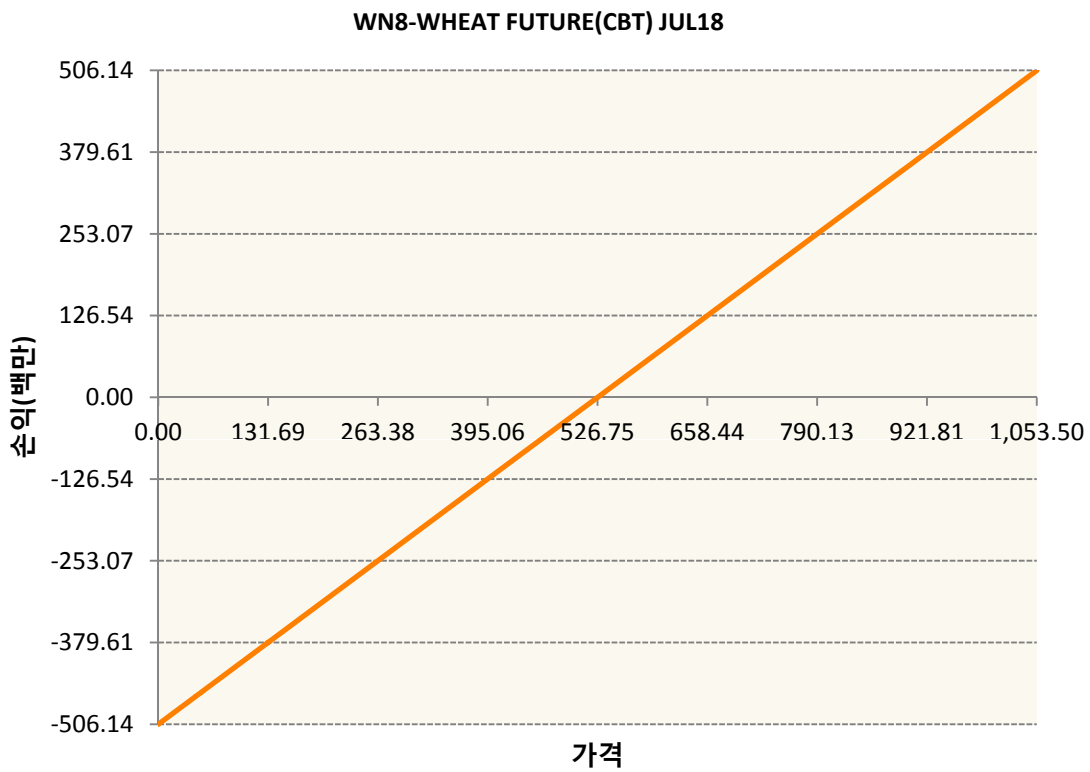
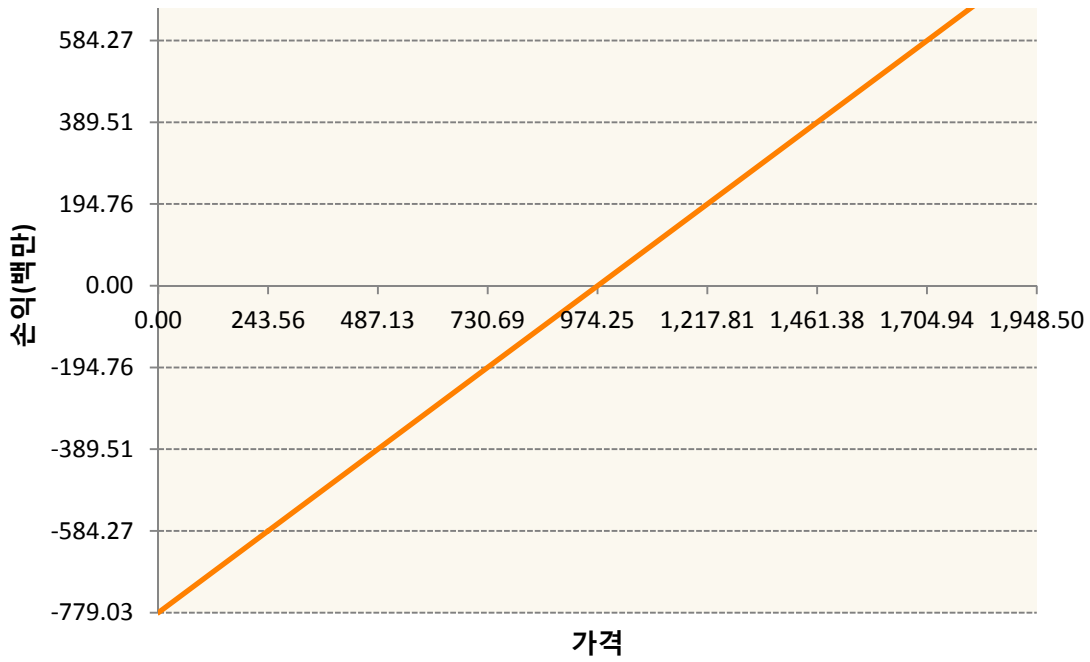


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18



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	20
KCN8	COFFEE 'C' FUTURE JUL18	26
KR4175N60C	2018-06 달러선물	26

KWN8	KC HRW WHEAT FUT JUL18	16
SBN8	SUGAR #11 (WORLD) JUL18	27
SMN8	SOYBEAN MEAL FUTR JUL18	34
SN8	SOYBEAN FUTURE JUL18	62
WN8	WHEAT FUTURE(CBT) JUL18	40

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

(단위:백만원)

**327**