

공시일	2018-06-12
기준일	2018-06-11

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	2018-06-12
기준일	2018-06-11

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	2018-06-12
기준일	2018-06-11

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	4,755	0	4,755	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI500000 신한CSI500미래S180608

373

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

403

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-06-12
기준일	2018-06-11

유로인덱스모(주식-파생형)

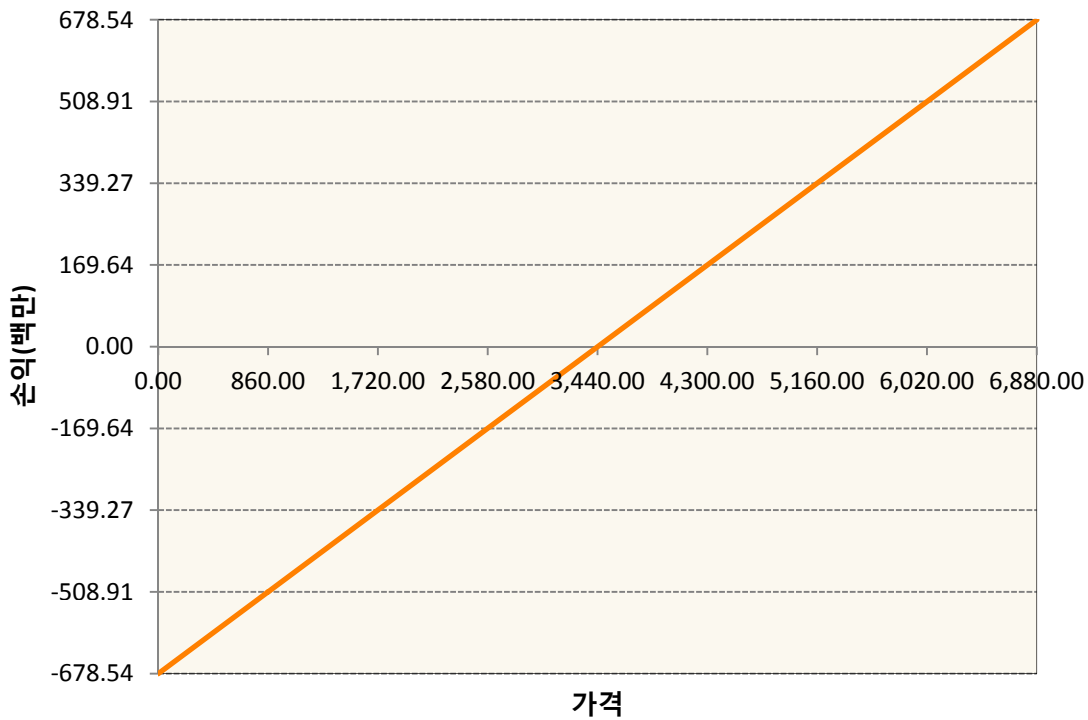
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	679	0	679	

2. 만기시점의 손익구조

VGM8-EURO STOXX 50 JUN18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	54
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

33

공시일	2018-06-12
기준일	2018-06-11

차이나인덱스모(주식-파생형)

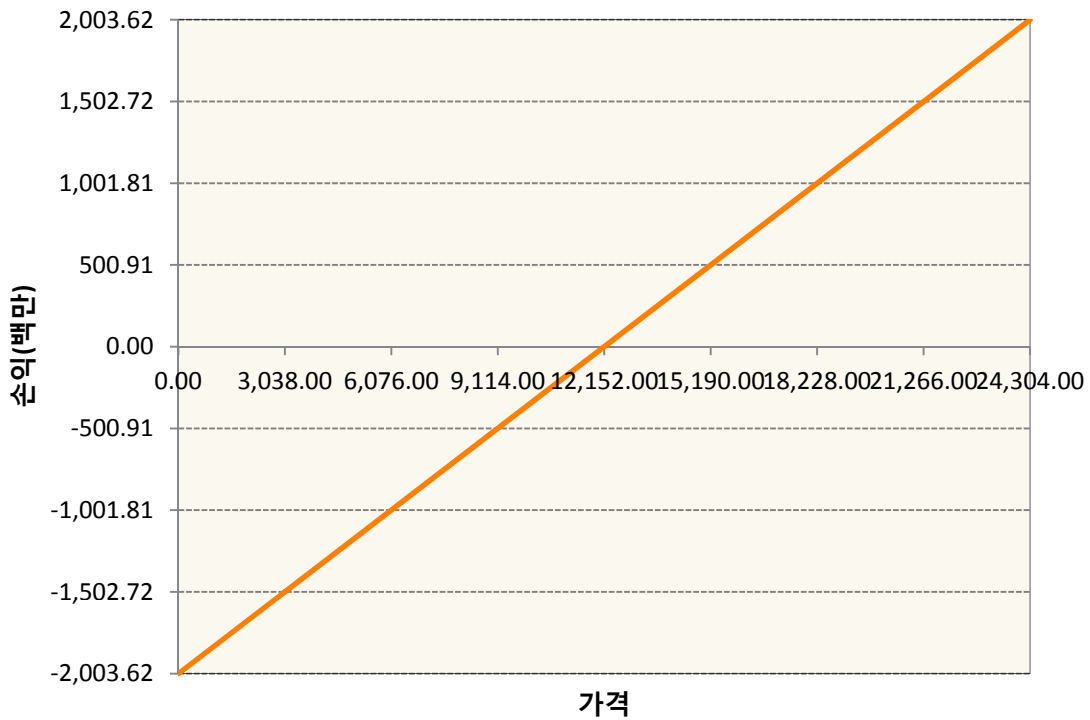
1. 계약금액

(단위:백만원)

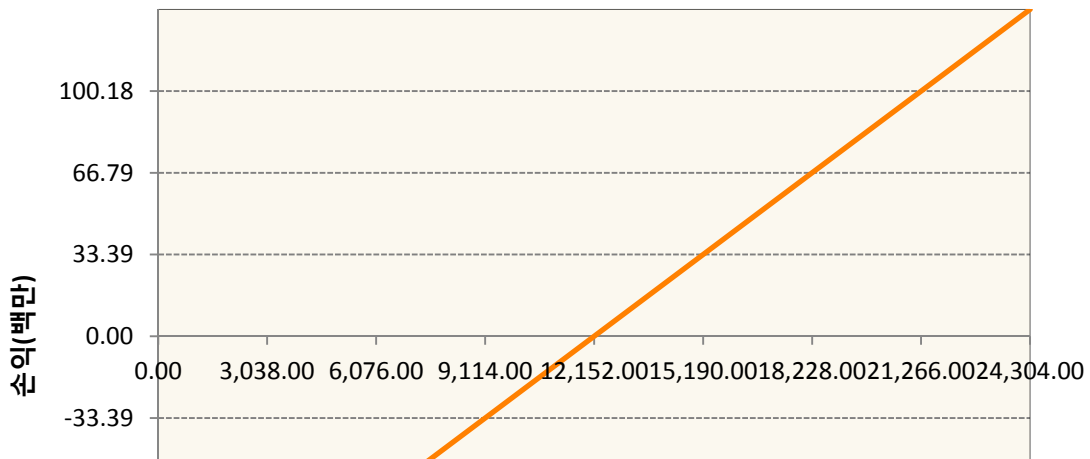
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,137	0	2,137	장내

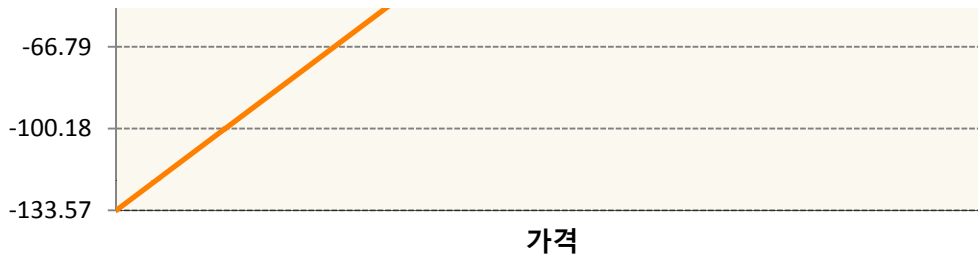
2. 만기시점의 손익구조

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)

152

공시일	2018-06-12
기준일	2018-06-11

커버드콜모(주식혼합-파생형)

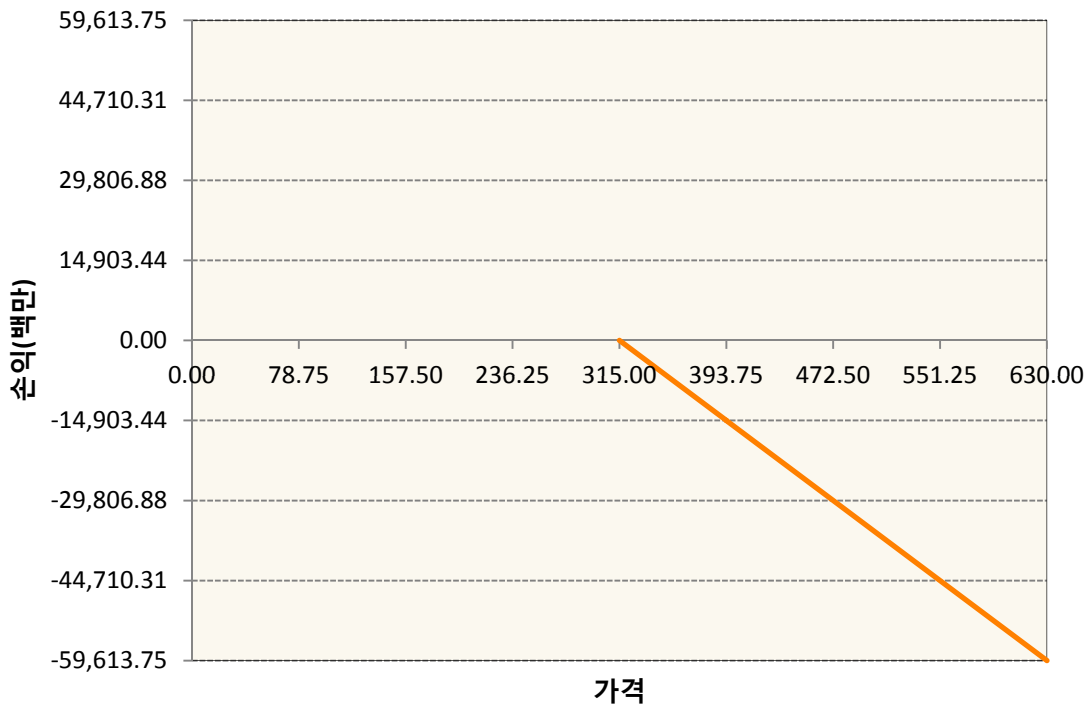
1. 계약금액

(단위:백만원)

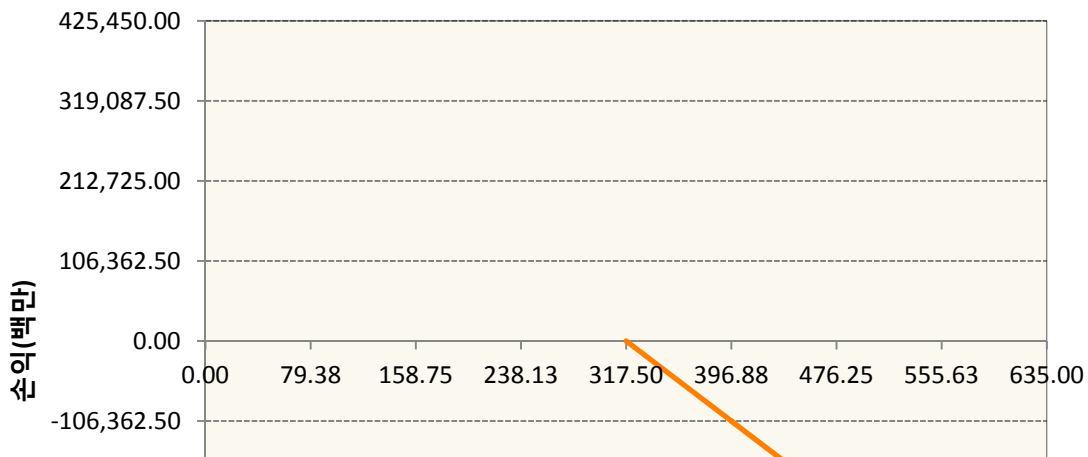
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	1,171	0	1,171	장내
누계	유가증권	옵션	0	793,039	-793,039	장내

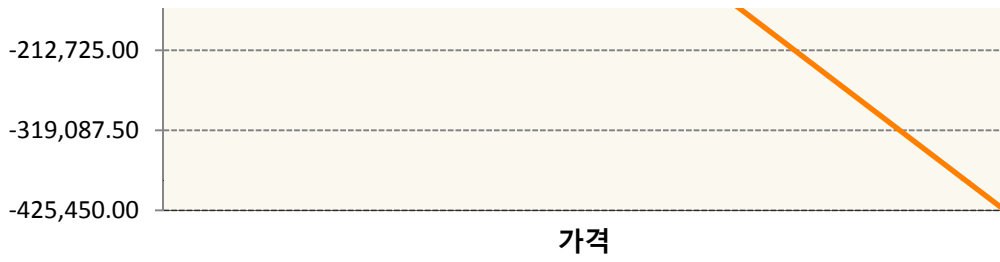
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63159-2018-06 콜315

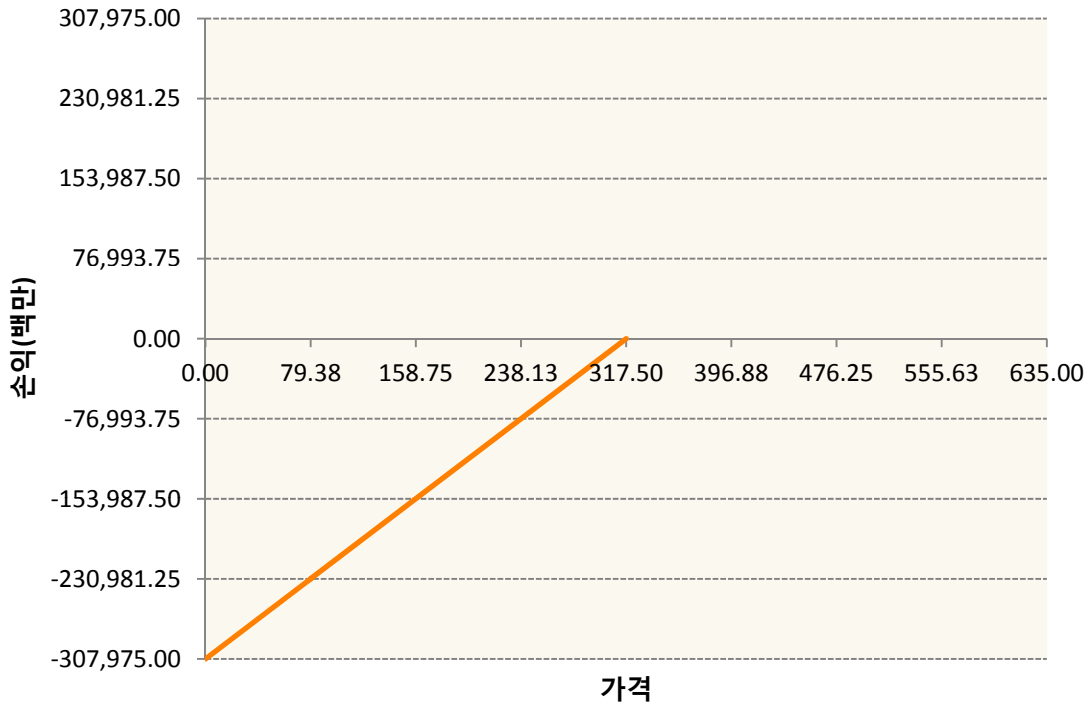


KR4201N63175-2018-06 콜317.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N6312018-06 콜315

4,390

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	834	834	834	834	833	832	830
-5.33%	832	830	825	818	809	797	783
-2.67%	751	722	689	654	617	578	539
0%	143	96	48	0	-48	-97	-146
2.67%	-1,204	-1,217	-1,233	-1,252	-1,275	-1,300	-1,328
5.33%	-2,787	-2,788	-2,789	-2,792	-2,796	-2,802	-2,810
8.00%	-4,388	-4,388	-4,388	-4,388	-4,388	-4,389	-4,390

KR4201N6312018-06 콜317.5

29,574

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,088	4,088	4,088	4,087	4,085	4,081	4,073

-5.33%	4,084	4,077	4,063	4,038	4,002	3,952	3,887
-2.67%	3,843	3,712	3,554	3,374	3,175	2,959	2,728
0%	1,067	712	356	0	-356	-712	-1,068
2.67%	-7,206	-7,366	-7,551	-7,758	-7,983	-8,224	-8,479
5.33%	-18,213	-18,226	-18,251	-18,291	-18,346	-18,418	-18,507
8.00%	-29,538	-29,538	-29,539	-29,541	-29,547	-29,557	-29,574
KR4301N6312018-06 풋317.5							23,301
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-23,301	-23,301	-23,301	-23,301	-23,301	-23,301	-23,301
-5.33%	-15,097	-15,097	-15,097	-15,097	-15,097	-15,097	-15,097
-2.67%	-6,894	-6,895	-6,898	-6,904	-6,912	-6,925	-6,942
0%	359	240	120	0	-120	-240	-360
2.67%	1,581	1,578	1,573	1,563	1,549	1,530	1,505
5.33%	1,583	1,583	1,583	1,583	1,583	1,583	1,583
8.00%	1,583	1,583	1,583	1,583	1,583	1,583	1,583

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

(단위:백만원)

76,741

공시일	2018-06-12
기준일	2018-06-11

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

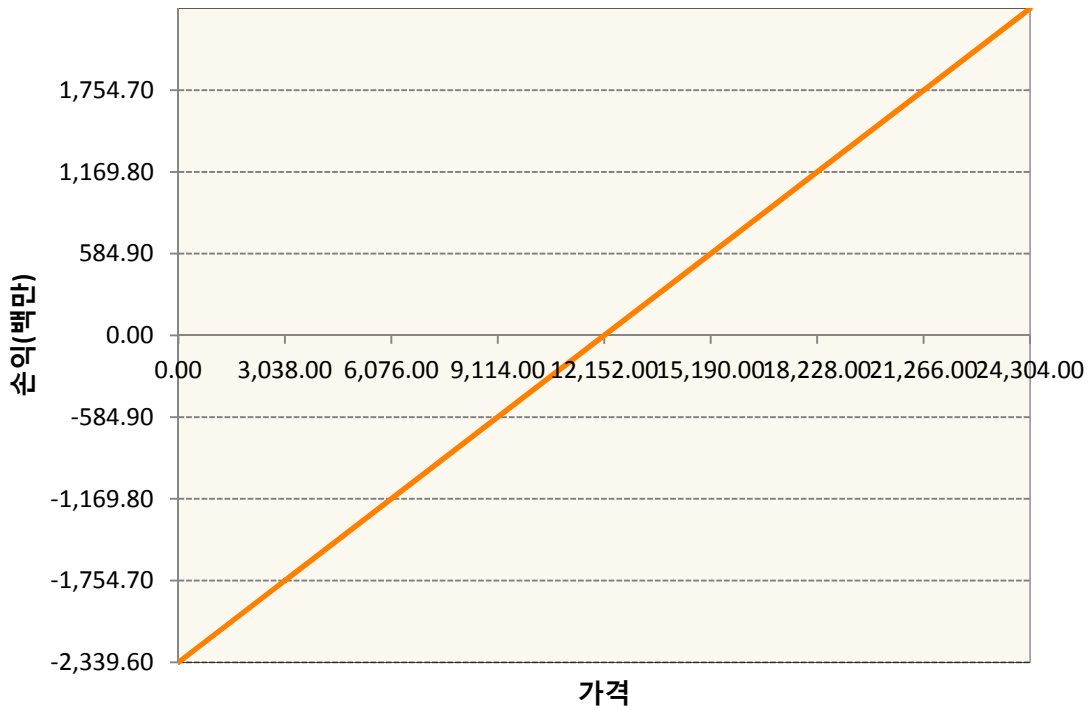
1. 계약금액

(단위:백만원)

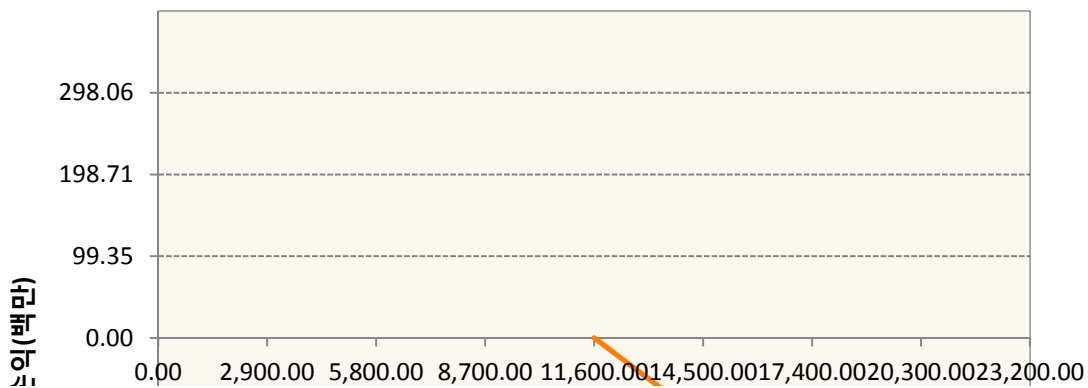
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,340	0	2,340	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,808	-5,808	장내

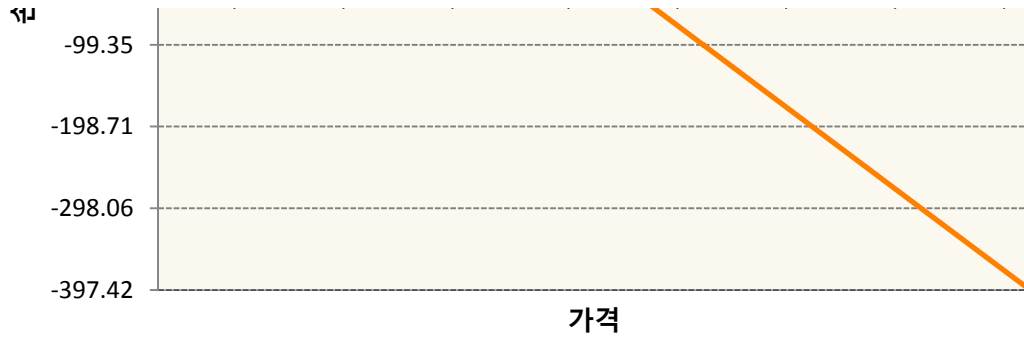
2. 만기시점의 손익구조

HCM8-HSCEI Futures Jun18

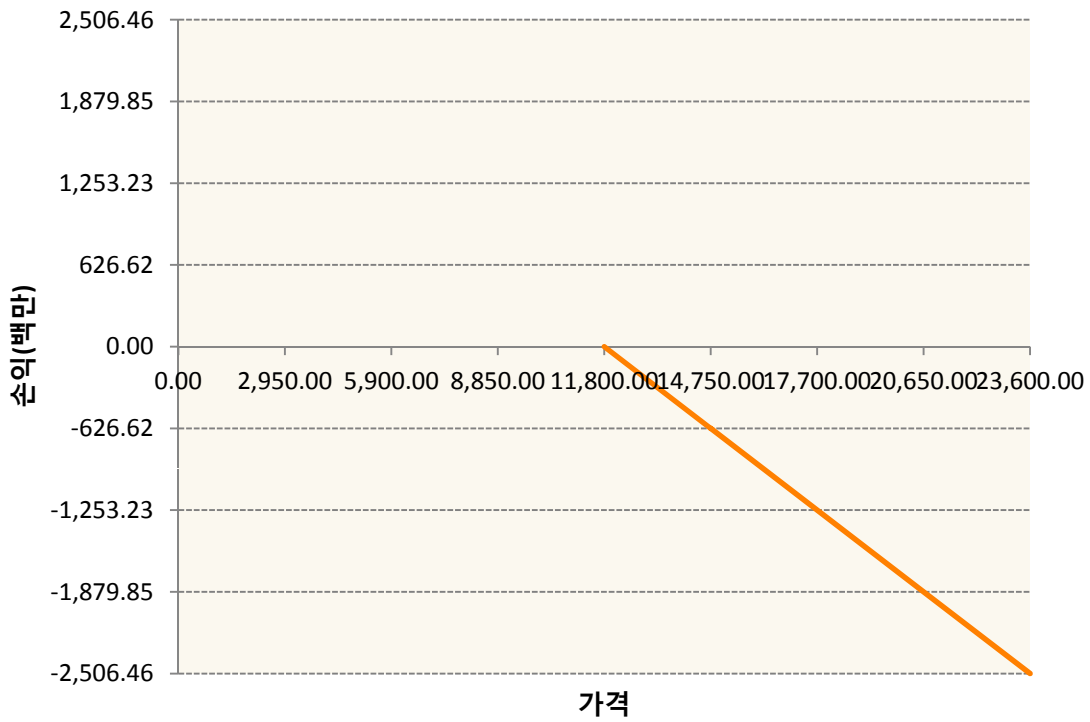


OHHIM8-C116-HSCEI

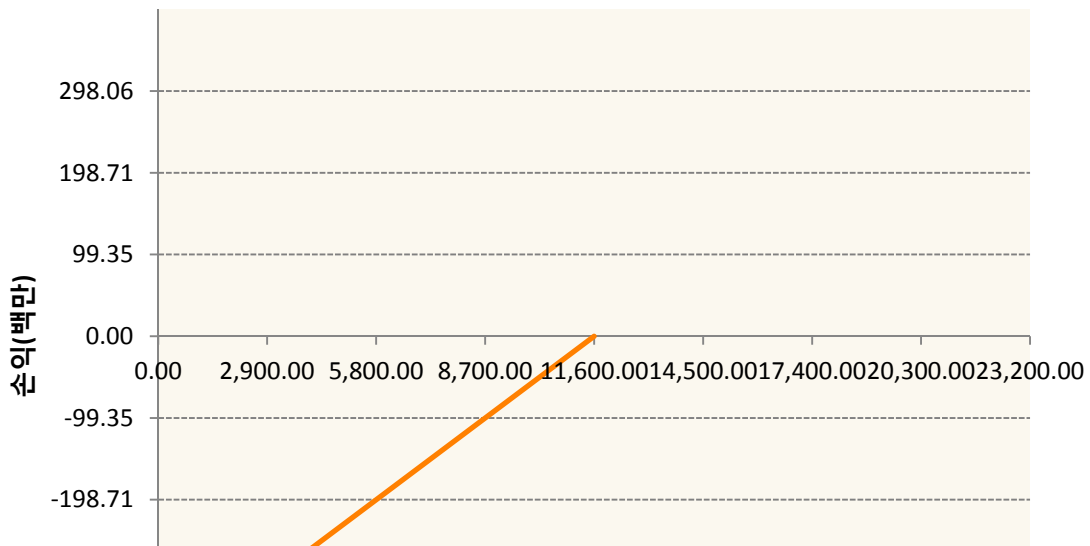


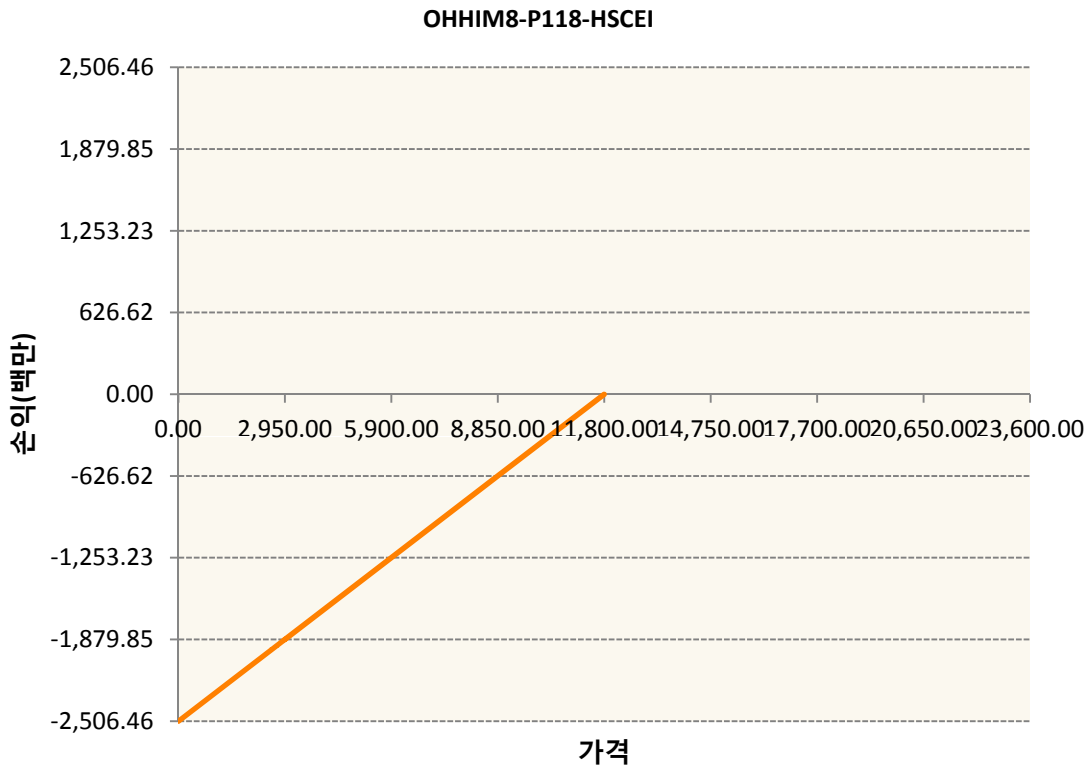
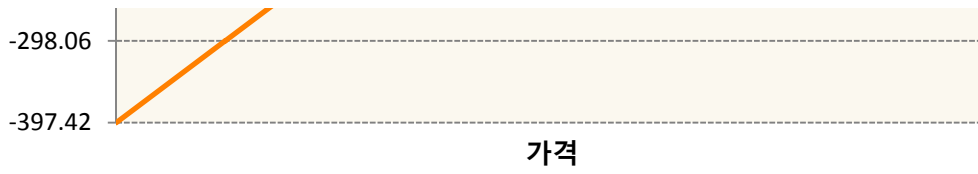


OHHIM8-C118-HSCEI



OHHIM8-P116-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCM8	HSCEI Futures Jun18	187
OHHIM8-C1	HSCEI	32
OHHIM8-C1	HSCEI	201
OHHIM8-P1	HSCEI	32
OHHIM8-P1	HSCEI	201

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	579

공시일	2018-06-12
기준일	2018-06-11

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

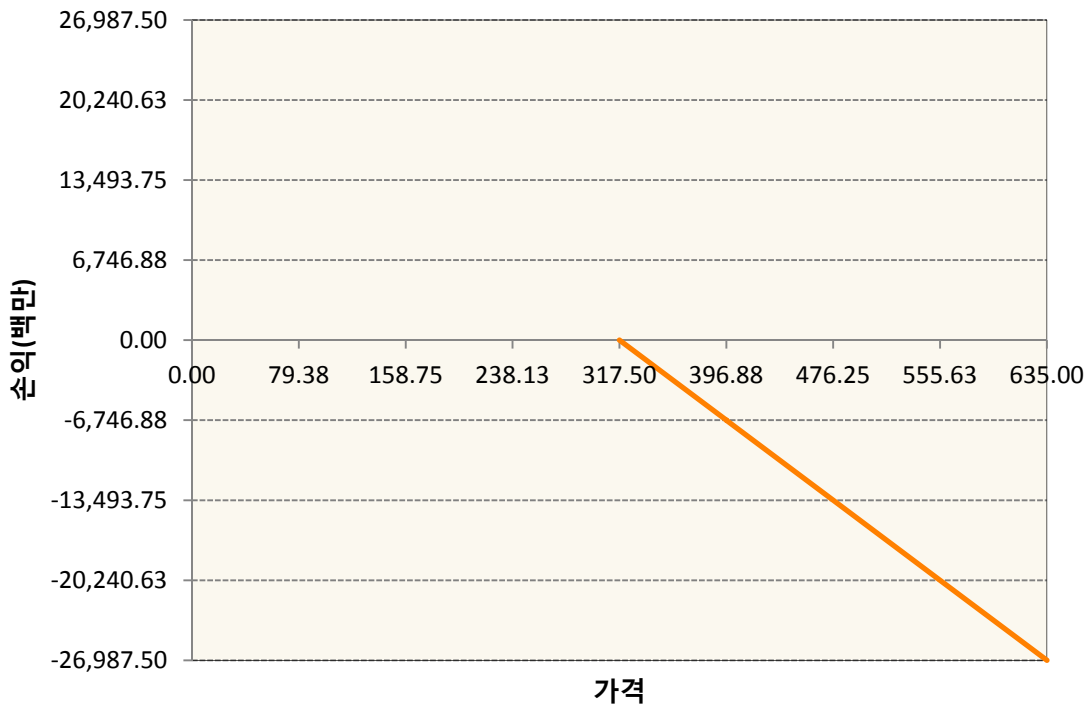
1. 계약금액

(단위:백만원)

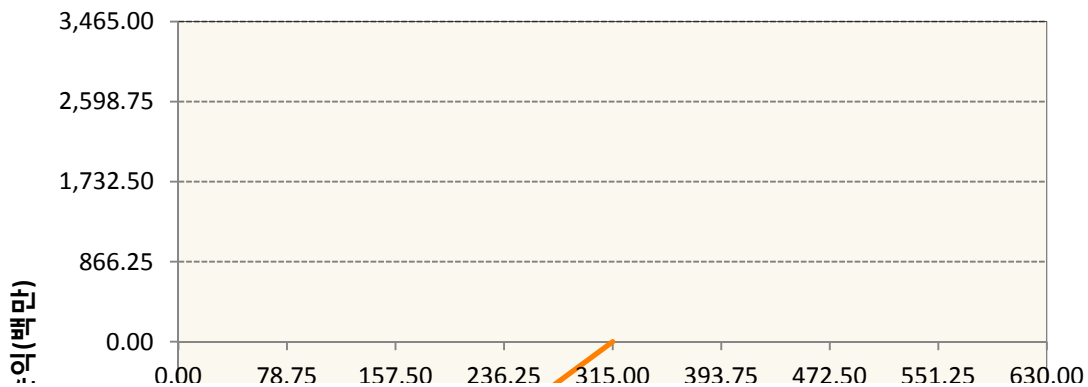
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	4,001	-4,001	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	50,773	-50,773	장내

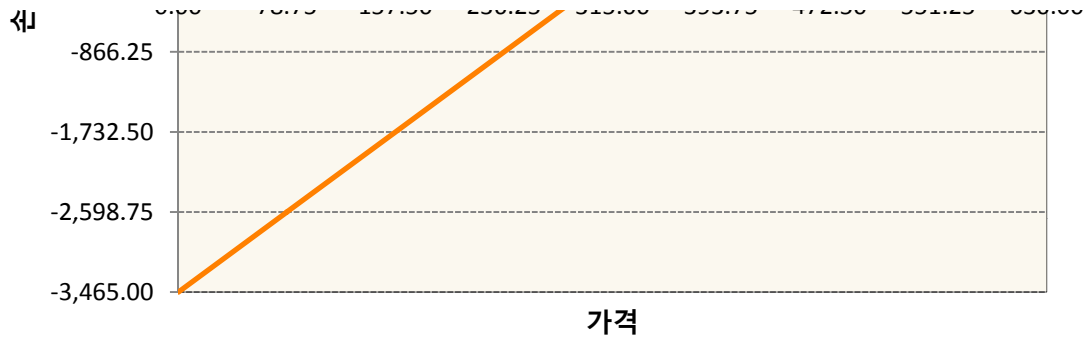
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63175-2018-06 콜317.5

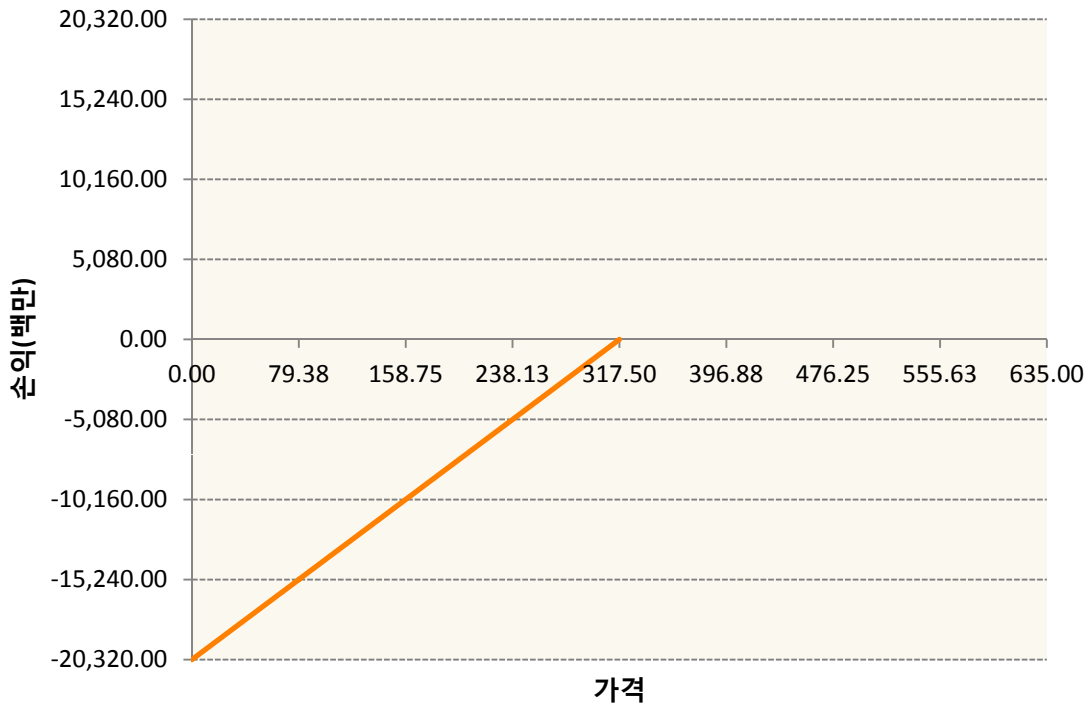


KR4301N63157-2018-06 풋315





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 1,876

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	259	259	259	259	259	259	258
-5.33%	259	259	258	256	254	251	247
-2.67%	244	235	225	214	201	188	173
0%	68	45	23	0	-23	-45	-68
2.67%	-457	-467	-479	-492	-506	-522	-538
5.33%	-1,155	-1,156	-1,158	-1,160	-1,164	-1,168	-1,174
8.00%	-1,874	-1,874	-1,874	-1,874	-1,874	-1,875	-1,876

KR4301N6312018-06 풋315 248

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-248	-248	-248	-248	-248	-248	-248
-5.33%	-155	-155	-155	-155	-155	-155	-155
-2.67%	-62	-62	-62	-62	-63	-63	-64
0%	3	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	7	7	7	7	7	7	7
5.33%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	7	7	7	7	7	7	7

KR4301N6312018-06 풋317.5 1,537

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,537	-1,537	-1,537	-1,537	-1,537	-1,537	-1,537
-5.33%	-996	-996	-996	-996	-996	-996	-996
-2.67%	-455	-455	-455	-455	-456	-457	-458
0%	24	16	8	0	-8	-16	-24
2.67%	104	104	104	103	102	101	99
5.33%	104	104	104	104	104	104	104
8.00%	104	104	104	104	104	104	104

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

(단위:백만원)

8,804

공시일	2018-06-12
기준일	2018-06-11

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

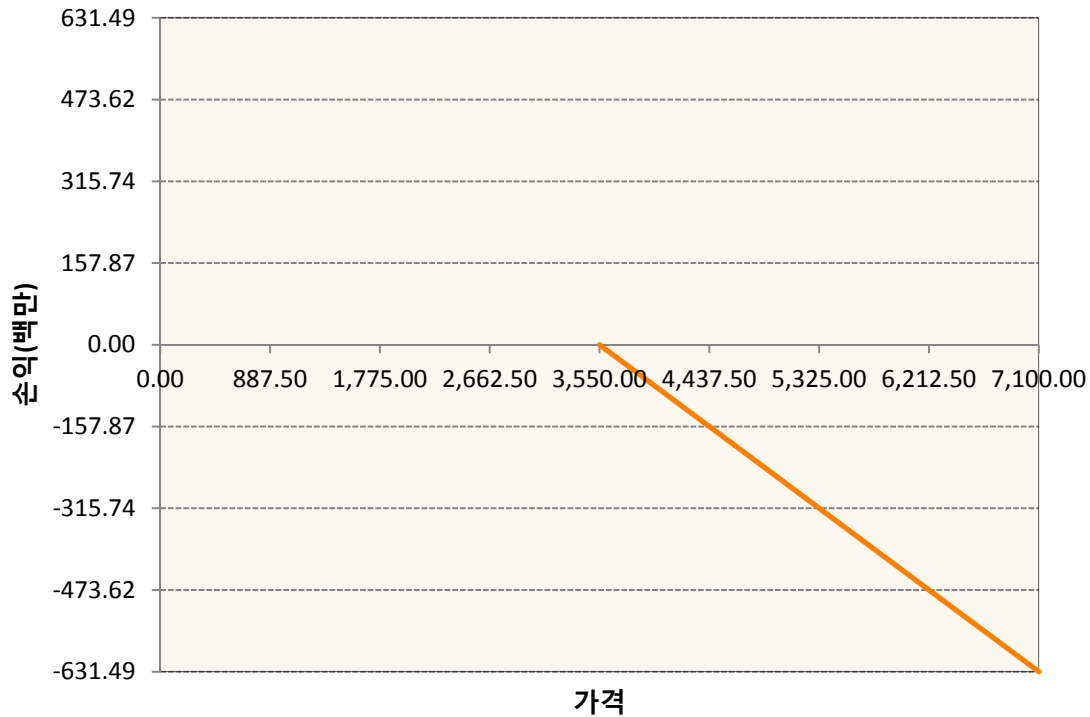
1. 계약금액

(단위:백만원)

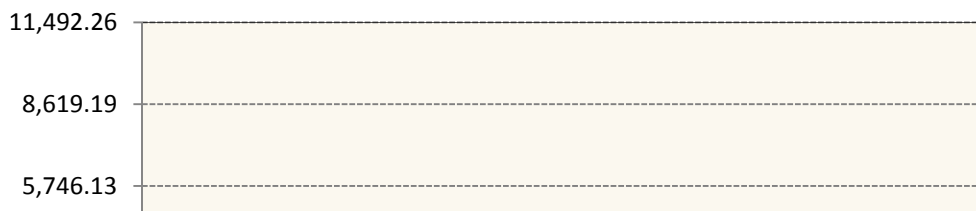
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,832	0	3,832	
누계	유가증권	스왑	53,571	0	53,571	장외
누계	유가증권	옵션	0	24,247	-24,247	장내
누계	지수	스왑	50,825	0	50,825	장외

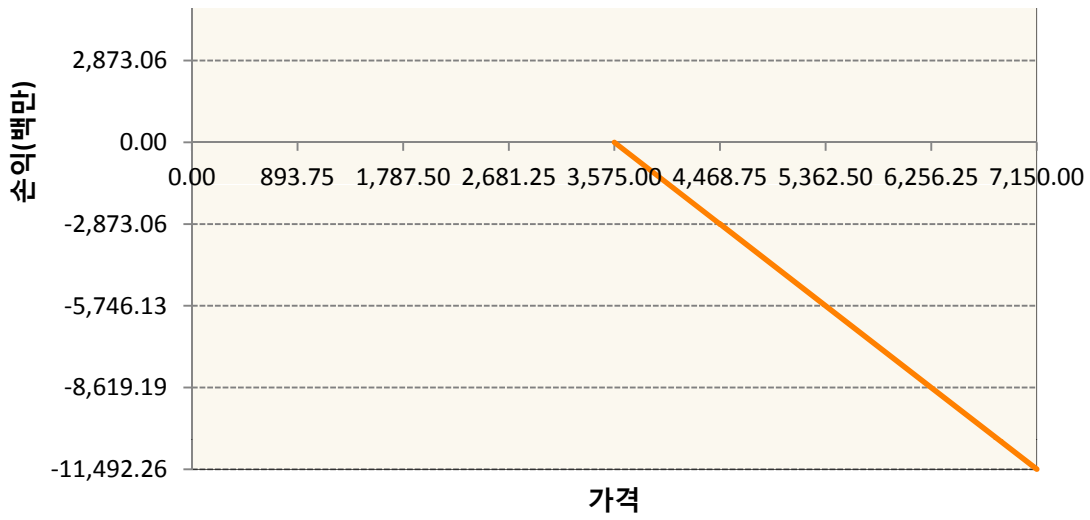
2. 만기시점의 손익구조

OESXM8-C3550-EURO STOXX 50

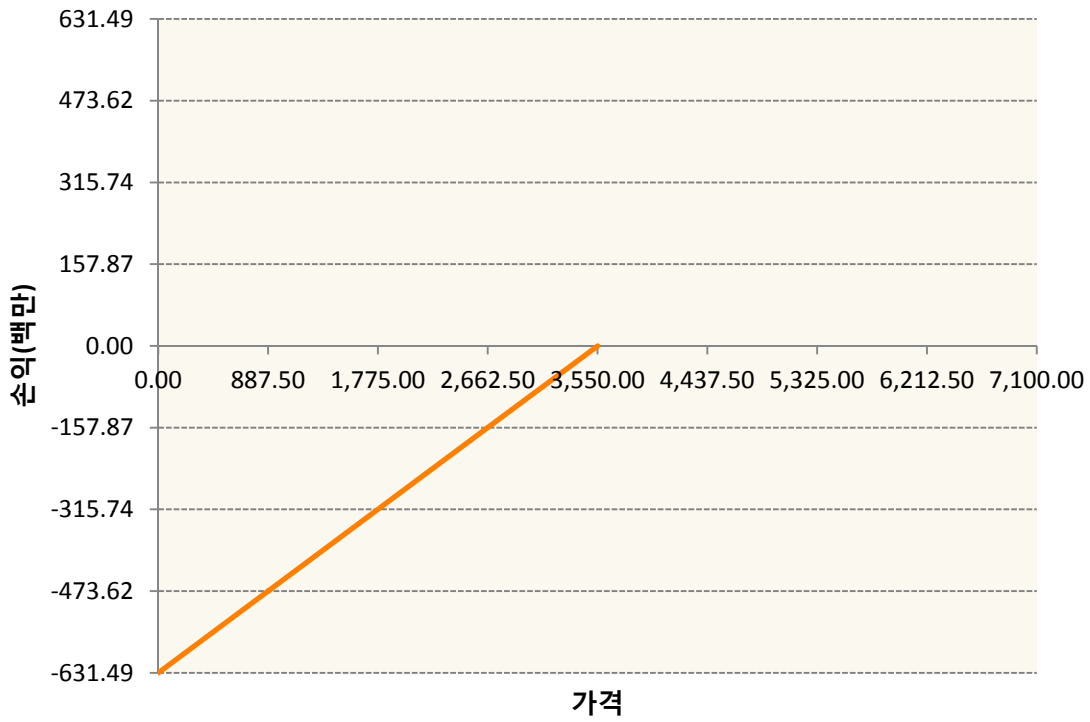


OESXM8-C3575-EURO STOXX 50



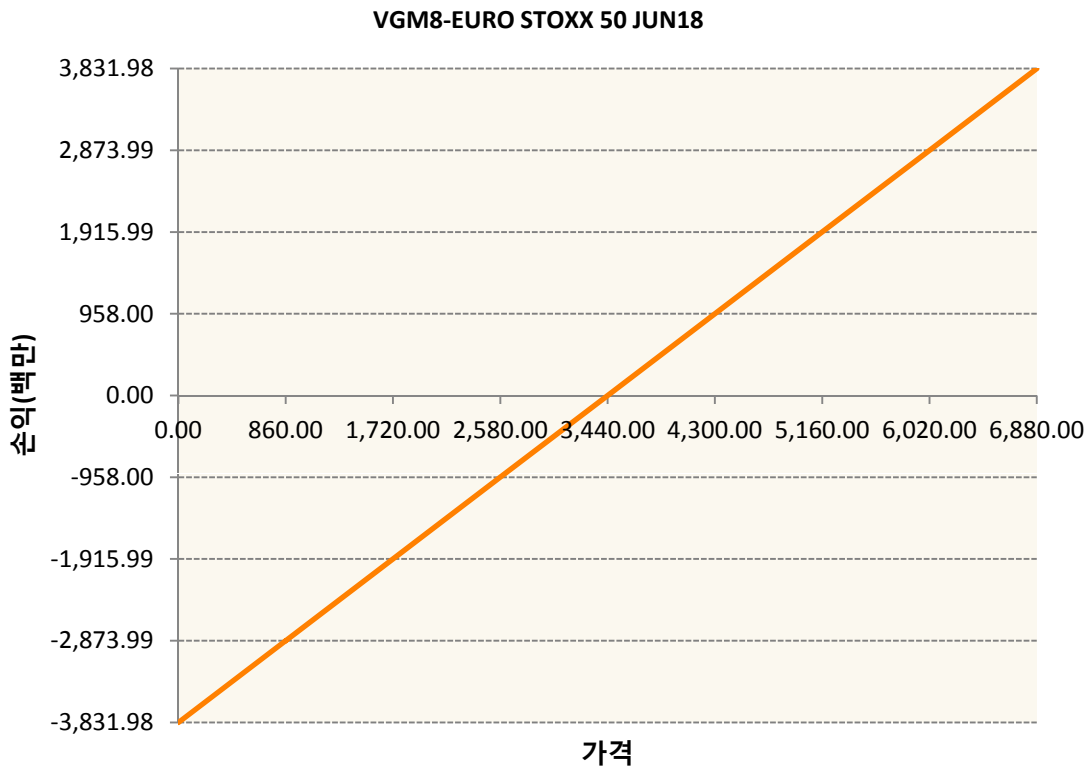
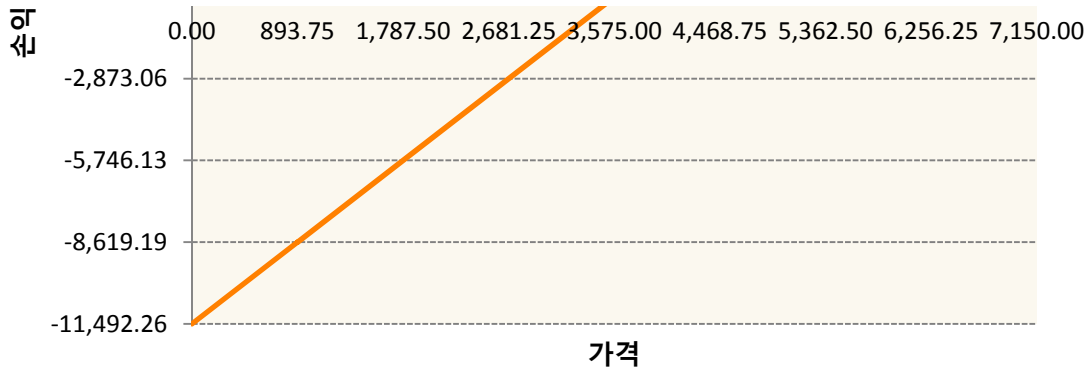


OESXM8-P3550-EURO STOXX 50



OESXM8-P3575-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		30
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		31
OESXM8-C3 EURO STOXX 50		51
OESXM8-C3 EURO STOXX 50		919
OESXM8-P3! EURO STOXX 50		51
OESXM8-P3! EURO STOXX 50		919
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18		307

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

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

(단위:백만원)

1,191

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)

214

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

(단위:백만원)

42

공시일	2018-06-12
기준일	2018-06-11

리디파인K200(주식혼합-파생재간

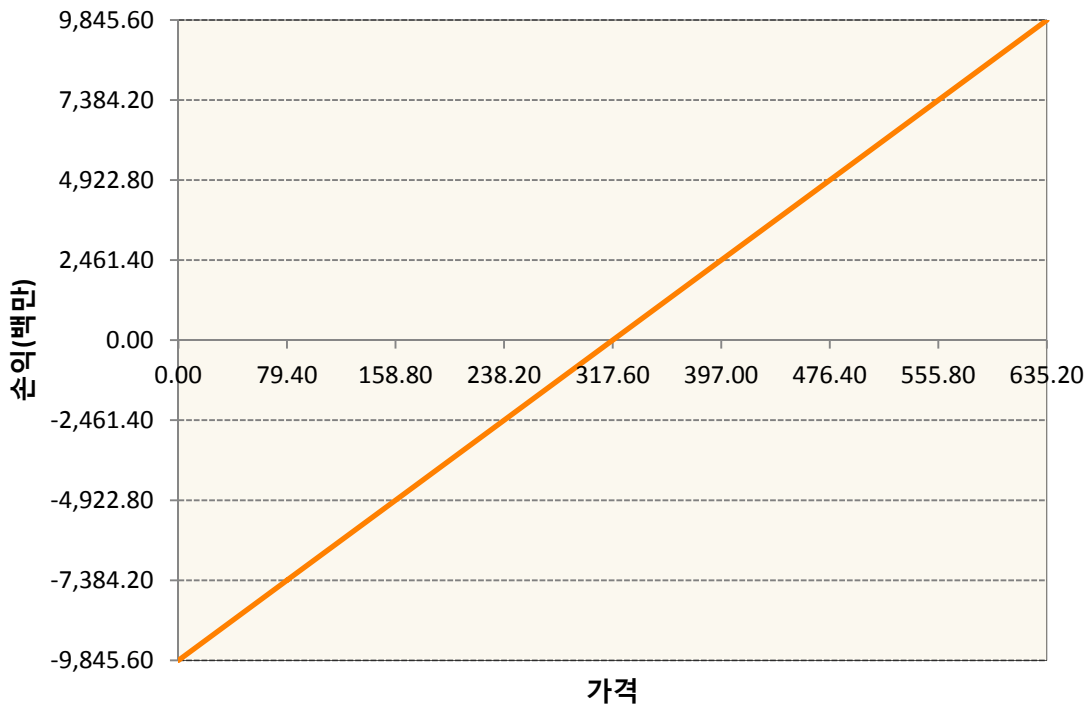
1. 계약금액

(단위:백만원)

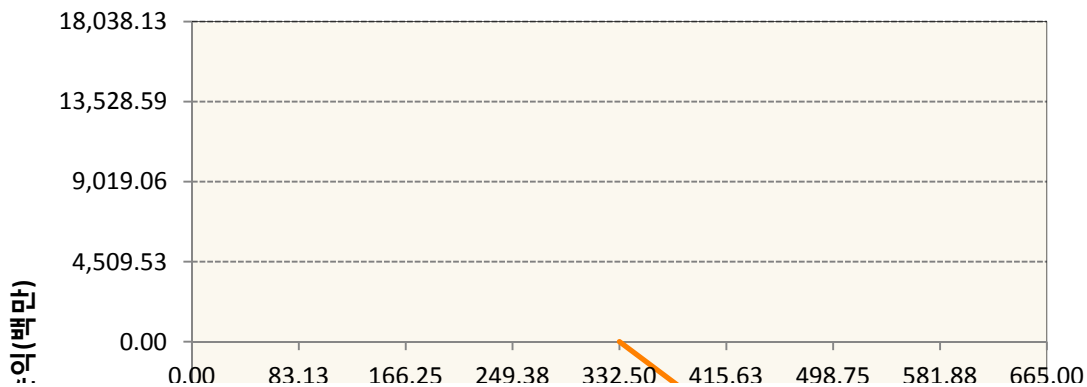
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5,867	0	5,867	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,846	0	9,846	장내
누계	유가증권	옵션	1,905	18,038	-16,133	장내

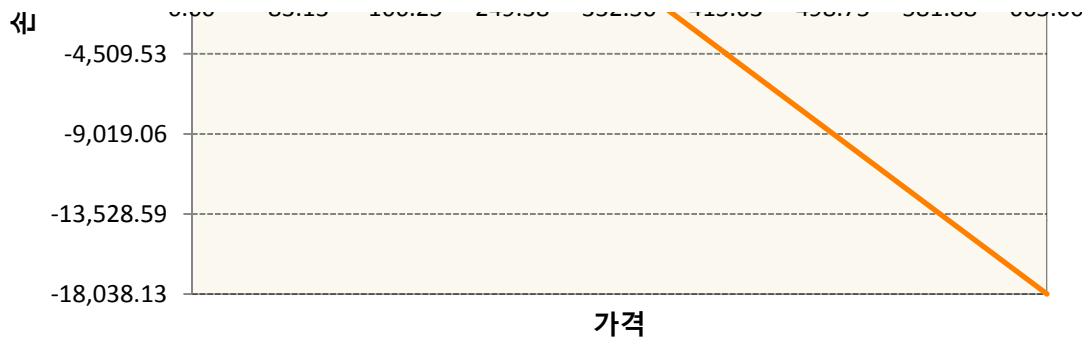
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

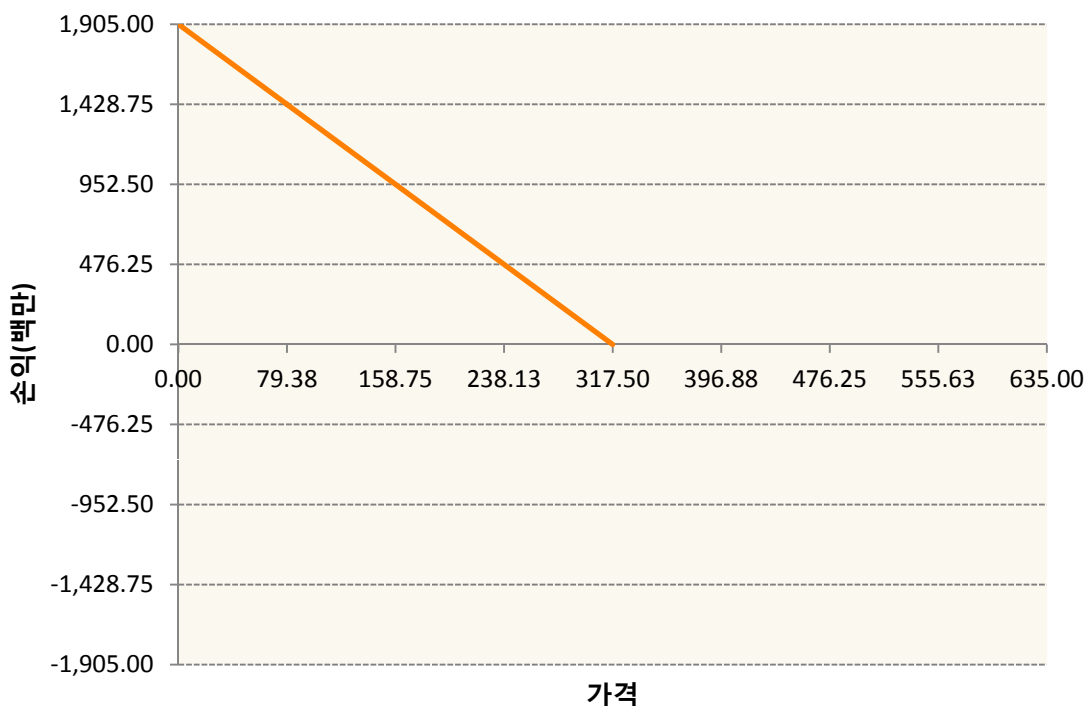


KR4201N63324-2018-06 콜332.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물							787
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-787	-787	-787	-787	-787	-787	-787
-5.33%	-524	-524	-524	-524	-524	-524	-524
-2.67%	-262	-262	-262	-262	-262	-262	-262
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	262	262	262	262	262	262	262
5.33%	524	524	524	524	524	524	524
8.00%	787	787	787	787	787	787	787
KR4201N63E 2018-06 콜332.5							595
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	5	5	5	5	5	5
-5.33%	5	5	5	5	5	5	5
-2.67%	5	5	5	5	5	4	4
0%	5	4	2	0	-3	-7	-11
2.67%	-18	-27	-36	-47	-58	-69	-81
5.33%	-180	-195	-209	-224	-239	-254	-269
8.00%	-551	-556	-562	-569	-577	-586	-595

KR4301N6312018-06 풋317.5

144

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	144	144	144	144	144	144	144
-5.33%	93	93	93	93	93	93	93
-2.67%	43	43	43	43	43	43	43
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-9	-9
5.33%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10

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

(단위:백만원)

933

공시일	2018-06-12
기준일	2018-06-11

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

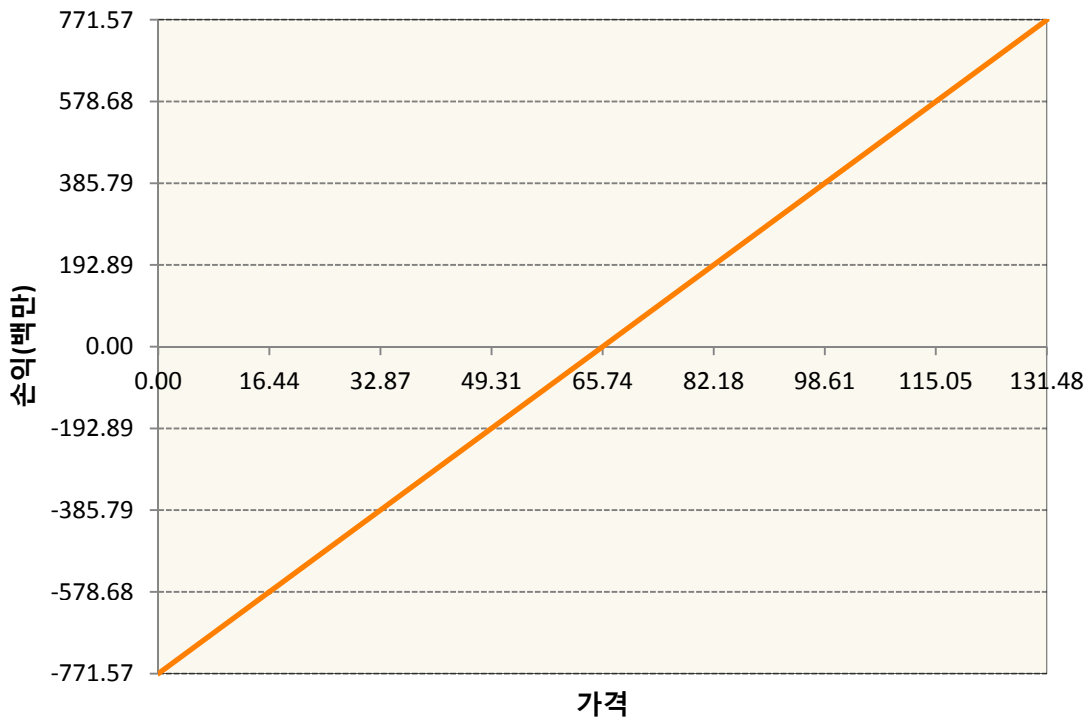
1. 계약금액

(단위:백만원)

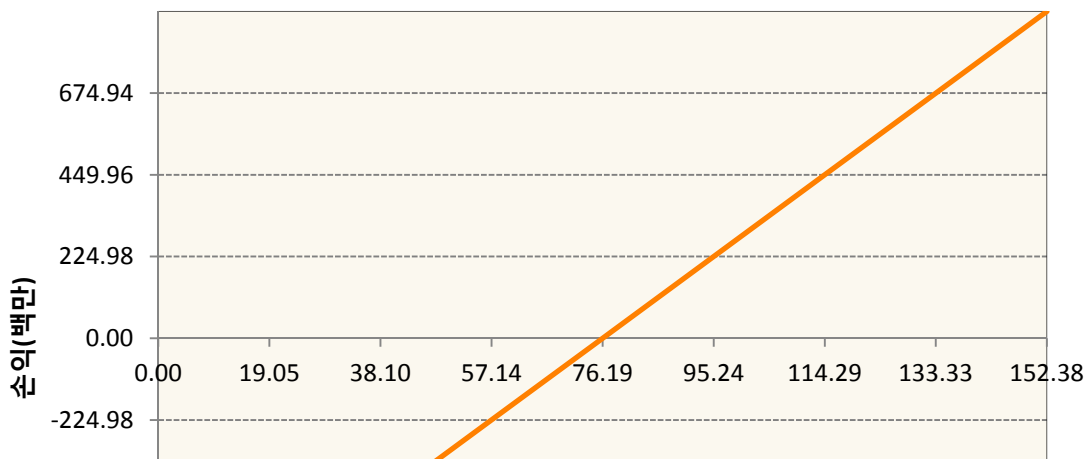
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,805	591	3,214	

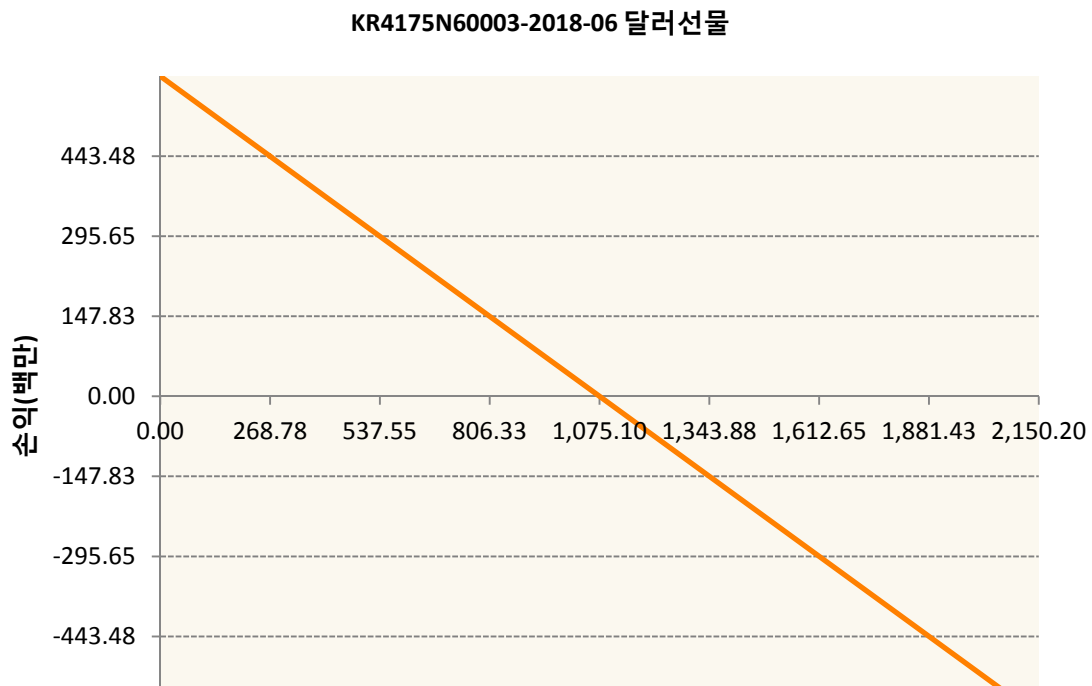
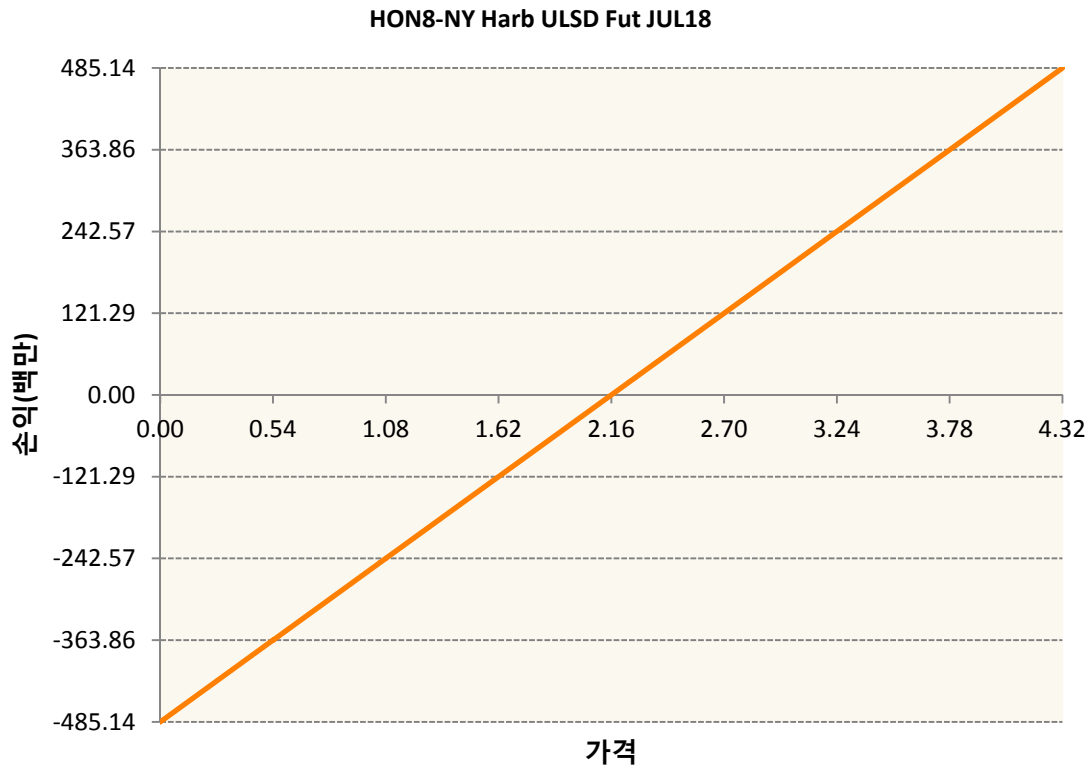
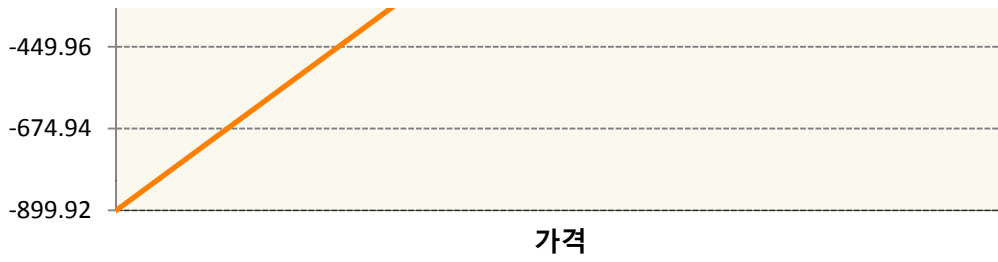
2. 만기시점의 손익구조

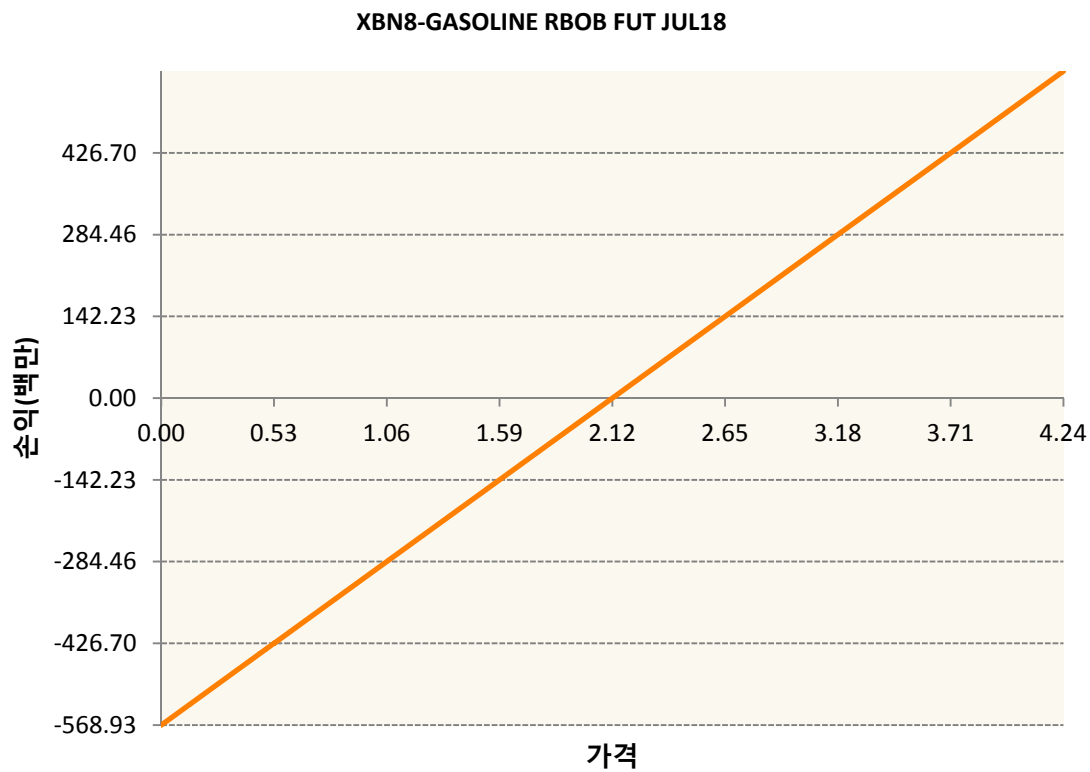
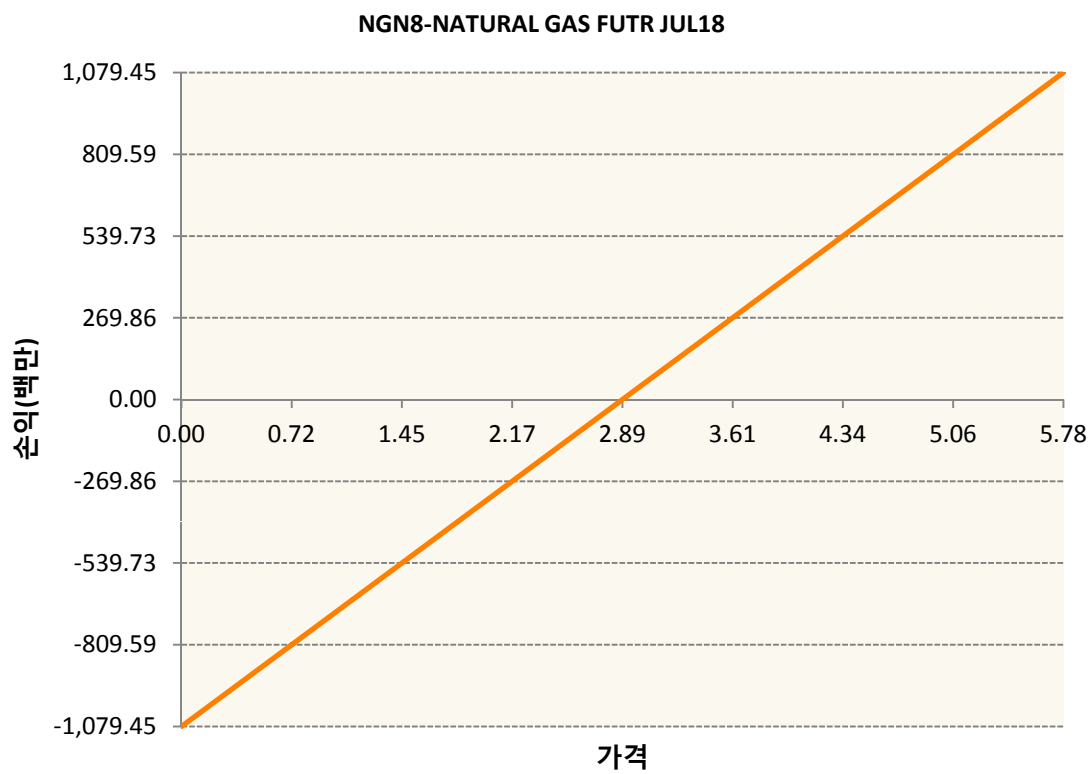
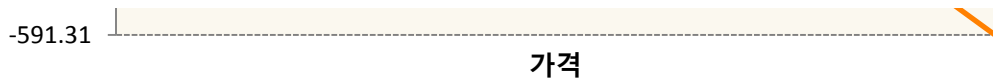
CLN8-WTI CRUDE FUTURE JUL18



COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN8	WTI CRUDE FUTURE JUL18	62
COU8	BRENT CRUDE FUTR SEP18	72
HON8	NY Harb ULSD Fut JUL18	39
KR4175N60C	2018-06 달러선물	47
NGN8	NATURAL GAS FUTR JUL18	86
XBN8	GASOLINE RBOB FUT JUL18	46

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

453

공시일	2018-06-12
기준일	2018-06-11

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

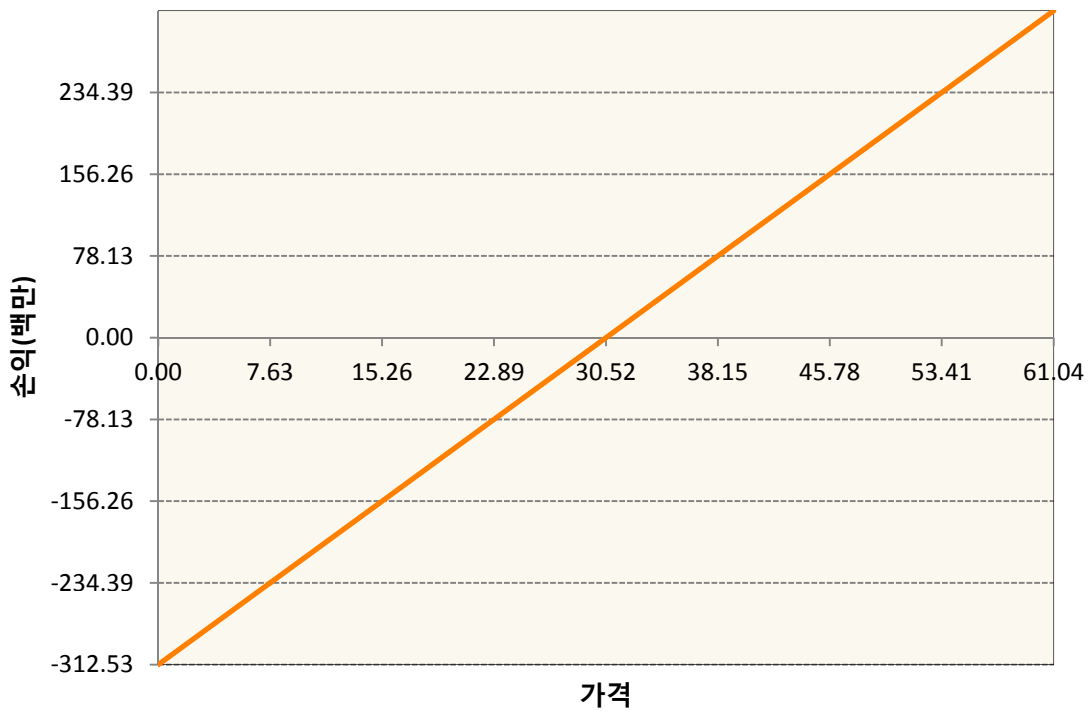
1. 계약금액

(단위:백만원)

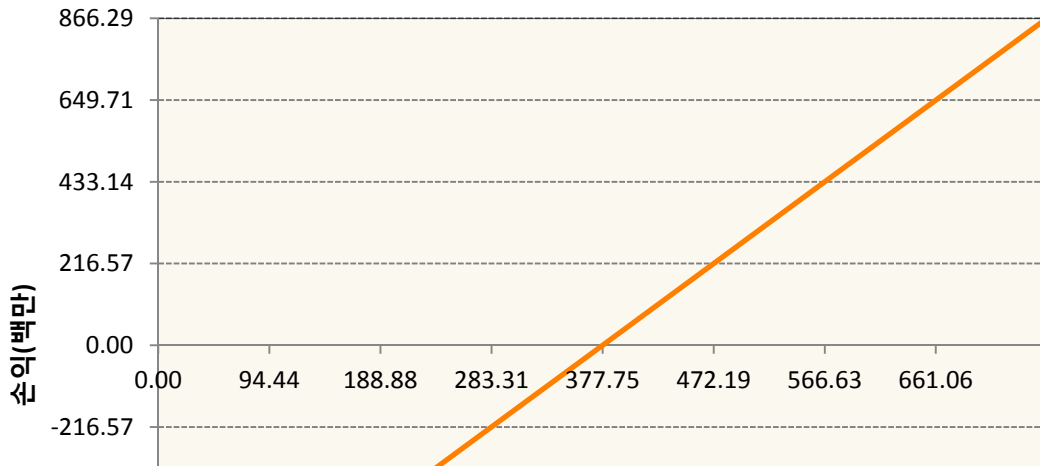
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,007	323	3,685	

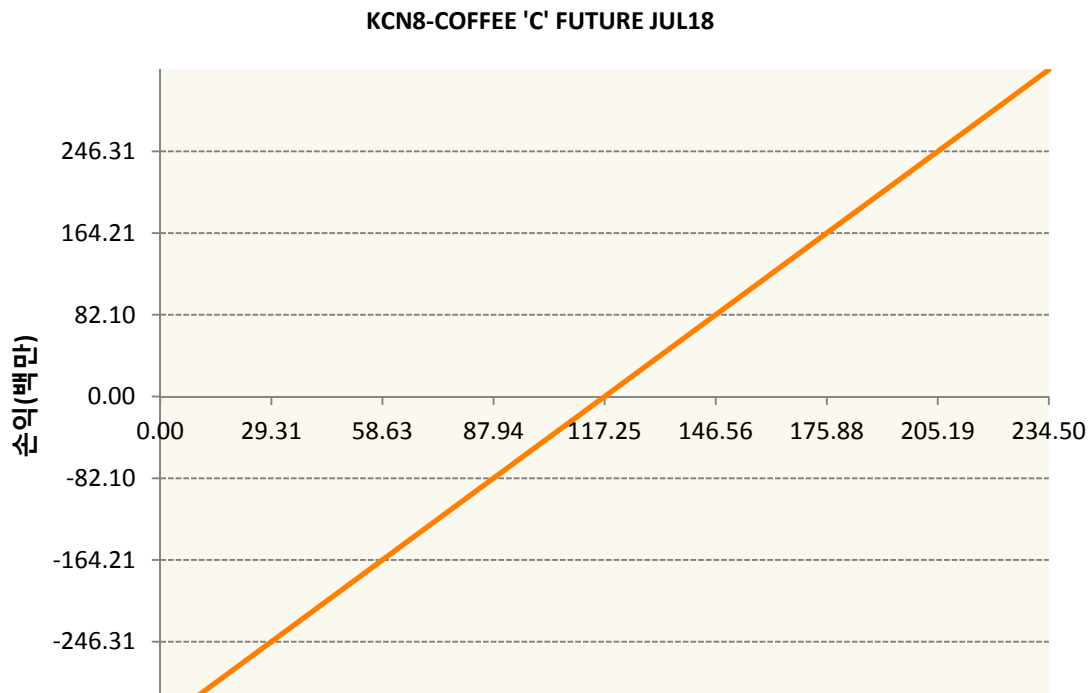
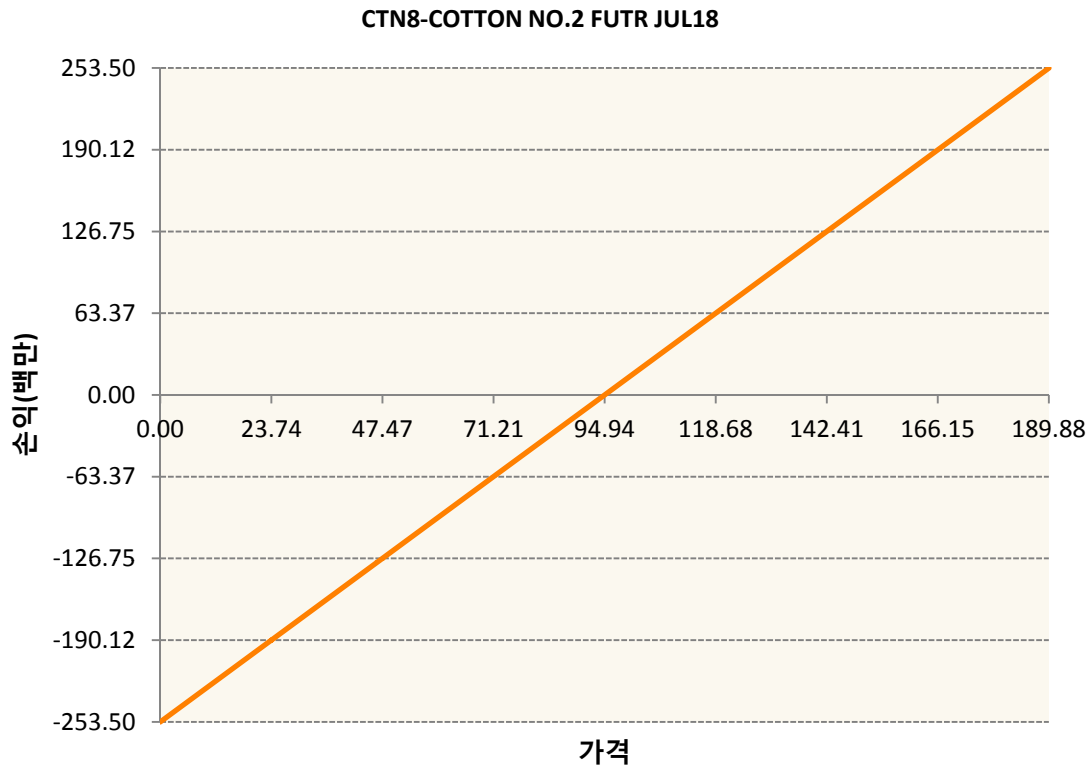
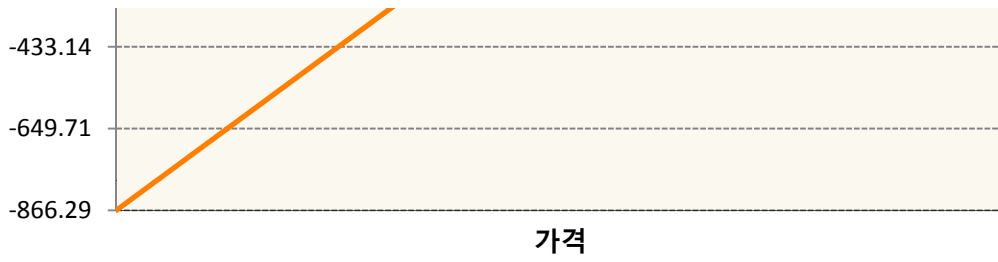
2. 만기시점의 손익구조

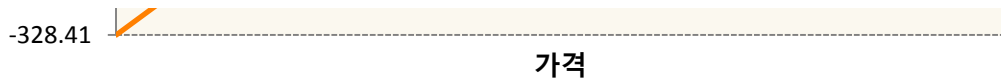
BON8-SOYBEAN OIL FUTR JUL18



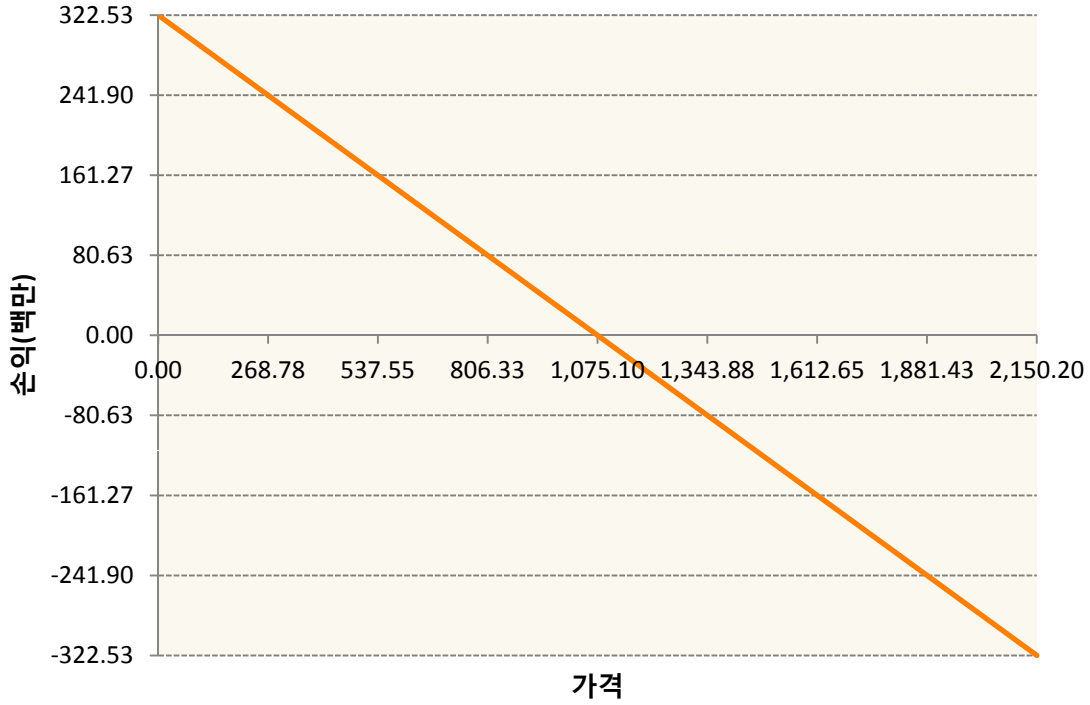
CN8-CORN FUTURE JUL18



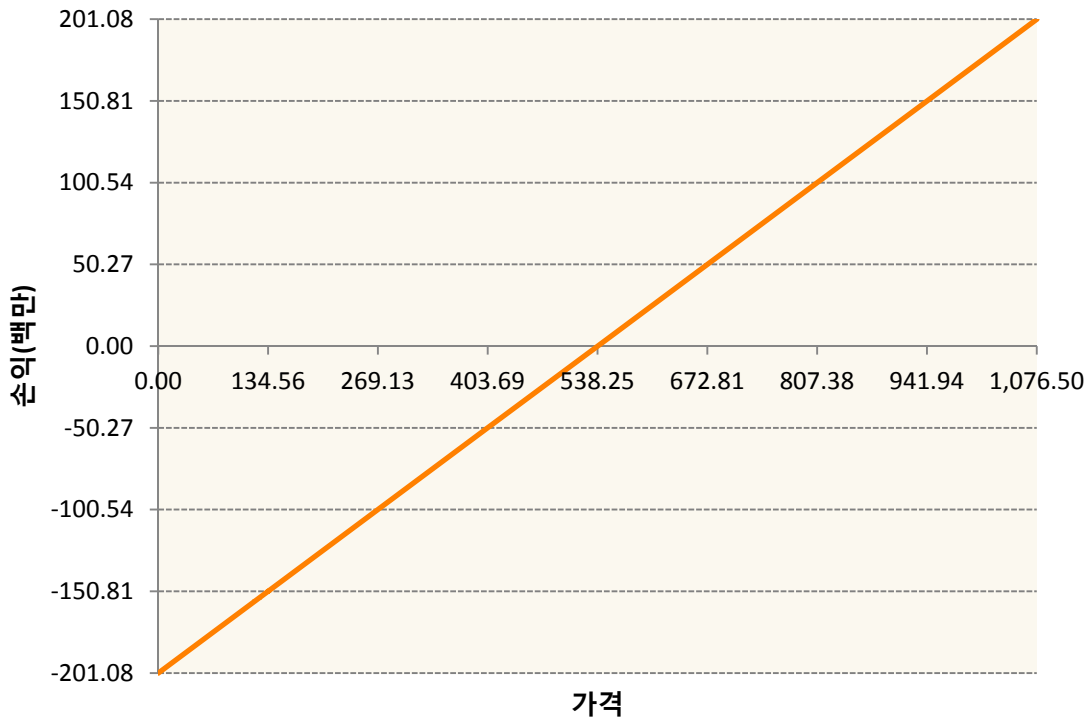




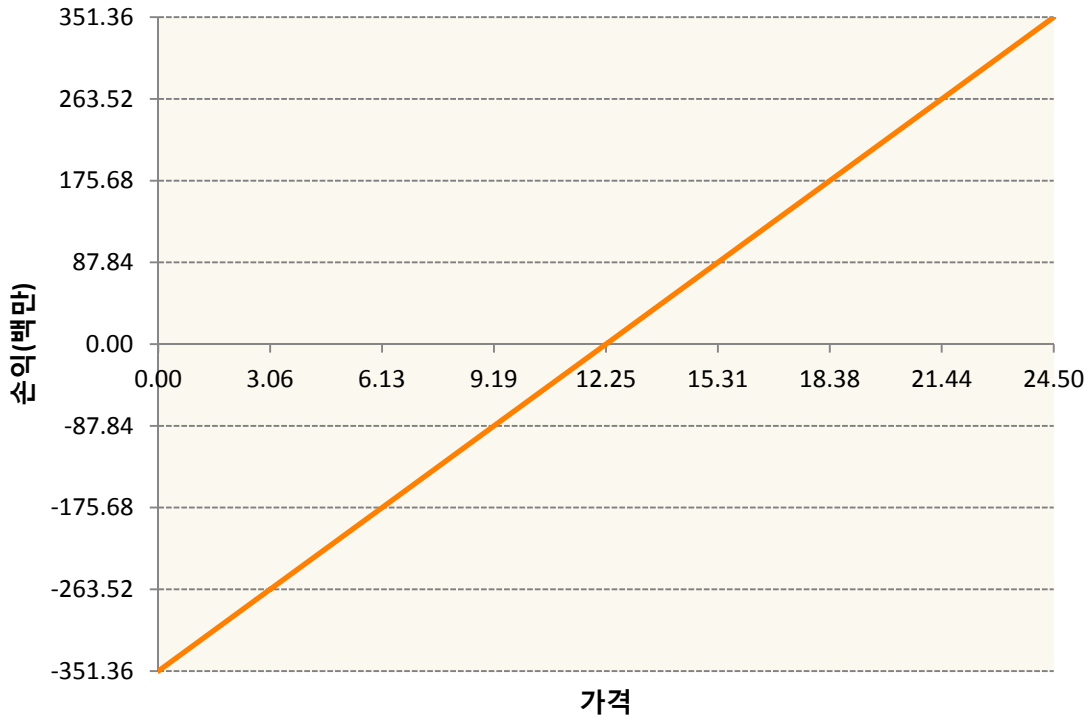
KR4175N60003-2018-06 달러선물



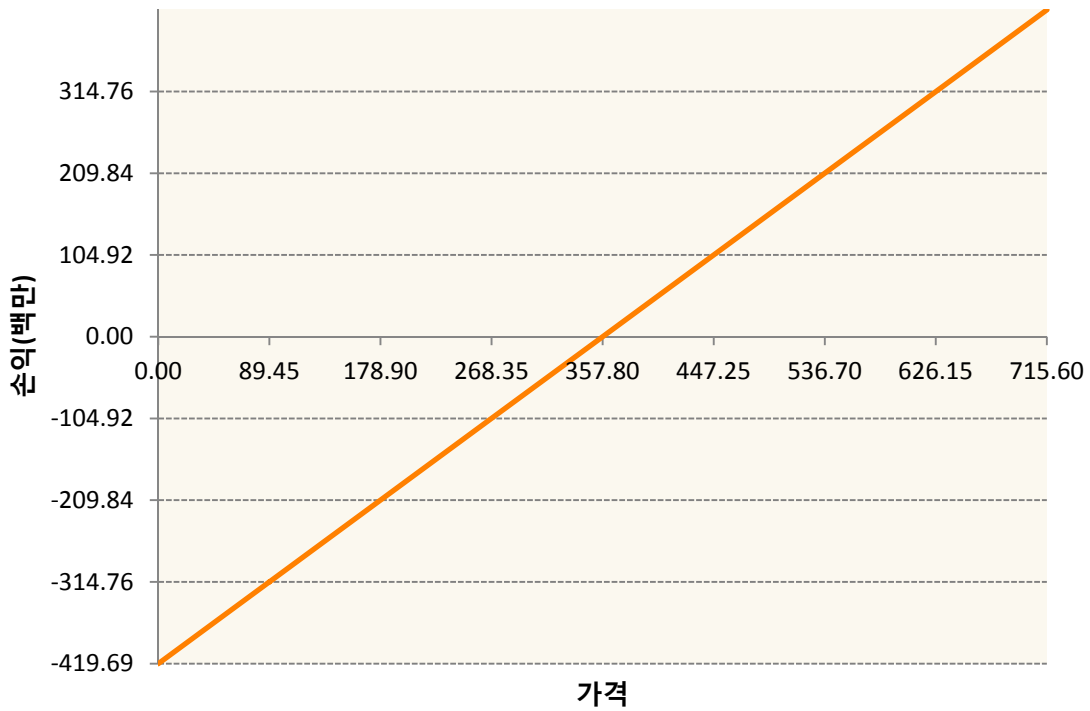
KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18



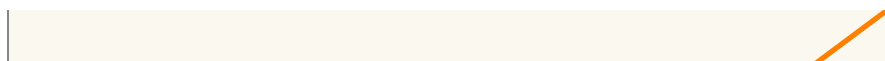
SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18

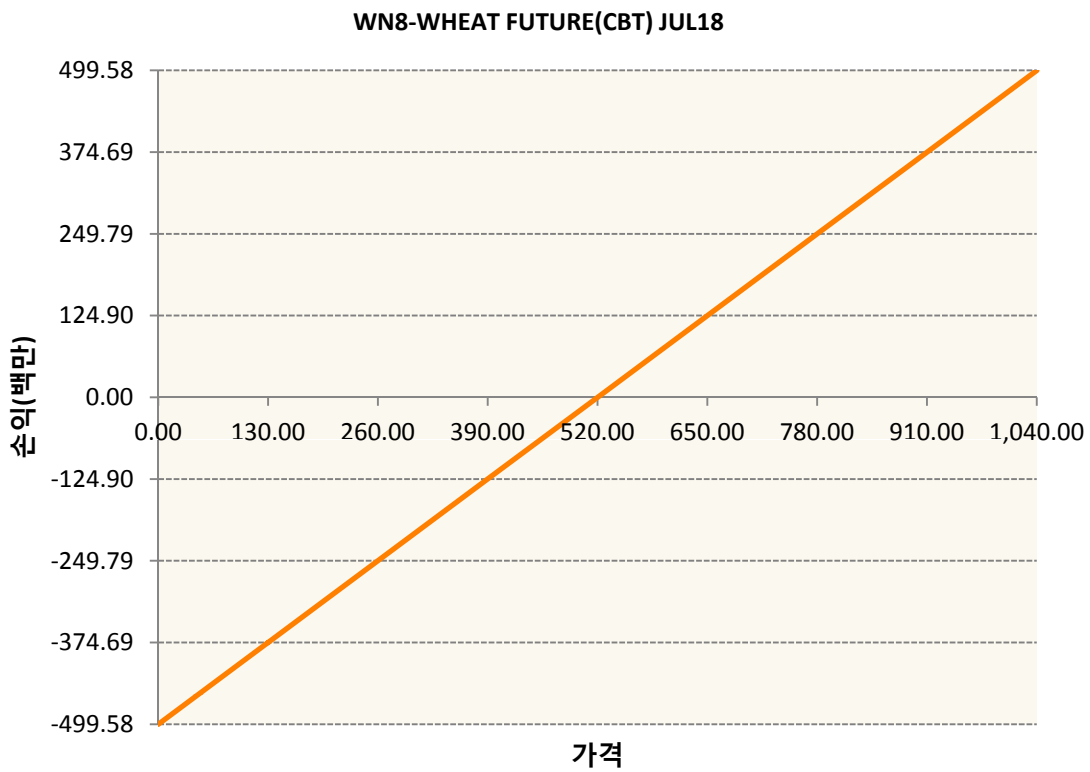
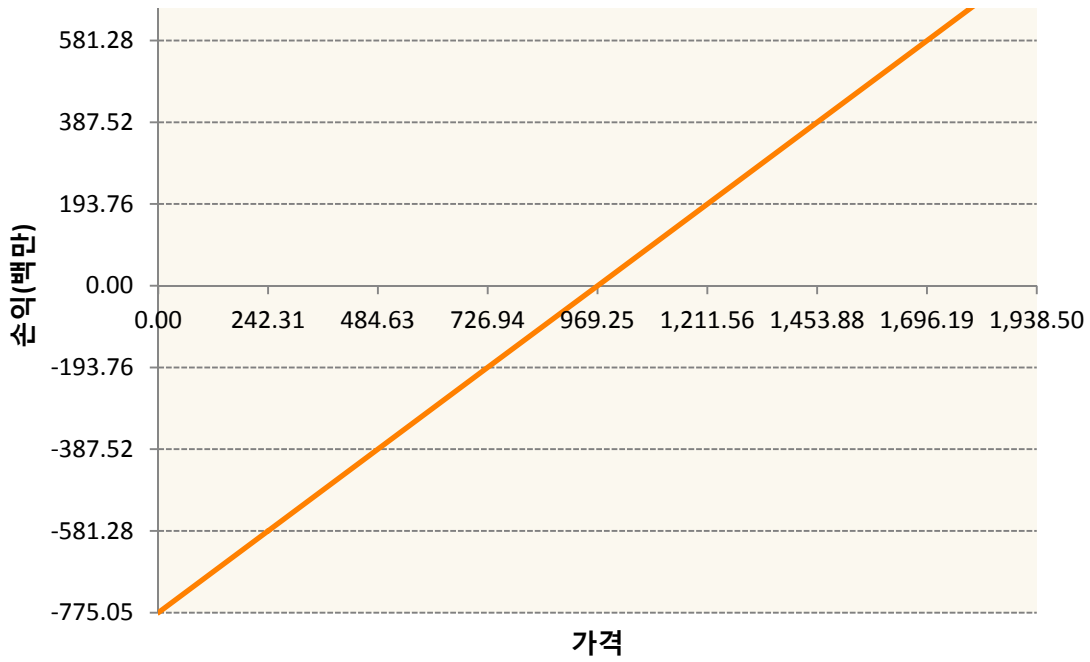


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18



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	20
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	62
WN8	WHEAT FUTURE(CBT) JUL18	40

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

(단위:백만원)

328