

공시일	2018-06-14
기준일	2018-06-12

## 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

공시일	2018-06-14
기준일	2018-06-12

## 스마트인덱스모

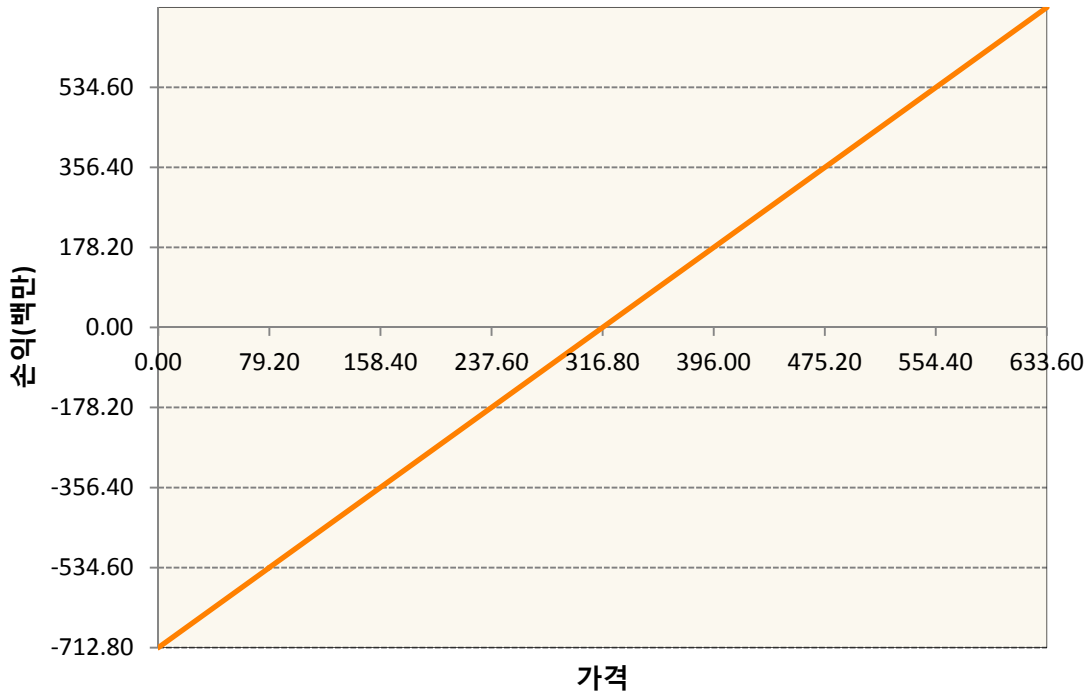
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

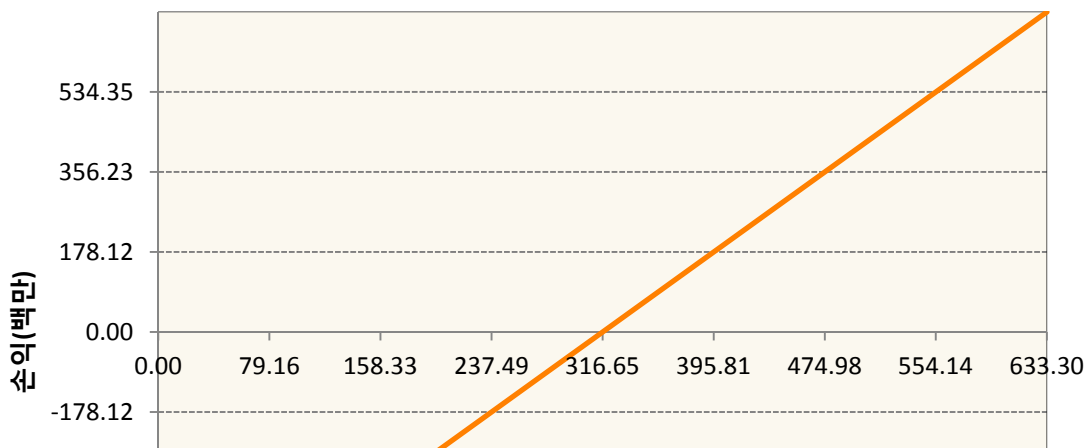
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	714	713	0	장내
누계	유가증권	선물	1,425	0	1,425	장내

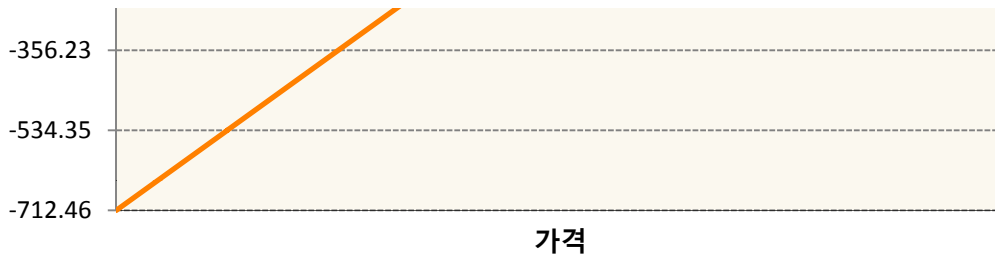
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물



KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)


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

83
----

공시일	2018-06-14
기준일	2018-06-12

## 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

1,133

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

470

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-06-14
기준일	2018-06-12

## 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)

SWCSI50000 신한CSI500미래S180608

377

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

407

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-06-14
기준일	2018-06-12

## 유로인덱스모(주식-파생형)

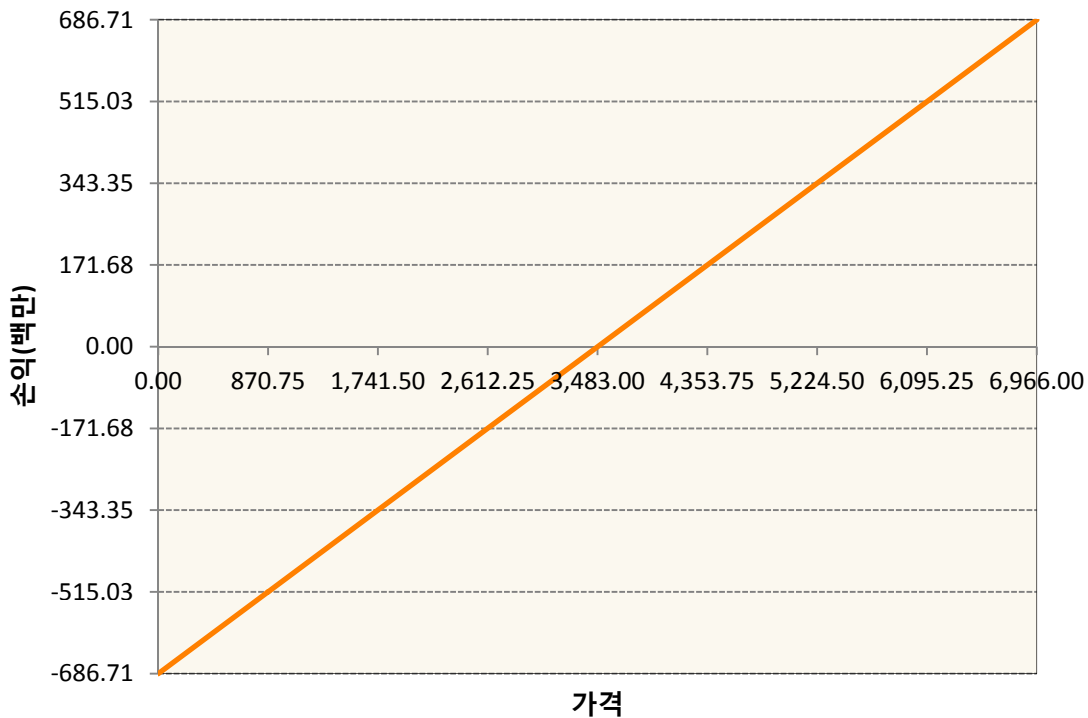
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	687	0	687	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGM8-EURO STOXX 50 JUN18



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	55
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

34
----

공시일	2018-06-14
기준일	2018-06-12

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

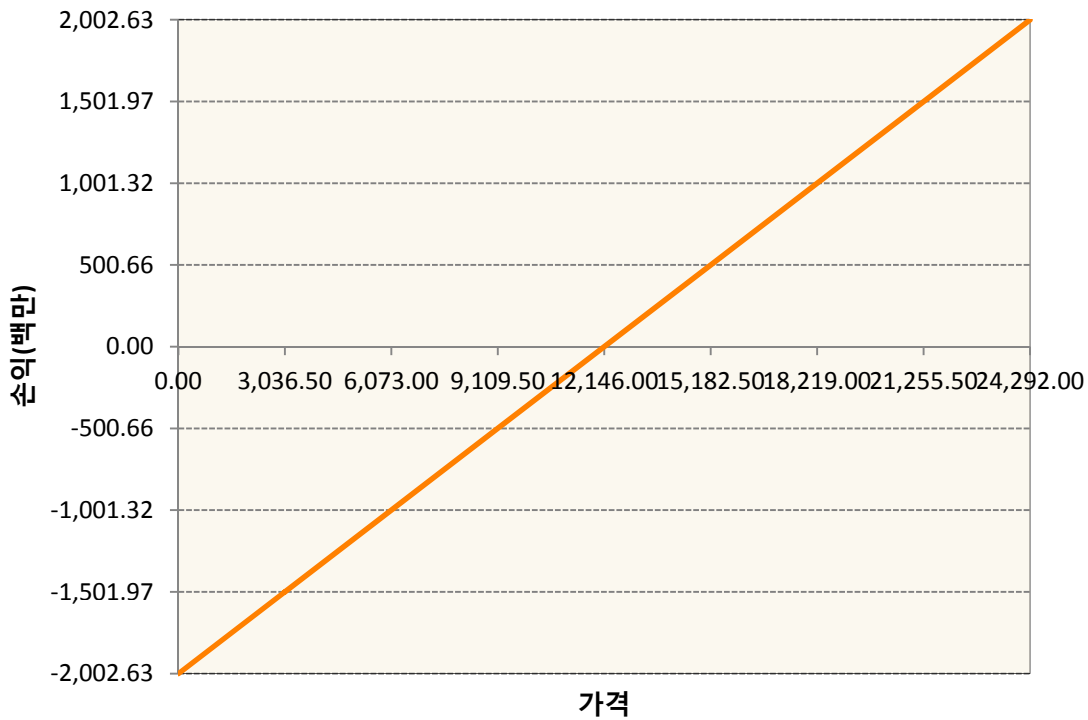
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

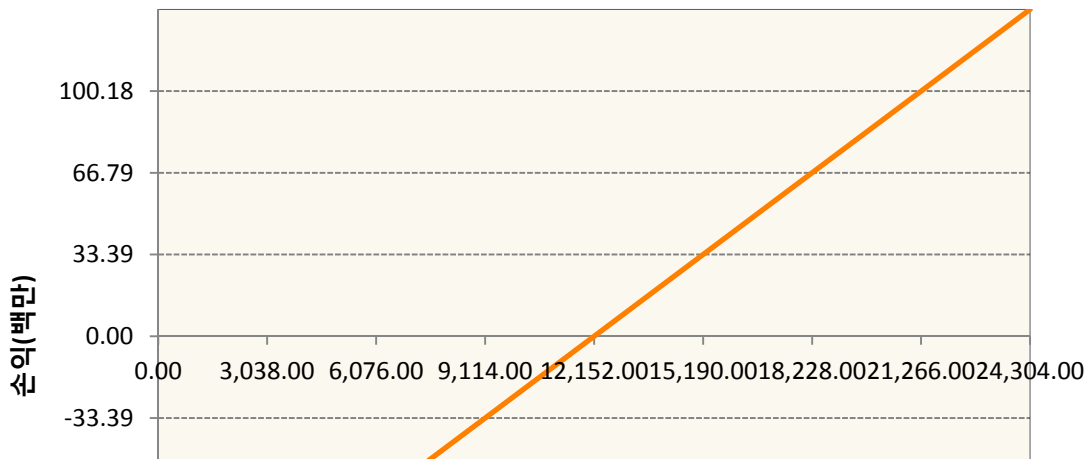
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,136	0	2,136	장내

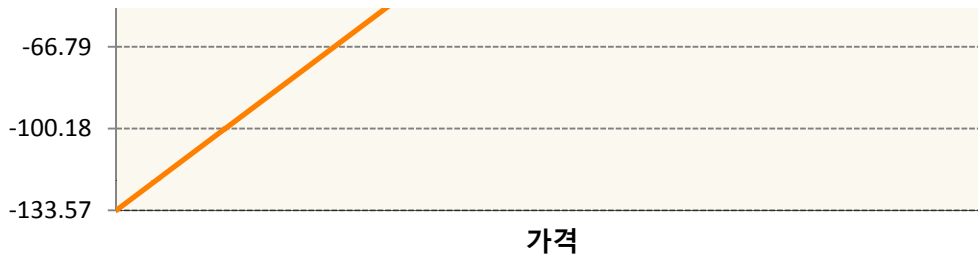
### 2. 만기시점의 손익구조

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	2018-06-14
기준일	2018-06-12

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

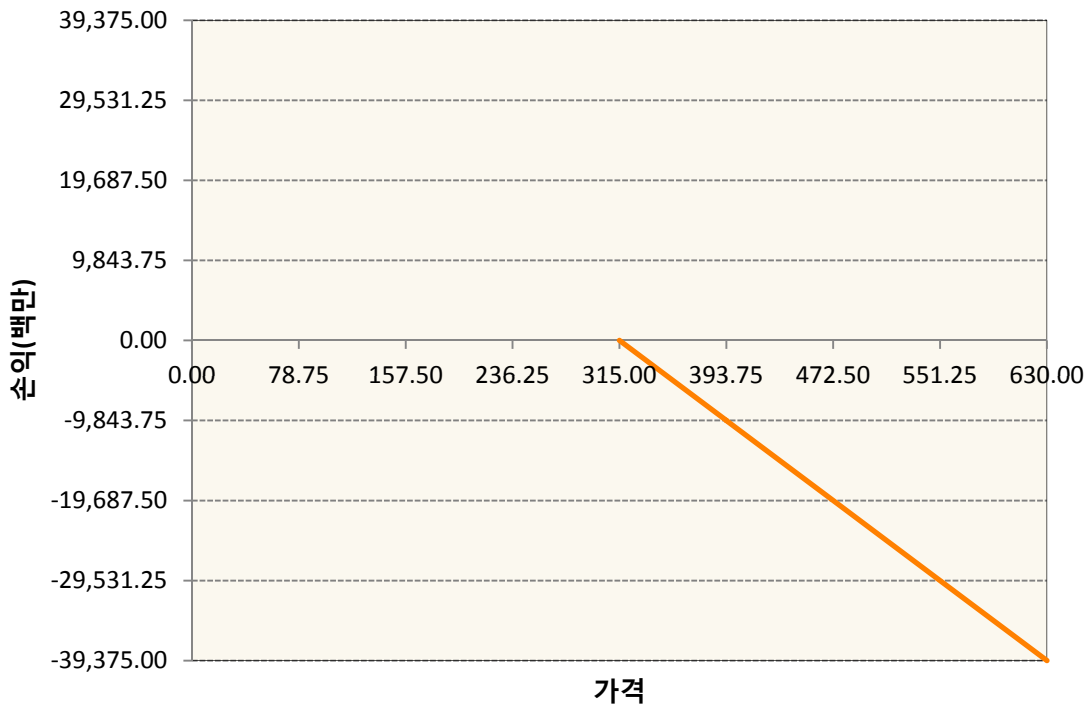
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

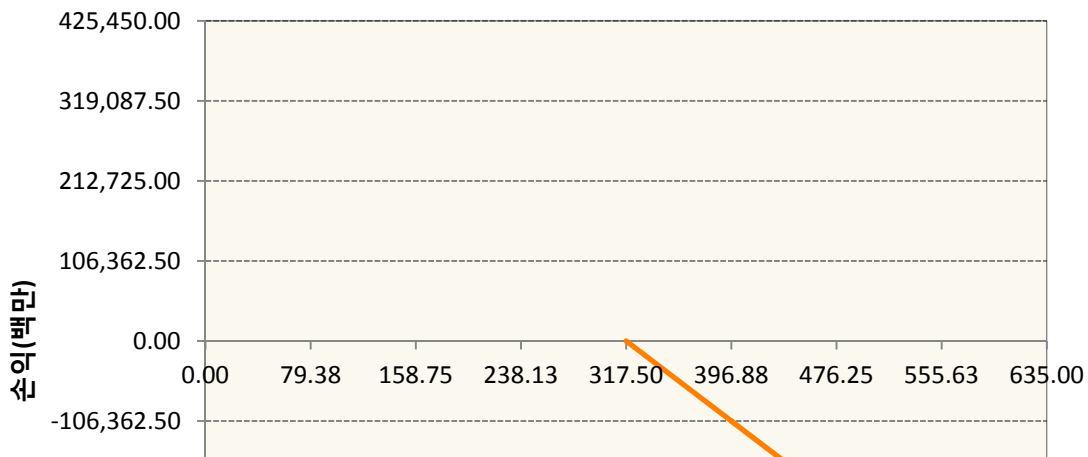
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	20,041	16,227	3,815	장내
누계	유가증권	옵션	0	480,859	-480,859	장내

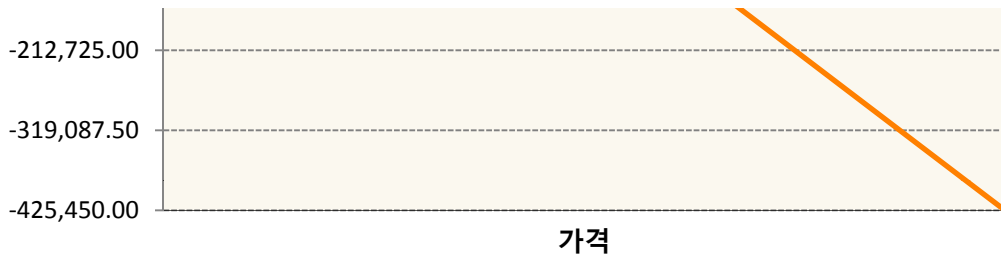
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63159-2018-06 콜315

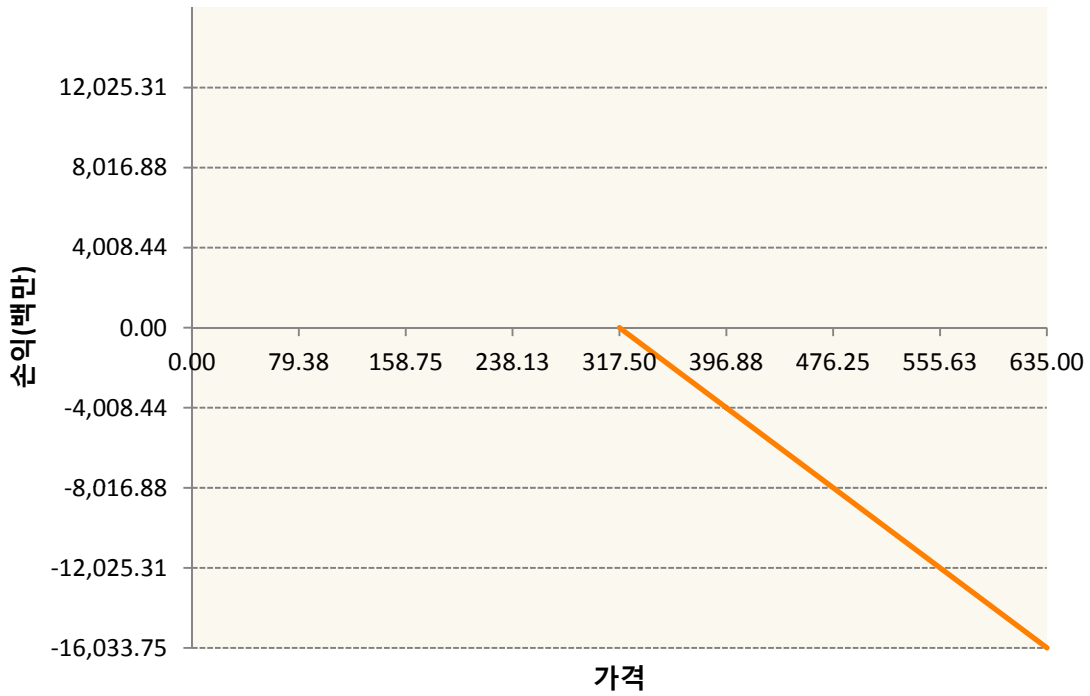


KR4201N63175-2018-06 콜317.5





KR4201N73174-2018-07 콜317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)


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

<b>43,216</b>
---------------

공시일	2018-06-14
기준일	2018-06-12

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

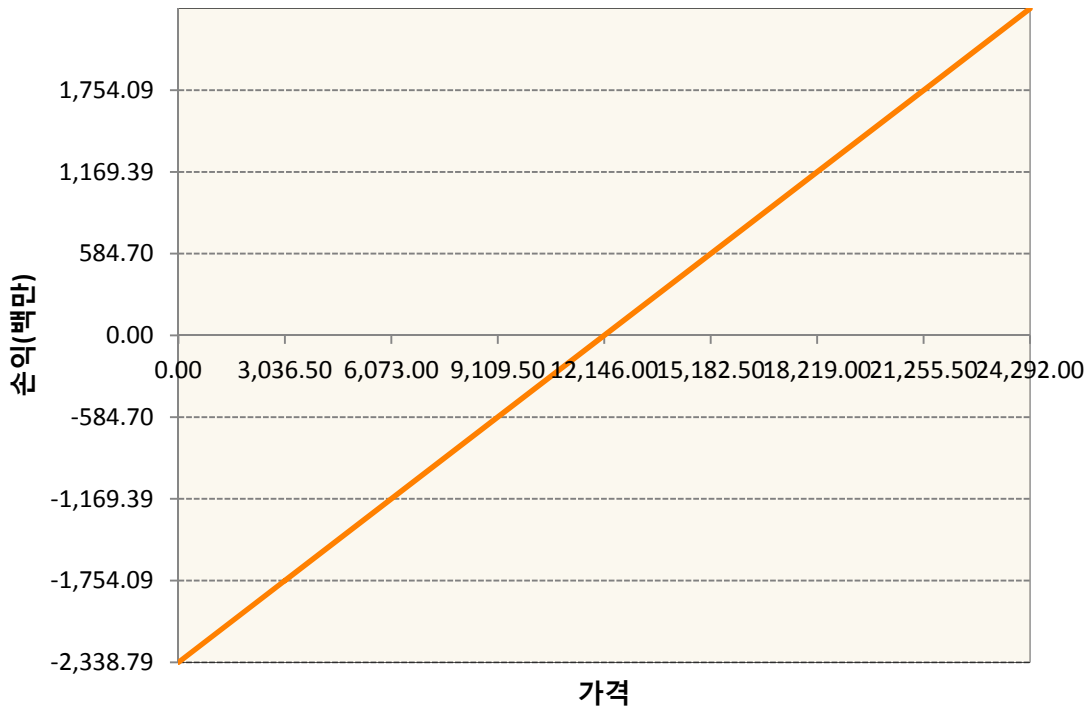
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

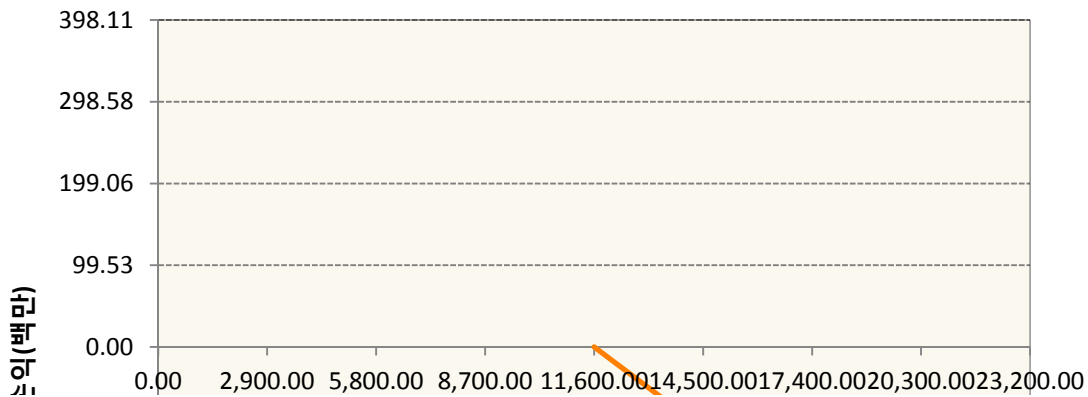
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,339	0	2,339	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,818	-5,818	장내

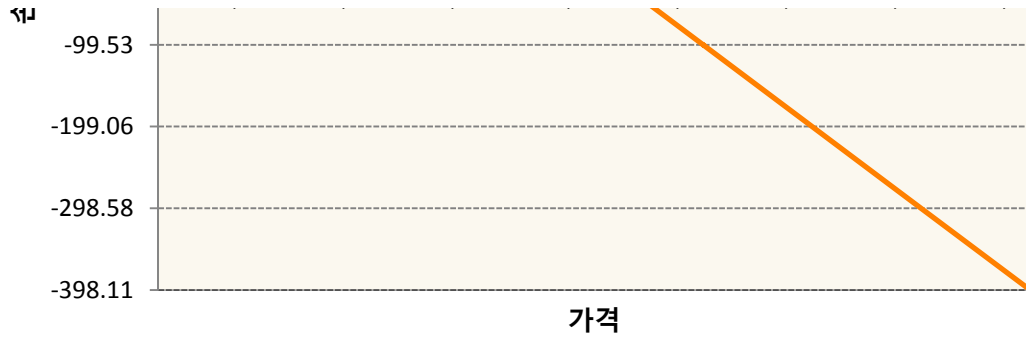
### 2. 만기시점의 손익구조

HCM8-HSCEI Futures Jun18

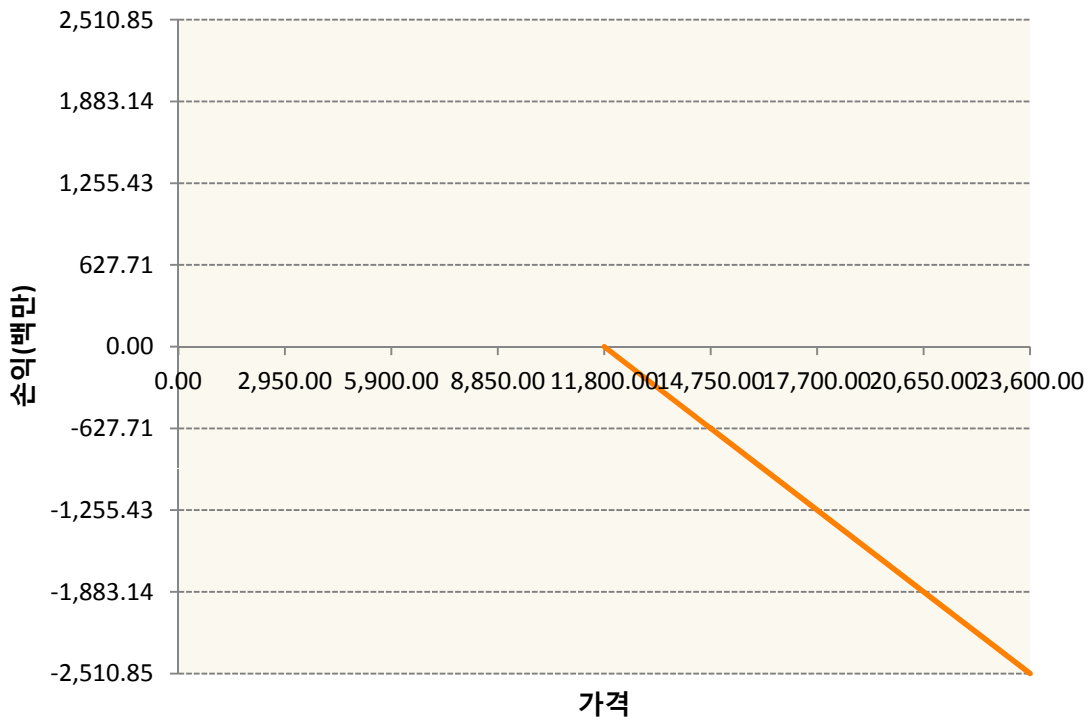


OHHIM8-C116-HSCEI

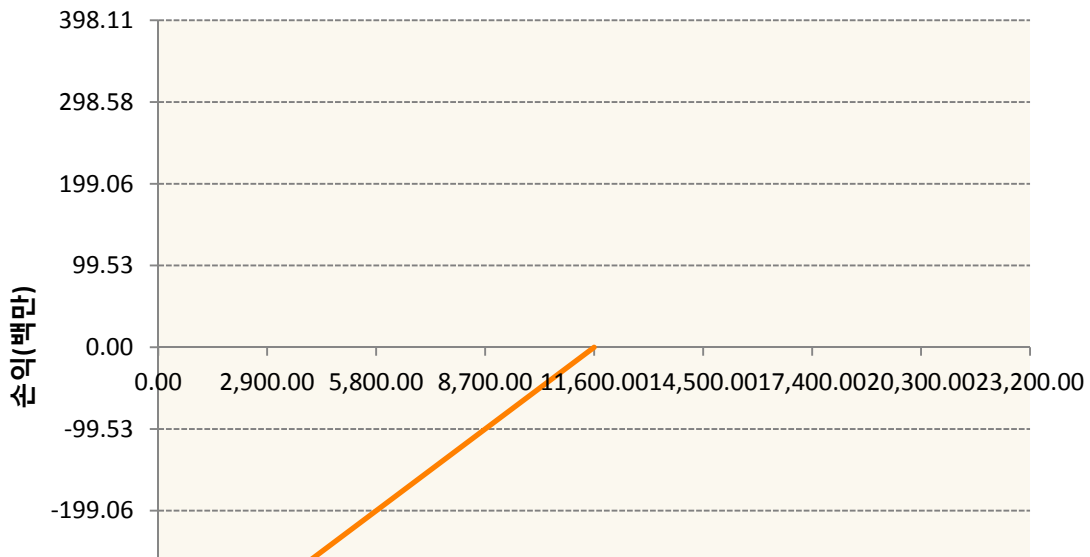


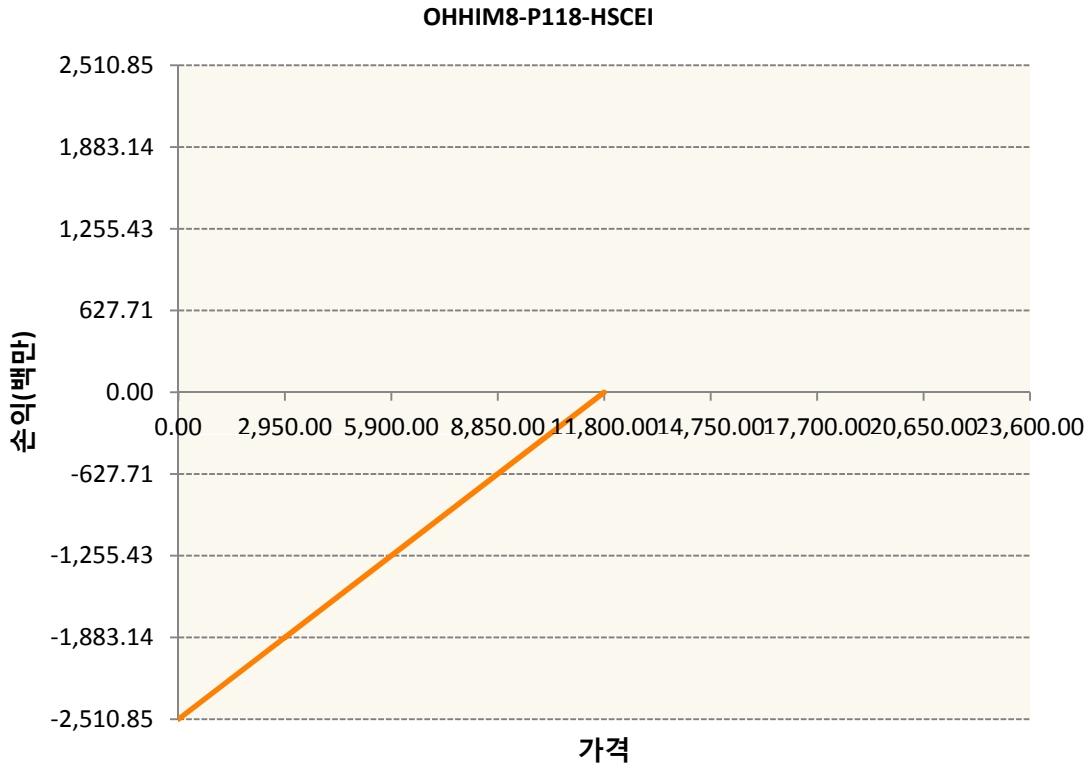
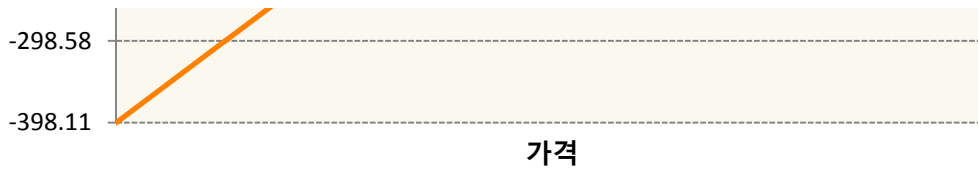


OHHIM8-C118-HSCEI



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)
	578



5.33%	989	989	989	989	989	989	989
8.00%	1,483	1,483	1,483	1,483	1,483	1,483	1,483

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX\_3 281

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-281	-281	-281	-281	-281	-281	-281
-5.33%	-187	-187	-187	-187	-187	-187	-187
-2.67%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	94	94	94	94	94	94	94
5.33%	187	187	187	187	187	187	187
8.00%	281	281	281	281	281	281	281

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX\_5 240

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-240	-240	-240	-240	-240	-240	-240
-5.33%	-160	-160	-160	-160	-160	-160	-160
-2.67%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	80	80	80	80	80	80	80
5.33%	160	160	160	160	160	160	160
8.00%	240	240	240	240	240	240	240

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX\_7 256

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-256	-256	-256	-256	-256	-256	-256
-5.33%	-171	-171	-171	-171	-171	-171	-171
-2.67%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	85	85	85	85	85	85	85
5.33%	171	171	171	171	171	171	171
8.00%	256	256	256	256	256	256	256

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX\_8 474

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-474	-474	-474	-474	-474	-474	-474
-5.33%	-316	-316	-316	-316	-316	-316	-316
-2.67%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	158	158	158	158	158	158	158
5.33%	316	316	316	316	316	316	316
8.00%	474	474	474	474	474	474	474

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX\_11 641

기초자산의 변동성							
-----------	--	--	--	--	--	--	--

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-641	-641	-641	-641	-641	-641	-641
-5.33%	-427	-427	-427	-427	-427	-427	-427
-2.67%	-214	-214	-214	-214	-214	-214	-214
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	214	214	214	214	214	214	214
5.33%	427	427	427	427	427	427	427
8.00%	641	641	641	641	641	641	641
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12							481

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-481	-481	-481	-481	-481	-481	-481
-5.33%	-321	-321	-321	-321	-321	-321	-321
-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%	321	321	321	321	321	321	321
8.00%	481	481	481	481	481	481	481

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

(단위:백만원)

**6,296**

공시일	2018-06-14
기준일	2018-06-12

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

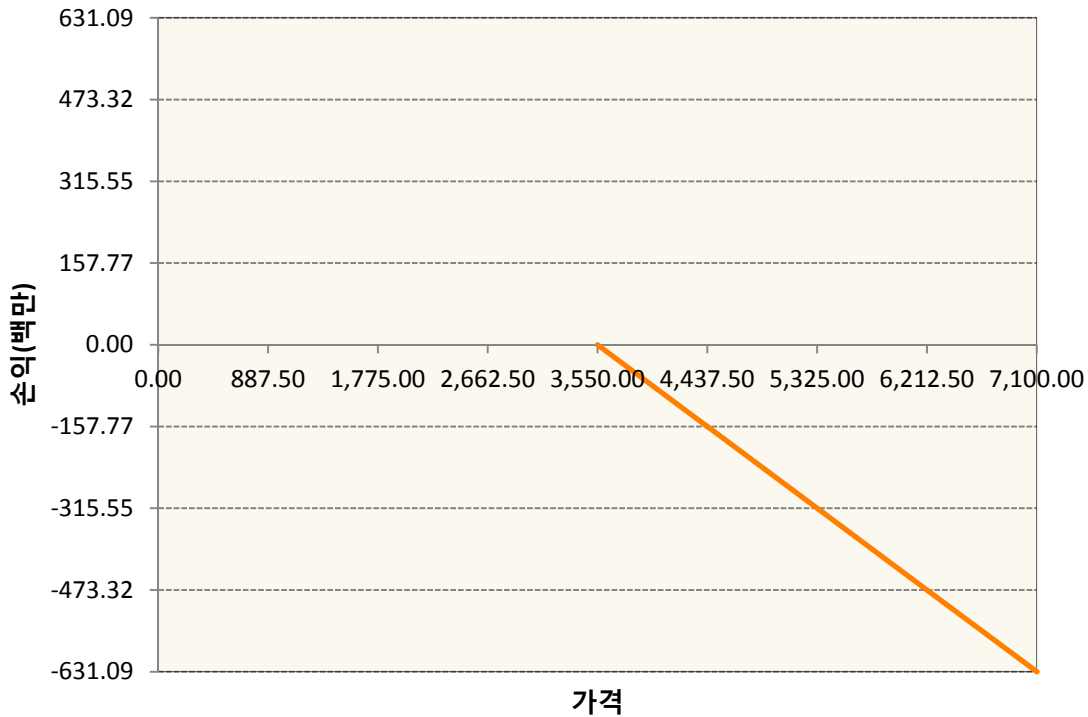
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

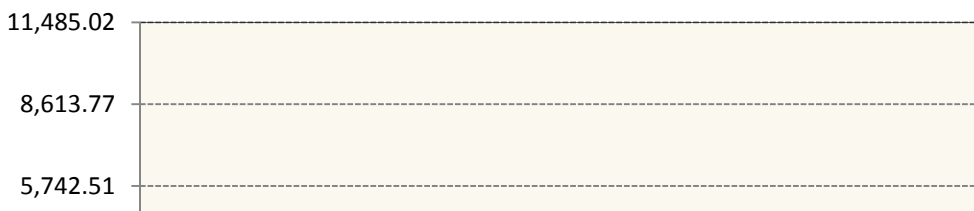
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,880	0	3,880	
누계	유가증권	스왑	53,536	0	53,536	장외
누계	유가증권	옵션	0	24,232	-24,232	장내
누계	지수	스왑	50,793	0	50,793	장외

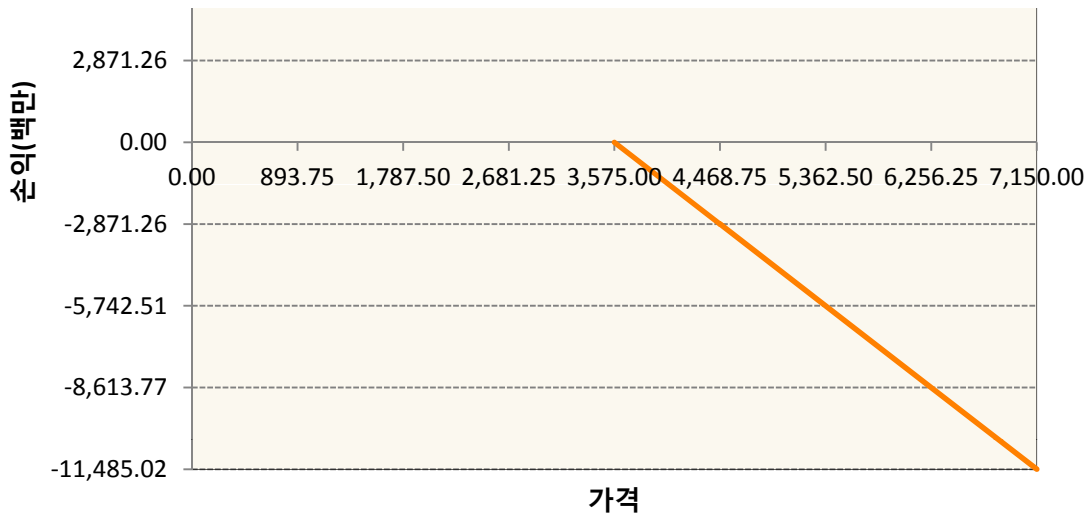
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXM8-C3550-EURO STOXX 50**

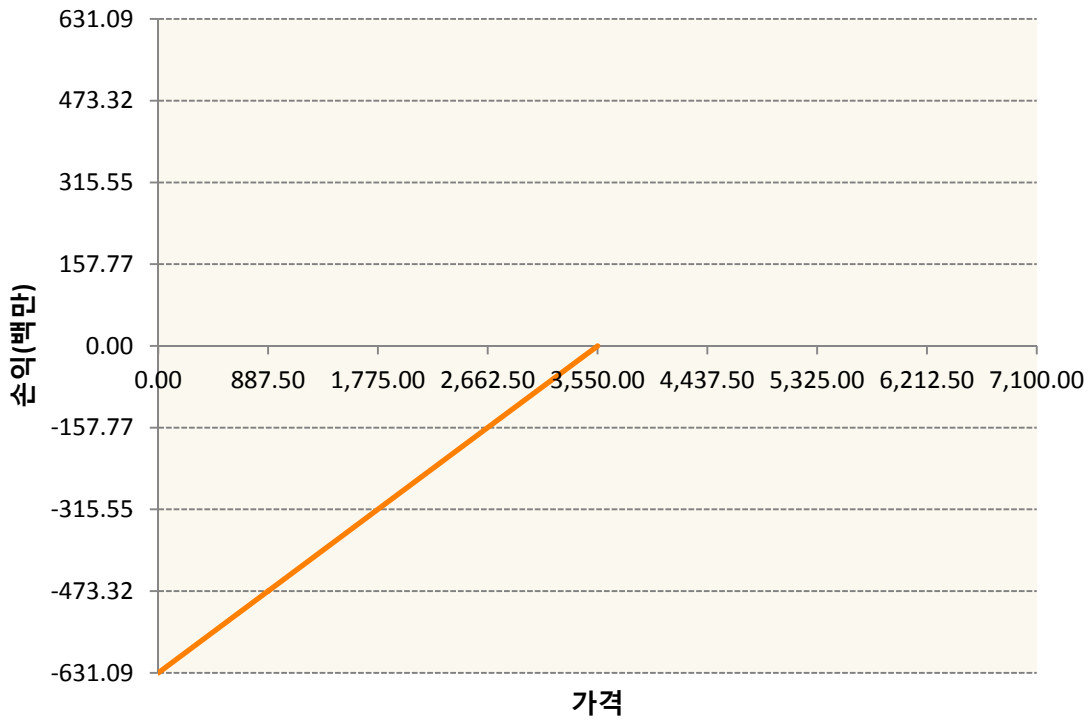


**OESXM8-C3575-EURO STOXX 50**



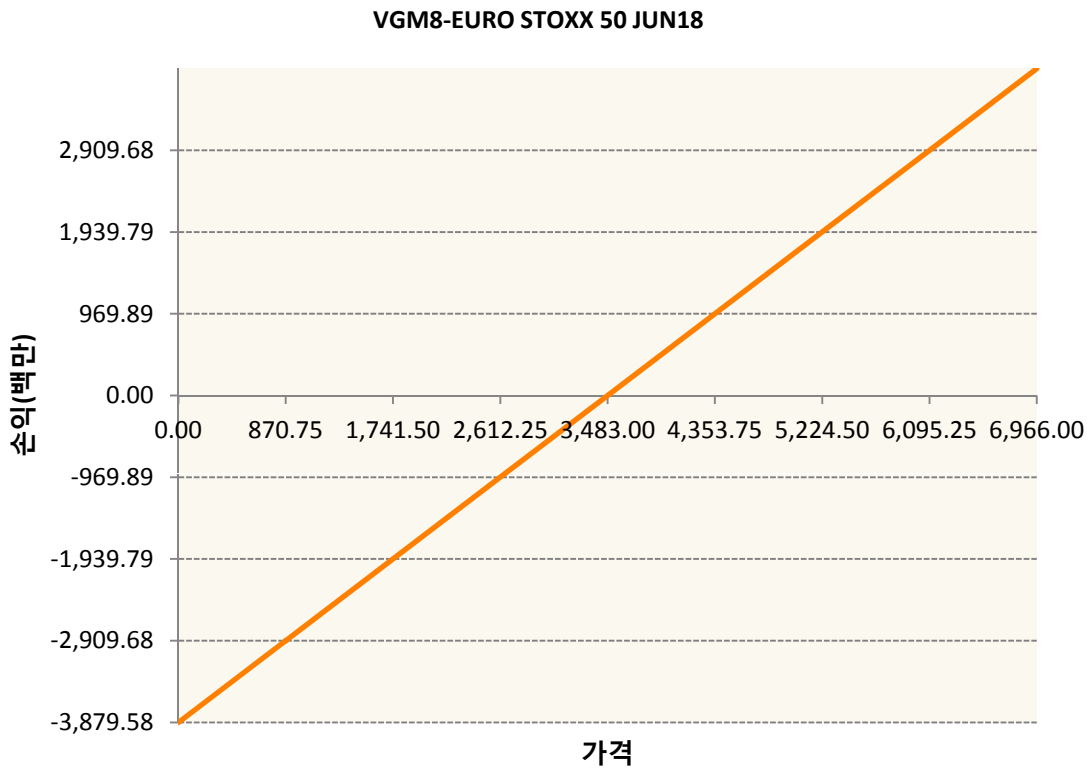
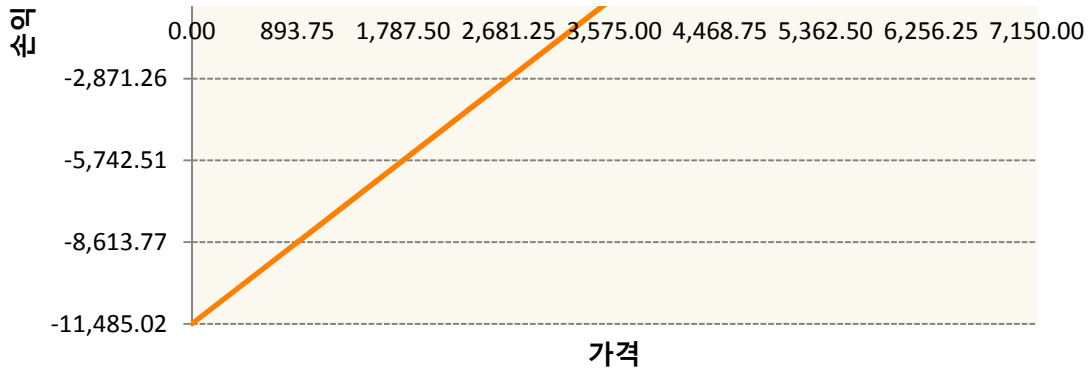


OESXM8-P3550-EURO STOXX 50



OESXM8-P3575-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		11
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		12
OESXM8-C3: EURO STOXX 50		50
OESXM8-C3: EURO STOXX 50		919
OESXM8-P3! EURO STOXX 50		50
OESXM8-P3! EURO STOXX 50		919
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18		310

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



공시일	2018-06-14
기준일	2018-06-12

## ETF스마트레버리지목표전환형8호

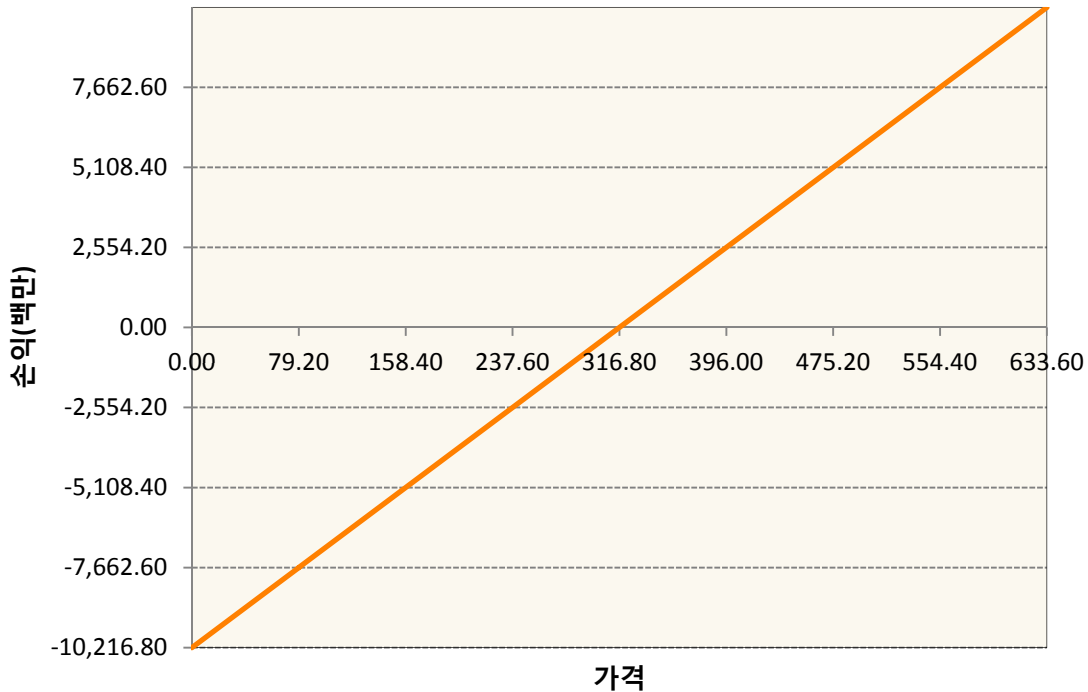
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

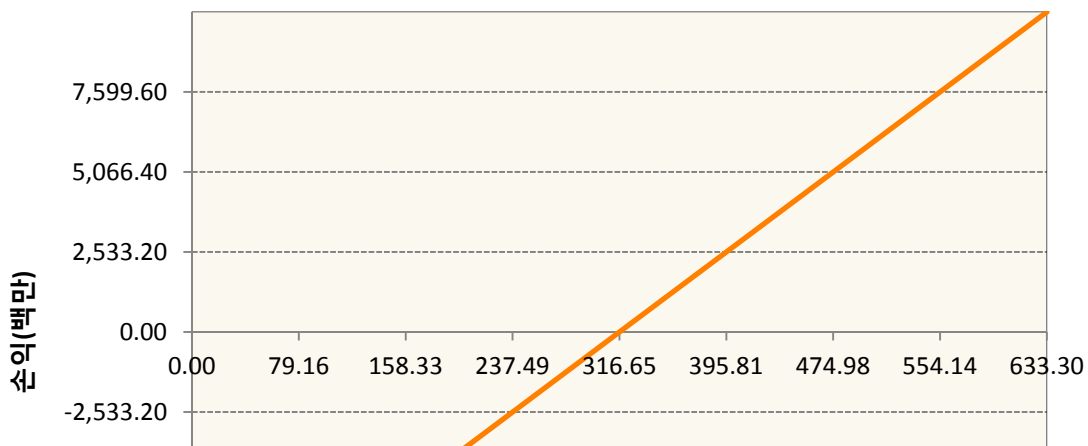
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	10,154	10,149	5	장내
누계	유가증권	선물	20,350	0	20,350	장내

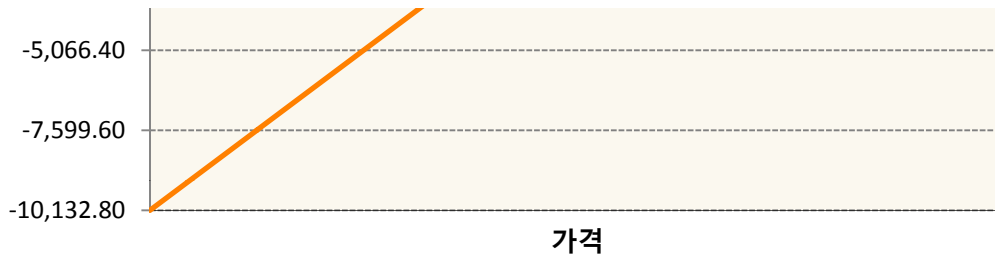
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물



KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)


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

<b>1,184</b>
--------------

공시일	2018-06-14
기준일	2018-06-12

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

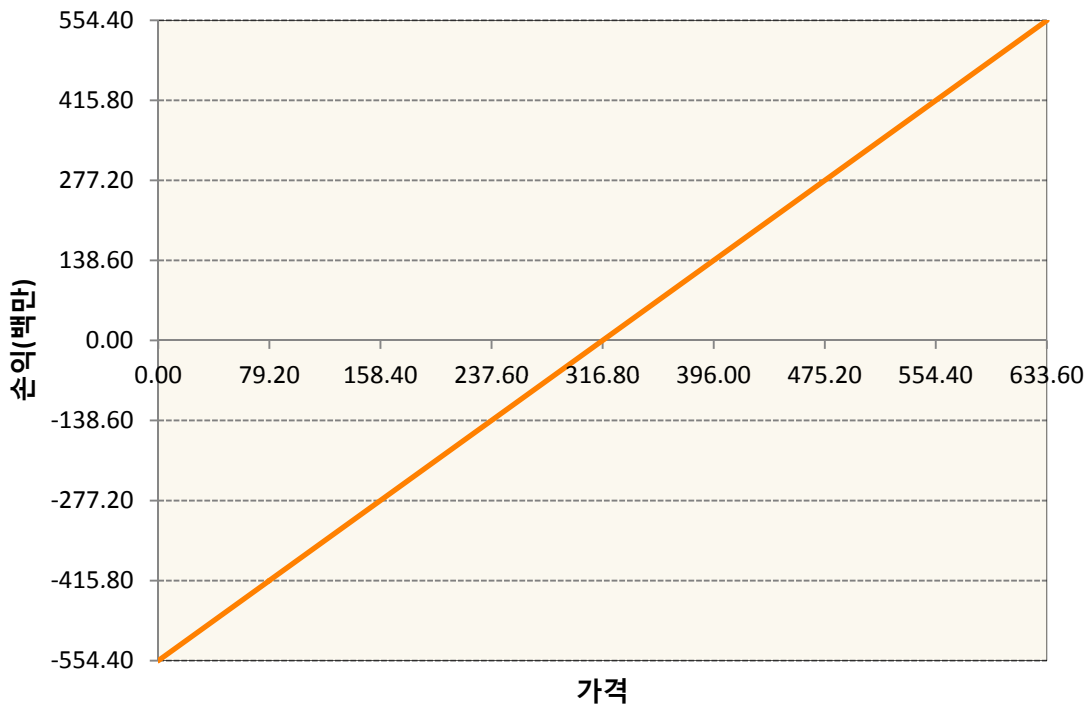
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

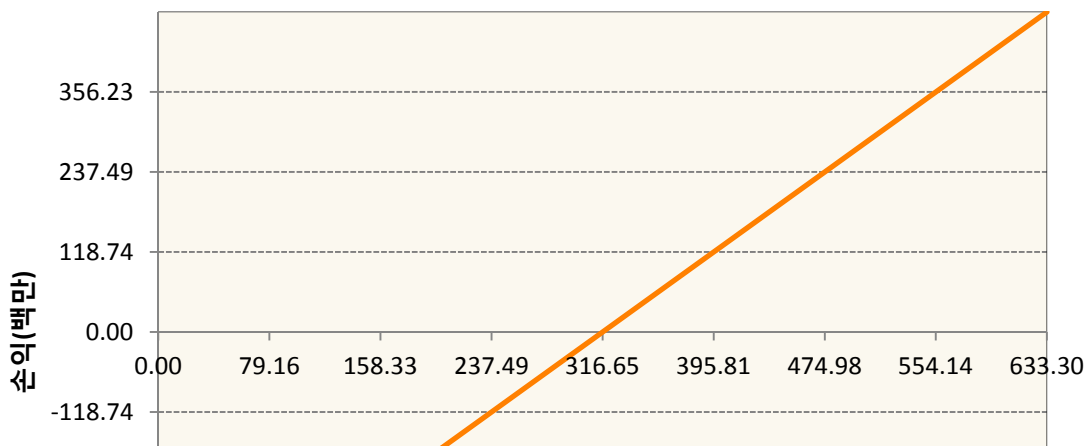
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	476	476	0	장내
누계	유가증권	선물	1,029	0	1,029	장내

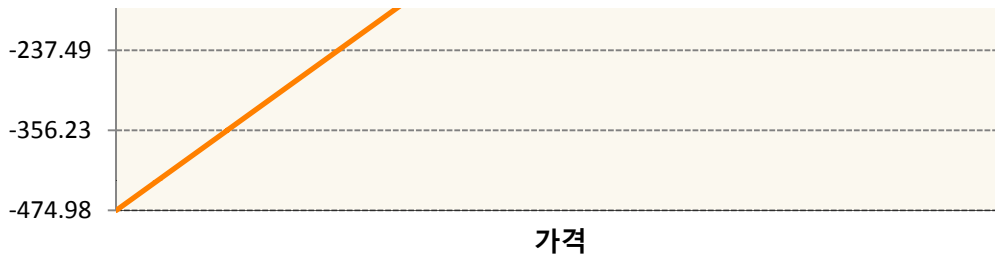
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물



KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)


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

<b>60</b>
-----------

공시일	2018-06-14
기준일	2018-06-12

## ETF스마트레버리지목표전환형10

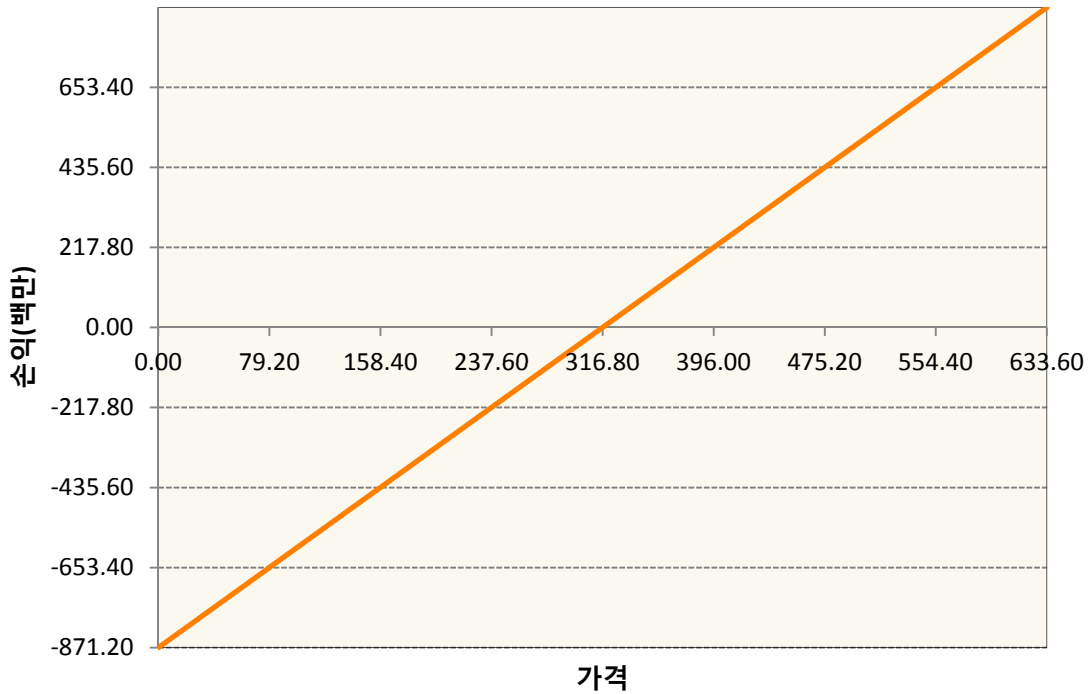
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

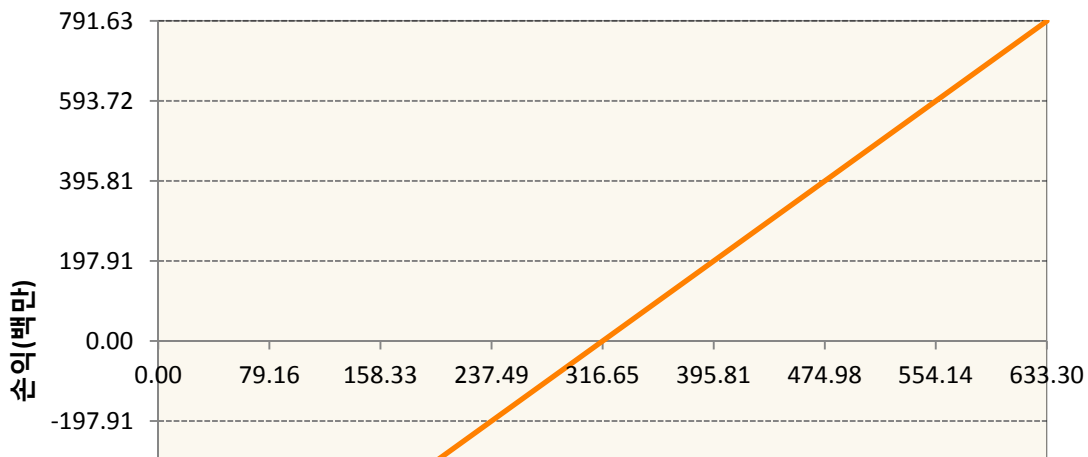
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	794	793	0	장내
누계	유가증권	선물	1,663	0	1,663	장내

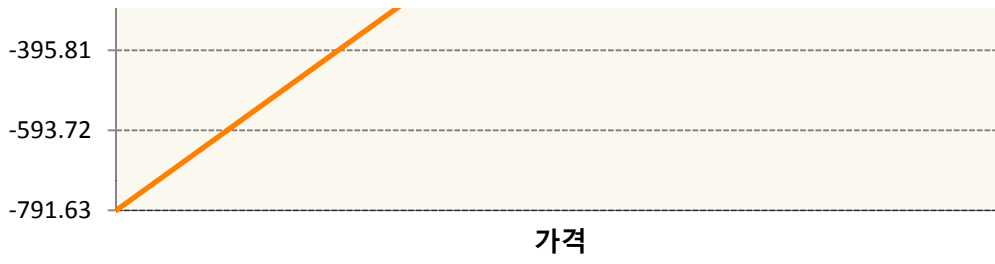
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물



KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)


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

97
----

공시일	2018-06-14
기준일	2018-06-12

## 스마트KRX300인덱스1호(주식-파)

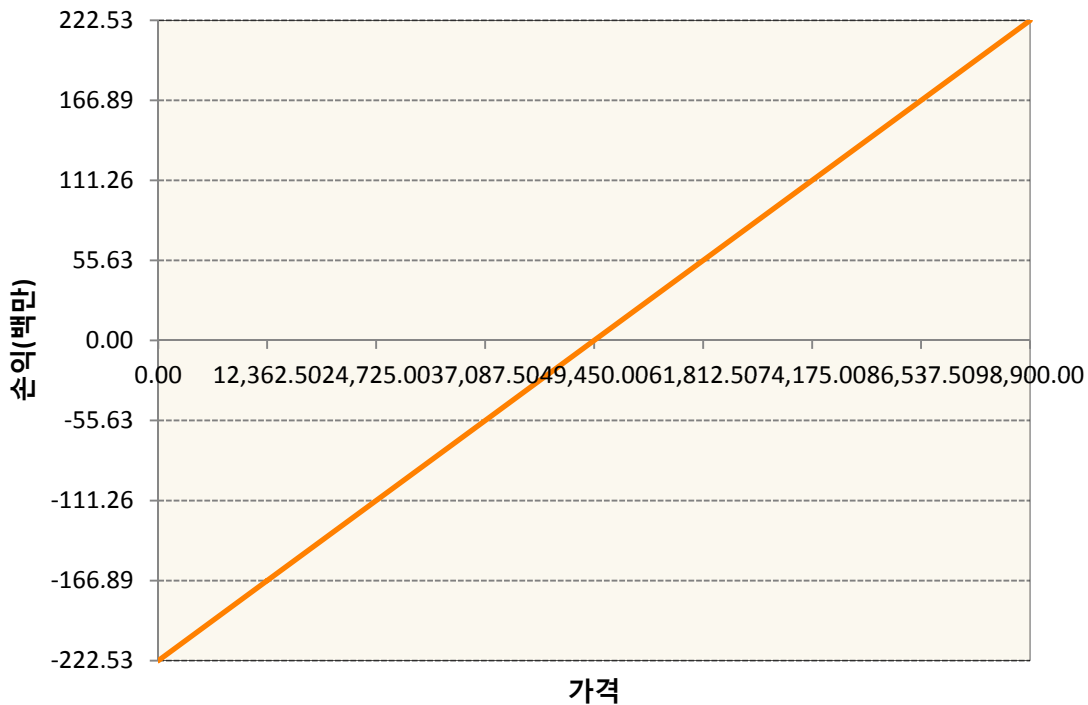
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

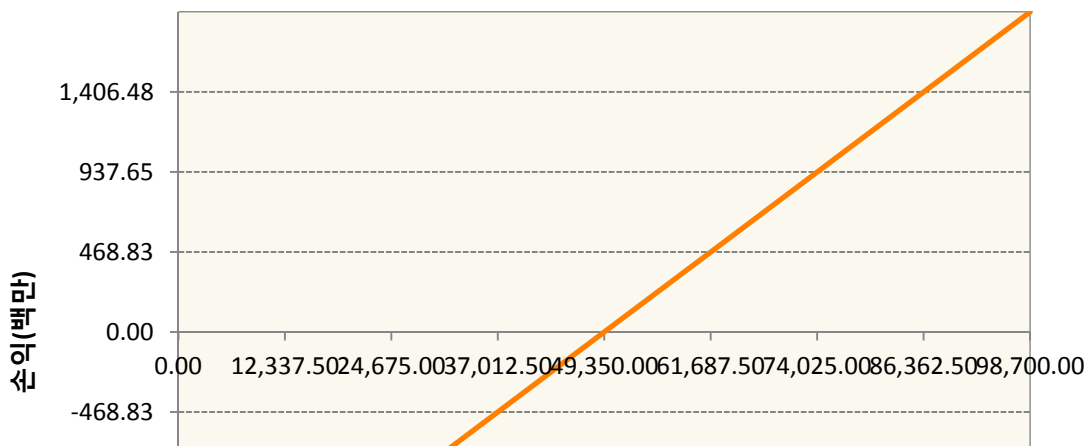
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,869	1,878	-9	장내
누계	유가증권	선물	2,098	0	2,098	장내

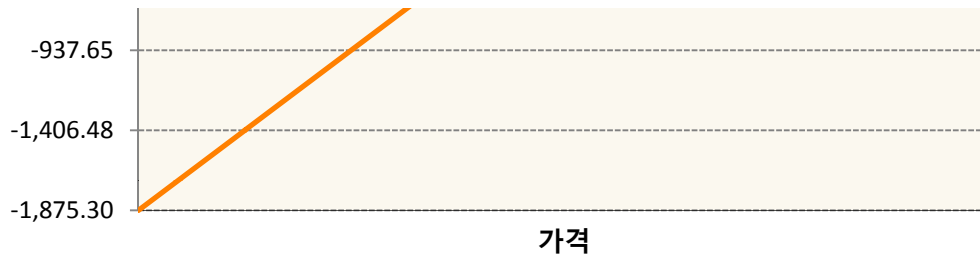
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4111N60008-2018-06 삼성전자개별선물



KR4111N70007-2018-07 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)


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

<b>211</b>
------------

공시일	2018-06-14
기준일	2018-06-12

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1

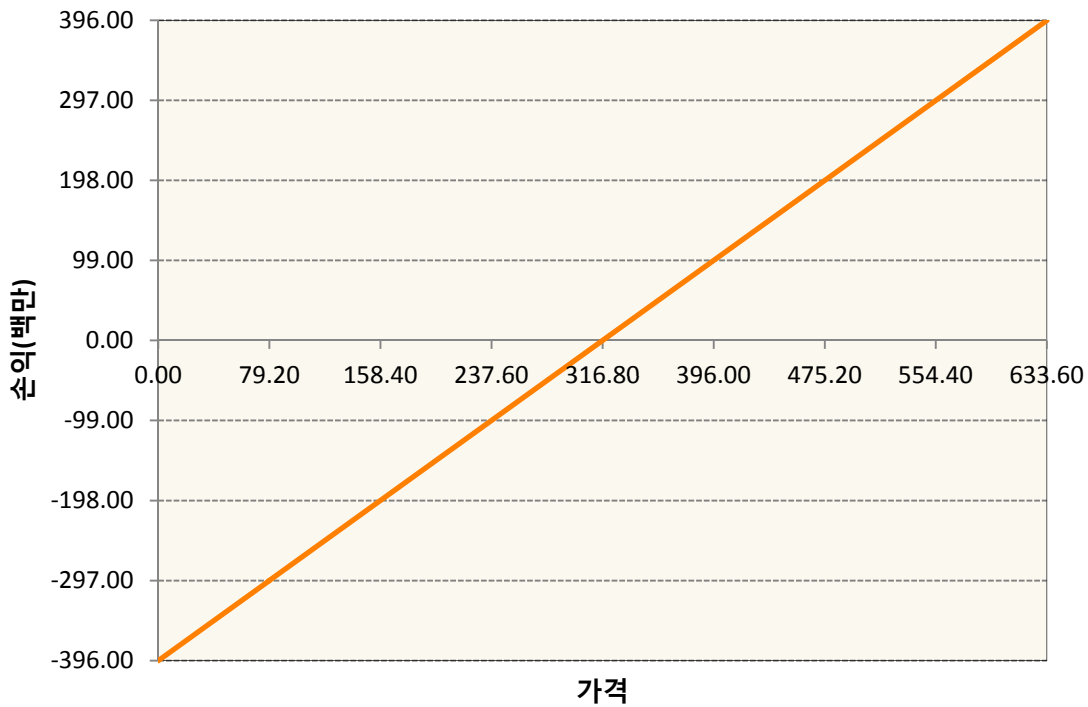
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

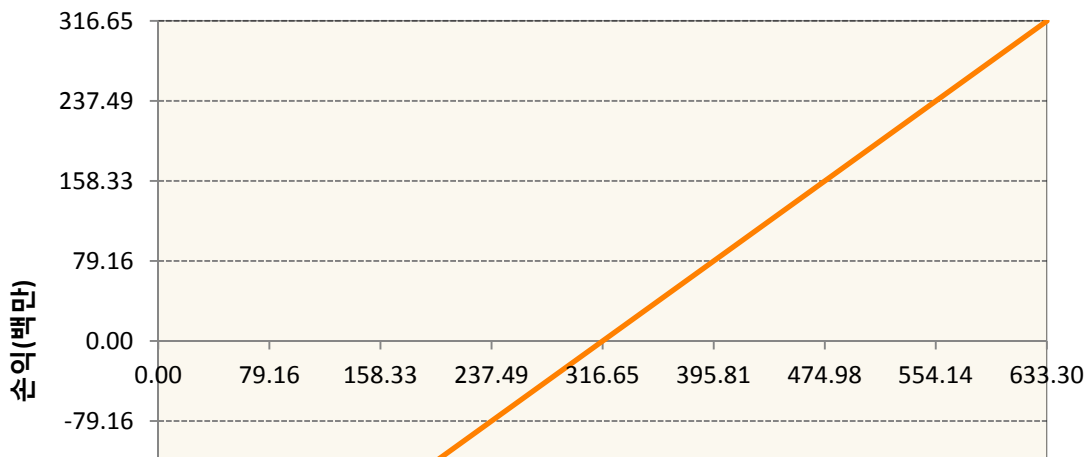
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	317	317	0	장내
누계	유가증권	선물	713	0	713	장내

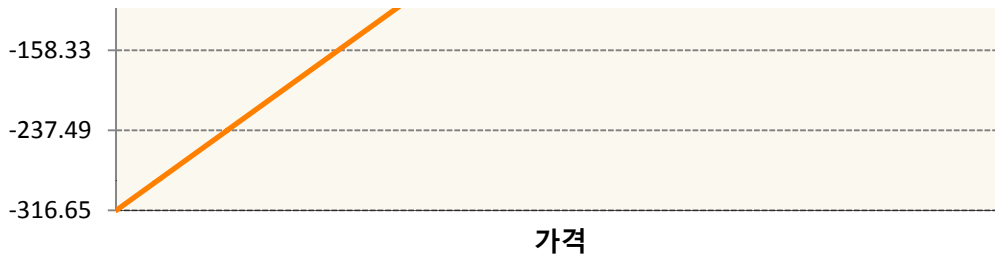
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물



KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)


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

41
----

공시일	2018-06-14
기준일	2018-06-12

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

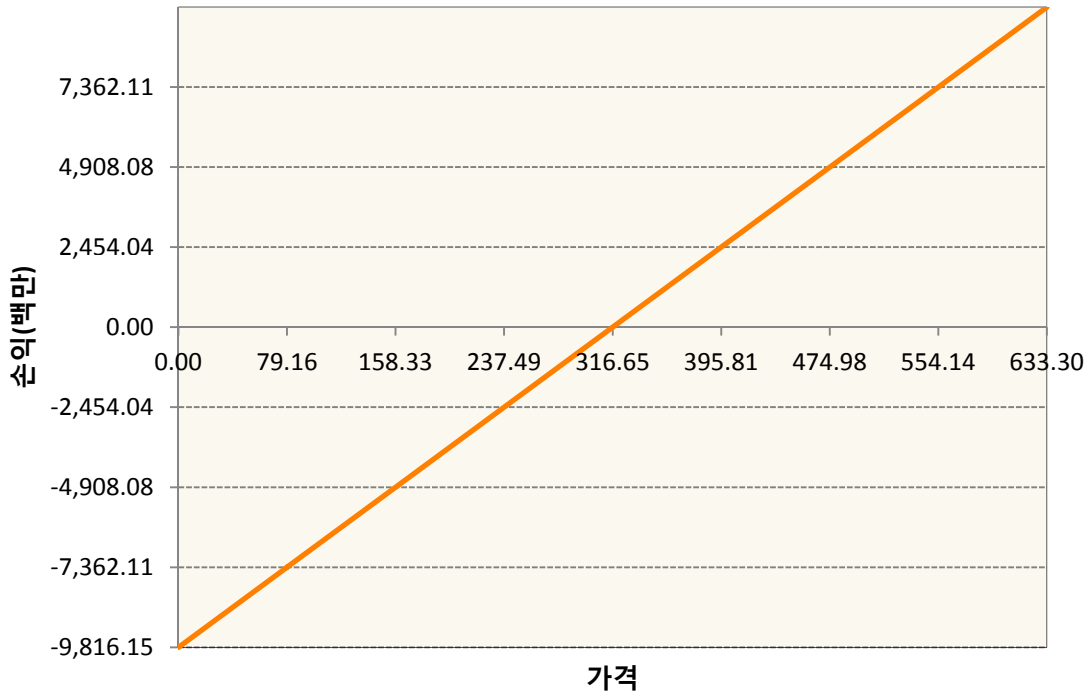
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

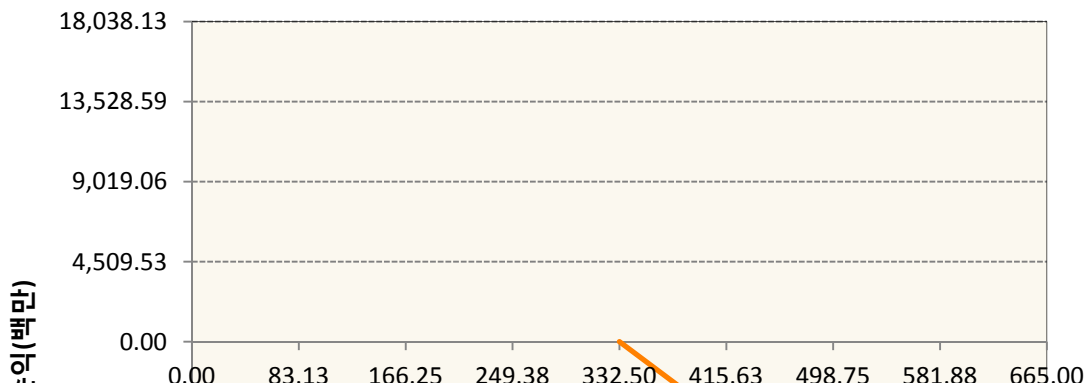
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,816	0	9,816	장내
누계	유가증권	옵션	0	18,038	-18,038	장내

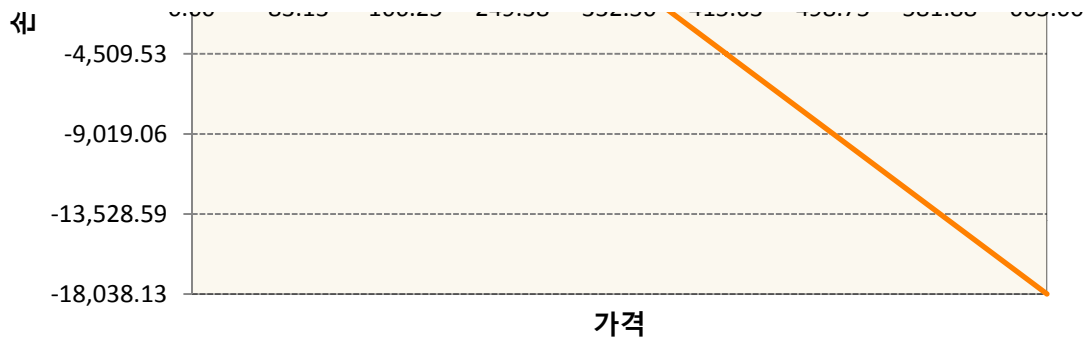
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



KR4201N63324-2018-06 콜332.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)


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

742
-----

공시일	2018-06-14
기준일	2018-06-12

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

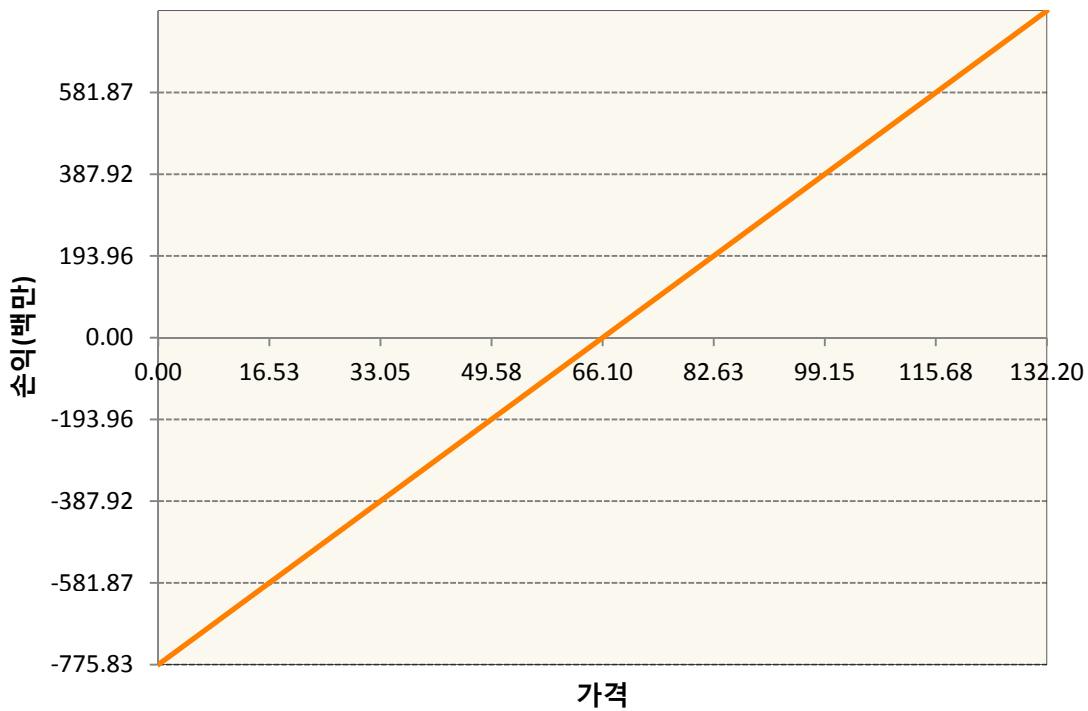
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

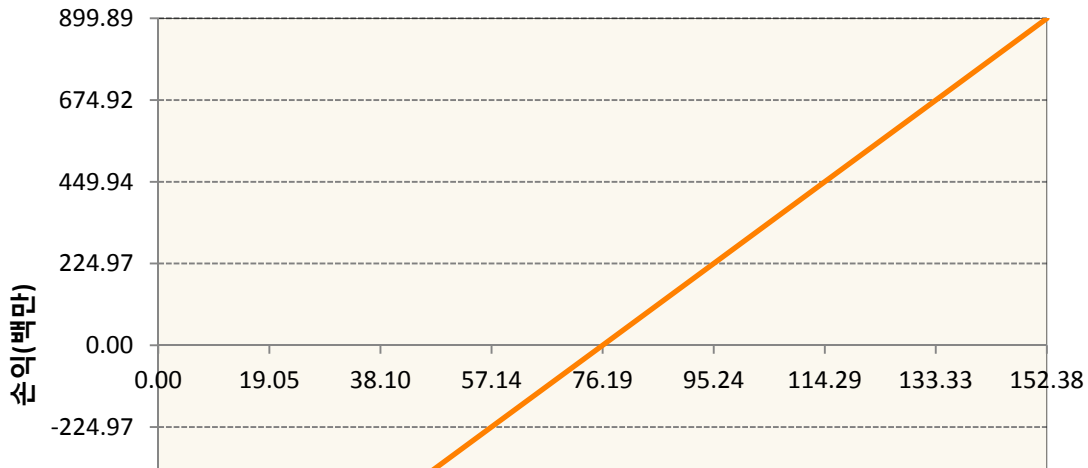
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,828	593	3,235	

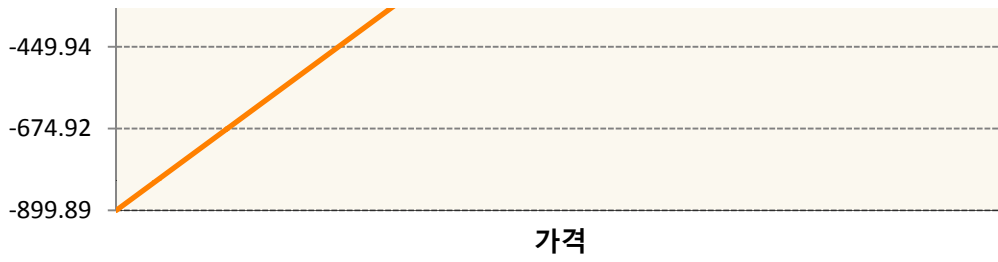
### 2. 만기시점의 손익구조

**CLN8-WTI CRUDE FUTURE JUL18**

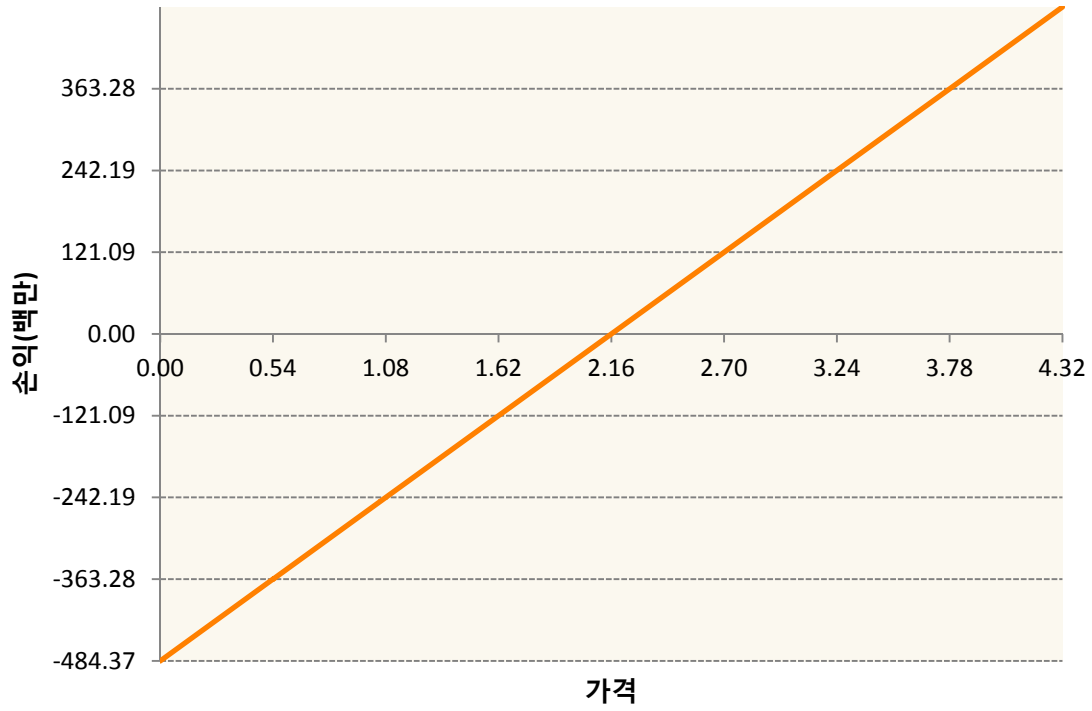


**COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18**

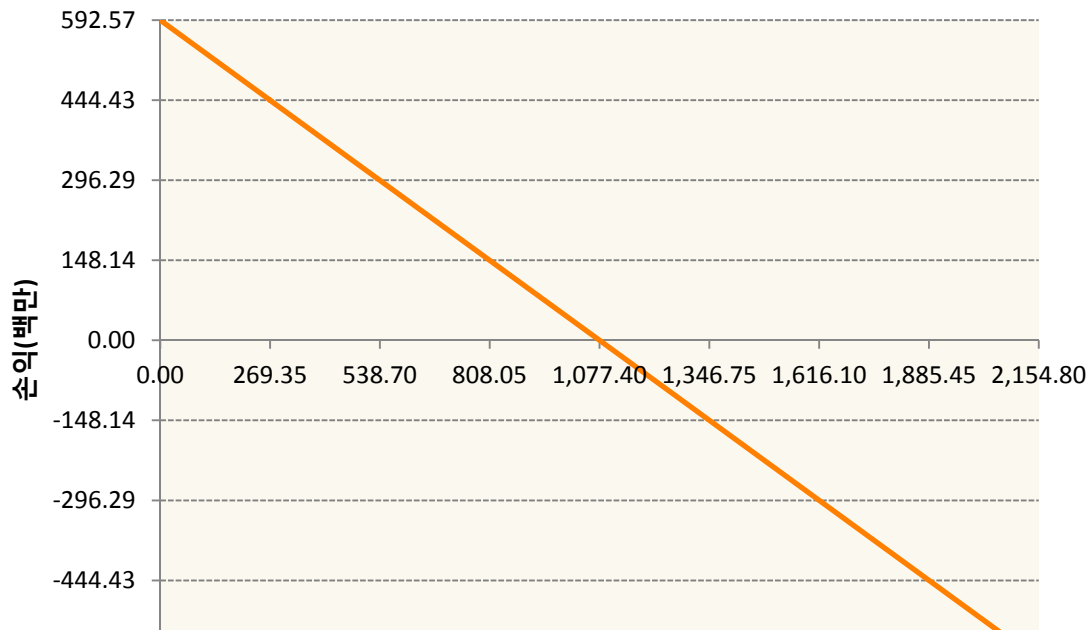


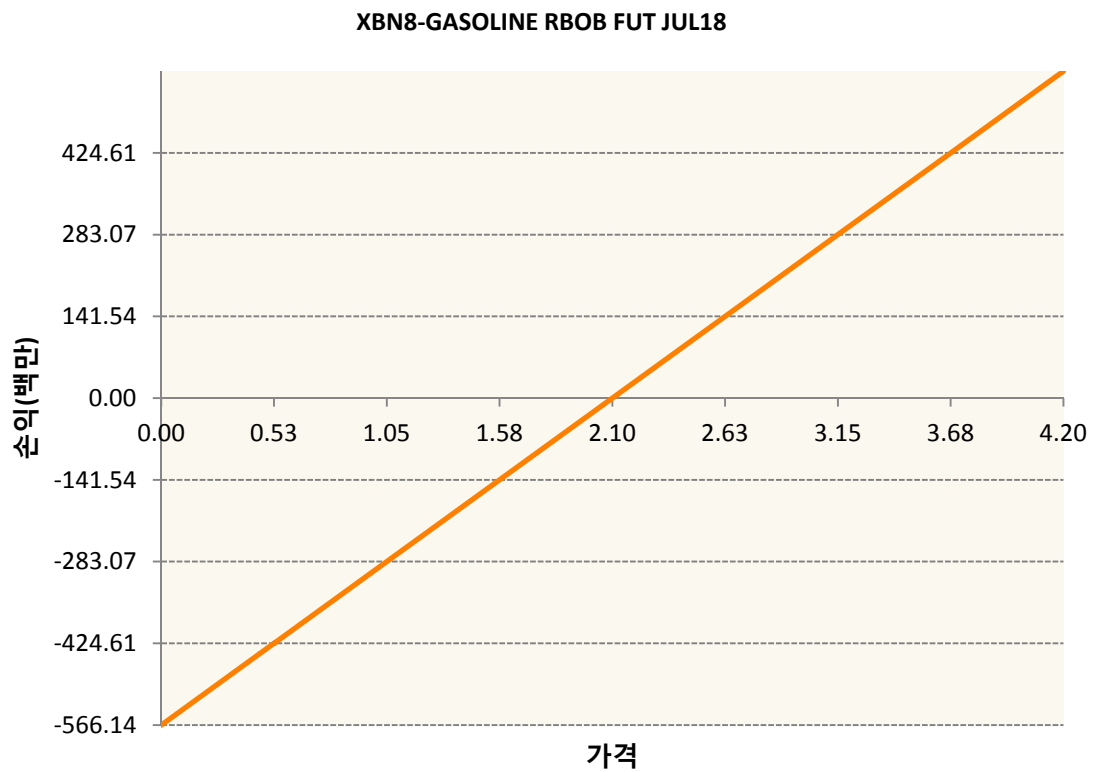
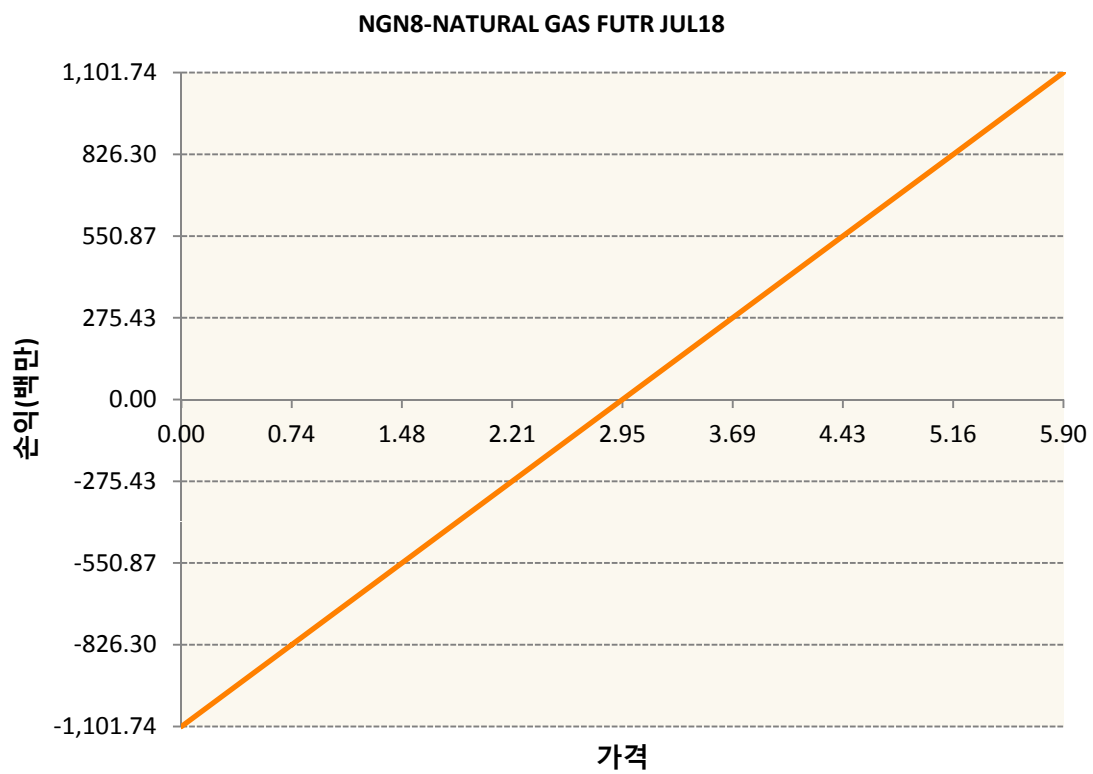
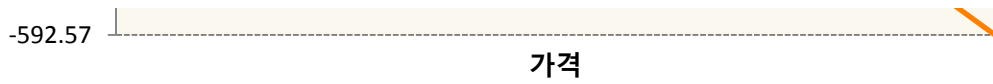


HON8-NY Harb ULSD Fut JUL18



KR4175N60003-2018-06 달러선물





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

CLN8	WTI CRUDE FUTURE JUL18	62
COU8	BRENT CRUDE FUTR SEP18	72
HON8	NY Harb ULSD Fut JUL18	39
KR4175N60C	2018-06 달러선물	47
NGN8	NATURAL GAS FUTR JUL18	88
XBN8	GASOLINE RBOB FUT JUL18	45

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

<b>456</b>
------------

공시일	2018-06-14
기준일	2018-06-12

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

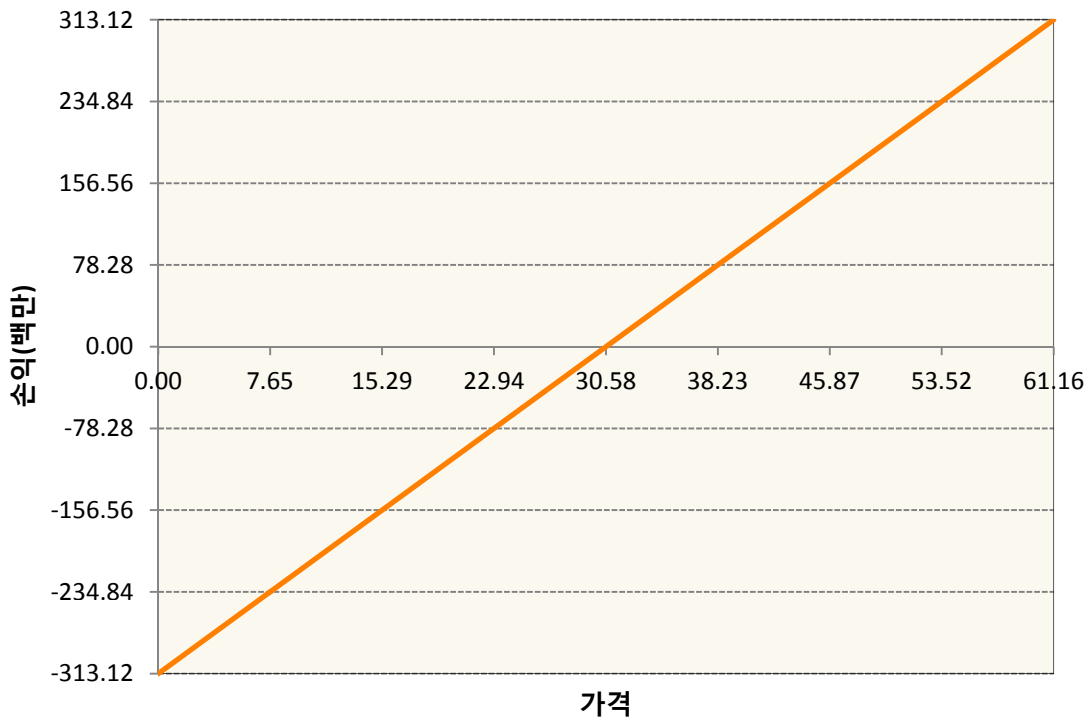
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

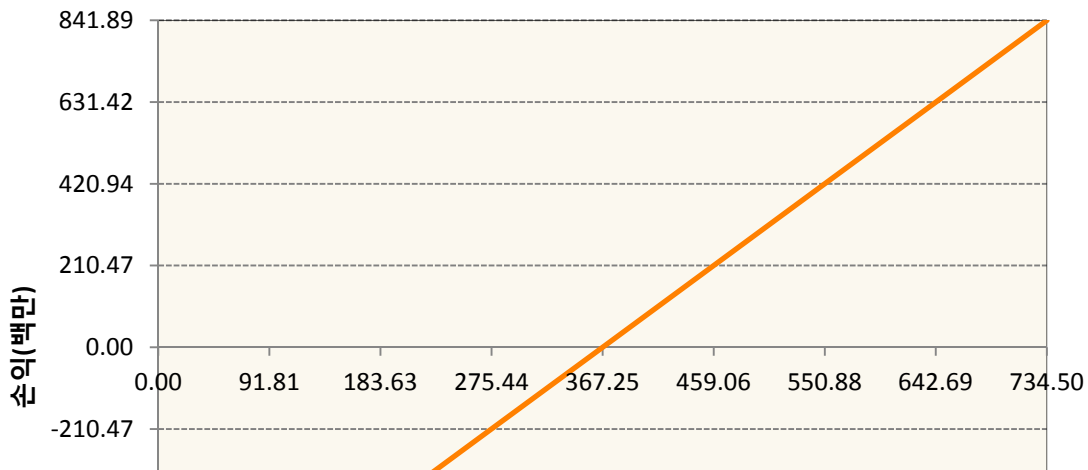
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,959	323	3,635	

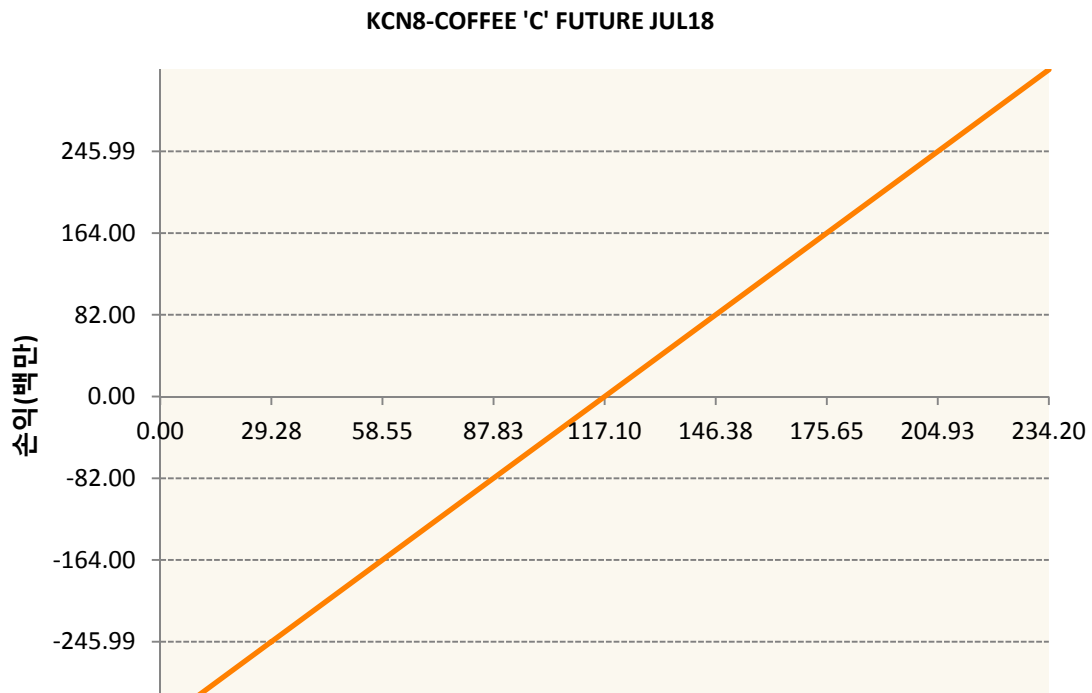
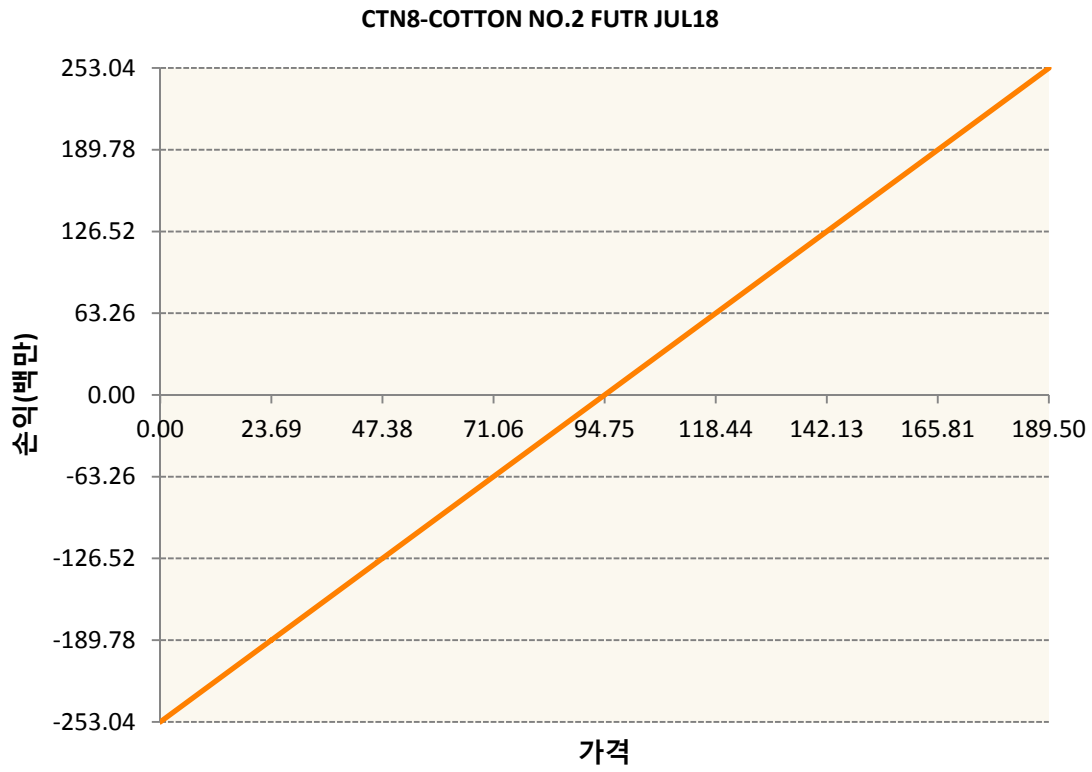
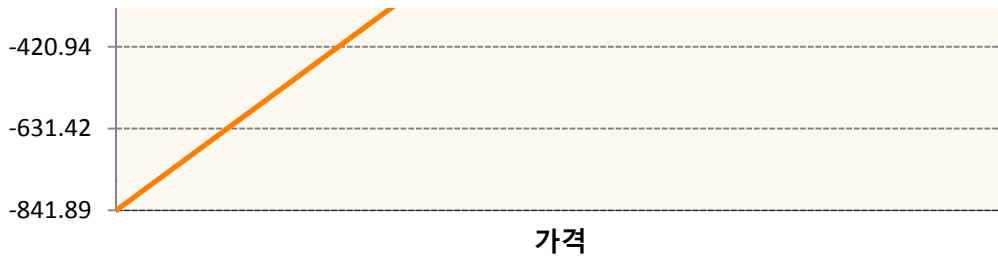
### 2. 만기시점의 손익구조

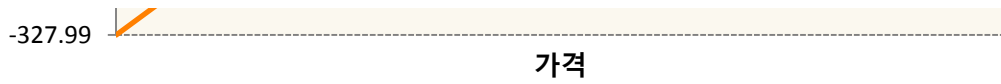
**BON8-SOYBEAN OIL FUTR JUL18**



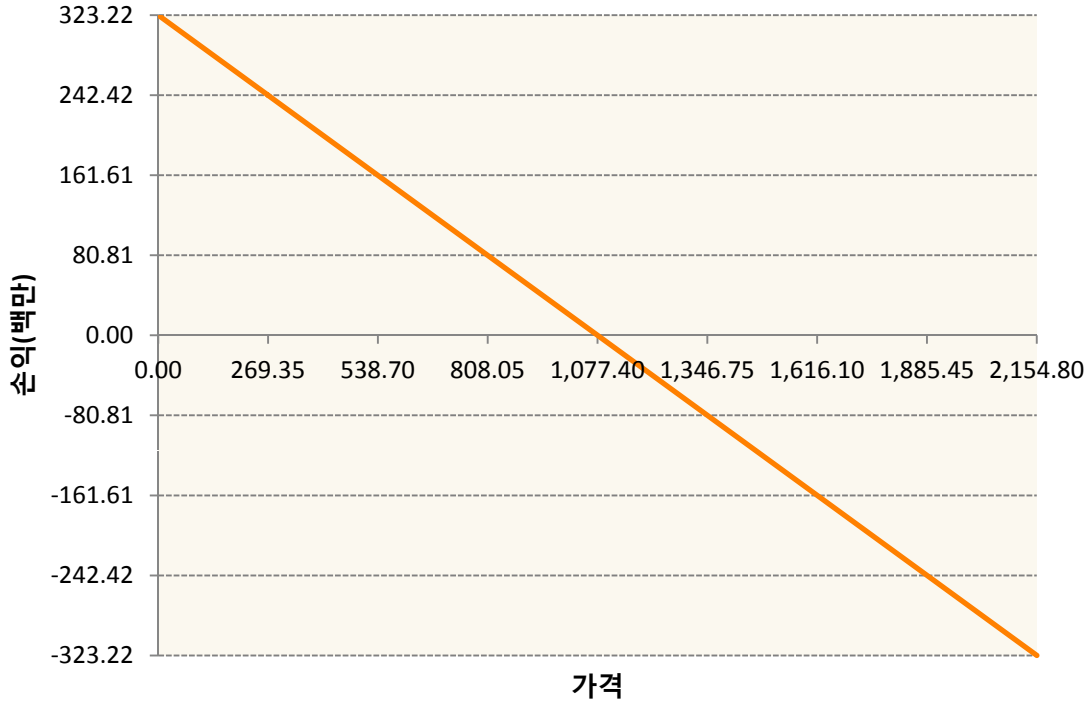
**CN8-CORN FUTURE JUL18**



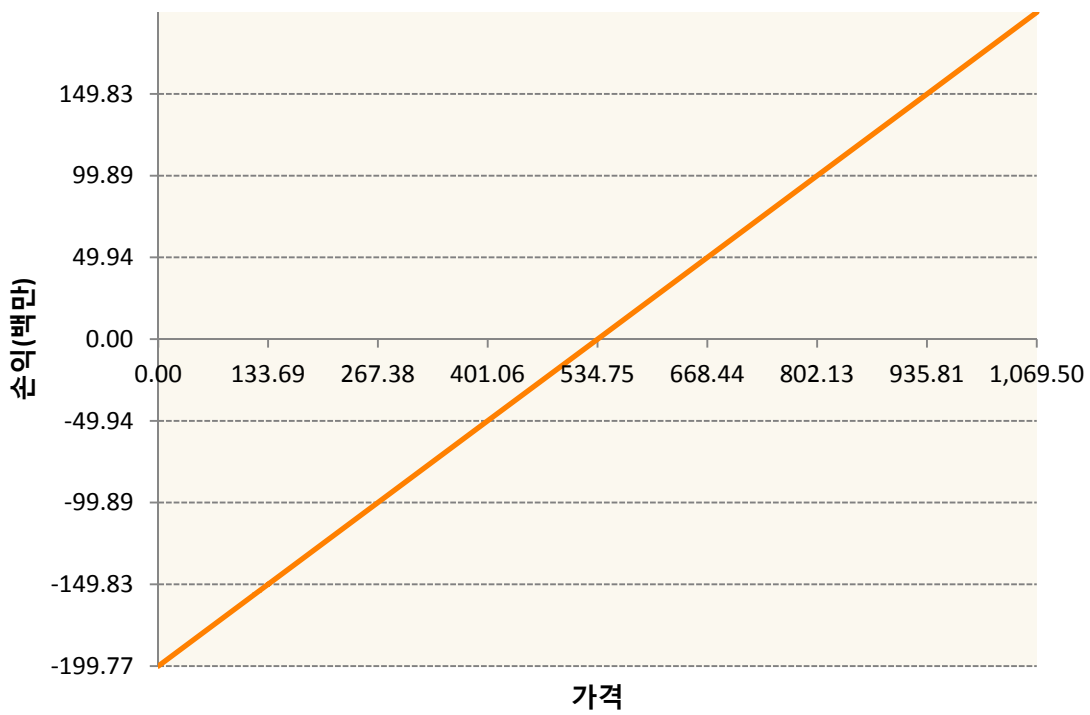




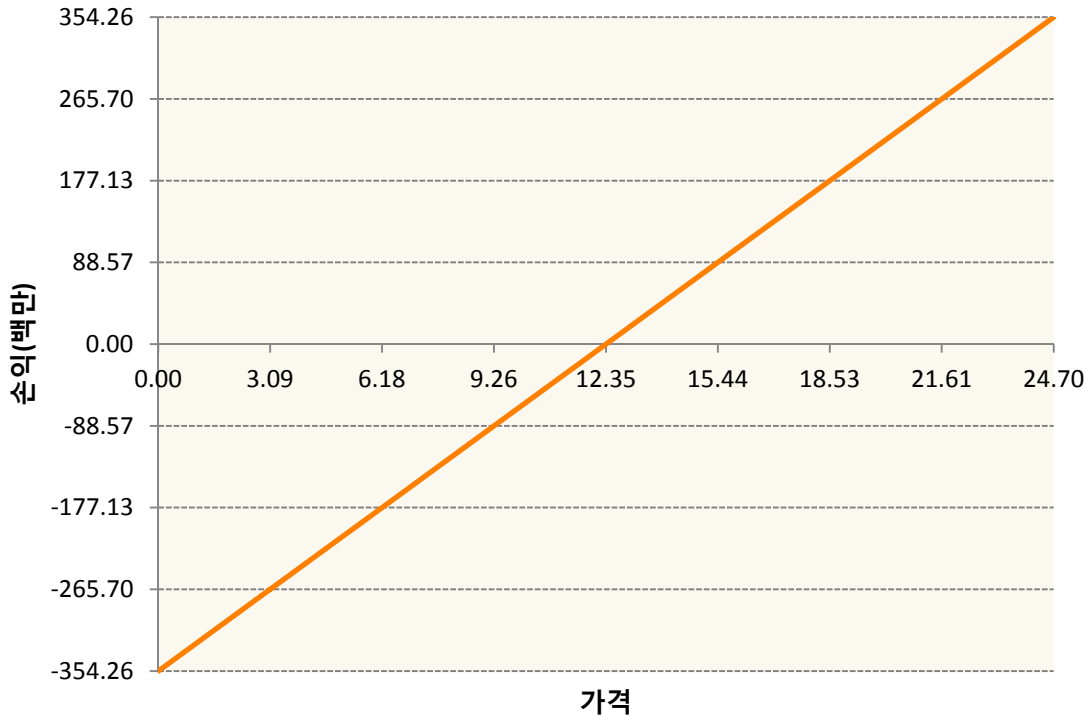
KR4175N60003-2018-06 달러선물



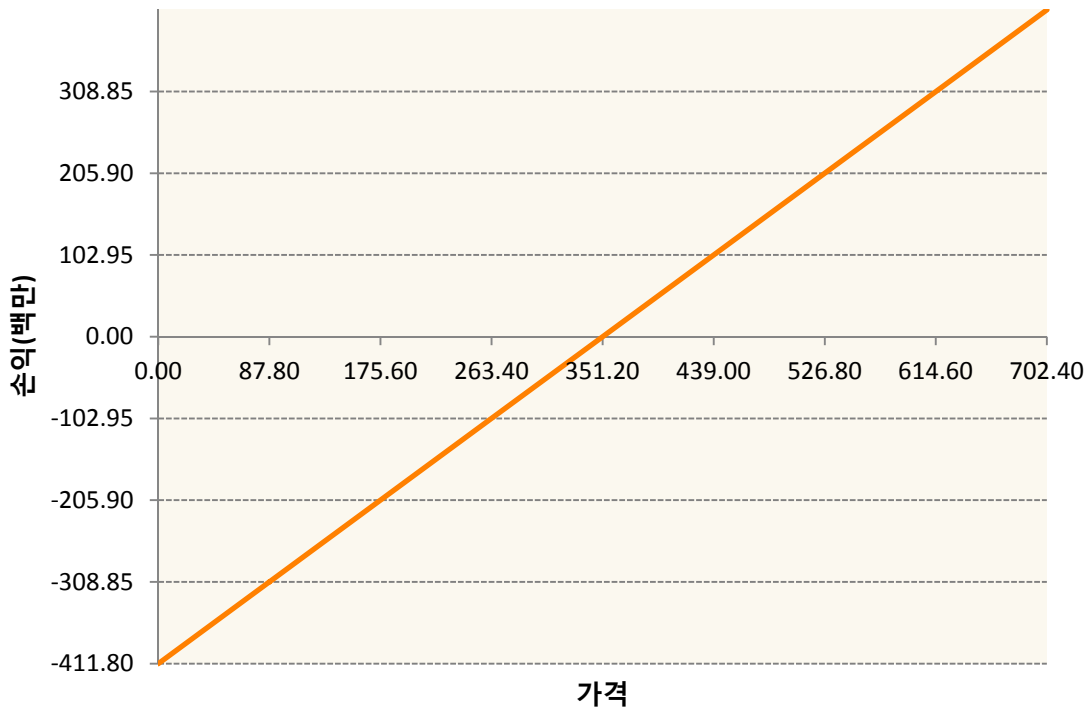
KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18



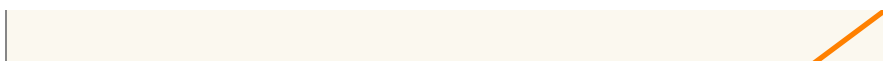
SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18

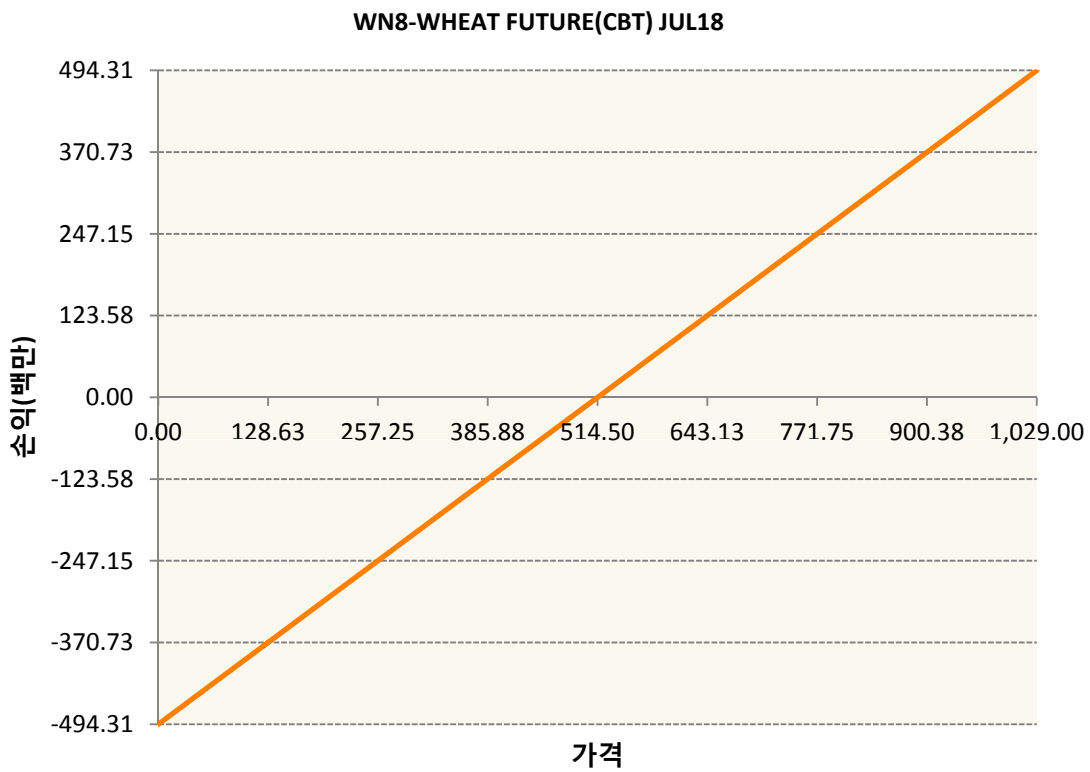
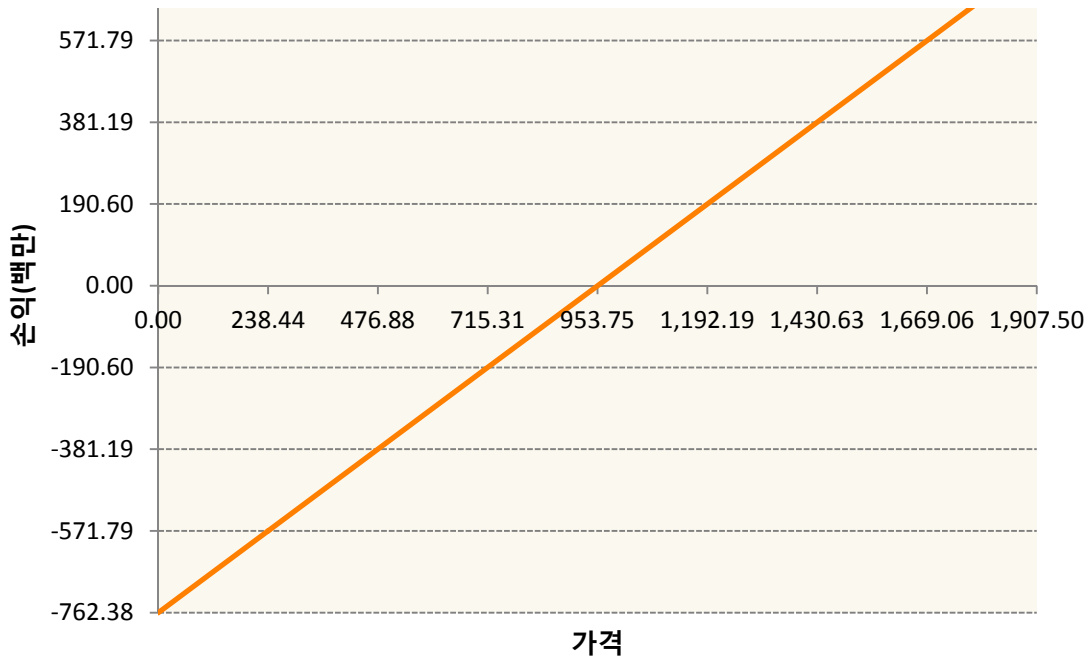


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18



SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BON8	SOYBEAN OIL FUTR JUL18	25
CN8	CORN FUTURE JUL18	67
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	33
SN8	SOYBEAN FUTURE JUL18	61
WN8	WHEAT FUTURE(CBT) JUL18	40

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

(단위:백만원)

**325**