

공시일	2018-06-15
기준일	2018-06-14

## 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	2018-06-15
기준일	2018-06-14

## 스마트인덱스모

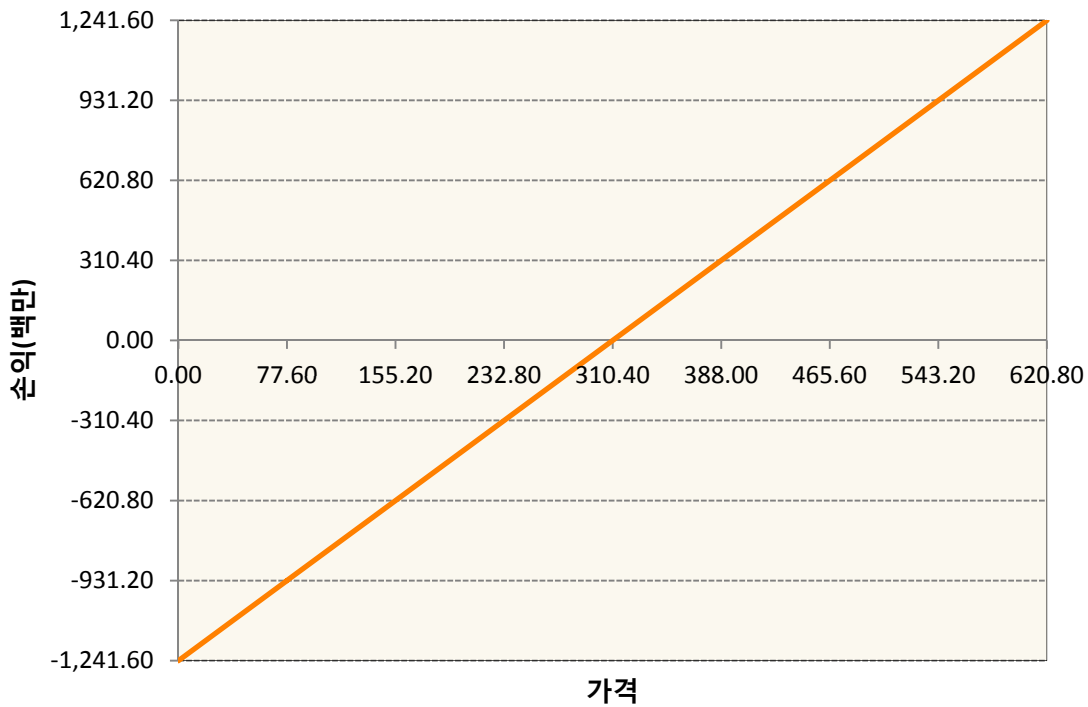
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	548	0	548	장내
누계	유가증권	선물	1,242	0	1,242	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

(단위:백만원)

공시일	2018-06-15
기준일	2018-06-14

## 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

1,131

\* 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	2018-06-15
기준일	2018-06-14

## 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

370

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

399

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-06-15
기준일	2018-06-14

## 유로인덱스모(주식-파생형)

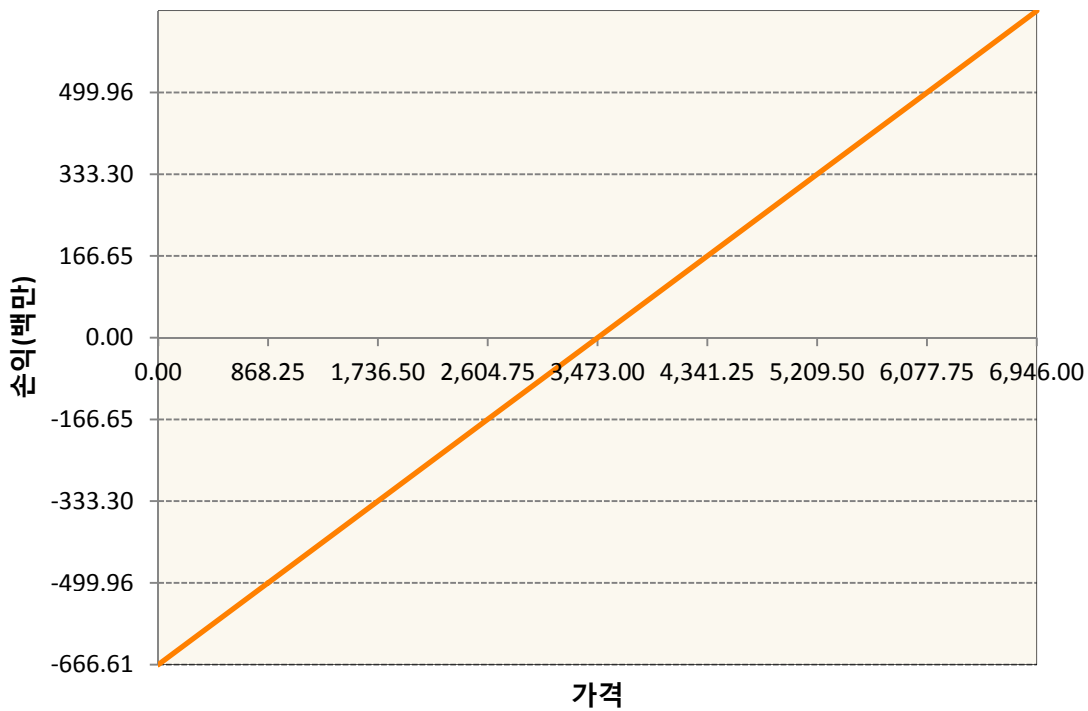
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	667	0	667	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGU8-EURO STOXXX 50 SEP18



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU8	EURO STOXXX 50 SEP18	53
------	----------------------	----

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

(단위:백만원)

32
----

공시일	2018-06-15
기준일	2018-06-14

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

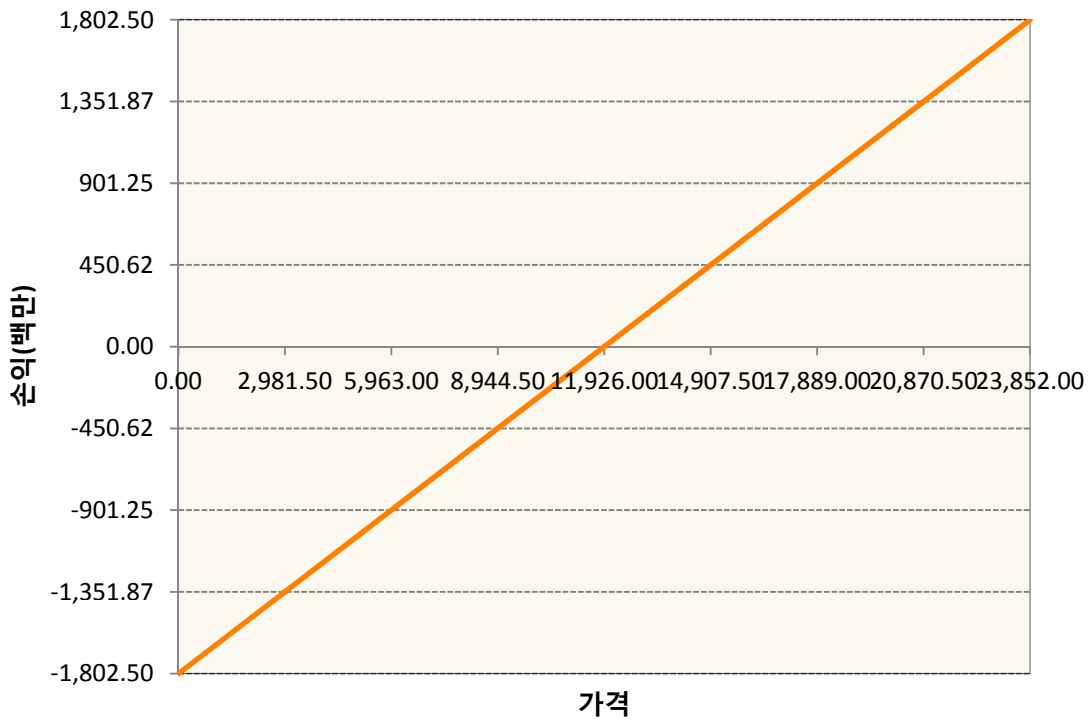
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

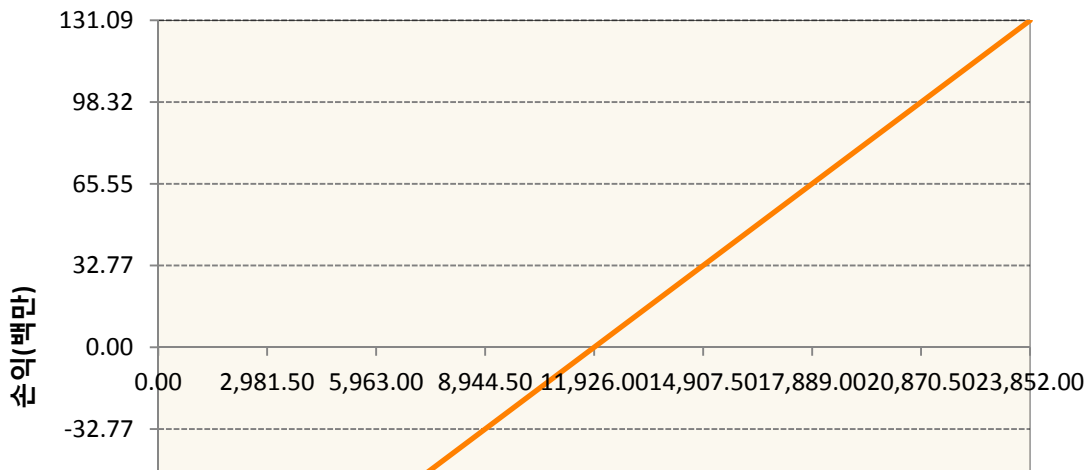
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,934	0	1,934	장내

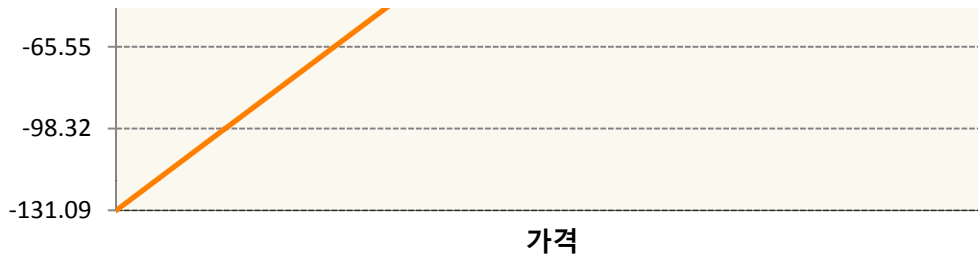
### 2. 만기시점의 손익구조

HCM8-HSCEI Futures Jun18



MHCM8-MINI H-SHR IDX FU Jun18





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

HCM8	HSCEI Futures Jun18	144
MHCM8	MINI H-SHR IDX FU Jun18	10

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

<b>137</b>
------------

공시일	2018-06-15
기준일	2018-06-14

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

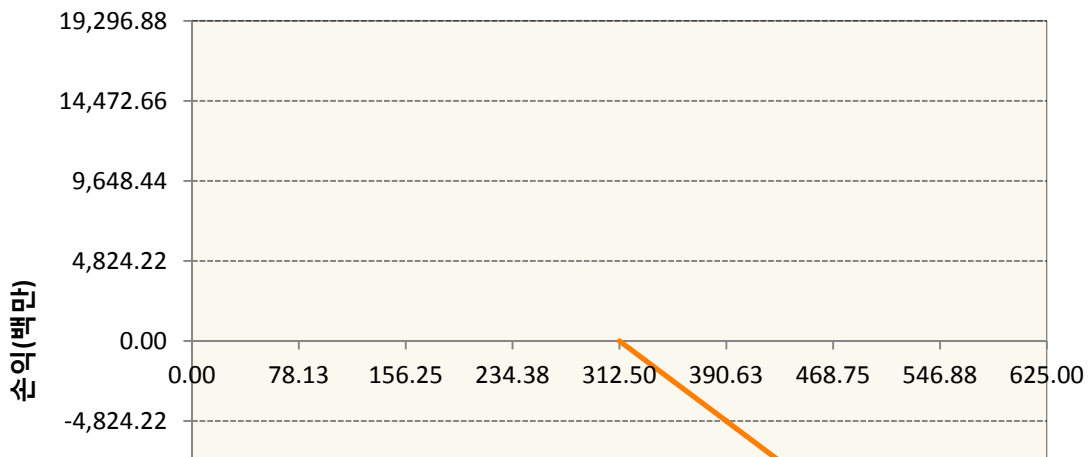
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	106,149	-106,149	장내
누계	유가증권	옵션	0	120,939	-120,939	장내

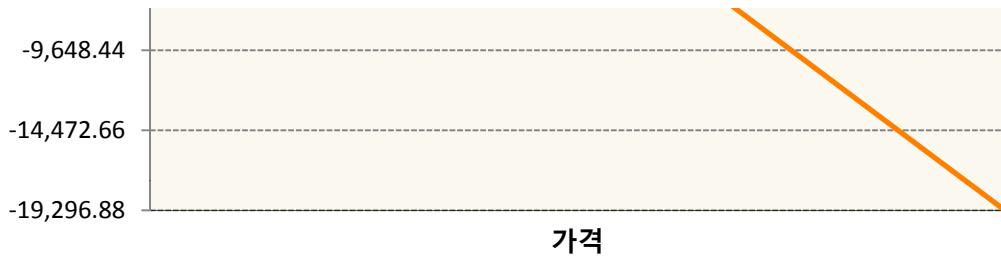
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201N73109-2018-07 콜310**

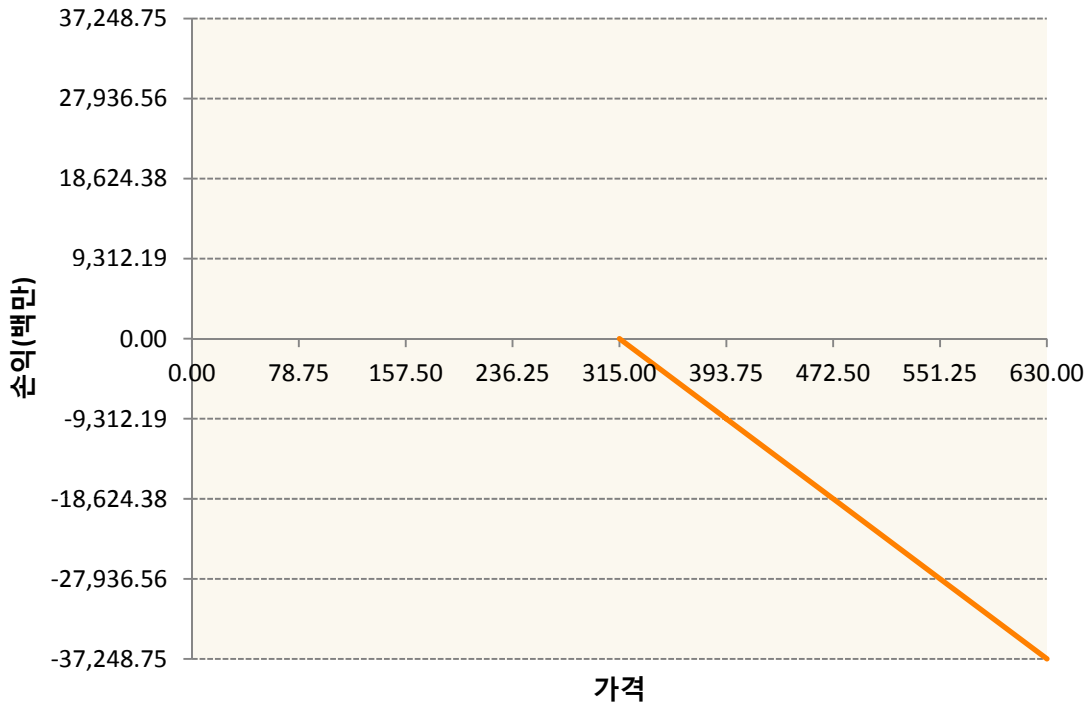


**KR4201N73125-2018-07 콜312.5**

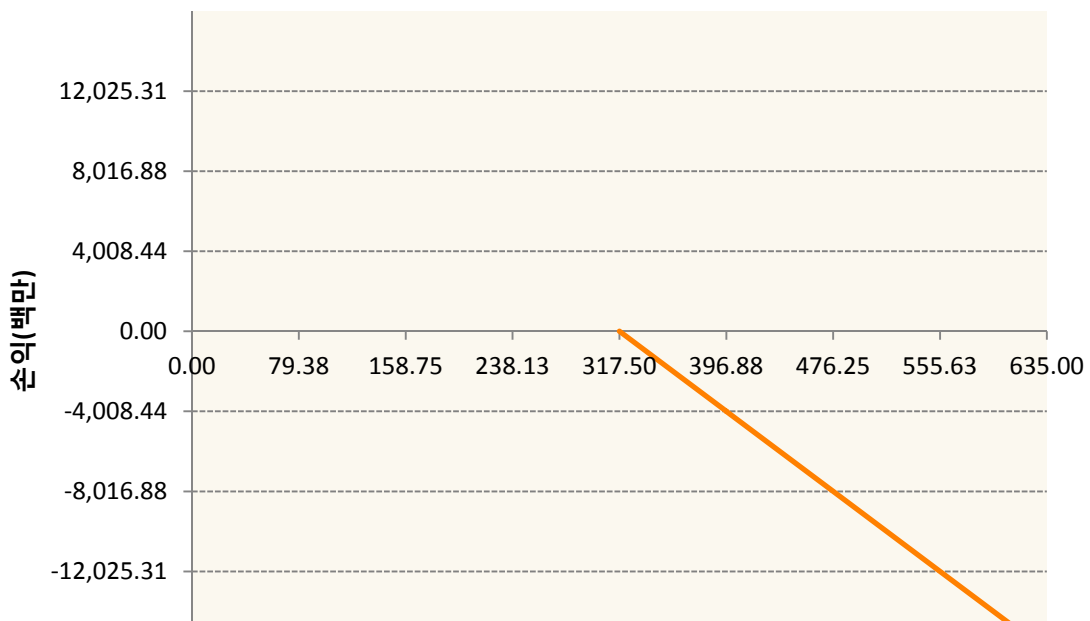


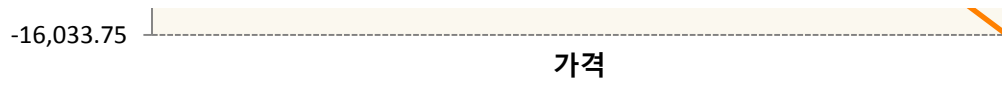


**KR4201N73158-2018-07 콜315**



**KR4201N73174-2018-07 콜317.5**





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


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

<b>6,626</b>
--------------

공시일	2018-06-15
기준일	2018-06-14

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

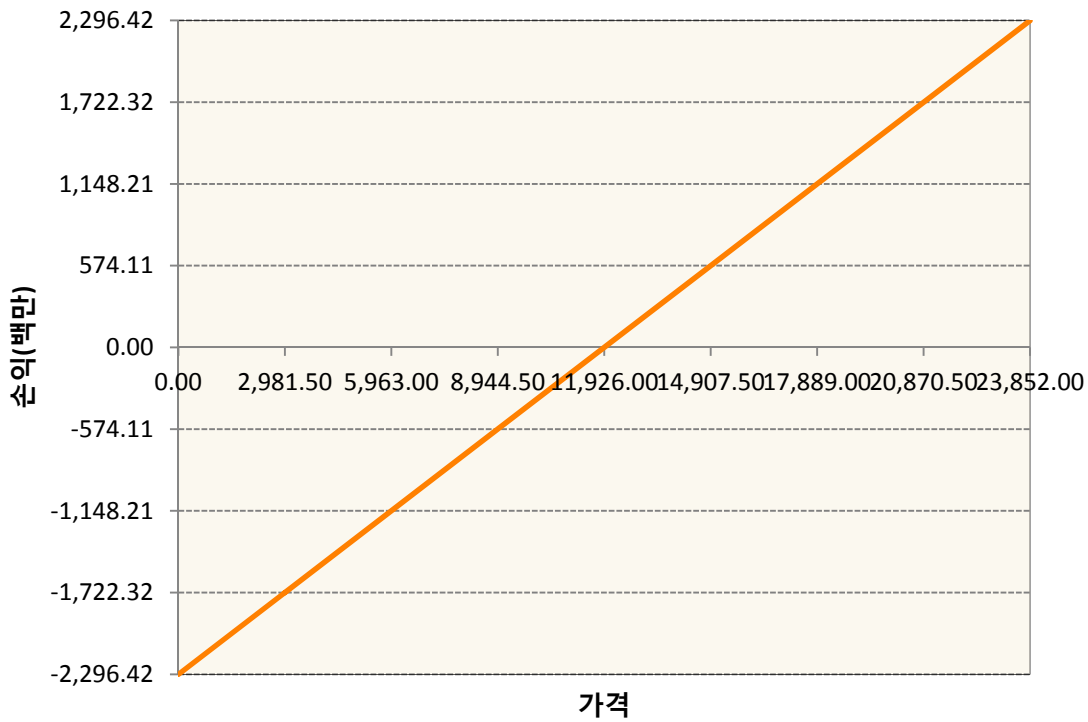
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

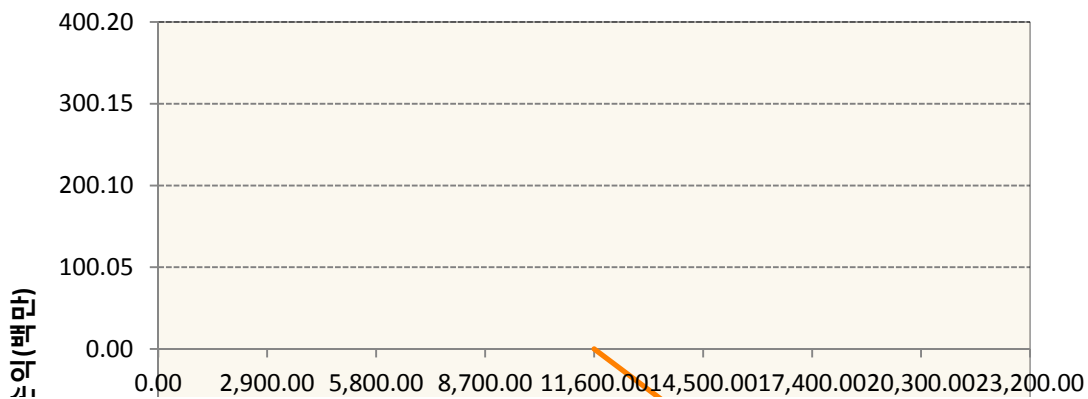
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,296	0	2,296	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,848	-5,848	장내

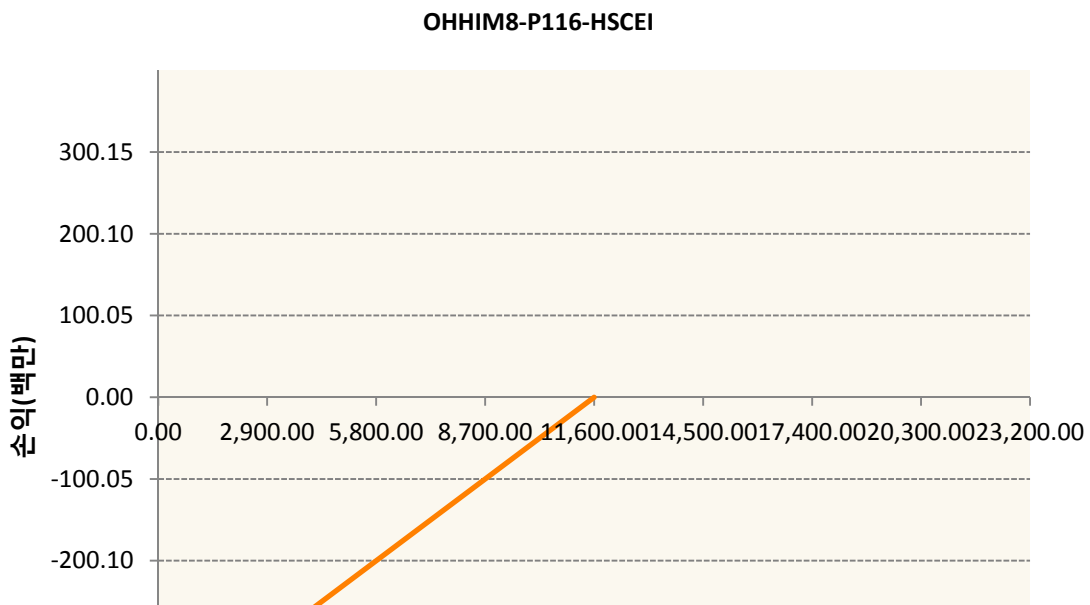
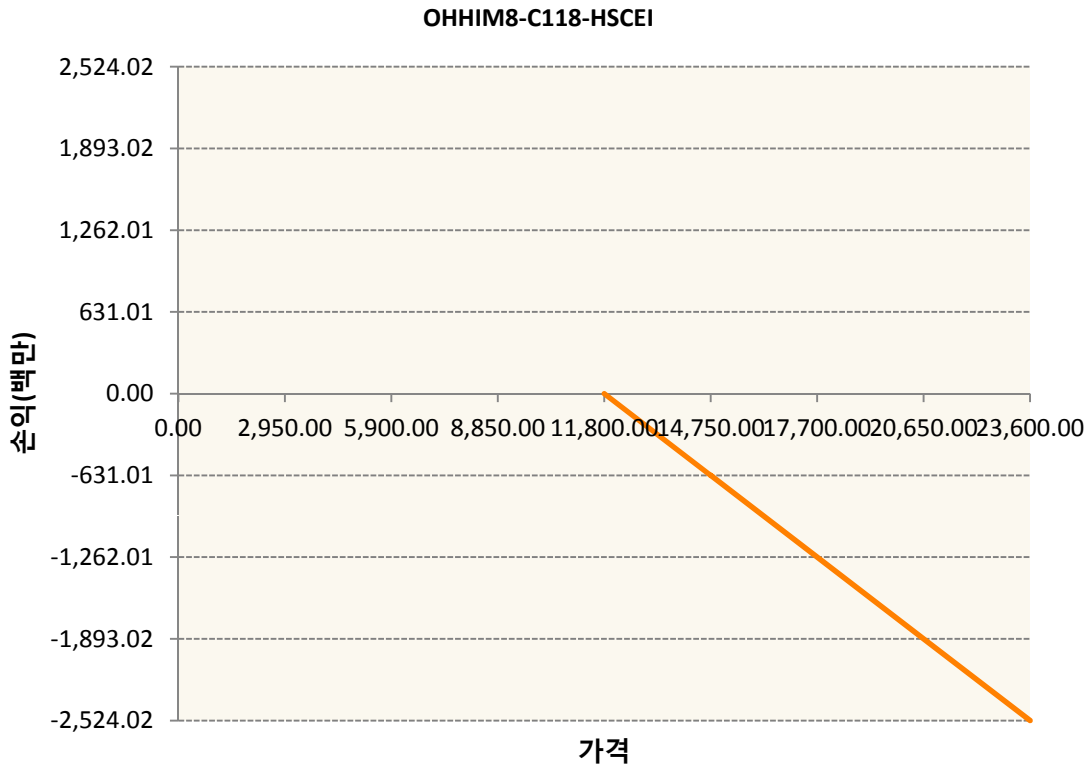
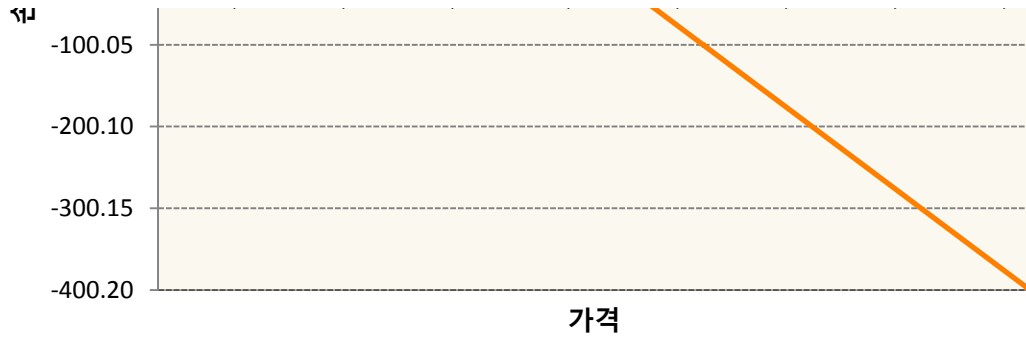
### 2. 만기시점의 손익구조

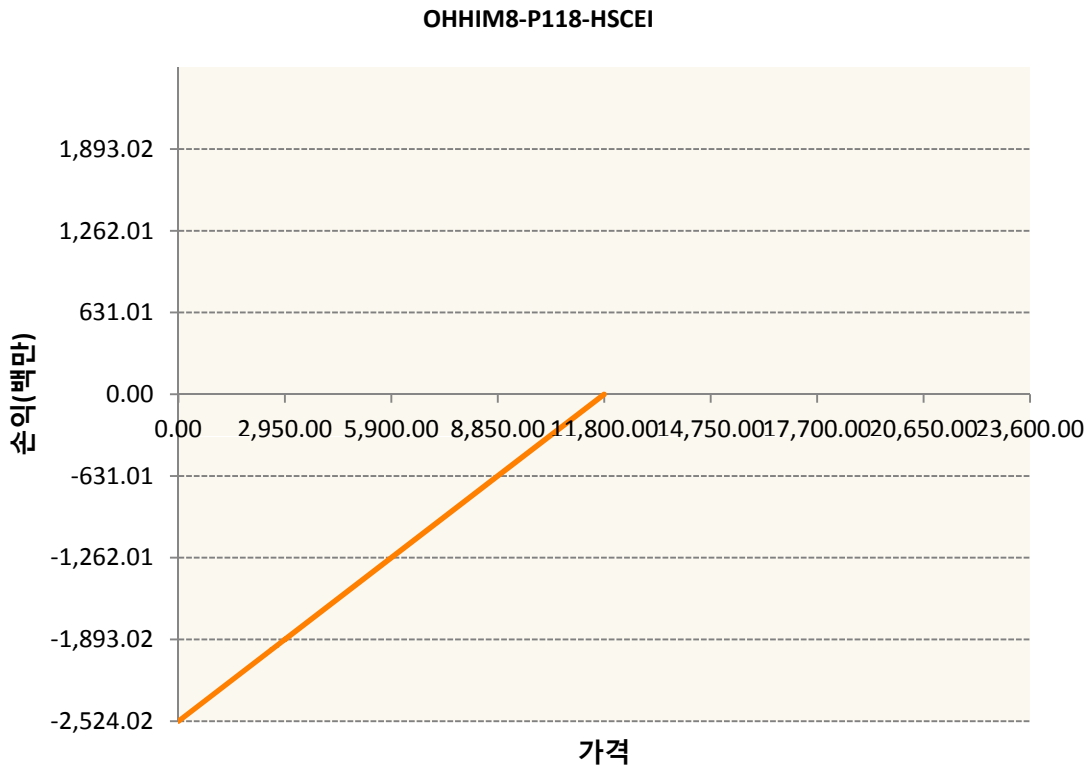
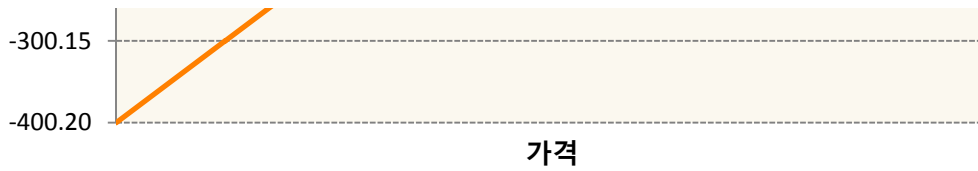
HCM8-HSCEI Futures Jun18



OHHIM8-C116-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCM8	HSCEI Futures Jun18	184
OHHIM8-C1	HSCEI	32
OHHIM8-C1	HSCEI	202
OHHIM8-P1	HSCEI	32
OHHIM8-P1	HSCEI	202

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	577



2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7							257
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-257	-257	-257	-257	-257	-257	-257
-5.33%	-171	-171	-171	-171	-171	-171	-171
-2.67%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	86	86	86	86	86	86	86
5.33%	171	171	171	171	171	171	171
8.00%	257	257	257	257	257	257	257

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8							475
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-475	-475	-475	-475	-475	-475	-475
-5.33%	-317	-317	-317	-317	-317	-317	-317
-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%	317	317	317	317	317	317	317
8.00%	475	475	475	475	475	475	475

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11							642
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-642	-642	-642	-642	-642	-642	-642
-5.33%	-428	-428	-428	-428	-428	-428	-428
-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%	428	428	428	428	428	428	428
8.00%	642	642	642	642	642	642	642

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)

**3,861**

공시일	2018-06-15
기준일	2018-06-14

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

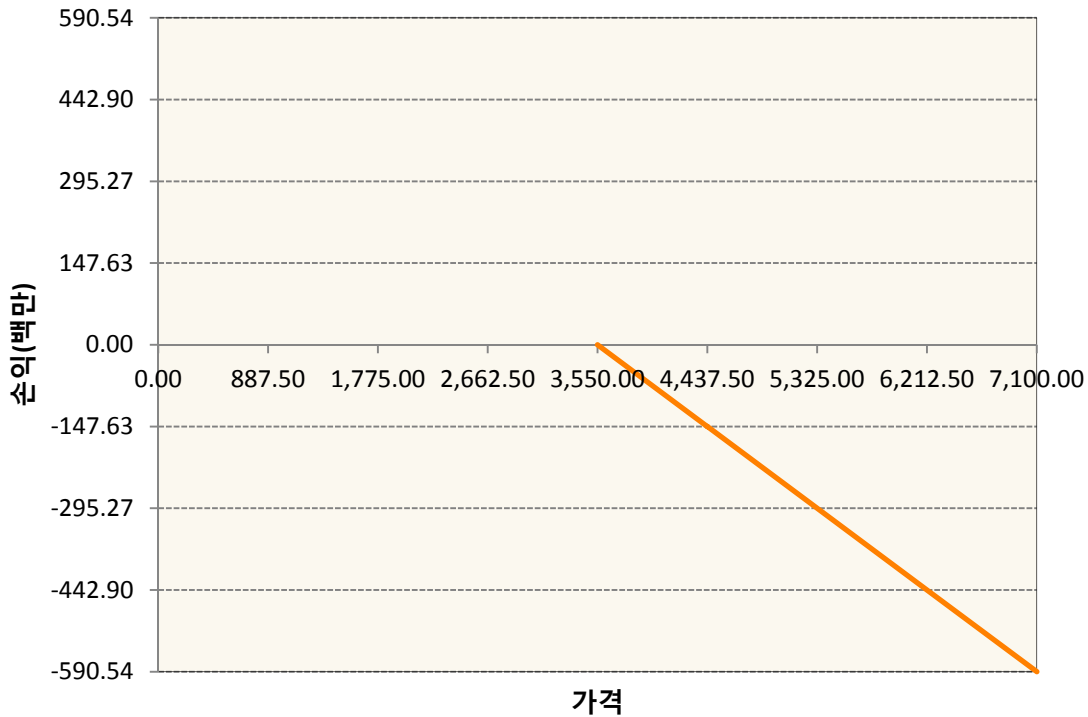
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

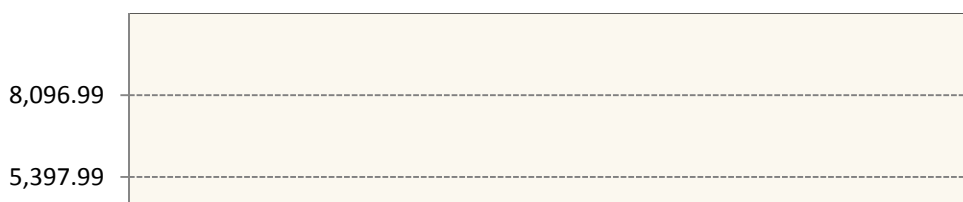
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,064	0	3,064	
누계	유가증권	스왑	53,950	0	53,950	장외
누계	유가증권	옵션	0	22,773	-22,773	장내
누계	지수	스왑	51,186	0	51,186	장외

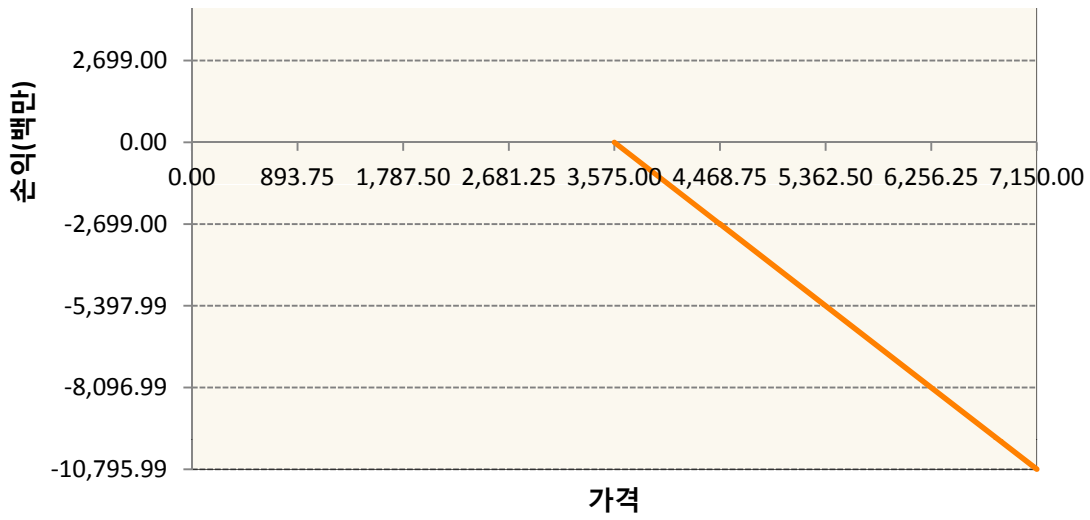
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXM8-C3550-EURO STOXX 50**

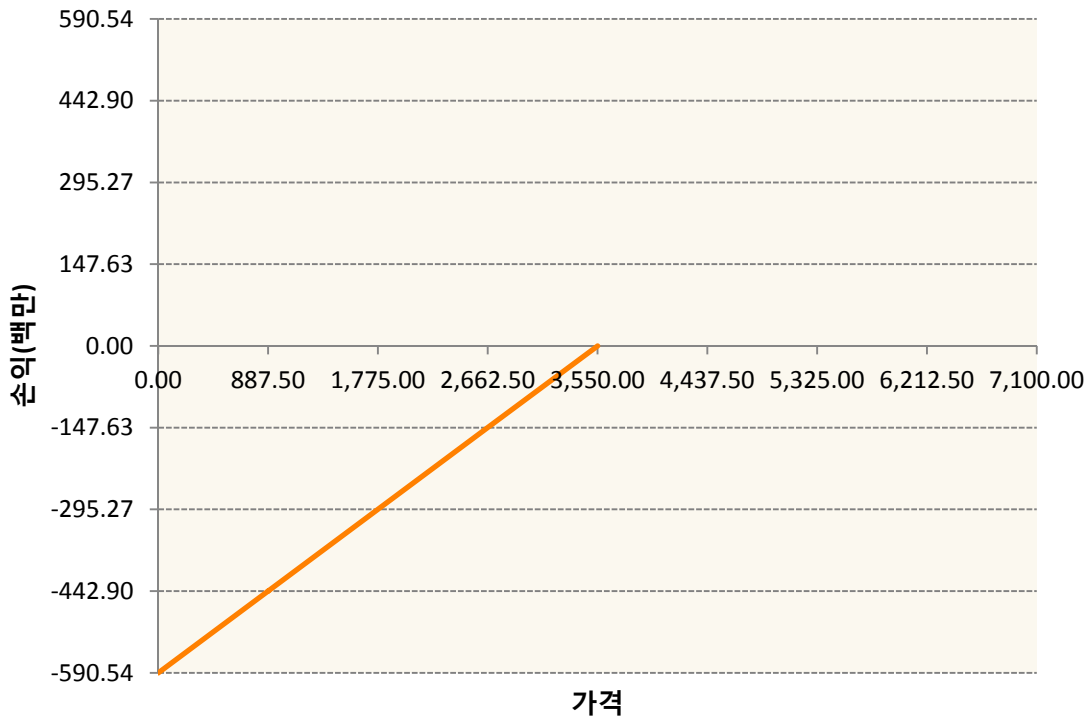


**OESXM8-C3575-EURO STOXX 50**

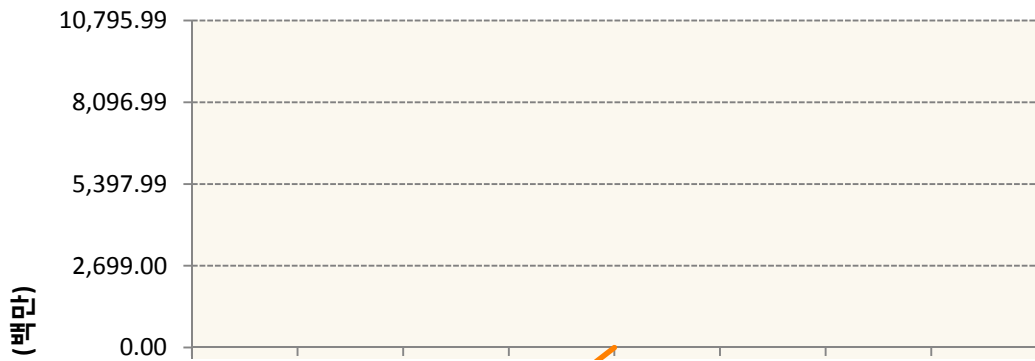


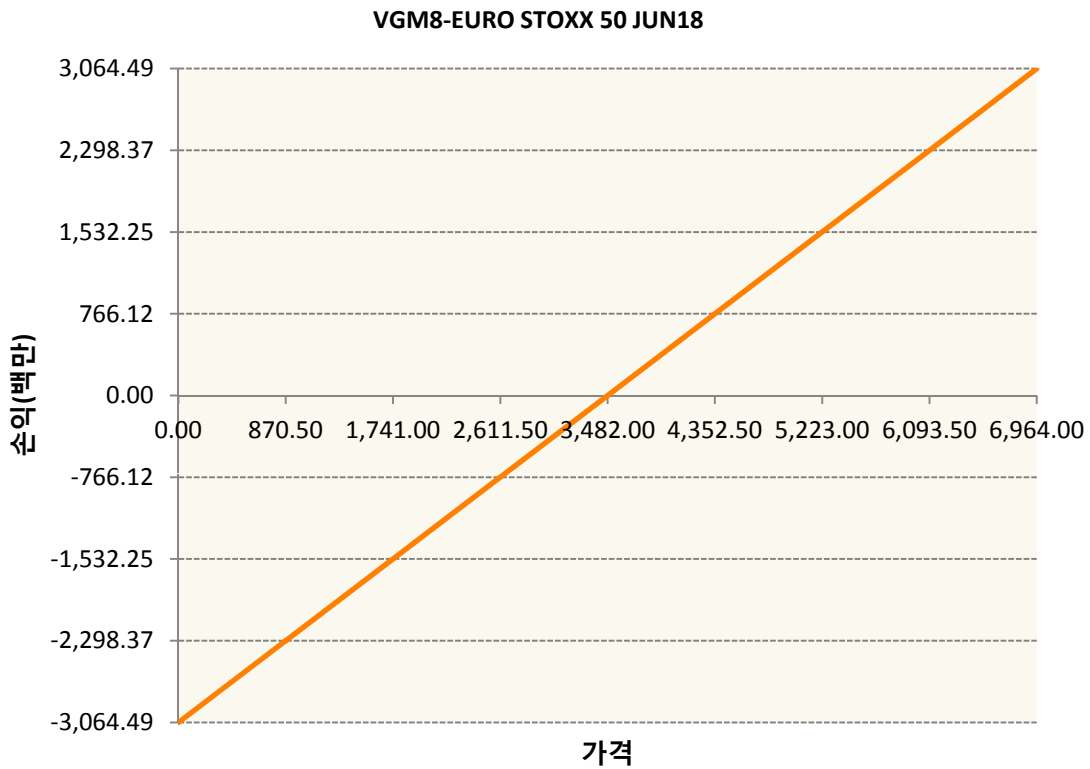
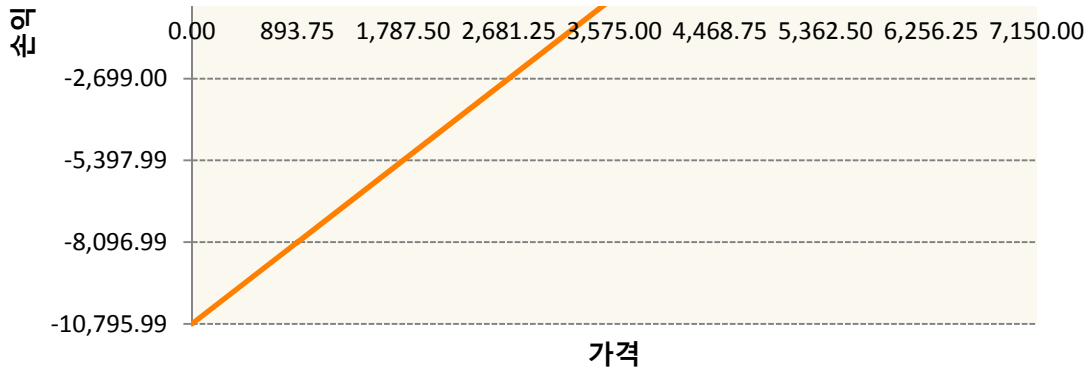


OESXM8-P3550-EURO STOXX 50



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		47
OESXM8-C3 EURO STOXX 50		864
OESXM8-P3! EURO STOXX 50		47
OESXM8-P3! EURO STOXX 50		864
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18		245

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



공시일	2018-06-15
기준일	2018-06-14

## ETF스마트레버리지목표전환형8호

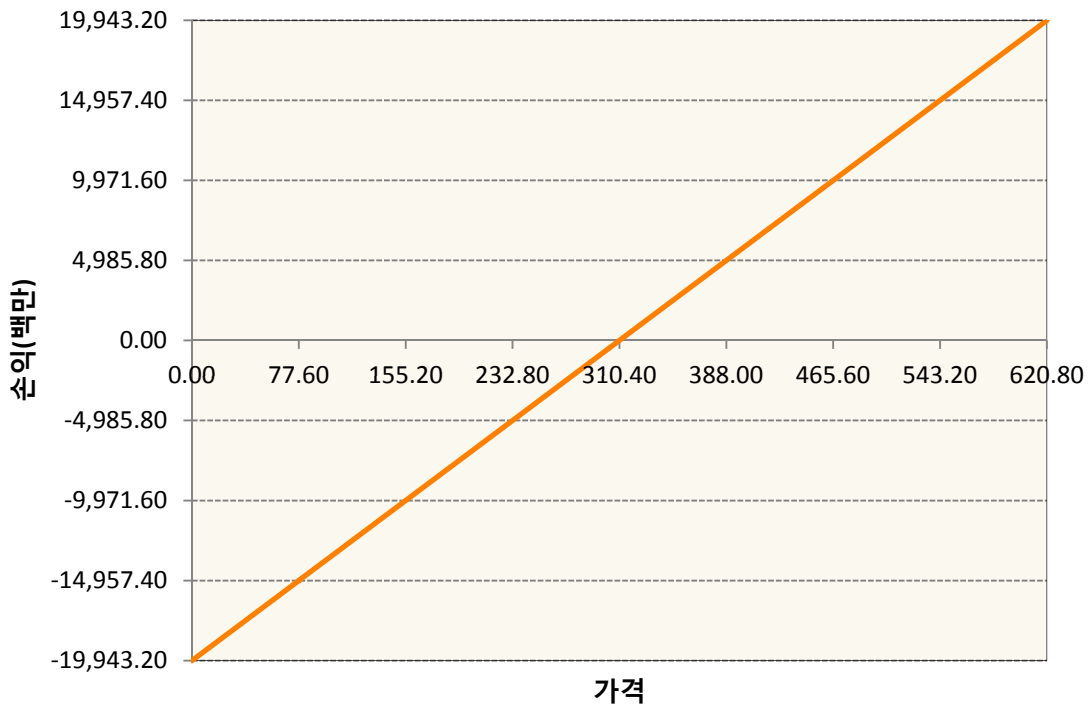
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	10,090	0	10,090	장내
누계	유가증권	선물	19,943	0	19,943	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

(단위:백만원)

공시일	2018-06-15
기준일	2018-06-14

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

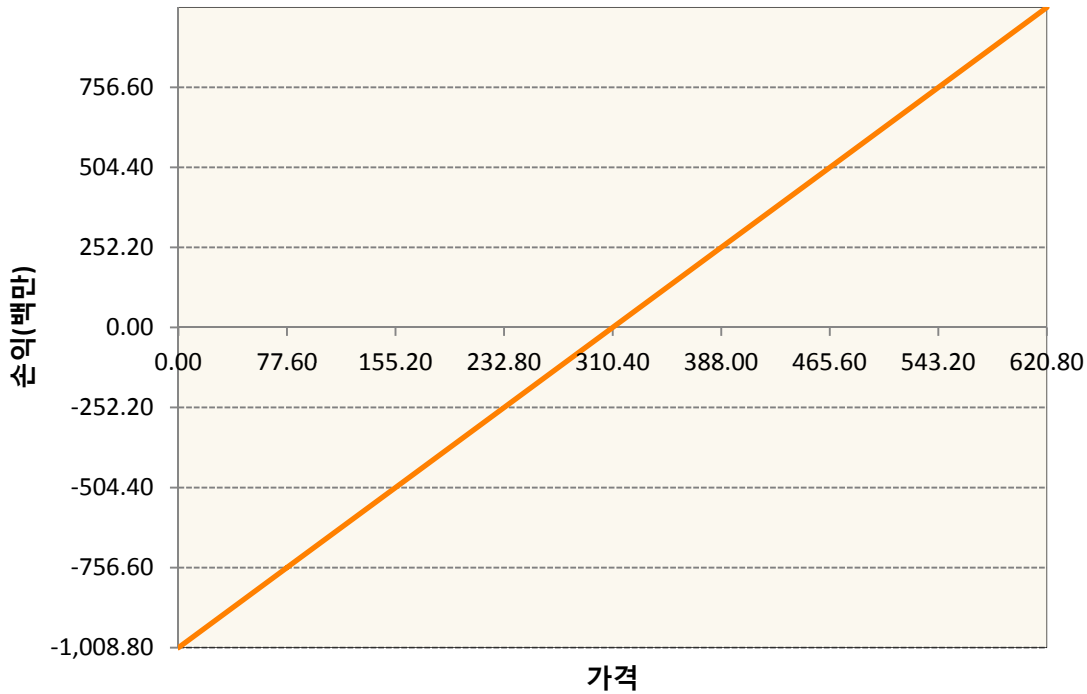
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	548	0	548	장내
누계	유가증권	선물	1,009	0	1,009	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

(단위:백만원)

공시일	2018-06-15
기준일	2018-06-14

## ETF스마트레버리지목표전환형10

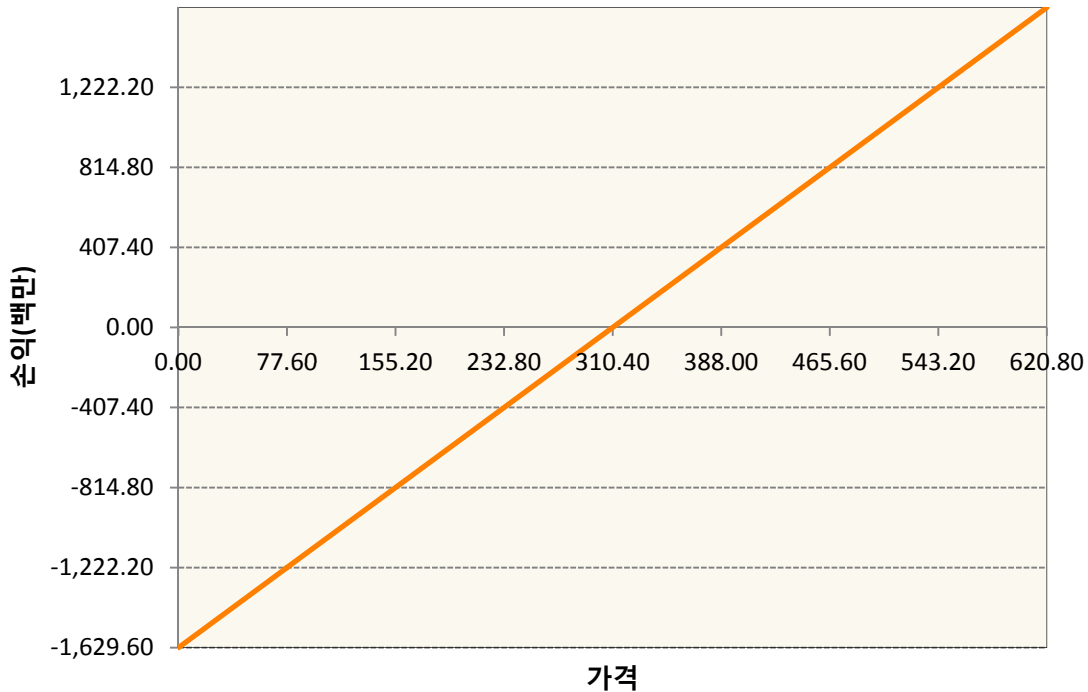
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	860	0	860	장내
누계	유가증권	선물	1,630	0	1,630	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

(단위:백만원)

공시일	2018-06-15
기준일	2018-06-14

## 스마트KRX300인덱스1호(주식-파)

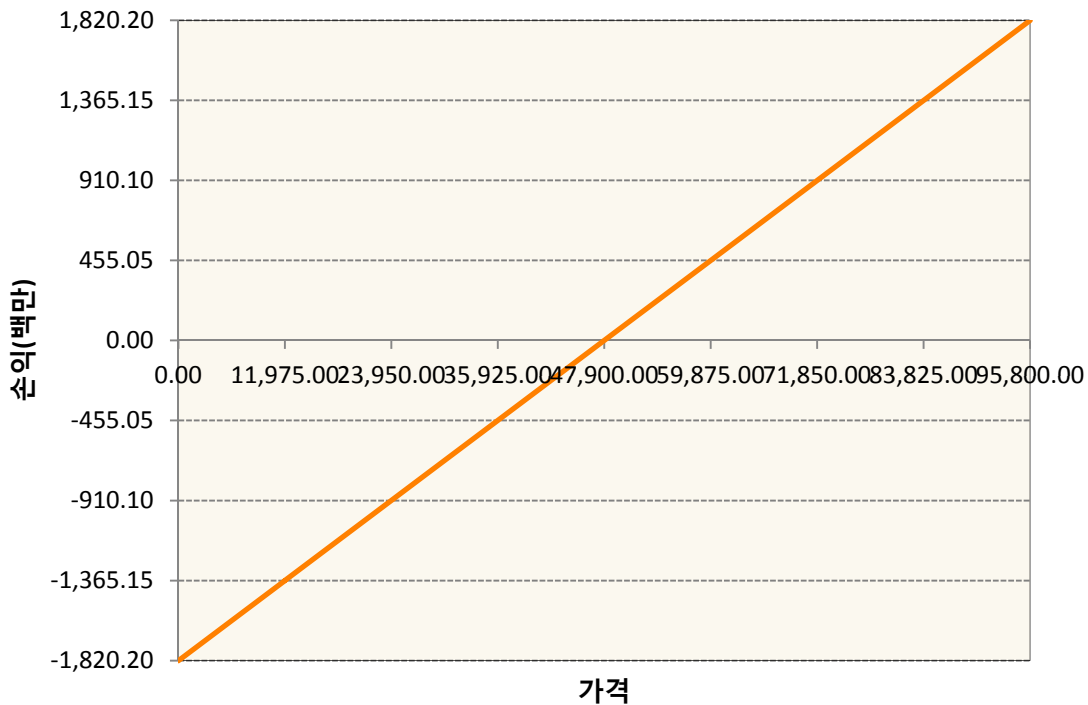
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,820	0	1,820	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4111N70007-2018-07 삼성전자개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

(단위:백만원)

185

공시일	2018-06-15
기준일	2018-06-14

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1

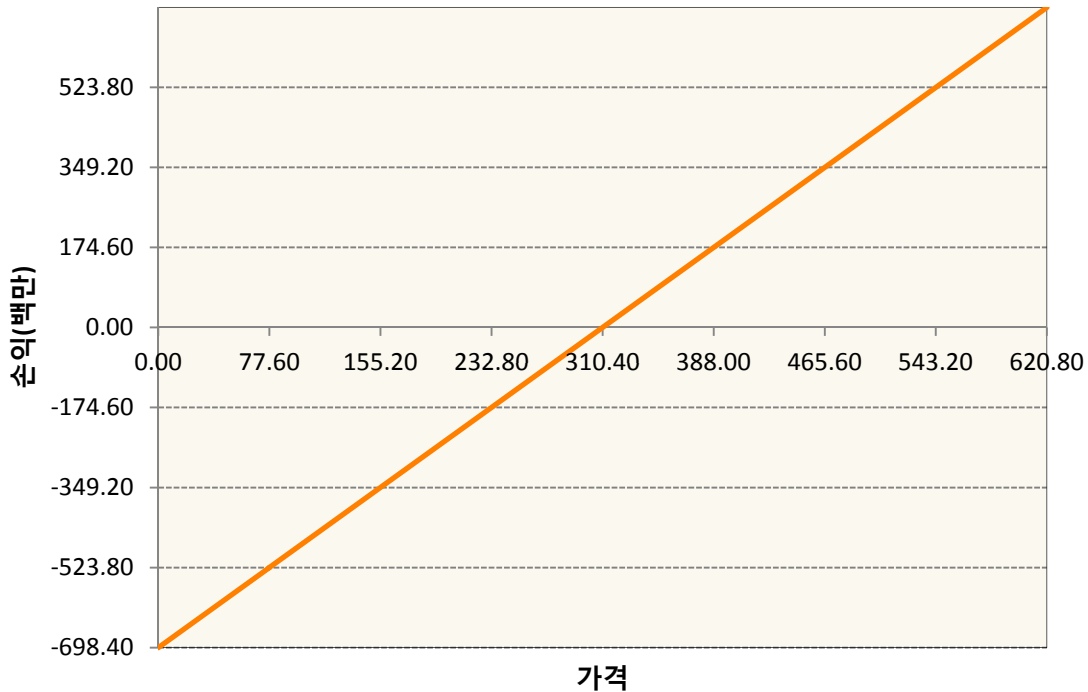
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	391	0	391	장내
누계	유가증권	선물	698	0	698	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

(단위:백만원)

41

공시일	2018-06-15
기준일	2018-06-14

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

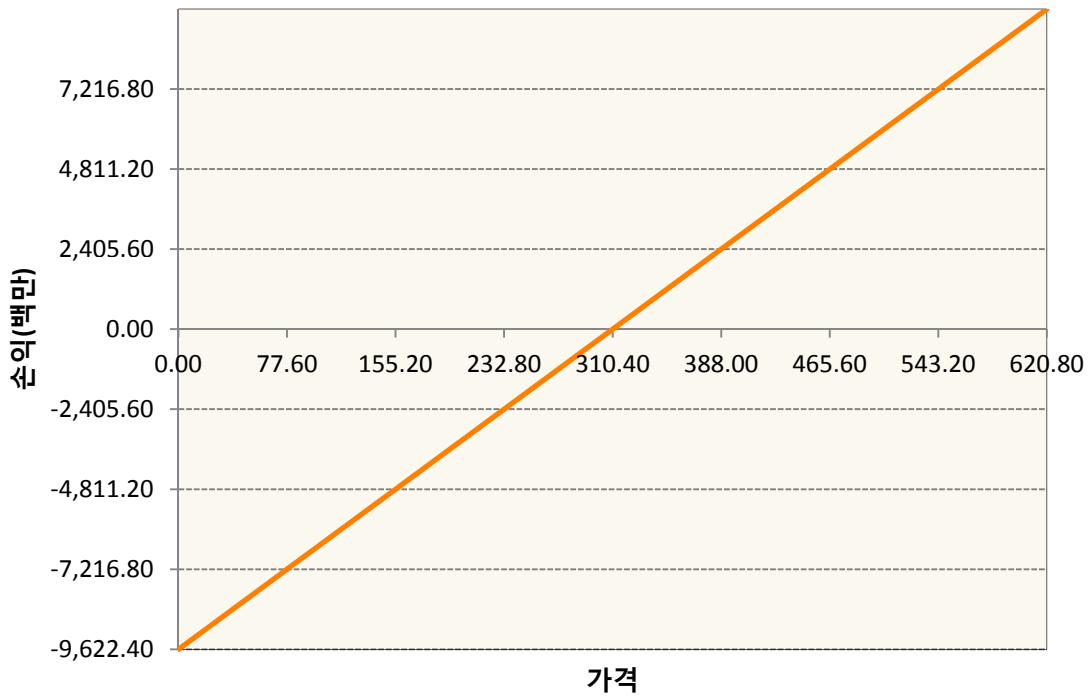
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

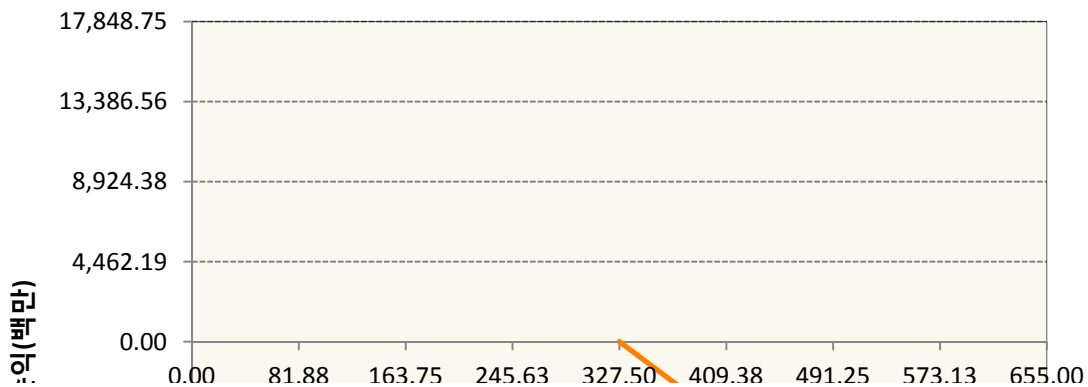
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	17,862	-17,862	장내
누계	유가증권	선물	9,622	0	9,622	장내
누계	유가증권	옵션	0	17,849	-17,849	장내

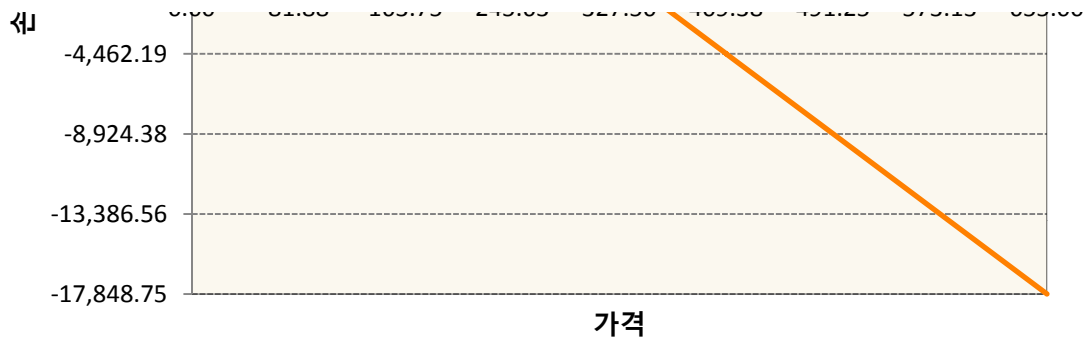
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



KR4201N73273-2018-07 콜327.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)


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

1,165
-------

공시일	2018-06-15
기준일	2018-06-14

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

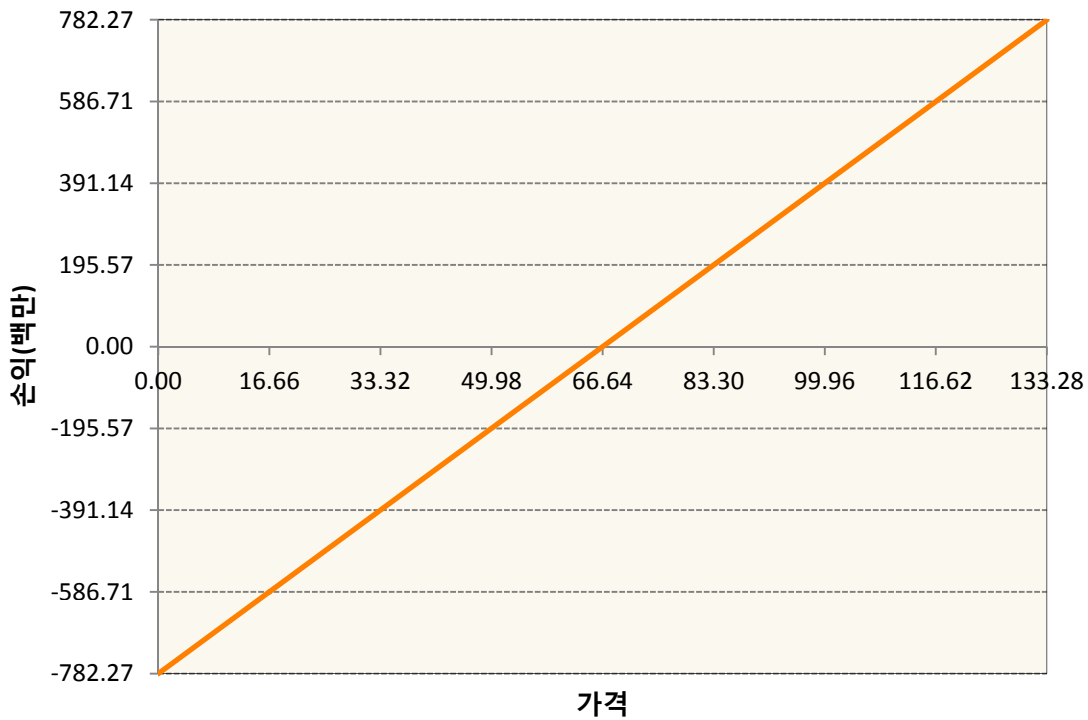
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

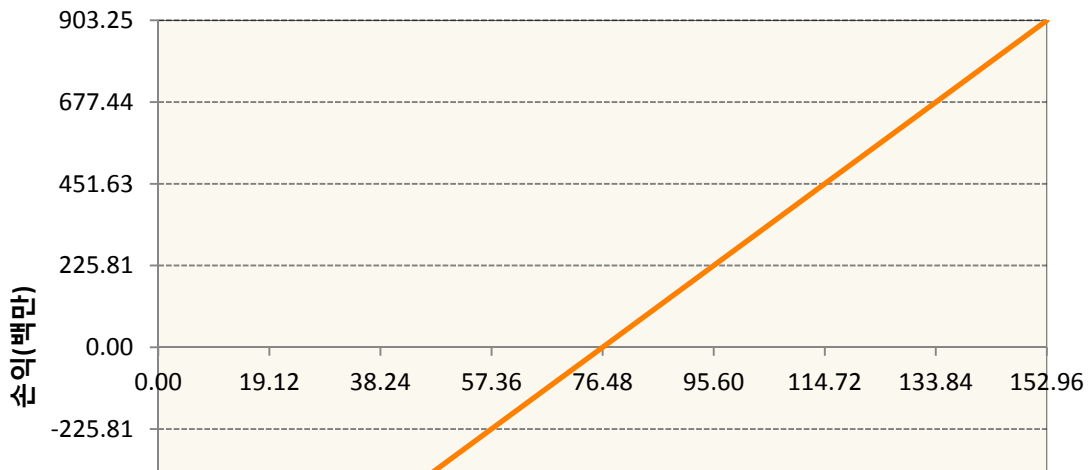
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,855	596	3,259	

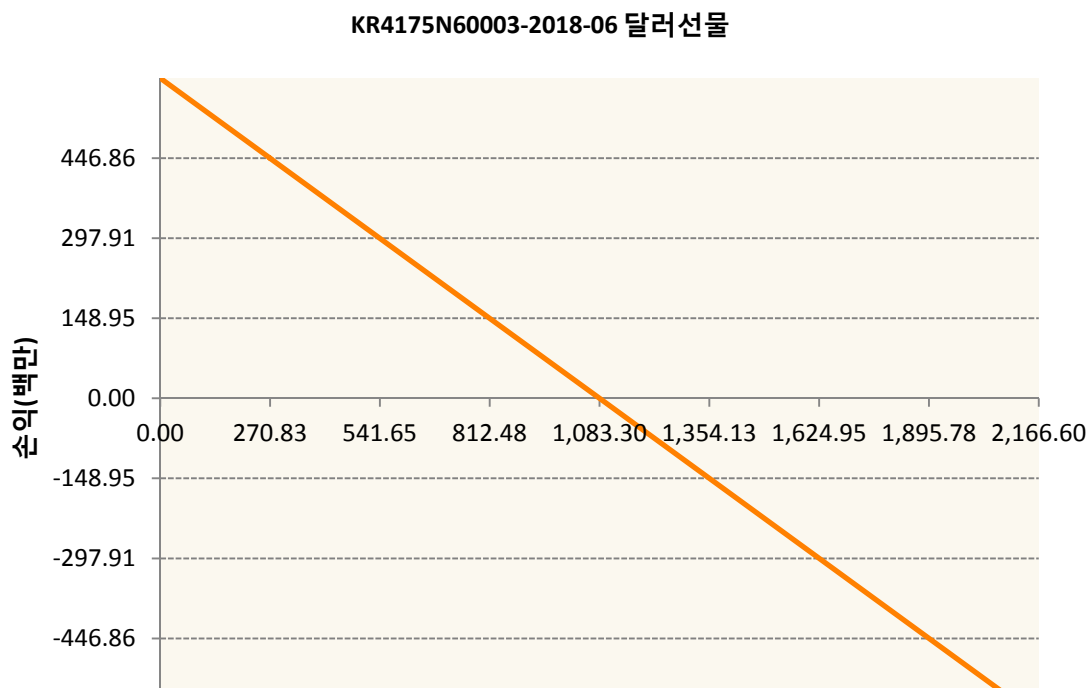
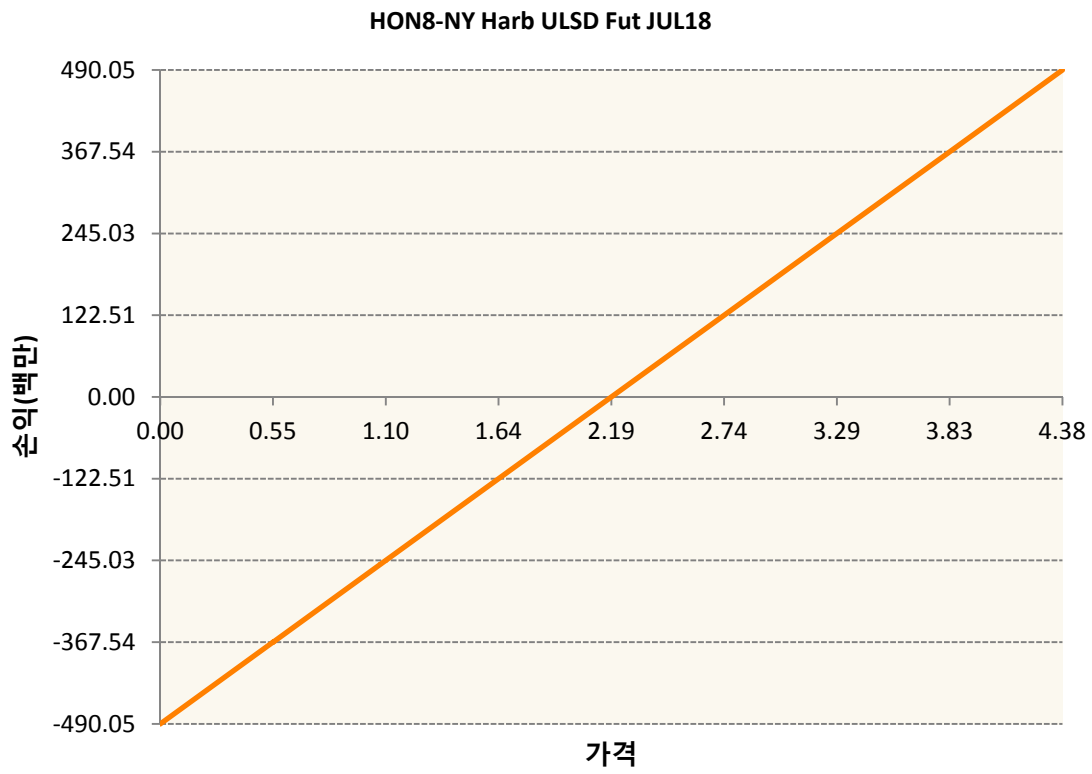
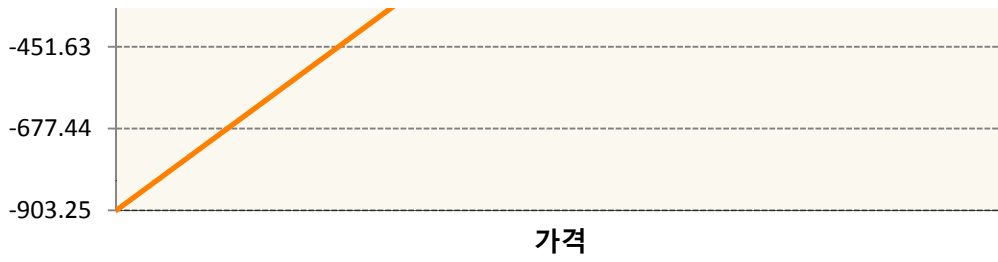
### 2. 만기시점의 손익구조

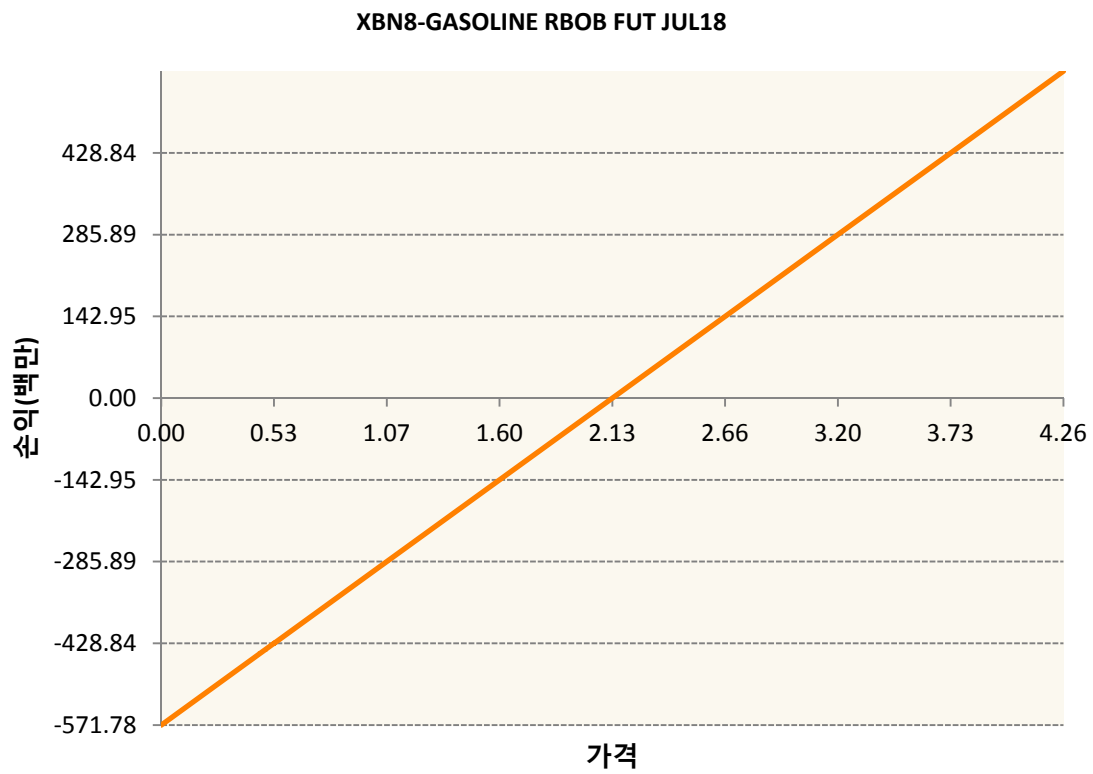
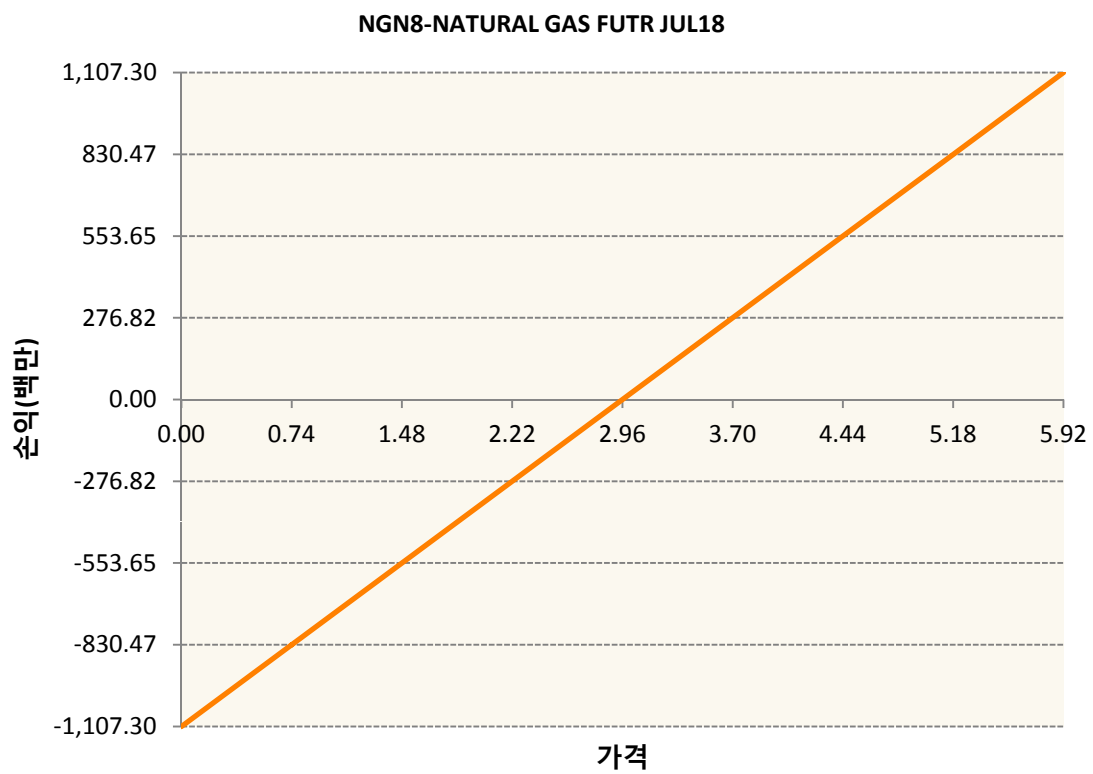
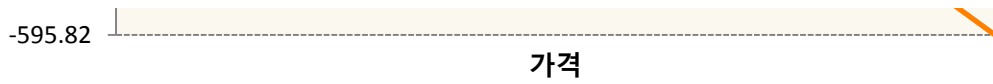
**CLN8-WTI CRUDE FUTURE JUL18**



**COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18**







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

CLN8	WTI CRUDE FUTURE JUL18	63
COU8	BRENT CRUDE FUTR SEP18	72
HON8	NY Harb ULSD Fut JUL18	39
KR4175N60C	2018-06 달러선물	48
NGN8	NATURAL GAS FUTR JUL18	89
XBN8	GASOLINE RBOB FUT JUL18	46

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

456

공시일	2018-06-15
기준일	2018-06-14

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

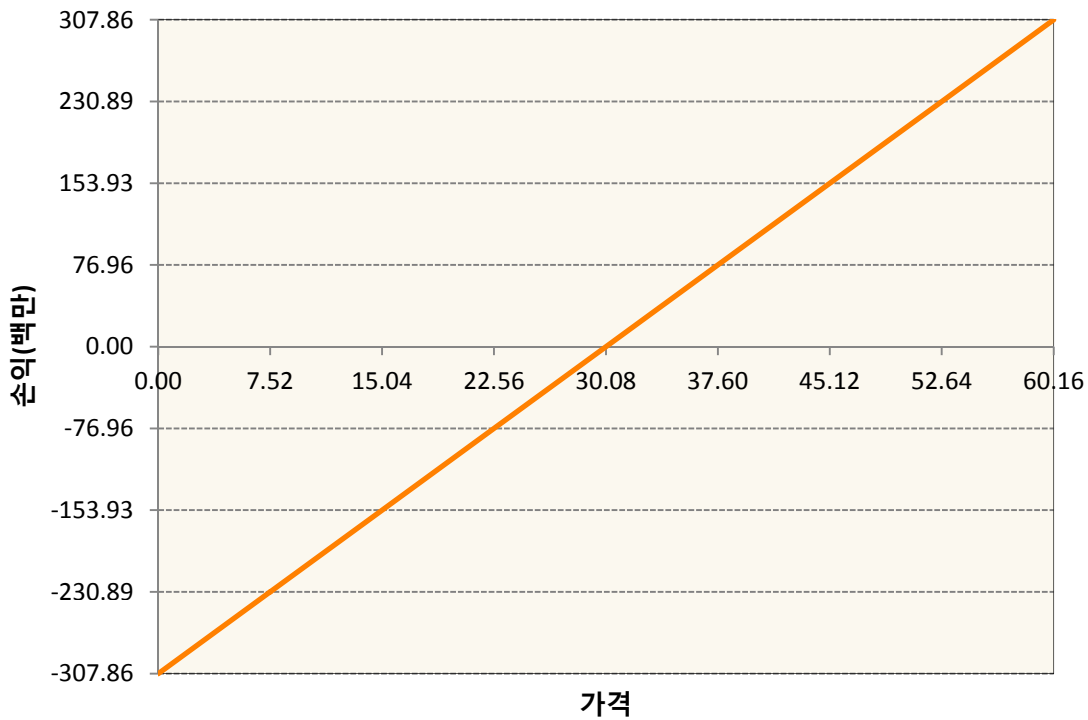
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

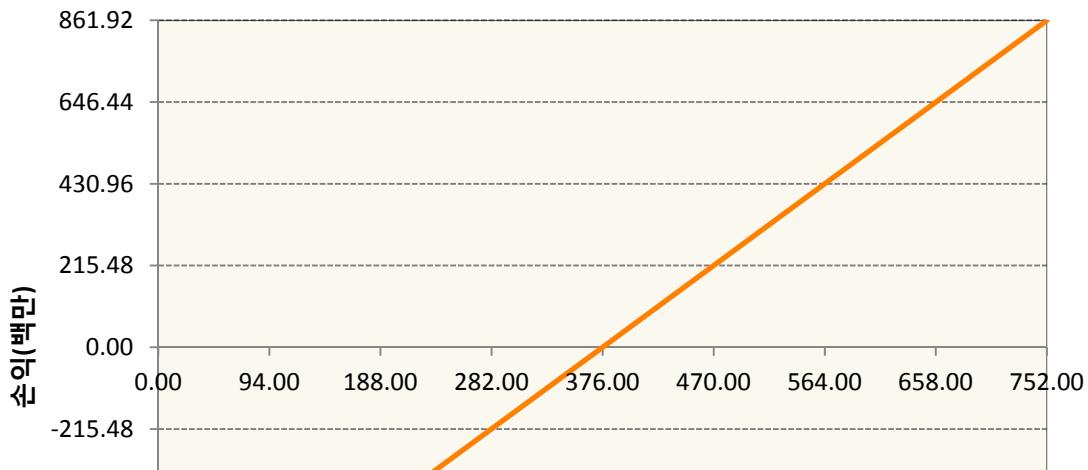
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,958	325	3,633	

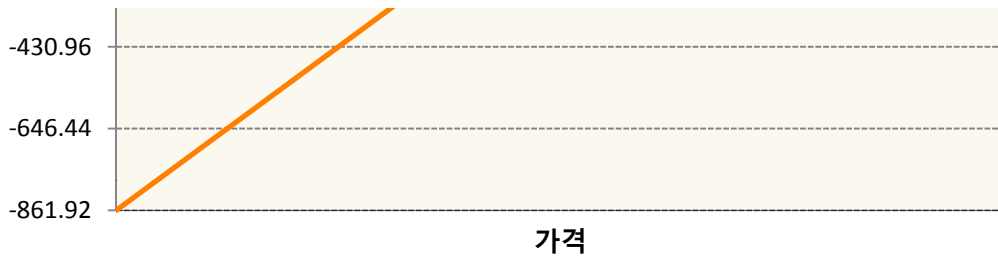
### 2. 만기시점의 손익구조

**BON8-SOYBEAN OIL FUTR JUL18**

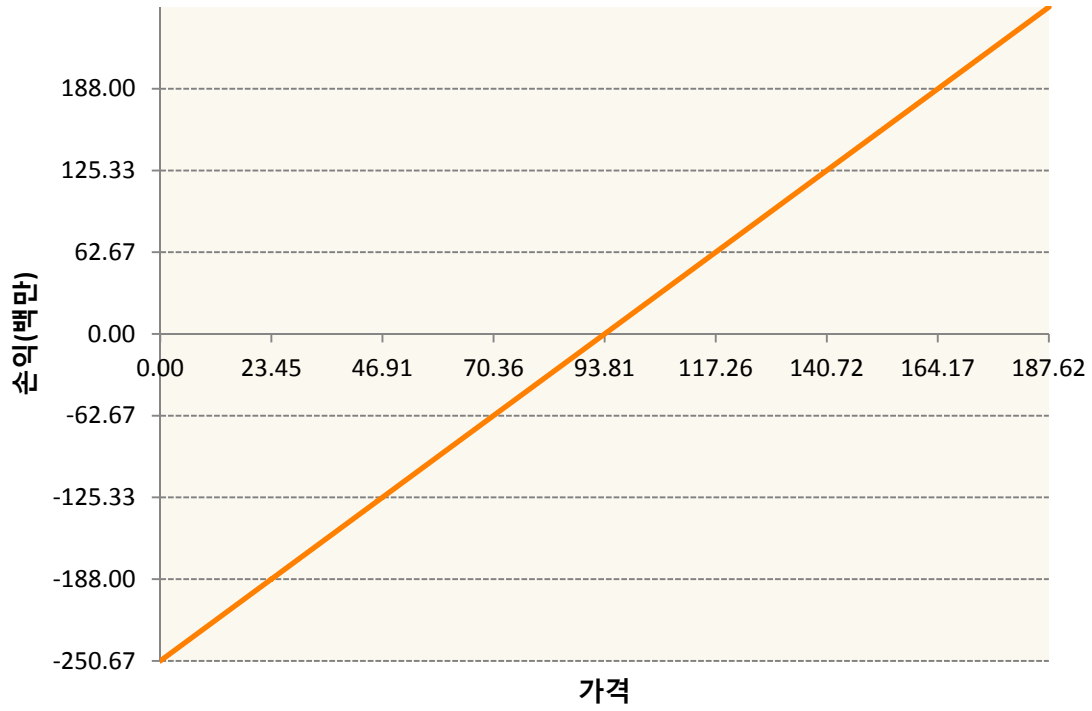


**CN8-CORN FUTURE JUL18**

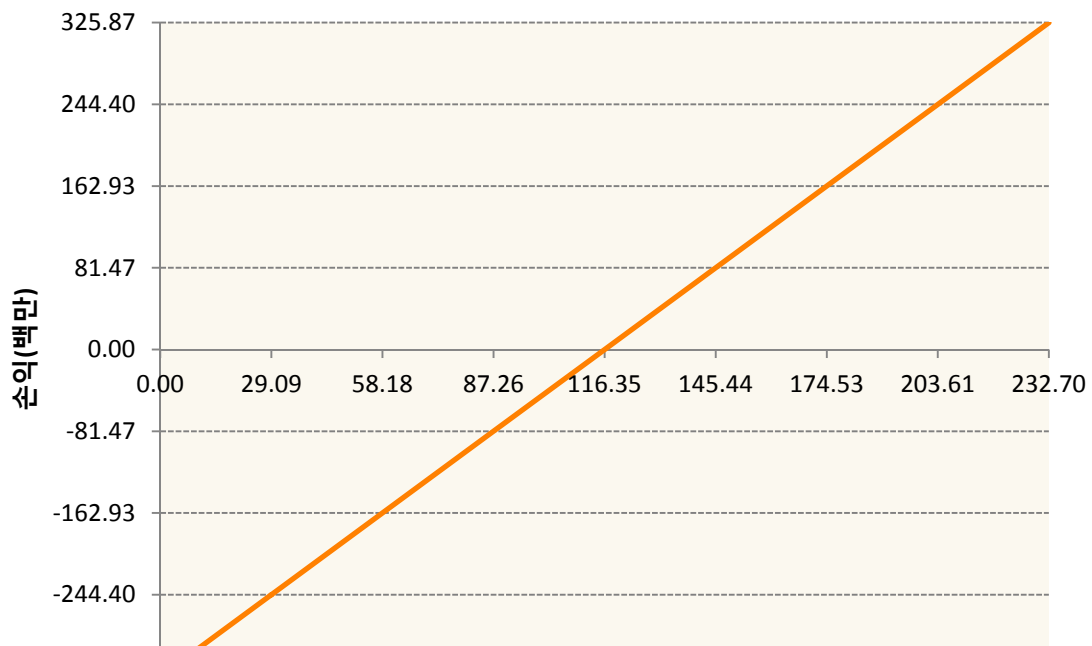


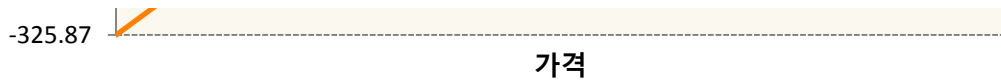


**CTN8-COTTON NO.2 FUTR JUL18**

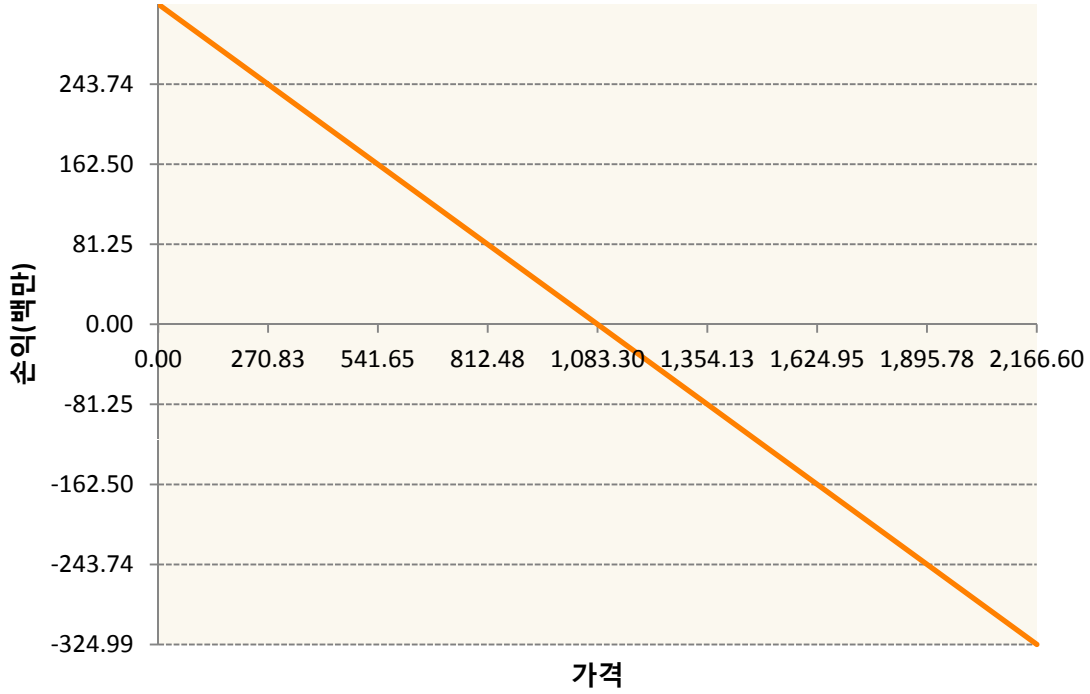


**KCN8-COFFEE 'C' FUTURE JUL18**

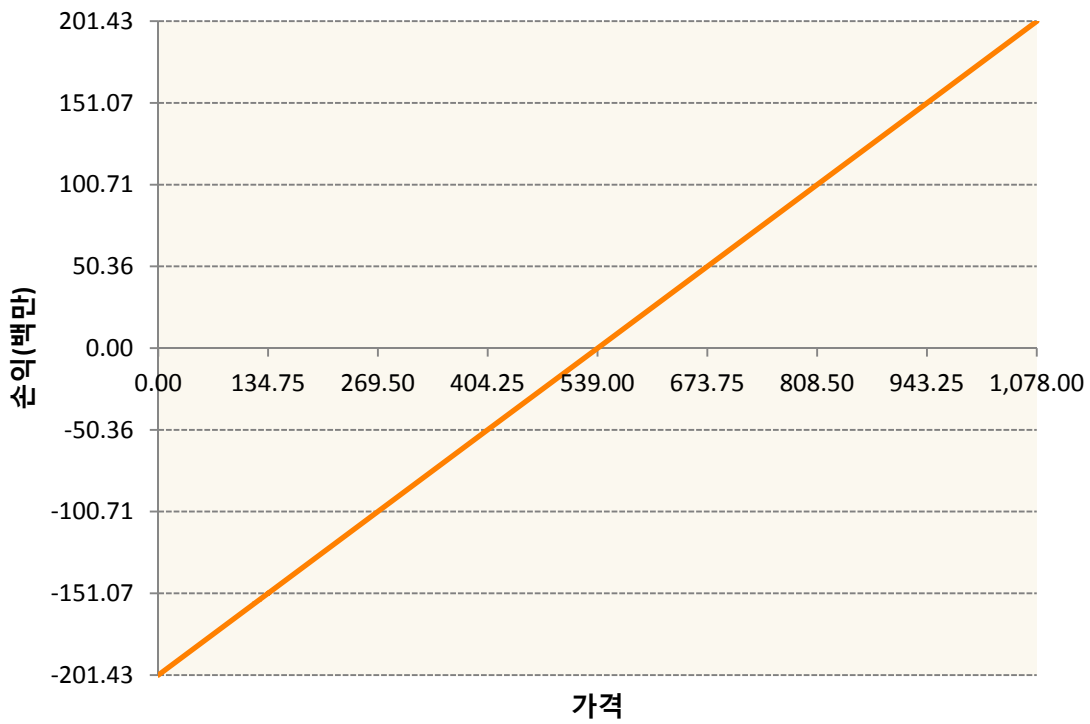




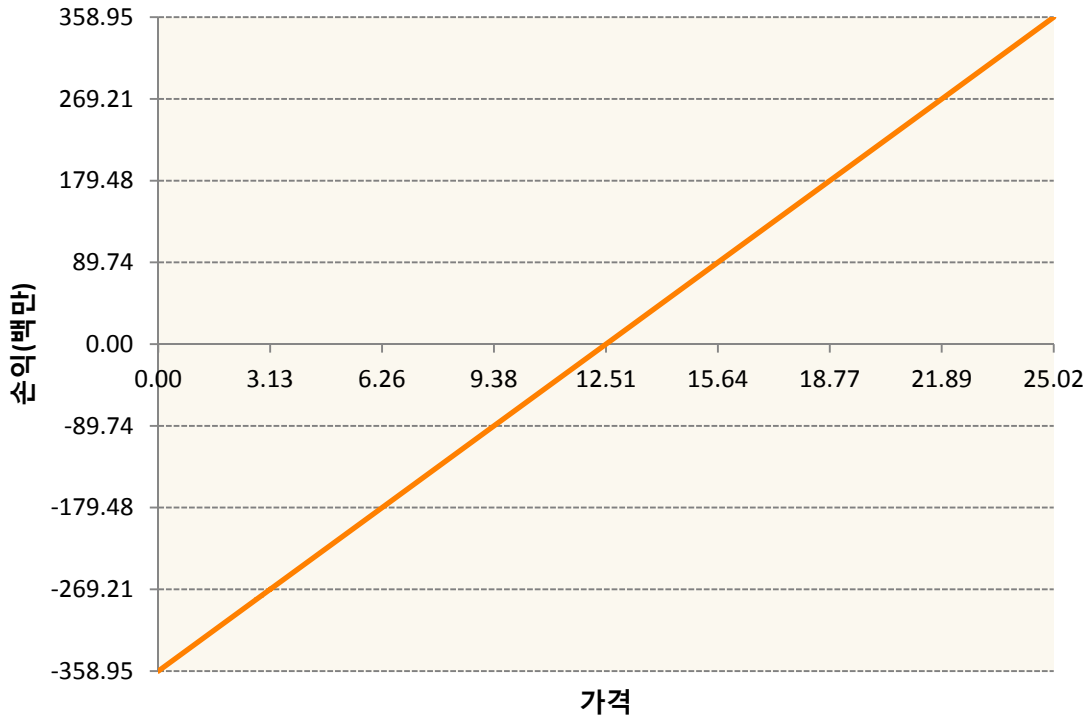
KR4175N60003-2018-06 달러선물



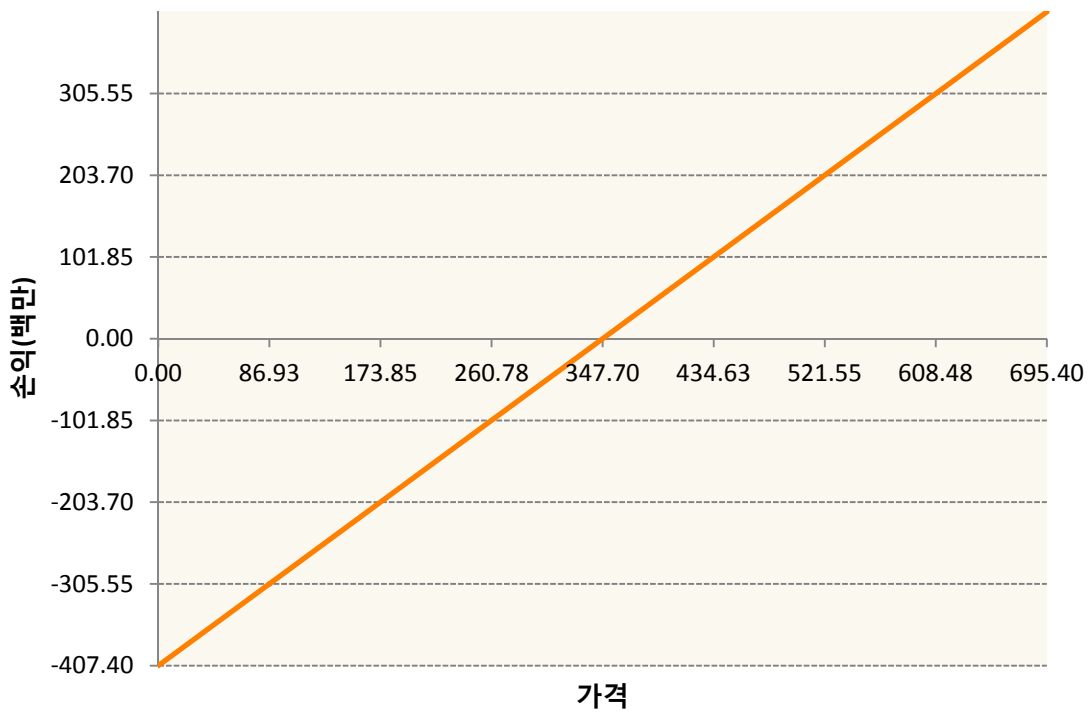
KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18



SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18

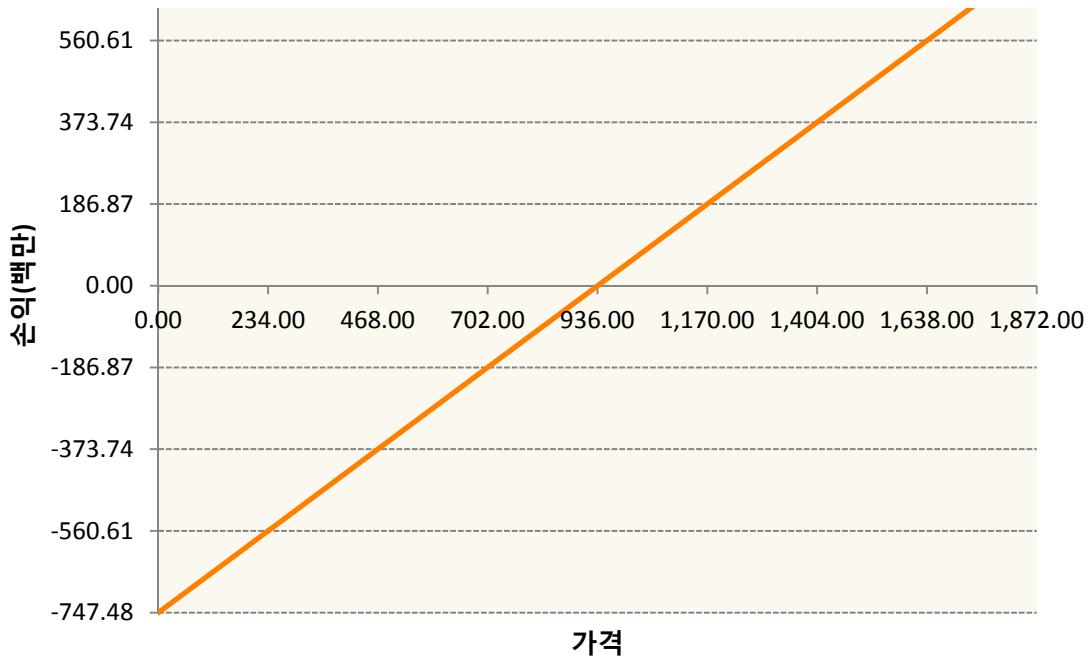


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18

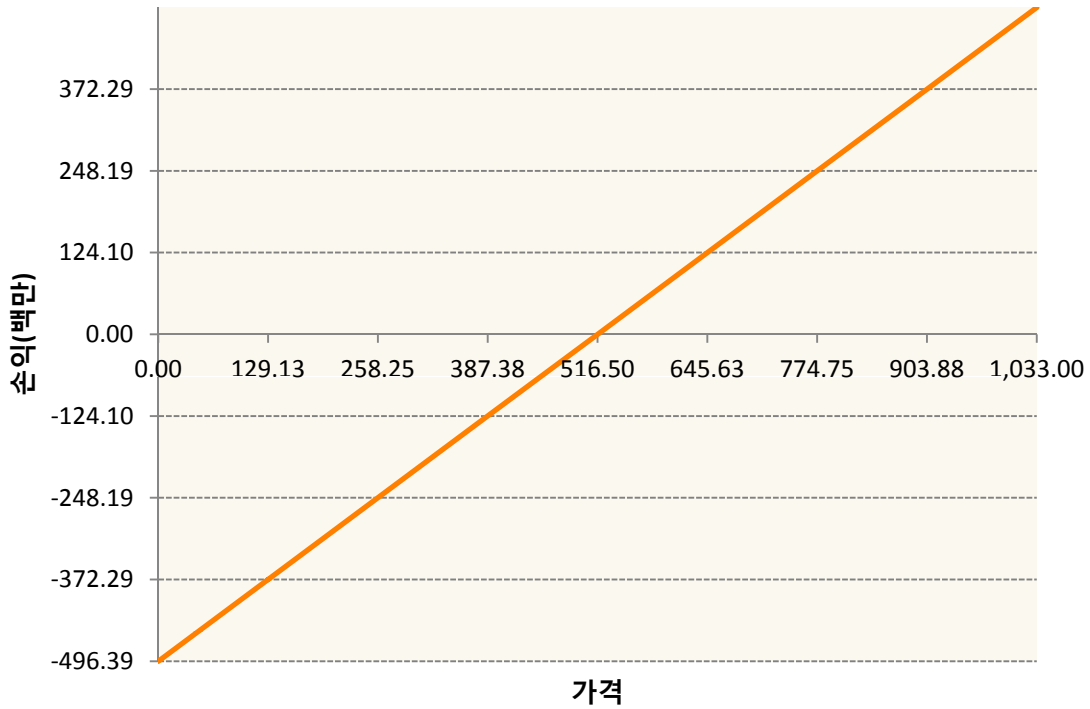


SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18





WN8-WHEAT FUTURE(CBT) 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	29
SMN8	SOYBEAN MEAL FUTR JUL18	33
SN8	SOYBEAN FUTURE JUL18	60
WN8	WHEAT FUTURE(CBT) JUL18	40

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

(단위:백만원)

**327**