

공시일	2018-06-28
기준일	2018-06-27

## 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	7	0	7	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	2018-06-28
기준일	2018-06-27

## 스마트인덱스모

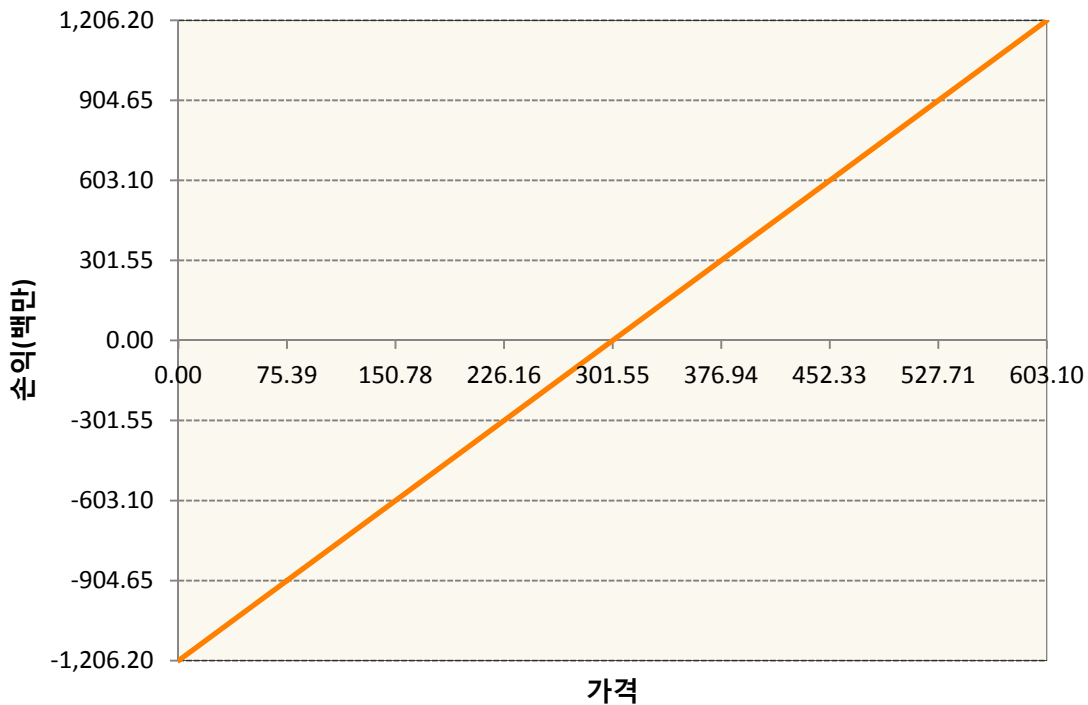
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,206	0	1,206	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물

97

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97
-5.33%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64
-2.67%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	32	32	32	32	32	32	32
5.33%	64	64	64	64	64	64	64
8.00%	97	97	97	97	97	97	97

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

(단위:백만원)

72

공시일	2018-06-28
기준일	2018-06-27

## 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

1,103

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

462

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-06-28
기준일	2018-06-27

## 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

328

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

384

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-06-28
기준일	2018-06-27

## 유로인덱스모(주식-파생형)

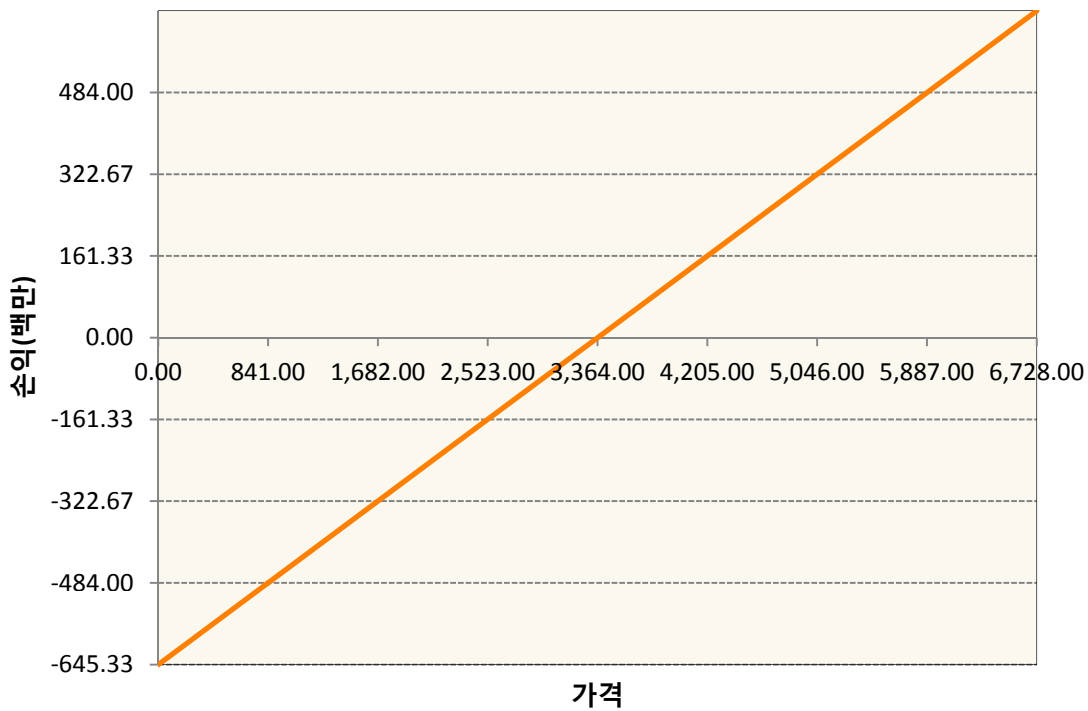
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	645	0	645	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGU8-EURO STOXXX 50 SEP18



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU8	EURO STOXXX 50 SEP18	52
------	----------------------	----

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

(단위:백만원)

32
----

공시일	2018-06-28
기준일	2018-06-27

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

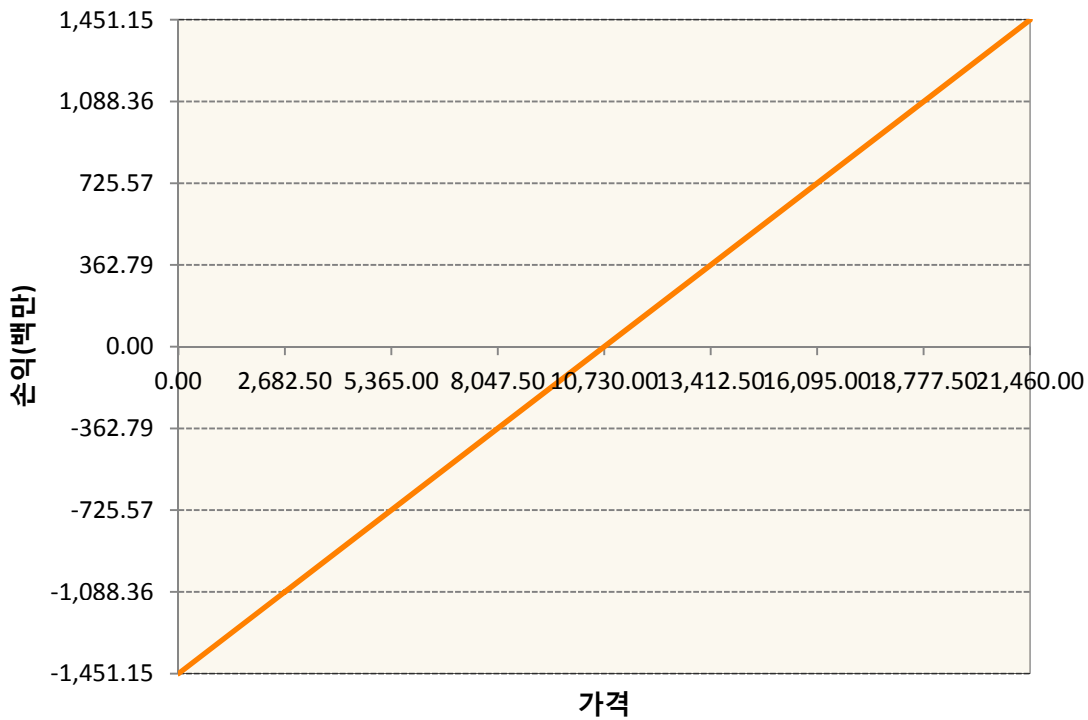
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

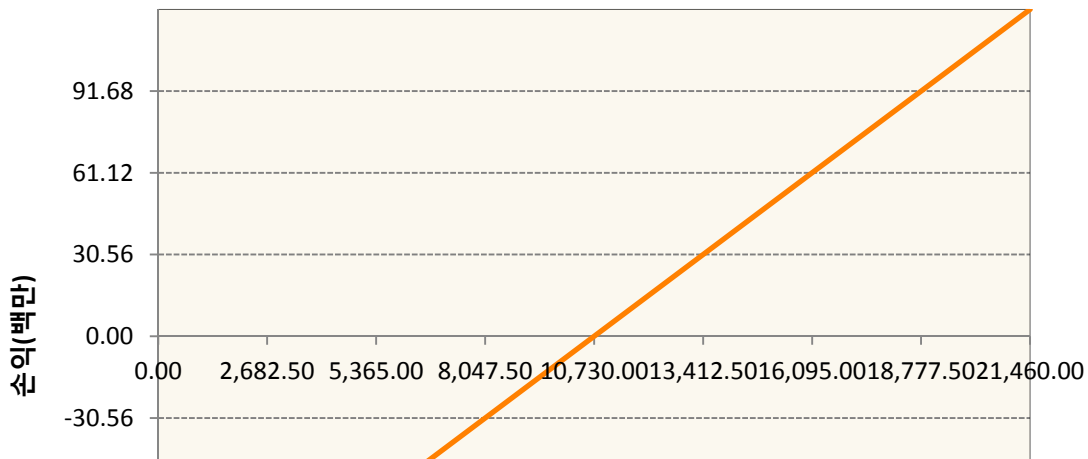
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,573	0	1,573	장내

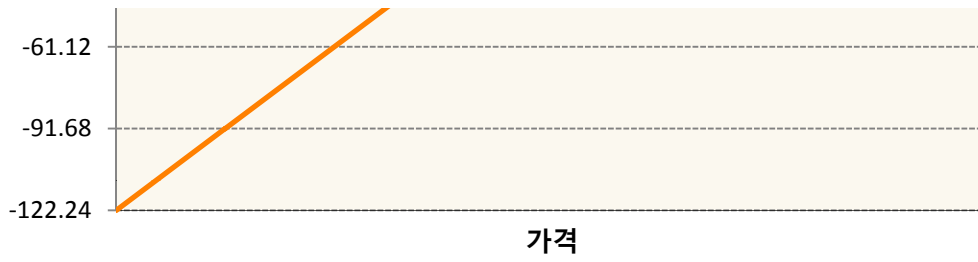
### 2. 만기시점의 손익구조

HCN8-HSCEI Futures Jul18



MHCN8-MINI H-SHR IDX FU JUL18





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

HCN8	HSCEI Futures Jul18	116
MHCN8	MINI H-SHR IDX FU JUL18	10

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

<b>113</b>
------------

공시일	2018-06-28
기준일	2018-06-27

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

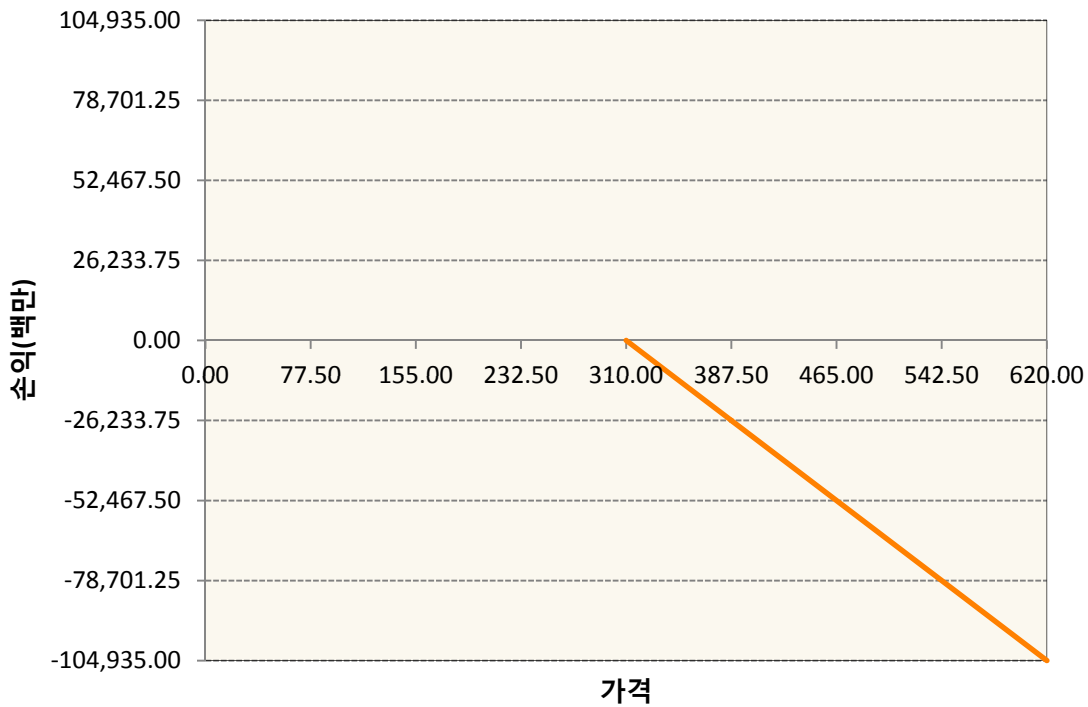
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

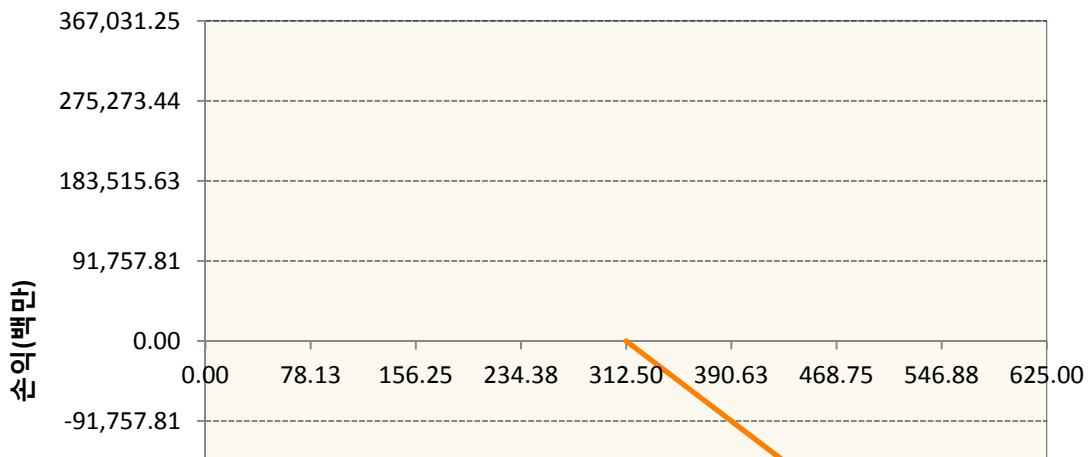
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	766,466	-766,466	장내

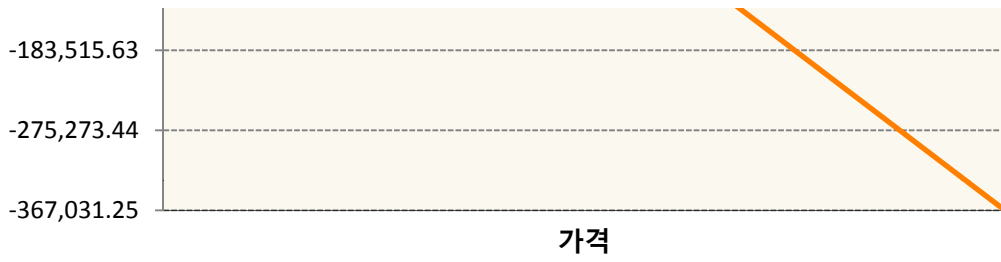
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201N73109-2018-07 콜310**

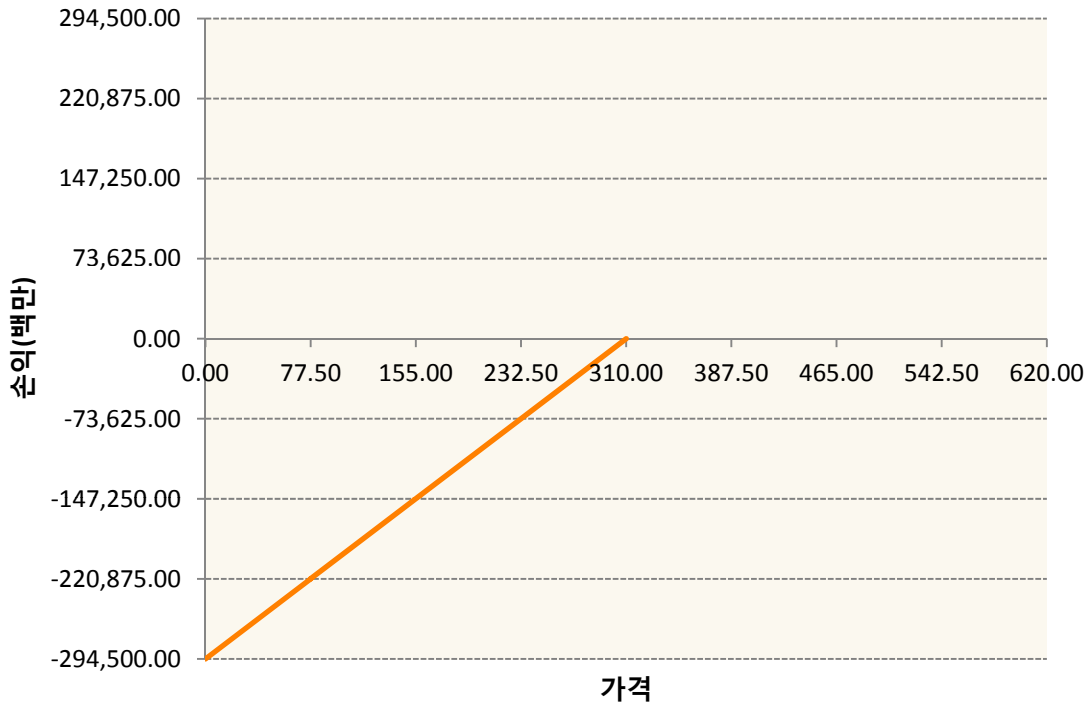


**KR4201N73125-2018-07 콜312.5**





KR4301N73107-2018-07 풋310



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N7312018-07 콜310

5,351

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,407	1,391	1,366	1,330	1,284	1,226	1,159
-5.33%	1,346	1,295	1,229	1,149	1,057	954	842
-2.67%	1,127	1,013	885	747	599	445	284
0%	561	378	191	0	-194	-389	-587
2.67%	-545	-757	-970	-1,182	-1,395	-1,607	-1,819
5.33%	-2,251	-2,436	-2,626	-2,820	-3,017	-3,217	-3,419
8.00%	-4,453	-4,576	-4,712	-4,859	-5,016	-5,180	-5,351

KR4201N7312018-07 콜312.5

17,342

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,007	3,970	3,905	3,810	3,681	3,516	3,317

-5.33%	3,870	3,736	3,554	3,327	3,056	2,745	2,398
-2.67%	3,326	2,997	2,618	2,196	1,738	1,249	734
0%	1,796	1,221	620	0	-636	-1,285	-1,944
2.67%	-1,420	-2,153	-2,887	-3,622	-4,357	-5,094	-5,830
5.33%	-6,706	-7,403	-8,108	-8,821	-9,540	-10,262	-10,989
8.00%	-13,862	-14,367	-14,910	-15,485	-16,085	-16,705	-17,342

KR4301N7312018-07 풋310

21,833

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21,822	-21,822	-21,822	-21,823	-21,824	-21,827	-21,833
-5.33%	-14,172	-14,174	-14,179	-14,189	-14,205	-14,230	-14,265
-2.67%	-6,555	-6,591	-6,644	-6,715	-6,803	-6,908	-7,030
0%	611	424	219	0	-231	-472	-721
2.67%	5,820	5,508	5,195	4,882	4,569	4,257	3,944
5.33%	8,015	7,833	7,632	7,414	7,184	6,943	6,693
8.00%	8,456	8,416	8,357	8,280	8,183	8,068	7,937

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

(단위:백만원)

**45,493**

공시일	2018-06-28
기준일	2018-06-27

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

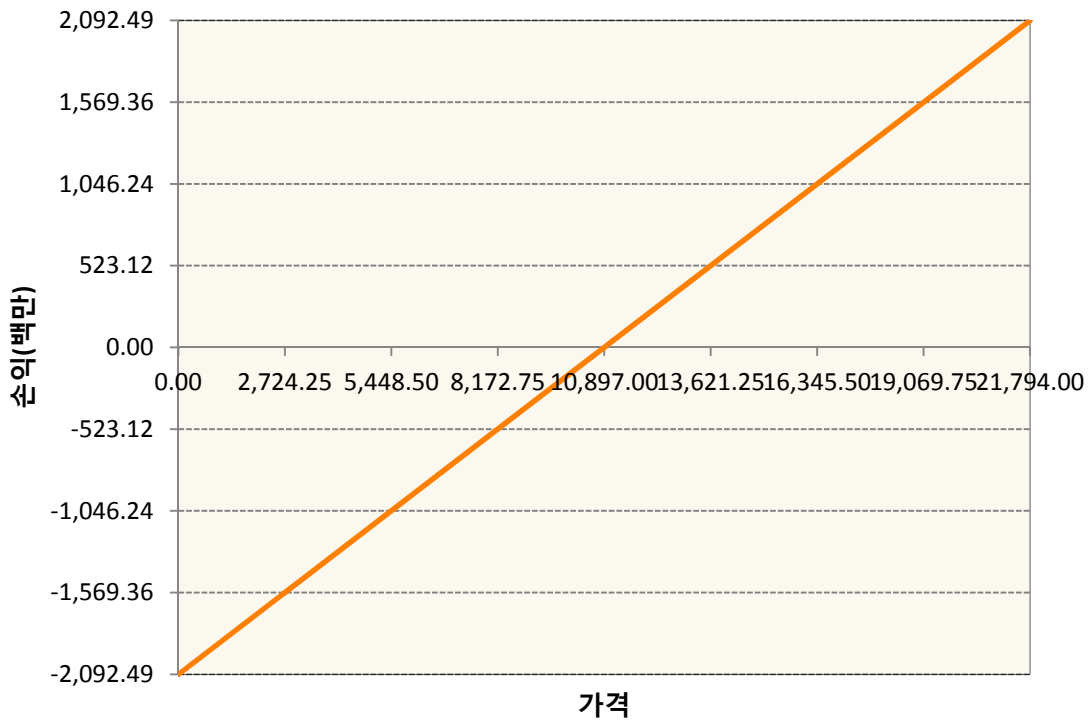
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

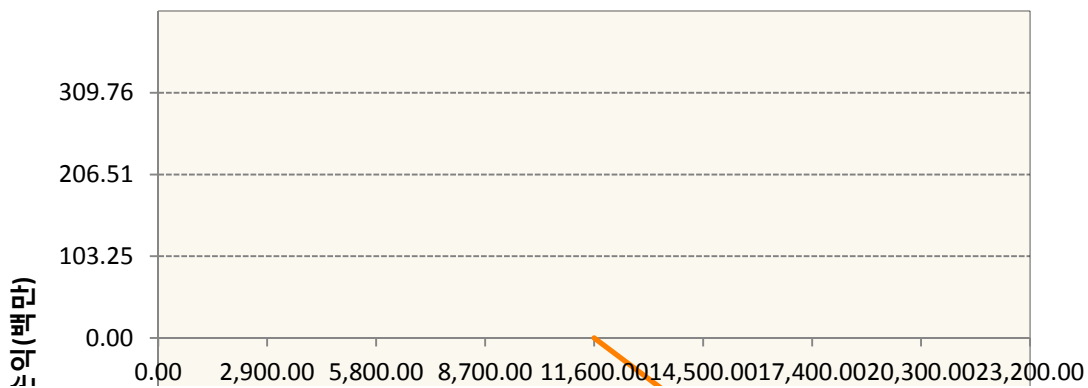
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,092	0	2,092	장내
누계	유가증권	옵션	0	6,036	-6,036	장내

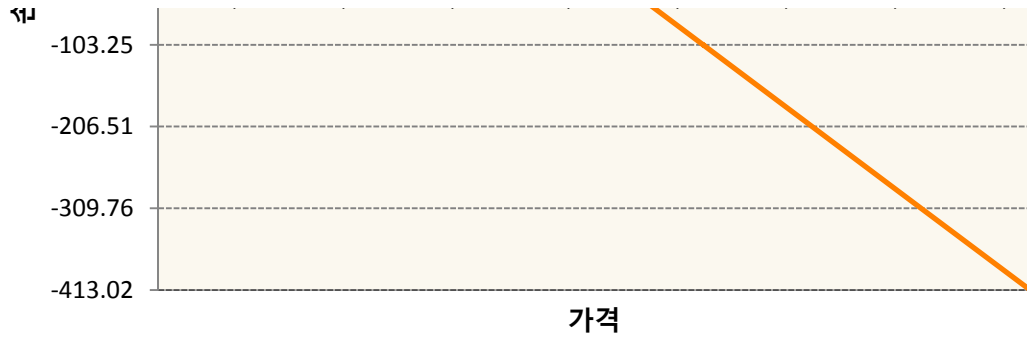
### 2. 만기시점의 손익구조

HCM8-HSCEI Futures Jun18

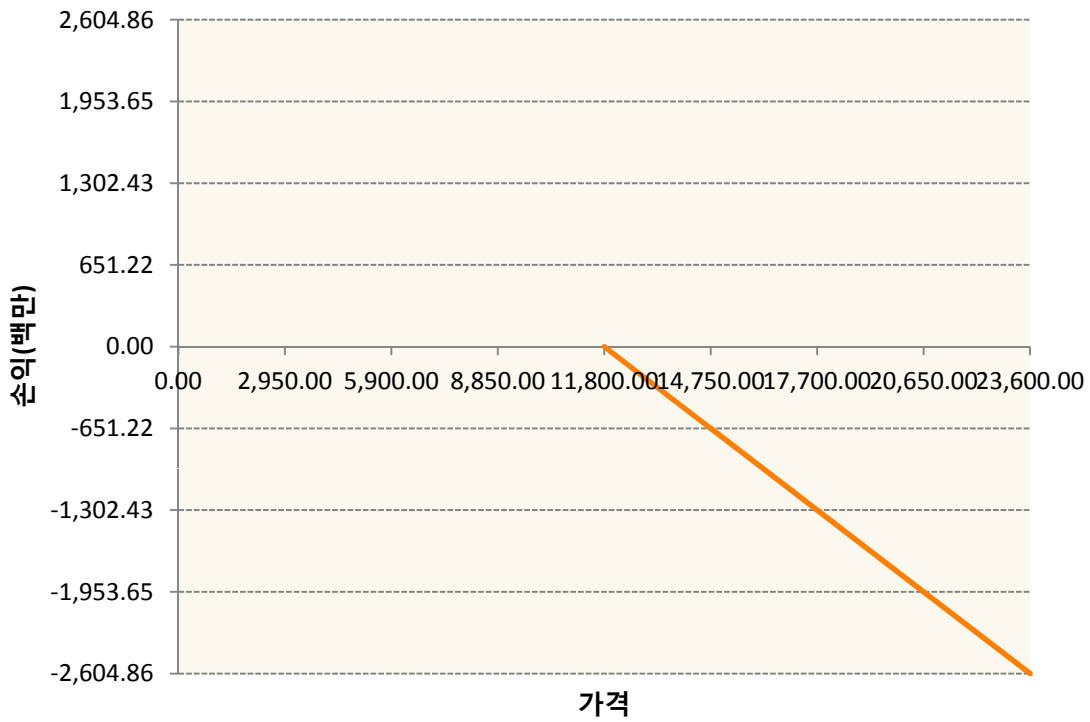


OHHIM8-C116-HSCEI

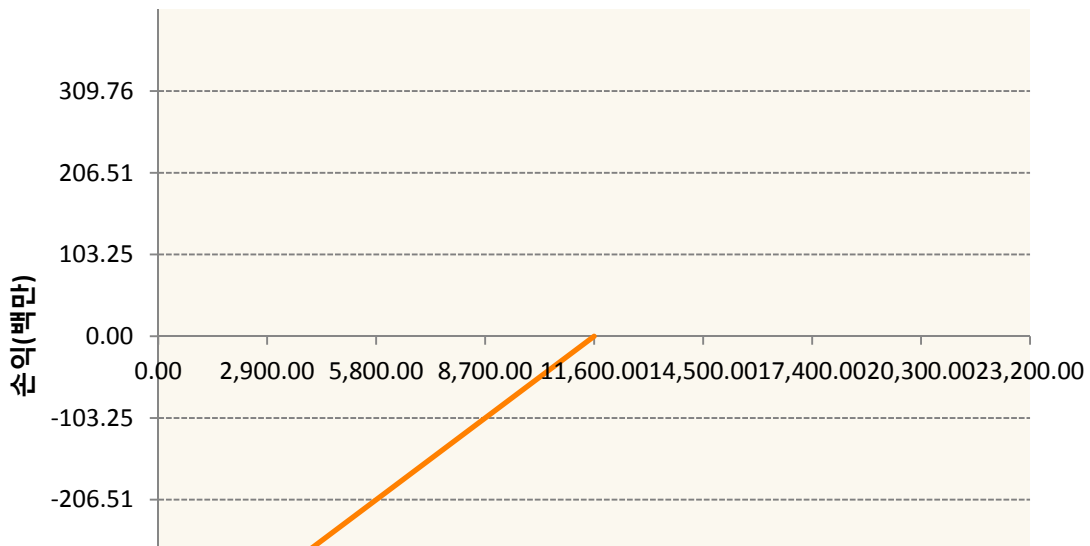


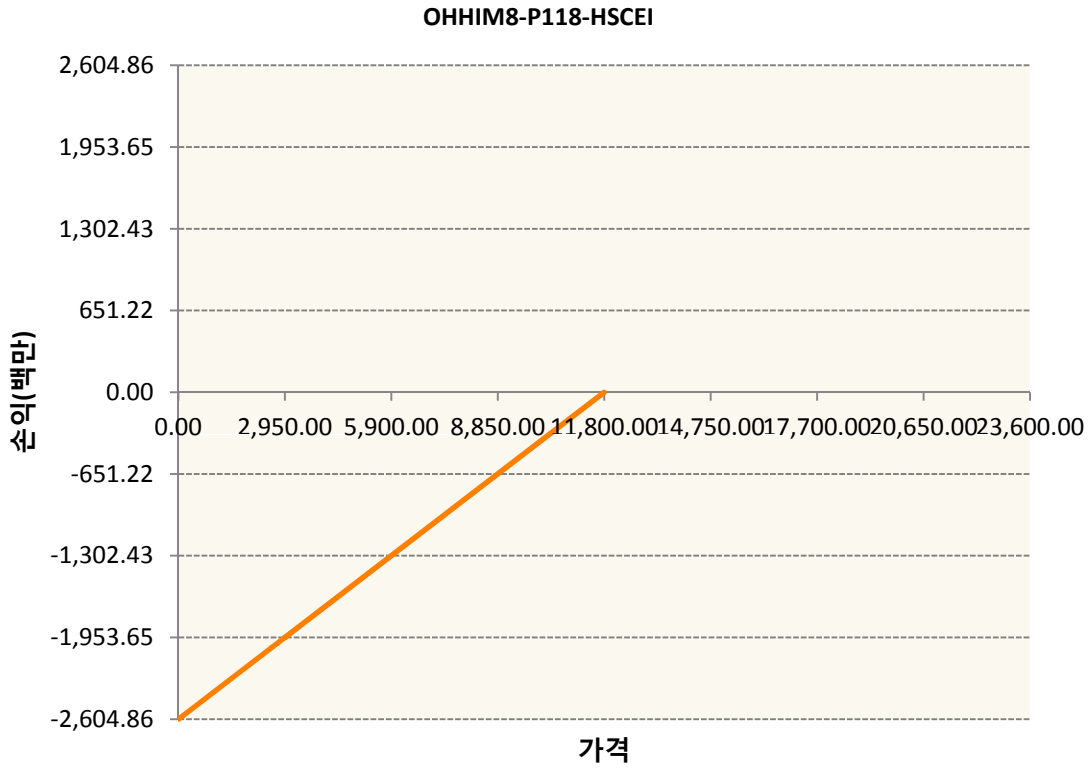
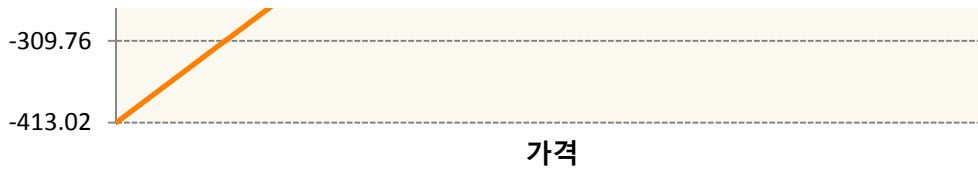


OHHIM8-C118-HSCEI



OHHIM8-P116-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCM8	HSCEI Futures Jun18	167
OHHIM8-C1	HSCEI	33
OHHIM8-C1	HSCEI	208
OHHIM8-P1	HSCEI	33
OHHIM8-P1	HSCEI	208

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	583

공시일	2018-06-28
기준일	2018-06-27

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

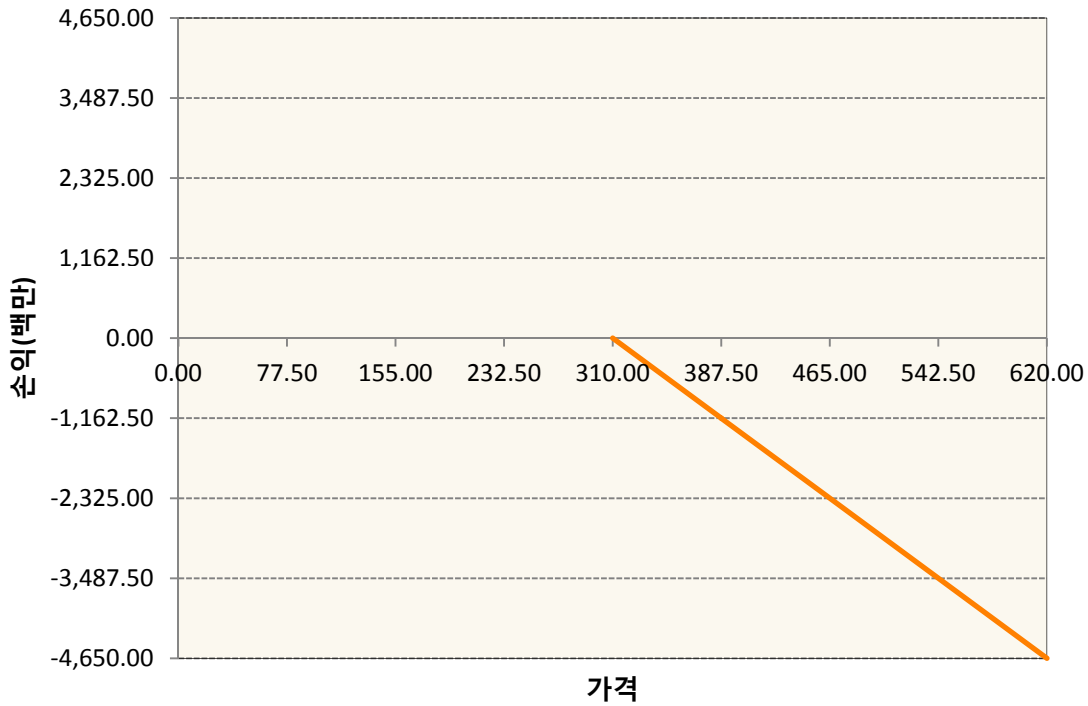
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

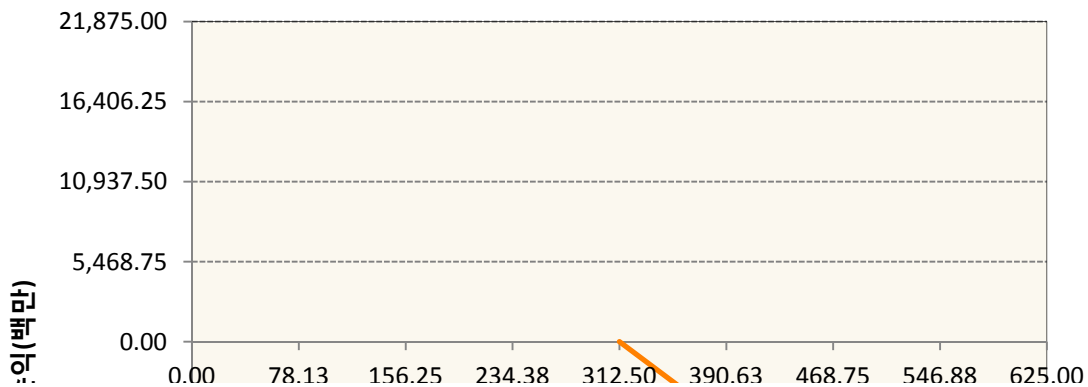
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	45,900	-45,900	장내

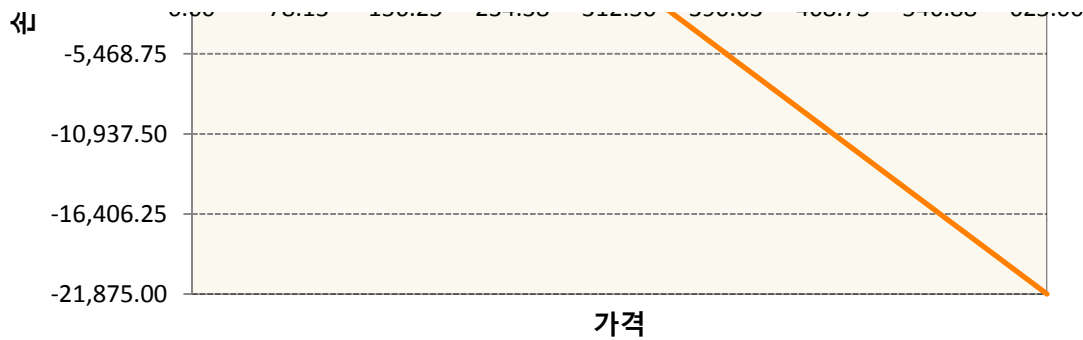
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N73109-2018-07 콜310

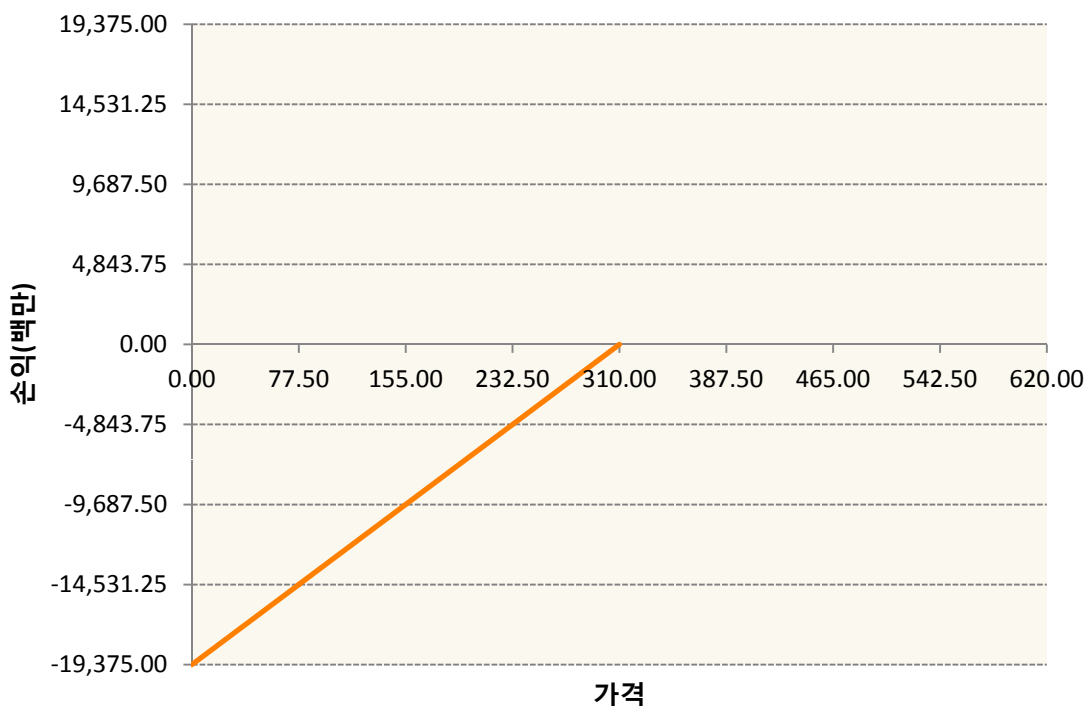


KR4201N73125-2018-07 콜312.5





KR4301N73107-2018-07 풋310



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_2							1,498	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,498	-1,498	-1,498	-1,498	-1,498	-1,498	-1,498	
-5.33%	-999	-999	-999	-999	-999	-999	-999	
-2.67%	-499	-499	-499	-499	-499	-499	-499	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	499	499	499	499	499	499	499	
5.33%	999	999	999	999	999	999	999	
8.00%	1,498	1,498	1,498	1,498	1,498	1,498	1,498	
2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_3							283	
	기초자산의 변동성							



0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	216	216	216	216	216	216	216
5.33%	432	432	432	432	432	432	432
8.00%	648	648	648	648	648	648	648

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX\_12

486

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-486	-486	-486	-486	-486	-486	-486
-5.33%	-324	-324	-324	-324	-324	-324	-324
-2.67%	-162	-162	-162	-162	-162	-162	-162
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	162	162	162	162	162	162	162
5.33%	324	324	324	324	324	324	324
8.00%	486	486	486	486	486	486	486

KR4201N7312018-07 콜310

237

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	62	62	61	59	57	54	51
-5.33%	60	57	54	51	47	42	37
-2.67%	50	45	39	33	27	20	13
0%	25	17	8	0	-9	-17	-26
2.67%	-24	-34	-43	-52	-62	-71	-81
5.33%	-100	-108	-116	-125	-134	-143	-151
8.00%	-197	-203	-209	-215	-222	-230	-237

KR4201N7312018-07 콜312.5

1,034

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	239	237	233	227	219	210	198
-5.33%	231	223	212	198	182	164	143
-2.67%	198	179	156	131	104	74	44
0%	107	73	37	0	-38	-77	-116
2.67%	-85	-128	-172	-216	-260	-304	-347
5.33%	-400	-441	-483	-526	-569	-612	-655
8.00%	-826	-856	-889	-923	-959	-996	-1,034

KR4301N7312018-07 풋310

1,436

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,436	-1,436	-1,436	-1,436	-1,436	-1,436	-1,436
-5.33%	-932	-932	-933	-933	-935	-936	-939
-2.67%	-431	-434	-437	-442	-448	-455	-462
0%	40	28	14	0	-15	-31	-47
2.67%	383	362	342	321	301	280	259
5.33%	527	515	502	488	473	457	440
8.00%	556	554	550	545	538	531	522

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

(단위:백만원)

6,692

공시일	2018-06-28
기준일	2018-06-27

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

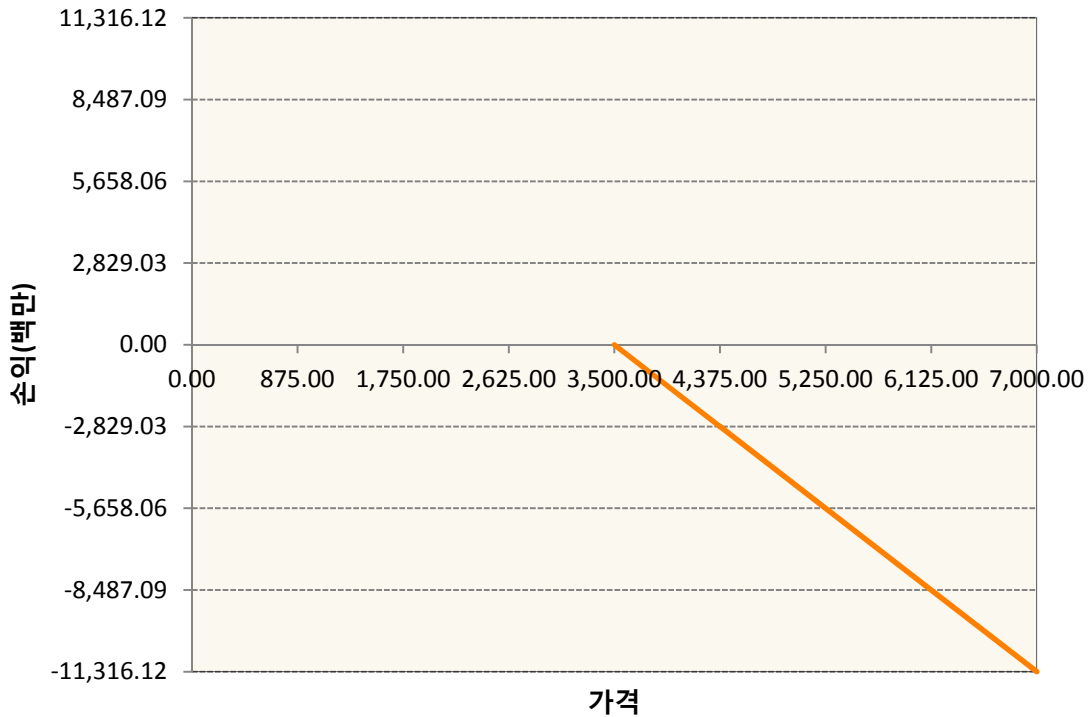
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

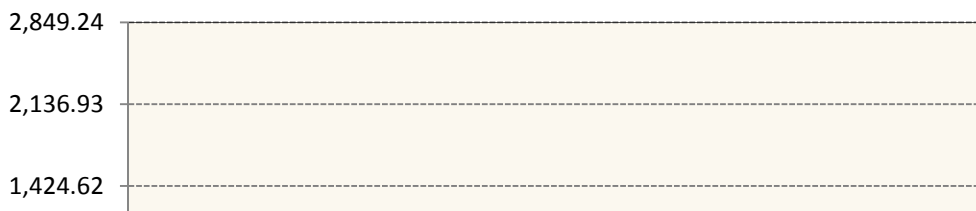
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,577	0	6,577	
누계	유가증권	스왑	44,537	0	44,537	장외
누계	유가증권	옵션	0	28,331	-28,331	장내
누계	지수	스왑	52,150	0	52,150	장외

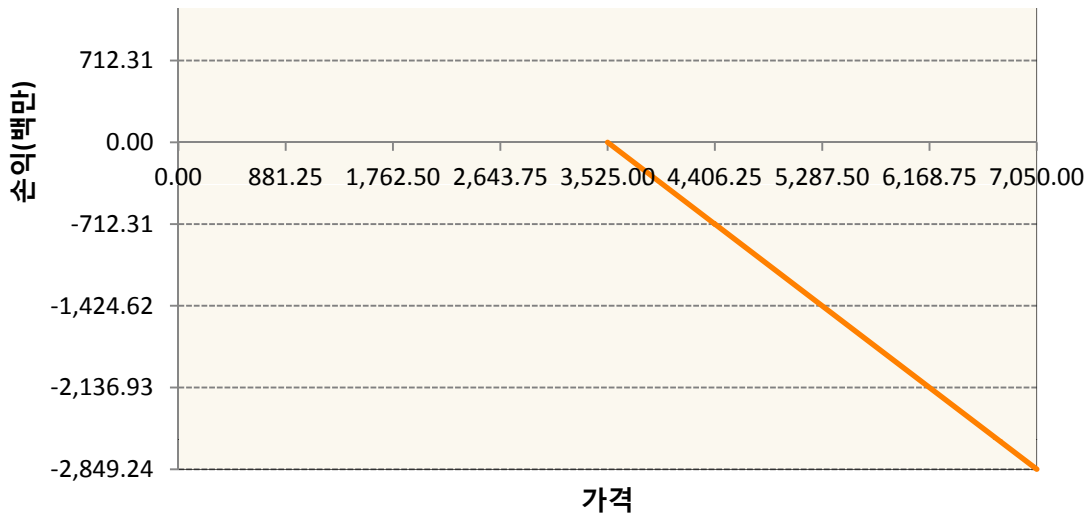
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXN8-C3500-EURO STOXX 50**

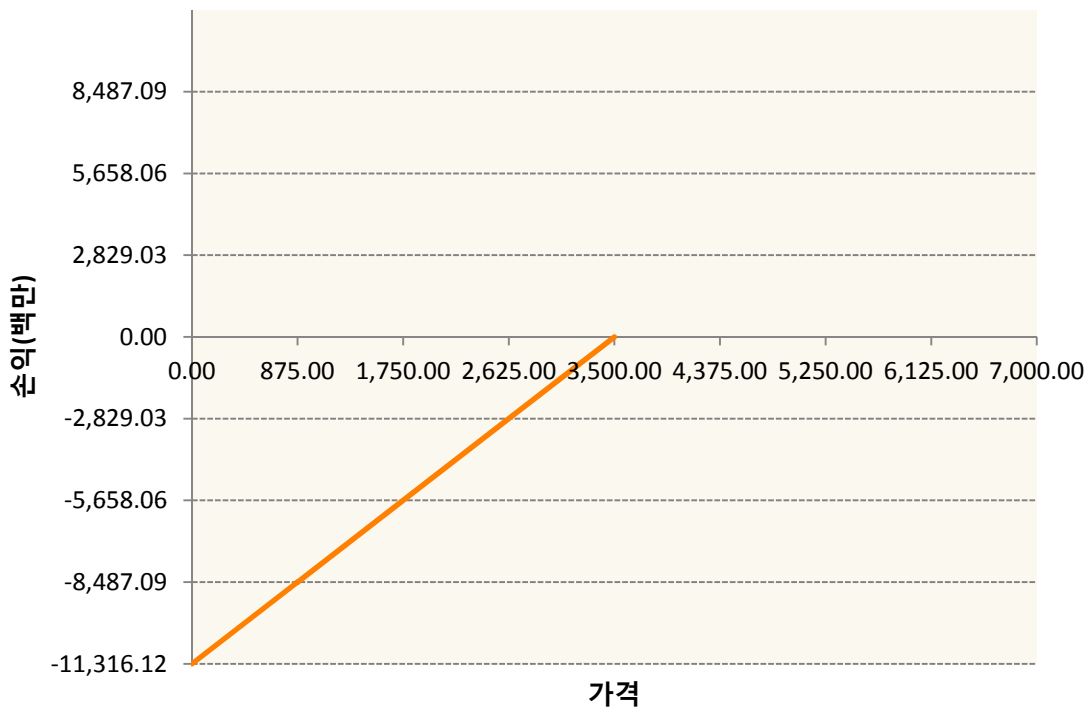


**OESXN8-C3525-EURO STOXX 50**

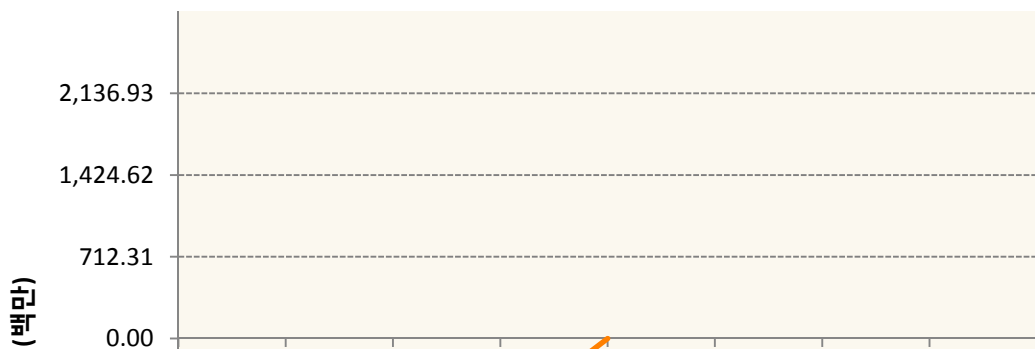


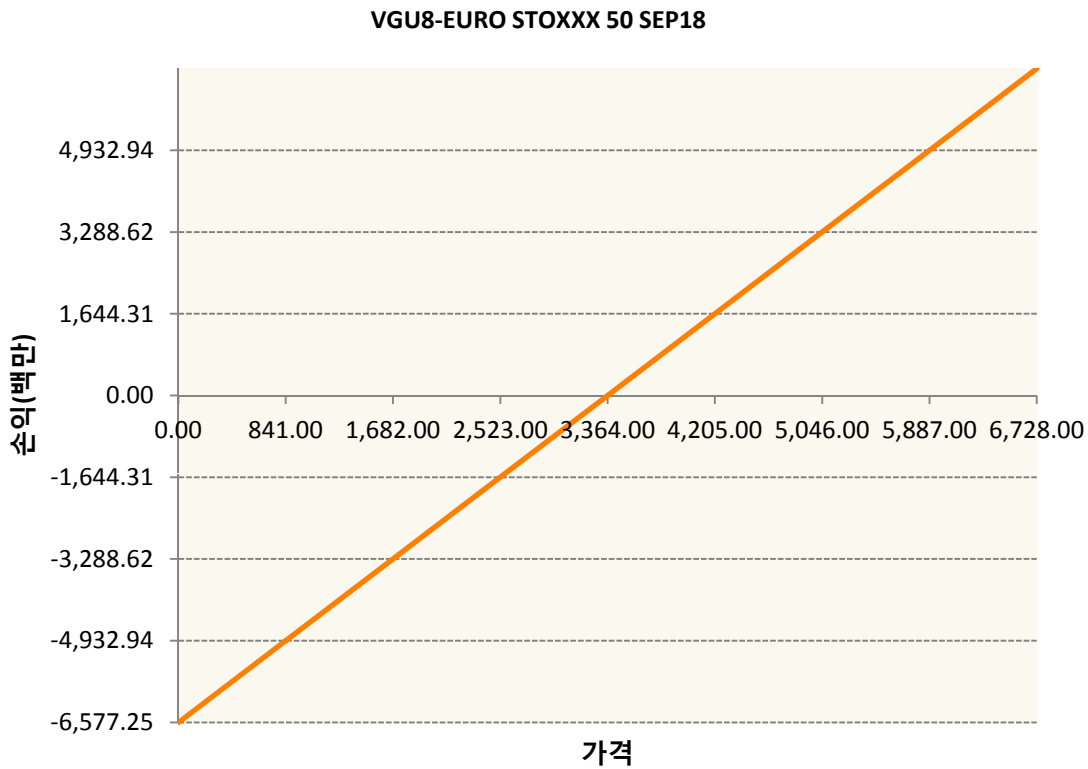
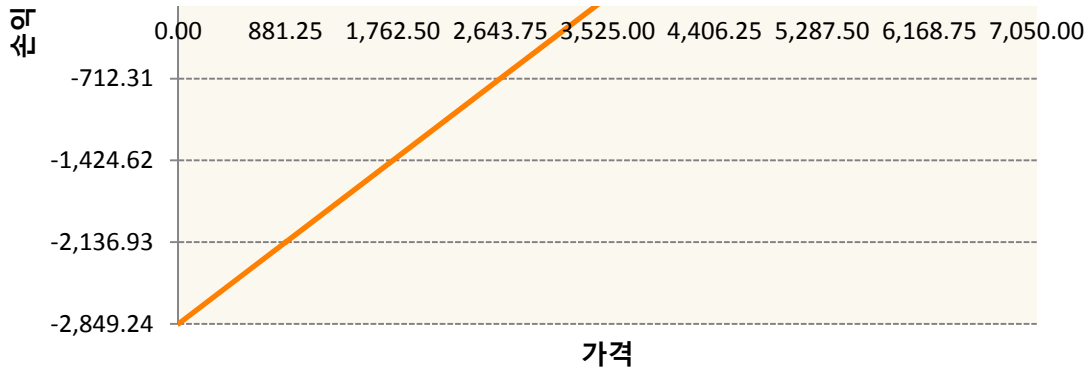


OESXN8-P3500-EURO STOXX 50



OESXN8-P3525-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		75
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		64
OESXN8-C3! EURO STOXX 50		905
OESXN8-C3! EURO STOXX 50		228
OESXN8-P3! EURO STOXX 50		905
OESXN8-P3! EURO STOXX 50		228
VGU8	EURO STOXXX 50 SEP18	526

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





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

(단위:백만원)

1,152



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

(단위:백만원)

81



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

(단위:백만원)

126



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

(단위:백만원)

177

공시일	2018-06-28
기준일	2018-06-27

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1

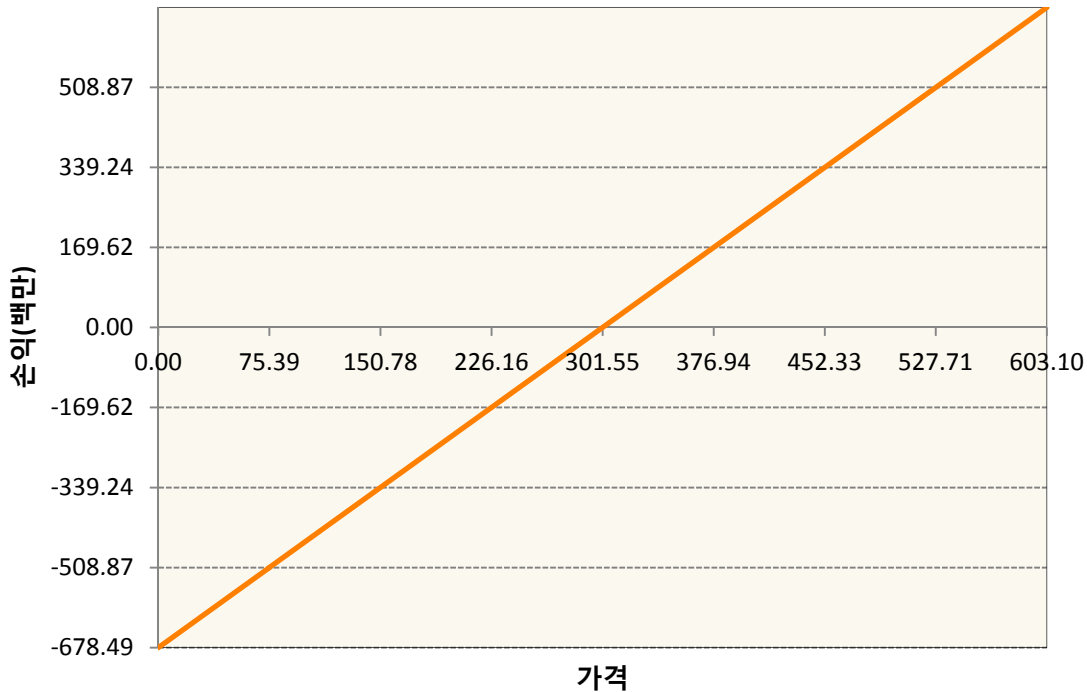
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	678	0	678	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물

54

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	18	18	18	18	18	18	18
5.33%	36	36	36	36	36	36	36
8.00%	54	54	54	54	54	54	54

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-06-28
기준일	2018-06-27

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

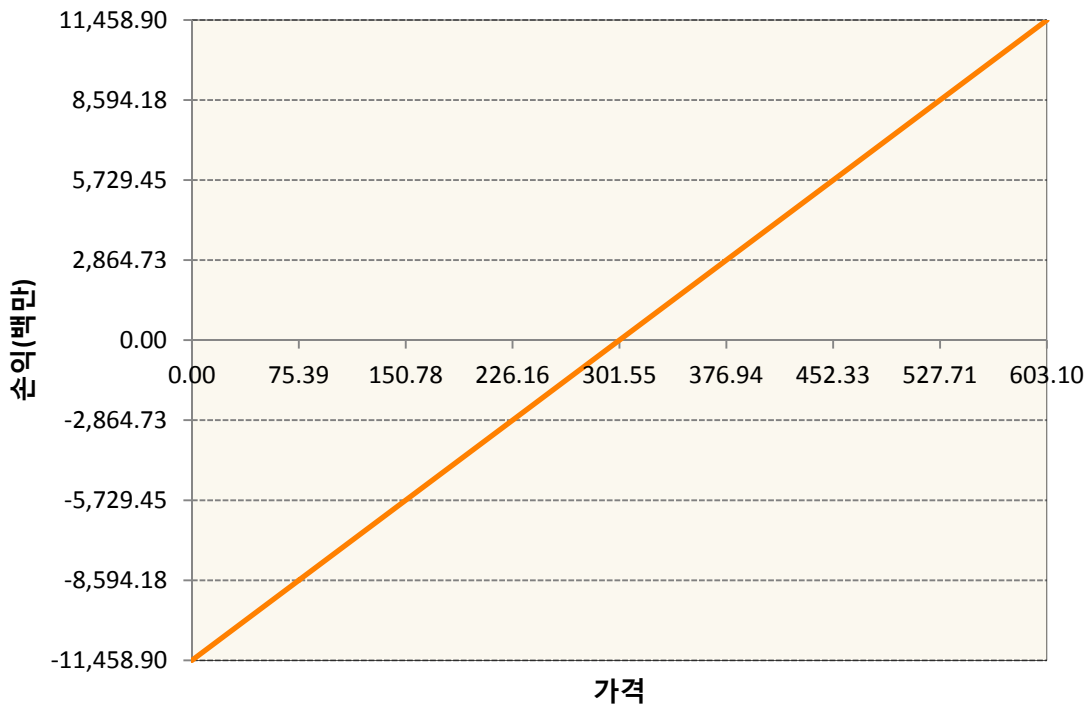
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

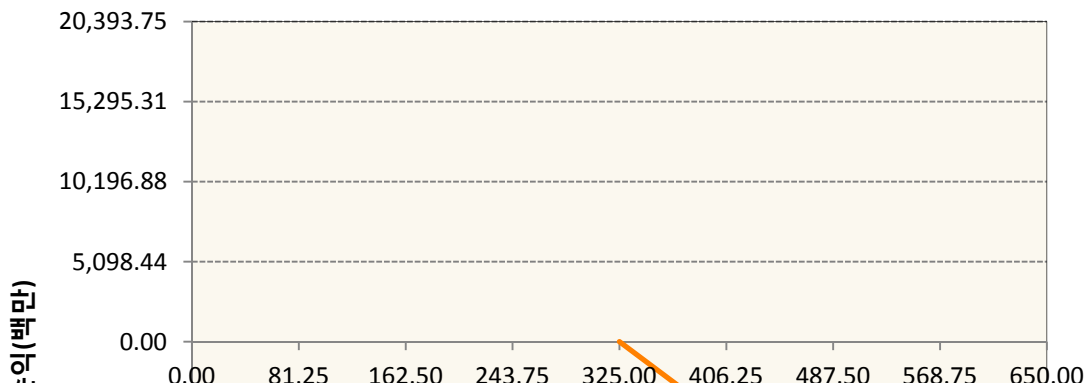
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,459	0	11,459	장내
누계	유가증권	옵션	1,473	20,394	-18,921	장내

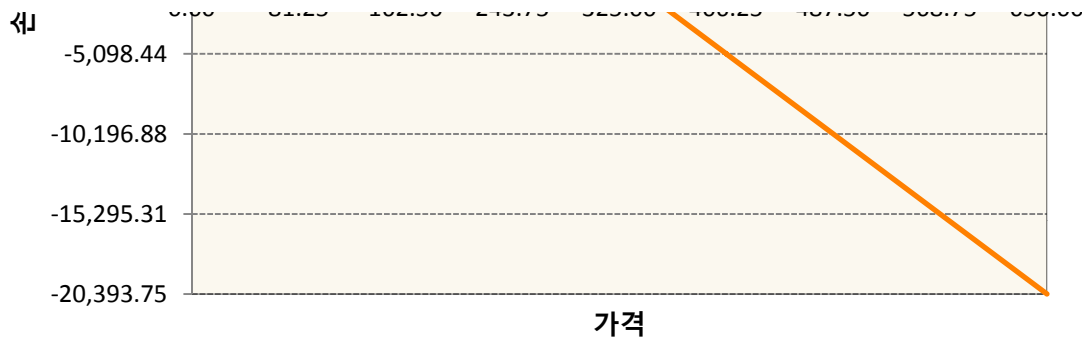
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

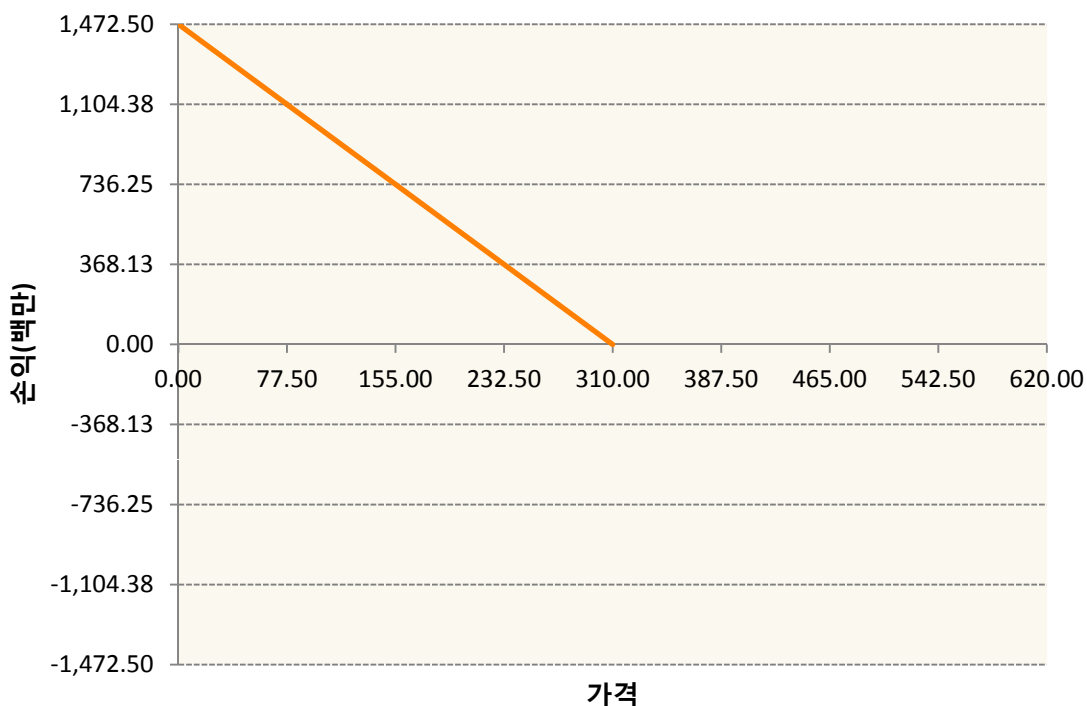


KR4201N73257-2018-07 콜325





KR4301N73107-2018-07 풋310



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물							919
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-919	-919	-919	-919	-919	-919	-919
-5.33%	-613	-613	-613	-613	-613	-613	-613
-2.67%	-306	-306	-306	-306	-306	-306	-306
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	306	306	306	306	306	306	306
5.33%	613	613	613	613	613	613	613
8.00%	919	919	919	919	919	919	919
KR4201N732 2018-07 콜325							598
기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	68	68	68	67	65	62	58
-5.33%	68	67	64	61	56	49	40
-2.67%	64	59	52	43	32	18	2
0%	47	34	18	0	-21	-43	-68
2.67%	-6	-31	-59	-88	-119	-151	-184
5.33%	-128	-165	-203	-242	-280	-319	-359
8.00%	-350	-391	-433	-474	-515	-557	-598

KR4301N7312018-07 풋310

109

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	109	109	109	109	109	109	109
-5.33%	71	71	71	71	71	71	71
-2.67%	33	33	33	34	34	35	35
0%	-3	-2	-1	0	1	2	4
2.67%	-29	-28	-26	-24	-23	-21	-20
5.33%	-40	-39	-38	-37	-36	-35	-33
8.00%	-42	-42	-42	-41	-41	-40	-40

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

(단위:백만원)

1,171

공시일	2018-06-28
기준일	2018-06-27

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

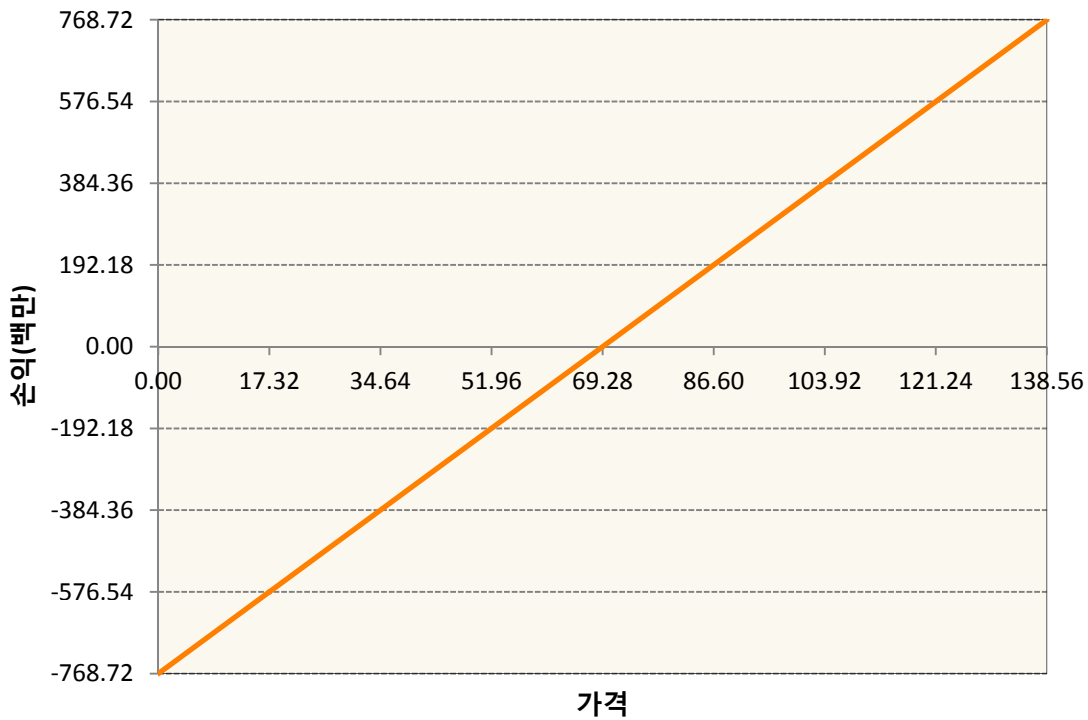
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

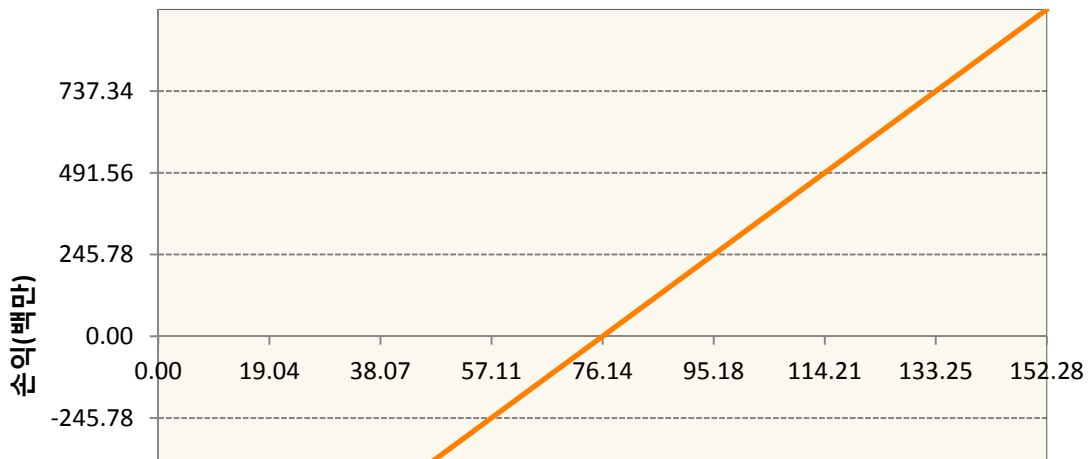
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,757	615	3,142	

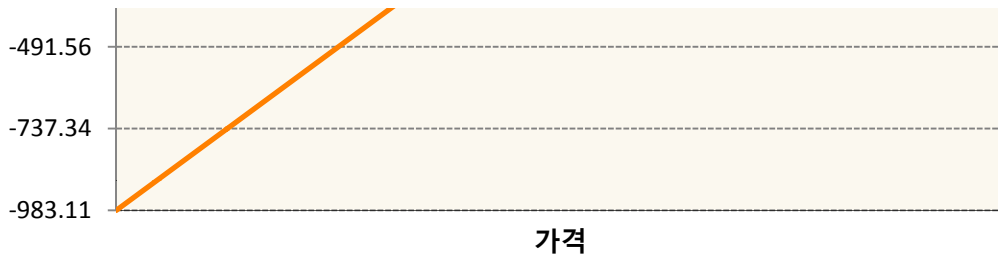
### 2. 만기시점의 손익구조

**CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18**

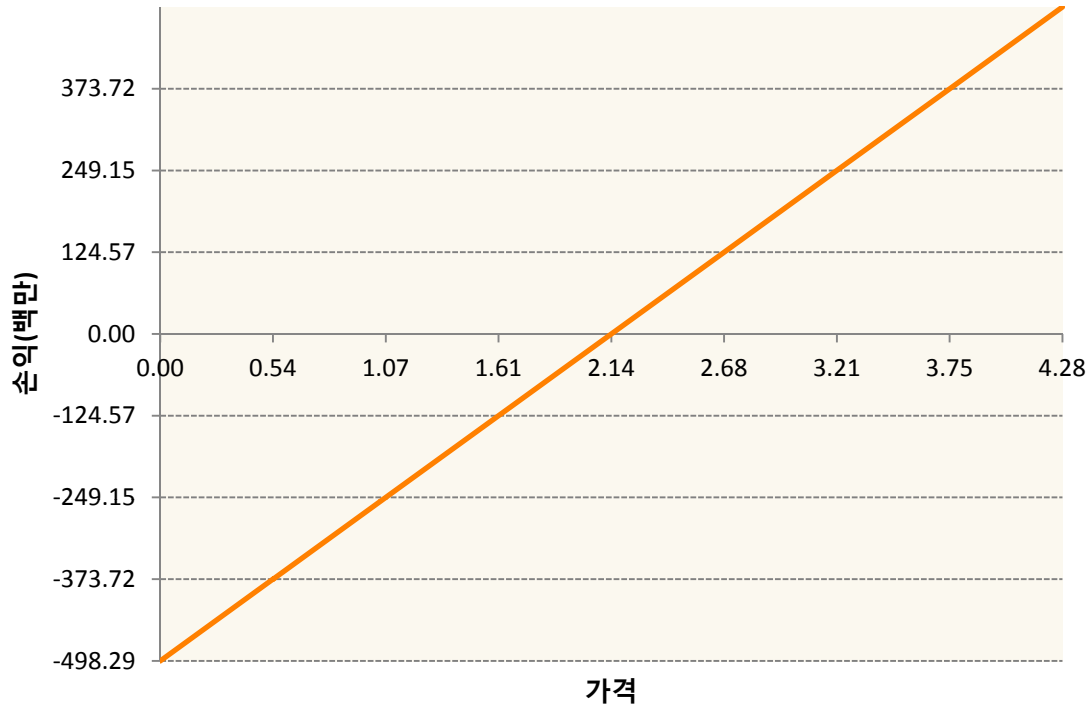


**COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18**

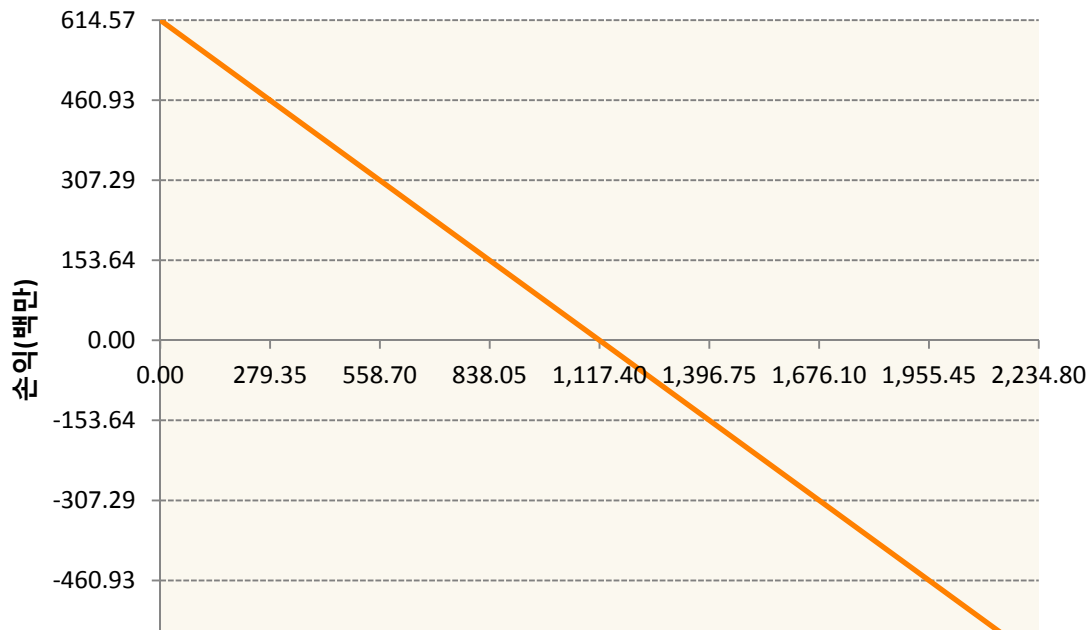


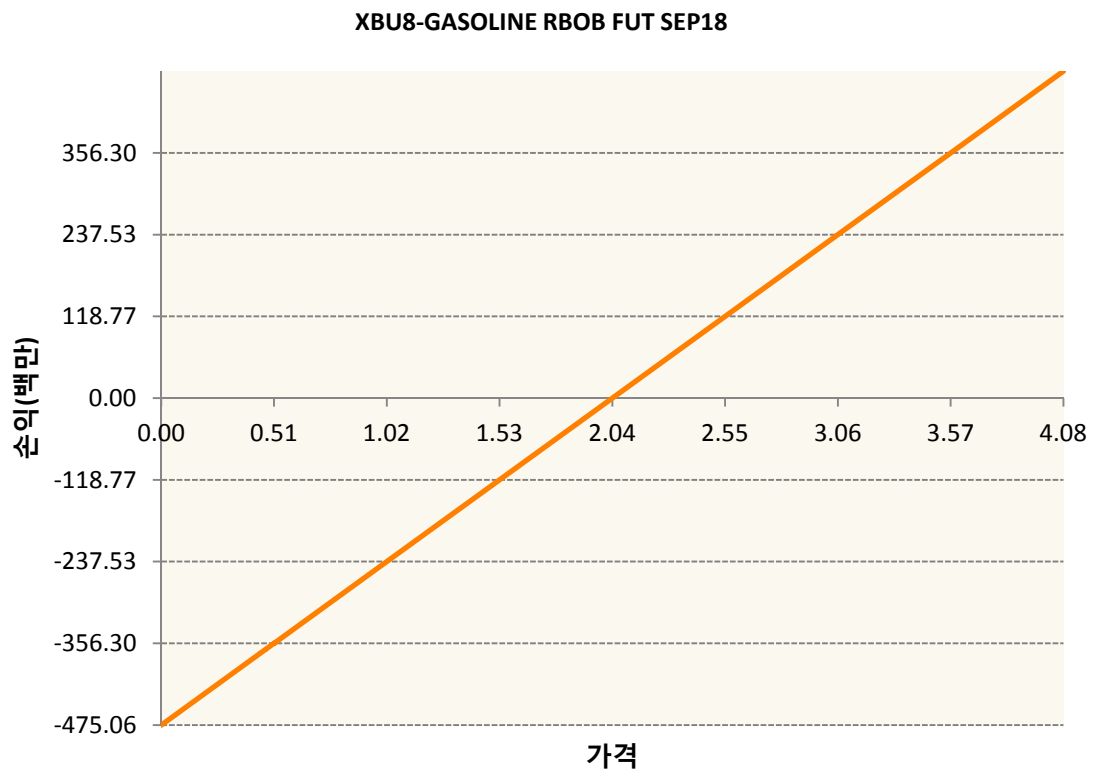
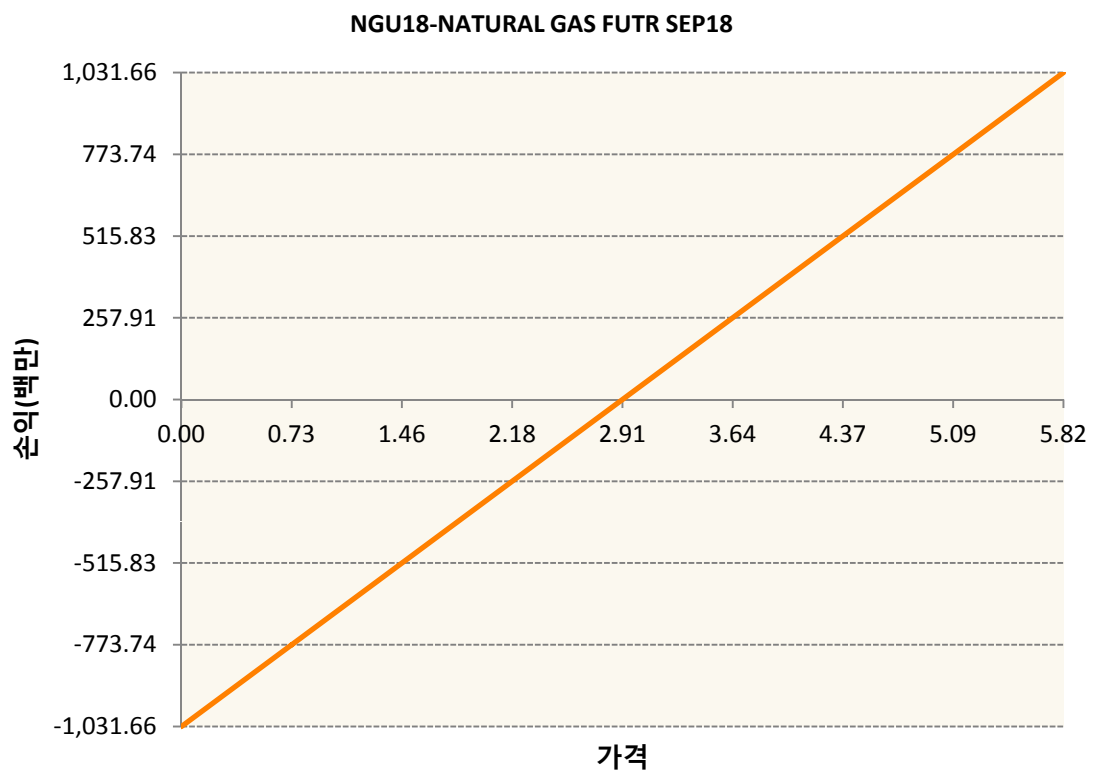
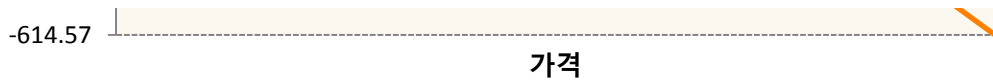


HOU8-NY Harb ULSD Fut SEP18



KR4175N70002-2018-07 달러선물





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

CLU8	WTI CRUDE FUTURE SEP18	61
COU8	BRENT CRUDE FUTR SEP18	79
HOU8	NY Harb ULSD Fut SEP18	40
KR4175N70C	2018-07 달러선물	49
NGU18	NATURAL GAS FUTR SEP18	83
XBU8	GASOLINE RBOB FUT SEP18	38

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

**439**

공시일	2018-06-28
기준일	2018-06-27

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

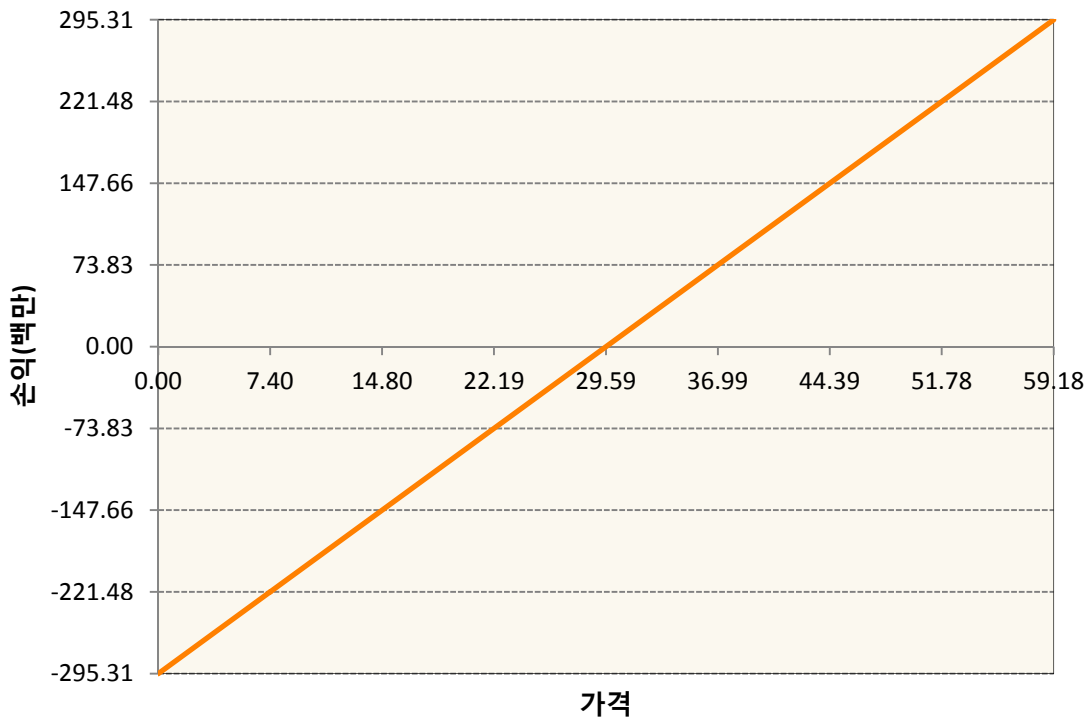
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

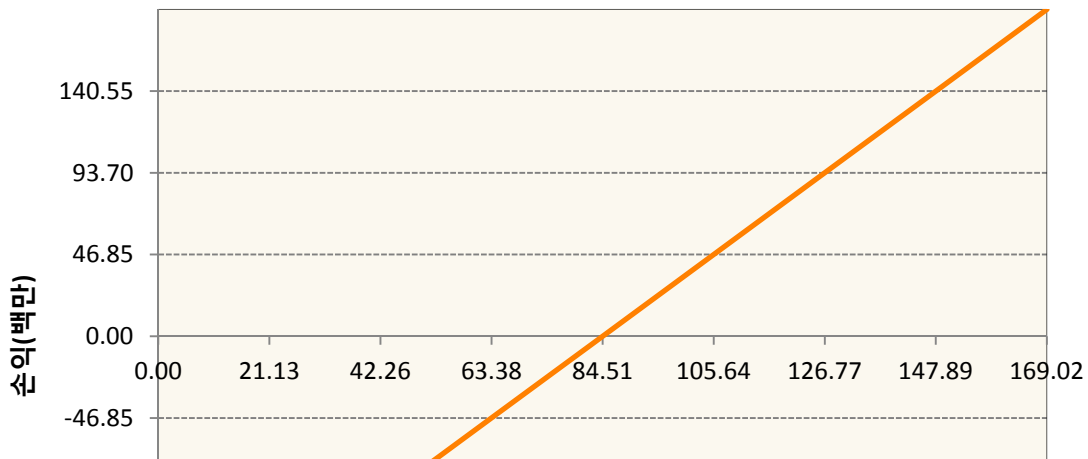
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,710	112	3,598	

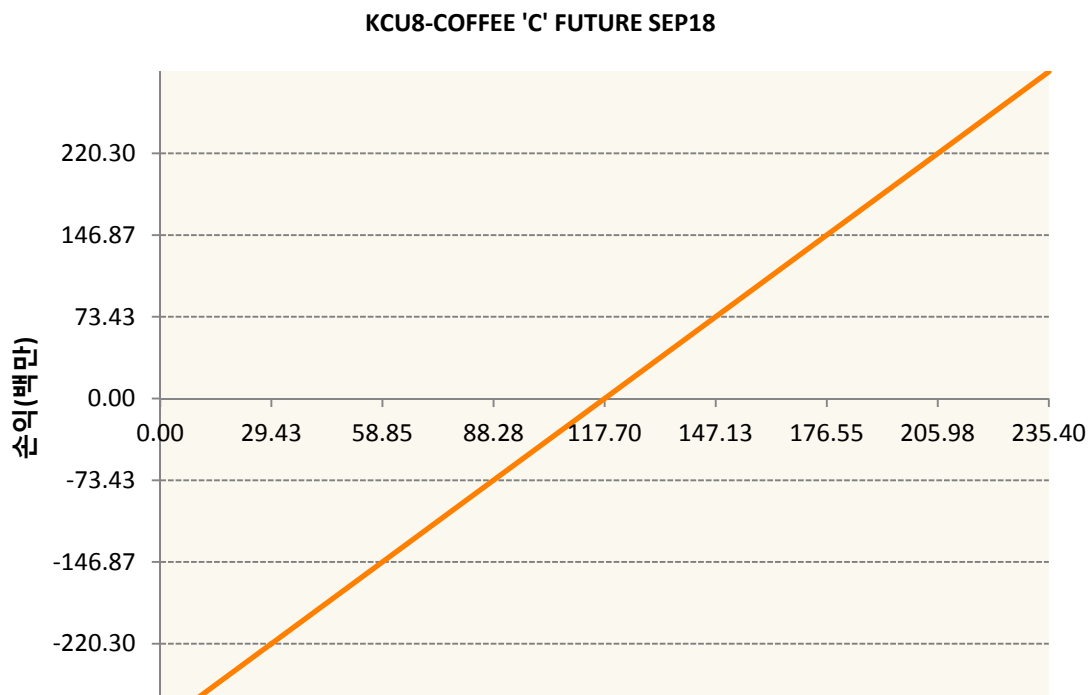
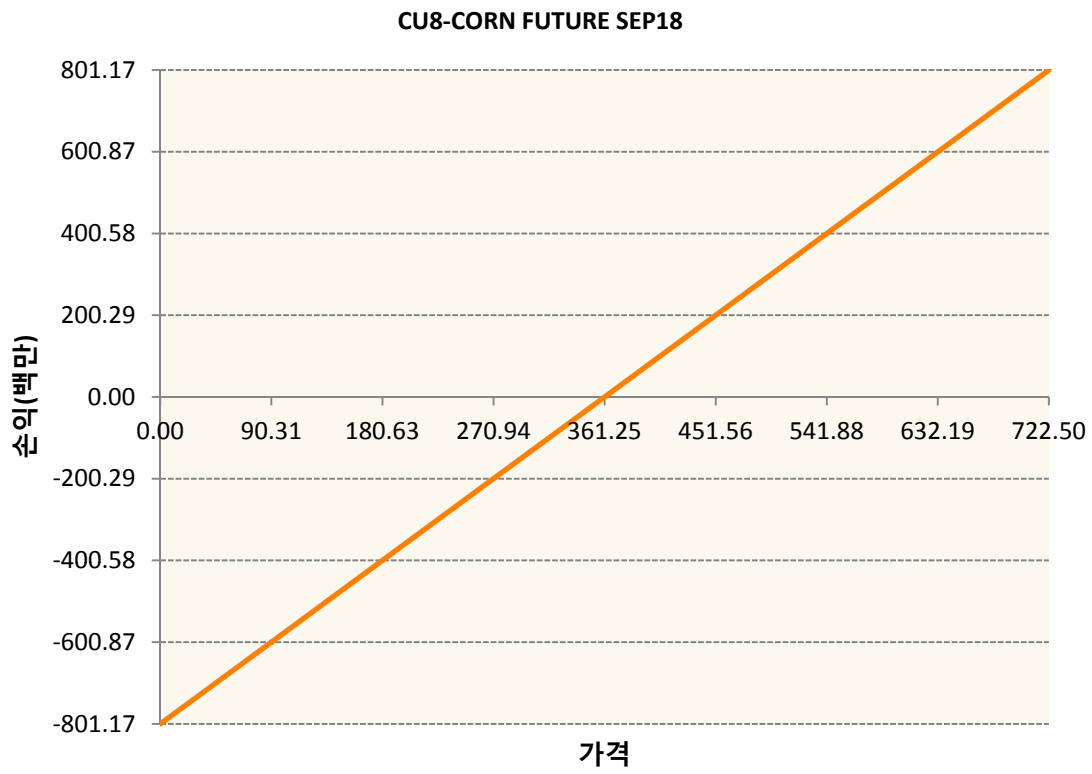
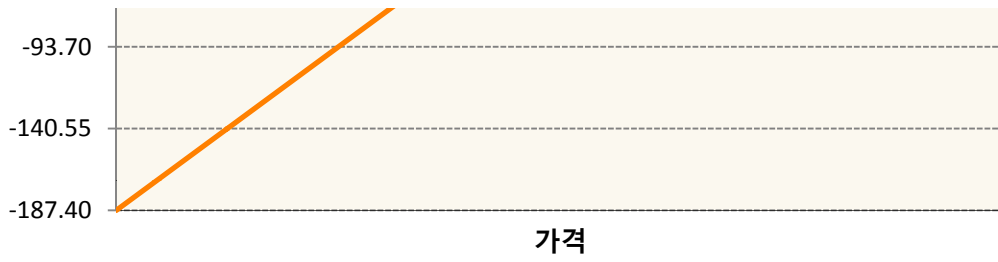
### 2. 만기시점의 손익구조

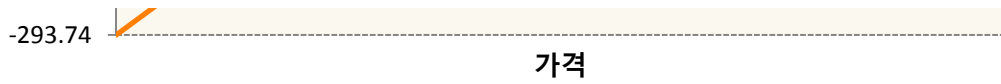
**BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18**



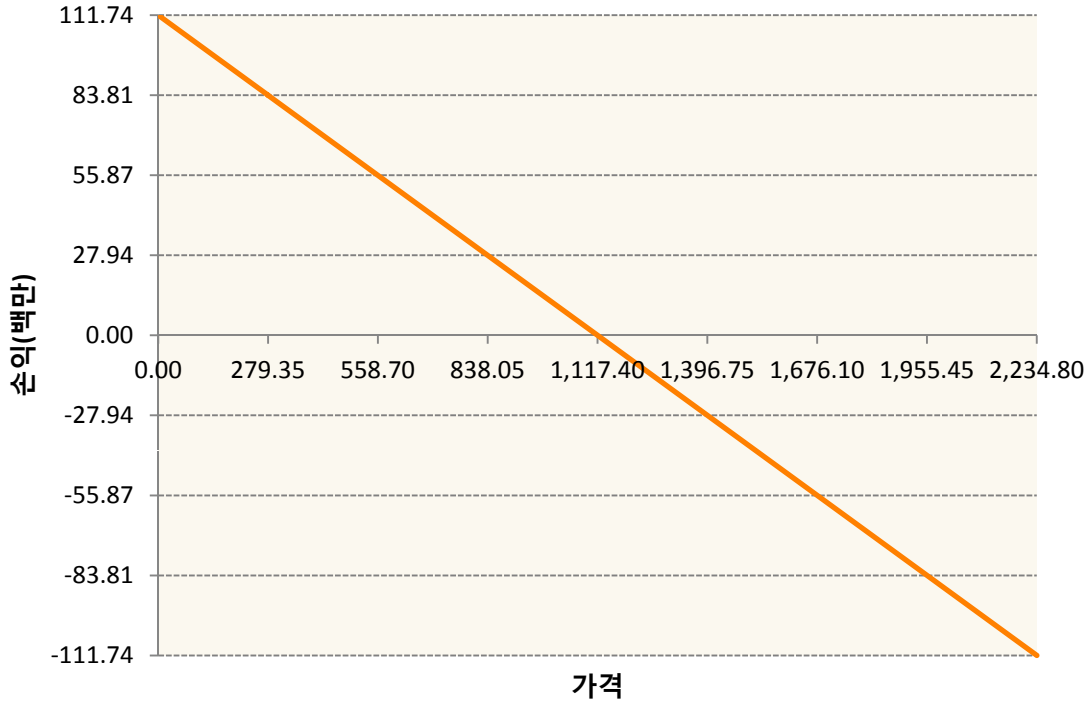
**CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18**



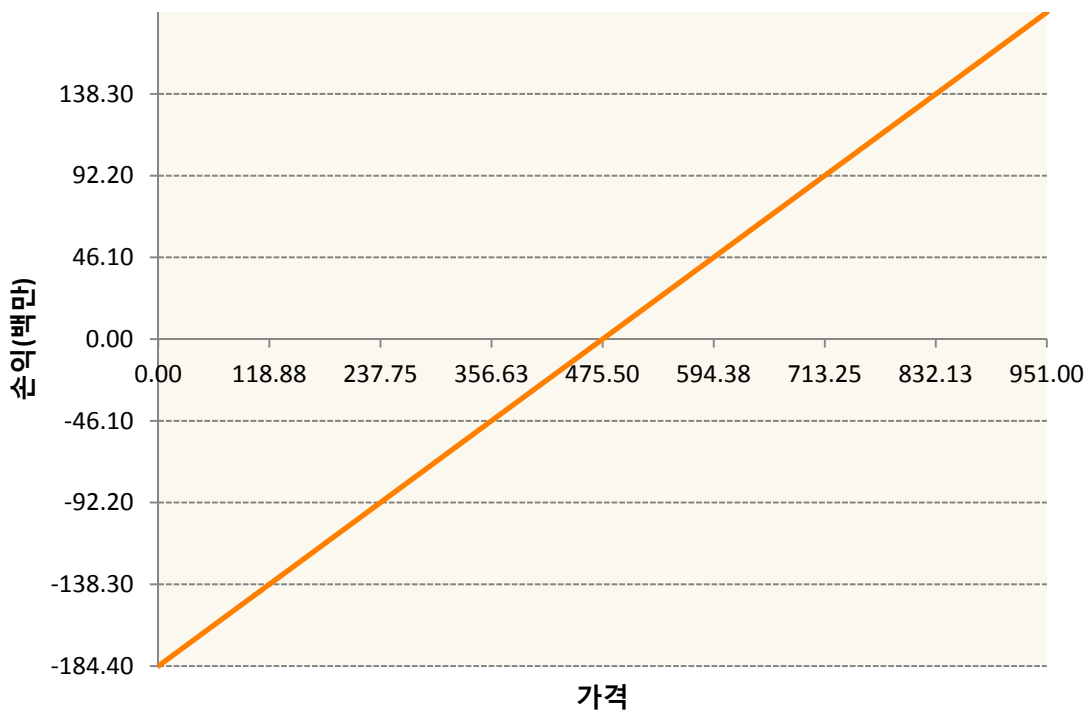




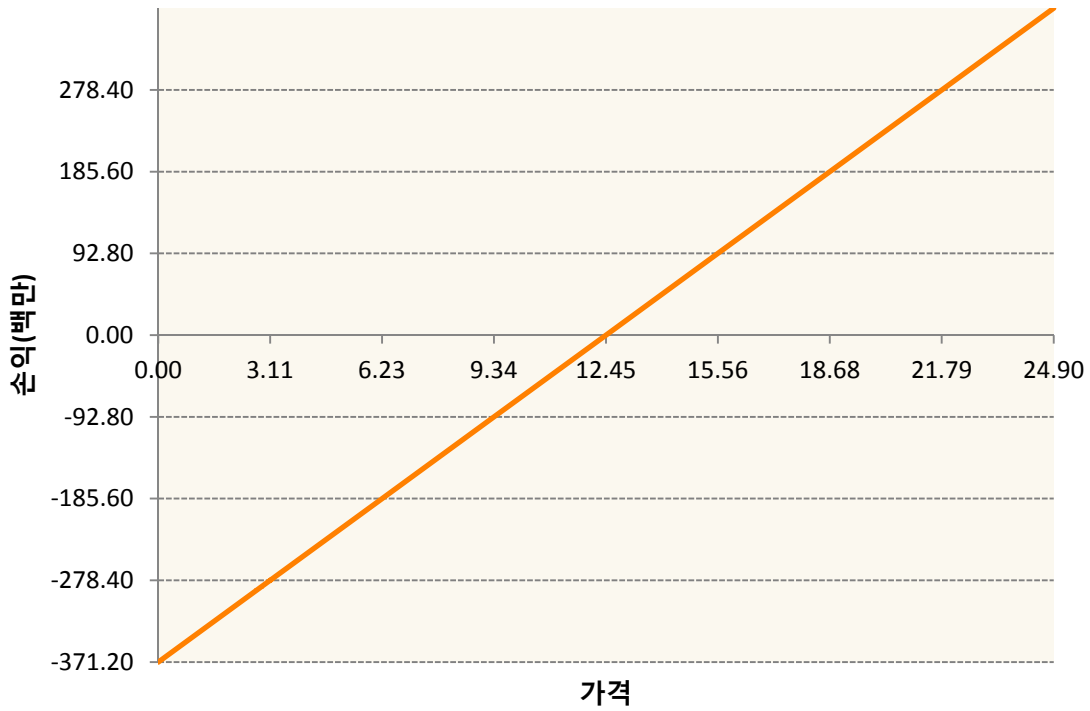
KR4175N70002-2018-07 달러선물



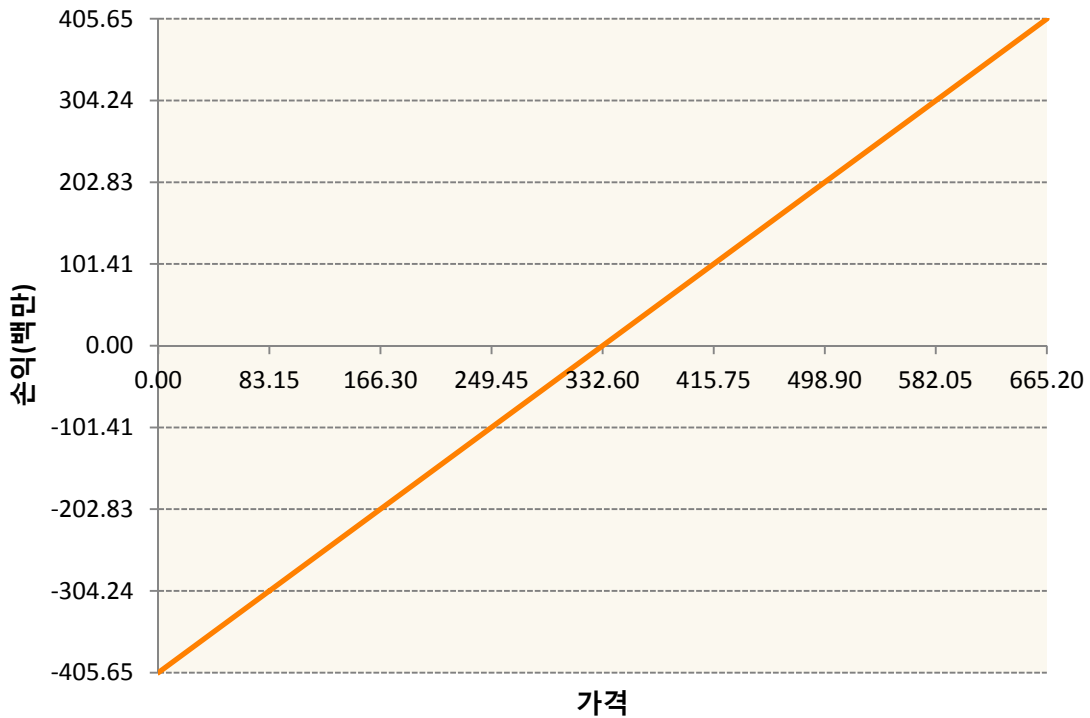
KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

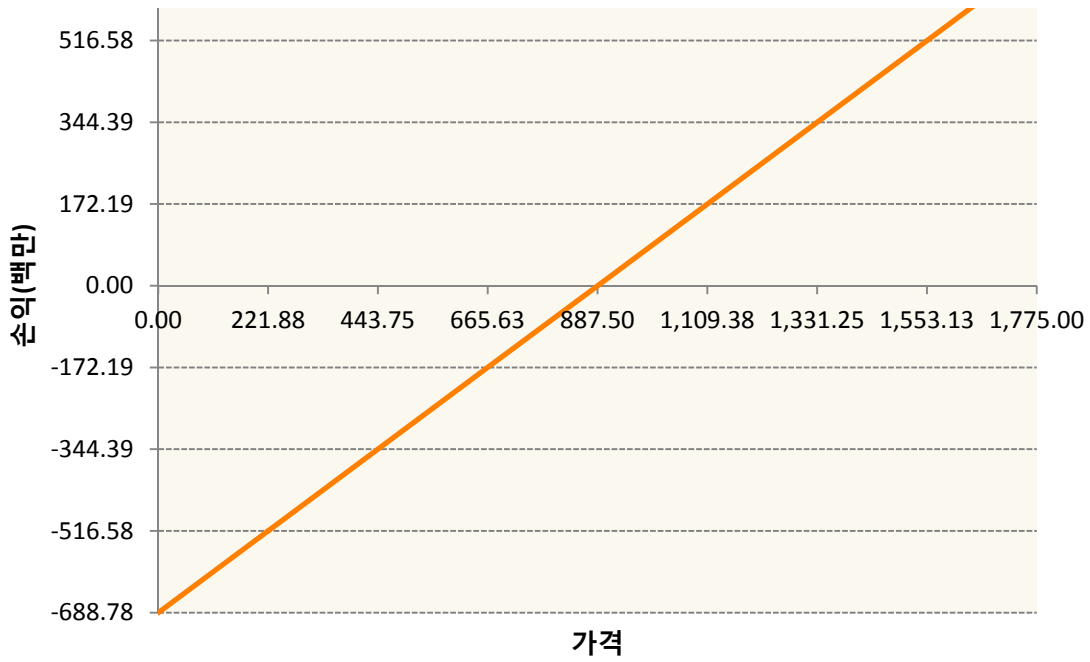


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

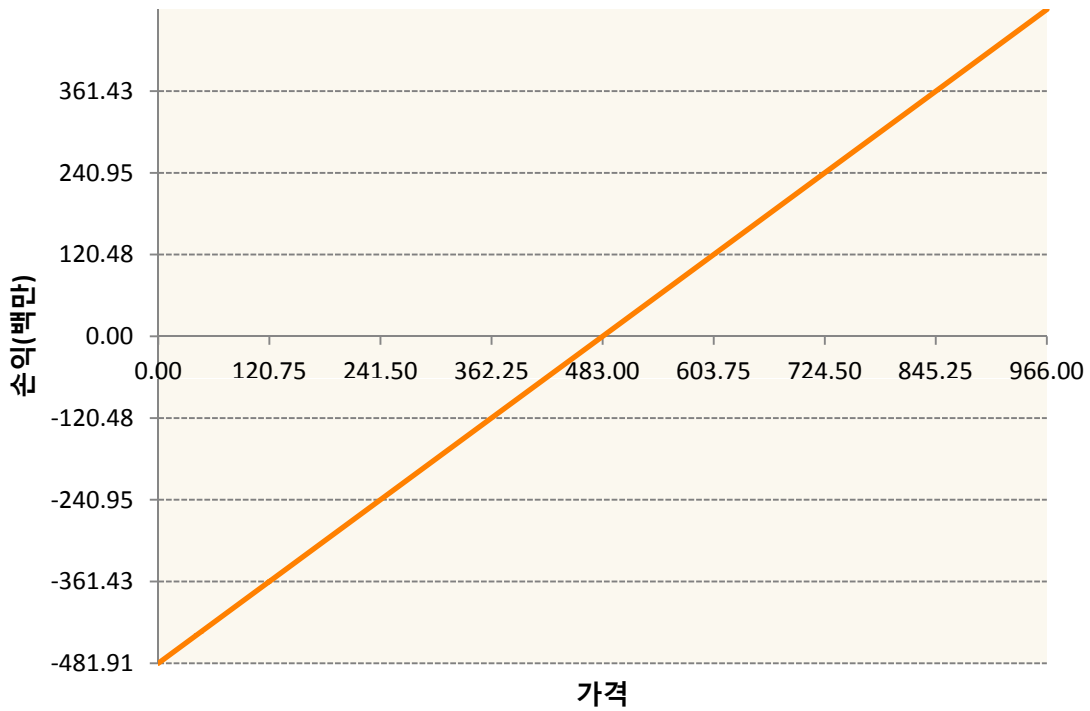


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





WU8-WHEAT FUTURE(CBT) SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	24
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	15
CU8	CORN FUTURE SEP18	64
KCU8	COFFEE 'C' FUTURE SEP18	23
KR4175N70C	2018-07 달러선물	9

KWU8	KC HRW WHEAT FUT SEP18	15
SBV8	SUGAR #11 (WORLD) OCT18	30
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	32
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	55
WU8	WHEAT FUTURE(CBT) SEP18	39

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

(단위:백만원)

**304**