

공시일	2018-06-29
기준일	2018-06-28

## 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	2018-06-29
기준일	2018-06-28

## 스마트인덱스모

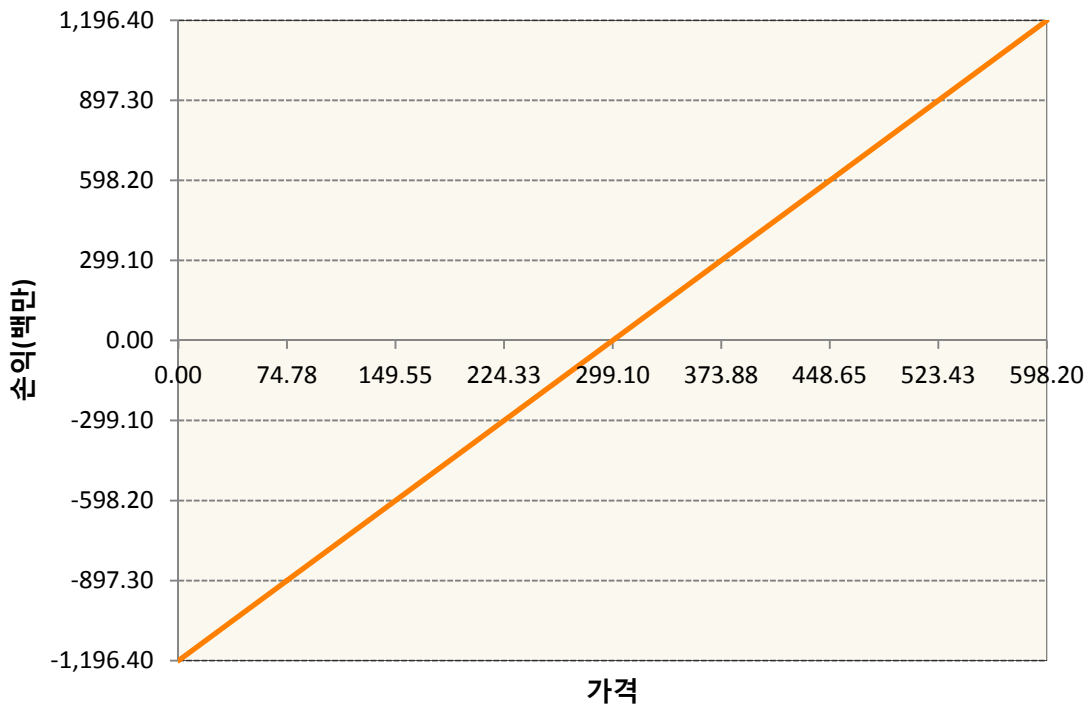
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,196	0	1,196	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



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

(단위:백만원)

71

공시일	2018-06-29
기준일	2018-06-28

## 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

1,097

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

460

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-06-29
기준일	2018-06-28

## 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

322

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

378

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-06-29
기준일	2018-06-28

## 유로인덱스모(주식-파생형)

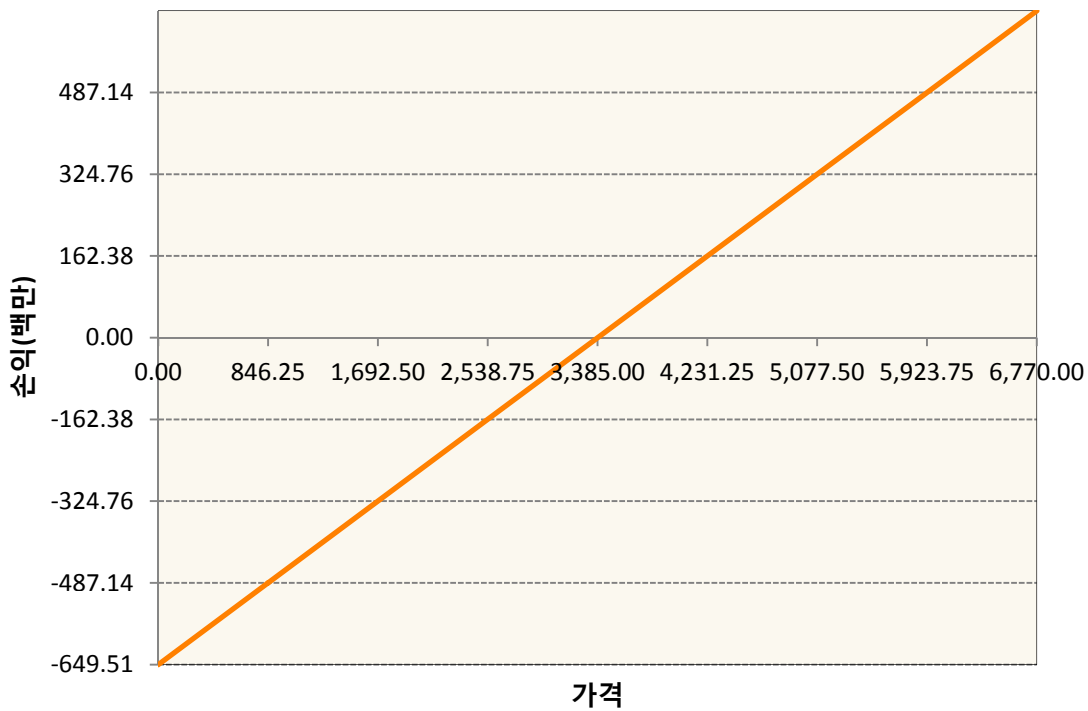
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	650	0	650	

### 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	2018-06-29
기준일	2018-06-28

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

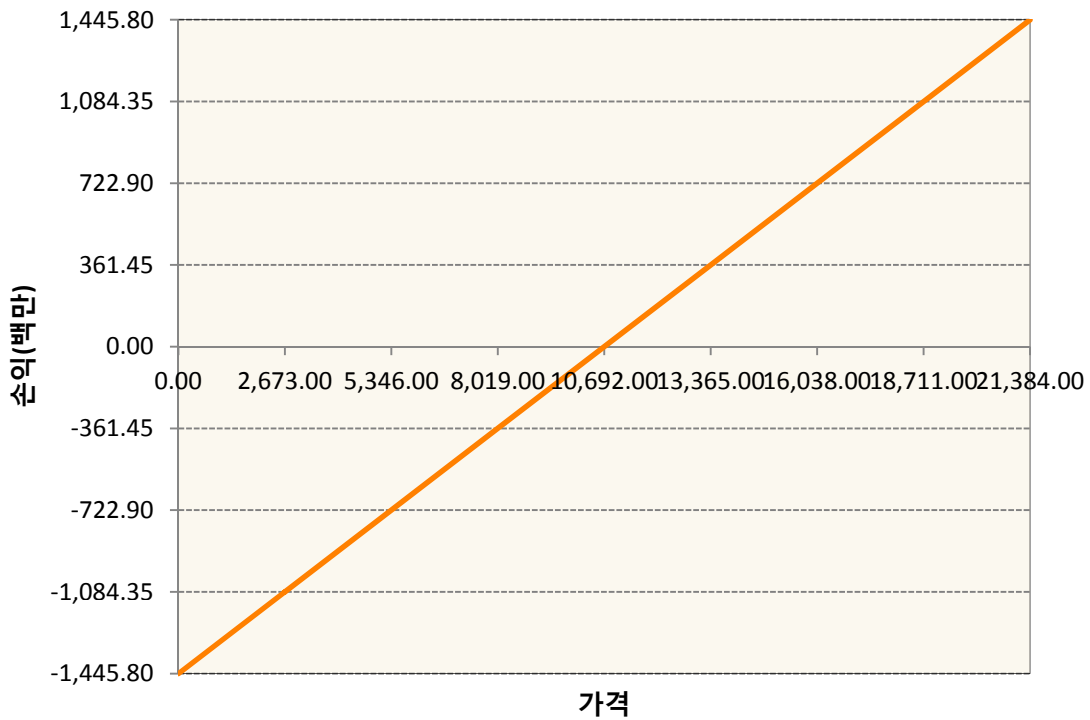
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

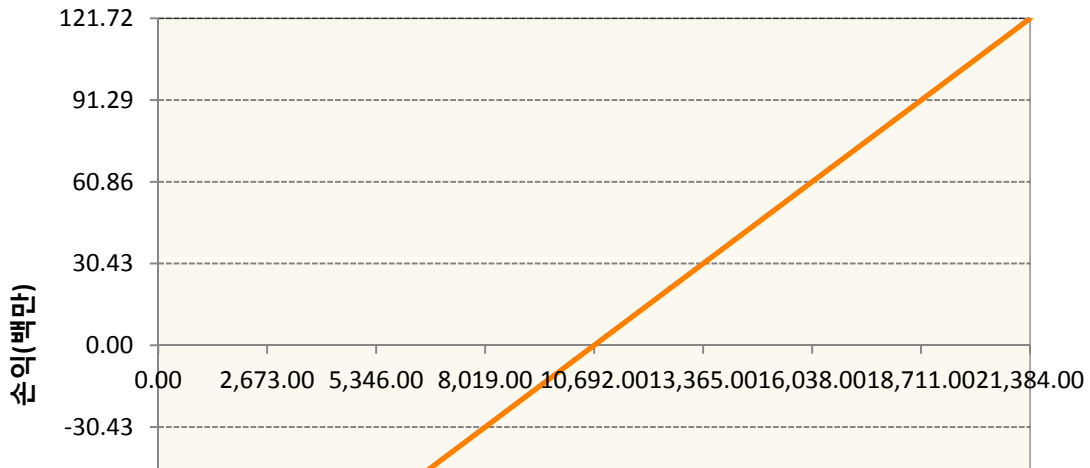
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,568	0	1,568	장내

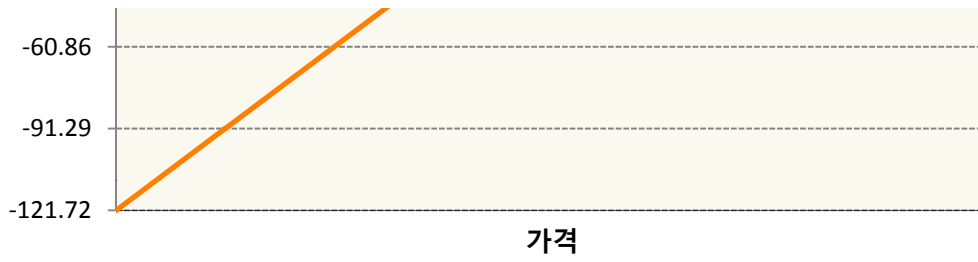
### 2. 만기시점의 손익구조

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	2018-06-29
기준일	2018-06-28

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

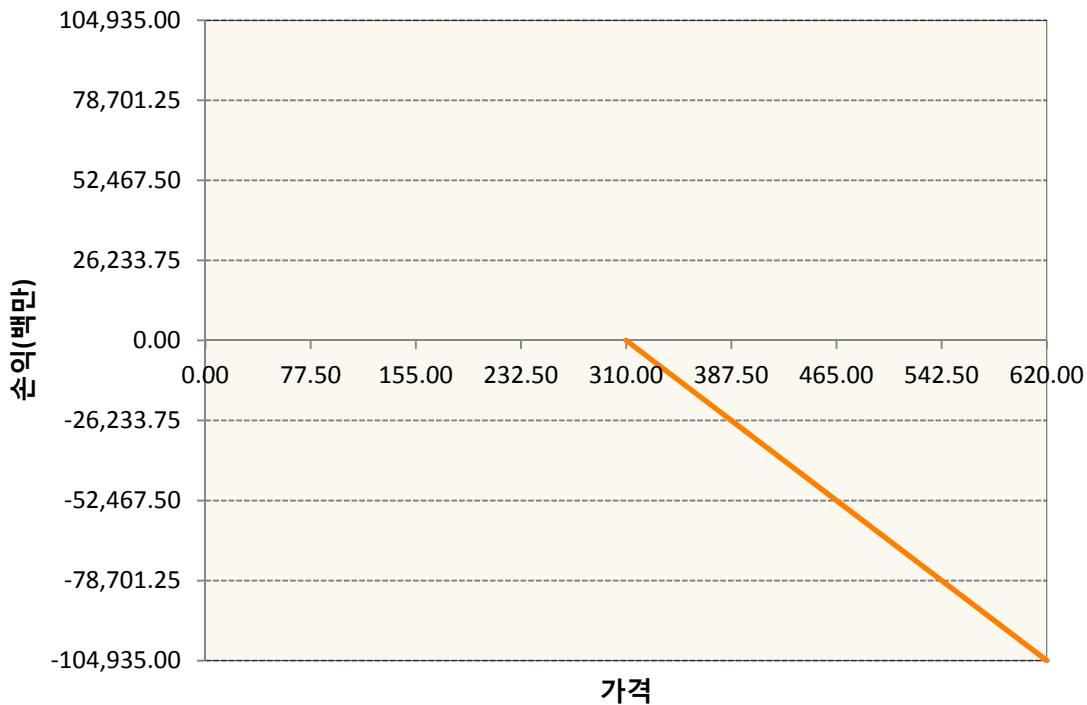
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

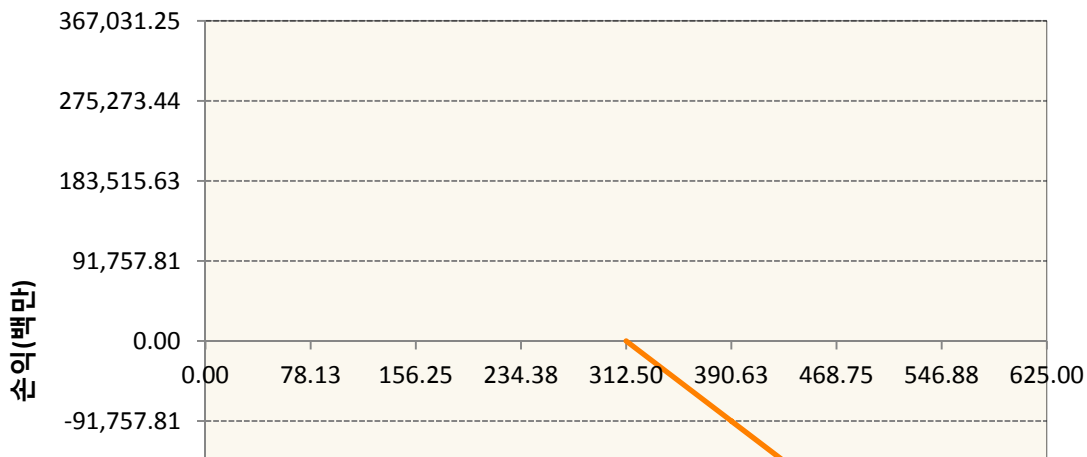
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	766,466	-766,466	장내

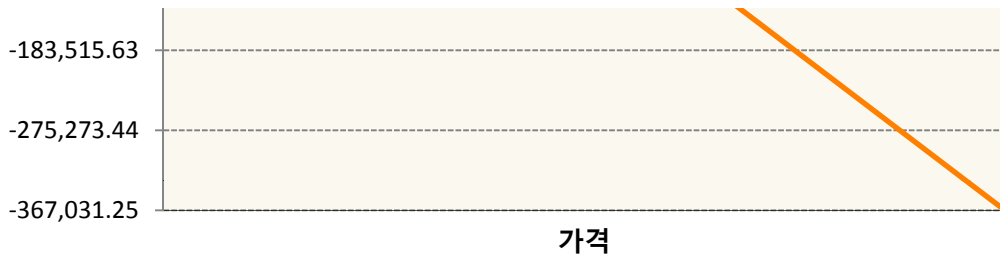
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201N73109-2018-07 콜310**

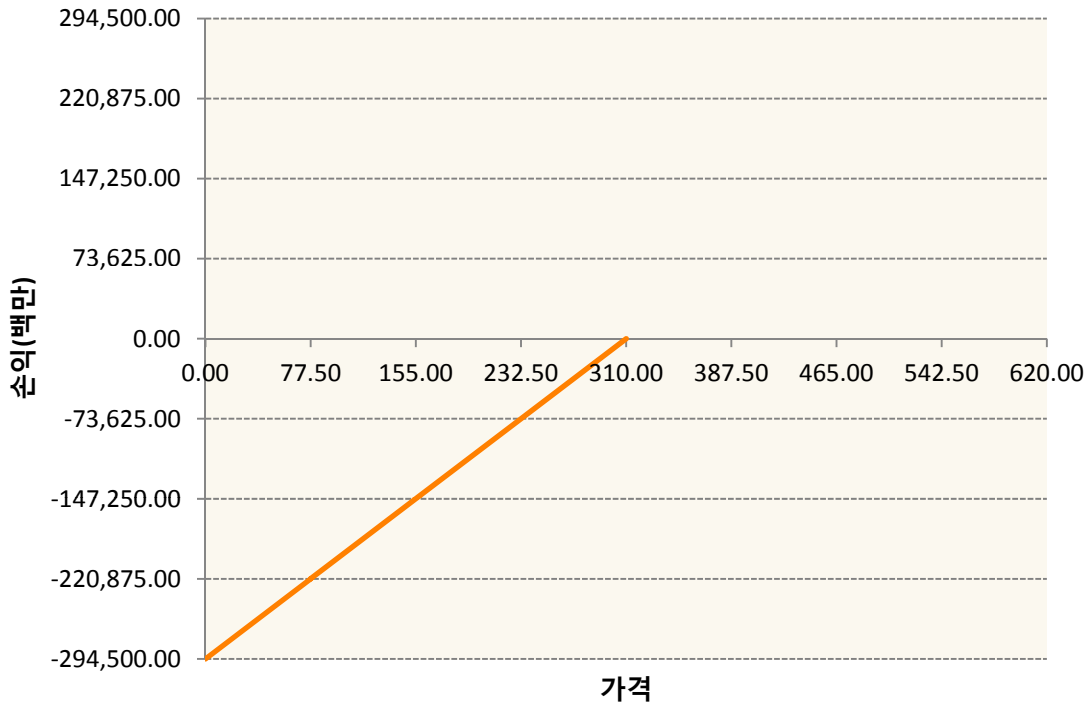


**KR4201N73125-2018-07 콜312.5**





KR4301N73107-2018-07 풋310



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N7312018-07 콜310

4,687

		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	966	959	945	924	895	856	808	
-5.33%	939	910	869	816	750	673	586	
-2.67%	823	745	652	547	430	304	169	
0%	468	321	164	0	-170	-344	-522	
2.67%	-330	-531	-734	-937	-1,141	-1,345	-1,550	
5.33%	-1,712	-1,914	-2,119	-2,324	-2,530	-2,736	-2,944	
8.00%	-3,655	-3,809	-3,972	-4,143	-4,320	-4,502	-4,687	

KR4201N7312018-07 콜312.5

14,994

		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,685	2,668	2,636	2,582	2,503	2,395	2,257	

-5.33%	2,628	2,556	2,448	2,301	2,114	1,889	1,627
-2.67%	2,354	2,141	1,877	1,567	1,214	825	404
0%	1,438	997	515	0	-541	-1,105	-1,686
2.67%	-791	-1,453	-2,125	-2,806	-3,493	-4,186	-4,882
5.33%	-4,933	-5,663	-6,393	-7,124	-7,856	-8,588	-9,320
8.00%	-11,096	-11,703	-12,332	-12,979	-13,641	-14,313	-14,994

KR4301N7312018-07 풋310

22,043

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,036	-22,036	-22,036	-22,036	-22,037	-22,039	-22,043
-5.33%	-14,486	-14,487	-14,489	-14,494	-14,503	-14,519	-14,542
-2.67%	-6,946	-6,962	-6,990	-7,031	-7,087	-7,159	-7,247
0%	412	297	159	0	-178	-371	-578
2.67%	6,666	6,370	6,069	5,763	5,454	5,142	4,828
5.33%	10,342	10,048	9,747	9,441	9,131	8,818	8,502
8.00%	11,553	11,432	11,286	11,119	10,932	10,730	10,512

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

(단위:백만원)

**40,955**

공시일	2018-06-29
기준일	2018-06-28

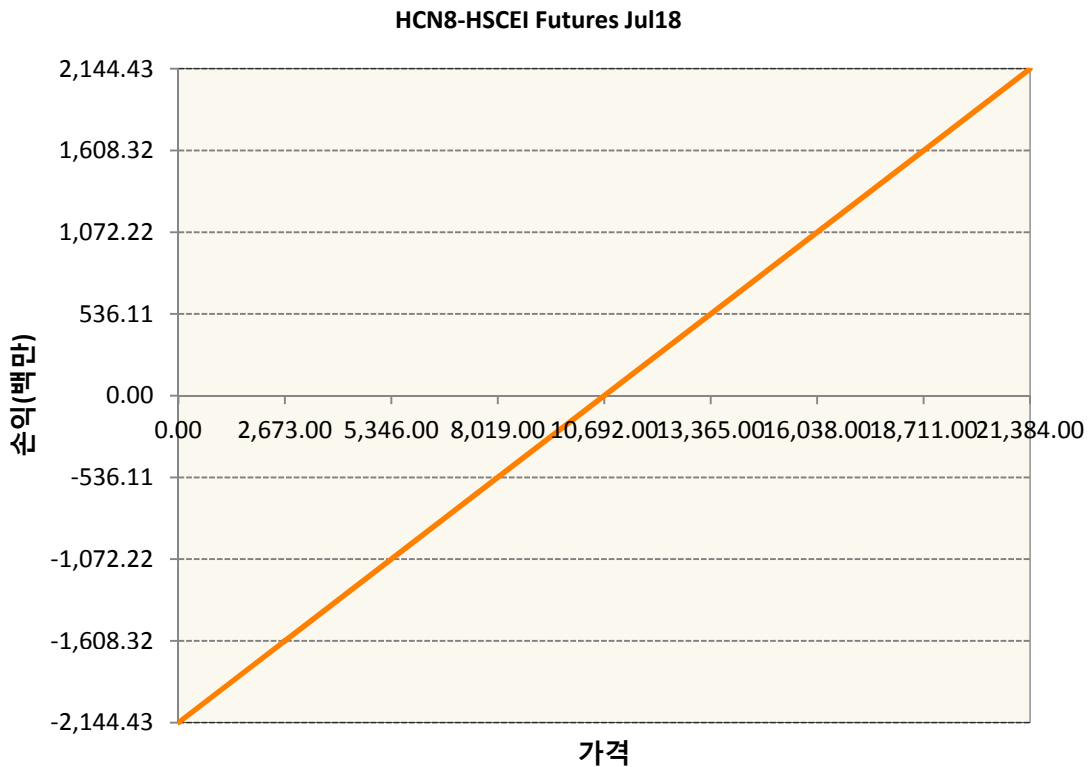
## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,144	0	2,144	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN8	HSCEI Futures Jul18	172
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

<b>155</b>
------------

공시일	2018-06-29
기준일	2018-06-28

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

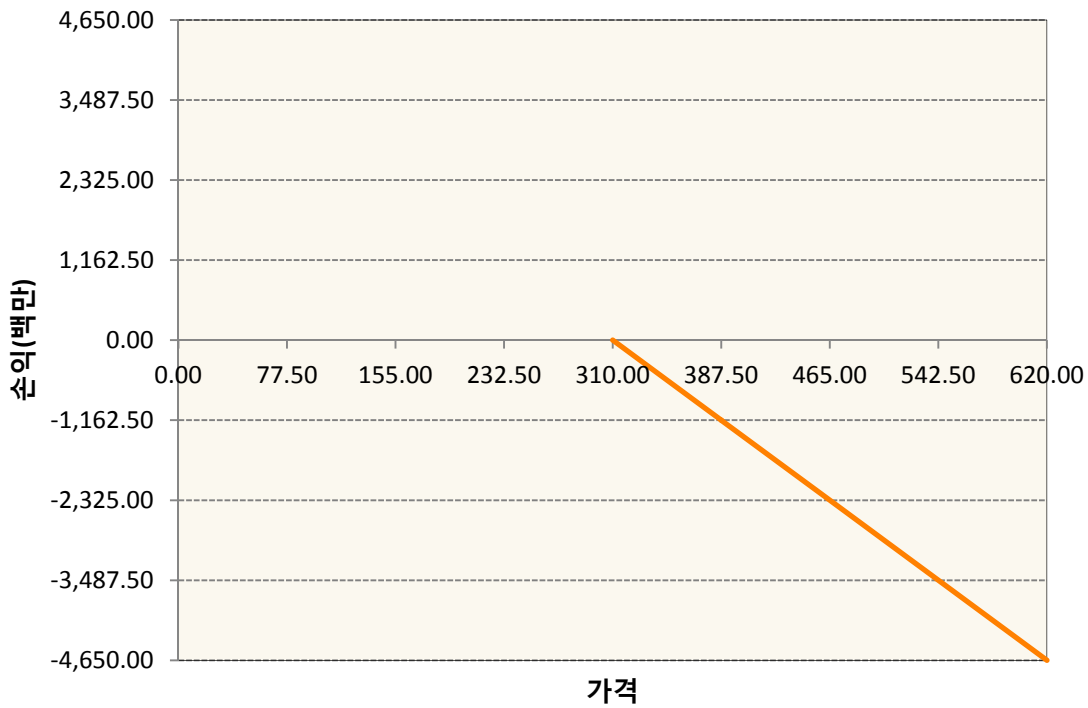
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

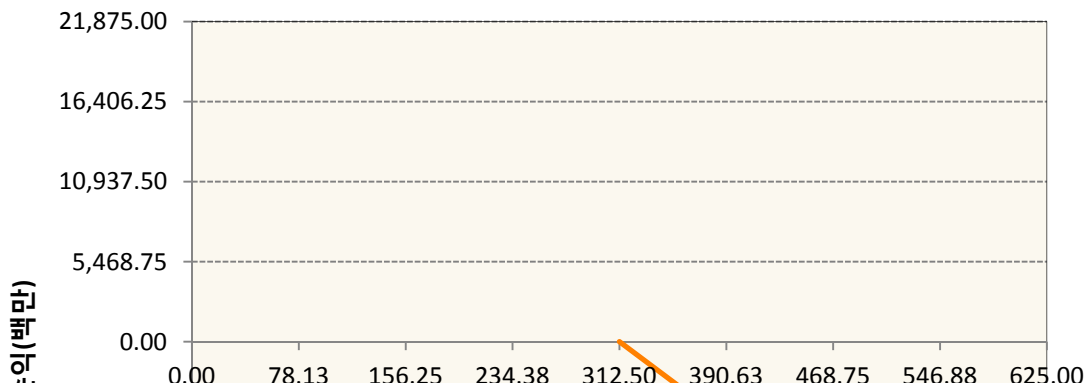
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	45,900	-45,900	장내

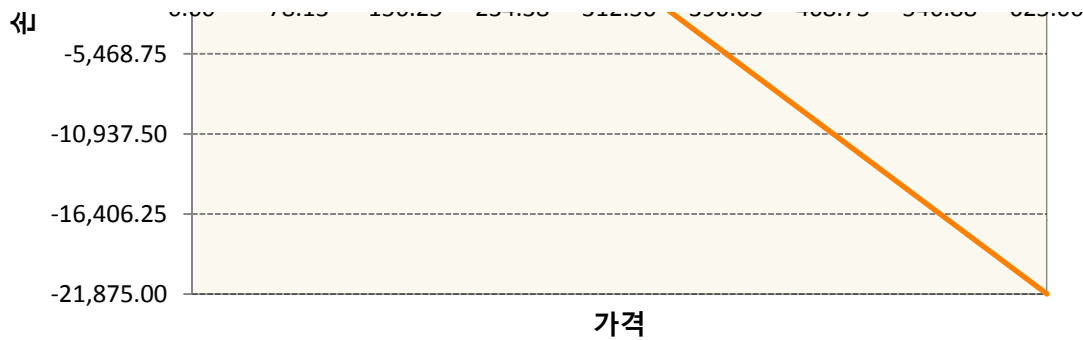
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N73109-2018-07 콜310

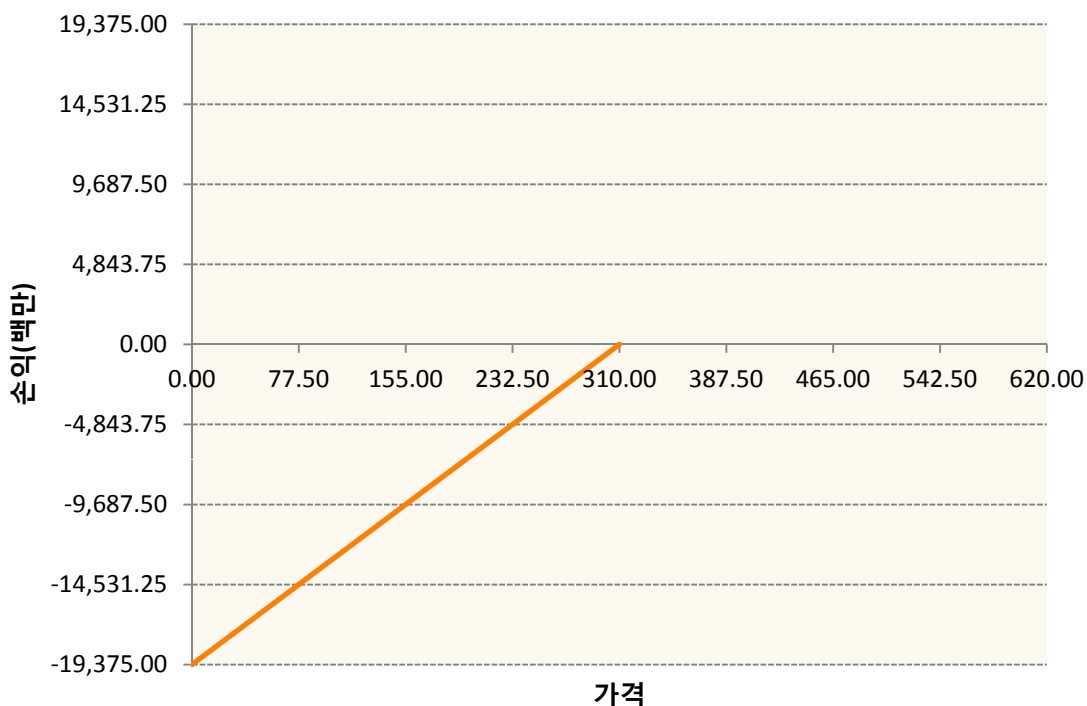


KR4201N73125-2018-07 콜312.5





KR4301N73107-2018-07 풋310



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,499
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,499	-1,499	-1,499	-1,499	-1,499	-1,499	-1,499
-5.33%	-999	-999	-999	-999	-999	-999	-999
-2.67%	-500	-500	-500	-500	-500	-500	-500
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	499	500	499	499	500	500	499
5.33%	999	999	999	999	999	999	999
8.00%	1,499	1,499	1,499	1,499	1,499	1,499	1,499
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							284
	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

208

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	43	42	42	41	40	38	36
-5.33%	42	40	39	36	33	30	26
-2.67%	36	33	29	24	19	13	8
0%	21	14	7	0	-8	-15	-23
2.67%	-15	-24	-33	-42	-51	-60	-69
5.33%	-76	-85	-94	-103	-112	-121	-130
8.00%	-162	-169	-176	-184	-191	-199	-208

KR4201N7312018-07 콜312.5

894

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	160	159	157	154	149	143	135
-5.33%	157	152	146	137	126	113	97
-2.67%	140	128	112	93	72	49	24
0%	86	59	31	0	-32	-66	-100
2.67%	-47	-87	-127	-167	-208	-249	-291
5.33%	-294	-337	-381	-425	-468	-512	-555
8.00%	-661	-697	-735	-774	-813	-853	-894

KR4301N7312018-07 풋310

1,450

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,450	-1,450	-1,450	-1,450	-1,450	-1,450	-1,450
-5.33%	-953	-953	-953	-954	-954	-955	-957
-2.67%	-457	-458	-460	-463	-466	-471	-477
0%	27	20	10	0	-12	-24	-38
2.67%	439	419	399	379	359	338	318
5.33%	680	661	641	621	601	580	559
8.00%	760	752	743	732	719	706	692

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

(단위:백만원)

6,432

공시일	2018-06-29
기준일	2018-06-28

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

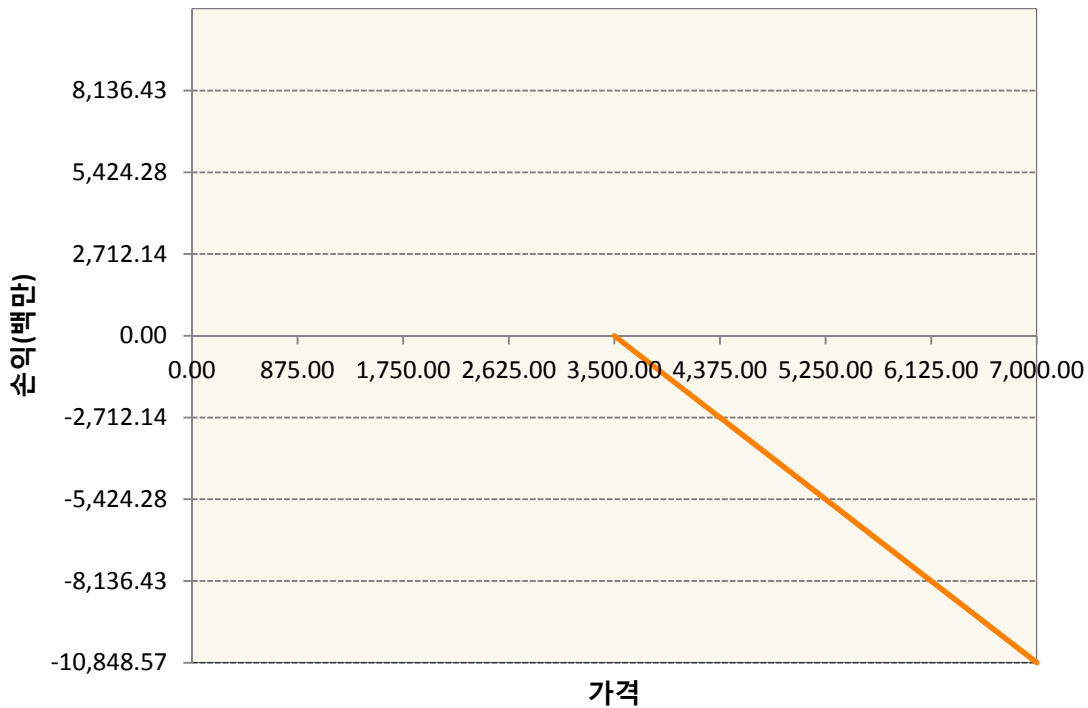
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

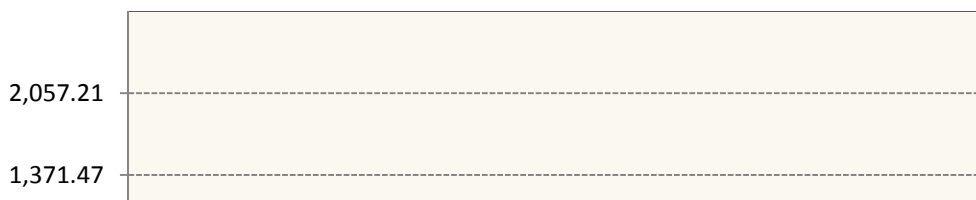
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,144	0	6,144	
누계	유가증권	스왑	44,303	0	44,303	장외
누계	유가증권	옵션	0	27,183	-27,183	장내
누계	지수	스왑	51,876	0	51,876	장외

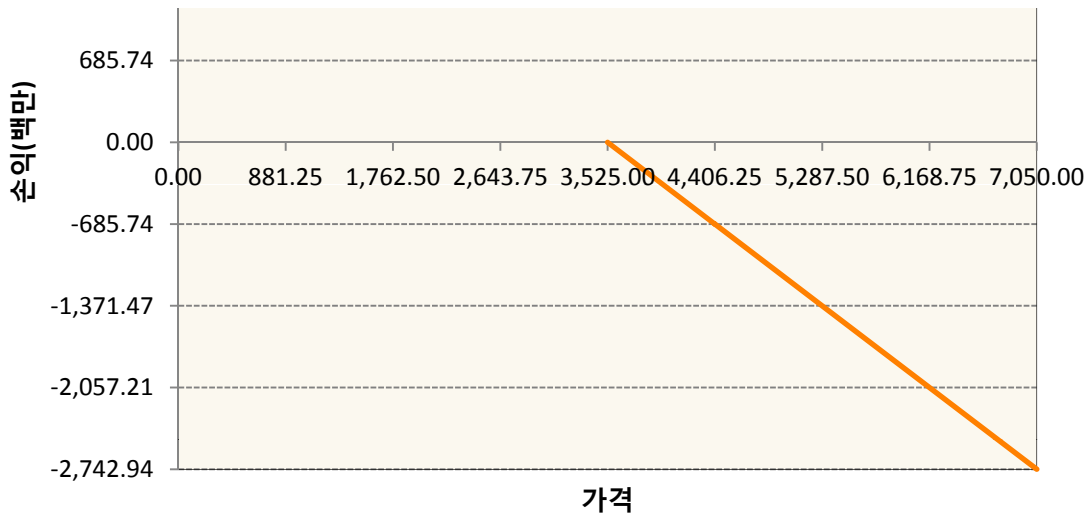
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXN8-C3500-EURO STOXX 50

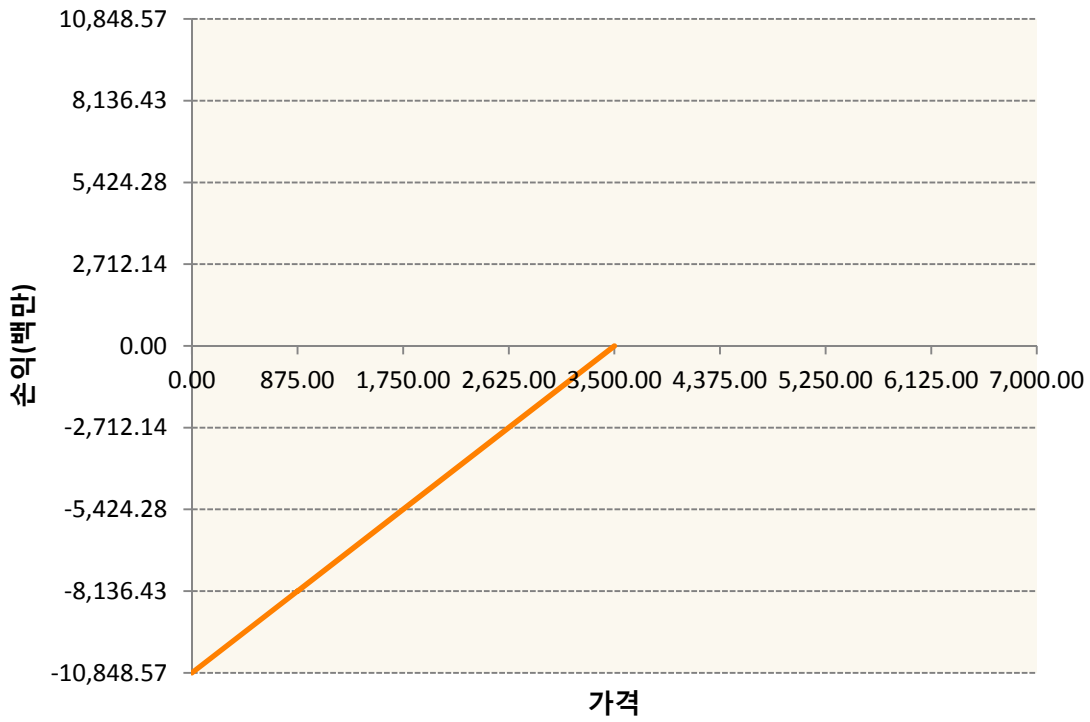


OESXN8-C3525-EURO STOXX 50

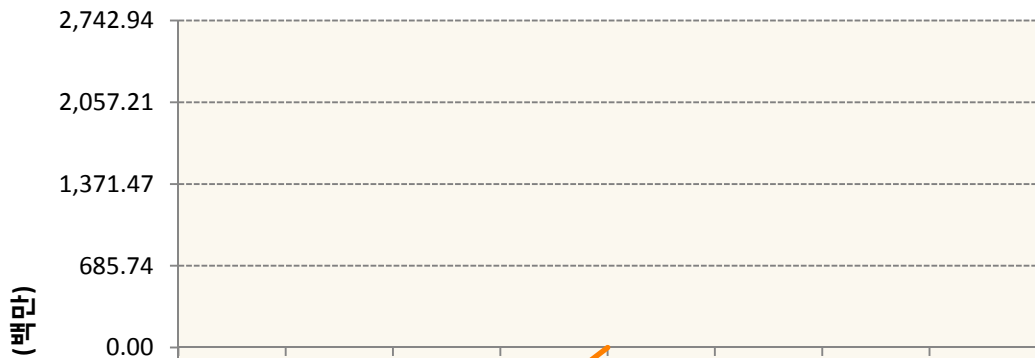


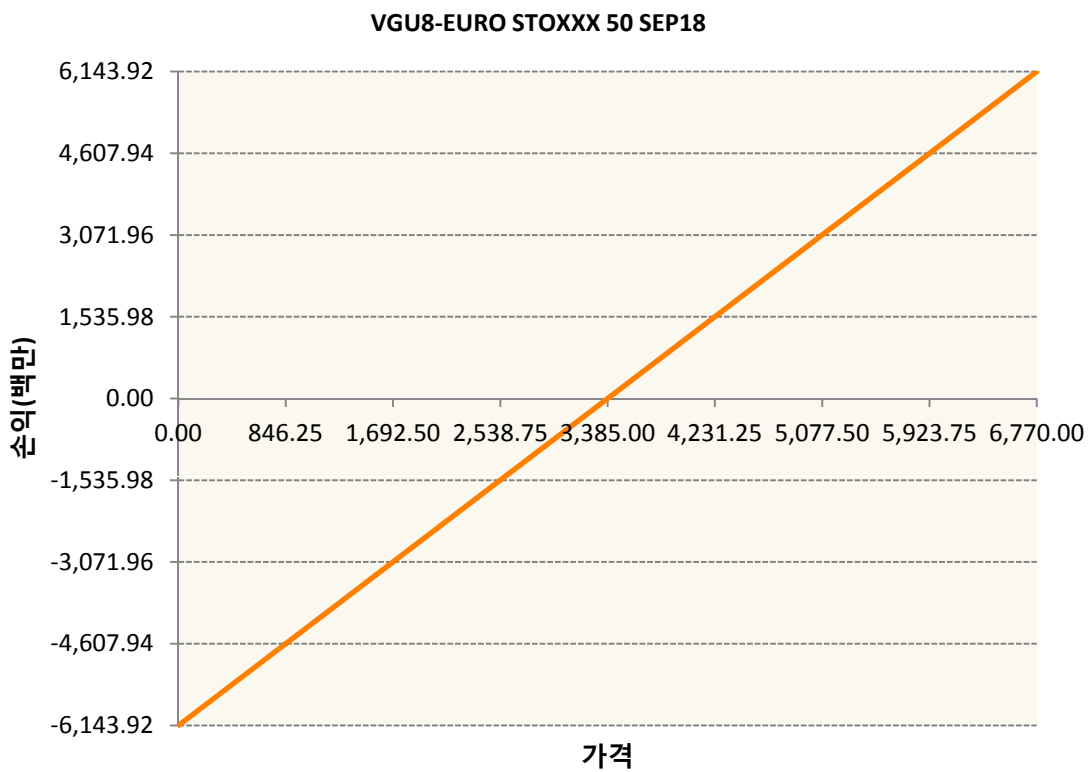
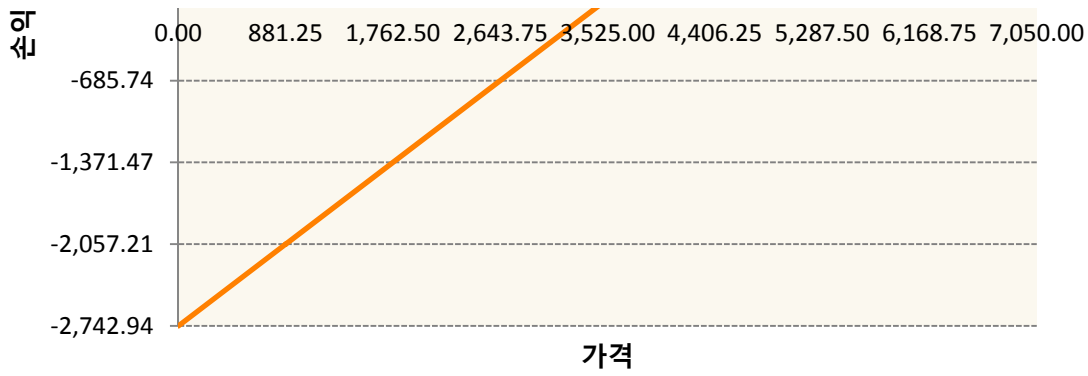


OESXN8-P3500-EURO STOXX 50



OESXN8-P3525-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		44
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		38
OESXN8-C3! EURO STOXX 50		868
OESXN8-C3! EURO STOXX 50		219
OESXN8-P3! EURO STOXX 50		868
OESXN8-P3! EURO STOXX 50		219
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18		492

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





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

(단위:백만원)

1,143



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

(단위:백만원)

80



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

(단위:백만원)

124



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

(단위:백만원)

174

공시일	2018-06-29
기준일	2018-06-28

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1

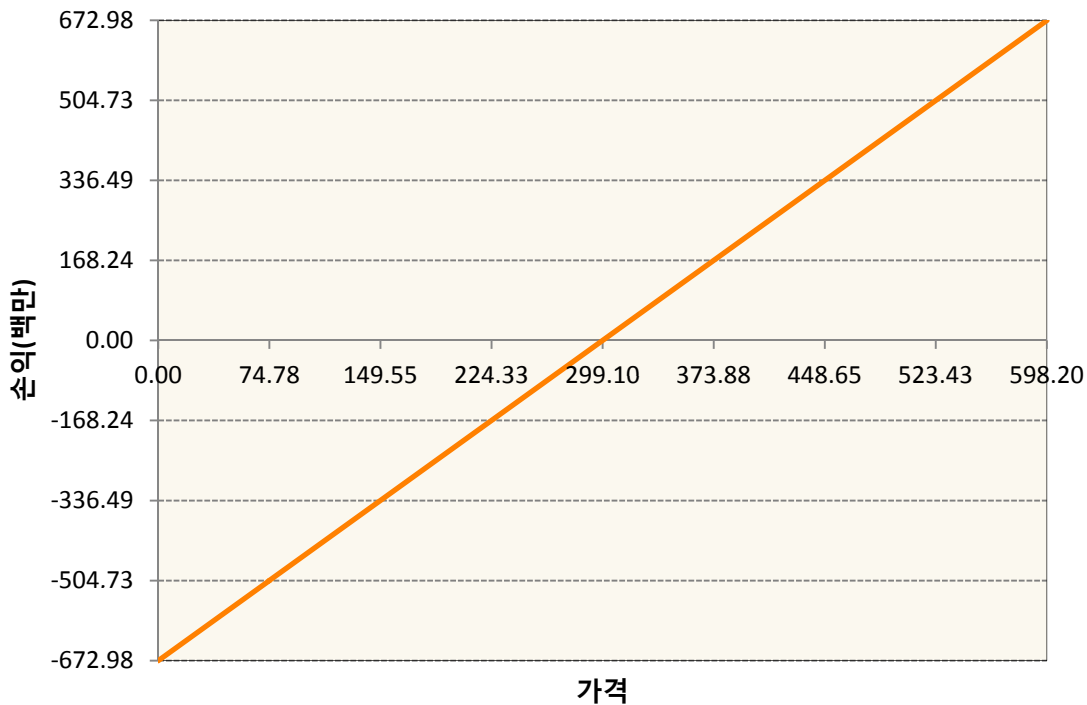
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	673	0	673	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	2018-06-29
기준일	2018-06-28

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

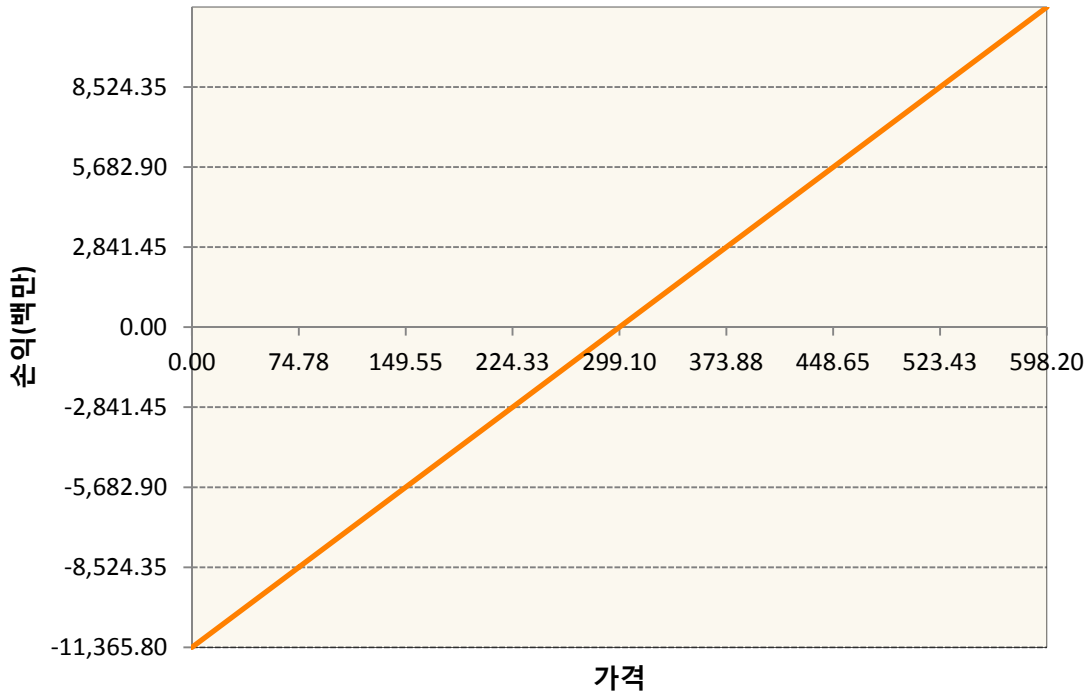
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

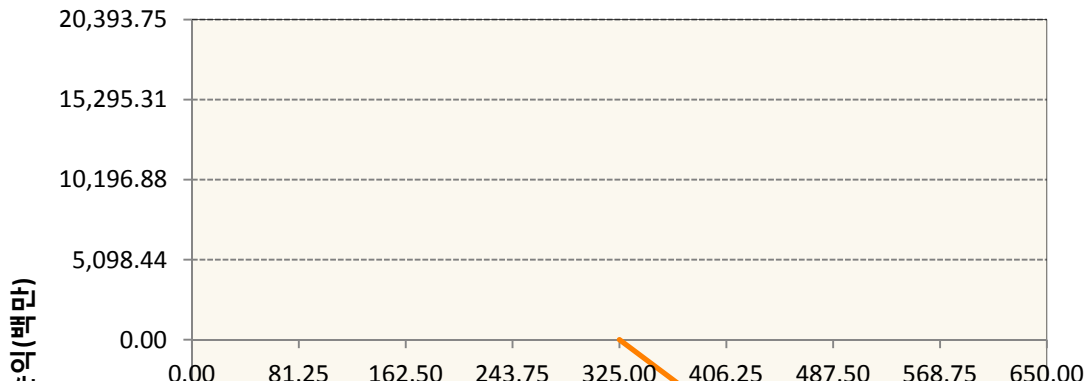
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,366	0	11,366	장내
누계	유가증권	옵션	1,473	20,394	-18,921	장내

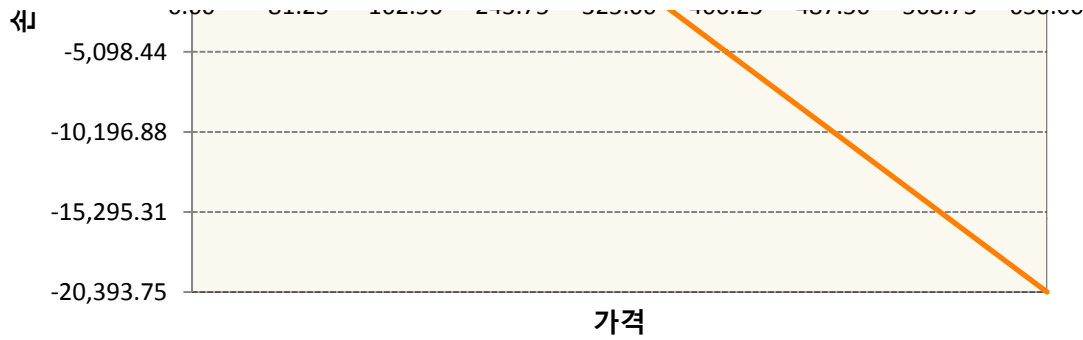
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

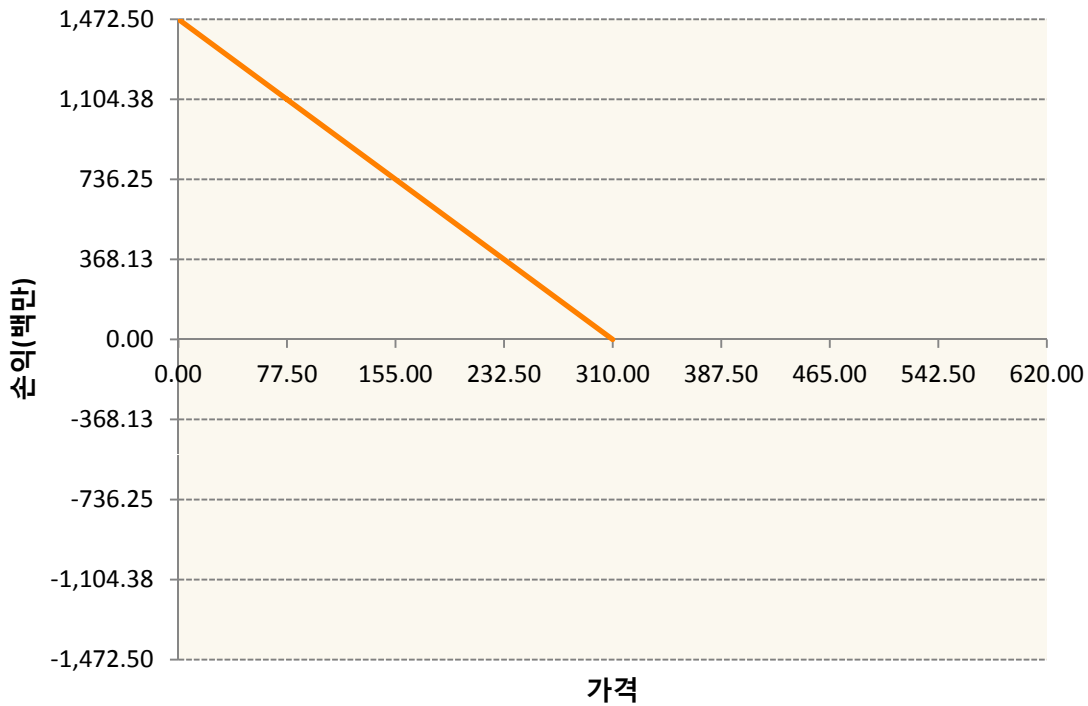


KR4201N73257-2018-07 콜325





KR4301N73107-2018-07 풋310



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물							907
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-907	-907	-907	-907	-907	-907	-907
-5.33%	-604	-604	-604	-604	-604	-604	-604
-2.67%	-302	-302	-302	-302	-302	-302	-302
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	302	302	302	302	302	302	302
5.33%	604	604	604	604	604	604	604
8.00%	907	907	907	907	907	907	907
KR4201N732 2018-07 콜325							481
기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	40	40	40	39	38	37	34
-5.33%	40	40	38	37	34	29	23
-2.67%	39	36	32	27	19	10	-2
0%	31	23	13	0	-15	-33	-52
2.67%	2	-16	-37	-60	-85	-112	-140
5.33%	-77	-108	-141	-175	-209	-244	-280
8.00%	-241	-281	-321	-361	-401	-441	-481

KR4301N7312018-07 풋310

110

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	110	110	110	110	110	110	110
-5.33%	72	72	72	72	73	73	73
-2.67%	35	35	35	35	35	36	36
0%	-2	-1	-1	0	1	2	3
2.67%	-33	-32	-30	-29	-27	-26	-24
5.33%	-52	-50	-49	-47	-46	-44	-43
8.00%	-58	-57	-56	-56	-55	-54	-53

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

(단위:백만원)

1,056

공시일	2018-06-29
기준일	2018-06-28

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

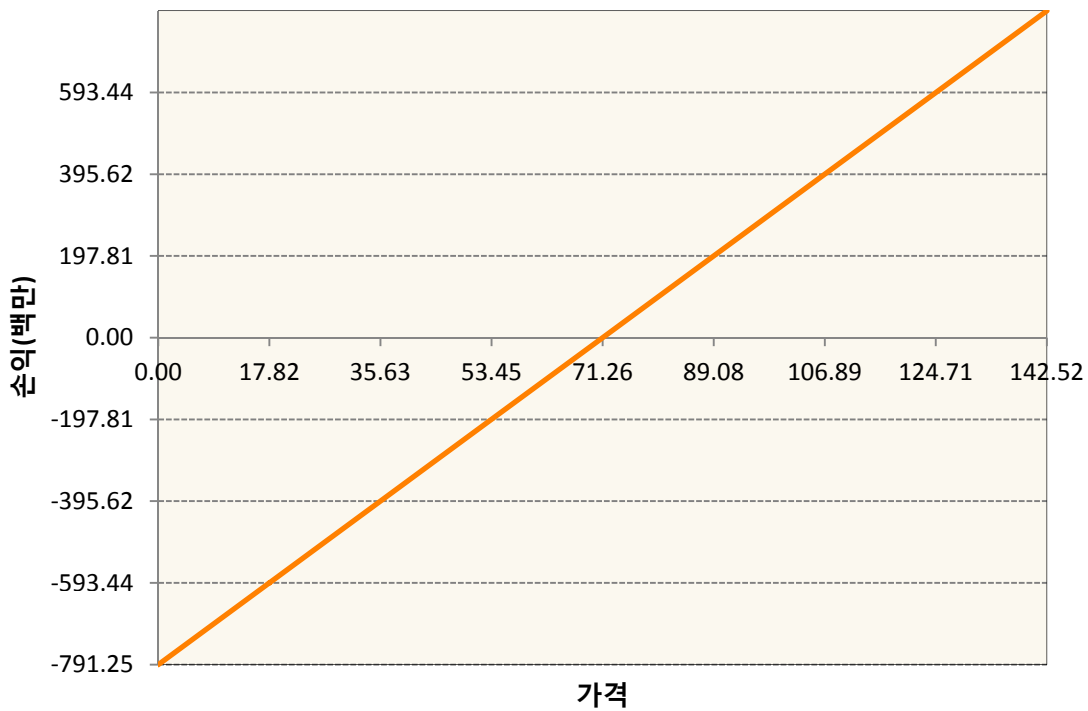
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

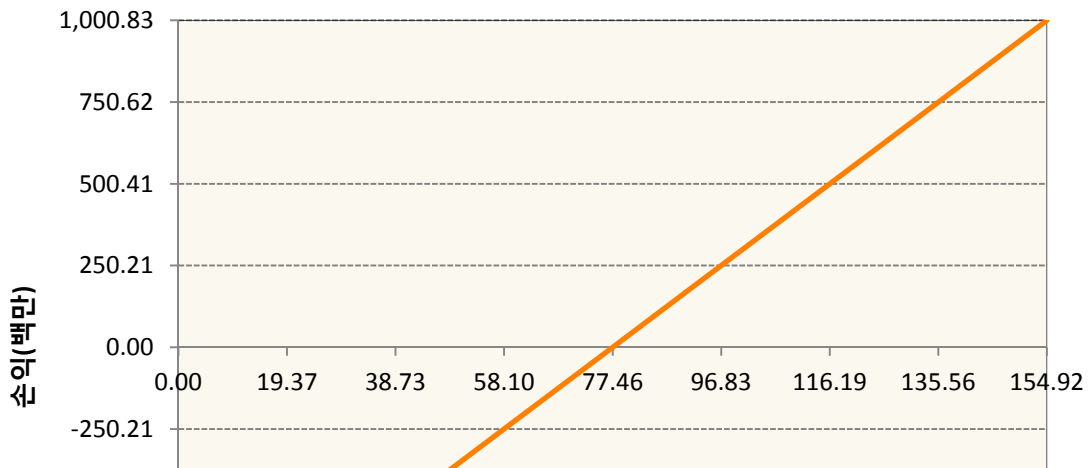
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,836	618	3,217	

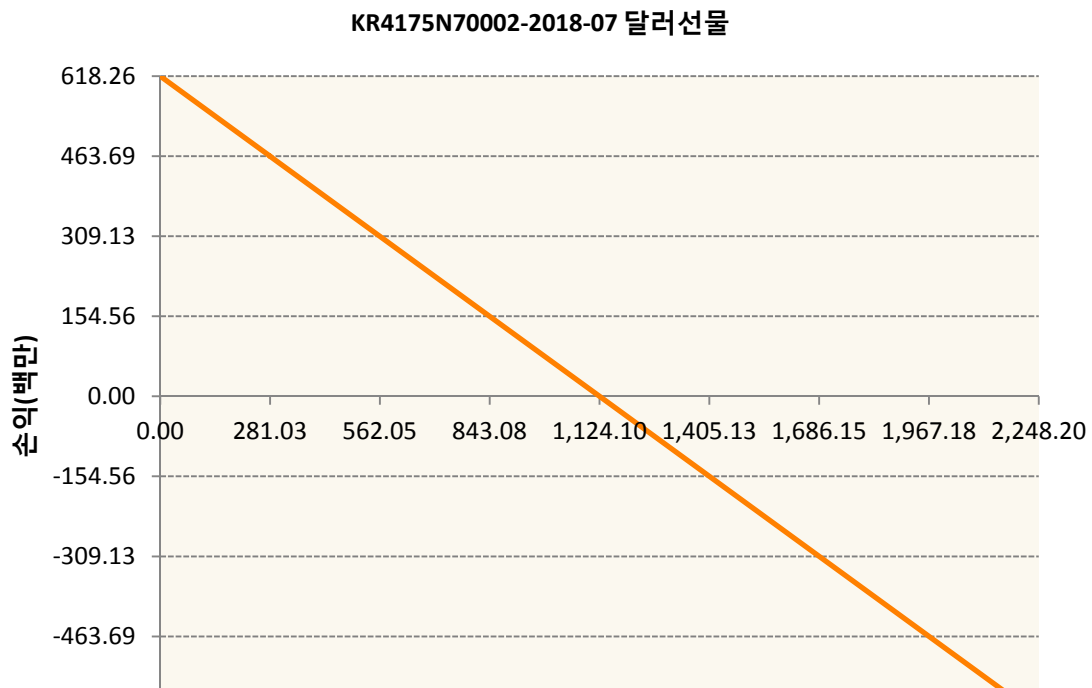
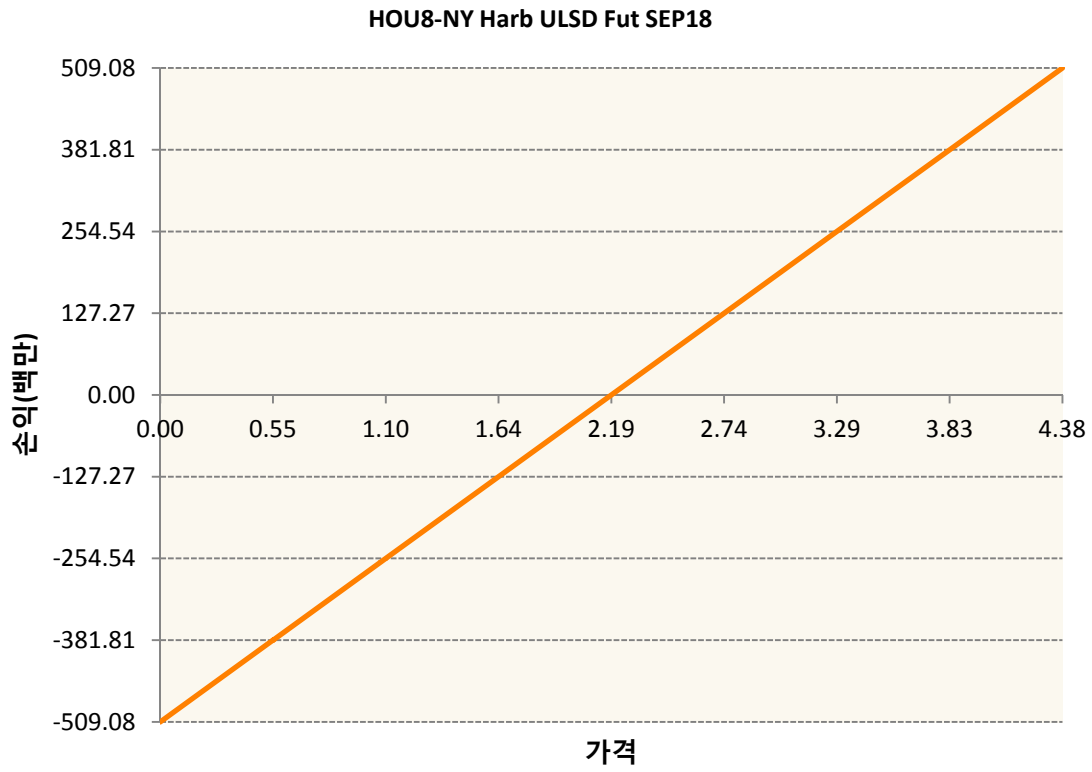
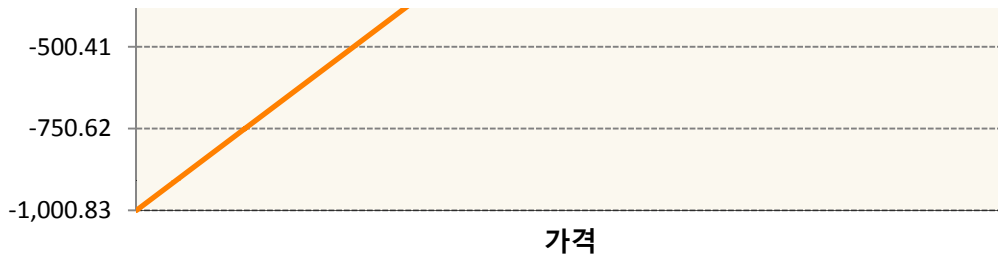
### 2. 만기시점의 손익구조

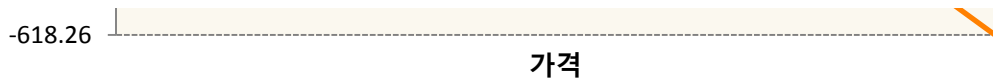
**CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18**



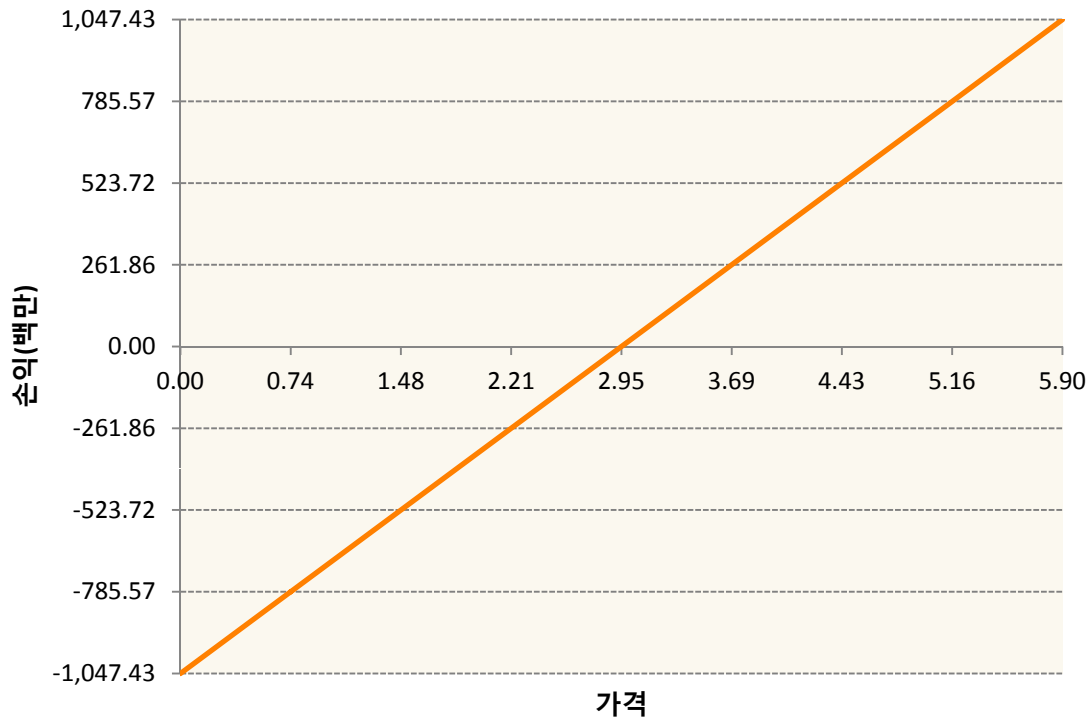
**COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18**



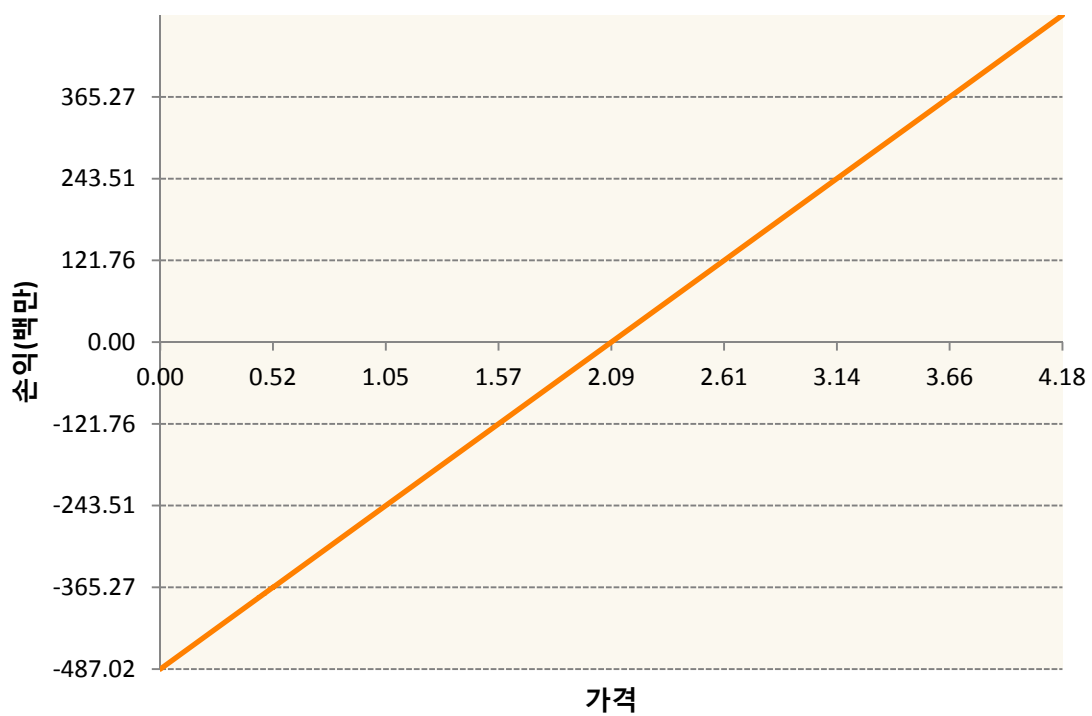




**NGU18-NATURAL GAS FUTR SEP18**



**XBU8-GASOLINE RBOB FUT SEP18**



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

CLU8	WTI CRUDE FUTURE SEP18	63
COU8	BRENT CRUDE FUTR SEP18	80
HOU8	NY Harb ULSD Fut SEP18	41
KR4175N70C	2018-07 달러선물	49
NGU18	NATURAL GAS FUTR SEP18	84
XBU8	GASOLINE RBOB FUT SEP18	39

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

**449**

공시일	2018-06-29
기준일	2018-06-28

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

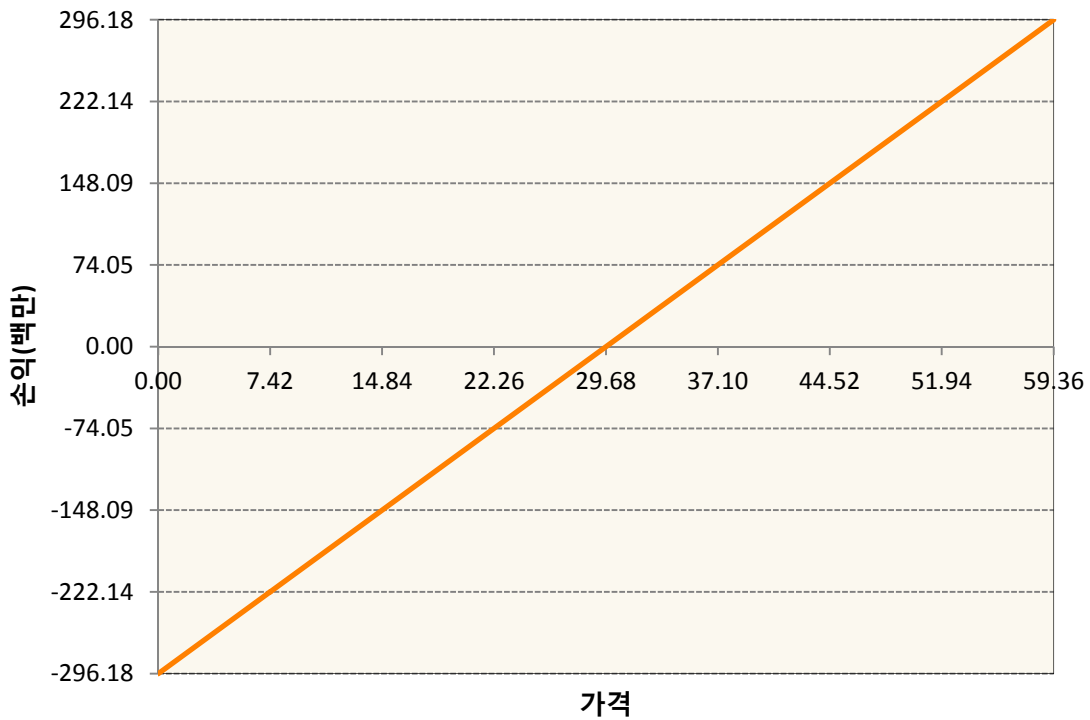
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

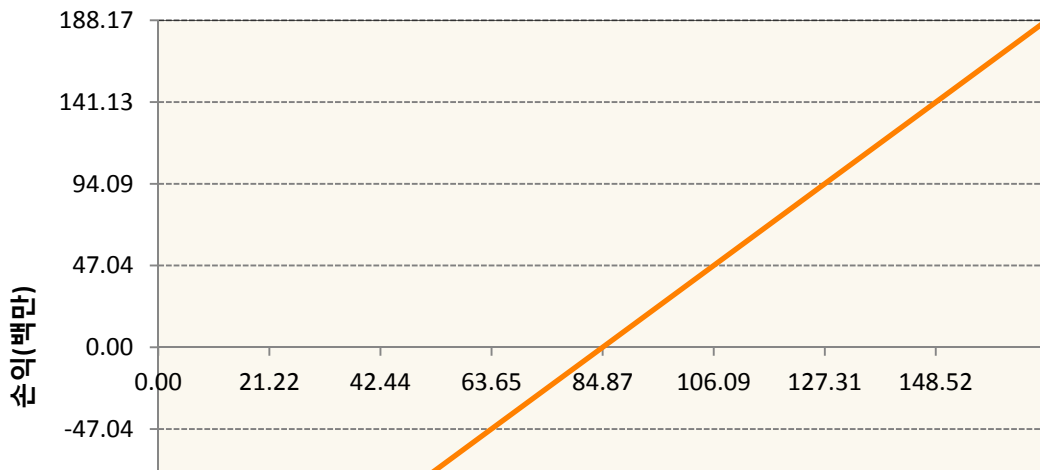
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,705	112	3,593	

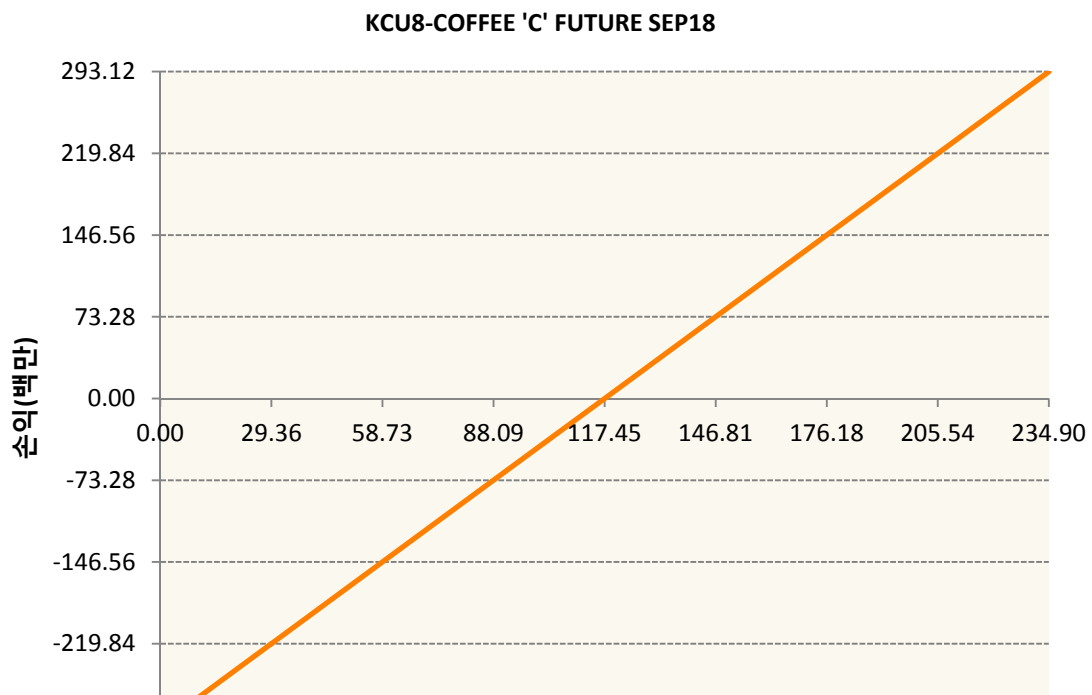
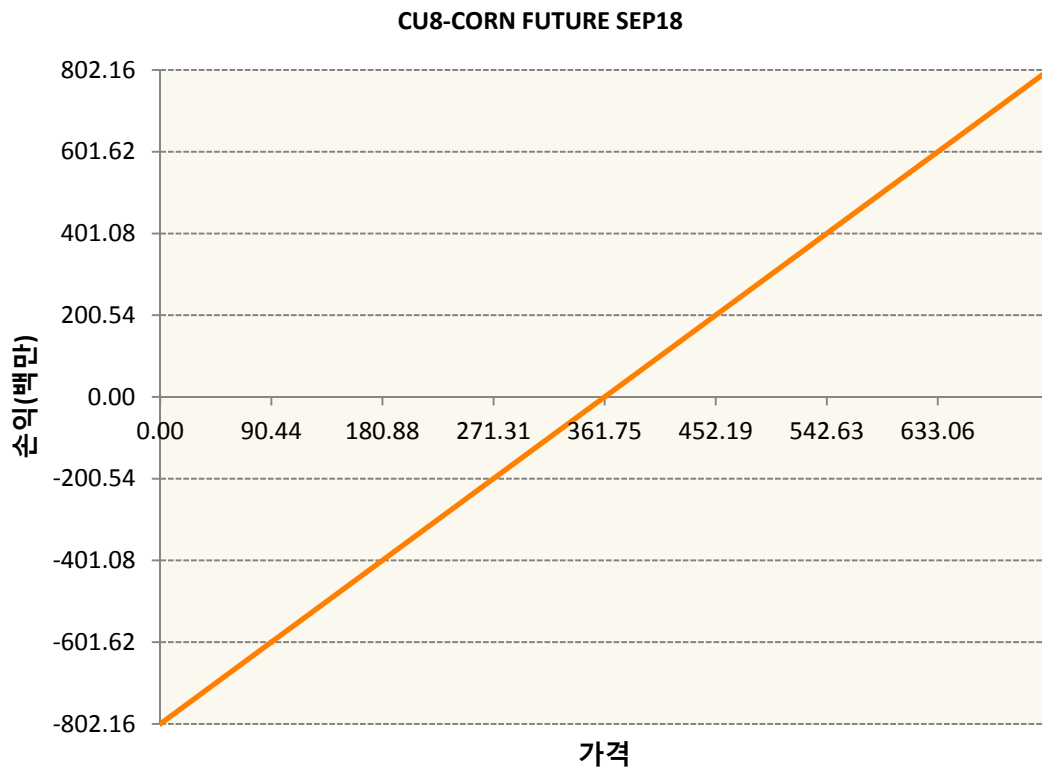
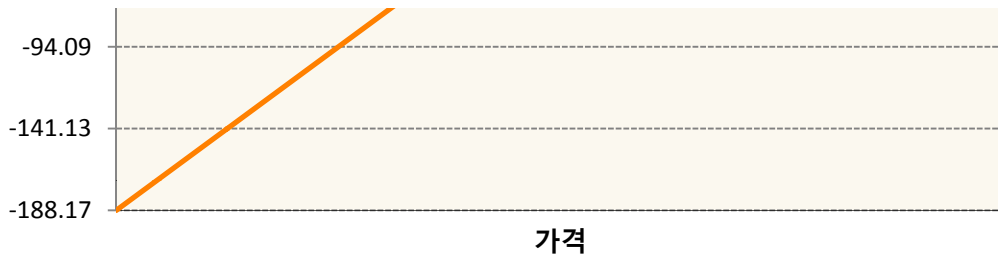
### 2. 만기시점의 손익구조

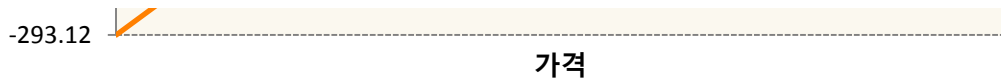
**BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18**



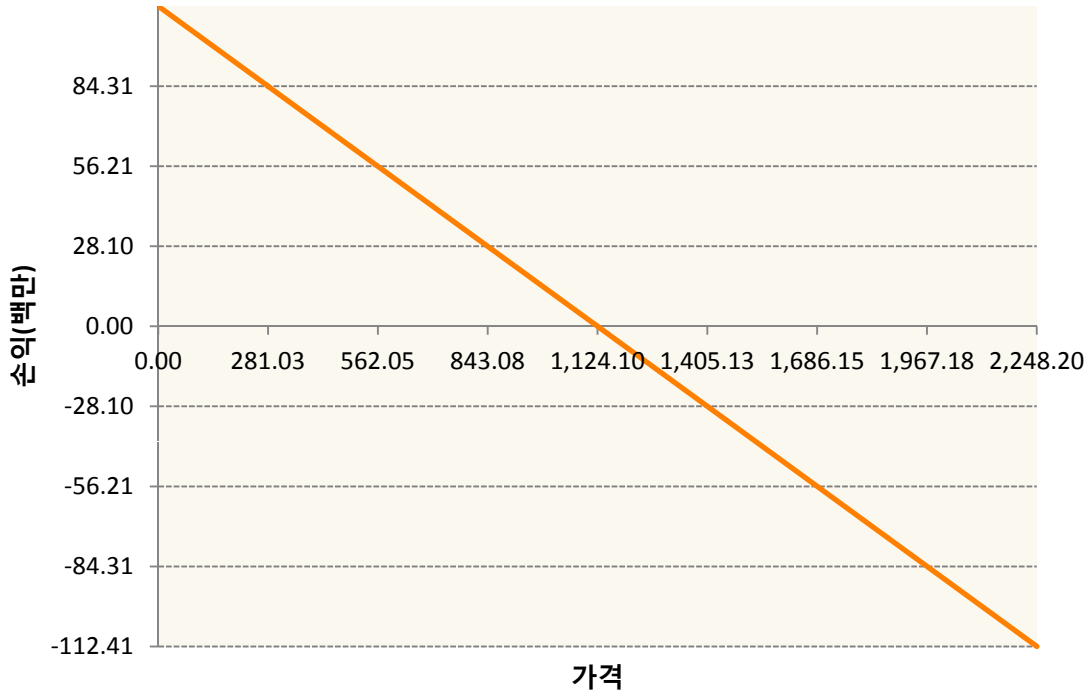
**CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18**



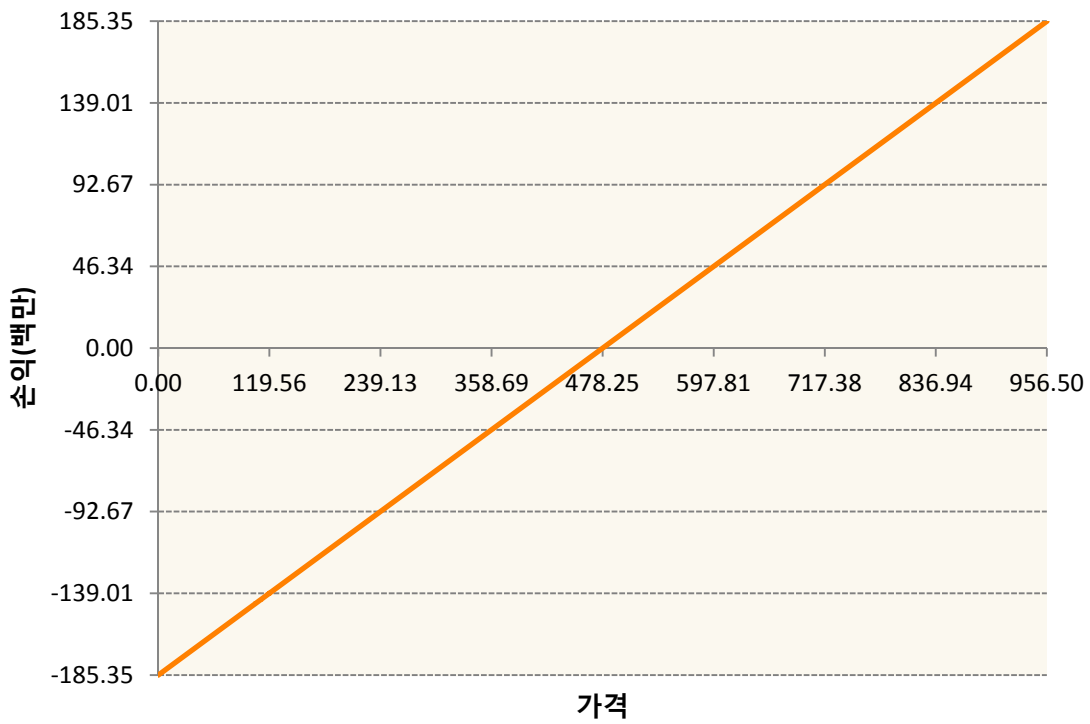




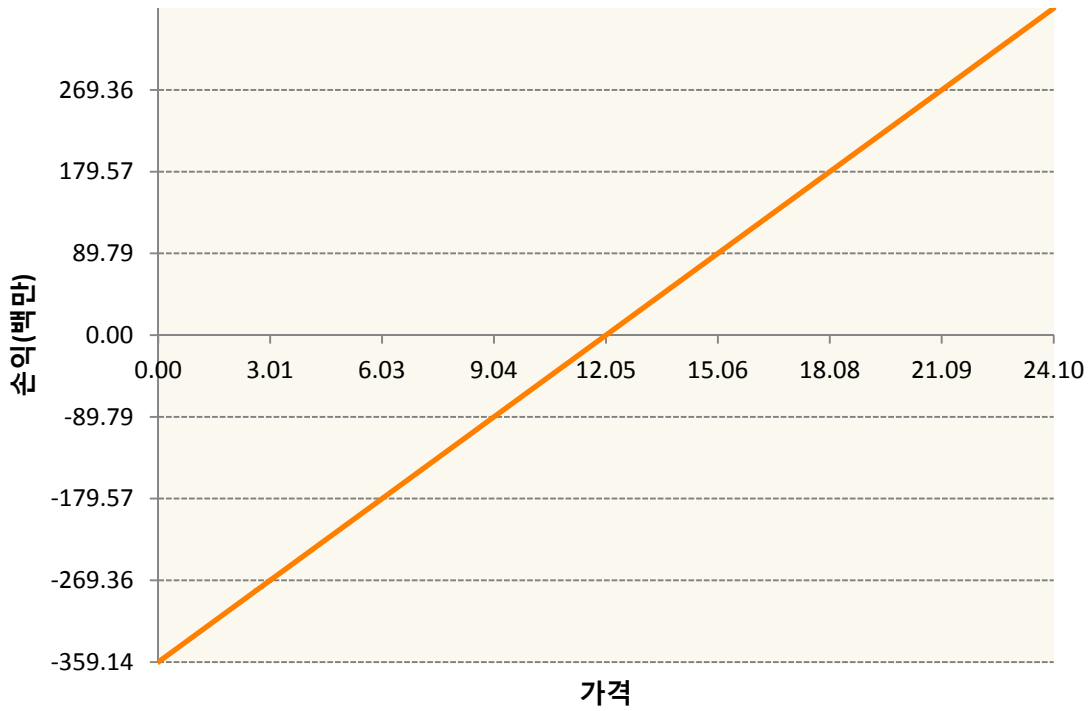
KR4175N70002-2018-07 달러선물



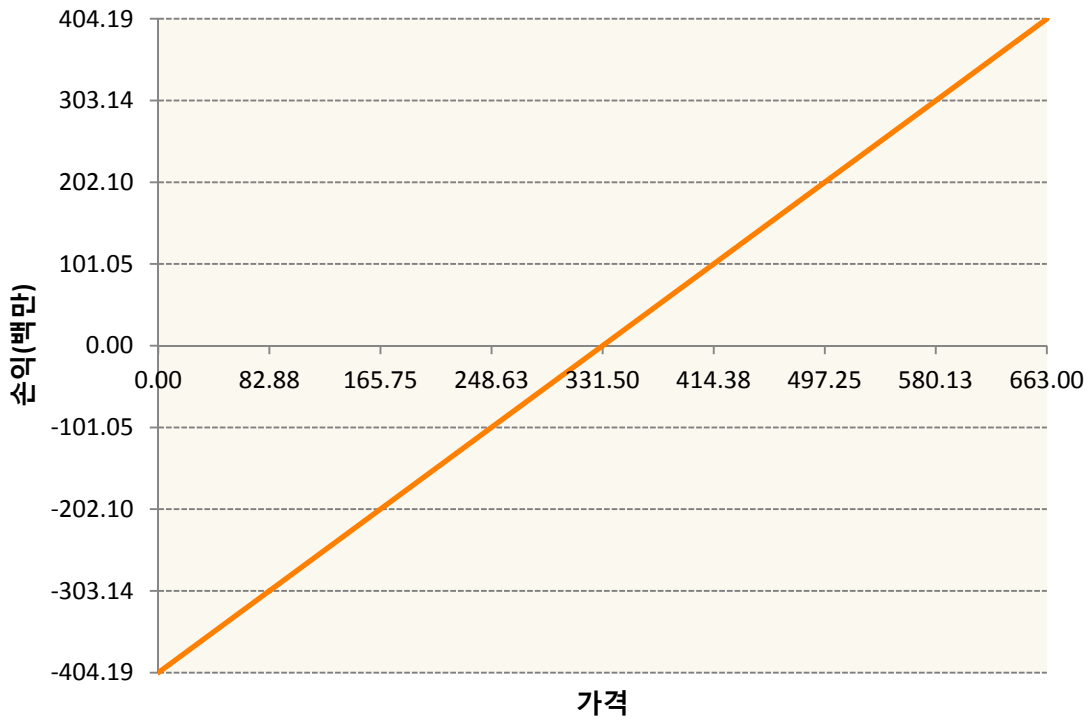
KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

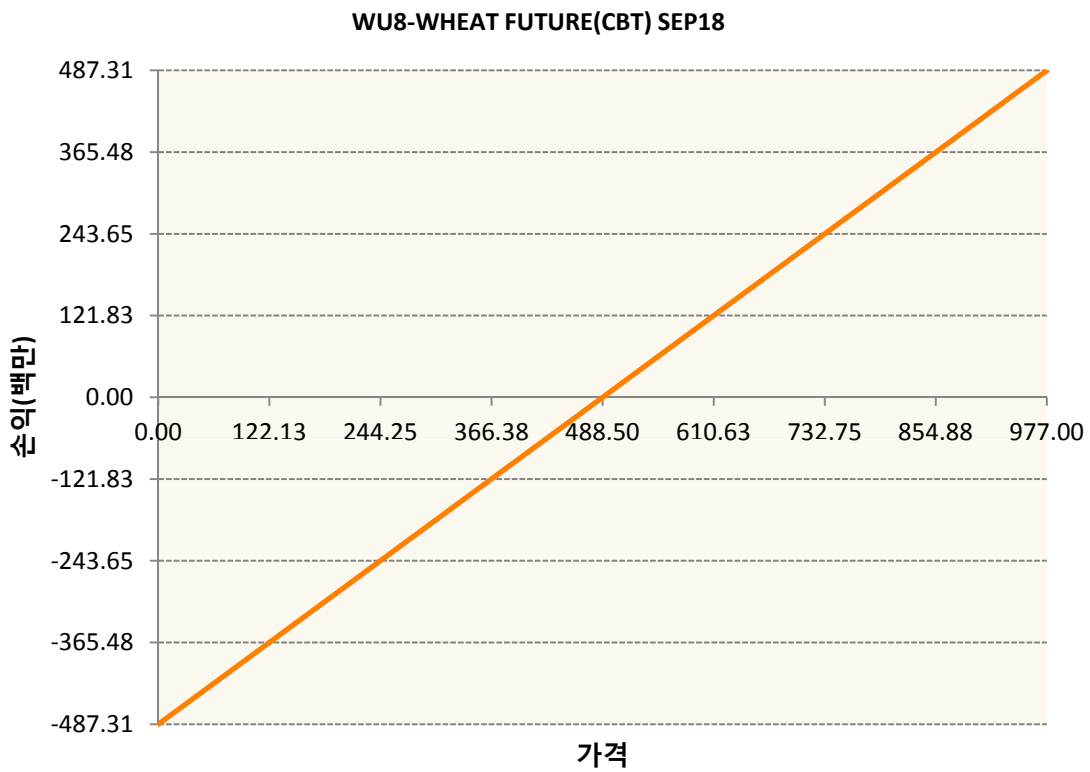
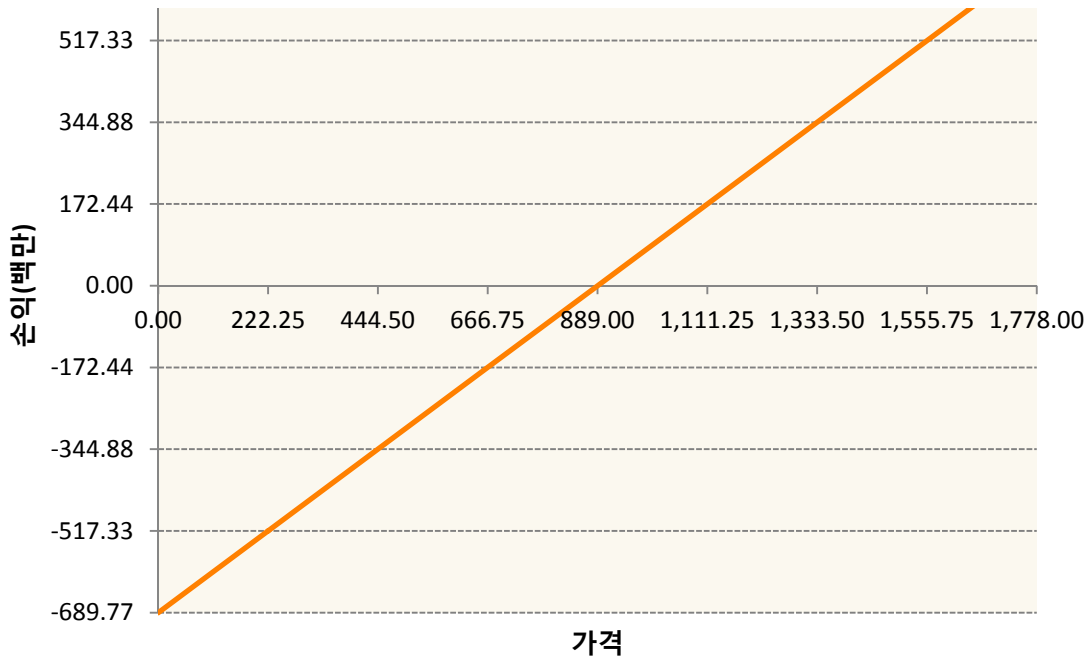


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





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	29
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)

**303**