

공시일	2018-07-02
기준일	2018-06-29

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

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

(단위:백만원)

71

공시일	2018-07-02
기준일	2018-06-29

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

1,099

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

461

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-07-02
기준일	2018-06-29

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

333

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

392

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-07-02
기준일	2018-06-29

유로인덱스모(주식-파생형)

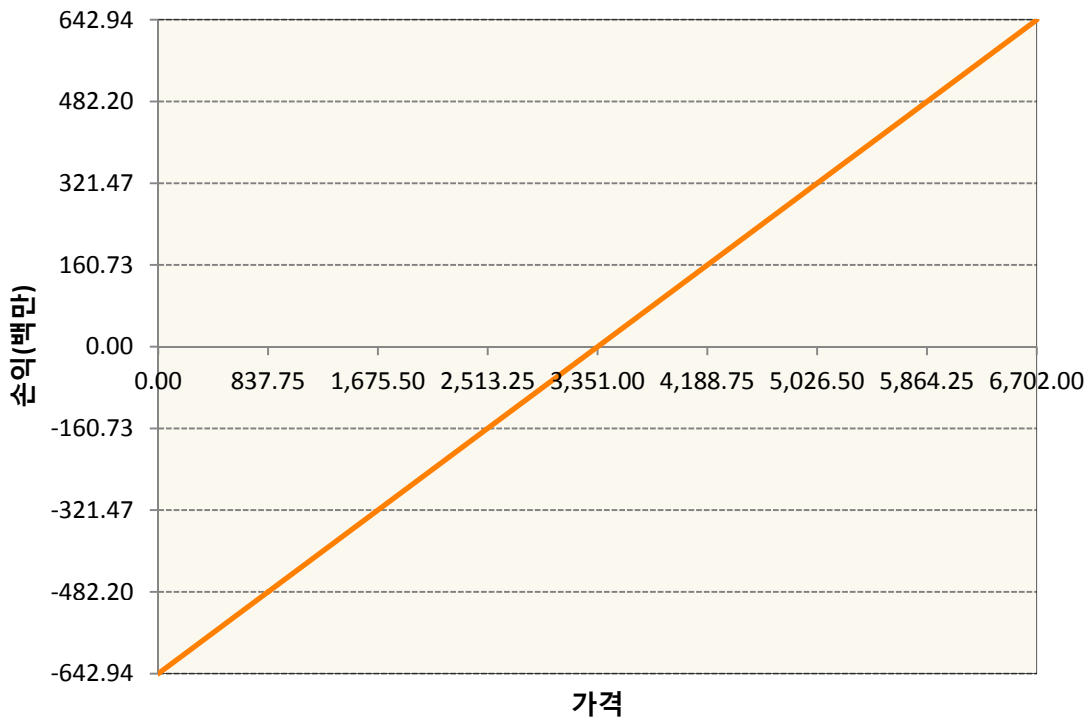
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	643	0	643	

2. 만기시점의 손익구조

VGU8-EURO STOXXX 50 SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU8	EURO STOXXX 50 SEP18	51
------	----------------------	----

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

(단위:백만원)

32

공시일	2018-07-02
기준일	2018-06-29

차이나인덱스모(주식-파생형)

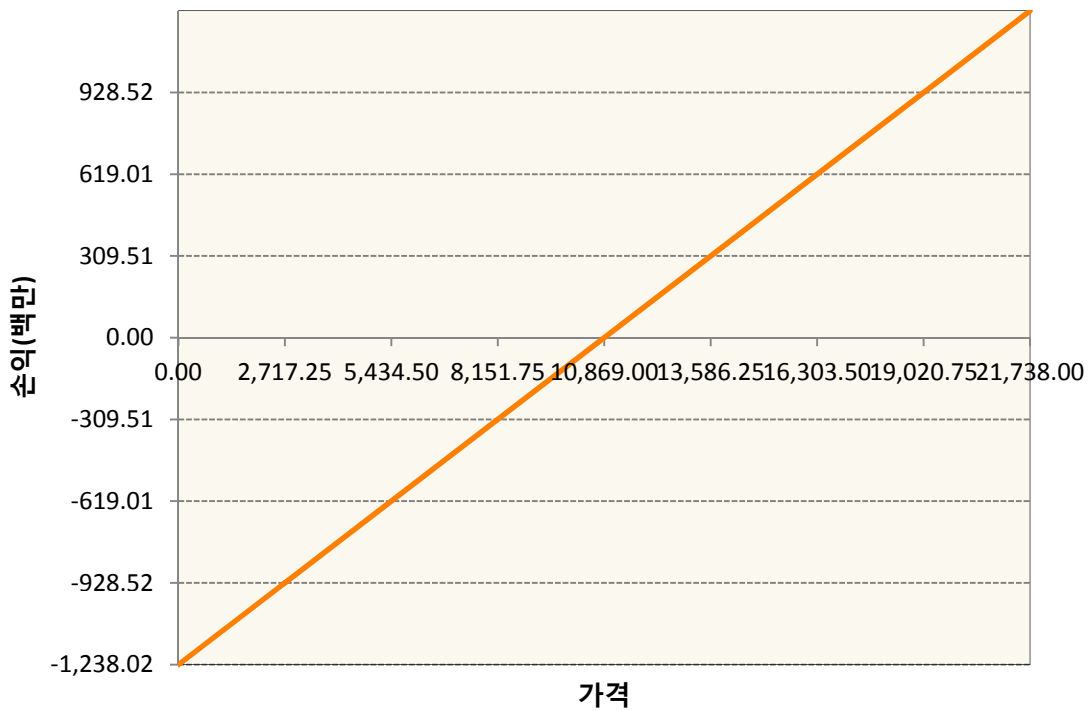
1. 계약금액

(단위:백만원)

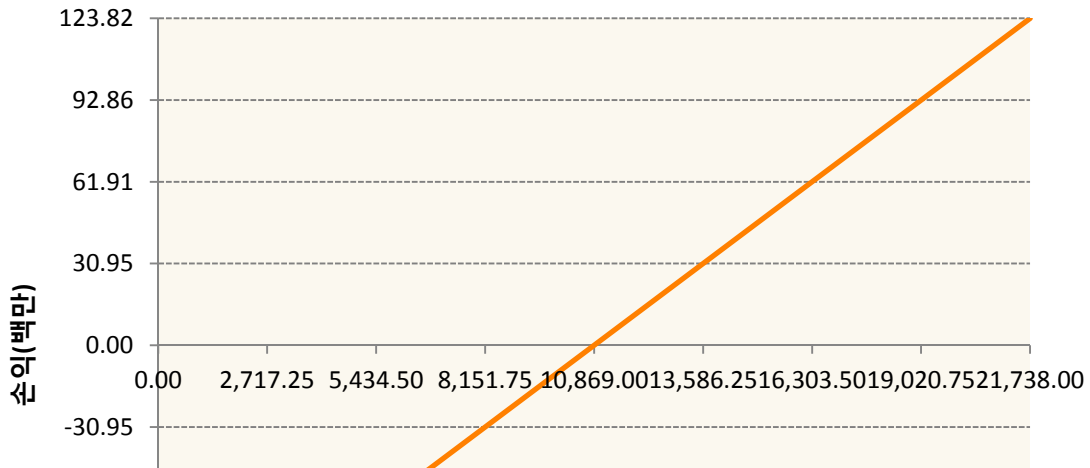
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,362	0	1,362	장내

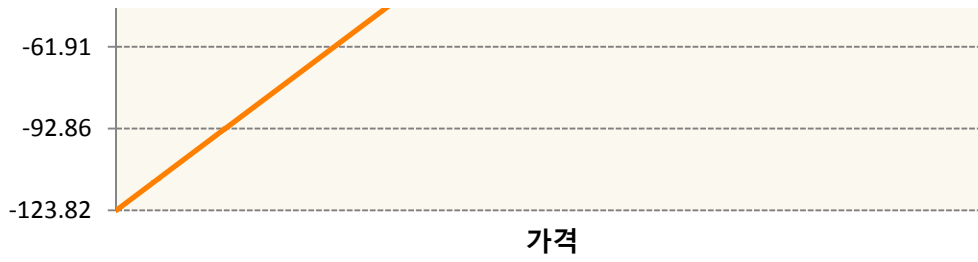
2. 만기시점의 손익구조

HCN8-HSCEI Futures Jul18



MHCN8-MINI H-SHR IDX FU JUL18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCN8	HSCEI Futures Jul18	99
MHCN8	MINI H-SHR IDX FU JUL18	10

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

98

공시일	2018-07-02
기준일	2018-06-29

커버드콜모(주식혼합-파생형)

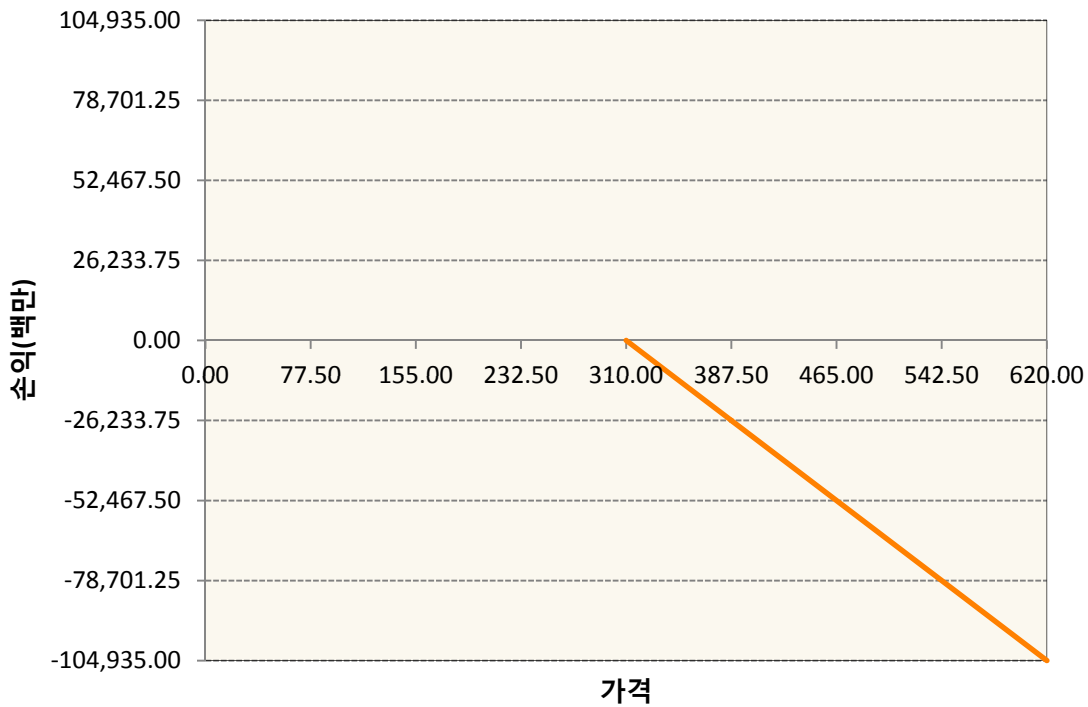
1. 계약금액

(단위:백만원)

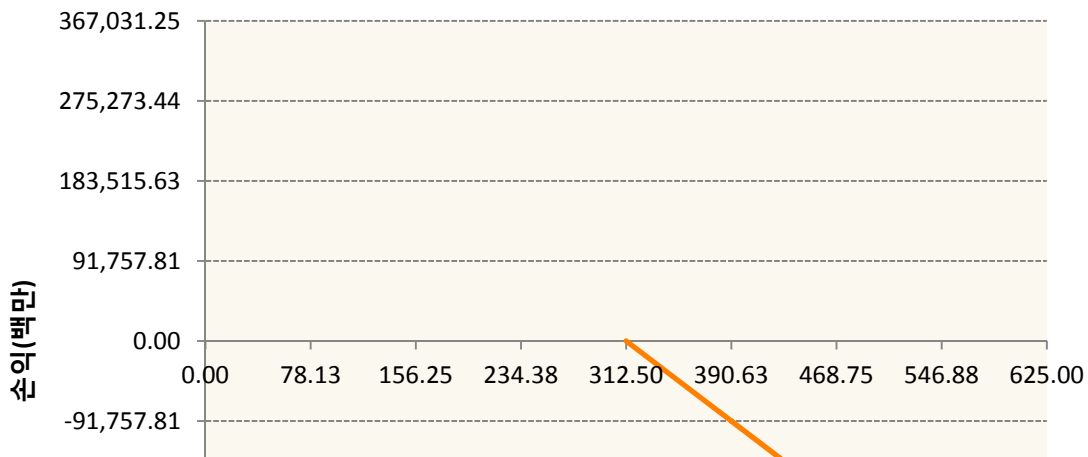
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	766,466	-766,466	장내

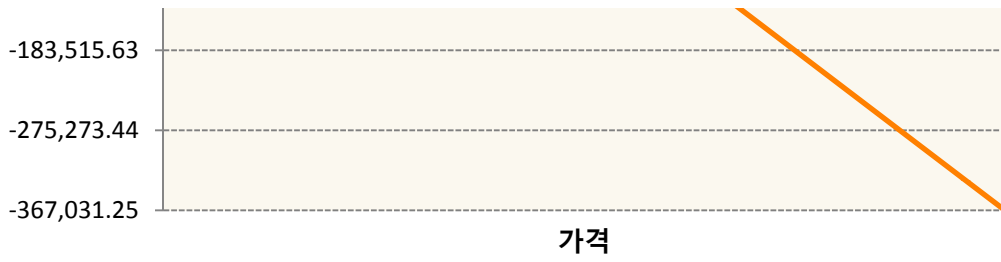
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N73109-2018-07 콜310

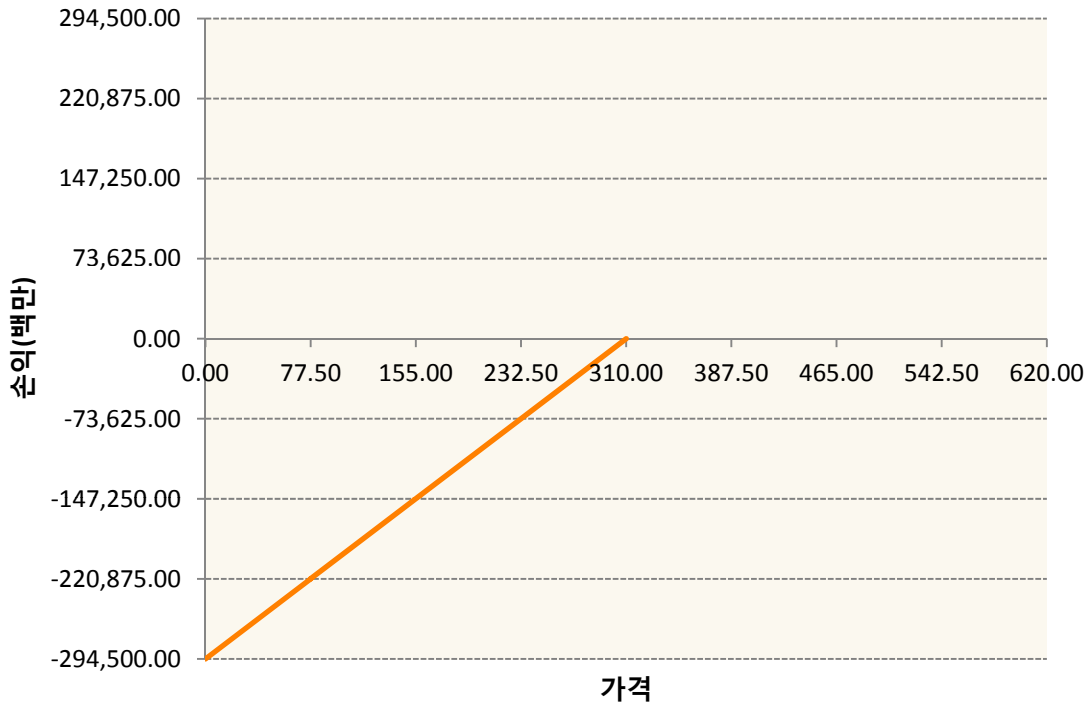


KR4201N73125-2018-07 콜312.5





KR4301N73107-2018-07 풋310



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N7312018-07 콜310

4,898

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,013	1,007	994	974	946	910	864
-5.33%	986	957	917	864	800	725	640
-2.67%	861	782	688	583	467	342	210
0%	469	320	163	0	-168	-340	-515
2.67%	-412	-609	-806	-1,004	-1,202	-1,401	-1,599
5.33%	-1,916	-2,103	-2,293	-2,485	-2,678	-2,872	-3,068
8.00%	-3,983	-4,114	-4,256	-4,407	-4,565	-4,729	-4,898

KR4201N7312018-07 콜312.5

15,681

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,802	2,787	2,757	2,707	2,633	2,532	2,402

-5.33%	2,744	2,674	2,569	2,425	2,244	2,025	1,772
-2.67%	2,453	2,238	1,973	1,663	1,314	931	517
0%	1,448	999	514	0	-537	-1,094	-1,666
2.67%	-1,019	-1,675	-2,338	-3,006	-3,678	-4,354	-5,032
5.33%	-5,554	-6,242	-6,933	-7,626	-8,321	-9,017	-9,714
8.00%	-12,162	-12,692	-13,252	-13,835	-14,436	-15,053	-15,681

KR4301N7312018-07 풋310

22,148

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,145	-22,145	-22,145	-22,145	-22,145	-22,146	-22,148
-5.33%	-14,558	-14,559	-14,560	-14,563	-14,570	-14,581	-14,598
-2.67%	-6,980	-6,994	-7,017	-7,052	-7,101	-7,163	-7,240
0%	402	289	154	0	-170	-354	-551
2.67%	6,461	6,175	5,886	5,595	5,302	5,008	4,714
5.33%	9,569	9,337	9,094	8,841	8,581	8,315	8,044
8.00%	10,339	10,274	10,187	10,081	9,955	9,812	9,654

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

(단위:백만원)

42,762

공시일	2018-07-02
기준일	2018-06-29

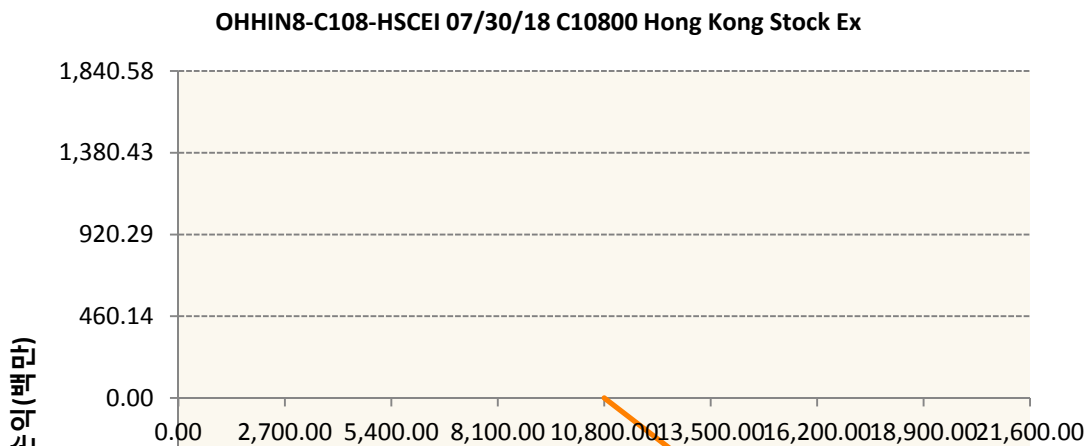
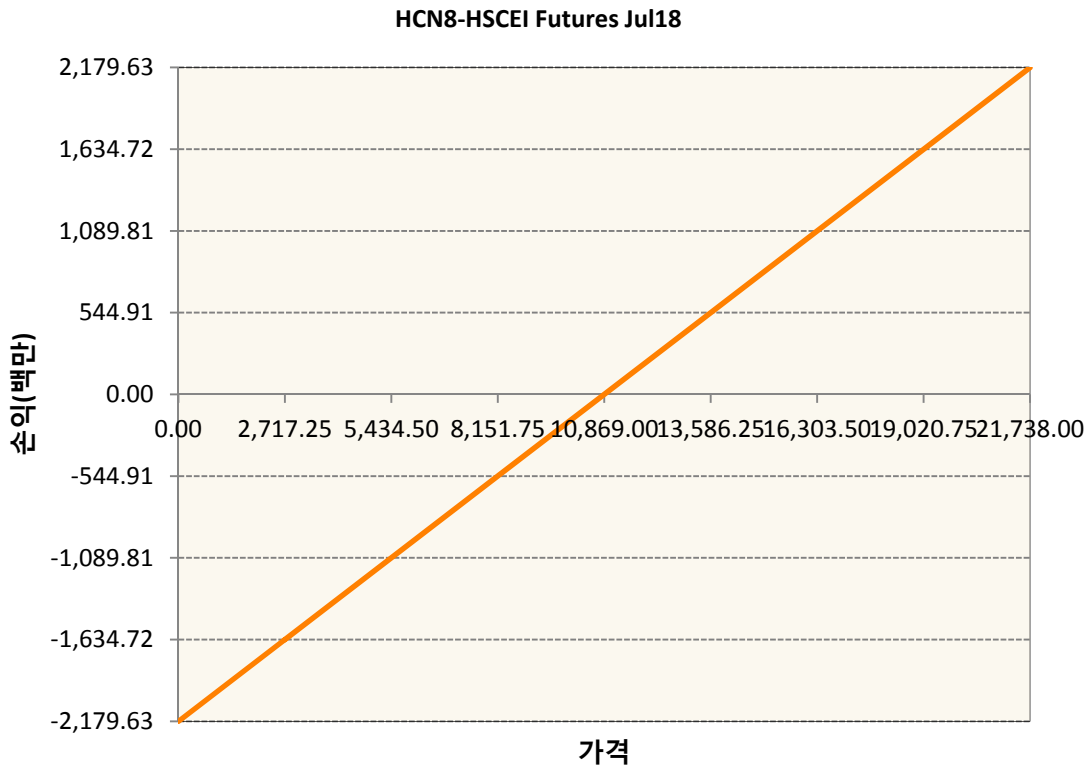
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

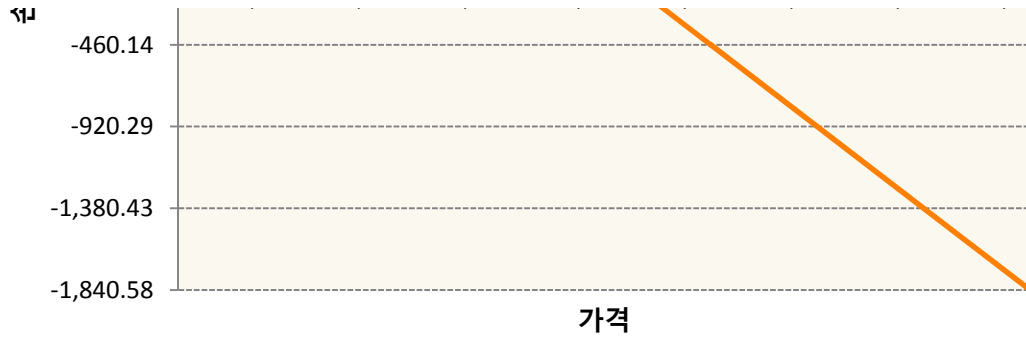
1. 계약금액

(단위:백만원)

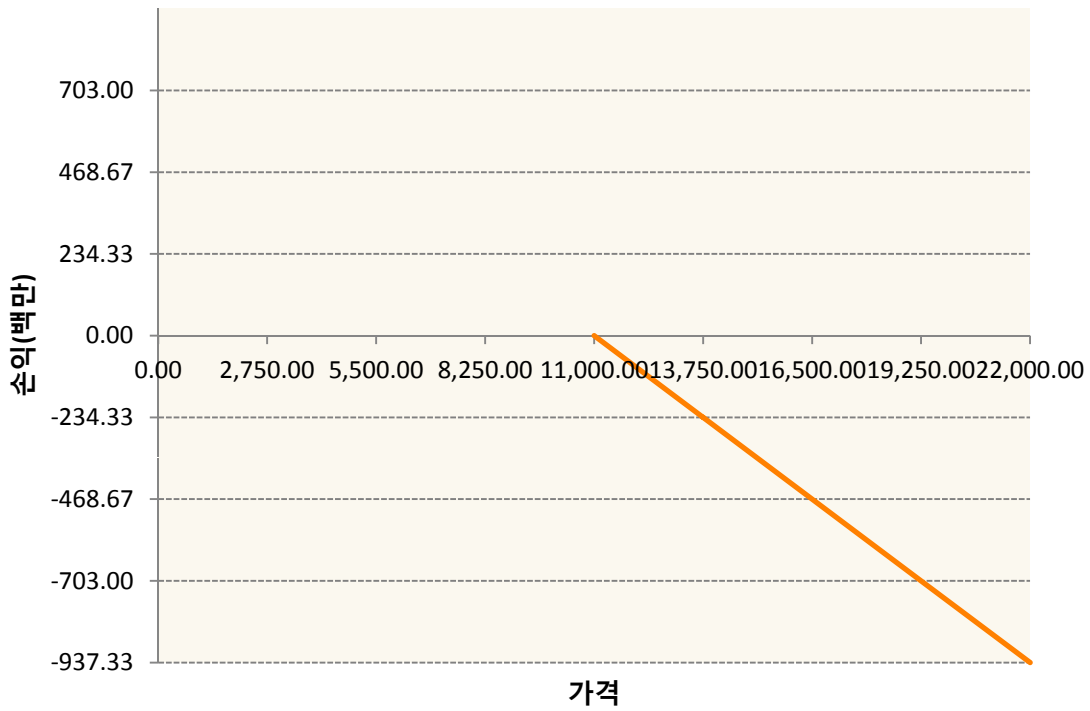
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,180	0	2,180	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,556	-5,556	장내

2. 만기시점의 손익구조

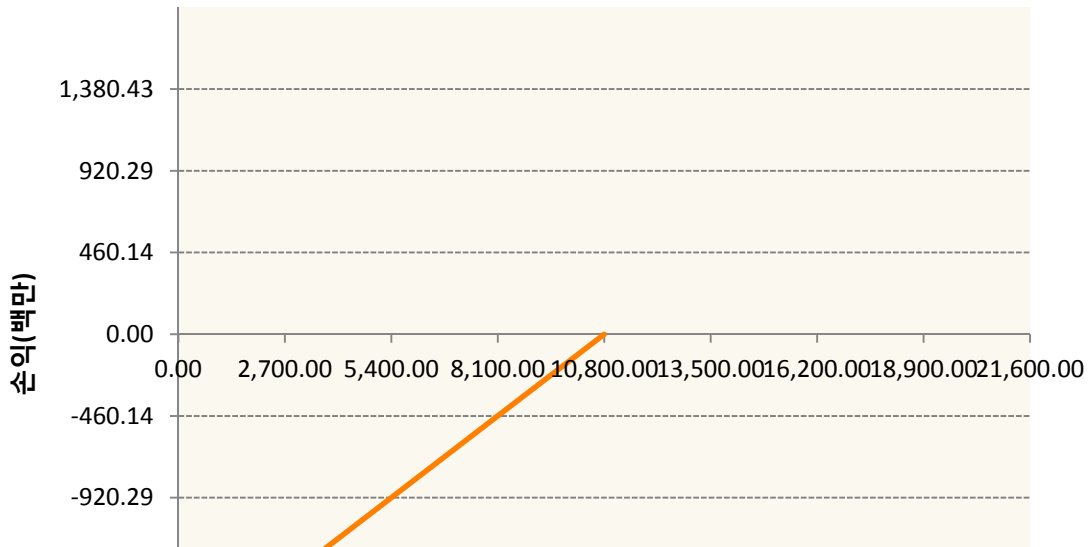


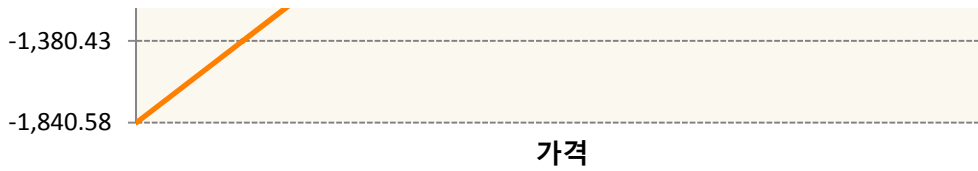


OHHIN8-C110-HSCEI 07/30/18 C11000 Hong Kong Stock Ex

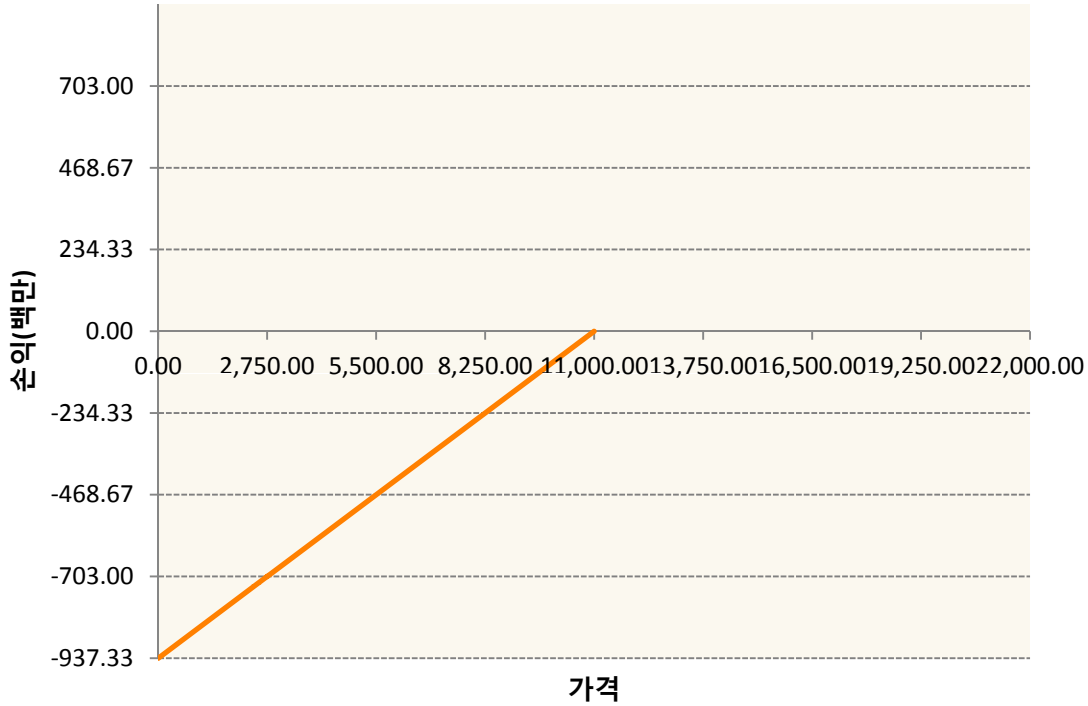


OHHIN8-P108-HSCEI 07/30/18 P10800 Hong Kong Stock Ex





OHHIN8-P110-HSCEI 07/30/18 P11000 Hong Kong Stock Ex



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN8	HSCEI Futures Jul18	174
OHHIN8-C1	(HSCEI 07/30/18 C10800 Hong Kong Stock Ex	147
OHHIN8-C1	: HSCEI 07/30/18 C11000 Hong Kong Stock Ex	75
OHHIN8-P1	(HSCEI 07/30/18 P10800 Hong Kong Stock Ex	147
OHHIN8-P11	HSCEI 07/30/18 P11000 Hong Kong Stock Ex	75

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

(단위:백만원)

558

공시일	2018-07-02
기준일	2018-06-29

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

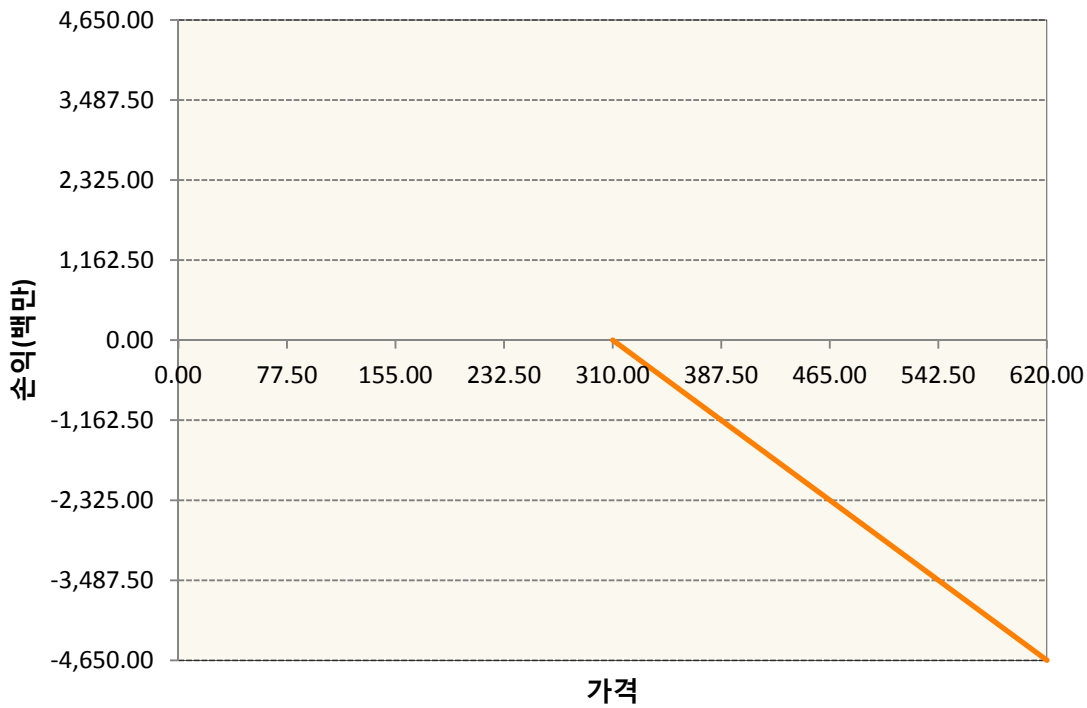
1. 계약금액

(단위:백만원)

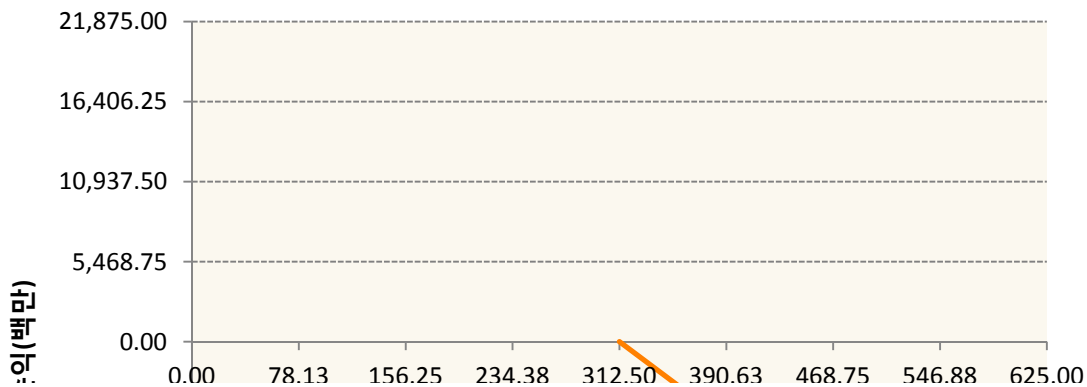
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	45,900	-45,900	장내

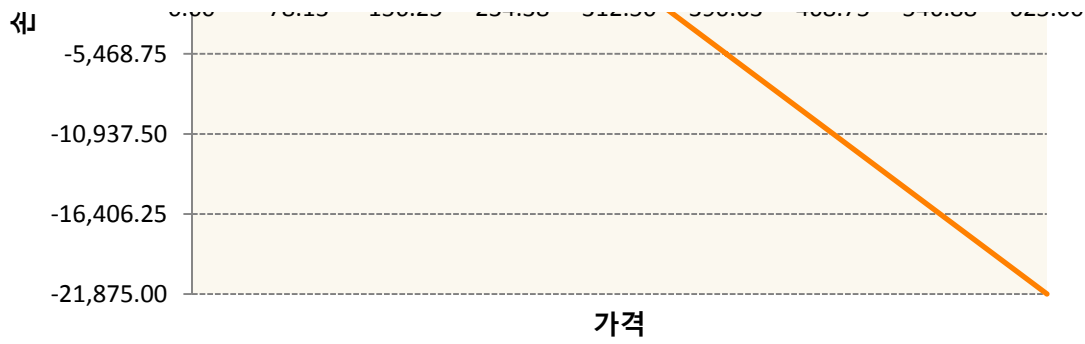
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N73109-2018-07 콜310

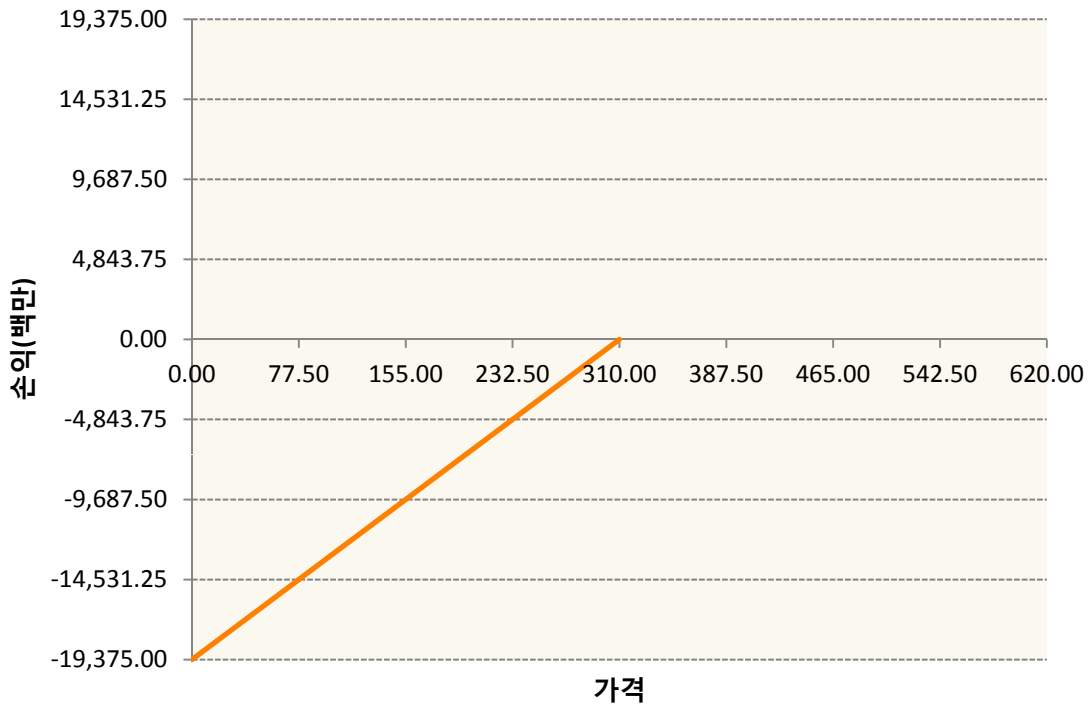


KR4201N73125-2018-07 콜312.5





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

217

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	45	45	44	43	42	40	38
-5.33%	44	42	41	38	35	32	28
-2.67%	38	35	31	26	21	15	9
0%	21	14	7	0	-7	-15	-23
2.67%	-18	-27	-36	-44	-53	-62	-71
5.33%	-85	-93	-102	-110	-119	-127	-136
8.00%	-177	-182	-189	-195	-202	-210	-217

KR4201N7312018-07 콜312.5

935

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	167	166	164	161	157	151	143
-5.33%	164	159	153	145	134	121	106
-2.67%	146	133	118	99	78	55	31
0%	86	60	31	0	-32	-65	-99
2.67%	-61	-100	-139	-179	-219	-260	-300
5.33%	-331	-372	-413	-454	-496	-537	-579
8.00%	-725	-756	-790	-825	-860	-897	-935

KR4301N7312018-07 풋310

1,457

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,457	-1,457	-1,457	-1,457	-1,457	-1,457	-1,457
-5.33%	-958	-958	-958	-958	-959	-959	-960
-2.67%	-459	-460	-462	-464	-467	-471	-476
0%	26	19	10	0	-11	-23	-36
2.67%	425	406	387	368	349	329	310
5.33%	630	614	598	582	565	547	529
8.00%	680	676	670	663	655	646	635

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

(단위:백만원)

6,538

공시일	2018-07-02
기준일	2018-06-29

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

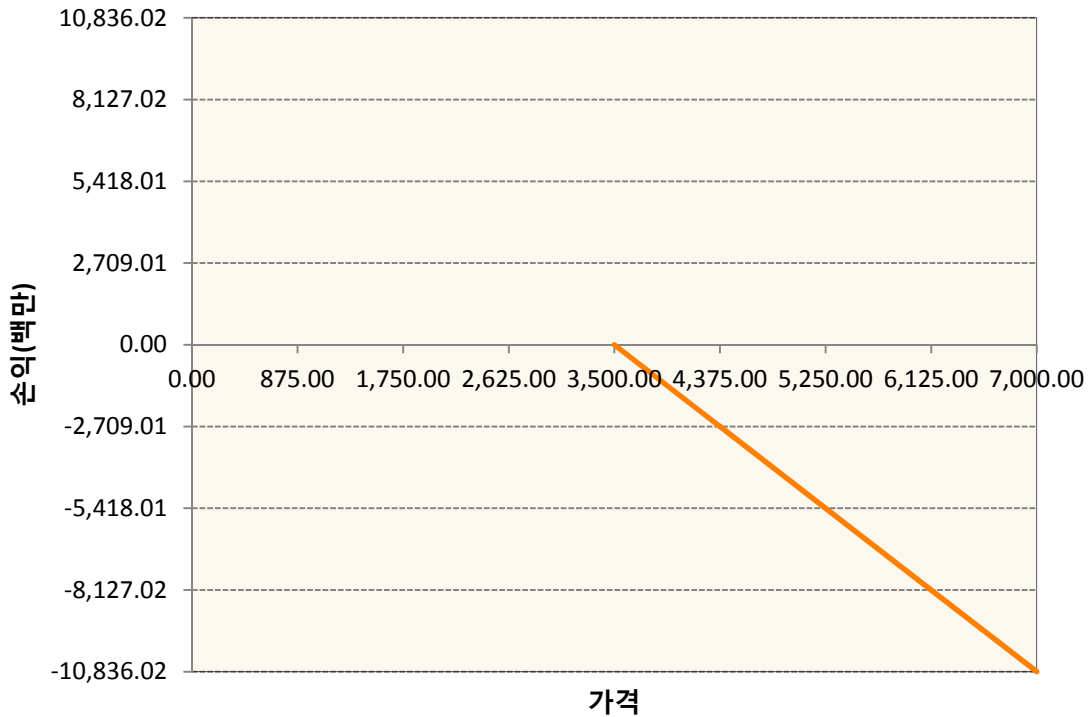
1. 계약금액

(단위:백만원)

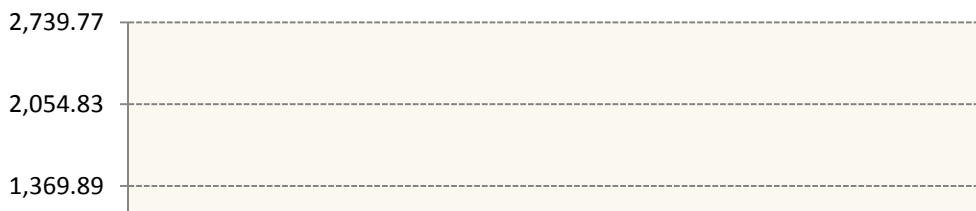
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,081	0	6,081	
누계	유가증권	스왑	44,252	0	44,252	장외
누계	유가증권	옵션	0	27,152	-27,152	장내
누계	지수	스왑	51,816	0	51,816	장외

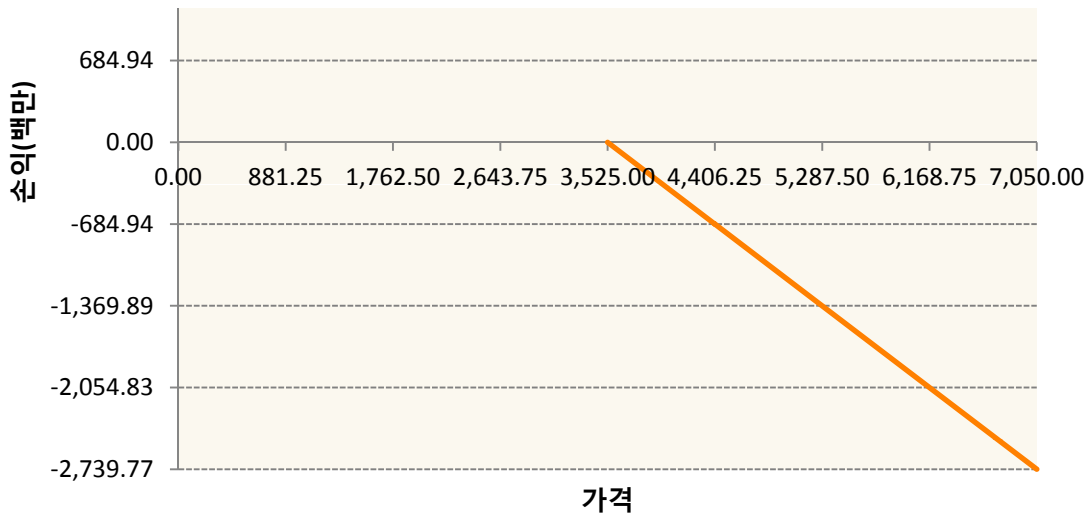
2. 만기시점의 손익구조

OESXN8-C3500-EURO STOXX 50

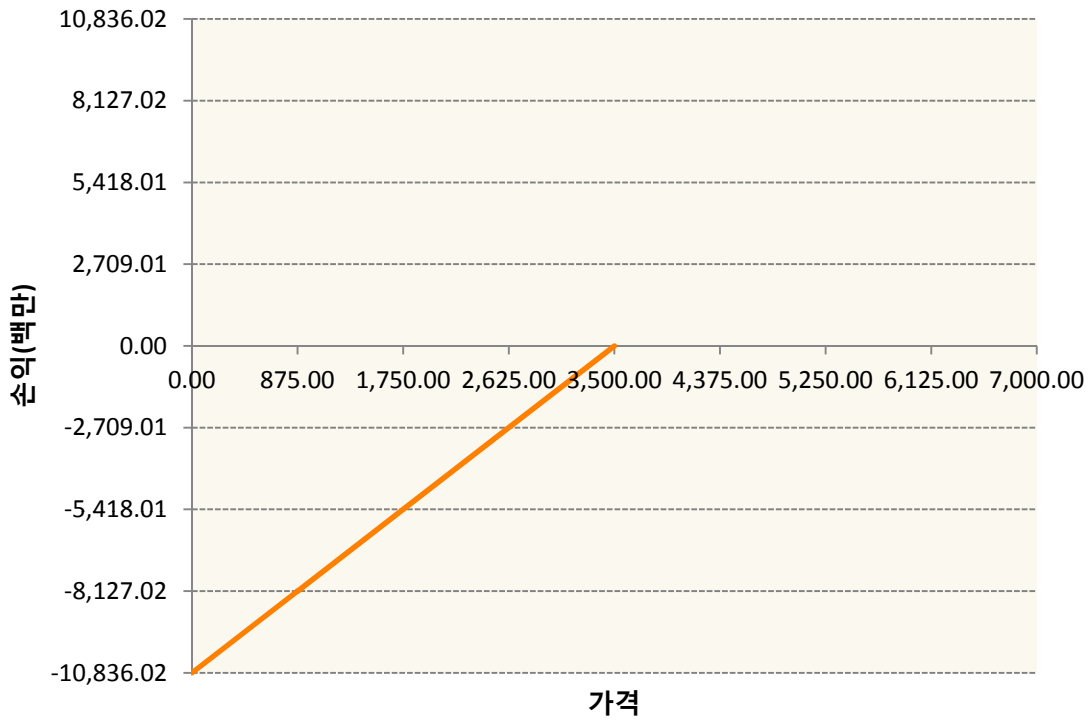


OESXN8-C3525-EURO STOXX 50

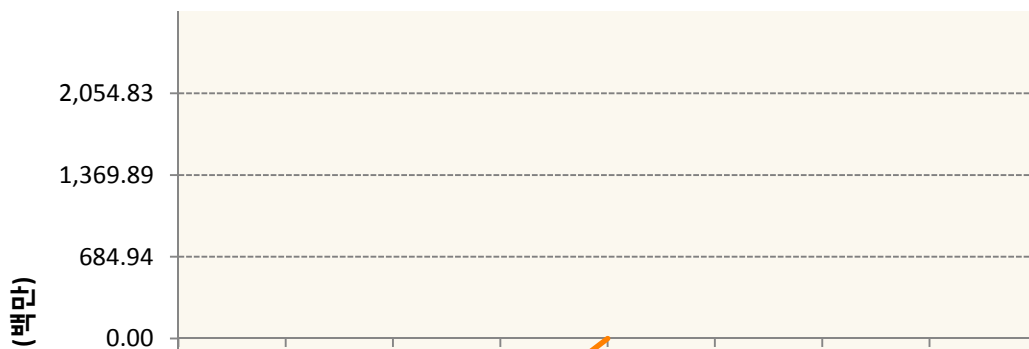


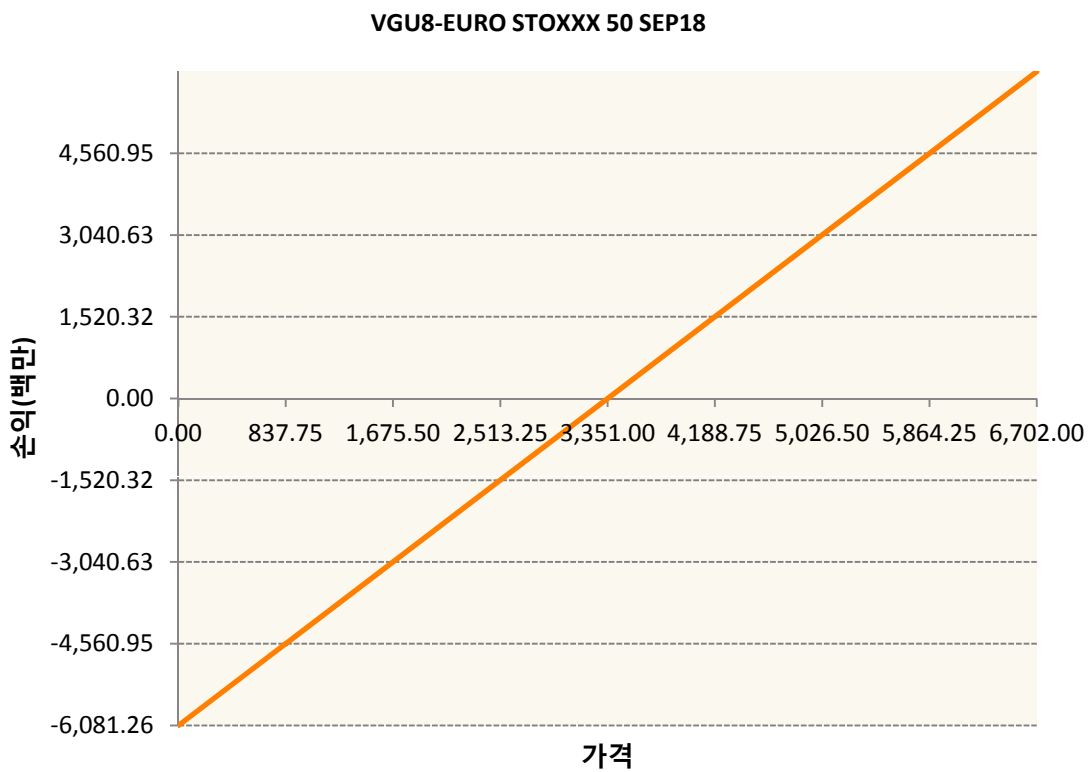
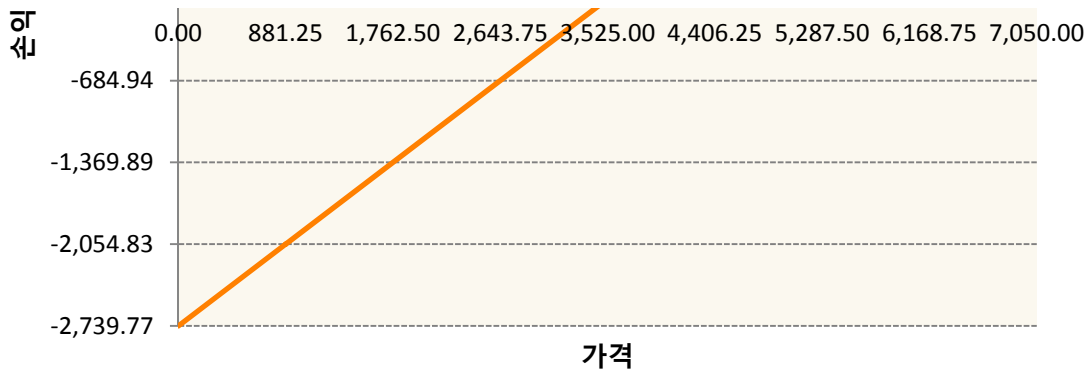


OESXN8-P3500-EURO STOXX 50



OESXN8-P3525-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		78
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY		67
OESXN8-C3! EURO STOXX 50		867
OESXN8-C3! EURO STOXX 50		219
OESXN8-P3! EURO STOXX 50		867
OESXN8-P3! EURO STOXX 50		219
VGU8	EURO STOXXX 50 SEP18	487

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

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

(단위:백만원)

1,148

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

(단위:백만원)

80

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

(단위:백만원)

125

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

(단위:백만원)

173

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-07-02
기준일	2018-06-29

리디파인K200(주식혼합-파생재간

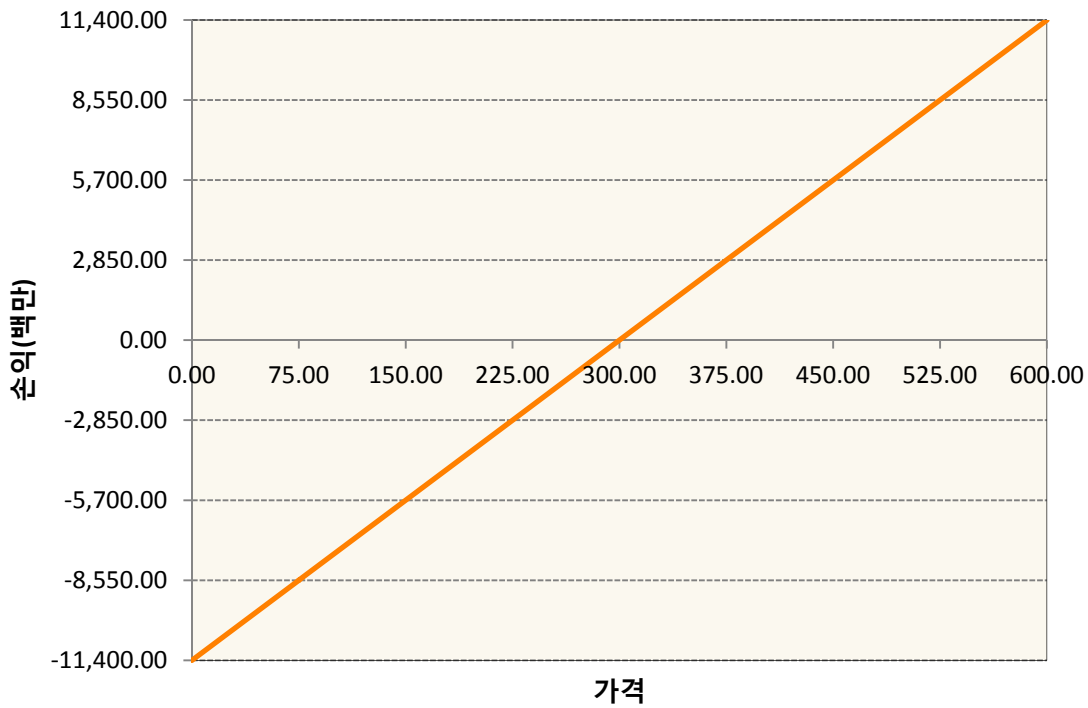
1. 계약금액

(단위:백만원)

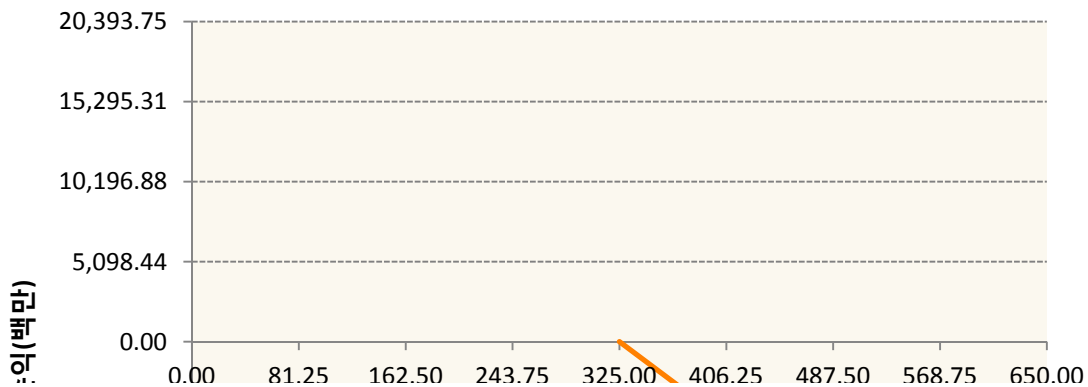
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	75	0	75	장내
누계	유가증권	선물	11,400	0	11,400	장내
누계	유가증권	옵션	1,550	20,394	-18,844	장내

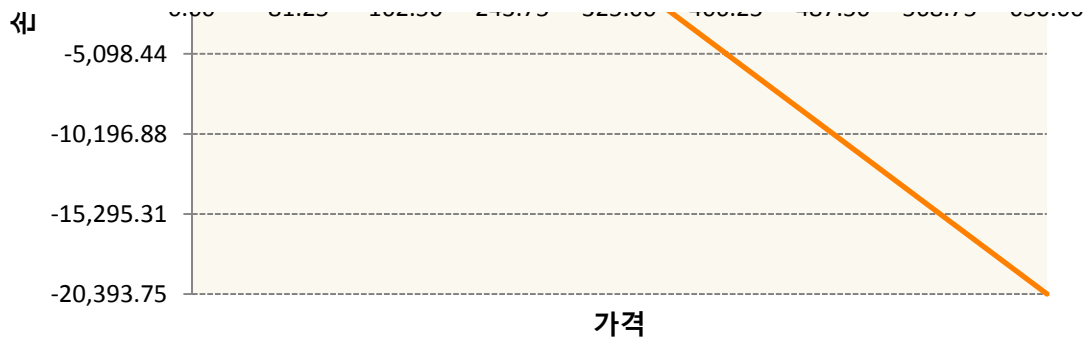
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

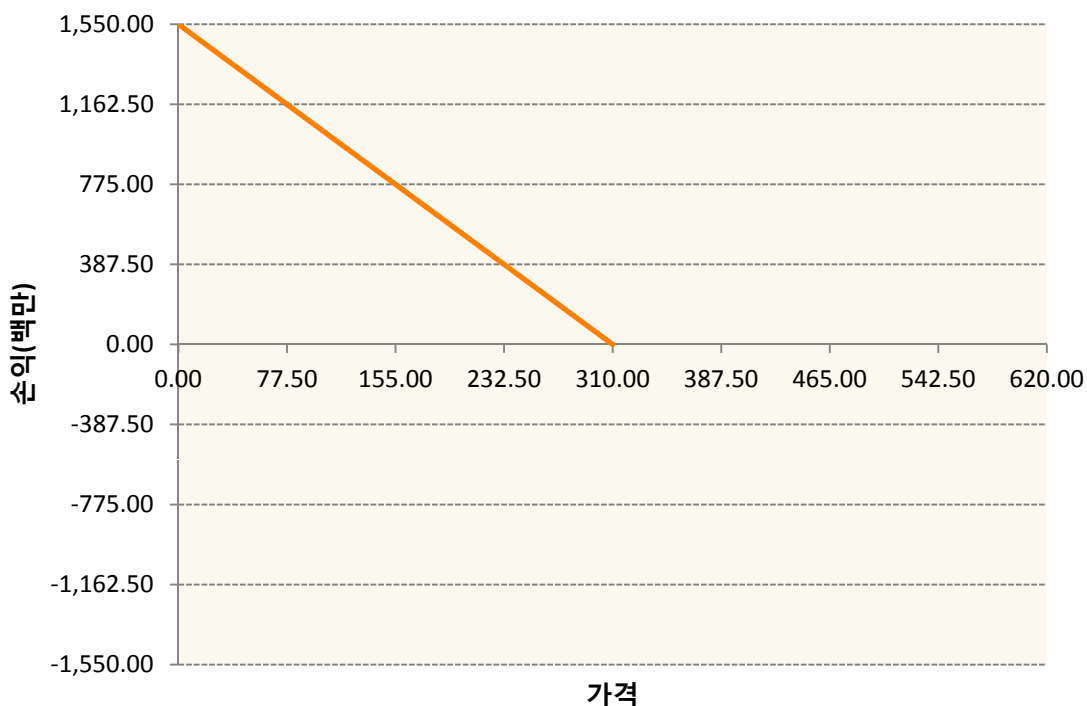


KR4201N73257-2018-07 콜325





KR4301N73107-2018-07 풋310



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물								911
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-911	-911	-911	-911	-911	-911	-911	-911
-5.33%	-607	-607	-607	-607	-607	-607	-607	-607
-2.67%	-304	-304	-304	-304	-304	-304	-304	-304
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	304	304	304	304	304	304	304	304
5.33%	607	607	607	607	607	607	607	607
8.00%	911	911	911	911	911	911	911	911
KR4201N732 2018-07 콜325								501
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	40	40	40	40	39	37	35
-5.33%	40	40	39	37	34	30	25
-2.67%	39	36	33	27	20	11	0
0%	31	23	13	0	-15	-32	-51
2.67%	-1	-19	-40	-63	-88	-115	-143
5.33%	-88	-120	-152	-186	-220	-254	-289
8.00%	-269	-307	-346	-385	-424	-463	-501

KR4301N7312018-07 풋310

117

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	117	117	117	117	117	117	117
-5.33%	77	77	77	77	77	77	77
-2.67%	37	37	37	37	37	38	38
0%	-2	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-34	-32	-31	-29	-28	-26	-25
5.33%	-50	-49	-48	-47	-45	-44	-42
8.00%	-54	-54	-54	-53	-52	-52	-51

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

(단위:백만원)

1,080

공시일	2018-07-02
기준일	2018-06-29

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

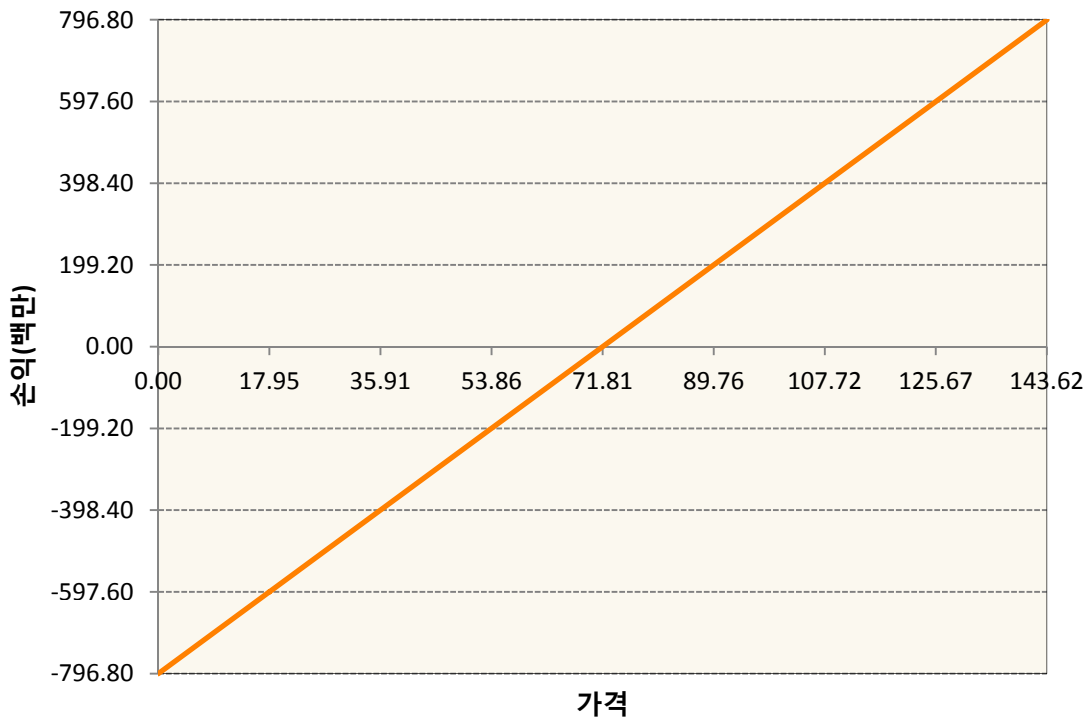
1. 계약금액

(단위:백만원)

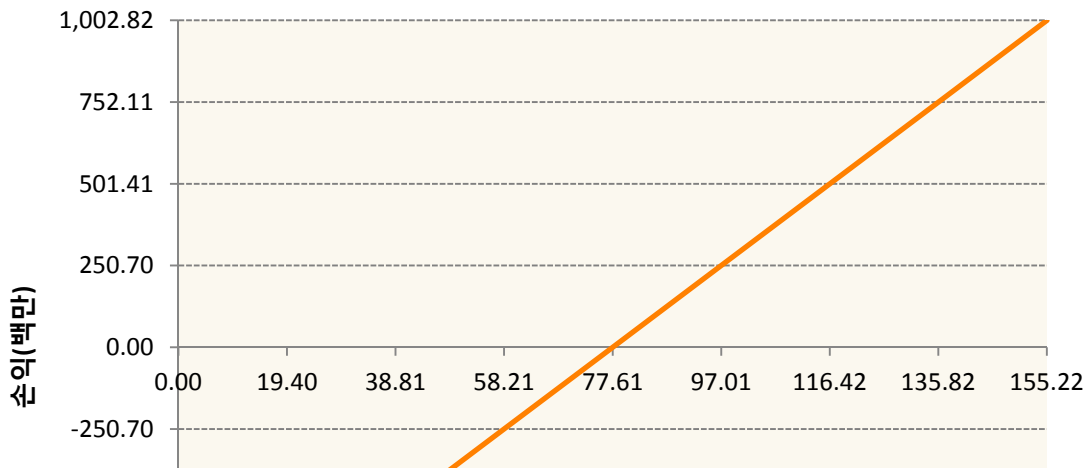
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,831	613	3,218	

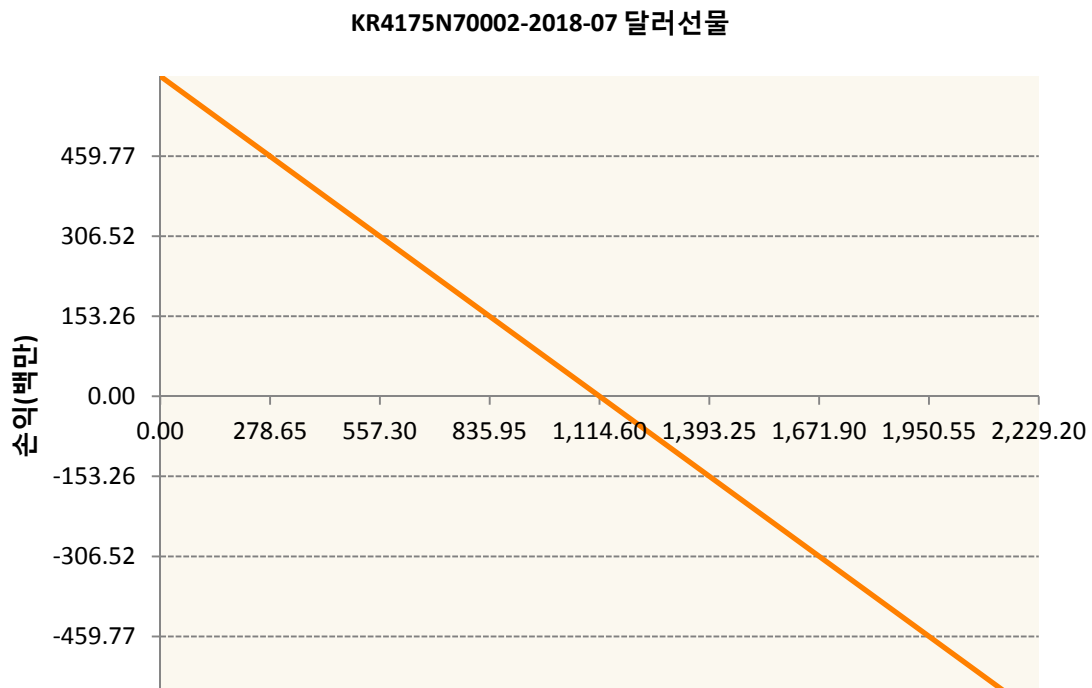
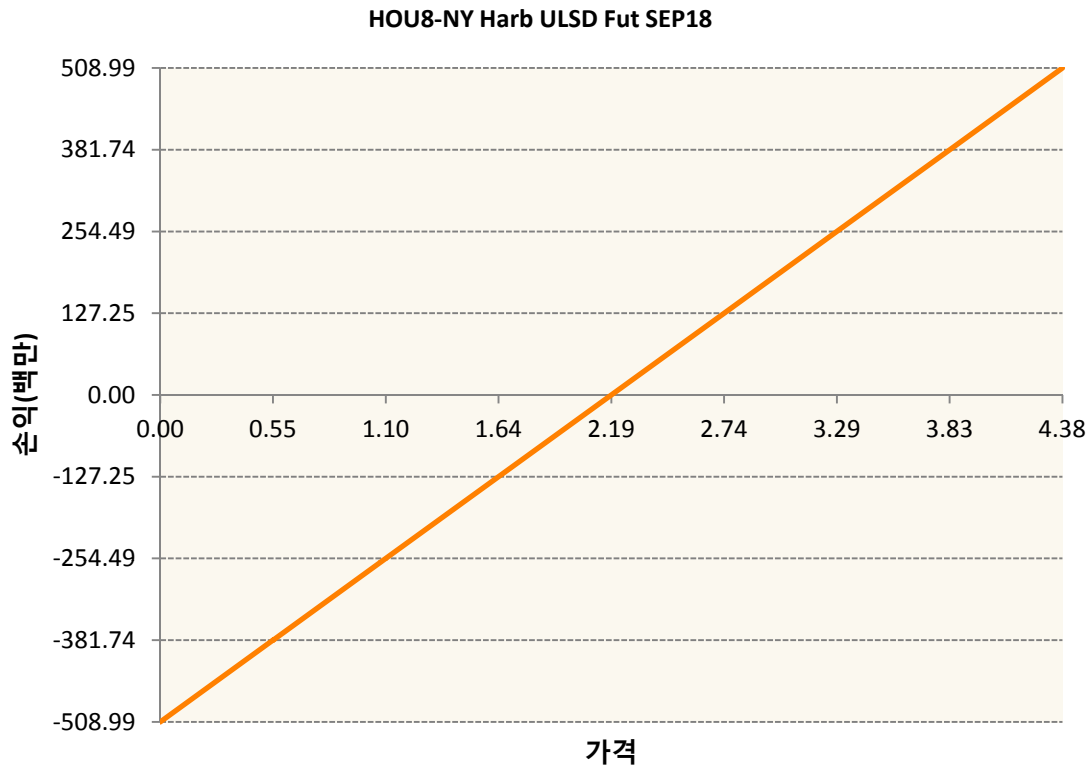
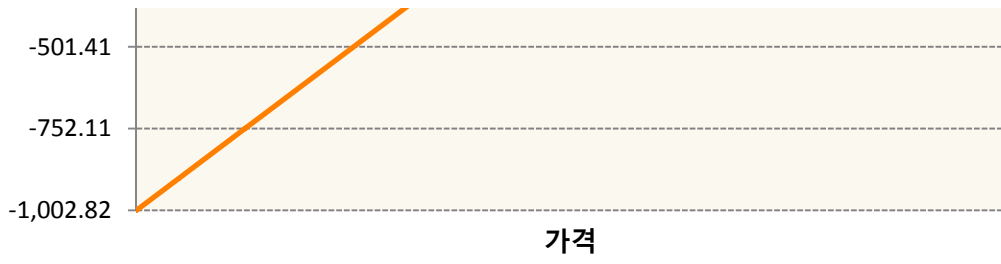
2. 만기시점의 손익구조

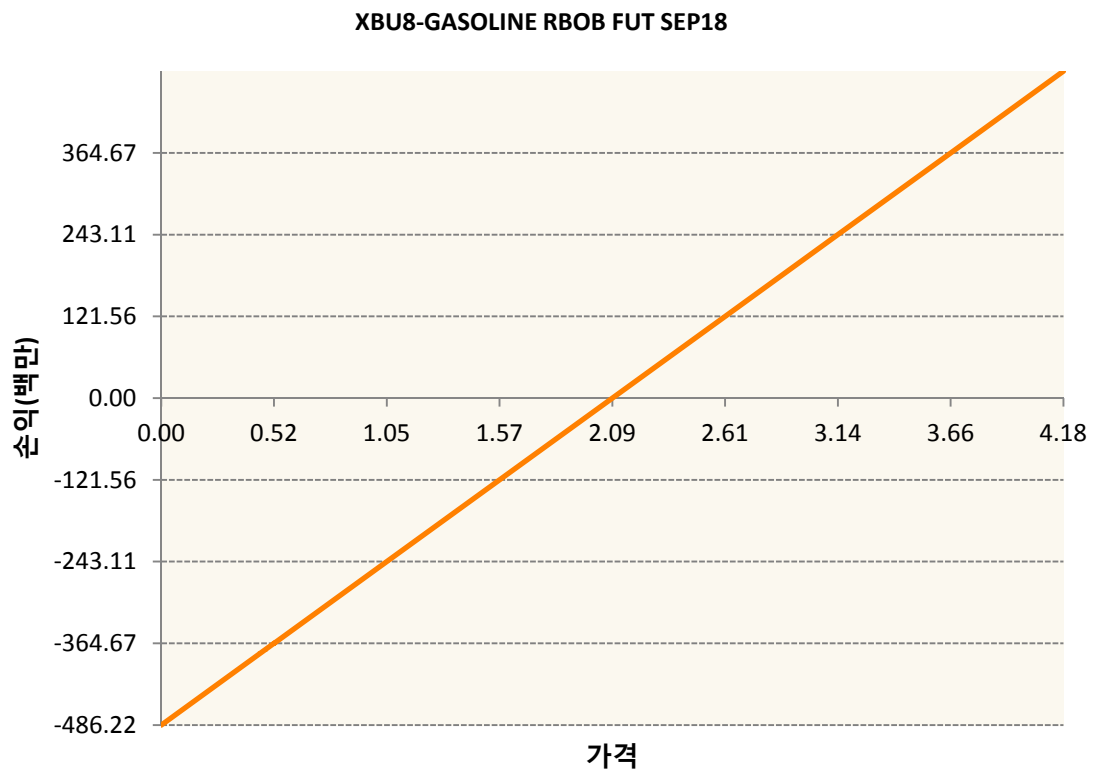
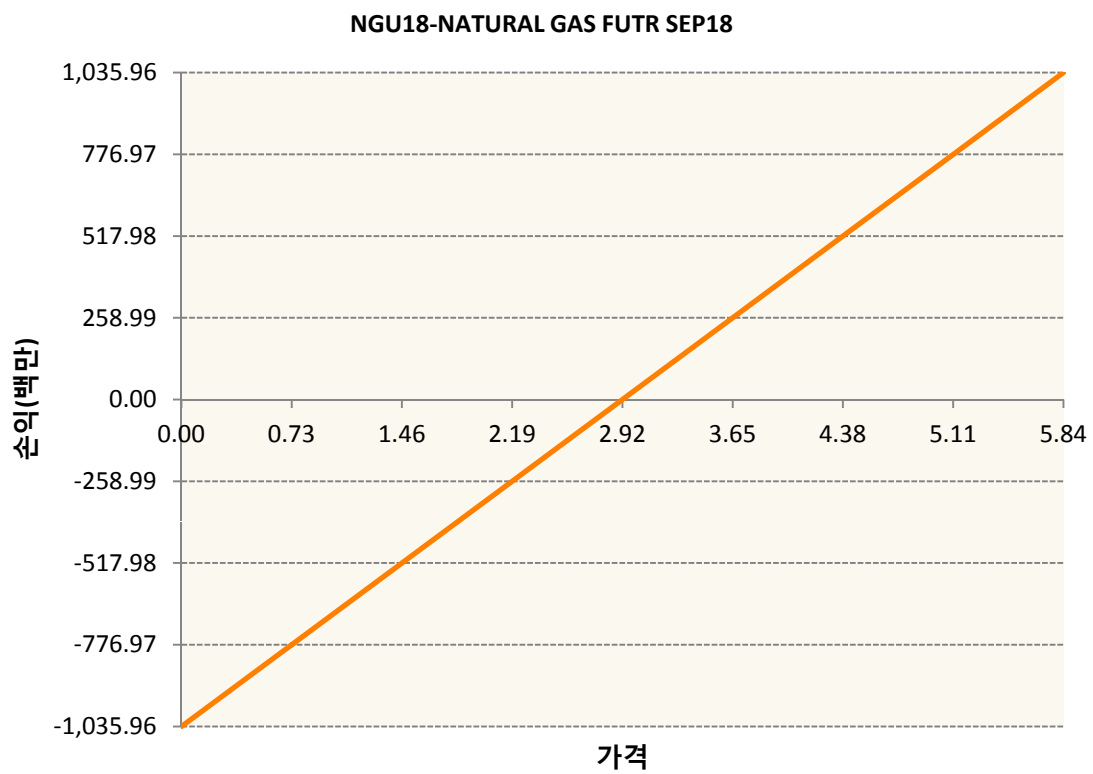
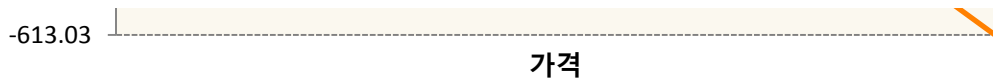
CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18



COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU8	WTI CRUDE FUTURE SEP18	64
COU8	BRENT CRUDE FUTR SEP18	80
HOU8	NY Harb ULSD Fut SEP18	41
KR4175N70C	2018-07 달러선물	49
NGU18	NATURAL GAS FUTR SEP18	83
XBU8	GASOLINE RBOB FUT SEP18	39

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

447

공시일	2018-07-02
기준일	2018-06-29

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

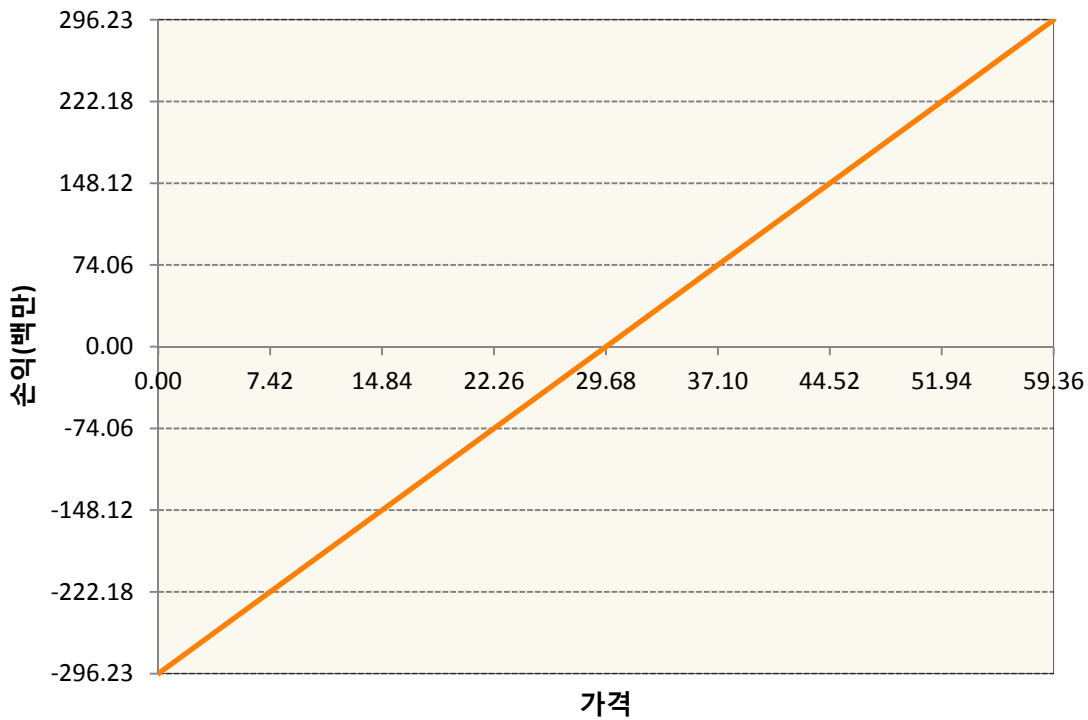
1. 계약금액

(단위:백만원)

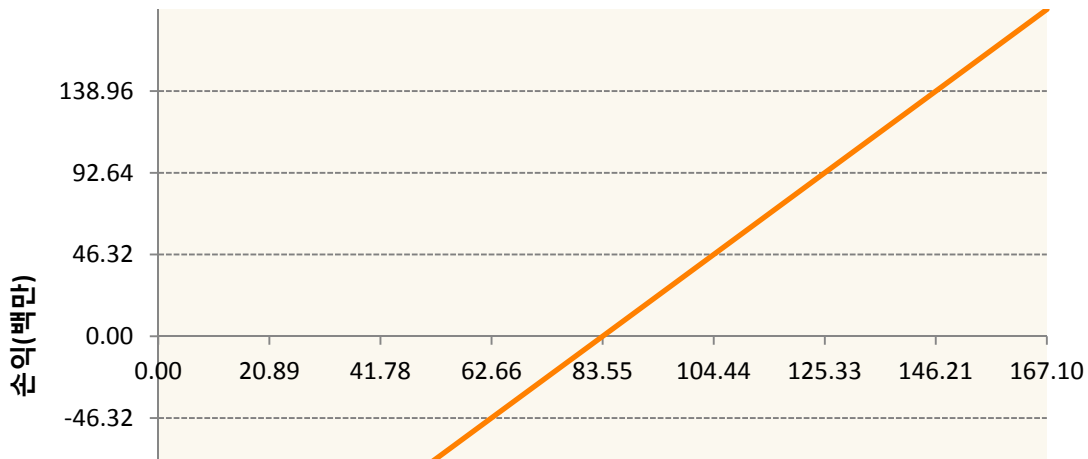
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,677	78	3,599	

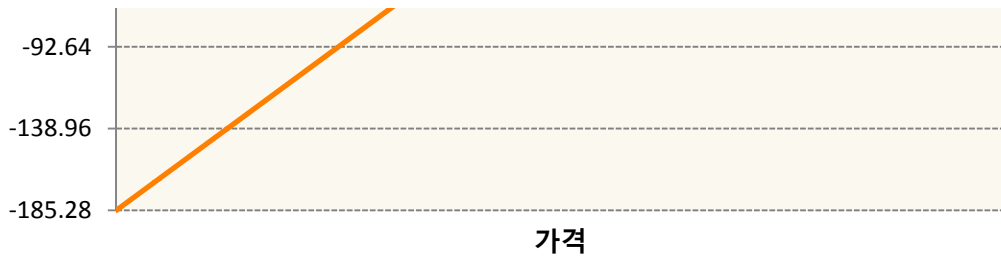
2. 만기시점의 손익구조

BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18

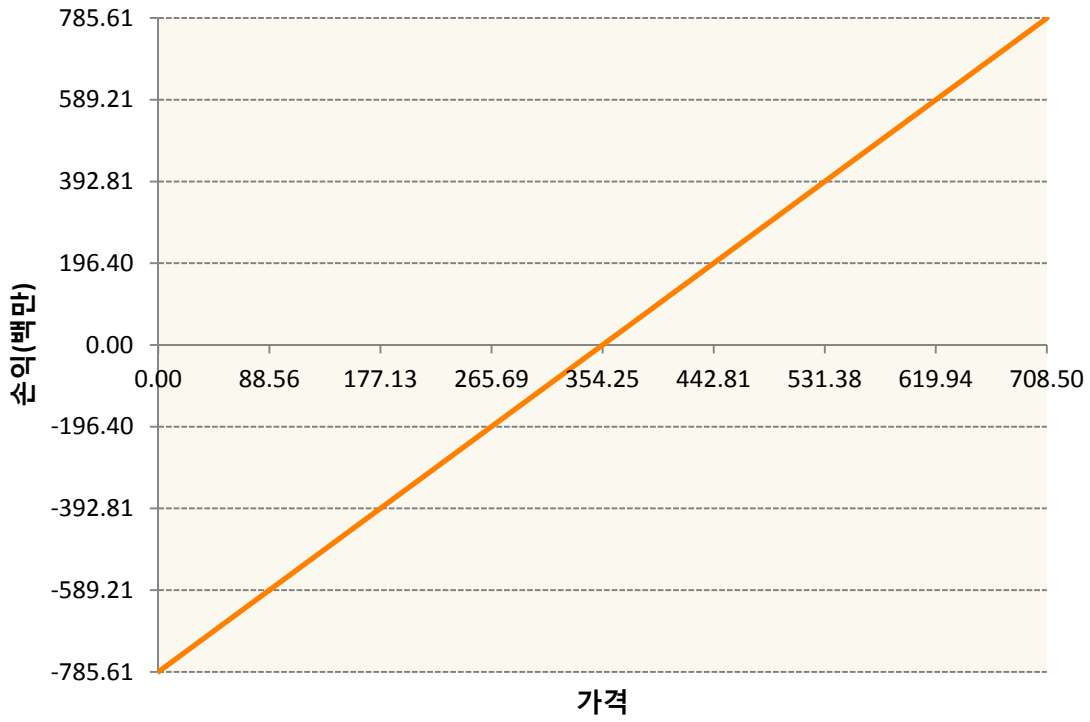


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

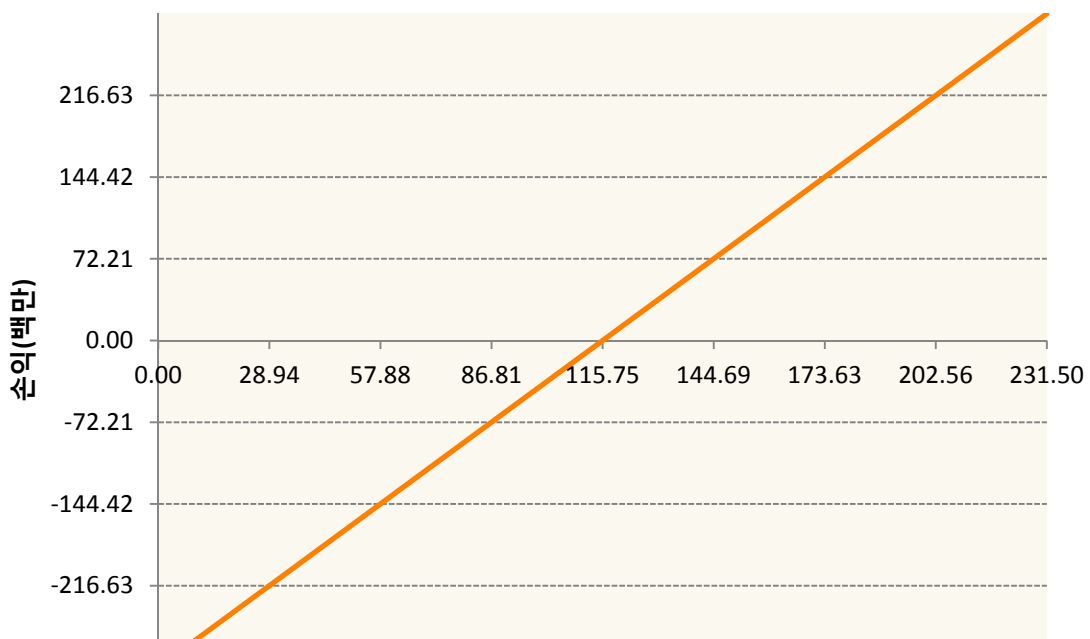


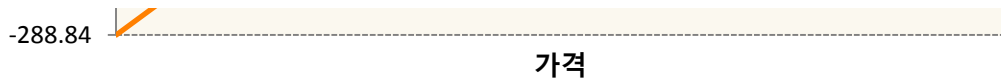


CU8-CORN FUTURE SEP18

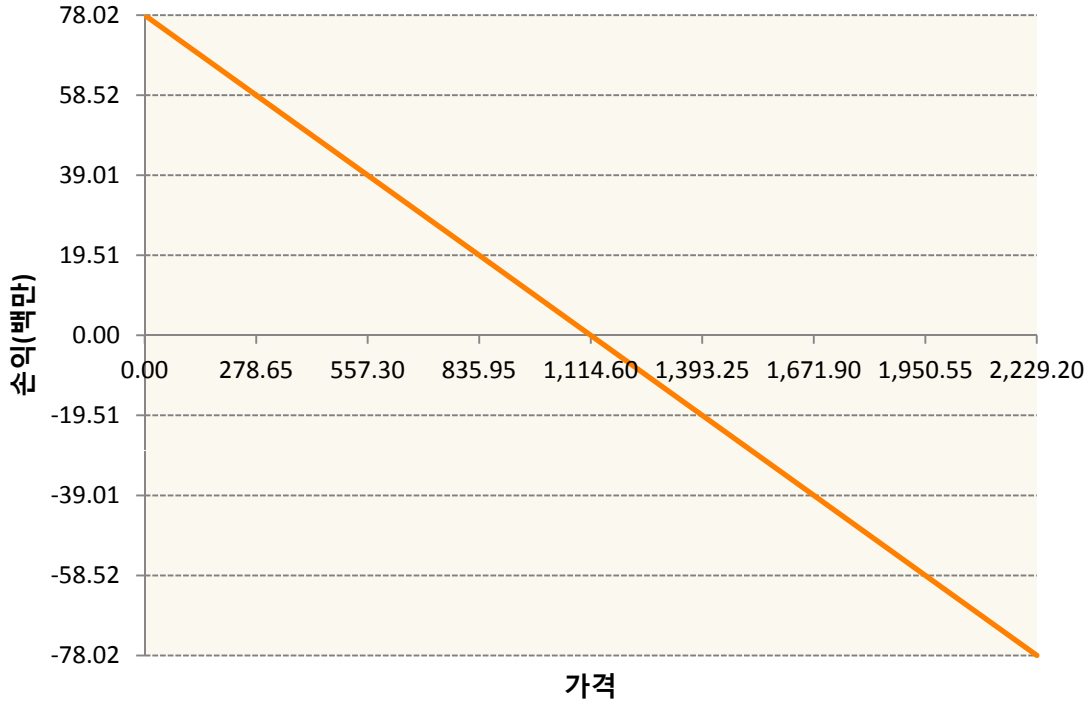


KCU8-COFFEE 'C' FUTURE SEP18

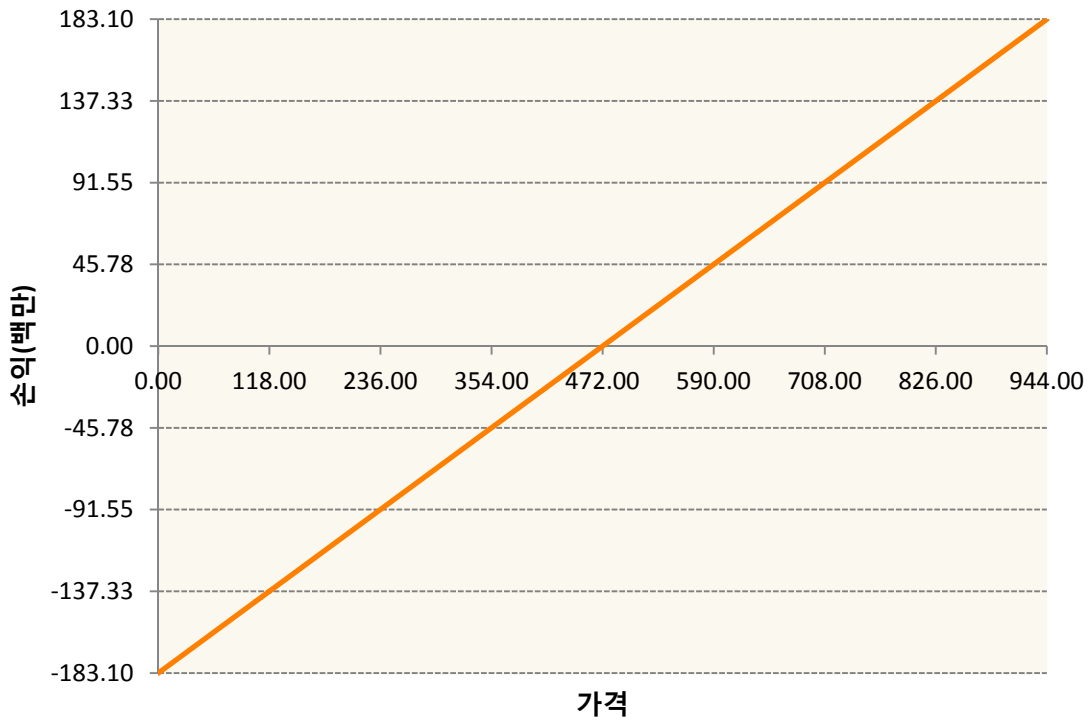




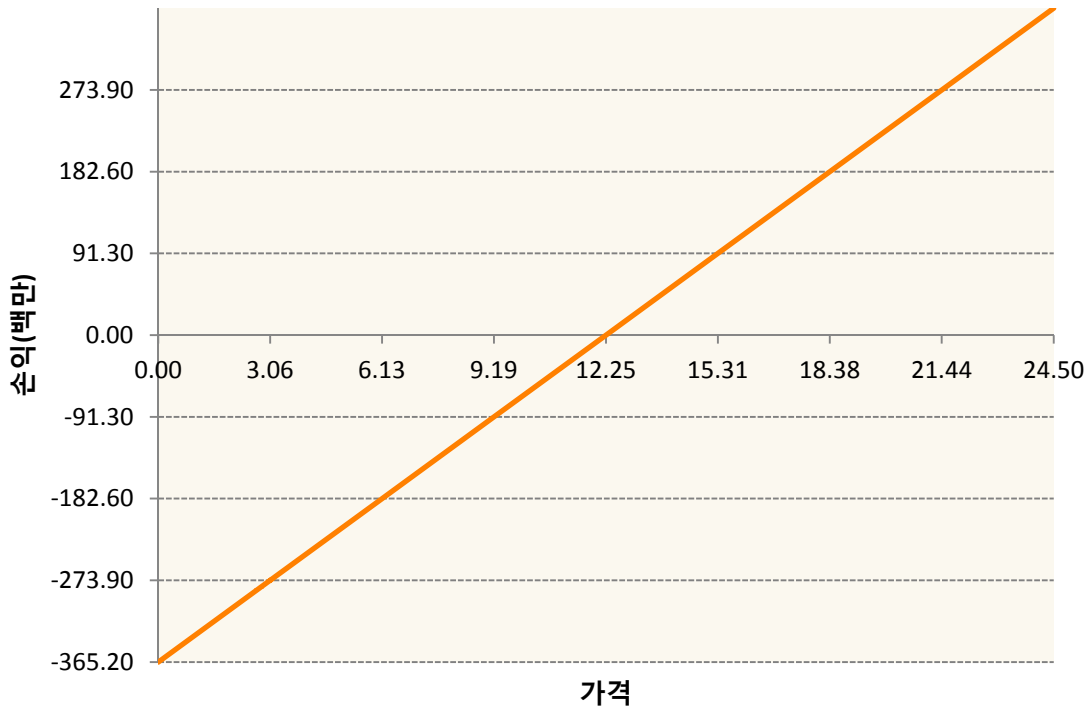
KR4175N70002-2018-07 달러선물



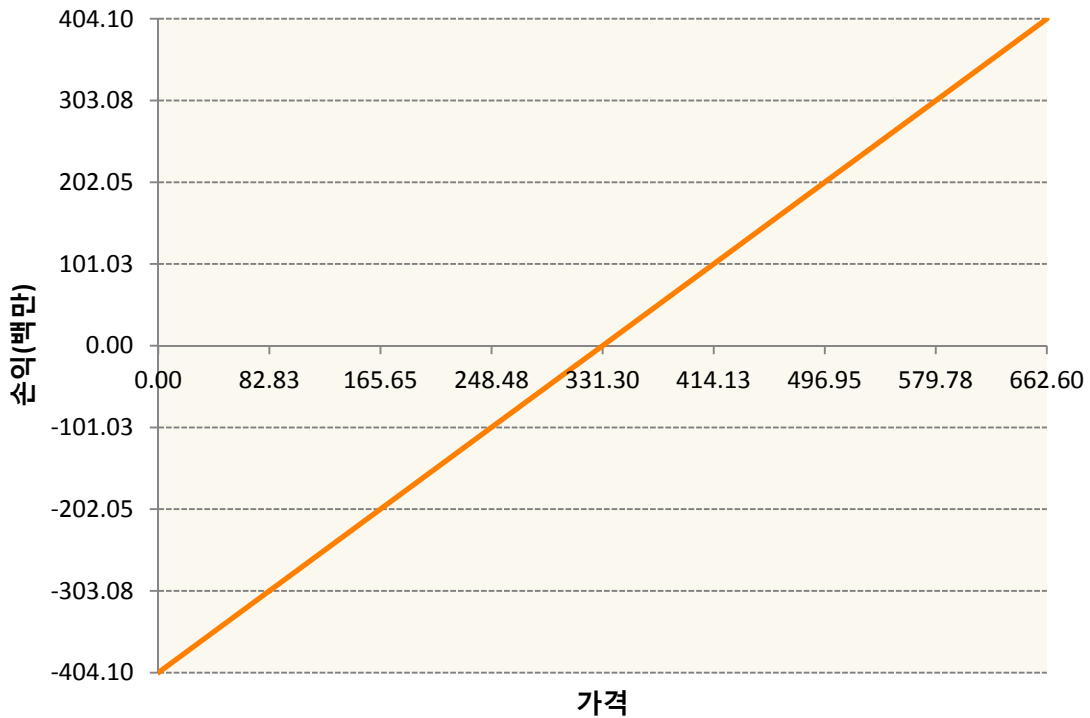
KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18



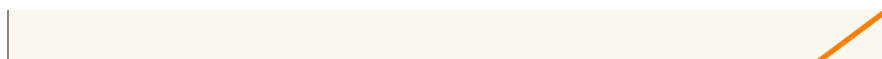
SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

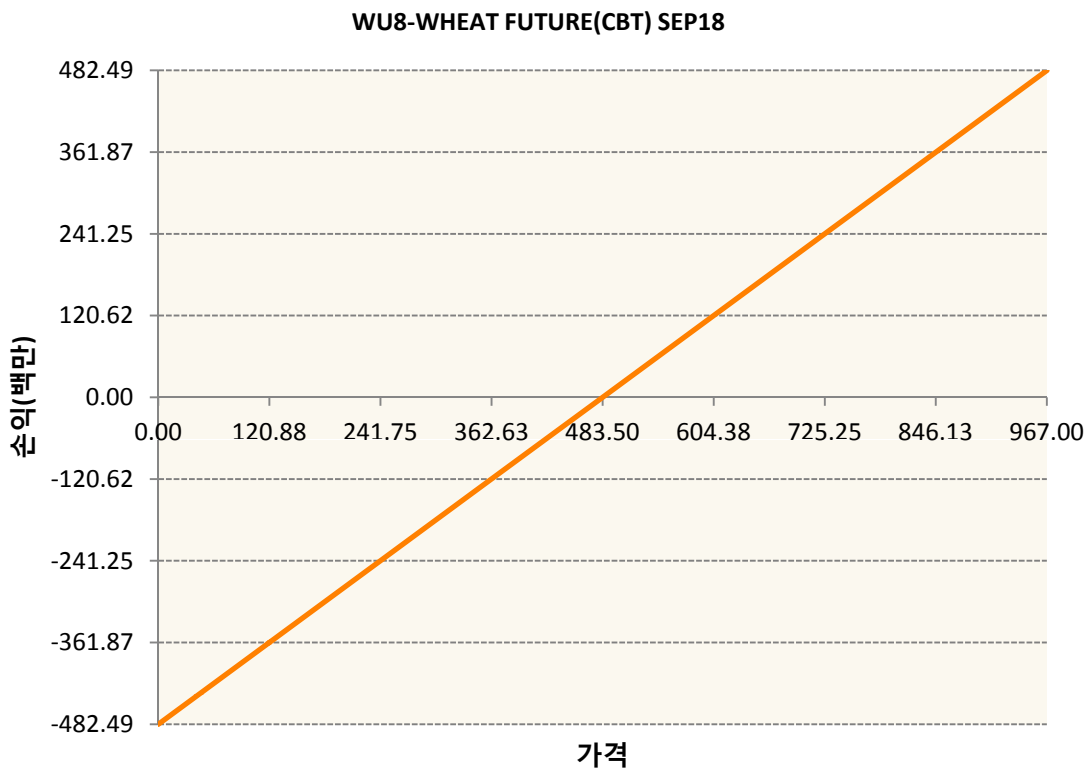
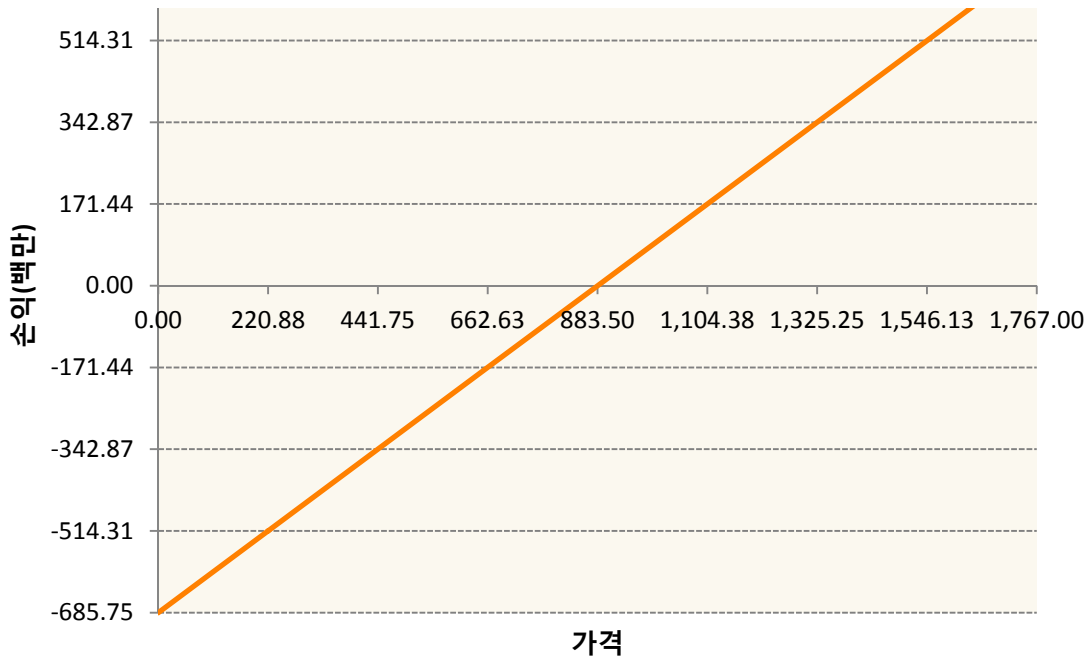


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



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	63
KCU8	COFFEE 'C' FUTURE SEP18	23
KR4175N70C	2018-07 달러선물	6

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)

300