

공시일	2018-07-03
기준일	2018-07-02

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	2018-07-03
기준일	2018-07-02

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

1,104

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

463

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-07-03
기준일	2018-07-02

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

326

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

388

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-07-03
기준일	2018-07-02

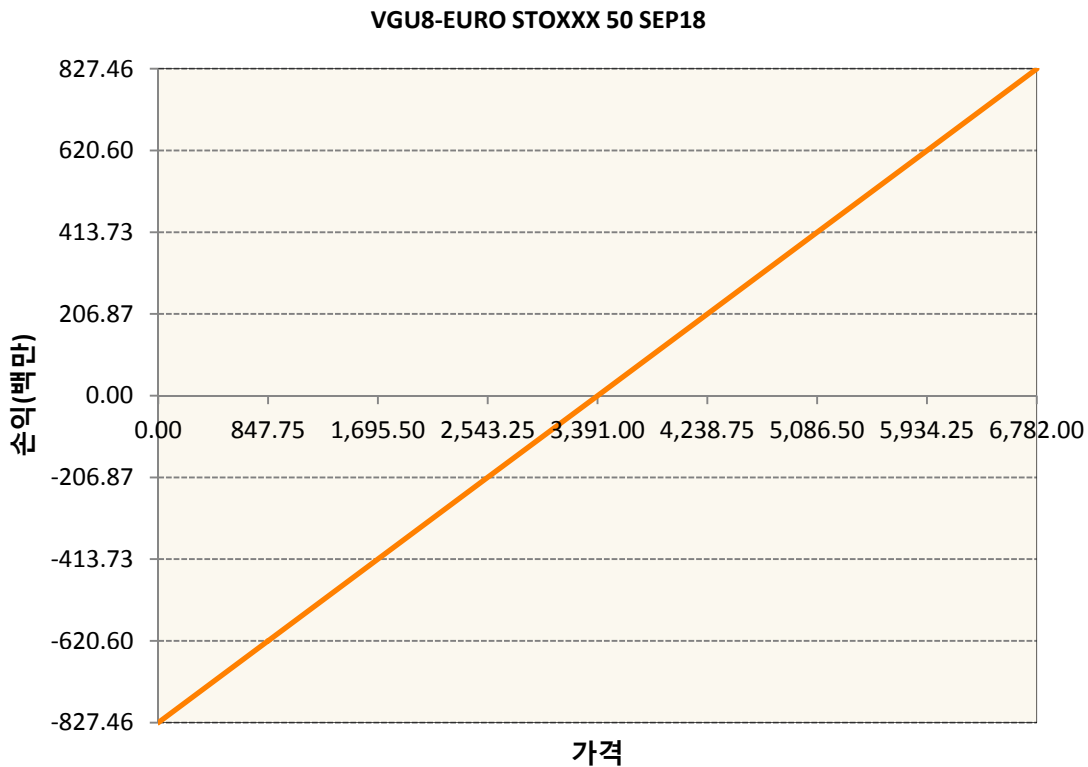
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	827	0	827	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU8	EURO STOXXX 50 SEP18	66
------	----------------------	----

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

(단위:백만원)

41

공시일	2018-07-03
기준일	2018-07-02

차이나인덱스모(주식-파생형)

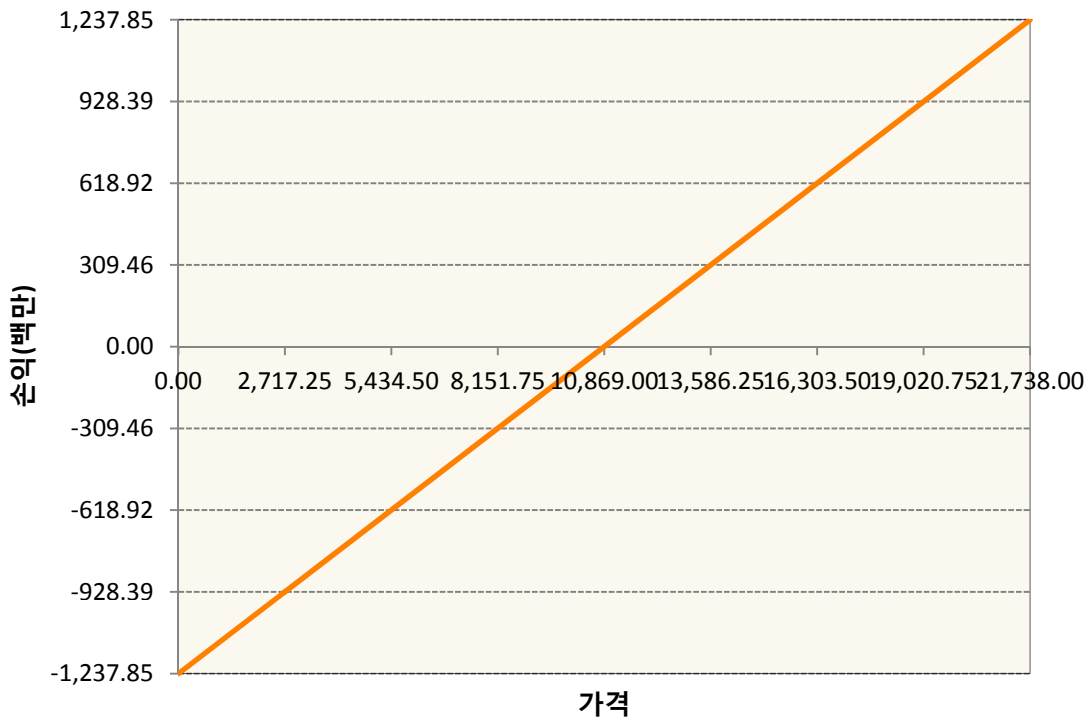
1. 계약금액

(단위:백만원)

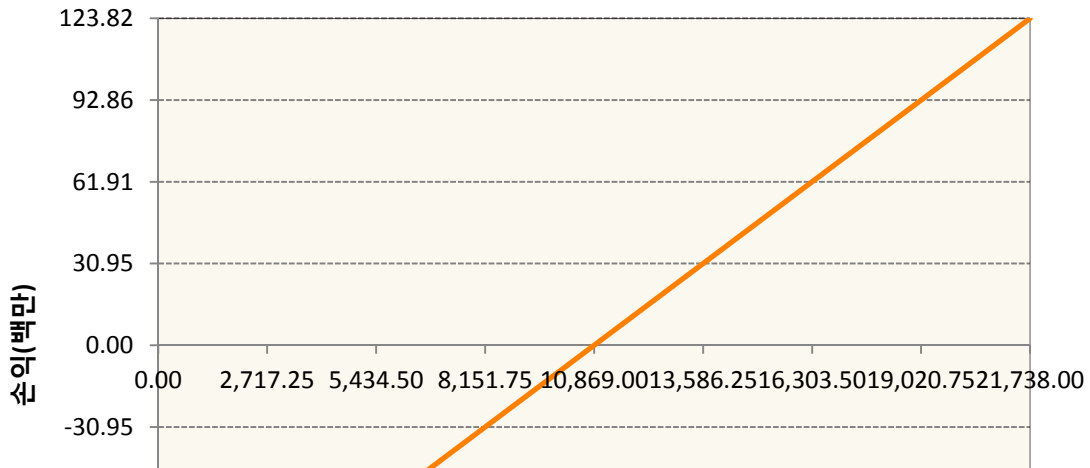
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,362	0	1,362	장내

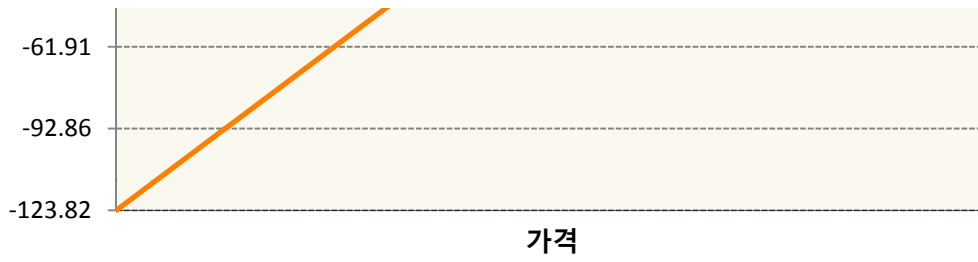
2. 만기시점의 손익구조

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	2018-07-03
기준일	2018-07-02

커버드콜모(주식혼합-파생형)

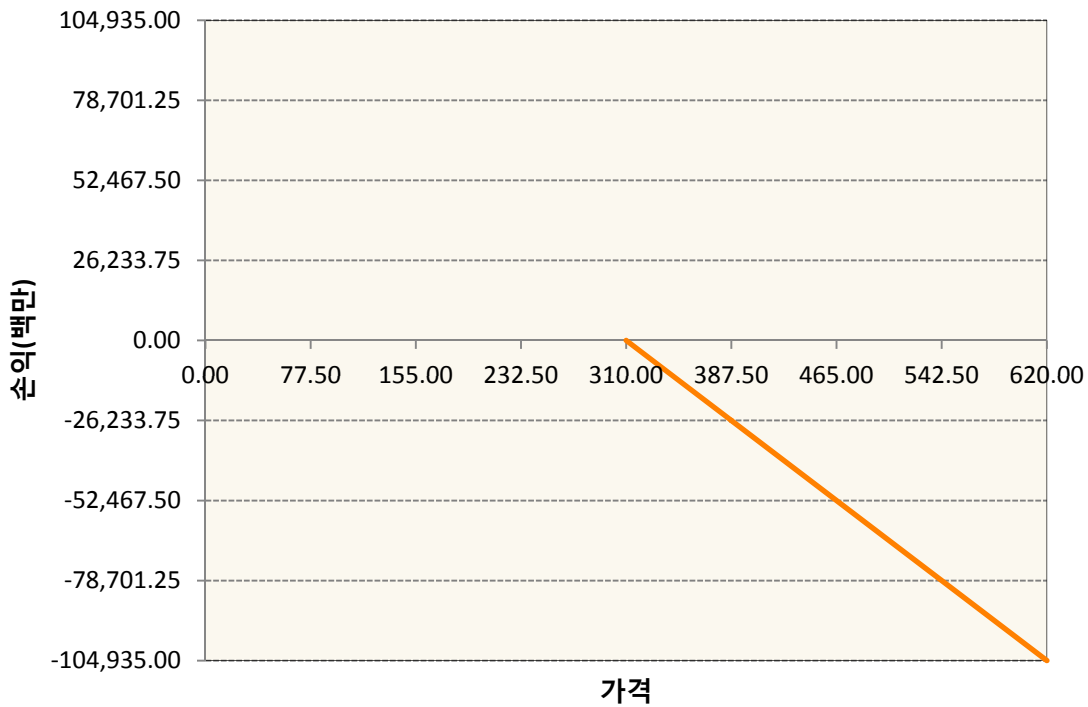
1. 계약금액

(단위:백만원)

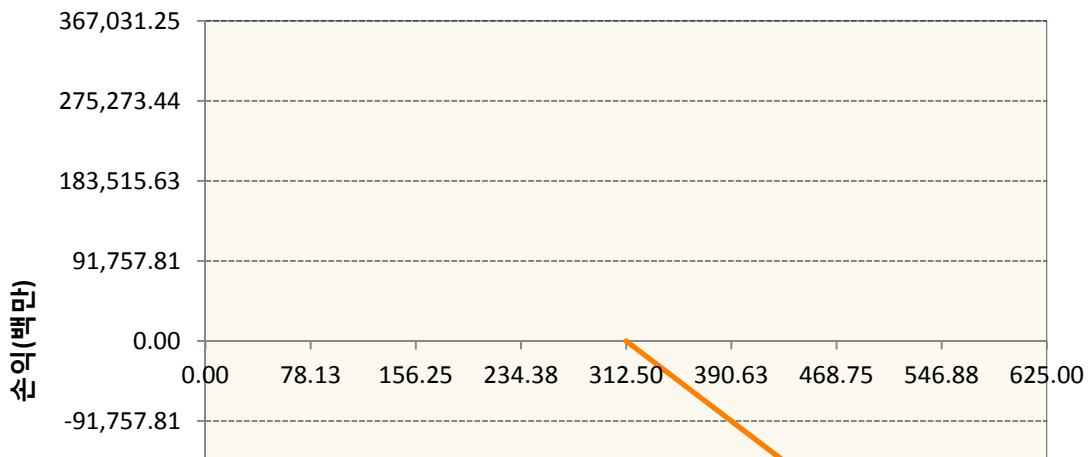
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	766,466	-766,466	장내

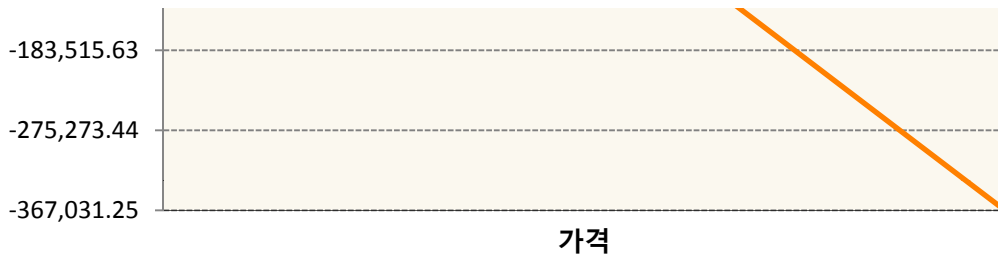
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N73109-2018-07 콜310

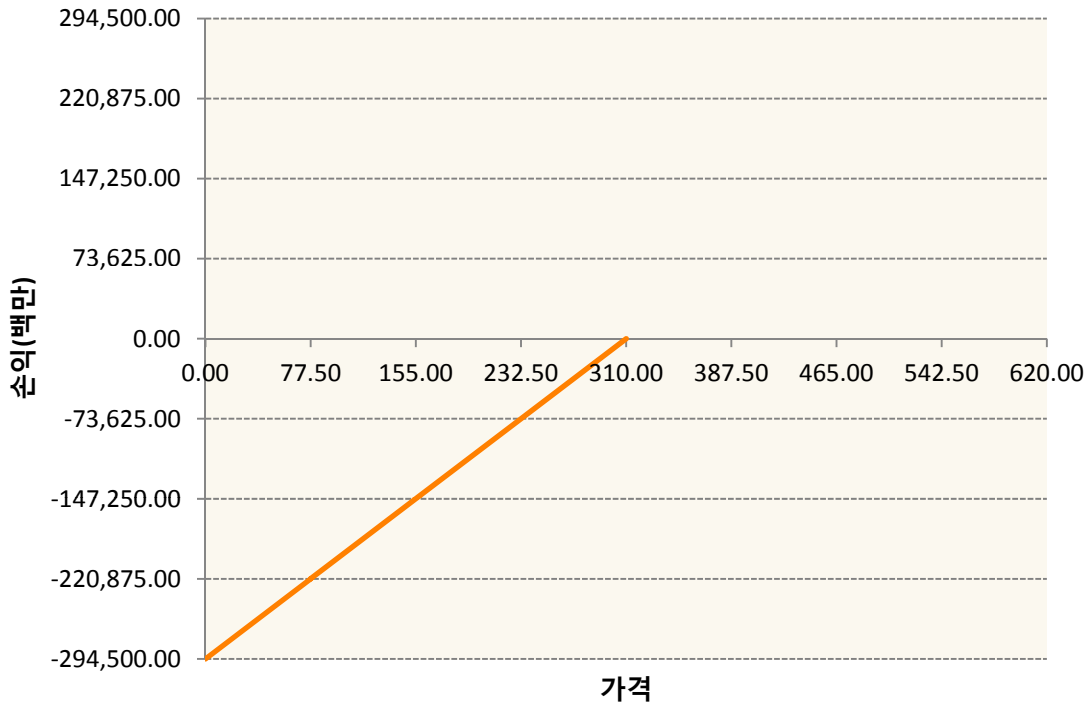


KR4201N73125-2018-07 콜312.5





KR4301N73107-2018-07 풋310



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N7312018-07 콜310

3,575

		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	363	363	361	358	352	343	330	
-5.33%	361	357	349	335	315	288	254	
-2.67%	342	321	290	248	197	136	66	
0%	237	170	91	0	-100	-209	-325	
2.67%	-132	-267	-408	-555	-706	-861	-1,018	
5.33%	-1,020	-1,199	-1,377	-1,556	-1,735	-1,914	-2,093	
8.00%	-2,571	-2,732	-2,896	-3,063	-3,232	-3,403	-3,575	

KR4201N7312018-07 콜312.5

11,020

		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	922	922	919	912	899	876	841	

-5.33%	919	910	892	860	810	738	643
-2.67%	882	833	756	648	508	335	131
0%	652	478	259	0	-296	-623	-979
2.67%	-260	-657	-1,088	-1,545	-2,023	-2,520	-3,031
5.33%	-2,693	-3,289	-3,890	-4,495	-5,104	-5,714	-6,327
8.00%	-7,334	-7,939	-8,549	-9,163	-9,780	-10,399	-11,020

KR4301N7312018-07 풋310

22,148

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,148	-22,148	-22,148	-22,148	-22,148	-22,148	-22,148
-5.33%	-14,731	-14,731	-14,731	-14,731	-14,731	-14,733	-14,736
-2.67%	-7,314	-7,314	-7,316	-7,321	-7,329	-7,343	-7,364
0%	90	73	43	0	-58	-130	-217
2.67%	7,242	7,111	6,959	6,790	6,606	6,409	6,202
5.33%	12,906	12,616	12,325	12,033	11,740	11,447	11,154
8.00%	15,625	15,416	15,193	14,958	14,715	14,465	14,208

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

(단위:백만원)

33,541

공시일	2018-07-03
기준일	2018-07-02

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

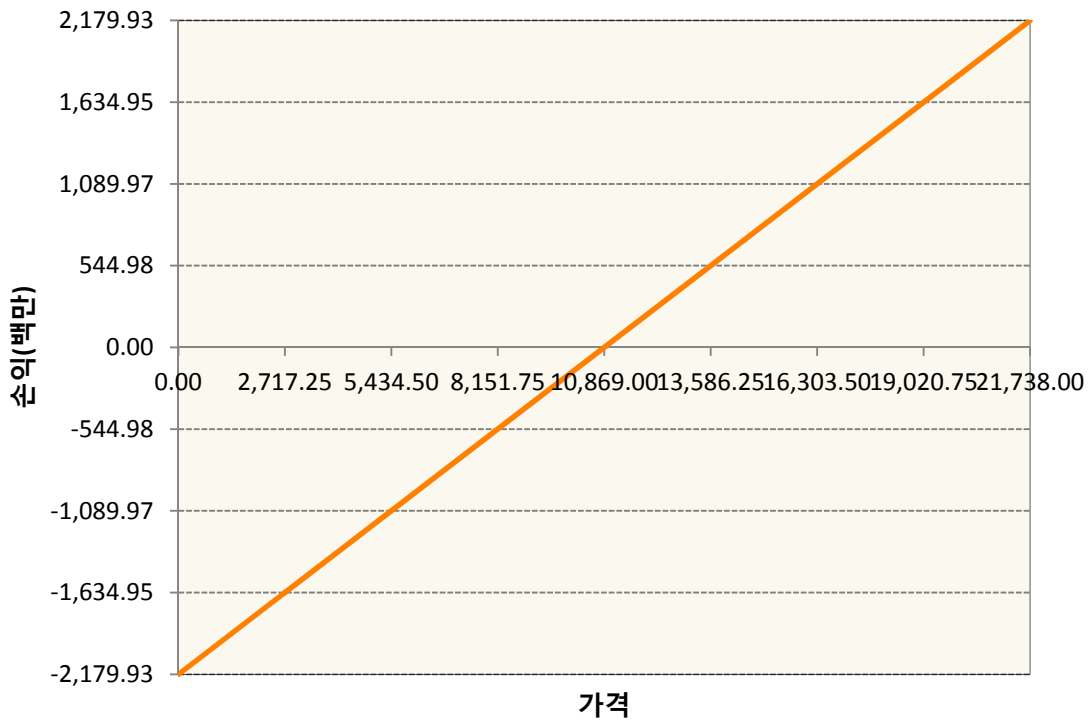
1. 계약금액

(단위:백만원)

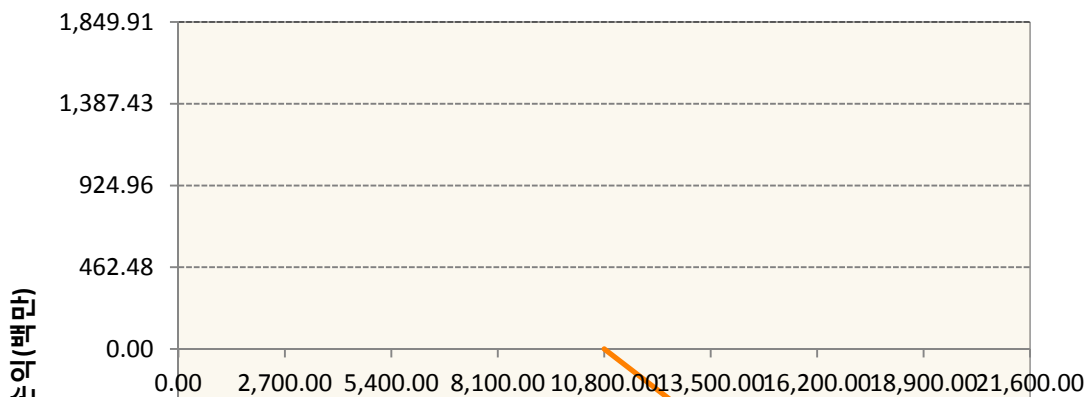
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,180	0	2,180	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,584	-5,584	장내

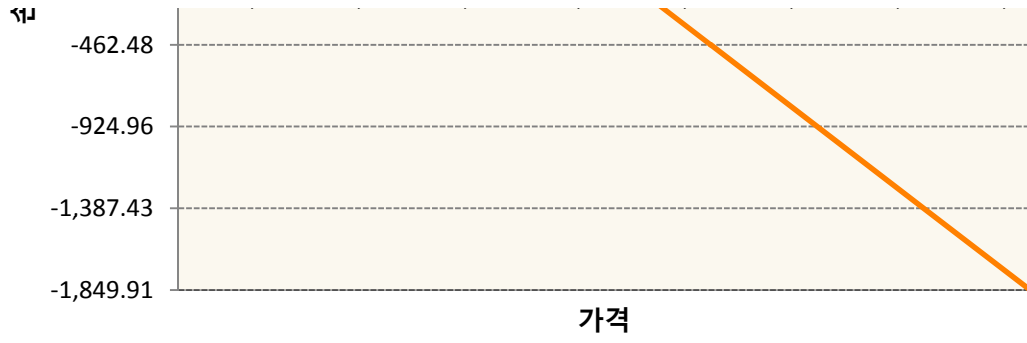
2. 만기시점의 손익구조

HCN8-HSCEI Futures Jul18

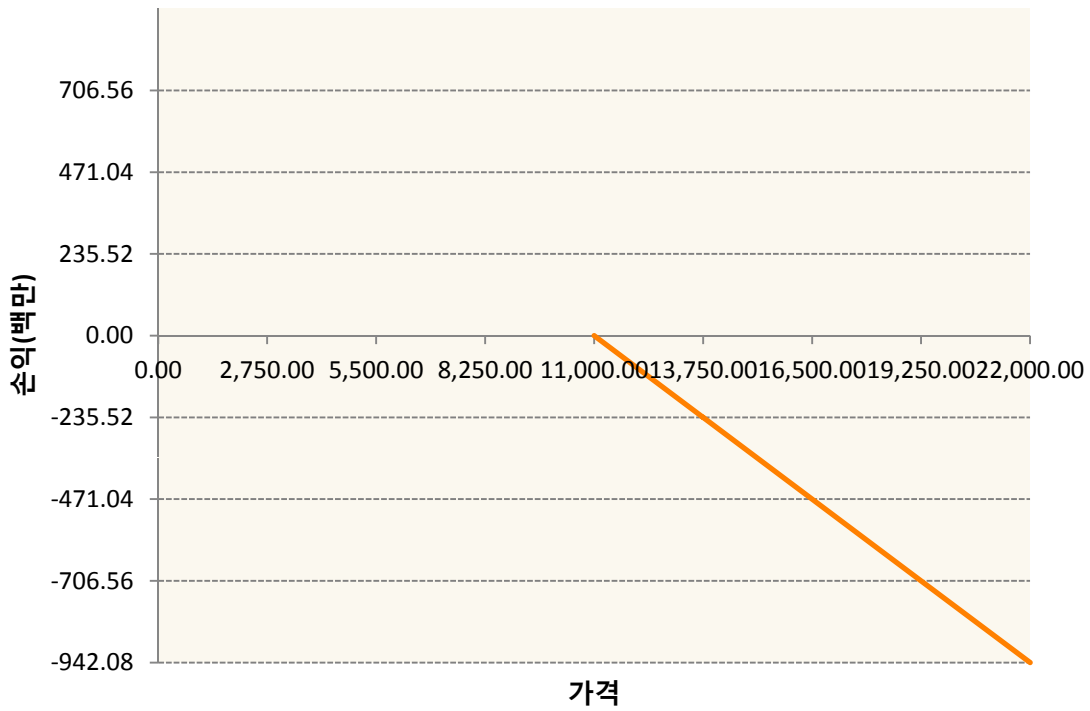


OHHIN8-C108-HSCEI

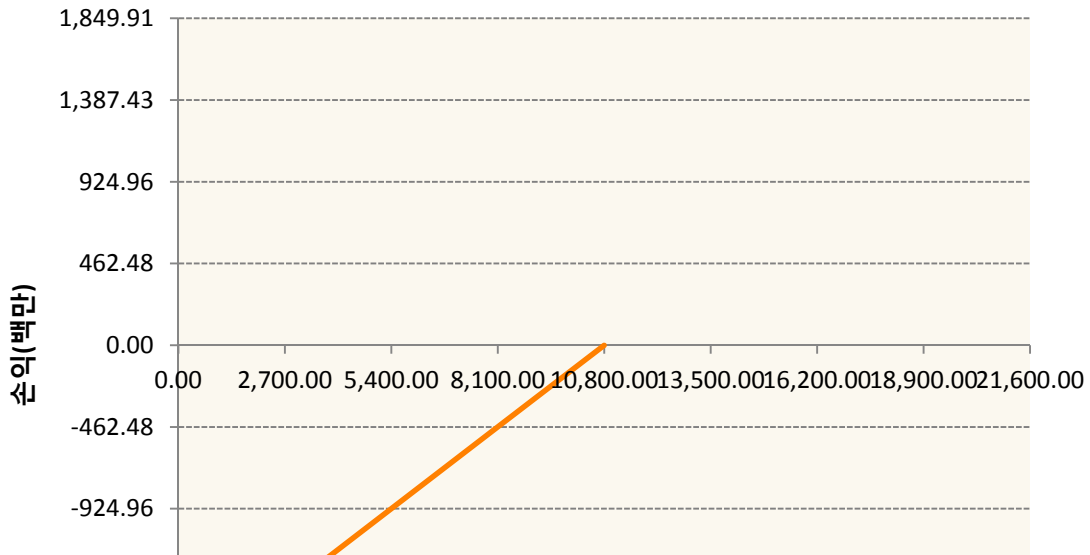


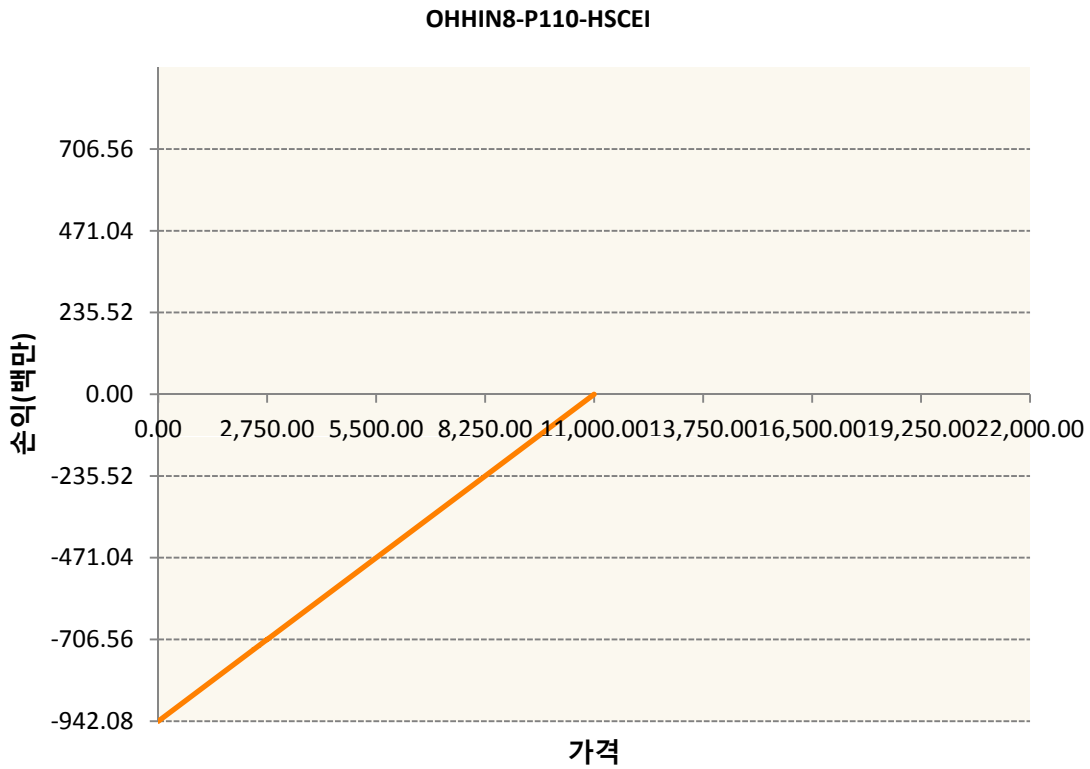
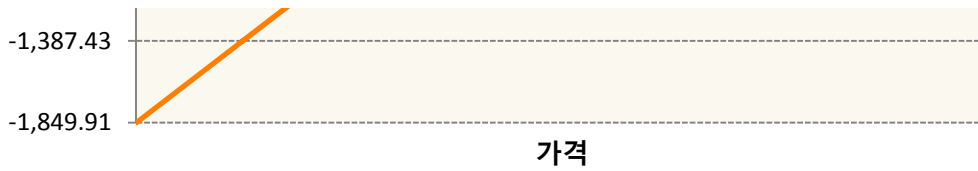


OHHIN8-C110-HSCEI



OHHIN8-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCN8	HSCEI Futures Jul18	174
OHHIN8-C1	(HSCEI	148
OHHIN8-C1	: HSCEI	75
OHHIN8-P1	(HSCEI	148
OHHIN8-P11	HSCEI	75

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	560

공시일	2018-07-03
기준일	2018-07-02

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

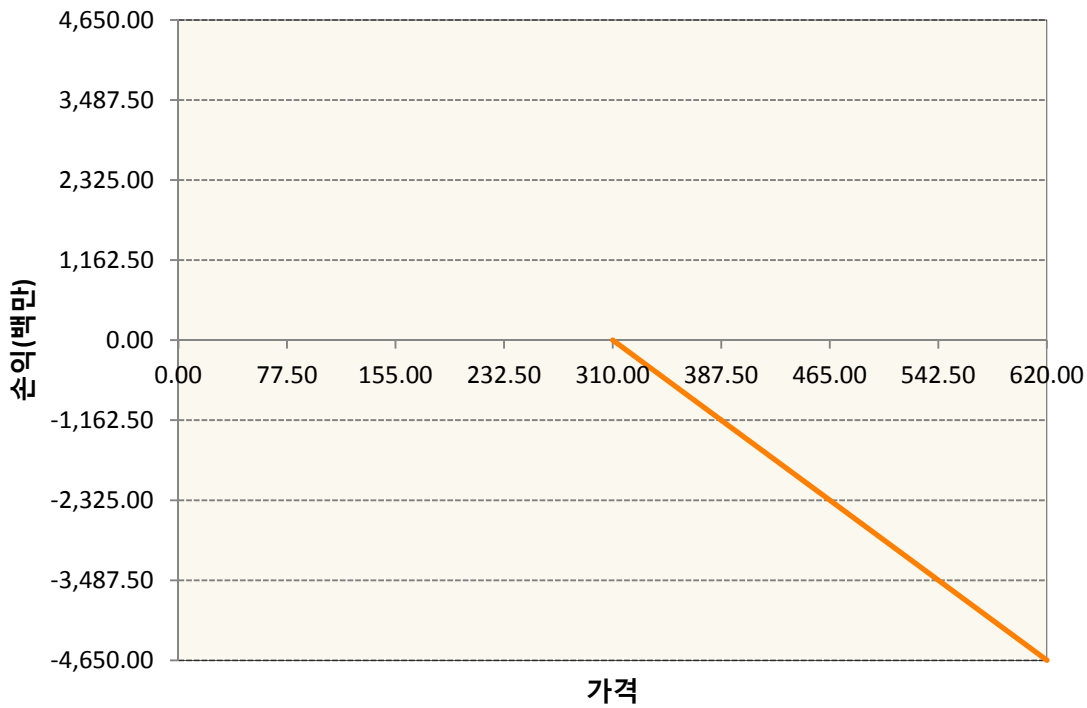
1. 계약금액

(단위:백만원)

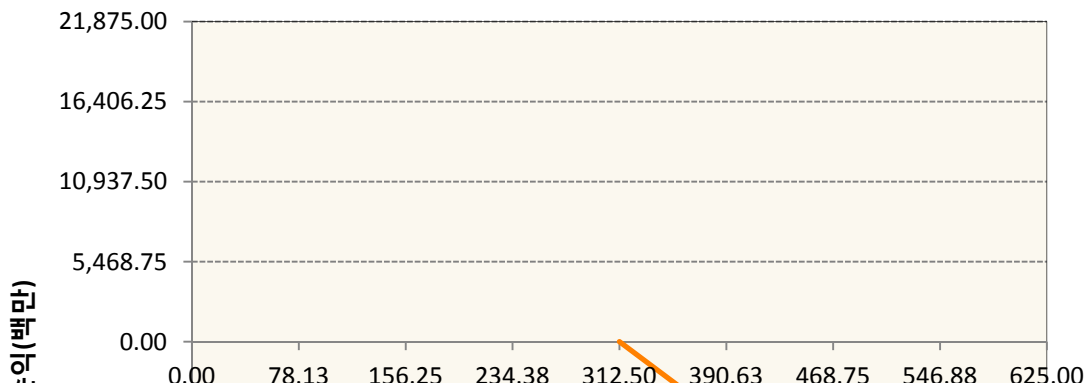
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	45,900	-45,900	장내

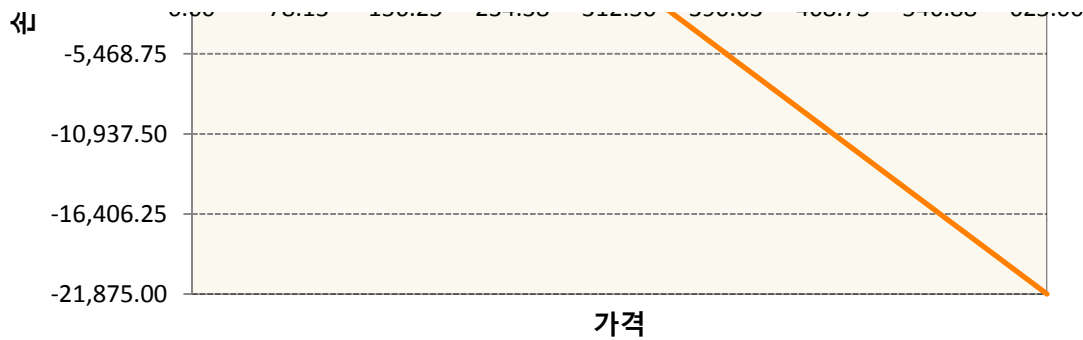
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N73109-2018-07 콜310

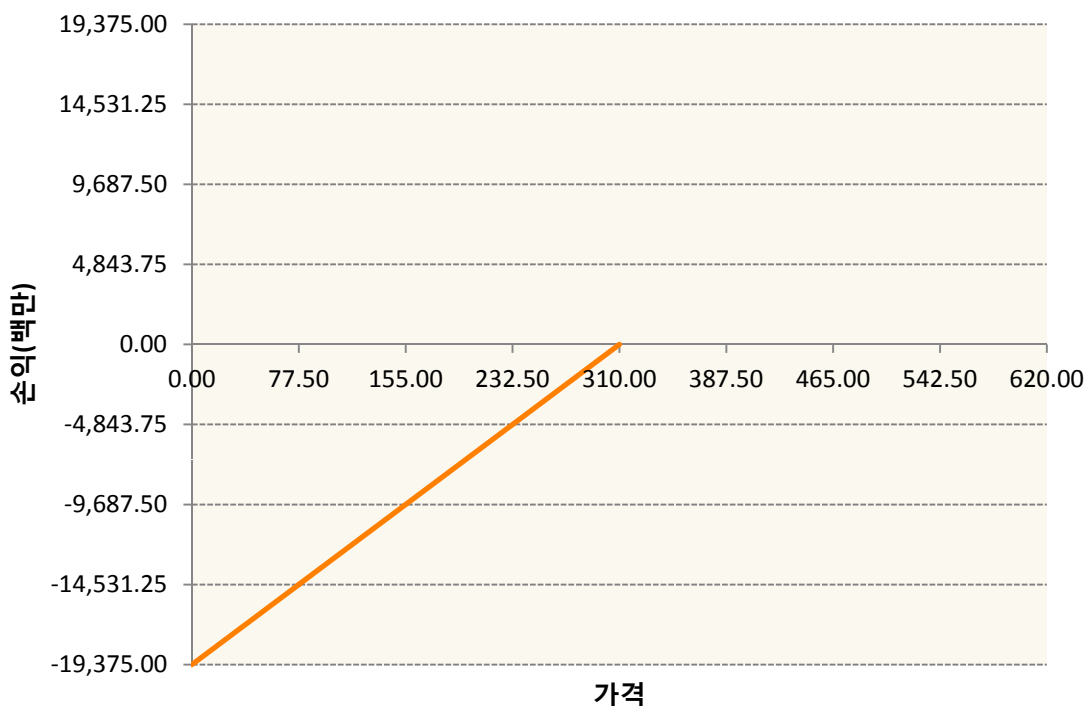


KR4201N73125-2018-07 콜312.5





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

158

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	16	16	16	16	16	15	15
-5.33%	16	16	15	15	14	13	11
-2.67%	15	14	13	11	9	6	3
0%	11	8	4	0	-4	-9	-14
2.67%	-6	-12	-18	-25	-31	-38	-45
5.33%	-45	-53	-61	-69	-77	-85	-93
8.00%	-114	-121	-128	-136	-143	-151	-158

KR4201N7312018-07 콜312.5

657

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	55	55	55	54	54	52	50
-5.33%	55	54	53	51	48	44	38
-2.67%	53	50	45	39	30	20	8
0%	39	28	15	0	-18	-37	-58
2.67%	-15	-39	-65	-92	-121	-150	-181
5.33%	-161	-196	-232	-268	-304	-341	-377
8.00%	-437	-473	-510	-546	-583	-620	-657

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%	-969	-969	-969	-969	-969	-969	-969
-2.67%	-481	-481	-481	-482	-482	-483	-484
0%	6	5	3	0	-4	-9	-14
2.67%	476	468	458	447	435	422	408
5.33%	849	830	811	792	772	753	734
8.00%	1,028	1,014	1,000	984	968	952	935

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

(단위:백만원)

6,003

공시일	2018-07-03
기준일	2018-07-02

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

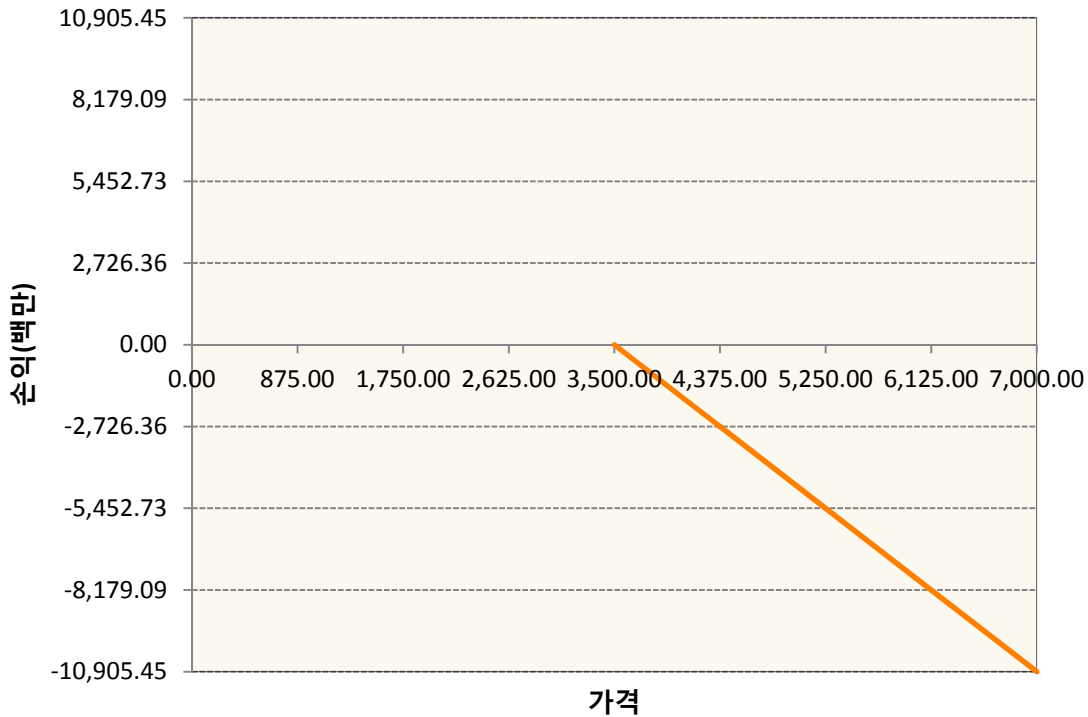
1. 계약금액

(단위:백만원)

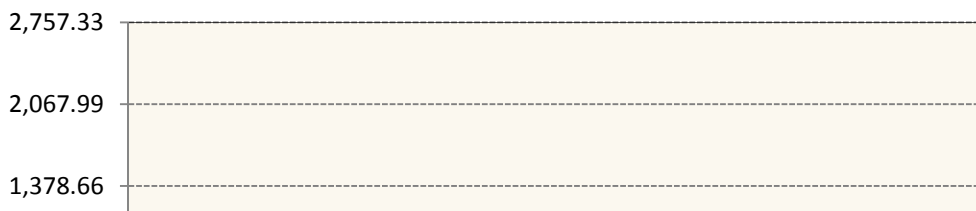
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,154	0	6,154	
누계	유가증권	스왑	44,535	0	44,535	장외
누계	유가증권	옵션	0	27,326	-27,326	장내
누계	지수	스왑	52,148	0	52,148	장외

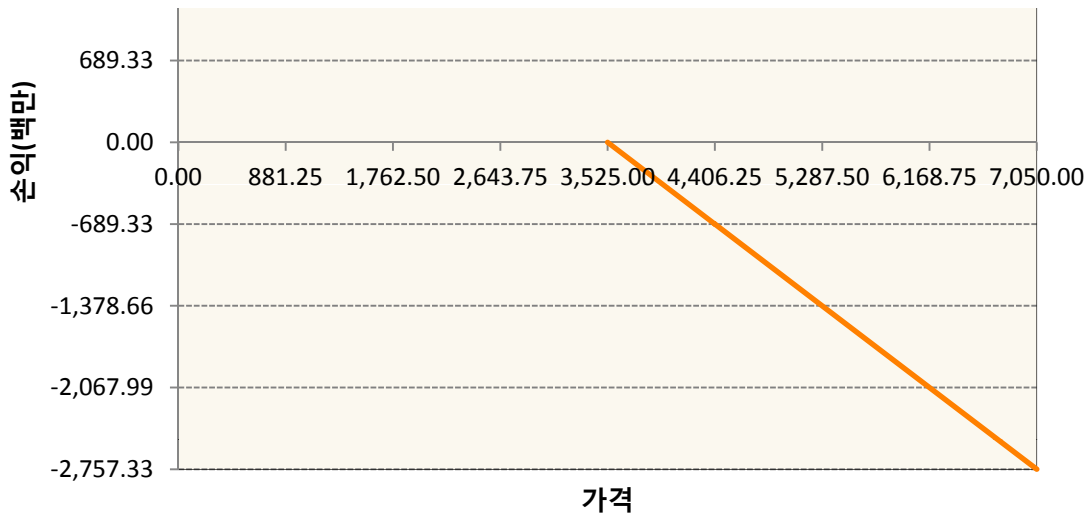
2. 만기시점의 손익구조

OESXN8-C3500-EURO STOXX 50

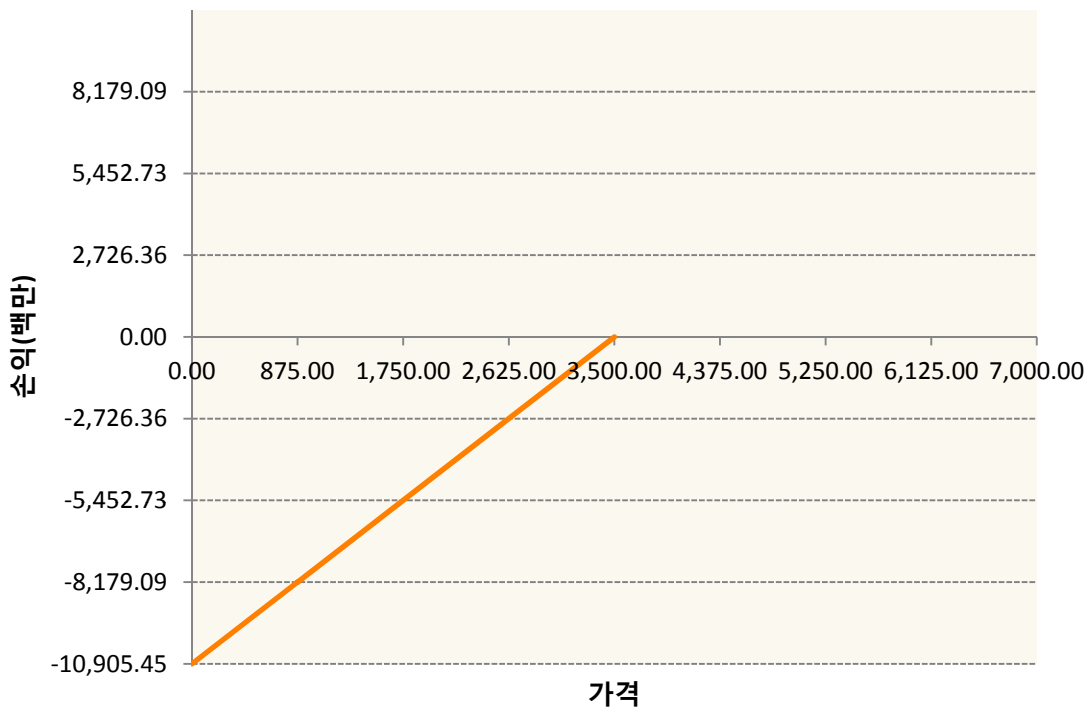


OESXN8-C3525-EURO STOXX 50

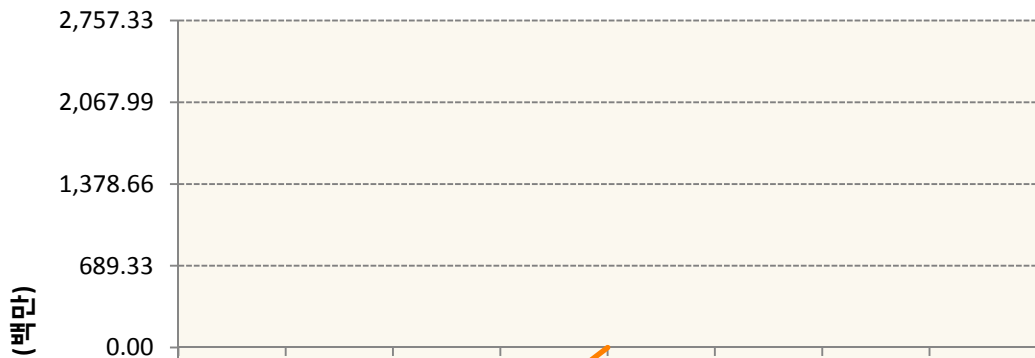


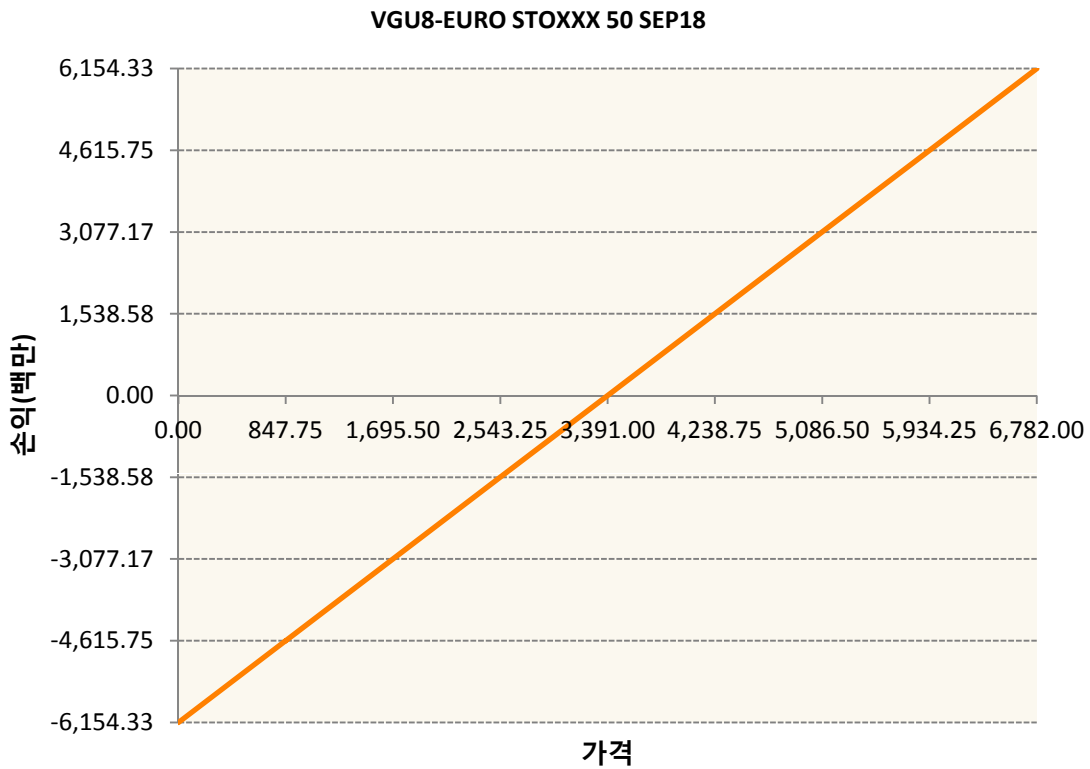
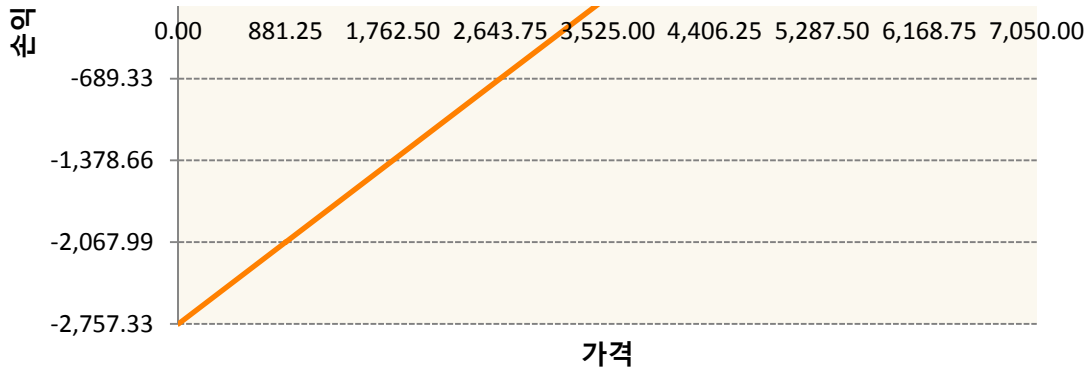


OESXN8-P3500-EURO STOXX 50



OESXN8-P3525-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		44
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY		38
OESXN8-C3!EURO STOXX 50		872
OESXN8-C3!EURO STOXX 50		221
OESXN8-P3!EURO STOXX 50		872
OESXN8-P3!EURO STOXX 50		221
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18		492

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

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

(단위:백만원)

1,138

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)

170

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-07-03
기준일	2018-07-02

리디파인K200(주식혼합-파생재간

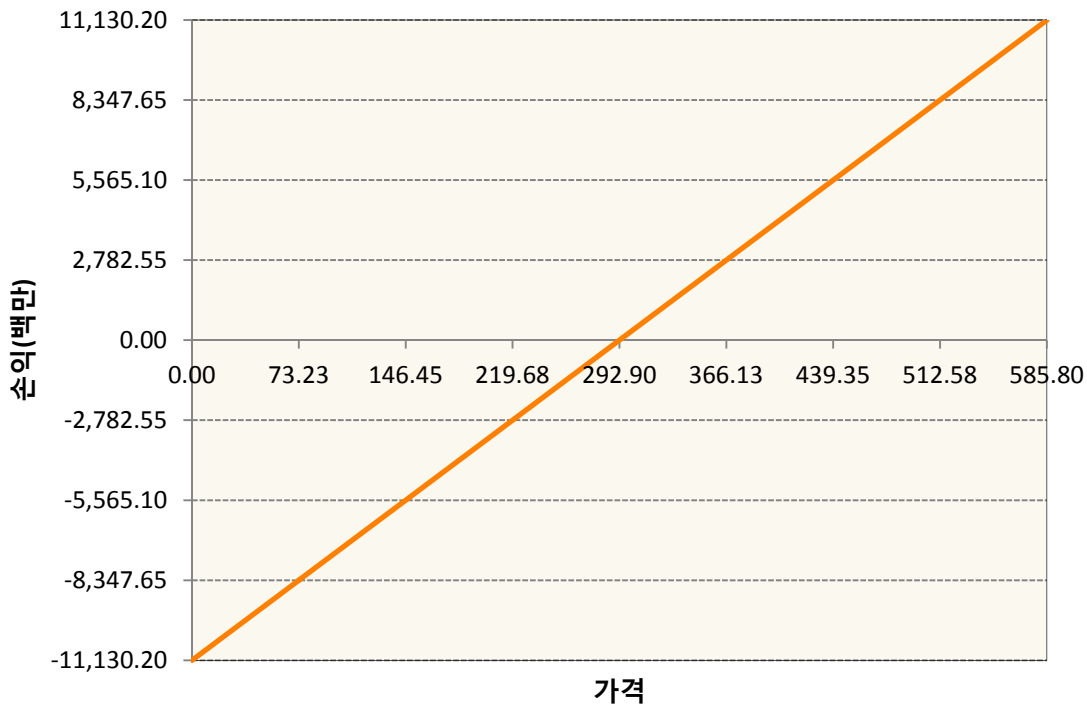
1. 계약금액

(단위:백만원)

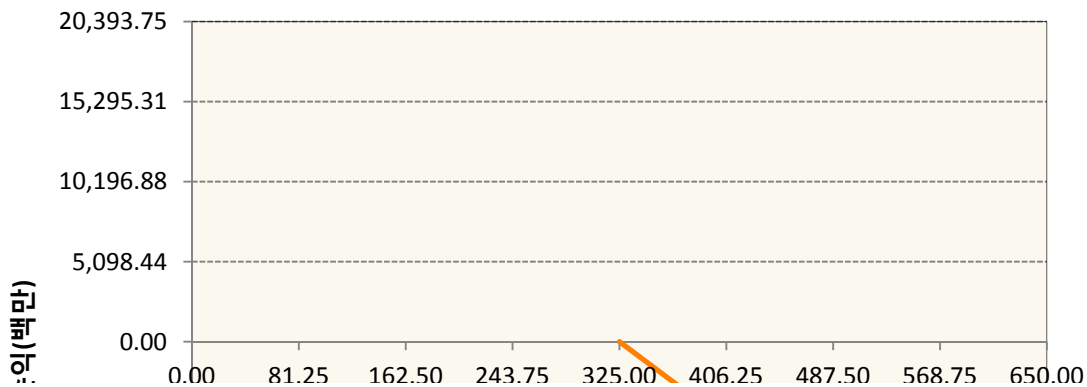
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,130	0	11,130	장내
누계	유가증권	옵션	1,550	20,394	-18,844	장내

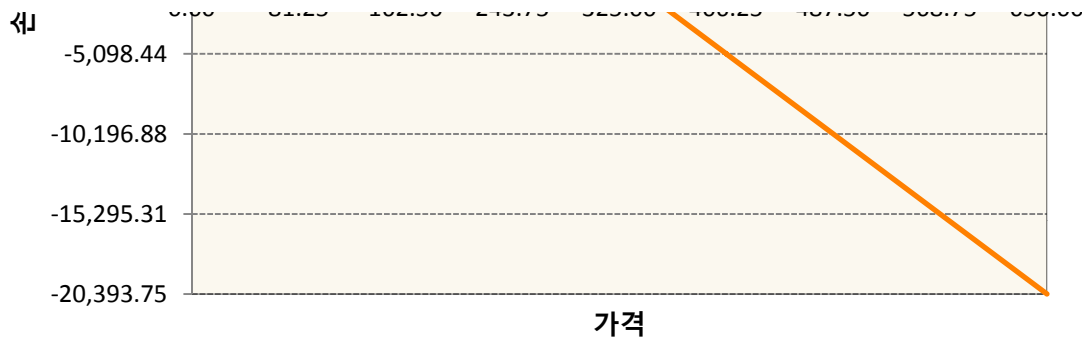
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

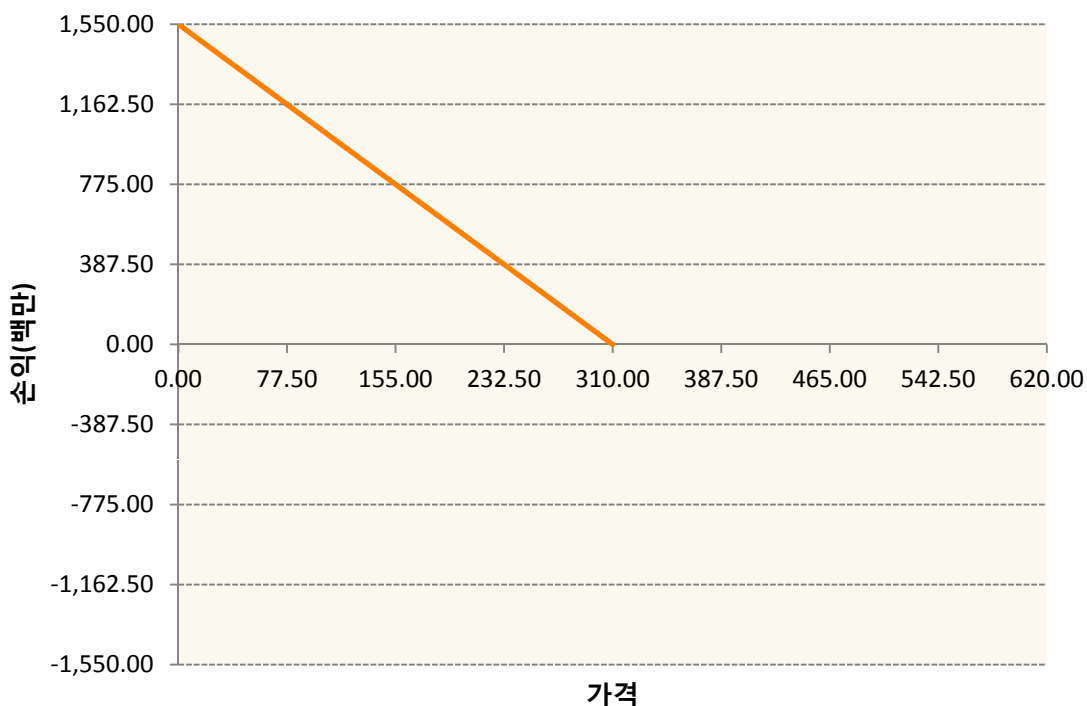


KR4201N73257-2018-07 콜325





KR4301N73107-2018-07 풋310



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물								891
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-891	-891	-891	-891	-891	-891	-891	-891
-5.33%	-594	-594	-594	-594	-594	-594	-594	-594
-2.67%	-297	-297	-297	-297	-297	-297	-297	-297
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	297	297	297	297	297	297	297	297
5.33%	594	594	594	594	594	594	594	594
8.00%	891	891	891	891	891	891	891	891
KR4201N732 2018-07 콜325								283
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8	8	8	8	8	8	8
-5.33%	8	8	8	8	8	7	5
-2.67%	8	8	7	6	5	2	-1
0%	7	6	4	0	-5	-12	-20
2.67%	2	-4	-11	-21	-33	-47	-62
5.33%	-24	-39	-57	-76	-98	-120	-145
8.00%	-104	-132	-161	-190	-221	-252	-283
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%	78	78	78	78	78	78	78
-2.67%	38	38	39	39	39	39	39
0%	0	0	0	0	0	1	1
2.67%	-38	-37	-37	-36	-35	-34	-33
5.33%	-68	-66	-65	-63	-62	-60	-59
8.00%	-82	-81	-80	-79	-77	-76	-75

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

(단위:백만원)

895

공시일	2018-07-03
기준일	2018-07-02

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

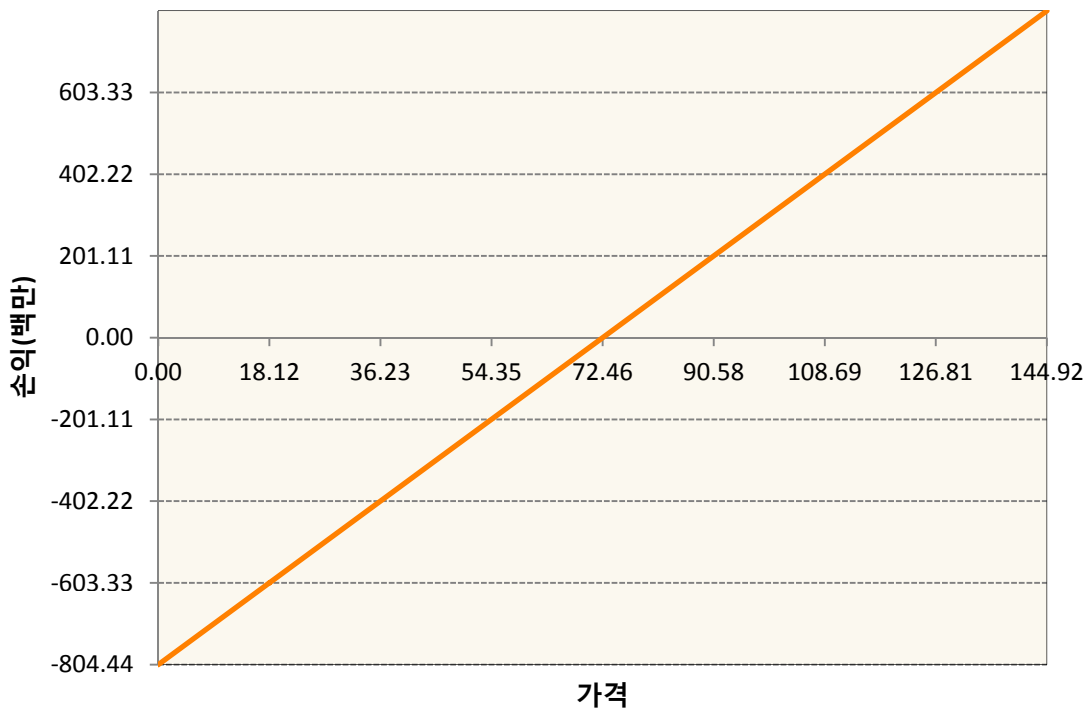
1. 계약금액

(단위:백만원)

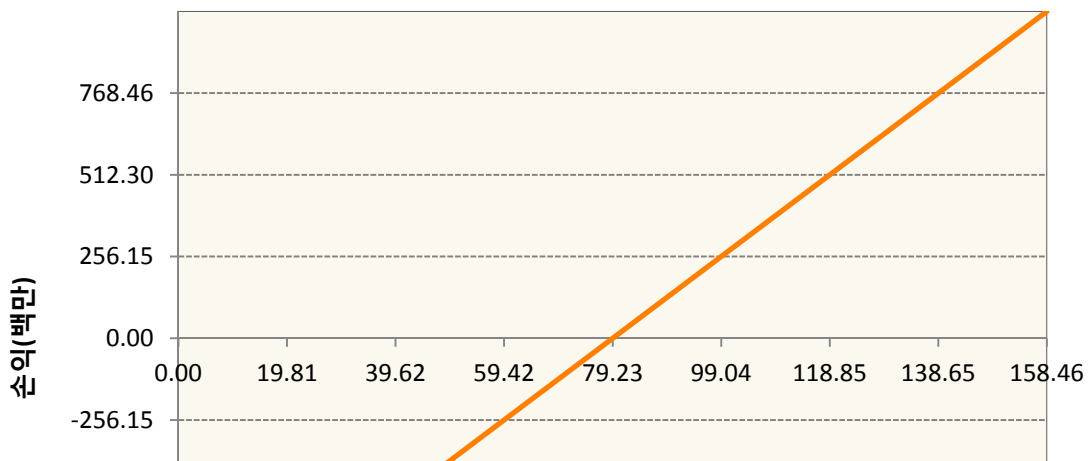
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,872	615	3,256	

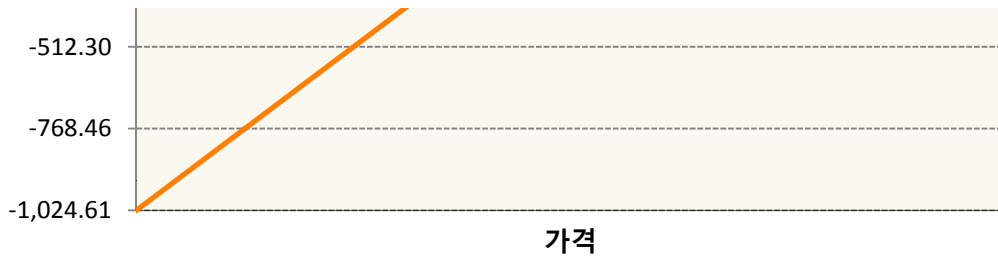
2. 만기시점의 손익구조

CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18

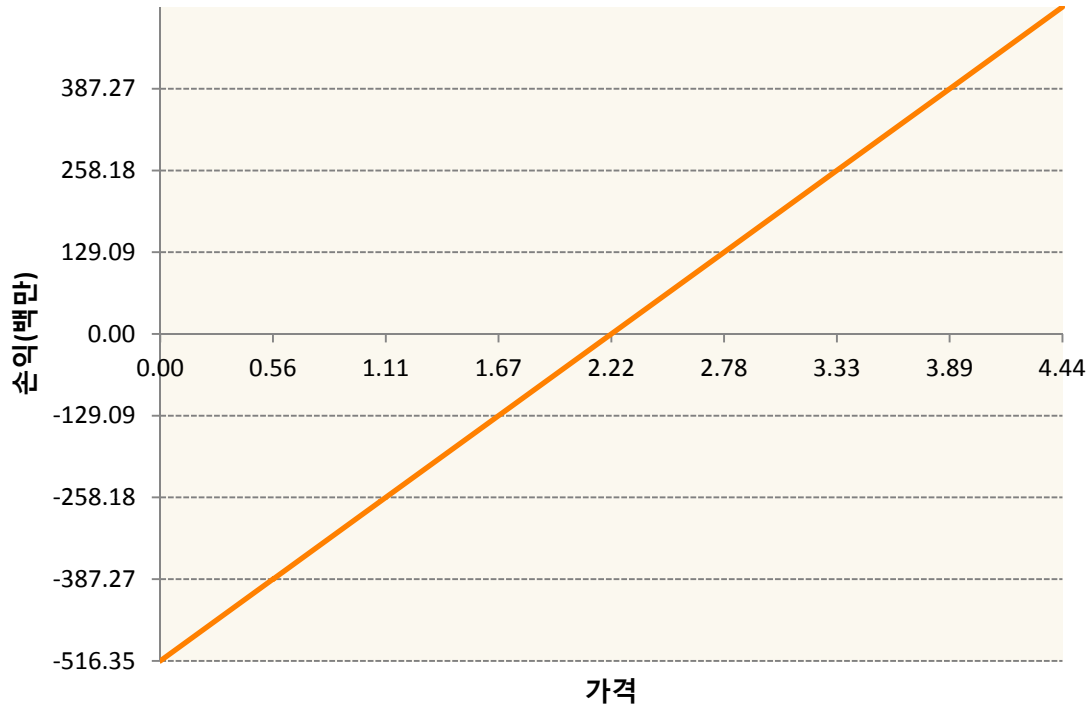


COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18

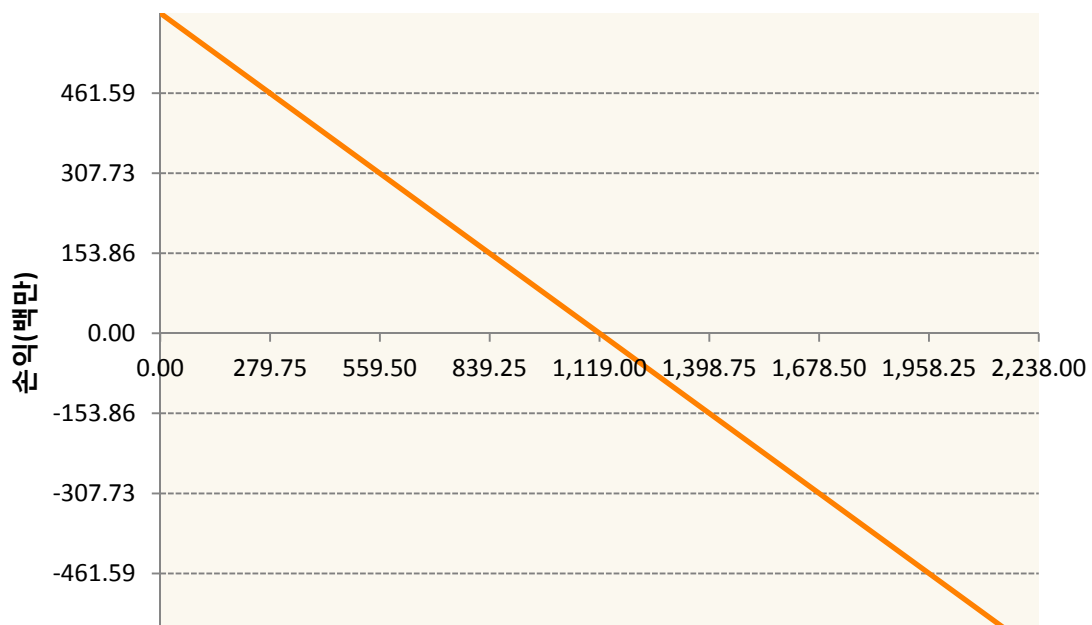


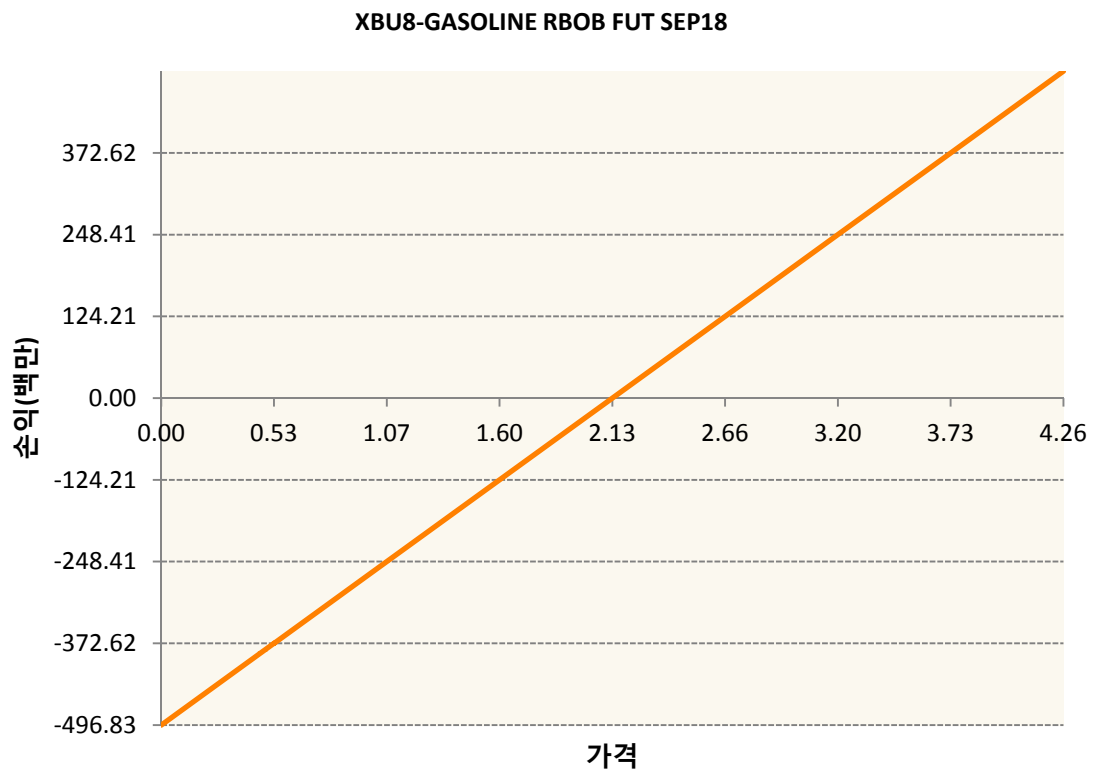
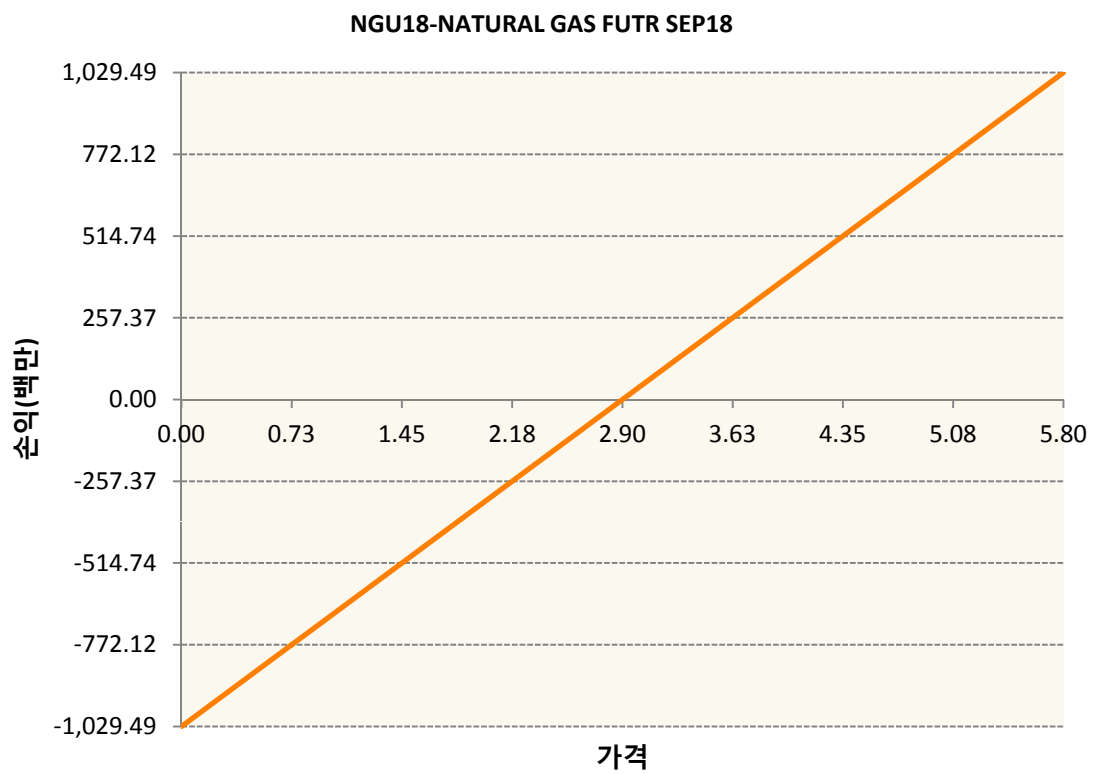
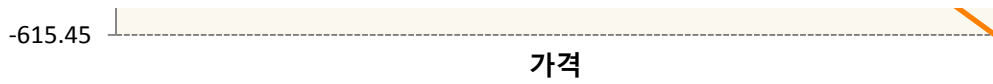


HOU8-NY Harb ULSD Fut SEP18



KR4175N70002-2018-07 달러선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU8	WTI CRUDE FUTURE SEP18	64
COU8	BRENT CRUDE FUTR SEP18	82
HOU8	NY Harb ULSD Fut SEP18	41
KR4175N70C	2018-07 달러선물	49
NGU18	NATURAL GAS FUTR SEP18	82
XBU8	GASOLINE RBOB FUT SEP18	40

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

451

공시일	2018-07-03
기준일	2018-07-02

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

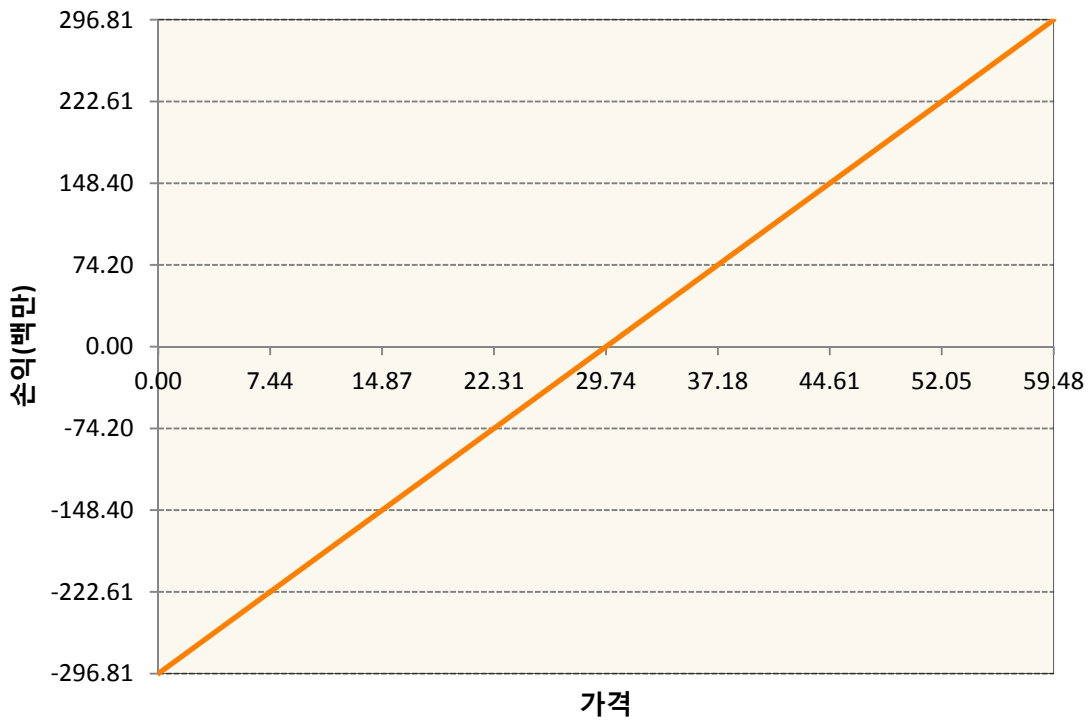
1. 계약금액

(단위:백만원)

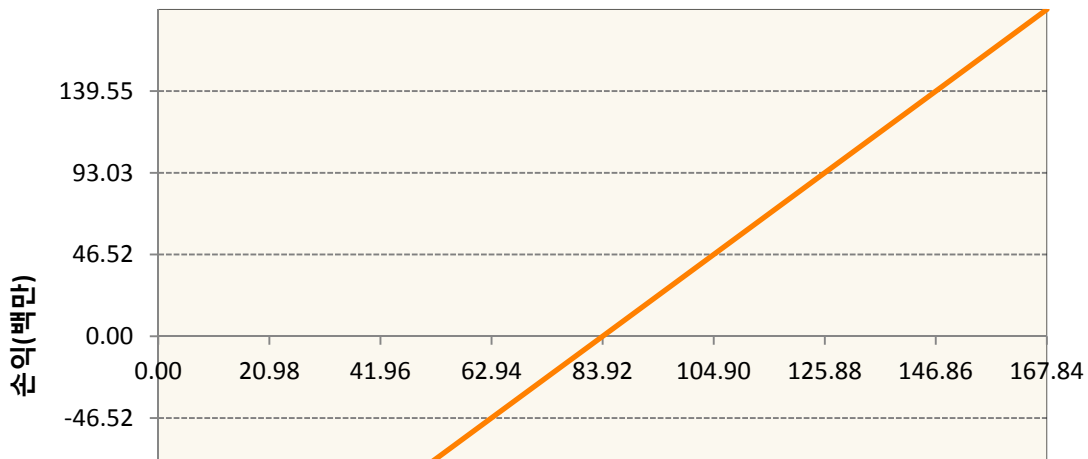
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,707	78	3,629	

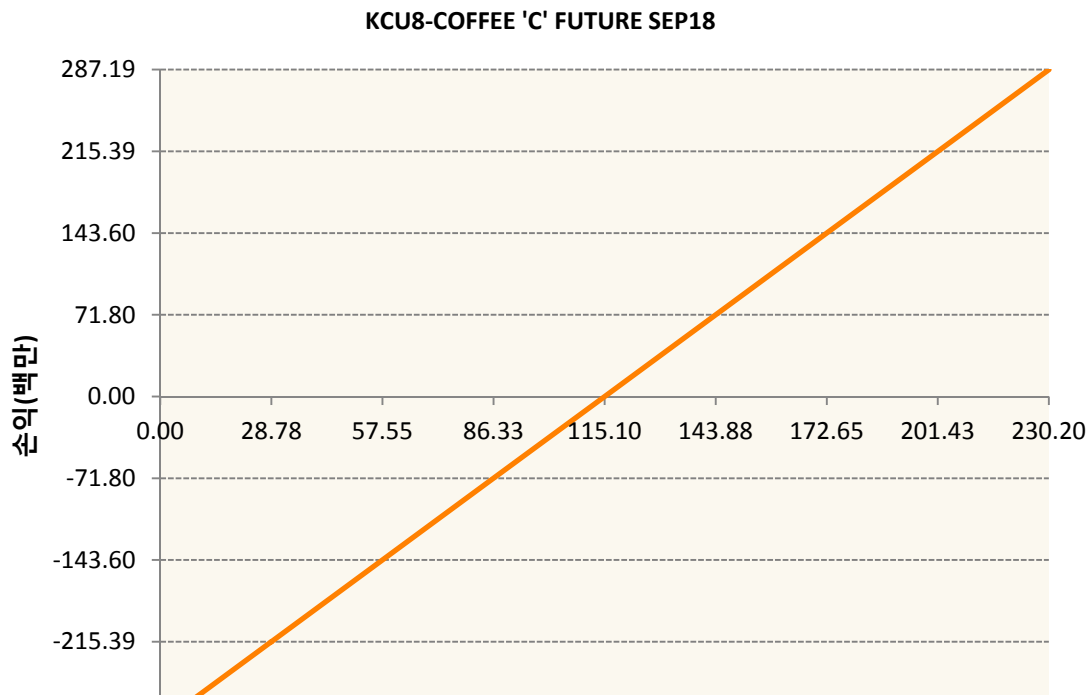
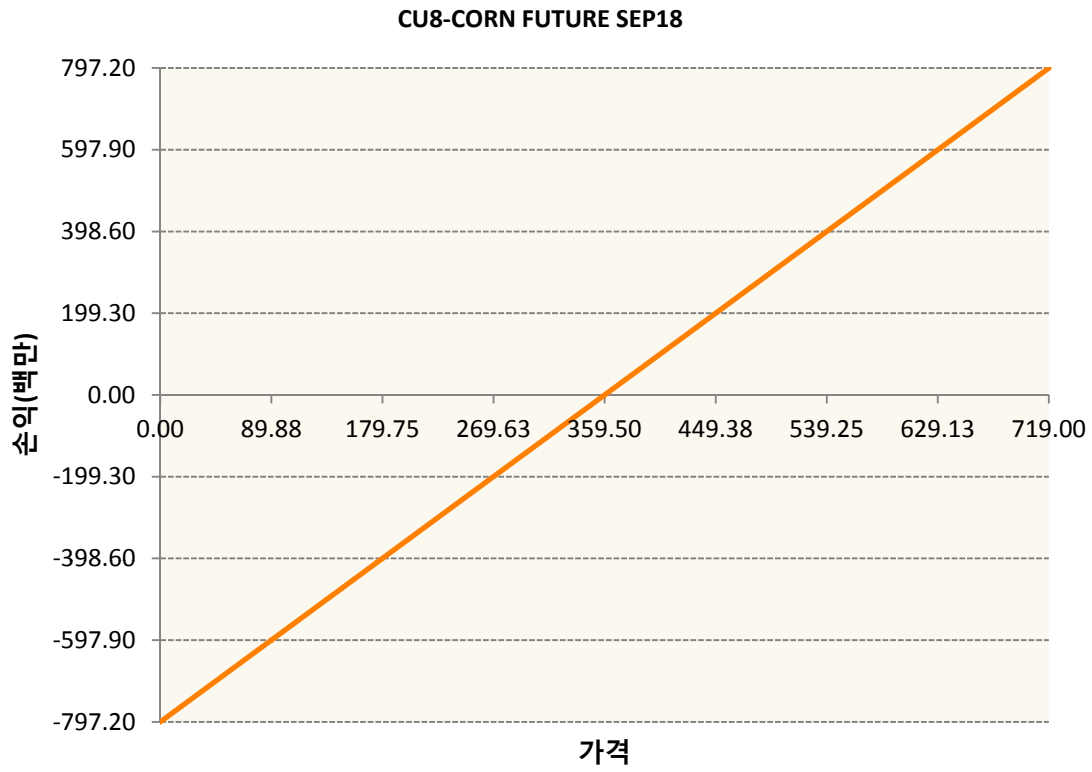
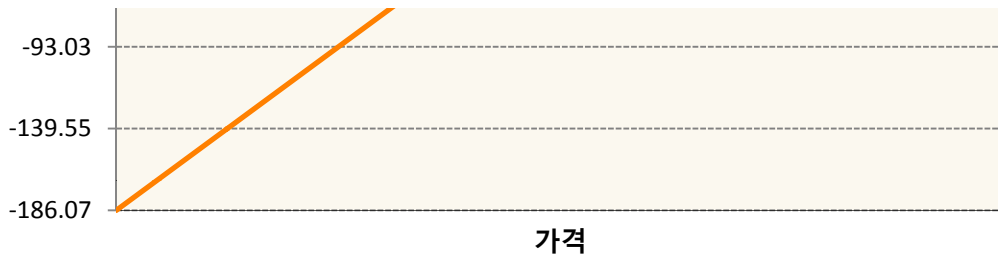
2. 만기시점의 손익구조

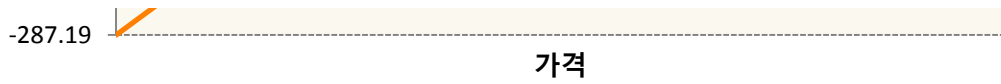
BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18



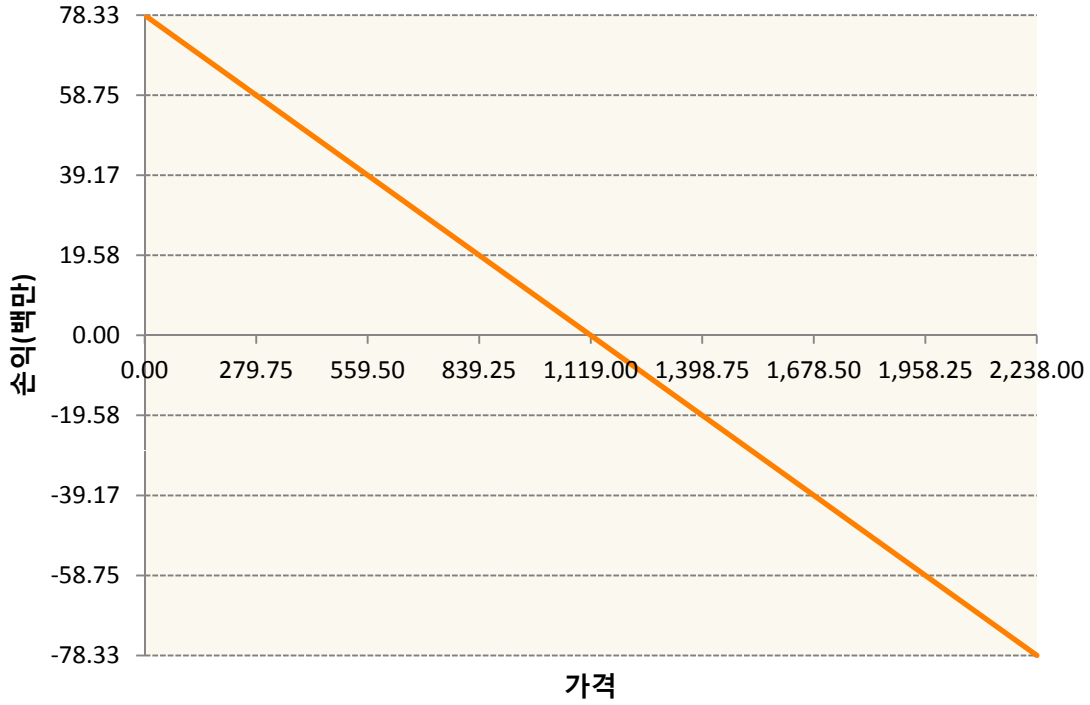
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



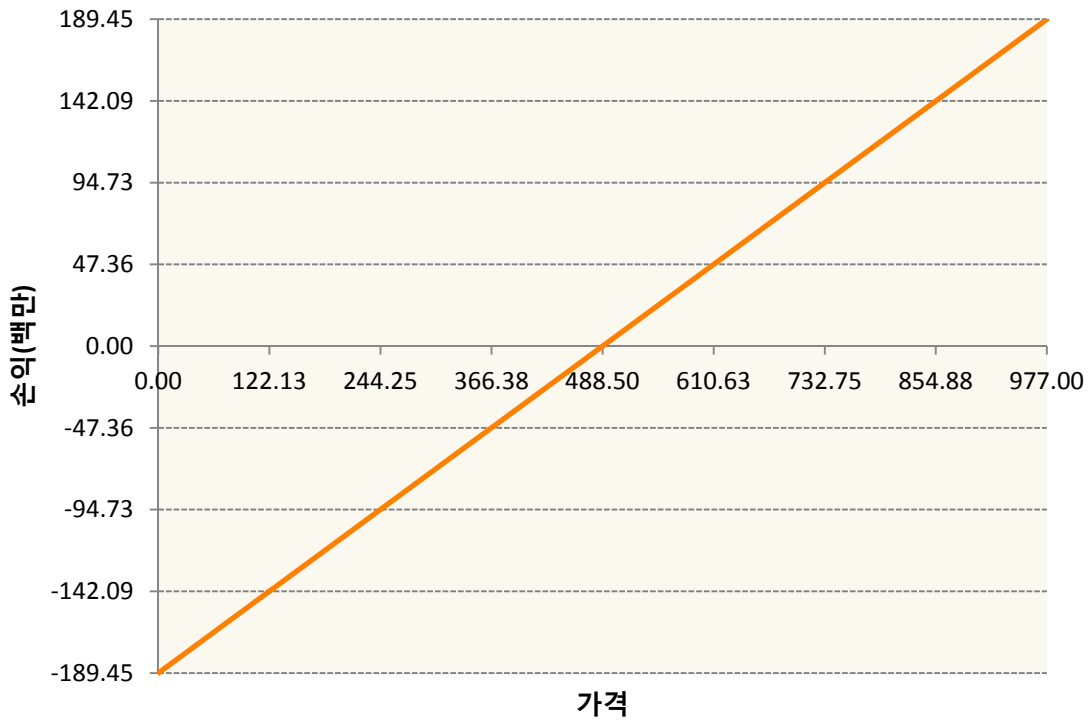




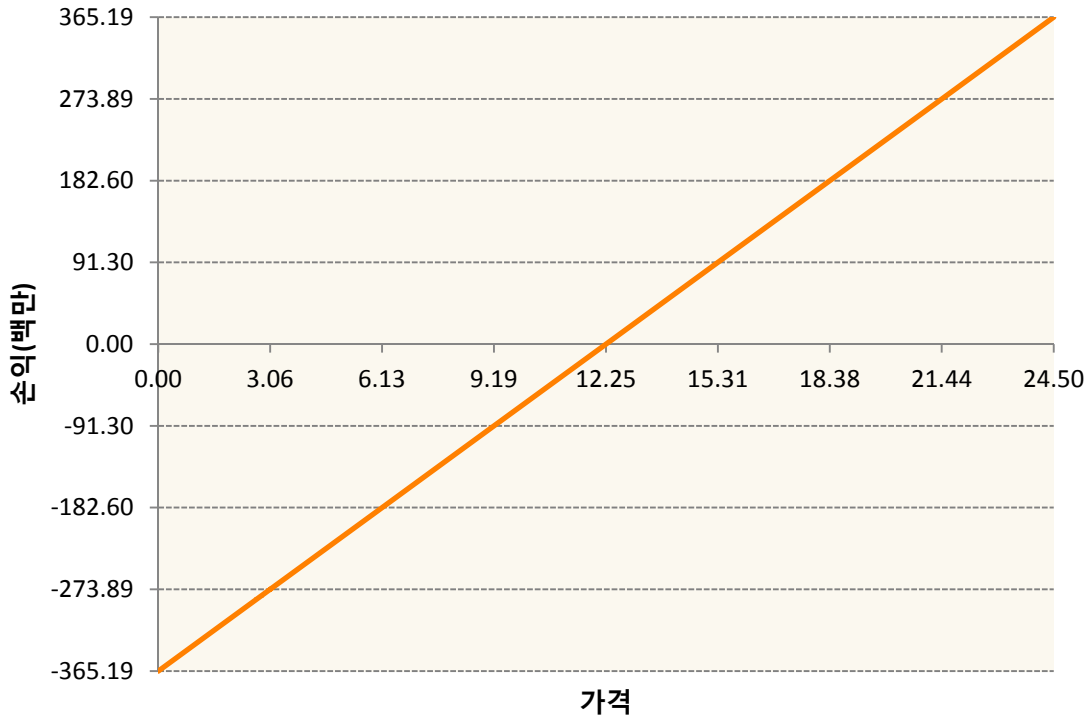
KR4175N70002-2018-07 달러선물



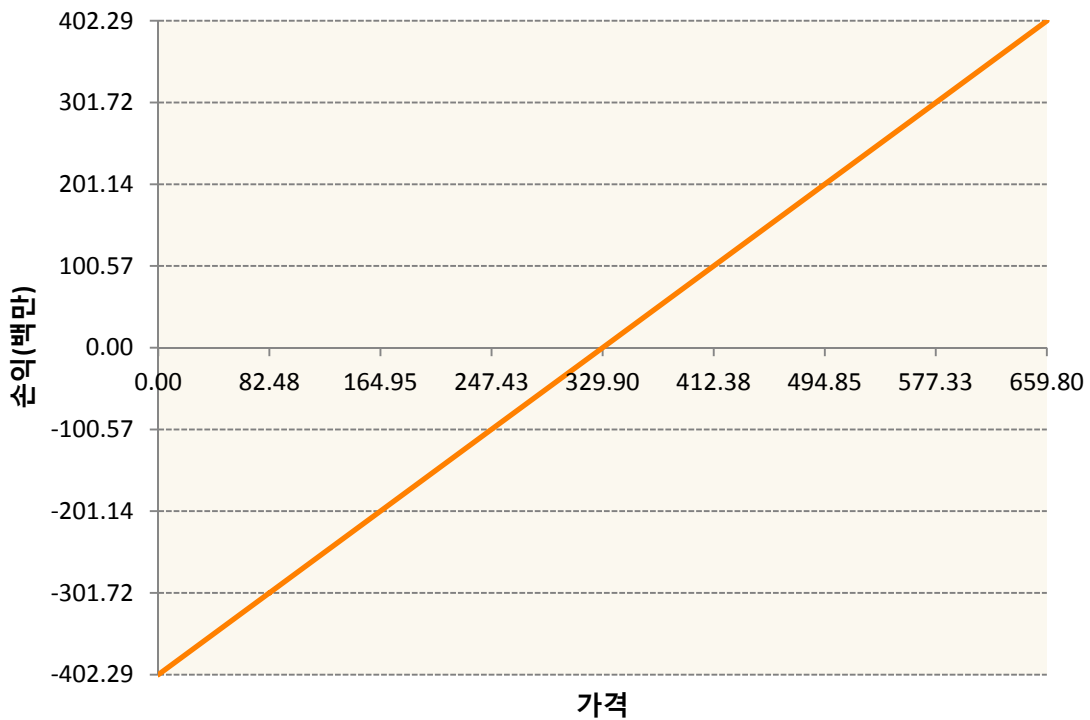
KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

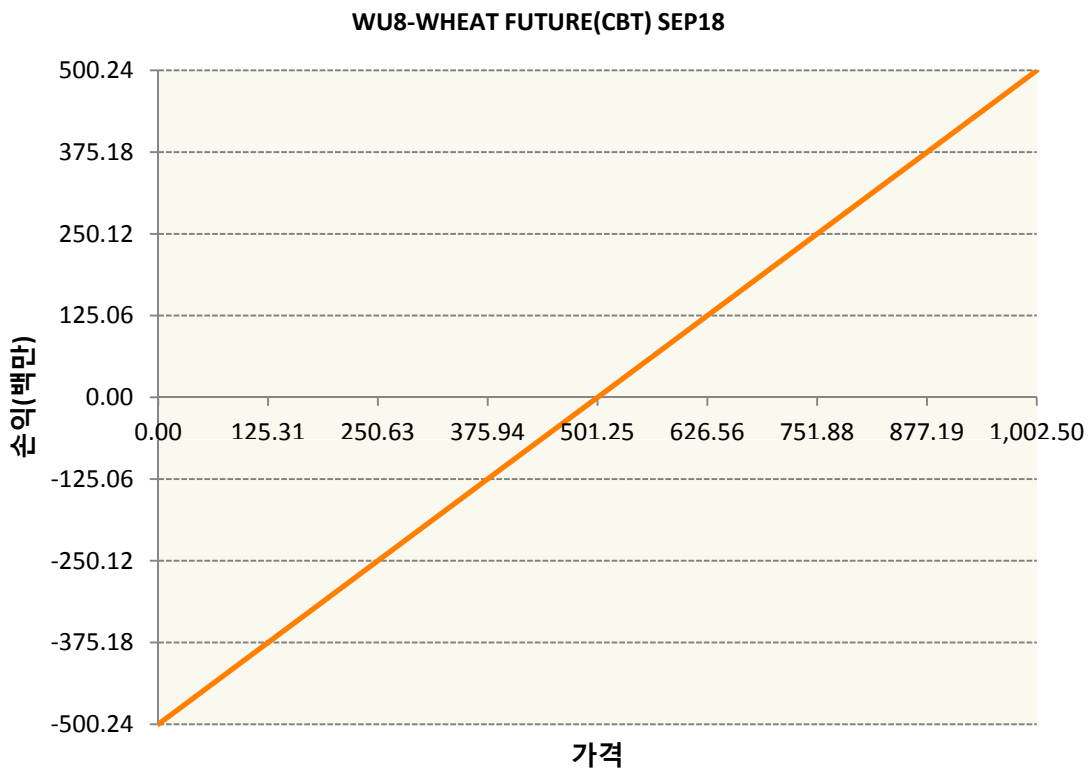
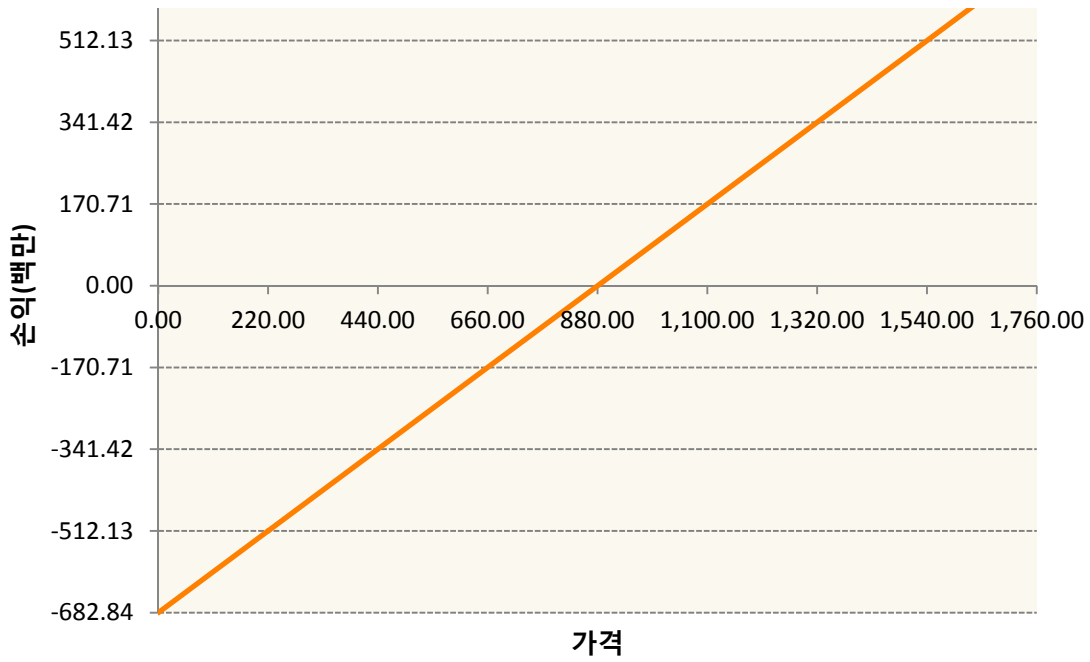


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



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	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	40

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

(단위:백만원)

304