

공시일	2018-07-04
기준일	2018-07-03

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	2018-07-04
기준일	2018-07-03

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

1,100

* 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	2018-07-04
기준일	2018-07-03

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

330

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

394

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-07-04
기준일	2018-07-03

유로인덱스모(주식-파생형)

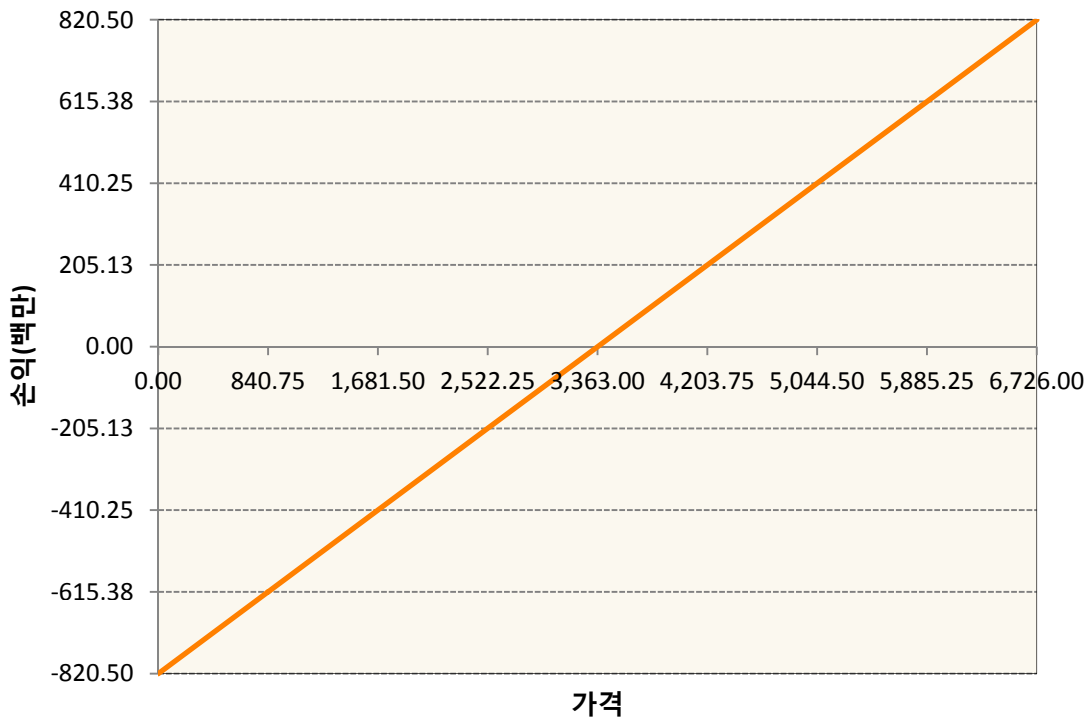
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	821	0	821	

2. 만기시점의 손익구조

VGU8-EURO STOXXX 50 SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

41

공시일	2018-07-04
기준일	2018-07-03

차이나인덱스모(주식-파생형)

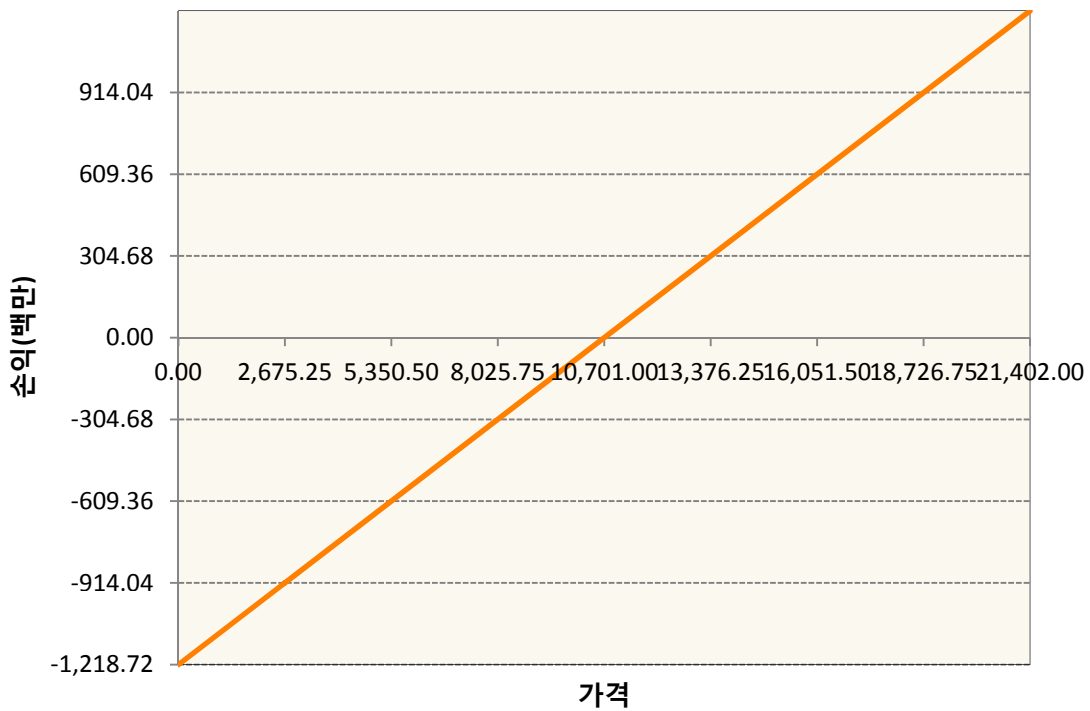
1. 계약금액

(단위:백만원)

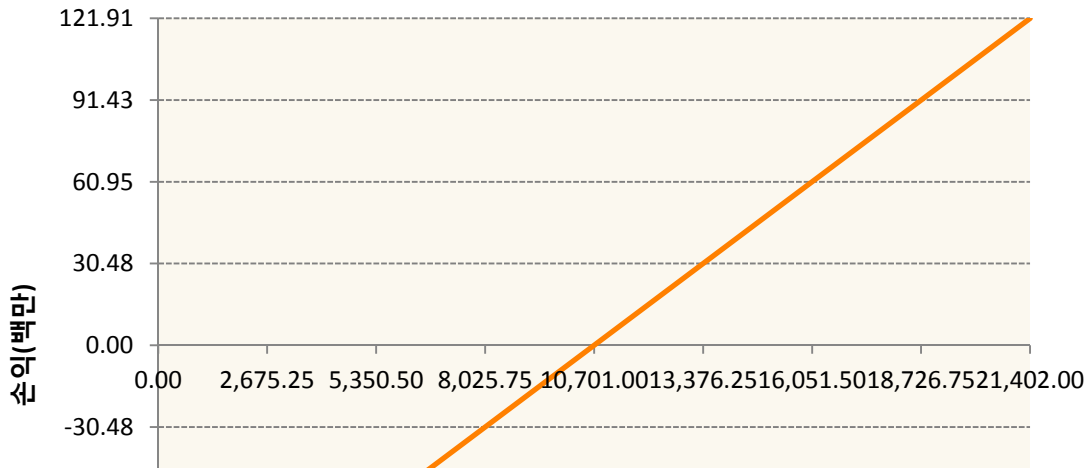
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,341	0	1,341	장내

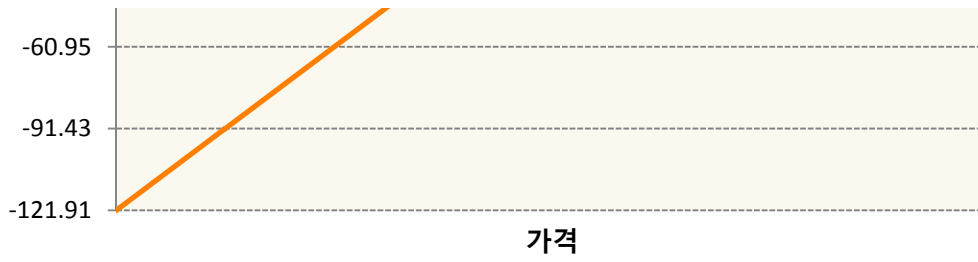
2. 만기시점의 손익구조

HCN8-HSCEI Futures Jul18



MHCN8-MINI H-SHR IDX FU JUL18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCN8	HSCEI Futures Jul18	97
MHCN8	MINI H-SHR IDX FU JUL18	10

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

97

공시일	2018-07-04
기준일	2018-07-03

커버드콜모(주식혼합-파생형)

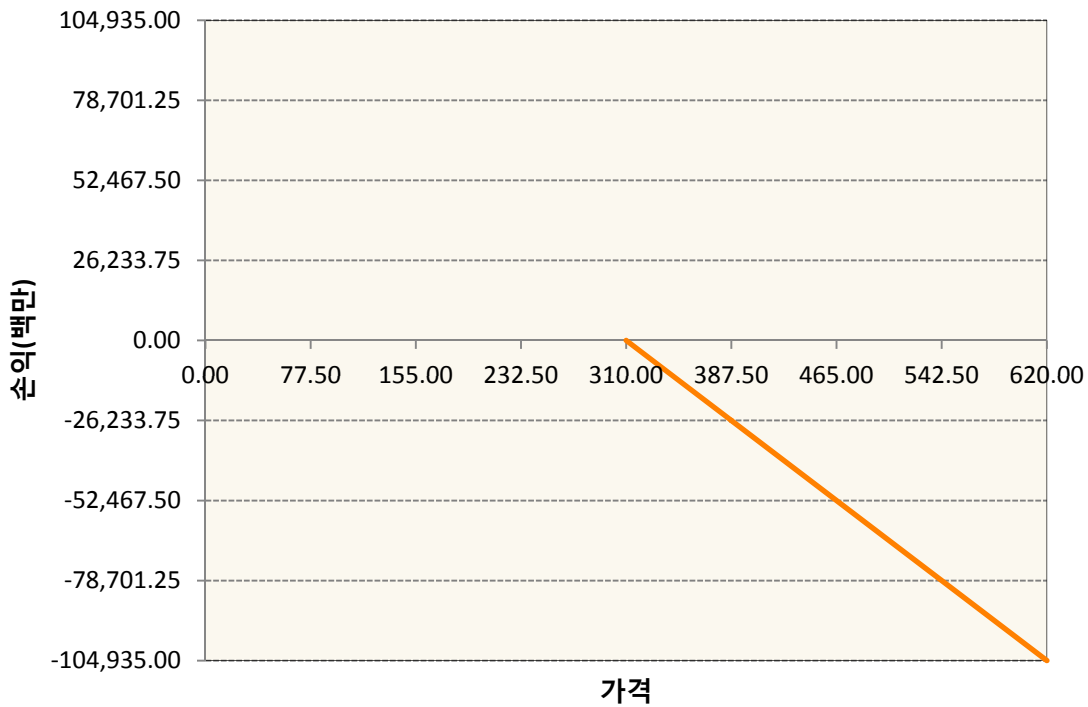
1. 계약금액

(단위:백만원)

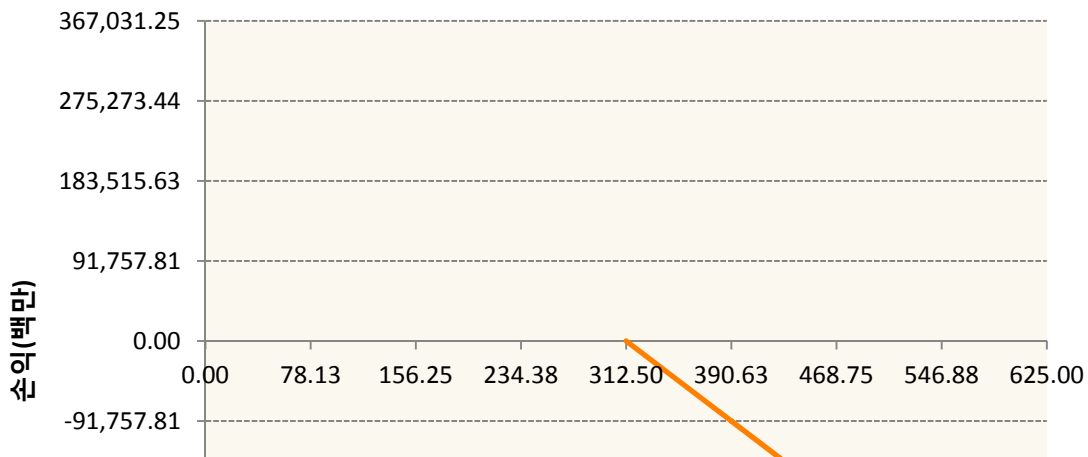
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	766,466	-766,466	장내

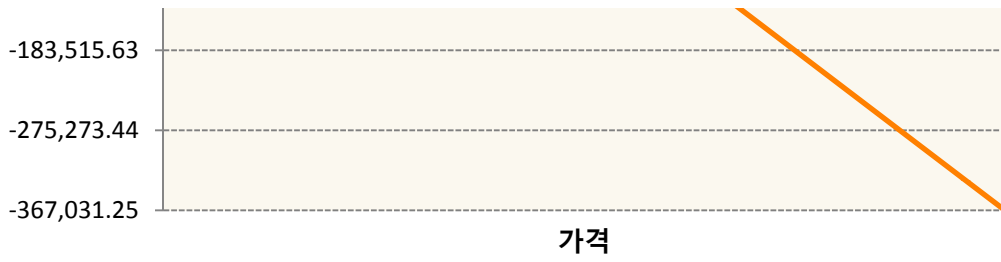
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N73109-2018-07 콜310

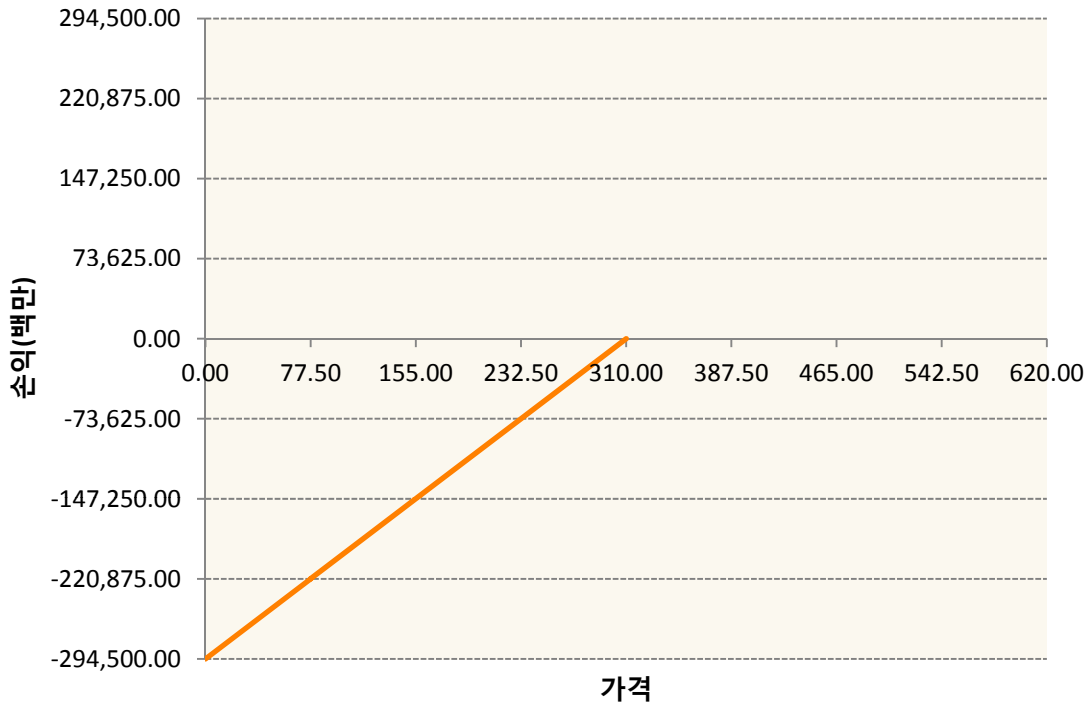


KR4201N73125-2018-07 콜312.5





KR4301N73107-2018-07 풋310



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N7312018-07 콜310

3,581

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	325	325	324	322	318	311	301
-5.33%	324	321	315	304	288	266	238
-2.67%	309	292	266	230	185	132	69
0%	216	156	83	0	-92	-193	-301
2.67%	-143	-270	-404	-544	-687	-834	-983
5.33%	-1,046	-1,216	-1,386	-1,556	-1,726	-1,896	-2,067
8.00%	-2,648	-2,795	-2,947	-3,102	-3,260	-3,419	-3,581

KR4201N7312018-07 콜312.5

10,976

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	808	808	806	802	793	777	751

-5.33%	806	800	788	764	725	668	591
-2.67%	779	741	678	588	469	319	141
0%	581	428	233	0	-268	-568	-895
2.67%	-284	-657	-1,061	-1,491	-1,943	-2,411	-2,894
5.33%	-2,732	-3,302	-3,875	-4,453	-5,032	-5,614	-6,197
8.00%	-7,516	-8,080	-8,652	-9,228	-9,808	-10,391	-10,976

KR4301N7312018-07 풋310

22,199

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,199	-22,199	-22,199	-22,199	-22,199	-22,199	-22,199
-5.33%	-14,771	-14,771	-14,771	-14,771	-14,771	-14,772	-14,774
-2.67%	-7,343	-7,343	-7,345	-7,348	-7,354	-7,364	-7,381
0%	75	61	36	0	-50	-113	-190
2.67%	7,254	7,131	6,988	6,829	6,655	6,470	6,274
5.33%	12,866	12,589	12,311	12,032	11,754	11,475	11,196
8.00%	15,371	15,192	14,997	14,790	14,572	14,346	14,113

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

(단위:백만원)

33,450

공시일	2018-07-04
기준일	2018-07-03

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

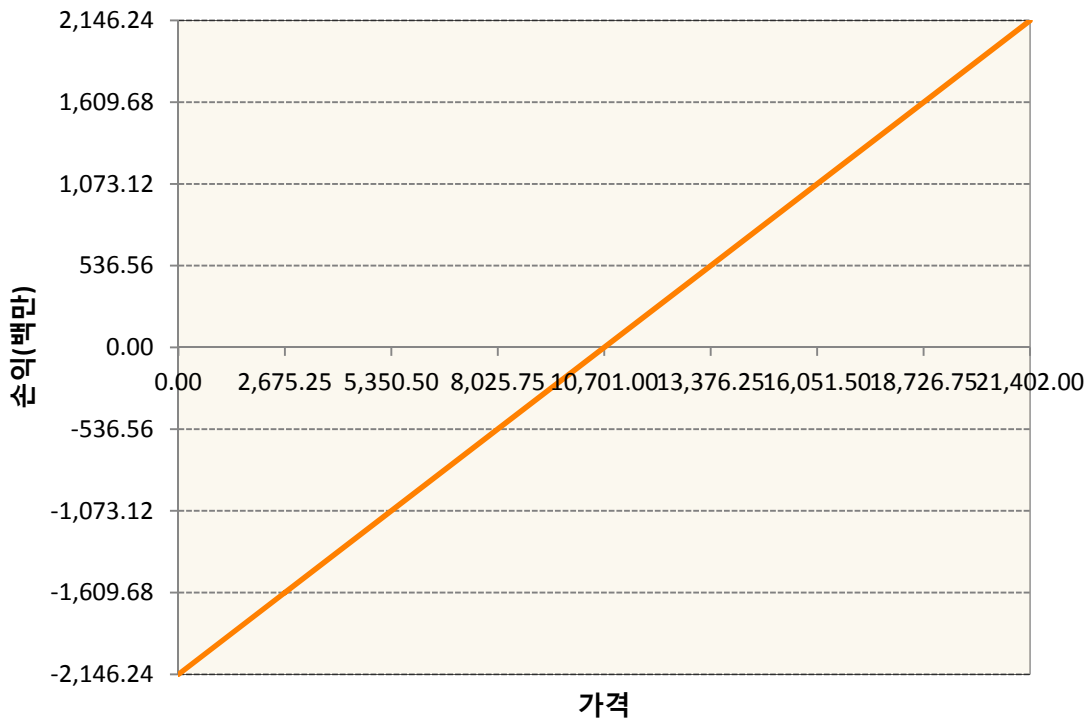
1. 계약금액

(단위:백만원)

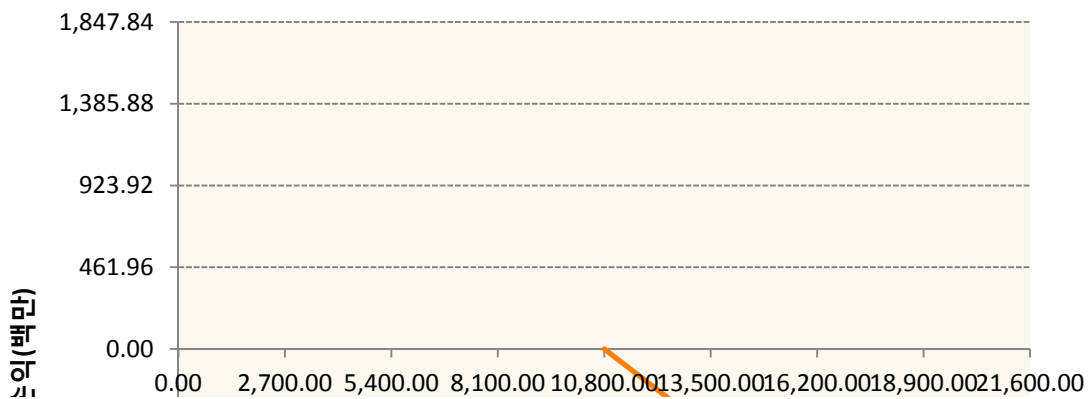
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,146	0	2,146	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,578	-5,578	장내

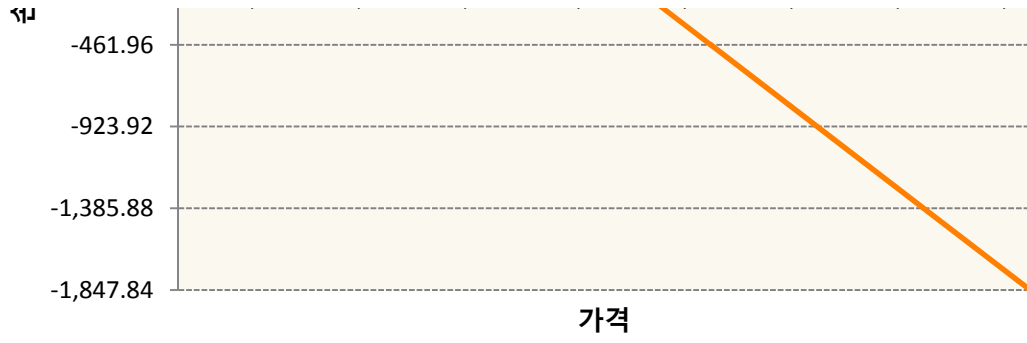
2. 만기시점의 손익구조

HCN8-HSCEI Futures Jul18

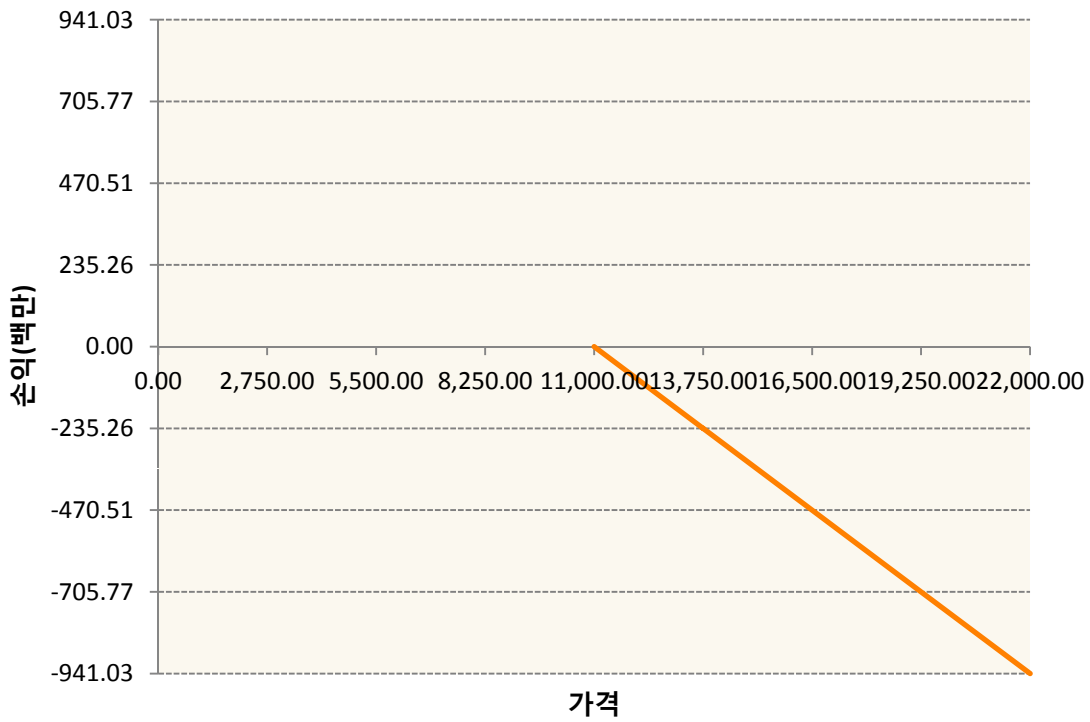


OHHIN8-C108-HSCEI

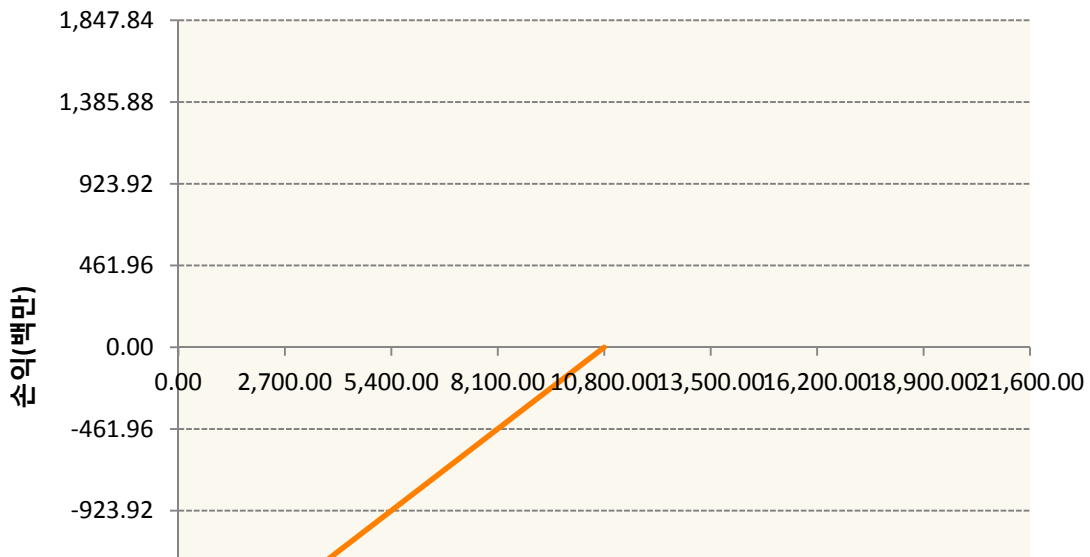


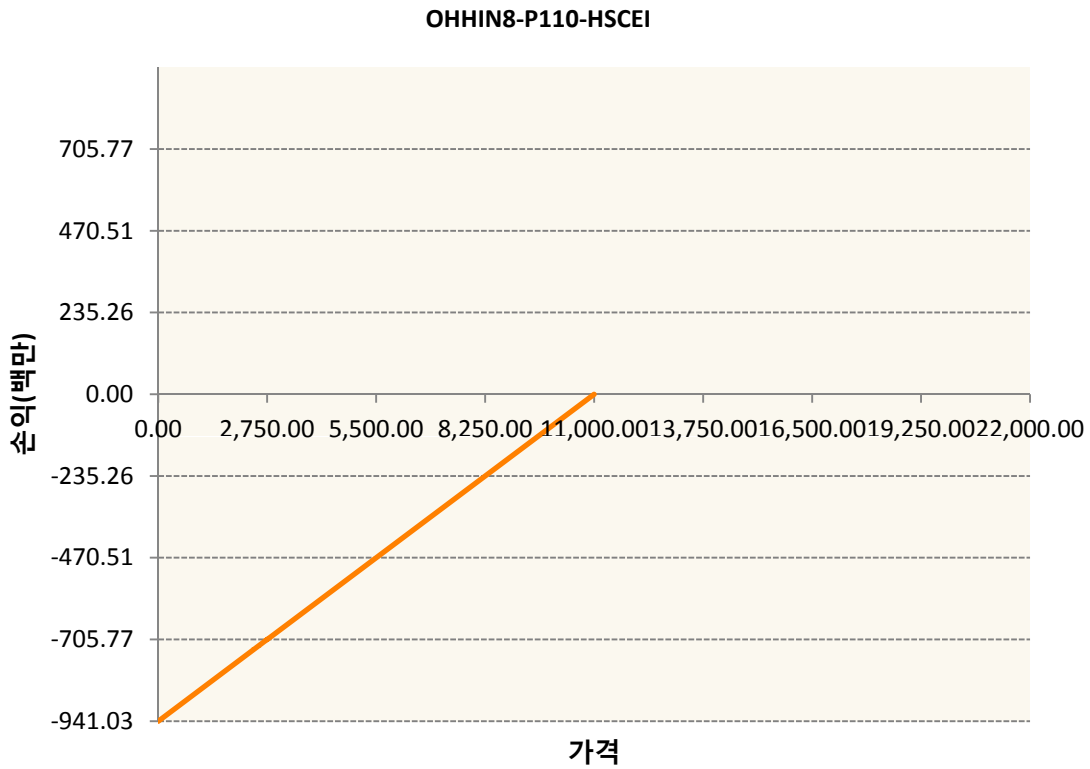
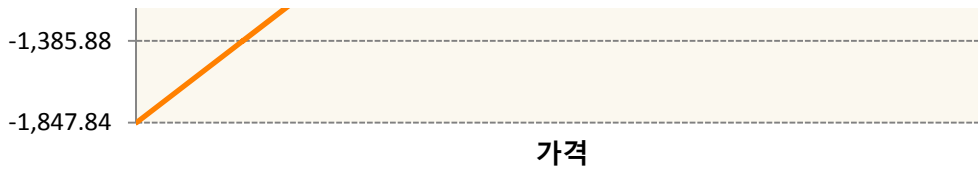


OHHIN8-C110-HSCEI



OHHIN8-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCN8	HSCEI Futures Jul18	172
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)
	557

공시일	2018-07-04
기준일	2018-07-03

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

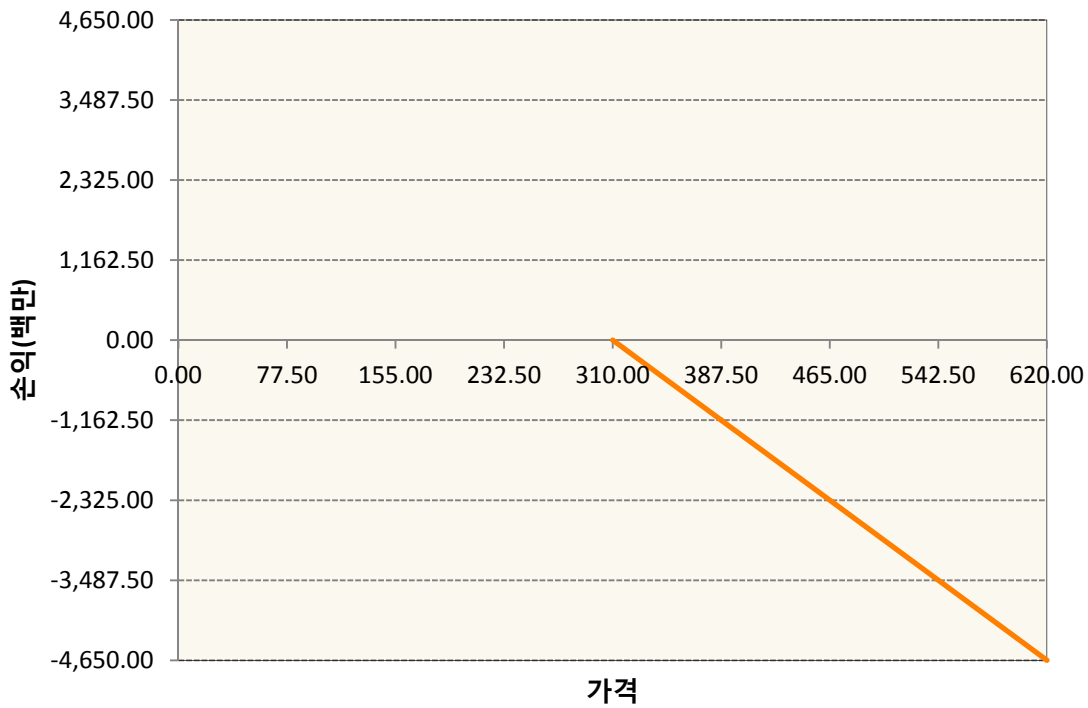
1. 계약금액

(단위:백만원)

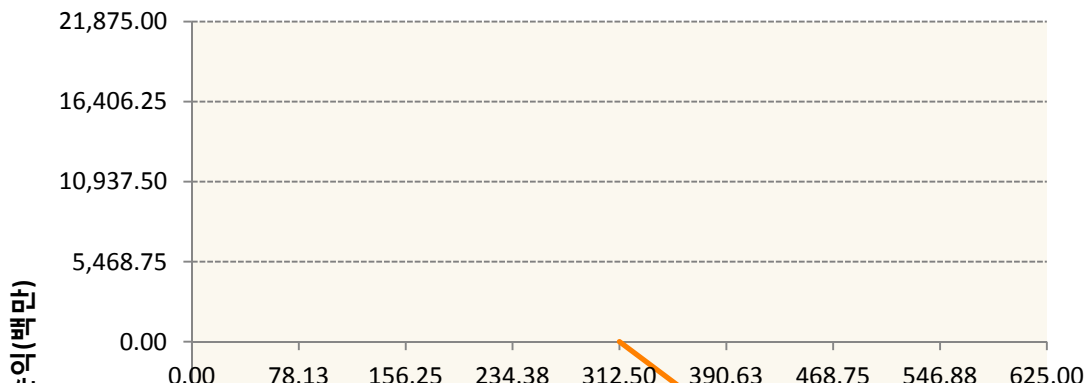
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	45,900	-45,900	장내

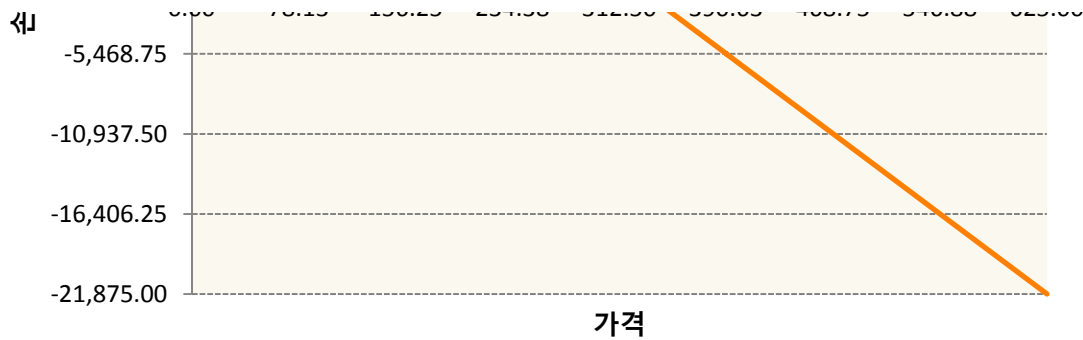
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N73109-2018-07 콜310

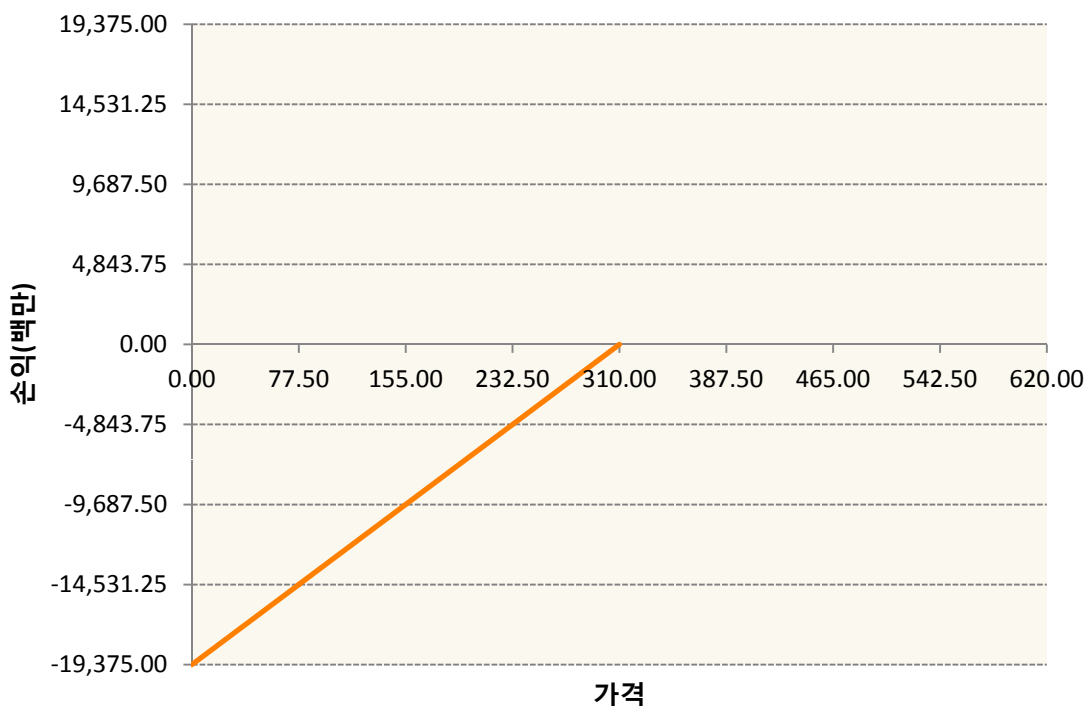


KR4201N73125-2018-07 콜312.5





KR4301N73107-2018-07 풋310



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_2							1,499
	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	-499	-500
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	500	500	499	499	500	500	500
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 UBSCFXC1 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

159

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	14	14	14	14	14	14	13
-5.33%	14	14	14	13	13	12	11
-2.67%	14	13	12	10	8	6	3
0%	10	7	4	0	-4	-9	-13
2.67%	-6	-12	-18	-24	-30	-37	-44
5.33%	-46	-54	-61	-69	-76	-84	-92
8.00%	-117	-124	-131	-137	-144	-152	-159

KR4201N7312018-07 콜312.5

654

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	48	48	48	48	47	46	45
-5.33%	48	48	47	46	43	40	35
-2.67%	46	44	40	35	28	19	8
0%	35	26	14	0	-16	-34	-53
2.67%	-17	-39	-63	-89	-116	-144	-172
5.33%	-163	-197	-231	-265	-300	-335	-369
8.00%	-448	-482	-516	-550	-585	-619	-654

KR4301N7312018-07 풋310

1,460

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,460	-1,460	-1,460	-1,460	-1,460	-1,460	-1,460
-5.33%	-972	-972	-972	-972	-972	-972	-972
-2.67%	-483	-483	-483	-483	-484	-485	-486
0%	5	4	2	0	-3	-7	-12
2.67%	477	469	460	449	438	426	413
5.33%	846	828	810	792	773	755	737
8.00%	1,011	999	987	973	959	944	928

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

(단위:백만원)

5,998

공시일	2018-07-04
기준일	2018-07-03

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

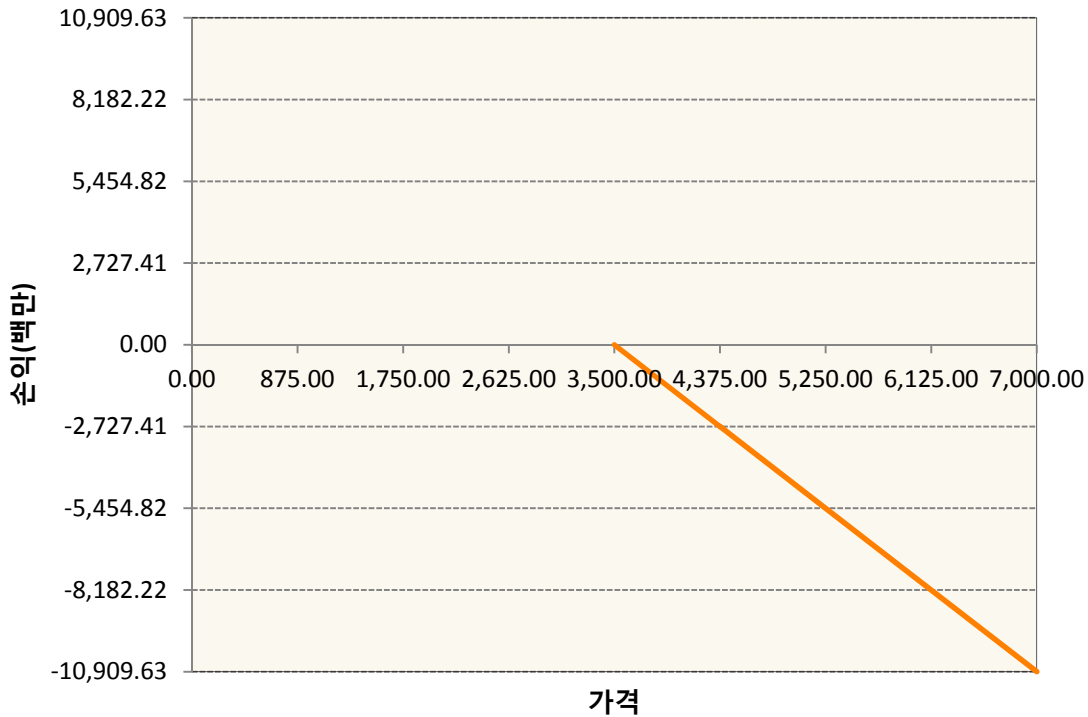
1. 계약금액

(단위:백만원)

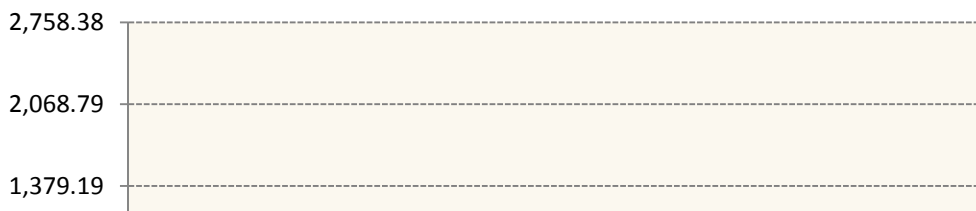
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,103	0	6,103	
누계	유가증권	스왑	44,552	0	44,552	장외
누계	유가증권	옵션	0	27,336	-27,336	장내
누계	지수	스왑	52,168	0	52,168	장외

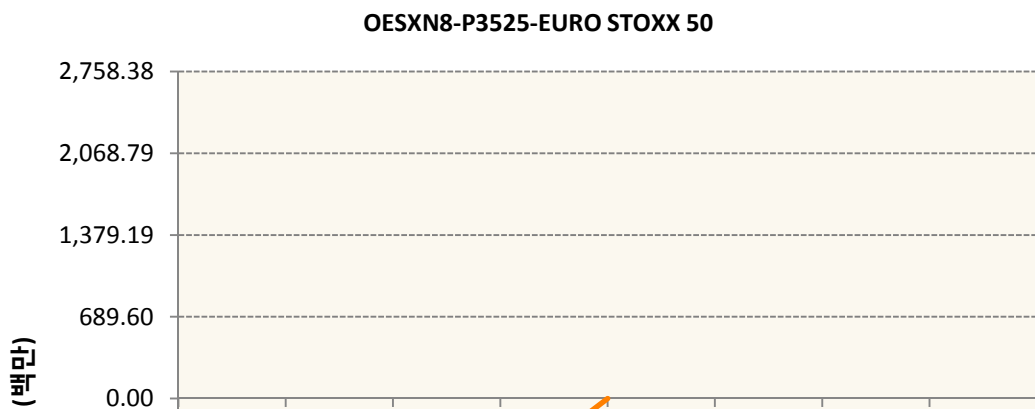
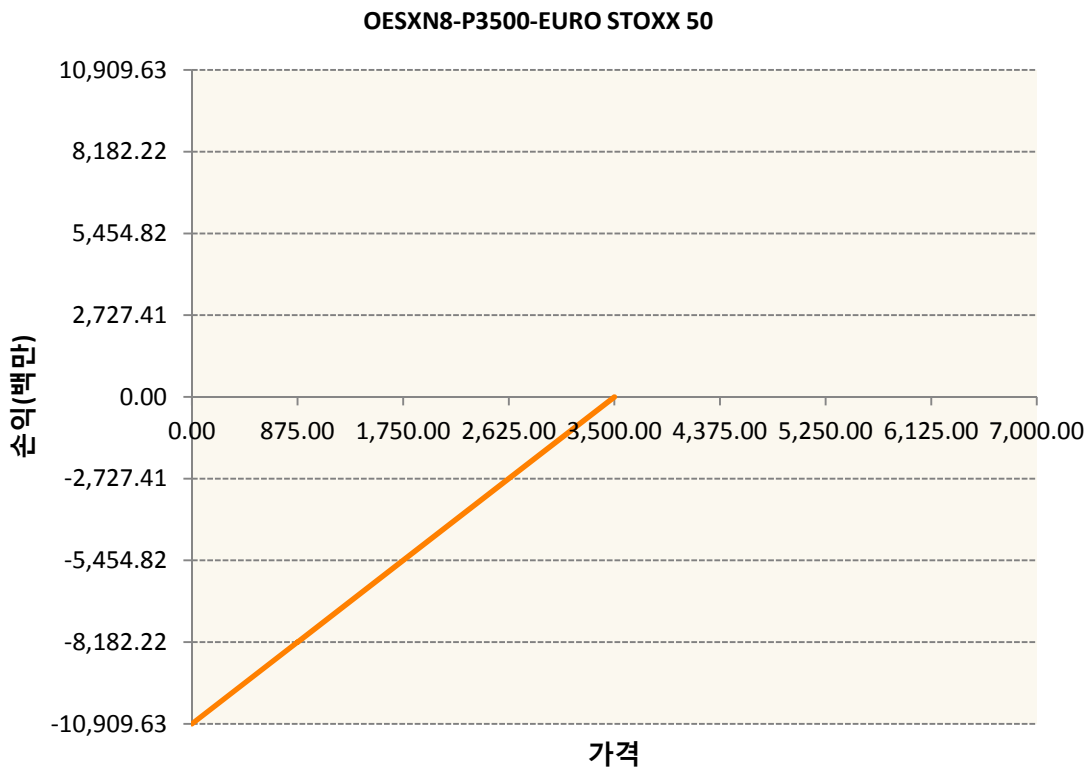
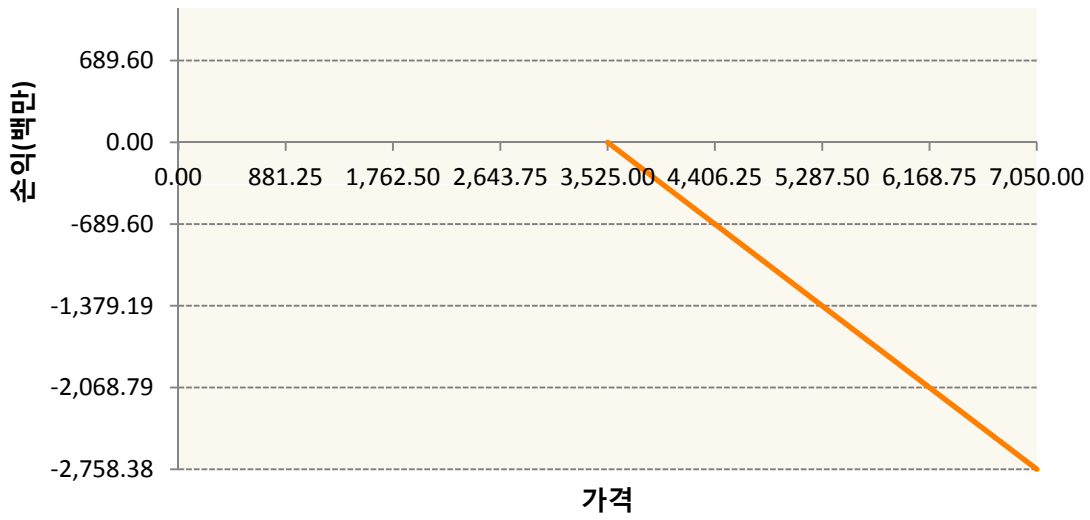
2. 만기시점의 손익구조

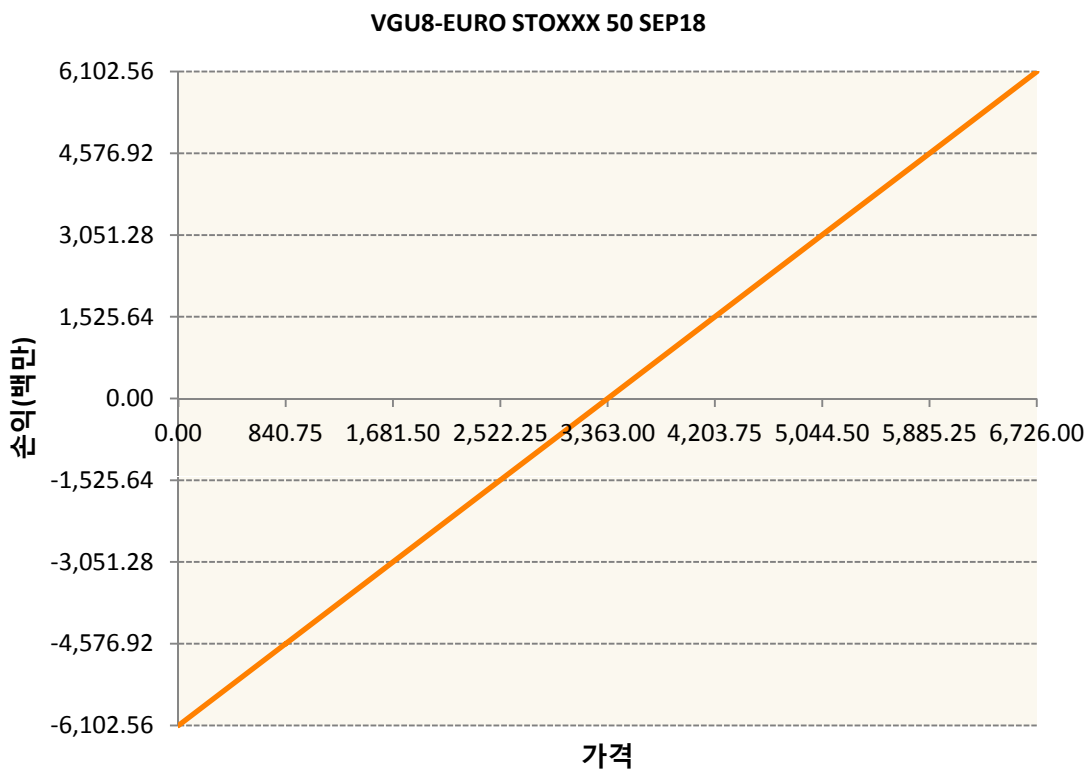
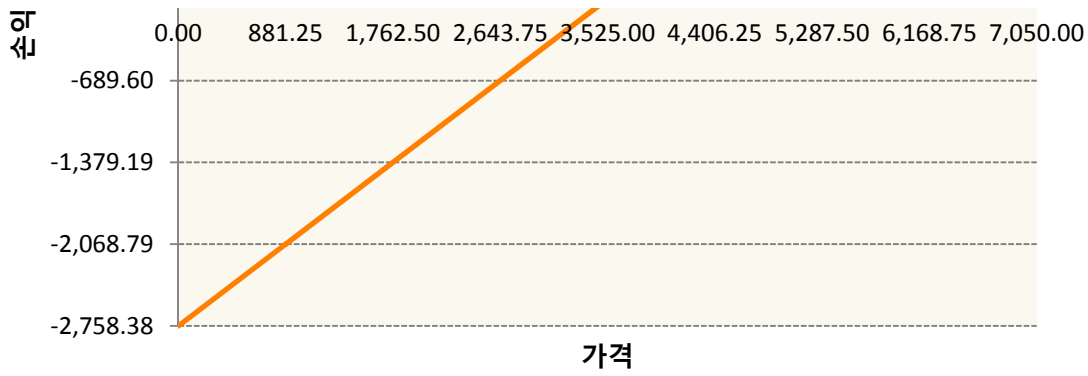
OESXN8-C3500-EURO STOXX 50



OESXN8-C3525-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY -	994.569	69
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY		59
OESXN8-C3! EURO STOXX 50		873
OESXN8-C3! EURO STOXX 50		221
OESXN8-P3! EURO STOXX 50		873
OESXN8-P3! EURO STOXX 50		221
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18		488

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

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

(단위:백만원)

1,139

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

(단위:백만원)

89

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

(단위:백만원)

133

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

(단위:백만원)

172

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-07-04
기준일	2018-07-03

리디파인K200(주식혼합-파생재간

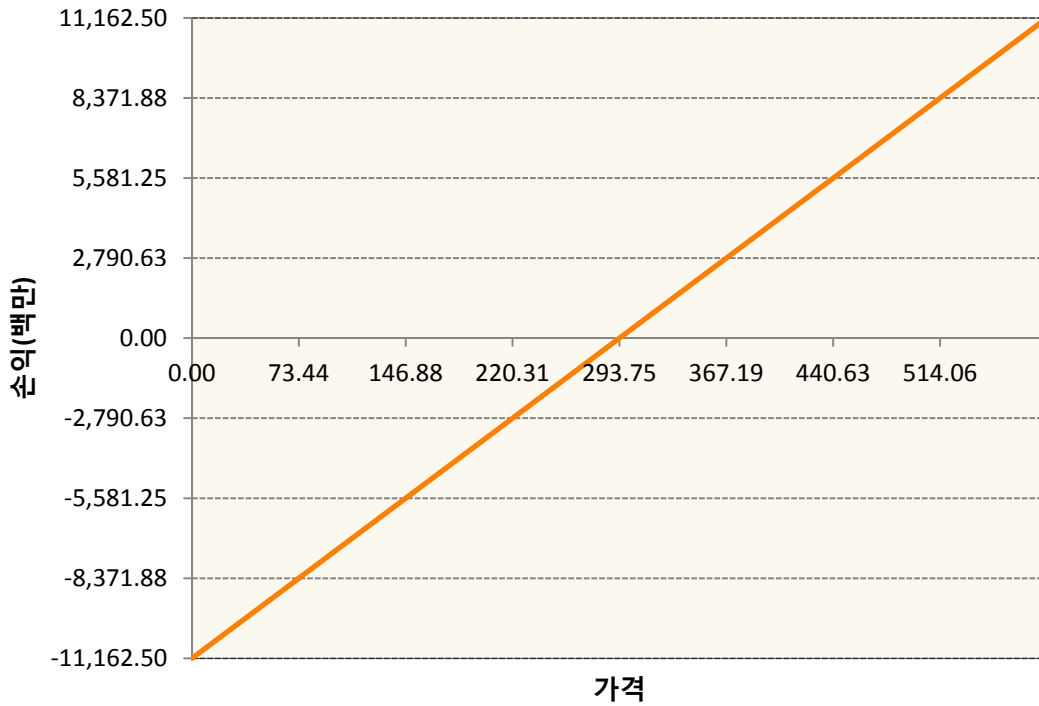
1. 계약금액

(단위:백만원)

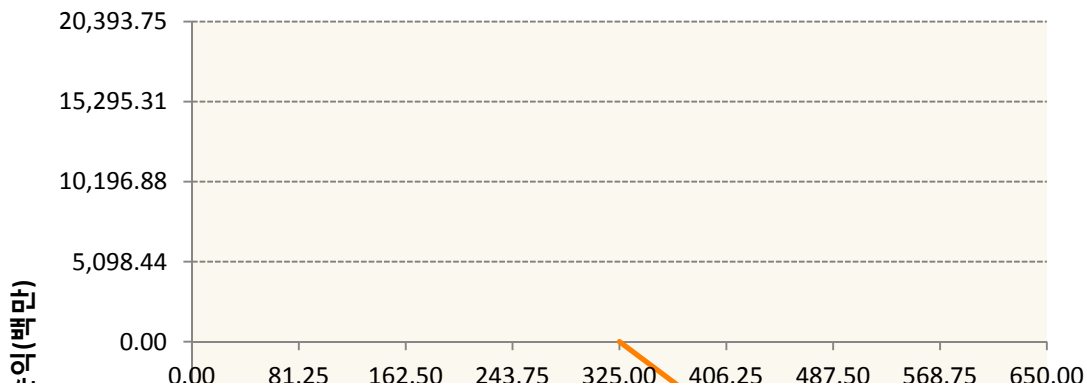
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,163	0	11,163	장내
누계	유가증권	옵션	1,550	20,394	-18,844	장내

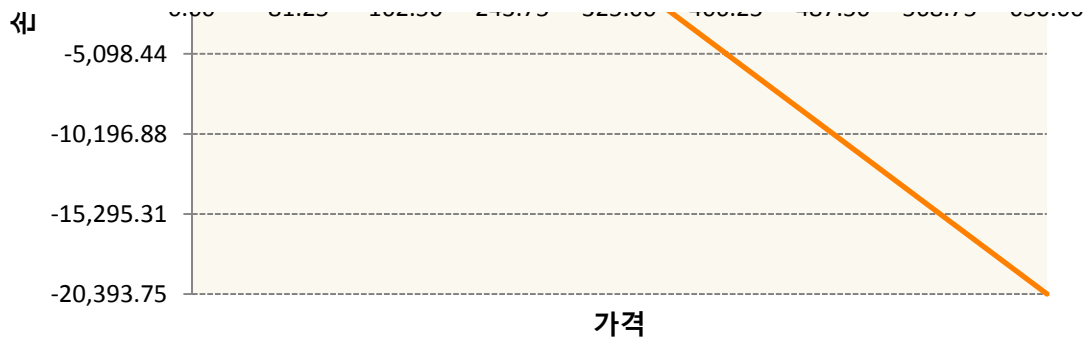
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

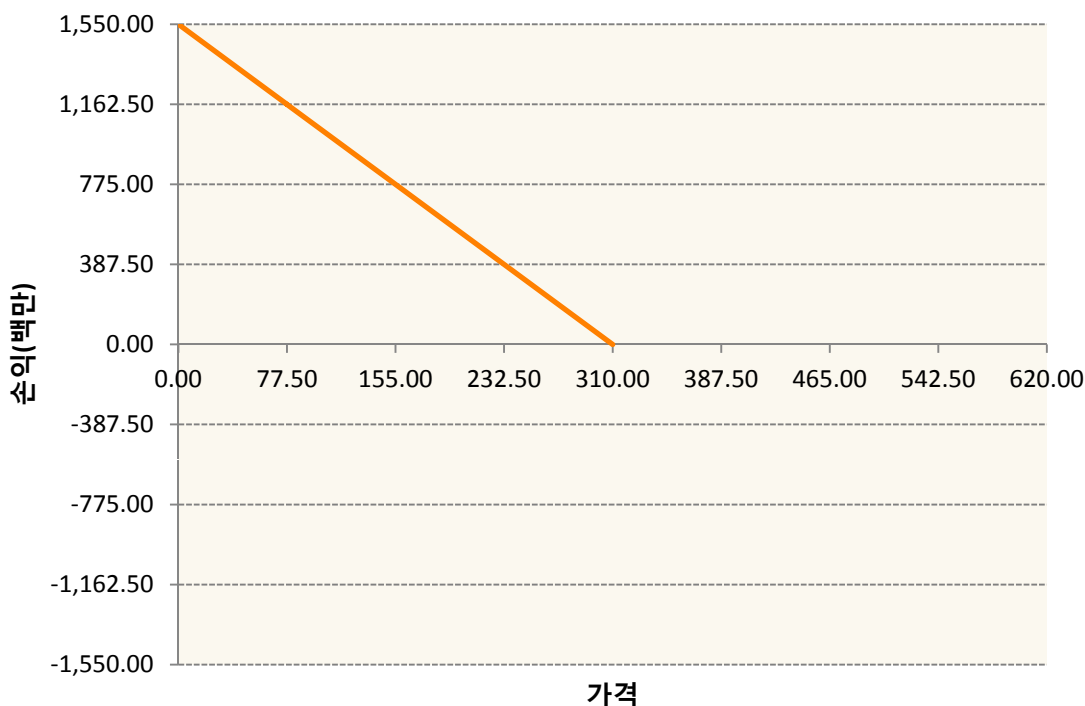


KR4201N73257-2018-07 콜325





KR4301N73107-2018-07 풋310



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물							892
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-892	-892	-892	-892	-892	-892	-892
-5.33%	-595	-595	-595	-595	-595	-595	-595
-2.67%	-297	-297	-297	-297	-297	-297	-297
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	297	297	297	297	297	297	297
5.33%	595	595	595	595	595	595	595
8.00%	892	892	892	892	892	892	892
KR4201N732 2018-07 콜325							271
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6	6	6	6	6	6	6
-5.33%	6	6	6	6	6	5	4
-2.67%	6	6	6	5	4	2	-1
0%	6	5	3	0	-4	-10	-17
2.67%	1	-3	-10	-19	-29	-41	-55
5.33%	-22	-36	-52	-70	-90	-111	-134
8.00%	-100	-127	-154	-183	-212	-241	-271

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%	39	39	39	39	39	39	39
0%	0	0	0	0	0	1	1
2.67%	-38	-38	-37	-36	-35	-34	-33
5.33%	-68	-66	-65	-63	-62	-60	-59
8.00%	-81	-80	-79	-78	-77	-76	-74

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

(단위:백만원)

884

공시일	2018-07-04
기준일	2018-07-03

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

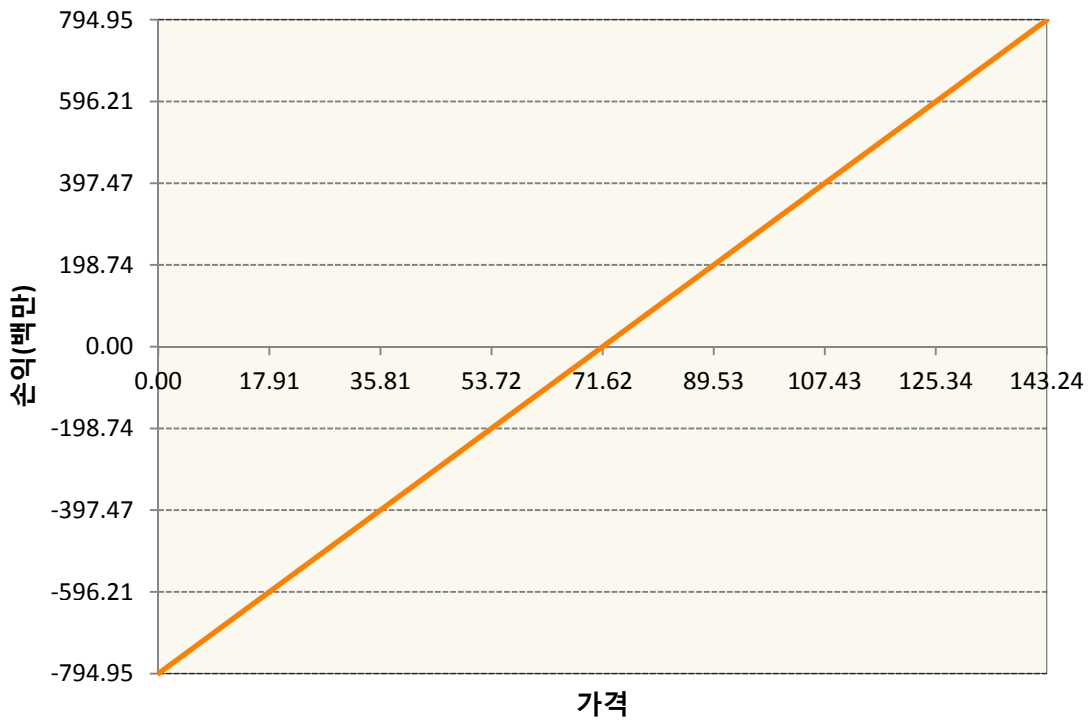
1. 계약금액

(단위:백만원)

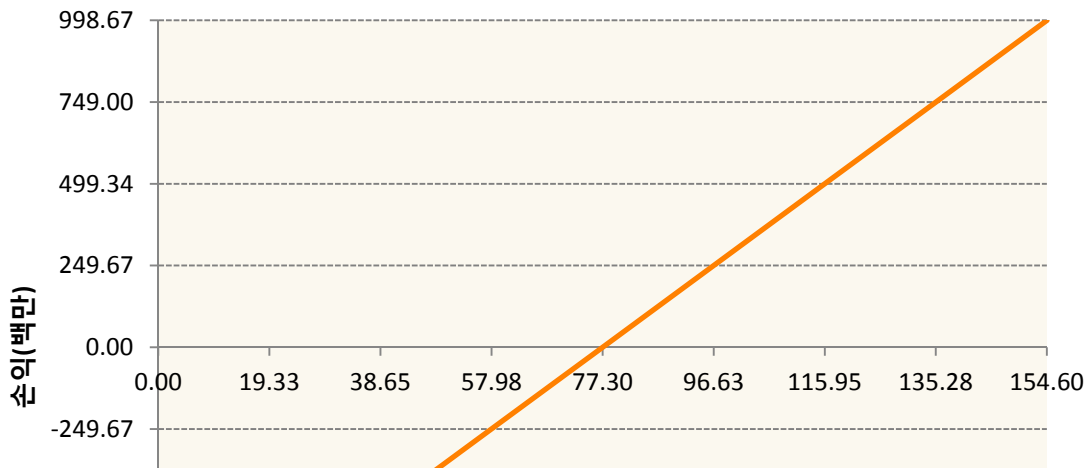
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,793	615	3,178	

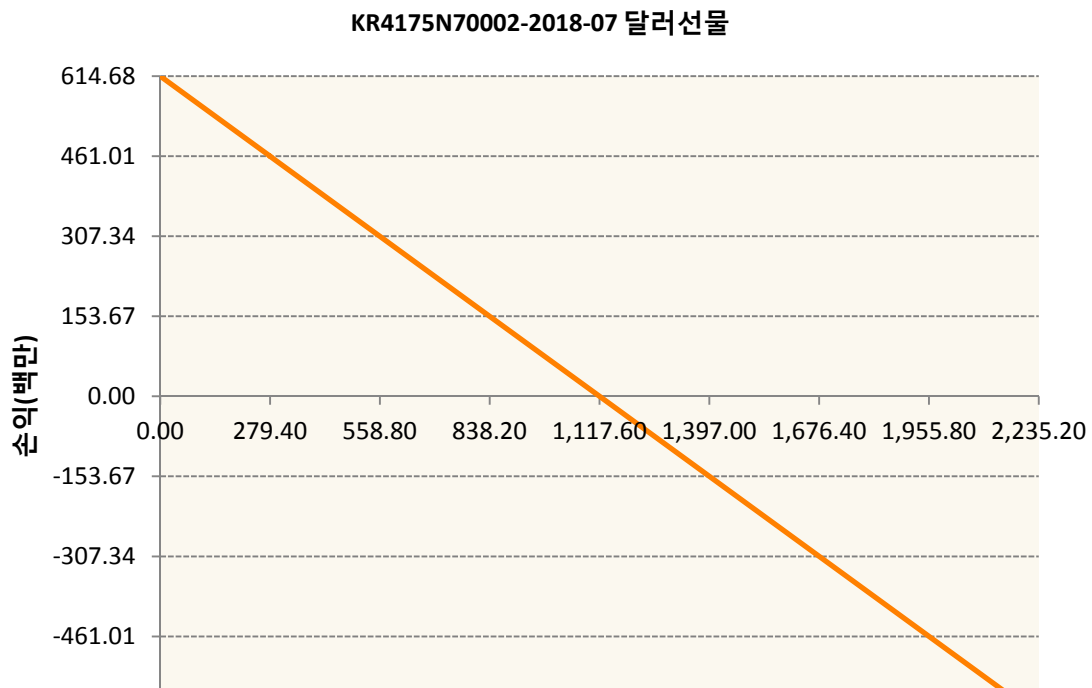
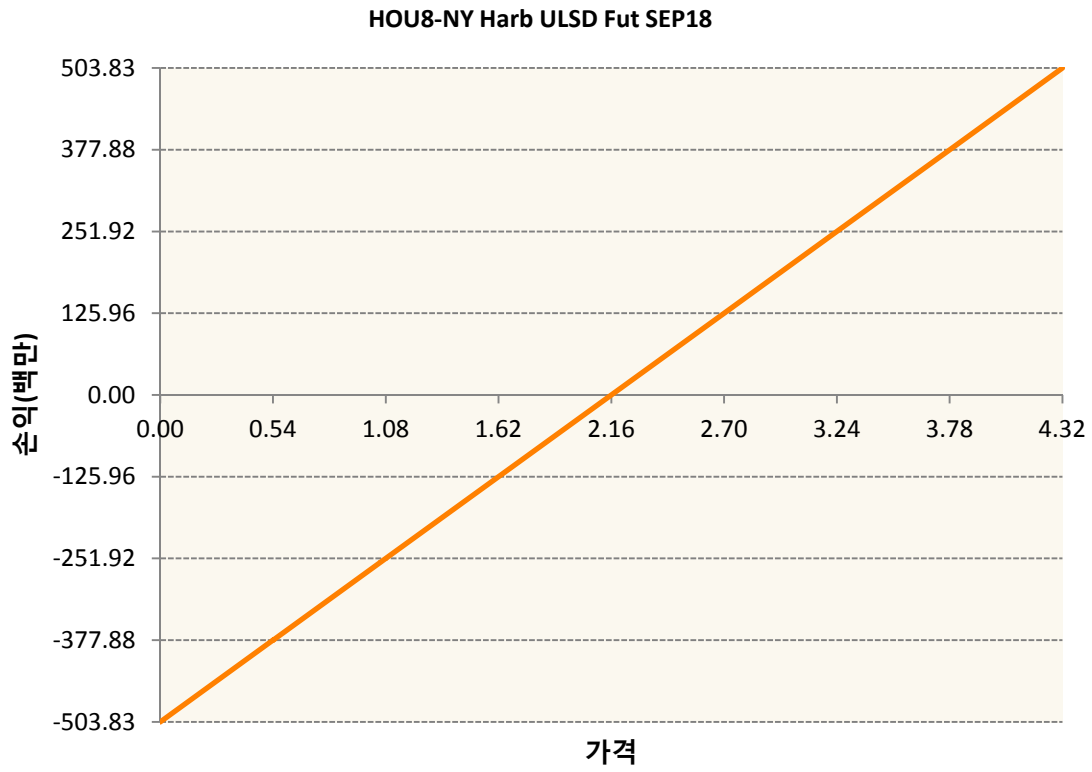
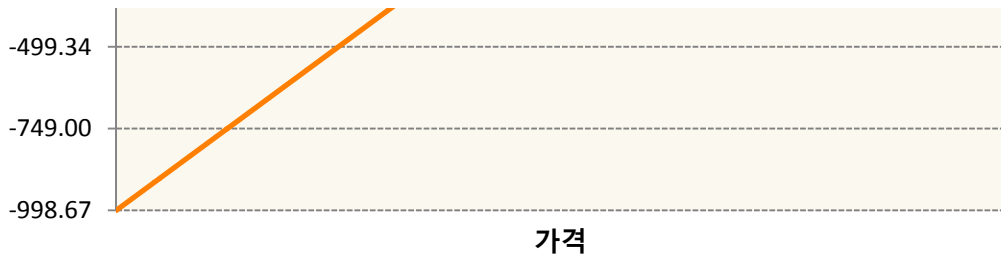
2. 만기시점의 손익구조

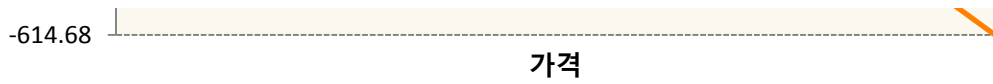
CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18



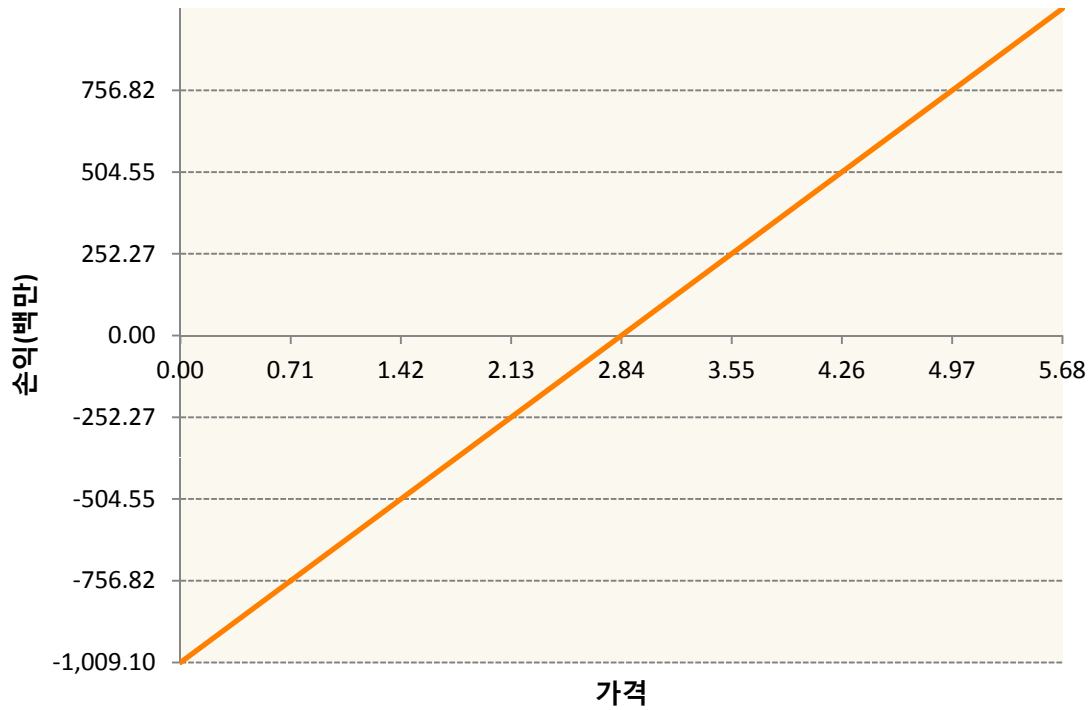
COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18



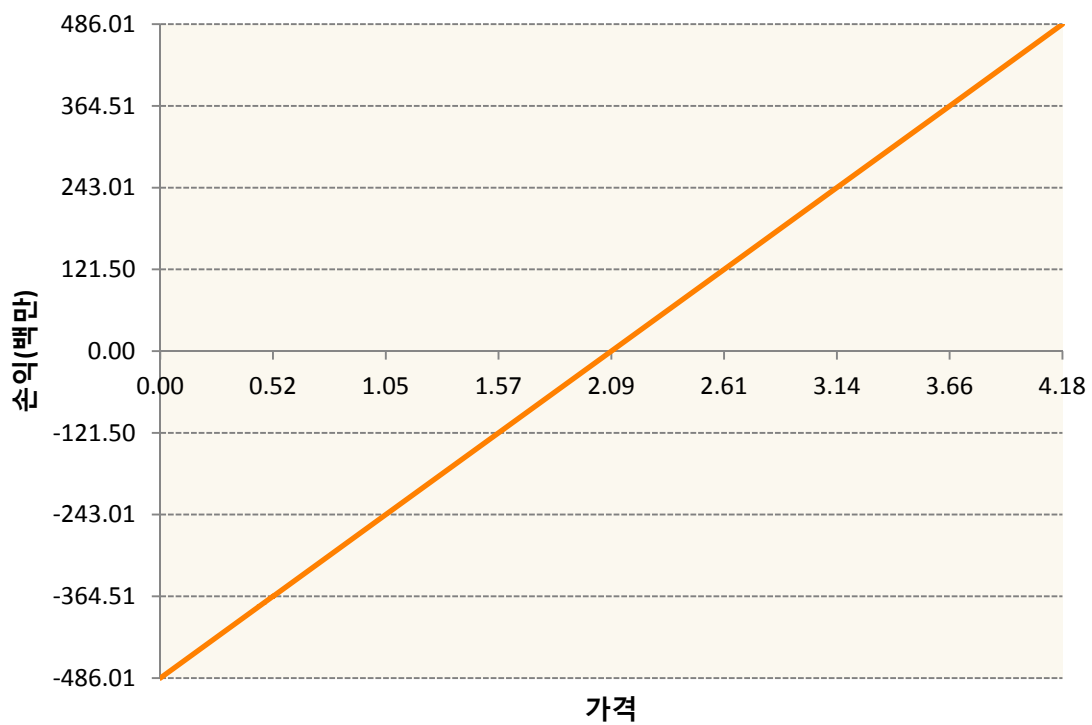




NGU18-NATURAL GAS FUTR SEP18



XBU8-GASOLINE RBOB FUT SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU8	WTI CRUDE FUTURE SEP18	64
COU8	BRENT CRUDE FUTR SEP18	80
HOU8	NY Harb ULSD Fut SEP18	40
KR4175N70C	2018-07 달러선물	49
NGU18	NATURAL GAS FUTR SEP18	81
XBU8	GASOLINE RBOB FUT SEP18	39

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

443

공시일	2018-07-04
기준일	2018-07-03

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

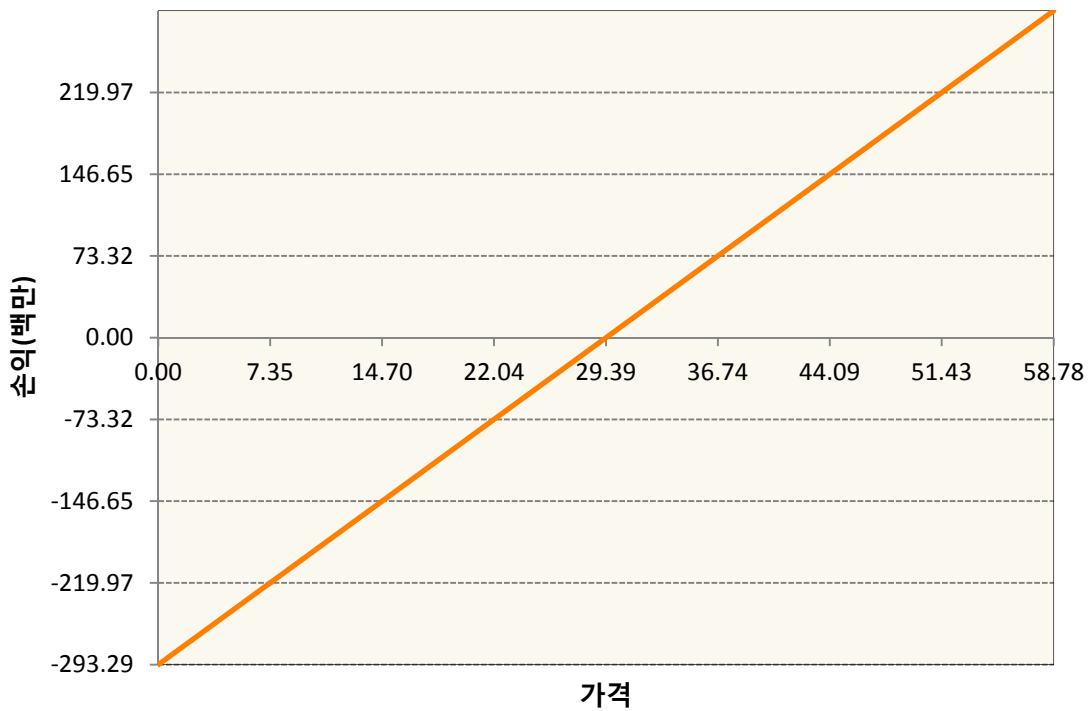
1. 계약금액

(단위:백만원)

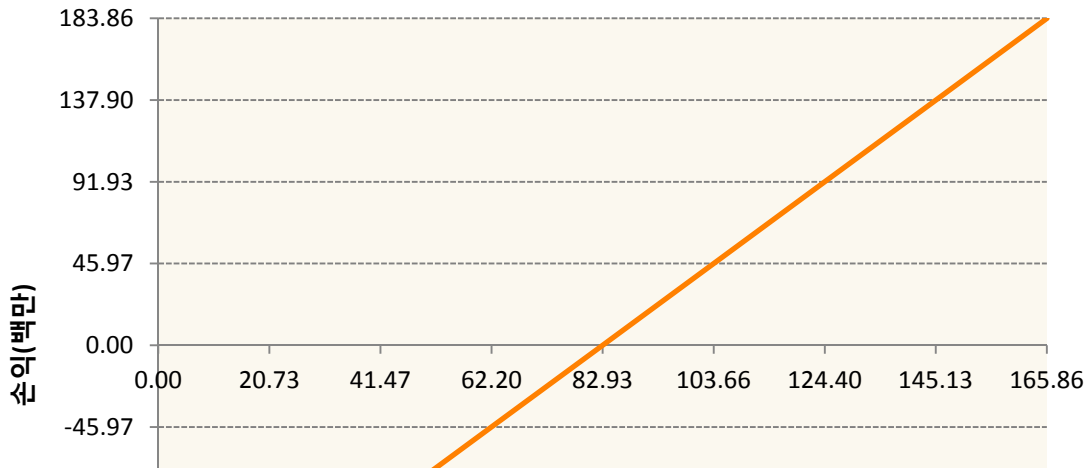
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,605	78	3,527	

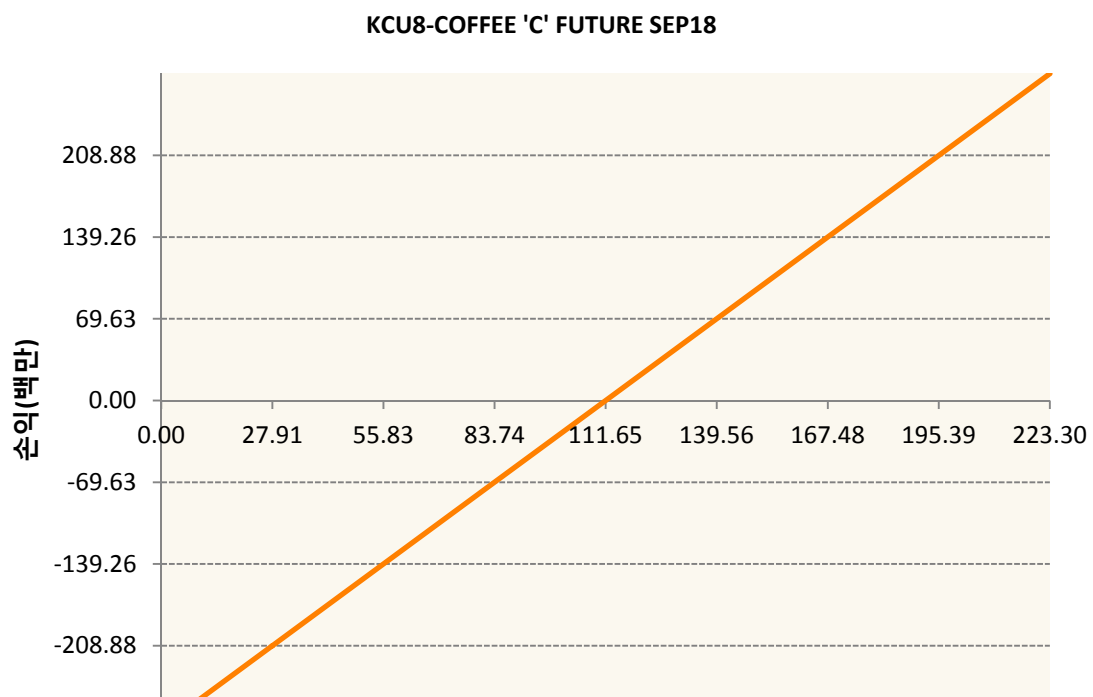
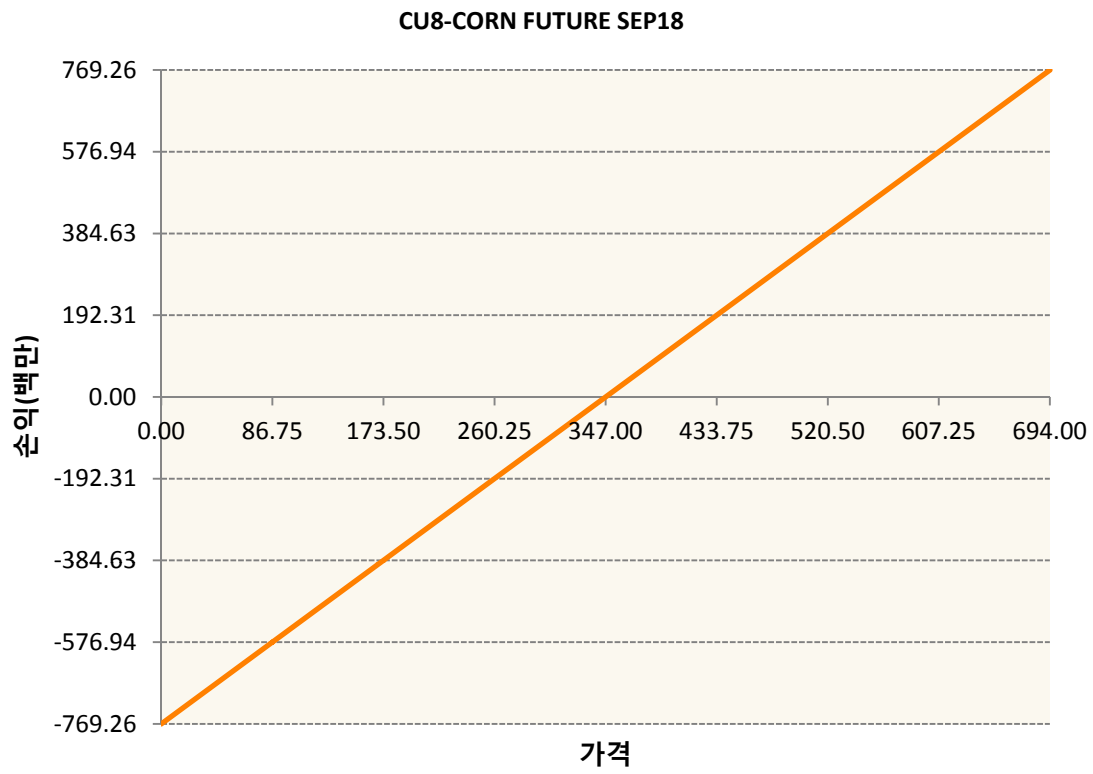
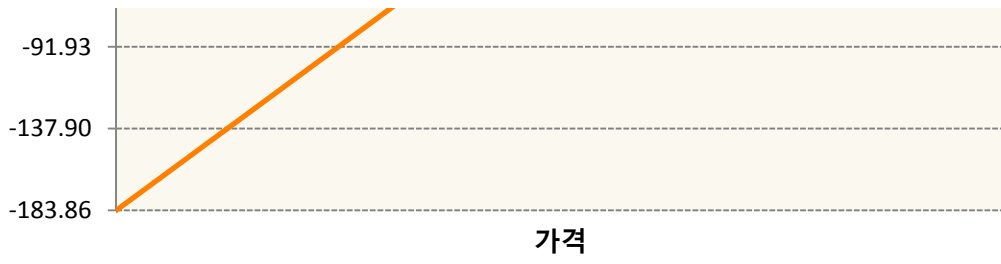
2. 만기시점의 손익구조

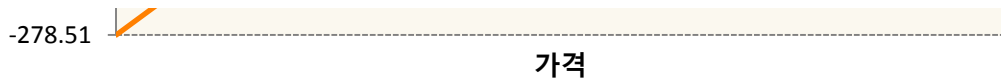
BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18



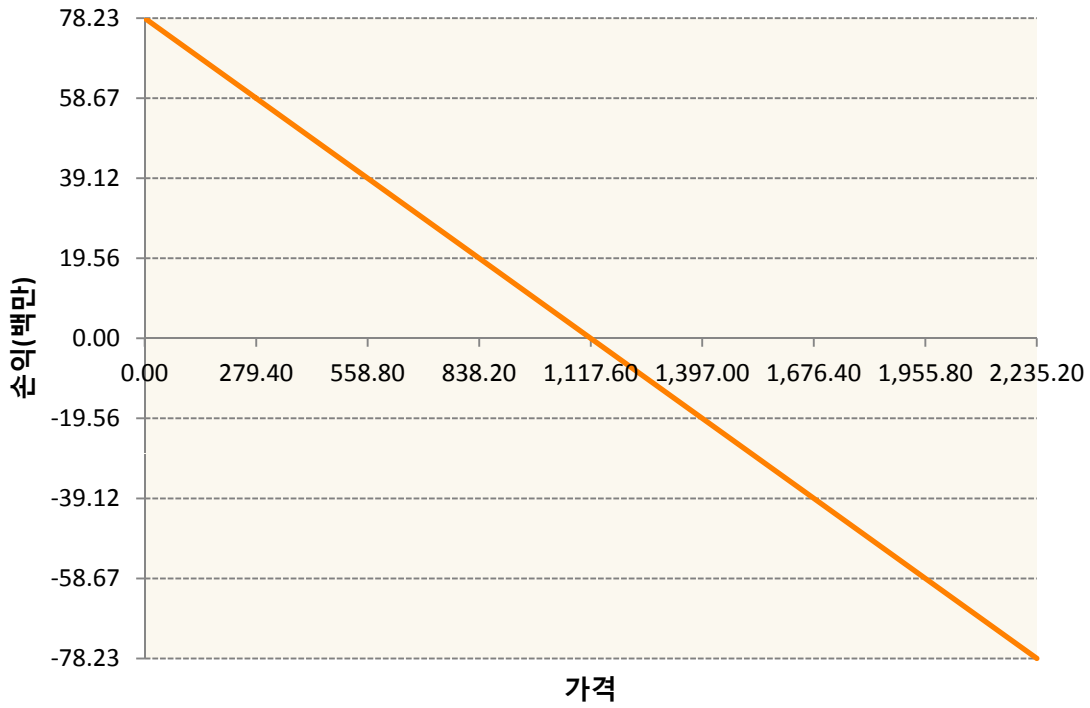
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



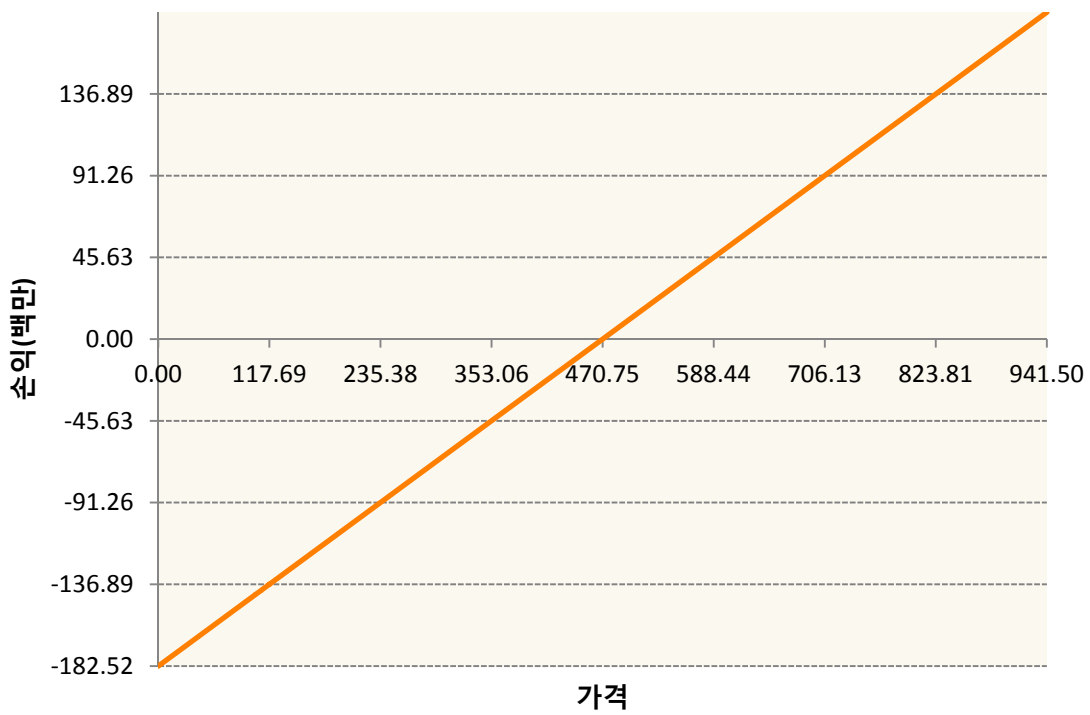




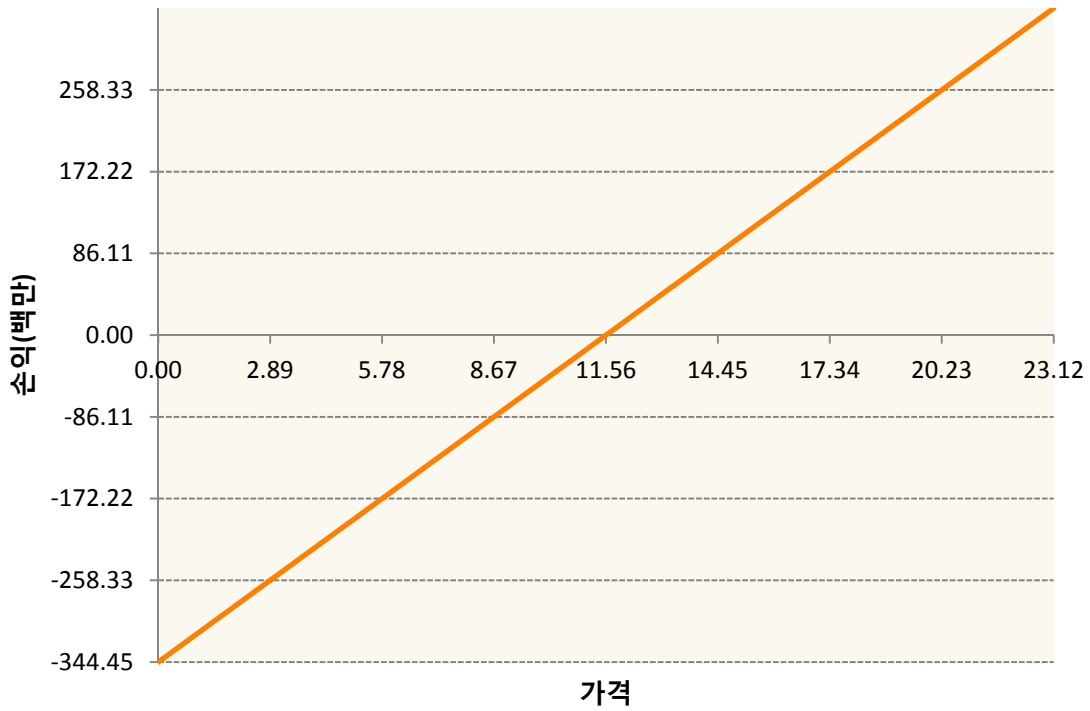
KR4175N70002-2018-07 달러선물



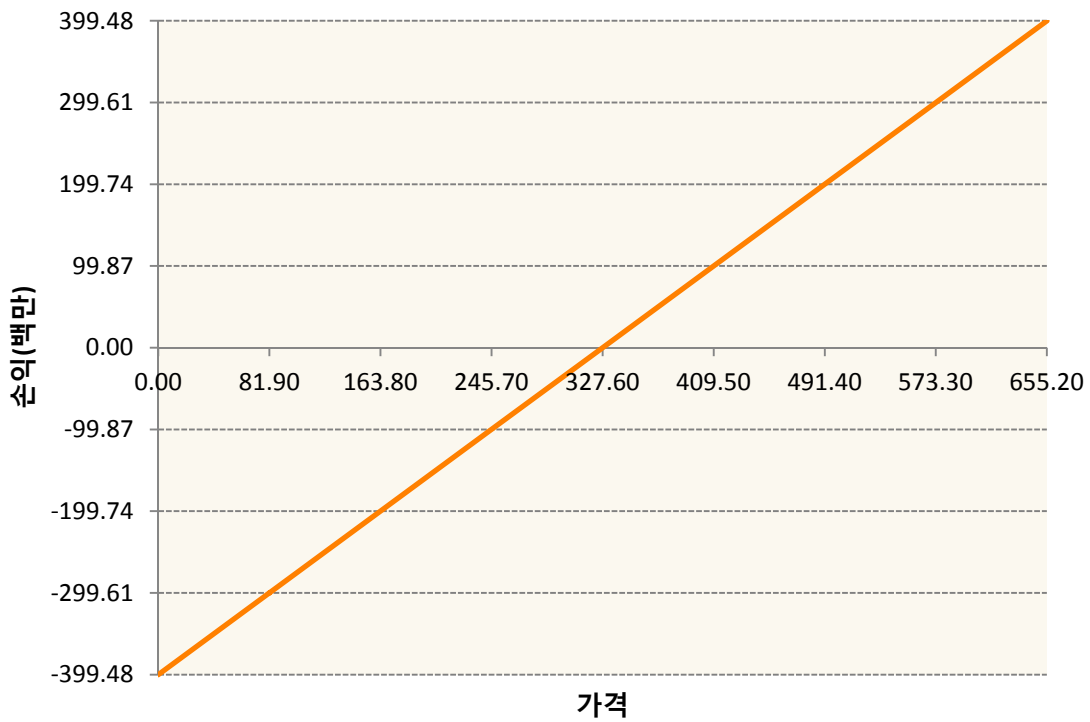
KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18



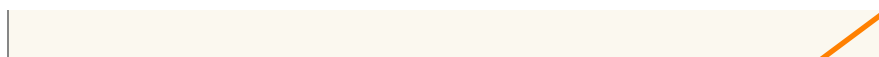
SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

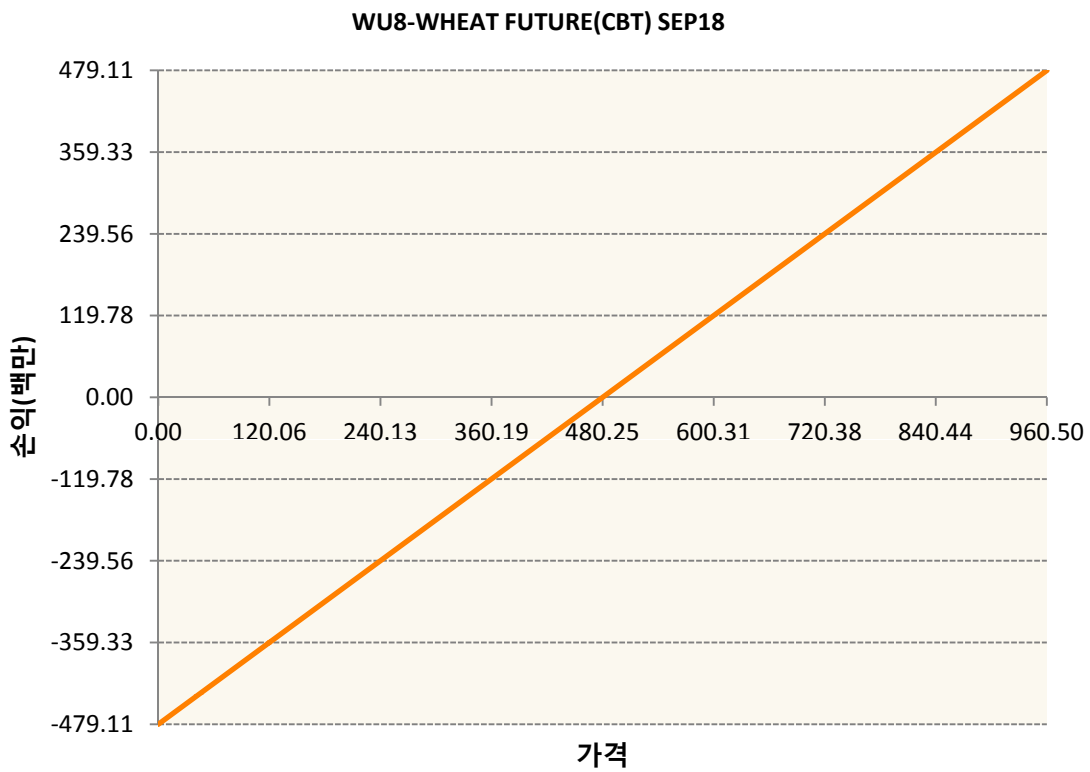
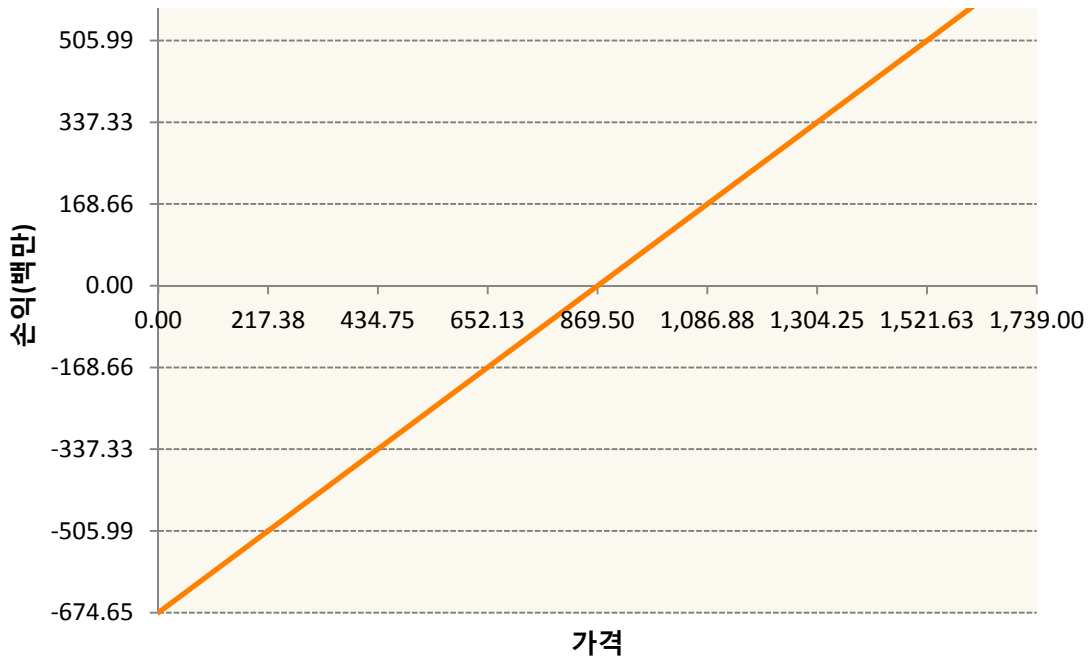


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	23
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	15
CU8	CORN FUTURE SEP18	62
KCU8	COFFEE 'C' FUTURE SEP18	22
KR4175N70C	2018-07 달러선물	6

KWU8	KC HRW WHEAT FUT SEP18	15
SBV8	SUGAR #11 (WORLD) OCT18	28
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	32
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	54
WU8	WHEAT FUTURE(CBT) SEP18	38

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

(단위:백만원)

296