

공시일	2018-07-05
기준일	2018-07-04

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	2018-07-05
기준일	2018-07-04

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

1,101

* 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	2018-07-05
기준일	2018-07-04

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

325

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

387

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-07-05
기준일	2018-07-04

유로인덱스모(주식-파생형)

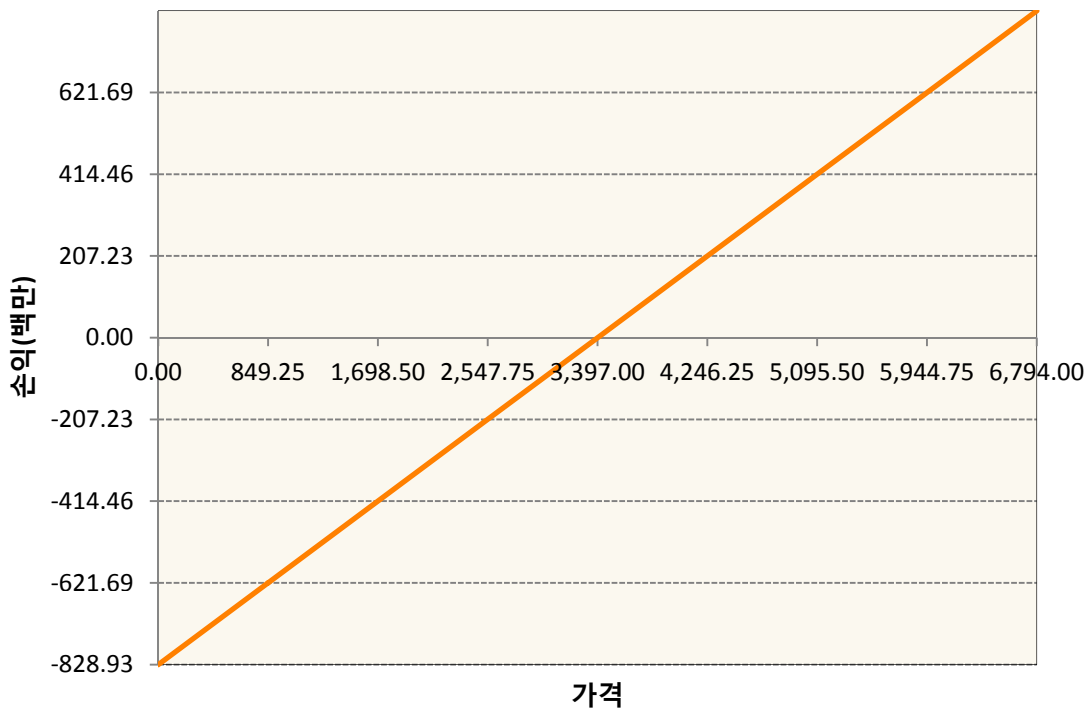
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	829	0	829	

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	2018-07-05
기준일	2018-07-04

차이나인덱스모(주식-파생형)

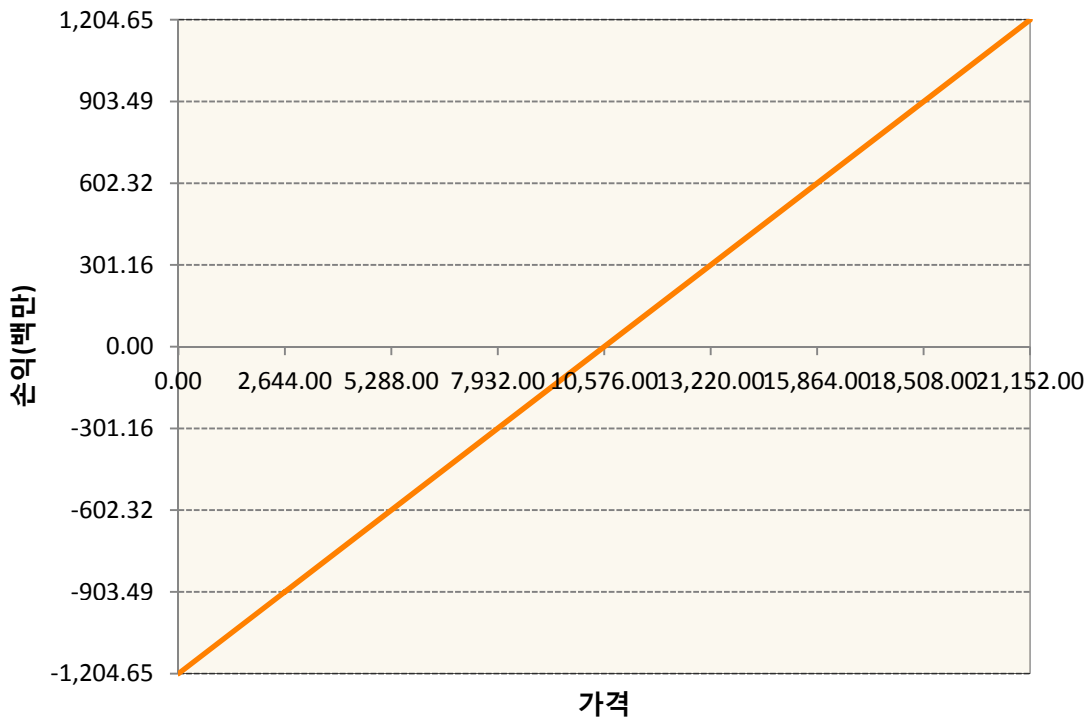
1. 계약금액

(단위:백만원)

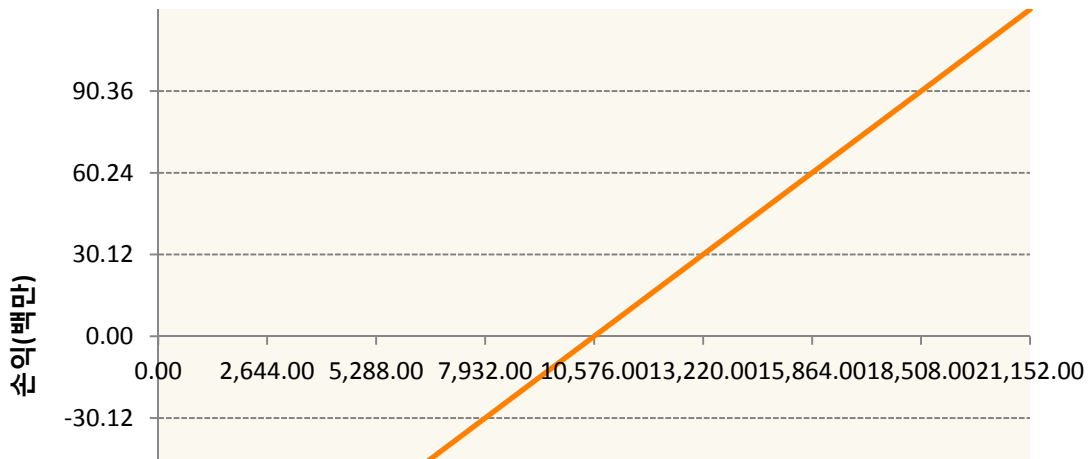
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,325	0	1,325	장내

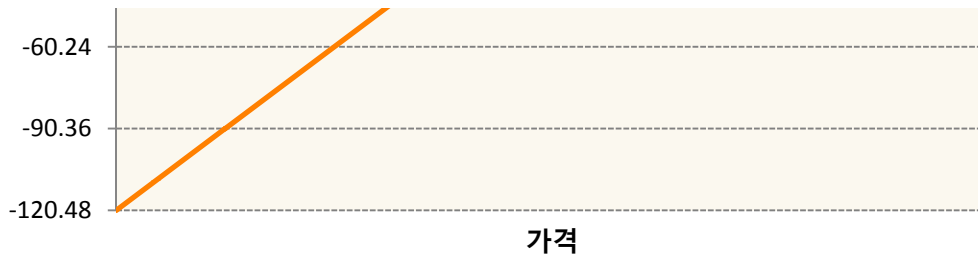
2. 만기시점의 손익구조

HCN8-HSCEI Futures Jul18



MHCN8-MINI H-SHR IDX FU JUL18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCN8	HSCEI Futures Jul18	96
MHCN8	MINI H-SHR IDX FU JUL18	10

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

96

공시일	2018-07-05
기준일	2018-07-04

커버드콜모(주식혼합-파생형)

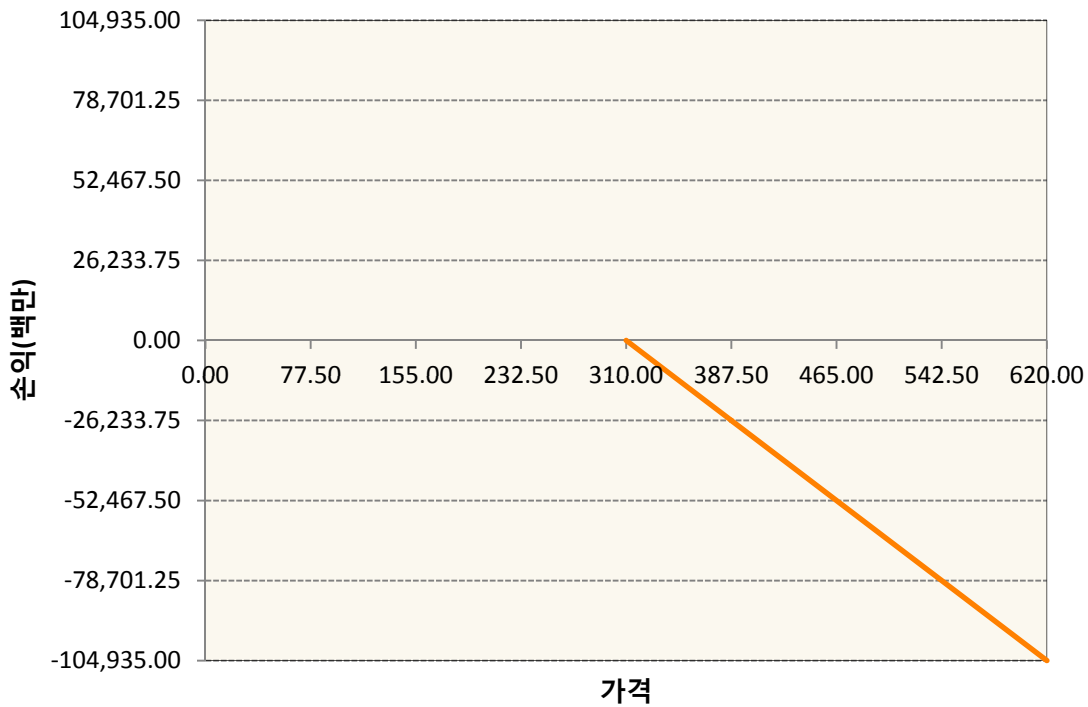
1. 계약금액

(단위:백만원)

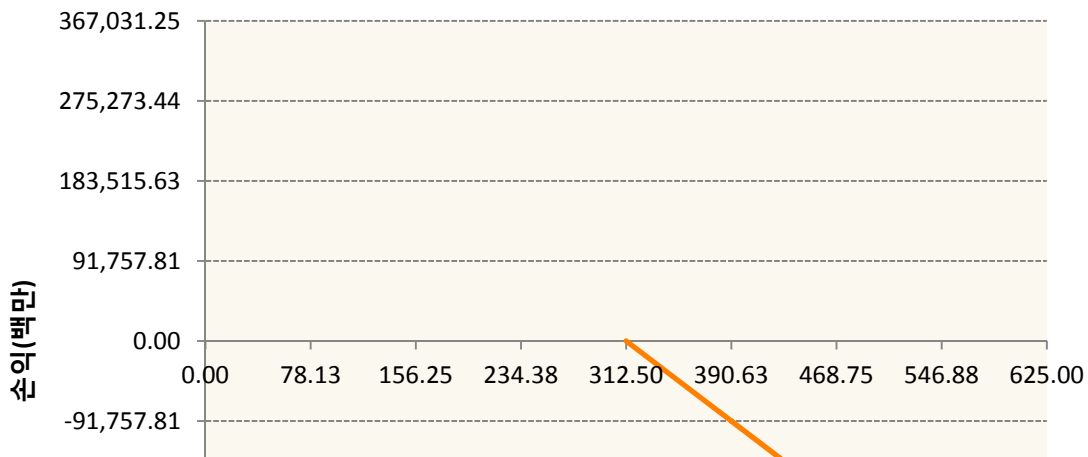
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	766,466	-766,466	장내

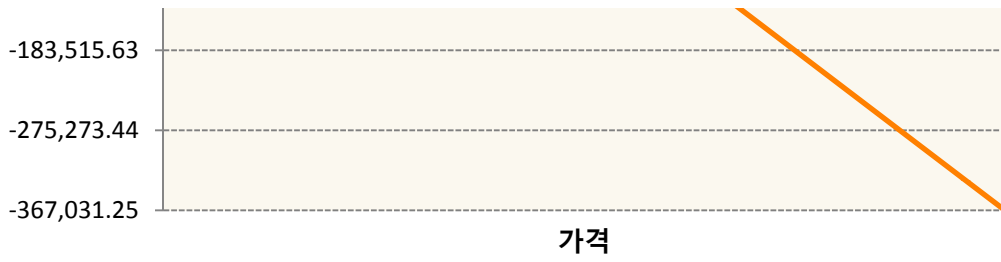
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N73109-2018-07 콜310

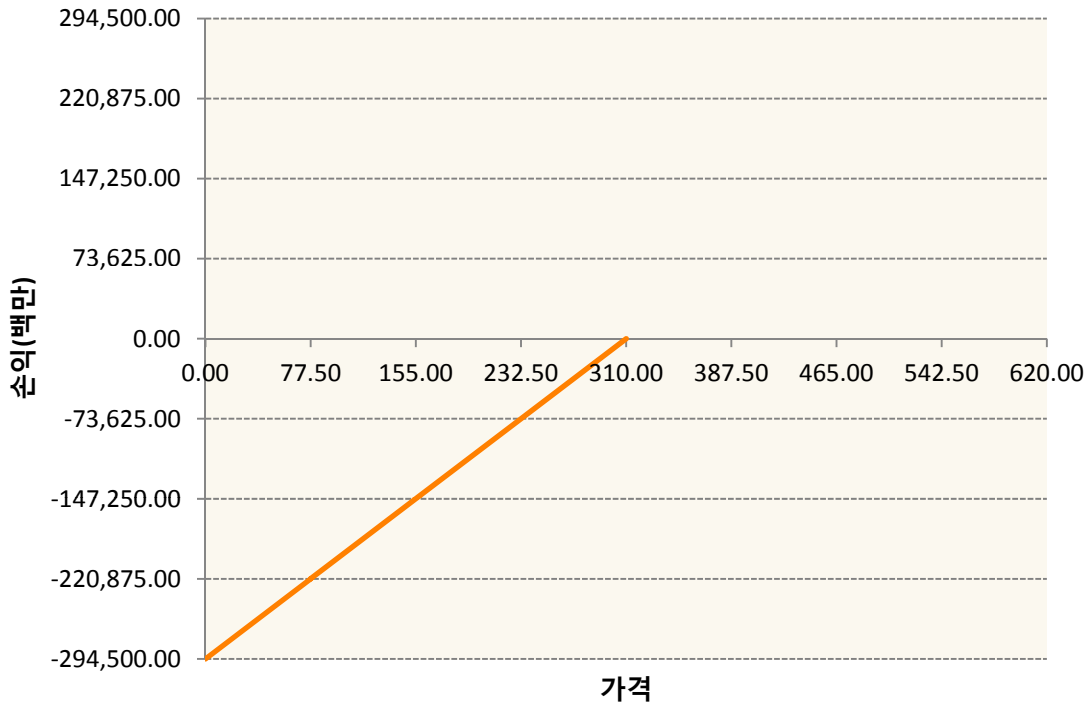


KR4201N73125-2018-07 콜312.5





KR4301N73107-2018-07 풋310



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N7312018-07 콜310

3,281

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	223	223	223	222	220	216	211
-5.33%	223	221	219	213	204	190	171
-2.67%	216	206	190	167	136	97	51
0%	160	117	64	0	-73	-155	-244
2.67%	-107	-213	-327	-447	-572	-702	-835
5.33%	-883	-1,040	-1,197	-1,355	-1,514	-1,672	-1,831
8.00%	-2,385	-2,528	-2,674	-2,823	-2,974	-3,127	-3,281

KR4201N7312018-07 콜312.5

9,908

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	532	531	531	529	525	518	504

-5.33%	531	529	523	511	490	457	408
-2.67%	520	500	465	409	330	227	98
0%	409	308	172	0	-205	-440	-704
2.67%	-199	-495	-825	-1,185	-1,570	-1,974	-2,395
5.33%	-2,222	-2,734	-3,254	-3,780	-4,311	-4,845	-5,383
8.00%	-6,606	-7,149	-7,697	-8,247	-8,799	-9,353	-9,908

KR4301N7312018-07 풋310

22,166

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,166	-22,166	-22,166	-22,166	-22,166	-22,166	-22,166
-5.33%	-14,765	-14,765	-14,765	-14,765	-14,765	-14,765	-14,765
-2.67%	-7,364	-7,364	-7,364	-7,365	-7,367	-7,371	-7,379
0%	35	29	18	0	-27	-65	-114
2.67%	7,310	7,231	7,134	7,019	6,888	6,745	6,590
5.33%	13,370	13,123	12,873	12,621	12,368	12,114	11,858
8.00%	16,280	16,096	15,900	15,693	15,479	15,258	15,031

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

(단위:백만원)

31,332

공시일	2018-07-05
기준일	2018-07-04

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

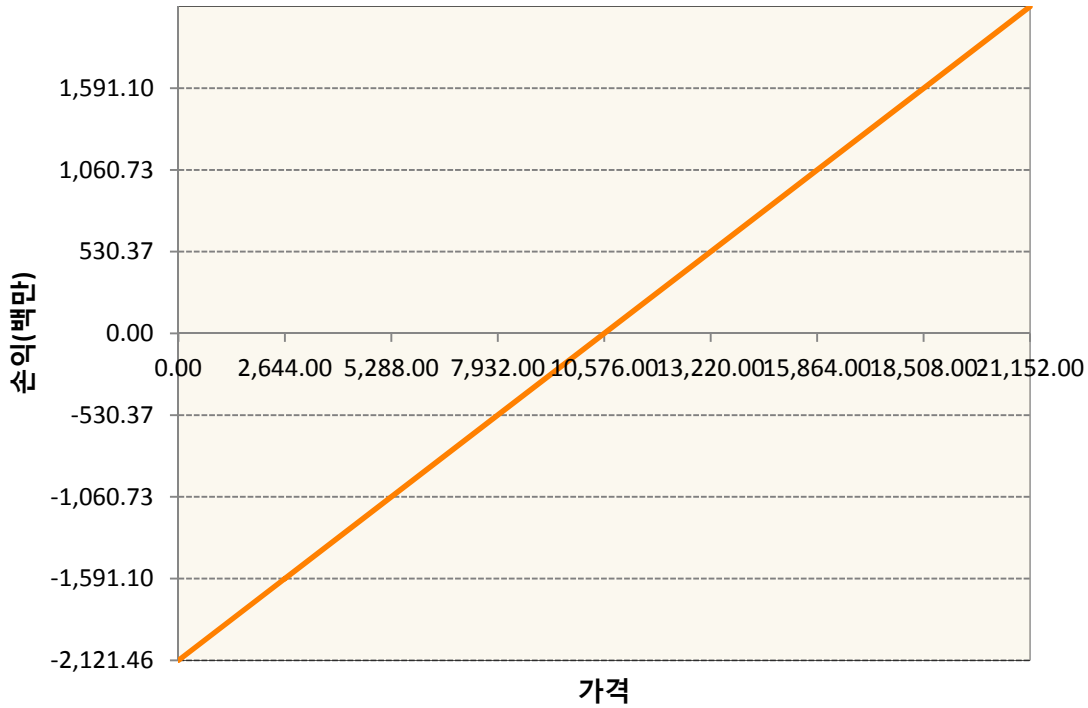
1. 계약금액

(단위:백만원)

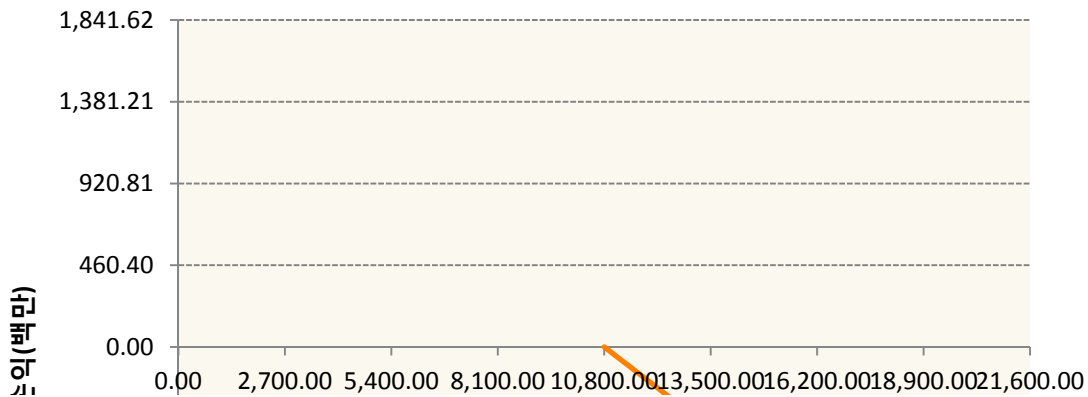
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,121	0	2,121	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,559	-5,559	장내

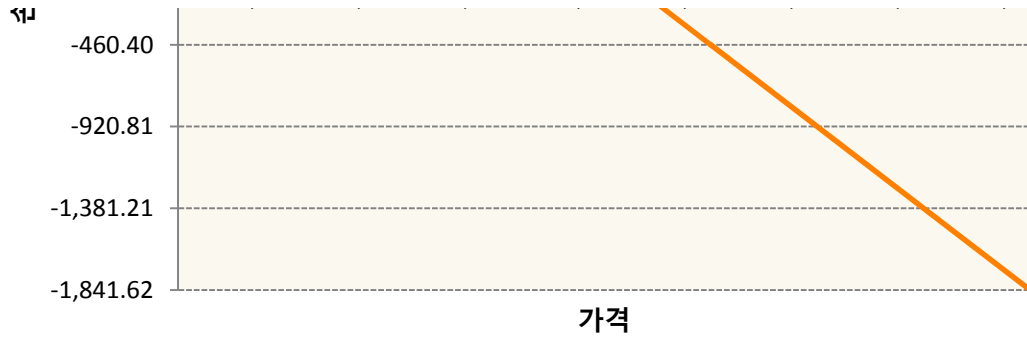
2. 만기시점의 손익구조

HCN8-HSCEI Futures Jul18

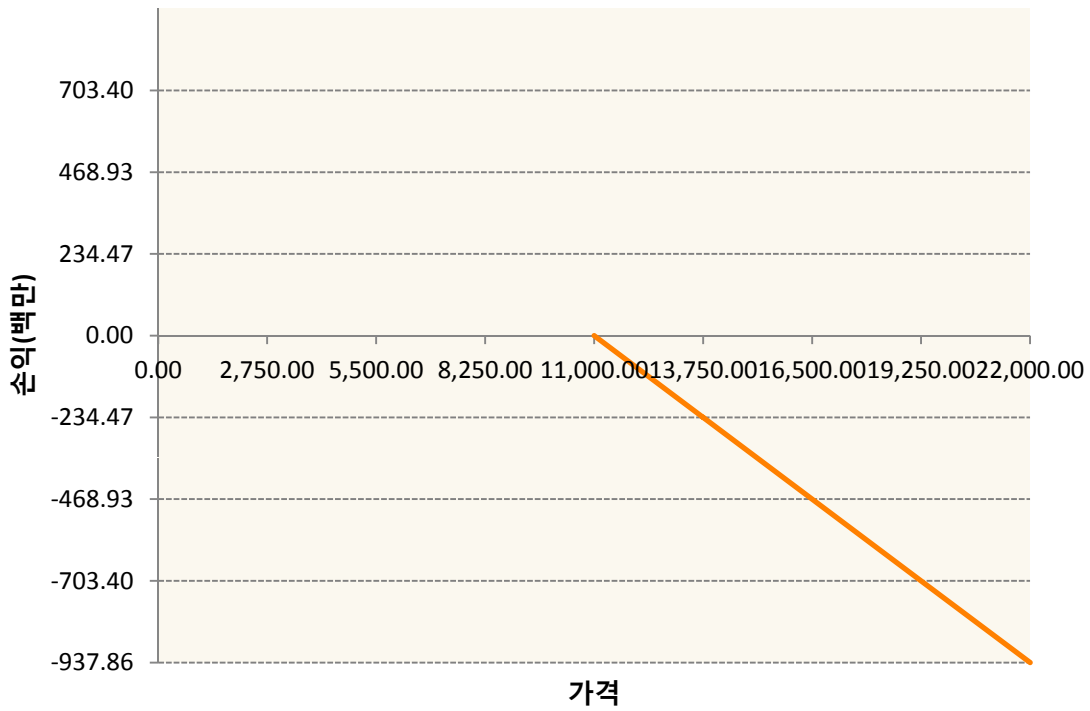


OHHIN8-C108-HSCEI

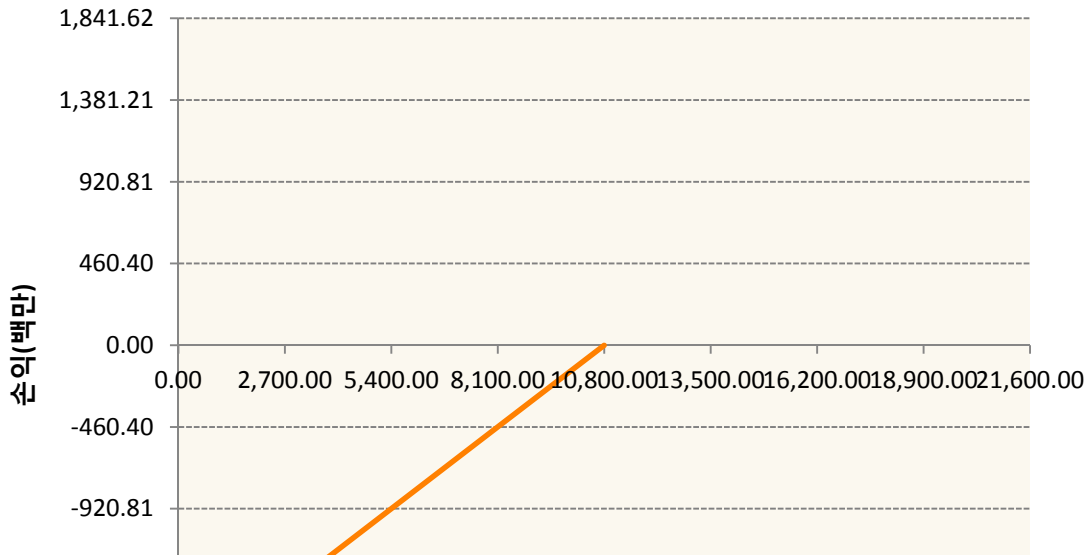


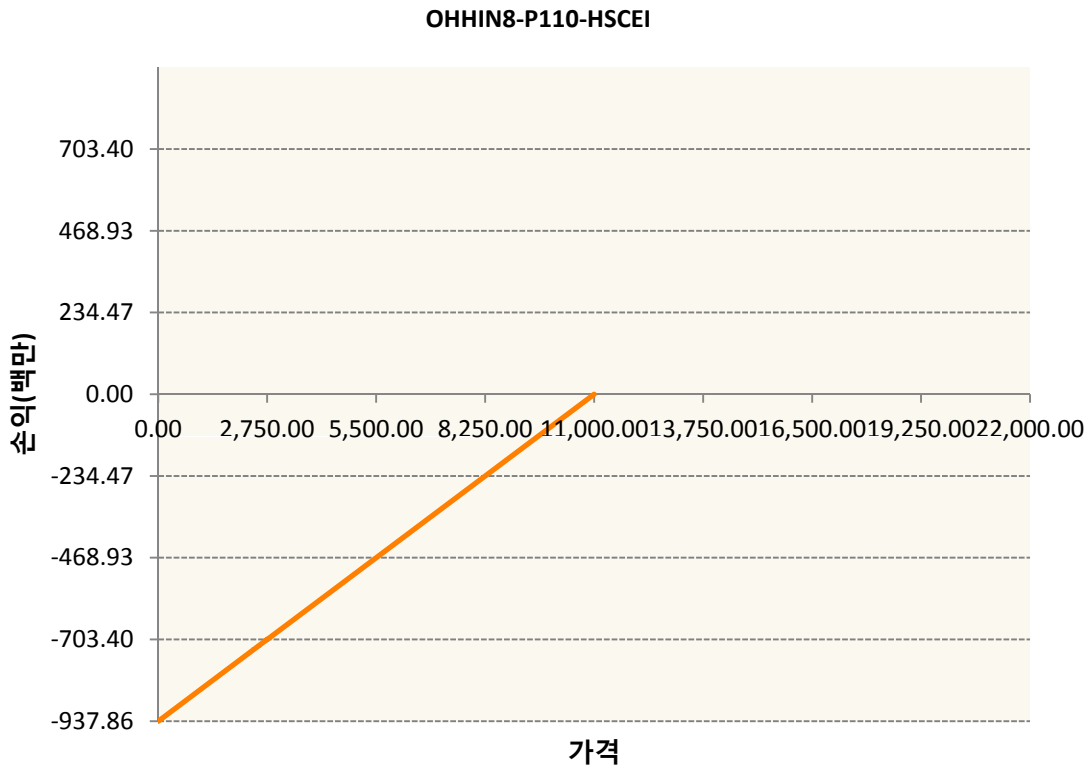
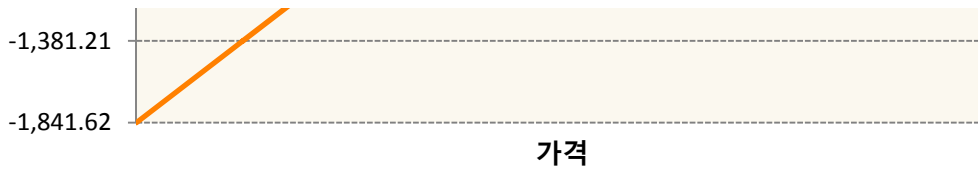


OHHIN8-C110-HSCEI



OHHIN8-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCN8	HSCEI Futures Jul18	170
OHHIN8-C1	(HSCEI	147
OHHIN8-C1	: HSCEI	75
OHHIN8-P1	(HSCEI	147
OHHIN8-P11	HSCEI	75

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	555

공시일	2018-07-05
기준일	2018-07-04

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

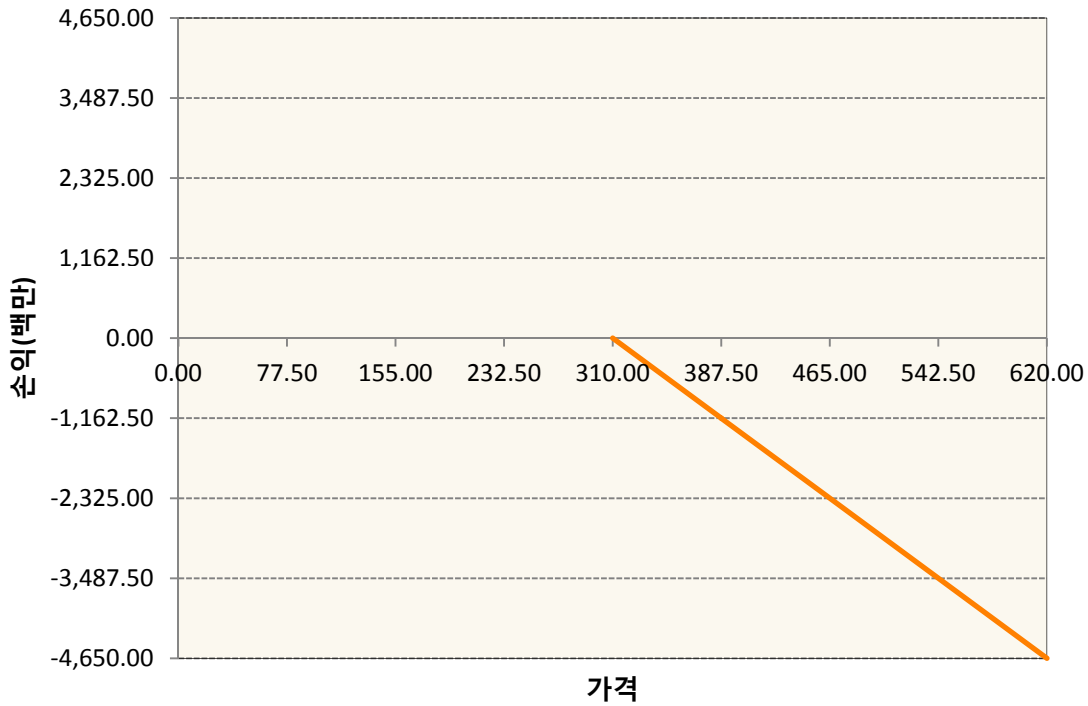
1. 계약금액

(단위:백만원)

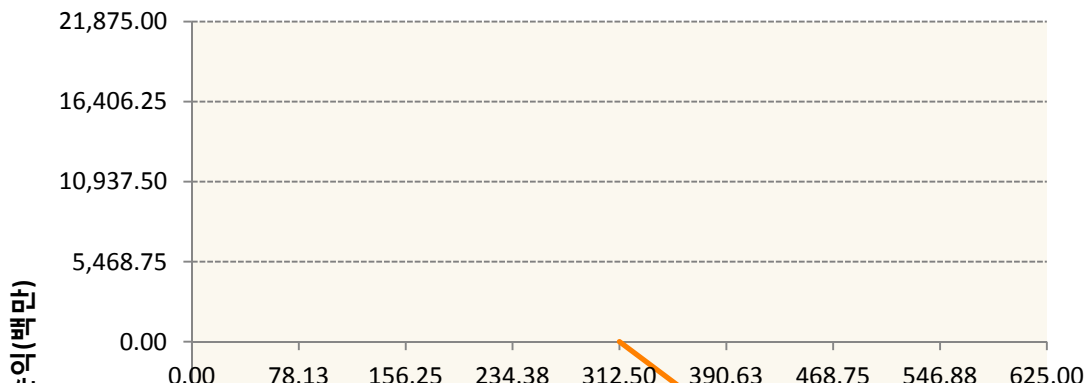
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	45,900	-45,900	장내

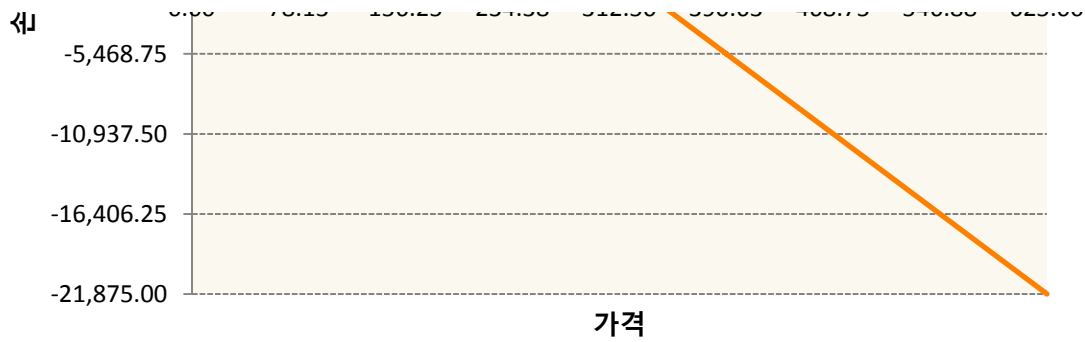
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N73109-2018-07 콜310

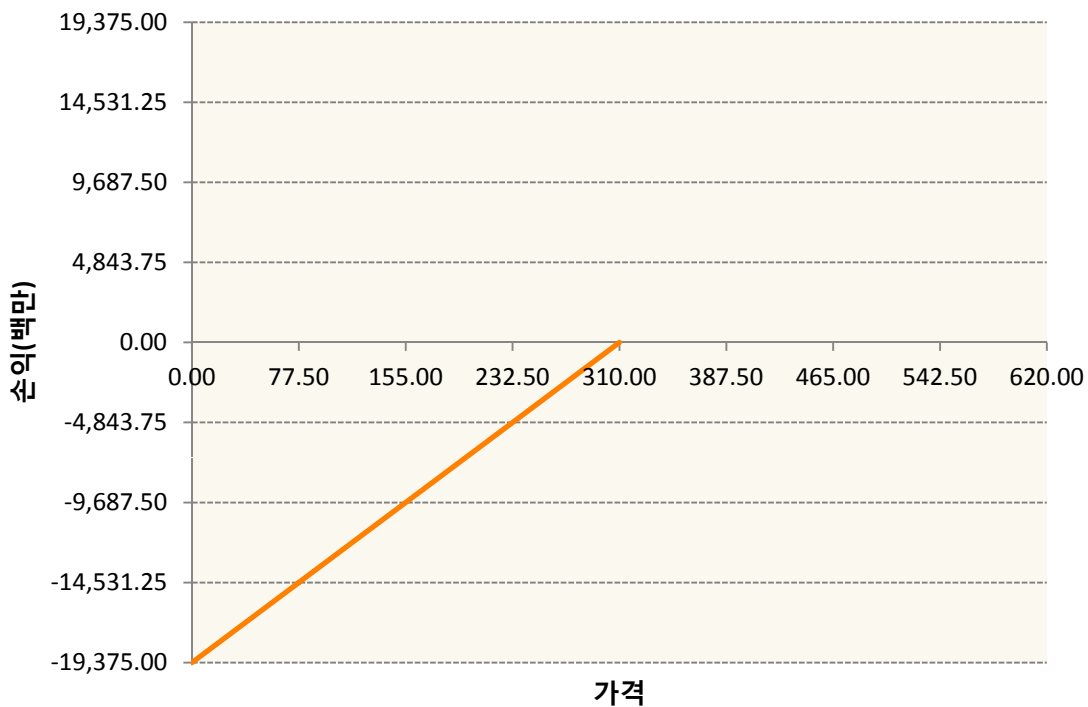


KR4201N73125-2018-07 콜312.5





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

145

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10	10	10	10	10	10	9
-5.33%	10	10	10	9	9	8	8
-2.67%	10	9	8	7	6	4	2
0%	7	5	3	0	-3	-7	-11
2.67%	-5	-9	-14	-20	-25	-31	-37
5.33%	-39	-46	-53	-60	-67	-74	-81
8.00%	-106	-112	-119	-125	-132	-139	-145

KR4201N7312018-07 콜312.5

591

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	32	32	32	32	31	31	30
-5.33%	32	32	31	30	29	27	24
-2.67%	31	30	28	24	20	14	6
0%	24	18	10	0	-12	-26	-42
2.67%	-12	-29	-49	-71	-94	-118	-143
5.33%	-132	-163	-194	-225	-257	-289	-321
8.00%	-394	-426	-459	-492	-524	-557	-591

KR4301N7312018-07 풋310

1,458

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,458	-1,458	-1,458	-1,458	-1,458	-1,458	-1,458
-5.33%	-971	-971	-971	-971	-971	-971	-971
-2.67%	-484	-484	-484	-485	-485	-485	-485
0%	2	2	1	0	-2	-4	-7
2.67%	481	476	469	462	453	444	434
5.33%	880	863	847	830	814	797	780
8.00%	1,071	1,059	1,046	1,032	1,018	1,004	989

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

(단위:백만원)

5,875

공시일	2018-07-05
기준일	2018-07-04

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

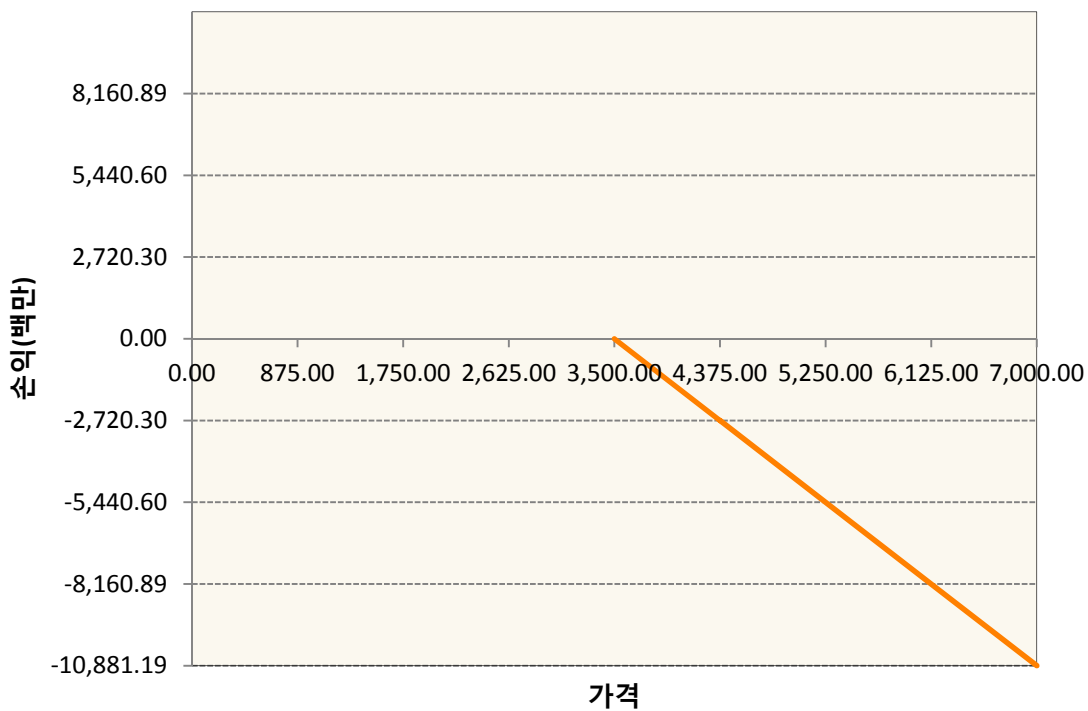
1. 계약금액

(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	6,166	0	6,166	
누계	유가증권	스왑	44,436	0	44,436	장외
누계	유가증권	옵션	0	27,265	-27,265	장내
누계	지수	스왑	52,032	0	52,032	장외

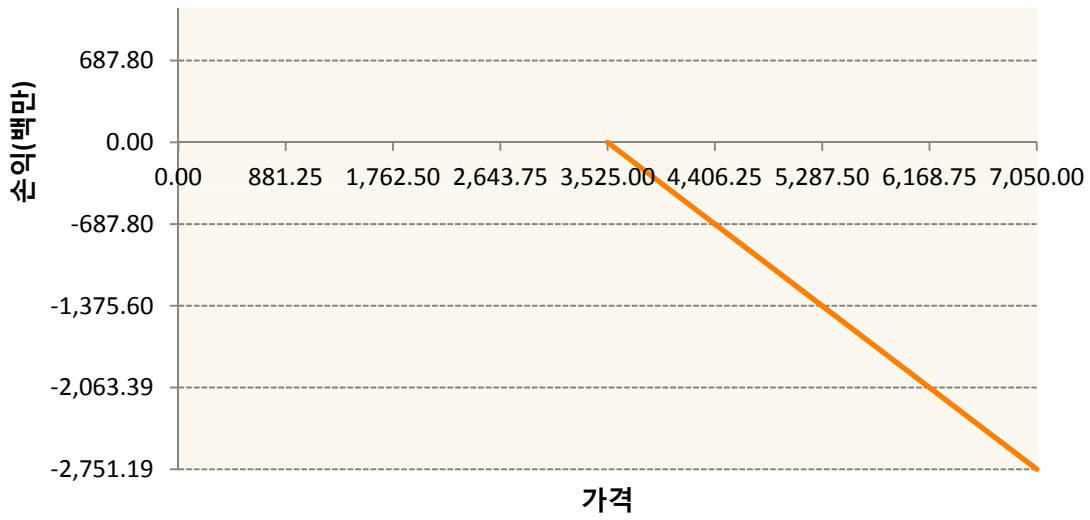
2. 만기시점의 손익구조

OESXN8-C3500-EURO STOXX 50

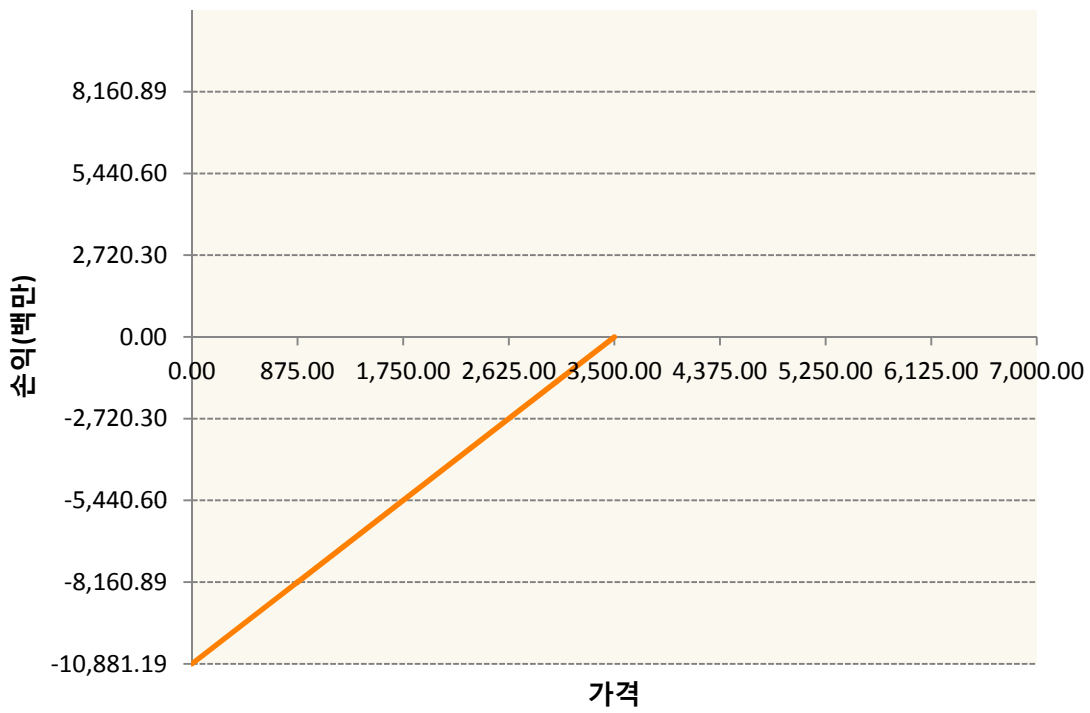


OESXN8-C3525-EURO STOXX 50

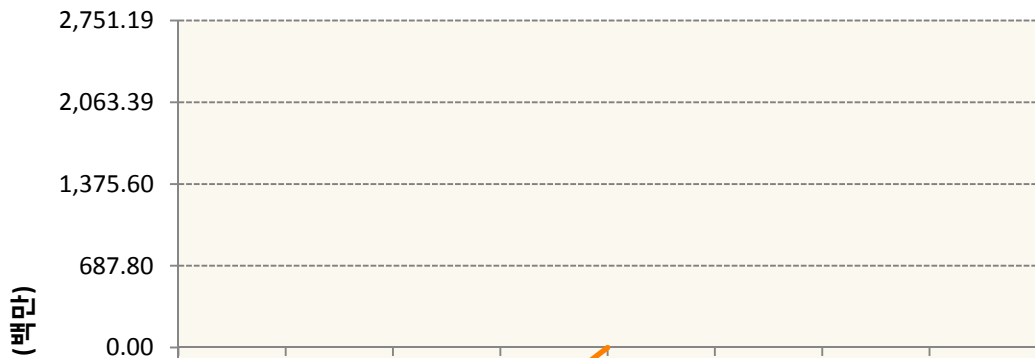


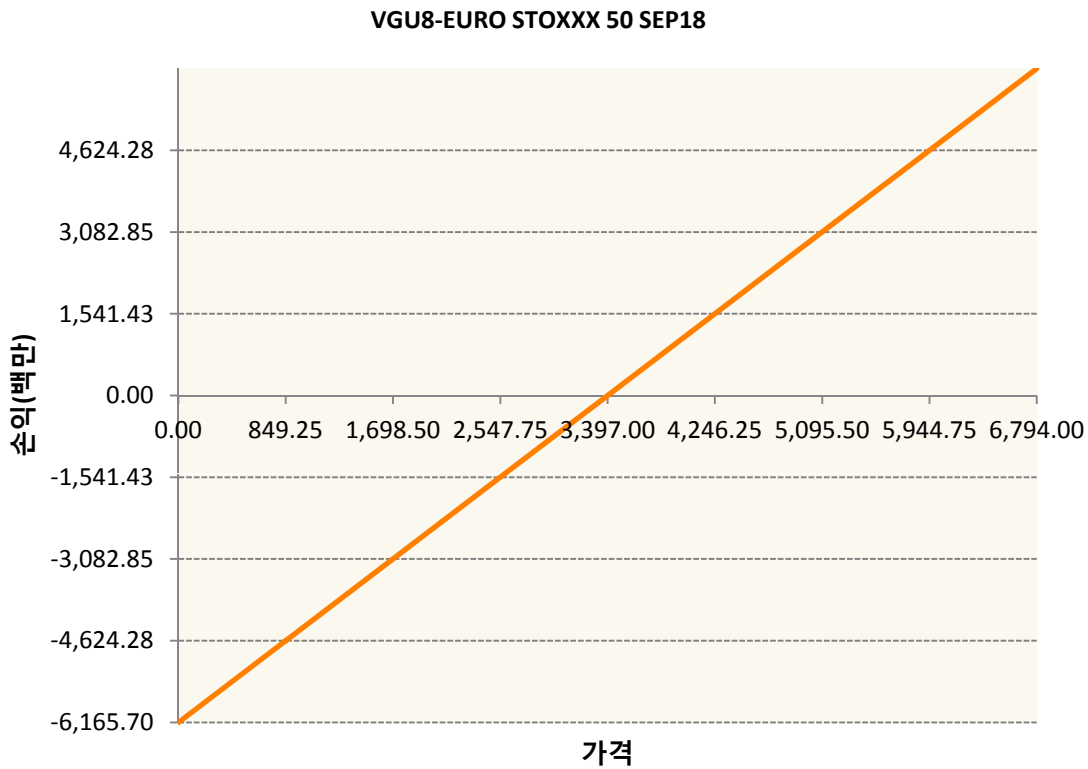
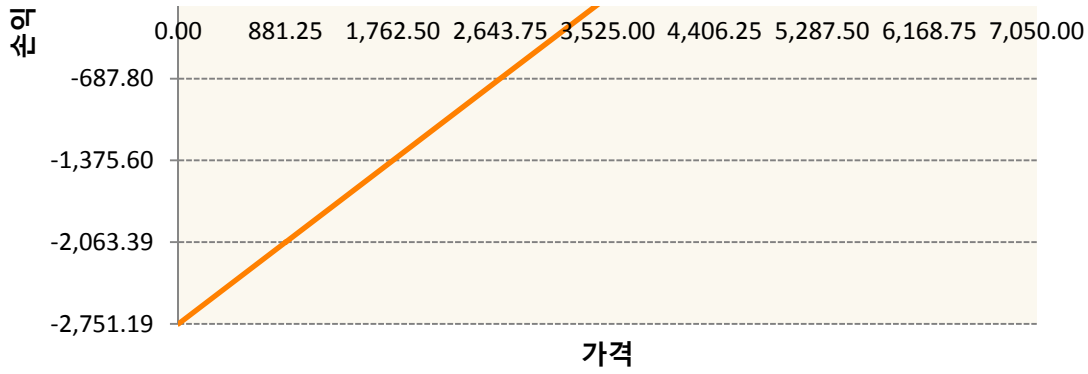


OESXN8-P3500-EURO STOXX 50



OESXN8-P3525-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		31
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY		26
OESXN8-C3! EURO STOXX 50		870
OESXN8-C3! EURO STOXX 50		220
OESXN8-P3! EURO STOXX 50		870
OESXN8-P3! EURO STOXX 50		220
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18		493

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

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

(단위:백만원)

1,134

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

(단위:백만원)

88

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

(단위:백만원)

132

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

(단위:백만원)

171

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-07-05
기준일	2018-07-04

리디파인K200(주식혼합-파생재간

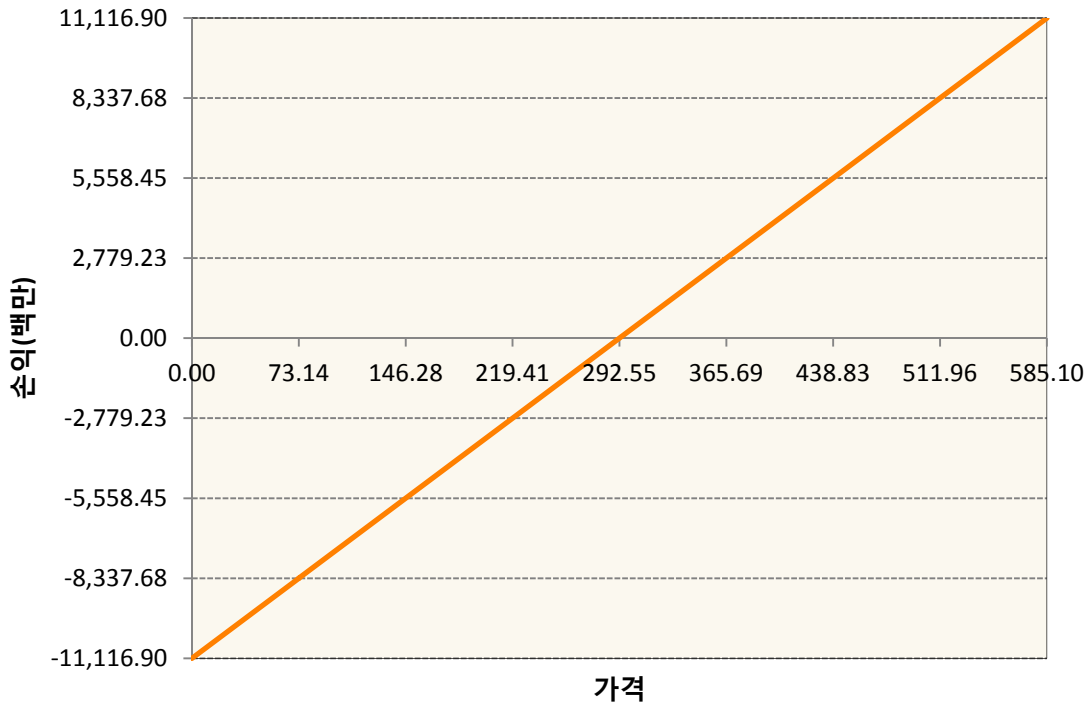
1. 계약금액

(단위:백만원)

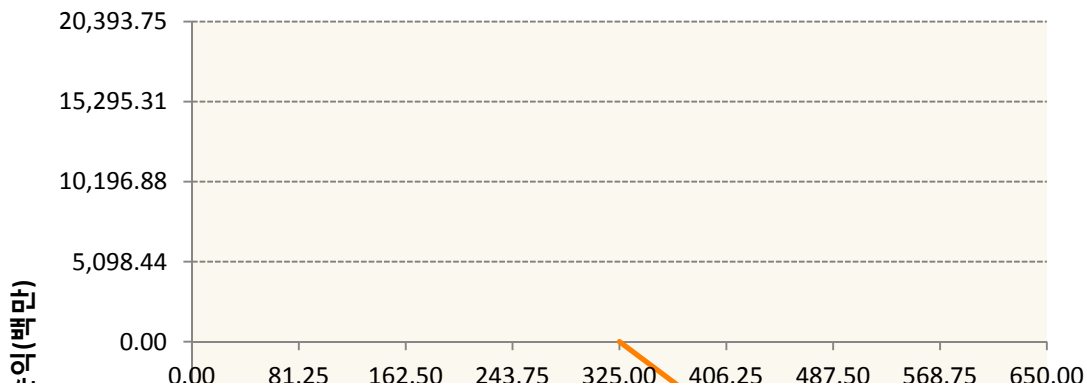
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,117	0	11,117	장내
누계	유가증권	옵션	1,550	20,394	-18,844	장내

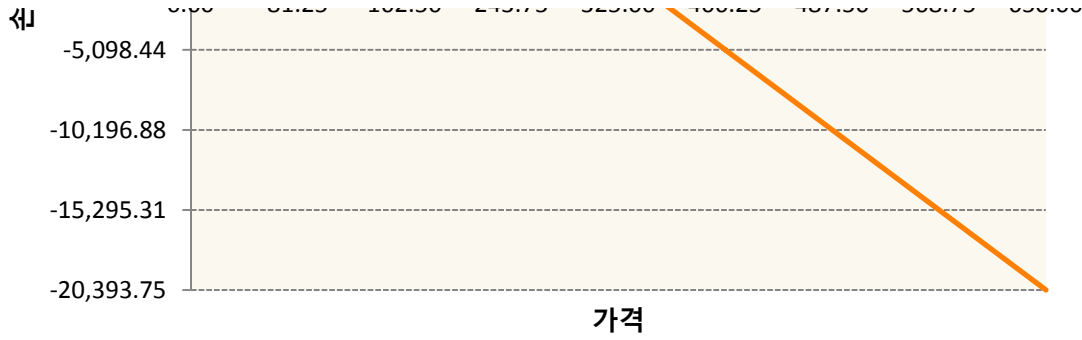
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

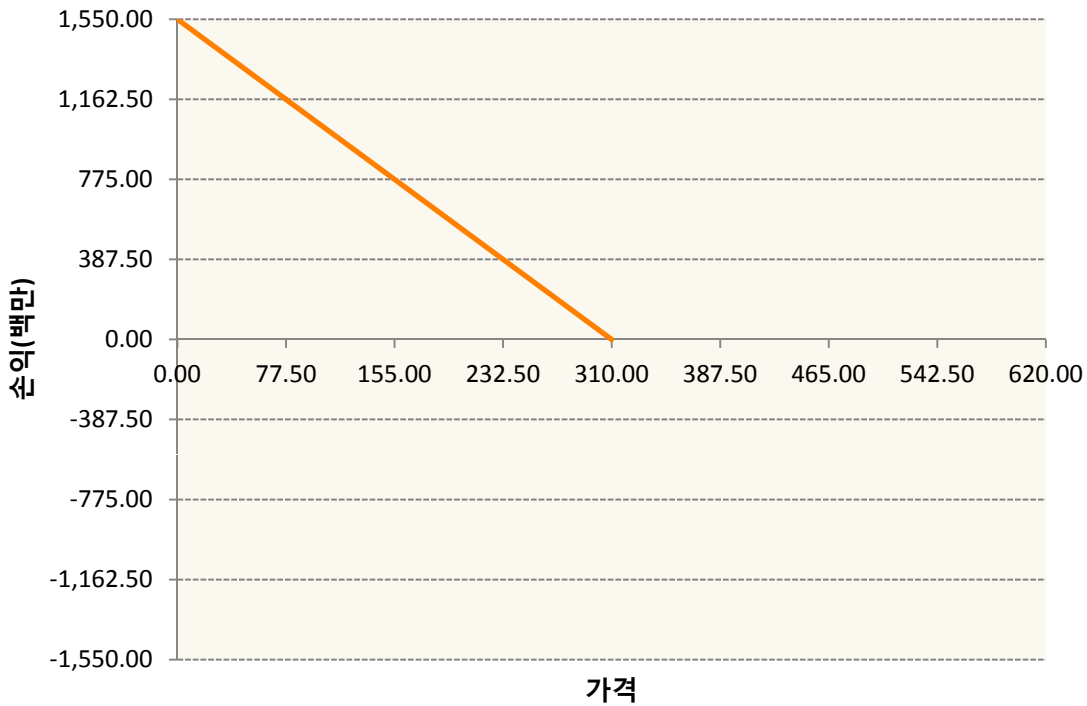


KR4201N73257-2018-07 콜325





KR4301N73107-2018-07 풋310



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물							888
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-888	-888	-888	-888	-888	-888	-888
-5.33%	-592	-592	-592	-592	-592	-592	-592
-2.67%	-296	-296	-296	-296	-296	-296	-296
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	296	296	296	296	296	296	296
5.33%	592	592	592	592	592	592	592
8.00%	888	888	888	888	888	888	888
KR4201N732 2018-07 콜325							223
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3	3	3	3	3	3	3
-5.33%	3	3	3	3	3	3	2
-2.67%	3	3	3	3	2	1	-1
0%	3	3	2	0	-3	-6	-11
2.67%	1	-2	-6	-12	-19	-29	-39
5.33%	-14	-24	-36	-50	-67	-84	-103
8.00%	-74	-96	-120	-144	-170	-196	-223

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	0	1
2.67%	-38	-38	-38	-37	-36	-35	-35
5.33%	-70	-69	-68	-66	-65	-64	-62
8.00%	-86	-85	-84	-83	-81	-80	-79

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

(단위:백만원)

850

공시일	2018-07-05
기준일	2018-07-04

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

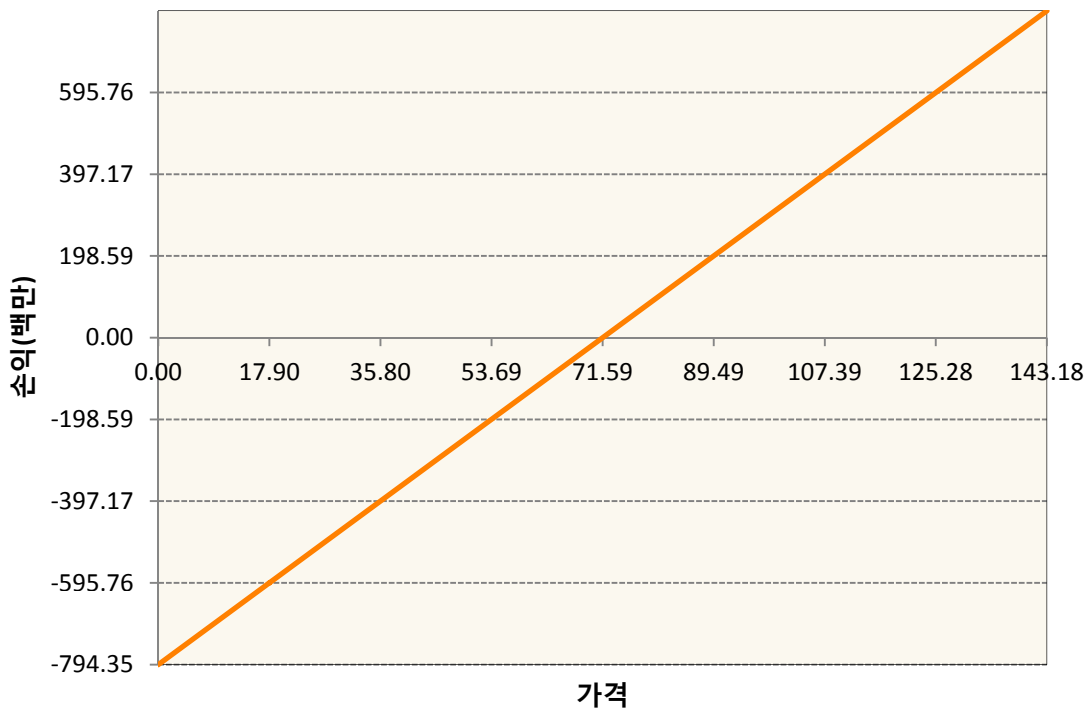
1. 계약금액

(단위:백만원)

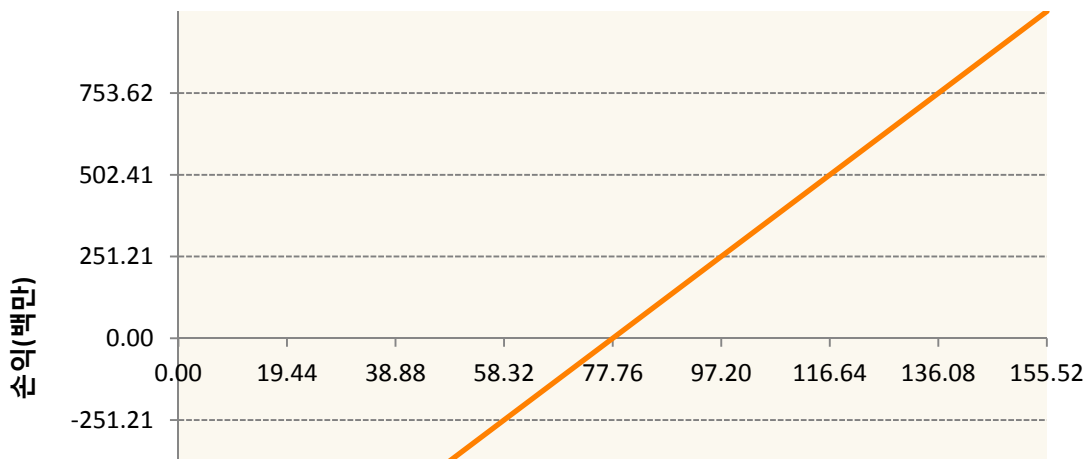
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,804	613	3,190	

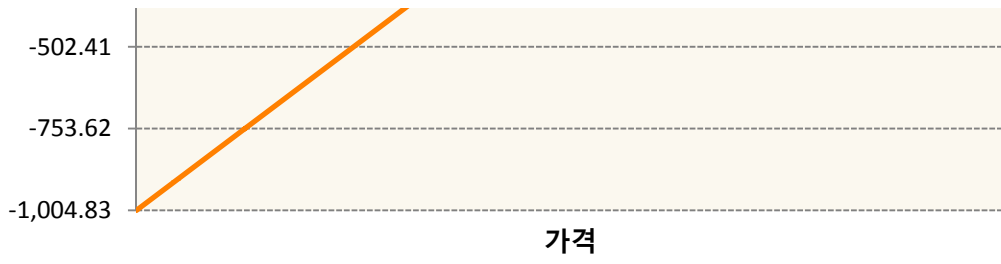
2. 만기시점의 손익구조

CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18

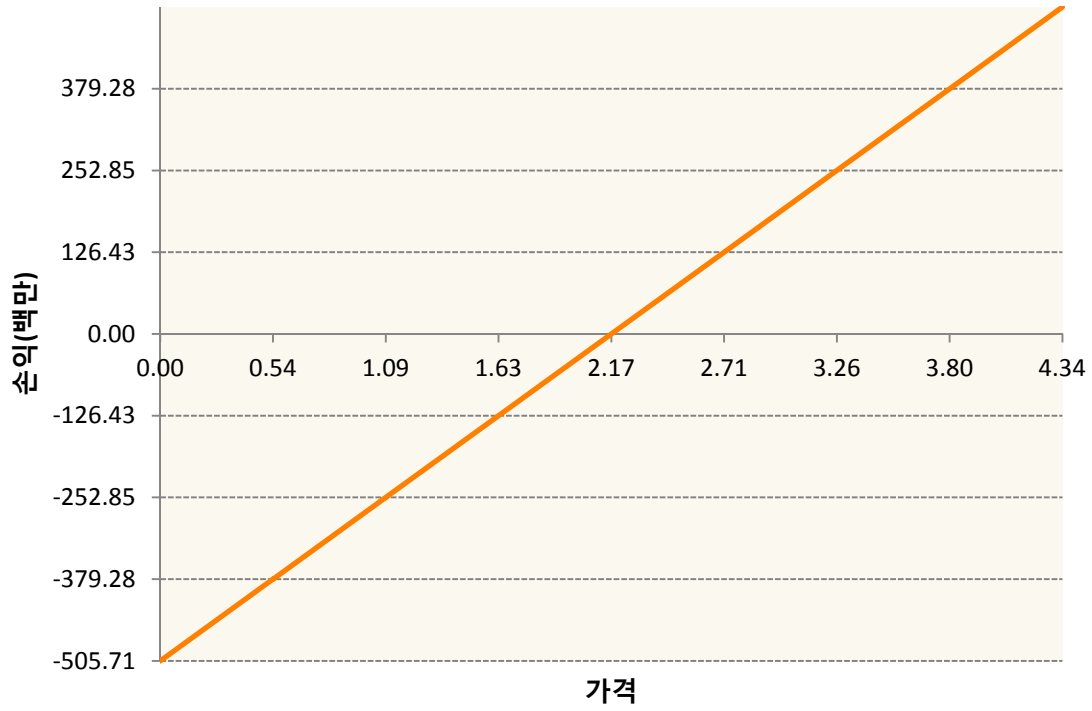


COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18

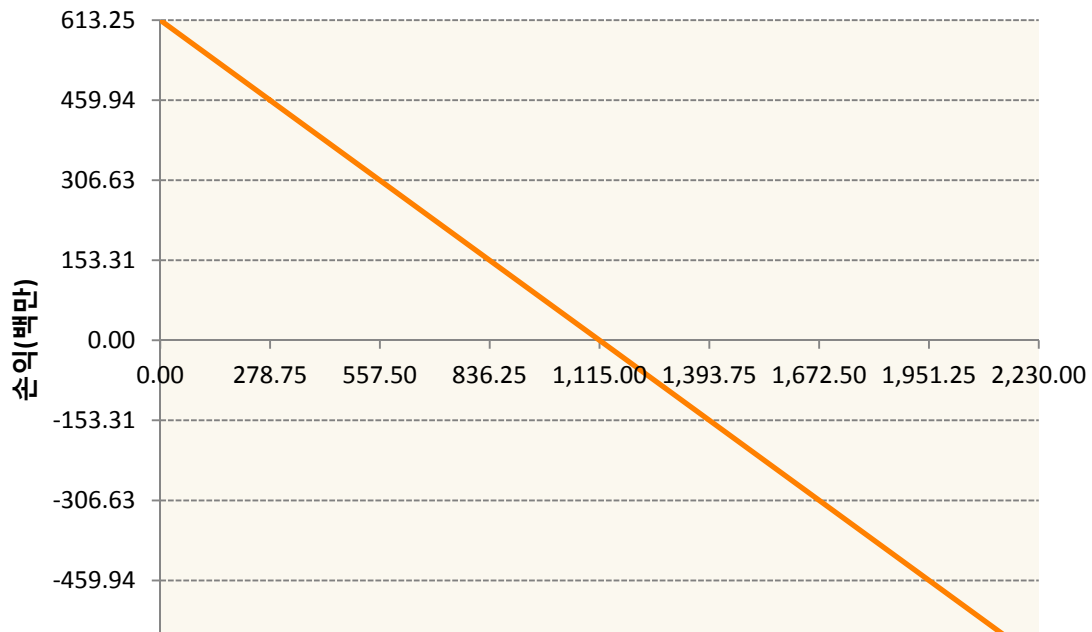


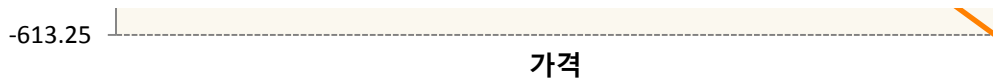


HOU8-NY Harb ULSD Fut SEP18

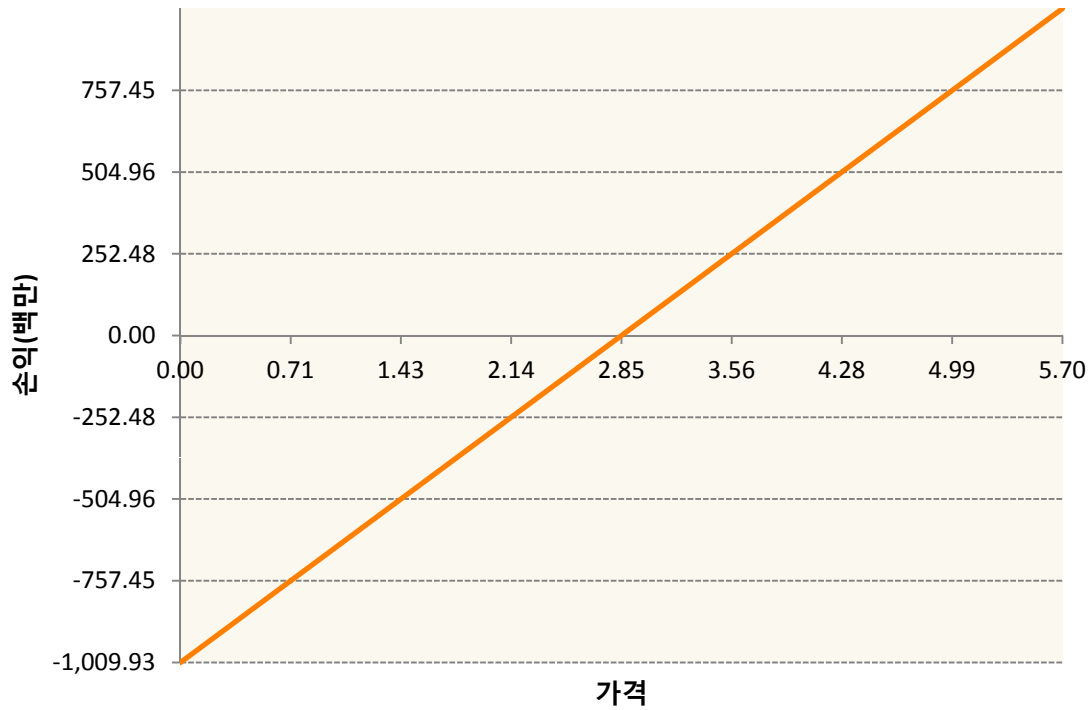


KR4175N70002-2018-07 달러선물

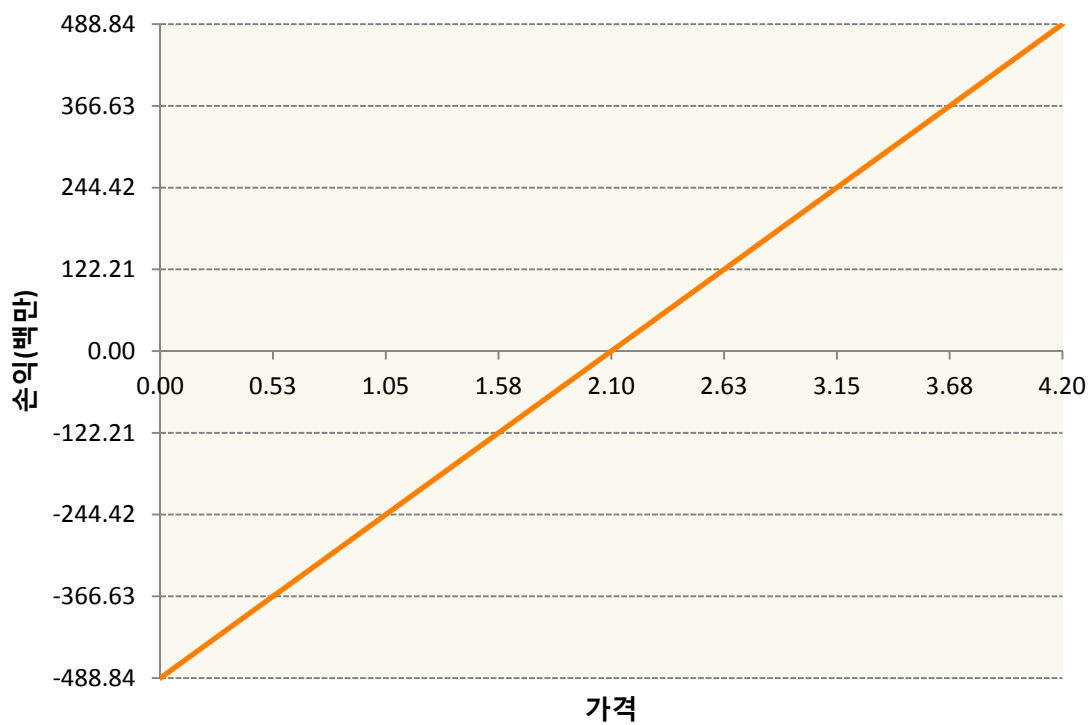




NGU18-NATURAL GAS FUTR SEP18



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	2018-07-05
기준일	2018-07-04

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

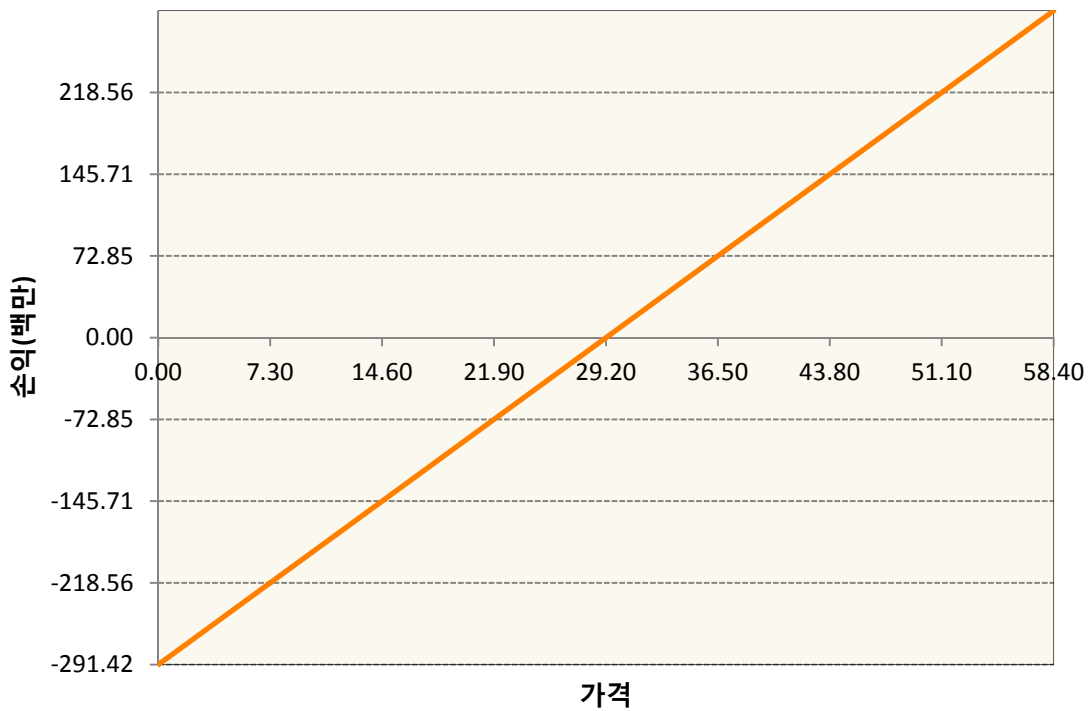
1. 계약금액

(단위:백만원)

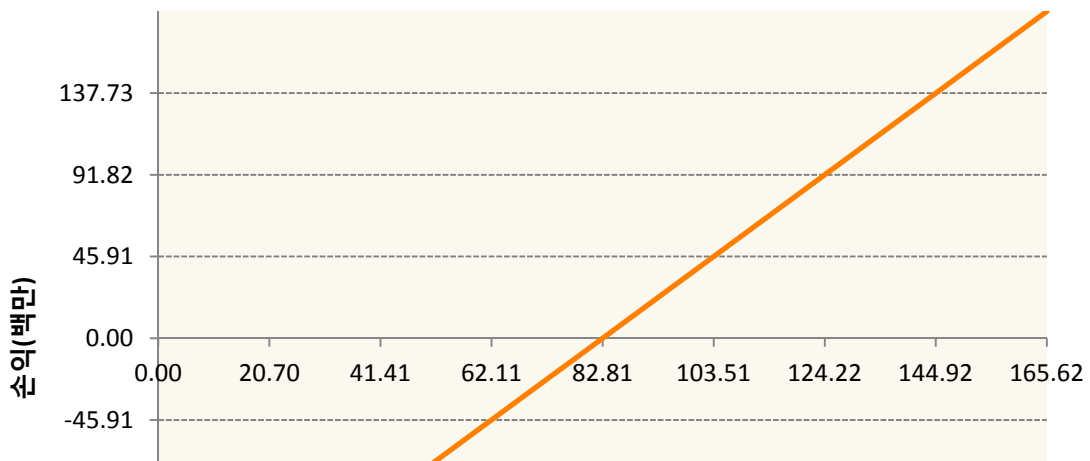
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,620	78	3,542	

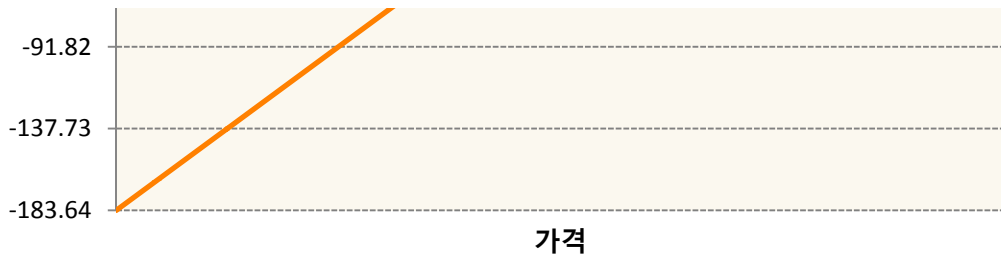
2. 만기시점의 손익구조

BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18

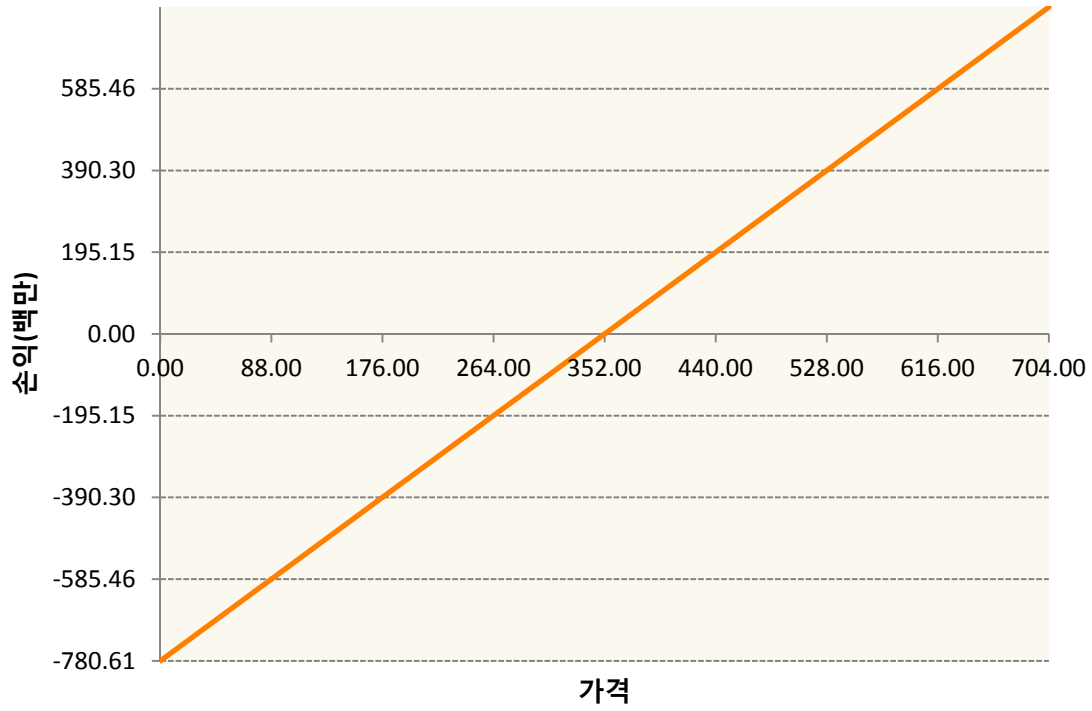


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

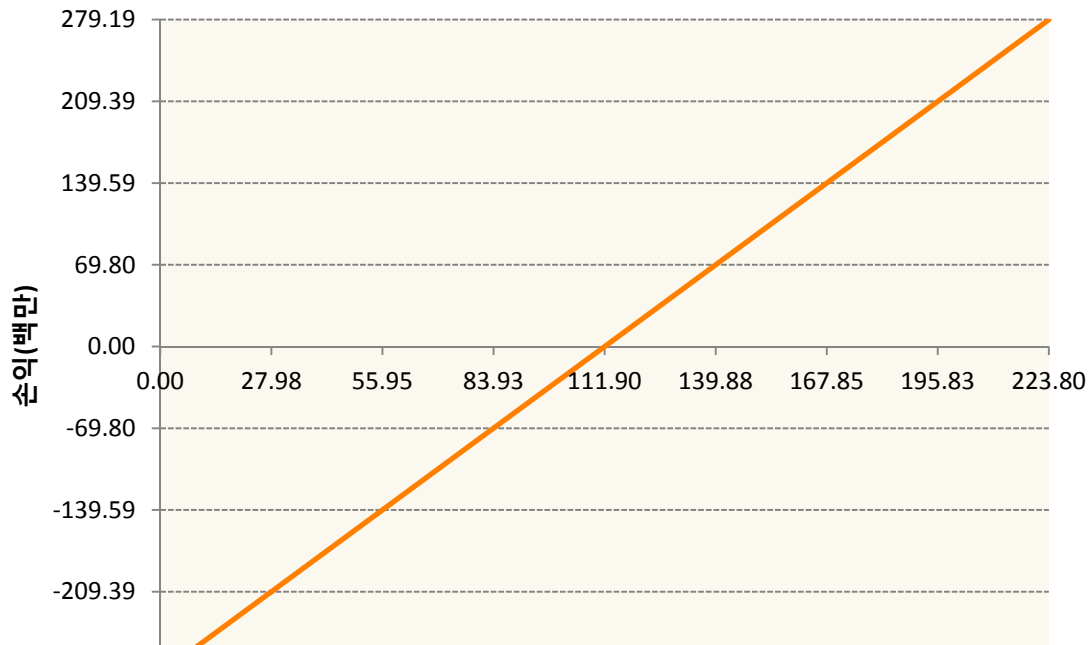


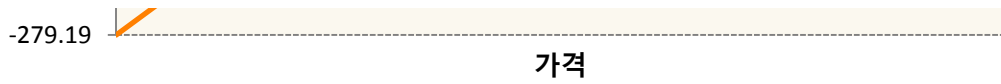


CU8-CORN FUTURE SEP18



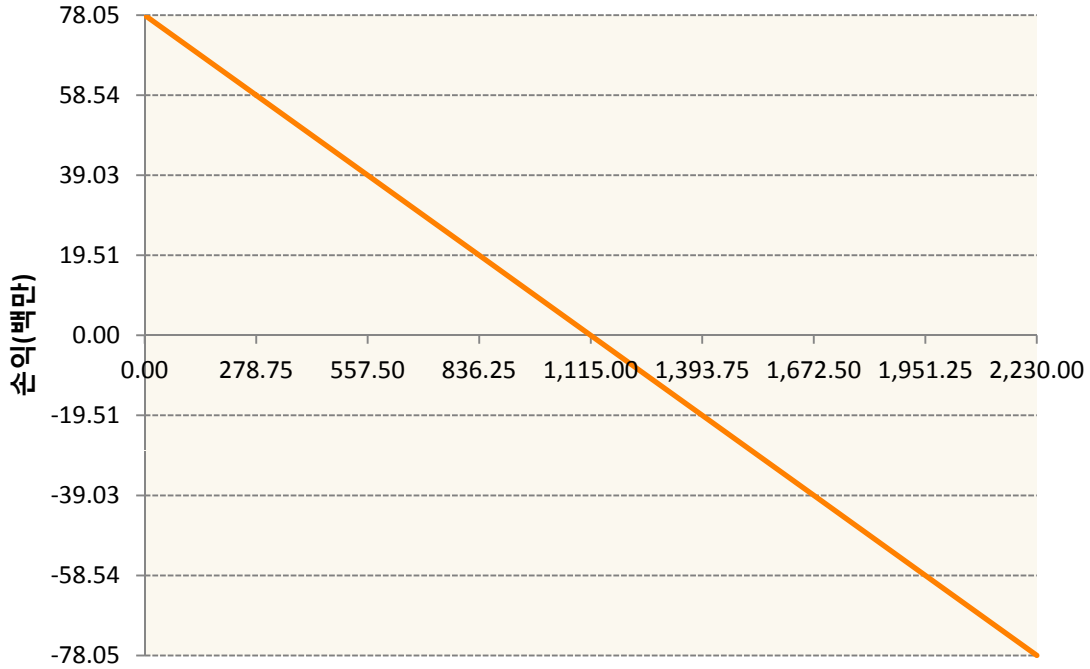
KCU8-COFFEE 'C' FUTURE SEP18





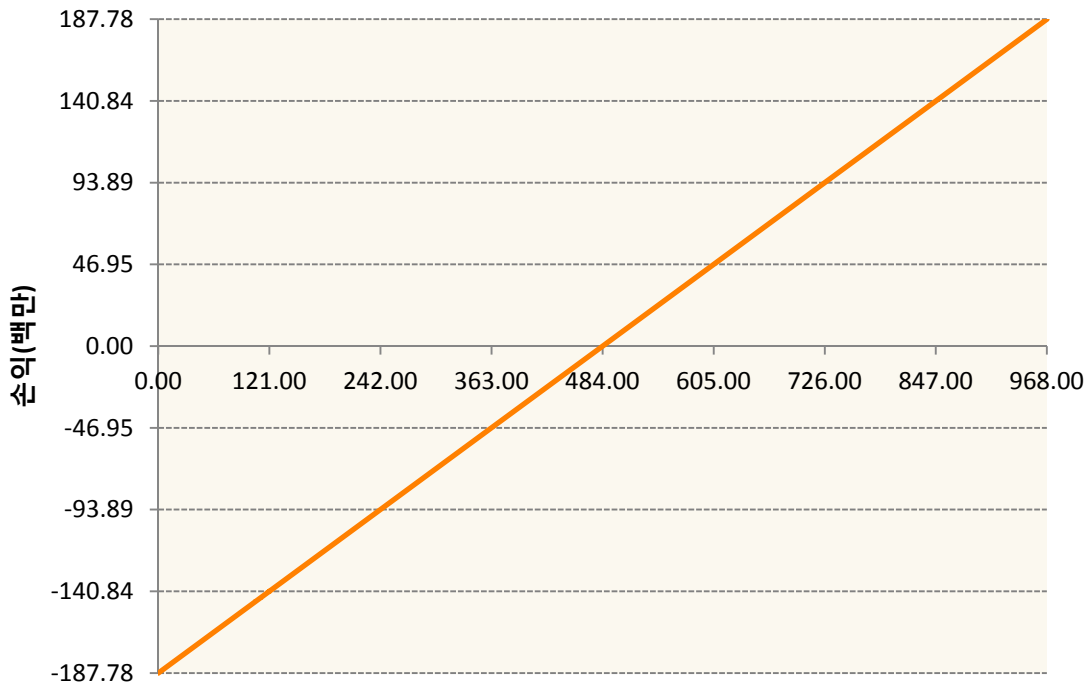
가격

KR4175N70002-2018-07 달러선물



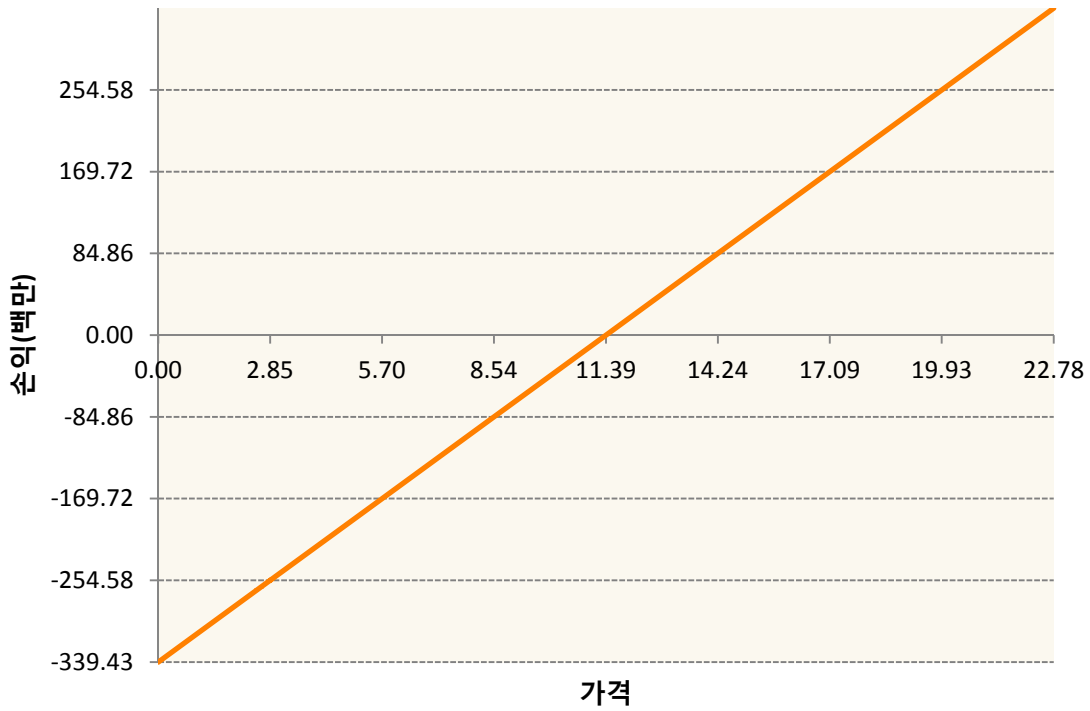
가격

KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18

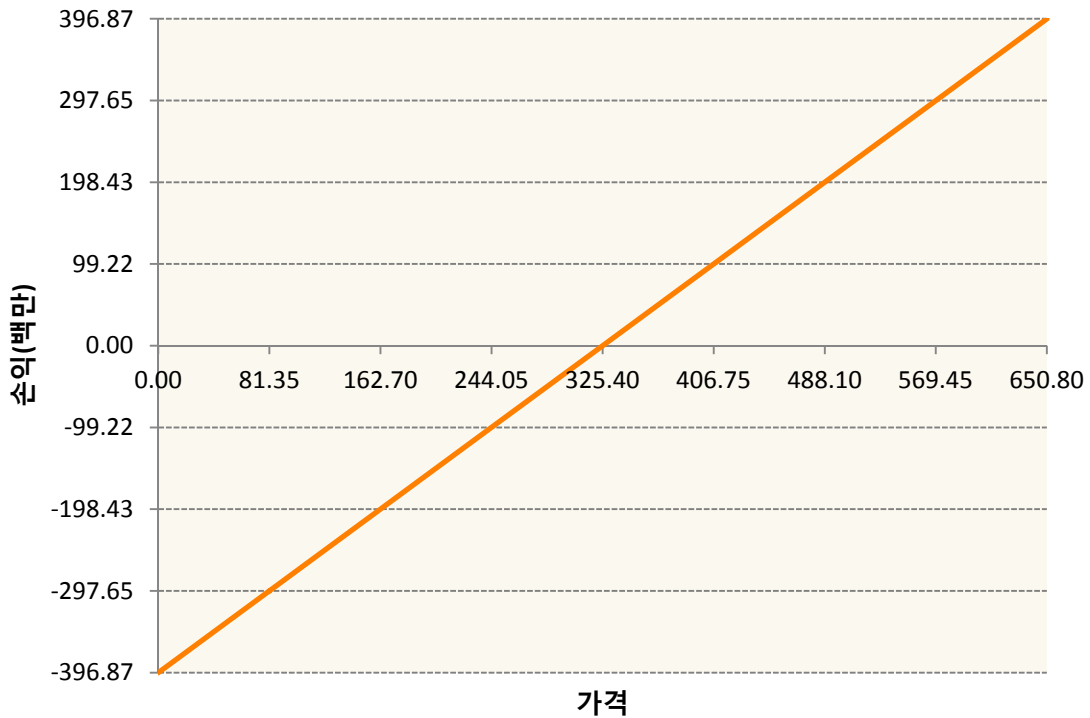


가격

SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

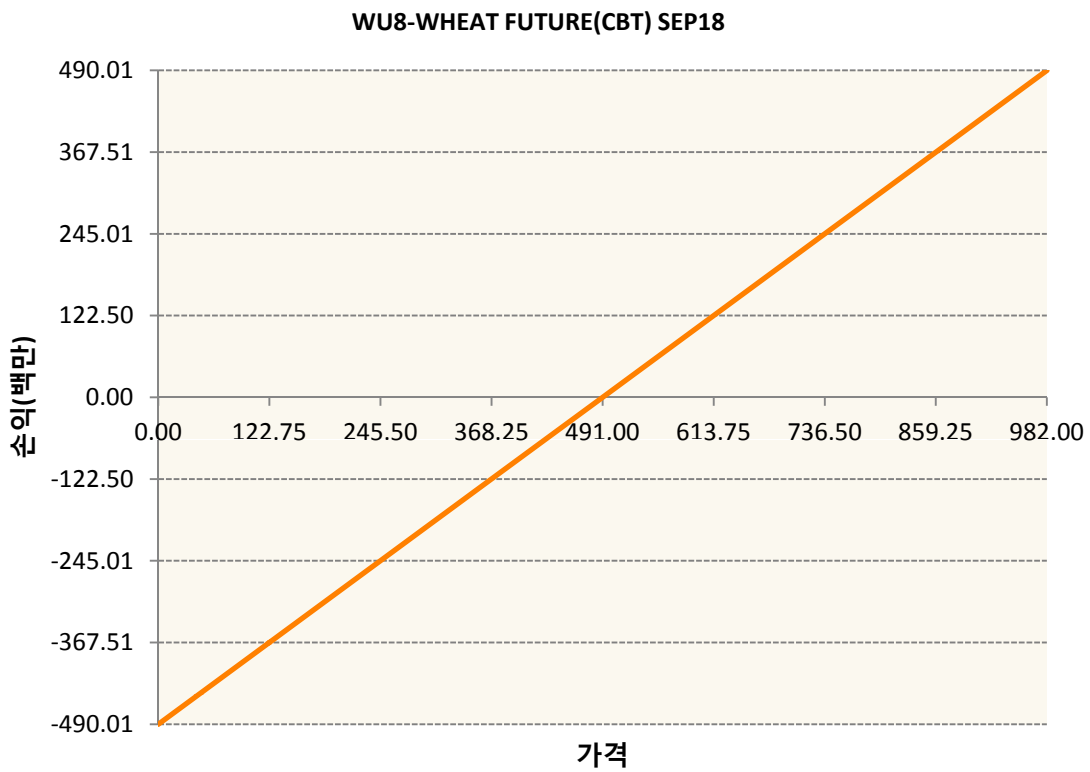
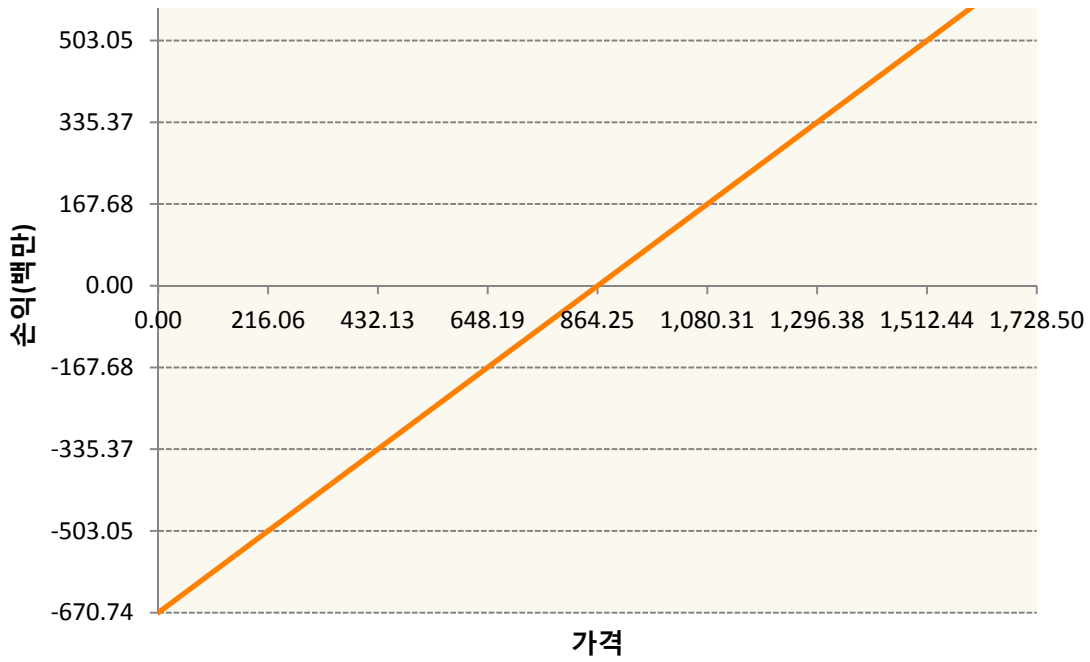


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



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	27
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	32
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	54
WU8	WHEAT FUTURE(CBT) SEP18	39

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

(단위:백만원)

297