

공시일	2018-07-06
기준일	2018-07-05

## 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)

70

공시일	2018-07-06
기준일	2018-07-05

## 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	2018-07-06
기준일	2018-07-05

## 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

318
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

379
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-07-06
기준일	2018-07-05

## 유로인덱스모(주식-파생형)

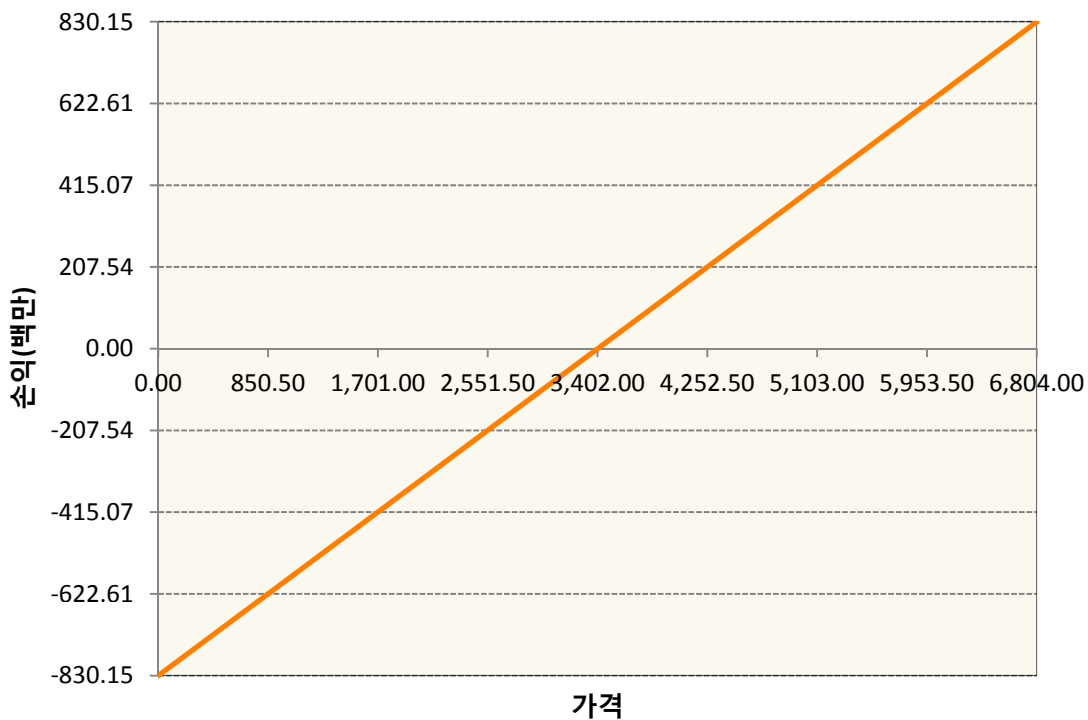
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	830	0	830	

### 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	2018-07-06
기준일	2018-07-05

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

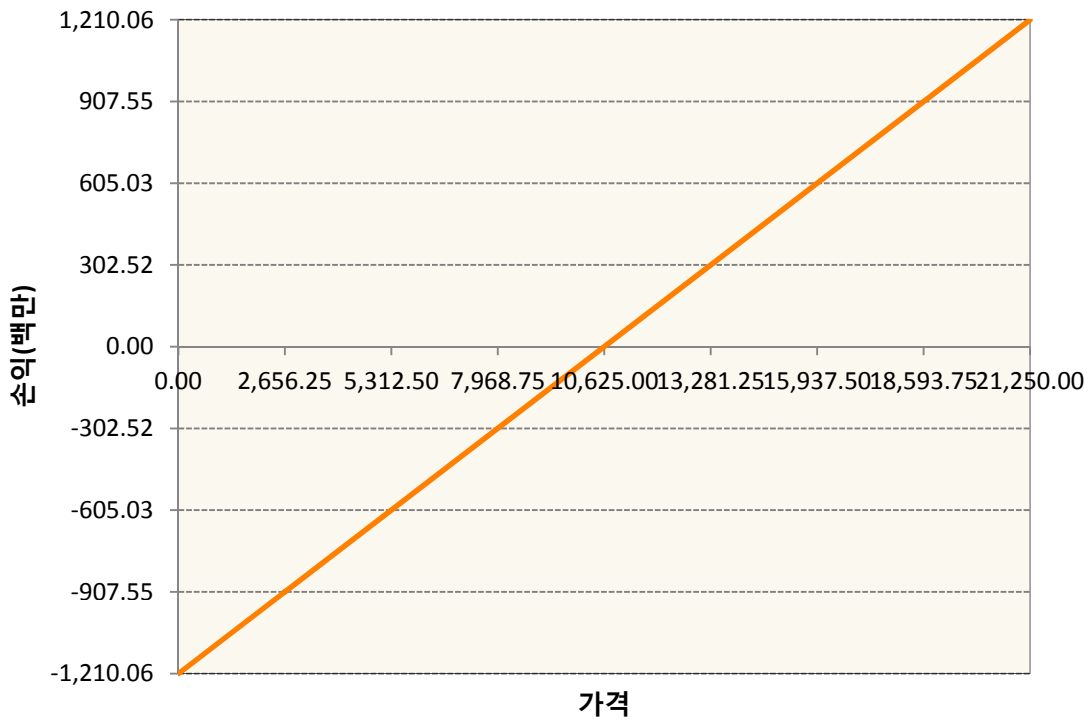
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

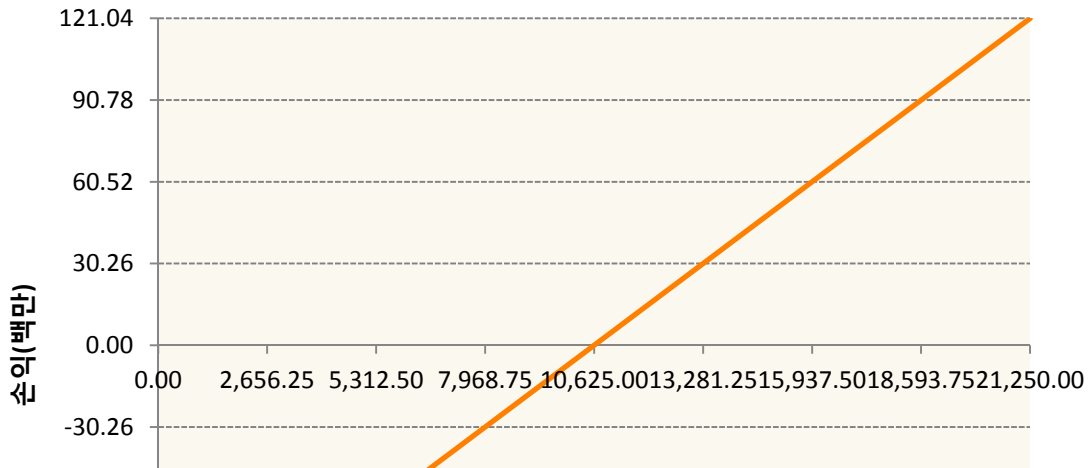
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,331	0	1,331	장내

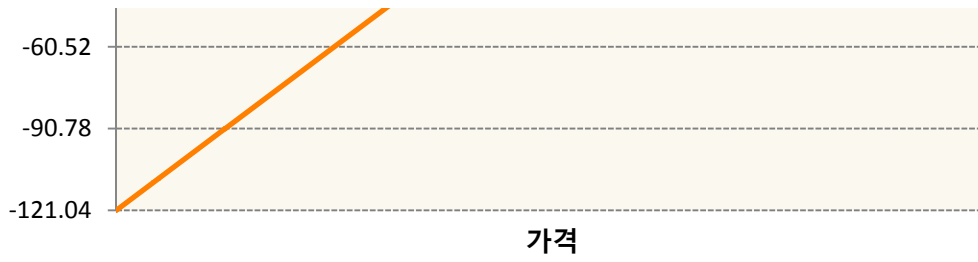
### 2. 만기시점의 손익구조

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)

<b>96</b>
-----------

공시일	2018-07-06
기준일	2018-07-05

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

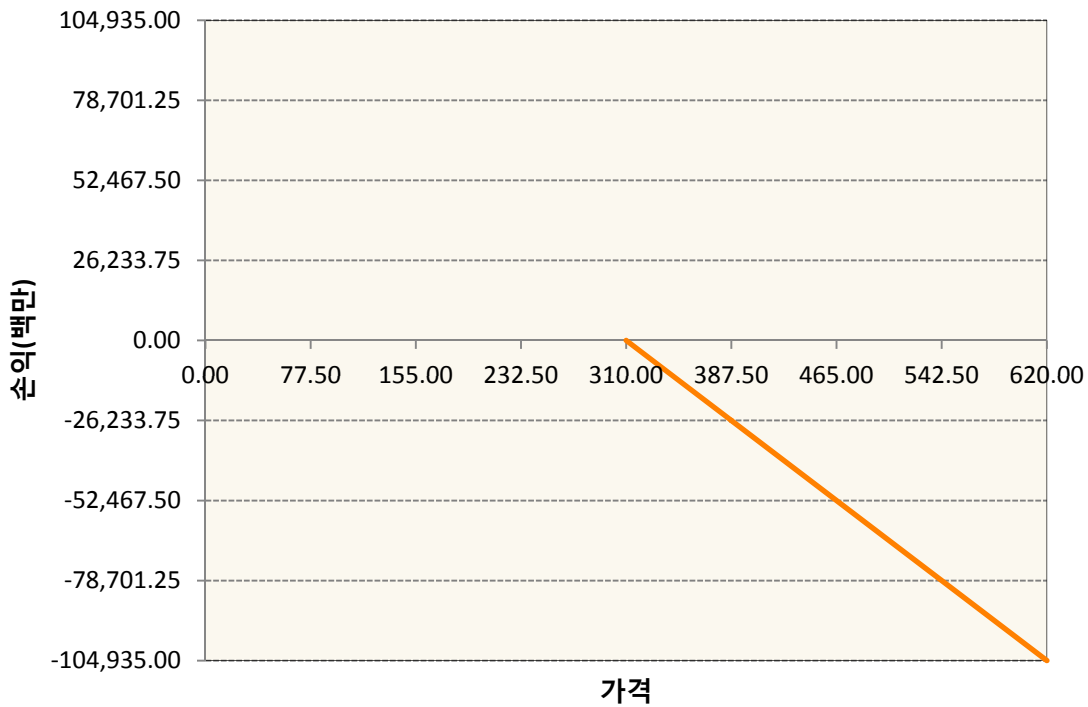
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

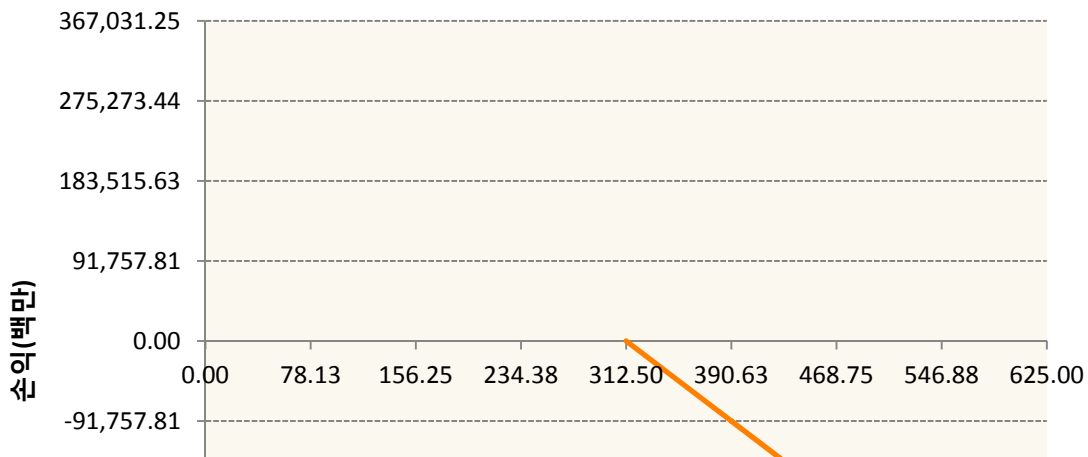
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	766,466	-766,466	장내

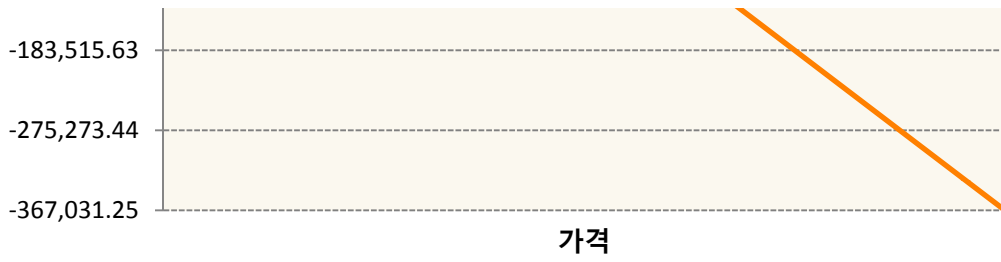
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201N73109-2018-07 콜310**

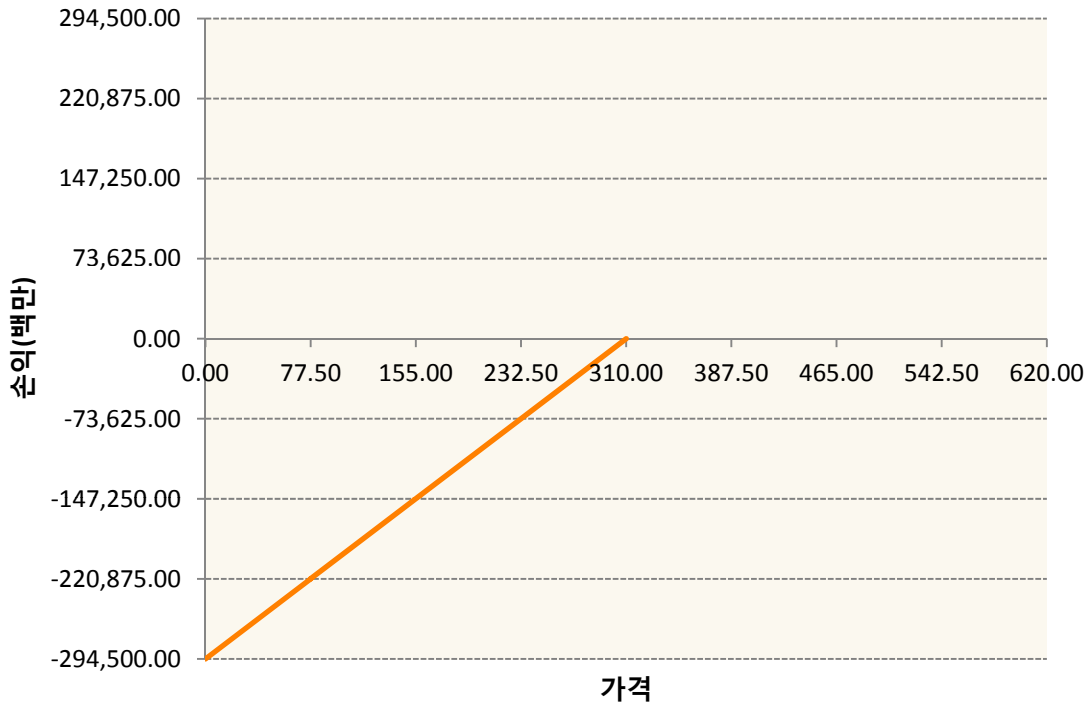


**KR4201N73125-2018-07 콜312.5**





KR4301N73107-2018-07 풋310



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N7312018-07 콜310

3,051

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	153	153	153	153	152	150	147
-5.33%	153	153	151	149	144	136	124
-2.67%	150	145	136	121	100	73	39
0%	116	87	48	0	-57	-123	-196
2.67%	-85	-172	-268	-371	-480	-594	-712
5.33%	-767	-911	-1,056	-1,201	-1,348	-1,494	-1,641
8.00%	-2,208	-2,343	-2,482	-2,622	-2,764	-2,907	-3,051

KR4201N7312018-07 콜312.5

9,077

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	348	348	348	347	346	342	336

-5.33%	348	347	345	339	328	310	281
-2.67%	343	334	315	282	232	162	72
0%	282	218	124	0	-154	-336	-545
2.67%	-149	-382	-650	-949	-1,274	-1,621	-1,986
5.33%	-1,858	-2,316	-2,784	-3,261	-3,744	-4,232	-4,724
8.00%	-5,975	-6,487	-7,002	-7,519	-8,037	-8,557	-9,077

KR4301N7312018-07 풋310

22,139

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,139	-22,139	-22,139	-22,139	-22,139	-22,139	-22,139
-5.33%	-14,754	-14,754	-14,754	-14,754	-14,754	-14,754	-14,754
-2.67%	-7,369	-7,369	-7,369	-7,369	-7,370	-7,372	-7,375
0%	16	14	9	0	-15	-37	-67
2.67%	7,336	7,285	7,217	7,134	7,036	6,925	6,802
5.33%	13,683	13,464	13,242	13,016	12,787	12,557	12,325
8.00%	16,850	16,672	16,483	16,286	16,082	15,872	15,658

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

(단위:백만원)

29,691

공시일	2018-07-06
기준일	2018-07-05

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

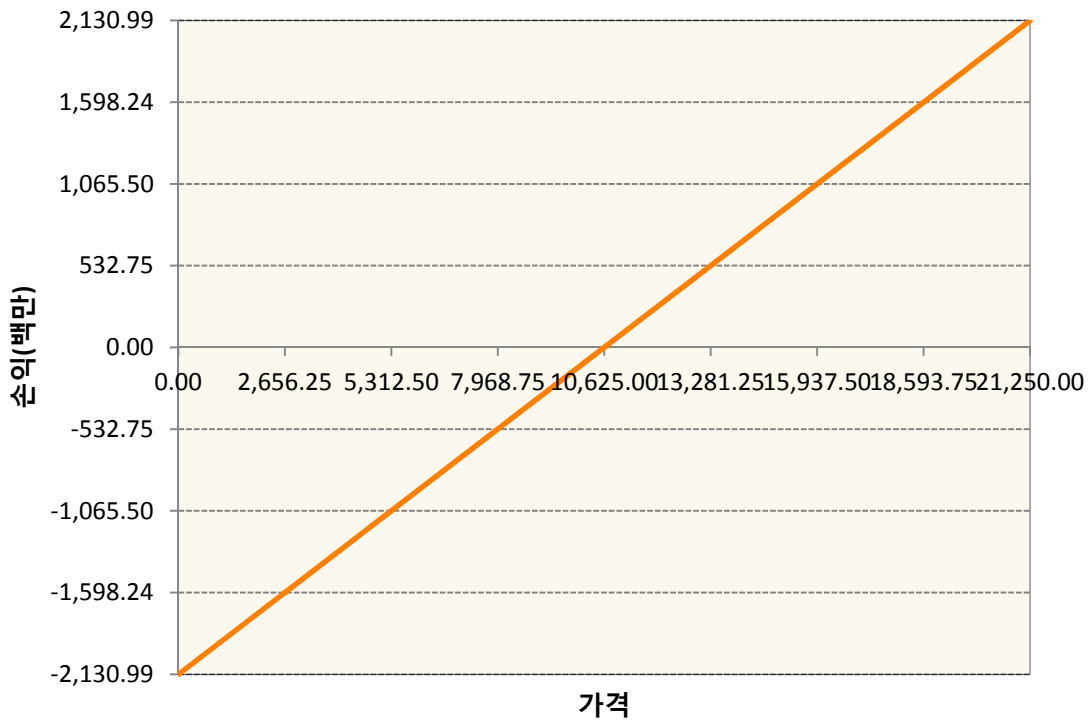
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

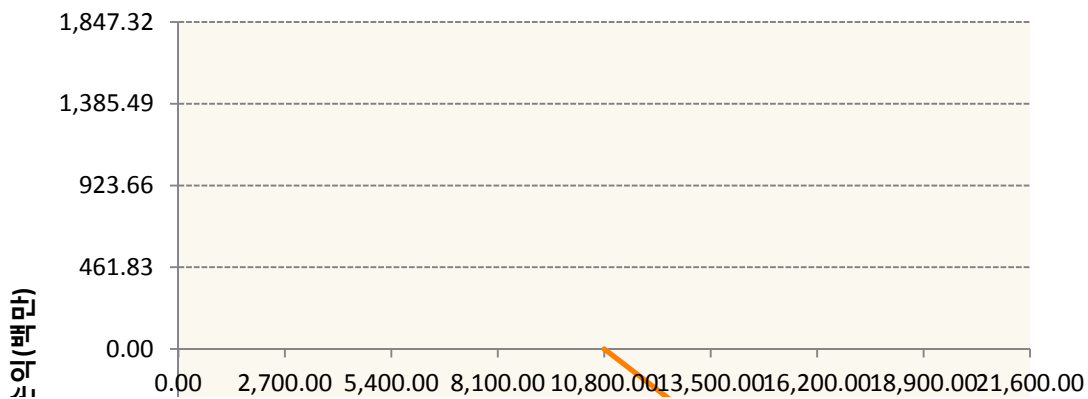
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,131	0	2,131	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,576	-5,576	장내

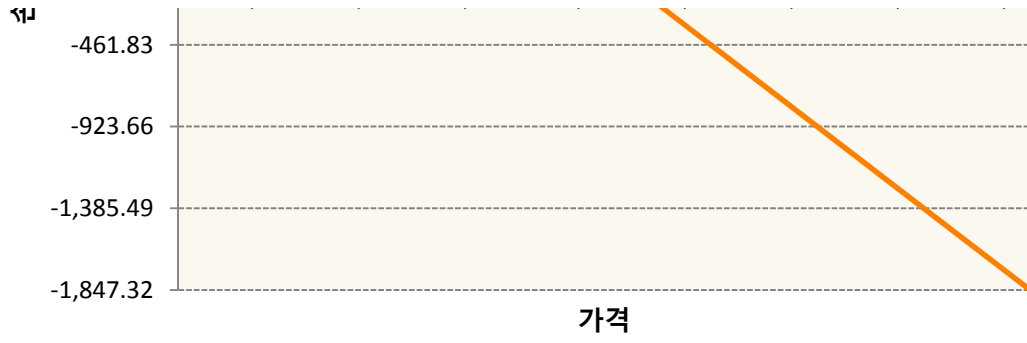
### 2. 만기시점의 손익구조

HCN8-HSCEI Futures Jul18

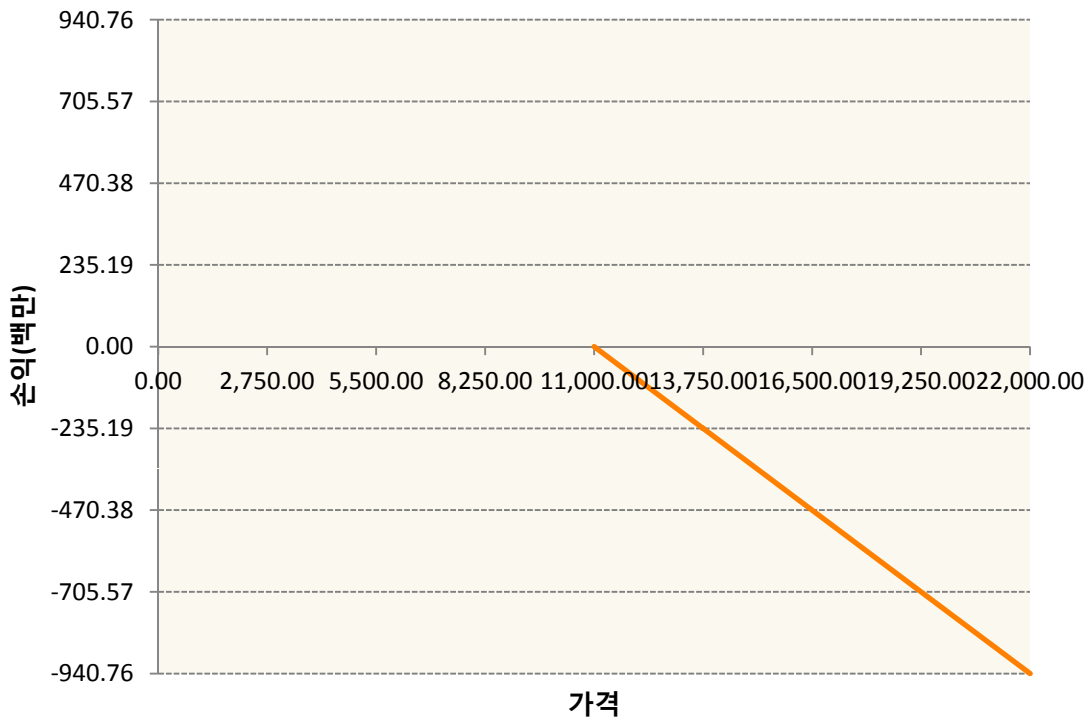


OHHIN8-C108-HSCEI

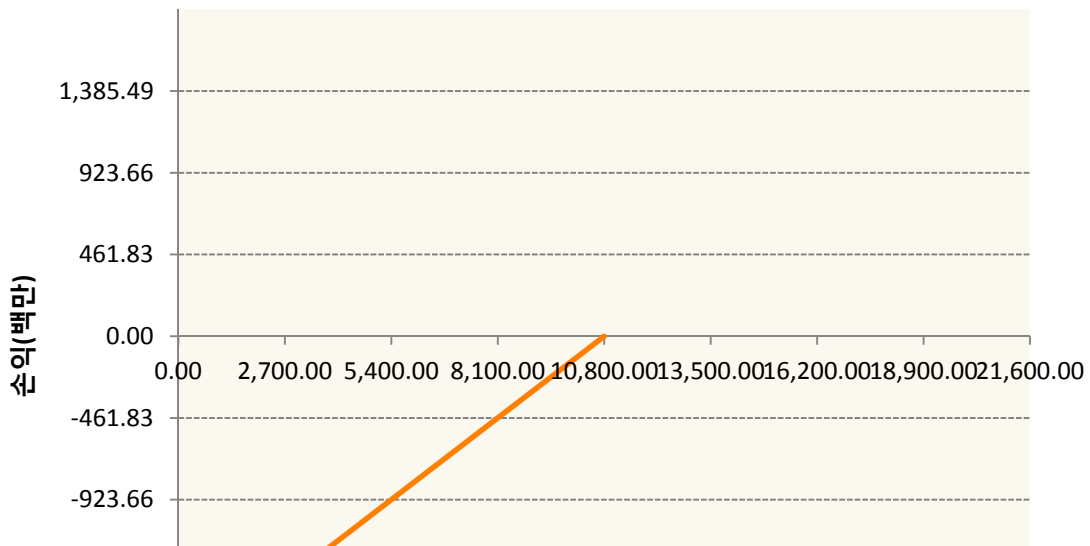


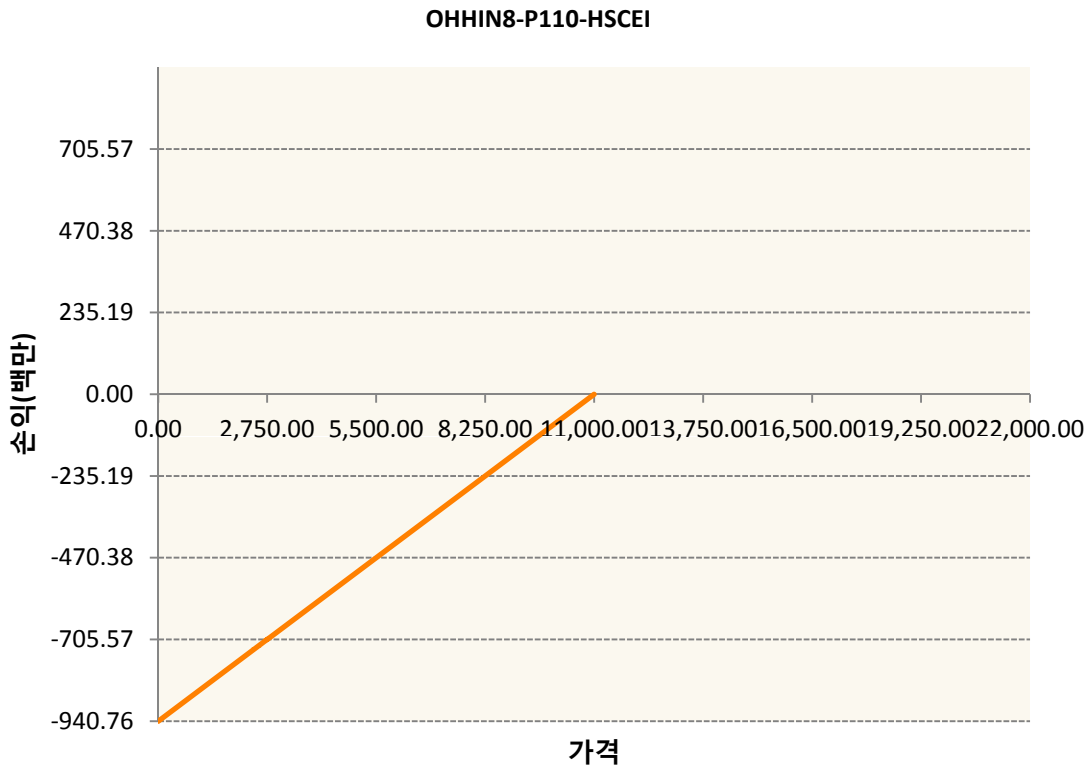
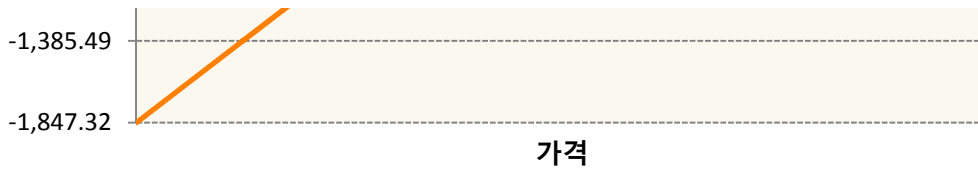


OHHIN8-C110-HSCEI



OHHIN8-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCN8	HSCEI Futures Jul18	170
OHHIN8-C1	(HSCEI	148
OHHIN8-C1	: HSCEI	75
OHHIN8-P1	(HSCEI	148
OHHIN8-P11	HSCEI	75

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	557

공시일	2018-07-06
기준일	2018-07-05

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

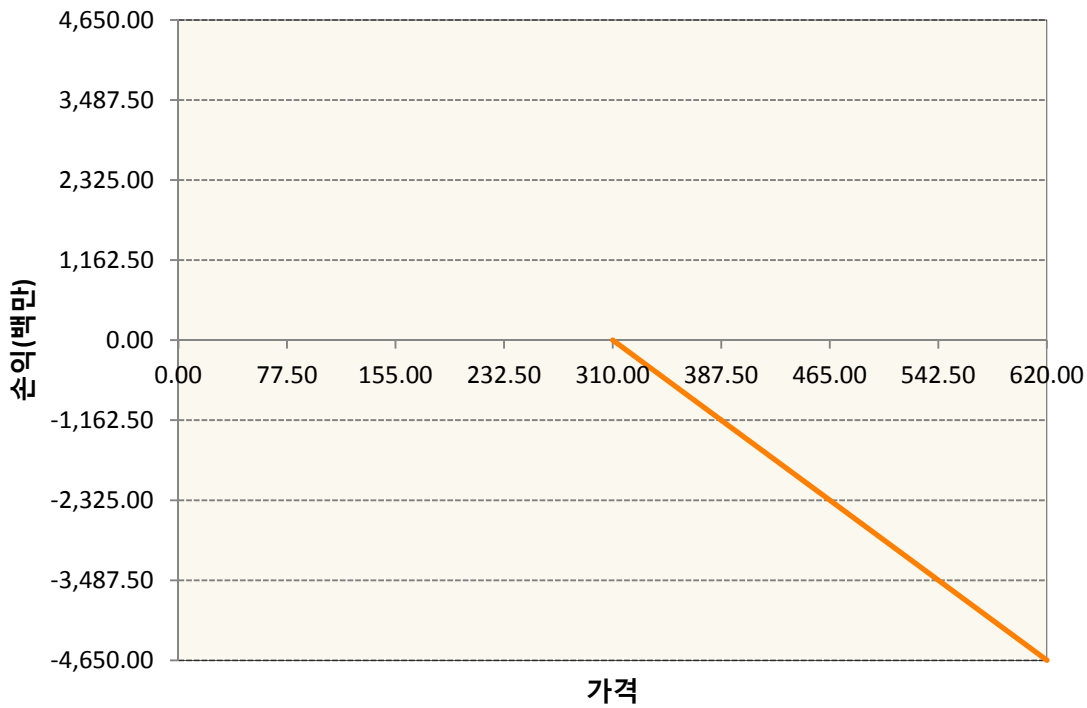
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

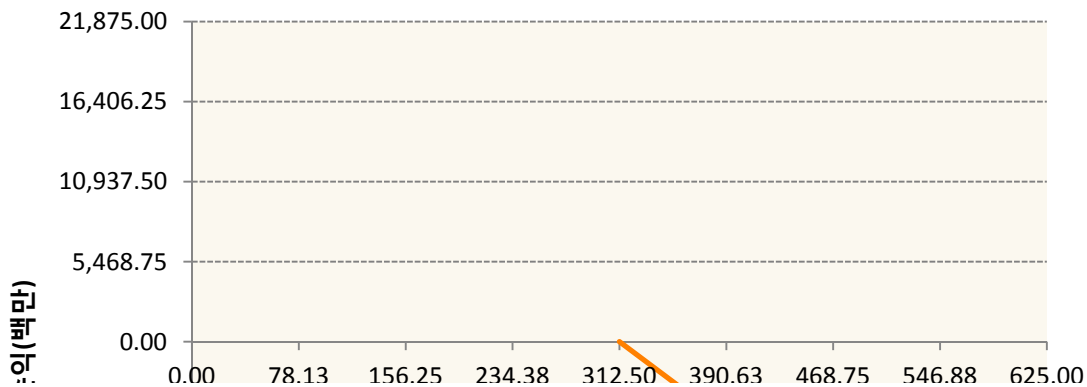
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	45,900	-45,900	장내

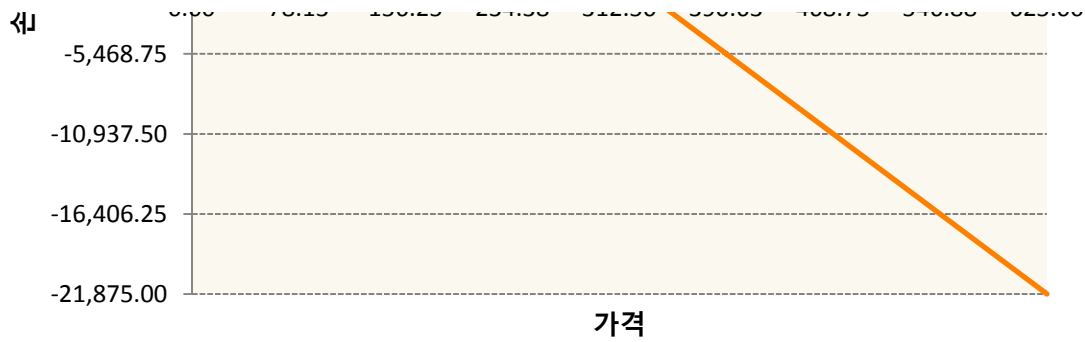
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N73109-2018-07 콜310

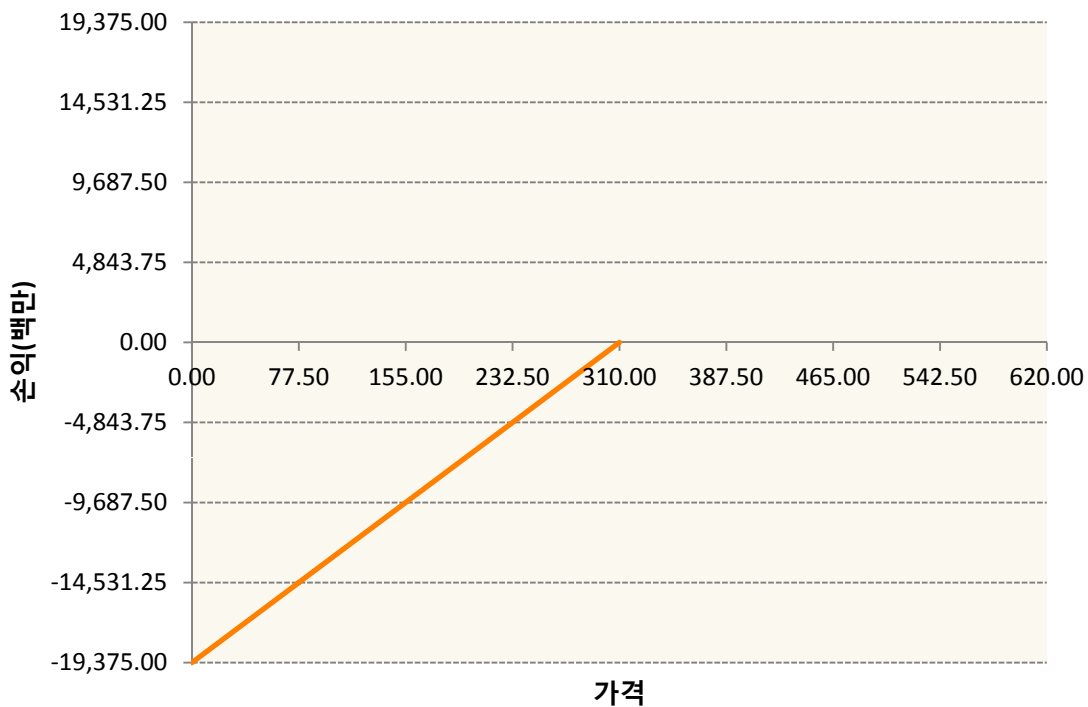


KR4201N73125-2018-07 콜312.5





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%	-499	-499	-500	-500	-500	-499	-500
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	500	500	500	500	499	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 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

135

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7	7	7	7	7	7	7
-5.33%	7	7	7	7	6	6	5
-2.67%	7	6	6	5	4	3	2
0%	5	4	2	0	-3	-5	-9
2.67%	-4	-8	-12	-16	-21	-26	-32
5.33%	-34	-40	-47	-53	-60	-66	-73
8.00%	-98	-104	-110	-116	-122	-129	-135

KR4201N7312018-07 콜312.5

541

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	21	21	21	21	21	20	20
-5.33%	21	21	21	20	20	18	17
-2.67%	20	20	19	17	14	10	4
0%	17	13	7	0	-9	-20	-32
2.67%	-9	-23	-39	-57	-76	-97	-118
5.33%	-111	-138	-166	-194	-223	-252	-282
8.00%	-356	-387	-417	-448	-479	-510	-541

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%	-971	-971	-971	-971	-971	-971	-971
-2.67%	-485	-485	-485	-485	-485	-485	-485
0%	1	1	1	0	-1	-2	-4
2.67%	483	479	475	469	463	456	447
5.33%	900	886	871	856	841	826	811
8.00%	1,109	1,097	1,084	1,071	1,058	1,044	1,030

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

(단위:백만원)

5,780

공시일	2018-07-06
기준일	2018-07-05

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

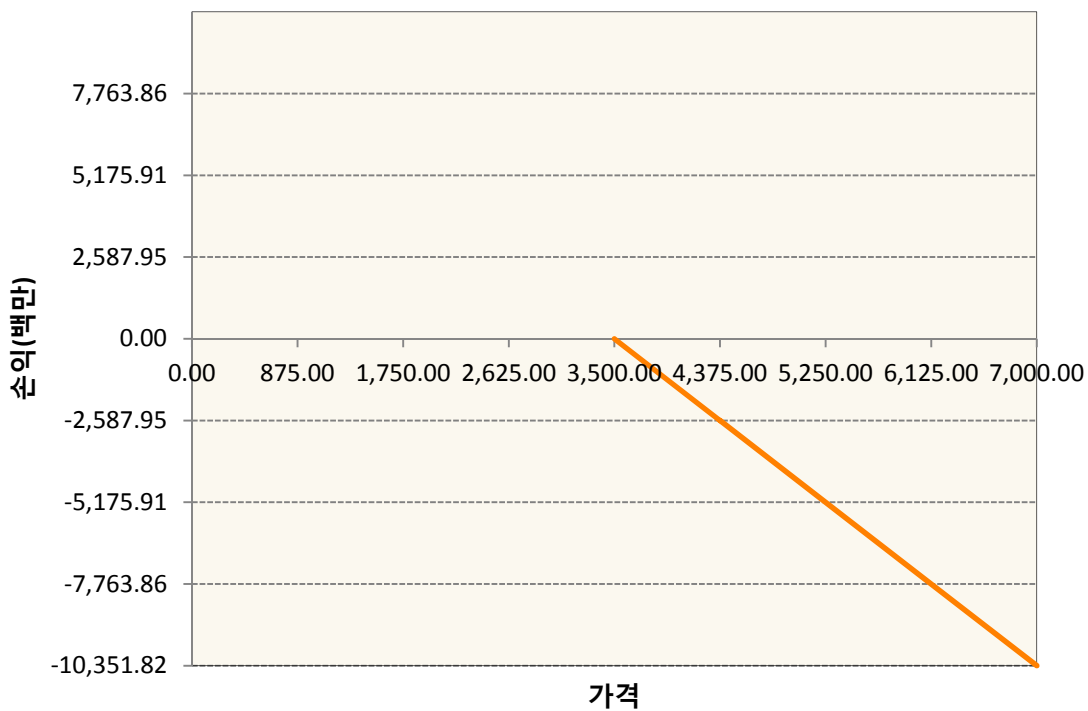
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

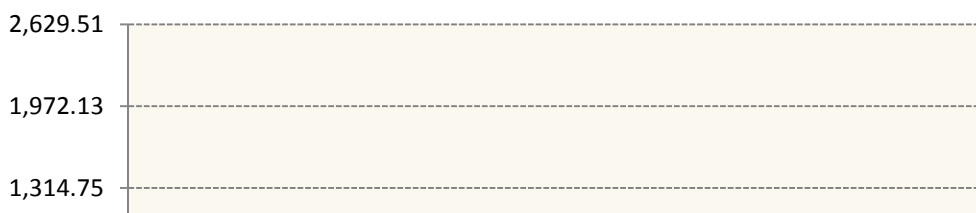
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,479	0	5,479	
누계	유가증권	스왑	44,705	0	44,705	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,963	-25,963	장내
누계	지수	스왑	52,347	0	52,347	장외

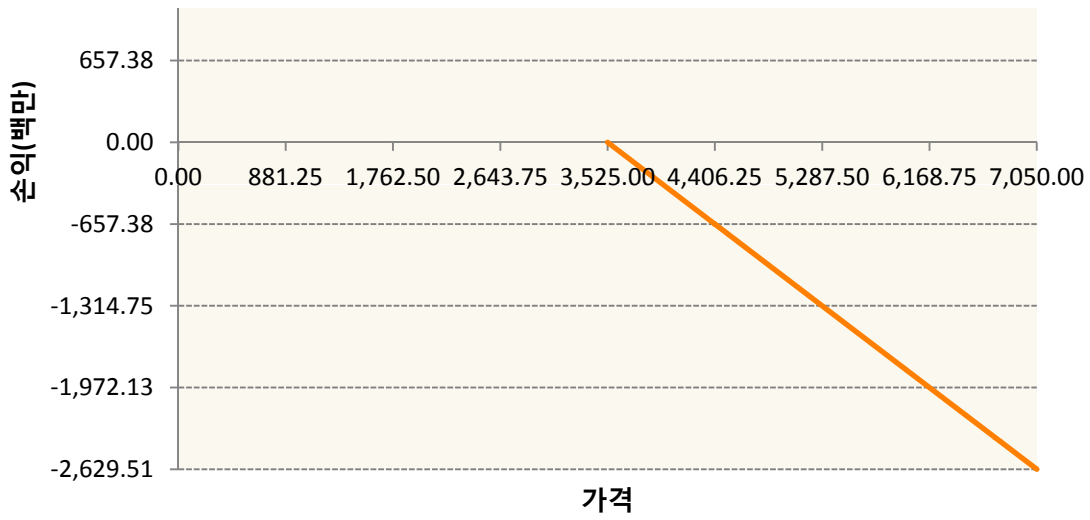
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXN8-C3500-EURO STOXX 50**

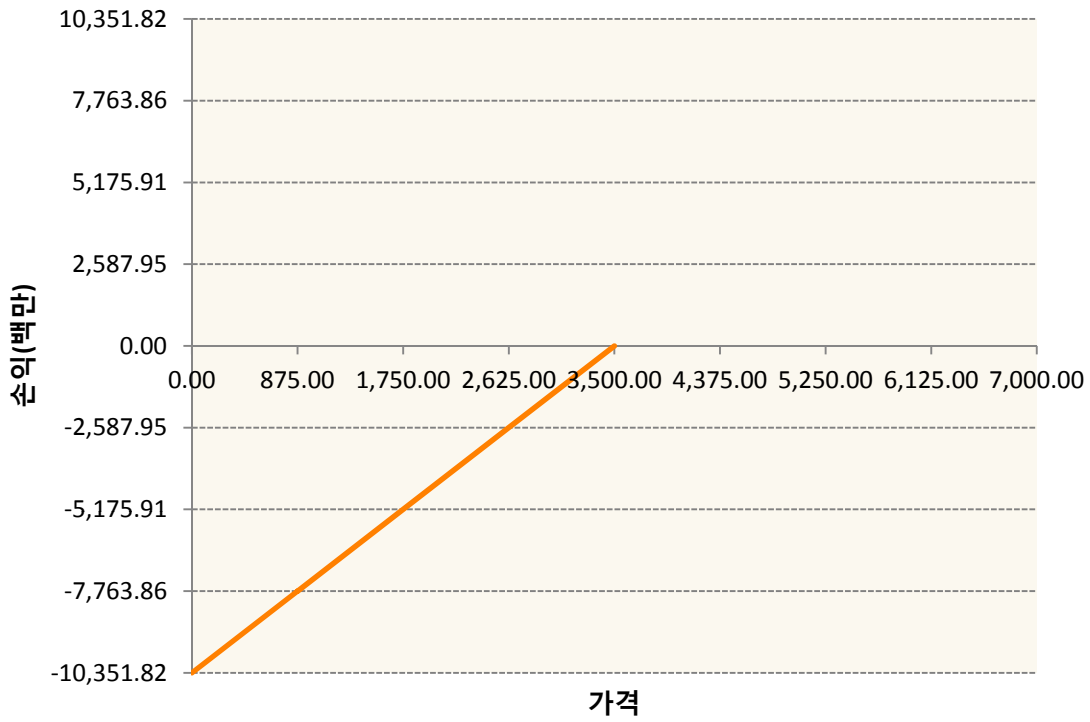


**OESXN8-C3525-EURO STOXX 50**

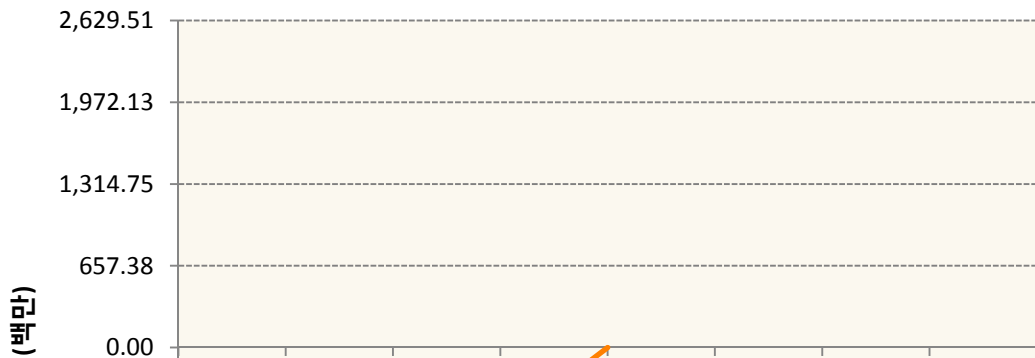


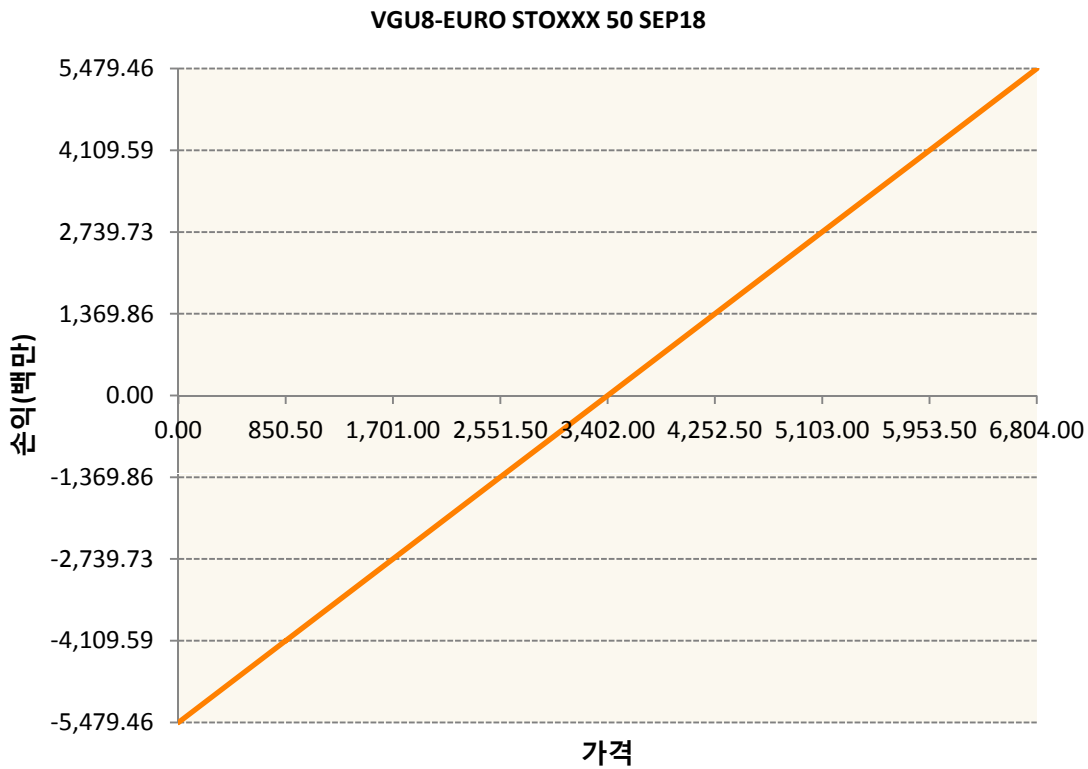
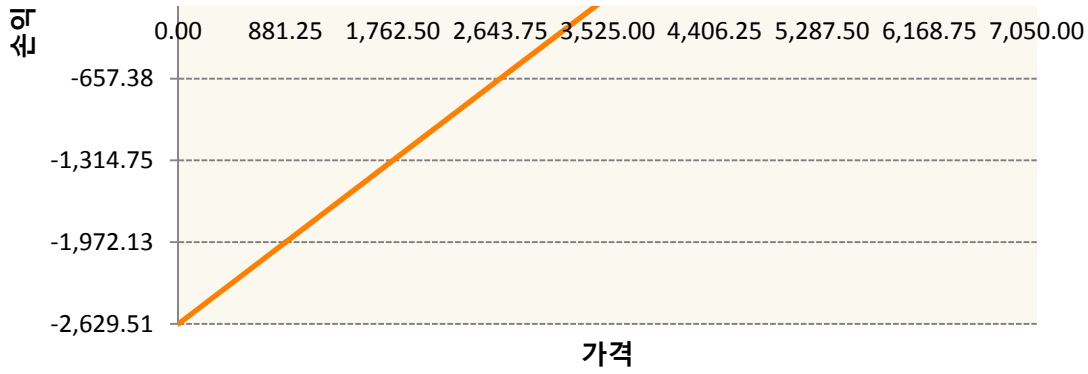


OESXN8-P3500-EURO STOXX 50



OESXN8-P3525-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		23
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY		20
OESXN8-C3! EURO STOXX 50		828
OESXN8-C3! EURO STOXX 50		210
OESXN8-P3! EURO STOXX 50		828
OESXN8-P3! EURO STOXX 50		210
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18		438

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





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

(단위:백만원)

1,132



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)

170



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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-07-06
기준일	2018-07-05

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

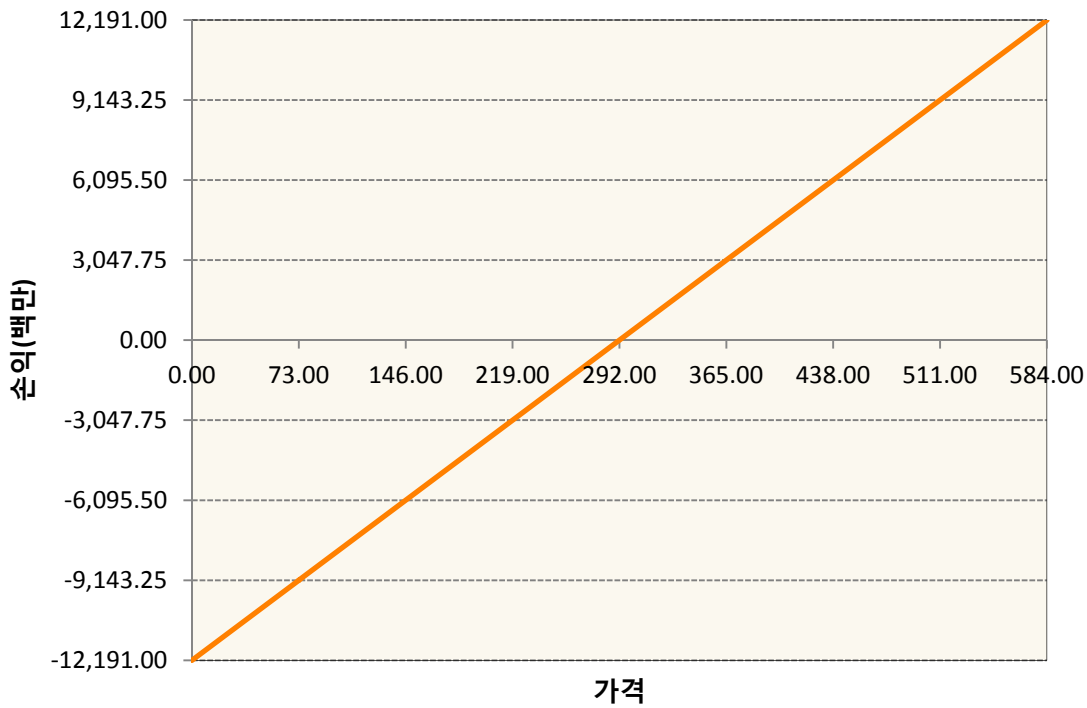
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

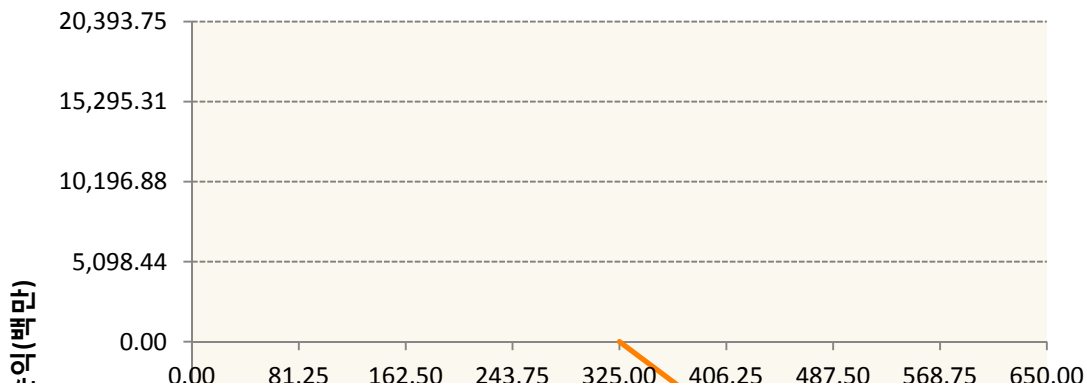
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,094	0	1,094	장내
신규	유가증권	옵션	73	0	73	장내
누계	유가증권	선물	12,191	0	12,191	장내
누계	유가증권	옵션	1,628	20,394	-18,766	장내

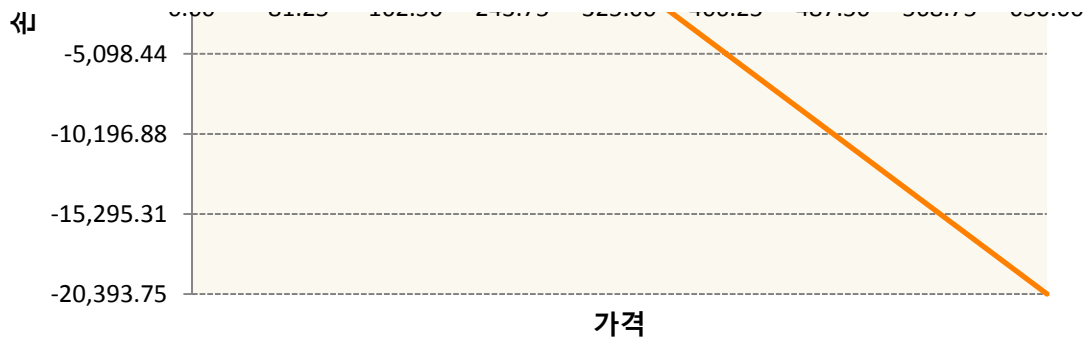
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

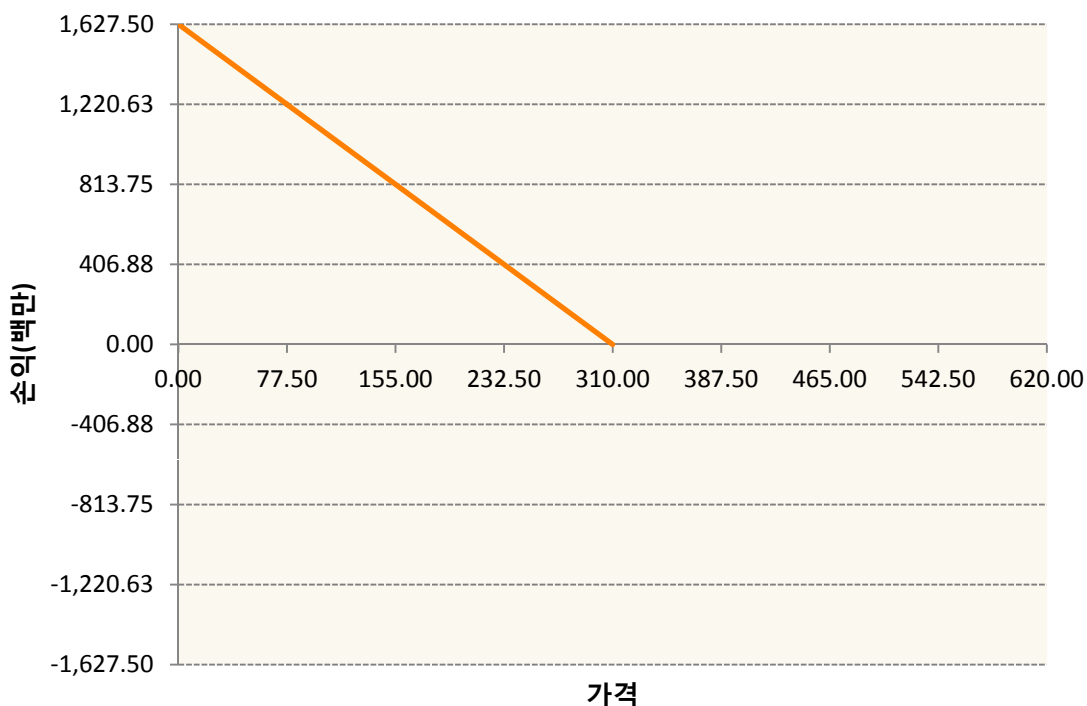


KR4201N73257-2018-07 콜325





KR4301N73107-2018-07 풋310



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물							974
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-974	-974	-974	-974	-974	-974	-974
-5.33%	-649	-649	-649	-649	-649	-649	-649
-2.67%	-325	-325	-325	-325	-325	-325	-325
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	325	325	325	325	325	325	325
5.33%	649	649	649	649	649	649	649
8.00%	974	974	974	974	974	974	974
KR4201N732 2018-07 콜325							185
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2	2	2	2	2	2	2
-5.33%	2	2	2	2	2	1	1
-2.67%	2	2	2	1	1	1	0
0%	2	1	1	0	-1	-4	-7
2.67%	0	-1	-4	-8	-13	-19	-27
5.33%	-9	-16	-25	-36	-49	-63	-79
8.00%	-55	-74	-94	-116	-138	-161	-185

KR4301N7312018-07 풋310

122

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	122	122	122	122	122	122	122
-5.33%	82	82	82	82	82	82	82
-2.67%	41	41	41	41	41	41	41
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-41	-40	-40	-39	-39	-38	-38
5.33%	-76	-74	-73	-72	-71	-69	-68
8.00%	-93	-92	-91	-90	-89	-88	-87

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

(단위:백만원)

899

공시일	2018-07-06
기준일	2018-07-05

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

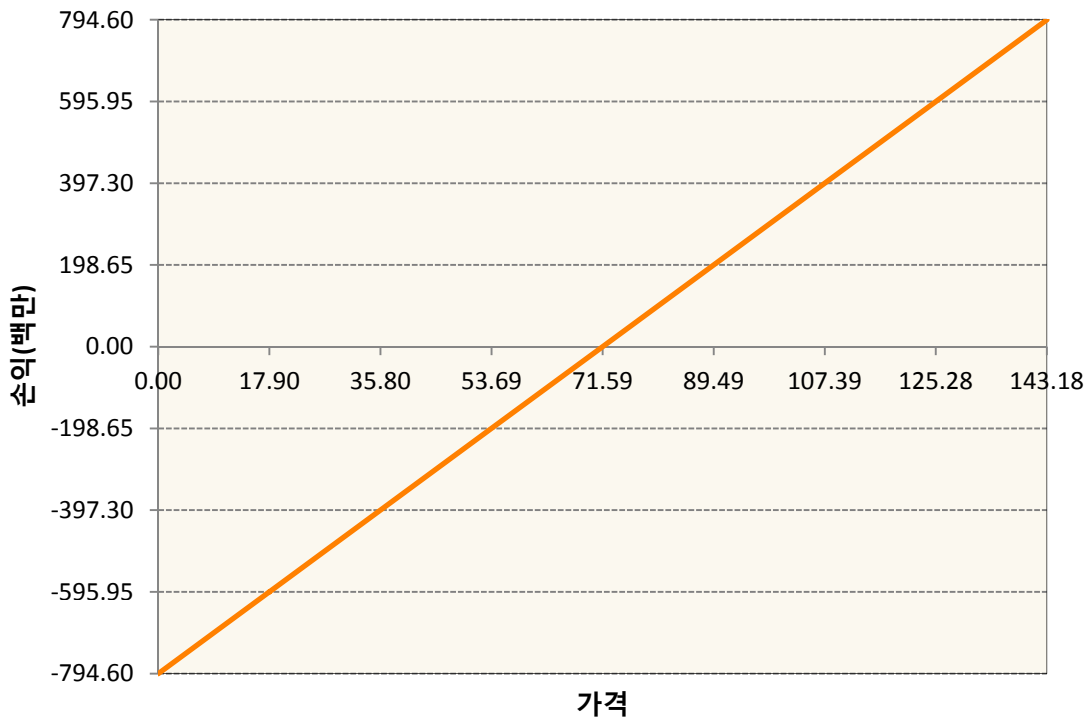
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

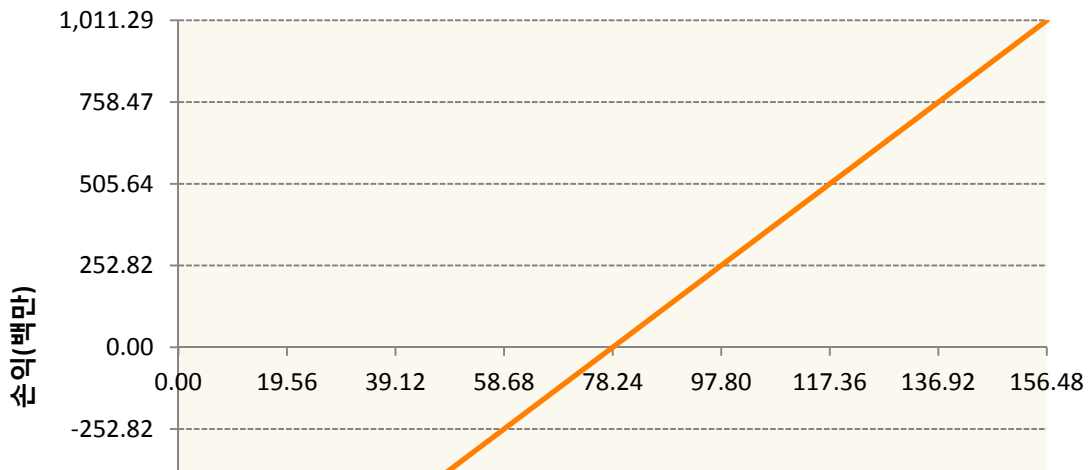
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,810	615	3,196	

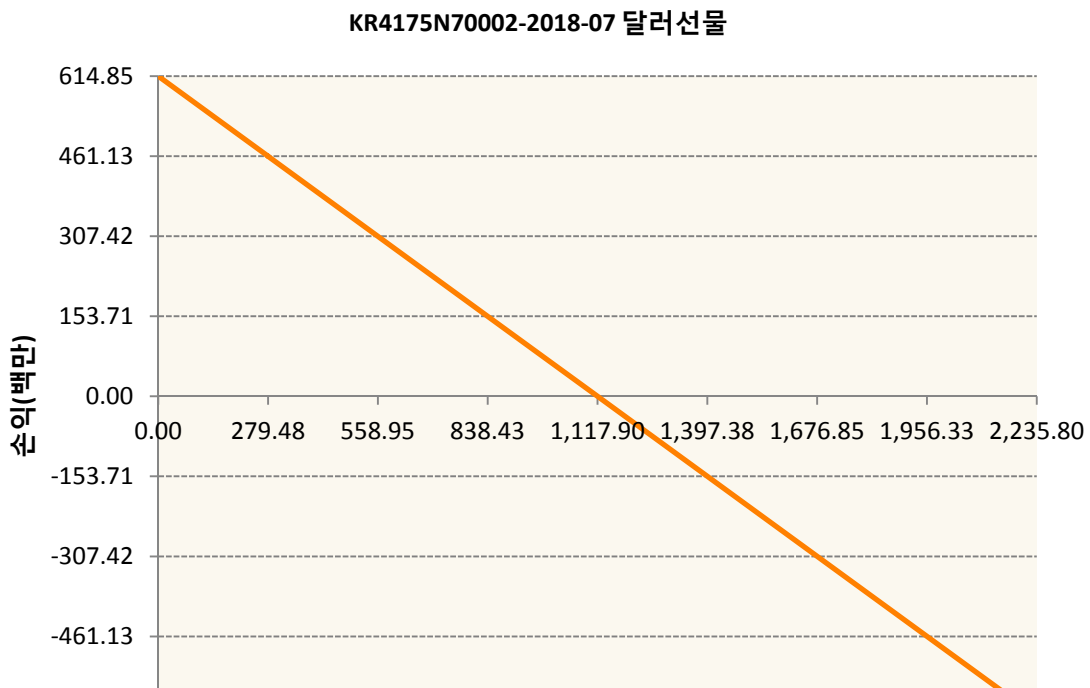
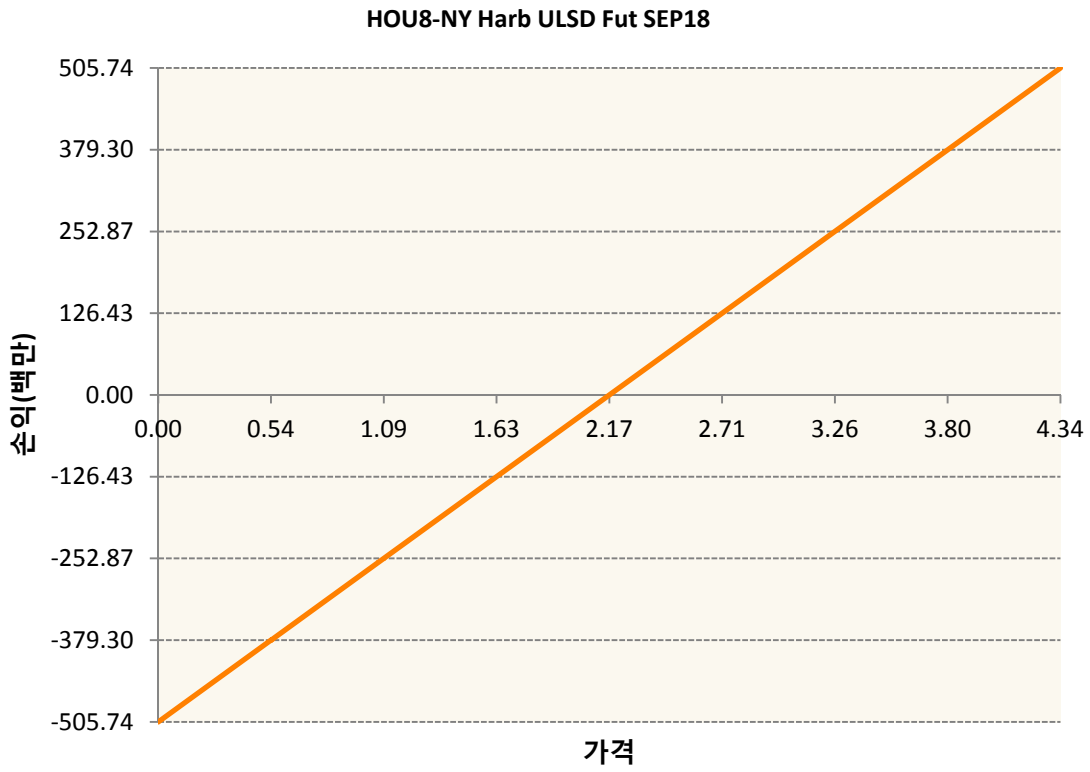
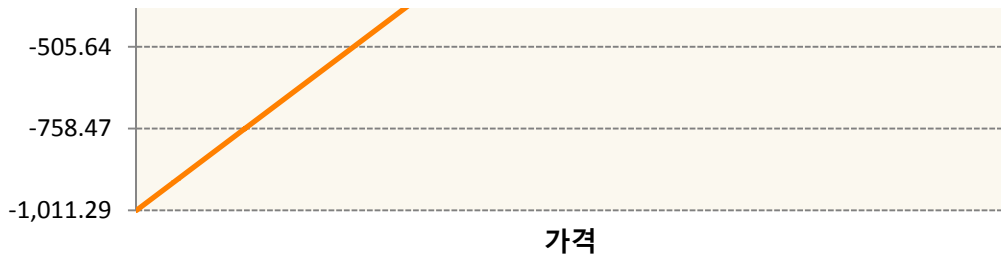
### 2. 만기시점의 손익구조

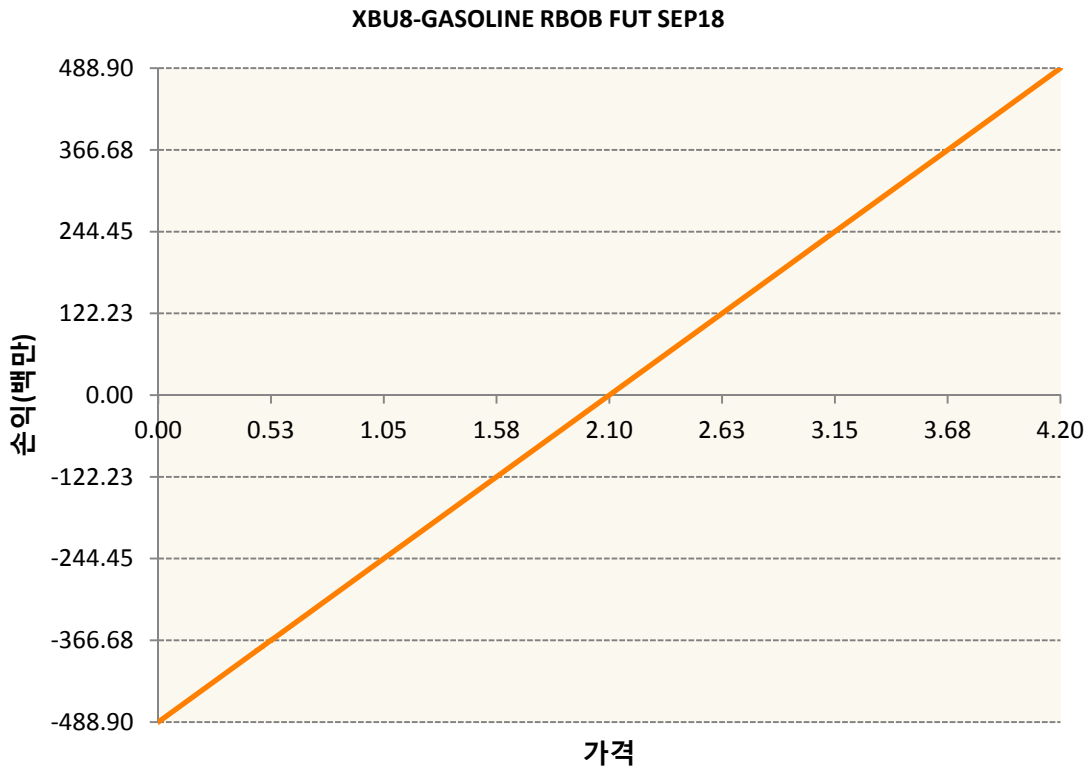
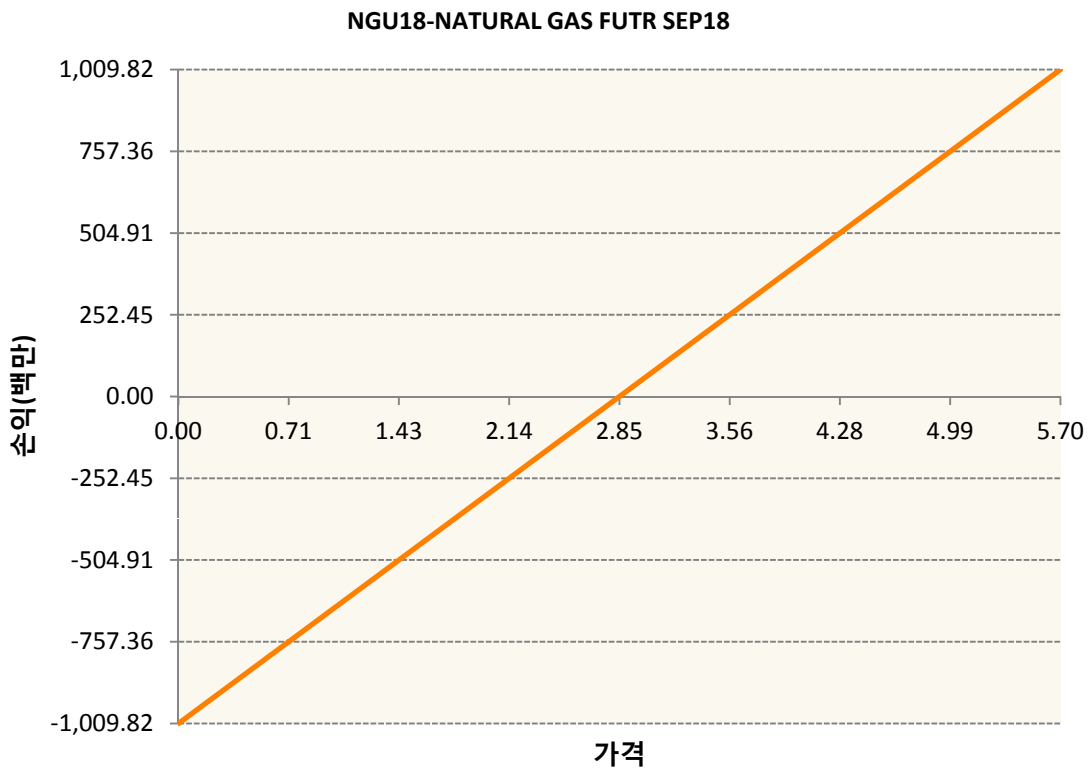
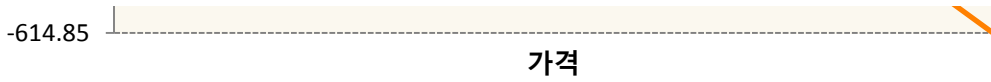
**CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18**



**COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18**







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

CLU8	WTI CRUDE FUTURE SEP18	64
COU8	BRENT CRUDE FUTR SEP18	81
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)

**450**

공시일	2018-07-06
기준일	2018-07-05

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

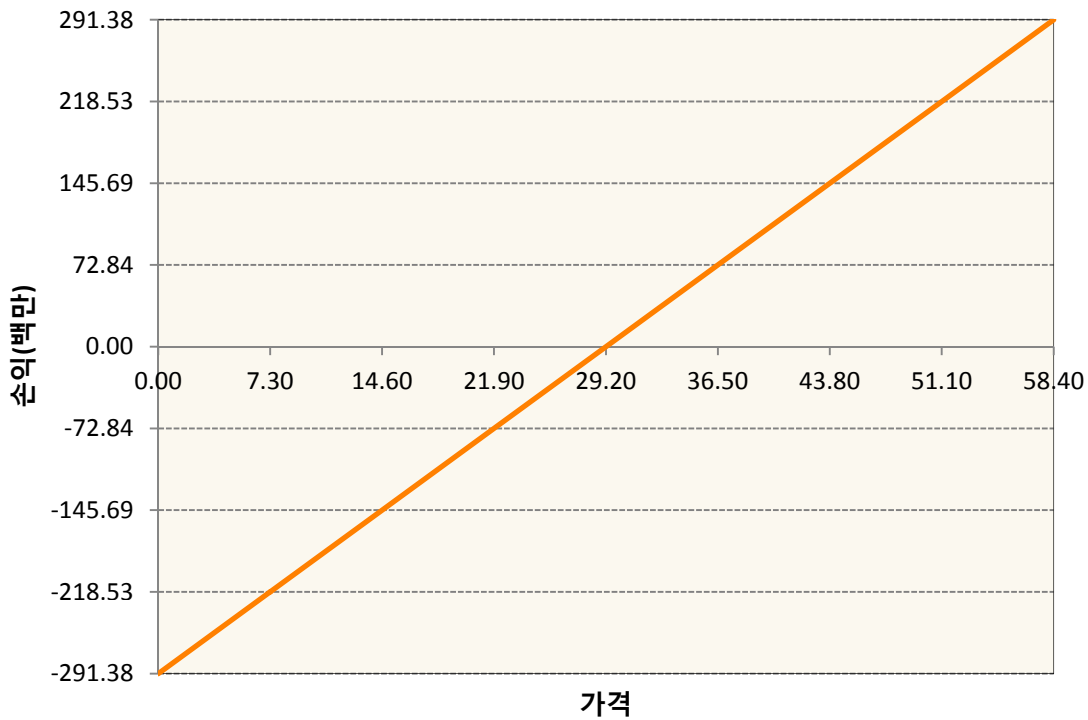
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

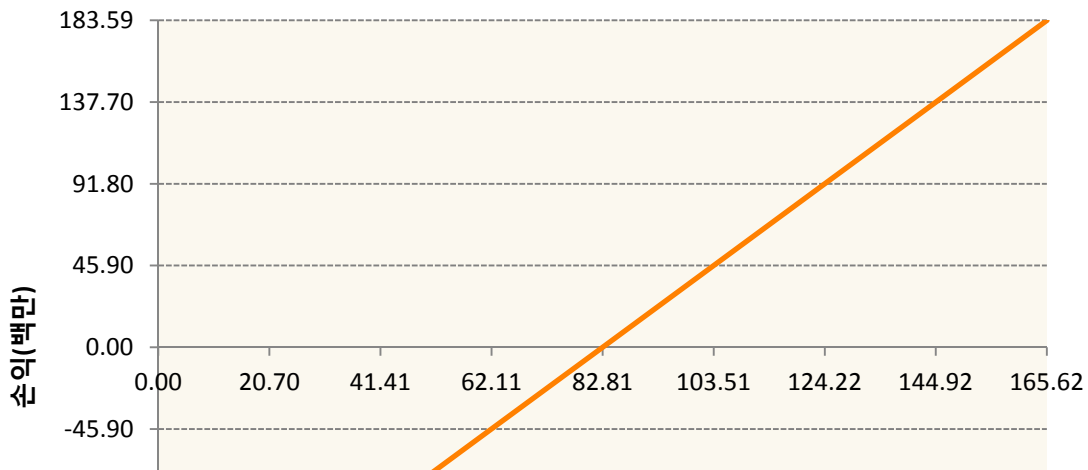
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,619	78	3,541	

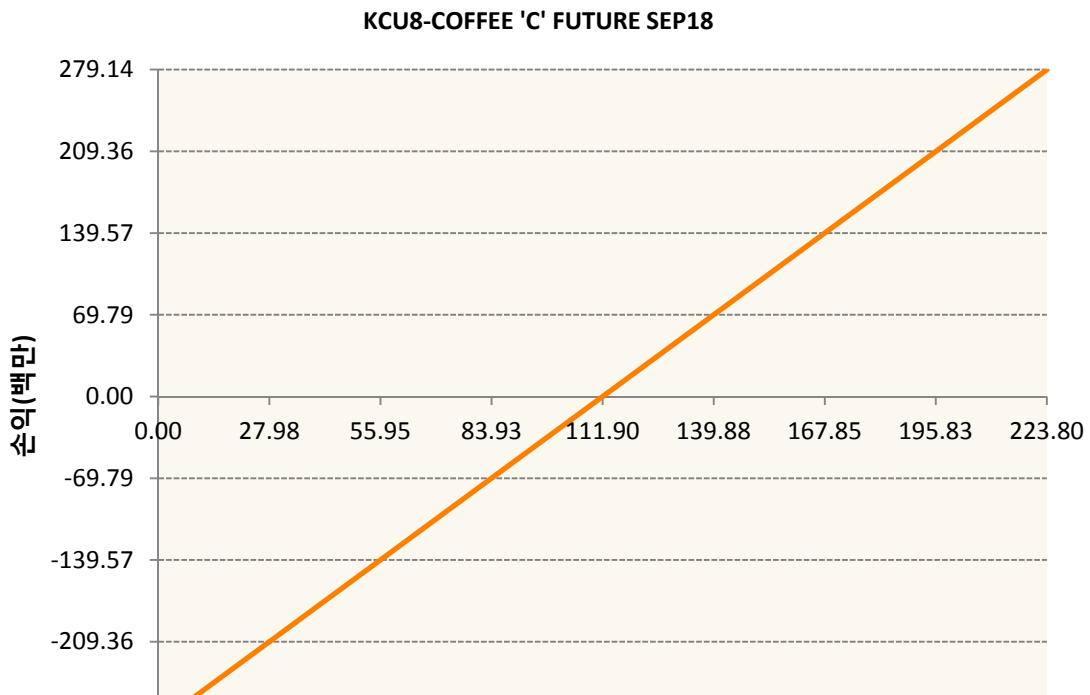
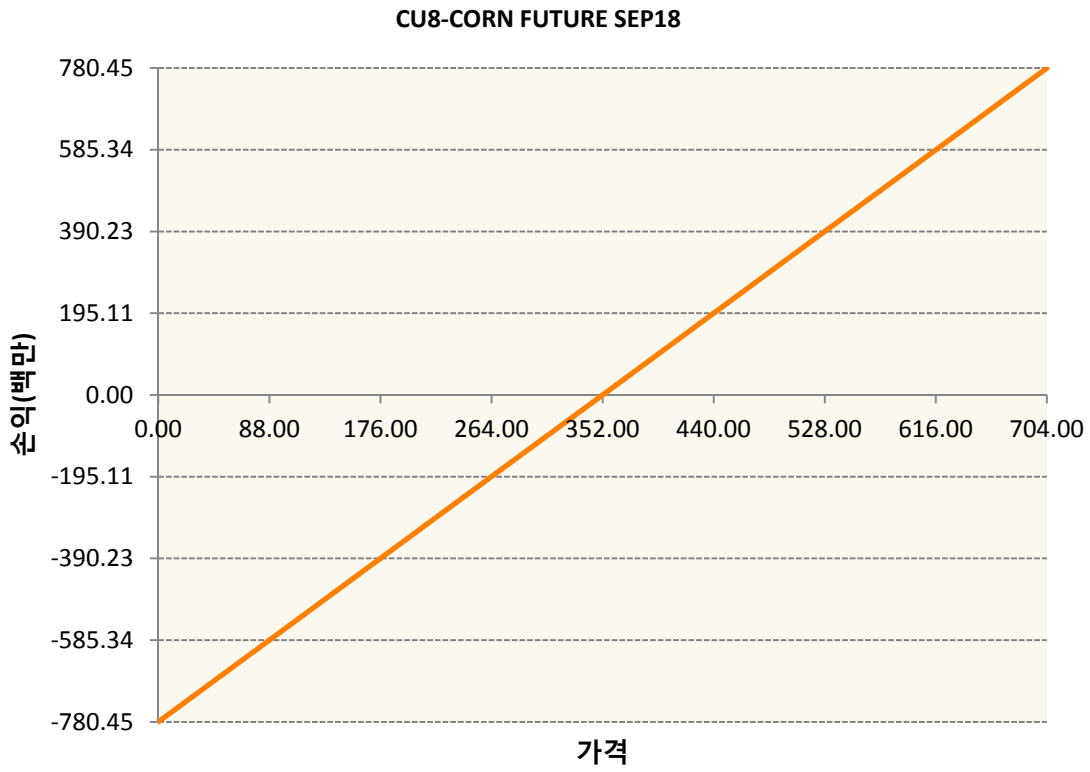
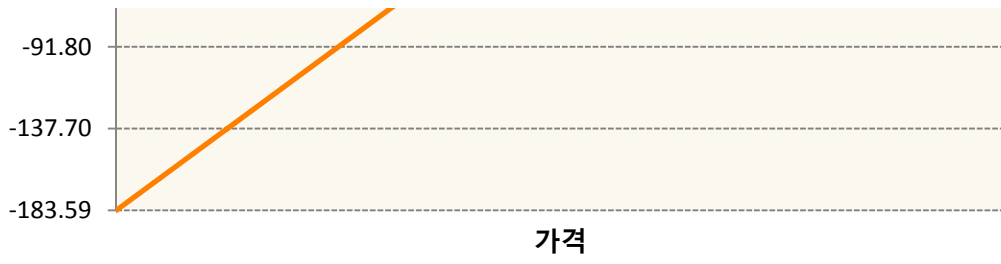
### 2. 만기시점의 손익구조

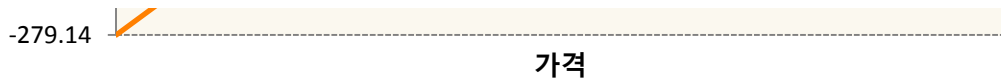
**BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18**



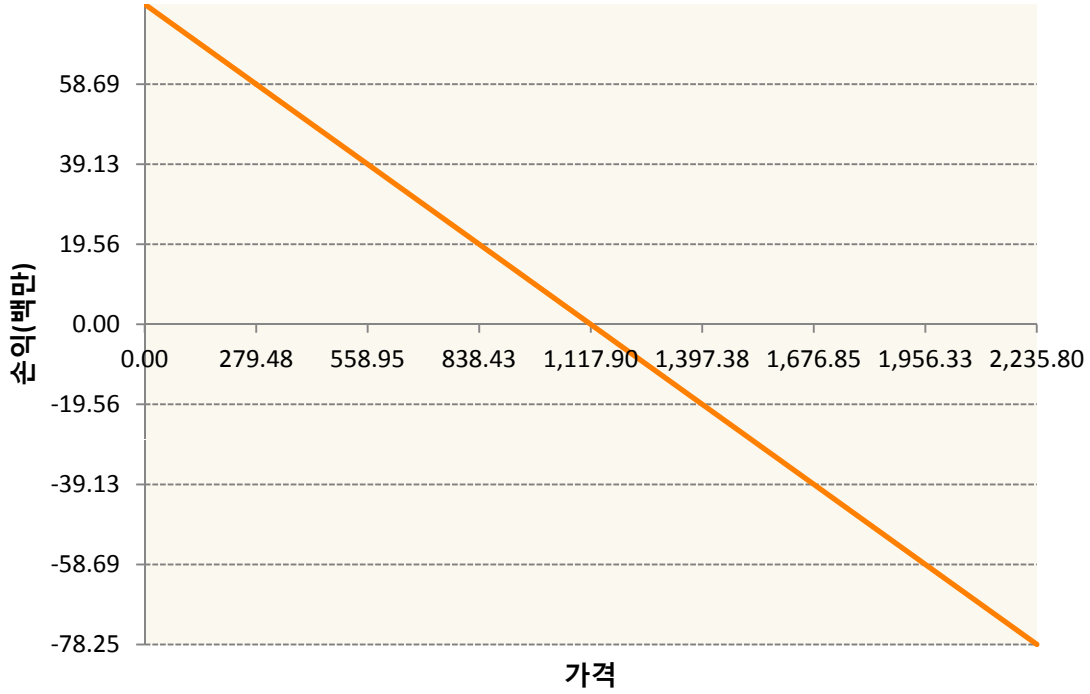
**CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18**



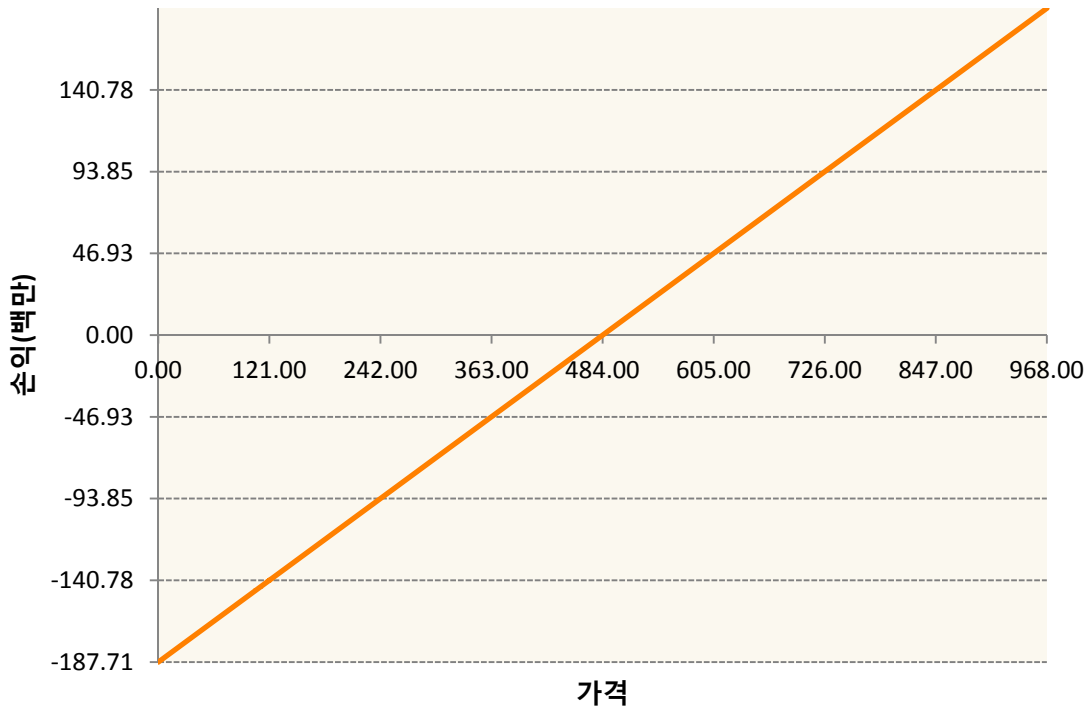




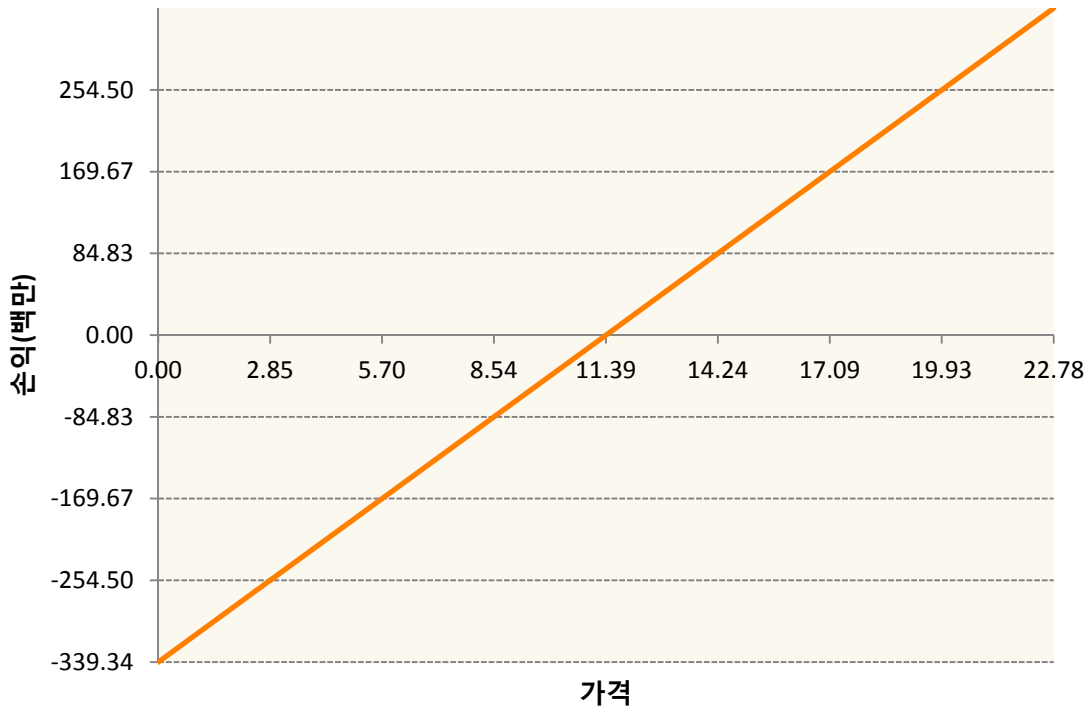
**KR4175N70002-2018-07 달러선물**



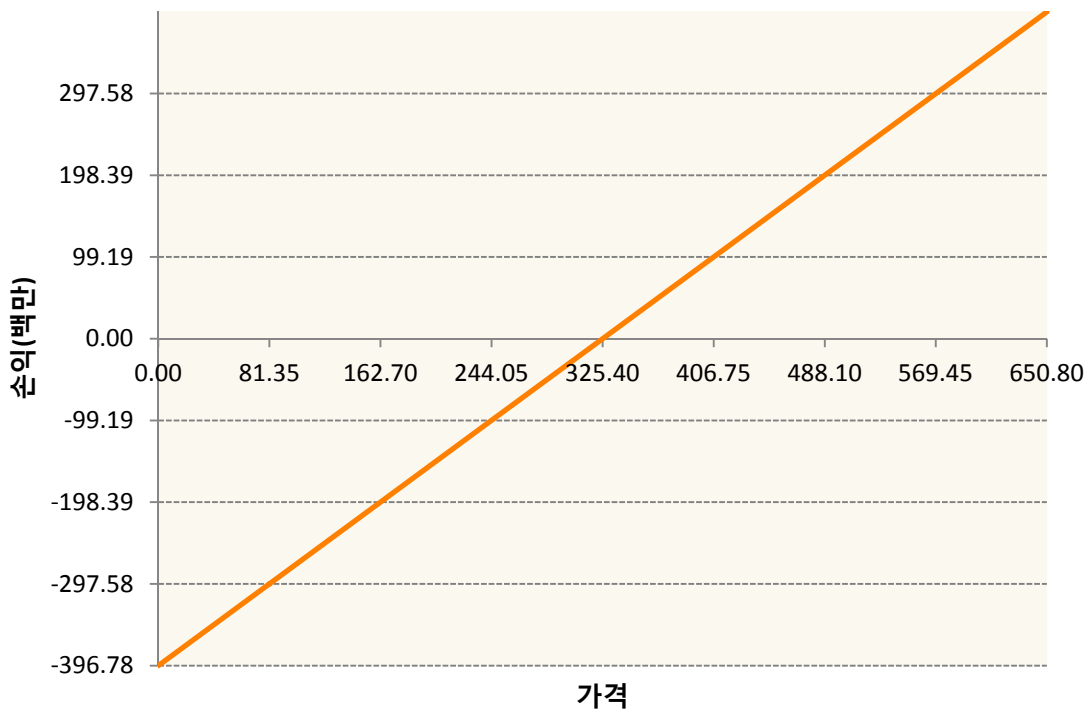
**KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18**



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

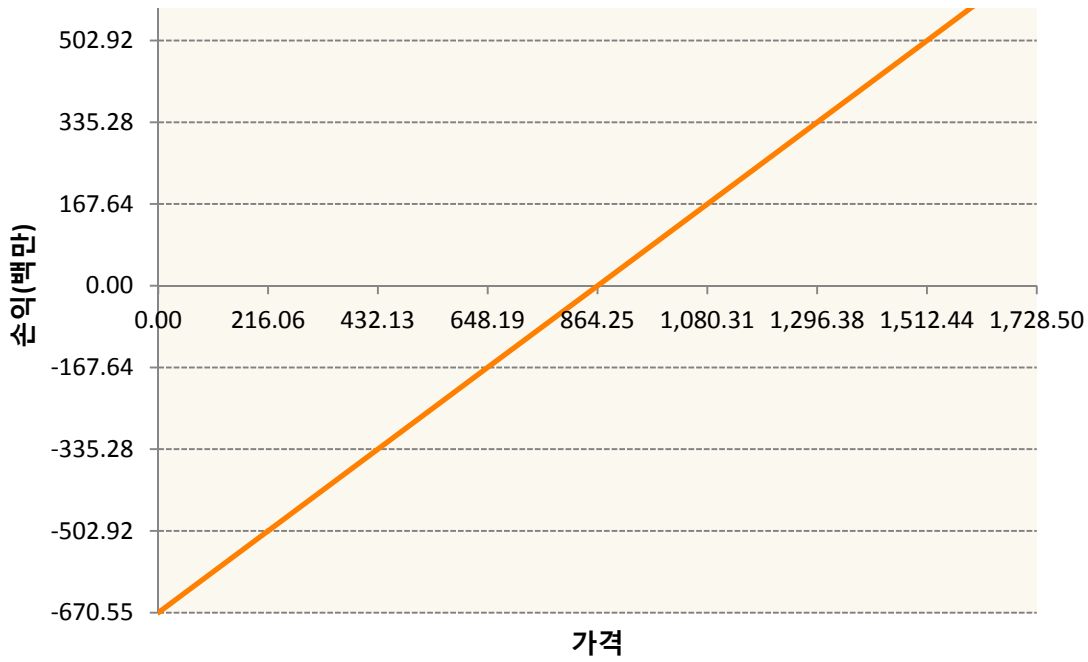


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

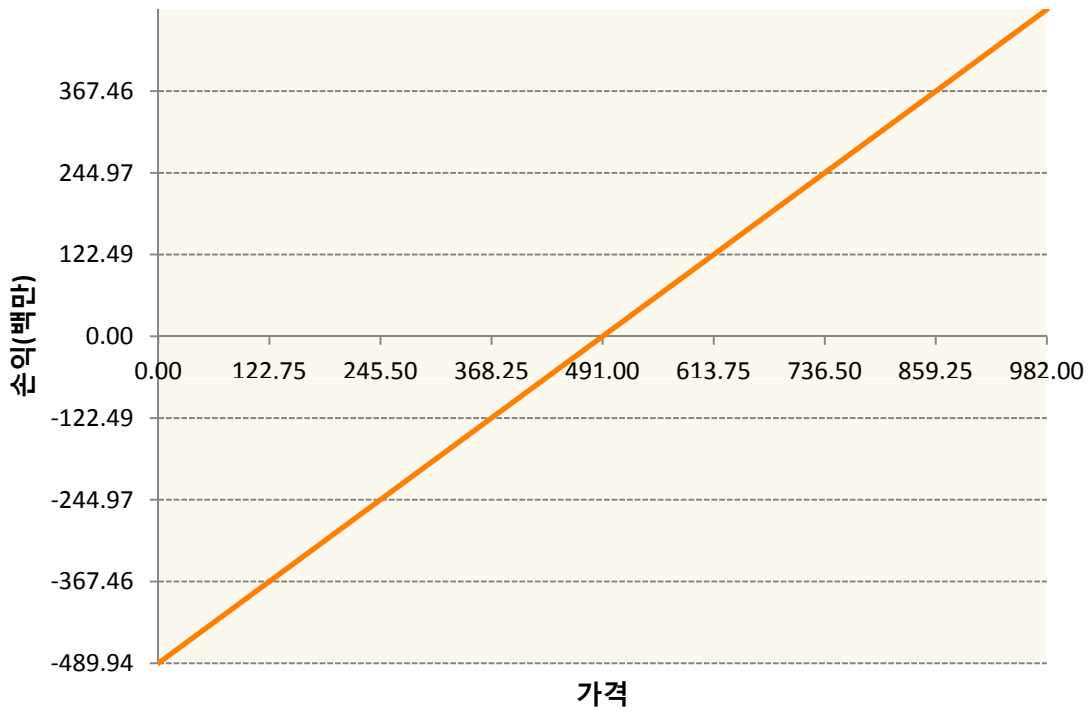


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





WU8-WHEAT FUTURE(CBT) SEP18



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**