

공시일	2018-07-09
기준일	2018-07-06

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	2018-07-09
기준일	2018-07-06

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

1,108

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

465

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-07-09
기준일	2018-07-06

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

317

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

382

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-07-09
기준일	2018-07-06

유로인덱스모(주식-파생형)

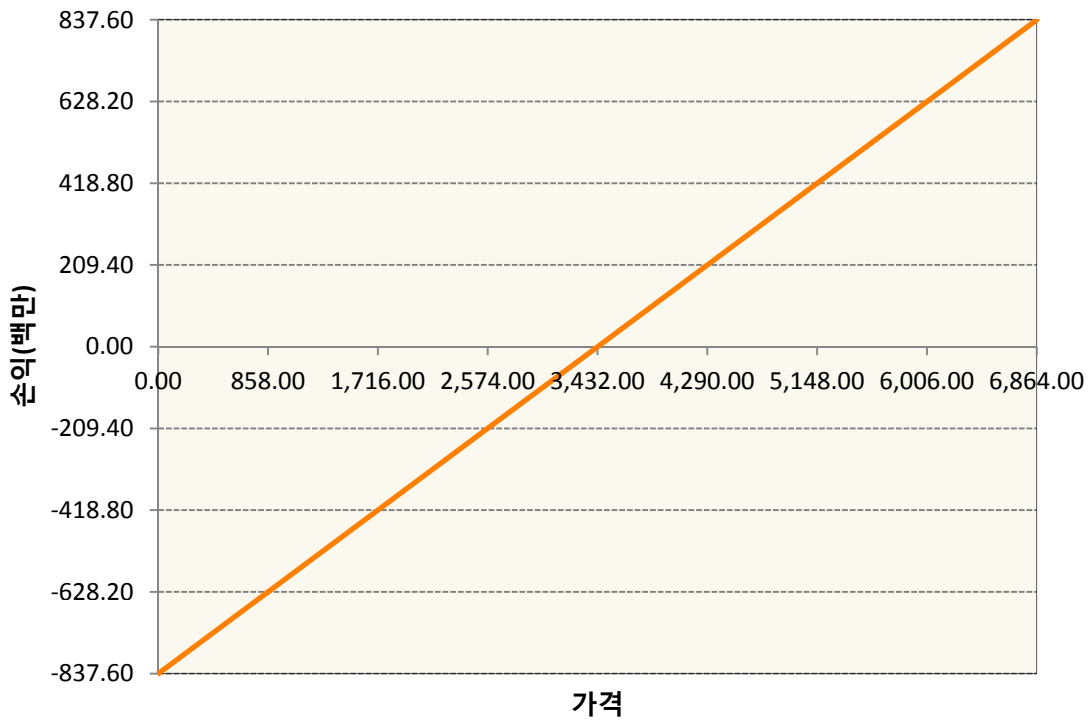
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	838	0	838	

2. 만기시점의 손익구조

VGU8-EURO STOXXX 50 SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU8	EURO STOXXX 50 SEP18	67
------	----------------------	----

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

(단위:백만원)

42

공시일	2018-07-09
기준일	2018-07-06

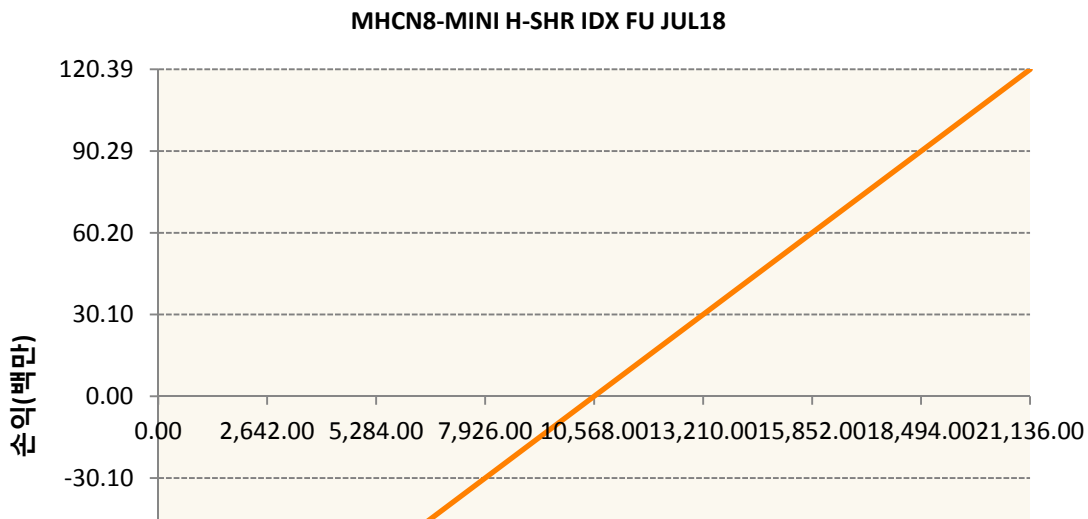
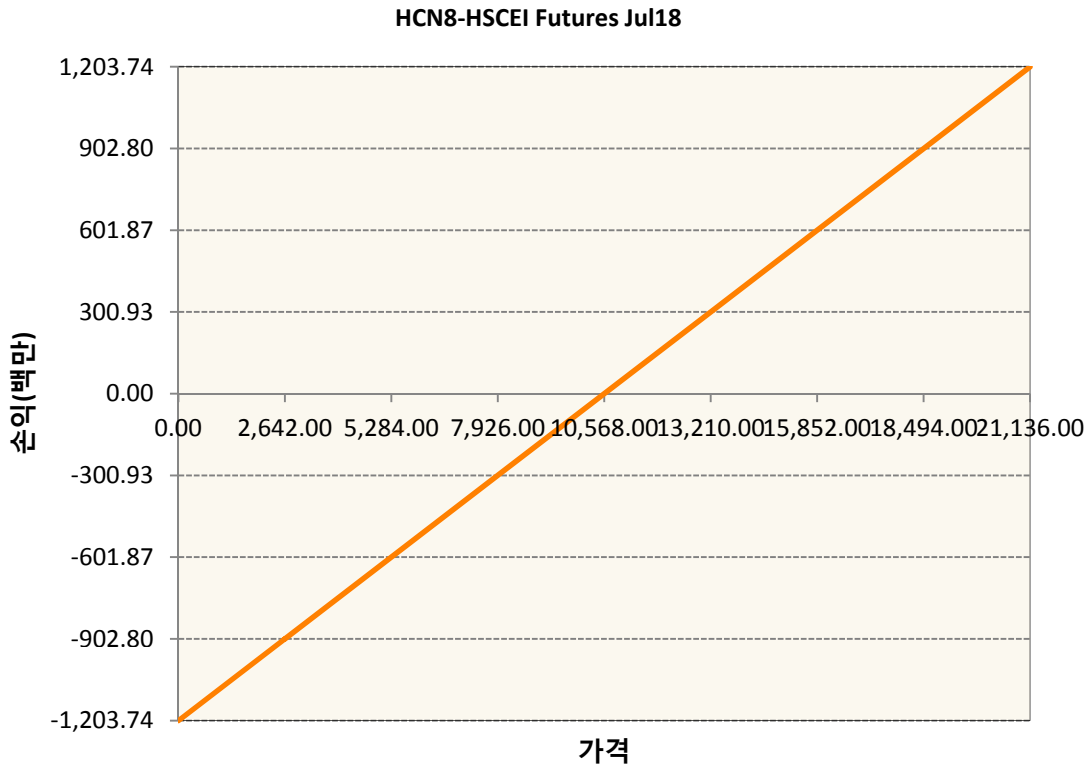
차이나인덱스모(주식-파생형)

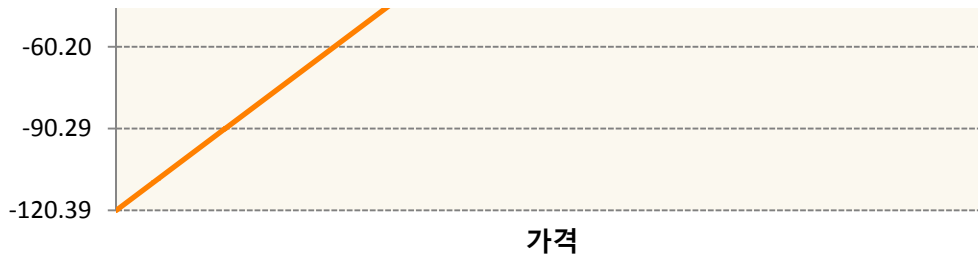
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,324	0	1,324	장내

2. 만기시점의 손익구조





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	2018-07-09
기준일	2018-07-06

커버드콜모(주식혼합-파생형)

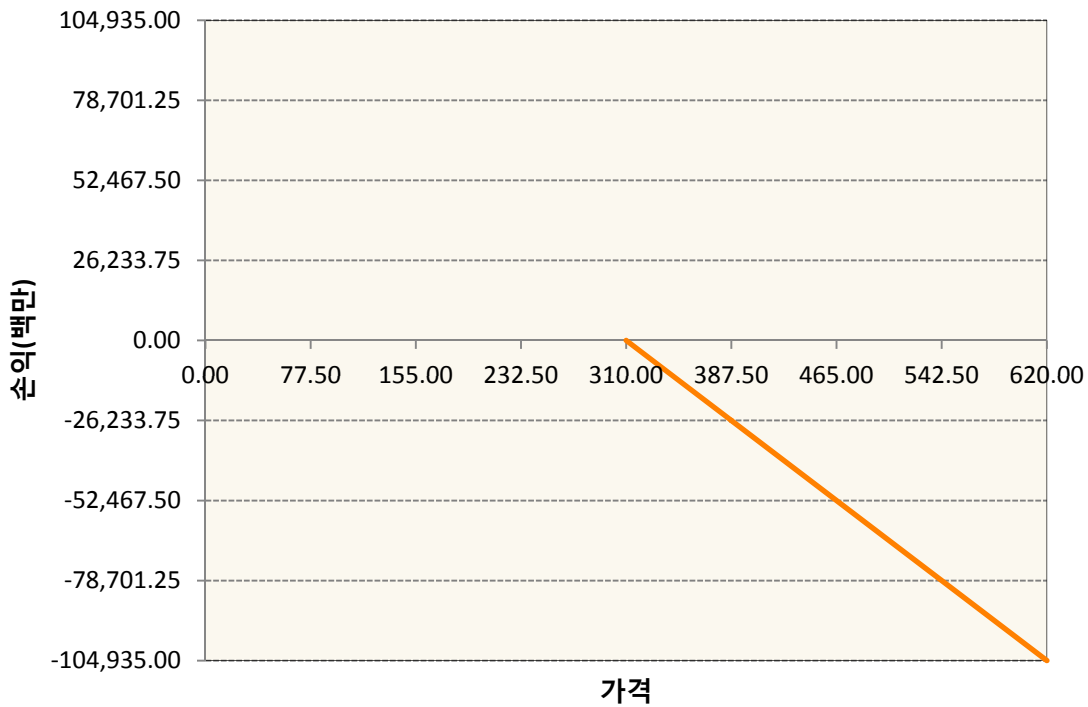
1. 계약금액

(단위:백만원)

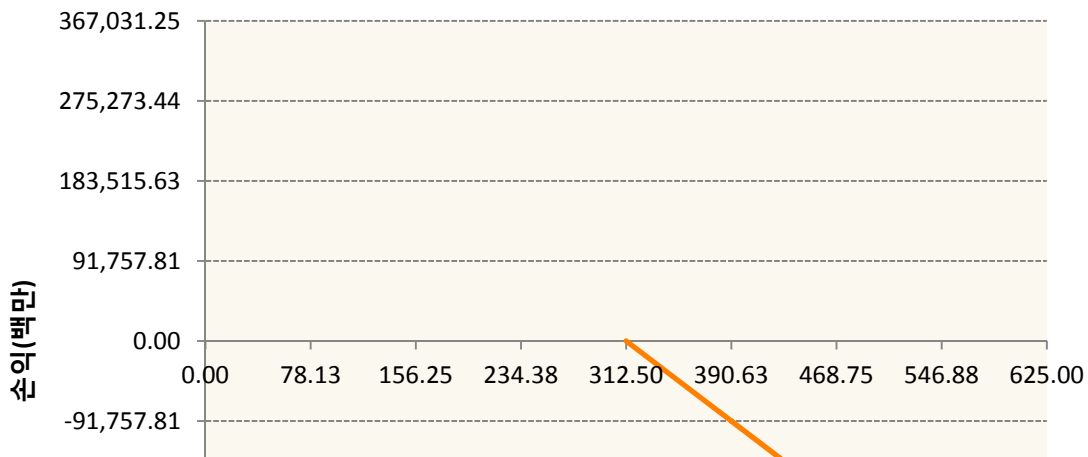
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	766,466	-766,466	장내

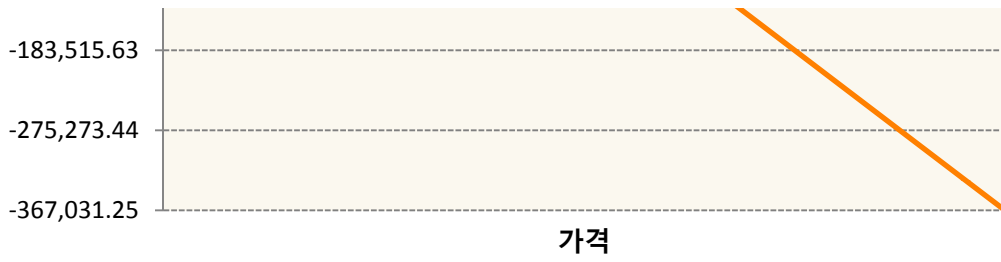
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N73109-2018-07 콜310

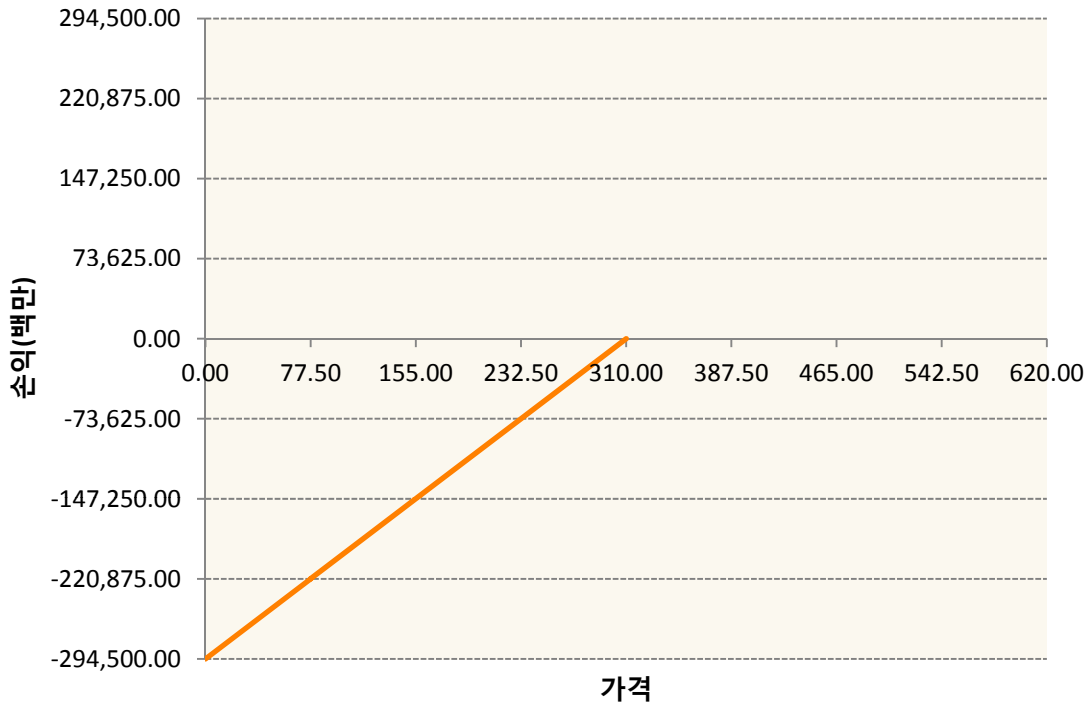


KR4201N73125-2018-07 콜312.5





KR4301N73107-2018-07 풋310



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N7312018-07 콜310 3,250

		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	146	146	146	146	145	144	142	
-5.33%	146	146	145	143	139	133	124	
-2.67%	143	139	132	119	101	78	48	
0%	110	83	46	0	-54	-116	-184	
2.67%	-113	-200	-295	-396	-502	-611	-724	
5.33%	-899	-1,036	-1,173	-1,311	-1,449	-1,586	-1,724	
8.00%	-2,524	-2,636	-2,753	-2,874	-2,997	-3,123	-3,250	

KR4201N7312018-07 콜312.5 9,632

		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	320	320	320	320	319	317	313	

-5.33%	320	320	318	315	307	294	272
-2.67%	317	310	294	268	226	168	91
0%	260	201	114	0	-142	-310	-504
2.67%	-206	-438	-702	-993	-1,307	-1,641	-1,990
5.33%	-2,166	-2,614	-3,067	-3,526	-3,988	-4,452	-4,919
8.00%	-6,863	-7,311	-7,767	-8,228	-8,693	-9,161	-9,632

KR4301N7312018-07 풋310

22,254

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,254	-22,254	-22,254	-22,254	-22,254	-22,254	-22,254
-5.33%	-14,831	-14,831	-14,831	-14,831	-14,831	-14,831	-14,831
-2.67%	-7,407	-7,407	-7,407	-7,408	-7,408	-7,409	-7,412
0%	15	13	9	0	-14	-35	-64
2.67%	7,353	7,294	7,220	7,131	7,028	6,914	6,789
5.33%	13,383	13,164	12,944	12,723	12,502	12,280	12,058
8.00%	15,776	15,659	15,527	15,383	15,228	15,064	14,893

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

(단위:백만원)

30,423

공시일	2018-07-09
기준일	2018-07-06

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

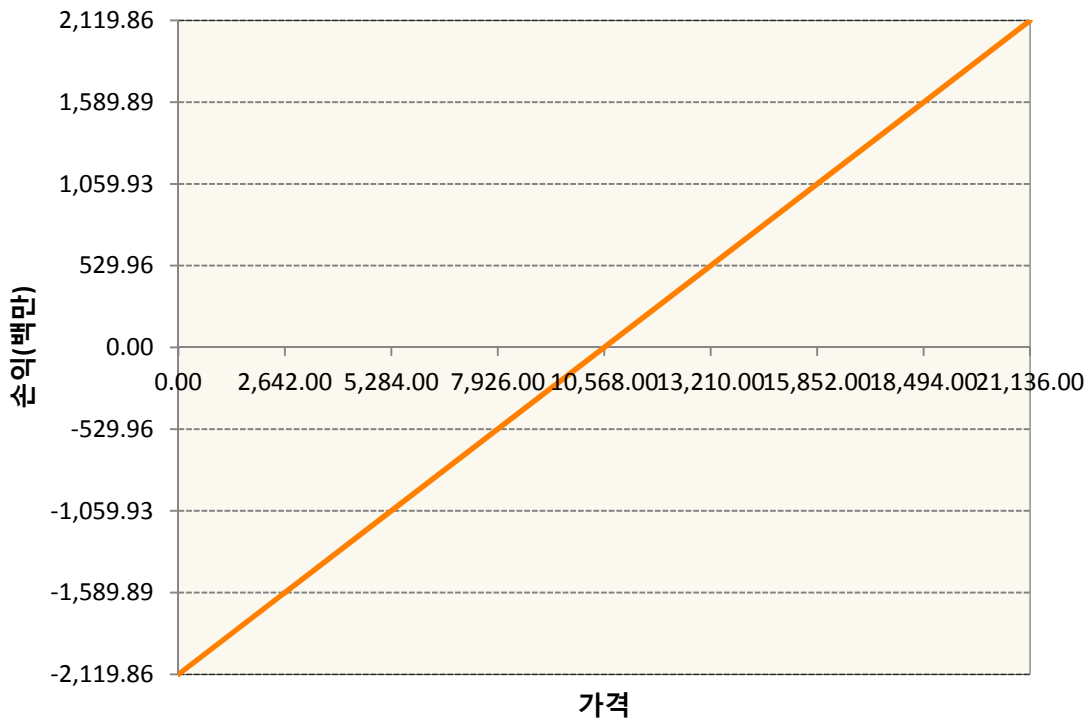
1. 계약금액

(단위:백만원)

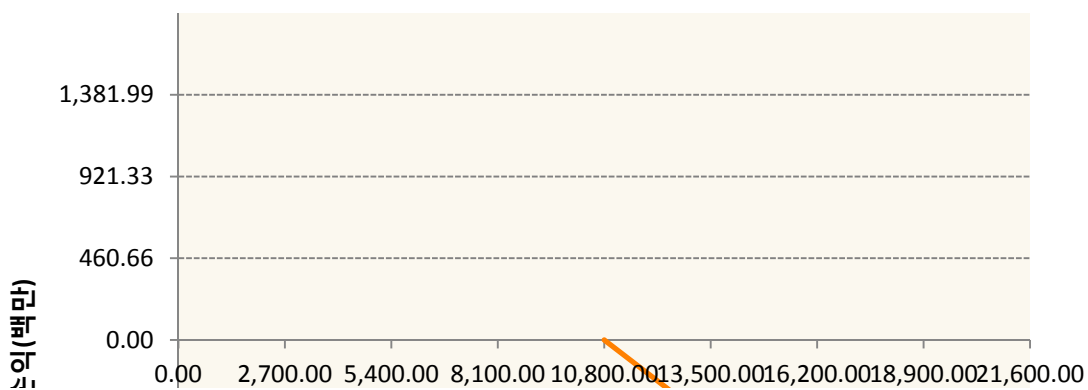
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,120	0	2,120	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,562	-5,562	장내

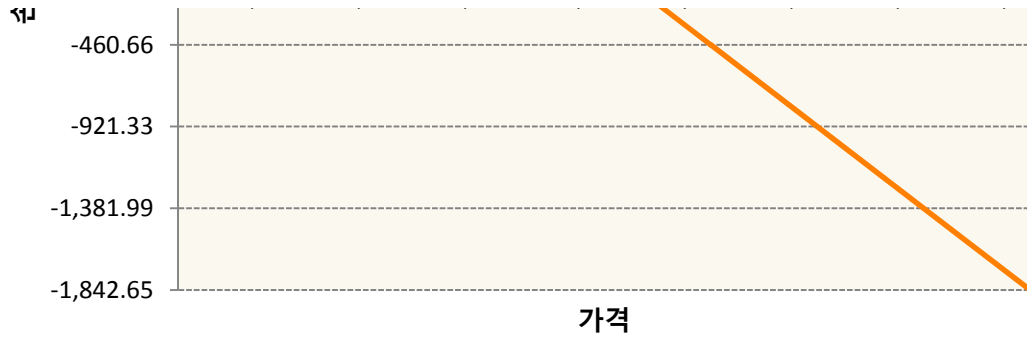
2. 만기시점의 손익구조

HCN8-HSCEI Futures Jul18

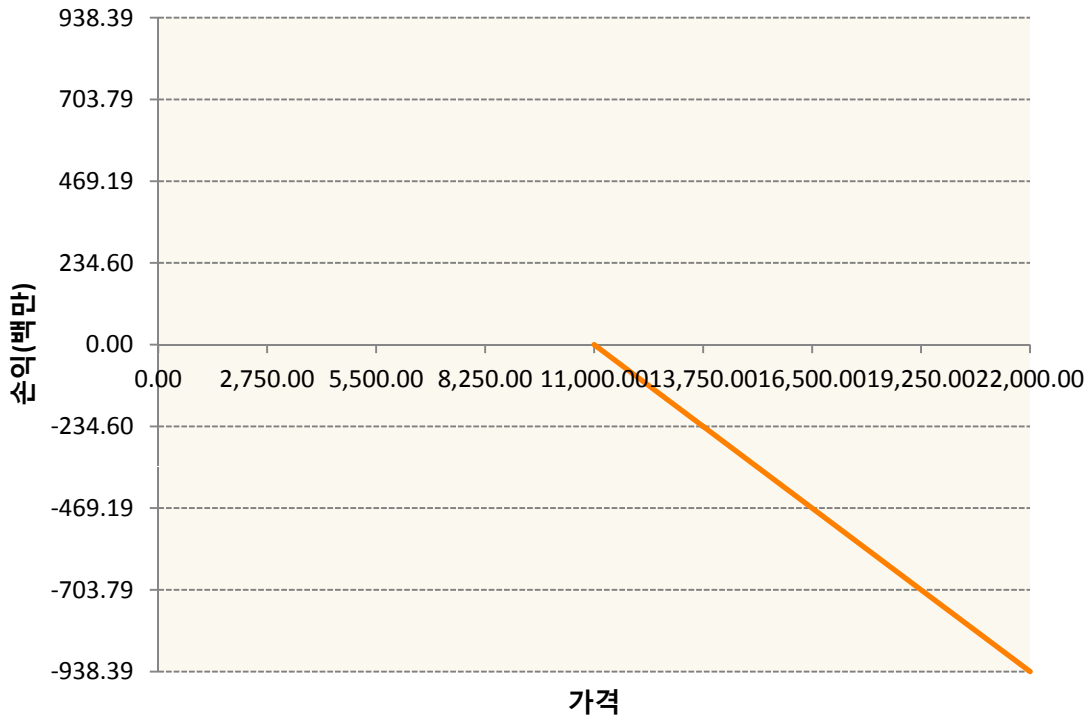


OHHIN8-C108-HSCEI

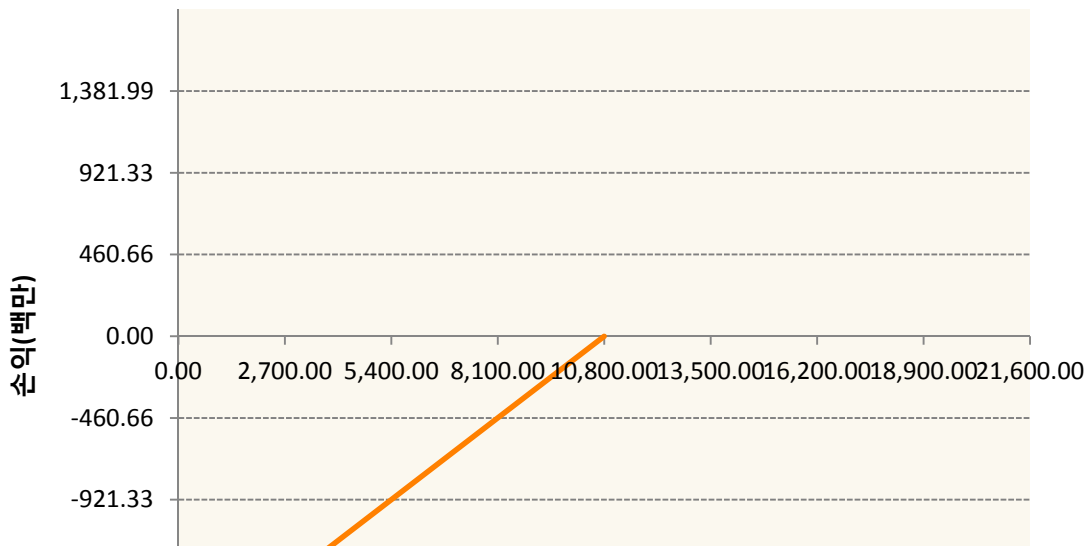


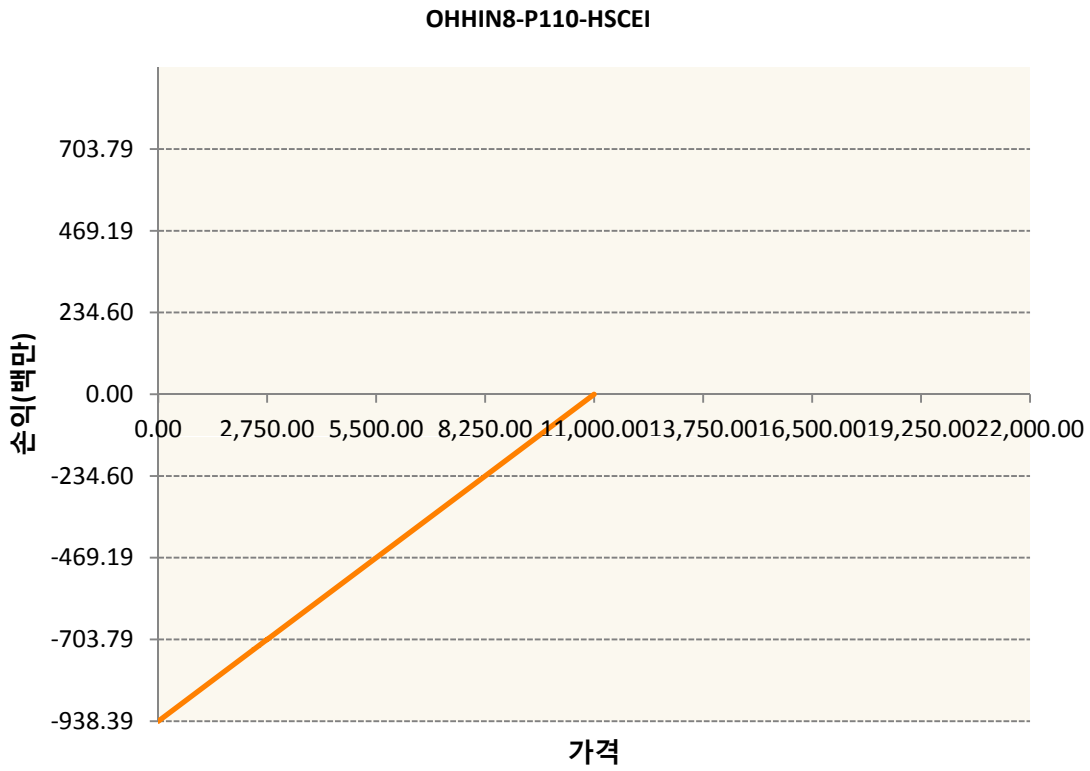
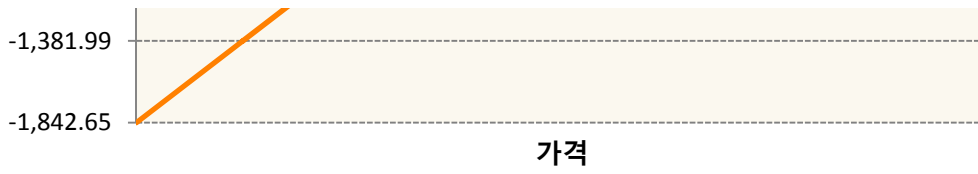


OHHIN8-C110-HSCEI



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	2018-07-09
기준일	2018-07-06

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

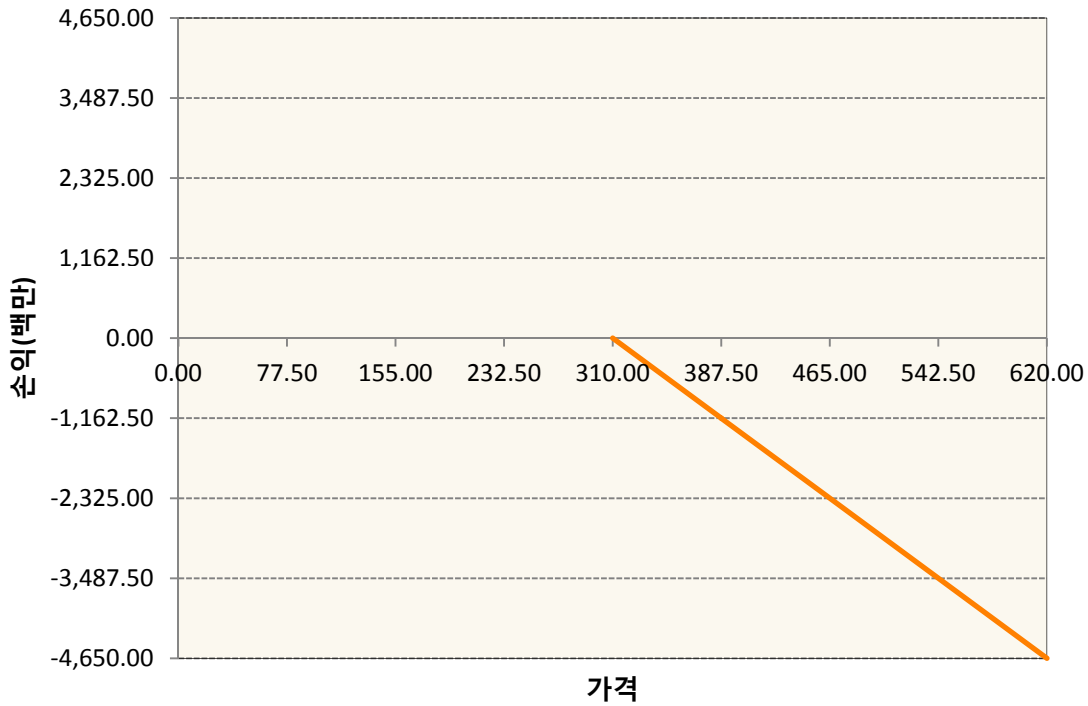
1. 계약금액

(단위:백만원)

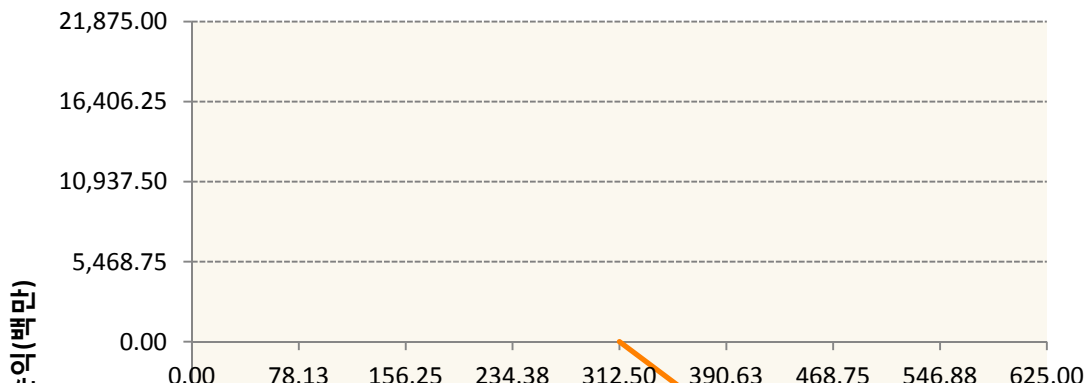
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	45,900	-45,900	장내

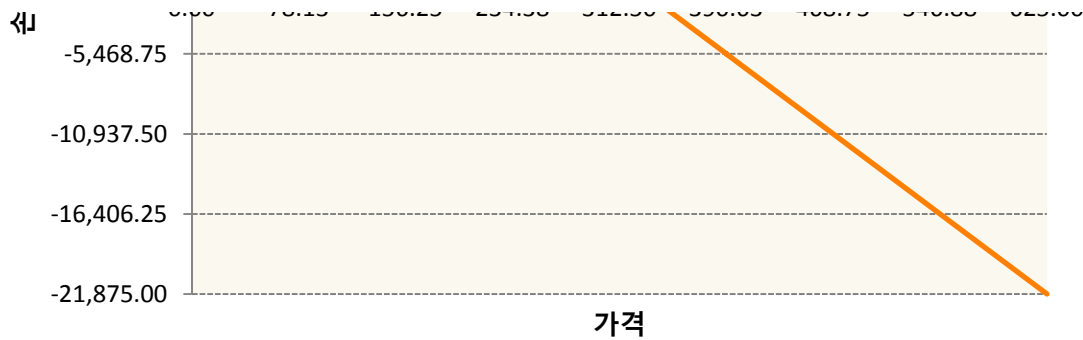
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N73109-2018-07 콜310

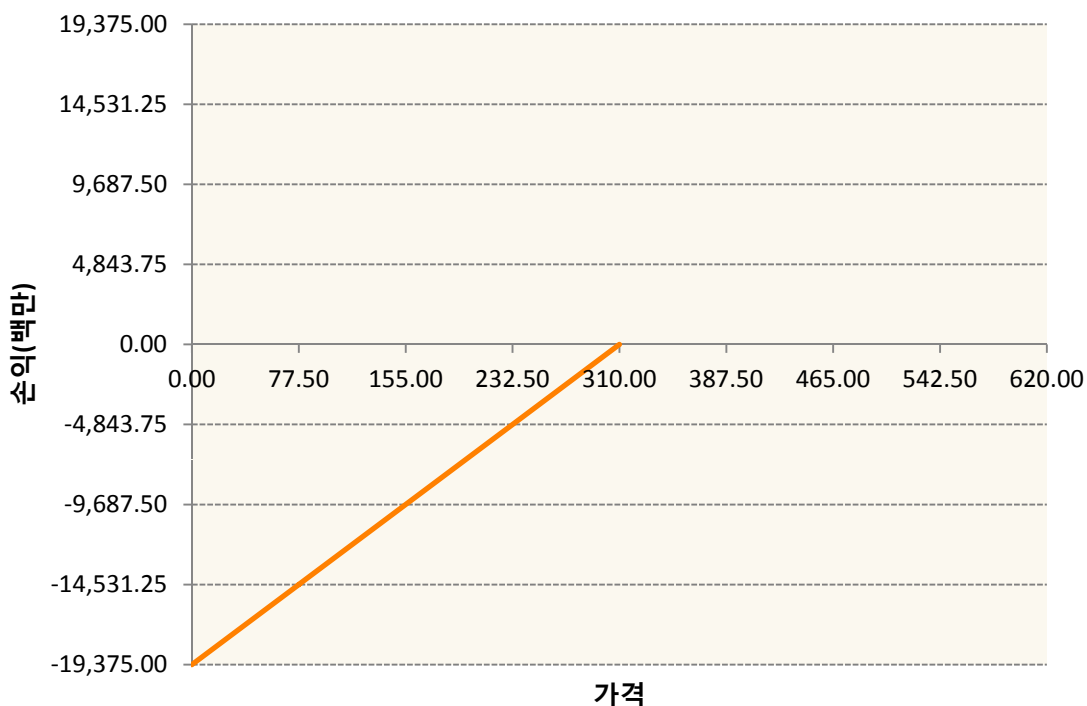


KR4201N73125-2018-07 콜312.5





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

144

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	6	5
-2.67%	6	6	6	5	4	3	2
0%	5	4	2	0	-2	-5	-8
2.67%	-5	-9	-13	-18	-22	-27	-32
5.33%	-40	-46	-52	-58	-64	-70	-76
8.00%	-112	-117	-122	-127	-133	-138	-144

KR4201N7312018-07 콜312.5

574

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19	19	19	19	19	19	19
-5.33%	19	19	19	19	18	18	16
-2.67%	19	18	18	16	13	10	5
0%	16	12	7	0	-8	-19	-30
2.67%	-12	-26	-42	-59	-78	-98	-119
5.33%	-129	-156	-183	-210	-238	-265	-293
8.00%	-409	-436	-463	-490	-518	-546	-574

KR4301N7312018-07 풋310

1,464

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,464	-1,464	-1,464	-1,464	-1,464	-1,464	-1,464
-5.33%	-976	-976	-976	-976	-976	-976	-976
-2.67%	-487	-487	-487	-487	-487	-487	-488
0%	1	1	1	0	-1	-2	-4
2.67%	484	480	475	469	462	455	447
5.33%	880	866	852	837	823	808	793
8.00%	1,038	1,030	1,022	1,012	1,002	991	980

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

(단위:백만원)

5,823

공시일	2018-07-09
기준일	2018-07-06

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

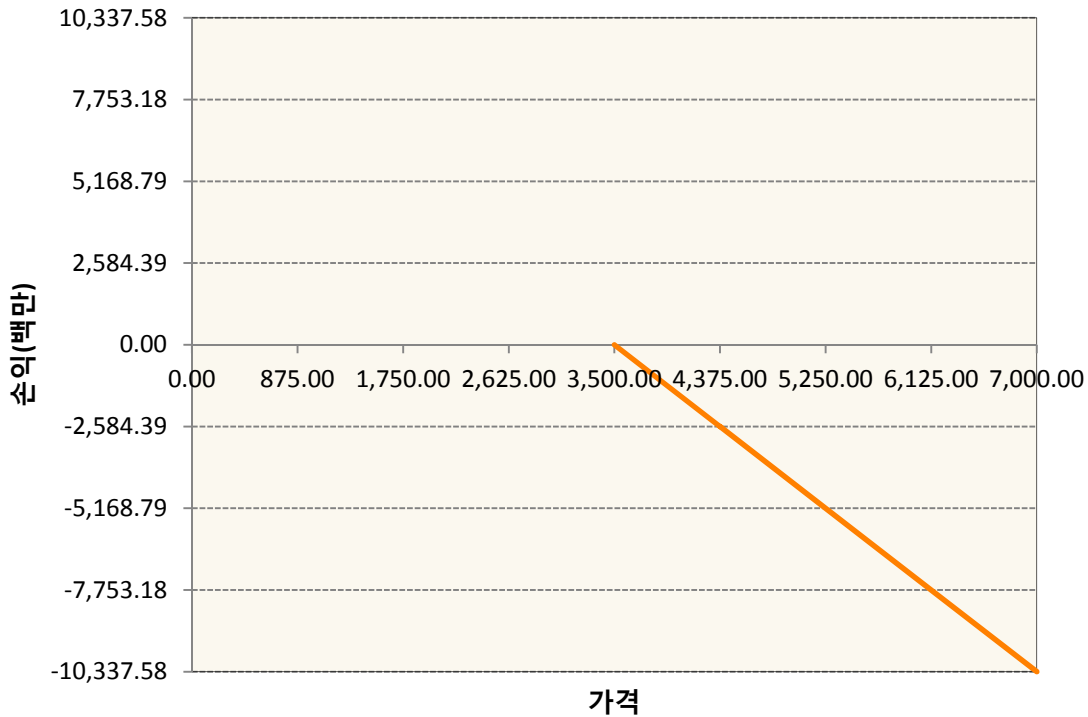
1. 계약금액

(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	5,529	0	5,529	
누계	유가증권	스왑	44,646	0	44,646	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,927	-25,927	장내
누계	지수	스왑	52,278	0	52,278	장외

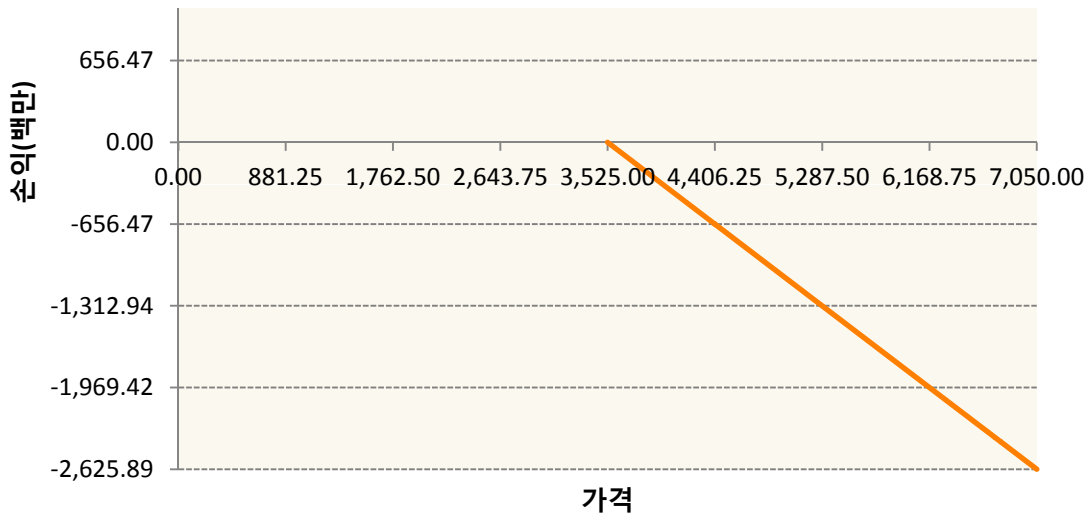
2. 만기시점의 손익구조

OESXN8-C3500-EURO STOXX 50

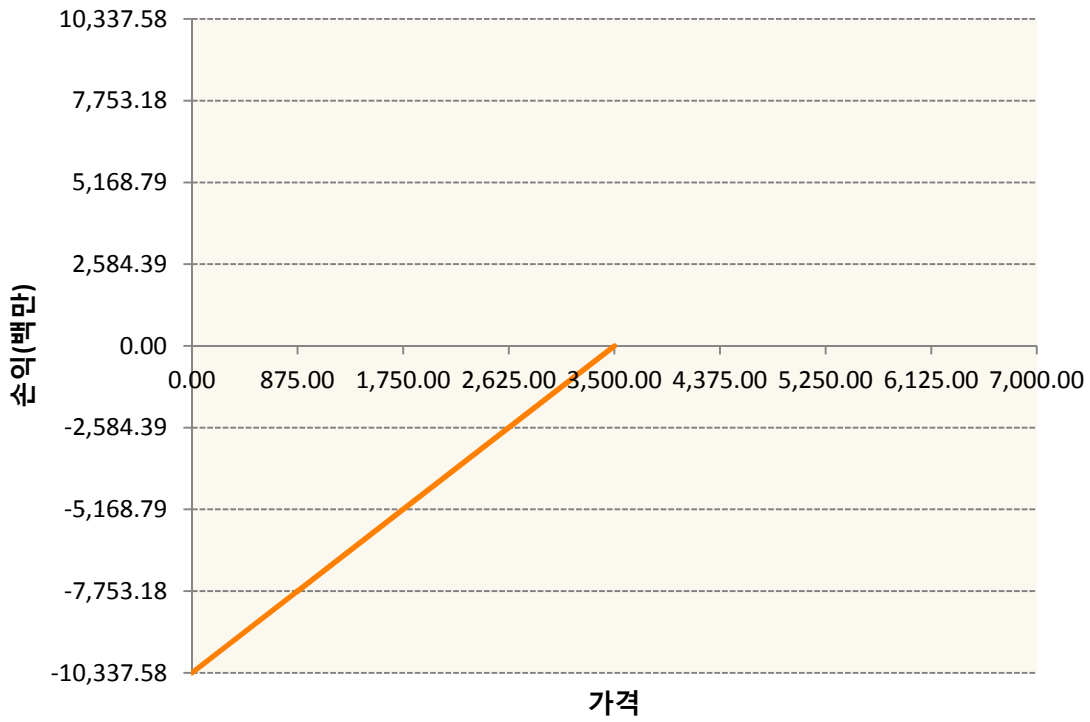


OESXN8-C3525-EURO STOXX 50

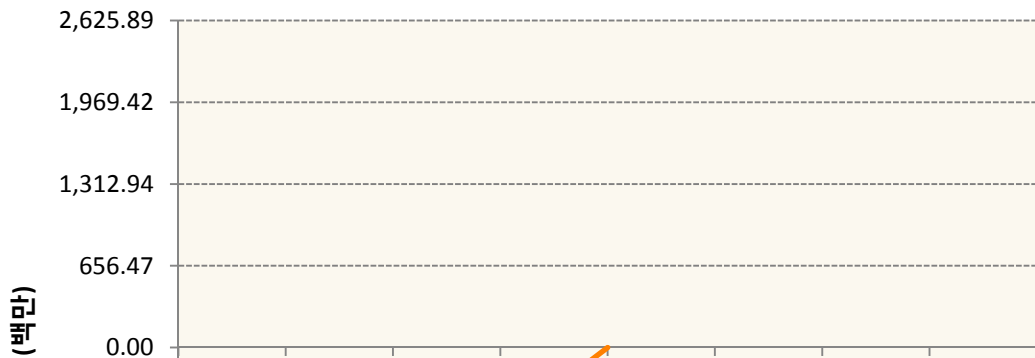


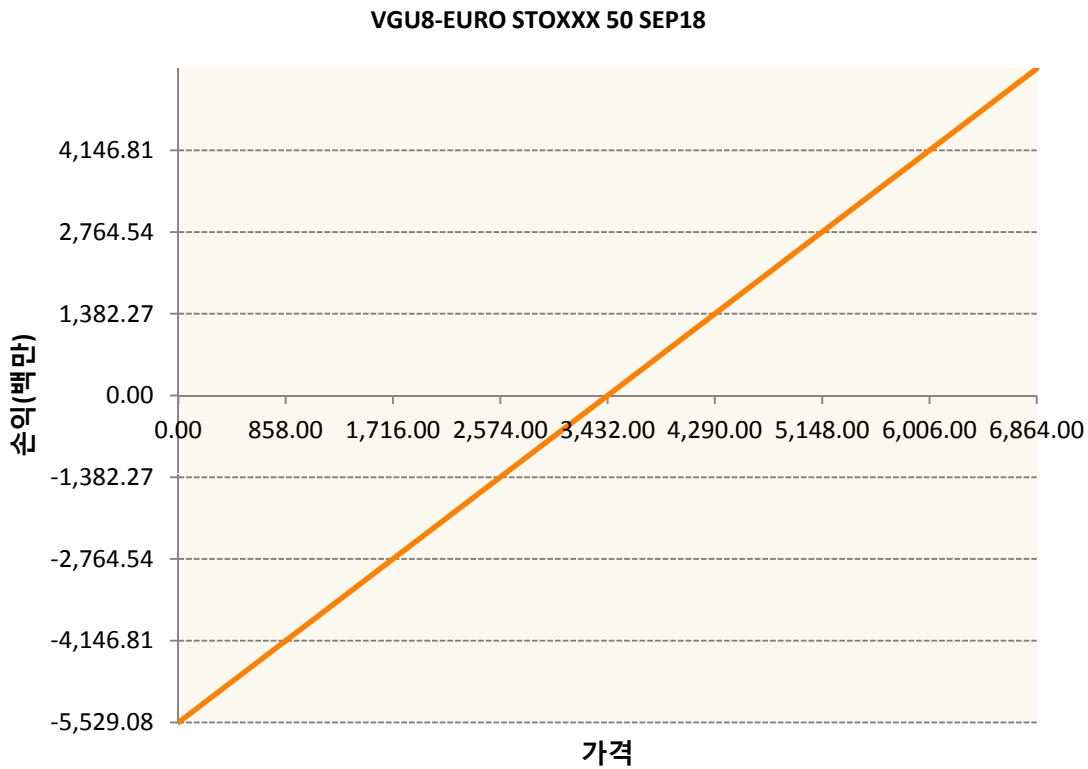
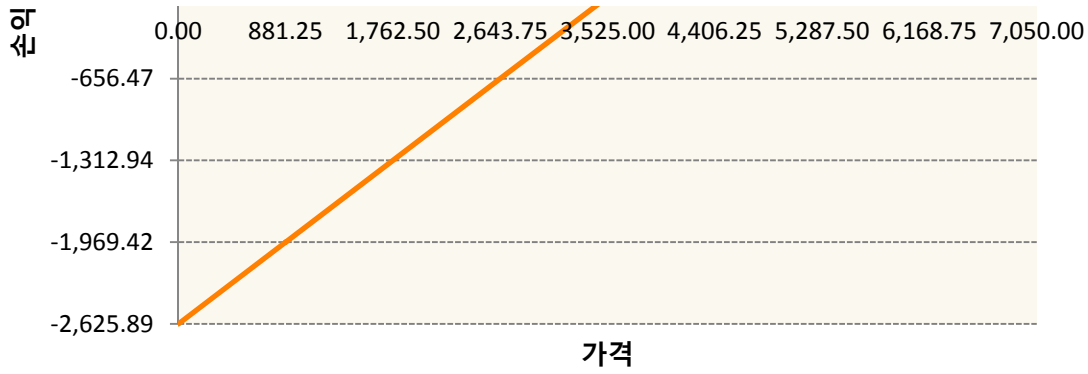


OESXN8-P3500-EURO STOXX 50



OESXN8-P3525-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		6
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY		5
OESXN8-C3! EURO STOXX 50		827
OESXN8-C3! EURO STOXX 50		210
OESXN8-P3! EURO STOXX 50		827
OESXN8-P3! EURO STOXX 50		210
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18		442

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)

89

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

(단위:백만원)

133

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

(단위:백만원)

165

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-07-09
기준일	2018-07-06

리디파인K200(주식혼합-파생재간

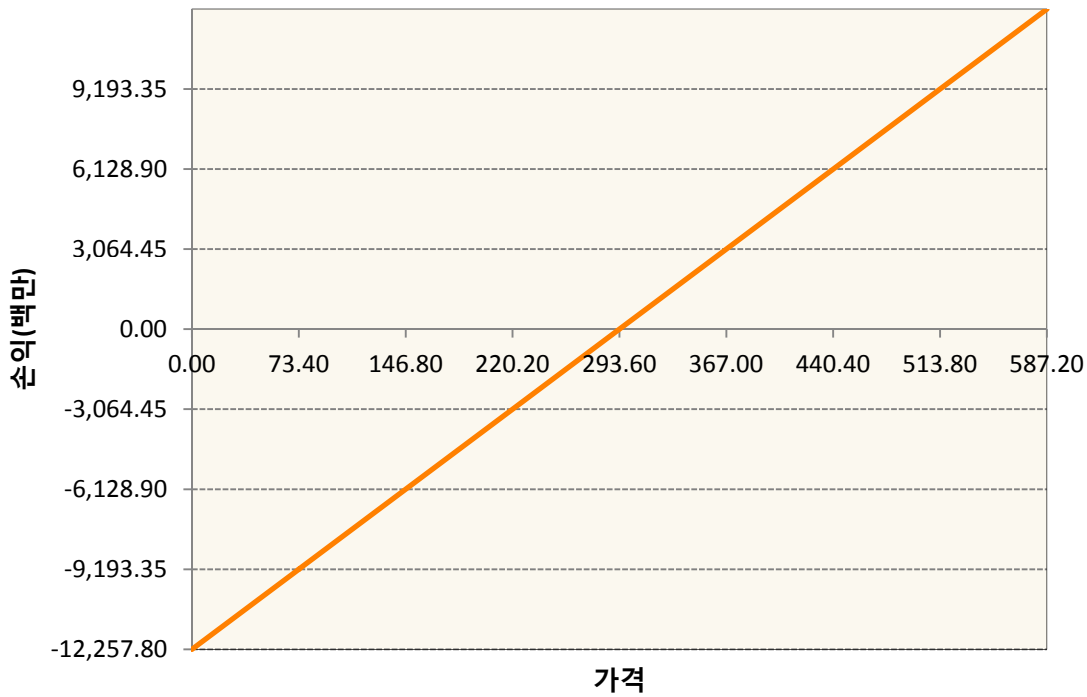
1. 계약금액

(단위:백만원)

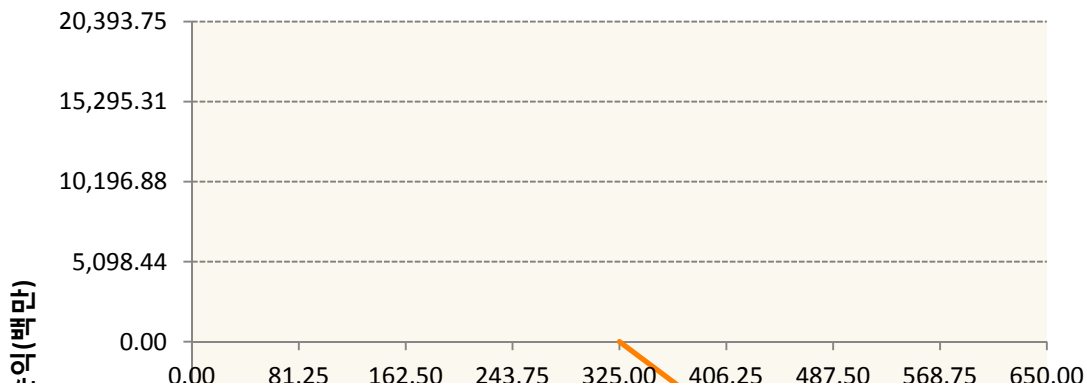
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,258	0	12,258	장내
누계	유가증권	옵션	1,628	20,394	-18,766	장내

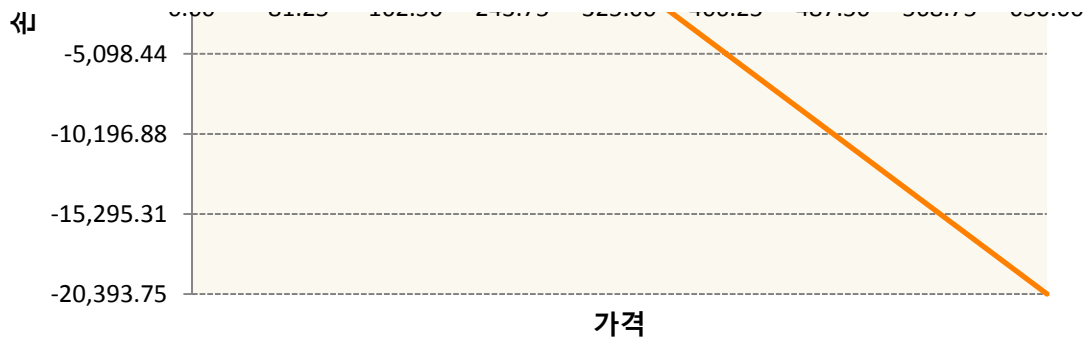
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

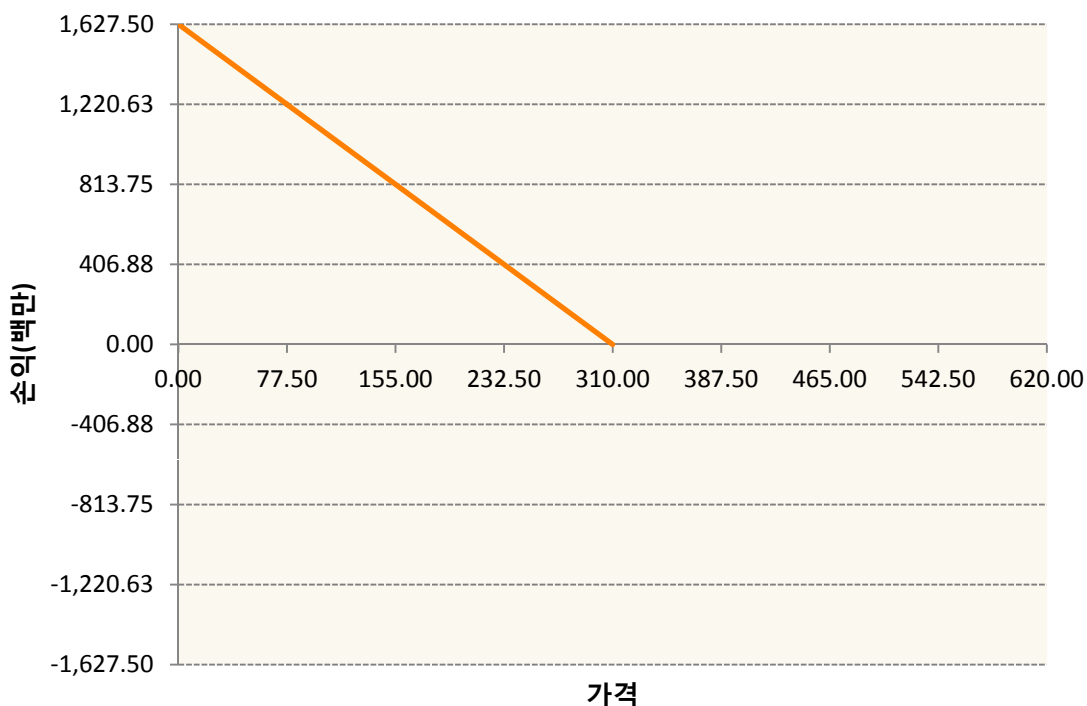


KR4201N73257-2018-07 콜325





KR4301N73107-2018-07 풋310



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물							979
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-979	-979	-979	-979	-979	-979	-979
-5.33%	-653	-653	-653	-653	-653	-653	-653
-2.67%	-326	-326	-326	-326	-326	-326	-326
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	326	326	326	326	326	326	326
5.33%	653	653	653	653	653	653	653
8.00%	979	979	979	979	979	979	979
KR4201N732 2018-07 콜325							188
기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1
-2.67%	1	1	1	1	1	0	0
0%	1	1	1	0	-1	-3	-5
2.67%	0	-1	-3	-7	-11	-17	-24
5.33%	-9	-16	-25	-36	-48	-61	-76
8.00%	-61	-80	-100	-121	-143	-165	-188

KR4301N7312018-07 풋310

123

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	123	123	123	123	123	123	123
-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%	-74	-73	-72	-70	-69	-68	-67
8.00%	-87	-87	-86	-85	-84	-83	-82

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

(단위:백만원)

899

공시일	2018-07-09
기준일	2018-07-06

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

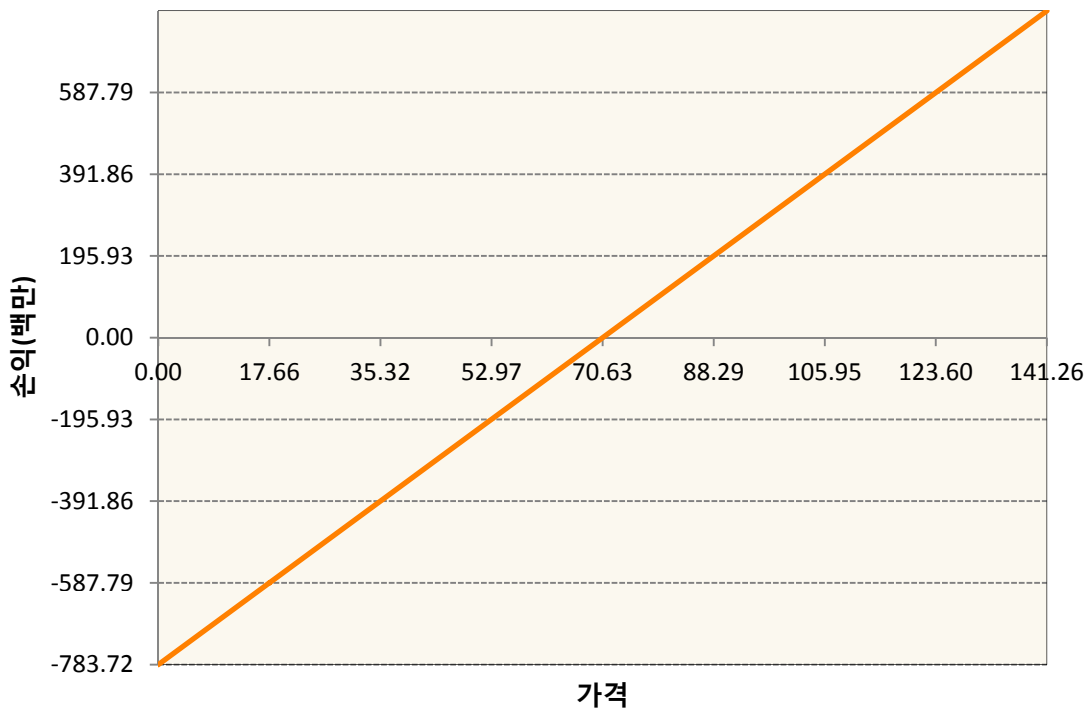
1. 계약금액

(단위:백만원)

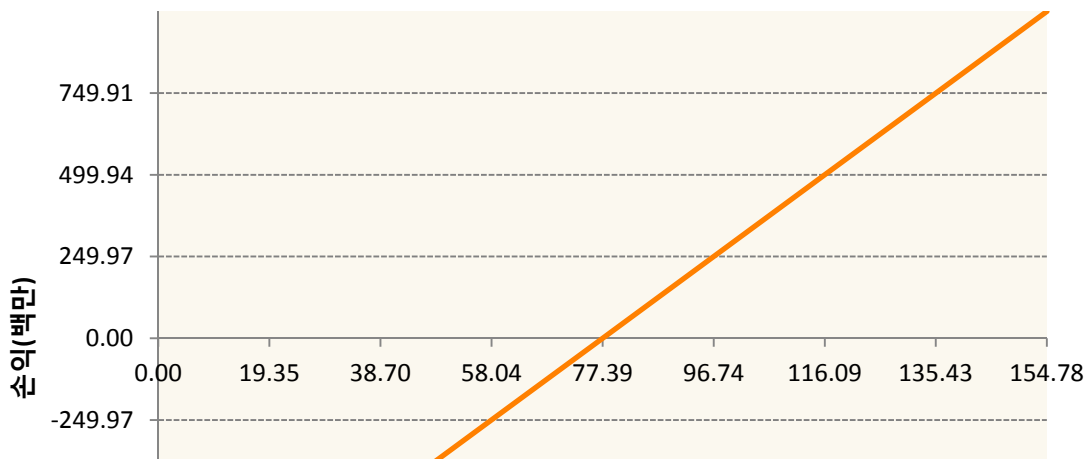
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,781	614	3,167	

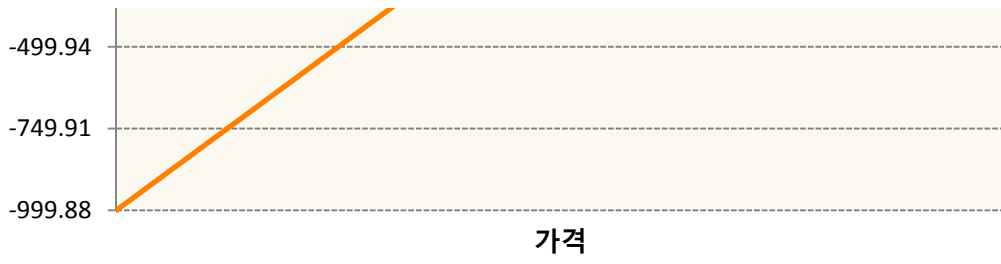
2. 만기시점의 손익구조

CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18

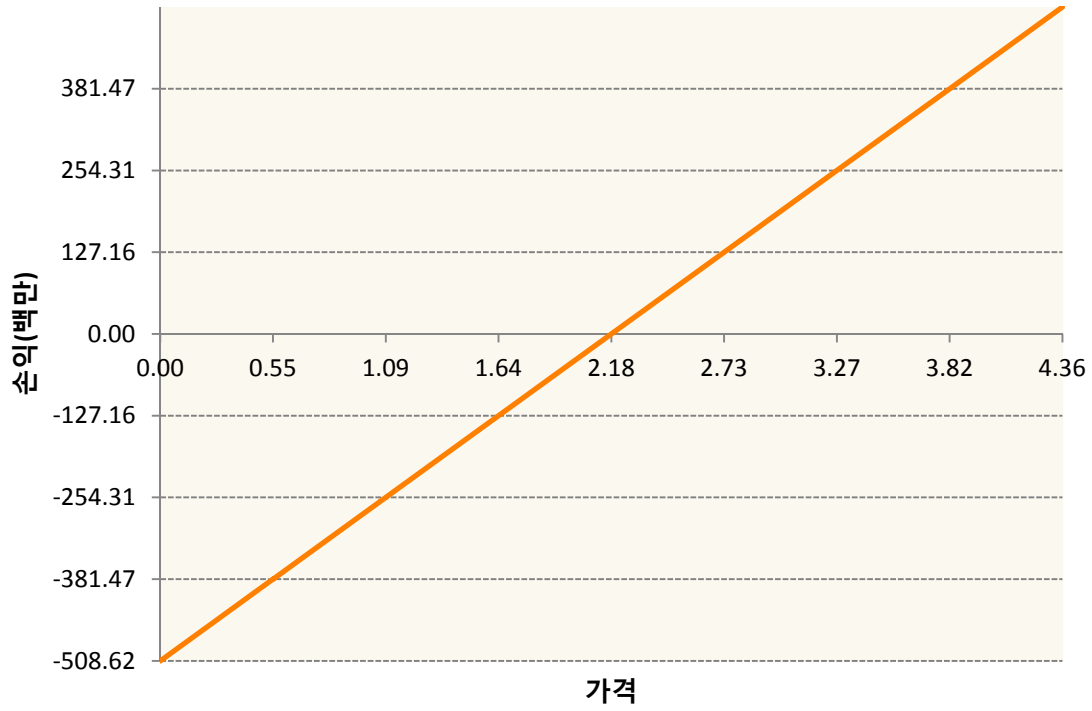


COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18

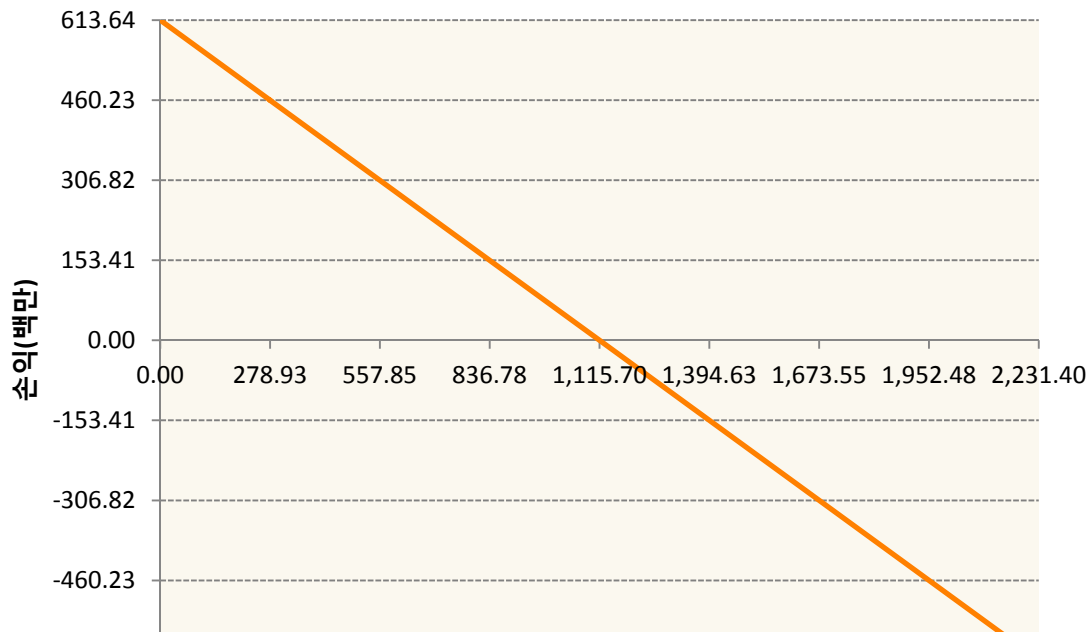


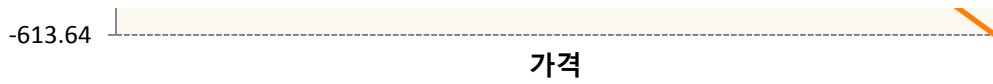


HOU8-NY Harb ULSD Fut SEP18

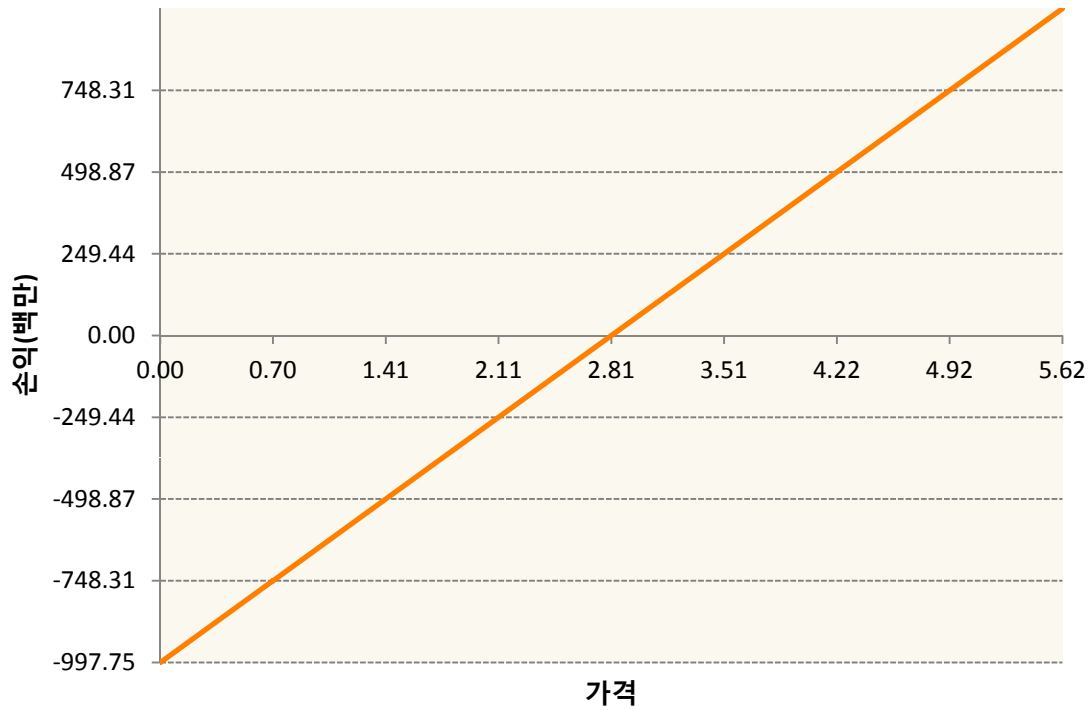


KR4175N70002-2018-07 달러선물

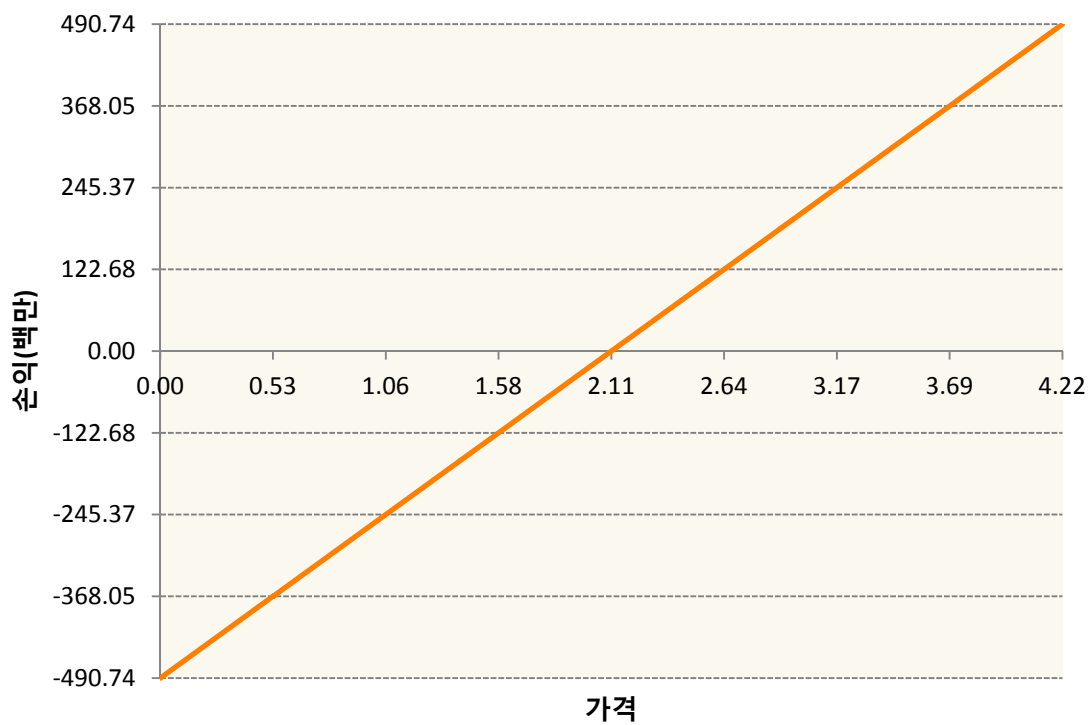




NGU18-NATURAL GAS FUTR SEP18



XBU8-GASOLINE RBOB FUT SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU8	WTI CRUDE FUTURE SEP18	63
COU8	BRENT CRUDE FUTR SEP18	80
HOU8	NY Harb ULSD Fut SEP18	41
KR4175N70C	2018-07 달러선물	49
NGU18	NATURAL GAS FUTR SEP18	80
XBU8	GASOLINE RBOB FUT SEP18	39

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

439

공시일	2018-07-09
기준일	2018-07-06

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

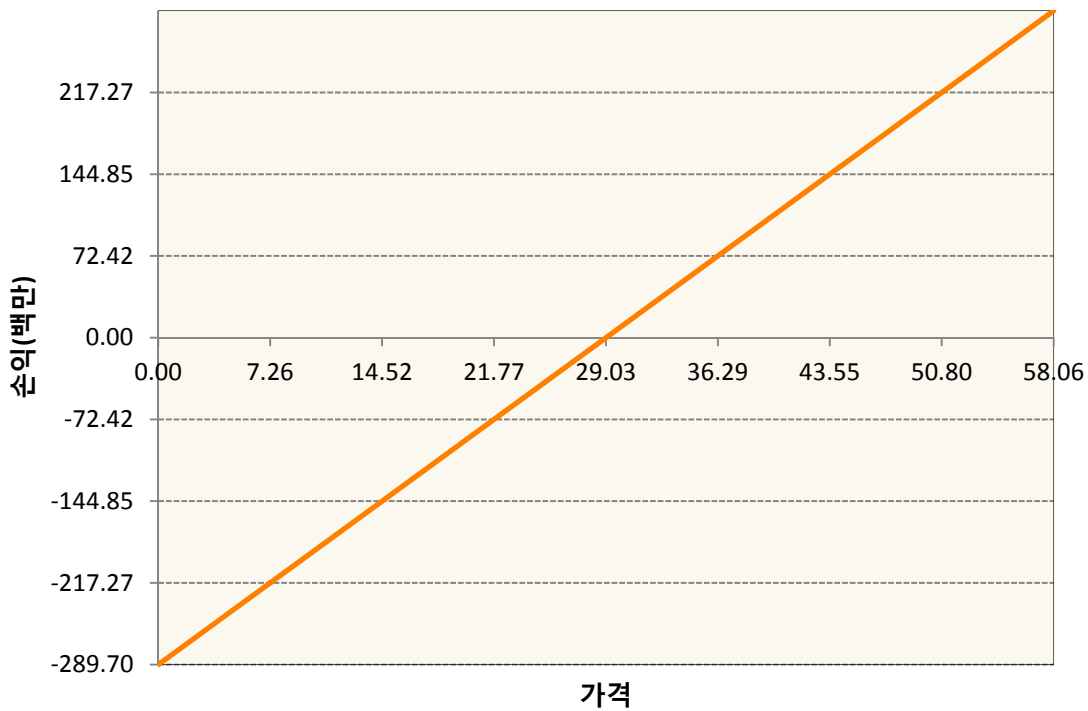
1. 계약금액

(단위:백만원)

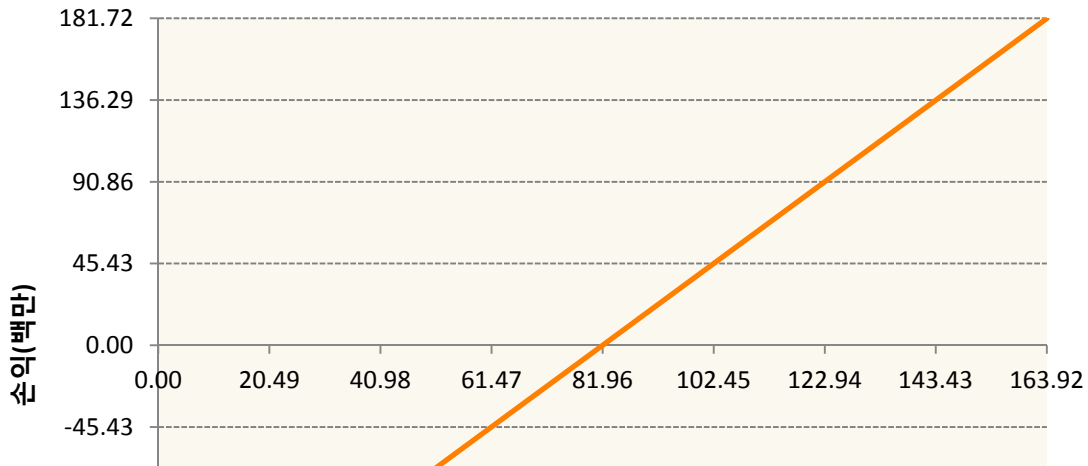
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,626	78	3,548	

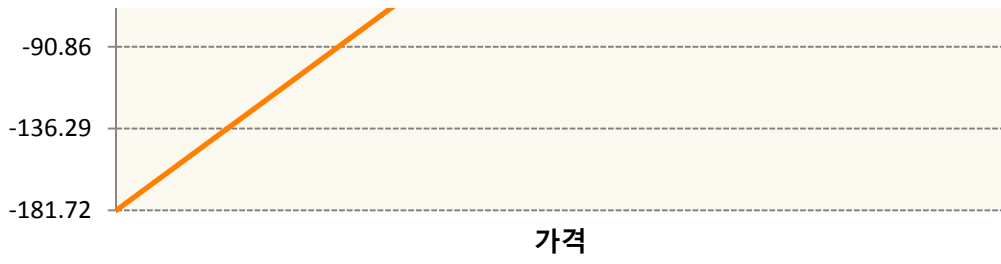
2. 만기시점의 손익구조

BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18

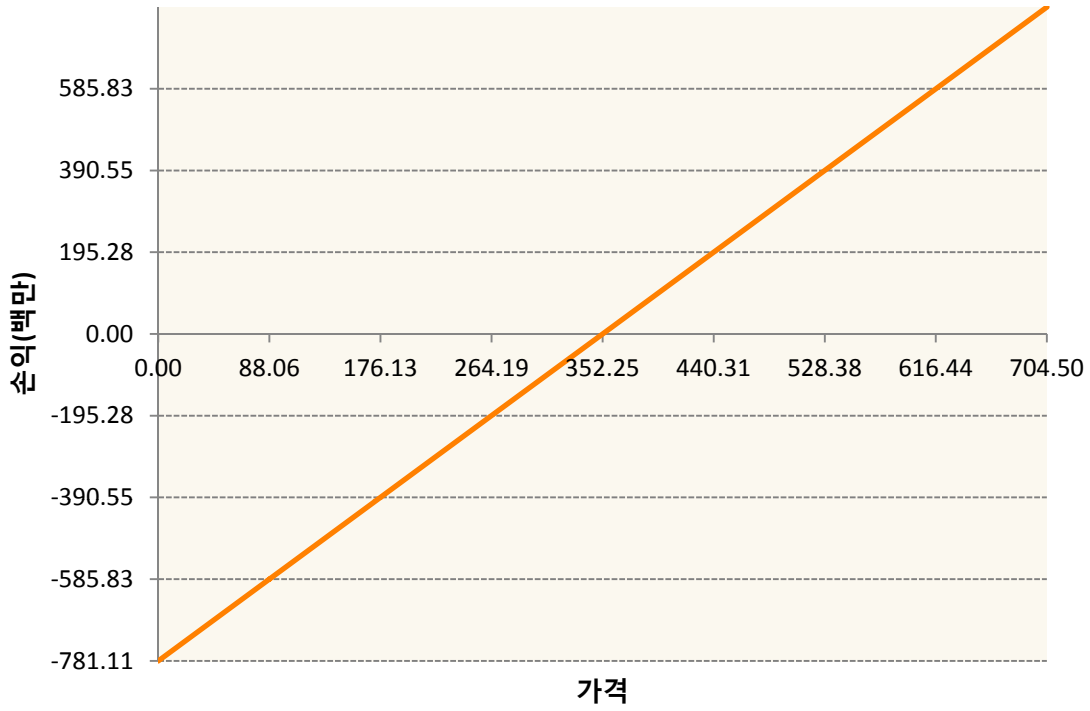


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

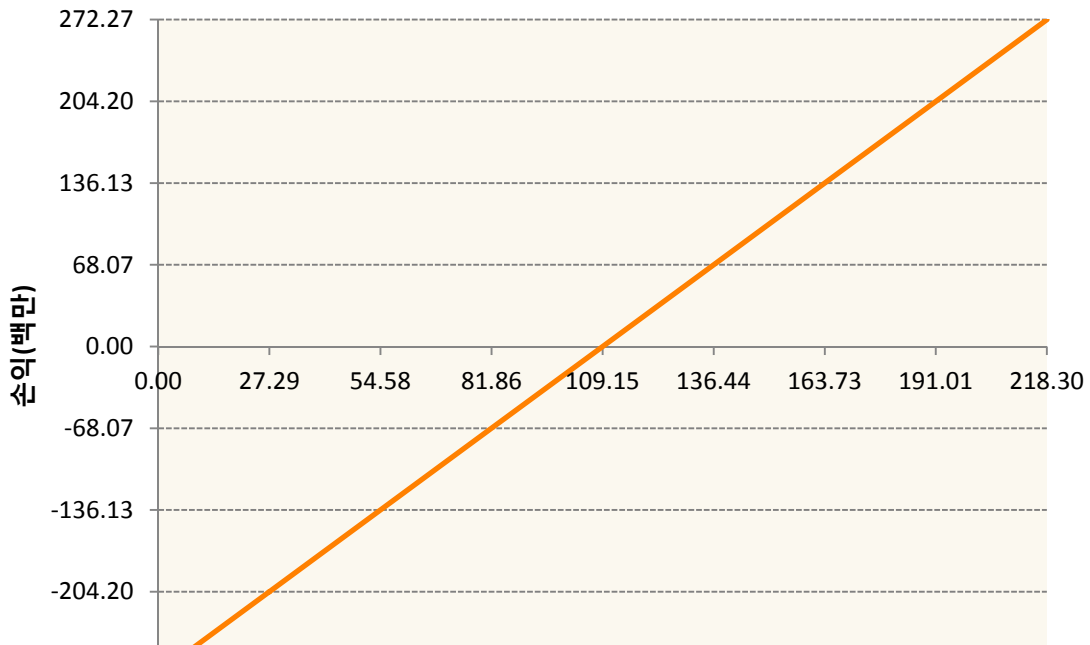


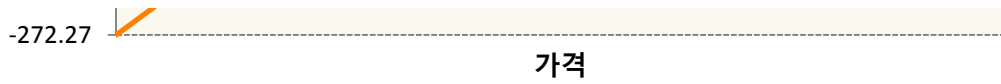


CU8-CORN FUTURE SEP18

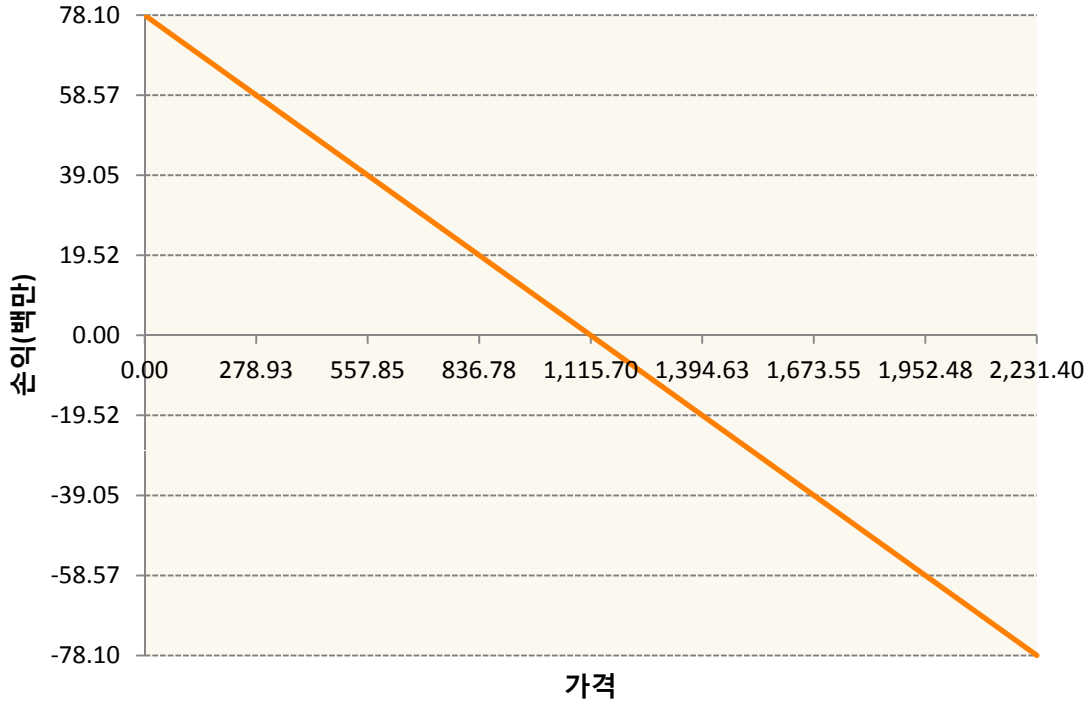


KCU8-COFFEE 'C' FUTURE SEP18

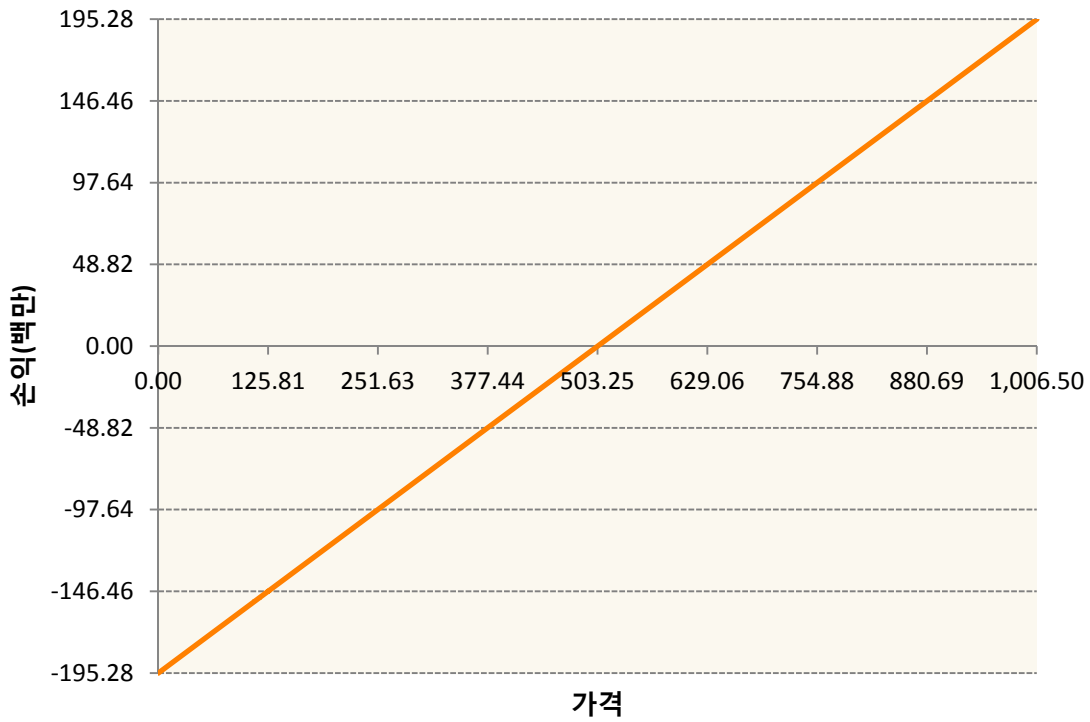




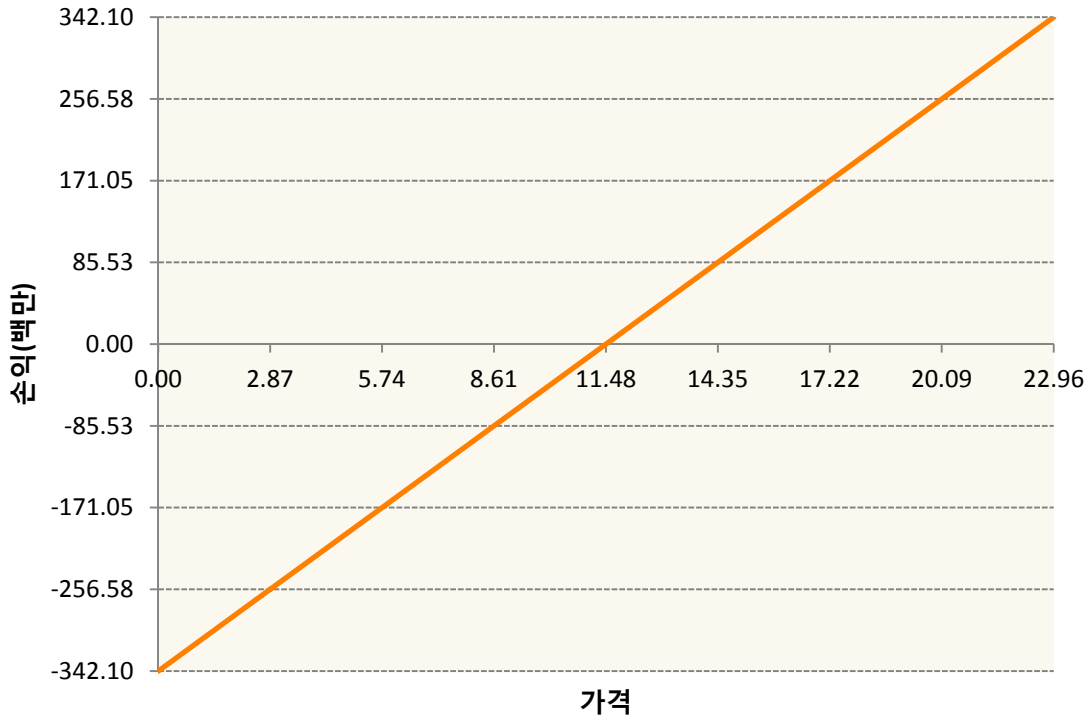
KR4175N70002-2018-07 달러선물



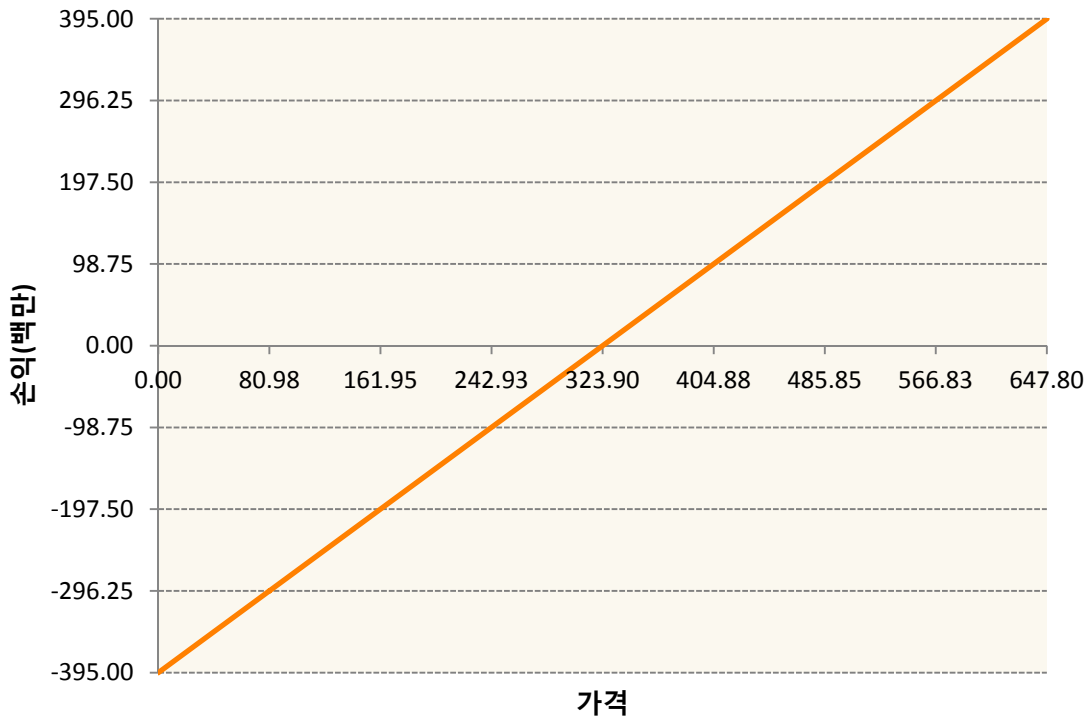
KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18



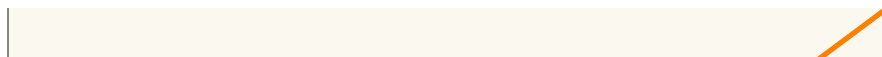
SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

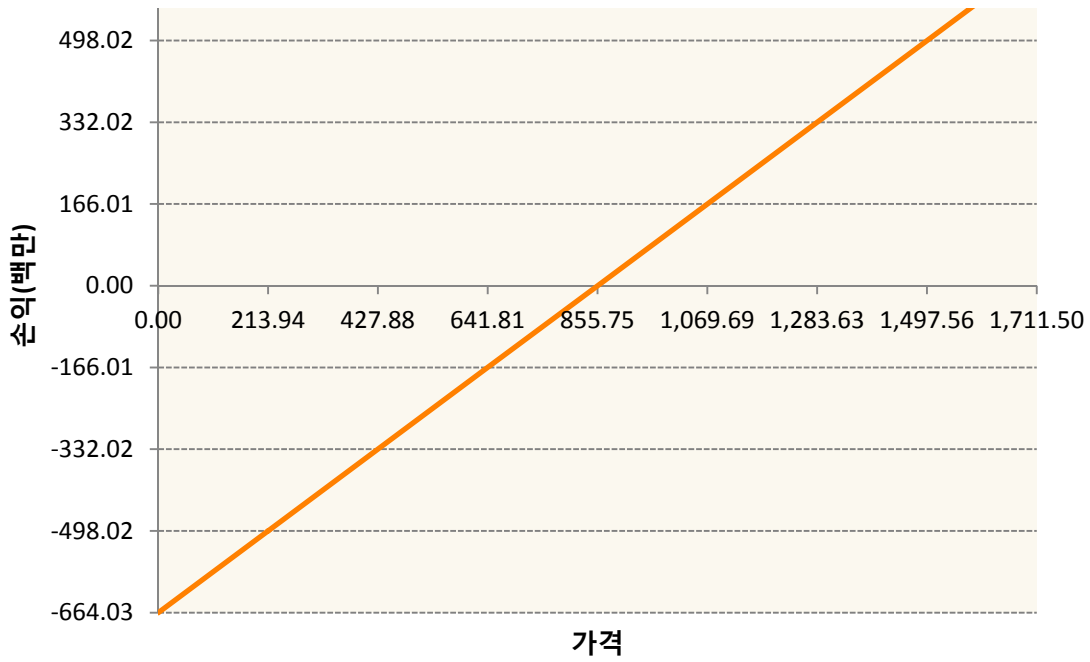


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

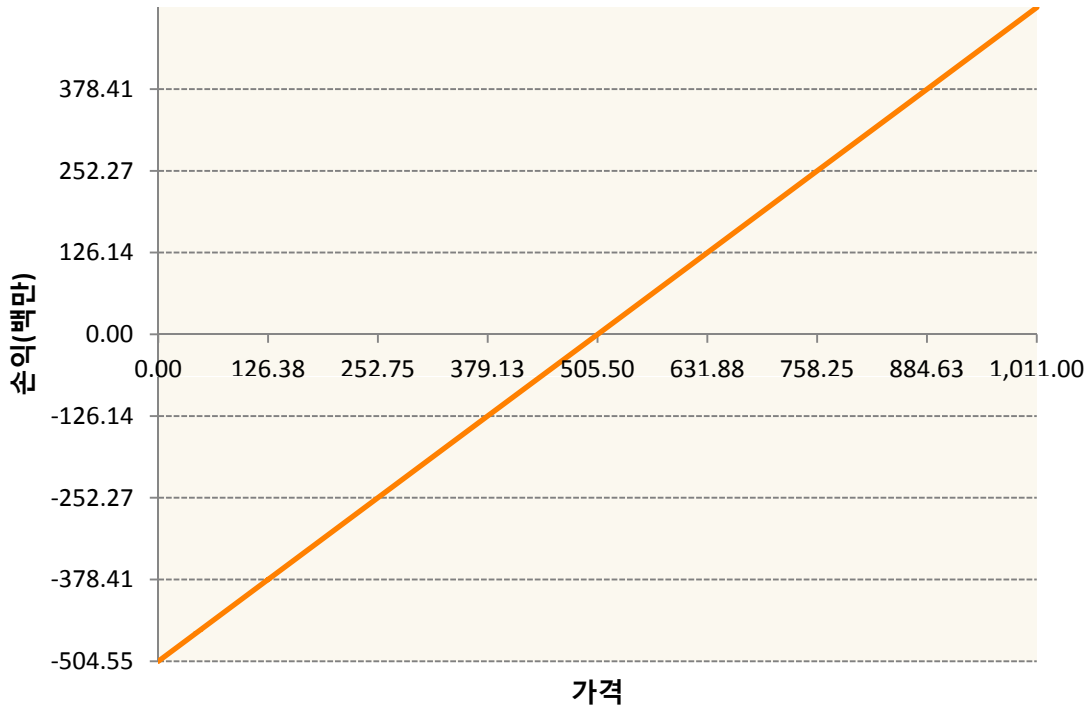


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





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	16
SBV8	SUGAR #11 (WORLD) OCT18	27
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	32
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	53
WU8	WHEAT FUTURE(CBT) SEP18	40

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

(단위:백만원)

299