

공시일	2018-07-13
기준일	2018-07-12

## 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	2018-07-13
기준일	2018-07-12

## 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

1,120

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

475

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-07-13
기준일	2018-07-12

## 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

329

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

402

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-07-13
기준일	2018-07-12

## 유로인덱스모(주식-파생형)

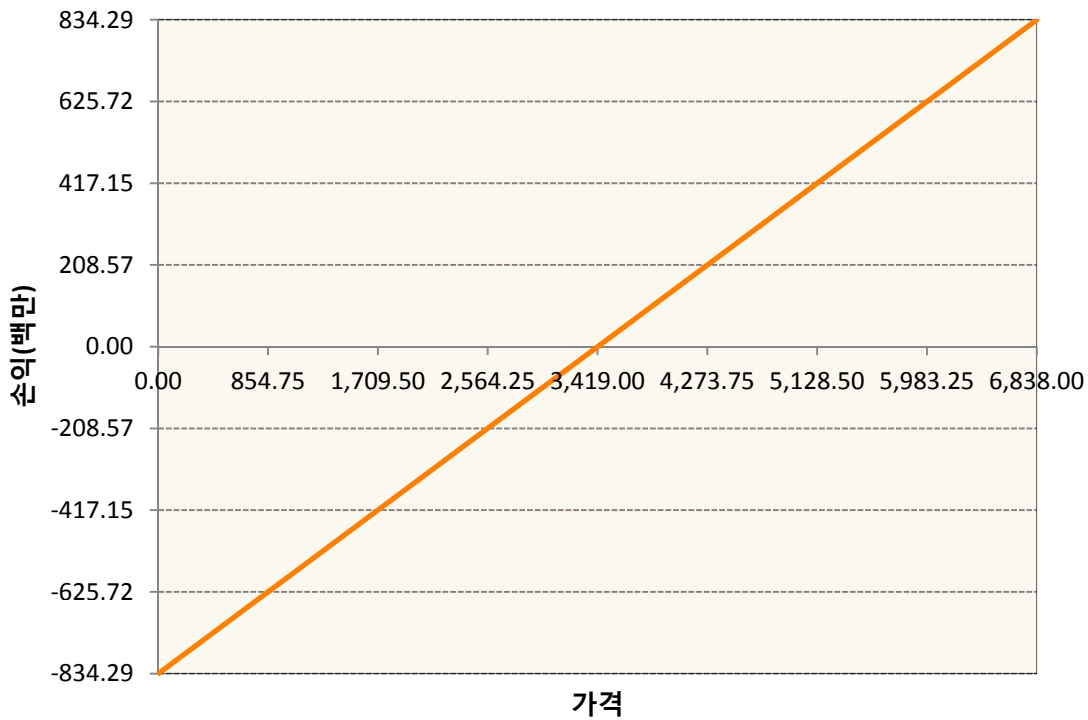
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	834	0	834	

### 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	2018-07-13
기준일	2018-07-12

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

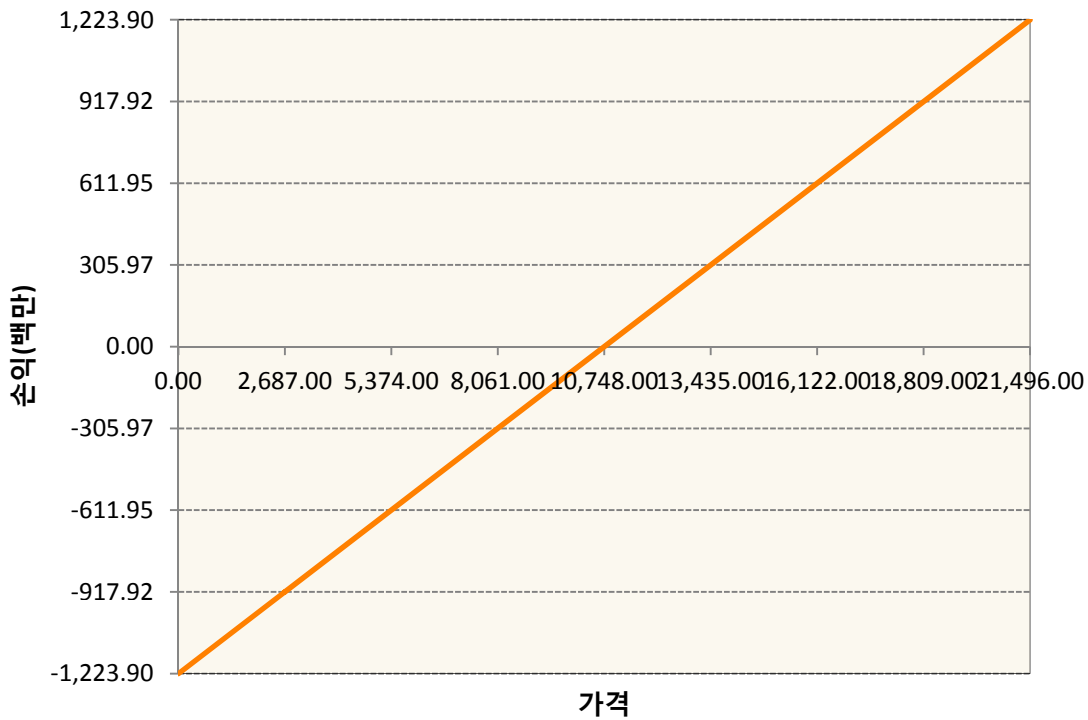
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

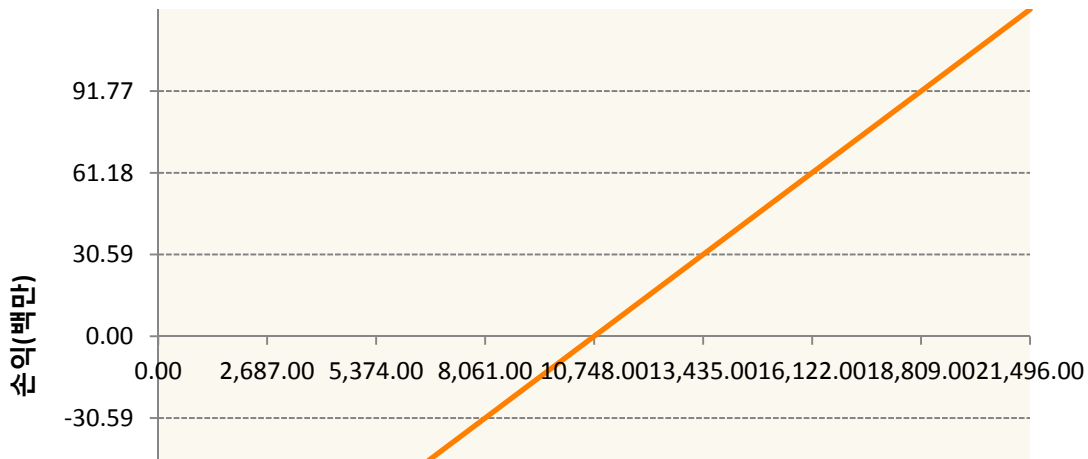
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,346	0	1,346	장내

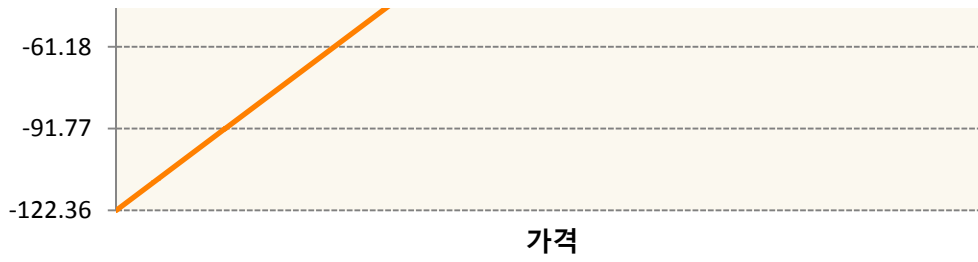
### 2. 만기시점의 손익구조

HCN8-HSCEI Futures Jul18



MHCN8-MINI H-SHR IDX FU JUL18





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

HCN8	HSCEI Futures Jul18	98
MHCN8	MINI H-SHR IDX FU JUL18	10

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

<b>98</b>
-----------

공시일	2018-07-13
기준일	2018-07-12

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

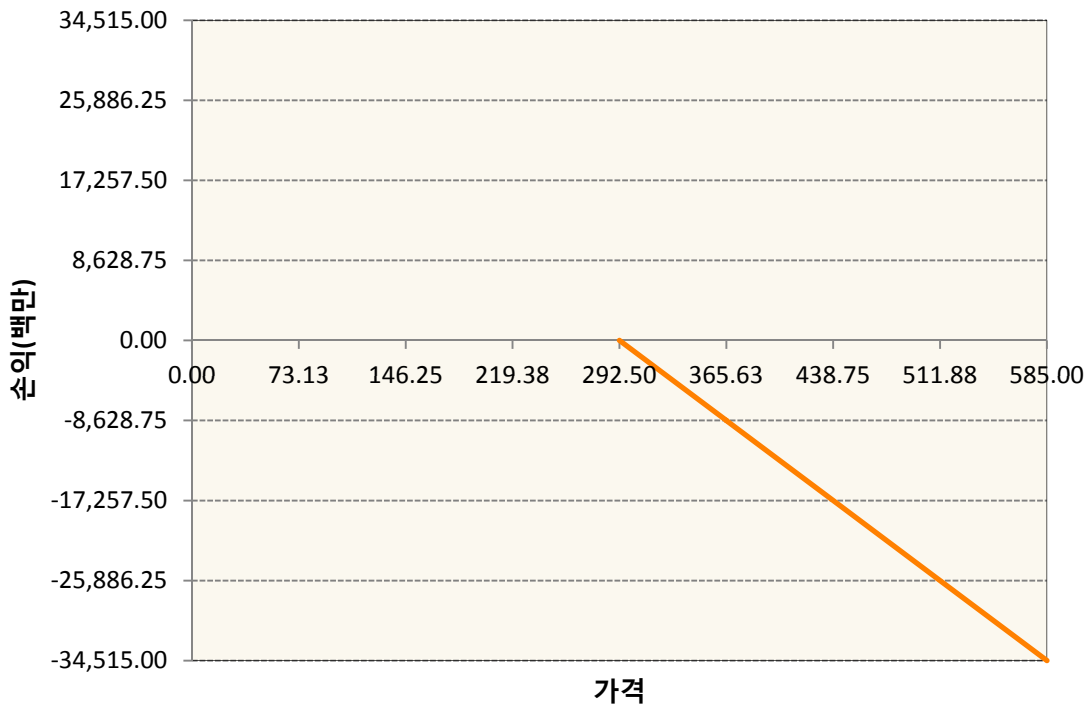
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

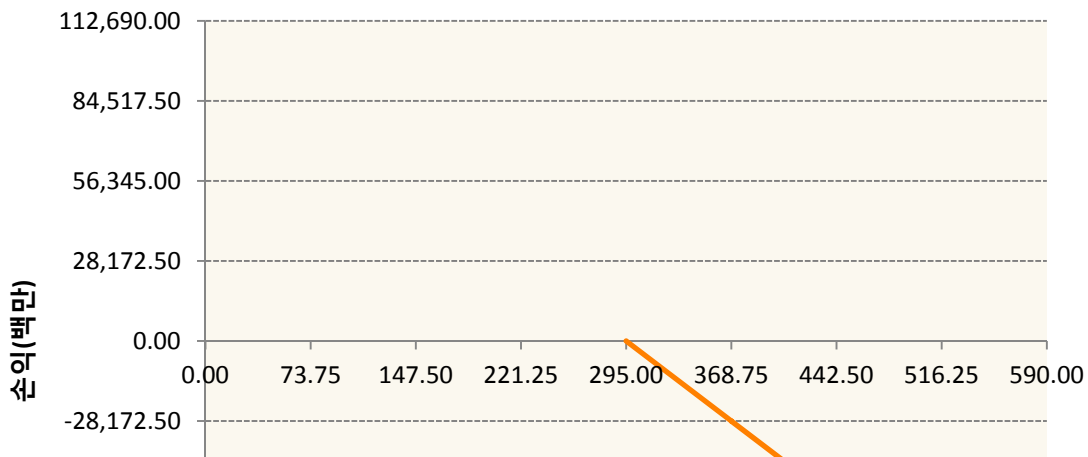
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	156,730	-156,730	장내
누계	유가증권	옵션	0	154,643	-154,643	장내

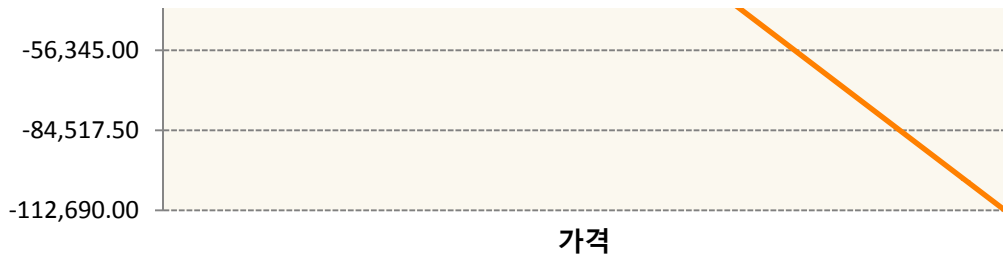
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201N82928-2018-08 콜292.5**

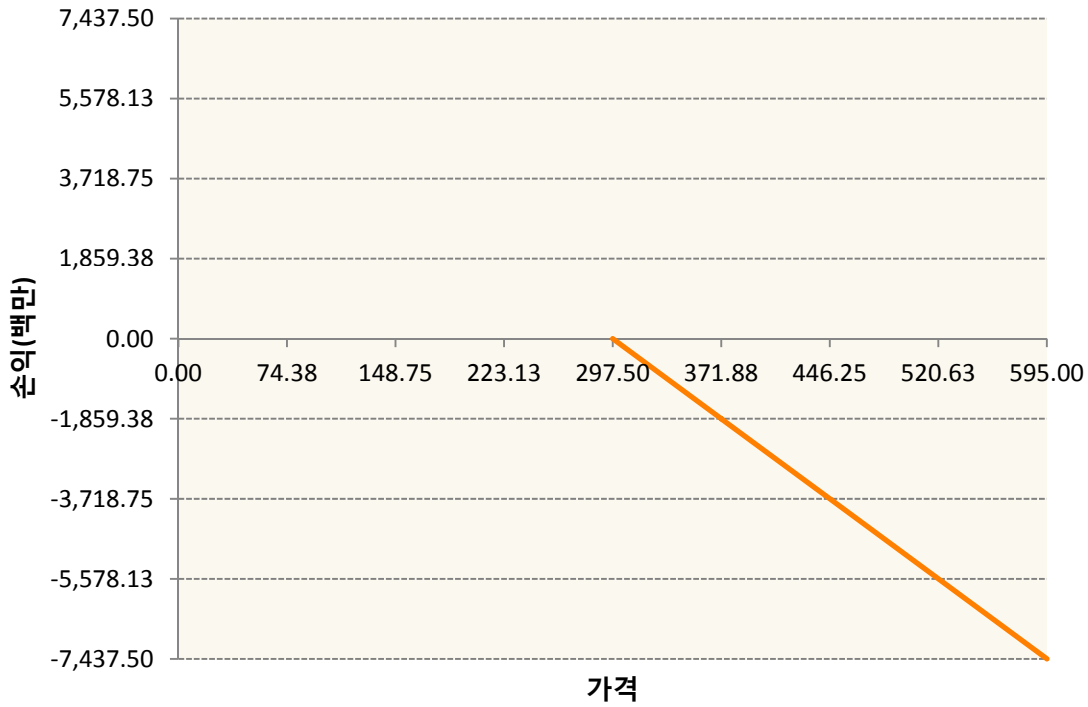


**KR4201N82951-2018-08 콜295**





KR4201N82977-2018-08 콜297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N82977-2018-08 콜292.5

2,185

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,143	1,098	1,047	992	932	868	802
-5.33%	991	922	849	773	696	616	535
-2.67%	713	625	536	447	357	266	175
0%	281	187	94	0	-94	-187	-281
2.67%	-309	-392	-478	-565	-653	-743	-833
5.33%	-1,030	-1,094	-1,163	-1,236	-1,312	-1,391	-1,472
8.00%	-1,845	-1,887	-1,937	-1,992	-2,053	-2,117	-2,185

KR4201N82977-2018-08 콜295

6,817

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,311	3,188	3,045	2,883	2,705	2,515	2,313

-5.33%	2,916	2,713	2,496	2,268	2,030	1,784	1,532
-2.67%	2,154	1,882	1,604	1,323	1,038	752	463
0%	916	611	305	0	-305	-611	-916
2.67%	-833	-1,122	-1,414	-1,709	-2,006	-2,305	-2,605
5.33%	-3,040	-3,272	-3,518	-3,773	-4,037	-4,308	-4,583
8.00%	-5,590	-5,752	-5,935	-6,136	-6,352	-6,579	-6,817

KR4201N829 2018-08 콜 297.5

428

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	193	186	178	168	158	146	134
-5.33%	172	160	147	134	119	104	88
-2.67%	130	114	96	79	61	42	24
0%	60	40	20	0	-20	-40	-60
2.67%	-44	-64	-84	-104	-124	-144	-164
5.33%	-180	-196	-214	-232	-250	-269	-287
8.00%	-340	-352	-366	-380	-396	-412	-428

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

(단위:백만원)

8,727

공시일	2018-07-13
기준일	2018-07-12

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

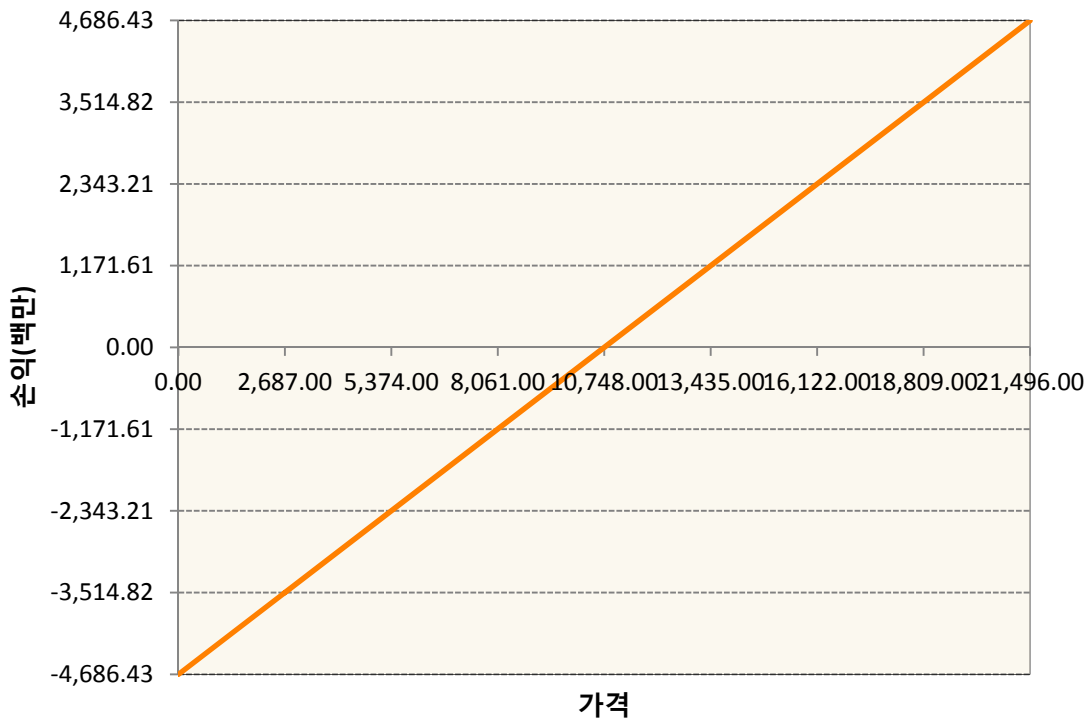
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

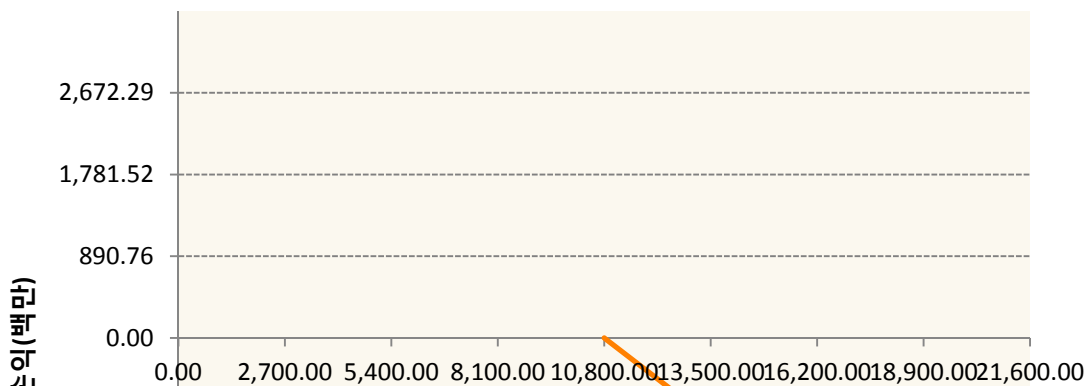
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,686	0	4,686	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,755	-10,755	장내

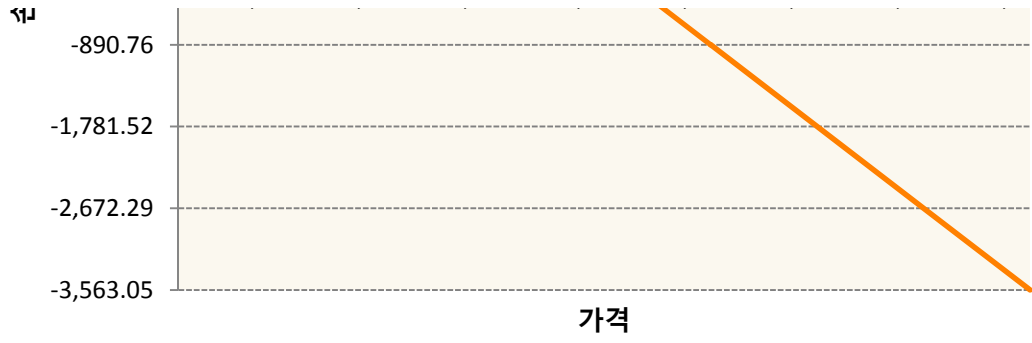
### 2. 만기시점의 손익구조

HCN8-HSCEI Futures Jul18

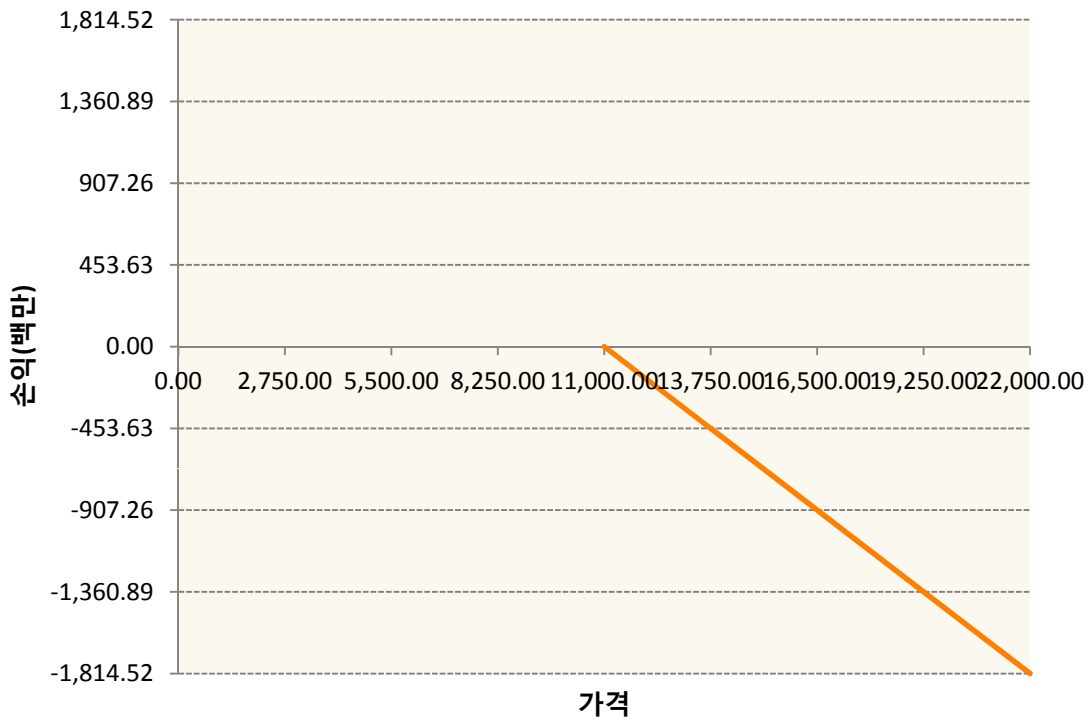


OHHIN8-C108-HSCEI

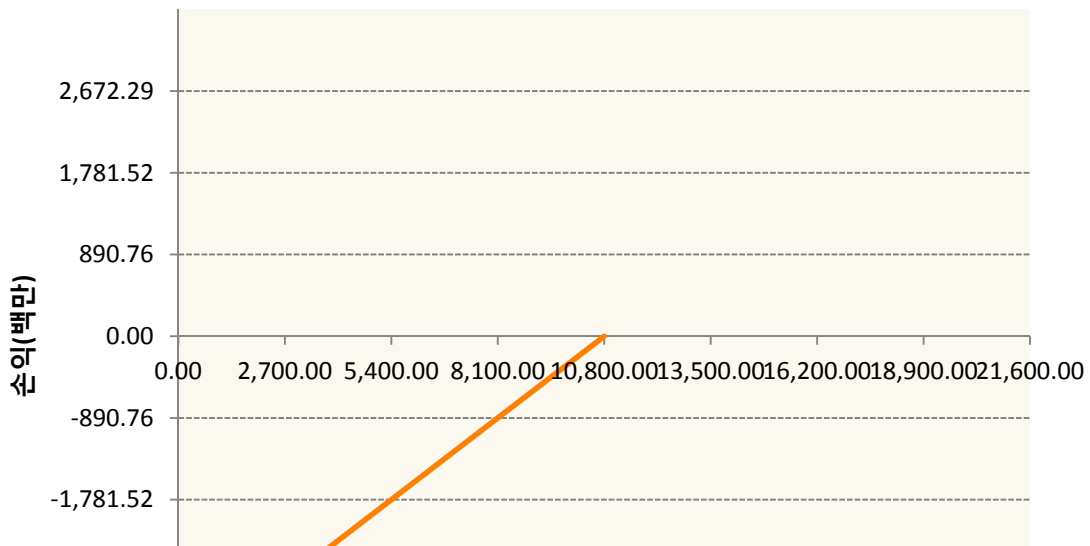


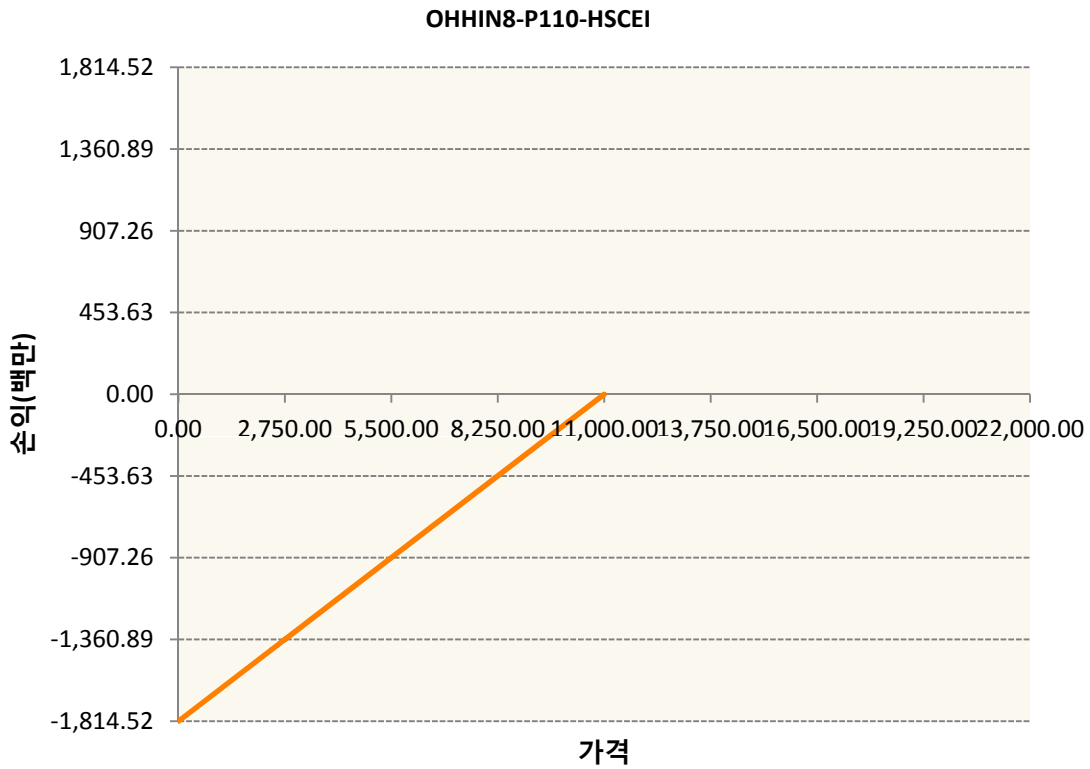
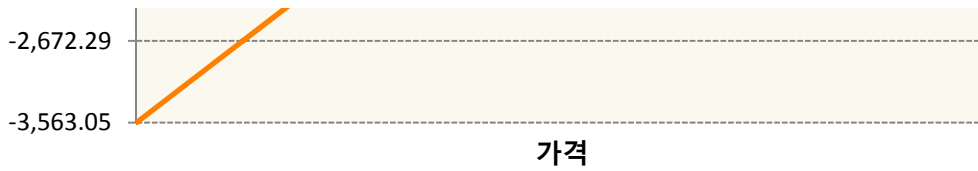


OHHIN8-C110-HSCEI



OHHIN8-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCN8	HSCEI Futures Jul18	375
OHHIN8-C1	(HSCEI	285
OHHIN8-C1	: HSCEI	145
OHHIN8-P1	(HSCEI	285
OHHIN8-P11	HSCEI	145

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,122



2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7							259
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-259	-259	-259	-259	-259	-259	-259
-5.33%	-173	-173	-173	-173	-173	-173	-173
-2.67%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	86	86	86	86	86	86	86
5.33%	173	173	173	173	173	173	173
8.00%	259	259	259	259	259	259	259

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8							479
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-479	-479	-479	-479	-479	-479	-479
-5.33%	-320	-320	-320	-320	-320	-320	-320
-2.67%	-160	-160	-160	-160	-160	-160	-160
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	160	160	160	160	160	160	160
5.33%	320	320	320	320	320	320	320
8.00%	479	479	479	479	479	479	479

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11							648
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-648	-648	-648	-648	-648	-648	-648
-5.33%	-432	-432	-432	-432	-432	-432	-432
-2.67%	-216	-216	-216	-216	-216	-216	-216
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

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

(단위:백만원)

3,898

공시일	2018-07-13
기준일	2018-07-12

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

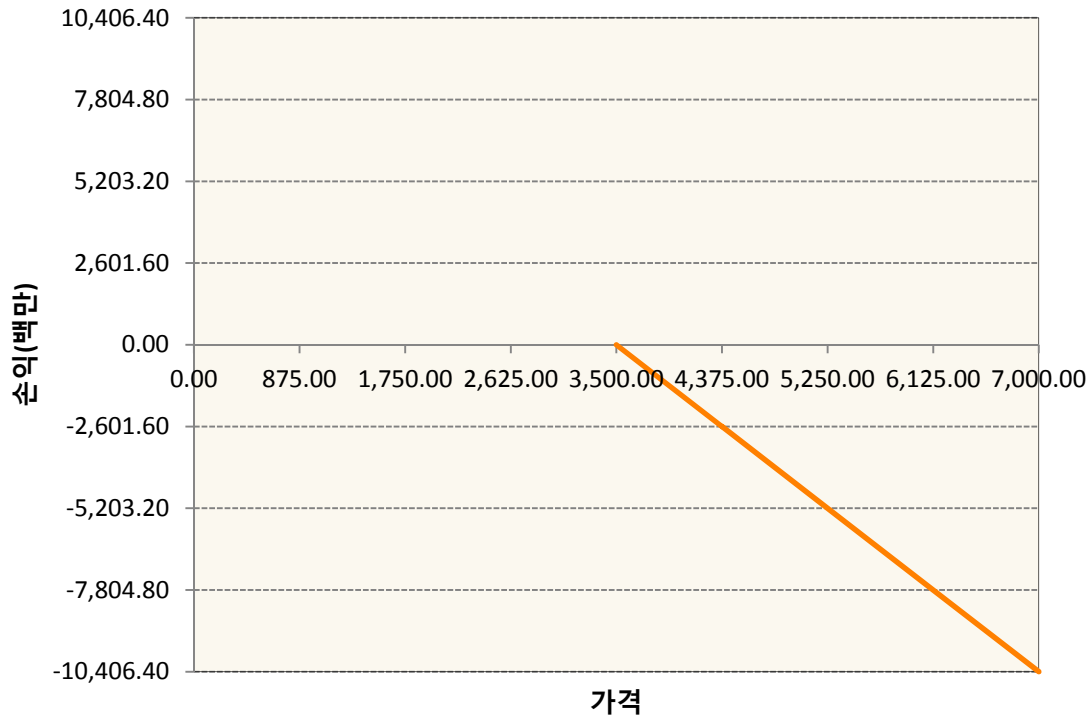
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

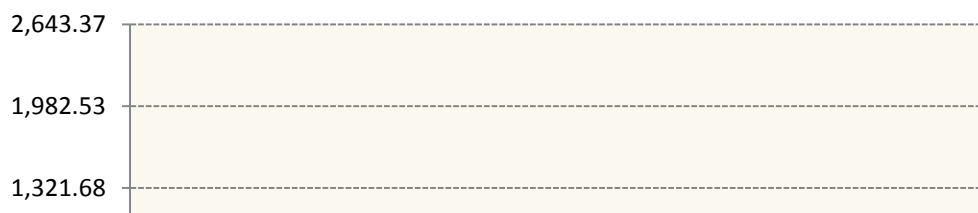
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,507	0	5,507	
누계	유가증권	스왑	44,941	0	44,941	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,100	-26,100	장내
누계	지수	스왑	52,623	0	52,623	장외

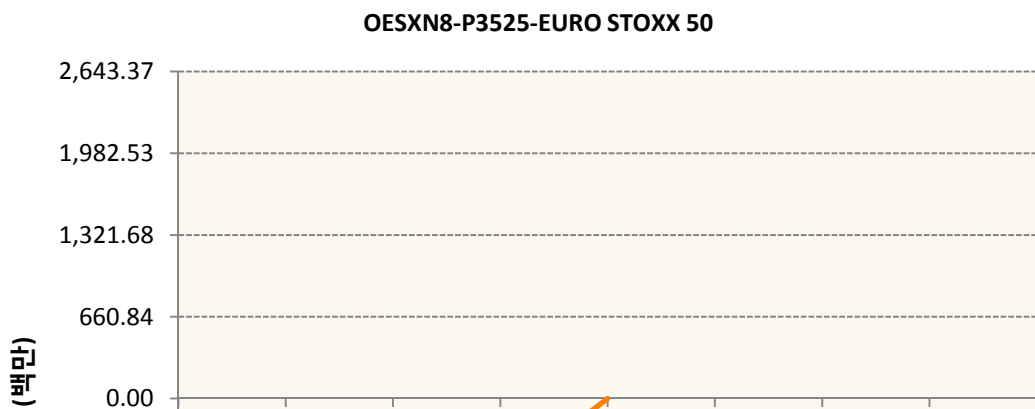
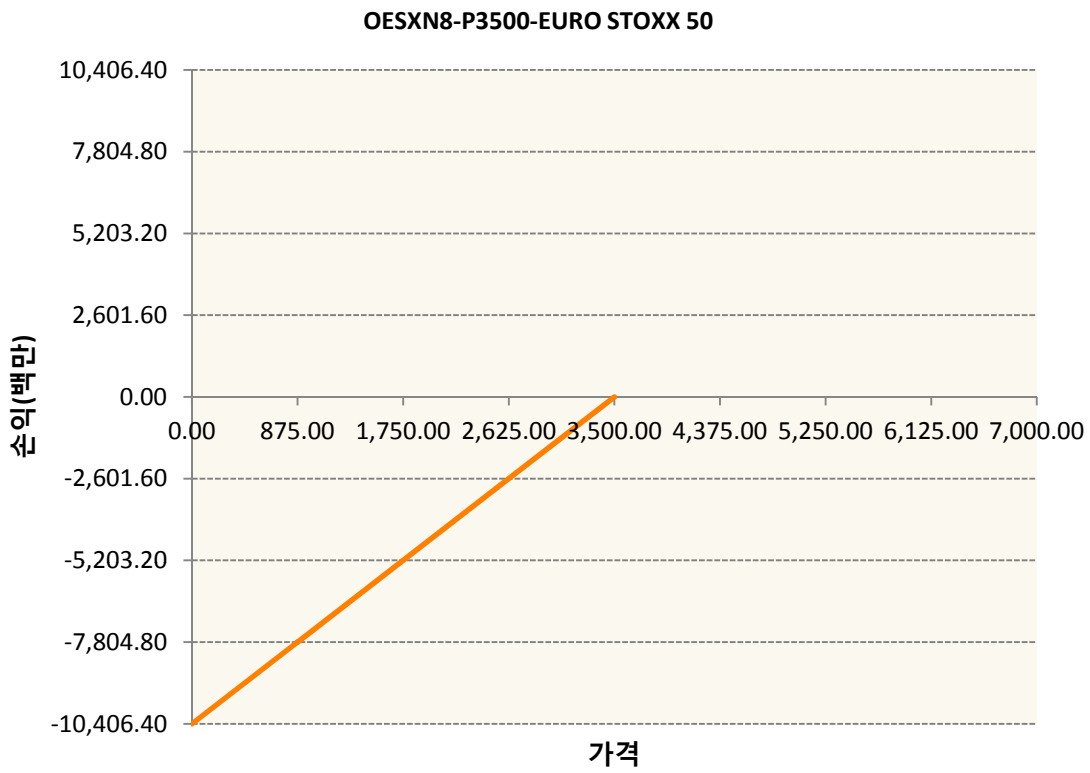
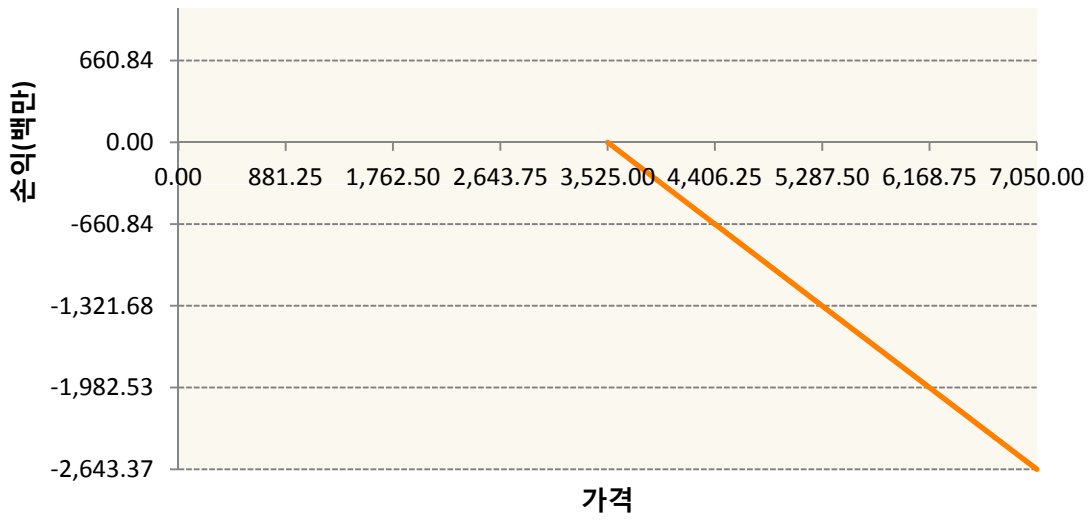
### 2. 만기시점의 손익구조

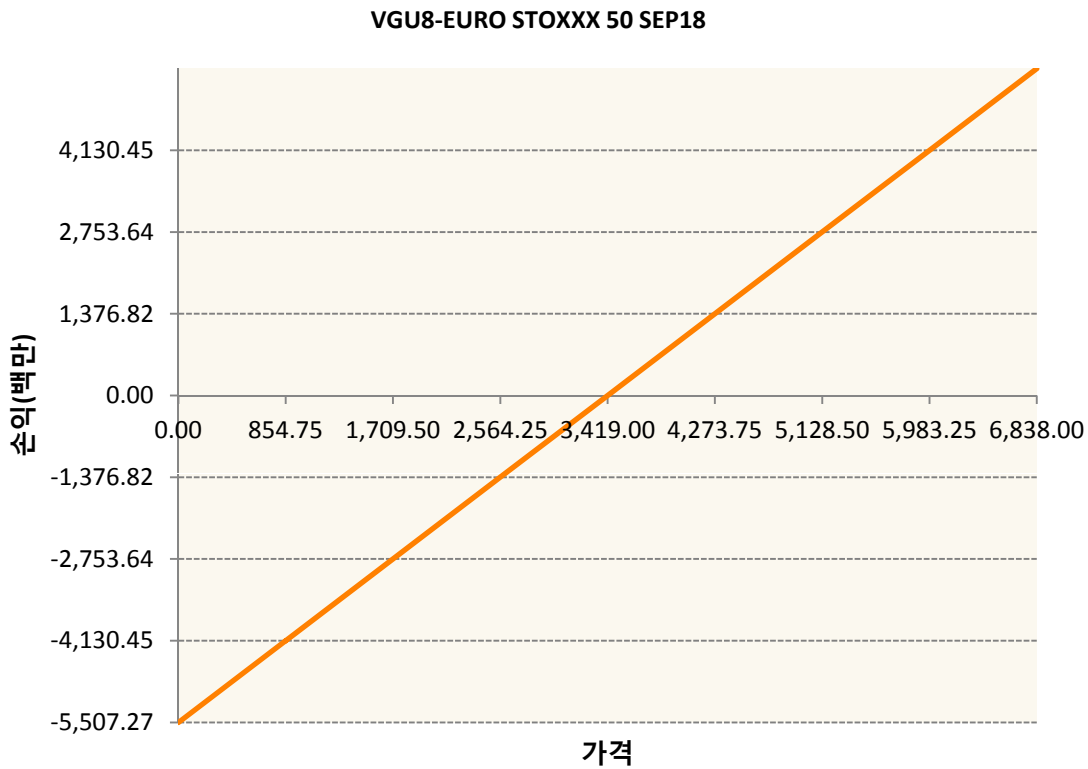
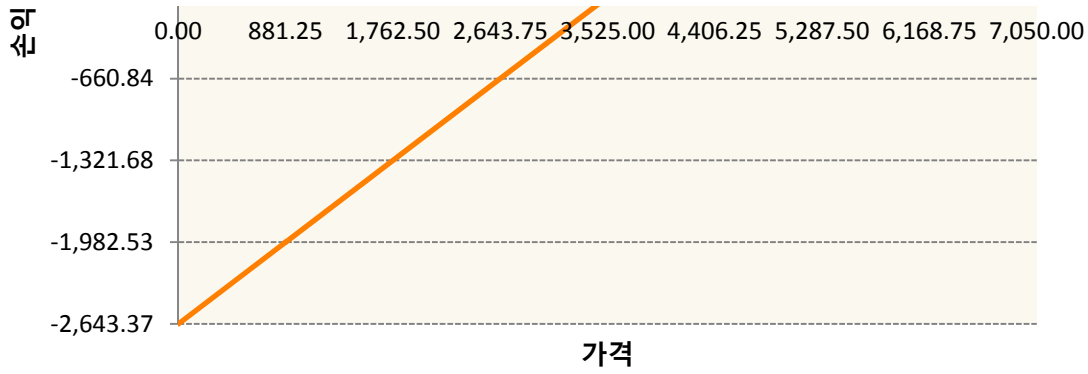
**OESXN8-C3500-EURO STOXX 50**



**OESXN8-C3525-EURO STOXX 50**







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		5
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY		4
OESXN8-C3! EURO STOXX 50		832
OESXN8-C3! EURO STOXX 50		211
OESXN8-P3! EURO STOXX 50		832
OESXN8-P3! EURO STOXX 50		211
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18		441

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





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

(단위:백만원)

1,144



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

(단위:백만원)

89



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

(단위:백만원)

134



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

(단위:백만원)

166



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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-07-13
기준일	2018-07-12

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

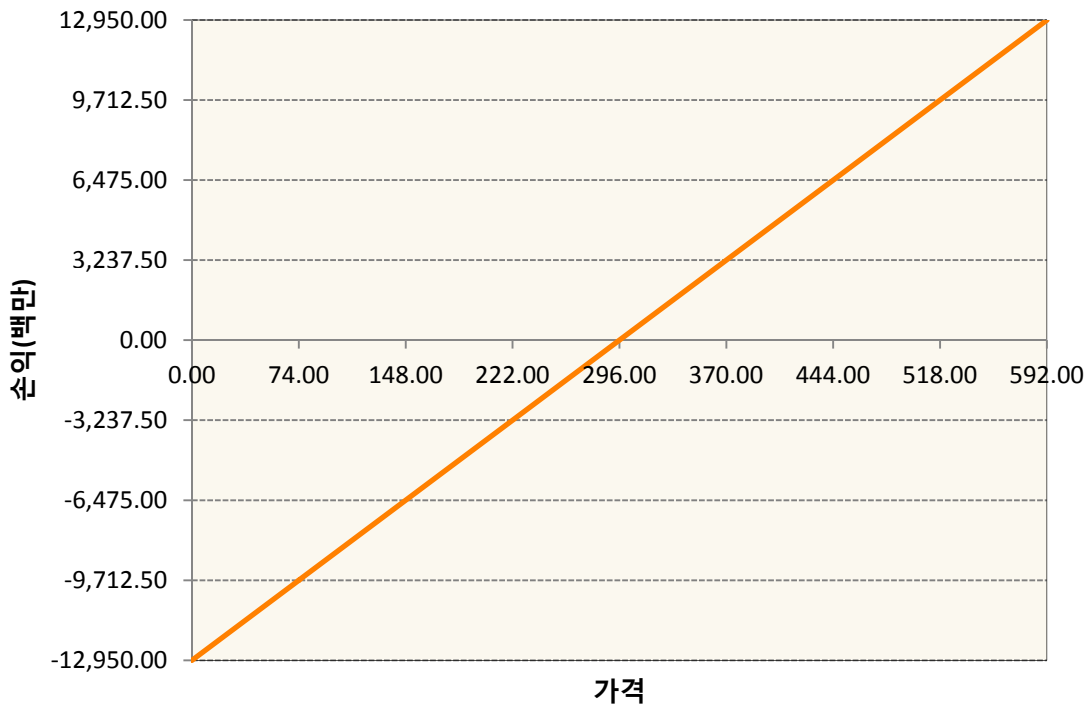
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

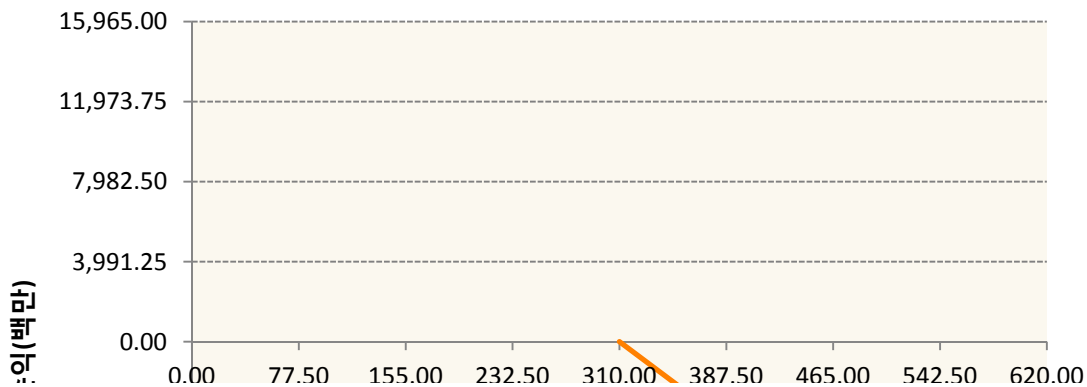
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	1,459	23,797	-22,338	장내
누계	유가증권	선물	12,950	0	12,950	장내
누계	유가증권	옵션	1,480	23,778	-22,298	장내

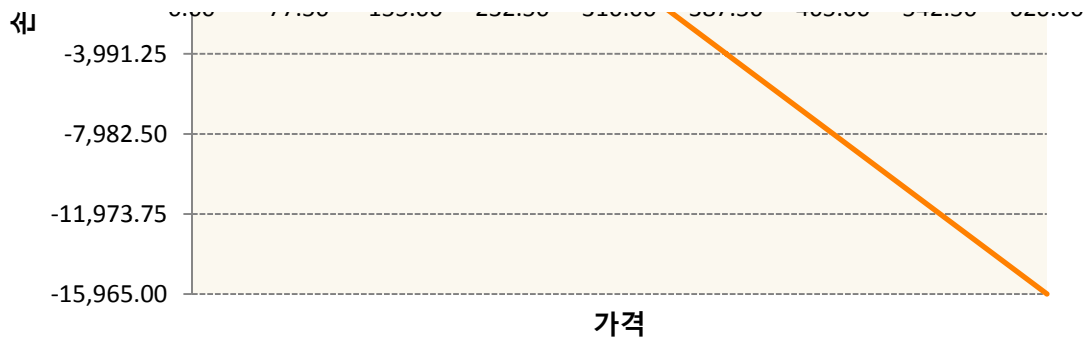
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

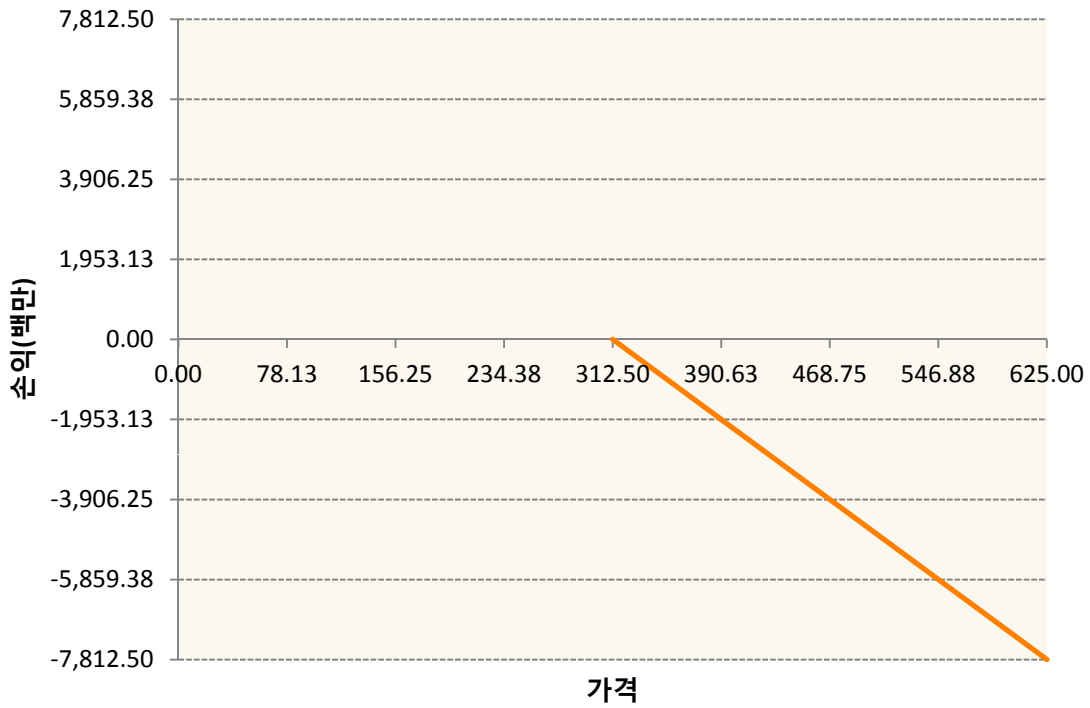


KR4201N83108-2018-08 콜310

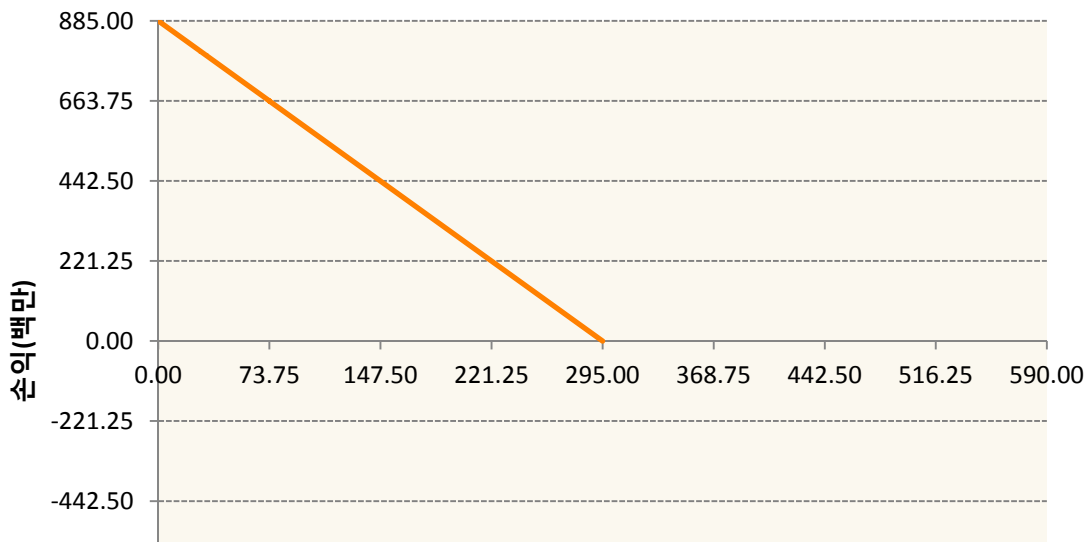


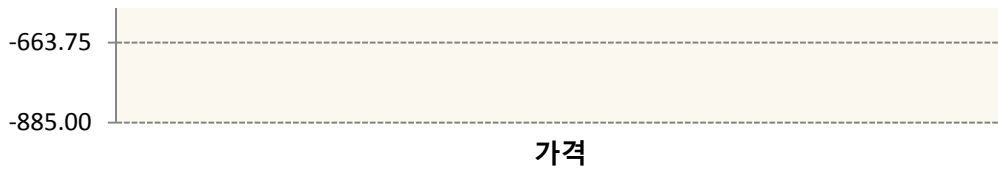


KR4201N83124-2018-08 콜312.5

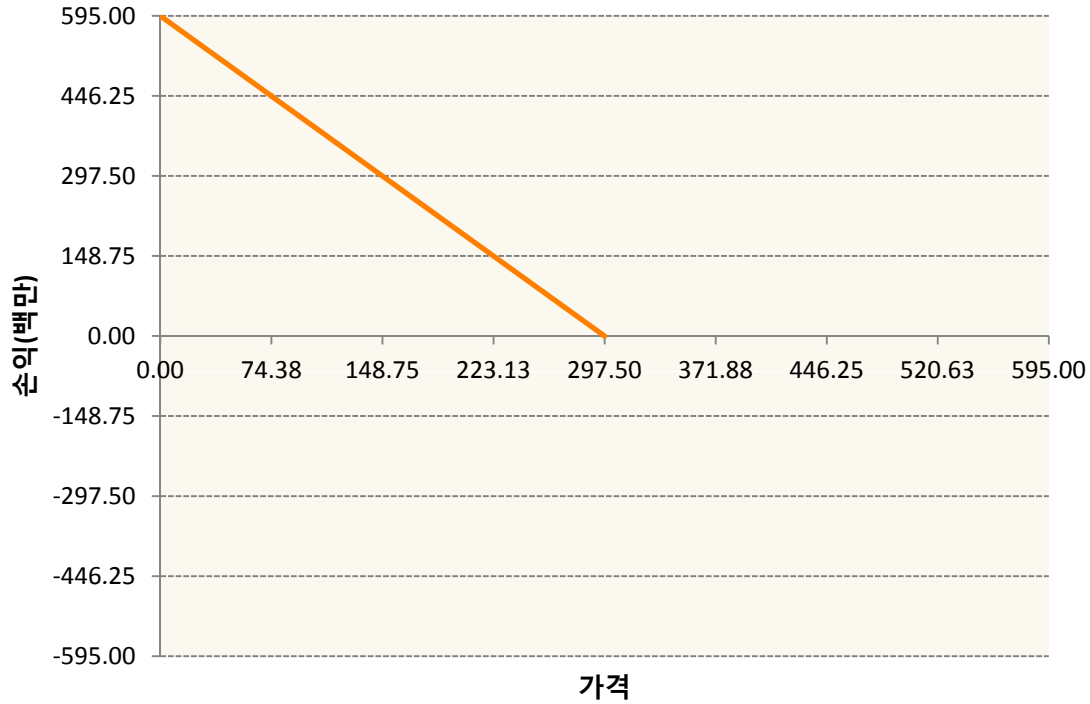


KR4301N82959-2018-08 풋295





KR4301N82975-2018-08 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물 1,030

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,030	-1,030	-1,030	-1,030	-1,030	-1,030	-1,030
-5.33%	-687	-687	-687	-687	-687	-687	-687
-2.67%	-343	-343	-343	-343	-343	-343	-343
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	343	343	343	343	343	343	343
5.33%	687	687	687	687	687	687	687
8.00%	1,030	1,030	1,030	1,030	1,030	1,030	1,030

KR4201N8312018-08 콜310 680

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	199	195	188	179	167	153	137
-5.33%	188	178	164	148	129	108	85
-2.67%	159	139	117	91	64	35	5

0%	97	67	34	0	-35	-71	-108
2.67%	-15	-54	-95	-135	-176	-217	-259
5.33%	-190	-233	-276	-320	-363	-406	-449
8.00%	-430	-470	-512	-553	-595	-637	-680

KR4201N8312018-08 콜312.5

310

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	83	81	78	75	70	64	57
-5.33%	79	75	69	62	54	45	35
-2.67%	68	60	50	39	27	14	0
0%	43	30	15	0	-16	-33	-50
2.67%	-3	-21	-40	-59	-78	-98	-117
5.33%	-78	-99	-120	-141	-162	-183	-204
8.00%	-184	-205	-226	-247	-268	-289	-310

KR4301N8292018-08 풋295

58

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	57	57	57	57	57	58	58
-5.33%	34	34	34	35	35	36	36
-2.67%	12	13	14	15	16	17	18
0%	-4	-2	-1	0	1	2	4
2.67%	-12	-11	-10	-9	-8	-7	-6
5.33%	-15	-14	-14	-13	-13	-12	-11
8.00%	-15	-15	-15	-15	-14	-14	-14

KR4301N8292018-08 풋297.5

41

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	40	40	40	40	40	40	41
-5.33%	25	25	25	25	25	26	26
-2.67%	10	10	11	11	12	12	13
0%	-2	-2	-1	0	1	2	2
2.67%	-9	-9	-8	-7	-7	-6	-5
5.33%	-12	-12	-11	-11	-10	-10	-9
8.00%	-13	-13	-13	-12	-12	-12	-12

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

(단위:백만원)

1,619

공시일	2018-07-13
기준일	2018-07-12

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

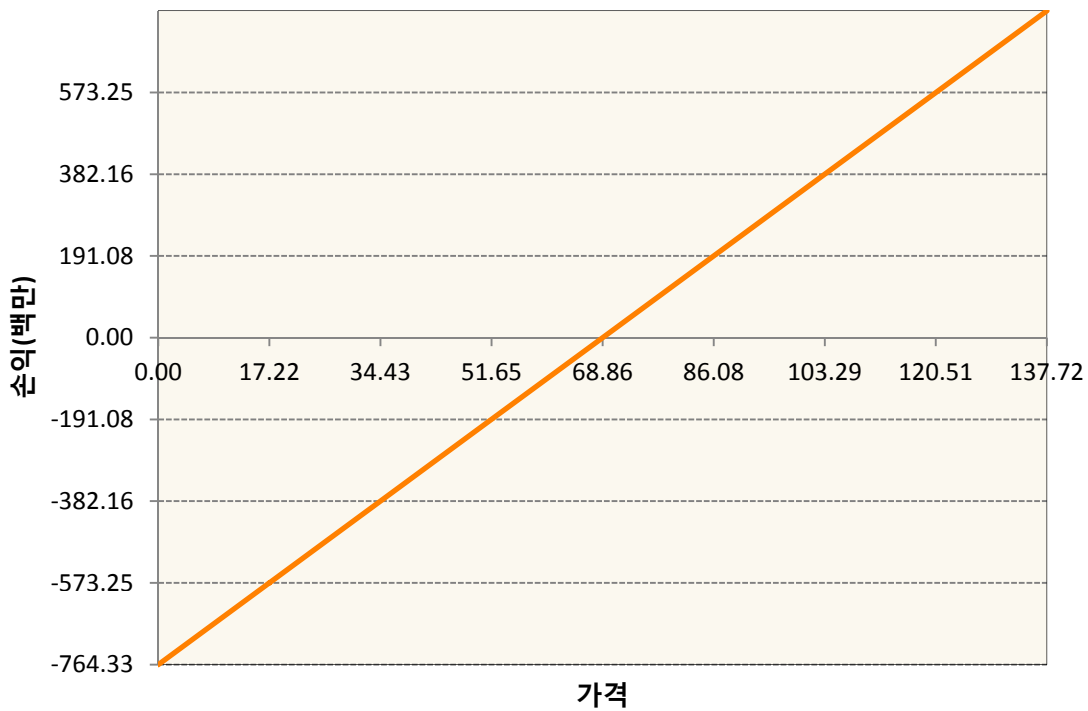
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

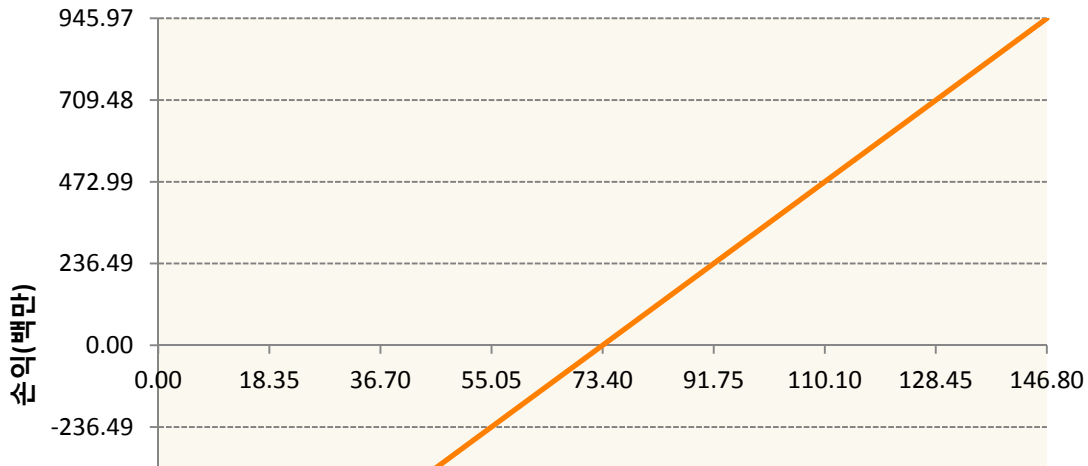
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,667	619	3,048	

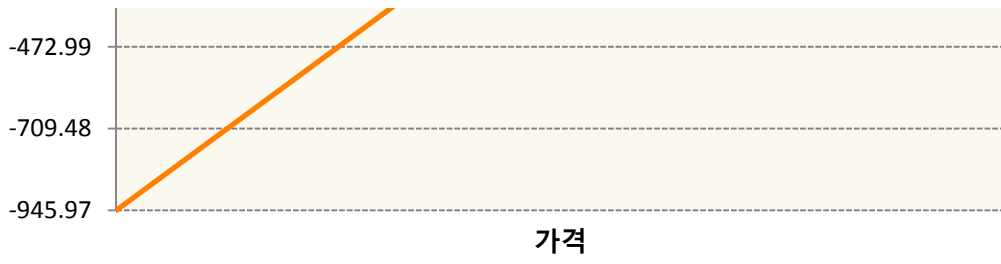
### 2. 만기시점의 손익구조

**CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18**

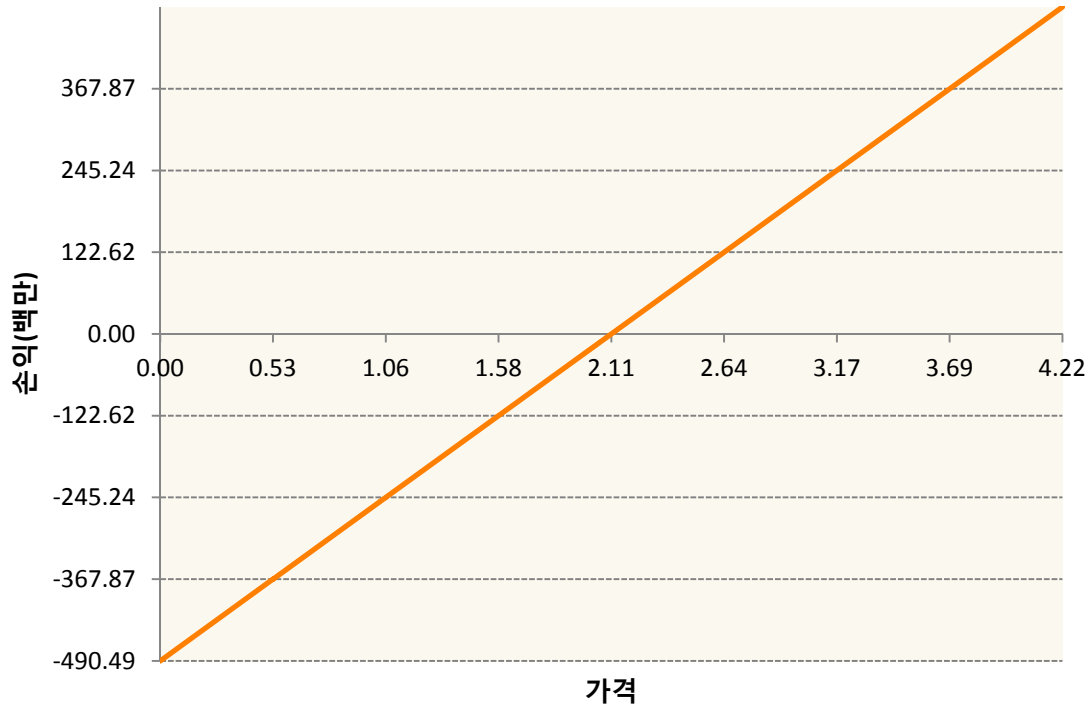


**COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18**

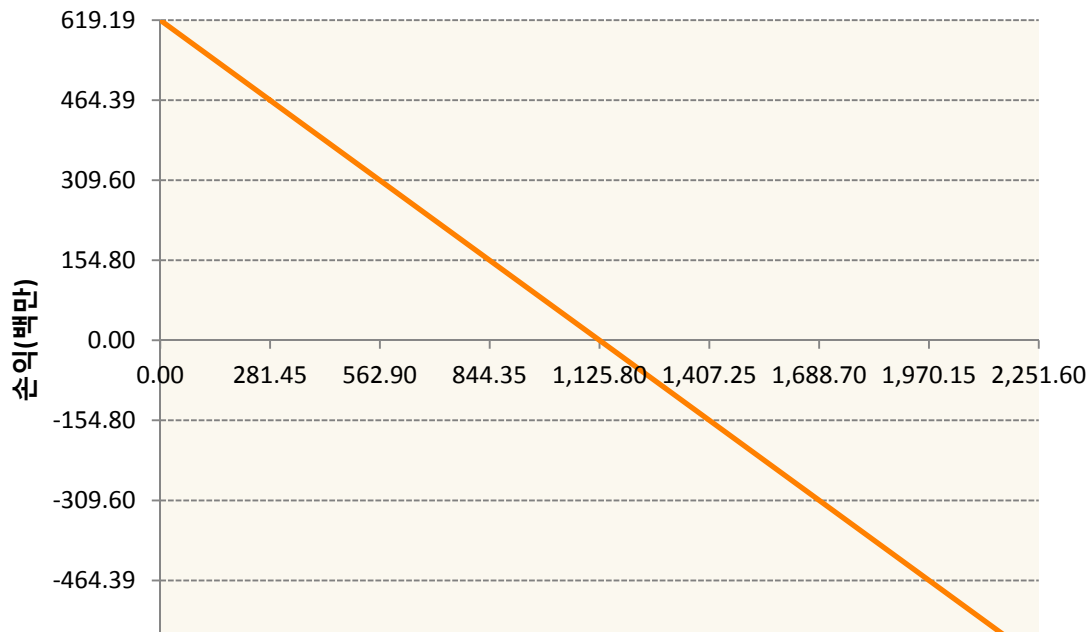


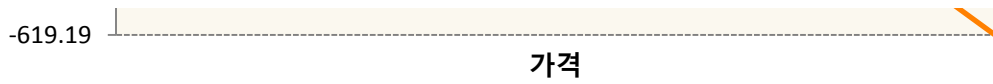


**HOU8-NY Harb ULSD Fut SEP18**

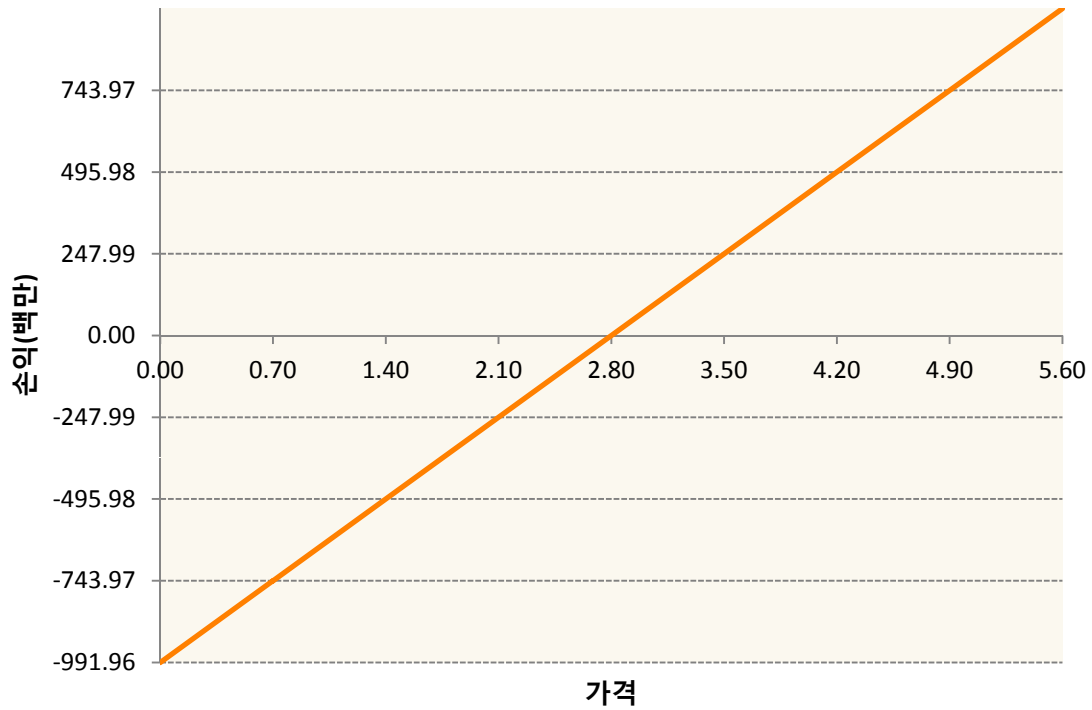


**KR4175N70002-2018-07 달러선물**

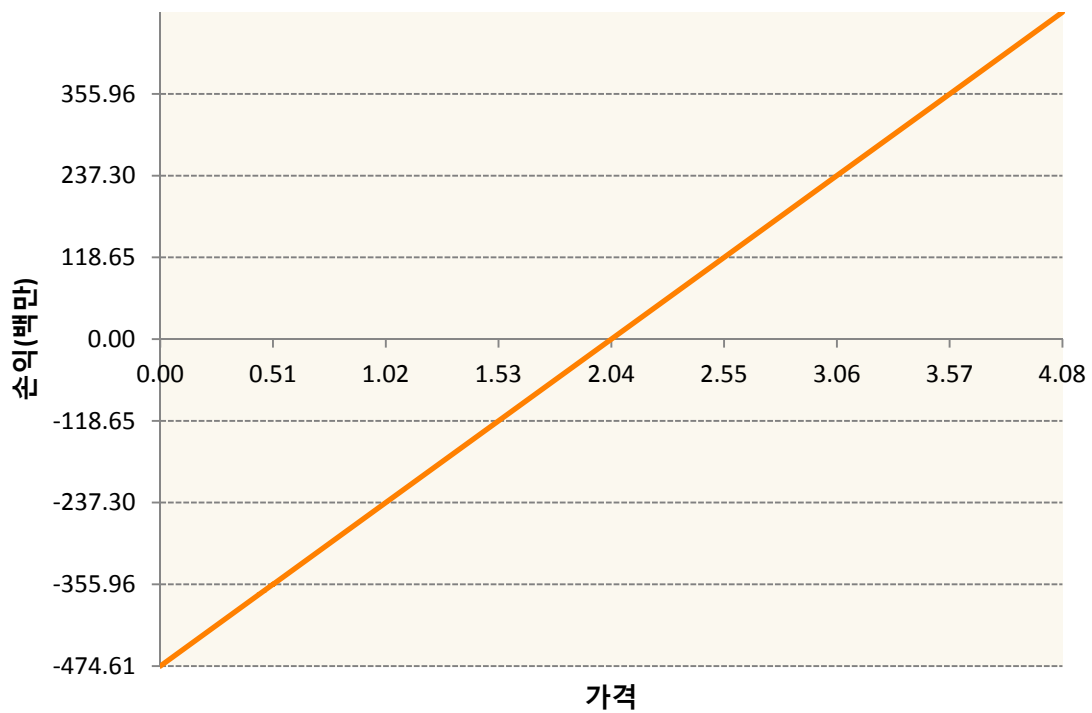




NGU18-NATURAL GAS FUTR SEP18



XBU8-GASOLINE RBOB FUT SEP18



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

CLU8	WTI CRUDE FUTURE SEP18	61
COU8	BRENT CRUDE FUTR SEP18	76
HOU8	NY Harb ULSD Fut SEP18	39
KR4175N70C	2018-07 달러선물	50
NGU18	NATURAL GAS FUTR SEP18	79
XBU8	GASOLINE RBOB FUT SEP18	38

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

432

공시일	2018-07-13
기준일	2018-07-12

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

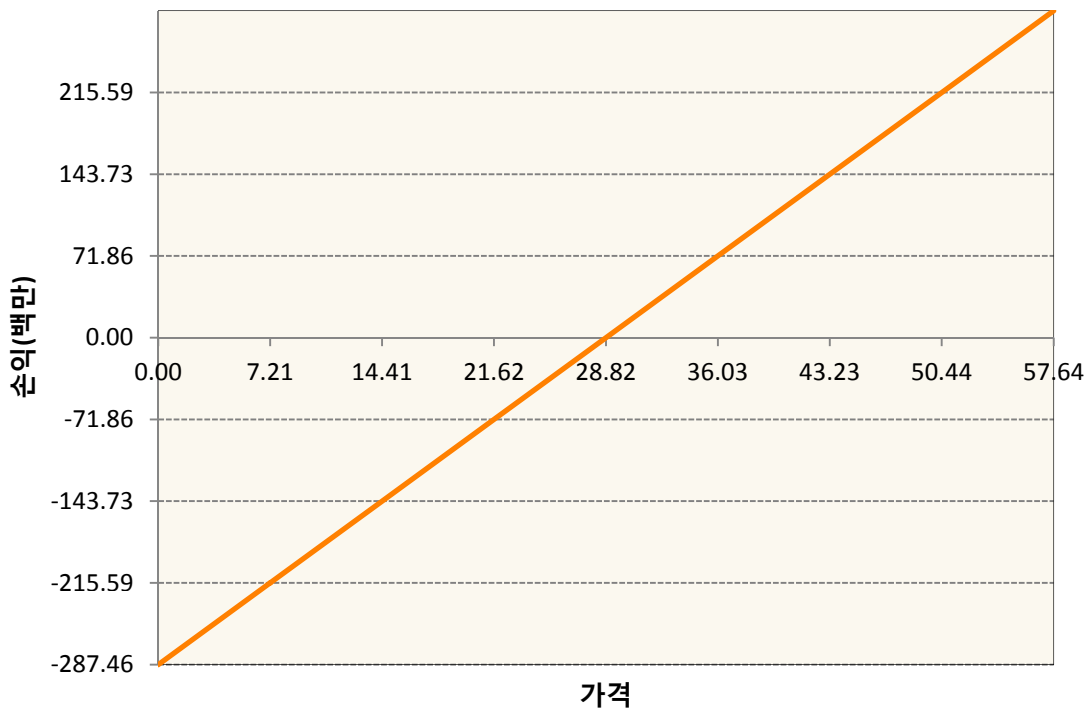
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

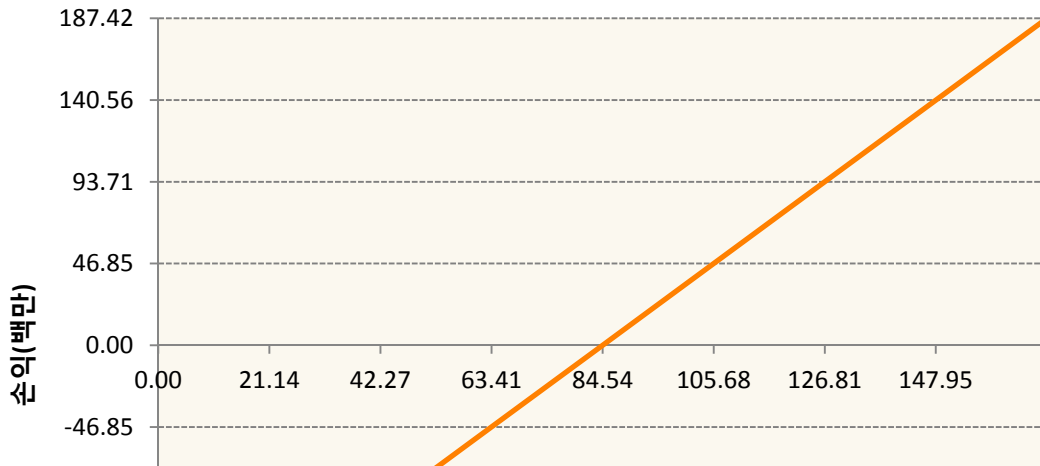
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,555	79	3,476	

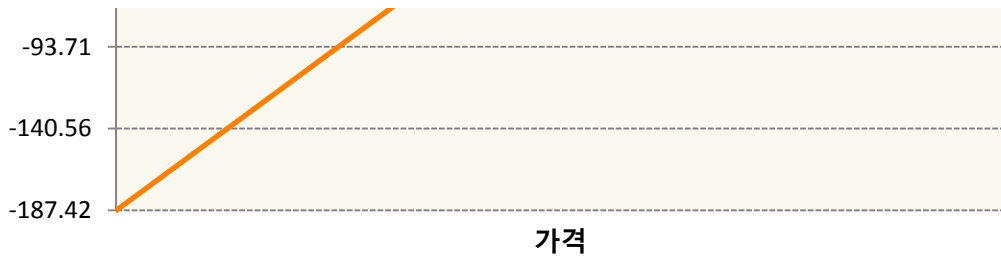
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18**

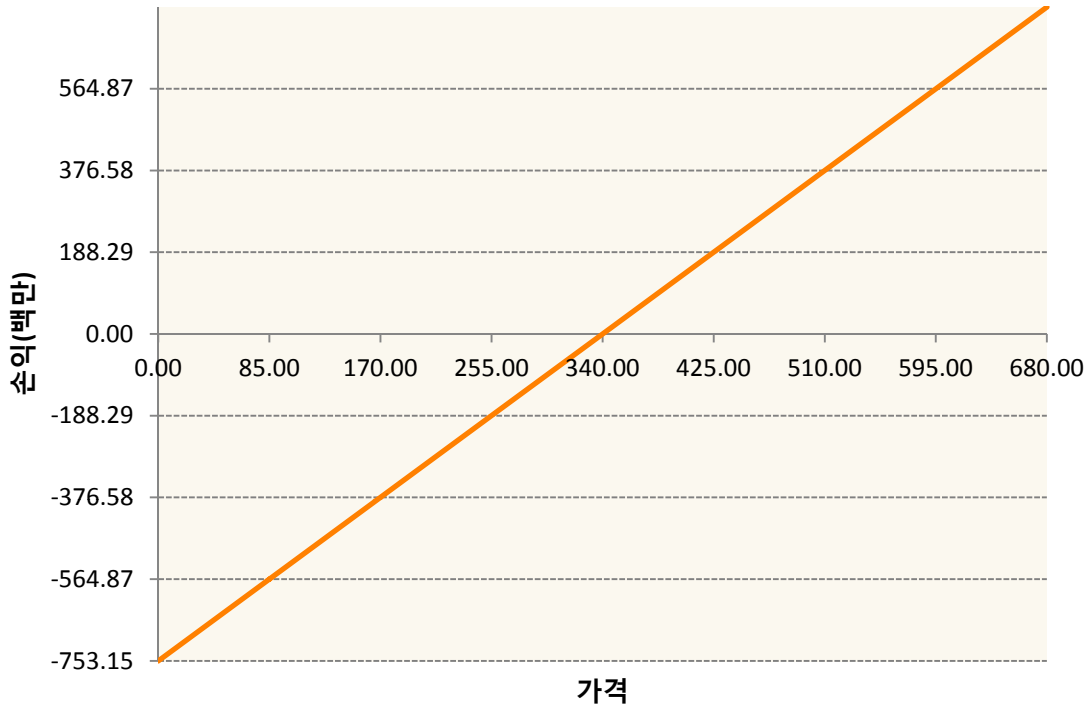


**CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18**

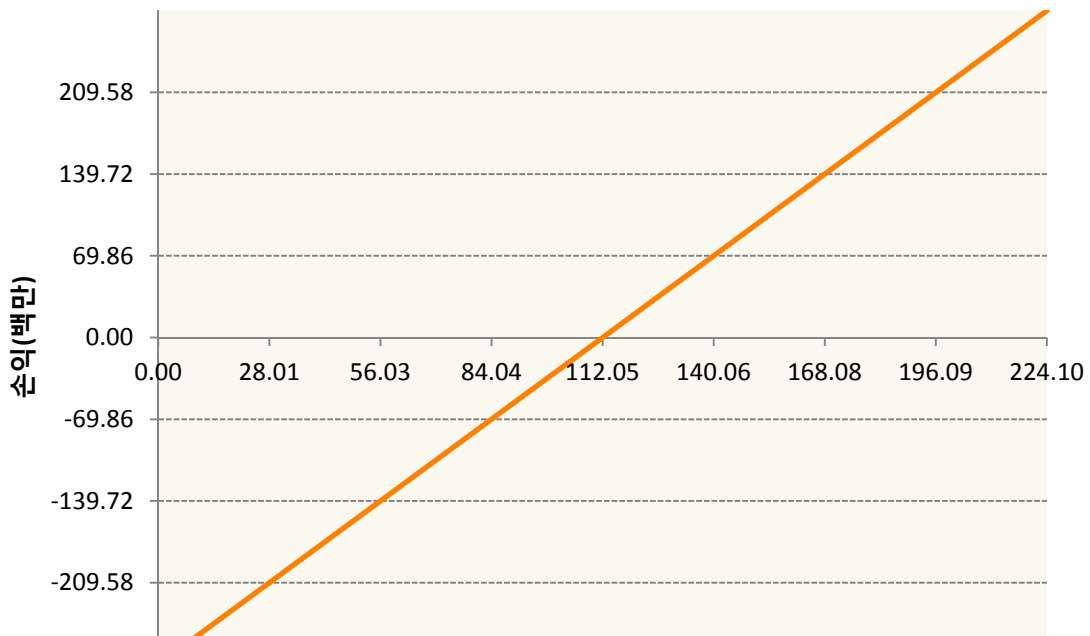


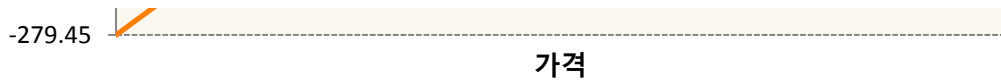


**CU8-CORN FUTURE SEP18**

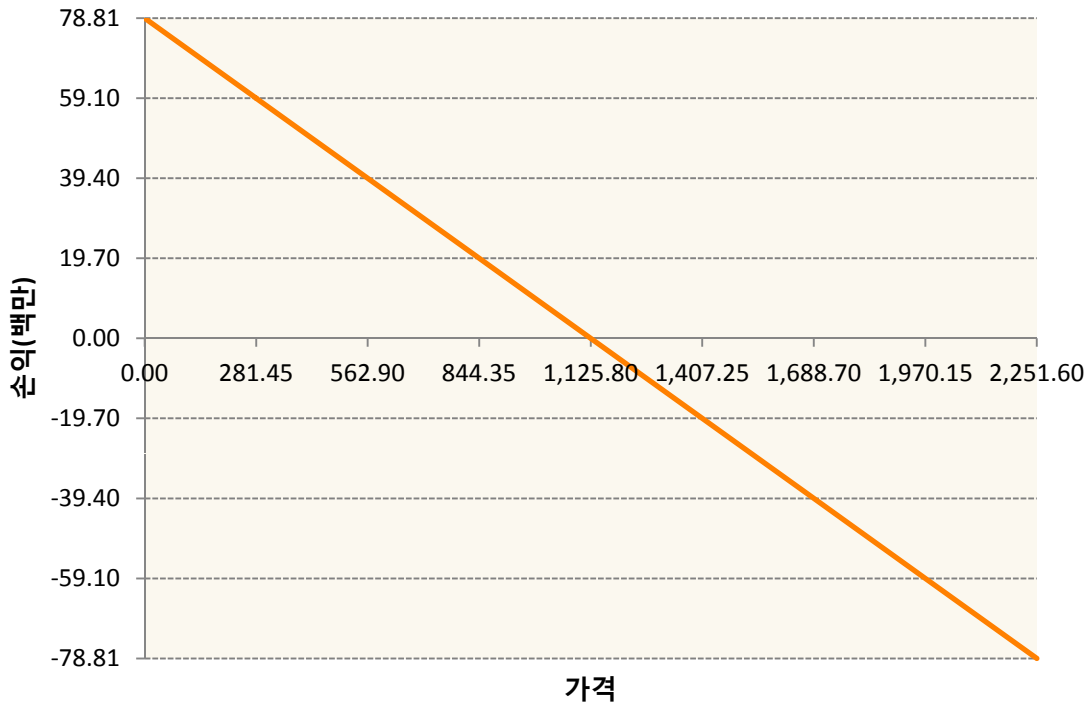


**KCU8-COFFEE 'C' FUTURE SEP18**

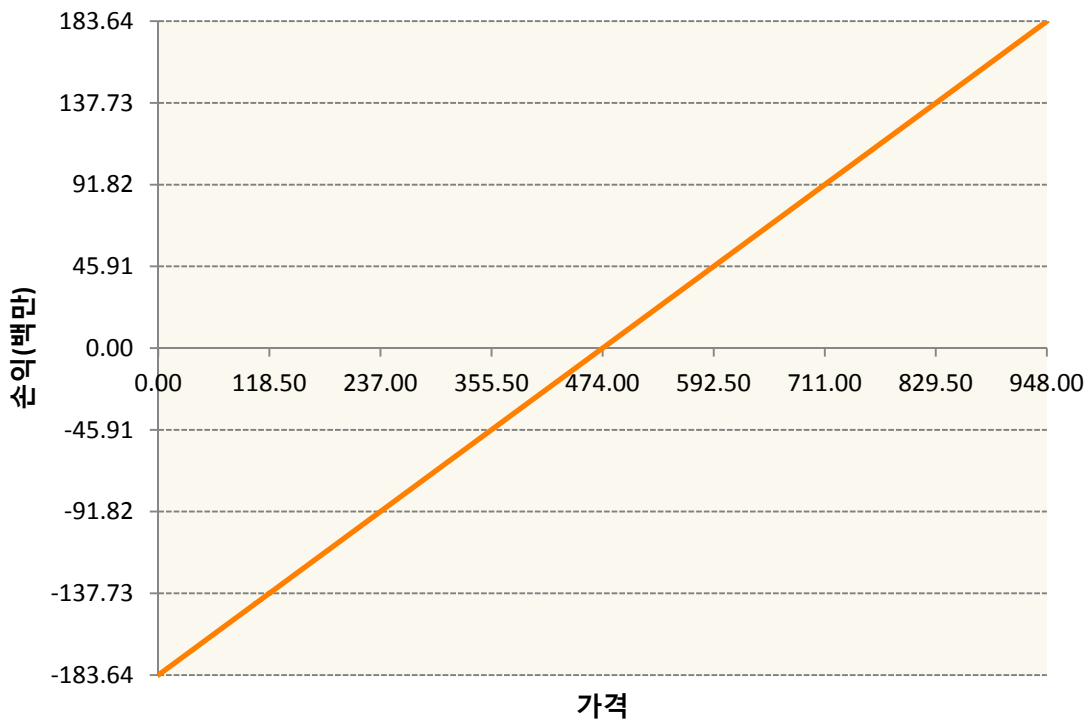




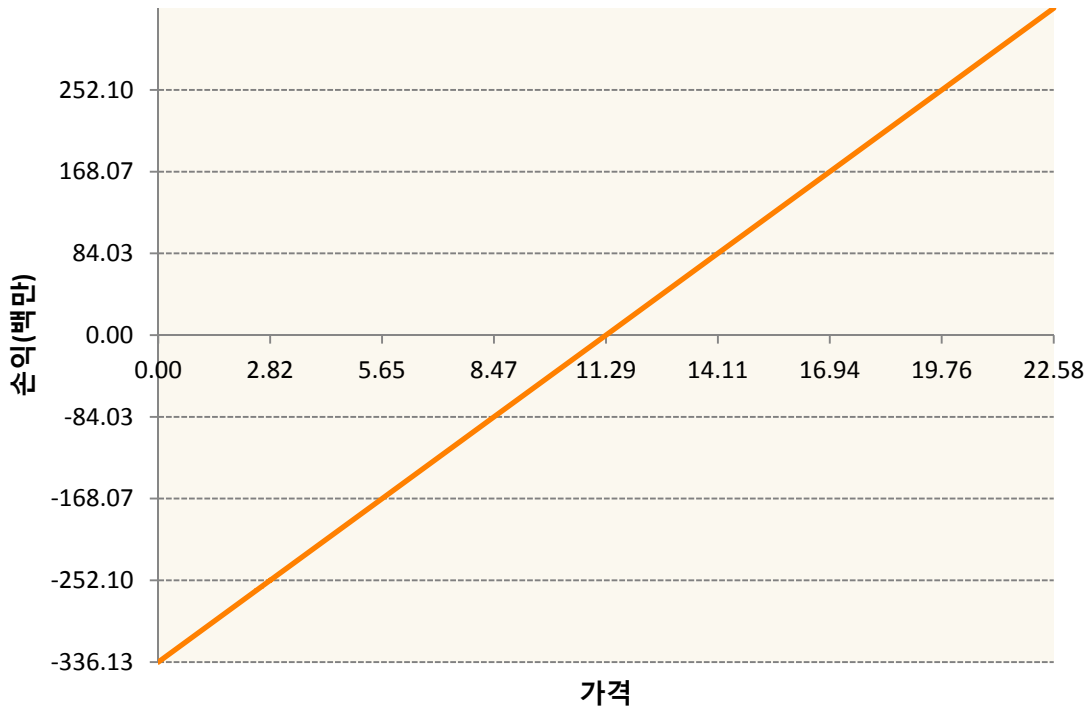
**KR4175N70002-2018-07 달러선물**



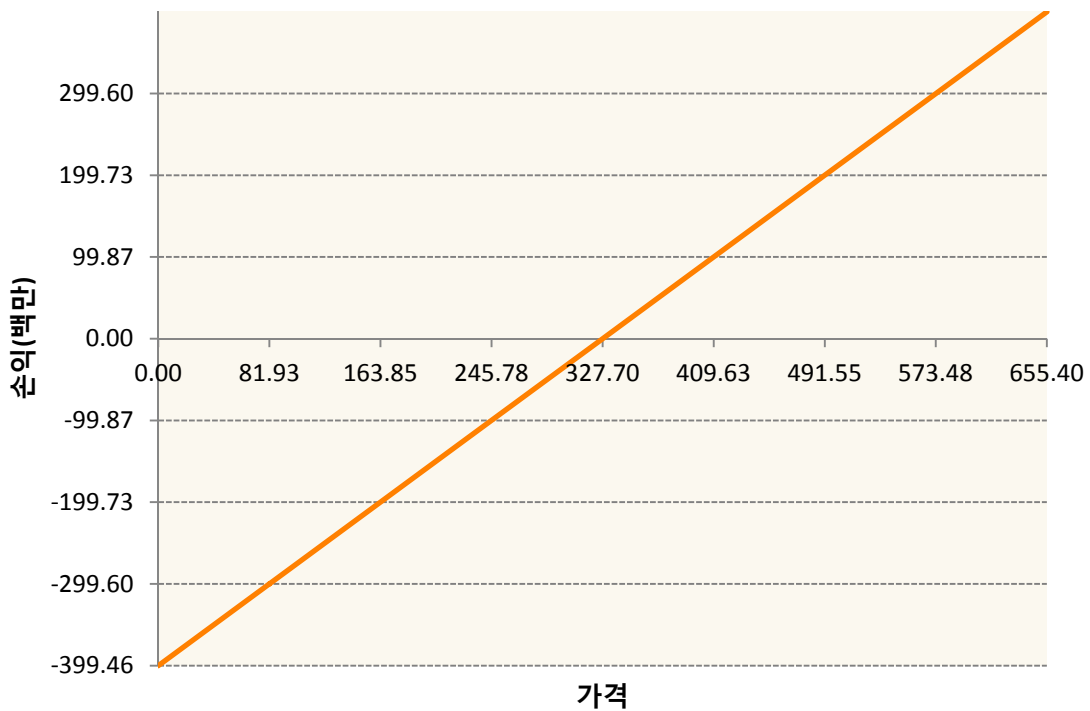
**KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18**



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

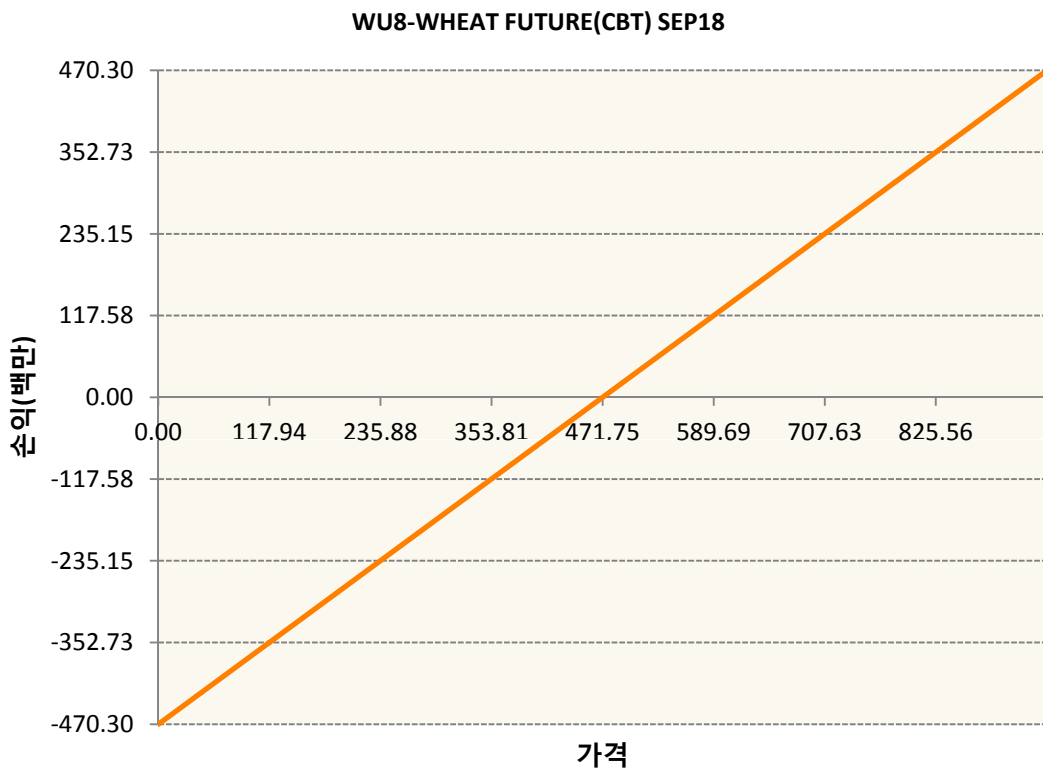
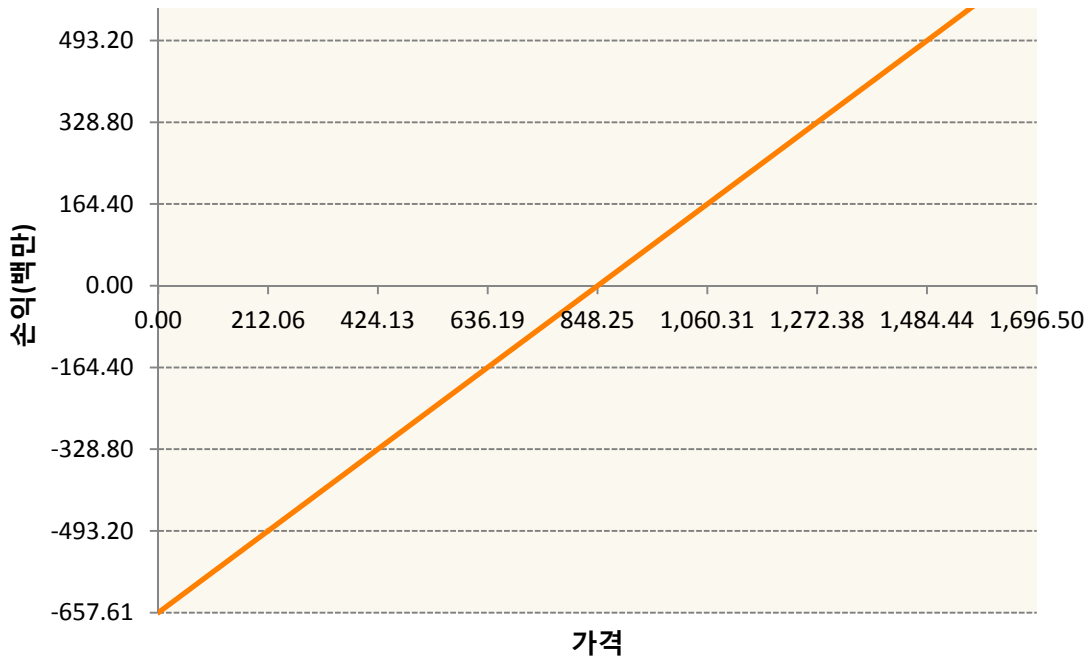


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	23
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	15
CU8	CORN FUTURE SEP18	60
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	53
WU8	WHEAT FUTURE(CBT) SEP18	38

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

(단위:백만원)

**295**