

공시일	2018-07-17
기준일	2018-07-16

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

공시일	2018-07-17
기준일	2018-07-16

스마트인덱스모

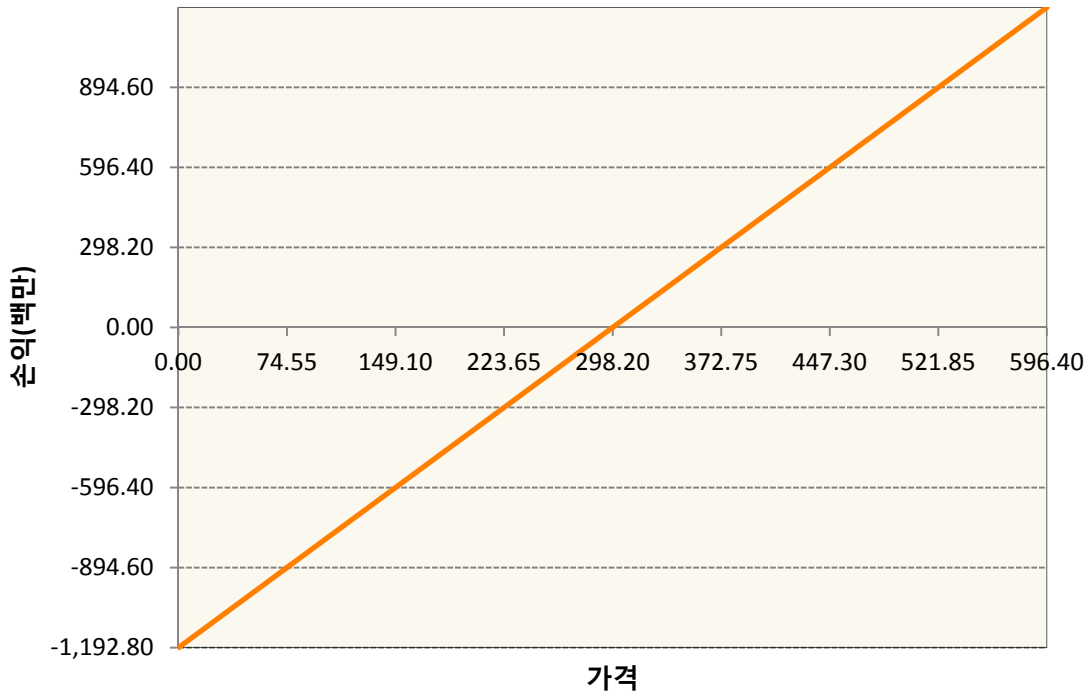
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,193	0	1,193	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물

95

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-95	-95	-95	-95	-95	-95	-95
-5.33%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
-2.67%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	32	32	32	32	32	32	32
5.33%	63	63	63	63	63	63	63
8.00%	95	95	95	95	95	95	95

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

(단위:백만원)

72

공시일	2018-07-17
기준일	2018-07-16

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

1,130

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

479

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-07-17
기준일	2018-07-16

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)

SWCSI500000 신한CSI500미래S180608

329

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

405

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-07-17
기준일	2018-07-16

유로인덱스모(주식-파생형)

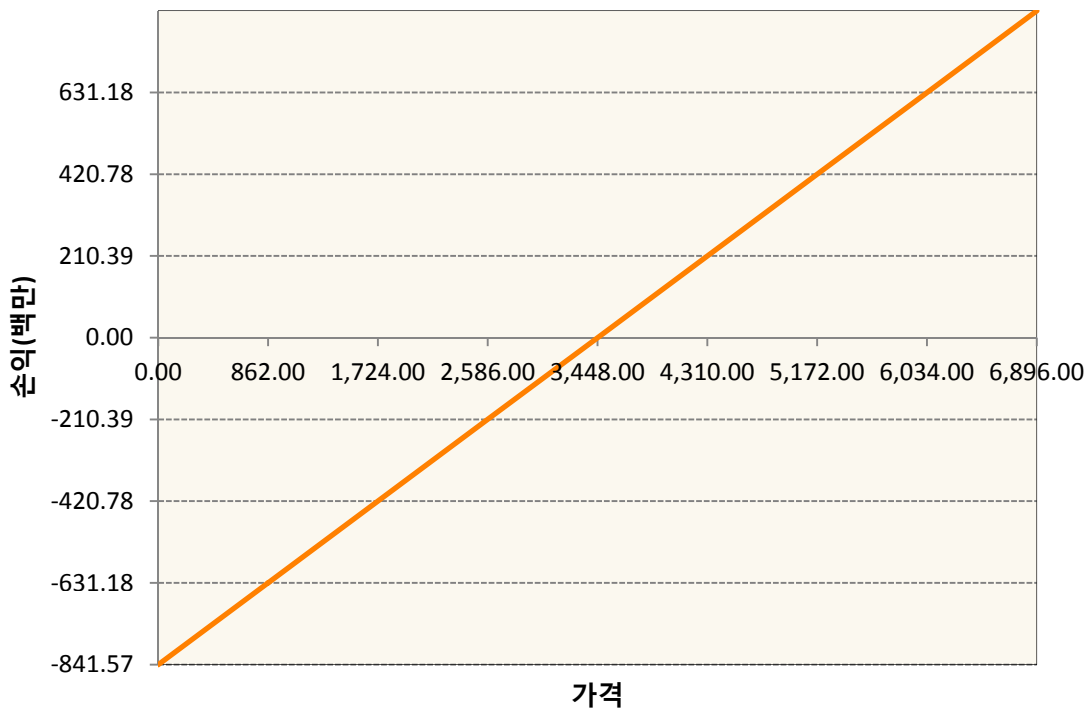
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	842	0	842	

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	2018-07-17
기준일	2018-07-16

차이나인덱스모(주식-파생형)

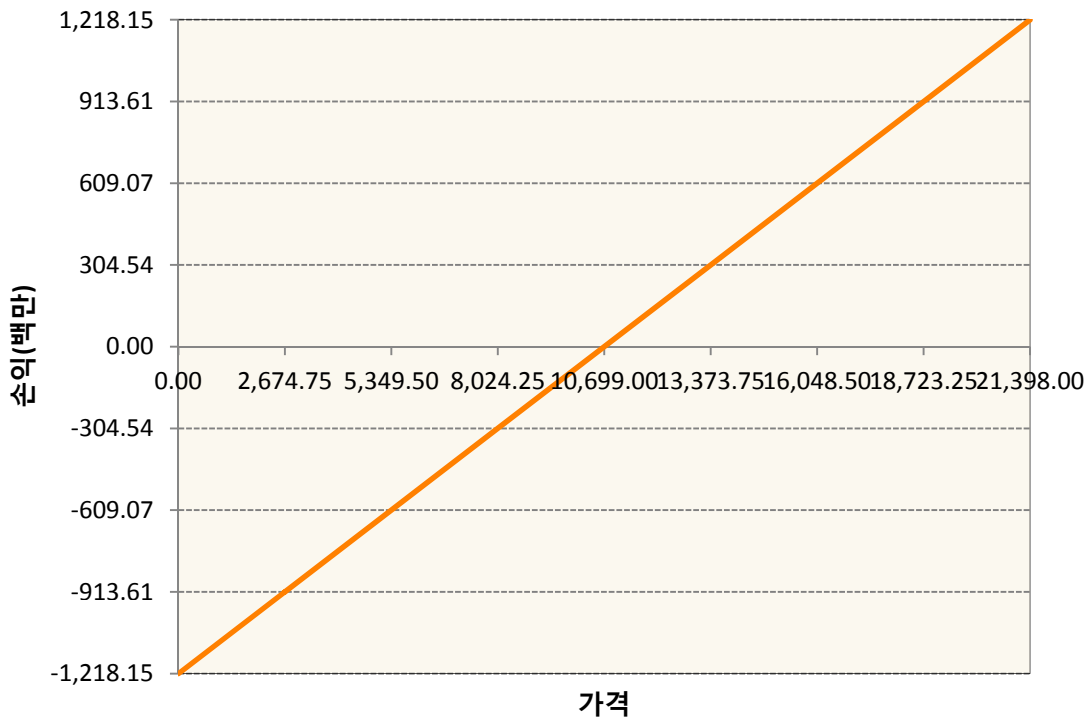
1. 계약금액

(단위:백만원)

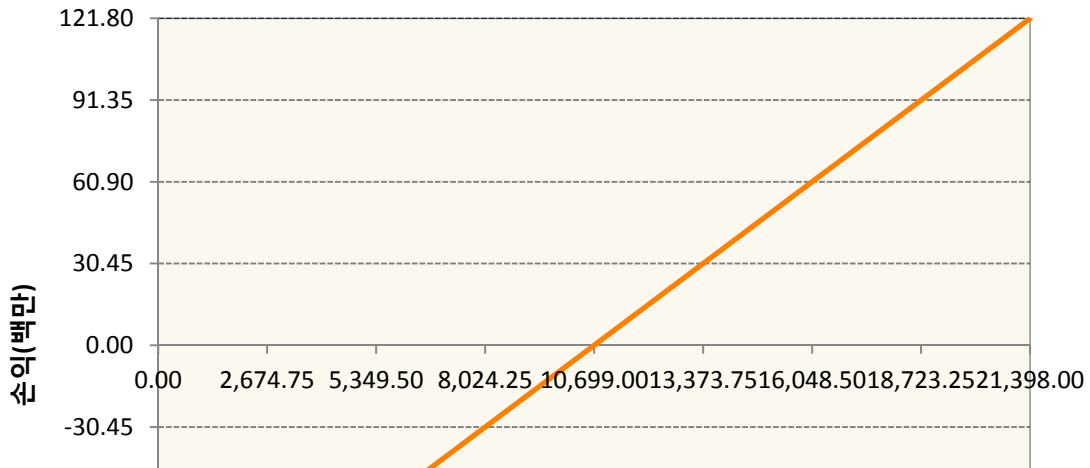
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,340	0	1,340	장내

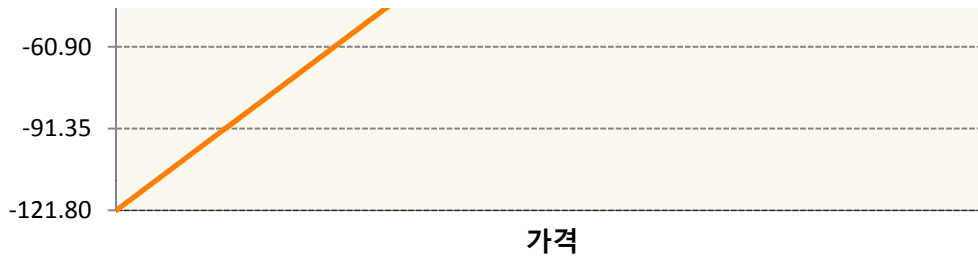
2. 만기시점의 손익구조

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	2018-07-17
기준일	2018-07-16

커버드콜모(주식혼합-파생형)

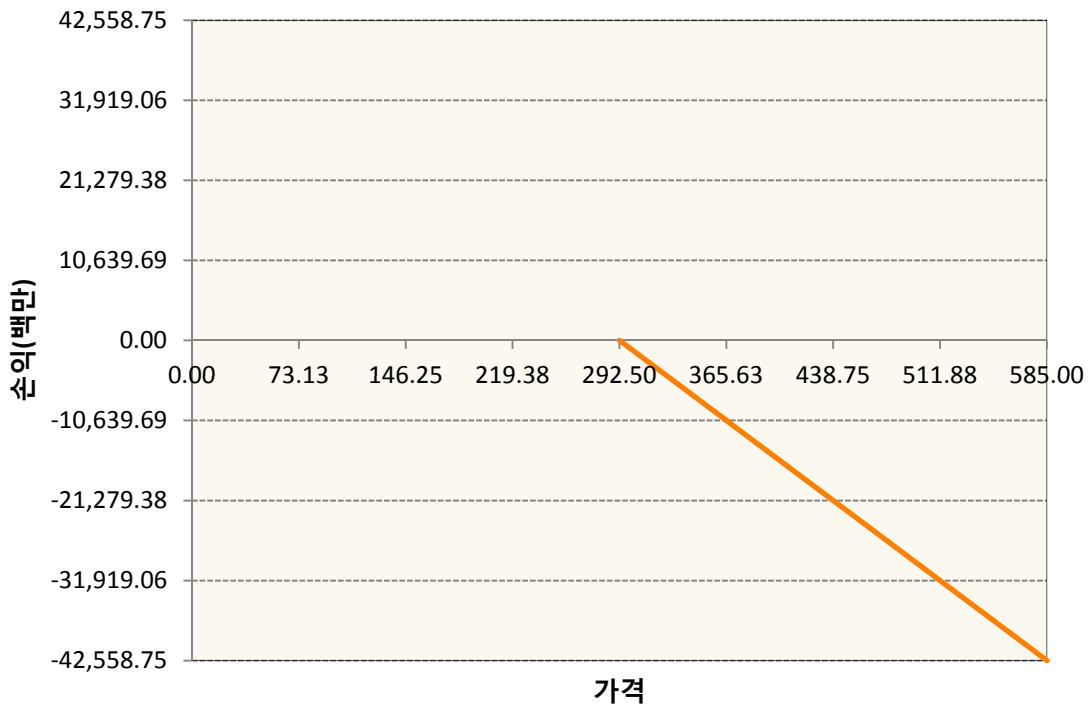
1. 계약금액

(단위:백만원)

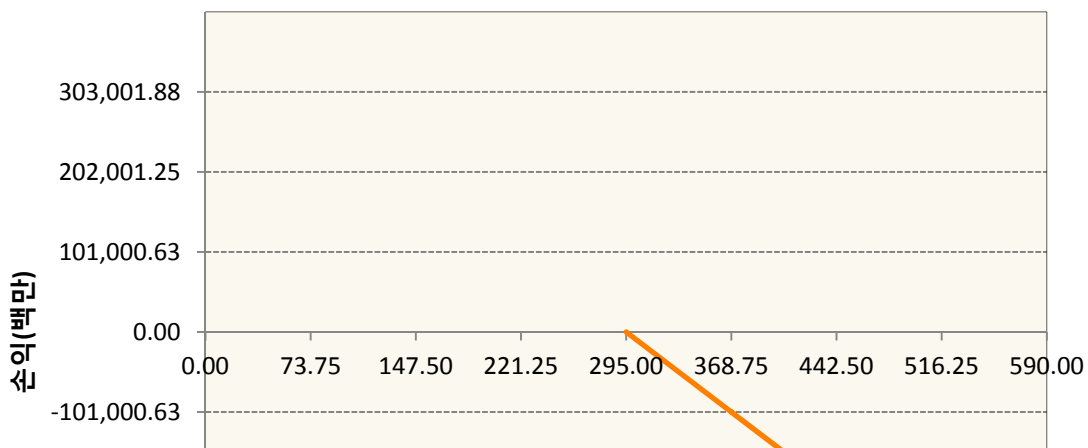
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	8,252	-8,252	장내
누계	유가증권	옵션	0	725,561	-725,561	장내

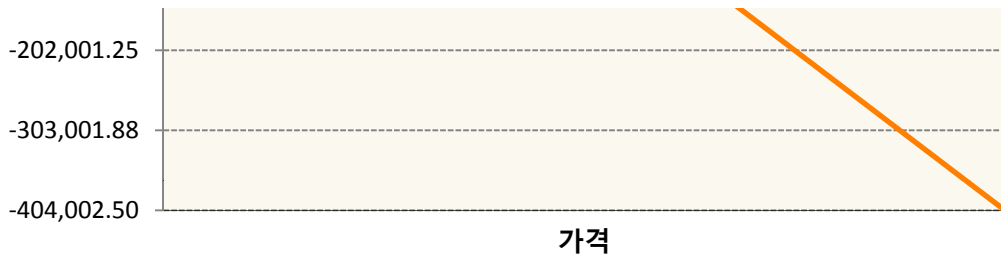
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N82928-2018-08 콜292.5

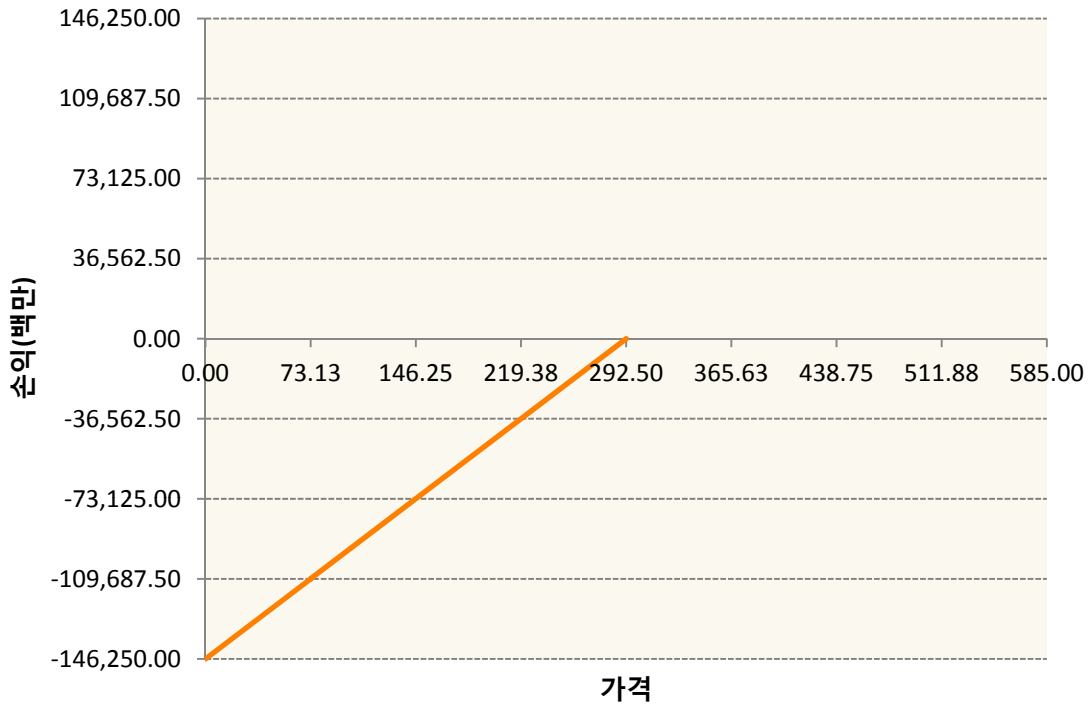


KR4201N82951-2018-08 콜295

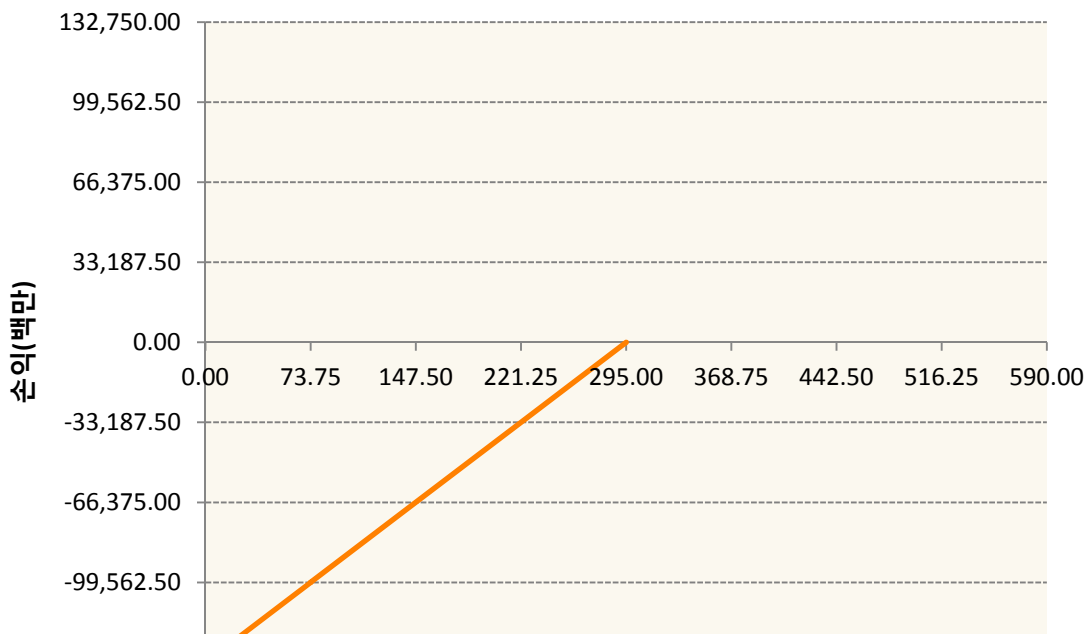




KR4301N82926-2018-08 풋292.5



KR4301N82959-2018-08 풋295



-132,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N829 2018-08 콜292.5							2,848
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,535	1,481	1,420	1,353	1,282	1,207	1,129
-5.33%	1,322	1,237	1,149	1,059	967	873	778
-2.67%	924	821	716	612	508	403	299
0%	310	208	104	0	-104	-209	-314
2.67%	-507	-591	-678	-769	-862	-957	-1,054
5.33%	-1,480	-1,536	-1,600	-1,669	-1,744	-1,823	-1,905
8.00%	-2,549	-2,581	-2,621	-2,669	-2,723	-2,783	-2,848
KR4201N829 2018-08 콜295							25,894
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12,905	12,472	11,971	11,412	10,804	10,154	9,469
-5.33%	11,299	10,578	9,816	9,021	8,200	7,358	6,498
-2.67%	8,138	7,192	6,236	5,274	4,307	3,336	2,362
0%	3,007	2,006	1,003	0	-1,004	-2,009	-3,015
2.67%	-4,112	-4,977	-5,869	-6,782	-7,710	-8,652	-9,604
5.33%	-12,845	-13,467	-14,149	-14,880	-15,652	-16,456	-17,288
8.00%	-22,655	-23,031	-23,485	-24,006	-24,587	-25,218	-25,894
KR4301N829 2018-08 풋292.5							8,514
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,325	-8,337	-8,355	-8,382	-8,417	-8,461	-8,514
-5.33%	-4,496	-4,567	-4,650	-4,744	-4,847	-4,958	-5,075
-2.67%	-1,324	-1,488	-1,653	-1,820	-1,989	-2,158	-2,328
0%	463	313	158	0	-161	-324	-489
2.67%	1,028	969	897	814	720	616	505
5.33%	1,119	1,108	1,091	1,065	1,030	986	933
8.00%	1,126	1,125	1,123	1,118	1,109	1,096	1,077
KR4301N829 2018-08 풋295							8,303
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,191	-8,196	-8,205	-8,220	-8,241	-8,268	-8,303
-5.33%	-4,685	-4,726	-4,778	-4,841	-4,913	-4,994	-5,082
-2.67%	-1,570	-1,696	-1,828	-1,964	-2,103	-2,245	-2,389
0%	465	311	156	0	-157	-314	-471
2.67%	1,255	1,176	1,086	987	880	766	647

5.33%	1,417	1,398	1,371	1,334	1,288	1,232	1,168
8.00%	1,433	1,431	1,427	1,418	1,405	1,386	1,361

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

(단위:백만원)

44,940

공시일	2018-07-17
기준일	2018-07-16

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

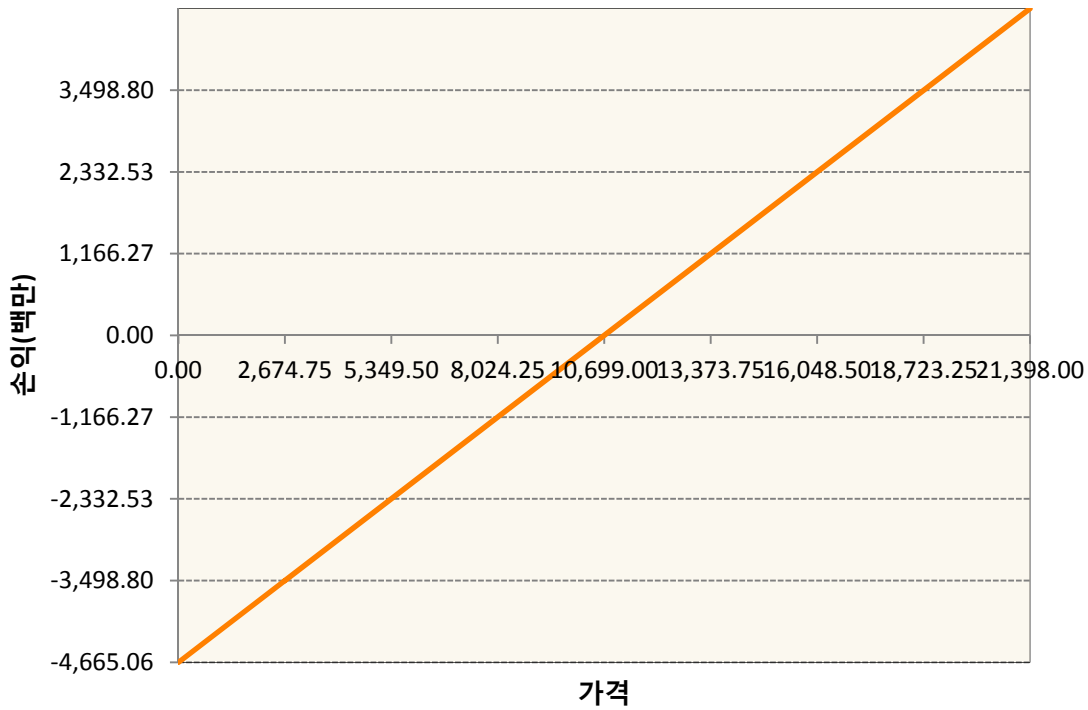
1. 계약금액

(단위:백만원)

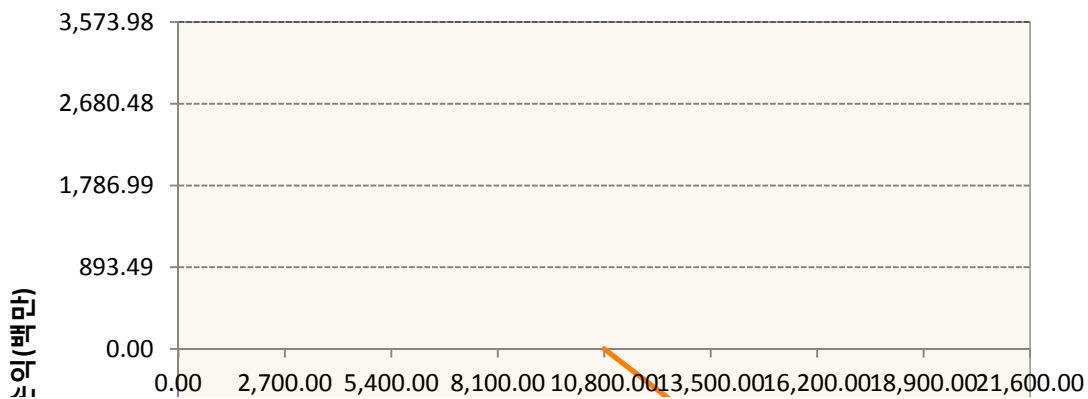
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,665	0	4,665	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,788	-10,788	장내

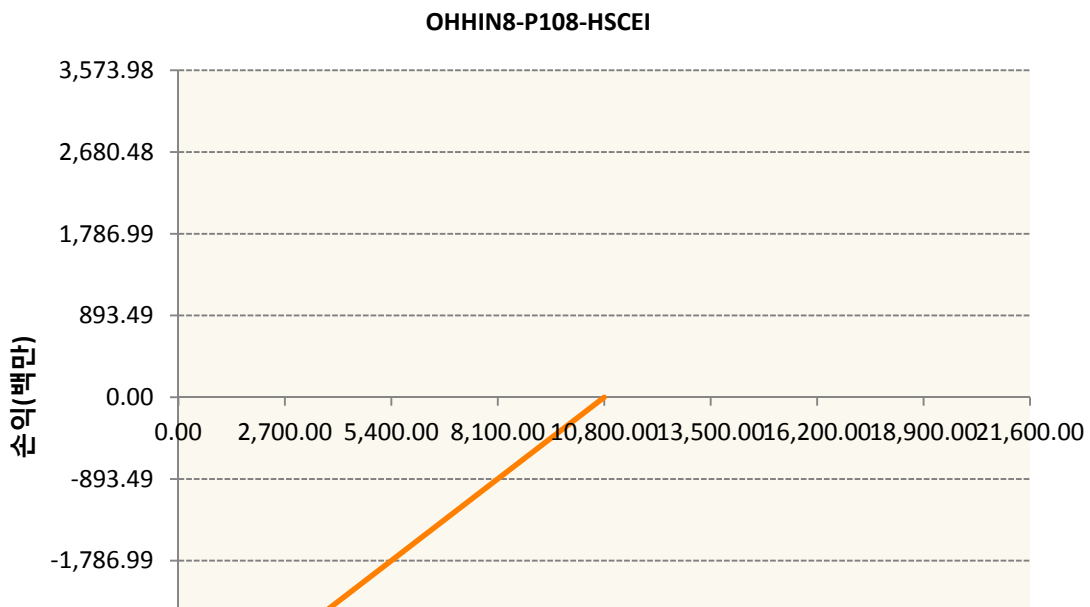
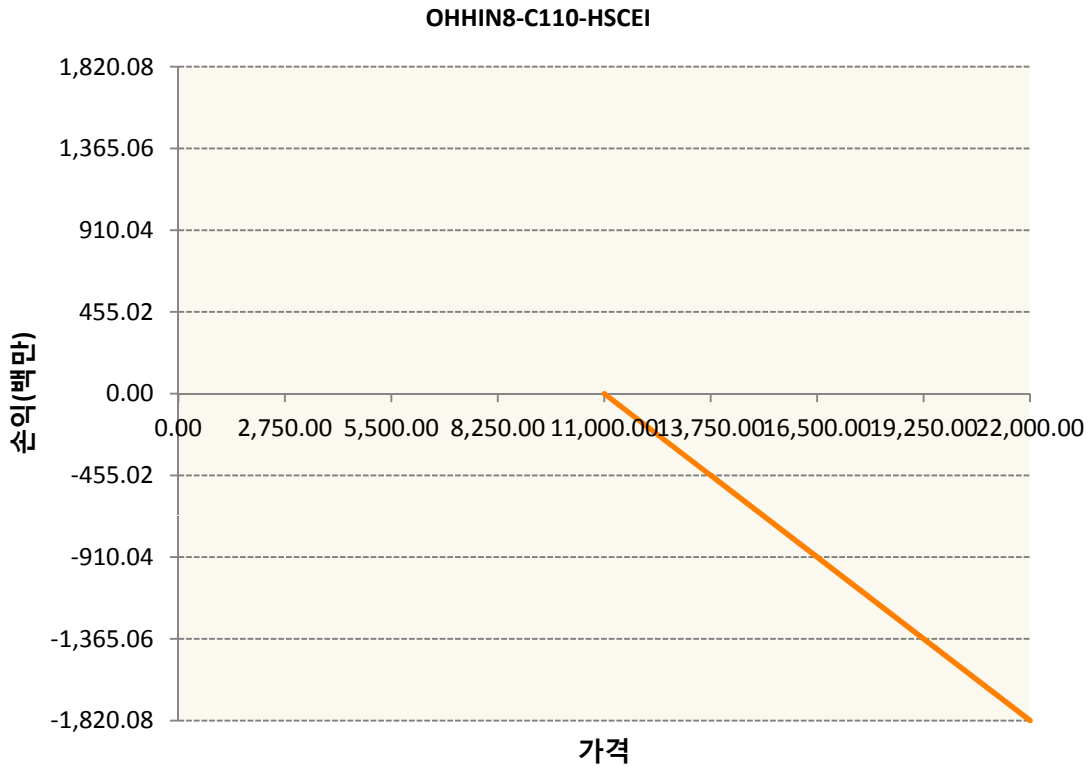
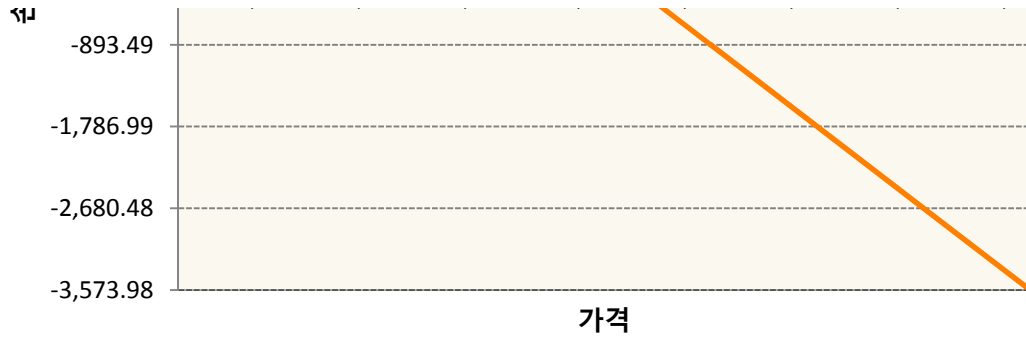
2. 만기시점의 손익구조

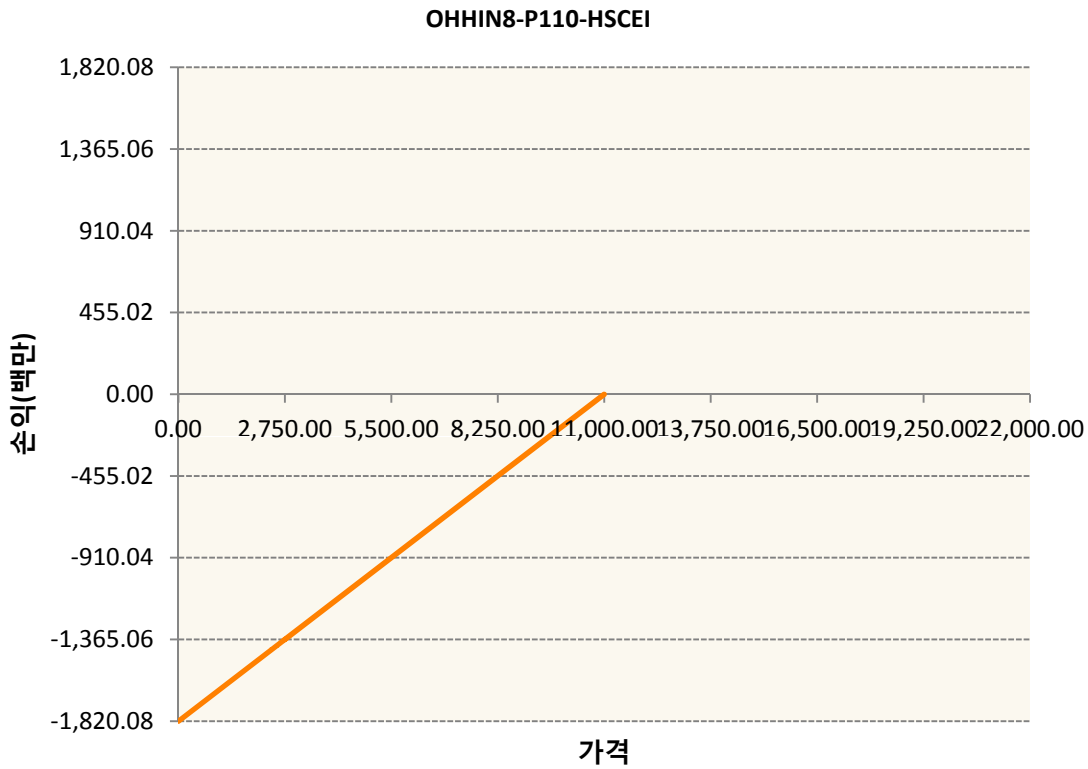
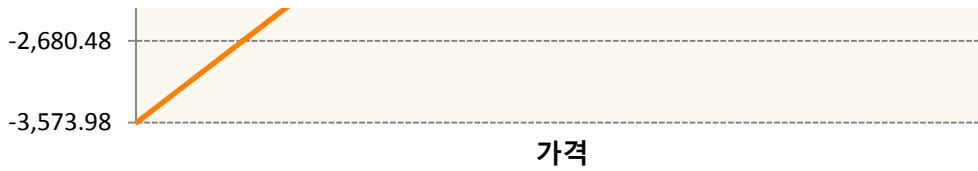
HCN8-HSCEI Futures Jul18



OHHIN8-C108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCN8	HSCEI Futures Jul18	373
OHHIN8-C1	HSCEI	286
OHHIN8-C1	HSCEI	146
OHHIN8-P1	HSCEI	286
OHHIN8-P11	HSCEI	146

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

공시일	2018-07-17
기준일	2018-07-16

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

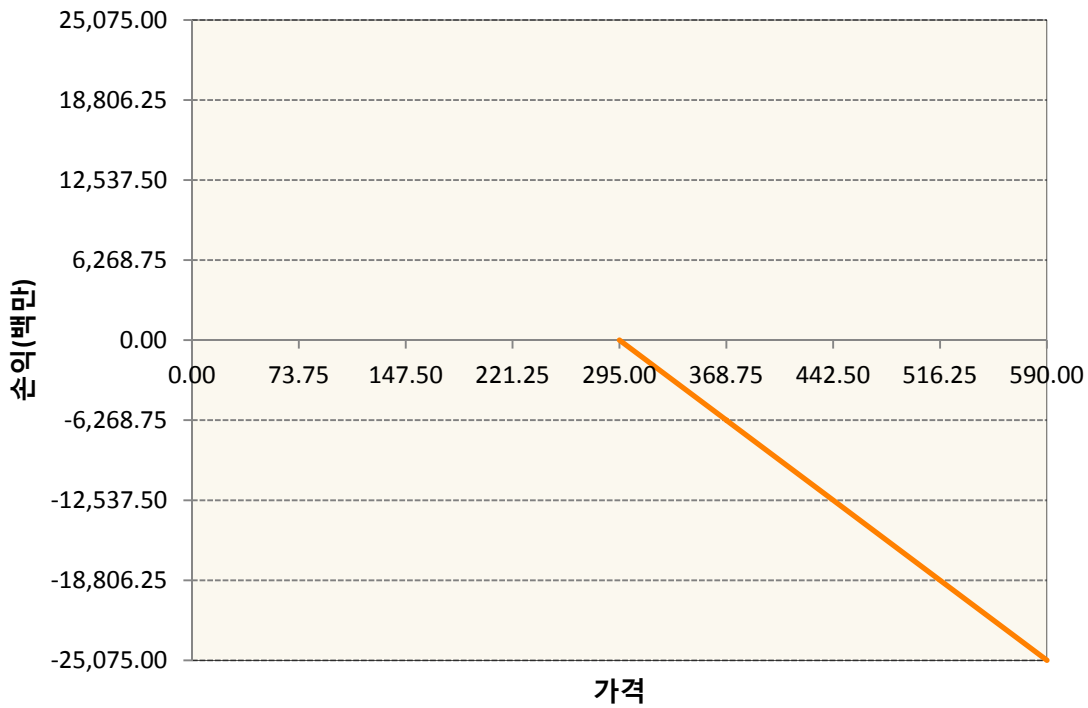
1. 계약금액

(단위:백만원)

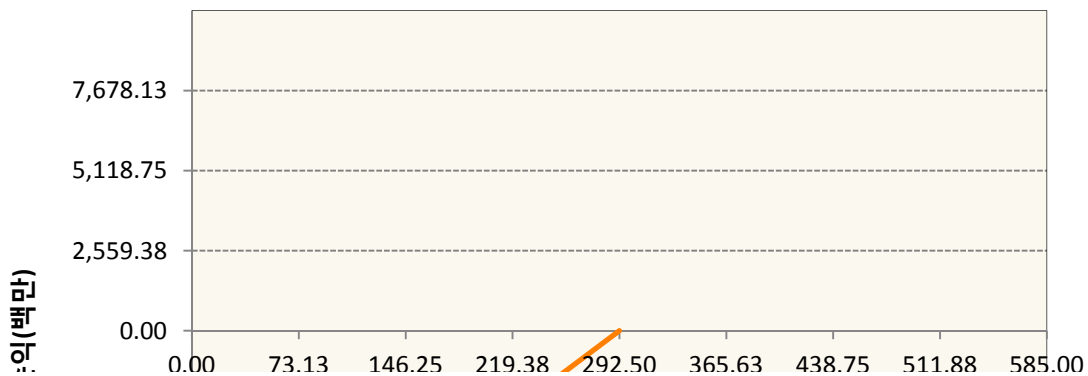
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	45,200	0	45,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	43,425	-43,425	장내

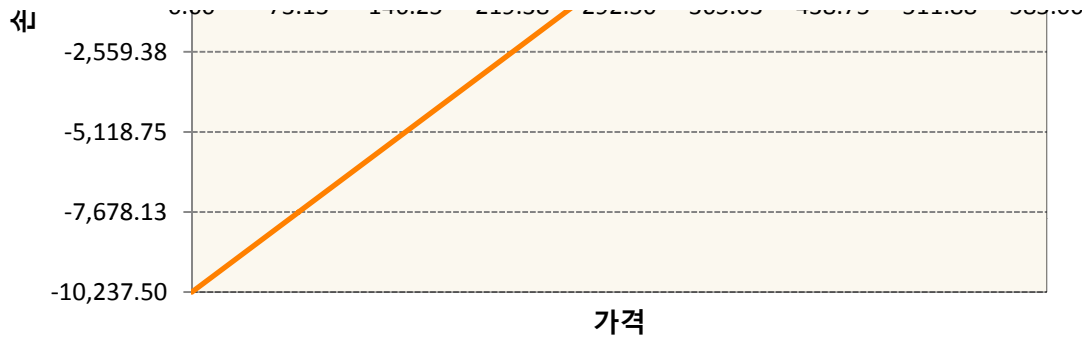
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N82951-2018-08 콜295

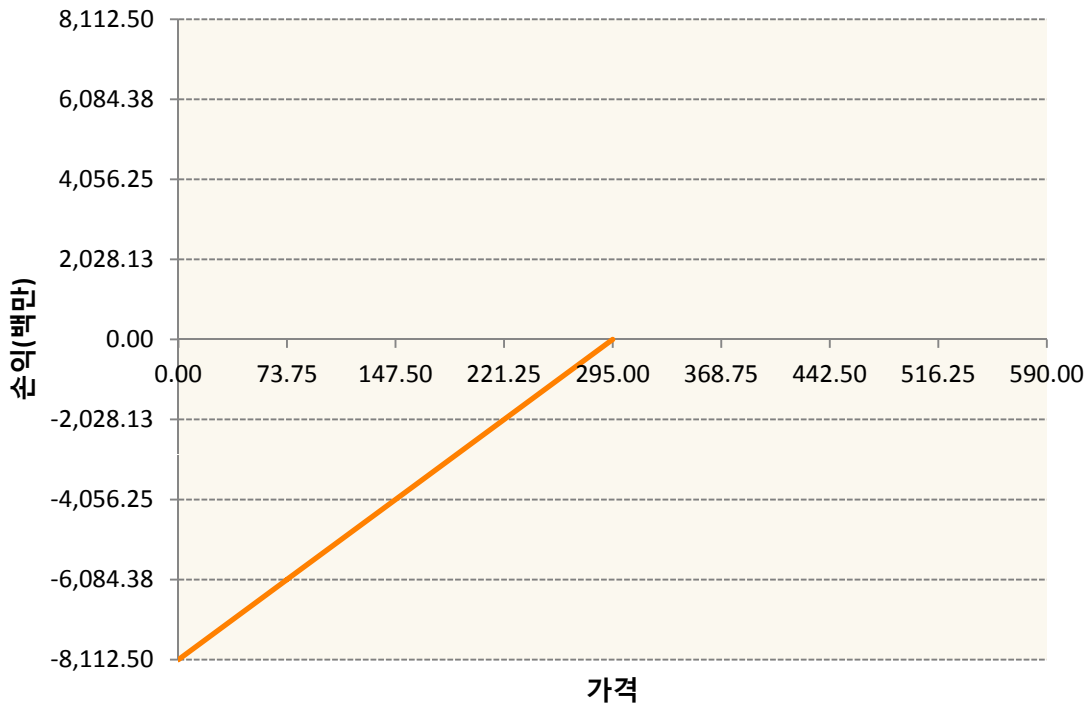


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





KR4301N82959-2018-08 풋295



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	-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 UBSCFXC1 INDEX_3							284
	기초자산의 변동성						

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

KR4201N829 2018-08 콜295

1,607

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	801	774	743	708	671	630	588
-5.33%	701	657	609	560	509	457	403
-2.67%	505	446	387	327	267	207	147
0%	187	124	62	0	-62	-125	-187
2.67%	-255	-309	-364	-421	-479	-537	-596
5.33%	-797	-836	-878	-924	-971	-1,021	-1,073
8.00%	-1,406	-1,429	-1,458	-1,490	-1,526	-1,565	-1,607

KR4301N829 2018-08 풋292.5

596

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-583	-584	-585	-587	-589	-592	-596
-5.33%	-315	-320	-325	-332	-339	-347	-355
-2.67%	-93	-104	-116	-127	-139	-151	-163
0%	32	22	11	0	-11	-23	-34
2.67%	72	68	63	57	50	43	35
5.33%	78	78	76	75	72	69	65
8.00%	79	79	79	78	78	77	75

KR4301N829 2018-08 풋295

507

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-501	-501	-501	-502	-504	-505	-507
-5.33%	-286	-289	-292	-296	-300	-305	-311
-2.67%	-96	-104	-112	-120	-129	-137	-146
0%	28	19	10	0	-10	-19	-29
2.67%	77	72	66	60	54	47	40
5.33%	87	85	84	82	79	75	71
8.00%	88	87	87	87	86	85	83

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

(단위:백만원)

6,332

공시일	2018-07-17
기준일	2018-07-16

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

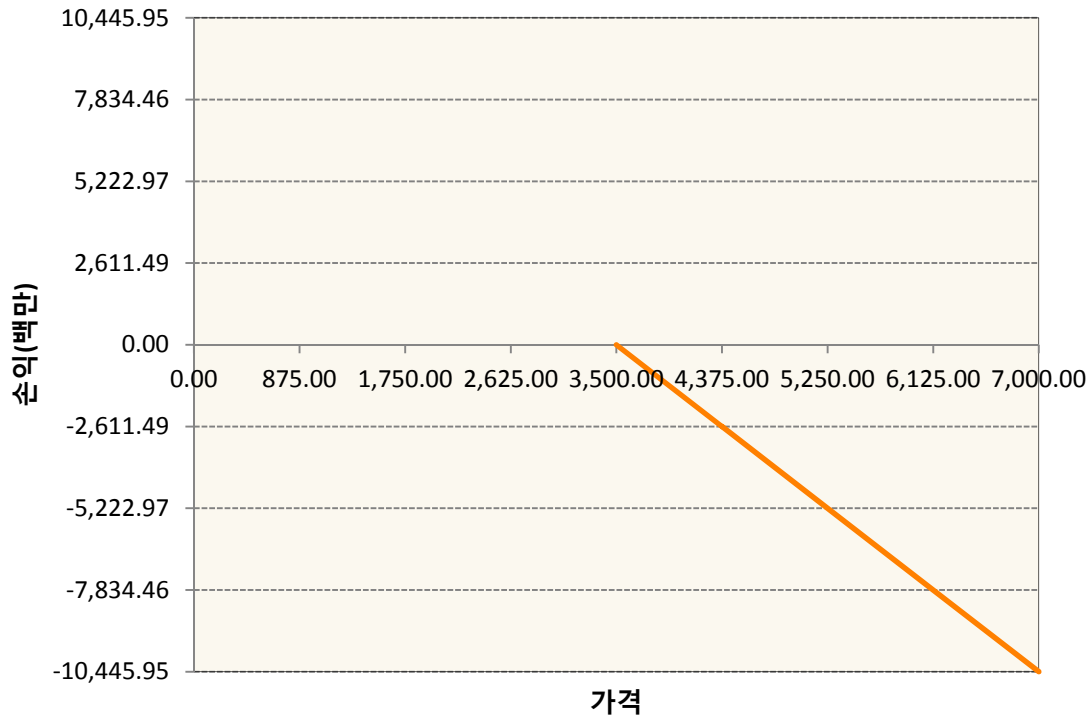
1. 계약금액

(단위:백만원)

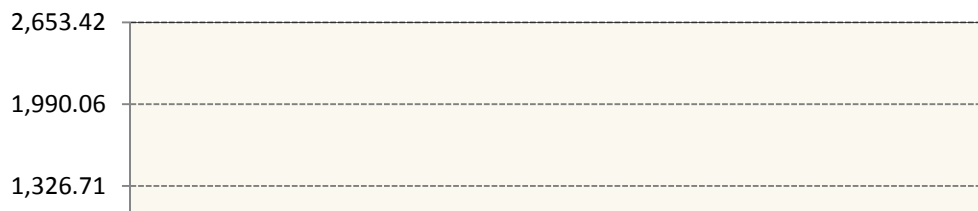
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,556	0	5,556	
누계	유가증권	스왑	45,113	0	45,113	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,199	-26,199	장내
누계	지수	스왑	52,825	0	52,825	장외

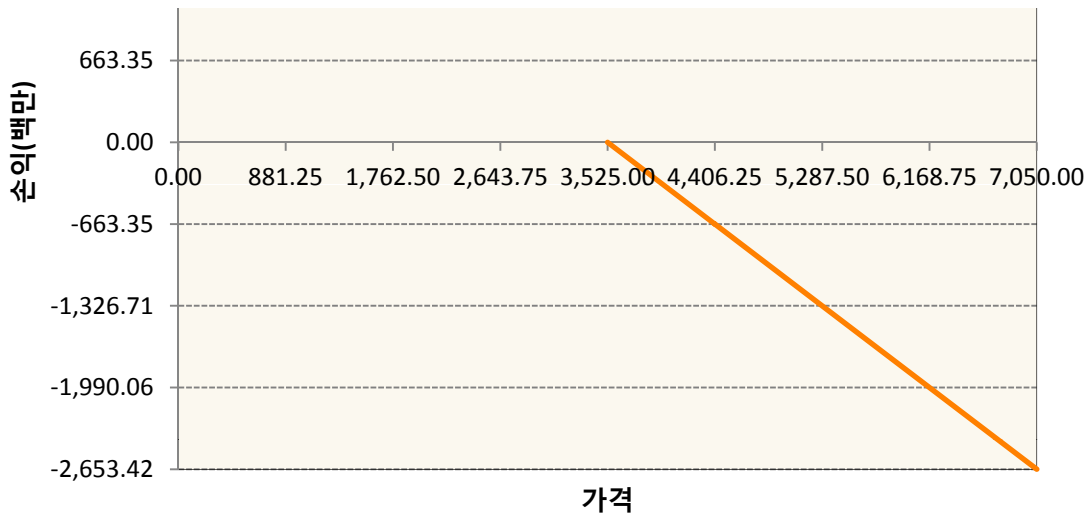
2. 만기시점의 손익구조

OESXN8-C3500-EURO STOXX 50

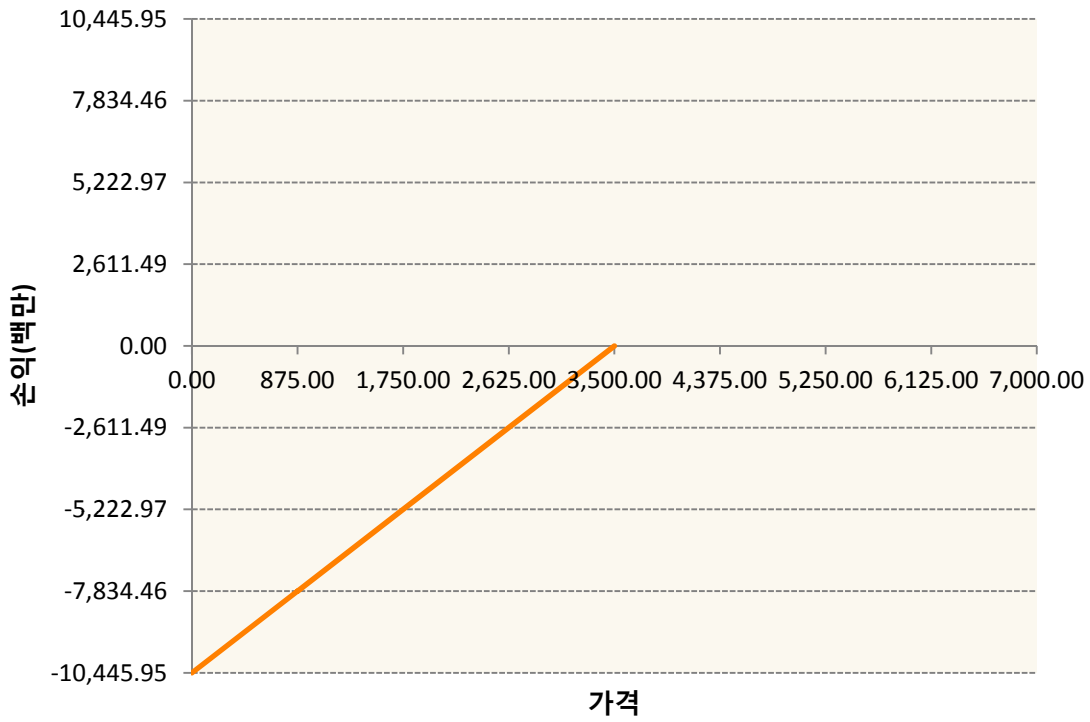


OESXN8-C3525-EURO STOXX 50

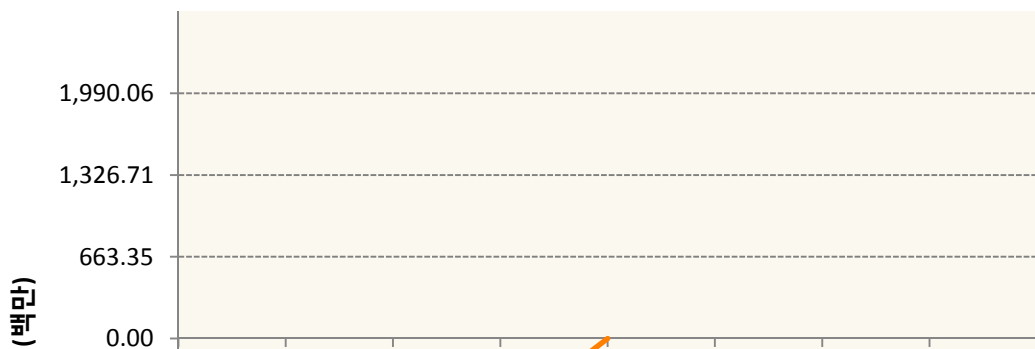


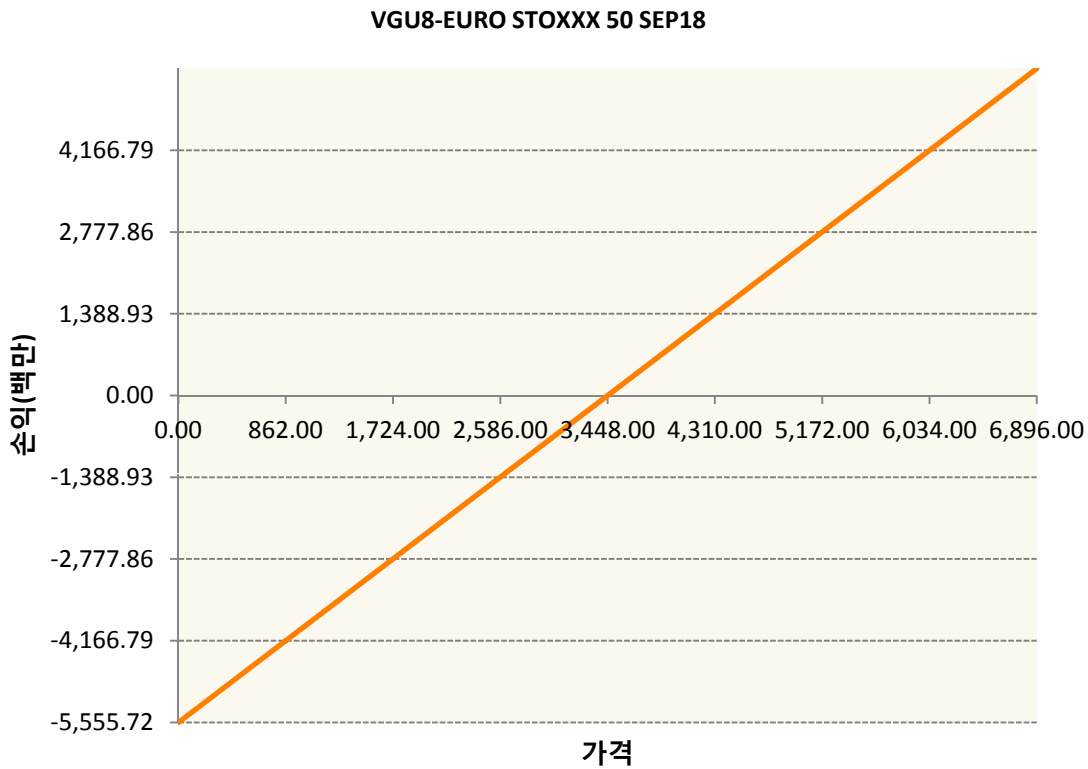
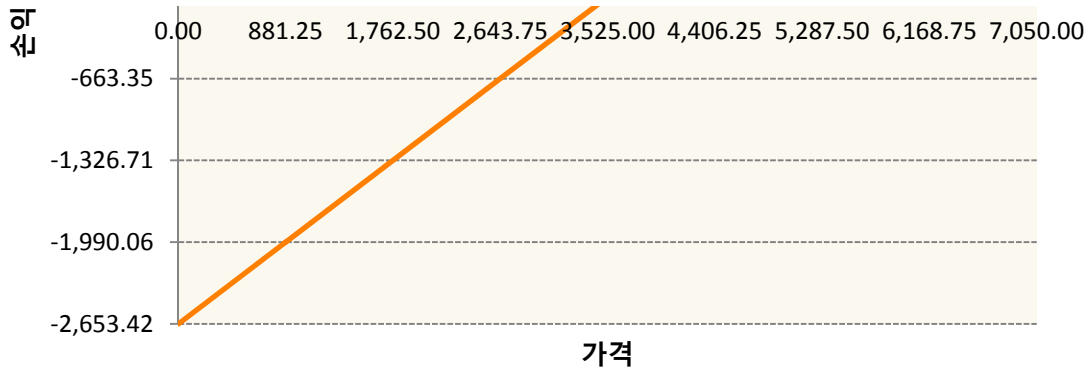


OESXN8-P3500-EURO STOXX 50



OESXN8-P3525-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		35
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		30
OESXN8-C3! EURO STOXX 50		836
OESXN8-C3! EURO STOXX 50		212
OESXN8-P3! EURO STOXX 50		836
OESXN8-P3! EURO STOXX 50		212
VGU8	EURO STOXXX 50 SEP18	444

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

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

(단위:백만원)

1,163

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

(단위:백만원)

90

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

(단위:백만원)

136

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

(단위:백만원)

169

공시일	2018-07-17
기준일	2018-07-16

스마트KRX300인덱스목표전환형1

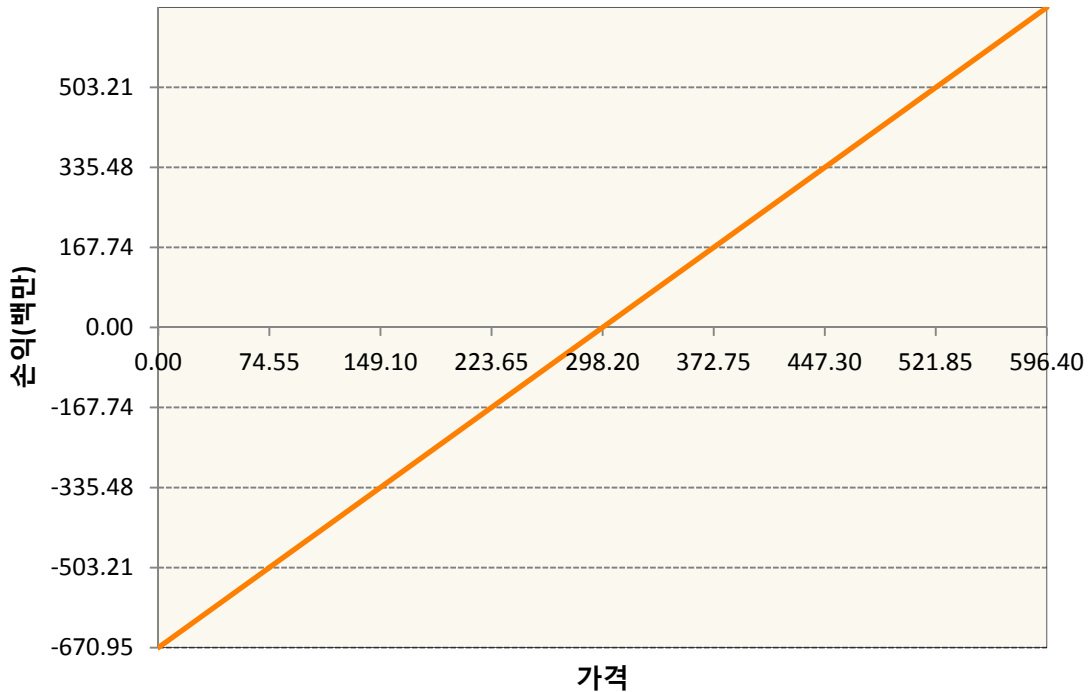
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	671	0	671	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물

54

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	18	18	18	18	18	18	18
5.33%	36	36	36	36	36	36	36
8.00%	54	54	54	54	54	54	54

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

(단위:백만원)

41

공시일	2018-07-17
기준일	2018-07-16

리디파인K200(주식혼합-파생재간

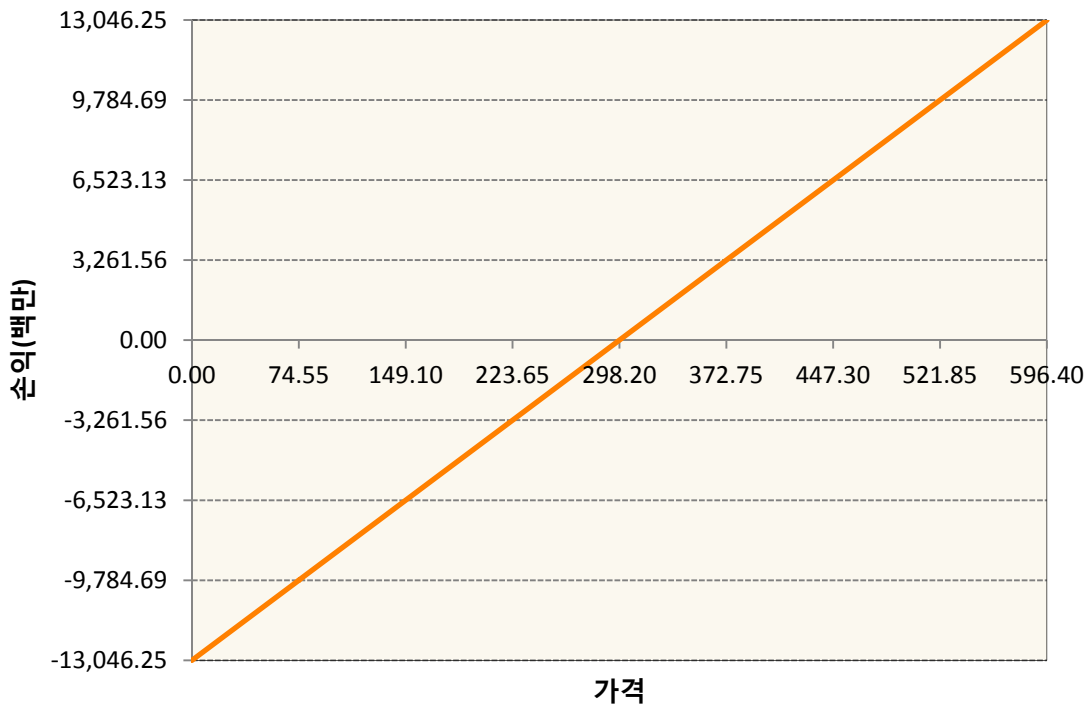
1. 계약금액

(단위:백만원)

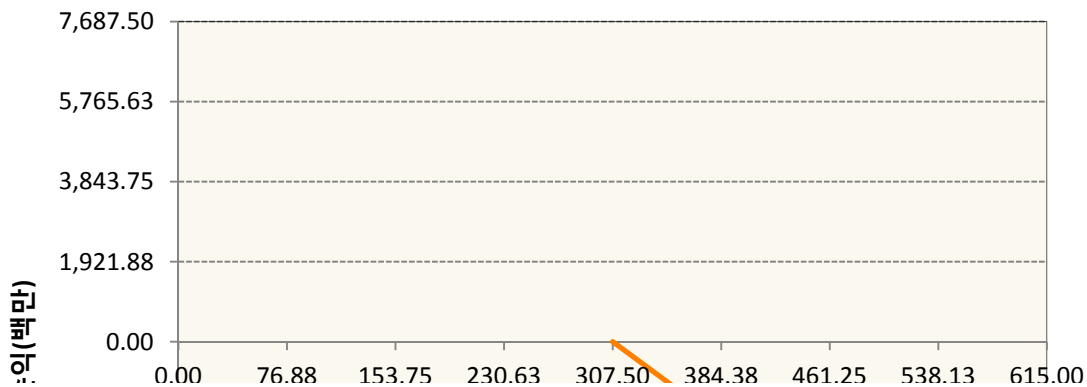
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,046	0	13,046	장내
누계	유가증권	옵션	2,134	23,653	-21,518	장내

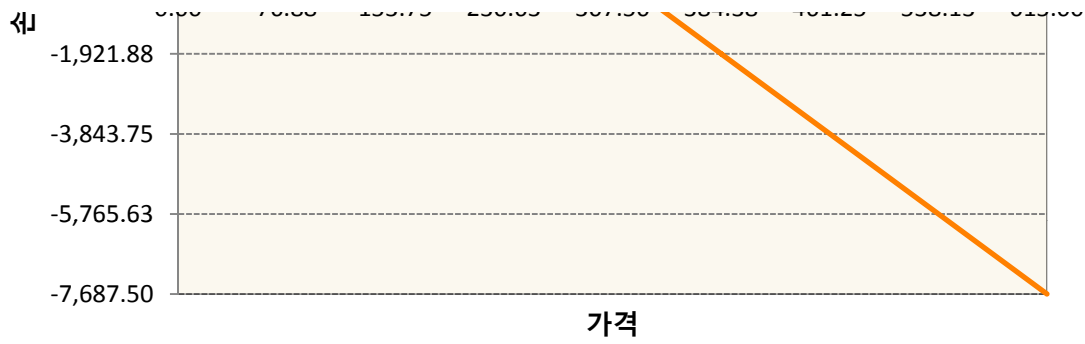
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

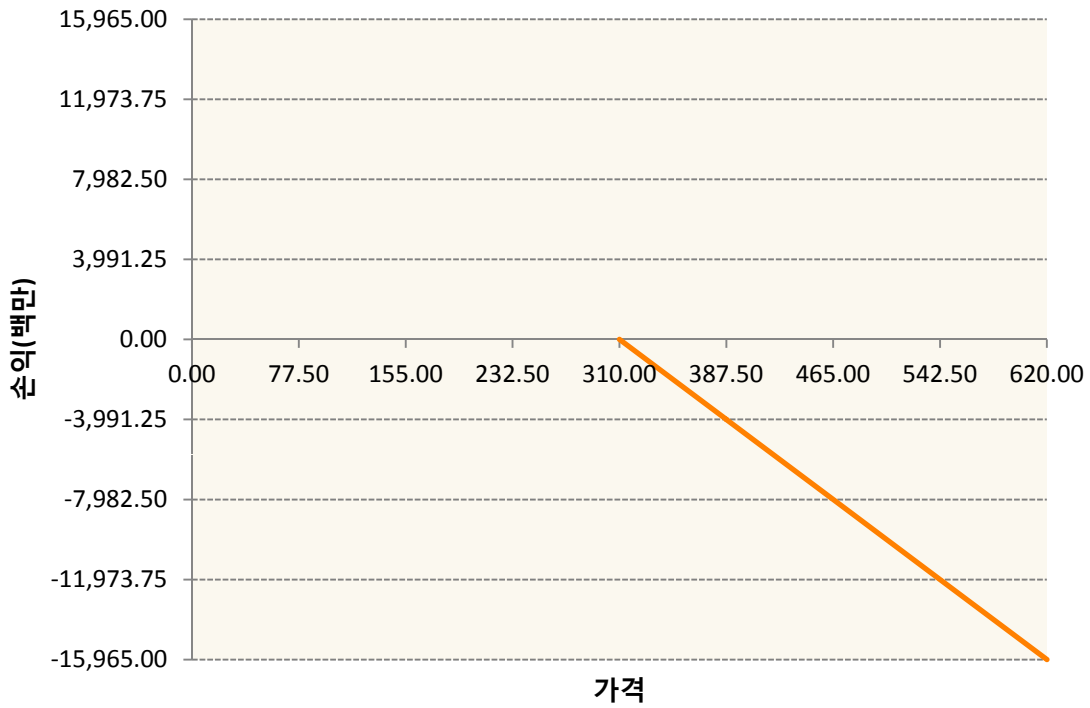


KR4201N83074-2018-08 콜307.5

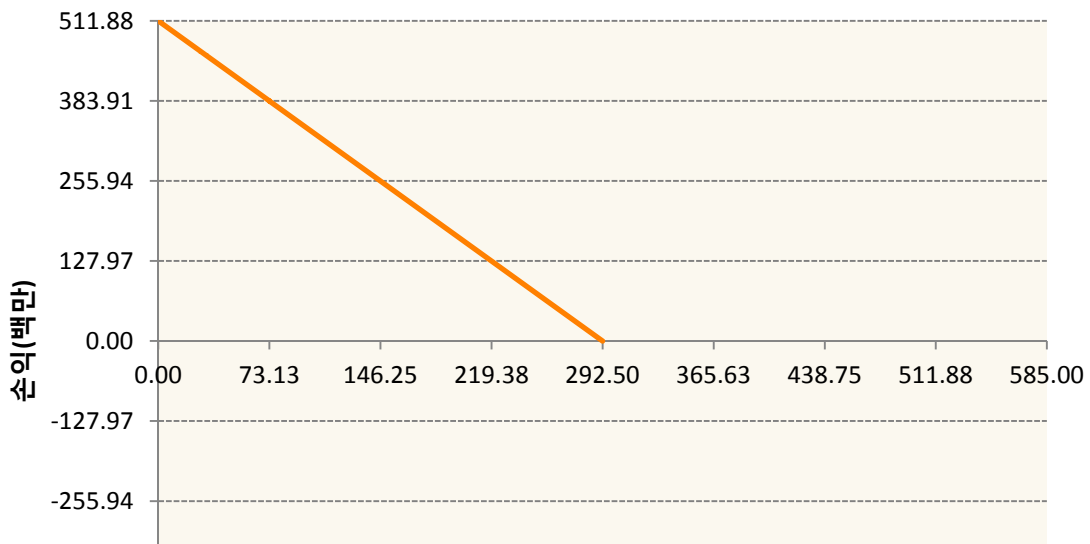


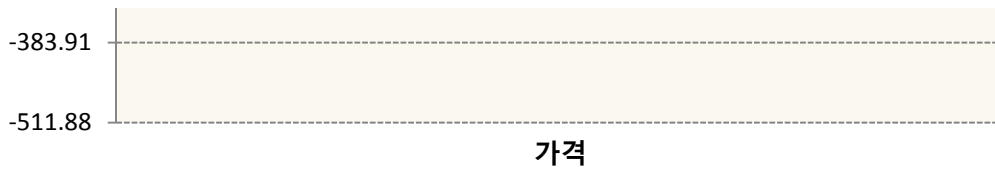


KR4201N83108-2018-08 콜310

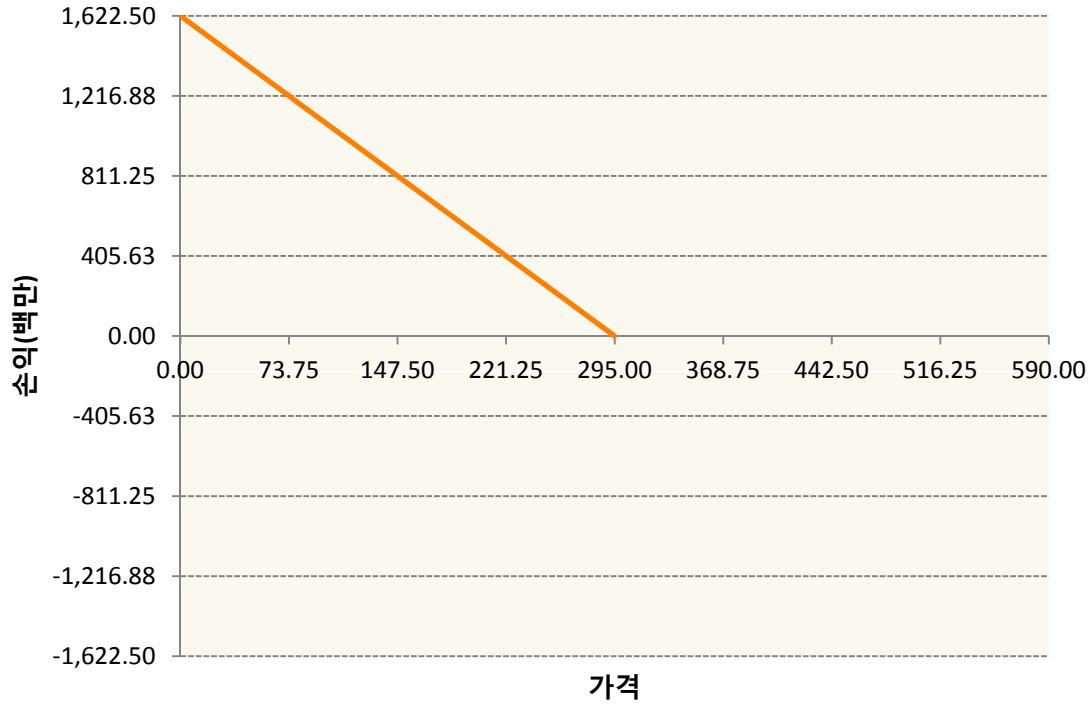


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





KR4301N82959-2018-08 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물 1,041

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,041	-1,041	-1,041	-1,041	-1,041	-1,041	-1,041
-5.33%	-694	-694	-694	-694	-694	-694	-694
-2.67%	-347	-347	-347	-347	-347	-347	-347
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	347	347	347	347	347	347	347
5.33%	694	694	694	694	694	694	694
8.00%	1,041	1,041	1,041	1,041	1,041	1,041	1,041

KR4201N83C 2018-08 콜307.5 373

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	119	116	113	108	102	95	87
-5.33%	111	105	98	89	80	69	58
-2.67%	92	80	68	55	42	27	12

0%	49	33	17	0	-17	-35	-52
2.67%	-24	-43	-62	-81	-100	-119	-138
5.33%	-133	-152	-170	-189	-208	-226	-245
8.00%	-275	-290	-306	-322	-339	-356	-373

KR4201N8312018-08 콜310

724

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	209	205	199	190	180	168	153
-5.33%	198	187	175	159	141	122	100
-2.67%	166	146	124	100	74	46	17
0%	95	65	33	0	-34	-68	-103
2.67%	-35	-73	-111	-150	-189	-227	-266
5.33%	-236	-276	-315	-355	-394	-434	-474
8.00%	-509	-543	-578	-613	-650	-687	-724

KR4301N829 2018-08 풋292.5

30

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	29	29	29	29	29	30	30
-5.33%	16	16	16	17	17	17	18
-2.67%	5	5	6	6	7	8	8
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-4	-3	-3	-3	-3	-2	-2
5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-3	-3
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4

KR4301N829 2018-08 풋295

101

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	100	100	100	100	101	101	101
-5.33%	57	58	58	59	60	61	62
-2.67%	19	21	22	24	26	27	29
0%	-6	-4	-2	0	2	4	6
2.67%	-15	-14	-13	-12	-11	-9	-8
5.33%	-17	-17	-17	-16	-16	-15	-14
8.00%	-18	-17	-17	-17	-17	-17	-17

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

(단위:백만원)

1,782

공시일	2018-07-17
기준일	2018-07-16

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

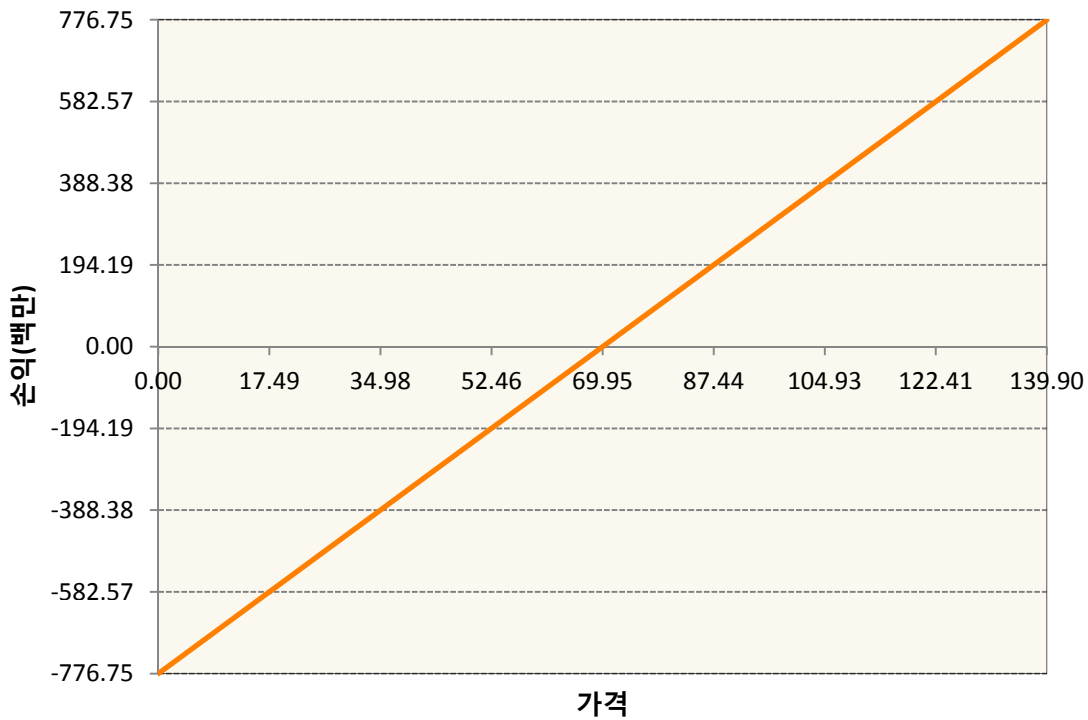
1. 계약금액

(단위:백만원)

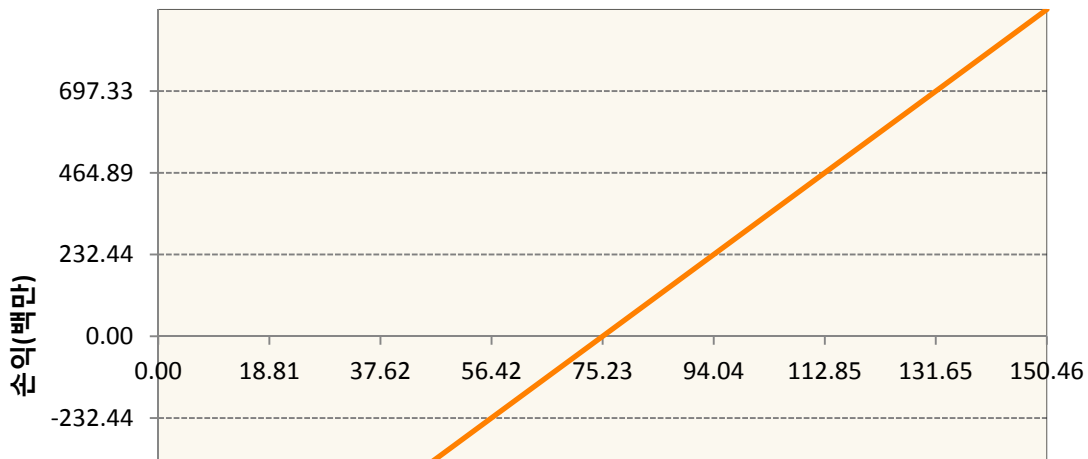
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,654	620	3,034	

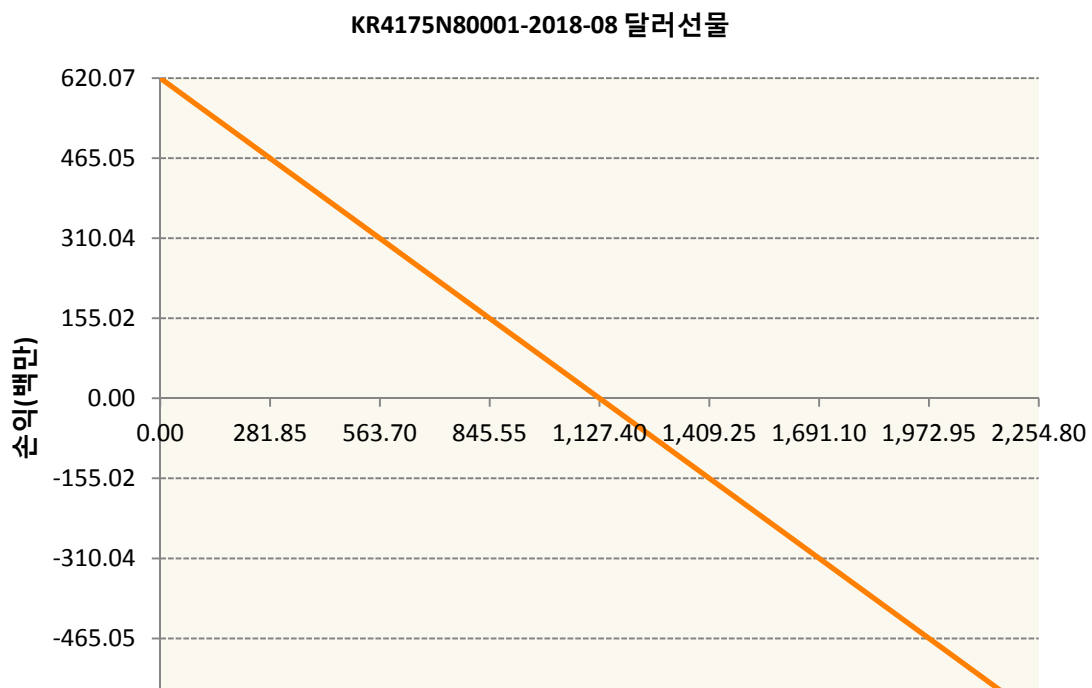
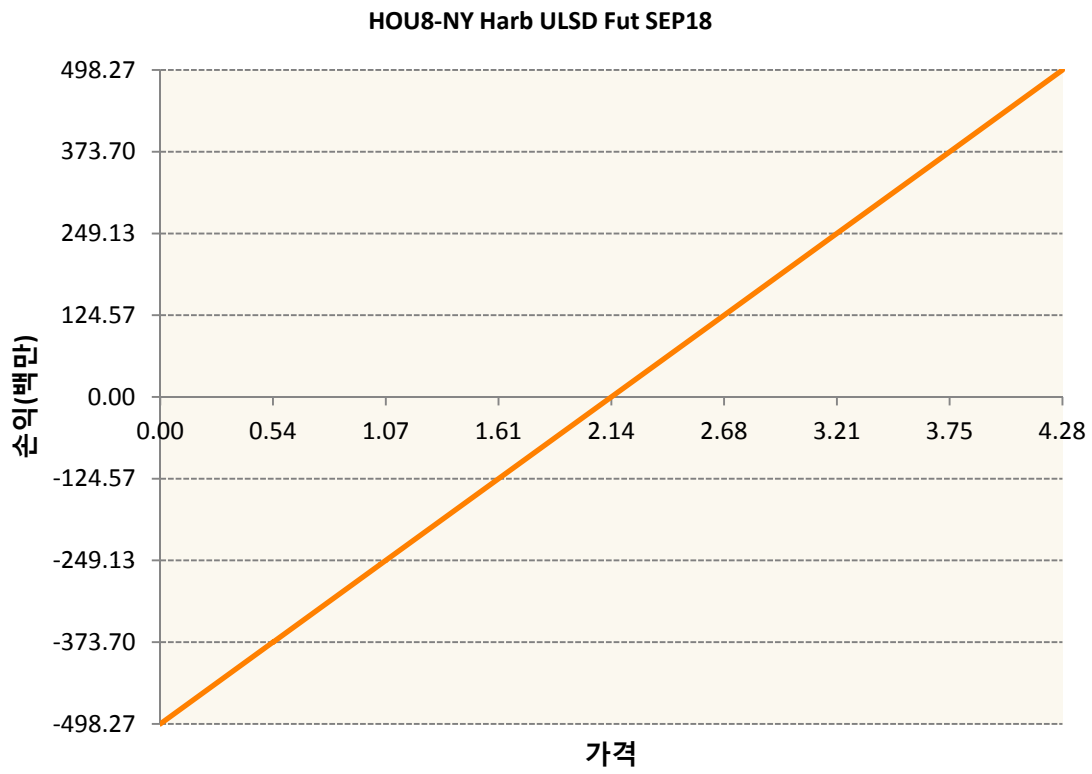
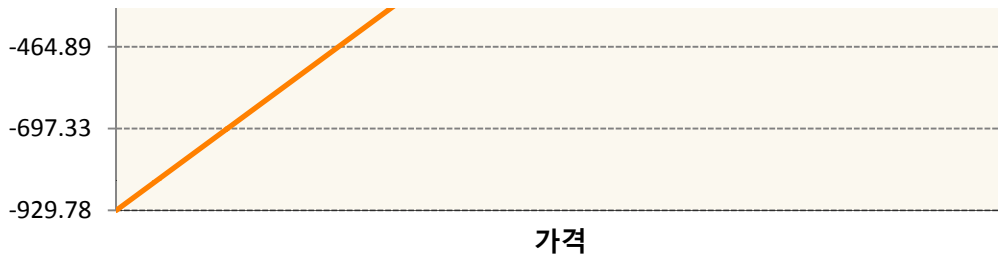
2. 만기시점의 손익구조

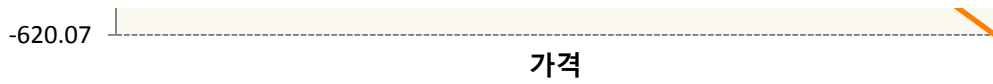
CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18



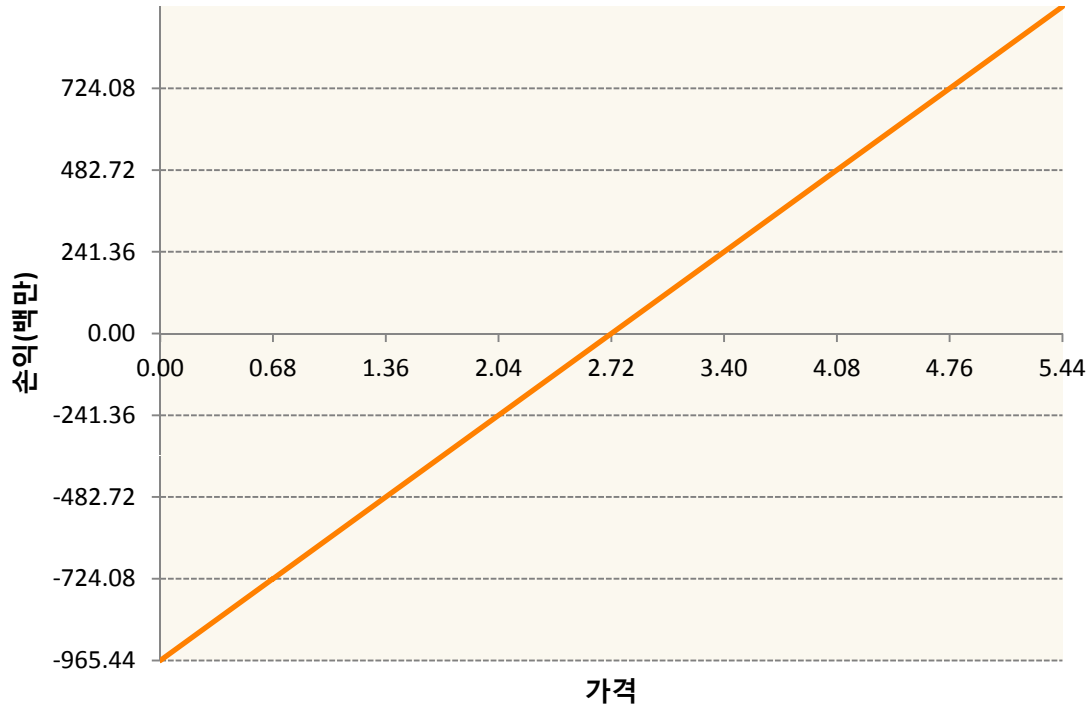
COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18



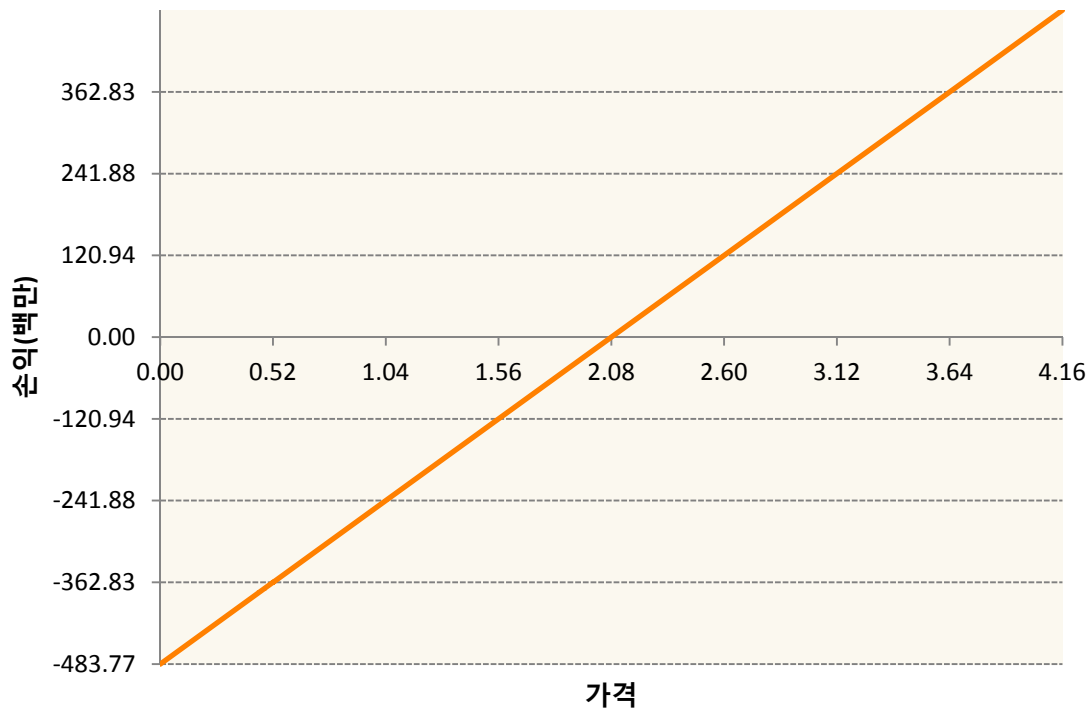




NGU18-NATURAL GAS FUTR SEP18



XBU8-GASOLINE RBOB FUT SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU8	WTI CRUDE FUTURE SEP18	62
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	74
HOU8	NY Harb ULSD Fut SEP18	40
KR4175N80C	2018-08 달러선물	50
NGU18	NATURAL GAS FUTR SEP18	77
XBU8	GASOLINE RBOB FUT SEP18	39

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

429

공시일	2018-07-17
기준일	2018-07-16

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

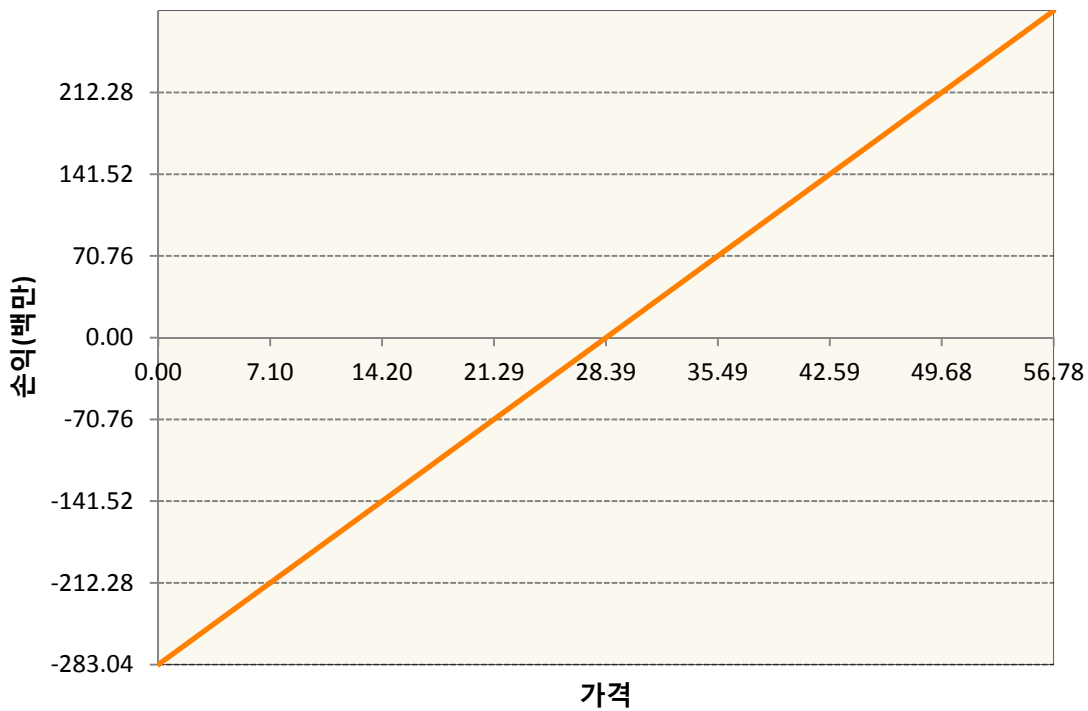
1. 계약금액

(단위:백만원)

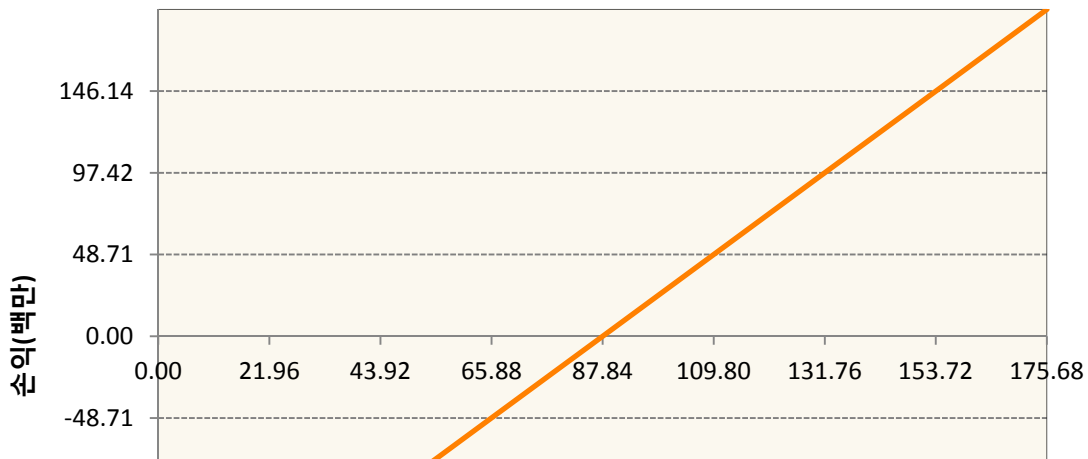
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,524	79	3,445	

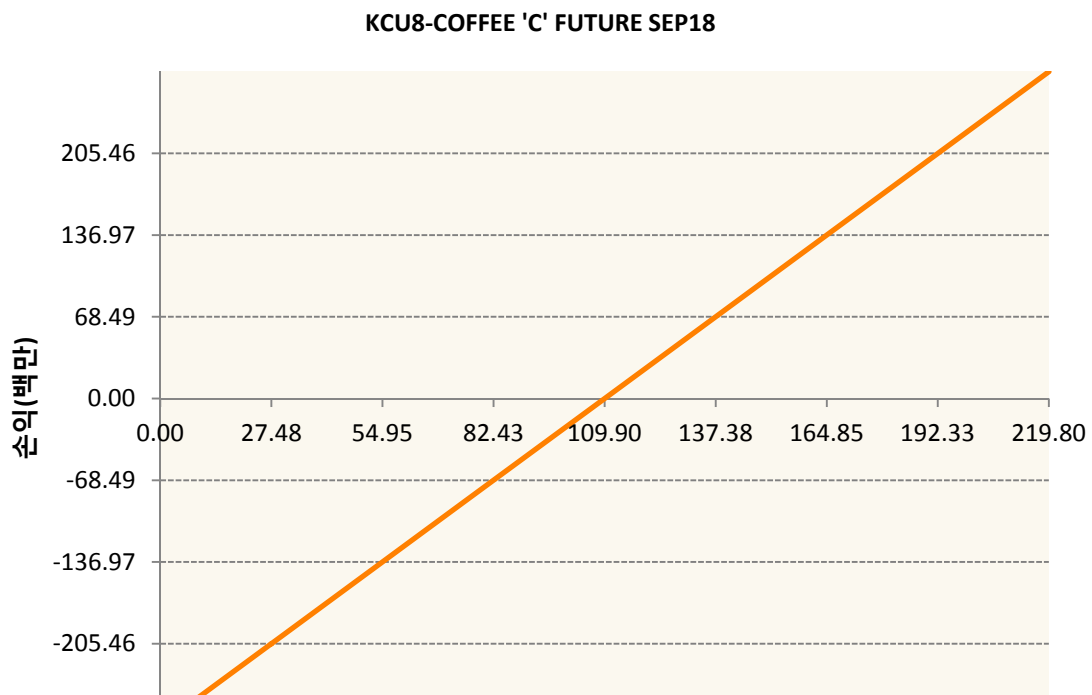
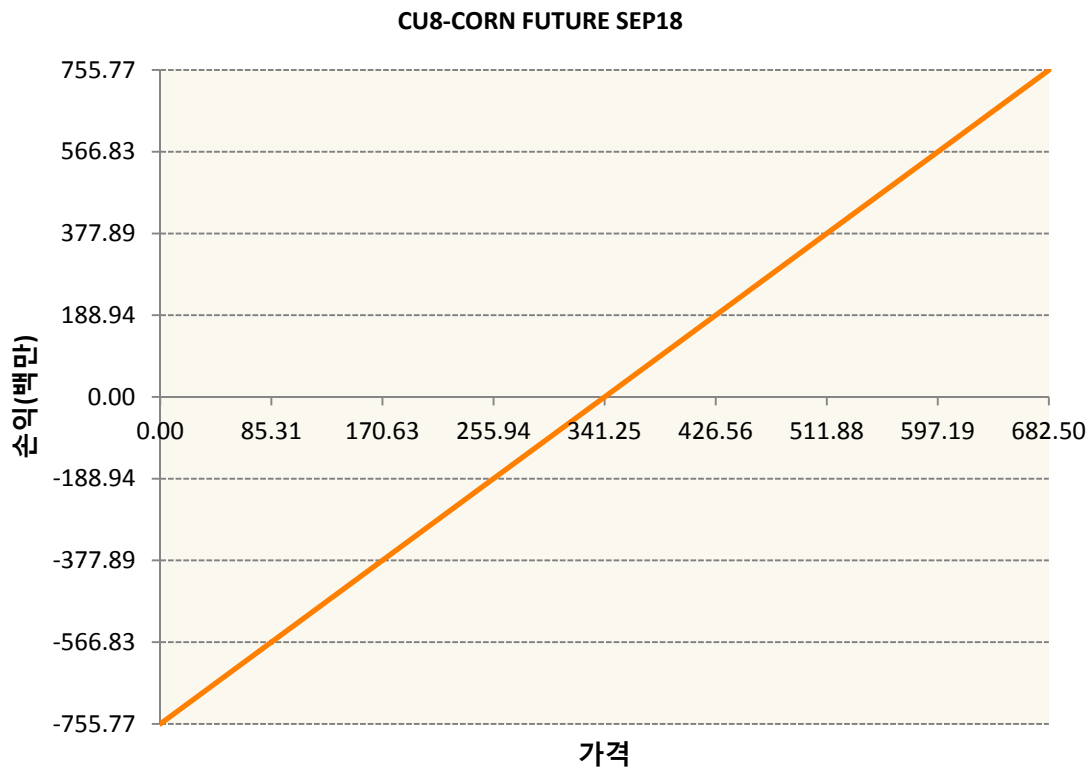
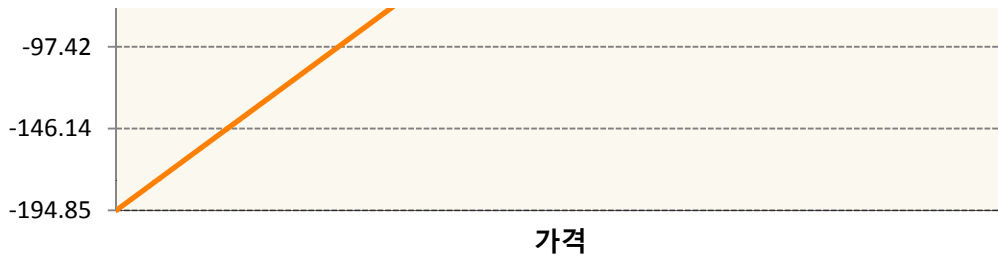
2. 만기시점의 손익구조

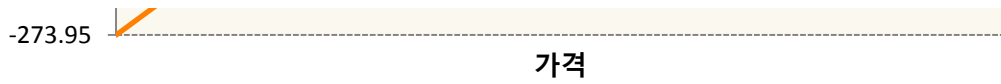
BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18



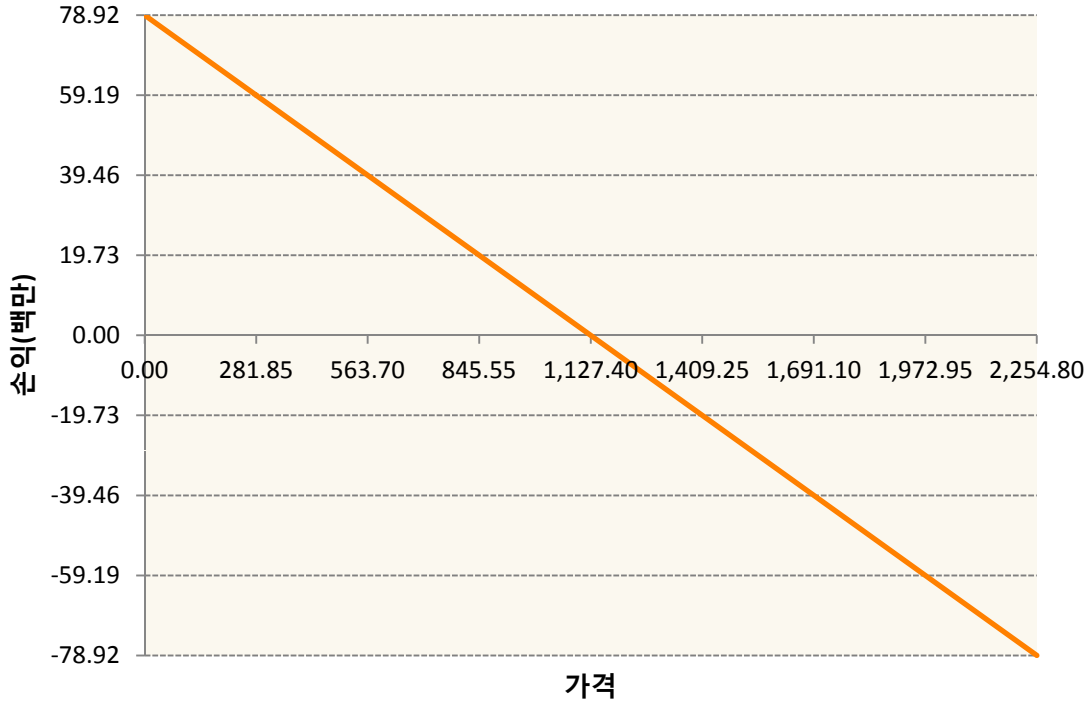
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



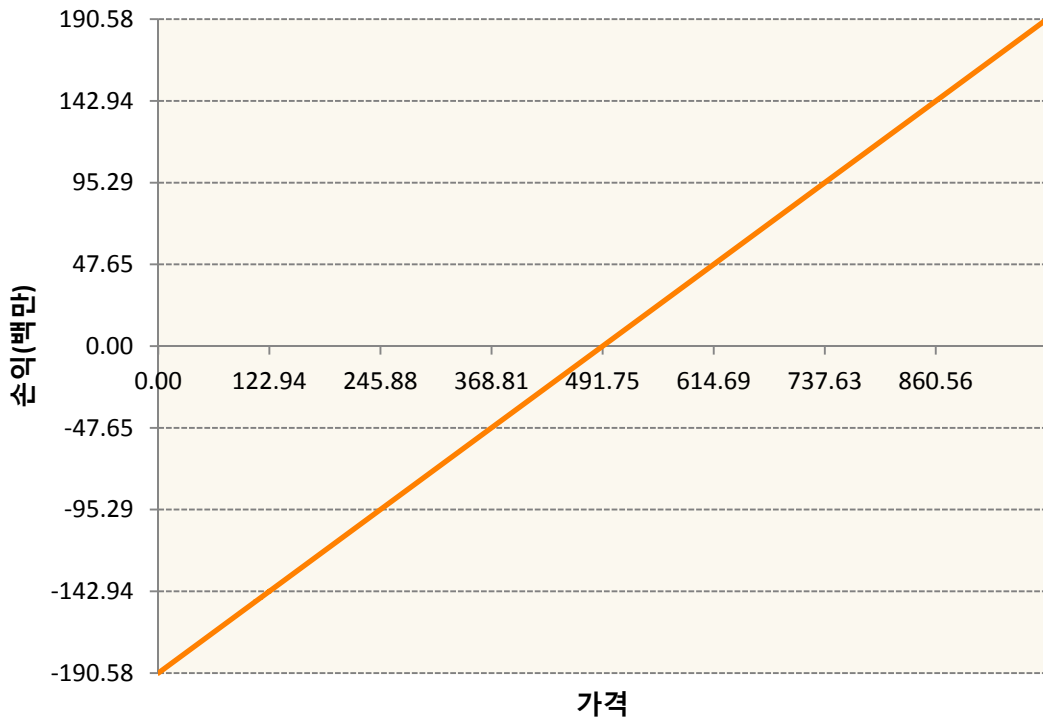




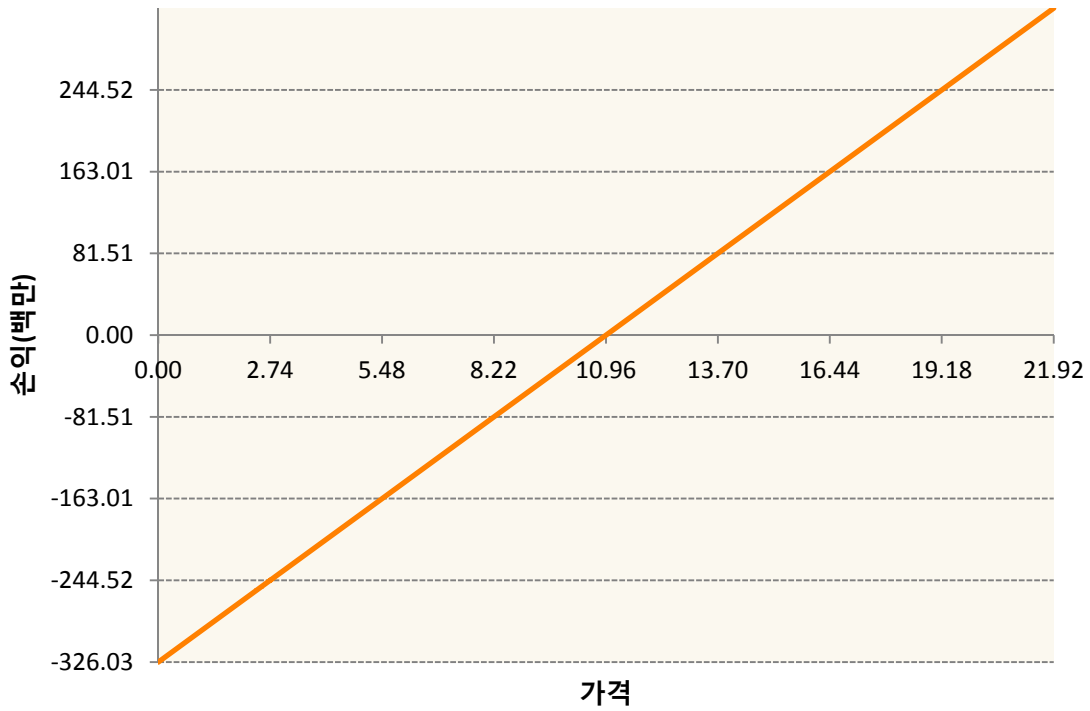
KR4175N80001-2018-08 달러선물



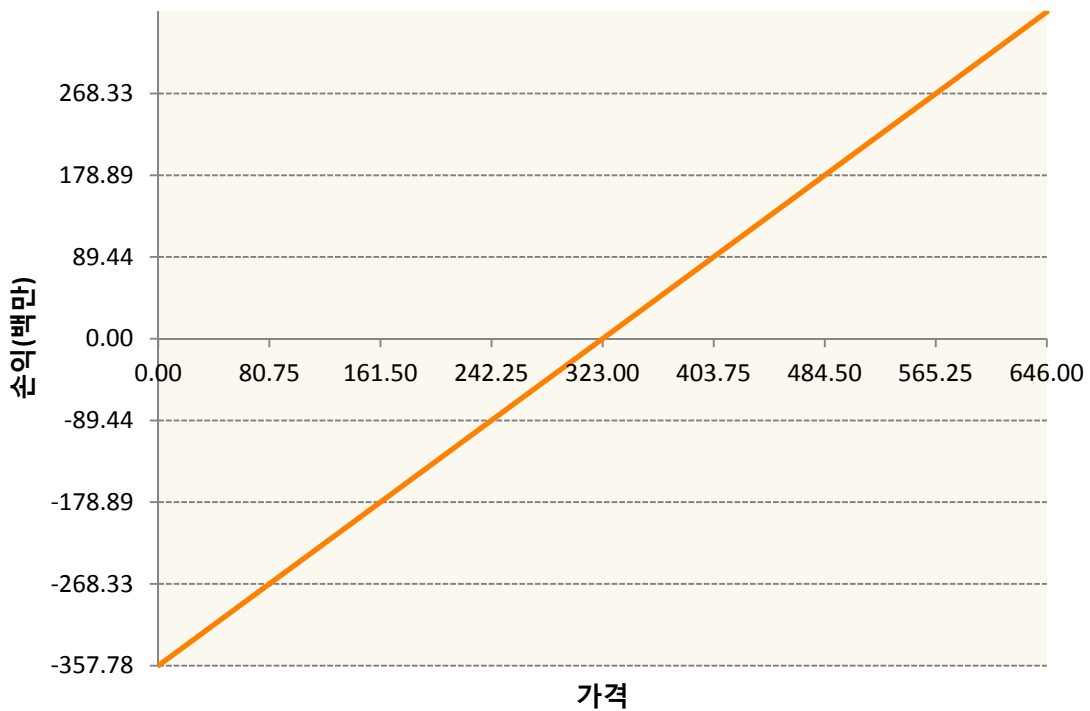
KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18



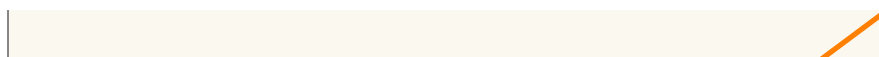
SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

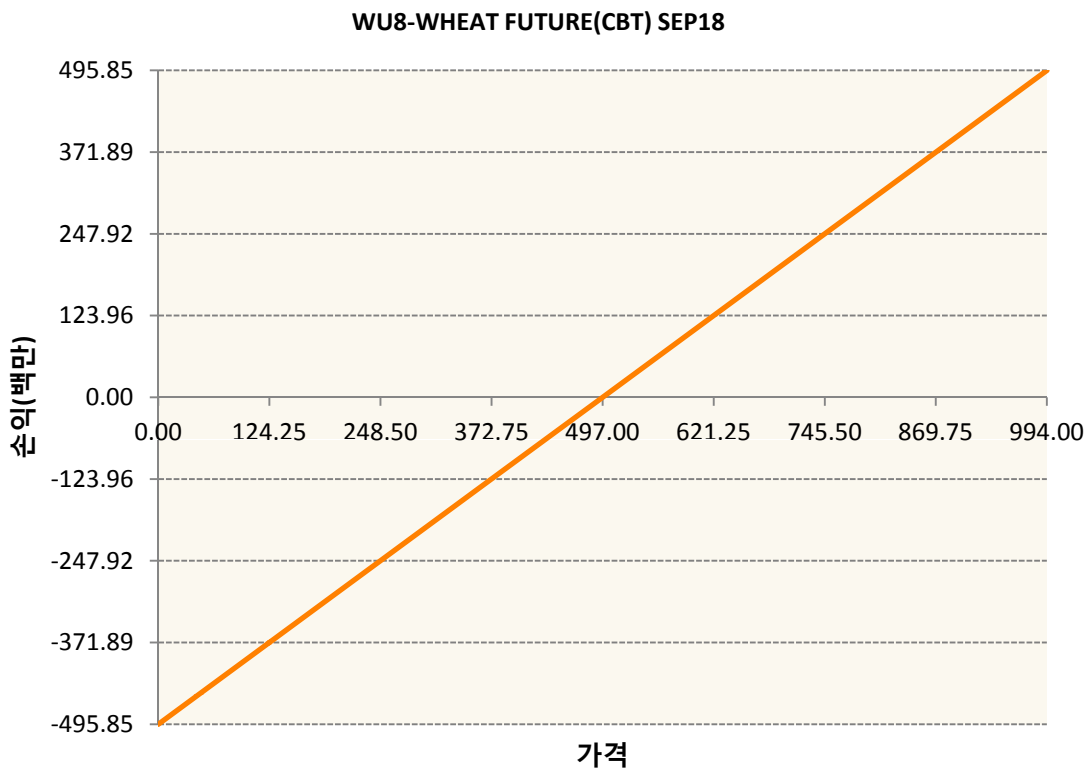
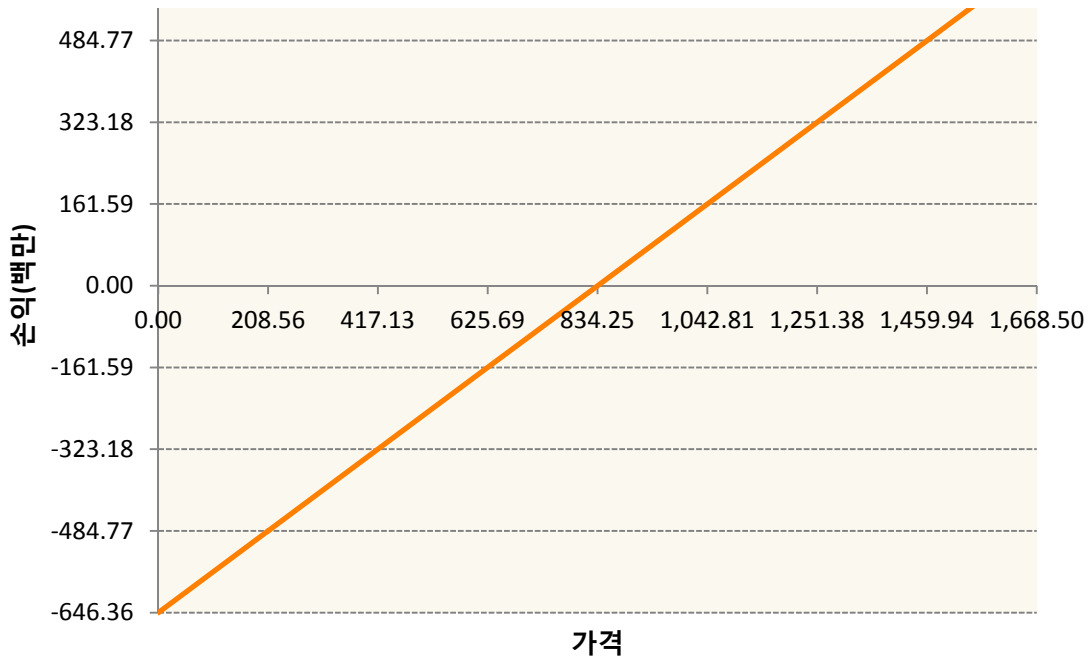


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	23
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	16
CU8	CORN FUTURE SEP18	60
KCU8	COFFEE 'C' FUTURE SEP18	22
KR4175N80C	2018-08 달러선물	6

KWU8	KC HRW WHEAT FUT SEP18	15
SBV8	SUGAR #11 (WORLD) OCT18	26
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	29
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	52
WU8	WHEAT FUTURE(CBT) SEP18	40

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

(단위:백만원)

296