

공시일	2018-07-18
기준일	2018-07-17

## 포커스농산물모(채권-파생평)

### 1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	1	-1	장외
누계	지수	스왑	6	0	6	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	2018-07-18
기준일	2018-07-17

## 스마트인덱스모

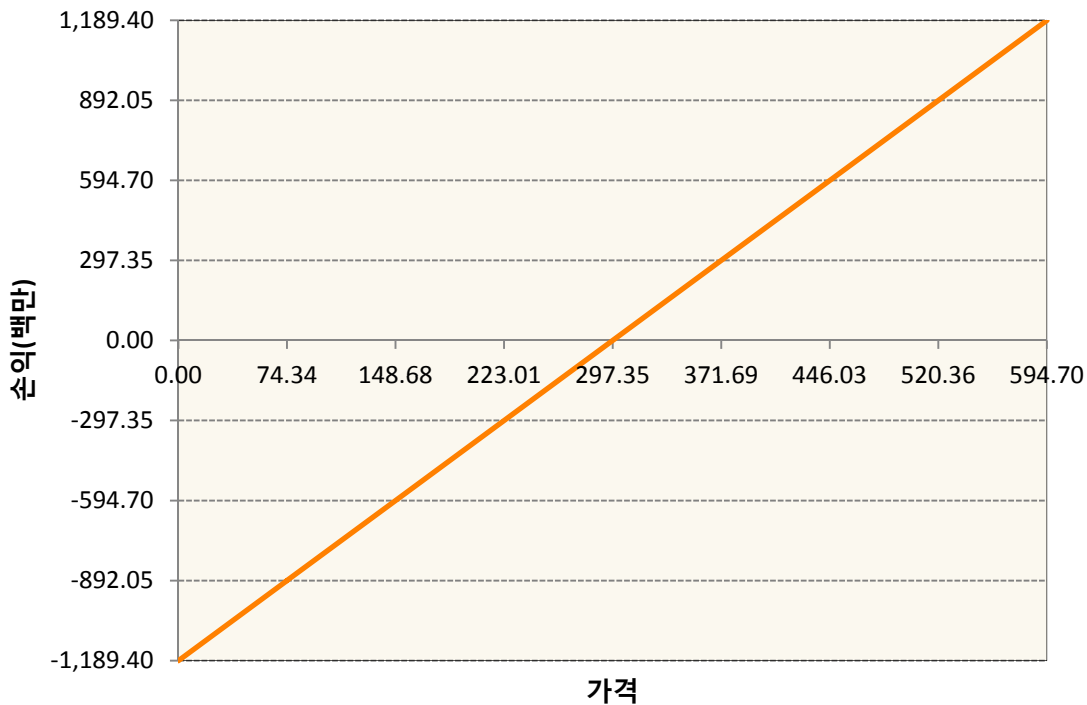
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,189	0	1,189	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	2018-07-18
기준일	2018-07-17

## 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

1,129

\* 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	2018-07-18
기준일	2018-07-17

## 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	2018-07-18
기준일	2018-07-17

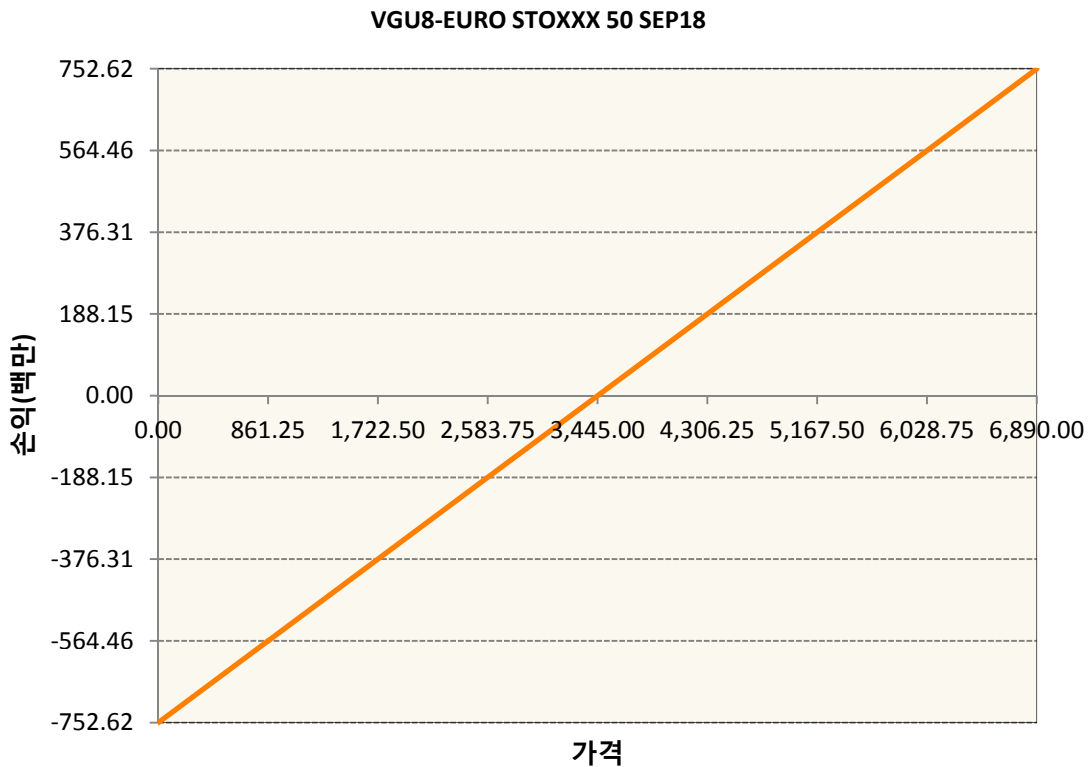
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	753	0	753	

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU8	EURO STOXXX 50 SEP18	60
------	----------------------	----

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

(단위:백만원)

37
----

공시일	2018-07-18
기준일	2018-07-17

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

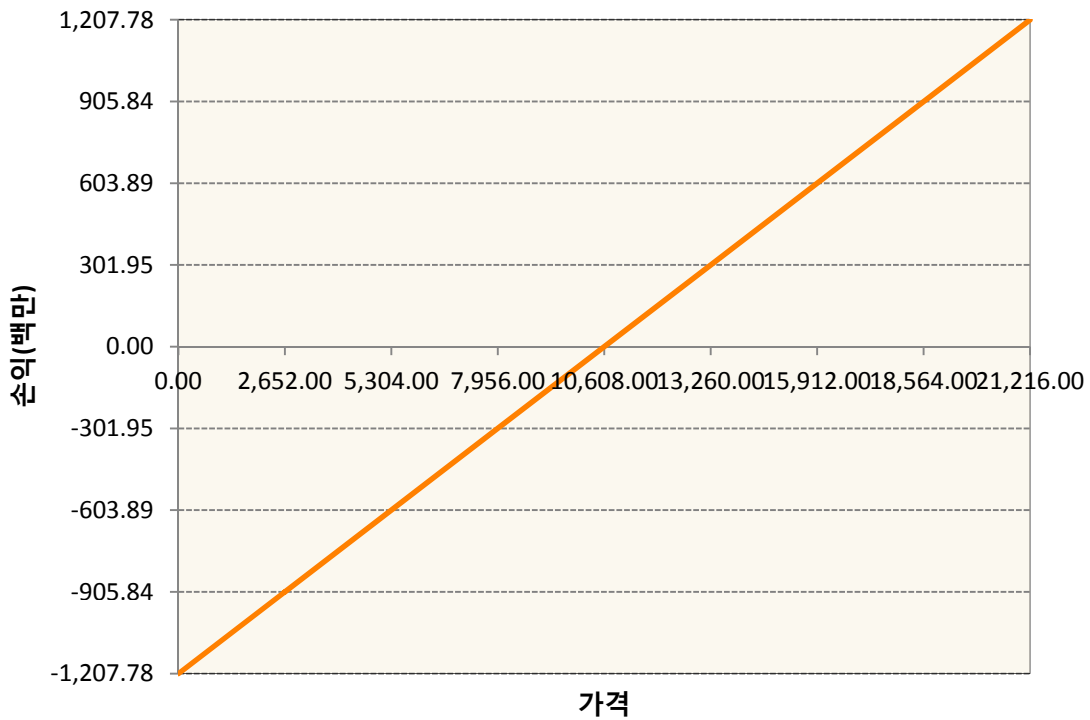
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

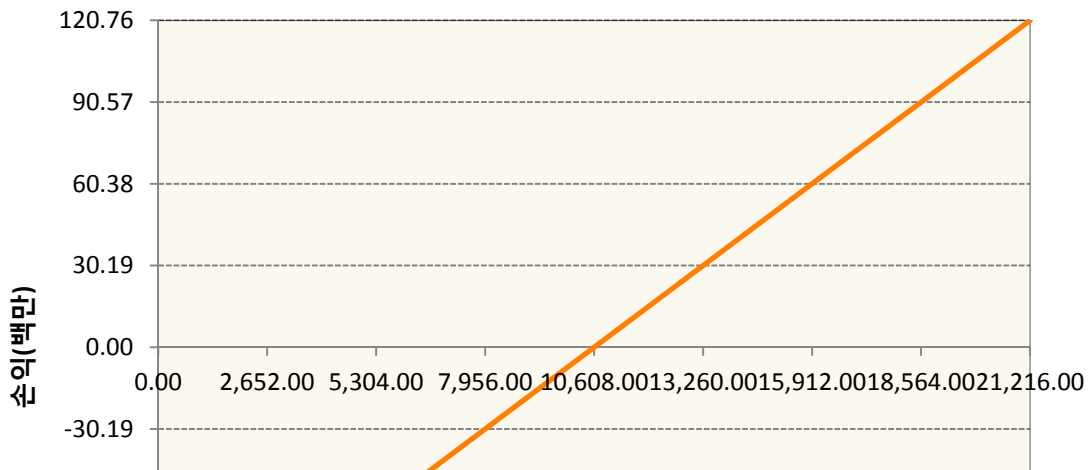
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,329	0	1,329	장내

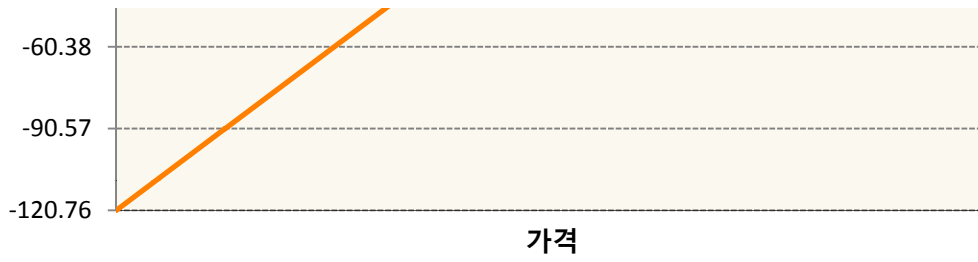
### 2. 만기시점의 손익구조

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	2018-07-18
기준일	2018-07-17

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

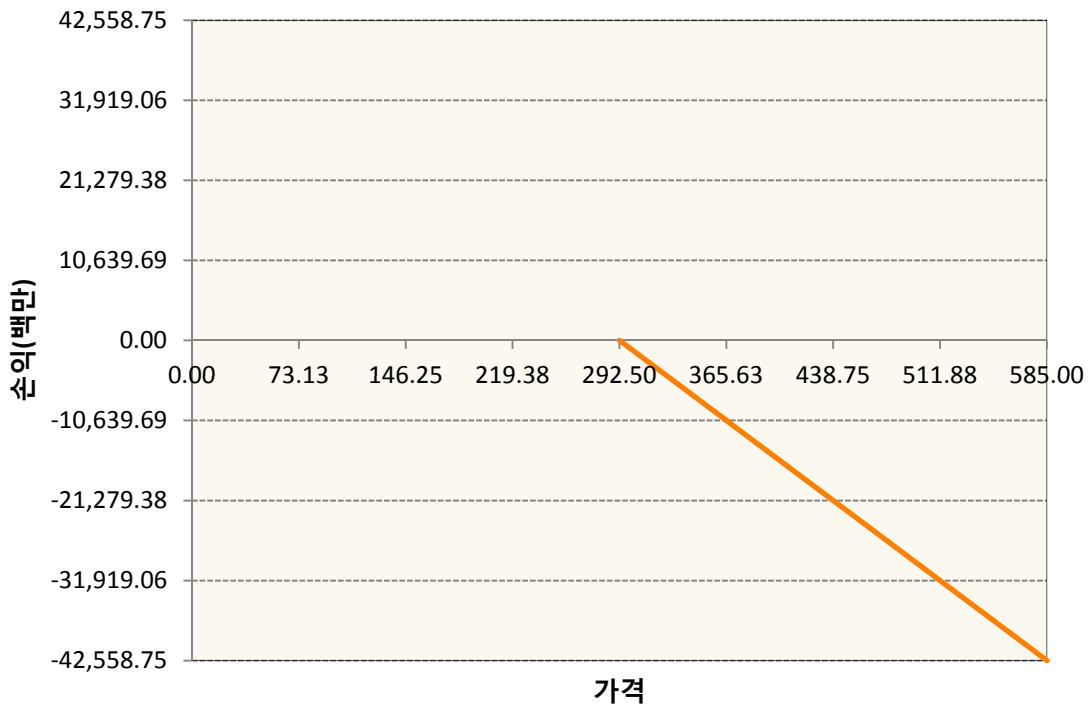
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

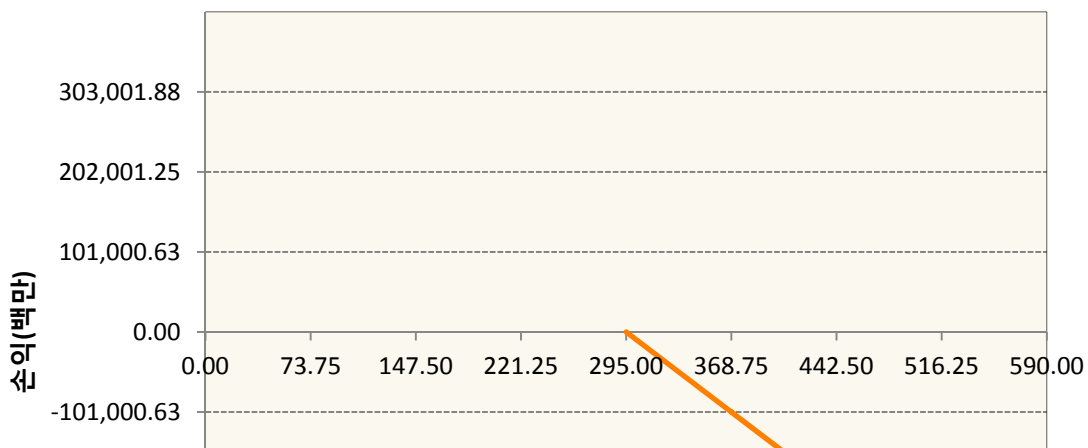
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	725,561	-725,561	장내

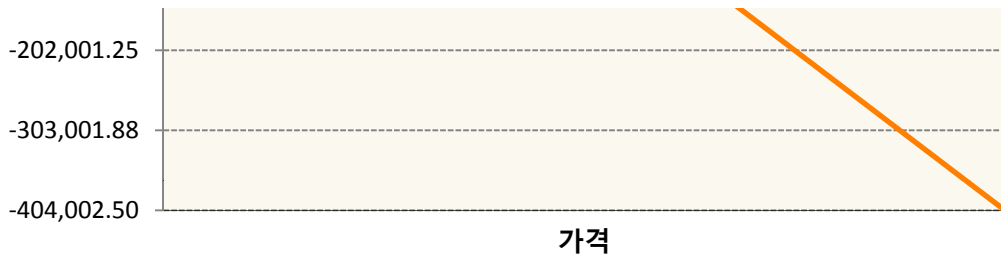
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201N82928-2018-08 콜292.5**

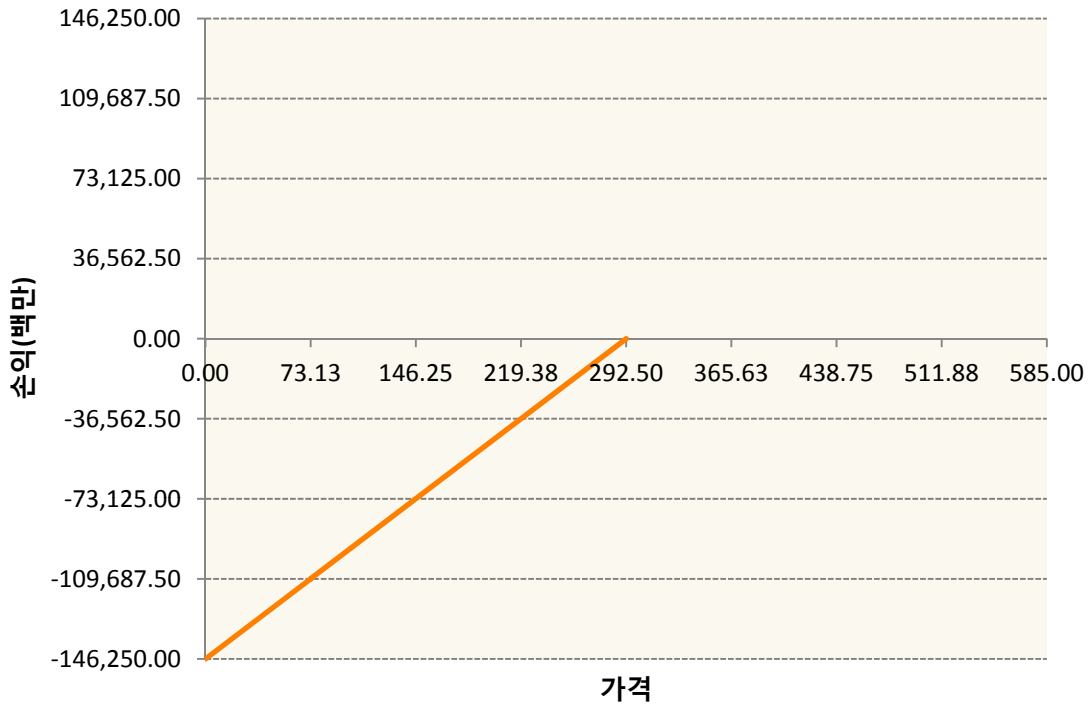


**KR4201N82951-2018-08 콜295**

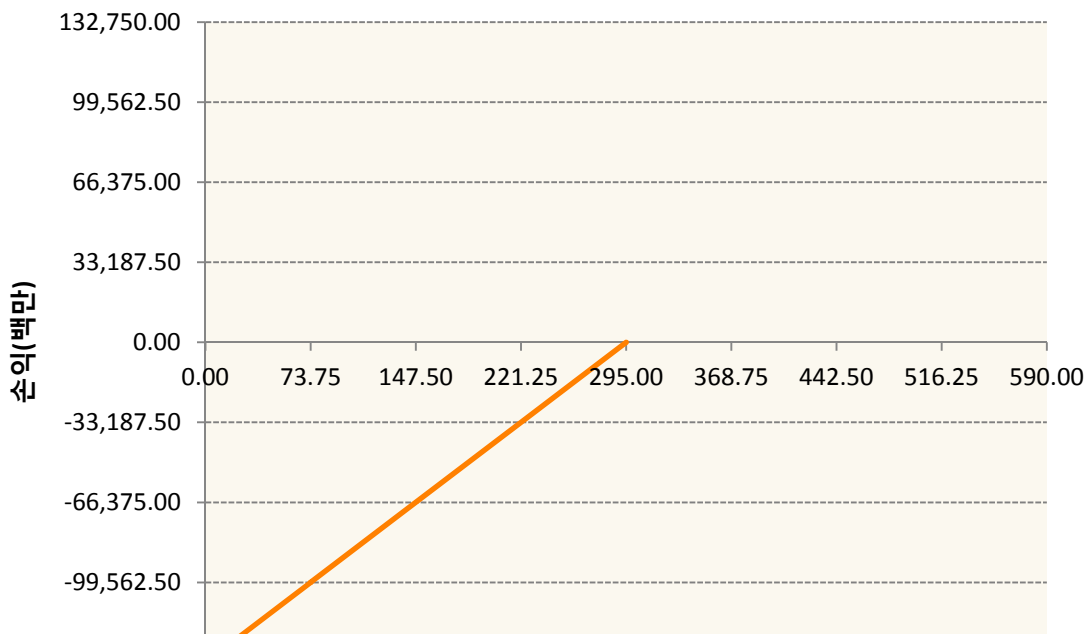




**KR4301N82926-2018-08 풋292.5**



**KR4301N82959-2018-08 풋295**



-132,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N829 2018-08 콜292.5							2,831
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,479	1,430	1,373	1,312	1,245	1,175	1,101
-5.33%	1,282	1,202	1,119	1,033	945	855	764
-2.67%	903	803	702	601	500	398	297
0%	303	203	102	0	-102	-204	-307
2.67%	-506	-588	-674	-762	-853	-946	-1,040
5.33%	-1,476	-1,530	-1,592	-1,660	-1,732	-1,809	-1,889
8.00%	-2,544	-2,574	-2,613	-2,659	-2,711	-2,769	-2,831
KR4201N829 2018-08 콜295							25,707
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12,363	11,975	11,519	11,004	10,439	9,832	9,188
-5.33%	10,902	10,228	9,511	8,758	7,978	7,174	6,352
-2.67%	7,915	7,005	6,084	5,156	4,222	3,282	2,339
0%	2,934	1,957	979	0	-979	-1,959	-2,939
2.67%	-4,089	-4,938	-5,812	-6,704	-7,612	-8,532	-9,462
5.33%	-12,782	-13,388	-14,053	-14,766	-15,517	-16,301	-17,111
8.00%	-22,581	-22,943	-23,379	-23,882	-24,442	-25,053	-25,707
KR4301N829 2018-08 풋292.5							8,669
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,510	-8,518	-8,533	-8,555	-8,584	-8,622	-8,669
-5.33%	-4,661	-4,722	-4,796	-4,881	-4,975	-5,077	-5,186
-2.67%	-1,413	-1,568	-1,727	-1,887	-2,049	-2,213	-2,377
0%	463	312	158	0	-160	-322	-485
2.67%	1,063	1,003	931	846	752	649	539
5.33%	1,159	1,148	1,131	1,105	1,071	1,027	974
8.00%	1,166	1,166	1,163	1,159	1,150	1,138	1,119
KR4301N829 2018-08 풋295							8,434
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,342	-8,345	-8,352	-8,364	-8,381	-8,404	-8,434
-5.33%	-4,828	-4,862	-4,907	-4,962	-5,027	-5,100	-5,180
-2.67%	-1,660	-1,778	-1,901	-2,030	-2,162	-2,297	-2,435
0%	460	307	154	0	-154	-309	-464
2.67%	1,298	1,218	1,127	1,027	920	806	687

5.33%	1,469	1,451	1,423	1,386	1,340	1,285	1,221
8.00%	1,487	1,484	1,480	1,472	1,459	1,441	1,416

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

(단위:백만원)

**45,387**

공시일	2018-07-18
기준일	2018-07-17

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

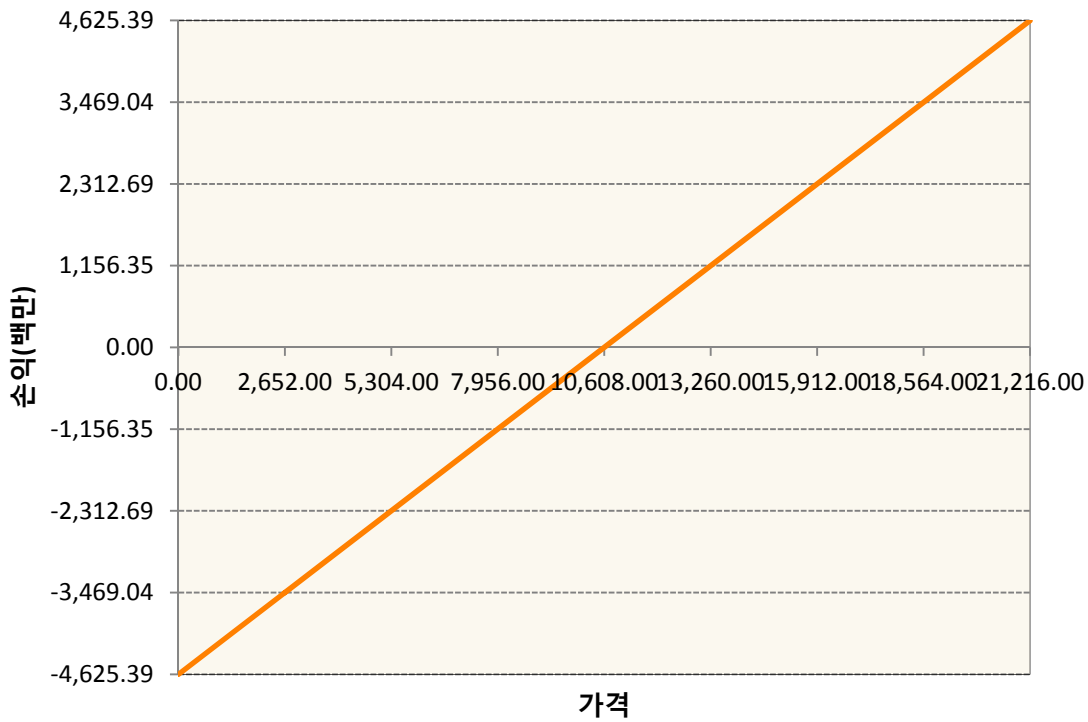
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

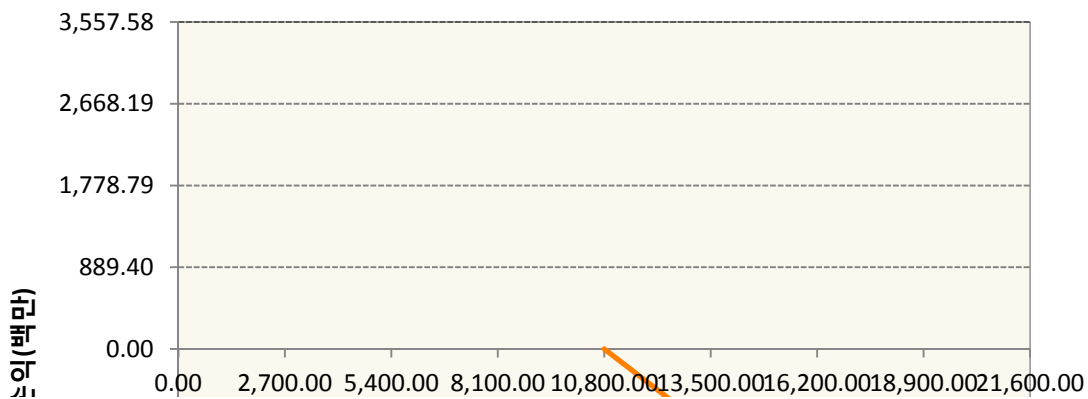
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,625	0	4,625	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,739	-10,739	장내

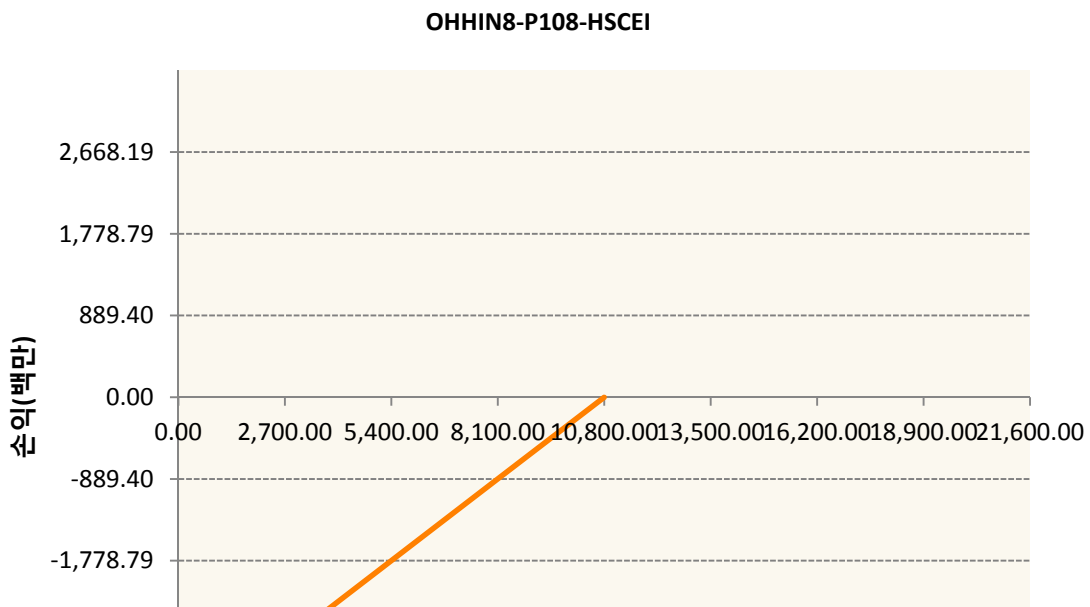
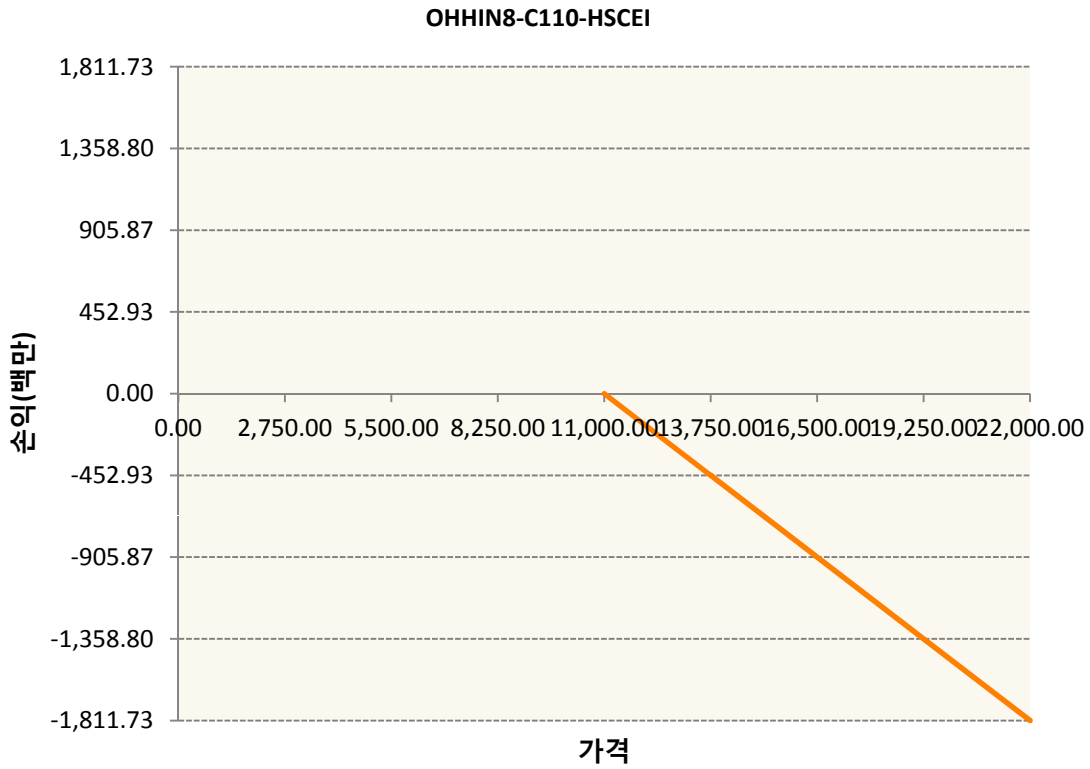
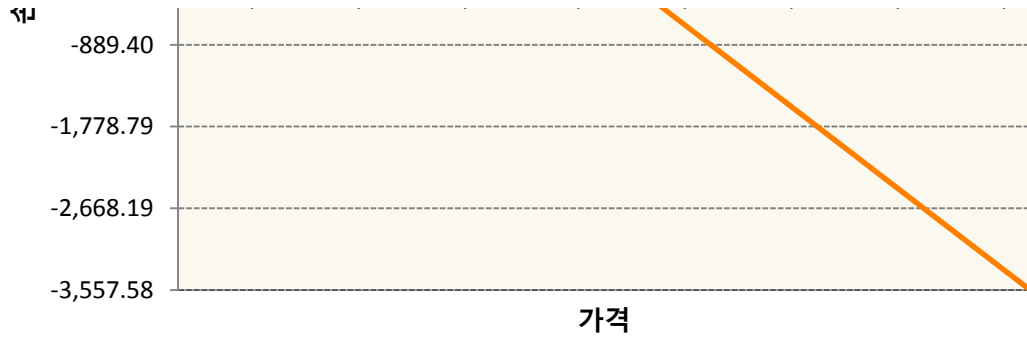
### 2. 만기시점의 손익구조

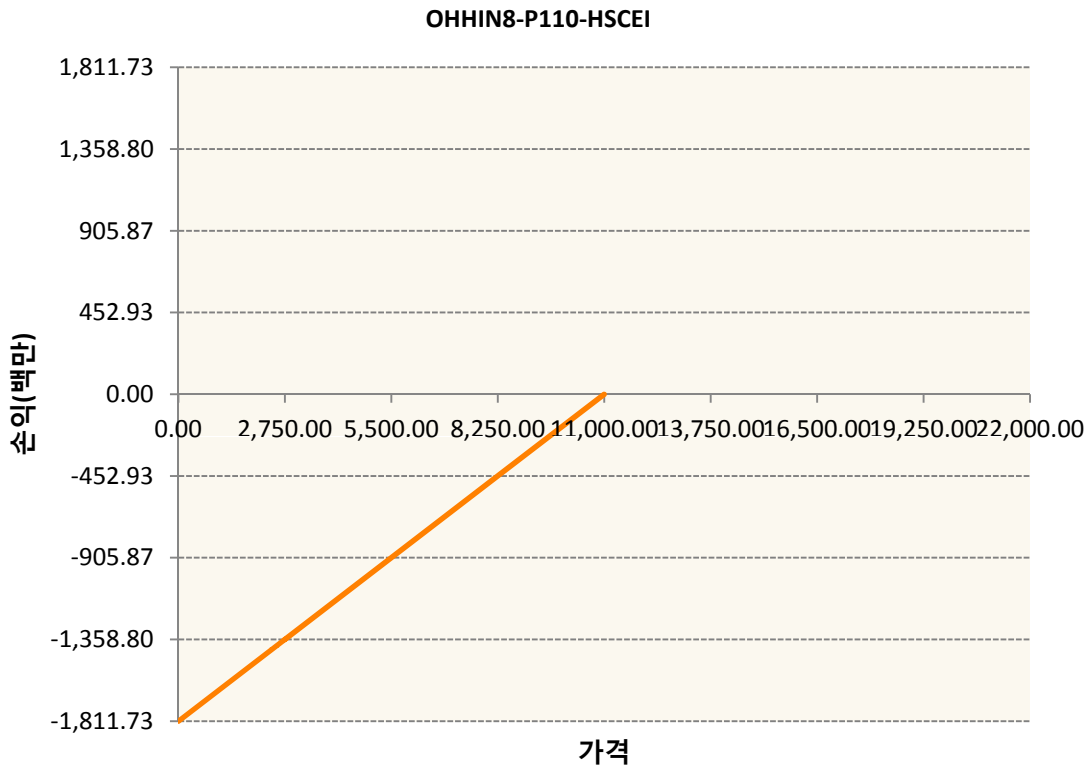
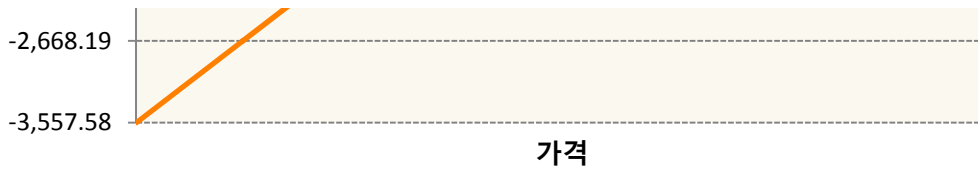
HCN8-HSCEI Futures Jul18



OHHIN8-C108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCN8	HSCEI Futures Jul18	370
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)
	<b>1,116</b>

공시일	2018-07-18
기준일	2018-07-17

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

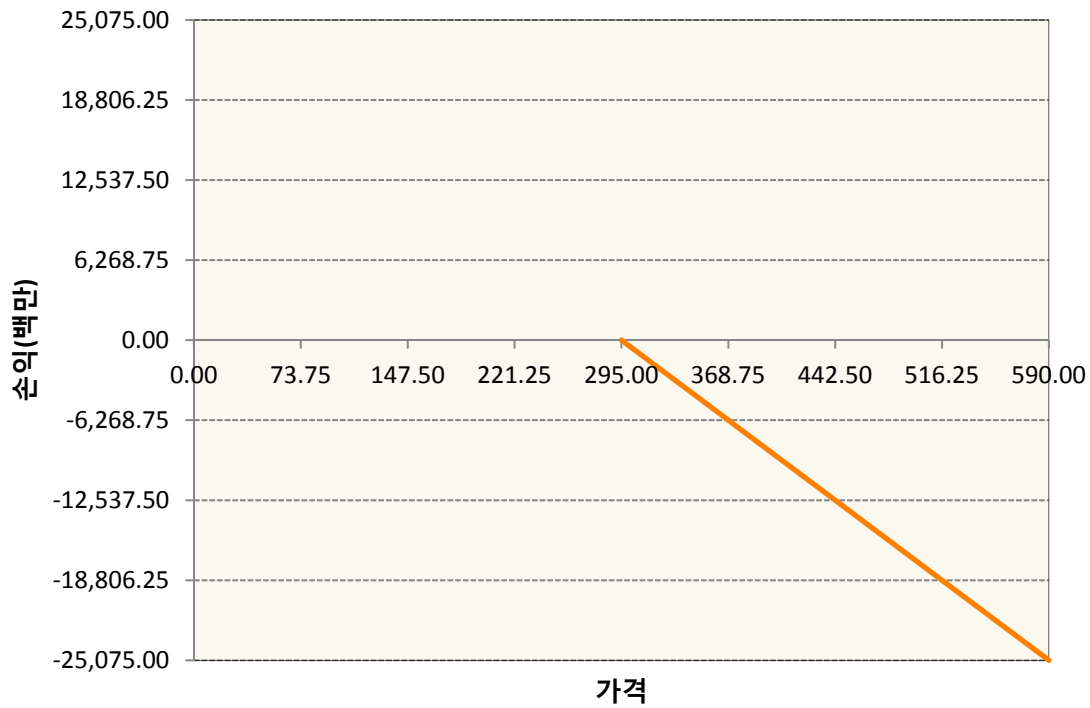
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

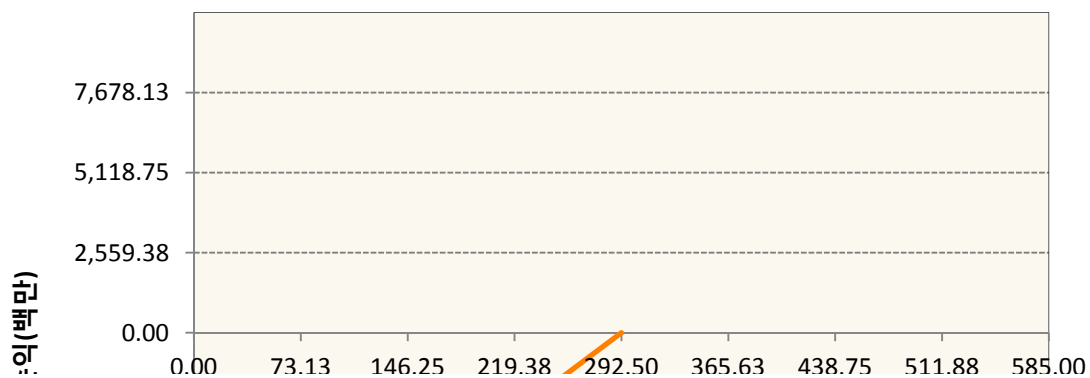
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	45,200	0	45,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	43,425	-43,425	장내

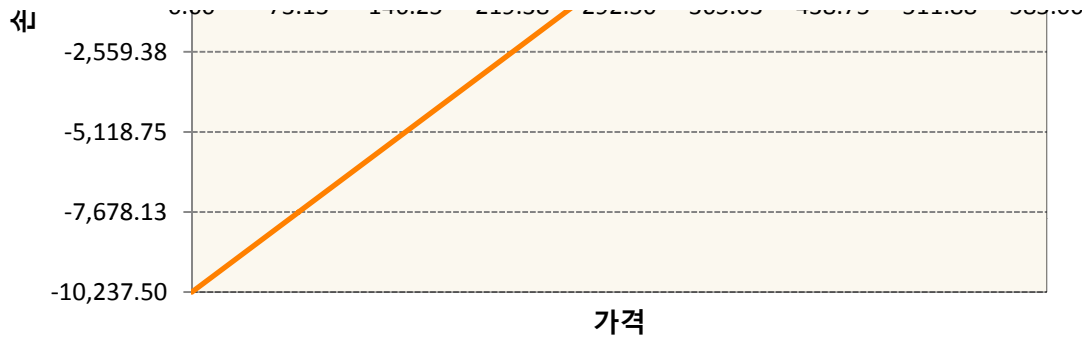
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N82951-2018-08 콜295

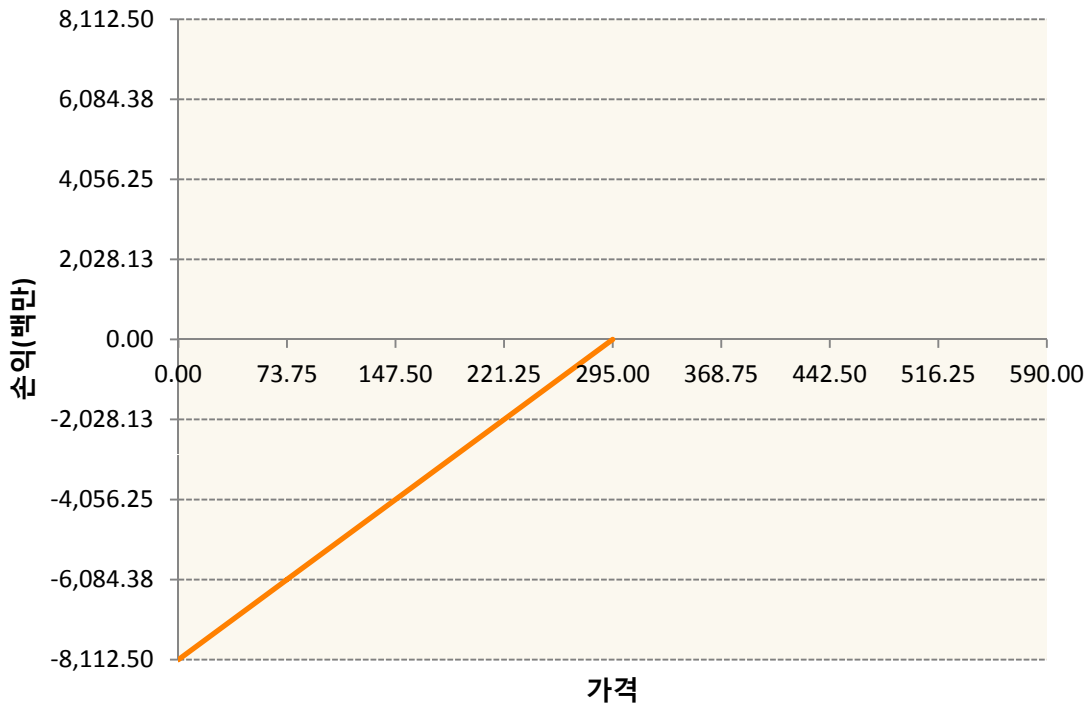


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





KR4301N82959-2018-08 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_2							1,497
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,497	-1,497	-1,497	-1,497	-1,497	-1,497	-1,497
-5.33%	-998	-998	-998	-998	-998	-998	-998
-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%	998	998	998	998	998	998	998
8.00%	1,497	1,497	1,497	1,497	1,497	1,497	1,497
2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_3							283
	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

1,596

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	767	743	715	683	648	610	570
-5.33%	677	635	590	544	495	445	394
-2.67%	491	435	378	320	262	204	145
0%	182	121	61	0	-61	-122	-182
2.67%	-254	-306	-361	-416	-472	-530	-587
5.33%	-793	-831	-872	-916	-963	-1,012	-1,062
8.00%	-1,402	-1,424	-1,451	-1,482	-1,517	-1,555	-1,596

KR4301N829 2018-08 풋292.5

607

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-596	-596	-597	-599	-601	-604	-607
-5.33%	-326	-331	-336	-342	-348	-355	-363
-2.67%	-99	-110	-121	-132	-143	-155	-166
0%	32	22	11	0	-11	-23	-34
2.67%	74	70	65	59	53	45	38
5.33%	81	80	79	77	75	72	68
8.00%	82	82	81	81	81	80	78

KR4301N829 2018-08 풋295

515

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-510	-510	-510	-511	-512	-514	-515
-5.33%	-295	-297	-300	-303	-307	-312	-317
-2.67%	-101	-109	-116	-124	-132	-140	-149
0%	28	19	9	0	-9	-19	-28
2.67%	79	74	69	63	56	49	42
5.33%	90	89	87	85	82	79	75
8.00%	91	91	90	90	89	88	87

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

(단위:백만원)

6,358

공시일	2018-07-18
기준일	2018-07-17

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

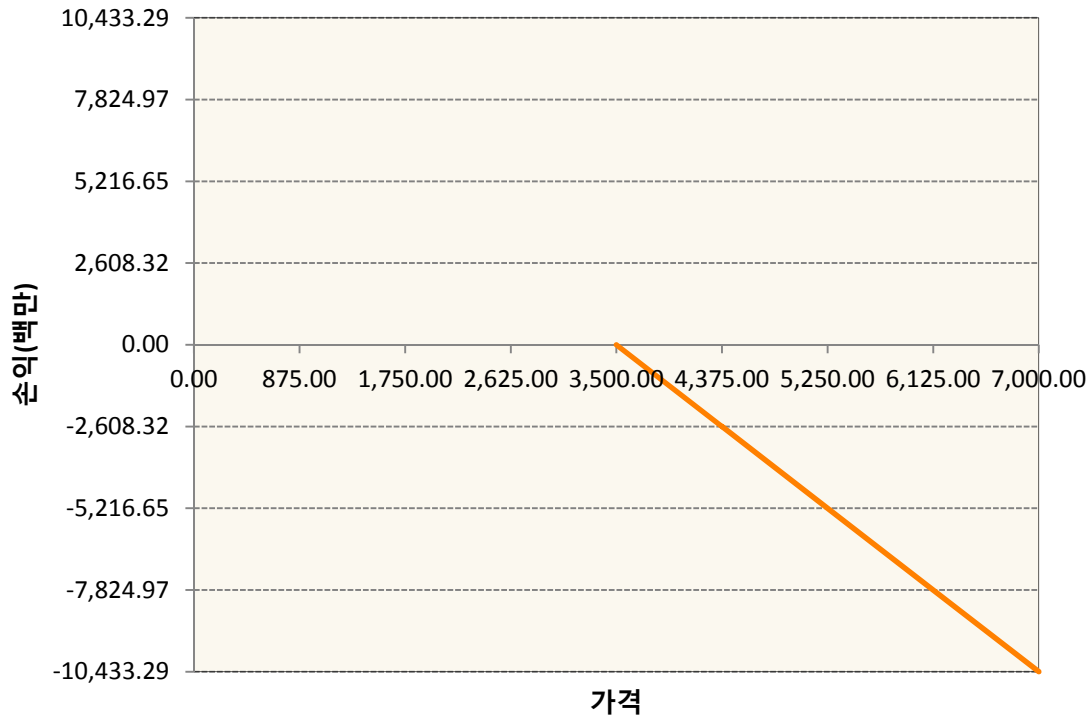
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

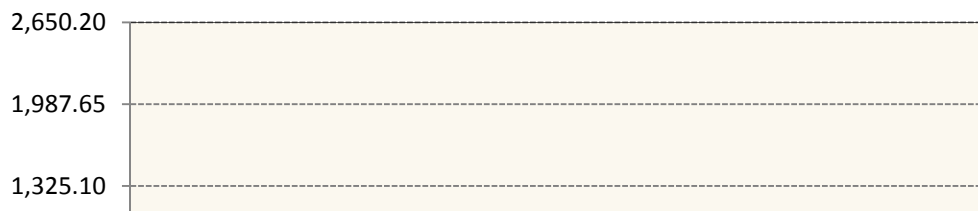
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,550	0	5,550	
누계	유가증권	스왑	45,057	0	45,057	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,167	-26,167	장내
누계	지수	스왑	52,759	0	52,759	장외

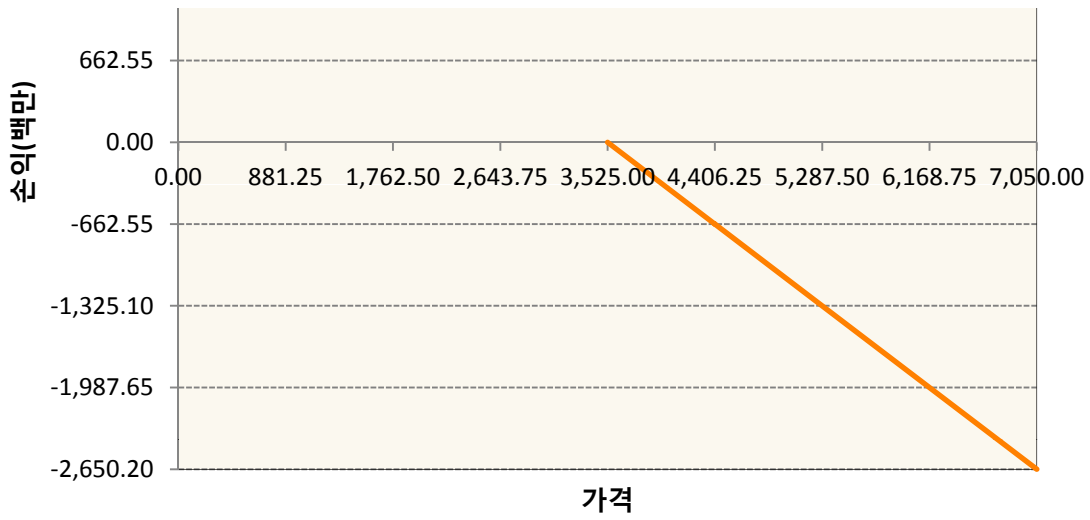
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXN8-C3500-EURO STOXX 50**

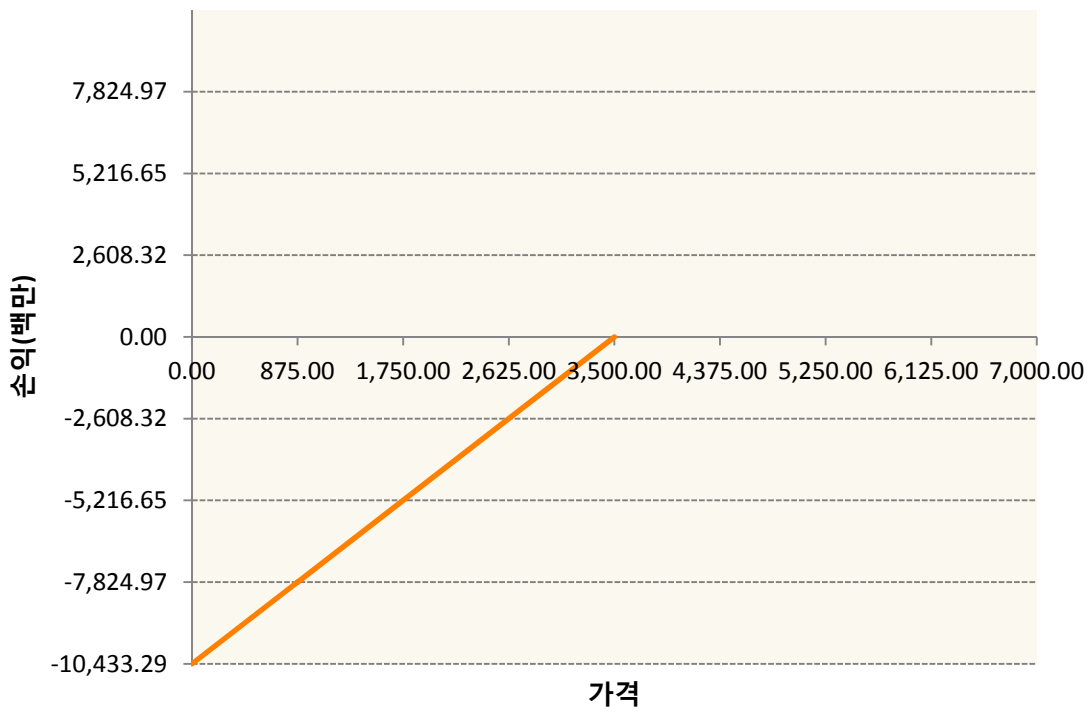


**OESXN8-C3525-EURO STOXX 50**

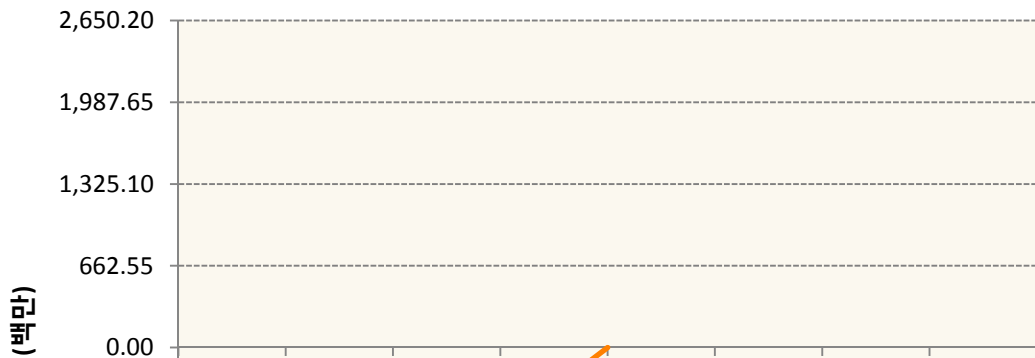


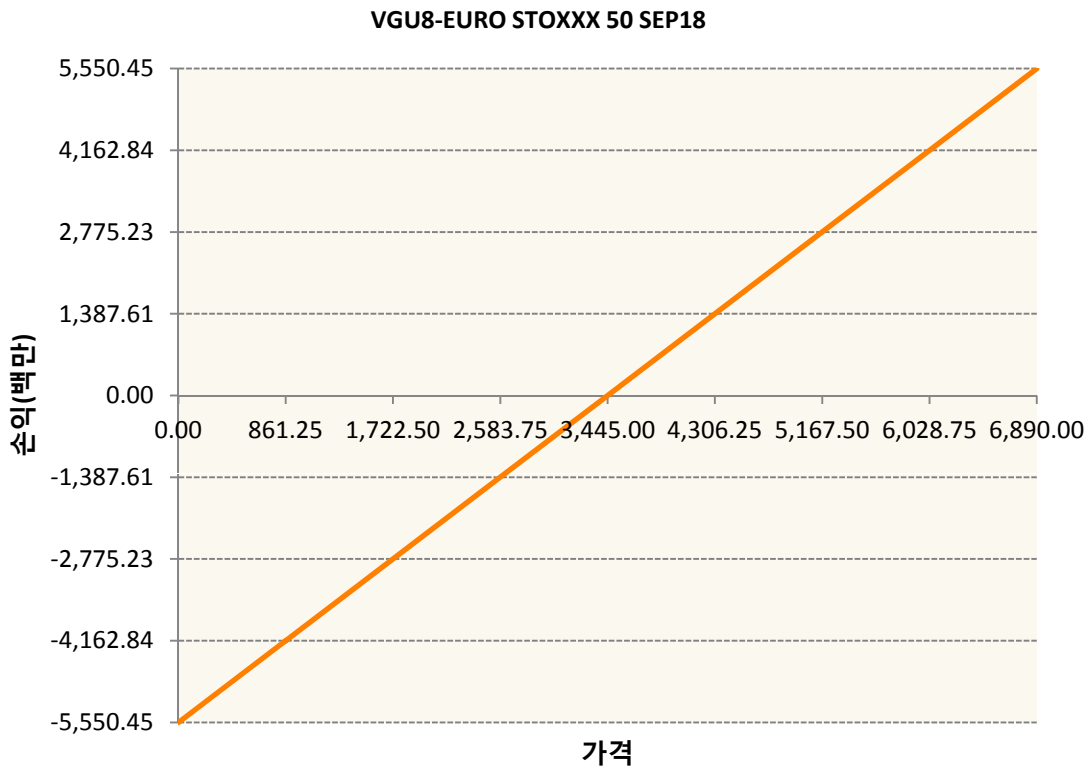
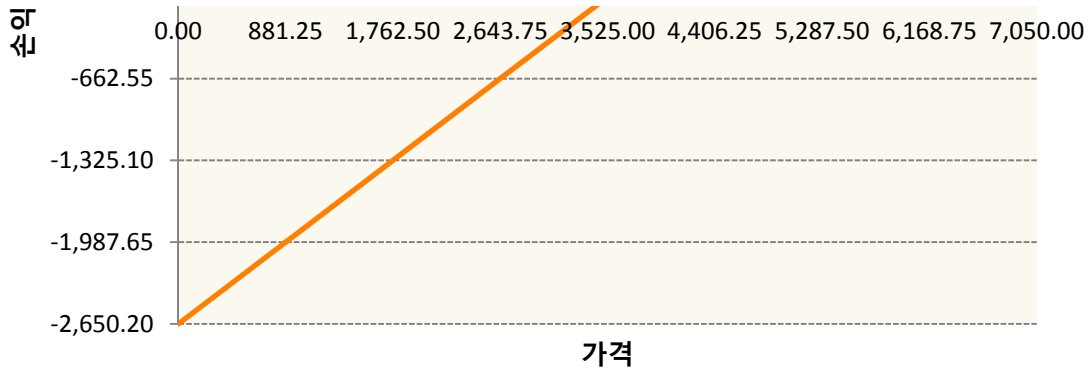


OESXN8-P3500-EURO STOXX 50



OESXN8-P3525-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY -	994.569	29
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY		24
OESXN8-C3! EURO STOXX 50		835
OESXN8-C3! EURO STOXX 50		212
OESXN8-P3! EURO STOXX 50		835
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)

1,160



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

(단위:백만원)

90



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

(단위:백만원)

135



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

(단위:백만원)

168



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

(단위:백만원)

41

공시일	2018-07-18
기준일	2018-07-17

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

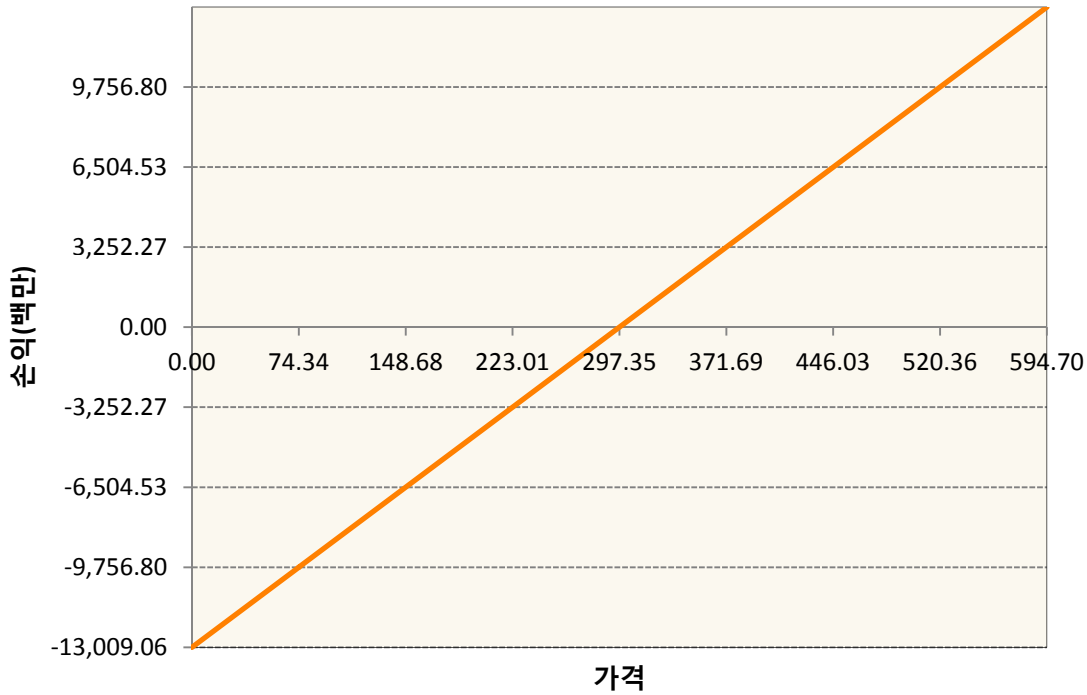
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

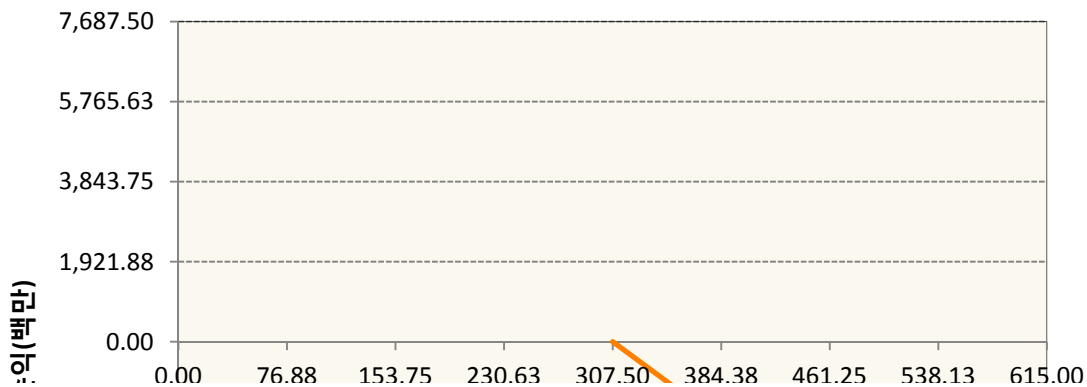
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,009	0	13,009	장내
누계	유가증권	옵션	2,134	23,653	-21,518	장내

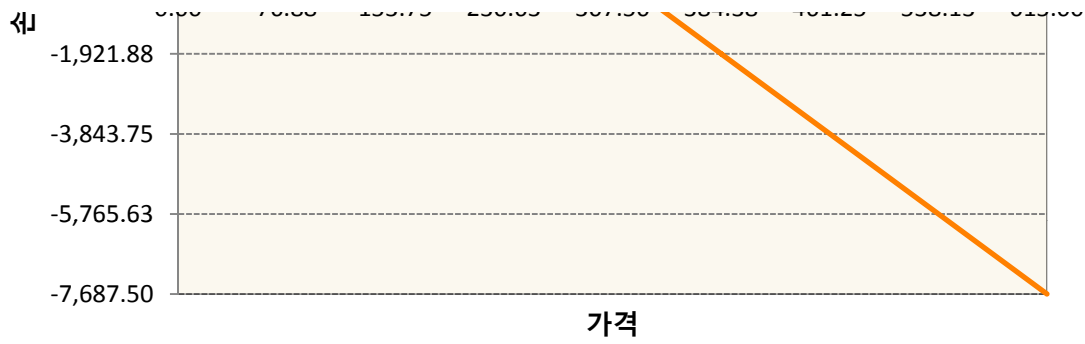
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

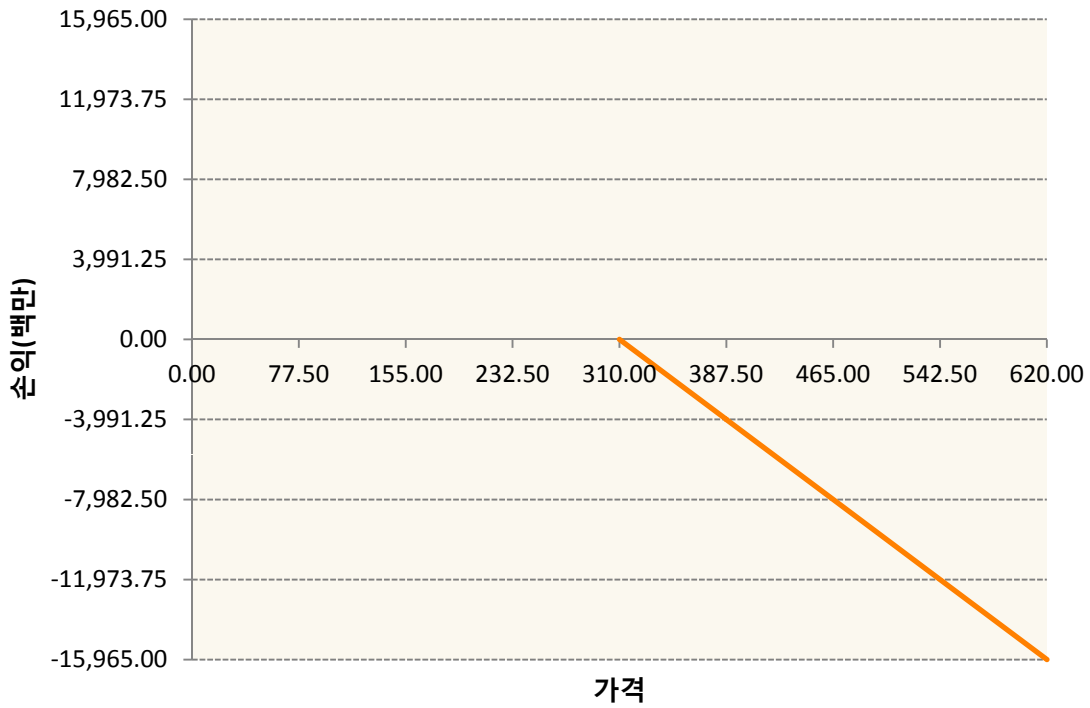


KR4201N83074-2018-08 콜307.5

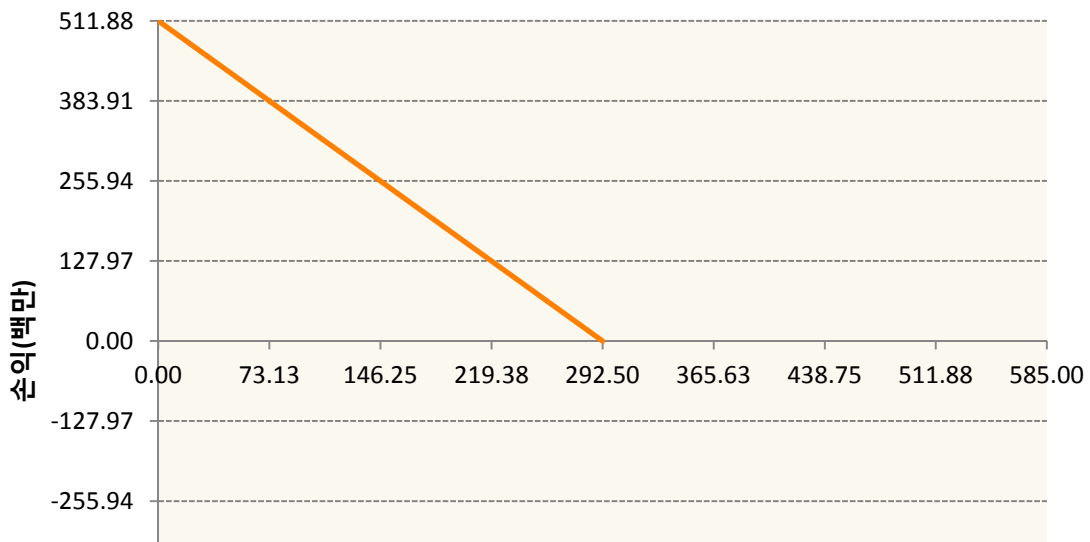


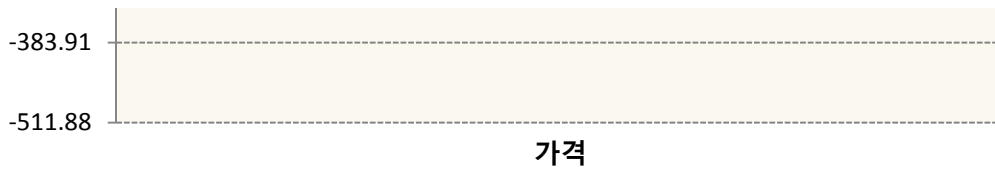


**KR4201N83108-2018-08 콜310**

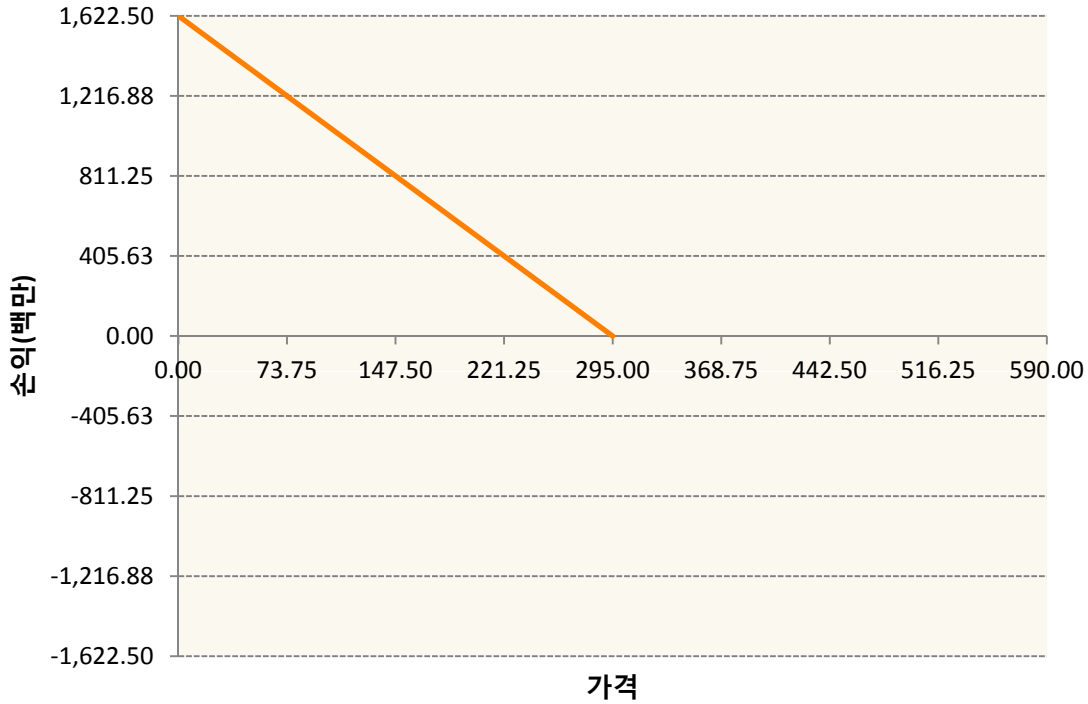


**KR4301N82926-2018-08 풋292.5**





KR4301N82959-2018-08 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물 1,039

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,039	-1,039	-1,039	-1,039	-1,039	-1,039	-1,039
-5.33%	-693	-693	-693	-693	-693	-693	-693
-2.67%	-346	-346	-346	-346	-346	-346	-346
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	346	346	346	346	346	346	346
5.33%	693	693	693	693	693	693	693
8.00%	1,039	1,039	1,039	1,039	1,039	1,039	1,039

KR4201N83C 2018-08 콜307.5 367

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	110	108	105	101	95	89	82
-5.33%	104	99	92	84	75	65	55
-2.67%	86	76	65	53	40	26	12

0%	47	32	16	0	-16	-33	-50
2.67%	-23	-42	-60	-78	-97	-115	-134
5.33%	-130	-148	-166	-185	-203	-221	-240
8.00%	-271	-285	-301	-317	-333	-350	-367

KR4201N8312018-08 콜310

709

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	192	189	184	177	167	156	143
-5.33%	183	174	163	149	133	115	95
-2.67%	155	137	117	94	70	44	17
0%	90	61	31	0	-32	-65	-99
2.67%	-33	-70	-107	-145	-182	-220	-257
5.33%	-230	-268	-307	-345	-384	-422	-461
8.00%	-498	-532	-566	-601	-637	-673	-709

KR4301N829 2018-08 풋292.5

30

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

KR4301N829 2018-08 풋295

103

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	102	102	102	102	102	103	103
-5.33%	59	59	60	61	61	62	63
-2.67%	20	22	23	25	26	28	30
0%	-6	-4	-2	0	2	4	6
2.67%	-16	-15	-14	-13	-11	-10	-8
5.33%	-18	-18	-17	-17	-16	-16	-15
8.00%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-17

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

(단위:백만원)

1,761

공시일	2018-07-18
기준일	2018-07-17

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

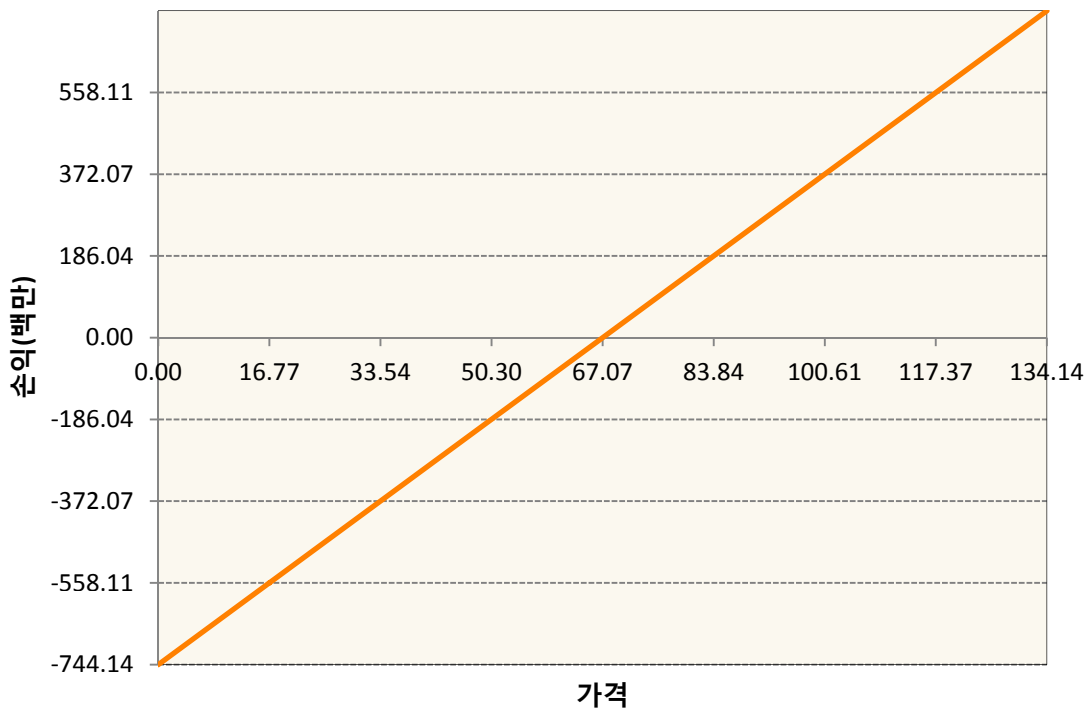
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

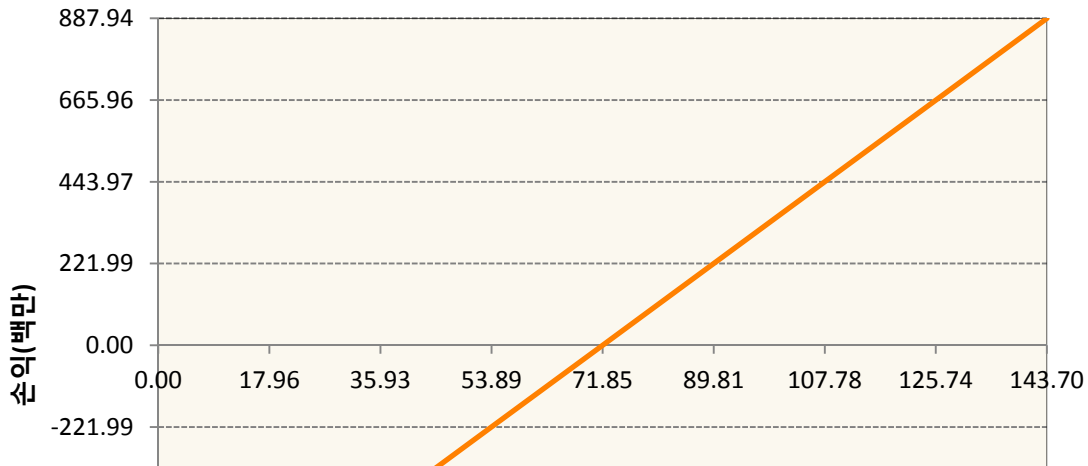
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,540	618	2,922	

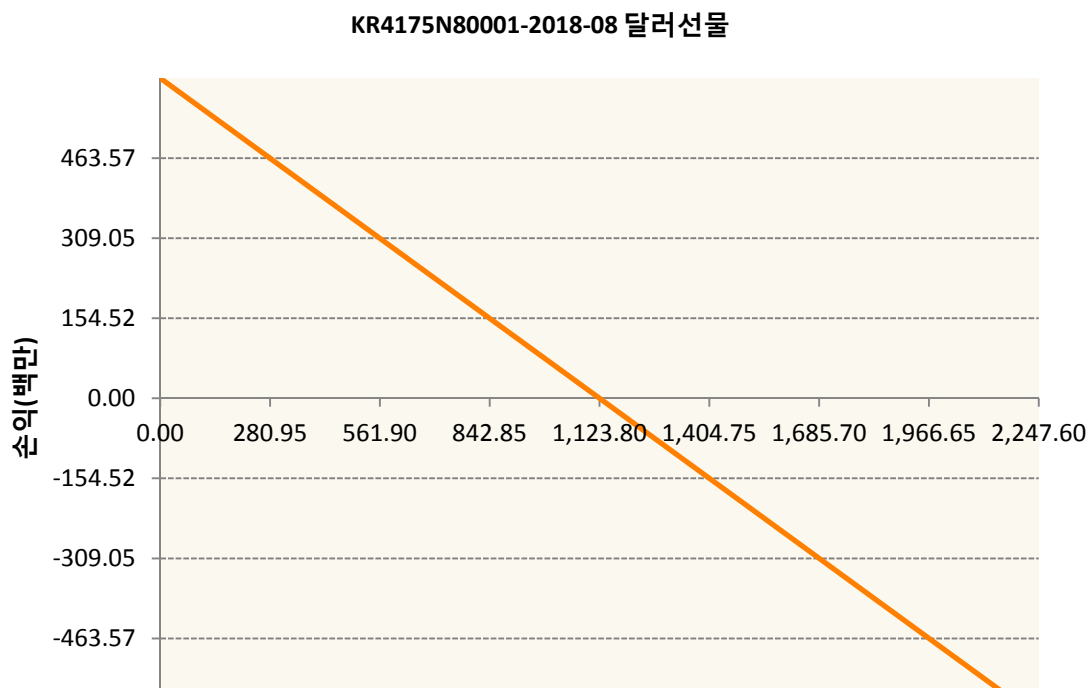
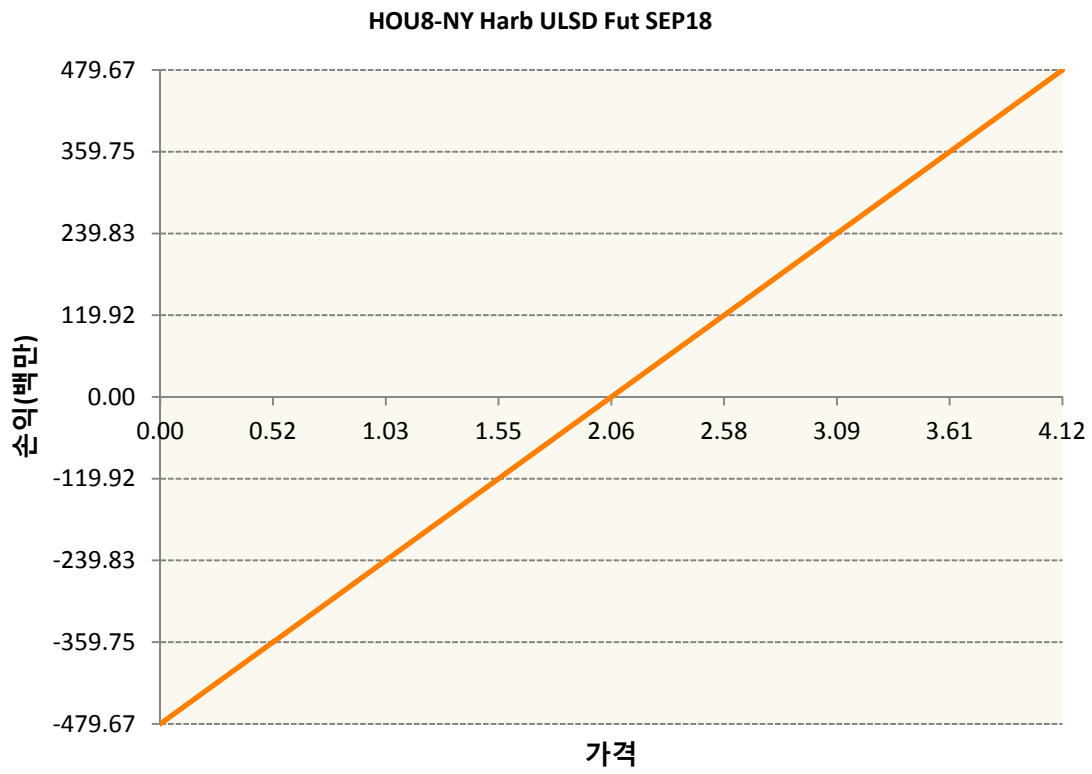
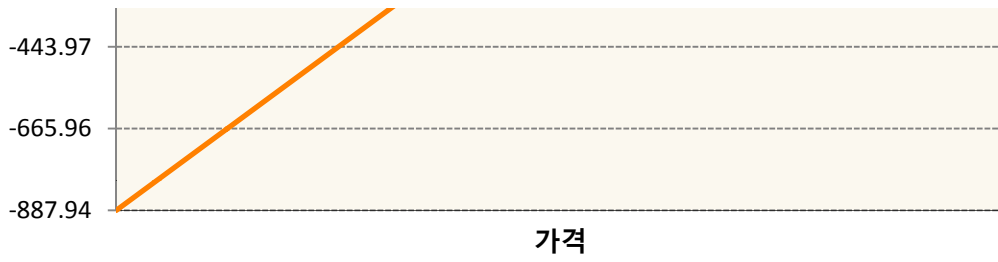
### 2. 만기시점의 손익구조

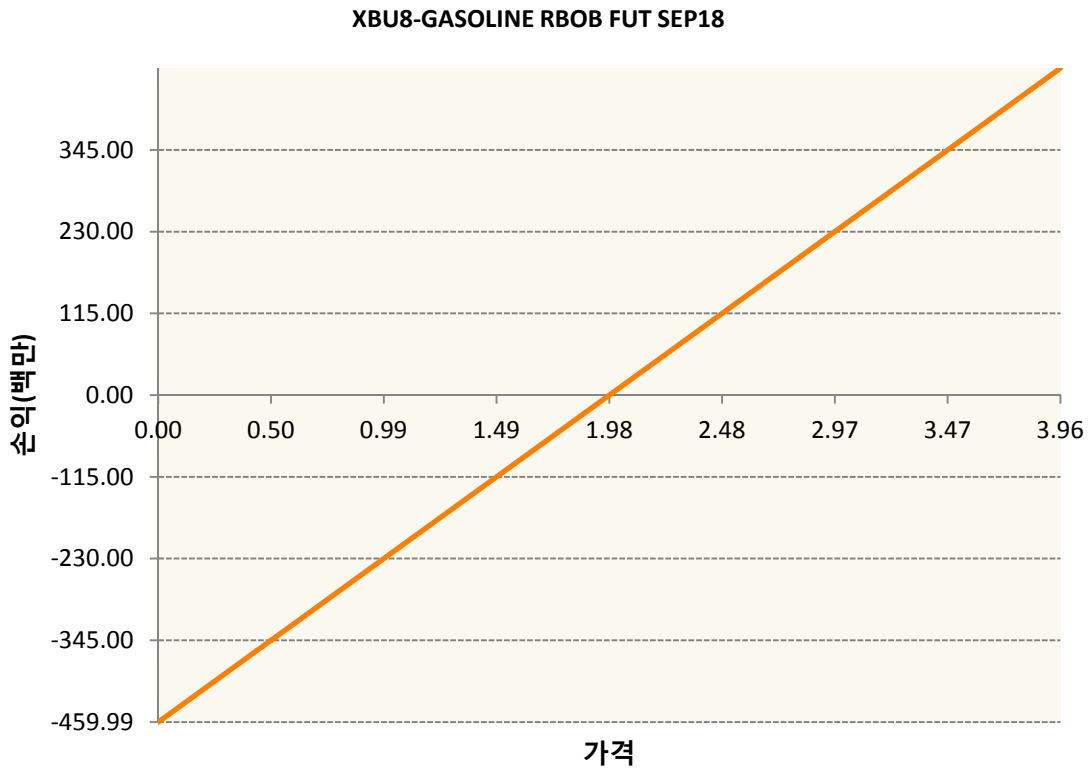
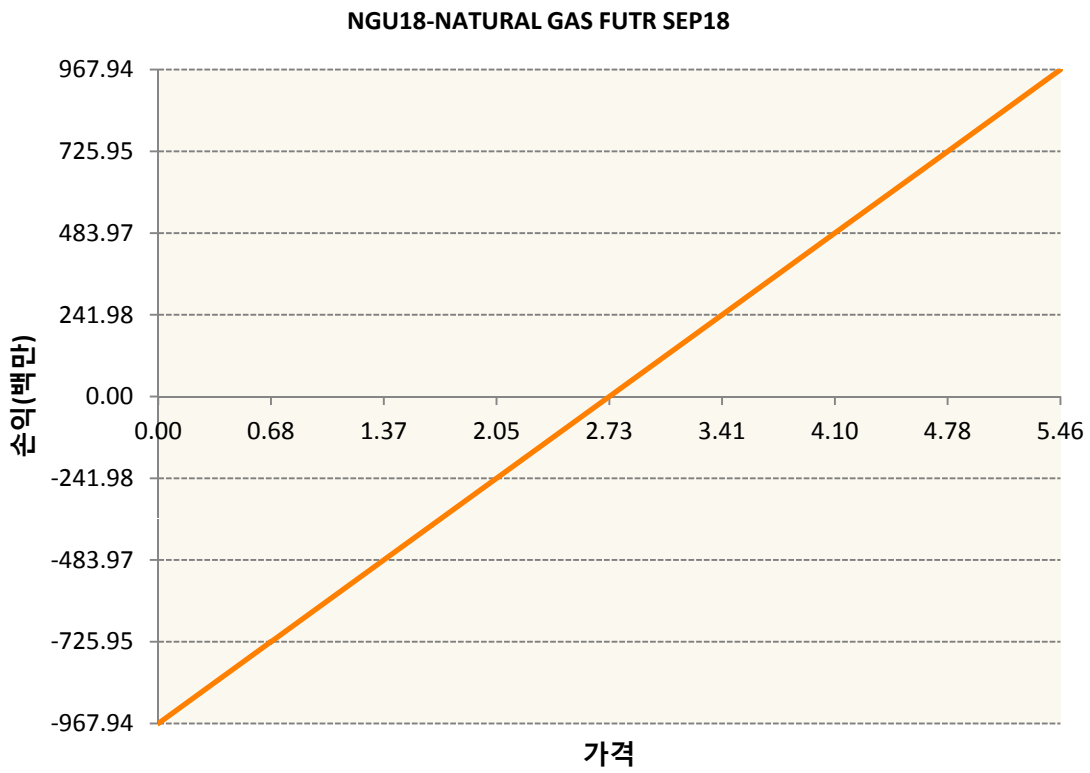
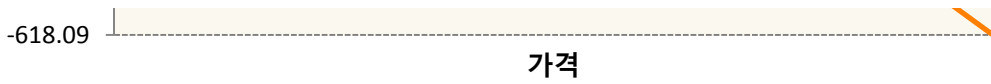
**CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18**



**COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18**







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

CLU8	WTI CRUDE FUTURE SEP18	60
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	71
HOU8	NY Harb ULSD Fut SEP18	38
KR4175N80C	2018-08 달러선물	49
NGU18	NATURAL GAS FUTR SEP18	77
XBU8	GASOLINE RBOB FUT SEP18	37

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

420

공시일	2018-07-18
기준일	2018-07-17

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

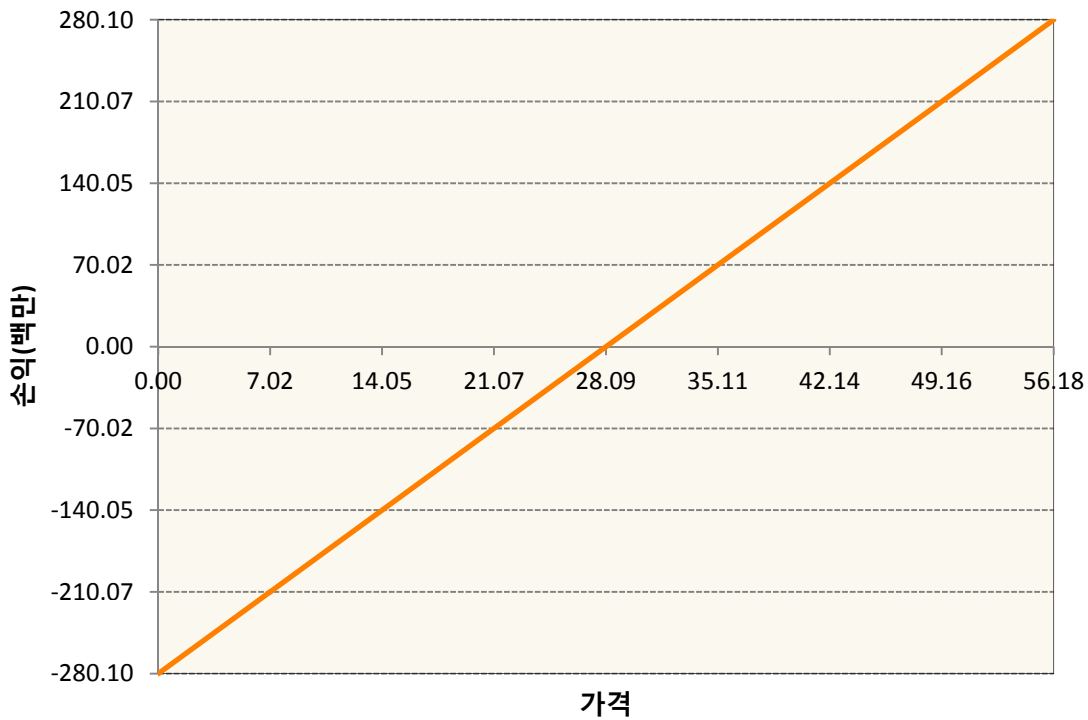
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

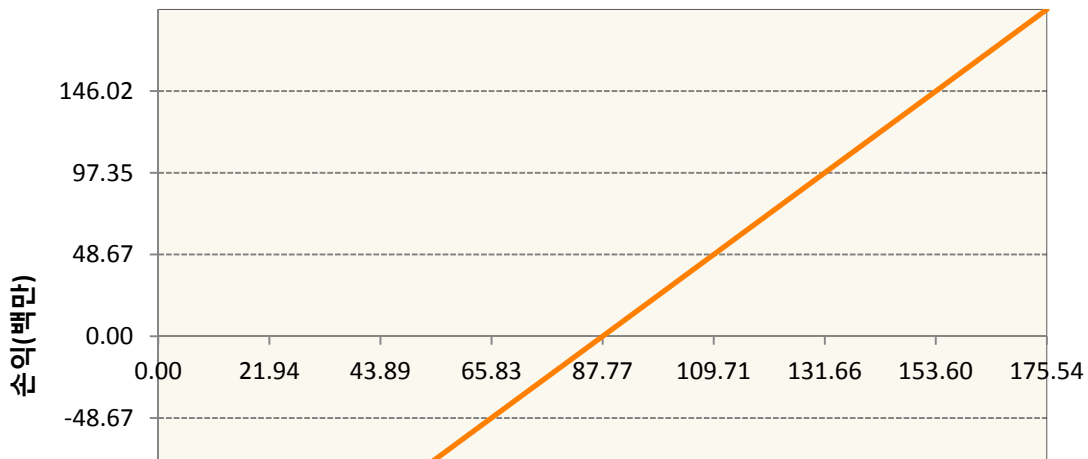
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,532	79	3,454	

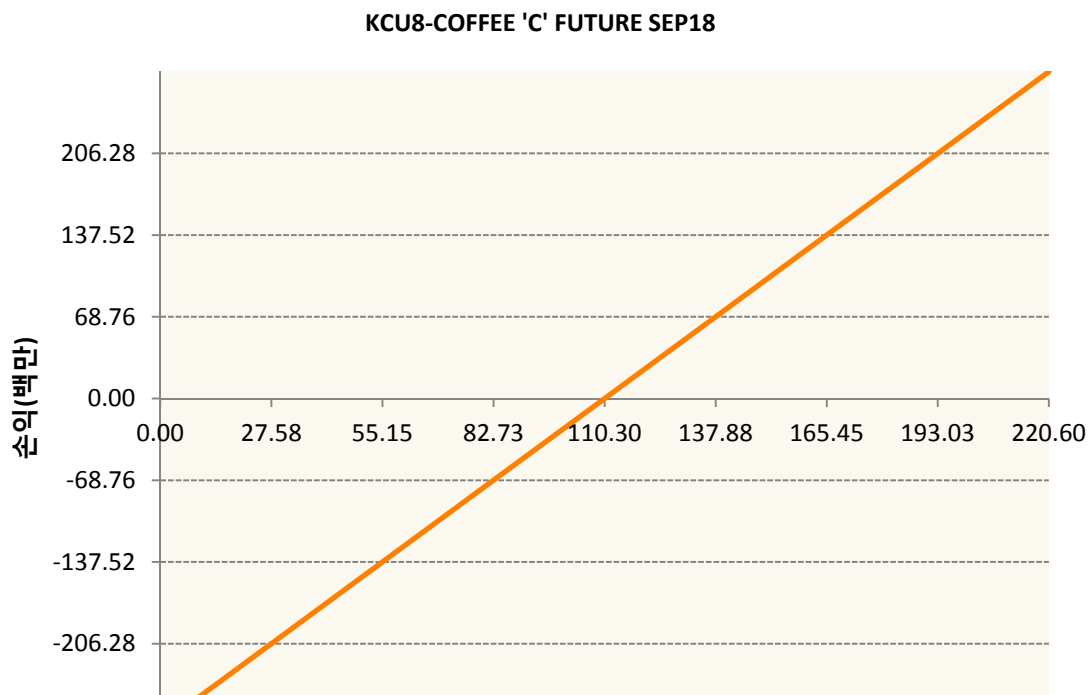
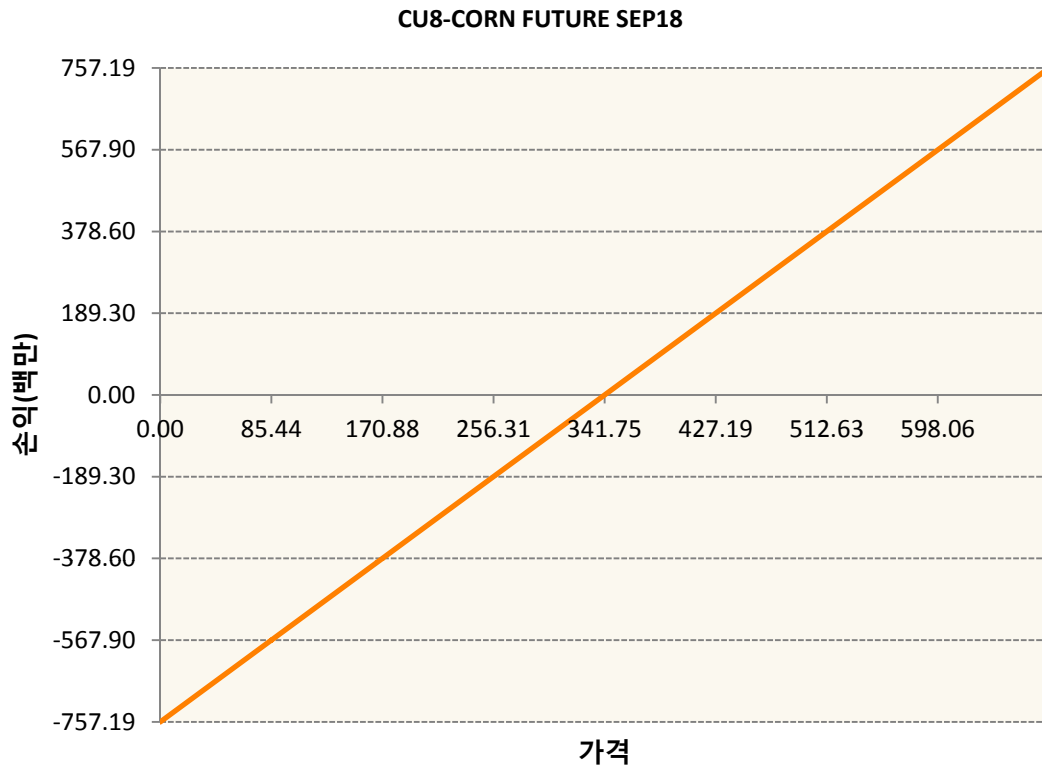
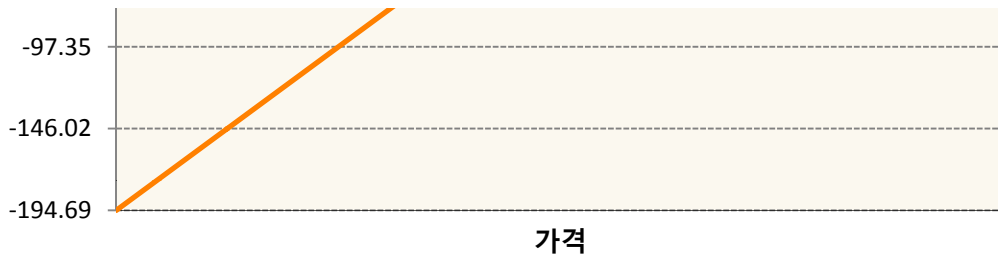
### 2. 만기시점의 손익구조

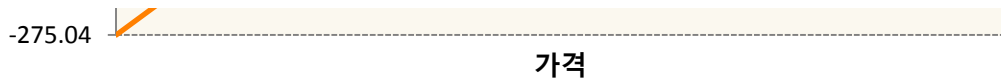
**BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18**



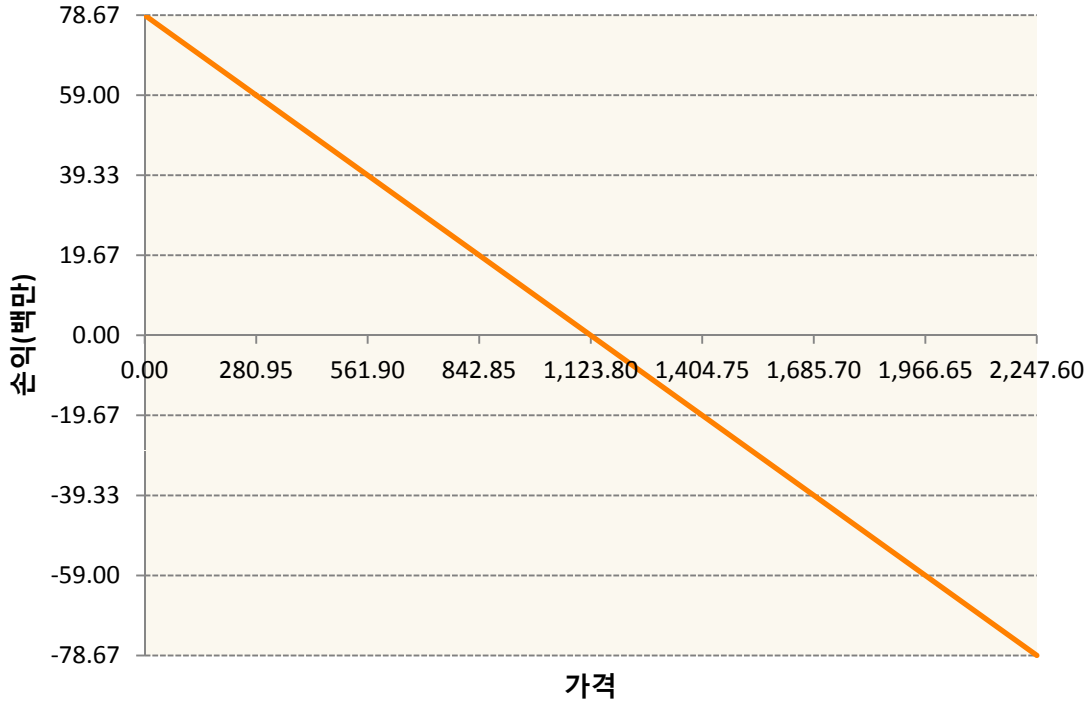
**CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18**



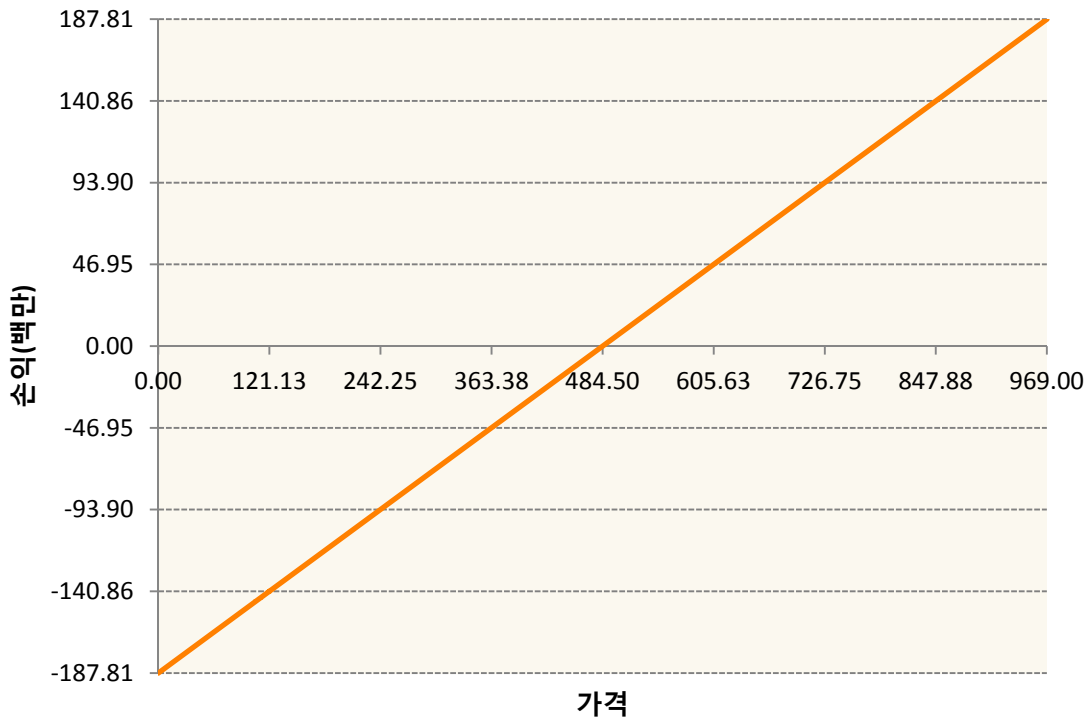




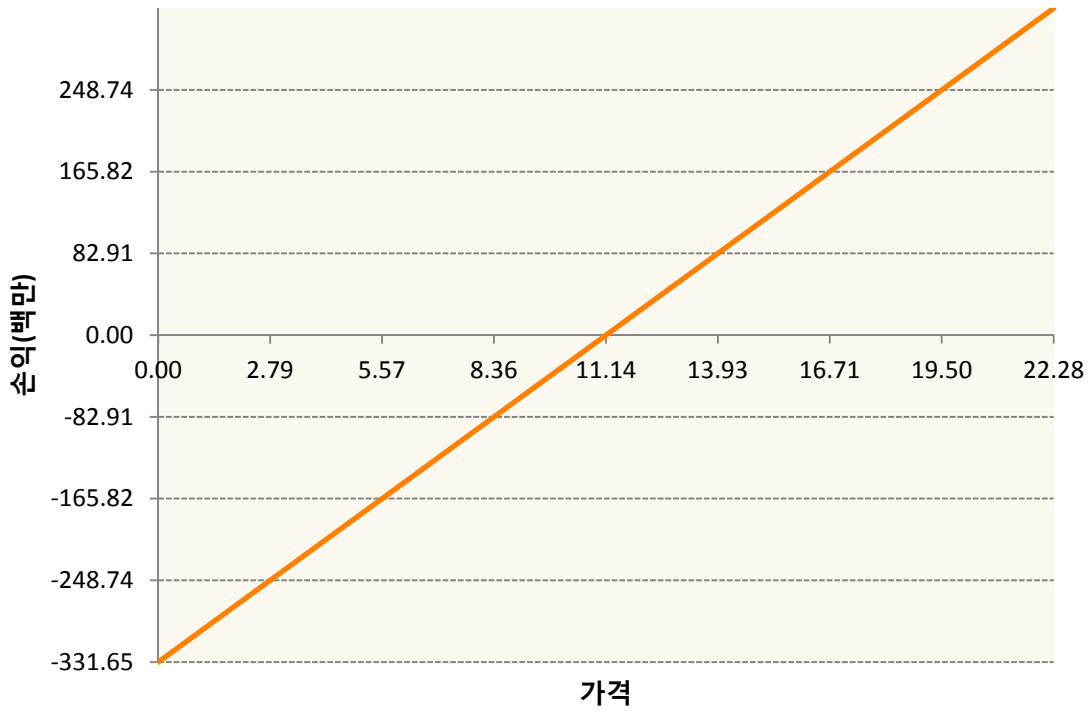
**KR4175N80001-2018-08 달러선물**



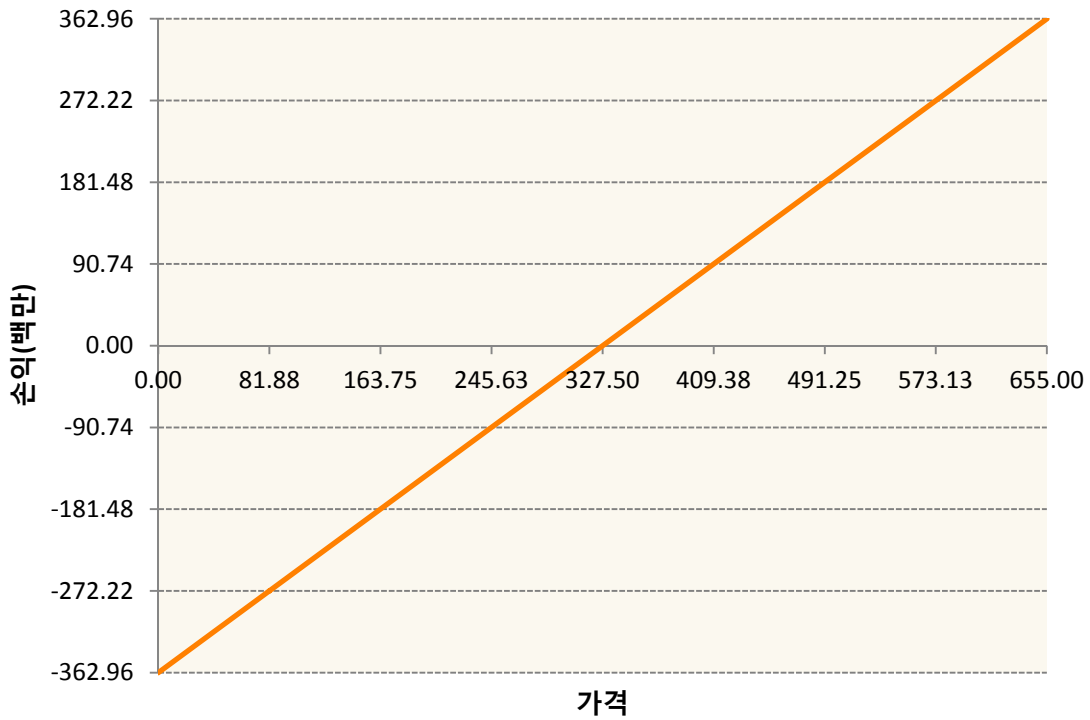
**KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18**



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

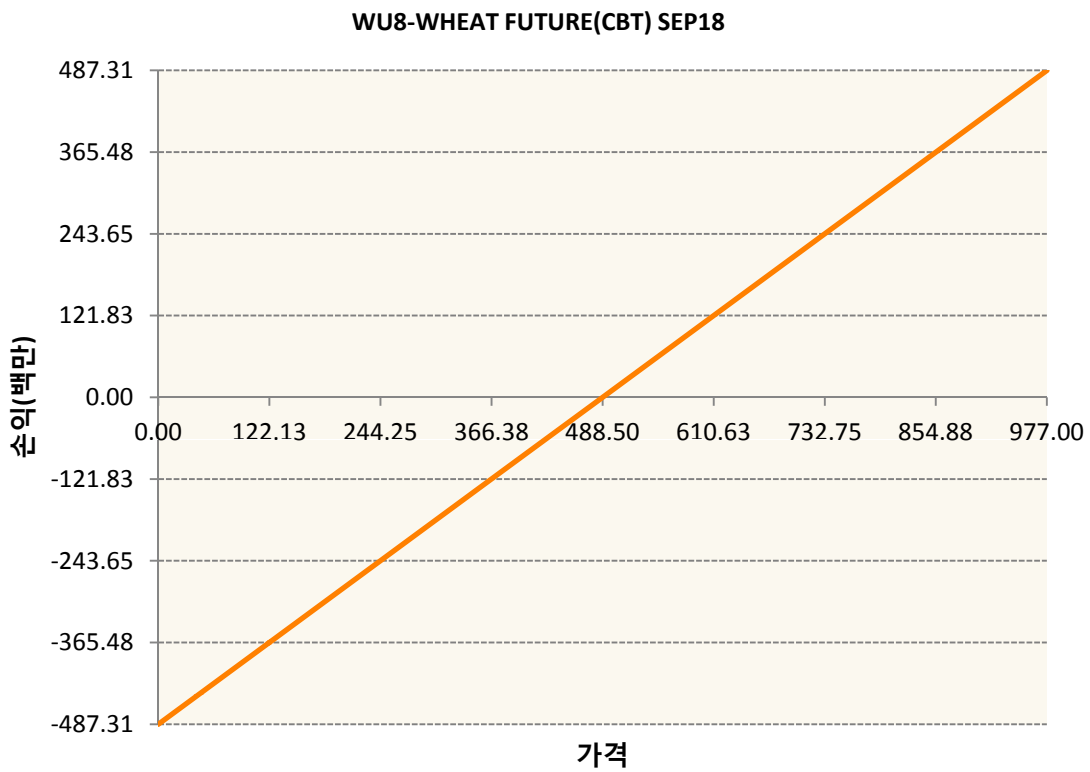
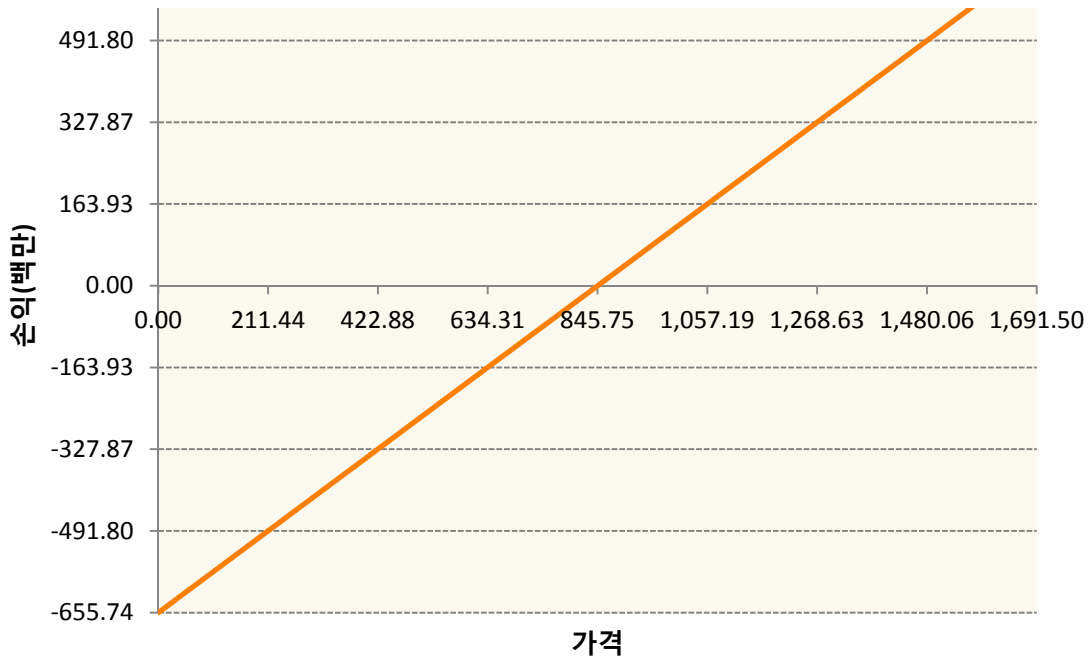


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	22
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	16
CU8	CORN FUTURE SEP18	61
KCU8	COFFEE 'C' FUTURE SEP18	22
KR4175N80C	2018-08 달러선물	6

KWU8	KC HRW WHEAT FUT SEP18	15
SBV8	SUGAR #11 (WORLD) OCT18	27
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	29
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	52
WU8	WHEAT FUTURE(CBT) SEP18	39

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

(단위:백만원)

**297**