

공시일	2018-07-20
기준일	2018-07-19

## 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	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	2018-07-20
기준일	2018-07-19

## 스마트인덱스모

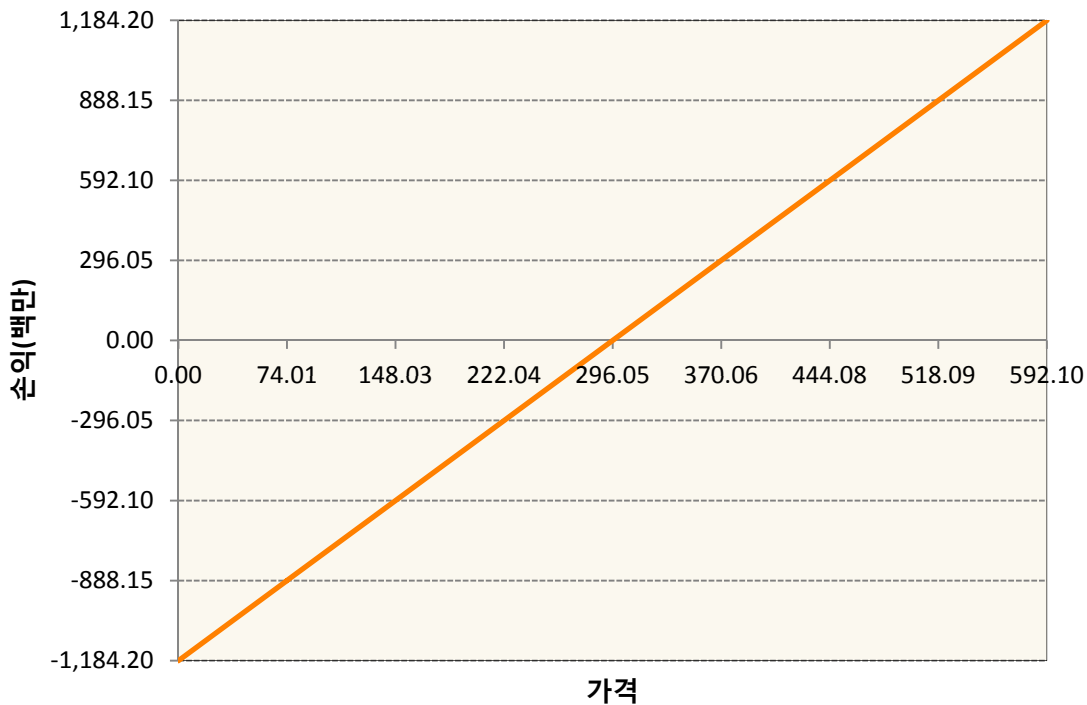
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,184	0	1,184	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



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

(단위:백만원)

72

공시일	2018-07-20
기준일	2018-07-19

## 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

1,134

\* 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	2018-07-20
기준일	2018-07-19

## 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

319

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

392

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-07-20
기준일	2018-07-19

## 유로인덱스모(주식-파생형)

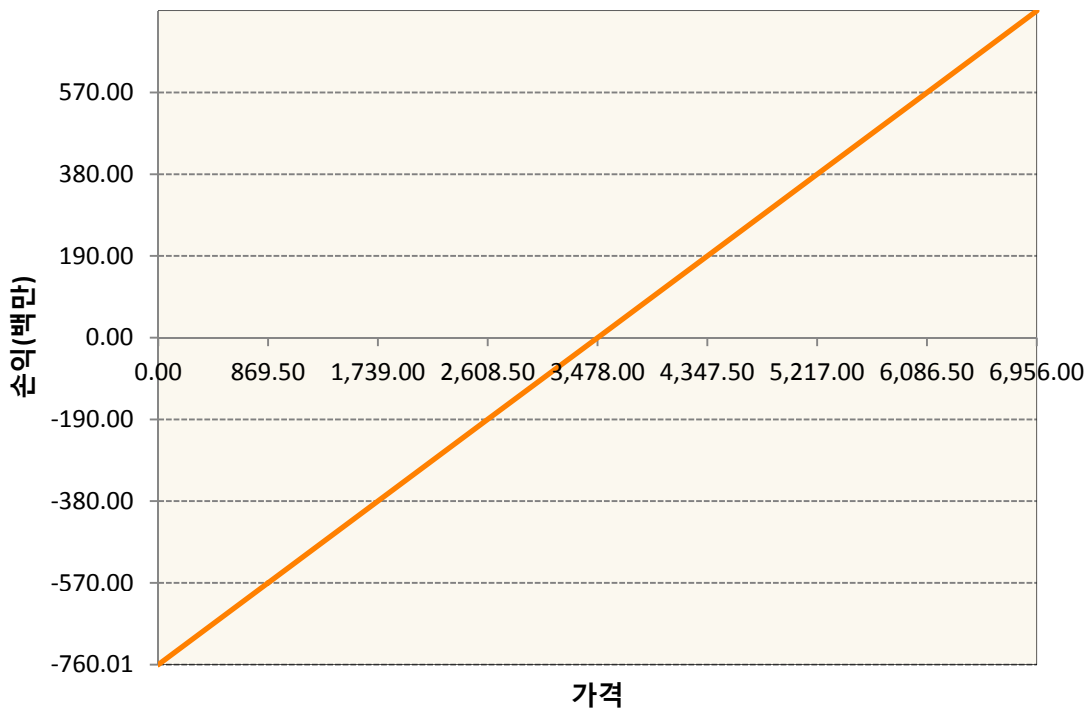
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	760	0	760	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGU8-EURO STOXXX 50 SEP18



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU8	EURO STOXXX 50 SEP18	61
------	----------------------	----

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

(단위:백만원)

38
----

공시일	2018-07-20
기준일	2018-07-19

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

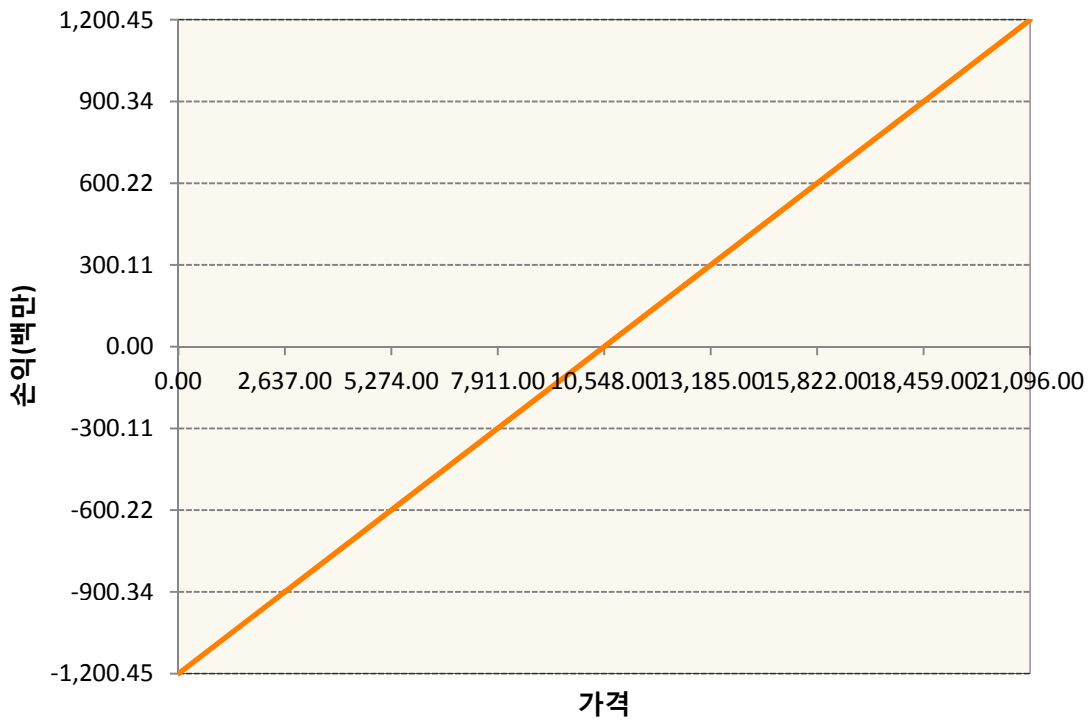
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

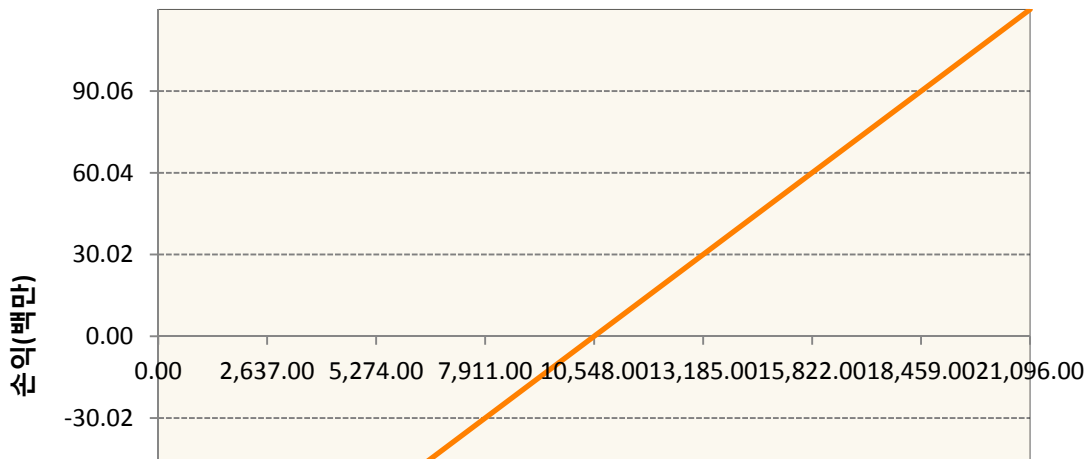
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,321	0	1,321	장내

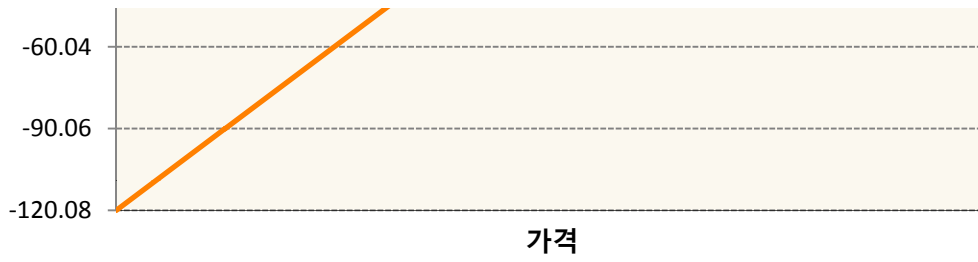
### 2. 만기시점의 손익구조

HCN8-HSCEI Futures Jul18



MHCN8-MINI H-SHR IDX FU JUL18





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

HCN8	HSCEI Futures Jul18	96
MHCN8	MINI H-SHR IDX FU JUL18	10

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

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

공시일	2018-07-20
기준일	2018-07-19

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

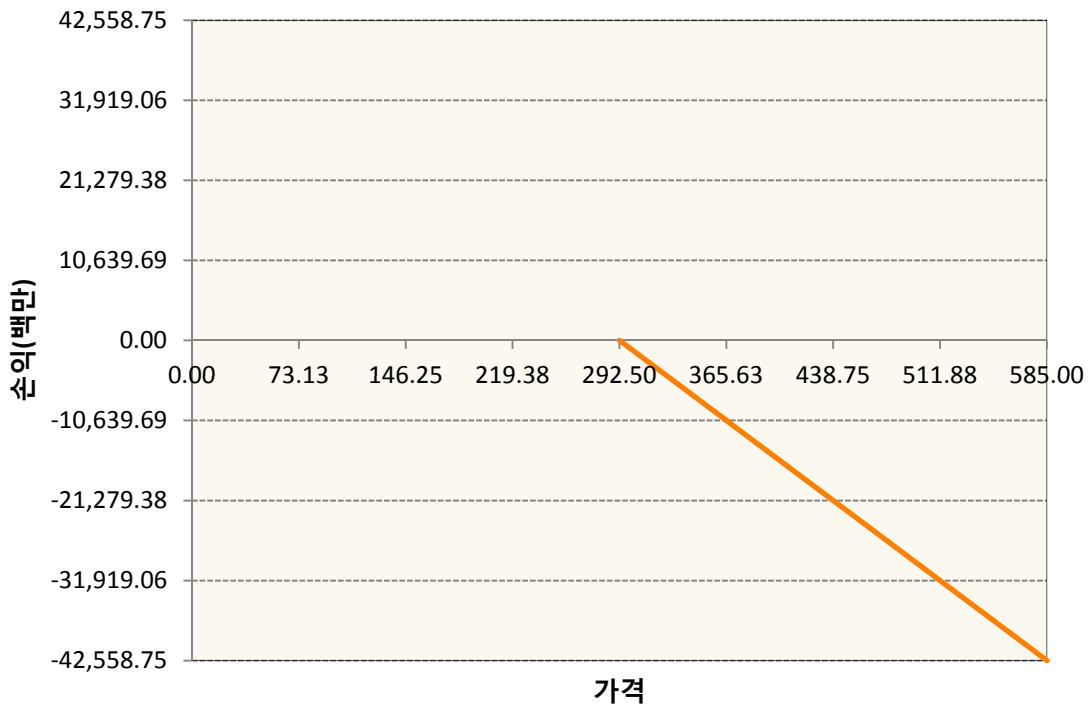
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

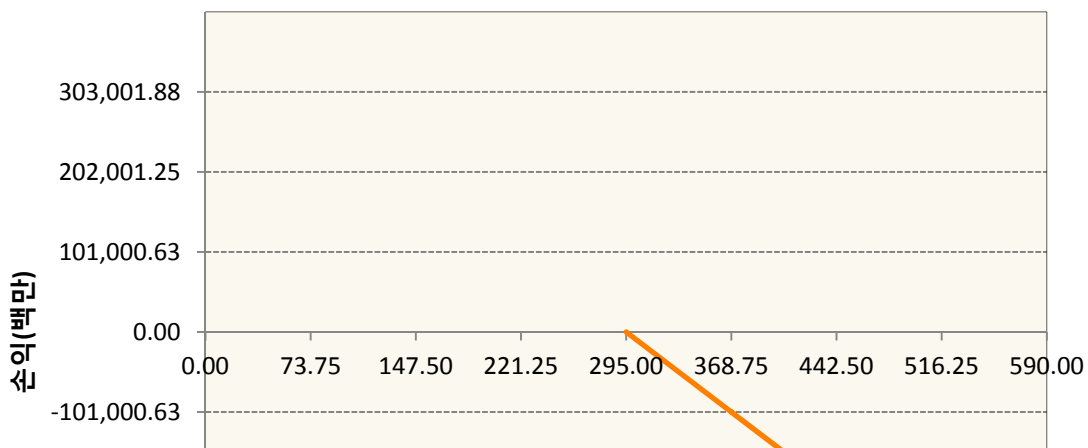
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	725,561	-725,561	장내

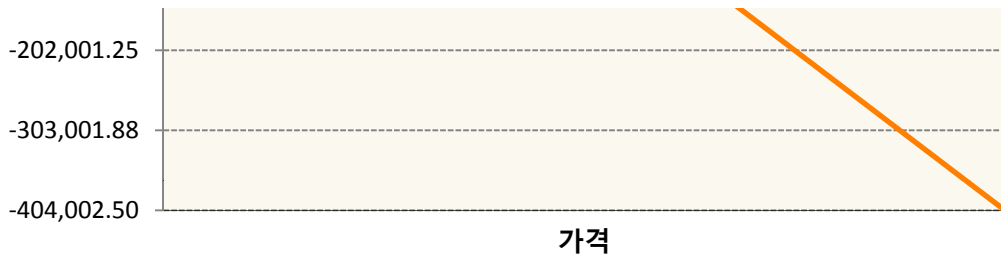
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201N82928-2018-08 콜292.5**

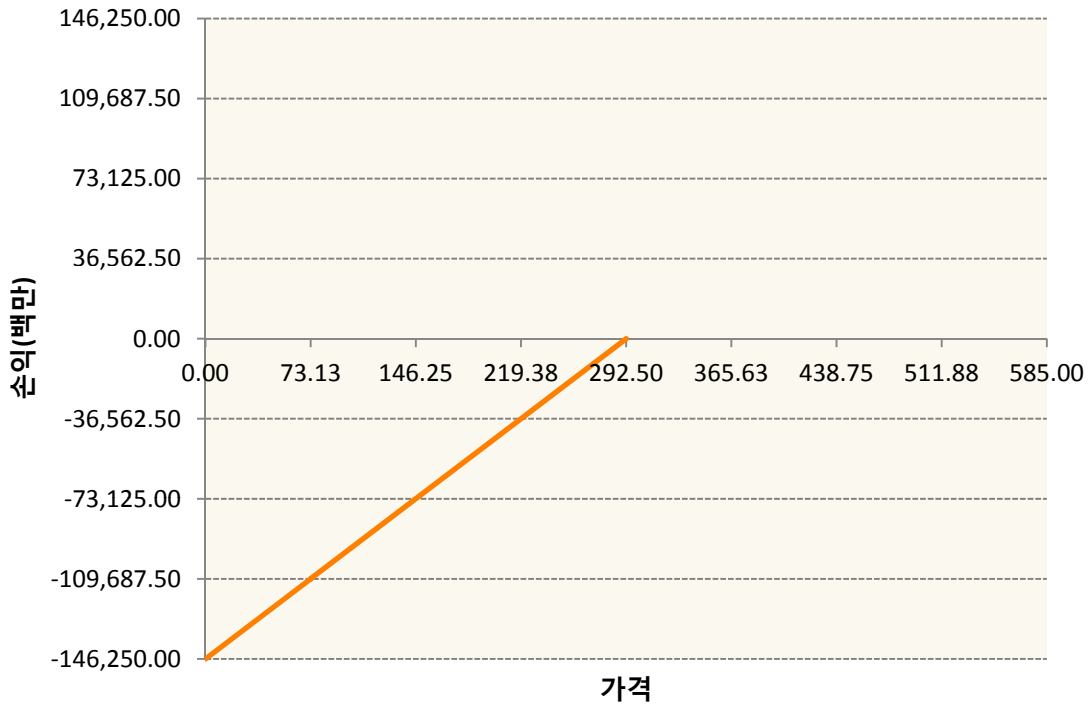


**KR4201N82951-2018-08 콜295**

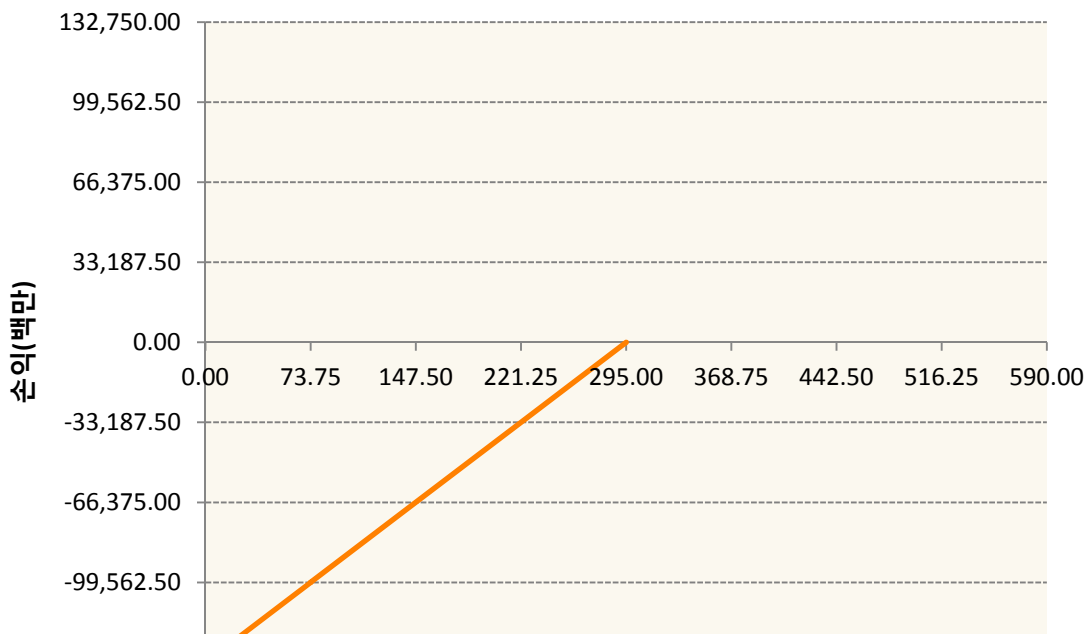




**KR4301N82926-2018-08 풋292.5**



**KR4301N82959-2018-08 풋295**



-132,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N829 2018-08 콜292.5 2,794

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,374	1,333	1,285	1,231	1,172	1,109	1,042
-5.33%	1,207	1,135	1,060	981	900	816	731
-2.67%	863	768	673	577	481	385	288
0%	293	196	98	0	-98	-197	-295
2.67%	-497	-577	-660	-746	-834	-924	-1,015
5.33%	-1,457	-1,510	-1,570	-1,635	-1,705	-1,779	-1,856
8.00%	-2,521	-2,550	-2,586	-2,630	-2,679	-2,734	-2,794

KR4201N829 2018-08 콜295 25,299

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,370	11,053	10,671	10,229	9,737	9,200	8,624
-5.33%	10,156	9,563	8,922	8,242	7,530	6,792	6,032
-2.67%	7,492	6,646	5,786	4,914	4,035	3,148	2,256
0%	2,820	1,880	940	0	-940	-1,881	-2,821
2.67%	-3,984	-4,812	-5,663	-6,529	-7,408	-8,298	-9,195
5.33%	-12,560	-13,151	-13,796	-14,486	-15,213	-15,970	-16,752
8.00%	-22,310	-22,656	-23,073	-23,553	-24,089	-24,673	-25,299

KR4301N829 2018-08 풋292.5 8,959

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,841	-8,847	-8,856	-8,872	-8,893	-8,923	-8,959
-5.33%	-4,970	-5,017	-5,075	-5,145	-5,224	-5,312	-5,408
-2.67%	-1,591	-1,733	-1,879	-2,027	-2,179	-2,332	-2,488
0%	469	315	158	0	-160	-321	-483
2.67%	1,162	1,097	1,019	931	833	727	614
5.33%	1,275	1,263	1,244	1,217	1,181	1,136	1,082
8.00%	1,283	1,283	1,280	1,275	1,267	1,254	1,235

KR4301N829 2018-08 풋295 8,670

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,604	-8,606	-8,610	-8,618	-8,630	-8,647	-8,670
-5.33%	-5,084	-5,109	-5,143	-5,187	-5,239	-5,300	-5,368
-2.67%	-1,833	-1,935	-2,045	-2,160	-2,280	-2,405	-2,532
0%	454	303	152	0	-152	-303	-455
2.67%	1,408	1,322	1,226	1,122	1,012	896	776

5.33%	1,610	1,589	1,559	1,520	1,472	1,415	1,350
8.00%	1,630	1,627	1,623	1,614	1,601	1,582	1,557

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

(단위:백만원)

**46,088**

공시일	2018-07-20
기준일	2018-07-19

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

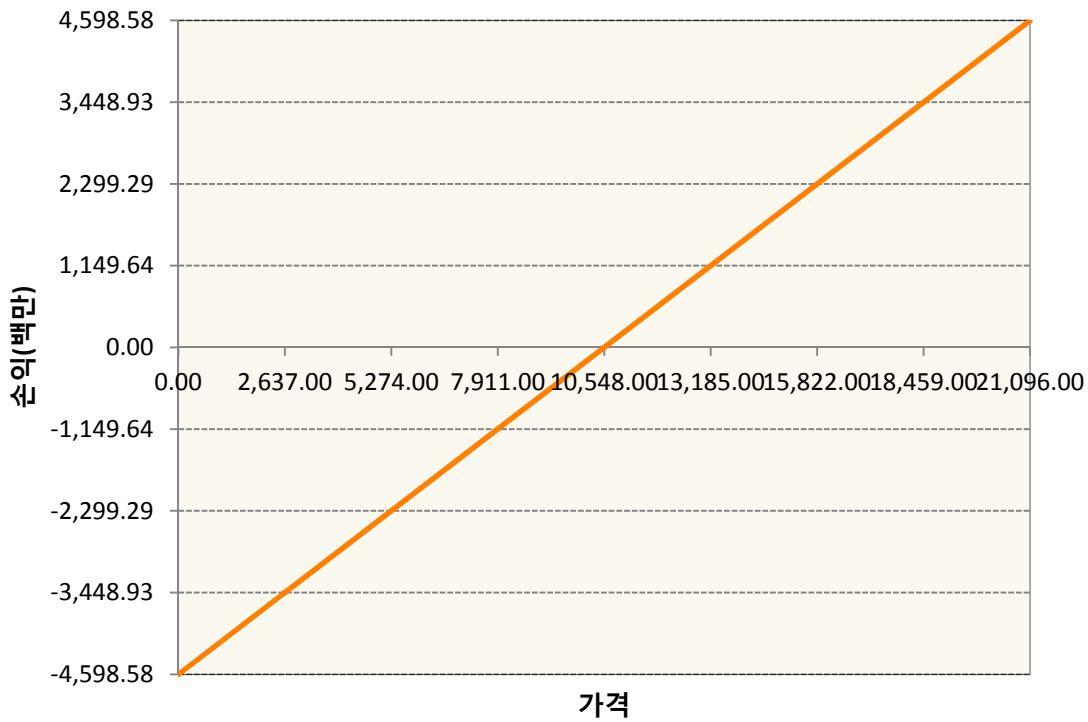
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

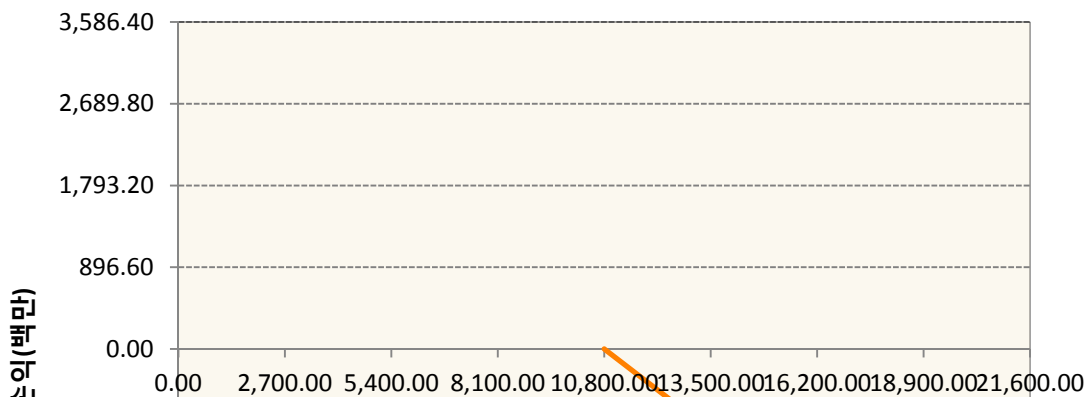
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,599	0	4,599	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,826	-10,826	장내

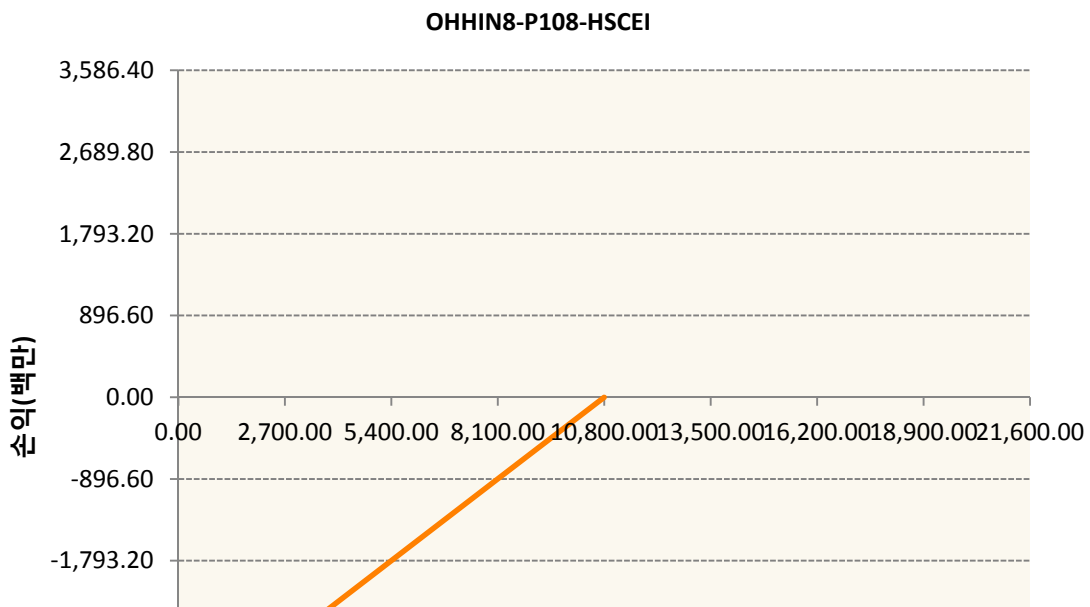
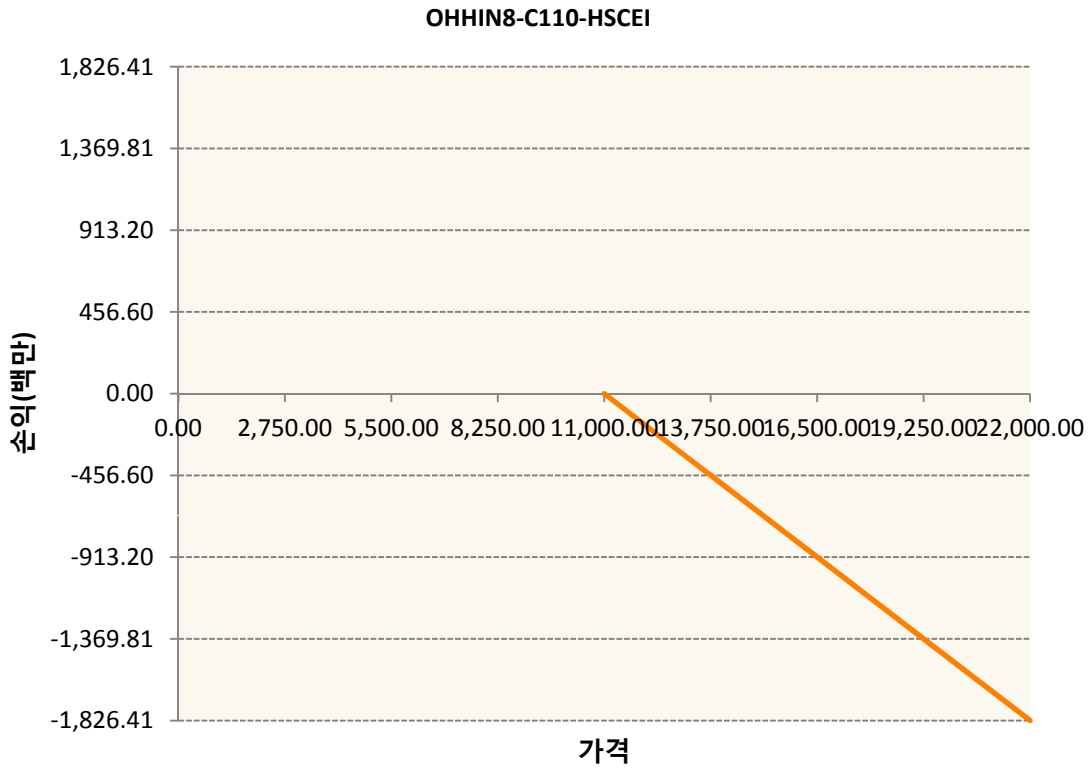
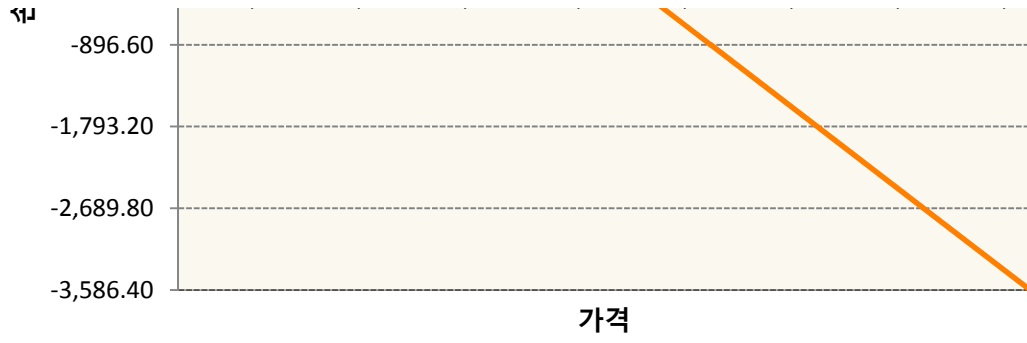
### 2. 만기시점의 손익구조

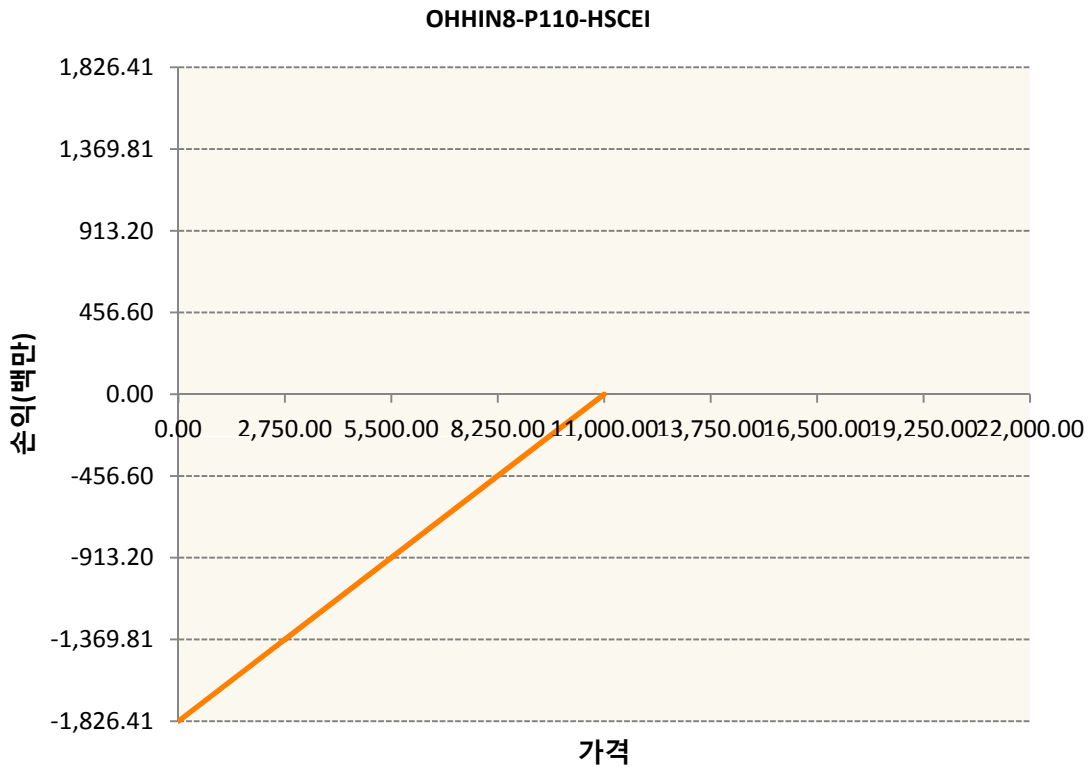
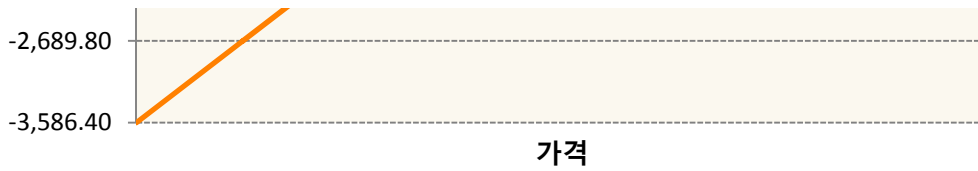
HCN8-HSCEI Futures Jul18



OHHIN8-C108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCN8	HSCEI Futures Jul18	368
OHHIN8-C1	HSCEI	287
OHHIN8-C1	HSCEI	146
OHHIN8-P1	HSCEI	287
OHHIN8-P11	HSCEI	146

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	<b>1,120</b>

공시일	2018-07-20
기준일	2018-07-19

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

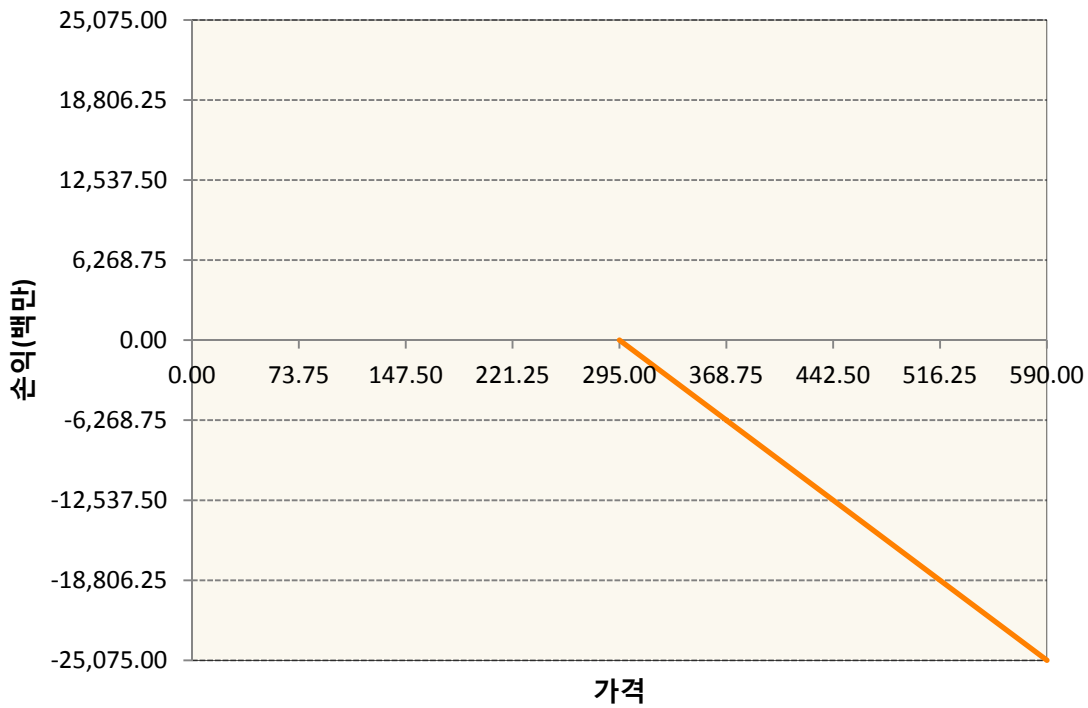
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

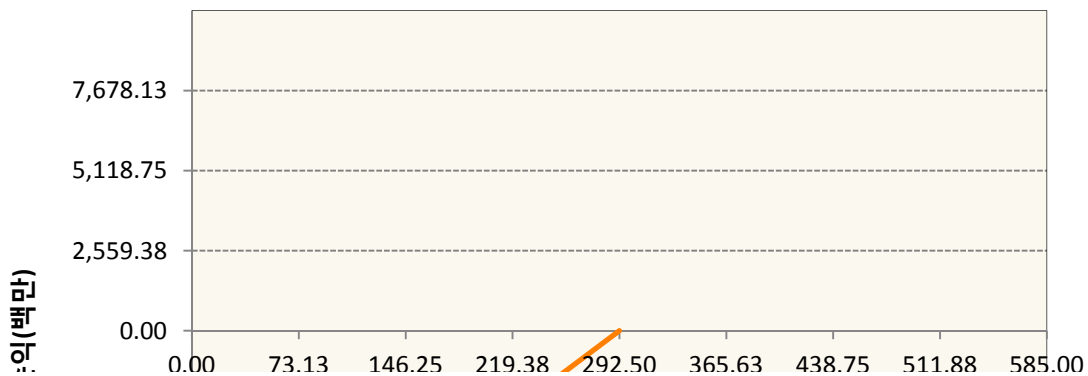
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	45,200	0	45,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	43,425	-43,425	장내

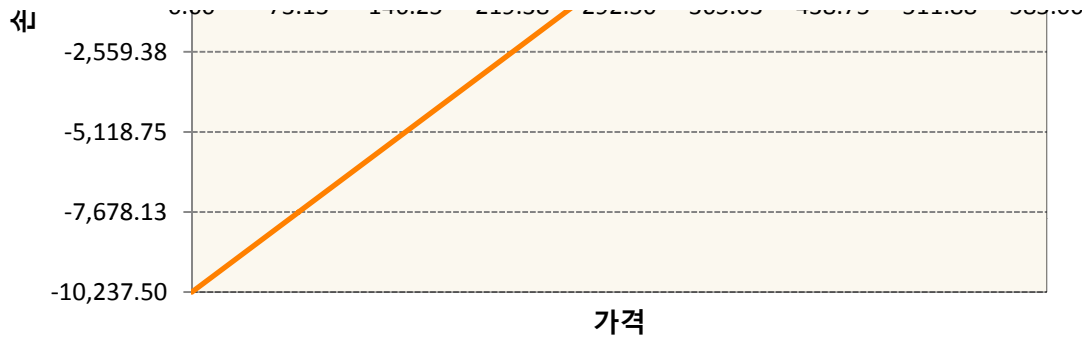
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N82951-2018-08 콜295

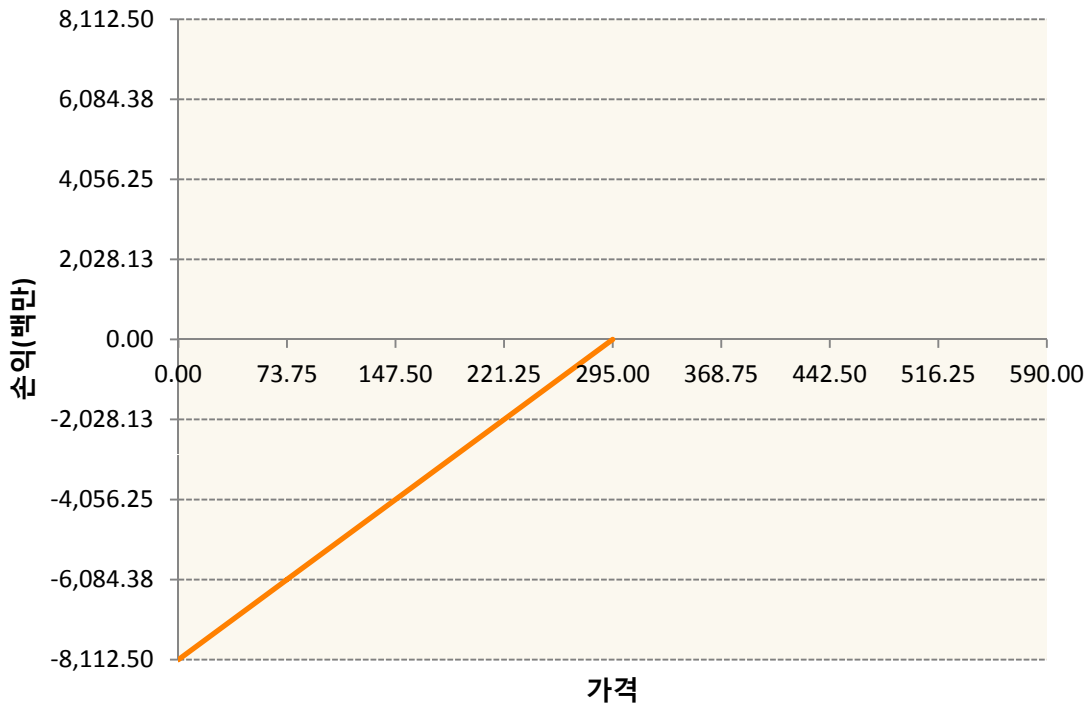


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





KR4301N82959-2018-08 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,502
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,502	-1,502	-1,502	-1,502	-1,502	-1,502	-1,502
-5.33%	-1,001	-1,001	-1,001	-1,001	-1,001	-1,001	-1,001
-2.67%	-501	-501	-501	-501	-501	-501	-501
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	501	501	501	501	501	501	501
5.33%	1,001	1,001	1,001	1,001	1,001	1,001	1,001
8.00%	1,502	1,502	1,502	1,502	1,502	1,502	1,502
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							284
	기초자산의 변동성						



0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	162	162	162	162	162	162	162
5.33%	325	325	325	325	325	325	325
8.00%	487	487	487	487	487	487	487

KR4201N829 2018-08 콜295

1,570

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	706	686	662	635	604	571	535
-5.33%	630	594	554	512	467	422	374
-2.67%	465	412	359	305	250	195	140
0%	175	117	58	0	-58	-117	-175
2.67%	-247	-299	-351	-405	-460	-515	-571
5.33%	-780	-816	-856	-899	-944	-991	-1,040
8.00%	-1,385	-1,406	-1,432	-1,462	-1,495	-1,531	-1,570

KR4301N829 2018-08 풋292.5

627

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-619	-619	-620	-621	-623	-625	-627
-5.33%	-348	-351	-355	-360	-366	-372	-379
-2.67%	-111	-121	-131	-142	-153	-163	-174
0%	33	22	11	0	-11	-22	-34
2.67%	81	77	71	65	58	51	43
5.33%	89	88	87	85	83	79	76
8.00%	90	90	90	89	89	88	86

KR4301N829 2018-08 풋295

530

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-526	-526	-526	-527	-527	-528	-530
-5.33%	-311	-312	-314	-317	-320	-324	-328
-2.67%	-112	-118	-125	-132	-139	-147	-155
0%	28	19	9	0	-9	-19	-28
2.67%	86	81	75	69	62	55	47
5.33%	98	97	95	93	90	86	82
8.00%	100	99	99	99	98	97	95

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

(단위:백만원)

6,419

공시일	2018-07-20
기준일	2018-07-19

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

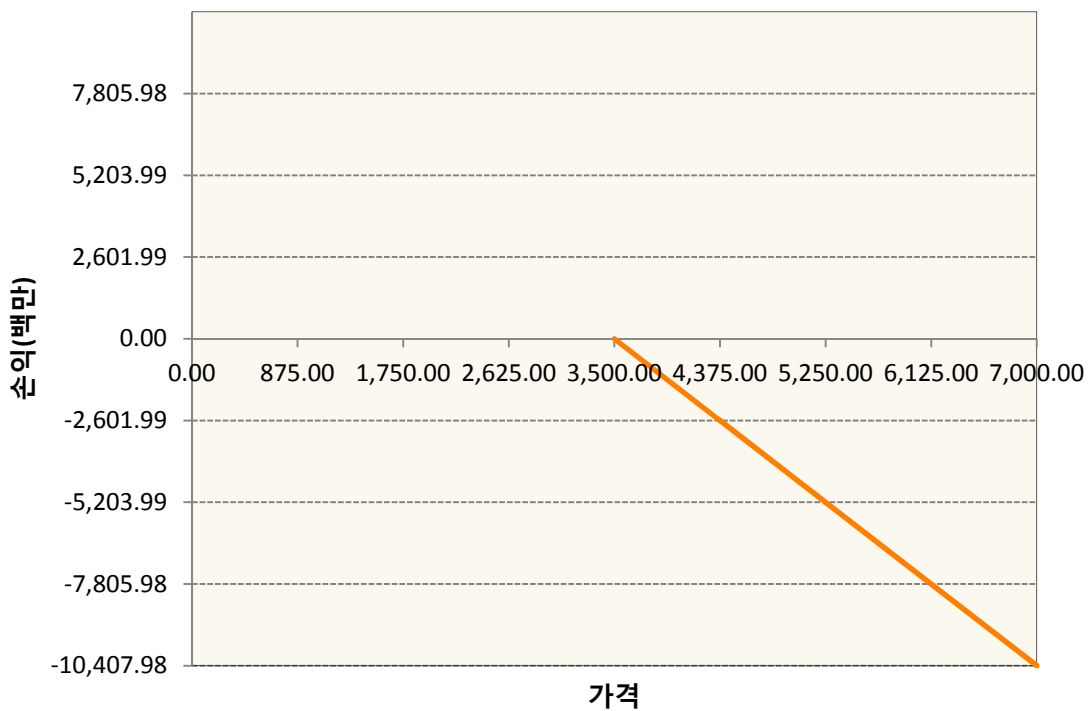
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

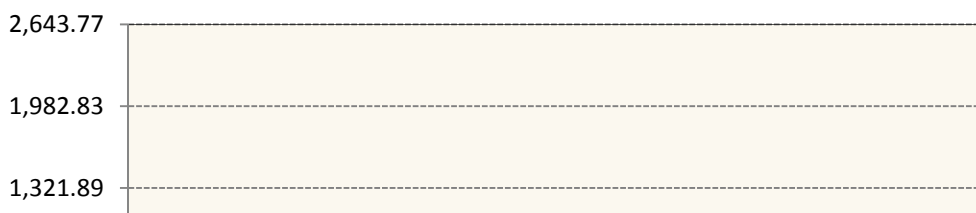
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,605	0	5,605	
누계	유가증권	스왑	44,948	0	44,948	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,103	-26,103	장내
누계	지수	스왑	52,631	0	52,631	장외

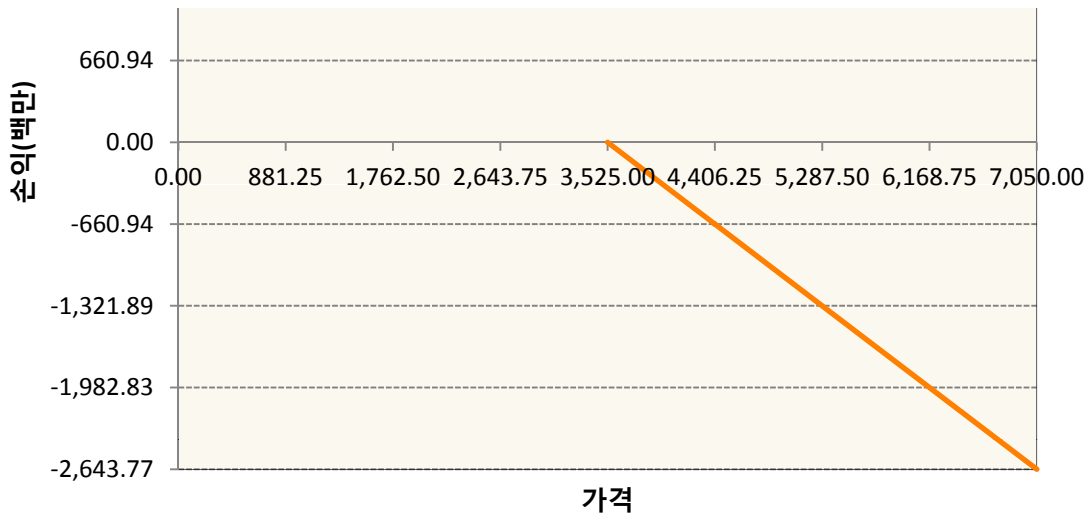
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXN8-C3500-EURO STOXX 50**

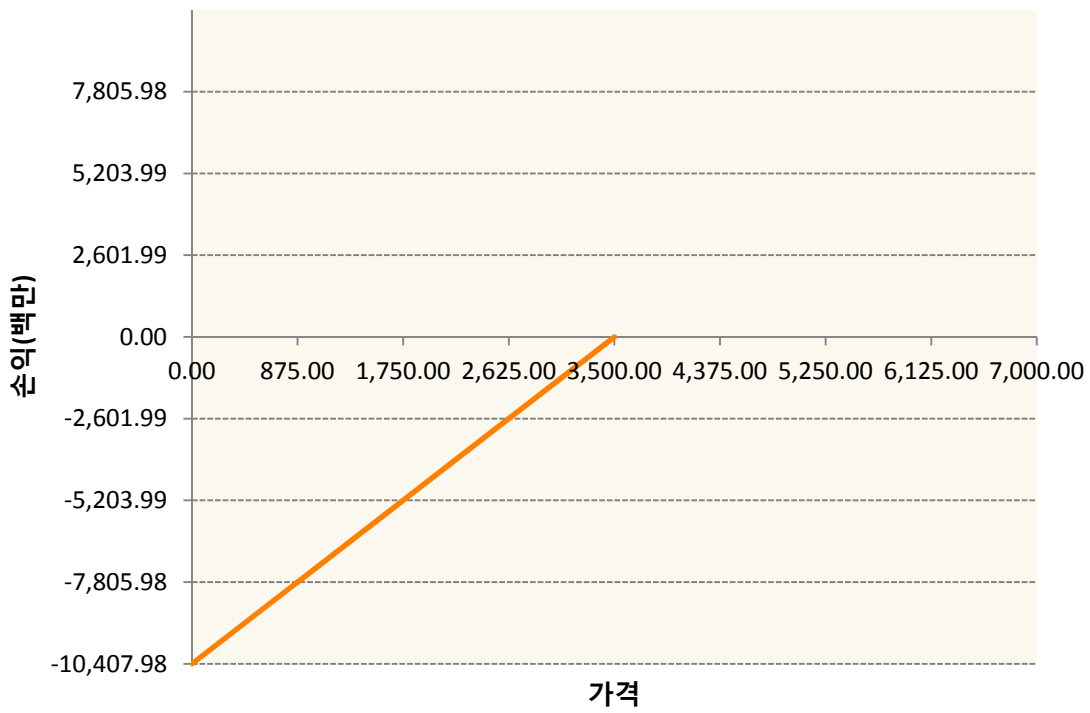


**OESXN8-C3525-EURO STOXX 50**

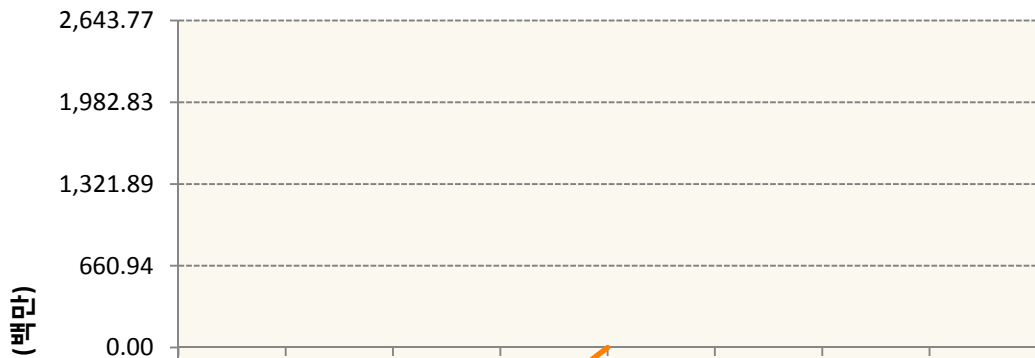


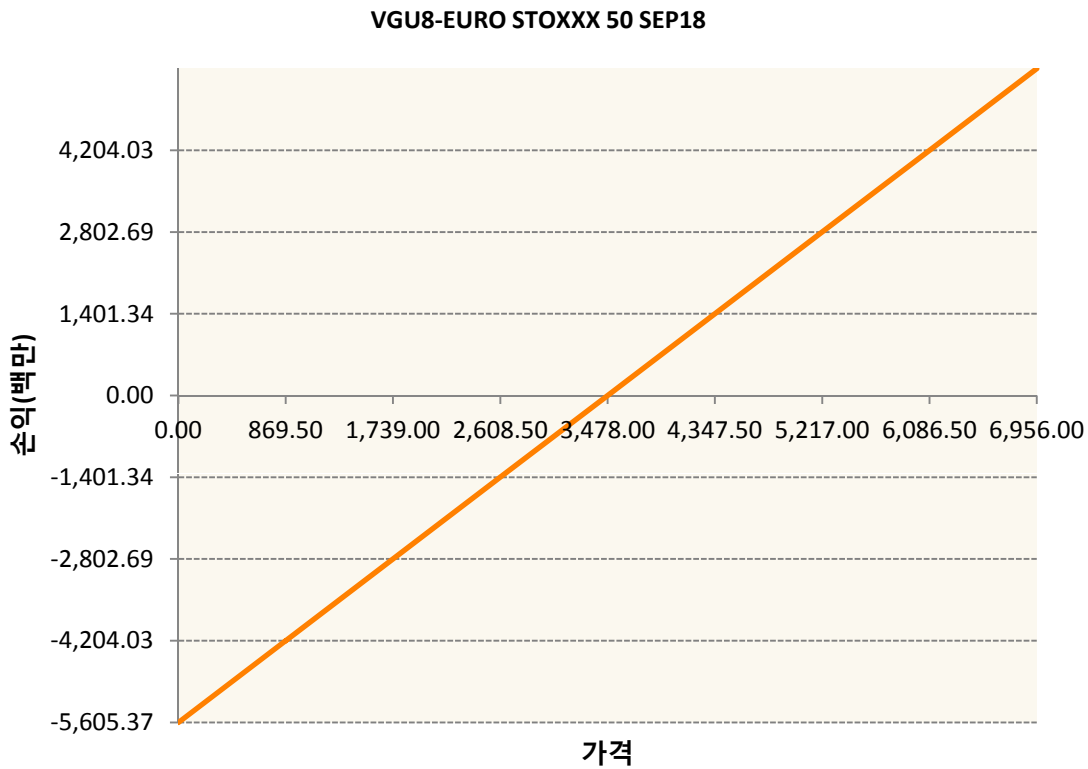
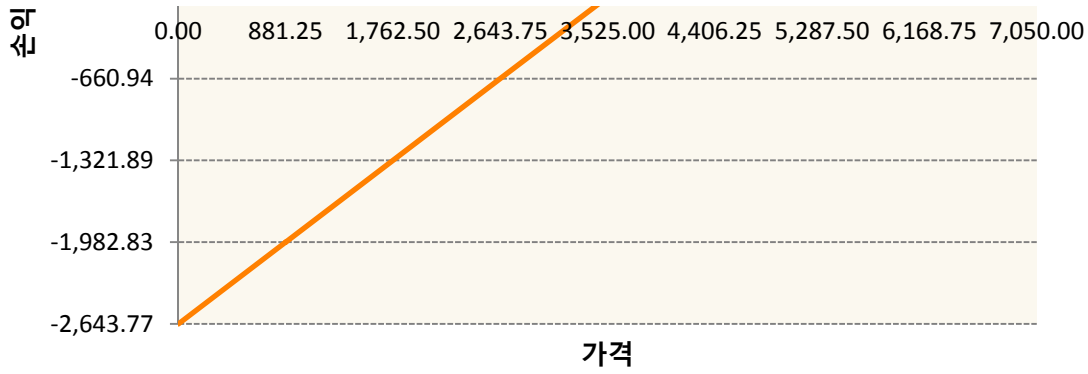


OESXN8-P3500-EURO STOXX 50



OESXN8-P3525-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY -	994.569	70
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY		60
OESXN8-C3!EURO STOXX 50		833
OESXN8-C3!EURO STOXX 50		211
OESXN8-P3!EURO STOXX 50		833
OESXN8-P3!EURO STOXX 50		211
VGU8	EURO STOXXX 50 SEP18	448

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





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

(단위:백만원)

1,141



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)

171

공시일	2018-07-20
기준일	2018-07-19

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1

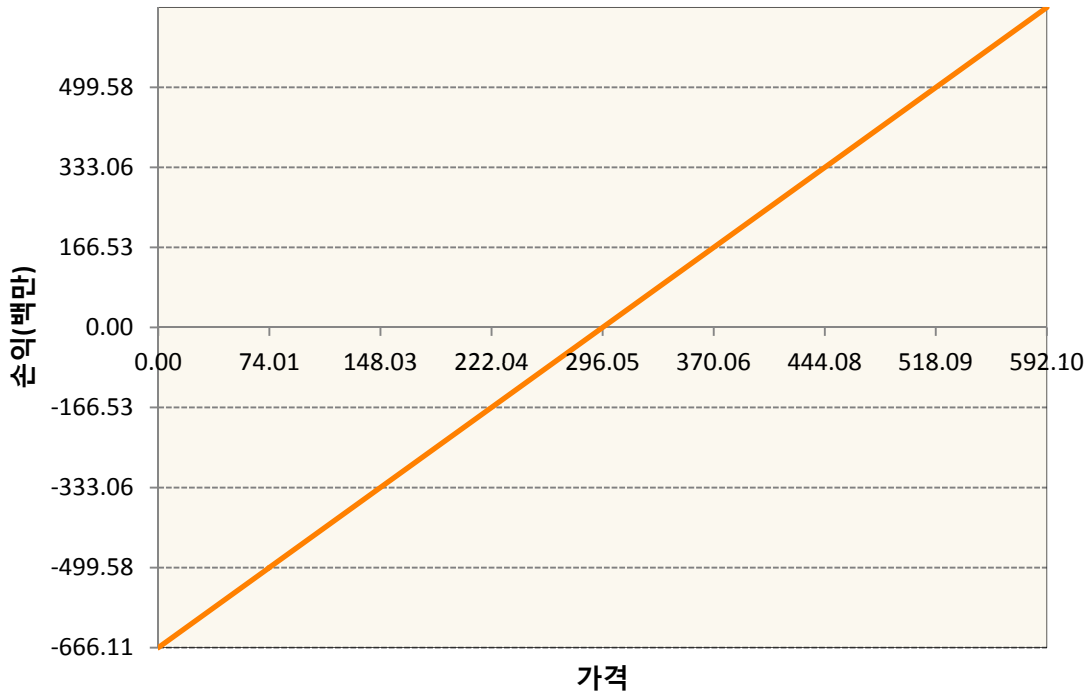
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	666	0	666	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물

53

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-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%	53	53	53	53	53	53	53

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-07-20
기준일	2018-07-19

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

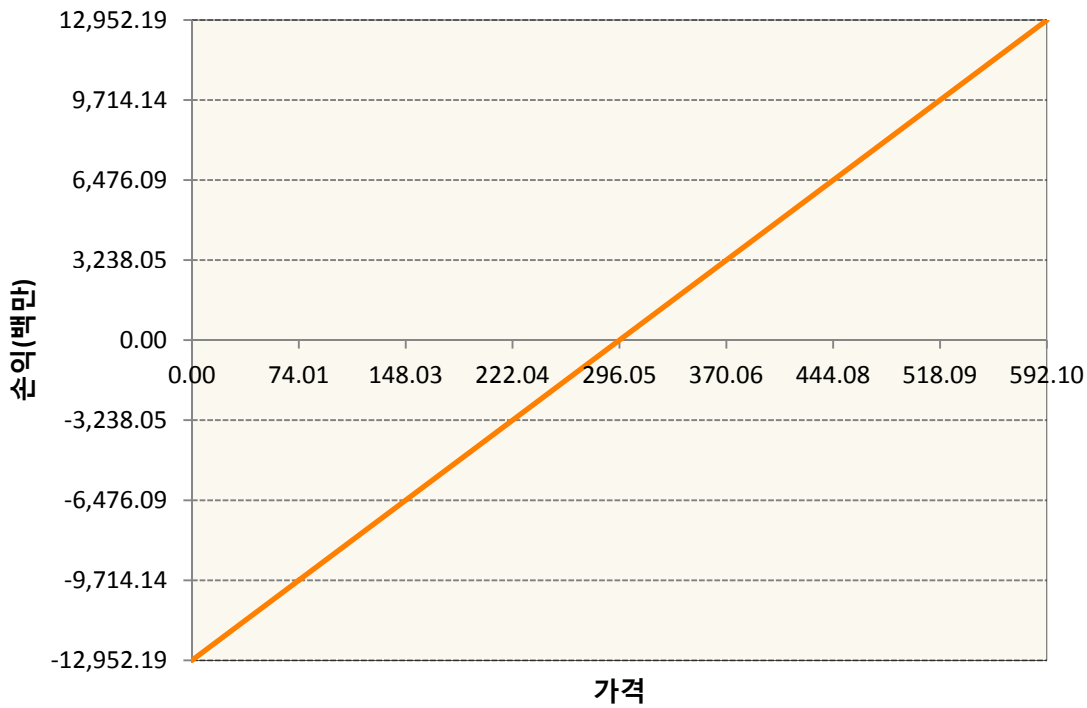
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

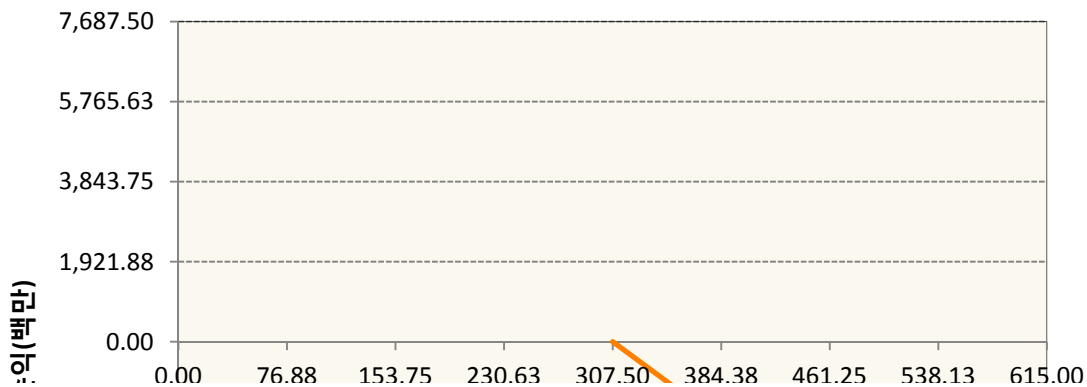
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,952	0	12,952	장내
누계	유가증권	옵션	2,134	23,653	-21,518	장내

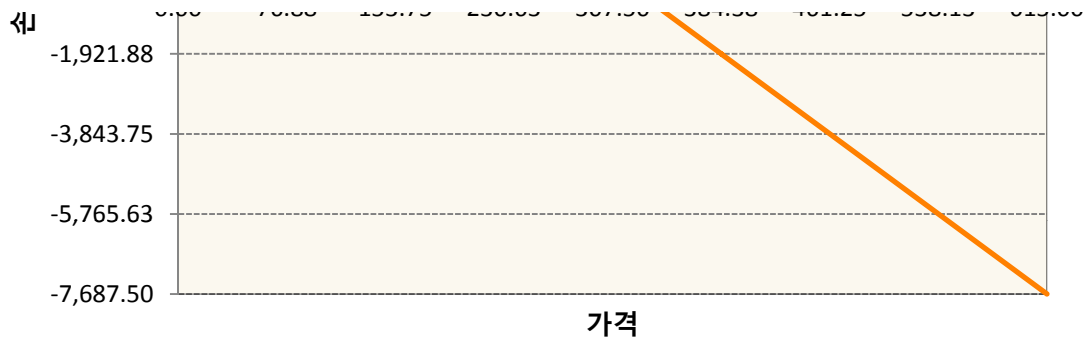
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

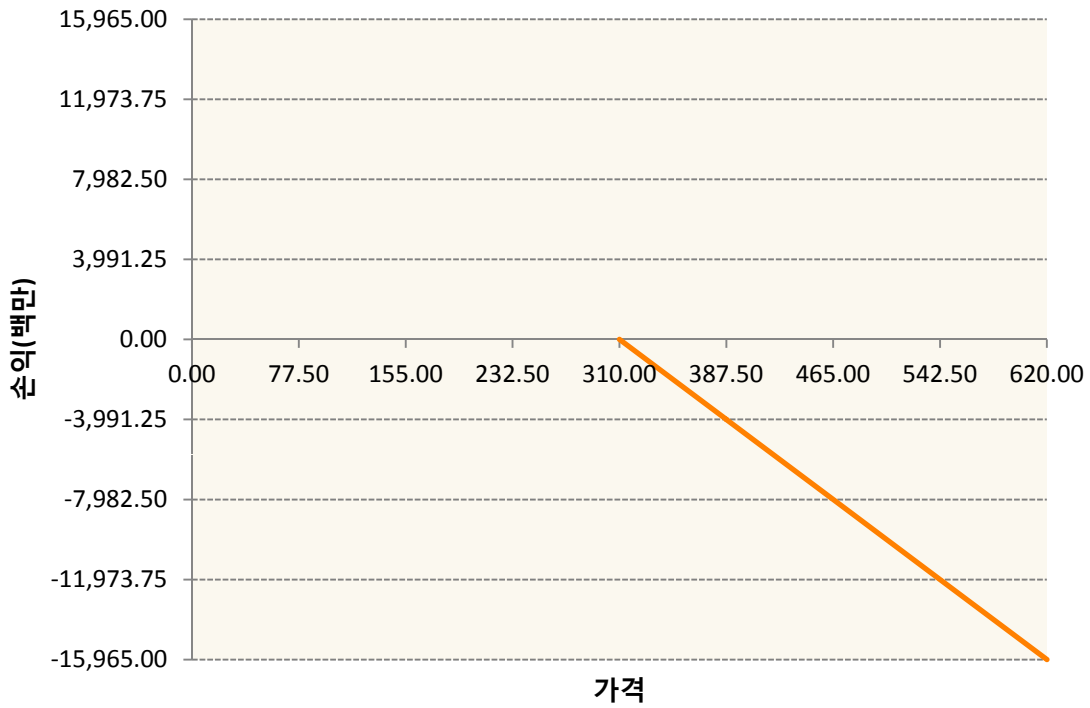


KR4201N83074-2018-08 콜307.5

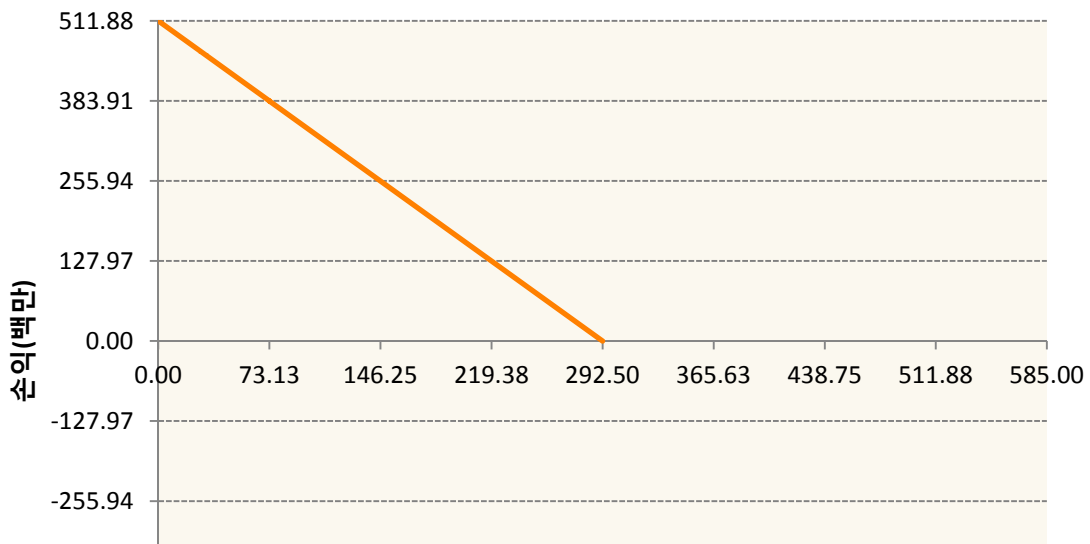


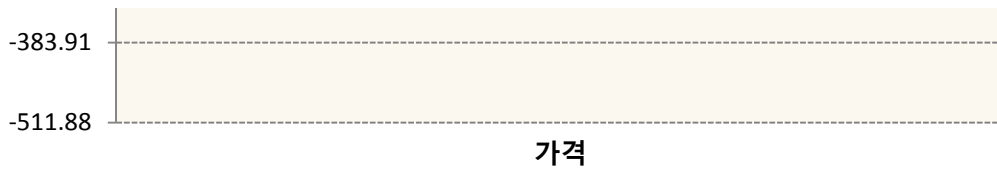


KR4201N83108-2018-08 콜310

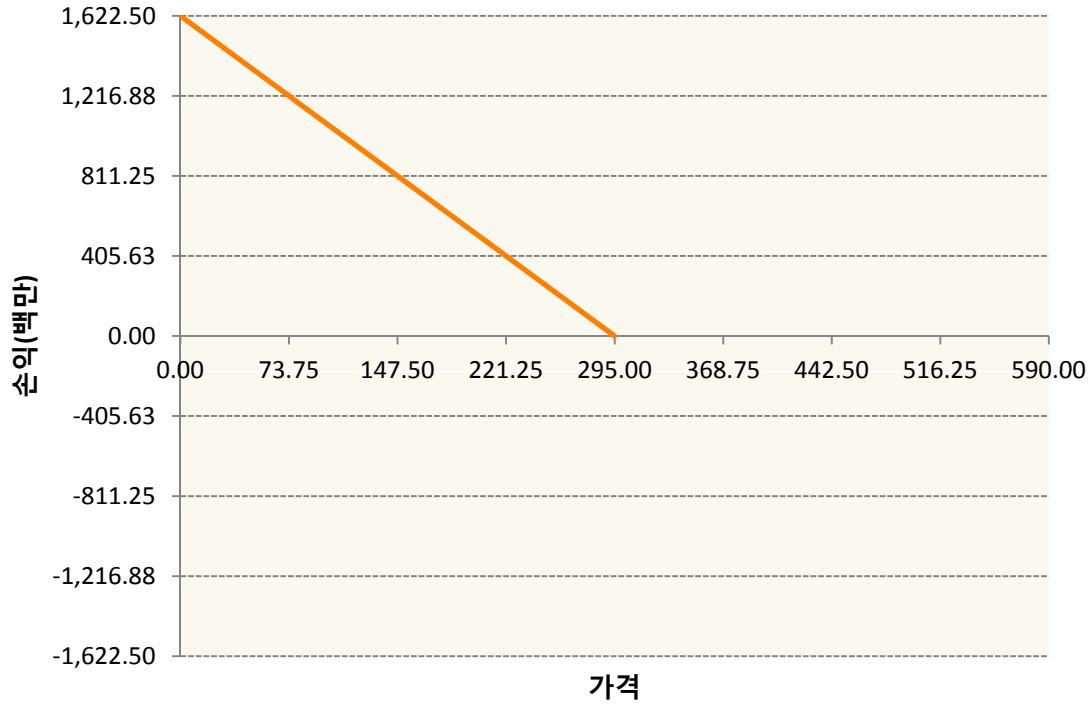


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





KR4301N82959-2018-08 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물 1,036

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,036	-1,036	-1,036	-1,036	-1,036	-1,036	-1,036
-5.33%	-690	-690	-690	-690	-690	-690	-690
-2.67%	-345	-345	-345	-345	-345	-345	-345
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	345	345	345	345	345	345	345
5.33%	690	690	690	690	690	690	690
8.00%	1,036	1,036	1,036	1,036	1,036	1,036	1,036

KR4201N83C 2018-08 콜307.5 354

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	95	94	92	88	84	79	73
-5.33%	91	87	81	75	67	59	50
-2.67%	77	68	58	48	36	24	11

0%	43	29	15	0	-15	-31	-47
2.67%	-21	-39	-56	-74	-91	-109	-126
5.33%	-123	-140	-158	-176	-193	-211	-229
8.00%	-260	-275	-290	-305	-321	-337	-354

KR4201N8312018-08 콜310

680

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	164	162	158	153	146	137	126
-5.33%	158	151	142	131	117	102	84
-2.67%	136	121	104	84	63	39	15
0%	81	56	29	0	-30	-60	-91
2.67%	-30	-64	-99	-134	-170	-205	-241
5.33%	-215	-252	-289	-326	-363	-400	-437
8.00%	-476	-508	-541	-575	-610	-645	-680

KR4301N829 2018-08 풋292.5

31

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	31	31	31	31	31	31	31
-5.33%	17	18	18	18	18	19	19
-2.67%	6	6	7	7	8	8	9
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-4	-4	-4	-3	-3	-3	-2
5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4

KR4301N829 2018-08 풋295

106

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	105	105	105	105	105	106	106
-5.33%	62	62	63	63	64	65	66
-2.67%	22	24	25	26	28	29	31
0%	-6	-4	-2	0	2	4	6
2.67%	-17	-16	-15	-14	-12	-11	-9
5.33%	-20	-19	-19	-19	-18	-17	-16
8.00%	-20	-20	-20	-20	-20	-19	-19

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

(단위:백만원)

1,717

공시일	2018-07-20
기준일	2018-07-19

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

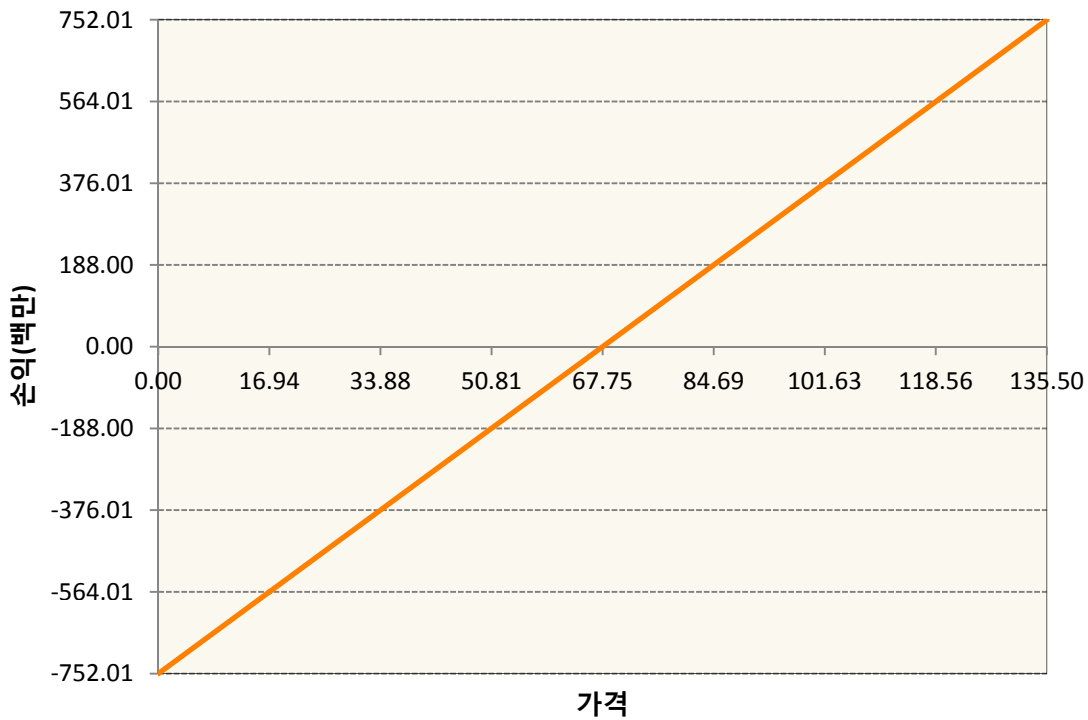
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

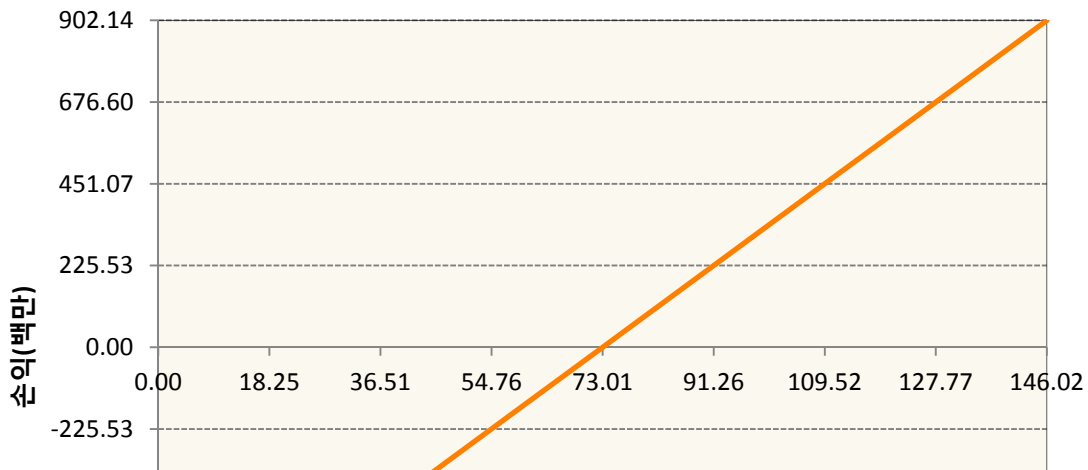
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,564	623	2,941	

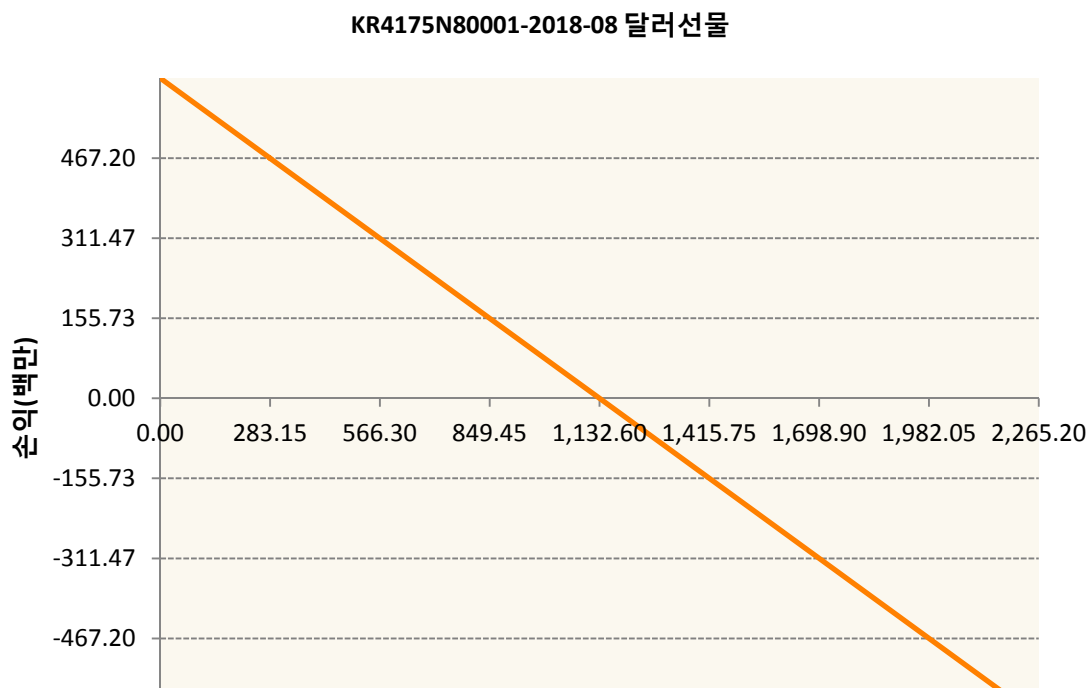
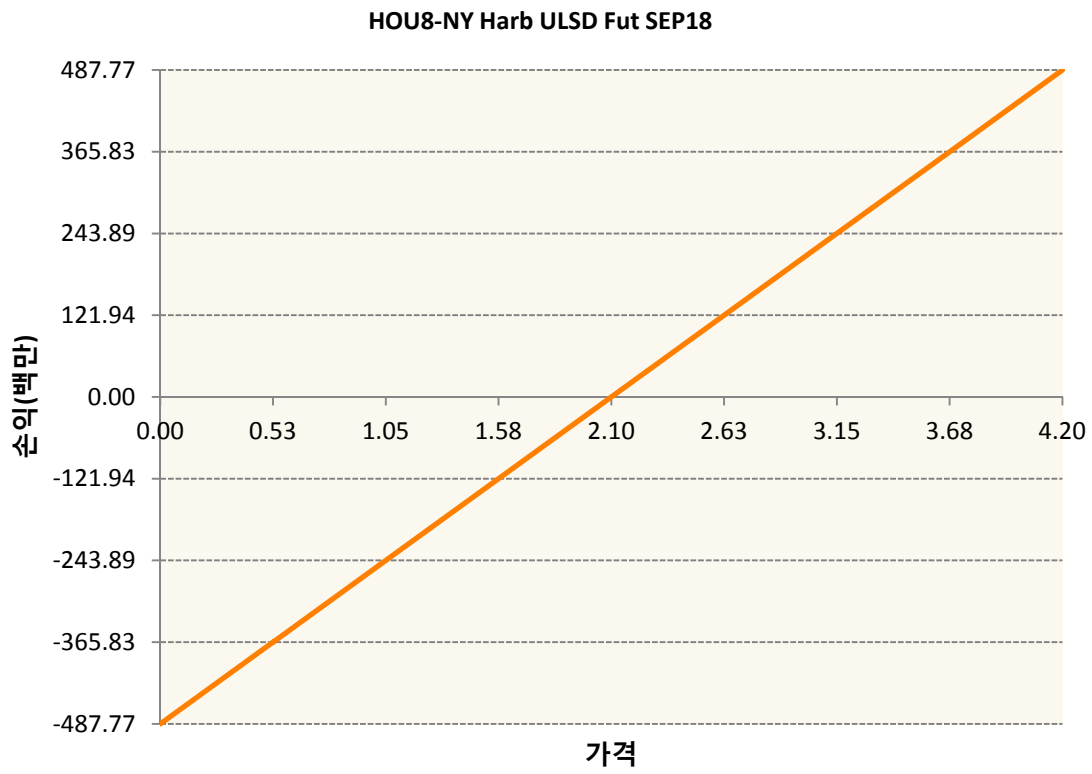
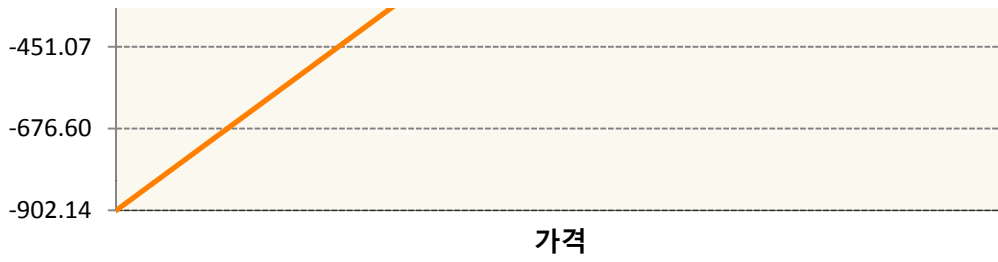
### 2. 만기시점의 손익구조

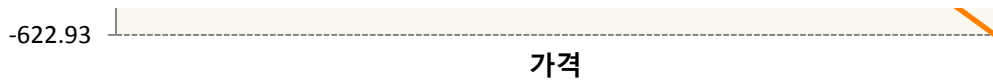
**CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18**



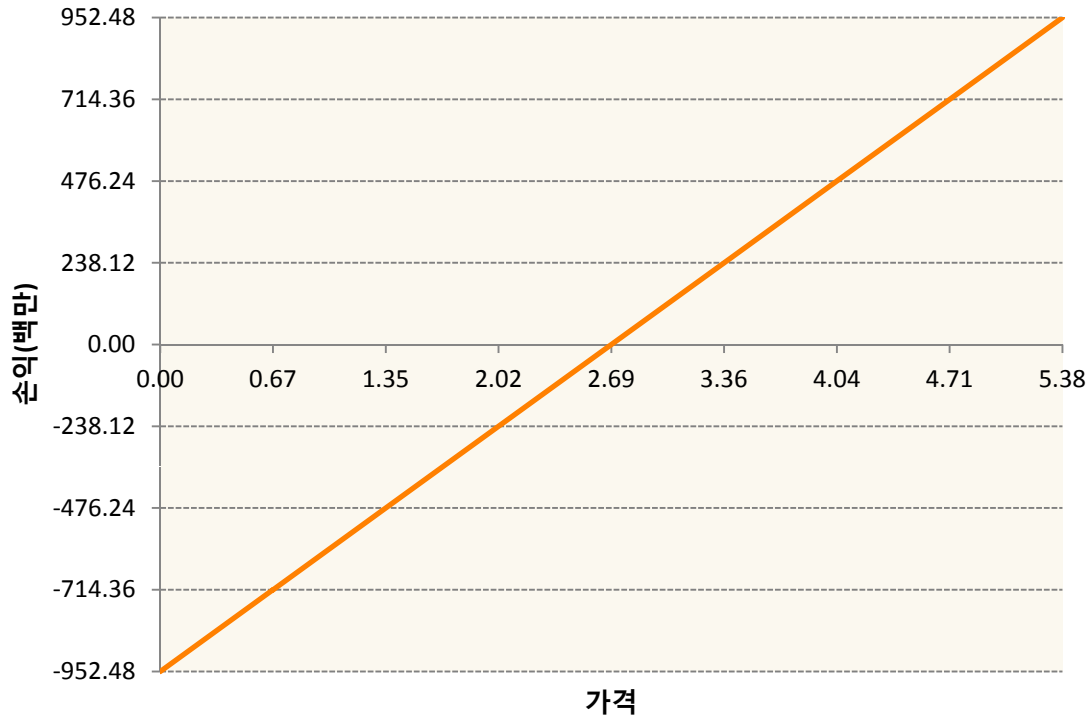
**COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18**



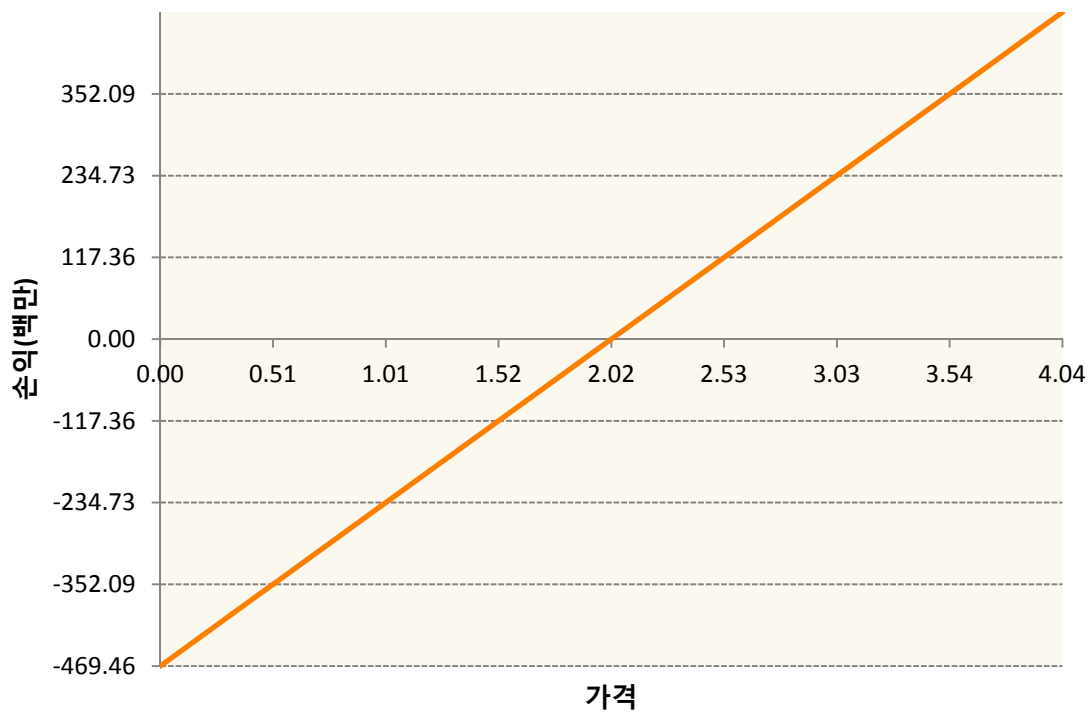




**NGU18-NATURAL GAS FUTR SEP18**



**XBU8-GASOLINE RBOB FUT SEP18**



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

CLU8	WTI CRUDE FUTURE SEP18	60
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	72
HOU8	NY Harb ULSD Fut SEP18	39
KR4175N80C	2018-08 달러선물	50
NGU18	NATURAL GAS FUTR SEP18	76
XBU8	GASOLINE RBOB FUT SEP18	38

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

421

공시일	2018-07-20
기준일	2018-07-19

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

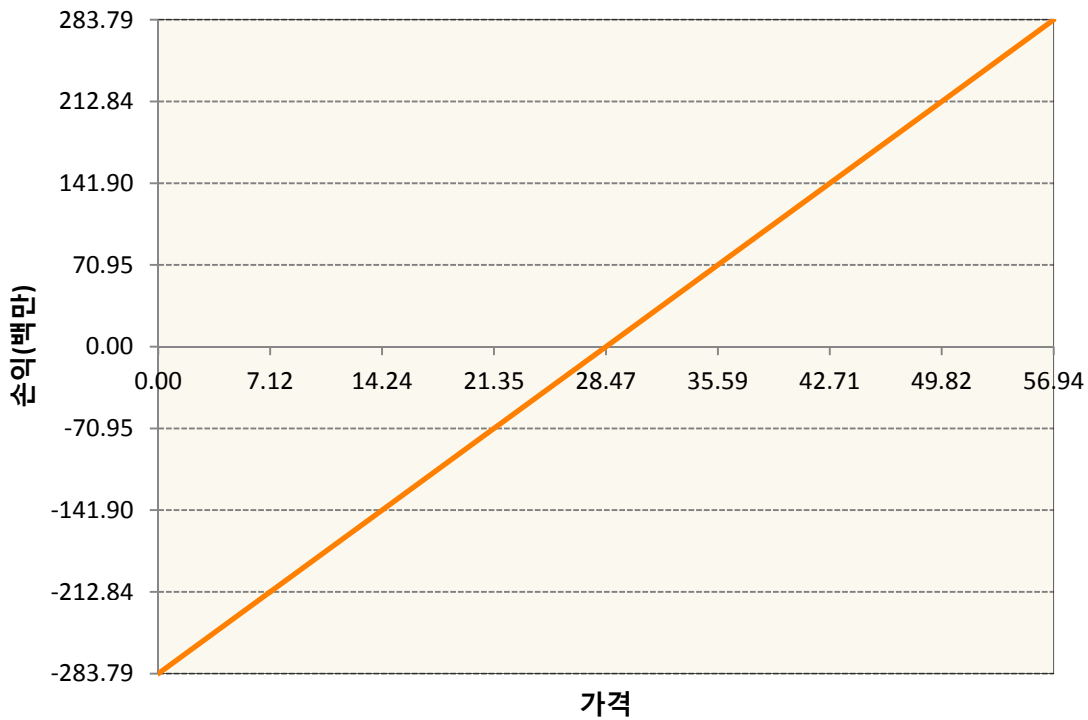
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

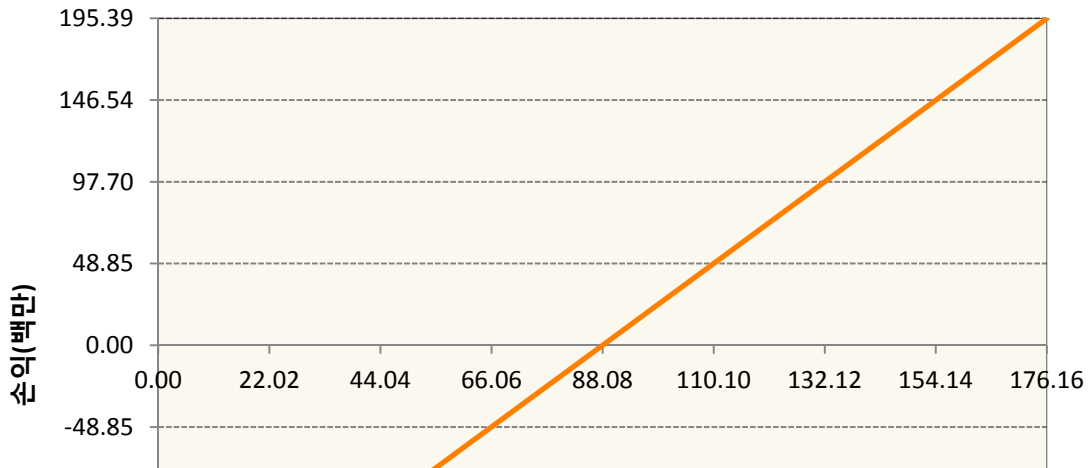
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,555	79	3,476	

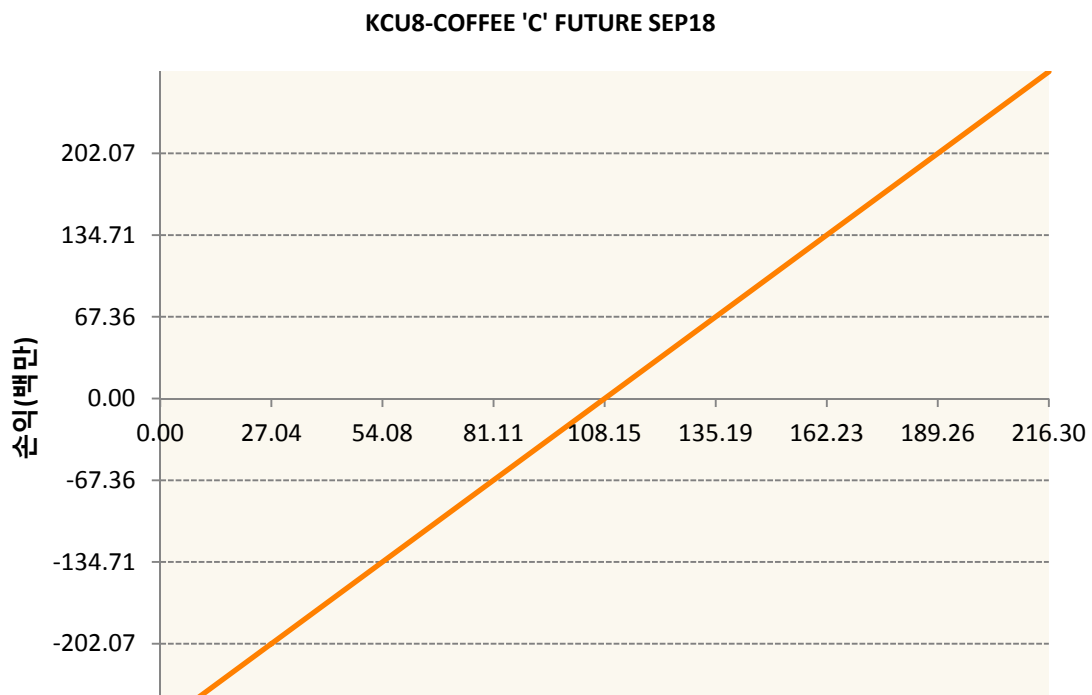
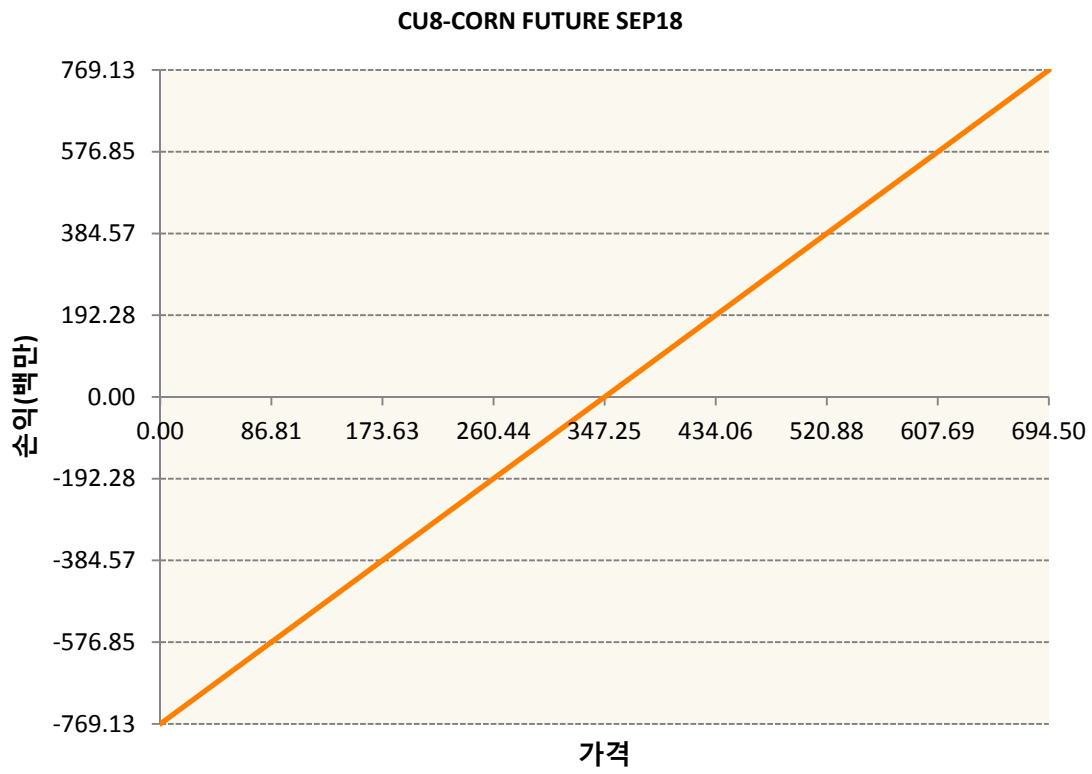
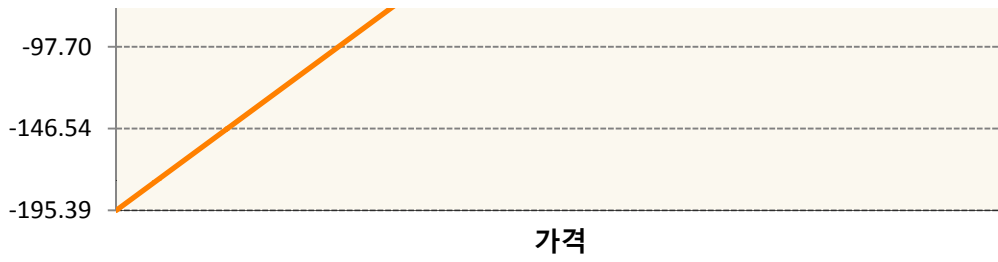
### 2. 만기시점의 손익구조

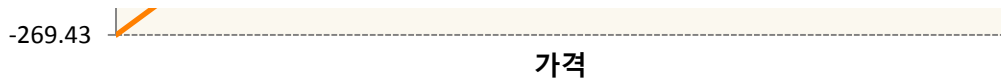
**BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18**



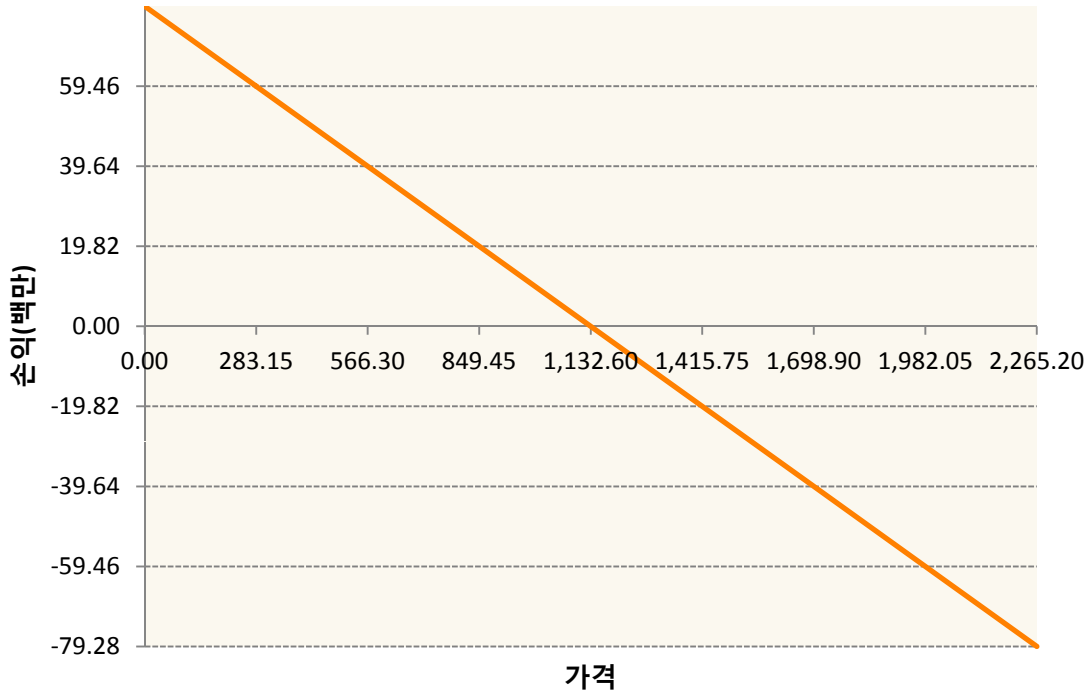
**CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18**



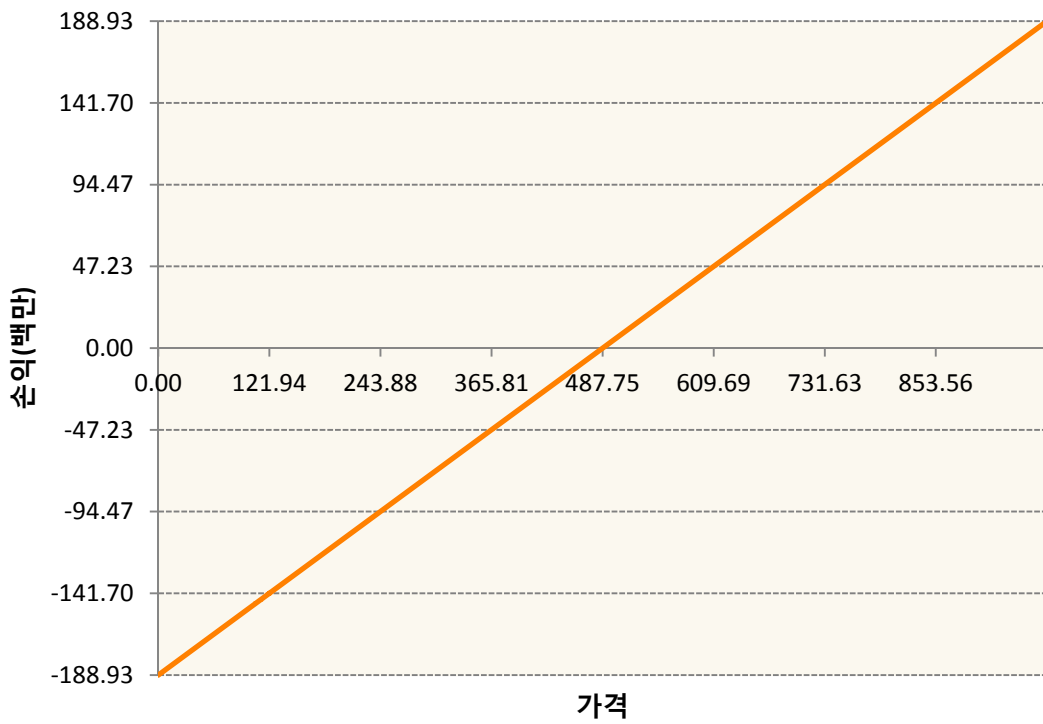




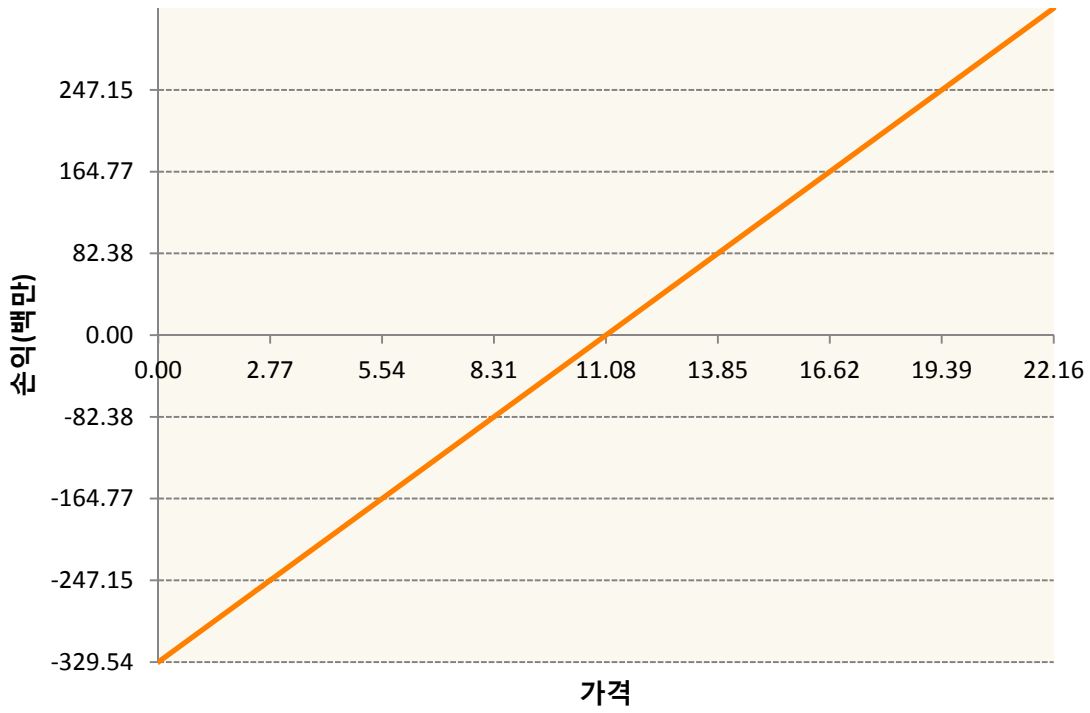
**KR4175N80001-2018-08 달러선물**



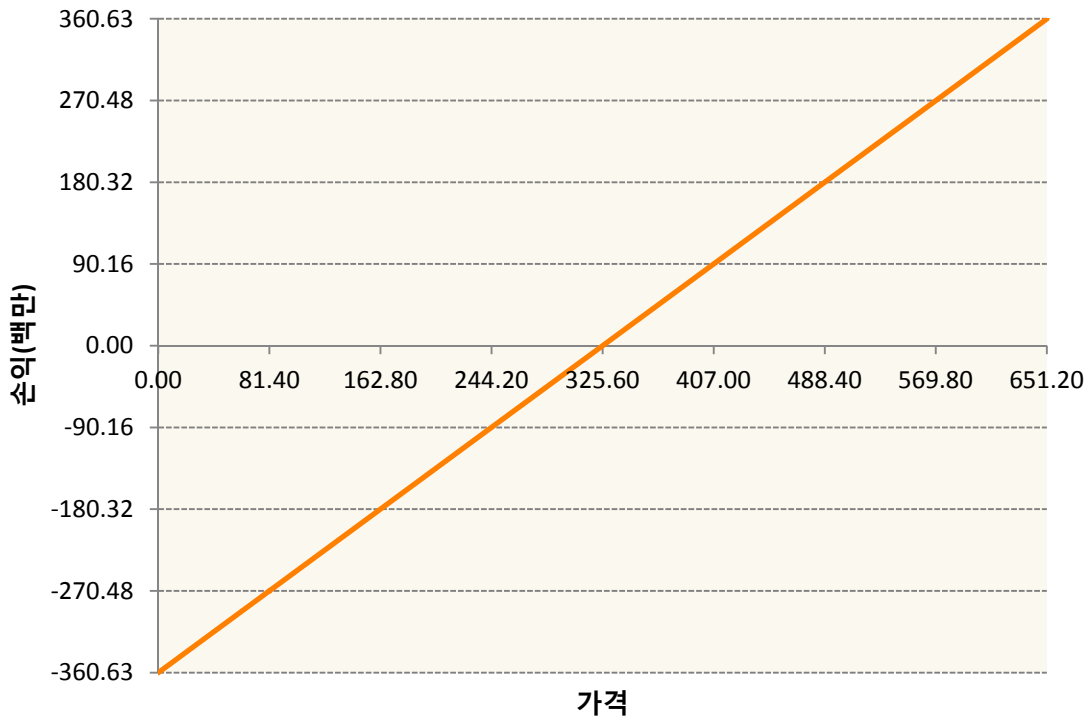
**KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18**



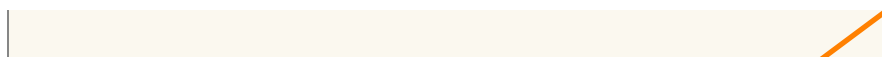
SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

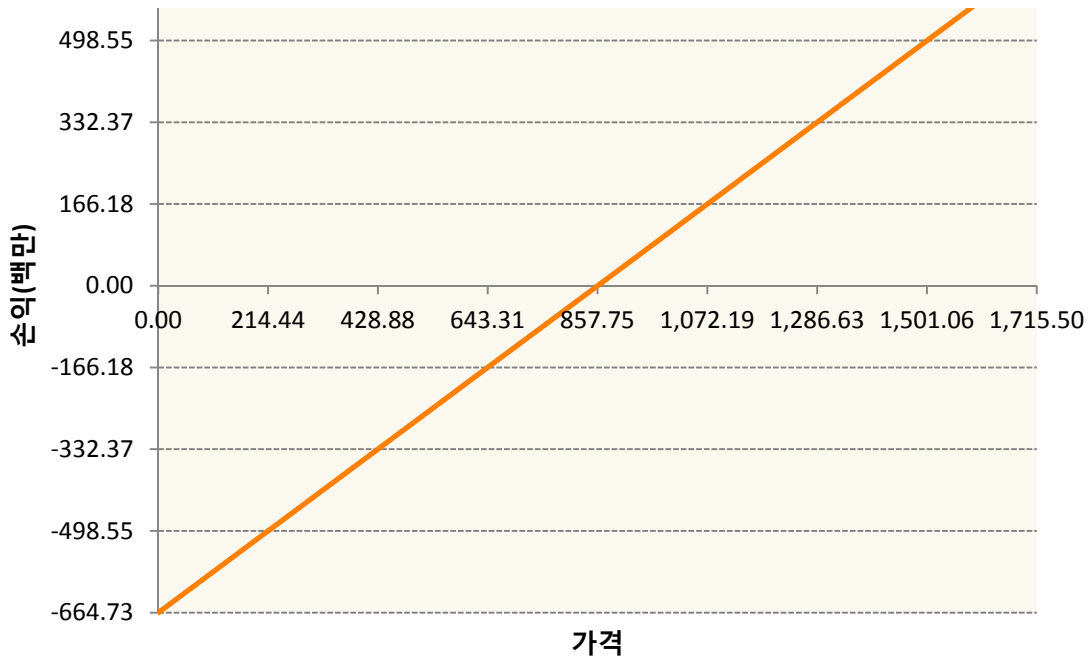


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

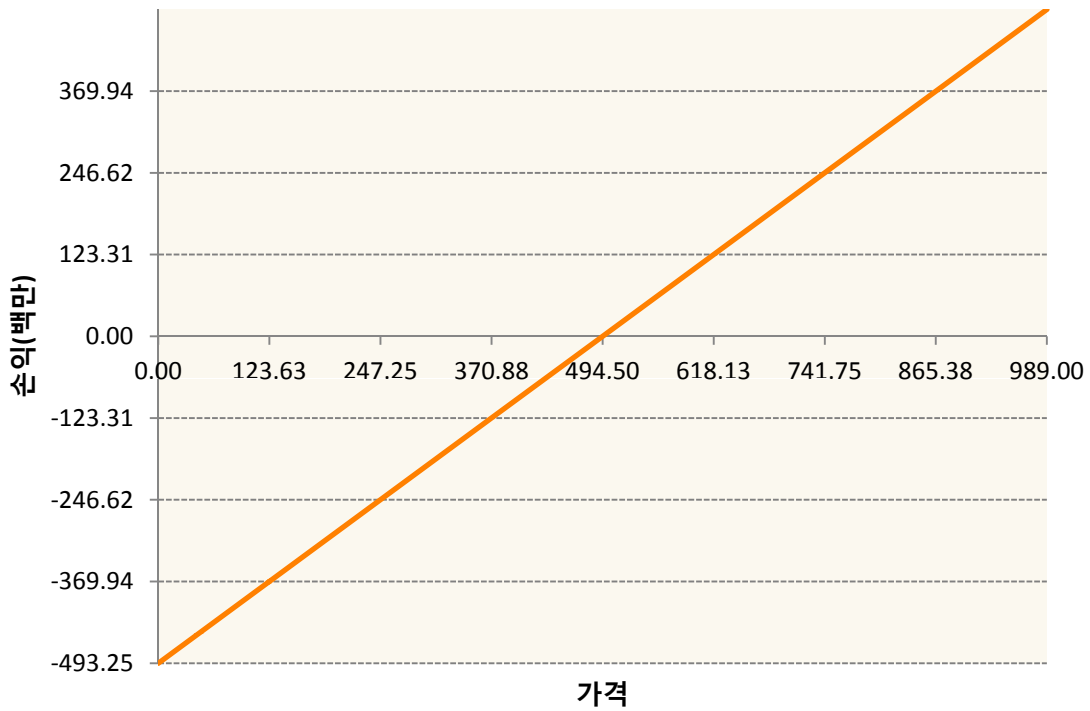


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





WU8-WHEAT FUTURE(CBT) SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	23
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	16
CU8	CORN FUTURE SEP18	62
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	53
WU8	WHEAT FUTURE(CBT) SEP18	39

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

(단위:백만원)

**298**