

공시일	2018-07-23
기준일	2018-07-20

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	2018-07-23
기준일	2018-07-20

스마트인덱스모

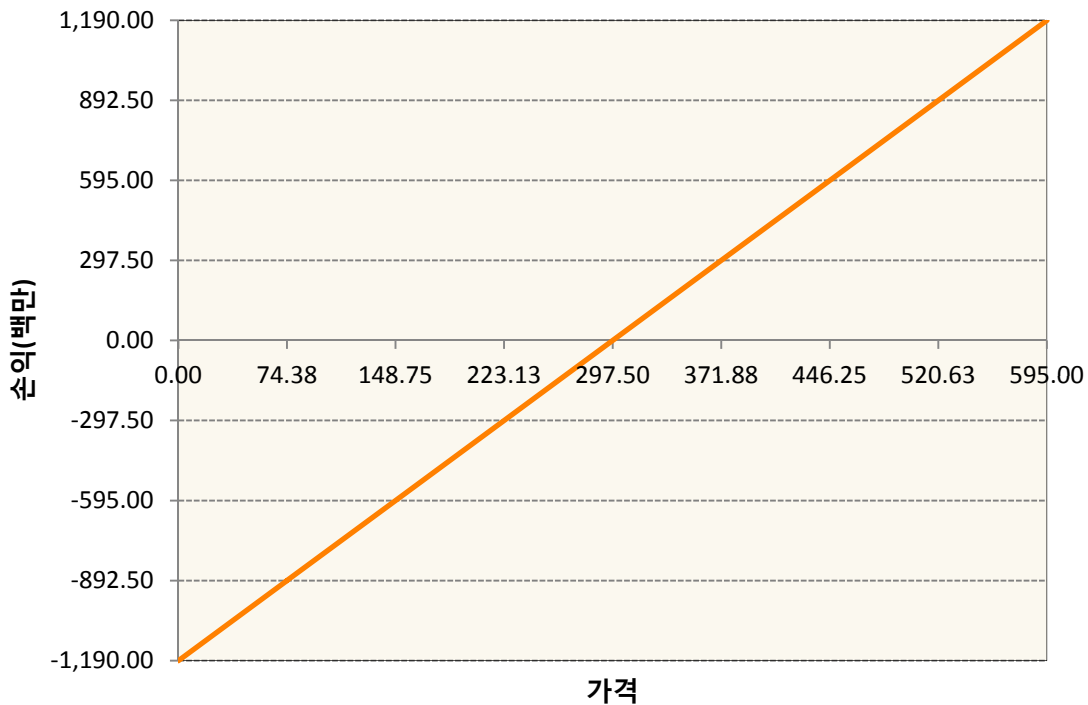
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,190	0	1,190	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N900 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	2018-07-23
기준일	2018-07-20

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)

478

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-07-23
기준일	2018-07-20

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

323

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

398

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-07-23
기준일	2018-07-20

유로인덱스모(주식-파생형)

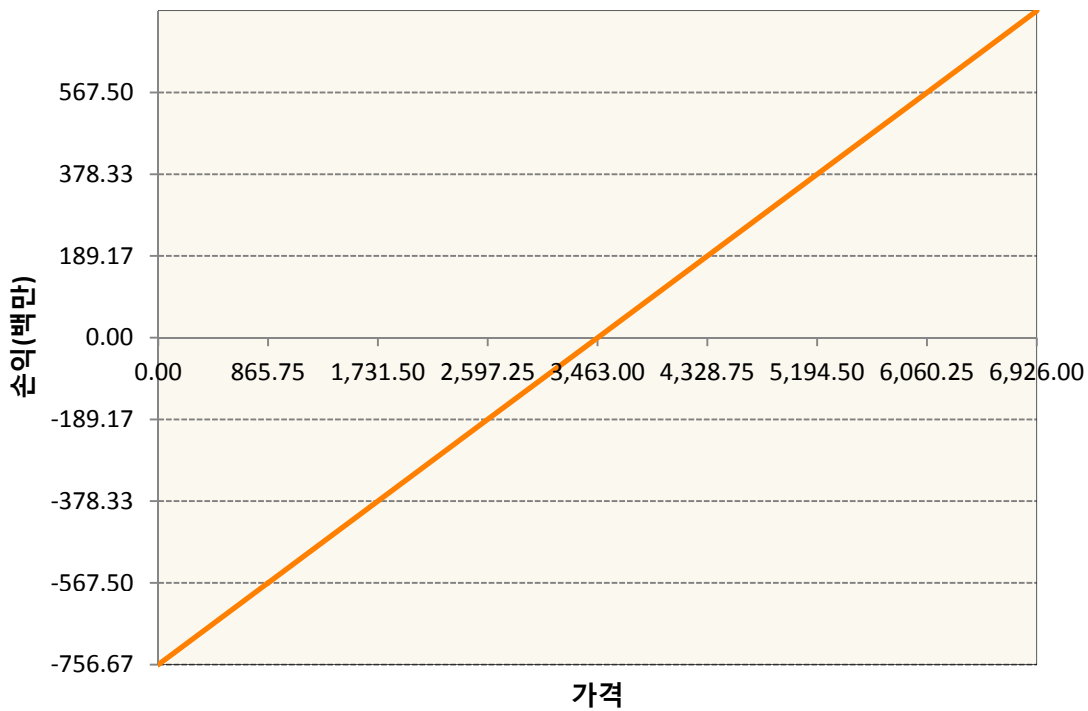
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	757	0	757	

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	2018-07-23
기준일	2018-07-20

차이나인덱스모(주식-파생형)

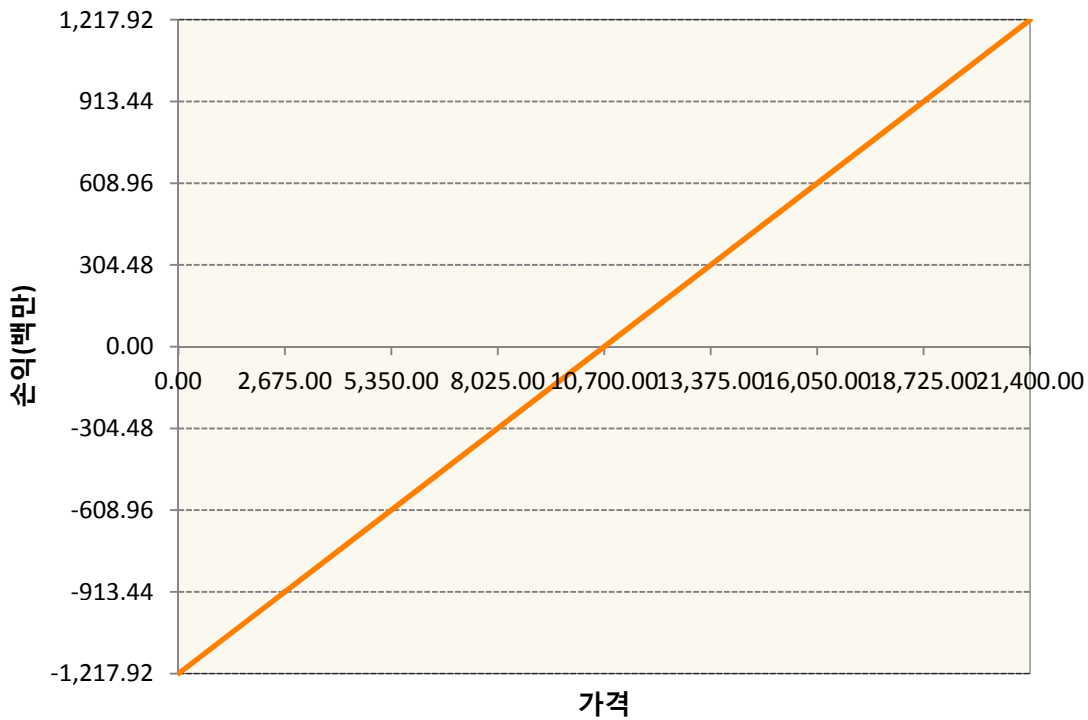
1. 계약금액

(단위:백만원)

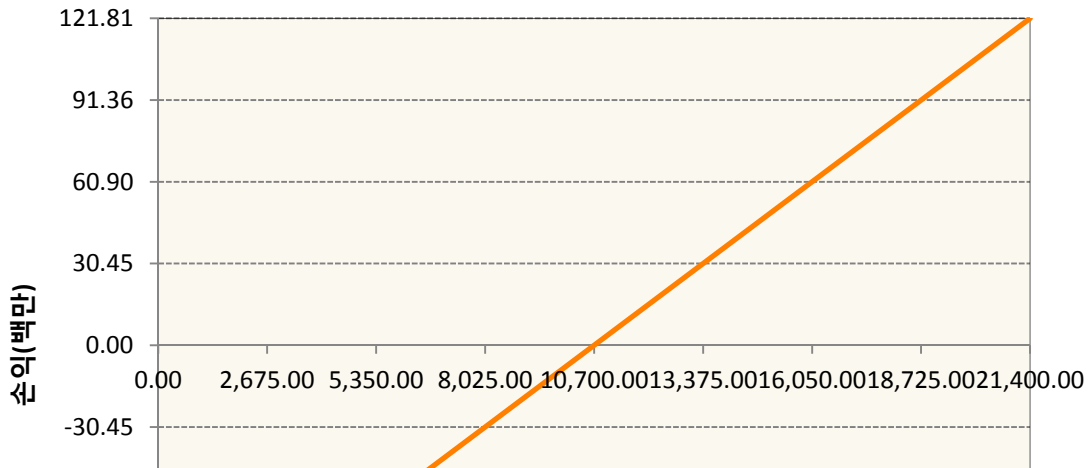
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,340	0	1,340	장내

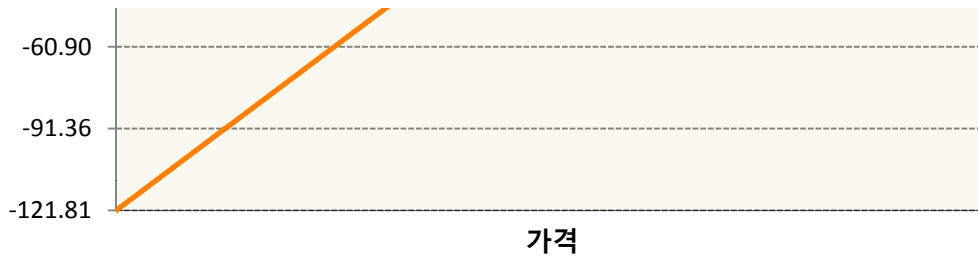
2. 만기시점의 손익구조

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	2018-07-23
기준일	2018-07-20

커버드콜모(주식혼합-파생형)

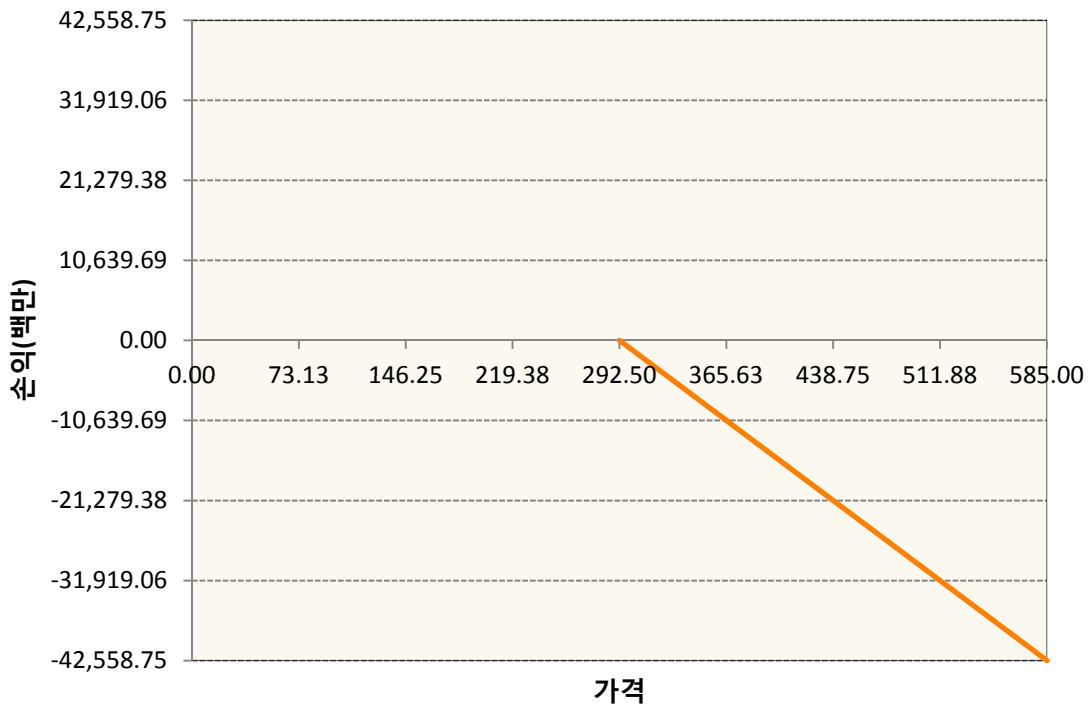
1. 계약금액

(단위:백만원)

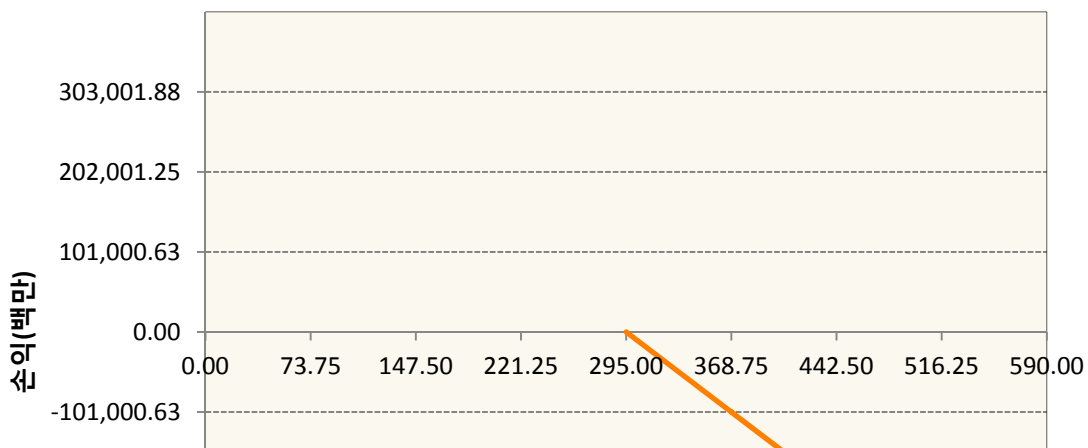
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	725,561	-725,561	장내

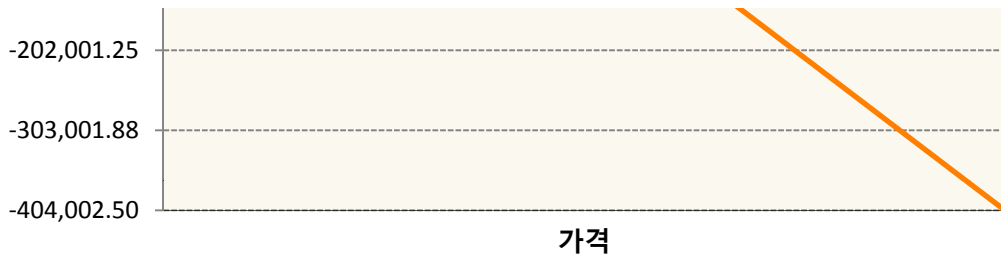
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N82928-2018-08 콜292.5

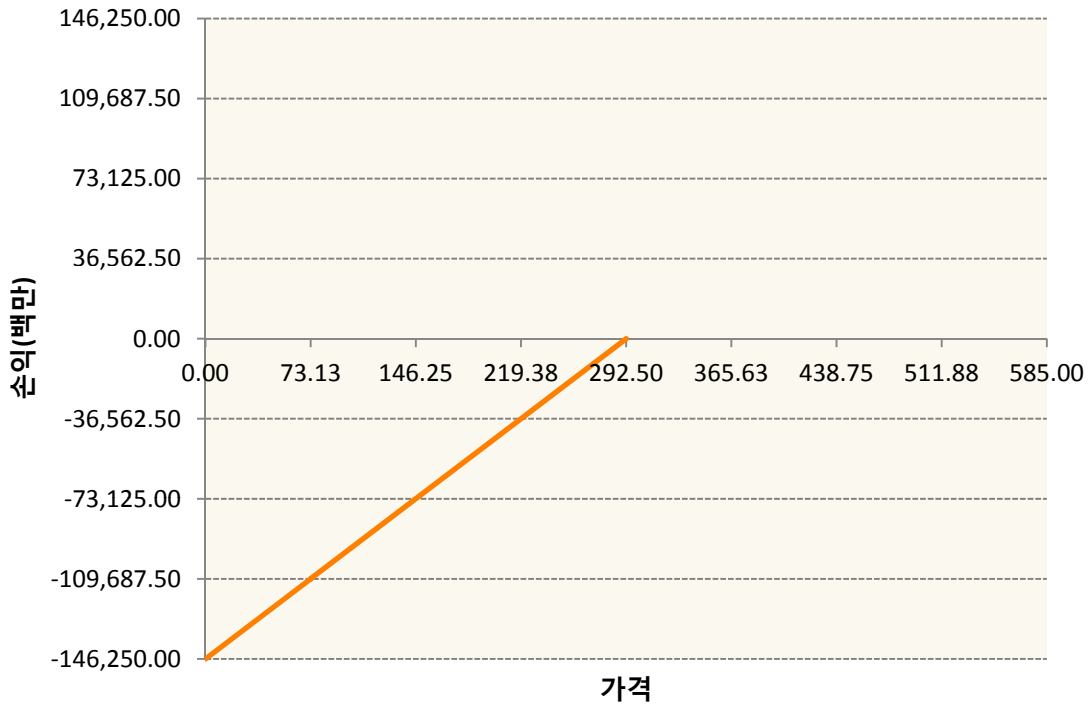


KR4201N82951-2018-08 콜295

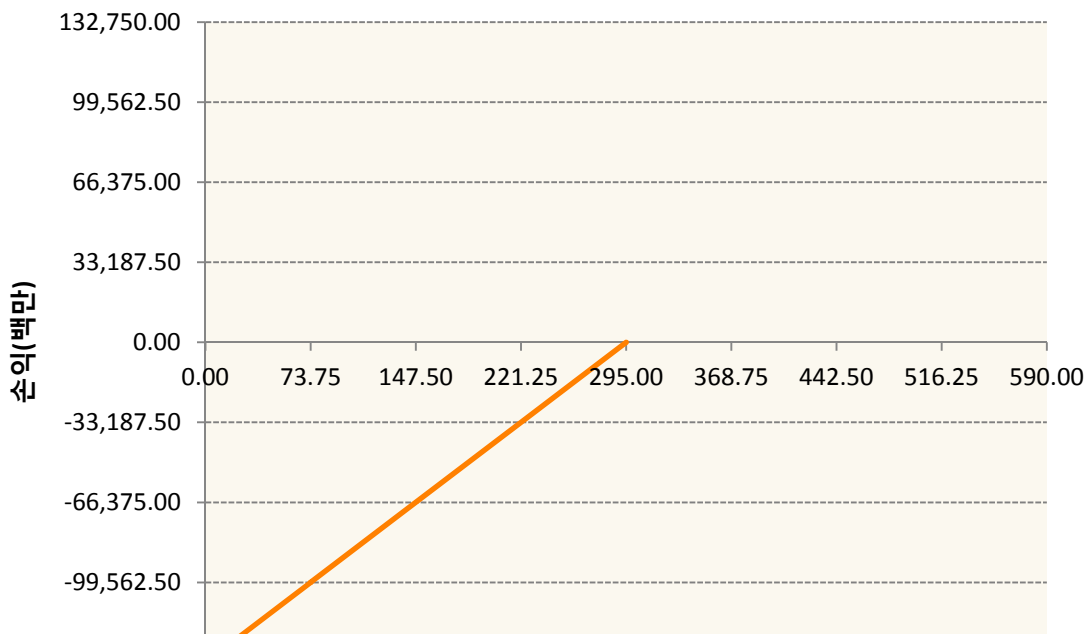




KR4301N82926-2018-08 풋292.5



KR4301N82959-2018-08 풋295



-132,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N829 2018-08 콜292.5							2,855
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,426	1,385	1,337	1,283	1,225	1,163	1,097
-5.33%	1,249	1,177	1,102	1,024	943	861	777
-2.67%	883	790	696	602	508	414	319
0%	281	188	94	0	-95	-189	-284
2.67%	-545	-618	-695	-775	-857	-942	-1,028
5.33%	-1,535	-1,580	-1,633	-1,691	-1,754	-1,822	-1,893
8.00%	-2,619	-2,642	-2,672	-2,709	-2,753	-2,801	-2,855
KR4201N829 2018-08 콜295							25,881
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,794	11,478	11,097	10,659	10,172	9,643	9,077
-5.33%	10,513	9,918	9,277	8,601	7,896	7,167	6,418
-2.67%	7,679	6,840	5,989	5,130	4,265	3,395	2,521
0%	2,726	1,819	910	0	-910	-1,821	-2,732
2.67%	-4,414	-5,182	-5,977	-6,792	-7,623	-8,467	-9,322
5.33%	-13,295	-13,813	-14,391	-15,017	-15,683	-16,383	-17,110
8.00%	-23,265	-23,549	-23,903	-24,320	-24,793	-25,315	-25,881
KR4301N829 2018-08 풋292.5							8,723
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,602	-8,607	-8,617	-8,633	-8,656	-8,686	-8,723
-5.33%	-4,728	-4,780	-4,842	-4,916	-4,998	-5,089	-5,186
-2.67%	-1,432	-1,577	-1,725	-1,876	-2,027	-2,180	-2,334
0%	427	288	146	0	-148	-299	-451
2.67%	967	919	859	788	707	617	520
5.33%	1,038	1,032	1,020	1,001	975	942	900
8.00%	1,043	1,042	1,041	1,038	1,033	1,025	1,012
KR4301N829 2018-08 풋295							8,505
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,437	-8,439	-8,444	-8,452	-8,464	-8,482	-8,505
-5.33%	-4,910	-4,937	-4,973	-5,019	-5,074	-5,137	-5,207
-2.67%	-1,699	-1,807	-1,921	-2,039	-2,162	-2,287	-2,415
0%	431	288	144	0	-145	-290	-435
2.67%	1,216	1,148	1,069	981	886	784	677

5.33%	1,353	1,340	1,320	1,292	1,256	1,211	1,158
8.00%	1,364	1,363	1,360	1,355	1,347	1,334	1,316

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

(단위:백만원)

46,343

공시일	2018-07-23
기준일	2018-07-20

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

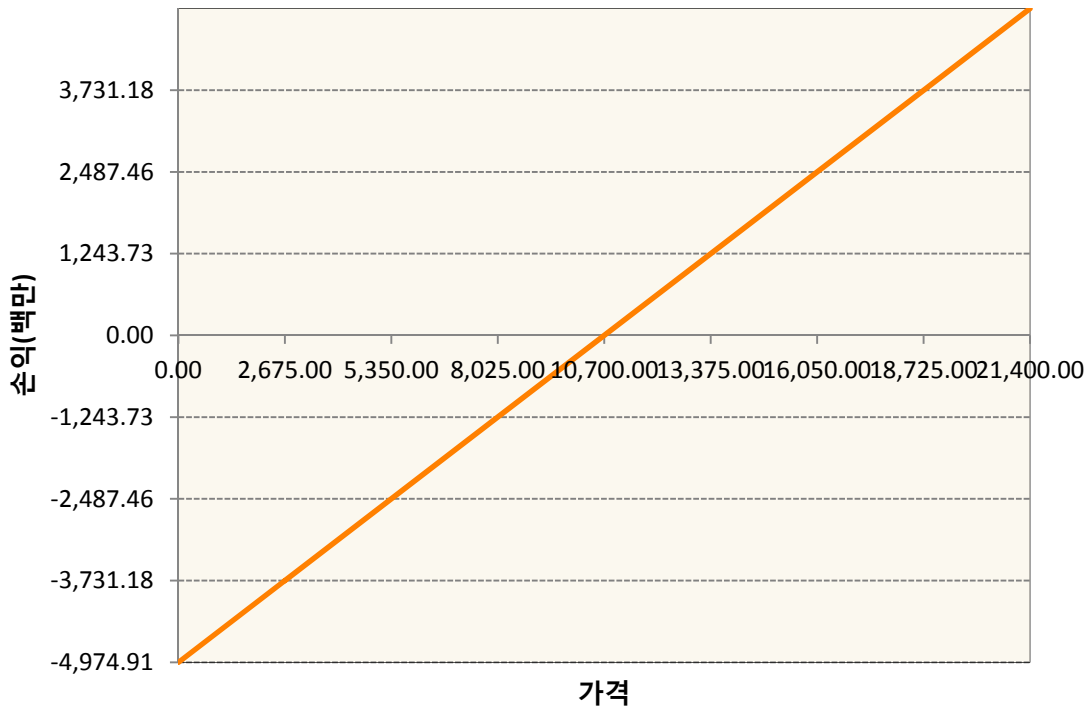
1. 계약금액

(단위:백만원)

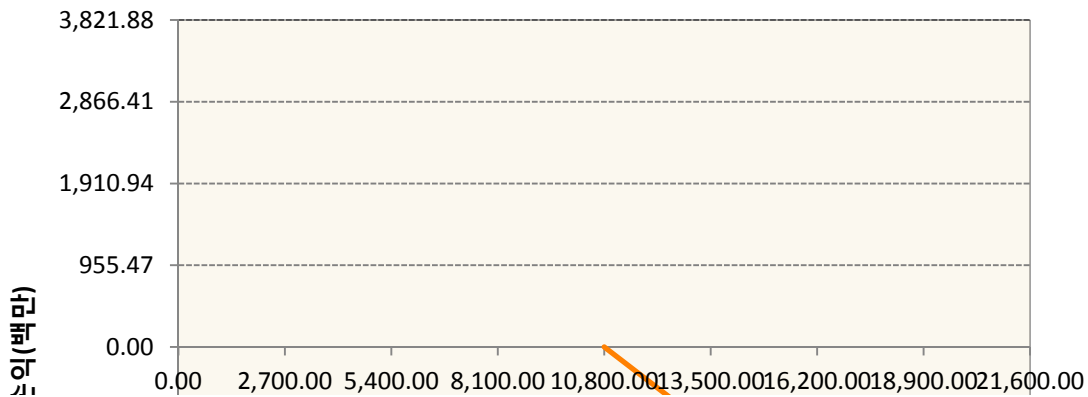
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,975	0	4,975	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,457	-11,457	장내

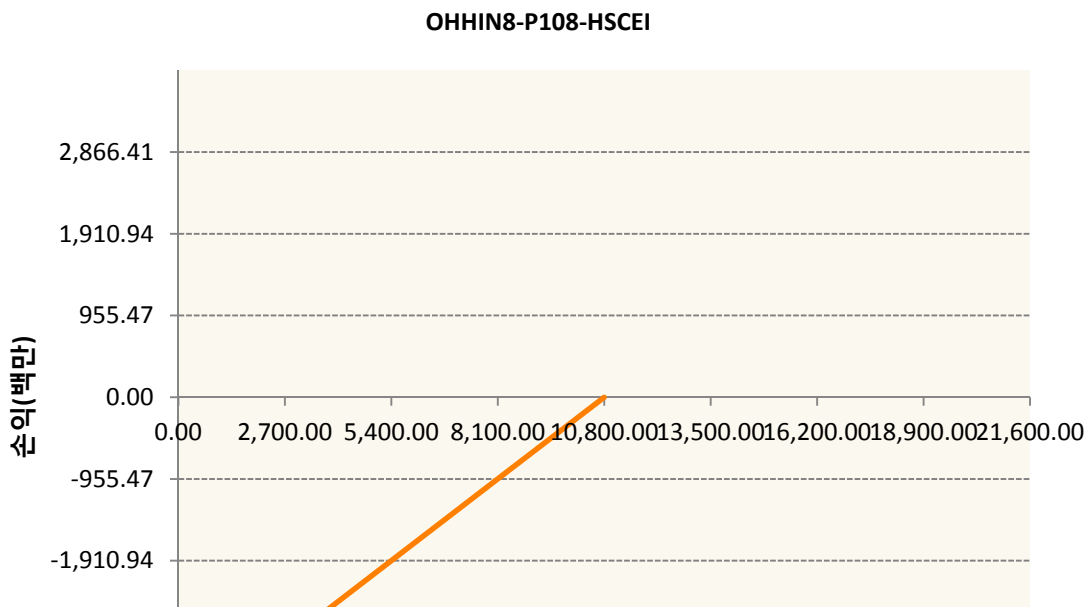
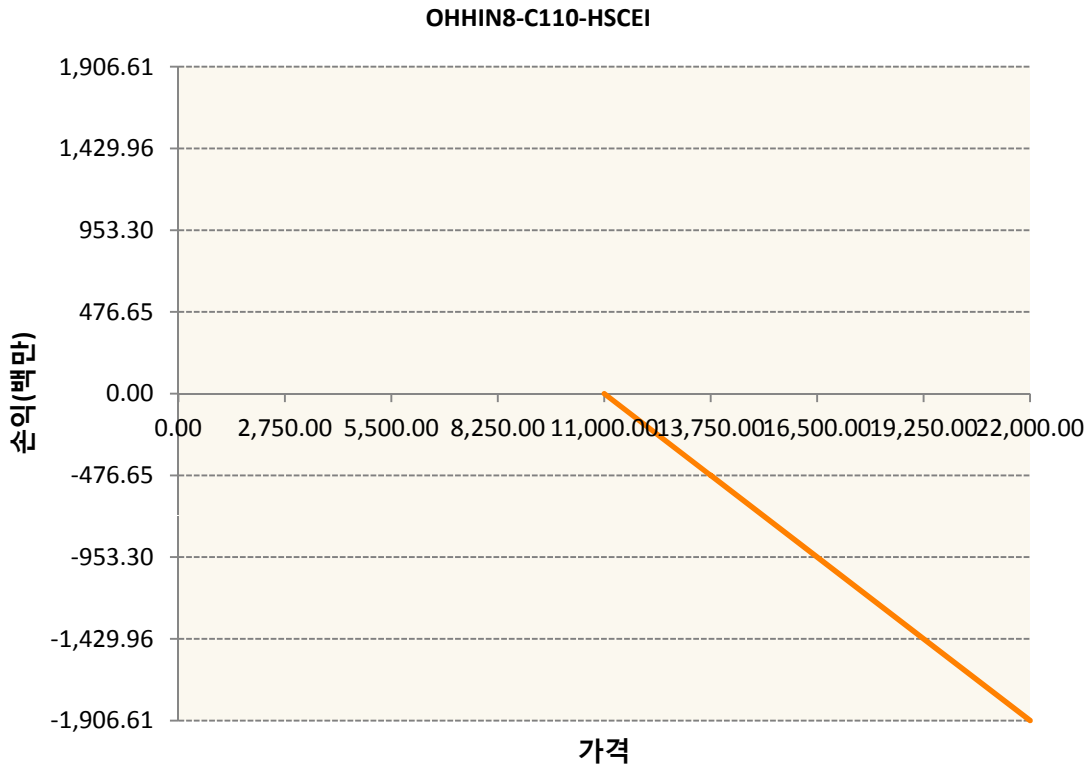
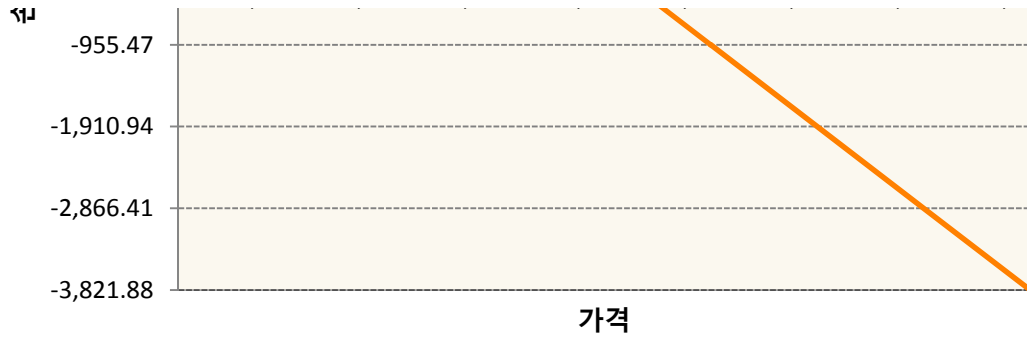
2. 만기시점의 손익구조

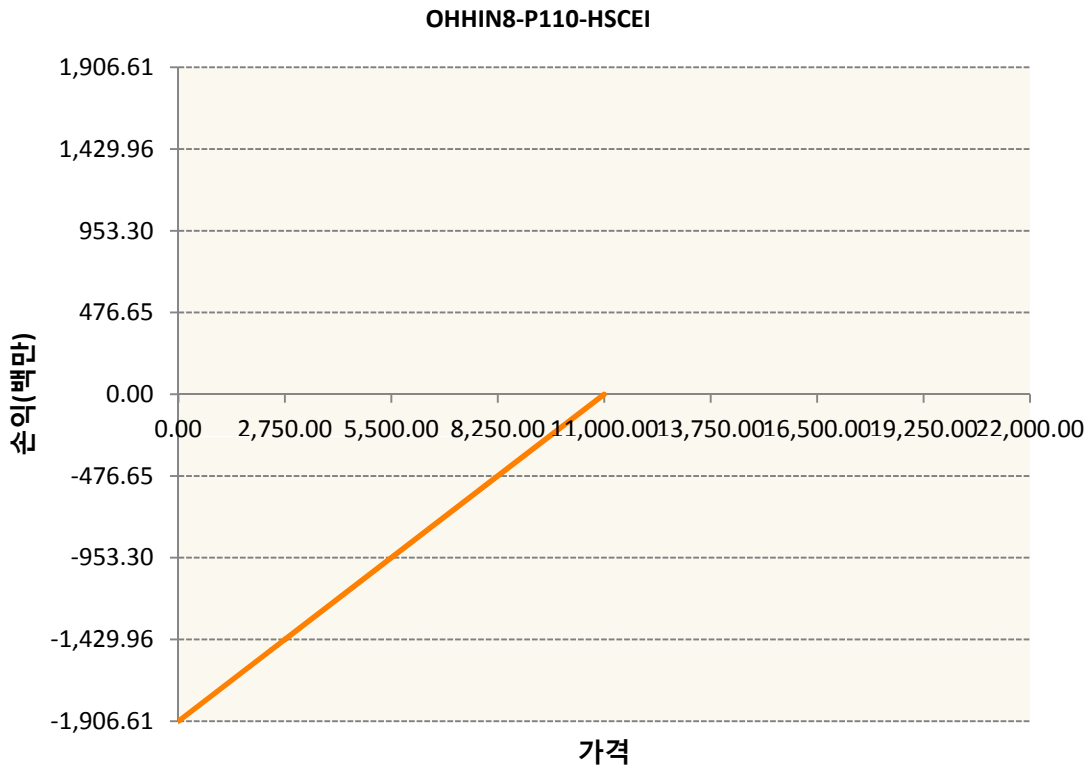
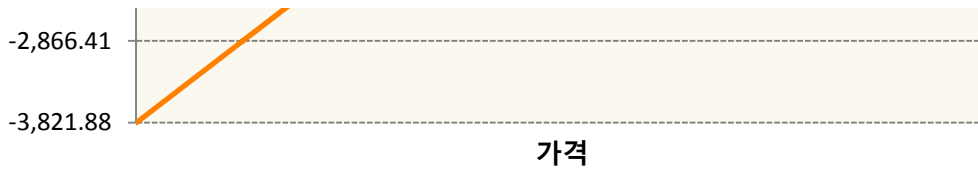
HCN8-HSCEI Futures Jul18



OHHIN8-C108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCN8	HSCEI Futures Jul18	398
OHHIN8-C1	(HSCEI	306
OHHIN8-C1	: HSCEI	153
OHHIN8-P1	(HSCEI	306
OHHIN8-P1	: HSCEI	153

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,193

공시일	2018-07-23
기준일	2018-07-20

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

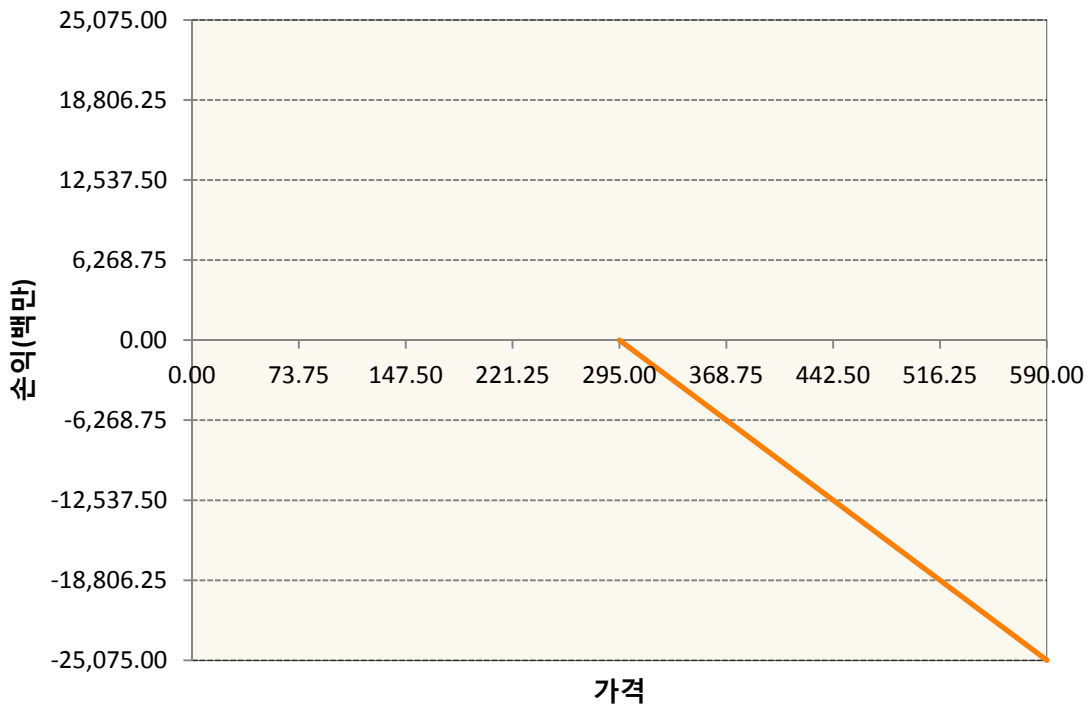
1. 계약금액

(단위:백만원)

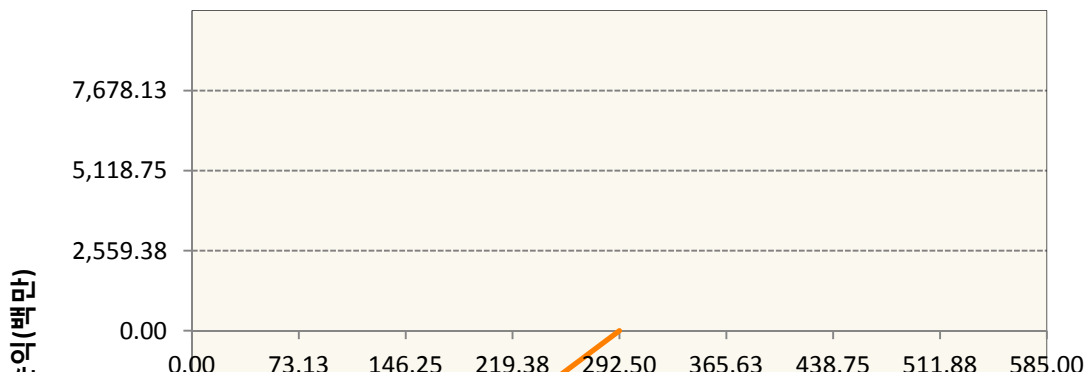
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	45,200	0	45,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	43,425	-43,425	장내

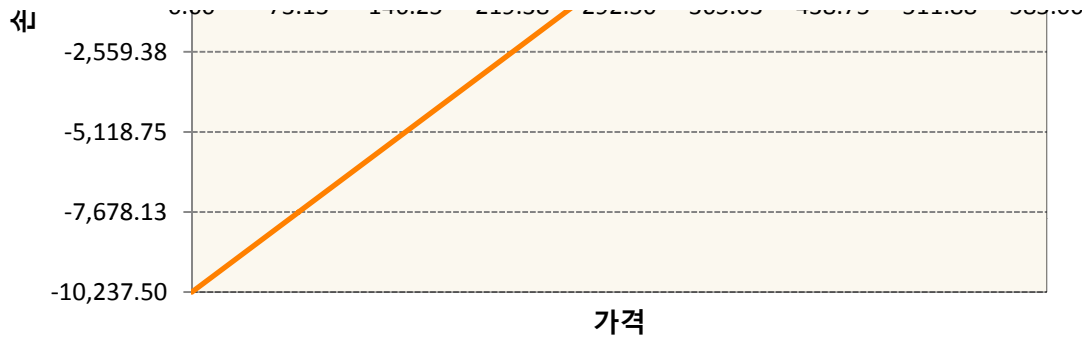
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N82951-2018-08 콜295

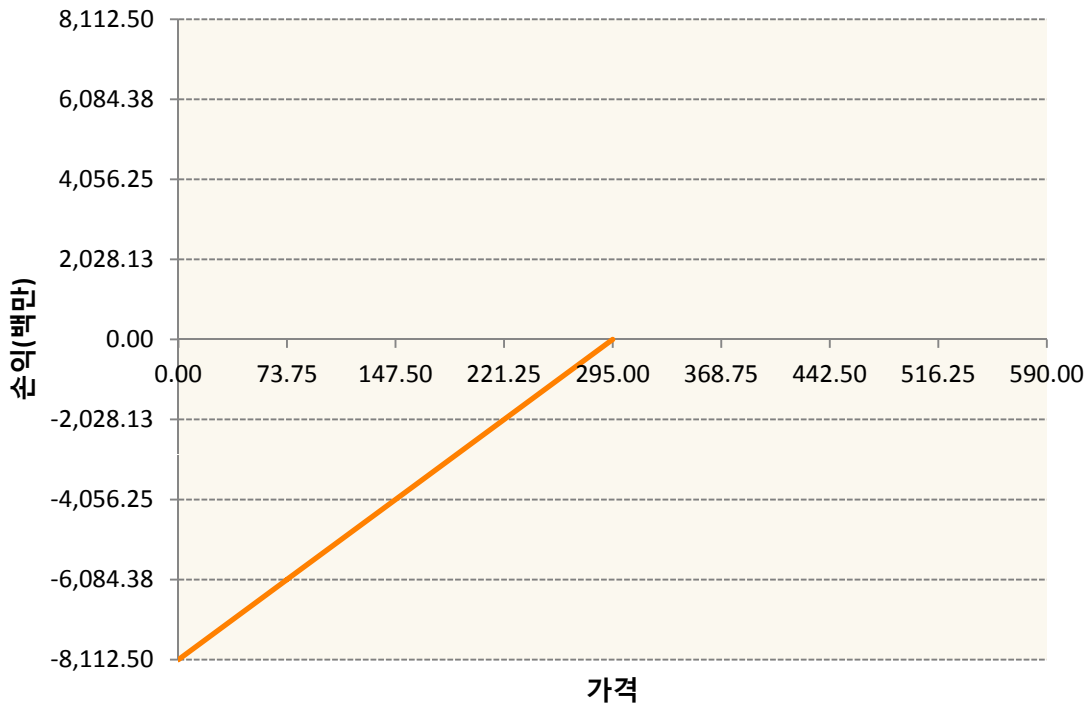


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





KR4301N82959-2018-08 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_2							1,505
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,505	-1,505	-1,505	-1,505	-1,505	-1,505	-1,505
-5.33%	-1,003	-1,003	-1,003	-1,003	-1,003	-1,003	-1,003
-2.67%	-502	-502	-502	-502	-502	-502	-502
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	502	502	502	502	502	502	502
5.33%	1,003	1,003	1,003	1,003	1,003	1,003	1,003
8.00%	1,505	1,505	1,505	1,505	1,505	1,505	1,505
2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_3							285
	기초자산의 변동성						

0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	163	163	163	163	163	163	163
5.33%	325	325	325	325	325	325	325
8.00%	488	488	488	488	488	488	488

KR4201N829 2018-08 콜295

1,606

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	732	712	689	662	631	599	563
-5.33%	652	616	576	534	490	445	398
-2.67%	477	425	372	318	265	211	156
0%	169	113	56	0	-57	-113	-170
2.67%	-274	-322	-371	-422	-473	-526	-579
5.33%	-825	-857	-893	-932	-973	-1,017	-1,062
8.00%	-1,444	-1,462	-1,484	-1,509	-1,539	-1,571	-1,606

KR4301N829 2018-08 풋292.5

611

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-602	-603	-603	-604	-606	-608	-611
-5.33%	-331	-335	-339	-344	-350	-356	-363
-2.67%	-100	-110	-121	-131	-142	-153	-163
0%	30	20	10	0	-10	-21	-32
2.67%	68	64	60	55	49	43	36
5.33%	73	72	71	70	68	66	63
8.00%	73	73	73	73	72	72	71

KR4301N829 2018-08 풋295

520

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-516	-516	-516	-517	-517	-518	-520
-5.33%	-300	-302	-304	-307	-310	-314	-318
-2.67%	-104	-110	-117	-125	-132	-140	-148
0%	26	18	9	0	-9	-18	-27
2.67%	74	70	65	60	54	48	41
5.33%	83	82	81	79	77	74	71
8.00%	83	83	83	83	82	82	80

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

(단위:백만원)

6,431

공시일	2018-07-23
기준일	2018-07-20

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

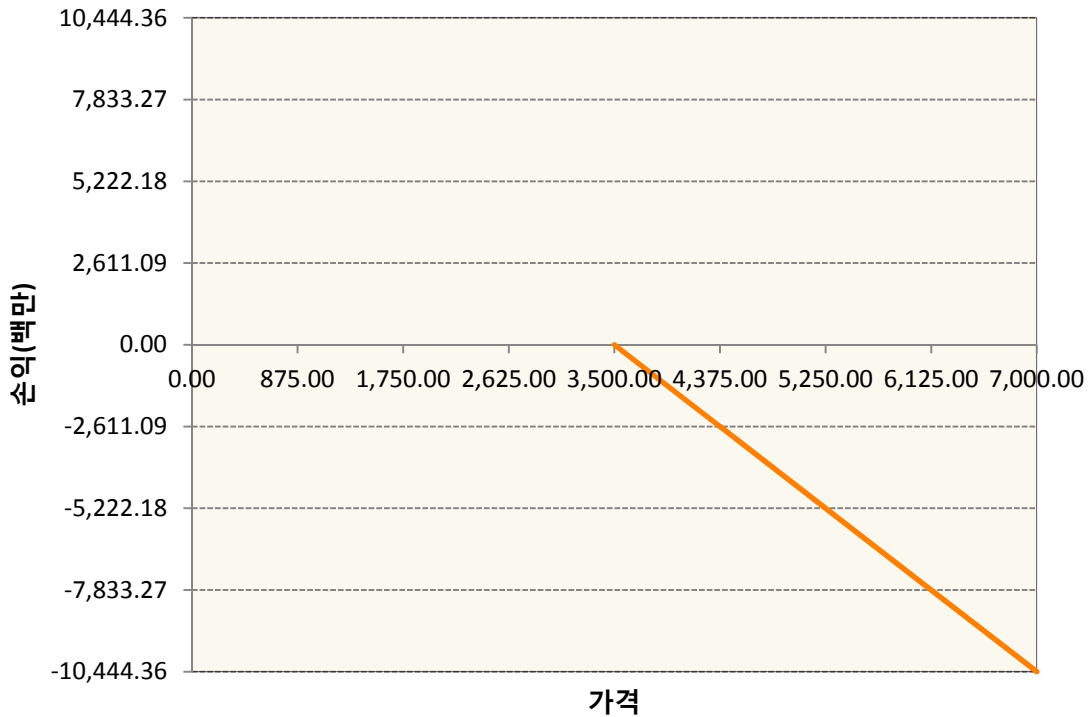
1. 계약금액

(단위:백만원)

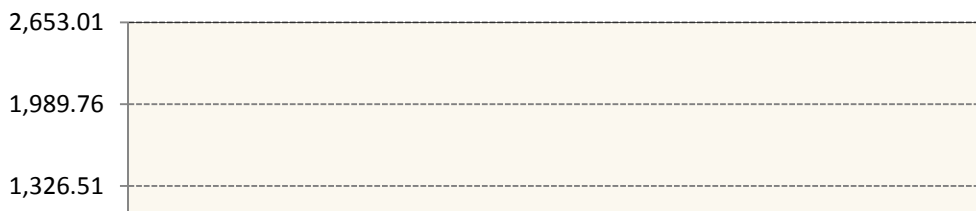
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,581	0	5,581	
누계	유가증권	스왑	45,107	0	45,107	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,195	-26,195	장내
누계	지수	스왑	52,818	0	52,818	장외

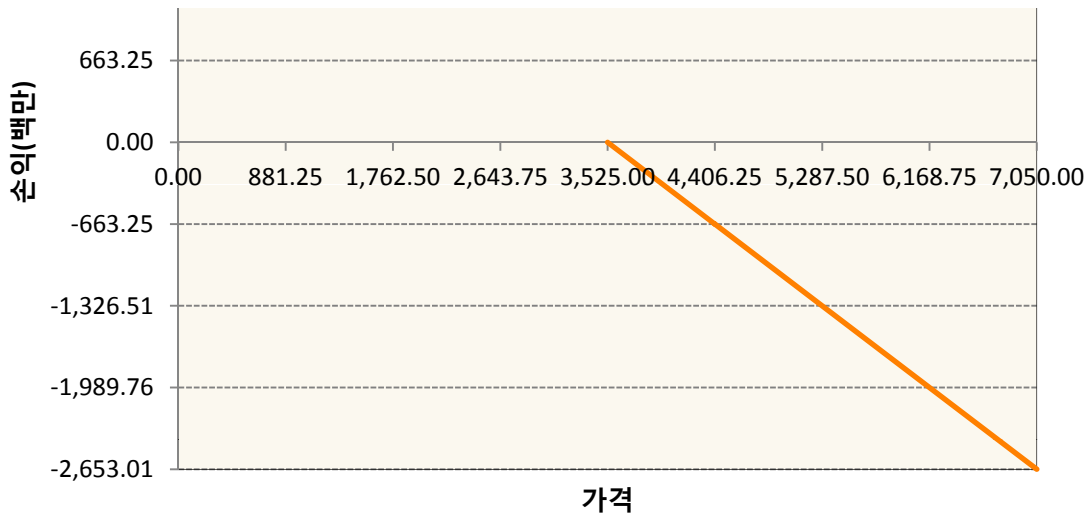
2. 만기시점의 손익구조

OESXN8-C3500-EURO STOXX 50

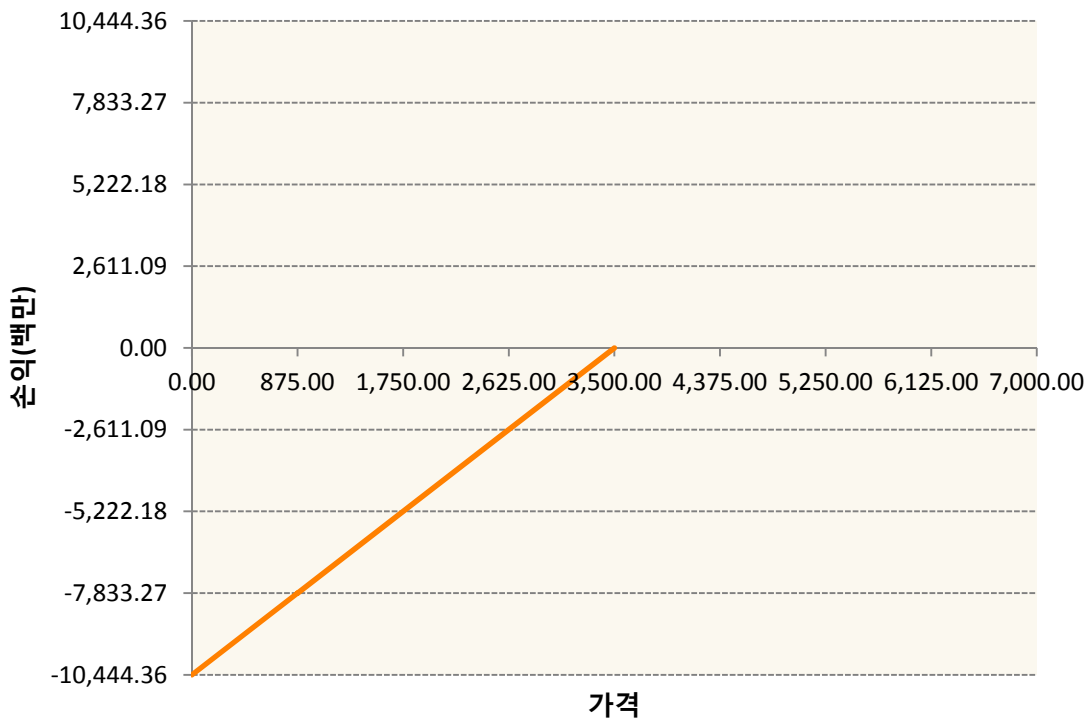


OESXN8-C3525-EURO STOXX 50

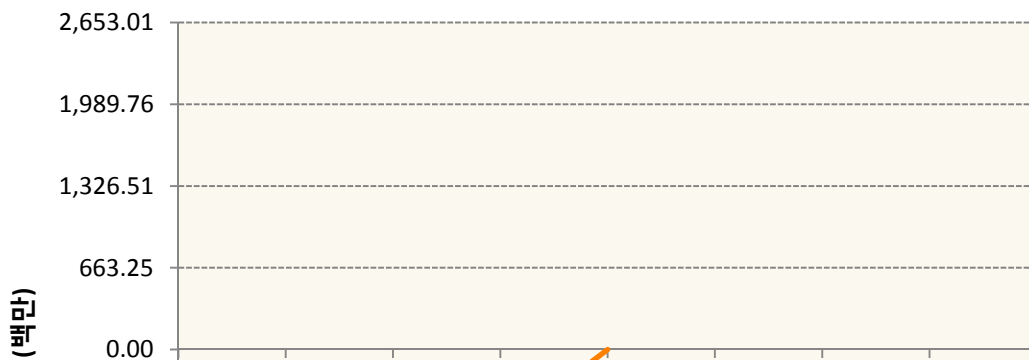


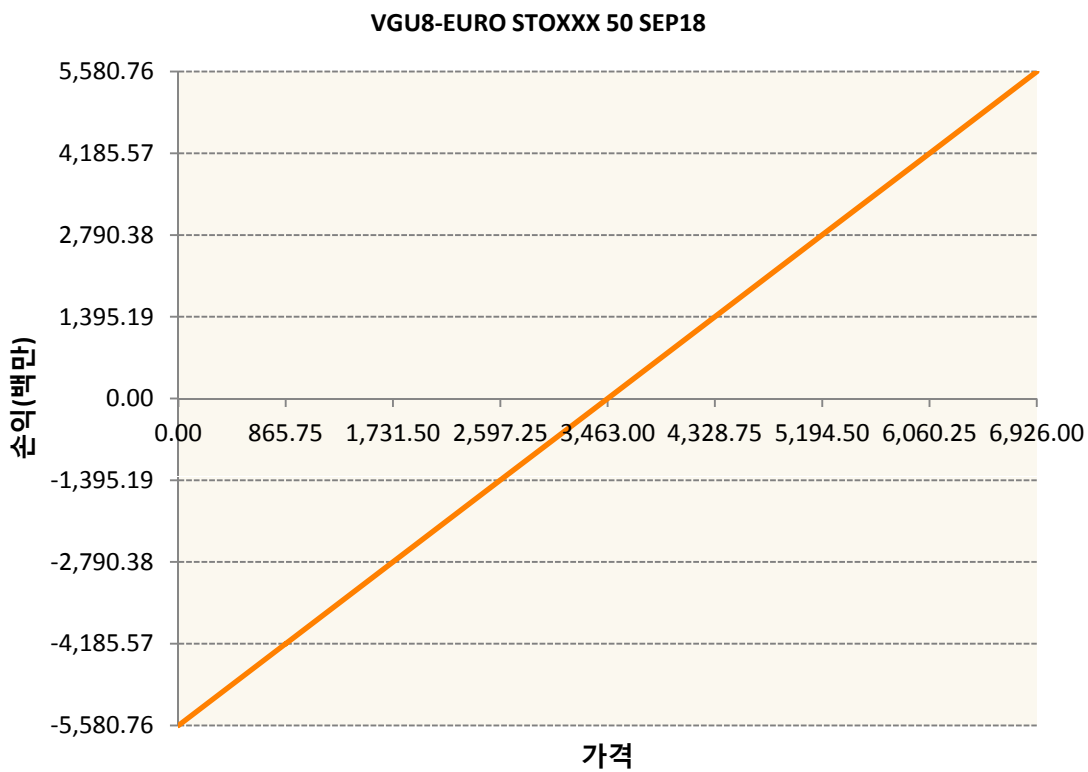
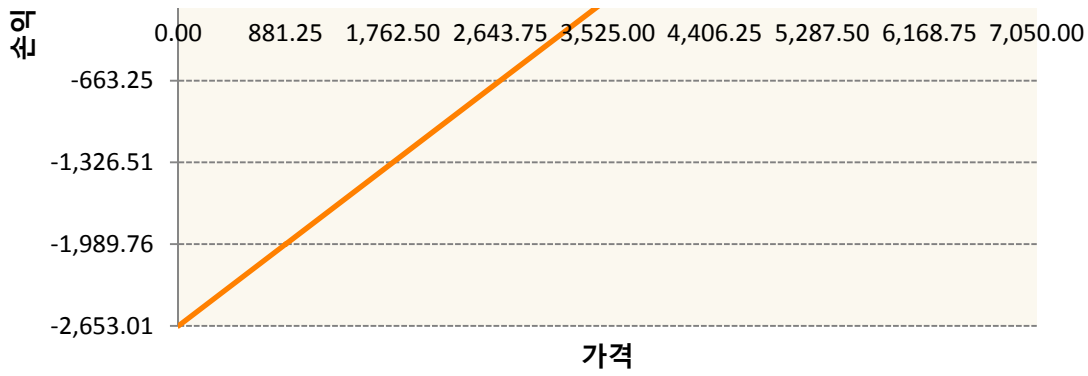


OESXN8-P3500-EURO STOXX 50



OESXN8-P3525-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		57
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		49
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		446

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

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

(단위:백만원)

1,146

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)

173

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

(단위:백만원)

41

공시일	2018-07-23
기준일	2018-07-20

리디파인K200(주식혼합-파생재간

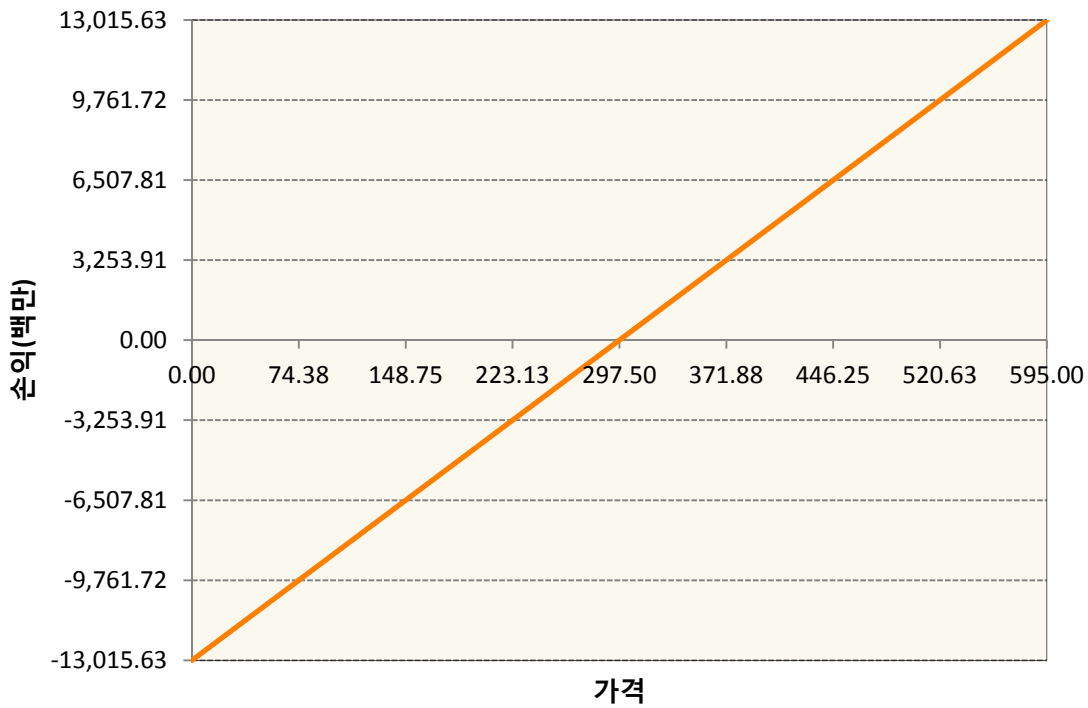
1. 계약금액

(단위:백만원)

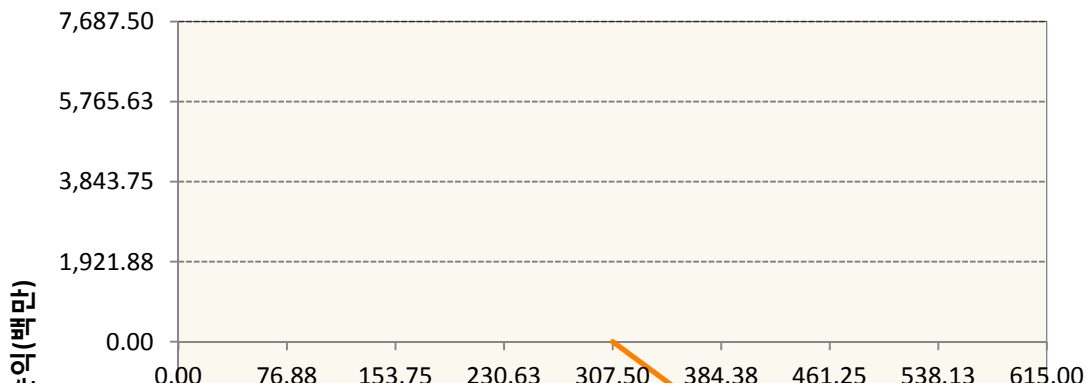
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,016	0	13,016	장내
누계	유가증권	옵션	2,134	23,653	-21,518	장내

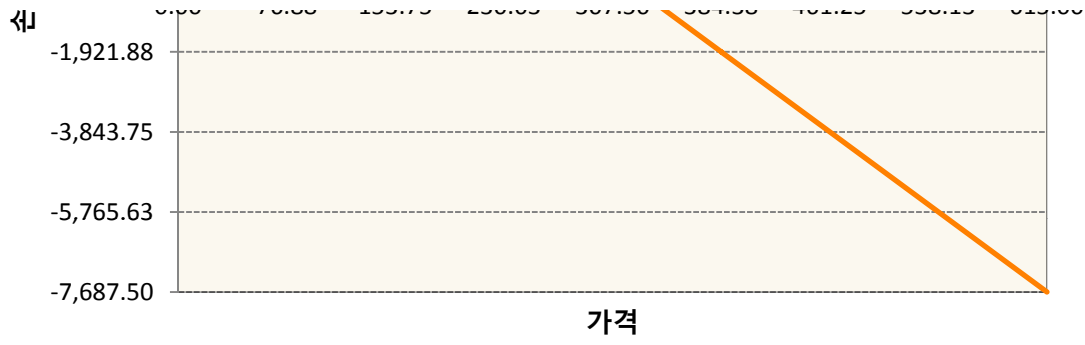
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

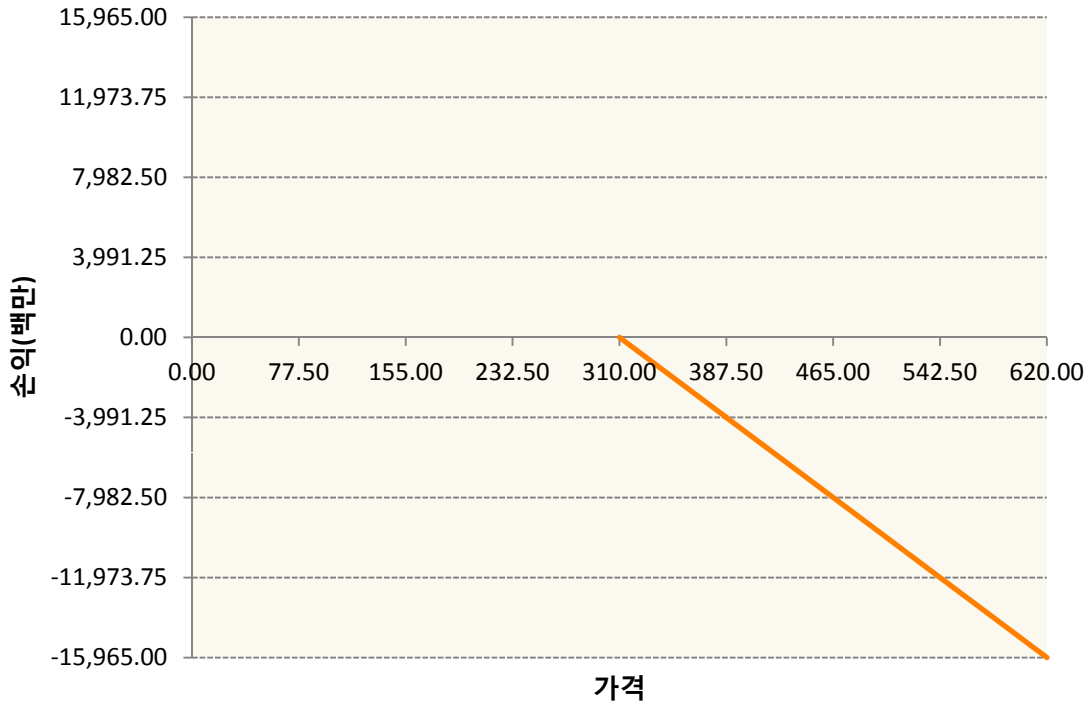


KR4201N83074-2018-08 콜307.5

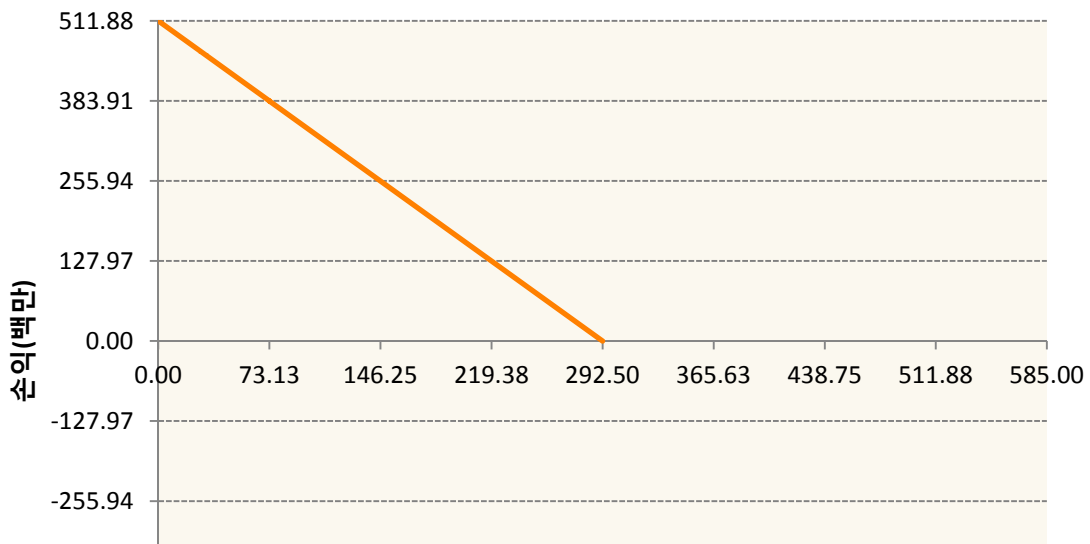


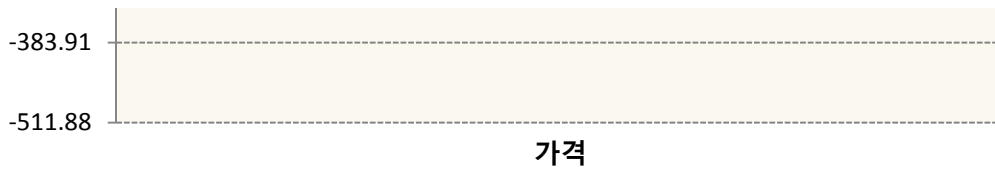


KR4201N83108-2018-08 콜310

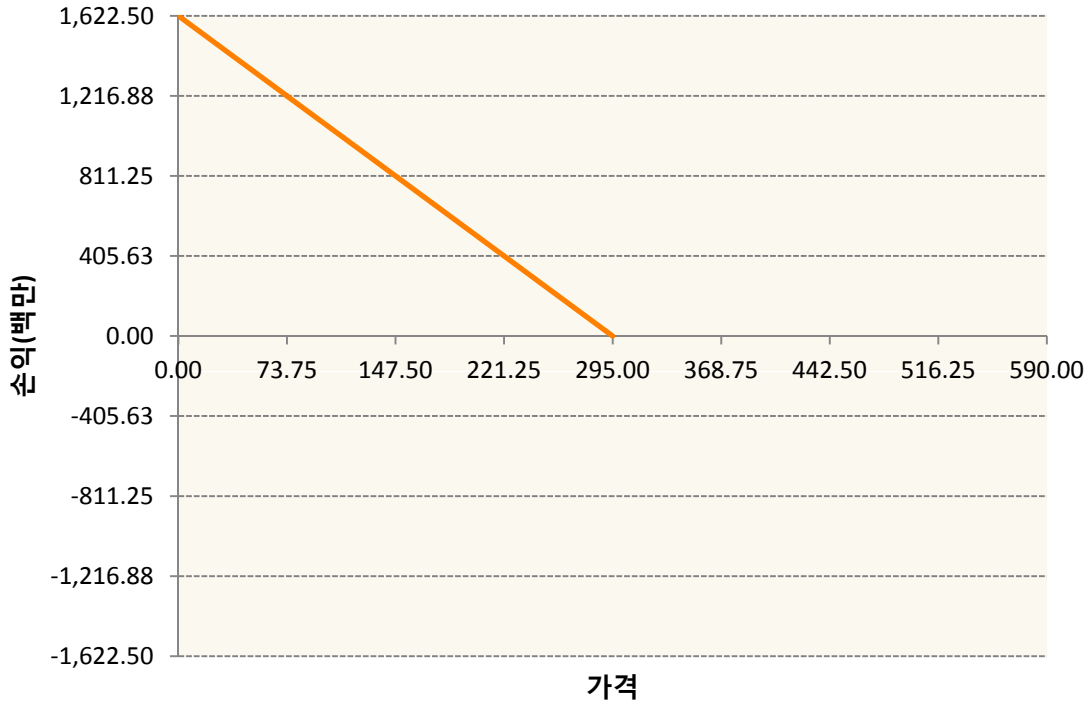


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





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 콜307.5 363

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	98	97	94	91	87	82	76
-5.33%	93	89	84	78	70	62	53
-2.67%	79	70	60	50	38	26	13

0%	43	29	15	0	-15	-30	-46
2.67%	-26	-43	-60	-77	-94	-111	-128
5.33%	-133	-150	-166	-183	-200	-217	-234
8.00%	-277	-290	-303	-318	-333	-348	-363

KR4201N8312018-08 콜310

699

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	168	166	162	157	150	142	131
-5.33%	161	155	146	135	122	107	90
-2.67%	139	124	107	87	66	43	19
0%	81	55	28	0	-29	-59	-90
2.67%	-37	-71	-106	-140	-175	-210	-245
5.33%	-233	-269	-304	-340	-376	-412	-448
8.00%	-506	-536	-568	-600	-632	-665	-699

KR4301N829 2018-08 풋292.5

31

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	30	30	30	30	30	30	31
-5.33%	17	17	17	17	17	18	18
-2.67%	5	6	6	7	7	8	8
0%	-1	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-3	-3	-3	-3	-2	-2	-2
5.33%	-4	-4	-4	-4	-3	-3	-3
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4

KR4301N829 2018-08 풋295

104

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	103	103	103	103	103	104	104
-5.33%	60	60	61	61	62	63	64
-2.67%	21	22	23	25	26	28	30
0%	-5	-4	-2	0	2	4	5
2.67%	-15	-14	-13	-12	-11	-10	-8
5.33%	-17	-16	-16	-16	-15	-15	-14
8.00%	-17	-17	-17	-17	-16	-16	-16

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

(단위:백만원)

1,753

공시일	2018-07-23
기준일	2018-07-20

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

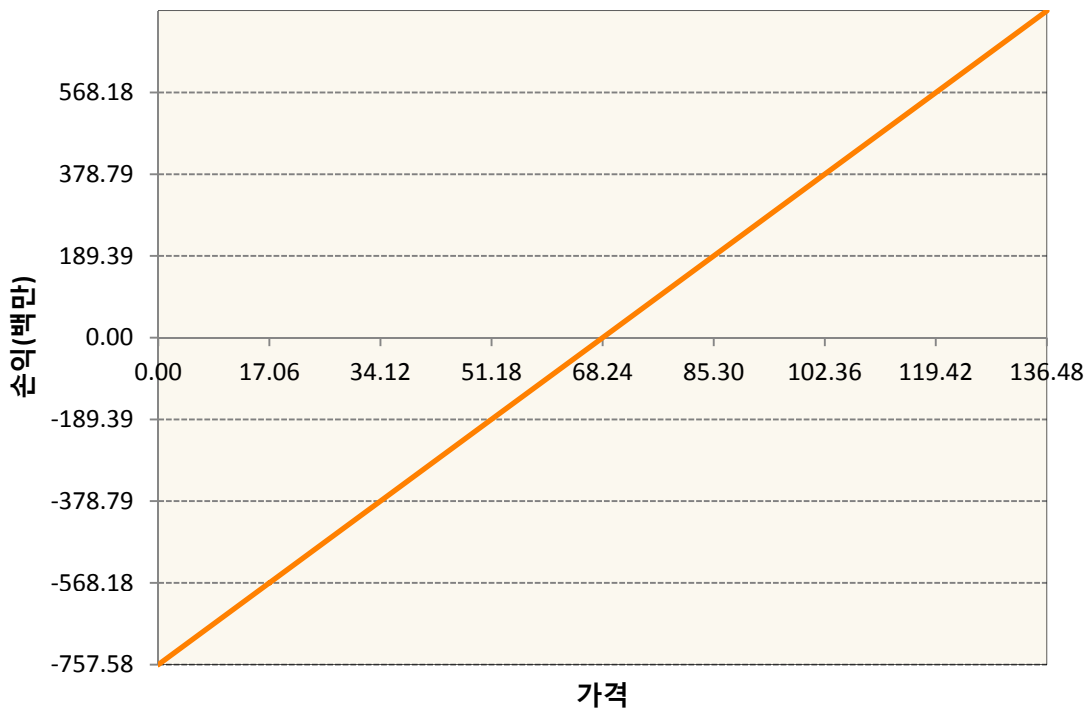
1. 계약금액

(단위:백만원)

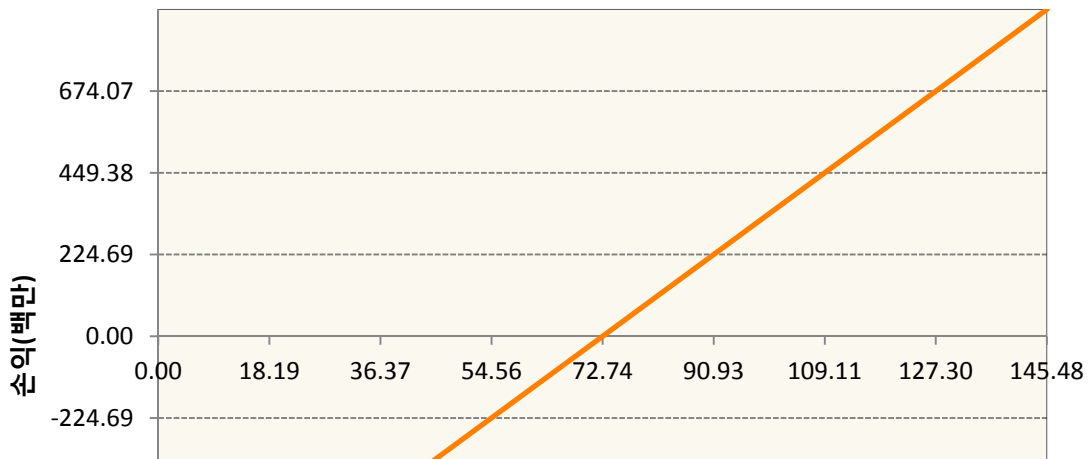
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,582	624	2,959	

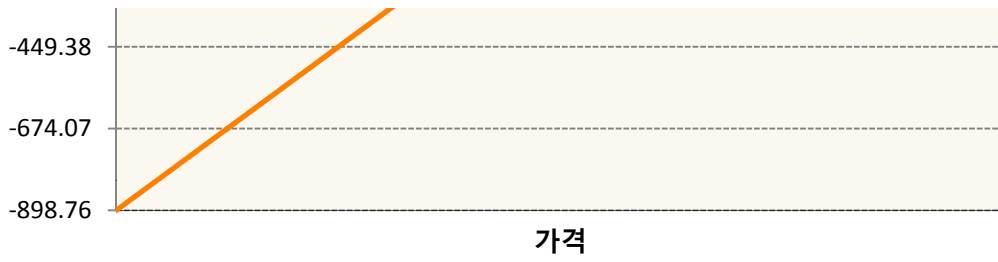
2. 만기시점의 손익구조

CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18

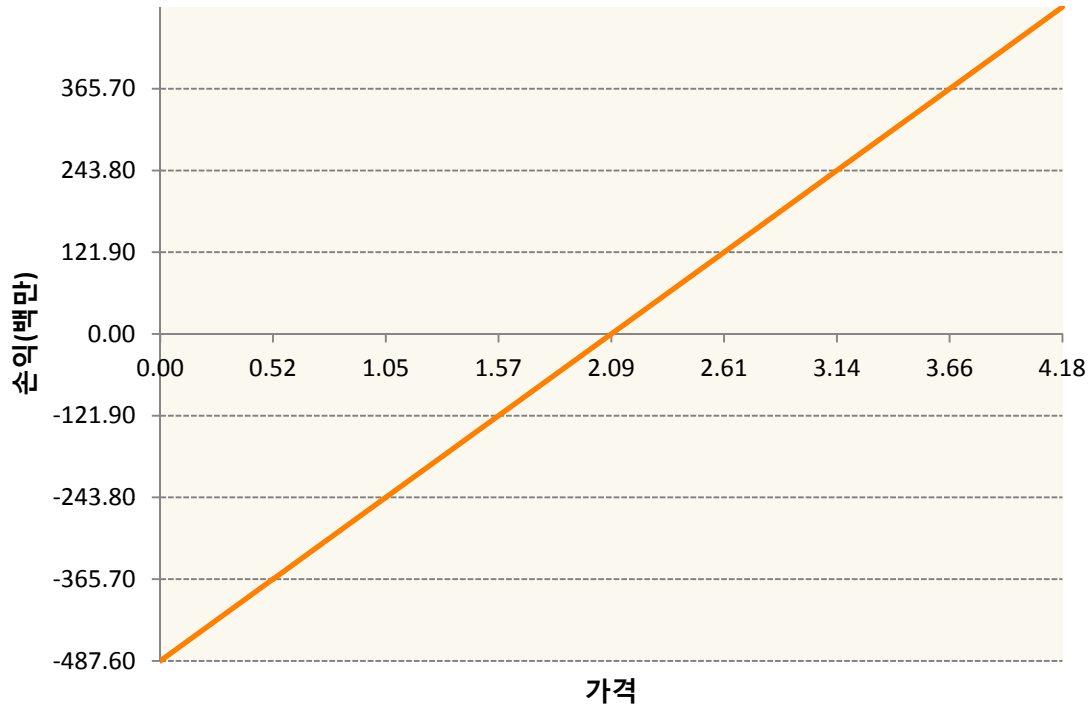


COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18

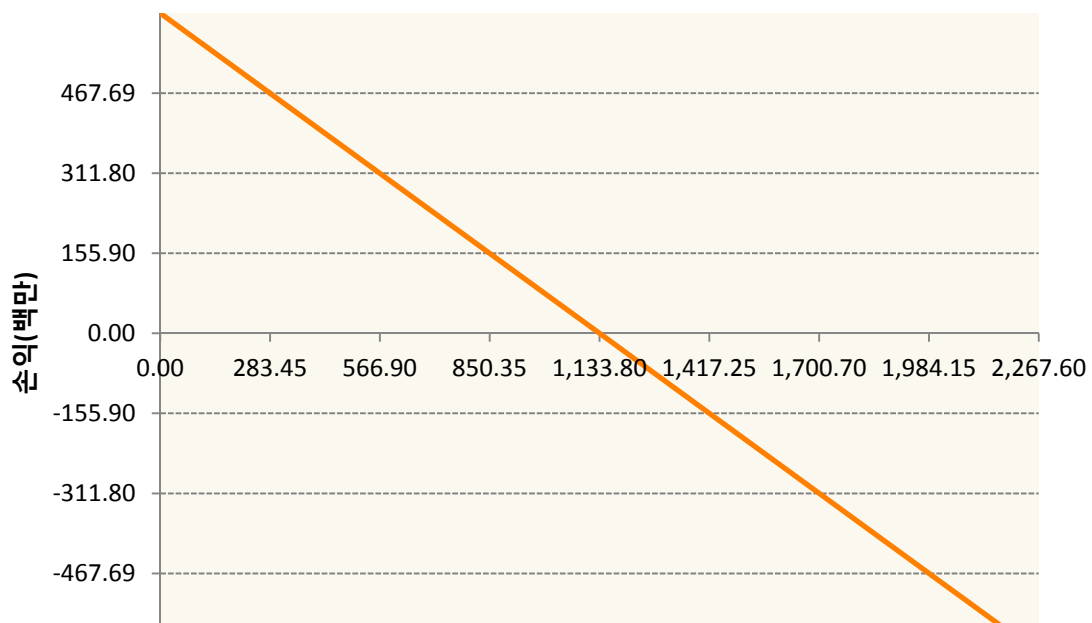


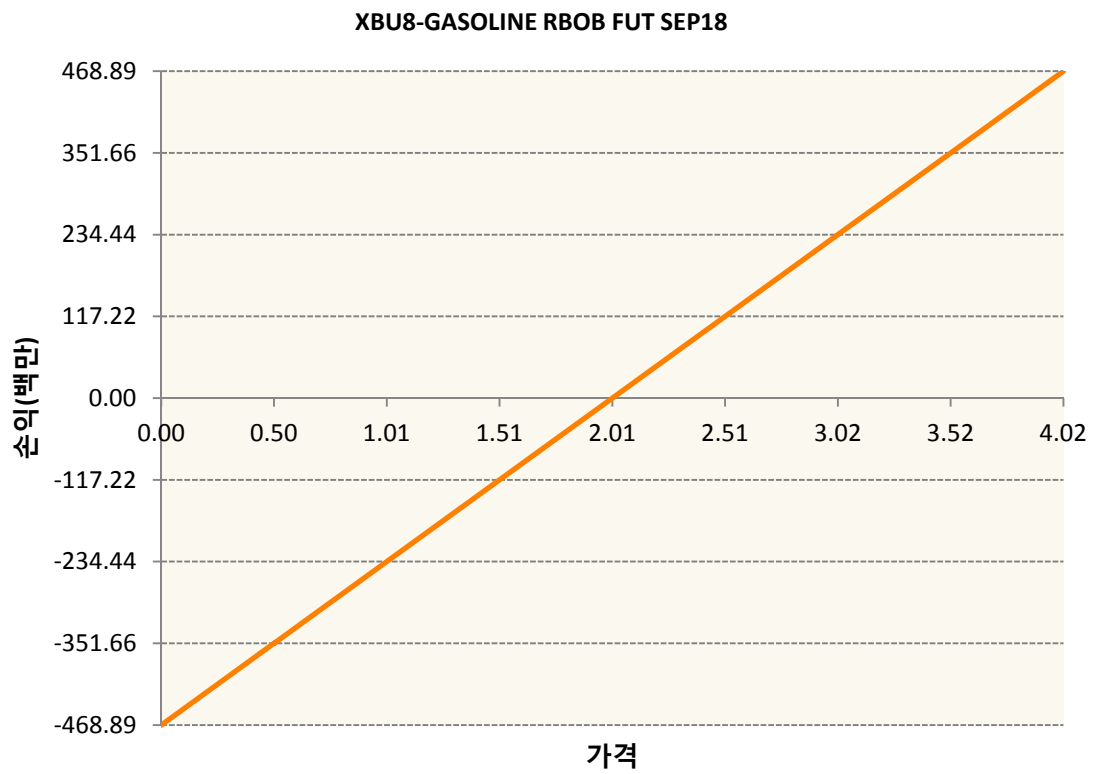
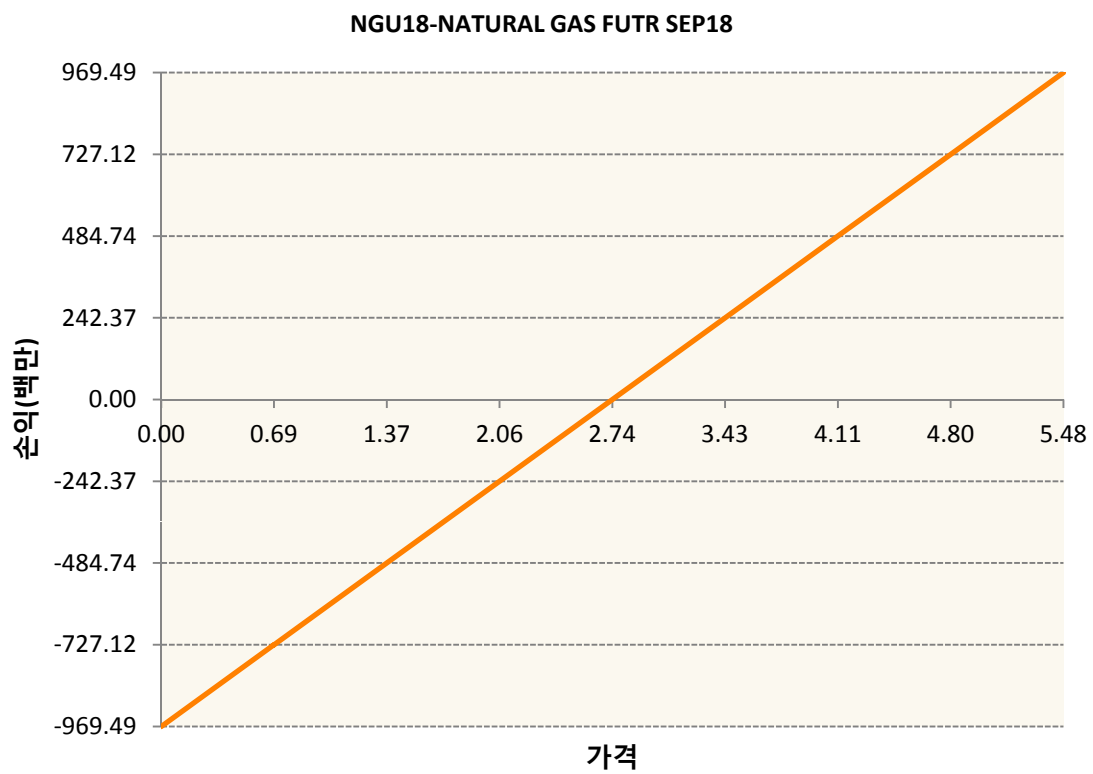
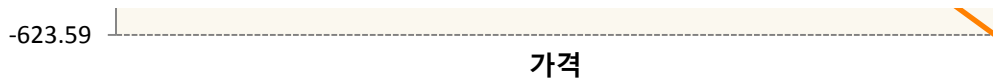


HOU8-NY Harb ULSD Fut SEP18



KR4175N80001-2018-08 달러선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU8	WTI CRUDE FUTURE SEP18	61
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	72
HOU8	NY Harb ULSD Fut SEP18	39
KR4175N80C	2018-08 달러선물	50
NGU18	NATURAL GAS FUTR SEP18	78
XBU8	GASOLINE RBOB FUT SEP18	38

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

423

공시일	2018-07-23
기준일	2018-07-20

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

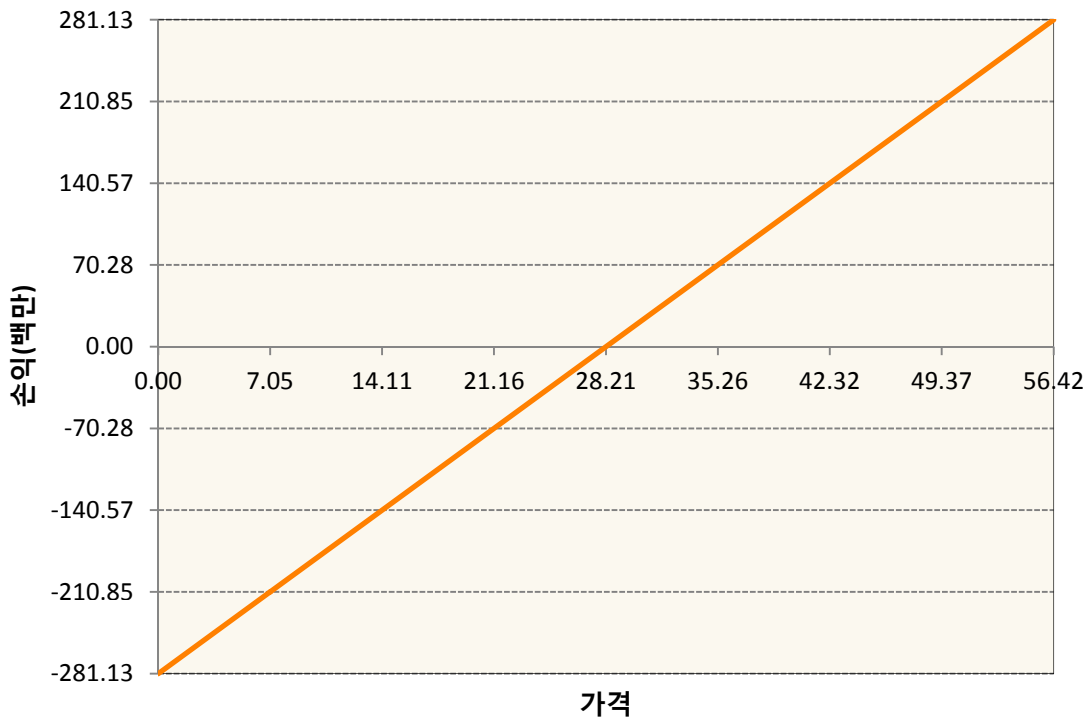
1. 계약금액

(단위:백만원)

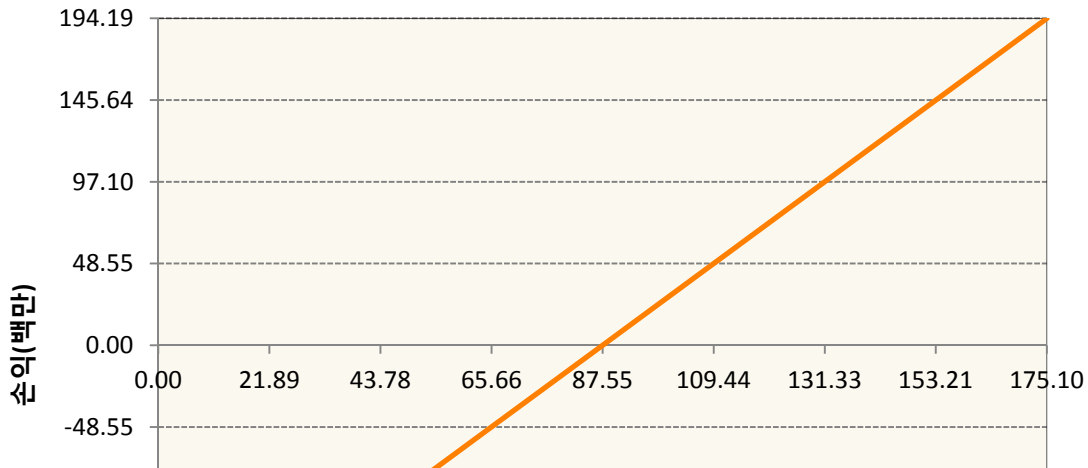
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,575	79	3,496	

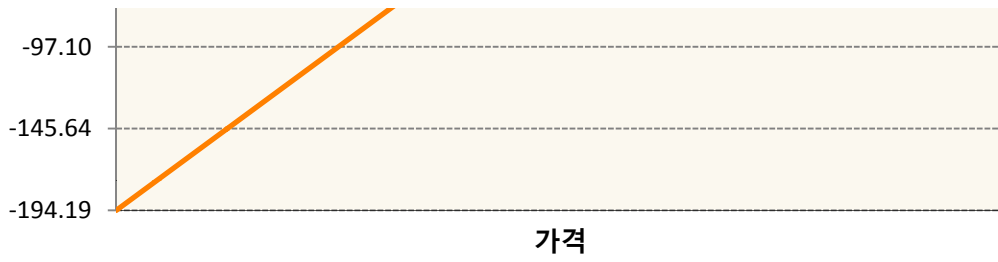
2. 만기시점의 손익구조

BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18

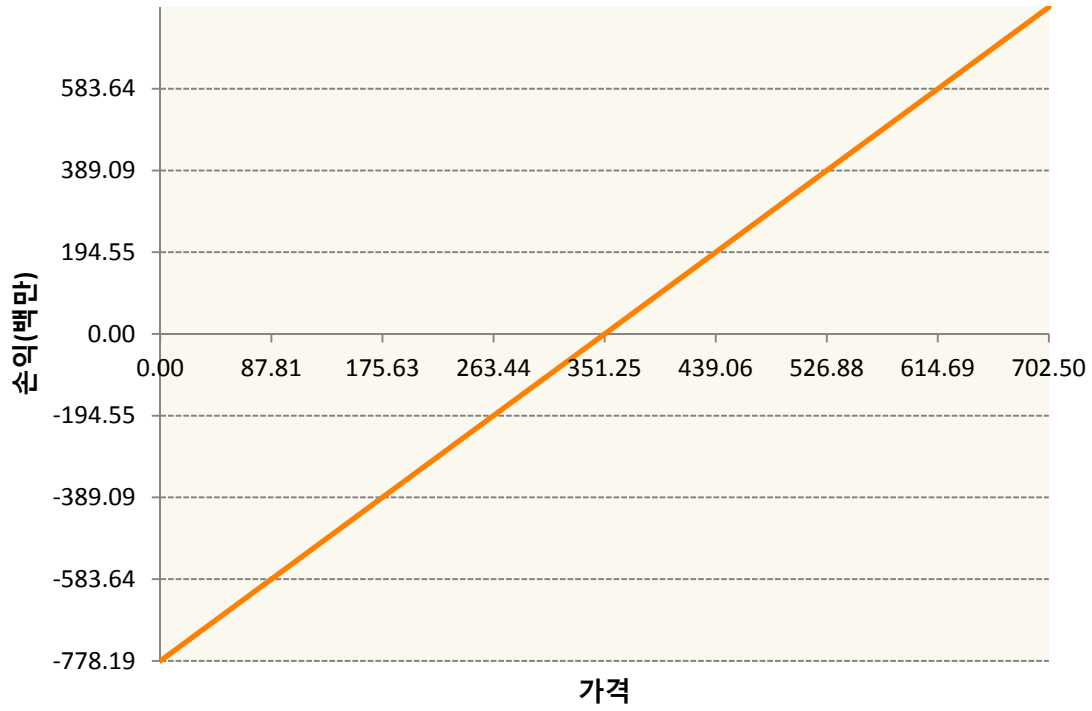


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

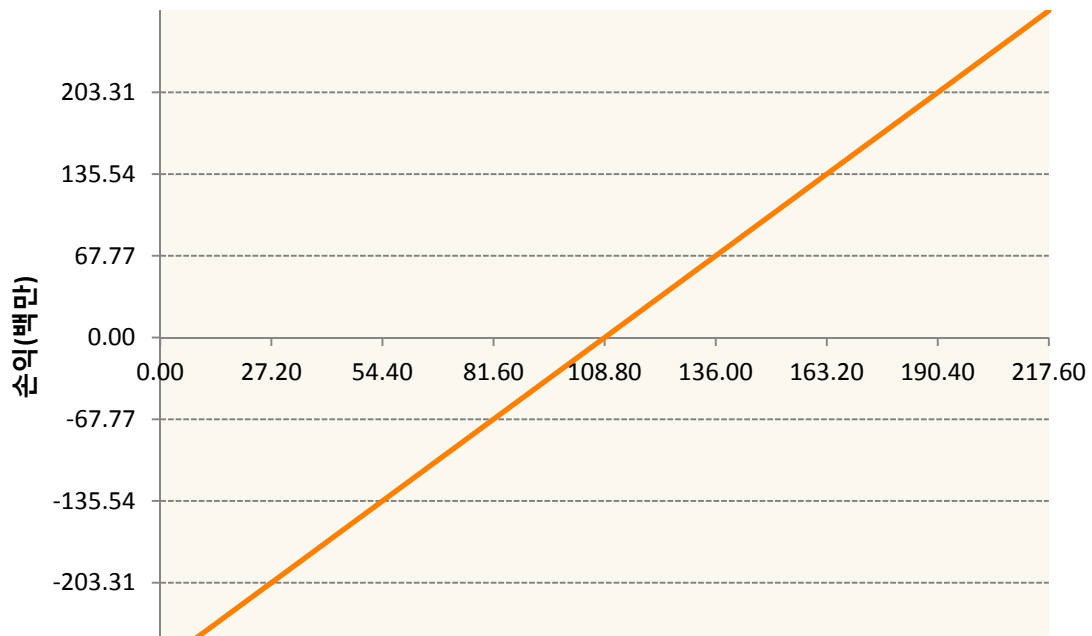


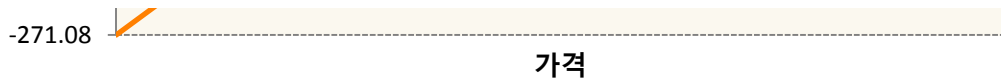


CU8-CORN FUTURE SEP18

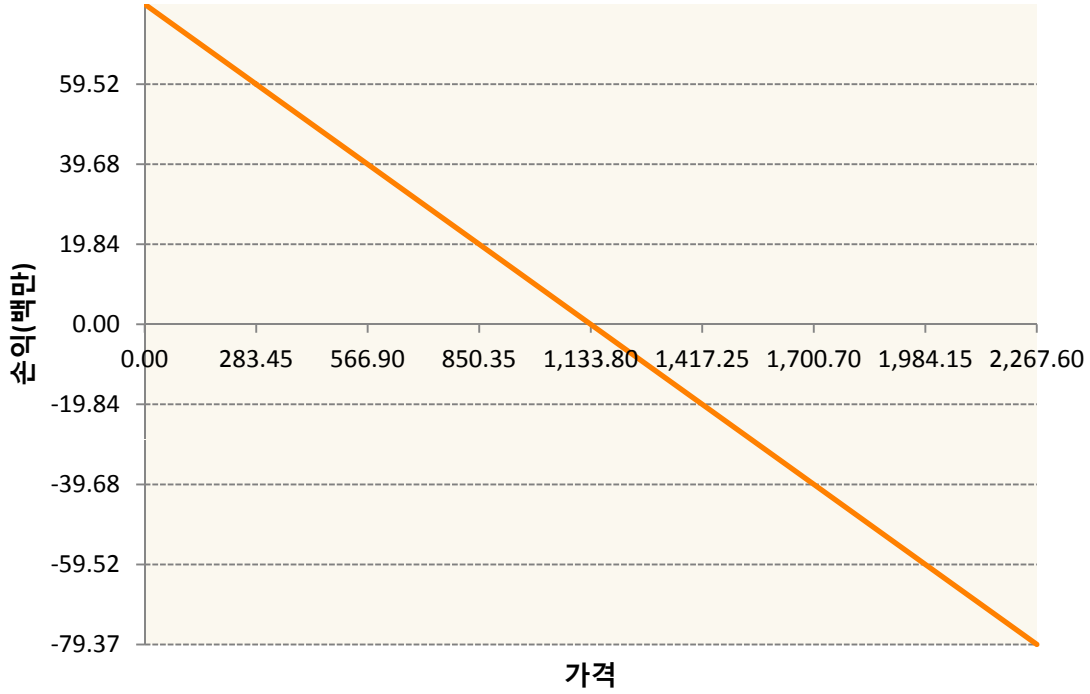


KCU8-COFFEE 'C' FUTURE SEP18

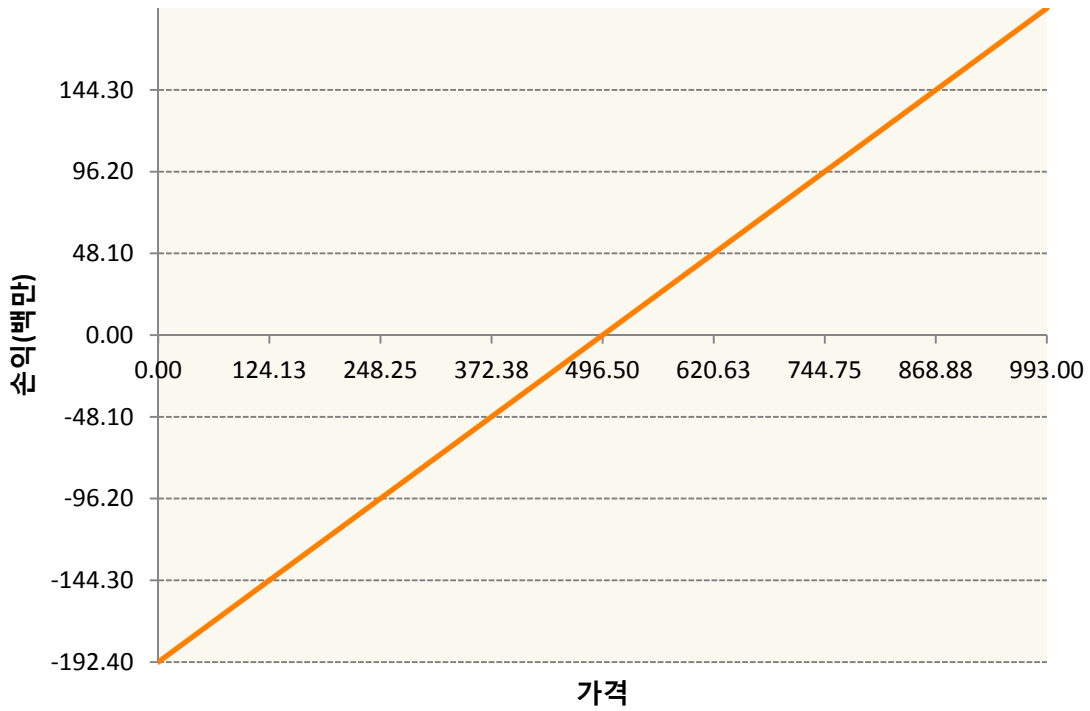




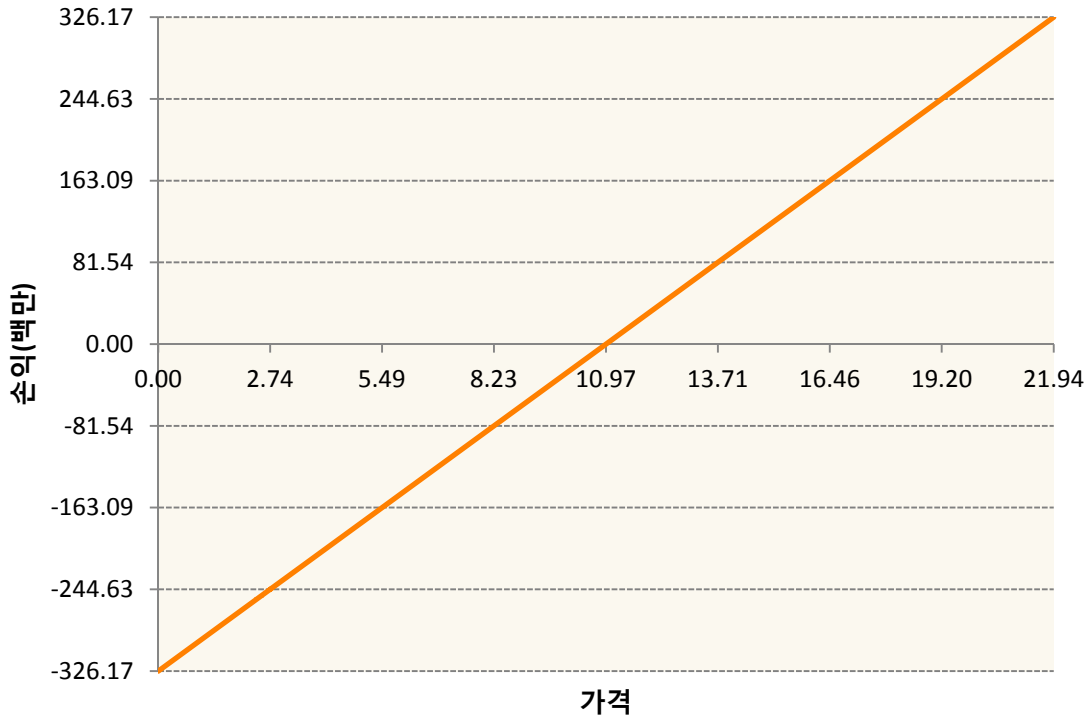
KR4175N80001-2018-08 달러선물



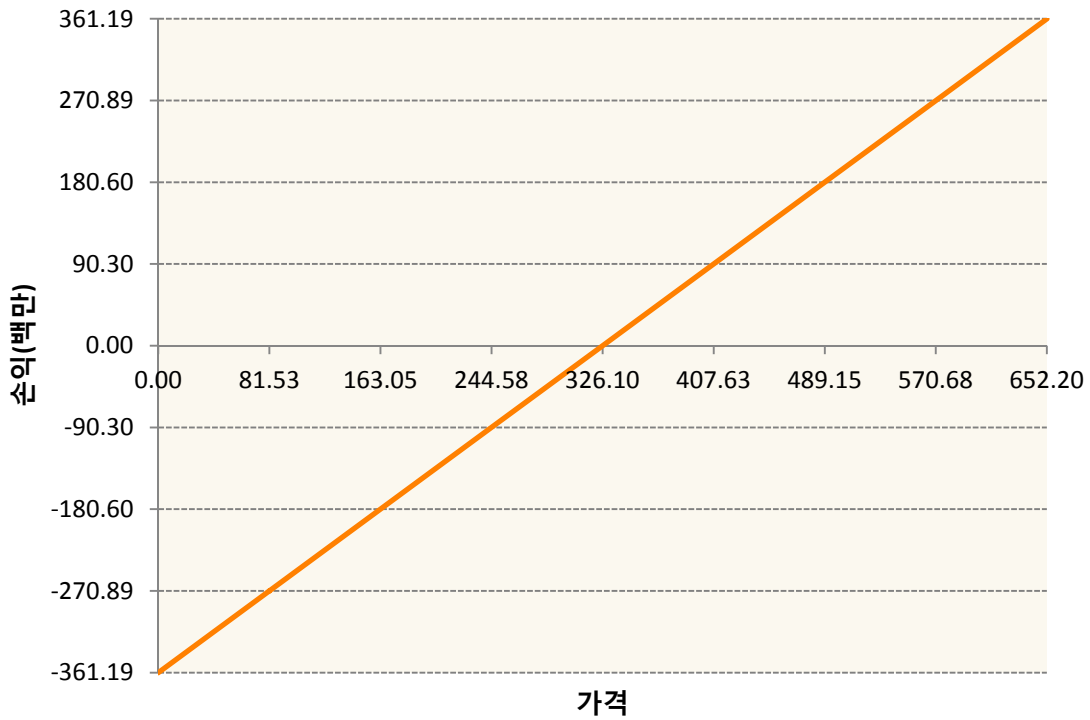
KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

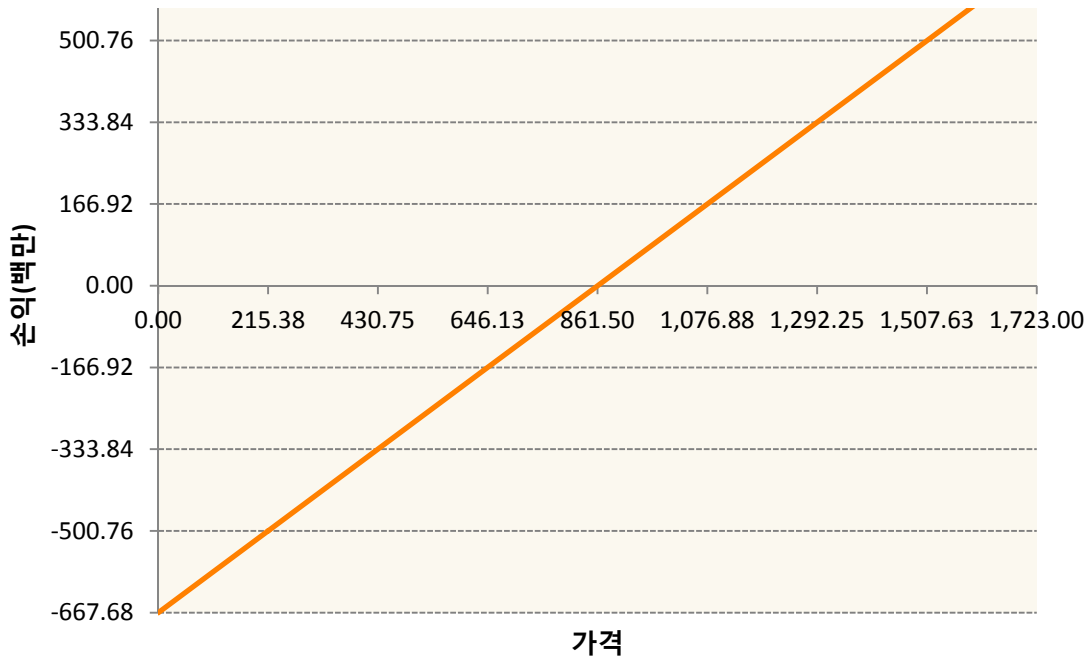


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

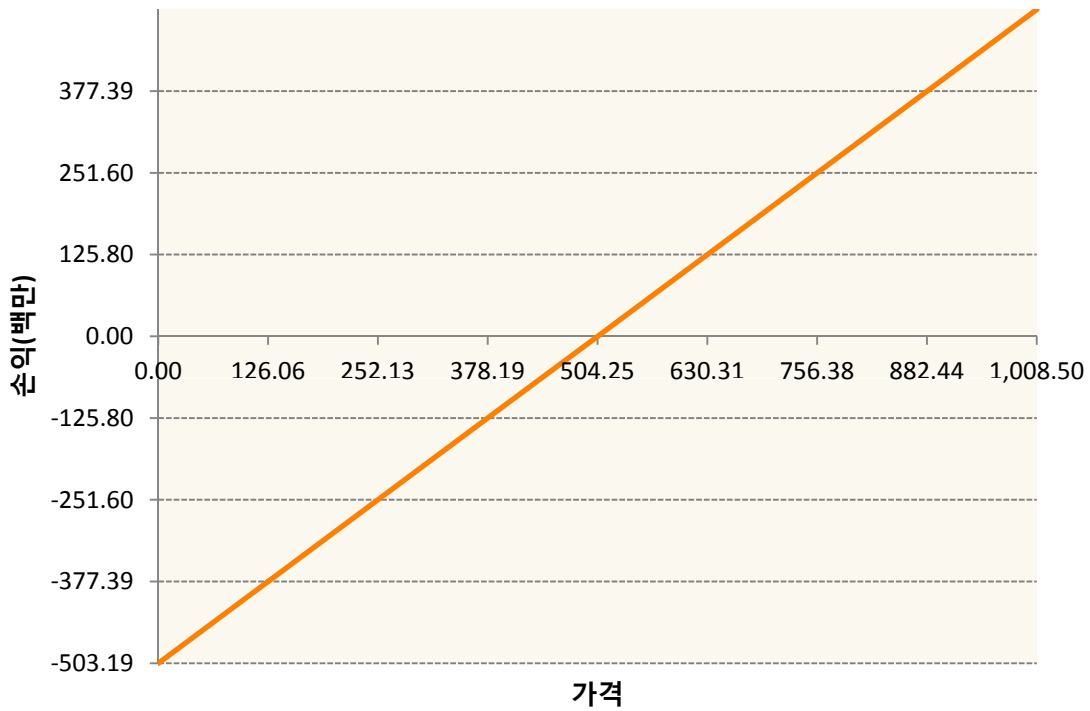


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





WU8-WHEAT FUTURE(CBT) SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	22
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	40

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

(단위:백만원)

300