

공시일	2018-07-24
기준일	2018-07-23

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	2018-07-24
기준일	2018-07-23

스마트인덱스모

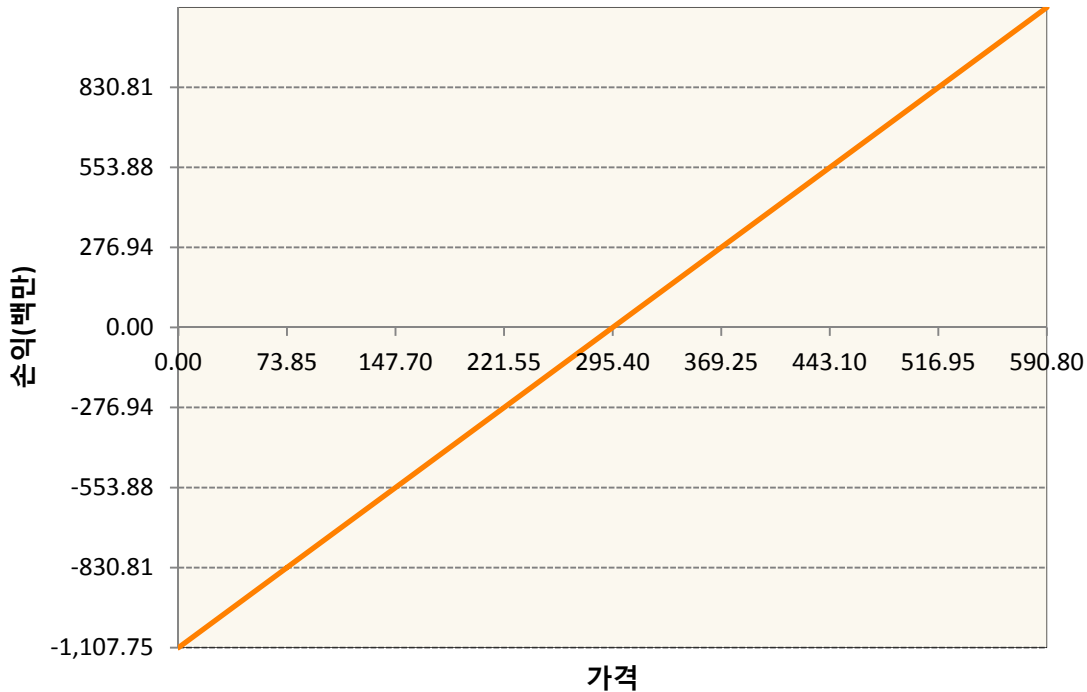
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	74	-74	장내
누계	유가증권	선물	1,108	0	1,108	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물

88

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-5.33%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
-2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	29	29	29	29	29	29	29
5.33%	59	59	59	59	59	59	59
8.00%	88	88	88	88	88	88	88

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

(단위:백만원)

67

공시일	2018-07-24
기준일	2018-07-23

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

1,133

* 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	2018-07-24
기준일	2018-07-23

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

324

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

400

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-07-24
기준일	2018-07-23

유로인덱스모(주식-파생형)

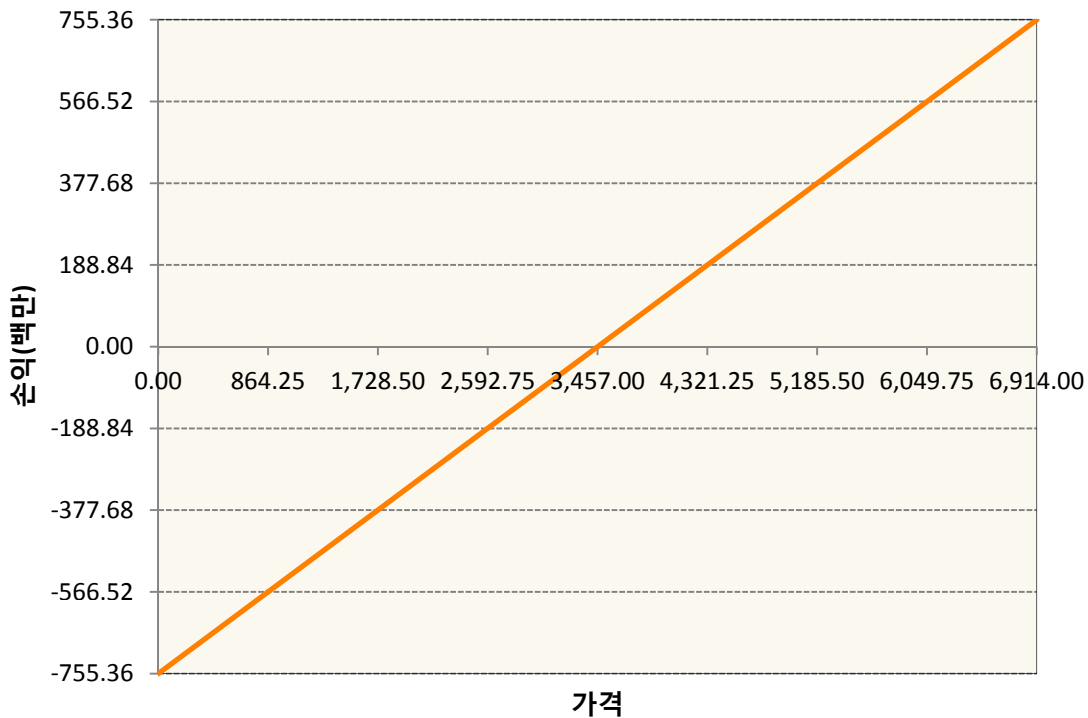
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	755	0	755	

2. 만기시점의 손익구조

VGU8-EURO STOXXX 50 SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

38

공시일	2018-07-24
기준일	2018-07-23

차이나인덱스모(주식-파생형)

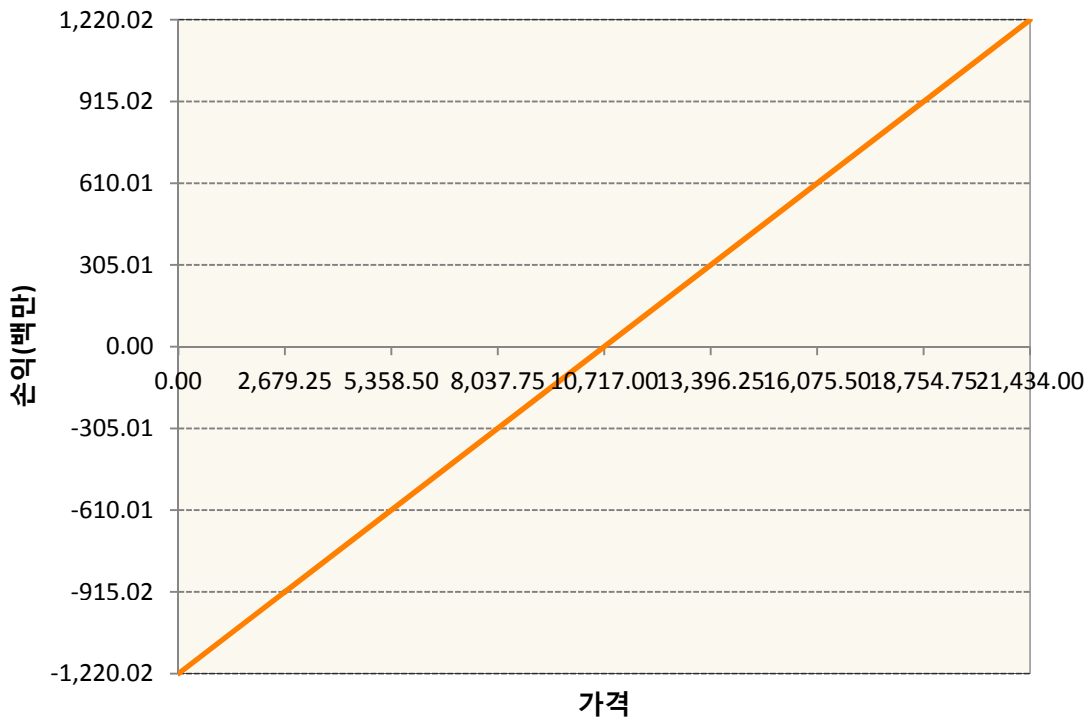
1. 계약금액

(단위:백만원)

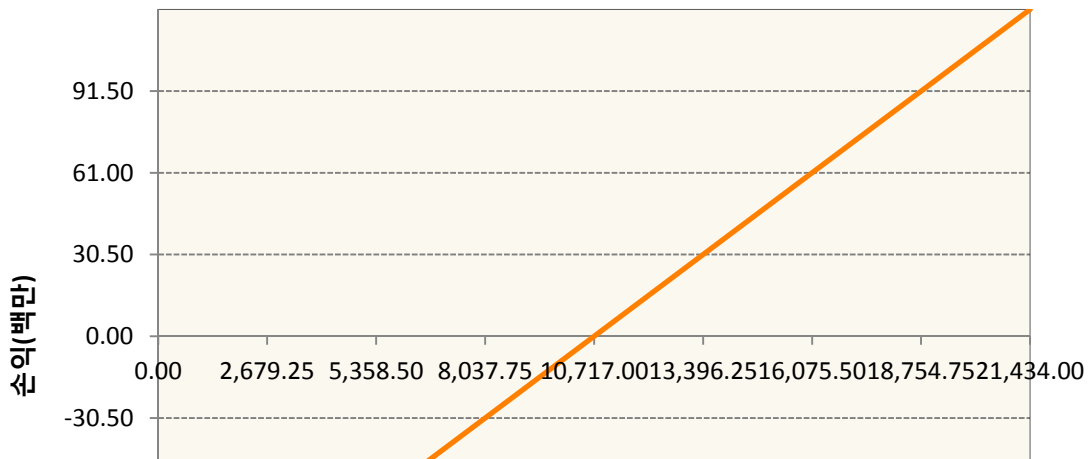
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,342	0	1,342	장내

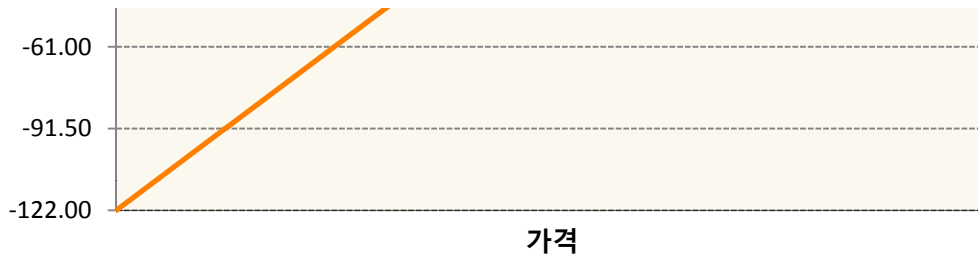
2. 만기시점의 손익구조

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)

97

공시일	2018-07-24
기준일	2018-07-23

커버드콜모(주식혼합-파생형)

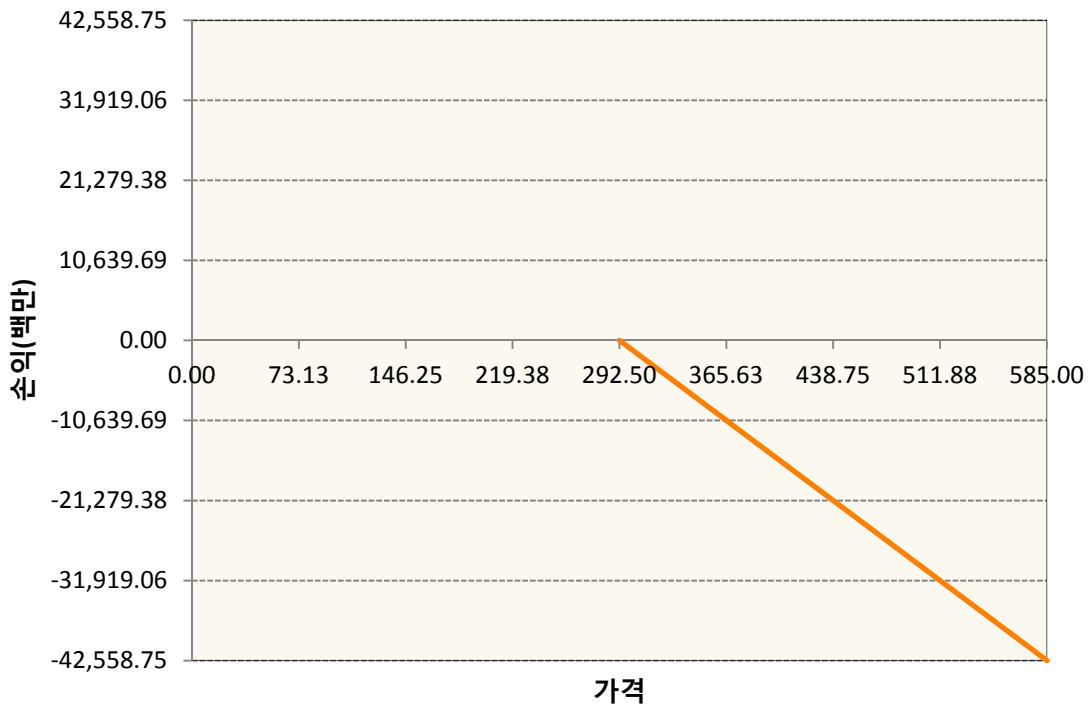
1. 계약금액

(단위:백만원)

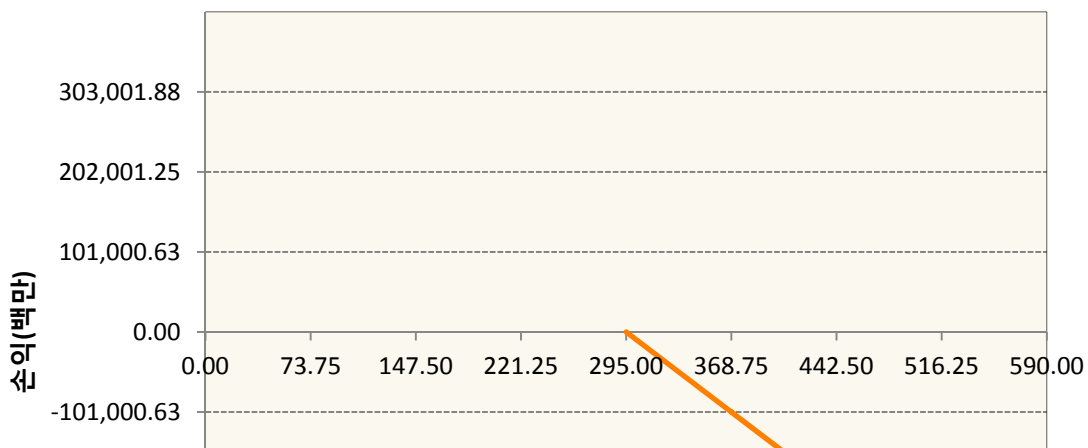
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	725,561	-725,561	장내

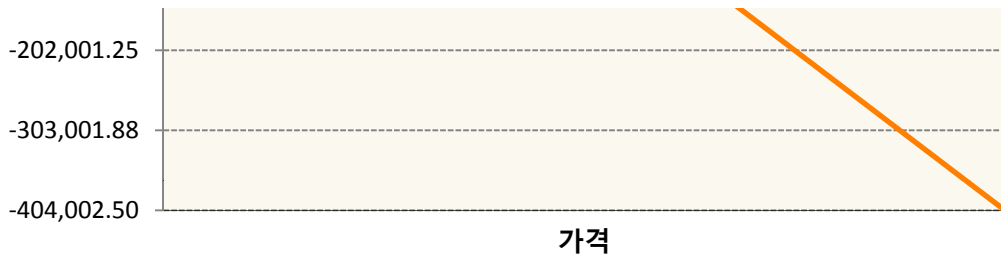
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N82928-2018-08 콜292.5

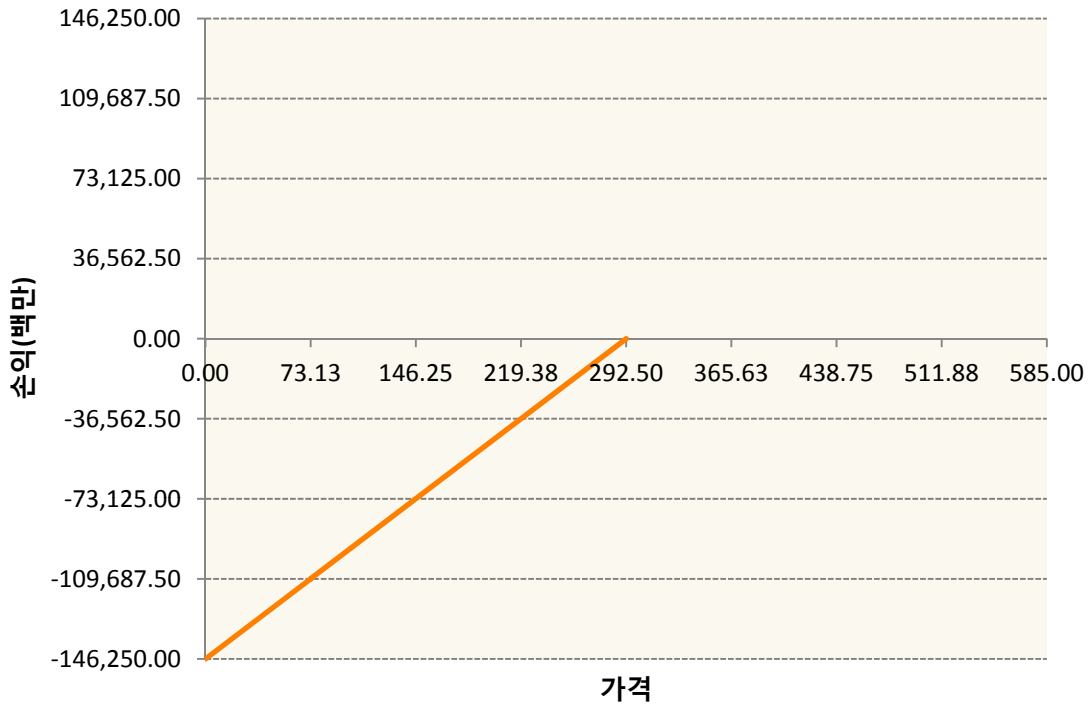


KR4201N82951-2018-08 콜295

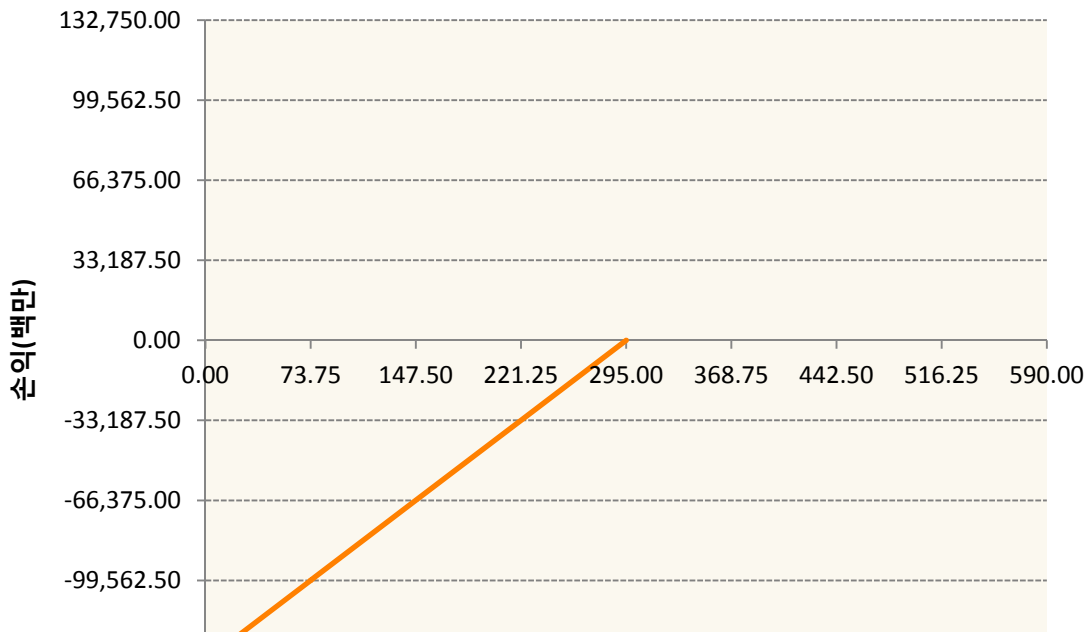




KR4301N82926-2018-08 풋292.5



KR4301N82959-2018-08 풋295



-132,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N829 2018-08 콜292.5							2,752
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,186	1,160	1,127	1,088	1,045	997	945
-5.33%	1,069	1,014	955	891	824	755	684
-2.67%	787	705	623	539	455	370	285
0%	266	178	89	0	-89	-178	-267
2.67%	-501	-574	-649	-727	-807	-888	-970
5.33%	-1,459	-1,505	-1,557	-1,613	-1,675	-1,740	-1,808
8.00%	-2,527	-2,550	-2,579	-2,615	-2,656	-2,702	-2,752
KR4201N829 2018-08 콜295							24,777
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,582	9,391	9,143	8,841	8,489	8,093	7,658
-5.33%	8,785	8,350	7,862	7,330	6,760	6,161	5,535
-2.67%	6,689	5,981	5,251	4,506	3,747	2,978	2,201
0%	2,535	1,690	845	0	-845	-1,690	-2,534
2.67%	-3,975	-4,732	-5,506	-6,293	-7,090	-7,895	-8,707
5.33%	-12,480	-13,000	-13,571	-14,183	-14,828	-15,501	-16,197
8.00%	-22,261	-22,541	-22,886	-23,288	-23,742	-24,240	-24,777
KR4301N829 2018-08 풋292.5							9,404
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,345	-9,346	-9,350	-9,357	-9,368	-9,383	-9,404
-5.33%	-5,449	-5,475	-5,510	-5,555	-5,609	-5,671	-5,742
-2.67%	-1,887	-2,000	-2,118	-2,242	-2,371	-2,502	-2,636
0%	452	303	152	0	-152	-305	-458
2.67%	1,266	1,200	1,123	1,035	940	837	729
5.33%	1,391	1,380	1,363	1,338	1,305	1,263	1,214
8.00%	1,399	1,398	1,396	1,393	1,386	1,375	1,360
KR4301N829 2018-08 풋295							9,034
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,003	-9,004	-9,005	-9,008	-9,013	-9,022	-9,034
-5.33%	-5,481	-5,493	-5,511	-5,536	-5,569	-5,609	-5,656
-2.67%	-2,119	-2,192	-2,275	-2,365	-2,461	-2,562	-2,668
0%	422	281	141	0	-141	-281	-422
2.67%	1,540	1,452	1,356	1,253	1,145	1,033	917

5.33%	1,769	1,749	1,721	1,684	1,638	1,584	1,523
8.00%	1,789	1,787	1,783	1,776	1,765	1,749	1,727

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

(단위:백만원)

47,646

공시일	2018-07-24
기준일	2018-07-23

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

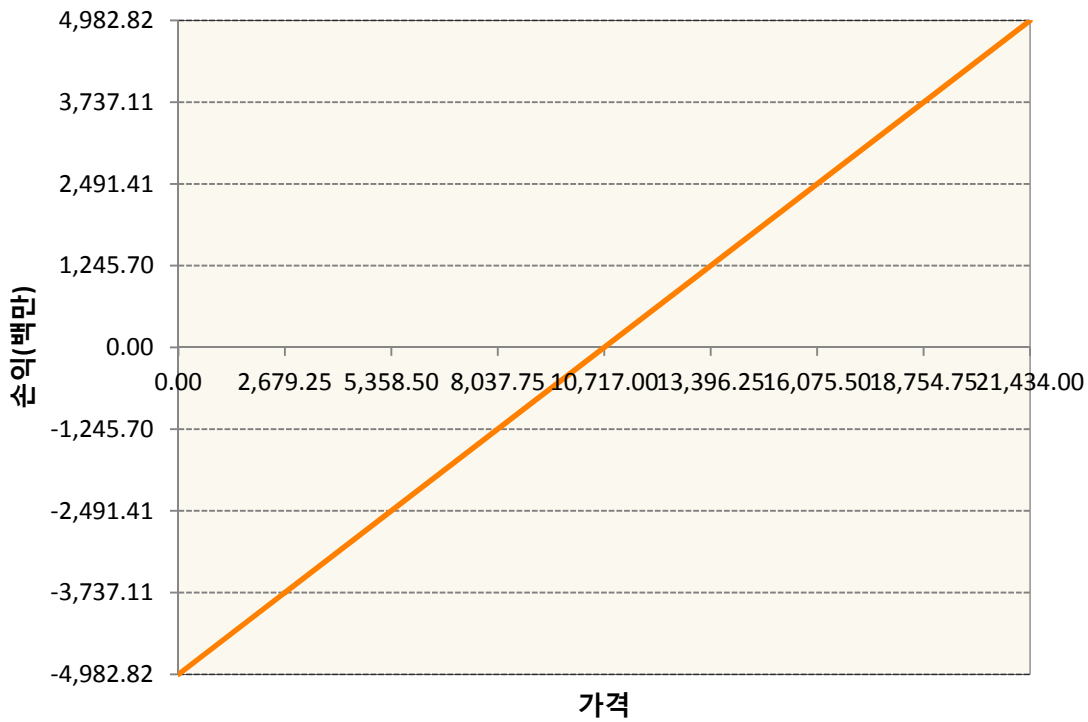
1. 계약금액

(단위:백만원)

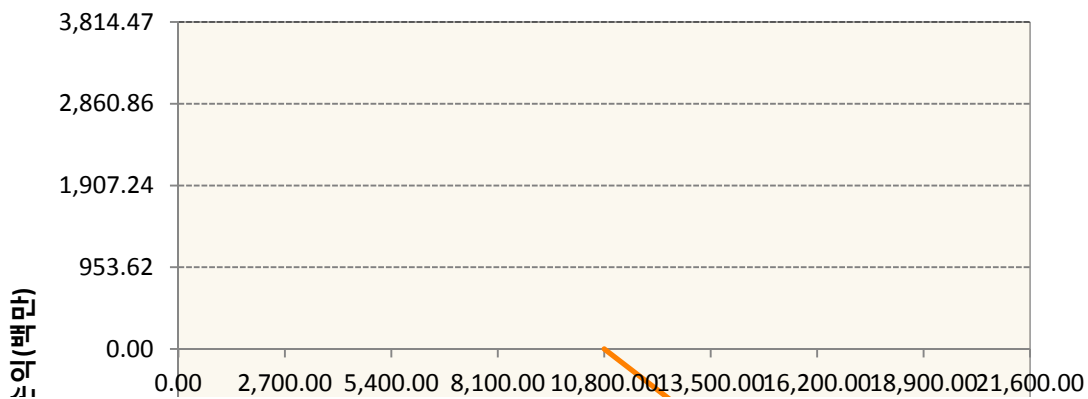
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,983	0	4,983	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,435	-11,435	장내

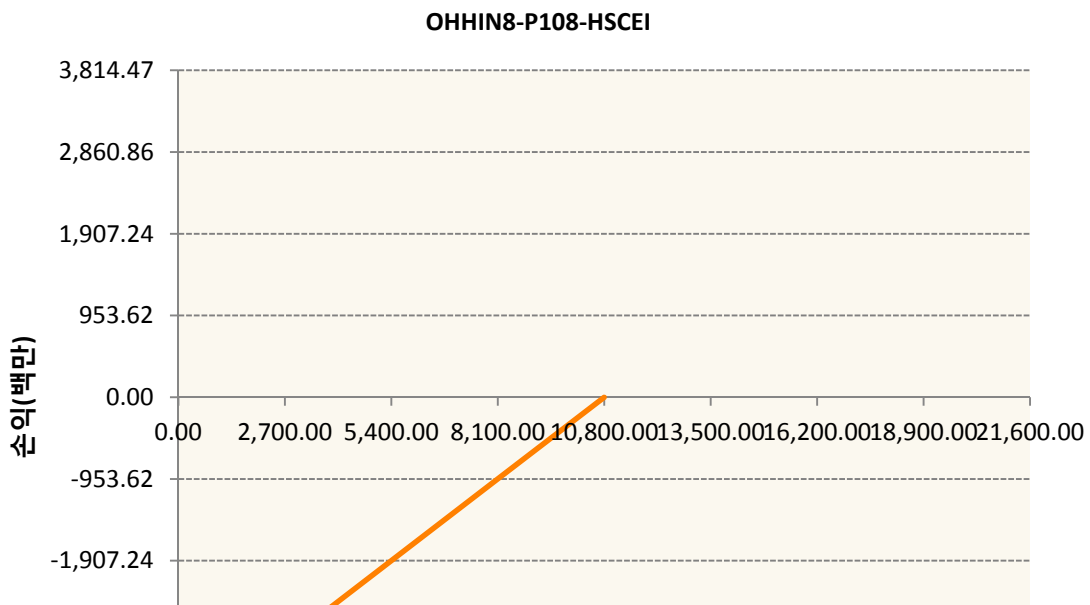
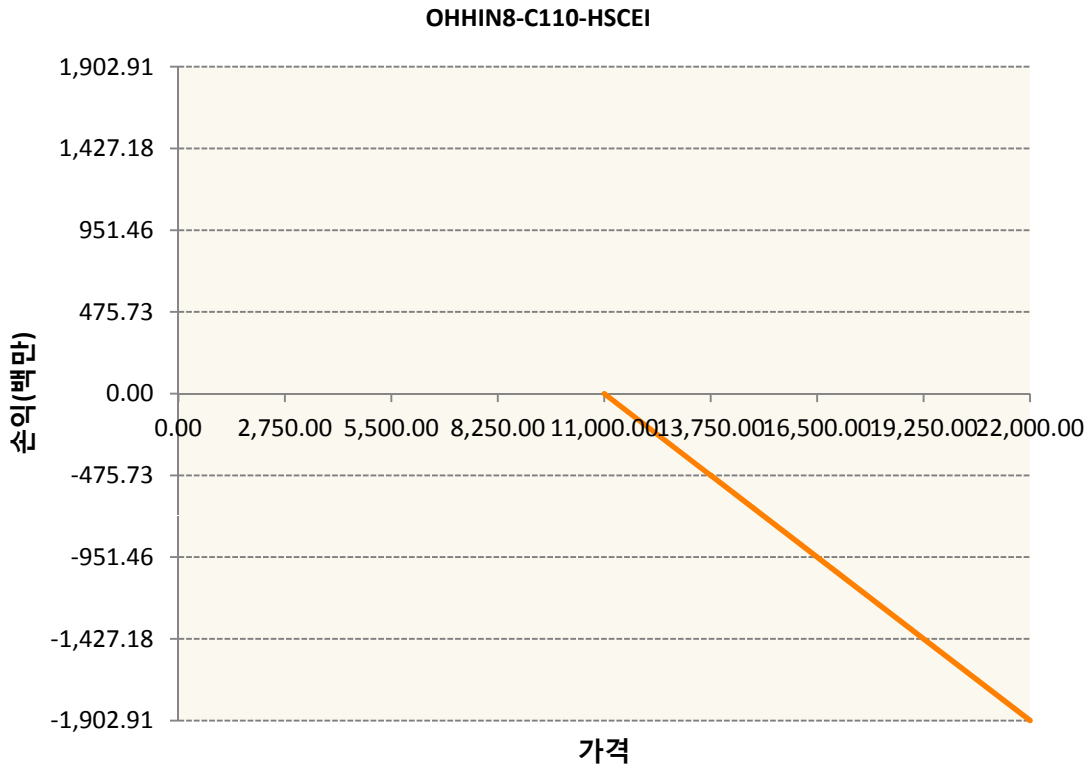
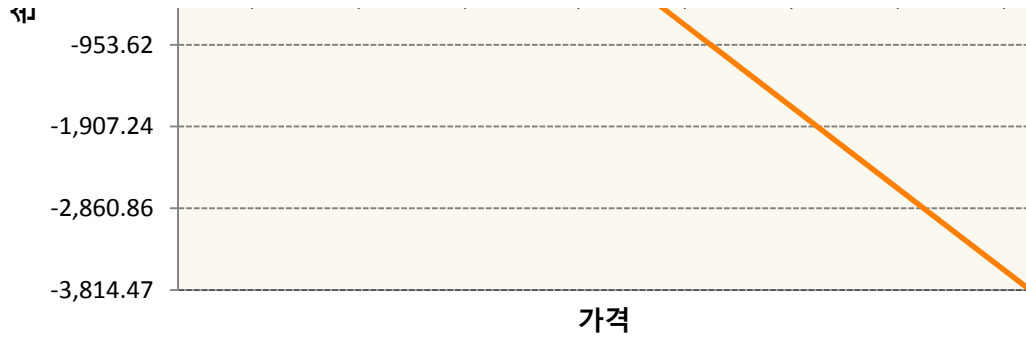
2. 만기시점의 손익구조

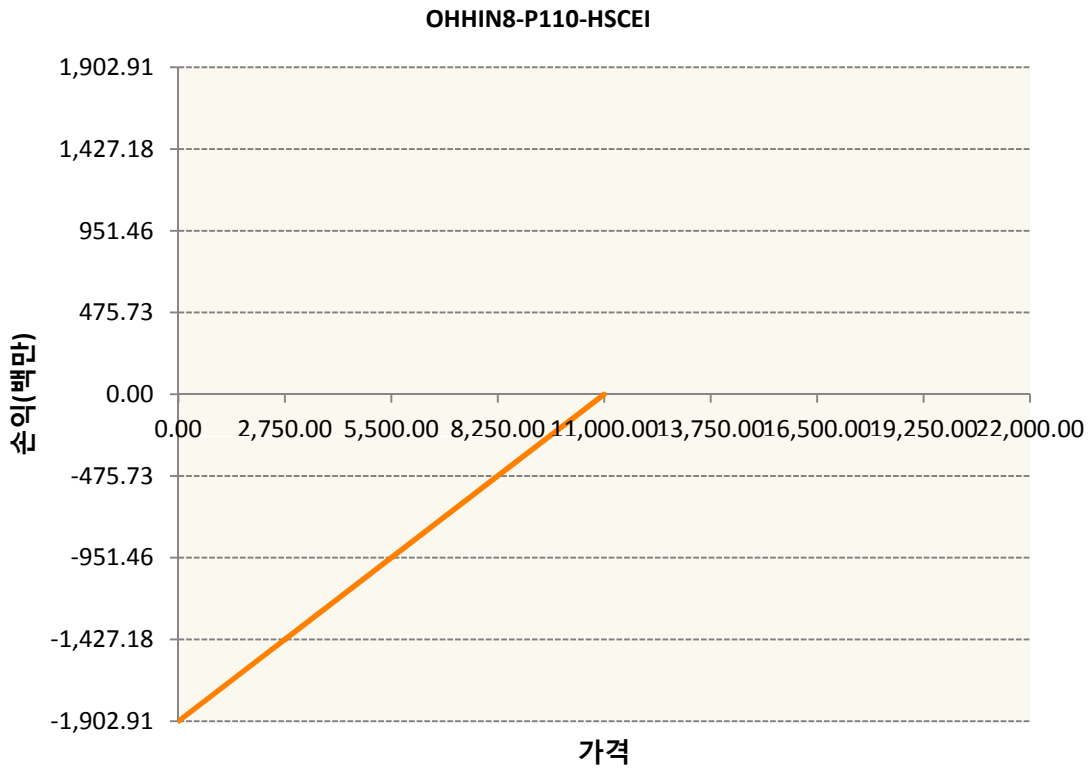
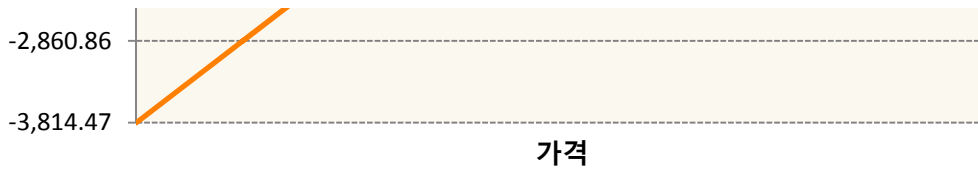
HCN8-HSCEI Futures Jul18



OHHIN8-C108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCN8	HSCEI Futures Jul18	399
OHHIN8-C1	(HSCEI	305
OHHIN8-C1	: HSCEI	152
OHHIN8-P1	(HSCEI	305
OHHIN8-P1	: HSCEI	152

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,192

공시일	2018-07-24
기준일	2018-07-23

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

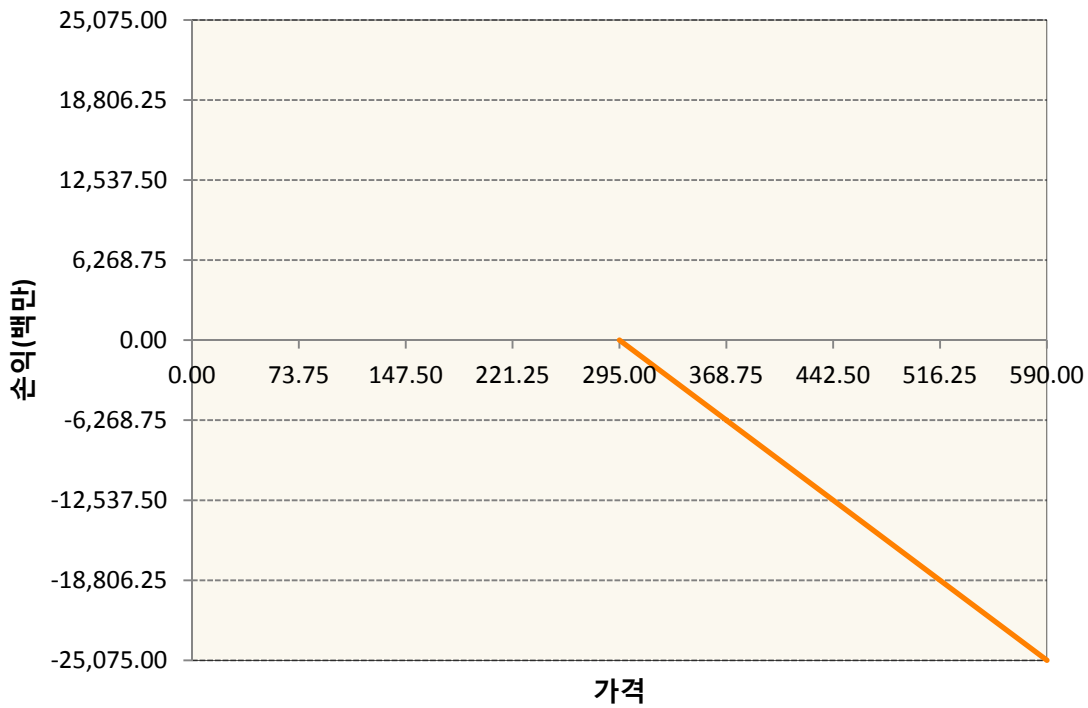
1. 계약금액

(단위:백만원)

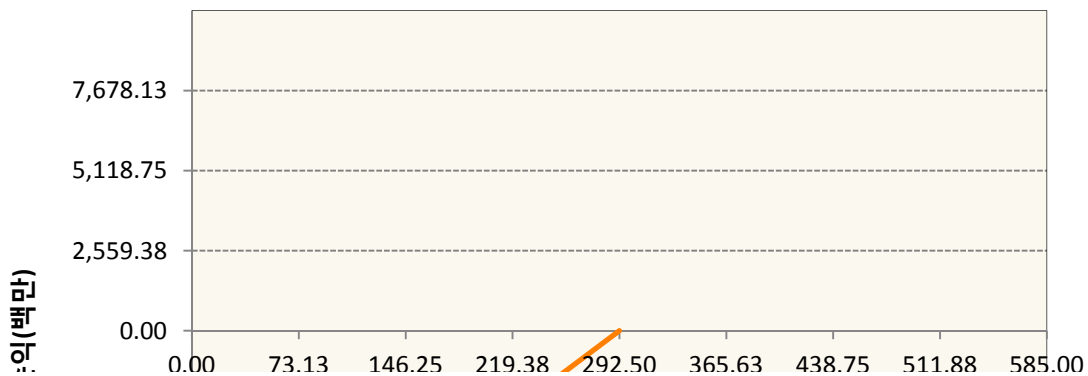
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	45,200	0	45,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	43,425	-43,425	장내

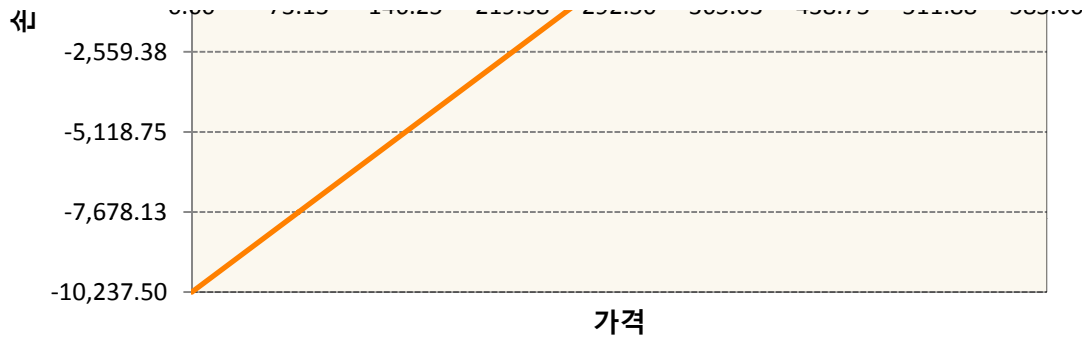
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N82951-2018-08 콜295

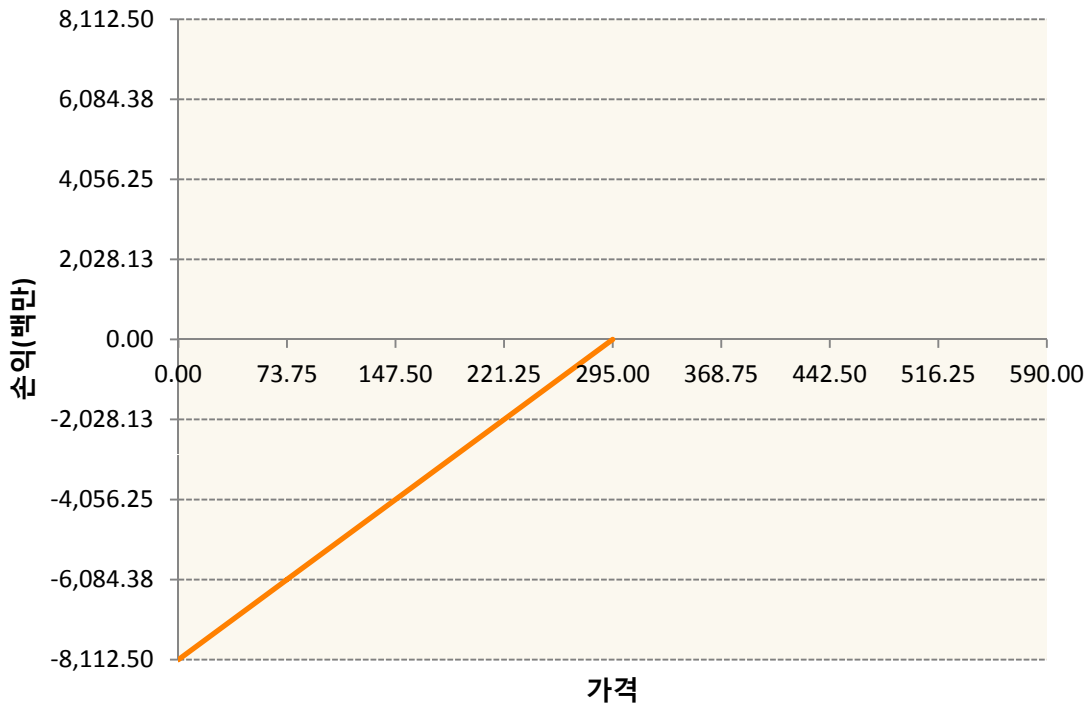


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





KR4301N82959-2018-08 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_2							1,502
	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 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%	325	325	325	325	325	325	325
8.00%	487	487	487	487	487	487	487

KR4201N829 2018-08 콜295

1,538

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	595	583	567	549	527	502	475
-5.33%	545	518	488	455	420	382	344
-2.67%	415	371	326	280	233	185	137
0%	157	105	52	0	-52	-105	-157
2.67%	-247	-294	-342	-391	-440	-490	-540
5.33%	-775	-807	-842	-880	-920	-962	-1,005
8.00%	-1,382	-1,399	-1,420	-1,445	-1,474	-1,504	-1,538

KR4301N829 2018-08 풋292.5

658

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-654	-654	-655	-655	-656	-657	-658
-5.33%	-381	-383	-386	-389	-393	-397	-402
-2.67%	-132	-140	-148	-157	-166	-175	-185
0%	32	21	11	0	-11	-21	-32
2.67%	89	84	79	72	66	59	51
5.33%	97	97	95	94	91	88	85
8.00%	98	98	98	97	97	96	95

KR4301N829 2018-08 풋295

552

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-550	-550	-550	-550	-551	-551	-552
-5.33%	-335	-336	-337	-338	-340	-343	-346
-2.67%	-129	-134	-139	-145	-150	-157	-163
0%	26	17	9	0	-9	-17	-26
2.67%	94	89	83	77	70	63	56
5.33%	108	107	105	103	100	97	93
8.00%	109	109	109	109	108	107	106

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

(단위:백만원)

6,522

공시일	2018-07-24
기준일	2018-07-23

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

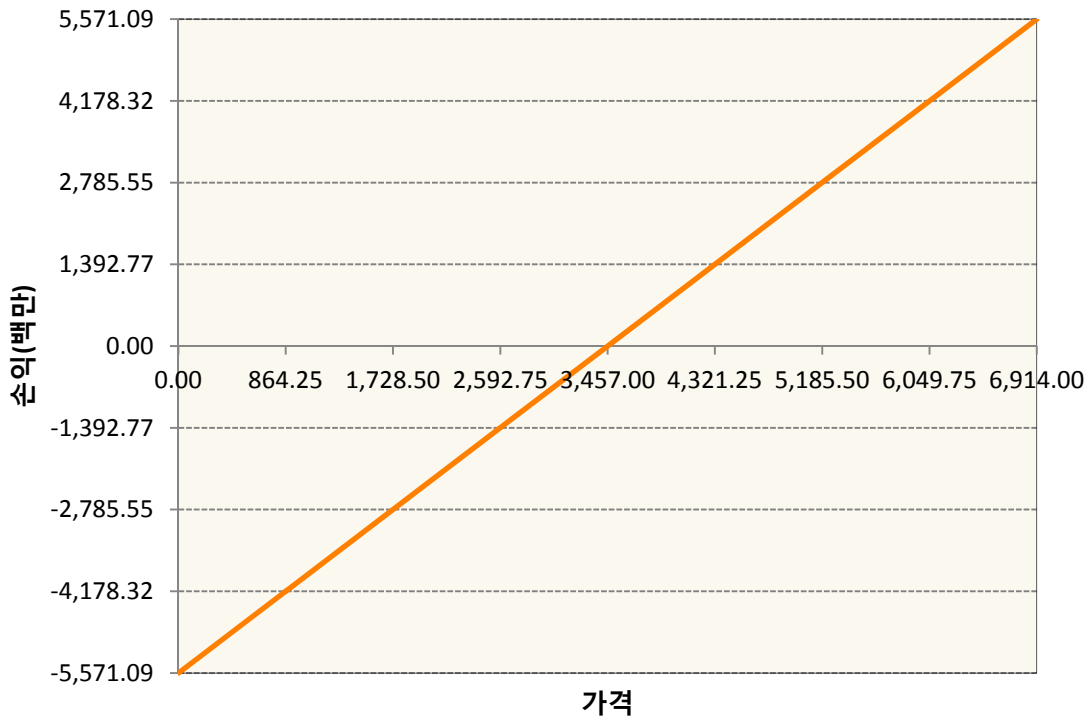
1. 계약금액

(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	지수	스왑	1	0	1	장외
누계	유가증권	선물	5,571	0	5,571	
누계	유가증권	스왑	45,743	0	45,743	장외
누계	지수	스왑	53,855	0	53,855	장외

2. 만기시점의 손익구조

VGU8-EURO STOXXX 50 SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	0
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	0
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18	446

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

(단위:백만원)

1,136

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)

170

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-07-24
기준일	2018-07-23

리디파인K200(주식혼합-파생재간

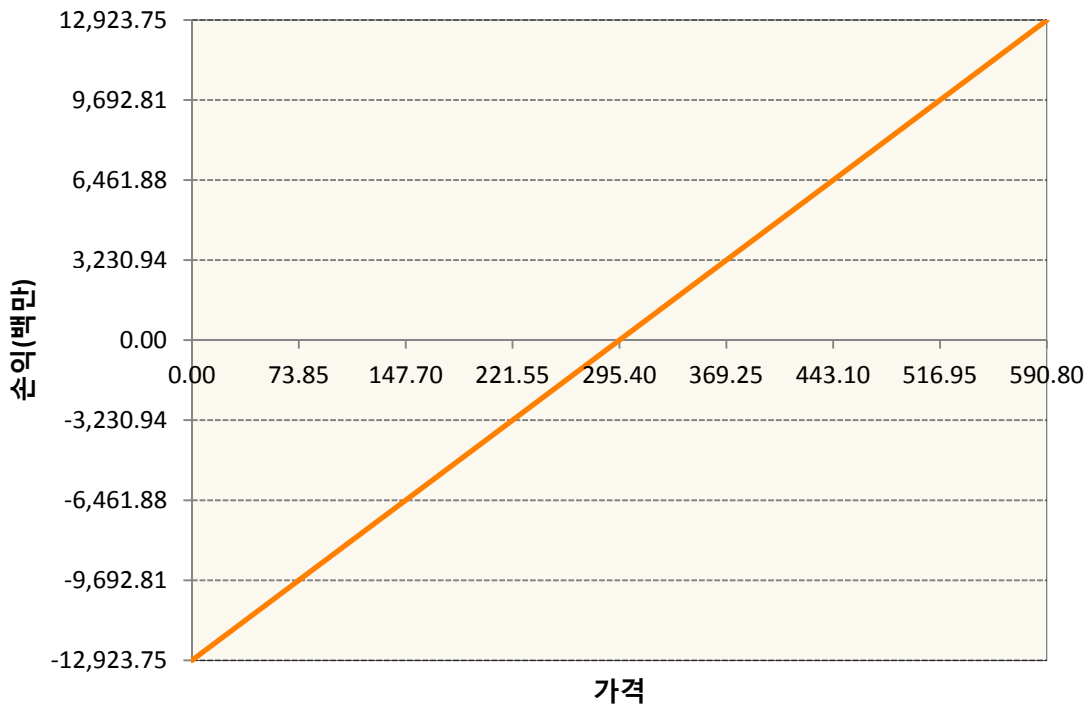
1. 계약금액

(단위:백만원)

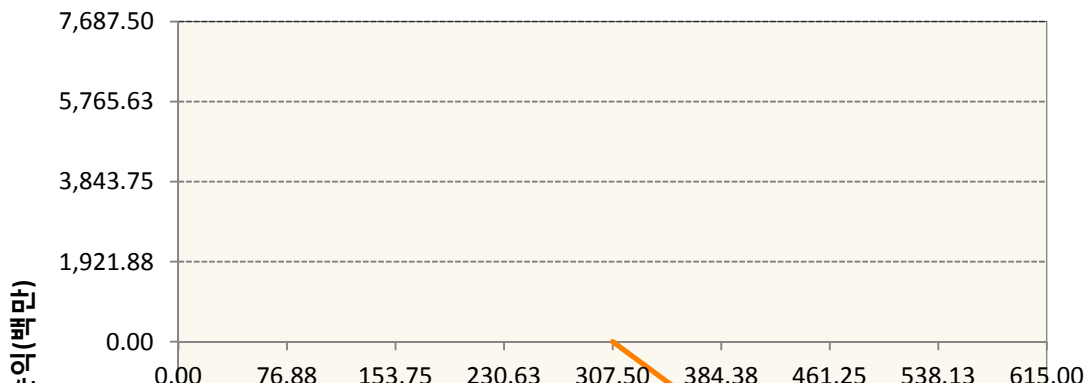
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,924	0	12,924	장내
누계	유가증권	옵션	2,134	23,653	-21,518	장내

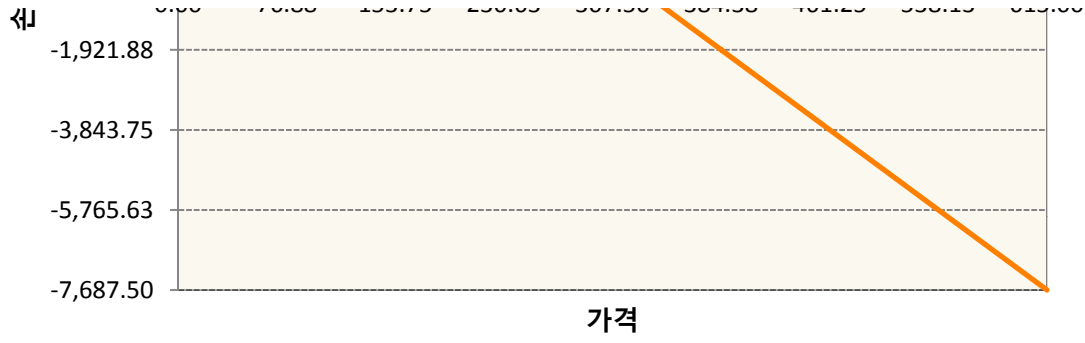
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

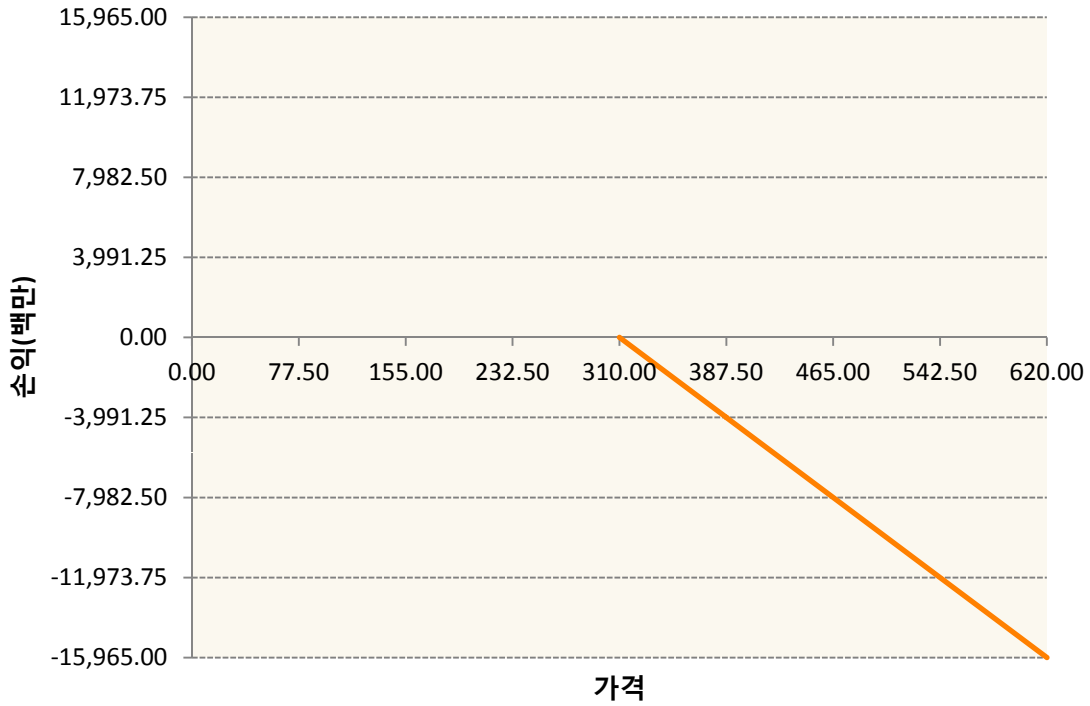


KR4201N83074-2018-08 콜307.5

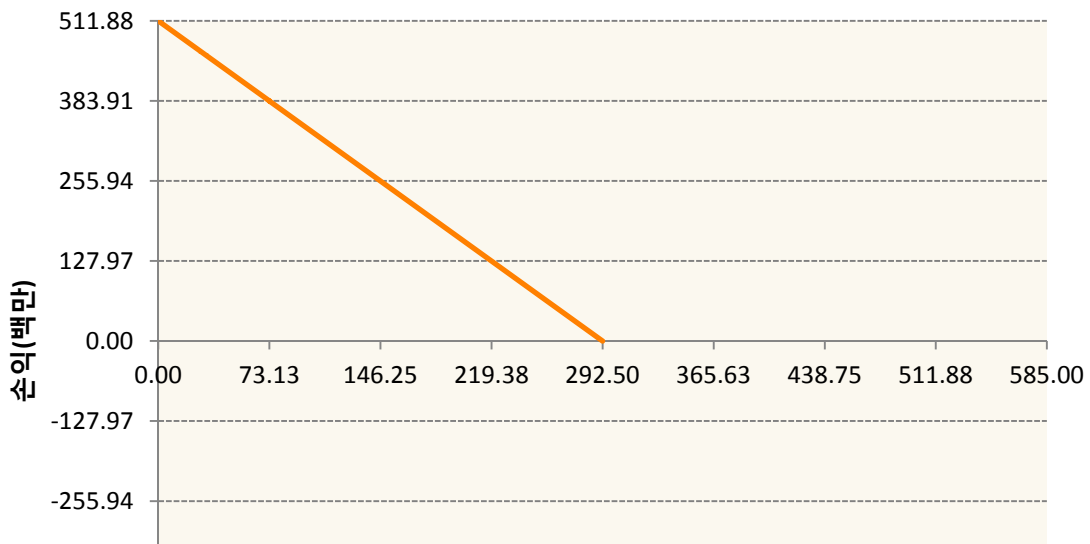


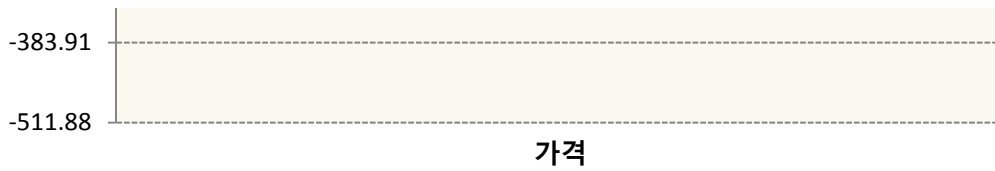


KR4201N83108-2018-08 콜310

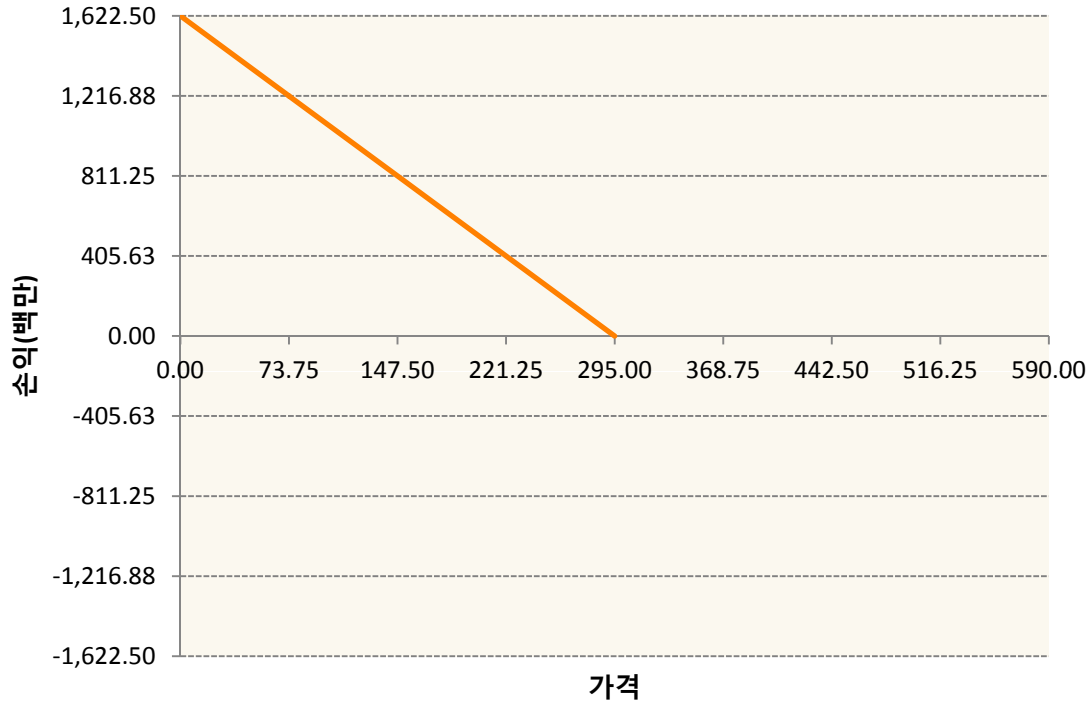


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





KR4301N82959-2018-08 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물 1,031

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,031	-1,031	-1,031	-1,031	-1,031	-1,031	-1,031
-5.33%	-687	-687	-687	-687	-687	-687	-687
-2.67%	-344	-344	-344	-344	-344	-344	-344
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	344	344	344	344	344	344	344
5.33%	687	687	687	687	687	687	687
8.00%	1,031	1,031	1,031	1,031	1,031	1,031	1,031

KR4201N83C 2018-08 콜307.5 331

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	69	69	68	66	64	61	57
-5.33%	67	65	62	58	53	47	40
-2.67%	59	53	46	38	30	20	10

0%	35	24	12	0	-13	-26	-39
2.67%	-19	-34	-50	-65	-80	-96	-111
5.33%	-113	-129	-145	-161	-177	-193	-209
8.00%	-247	-260	-273	-287	-302	-316	-331

KR4201N8312018-08 콜310

628

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	115	114	113	110	106	101	95
-5.33%	113	109	104	97	89	78	66
-2.67%	101	91	80	66	50	32	13
0%	63	44	23	0	-24	-49	-75
2.67%	-26	-55	-85	-116	-146	-177	-209
5.33%	-192	-226	-259	-293	-326	-360	-393
8.00%	-443	-472	-503	-534	-565	-597	-628

KR4301N829 2018-08 풋292.5

33

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	33	33	33	33	33	33	33
-5.33%	19	19	19	19	20	20	20
-2.67%	7	7	7	8	8	9	9
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-4	-4	-4	-4	-3	-3	-3
5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-4	-4
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5

KR4301N829 2018-08 풋295

110

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	110	110	110	110	110	110	110
-5.33%	67	67	67	68	68	69	69
-2.67%	26	27	28	29	30	31	33
0%	-5	-3	-2	0	2	3	5
2.67%	-19	-18	-17	-15	-14	-13	-11
5.33%	-22	-21	-21	-21	-20	-19	-19
8.00%	-22	-22	-22	-22	-22	-21	-21

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

(단위:백만원)

1,640

공시일	2018-07-24
기준일	2018-07-23

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

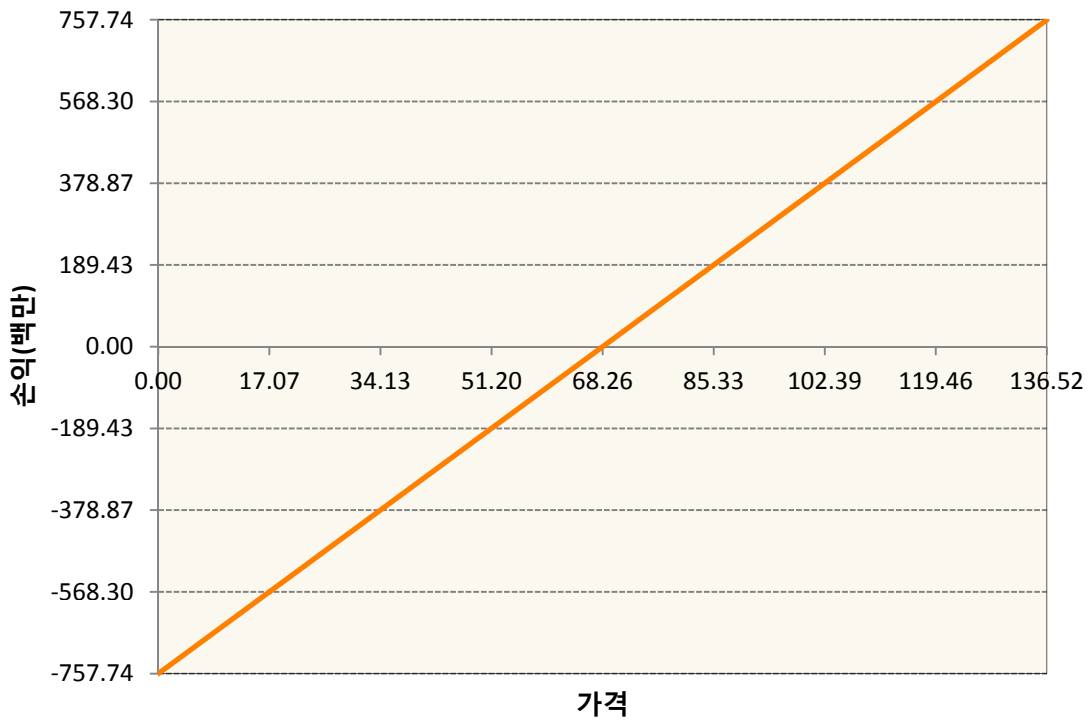
1. 계약금액

(단위:백만원)

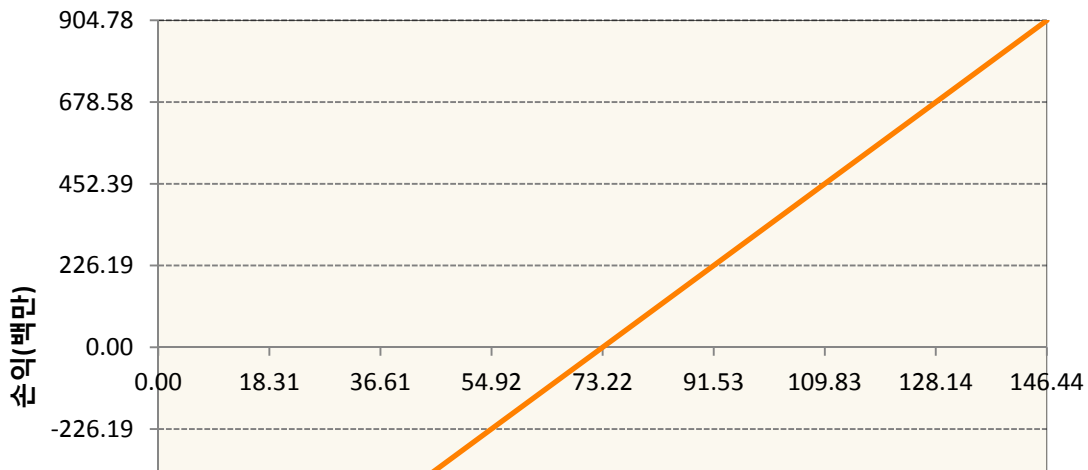
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,594	622	2,973	

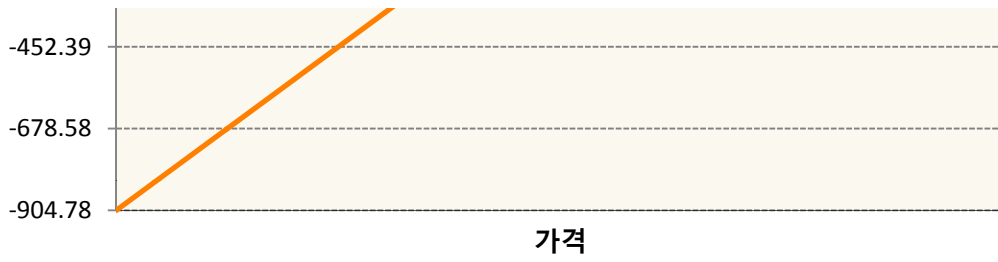
2. 만기시점의 손익구조

CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18

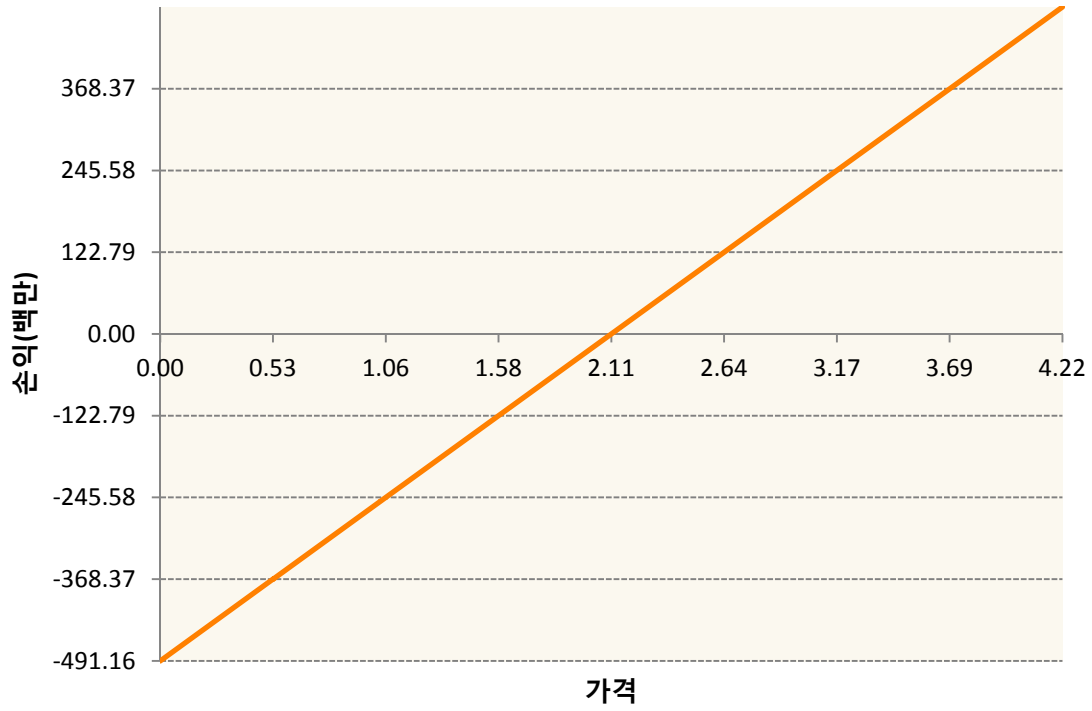


COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18

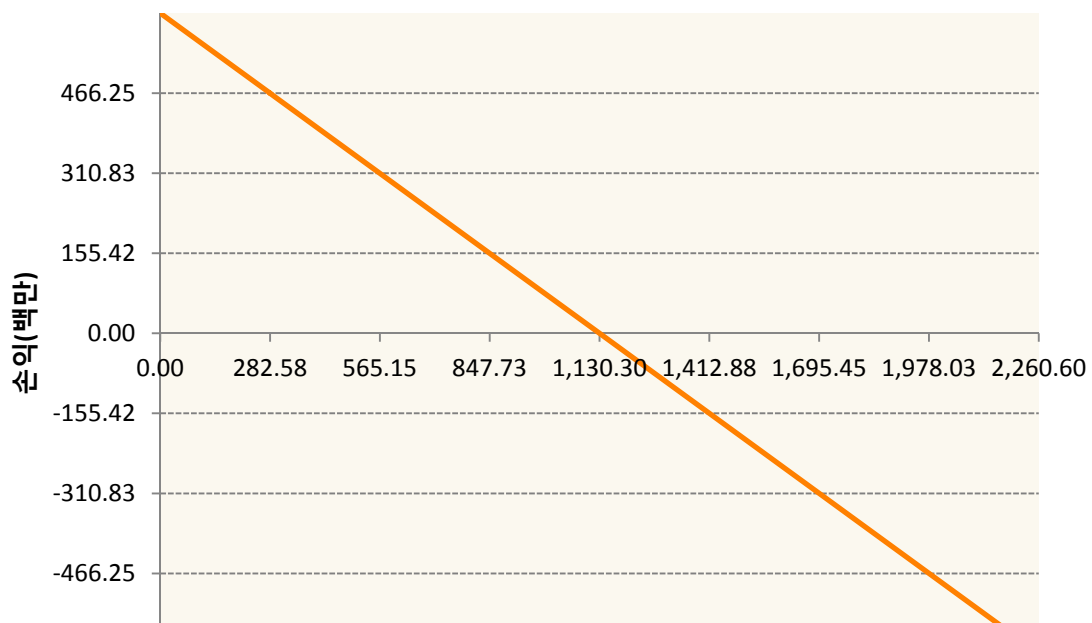


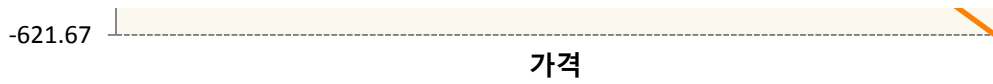


HOU8-NY Harb ULSD Fut SEP18

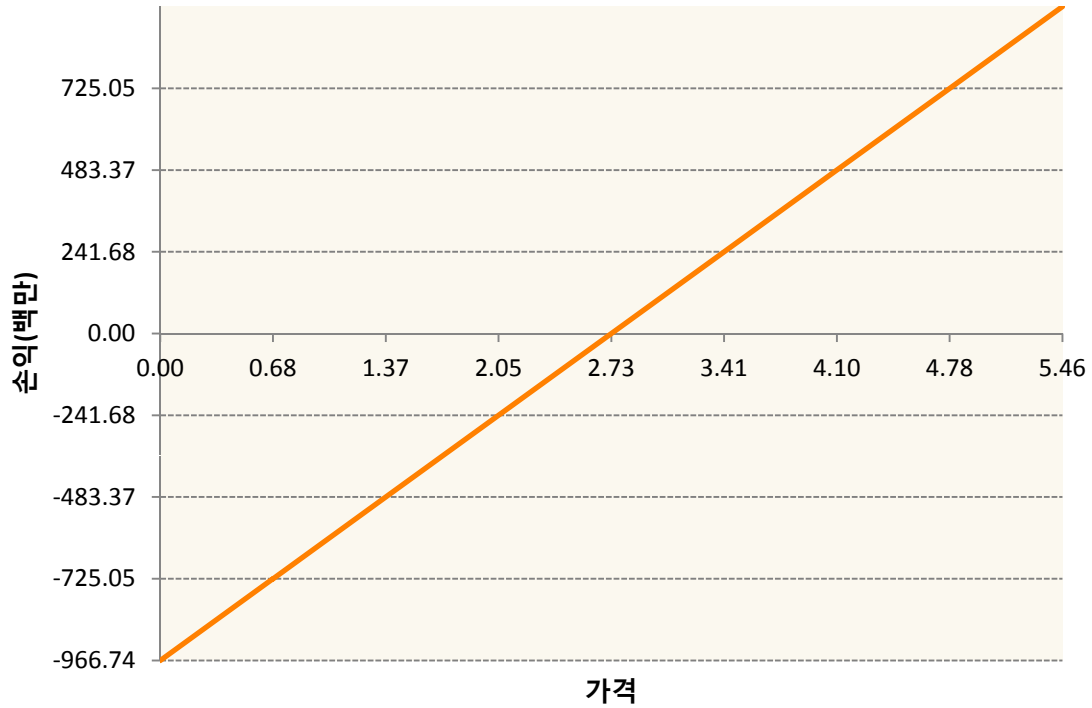


KR4175N80001-2018-08 달러선물

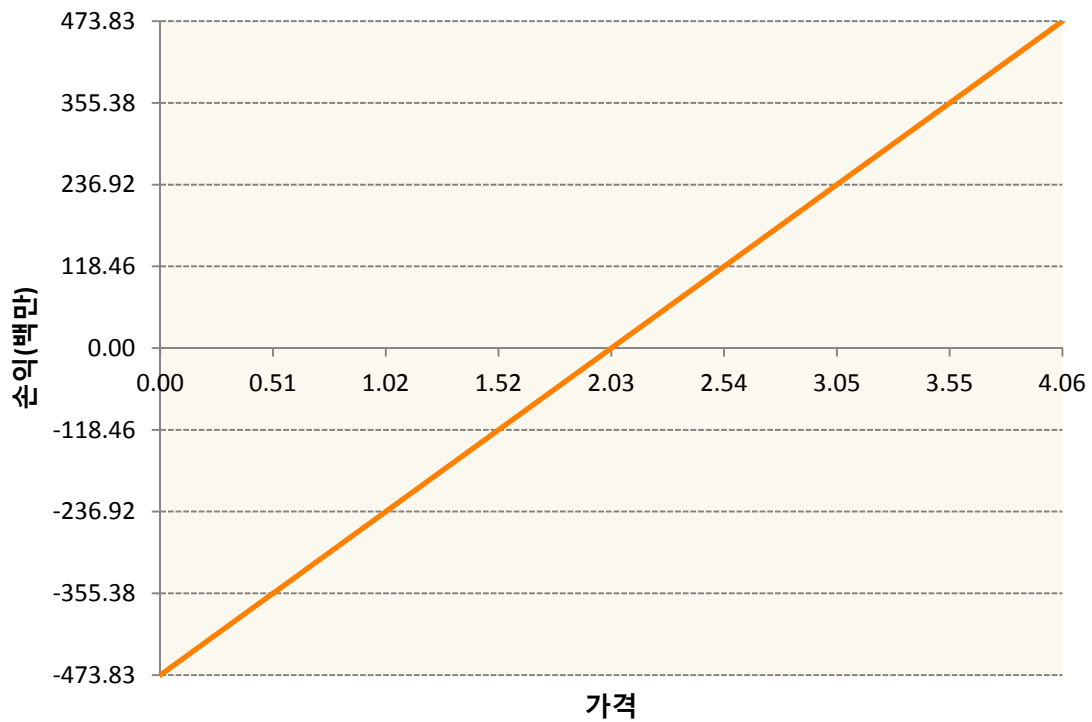




NGU18-NATURAL GAS FUTR SEP18



XBU8-GASOLINE RBOB FUT SEP18



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	77
XBU8	GASOLINE RBOB FUT SEP18	38

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

424

공시일	2018-07-24
기준일	2018-07-23

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

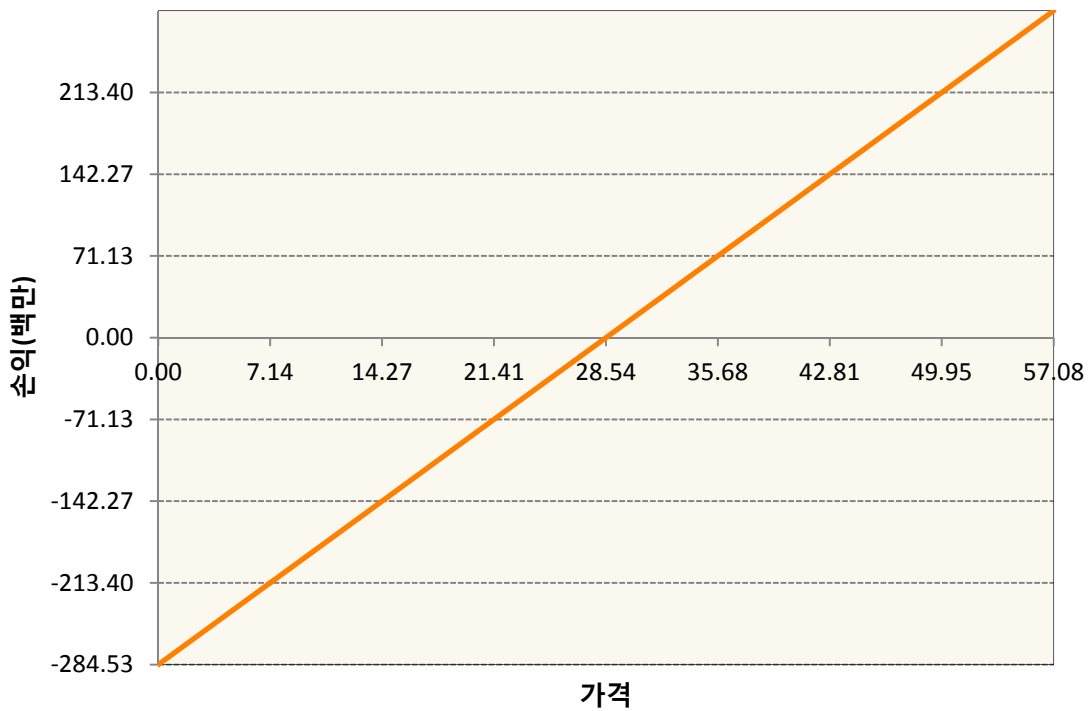
1. 계약금액

(단위:백만원)

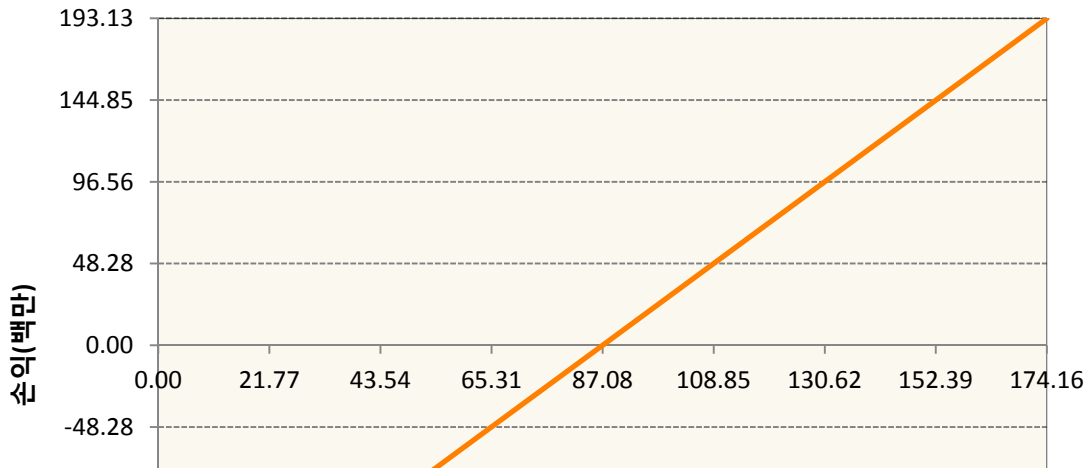
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,614	79	3,535	

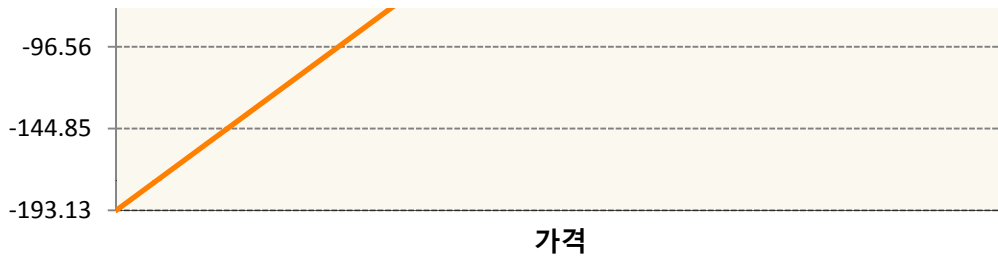
2. 만기시점의 손익구조

BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18

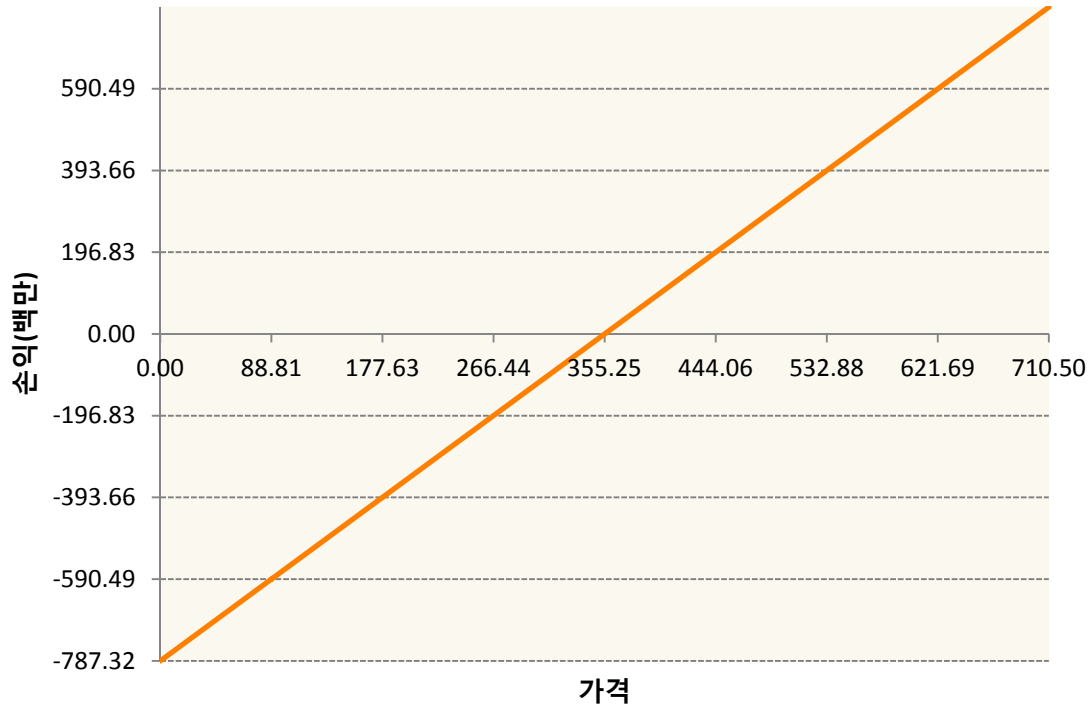


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

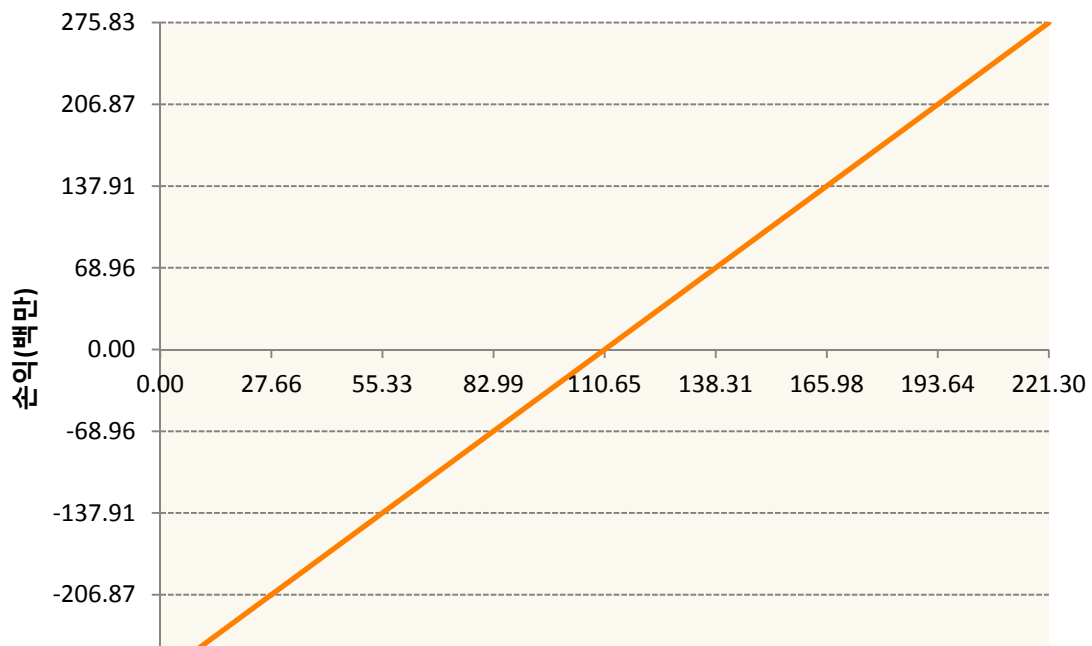


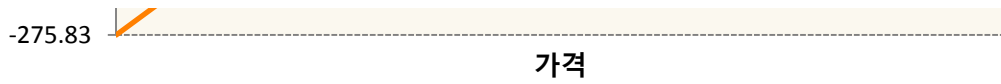


CU8-CORN FUTURE SEP18

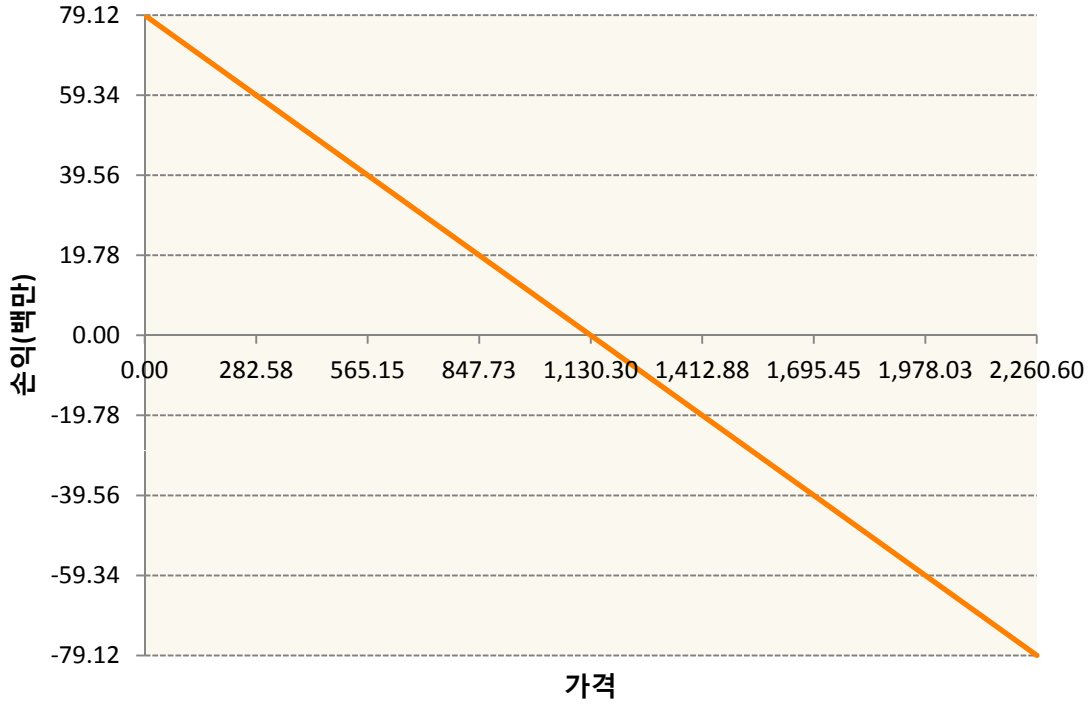


KCU8-COFFEE 'C' FUTURE SEP18

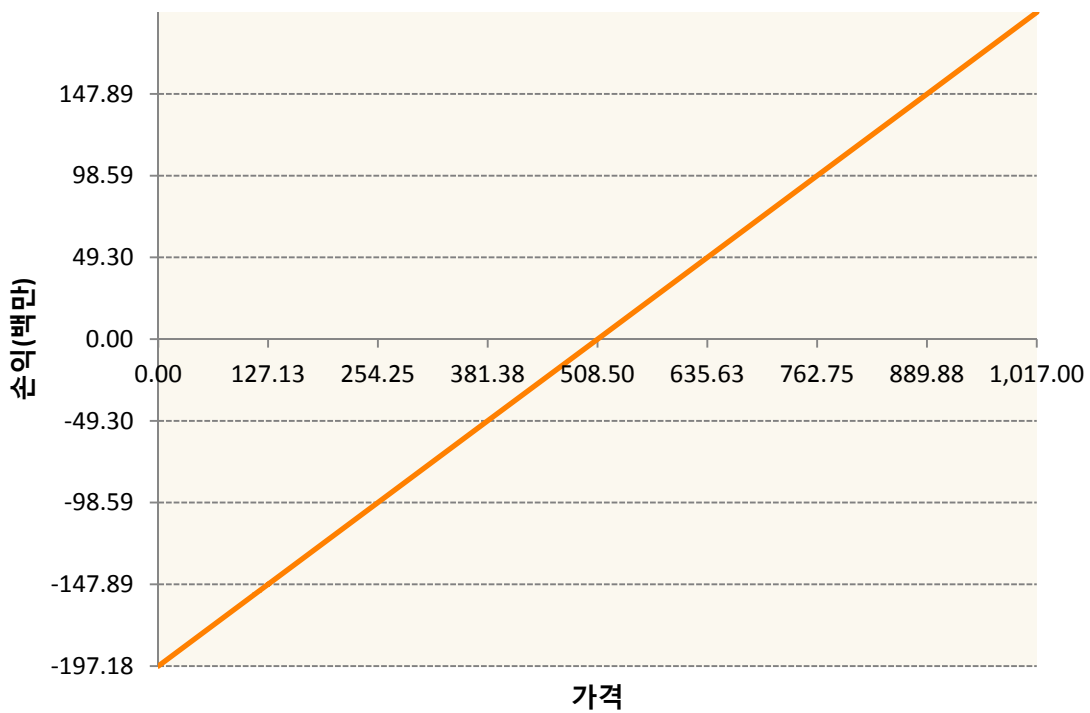




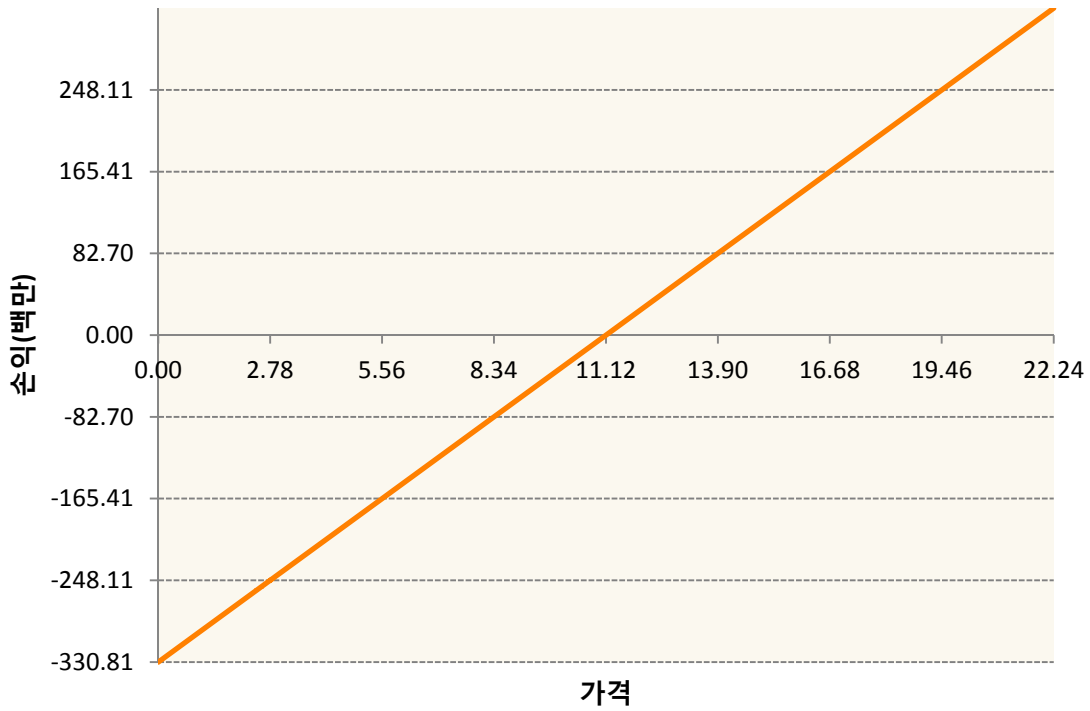
KR4175N80001-2018-08 달러선물



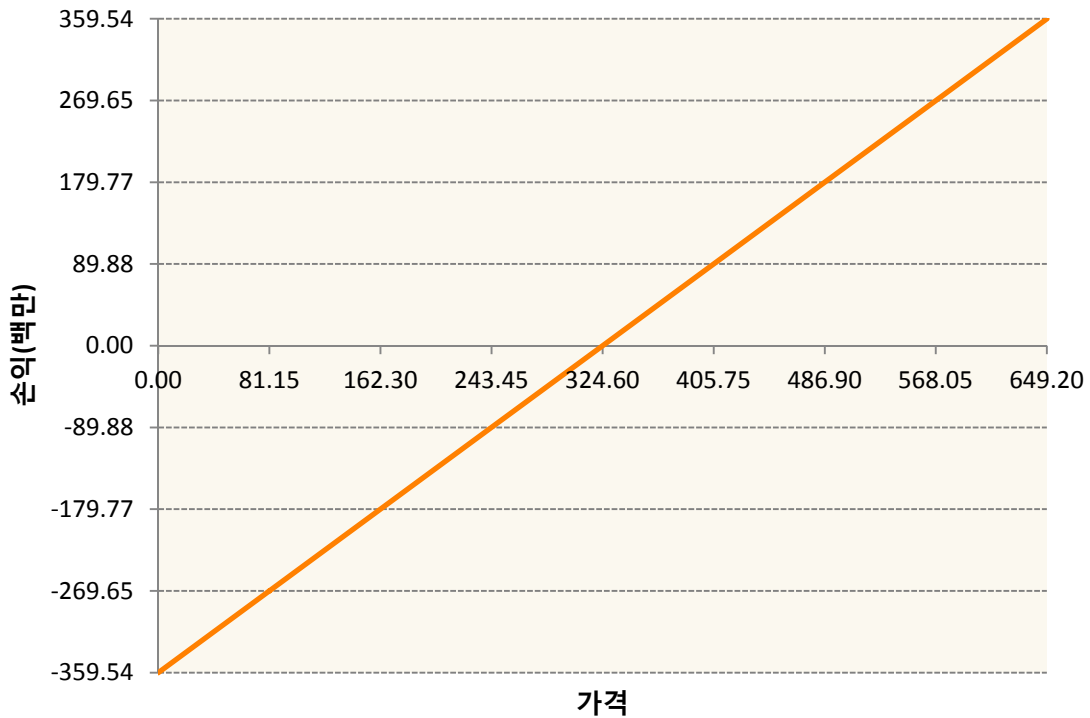
KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18



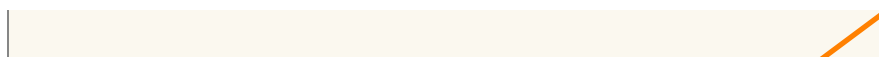
SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

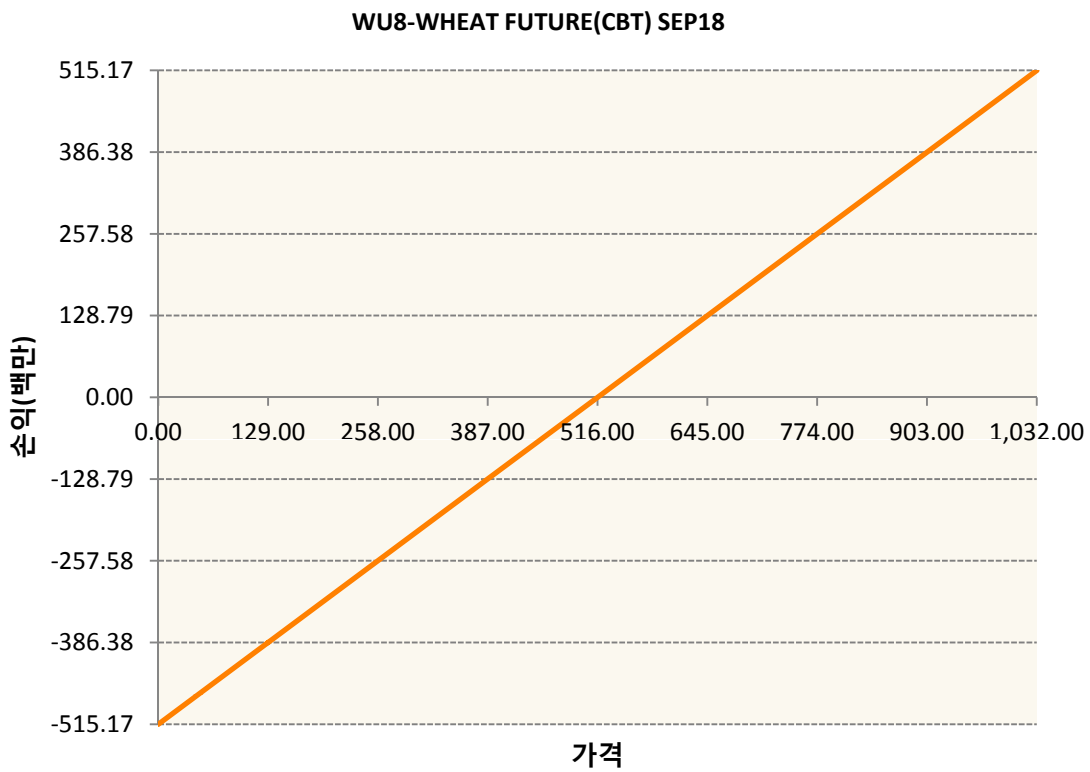
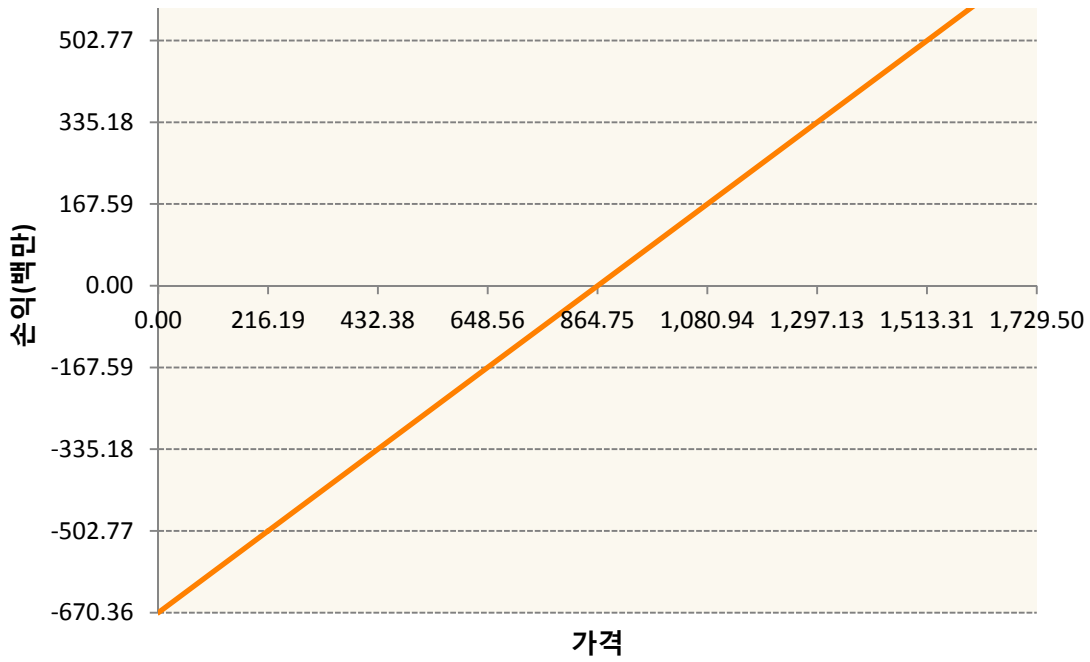


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	23
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	15
CU8	CORN FUTURE SEP18	63
KCU8	COFFEE 'C' FUTURE SEP18	22
KR4175N80C	2018-08 달러선물	6

KWU8	KC HRW WHEAT FUT SEP18	16
SBV8	SUGAR #11 (WORLD) OCT18	26
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	29
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	54
WU8	WHEAT FUTURE(CBT) SEP18	41

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

(단위:백만원)

305