

공시일	2018-07-25
기준일	2018-07-24

## 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	2018-07-25
기준일	2018-07-24

## 스마트인덱스모

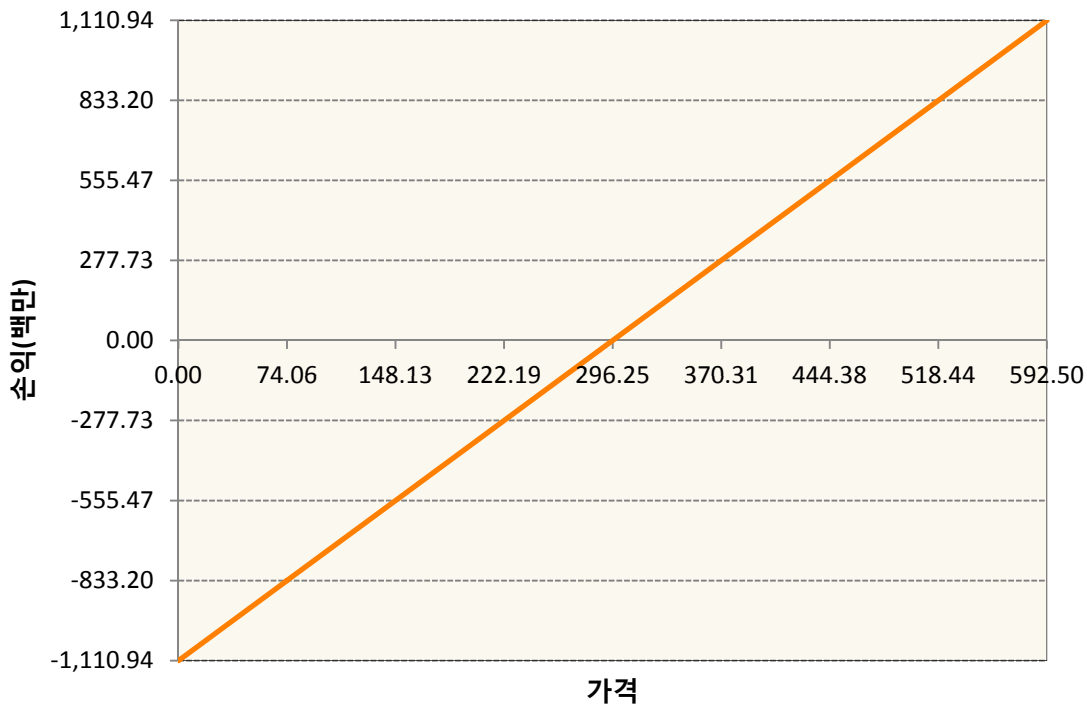
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,111	0	1,111	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물

89

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-5.33%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	30	30	30	30	30	30	30
5.33%	59	59	59	59	59	59	59
8.00%	89	89	89	89	89	89	89

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

(단위:백만원)

67

공시일	2018-07-25
기준일	2018-07-24

## 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)

478

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-07-25
기준일	2018-07-24

## 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

330

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

407

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-07-25
기준일	2018-07-24

## 유로인덱스모(주식-파생형)

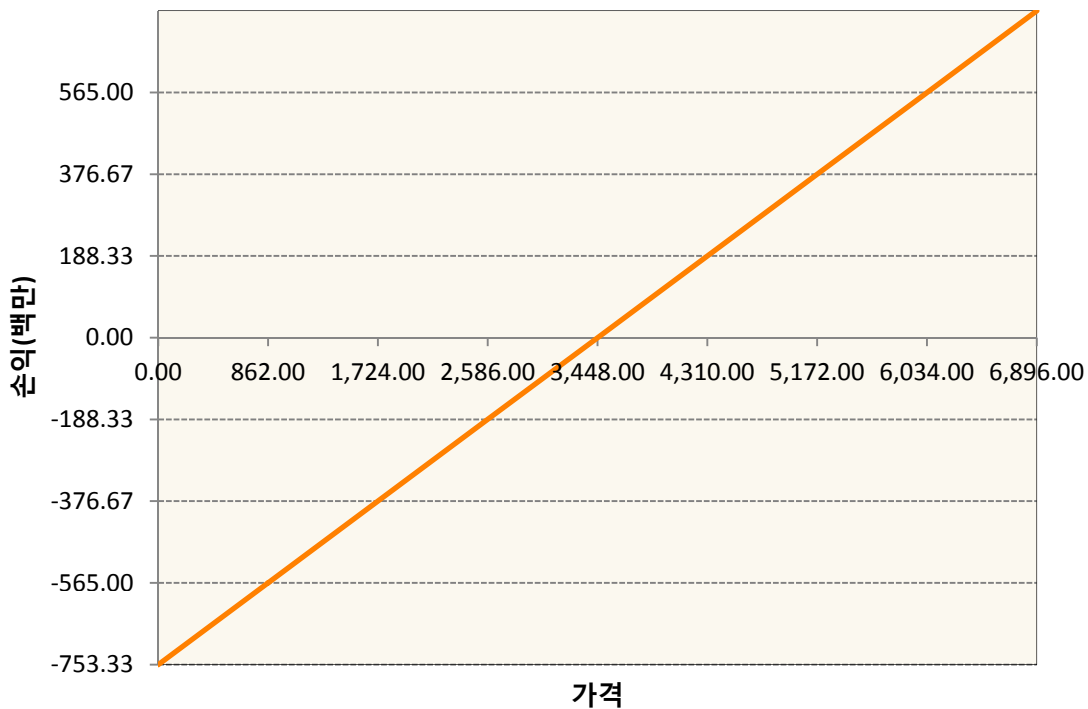
### 1. 계약금액

(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

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	2018-07-25
기준일	2018-07-24

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

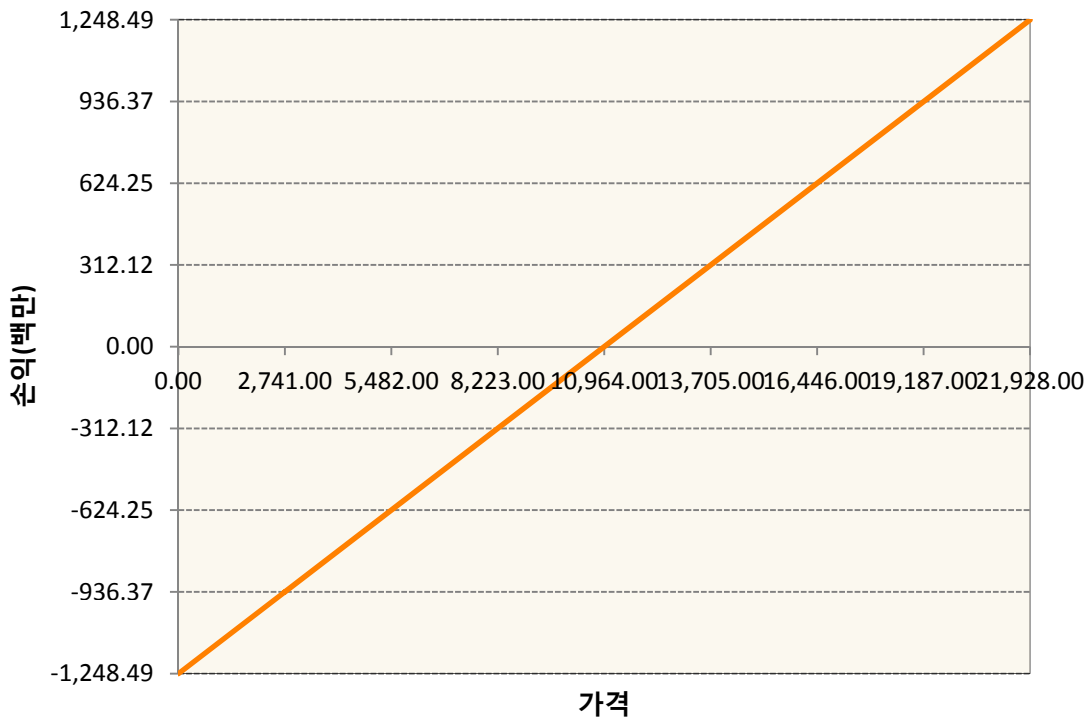
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

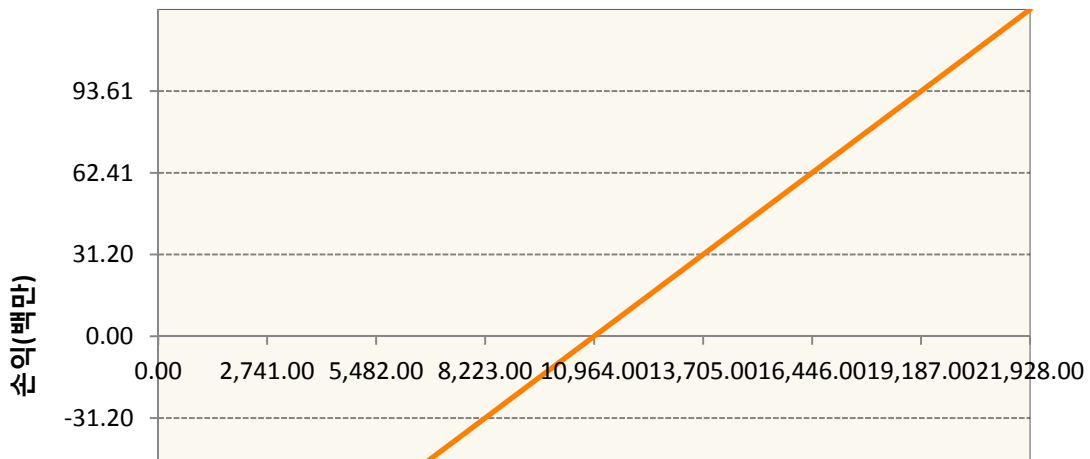
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,373	0	1,373	장내

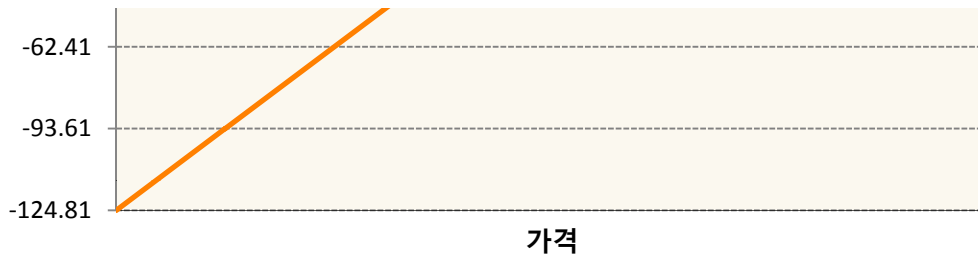
### 2. 만기시점의 손익구조

HCN8-HSCEI Futures Jul18



MHCN8-MINI H-SHR IDX FU JUL18





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

HCN8	HSCEI Futures Jul18	100
MHCN8	MINI H-SHR IDX FU JUL18	10

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

<b>100</b>
------------

공시일	2018-07-25
기준일	2018-07-24

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

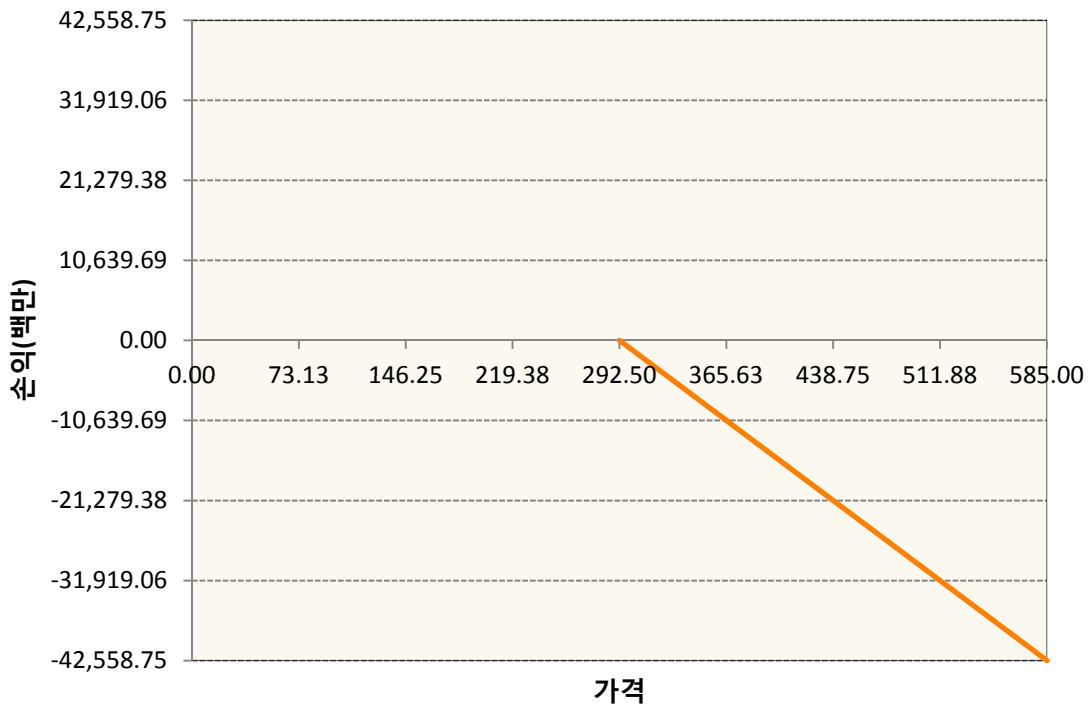
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

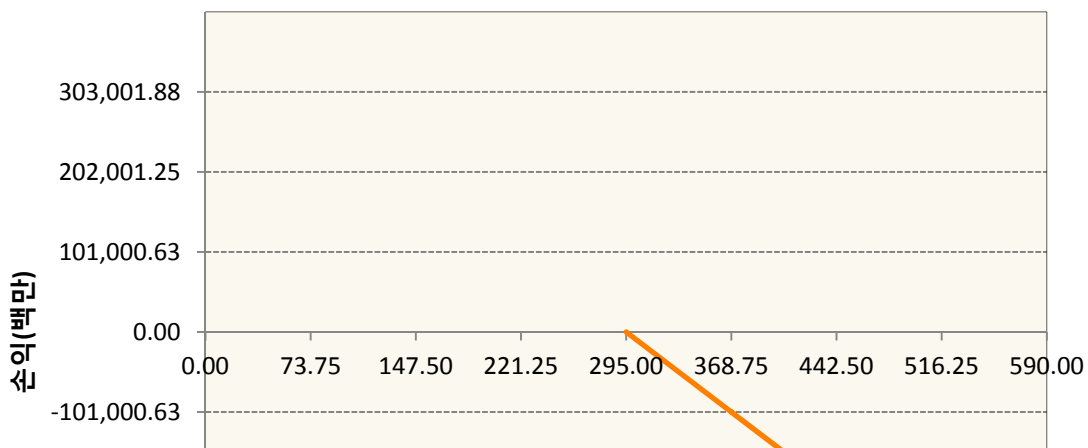
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	725,561	-725,561	장내

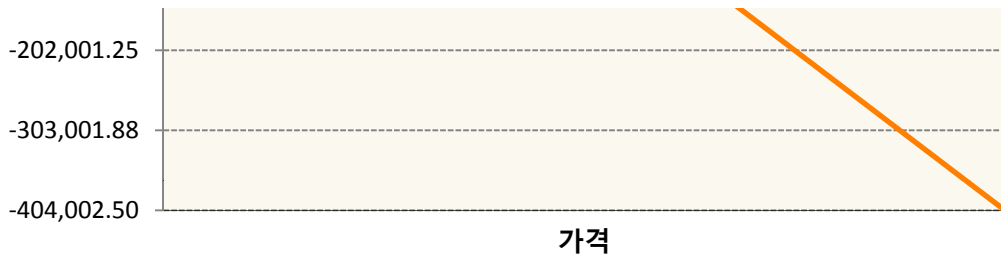
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201N82928-2018-08 콜292.5**

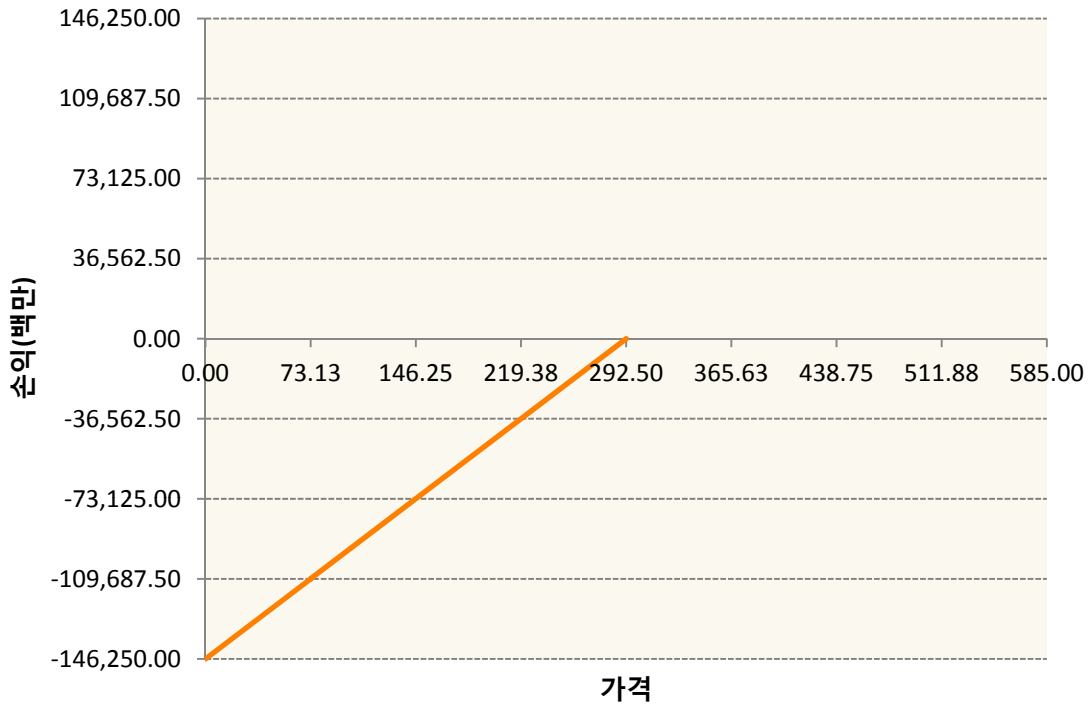


**KR4201N82951-2018-08 콜295**

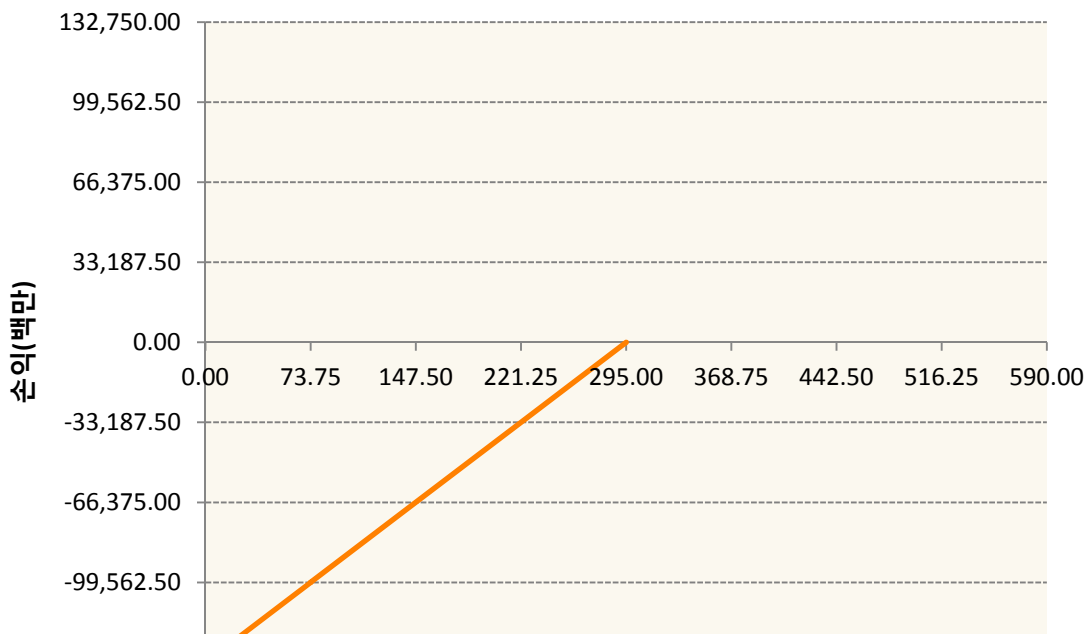




**KR4301N82926-2018-08 풋292.5**



**KR4301N82959-2018-08 풋295**



-132,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N829 2018-08 콜292.5							2,816
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,220	1,195	1,163	1,126	1,084	1,038	989
-5.33%	1,100	1,046	988	926	861	794	725
-2.67%	803	723	643	562	480	398	316
0%	253	169	84	0	-85	-169	-254
2.67%	-552	-617	-686	-757	-830	-905	-982
5.33%	-1,542	-1,580	-1,624	-1,673	-1,727	-1,785	-1,846
8.00%	-2,631	-2,648	-2,671	-2,699	-2,734	-2,773	-2,816
KR4201N829 2018-08 콜295							25,385
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,824	9,644	9,408	9,122	8,787	8,410	7,995
-5.33%	9,017	8,593	8,117	7,600	7,048	6,467	5,863
-2.67%	6,825	6,130	5,417	4,690	3,953	3,207	2,455
0%	2,431	1,621	810	0	-810	-1,621	-2,431
2.67%	-4,420	-5,112	-5,826	-6,557	-7,301	-8,056	-8,819
5.33%	-13,254	-13,697	-14,194	-14,736	-15,314	-15,923	-16,558
8.00%	-23,267	-23,485	-23,763	-24,098	-24,483	-24,914	-25,385
KR4301N829 2018-08 풋292.5							9,255
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,204	-9,205	-9,208	-9,214	-9,223	-9,236	-9,255
-5.33%	-5,296	-5,320	-5,354	-5,397	-5,448	-5,508	-5,574
-2.67%	-1,759	-1,872	-1,989	-2,111	-2,236	-2,364	-2,494
0%	407	274	138	0	-139	-279	-420
2.67%	1,038	992	936	869	794	711	622
5.33%	1,109	1,104	1,095	1,080	1,059	1,032	997
8.00%	1,112	1,112	1,111	1,110	1,107	1,101	1,093
KR4301N829 2018-08 풋295							8,951
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,926	-8,927	-8,928	-8,930	-8,934	-8,941	-8,951
-5.33%	-5,392	-5,403	-5,419	-5,443	-5,473	-5,511	-5,555
-2.67%	-2,032	-2,106	-2,188	-2,277	-2,371	-2,469	-2,572
0%	397	265	132	0	-132	-265	-397
2.67%	1,327	1,259	1,183	1,100	1,010	915	815

5.33%	1,473	1,463	1,446	1,422	1,390	1,352	1,306
8.00%	1,482	1,481	1,480	1,477	1,471	1,461	1,448

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

(단위:백만원)

**48,427**

공시일	2018-07-25
기준일	2018-07-24

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

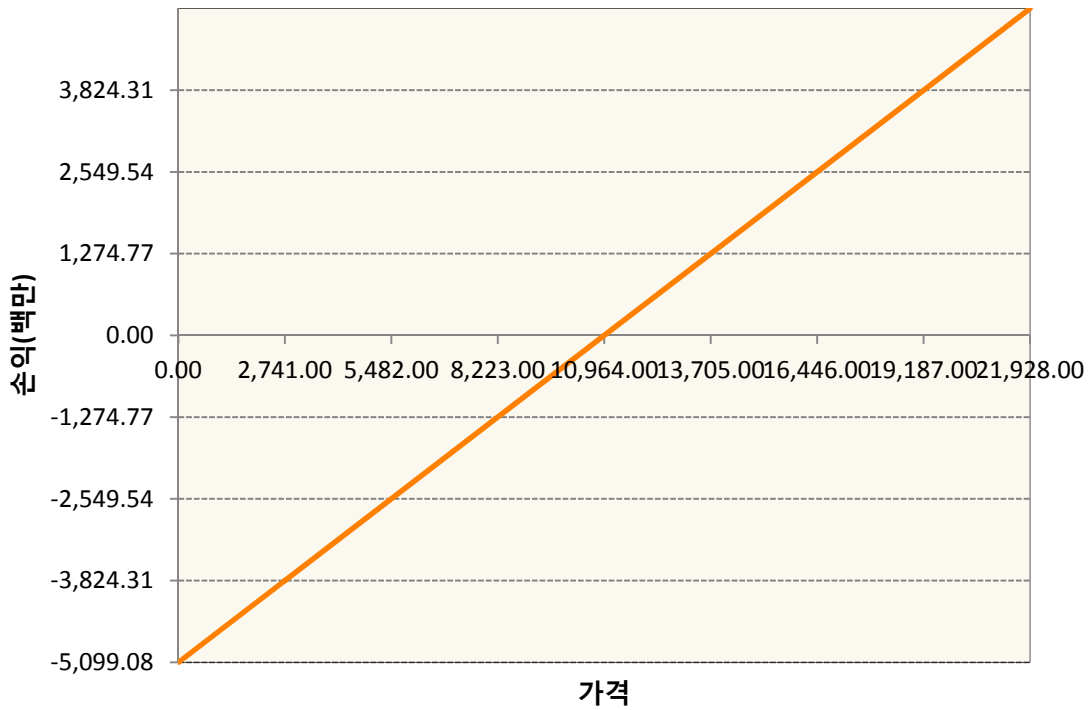
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

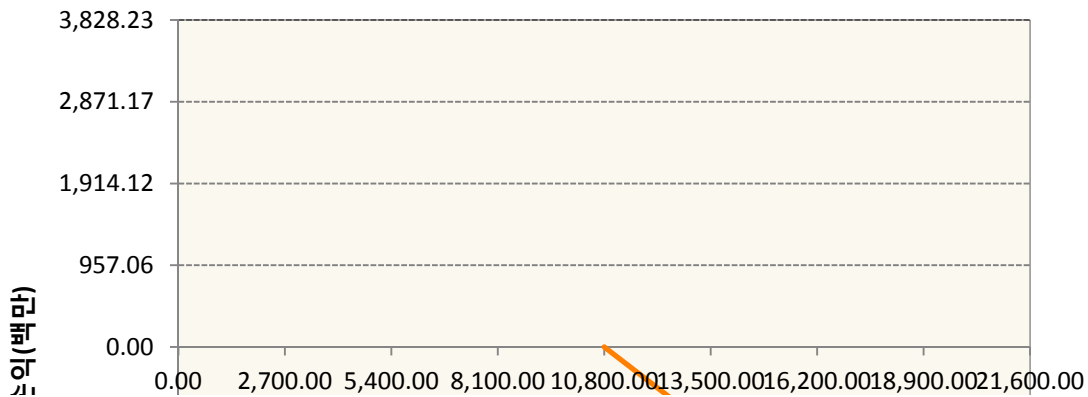
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,099	0	5,099	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,476	-11,476	장내

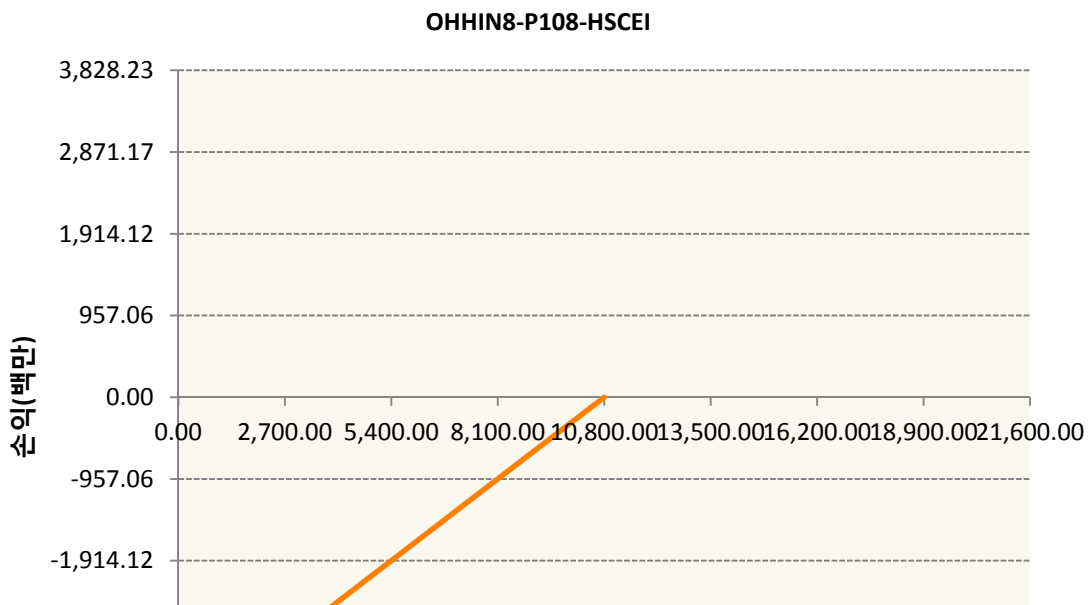
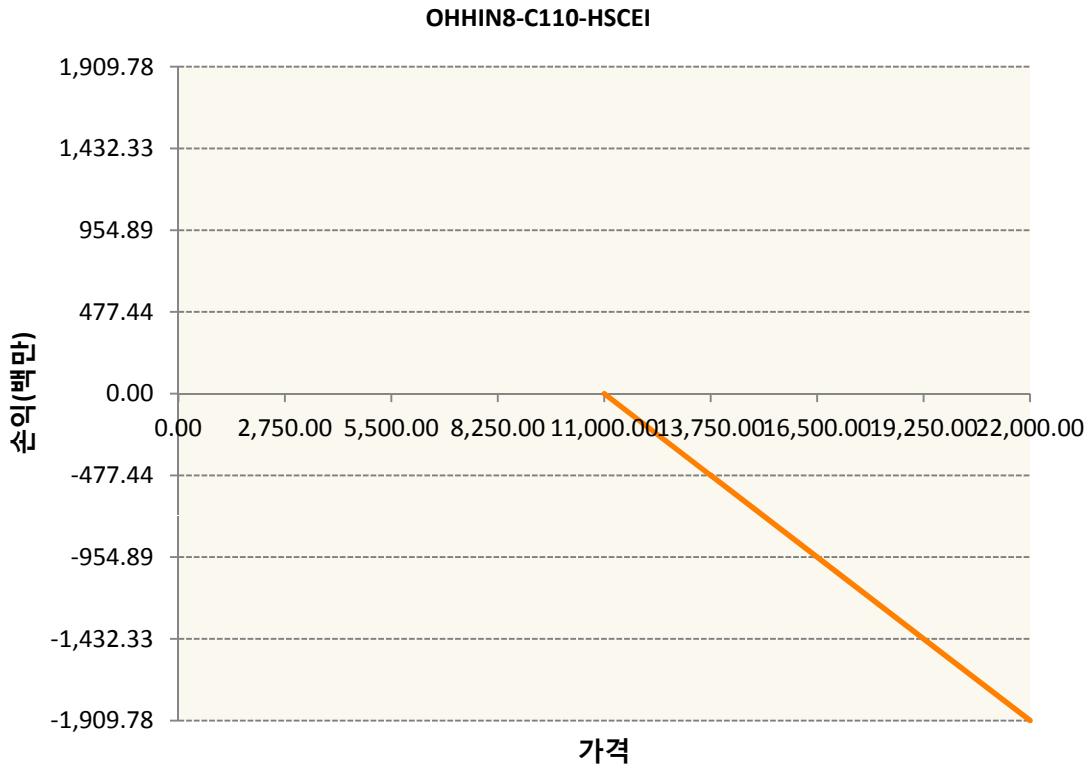
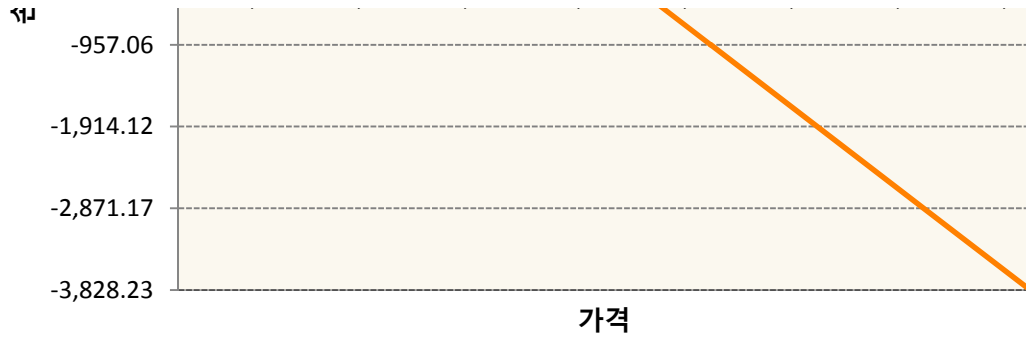
### 2. 만기시점의 손익구조

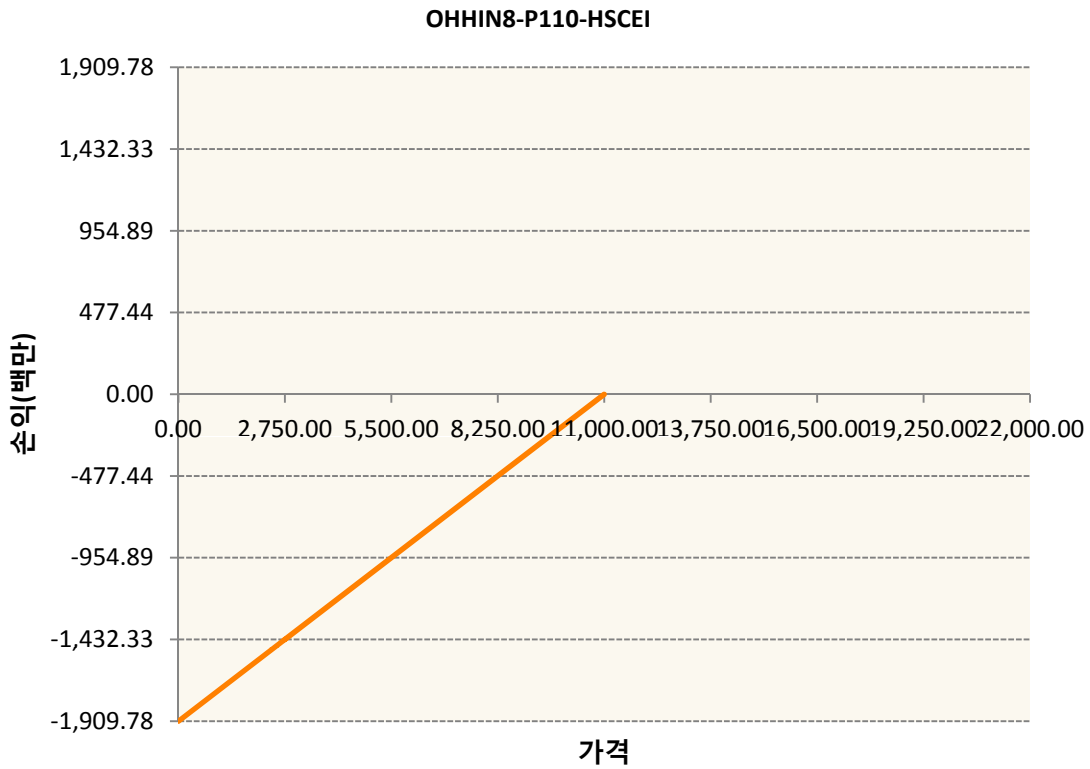
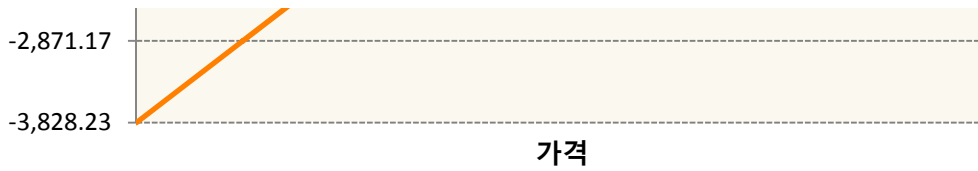
HCN8-HSCEI Futures Jul18



OHHIN8-C108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCN8	HSCEI Futures Jul18	408
OHHIN8-C1	HSCEI	306
OHHIN8-C1	HSCEI	153
OHHIN8-P1	HSCEI	306
OHHIN8-P11	HSCEI	153

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,203

공시일	2018-07-25
기준일	2018-07-24

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

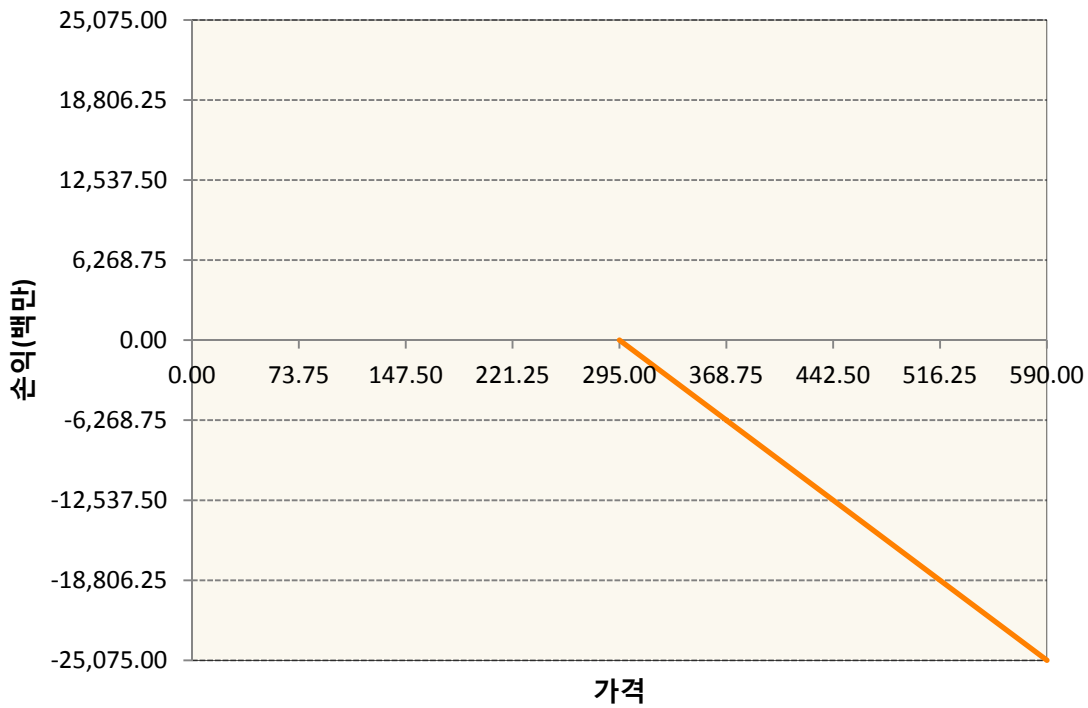
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

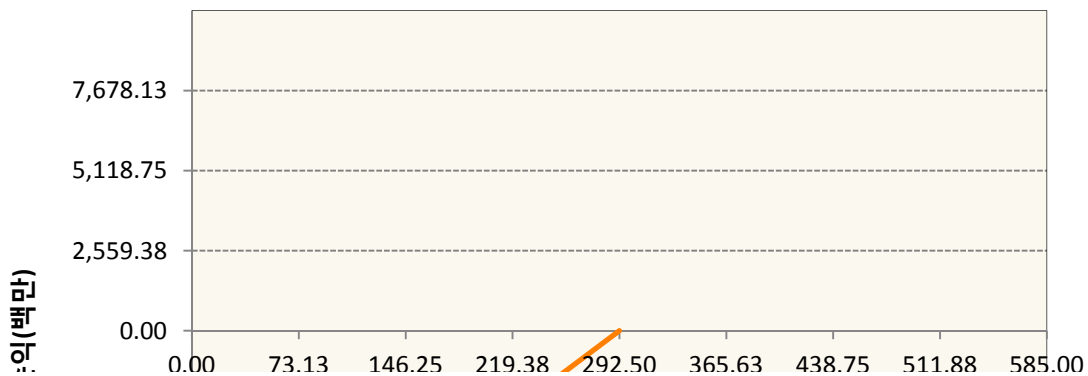
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	45,200	0	45,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	43,425	-43,425	장내

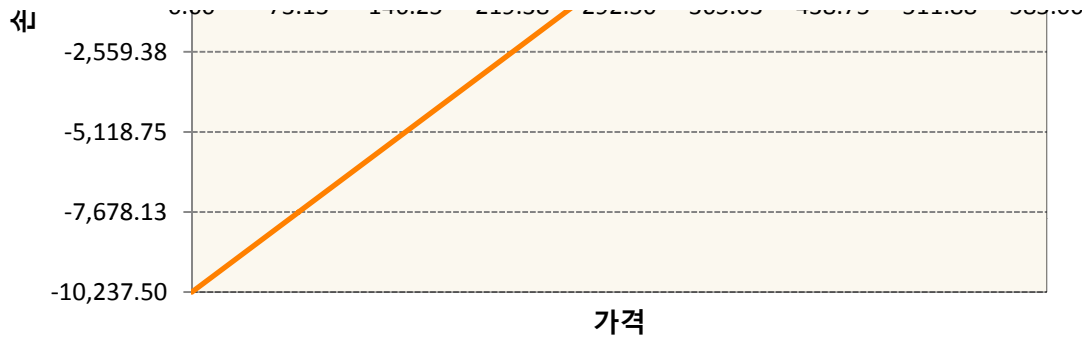
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N82951-2018-08 콜295

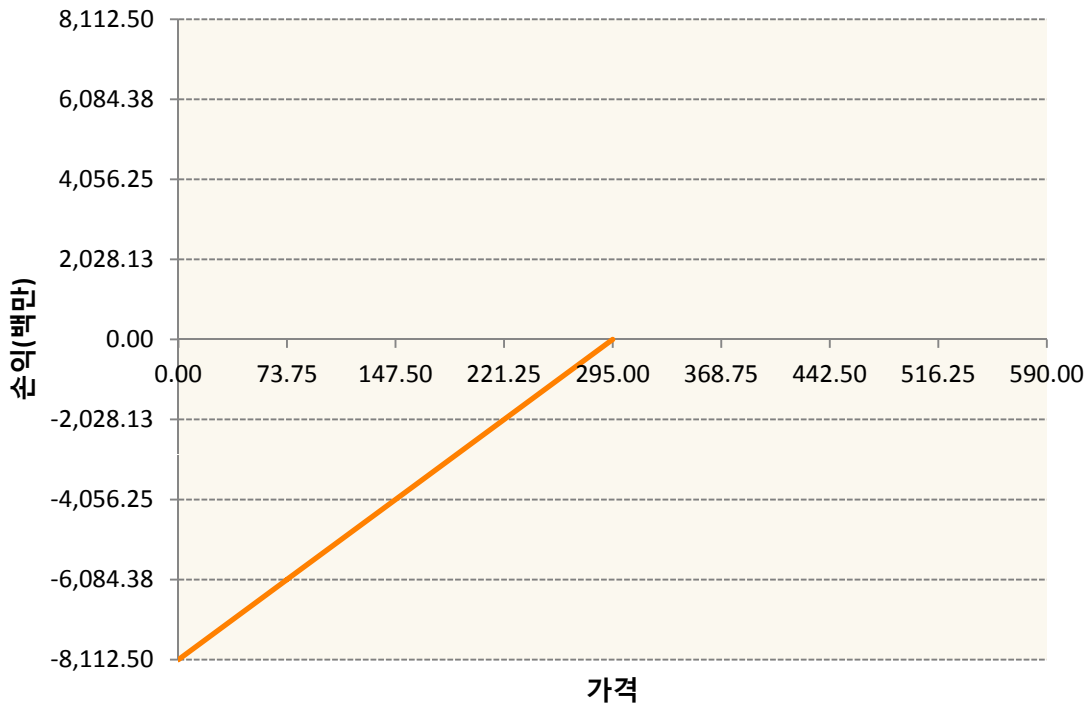


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





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

1,576

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	610	599	584	566	545	522	496
-5.33%	560	533	504	472	437	401	364
-2.67%	424	380	336	291	245	199	152
0%	151	101	50	0	-50	-101	-151
2.67%	-274	-317	-362	-407	-453	-500	-547
5.33%	-823	-850	-881	-915	-950	-988	-1,028
8.00%	-1,444	-1,458	-1,475	-1,496	-1,520	-1,546	-1,576

KR4301N829 2018-08 풋292.5

648

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-644	-644	-645	-645	-646	-647	-648
-5.33%	-371	-372	-375	-378	-381	-386	-390
-2.67%	-123	-131	-139	-148	-157	-165	-175
0%	29	19	10	0	-10	-20	-29
2.67%	73	69	66	61	56	50	44
5.33%	78	77	77	76	74	72	70
8.00%	78	78	78	78	77	77	76

KR4301N829 2018-08 풋295

547

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-545	-546	-546	-546	-546	-546	-547
-5.33%	-330	-330	-331	-333	-334	-337	-339
-2.67%	-124	-129	-134	-139	-145	-151	-157
0%	24	16	8	0	-8	-16	-24
2.67%	81	77	72	67	62	56	50
5.33%	90	89	88	87	85	83	80
8.00%	91	91	90	90	90	89	89

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

(단위:백만원)

6,561

공시일	2018-07-25
기준일	2018-07-24

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

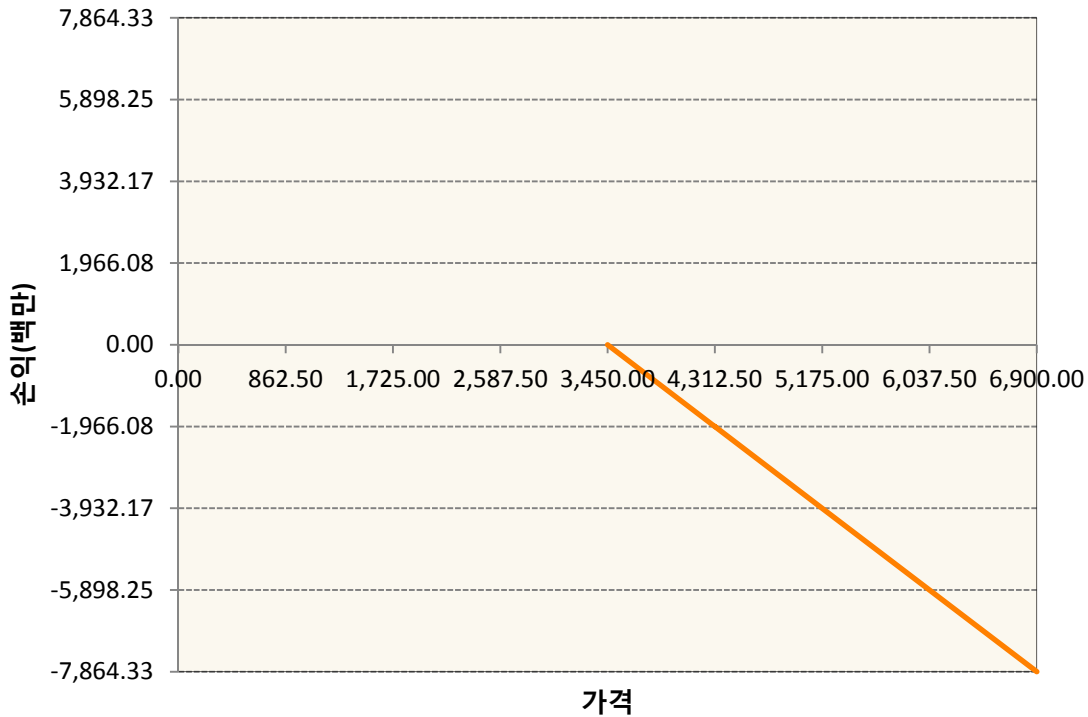
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

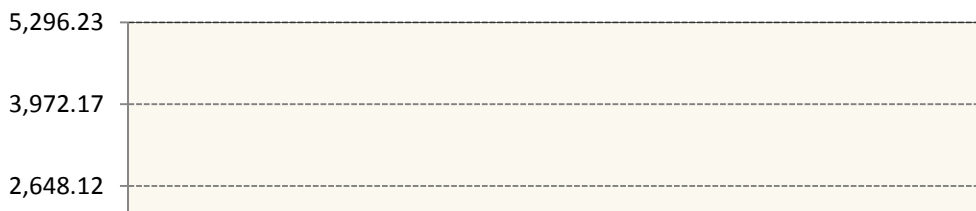
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,556	0	5,556	
누계	유가증권	스왑	45,701	0	45,701	장외
누계	유가증권	옵션	0	21,030	-21,030	장내
누계	지수	스왑	53,806	0	53,806	장외

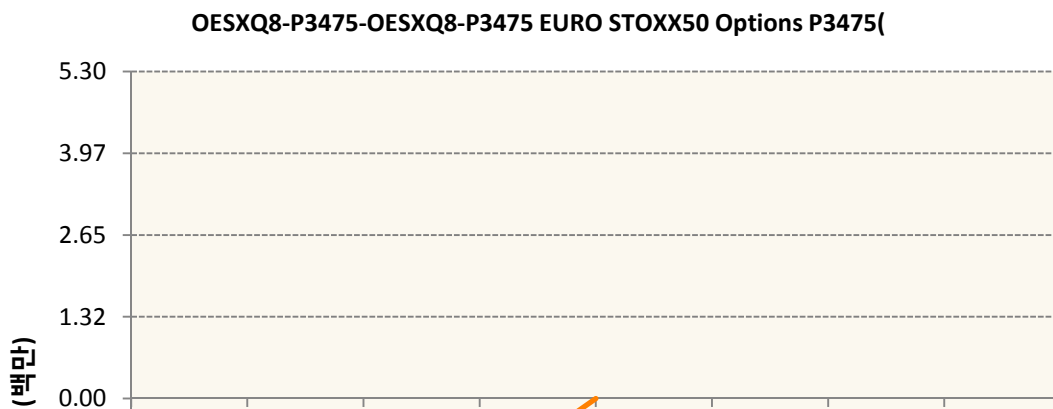
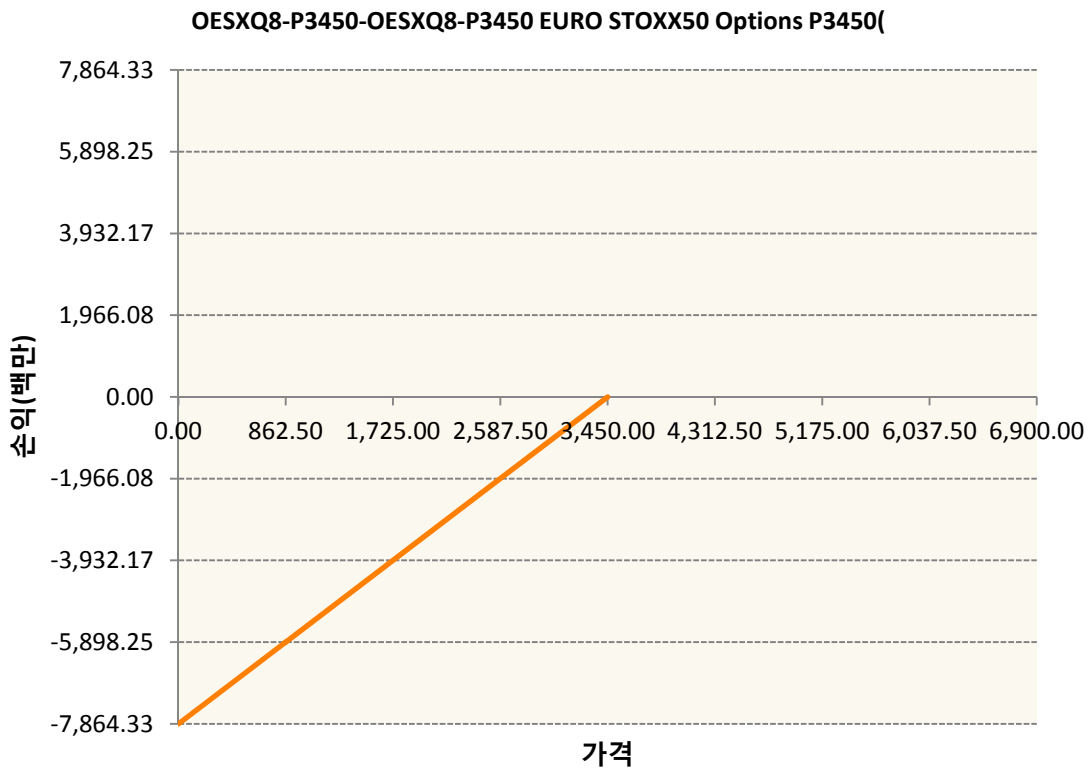
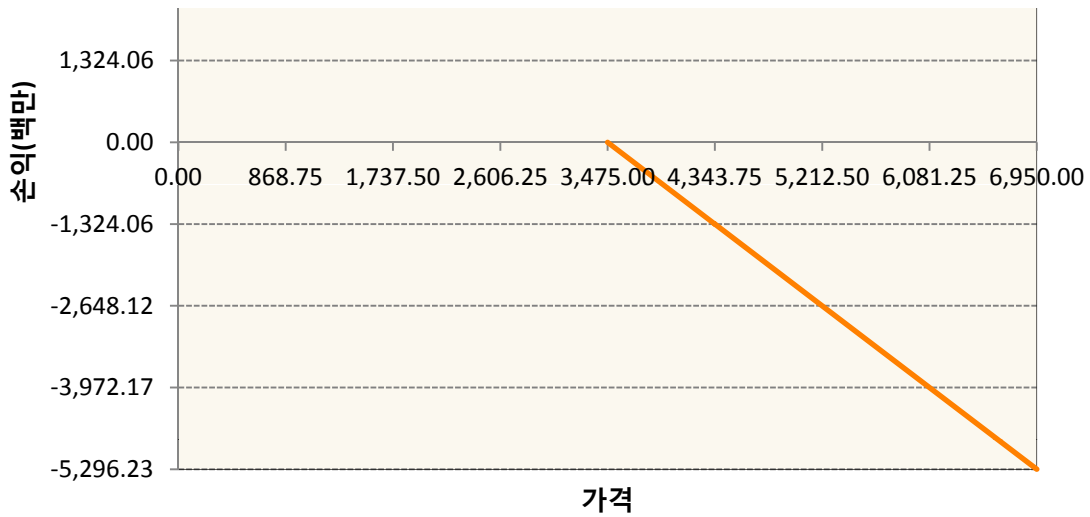
### 2. 만기시점의 손익구조

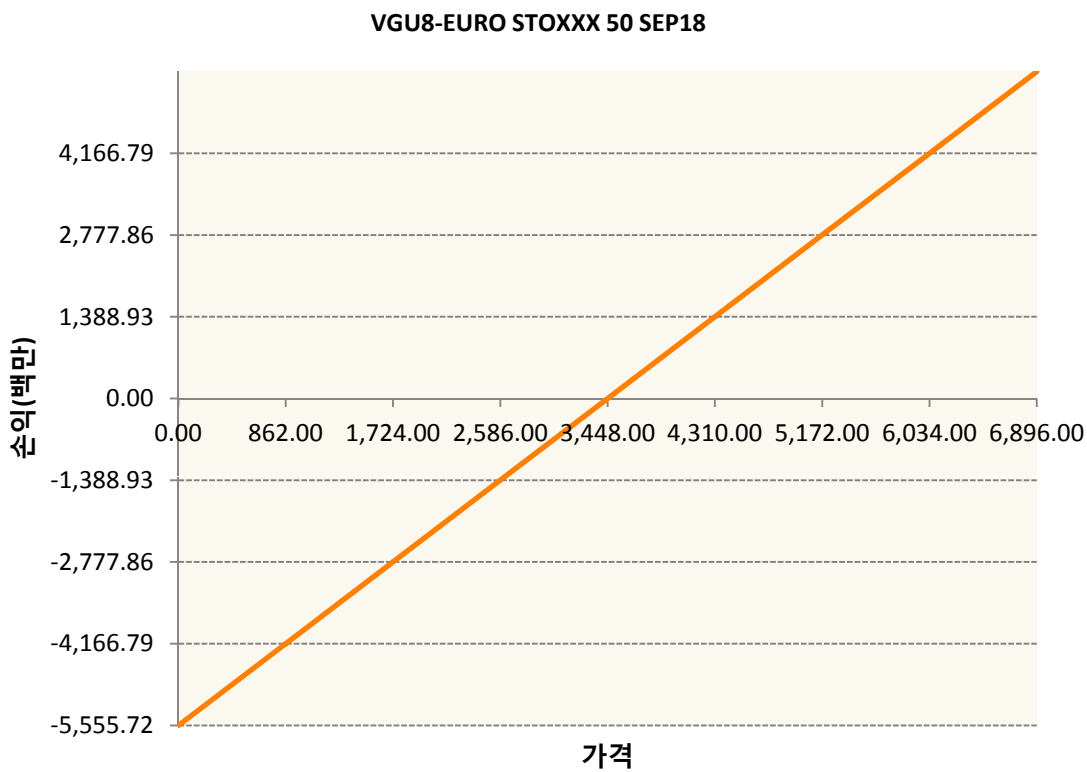
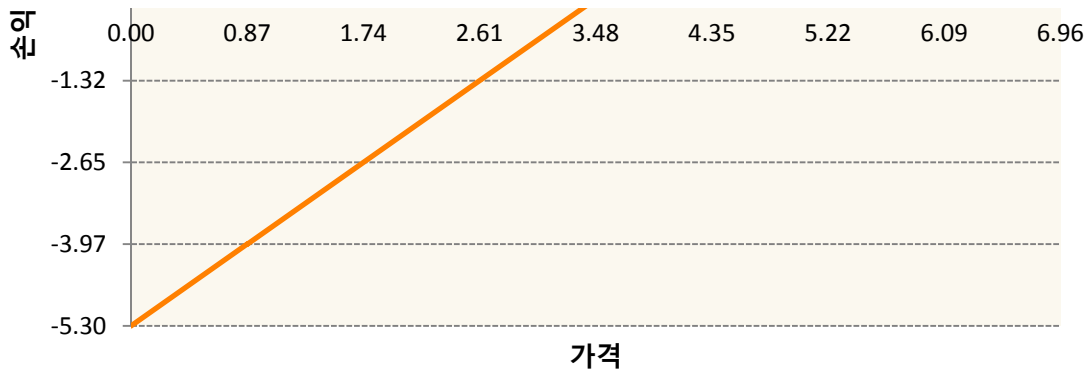
**OESXQ8-C3450-OESXQ8-C3450 EURO STOXX50 Options C3450(**



**OESXQ8-C3475-OESXQ8-C3475 EURO STOXX50 Options C3475(**







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	1
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	1
OESXQ8-C3 OESXQ8-C3450 EURO STOXX50 Options C3450(	629
OESXQ8-C3 OESXQ8-C3475 EURO STOXX50 Options C3475(	424
OESXQ8-P3 OESXQ8-P3450 EURO STOXX50 Options P3450(	629
OESXQ8-P3 OESXQ8-P3475 EURO STOXX50 Options P3475(	0.4
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18	444

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





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

(단위:백만원)

1,139



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)

40

공시일	2018-07-25
기준일	2018-07-24

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

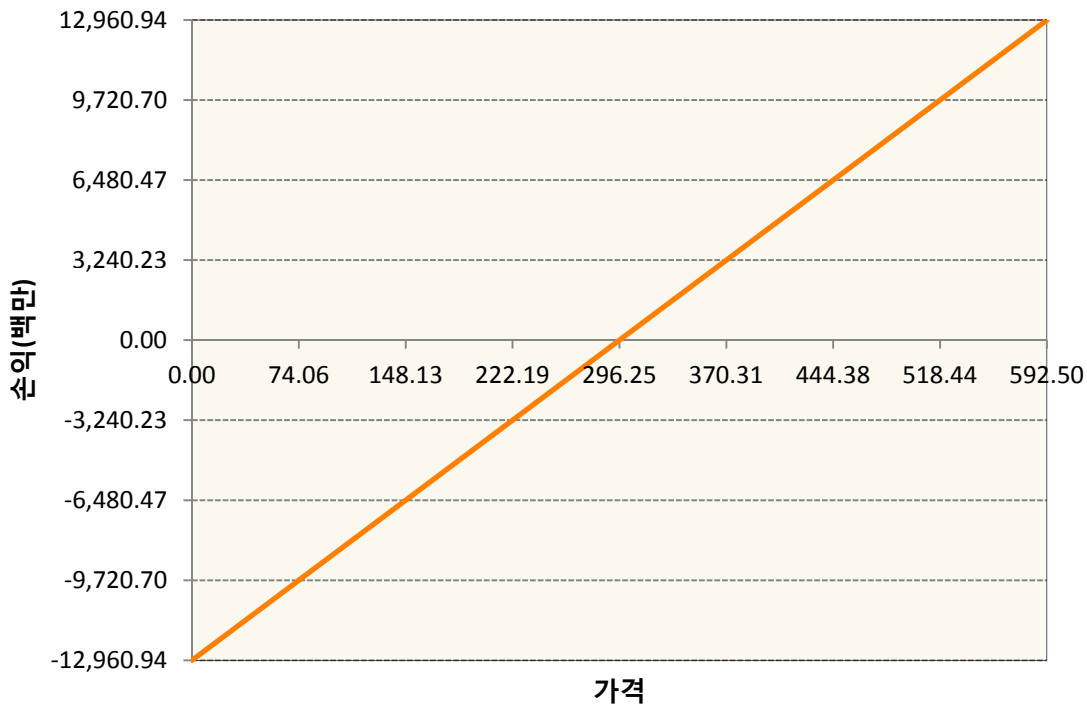
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

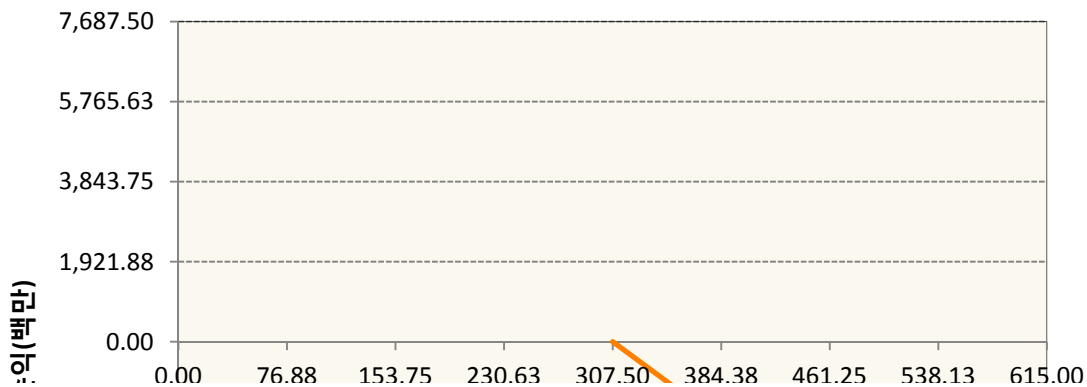
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,961	0	12,961	장내
누계	유가증권	옵션	2,134	23,653	-21,518	장내

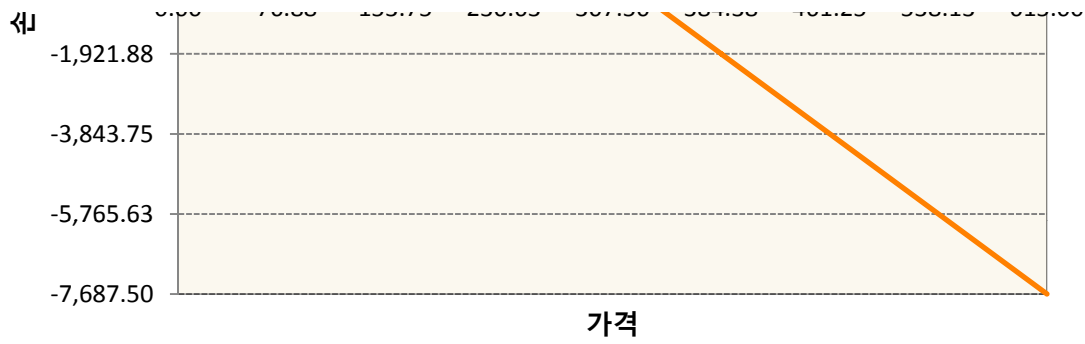
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

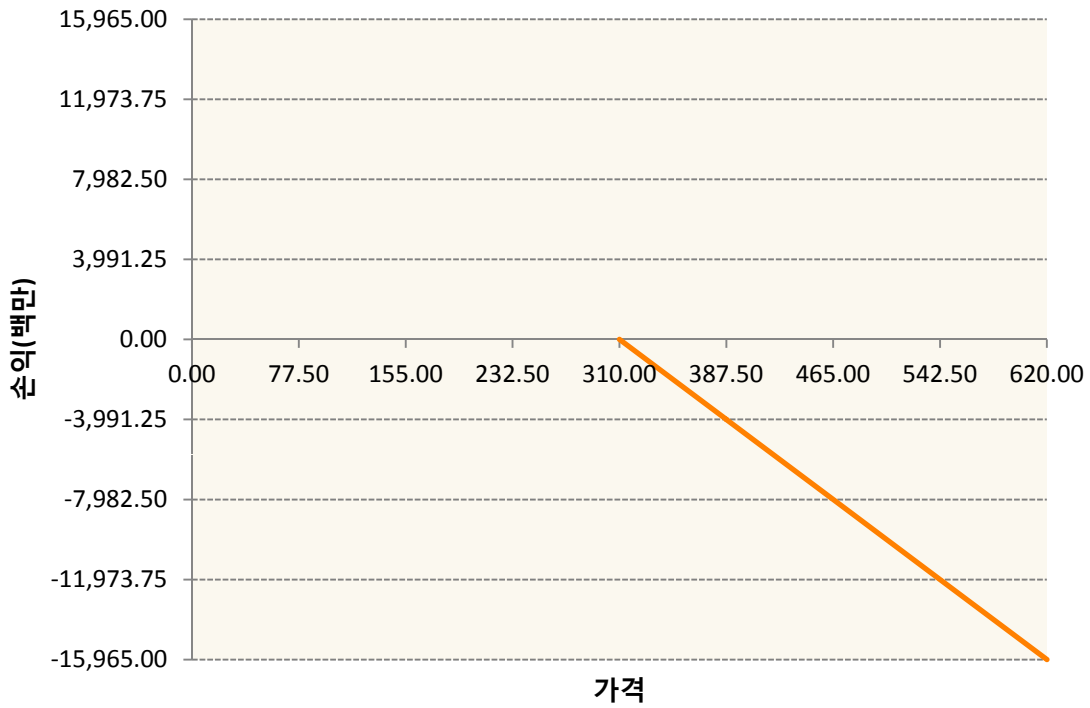


KR4201N83074-2018-08 콜307.5

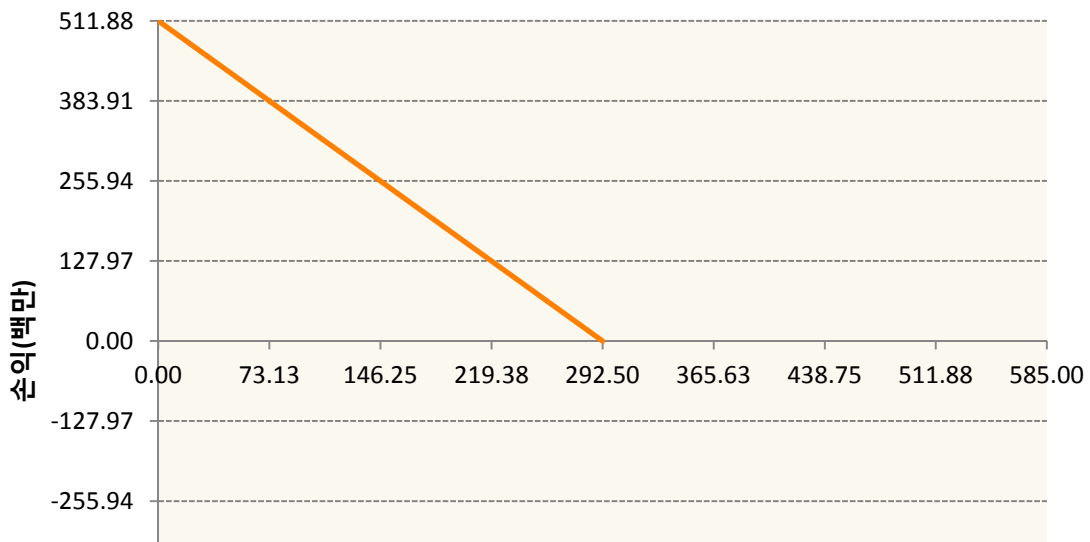


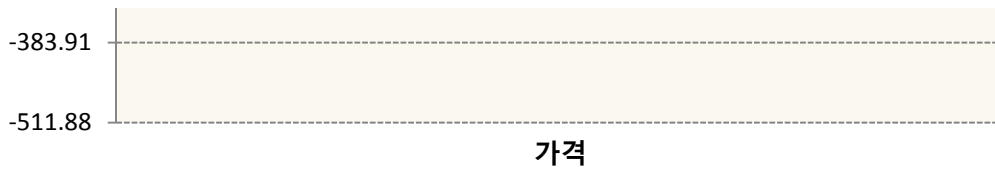


**KR4201N83108-2018-08 콜310**

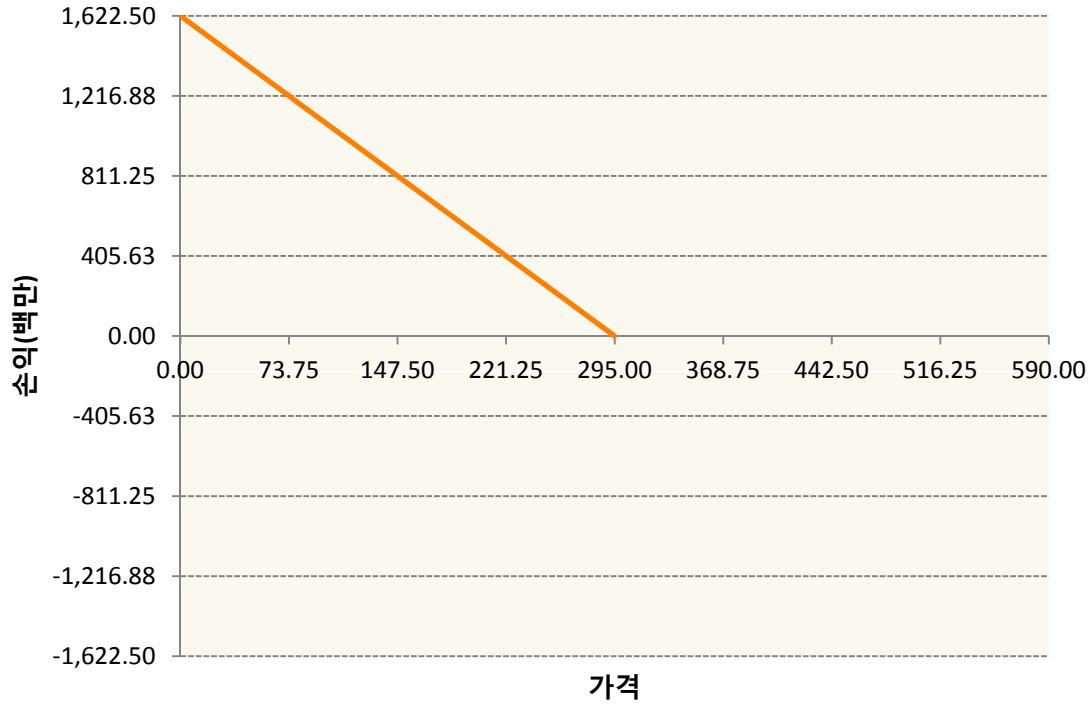


**KR4301N82926-2018-08 풋292.5**





KR4301N82959-2018-08 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물 1,034

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,034	-1,034	-1,034	-1,034	-1,034	-1,034	-1,034
-5.33%	-689	-689	-689	-689	-689	-689	-689
-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%	689	689	689	689	689	689	689
8.00%	1,034	1,034	1,034	1,034	1,034	1,034	1,034

KR4201N83C 2018-08 콜307.5 339

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	69	69	68	66	64	61	58
-5.33%	67	65	62	58	54	48	42
-2.67%	59	54	47	39	31	22	12

0%	34	23	12	0	-12	-25	-38
2.67%	-23	-38	-52	-67	-82	-97	-112
5.33%	-122	-137	-152	-167	-182	-198	-213
8.00%	-262	-274	-286	-299	-312	-326	-339

KR4201N8312018-08 콜310

644

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	114	113	112	110	106	102	96
-5.33%	112	108	104	98	90	80	69
-2.67%	100	91	80	66	51	35	16
0%	62	43	22	0	-23	-48	-73
2.67%	-32	-61	-90	-119	-149	-179	-210
5.33%	-208	-240	-272	-304	-336	-368	-400
8.00%	-471	-498	-526	-555	-584	-614	-644

KR4301N829 2018-08 풋292.5

32

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	32	32	32	32	32	32	32
-5.33%	19	19	19	19	19	19	20
-2.67%	6	7	7	7	8	8	9
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-4	-3	-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

109

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	109	109	109	109	109	109	109
-5.33%	66	66	66	67	67	67	68
-2.67%	25	26	27	28	29	30	31
0%	-5	-3	-2	0	2	3	5
2.67%	-16	-15	-14	-13	-12	-11	-10
5.33%	-18	-18	-18	-17	-17	-17	-16
8.00%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18

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

(단위:백만원)

1,669

공시일	2018-07-25
기준일	2018-07-24

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

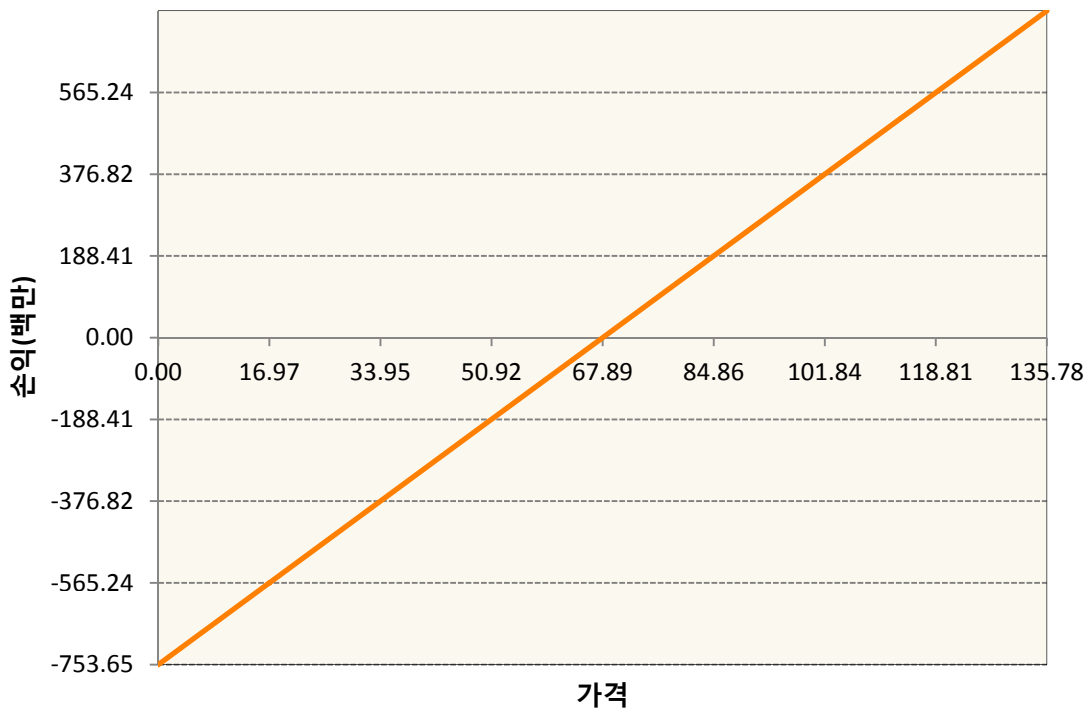
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

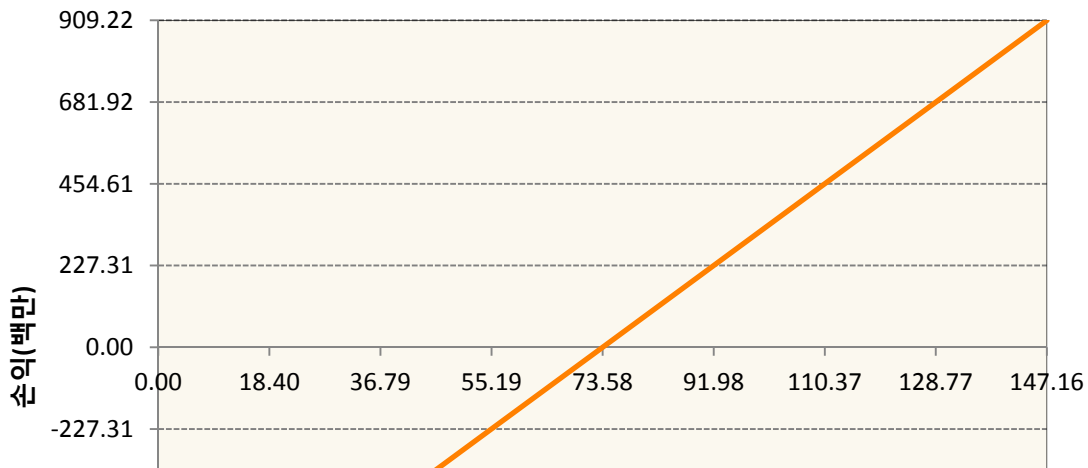
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,590	625	2,965	

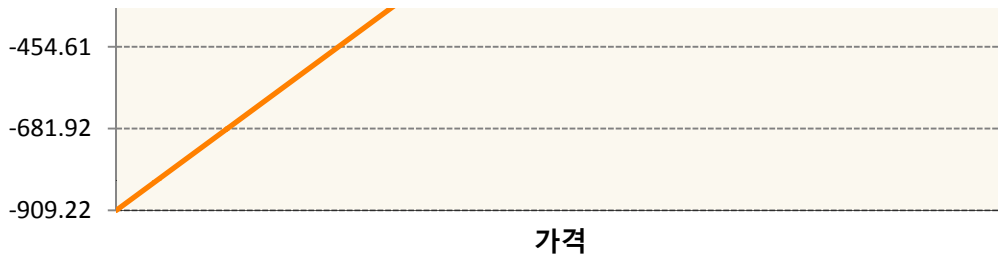
### 2. 만기시점의 손익구조

CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18

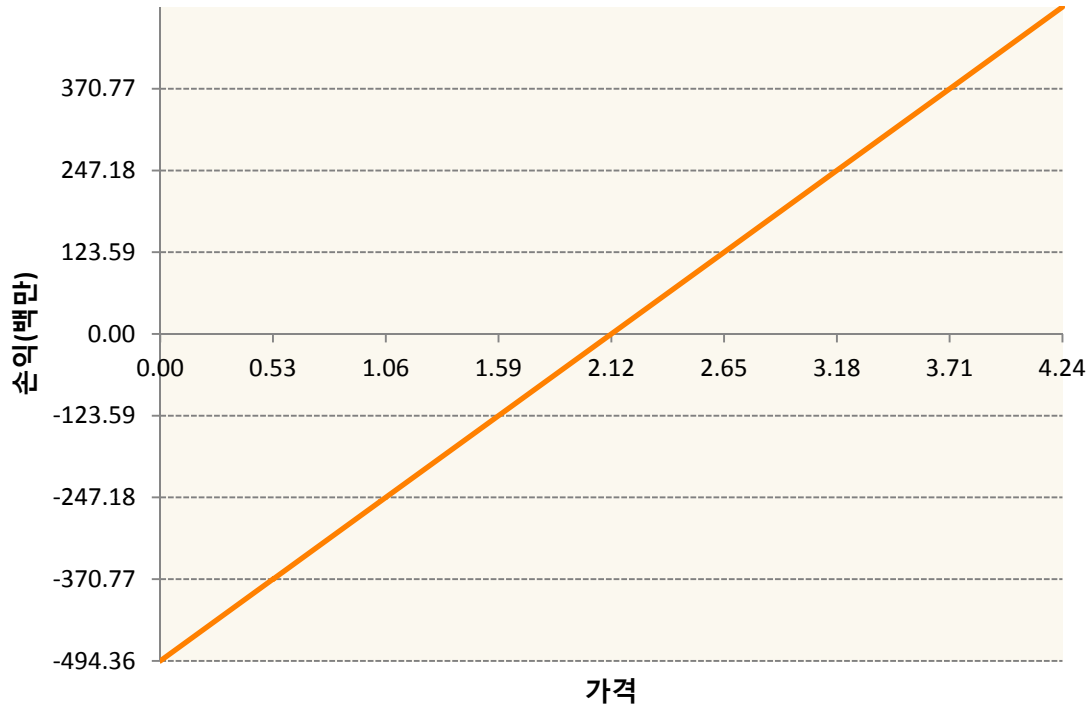


COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18

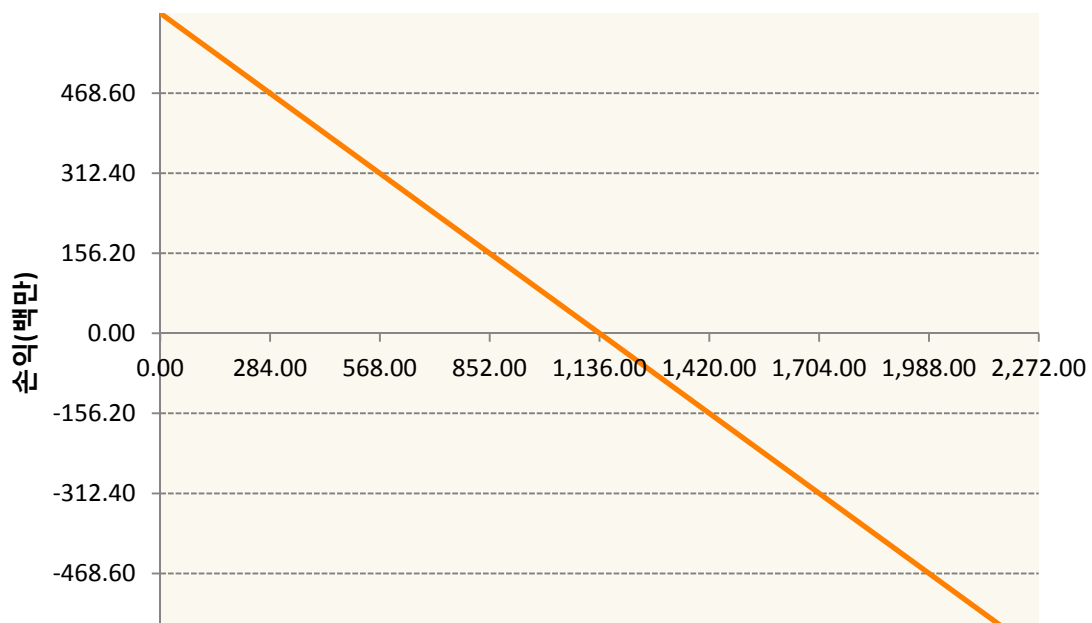


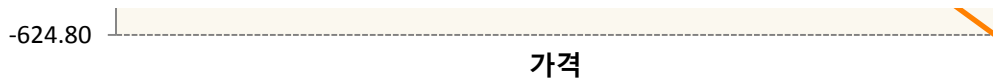


**HOU8-NY Harb ULSD Fut SEP18**

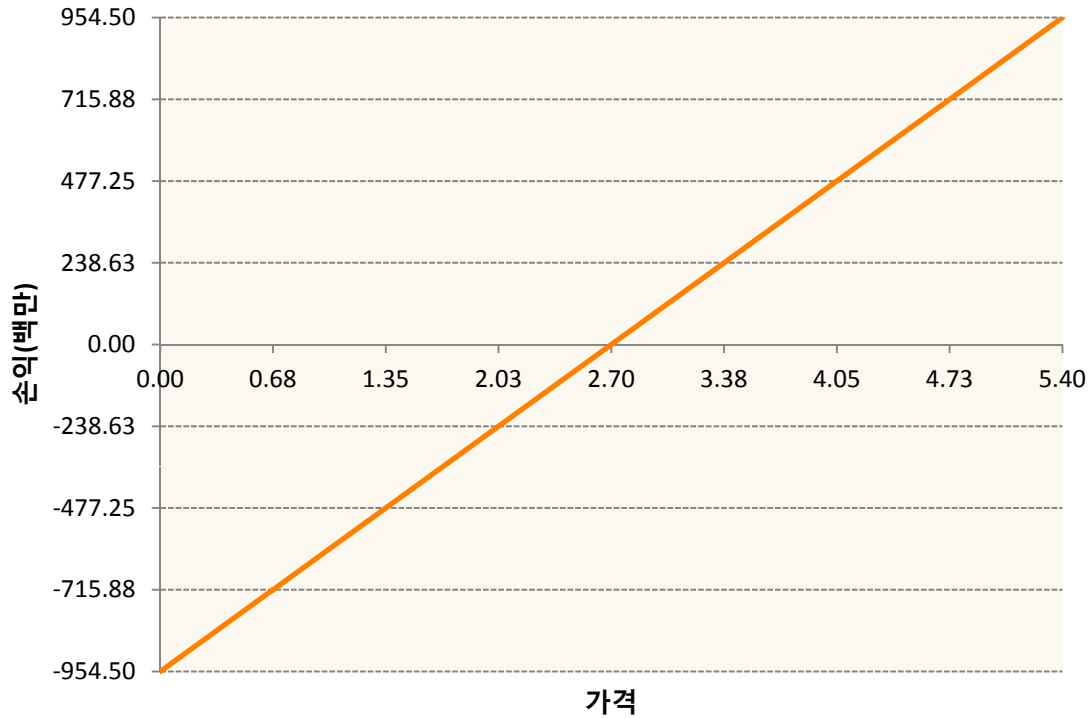


**KR4175N80001-2018-08 달러선물**

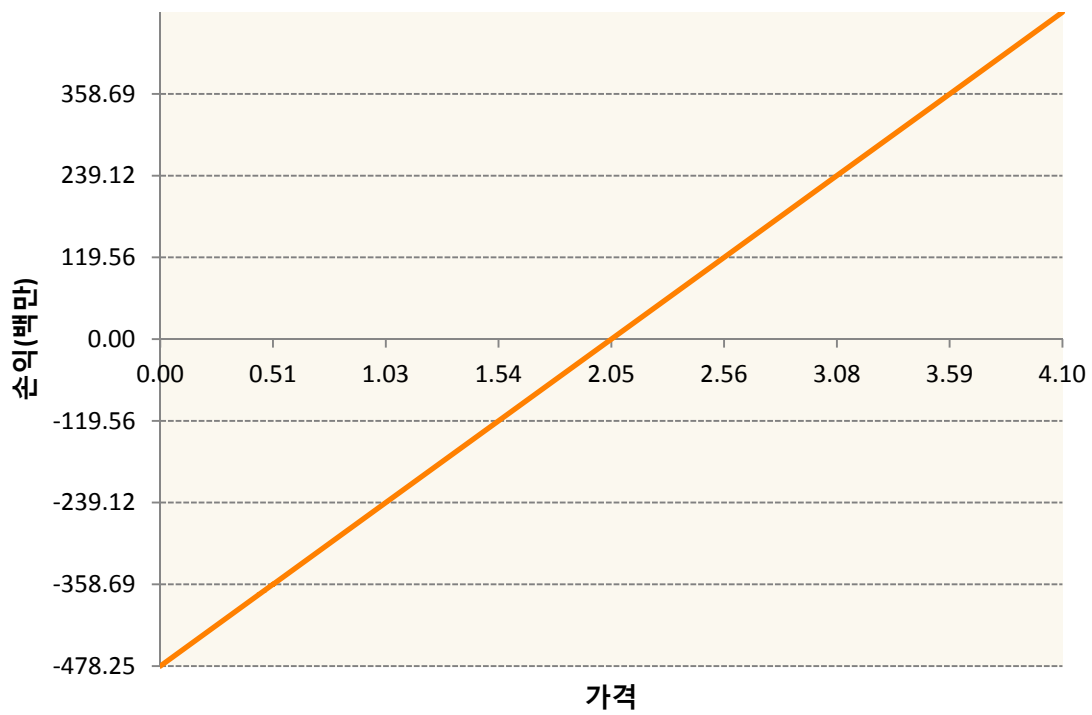




**NGU18-NATURAL GAS FUTR SEP18**



**XBU8-GASOLINE RBOB FUT SEP18**



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

CLU8	WTI CRUDE FUTURE SEP18	60
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	73
HOU8	NY Harb ULSD Fut SEP18	40
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)

446

공시일	2018-07-25
기준일	2018-07-24

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

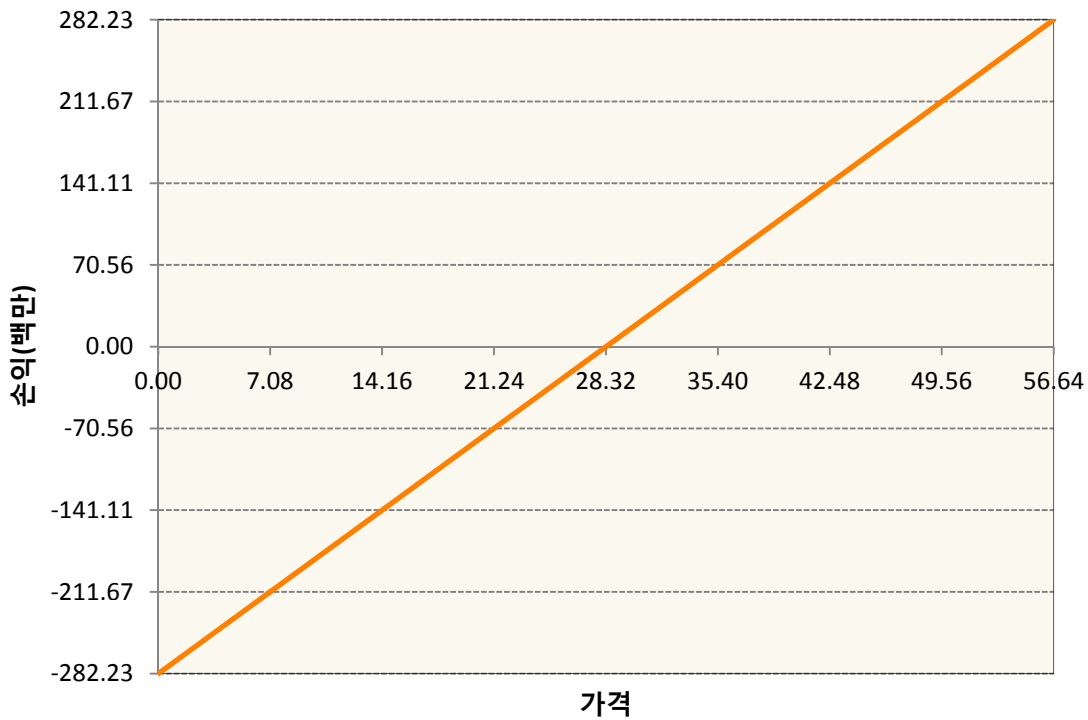
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

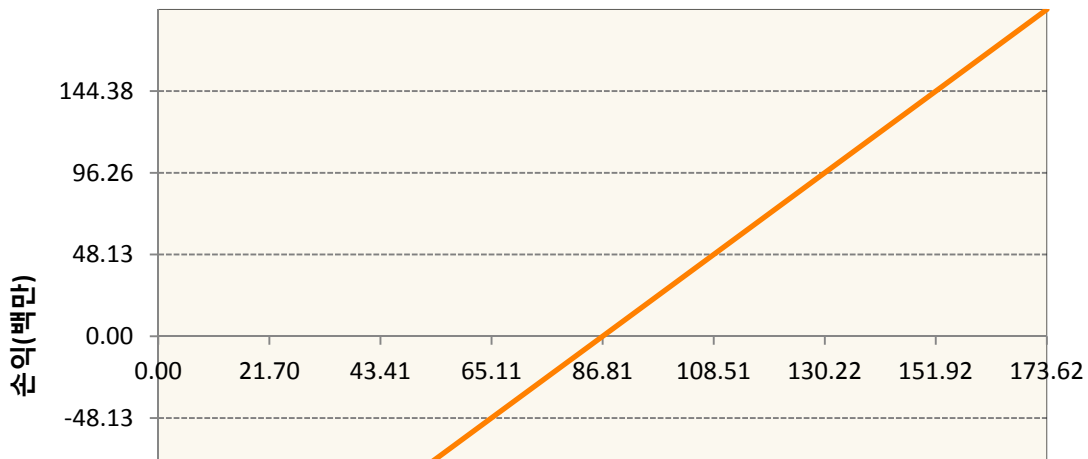
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,614	80	3,535	

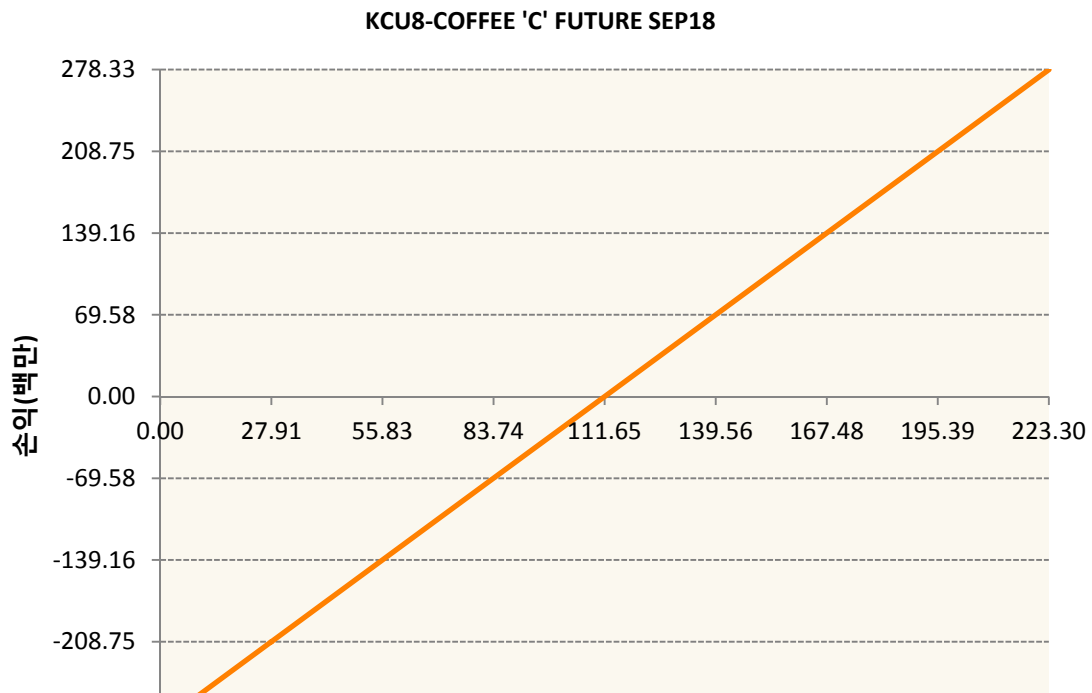
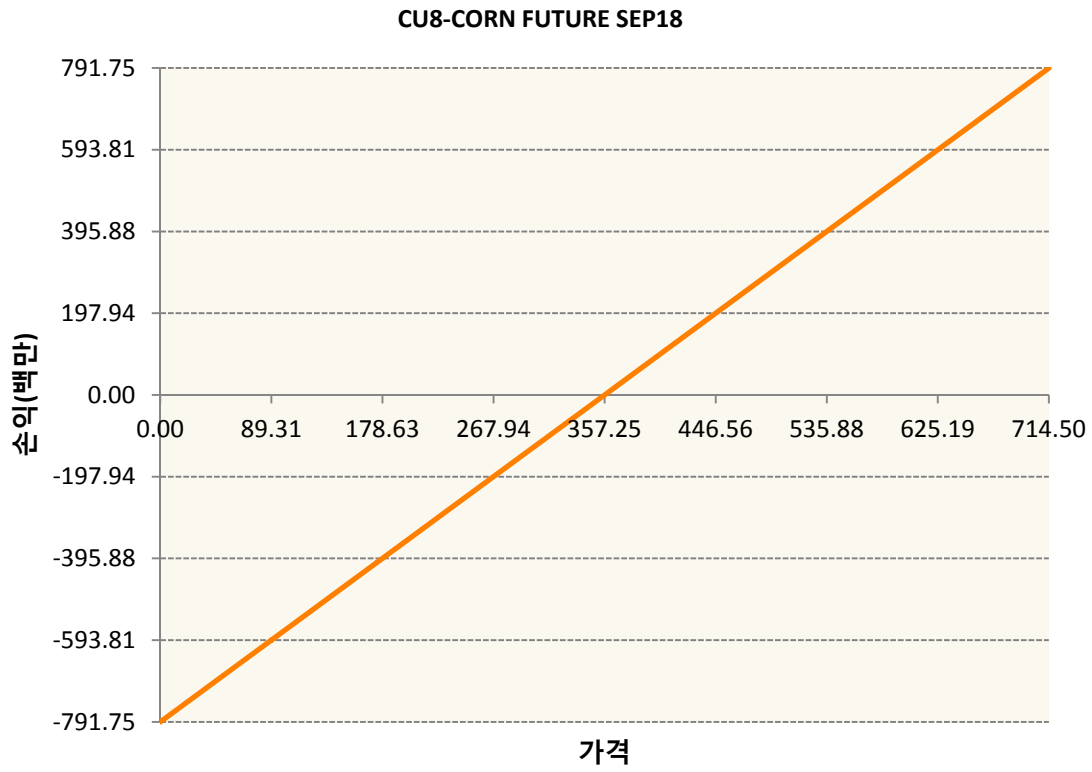
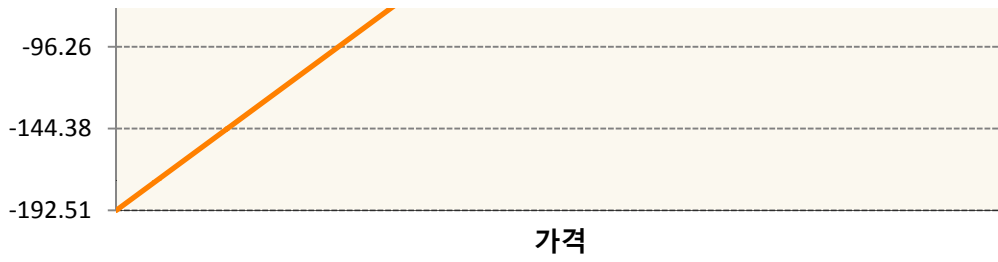
### 2. 만기시점의 손익구조

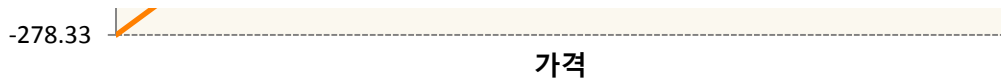
**BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18**



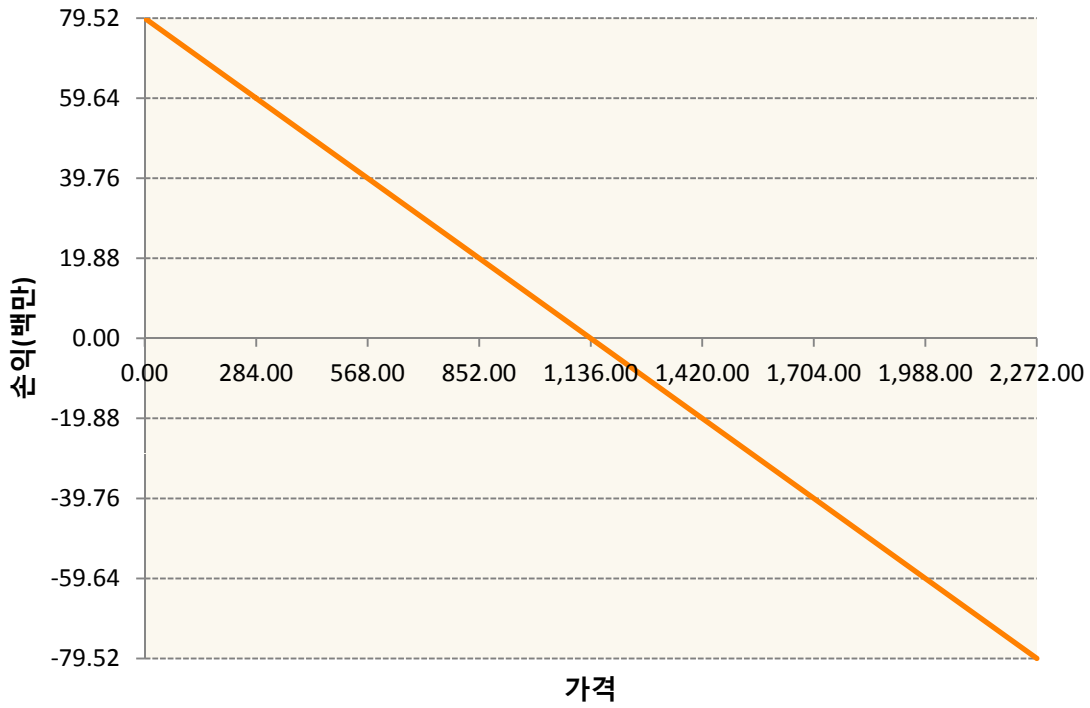
**CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18**



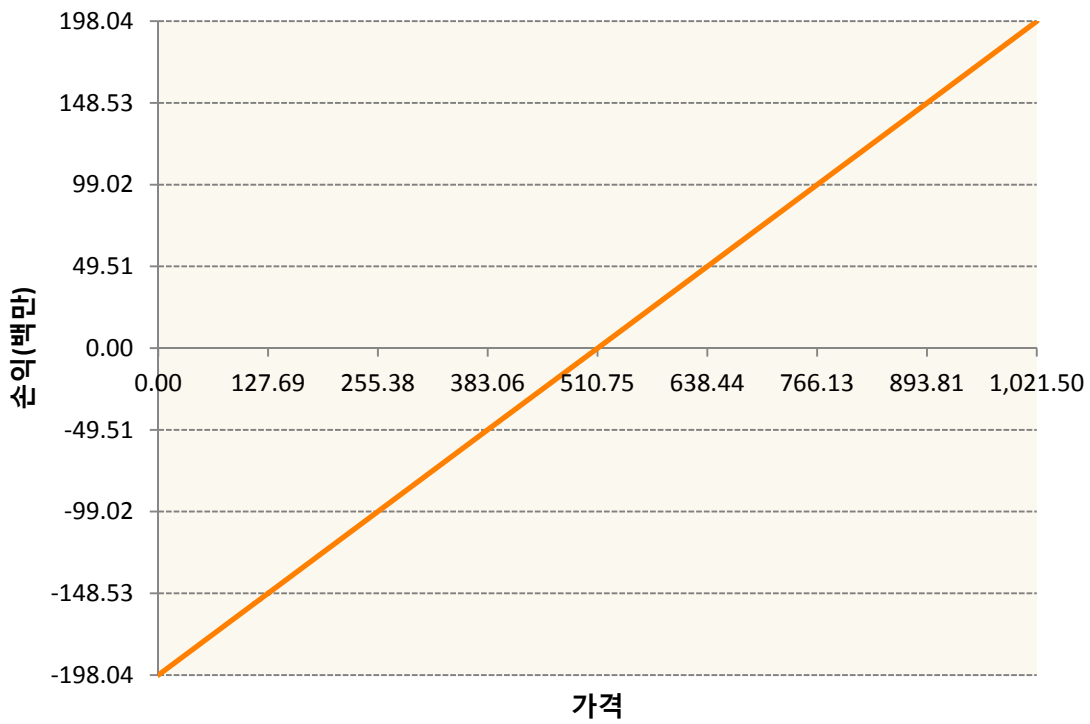




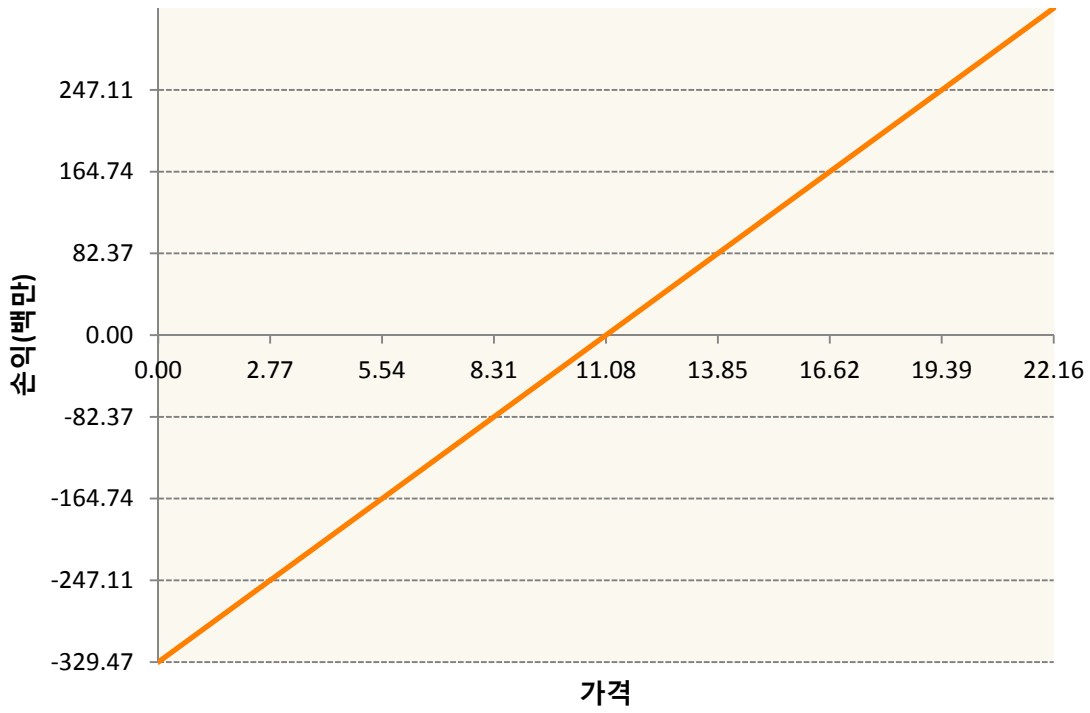
**KR4175N80001-2018-08 달러선물**



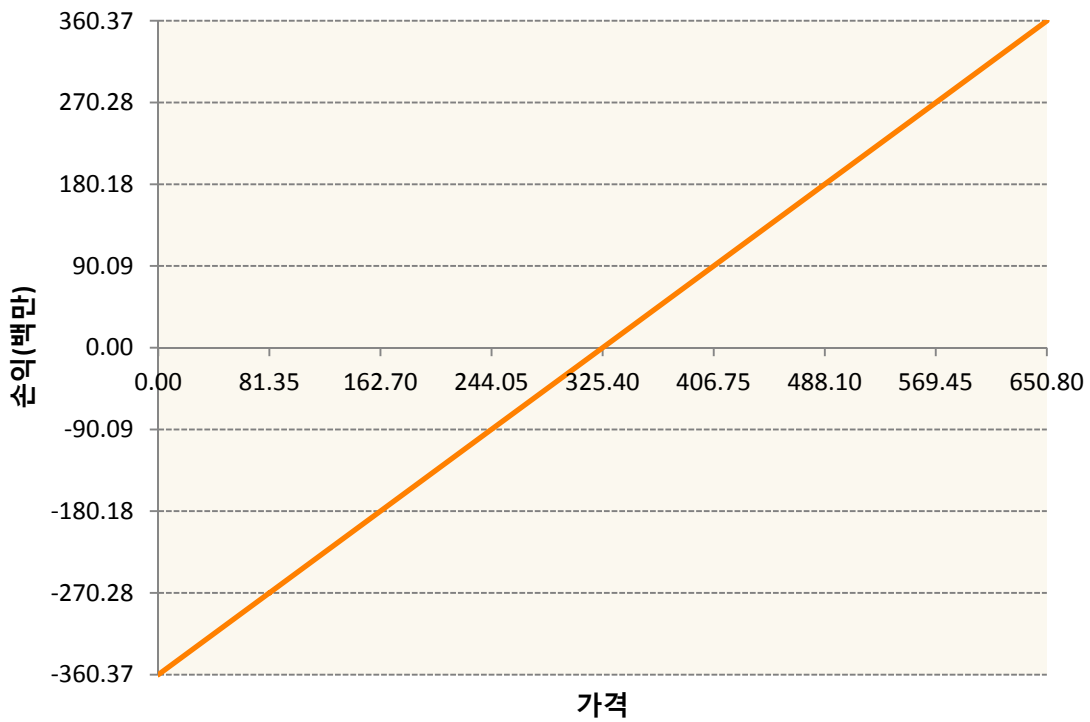
**KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18**



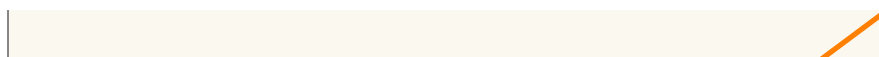
SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

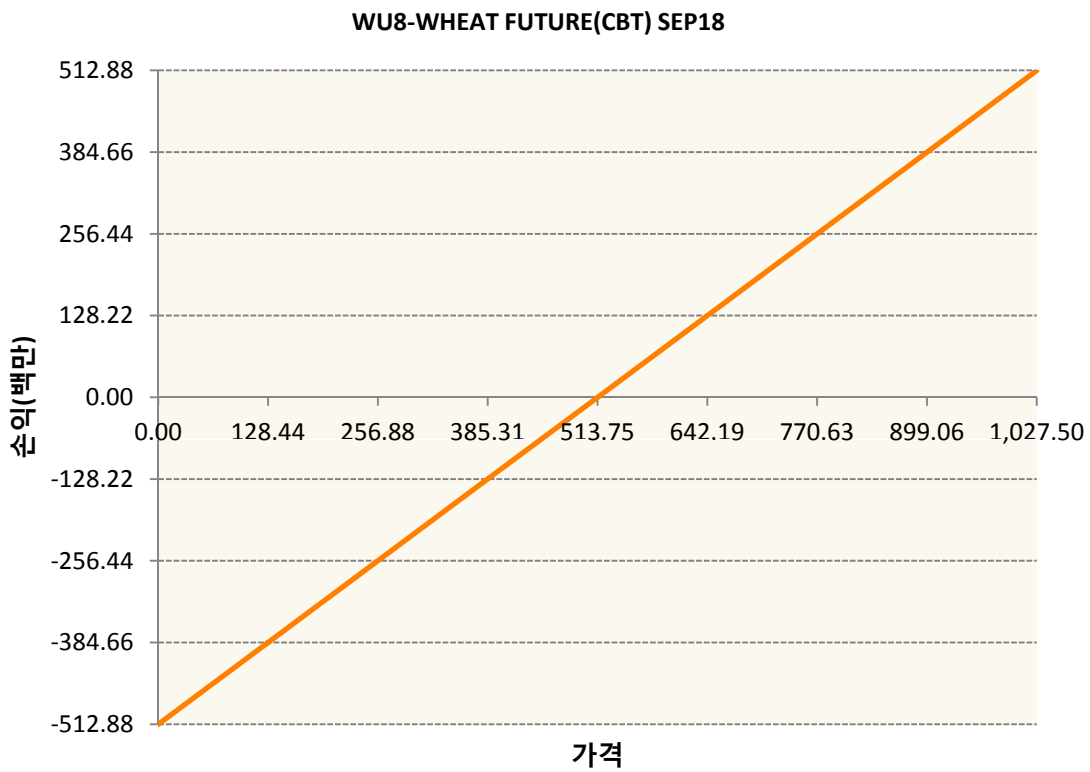
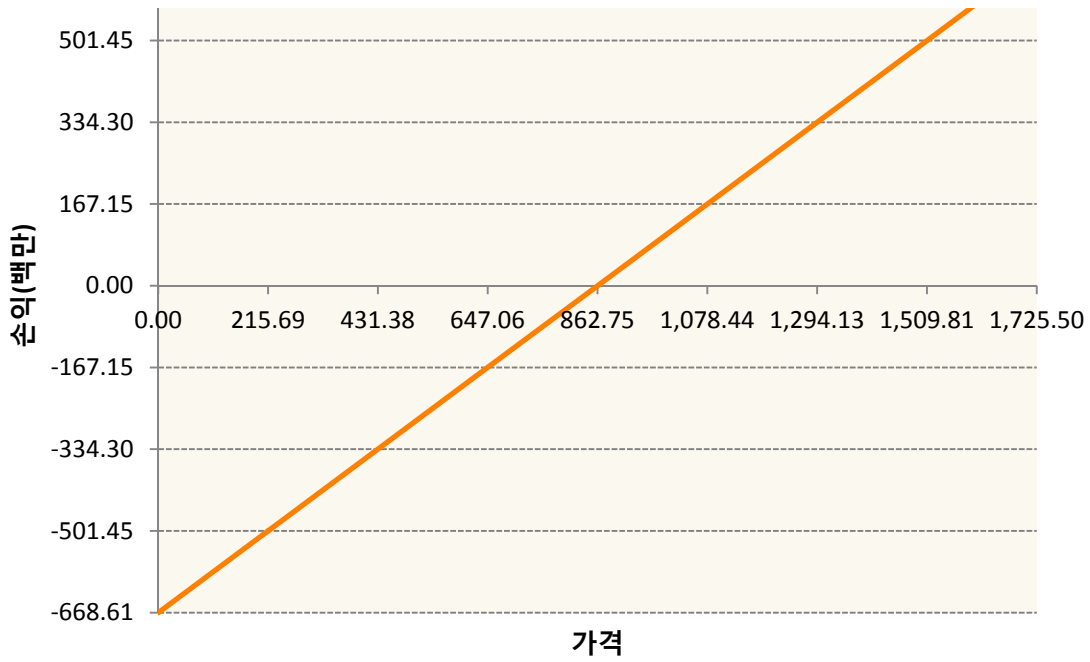


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	23
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	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	53
WU8	WHEAT FUTURE(CBT) SEP18	41

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

(단위:백만원)

**304**