

공시일	2018-07-26
기준일	2018-07-25

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	2018-07-26
기준일	2018-07-25

스마트인덱스모

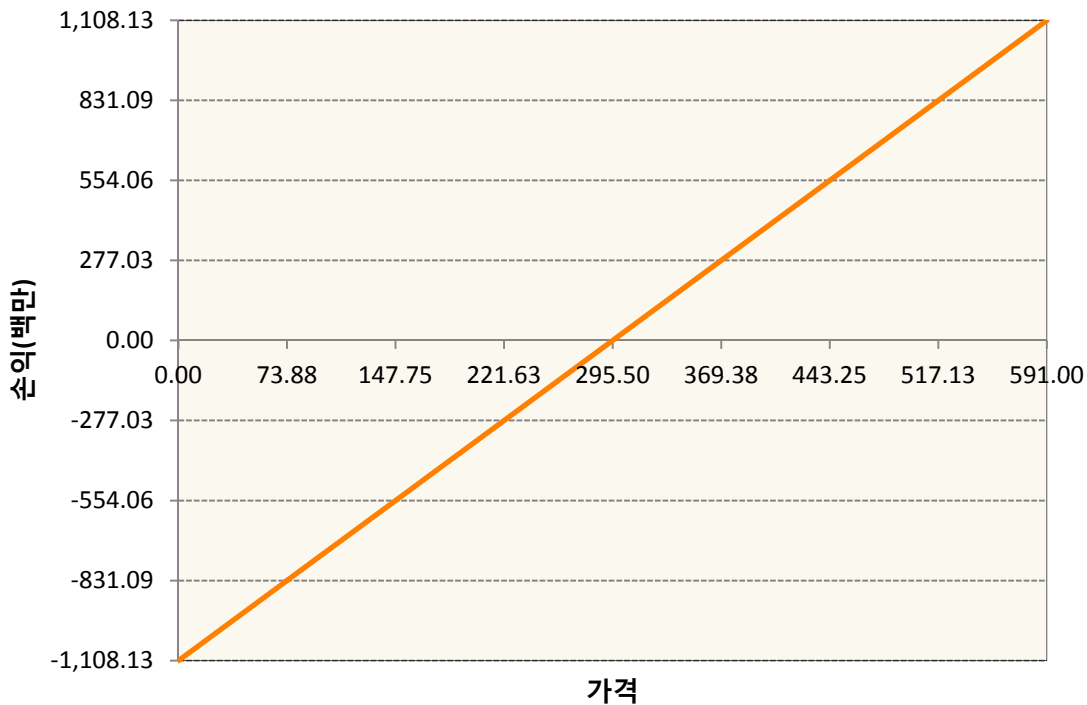
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,108	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	2018-07-26
기준일	2018-07-25

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

1,139

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

482

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-07-26
기준일	2018-07-25

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

330

* 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	2018-07-26
기준일	2018-07-25

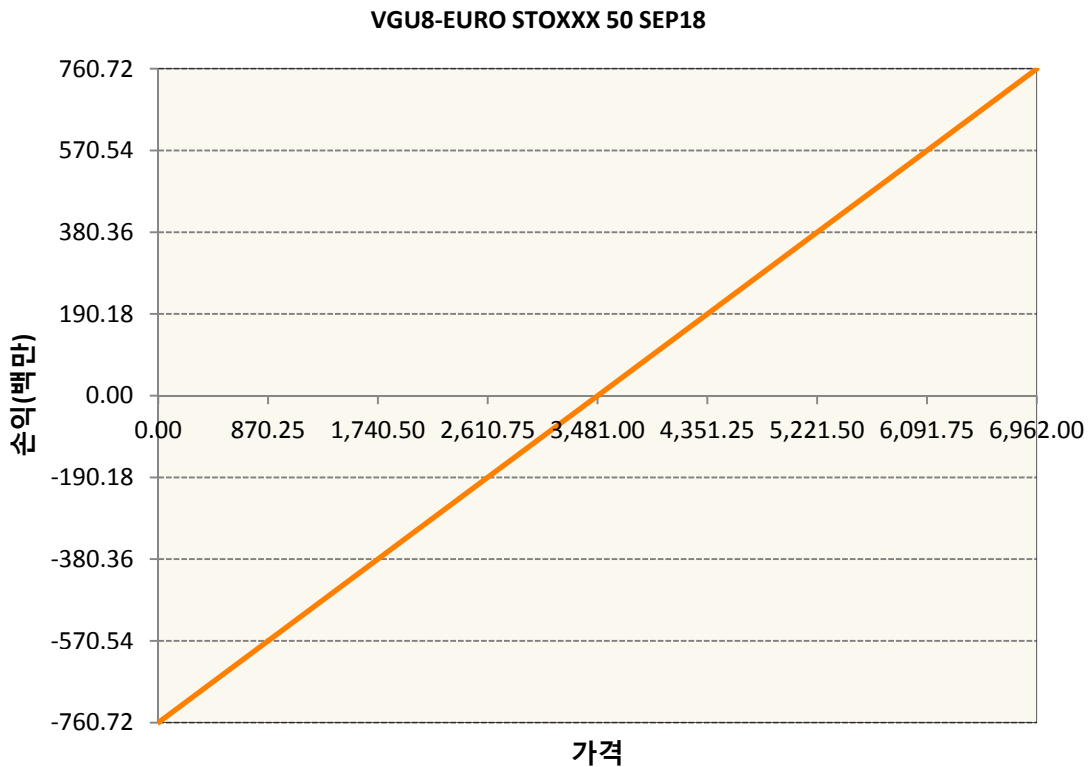
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	761	0	761	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

38

공시일	2018-07-26
기준일	2018-07-25

차이나인덱스모(주식-파생형)

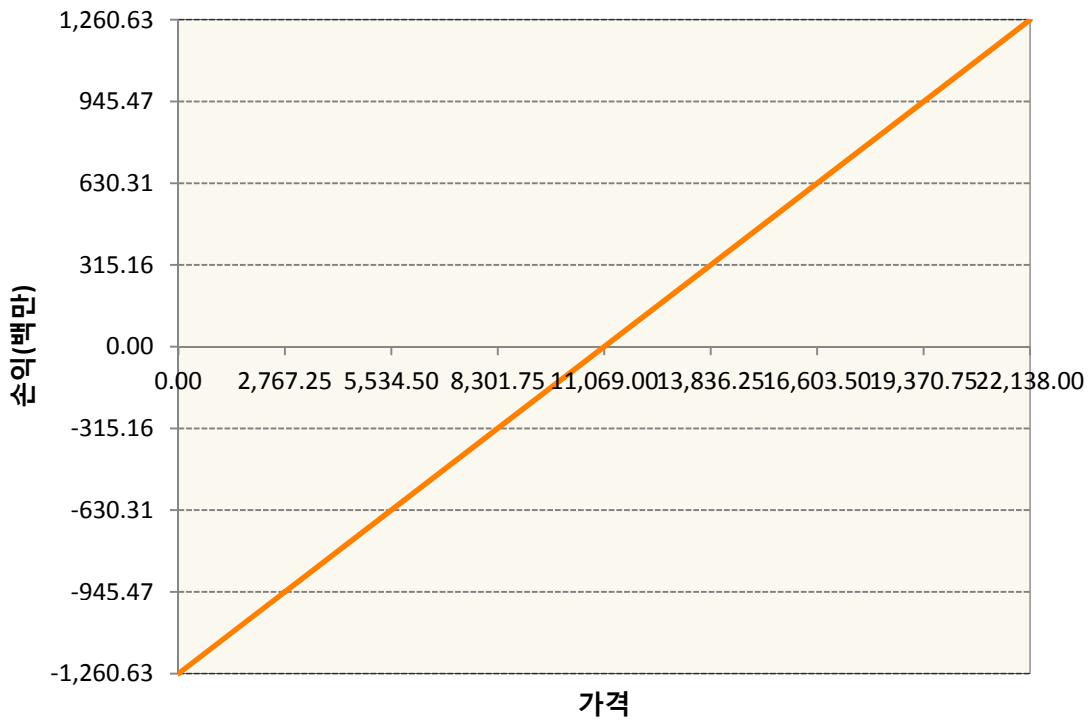
1. 계약금액

(단위:백만원)

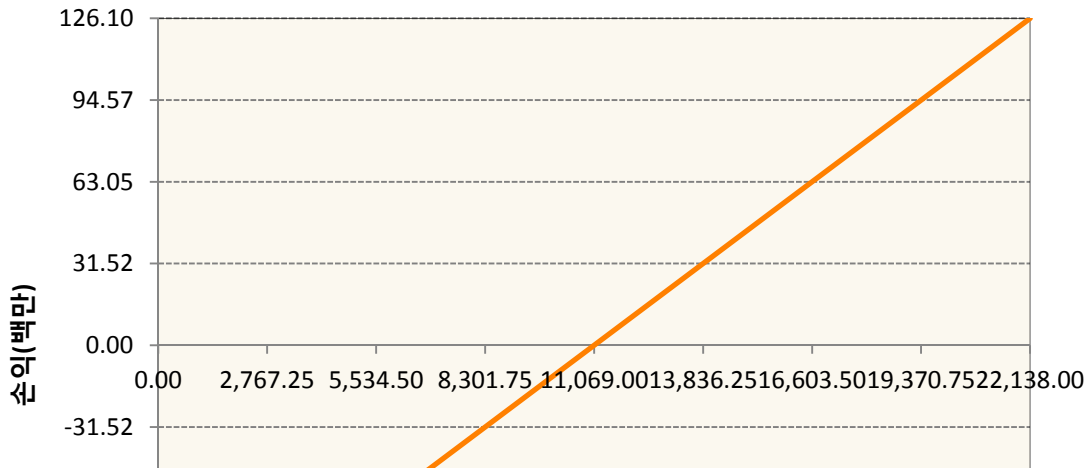
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,387	0	1,387	장내

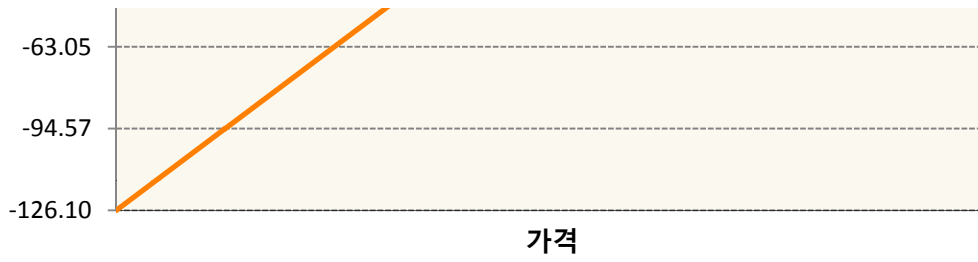
2. 만기시점의 손익구조

HCN8-HSCEI Futures Jul18



MHCN8-MINI H-SHR IDX FU JUL18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCN8	HSCEI Futures Jul18	101
MHCN8	MINI H-SHR IDX FU JUL18	10

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

101

공시일	2018-07-26
기준일	2018-07-25

커버드콜모(주식혼합-파생형)

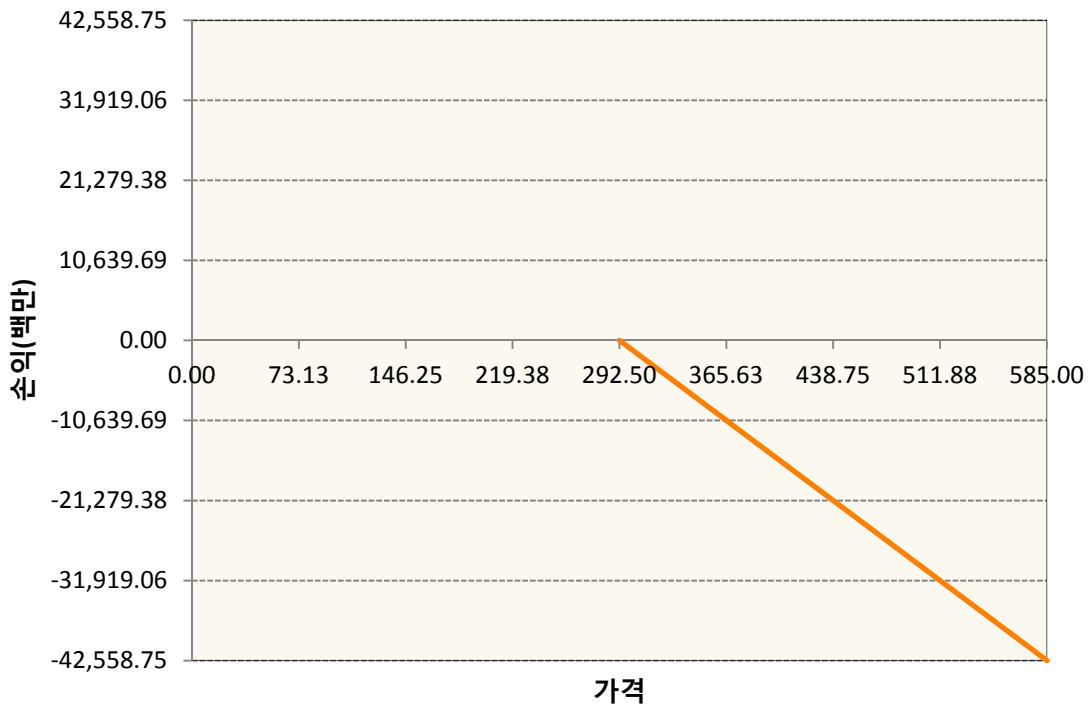
1. 계약금액

(단위:백만원)

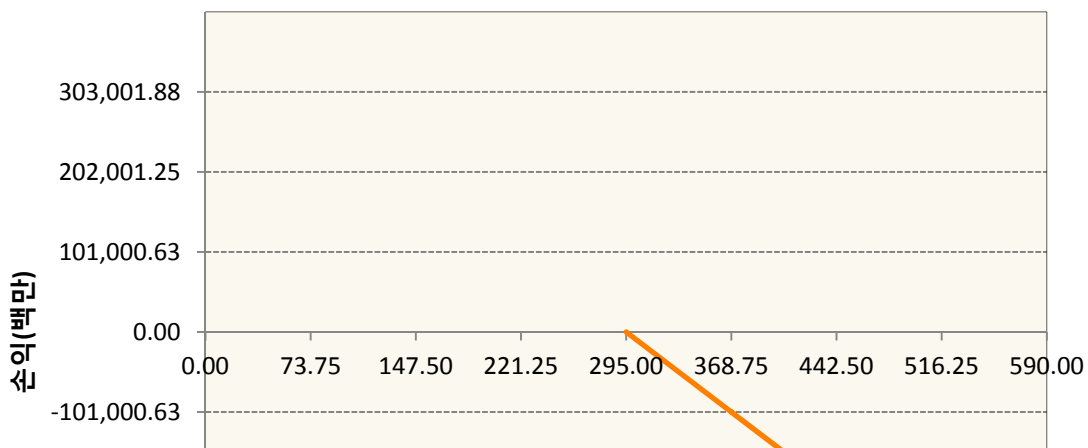
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	725,561	-725,561	장내

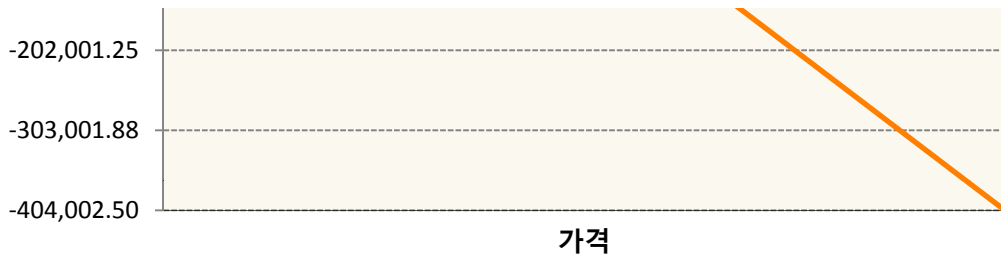
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N82928-2018-08 콜292.5

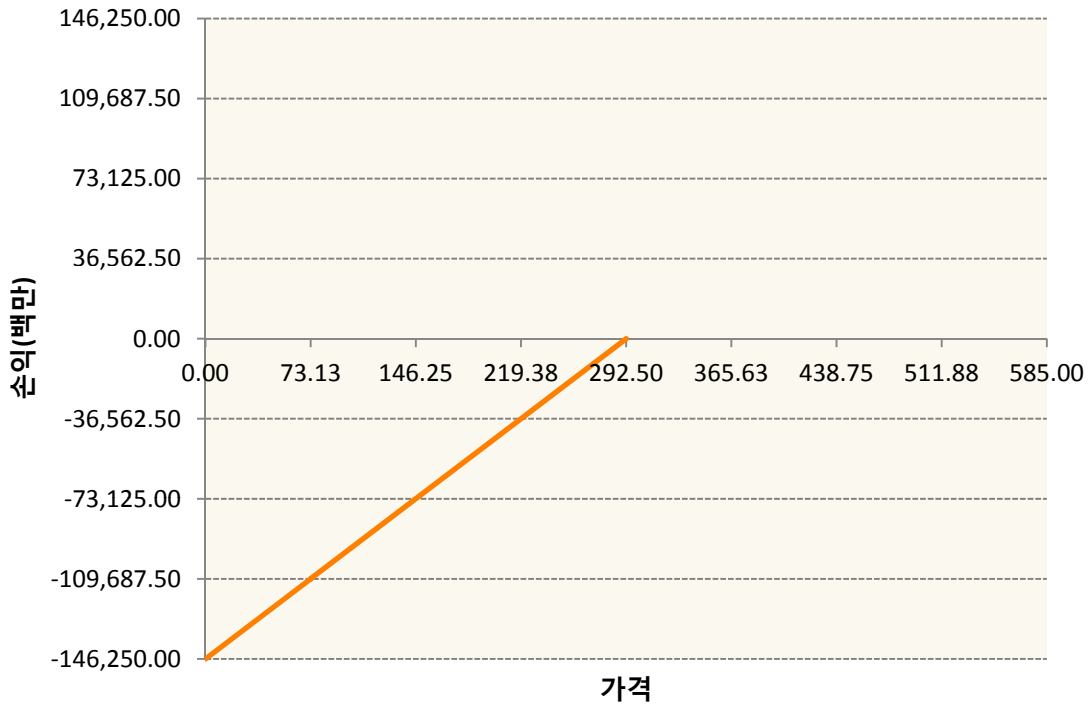


KR4201N82951-2018-08 콜295

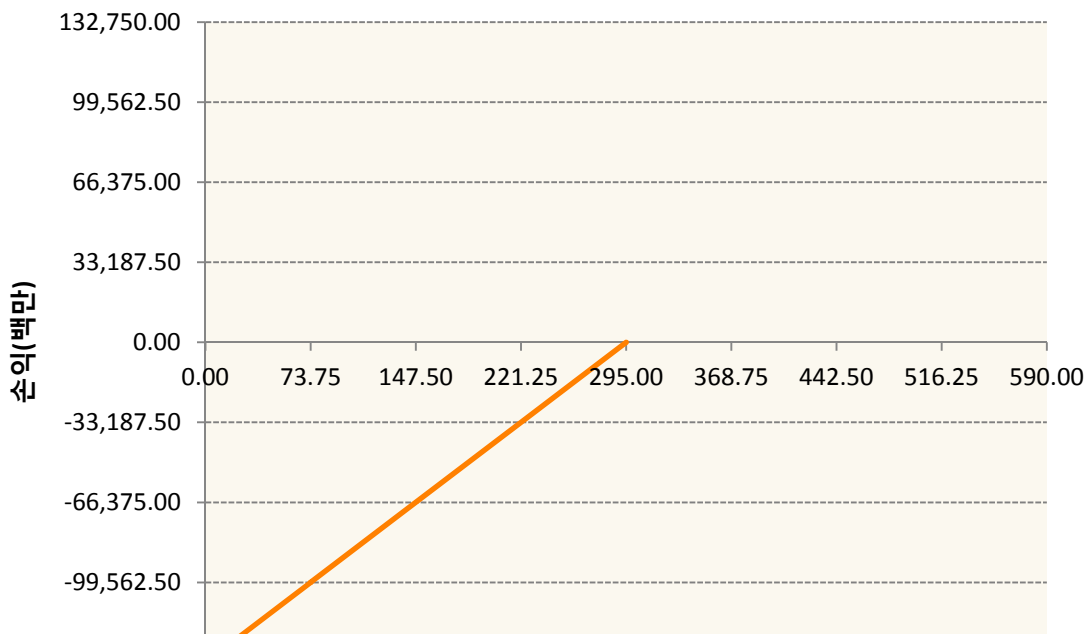




KR4301N82926-2018-08 풋292.5



KR4301N82959-2018-08 풋295



-132,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N829 2018-08 콜292.5 2,793

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,141	1,120	1,093	1,062	1,025	984	940
-5.33%	1,040	992	939	883	823	761	697
-2.67%	770	695	619	542	465	387	308
0%	245	163	82	0	-82	-164	-246
2.67%	-546	-609	-676	-745	-816	-889	-964
5.33%	-1,531	-1,567	-1,610	-1,657	-1,709	-1,765	-1,824
8.00%	-2,619	-2,635	-2,656	-2,683	-2,715	-2,752	-2,793

KR4201N829 2018-08 콜295 25,112

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,090	8,947	8,754	8,513	8,226	7,897	7,530
-5.33%	8,430	8,061	7,641	7,177	6,676	6,145	5,588
-2.67%	6,480	5,836	5,171	4,490	3,795	3,091	2,378
0%	2,341	1,561	780	0	-780	-1,561	-2,341
2.67%	-4,342	-5,017	-5,713	-6,423	-7,145	-7,877	-8,616
5.33%	-13,108	-13,537	-14,017	-14,540	-15,099	-15,686	-16,299
8.00%	-23,104	-23,309	-23,571	-23,888	-24,254	-24,663	-25,112

KR4301N829 2018-08 풋292.5 9,509

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,480	-9,480	-9,482	-9,484	-9,489	-9,497	-9,509
-5.33%	-5,566	-5,581	-5,603	-5,633	-5,671	-5,716	-5,768
-2.67%	-1,931	-2,026	-2,127	-2,233	-2,343	-2,457	-2,573
0%	391	262	132	0	-133	-266	-400
2.67%	1,061	1,019	966	903	833	755	671
5.33%	1,129	1,125	1,117	1,105	1,088	1,064	1,034
8.00%	1,131	1,131	1,130	1,129	1,127	1,123	1,117

KR4301N829 2018-08 풋295 9,160

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,147	-9,147	-9,147	-9,148	-9,150	-9,154	-9,160
-5.33%	-5,615	-5,621	-5,631	-5,646	-5,666	-5,693	-5,725
-2.67%	-2,201	-2,259	-2,325	-2,398	-2,477	-2,561	-2,650
0%	373	249	124	0	-124	-249	-373
2.67%	1,374	1,309	1,236	1,156	1,070	980	885

5.33%	1,520	1,511	1,496	1,475	1,448	1,413	1,373
8.00%	1,527	1,527	1,526	1,523	1,519	1,512	1,501

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

(단위:백만원)

49,352

공시일	2018-07-26
기준일	2018-07-25

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

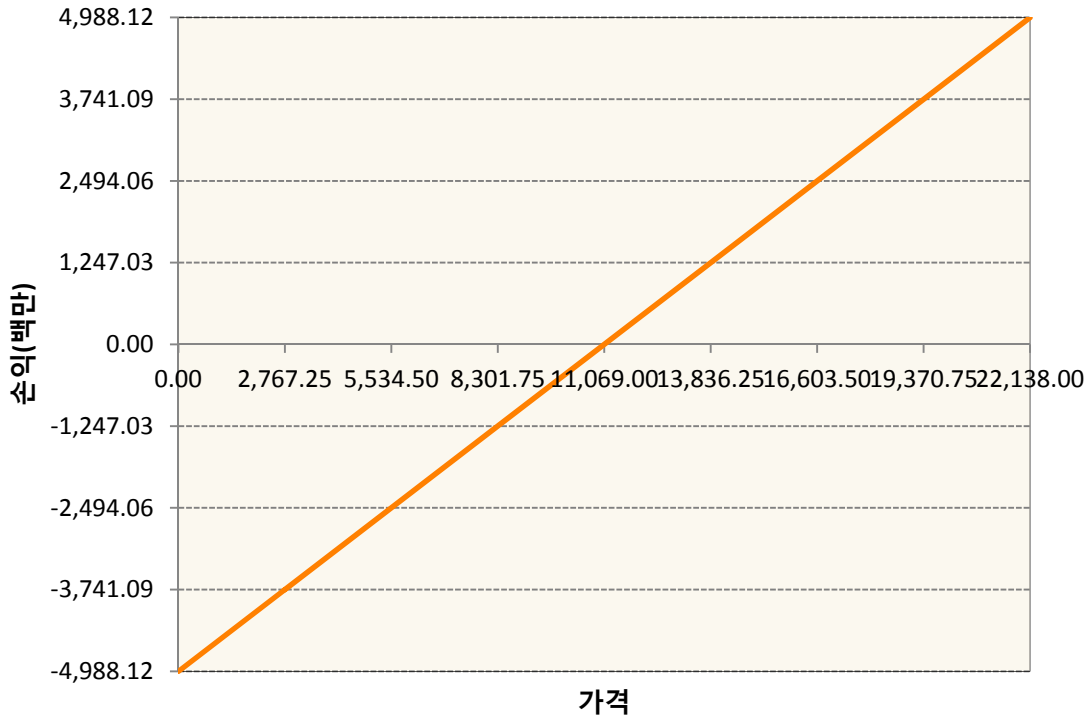
1. 계약금액

(단위:백만원)

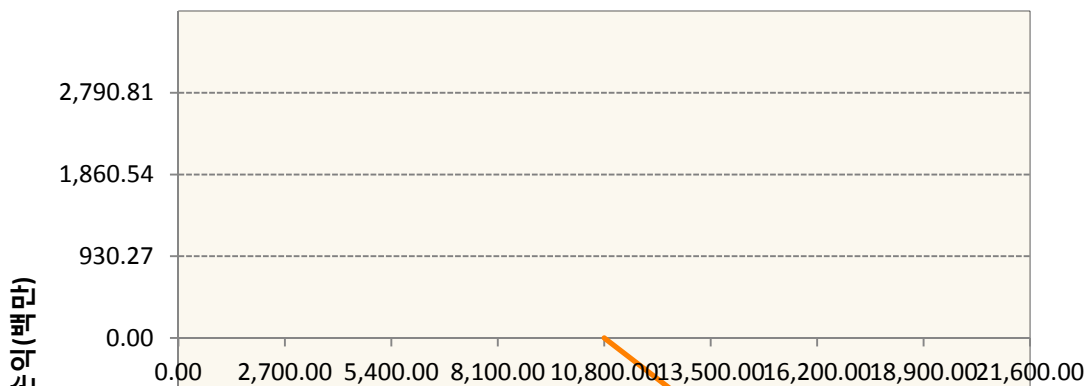
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,988	0	4,988	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,074	-11,074	장내

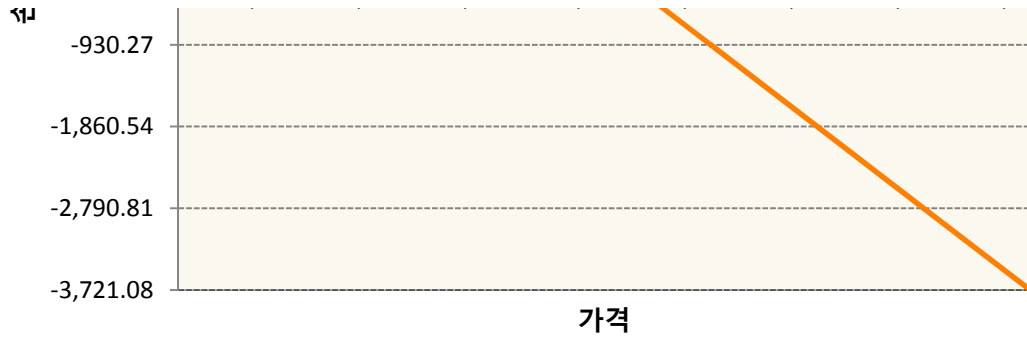
2. 만기시점의 손익구조

HCN8-HSCEI Futures Jul18

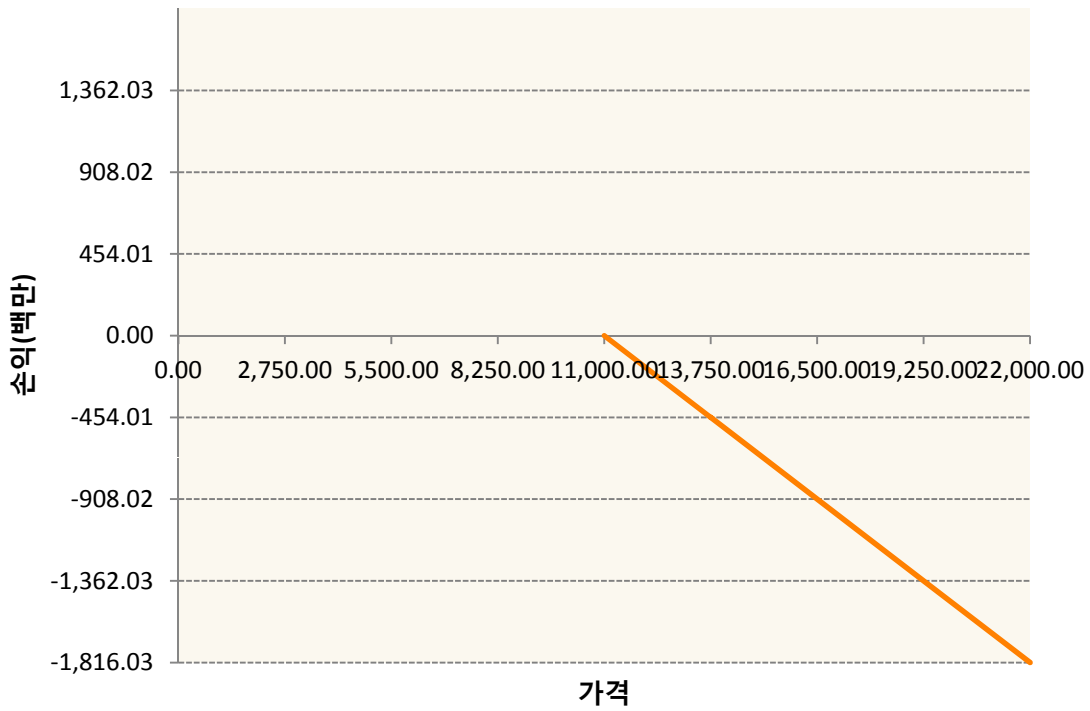


OHHIN8-C108-HSCEI

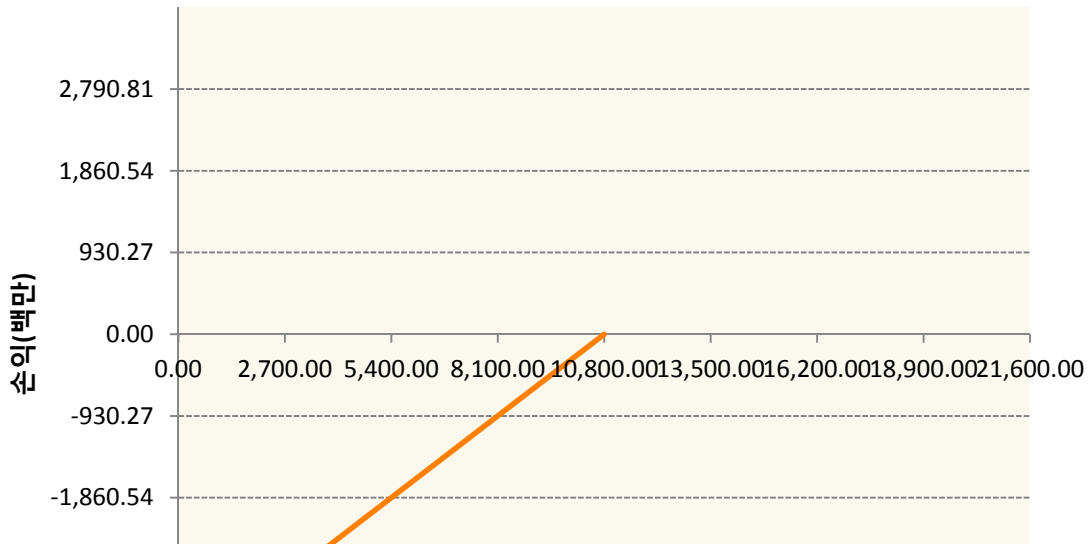


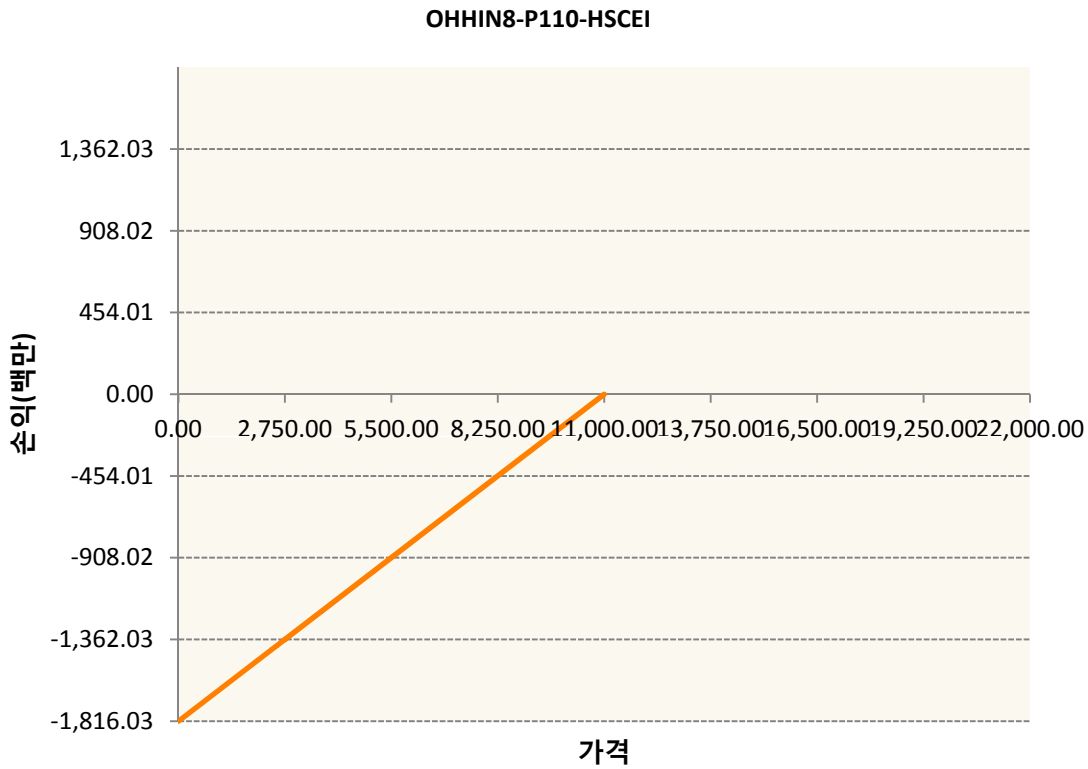
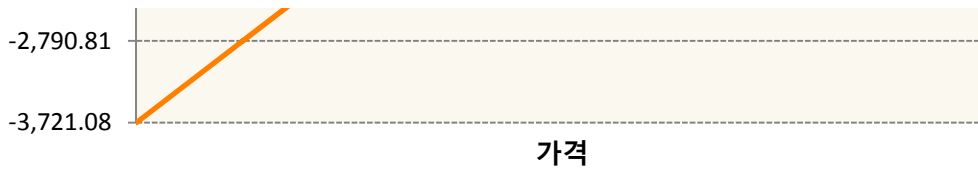


OHHIN8-C110-HSCEI



OHHIN8-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCN8	HSCEI Futures Jul18	399
OHHIN8-C1	(HSCEI	298
OHHIN8-C1	: HSCEI	145
OHHIN8-P1	(HSCEI	298
OHHIN8-P11	HSCEI	145

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,170

공시일	2018-07-26
기준일	2018-07-25

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

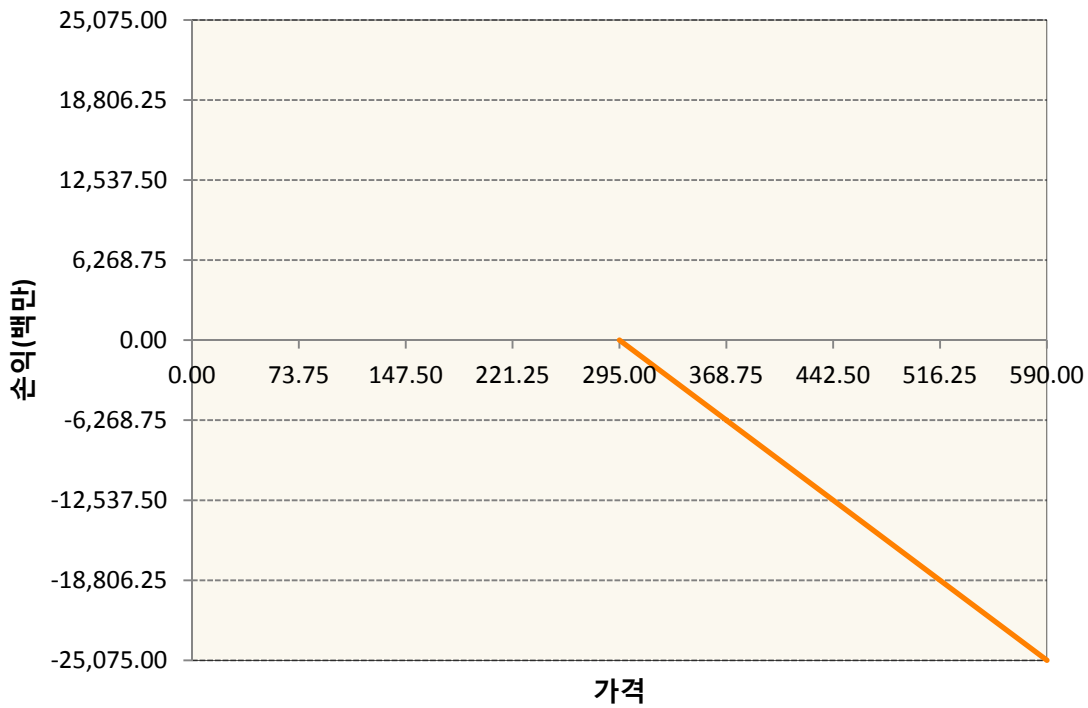
1. 계약금액

(단위:백만원)

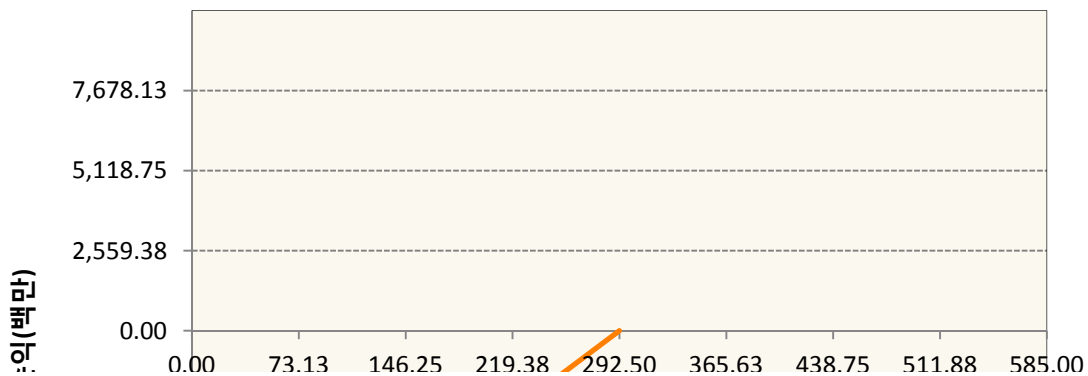
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	45,200	0	45,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	43,425	-43,425	장내

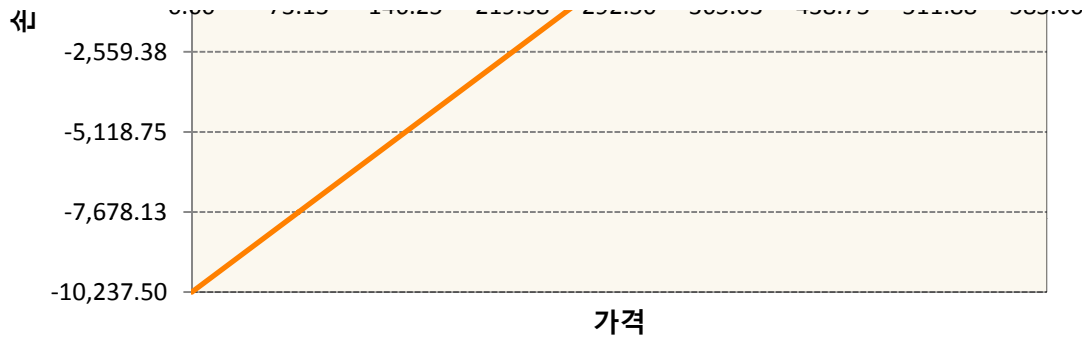
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N82951-2018-08 콜295

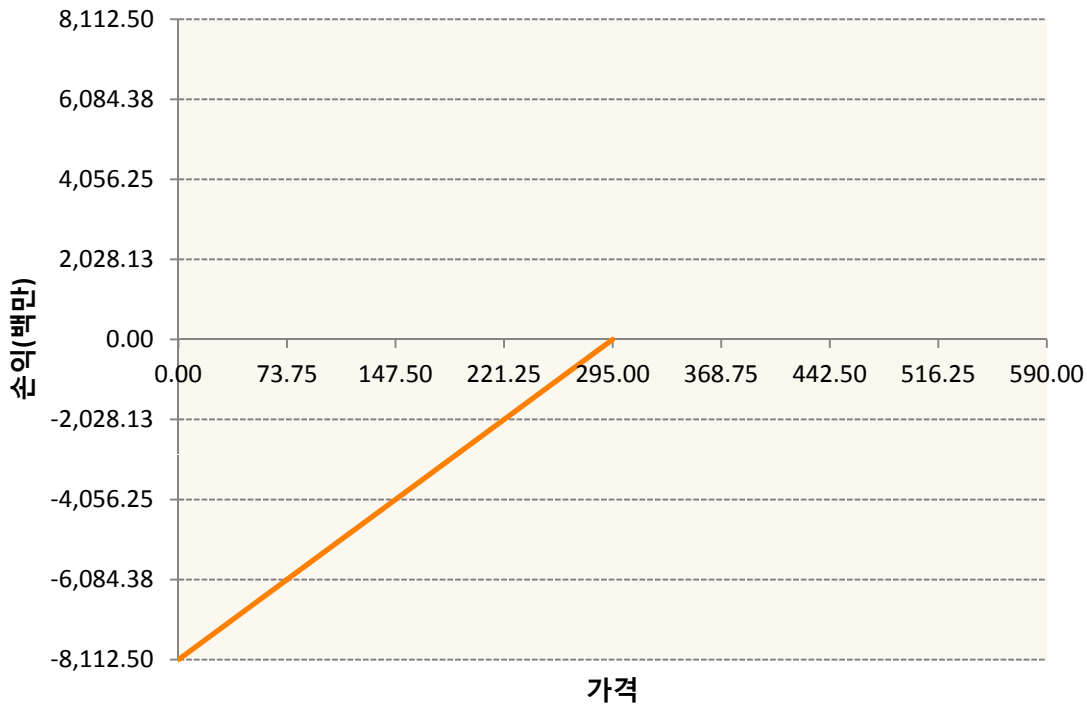


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





KR4301N82959-2018-08 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_2							1,506
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,506	-1,506	-1,506	-1,506	-1,506	-1,506	-1,506
-5.33%	-1,004	-1,004	-1,004	-1,004	-1,004	-1,004	-1,004
-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%	1,004	1,004	1,004	1,004	1,004	1,004	1,004
8.00%	1,506	1,506	1,506	1,506	1,506	1,506	1,506
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%	326	326	326	326	326	326	326
8.00%	488	488	488	488	488	488	488

KR4201N829 2018-08 콜295

1,559

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	564	555	543	528	511	490	467
-5.33%	523	500	474	445	414	381	347
-2.67%	402	362	321	279	236	192	148
0%	145	97	48	0	-48	-97	-145
2.67%	-269	-311	-355	-399	-443	-489	-535
5.33%	-814	-840	-870	-902	-937	-974	-1,012
8.00%	-1,434	-1,447	-1,463	-1,483	-1,505	-1,531	-1,559

KR4301N829 2018-08 풋292.5

666

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-664	-664	-664	-664	-664	-665	-666
-5.33%	-390	-391	-392	-394	-397	-400	-404
-2.67%	-135	-142	-149	-156	-164	-172	-180
0%	27	18	9	0	-9	-19	-28
2.67%	74	71	68	63	58	53	47
5.33%	79	79	78	77	76	74	72
8.00%	79	79	79	79	79	79	78

KR4301N829 2018-08 풋295

560

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-559	-559	-559	-559	-559	-559	-560
-5.33%	-343	-343	-344	-345	-346	-348	-350
-2.67%	-135	-138	-142	-147	-151	-157	-162
0%	23	15	8	0	-8	-15	-23
2.67%	84	80	76	71	65	60	54
5.33%	93	92	91	90	88	86	84
8.00%	93	93	93	93	93	92	92

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

(단위:백만원)

6,634

공시일	2018-07-26
기준일	2018-07-25

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

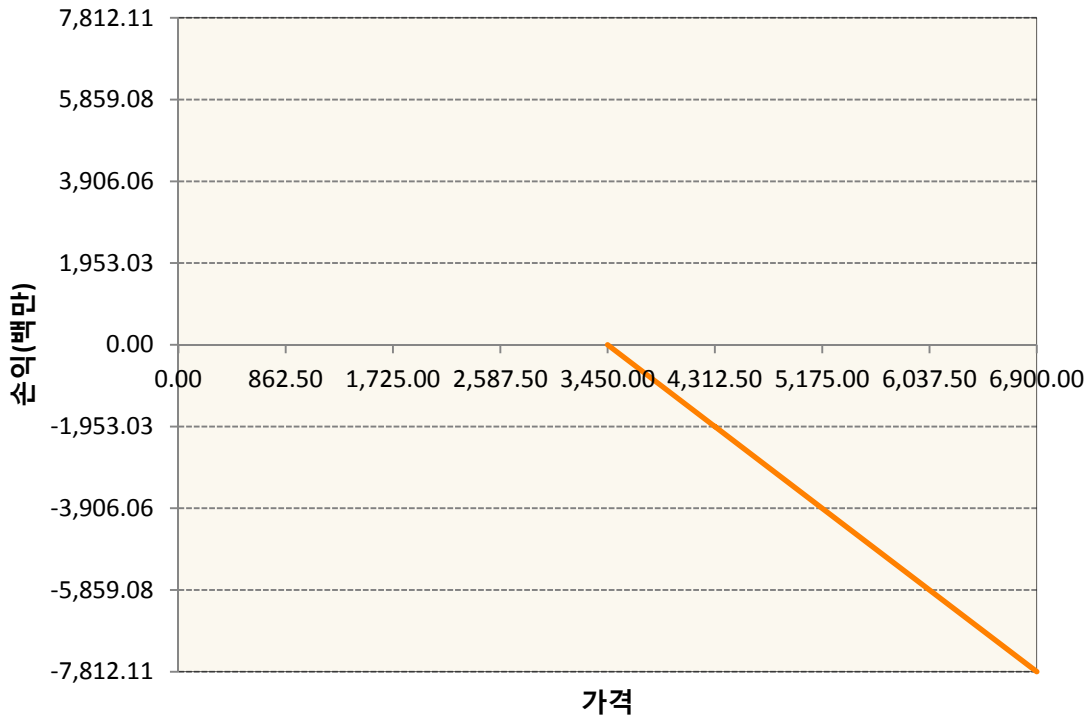
1. 계약금액

(단위:백만원)

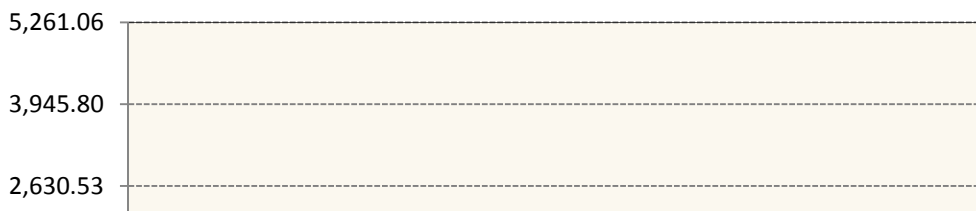
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,610	0	5,610	
누계	유가증권	스왑	45,397	0	45,397	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,891	-20,891	장내
누계	지수	스왑	53,448	0	53,448	장외

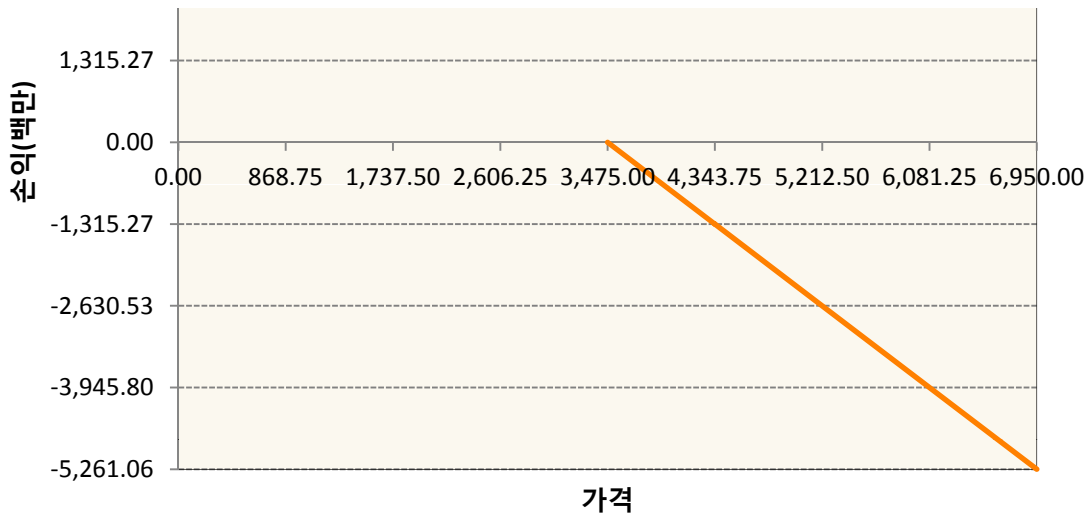
2. 만기시점의 손익구조

OESXQ8-C3450-EURO STOXX 50 OPT

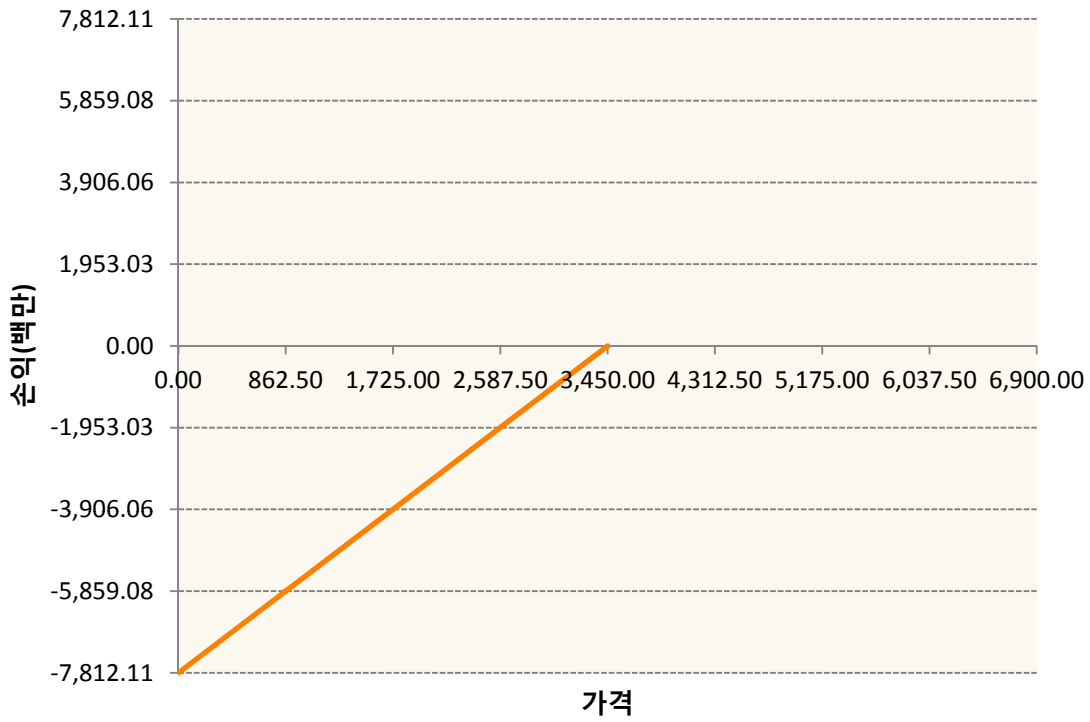


OESXQ8-C3475-EURO STOXX 50 OPT

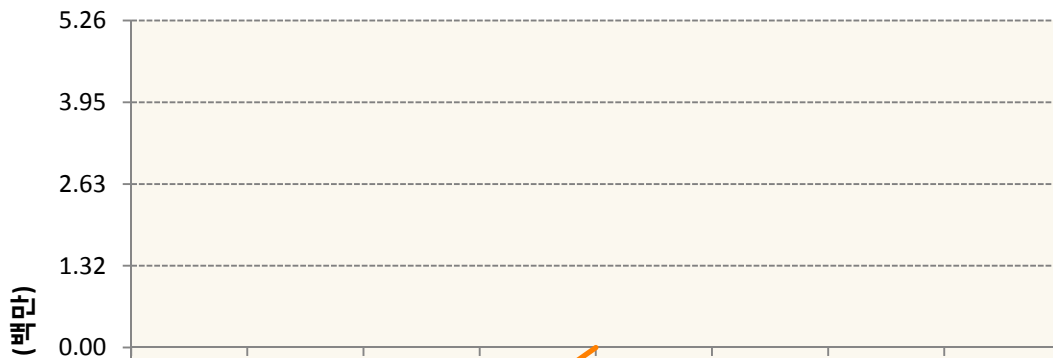


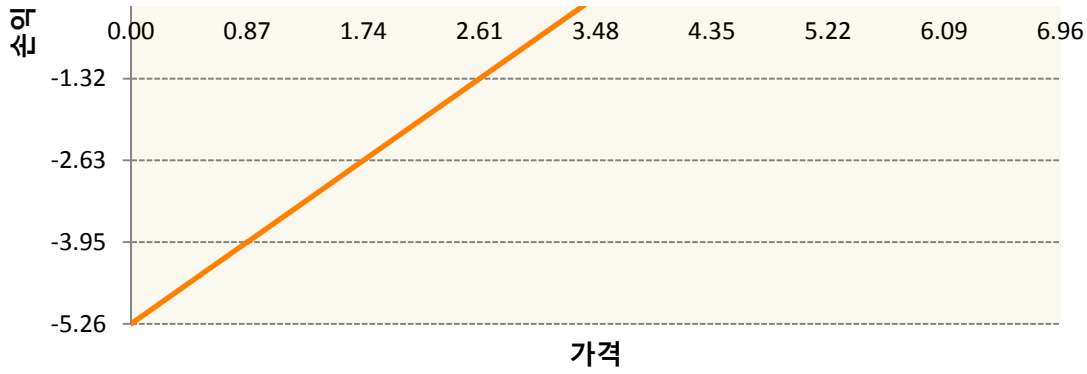


OESXQ8-P3450-EURO STOXX 50

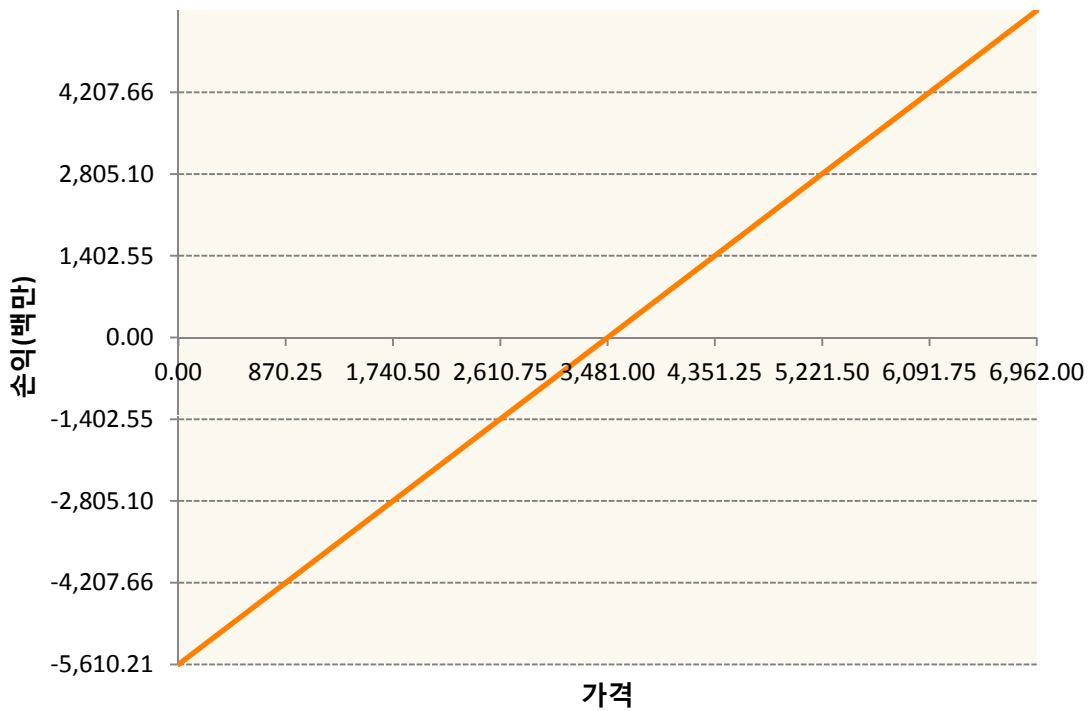


OESXQ8-P3475-EURO STOXX 50





VGU8-EURO STOXXX 50 SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY -	994.569	19
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY		16
OESXQ8-C3 EURO STOXX 50 OPT		625
OESXQ8-C3 EURO STOXX 50 OPT		421
OESXQ8-P3 EURO STOXX 50		625
OESXQ8-P3 EURO STOXX 50		0.4
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18		449

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

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)

166

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-07-26
기준일	2018-07-25

리디파인K200(주식혼합-파생재간

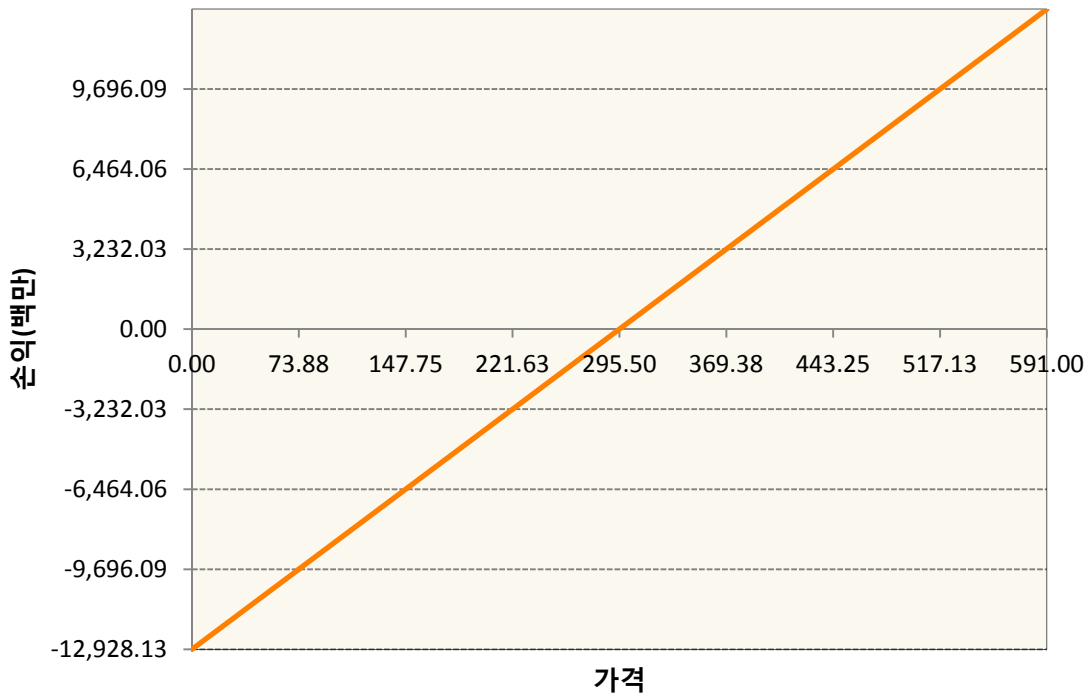
1. 계약금액

(단위:백만원)

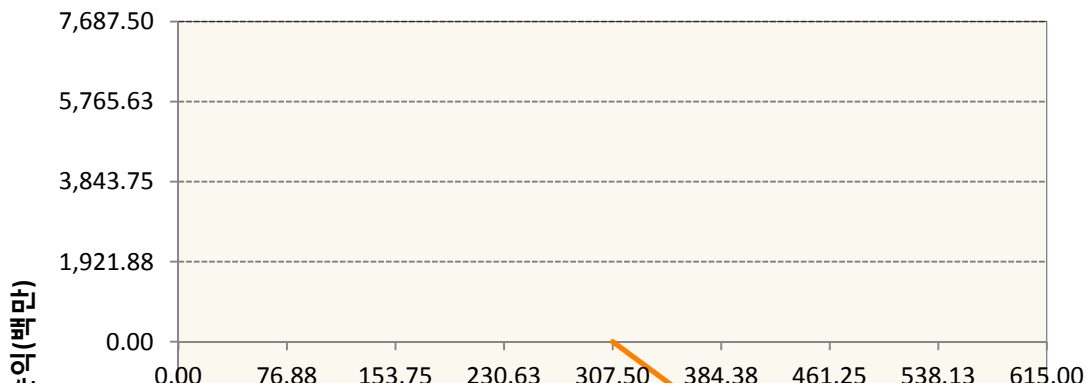
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	78	-78	장내
누계	유가증권	선물	12,928	0	12,928	장내
누계	유가증권	옵션	2,134	23,730	-21,596	장내

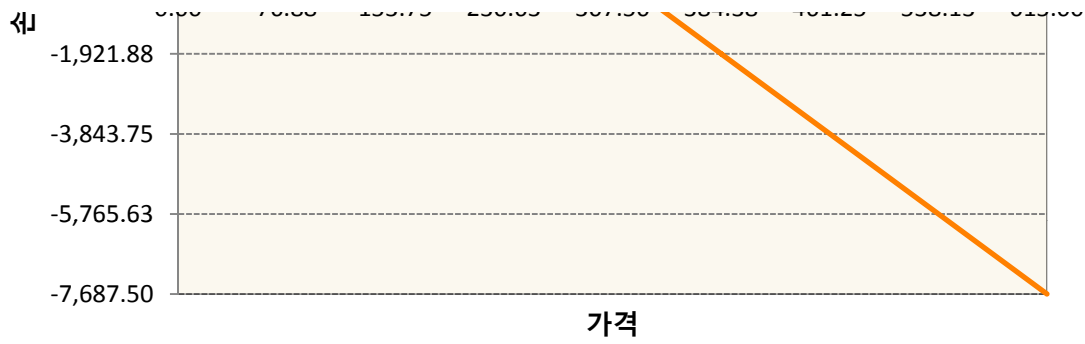
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

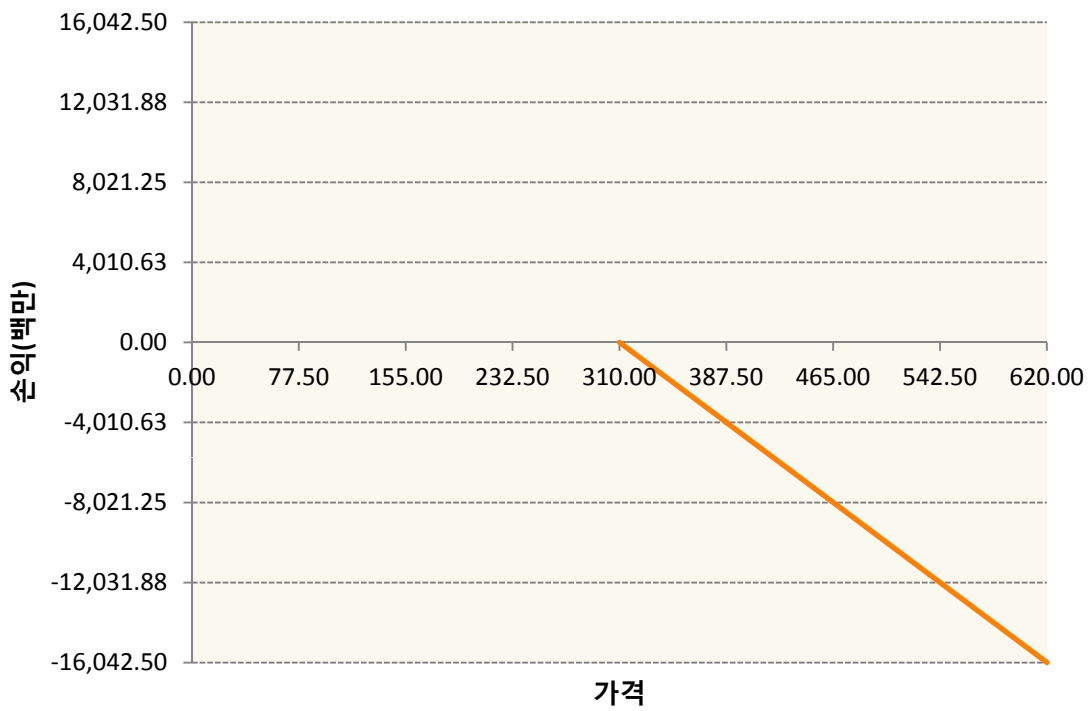


KR4201N83074-2018-08 콜307.5

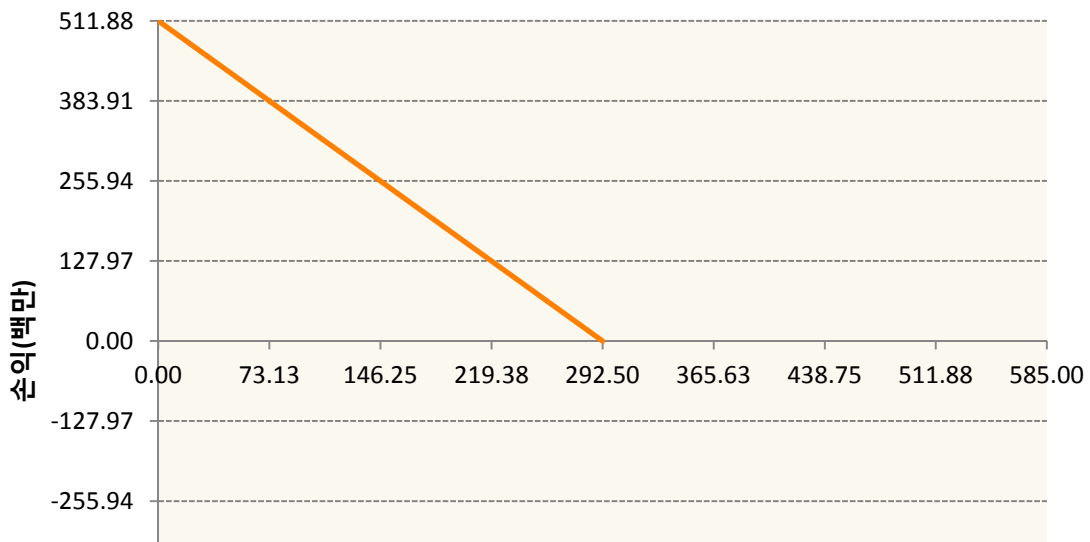


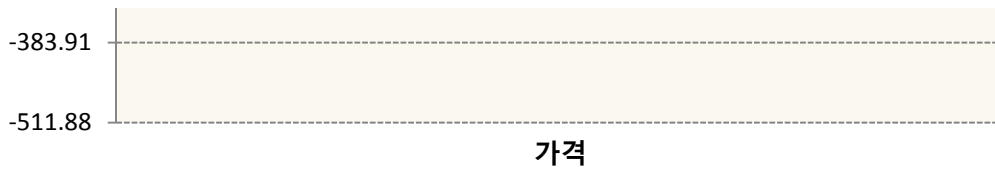


KR4201N83108-2018-08 콜310

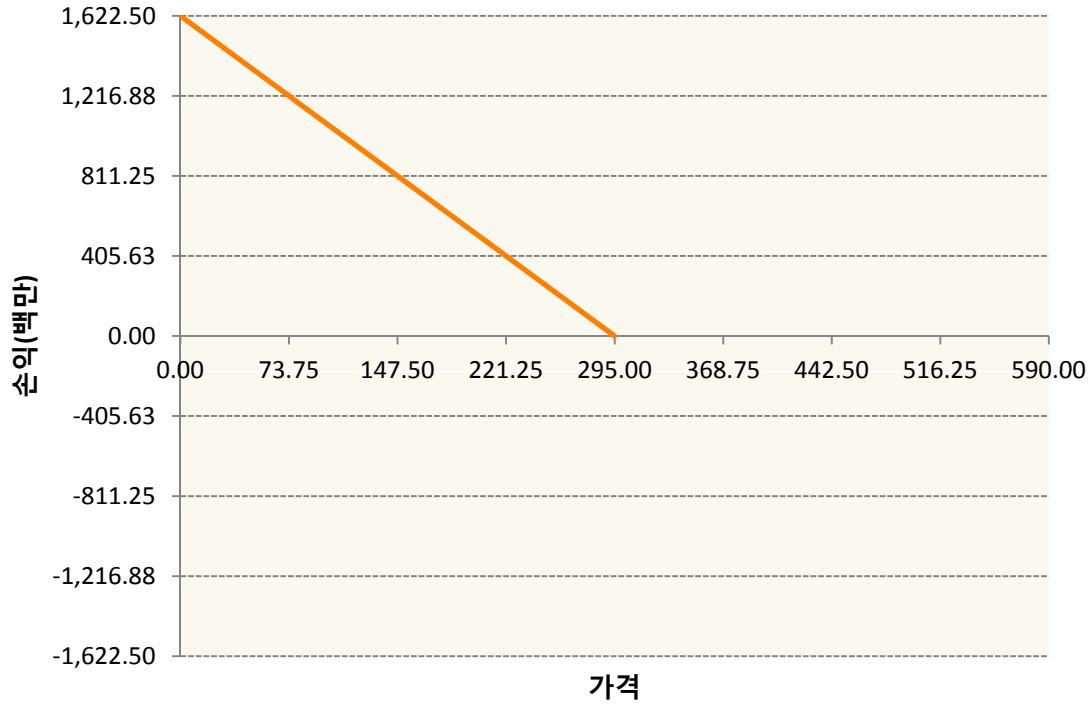


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





KR4301N82959-2018-08 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물 1,032

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,032	-1,032	-1,032	-1,032	-1,032	-1,032	-1,032
-5.33%	-688	-688	-688	-688	-688	-688	-688
-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%	688	688	688	688	688	688	688
8.00%	1,032	1,032	1,032	1,032	1,032	1,032	1,032

KR4201N83C 2018-08 콜307.5 329

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	60	60	59	58	56	54	51
-5.33%	59	57	55	52	48	43	38
-2.67%	52	48	42	35	28	20	11

0%	31	21	11	0	-11	-23	-35
2.67%	-21	-35	-49	-63	-78	-92	-106
5.33%	-116	-131	-145	-160	-175	-189	-204
8.00%	-254	-265	-277	-290	-302	-316	-329

KR4201N8312018-08 콜310

623

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	98	97	96	95	92	89	84
-5.33%	96	94	91	86	79	71	61
-2.67%	88	80	71	59	46	31	15
0%	56	39	20	0	-21	-44	-67
2.67%	-29	-56	-84	-112	-140	-169	-197
5.33%	-196	-227	-258	-289	-320	-351	-382
8.00%	-455	-481	-509	-537	-565	-594	-623

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	20	20	20	20	20	20
-2.67%	7	7	7	8	8	9	9
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-4	-4	-3	-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

112

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	112	112	112	112	112	112	112
-5.33%	69	69	69	69	69	70	70
-2.67%	27	28	28	29	30	31	32
0%	-5	-3	-2	0	2	3	5
2.67%	-17	-16	-15	-14	-13	-12	-11
5.33%	-19	-18	-18	-18	-18	-17	-17
8.00%	-19	-19	-19	-19	-19	-18	-18

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

(단위:백만원)

1,633

공시일	2018-07-26
기준일	2018-07-25

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

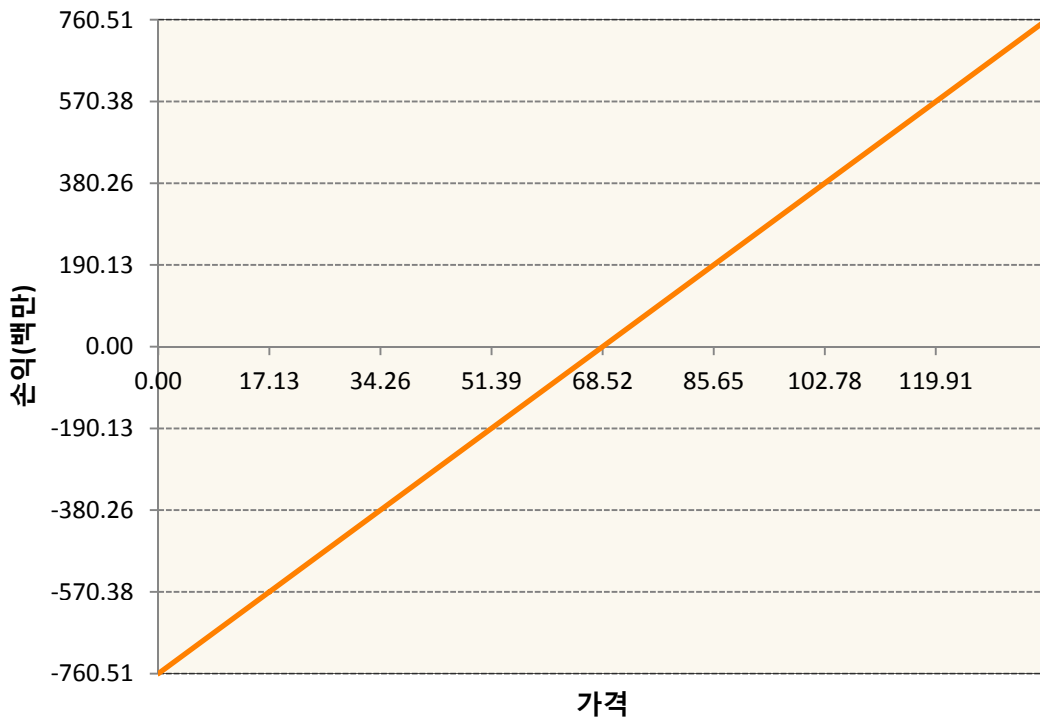
1. 계약금액

(단위:백만원)

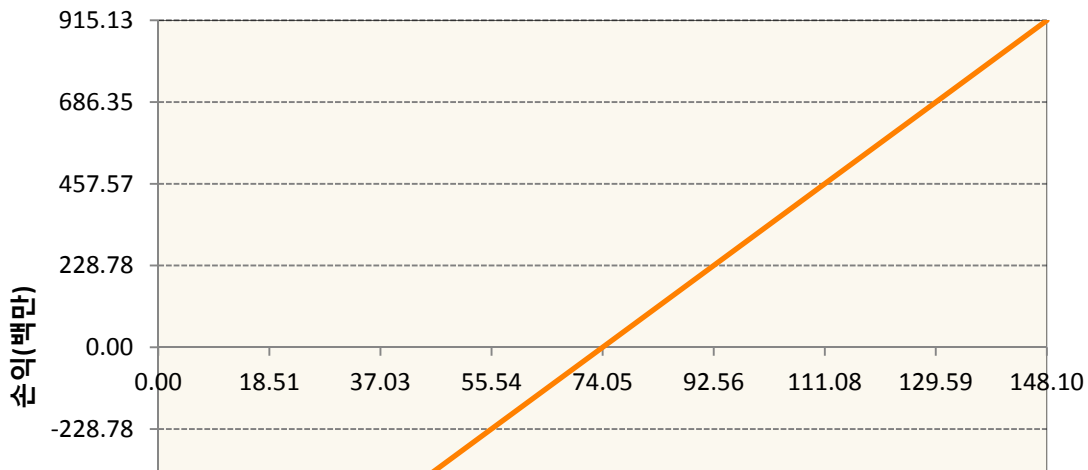
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,617	619	2,998	

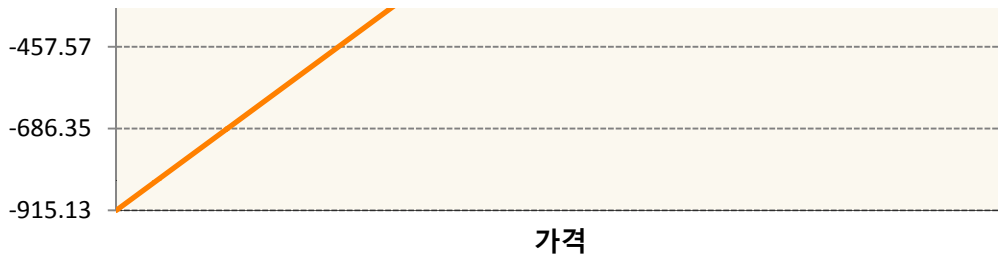
2. 만기시점의 손익구조

CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18

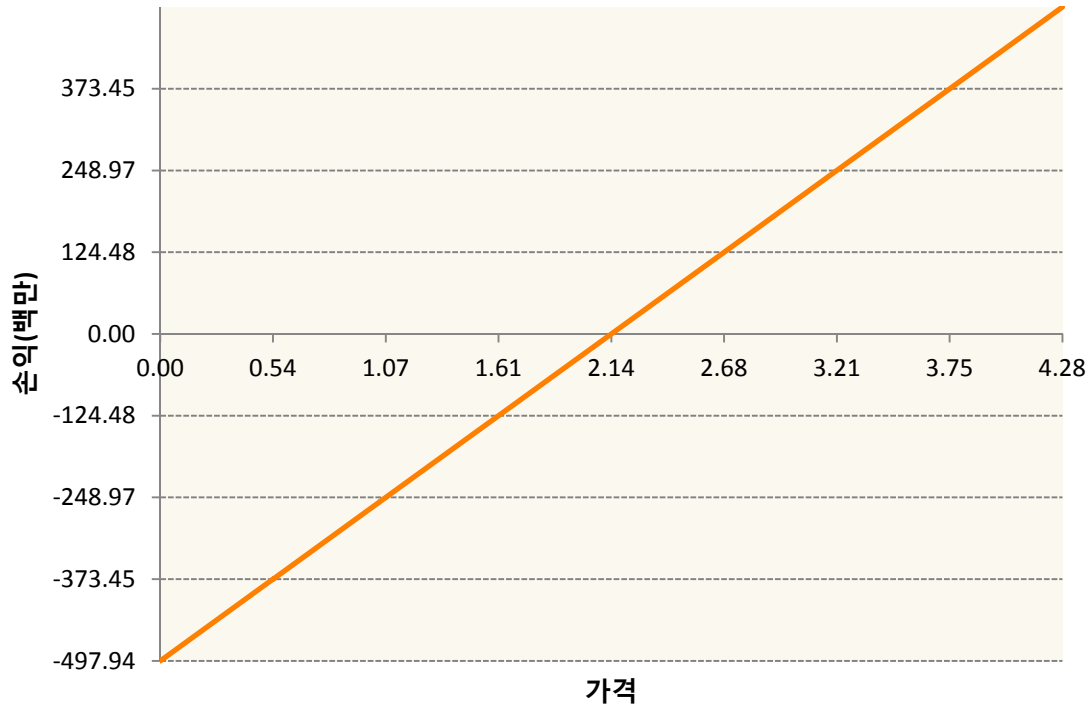


COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18

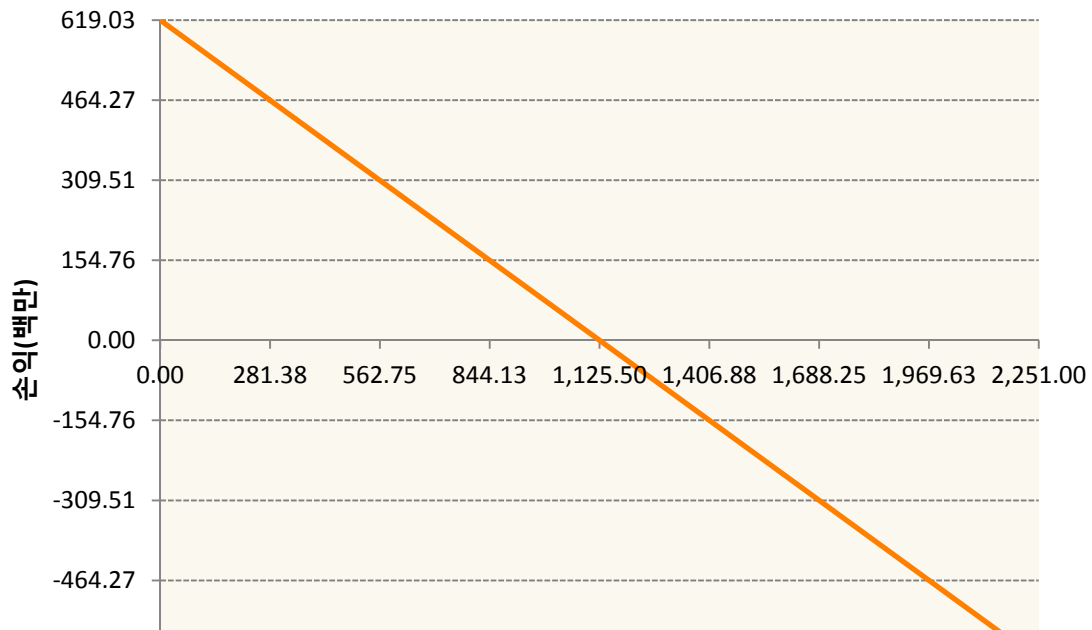


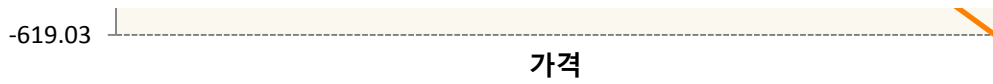


HOU8-NY Harb ULSD Fut SEP18

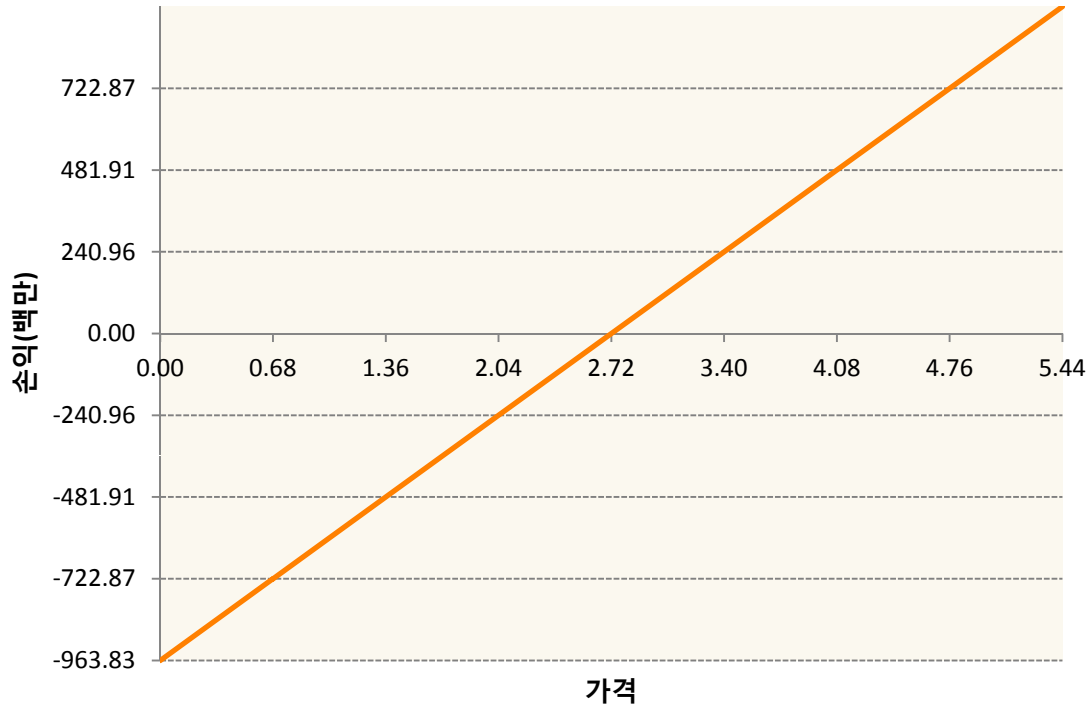


KR4175N80001-2018-08 달러선물

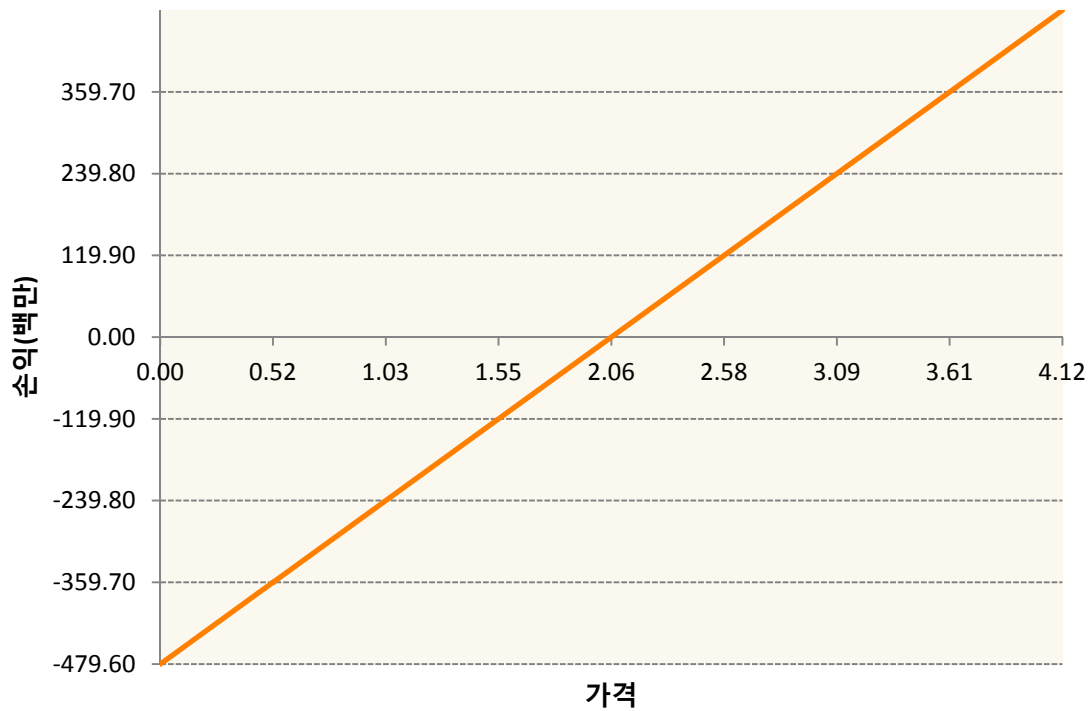




NGU18-NATURAL GAS FUTR SEP18



XBU8-GASOLINE RBOB FUT SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU8	WTI CRUDE FUTURE SEP18	61
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	73
HOU8	NY Harb ULSD Fut SEP18	40
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)

448

공시일	2018-07-26
기준일	2018-07-25

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

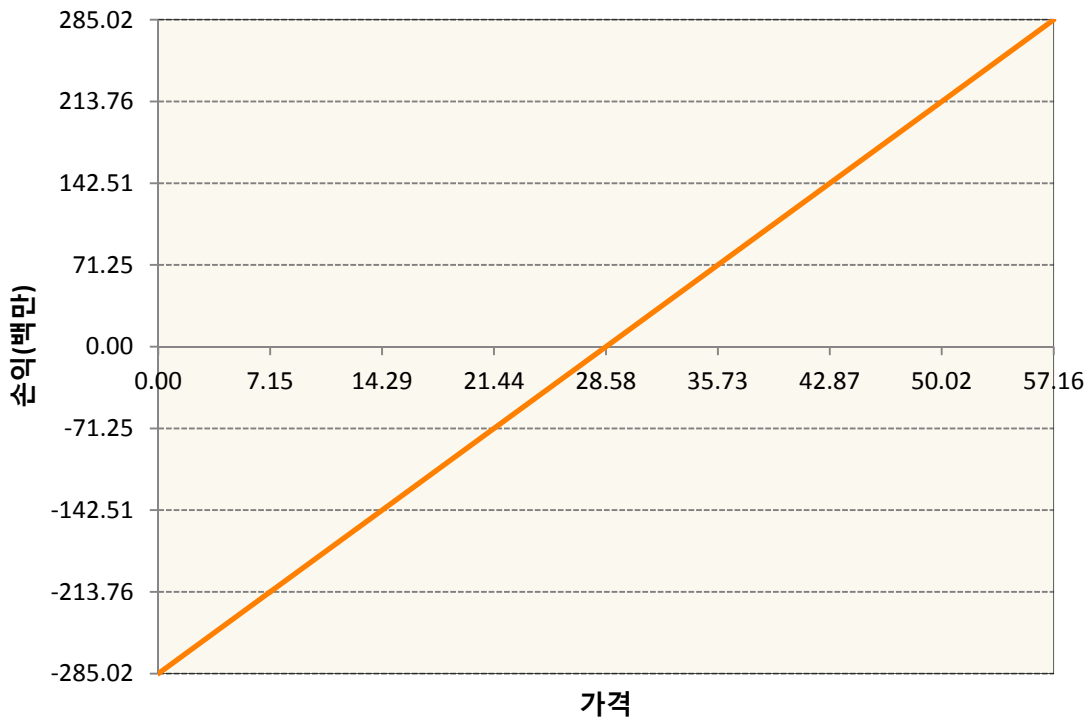
1. 계약금액

(단위:백만원)

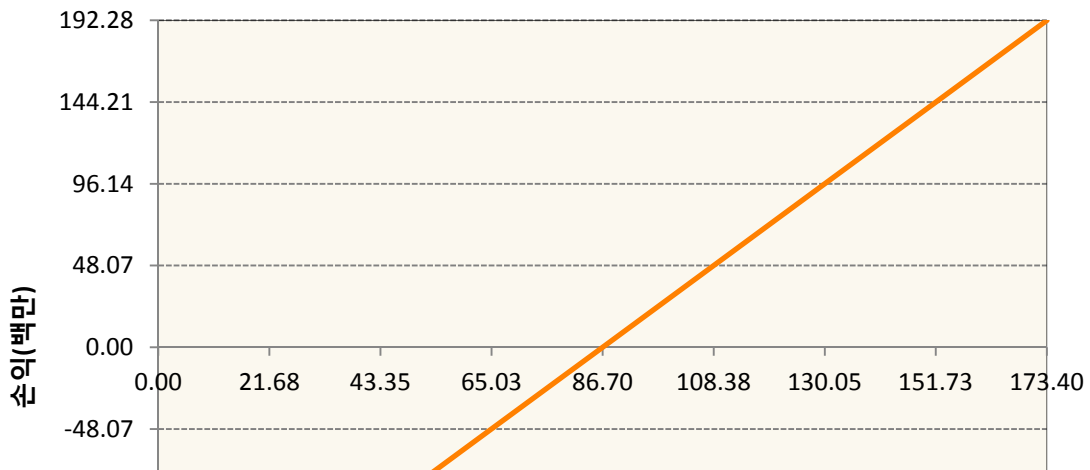
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,614	79	3,535	

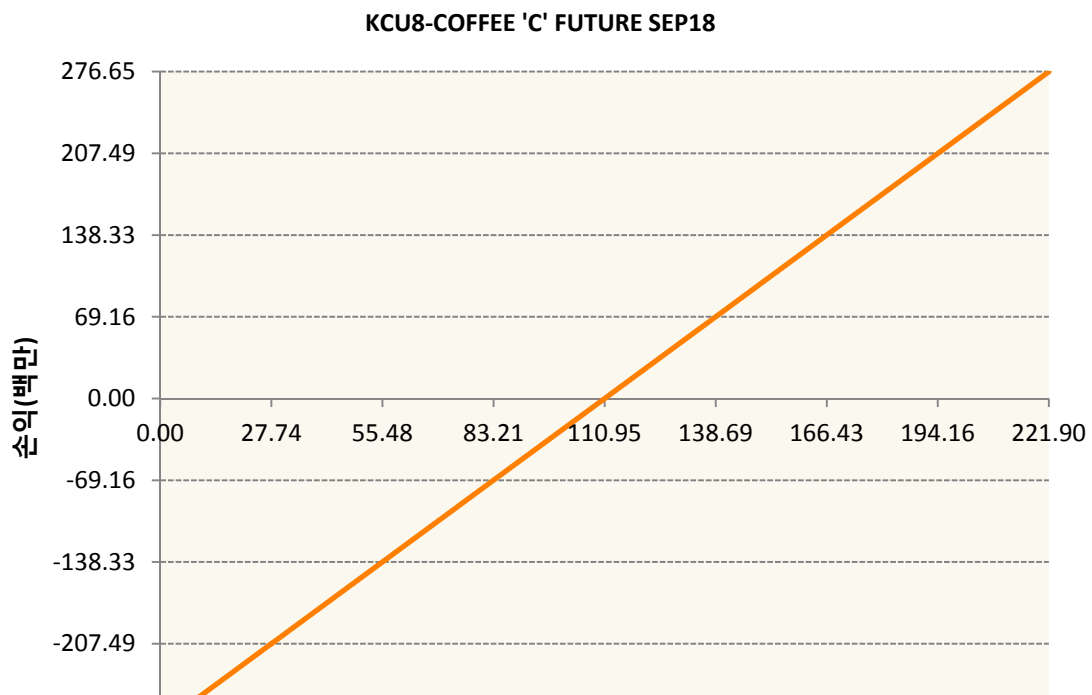
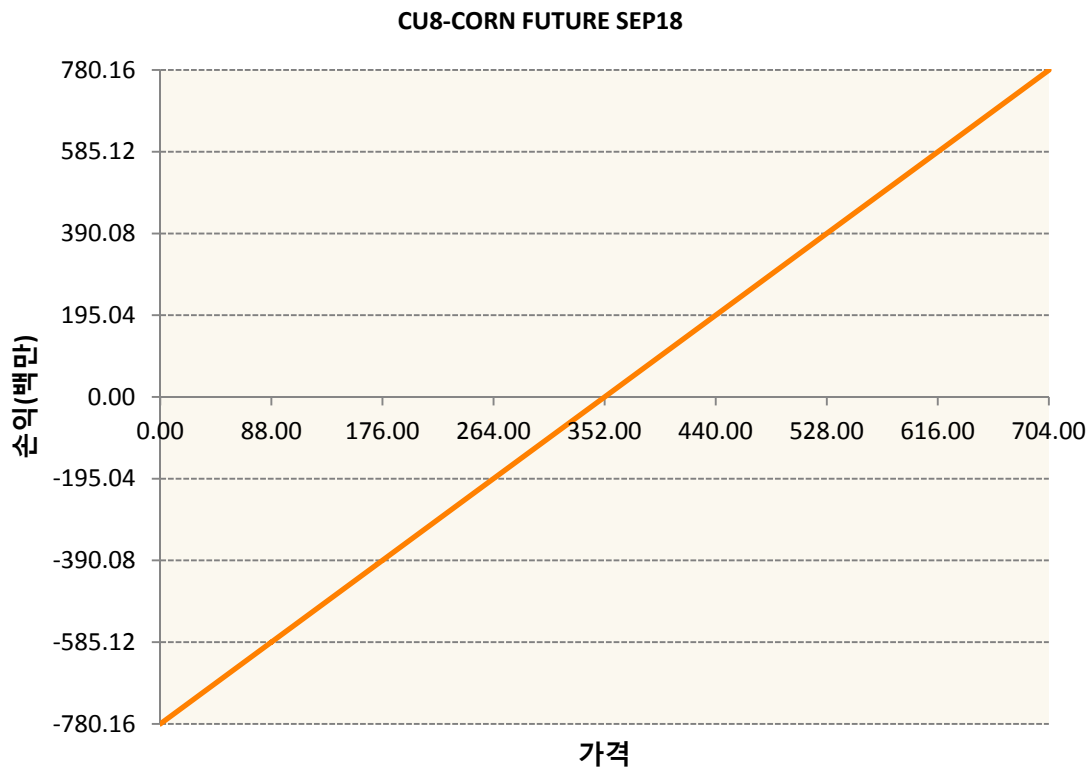
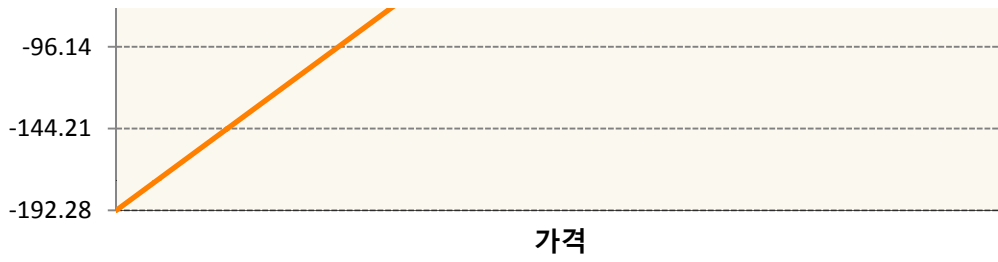
2. 만기시점의 손익구조

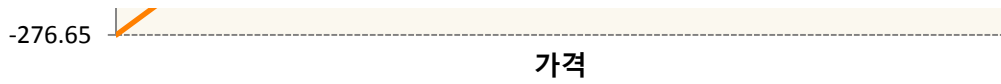
BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18



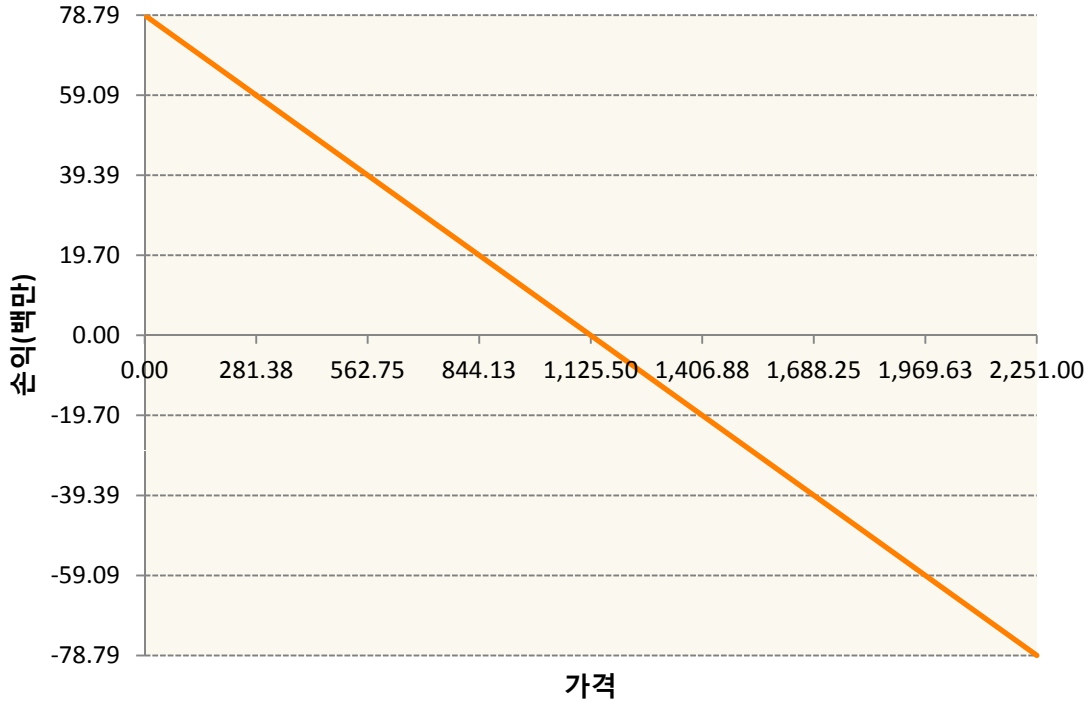
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



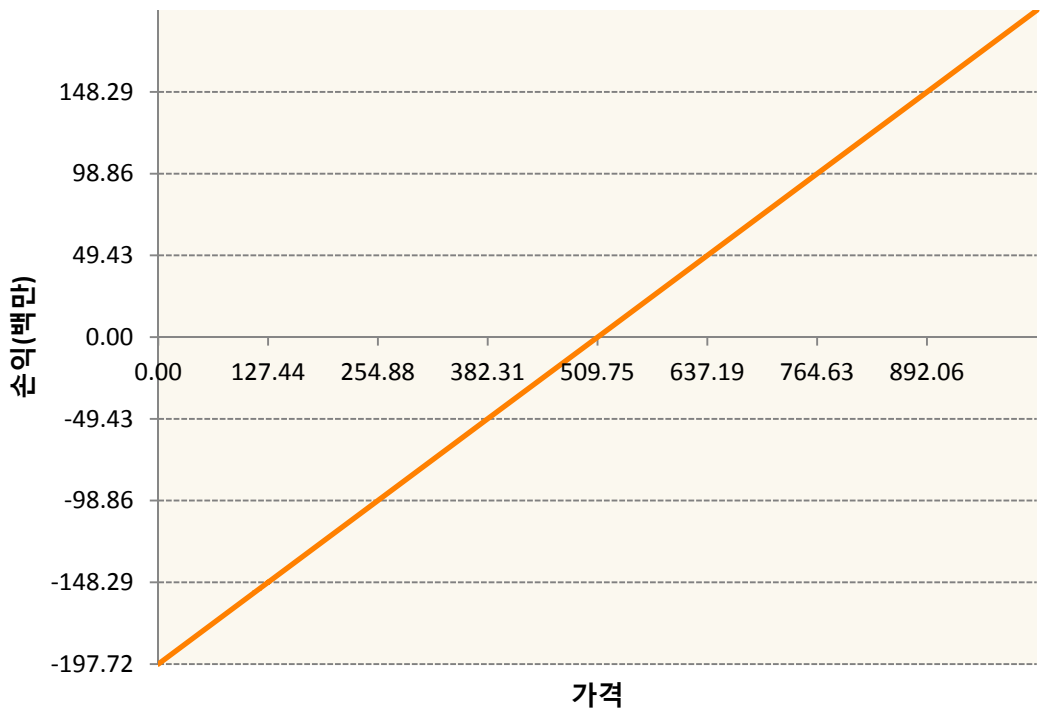




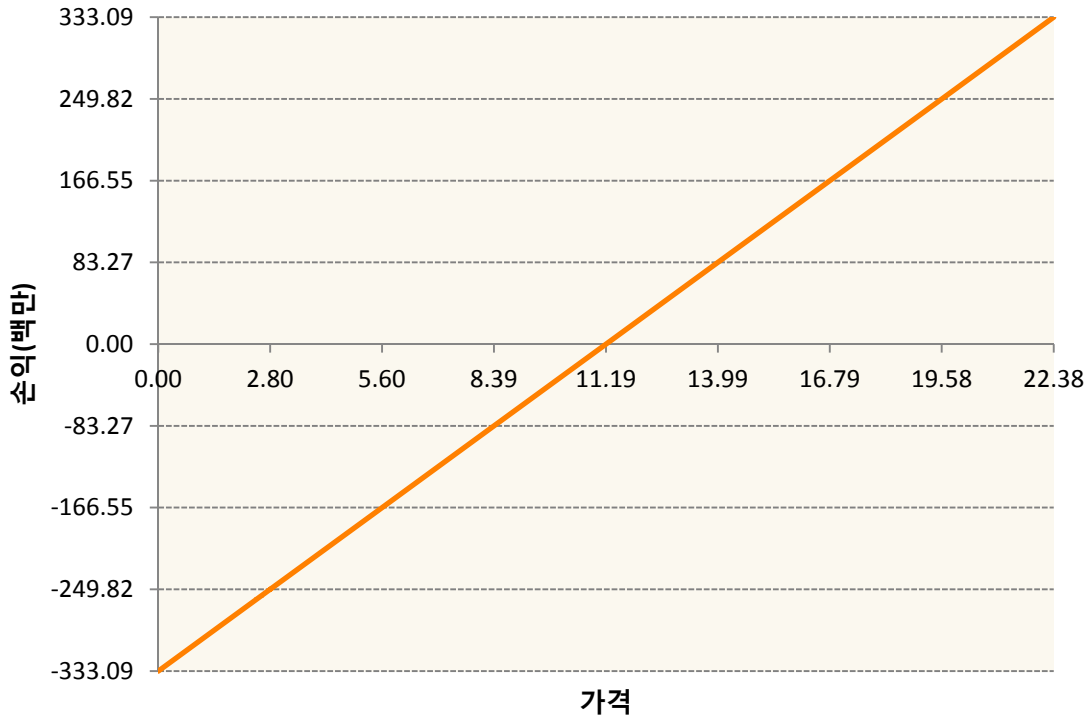
KR4175N80001-2018-08 달러선물



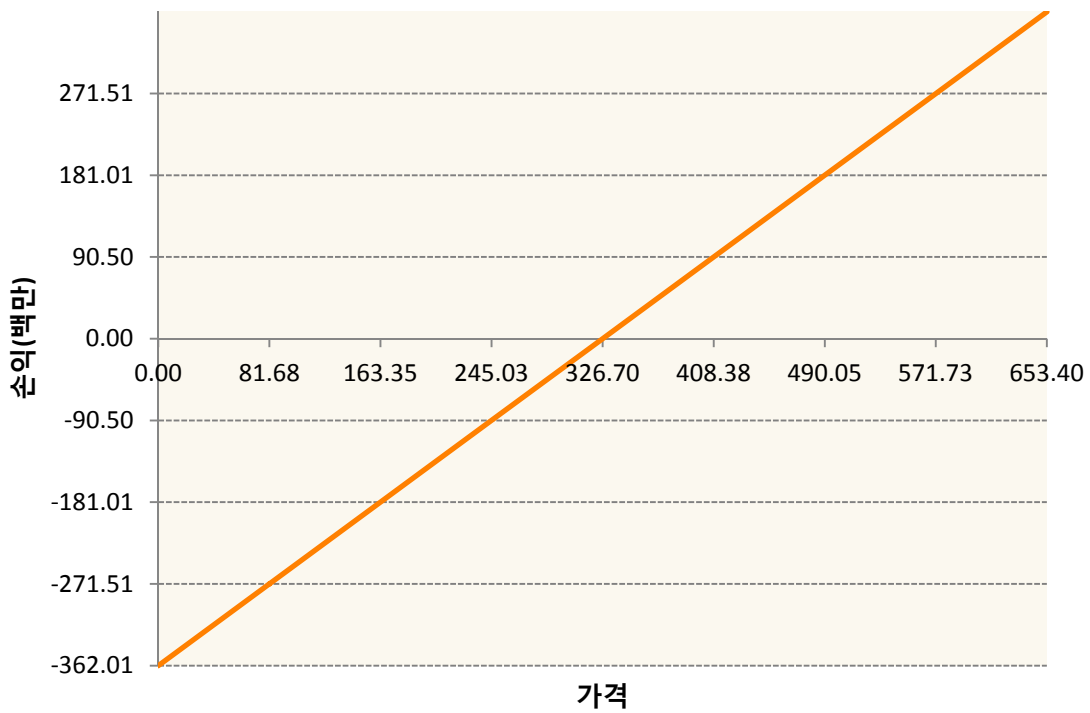
KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

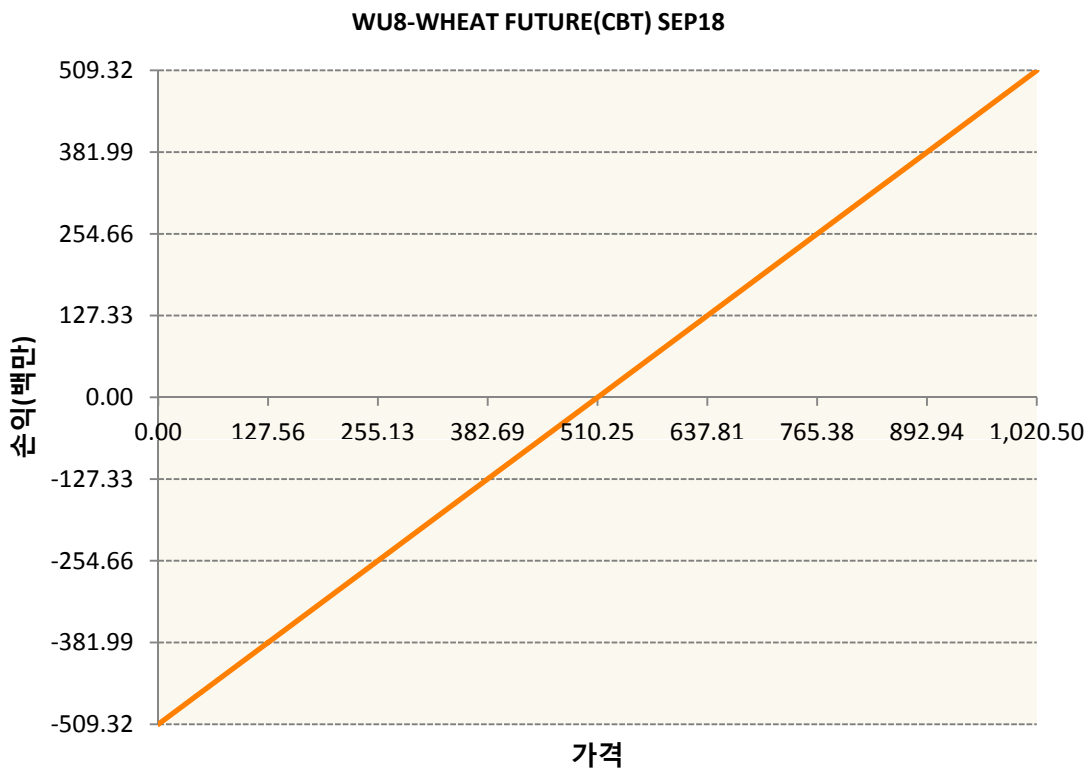
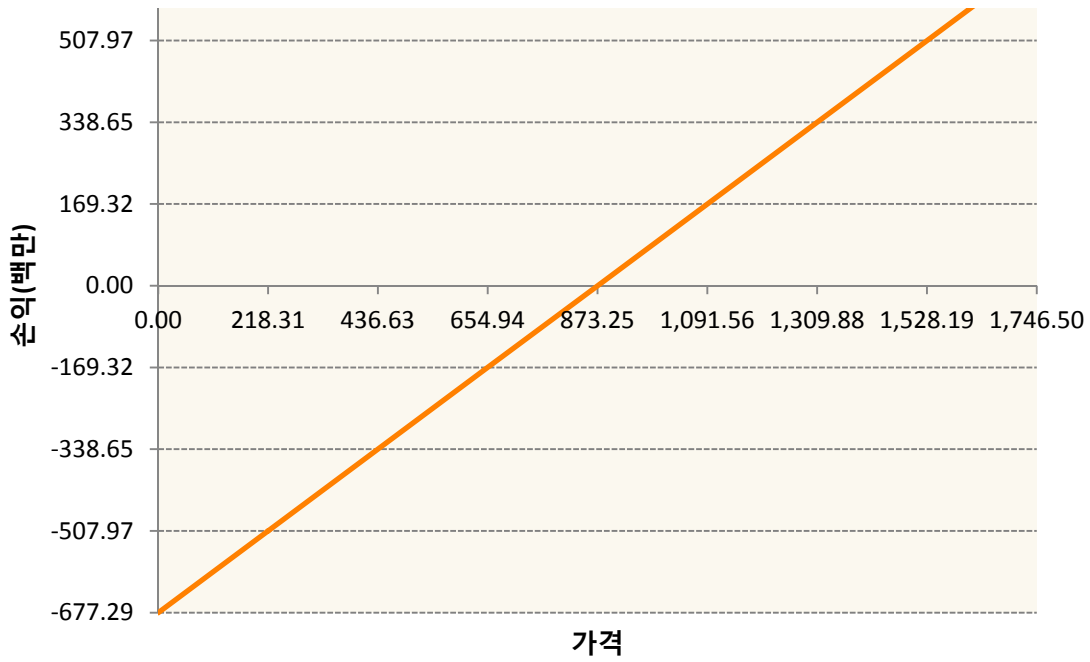


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



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	62
KCU8	COFFEE 'C' FUTURE SEP18	22
KR4175N80C	2018-08 달러선물	6

KWU8	KC HRW WHEAT FUT SEP18	16
SBV8	SUGAR #11 (WORLD) OCT18	27
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)

304