

공시일	2018-07-27
기준일	2018-07-26

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	2018-07-27
기준일	2018-07-26

스마트인덱스모

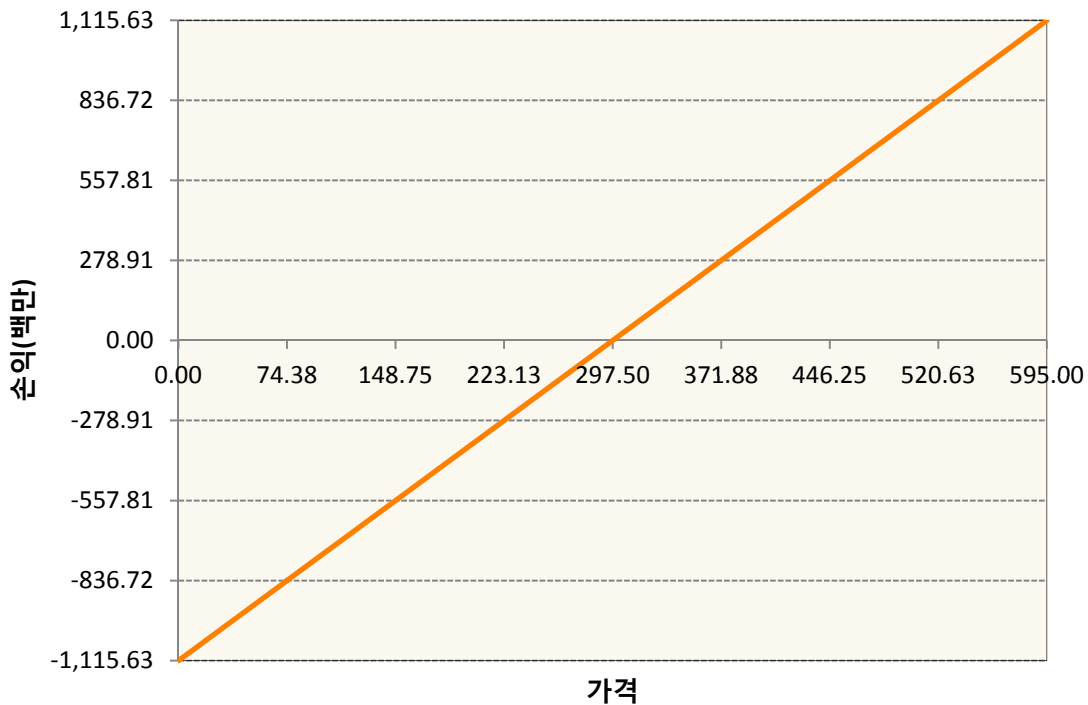
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,116	0	1,116	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)

68

공시일	2018-07-27
기준일	2018-07-26

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

1,145

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

485

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-07-27
기준일	2018-07-26

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

329

* 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	2018-07-27
기준일	2018-07-26

유로인덱스모(주식-파생형)

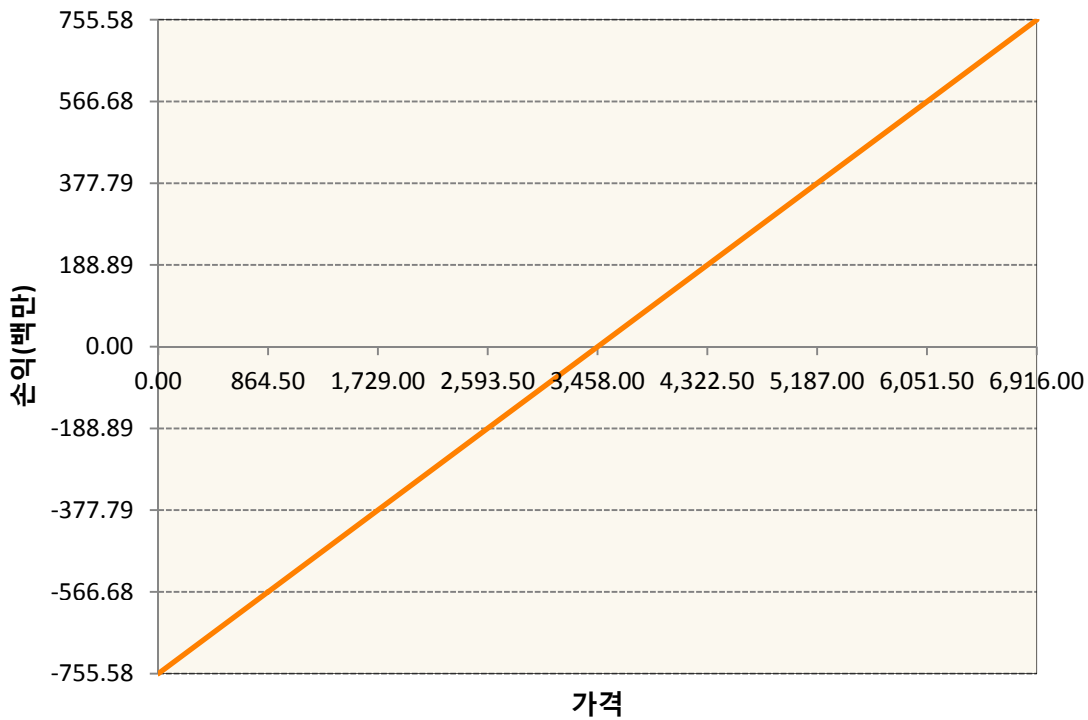
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	756	0	756	

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	2018-07-27
기준일	2018-07-26

차이나인덱스모(주식-파생형)

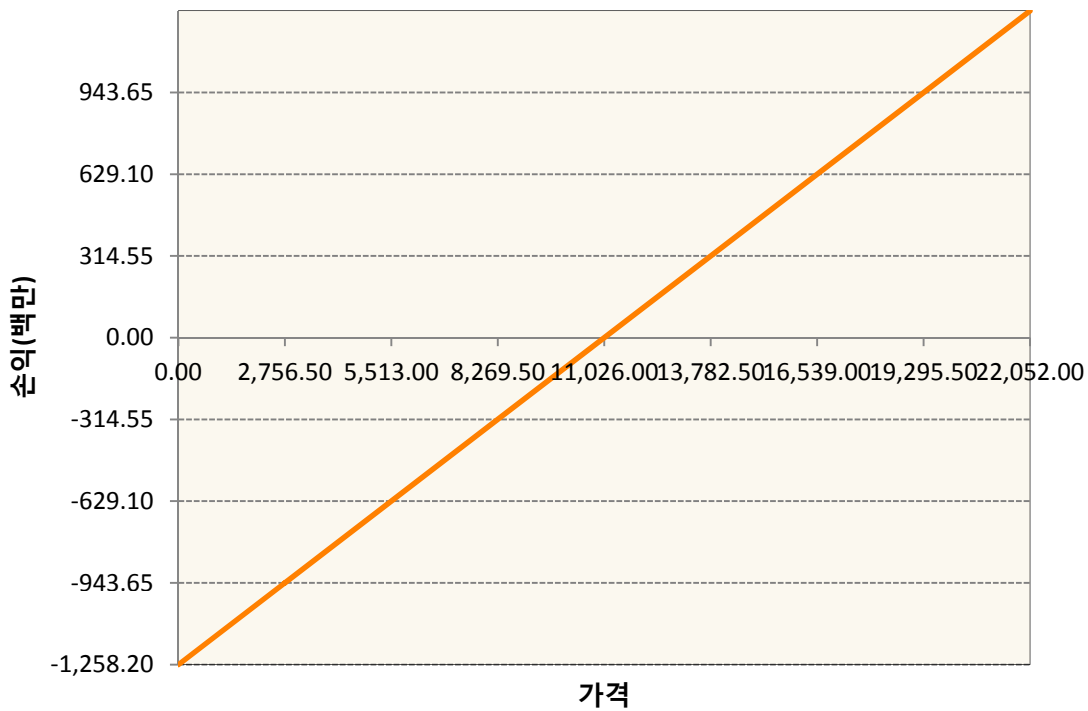
1. 계약금액

(단위:백만원)

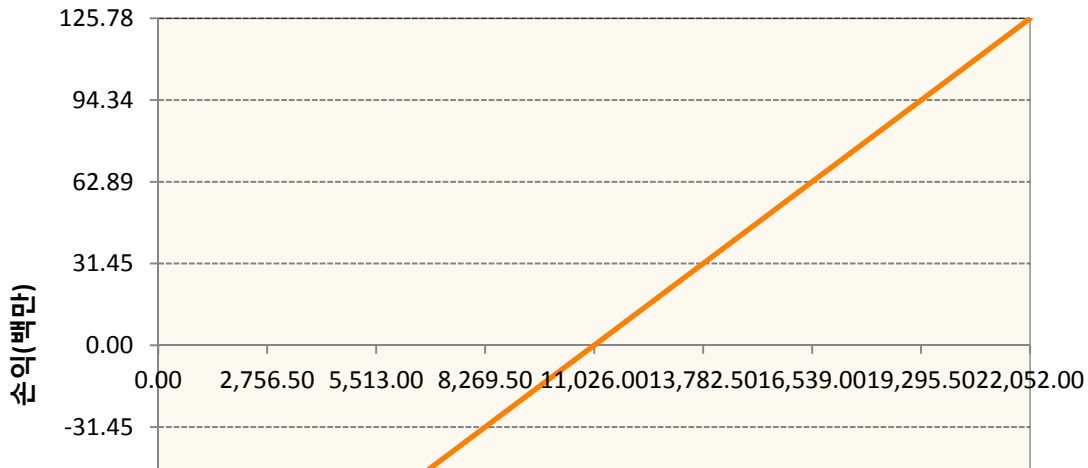
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,384	0	1,384	장내

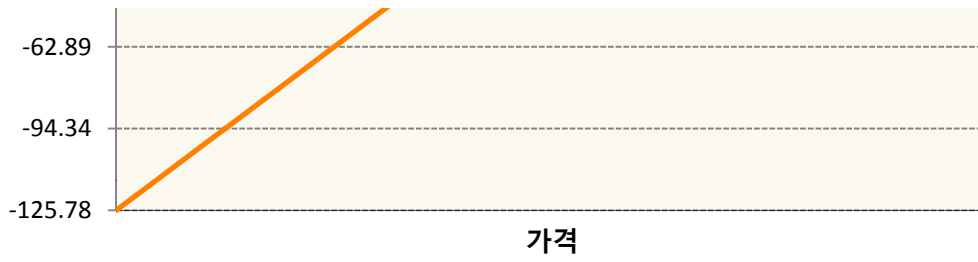
2. 만기시점의 손익구조

HCQ8-HSCEI Futures Aug18



MHCQ8-MINI H-SHR IDX FU Aug18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCQ8	HSCEI Futures Aug18	101
MHCQ8	MINI H-SHR IDX FU Aug18	10

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

101

공시일	2018-07-27
기준일	2018-07-26

커버드콜모(주식혼합-파생형)

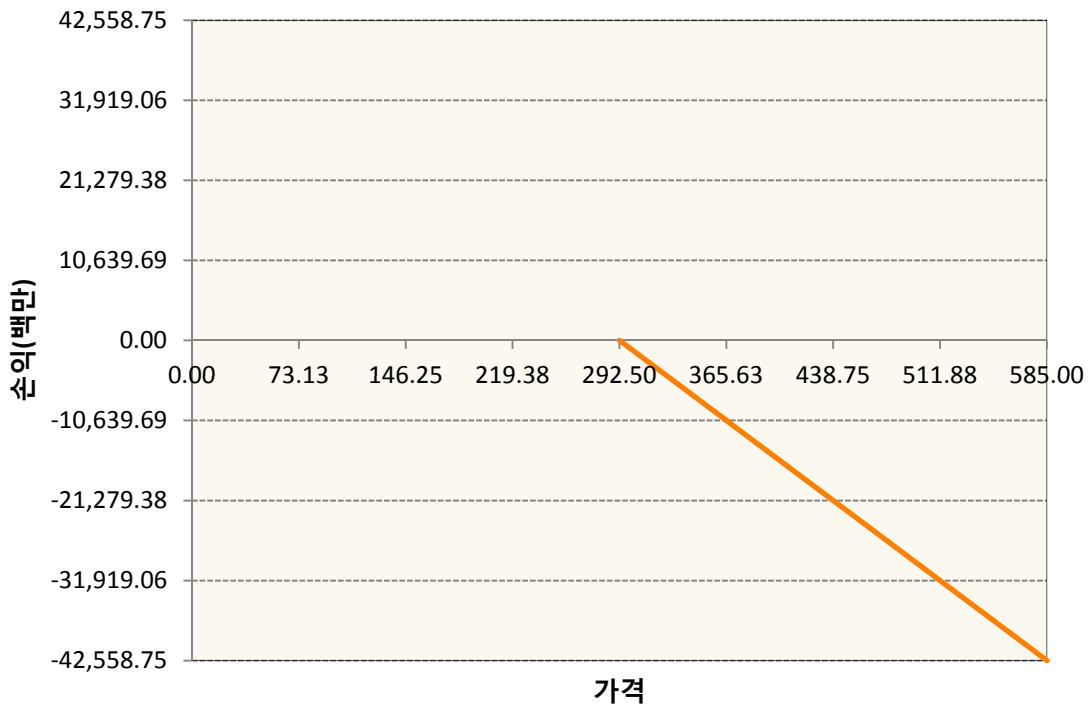
1. 계약금액

(단위:백만원)

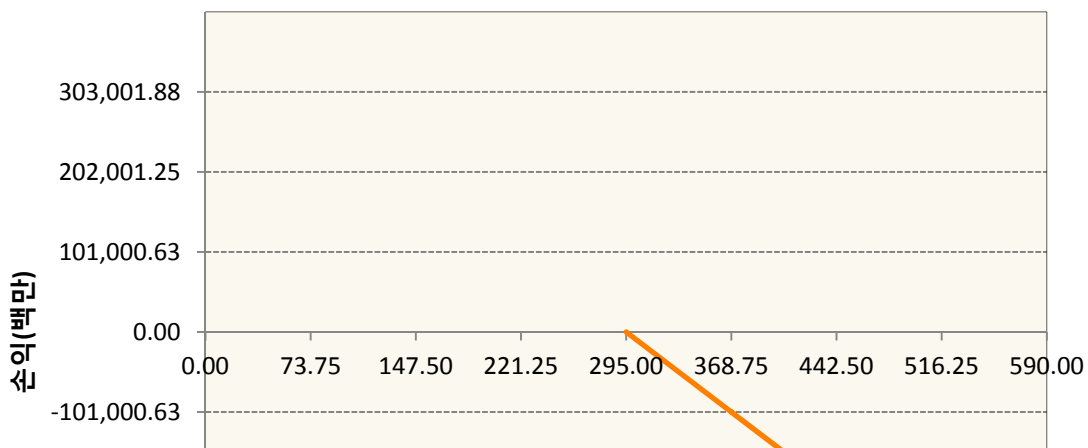
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	725,561	-725,561	장내

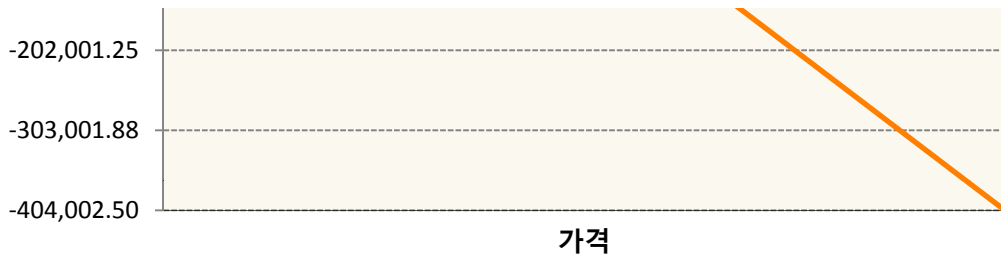
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N82928-2018-08 콜292.5

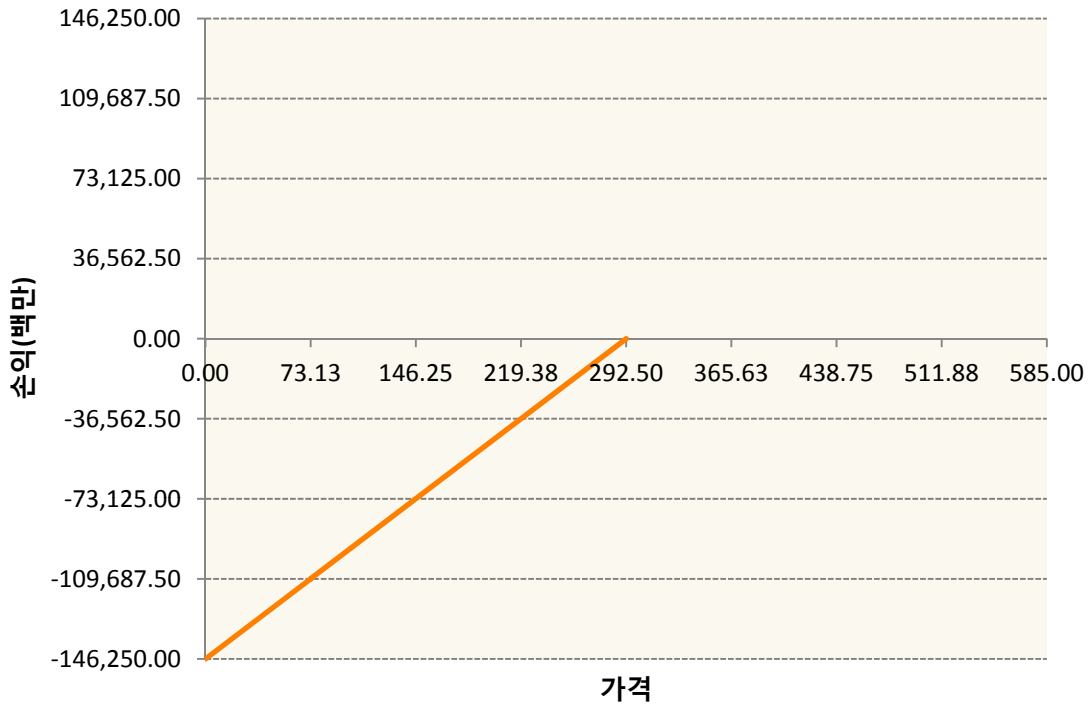


KR4201N82951-2018-08 콜295

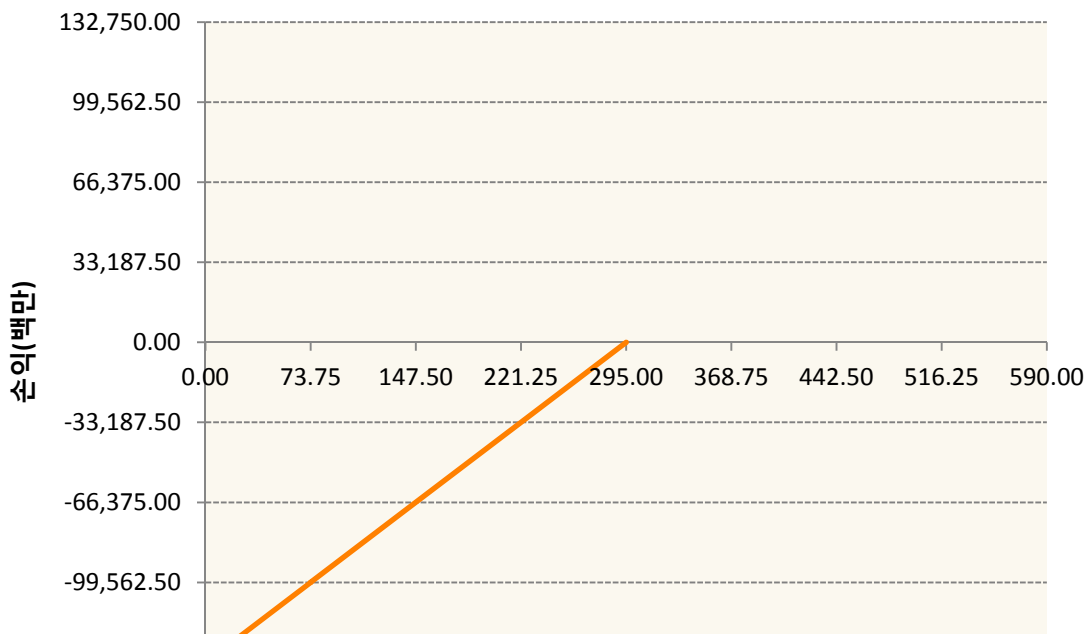




KR4301N82926-2018-08 풋292.5



KR4301N82959-2018-08 풋295



-132,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N829 2018-08 콜292.5							2,928
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,269	1,246	1,218	1,185	1,148	1,107	1,062
-5.33%	1,148	1,097	1,042	985	924	862	797
-2.67%	828	753	678	602	526	449	373
0%	225	151	76	0	-76	-153	-229
2.67%	-645	-696	-751	-810	-872	-936	-1,001
5.33%	-1,686	-1,711	-1,742	-1,779	-1,820	-1,865	-1,914
8.00%	-2,805	-2,814	-2,828	-2,846	-2,869	-2,896	-2,928
KR4201N829 2018-08 콜295							26,448
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,136	9,982	9,779	9,529	9,235	8,901	8,532
-5.33%	9,347	8,952	8,511	8,032	7,521	6,984	6,426
-2.67%	7,020	6,361	5,689	5,006	4,316	3,620	2,919
0%	2,214	1,477	739	0	-740	-1,481	-2,222
2.67%	-5,240	-5,809	-6,408	-7,030	-7,672	-8,328	-8,996
5.33%	-14,622	-14,934	-15,302	-15,717	-16,174	-16,665	-17,186
8.00%	-24,984	-25,110	-25,284	-25,508	-25,779	-26,093	-26,448
KR4301N829 2018-08 풋292.5							9,021
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,994	-8,994	-8,996	-8,998	-9,003	-9,011	-9,021
-5.33%	-5,057	-5,076	-5,102	-5,135	-5,176	-5,224	-5,278
-2.67%	-1,539	-1,644	-1,752	-1,862	-1,975	-2,089	-2,204
0%	300	205	104	0	-107	-217	-329
2.67%	636	620	597	565	527	481	429
5.33%	652	652	650	647	641	633	620
8.00%	653	653	653	652	652	651	650
KR4301N829 2018-08 풋295							8,846
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,834	-8,834	-8,834	-8,835	-8,837	-8,840	-8,846
-5.33%	-5,278	-5,285	-5,296	-5,312	-5,334	-5,362	-5,395
-2.67%	-1,900	-1,968	-2,042	-2,122	-2,206	-2,293	-2,384
0%	327	219	110	0	-110	-221	-333
2.67%	925	894	854	807	753	692	627

5.33%	971	969	965	958	947	932	913
8.00%	972	972	972	971	971	969	965

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

(단위:백만원)

49,896

공시일	2018-07-27
기준일	2018-07-26

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

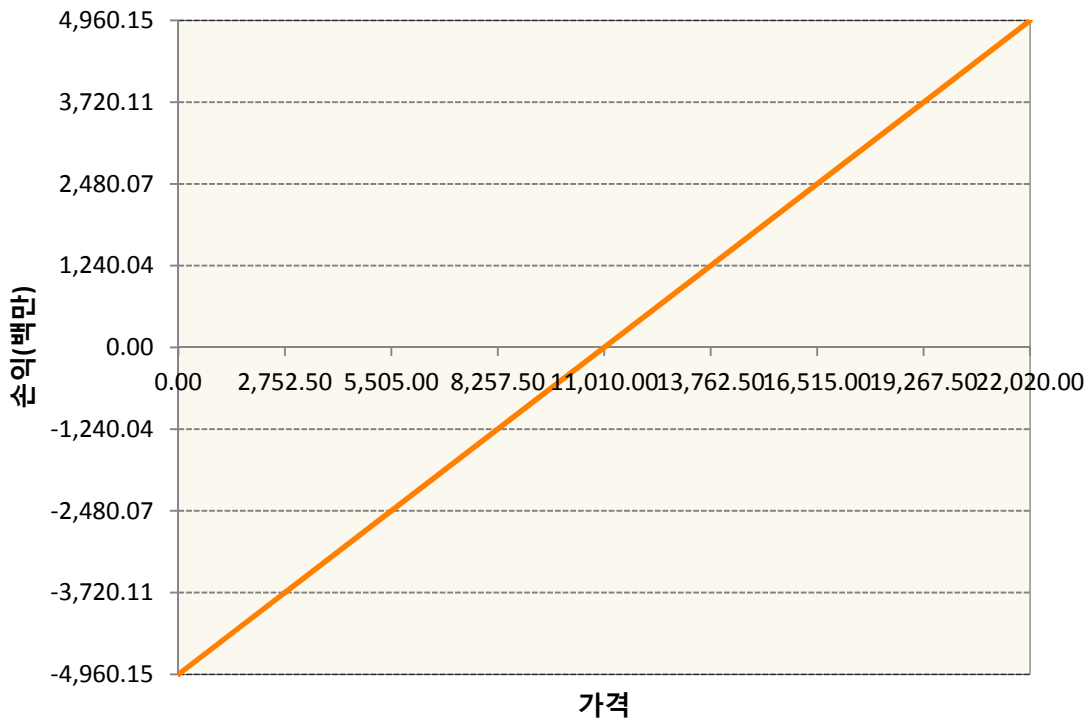
1. 계약금액

(단위:백만원)

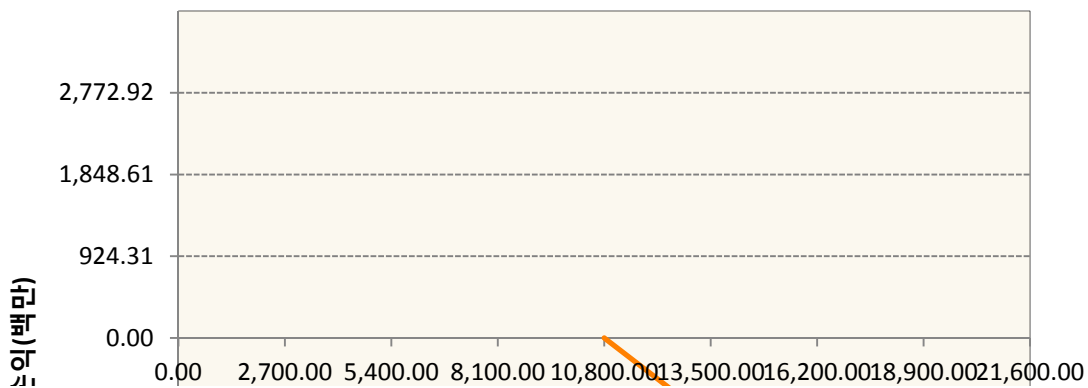
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,960	0	4,960	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,003	-11,003	장내

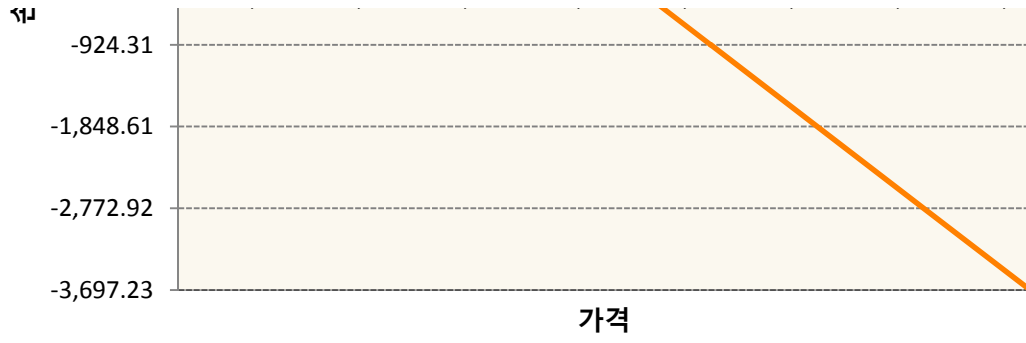
2. 만기시점의 손익구조

HCN8-HSCEI Futures Jul18

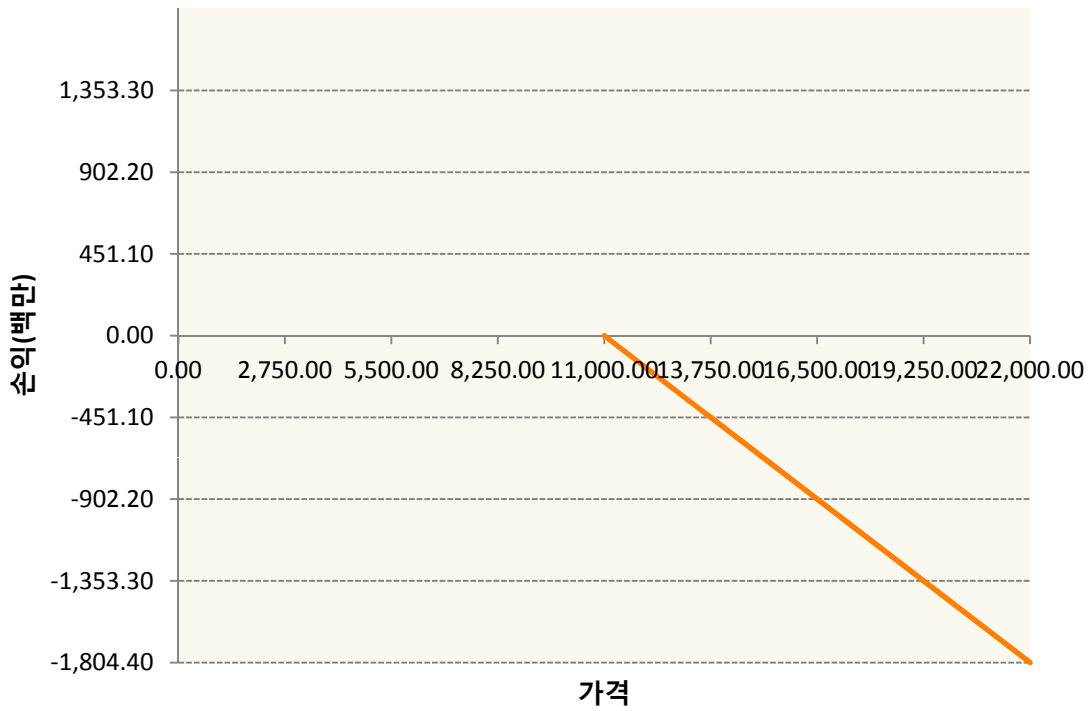


OHHIN8-C108-HSCEI

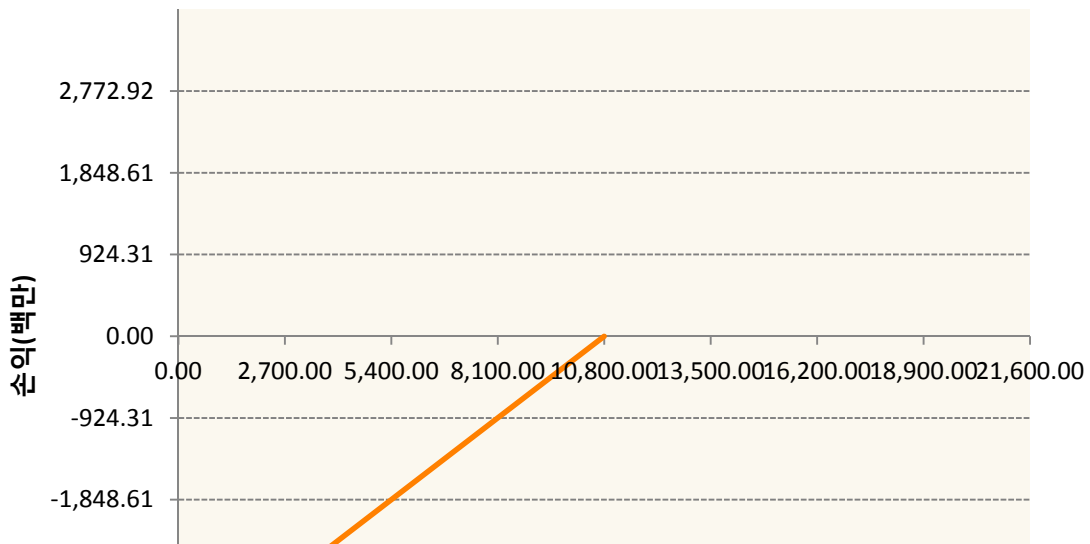


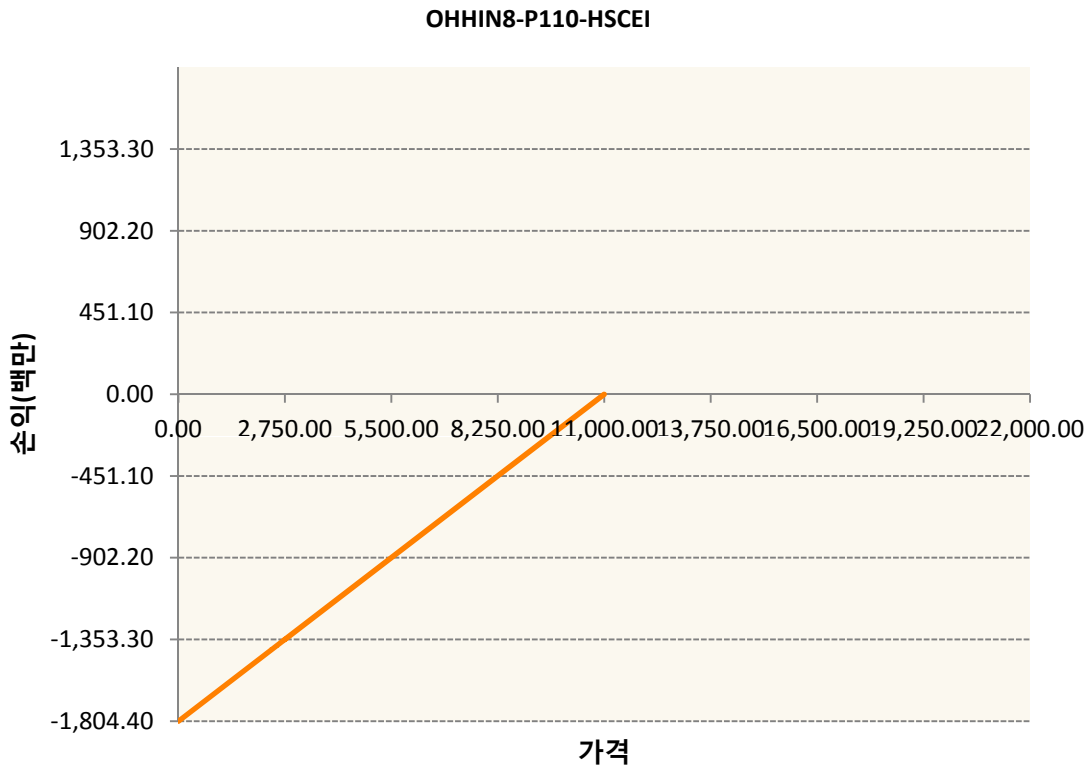
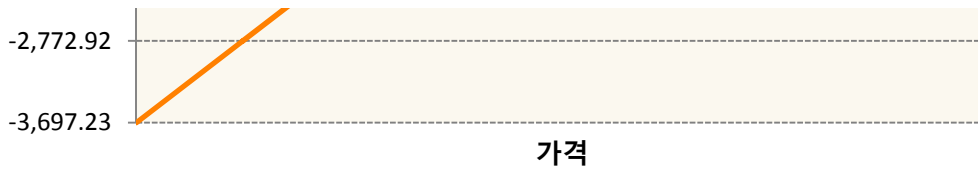


OHHIN8-C110-HSCEI



OHHIN8-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCN8	HSCEI Futures Jul18	397
OHHIN8-C1	HSCEI	296
OHHIN8-C1	HSCEI	144
OHHIN8-P1	HSCEI	296
OHHIN8-P11	HSCEI	144

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,162

공시일	2018-07-27
기준일	2018-07-26

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

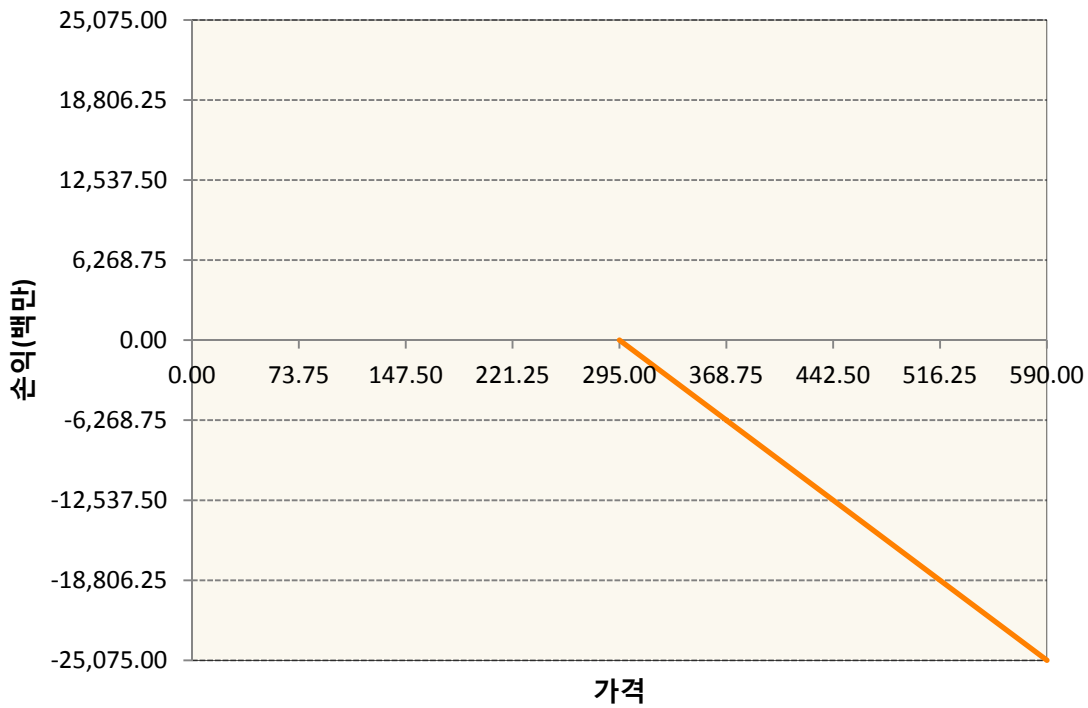
1. 계약금액

(단위:백만원)

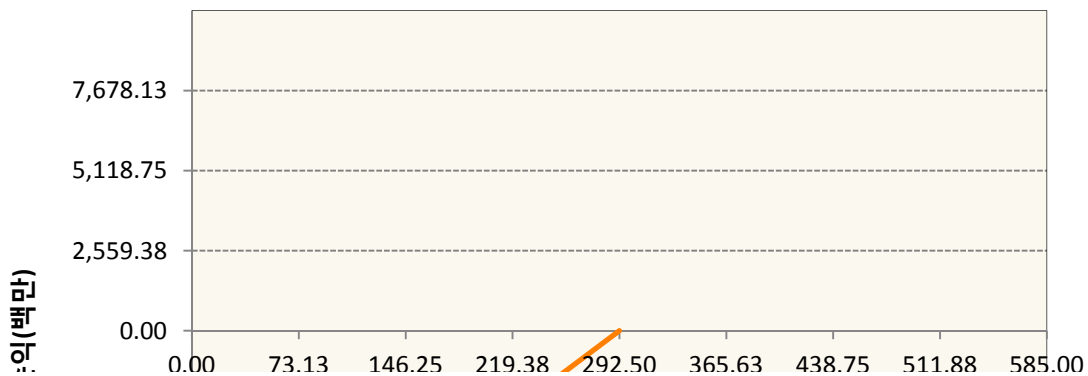
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	45,200	0	45,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	43,425	-43,425	장내

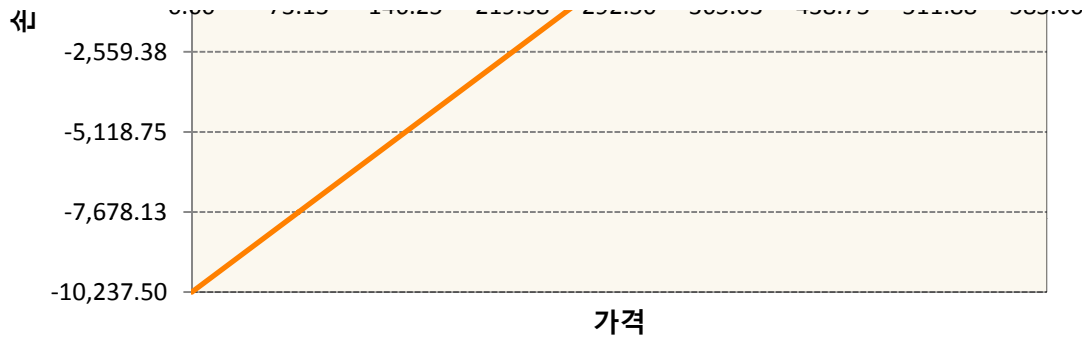
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N82951-2018-08 콜295

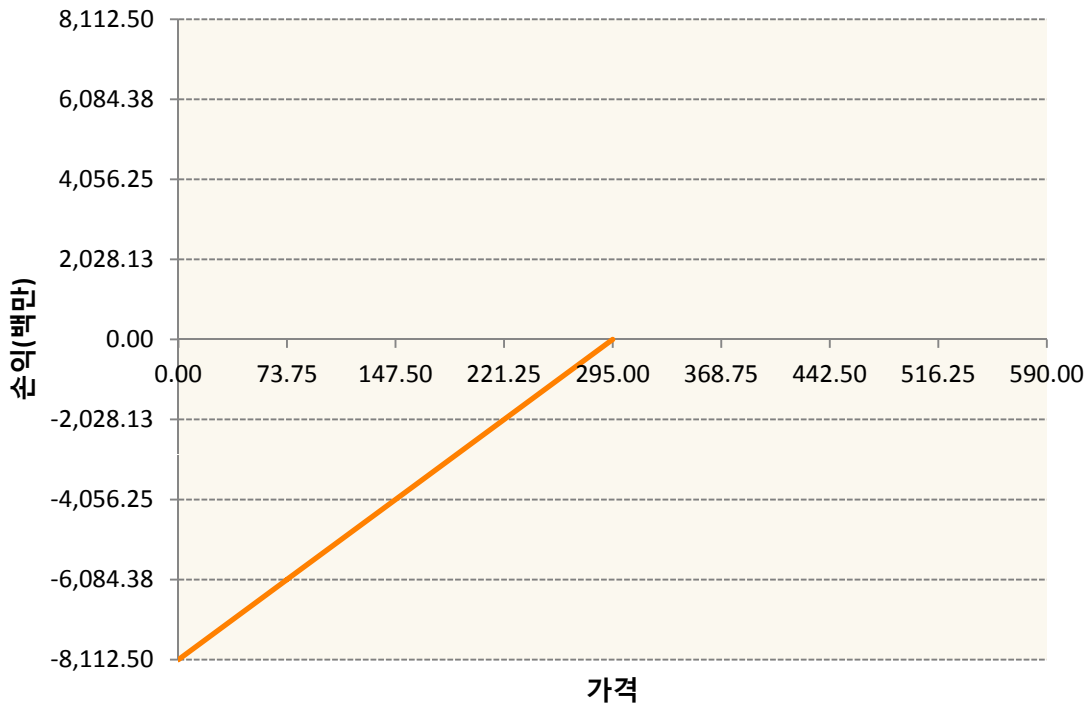


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





KR4301N82959-2018-08 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_2							1,496
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,496	-1,496	-1,496	-1,496	-1,496	-1,496	-1,496
-5.33%	-998	-998	-998	-998	-998	-998	-998
-2.67%	-499	-499	-499	-499	-499	-499	-499
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	499	499	499	499	499	499	499
5.33%	998	998	998	998	998	998	998
8.00%	1,496	1,496	1,496	1,496	1,496	1,496	1,496
2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_3							283
	기초자산의 변동성						

0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	162	162	162	162	162	162	162
5.33%	324	324	324	324	324	324	324
8.00%	485	485	485	485	485	485	485

KR4201N829 2018-08 콜295

1,642

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	629	620	607	591	573	552	530
-5.33%	580	556	528	498	467	433	399
-2.67%	436	395	353	311	268	225	181
0%	137	92	46	0	-46	-92	-138
2.67%	-325	-361	-398	-436	-476	-517	-558
5.33%	-908	-927	-950	-976	-1,004	-1,034	-1,067
8.00%	-1,551	-1,558	-1,569	-1,583	-1,600	-1,620	-1,642

KR4301N829 2018-08 풋292.5

631

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-630	-630	-630	-630	-630	-631	-631
-5.33%	-354	-355	-357	-359	-362	-366	-369
-2.67%	-108	-115	-123	-130	-138	-146	-154
0%	21	14	7	0	-8	-15	-23
2.67%	45	43	42	40	37	34	30
5.33%	46	46	46	45	45	44	43
8.00%	46	46	46	46	46	46	45

KR4301N829 2018-08 풋295

541

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-540	-540	-540	-540	-540	-540	-541
-5.33%	-323	-323	-324	-325	-326	-328	-330
-2.67%	-116	-120	-125	-130	-135	-140	-146
0%	20	13	7	0	-7	-14	-20
2.67%	57	55	52	49	46	42	38
5.33%	59	59	59	59	58	57	56
8.00%	59	59	59	59	59	59	59

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

(단위:백만원)

6,623

공시일	2018-07-27
기준일	2018-07-26

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

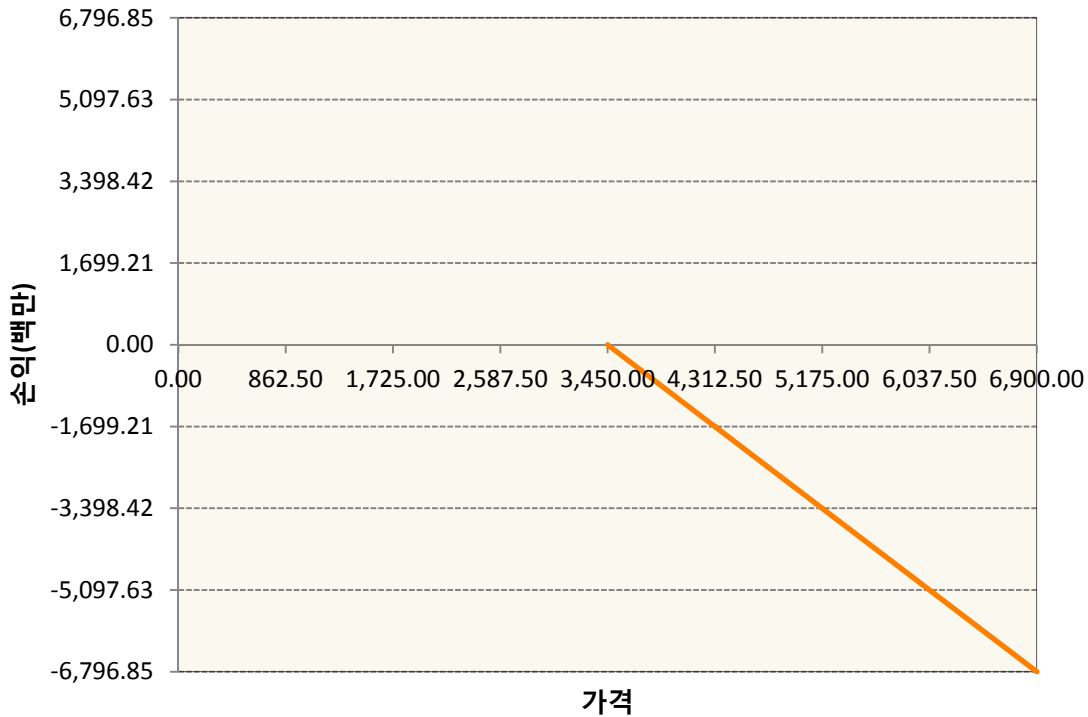
1. 계약금액

(단위:백만원)

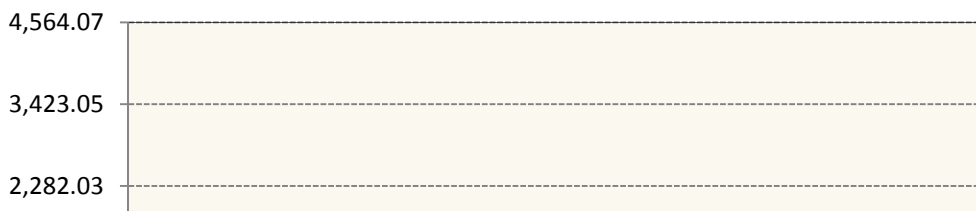
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,936	0	3,936	
누계	유가증권	스왑	45,289	0	45,289	장외
누계	유가증권	옵션	0	18,162	-18,162	장내
누계	지수	스왑	53,320	0	53,320	장외

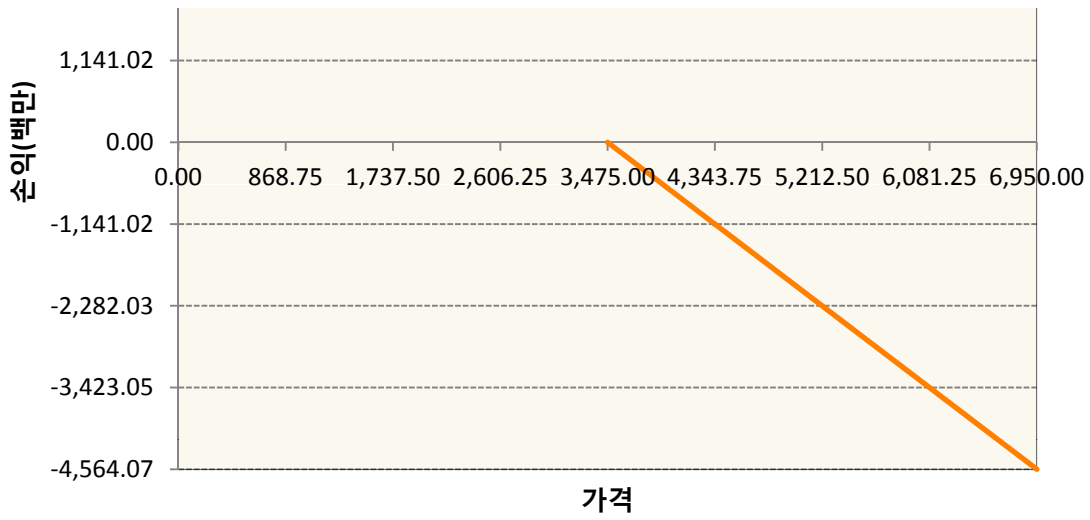
2. 만기시점의 손익구조

OESXQ8-C3450-EURO STOXX 50 OPT

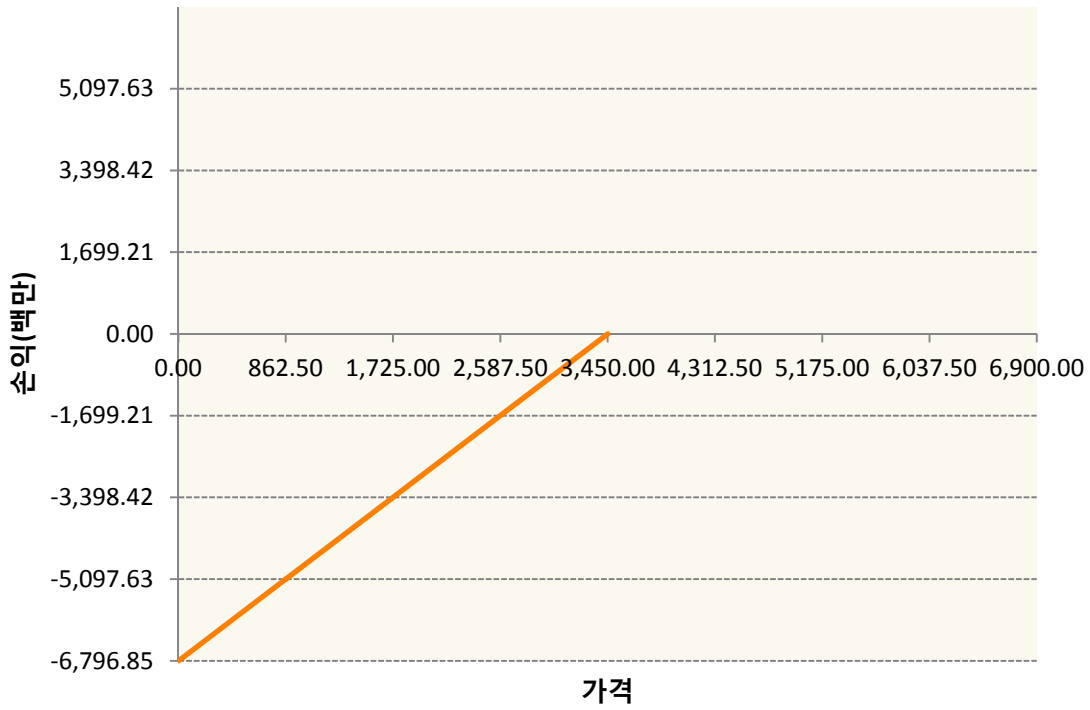


OESXQ8-C3475-EURO STOXX 50 OPT

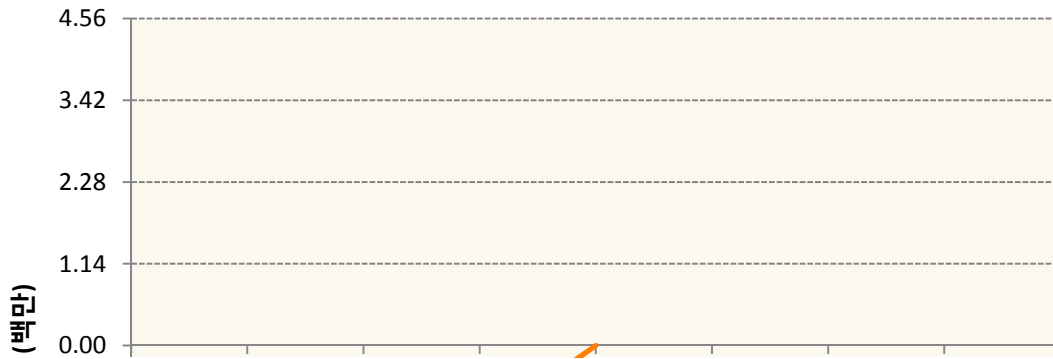


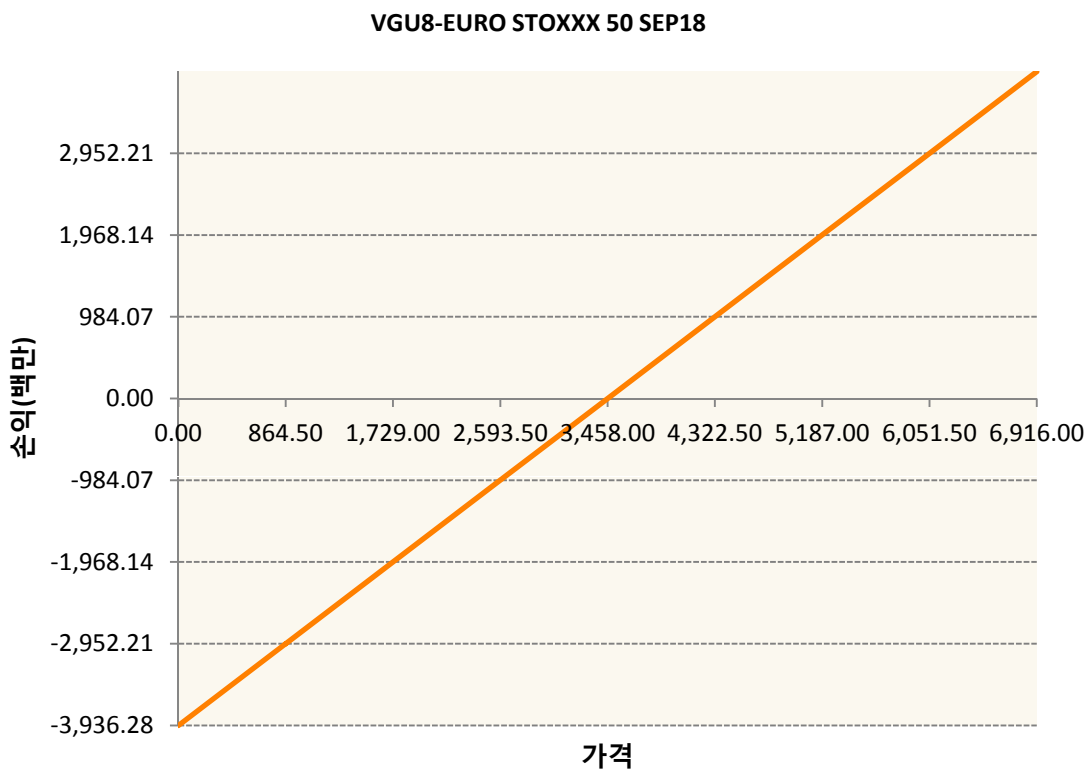
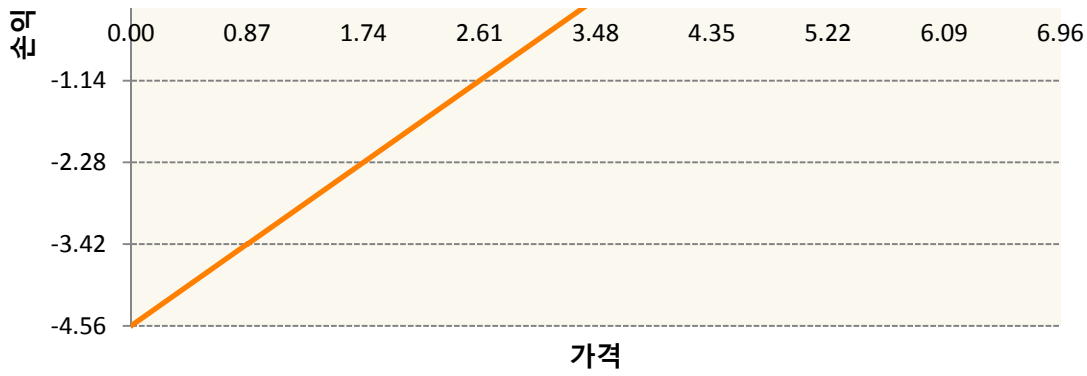


OESXQ8-P3450-EURO STOXX 50



OESXQ8-P3475-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY -	994.569	11
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		9
OESXQ8-C3 EURO STOXX 50 OPT		544
OESXQ8-C3 EURO STOXX 50 OPT		365
OESXQ8-P3 EURO STOXX 50		544
OESXQ8-P3 EURO STOXX 50		0.4
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18		315

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)

169

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

(단위:백만원)

41

공시일	2018-07-27
기준일	2018-07-26

리디파인K200(주식혼합-파생재간

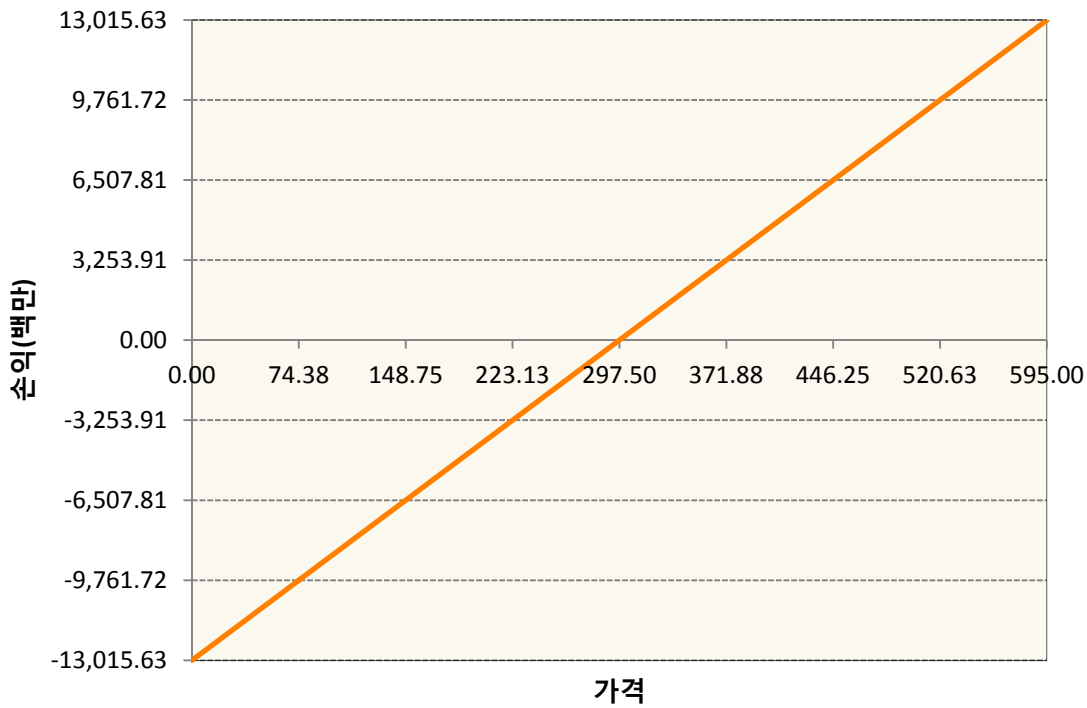
1. 계약금액

(단위:백만원)

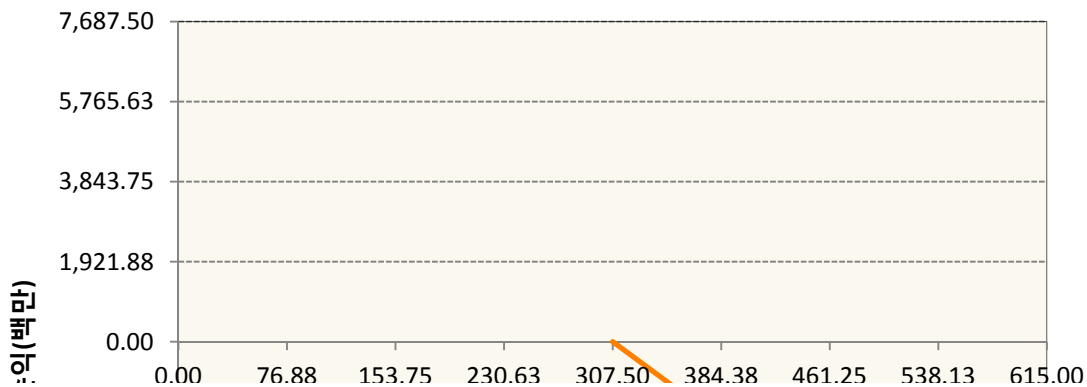
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,016	0	13,016	장내
누계	유가증권	옵션	2,134	23,730	-21,596	장내

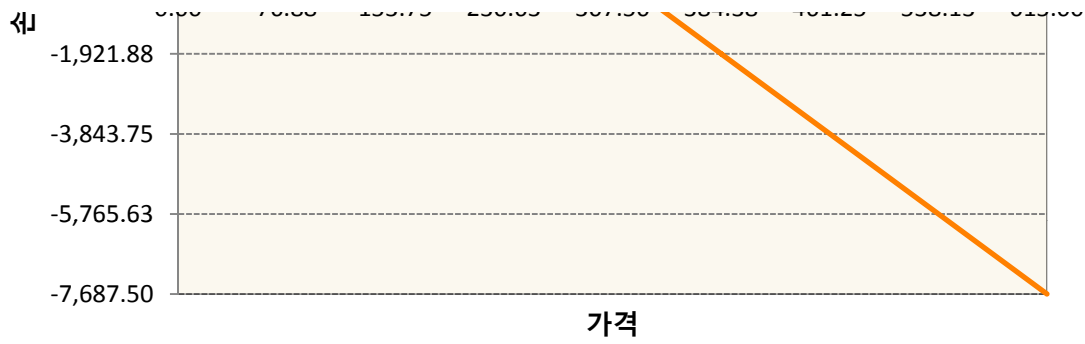
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

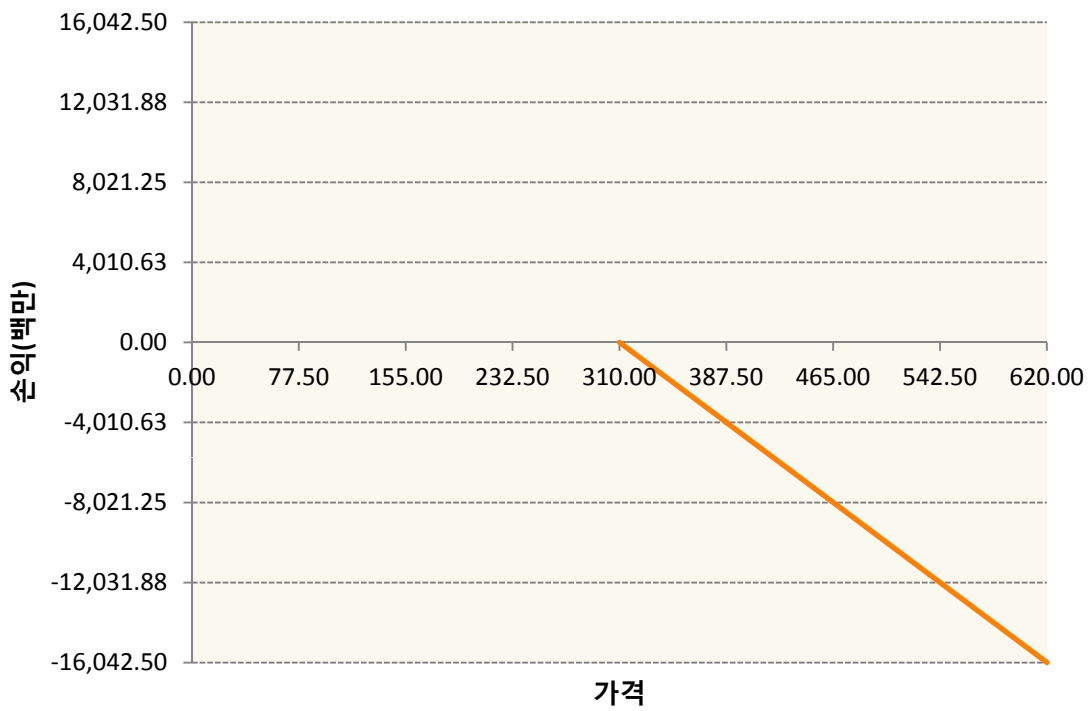


KR4201N83074-2018-08 콜307.5

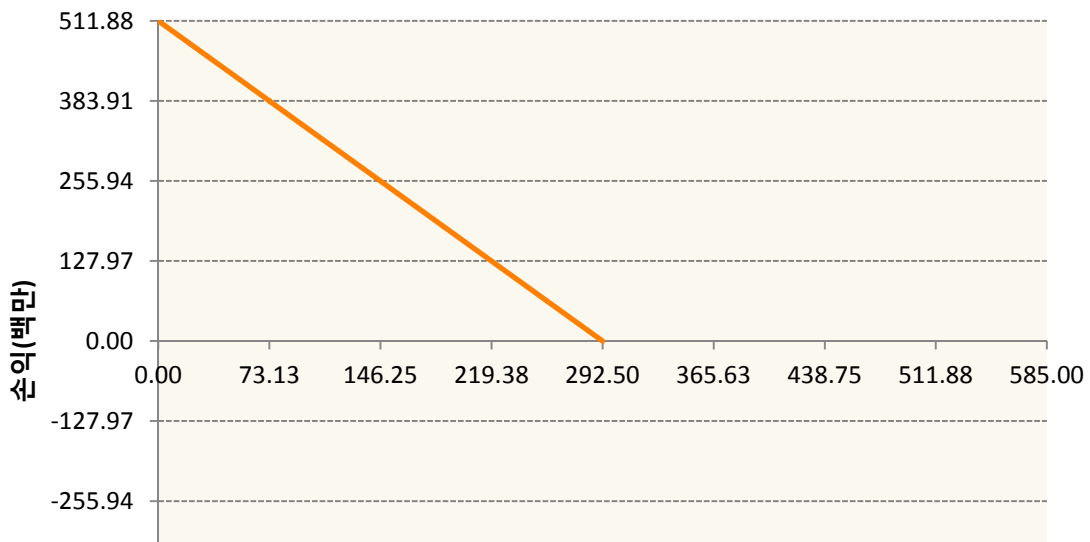


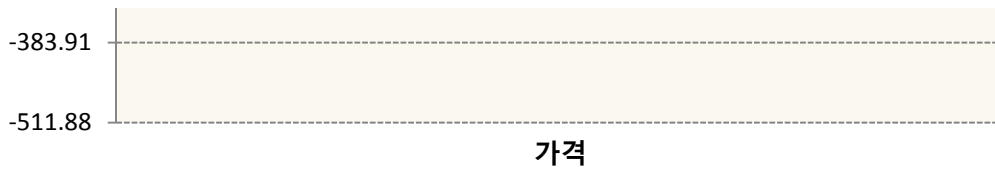


KR4201N83108-2018-08 콜310

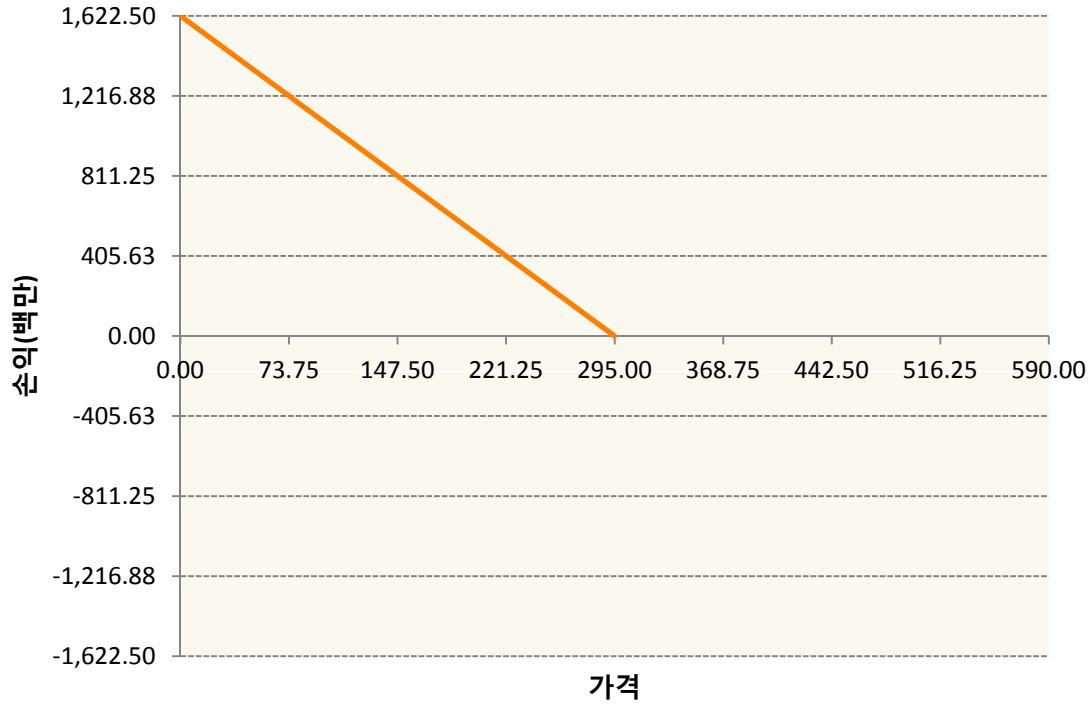


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





KR4301N82959-2018-08 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물 1,039

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 콜307.5 353

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	67	66	66	65	63	61	58
-5.33%	65	64	61	58	54	49	44
-2.67%	58	53	47	40	32	24	15

0%	32	22	11	0	-12	-23	-36
2.67%	-29	-43	-57	-71	-85	-99	-113
5.33%	-138	-151	-165	-178	-192	-206	-219
8.00%	-289	-298	-308	-319	-330	-341	-353

KR4201N8312018-08 콜310

671

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	108	108	107	105	103	99	95
-5.33%	107	104	101	96	89	81	71
-2.67%	97	89	79	67	53	38	22
0%	58	40	21	0	-22	-45	-68
2.67%	-43	-70	-98	-125	-154	-182	-210
5.33%	-236	-265	-294	-324	-353	-382	-411
8.00%	-524	-546	-569	-594	-619	-645	-671

KR4301N829 2018-08 풋292.5

32

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	31	31	31	31	32	32	32
-5.33%	18	18	18	18	18	18	18
-2.67%	5	6	6	7	7	7	8
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-1
5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2

KR4301N829 2018-08 풋295

108

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	108	108	108	108	108	108	108
-5.33%	65	65	65	65	65	66	66
-2.67%	23	24	25	26	27	28	29
0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-11	-11	-10	-10	-9	-8	-8
5.33%	-12	-12	-12	-12	-12	-11	-11
8.00%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12

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

(단위:백만원)

1,720

공시일	2018-07-27
기준일	2018-07-26

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

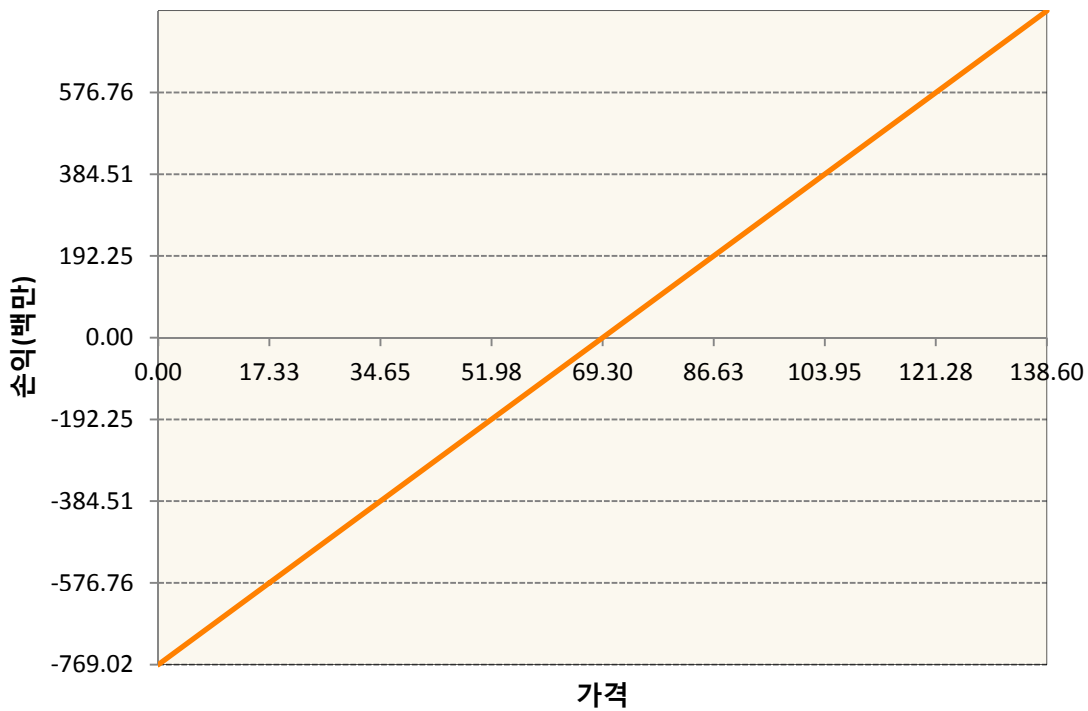
1. 계약금액

(단위:백만원)

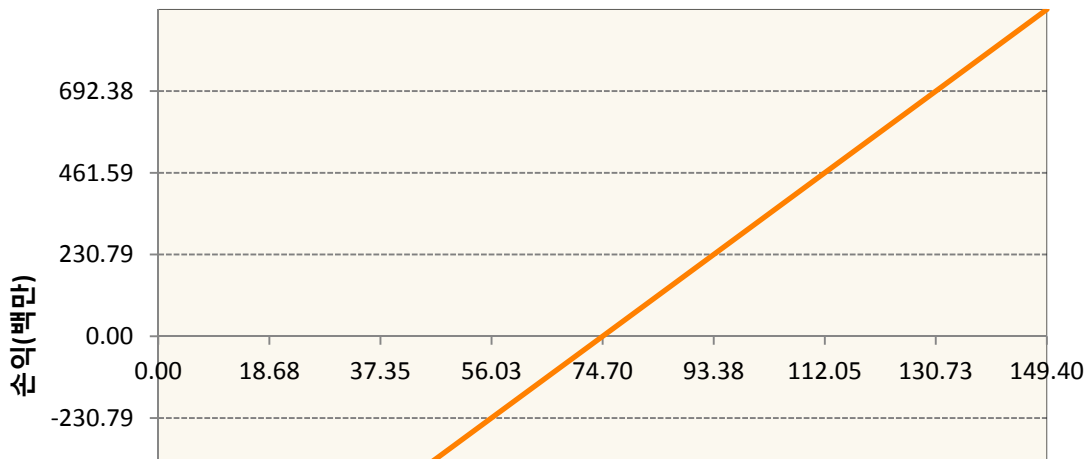
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,657	616	3,041	

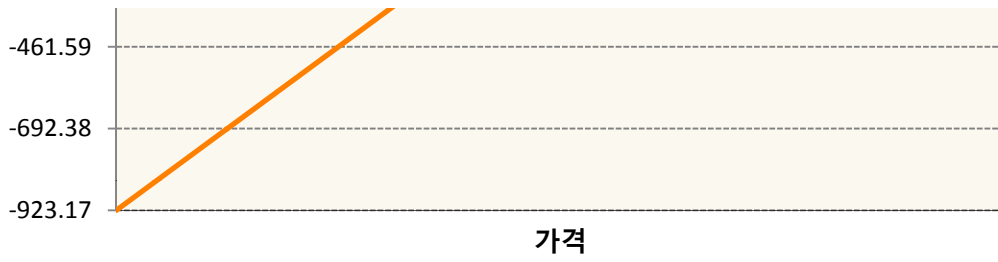
2. 만기시점의 손익구조

CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18

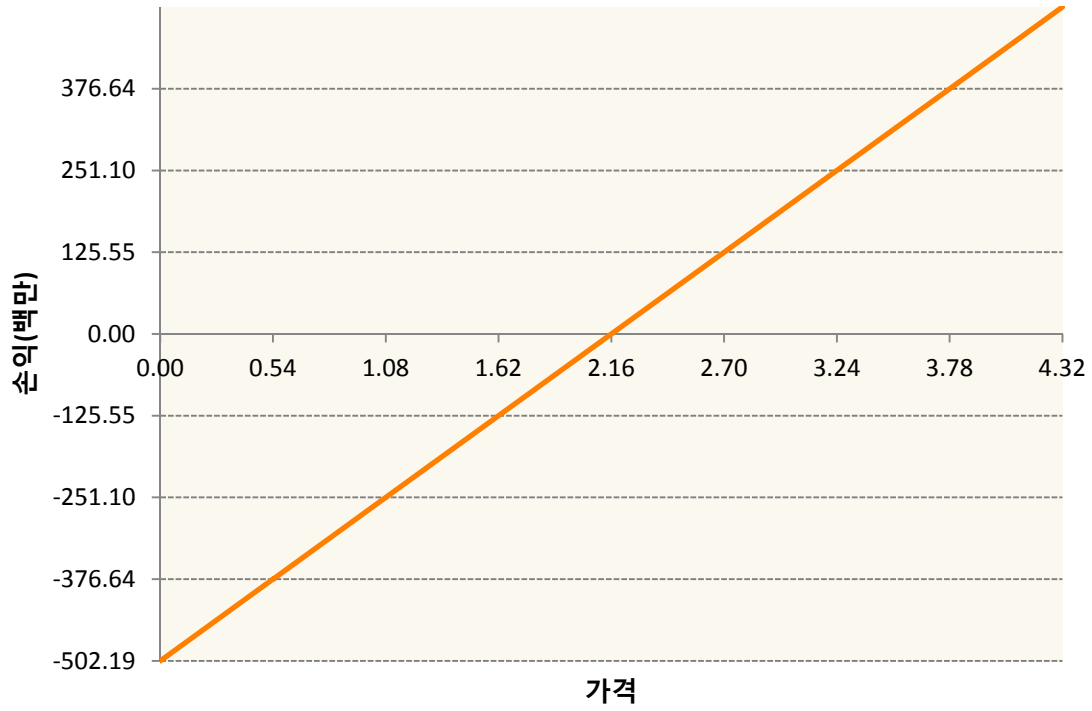


COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18

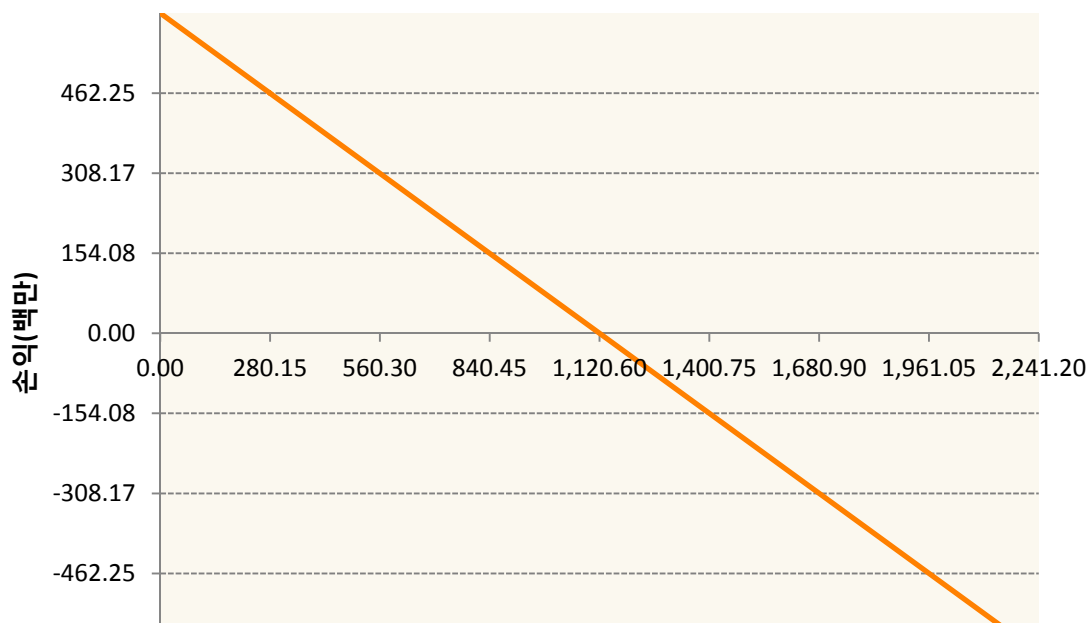


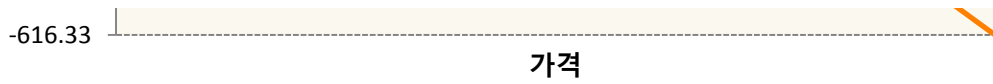


HOU8-NY Harb ULSD Fut SEP18

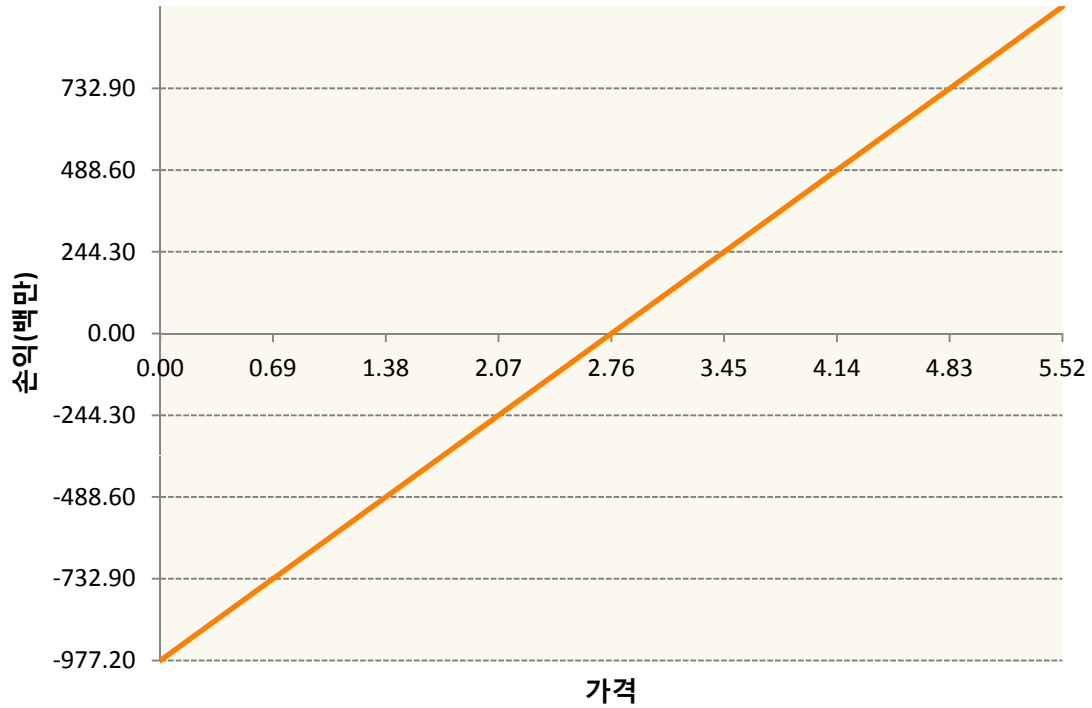


KR4175N80001-2018-08 달러선물

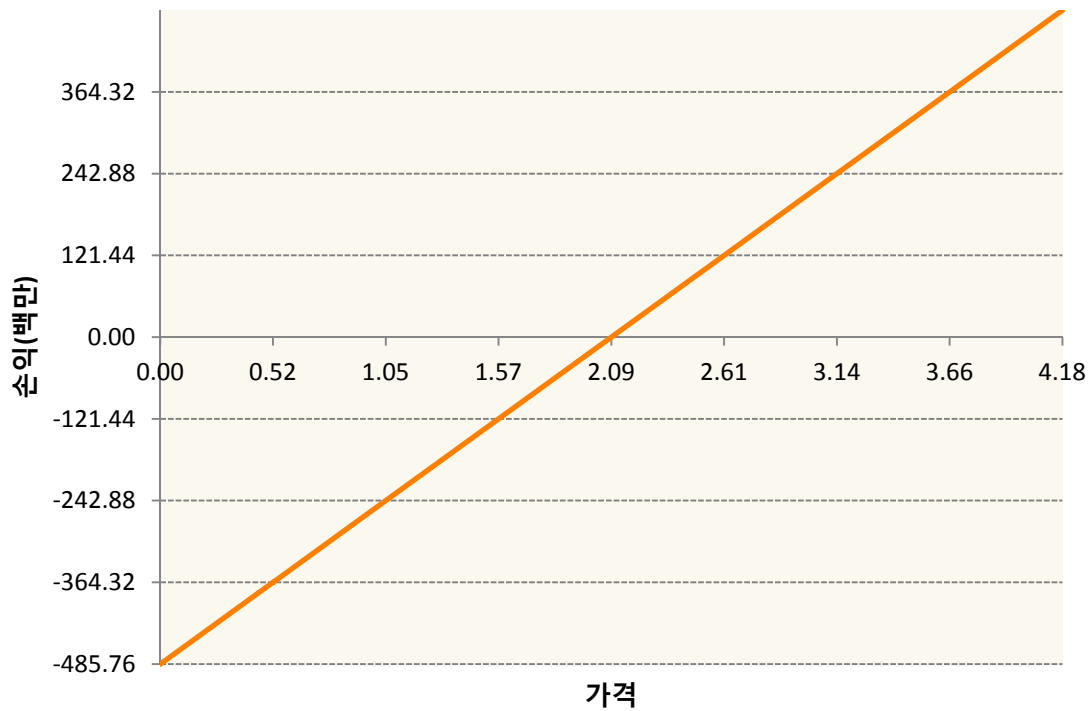




NGU18-NATURAL GAS FUTR SEP18



XBU8-GASOLINE RBOB FUT SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU8	WTI CRUDE FUTURE SEP18	62
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	74
HOU8	NY Harb ULSD Fut SEP18	40
KR4175N80C	2018-08 달러선물	49
NGU18	NATURAL GAS FUTR SEP18	78
XBU8	GASOLINE RBOB FUT SEP18	39

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

450

공시일	2018-07-27
기준일	2018-07-26

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

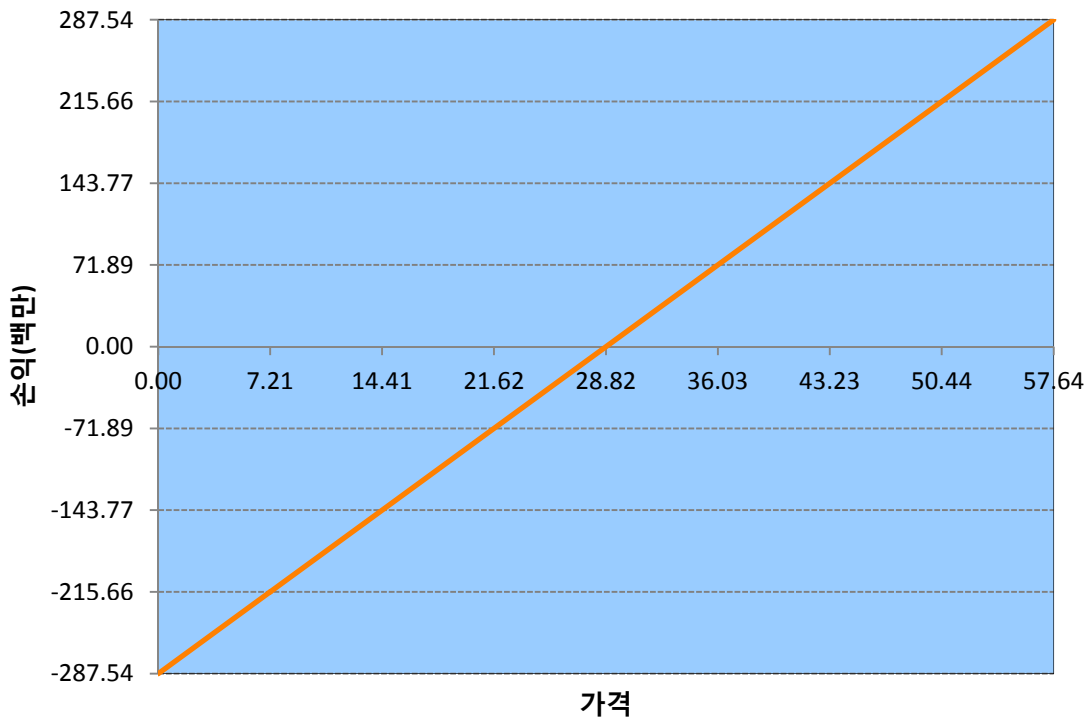
1. 계약금액

(단위:백만원)

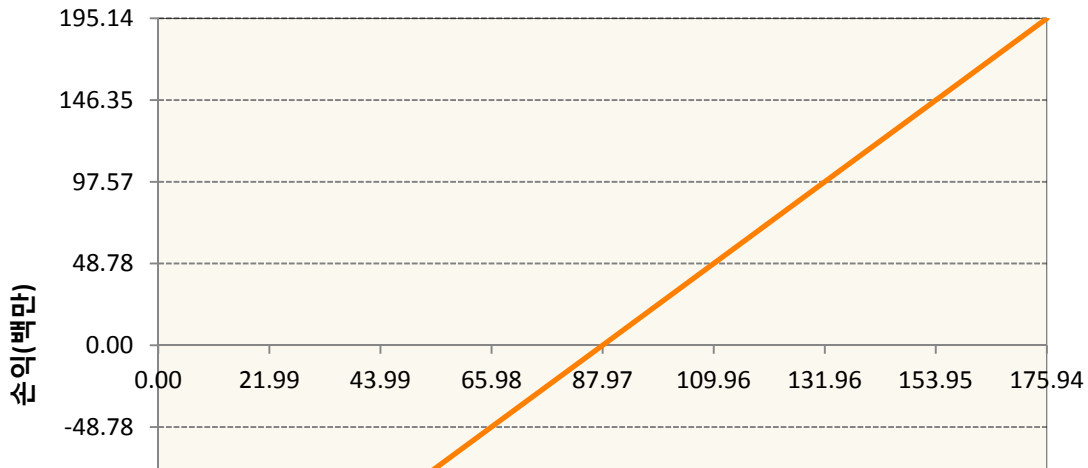
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,685	78	3,607	

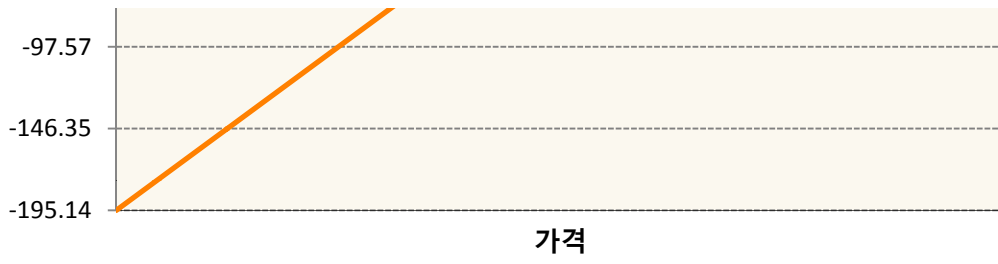
2. 만기시점의 손익구조

BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18

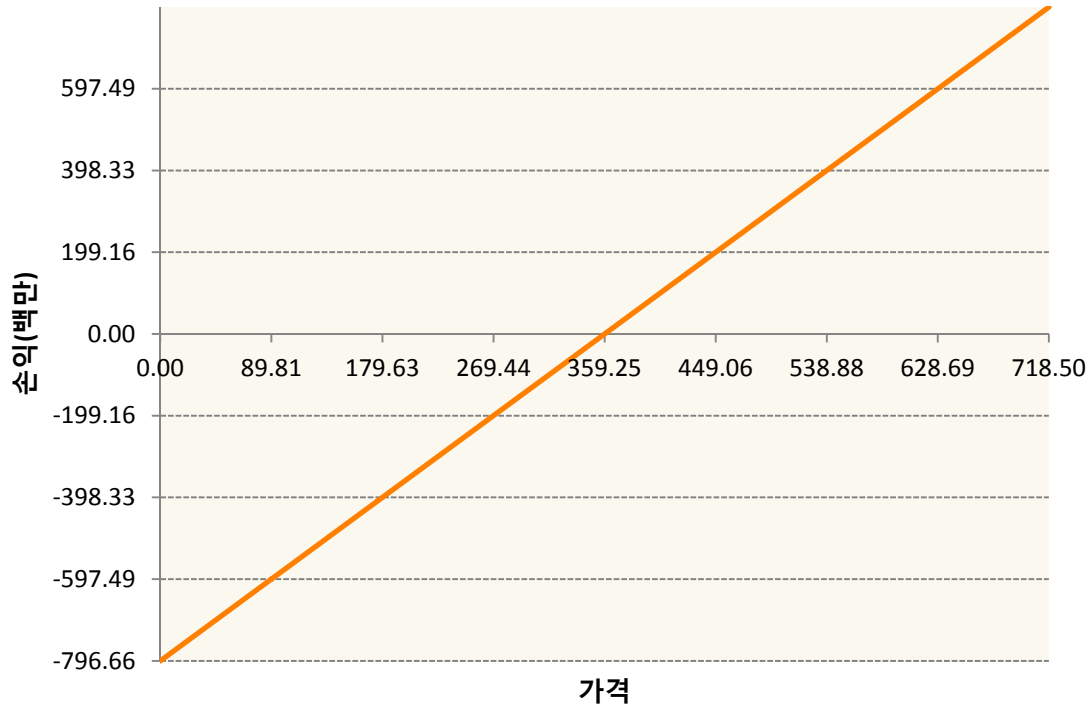


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

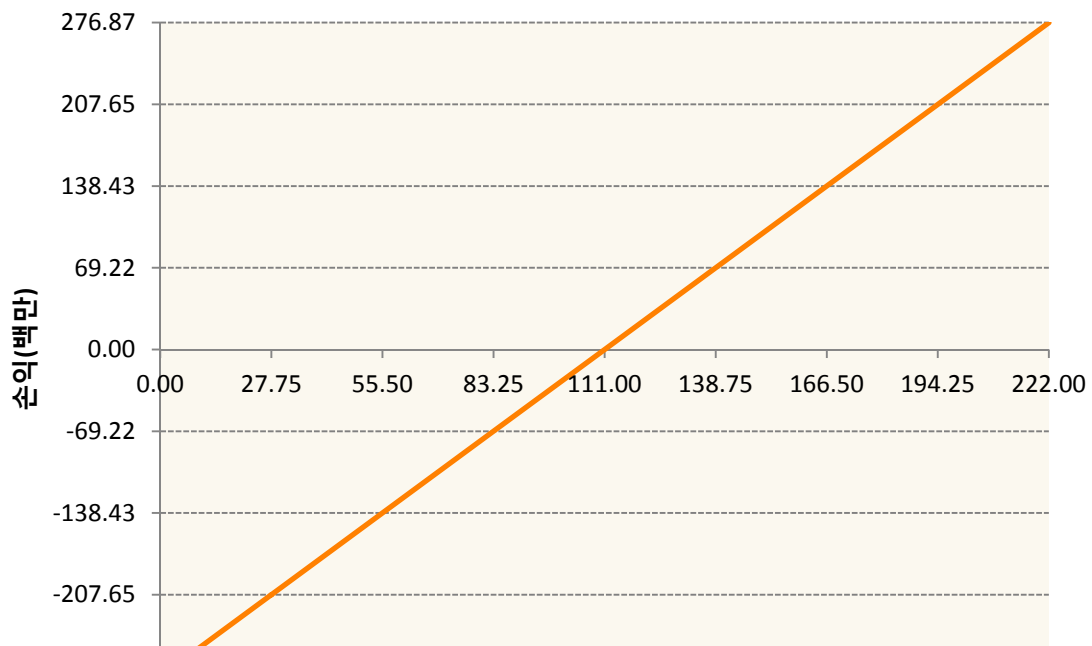


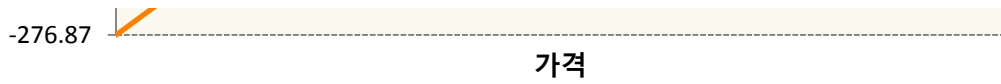


CU8-CORN FUTURE SEP18

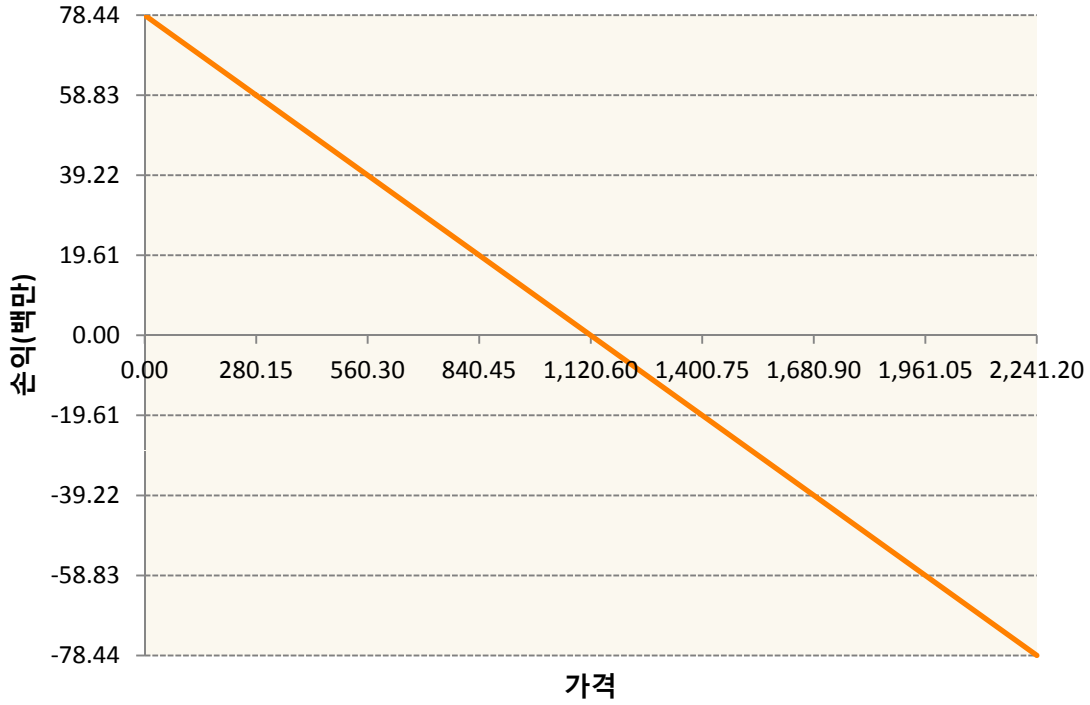


KCU8-COFFEE 'C' FUTURE SEP18

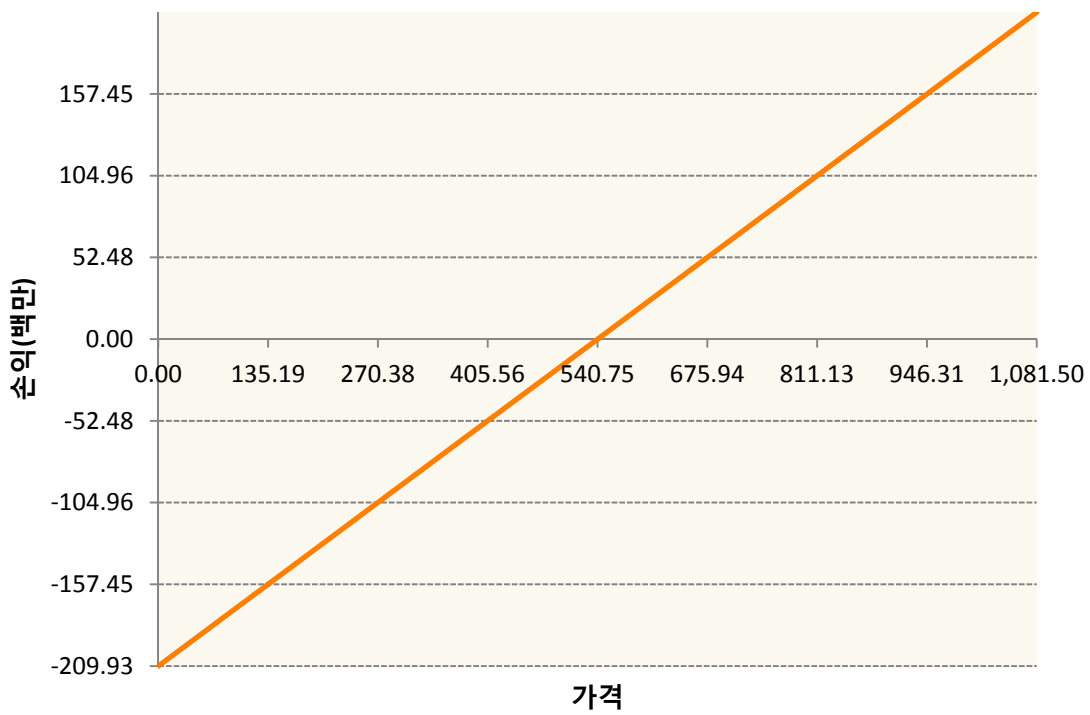




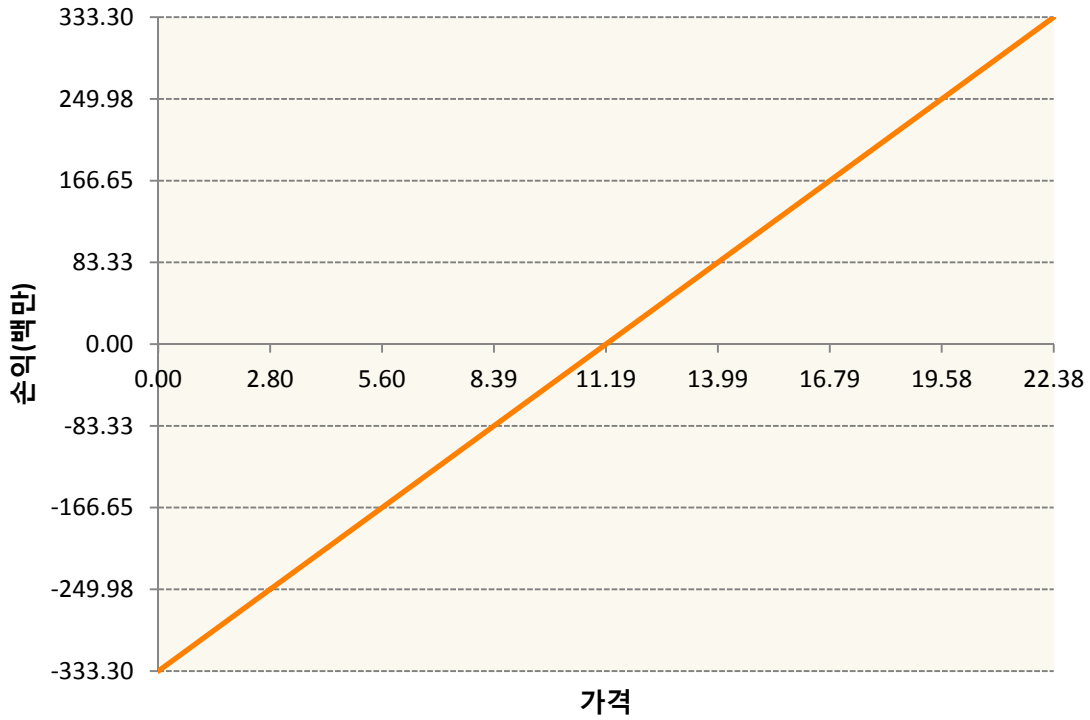
KR4175N80001-2018-08 달러선물



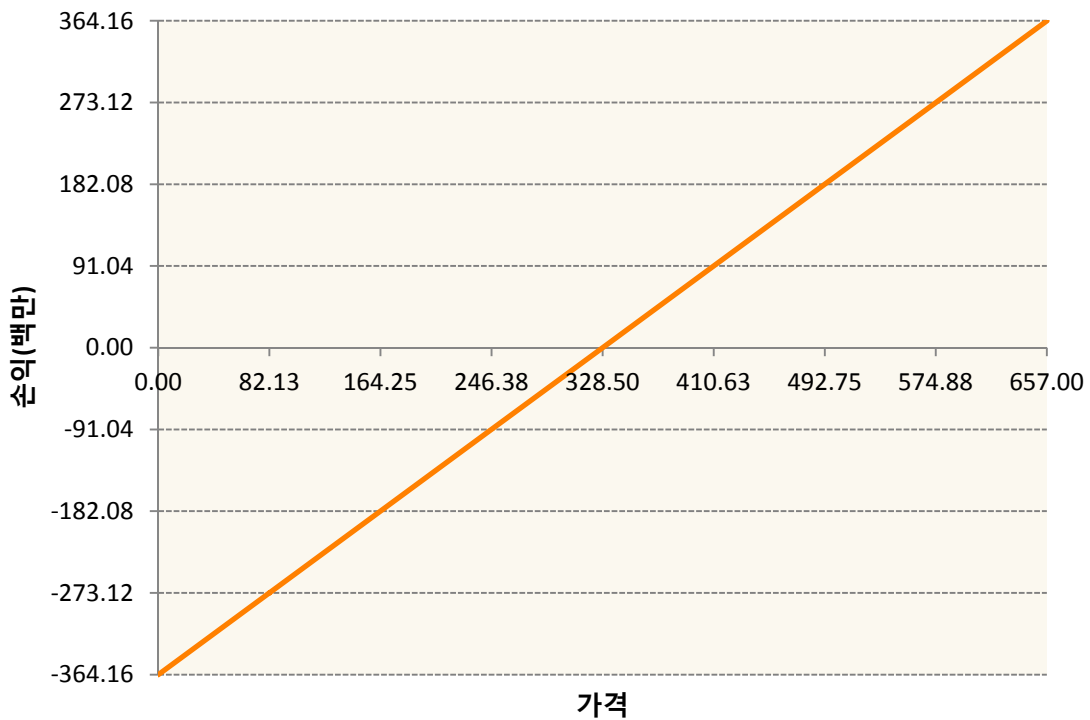
KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

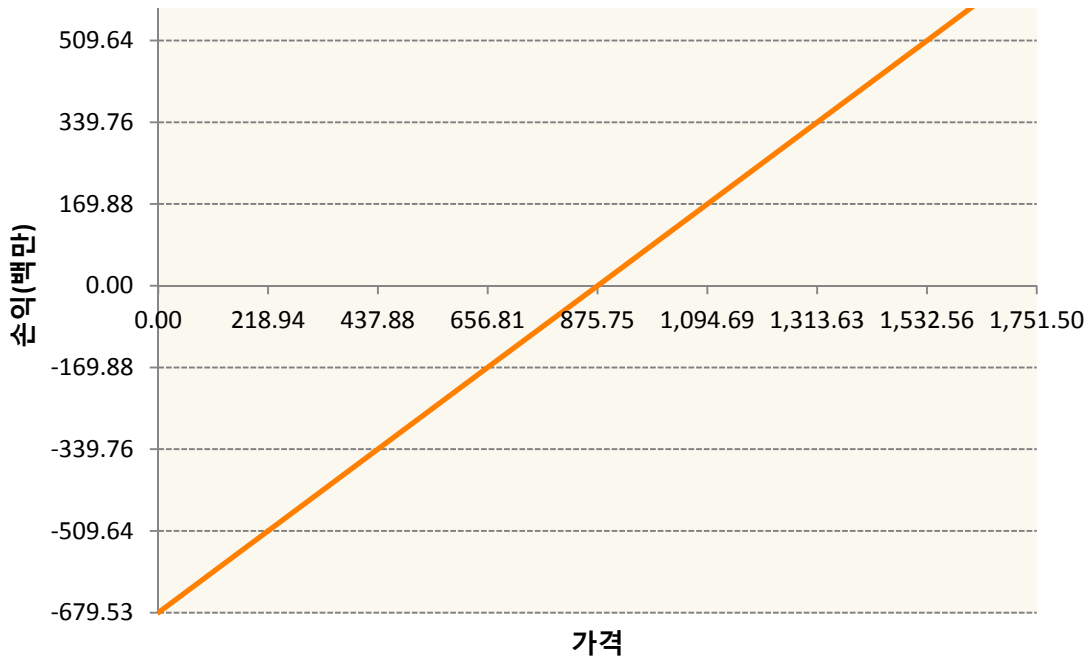


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

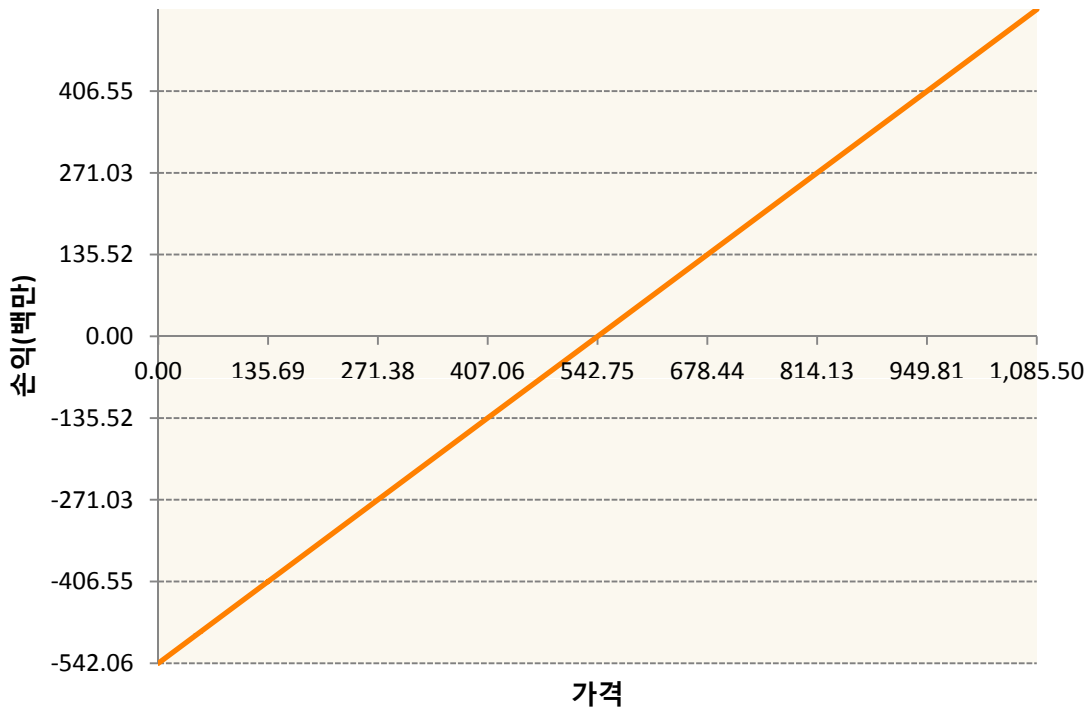


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





WU8-WHEAT FUTURE(CBT) SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	23
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	16
CU8	CORN FUTURE SEP18	64
KCU8	COFFEE 'C' FUTURE SEP18	22
KR4175N80C	2018-08 달러선물	6

KWU8	KC HRW WHEAT FUT SEP18	17
SBV8	SUGAR #11 (WORLD) OCT18	27
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	29
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	54
WU8	WHEAT FUTURE(CBT) SEP18	43

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

(단위:백만원)

312