

공시일	2018-07-31
기준일	2018-07-30

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	2018-07-31
기준일	2018-07-30

스마트인덱스모

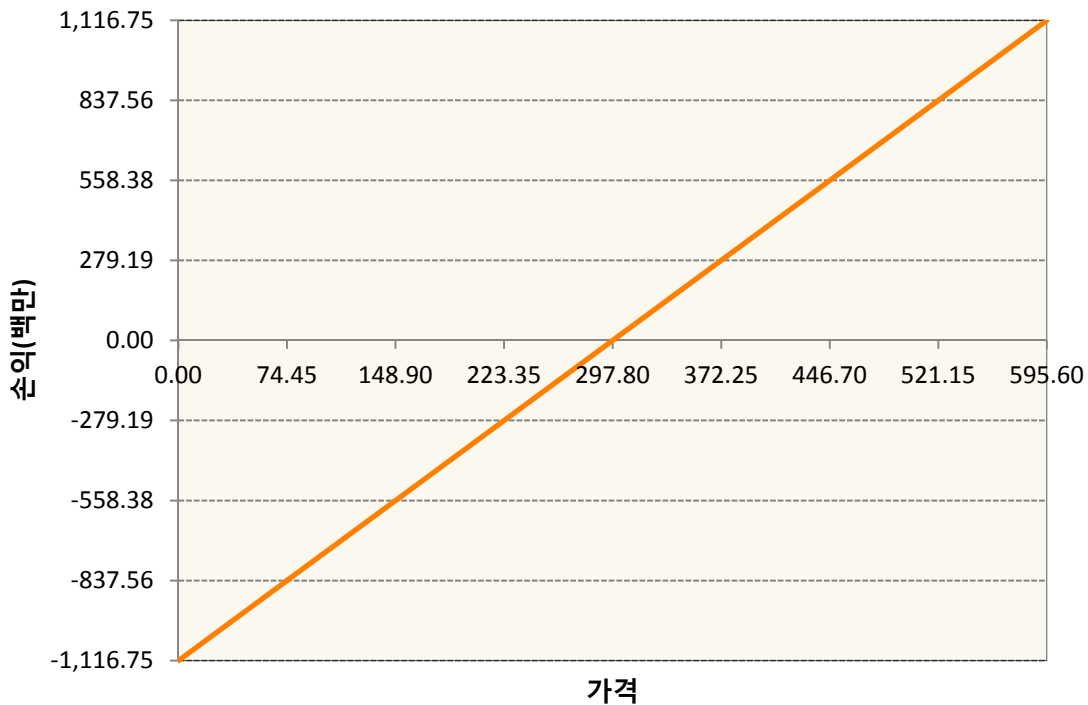
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,117	0	1,117	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	2018-07-31
기준일	2018-07-30

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

1,142

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

483

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-07-31
기준일	2018-07-30

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

322

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

388

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-07-31
기준일	2018-07-30

유로인덱스모(주식-파생형)

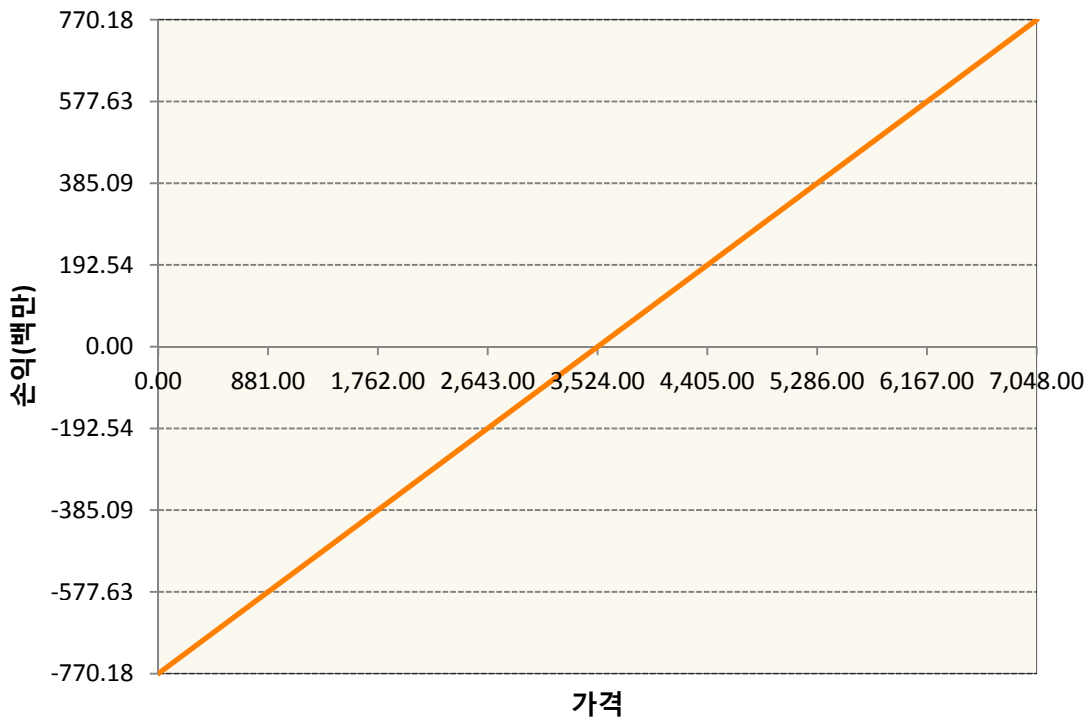
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	770	0	770	

2. 만기시점의 손익구조

VGU8-EURO STOXXX 50 SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU8	EURO STOXXX 50 SEP18	62
------	----------------------	----

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

(단위:백만원)

39

공시일	2018-07-31
기준일	2018-07-30

차이나인덱스모(주식-파생형)

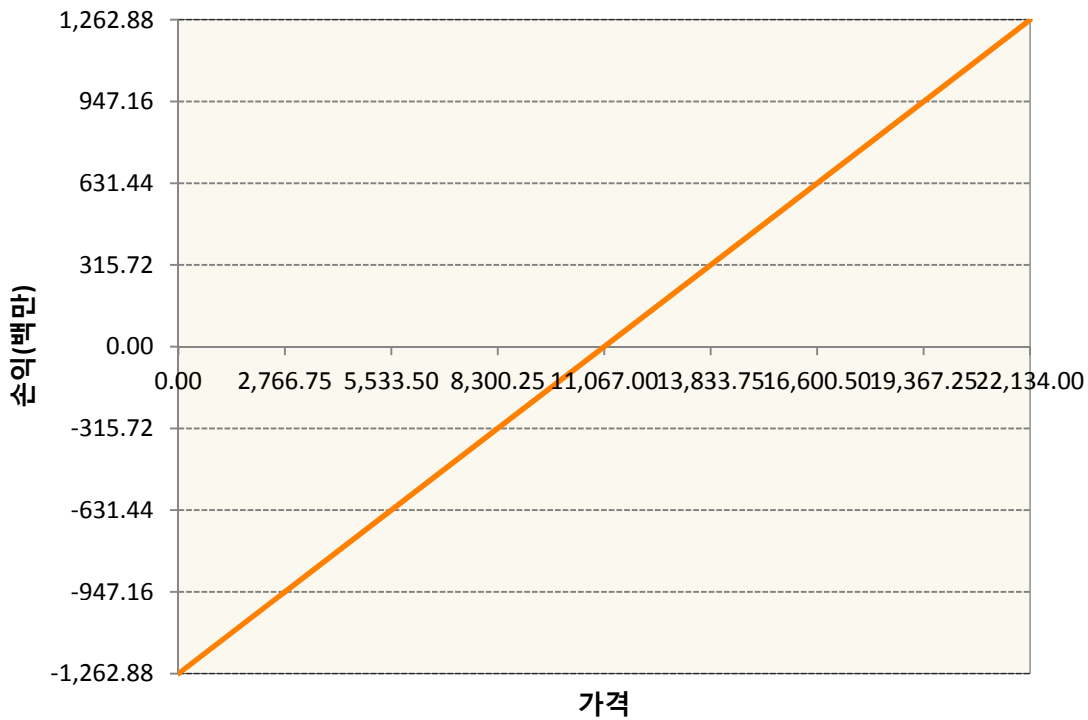
1. 계약금액

(단위:백만원)

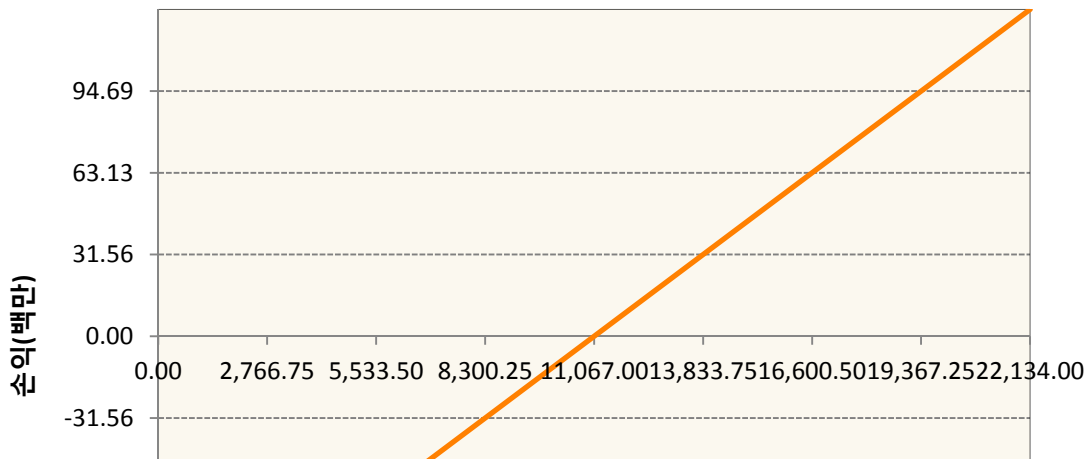
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,389	0	1,389	장내

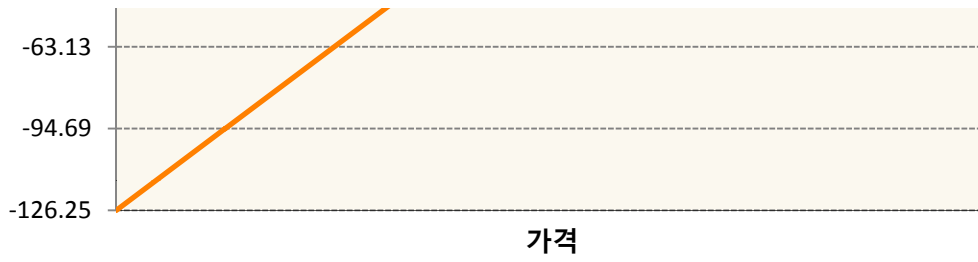
2. 만기시점의 손익구조

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	2018-07-31
기준일	2018-07-30

커버드콜모(주식혼합-파생형)

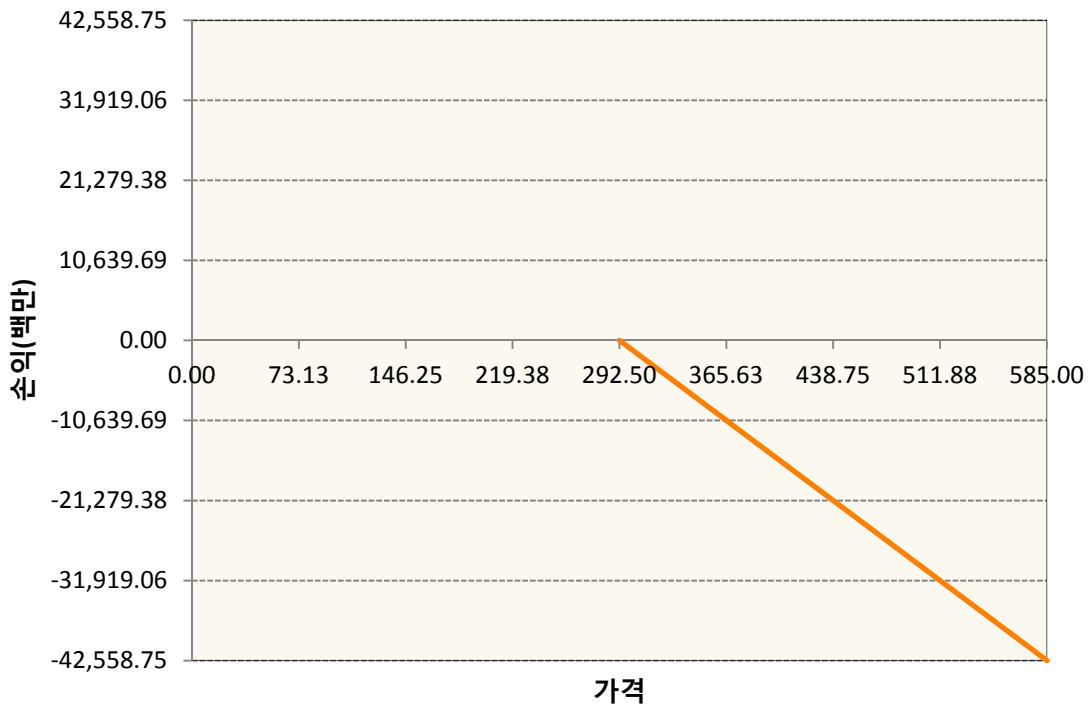
1. 계약금액

(단위:백만원)

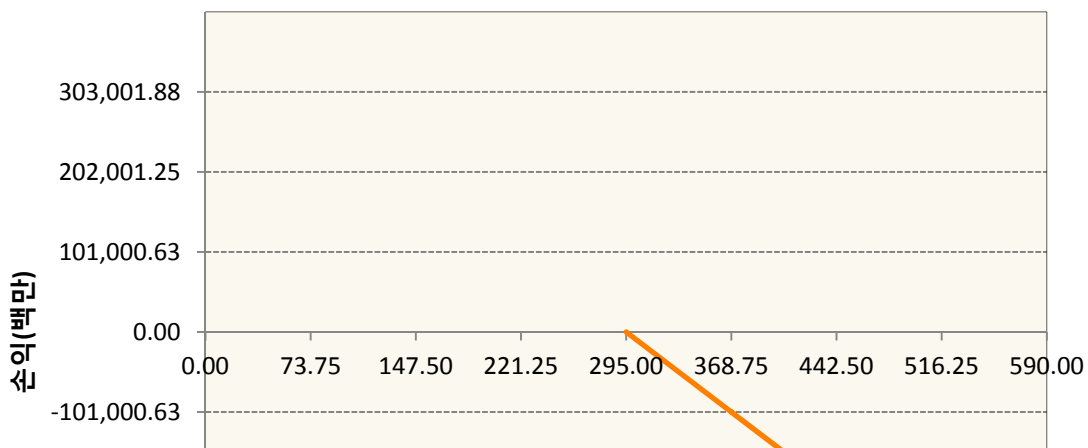
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	725,561	-725,561	장내

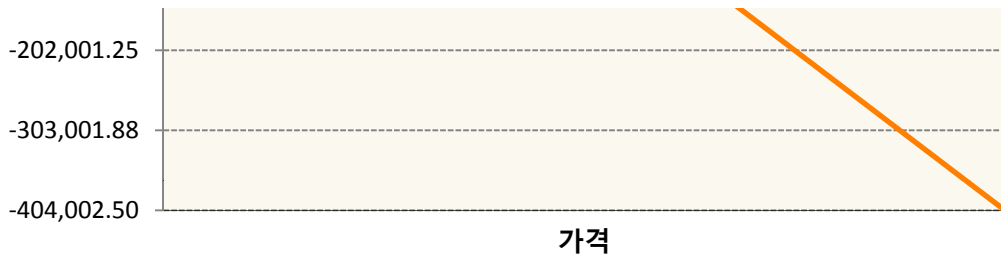
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N82928-2018-08 콜292.5

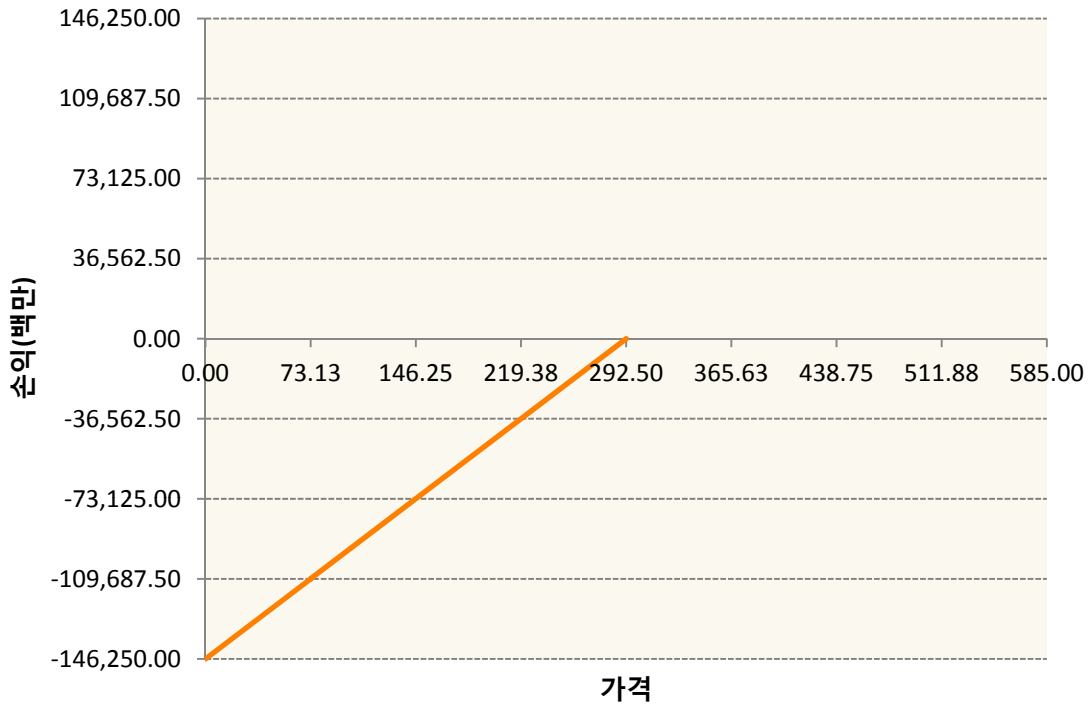


KR4201N82951-2018-08 콜295

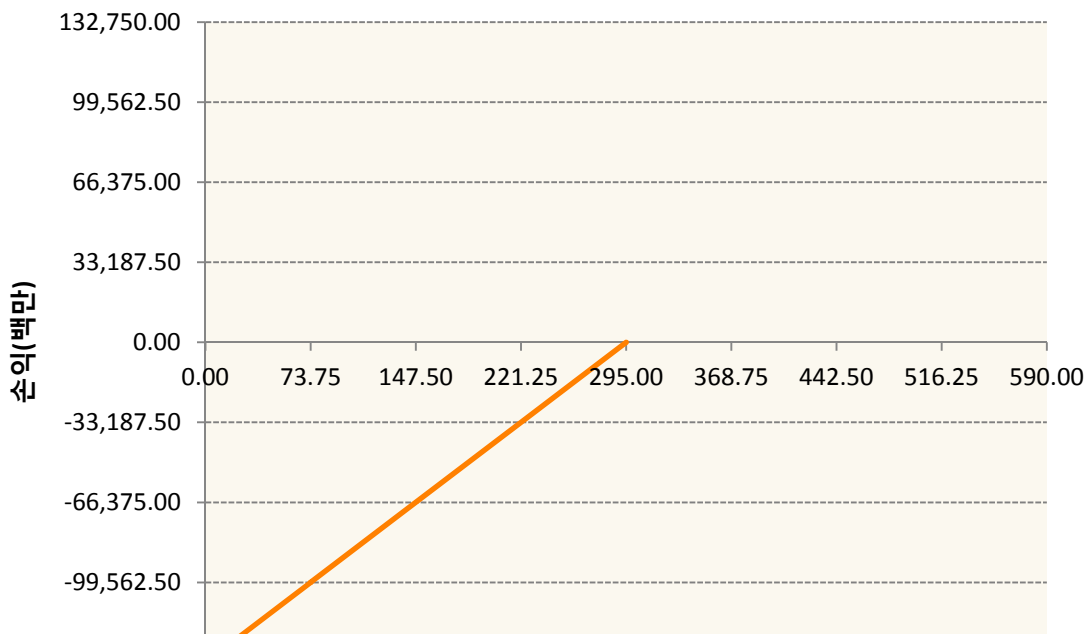




KR4301N82926-2018-08 풋292.5



KR4301N82959-2018-08 풋295



-132,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N829 2018-08 콜292.5 3,026

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,172	1,161	1,145	1,125	1,101	1,074	1,043
-5.33%	1,090	1,053	1,013	969	923	874	824
-2.67%	802	740	677	614	551	487	424
0%	182	122	62	0	-62	-125	-188
2.67%	-742	-776	-814	-856	-902	-949	-999
5.33%	-1,830	-1,842	-1,858	-1,878	-1,903	-1,932	-1,964
8.00%	-2,970	-2,973	-2,978	-2,985	-2,996	-3,009	-3,026

KR4201N829 2018-08 콜295 27,317

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,068	8,998	8,895	8,756	8,583	8,377	8,139
-5.33%	8,590	8,326	8,019	7,676	7,301	6,900	6,476
-2.67%	6,635	6,101	5,554	4,996	4,430	3,857	3,279
0%	1,832	1,223	613	0	-614	-1,229	-1,845
2.67%	-6,071	-6,479	-6,921	-7,389	-7,880	-8,388	-8,911
5.33%	-15,947	-16,116	-16,330	-16,587	-16,882	-17,212	-17,572
8.00%	-26,585	-26,629	-26,701	-26,805	-26,942	-27,113	-27,317

KR4301N829 2018-08 풋292.5 9,083

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,075	-9,075	-9,075	-9,076	-9,077	-9,079	-9,083
-5.33%	-5,120	-5,128	-5,141	-5,159	-5,183	-5,213	-5,247
-2.67%	-1,509	-1,594	-1,683	-1,774	-1,867	-1,962	-2,058
0%	219	151	78	0	-82	-166	-254
2.67%	414	409	400	387	369	346	318
5.33%	417	417	417	417	415	413	410
8.00%	417	417	417	417	417	417	417

KR4301N829 2018-08 풋295 8,963

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,961	-8,961	-8,961	-8,961	-8,961	-8,962	-8,963
-5.33%	-5,396	-5,398	-5,403	-5,410	-5,420	-5,434	-5,453
-2.67%	-1,951	-2,001	-2,057	-2,119	-2,184	-2,253	-2,325
0%	264	177	89	0	-90	-181	-273
2.67%	693	679	660	635	604	568	526

5.33%	707	707	706	704	701	697	689
8.00%	707	707	707	707	707	707	706

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

(단위:백만원)

52,777

공시일	2018-07-31
기준일	2018-07-30

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

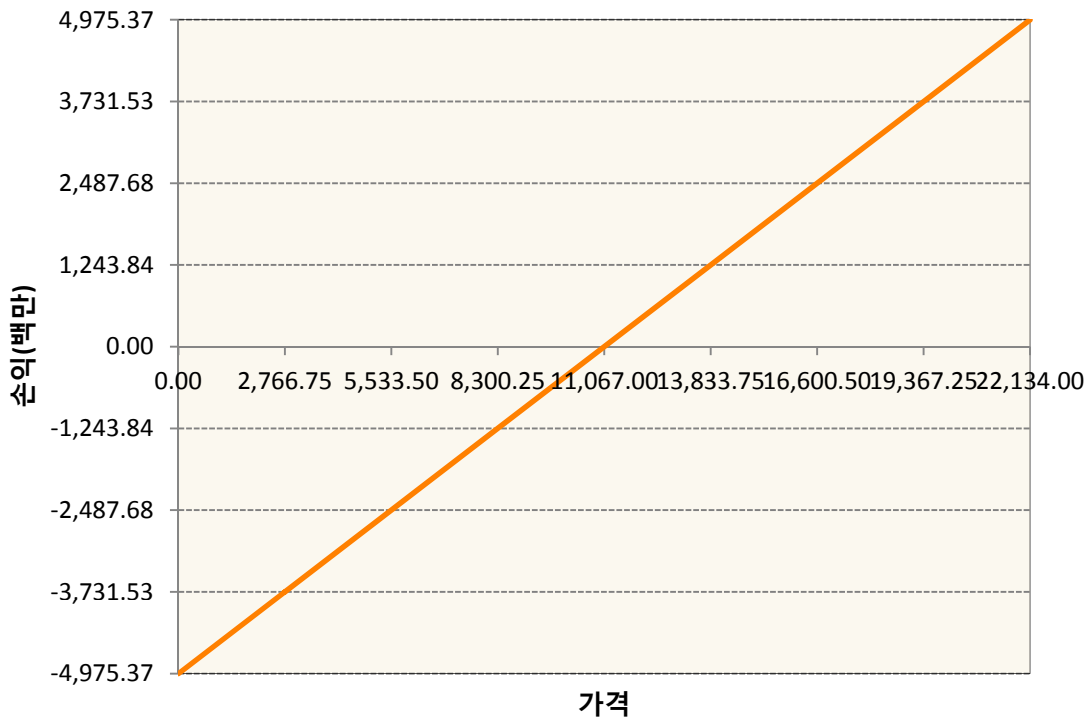
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

HCQ8-HSCEI Futures Aug18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCQ8	HSCEI Futures Aug18	398
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

362

공시일	2018-07-31
기준일	2018-07-30

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

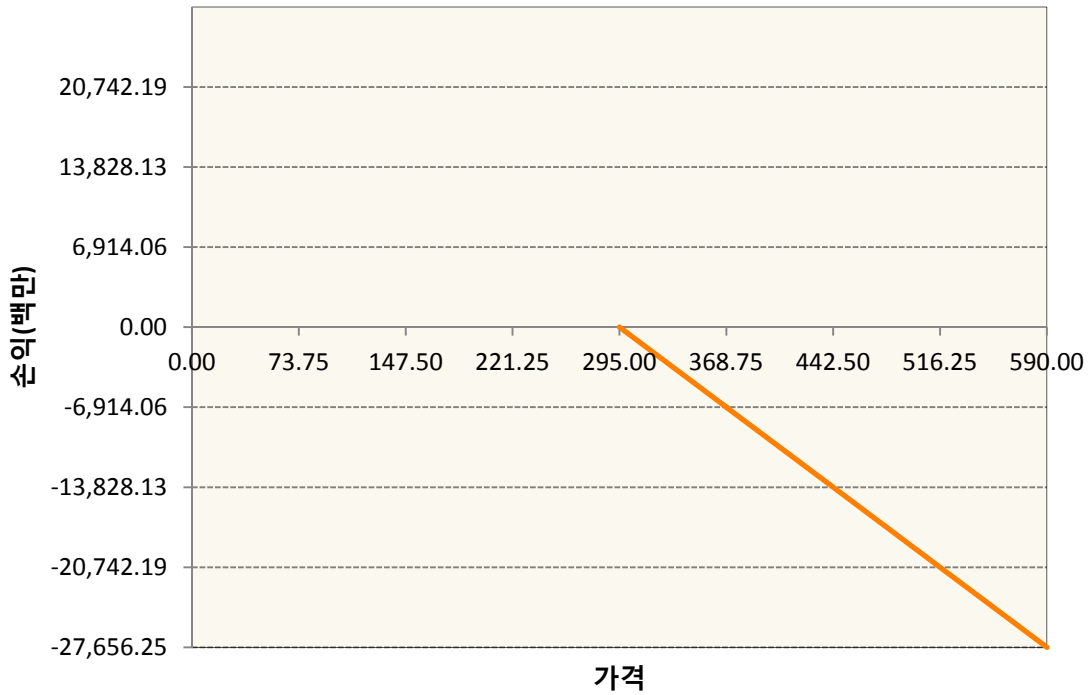
1. 계약금액

(단위:백만원)

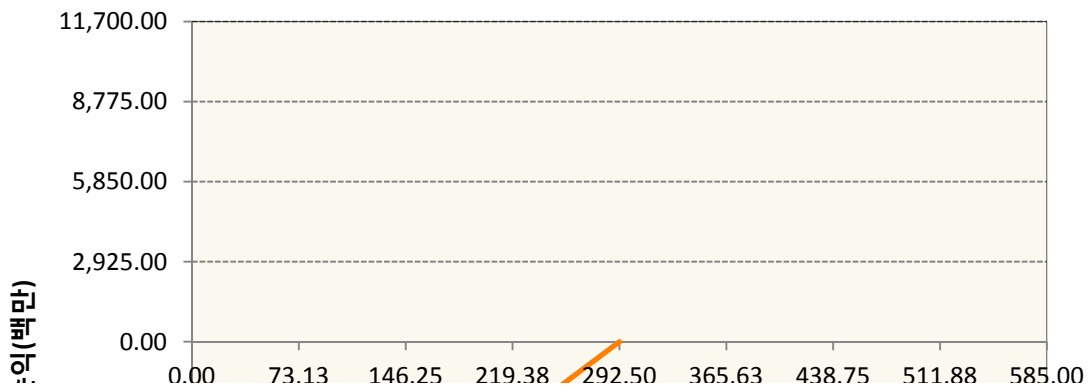
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	5,198	-5,198	장내
누계	유가증권	스왑	45,200	0	45,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	48,575	-48,575	장내

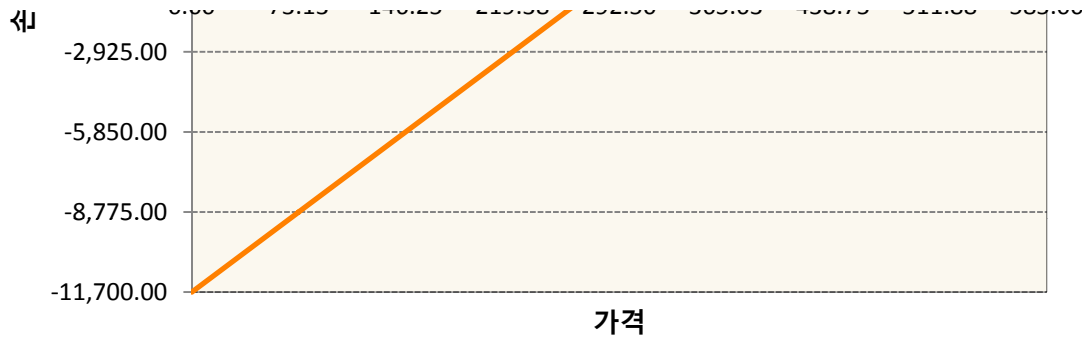
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N82951-2018-08 콜295

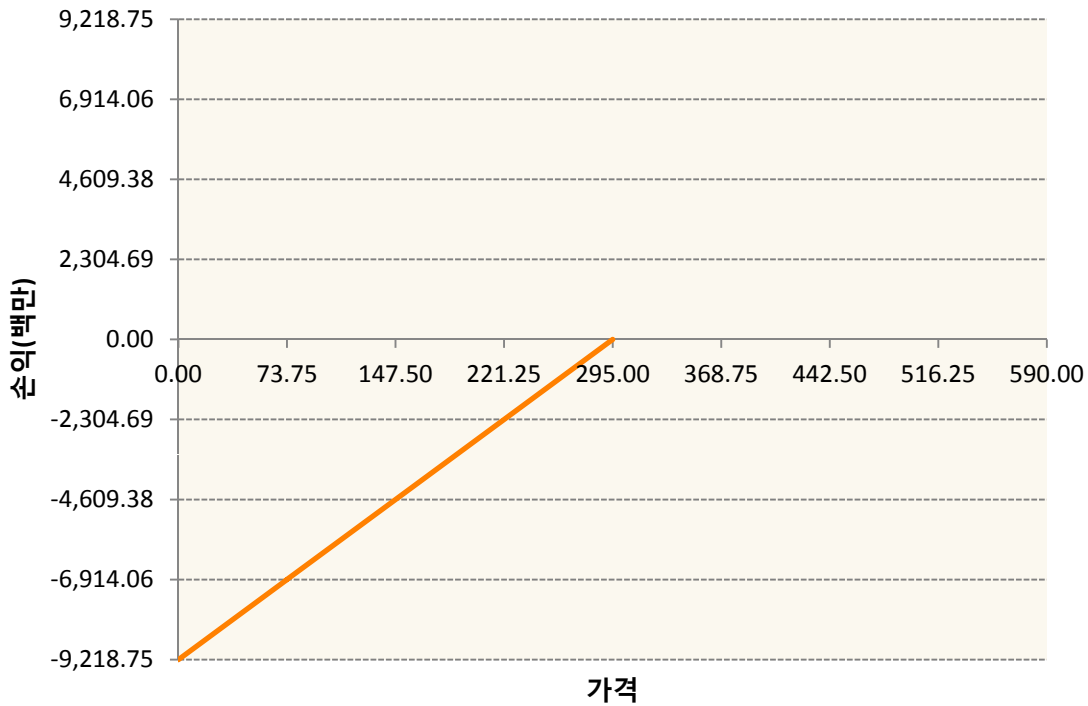


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





KR4301N82959-2018-08 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_2							1,494
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,494	-1,494	-1,494	-1,494	-1,494	-1,494	-1,494
-5.33%	-996	-996	-996	-996	-996	-996	-996
-2.67%	-498	-498	-498	-498	-498	-498	-498
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	498	498	498	498	498	498	498
5.33%	996	996	996	996	996	996	996
8.00%	1,494	1,494	1,494	1,494	1,494	1,494	1,494
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%	323	323	323	323	323	323	323
8.00%	485	485	485	485	485	485	485

KR4201N829 2018-08 콜295

1,870

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	621	616	609	599	588	573	557
-5.33%	588	570	549	525	500	472	443
-2.67%	454	418	380	342	303	264	224
0%	125	84	42	0	-42	-84	-126
2.67%	-416	-444	-474	-506	-539	-574	-610
5.33%	-1,092	-1,103	-1,118	-1,135	-1,156	-1,178	-1,203
8.00%	-1,820	-1,823	-1,828	-1,835	-1,844	-1,856	-1,870

KR4301N829 2018-08 풋292.5

727

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-726	-726	-726	-726	-726	-726	-727
-5.33%	-410	-410	-411	-413	-415	-417	-420
-2.67%	-121	-128	-135	-142	-149	-157	-165
0%	17	12	6	0	-7	-13	-20
2.67%	33	33	32	31	30	28	25
5.33%	33	33	33	33	33	33	33
8.00%	33	33	33	33	33	33	33

KR4301N829 2018-08 풋295

622

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-622	-622	-622	-622	-622	-622	-622
-5.33%	-375	-375	-375	-376	-376	-377	-379
-2.67%	-136	-139	-143	-147	-152	-156	-161
0%	18	12	6	0	-6	-13	-19
2.67%	48	47	46	44	42	39	37
5.33%	49	49	49	49	49	48	48
8.00%	49	49	49	49	49	49	49

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

(단위:백만원)

7,152

공시일	2018-07-31
기준일	2018-07-30

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

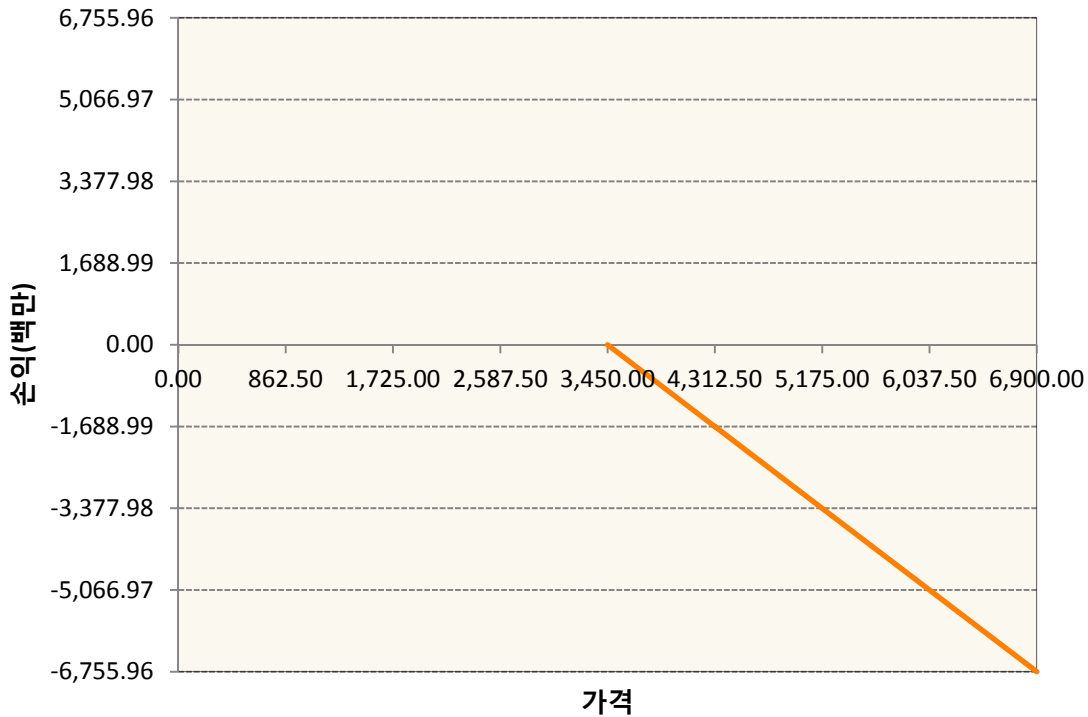
1. 계약금액

(단위:백만원)

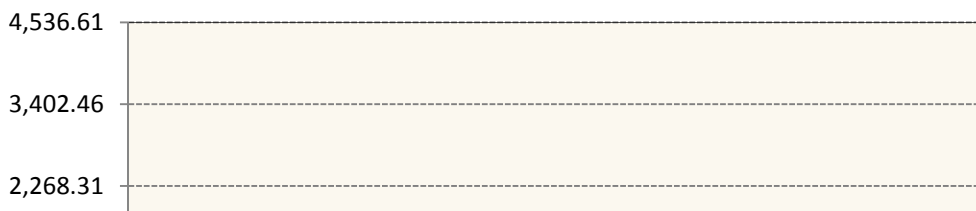
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,013	0	4,013	
누계	유가증권	스왑	45,016	0	45,016	장외
누계	유가증권	옵션	0	18,053	-18,053	장내
누계	지수	스왑	52,999	0	52,999	장외

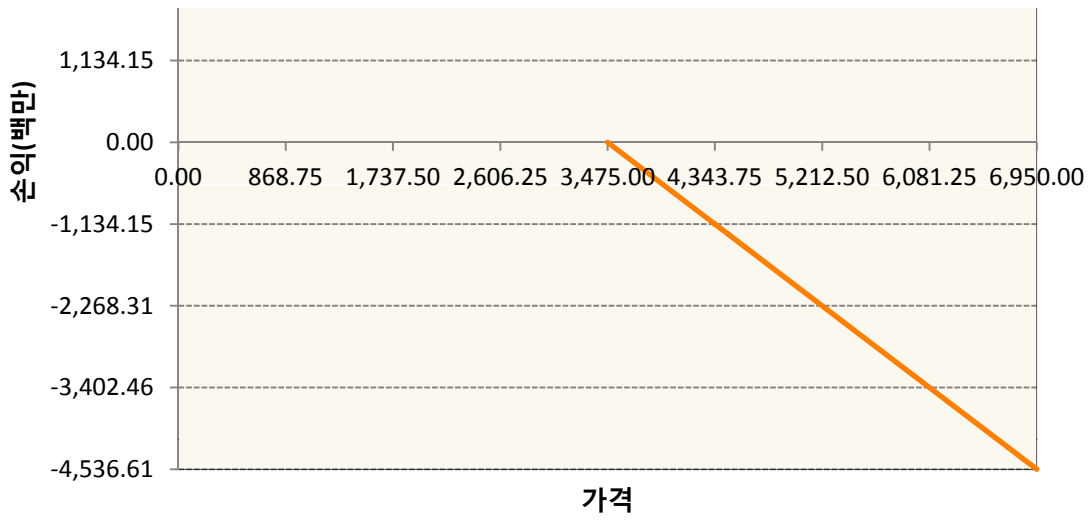
2. 만기시점의 손익구조

OESXQ8-C3450-EURO STOXX 50 OPT

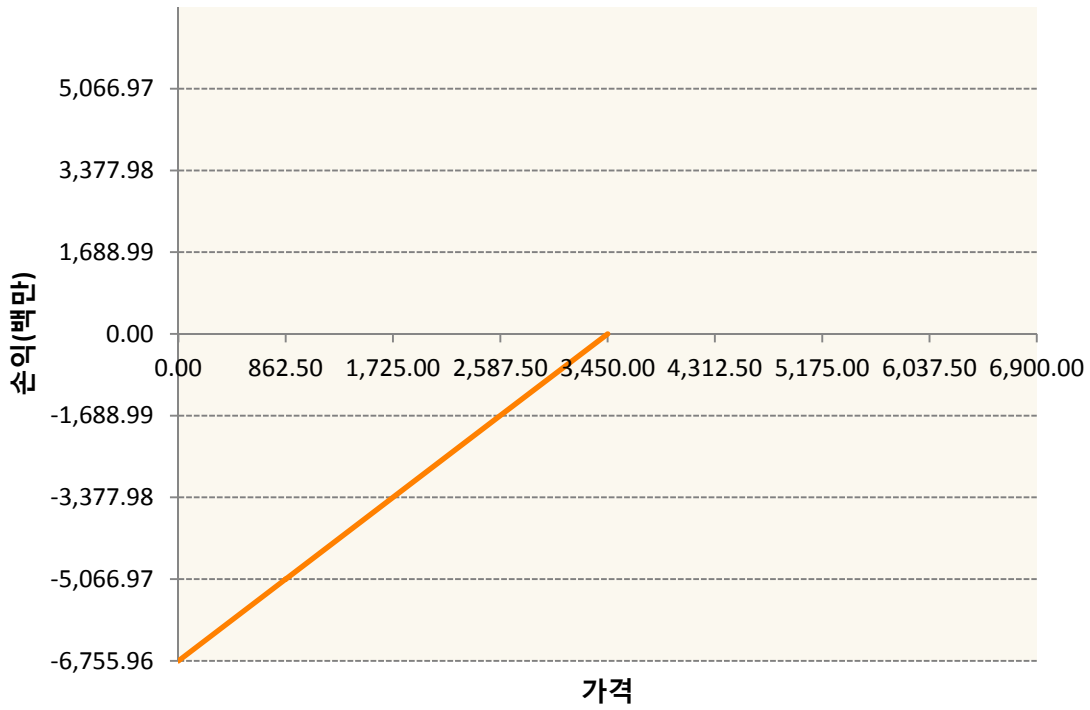


OESXQ8-C3475-EURO STOXX 50 OPT

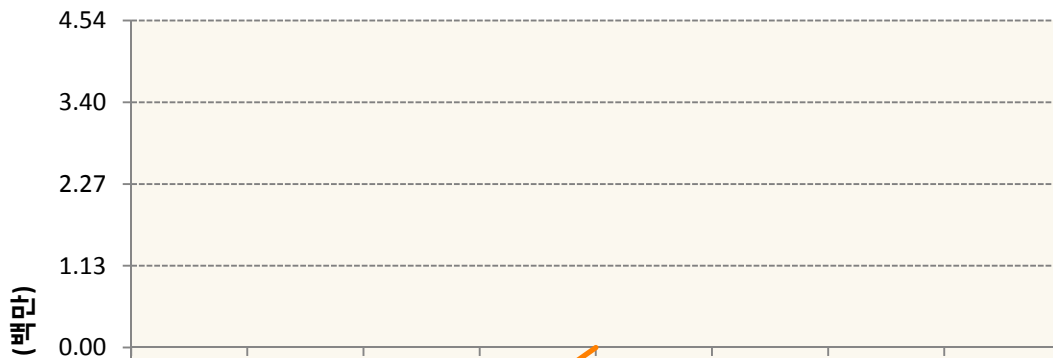


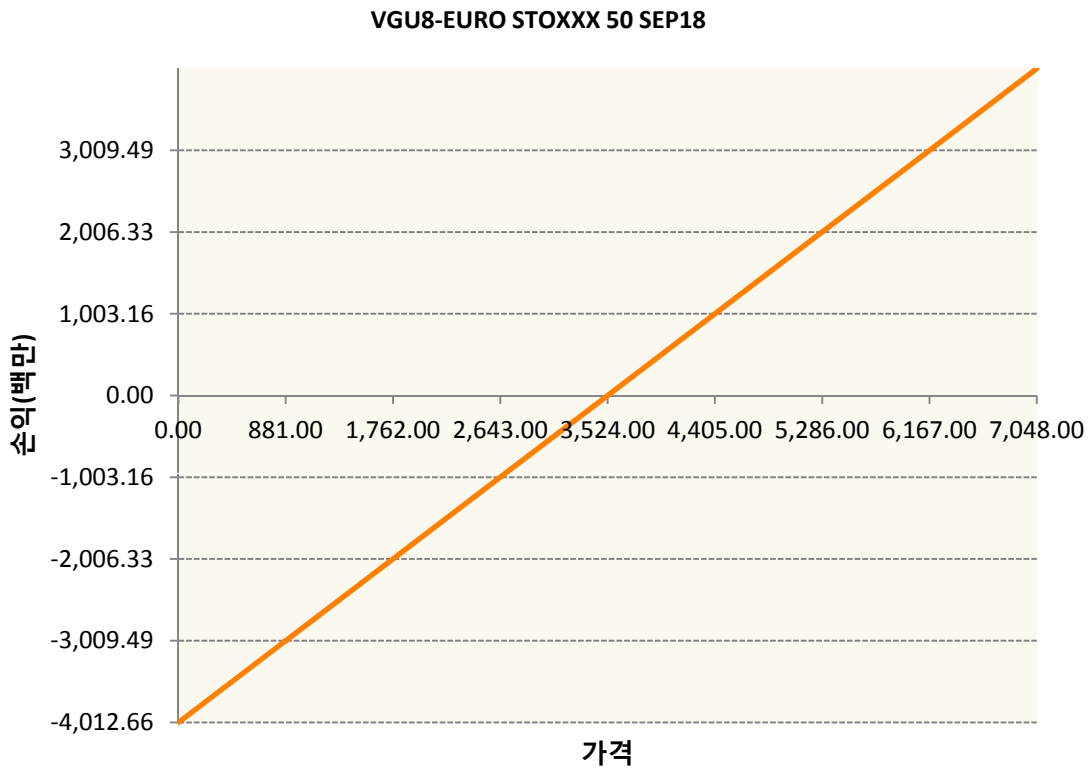
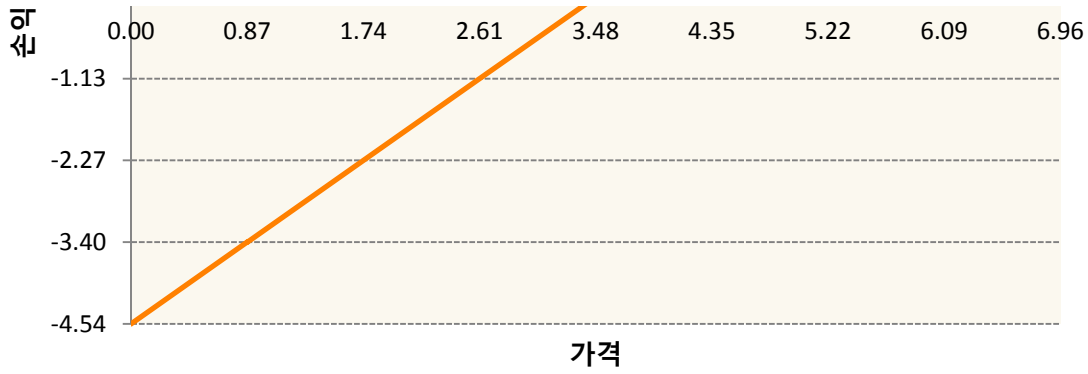


OESXQ8-P3450-EURO STOXX 50



OESXQ8-P3475-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		38
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY		32
OESXQ8-C3 EURO STOXX 50 OPT		540
OESXQ8-C3 EURO STOXX 50 OPT		363
OESXQ8-P3 EURO STOXX 50		540
OESXQ8-P3 EURO STOXX 50		0.4
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18		321

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

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

(단위:백만원)

1,147

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

공시일	2018-07-31
기준일	2018-07-30

스마트KRX300인덱스목표전환형1

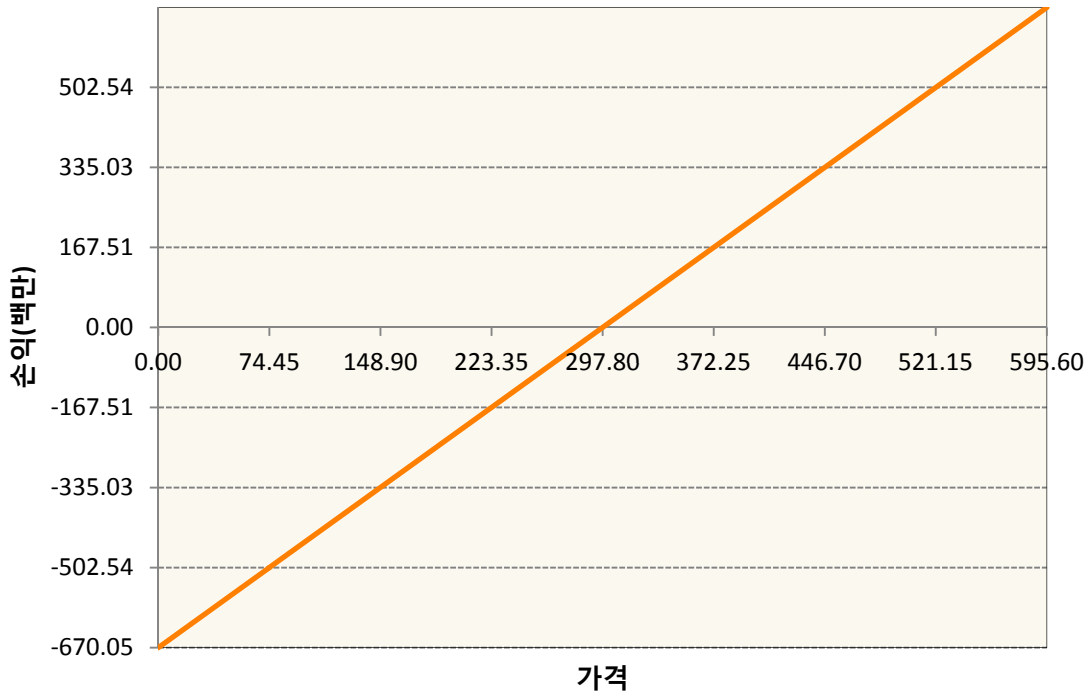
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	670	0	670	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물

54

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	18	18	18	18	18	18	18
5.33%	36	36	36	36	36	36	36
8.00%	54	54	54	54	54	54	54

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

(단위:백만원)

41

공시일	2018-07-31
기준일	2018-07-30

리디파인K200(주식혼합-파생재간

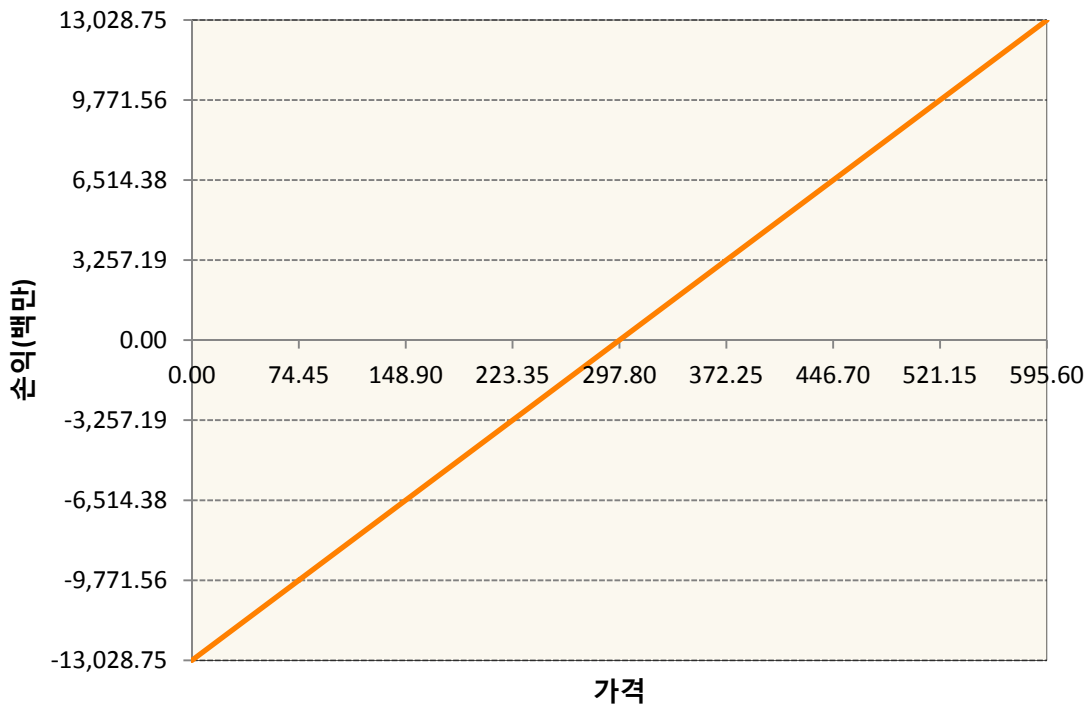
1. 계약금액

(단위:백만원)

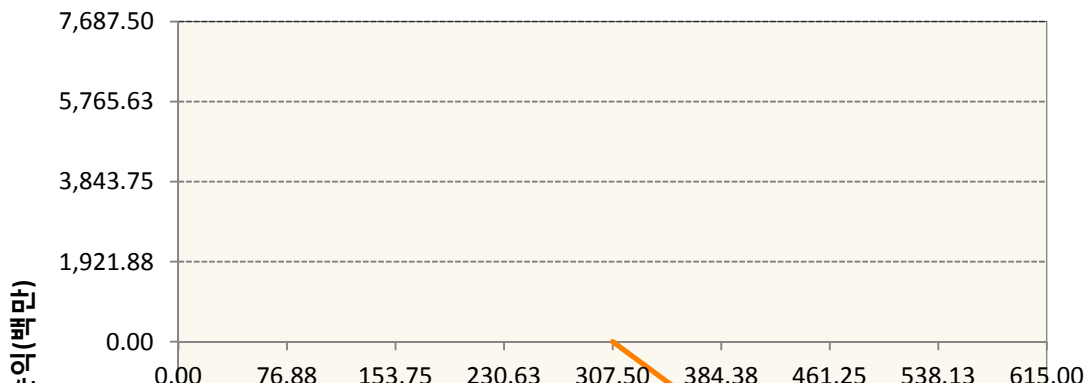
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,029	0	13,029	장내
누계	유가증권	옵션	2,134	23,730	-21,596	장내

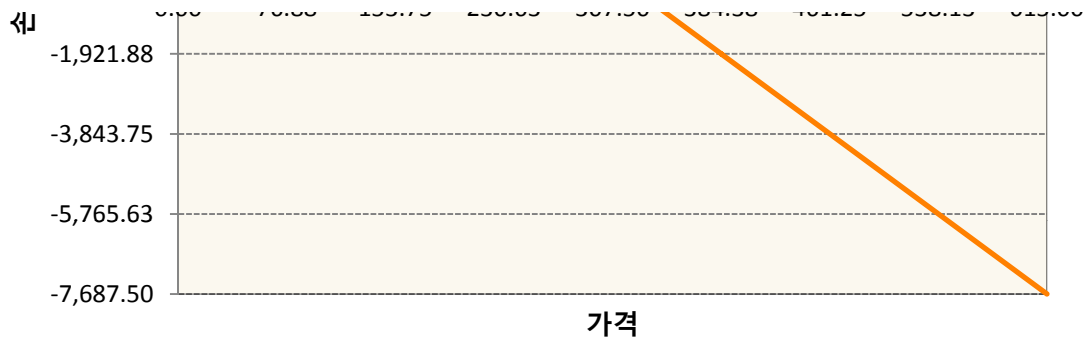
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

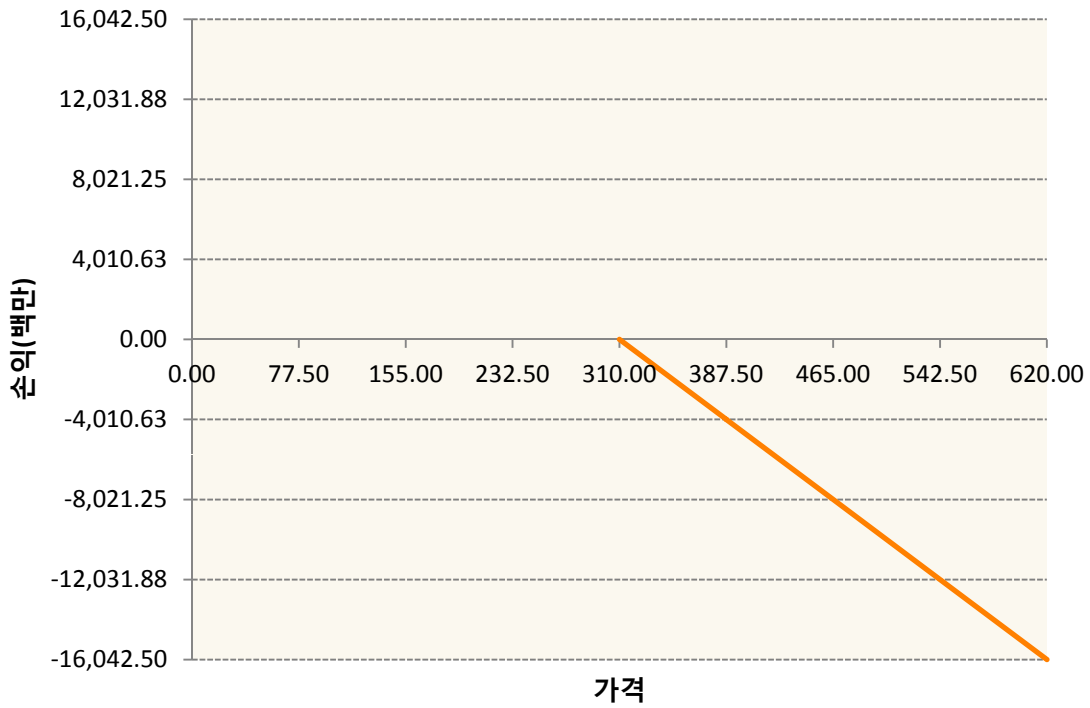


KR4201N83074-2018-08 콜307.5

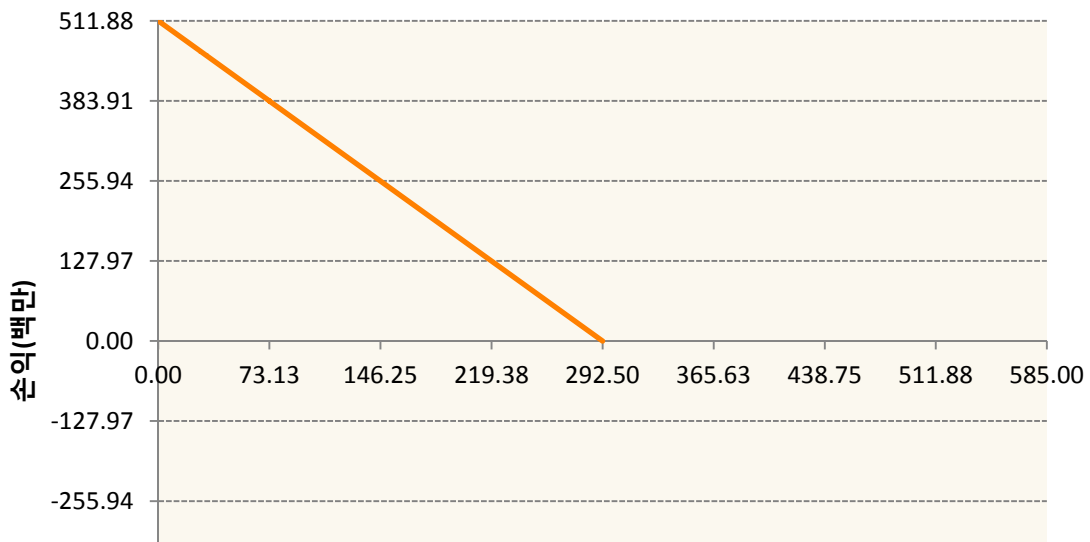


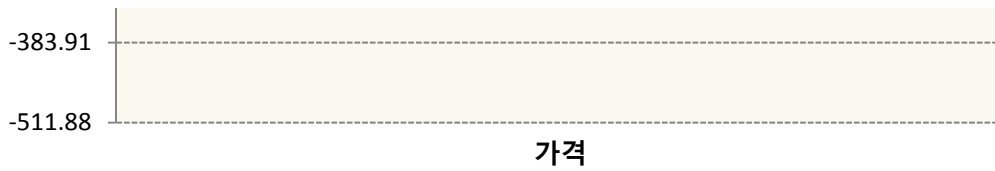


KR4201N83108-2018-08 콜310

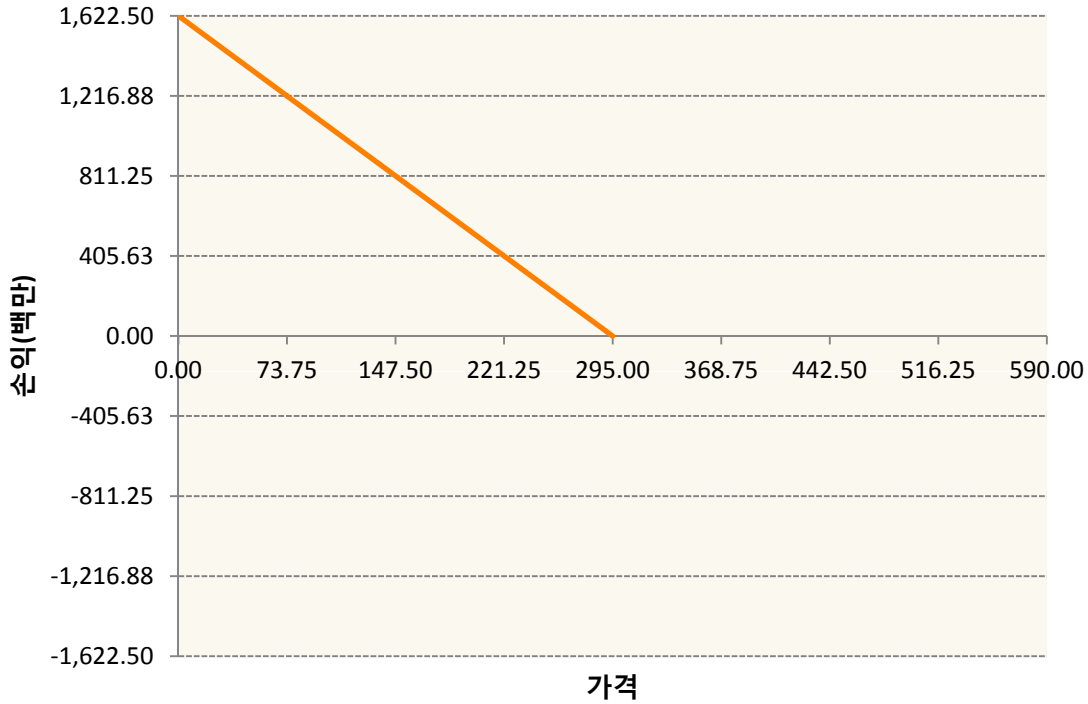


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





KR4301N82959-2018-08 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물 1,041

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,041	-1,041	-1,041	-1,041	-1,041	-1,041	-1,041
-5.33%	-694	-694	-694	-694	-694	-694	-694
-2.67%	-347	-347	-347	-347	-347	-347	-347
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	347	347	347	347	347	347	347
5.33%	694	694	694	694	694	694	694
8.00%	1,041	1,041	1,041	1,041	1,041	1,041	1,041

KR4201N83C 2018-08 콜307.5 351

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	47	47	47	47	46	45	44
-5.33%	47	46	45	44	42	39	36
-2.67%	43	40	37	32	27	21	15

0%	24	17	9	0	-9	-18	-28
2.67%	-32	-44	-55	-67	-79	-90	-102
5.33%	-145	-155	-166	-177	-188	-199	-211
8.00%	-306	-312	-319	-326	-334	-343	-351

KR4201N8312018-08 콜310

658

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	72	72	72	71	70	69	67
-5.33%	71	71	69	67	64	60	55
-2.67%	67	63	58	51	42	32	21
0%	42	29	15	0	-16	-34	-52
2.67%	-46	-68	-91	-114	-137	-160	-184
5.33%	-241	-265	-289	-313	-337	-362	-386
8.00%	-547	-562	-580	-598	-617	-637	-658

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%	18	18	18	18	18	18	18
-2.67%	5	6	6	6	7	7	7
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1

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%	66	66	66	66	66	66	67
-2.67%	24	24	25	26	27	28	28
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-8	-8	-8	-8	-7	-7	-6
5.33%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-8
8.00%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9

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

(단위:백만원)

1,696

공시일	2018-07-31
기준일	2018-07-30

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

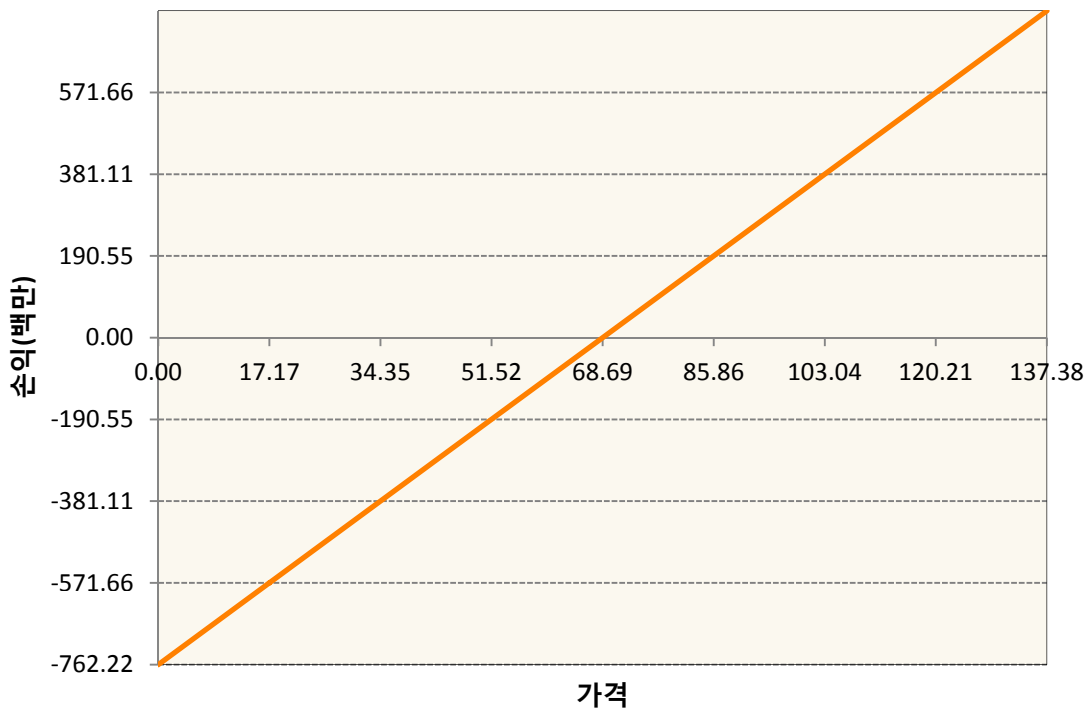
1. 계약금액

(단위:백만원)

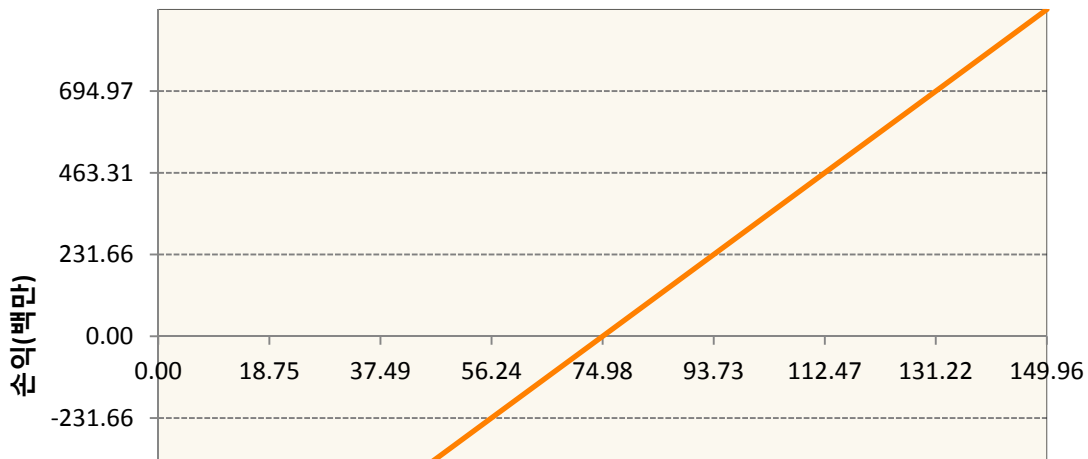
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,671	616	3,055	

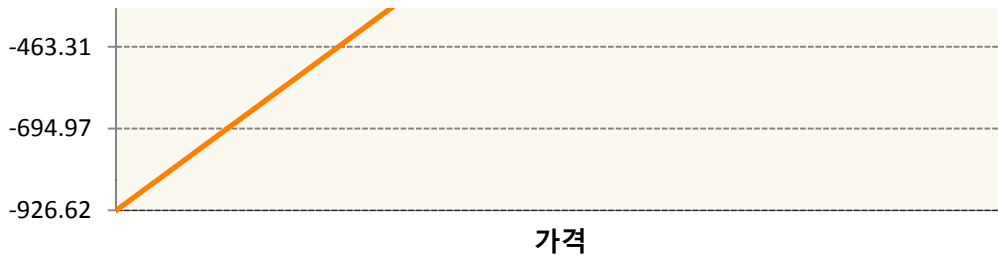
2. 만기시점의 손익구조

CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18

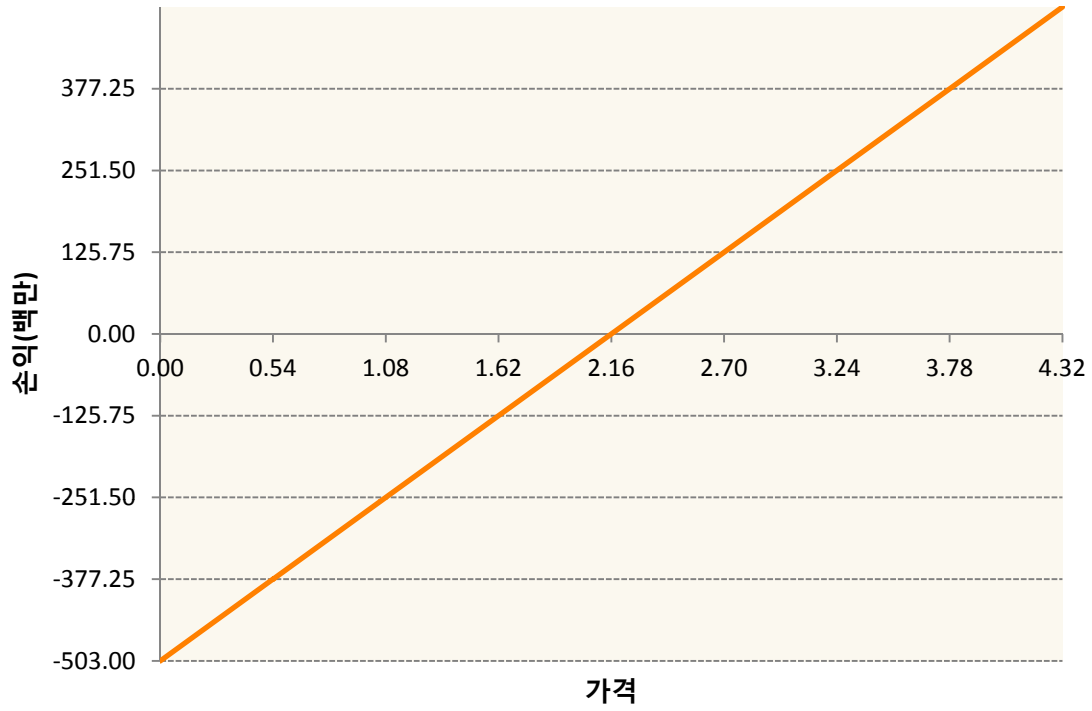


COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18

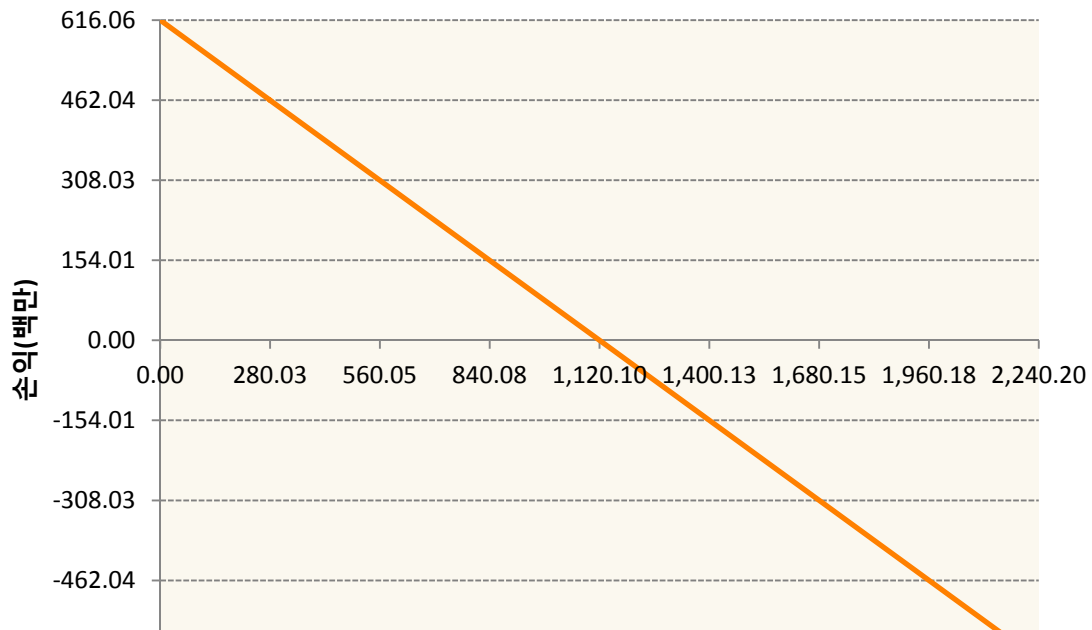


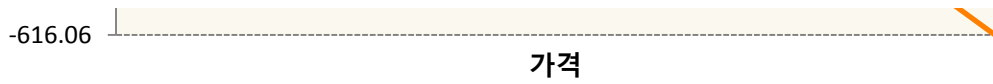


HOU8-NY Harb ULSD Fut SEP18

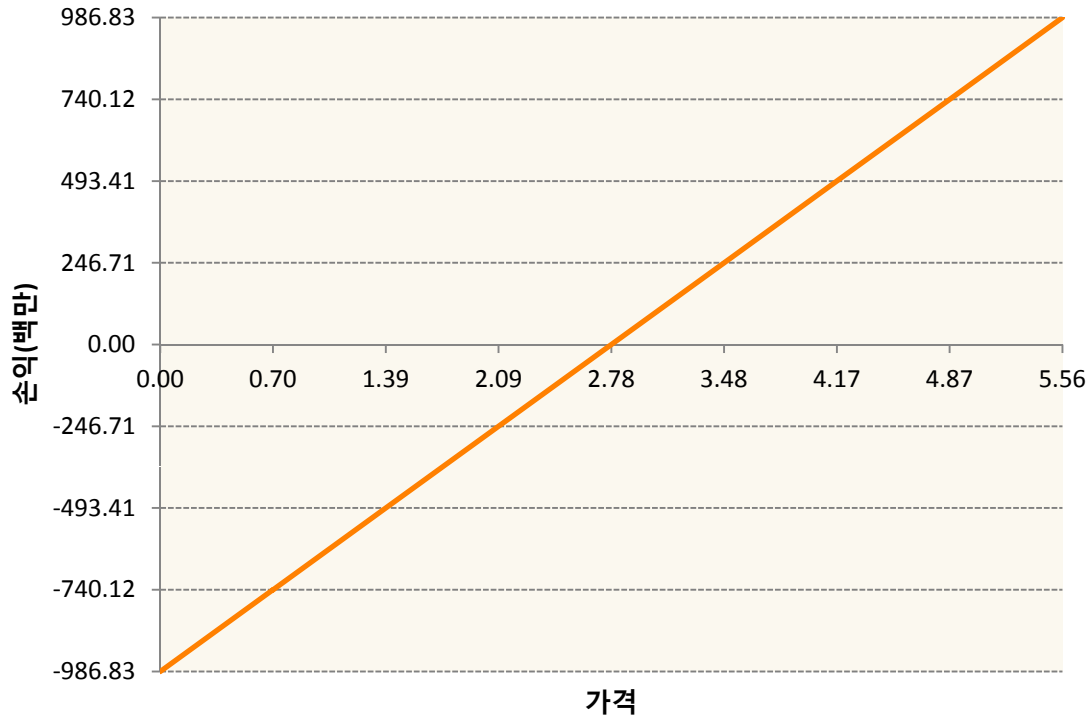


KR4175N80001-2018-08 달러선물

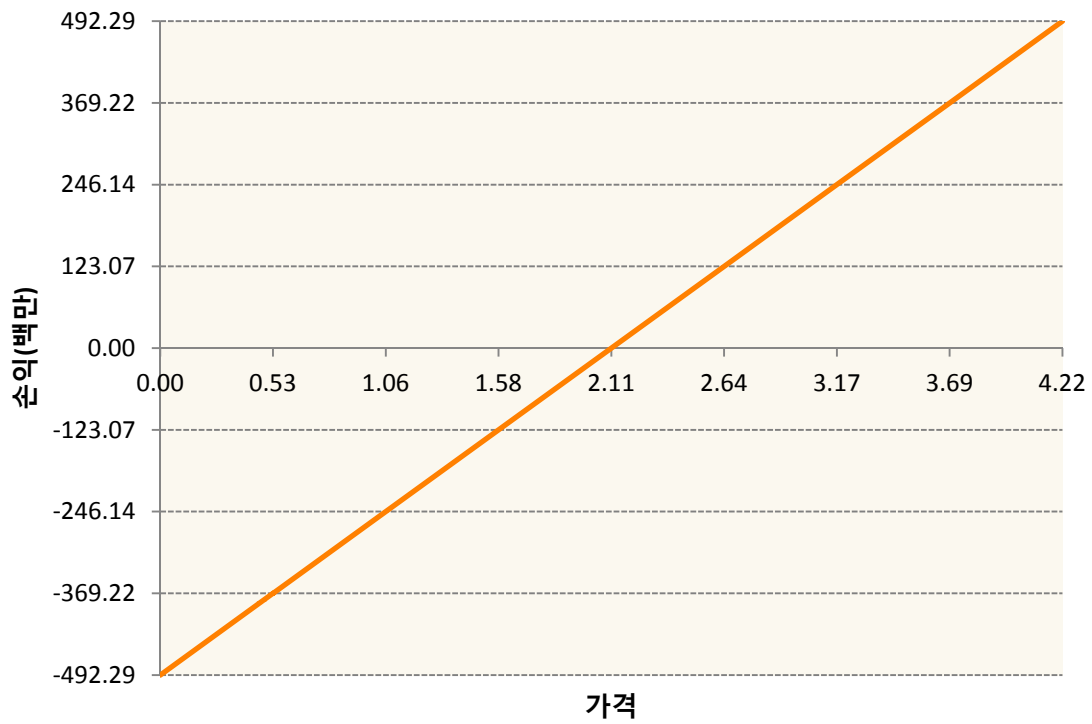




NGU18-NATURAL GAS FUTR SEP18



XBU8-GASOLINE RBOB FUT SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU8	WTI CRUDE FUTURE SEP18	61
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	74
HOU8	NY Harb ULSD Fut SEP18	40
KR4175N80C	2018-08 달러선물	49
NGU18	NATURAL GAS FUTR SEP18	79
XBU8	GASOLINE RBOB FUT SEP18	39

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

451

공시일	2018-07-31
기준일	2018-07-30

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

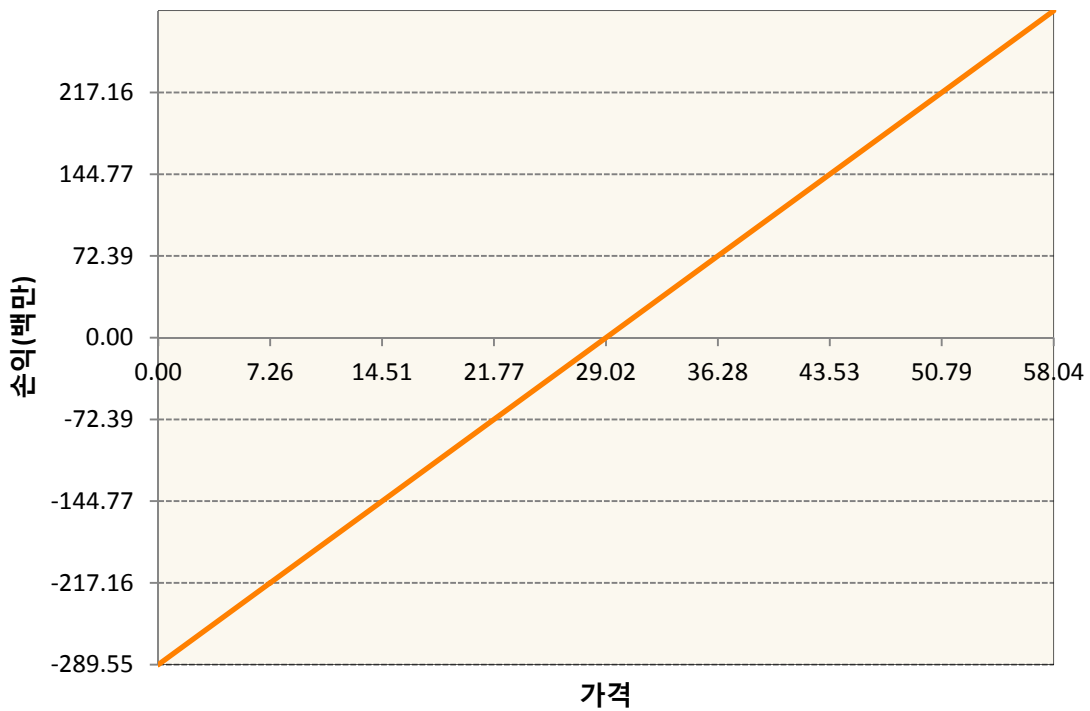
1. 계약금액

(단위:백만원)

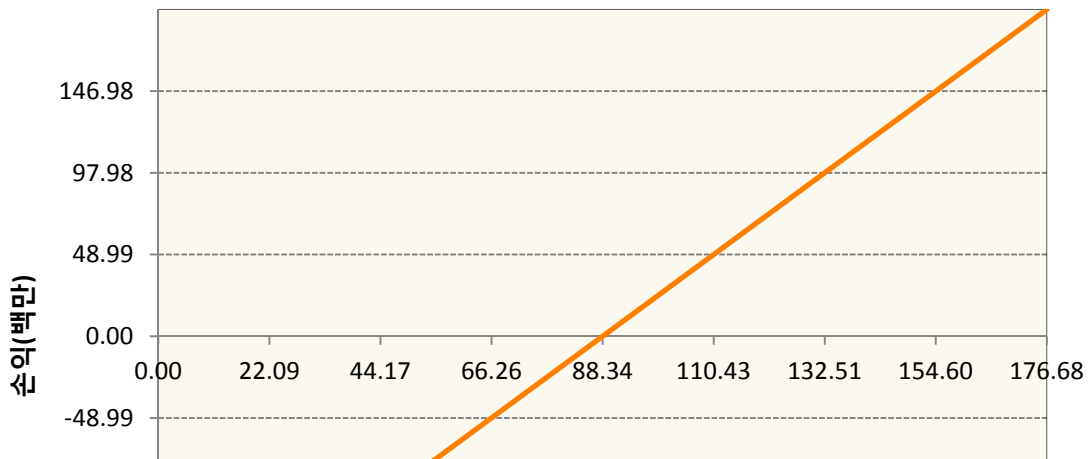
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,678	78	3,600	

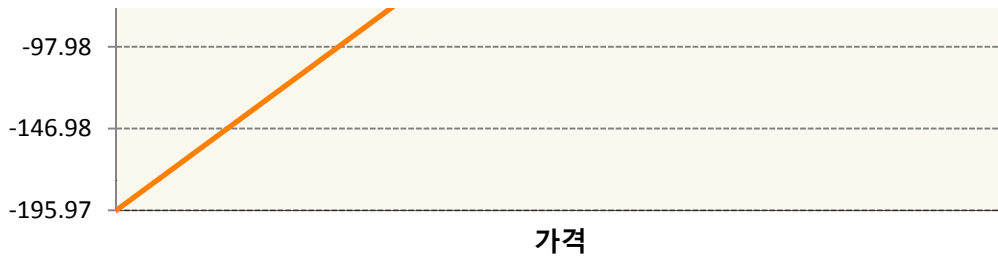
2. 만기시점의 손익구조

BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18

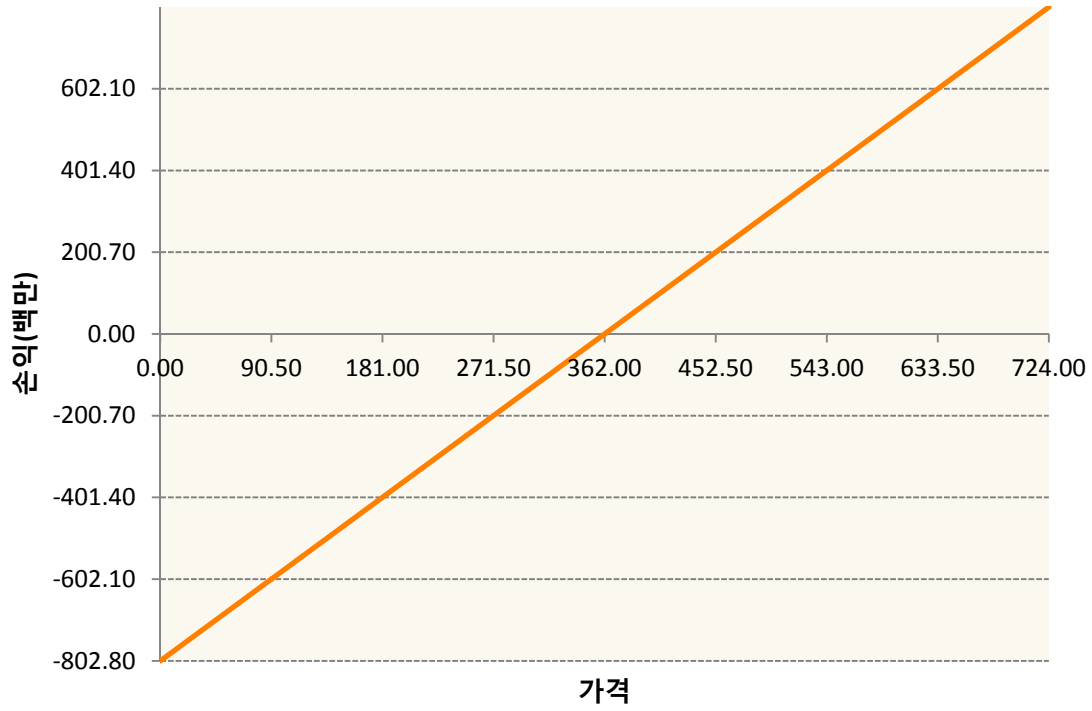


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

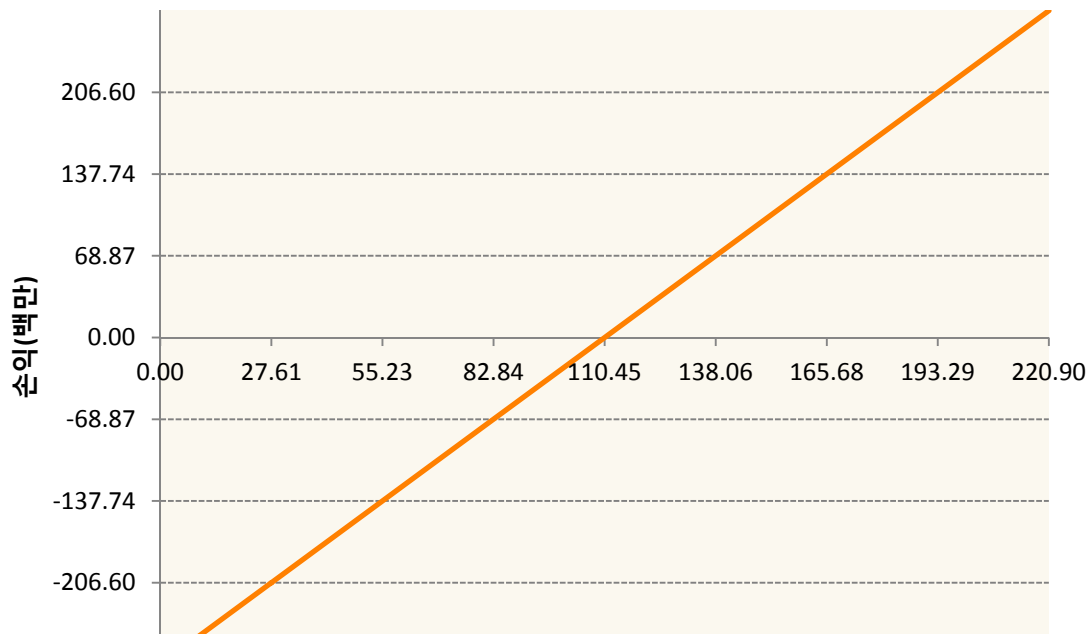


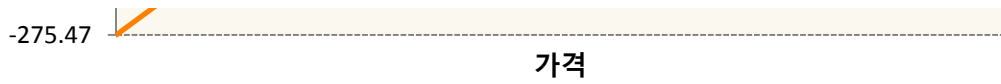


CU8-CORN FUTURE SEP18

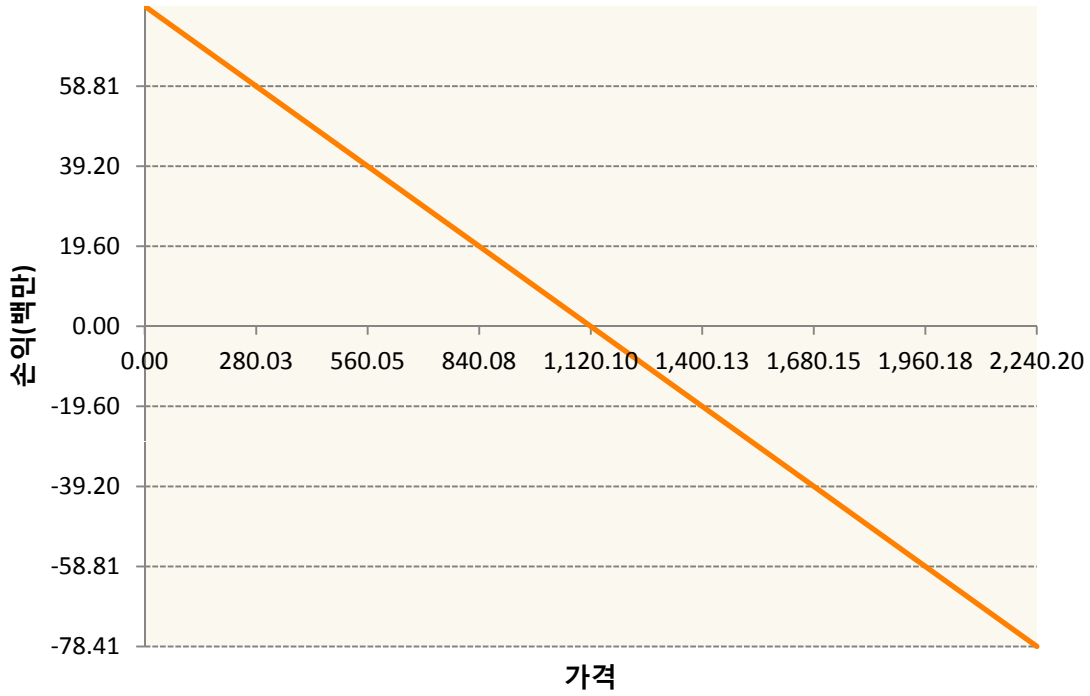


KCU8-COFFEE 'C' FUTURE SEP18

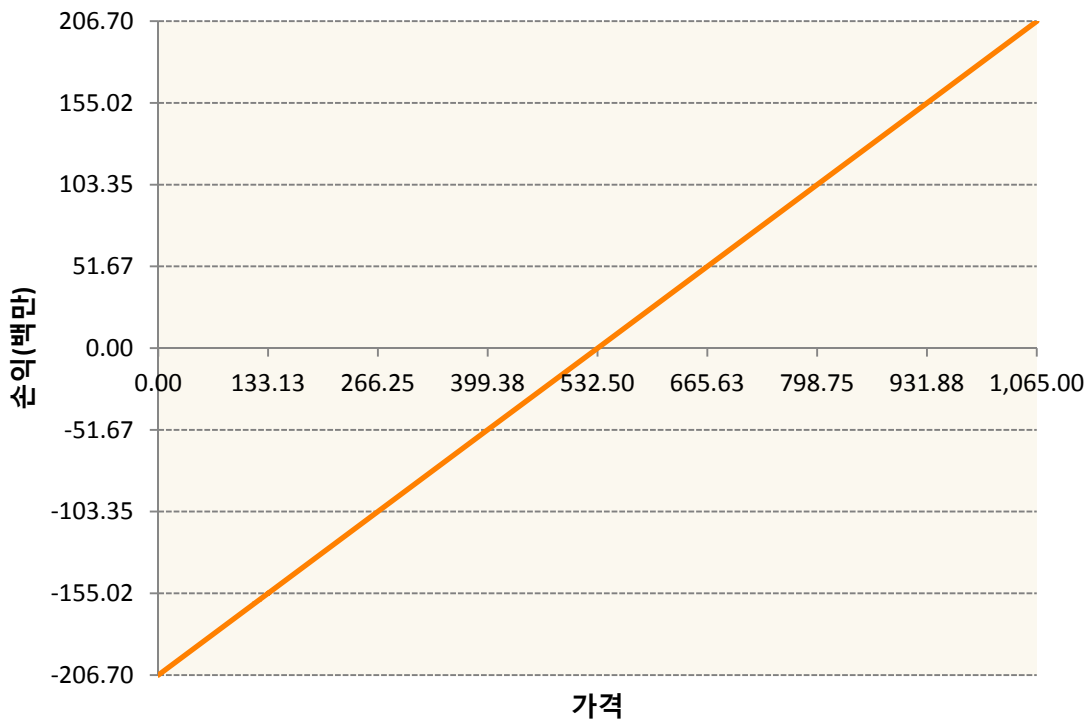




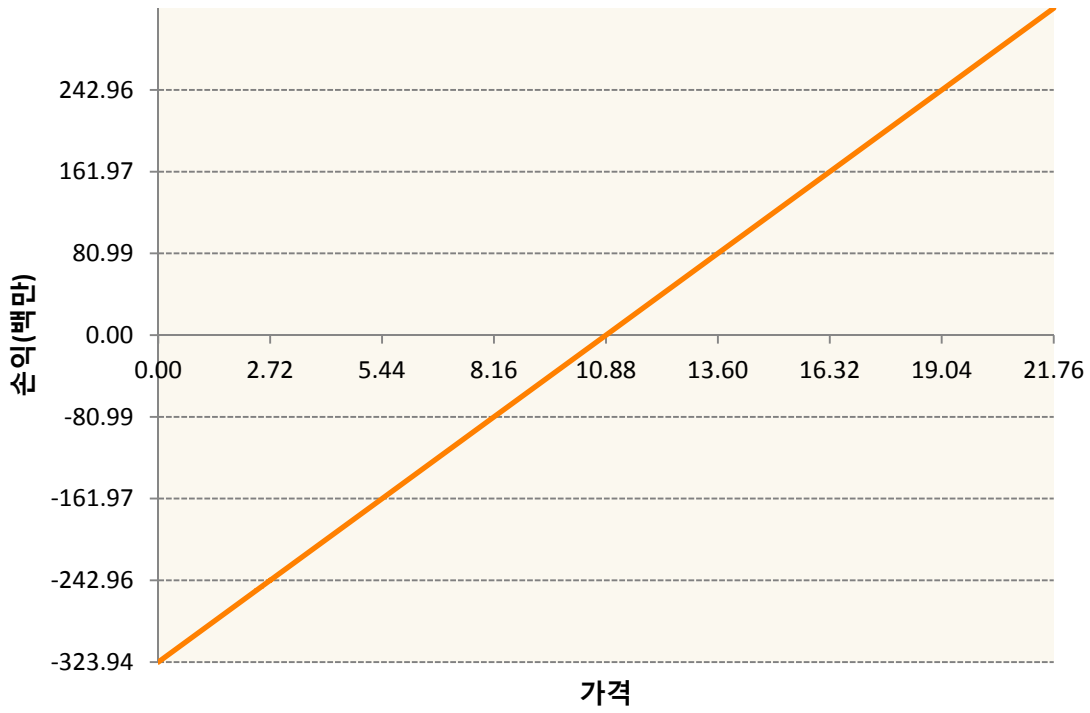
KR4175N80001-2018-08 달러선물



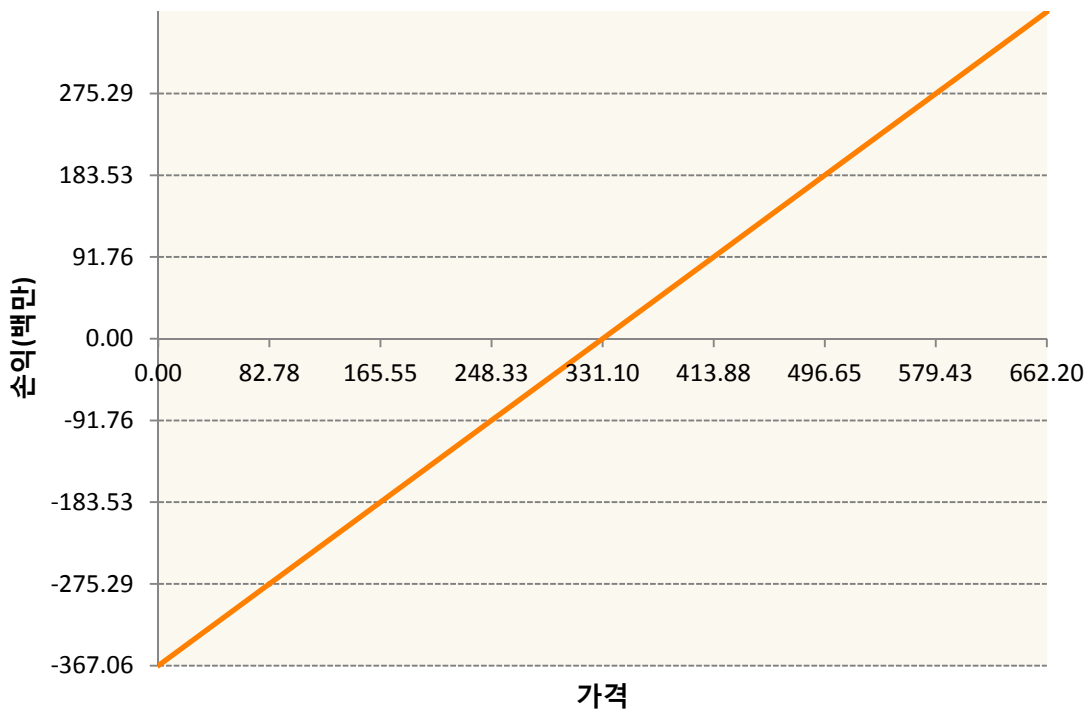
KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18



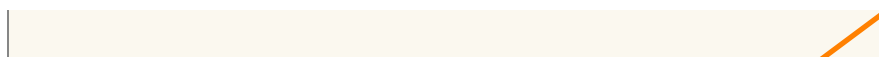
SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

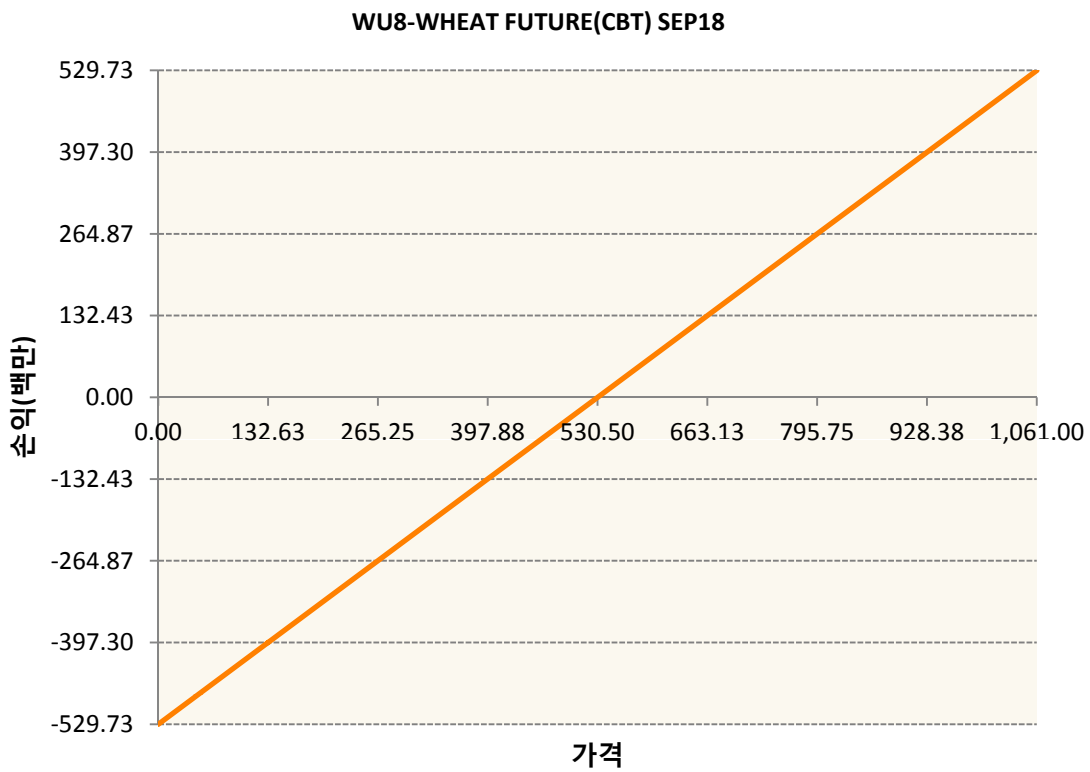
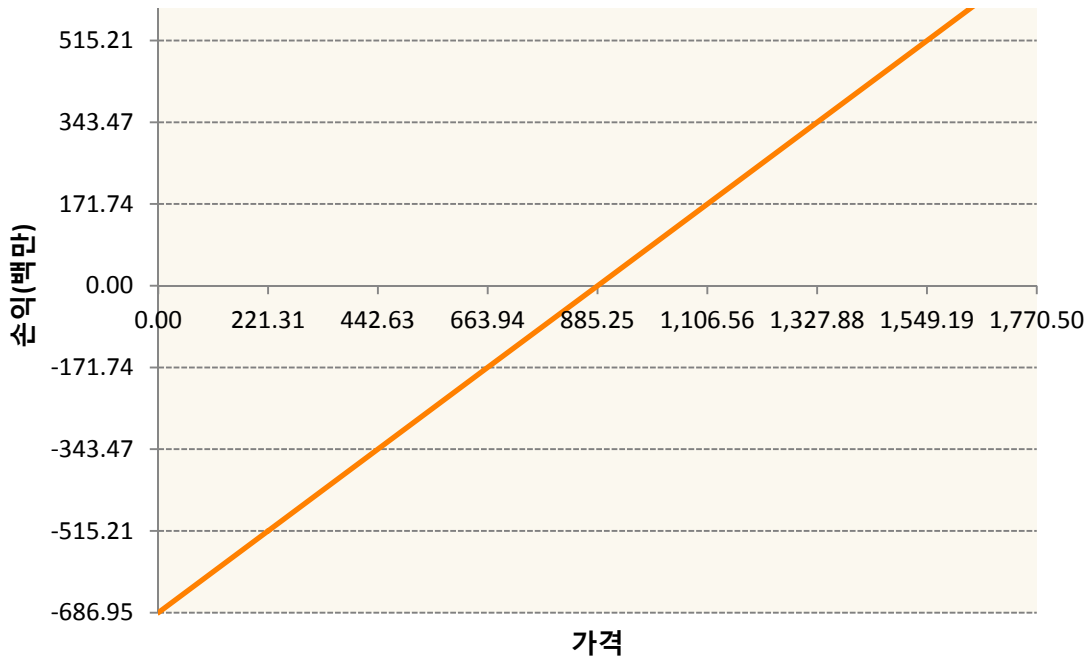


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	23
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	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	26
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	29
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	55
WU8	WHEAT FUTURE(CBT) SEP18	42

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

(단위:백만원)

311