

공시일	2018-08-02
기준일	2018-08-01

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	2018-08-02
기준일	2018-08-01

스마트인덱스모

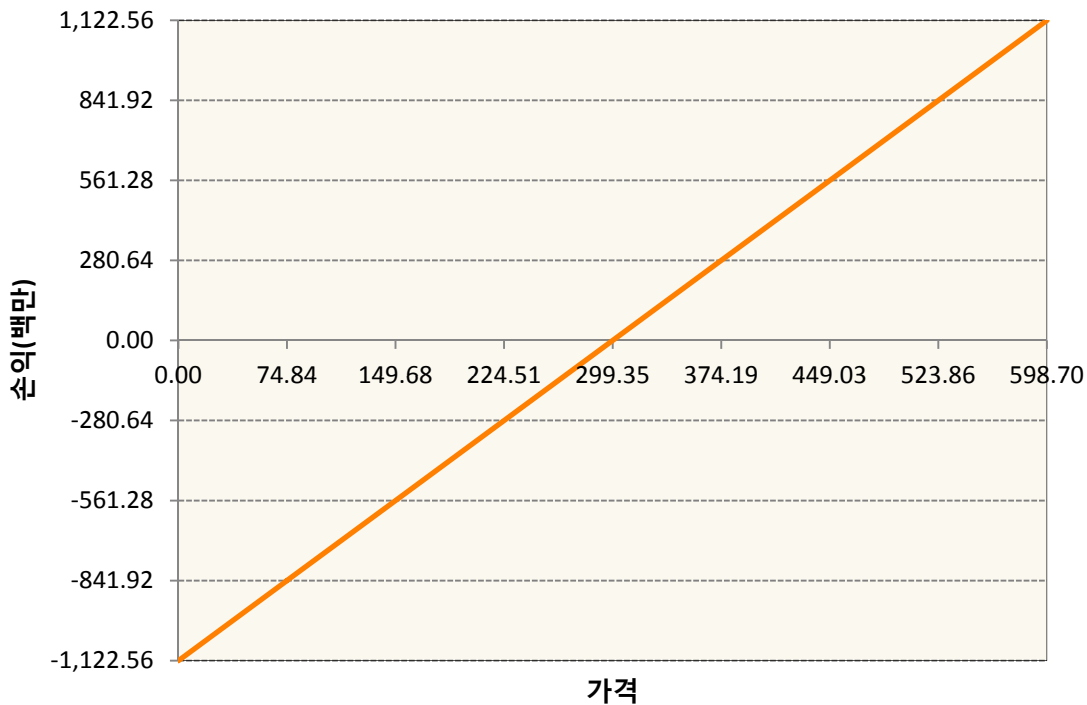
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,123	0	1,123	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물

90

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90
-5.33%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
-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%	60	60	60	60	60	60	60
8.00%	90	90	90	90	90	90	90

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

(단위:백만원)

68

공시일	2018-08-02
기준일	2018-08-01

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

1,141

* 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	2018-08-02
기준일	2018-08-01

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

317

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

383

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-02
기준일	2018-08-01

유로인덱스모(주식-파생형)

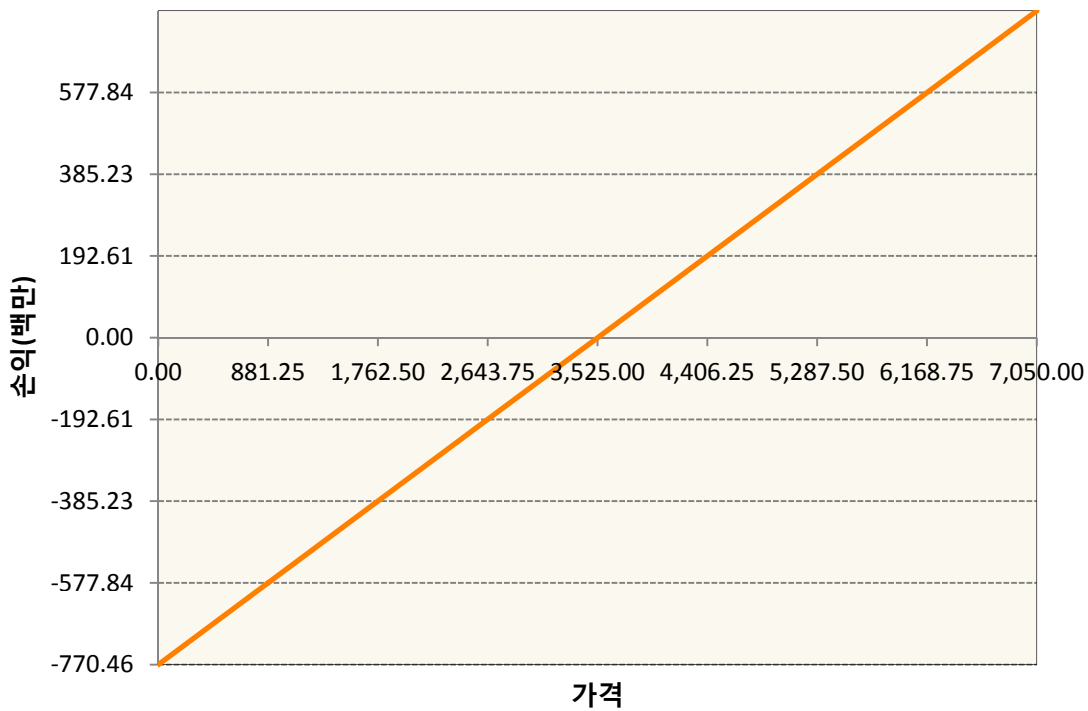
1. 계약금액

(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)

38

공시일	2018-08-02
기준일	2018-08-01

차이나인덱스모(주식-파생형)

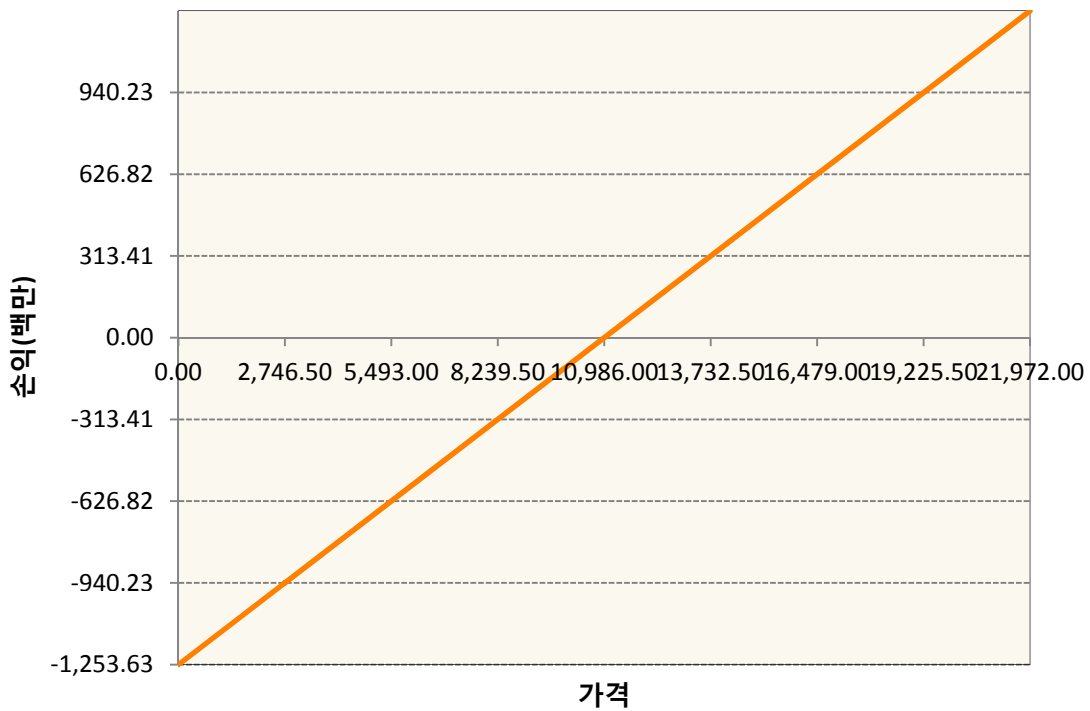
1. 계약금액

(단위:백만원)

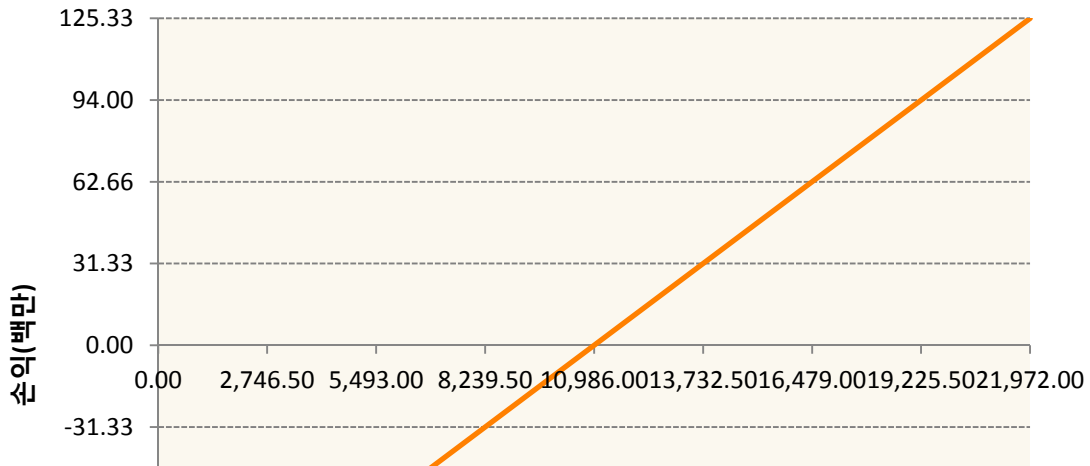
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,379	0	1,379	장내

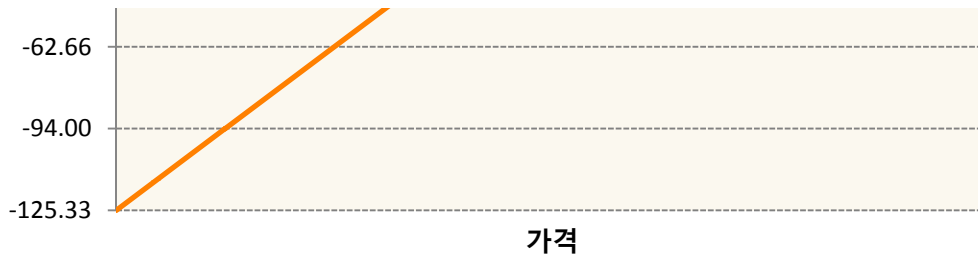
2. 만기시점의 손익구조

HCQ8-HSCEI Futures Aug18



MHCQ8-MINI H-SHR IDX FU Aug18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCQ8	HSCEI Futures Aug18	100
MHCQ8	MINI H-SHR IDX FU Aug18	10

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

100

공시일	2018-08-02
기준일	2018-08-01

커버드콜모(주식혼합-파생형)

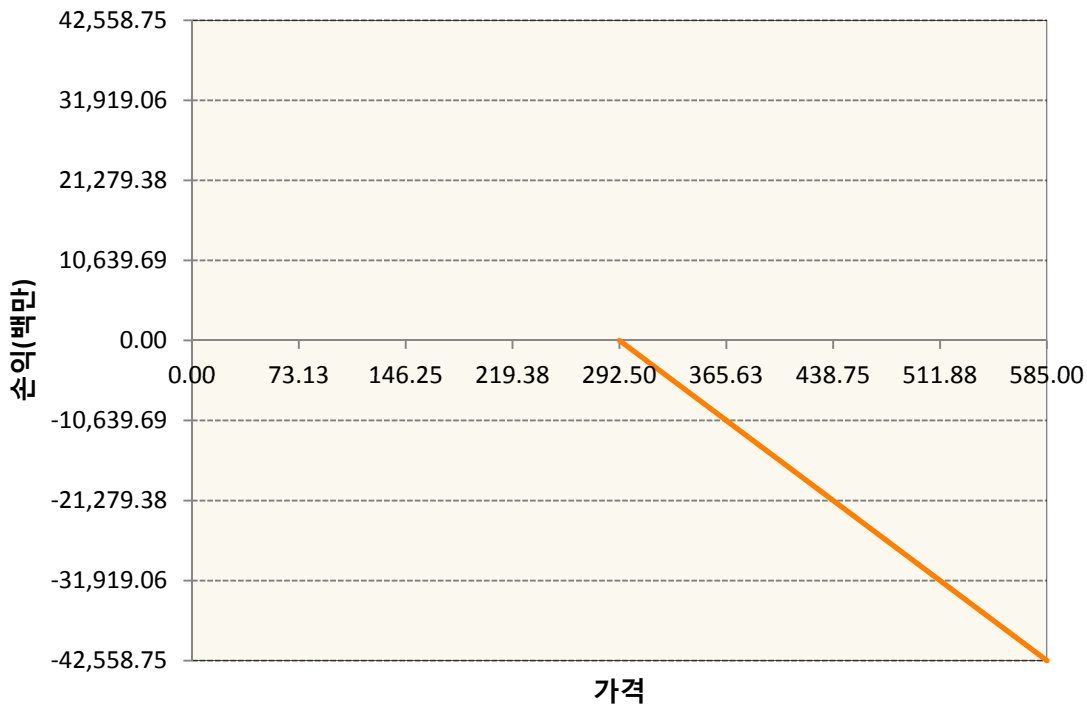
1. 계약금액

(단위:백만원)

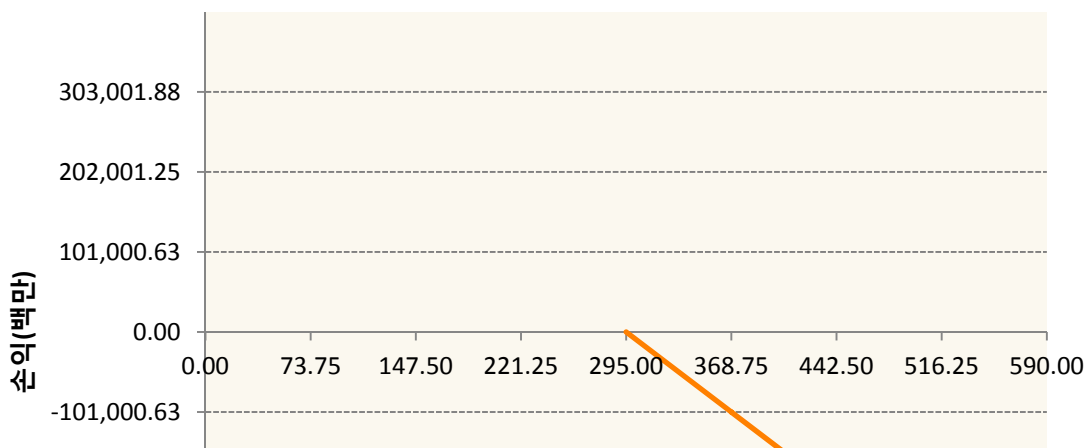
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	725,561	-725,561	장내

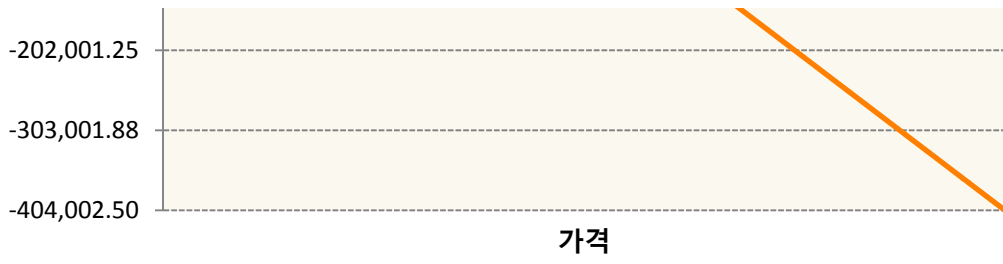
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N82928-2018-08 콜292.5

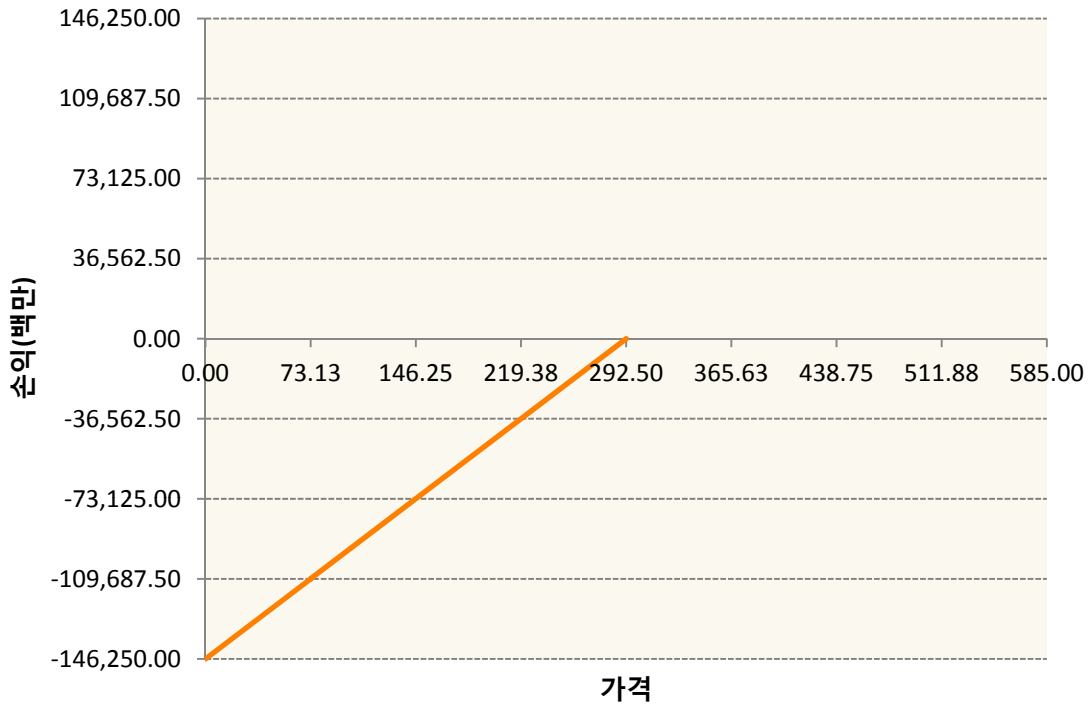


KR4201N82951-2018-08 콜295

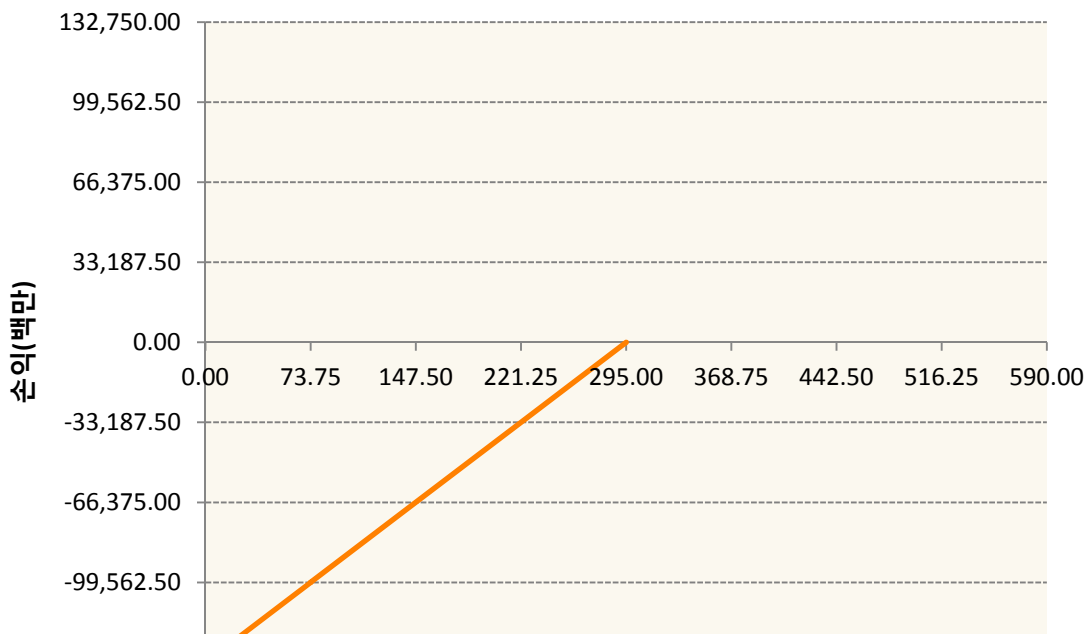




KR4301N82926-2018-08 풋292.5



KR4301N82959-2018-08 풋295



-132,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N829 2018-08 콜292.5							3,159
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,229	1,221	1,209	1,193	1,174	1,152	1,127
-5.33%	1,152	1,120	1,084	1,045	1,003	960	915
-2.67%	841	784	727	671	614	557	500
0%	147	100	51	0	-52	-104	-158
2.67%	-853	-874	-898	-927	-959	-993	-1,031
5.33%	-1,980	-1,985	-1,992	-2,003	-2,017	-2,034	-2,054
8.00%	-3,135	-3,135	-3,137	-3,140	-3,144	-3,150	-3,159
KR4201N829 2018-08 콜295							28,655
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,393	9,346	9,272	9,170	9,039	8,879	8,692
-5.33%	8,977	8,750	8,486	8,188	7,862	7,512	7,142
-2.67%	6,925	6,434	5,934	5,427	4,914	4,398	3,877
0%	1,556	1,043	524	0	-528	-1,060	-1,594
2.67%	-7,120	-7,392	-7,702	-8,044	-8,413	-8,805	-9,215
5.33%	-17,486	-17,564	-17,676	-17,822	-18,002	-18,214	-18,455
8.00%	-28,314	-28,327	-28,352	-28,394	-28,457	-28,544	-28,655
KR4301N829 2018-08 풋292.5							8,690
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,687	-8,687	-8,687	-8,687	-8,688	-8,688	-8,690
-5.33%	-4,710	-4,716	-4,725	-4,738	-4,756	-4,778	-4,805
-2.67%	-1,152	-1,233	-1,315	-1,398	-1,482	-1,566	-1,651
0%	113	82	44	0	-49	-102	-159
2.67%	168	168	167	164	160	154	145
5.33%	169	169	169	169	169	168	168
8.00%	169	169	169	169	169	169	169
KR4301N829 2018-08 풋295							8,735
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,734	-8,734	-8,734	-8,734	-8,734	-8,735	-8,735
-5.33%	-5,152	-5,153	-5,155	-5,160	-5,166	-5,175	-5,188
-2.67%	-1,700	-1,747	-1,800	-1,856	-1,915	-1,977	-2,041
0%	179	123	63	0	-65	-133	-202
2.67%	359	357	352	345	335	321	304

5.33%	360	360	360	360	360	359	358
8.00%	360	360	360	360	360	360	360

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

(단위:백만원)

53,523

공시일	2018-08-02
기준일	2018-08-01

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

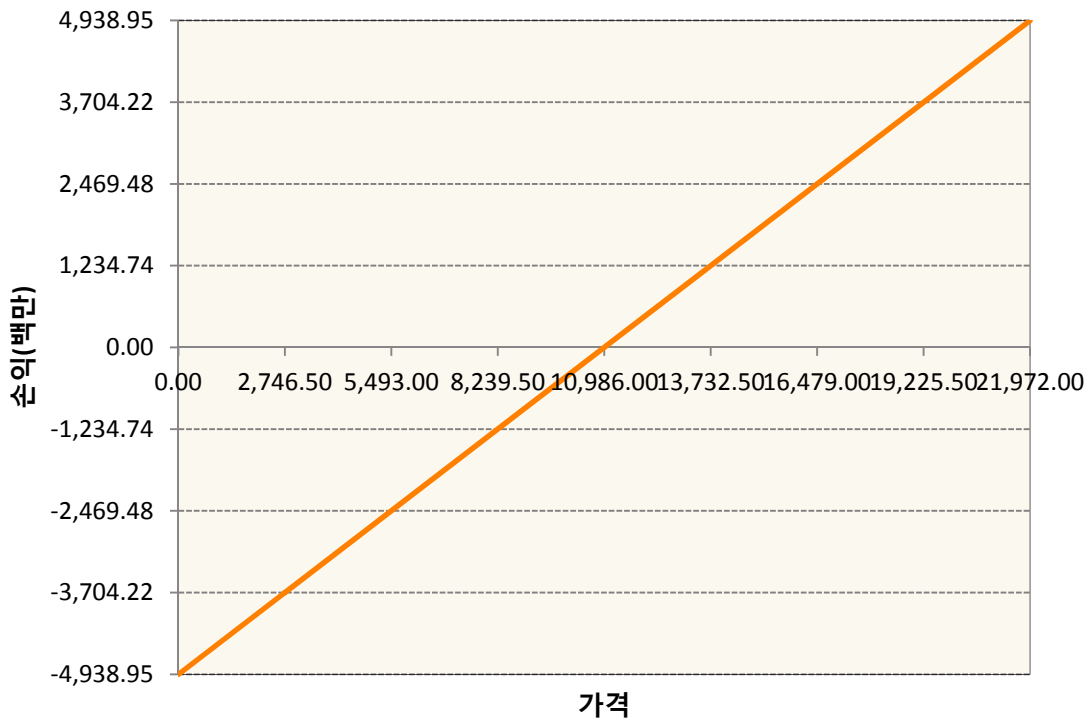
1. 계약금액

(단위:백만원)

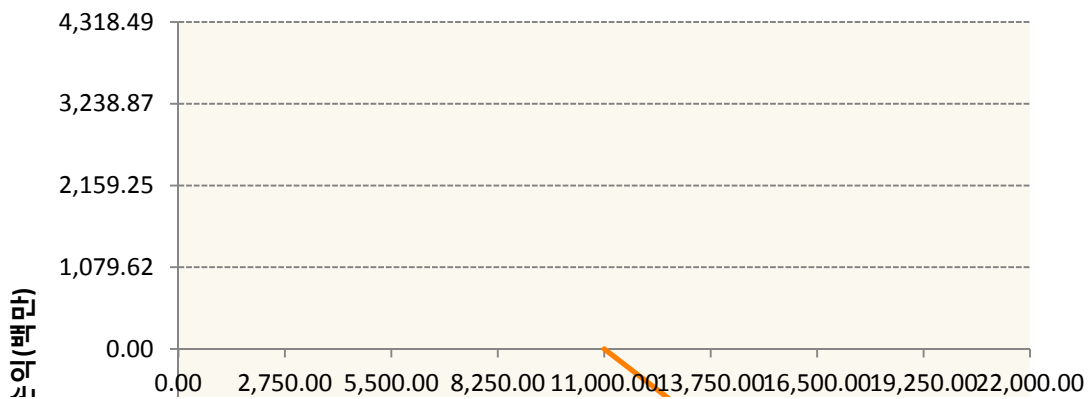
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,939	0	4,939	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,195	-11,195	장내

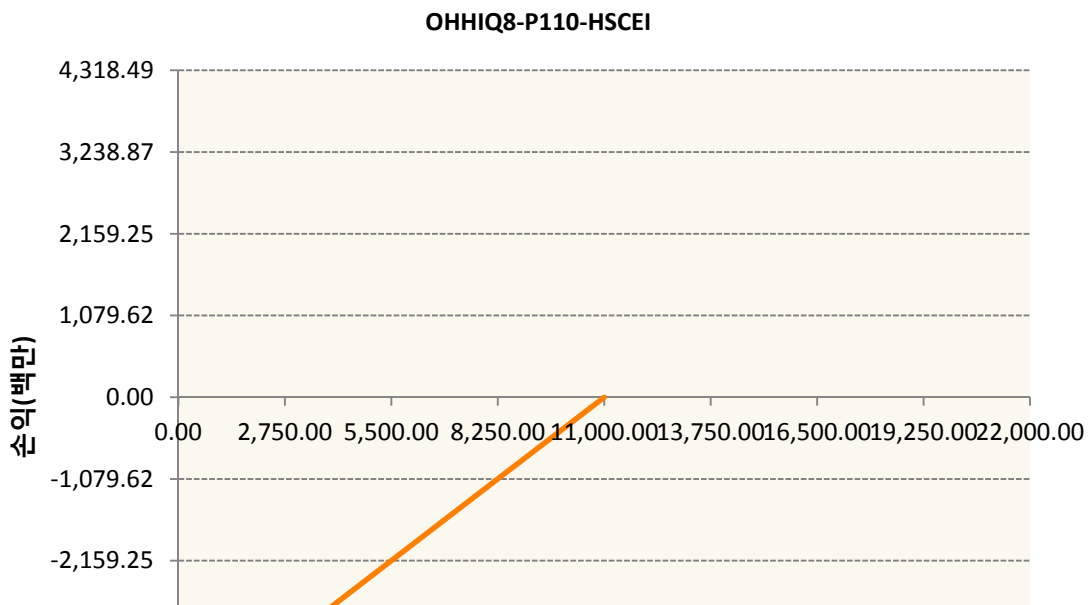
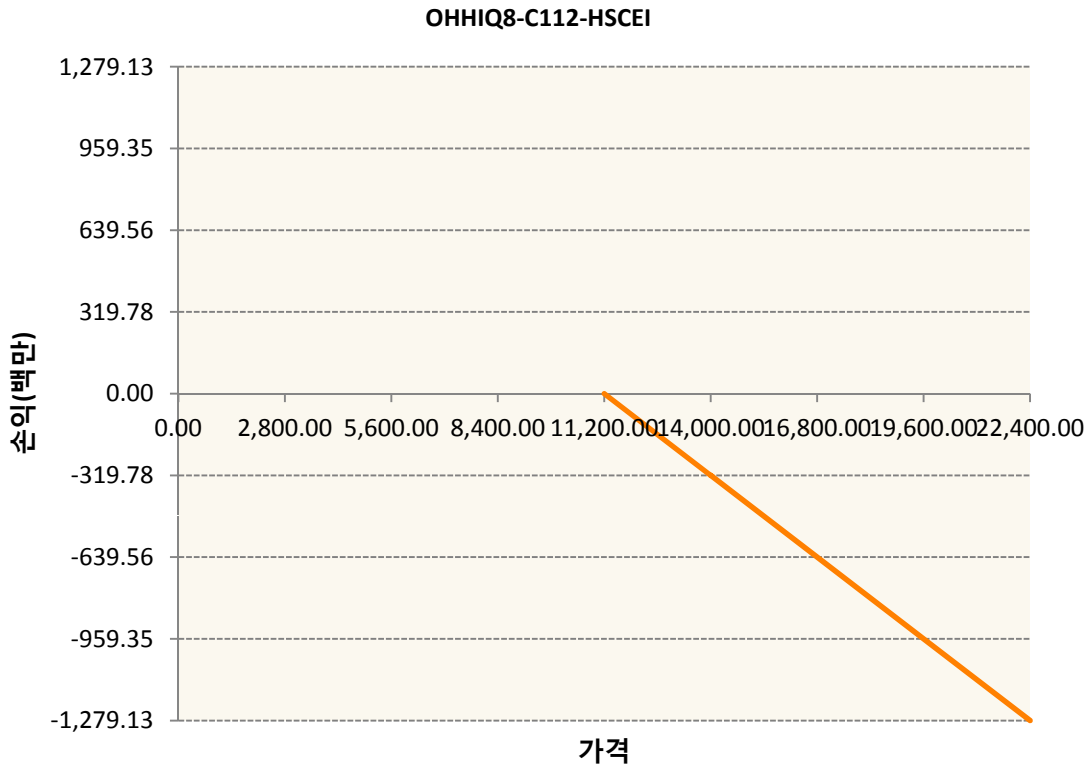
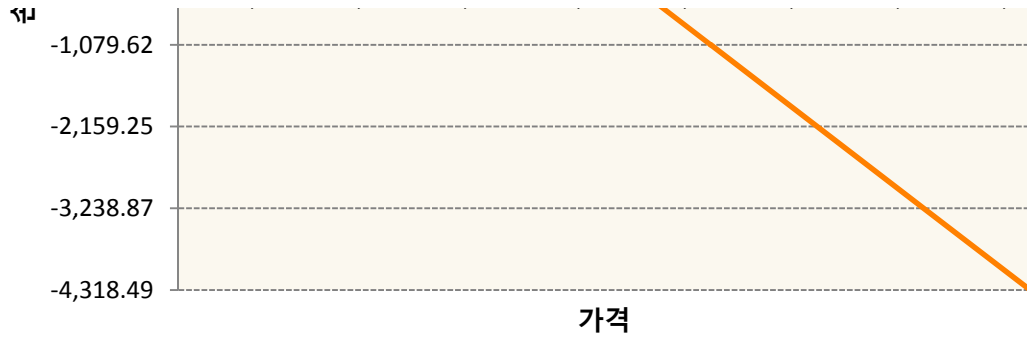
2. 만기시점의 손익구조

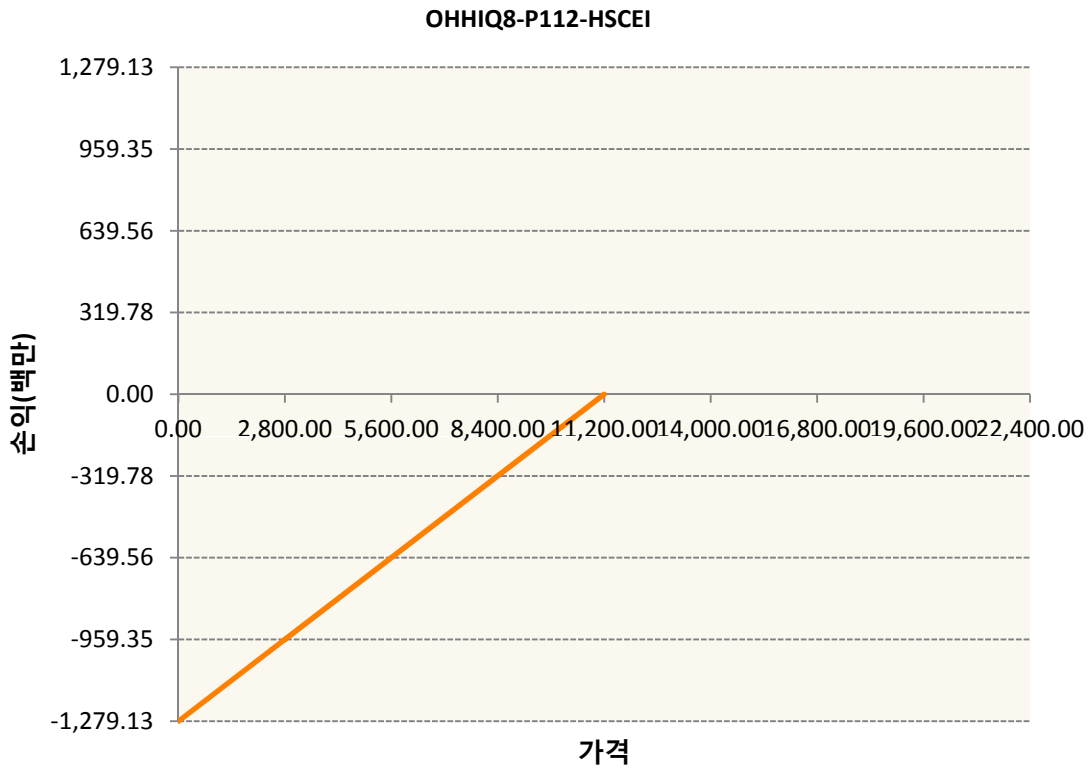
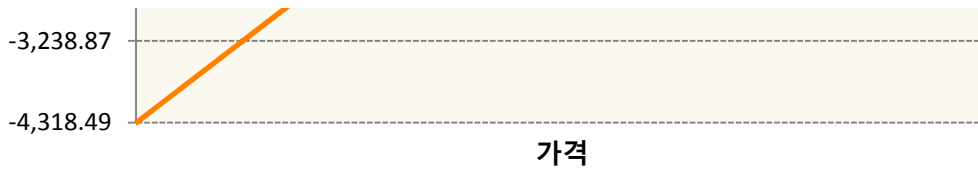
HCQ8-HSCEI Futures Aug18



OHHIQ8-C110-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ8	HSCEI Futures Aug18	395
OHHIQ8-C1	HSCEI	345
OHHIQ8-C1	HSCEI	102
OHHIQ8-P11	HSCEI	345
OHHIQ8-P11	HSCEI	102

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

공시일	2018-08-02
기준일	2018-08-01

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

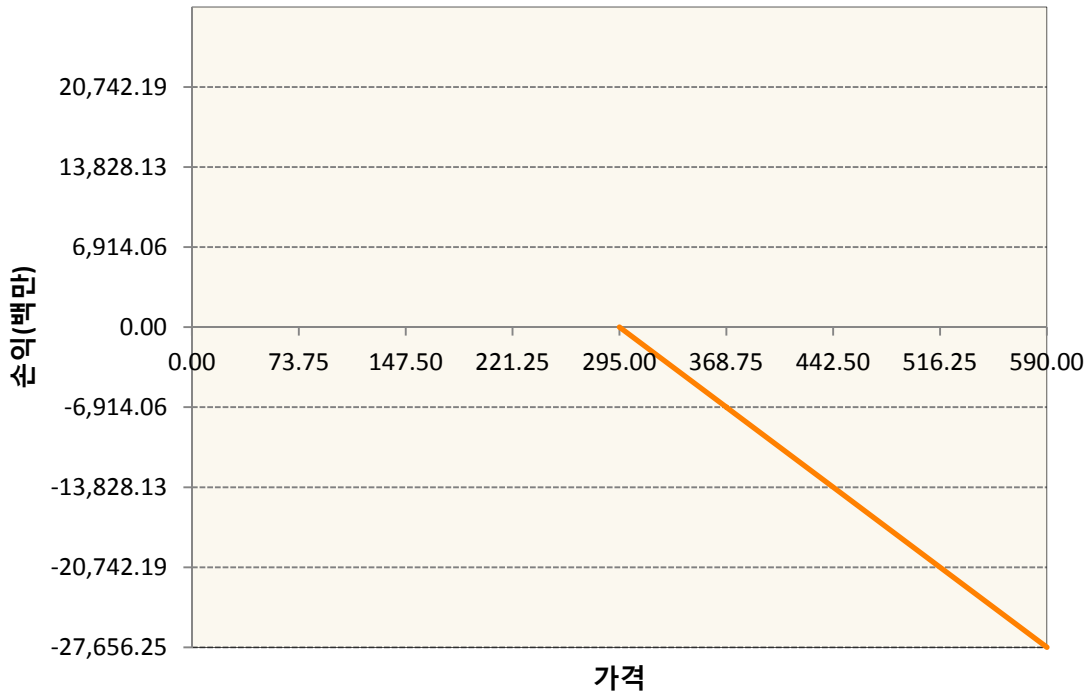
1. 계약금액

(단위:백만원)

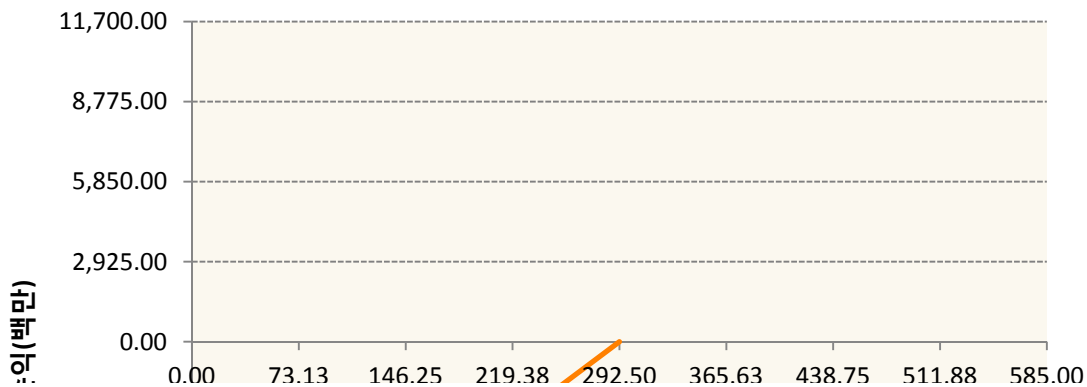
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	45,200	0	45,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	48,575	-48,575	장내

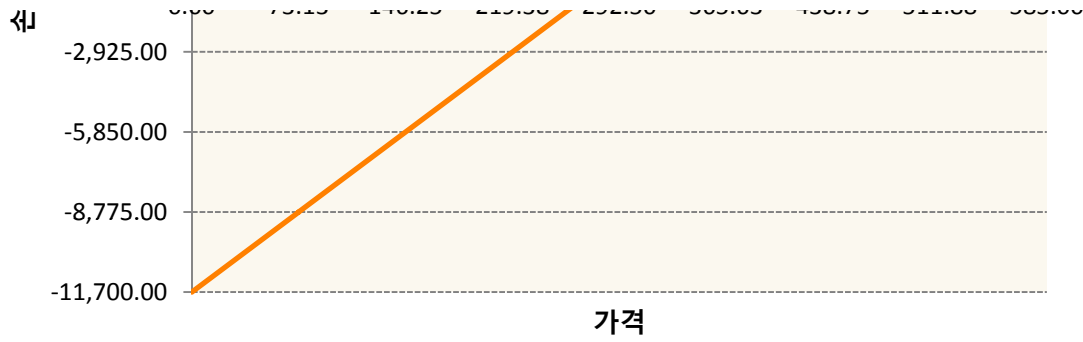
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N82951-2018-08 콜295

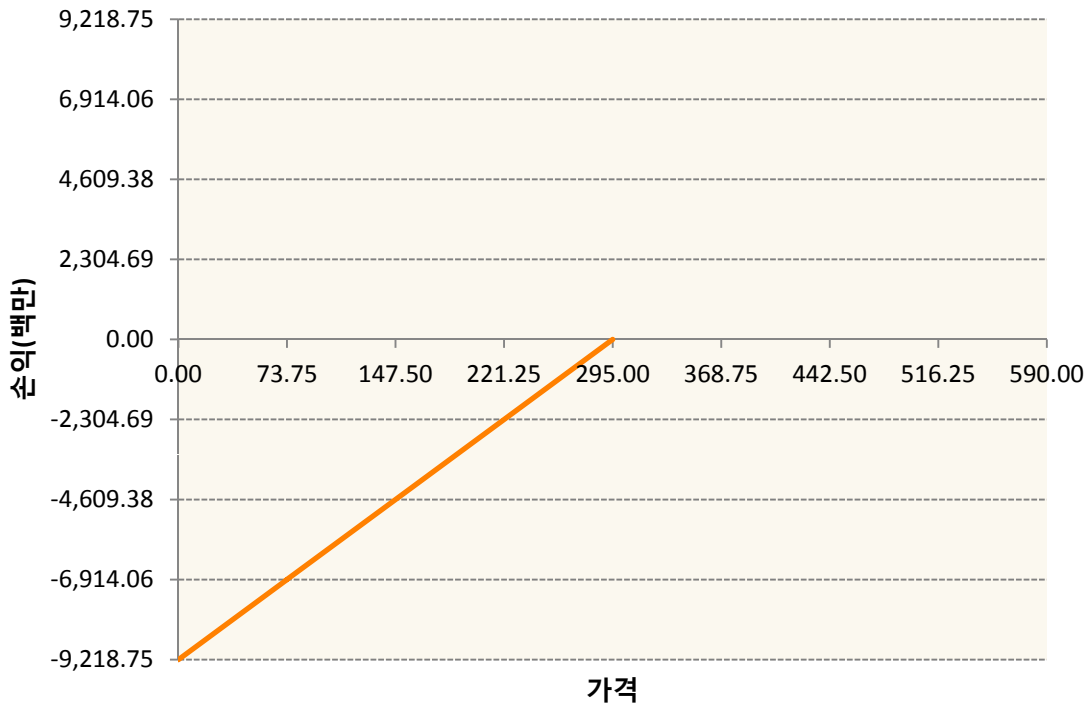


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





KR4301N82959-2018-08 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_2							1,498
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,498	-1,498	-1,498	-1,498	-1,498	-1,498	-1,498
-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%	1,498	1,498	1,498	1,498	1,498	1,498	1,498
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%	486	486	486	486	486	486	486

KR4201N829 2018-08 콜295

1,962

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	643	640	635	628	619	608	595
-5.33%	615	599	581	561	538	514	489
-2.67%	474	440	406	372	336	301	265
0%	106	71	36	0	-36	-73	-109
2.67%	-487	-506	-527	-551	-576	-603	-631
5.33%	-1,197	-1,202	-1,210	-1,220	-1,232	-1,247	-1,263
8.00%	-1,938	-1,939	-1,941	-1,944	-1,948	-1,954	-1,962

KR4301N829 2018-08 풋292.5

695

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-695	-695	-695	-695	-695	-695	-695
-5.33%	-377	-377	-378	-379	-380	-382	-384
-2.67%	-92	-99	-105	-112	-119	-125	-132
0%	9	7	4	0	-4	-8	-13
2.67%	13	13	13	13	13	12	12
5.33%	13	13	13	13	13	13	13
8.00%	13	13	13	13	13	13	13

KR4301N829 2018-08 풋295

607

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-607	-607	-607	-607	-607	-607	-607
-5.33%	-358	-358	-358	-358	-359	-359	-360
-2.67%	-118	-121	-125	-129	-133	-137	-142
0%	12	9	4	0	-5	-9	-14
2.67%	25	25	24	24	23	22	21
5.33%	25	25	25	25	25	25	25
8.00%	25	25	25	25	25	25	25

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

(단위:백만원)

7,178

공시일	2018-08-02
기준일	2018-08-01

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

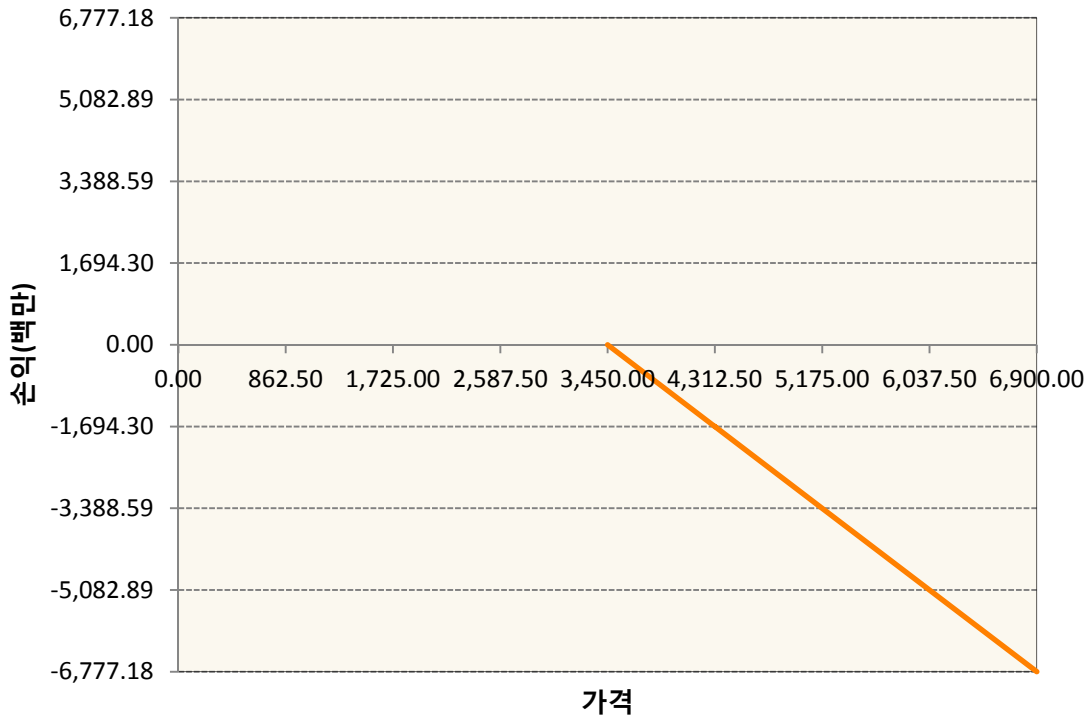
1. 계약금액

(단위:백만원)

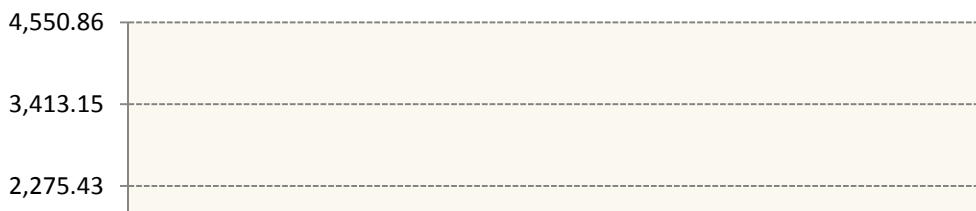
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,014	0	4,014	
누계	유가증권	스왑	45,160	0	45,160	장외
누계	유가증권	옵션	0	18,110	-18,110	장내
누계	지수	스왑	53,168	0	53,168	장외

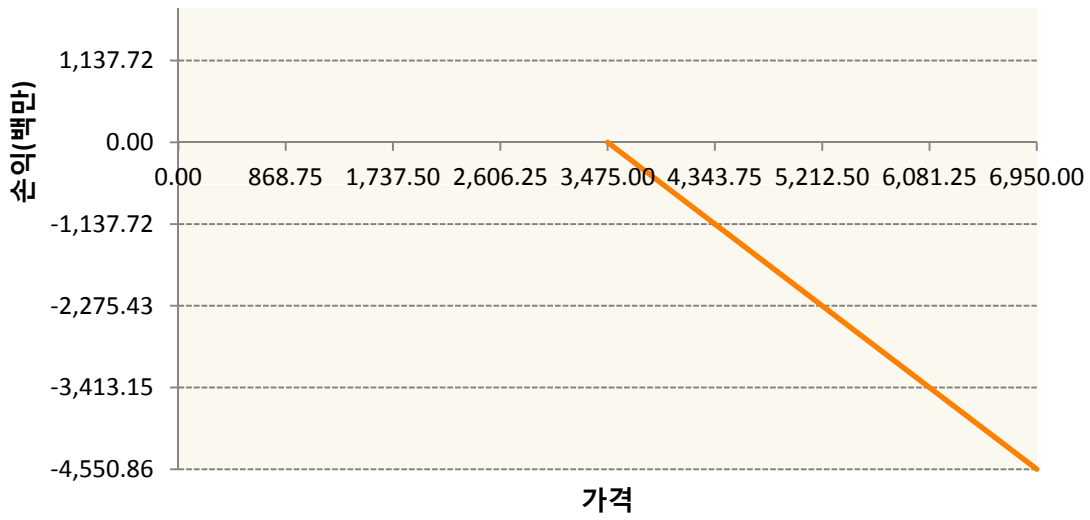
2. 만기시점의 손익구조

OESXQ8-C3450-EURO STOXX 50 OPT

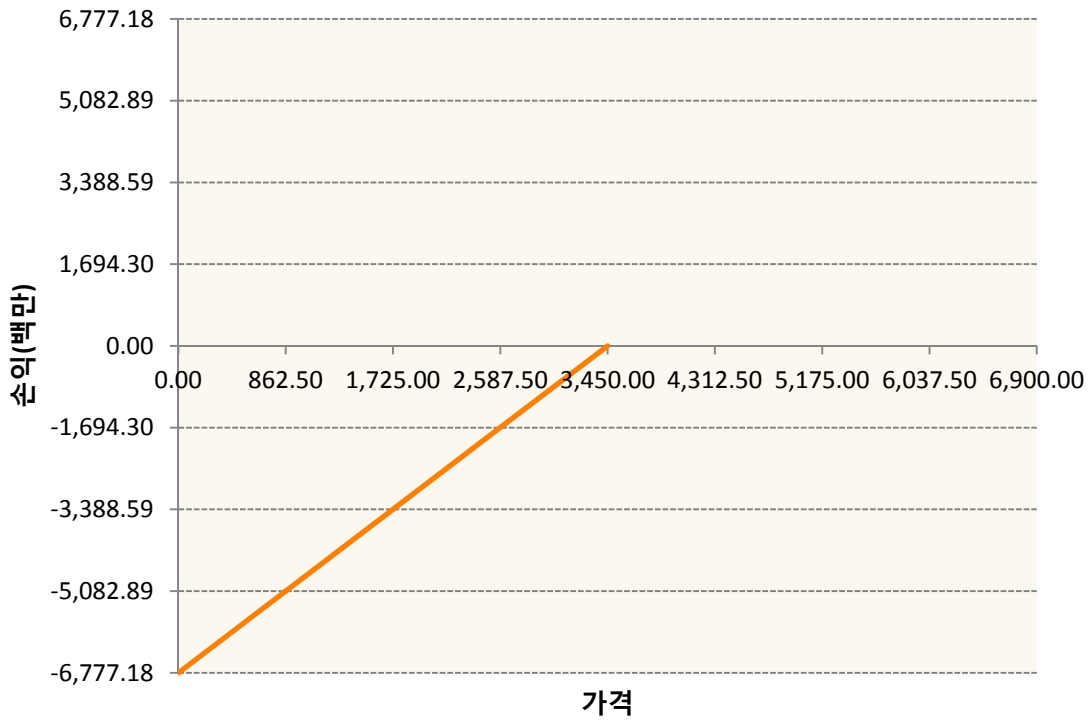


OESXQ8-C3475-EURO STOXX 50 OPT

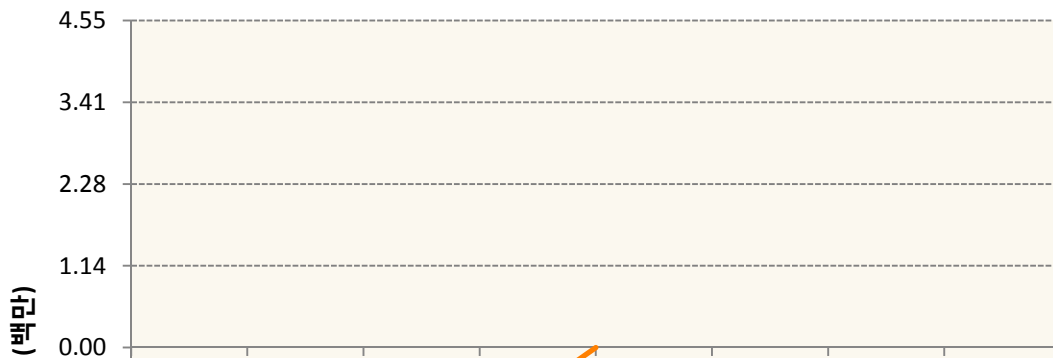


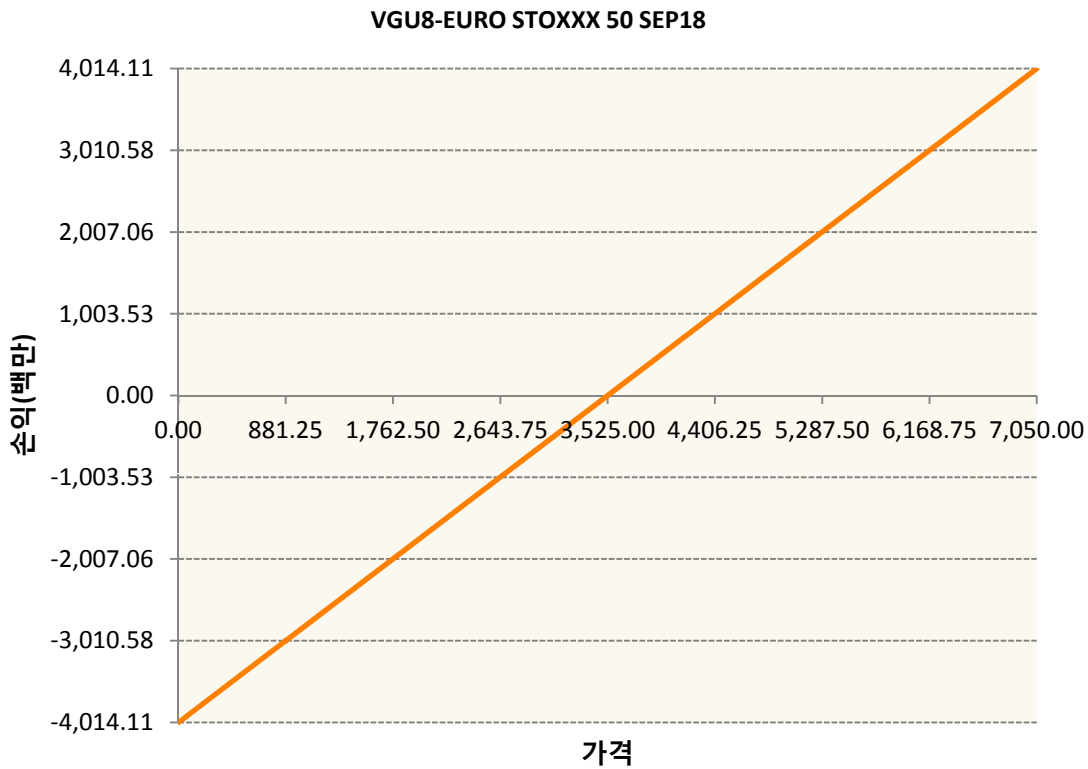
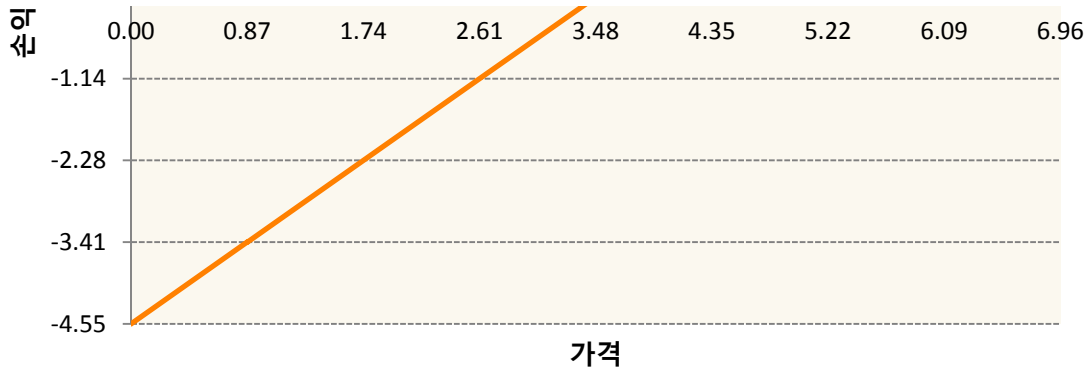


OESXQ8-P3450-EURO STOXX 50



OESXQ8-P3475-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY -	994.569	39
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY		33
OESXQ8-C3 ² EURO STOXX 50 OPT		542
OESXQ8-C3 ² EURO STOXX 50 OPT		364
OESXQ8-P3 ² EURO STOXX 50		542
OESXQ8-P3 ² 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)

1,153

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

(단위:백만원)

91

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

(단위:백만원)

136

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

(단위:백만원)

168

공시일	2018-08-02
기준일	2018-08-01

스마트KRX300인덱스목표전환형1

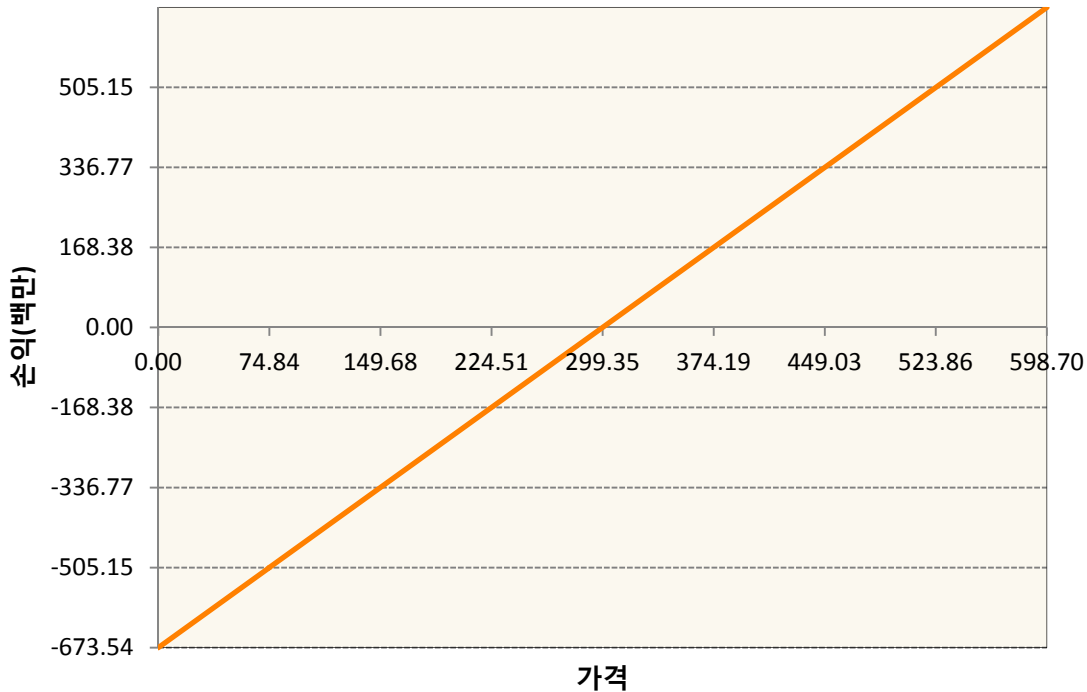
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	674	0	674	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	2018-08-02
기준일	2018-08-01

리디파인K200(주식혼합-파생재간

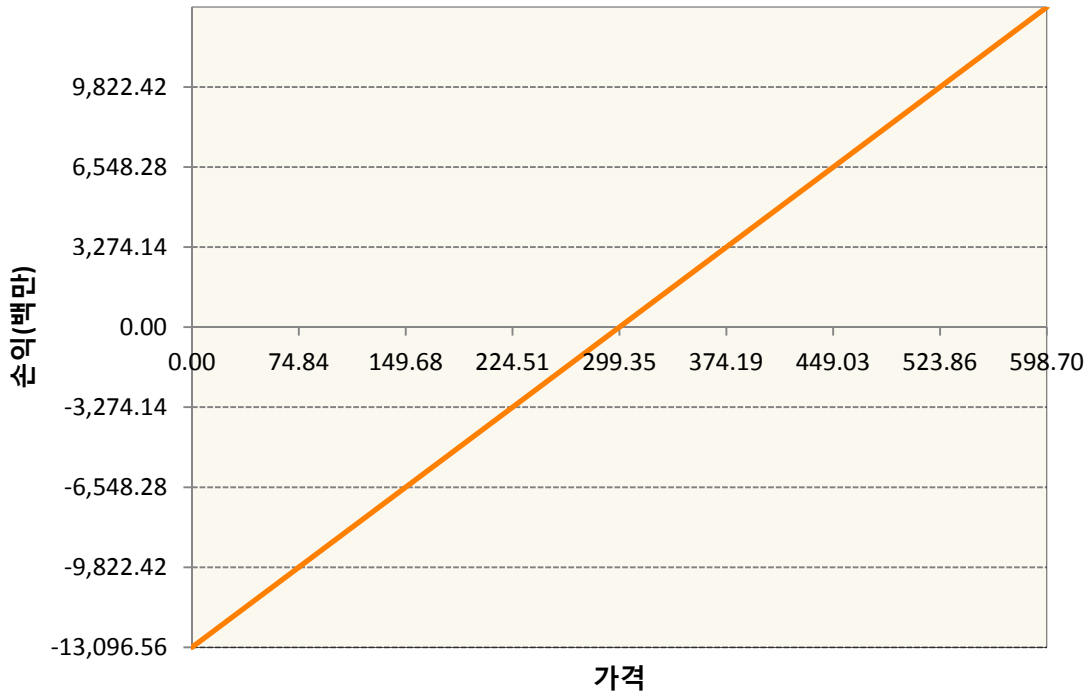
1. 계약금액

(단위:백만원)

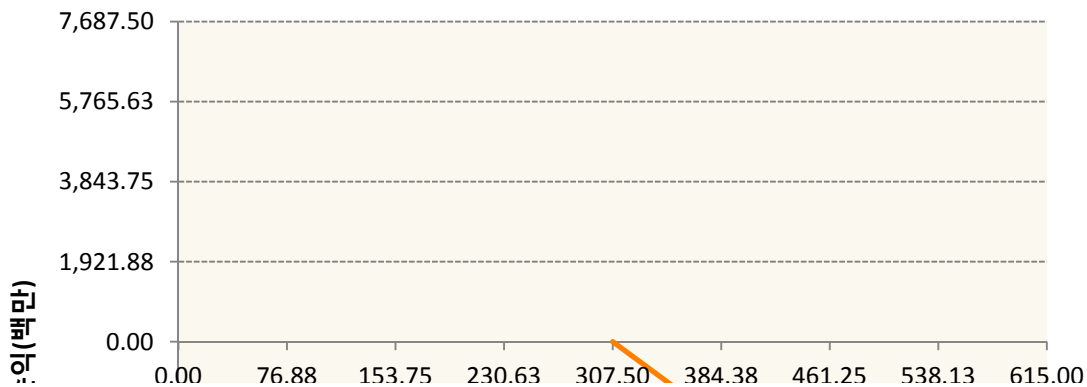
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,097	0	13,097	장내
누계	유가증권	옵션	2,134	23,730	-21,596	장내

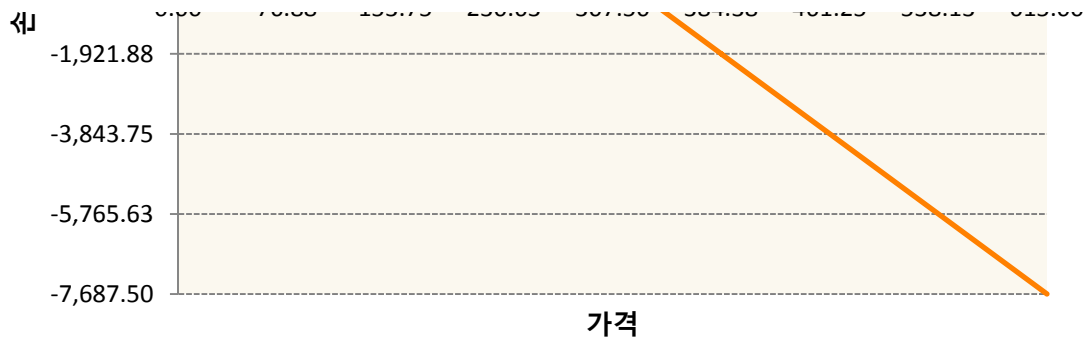
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

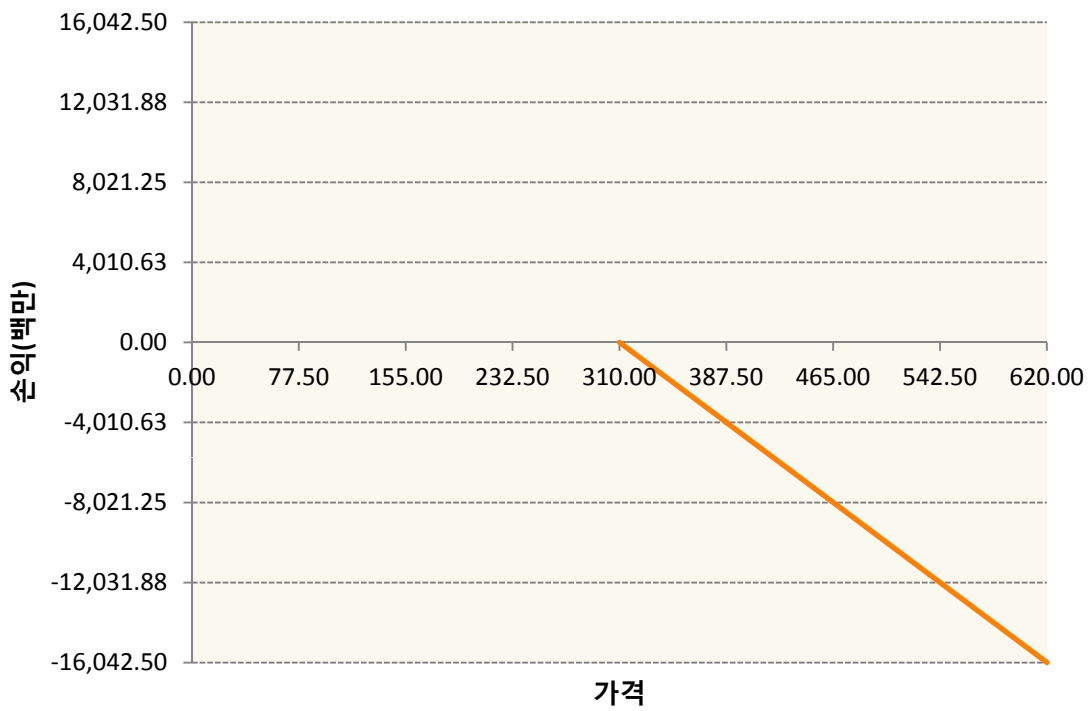


KR4201N83074-2018-08 콜307.5

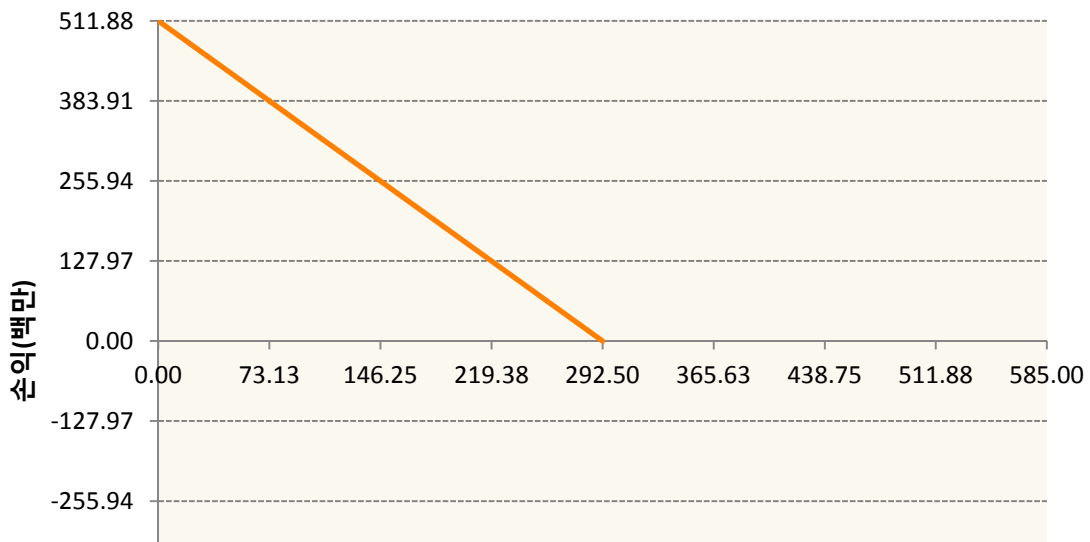


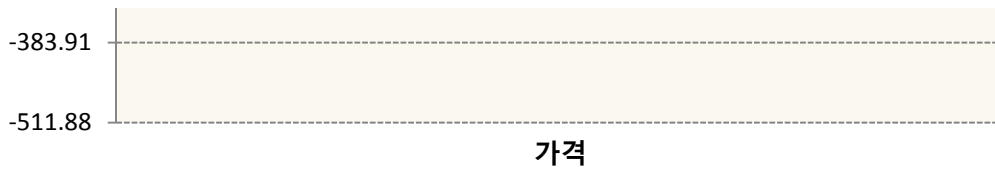


KR4201N83108-2018-08 콜310

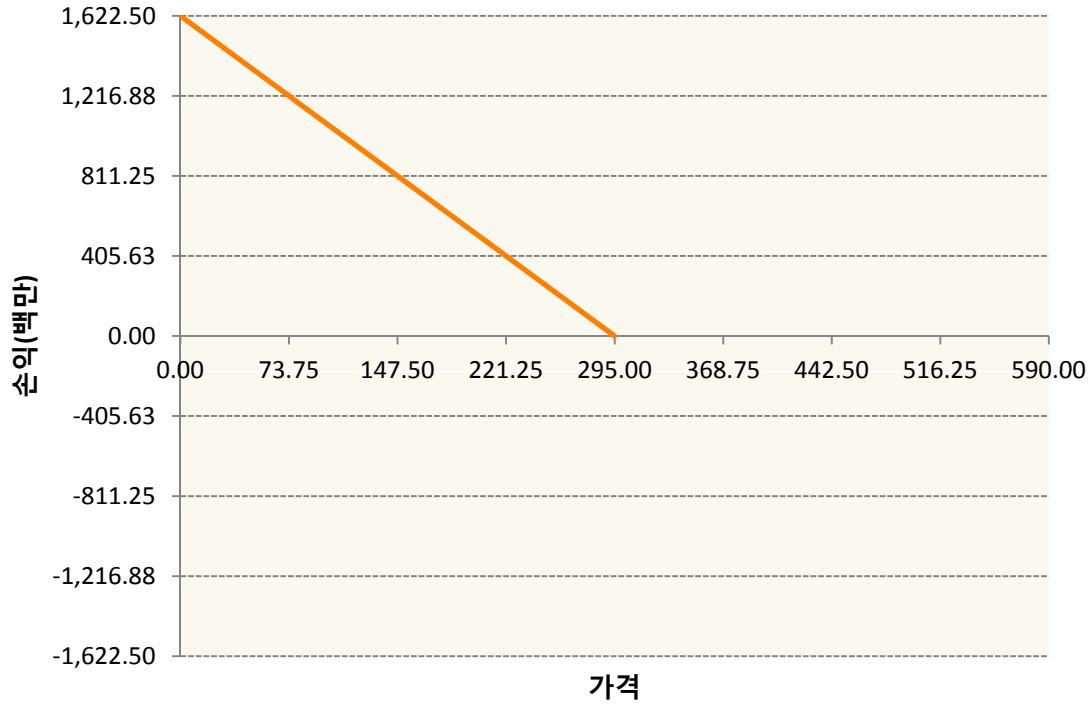


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





KR4301N82959-2018-08 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물 1,045

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,045	-1,045	-1,045	-1,045	-1,045	-1,045	-1,045
-5.33%	-697	-697	-697	-697	-697	-697	-697
-2.67%	-348	-348	-348	-348	-348	-348	-348
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	348	348	348	348	348	348	348
5.33%	697	697	697	697	697	697	697
8.00%	1,045	1,045	1,045	1,045	1,045	1,045	1,045

KR4201N83C 2018-08 콜307.5 371

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	43	43	43	43	43	42	41
-5.33%	43	43	42	41	40	38	35
-2.67%	40	38	35	31	27	22	17

0%	22	15	8	0	-8	-17	-25
2.67%	-40	-51	-61	-71	-82	-92	-102
5.33%	-166	-174	-183	-191	-201	-210	-219
8.00%	-340	-343	-347	-352	-358	-364	-371

KR4201N8312018-08 콜310

691

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	63	63	63	63	62	62	61
-5.33%	63	63	62	61	59	56	52
-2.67%	60	57	53	47	41	33	24
0%	37	26	14	0	-15	-30	-46
2.67%	-57	-77	-98	-119	-140	-161	-182
5.33%	-276	-295	-316	-336	-357	-377	-398
8.00%	-610	-620	-632	-646	-660	-675	-691

KR4301N829 2018-08 풋292.5

30

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	30	30	30	30	30	30	30
-5.33%	16	17	17	17	17	17	17
-2.67%	4	4	5	5	5	5	6
0%	0	0	0	0	0	0	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

107

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	107	107	107	107	107	107	107
-5.33%	63	63	63	63	63	63	63
-2.67%	21	21	22	23	23	24	25
0%	-2	-2	-1	0	1	2	2
2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4

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

(단위:백만원)

1,755

공시일	2018-08-02
기준일	2018-08-01

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

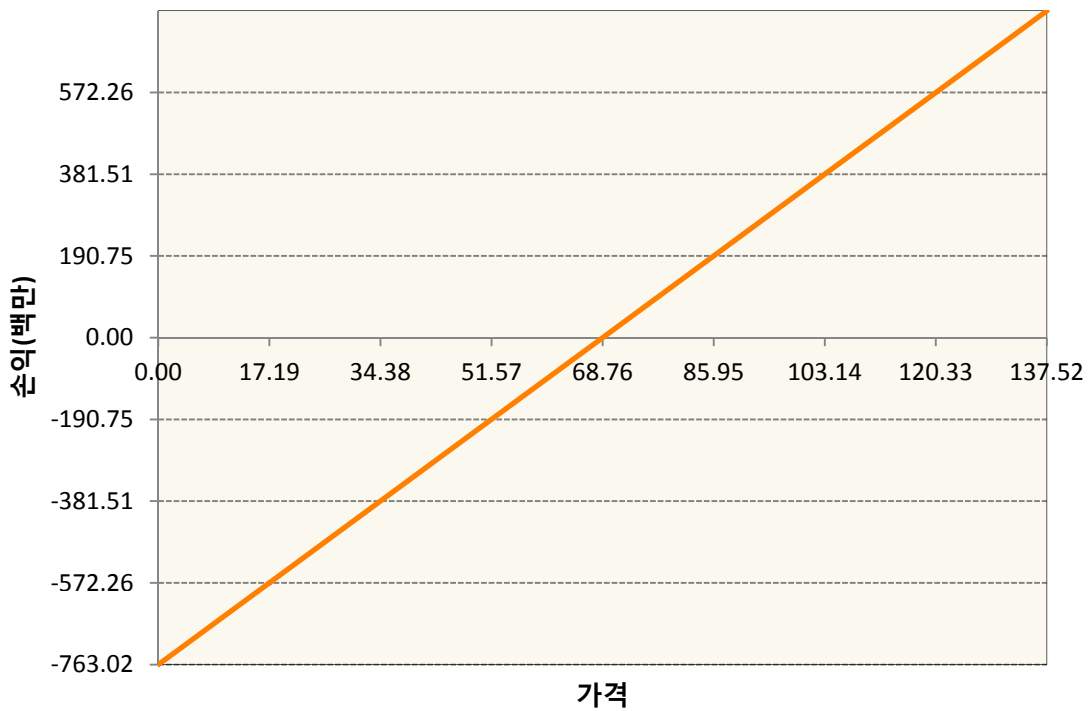
1. 계약금액

(단위:백만원)

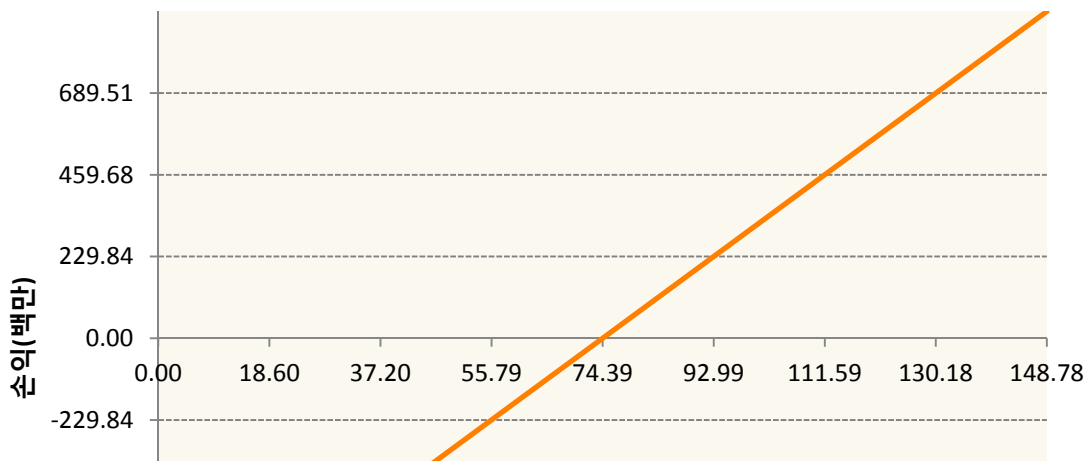
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,652	616	3,036	

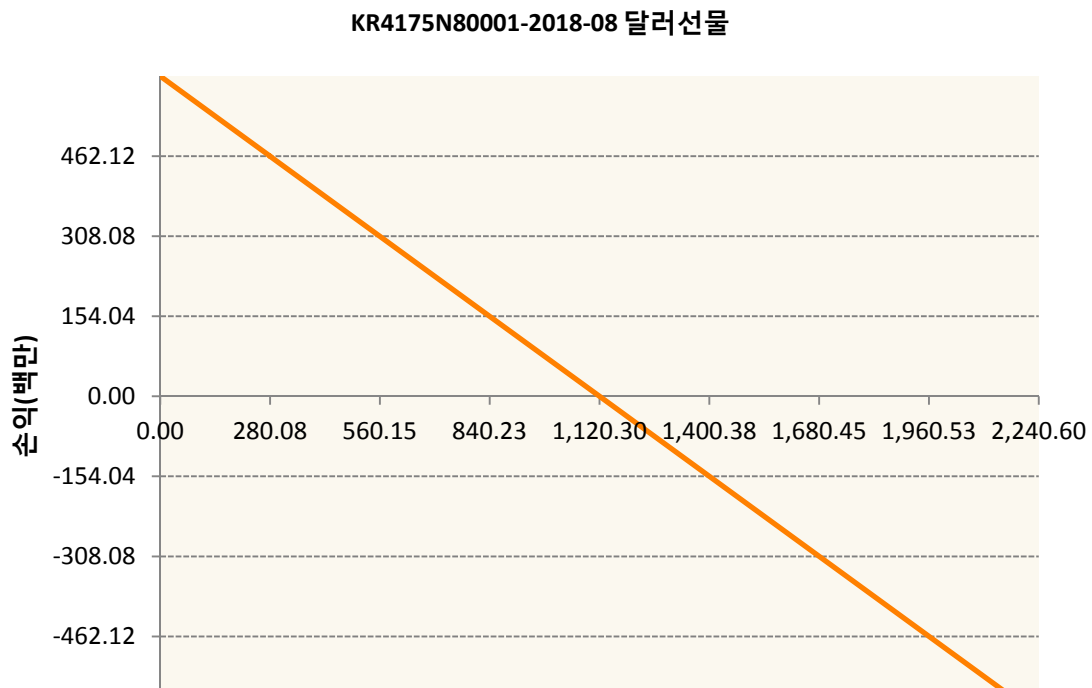
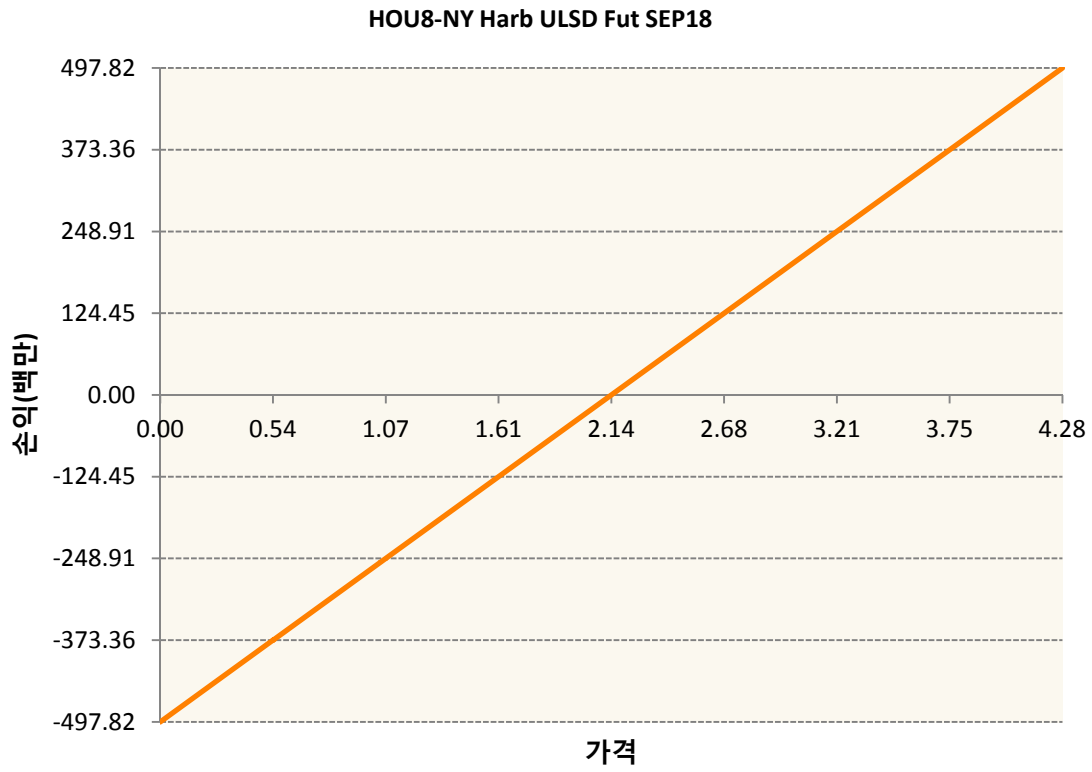
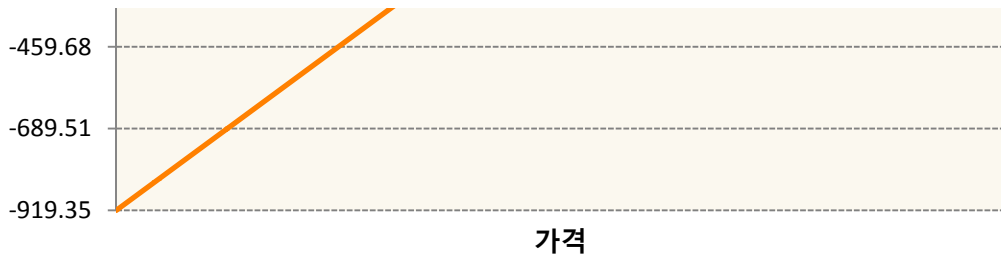
2. 만기시점의 손익구조

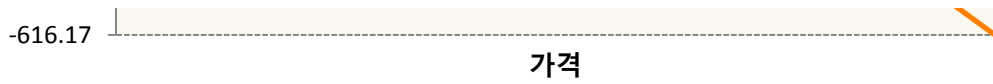
CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18



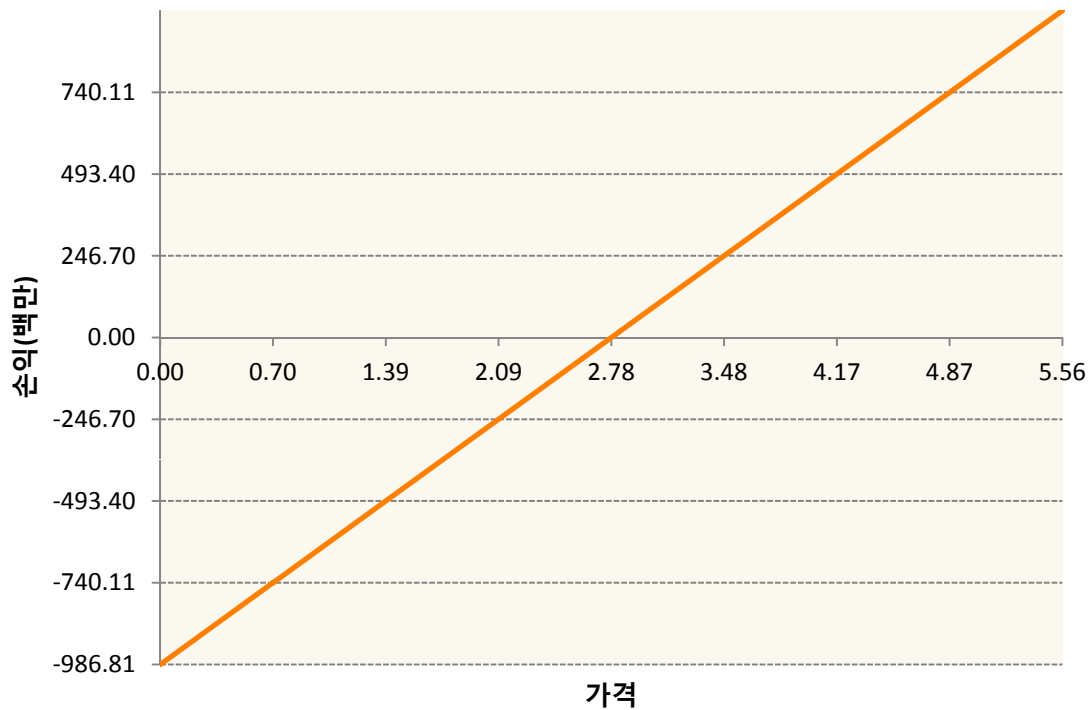
COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18



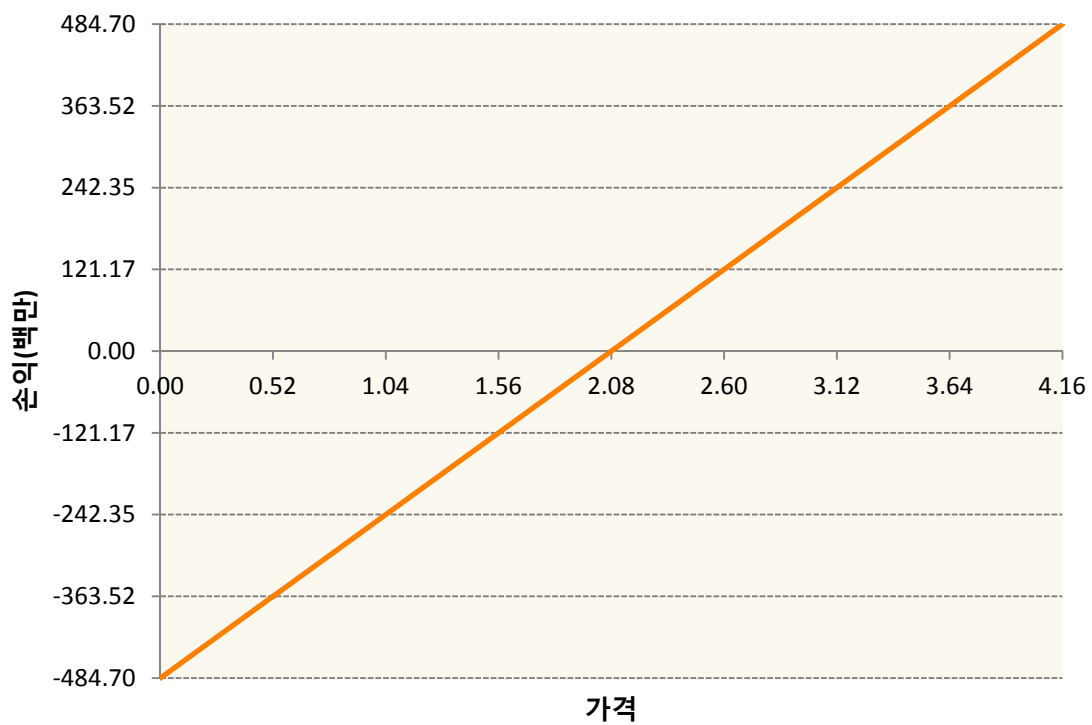




NGU18-NATURAL GAS FUTR SEP18



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)

448

공시일	2018-08-02
기준일	2018-08-01

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

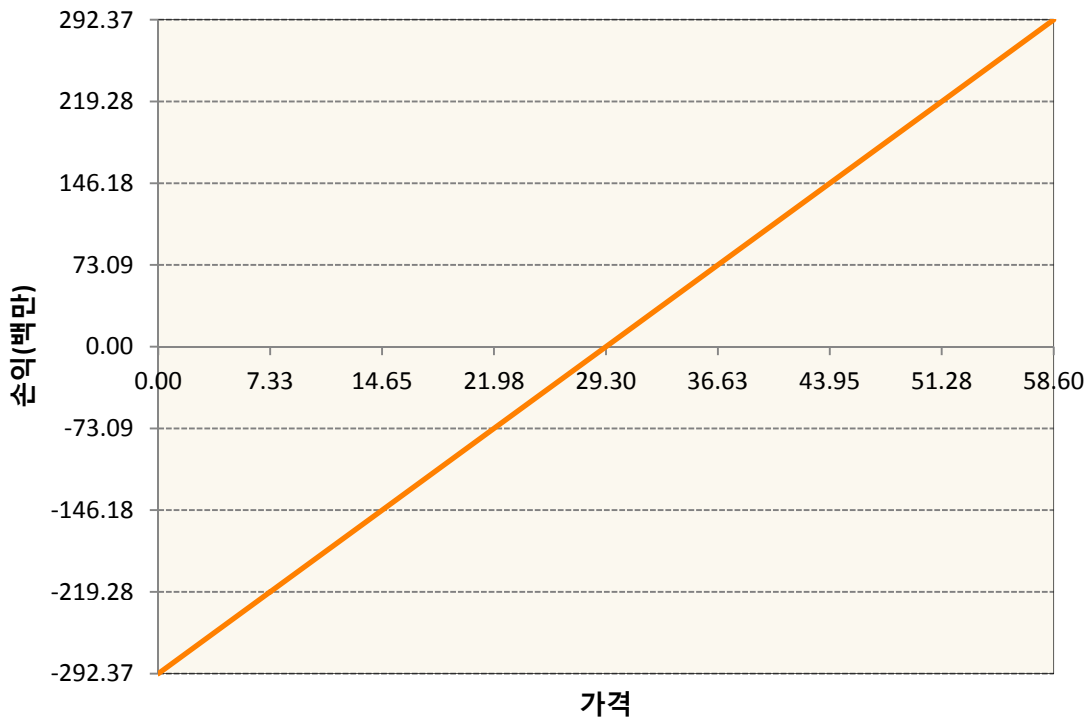
1. 계약금액

(단위:백만원)

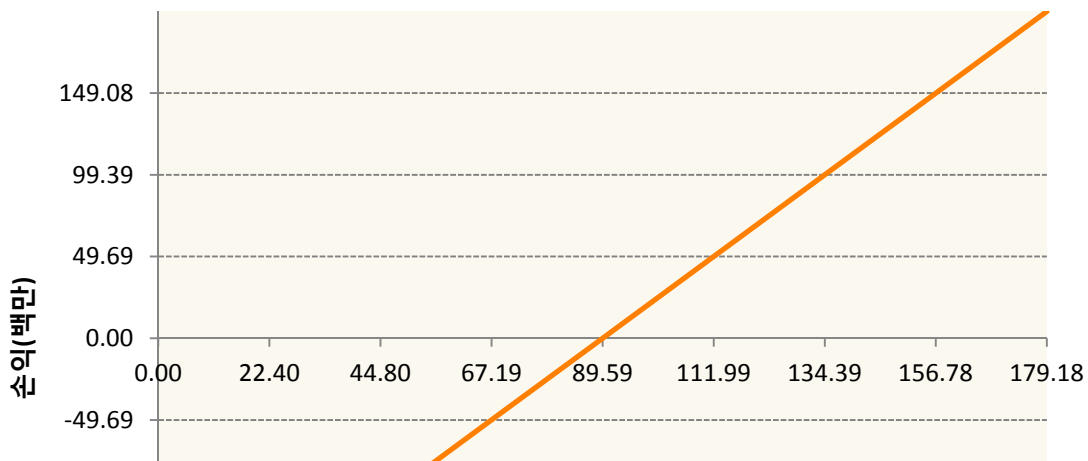
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,766	78	3,688	

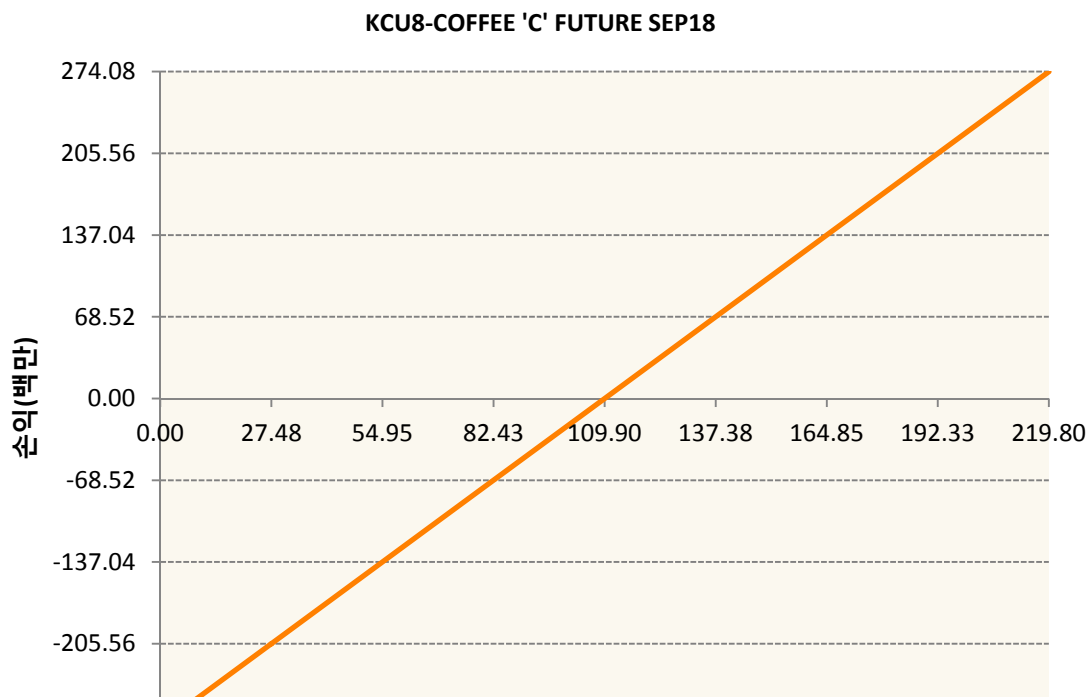
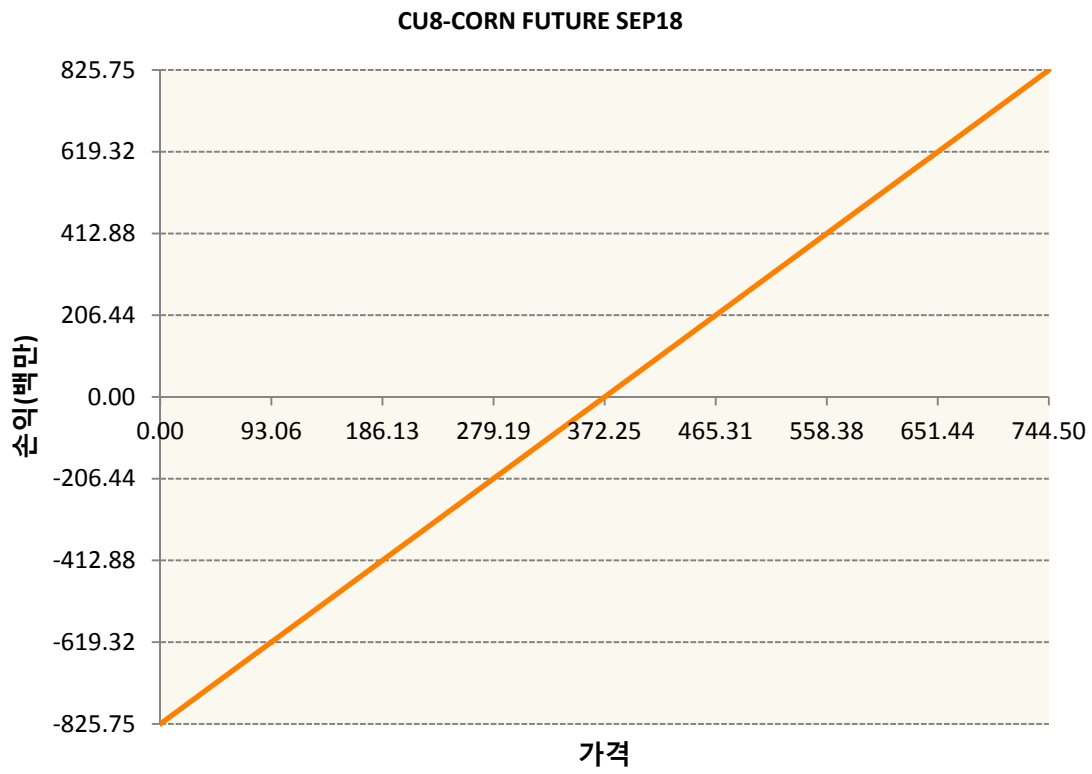
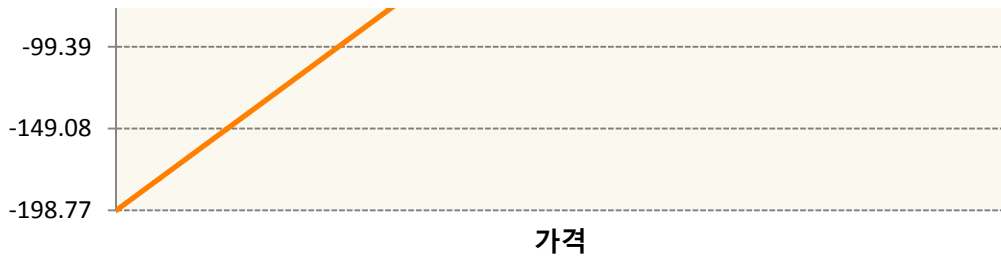
2. 만기시점의 손익구조

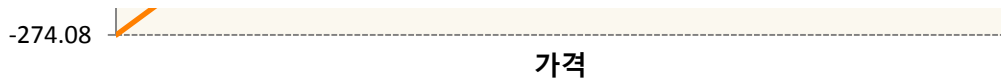
BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18



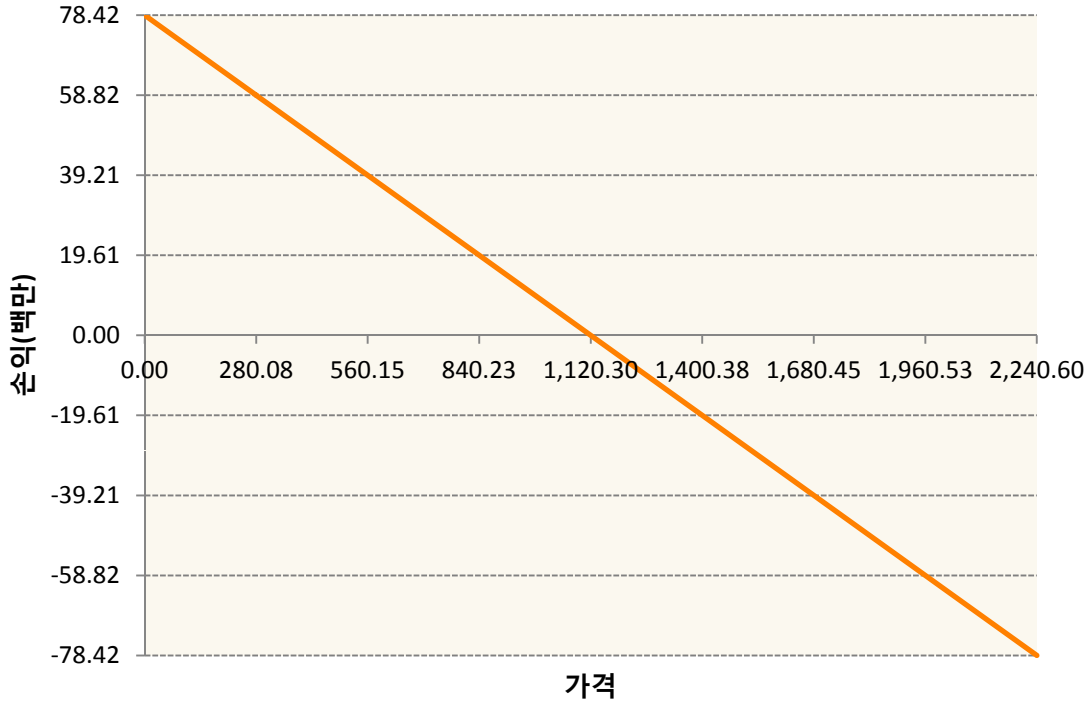
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



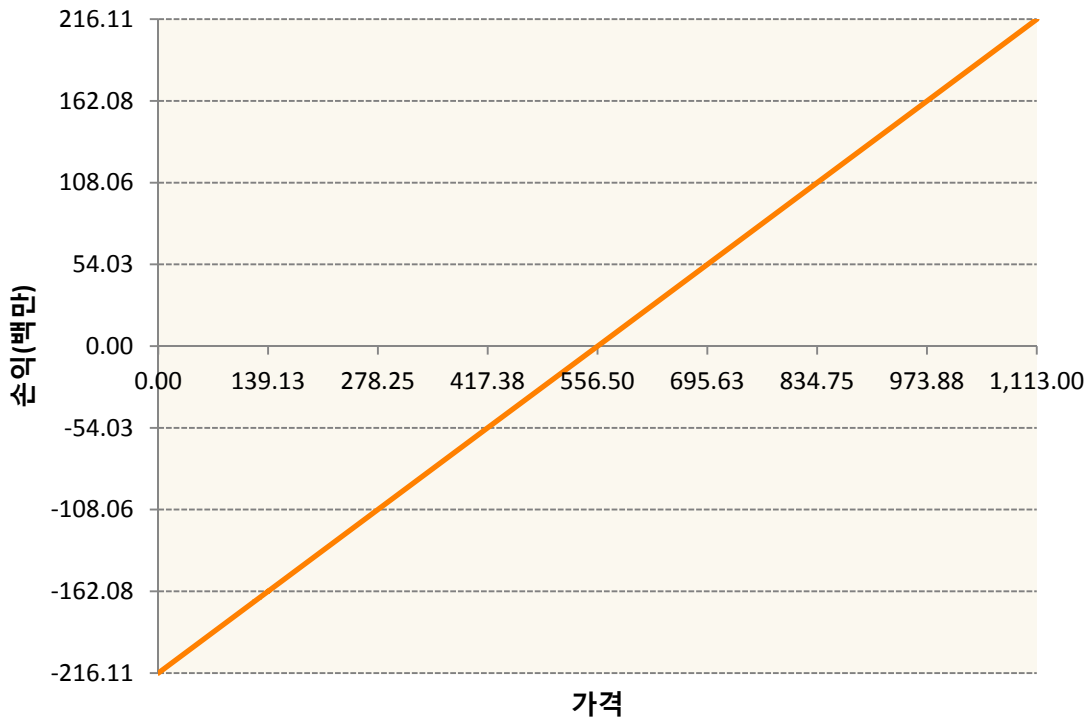




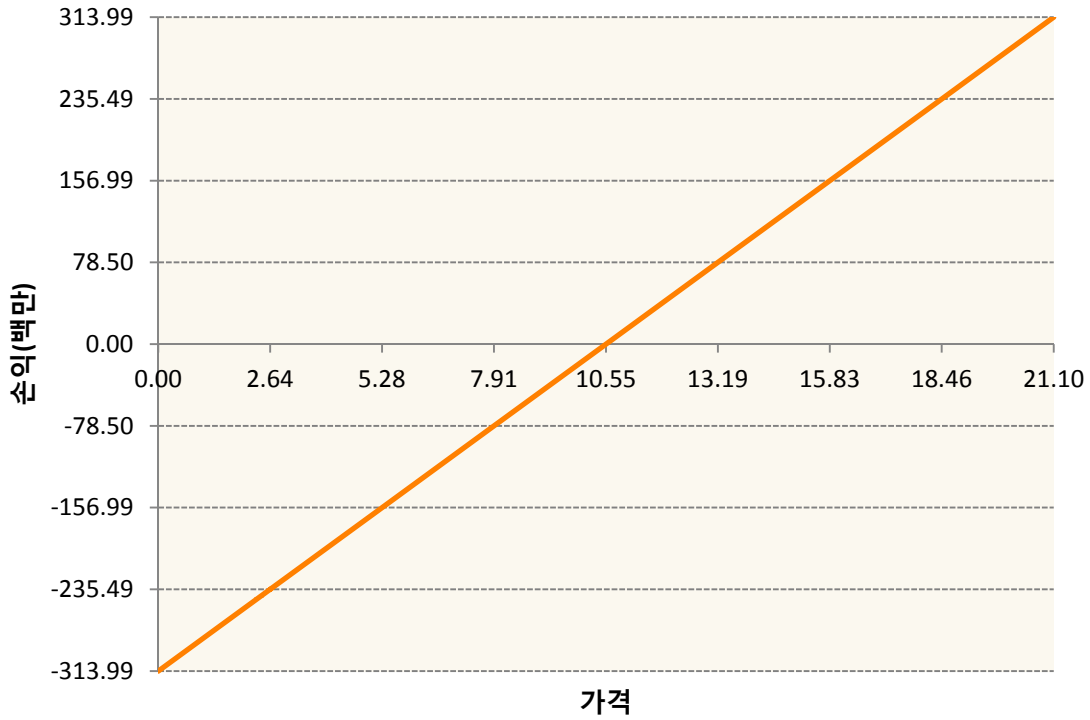
KR4175N80001-2018-08 달러선물



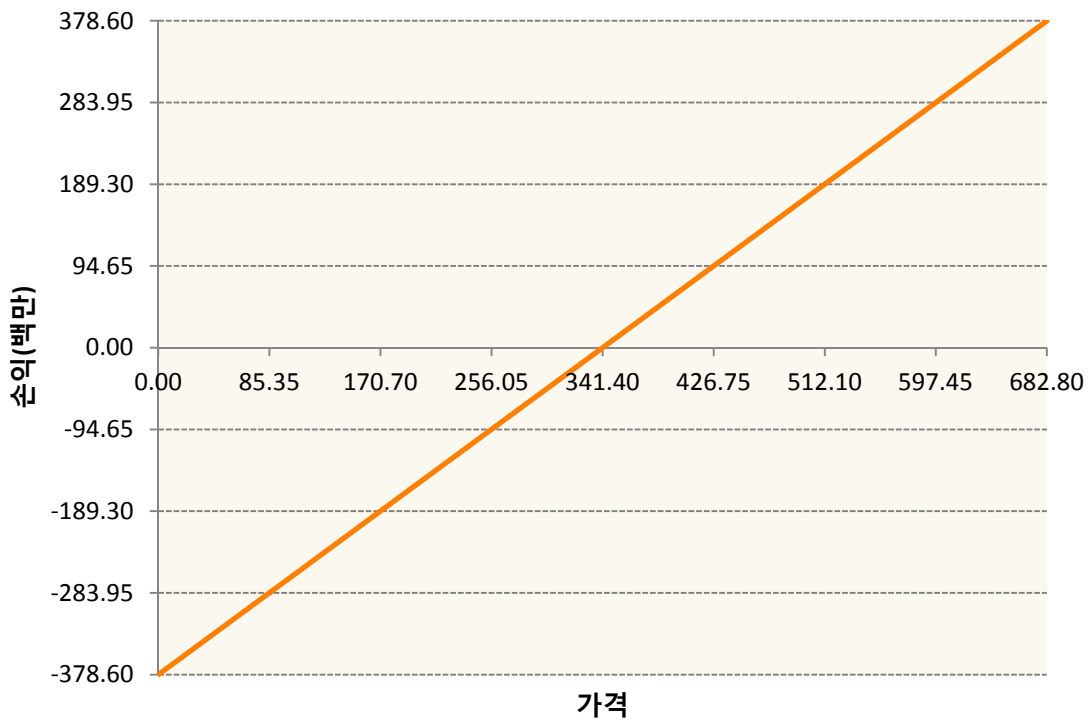
KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

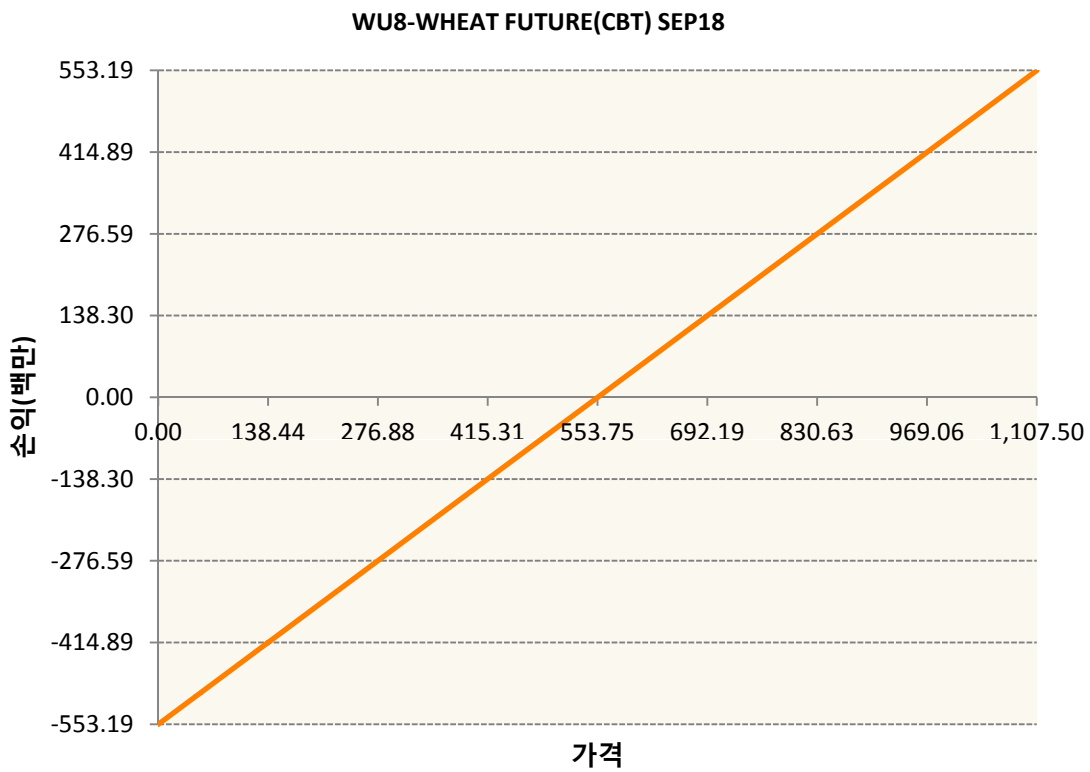
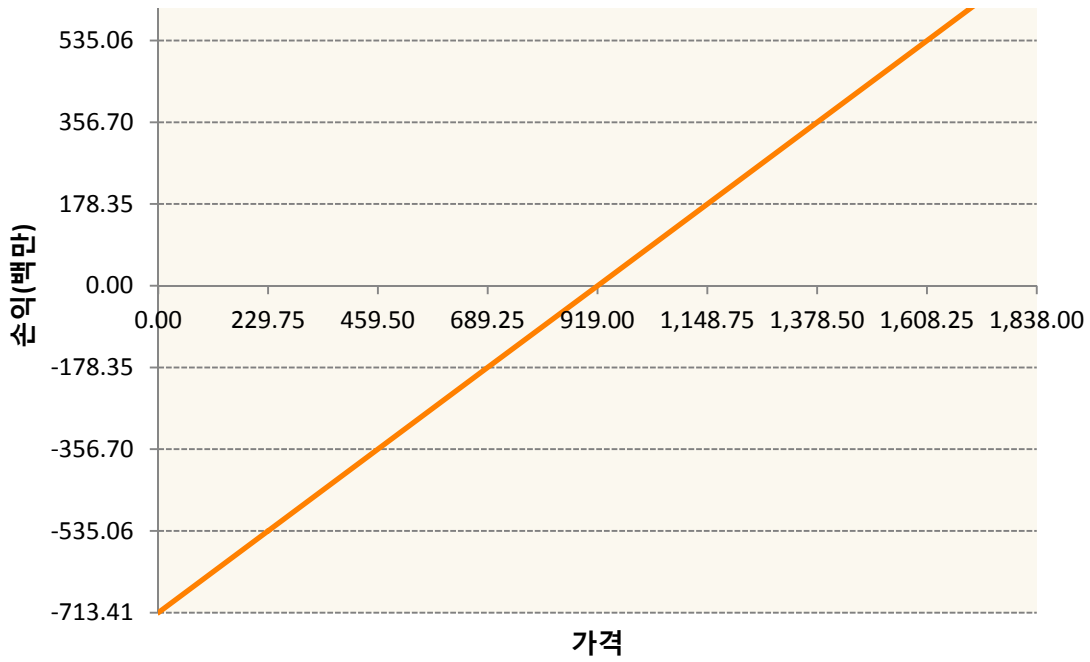


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	23
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	16
CU8	CORN FUTURE SEP18	66
KCU8	COFFEE 'C' FUTURE SEP18	22
KR4175N80C	2018-08 달러선물	6

KWU8	KC HRW WHEAT FUT SEP18	17
SBV8	SUGAR #11 (WORLD) OCT18	25
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	30
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	57
WU8	WHEAT FUTURE(CBT) SEP18	44

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

(단위:백만원)

318