

공시일	2018-08-03
기준일	2018-08-02

## 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



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

(단위:백만원)

67

공시일	2018-08-03
기준일	2018-08-02

## 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)

480

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-03
기준일	2018-08-02

## 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

309

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

374

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-03
기준일	2018-08-02

## 유로인덱스모(주식-파생형)

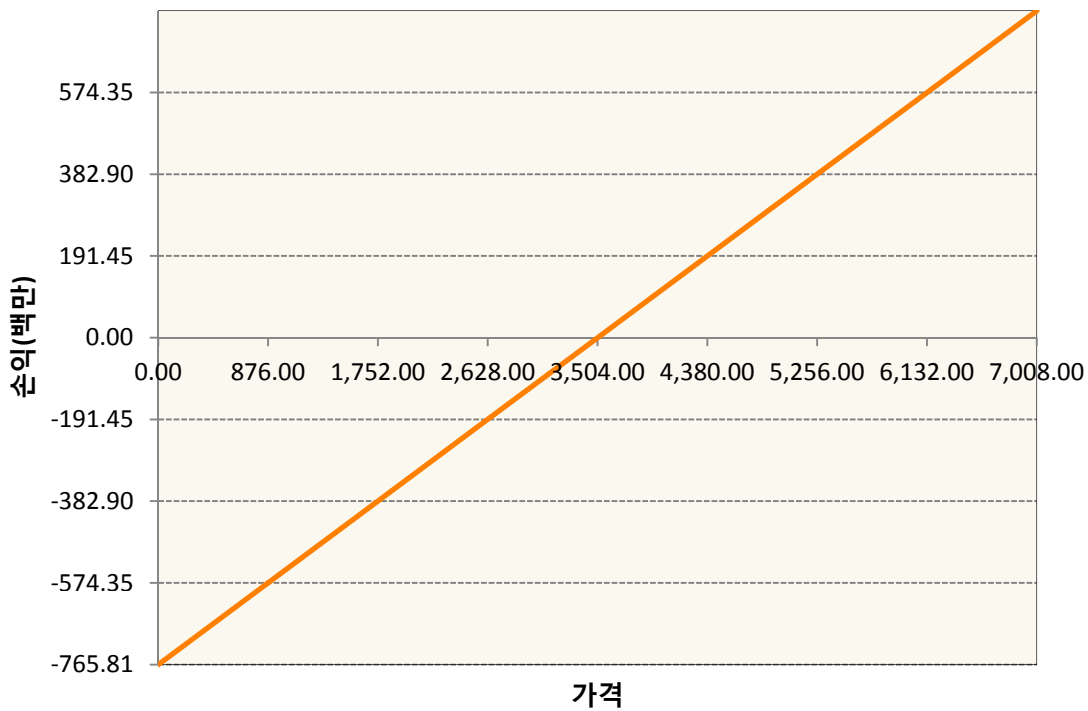
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

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

### 2. 만기시점의 손익구조

VGU8-EURO STOXXX 50 SEP18



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

38
----

공시일	2018-08-03
기준일	2018-08-02

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

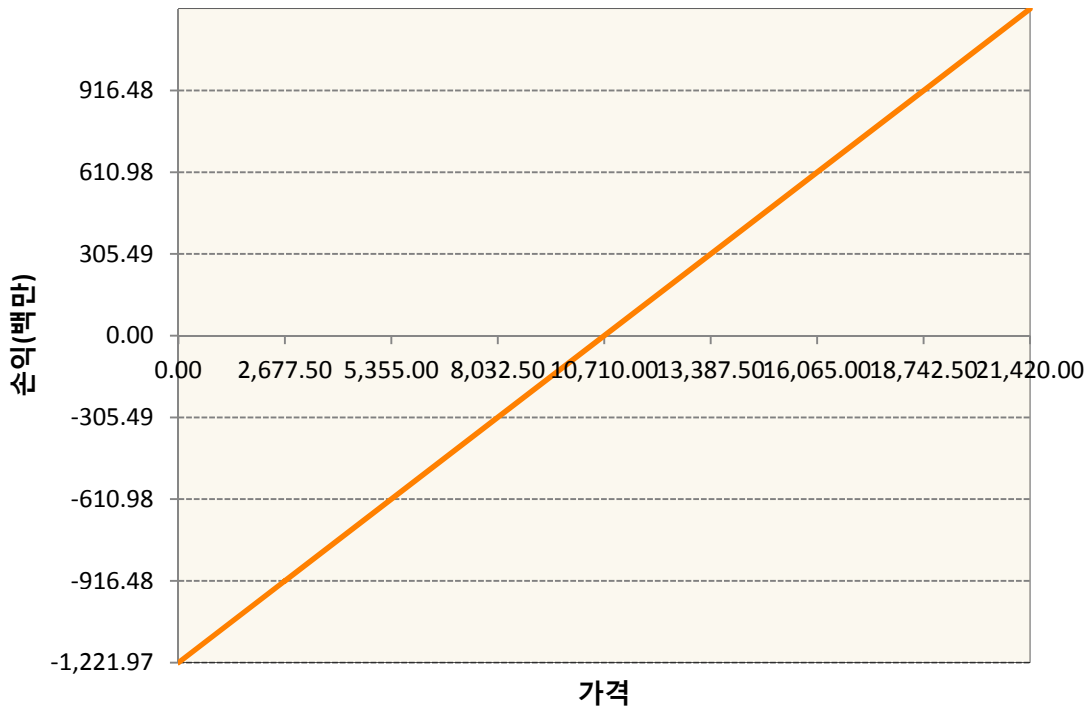
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

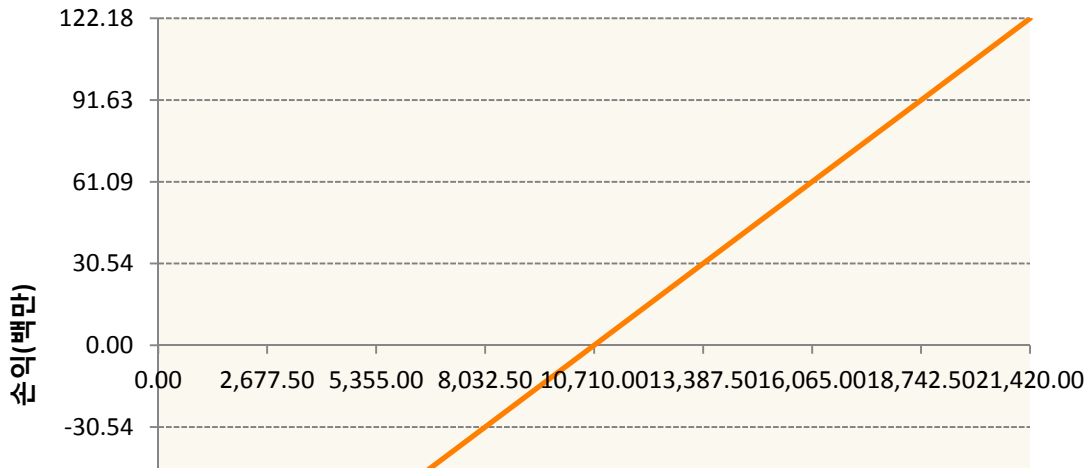
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,344	0	1,344	장내

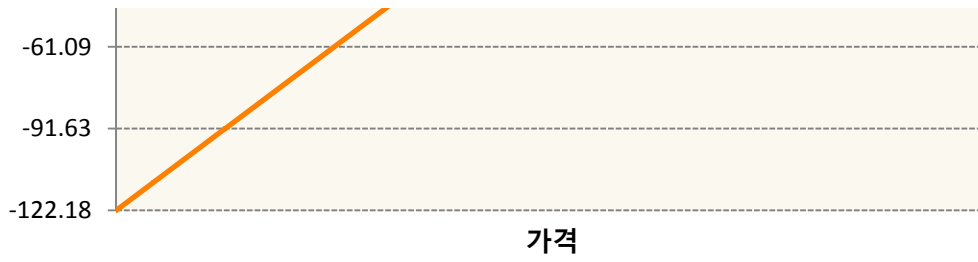
### 2. 만기시점의 손익구조

HCQ8-HSCEI Futures Aug18



MHCQ8-MINI H-SHR IDX FU Aug18





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

HCQ8	HSCEI Futures Aug18	98
MHCQ8	MINI H-SHR IDX FU Aug18	10

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

<b>97</b>
-----------

공시일	2018-08-03
기준일	2018-08-02

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

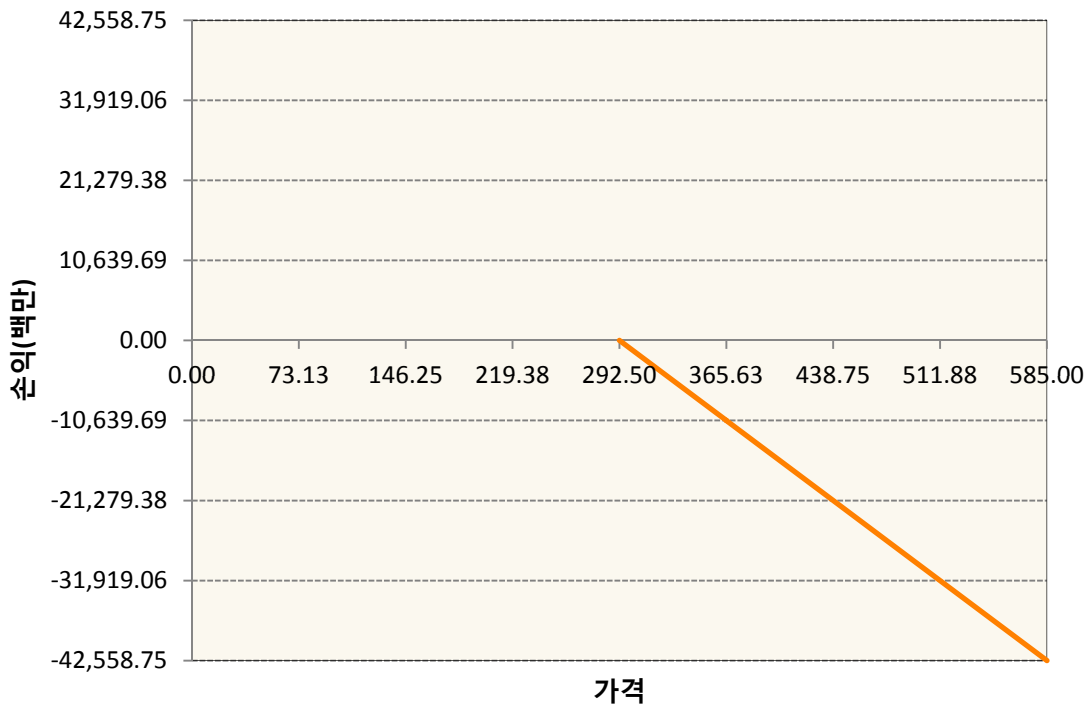
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

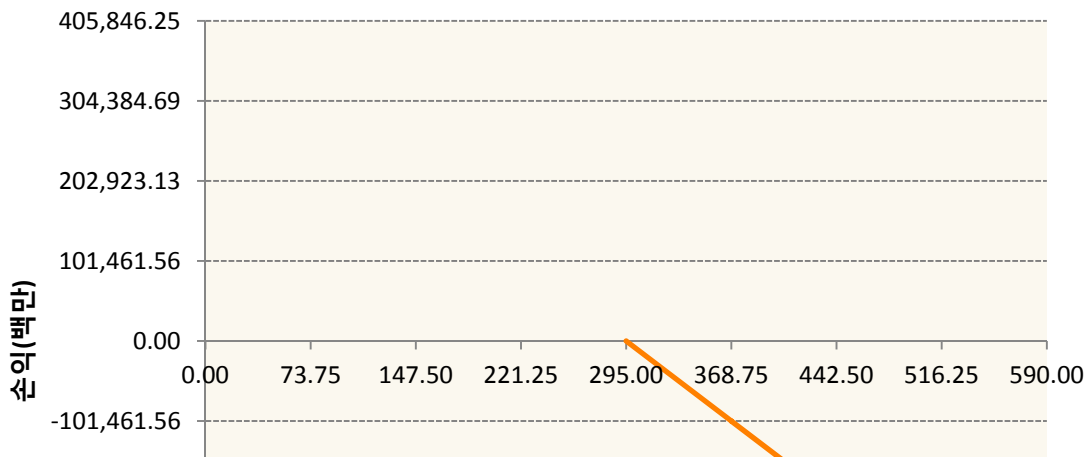
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	1,860	-1,860	장내
누계	유가증권	옵션	0	727,405	-727,405	장내

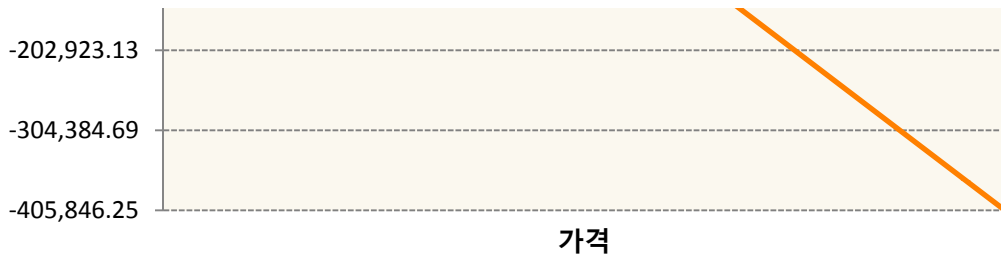
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201N82928-2018-08 콜292.5**

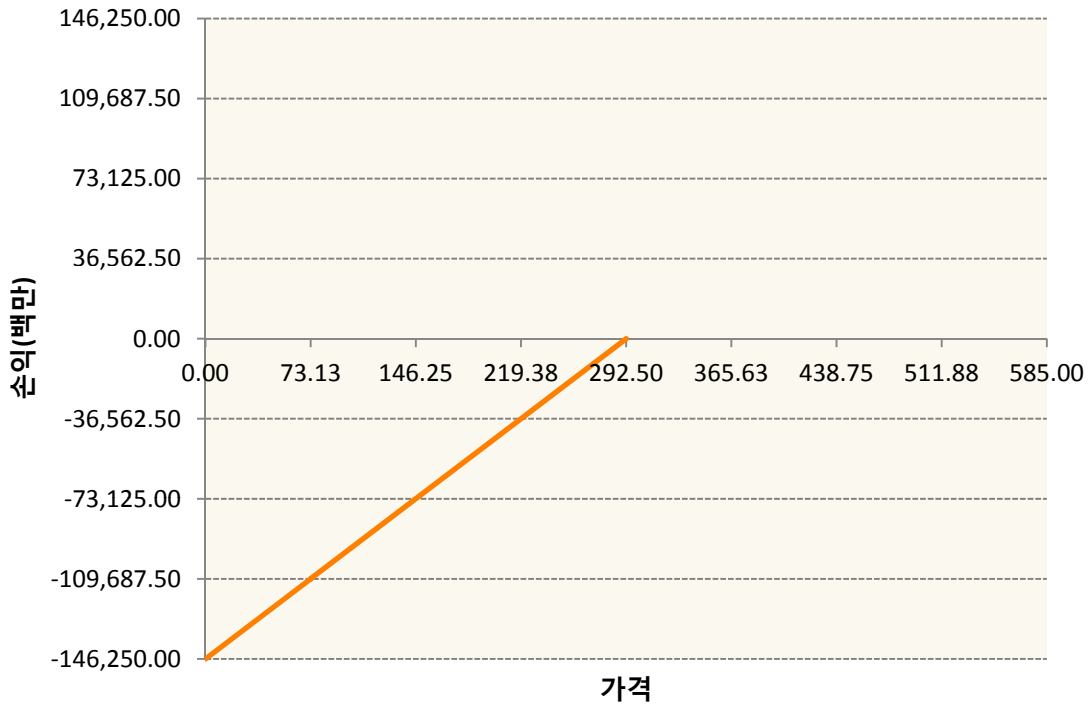


**KR4201N82951-2018-08 콜295**

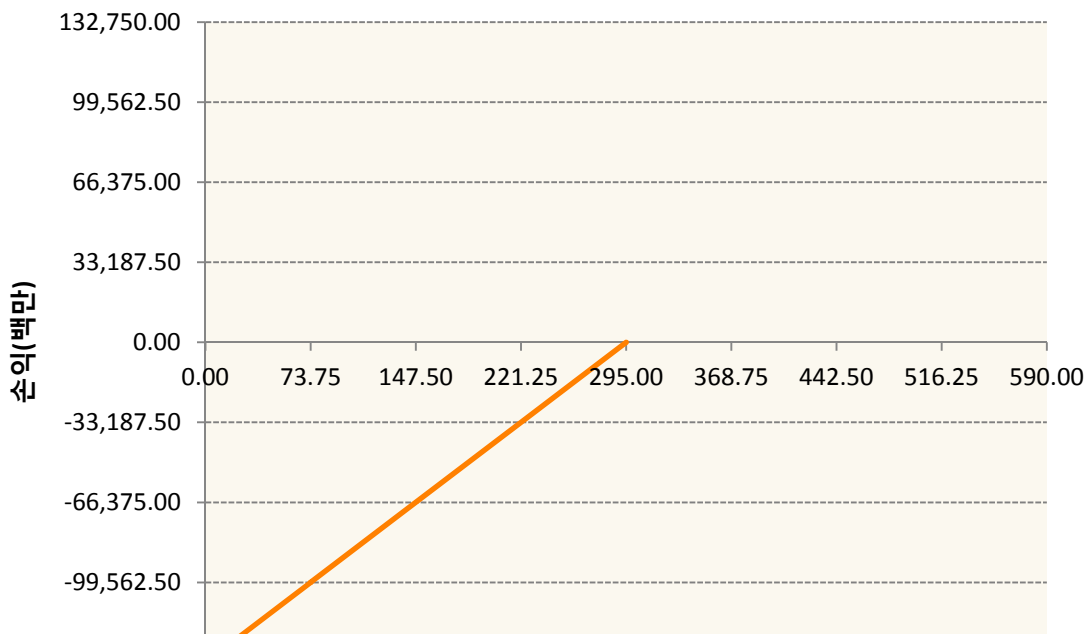




**KR4301N82926-2018-08 풋292.5**



**KR4301N82959-2018-08 풋295**



-132,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N829 2018-08 콜292.5 2,874

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	734	732	729	723	716	706	694
-5.33%	716	703	686	666	642	616	587
-2.67%	591	551	509	464	419	372	325
0%	163	109	54	0	-54	-109	-164
2.67%	-653	-687	-725	-765	-807	-851	-896
5.33%	-1,706	-1,717	-1,732	-1,750	-1,772	-1,797	-1,824
8.00%	-2,833	-2,834	-2,838	-2,843	-2,851	-2,861	-2,874

KR4201N829 2018-08 콜295 25,608

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,276	5,268	5,251	5,222	5,178	5,114	5,031
-5.33%	5,198	5,123	5,017	4,880	4,713	4,517	4,294
-2.67%	4,494	4,197	3,870	3,518	3,145	2,754	2,349
0%	1,541	1,029	515	0	-516	-1,032	-1,548
2.67%	-5,065	-5,477	-5,909	-6,354	-6,811	-7,278	-7,752
5.33%	-14,502	-14,665	-14,868	-15,106	-15,375	-15,672	-15,993
8.00%	-25,027	-25,061	-25,117	-25,198	-25,307	-25,444	-25,608

KR4301N829 2018-08 풋292.5 10,395

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10,395	-10,395	-10,395	-10,395	-10,395	-10,395	-10,395
-5.33%	-6,483	-6,483	-6,483	-6,485	-6,487	-6,491	-6,496
-2.67%	-2,604	-2,628	-2,657	-2,692	-2,733	-2,778	-2,828
0%	259	173	87	0	-87	-174	-262
2.67%	815	804	789	768	742	711	675
5.33%	825	825	825	824	823	820	817
8.00%	825	825	825	825	825	825	825

KR4301N829 2018-08 풋295 9,896

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,896	-9,896	-9,896	-9,896	-9,896	-9,896	-9,896
-5.33%	-6,375	-6,375	-6,375	-6,375	-6,376	-6,377	-6,379
-2.67%	-2,859	-2,866	-2,877	-2,891	-2,910	-2,934	-2,961
0%	229	153	77	0	-77	-155	-233
2.67%	1,280	1,253	1,220	1,182	1,139	1,091	1,041

5.33%	1,326	1,326	1,325	1,323	1,319	1,313	1,304
8.00%	1,327	1,327	1,327	1,326	1,326	1,326	1,326

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

(단위:백만원)

**57,754**

공시일	2018-08-03
기준일	2018-08-02

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

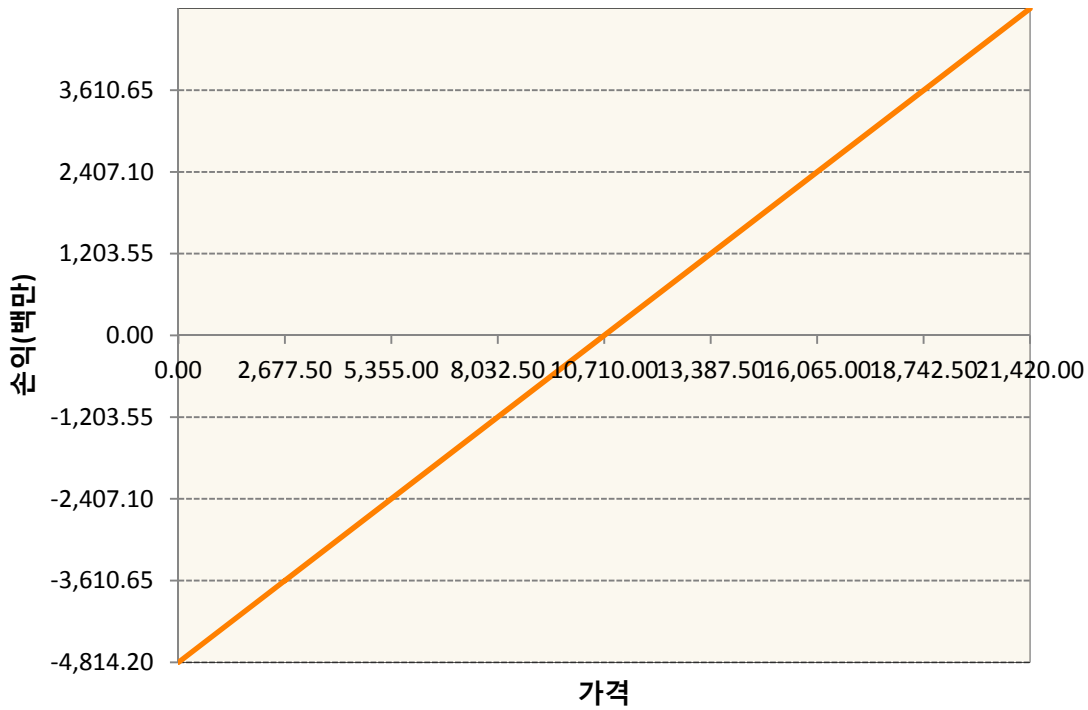
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

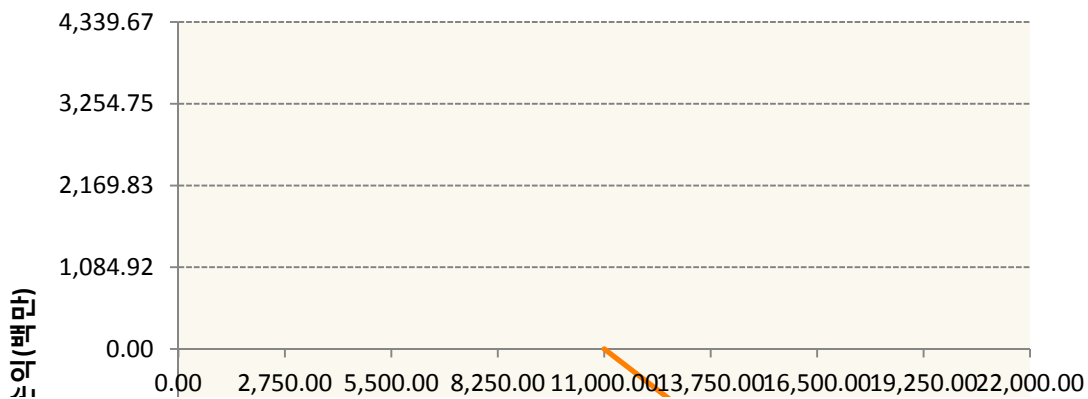
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,814	0	4,814	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,250	-11,250	장내

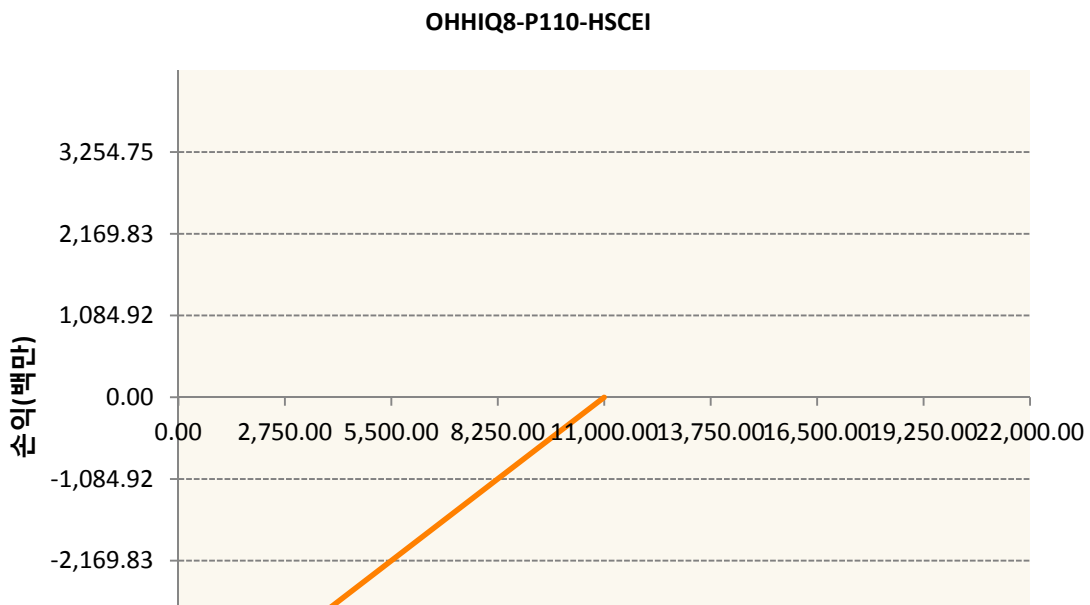
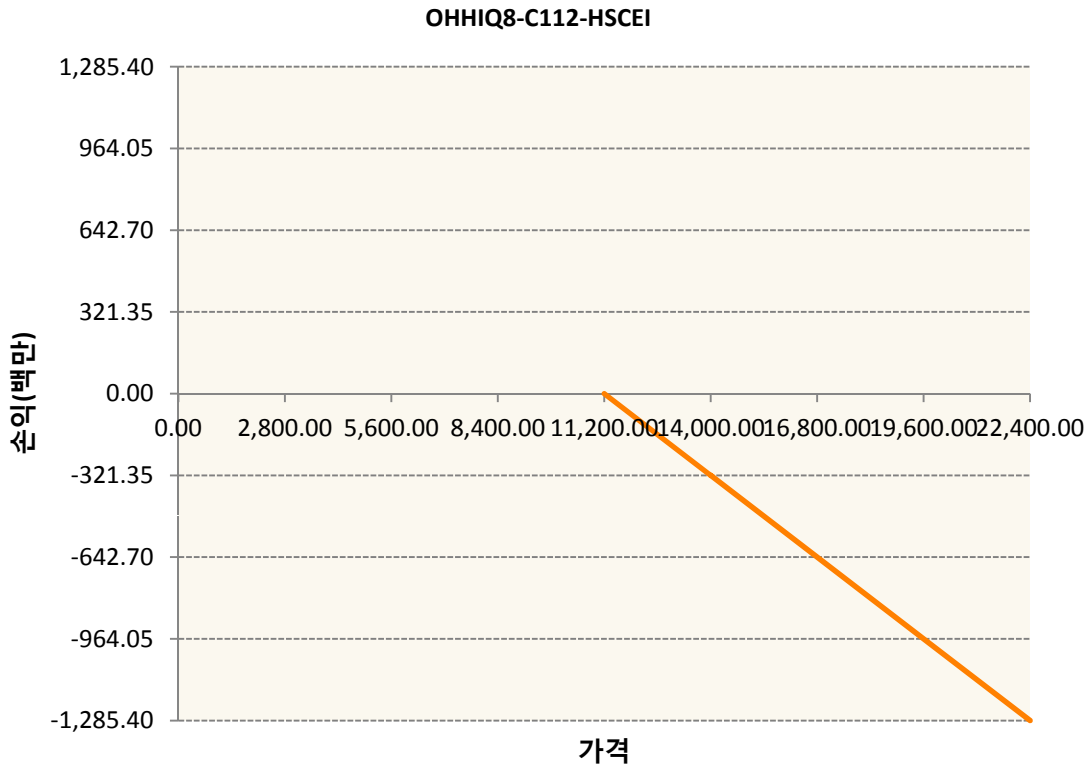
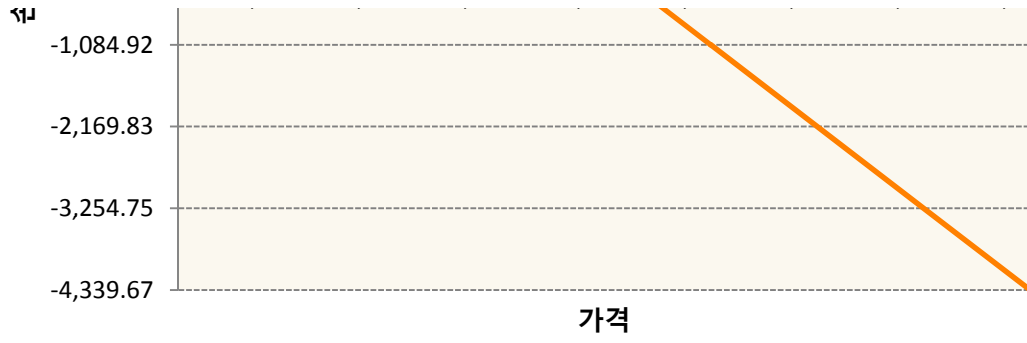
### 2. 만기시점의 손익구조

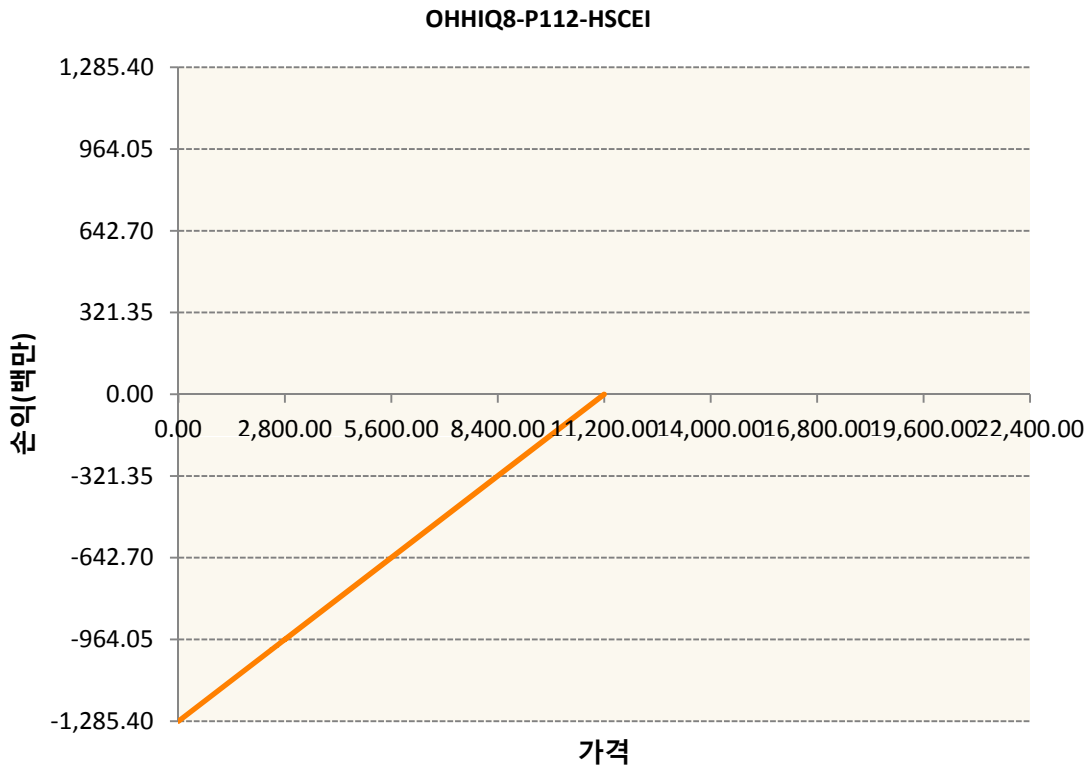
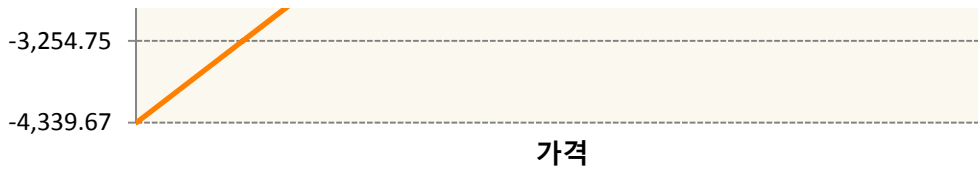
HCQ8-HSCEI Futures Aug18



OHHIQ8-C110-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ8	HSCEI Futures Aug18	385
OHHIQ8-C1	HSCEI	347
OHHIQ8-C1	HSCEI	103
OHHIQ8-P11	HSCEI	347
OHHIQ8-P11	HSCEI	103

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	<b>1,165</b>

공시일	2018-08-03
기준일	2018-08-02

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

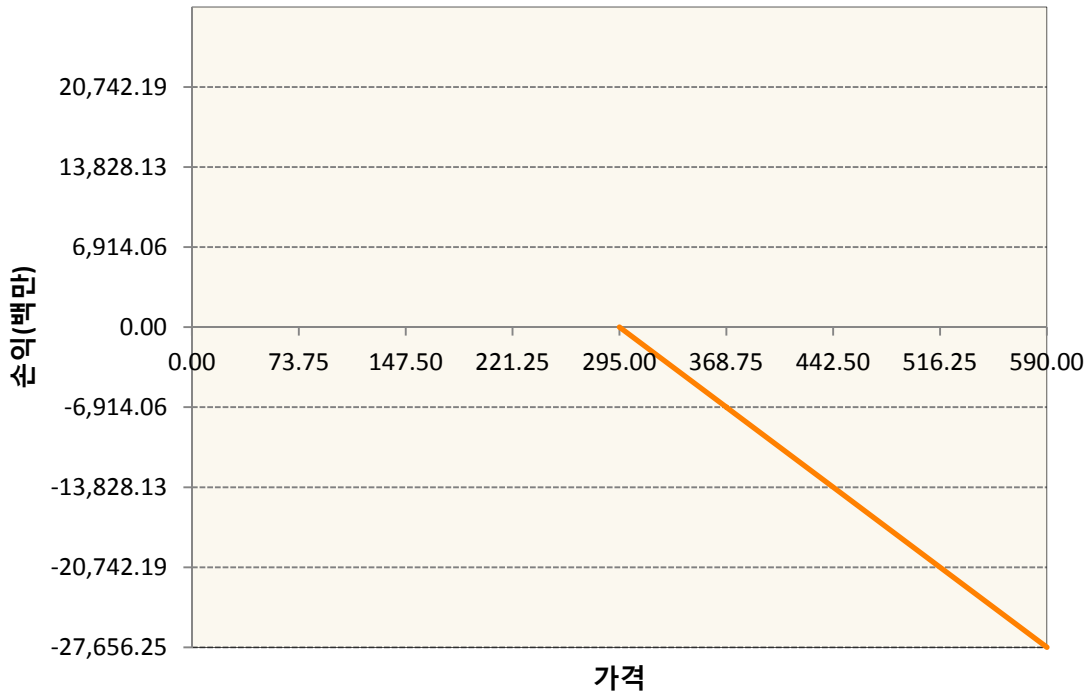
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

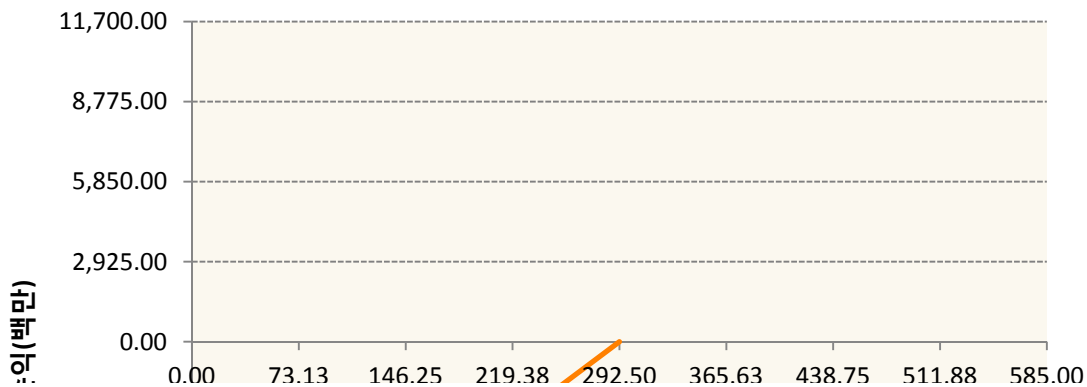
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	3,000	0	3,000	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	48,575	-48,575	장내

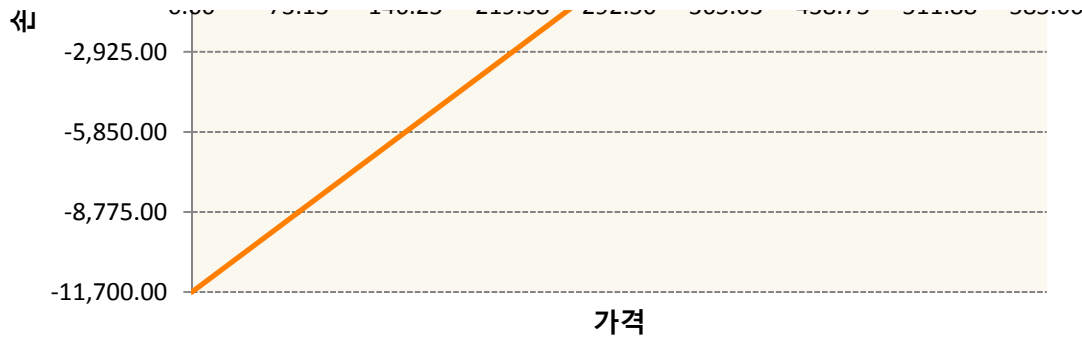
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N82951-2018-08 콜295

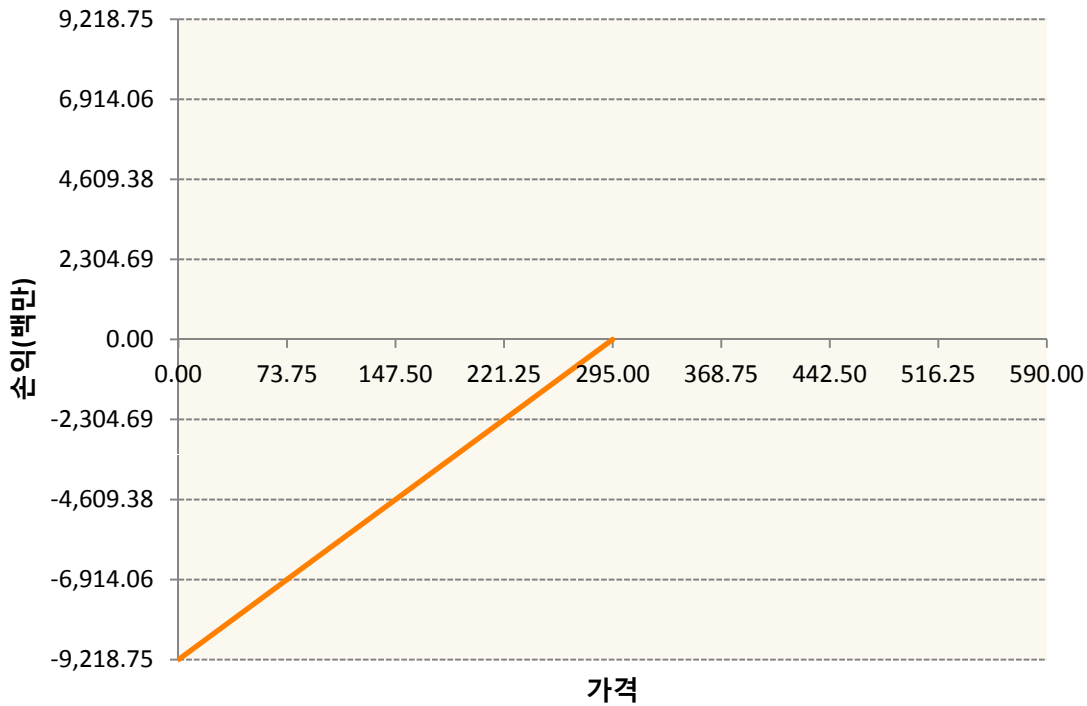


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





KR4301N82959-2018-08 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_2							1,501
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,501	-1,501	-1,501	-1,501	-1,501	-1,501	-1,501
-5.33%	-1,001	-1,001	-1,001	-1,001	-1,001	-1,001	-1,001
-2.67%	-500	-500	-500	-500	-500	-500	-500
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	500	500	500	500	500	500	500
5.33%	1,001	1,001	1,001	1,001	1,001	1,001	1,001
8.00%	1,501	1,501	1,501	1,501	1,501	1,501	1,501
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

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX\_13 243

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-243	-243	-243	-243	-243	-243	-243
-5.33%	-162	-162	-162	-162	-162	-162	-162
-2.67%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	81	81	81	81	81	81	81
5.33%	162	162	162	162	162	162	162
8.00%	243	243	243	243	243	243	243

KR4201N829 2018-08 콜295 1,745

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	360	359	358	356	353	349	343
-5.33%	354	349	342	333	321	308	293
-2.67%	306	286	264	240	214	188	160
0%	105	70	35	0	-35	-70	-105
2.67%	-345	-373	-403	-433	-464	-496	-528
5.33%	-988	-999	-1,013	-1,029	-1,048	-1,068	-1,090
8.00%	-1,705	-1,708	-1,712	-1,717	-1,725	-1,734	-1,745

KR4301N829 2018-08 풋292.5 832

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-832	-832	-832	-832	-832	-832	-832
-5.33%	-519	-519	-519	-519	-519	-519	-520
-2.67%	-208	-210	-213	-215	-219	-222	-226
0%	21	14	7	0	-7	-14	-21
2.67%	65	64	63	61	59	57	54
5.33%	66	66	66	66	66	66	65
8.00%	66	66	66	66	66	66	66

KR4301N829 2018-08 풋295 687

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-687	-687	-687	-687	-687	-687	-687
-5.33%	-443	-443	-443	-443	-443	-443	-443
-2.67%	-199	-199	-200	-201	-202	-204	-206
0%	16	11	5	0	-5	-11	-16
2.67%	89	87	85	82	79	76	72
5.33%	92	92	92	92	92	91	91
8.00%	92	92	92	92	92	92	92

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

(단위:백만원)

7,803

공시일	2018-08-03
기준일	2018-08-02

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

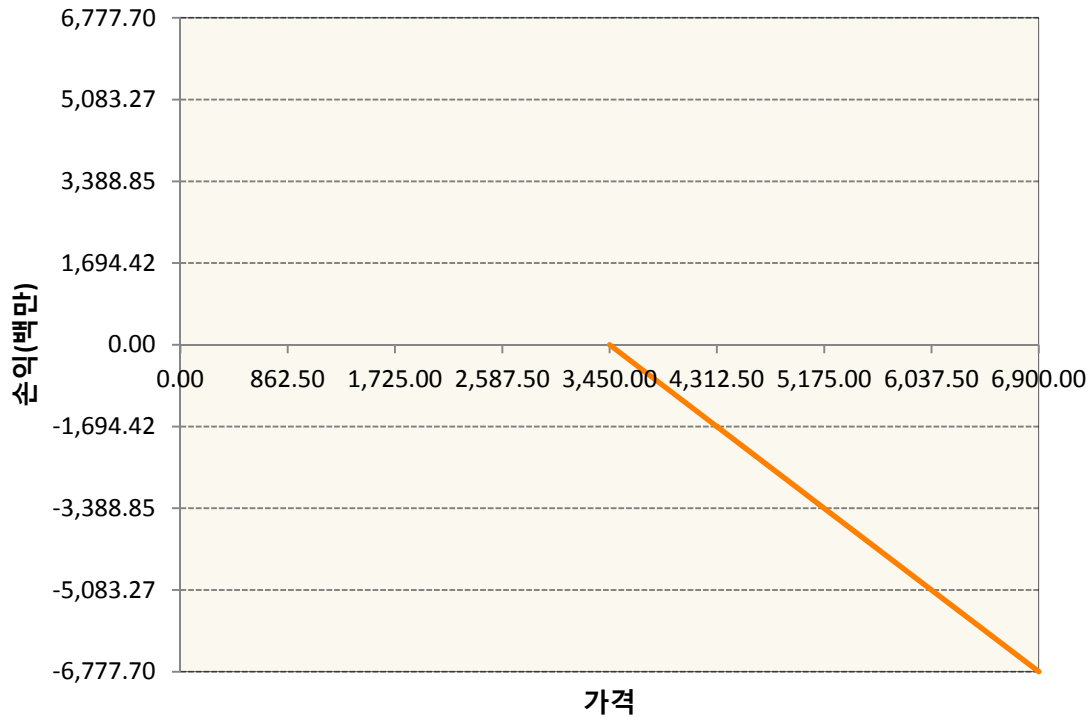
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

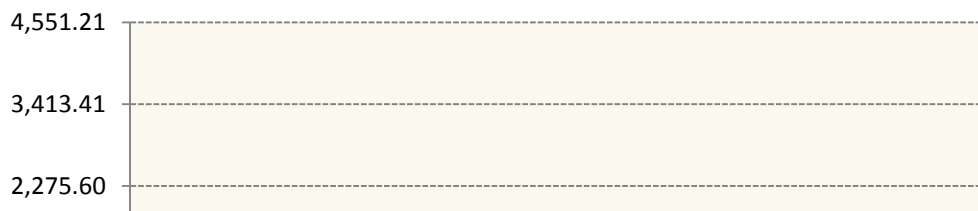
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,990	0	3,990	
누계	유가증권	스왑	45,162	0	45,162	장외
누계	유가증권	옵션	0	18,111	-18,111	장내
누계	지수	스왑	53,171	0	53,171	장외

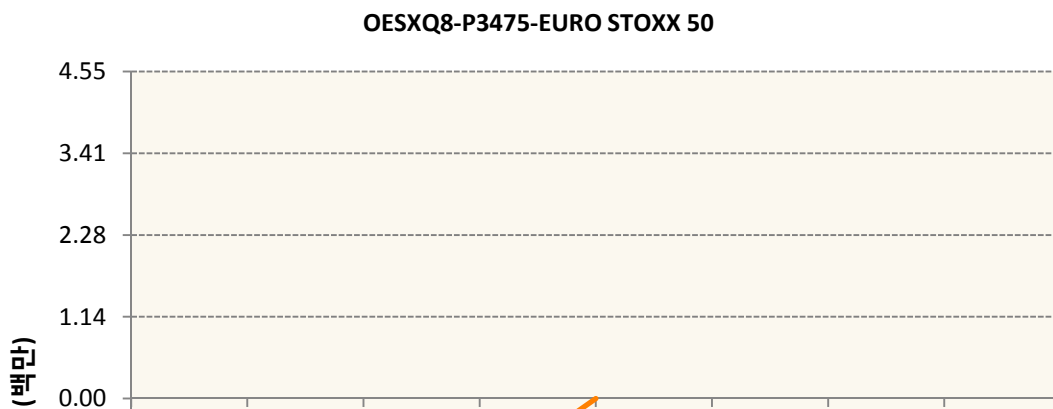
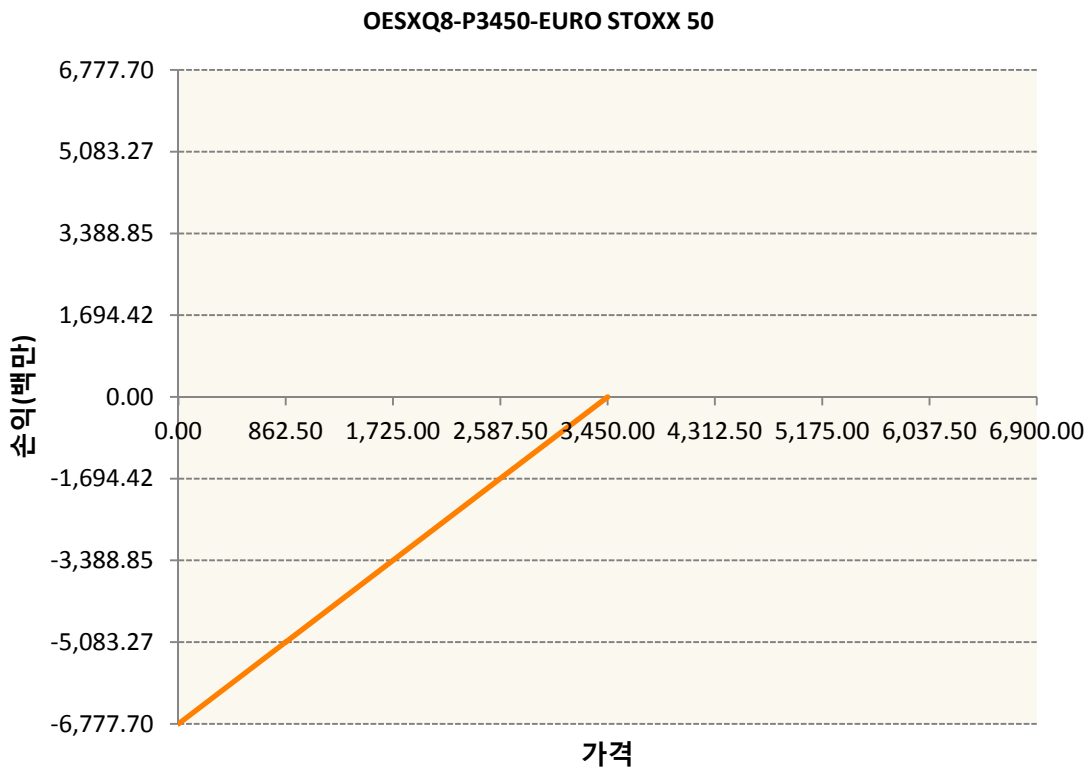
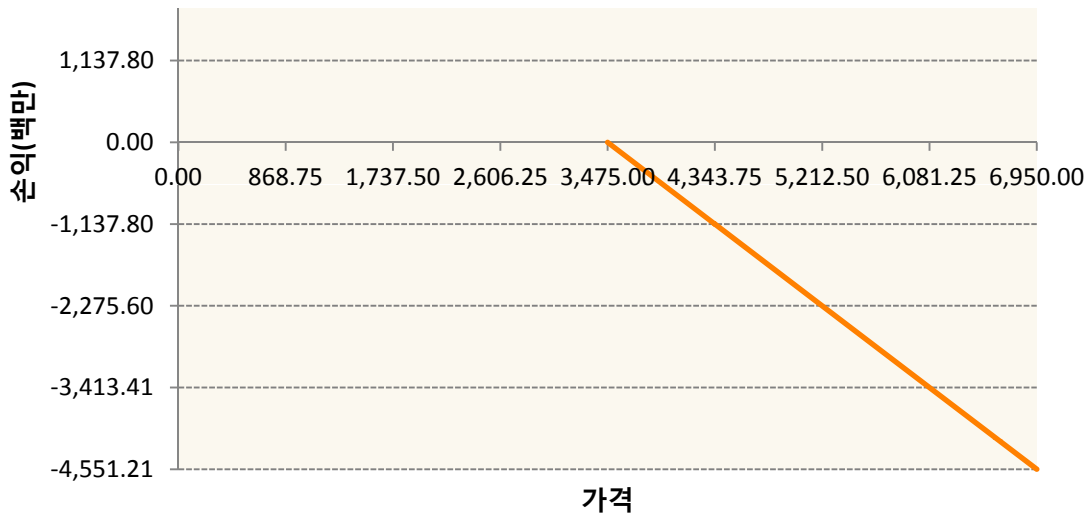
### 2. 만기시점의 손익구조

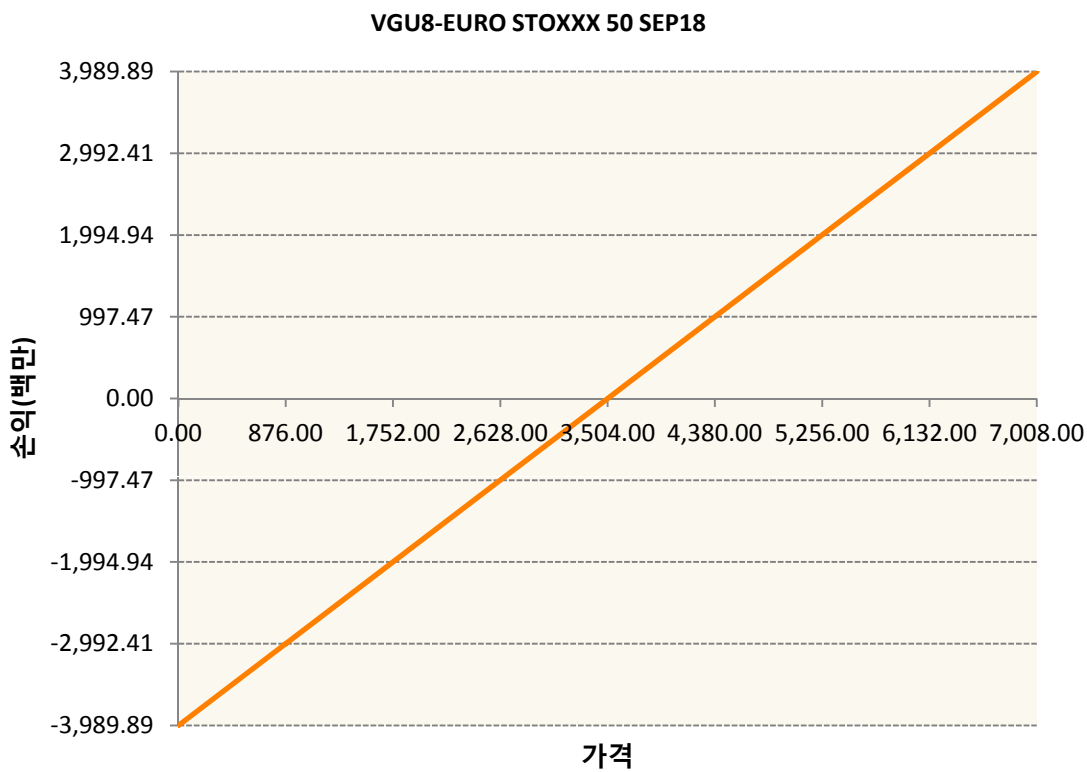
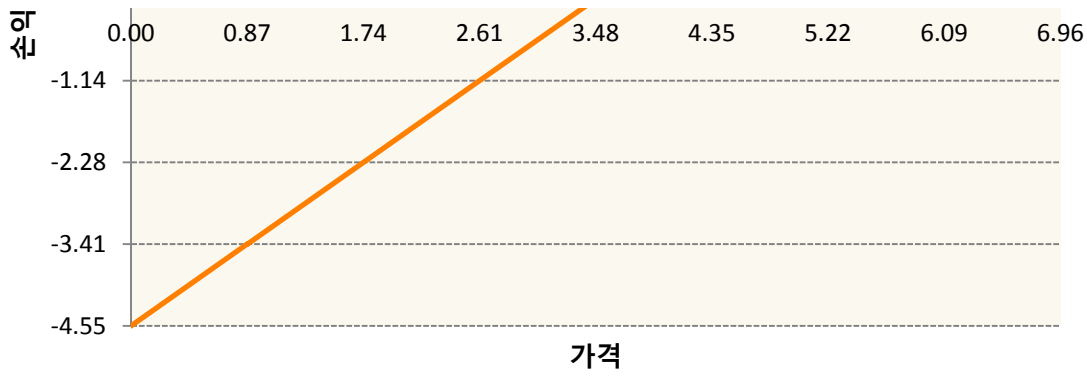
**OESXQ8-C3450-EURO STOXX 50 OPT**



**OESXQ8-C3475-EURO STOXX 50 OPT**







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY -	994.569	36
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		30
OESXQ8-C3 EURO STOXX 50 OPT		542
OESXQ8-C3 EURO STOXX 50 OPT		364
OESXQ8-P3 EURO STOXX 50		542
OESXQ8-P3 EURO STOXX 50		0.4
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18		319

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





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

(단위:백만원)

1,141



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)

165



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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-08-03
기준일	2018-08-02

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

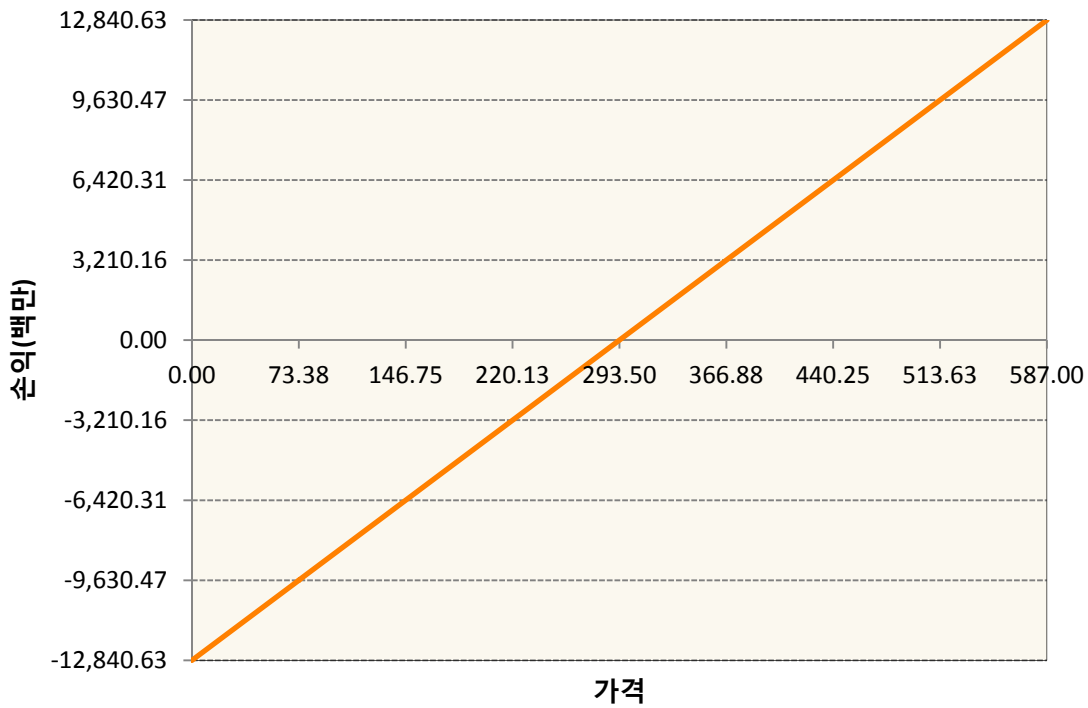
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

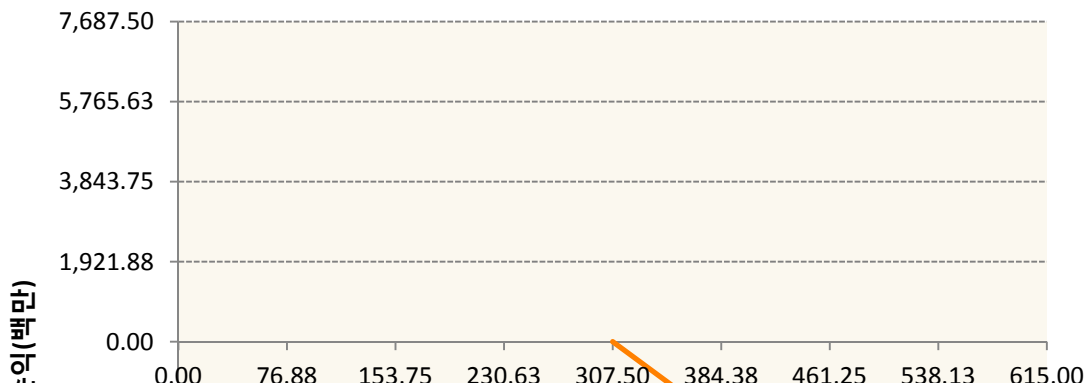
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,841	0	12,841	장내
누계	유가증권	옵션	2,134	23,730	-21,596	장내

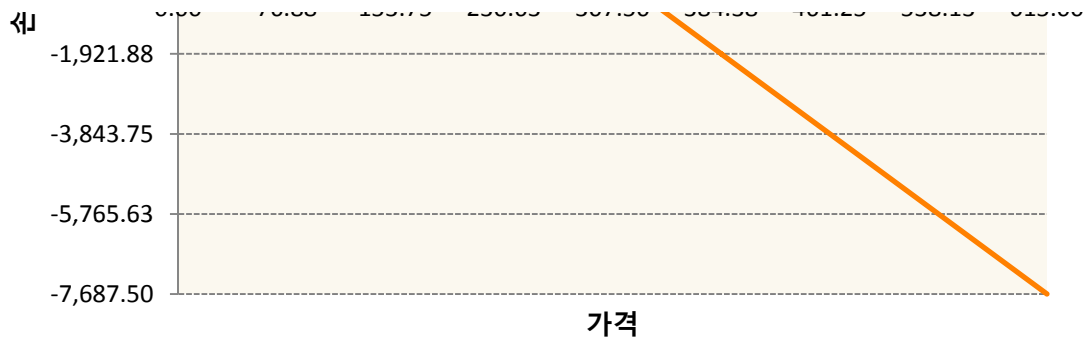
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

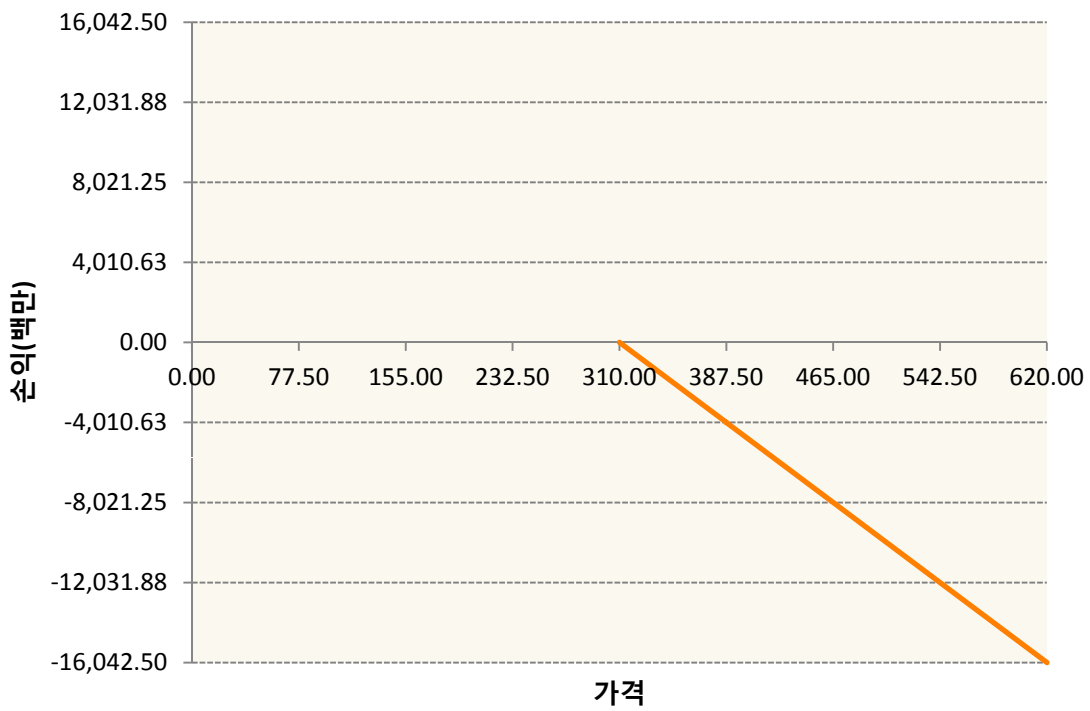


KR4201N83074-2018-08 콜307.5

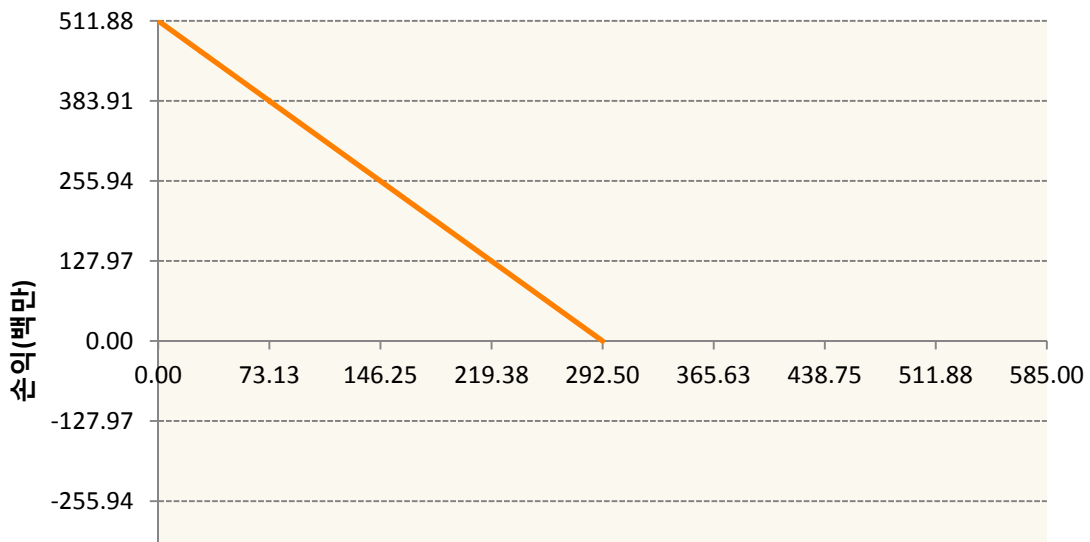


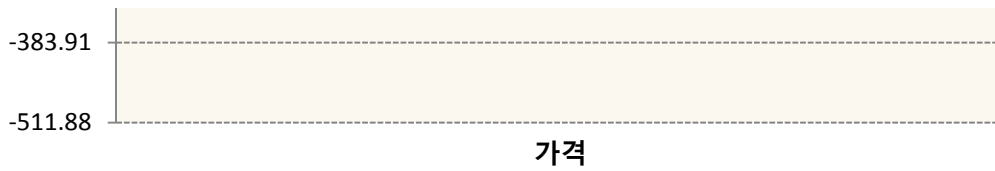


KR4201N83108-2018-08 콜310

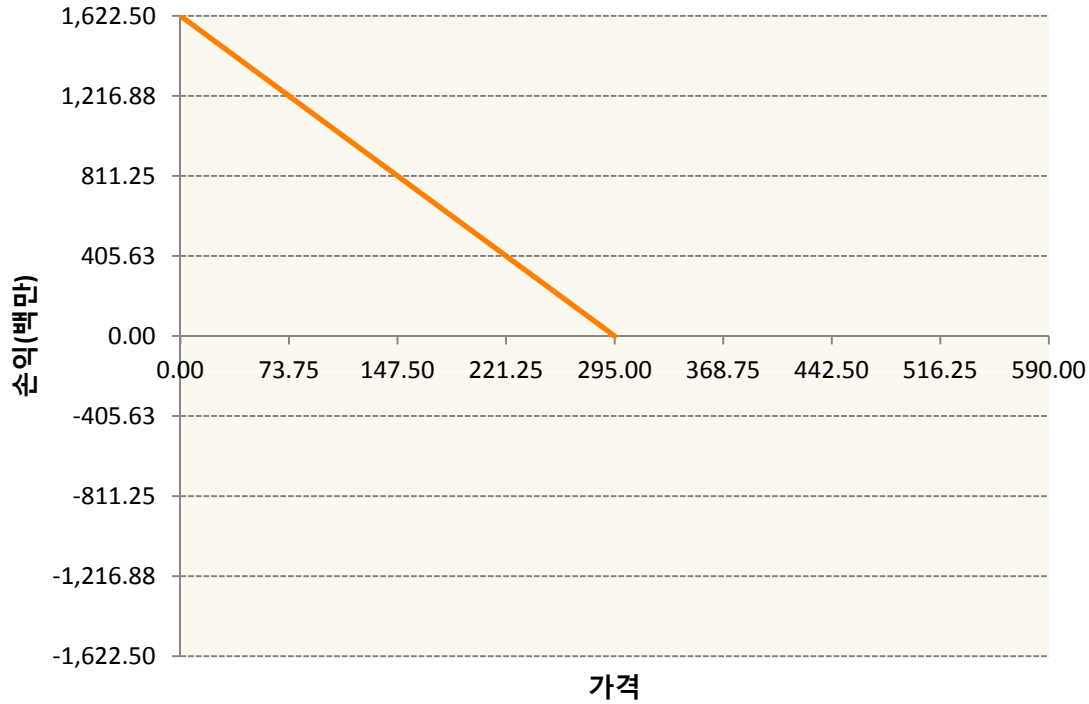


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





KR4301N82959-2018-08 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물 1,027

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,027	-1,027	-1,027	-1,027	-1,027	-1,027	-1,027
-5.33%	-685	-685	-685	-685	-685	-685	-685
-2.67%	-342	-342	-342	-342	-342	-342	-342
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	342	342	342	342	342	342	342
5.33%	685	685	685	685	685	685	685
8.00%	1,027	1,027	1,027	1,027	1,027	1,027	1,027

KR4201N83C 2018-08 콜307.5 282

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	16	16	16	16	16	16	16
-5.33%	16	16	16	16	15	15	14
-2.67%	16	15	14	13	11	9	6

0%	11	8	4	0	-5	-10	-16
2.67%	-16	-23	-32	-40	-49	-57	-66
5.33%	-96	-105	-115	-125	-135	-144	-154
8.00%	-239	-245	-251	-259	-266	-274	-282

KR4201N8312018-08 콜310

505

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	21	21	21	21	21	21	21
-5.33%	21	21	21	21	21	20	19
-2.67%	21	21	19	18	15	12	8
0%	16	12	7	0	-8	-17	-27
2.67%	-18	-32	-46	-61	-77	-93	-110
5.33%	-143	-164	-184	-205	-225	-246	-266
8.00%	-401	-417	-433	-451	-469	-487	-505

KR4301N829 2018-08 풋292.5

36

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	36	36	36	36	36	36	36
-5.33%	23	23	23	23	23	23	23
-2.67%	9	9	9	9	10	10	10
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-2	-2
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3

KR4301N829 2018-08 풋295

121

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	121	121	121	121	121	121	121
-5.33%	78	78	78	78	78	78	78
-2.67%	35	35	35	35	36	36	36
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-16	-15	-15	-14	-14	-13	-13
5.33%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
8.00%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16

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

(단위:백만원)

1,403

공시일	2018-08-03
기준일	2018-08-02

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

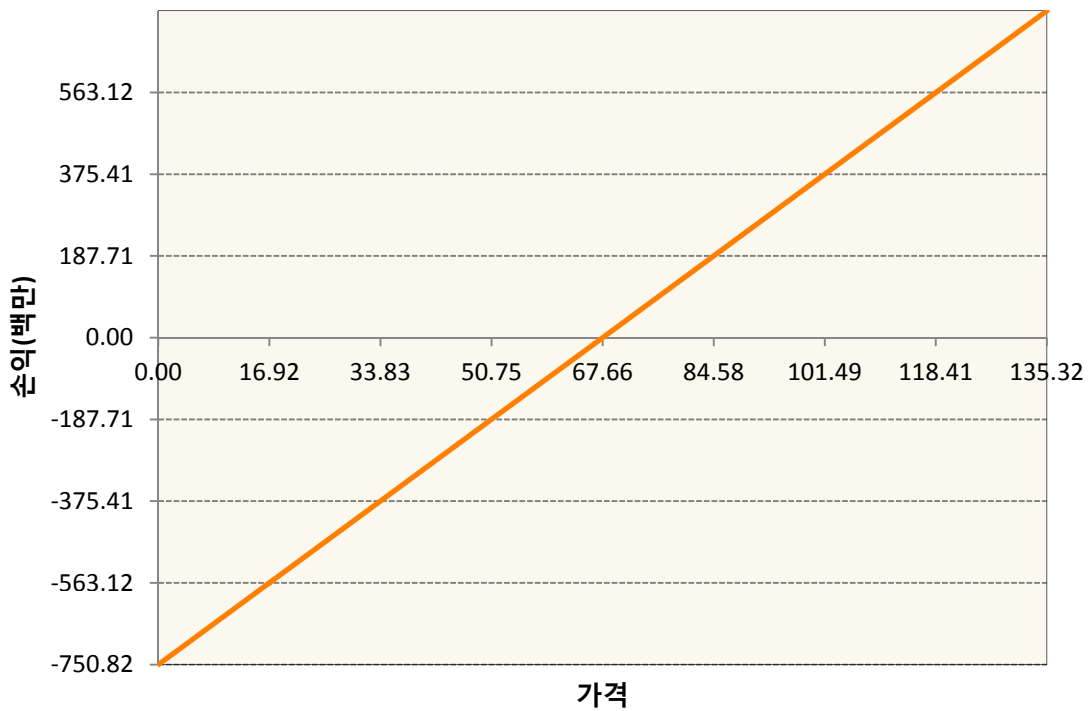
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

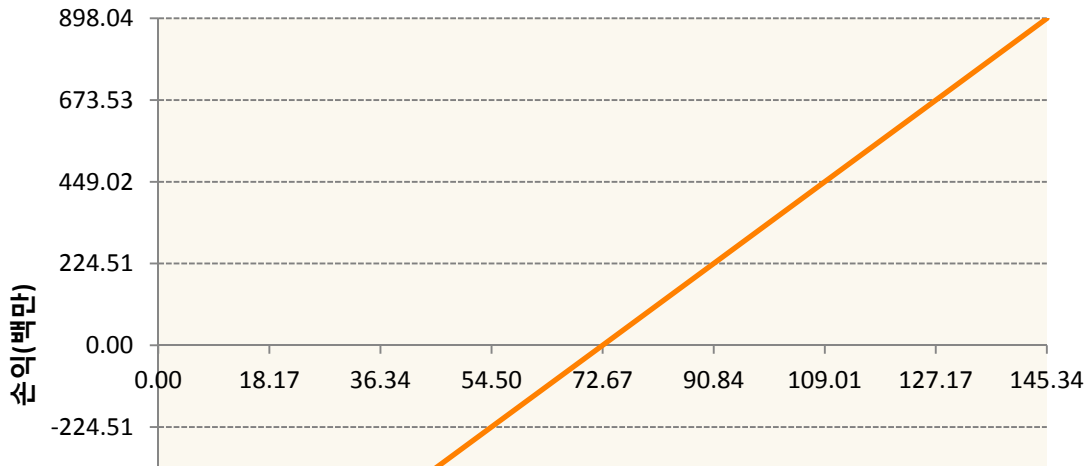
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,591	619	2,973	

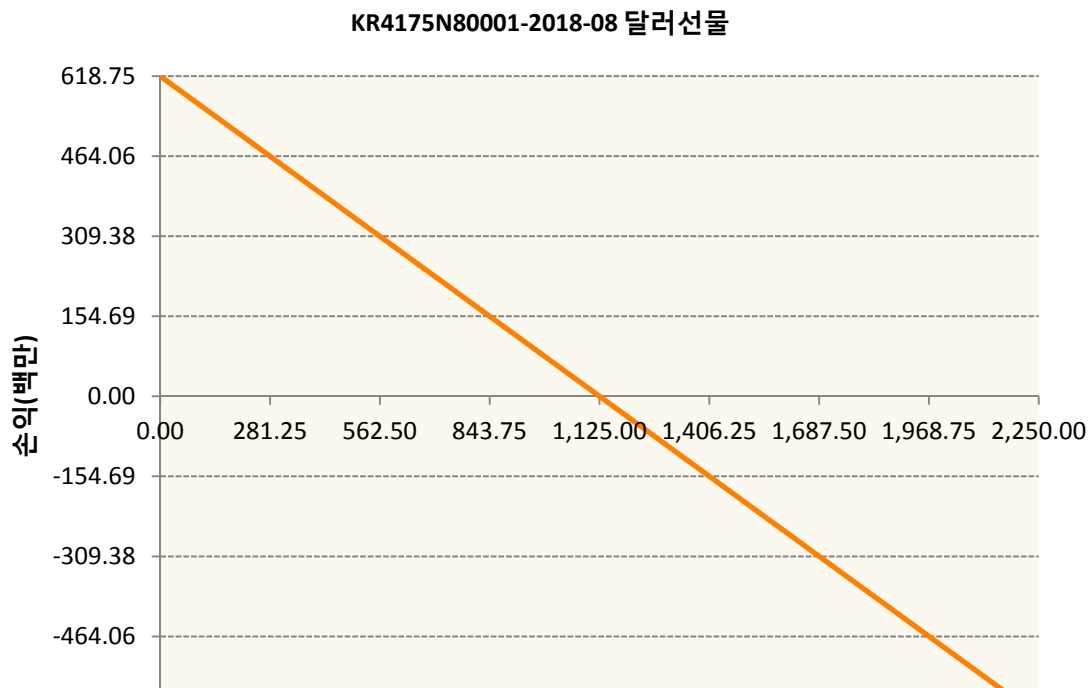
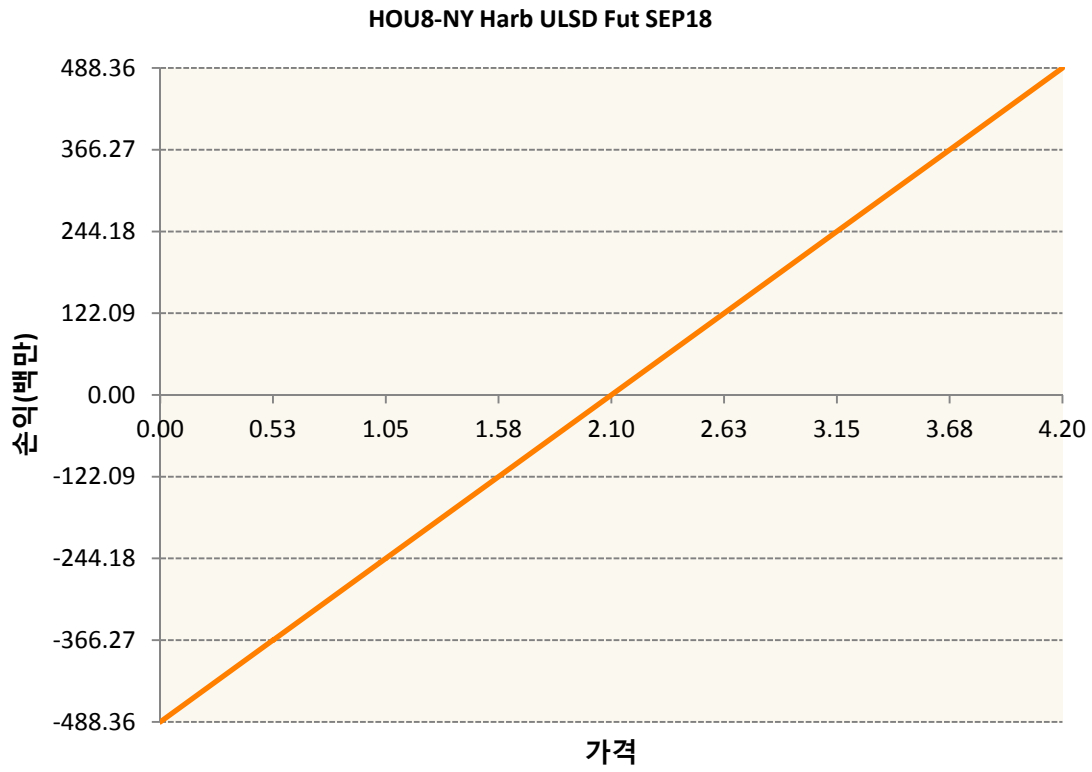
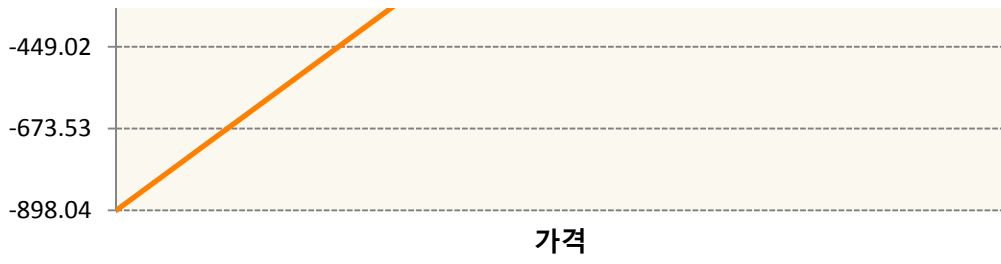
### 2. 만기시점의 손익구조

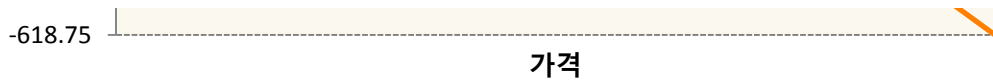
**CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18**



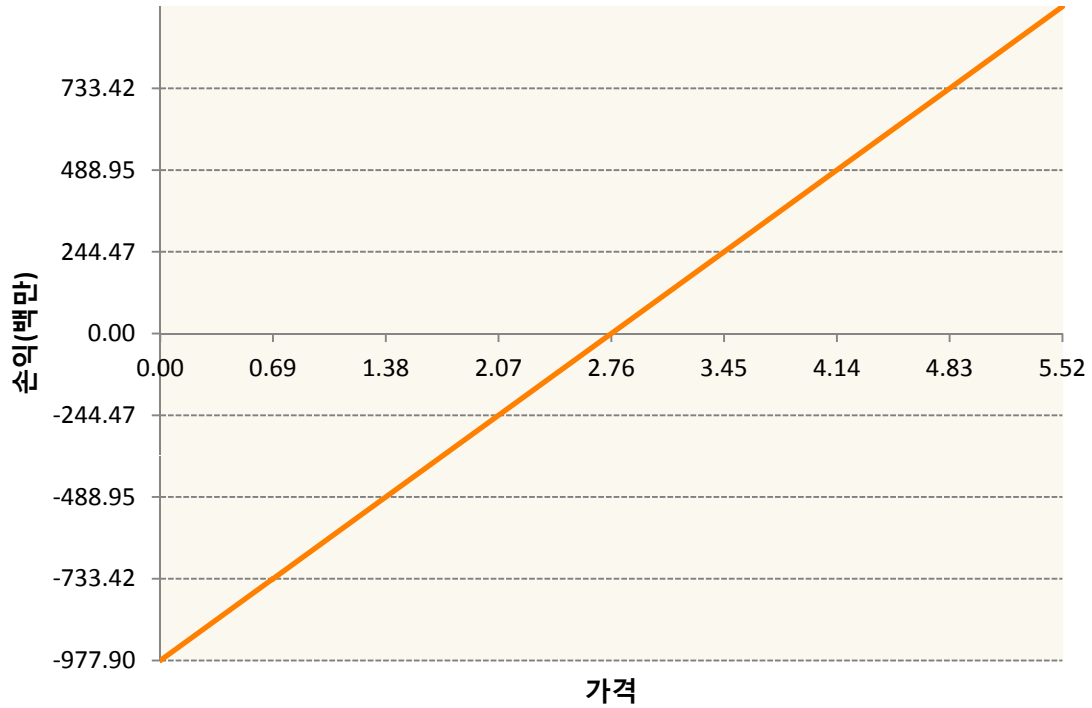
**COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18**



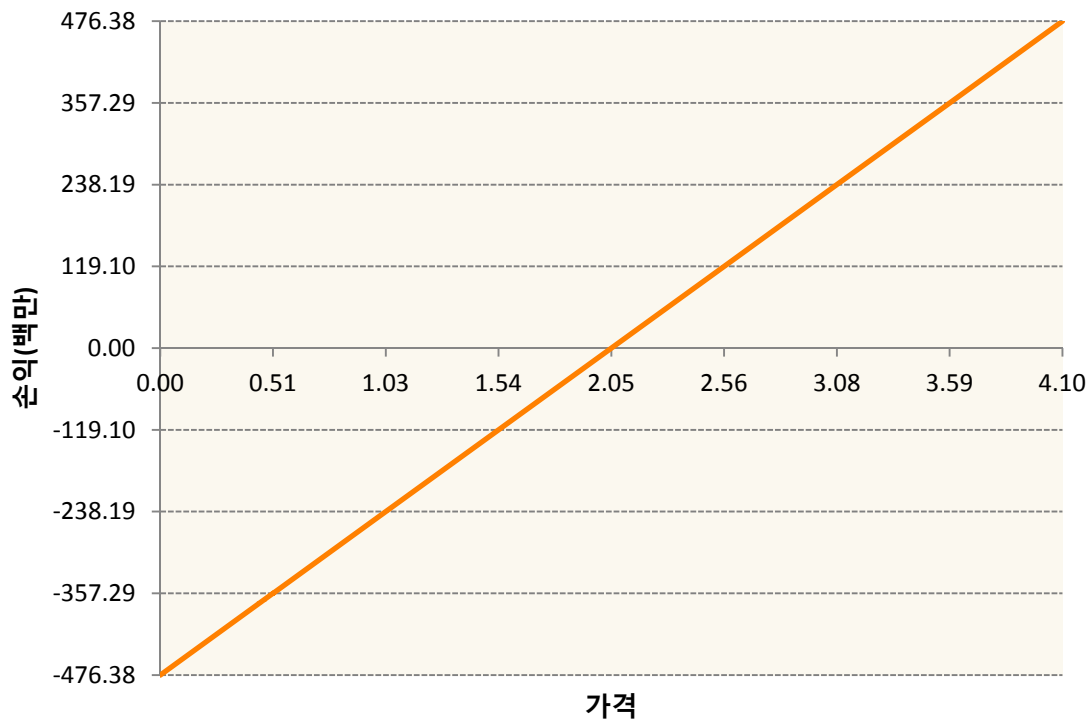




**NGU18-NATURAL GAS FUTR SEP18**



**XBU8-GASOLINE RBOB FUT SEP18**



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

CLU8	WTI CRUDE FUTURE SEP18	60
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	72
HOU8	NY Harb ULSD Fut SEP18	39
KR4175N80C	2018-08 달러선물	50
NGU18	NATURAL GAS FUTR SEP18	78
XBU8	GASOLINE RBOB FUT SEP18	38

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

<b>441</b>
------------

공시일	2018-08-03
기준일	2018-08-02

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

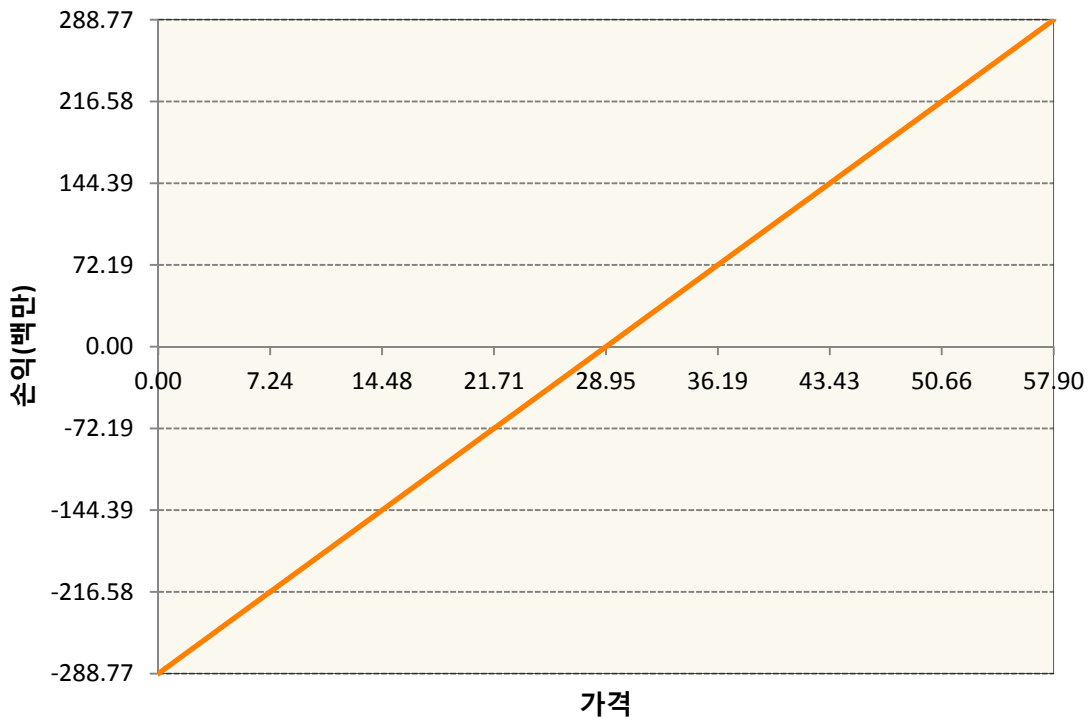
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

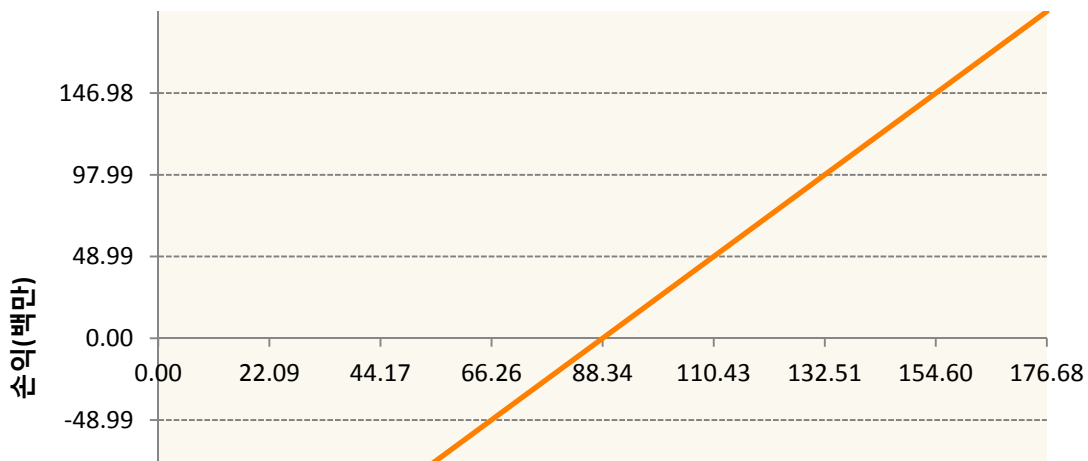
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,724	79	3,646	

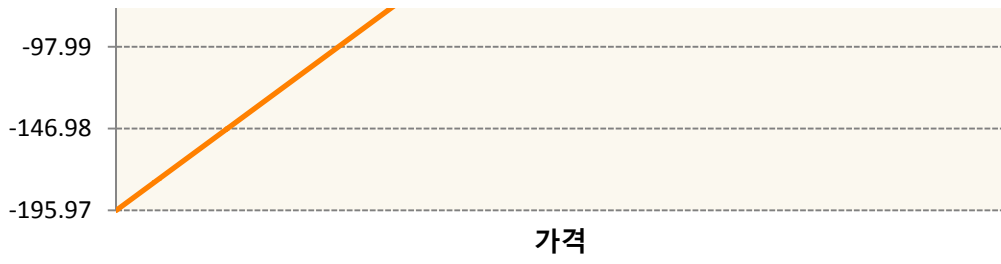
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18**

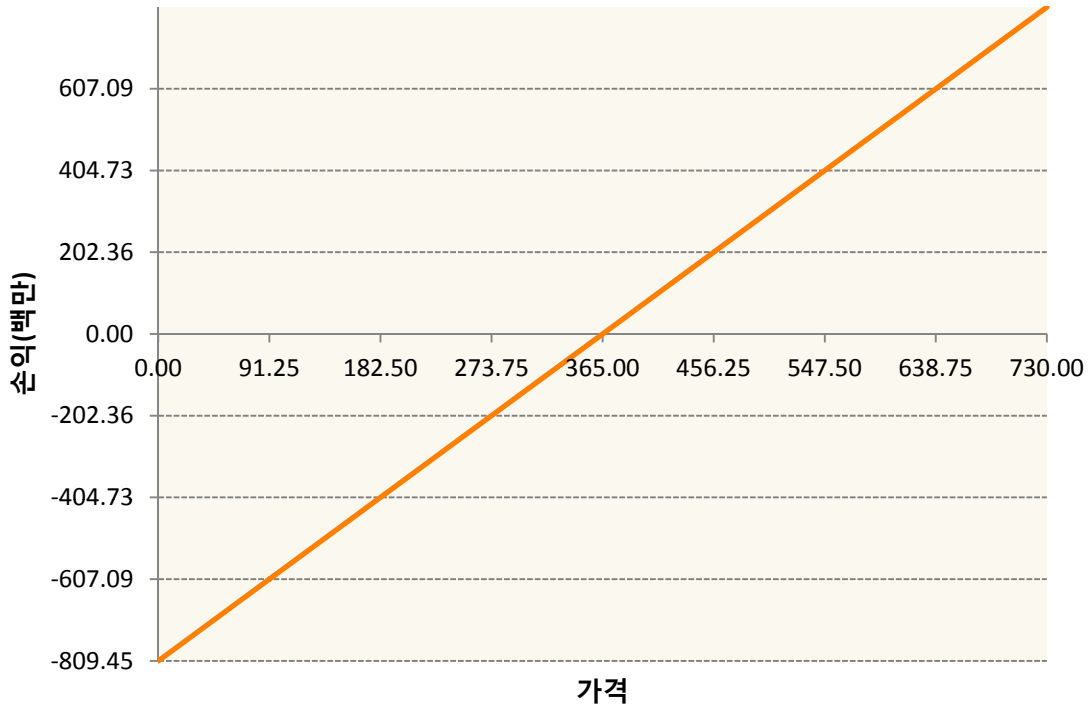


**CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18**

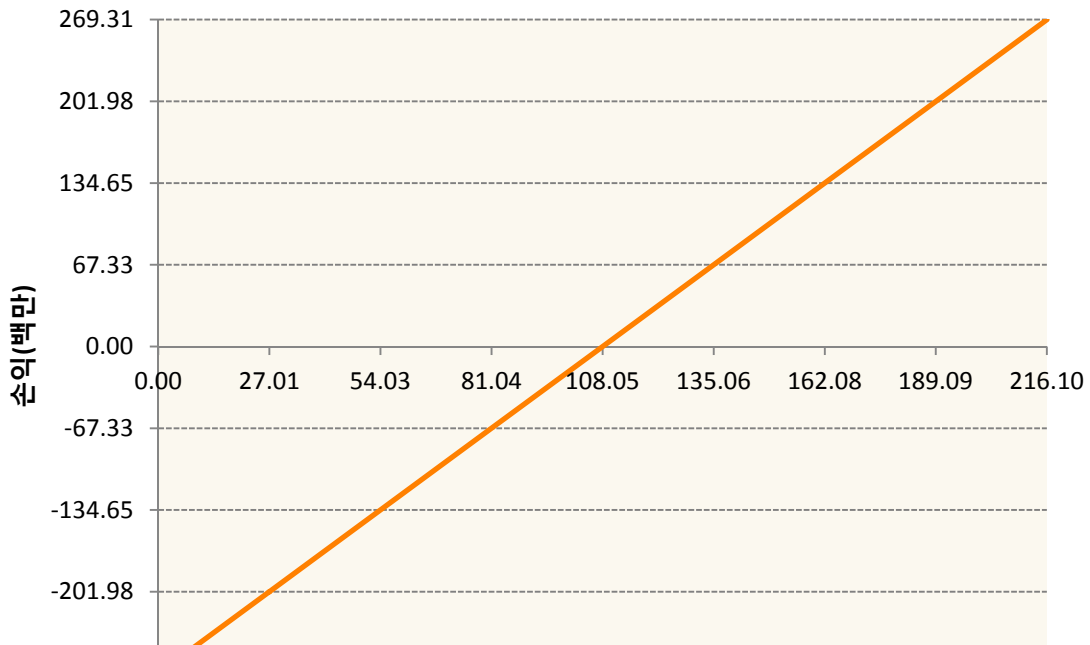


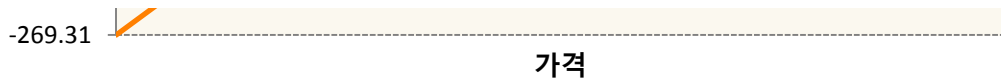


**CU8-CORN FUTURE SEP18**

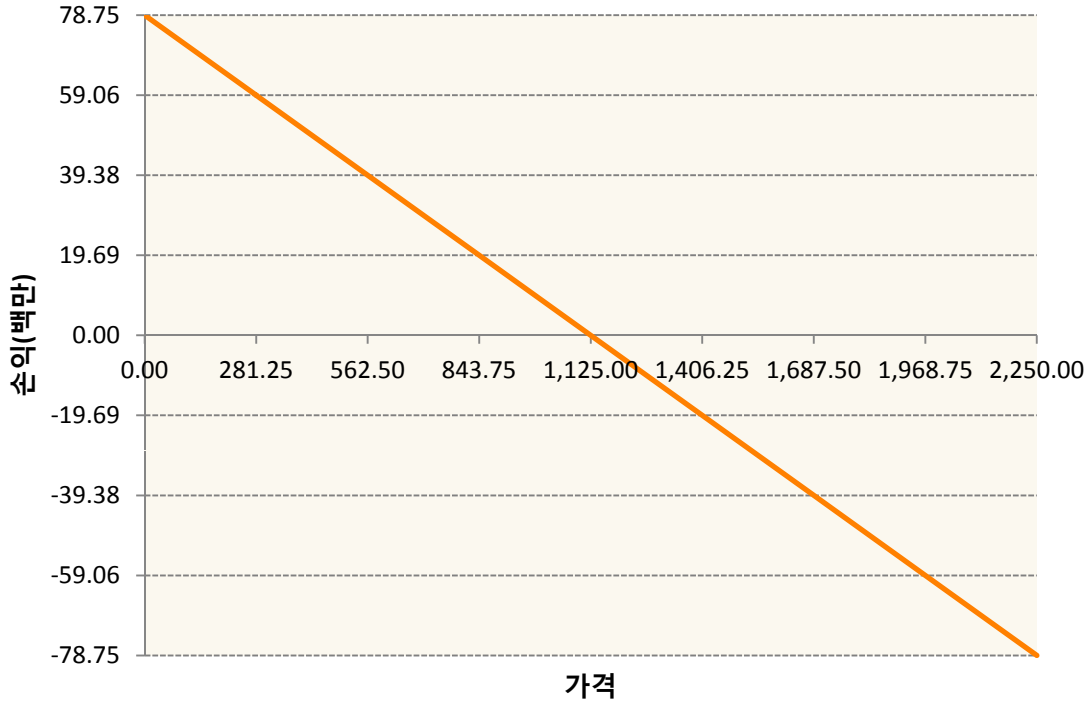


**KCU8-COFFEE 'C' FUTURE SEP18**

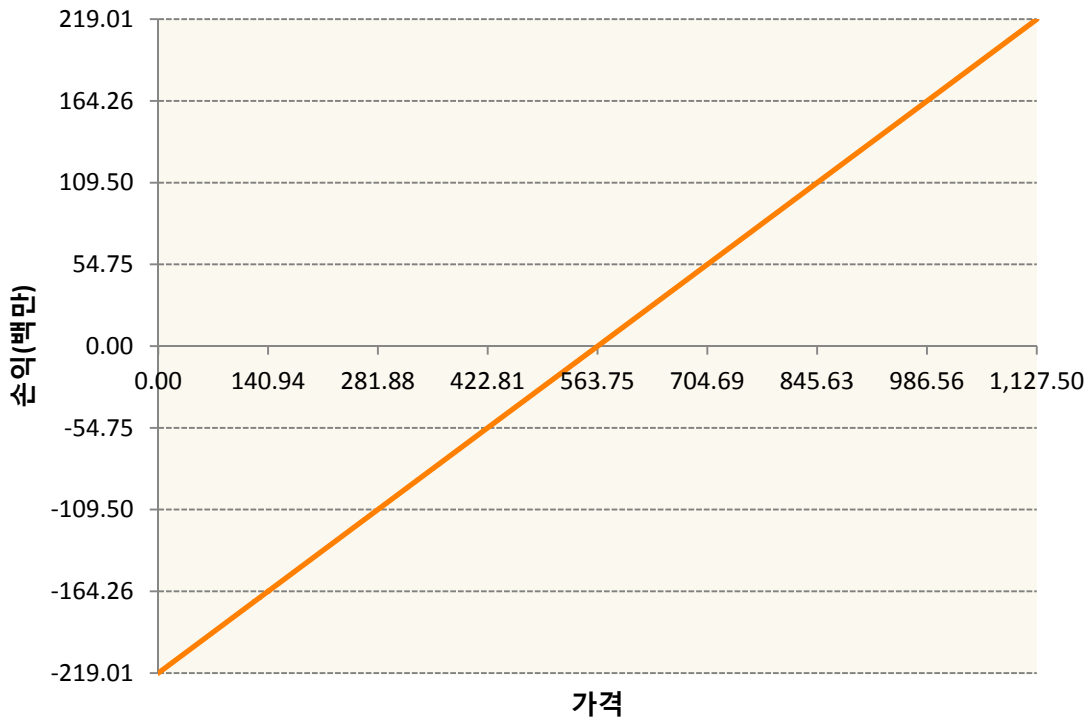




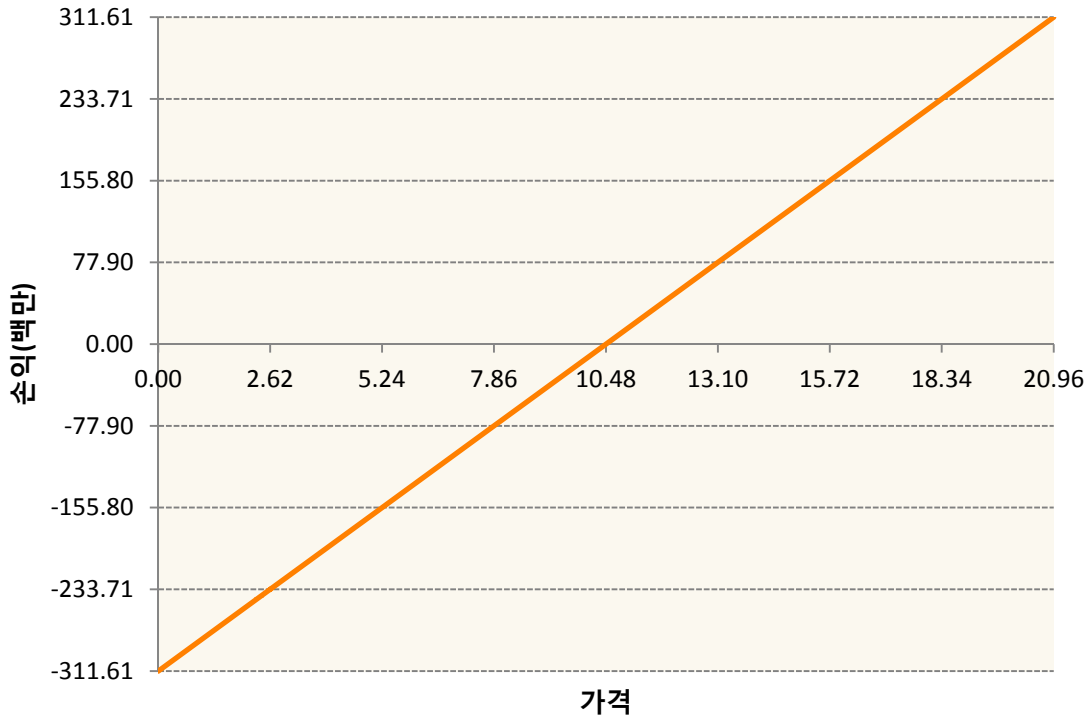
**KR4175N80001-2018-08 달러선물**



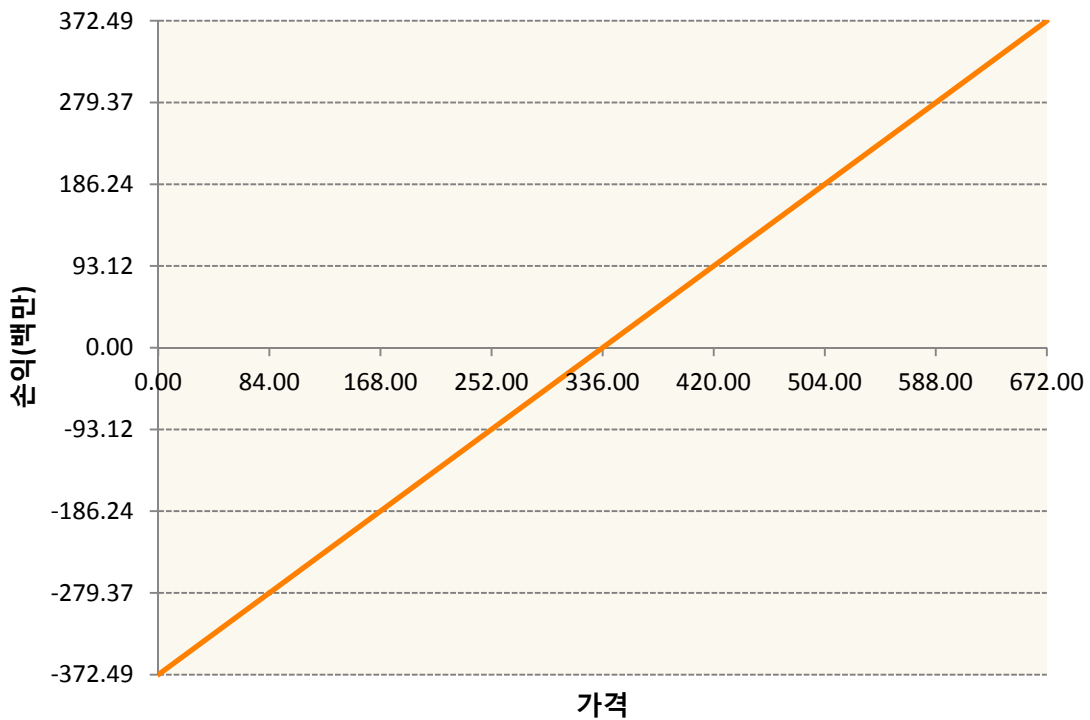
**KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18**



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

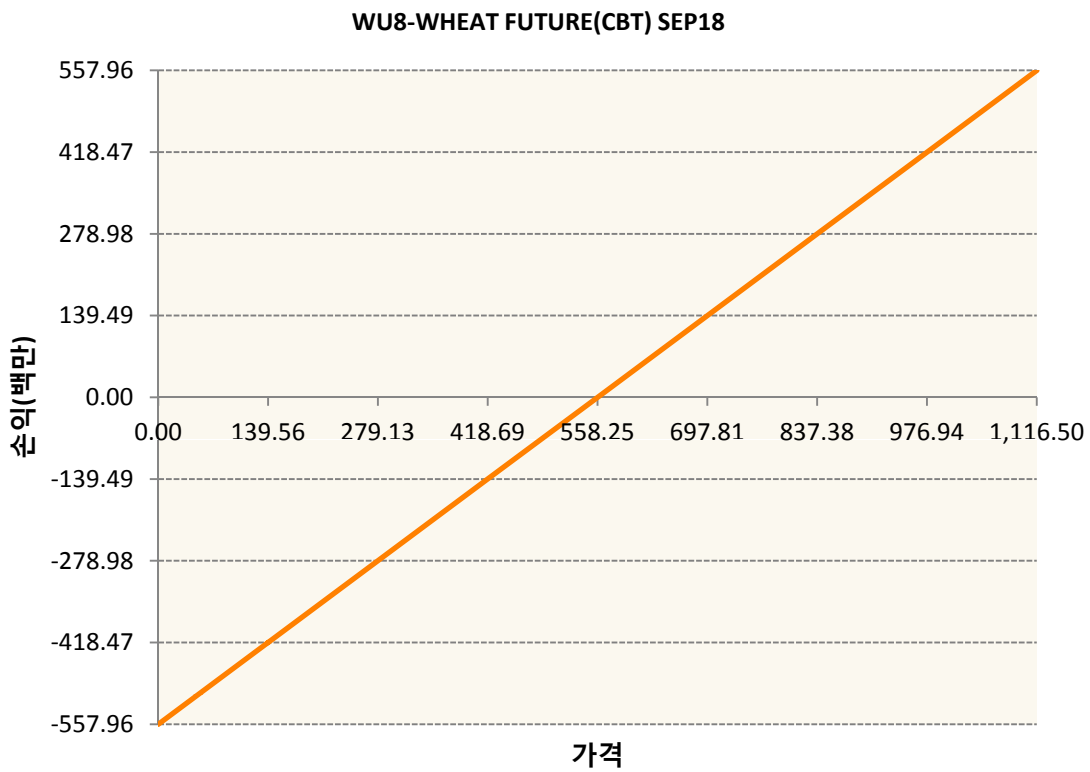
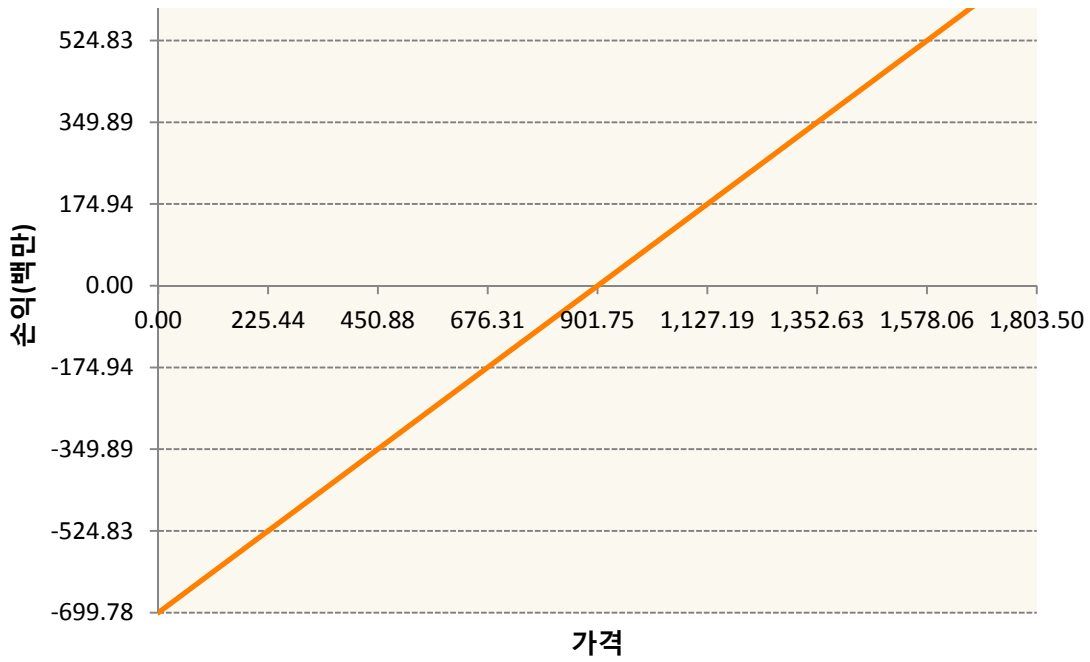


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



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	65
KCU8	COFFEE 'C' FUTURE SEP18	22
KR4175N80C 2018-08 달러선물		6

KWU8	KC HRW WHEAT FUT SEP18	18
SBV8	SUGAR #11 (WORLD) OCT18	25
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	30
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	56
WU8	WHEAT FUTURE(CBT) SEP18	45

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

(단위:백만원)

**315**