

공시일	2018-08-07
기준일	2018-08-06

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	2018-08-07
기준일	2018-08-06

스마트인덱스모

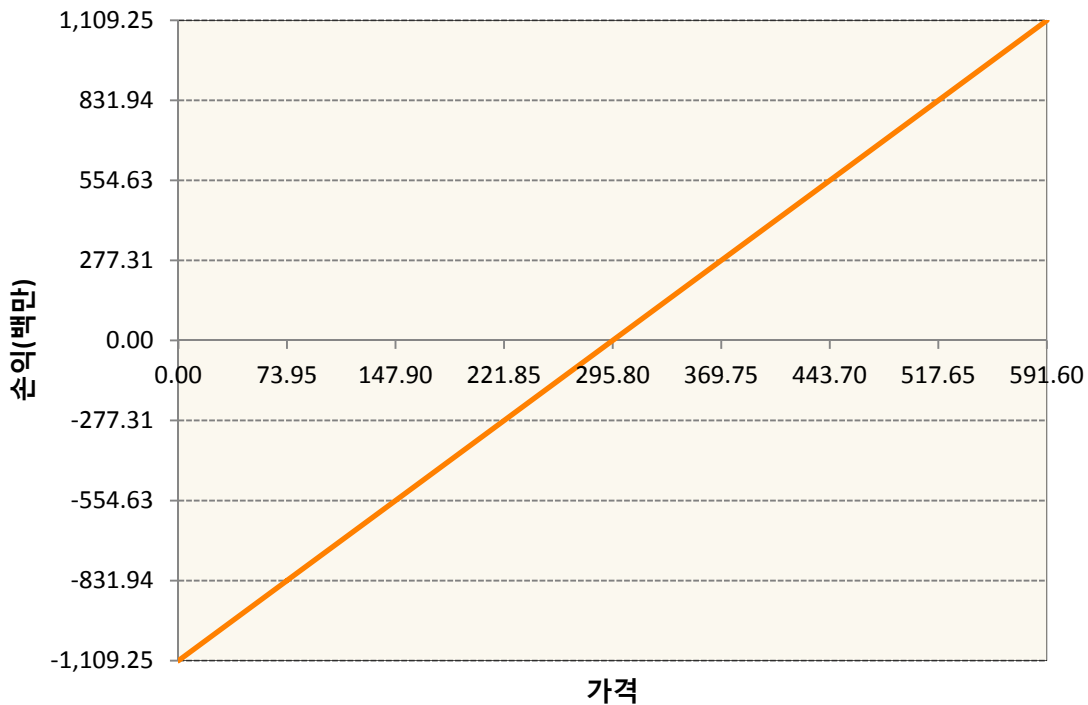
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,109	0	1,109	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	2018-08-07
기준일	2018-08-06

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)

482

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-07
기준일	2018-08-06

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

294

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

360

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-07
기준일	2018-08-06

유로인덱스모(주식-파생형)

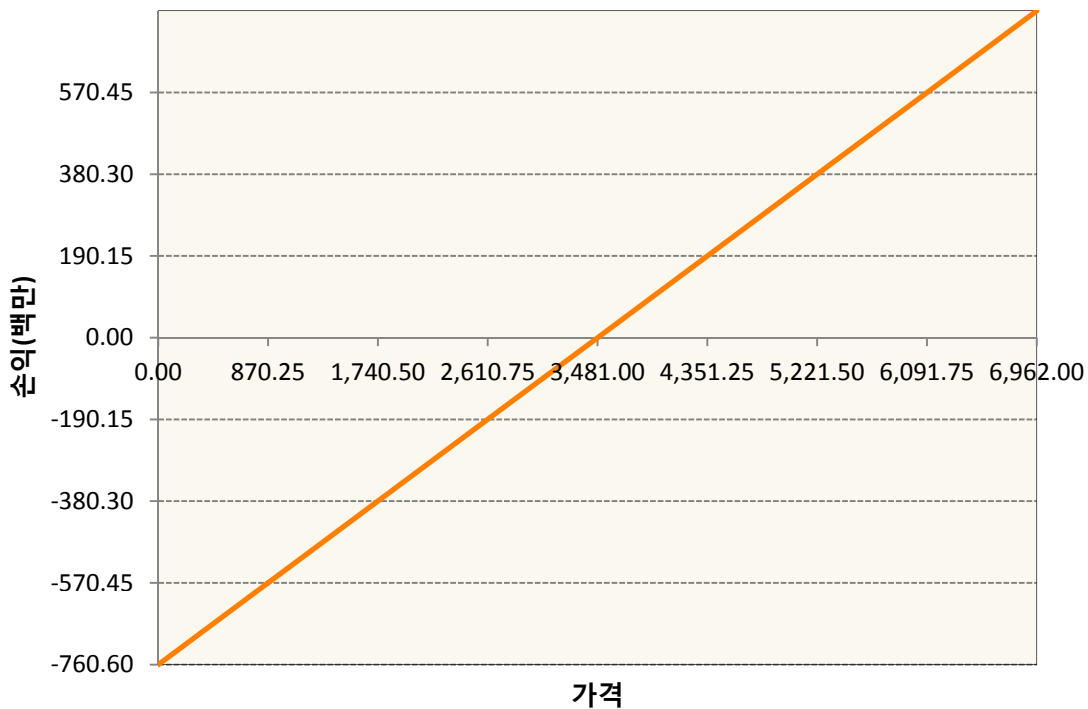
1. 계약금액

(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

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	2018-08-07
기준일	2018-08-06

차이나인덱스모(주식-파생형)

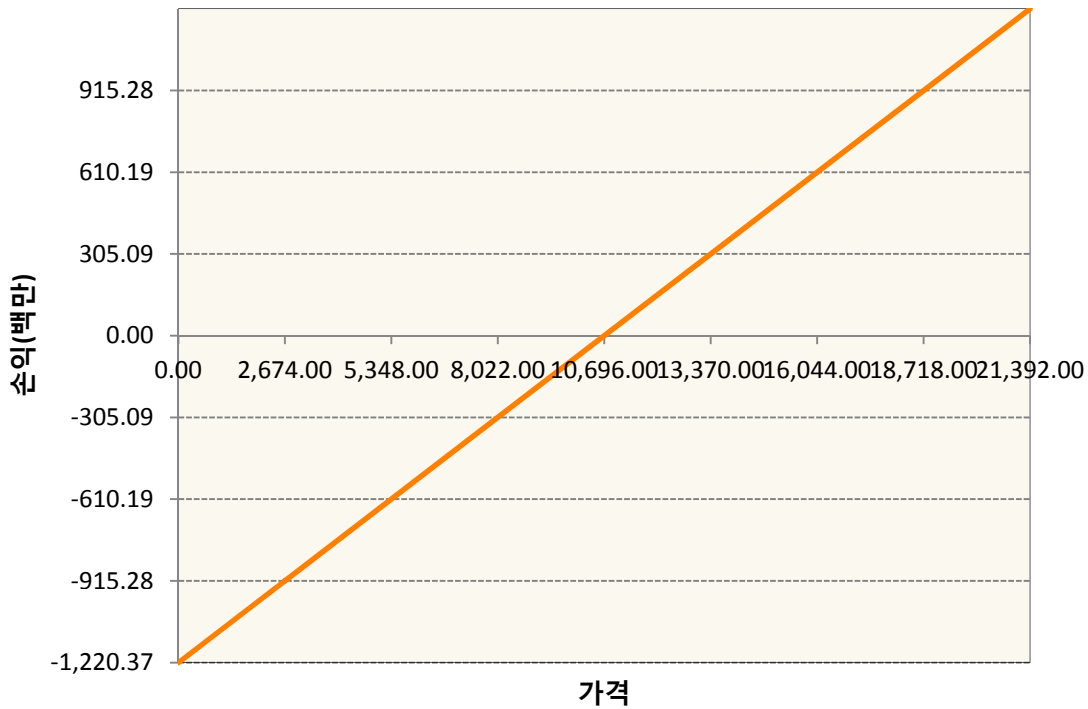
1. 계약금액

(단위:백만원)

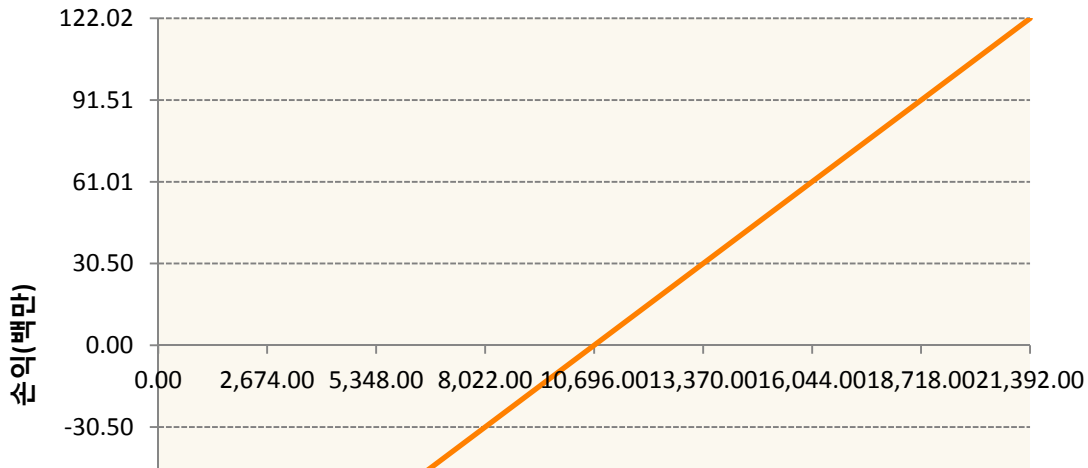
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,342	0	1,342	장내

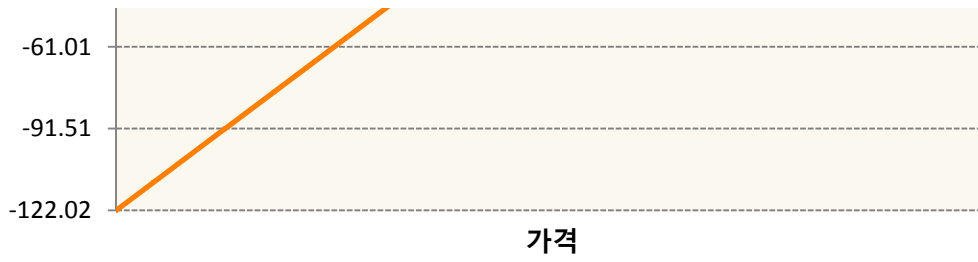
2. 만기시점의 손익구조

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)

98

공시일	2018-08-07
기준일	2018-08-06

커버드콜모(주식혼합-파생형)

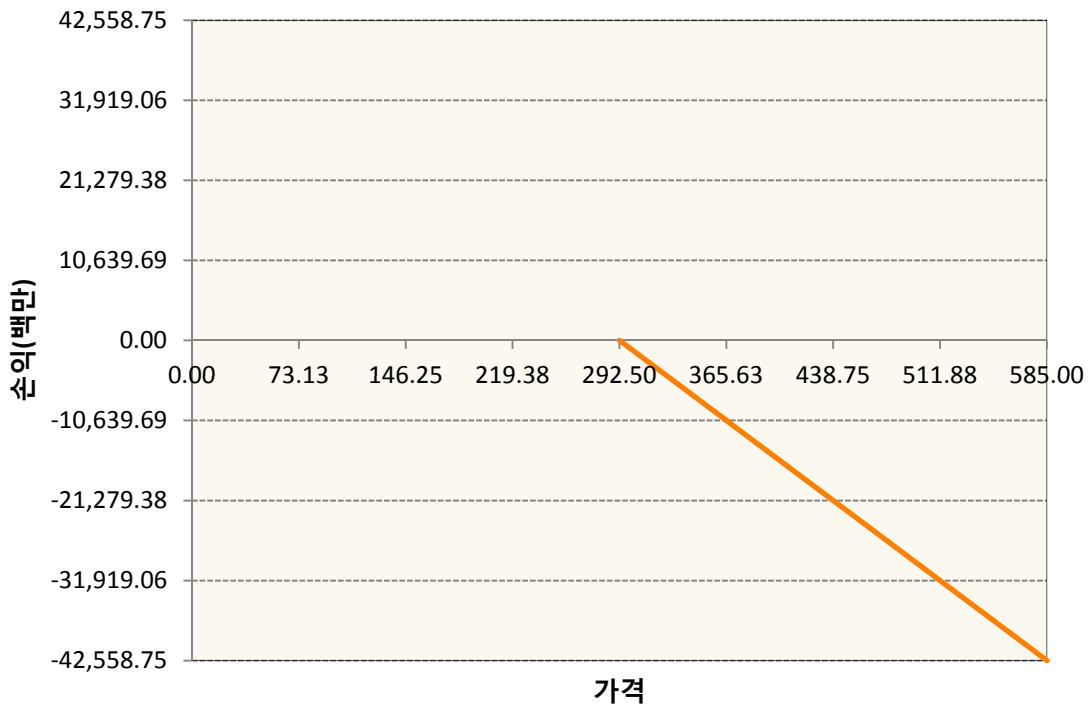
1. 계약금액

(단위:백만원)

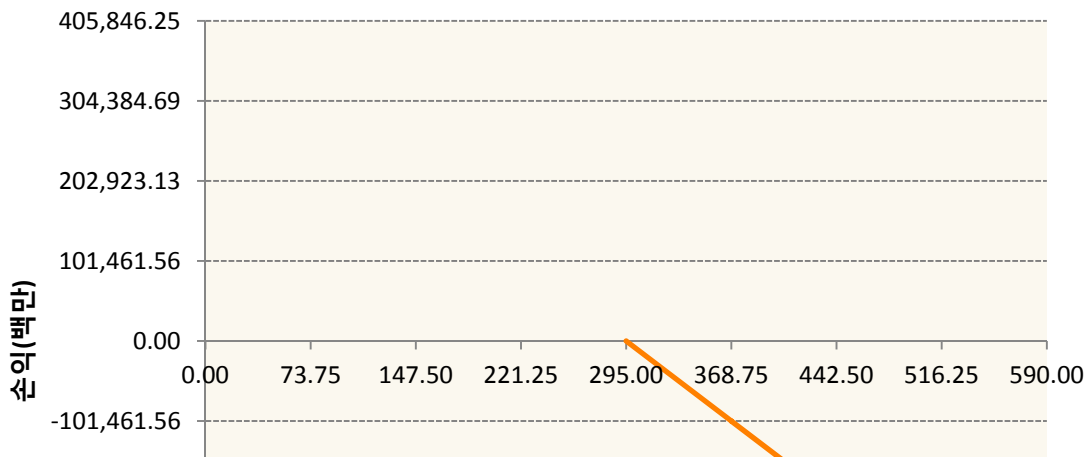
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	727,405	-727,405	장내

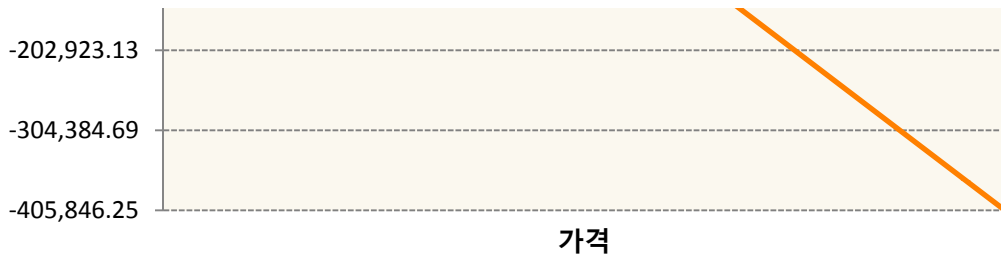
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N82928-2018-08 콜292.5

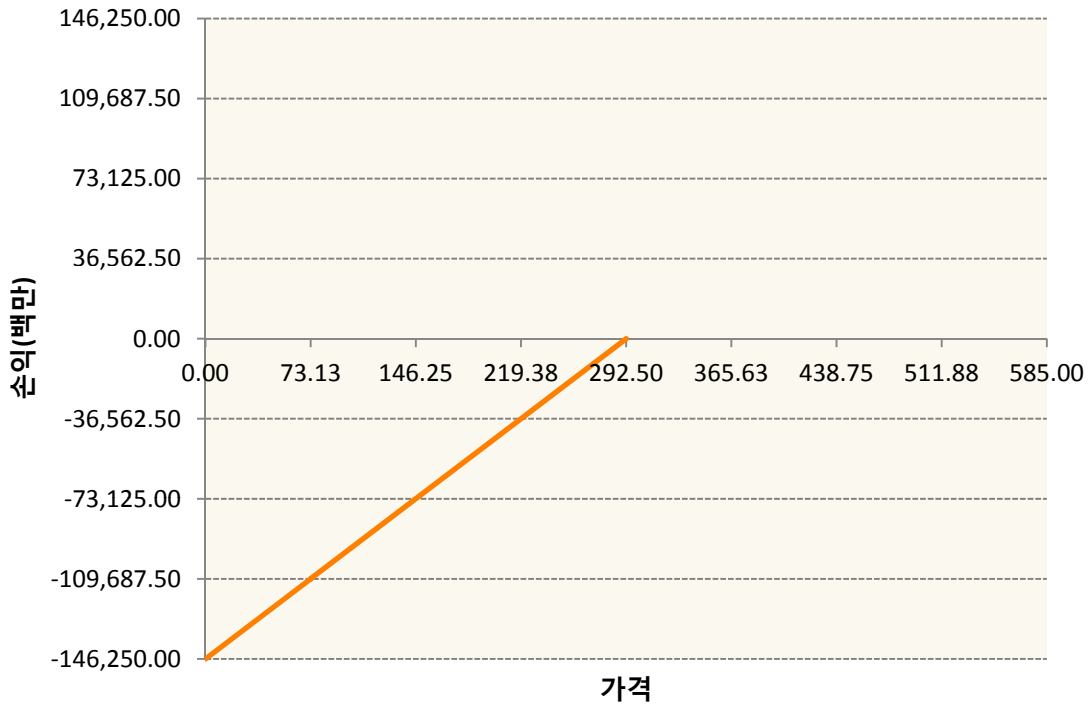


KR4201N82951-2018-08 콜295

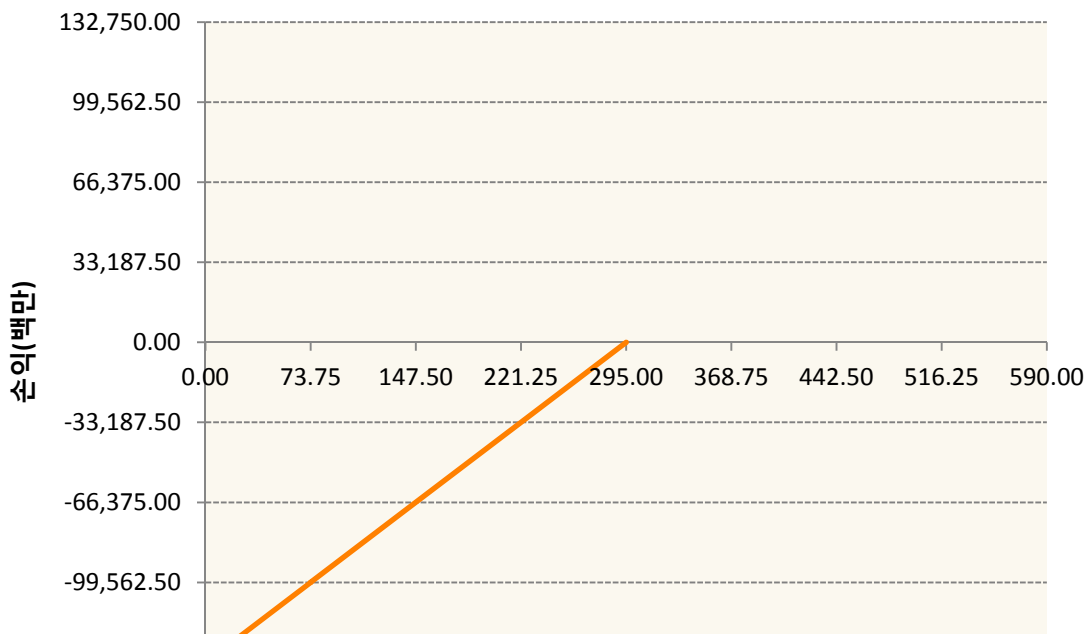




KR4301N82926-2018-08 풋292.5



KR4301N82959-2018-08 풋295



-132,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N829 2018-08 콜292.5 3,182

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	653	653	653	653	652	651	649
-5.33%	651	649	645	639	632	623	612
-2.67%	581	557	532	506	478	450	420
0%	97	65	33	0	-33	-67	-101
2.67%	-899	-906	-915	-927	-941	-957	-975
5.33%	-2,035	-2,036	-2,036	-2,038	-2,040	-2,043	-2,048
8.00%	-3,180	-3,180	-3,180	-3,181	-3,181	-3,181	-3,182

KR4201N829 2018-08 콜295 28,637

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,199	4,199	4,199	4,198	4,196	4,192	4,184
-5.33%	4,195	4,187	4,172	4,146	4,109	4,058	3,992
-2.67%	3,927	3,790	3,629	3,448	3,249	3,034	2,807
0%	1,008	672	336	0	-336	-672	-1,009
2.67%	-7,204	-7,336	-7,494	-7,672	-7,870	-8,083	-8,311
5.33%	-17,787	-17,796	-17,815	-17,845	-17,889	-17,948	-18,022
8.00%	-28,611	-28,611	-28,611	-28,613	-28,617	-28,625	-28,637

KR4301N829 2018-08 풋292.5 10,260

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10,260	-10,260	-10,260	-10,260	-10,260	-10,260	-10,260
-5.33%	-6,324	-6,324	-6,324	-6,324	-6,324	-6,324	-6,324
-2.67%	-2,395	-2,402	-2,412	-2,425	-2,441	-2,461	-2,483
0%	101	71	37	0	-39	-80	-122
2.67%	181	181	181	181	180	180	178
5.33%	181	181	181	181	181	181	181
8.00%	181	181	181	181	181	181	181

KR4301N829 2018-08 풋295 9,987

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,987	-9,987	-9,987	-9,987	-9,987	-9,987	-9,987
-5.33%	-6,445	-6,445	-6,445	-6,445	-6,445	-6,445	-6,445
-2.67%	-2,903	-2,904	-2,905	-2,907	-2,911	-2,916	-2,923
0%	146	97	49	0	-49	-97	-146
2.67%	534	534	533	531	528	523	517

5.33%	534	534	534	534	534	534	534
8.00%	534	534	534	534	534	534	534

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

(단위:백만원)

68,200

공시일	2018-08-07
기준일	2018-08-06

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

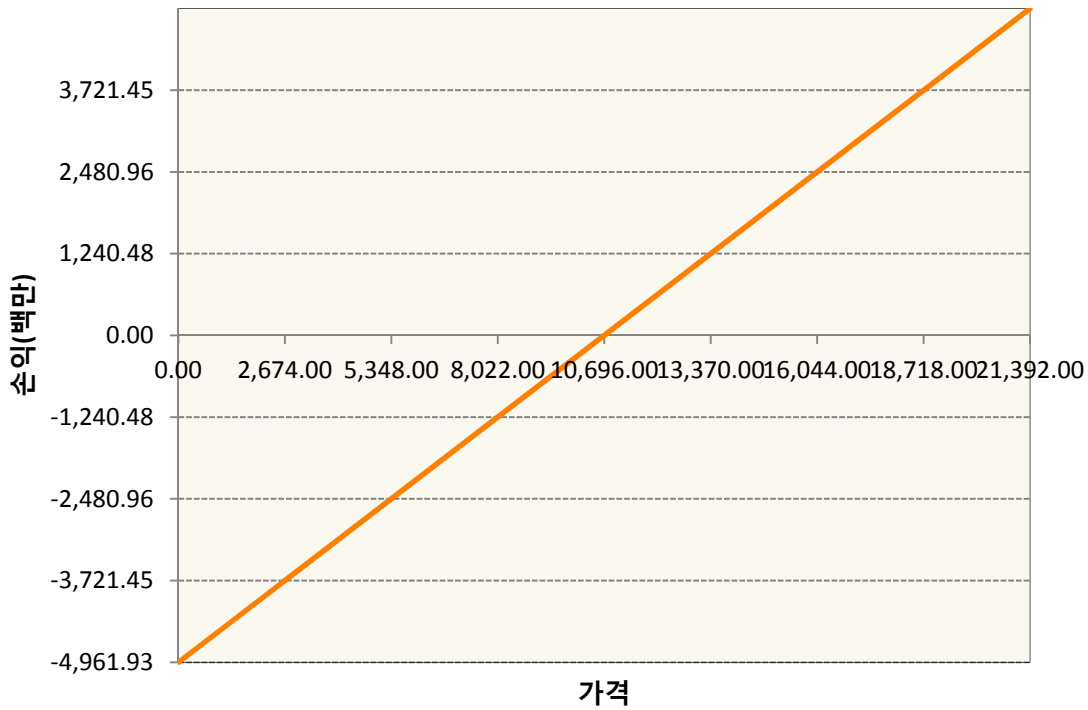
1. 계약금액

(단위:백만원)

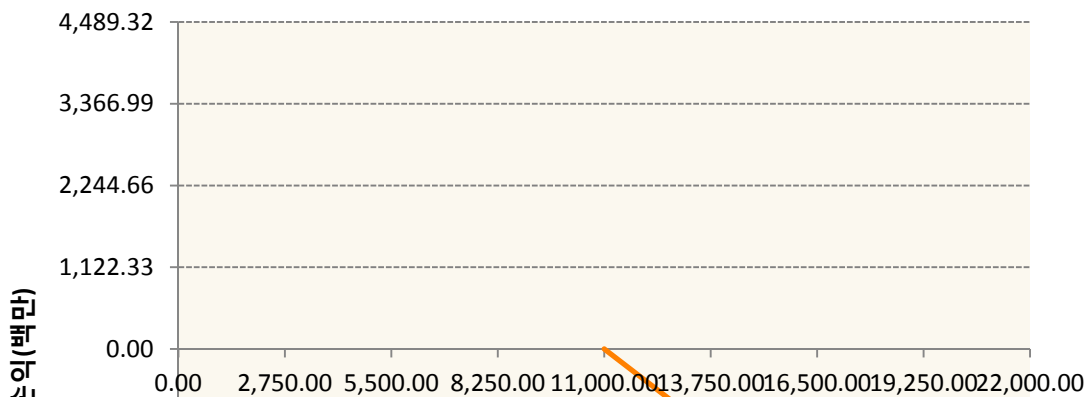
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,962	0	4,962	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,545	-11,545	장내

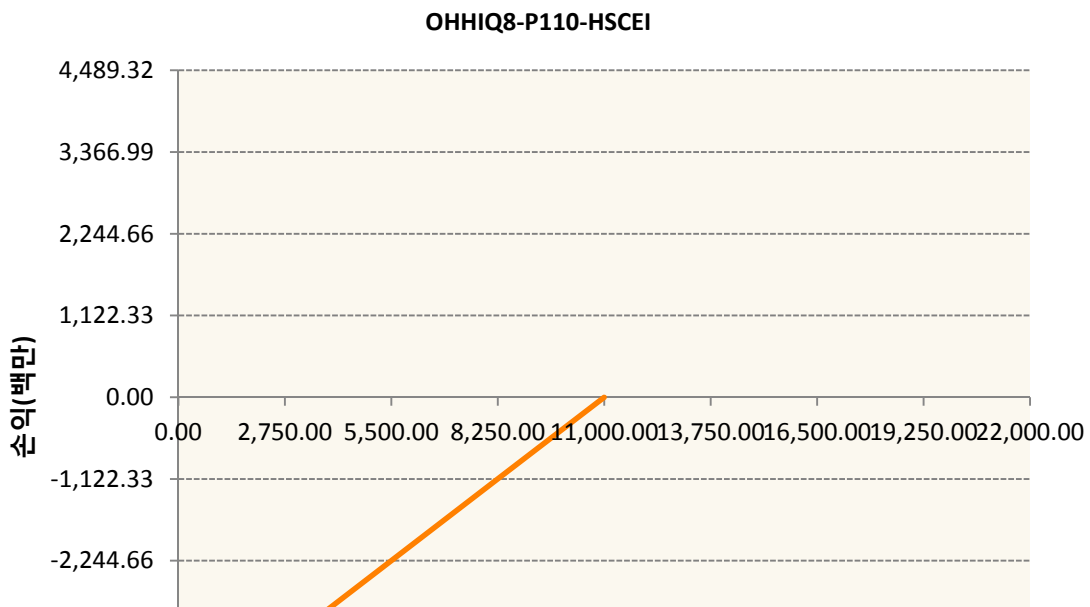
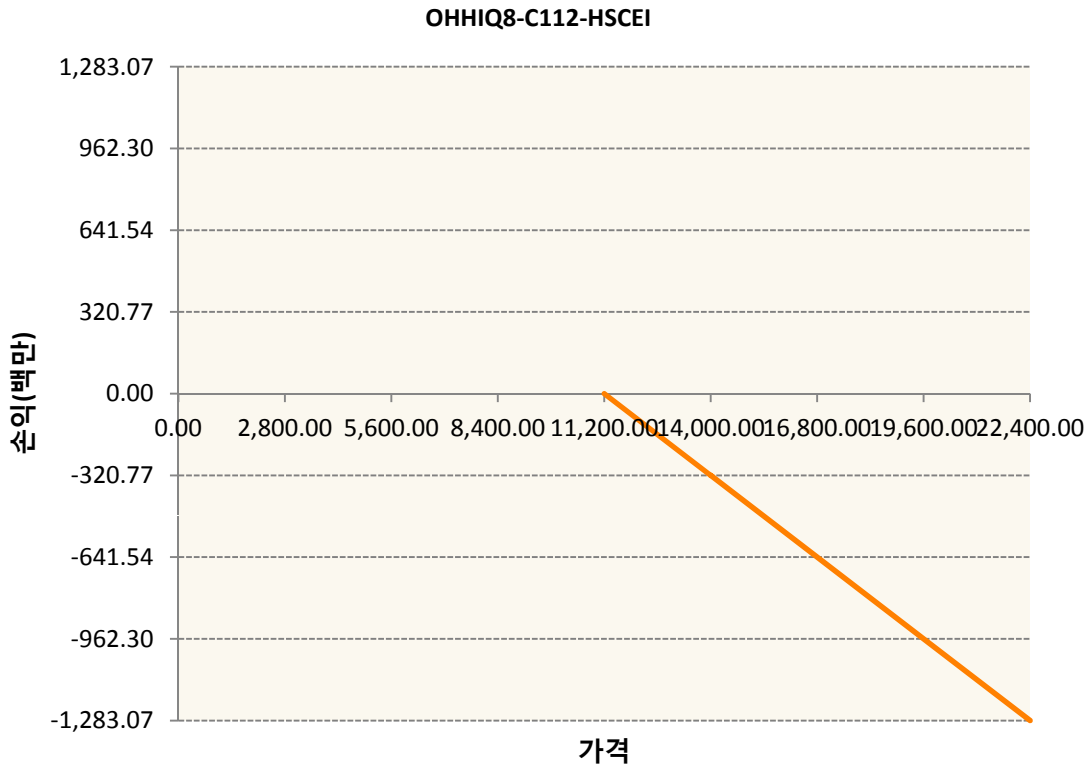
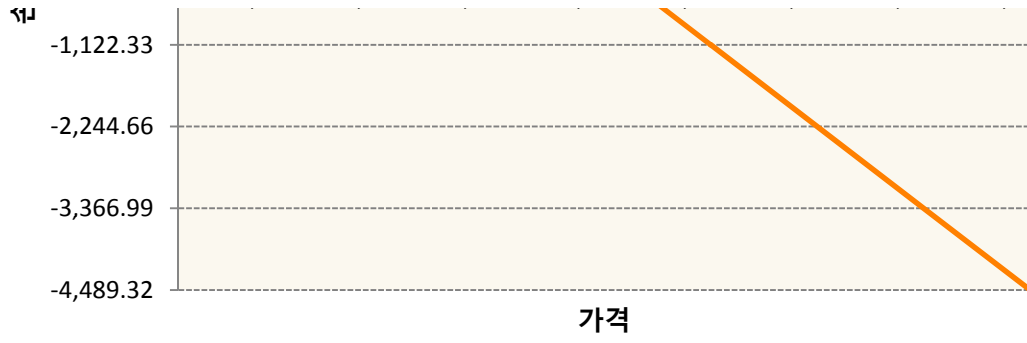
2. 만기시점의 손익구조

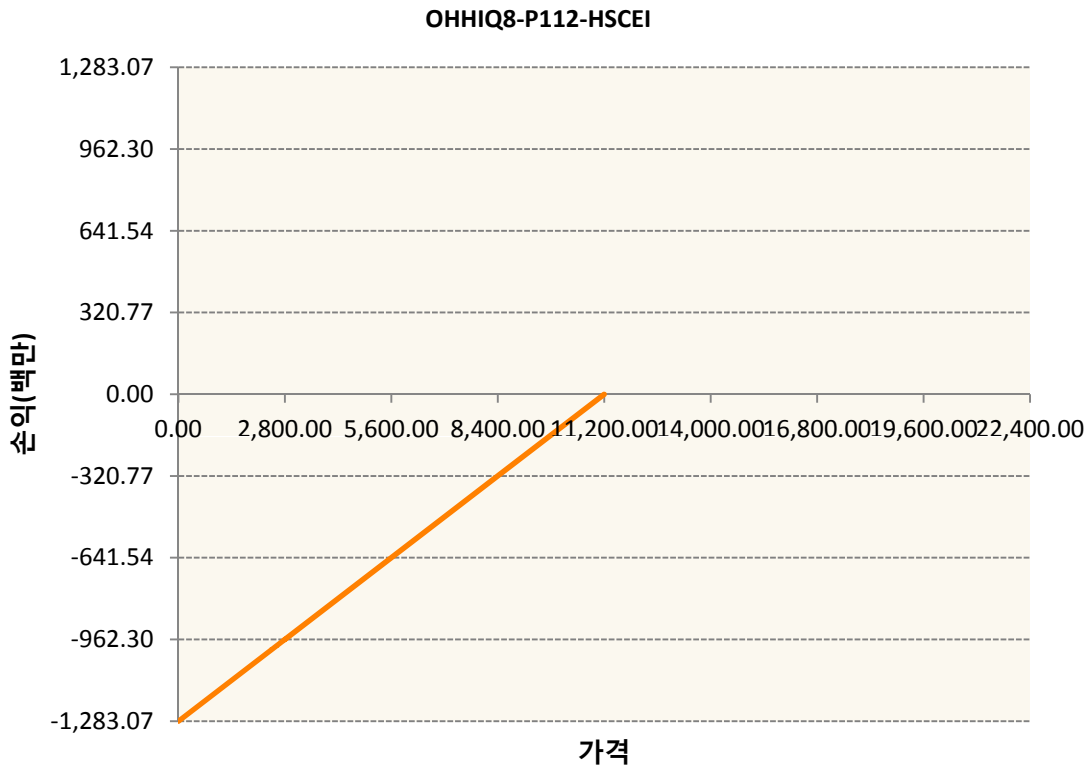
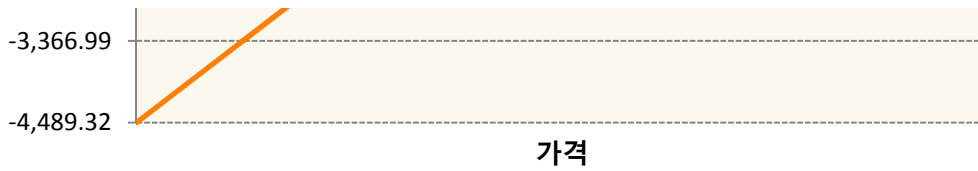
HCQ8-HSCEI Futures Aug18



OHHIQ8-C110-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ8	HSCEI Futures Aug18	397
OHHIQ8-C1	HSCEI	359
OHHIQ8-C1	HSCEI	103
OHHIQ8-P11	HSCEI	359
OHHIQ8-P11	HSCEI	103

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,202

공시일	2018-08-07
기준일	2018-08-06

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

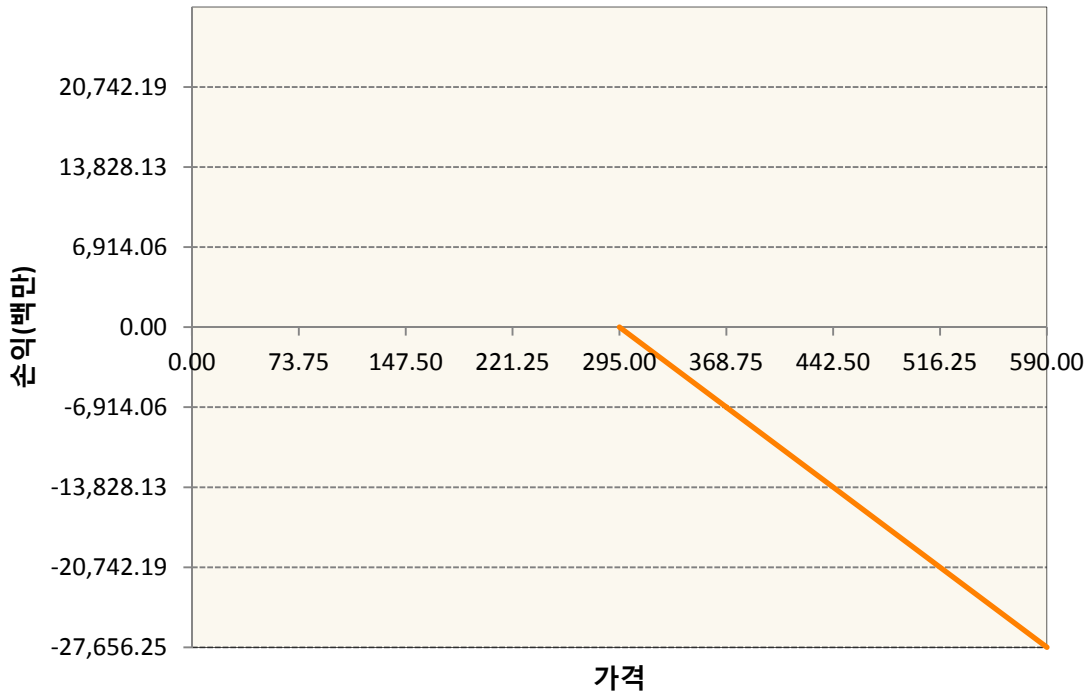
1. 계약금액

(단위:백만원)

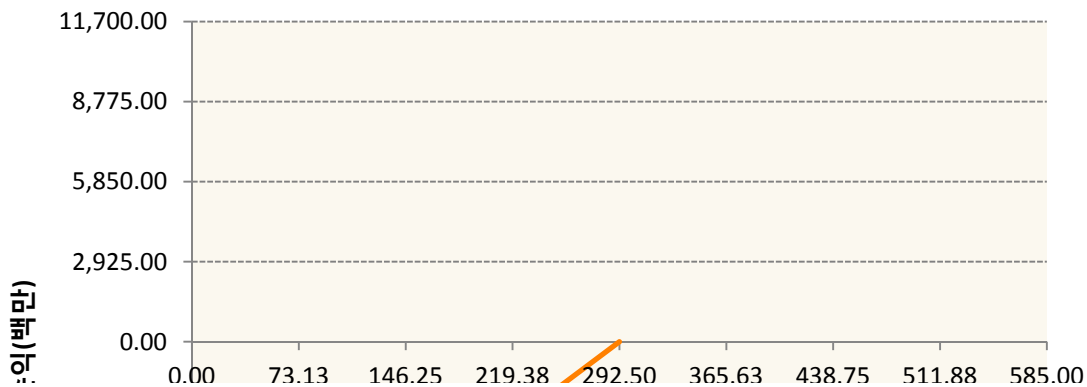
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	48,575	-48,575	장내

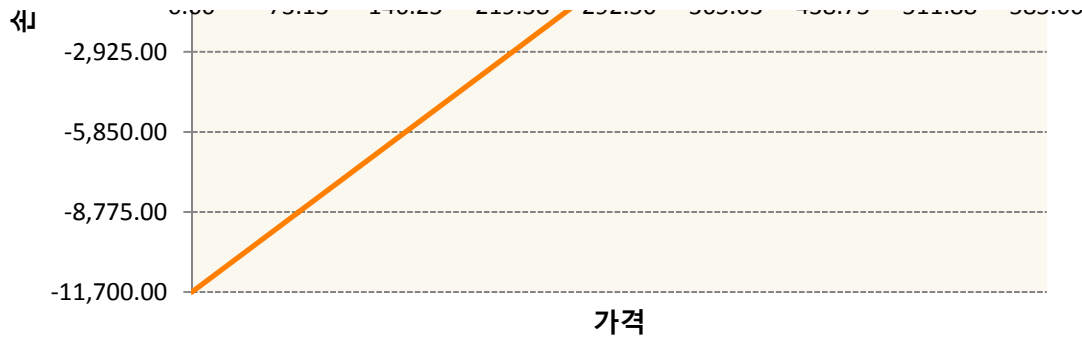
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N82951-2018-08 콜295

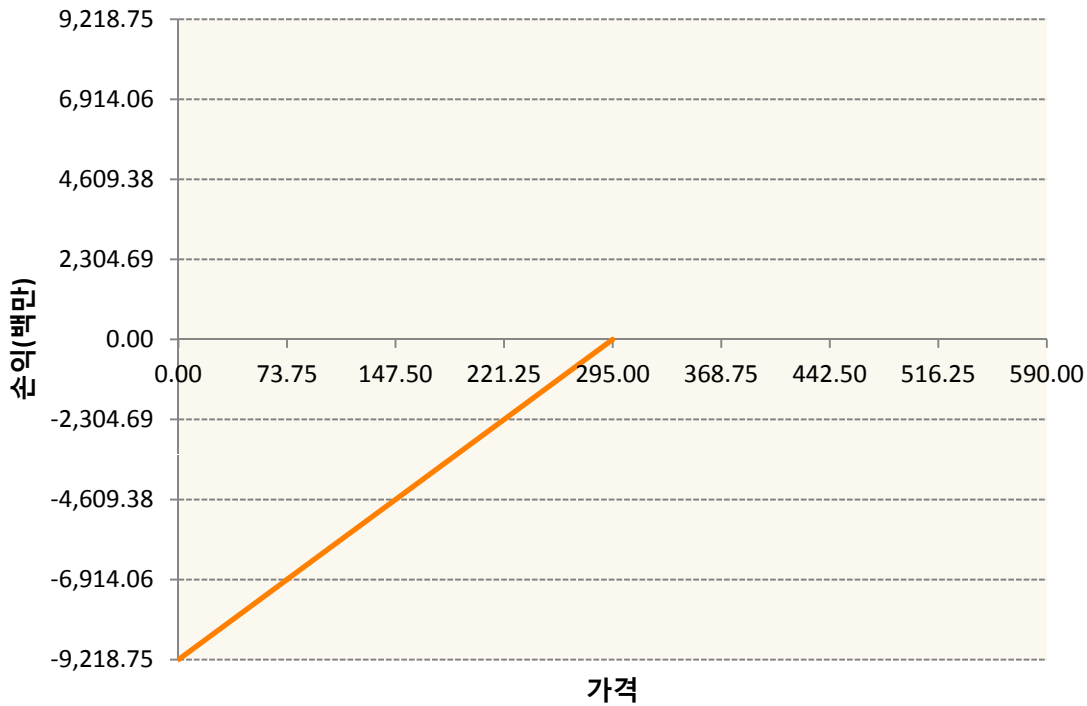


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





KR4301N82959-2018-08 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_2							1,503
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,503	-1,503	-1,503	-1,503	-1,503	-1,503	-1,503
-5.33%	-1,002	-1,002	-1,002	-1,002	-1,002	-1,002	-1,002
-2.67%	-501	-501	-501	-501	-501	-501	-501
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	501	501	501	501	501	501	501
5.33%	1,002	1,002	1,002	1,002	1,002	1,002	1,002
8.00%	1,503	1,503	1,503	1,503	1,503	1,503	1,503
2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_3							284
	기초자산의 변동성						

0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	163	163	163	163	163	163	163
5.33%	325	325	325	325	325	325	325
8.00%	488	488	488	488	488	488	488

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_13

244

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-244	-244	-244	-244	-244	-244	-244
-5.33%	-163	-163	-163	-163	-163	-163	-163
-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%	163	163	163	163	163	163	163
8.00%	244	244	244	244	244	244	244

KR4201N829 2018-08 콜295

1,951

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	286	286	286	286	286	286	285
-5.33%	286	285	284	283	280	276	272
-2.67%	268	258	247	235	221	207	191
0%	69	46	23	0	-23	-46	-69
2.67%	-491	-500	-511	-523	-536	-551	-566
5.33%	-1,212	-1,213	-1,214	-1,216	-1,219	-1,223	-1,228
8.00%	-1,950	-1,950	-1,950	-1,950	-1,950	-1,951	-1,951

KR4301N829 2018-08 풋292.5

821

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-821	-821	-821	-821	-821	-821	-821
-5.33%	-506	-506	-506	-506	-506	-506	-506
-2.67%	-192	-192	-193	-194	-195	-197	-199
0%	8	6	3	0	-3	-6	-10
2.67%	14	14	14	14	14	14	14
5.33%	14	14	14	14	14	14	14
8.00%	14	14	14	14	14	14	14

KR4301N829 2018-08 풋295

694

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-694	-694	-694	-694	-694	-694	-694
-5.33%	-448	-448	-448	-448	-448	-448	-448
-2.67%	-202	-202	-202	-202	-202	-202	-203
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	37	37	37	37	37	36	36
5.33%	37	37	37	37	37	37	37
8.00%	37	37	37	37	37	37	37

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

(단위:백만원)

8,468

공시일	2018-08-07
기준일	2018-08-06

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

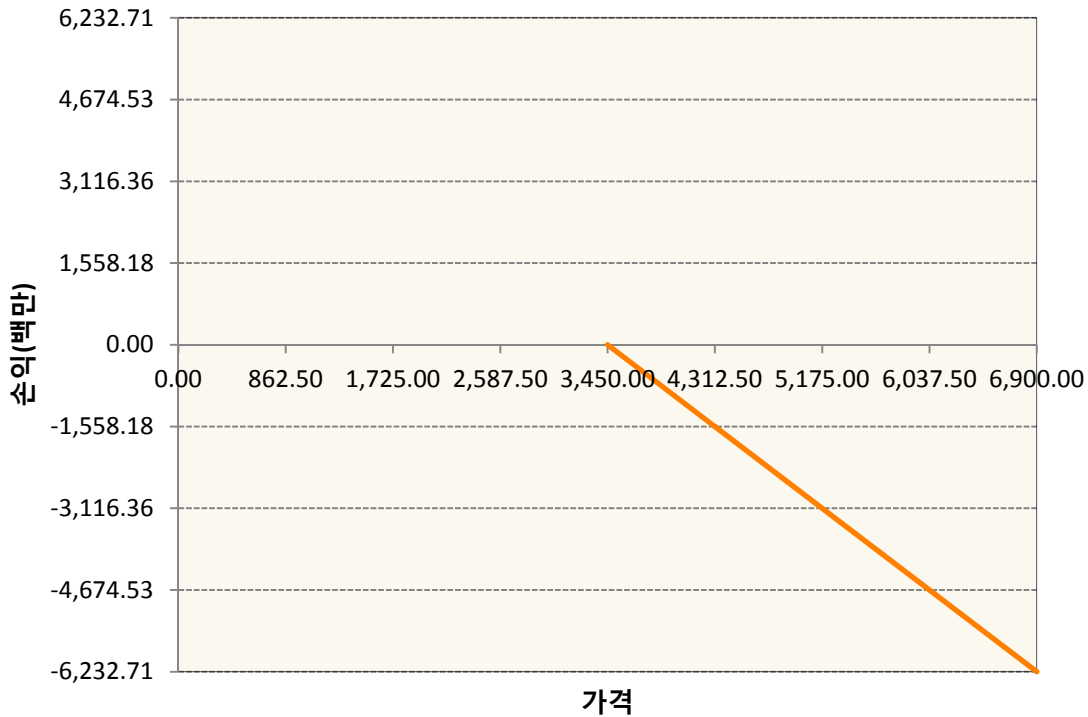
1. 계약금액

(단위:백만원)

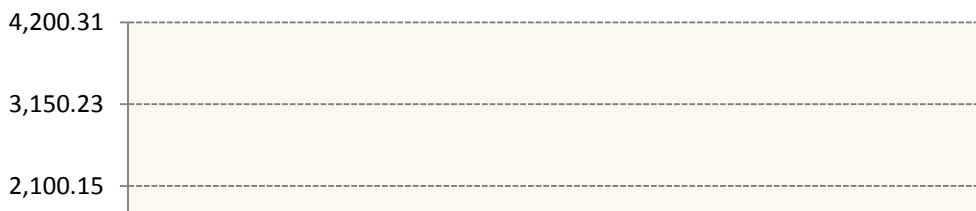
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,161	0	3,161	
누계	유가증권	스왑	44,818	0	44,818	장외
누계	유가증권	옵션	0	16,670	-16,670	장내
누계	지수	스왑	52,766	0	52,766	장외

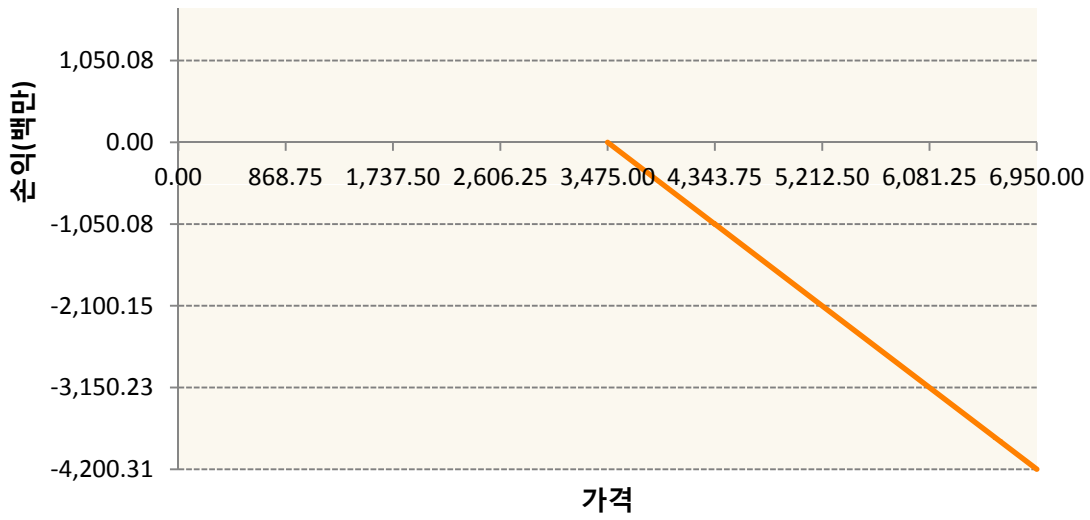
2. 만기시점의 손익구조

OESXQ8-C3450-EURO STOXX 50 OPT

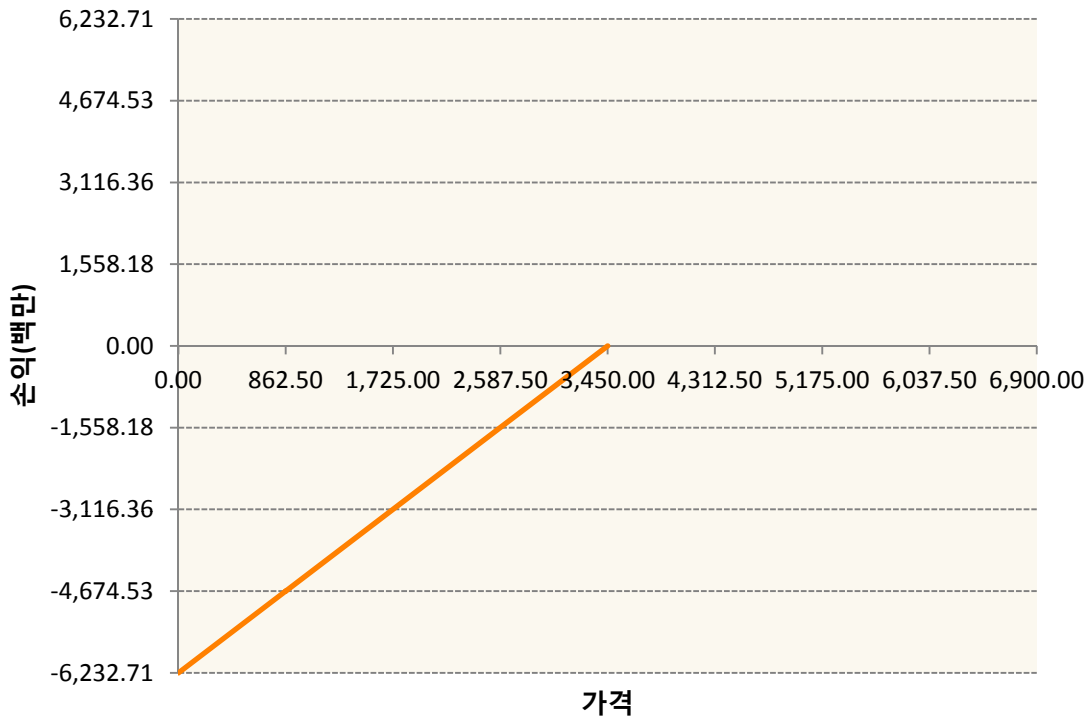


OESXQ8-C3475-EURO STOXX 50 OPT

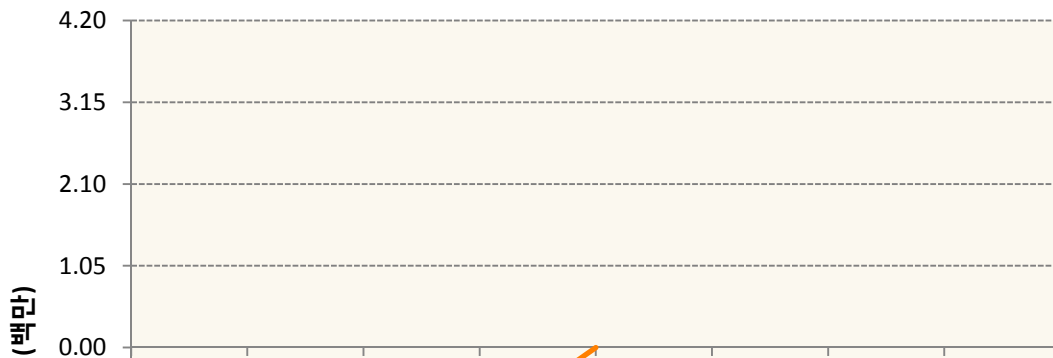


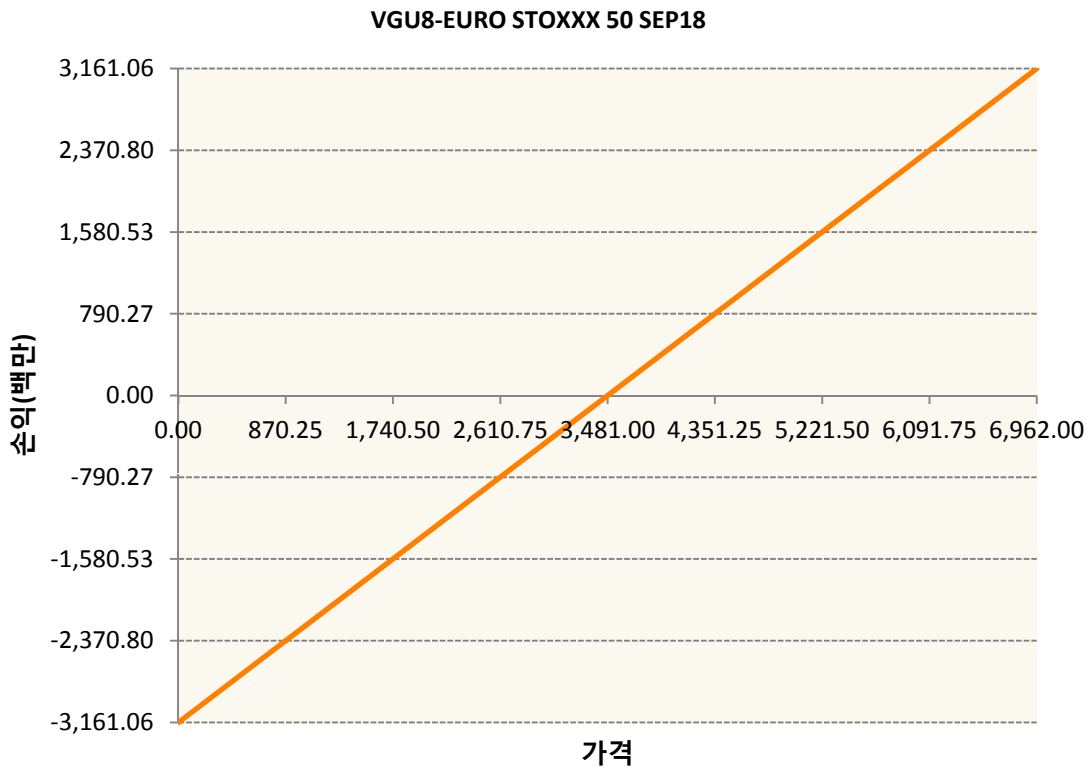
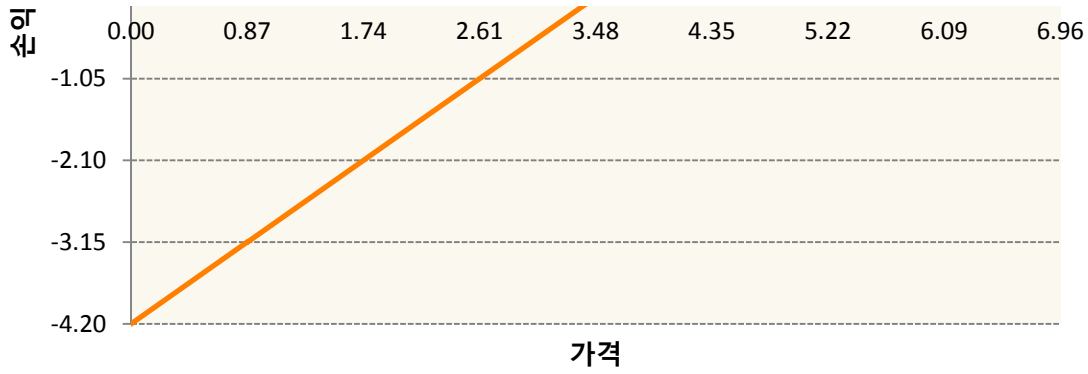


OESXQ8-P3450-EURO STOXX 50



OESXQ8-P3475-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		28
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		23
OESXQ8-C3 EURO STOXX 50 OPT		499
OESXQ8-C3 EURO STOXX 50 OPT		336
OESXQ8-P3 EURO STOXX 50		499
OESXQ8-P3 EURO STOXX 50		0.3
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18		253

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

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

(단위:백만원)

1,149

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

(단위:백만원)

90

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

(단위:백만원)

136

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

(단위:백만원)

166

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

(단위:백만원)

41

공시일	2018-08-07
기준일	2018-08-06

리디파인K200(주식혼합-파생재간

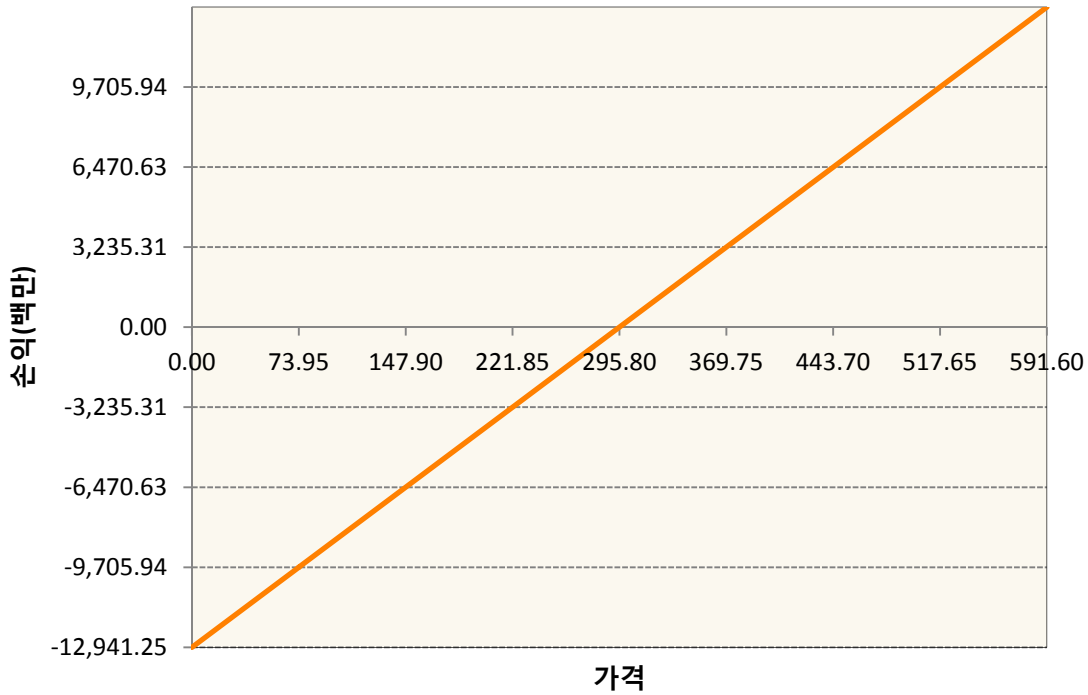
1. 계약금액

(단위:백만원)

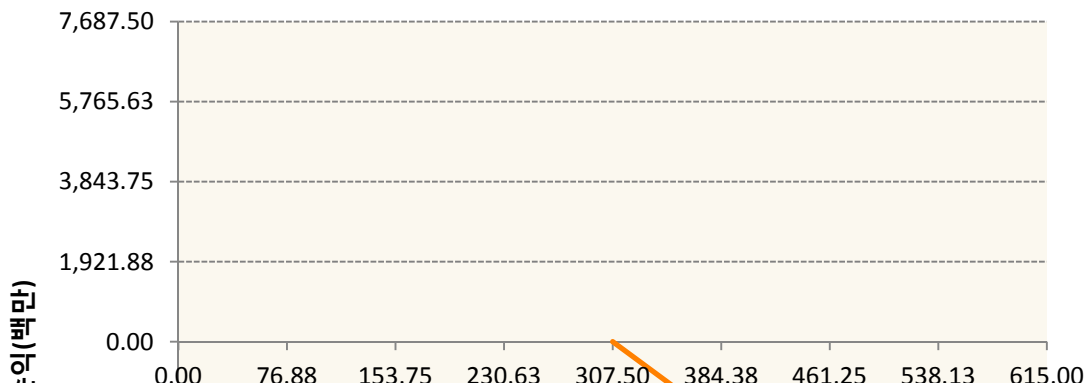
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,941	0	12,941	장내
누계	유가증권	옵션	2,134	23,730	-21,596	장내

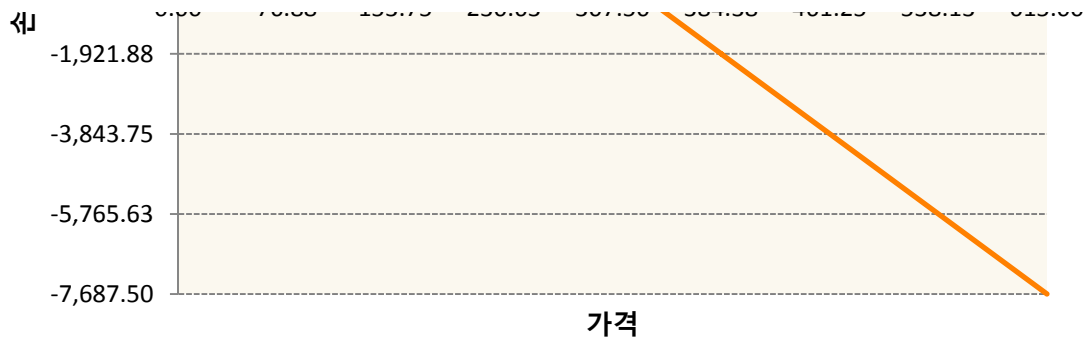
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

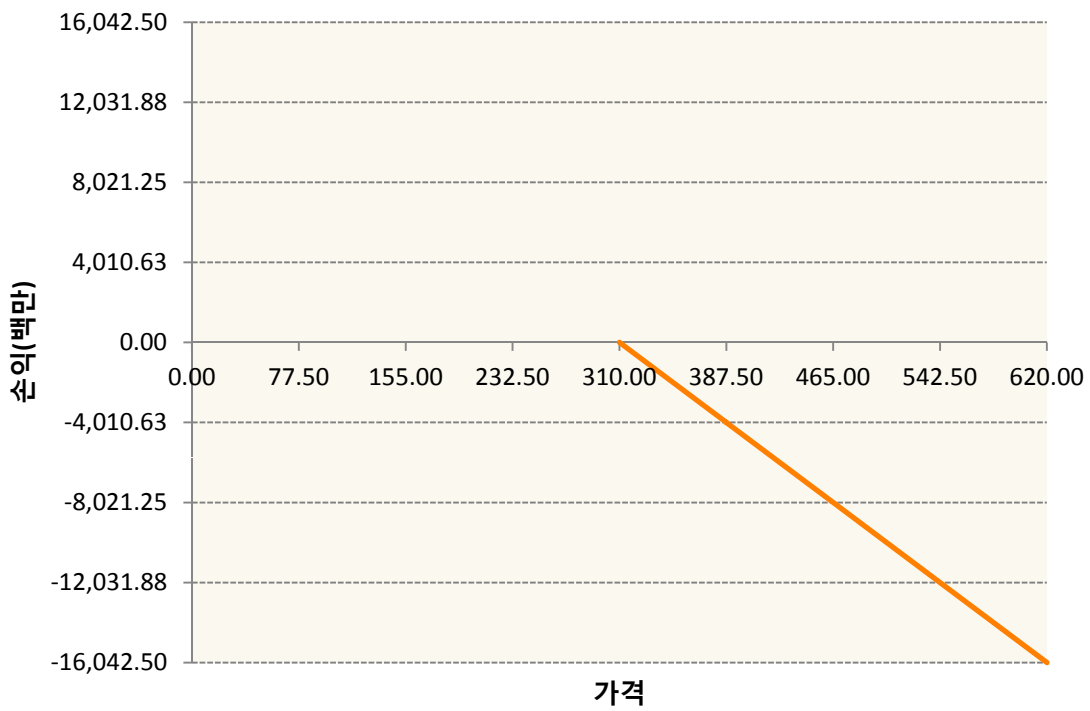


KR4201N83074-2018-08 콜307.5

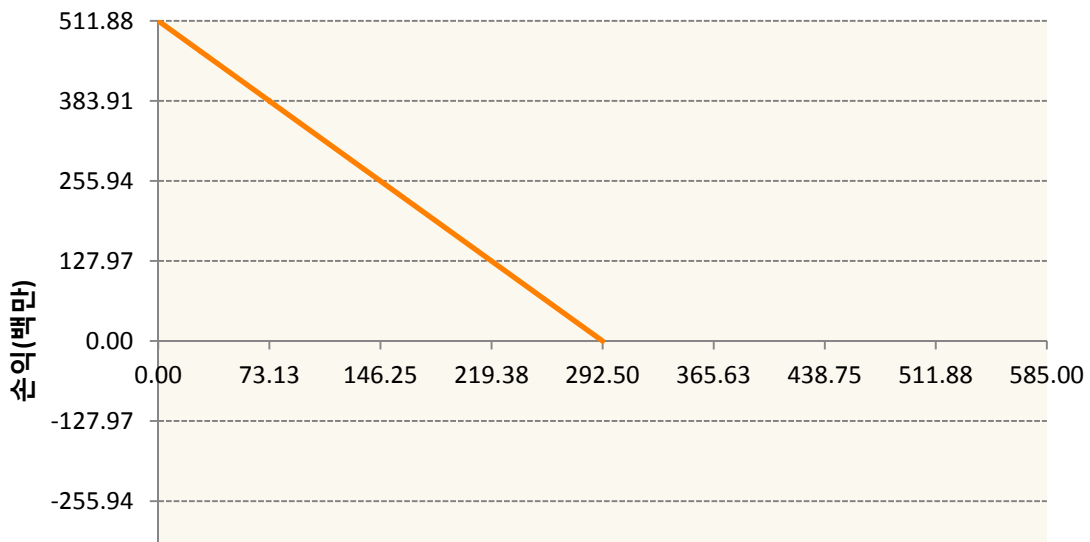


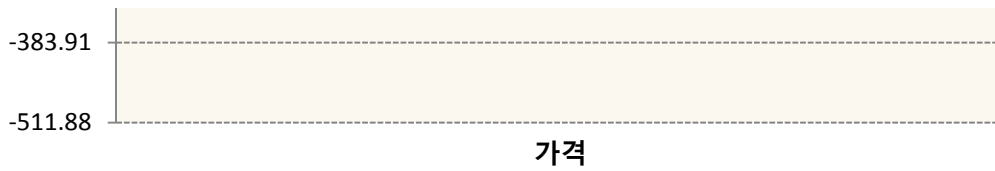


KR4201N83108-2018-08 콜310

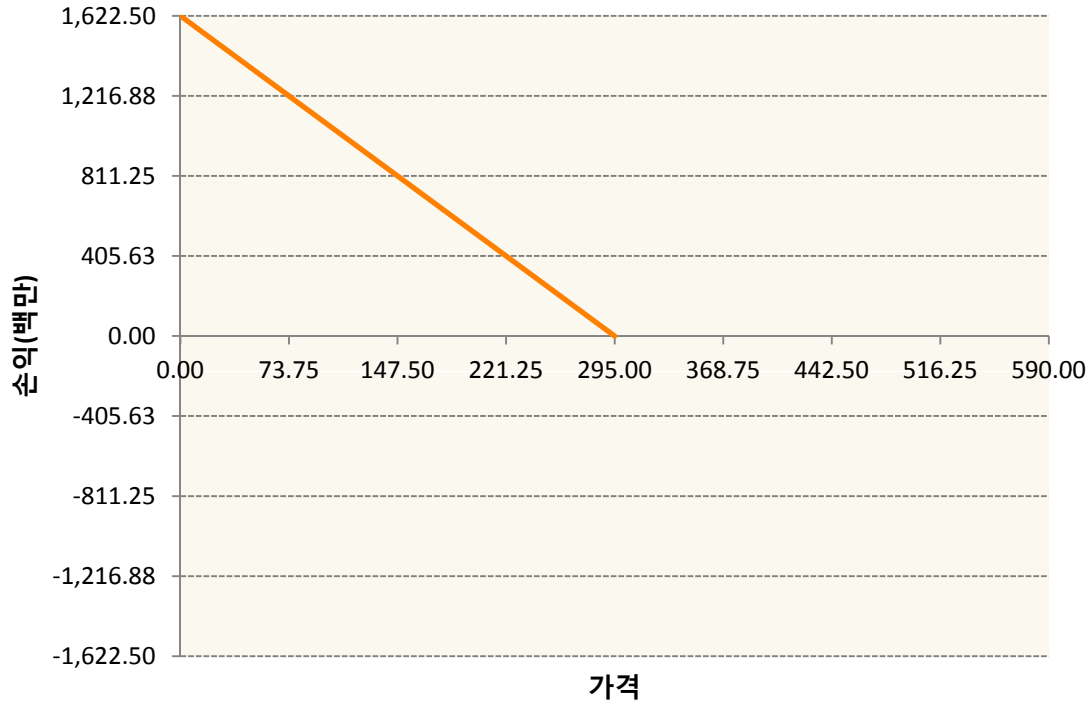


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





KR4301N82959-2018-08 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물 1,033

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,033	-1,033	-1,033	-1,033	-1,033	-1,033	-1,033
-5.33%	-689	-689	-689	-689	-689	-689	-689
-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%	689	689	689	689	689	689	689
8.00%	1,033	1,033	1,033	1,033	1,033	1,033	1,033

KR4201N83C 2018-08 콜307.5 294

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4	4	4	4	4	4	4
-5.33%	4	4	4	4	4	4	4
-2.67%	4	4	4	4	4	3	3

0%	3	3	1	0	-2	-4	-7
2.67%	-14	-19	-24	-29	-35	-40	-46
5.33%	-107	-113	-118	-124	-130	-136	-142
8.00%	-281	-282	-284	-286	-289	-291	-294

KR4201N8312018-08 콜310

505

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4	4	4	4	4	4	4
-5.33%	4	4	4	4	4	4	4
-2.67%	4	4	4	4	3	3	3
0%	3	3	2	0	-2	-5	-9
2.67%	-13	-20	-27	-36	-45	-54	-64
5.33%	-143	-156	-169	-183	-196	-209	-222
8.00%	-463	-468	-474	-481	-488	-496	-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%	22	22	22	22	22	22	22
-2.67%	8	8	8	8	9	9	9
0%	0	0	0	0	0	0	0
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

122

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	122	122	122	122	122	122	122
-5.33%	79	79	79	79	79	79	79
-2.67%	35	35	36	36	36	36	36
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-7	-7	-7	-6	-6	-6	-6
5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7

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

(단위:백만원)

1,259

공시일	2018-08-07
기준일	2018-08-06

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

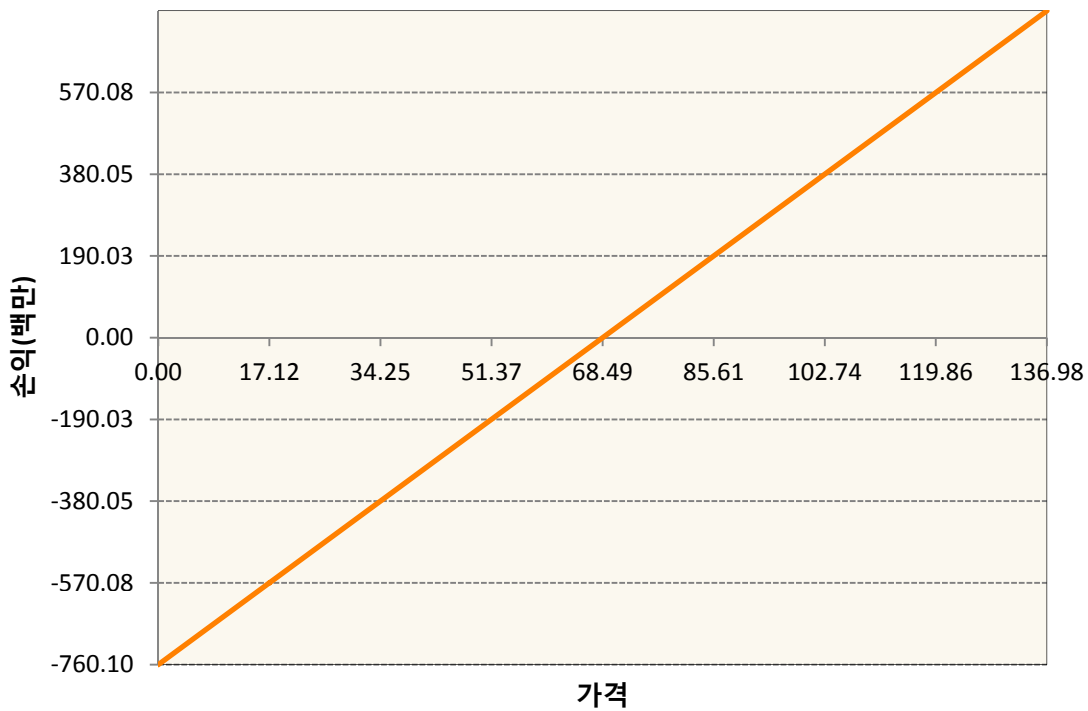
1. 계약금액

(단위:백만원)

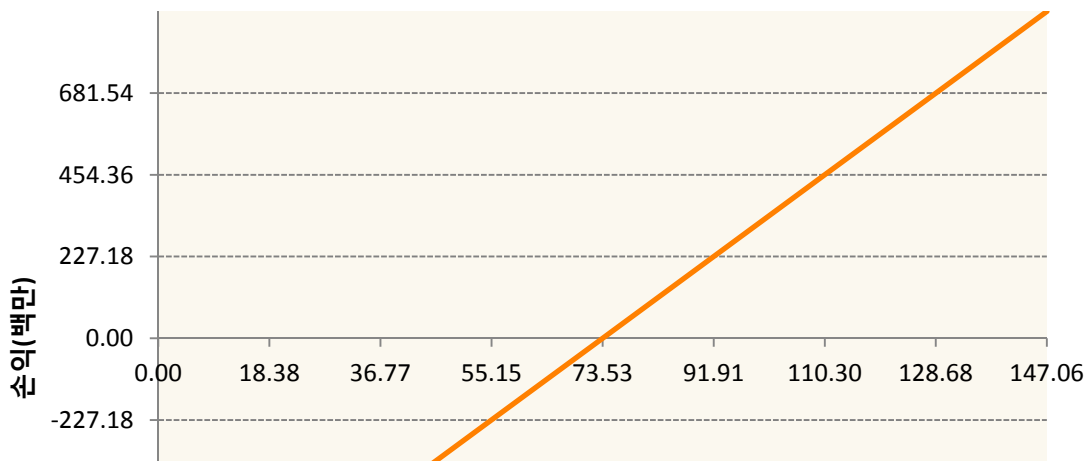
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,658	618	3,039	

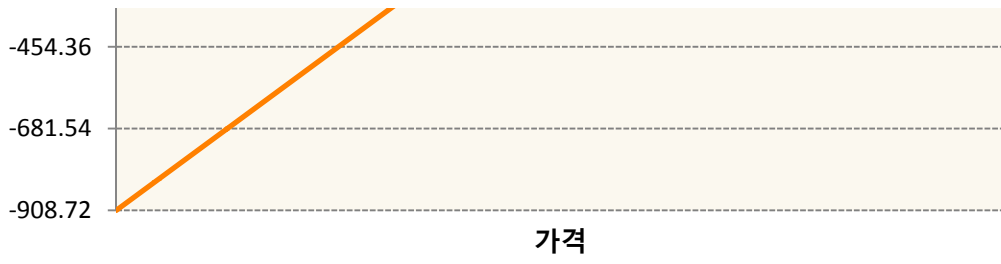
2. 만기시점의 손익구조

CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18

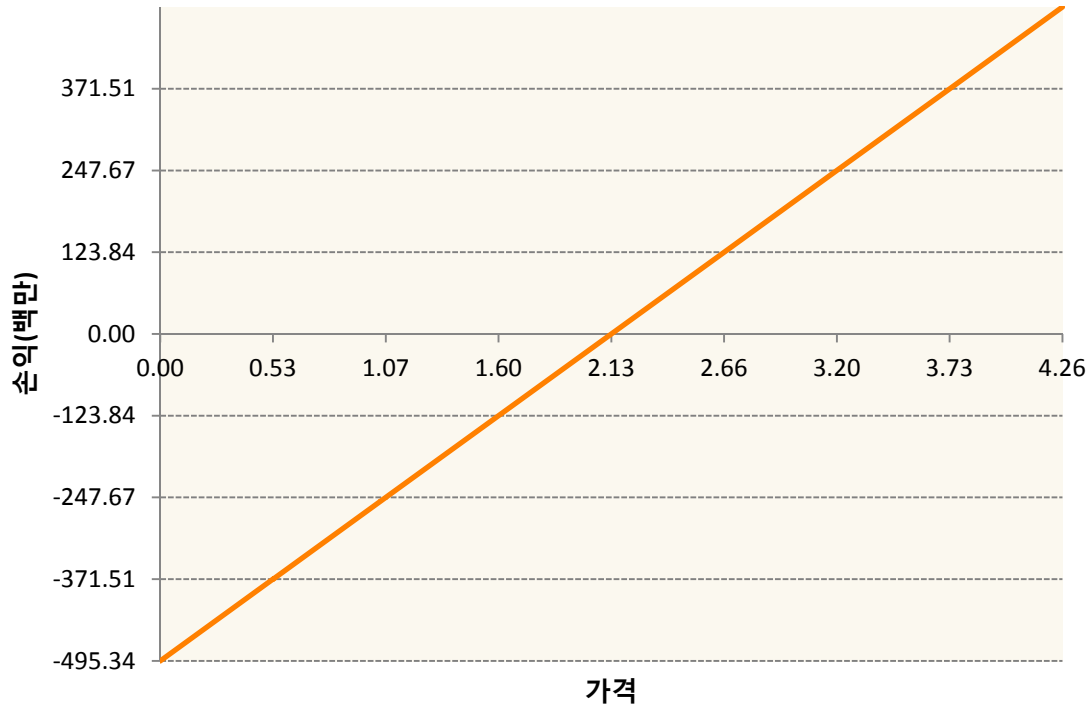


COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18

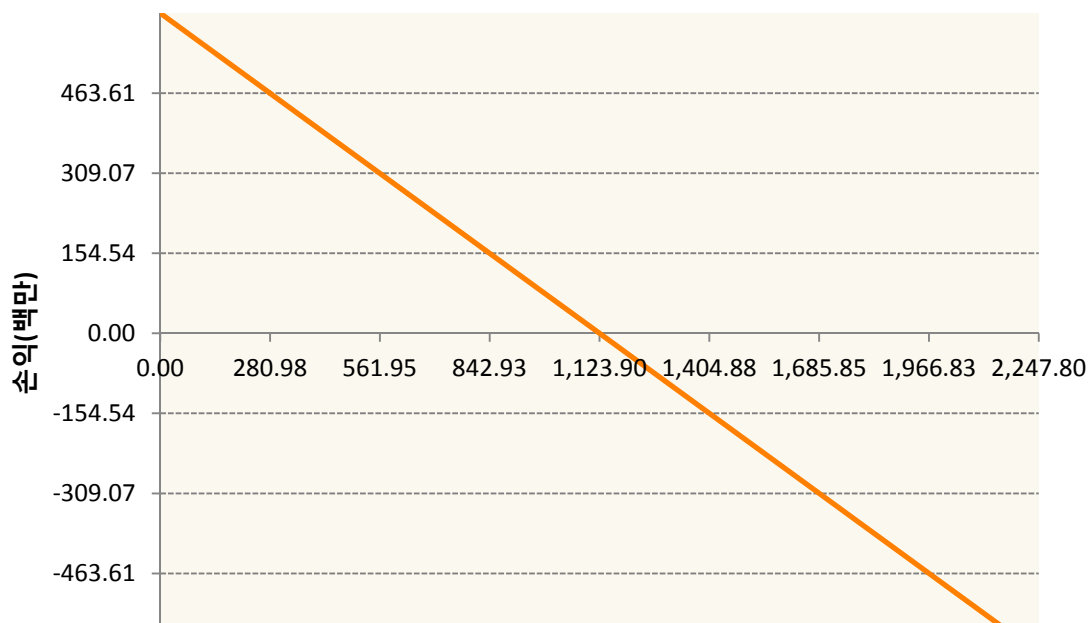


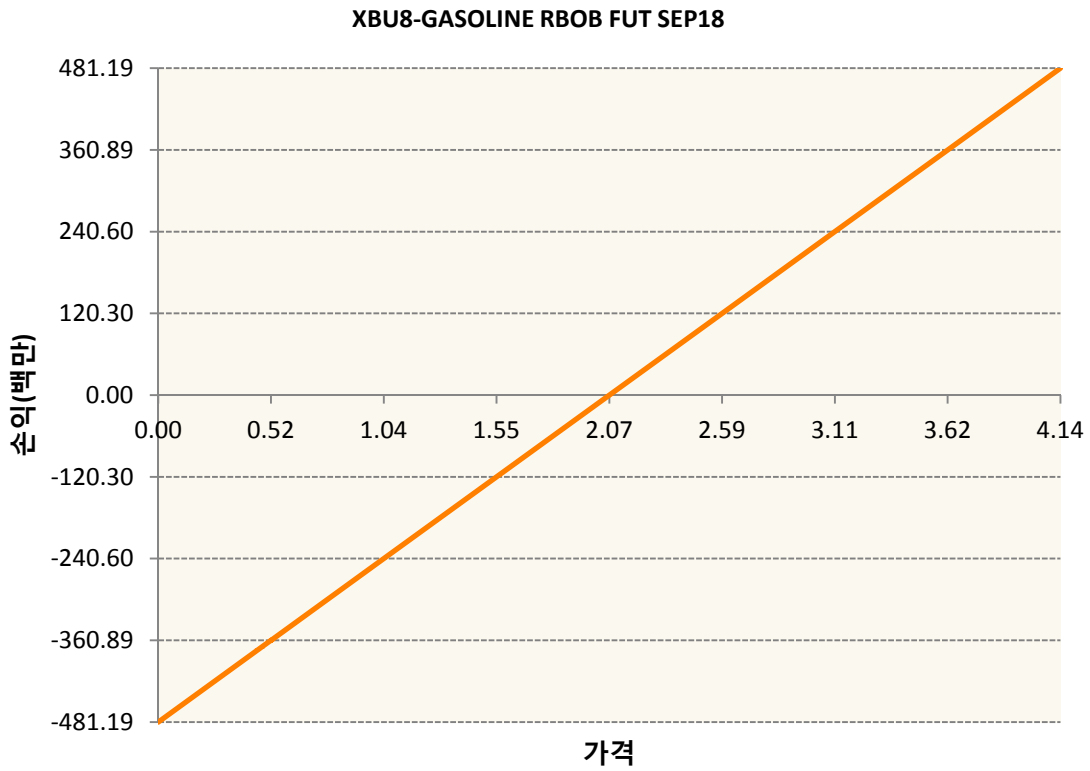
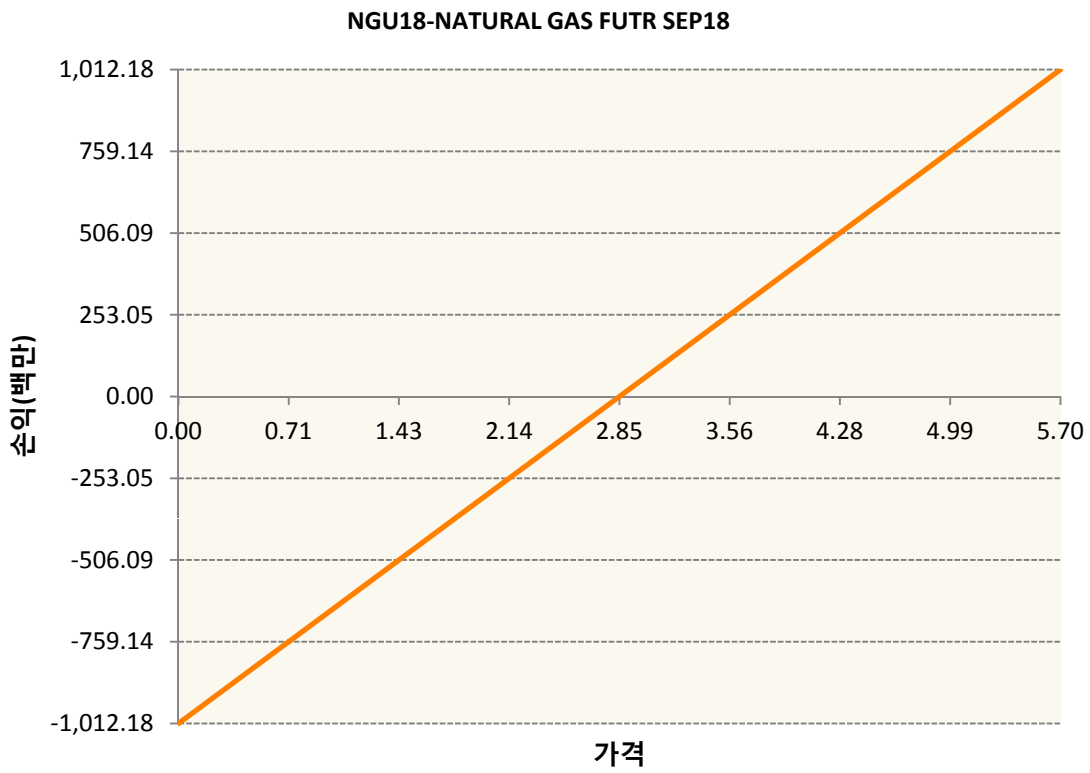
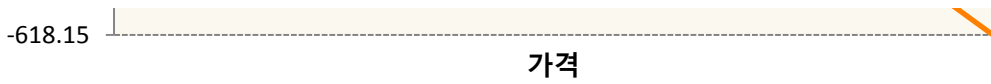


HOU8-NY Harb ULSD Fut SEP18



KR4175N80001-2018-08 달러선물





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	49
NGU18	NATURAL GAS FUTR SEP18	81
XBU8	GASOLINE RBOB FUT SEP18	38

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

447

공시일	2018-08-07
기준일	2018-08-06

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

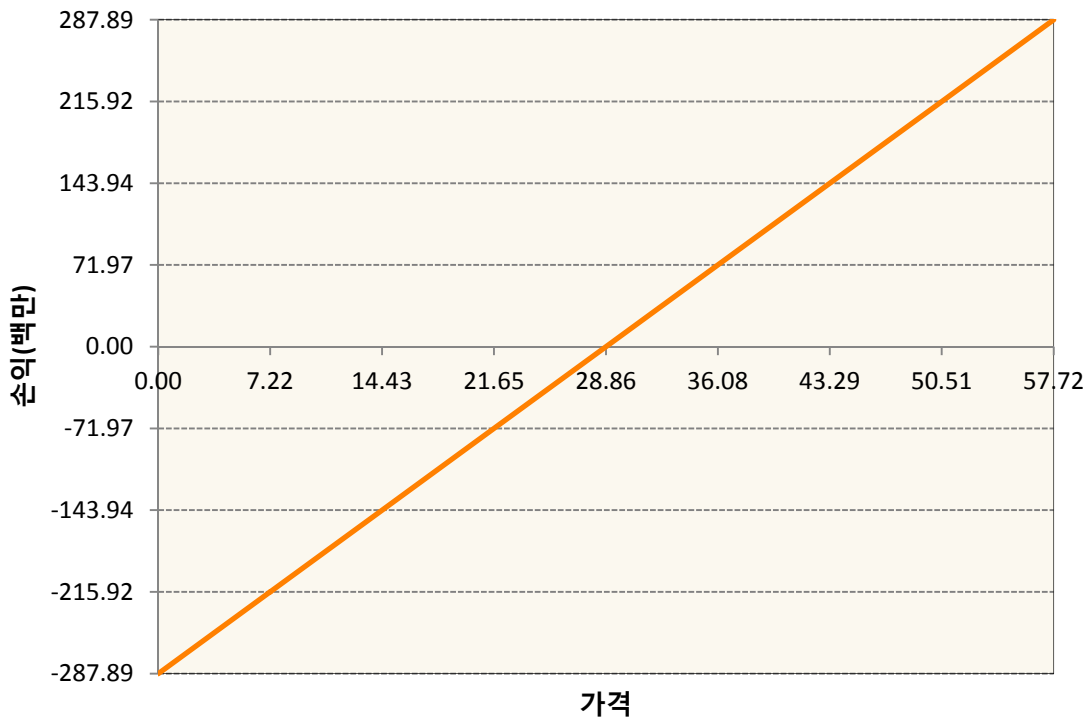
1. 계약금액

(단위:백만원)

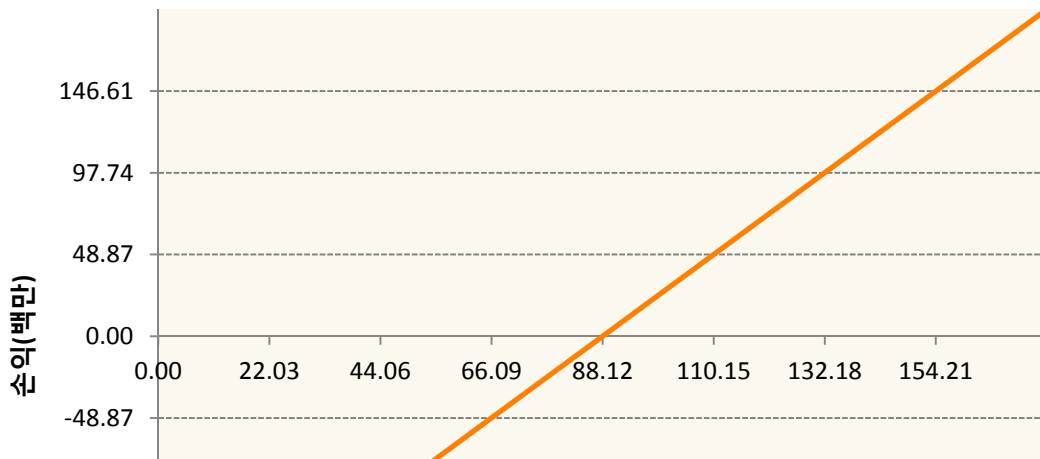
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,739	79	3,661	

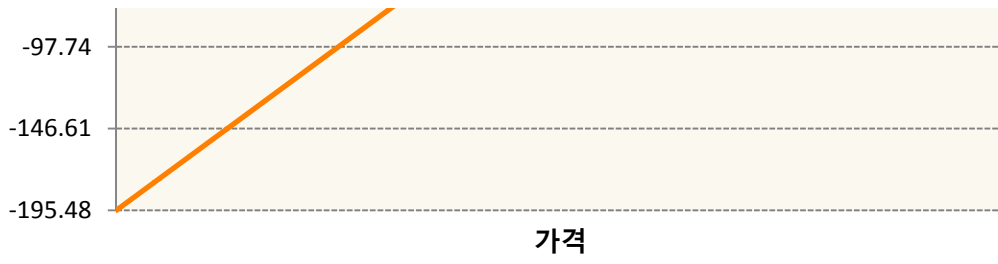
2. 만기시점의 손익구조

BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18

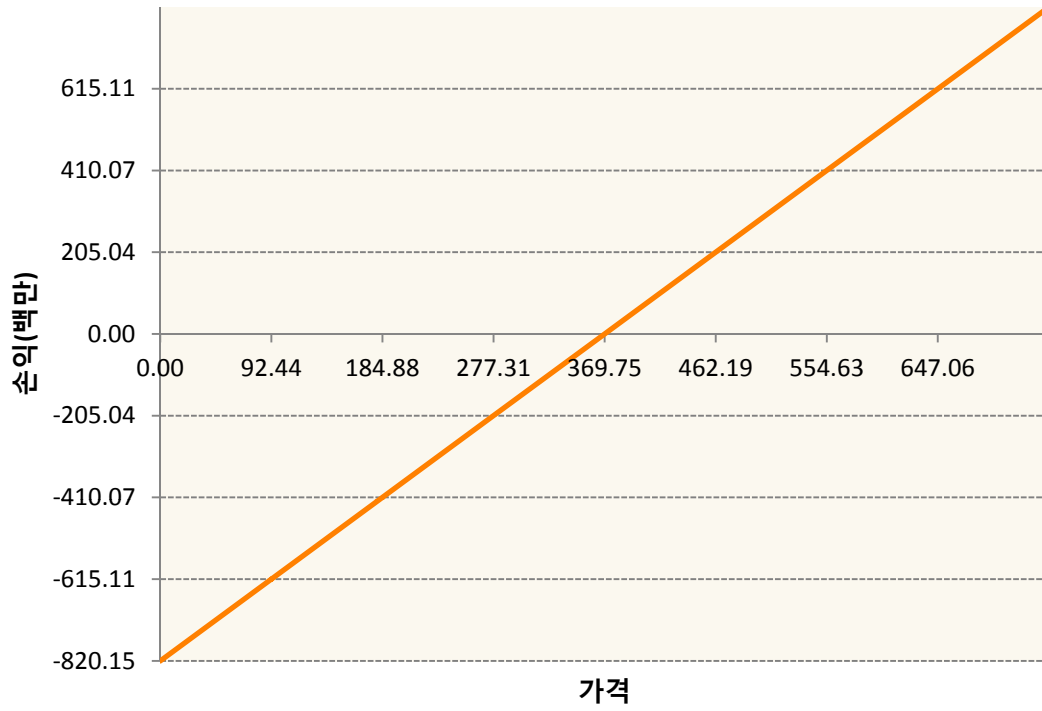


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

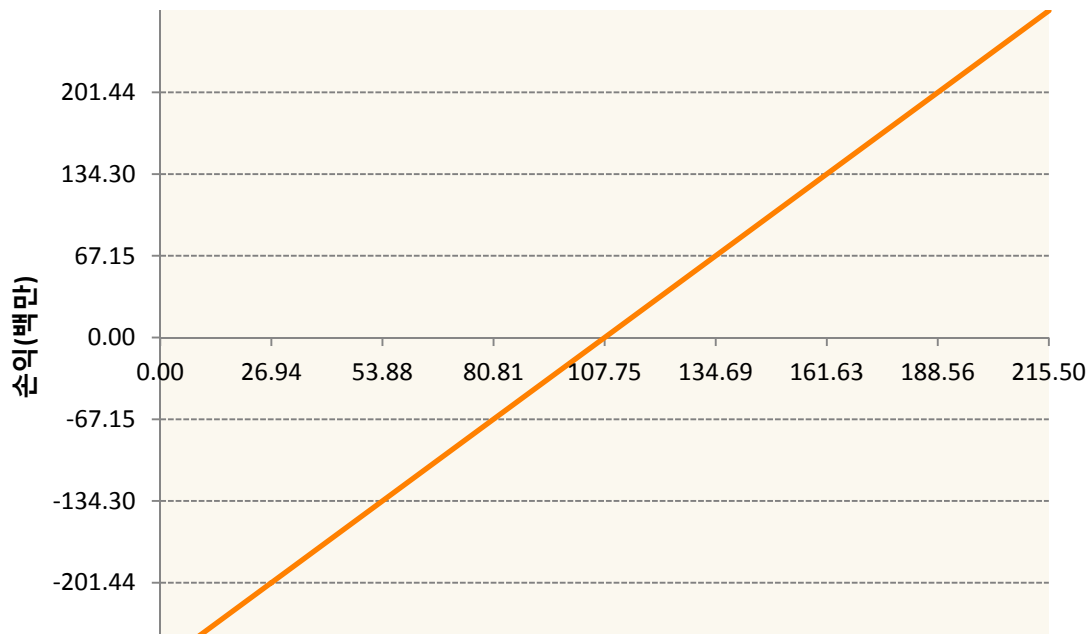


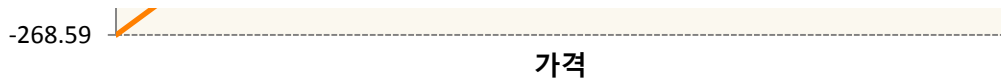


CU8-CORN FUTURE SEP18

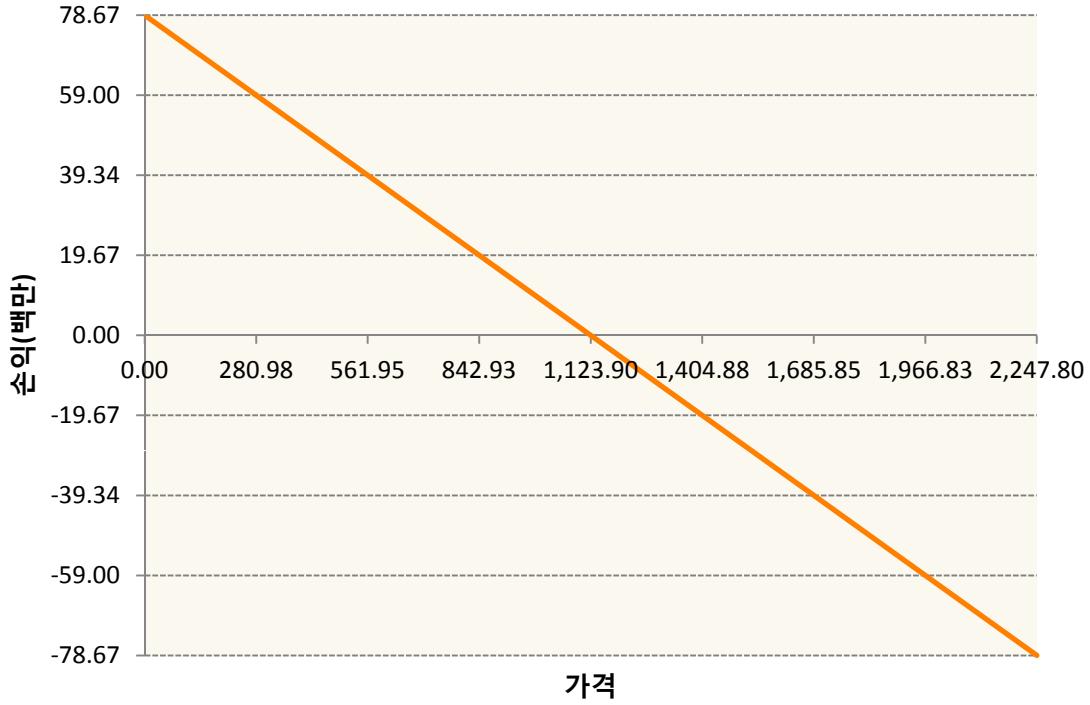


KCU8-COFFEE 'C' FUTURE SEP18

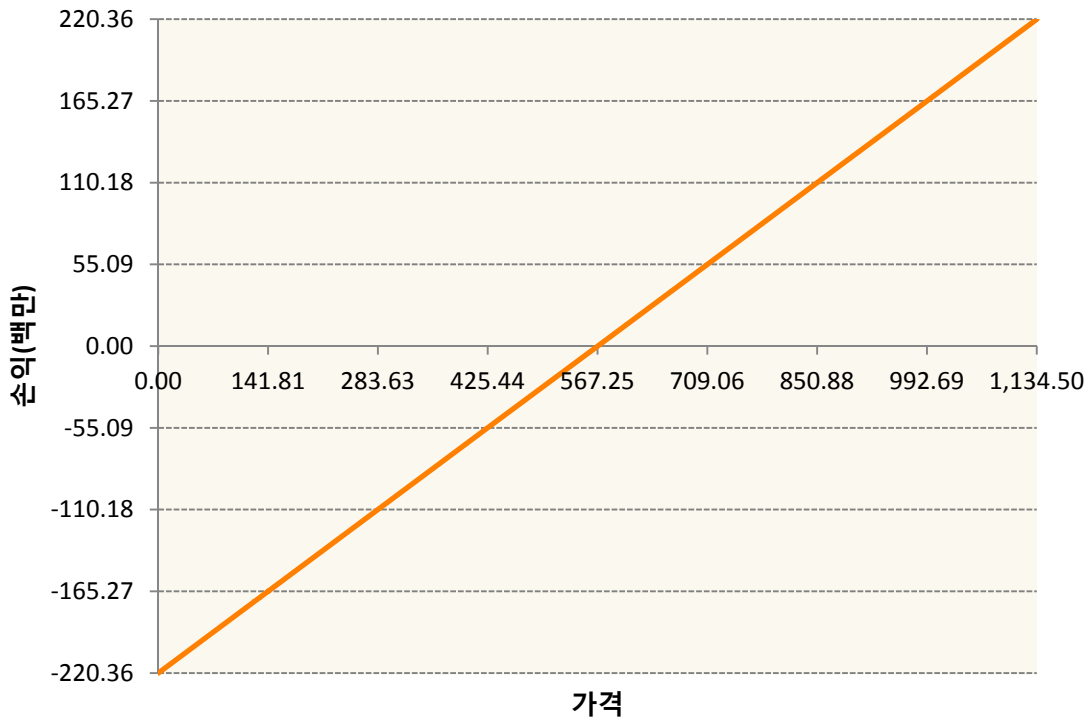




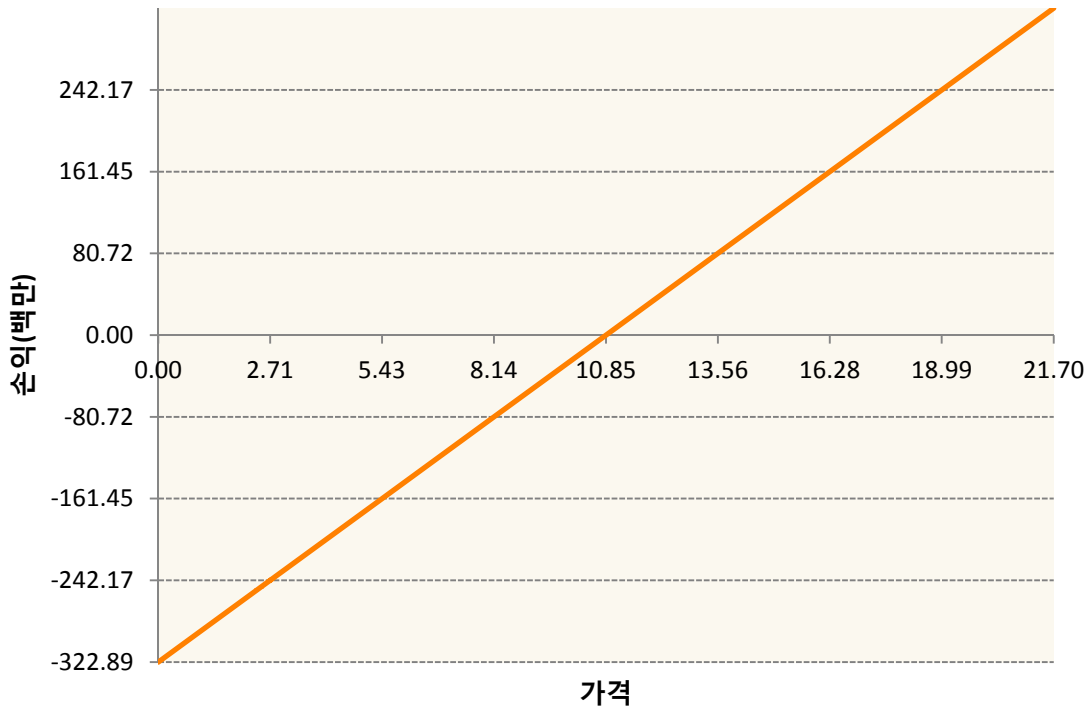
KR4175N80001-2018-08 달러선물



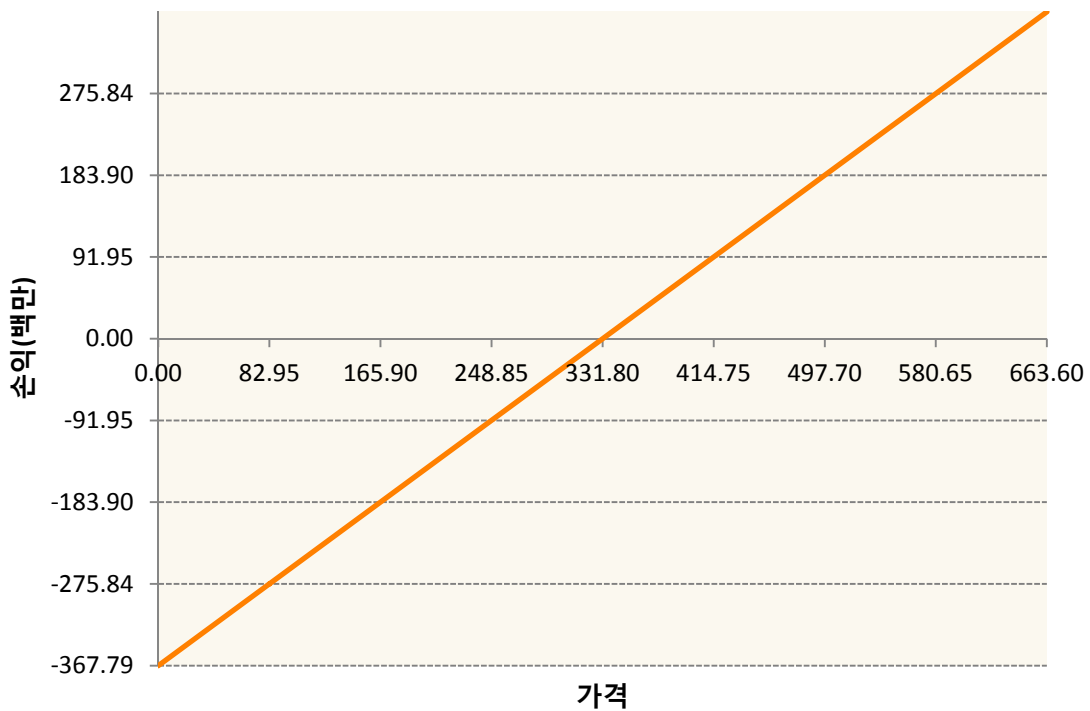
KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18



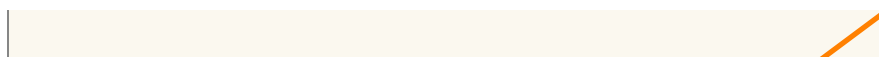
SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

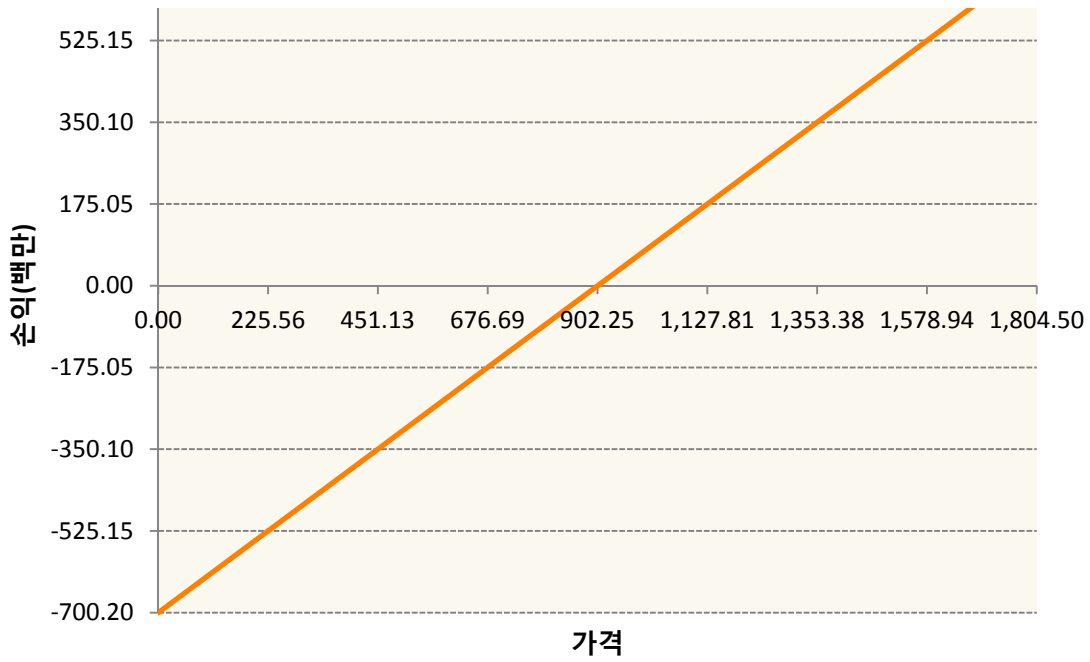


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

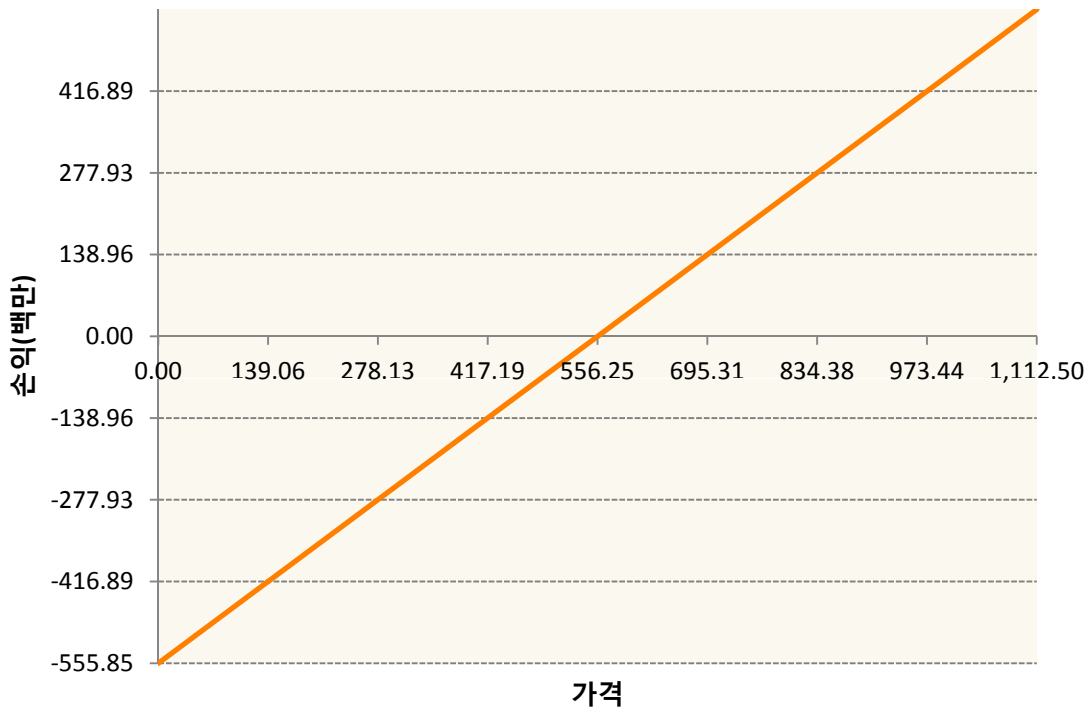


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





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	66
KCU8	COFFEE 'C' FUTURE SEP18	21
KR4175N80C	2018-08 달러선물	6

KWU8	KC HRW WHEAT FUT SEP18	18
SBV8	SUGAR #11 (WORLD) OCT18	26
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	29
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	56
WU8	WHEAT FUTURE(CBT) SEP18	44

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

(단위:백만원)

316