

공시일	2018-08-08
기준일	2018-08-07

## 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	2018-08-08
기준일	2018-08-07

## 스마트인덱스모

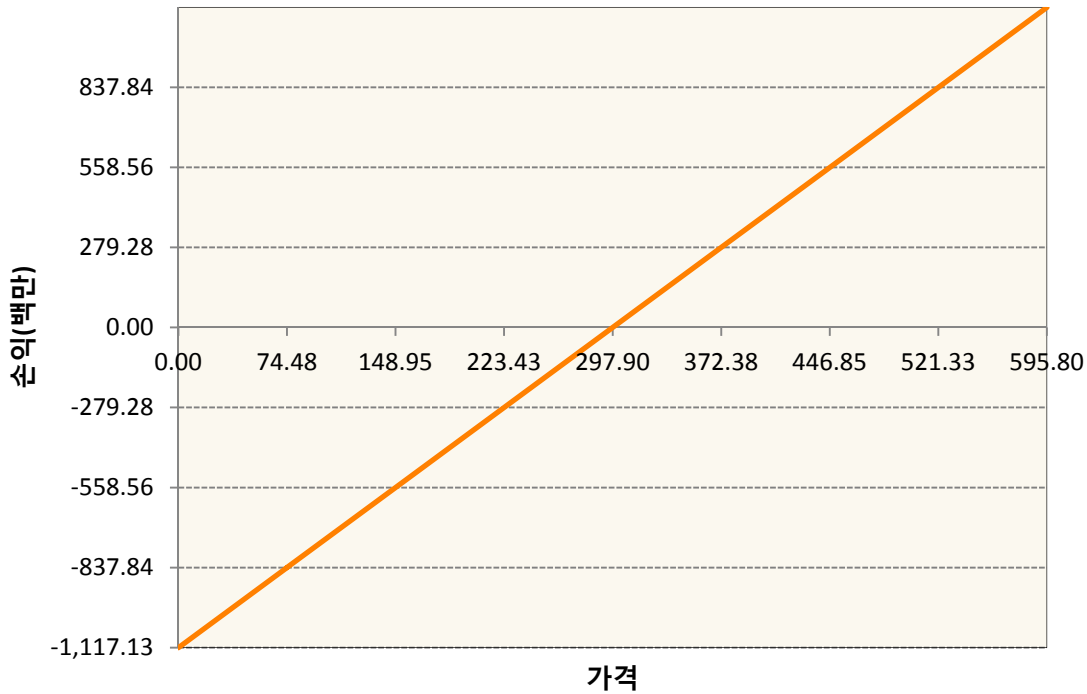
### 1. 계약금액

(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	2018-08-08
기준일	2018-08-07

## 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

1,143

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

481

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-08
기준일	2018-08-07

## 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

306

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

375

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-08
기준일	2018-08-07

## 유로인덱스모(주식-파생형)

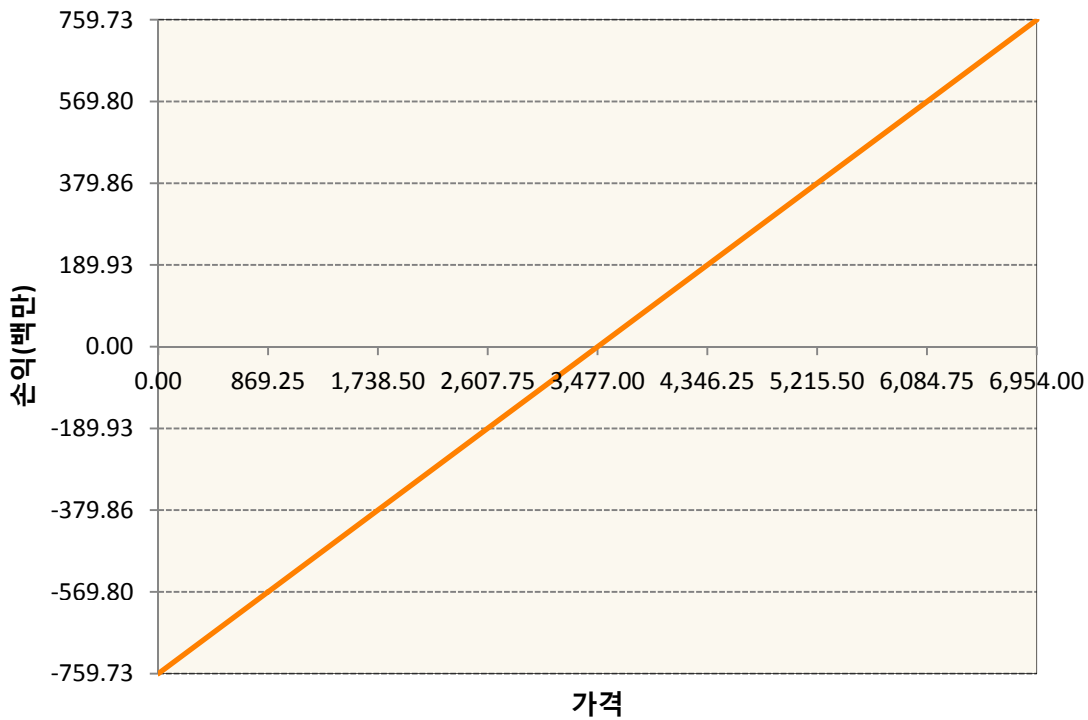
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	760	0	760	

### 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	2018-08-08
기준일	2018-08-07

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

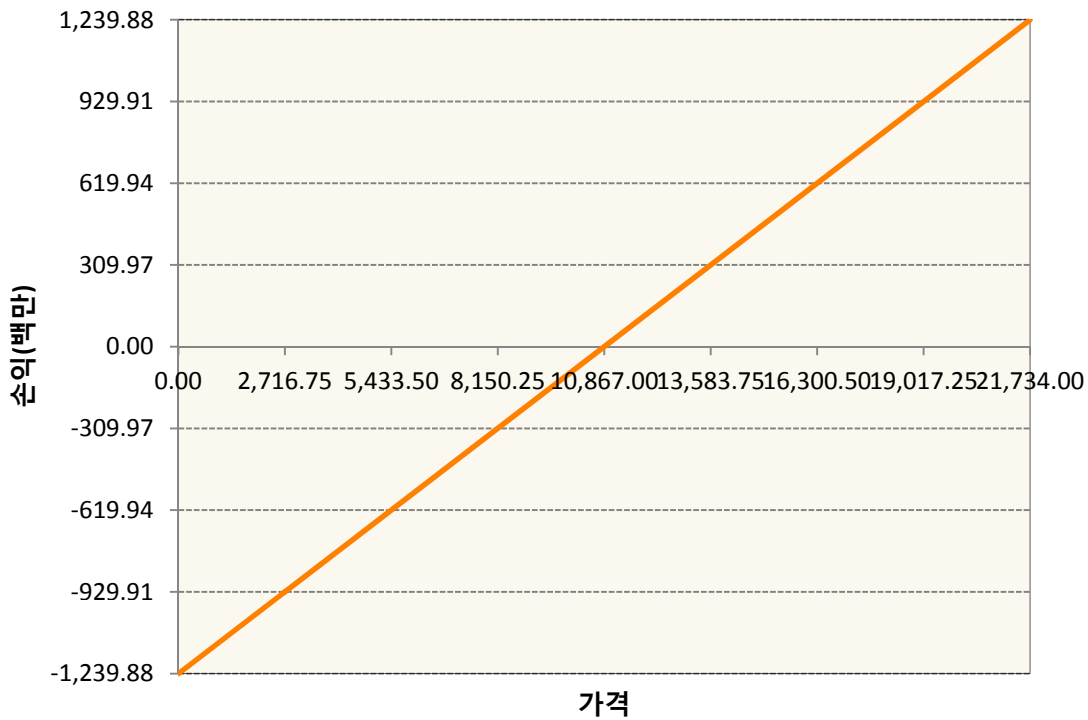
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

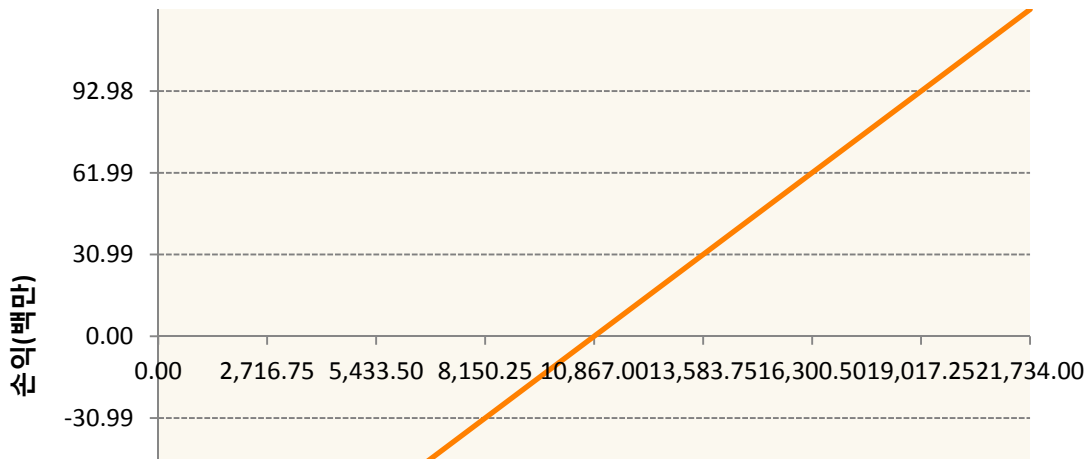
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,364	0	1,364	장내

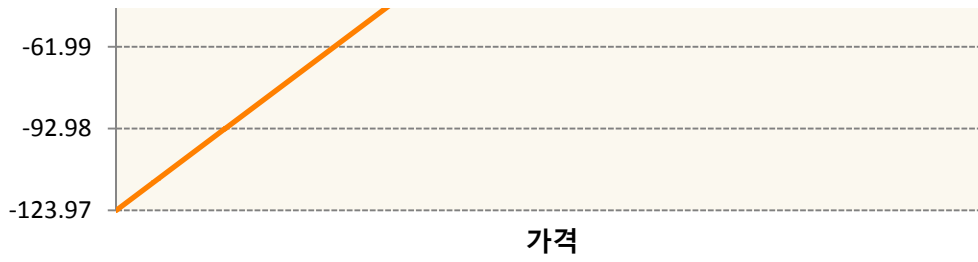
### 2. 만기시점의 손익구조

HCQ8-HSCEI Futures Aug18



MHCQ8-MINI H-SHR IDX FU Aug18





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

HCQ8	HSCEI Futures Aug18	99
MHCQ8	MINI H-SHR IDX FU Aug18	10

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

<b>99</b>
-----------

공시일	2018-08-08
기준일	2018-08-07

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

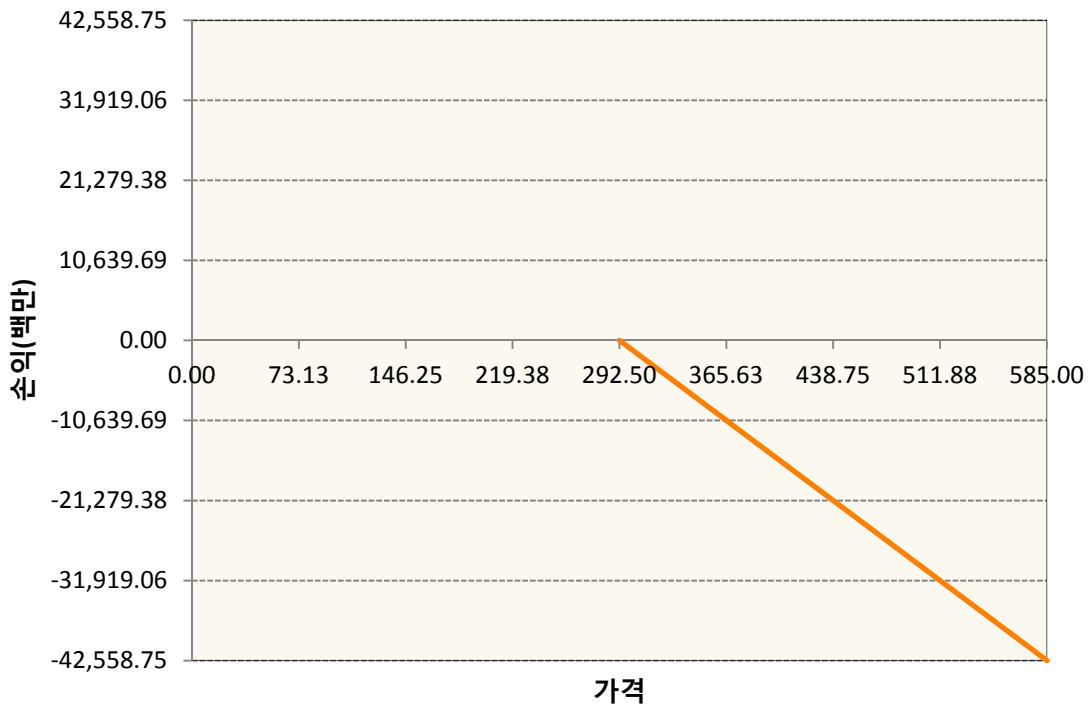
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

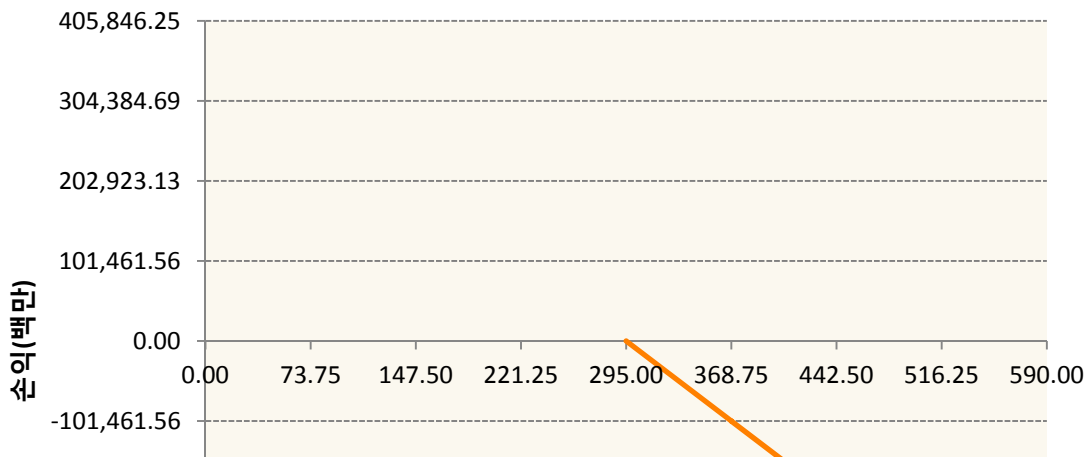
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	727,405	-727,405	장내

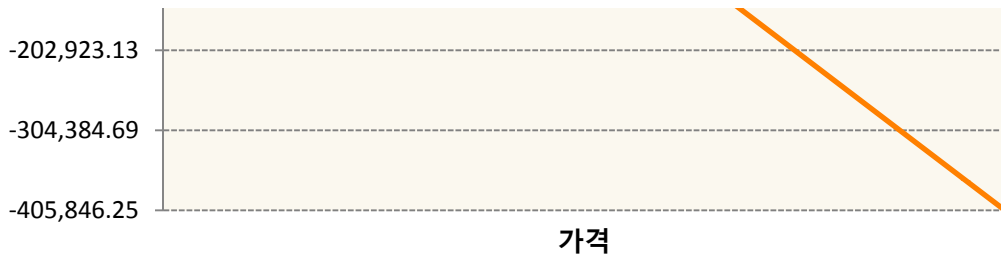
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201N82928-2018-08 콜292.5**

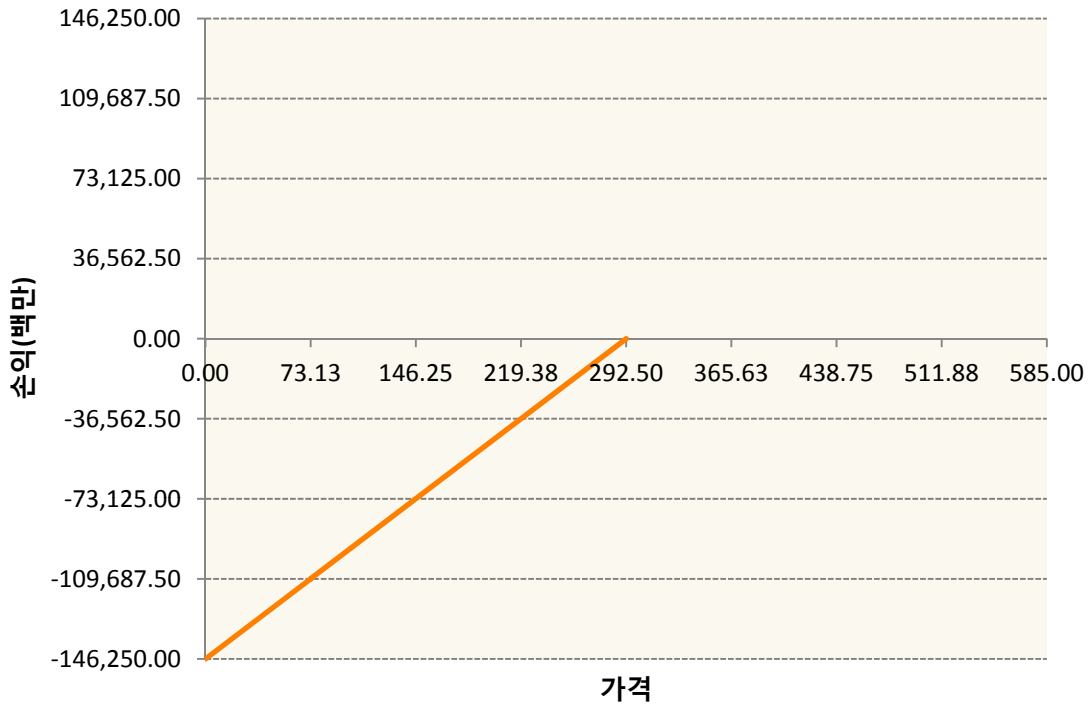


**KR4201N82951-2018-08 콜295**

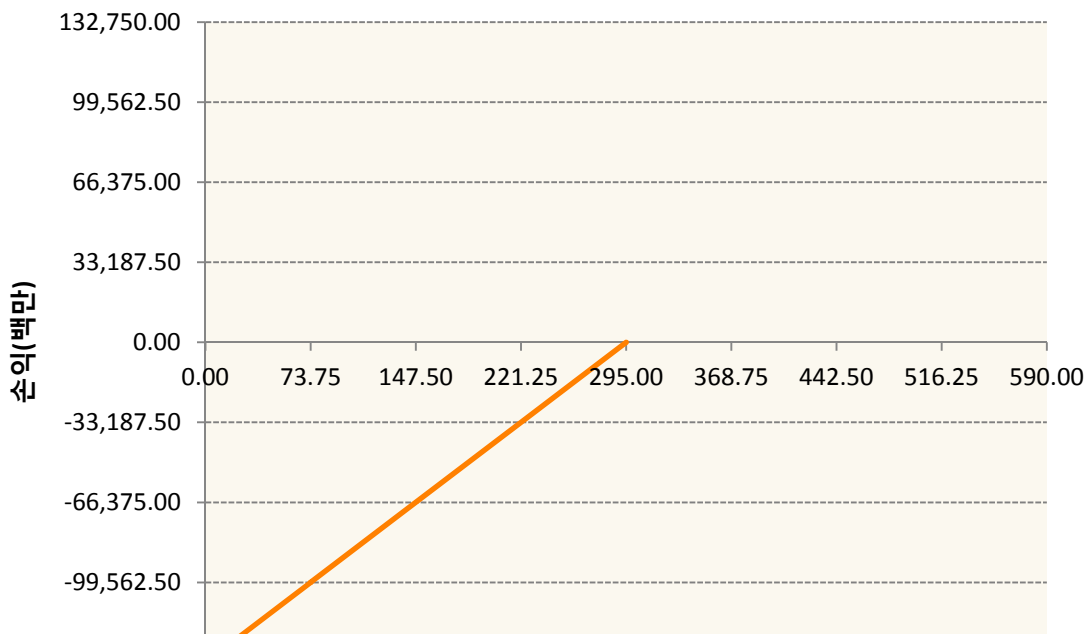




KR4301N82926-2018-08 풋292.5



KR4301N82959-2018-08 풋295





5.33%	135	135	135	135	135	135	135
8.00%	135	135	135	135	135	135	135

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

(단위:백만원)

**69,198**

공시일	2018-08-08
기준일	2018-08-07

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

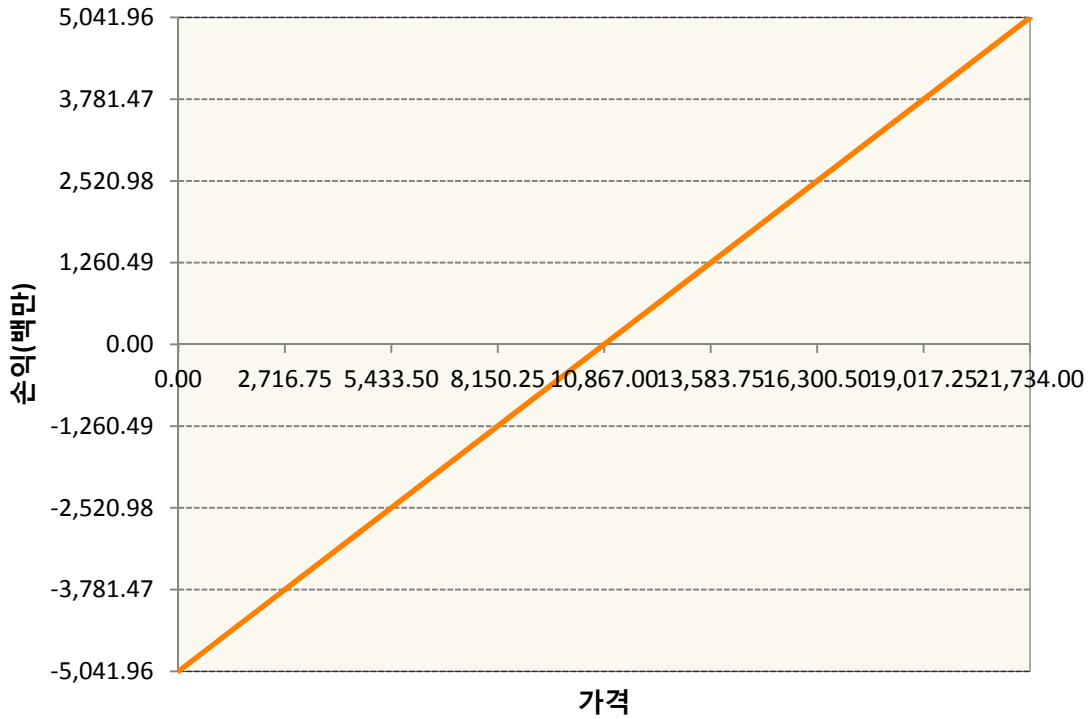
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

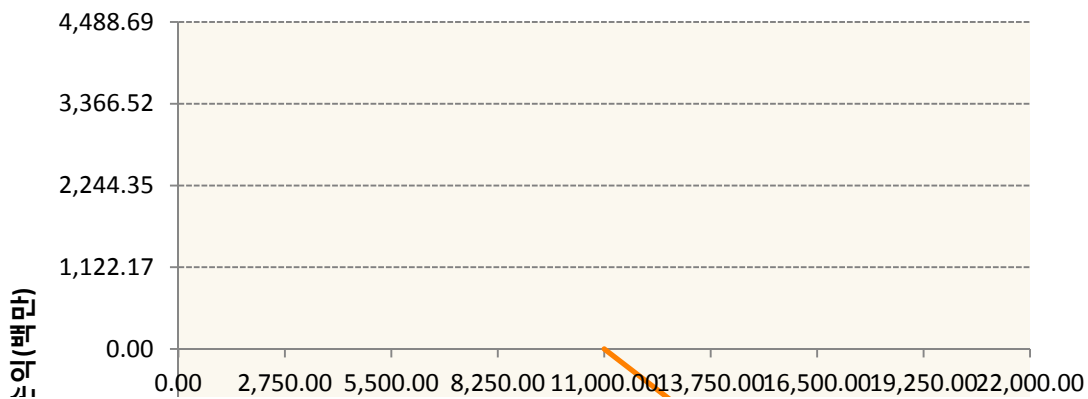
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,042	0	5,042	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,543	-11,543	장내

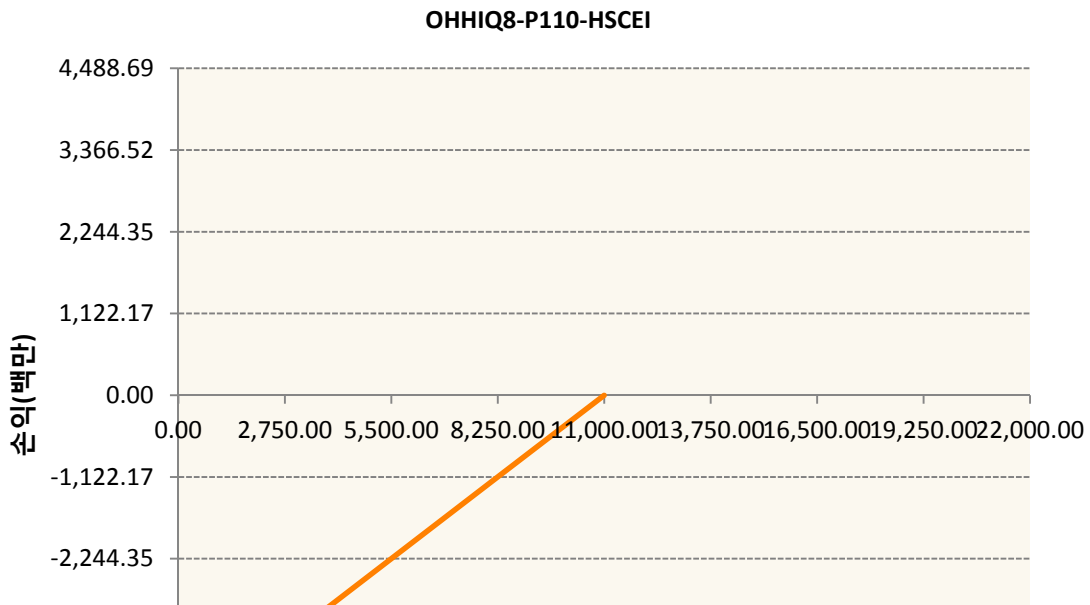
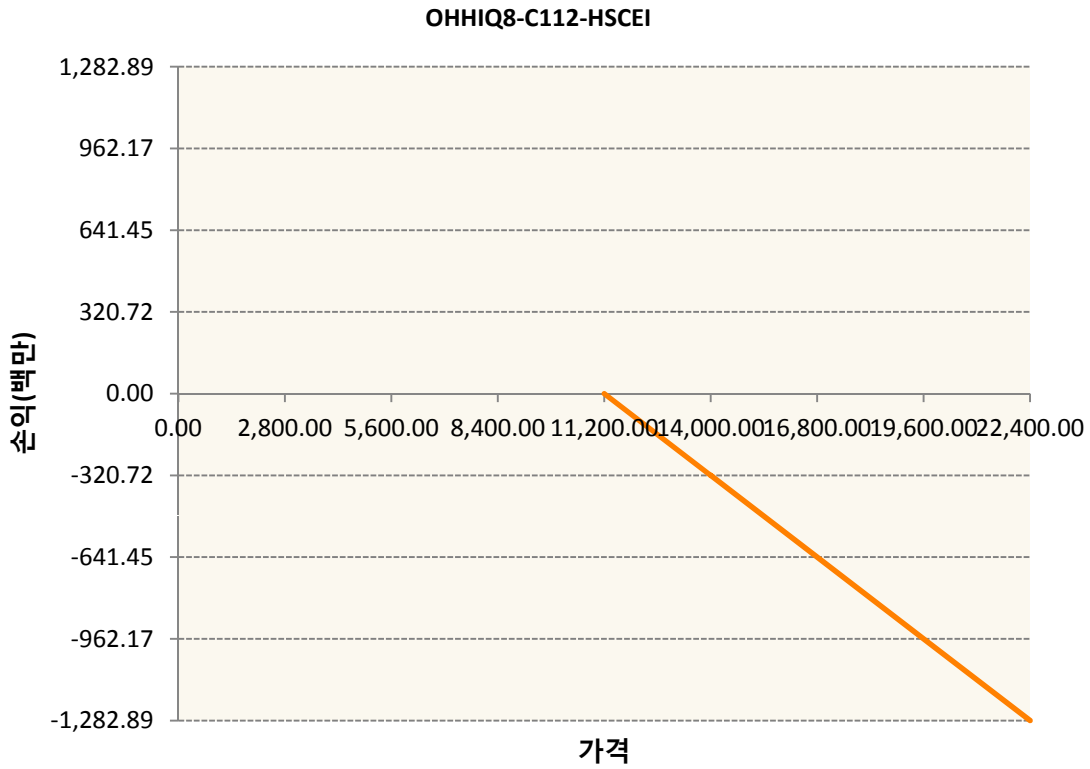
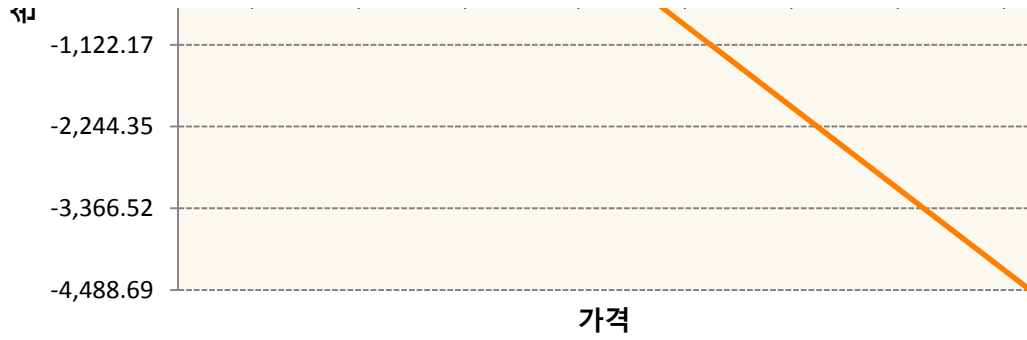
### 2. 만기시점의 손익구조

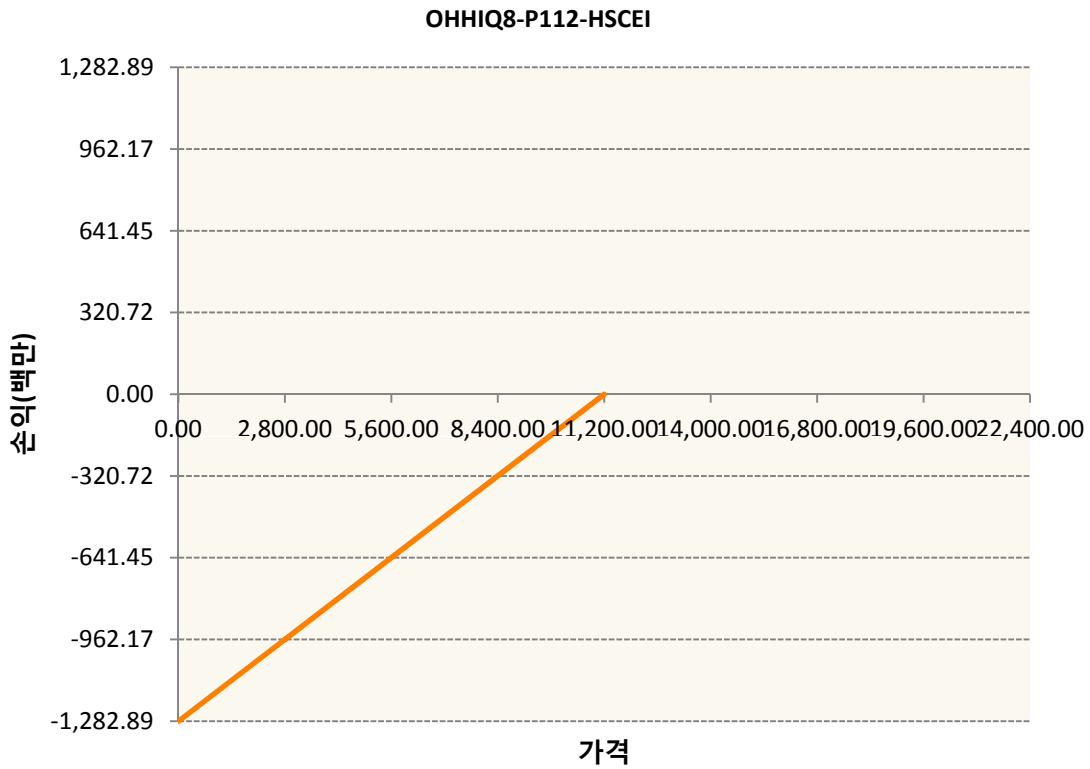
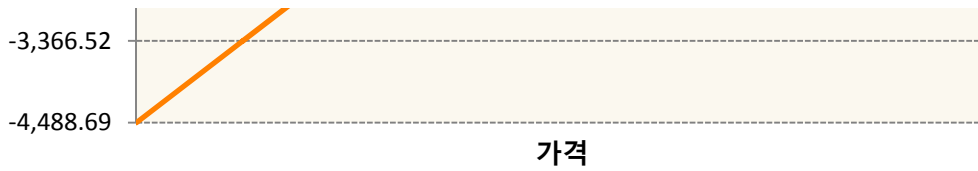
HCQ8-HSCEI Futures Aug18



OHHIQ8-C110-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ8	HSCEI Futures Aug18	403
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)
	<b>1,208</b>

공시일	2018-08-08
기준일	2018-08-07

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

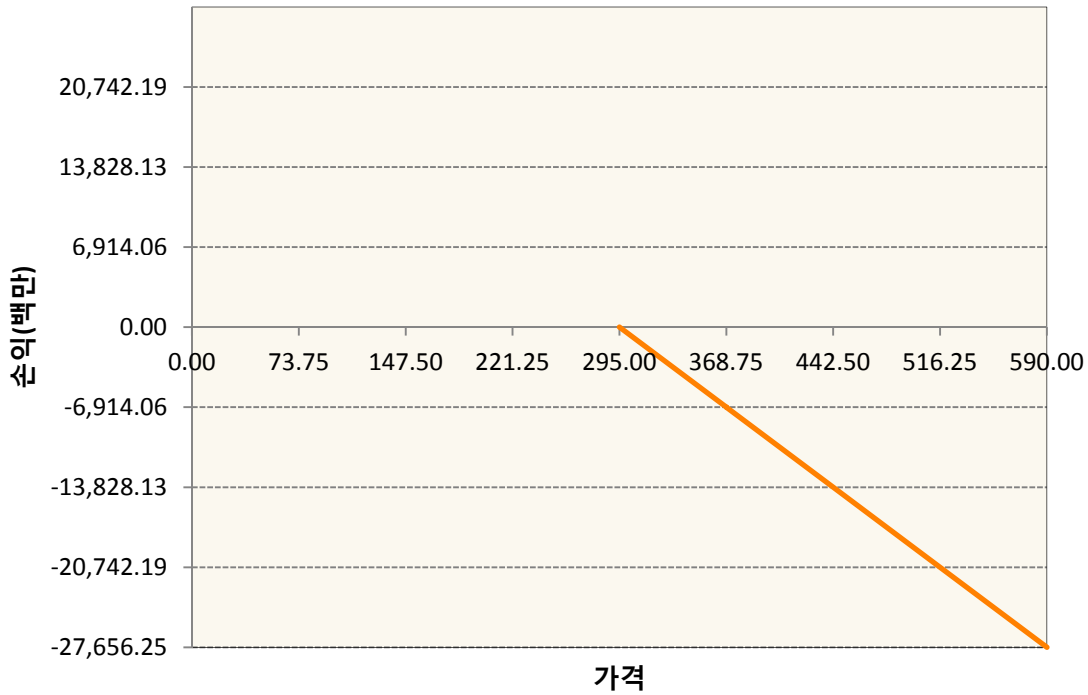
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

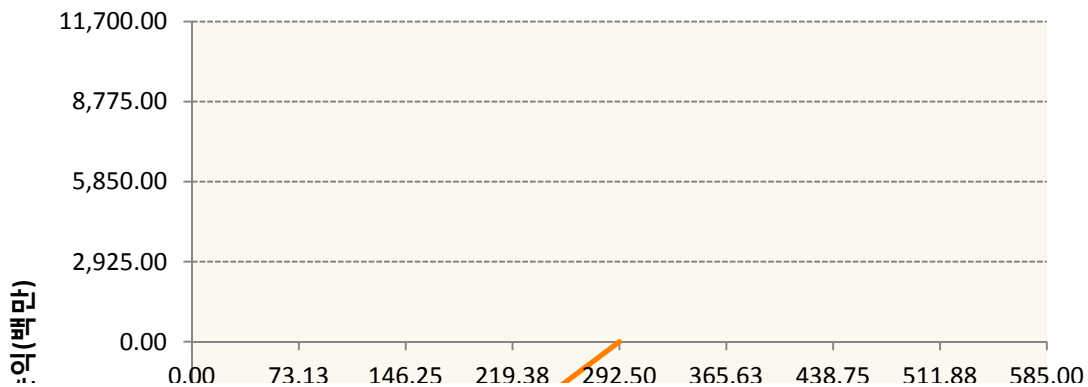
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	48,575	-48,575	장내

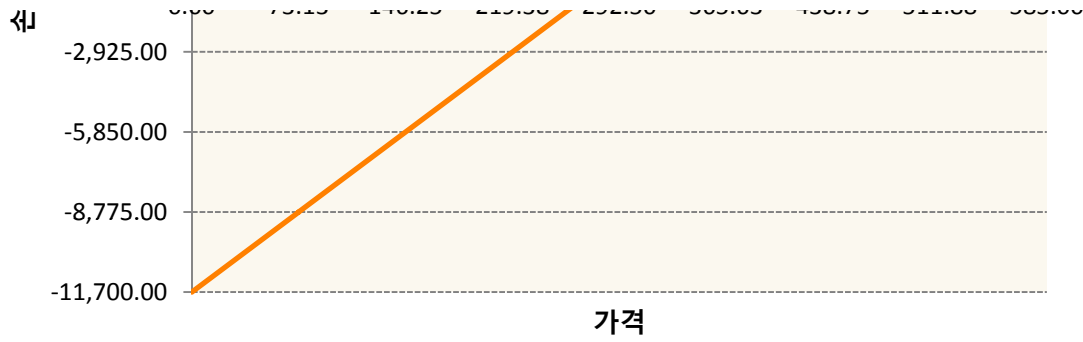
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N82951-2018-08 콜295

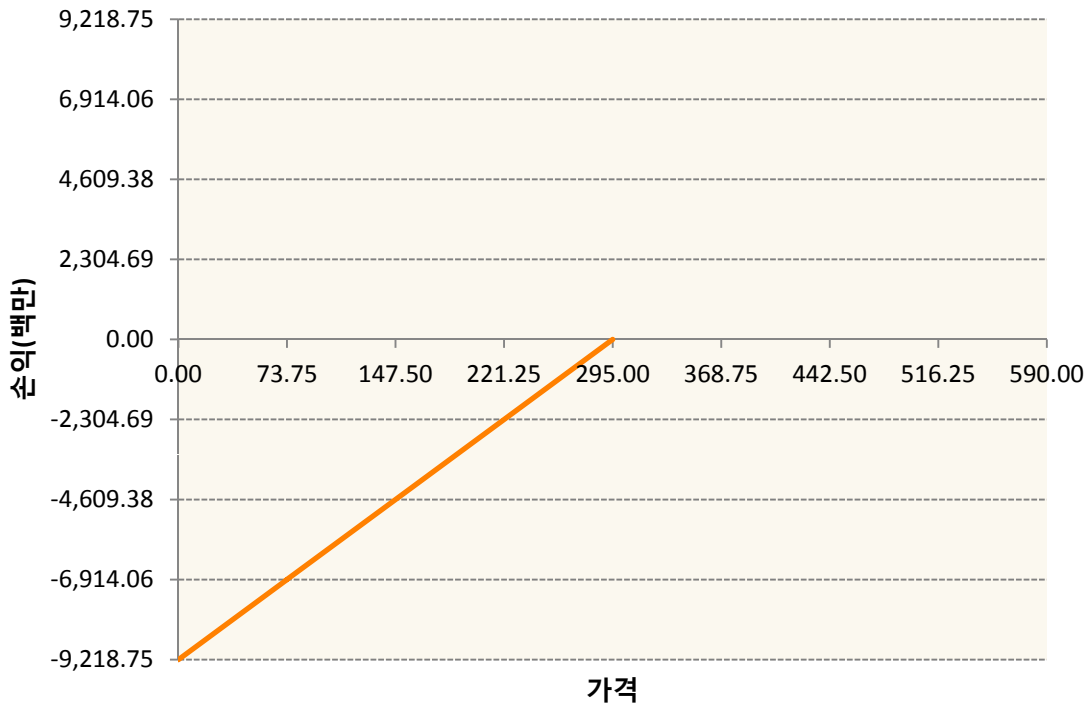


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





KR4301N82959-2018-08 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_2							1,507	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,507	-1,507	-1,507	-1,507	-1,507	-1,507	-1,507	
-5.33%	-1,004	-1,004	-1,004	-1,004	-1,004	-1,004	-1,004	
-2.67%	-502	-502	-502	-502	-502	-502	-502	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	502	502	502	502	502	502	502	
5.33%	1,004	1,004	1,004	1,004	1,004	1,004	1,004	
8.00%	1,507	1,507	1,507	1,507	1,507	1,507	1,507	
2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_3							285	
	기초자산의 변동성							



0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	163	163	163	163	163	163	163
5.33%	326	326	326	326	326	326	326
8.00%	489	489	489	489	489	489	489

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 2,090

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	342	342	342	342	342	342	342
-5.33%	342	342	341	340	339	337	334
-2.67%	323	314	304	293	280	268	254
0%	52	35	18	0	-18	-36	-54
2.67%	-607	-609	-612	-616	-622	-628	-636
5.33%	-1,347	-1,348	-1,348	-1,348	-1,348	-1,349	-1,350
8.00%	-2,090	-2,090	-2,090	-2,090	-2,090	-2,090	-2,090

KR4301N829 2018-08 풋292.5 762

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-762	-762	-762	-762	-762	-762	-762
-5.33%	-445	-445	-445	-445	-445	-445	-445
-2.67%	-130	-131	-132	-134	-135	-137	-139
0%	1	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

KR4301N829 2018-08 풋295 666

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-666	-666	-666	-666	-666	-666	-666
-5.33%	-418	-418	-418	-418	-418	-418	-418
-2.67%	-170	-170	-170	-171	-171	-171	-172
0%	5	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	9	9	9	9	9	9	9
5.33%	9	9	9	9	9	9	9
8.00%	9	9	9	9	9	9	9

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

(단위:백만원)

8,480

공시일	2018-08-08
기준일	2018-08-07

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

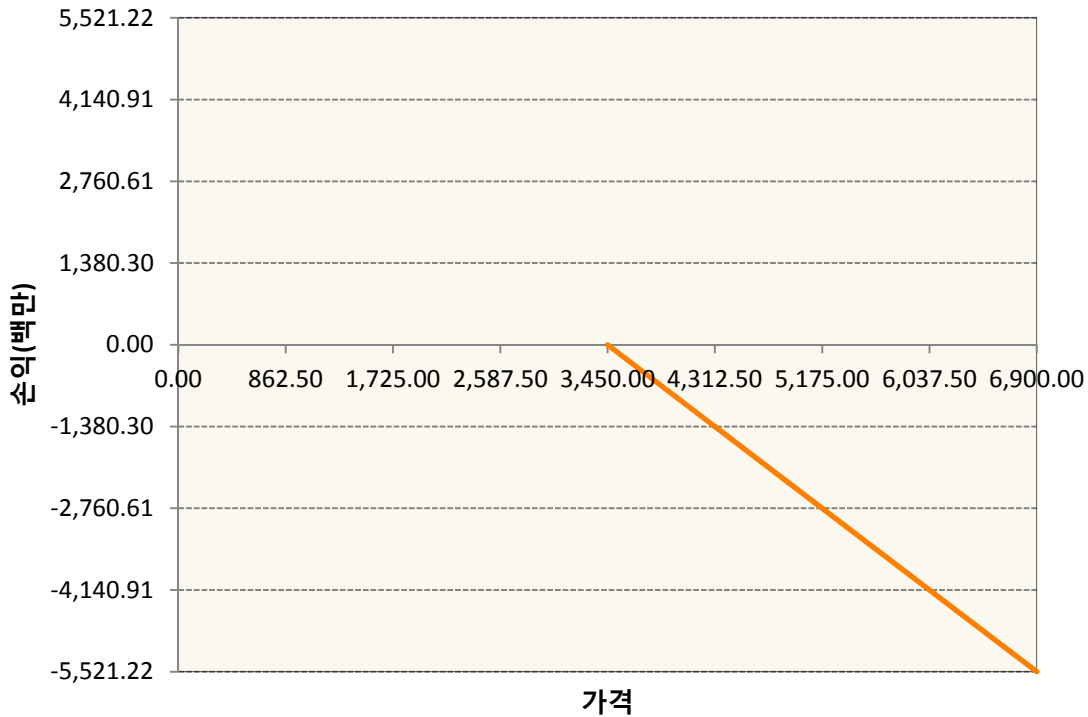
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

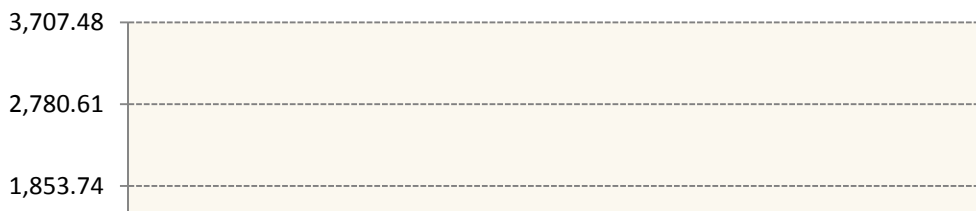
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,957	0	1,957	
누계	유가증권	스왑	44,866	0	44,866	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,754	-14,754	장내
누계	지수	스왑	52,823	0	52,823	장외

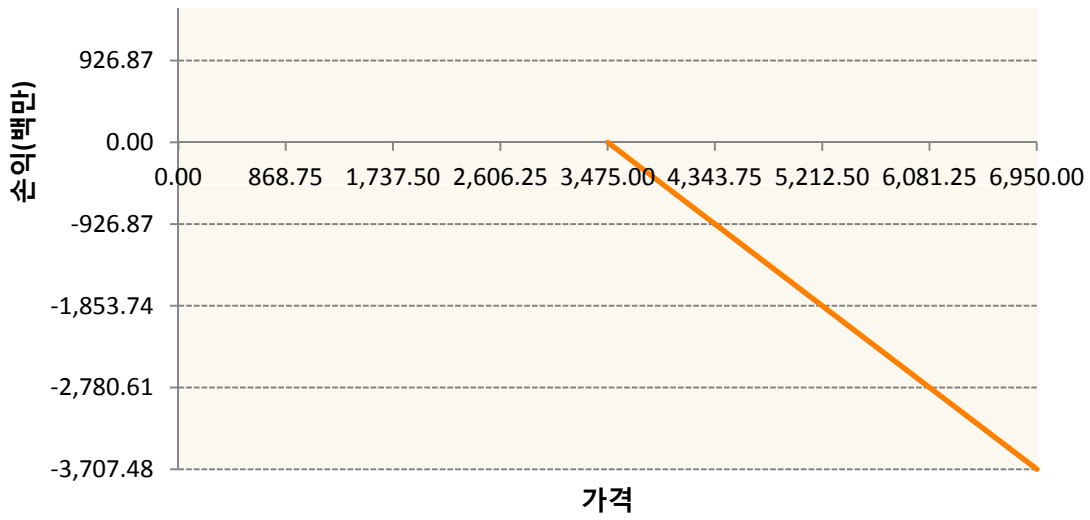
### 2. 만기시점의 손익구조

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

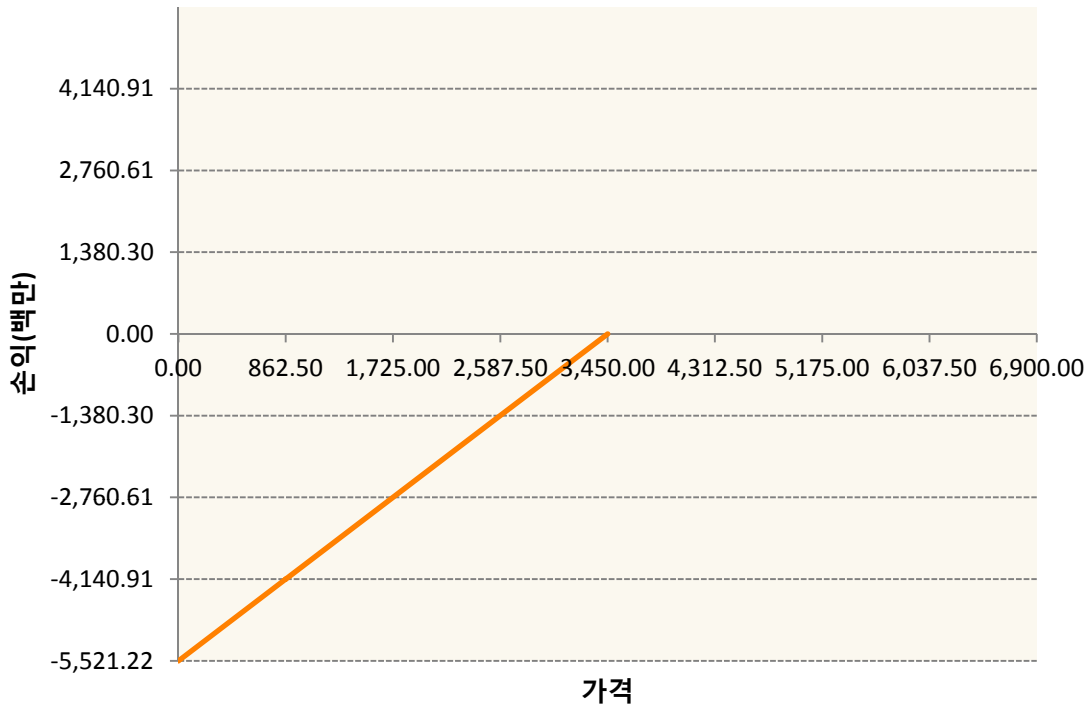


**OESXQ8-C3475-EURO STOXX 50 OPT**

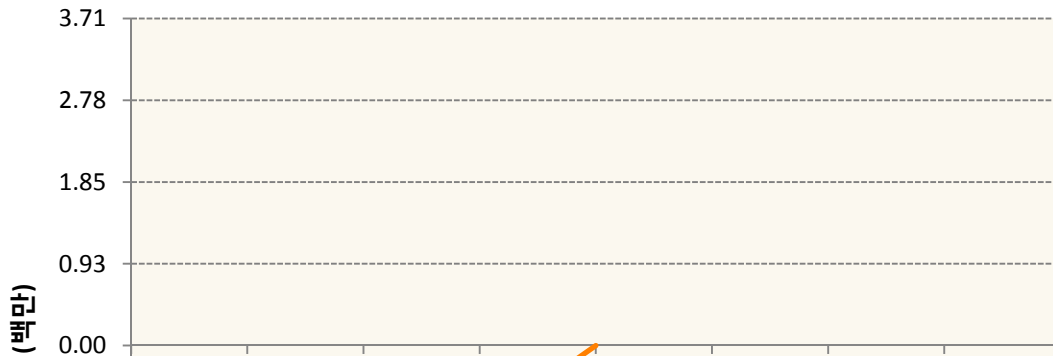


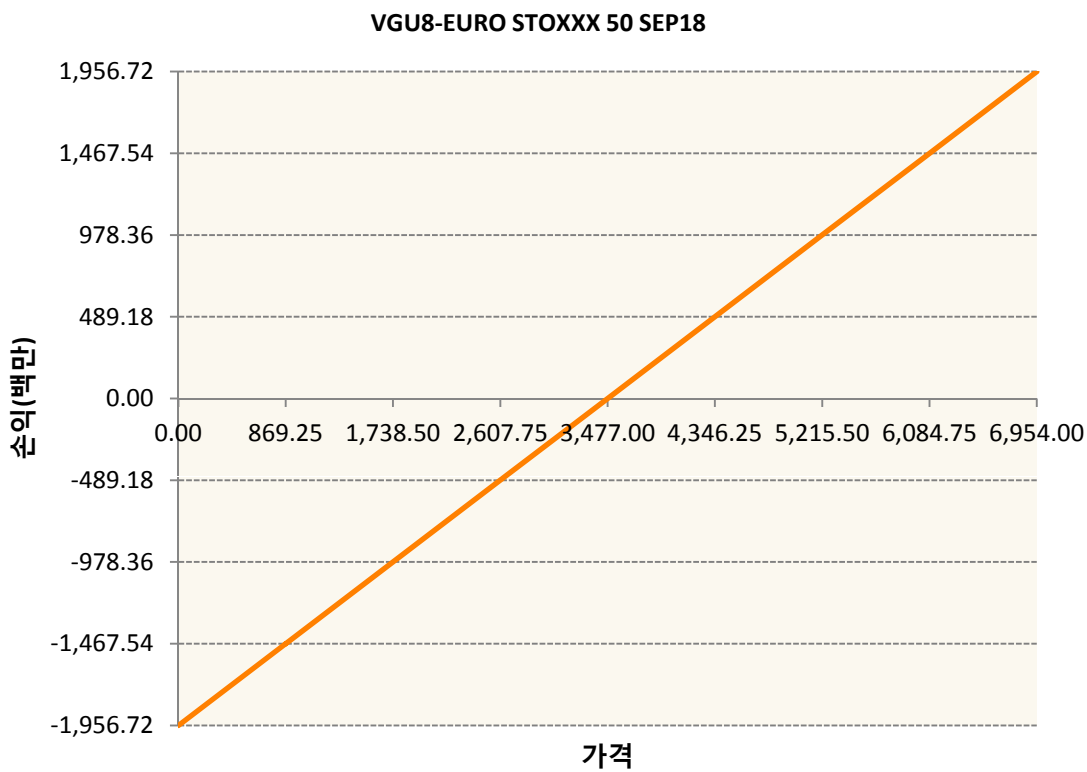
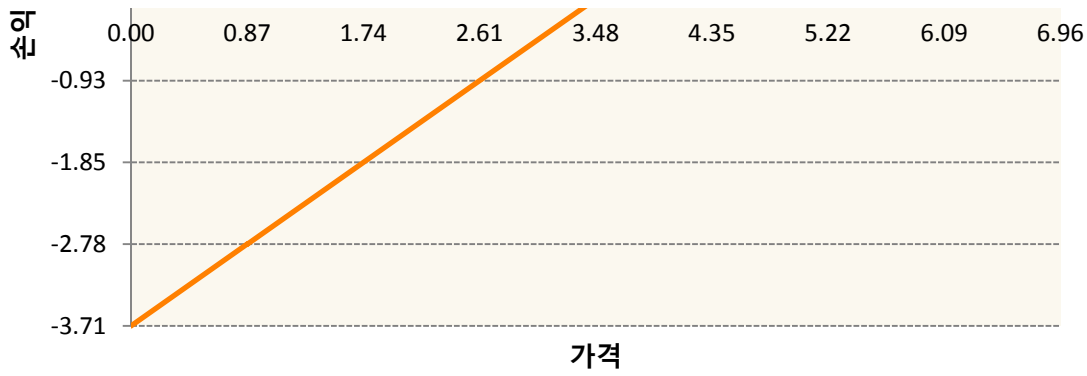


OESXQ8-P3450-EURO STOXX 50



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		442
OESXQ8-C3 EURO STOXX 50 OPT		297
OESXQ8-P3 EURO STOXX 50		442
OESXQ8-P3 EURO STOXX 50		0.3
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18		157

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





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

(단위:백만원)

1,145



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



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

(단위:백만원)

41

공시일	2018-08-08
기준일	2018-08-07

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

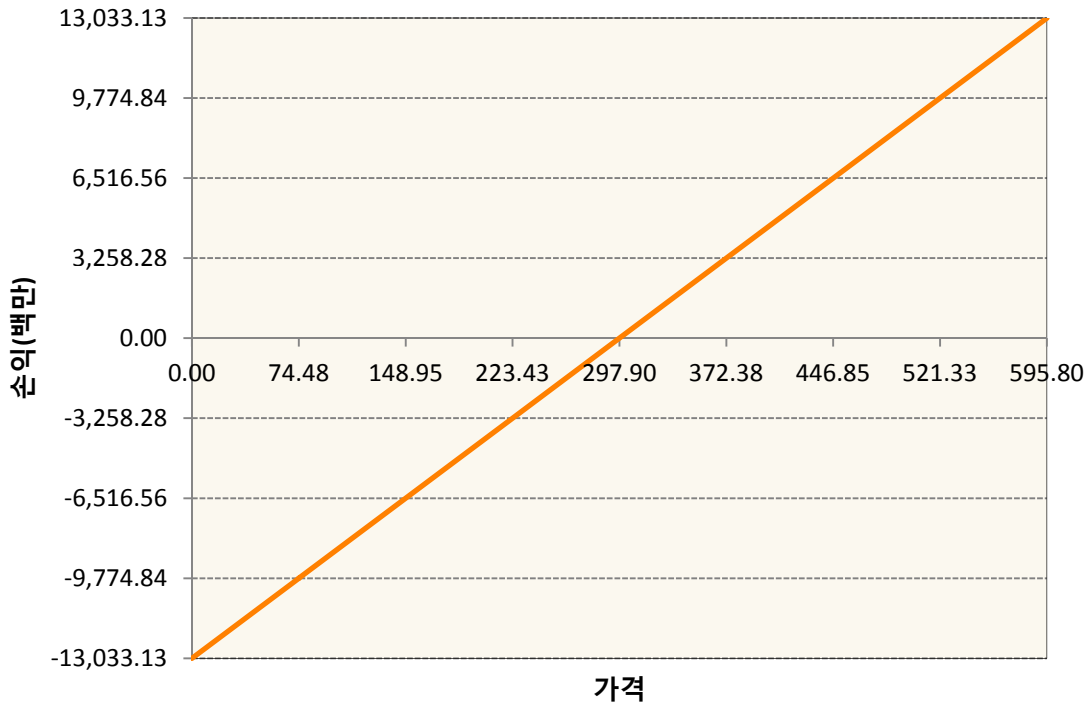
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

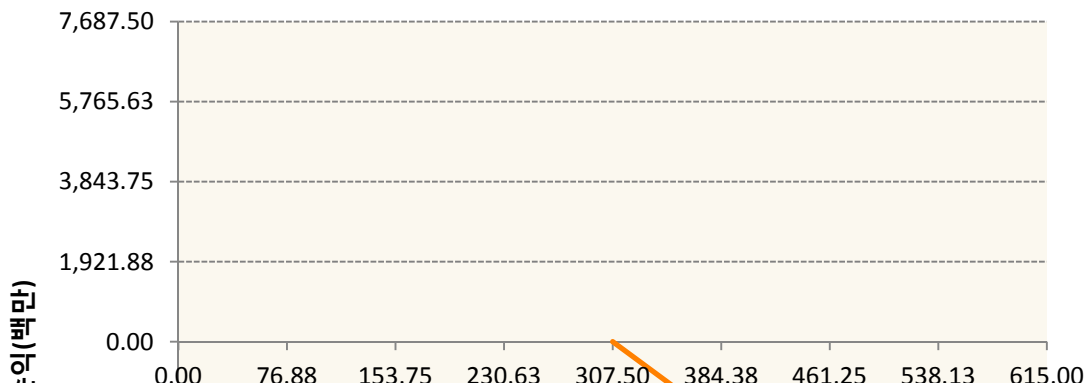
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,033	0	13,033	장내
누계	유가증권	옵션	2,134	23,730	-21,596	장내

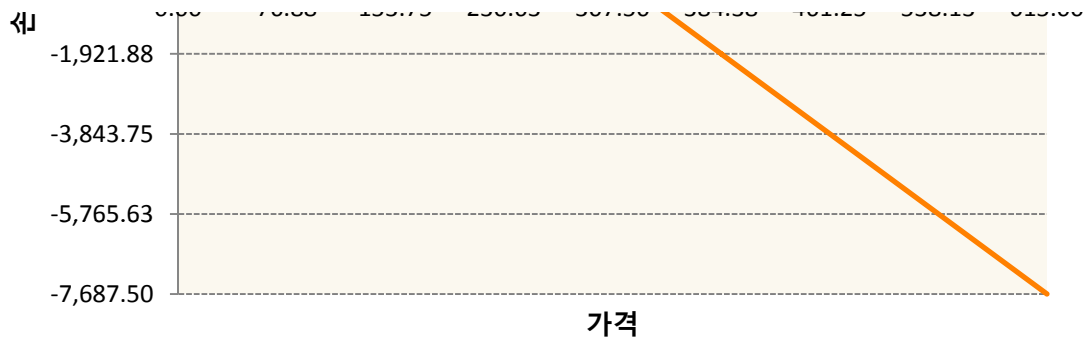
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

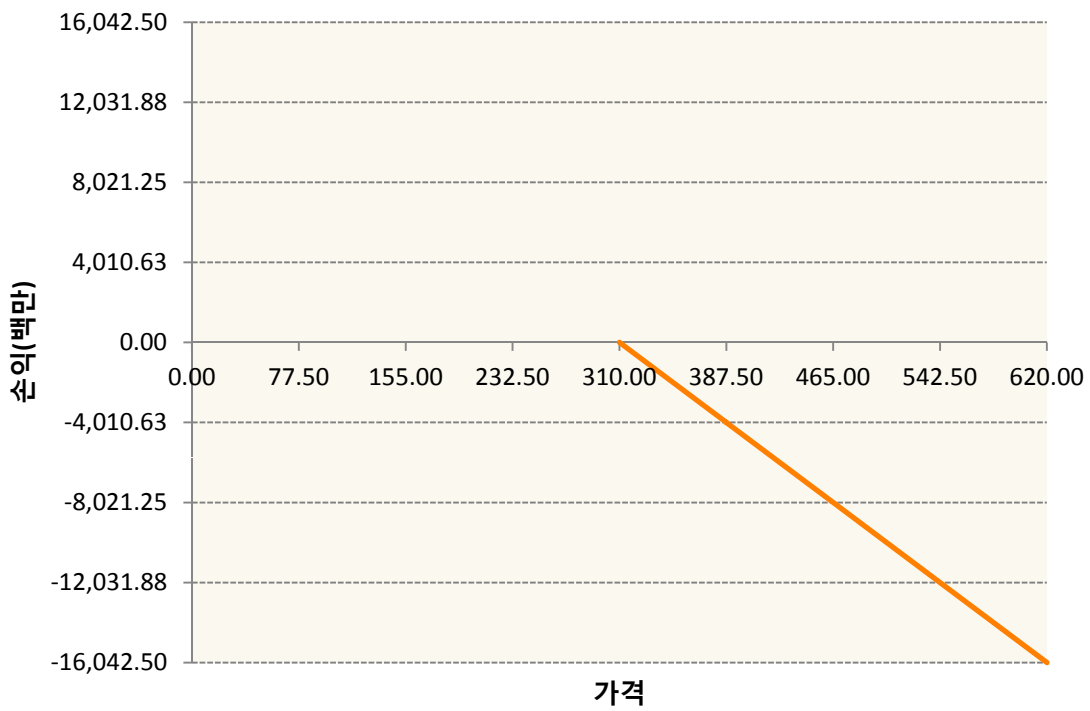


KR4201N83074-2018-08 콜307.5

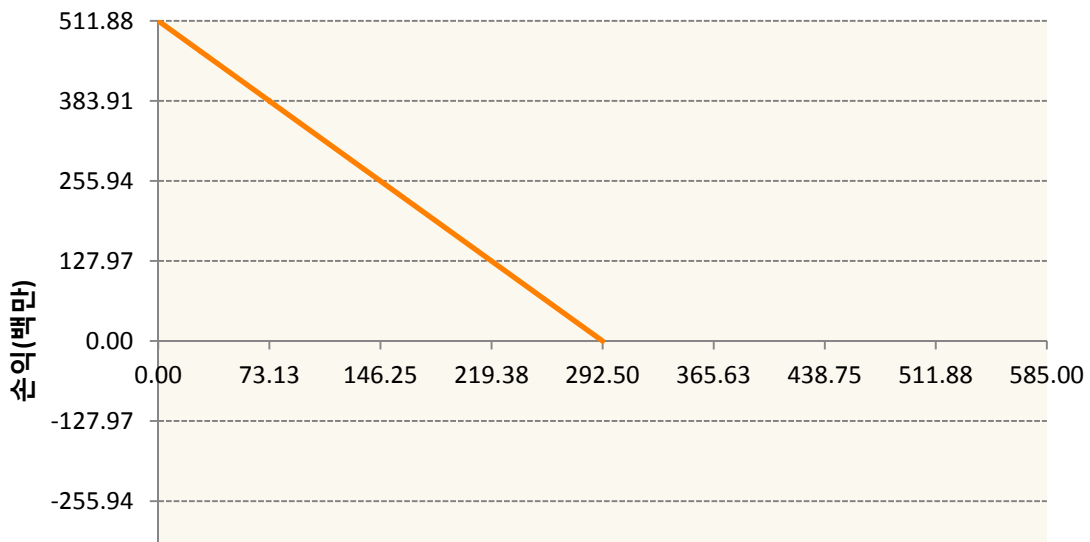


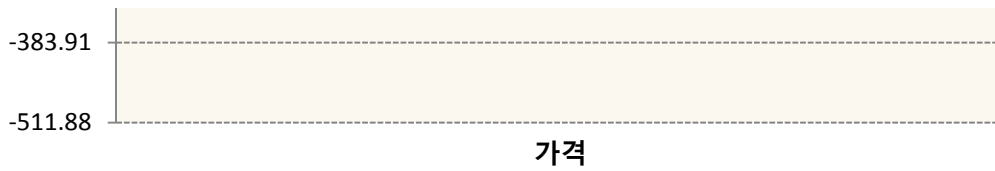


KR4201N83108-2018-08 콜310

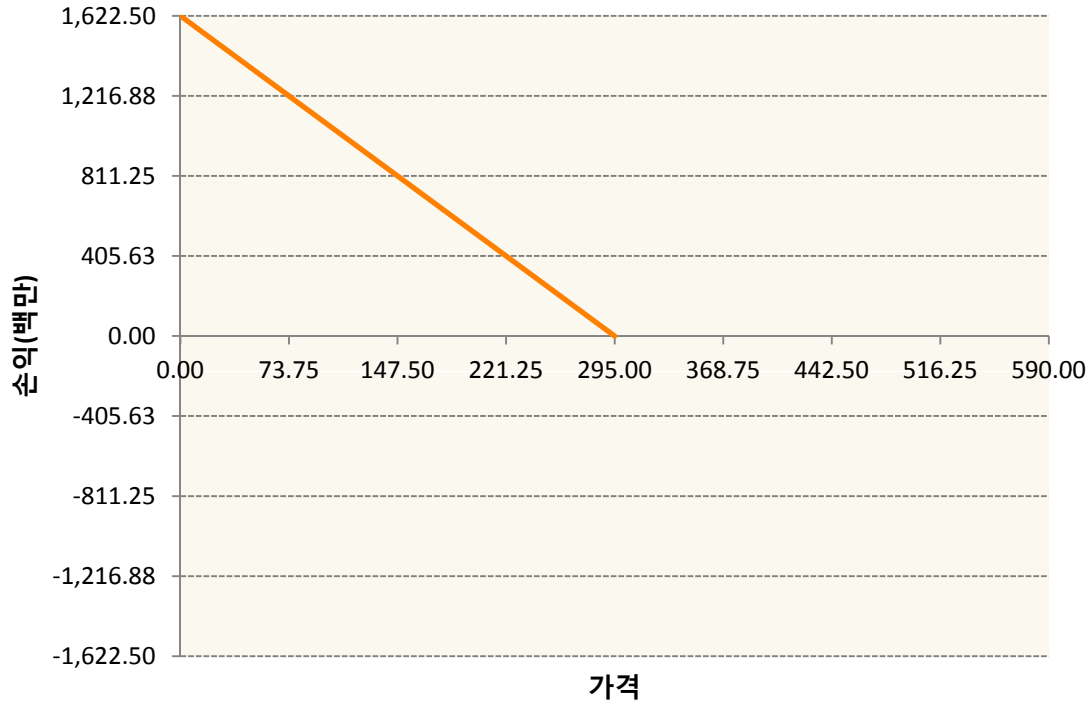


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





KR4301N82959-2018-08 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물 1,040

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,040	-1,040	-1,040	-1,040	-1,040	-1,040	-1,040
-5.33%	-693	-693	-693	-693	-693	-693	-693
-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%	693	693	693	693	693	693	693
8.00%	1,040	1,040	1,040	1,040	1,040	1,040	1,040

KR4201N83C 2018-08 콜307.5 337

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3	3	3	3	3	3	3
-5.33%	3	3	3	3	3	3	3
-2.67%	3	3	3	3	3	3	2

0%	2	2	1	0	-1	-3	-5
2.67%	-20	-24	-29	-34	-39	-44	-48
5.33%	-142	-145	-148	-152	-155	-159	-163
8.00%	-333	-333	-334	-334	-335	-336	-337

KR4201N8312018-08 콜310

581

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2	2	2	2	2	2	2
-5.33%	2	2	2	2	2	2	2
-2.67%	2	2	2	2	2	2	2
0%	2	2	1	0	-1	-3	-6
2.67%	-16	-23	-30	-38	-46	-55	-63
5.33%	-194	-203	-212	-222	-232	-242	-252
8.00%	-565	-566	-568	-570	-573	-577	-581

KR4301N829 2018-08 풋292.5

33

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	33	33	33	33	33	33	33
-5.33%	19	19	19	19	19	19	19
-2.67%	6	6	6	6	6	6	6
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

KR4301N829 2018-08 풋295

117

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	117	117	117	117	117	117	117
-5.33%	74	74	74	74	74	74	74
-2.67%	30	30	30	30	30	30	30
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2

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

(단위:백만원)

1,296

공시일	2018-08-08
기준일	2018-08-07

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

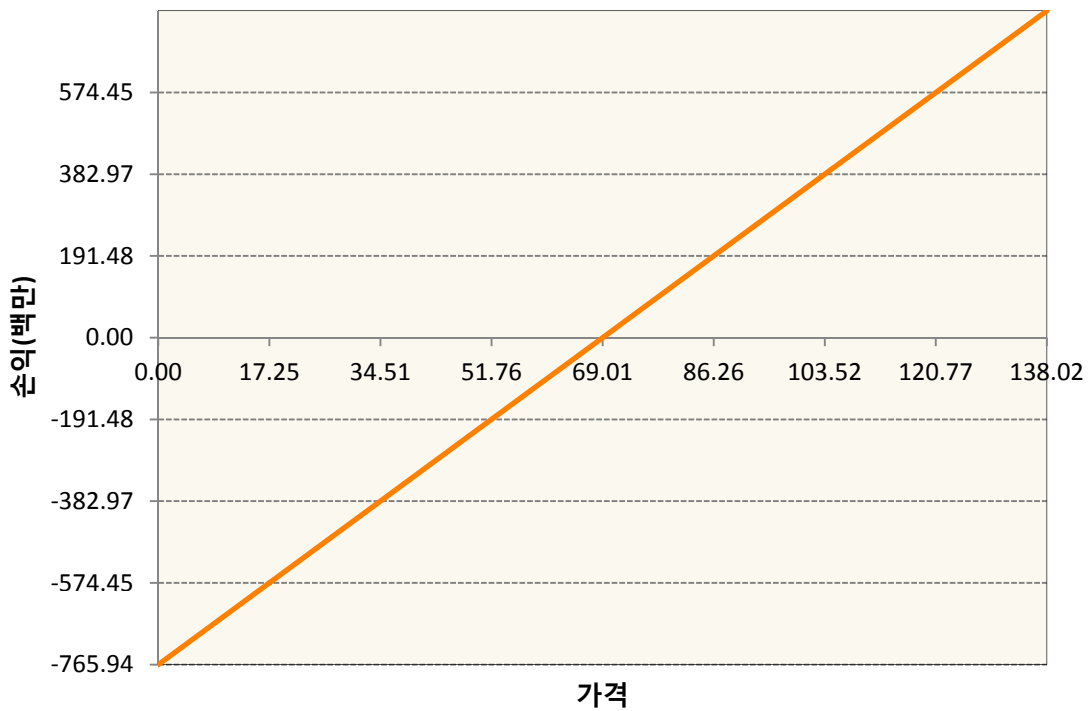
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

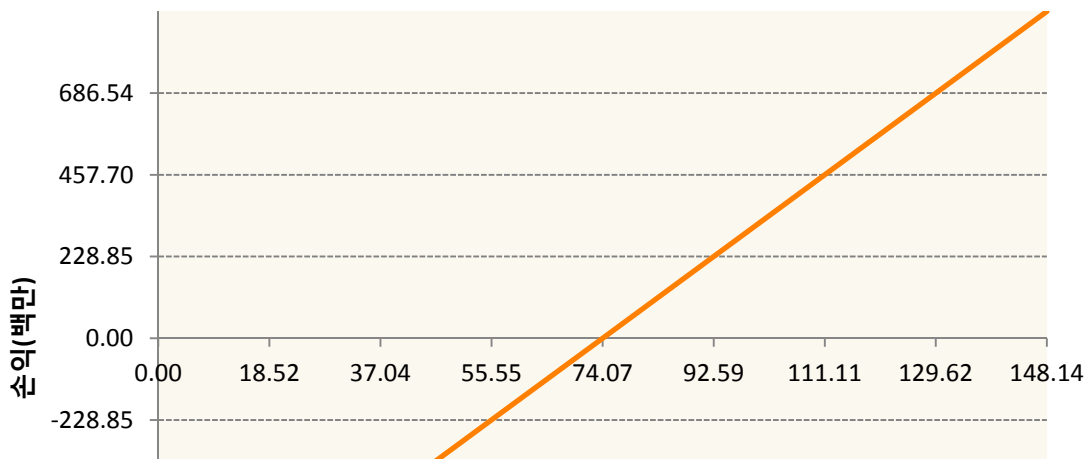
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,675	618	3,058	

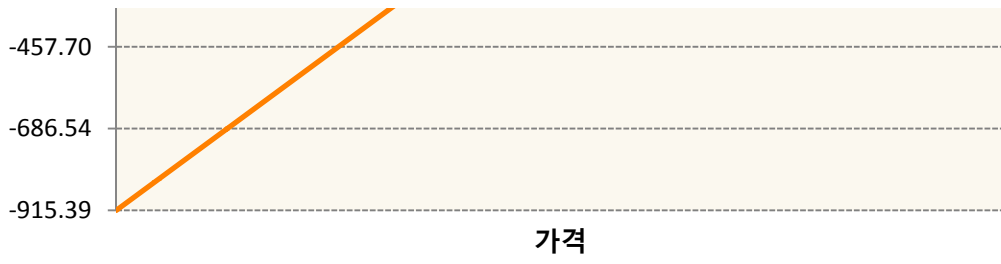
### 2. 만기시점의 손익구조

CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18

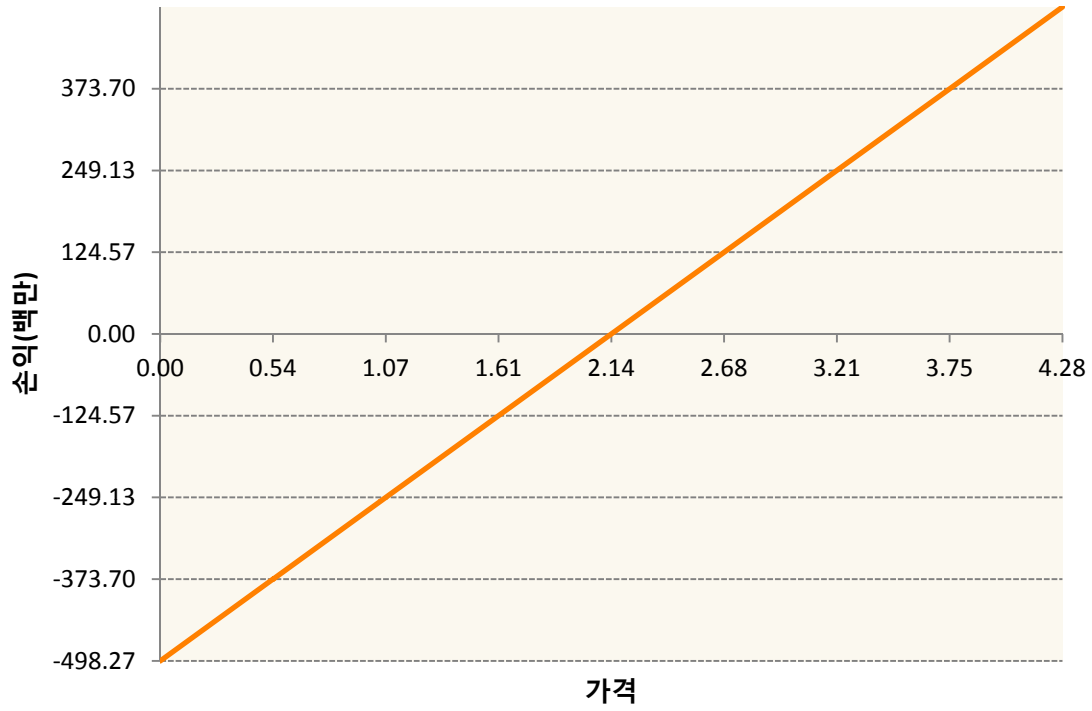


COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18

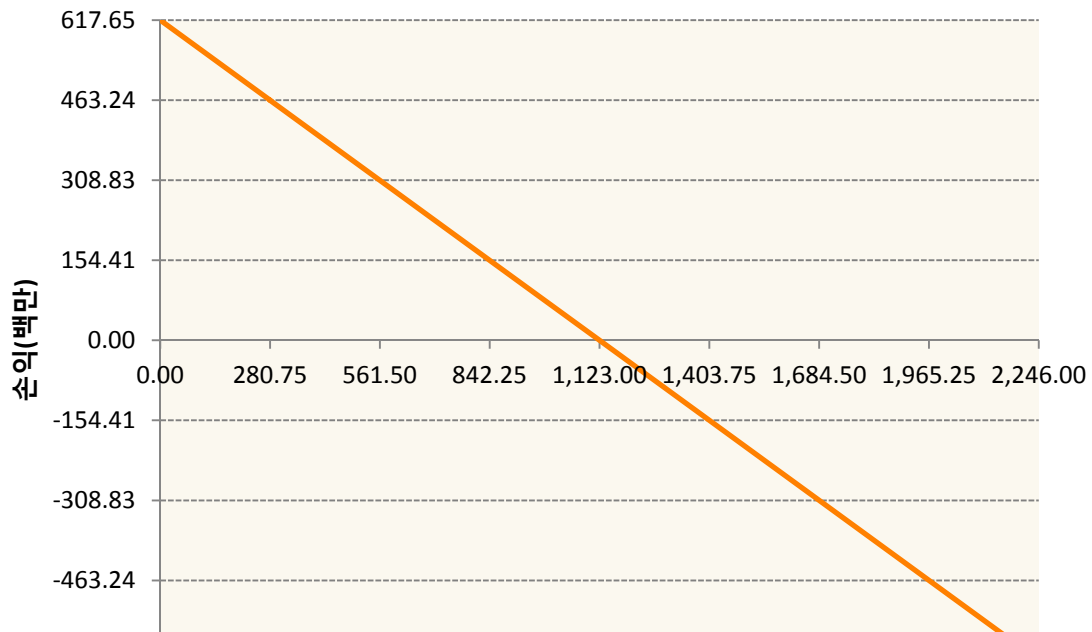


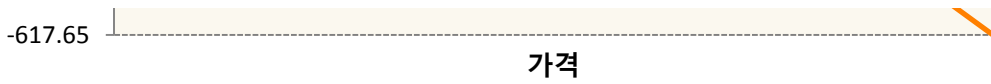


HOU8-NY Harb ULSD Fut SEP18

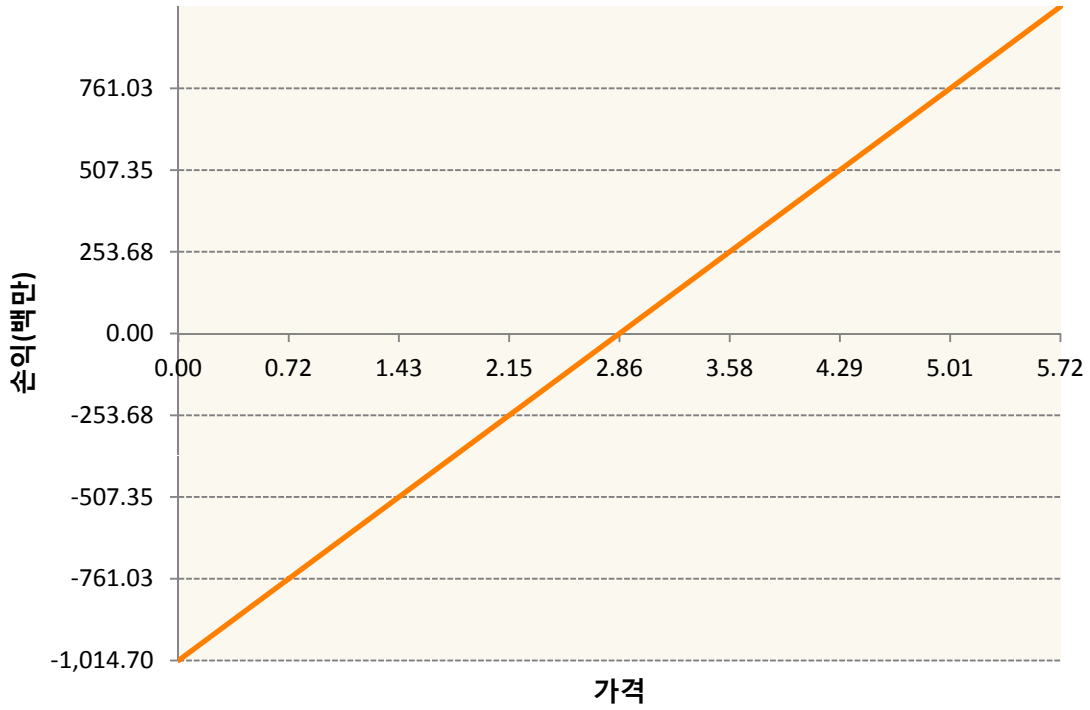


KR4175N80001-2018-08 달러선물

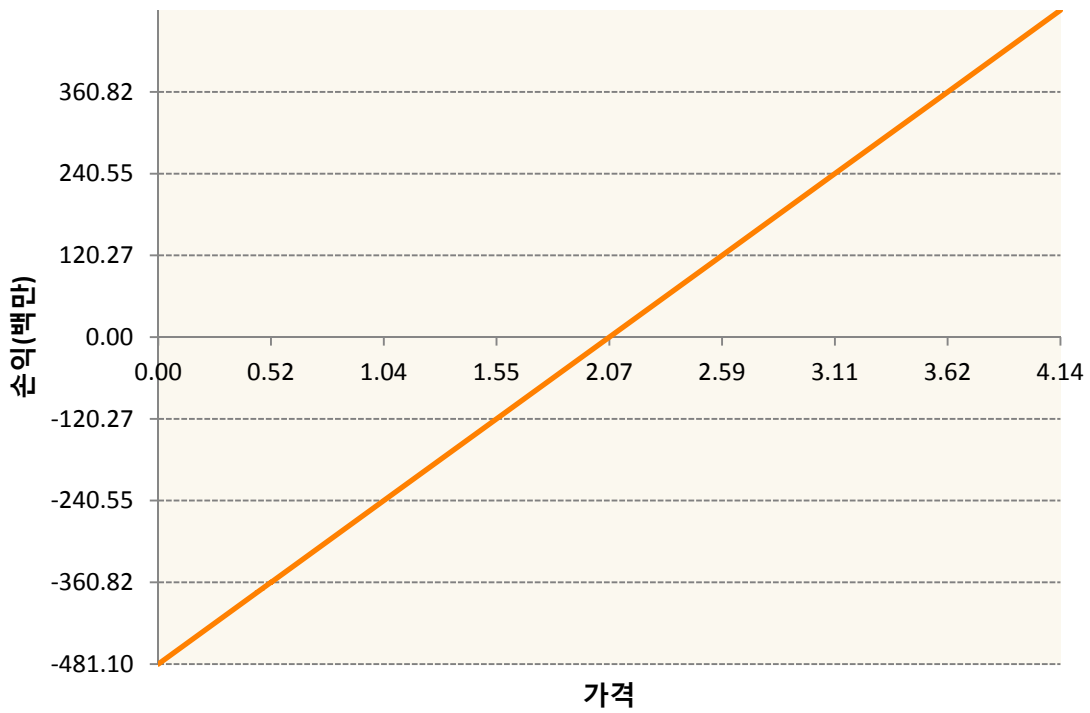




NGU18-NATURAL GAS FUTR SEP18



XBU8-GASOLINE RBOB FUT SEP18



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

CLU8	WTI CRUDE FUTURE SEP18	61
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	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)

**448**

공시일	2018-08-08
기준일	2018-08-07

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

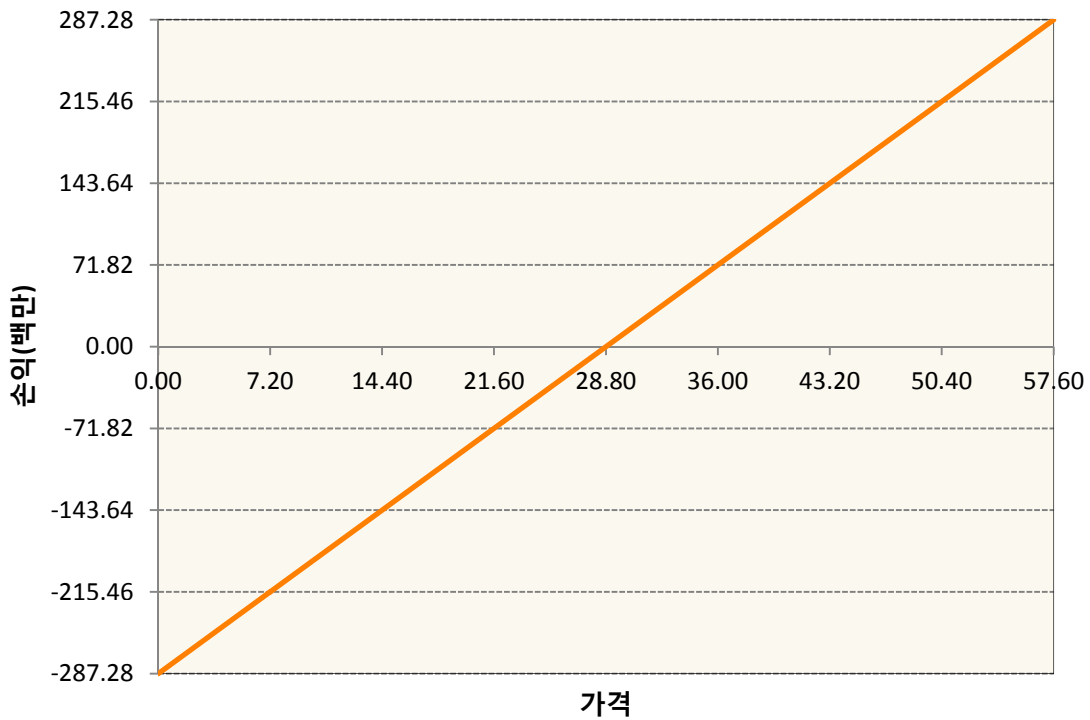
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

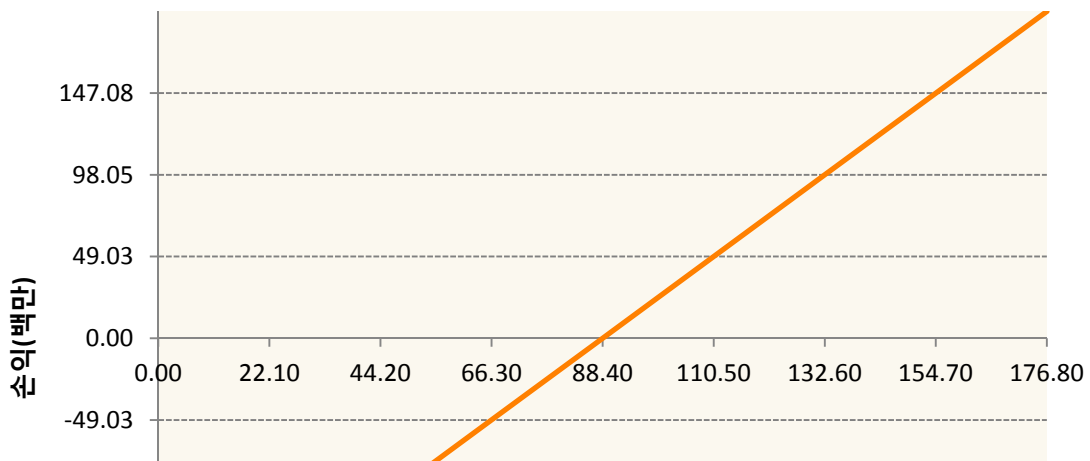
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,765	79	3,686	

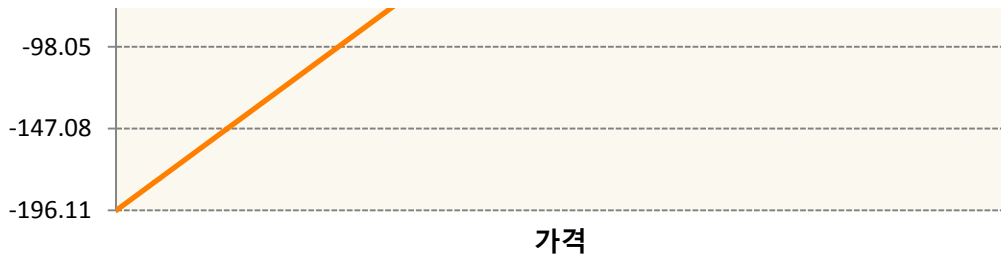
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18**

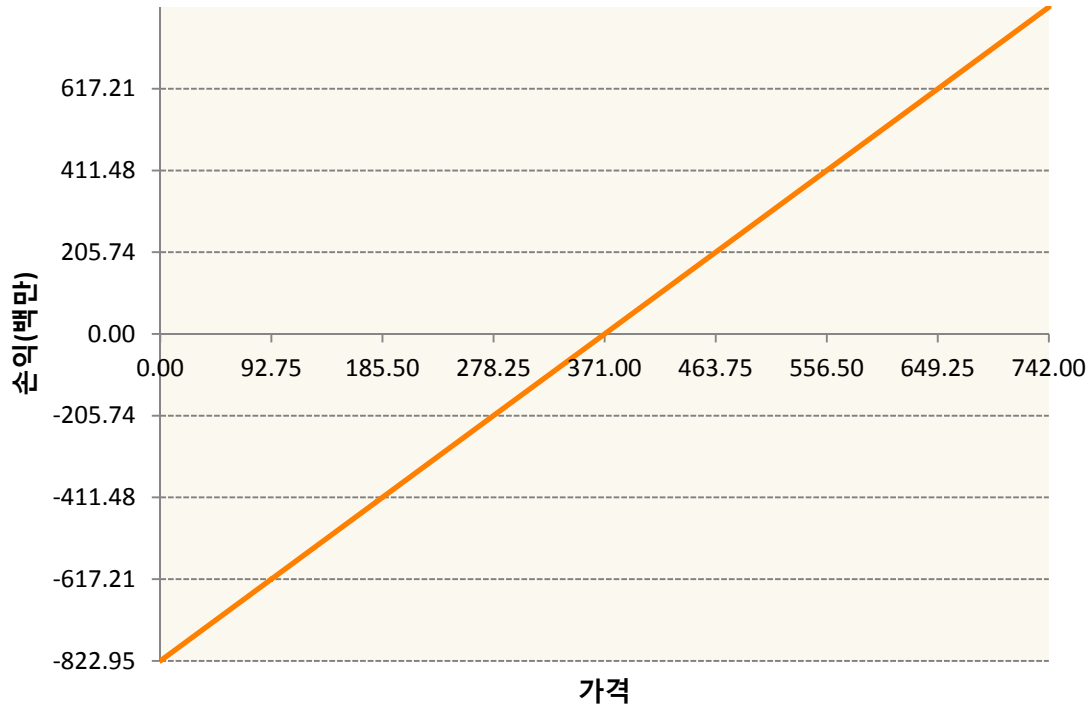


**CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18**

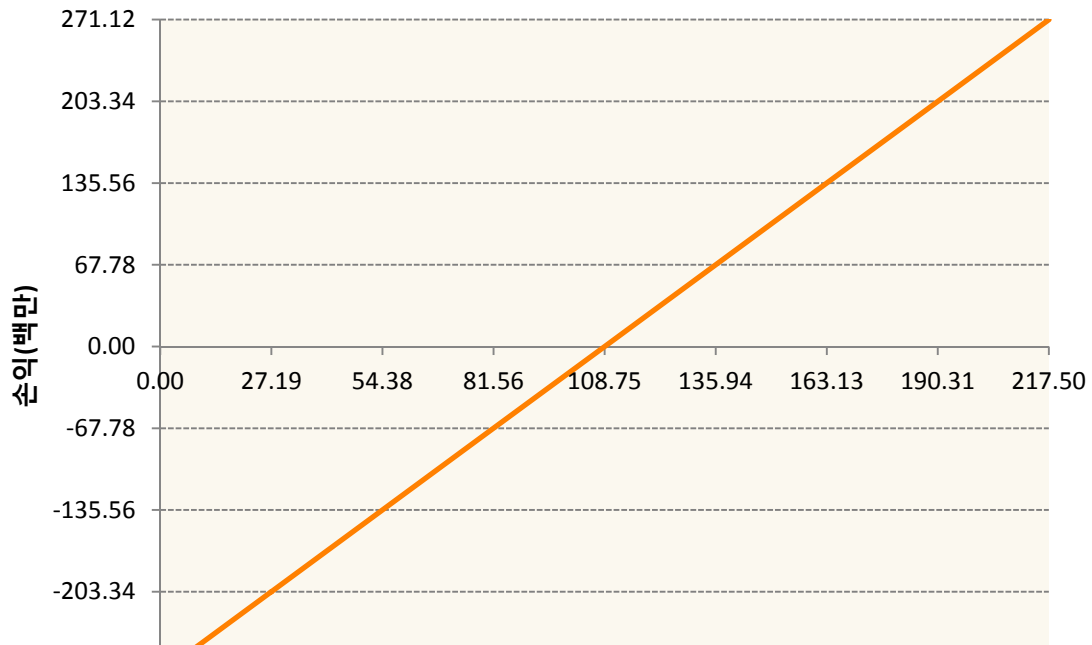


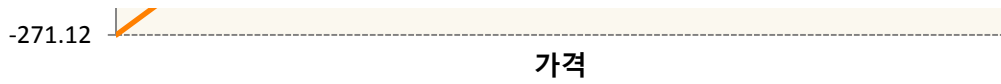


**CU8-CORN FUTURE SEP18**

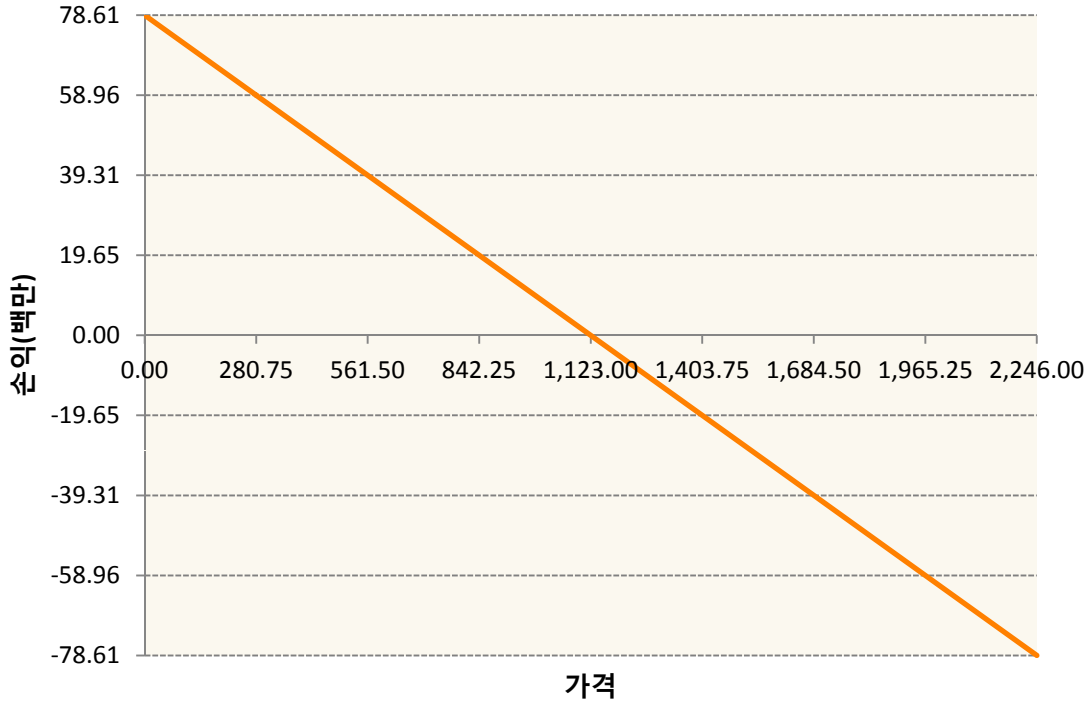


**KCU8-COFFEE 'C' FUTURE SEP18**

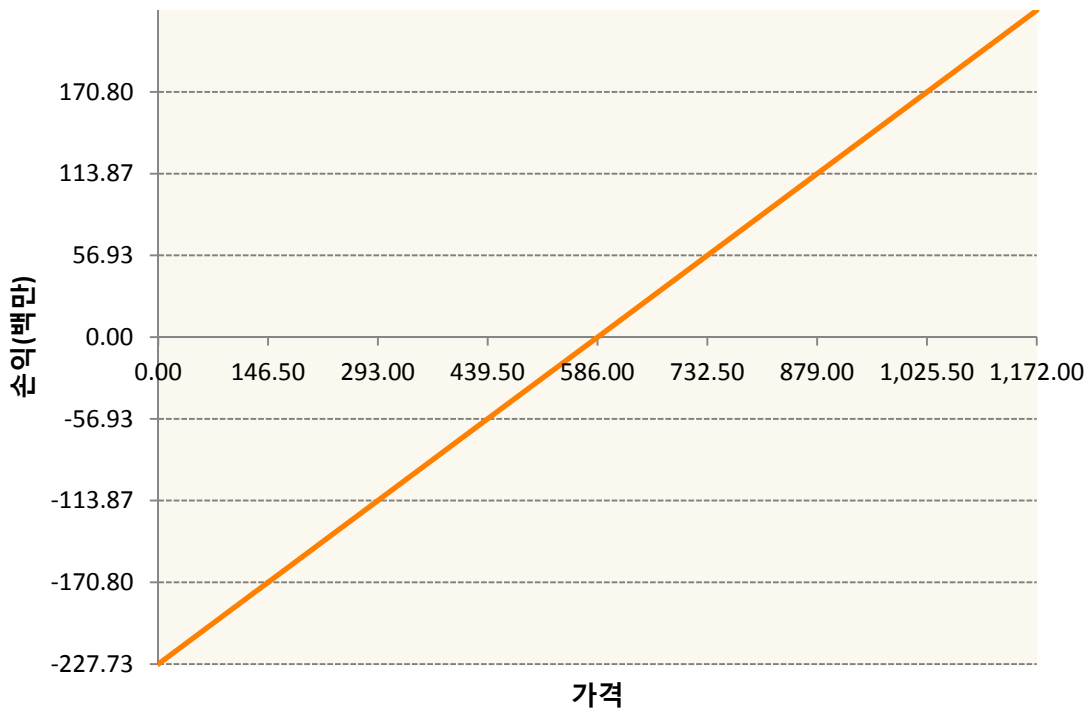




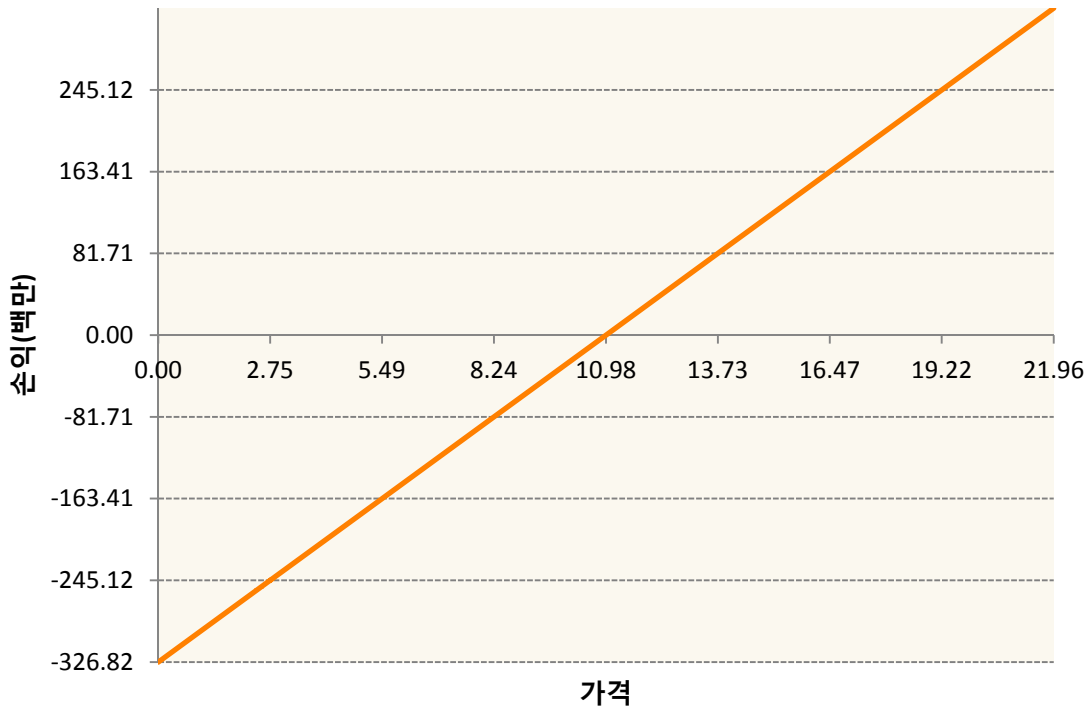
**KR4175N80001-2018-08 달러선물**



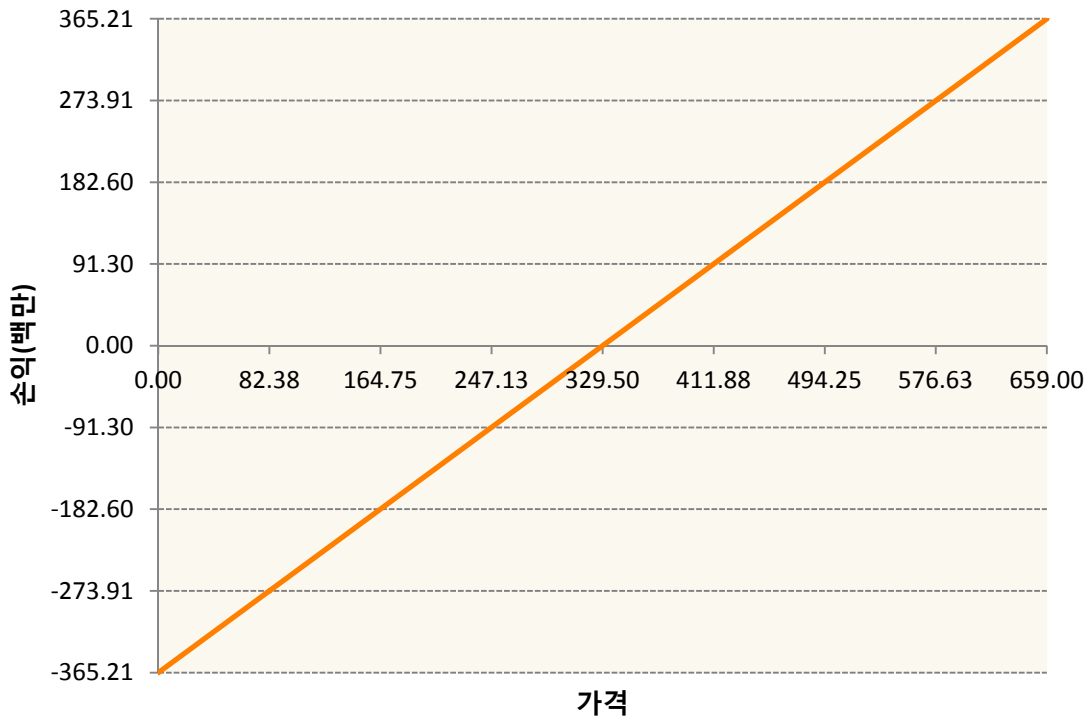
**KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18**



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

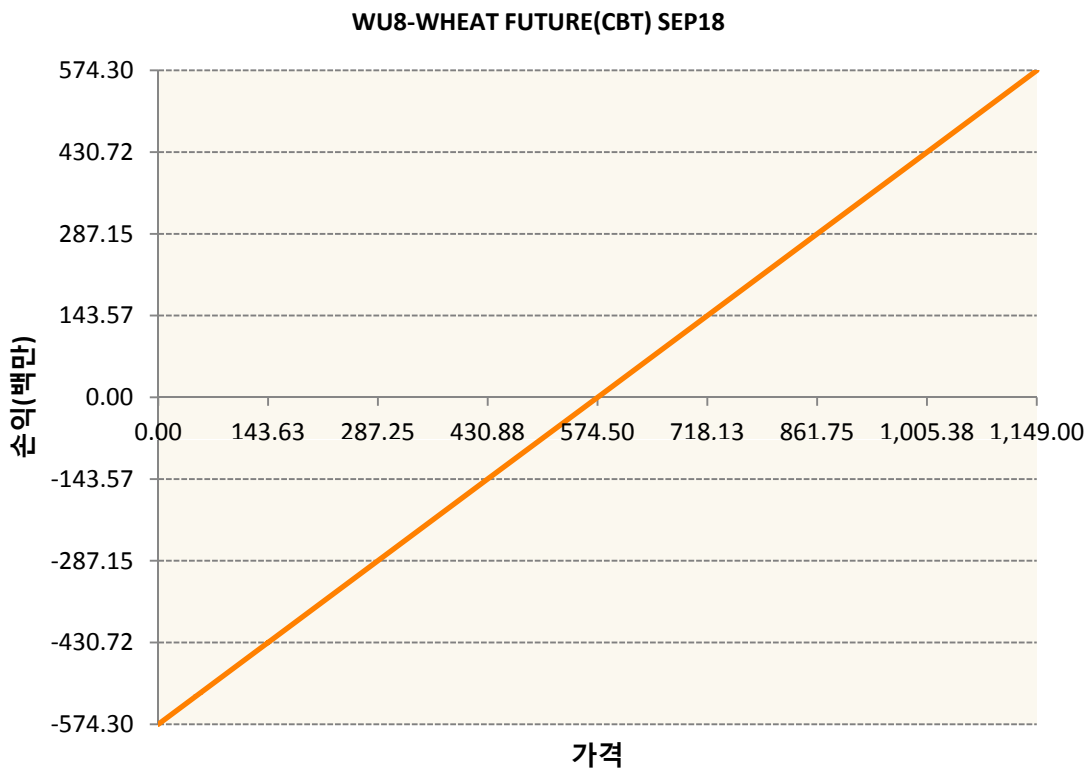
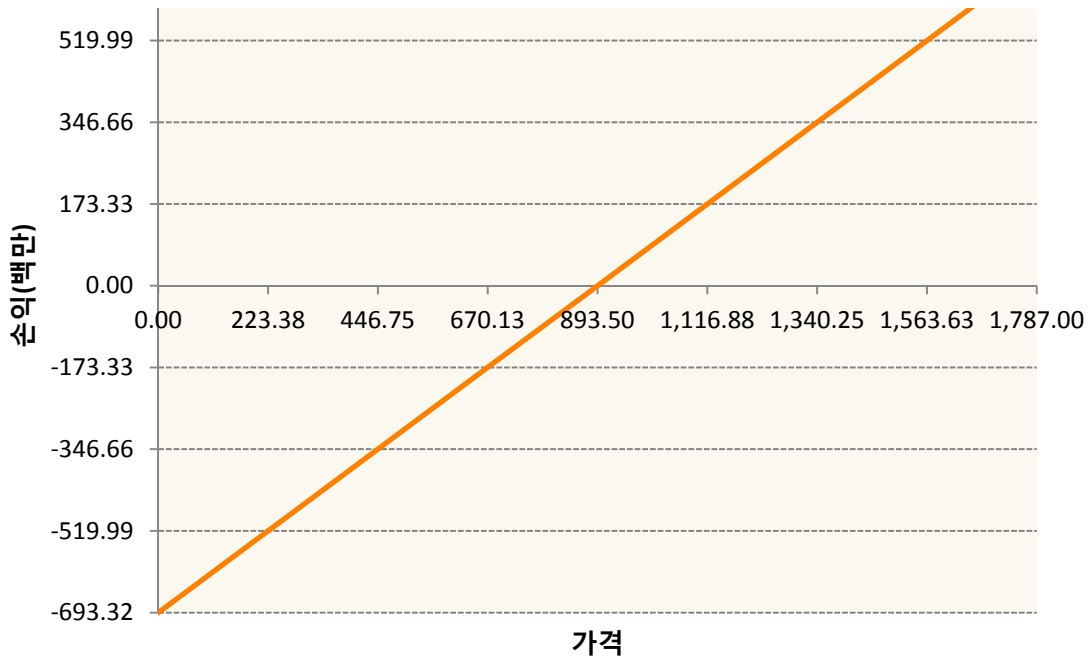


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



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	66
KCU8	COFFEE 'C' FUTURE SEP18	22
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	55
WU8	WHEAT FUTURE(CBT) SEP18	46

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

(단위:백만원)

**319**