

공시일	2018-08-09
기준일	2018-08-08

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	2018-08-09
기준일	2018-08-08

스마트인덱스모

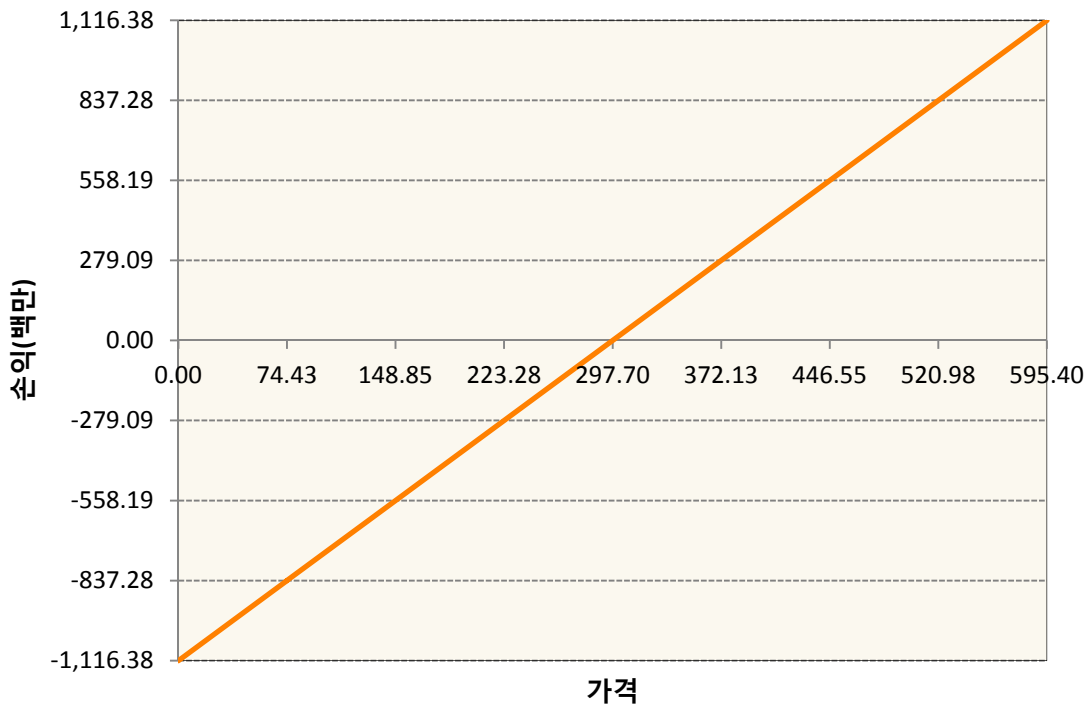
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,116	0	1,116	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	2018-08-09
기준일	2018-08-08

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

1,148

* 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	2018-08-09
기준일	2018-08-08

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

301

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

370

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-09
기준일	2018-08-08

유로인덱스모(주식-파생형)

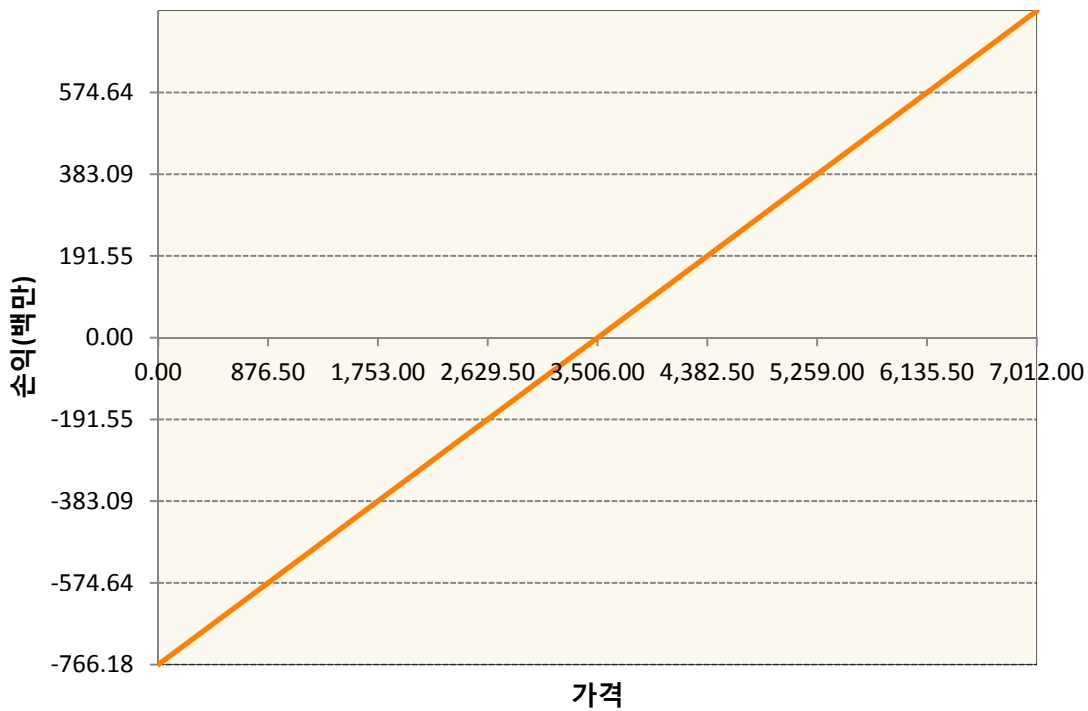
1. 계약금액

(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	2018-08-09
기준일	2018-08-08

차이나인덱스모(주식-파생형)

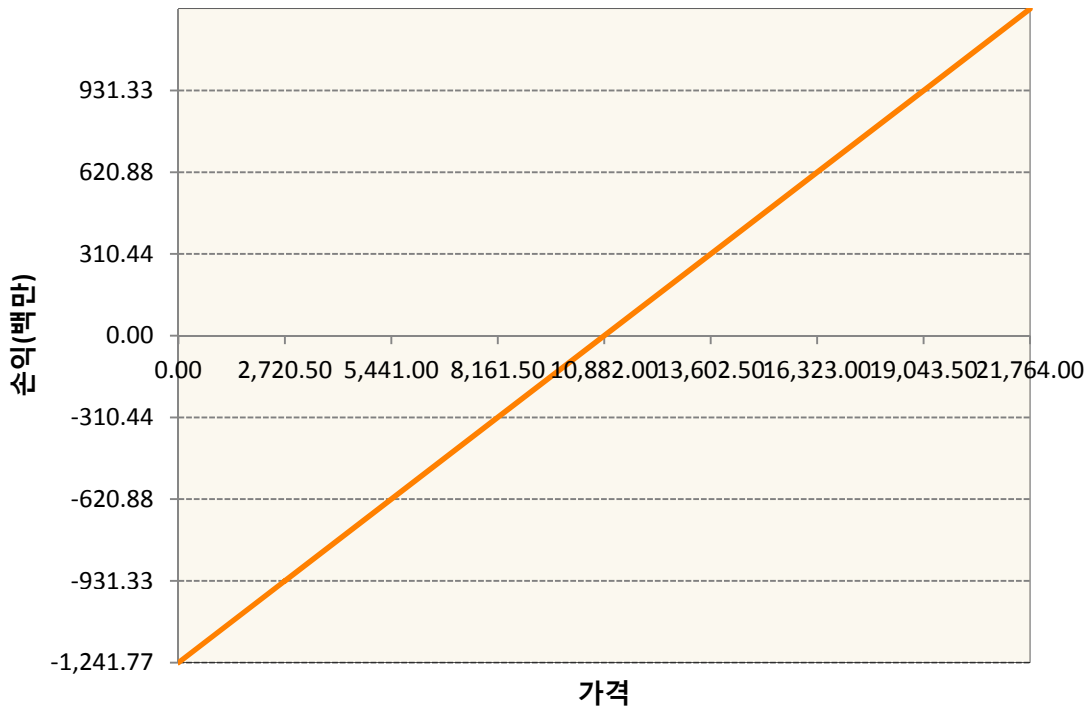
1. 계약금액

(단위:백만원)

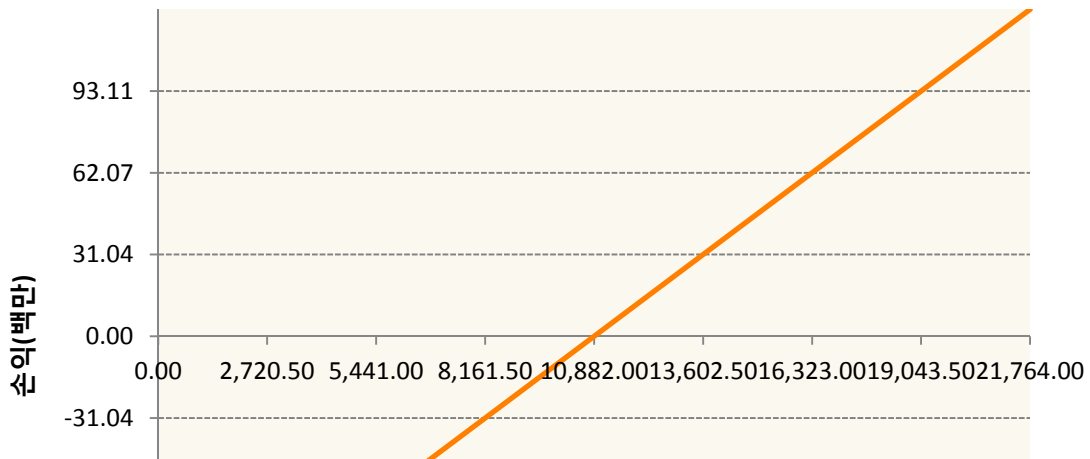
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,366	0	1,366	장내

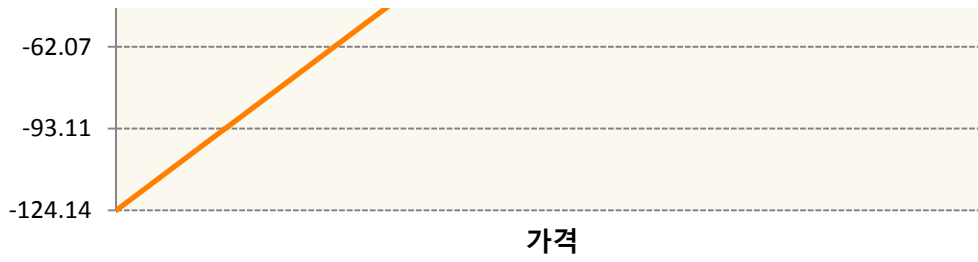
2. 만기시점의 손익구조

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)

100

공시일	2018-08-09
기준일	2018-08-08

커버드콜모(주식혼합-파생형)

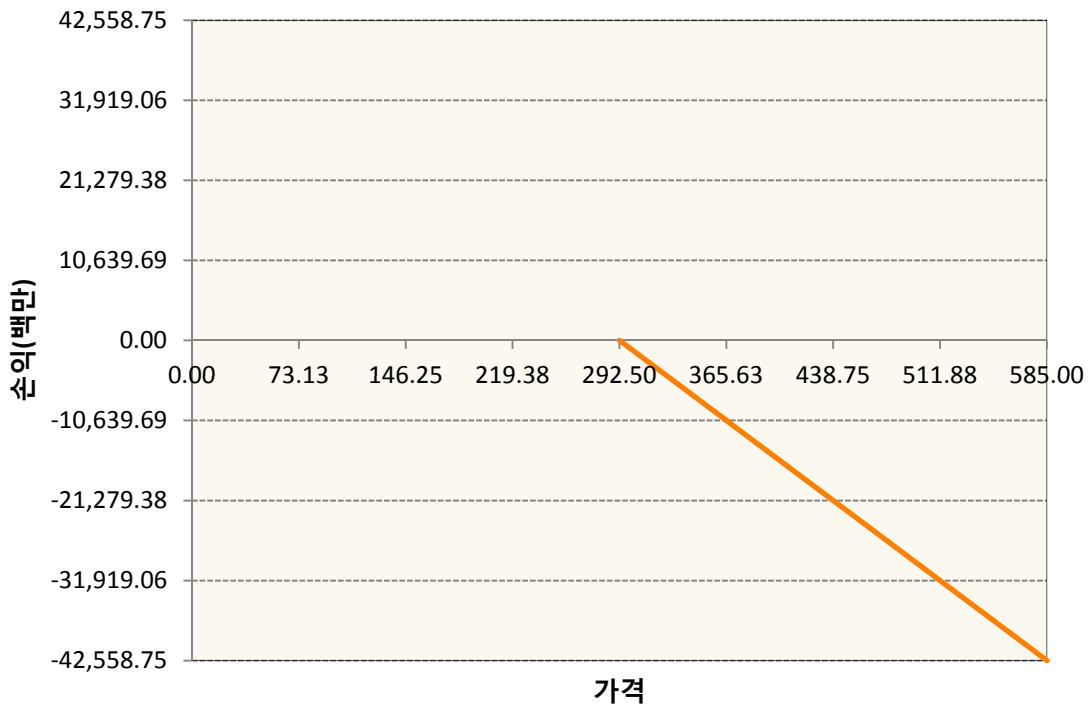
1. 계약금액

(단위:백만원)

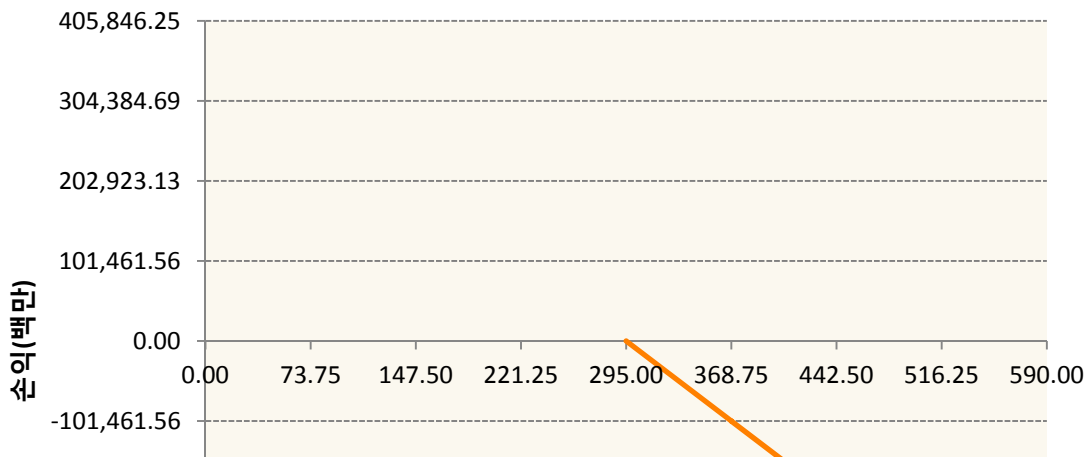
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	727,405	-727,405	장내

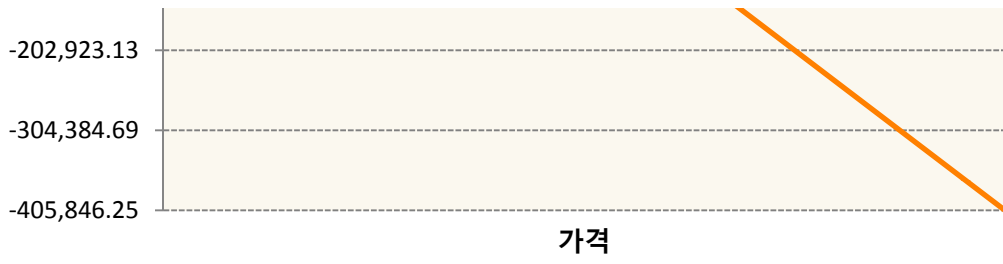
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N82928-2018-08 콜292.5

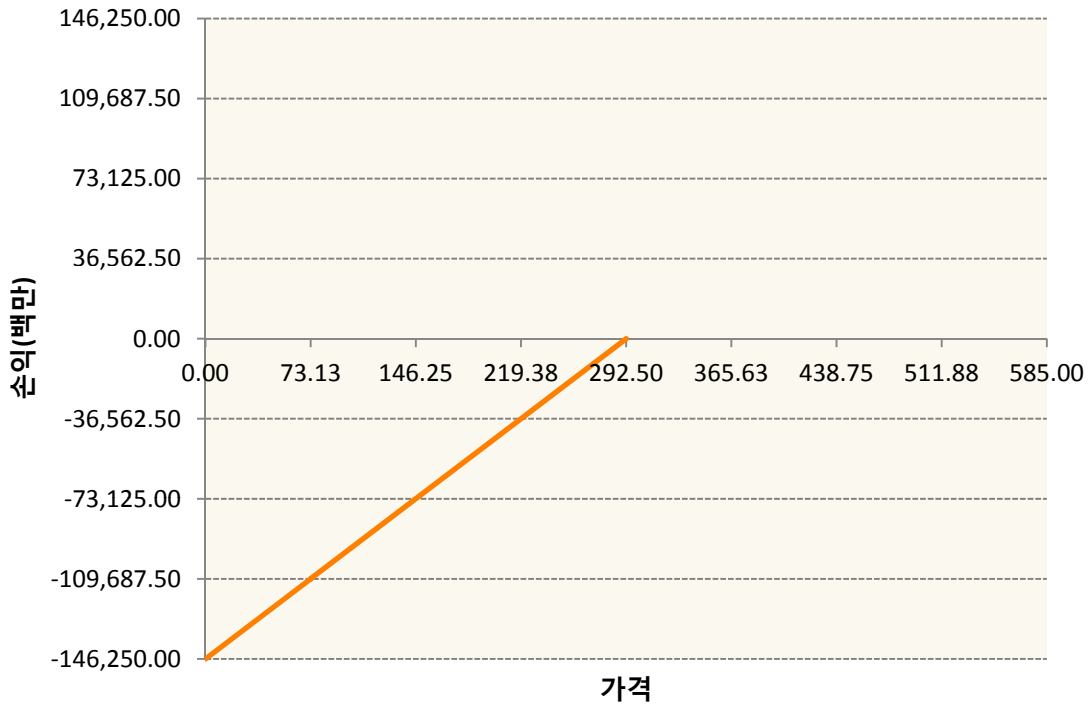


KR4201N82951-2018-08 콜295

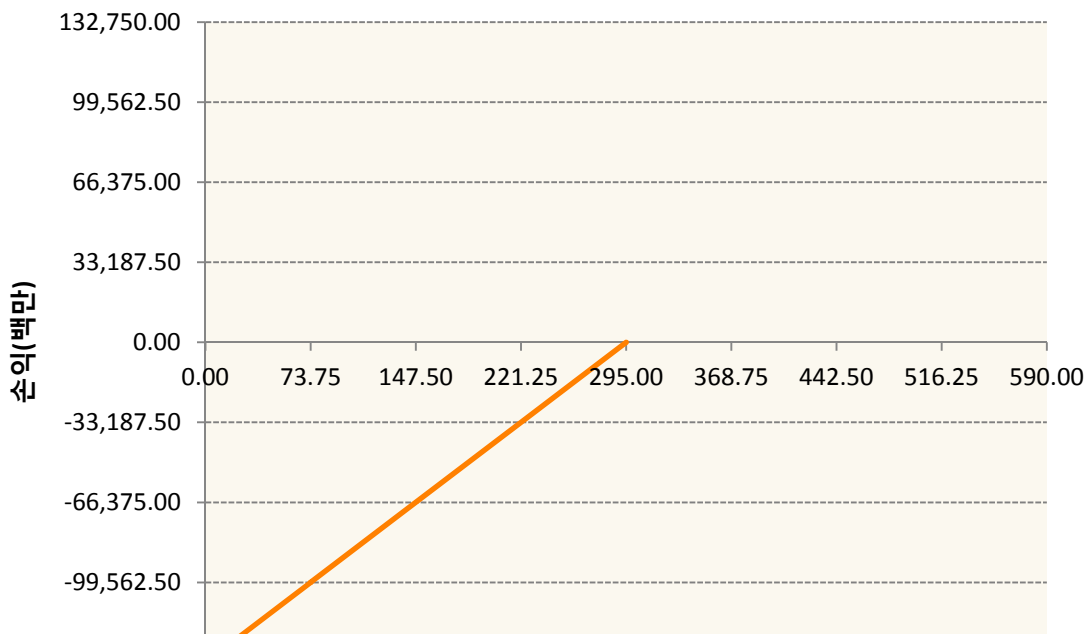




KR4301N82926-2018-08 풋292.5



KR4301N82959-2018-08 풋295



-132,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N829 2018-08 콜292.5							3,418
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	723	723	723	723	723	723	723
-5.33%	723	723	723	722	722	721	719
-2.67%	688	676	662	648	632	617	600
0%	27	19	10	0	-11	-24	-37
2.67%	-1,112	-1,112	-1,112	-1,112	-1,113	-1,113	-1,114
5.33%	-2,265	-2,265	-2,265	-2,265	-2,265	-2,265	-2,265
8.00%	-3,418	-3,418	-3,418	-3,418	-3,418	-3,418	-3,418
KR4201N829 2018-08 콜295							31,588
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,128	4,128	4,128	4,128	4,128	4,128	4,128
-5.33%	4,128	4,128	4,128	4,128	4,127	4,124	4,120
-2.67%	4,072	4,030	3,975	3,907	3,827	3,737	3,637
0%	485	329	167	0	-171	-345	-521
2.67%	-9,785	-9,787	-9,792	-9,802	-9,817	-9,838	-9,867
5.33%	-20,686	-20,686	-20,686	-20,686	-20,686	-20,686	-20,687
8.00%	-31,588	-31,588	-31,588	-31,588	-31,588	-31,588	-31,588
KR4301N829 2018-08 풋292.5							9,542
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,542	-9,542	-9,542	-9,542	-9,542	-9,542	-9,542
-5.33%	-5,579	-5,579	-5,579	-5,579	-5,579	-5,579	-5,579
-2.67%	-1,619	-1,621	-1,625	-1,630	-1,637	-1,645	-1,655
0%	1	1	1	0	-1	-4	-7
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							9,667
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,667	-9,667	-9,667	-9,667	-9,667	-9,667	-9,667
-5.33%	-6,101	-6,101	-6,101	-6,101	-6,101	-6,101	-6,101
-2.67%	-2,534	-2,534	-2,534	-2,535	-2,535	-2,535	-2,536
0%	32	24	13	0	-14	-30	-47
2.67%	47	47	47	47	47	47	47

5.33%	47	47	47	47	47	47	47
8.00%	47	47	47	47	47	47	47

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

(단위:백만원)

75,100

공시일	2018-08-09
기준일	2018-08-08

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

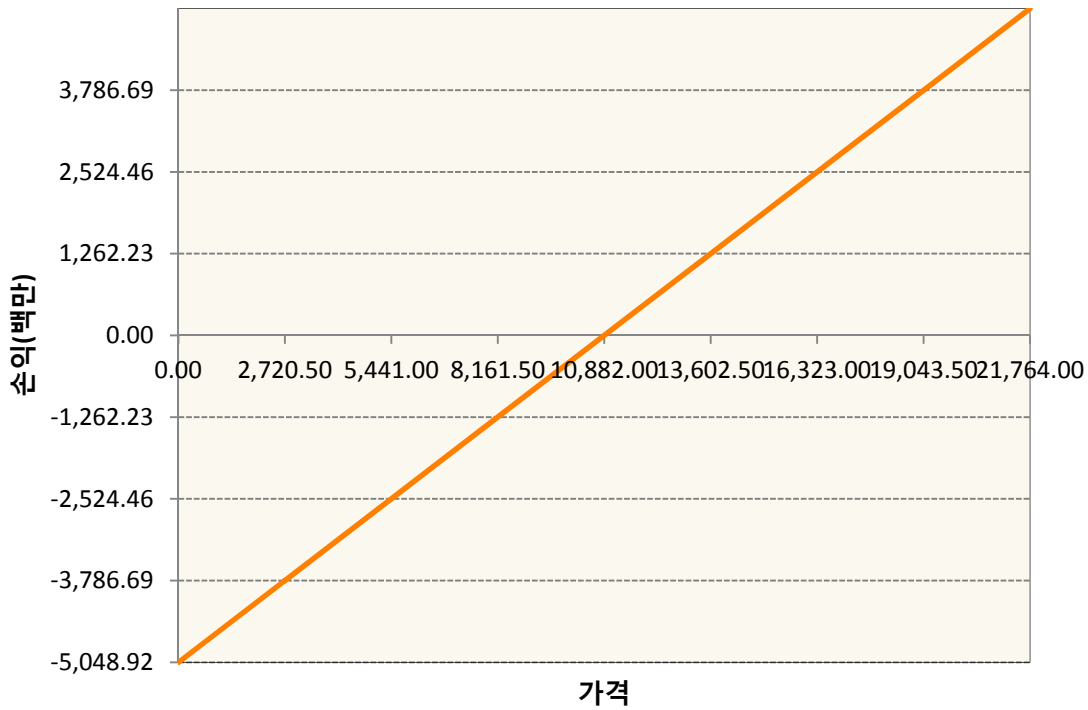
1. 계약금액

(단위:백만원)

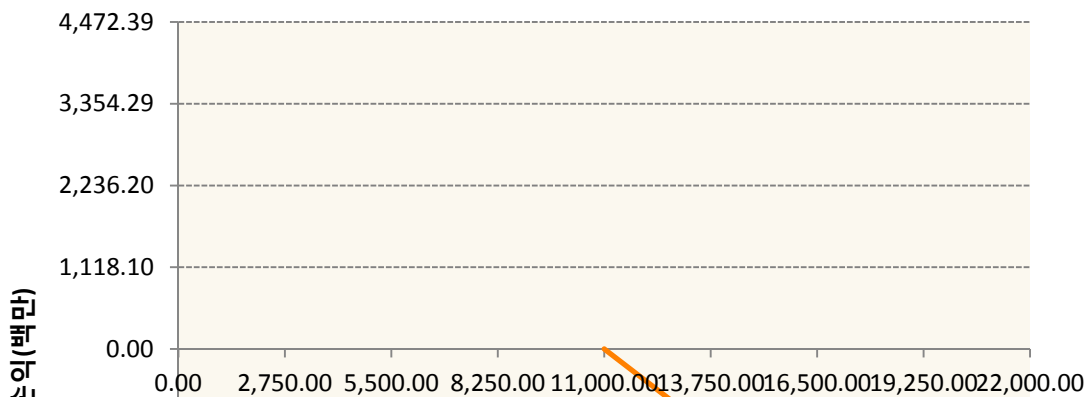
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,049	0	5,049	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,501	-11,501	장내

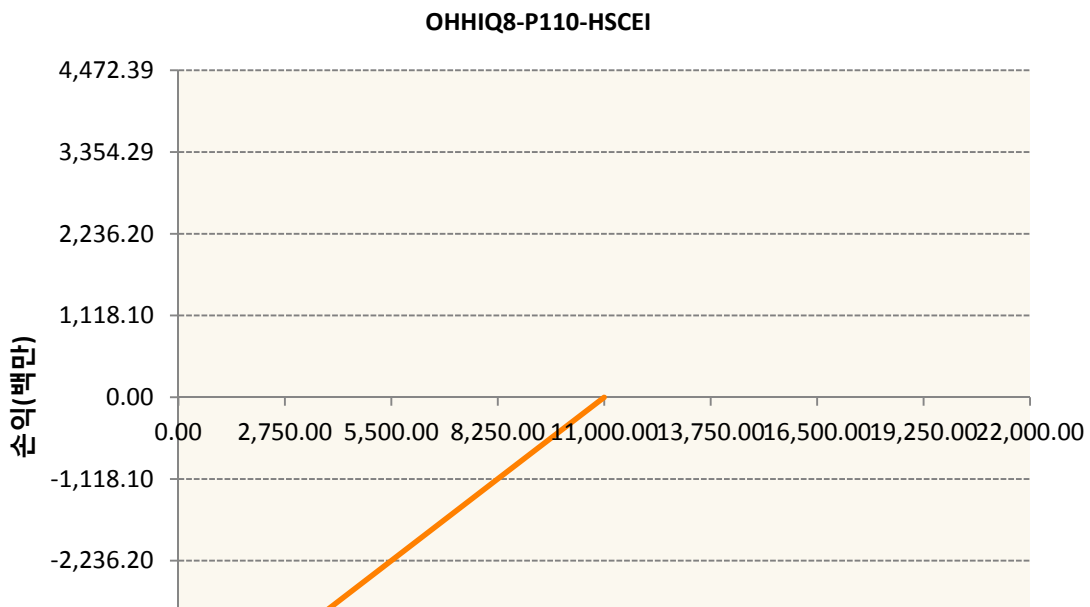
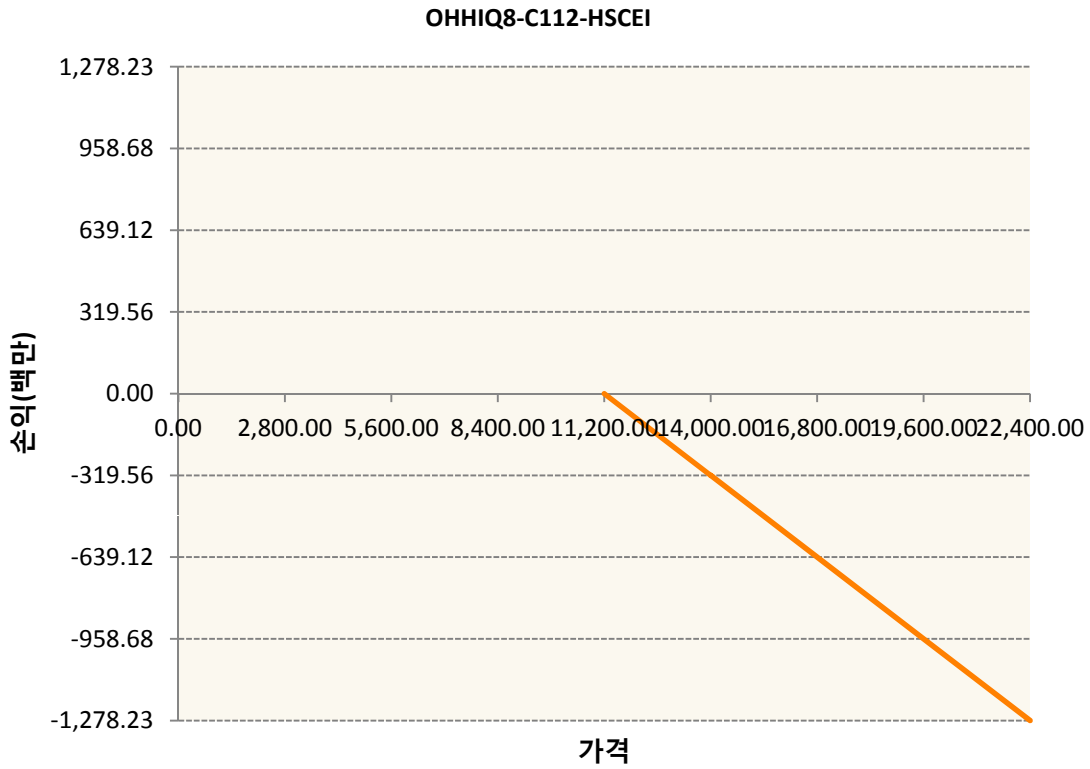
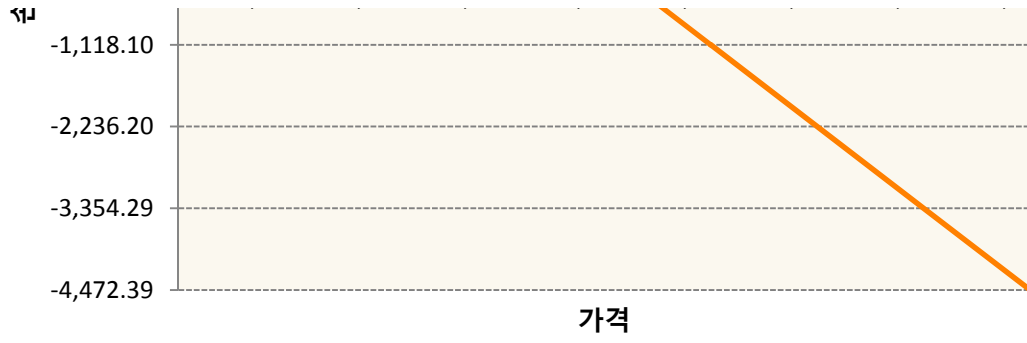
2. 만기시점의 손익구조

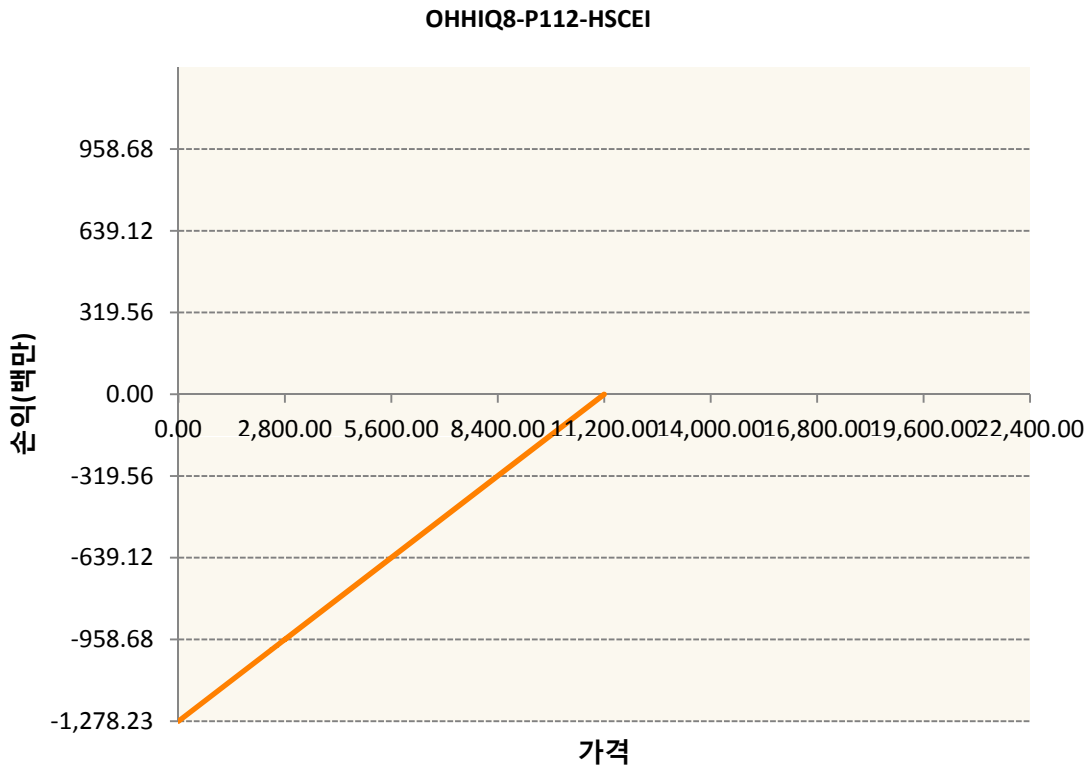
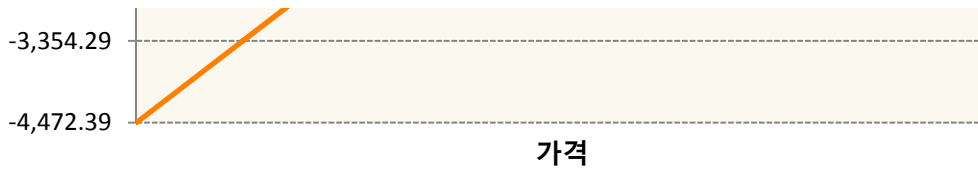
HCQ8-HSCEI Futures Aug18



OHHIQ8-C110-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ8	HSCEI Futures Aug18	404
OHHIQ8-C1:	HSCEI	358
OHHIQ8-C1:	HSCEI	102
OHHIQ8-P11:	HSCEI	358
OHHIQ8-P11:	HSCEI	102

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,206

공시일	2018-08-09
기준일	2018-08-08

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

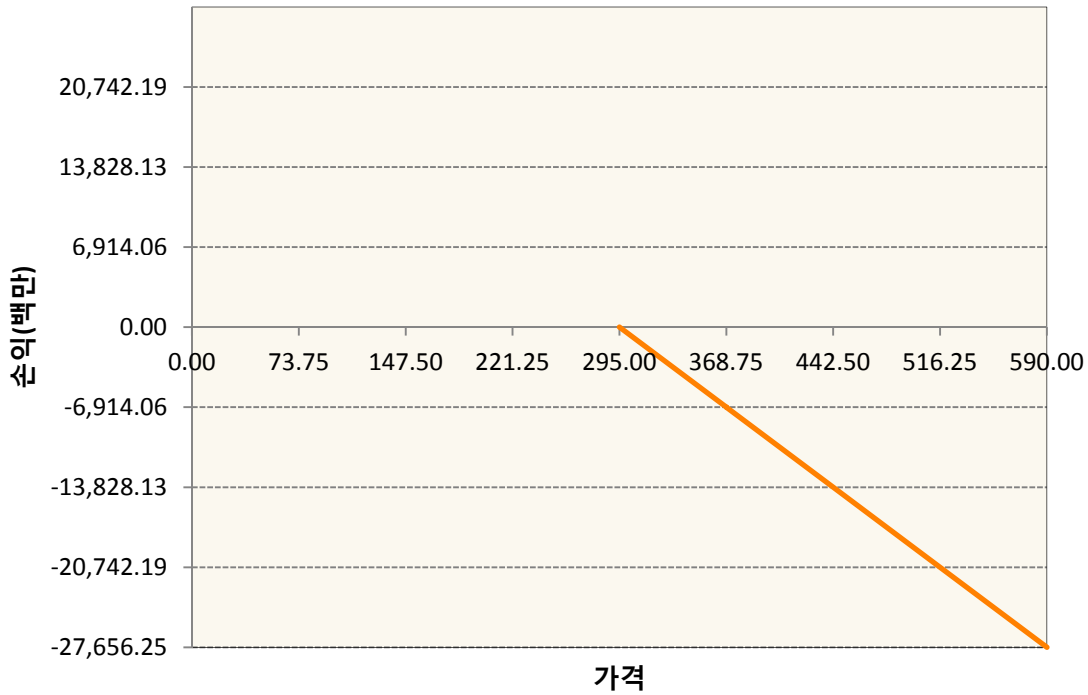
1. 계약금액

(단위:백만원)

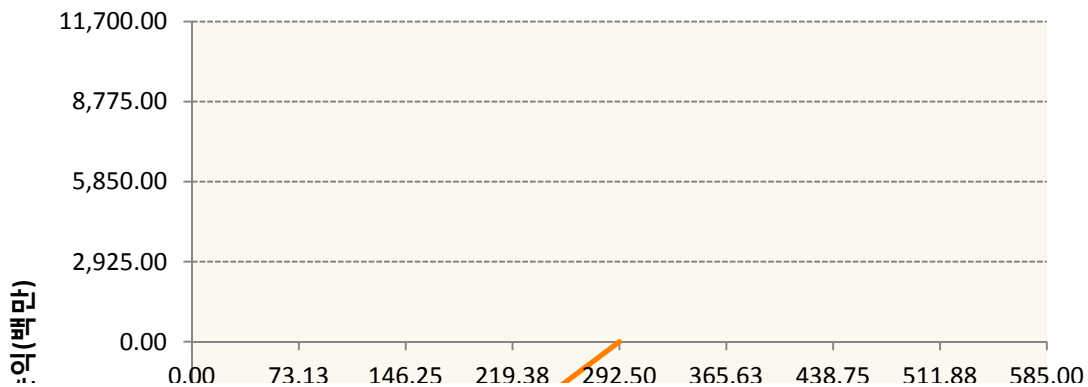
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	48,575	-48,575	장내

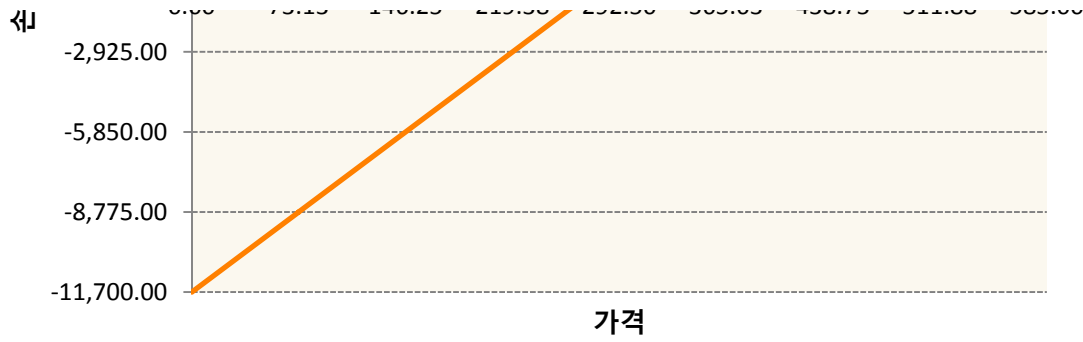
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N82951-2018-08 콜295

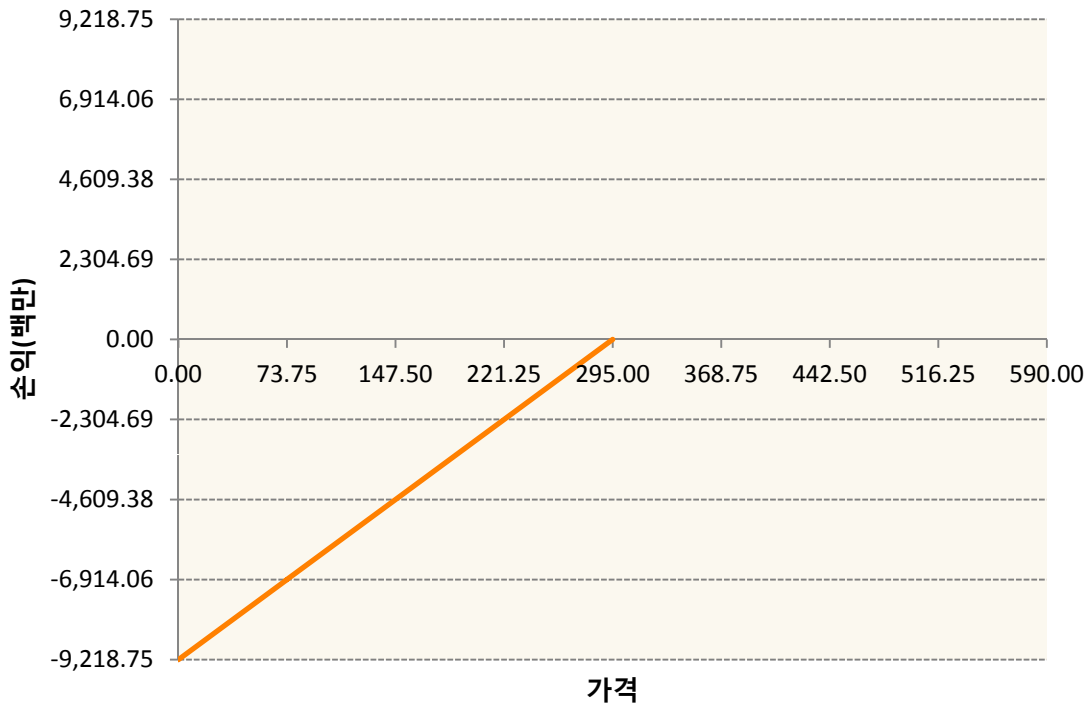


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





KR4301N82959-2018-08 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_2							1,500	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,500	-1,500	-1,500	-1,500	-1,500	-1,500	-1,500	
-5.33%	-1,000	-1,000	-1,000	-1,000	-1,000	-1,000	-1,000	
-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%	1,000	1,000	1,000	1,000	1,000	1,000	1,000	
8.00%	1,500	1,500	1,500	1,500	1,500	1,500	1,500	
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%	324	324	324	324	324	324	324
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 2,153

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	281	281	281	281	281	281	281
-5.33%	281	281	281	281	281	281	281
-2.67%	277	275	271	266	261	255	248
0%	33	22	11	0	-12	-23	-36
2.67%	-667	-667	-667	-668	-669	-670	-672
5.33%	-1,410	-1,410	-1,410	-1,410	-1,410	-1,410	-1,410
8.00%	-2,153	-2,153	-2,153	-2,153	-2,153	-2,153	-2,153

KR4301N829 2018-08 풋292.5 763

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-763	-763	-763	-763	-763	-763	-763
-5.33%	-446	-446	-446	-446	-446	-446	-446
-2.67%	-130	-130	-130	-130	-131	-132	-132
0%	0	0	0	0	0	0	-1
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 671

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-671	-671	-671	-671	-671	-671	-671
-5.33%	-424	-424	-424	-424	-424	-424	-424
-2.67%	-176	-176	-176	-176	-176	-176	-176
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	3	3	3	3	3	3	3
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

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

(단위:백만원)

8,845

공시일	2018-08-09
기준일	2018-08-08

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

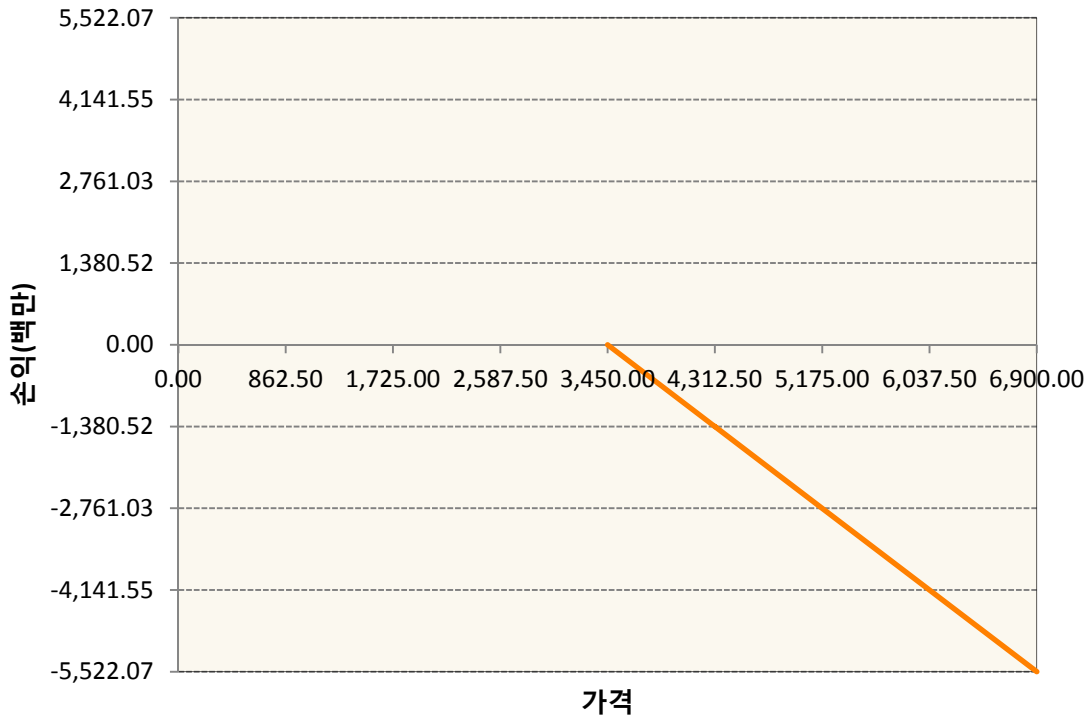
1. 계약금액

(단위:백만원)

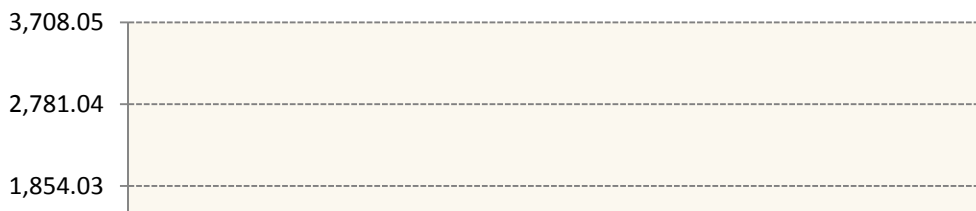
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,973	0	1,973	
누계	유가증권	스왑	44,873	0	44,873	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,756	-14,756	장내
누계	지수	스왑	52,830	0	52,830	장외

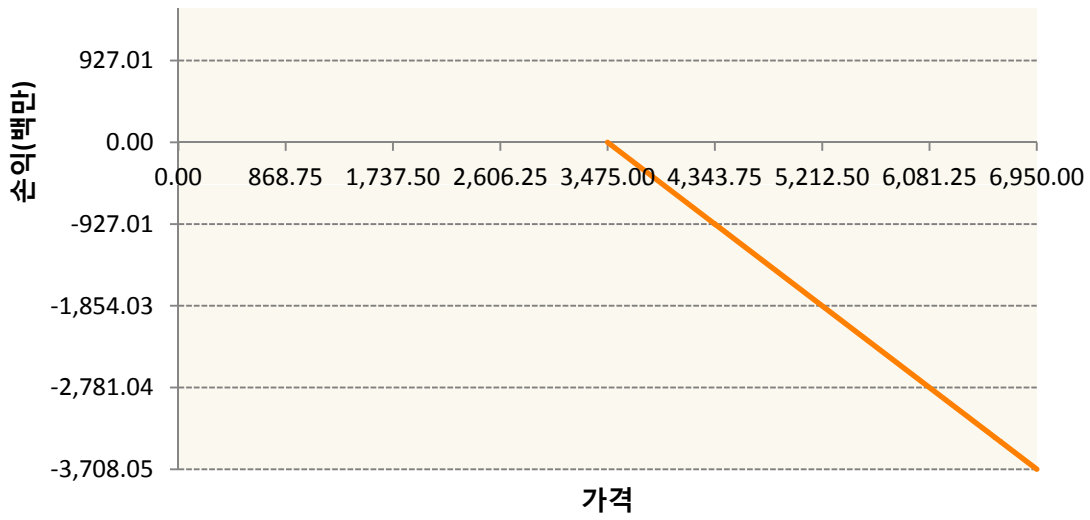
2. 만기시점의 손익구조

OESXQ8-C3450-EURO STOXX 50 OPT

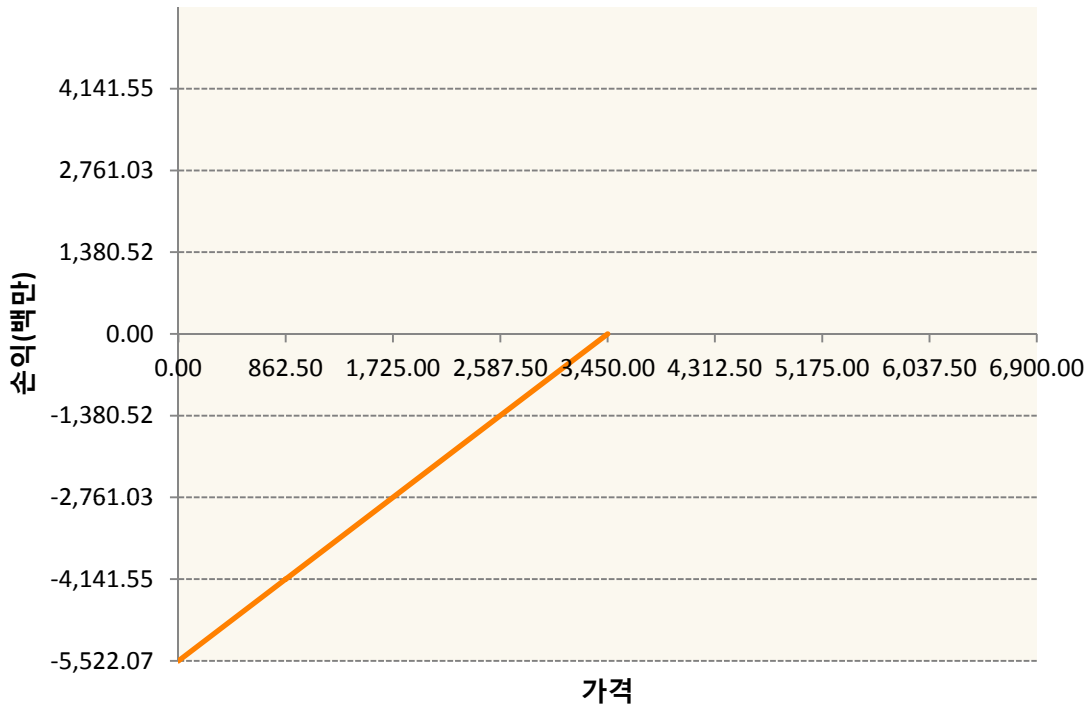


OESXQ8-C3475-EURO STOXX 50 OPT

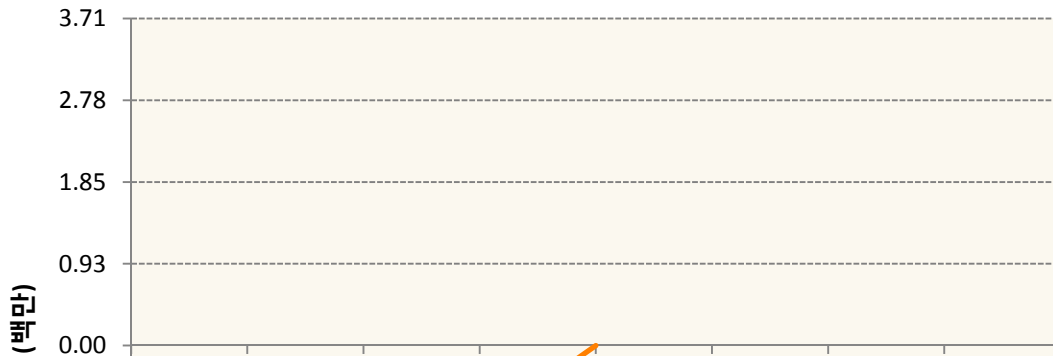


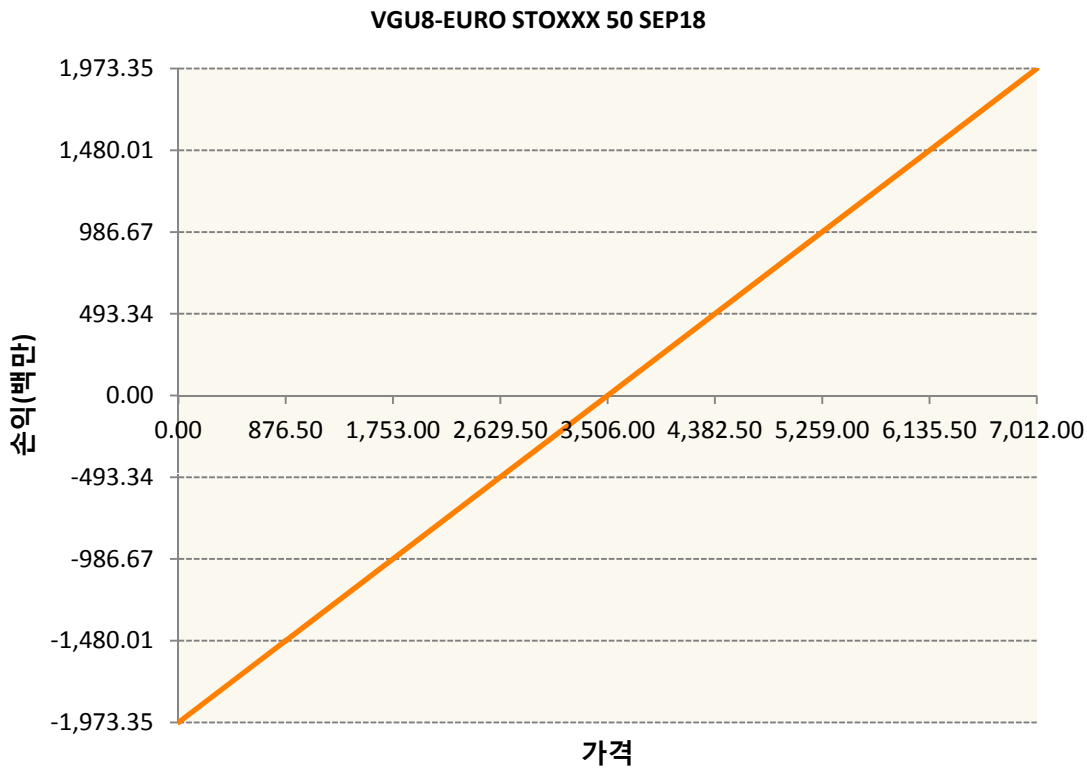
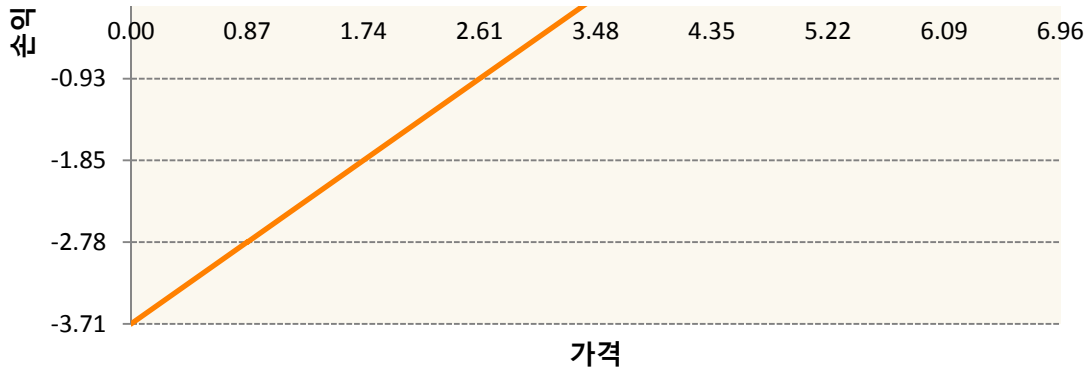


OESXQ8-P3450-EURO STOXX 50



OESXQ8-P3475-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		41
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY		35
OESXQ8-C34 EURO STOXX 50 OPT		442
OESXQ8-C34 EURO STOXX 50 OPT		297
OESXQ8-P34 EURO STOXX 50		442
OESXQ8-P34 EURO STOXX 50		0.3
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18		158

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	2018-08-09
기준일	2018-08-08

리디파인K200(주식혼합-파생재간

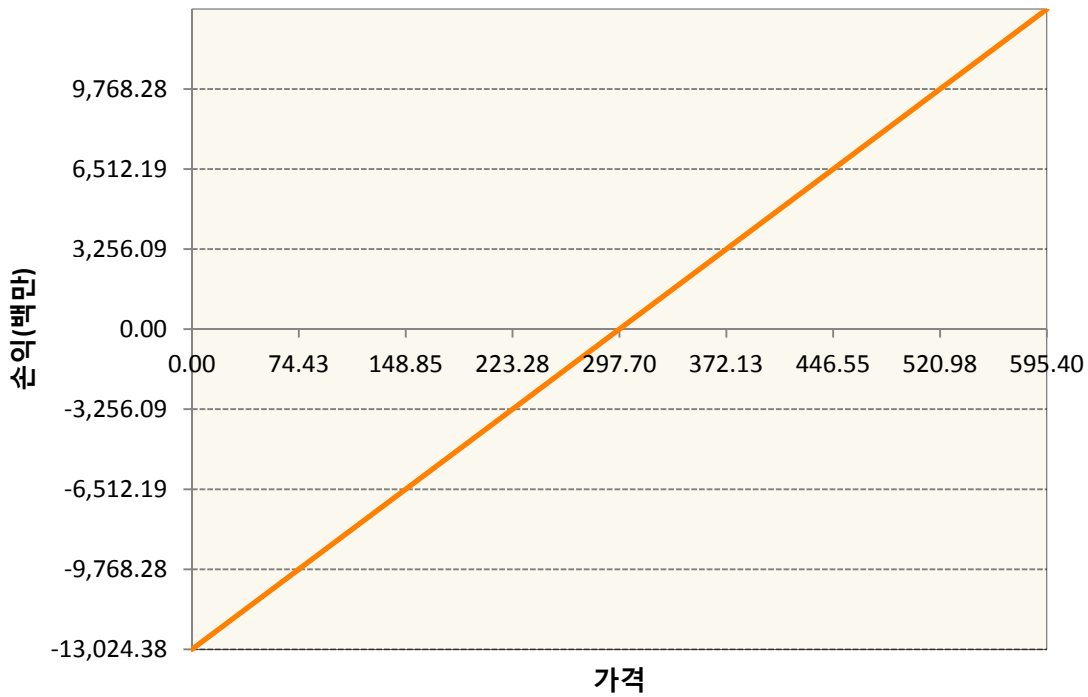
1. 계약금액

(단위:백만원)

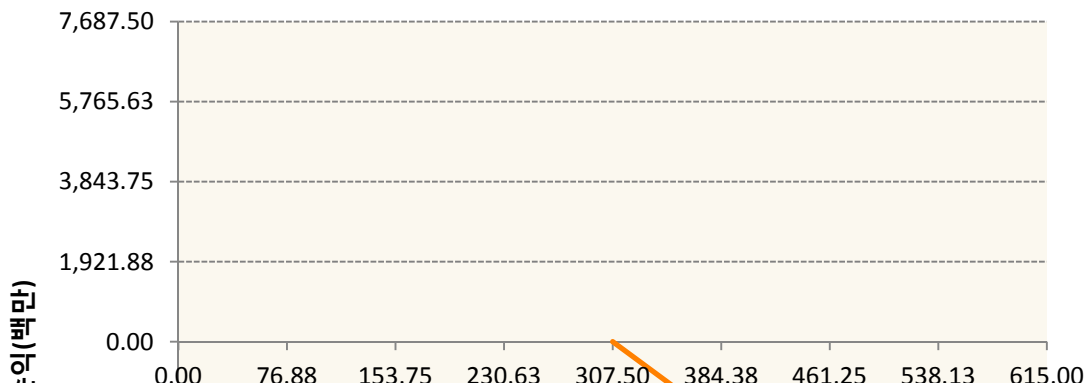
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,024	0	13,024	장내
누계	유가증권	옵션	2,134	23,730	-21,596	장내

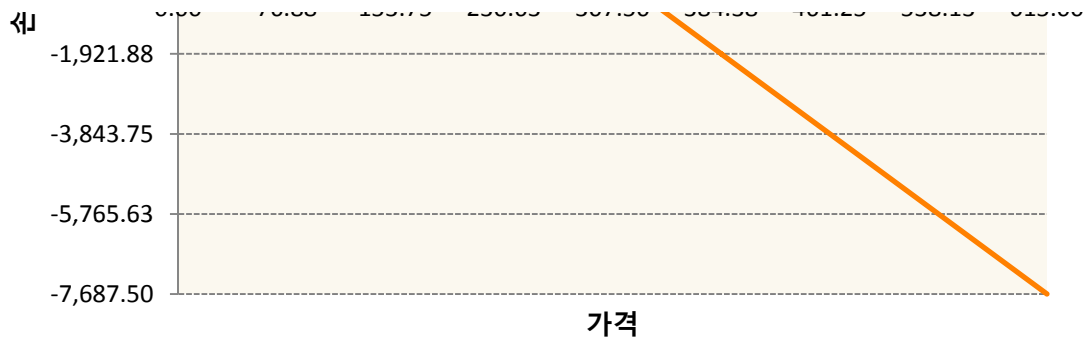
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

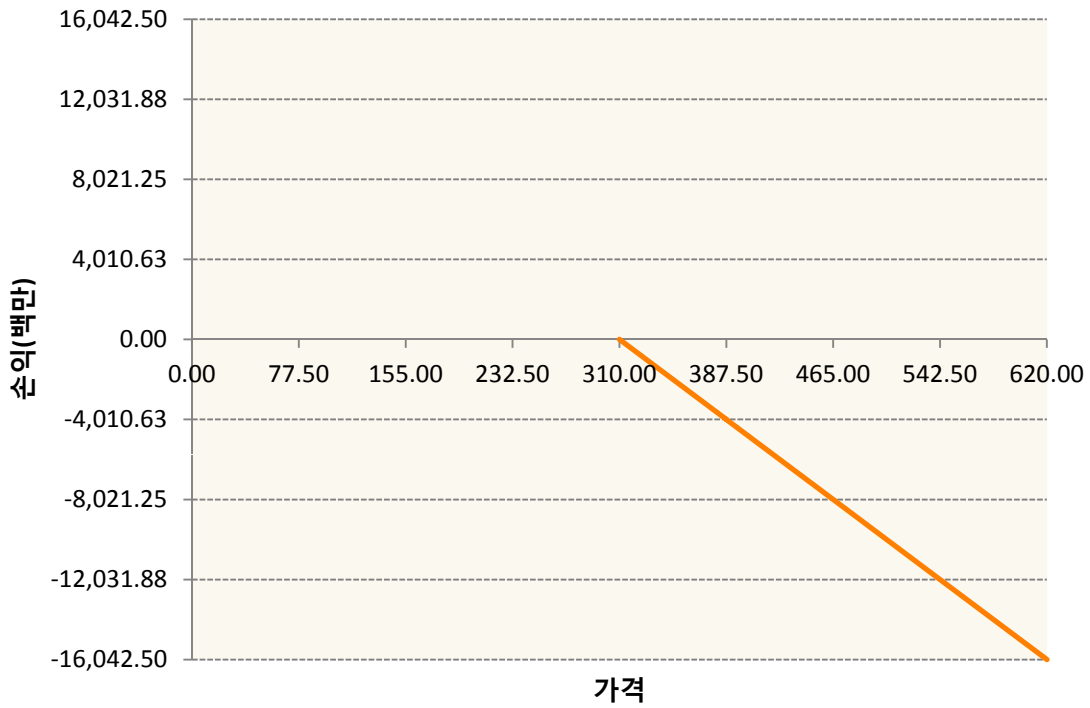


KR4201N83074-2018-08 콜307.5

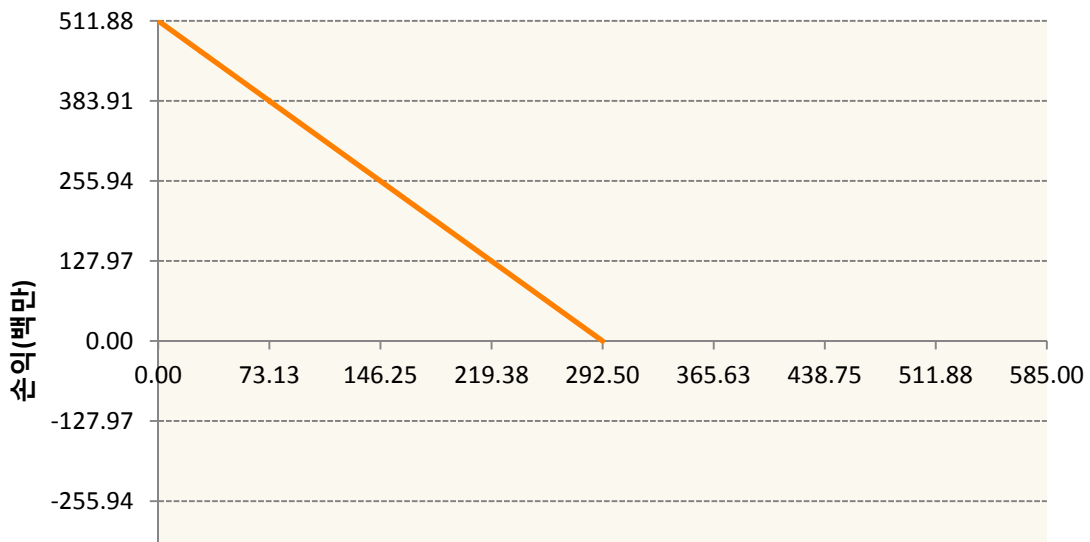


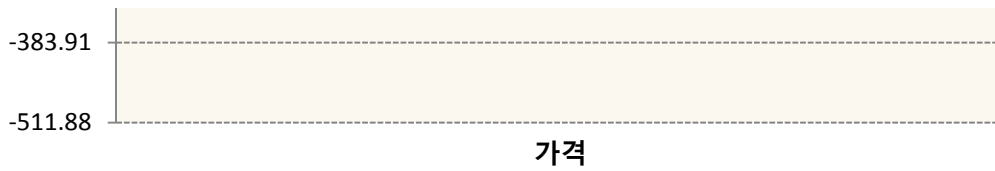


KR4201N83108-2018-08 콜310

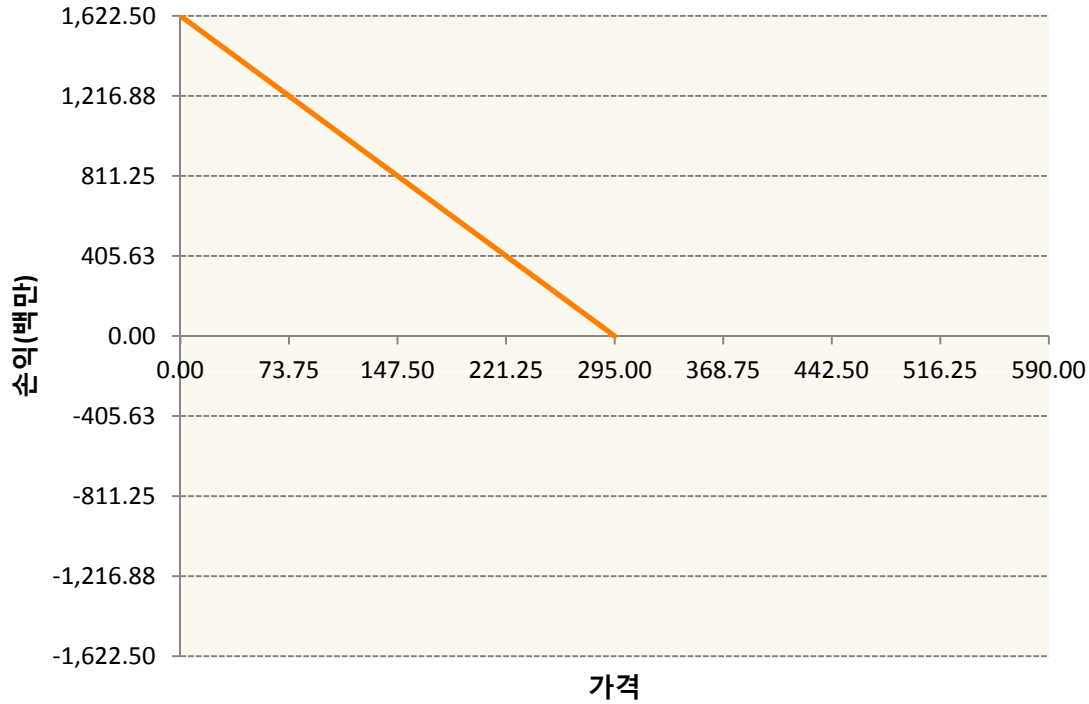


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





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%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0

0%	0	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	-11	-14	-17	-20	-23	-26	-29
5.33%	-140	-141	-142	-144	-146	-148	-150
8.00%	-336	-336	-336	-336	-336	-336	-337

KR4201N8312018-08 콜310

570

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	-5	-8	-11	-15	-19	-24	-29
5.33%	-174	-179	-185	-191	-197	-203	-210
8.00%	-567	-567	-567	-568	-568	-569	-570

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%	20	20	20	20	20	20	20
-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

118

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	118	118	118	118	118	118	118
-5.33%	75	75	75	75	75	75	75
-2.67%	31	31	31	31	31	31	31
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

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

(단위:백만원)

1,099

공시일	2018-08-09
기준일	2018-08-08

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

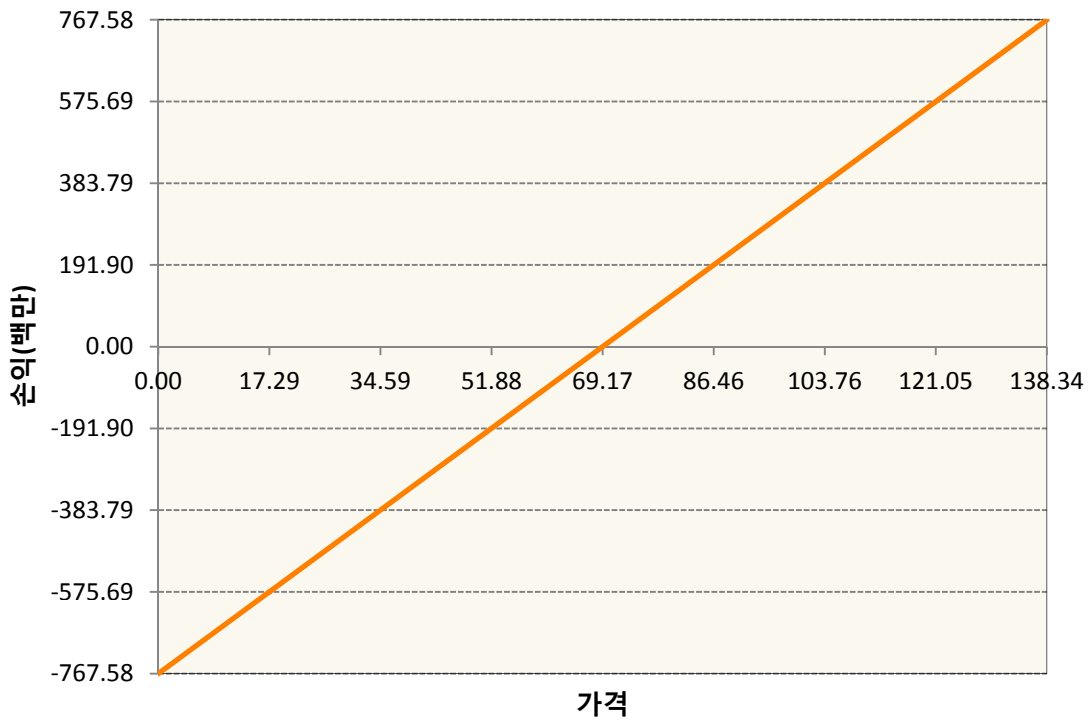
1. 계약금액

(단위:백만원)

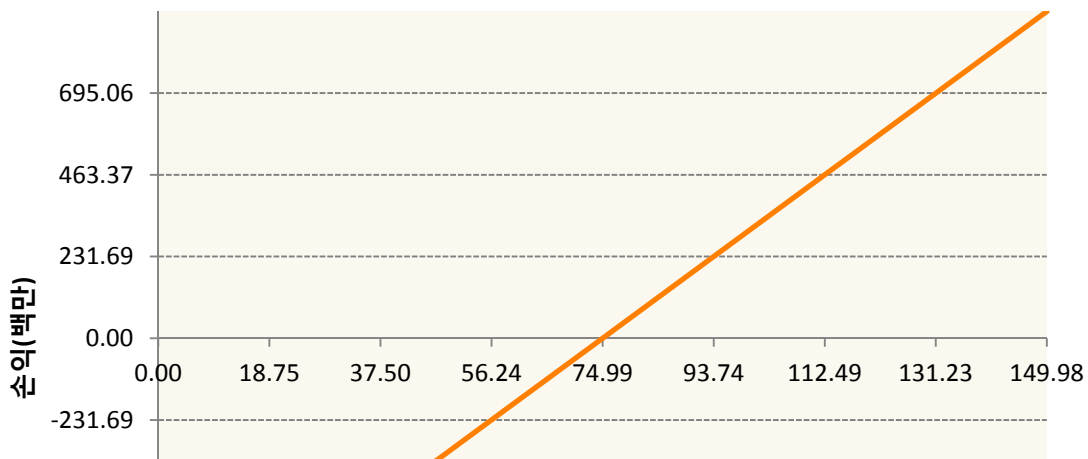
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,718	616	3,102	

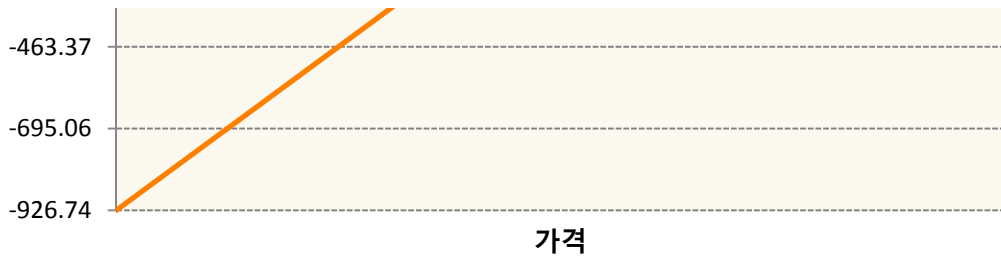
2. 만기시점의 손익구조

CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18

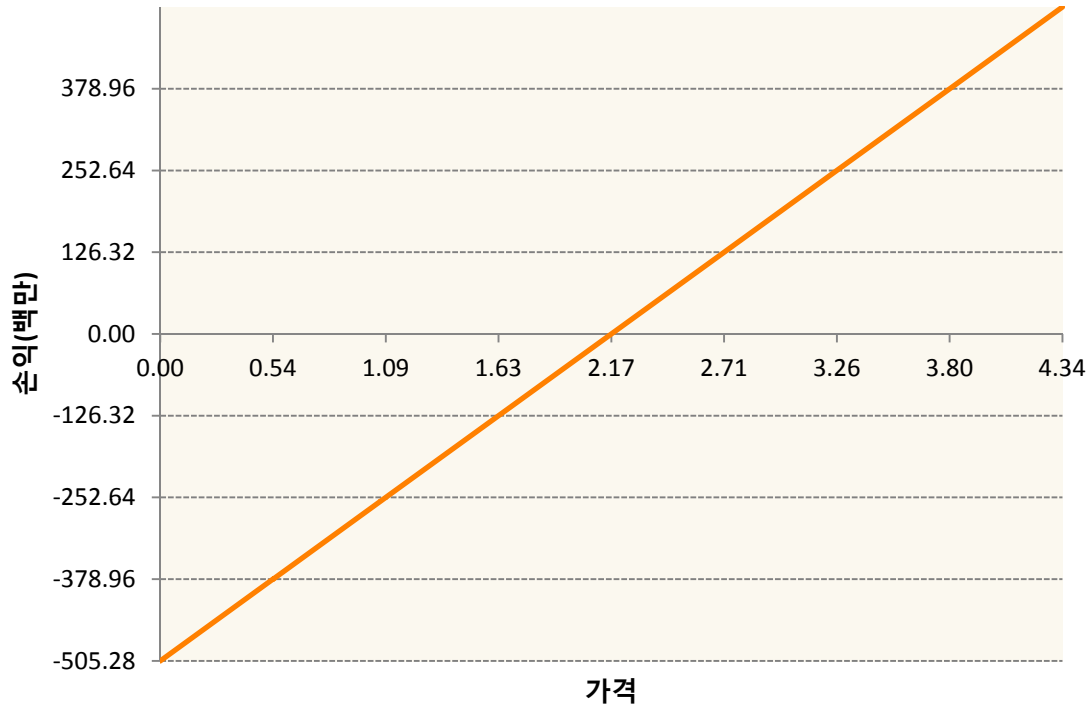


COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18

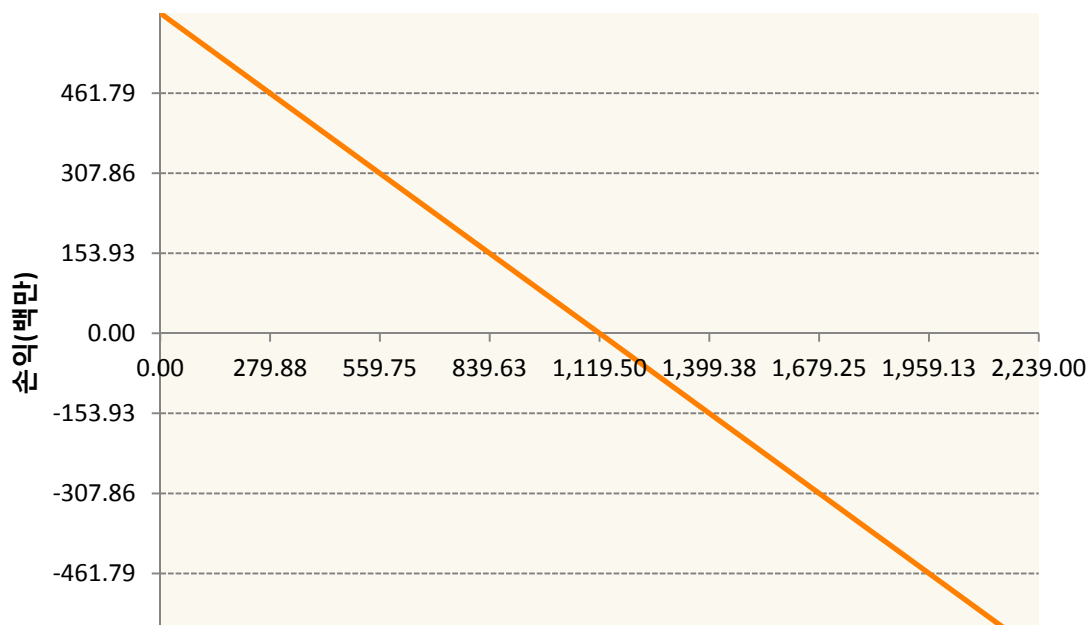


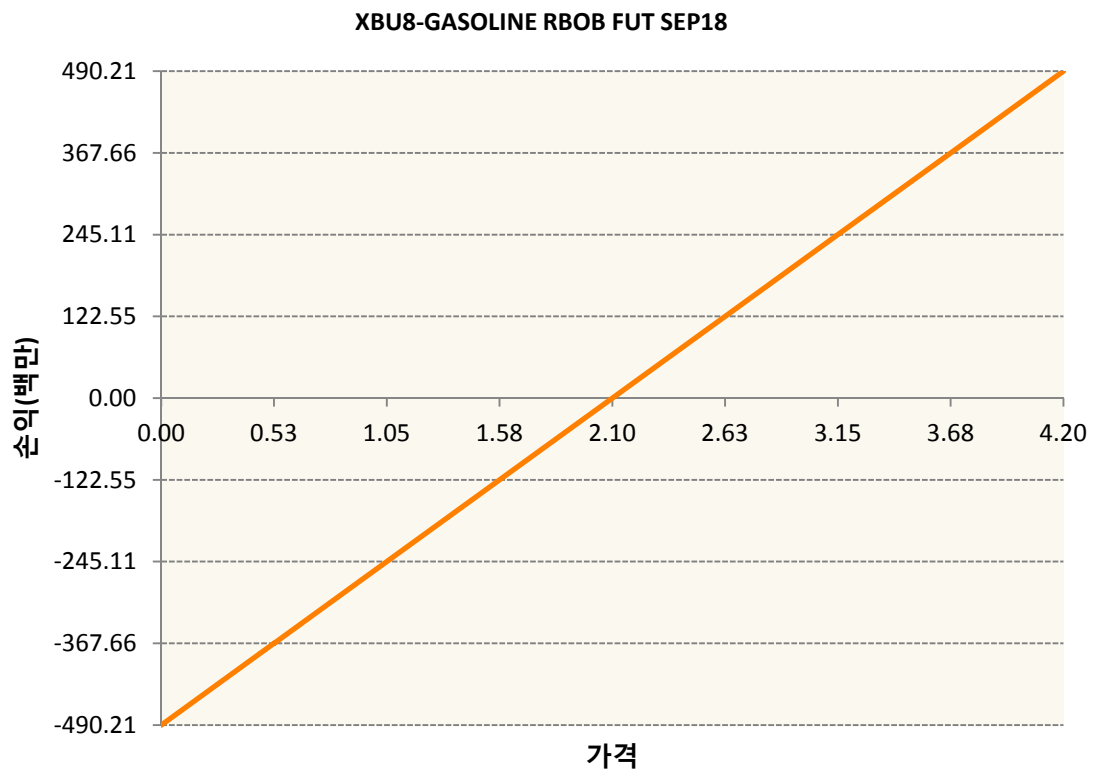
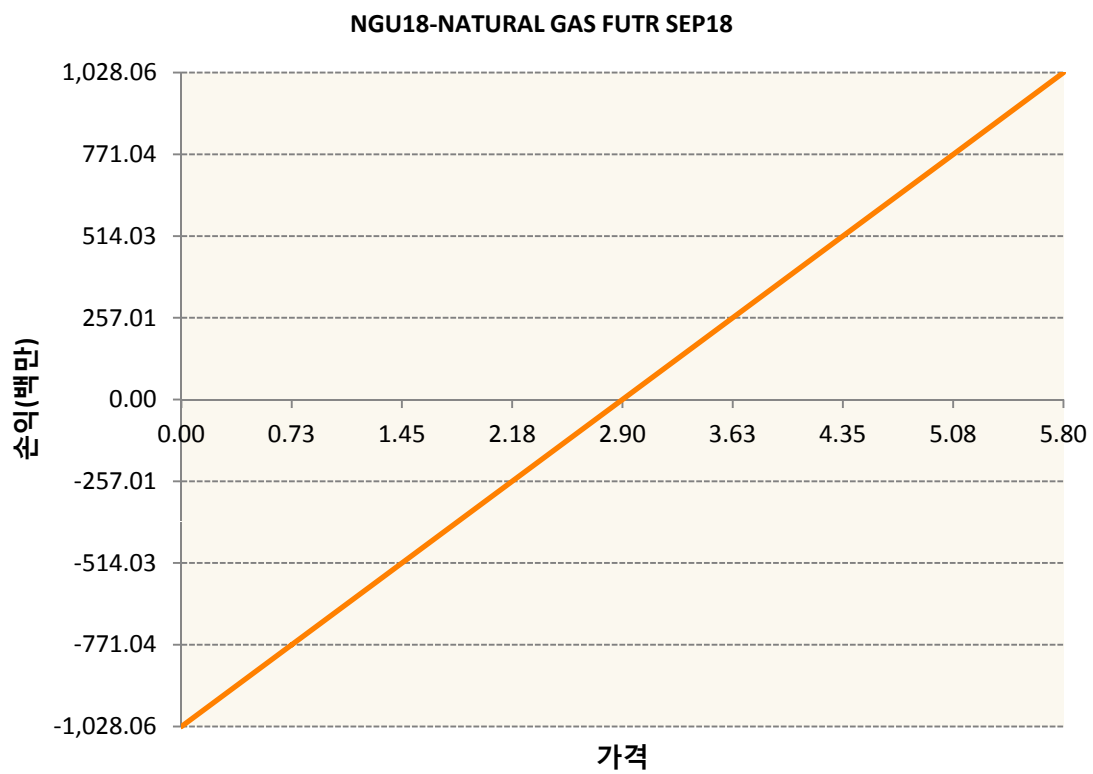
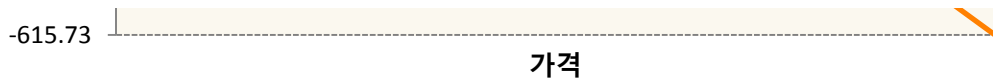


HOU8-NY Harb ULSD Fut SEP18



KR4175N80001-2018-08 달러선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU8	WTI CRUDE FUTURE SEP18	61
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	74
HOU8	NY Harb ULSD Fut SEP18	40
KR4175N80C	2018-08 달러선물	49
NGU18	NATURAL GAS FUTR SEP18	82
XBU8	GASOLINE RBOB FUT SEP18	39

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

453

공시일	2018-08-09
기준일	2018-08-08

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

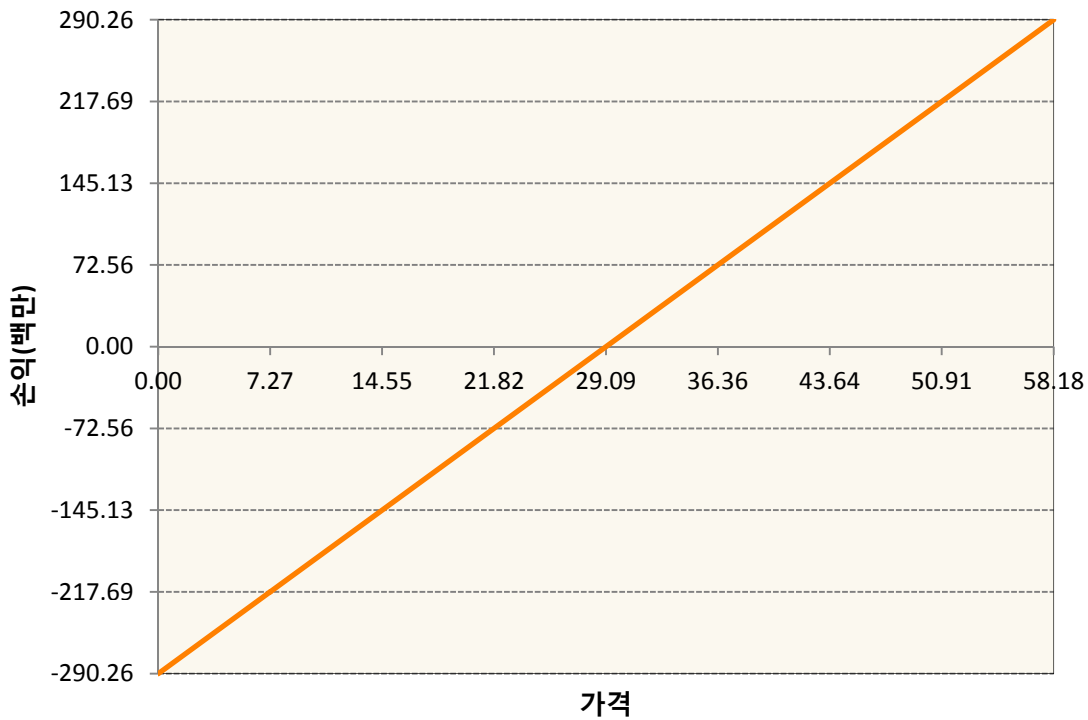
1. 계약금액

(단위:백만원)

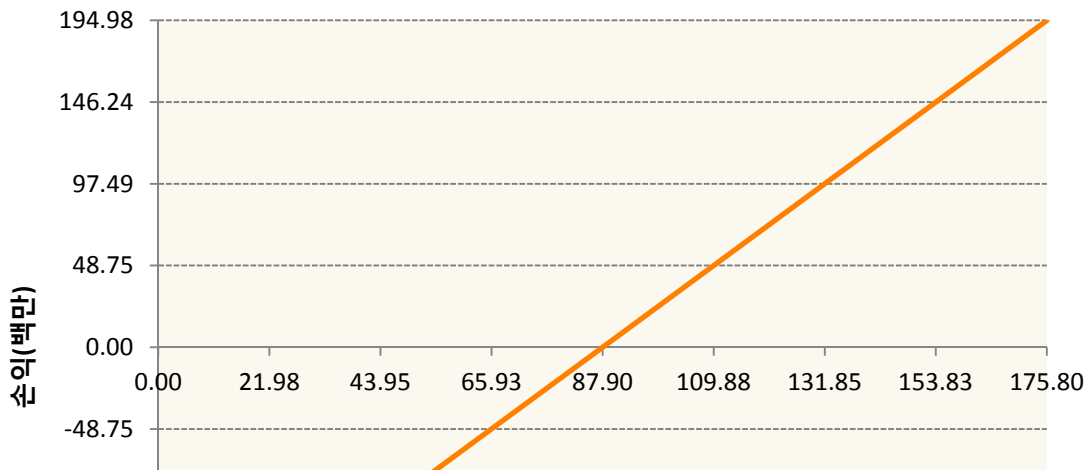
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,768	78	3,690	

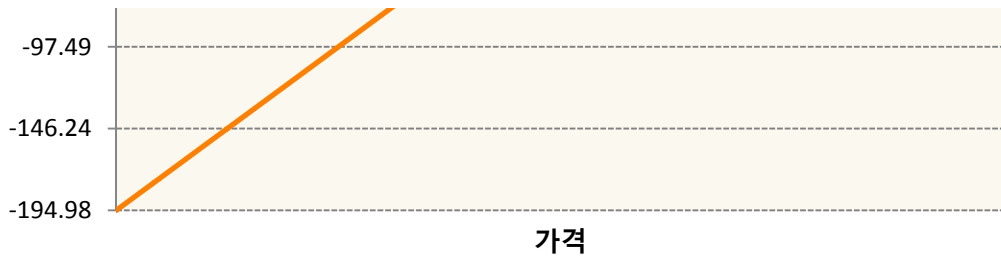
2. 만기시점의 손익구조

BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18

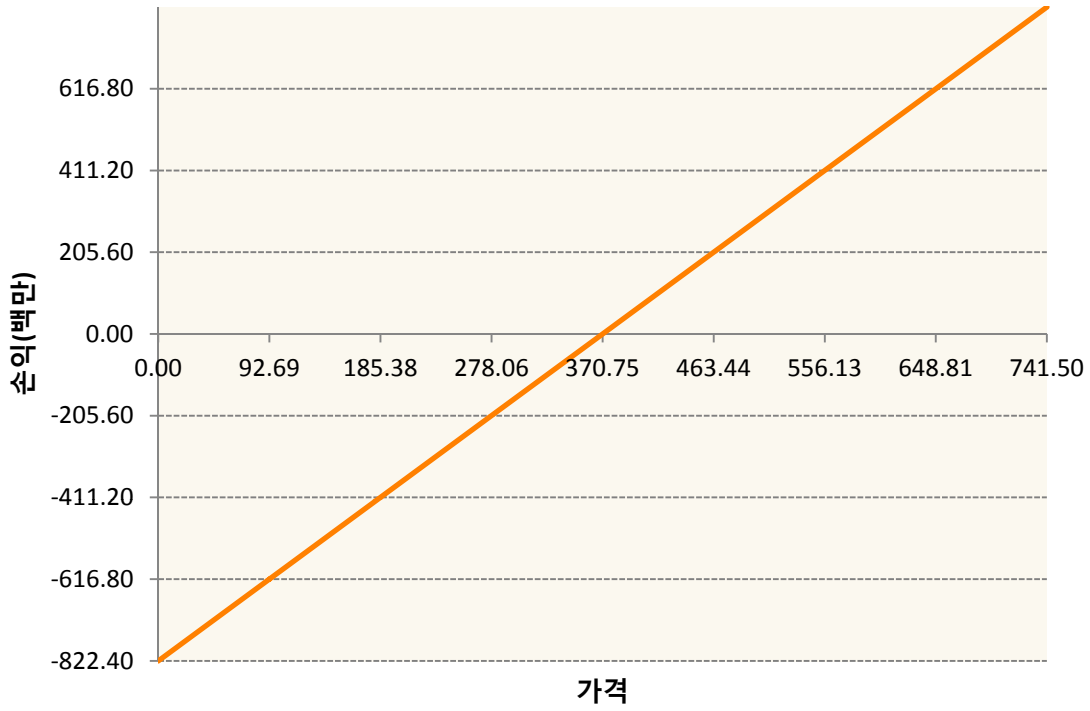


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

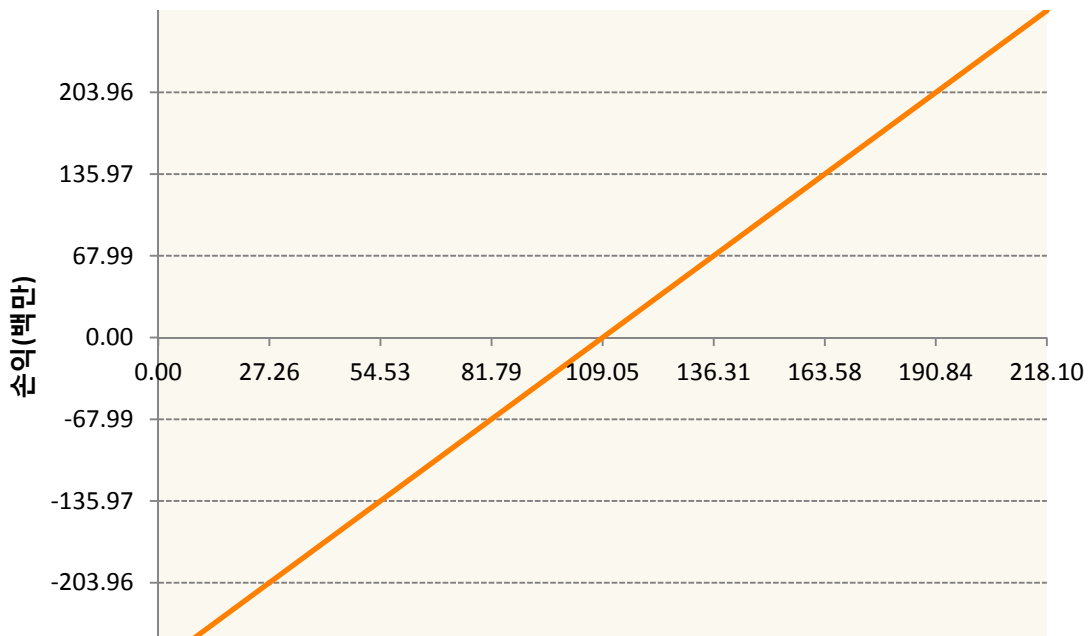


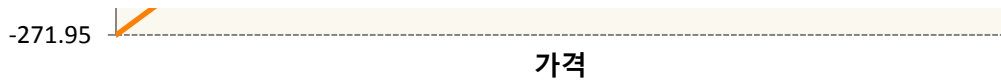


CU8-CORN FUTURE SEP18

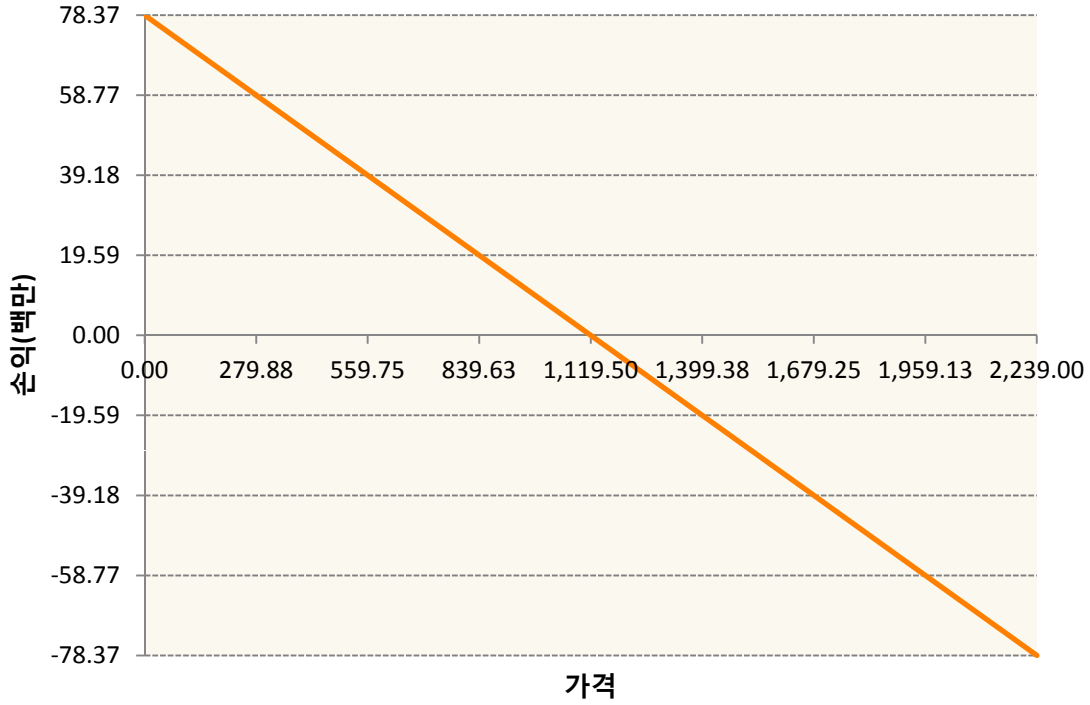


KCU8-COFFEE 'C' FUTURE SEP18

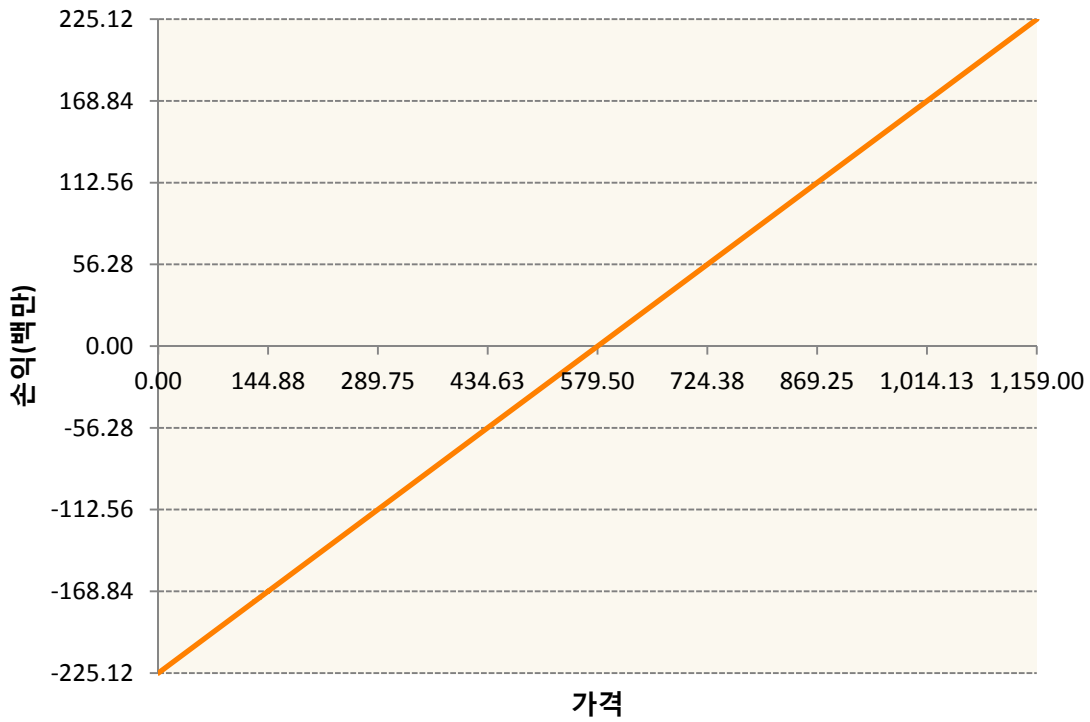




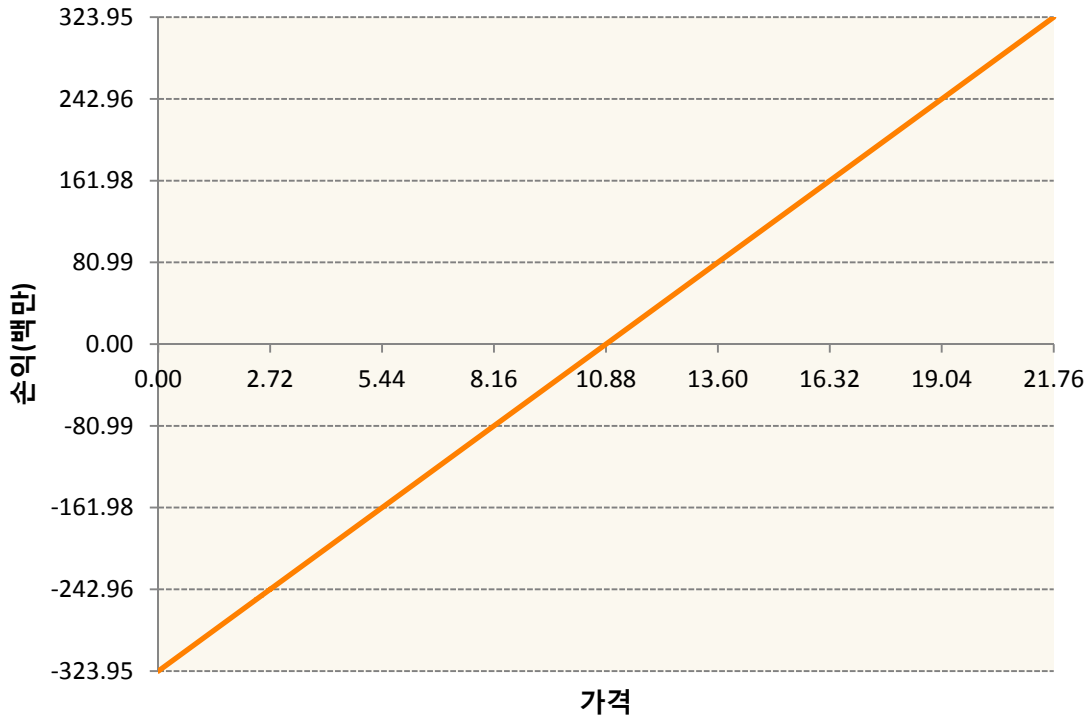
KR4175N80001-2018-08 달러선물



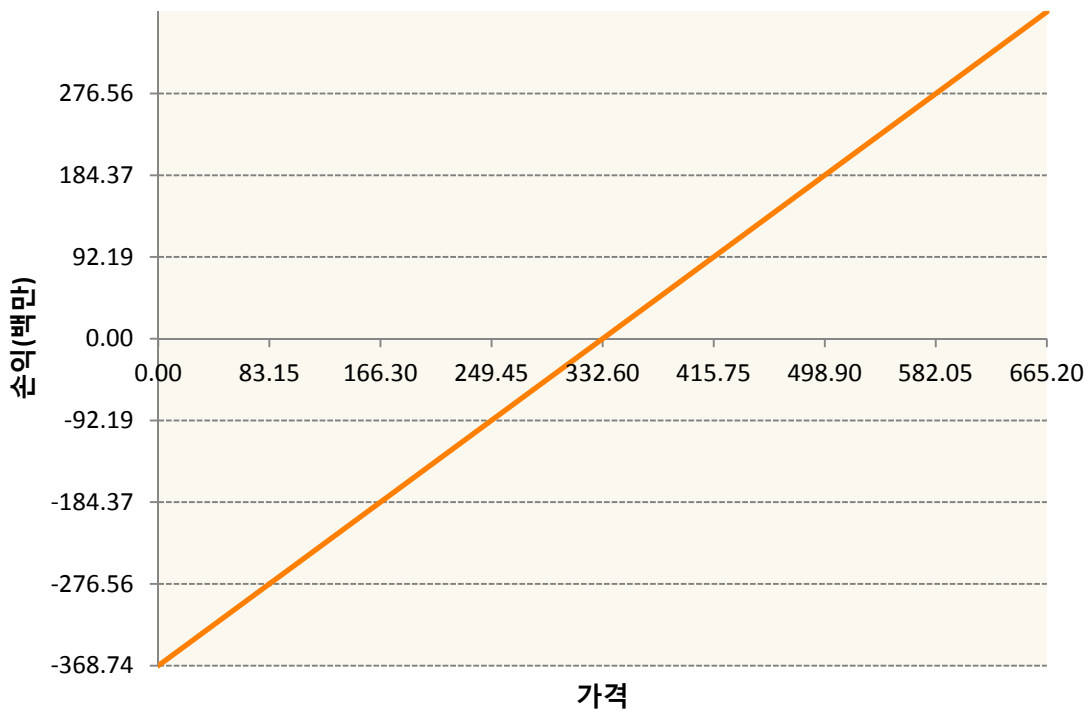
KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

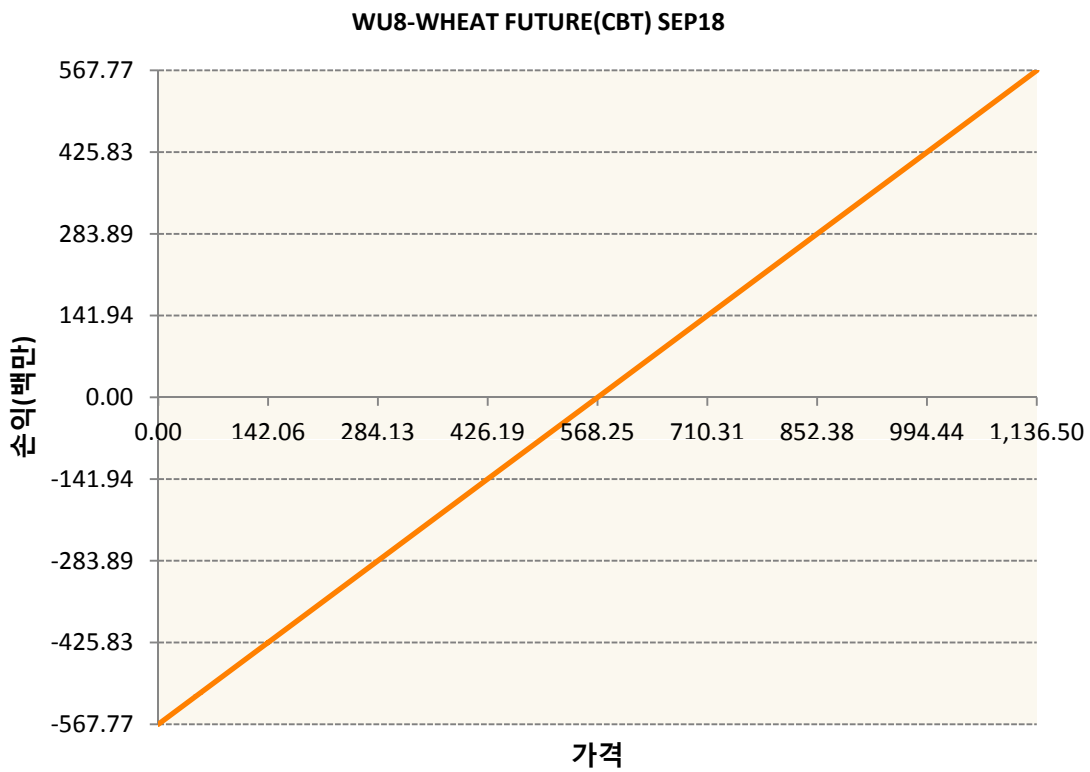
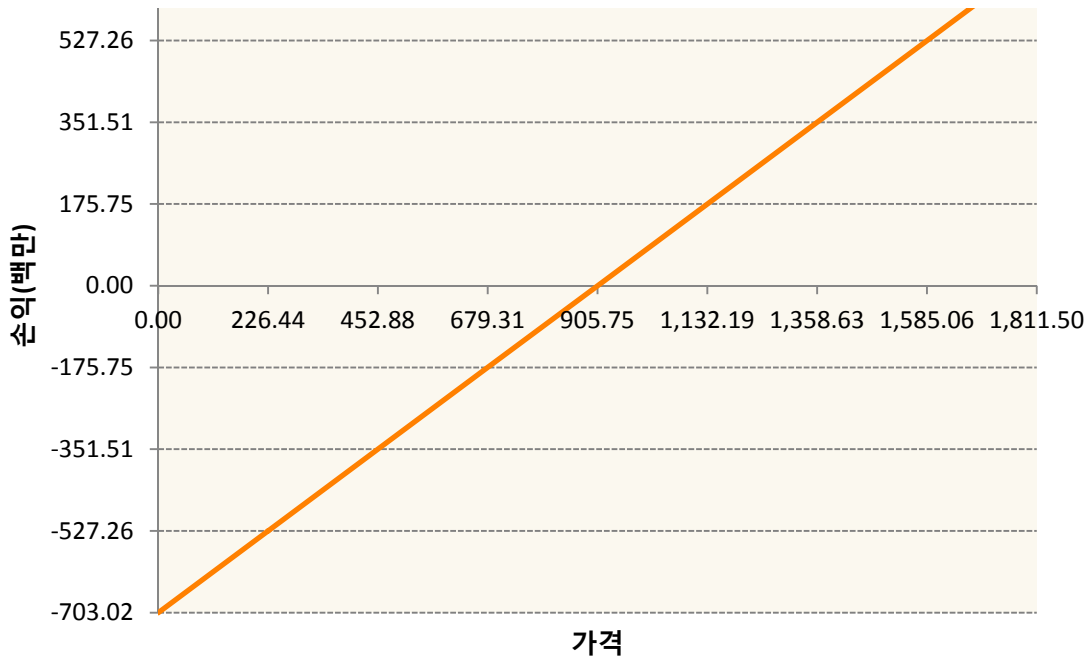


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



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	56
WU8	WHEAT FUTURE(CBT) SEP18	45

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

(단위:백만원)

319