

공시일	2018-08-10
기준일	2018-08-09

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	2018-08-10
기준일	2018-08-09

스마트인덱스모

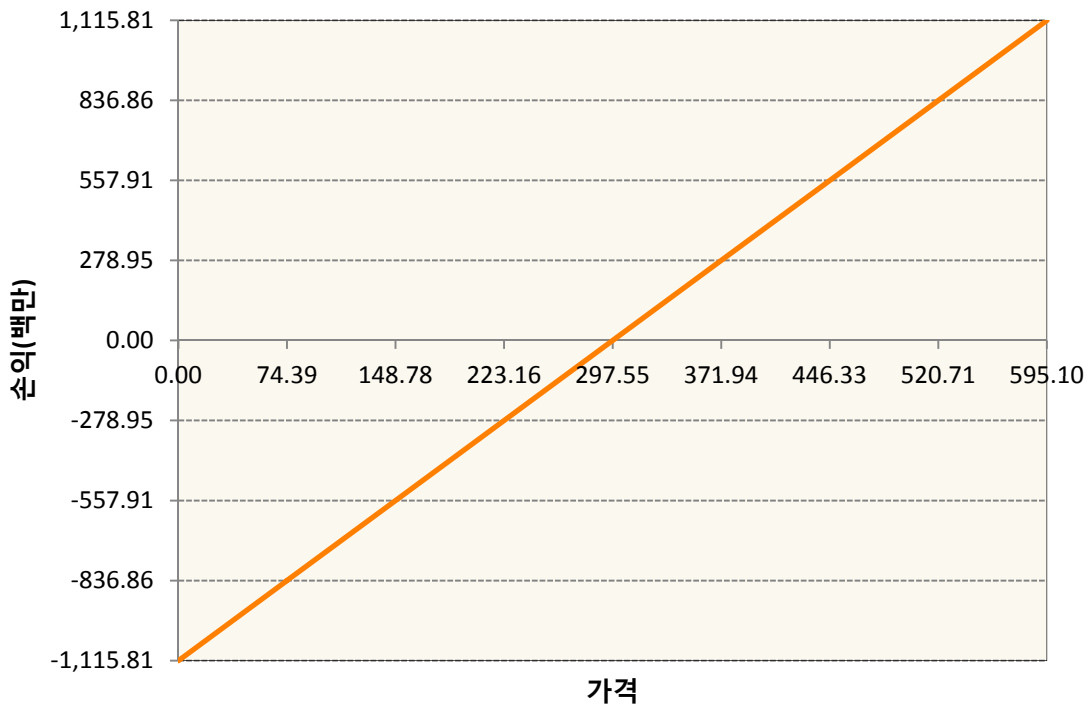
1. 계약금액

(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	2018-08-10
기준일	2018-08-09

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	2018-08-10
기준일	2018-08-09

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

310

* 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	2018-08-10
기준일	2018-08-09

유로인덱스모(주식-파생형)

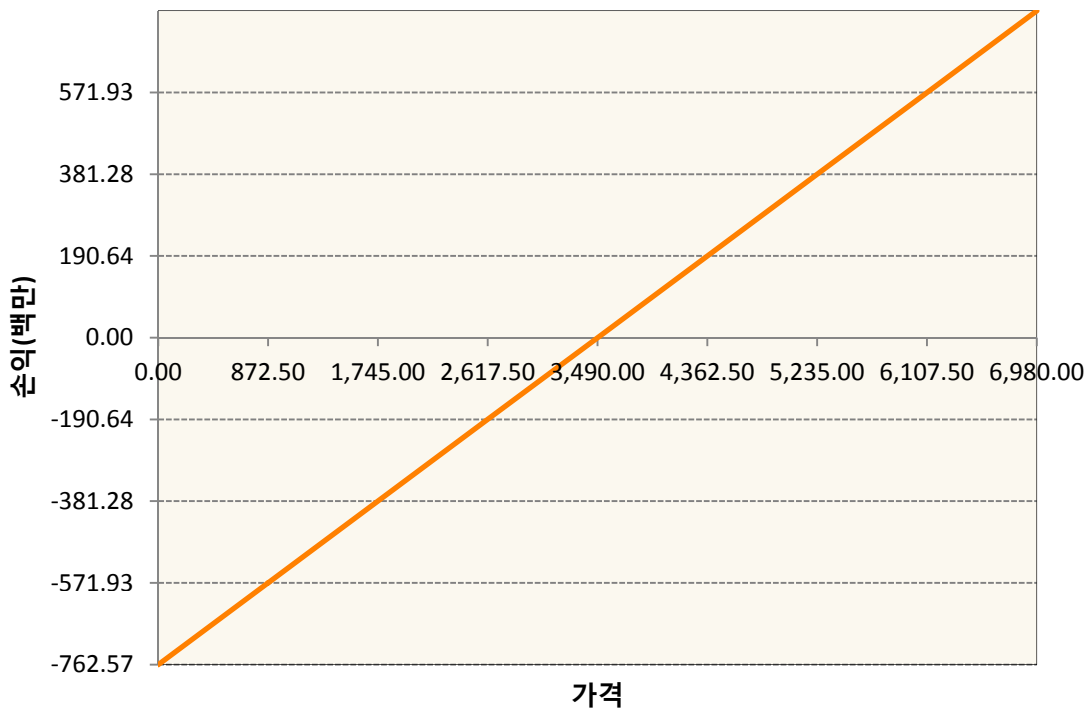
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	763	0	763	

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	2018-08-10
기준일	2018-08-09

차이나인덱스모(주식-파생형)

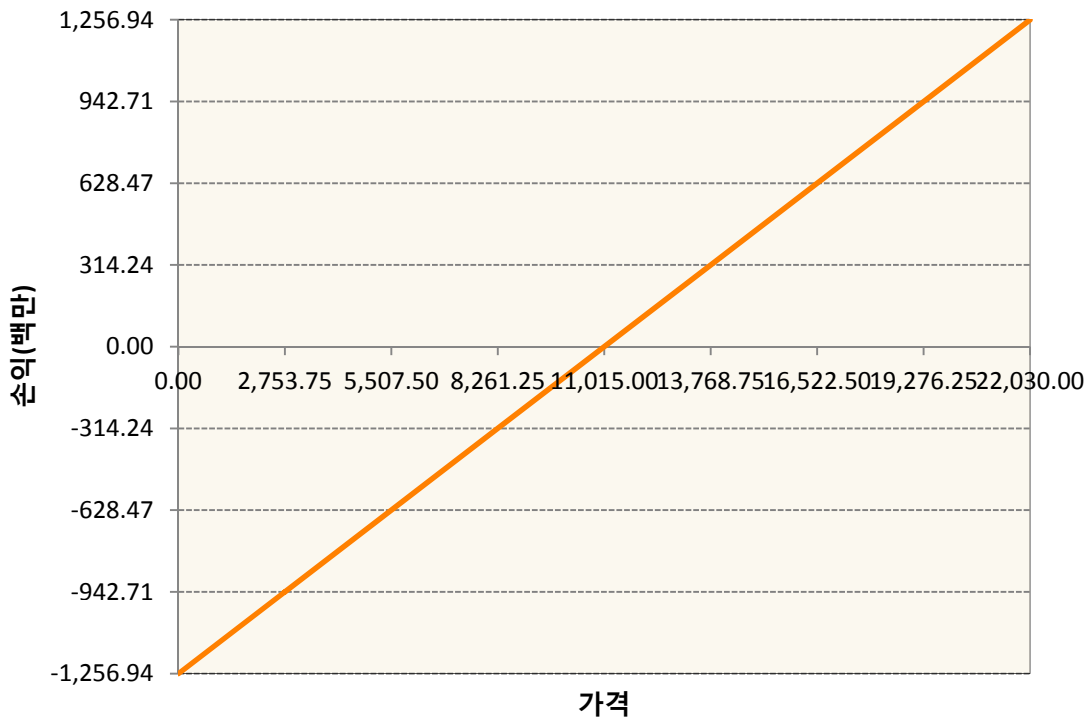
1. 계약금액

(단위:백만원)

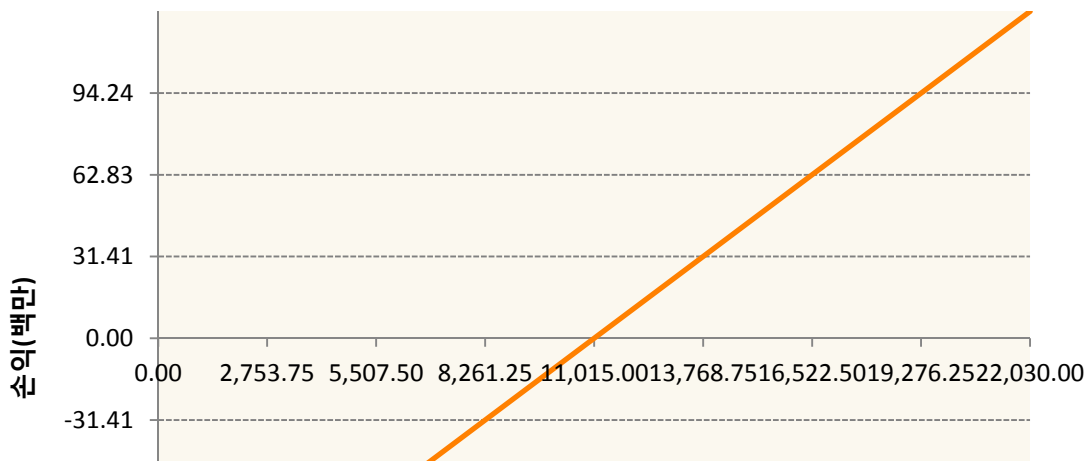
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,383	0	1,383	장내

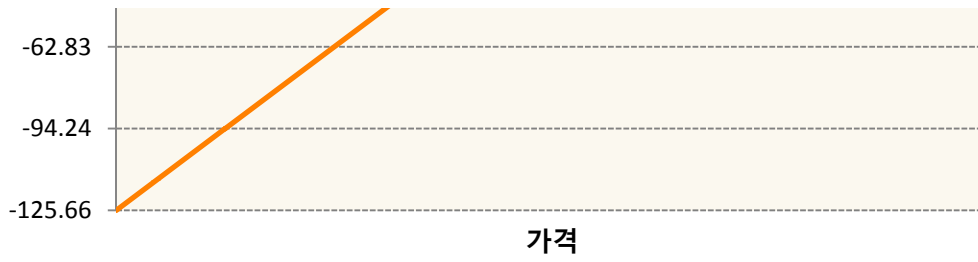
2. 만기시점의 손익구조

HCQ8-HSCEI Futures Aug18



MHCQ8-MINI H-SHR IDX FU Aug18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCQ8	HSCEI Futures Aug18	101
MHCQ8	MINI H-SHR IDX FU Aug18	10

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

101

공시일	2018-08-10
기준일	2018-08-09

커버드콜모(주식혼합-파생형)

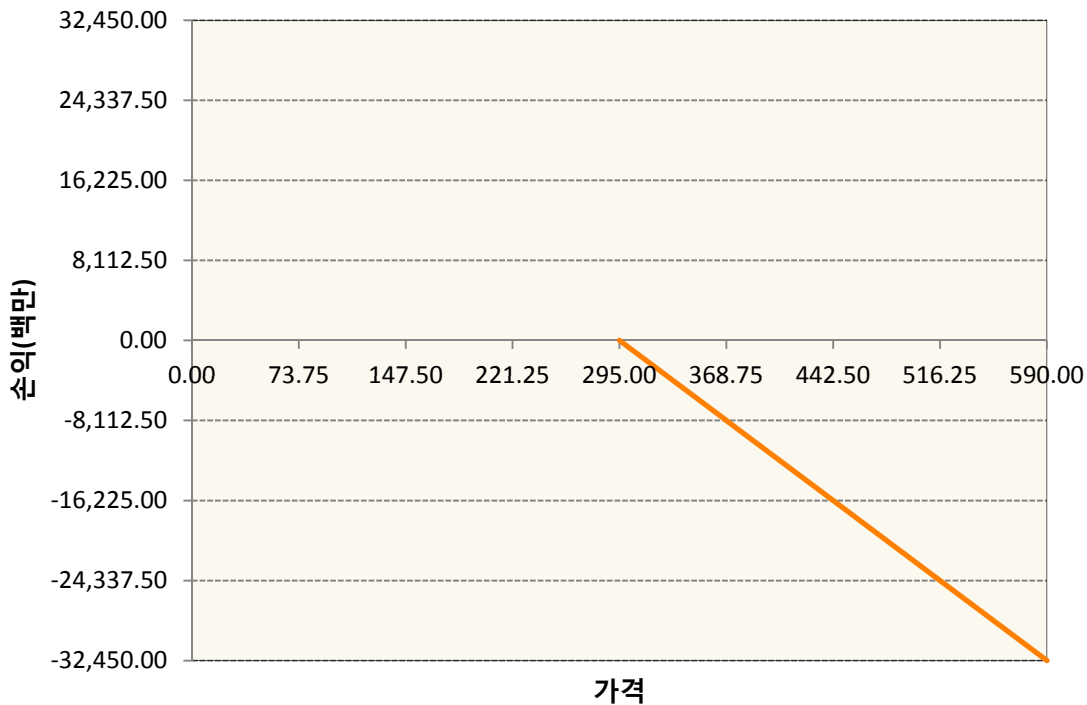
1. 계약금액

(단위:백만원)

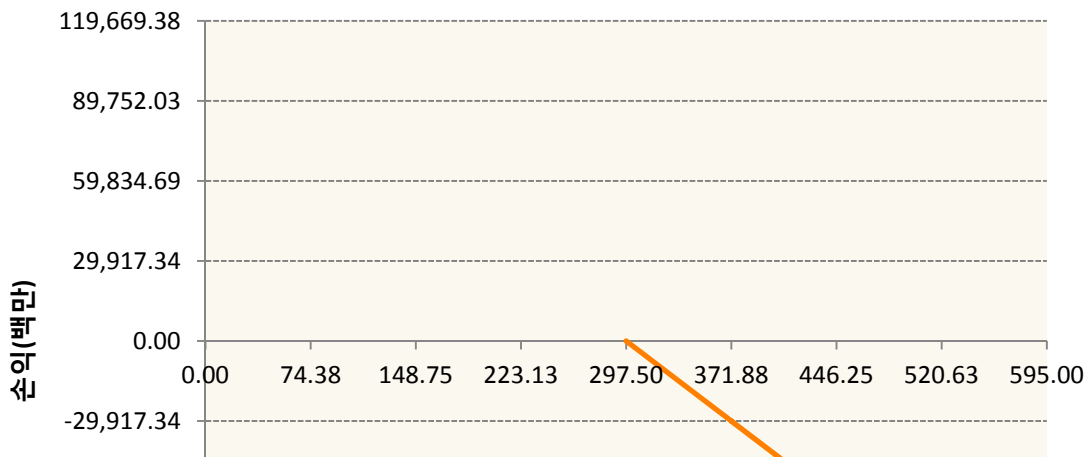
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	154,249	-154,249	장내
누계	유가증권	옵션	0	152,119	-152,119	장내

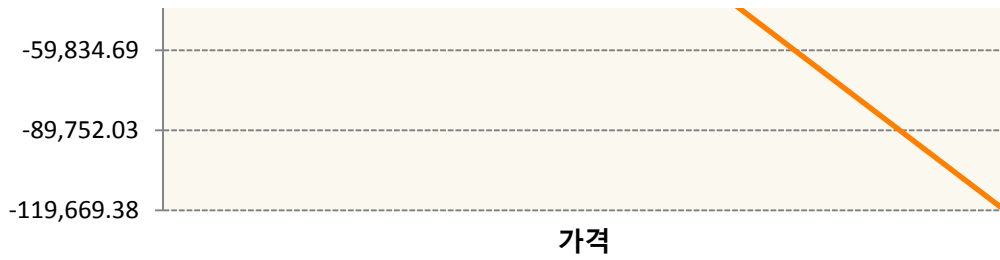
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92950-2018-09 콜295



KR4201N92976-2018-09 콜297.5





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N929 2018-09 콜295 2,066

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,114	1,068	1,016	960	900	836	770
-5.33%	960	891	819	744	667	589	509
-2.67%	687	601	514	427	339	251	163
0%	271	181	91	0	-91	-181	-272
2.67%	-287	-368	-451	-535	-621	-707	-794
5.33%	-966	-1,029	-1,096	-1,167	-1,241	-1,317	-1,396
8.00%	-1,731	-1,773	-1,822	-1,877	-1,936	-1,999	-2,066

KR4201N929 2018-09 콜297.5 7,292

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,668	3,523	3,356	3,170	2,967	2,751	2,523
-5.33%	3,209	2,979	2,734	2,477	2,211	1,937	1,656
-2.67%	2,356	2,053	1,746	1,435	1,121	806	488
0%	1,003	668	334	0	-334	-668	-1,002
2.67%	-879	-1,193	-1,512	-1,834	-2,158	-2,484	-2,812
5.33%	-3,230	-3,485	-3,754	-4,034	-4,323	-4,619	-4,920
8.00%	-5,937	-6,117	-6,320	-6,542	-6,779	-7,030	-7,292

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

8,632

공시일	2018-08-10
기준일	2018-08-09

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

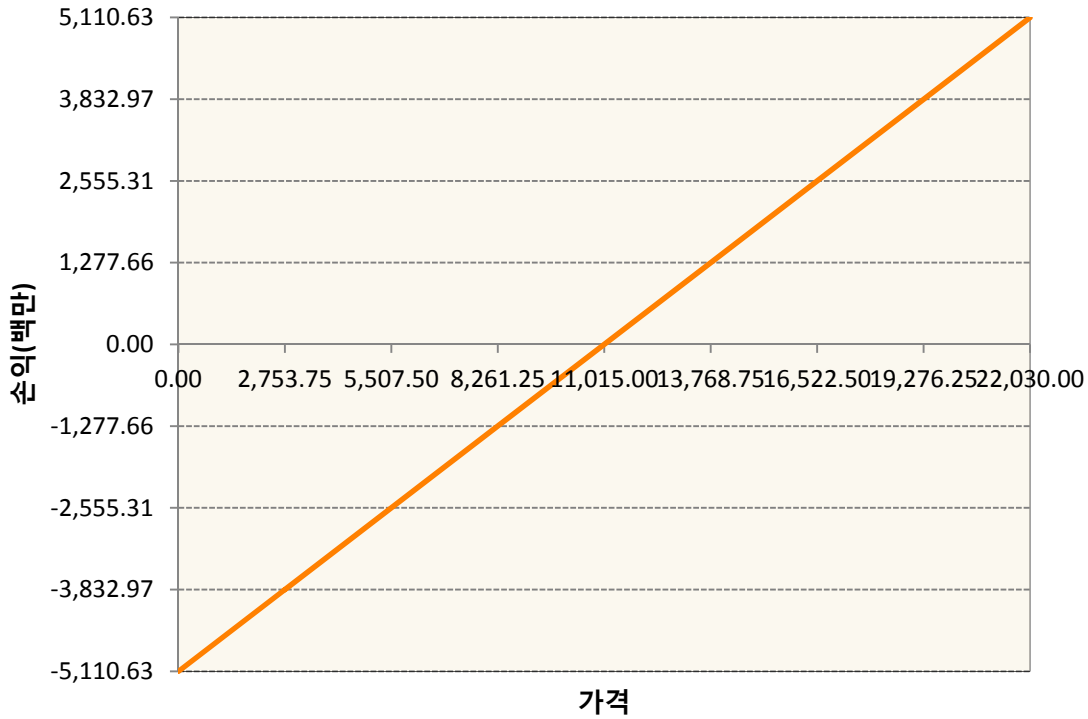
1. 계약금액

(단위:백만원)

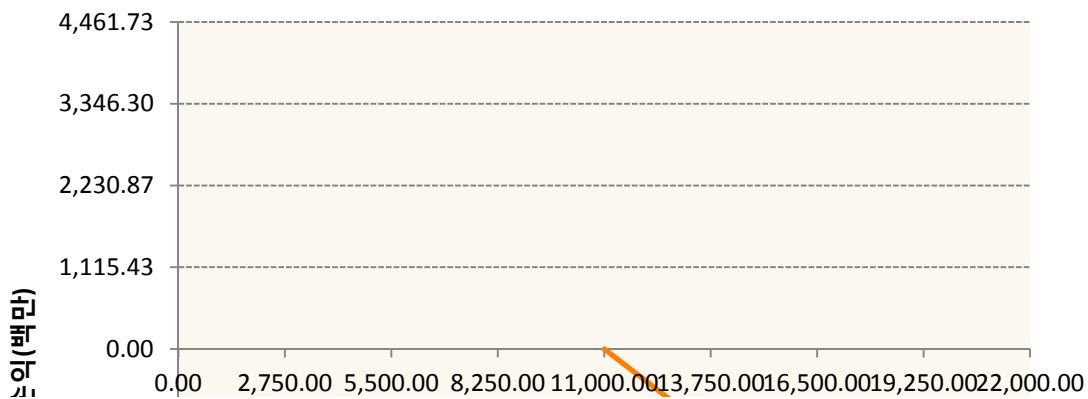
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,111	0	5,111	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,474	-11,474	장내

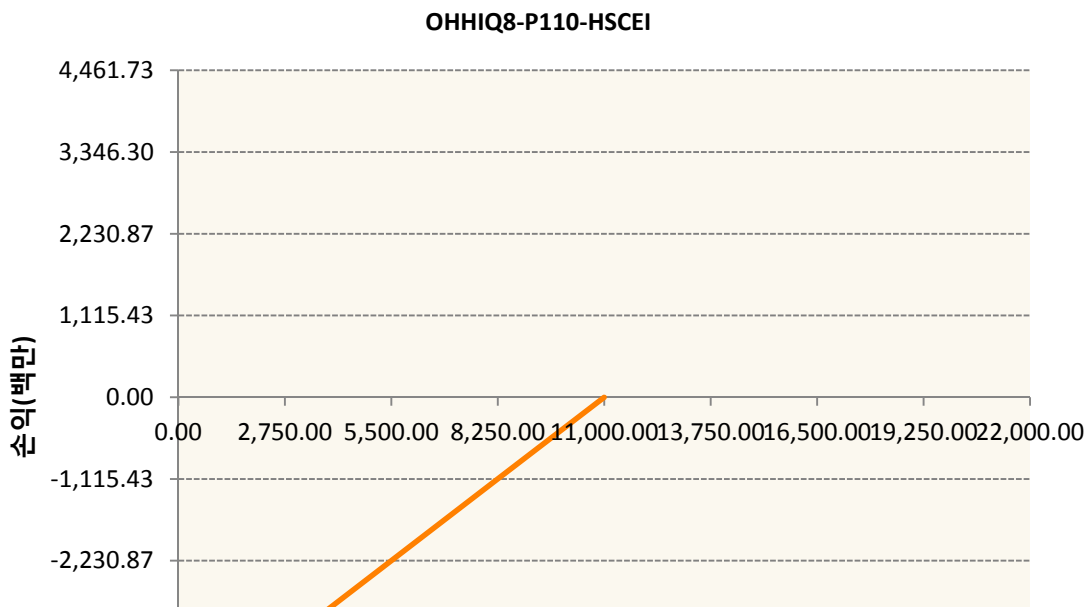
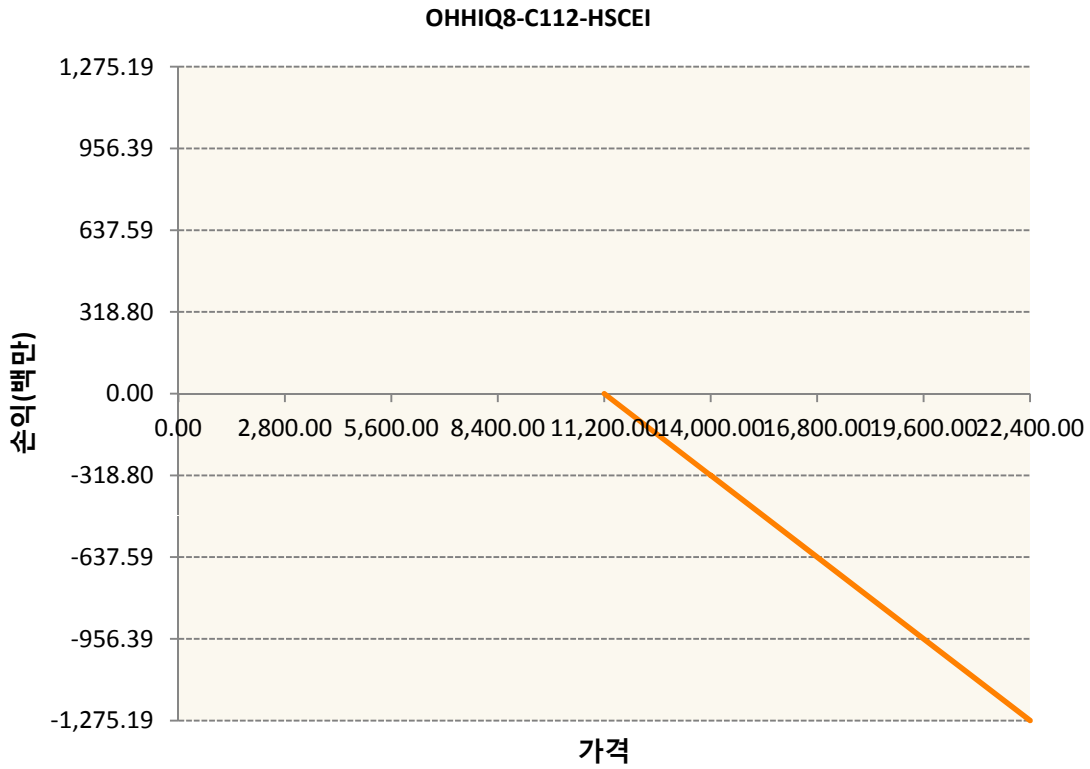
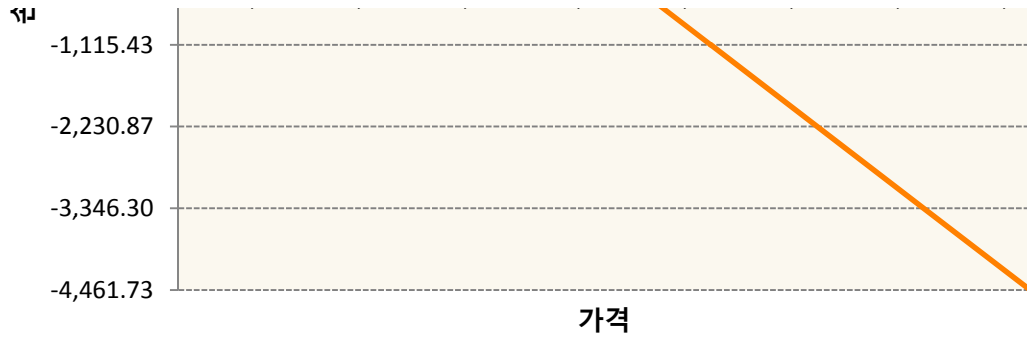
2. 만기시점의 손익구조

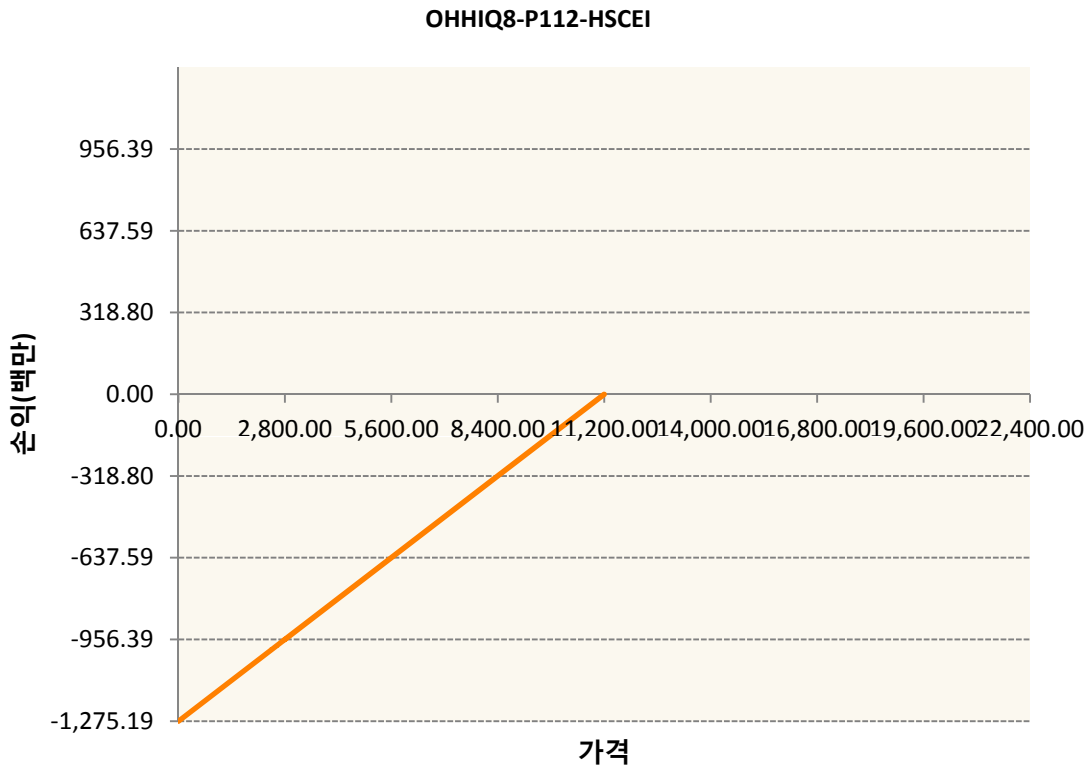
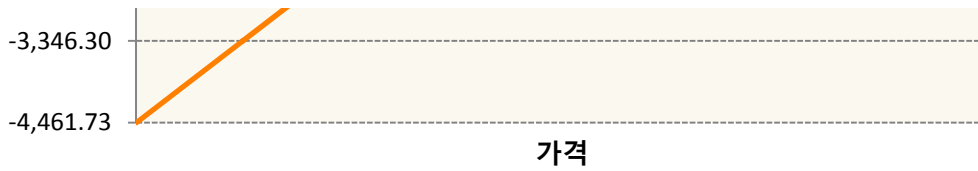
HCQ8-HSCEI Futures Aug18



OHHIQ8-C110-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ8	HSCEI Futures Aug18	409
OHHIQ8-C1	HSCEI	357
OHHIQ8-C1	HSCEI	102
OHHIQ8-P11	HSCEI	357
OHHIQ8-P11	HSCEI	102

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,209

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8							480
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-480	-480	-480	-480	-480	-480	-480
-5.33%	-320	-320	-320	-320	-320	-320	-320
-2.67%	-160	-160	-160	-160	-160	-160	-160
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	160	160	160	160	160	160	160
5.33%	320	320	320	320	320	320	320
8.00%	480	480	480	480	480	480	480
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11							648
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-648	-648	-648	-648	-648	-648	-648
-5.33%	-432	-432	-432	-432	-432	-432	-432
-2.67%	-216	-216	-216	-216	-216	-216	-216
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	216	216	216	216	216	216	216
5.33%	432	432	432	432	432	432	432
8.00%	648	648	648	648	648	648	648
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12							486
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-486	-486	-486	-486	-486	-486	-486
-5.33%	-324	-324	-324	-324	-324	-324	-324
-2.67%	-162	-162	-162	-162	-162	-162	-162
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
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

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

(단위:백만원)

3,900

공시일	2018-08-10
기준일	2018-08-09

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

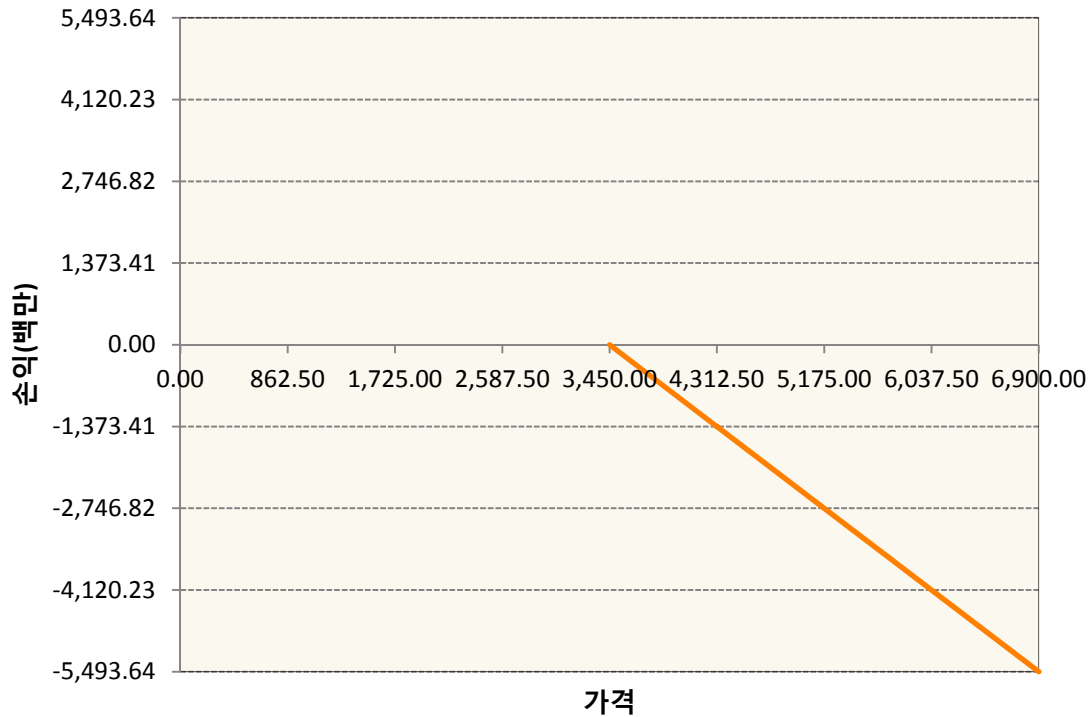
1. 계약금액

(단위:백만원)

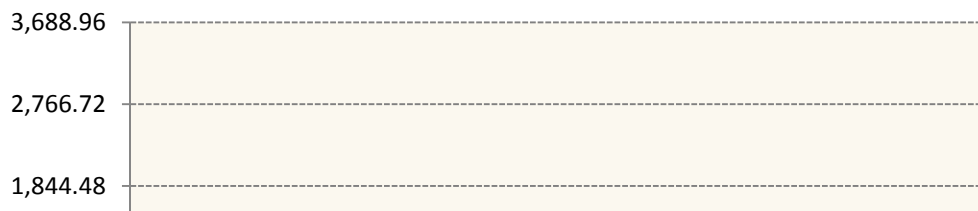
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,964	0	1,964	
누계	유가증권	스왑	44,641	0	44,641	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,680	-14,680	장내
누계	지수	스왑	52,558	0	52,558	장외

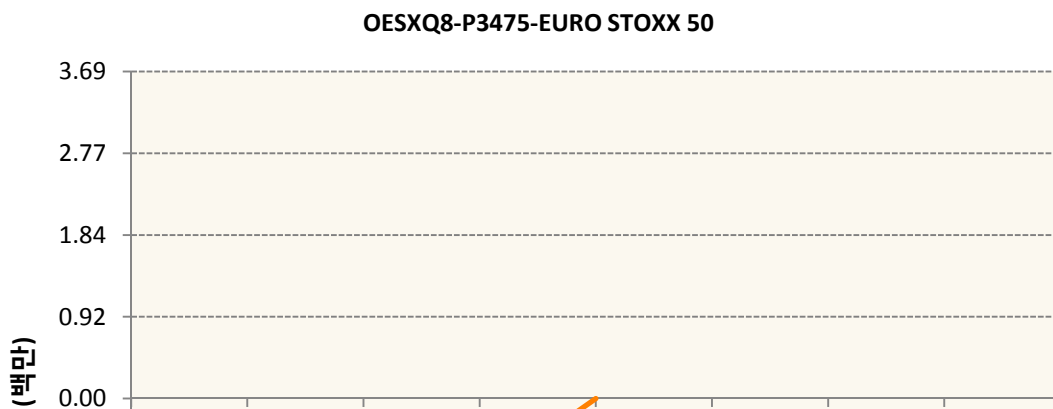
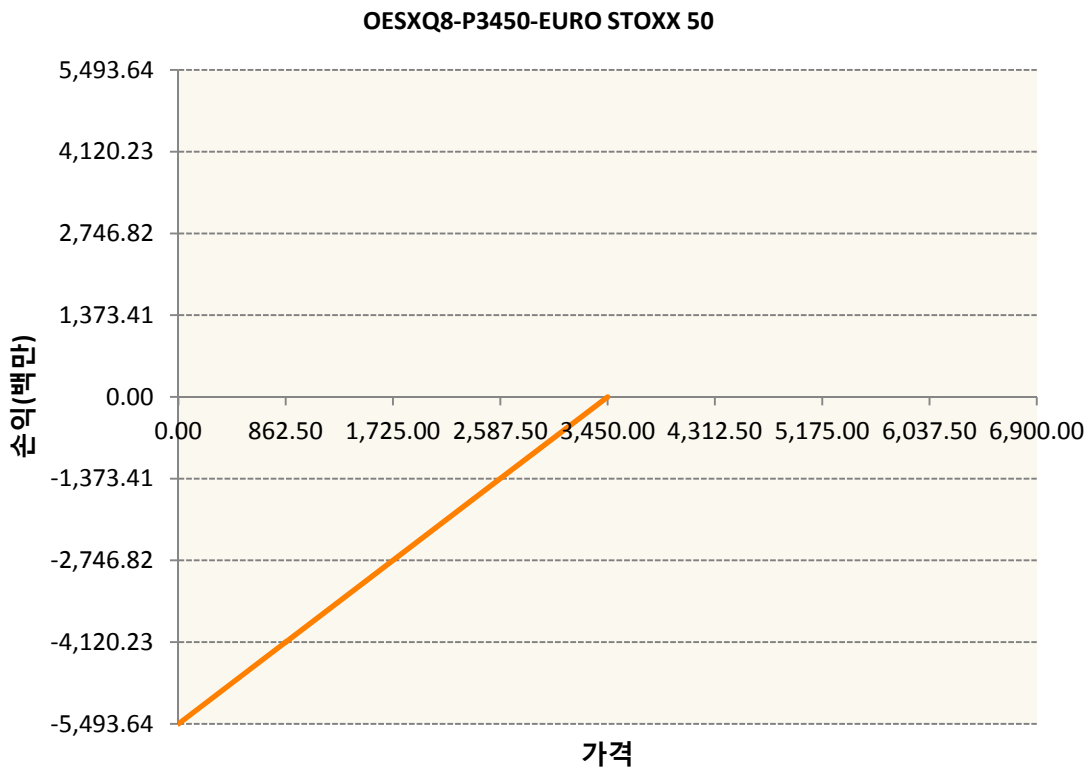
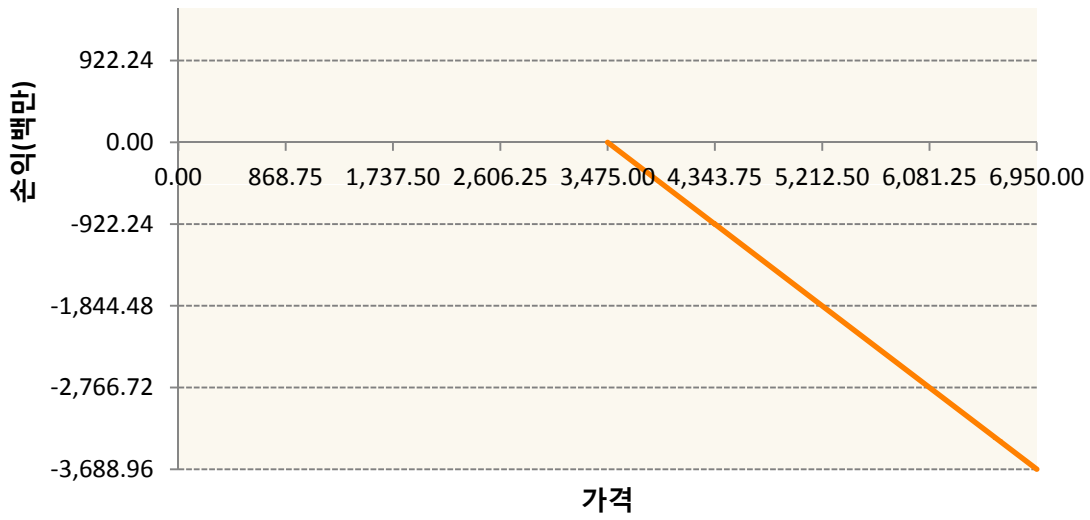
2. 만기시점의 손익구조

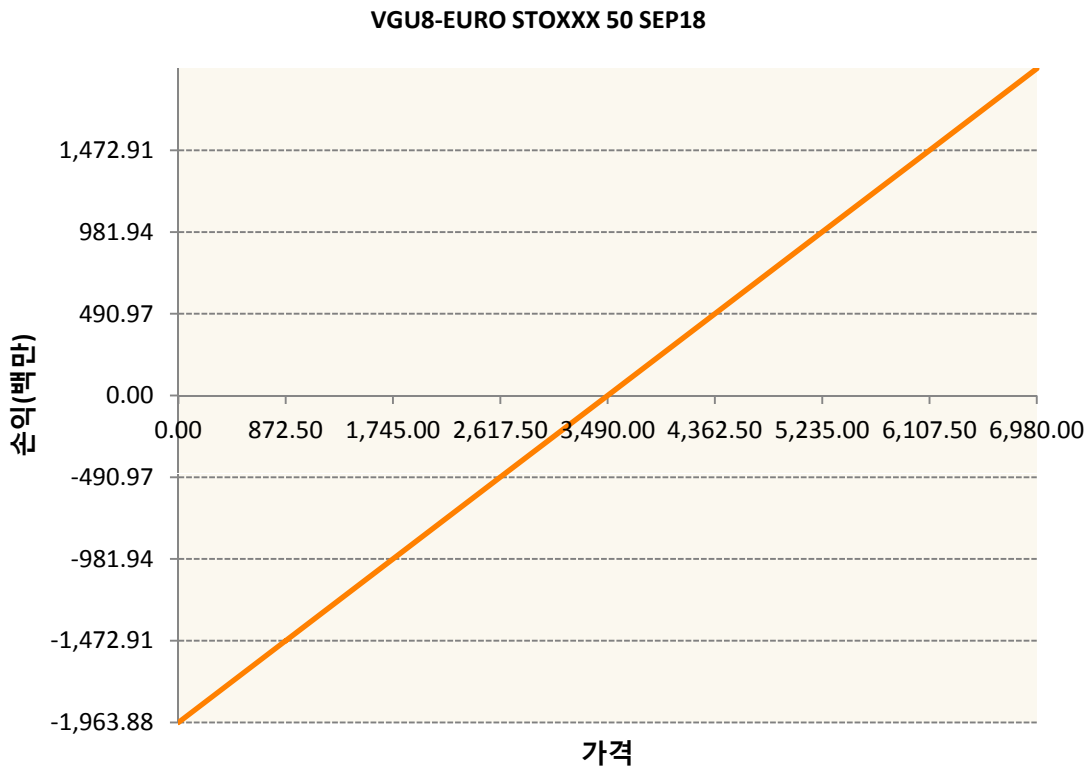
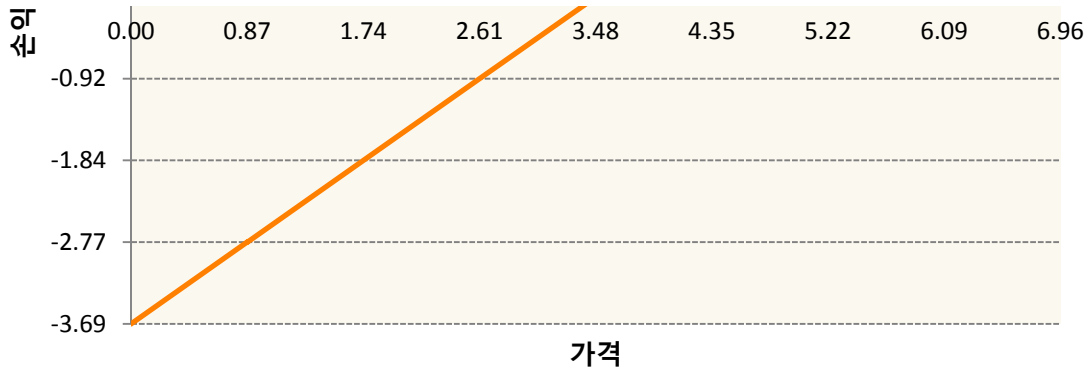
OESXQ8-C3450-EURO STOXX 50 OPT



OESXQ8-C3475-EURO STOXX 50 OPT







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY -	994.569	39
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY		33
OESXQ8-C3 EURO STOXX 50 OPT		439
OESXQ8-C3 EURO STOXX 50 OPT		295
OESXQ8-P3 EURO STOXX 50		439
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)

1,144

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)

169

공시일	2018-08-10
기준일	2018-08-09

스마트KRX300인덱스목표전환형1

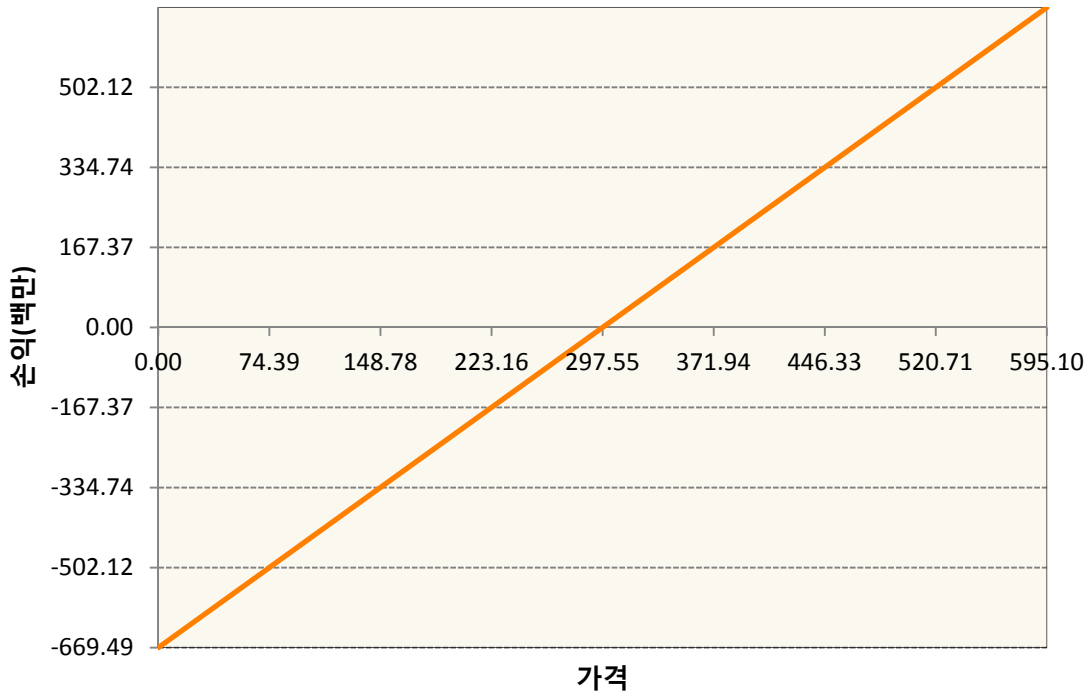
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	669	0	669	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	2018-08-10
기준일	2018-08-09

리디파인K200(주식혼합-파생재간

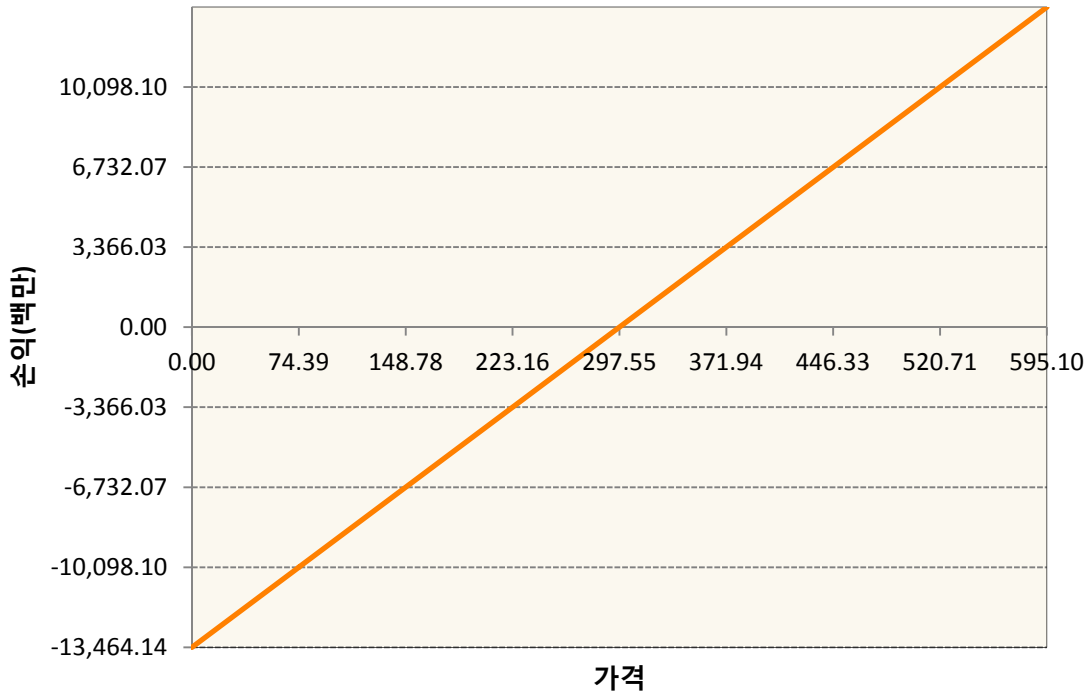
1. 계약금액

(단위:백만원)

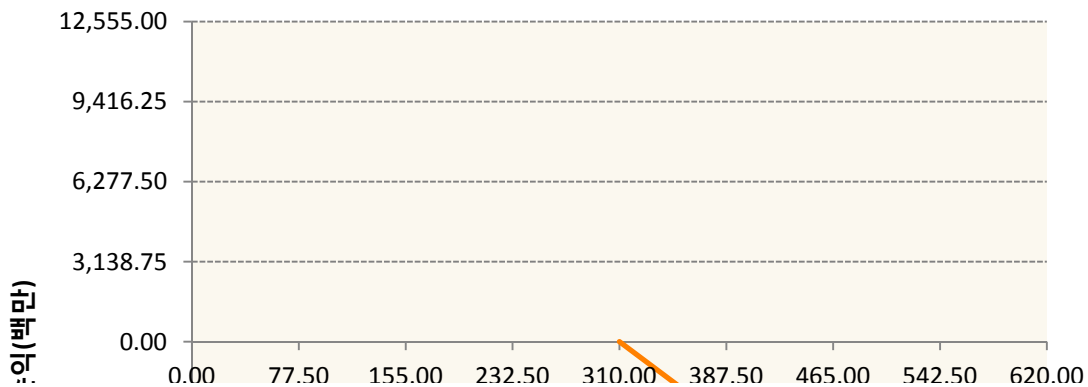
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	445	0	445	장내
신규	유가증권	옵션	1,609	24,295	-22,686	장내
누계	유가증권	선물	13,464	0	13,464	장내
누계	유가증권	옵션	1,630	24,274	-22,644	장내

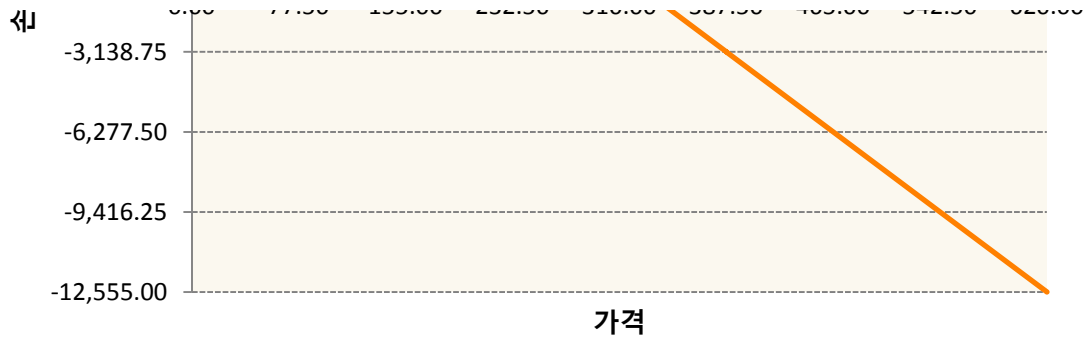
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

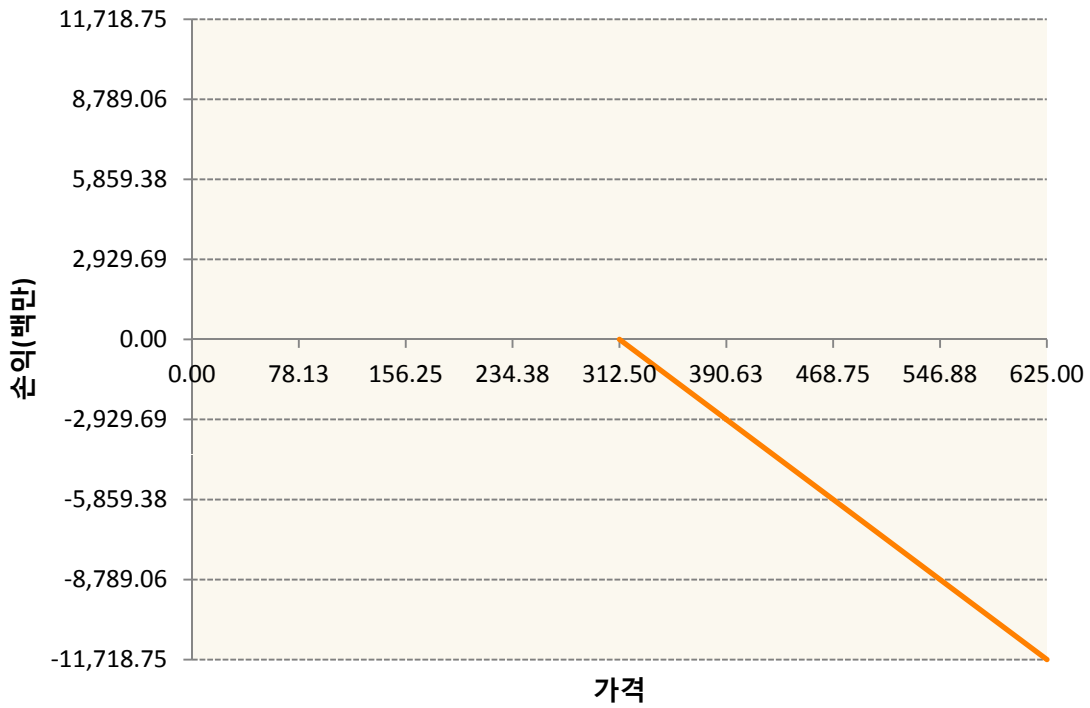


KR4201N93107-2018-09 콜310

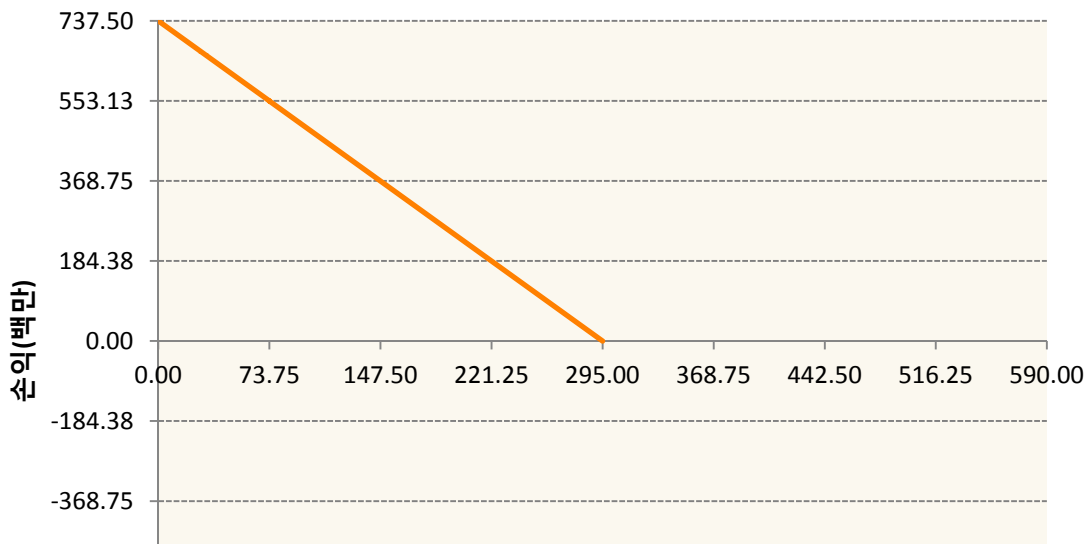


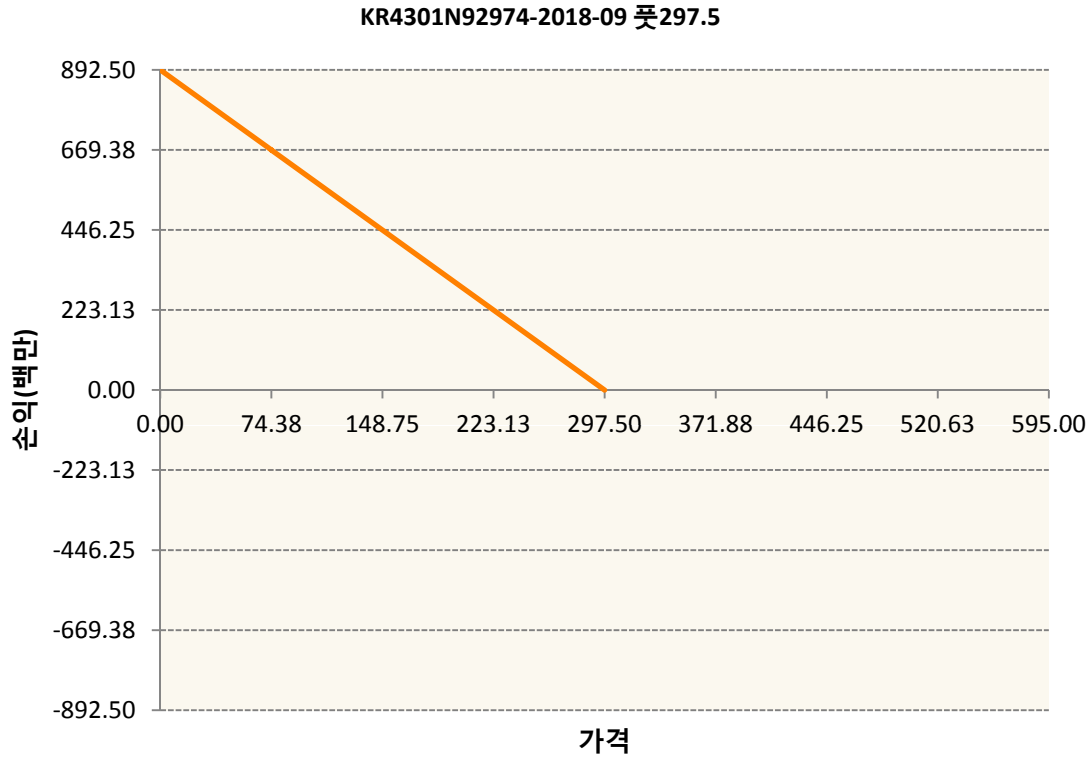
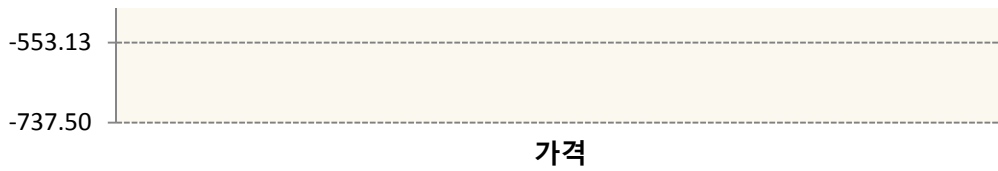


KR4201N93123-2018-09 콜312.5



KR4301N92958-2018-09 풋295





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물 1,077

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,077	-1,077	-1,077	-1,077	-1,077	-1,077	-1,077
-5.33%	-718	-718	-718	-718	-718	-718	-718
-2.67%	-359	-359	-359	-359	-359	-359	-359
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	359	359	359	359	359	359	359
5.33%	718	718	718	718	718	718	718
8.00%	1,077	1,077	1,077	1,077	1,077	1,077	1,077

KR4201N9312018-09 콜310 584

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	199	194	186	176	164	150	135
-5.33%	185	173	159	143	125	105	84
-2.67%	152	132	110	87	62	36	9

0%	88	59	30	0	-31	-62	-93
2.67%	-21	-55	-89	-123	-157	-192	-226
5.33%	-180	-215	-250	-285	-320	-355	-390
8.00%	-389	-420	-452	-484	-517	-551	-584

KR4201N9312018-09 콜312.5

511

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	160	156	150	142	132	121	108
-5.33%	150	141	130	116	101	84	66
-2.67%	126	110	91	71	50	27	4
0%	76	52	26	0	-27	-55	-83
2.67%	-11	-42	-72	-103	-135	-166	-197
5.33%	-144	-176	-209	-242	-275	-307	-340
8.00%	-323	-353	-384	-416	-447	-479	-511

KR4301N9292018-09 풋295

46

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	46	46	46	46	46	46	46
-5.33%	26	26	27	27	27	28	28
-2.67%	9	10	10	11	12	12	13
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-7	-6	-6	-5	-5	-4	-4
5.33%	-8	-8	-7	-7	-7	-7	-6
8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-7

KR4301N9292018-09 풋297.5

59

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	59	59	59	59	59	59	59
-5.33%	35	35	36	36	36	37	37
-2.67%	13	14	15	15	16	17	18
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-11	-10	-9	-8	-8	-7	-6
5.33%	-13	-12	-12	-12	-11	-11	-10
8.00%	-13	-13	-13	-13	-13	-12	-12

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

(단위:백만원)

1,762

공시일	2018-08-10
기준일	2018-08-09

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

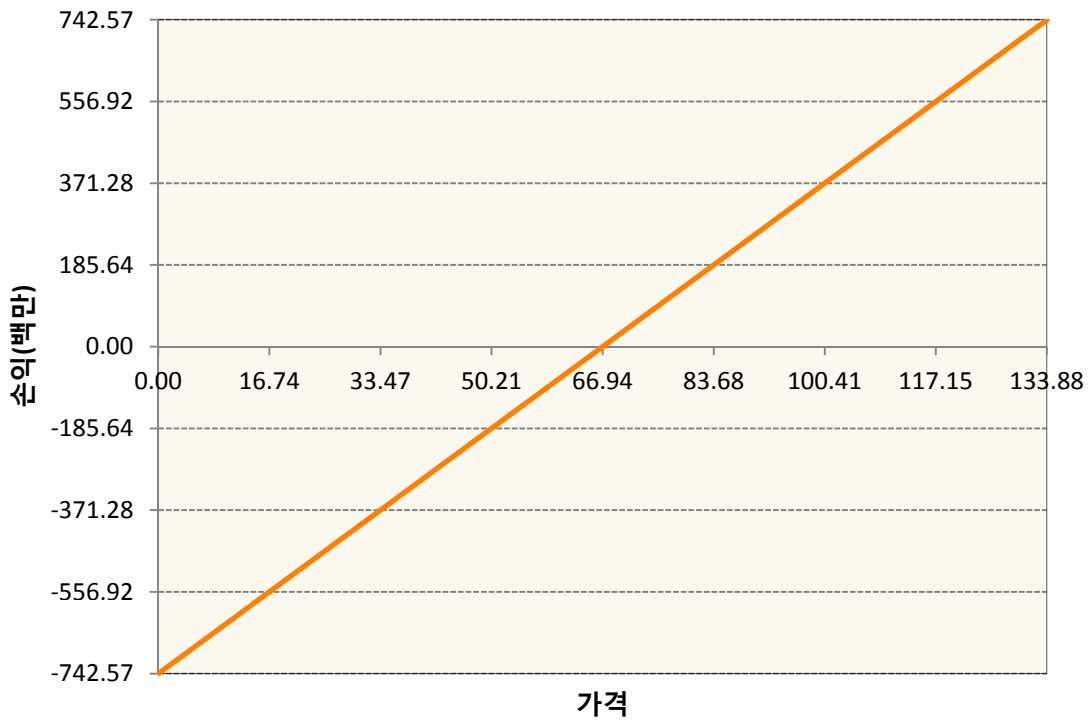
1. 계약금액

(단위:백만원)

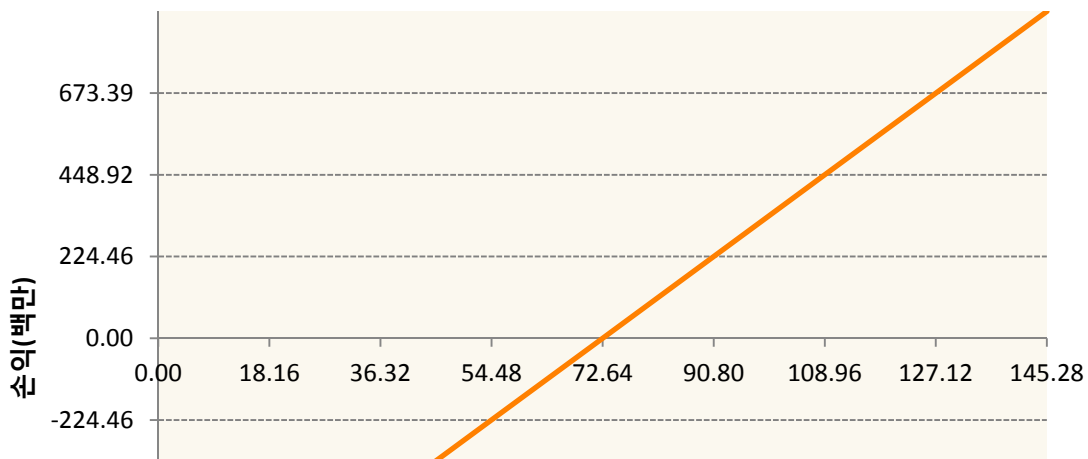
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,650	615	3,035	

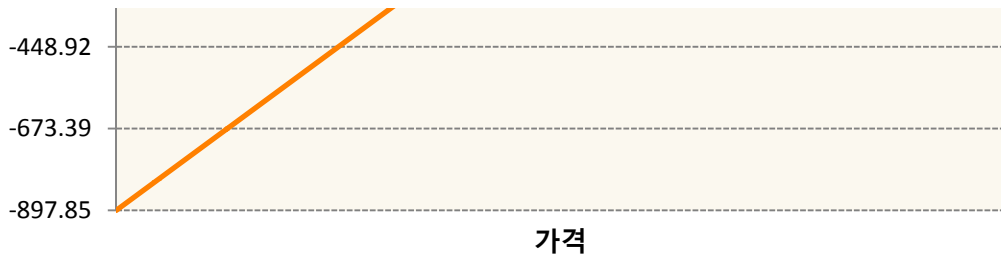
2. 만기시점의 손익구조

CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18

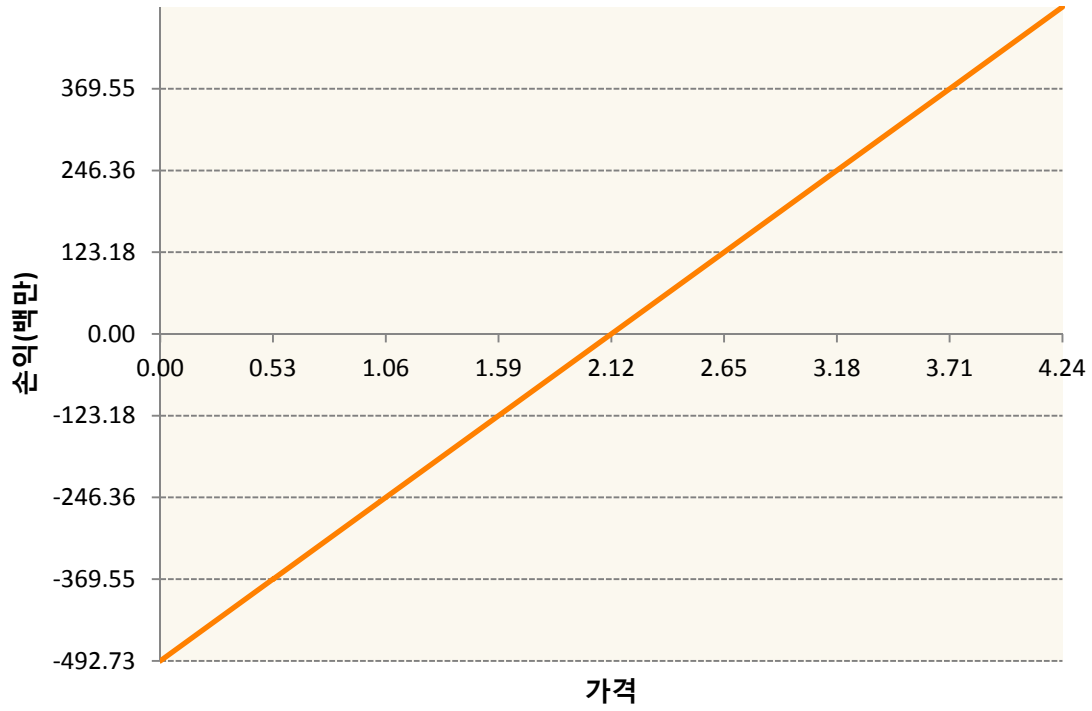


COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18

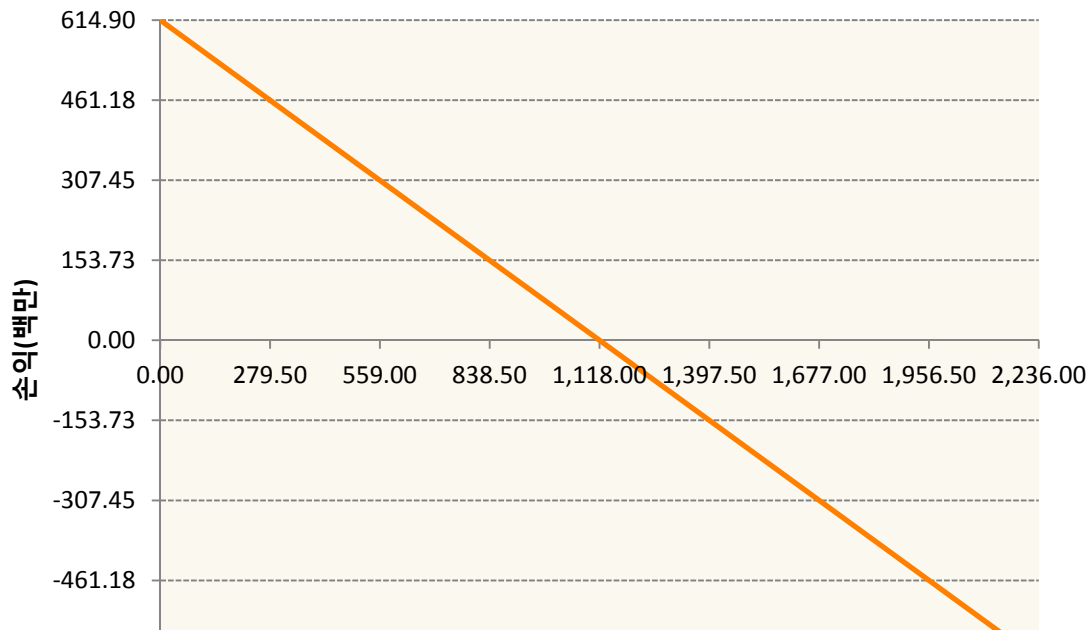


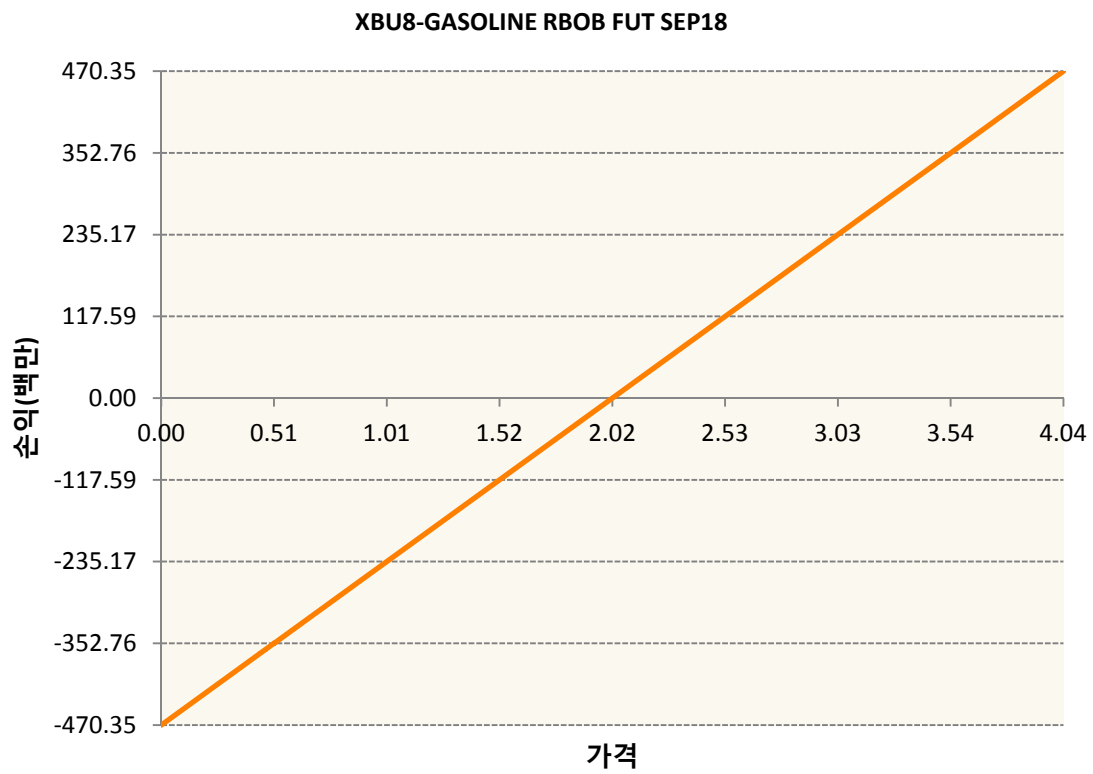
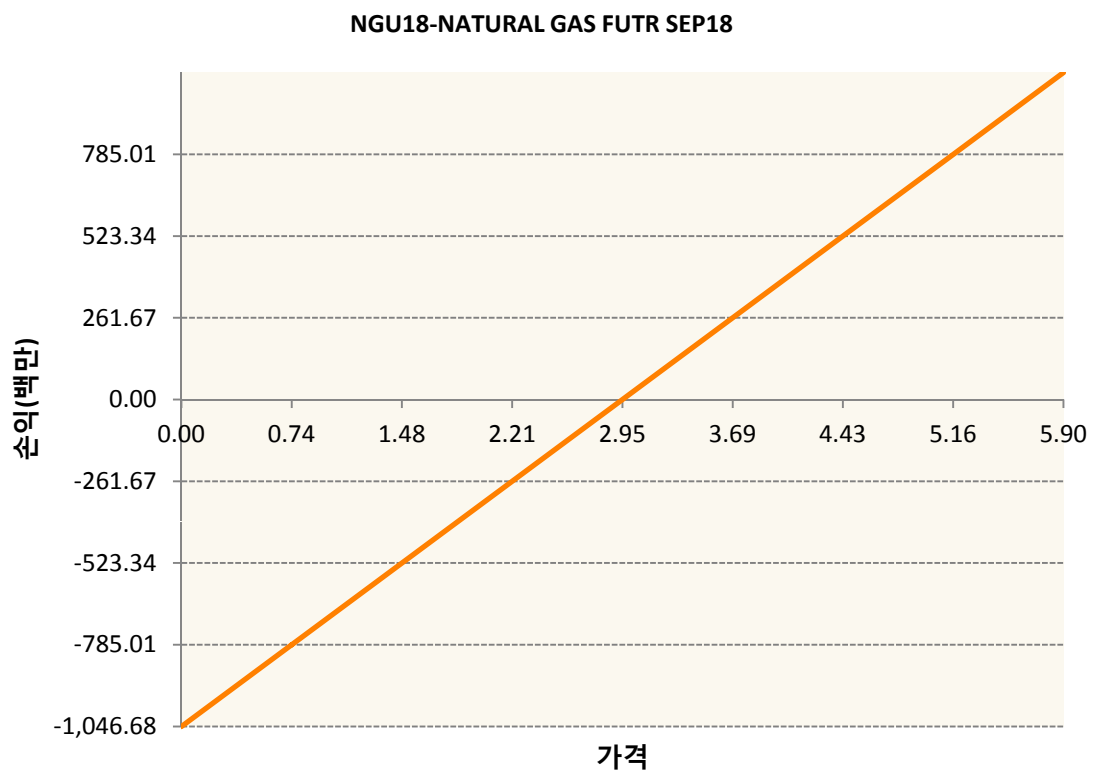
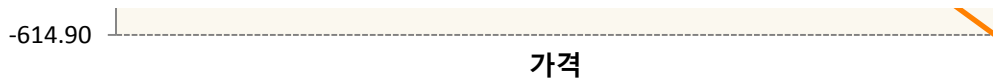


HOU8-NY Harb ULSD Fut SEP18



KR4175N80001-2018-08 달러선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU8	WTI CRUDE FUTURE SEP18	59
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	72
HOU8	NY Harb ULSD Fut SEP18	39
KR4175N80C	2018-08 달러선물	49
NGU18	NATURAL GAS FUTR SEP18	84
XBU8	GASOLINE RBOB FUT SEP18	38

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

448

공시일	2018-08-10
기준일	2018-08-09

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

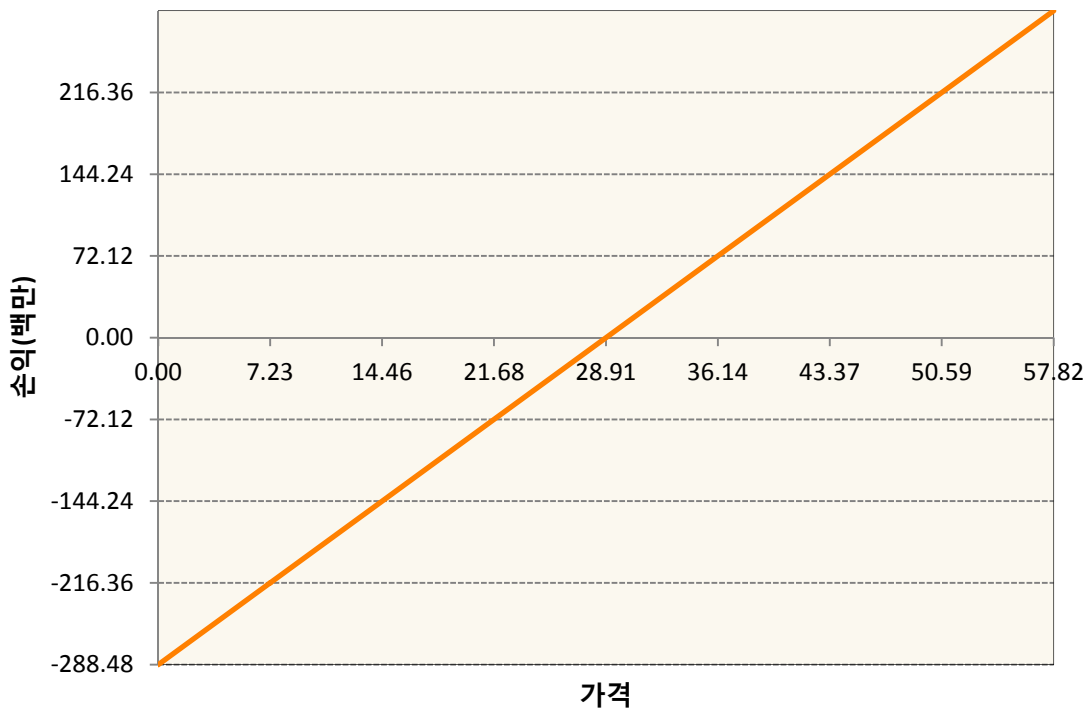
1. 계약금액

(단위:백만원)

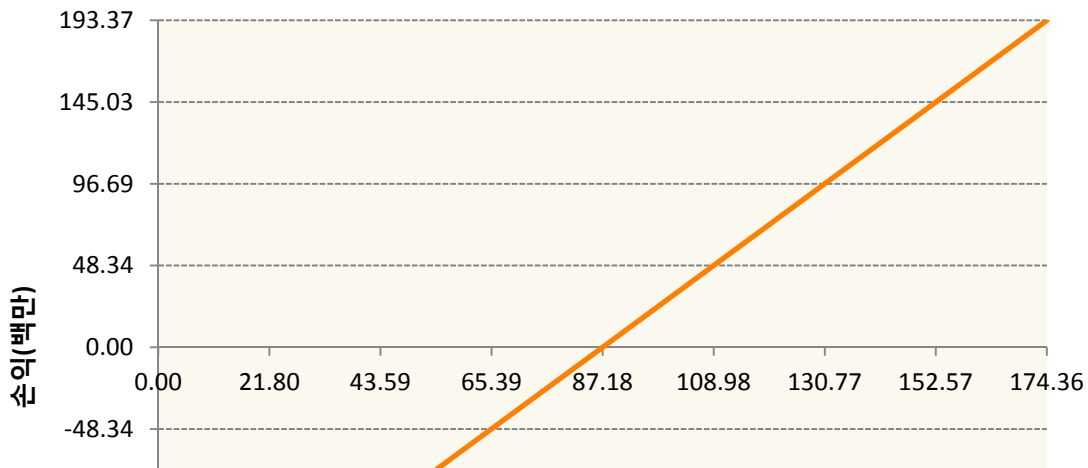
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,774	78	3,695	

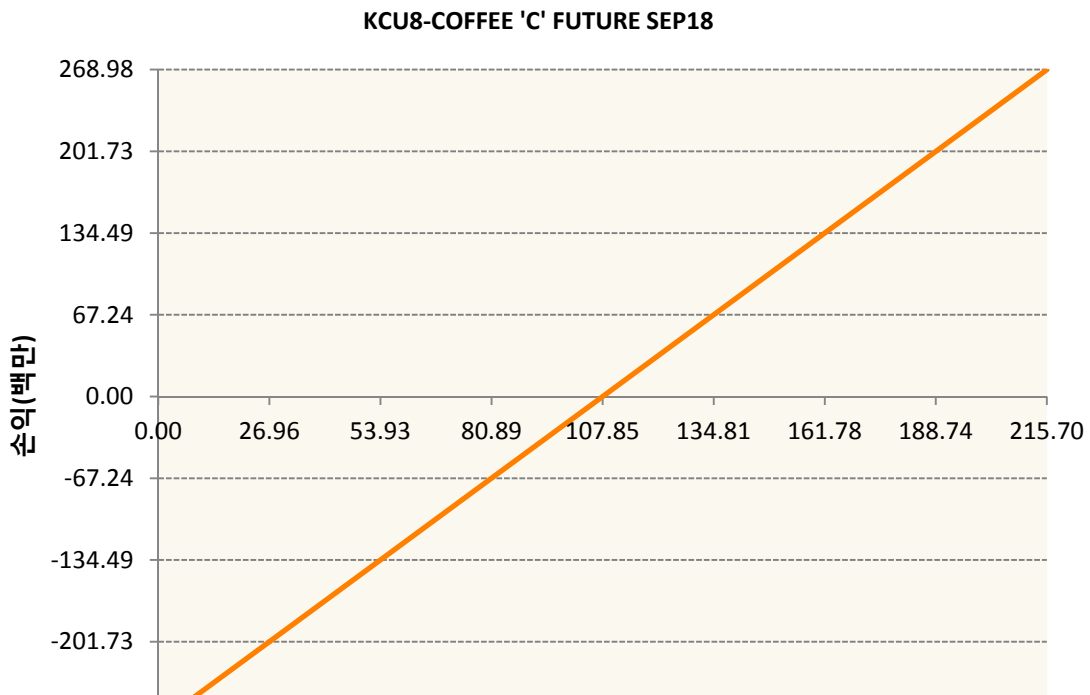
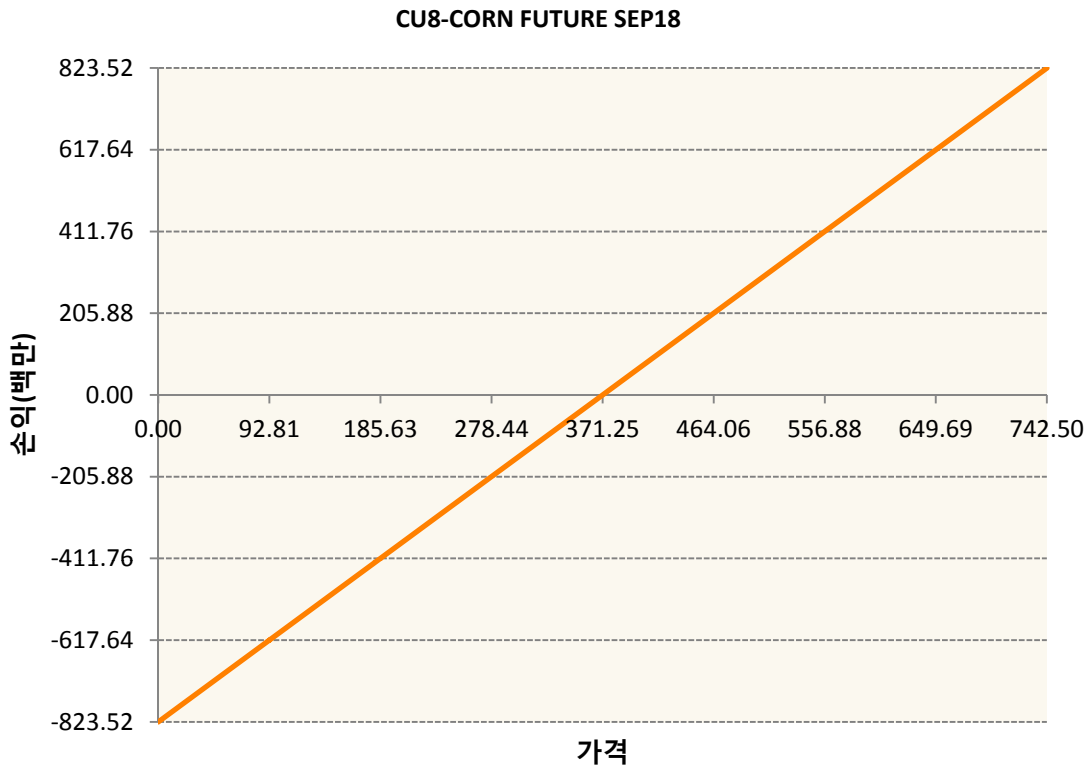
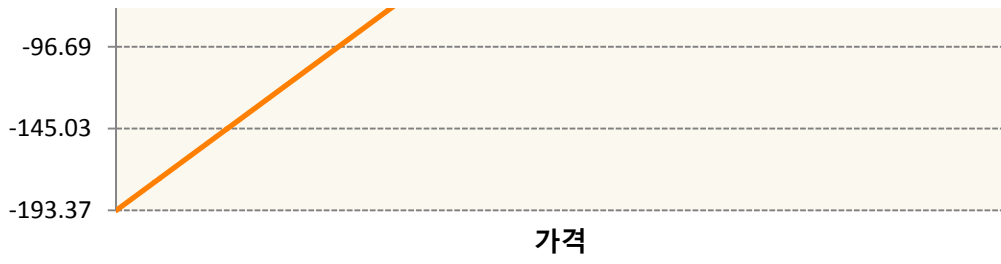
2. 만기시점의 손익구조

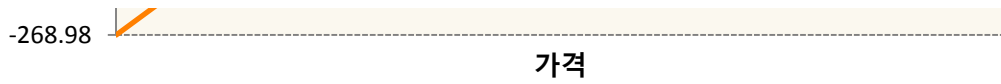
BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18



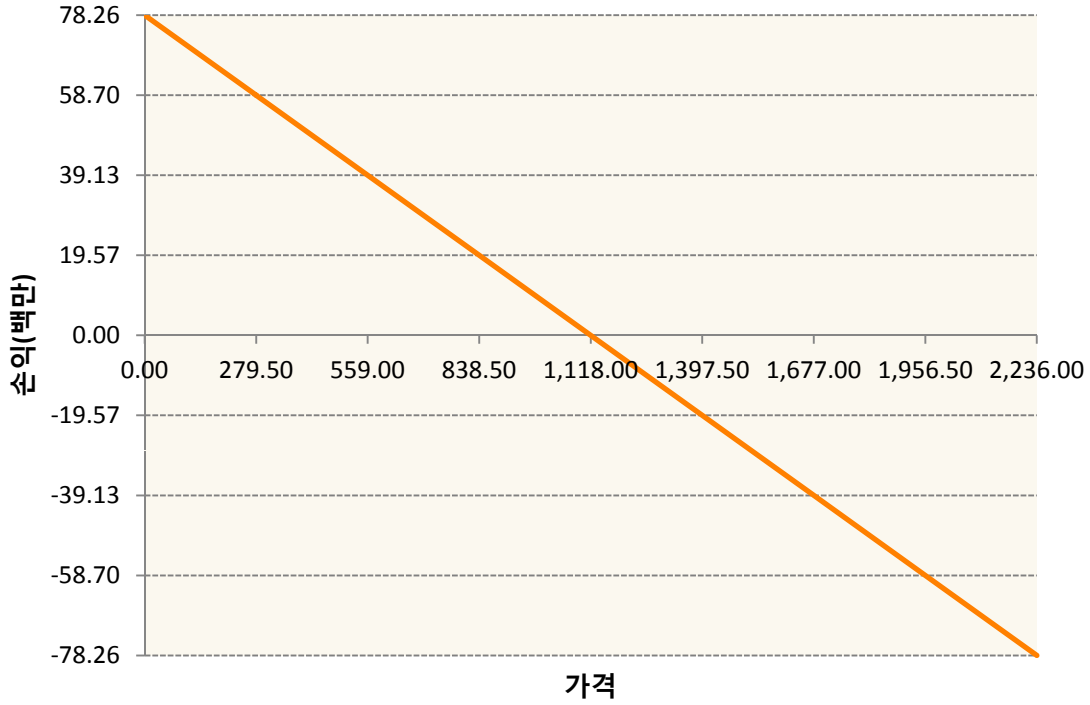
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



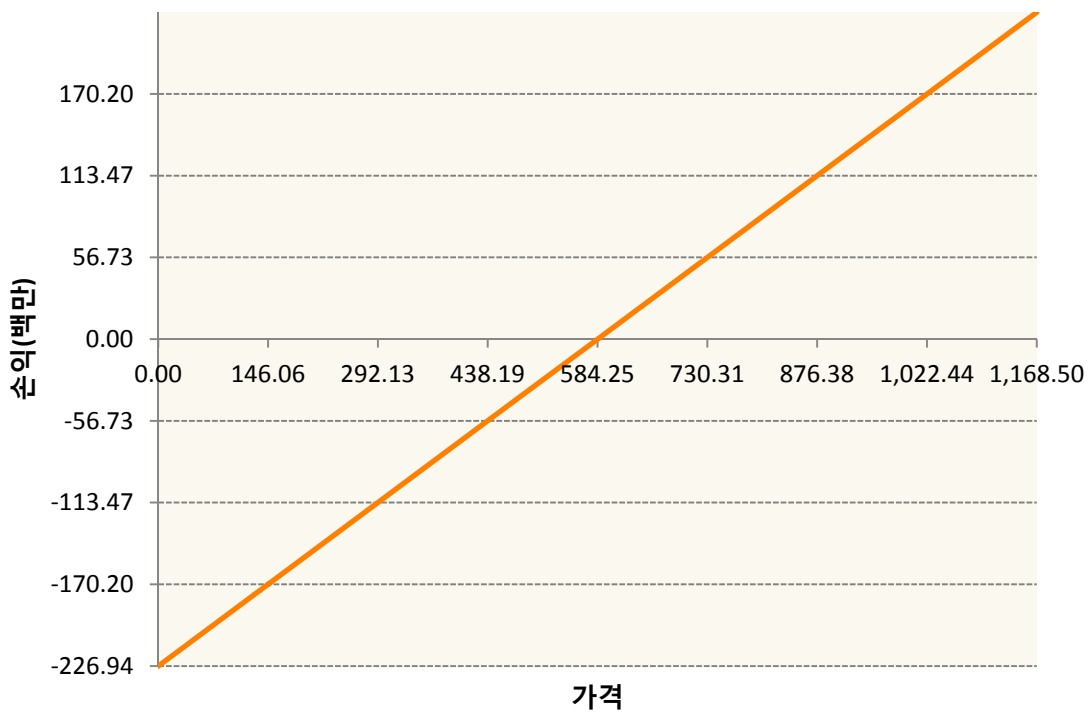




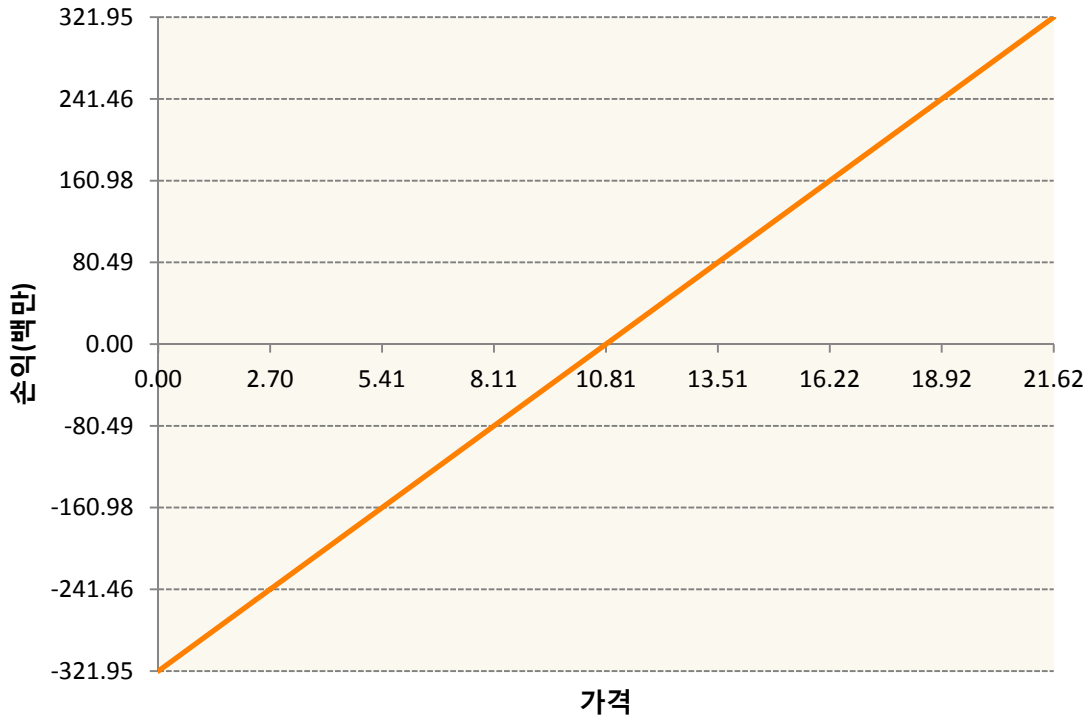
KR4175N80001-2018-08 달러선물



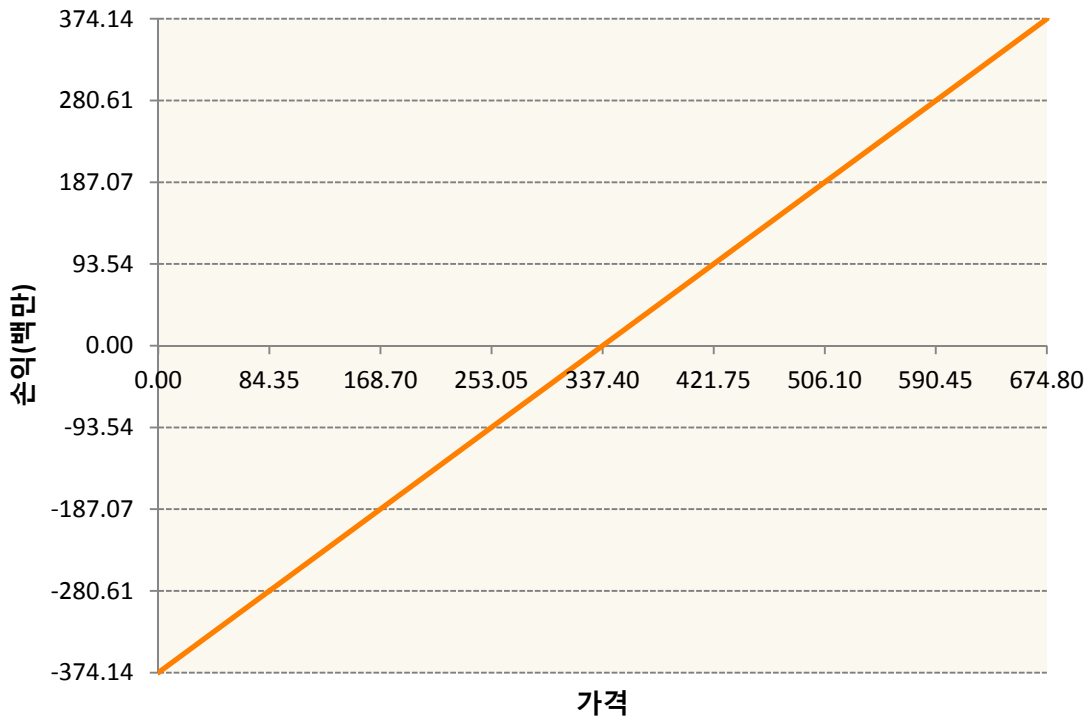
KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

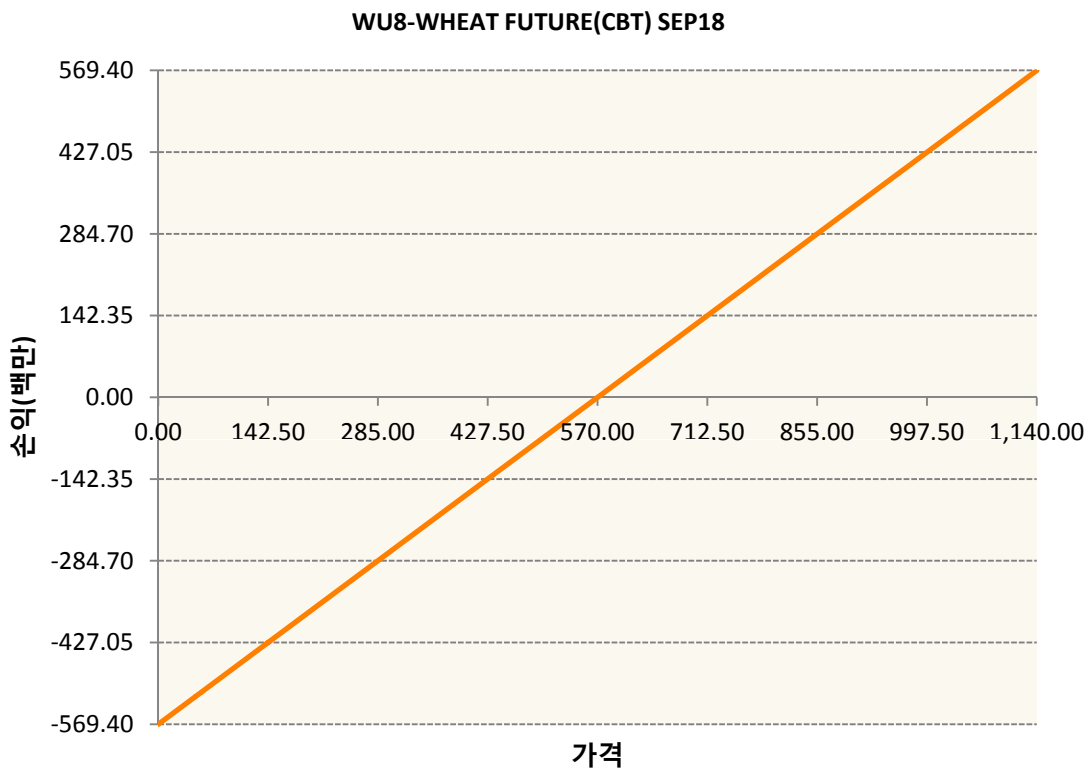
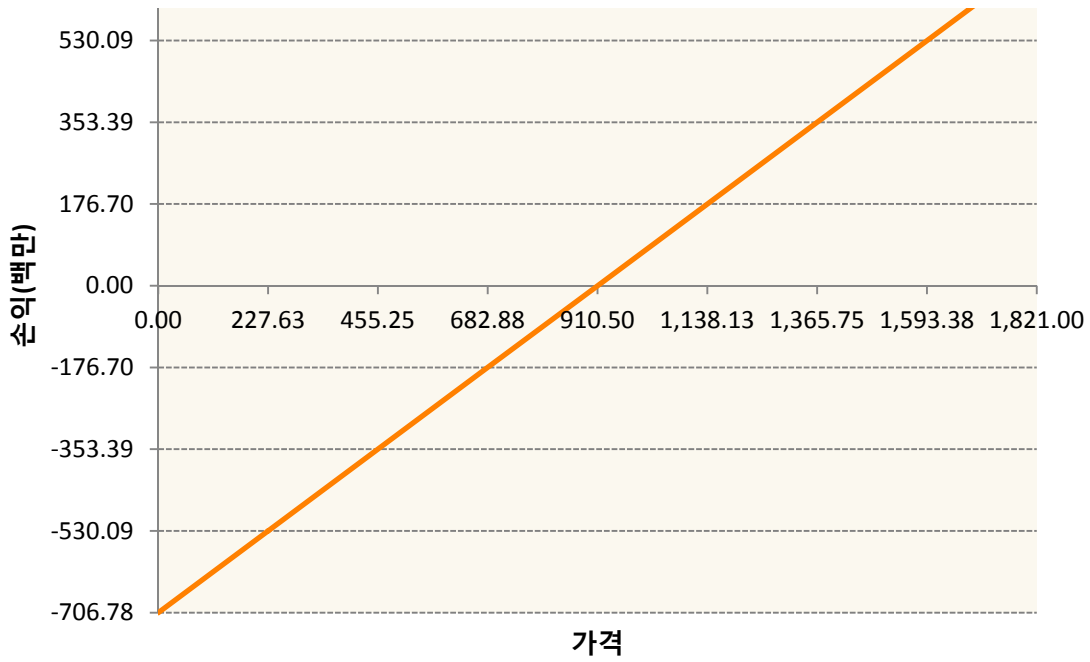


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	23
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	15
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	30
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	57
WU8	WHEAT FUTURE(CBT) SEP18	46

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

(단위:백만원)

319