

공시일	2018-08-13
기준일	2018-08-10

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	2018-08-13
기준일	2018-08-10

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

1,147

* 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	2018-08-13
기준일	2018-08-10

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)

384

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-13
기준일	2018-08-10

유로인덱스모(주식-파생형)

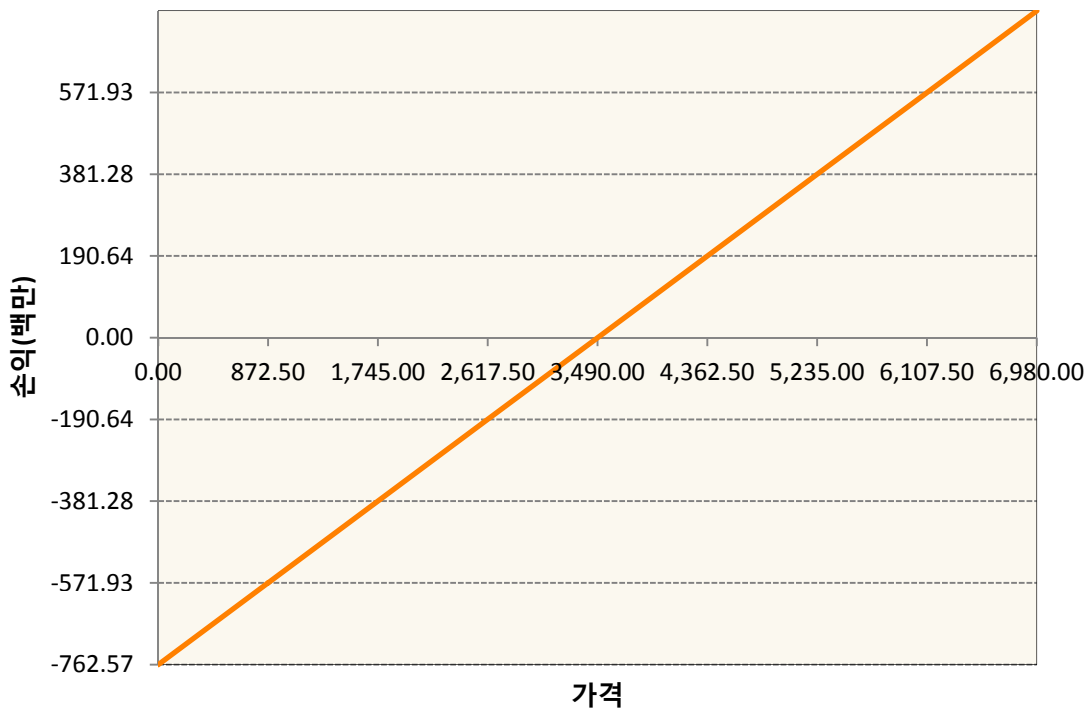
1. 계약금액

(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	2018-08-13
기준일	2018-08-10

차이나인덱스모(주식-파생형)

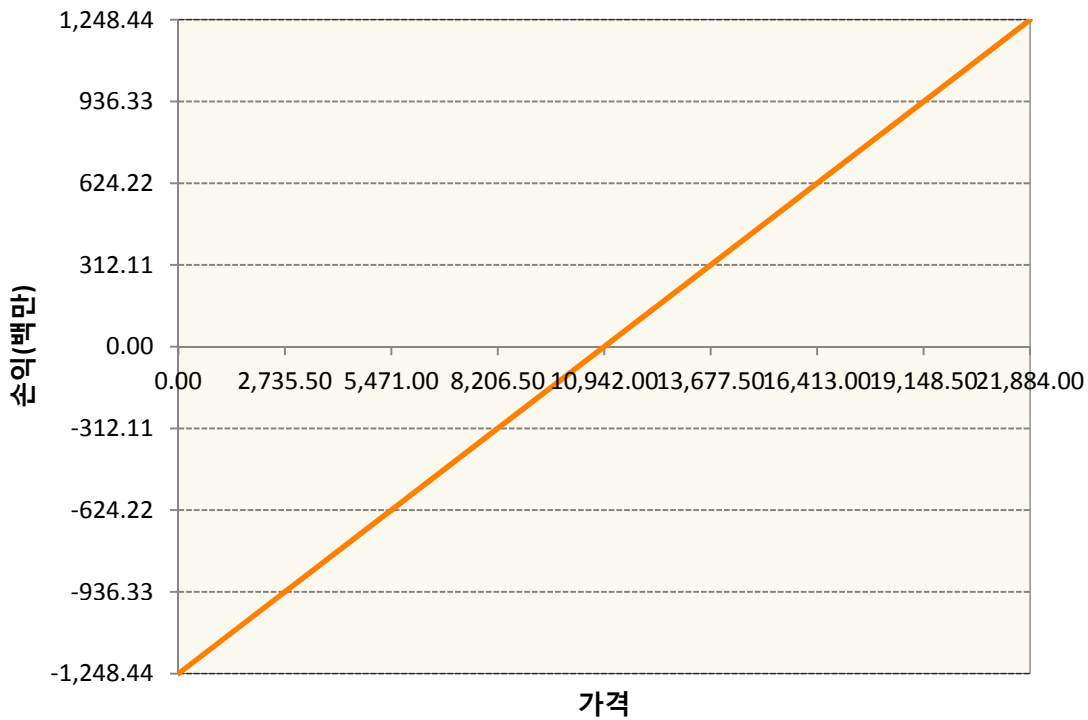
1. 계약금액

(단위:백만원)

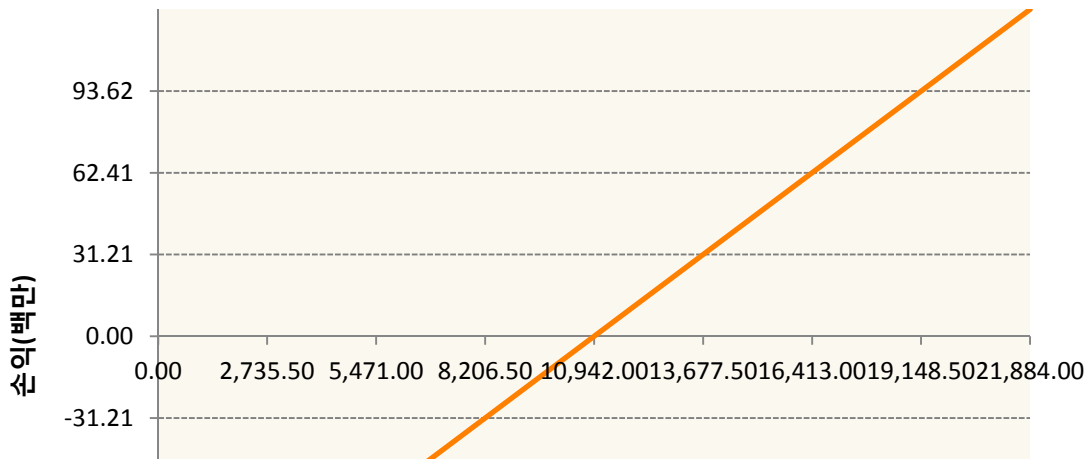
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,373	0	1,373	장내

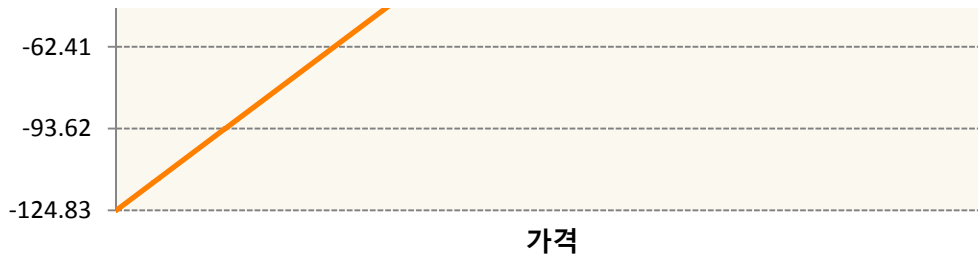
2. 만기시점의 손익구조

HCQ8-HSCEI Futures Aug18



MHCQ8-MINI H-SHR IDX FU Aug18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCQ8	HSCEI Futures Aug18	100
MHCQ8	MINI H-SHR IDX FU Aug18	10

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

100

공시일	2018-08-13
기준일	2018-08-10

커버드콜모(주식혼합-파생형)

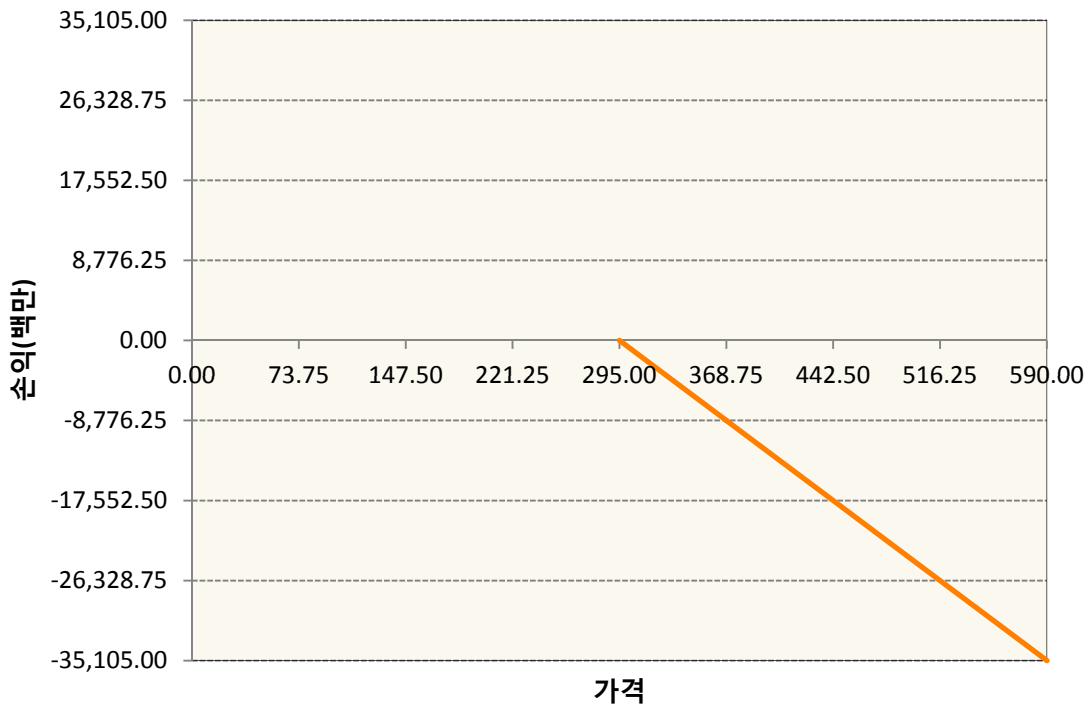
1. 계약금액

(단위:백만원)

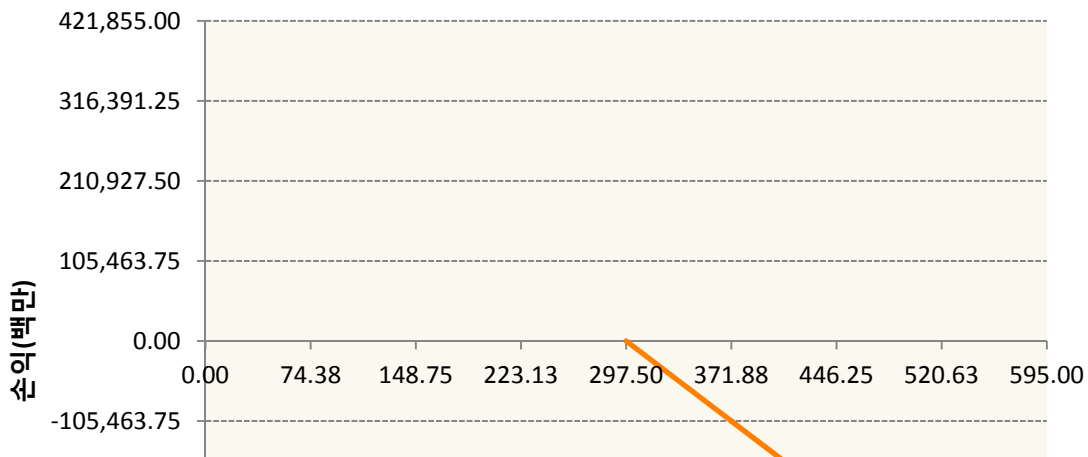
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	602,551	-602,551	장내
누계	유가증권	옵션	0	746,874	-746,874	장내

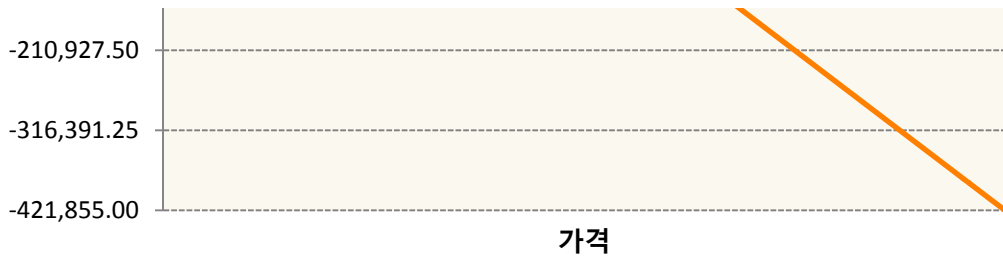
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92950-2018-09 콜295

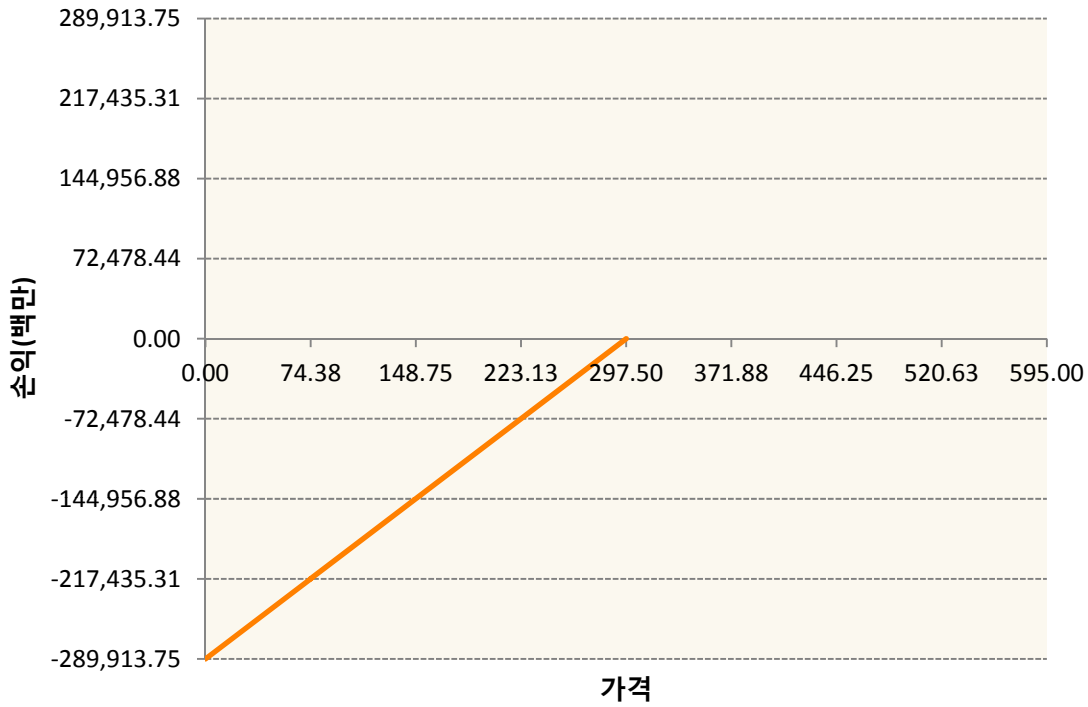


KR4201N92976-2018-09 콜297.5





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N929 2018-09 콜295

2,088

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	998	961	917	867	813	754	692
-5.33%	882	820	753	683	609	533	455
-2.67%	657	572	486	399	310	221	131
0%	288	192	96	0	-96	-192	-288
2.67%	-238	-330	-423	-517	-612	-707	-802
5.33%	-906	-982	-1,062	-1,145	-1,230	-1,317	-1,405
8.00%	-1,685	-1,740	-1,801	-1,867	-1,937	-2,011	-2,088

KR4201N929 2018-09 풋297.5

23,867

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,565	10,194	9,741	9,217	8,629	7,985	7,294

-5.33%	9,462	8,810	8,091	7,317	6,498	5,642	4,755
-2.67%	7,223	6,284	5,313	4,315	3,298	2,265	1,219
0%	3,393	2,266	1,135	0	-1,137	-2,275	-3,415
2.67%	-2,275	-3,419	-4,566	-5,717	-6,870	-8,024	-9,179
5.33%	-9,718	-10,711	-11,735	-12,784	-13,852	-14,935	-16,031
8.00%	-18,608	-19,354	-20,167	-21,033	-21,944	-22,890	-23,867

KR4301N929 2018-09 풋 297.5

20,352

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20,271	-20,272	-20,276	-20,284	-20,298	-20,320	-20,352
-5.33%	-12,671	-12,694	-12,730	-12,783	-12,853	-12,942	-13,047
-2.67%	-5,288	-5,421	-5,579	-5,759	-5,958	-6,174	-6,403
0%	967	650	327	0	-331	-665	-1,001
2.67%	4,747	4,424	4,096	3,763	3,426	3,087	2,746
5.33%	6,113	5,963	5,787	5,589	5,372	5,139	4,891
8.00%	6,382	6,348	6,296	6,224	6,132	6,020	5,889

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

(단위:백만원)

46,419

공시일	2018-08-13
기준일	2018-08-10

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

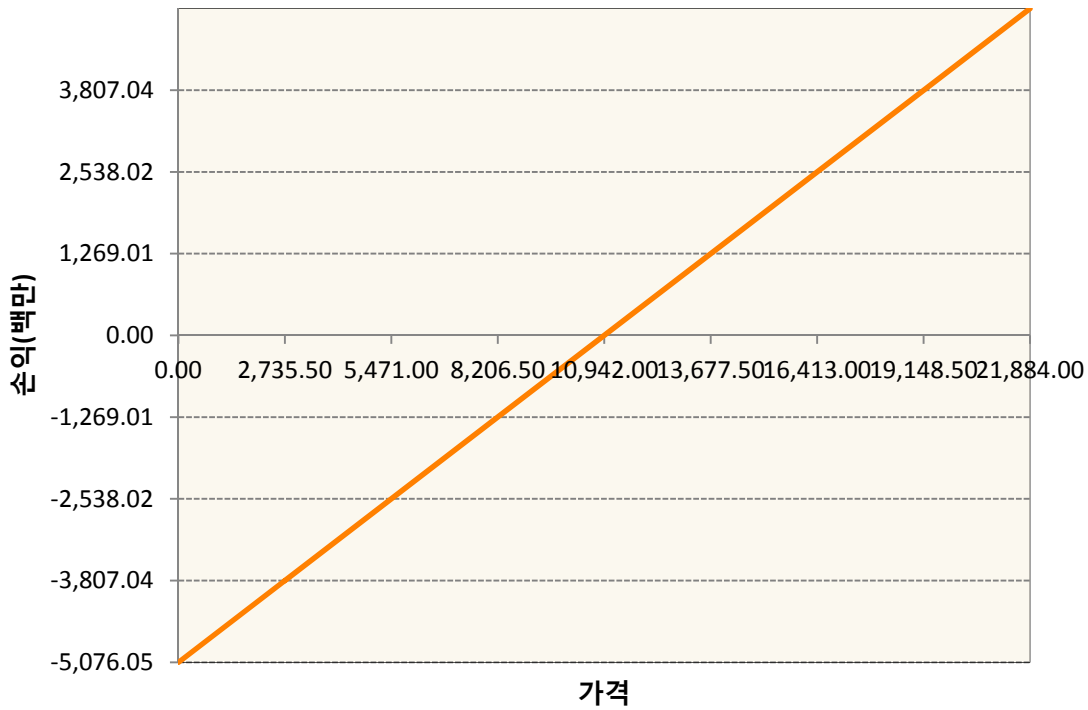
1. 계약금액

(단위:백만원)

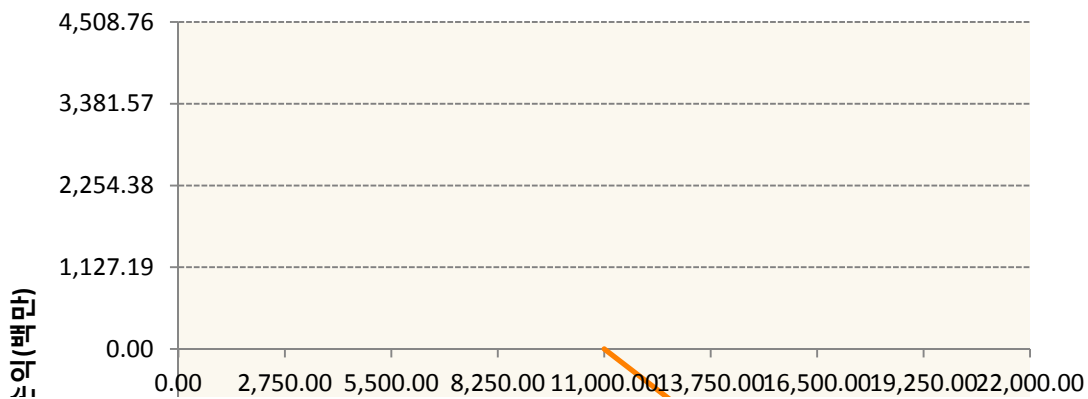
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,076	0	5,076	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,595	-11,595	장내

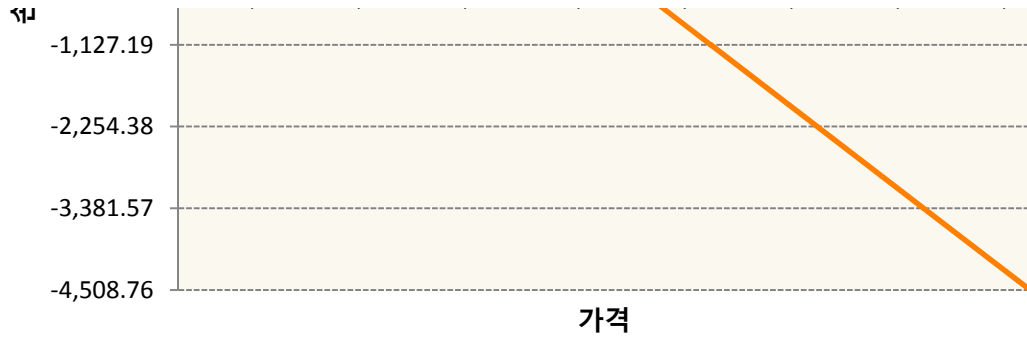
2. 만기시점의 손익구조

HCQ8-HSCEI Futures Aug18

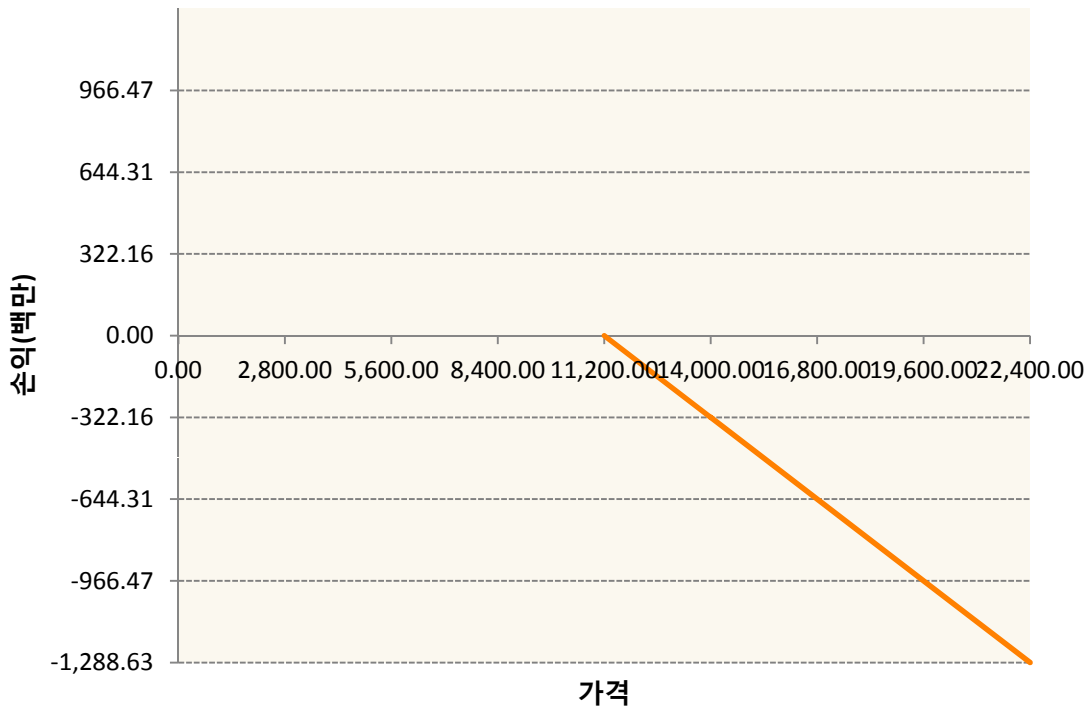


OHHIQ8-C110-HSCEI

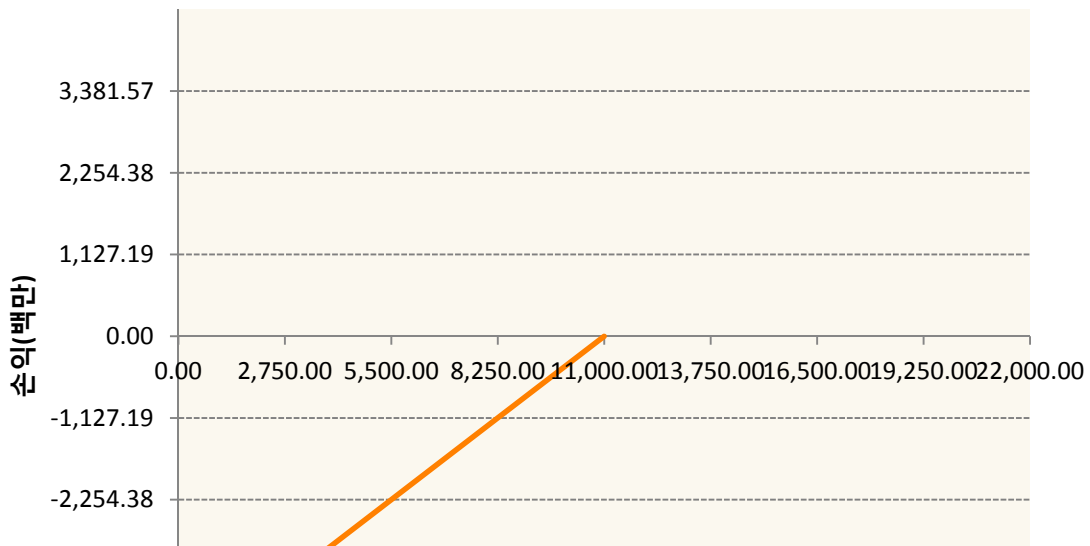


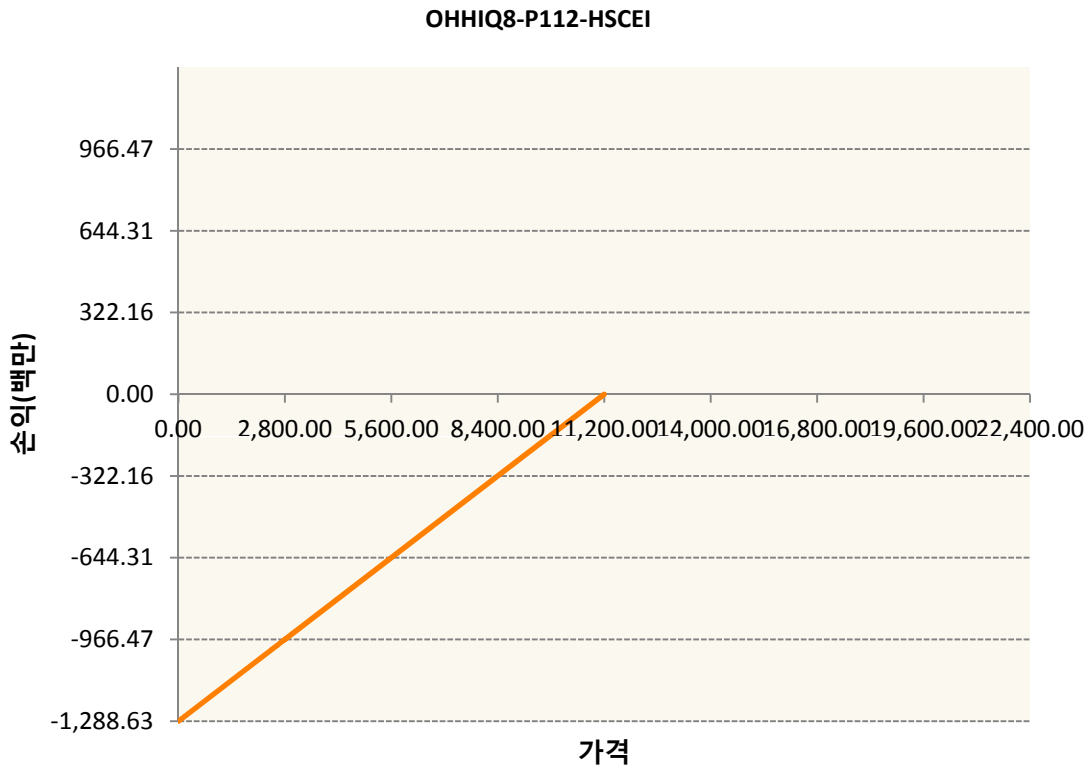
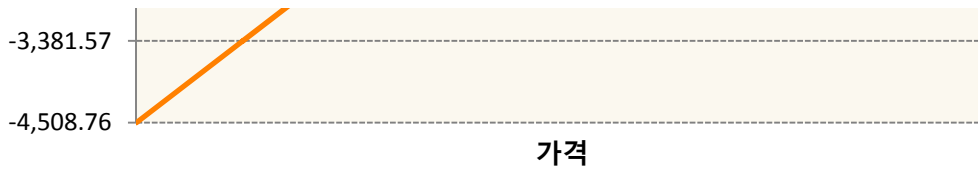


OHHIQ8-C112-HSCEI



OHHIQ8-P110-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ8	HSCEI Futures Aug18	406
OHHIQ8-C1	HSCEI	361
OHHIQ8-C1	HSCEI	103
OHHIQ8-P11	HSCEI	361
OHHIQ8-P11	HSCEI	103

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,216

공시일	2018-08-13
기준일	2018-08-10

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
신규	유가증권	옵션	0	50,283	-50,283	장내
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	49,668	-49,668	장내

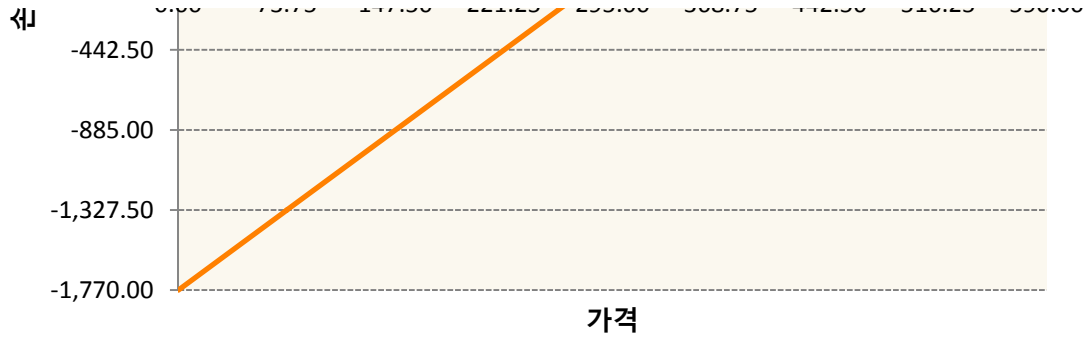
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92976-2018-09 콜297.5

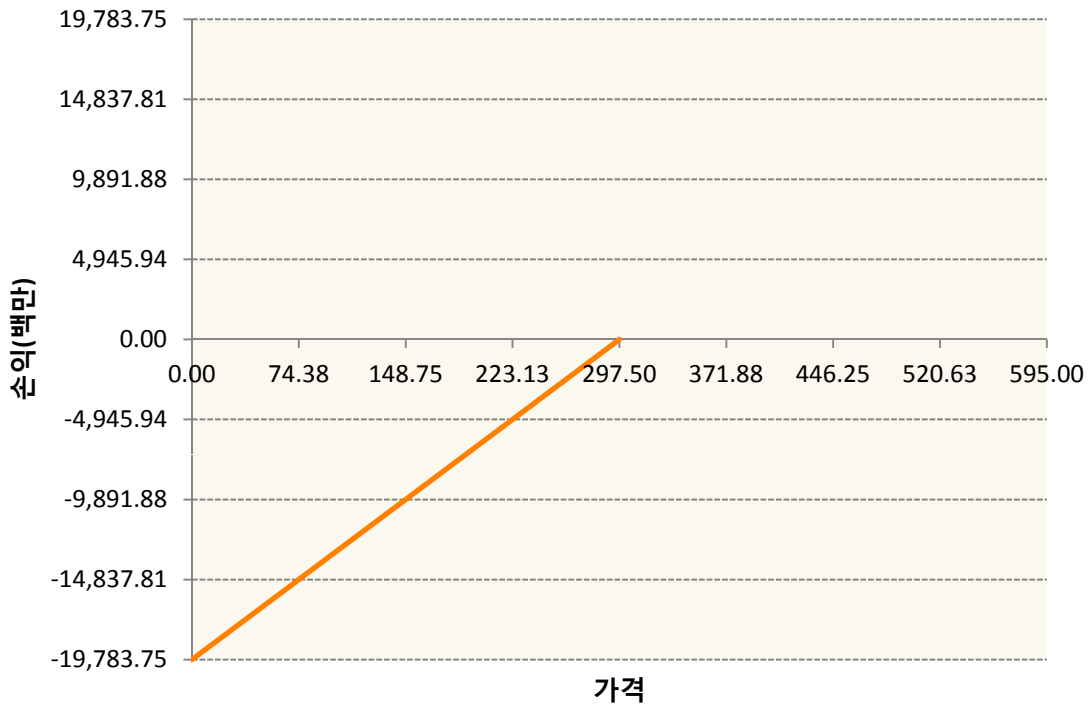


KR4301N92958-2018-09 풋295





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,974
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,974	-3,974	-3,974	-3,974	-3,974	-3,974	-3,974
-5.33%	-2,649	-2,649	-2,649	-2,649	-2,649	-2,649	-2,649
-2.67%	-1,325	-1,325	-1,325	-1,325	-1,325	-1,325	-1,325
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,325	1,325	1,325	1,325	1,325	1,325	1,325
5.33%	2,649	2,649	2,649	2,649	2,649	2,649	2,649
8.00%	3,974	3,974	3,974	3,974	3,974	3,974	3,974
KR4201N92974-2018-09 풋297.5							1,591
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	704	679	649	614	575	532	486
-5.33%	631	587	539	488	433	376	317
-2.67%	481	419	354	288	220	151	81
0%	226	151	76	0	-76	-152	-228
2.67%	-152	-228	-304	-381	-458	-535	-612
5.33%	-648	-714	-782	-852	-923	-995	-1,068
8.00%	-1,240	-1,290	-1,344	-1,402	-1,462	-1,525	-1,591

KR4301N929 2018-09 풋295

120

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-120
-5.33%	-72	-73	-73	-73	-74	-75	-76
-2.67%	-28	-29	-31	-32	-33	-35	-37
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	24	23	21	19	17	15	13
5.33%	30	29	28	27	26	25	24
8.00%	30	30	30	30	29	29	28

KR4301N929 2018-09 풋297.5

1,389

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,383	-1,383	-1,384	-1,384	-1,385	-1,387	-1,389
-5.33%	-865	-866	-869	-872	-877	-883	-890
-2.67%	-361	-370	-381	-393	-407	-421	-437
0%	66	44	22	0	-23	-45	-68
2.67%	324	302	279	257	234	211	187
5.33%	417	407	395	381	367	351	334
8.00%	435	433	430	425	418	411	402

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

(단위:백만원)

7,113

공시일	2018-08-13
기준일	2018-08-10

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

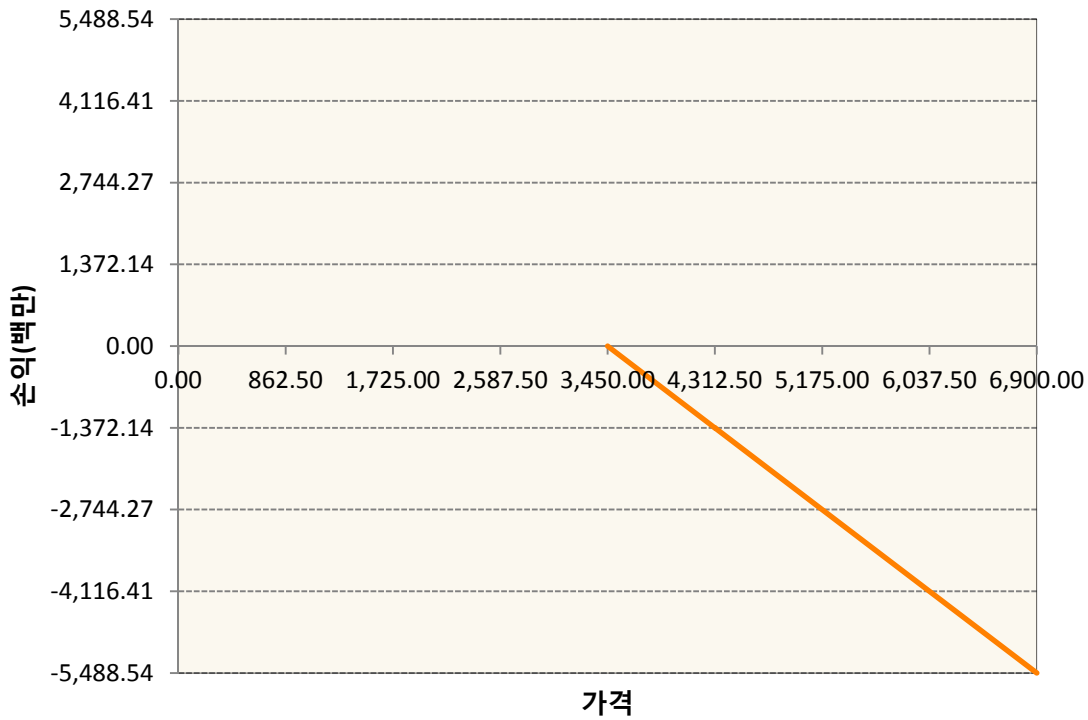
1. 계약금액

(단위:백만원)

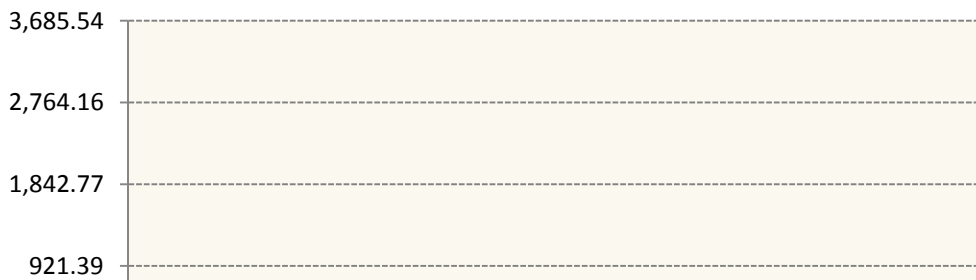
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,964	0	1,964	
누계	유가증권	옵션	0	14,666	-14,666	장내
누계	지수	스왑	97,107	0	97,107	장외

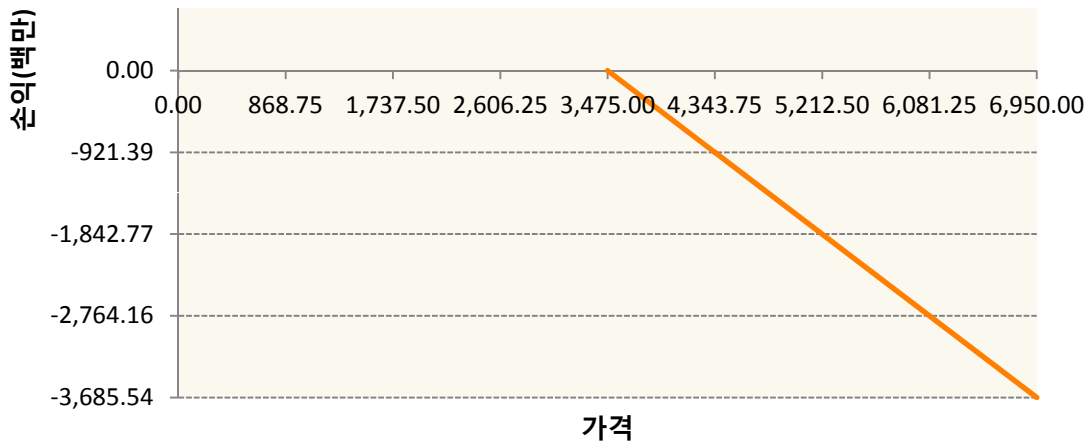
2. 만기시점의 손익구조

OESXQ8-C3450-EURO STOXX 50 OPT

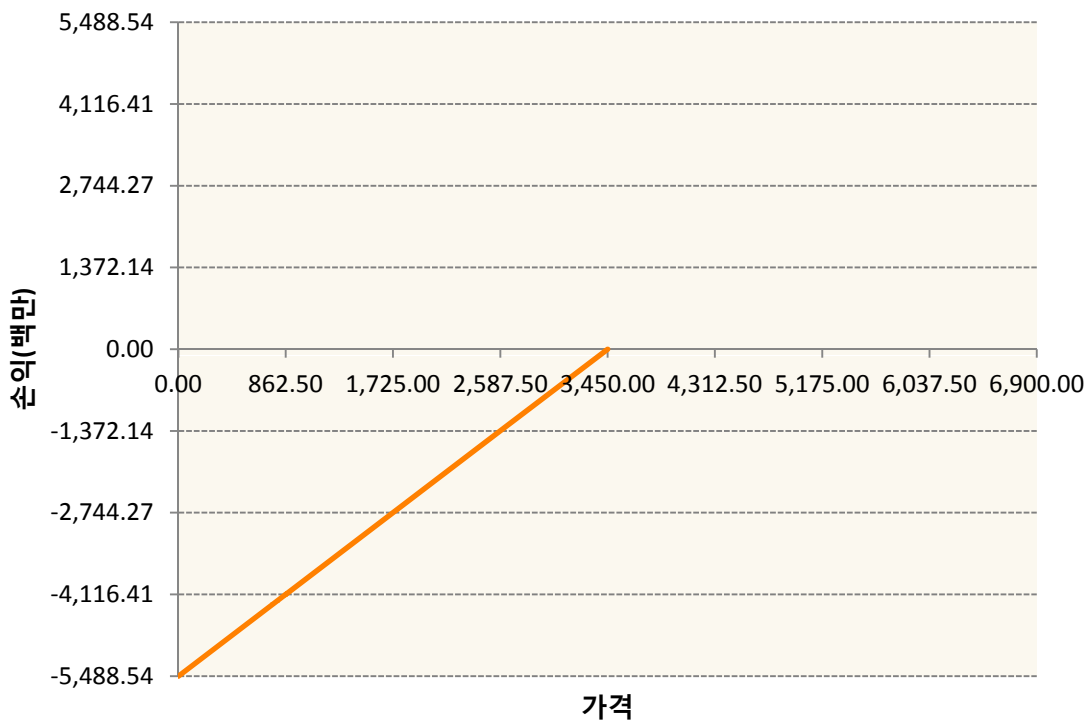


OESXQ8-C3475-EURO STOXX 50 OPT

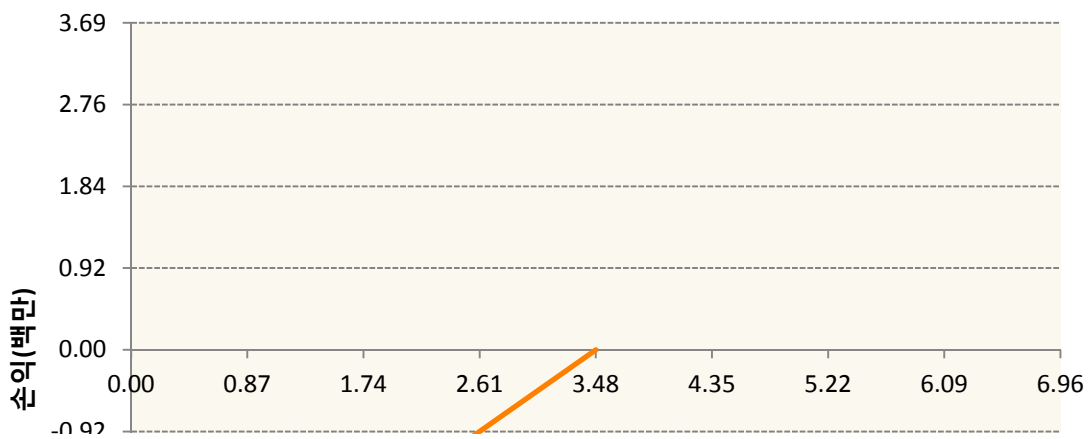


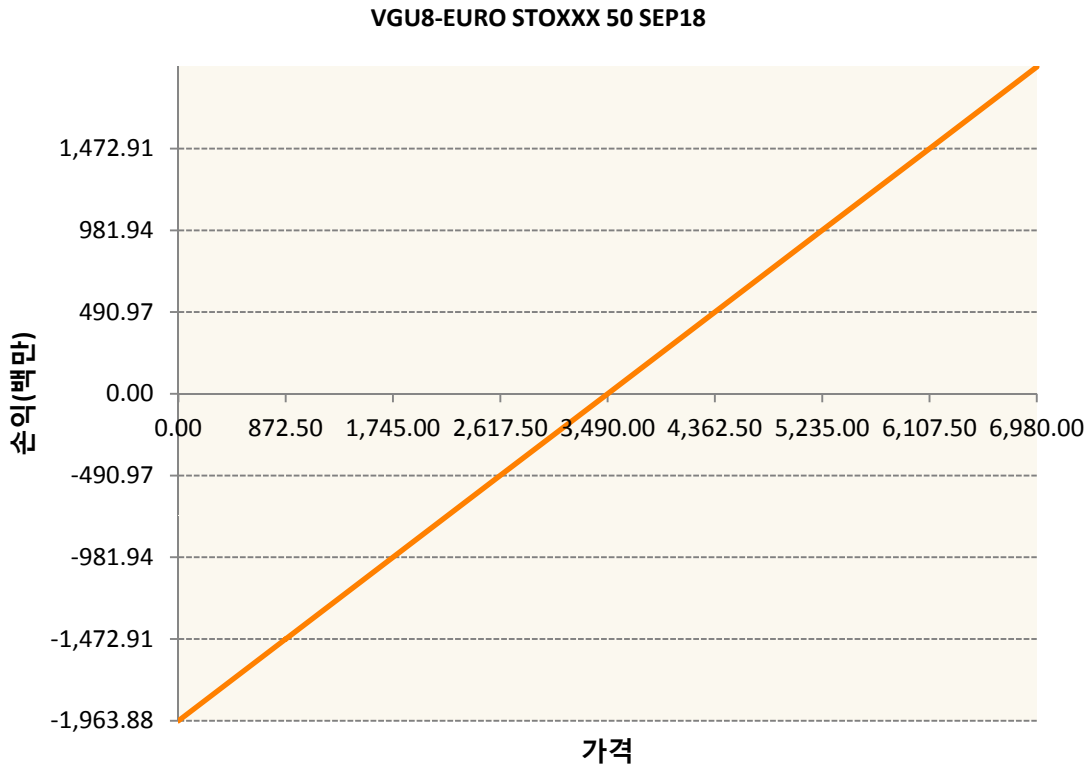
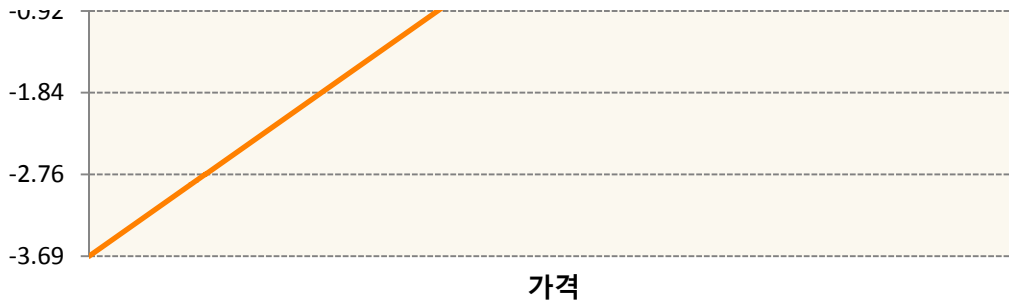


OESXQ8-P3450-EURO STOXX 50



OESXQ8-P3475-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	42
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	35
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)
	882

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

(단위:백만원)

1,134

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

(단위:백만원)

89

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

(단위:백만원)

134

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

(단위:백만원)

165

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-08-13
기준일	2018-08-10

리디파인K200(주식혼합-파생재간

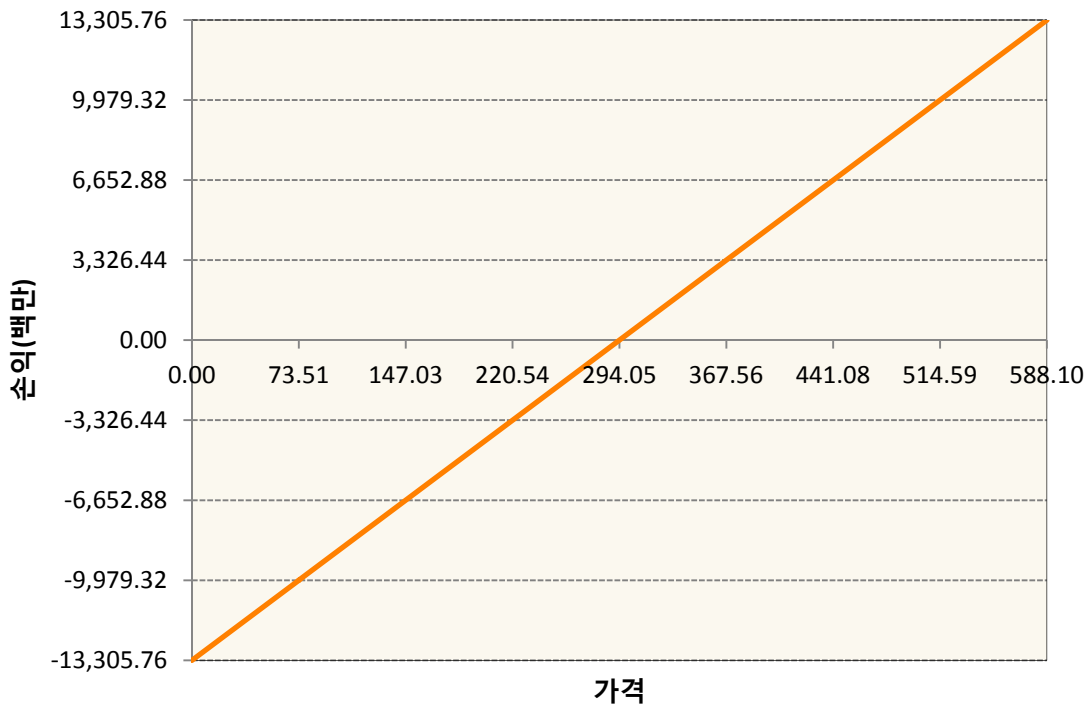
1. 계약금액

(단위:백만원)

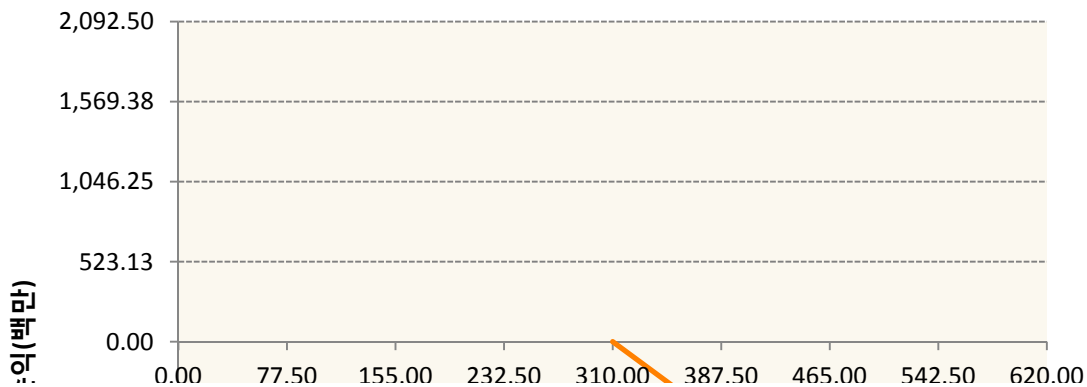
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	10,894	10,550	344	장내
누계	유가증권	선물	13,306	0	13,306	장내
누계	유가증권	옵션	1,339	24,358	-23,019	장내

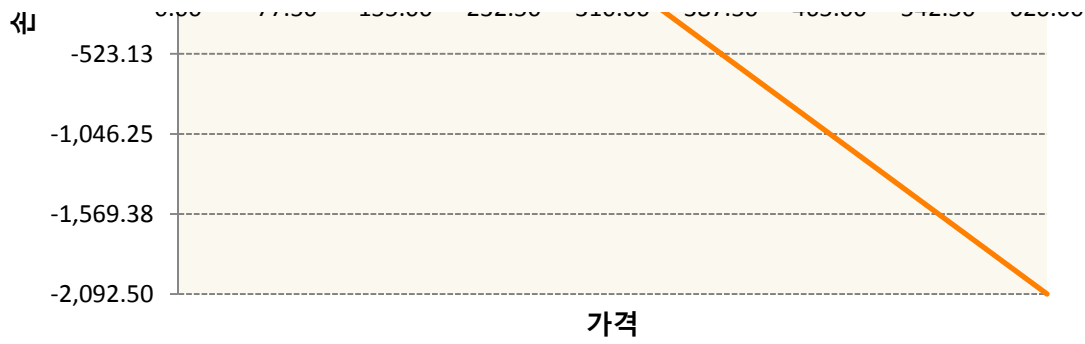
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

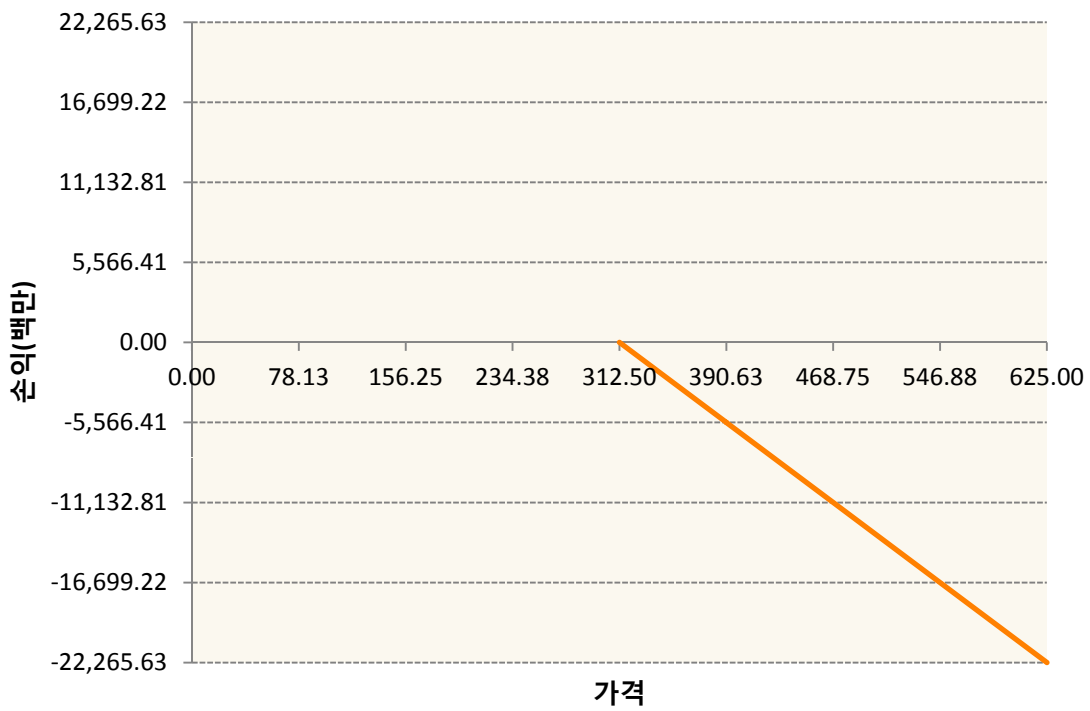


KR4201N93107-2018-09 콜310

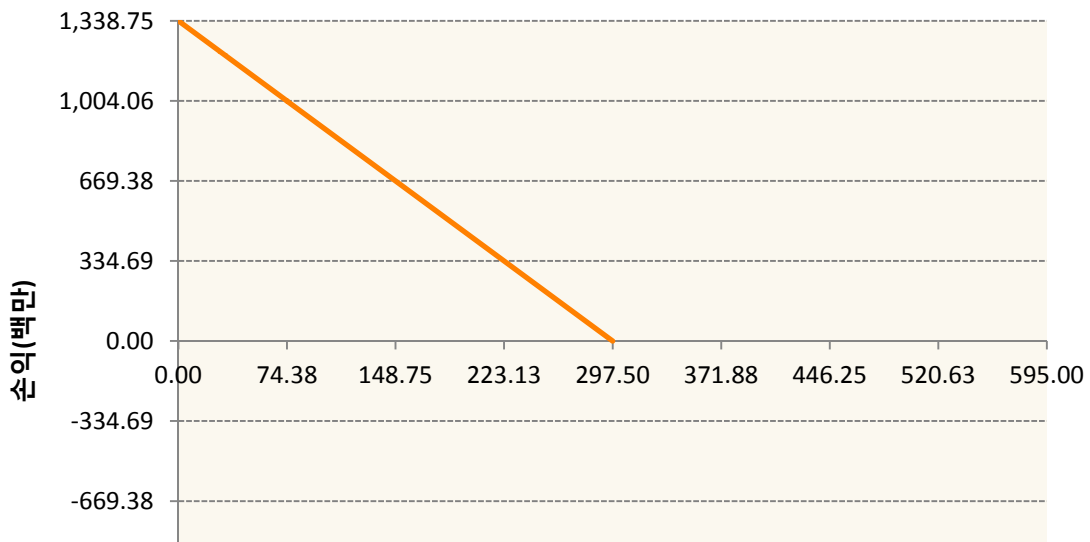


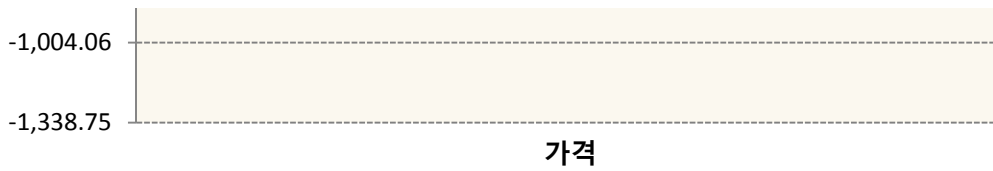


KR4201N93123-2018-09 콜312.5



KR4301N92974-2018-09 풋297.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물							1,063
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,063	-1,063	-1,063	-1,063	-1,063	-1,063	-1,063
-5.33%	-709	-709	-709	-709	-709	-709	-709
-2.67%	-354	-354	-354	-354	-354	-354	-354
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	354	354	354	354	354	354	354
5.33%	709	709	709	709	709	709	709
8.00%	1,063	1,063	1,063	1,063	1,063	1,063	1,063
KR4201N931 2018-09 콜310							87
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	25	25	24	23	21	19	17
-5.33%	24	22	21	19	16	13	10
-2.67%	20	18	15	12	8	4	0
0%	13	9	4	0	-5	-9	-14
2.67%	-1	-7	-12	-17	-22	-28	-33
5.33%	-23	-29	-35	-40	-46	-52	-58
8.00%	-54	-59	-65	-70	-76	-82	-87
KR4201N931 2018-09 콜312.5							863
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	228	223	215	205	191	175	155
-5.33%	217	205	190	171	148	122	93
-2.67%	188	165	138	107	73	36	-3
0%	122	84	43	0	-46	-93	-142
2.67%	-3	-55	-108	-162	-217	-272	-329
5.33%	-207	-267	-327	-388	-448	-508	-569
8.00%	-499	-559	-620	-680	-741	-802	-863
KR4301N92C 2018-09 풋297.5							94
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	94	94	94	94	94	94	94
-5.33%	59	59	59	59	59	60	60
-2.67%	24	25	26	27	28	29	30

0%	-4	-3	-2	0	2	3	5
2.67%	-22	-20	-19	-17	-16	-14	-13
5.33%	-28	-28	-27	-26	-25	-24	-23
8.00%	-29	-29	-29	-29	-28	-28	-27

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

(단위:백만원)

1,595

공시일	2018-08-13
기준일	2018-08-10

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

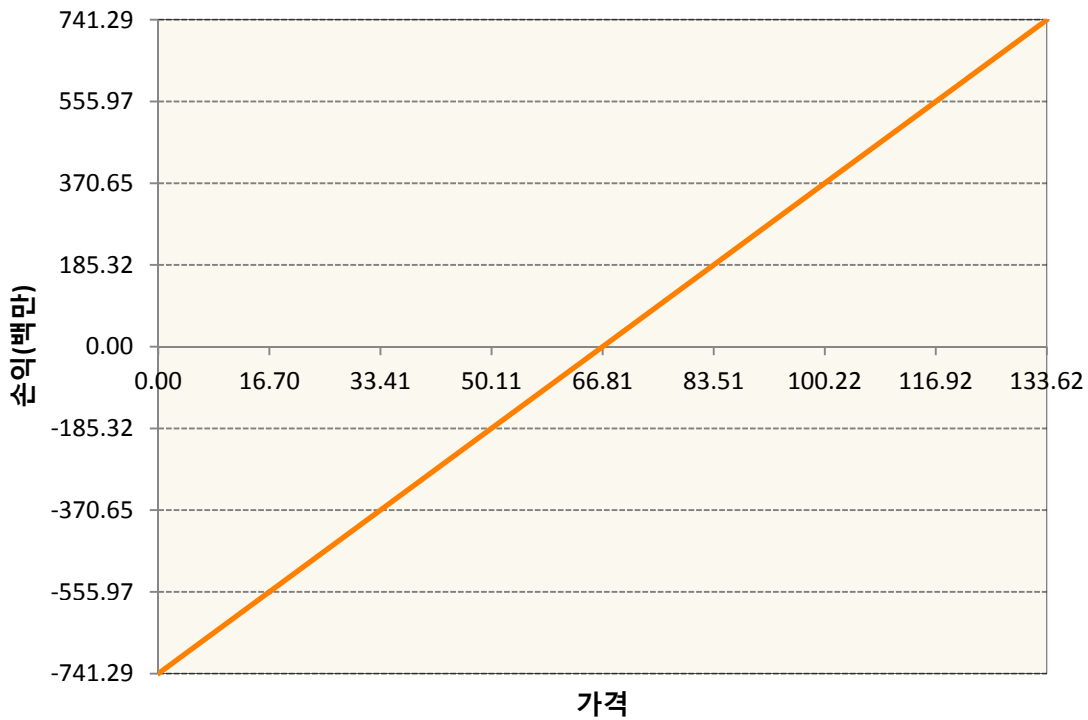
1. 계약금액

(단위:백만원)

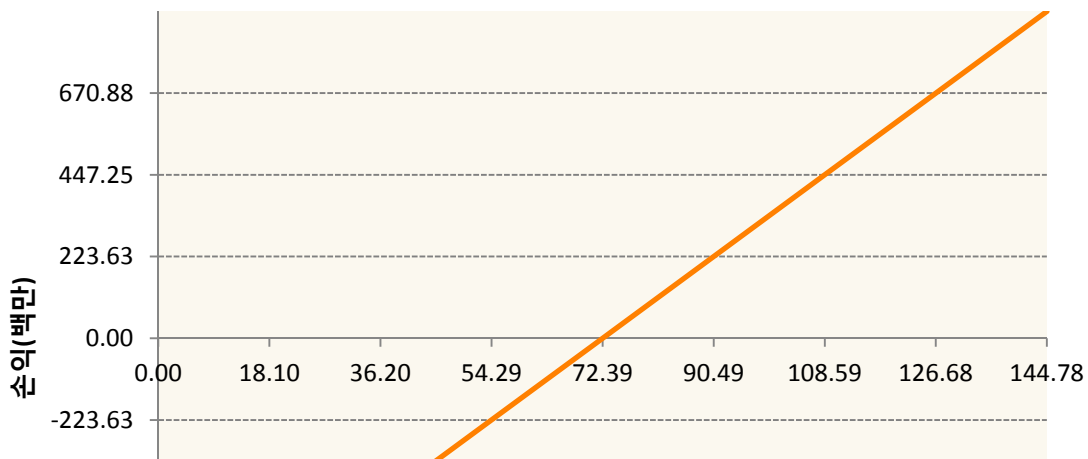
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,642	621	3,021	

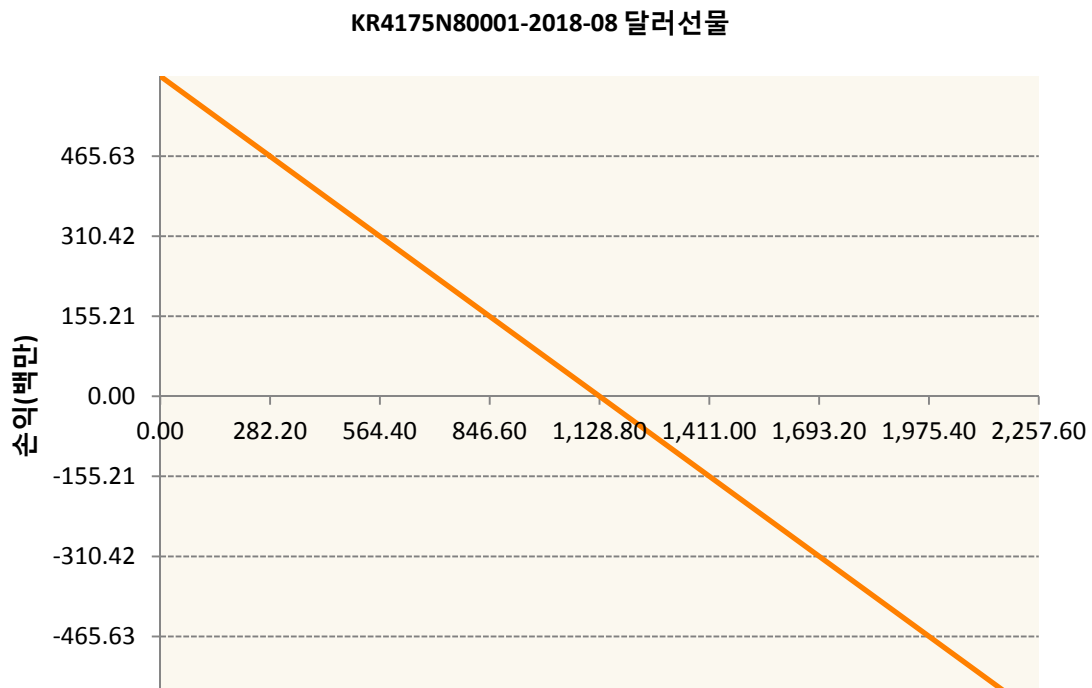
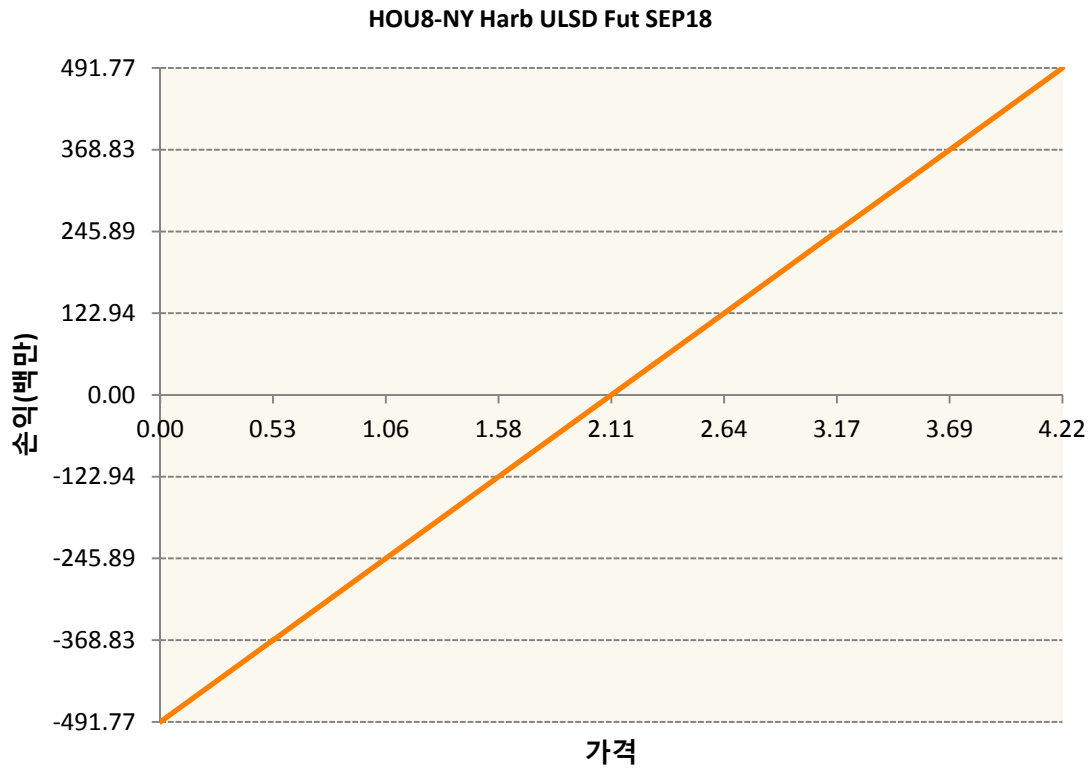
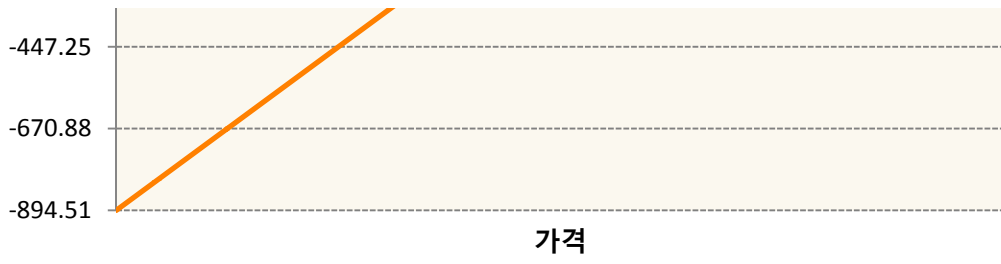
2. 만기시점의 손익구조

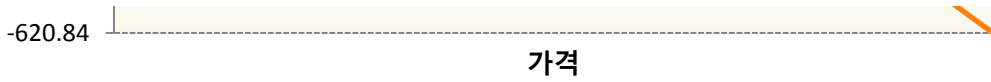
CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18



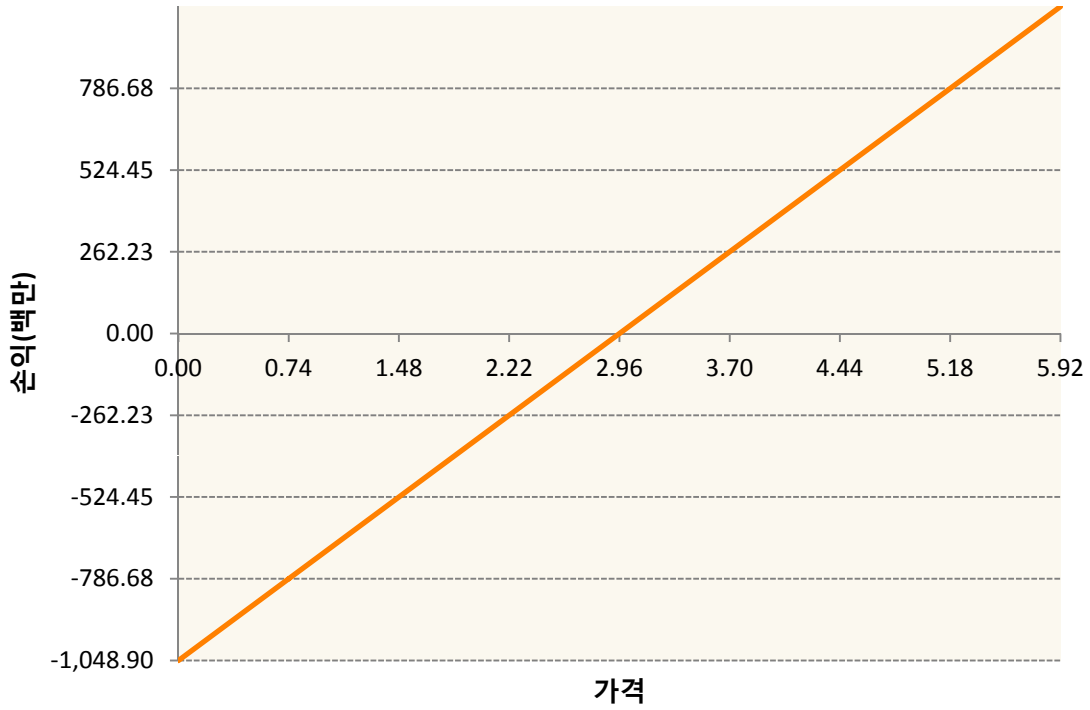
COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18



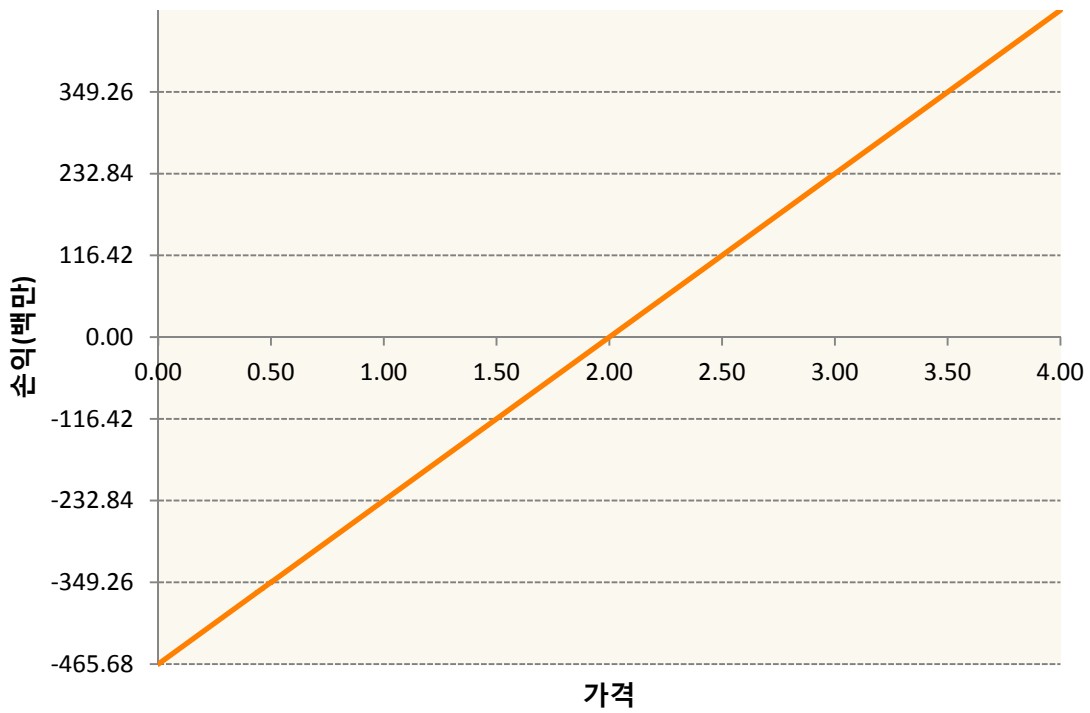




NGU18-NATURAL GAS FUTR SEP18



XBU8-GASOLINE RBOB FUT SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU8	WTI CRUDE FUTURE SEP18	59
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	72
HOU8	NY Harb ULSD Fut SEP18	39
KR4175N80C	2018-08 달러선물	50
NGU18	NATURAL GAS FUTR SEP18	84
XBU8	GASOLINE RBOB FUT SEP18	37

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

446

공시일	2018-08-13
기준일	2018-08-10

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

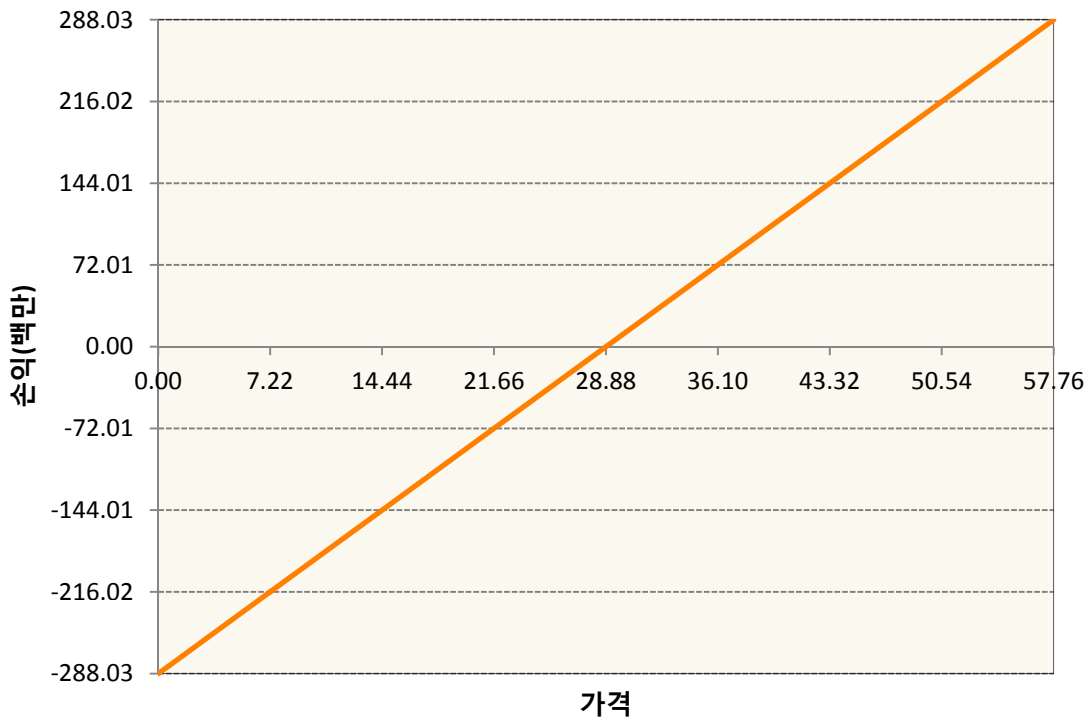
1. 계약금액

(단위:백만원)

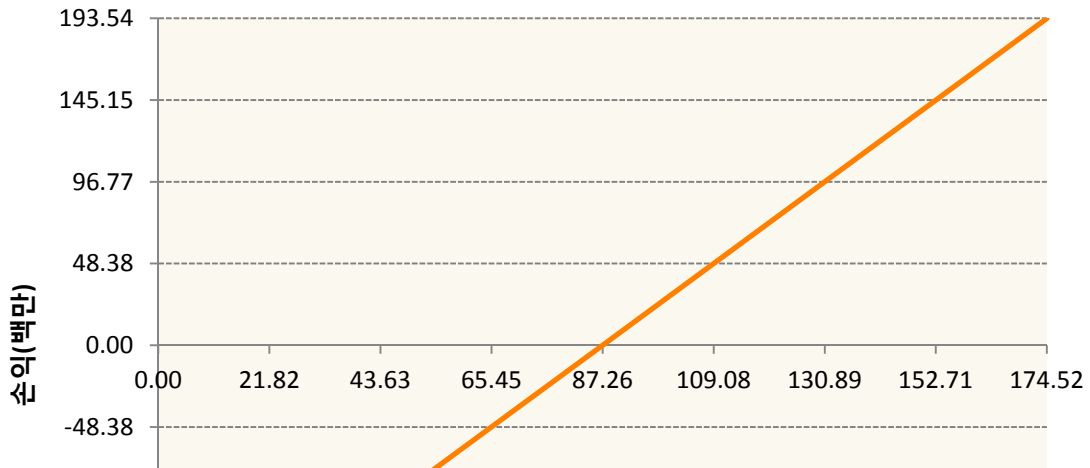
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,753	79	3,674	

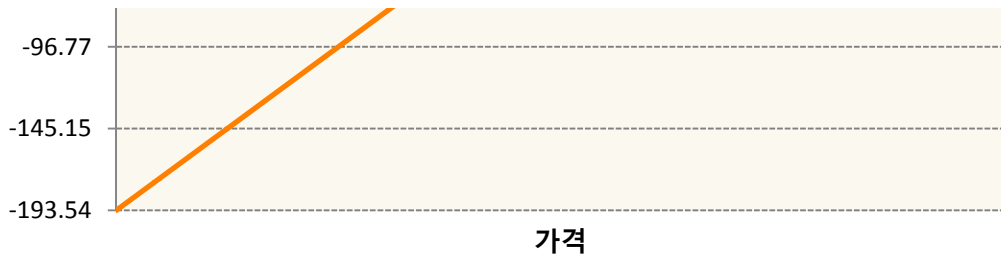
2. 만기시점의 손익구조

BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18

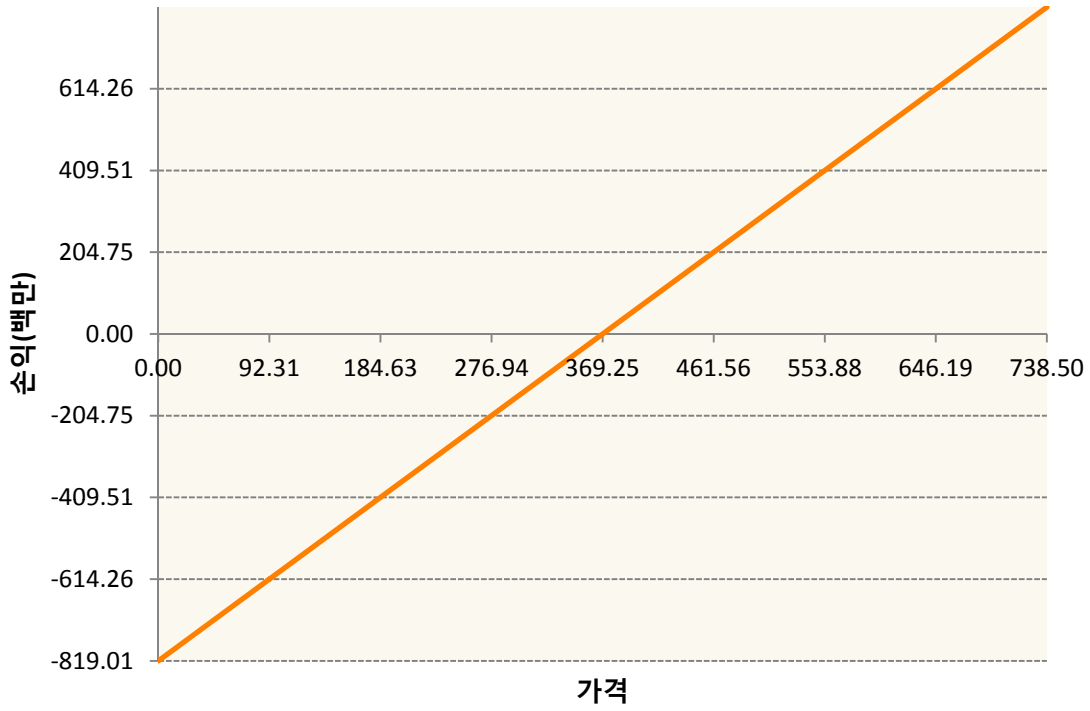


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

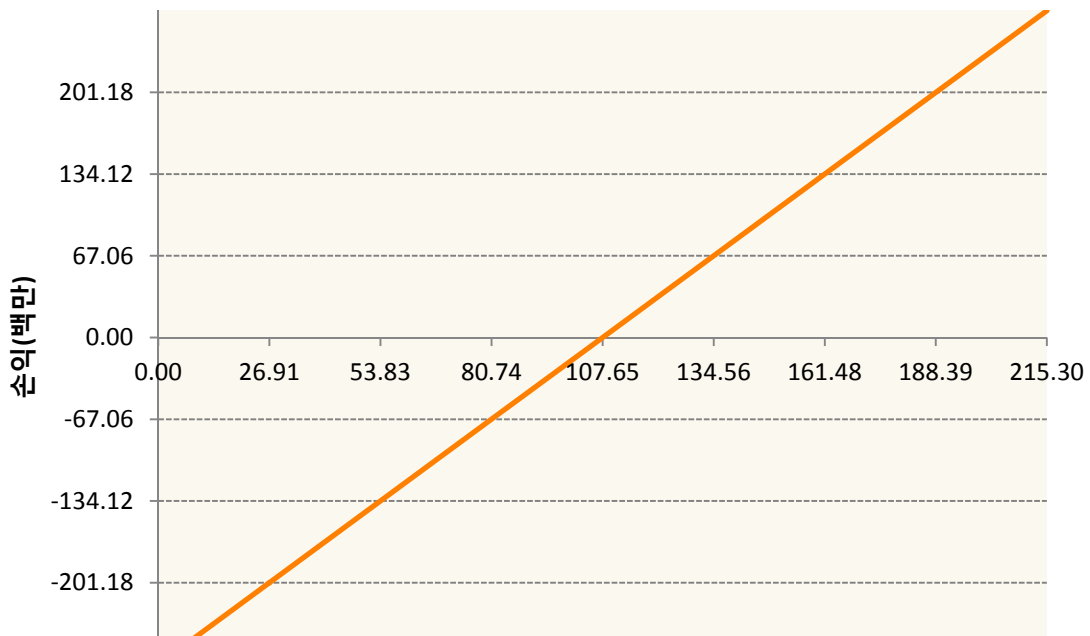


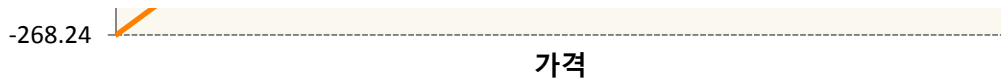


CU8-CORN FUTURE SEP18

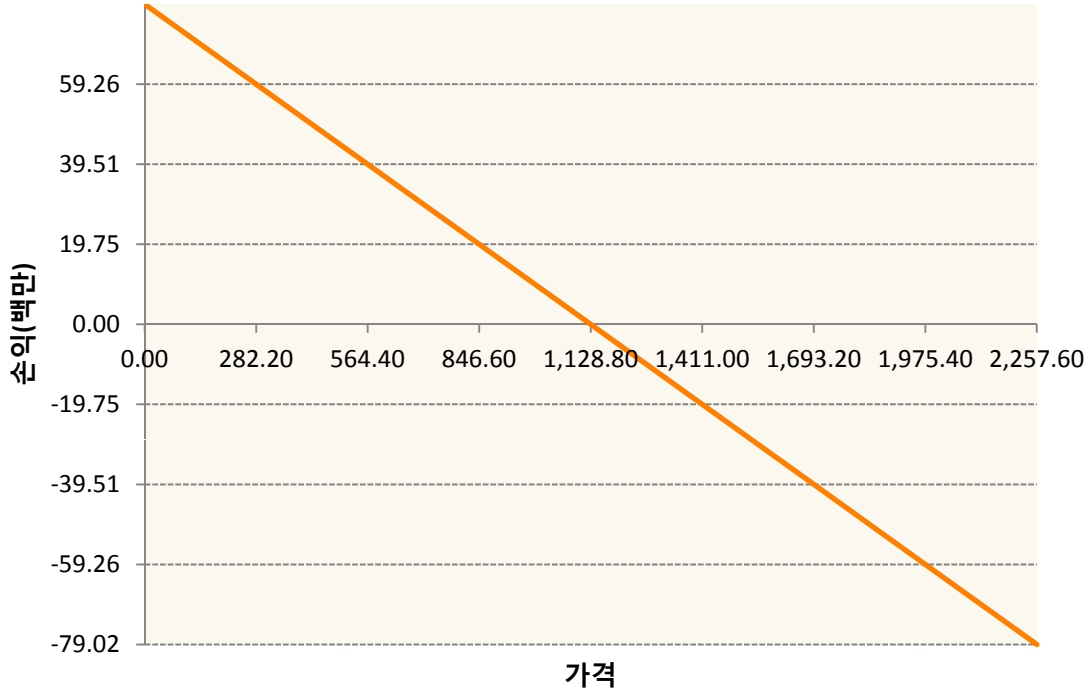


KCU8-COFFEE 'C' FUTURE SEP18

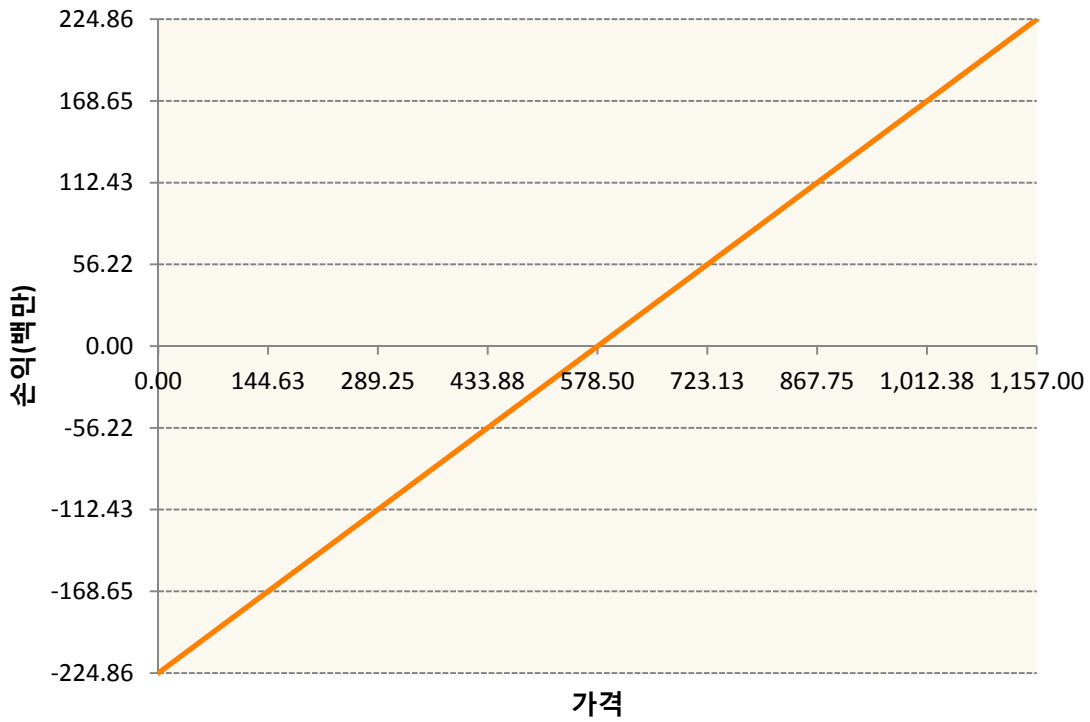




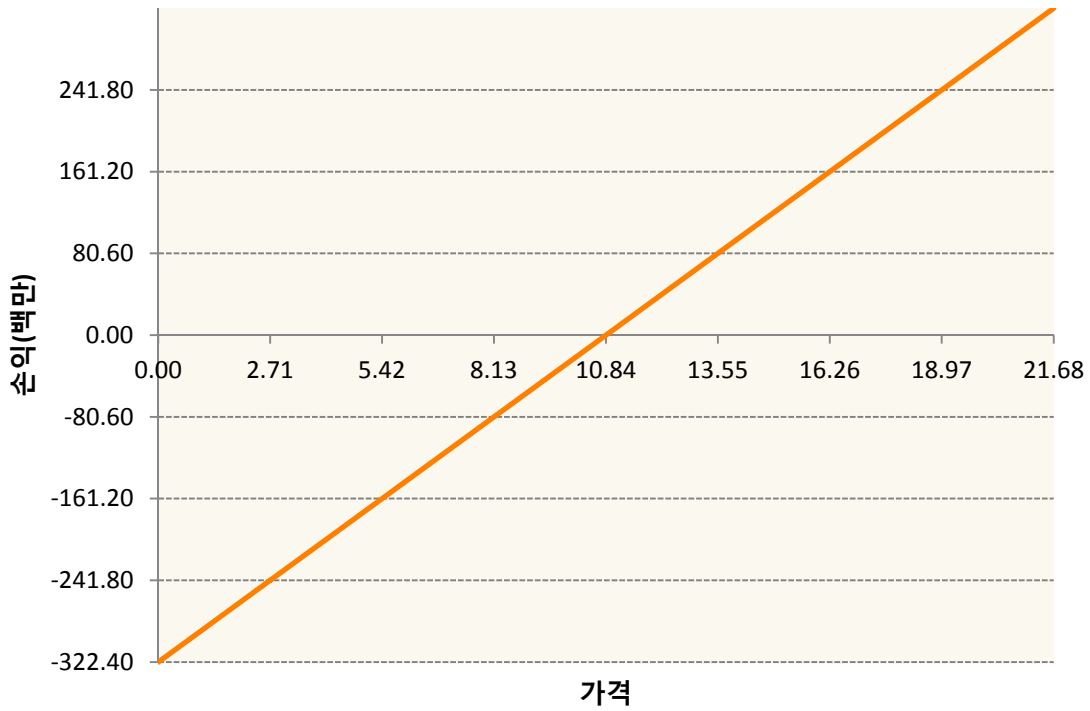
KR4175N80001-2018-08 달러선물



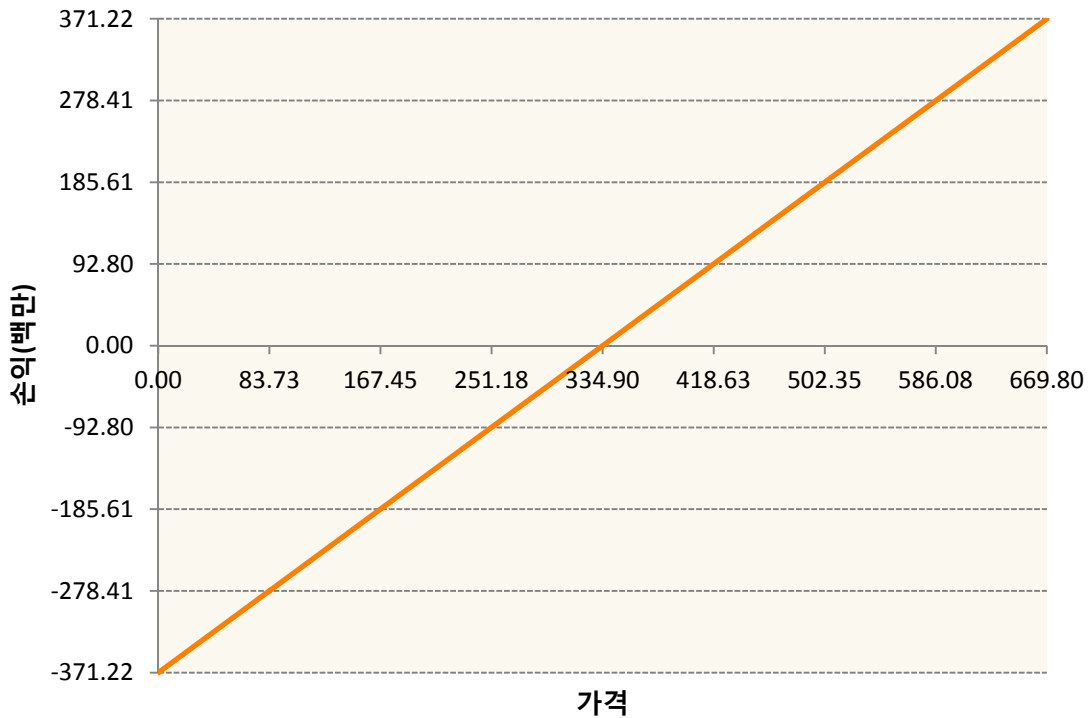
KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

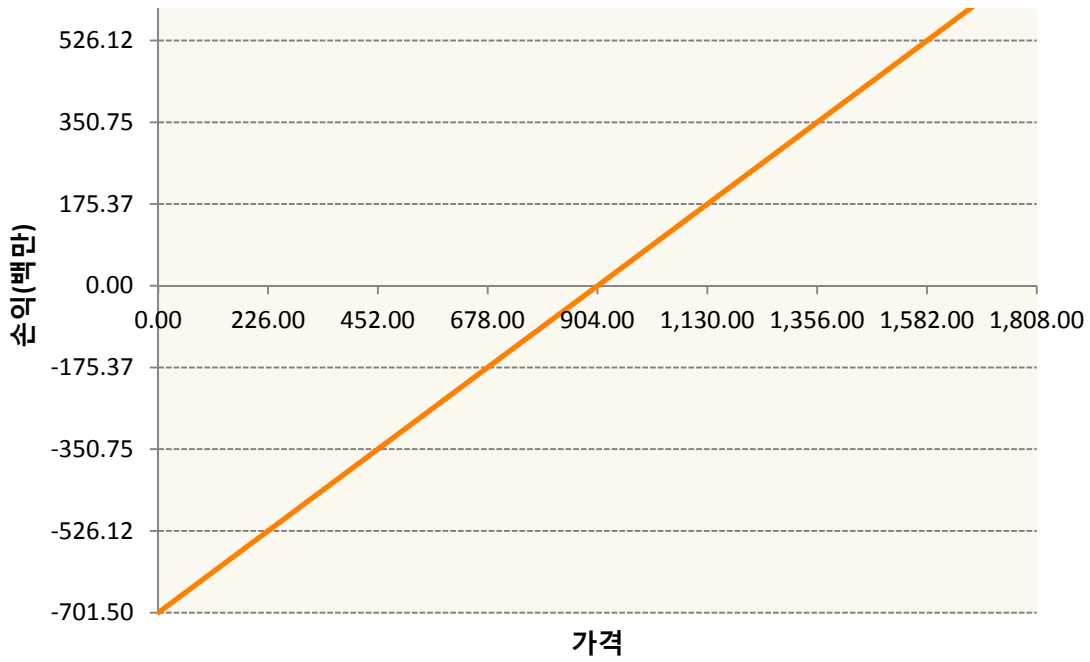


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

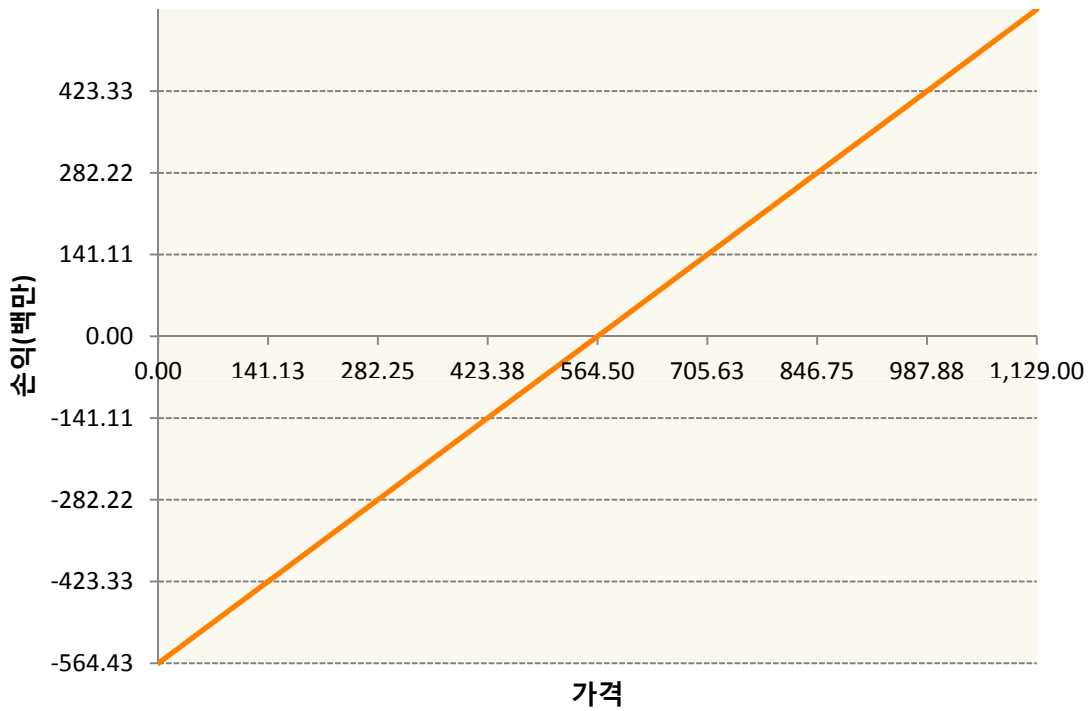


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





WU8-WHEAT FUTURE(CBT) SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	23
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	15
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	30
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	56
WU8	WHEAT FUTURE(CBT) SEP18	45

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

(단위:백만원)

317