

공시일	2018-08-14
기준일	2018-08-13

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)

66

공시일	2018-08-14
기준일	2018-08-13

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

1,134

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

480

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-14
기준일	2018-08-13

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

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	2018-08-14
기준일	2018-08-13

유로인덱스모(주식-파생형)

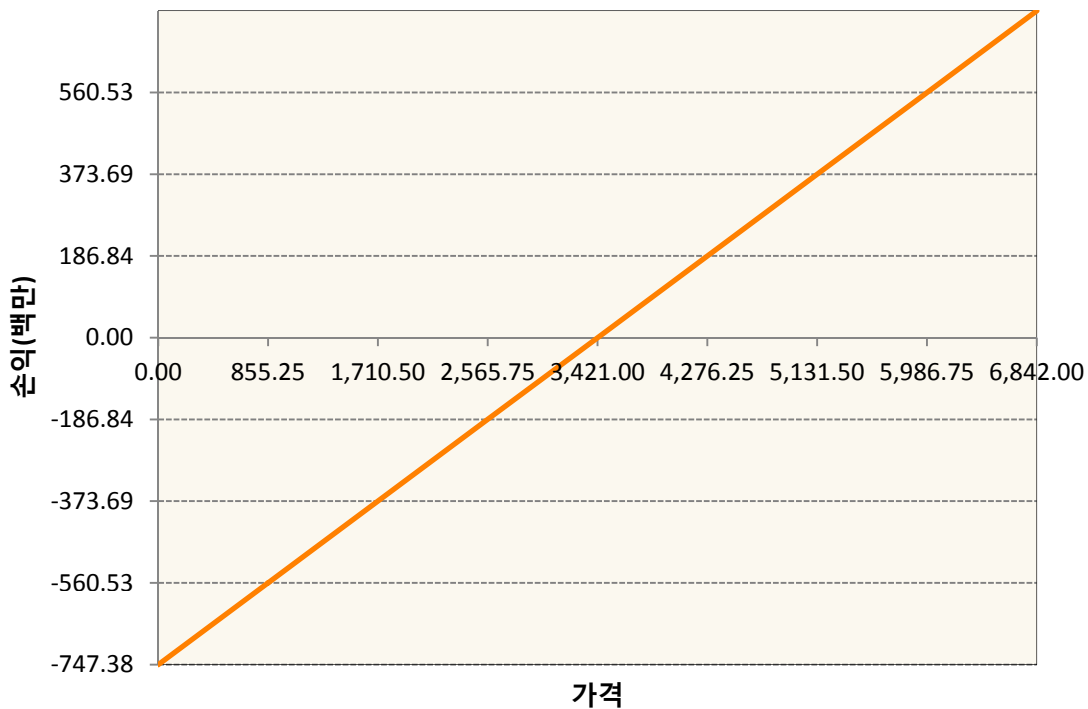
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	747	0	747	

2. 만기시점의 손익구조

VGU8-EURO STOXXX 50 SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU8	EURO STOXXX 50 SEP18	60
------	----------------------	----

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

(단위:백만원)

38

공시일	2018-08-14
기준일	2018-08-13

차이나인덱스모(주식-파생형)

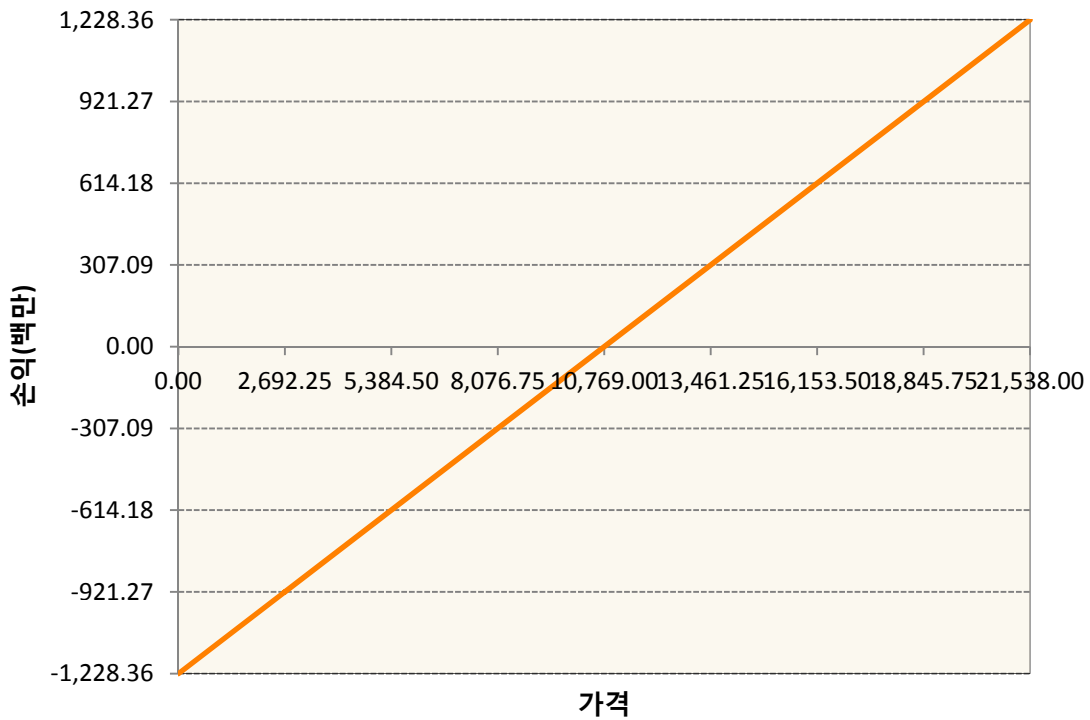
1. 계약금액

(단위:백만원)

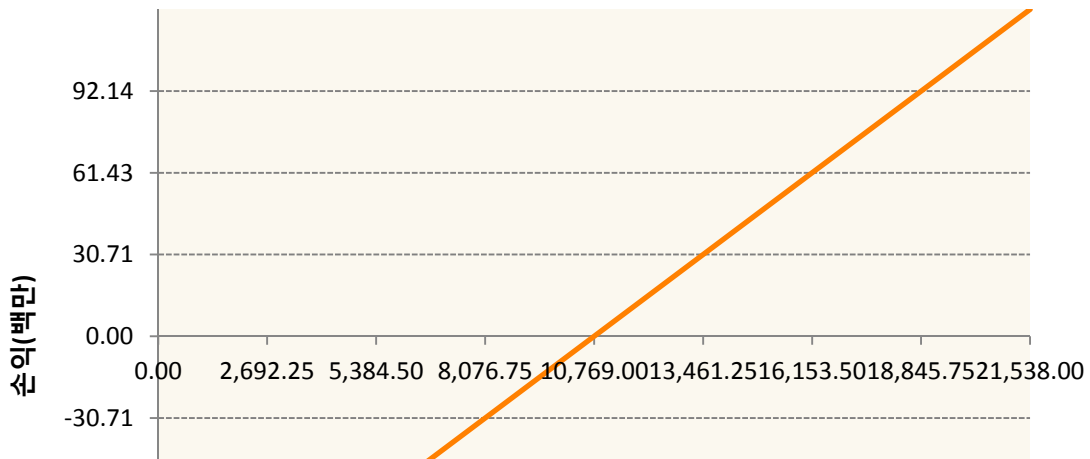
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,351	0	1,351	장내

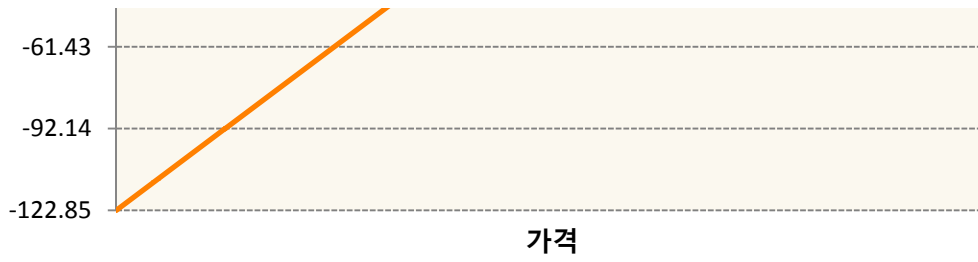
2. 만기시점의 손익구조

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)

99

공시일	2018-08-14
기준일	2018-08-13

커버드콜모(주식혼합-파생형)

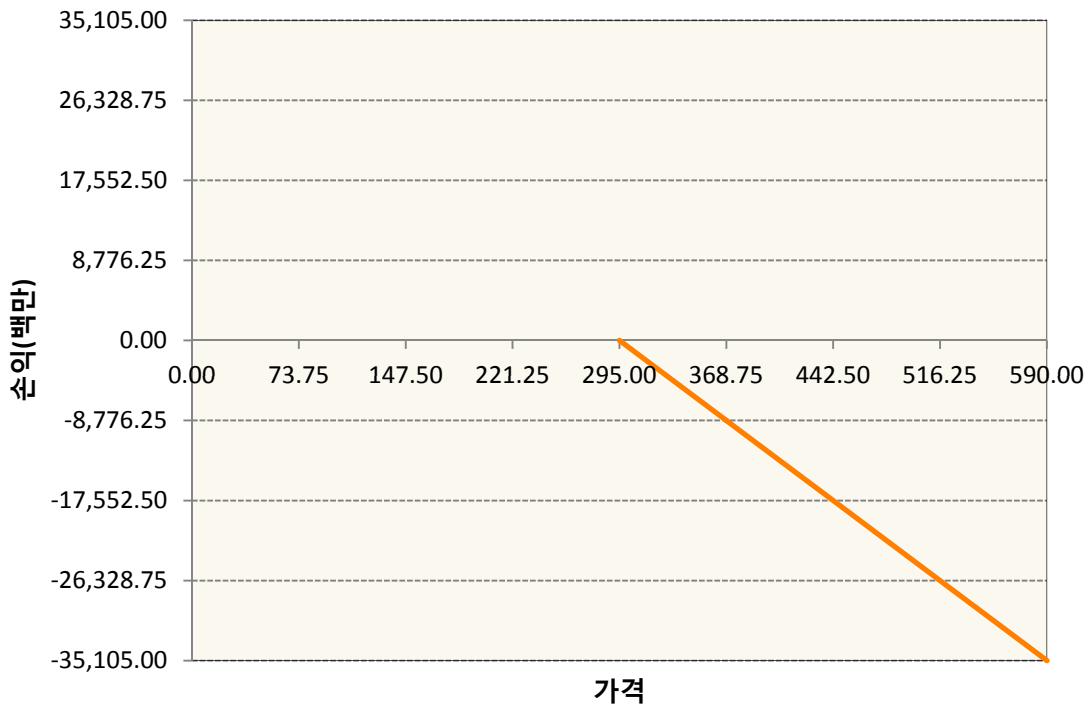
1. 계약금액

(단위:백만원)

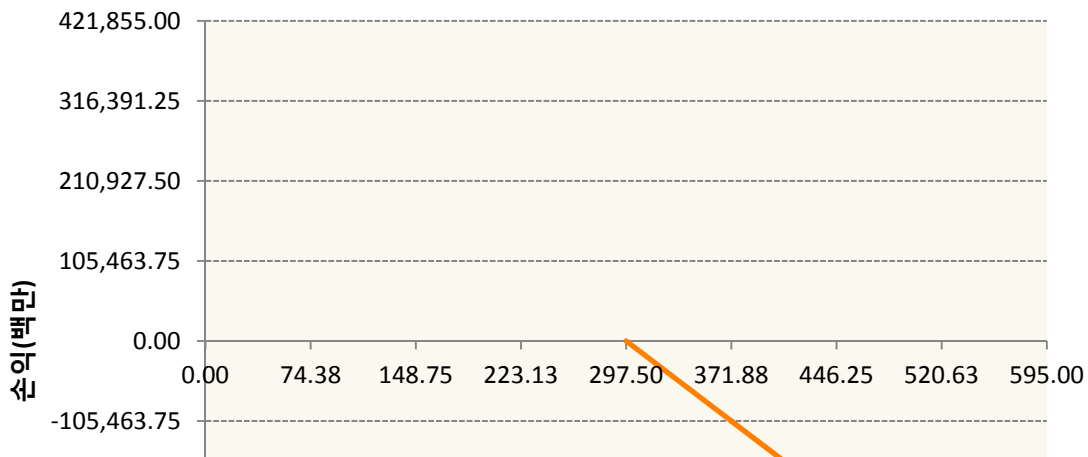
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	746,874	-746,874	장내

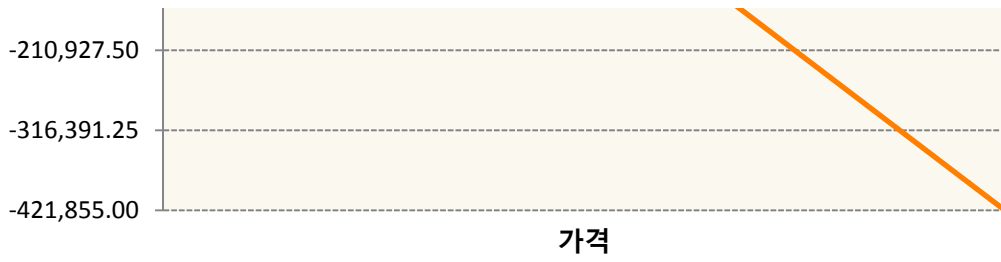
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92950-2018-09 콜295

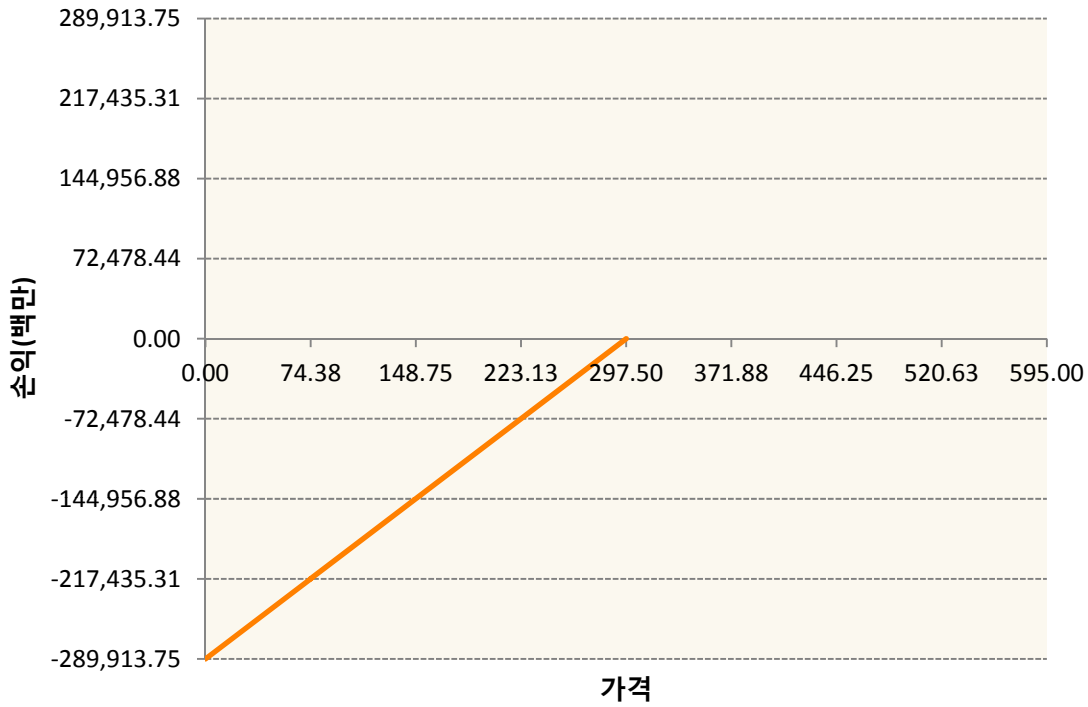


KR4201N92976-2018-09 콜297.5





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N929 2018-09 콜295

1,927

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	802	776	743	704	660	612	559
-5.33%	725	677	623	564	501	434	365
-2.67%	562	490	414	336	255	173	90
0%	272	182	91	0	-92	-184	-276
2.67%	-170	-264	-358	-453	-547	-642	-737
5.33%	-764	-848	-933	-1,021	-1,110	-1,199	-1,290
8.00%	-1,485	-1,549	-1,618	-1,691	-1,767	-1,846	-1,927

KR4201N929 2018-09 풋297.5

21,869

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,355	8,104	7,777	7,378	6,914	6,390	5,814

-5.33%	7,653	7,160	6,591	5,957	5,268	4,532	3,757
-2.67%	6,078	5,293	4,458	3,583	2,676	1,742	788
0%	3,140	2,107	1,060	0	-1,069	-2,145	-3,227
2.67%	-1,536	-2,673	-3,810	-4,947	-6,084	-7,221	-8,357
5.33%	-8,043	-9,107	-10,186	-11,277	-12,376	-13,483	-14,596
8.00%	-16,171	-17,026	-17,931	-18,875	-19,849	-20,849	-21,869
KR4301N929 2018-09 풋297.5							20,821
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20,745	-20,747	-20,750	-20,757	-20,770	-20,791	-20,821
-5.33%	-13,237	-13,252	-13,280	-13,323	-13,383	-13,461	-13,557
-2.67%	-5,847	-5,943	-6,066	-6,215	-6,387	-6,580	-6,791
0%	876	600	307	0	-318	-645	-979
2.67%	5,810	5,419	5,028	4,637	4,246	3,855	3,464
5.33%	8,333	8,045	7,739	7,420	7,091	6,752	6,407
8.00%	9,150	9,034	8,888	8,716	8,520	8,303	8,067

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

(단위:백만원)

43,948

공시일	2018-08-14
기준일	2018-08-13

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

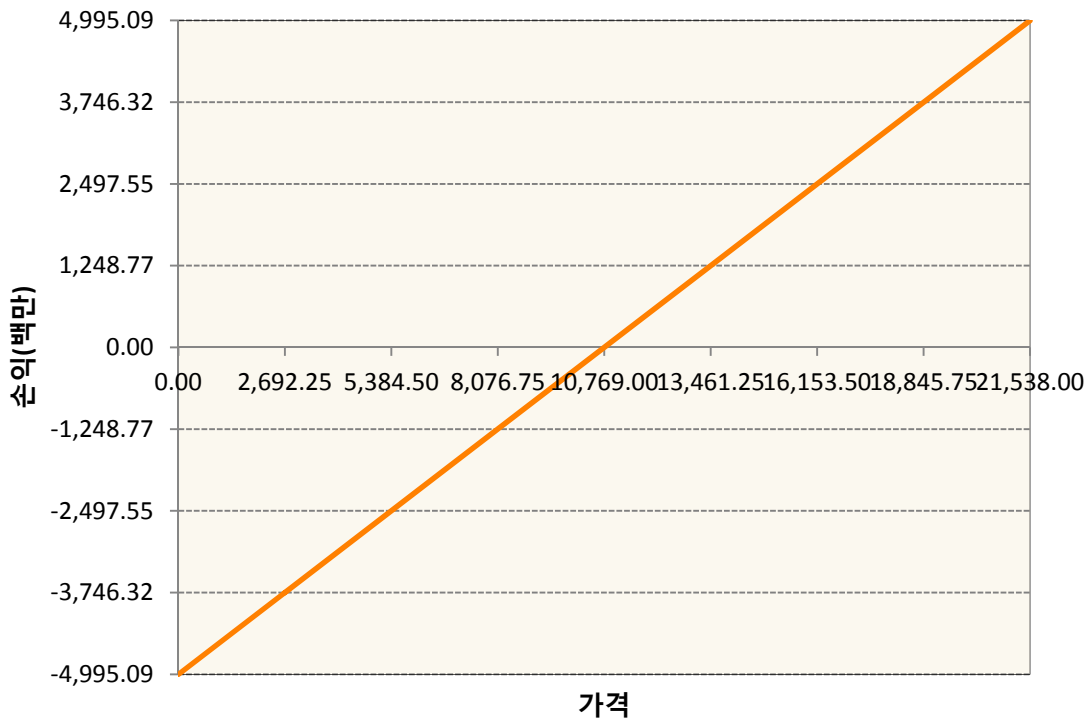
1. 계약금액

(단위:백만원)

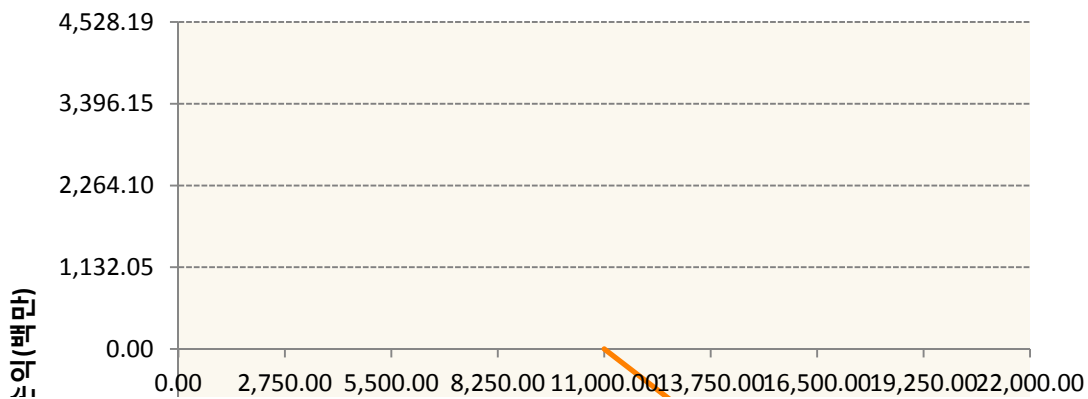
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,995	0	4,995	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,645	-11,645	장내

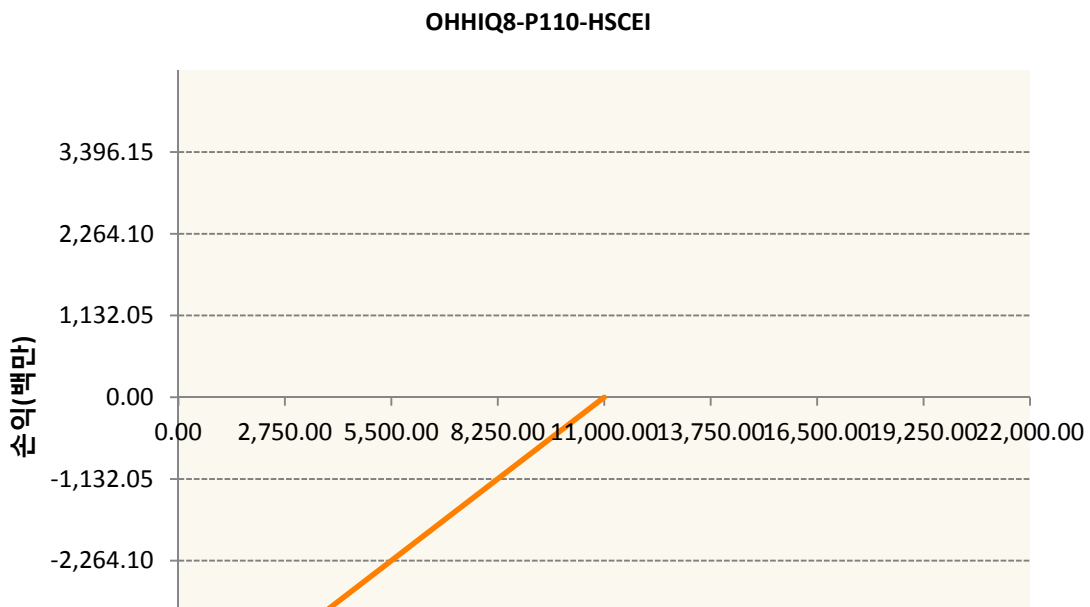
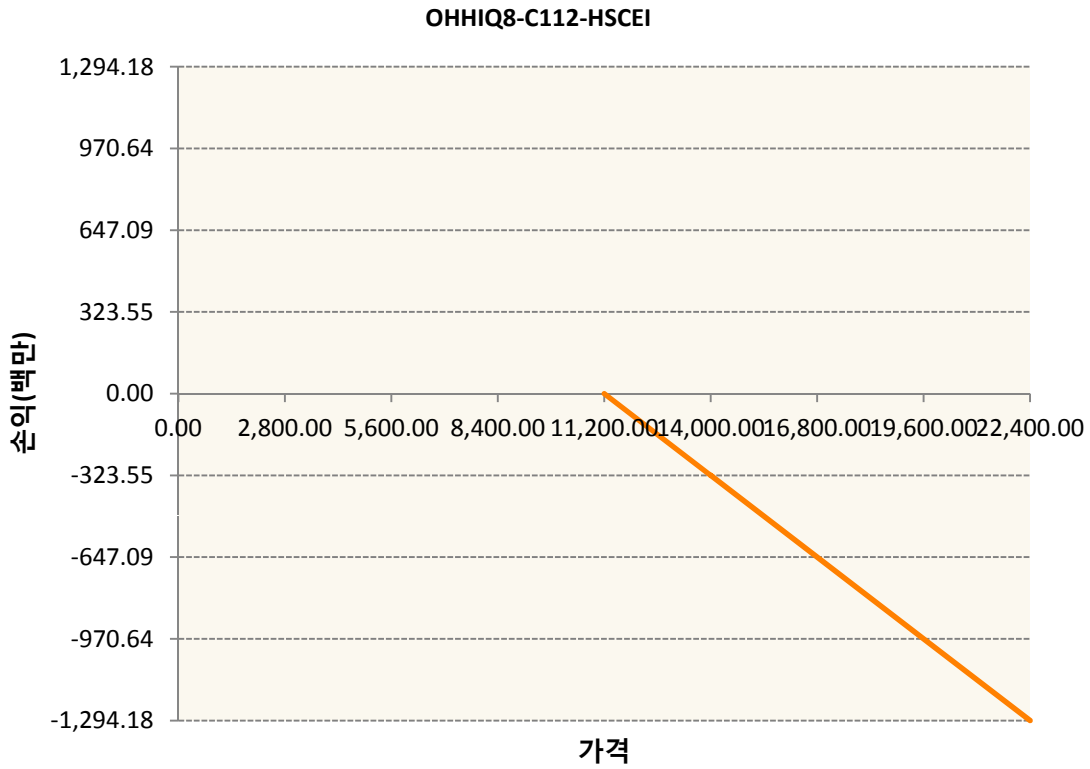
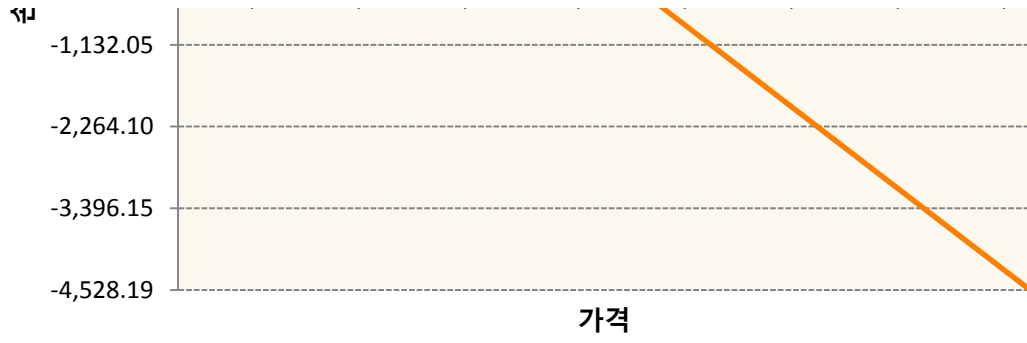
2. 만기시점의 손익구조

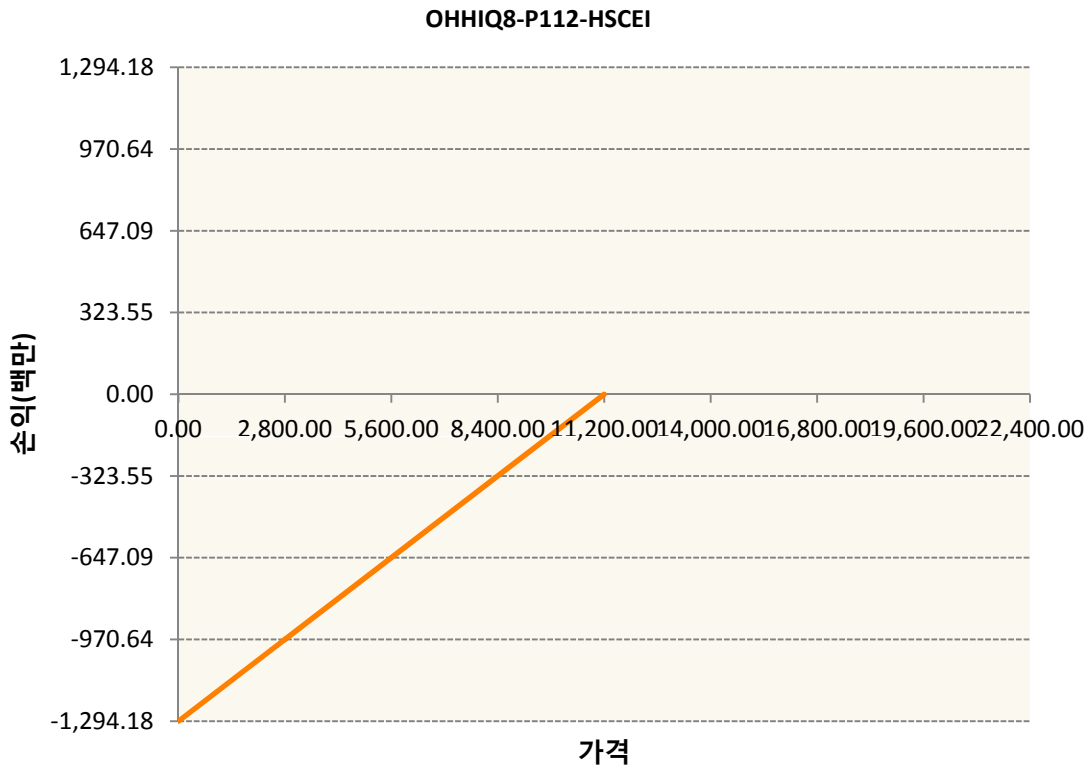
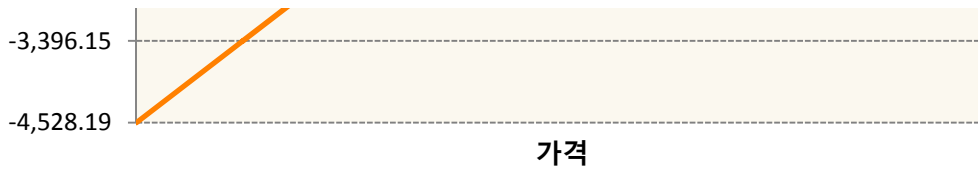
HCQ8-HSCEI Futures Aug18



OHHIQ8-C110-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ8	HSCEI Futures Aug18	400
OHHIQ8-C1	HSCEI	362
OHHIQ8-C1	HSCEI	104
OHHIQ8-P11	HSCEI	362
OHHIQ8-P11	HSCEI	104

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,214

공시일	2018-08-14
기준일	2018-08-13

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	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	49,668	-49,668	장내

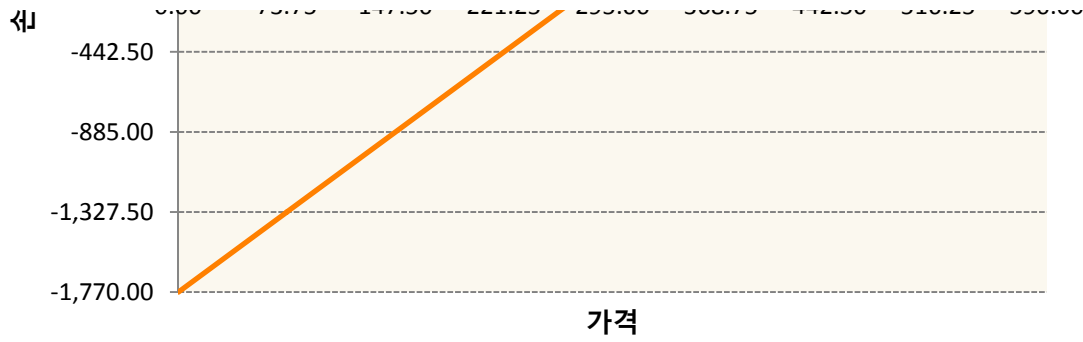
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92976-2018-09 콜297.5

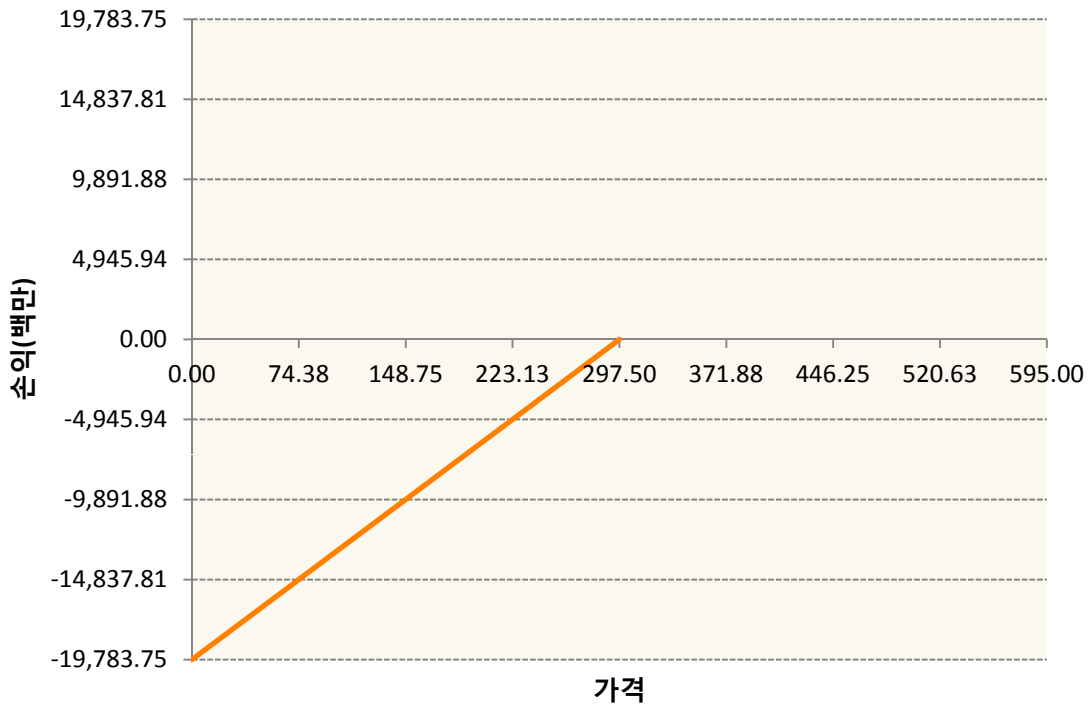


KR4301N92958-2018-09 풋295





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,979
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,979	-3,979	-3,979	-3,979	-3,979	-3,979	-3,979
-5.33%	-2,653	-2,653	-2,653	-2,653	-2,653	-2,653	-2,653
-2.67%	-1,326	-1,326	-1,326	-1,326	-1,326	-1,326	-1,326
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,326	1,326	1,326	1,326	1,326	1,326	1,326
5.33%	2,653	2,653	2,653	2,653	2,653	2,653	2,653
8.00%	3,979	3,979	3,979	3,979	3,979	3,979	3,979
KR4201N92974-2018-09 풋297.5							1,457
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	557	540	518	492	461	426	387
-5.33%	510	477	439	397	351	302	250
-2.67%	405	353	297	239	178	116	53
0%	209	140	71	0	-71	-143	-215
2.67%	-102	-178	-254	-330	-405	-481	-557
5.33%	-536	-607	-679	-752	-825	-899	-973
8.00%	-1,078	-1,135	-1,195	-1,258	-1,323	-1,389	-1,457

KR4301N929 2018-09 풋295

124

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-123	-123	-123	-124	-124	-124	-124
-5.33%	-77	-77	-78	-78	-79	-79	-80
-2.67%	-32	-33	-34	-36	-37	-38	-40
0%	6	4	2	0	-2	-4	-7
2.67%	32	30	27	25	23	20	18
5.33%	43	42	40	39	37	35	33
8.00%	46	46	45	44	43	42	41

KR4301N929 2018-09 풋297.5

1,421

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,416	-1,416	-1,416	-1,416	-1,417	-1,419	-1,421
-5.33%	-903	-904	-906	-909	-913	-919	-925
-2.67%	-399	-406	-414	-424	-436	-449	-463
0%	60	41	21	0	-22	-44	-67
2.67%	397	370	343	316	290	263	236
5.33%	569	549	528	506	484	461	437
8.00%	624	616	607	595	581	567	551

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

(단위:백만원)

6,971

공시일	2018-08-14
기준일	2018-08-13

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

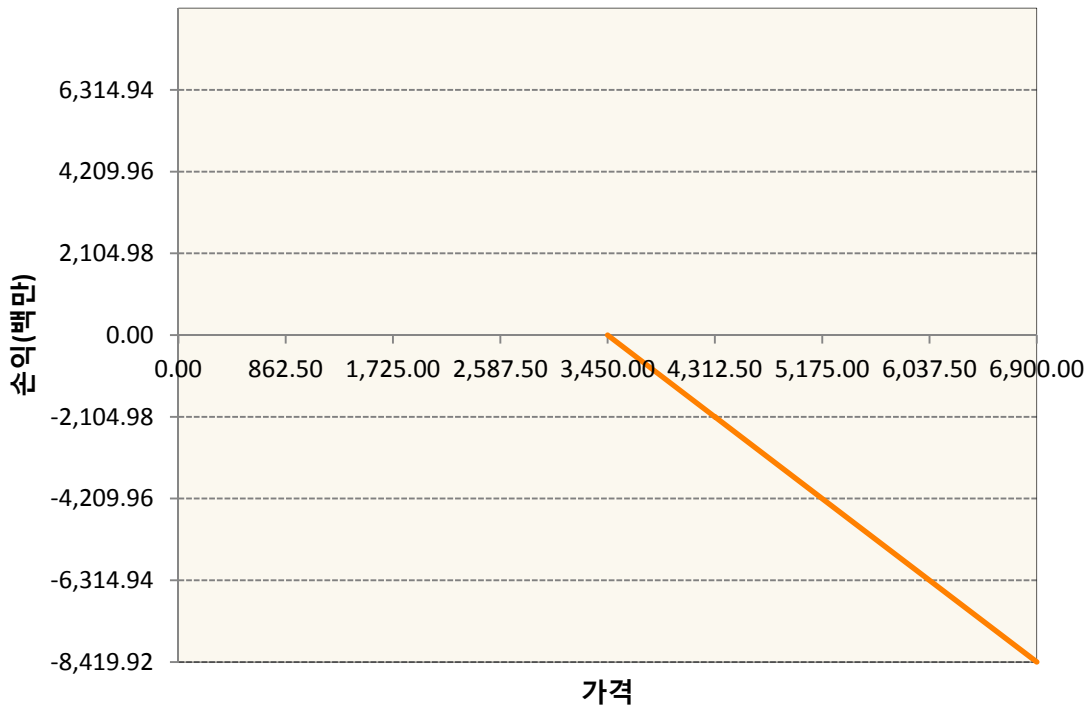
1. 계약금액

(단위:백만원)

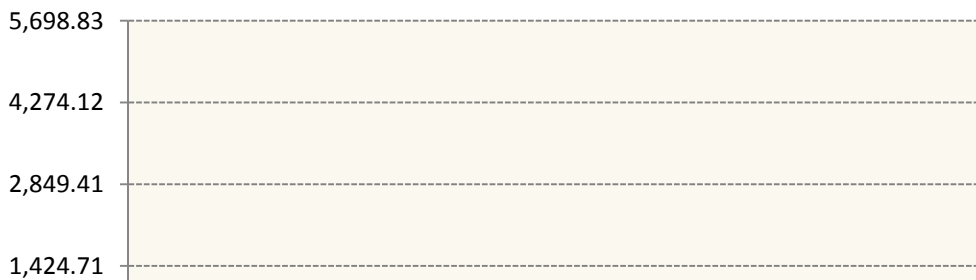
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	8	-8	장외
누계	유가증권	선물	6,828	0	6,828	
누계	유가증권	옵션	0	22,544	-22,544	장내
누계	지수	스왑	86,522	0	86,522	장외

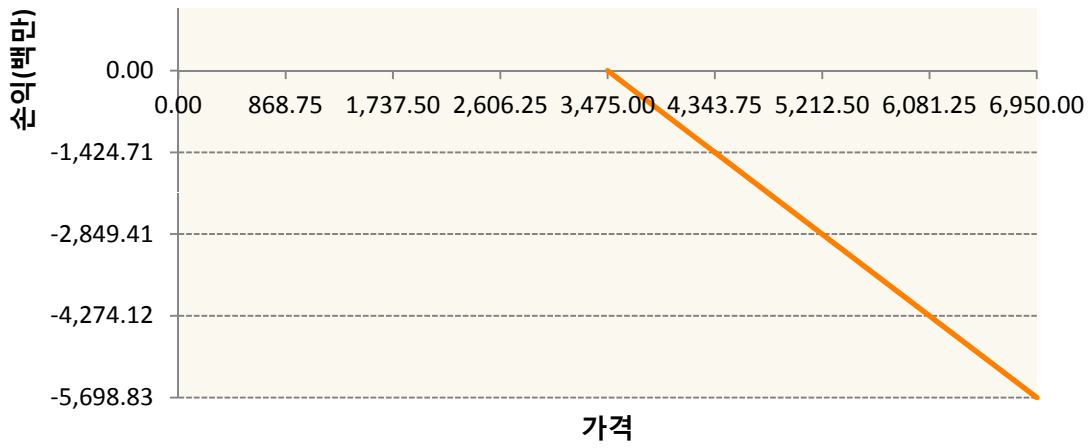
2. 만기시점의 손익구조

OESXQ8-C3450-EURO STOXX 50 OPT

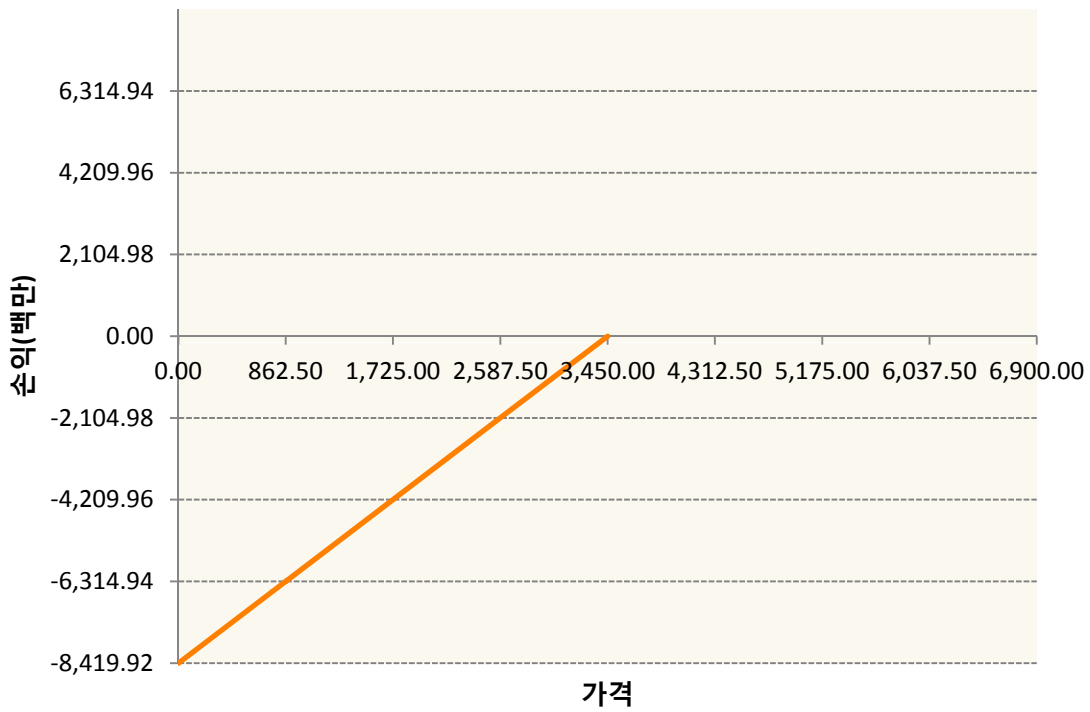


OESXQ8-C3475-EURO STOXX 50 OPT

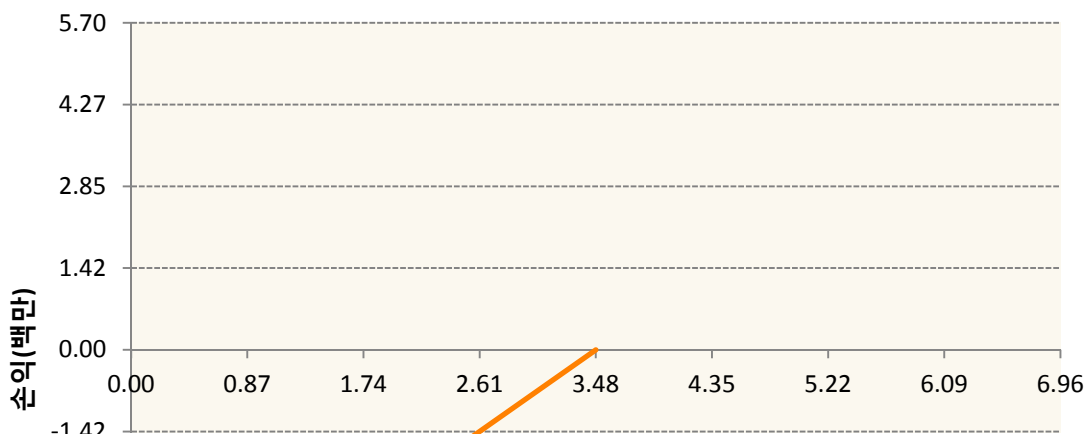


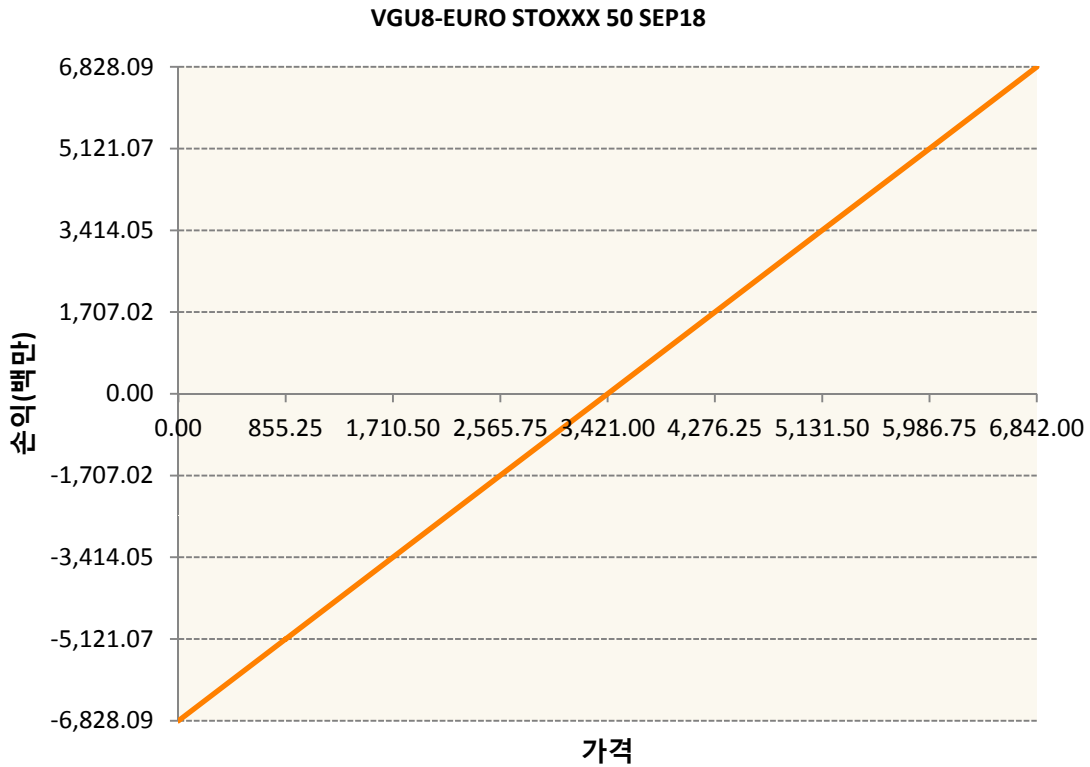


OESXQ8-P3450-EURO STOXX 50



OESXQ8-P3475-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	1
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	0.4
OESXQ8-C3 EURO STOXX 50 OPT	674
OESXQ8-C3 EURO STOXX 50 OPT	456
OESXQ8-P3 EURO STOXX 50	674
OESXQ8-P3 EURO STOXX 50	0.5
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18	546

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

1,479

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

(단위:백만원)

1,116

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

(단위:백만원)

88

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

(단위:백만원)

132

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

(단위:백만원)

162

공시일	2018-08-14
기준일	2018-08-13

스마트KRX300인덱스목표전환형1

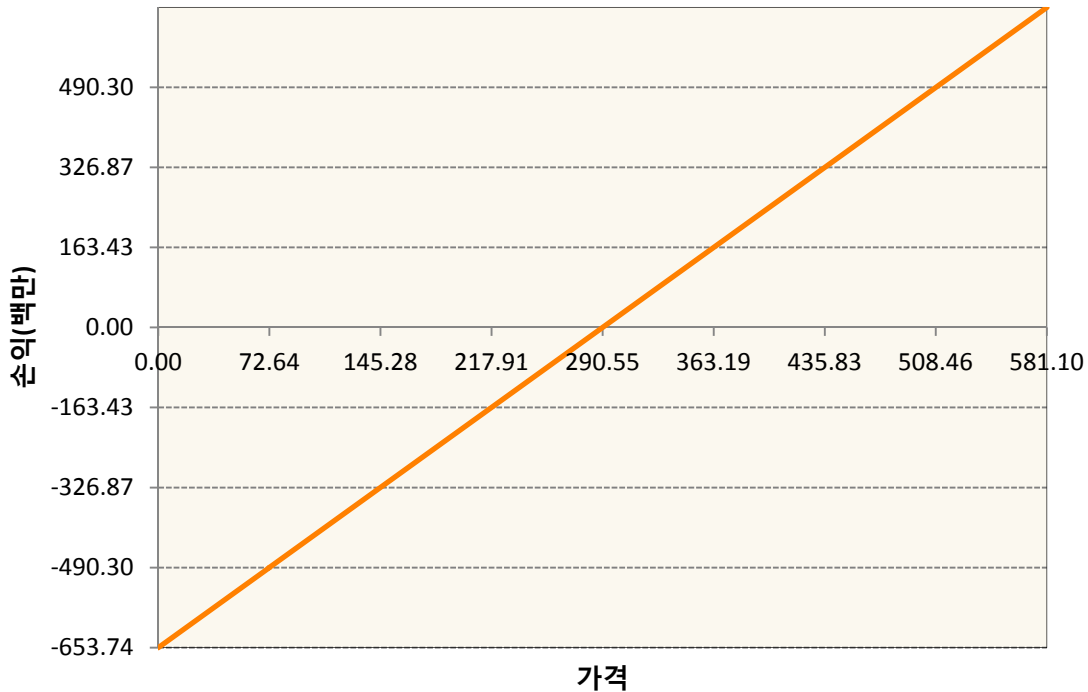
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	654	0	654	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물

52

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	17	17	17	17	17	17	17
5.33%	35	35	35	35	35	35	35
8.00%	52	52	52	52	52	52	52

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-08-14
기준일	2018-08-13

리디파인K200(주식혼합-파생재간

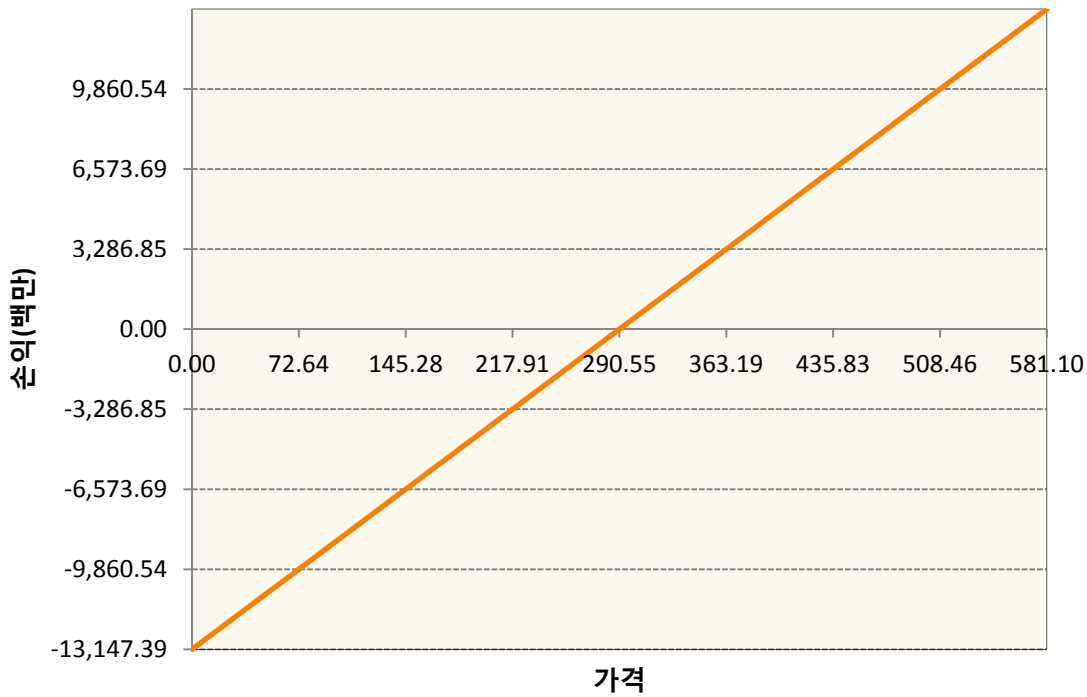
1. 계약금액

(단위:백만원)

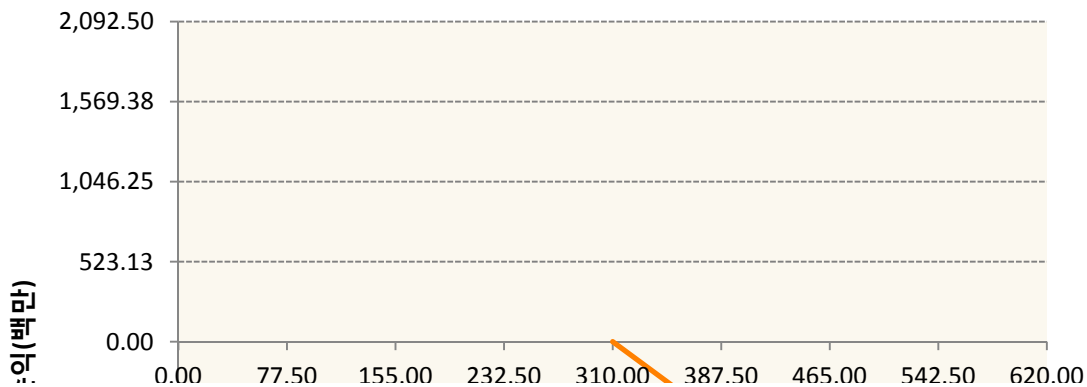
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,147	0	13,147	장내
누계	유가증권	옵션	1,339	24,358	-23,019	장내

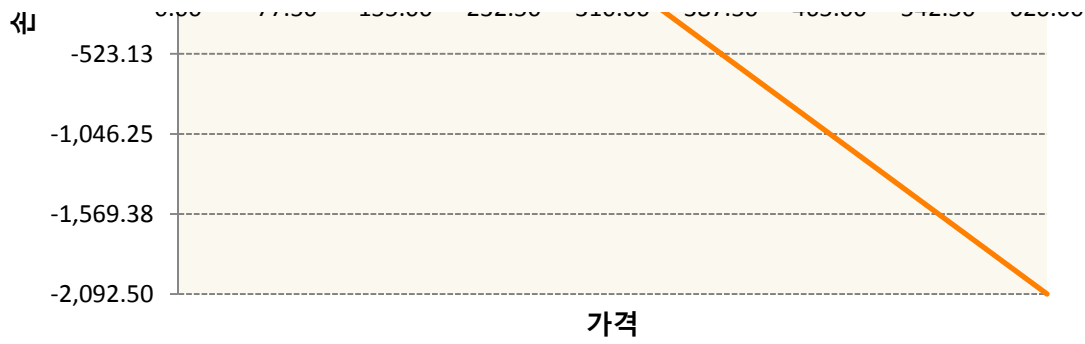
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

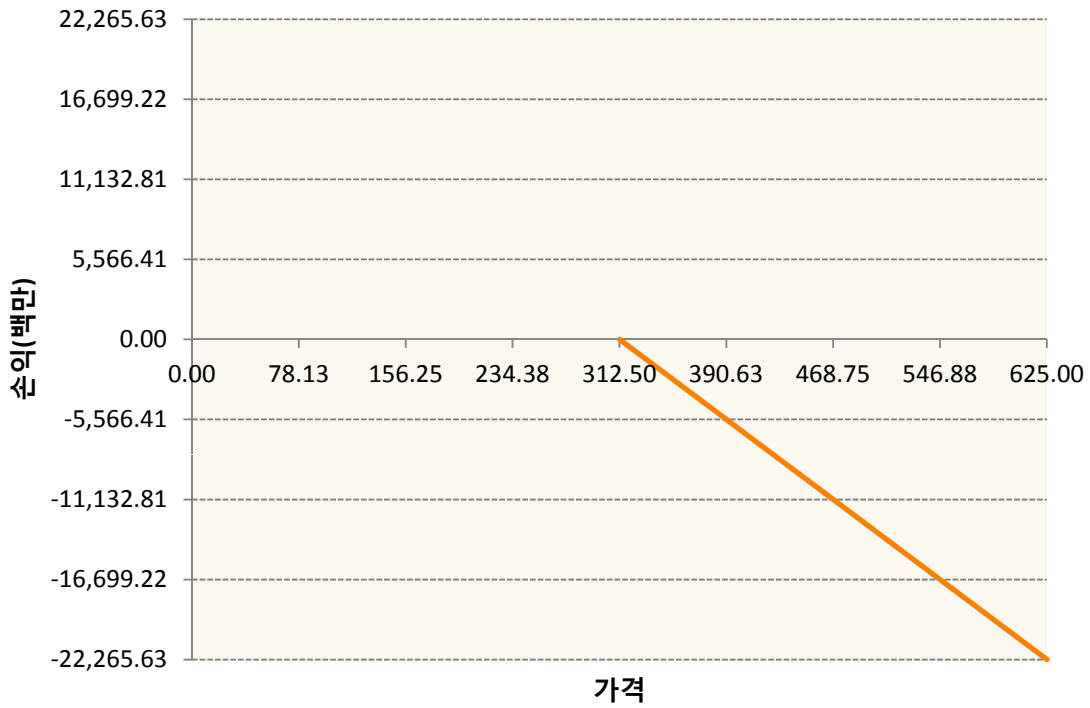


KR4201N93107-2018-09 콜310

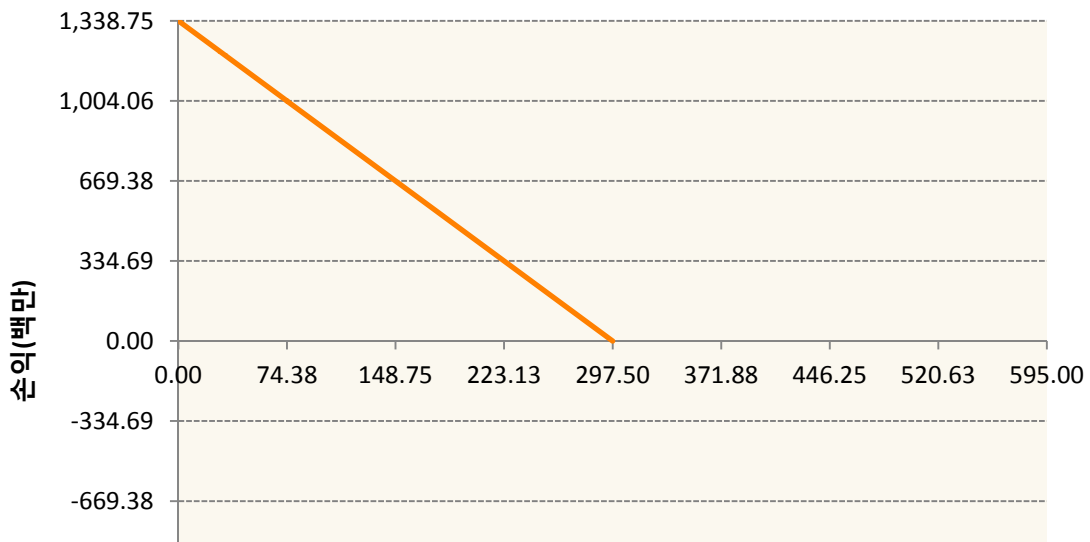


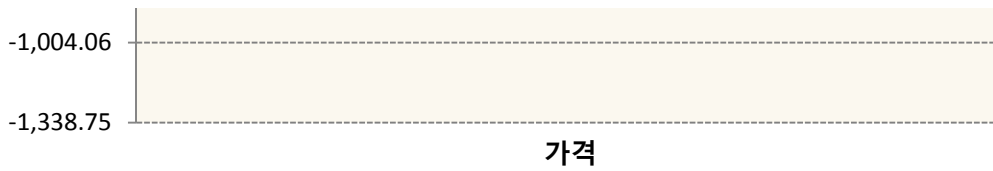


KR4201N93123-2018-09 콜312.5



KR4301N92974-2018-09 풋297.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물							1,049
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,049	-1,049	-1,049	-1,049	-1,049	-1,049	-1,049
-5.33%	-700	-700	-700	-700	-700	-700	-700
-2.67%	-350	-350	-350	-350	-350	-350	-350
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	350	350	350	350	350	350	350
5.33%	700	700	700	700	700	700	700
8.00%	1,049	1,049	1,049	1,049	1,049	1,049	1,049
KR4201N931 2018-09 콜310							77
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	18	18	18	17	16	14	13
-5.33%	18	17	16	14	12	10	8
-2.67%	16	14	11	9	6	3	-1
0%	10	7	4	0	-4	-8	-12
2.67%	0	-4	-9	-14	-19	-24	-29
5.33%	-17	-23	-28	-34	-39	-45	-50
8.00%	-43	-49	-54	-60	-65	-71	-77
KR4201N931 2018-09 콜312.5							752
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	164	161	156	149	140	128	113
-5.33%	158	151	140	126	109	89	66
-2.67%	141	125	105	81	53	23	-10
0%	98	69	36	0	-39	-80	-123
2.67%	9	-35	-81	-129	-179	-229	-281
5.33%	-149	-205	-261	-318	-375	-432	-490
8.00%	-392	-452	-512	-572	-632	-692	-752
KR4301N92C 2018-09 풋297.5							96
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	96	96	96	96	96	96	96
-5.33%	61	61	61	62	62	62	63
-2.67%	27	27	28	29	29	30	31

0%	-4	-3	-1	0	1	3	5
2.67%	-27	-25	-23	-21	-20	-18	-16
5.33%	-38	-37	-36	-34	-33	-31	-30
8.00%	-42	-42	-41	-40	-39	-38	-37

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

(단위:백만원)

1,461

공시일	2018-08-14
기준일	2018-08-13

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

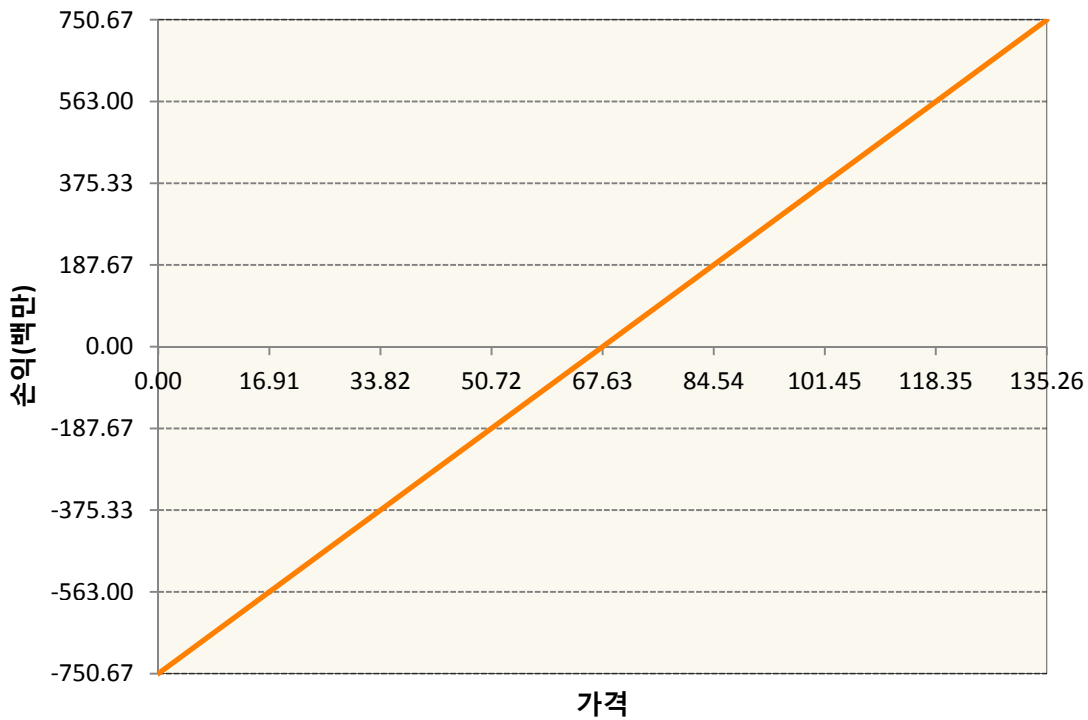
1. 계약금액

(단위:백만원)

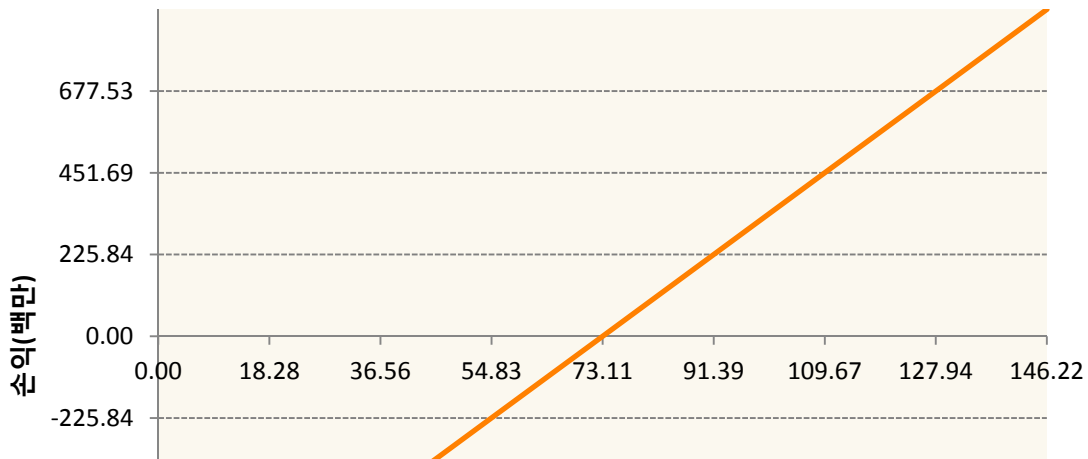
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,672	624	3,049	

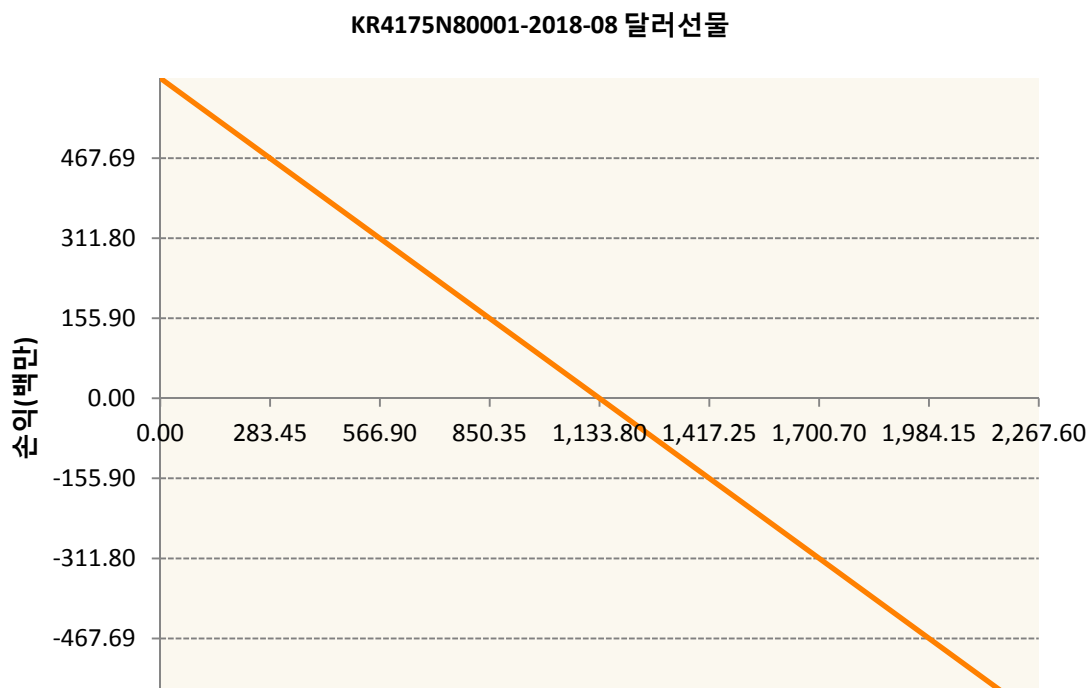
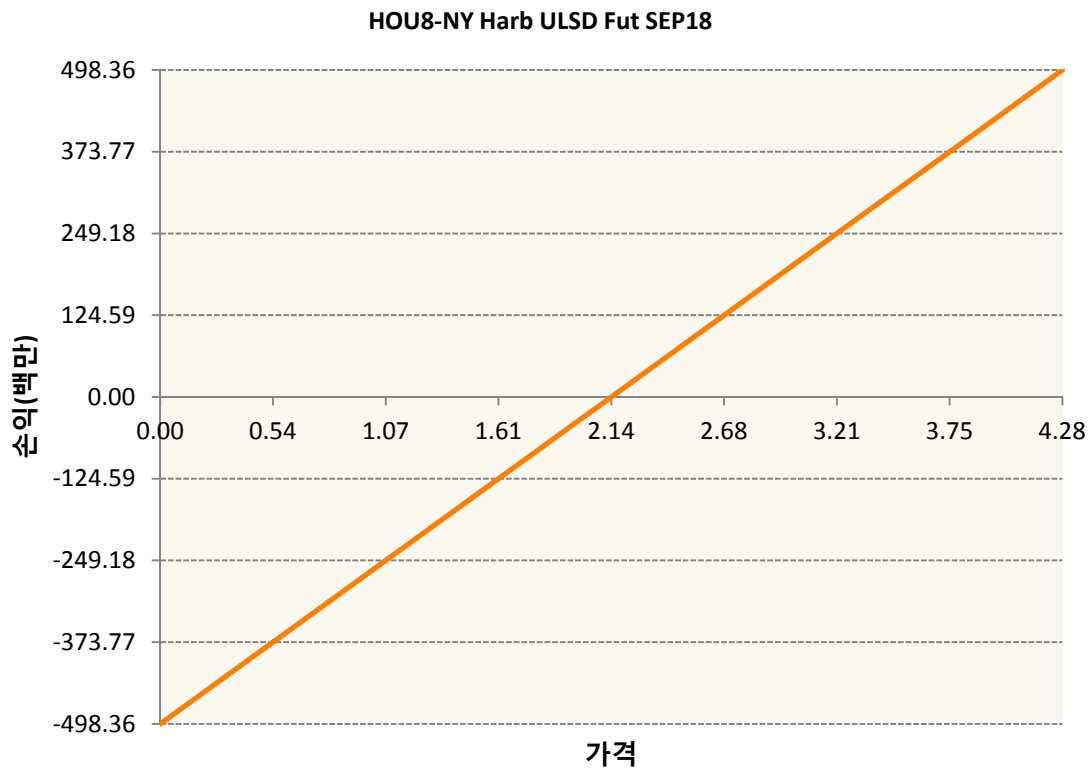
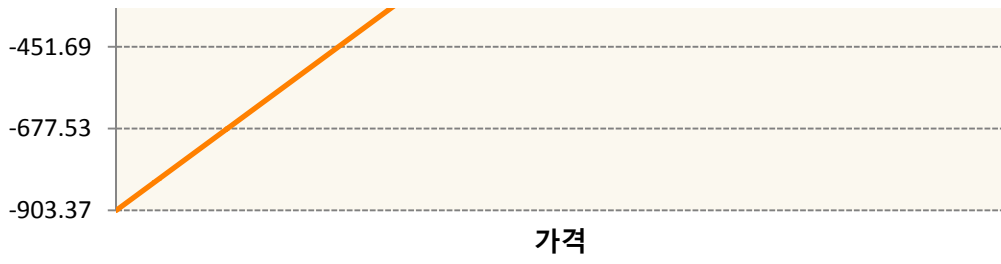
2. 만기시점의 손익구조

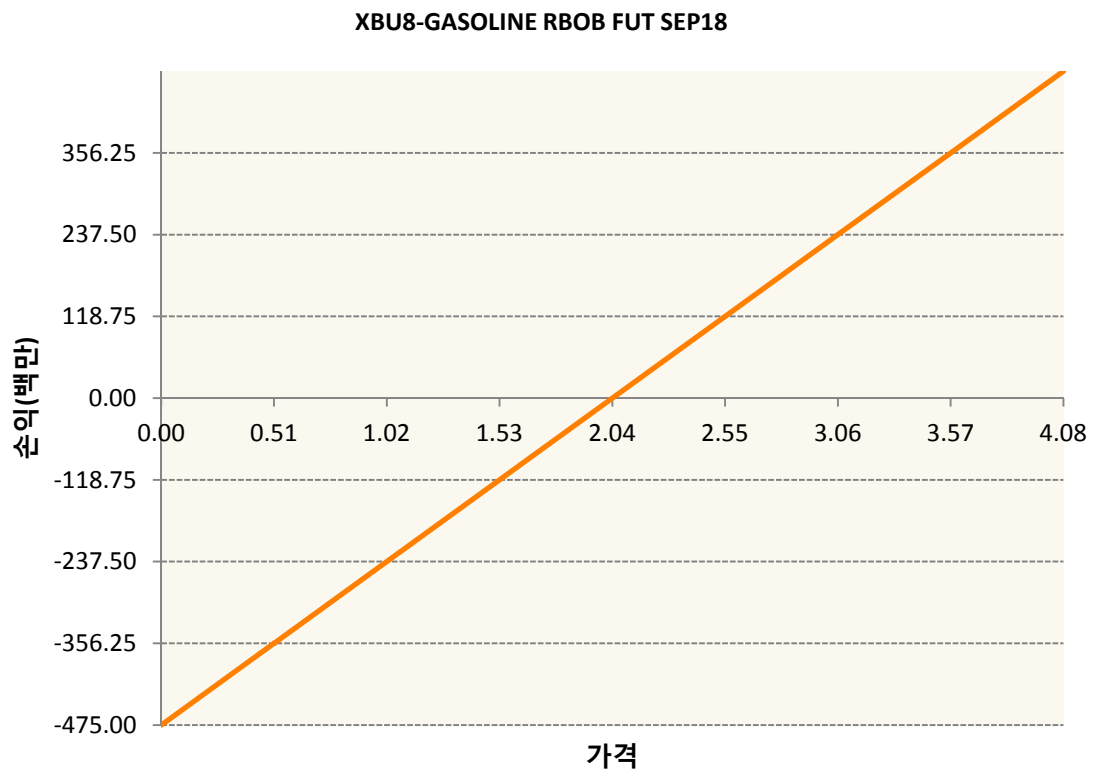
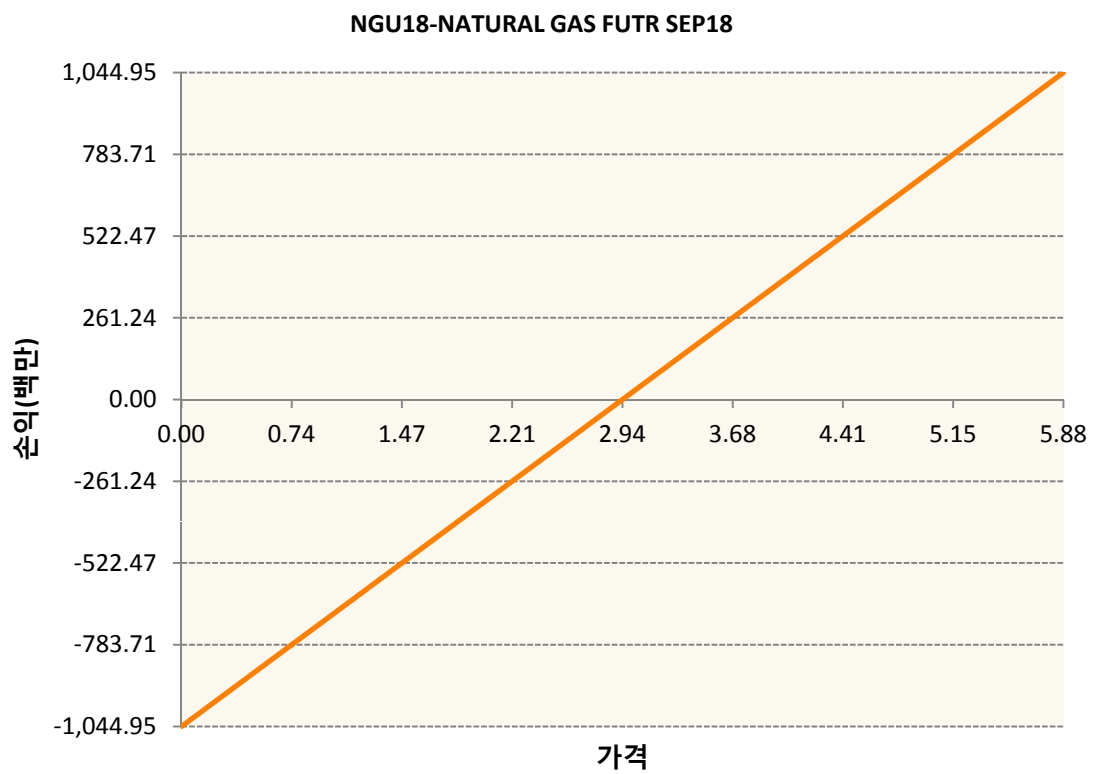
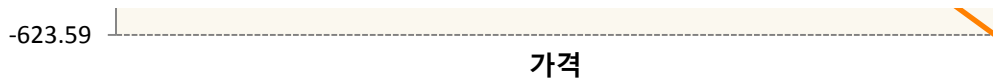
CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18



COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU8	WTI CRUDE FUTURE SEP18	60
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	72
HOU8	NY Harb ULSD Fut SEP18	40
KR4175N80C	2018-08 달러선물	50
NGU18	NATURAL GAS FUTR SEP18	84
XBU8	GASOLINE RBOB FUT SEP18	38

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

449

공시일	2018-08-14
기준일	2018-08-13

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

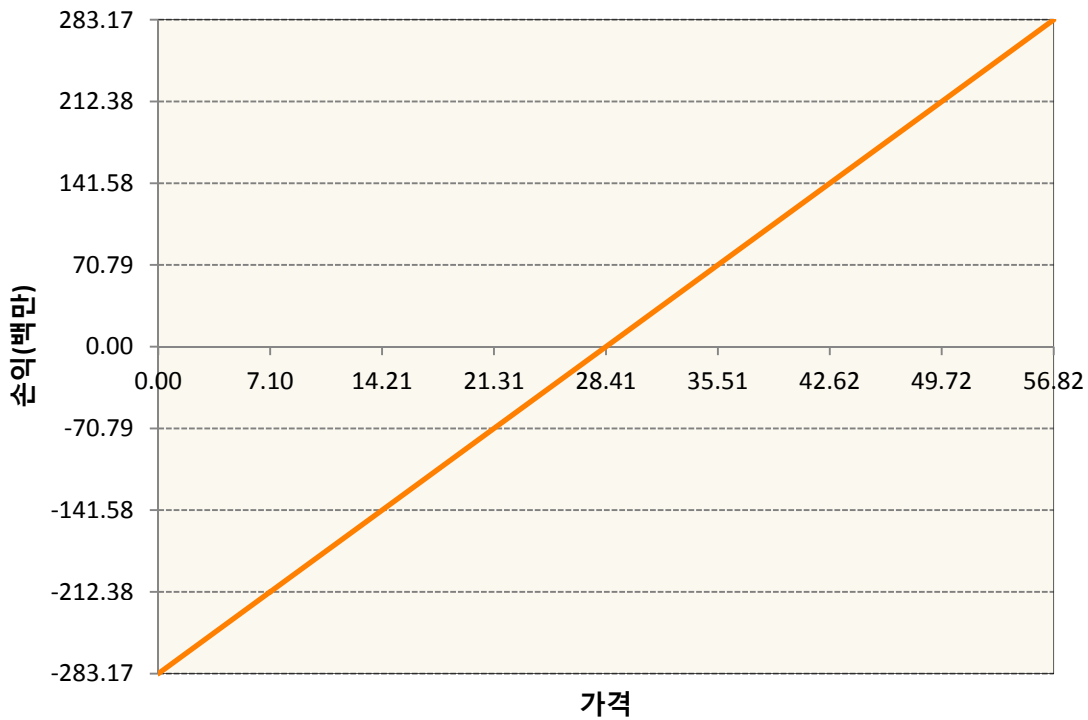
1. 계약금액

(단위:백만원)

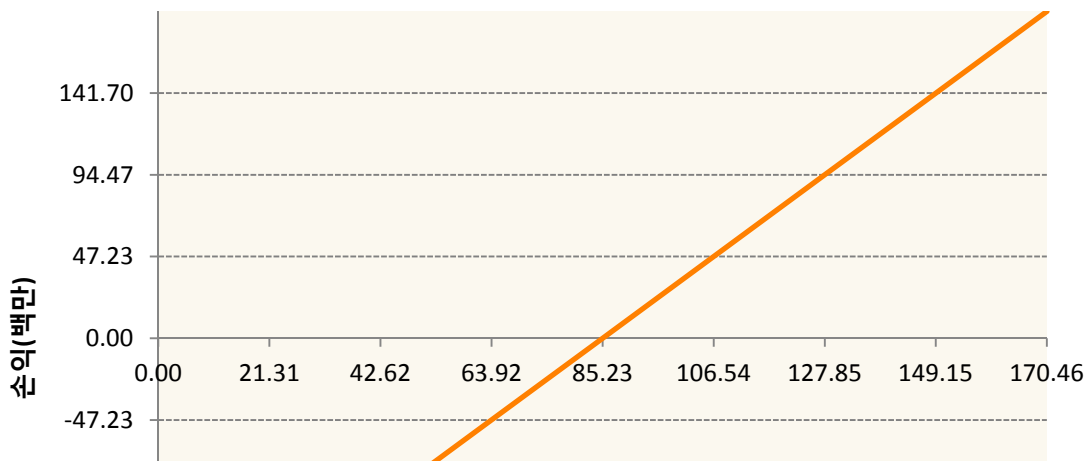
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,635	79	3,555	

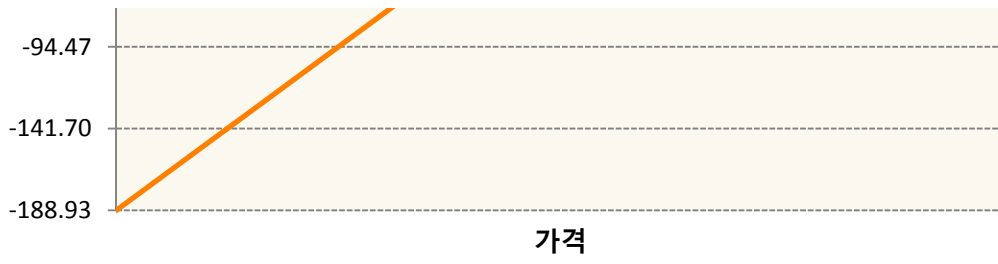
2. 만기시점의 손익구조

BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18

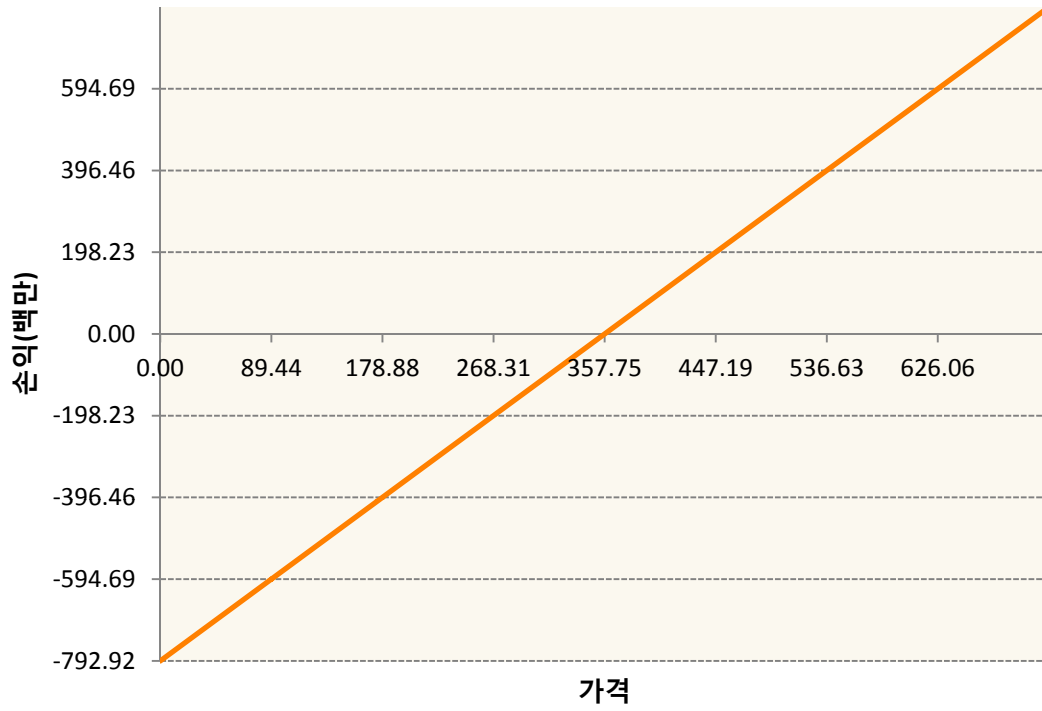


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

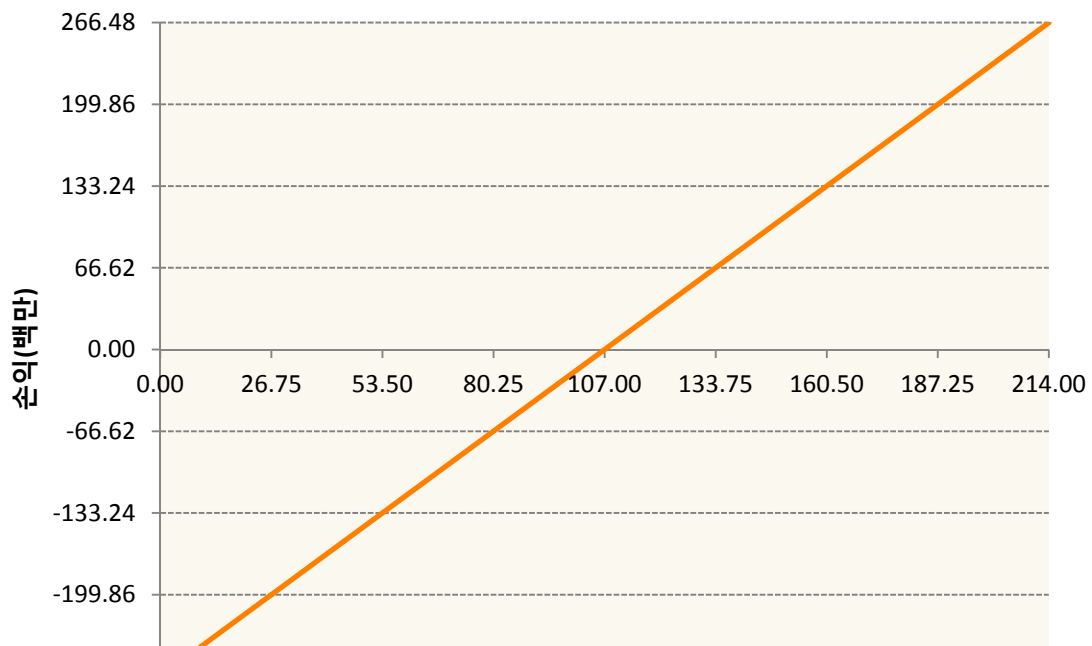


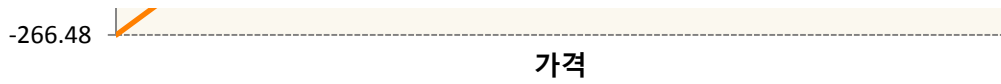


CU8-CORN FUTURE SEP18

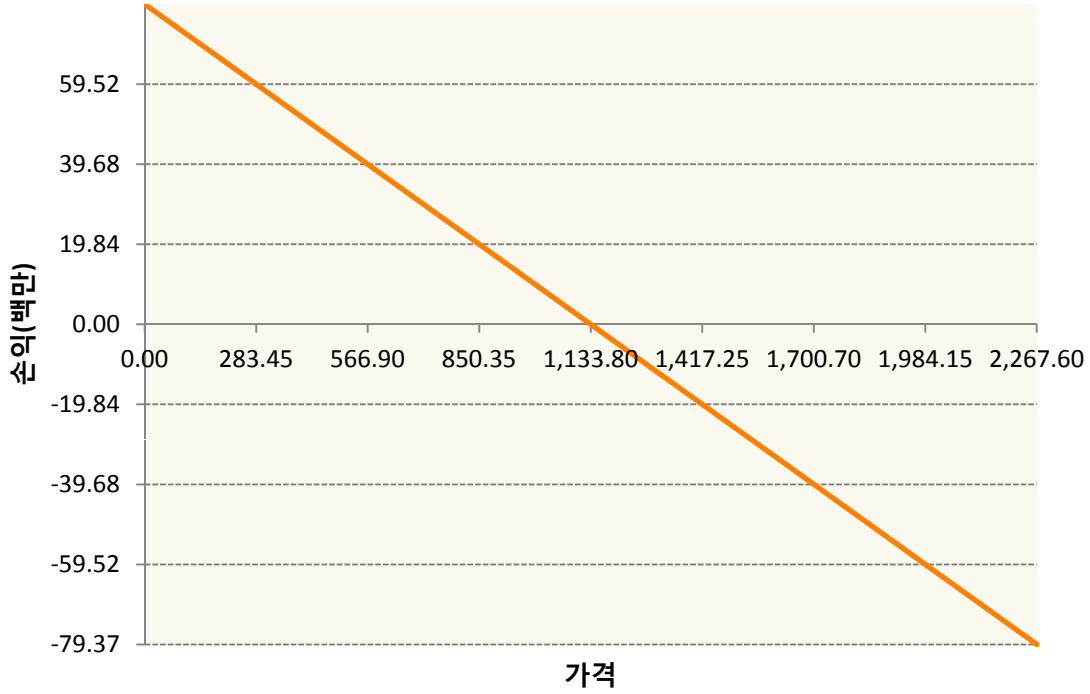


KCU8-COFFEE 'C' FUTURE SEP18

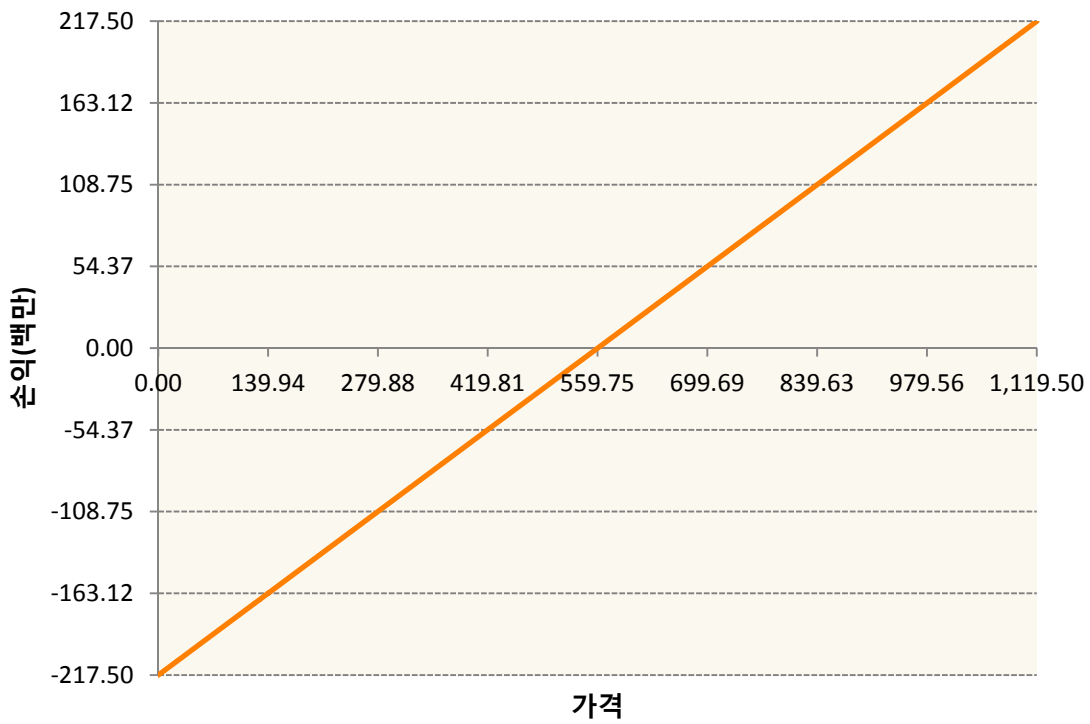




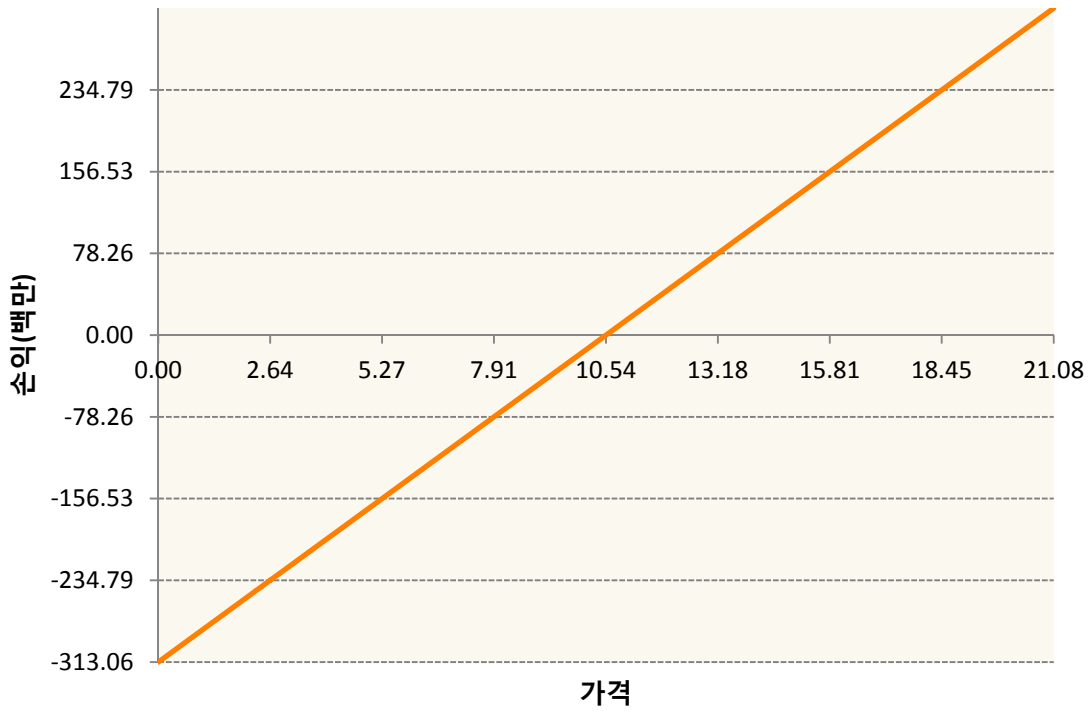
KR4175N80001-2018-08 달러선물



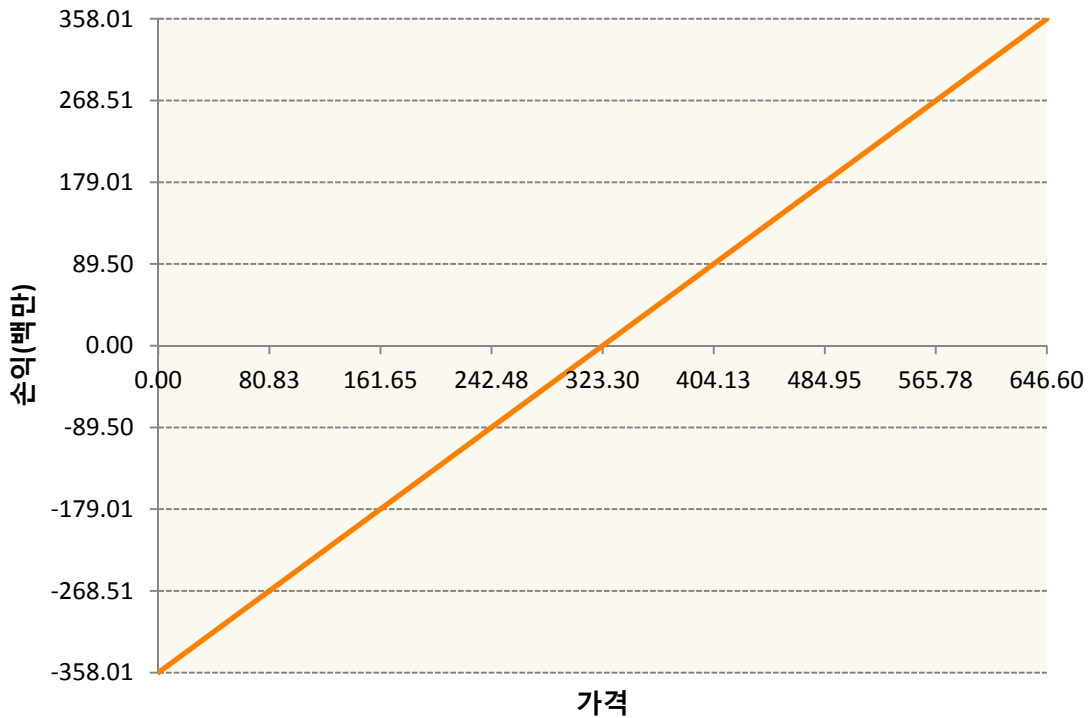
KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

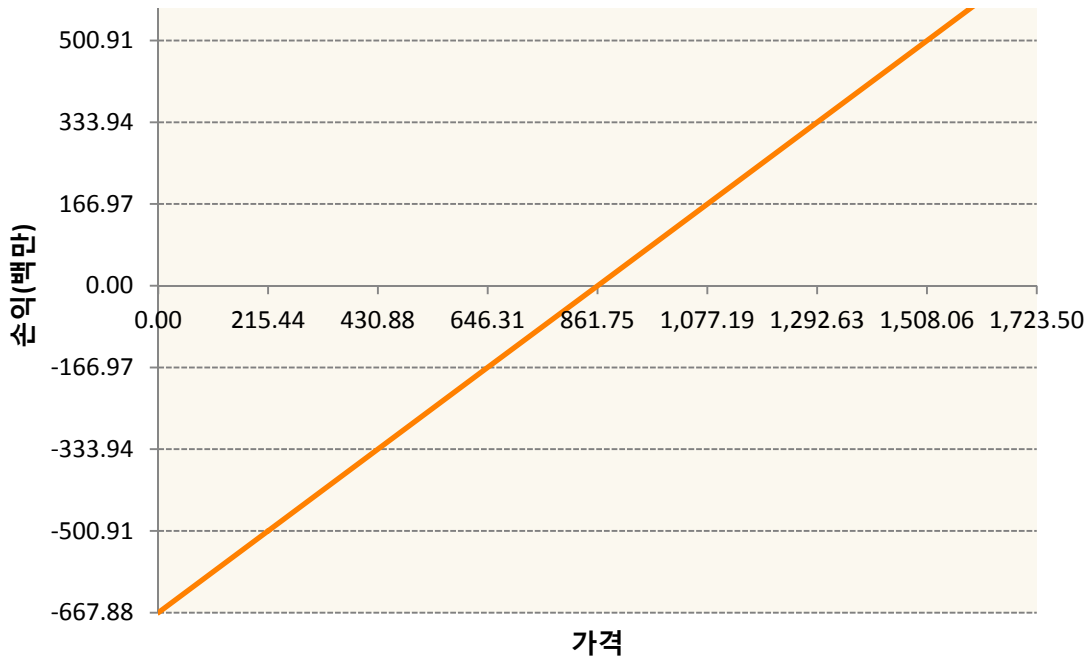


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

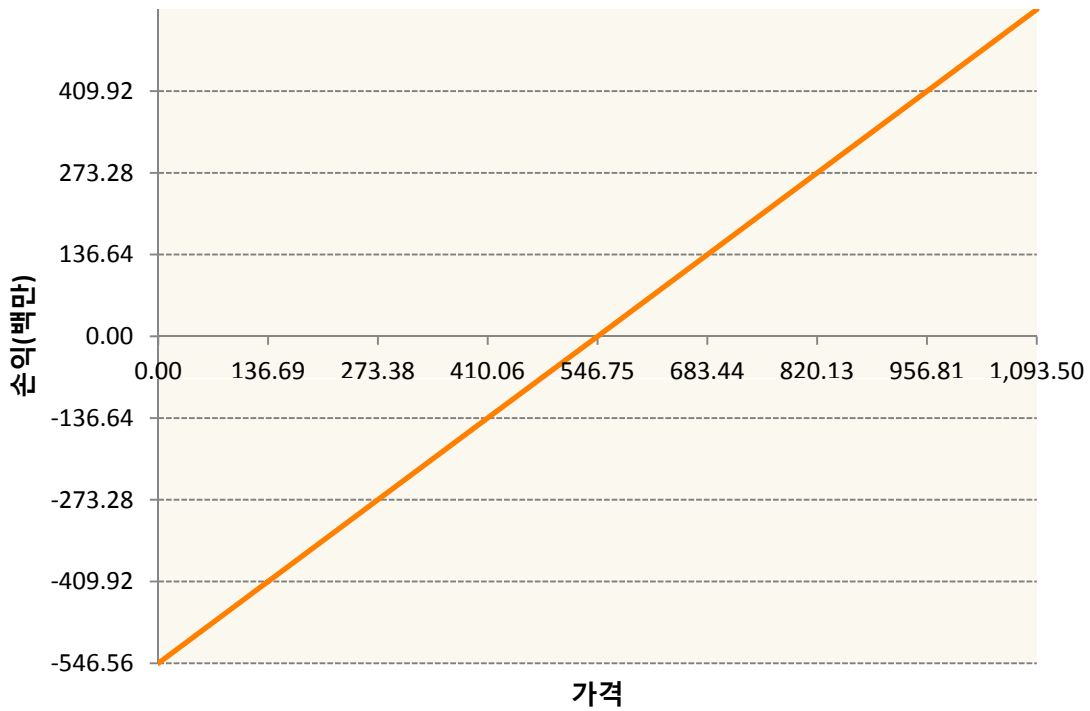


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





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	63
KCU8	COFFEE 'C' FUTURE SEP18	21
KR4175N80C	2018-08 달러선물	6

KWU8	KC HRW WHEAT FUT SEP18	17
SBV8	SUGAR #11 (WORLD) OCT18	25
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	29
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	53
WU8	WHEAT FUTURE(CBT) SEP18	44

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

(단위:백만원)

309