

공시일	2018-08-17
기준일	2018-08-16

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	2018-08-17
기준일	2018-08-16

스마트인덱스모

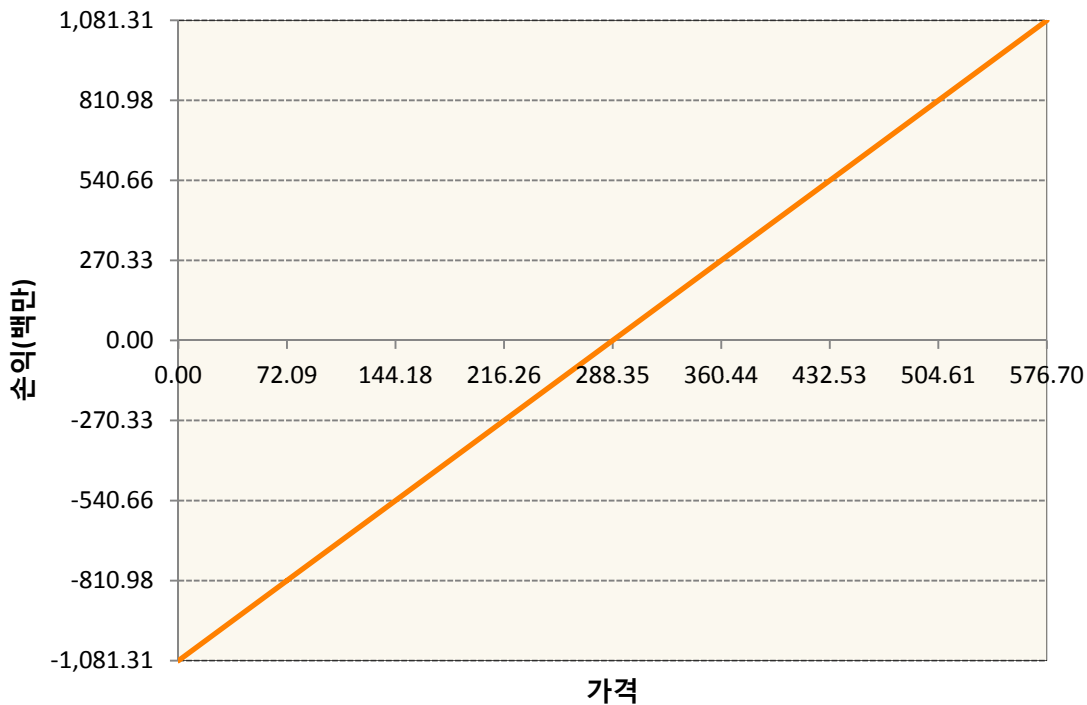
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,081	0	1,081	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물

86

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
-5.33%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	29	29	29	29	29	29	29
5.33%	58	58	58	58	58	58	58
8.00%	86	86	86	86	86	86	86

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

(단위:백만원)

66

공시일	2018-08-17
기준일	2018-08-16

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

1,121

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

475

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-17
기준일	2018-08-16

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

300

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

371

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-17
기준일	2018-08-16

유로인덱스모(주식-파생형)

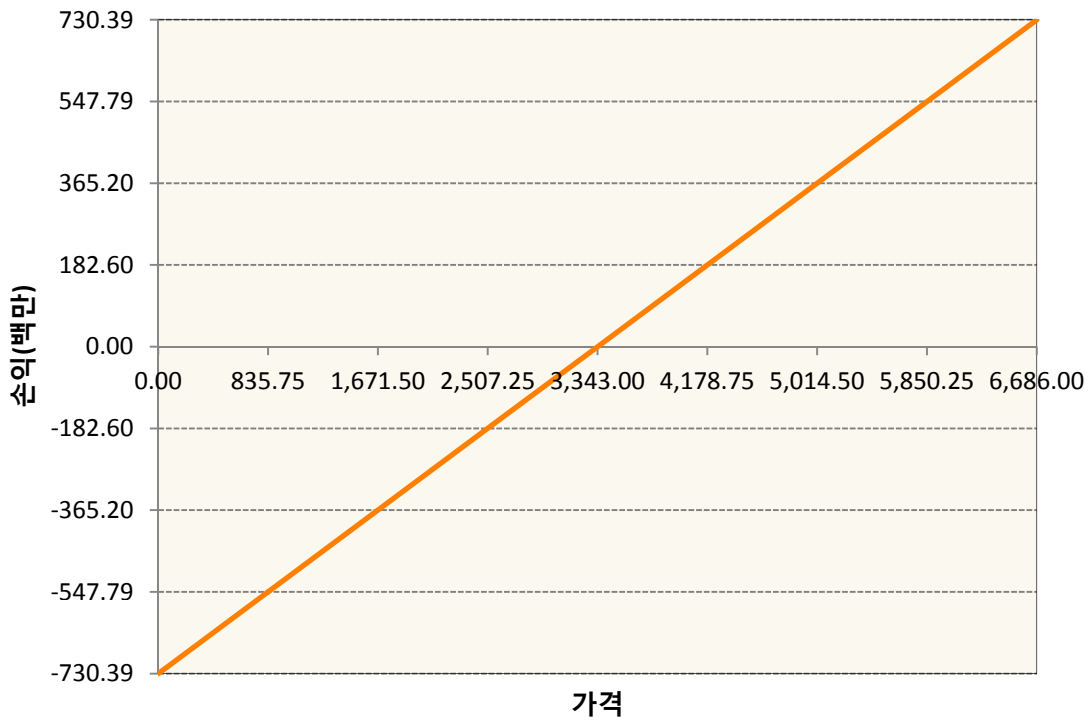
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	730	0	730	

2. 만기시점의 손익구조

VGU8-EURO STOXXX 50 SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU8	EURO STOXXX 50 SEP18	58
------	----------------------	----

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

(단위:백만원)

37

공시일	2018-08-17
기준일	2018-08-16

차이나인덱스모(주식-파생형)

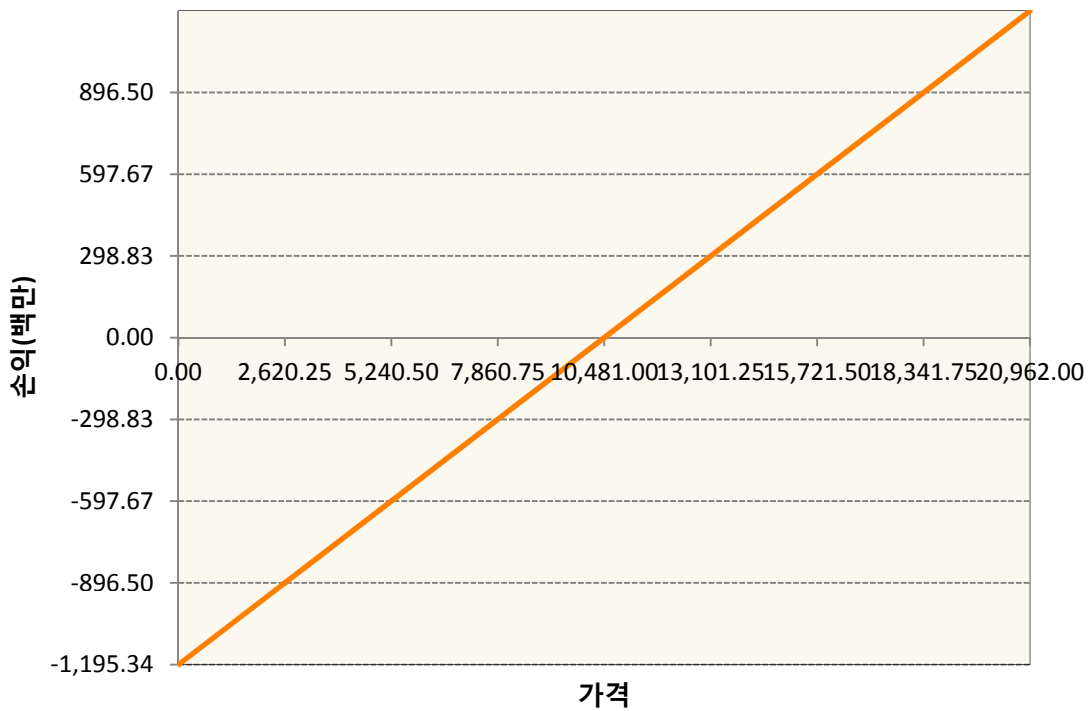
1. 계약금액

(단위:백만원)

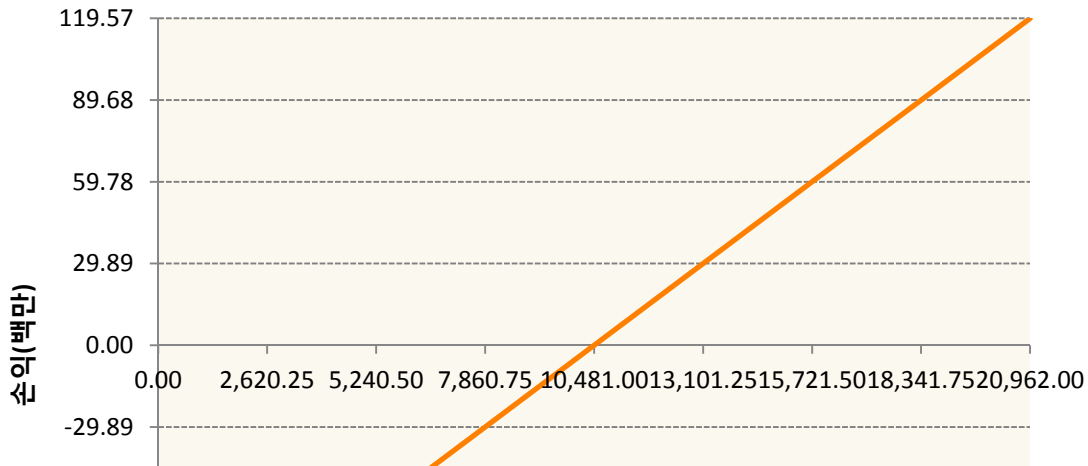
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,315	0	1,315	장내

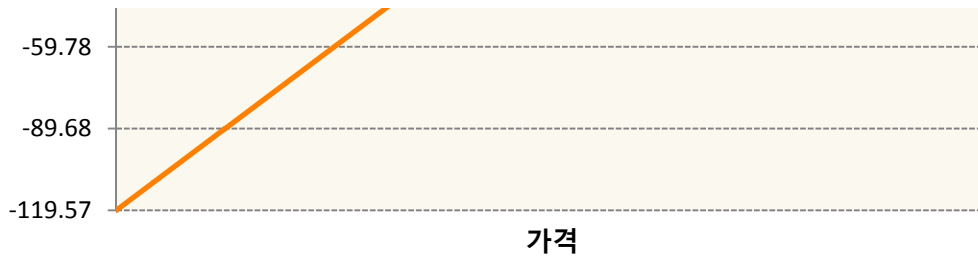
2. 만기시점의 손익구조

HCQ8-HSCEI Futures Aug18



MHCQ8-MINI H-SHR IDX FU Aug18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCQ8	HSCEI Futures Aug18	96
MHCQ8	MINI H-SHR IDX FU Aug18	10

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

96

공시일	2018-08-17
기준일	2018-08-16

커버드콜모(주식혼합-파생형)

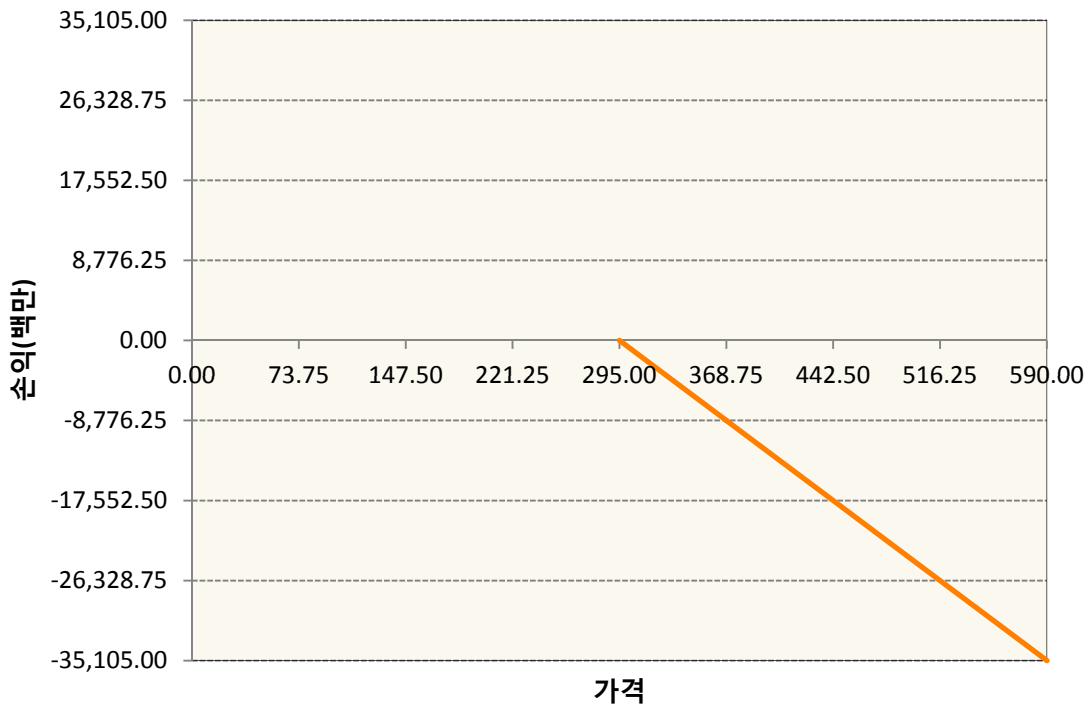
1. 계약금액

(단위:백만원)

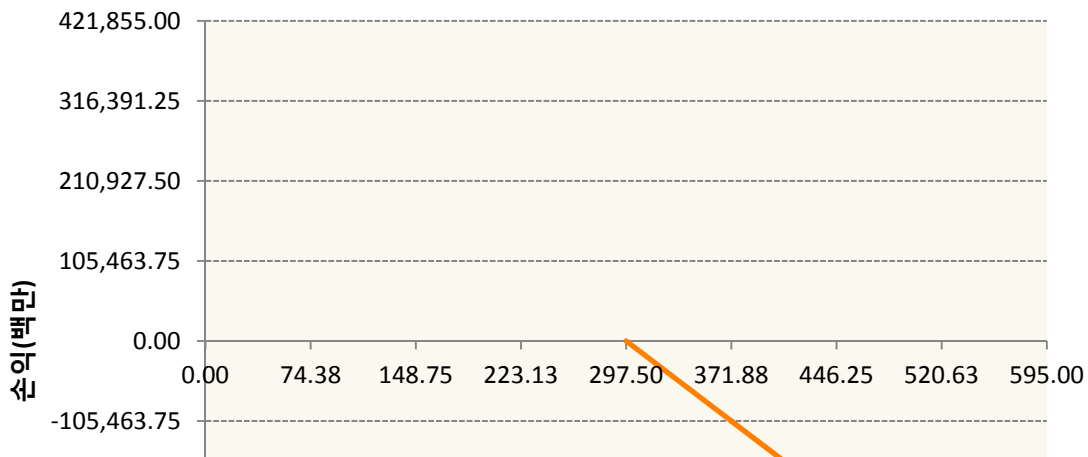
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	746,874	-746,874	장내

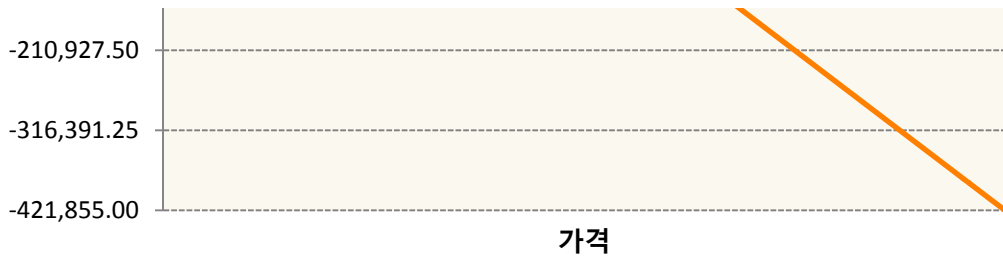
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92950-2018-09 콜295

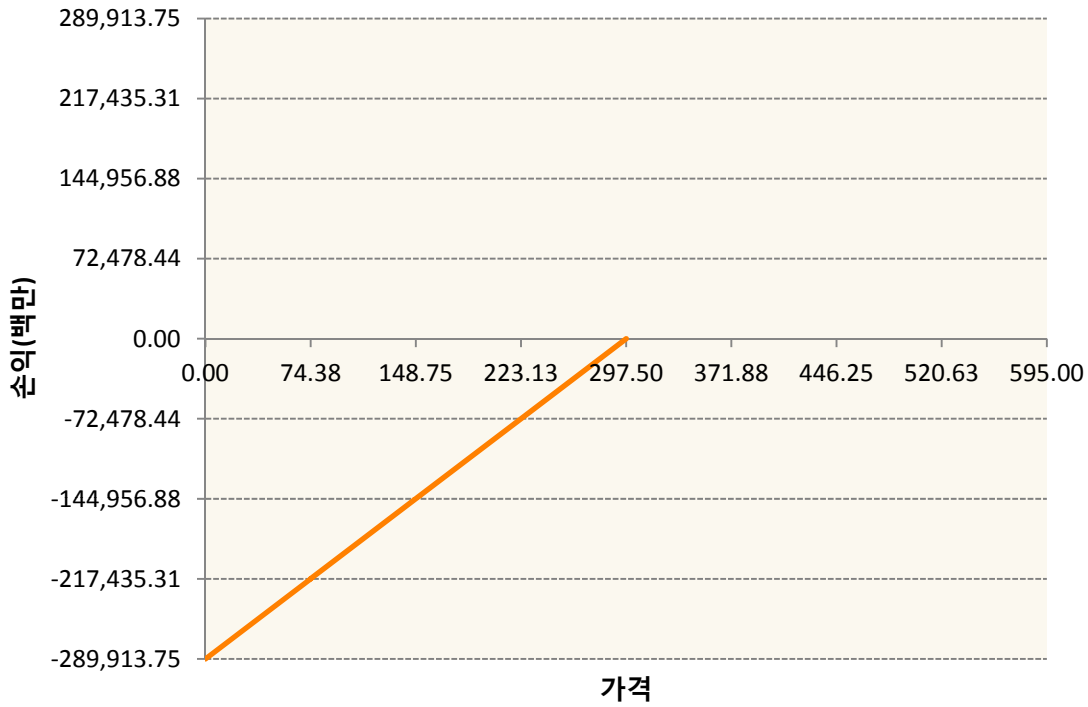


KR4201N92976-2018-09 콜297.5





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N929 2018-09 콜295

1,848

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	684	666	642	612	576	537	492
-5.33%	629	591	547	498	444	387	326
-2.67%	500	438	372	302	230	156	81
0%	250	168	84	0	-85	-171	-257
2.67%	-153	-243	-333	-423	-513	-602	-692
5.33%	-717	-799	-882	-966	-1,052	-1,138	-1,225
8.00%	-1,419	-1,481	-1,549	-1,620	-1,693	-1,770	-1,848

KR4201N929 2018-09 풋297.5

20,842

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,022	6,851	6,614	6,312	5,948	5,526	5,052

-5.33%	6,536	6,159	5,706	5,186	4,609	3,982	3,312
-2.67%	5,318	4,661	3,945	3,182	2,381	1,549	692
0%	2,845	1,918	968	0	-982	-1,974	-2,976
2.67%	-1,350	-2,422	-3,495	-4,568	-5,642	-6,716	-7,790
5.33%	-7,458	-8,491	-9,534	-10,584	-11,641	-12,702	-13,767
8.00%	-15,314	-16,154	-17,037	-17,953	-18,896	-19,860	-20,842
KR4301N929 2018-09 풋297.5							21,187
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21,148	-21,148	-21,149	-21,152	-21,159	-21,170	-21,187
-5.33%	-13,673	-13,680	-13,694	-13,718	-13,754	-13,805	-13,870
-2.67%	-6,257	-6,316	-6,397	-6,501	-6,628	-6,774	-6,940
0%	708	493	255	0	-270	-553	-845
2.67%	6,146	5,779	5,411	5,042	4,672	4,302	3,931
5.33%	9,126	8,821	8,503	8,176	7,842	7,502	7,157
8.00%	10,140	10,009	9,850	9,666	9,461	9,236	8,994

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

(단위:백만원)

43,297

공시일	2018-08-17
기준일	2018-08-16

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

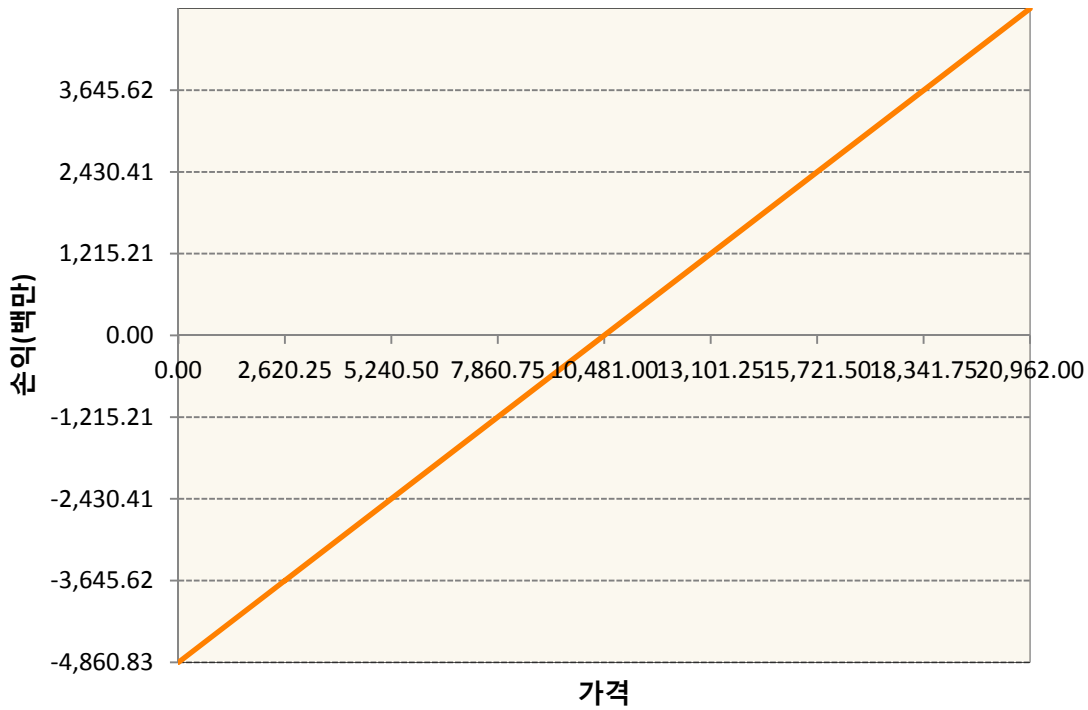
1. 계약금액

(단위:백만원)

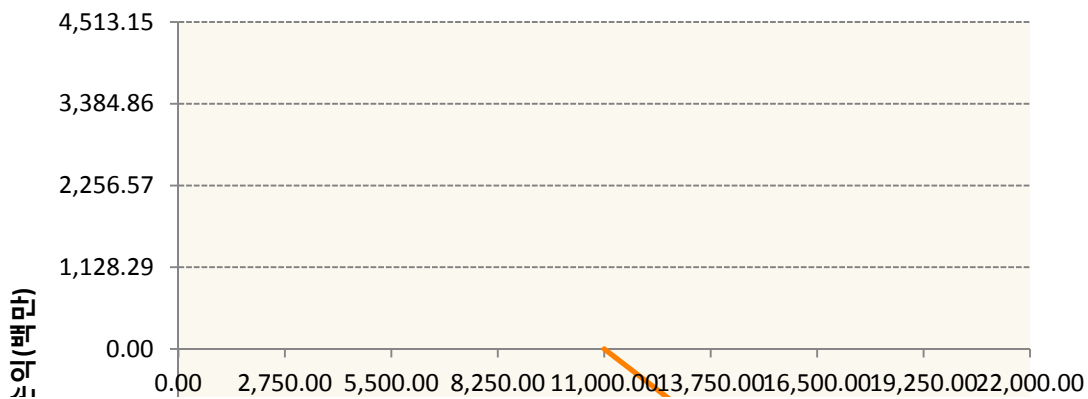
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,861	0	4,861	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,606	-11,606	장내

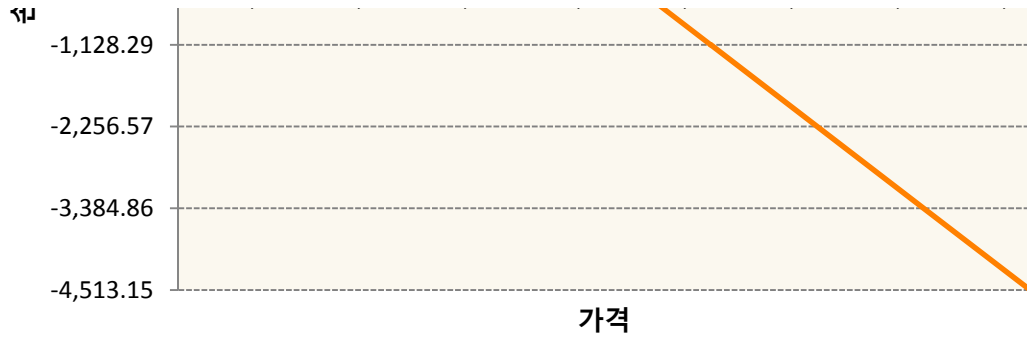
2. 만기시점의 손익구조

HCQ8-HSCEI Futures Aug18

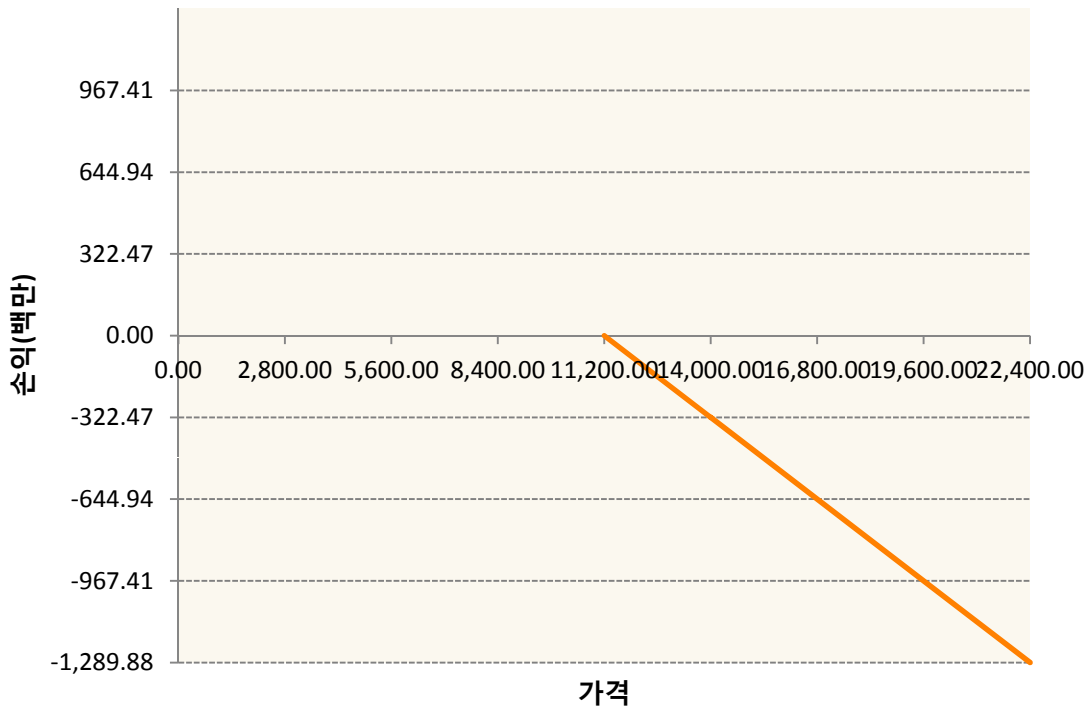


OHHIQ8-C110-HSCEI

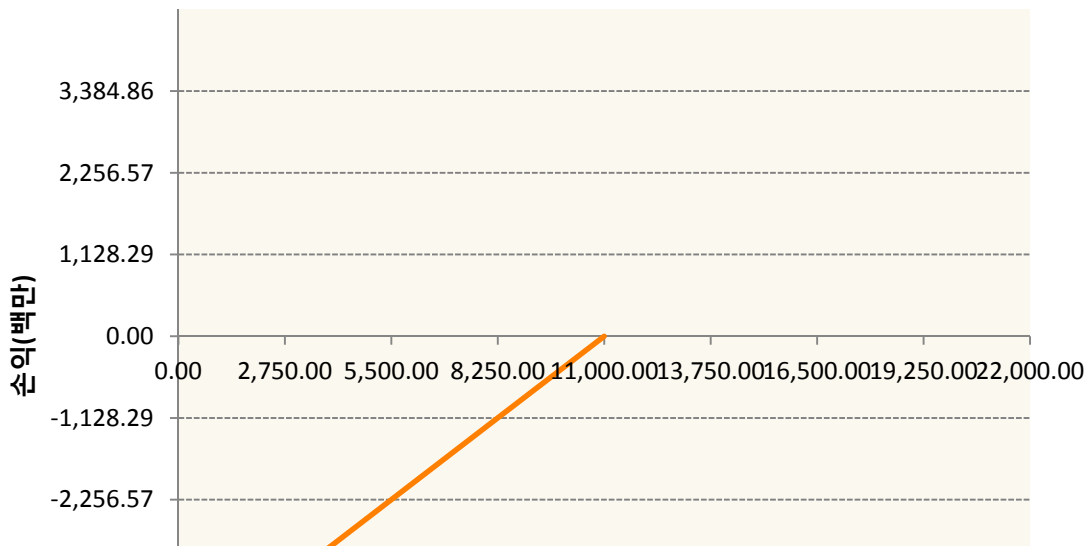


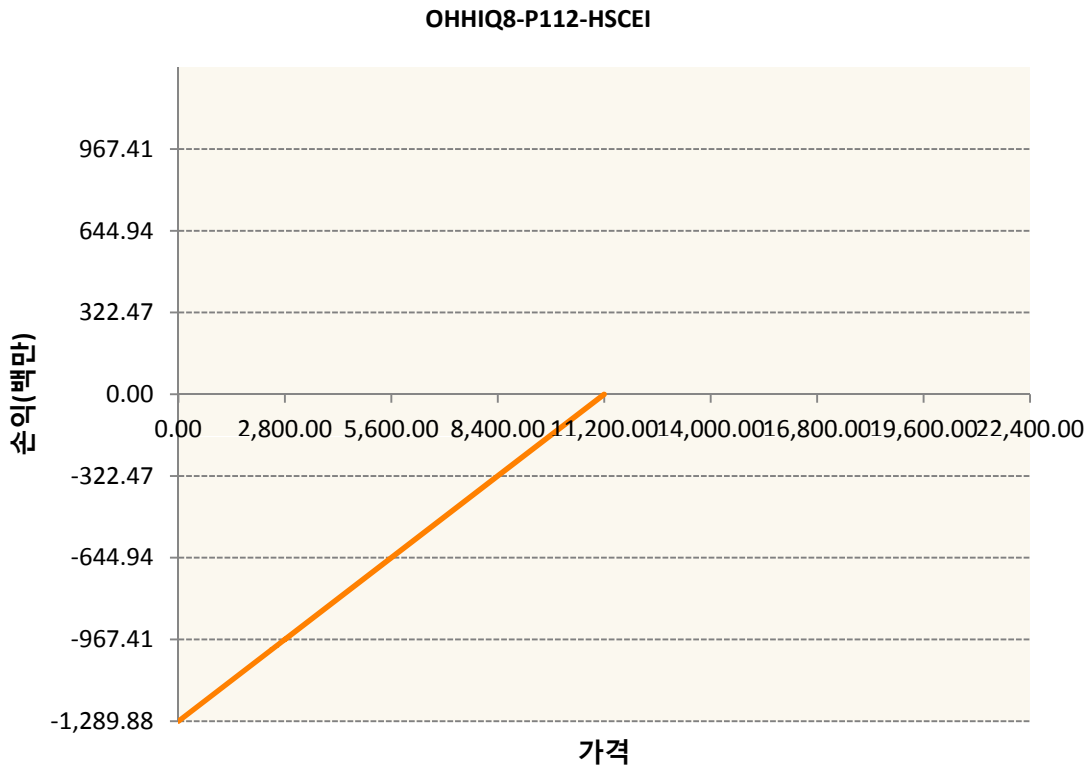
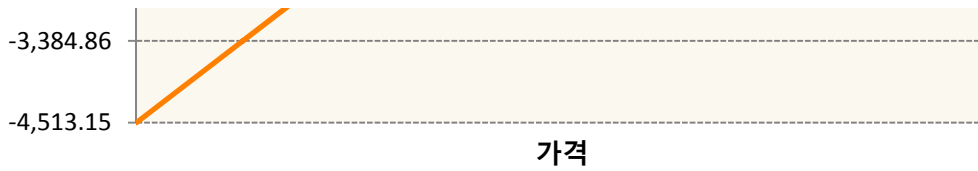


OHHIQ8-C112-HSCEI



OHHIQ8-P110-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ8	HSCEI Futures Aug18	389
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)
	1,204

공시일	2018-08-17
기준일	2018-08-16

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

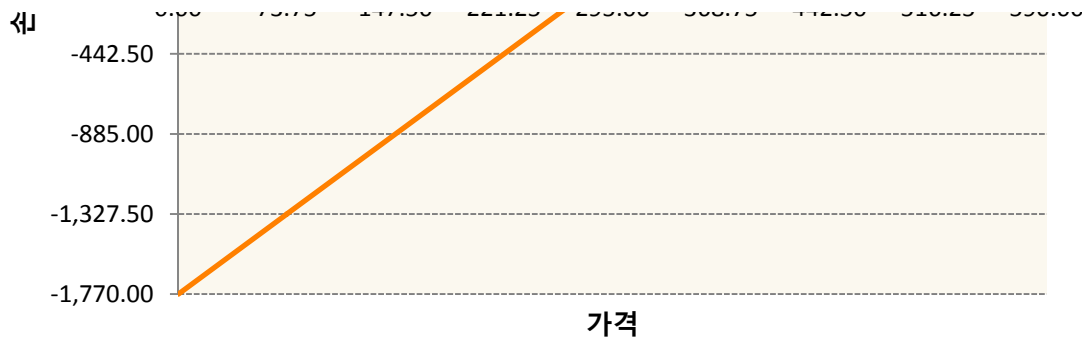
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92976-2018-09 콜297.5

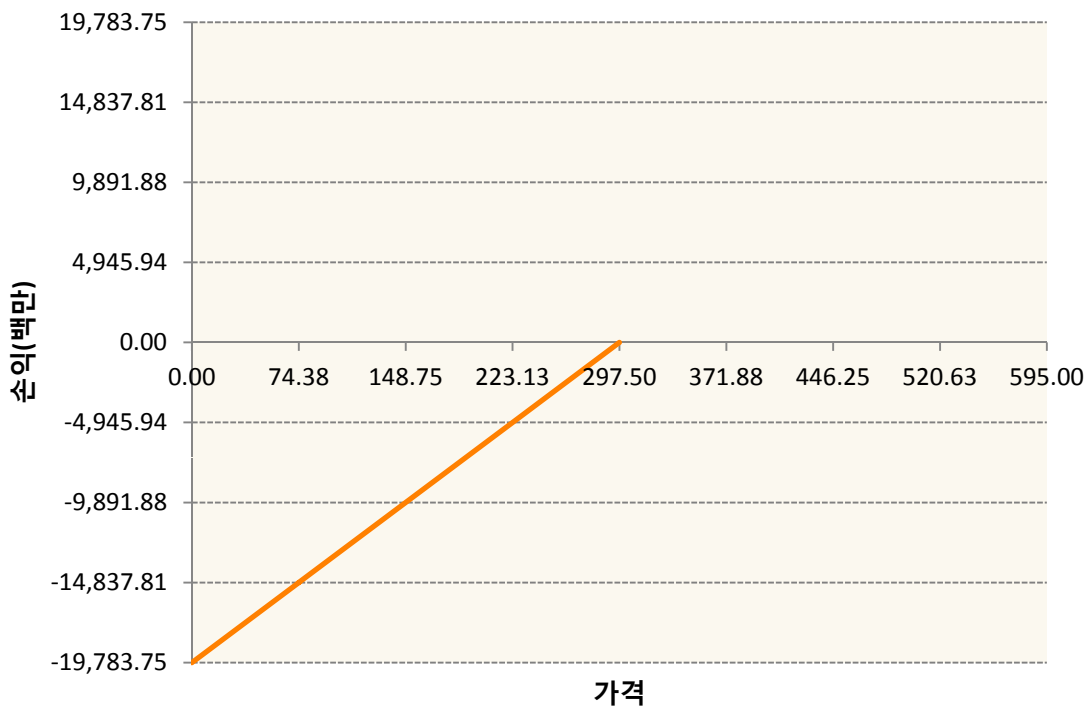


KR4301N92958-2018-09 풋295





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBСSFXC1 INDEX_14							3,973
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,973	-3,973	-3,973	-3,973	-3,973	-3,973	-3,973
-5.33%	-2,648	-2,648	-2,648	-2,648	-2,648	-2,648	-2,648
-2.67%	-1,324	-1,324	-1,324	-1,324	-1,324	-1,324	-1,324
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,324	1,324	1,324	1,324	1,324	1,324	1,324
5.33%	2,648	2,648	2,648	2,648	2,648	2,648	2,648
8.00%	3,973	3,973	3,973	3,973	3,973	3,973	3,973
KR4201N92974-2018-09 풋297.5							1,389
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	468	457	441	421	396	368	337
-5.33%	436	410	380	346	307	265	221
-2.67%	354	311	263	212	159	103	46
0%	190	128	65	0	-65	-132	-198
2.67%	-90	-161	-233	-304	-376	-448	-519
5.33%	-497	-566	-635	-705	-776	-847	-917
8.00%	-1,021	-1,077	-1,135	-1,196	-1,259	-1,324	-1,389

KR4301N929 2018-09 풋295

127

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127
-5.33%	-81	-81	-81	-81	-82	-82	-83
-2.67%	-35	-36	-37	-38	-39	-40	-41
0%	5	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	34	32	30	27	25	23	21
5.33%	48	46	45	43	41	39	37
8.00%	52	51	50	50	49	48	46

KR4301N929 2018-09 풋297.5

1,446

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,443	-1,443	-1,443	-1,443	-1,444	-1,445	-1,446
-5.33%	-933	-934	-934	-936	-939	-942	-947
-2.67%	-427	-431	-437	-444	-452	-462	-474
0%	48	34	17	0	-18	-38	-58
2.67%	419	394	369	344	319	294	268
5.33%	623	602	580	558	535	512	488
8.00%	692	683	672	660	646	630	614

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

(단위:백만원)

6,933

공시일	2018-08-17
기준일	2018-08-16

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

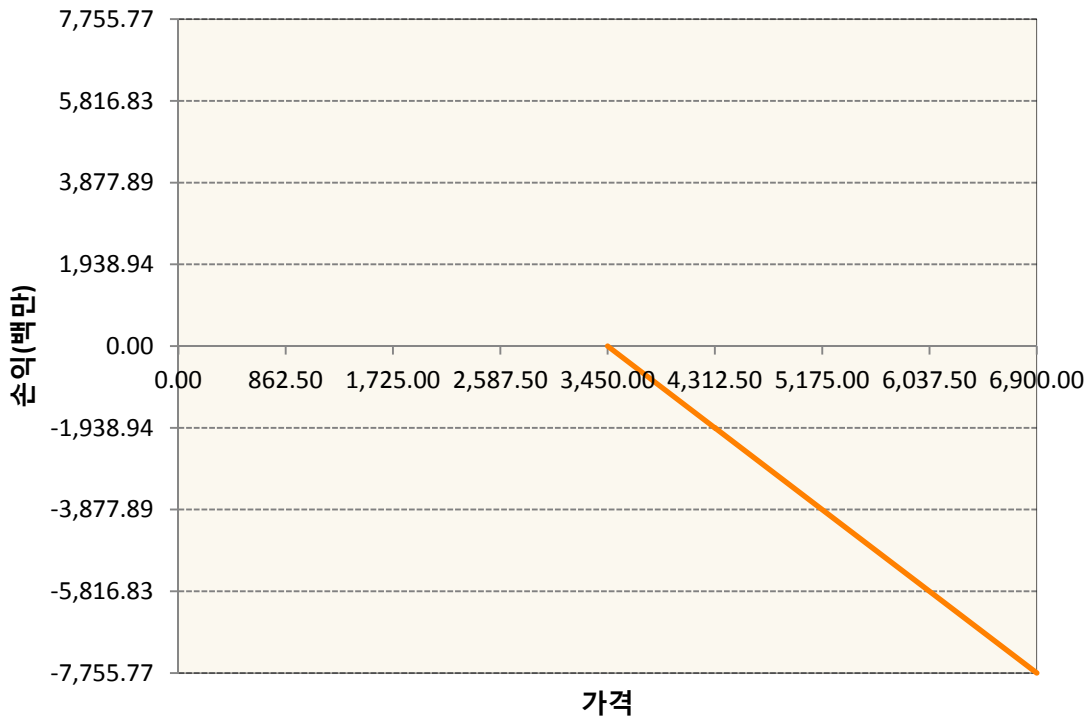
1. 계약금액

(단위:백만원)

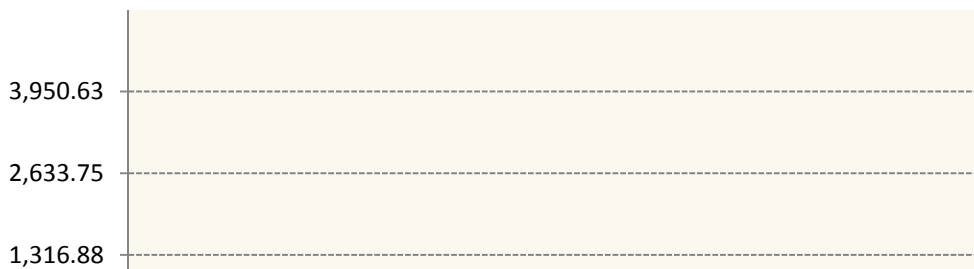
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,690	0	5,690	
누계	유가증권	옵션	0	20,784	-20,784	장내
누계	지수	스왑	86,073	0	86,073	장외

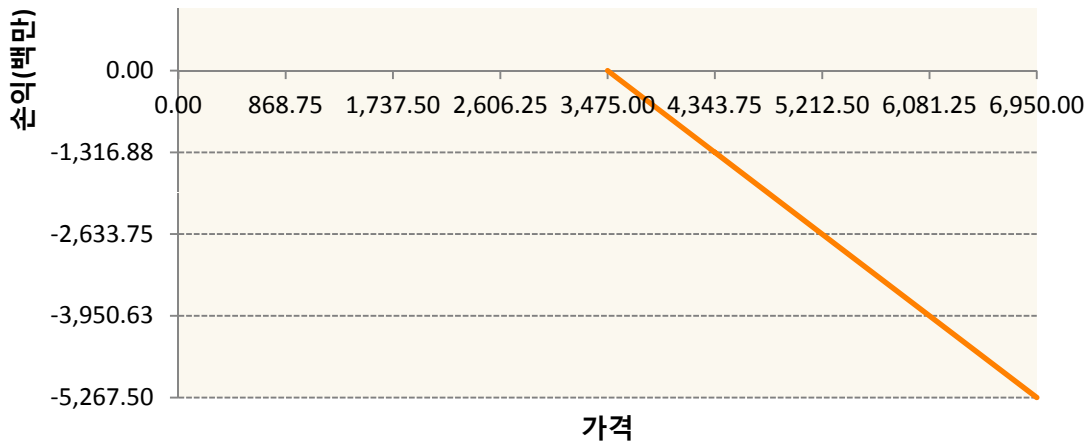
2. 만기시점의 손익구조

OESXQ8-C3450-EURO STOXX 50 OPT

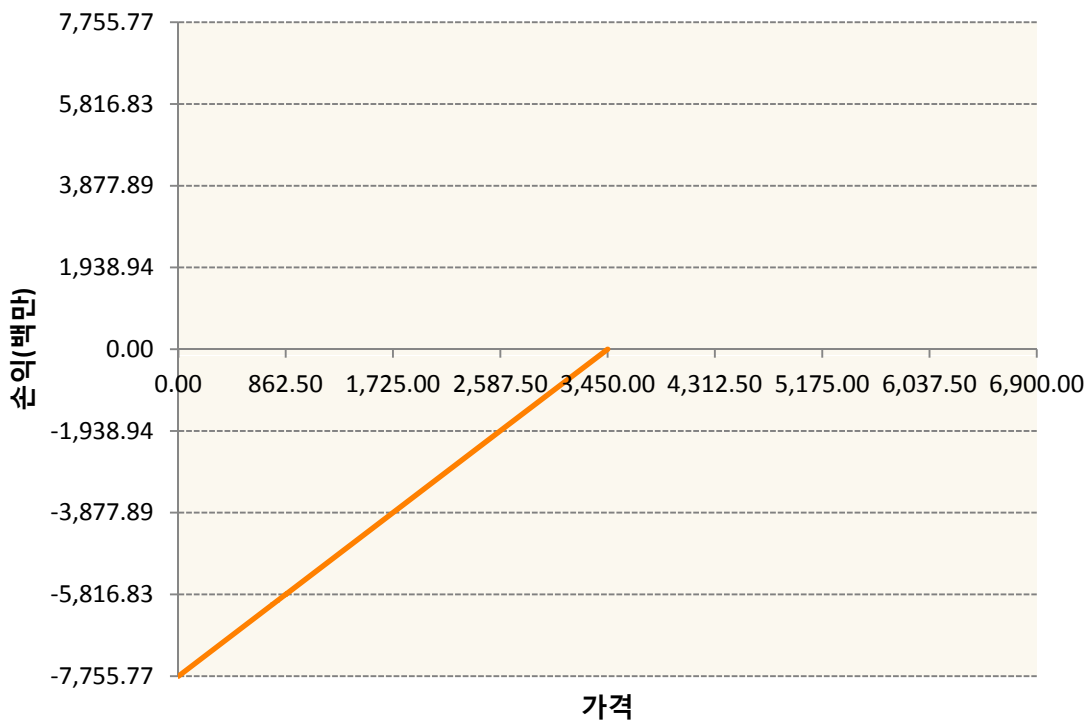


OESXQ8-C3475-EURO STOXX 50 OPT

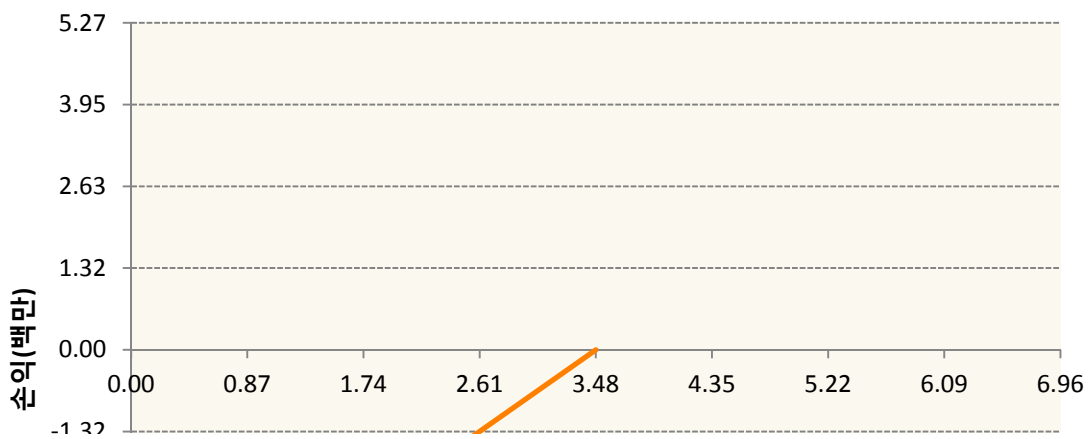


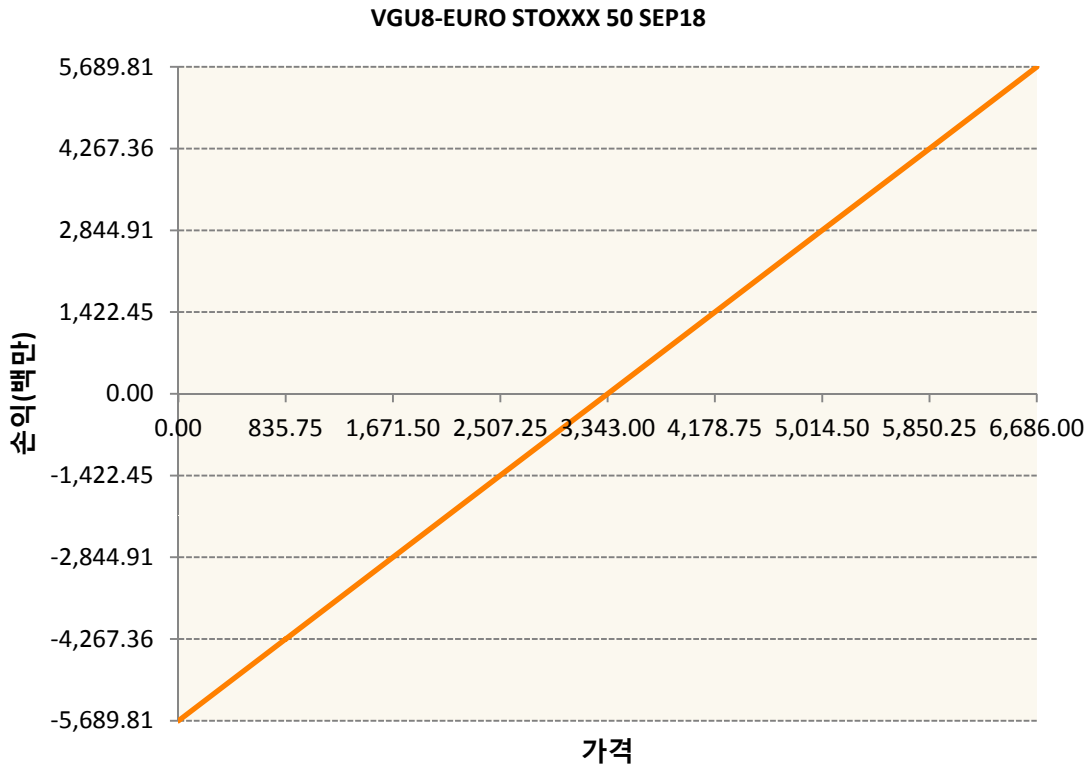
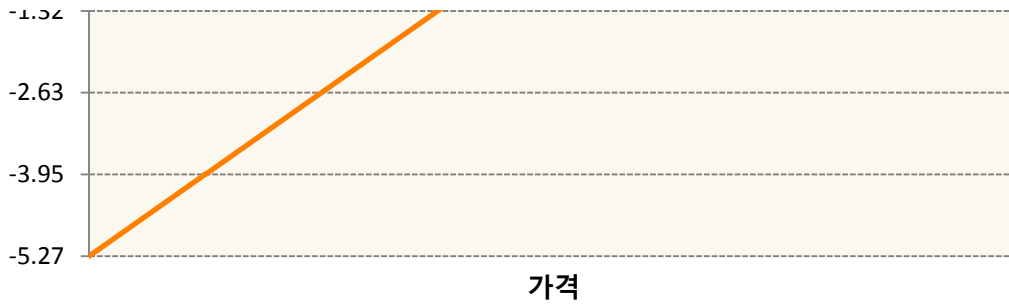


OESXQ8-P3450-EURO STOXX 50



OESXQ8-P3475-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	71
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	46
OESXQ8-C3 EURO STOXX 50 OPT	620
OESXQ8-C3 EURO STOXX 50 OPT	421
OESXQ8-P3 EURO STOXX 50	620
OESXQ8-P3 EURO STOXX 50	0.4
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18	455

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

1,406

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

(단위:백만원)

1,112

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

(단위:백만원)

88

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

(단위:백만원)

131

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

(단위:백만원)

160

공시일	2018-08-17
기준일	2018-08-16

스마트KRX300인덱스목표전환형1

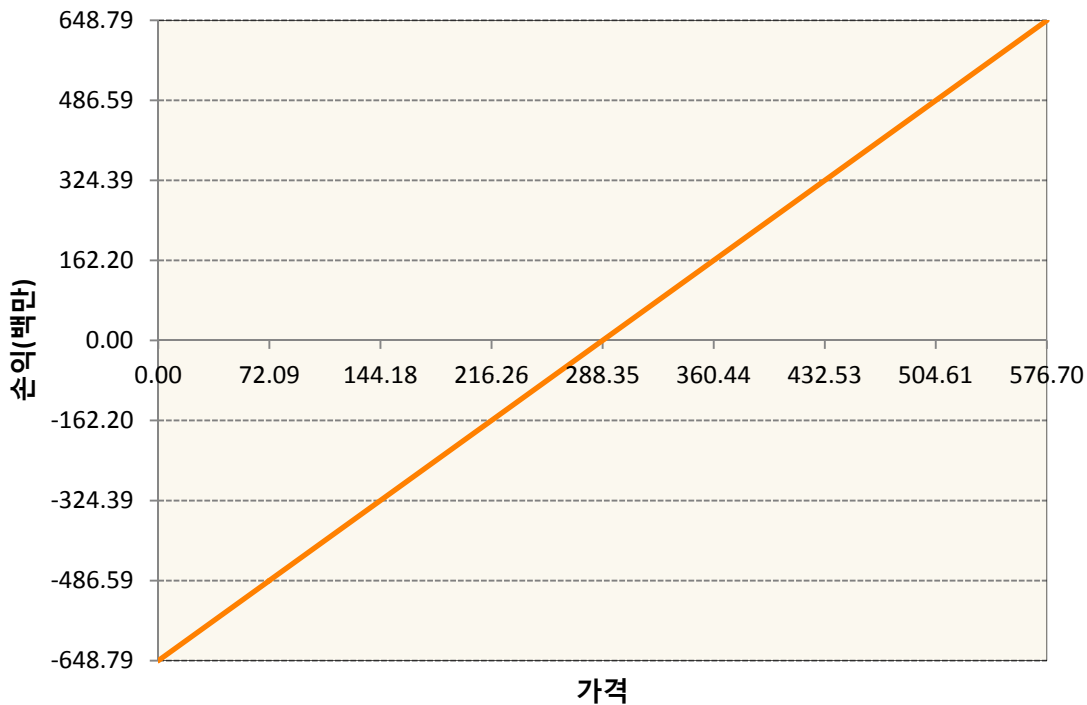
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	649	0	649	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N900 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)

39

공시일	2018-08-17
기준일	2018-08-16

리디파인K200(주식혼합-파생재간

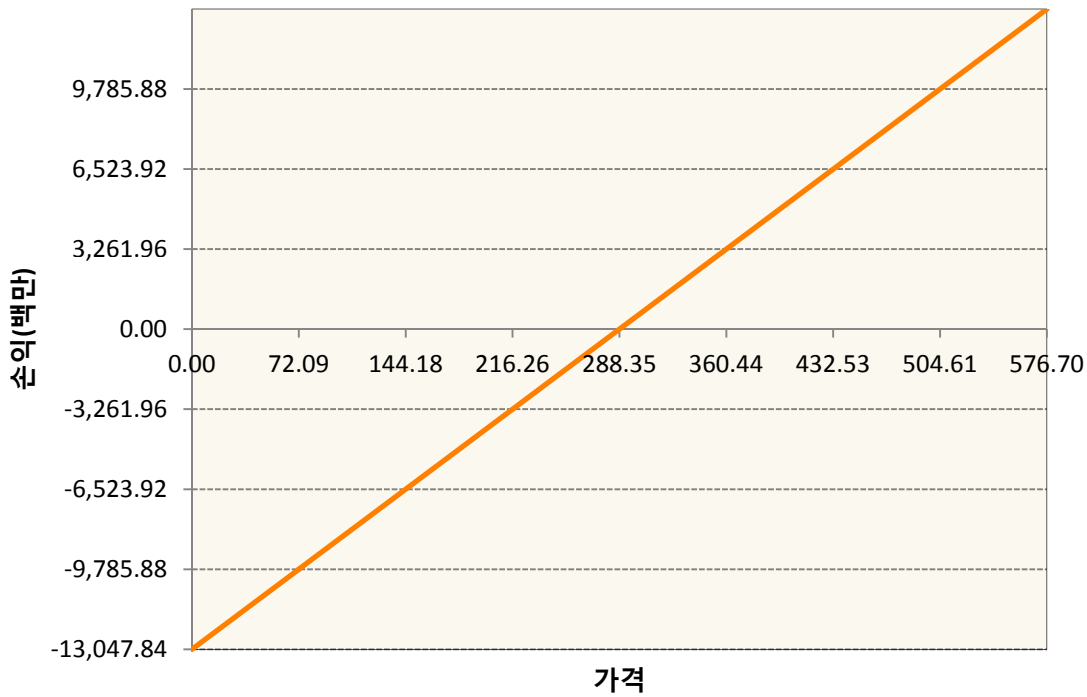
1. 계약금액

(단위:백만원)

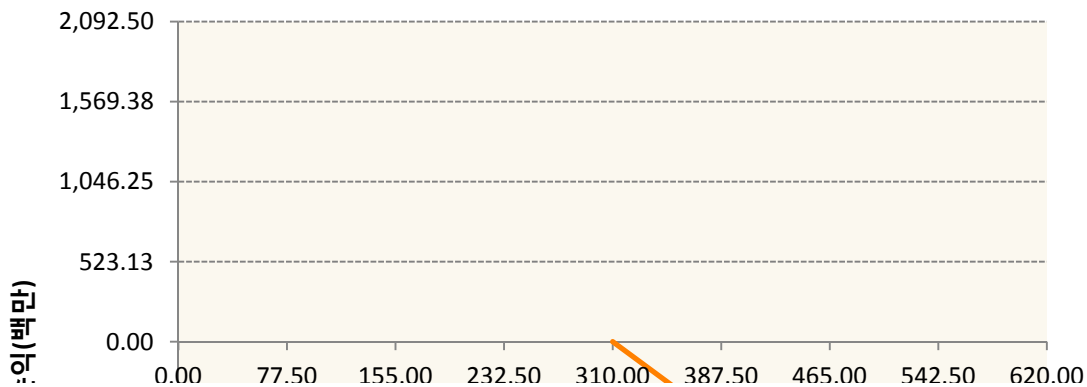
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,048	0	13,048	장내
누계	유가증권	옵션	1,339	24,358	-23,019	장내

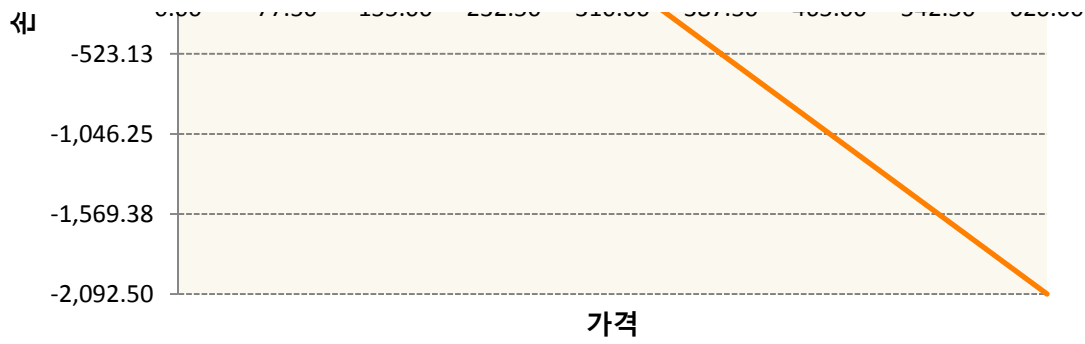
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

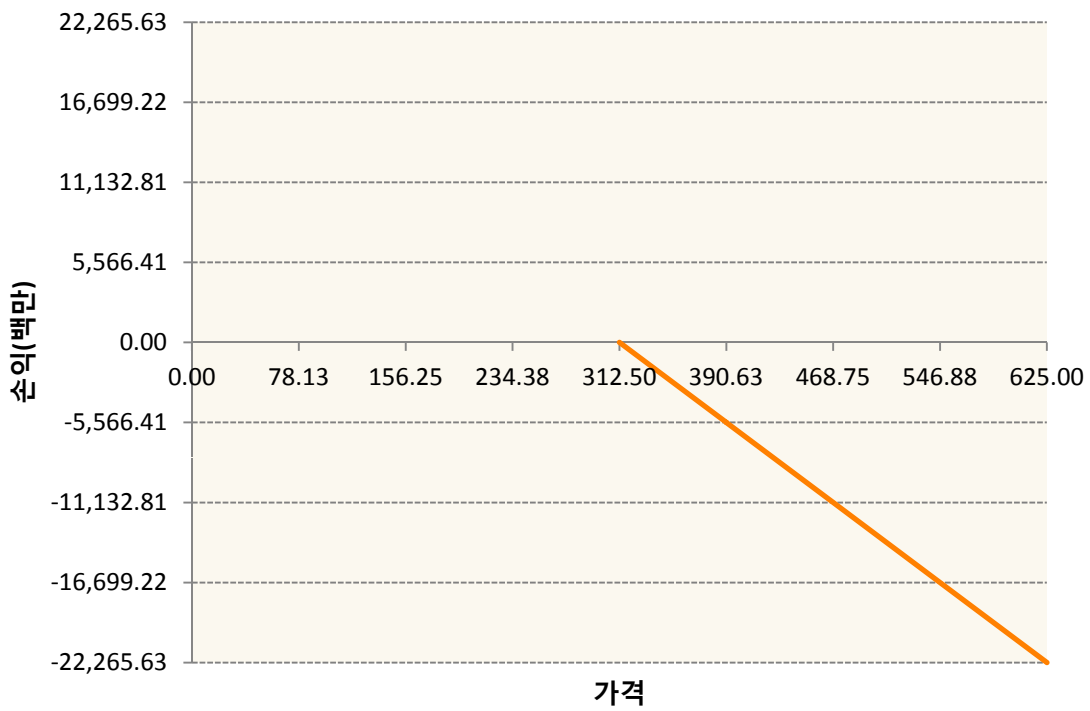


KR4201N93107-2018-09 콜310

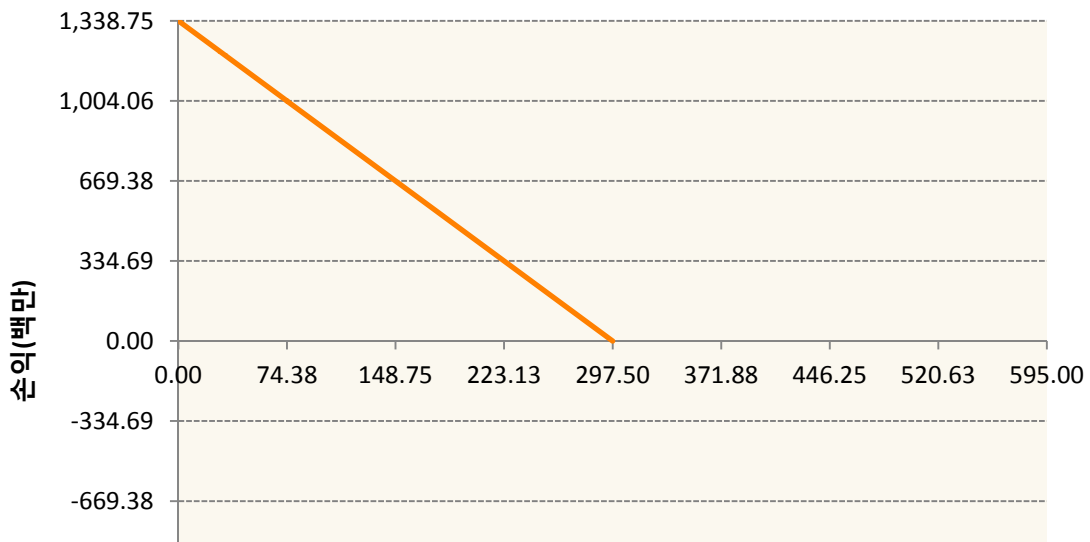


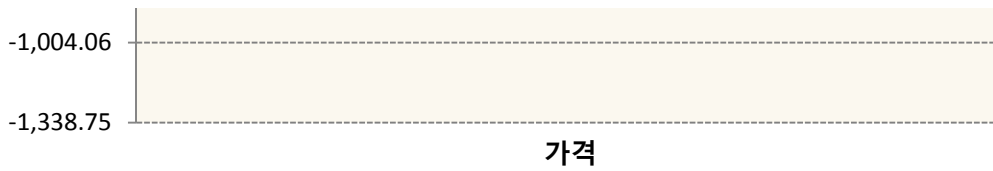


KR4201N93123-2018-09 콜312.5



KR4301N92974-2018-09 풋297.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물								1,043
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,043	-1,043	-1,043	-1,043	-1,043	-1,043	-1,043	-1,043
-5.33%	-696	-696	-696	-696	-696	-696	-696	-696
-2.67%	-348	-348	-348	-348	-348	-348	-348	-348
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	348	348	348	348	348	348	348	348
5.33%	696	696	696	696	696	696	696	696
8.00%	1,043	1,043	1,043	1,043	1,043	1,043	1,043	1,043
KR4201N931 2018-09 콜310								70
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	14	14	14	13	12	11	10	10
-5.33%	14	13	12	11	10	8	6	6
-2.67%	12	11	9	7	5	2	-1	-1
0%	9	6	3	0	-3	-7	-11	-11
2.67%	0	-4	-8	-12	-16	-21	-26	-26
5.33%	-15	-20	-25	-30	-35	-40	-45	-45
8.00%	-38	-44	-49	-54	-60	-65	-70	-70
KR4201N931 2018-09 콜312.5								684
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	124	122	119	115	109	100	89	89
-5.33%	121	116	109	99	86	71	52	52
-2.67%	110	98	83	65	43	18	-9	-9
0%	79	57	30	0	-33	-68	-106	-106
2.67%	9	-28	-68	-110	-154	-199	-246	-246
5.33%	-125	-175	-226	-278	-331	-384	-437	-437
8.00%	-343	-400	-457	-514	-571	-627	-684	-684
KR4301N92C 2018-09 풋297.5								98
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	98	98	98	98	98	98	98	98
-5.33%	63	63	63	63	64	64	64	64
-2.67%	29	29	30	30	31	31	32	32

0%	-3	-2	-1	0	1	3	4
2.67%	-28	-27	-25	-23	-22	-20	-18
5.33%	-42	-41	-39	-38	-36	-35	-33
8.00%	-47	-46	-45	-45	-44	-43	-42

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

(단위:백만원)

1,391

공시일	2018-08-17
기준일	2018-08-16

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

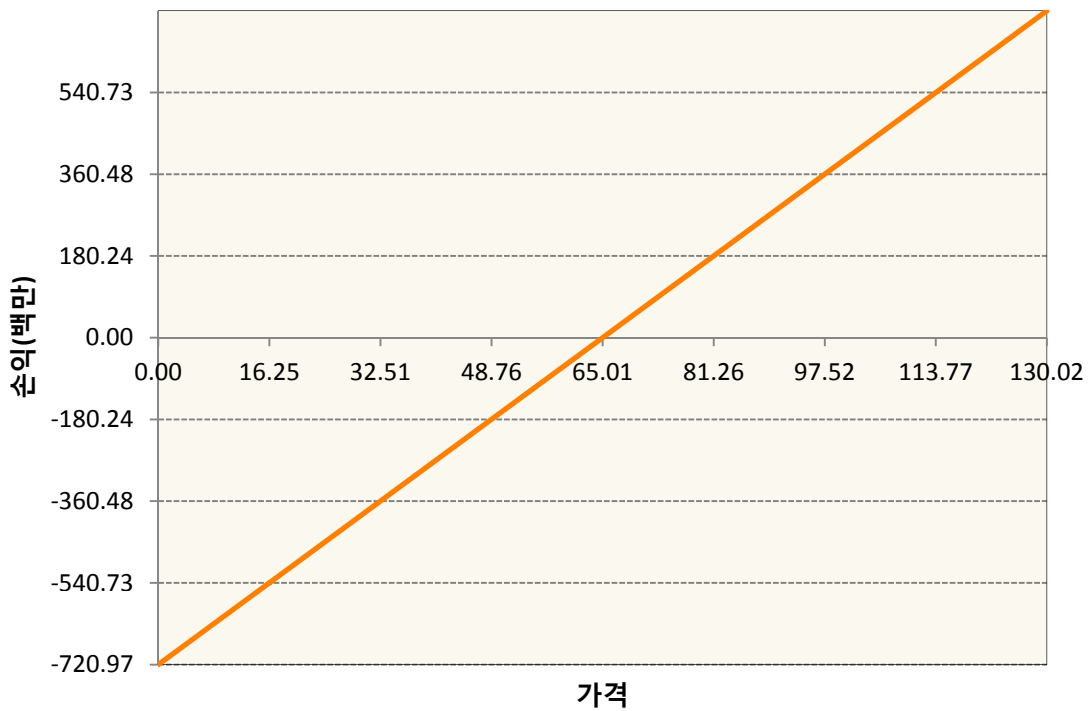
1. 계약금액

(단위:백만원)

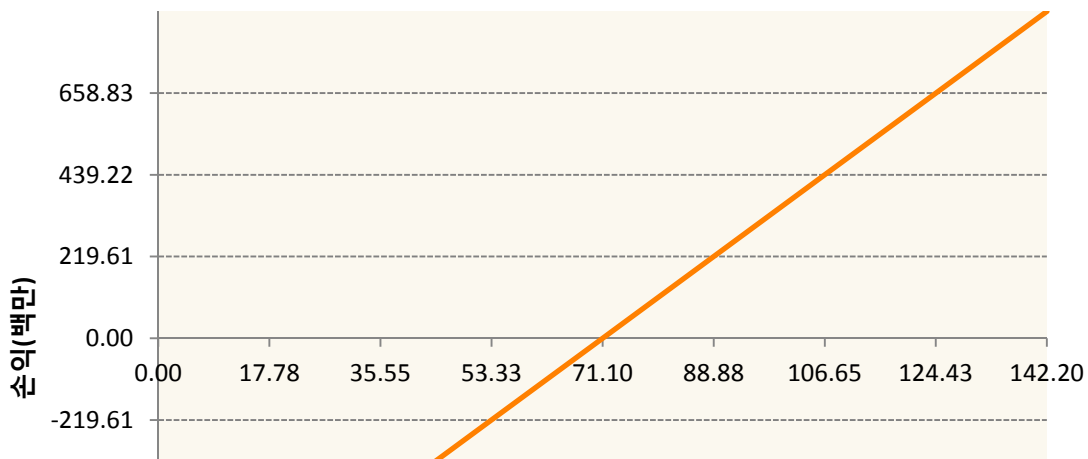
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,595	621	2,974	

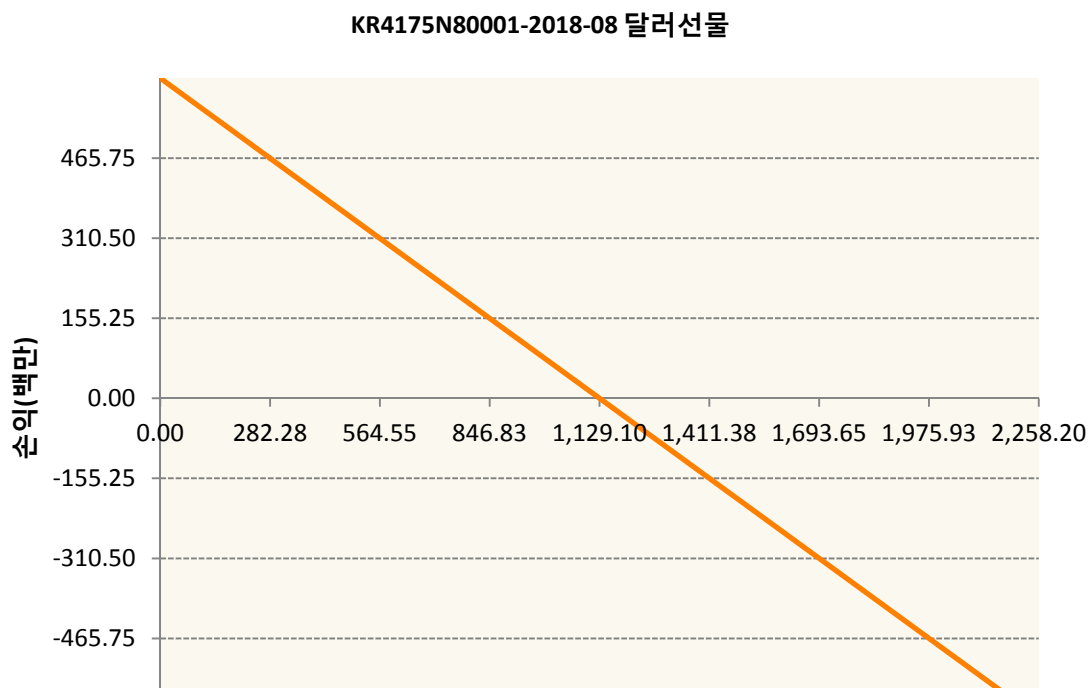
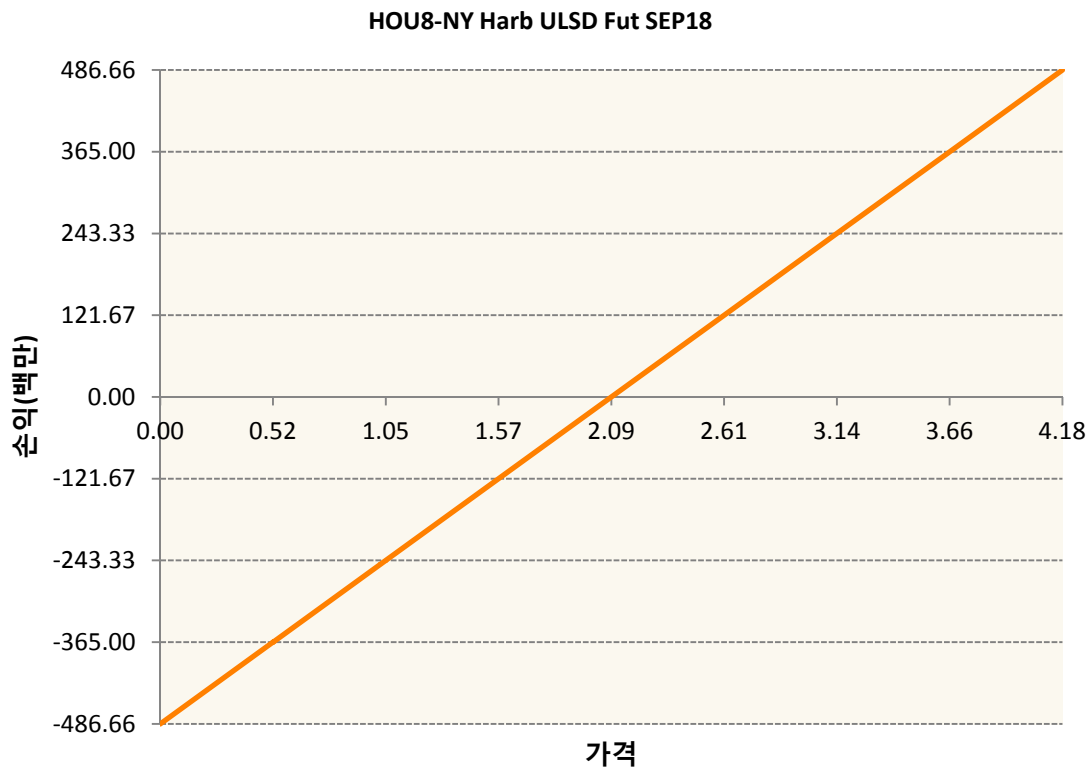
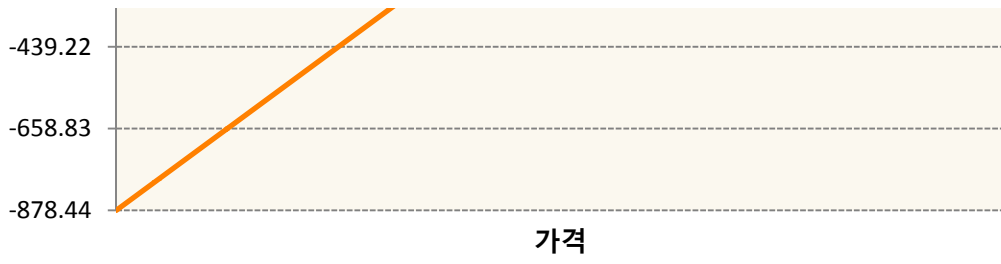
2. 만기시점의 손익구조

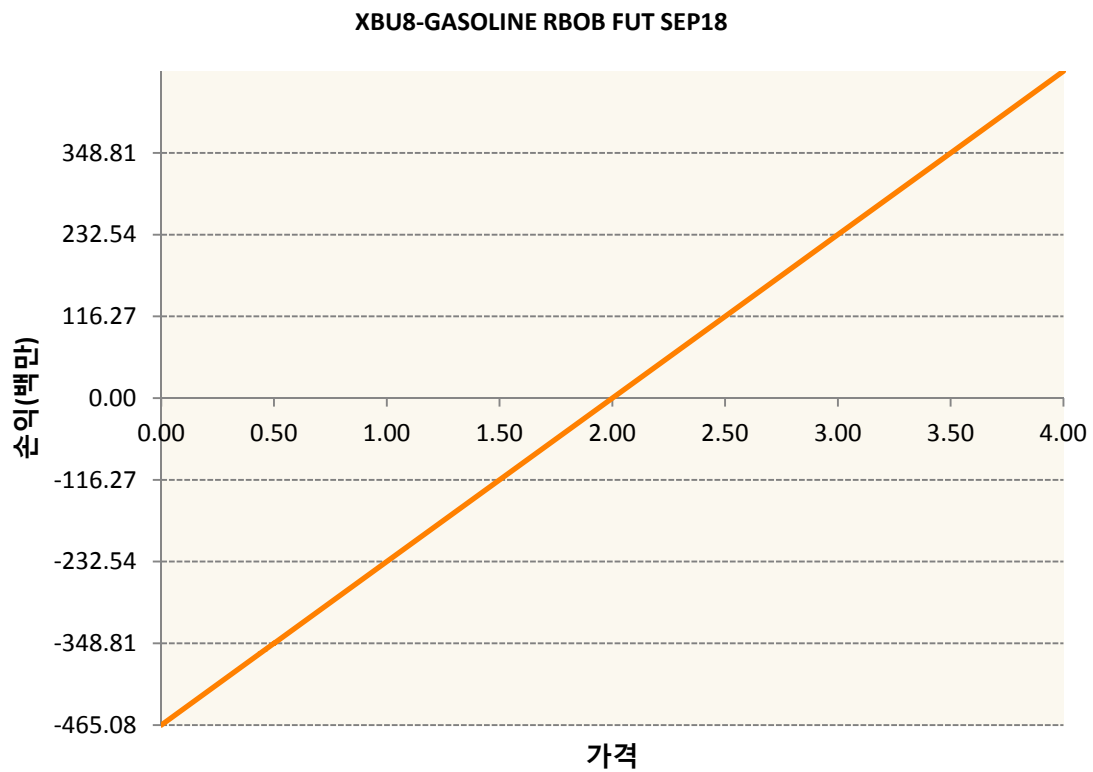
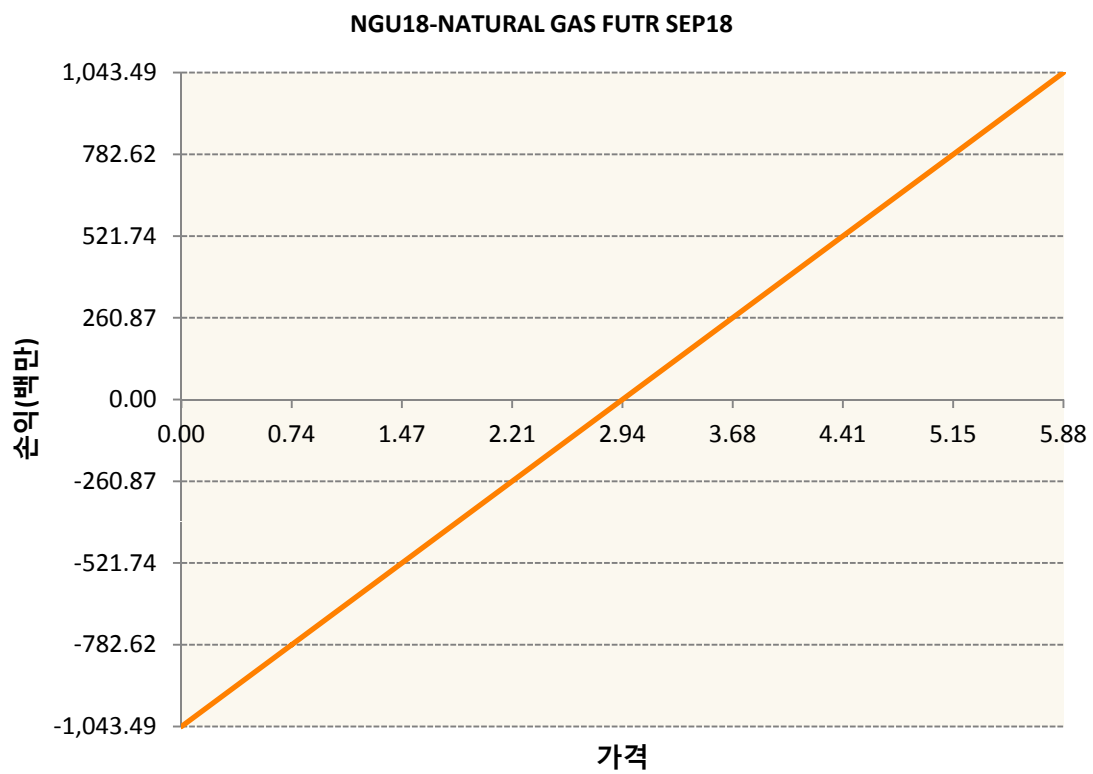
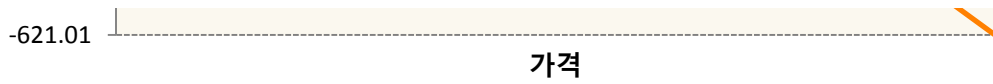
CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18



COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU8	WTI CRUDE FUTURE SEP18	58
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	70
HOU8	NY Harb ULSD Fut SEP18	39
KR4175N80C	2018-08 달러선물	50
NGU18	NATURAL GAS FUTR SEP18	83
XBU8	GASOLINE RBOB FUT SEP18	37

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

440

공시일	2018-08-17
기준일	2018-08-16

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

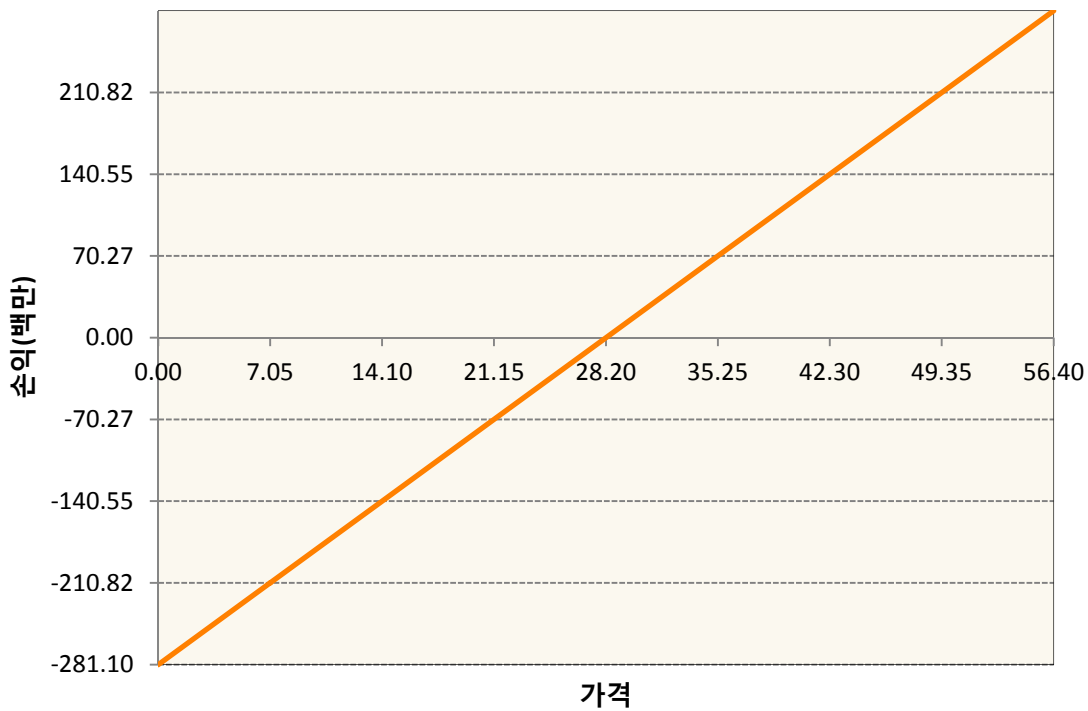
1. 계약금액

(단위:백만원)

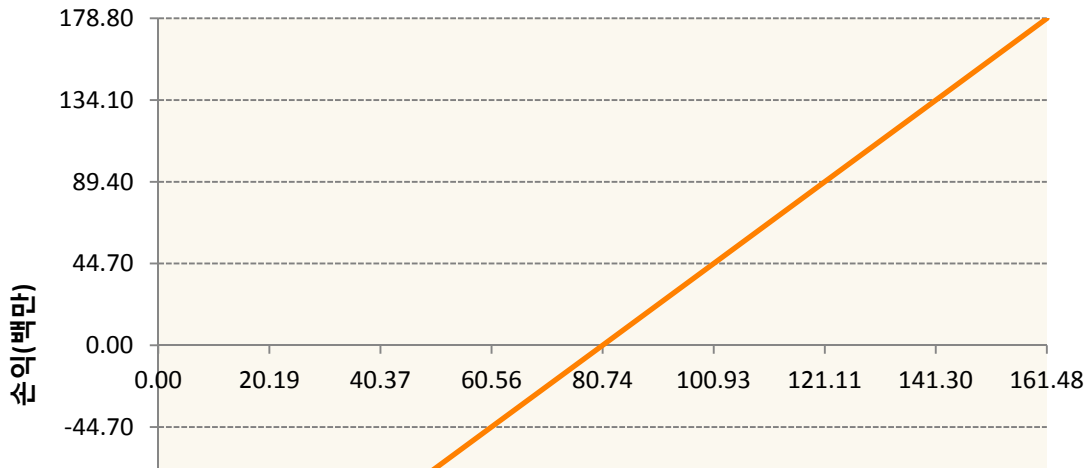
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,600	79	3,521	

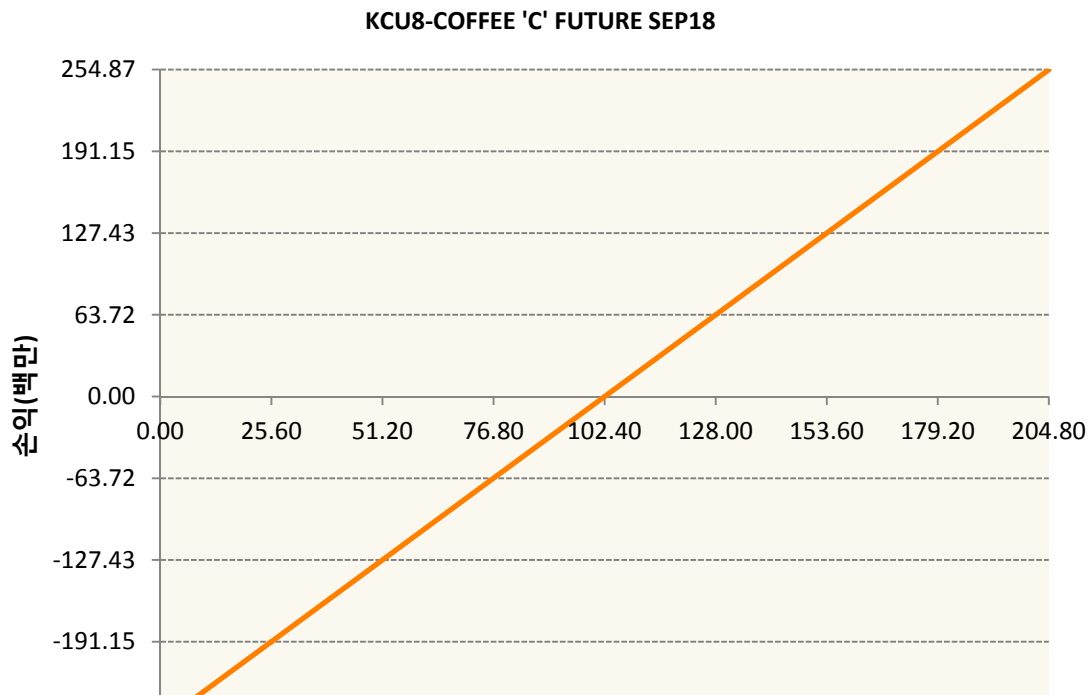
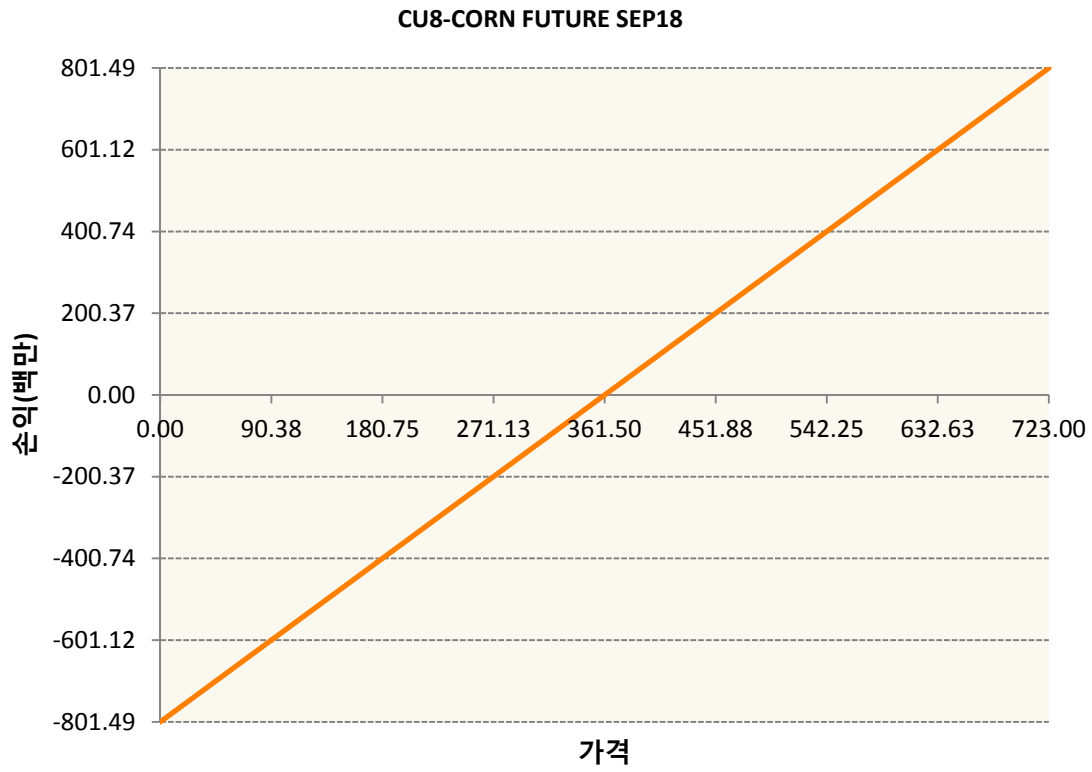
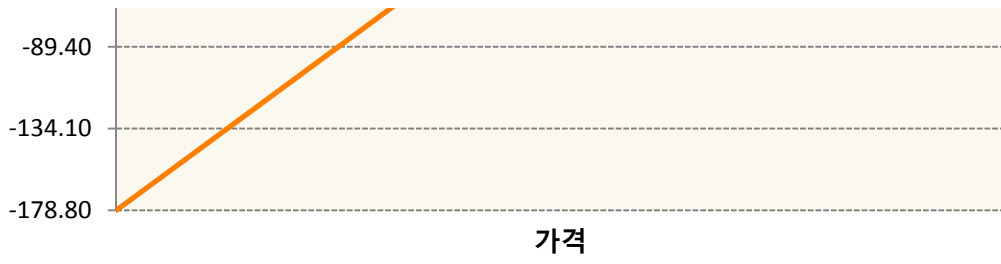
2. 만기시점의 손익구조

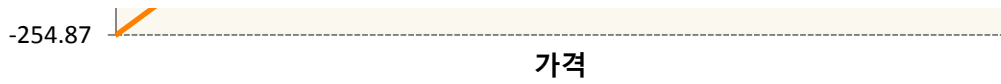
BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18



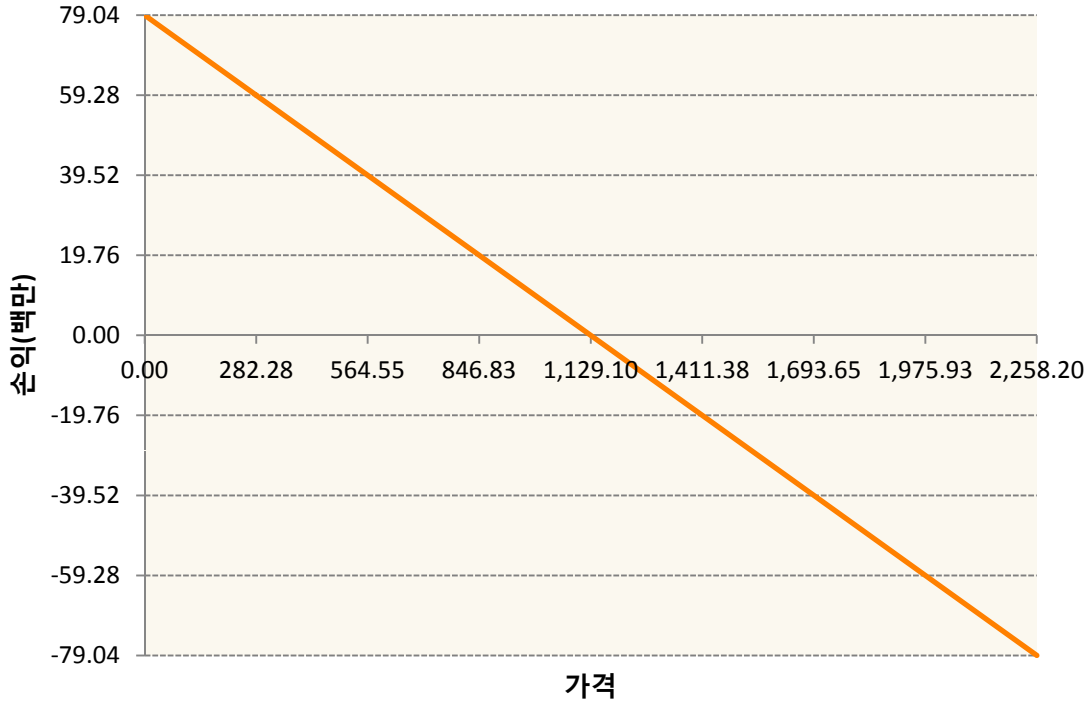
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



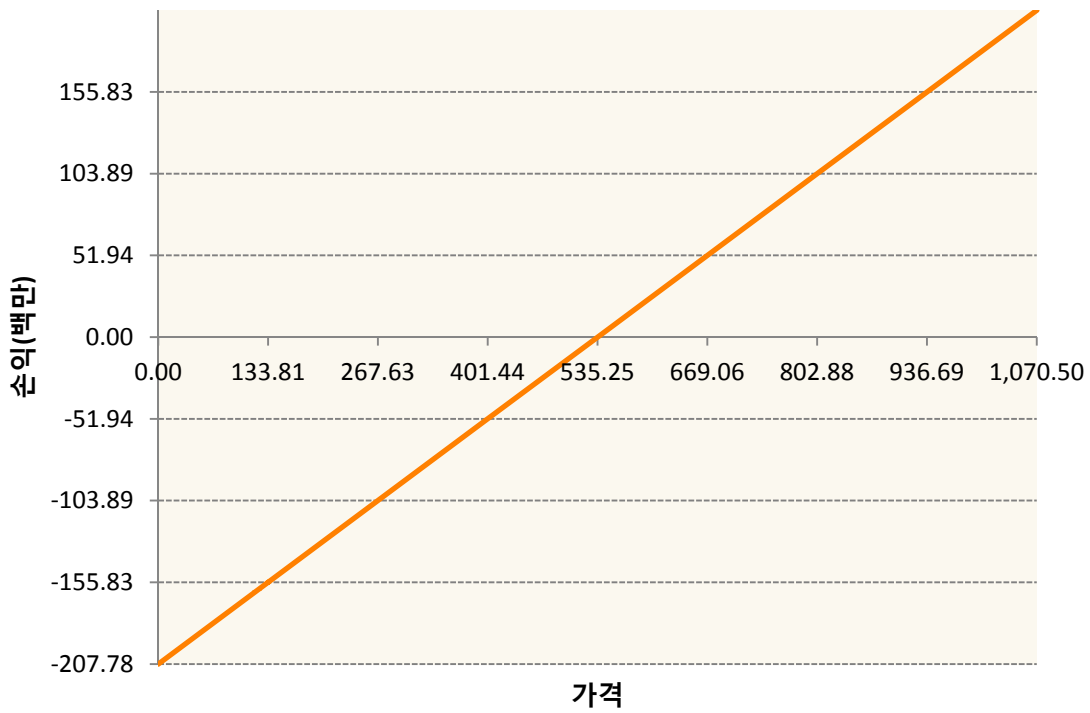




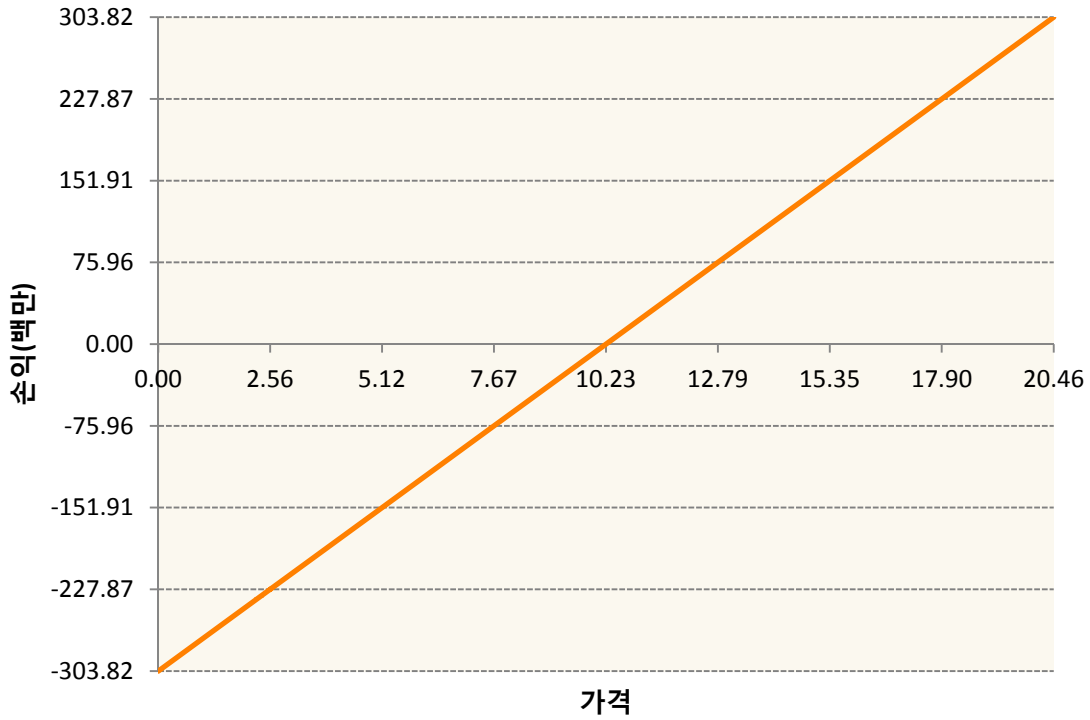
KR4175N80001-2018-08 달러선물



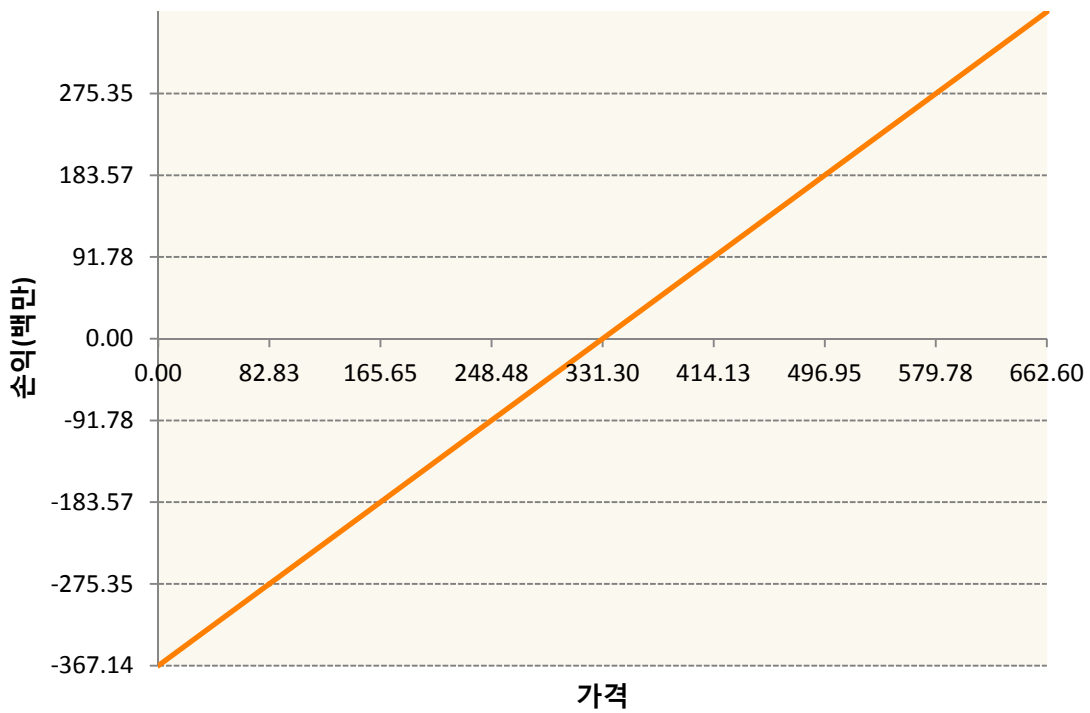
KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

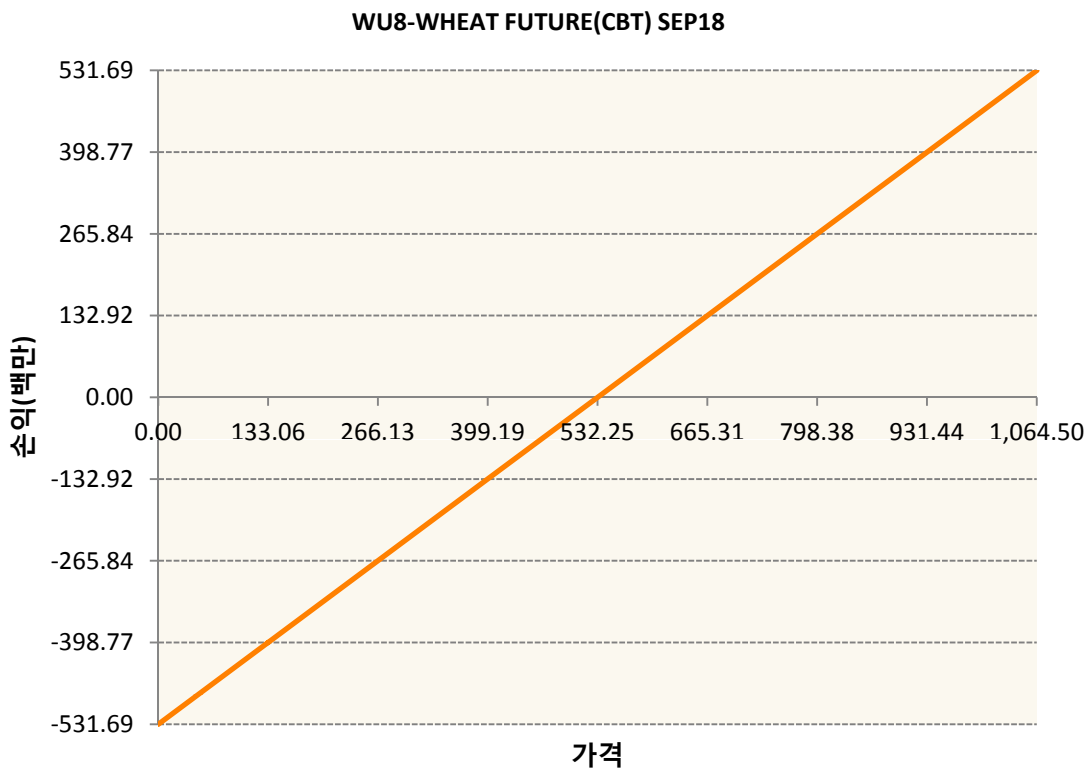
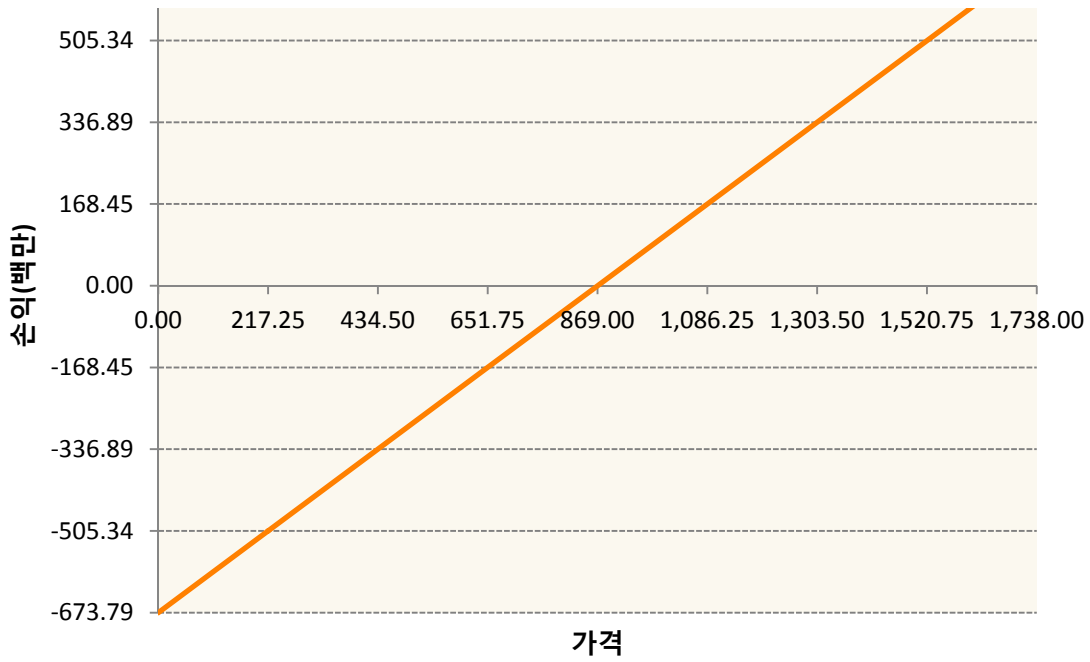


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	22
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	14
CU8	CORN FUTURE SEP18	64
KCU8	COFFEE 'C' FUTURE SEP18	20
KR4175N80C	2018-08 달러선물	6

KWU8	KC HRW WHEAT FUT SEP18	17
SBV8	SUGAR #11 (WORLD) OCT18	24
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	29
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	54
WU8	WHEAT FUTURE(CBT) SEP18	43

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

(단위:백만원)

305