

공시일	2018-08-20
기준일	2018-08-17

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	2018-08-20
기준일	2018-08-17

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

1,130

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

482

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-20
기준일	2018-08-17

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

293

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

367

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-20
기준일	2018-08-17

유로인덱스모(주식-파생형)

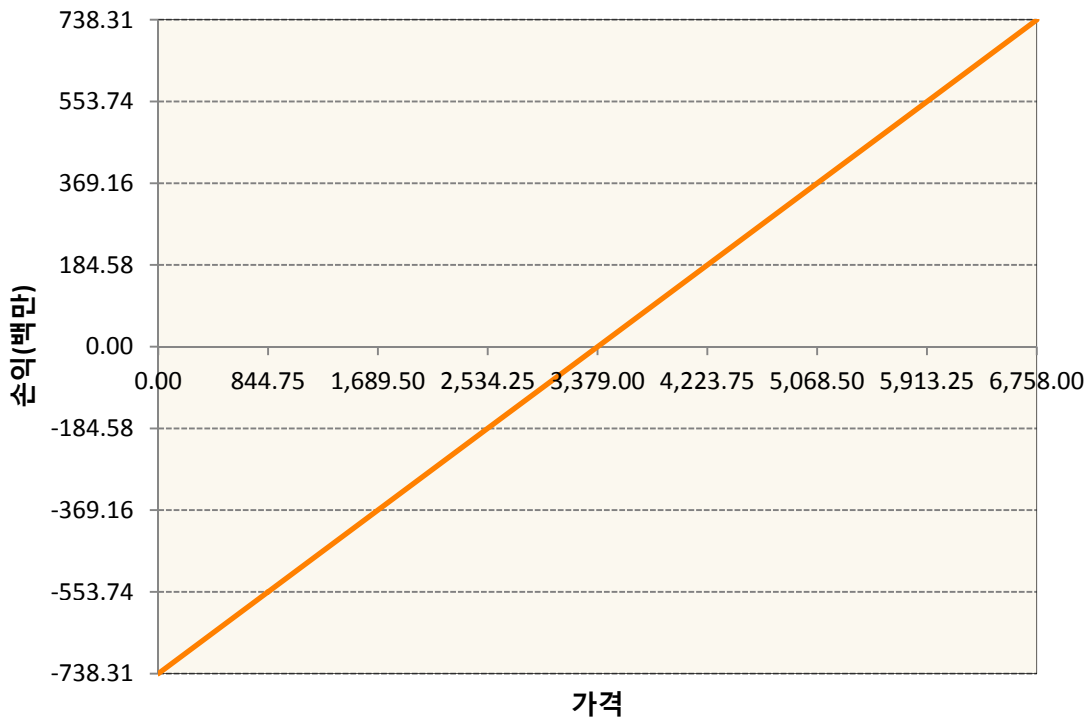
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	738	0	738	

2. 만기시점의 손익구조

VGU8-EURO STOXXX 50 SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU8	EURO STOXXX 50 SEP18	59
------	----------------------	----

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

(단위:백만원)

37

공시일	2018-08-20
기준일	2018-08-17

차이나인덱스모(주식-파생형)

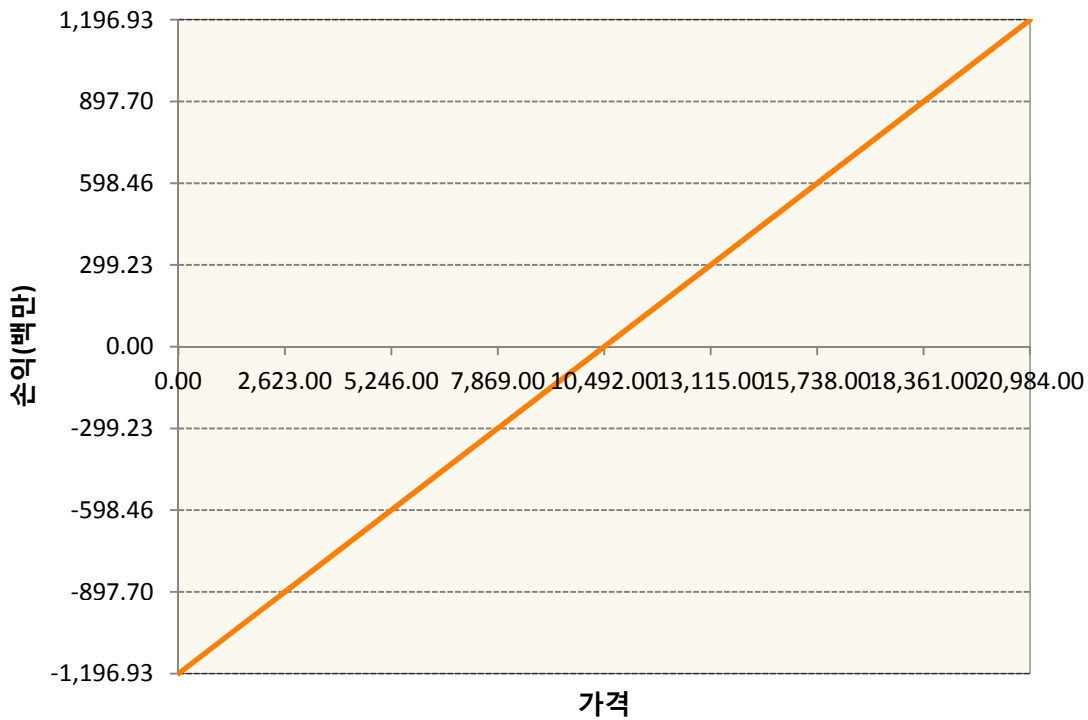
1. 계약금액

(단위:백만원)

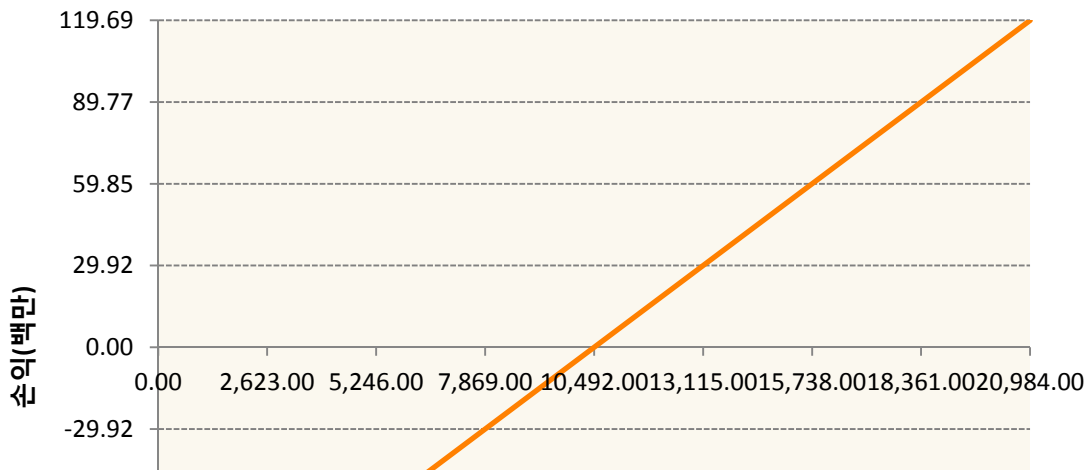
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,317	0	1,317	장내

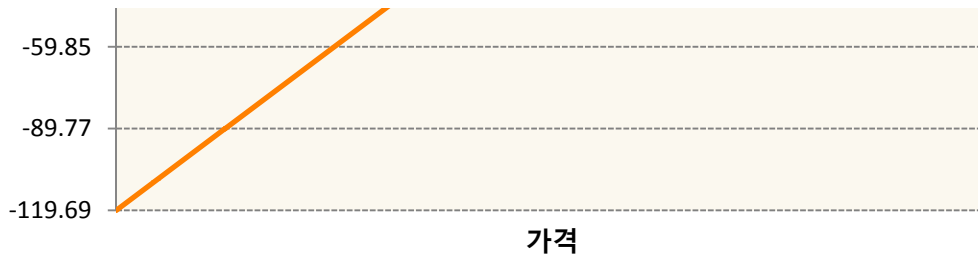
2. 만기시점의 손익구조

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)

97

공시일	2018-08-20
기준일	2018-08-17

커버드콜모(주식혼합-파생형)

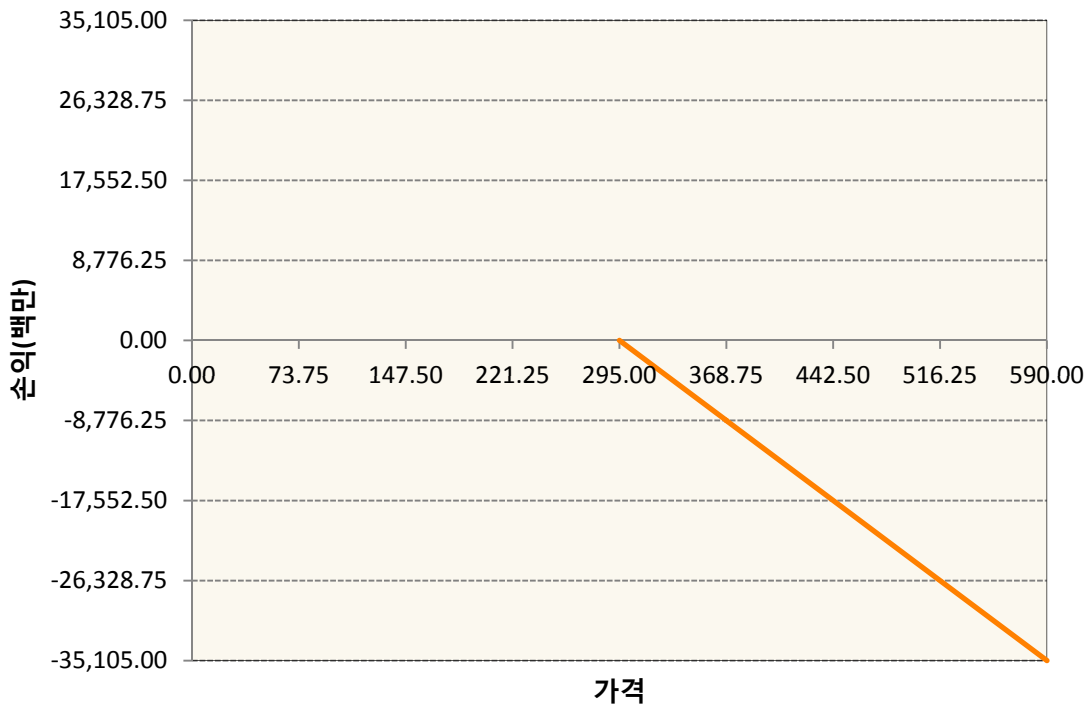
1. 계약금액

(단위:백만원)

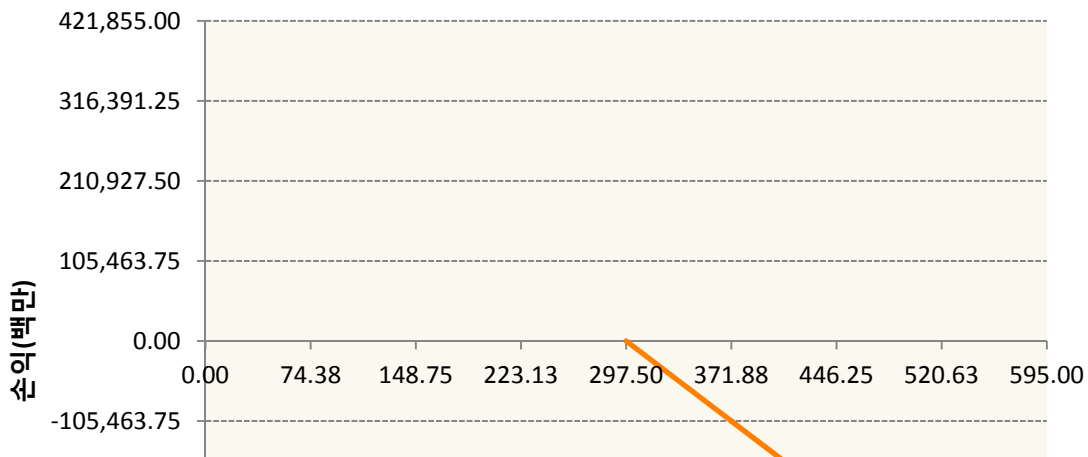
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	746,874	-746,874	장내

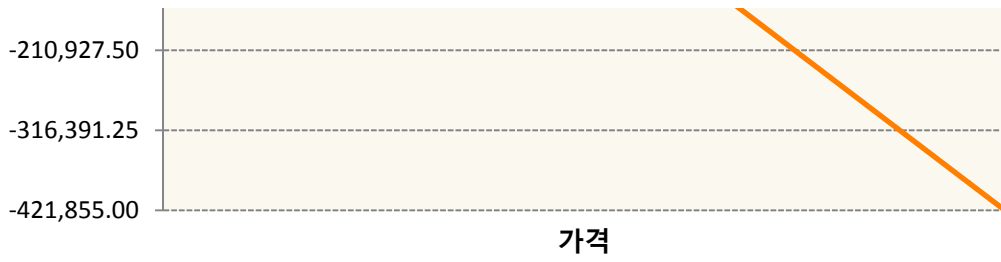
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92950-2018-09 콜295

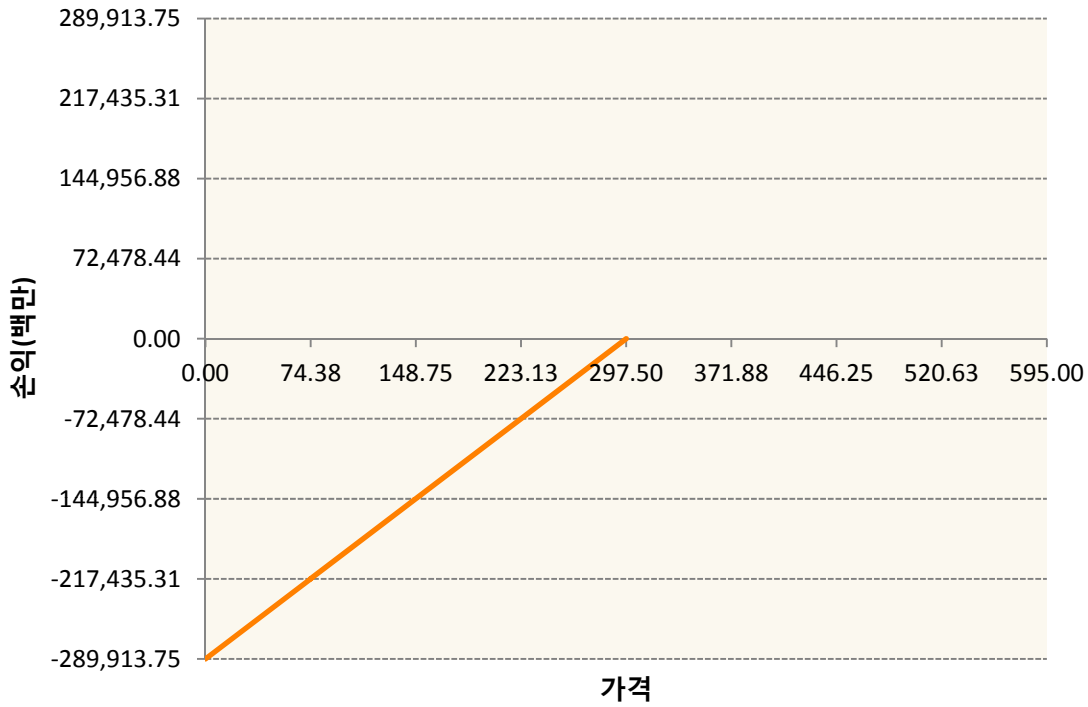


KR4201N92976-2018-09 콜297.5





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N929 2018-09 콜295

1,860

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	680	663	640	611	577	539	496
-5.33%	627	590	547	499	447	391	332
-2.67%	498	437	372	304	233	161	87
0%	246	165	83	0	-84	-168	-252
2.67%	-163	-251	-339	-427	-515	-603	-691
5.33%	-737	-816	-896	-978	-1,062	-1,145	-1,230
8.00%	-1,449	-1,508	-1,572	-1,640	-1,711	-1,785	-1,860

KR4201N929 2018-09 풋297.5

20,968

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,959	6,797	6,573	6,285	5,936	5,532	5,075

-5.33%	6,489	6,125	5,687	5,184	4,624	4,014	3,362
-2.67%	5,284	4,640	3,940	3,193	2,409	1,595	755
0%	2,797	1,885	951	0	-964	-1,939	-2,922
2.67%	-1,457	-2,508	-3,561	-4,613	-5,666	-6,719	-7,772
5.33%	-7,667	-8,670	-9,684	-10,707	-11,737	-12,772	-13,811
8.00%	-15,646	-16,447	-17,294	-18,175	-19,085	-20,017	-20,968

KR4301N929 2018-09 풋 297.5

21,236

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21,203	-21,204	-21,205	-21,207	-21,212	-21,221	-21,236
-5.33%	-13,719	-13,725	-13,737	-13,758	-13,791	-13,836	-13,896
-2.67%	-6,289	-6,343	-6,420	-6,518	-6,637	-6,777	-6,934
0%	690	480	249	0	-263	-538	-822
2.67%	6,084	5,725	5,367	5,007	4,648	4,288	3,927
5.33%	8,934	8,650	8,352	8,044	7,727	7,404	7,075
8.00%	9,838	9,726	9,588	9,424	9,239	9,034	8,812

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

(단위:백만원)

43,749

공시일	2018-08-20
기준일	2018-08-17

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

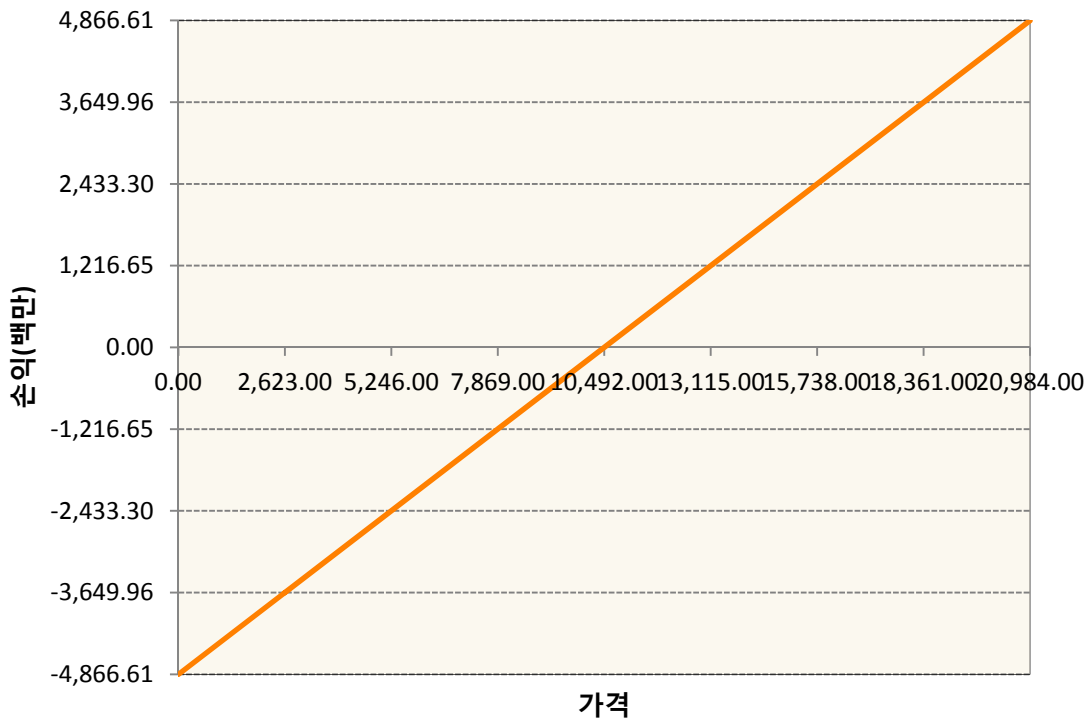
1. 계약금액

(단위:백만원)

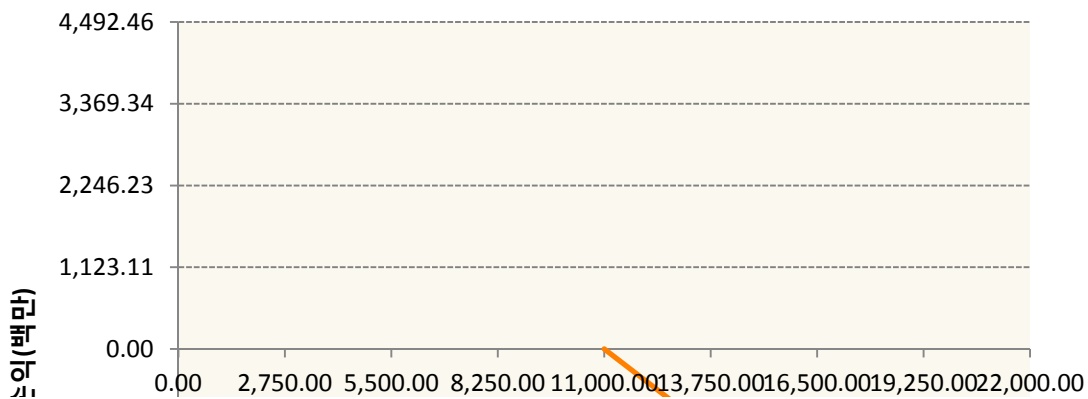
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,867	0	4,867	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,553	-11,553	장내

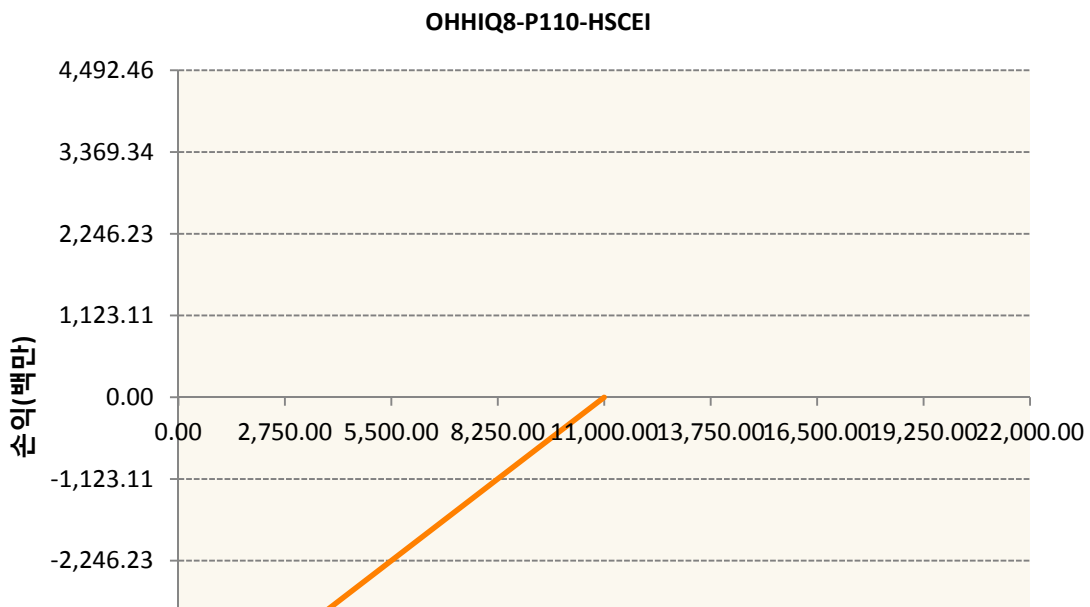
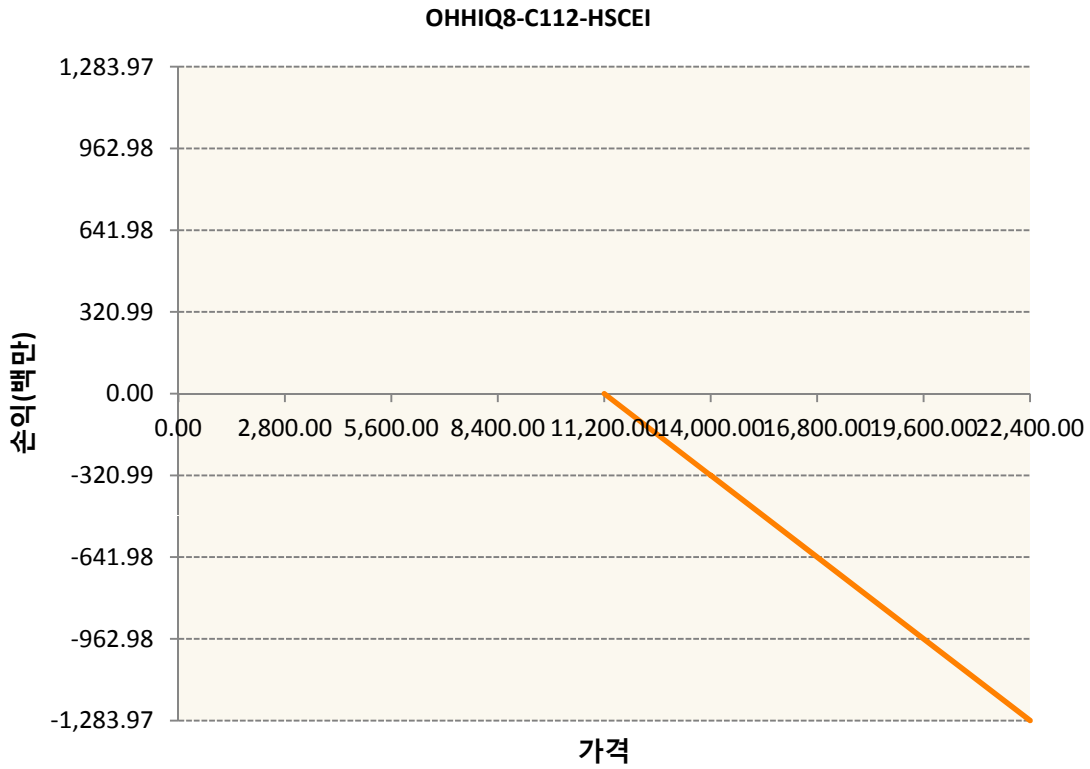
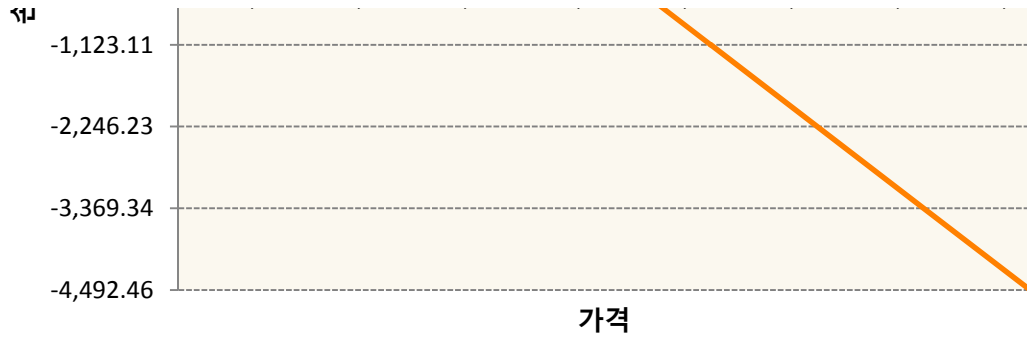
2. 만기시점의 손익구조

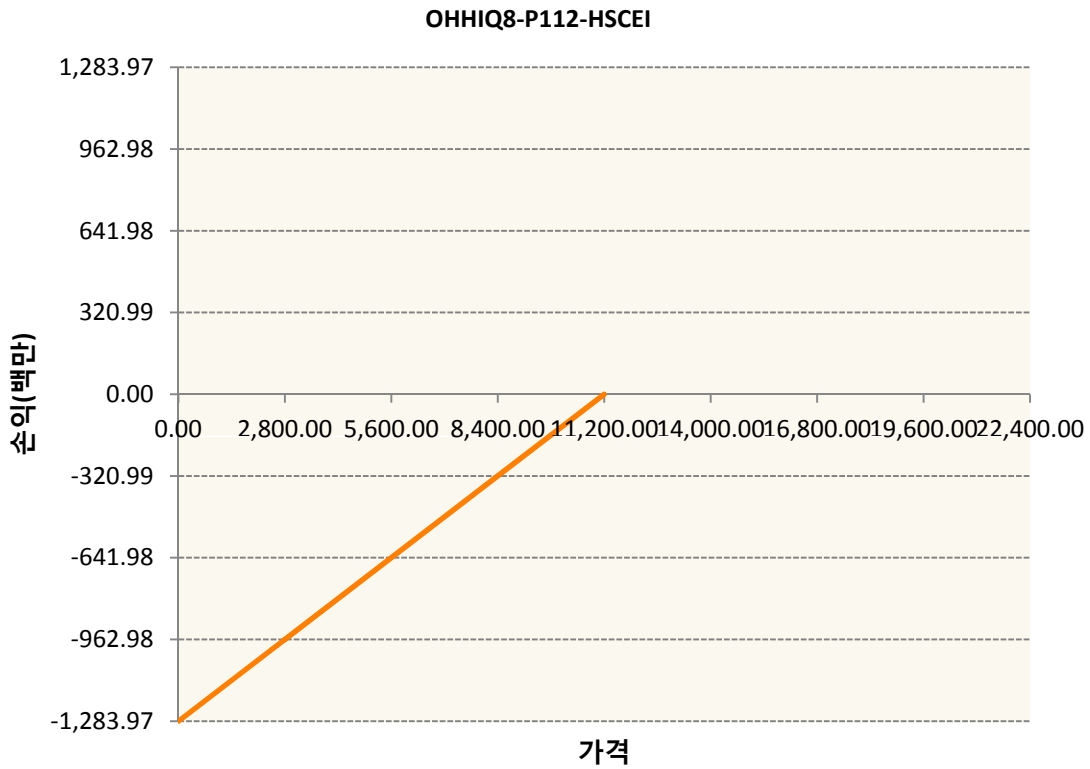
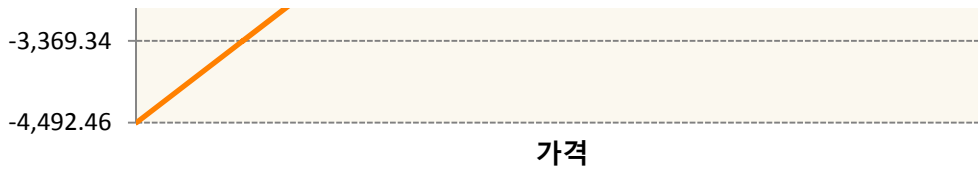
HCQ8-HSCEI Futures Aug18



OHHIQ8-C110-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ8	HSCEI Futures Aug18	389
OHHIQ8-C1:	HSCEI	359
OHHIQ8-C1:	HSCEI	103
OHHIQ8-P11	HSCEI	359
OHHIQ8-P11	HSCEI	103

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,204

공시일	2018-08-20
기준일	2018-08-17

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

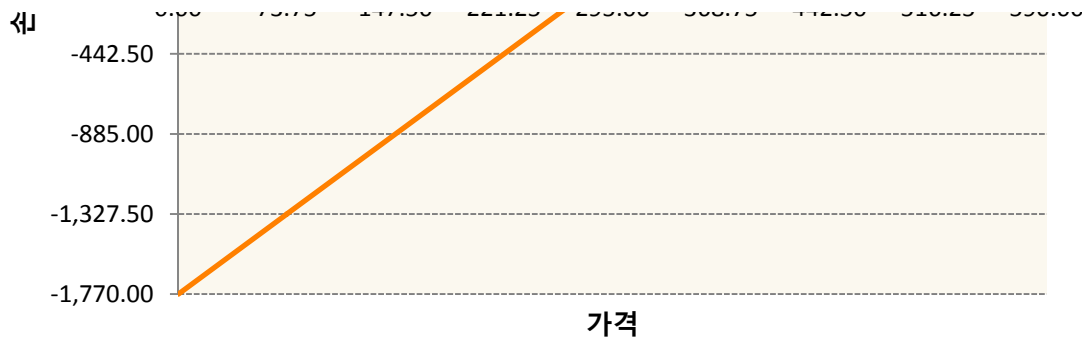
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92976-2018-09 콜297.5

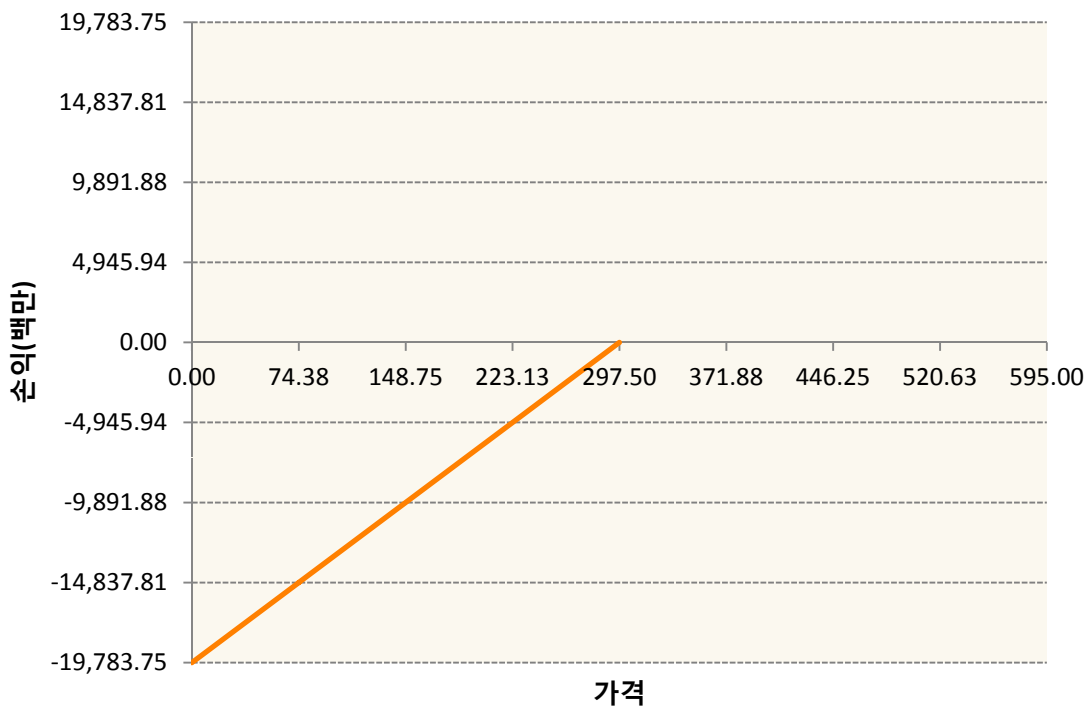


KR4301N92958-2018-09 풋295





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,971
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,971	-3,971	-3,971	-3,971	-3,971	-3,971	-3,971
-5.33%	-2,647	-2,647	-2,647	-2,647	-2,647	-2,647	-2,647
-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%	2,647	2,647	2,647	2,647	2,647	2,647	2,647
8.00%	3,971	3,971	3,971	3,971	3,971	3,971	3,971
KR4201N92974-2018-09 풋297.5							1,397
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	464	453	438	419	396	369	338
-5.33%	432	408	379	345	308	268	224
-2.67%	352	309	263	213	161	106	50
0%	186	126	63	0	-64	-129	-195
2.67%	-97	-167	-237	-307	-378	-448	-518
5.33%	-511	-578	-645	-714	-782	-851	-920
8.00%	-1,043	-1,096	-1,153	-1,211	-1,272	-1,334	-1,397

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%	-36	-36	-37	-38	-39	-40	-41
0%	5	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	34	31	29	27	25	23	20
5.33%	46	45	44	42	40	38	37
8.00%	50	49	49	48	47	46	45

KR4301N929 2018-09 풋297.5

1,449

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,447	-1,447	-1,447	-1,447	-1,448	-1,448	-1,449
-5.33%	-936	-937	-937	-939	-941	-944	-948
-2.67%	-429	-433	-438	-445	-453	-462	-473
0%	47	33	17	0	-18	-37	-56
2.67%	415	391	366	342	317	293	268
5.33%	610	590	570	549	527	505	483
8.00%	671	664	654	643	630	616	601

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

(단위:백만원)

6,961

공시일	2018-08-20
기준일	2018-08-17

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

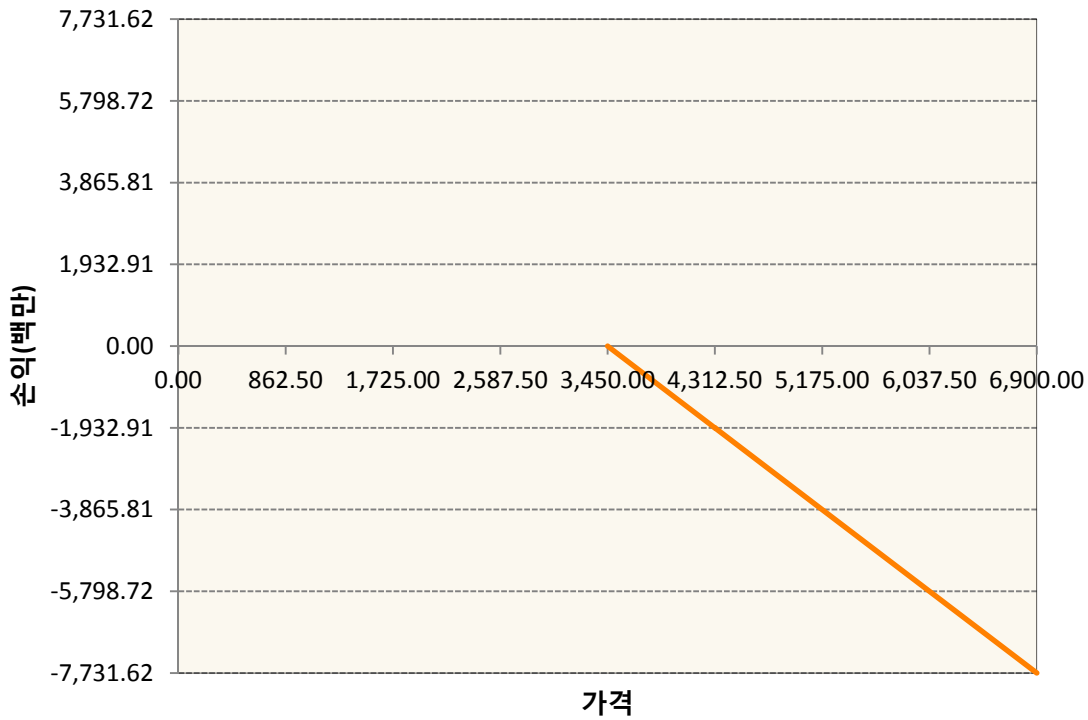
1. 계약금액

(단위:백만원)

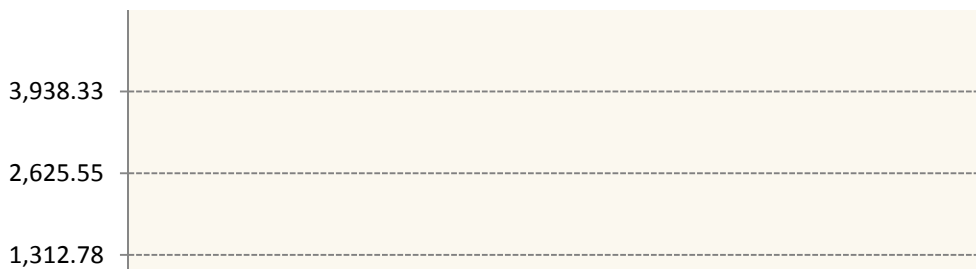
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,751	0	5,751	
누계	유가증권	옵션	0	20,720	-20,720	장내
누계	지수	스왑	85,805	0	85,805	장외

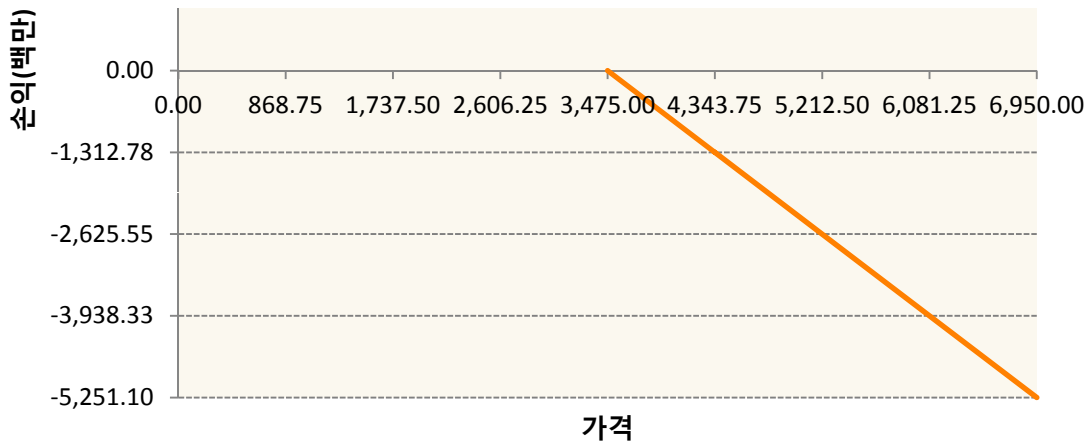
2. 만기시점의 손익구조

OESXQ8-C3450-EURO STOXX 50 OPT

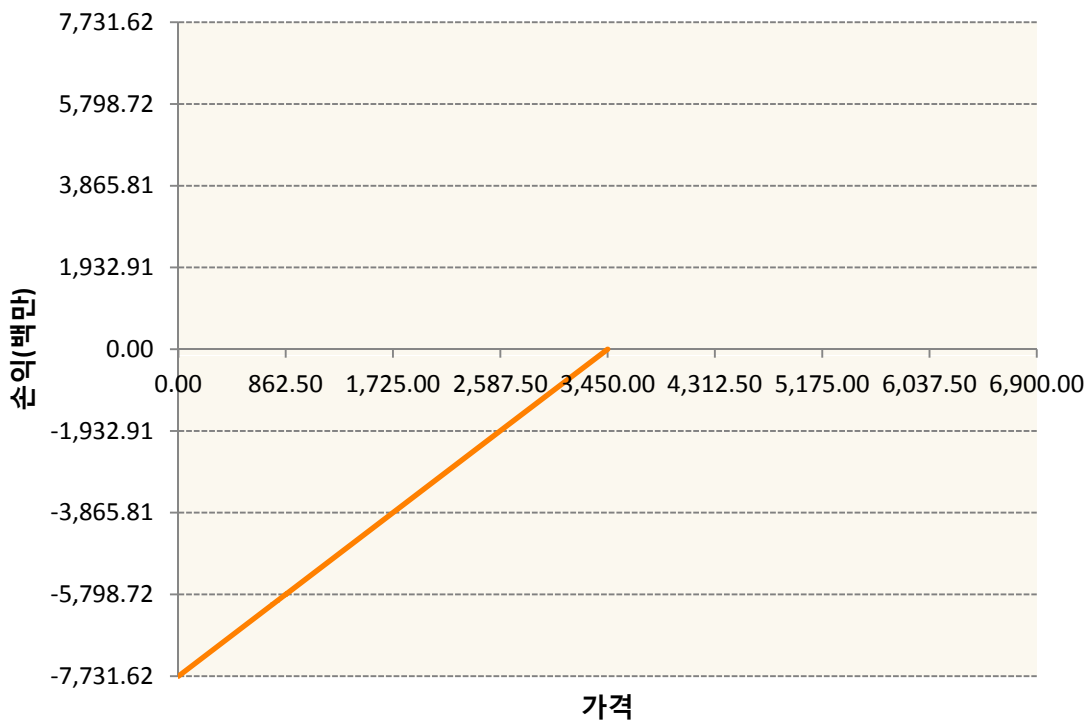


OESXQ8-C3475-EURO STOXX 50 OPT

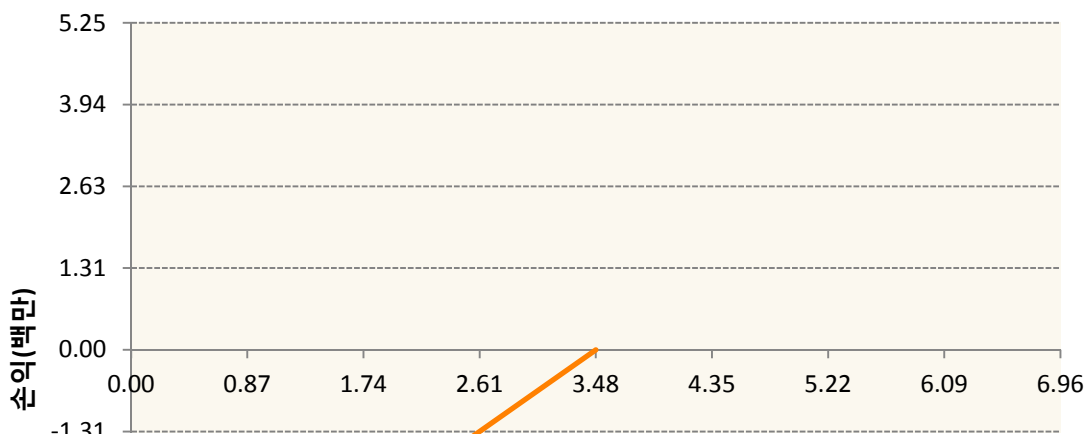


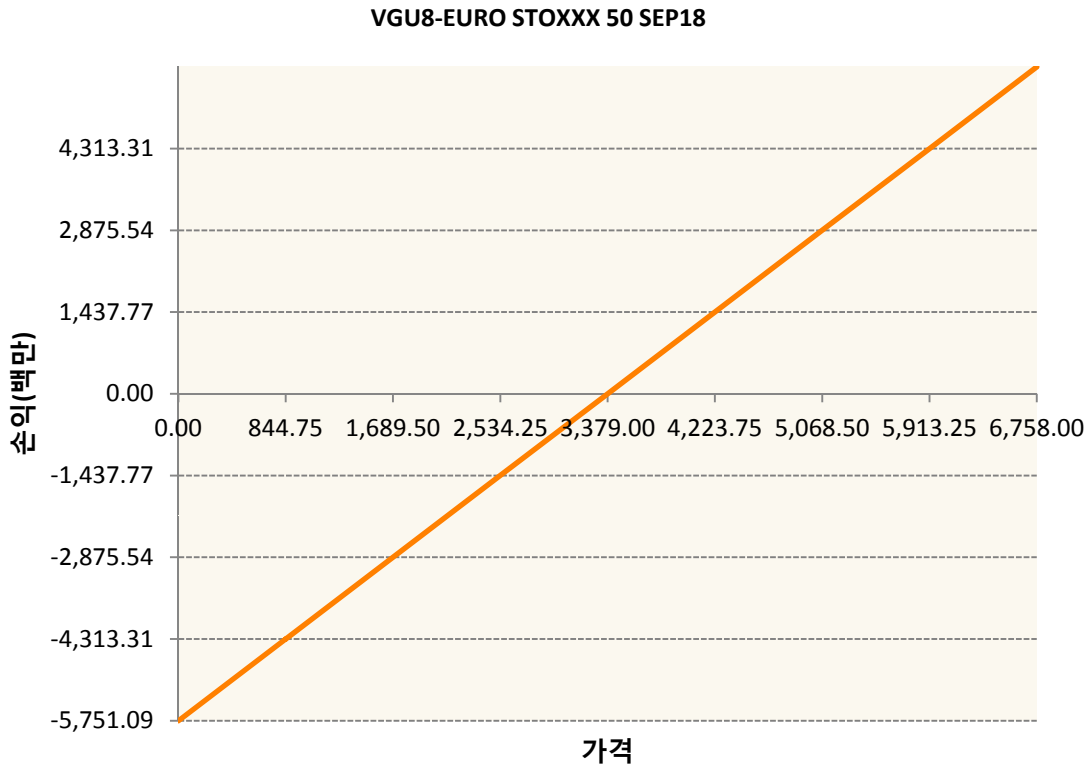
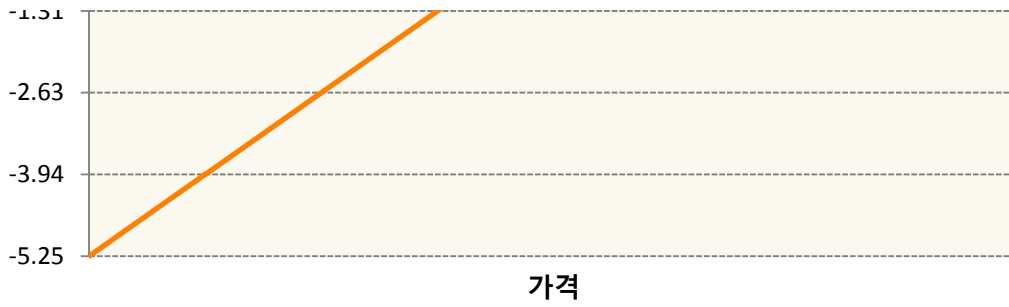


OESXQ8-P3450-EURO STOXX 50



OESXQ8-P3475-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	48
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	31
OESXQ8-C3 EURO STOXX 50 OPT	619
OESXQ8-C3 EURO STOXX 50 OPT	420
OESXQ8-P3 EURO STOXX 50	619
OESXQ8-P3 EURO STOXX 50	0.4
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18	460

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

1,376

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

(단위:백만원)

1,114

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)

159

공시일	2018-08-20
기준일	2018-08-17

스마트KRX300인덱스목표전환형1

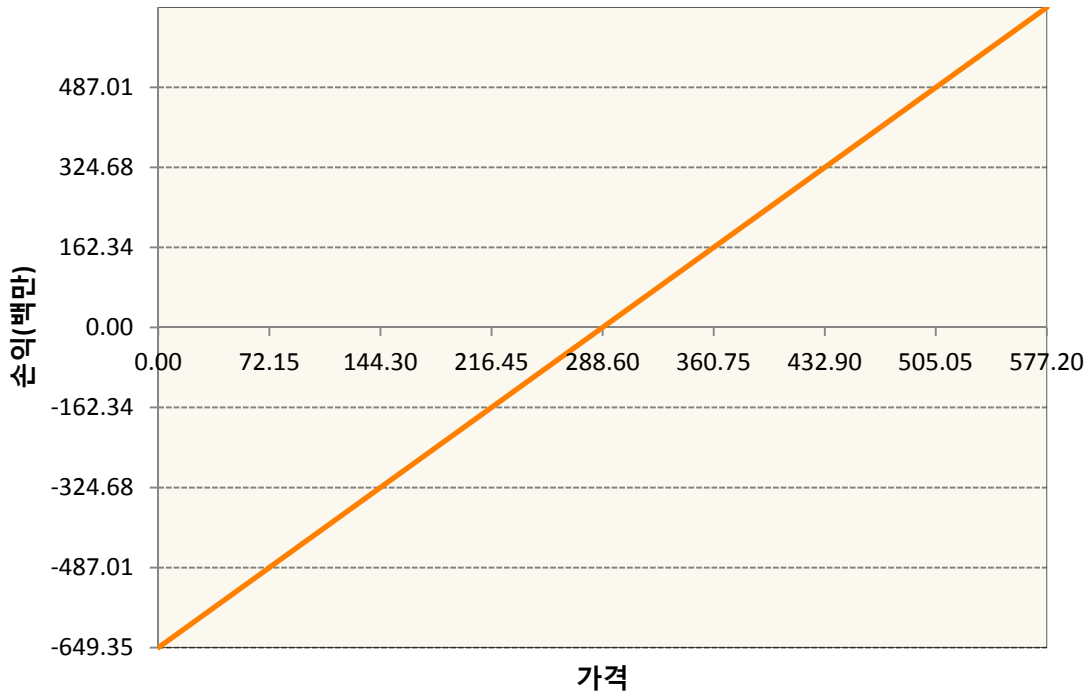
1. 계약금액

(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)

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)

39

공시일	2018-08-20
기준일	2018-08-17

리디파인K200(주식혼합-파생재간

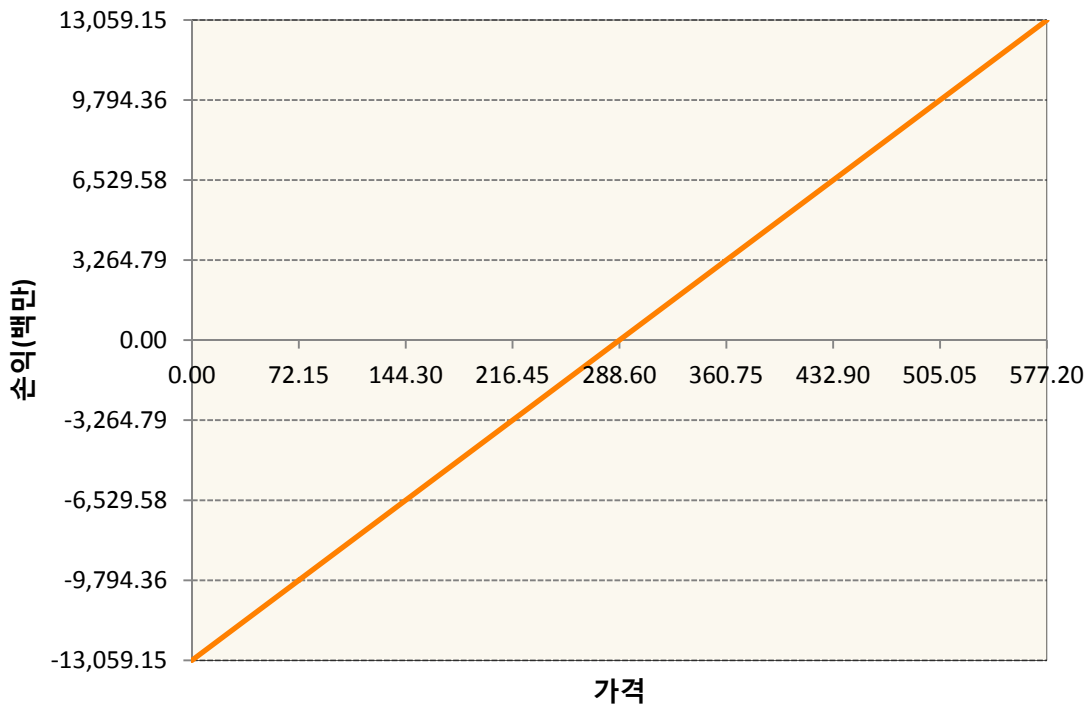
1. 계약금액

(단위:백만원)

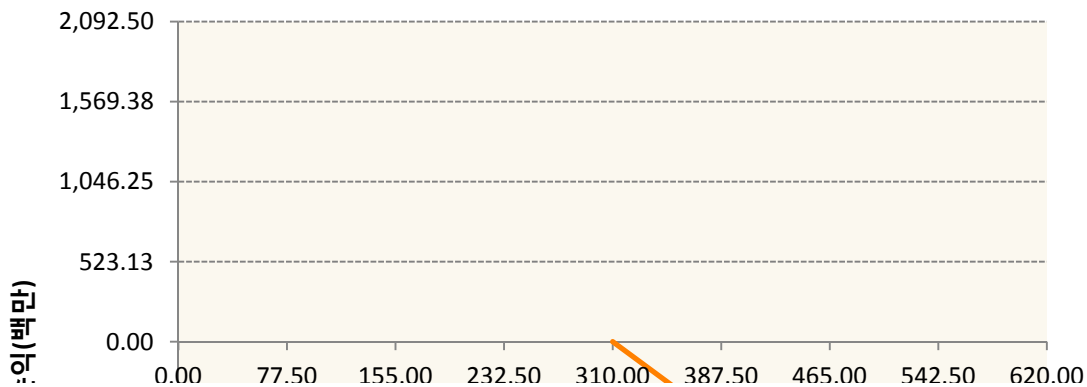
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,059	0	13,059	장내
누계	유가증권	옵션	1,339	24,358	-23,019	장내

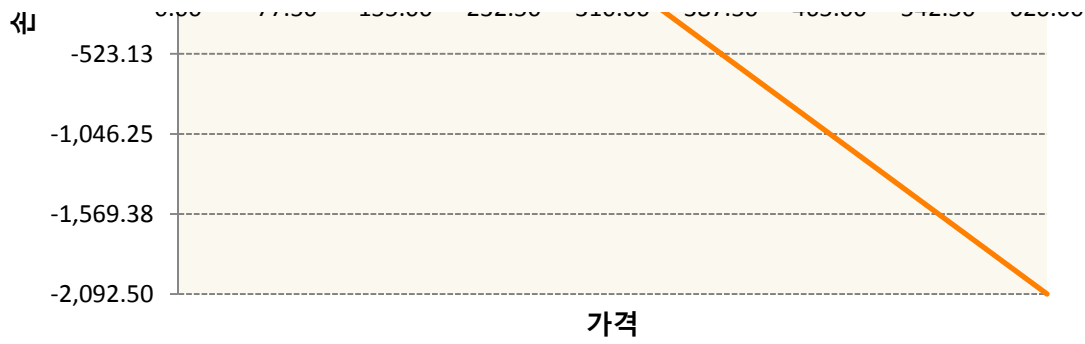
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

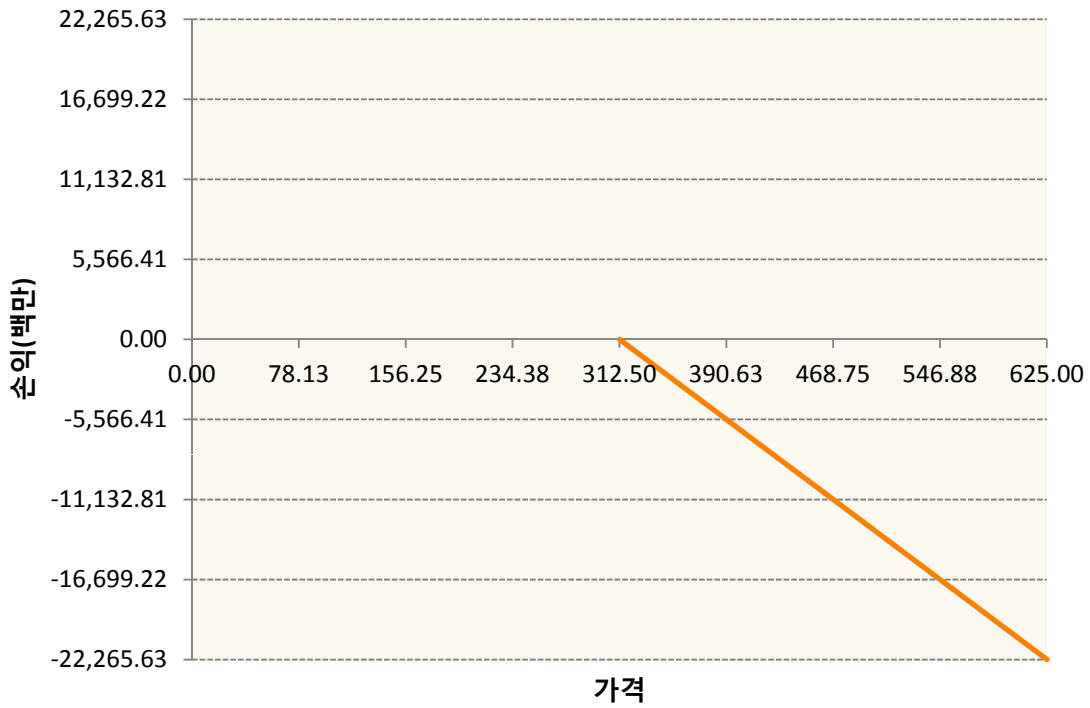


KR4201N93107-2018-09 콜310

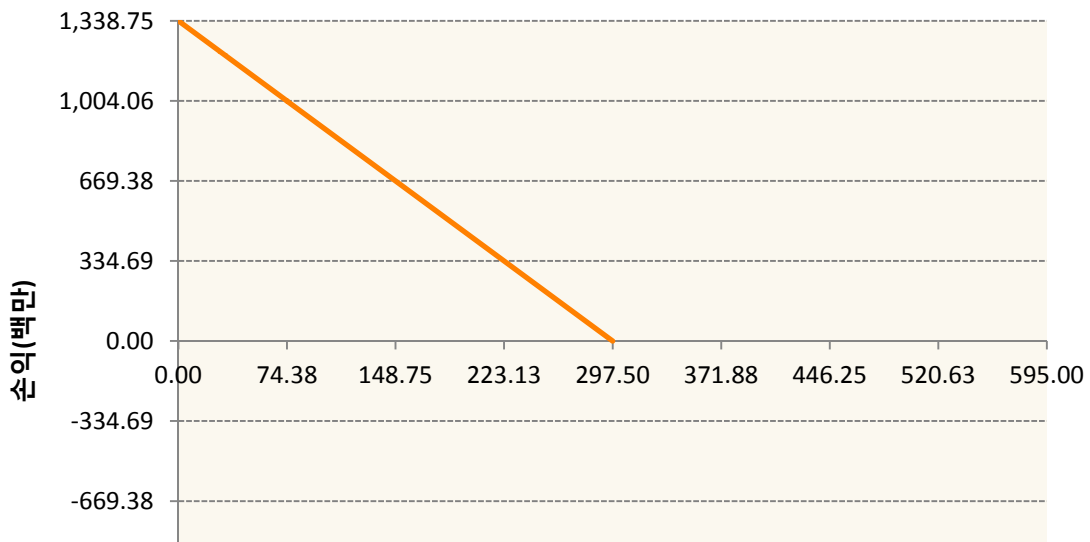


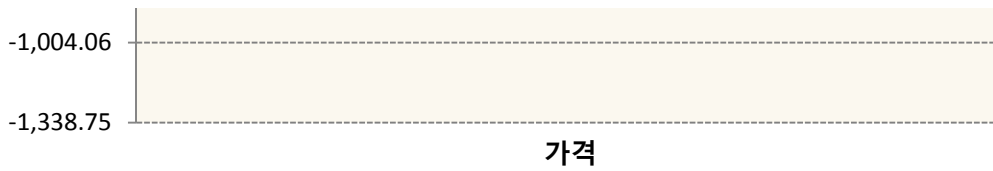


KR4201N93123-2018-09 콜312.5



KR4301N92974-2018-09 풋297.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물							1,045
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,045	-1,045	-1,045	-1,045	-1,045	-1,045	-1,045
-5.33%	-696	-696	-696	-696	-696	-696	-696
-2.67%	-348	-348	-348	-348	-348	-348	-348
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	348	348	348	348	348	348	348
5.33%	696	696	696	696	696	696	696
8.00%	1,045	1,045	1,045	1,045	1,045	1,045	1,045
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	13	13	12	11	10
-5.33%	13	13	12	11	10	8	6
-2.67%	12	11	9	7	5	2	0
0%	8	6	3	0	-3	-7	-11
2.67%	0	-4	-8	-12	-16	-21	-25
5.33%	-15	-20	-25	-30	-35	-40	-45
8.00%	-39	-44	-49	-55	-60	-65	-70
KR4201N931 2018-09 콜312.5							683
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	119	118	116	112	106	98	87
-5.33%	117	113	106	97	85	70	52
-2.67%	106	96	82	64	43	19	-8
0%	77	55	29	0	-32	-66	-103
2.67%	7	-29	-68	-110	-153	-197	-243
5.33%	-128	-177	-228	-279	-330	-382	-435
8.00%	-349	-405	-461	-516	-572	-628	-683
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
-5.33%	63	63	63	64	64	64	64
-2.67%	29	29	30	30	31	31	32

0%	-3	-2	-1	0	1	2	4
2.67%	-28	-26	-25	-23	-21	-20	-18
5.33%	-41	-40	-39	-37	-36	-34	-33
8.00%	-45	-45	-44	-44	-43	-42	-41

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

(단위:백만원)

1,392

공시일	2018-08-20
기준일	2018-08-17

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

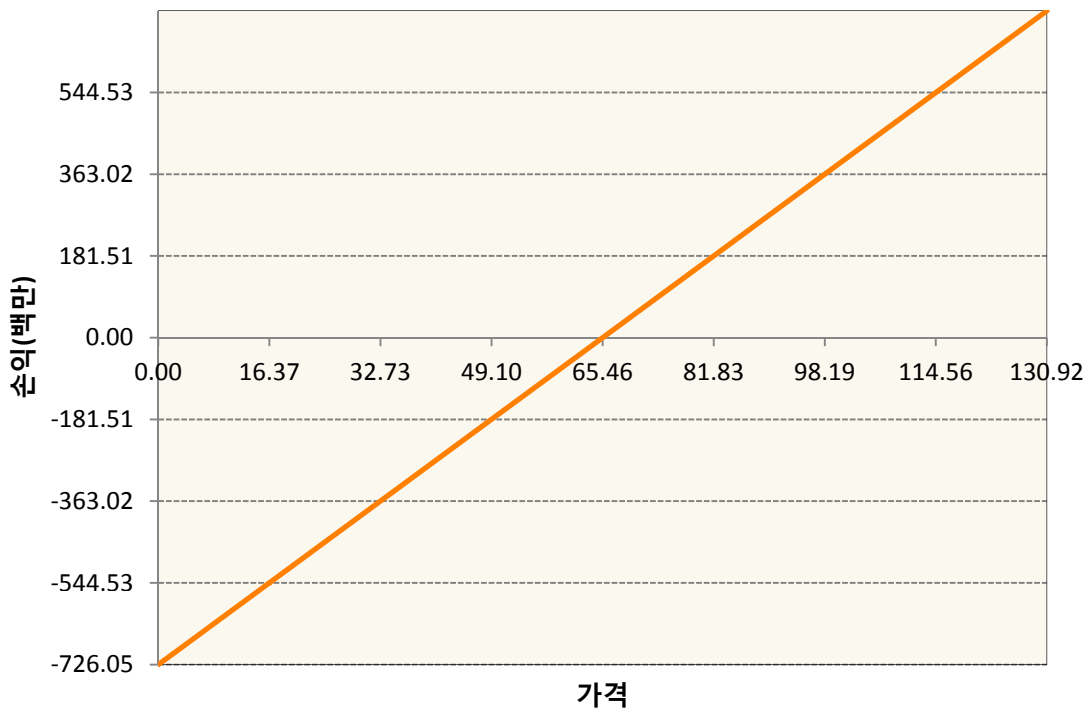
1. 계약금액

(단위:백만원)

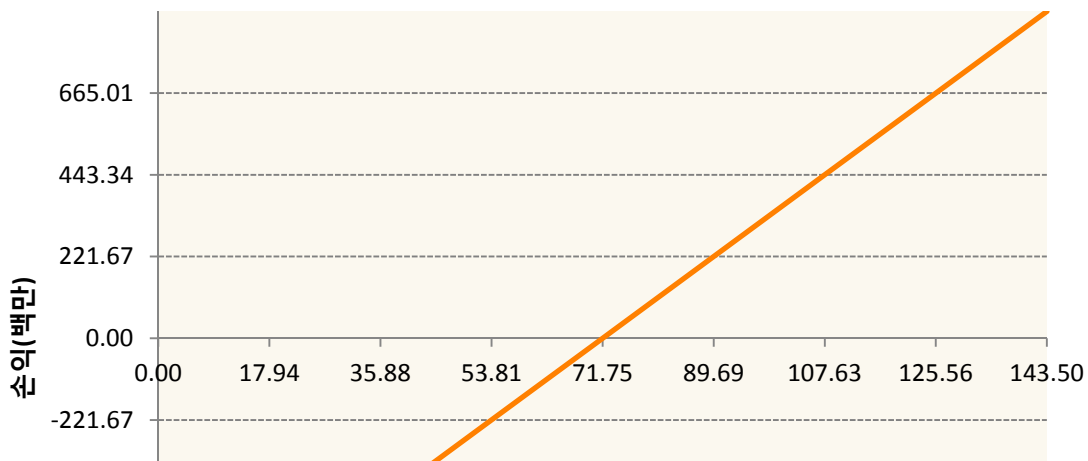
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,596	618	2,977	

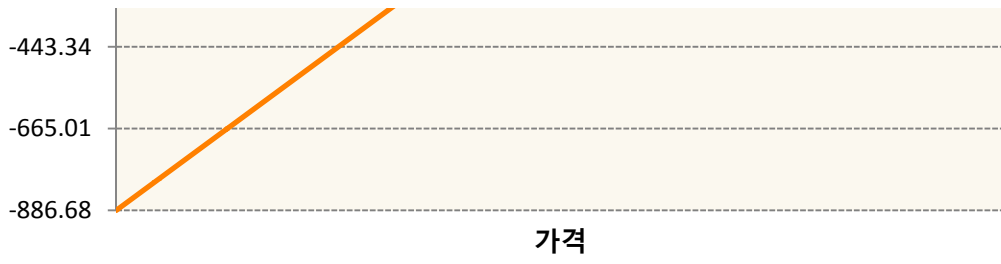
2. 만기시점의 손익구조

CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18

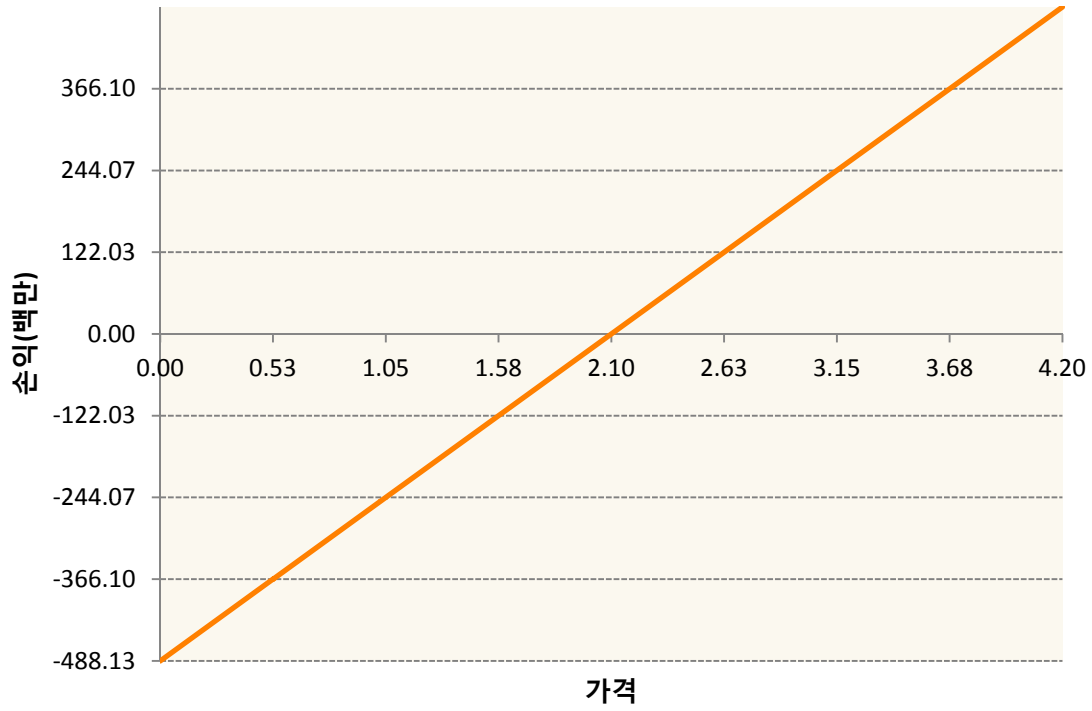


COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18

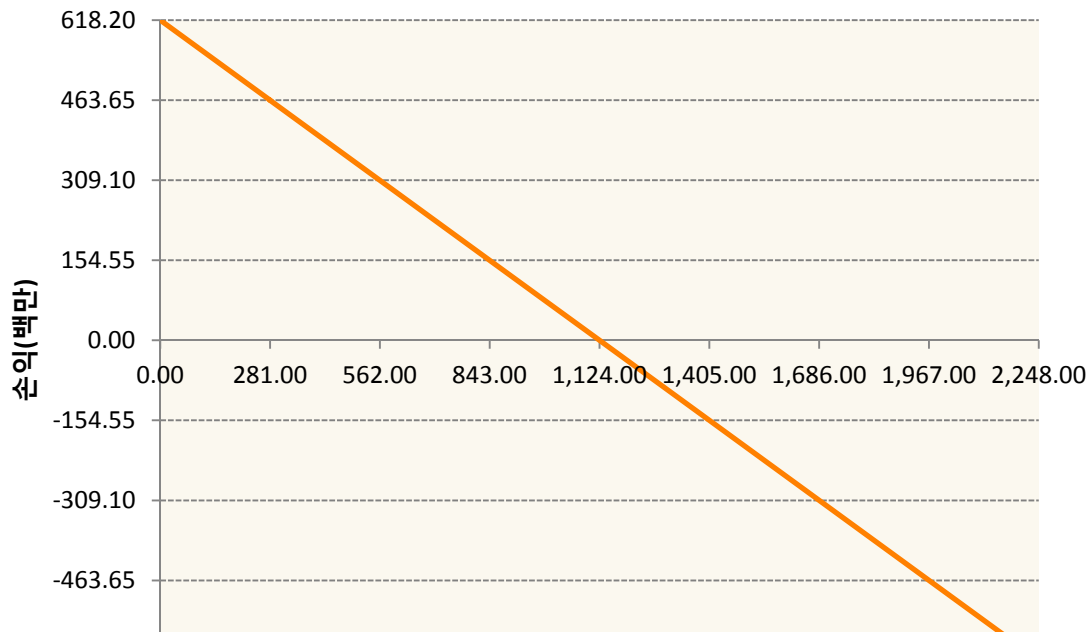


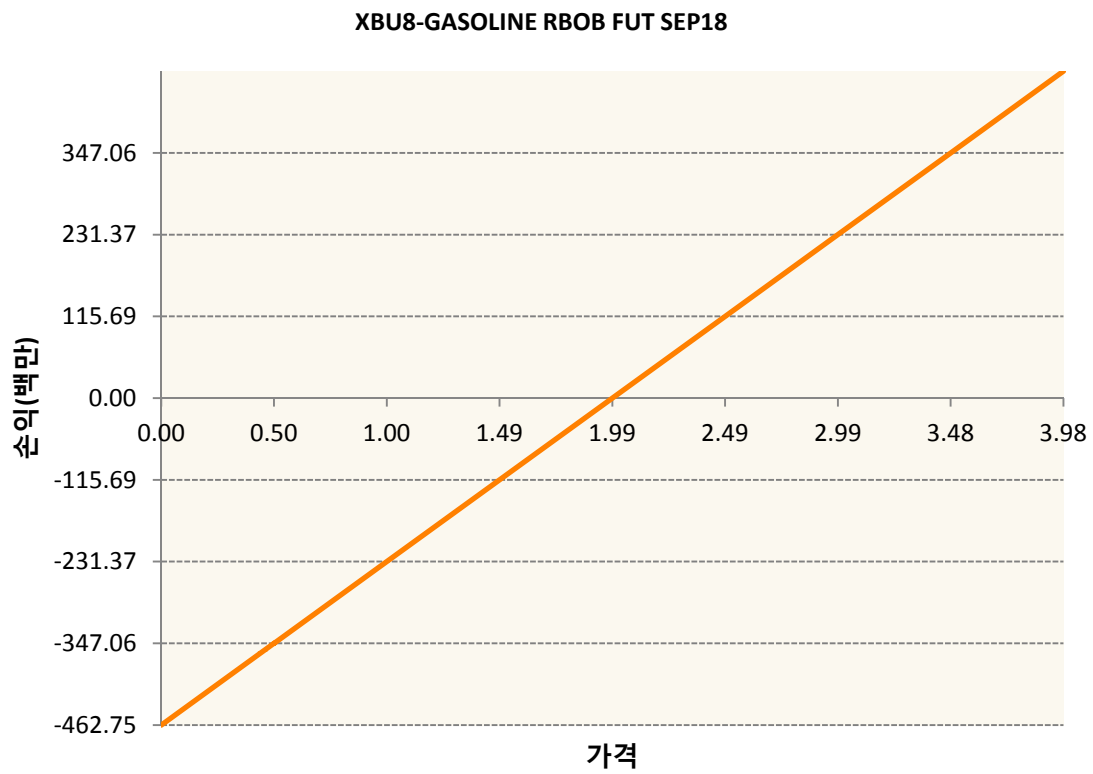
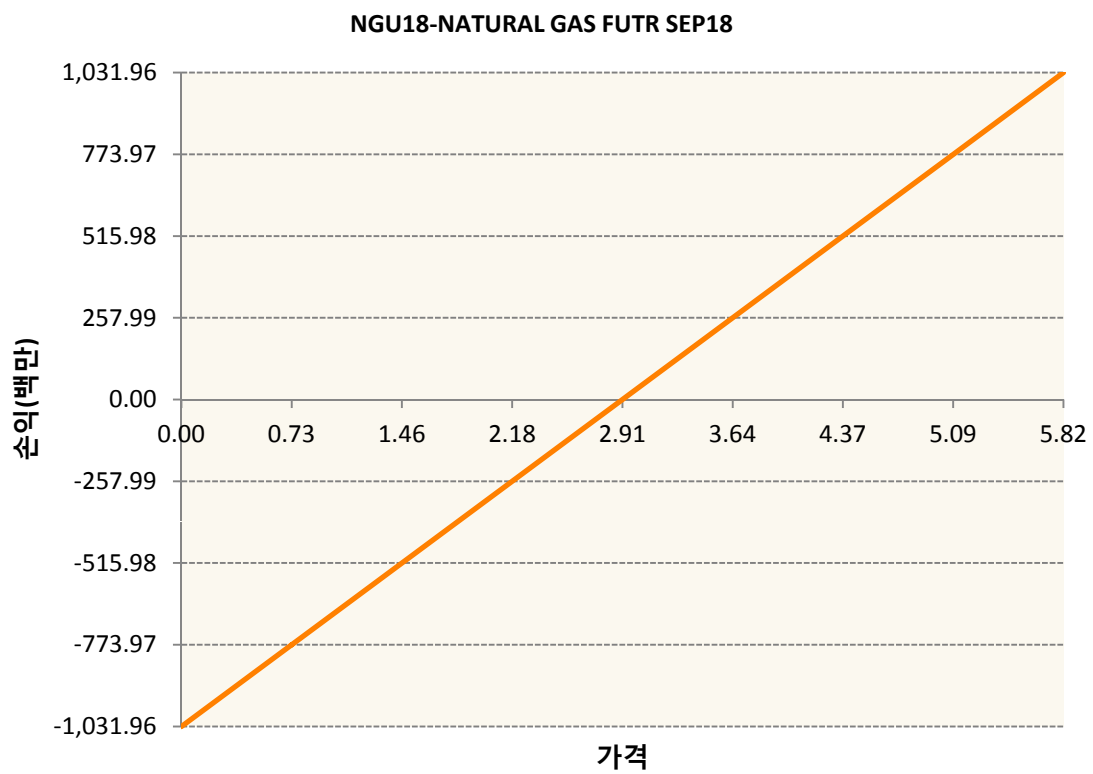
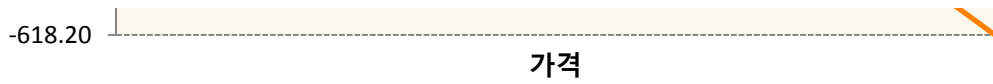


HOU8-NY Harb ULSD Fut SEP18



KR4175N90000-2018-09 달러선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU8	WTI CRUDE FUTURE SEP18	58
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	71
HOU8	NY Harb ULSD Fut SEP18	39
KR4175N90C	2018-09 달러선물	49
NGU18	NATURAL GAS FUTR SEP18	83
XBU8	GASOLINE RBOB FUT SEP18	37

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

440

공시일	2018-08-20
기준일	2018-08-17

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

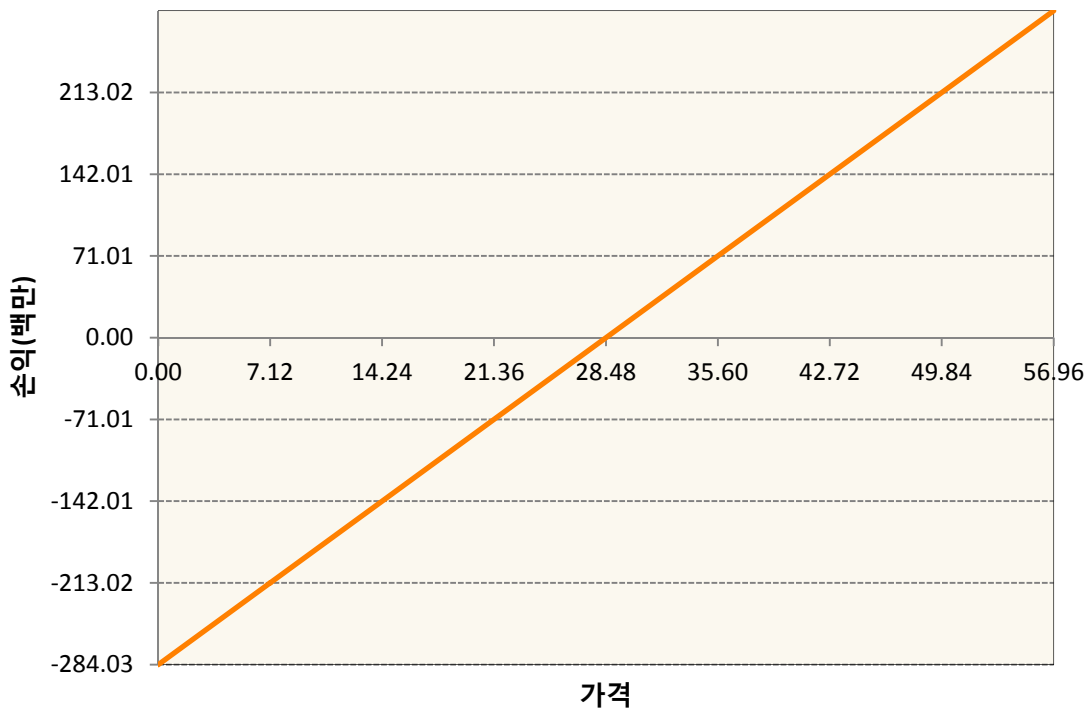
1. 계약금액

(단위:백만원)

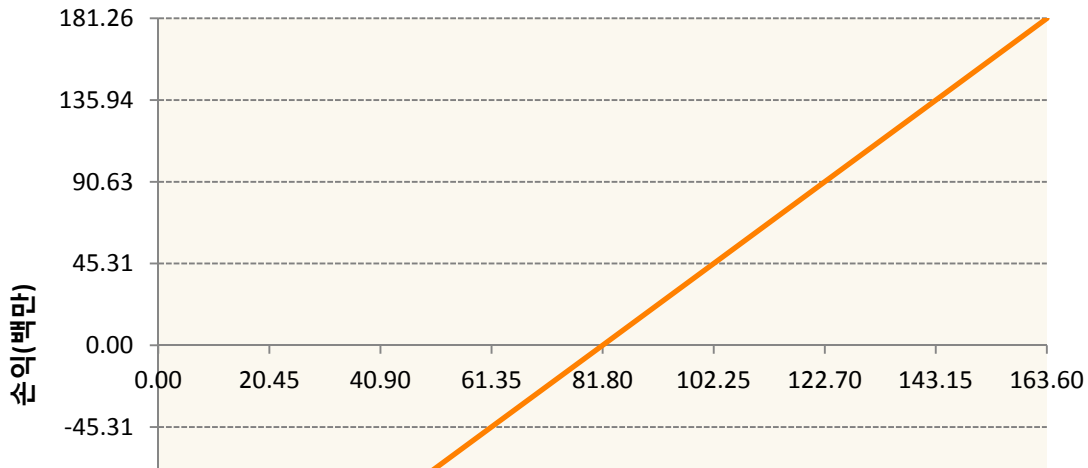
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,659	79	3,580	

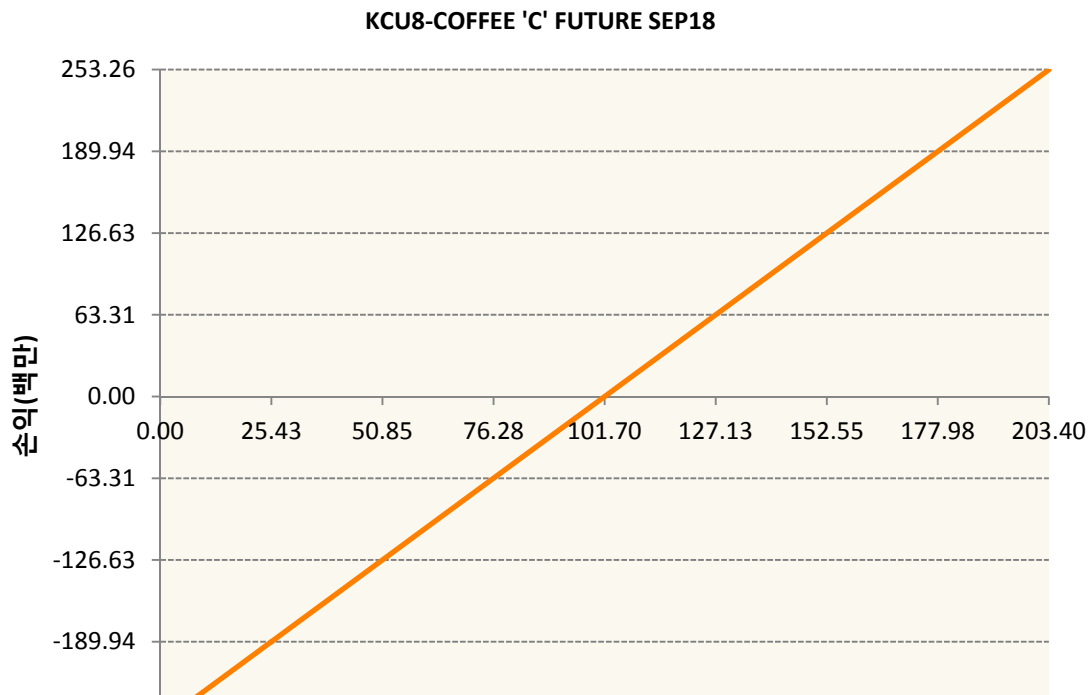
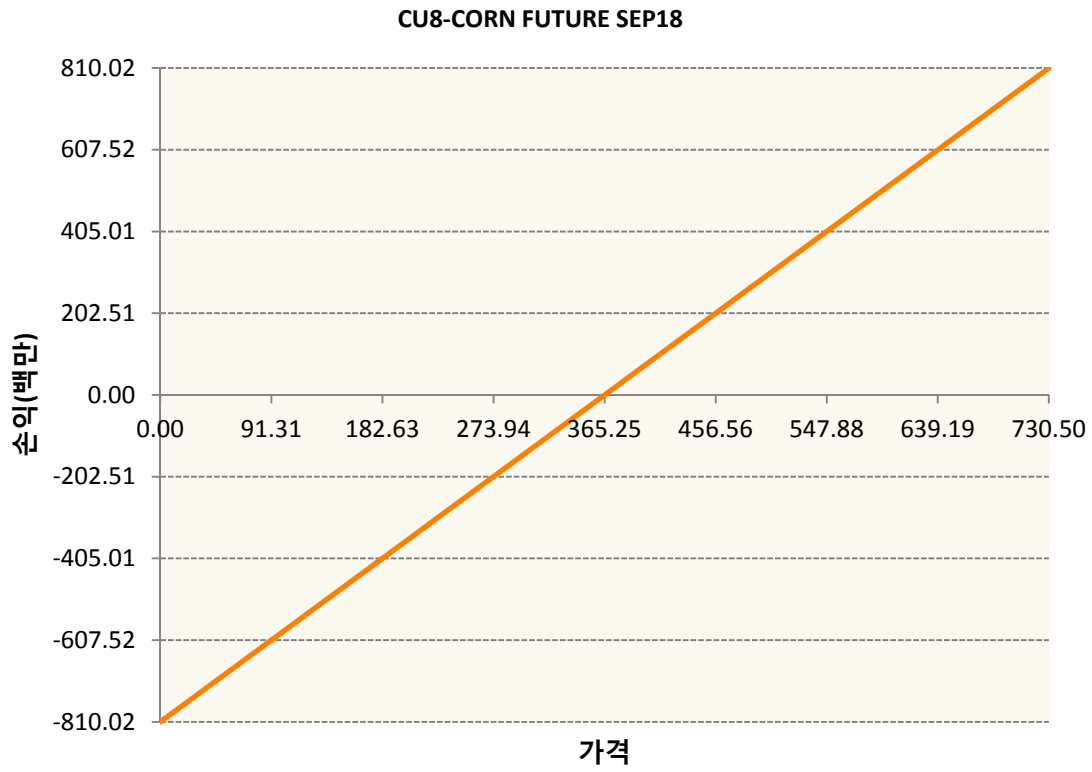
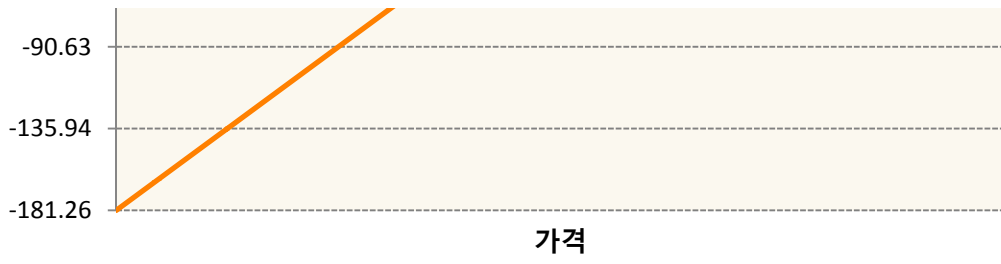
2. 만기시점의 손익구조

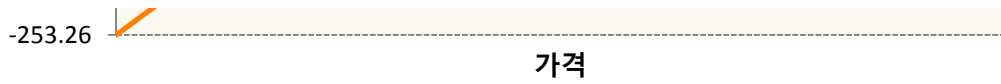
BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18



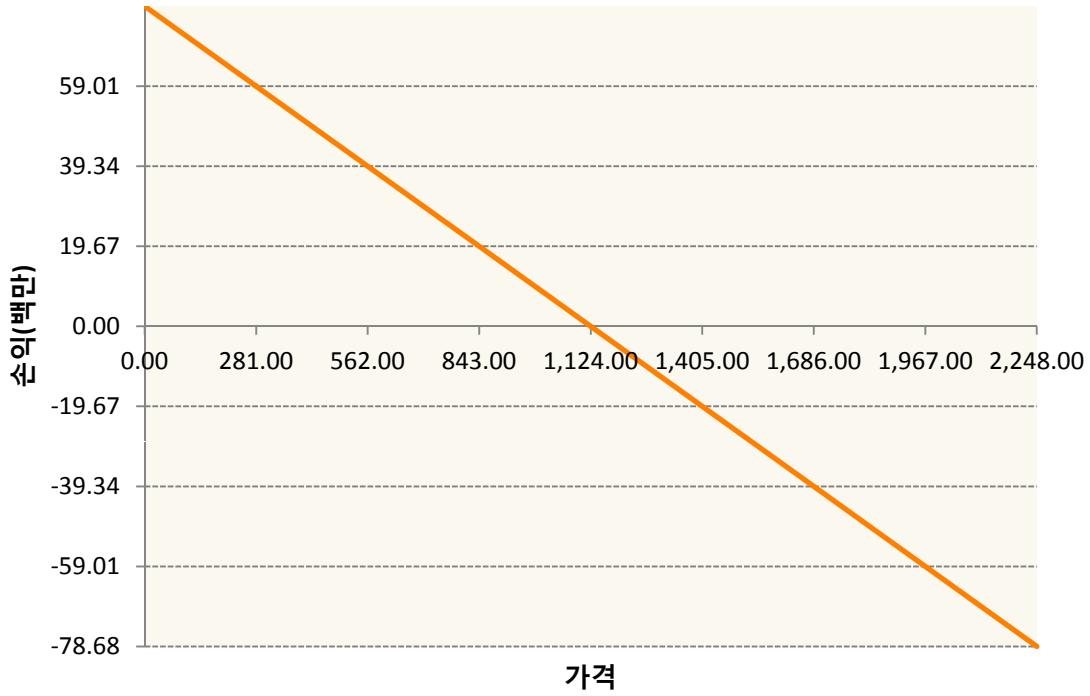
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



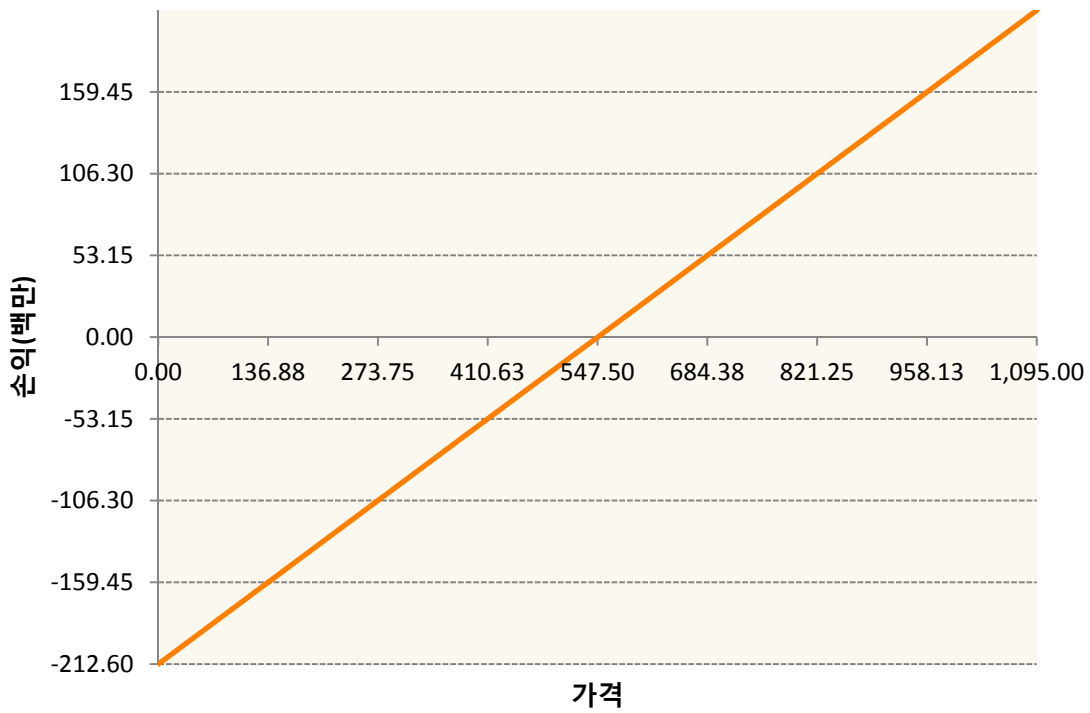




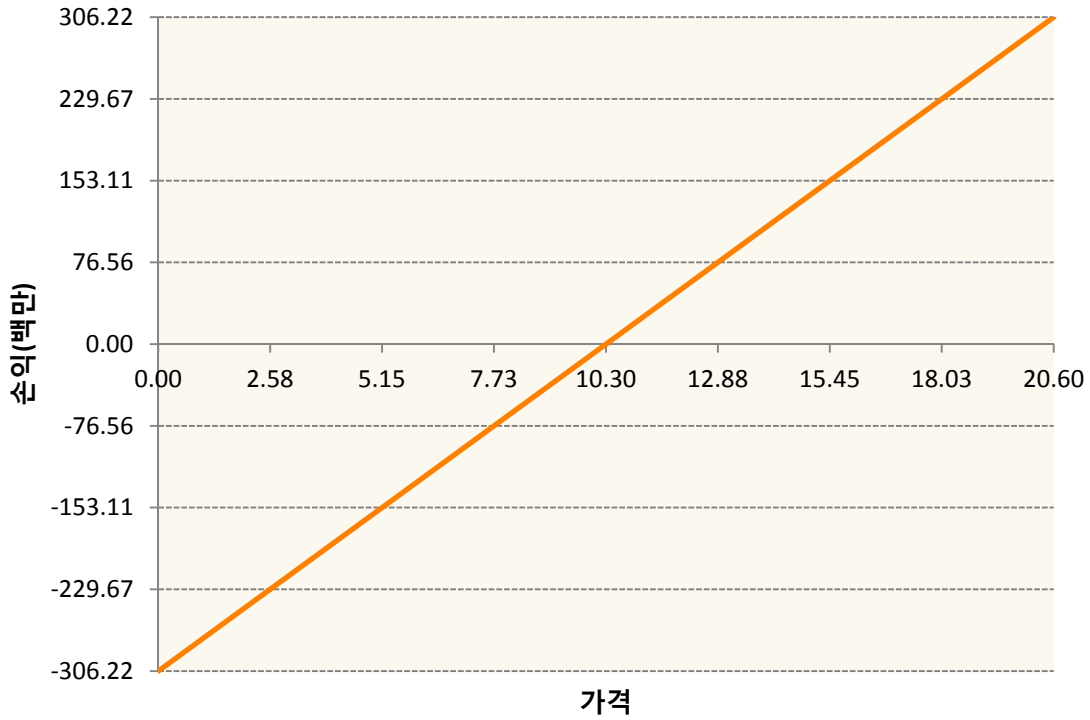
KR4175N90000-2018-09 달러선물



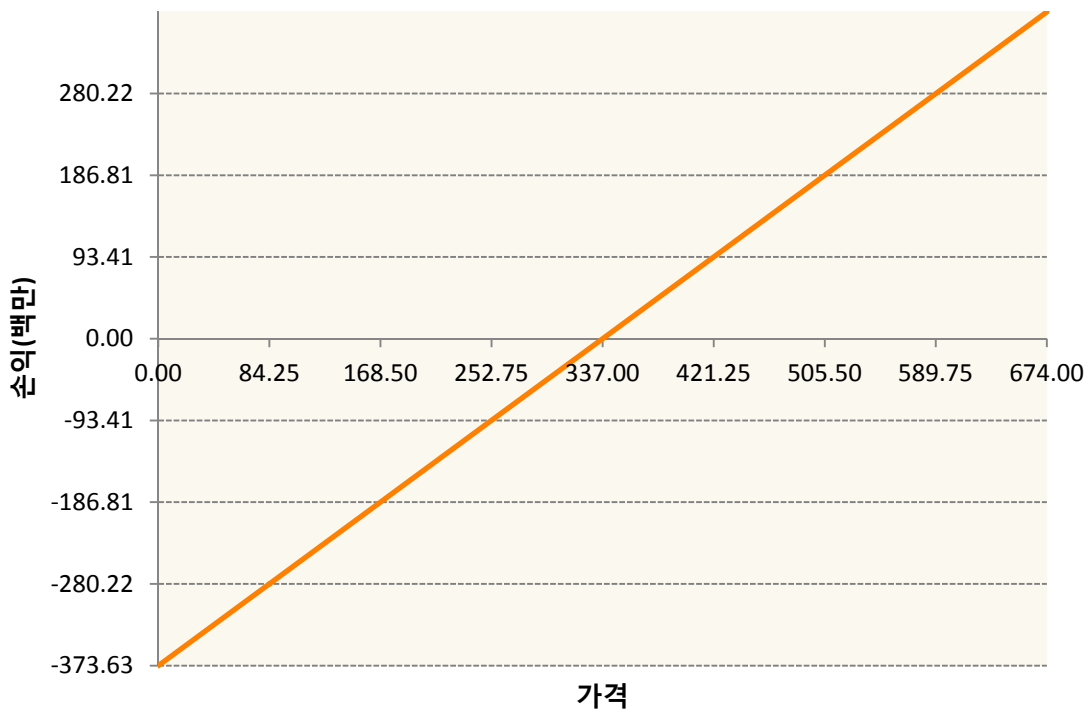
KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

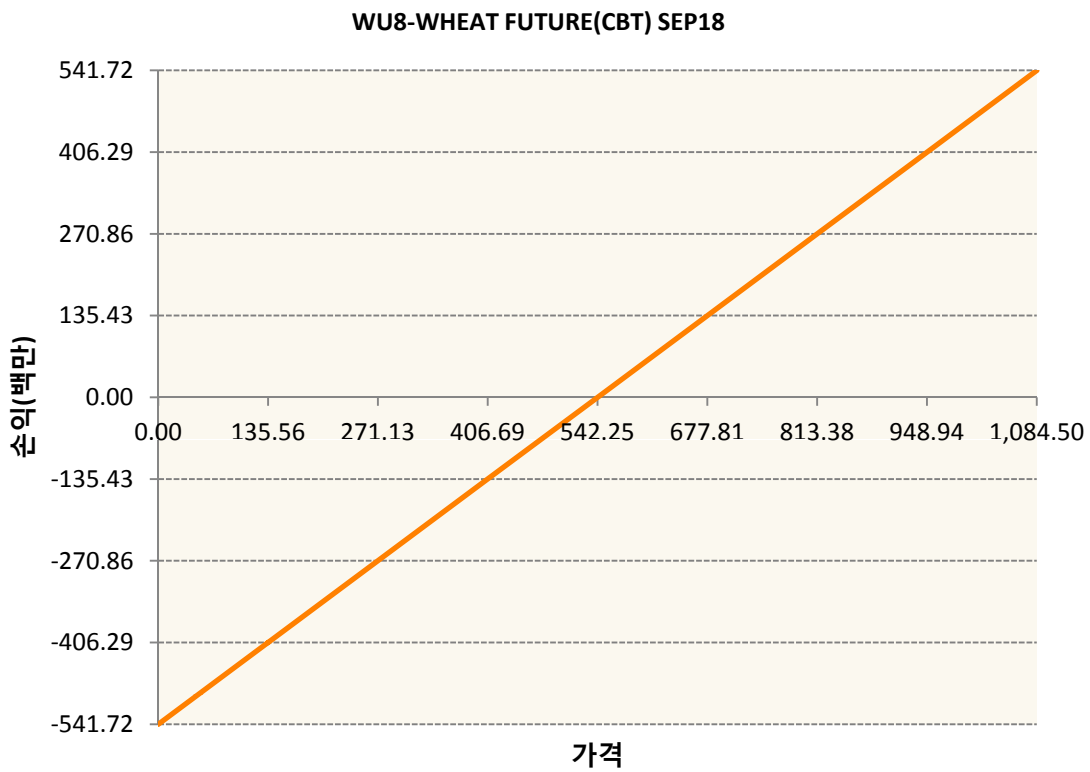
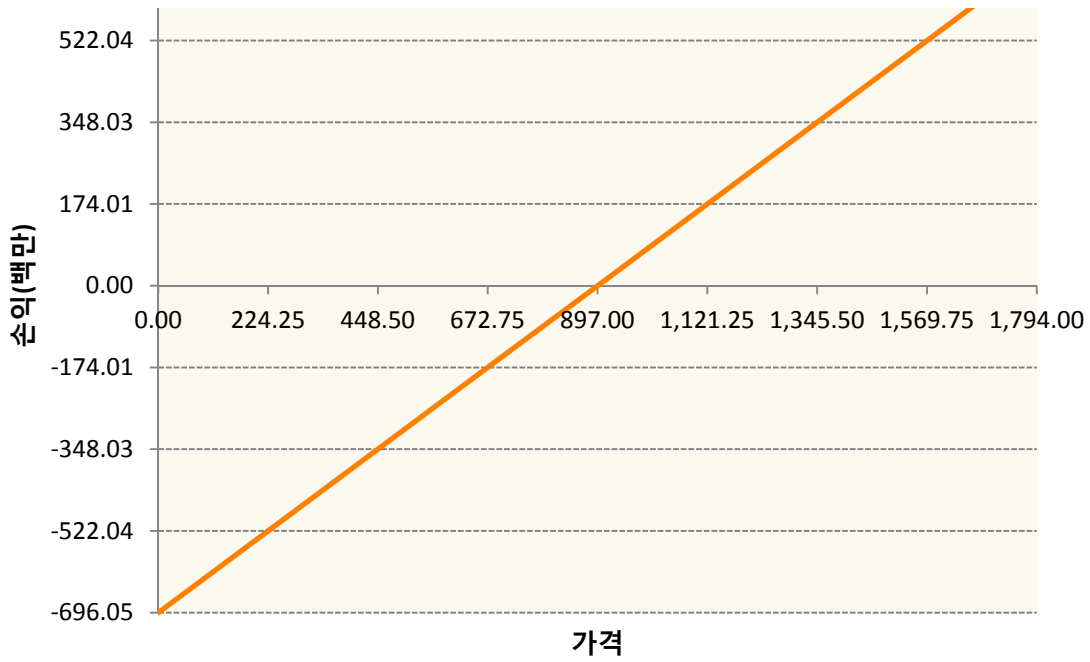


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



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	65
KCU8	COFFEE 'C' FUTURE SEP18	20
KR4175N90C	2018-09 달러선물	6

KWU8	KC HRW WHEAT FUT SEP18	17
SBV8	SUGAR #11 (WORLD) OCT18	24
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	30
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	56
WU8	WHEAT FUTURE(CBT) SEP18	43

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

(단위:백만원)

310