

공시일	2018-08-16
기준일	2018-08-14

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	2018-08-16
기준일	2018-08-14

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

1,128

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

477

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-16
기준일	2018-08-14

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	2018-08-16
기준일	2018-08-14

유로인덱스모(주식-파생형)

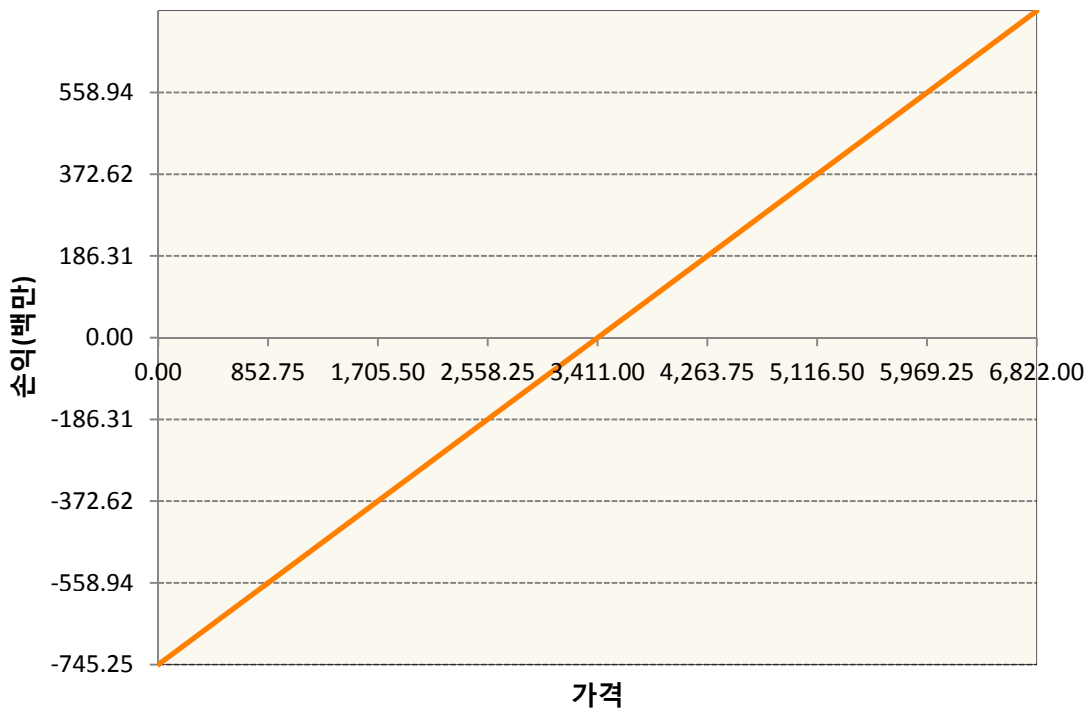
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	745	0	745	

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	2018-08-16
기준일	2018-08-14

차이나인덱스모(주식-파생형)

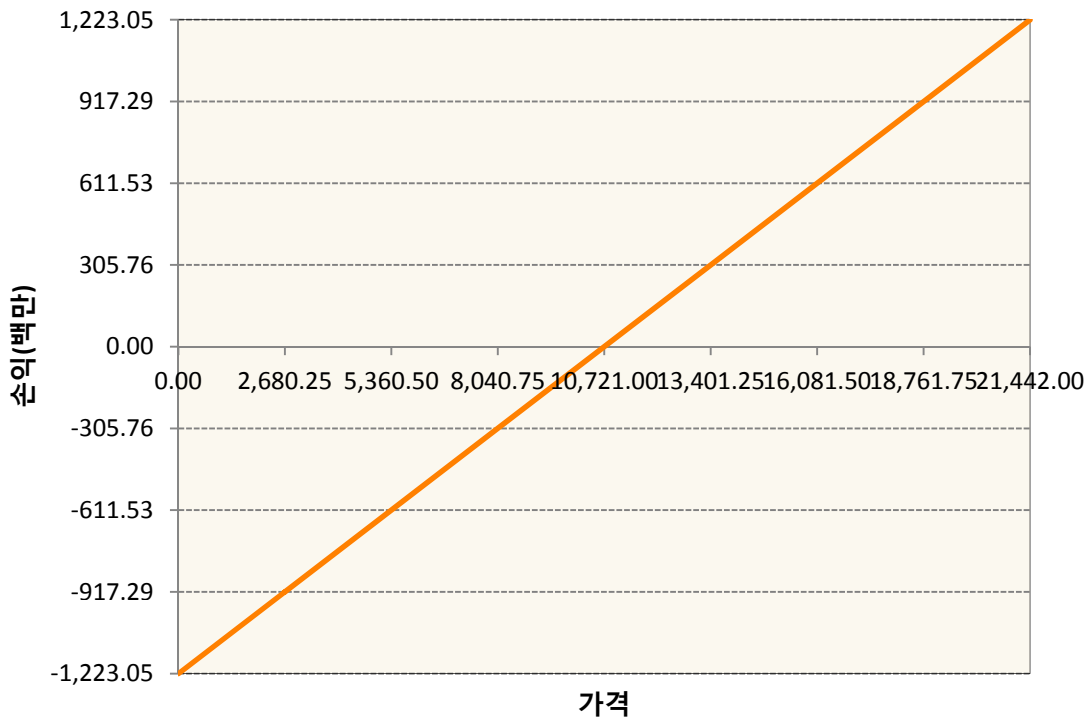
1. 계약금액

(단위:백만원)

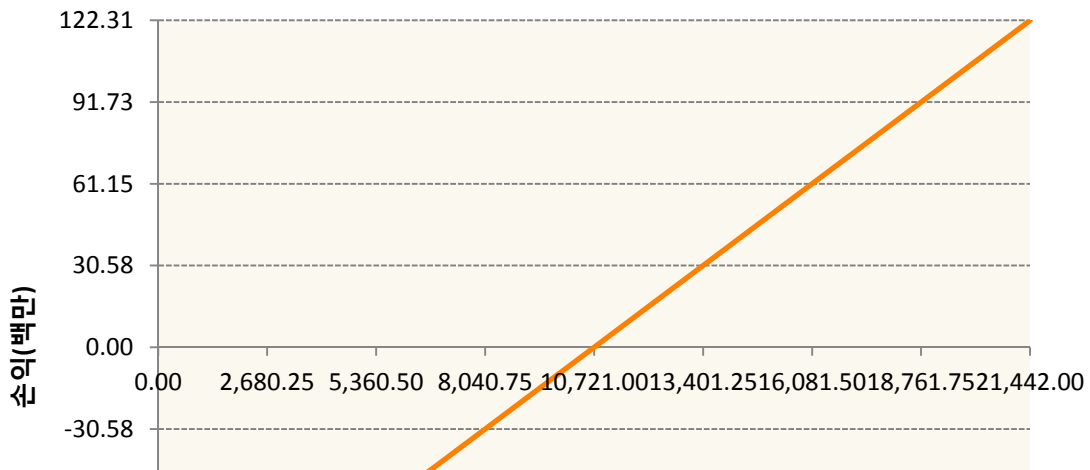
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,345	0	1,345	장내

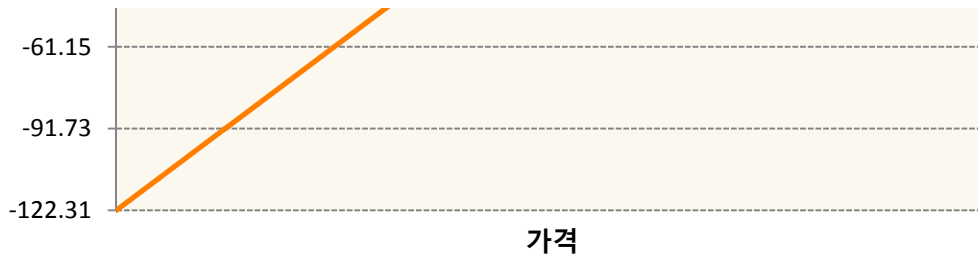
2. 만기시점의 손익구조

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)

98

공시일	2018-08-16
기준일	2018-08-14

커버드콜모(주식혼합-파생형)

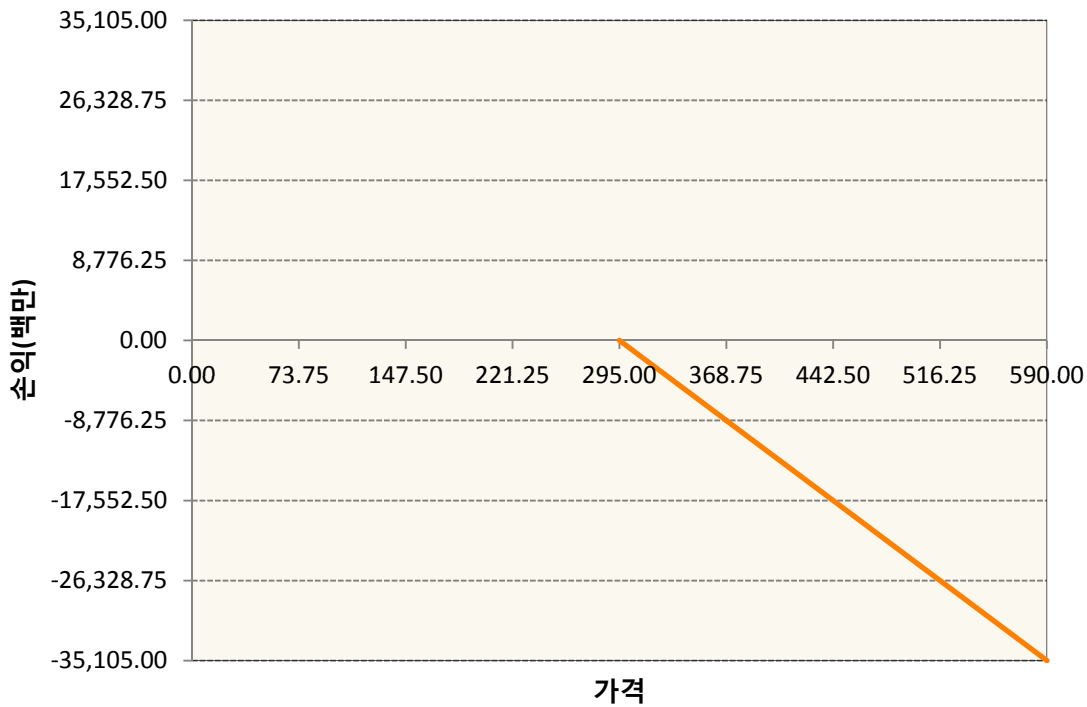
1. 계약금액

(단위:백만원)

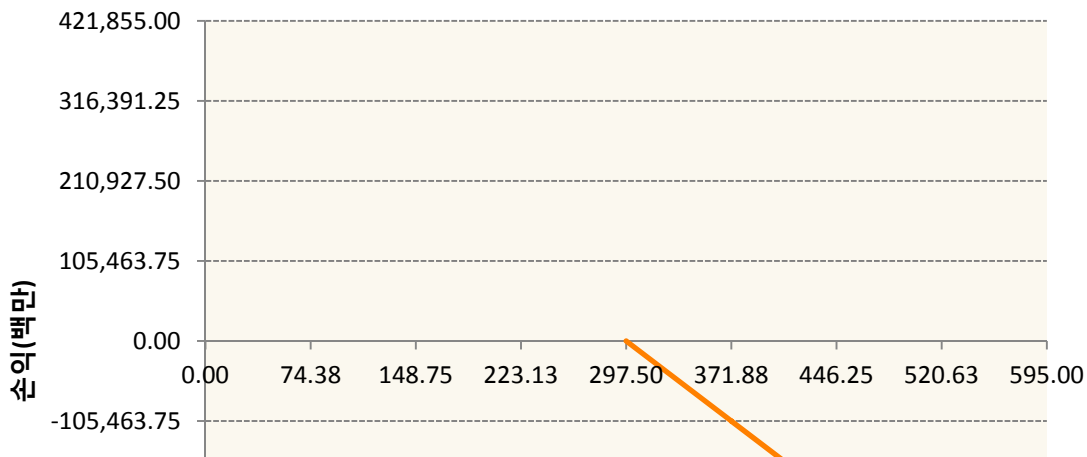
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	746,874	-746,874	장내

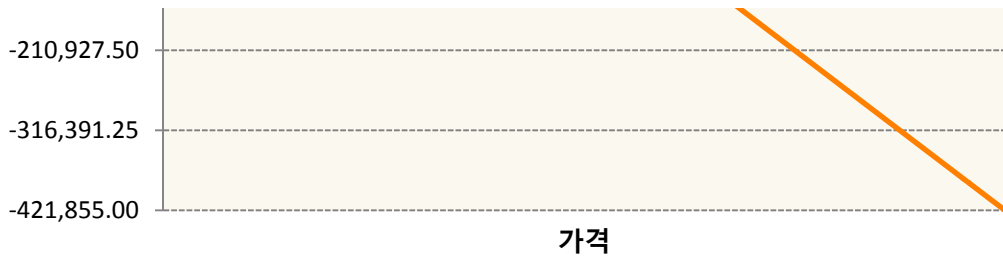
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92950-2018-09 콜295

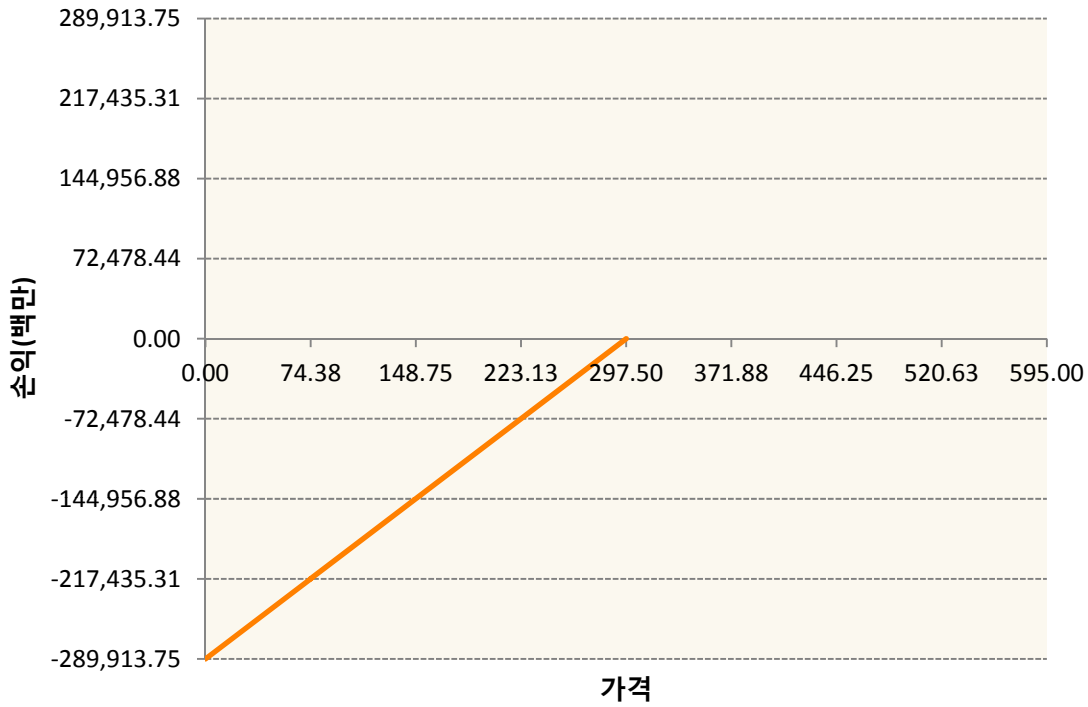


KR4201N92976-2018-09 콜297.5





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N929 2018-09 콜295

1,979

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	834	808	775	737	693	645	592
-5.33%	753	704	650	591	528	462	393
-2.67%	579	506	430	352	272	191	108
0%	269	180	90	0	-90	-180	-271
2.67%	-200	-291	-382	-474	-565	-657	-749
5.33%	-824	-902	-982	-1,065	-1,149	-1,234	-1,321
8.00%	-1,572	-1,629	-1,691	-1,758	-1,829	-1,902	-1,979

KR4201N929 2018-09 풋297.5

22,469

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,689	8,436	8,108	7,710	7,248	6,729	6,159

-5.33%	7,945	7,445	6,871	6,236	5,548	4,816	4,046
-2.67%	6,260	5,467	4,629	3,754	2,851	1,925	980
0%	3,116	2,088	1,048	0	-1,055	-2,116	-3,180
2.67%	-1,859	-2,965	-4,071	-5,178	-6,285	-7,392	-8,499
5.33%	-8,715	-9,717	-10,740	-11,778	-12,829	-13,890	-14,958
8.00%	-17,180	-17,954	-18,783	-19,657	-20,567	-21,506	-22,469

KR4301N929 2018-09 풋 297.5

20,849

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20,793	-20,794	-20,796	-20,801	-20,810	-20,826	-20,849
-5.33%	-13,250	-13,262	-13,286	-13,322	-13,373	-13,440	-13,524
-2.67%	-5,824	-5,915	-6,031	-6,171	-6,333	-6,513	-6,711
0%	856	583	297	0	-306	-619	-937
2.67%	5,489	5,130	4,770	4,409	4,048	3,687	3,325
5.33%	7,560	7,338	7,094	6,834	6,559	6,272	5,976
8.00%	8,095	8,027	7,934	7,817	7,677	7,516	7,336

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

(단위:백만원)

45,289

공시일	2018-08-16
기준일	2018-08-14

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

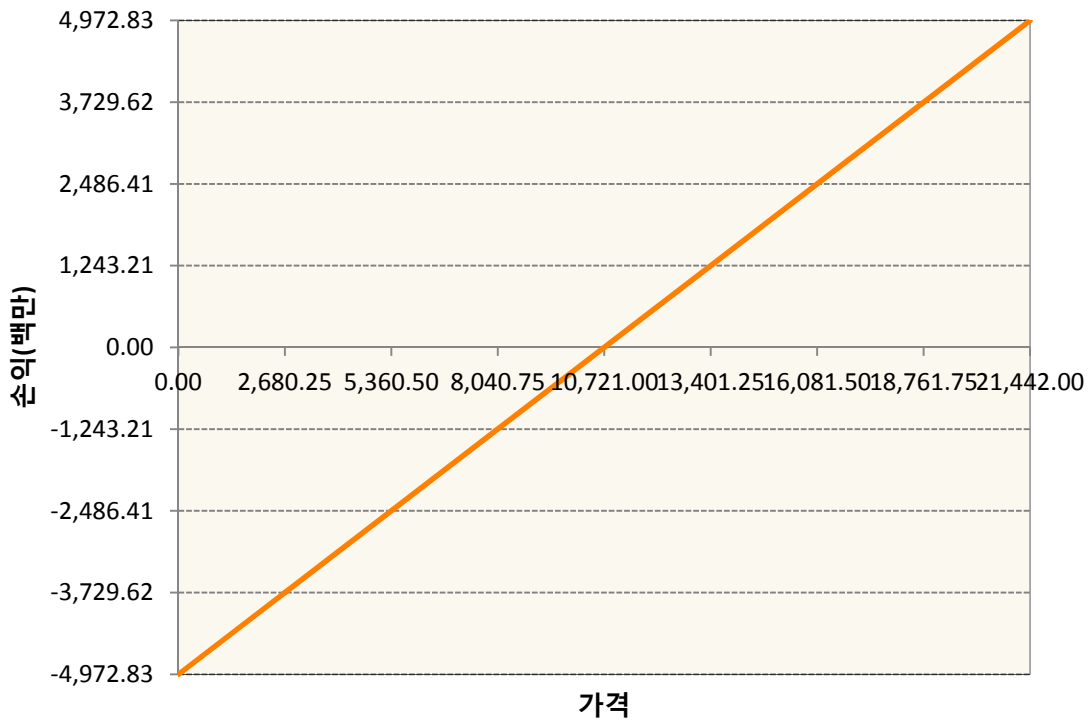
1. 계약금액

(단위:백만원)

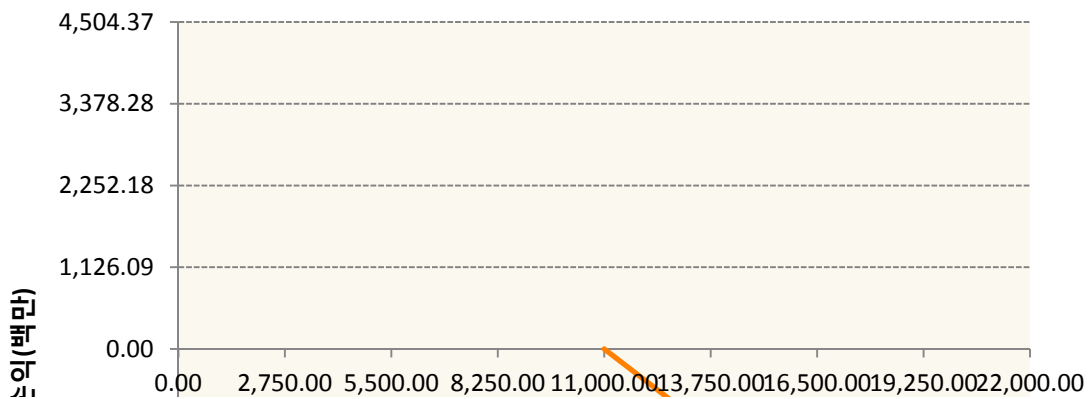
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,973	0	4,973	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,583	-11,583	장내

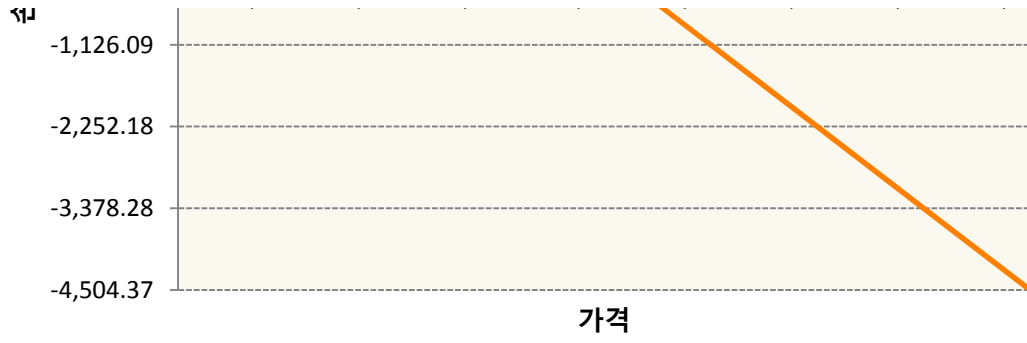
2. 만기시점의 손익구조

HCQ8-HSCEI Futures Aug18

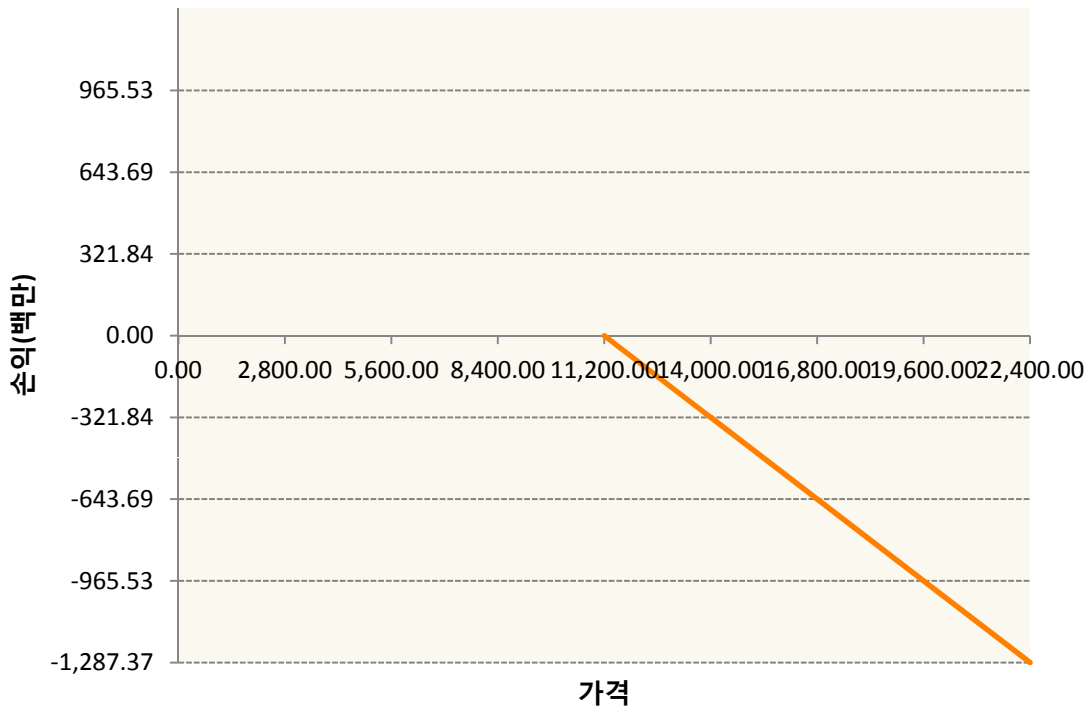


OHHIQ8-C110-HSCEI

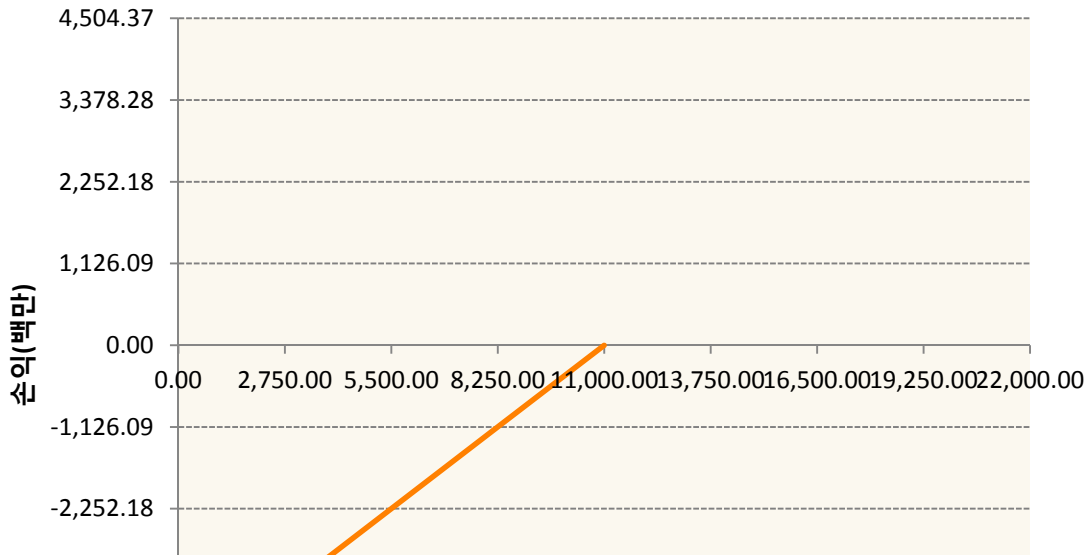


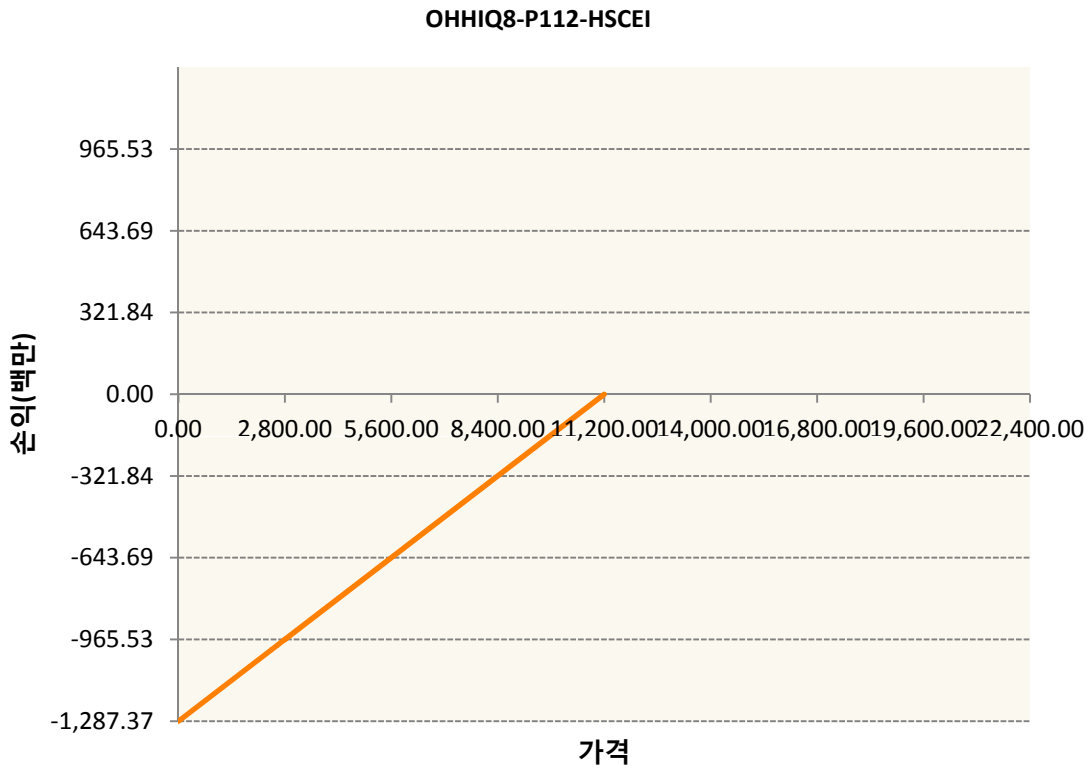
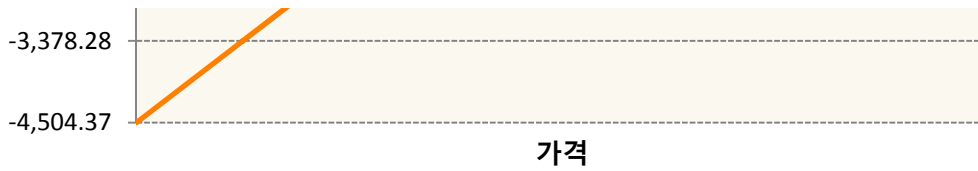


OHHIQ8-C112-HSCEI



OHHIQ8-P110-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ8	HSCEI Futures Aug18	398
OHHIQ8-C1:	HSCEI	360
OHHIQ8-C1:	HSCEI	103
OHHIQ8-P11:	HSCEI	360
OHHIQ8-P11:	HSCEI	103

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,210

공시일	2018-08-16
기준일	2018-08-14

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

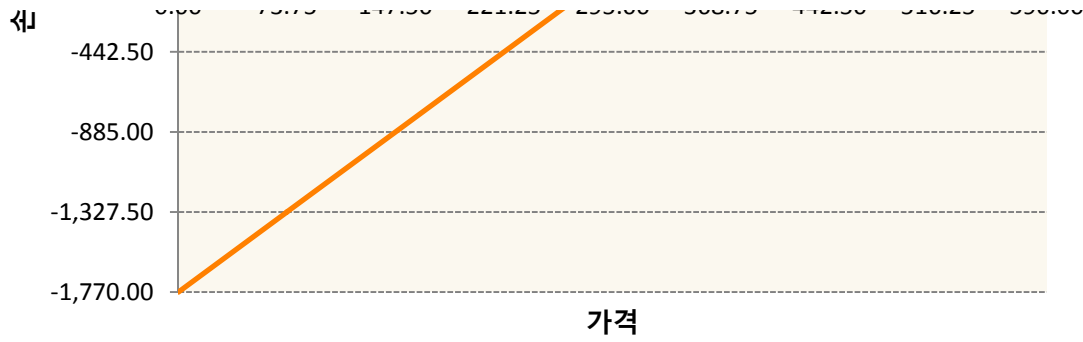
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92976-2018-09 콜297.5

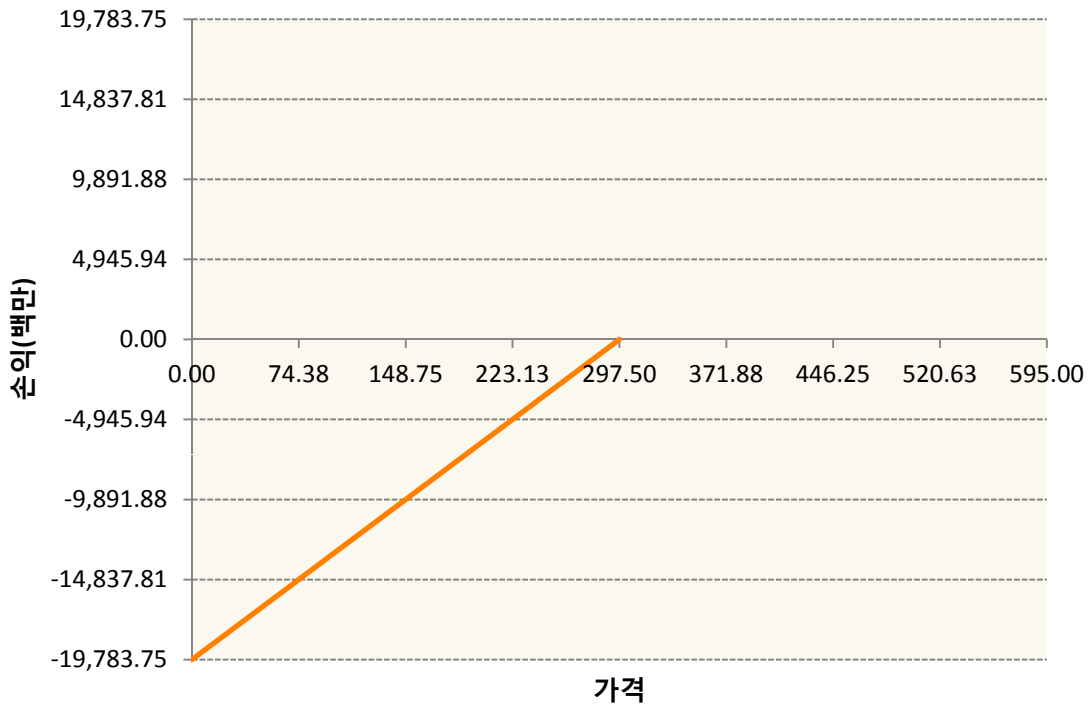


KR4301N92958-2018-09 풋295





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,975
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,975	-3,975	-3,975	-3,975	-3,975	-3,975	-3,975
-5.33%	-2,650	-2,650	-2,650	-2,650	-2,650	-2,650	-2,650
-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%	2,650	2,650	2,650	2,650	2,650	2,650	2,650
8.00%	3,975	3,975	3,975	3,975	3,975	3,975	3,975
KR4201N92974-2018-09 풋297.5							1,497
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	579	562	540	514	483	448	410
-5.33%	529	496	458	416	370	321	270
-2.67%	417	364	308	250	190	128	65
0%	208	139	70	0	-70	-141	-212
2.67%	-124	-198	-271	-345	-419	-493	-566
5.33%	-581	-648	-716	-785	-855	-926	-997
8.00%	-1,145	-1,196	-1,252	-1,310	-1,371	-1,433	-1,497

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	-123	-124	-124	-124
-5.33%	-77	-77	-77	-78	-78	-79	-79
-2.67%	-32	-33	-34	-35	-36	-38	-39
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	29	27	25	23	21	19	17
5.33%	38	37	36	35	33	32	30
8.00%	40	40	39	39	38	37	36

KR4301N929 2018-09 풋297.5

1,423

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,419	-1,419	-1,419	-1,419	-1,420	-1,421	-1,423
-5.33%	-904	-905	-907	-909	-913	-917	-923
-2.67%	-397	-404	-412	-421	-432	-444	-458
0%	58	40	20	0	-21	-42	-64
2.67%	375	350	325	301	276	252	227
5.33%	516	501	484	466	448	428	408
8.00%	552	548	541	533	524	513	501

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

(단위:백만원)

7,052

공시일	2018-08-16
기준일	2018-08-14

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

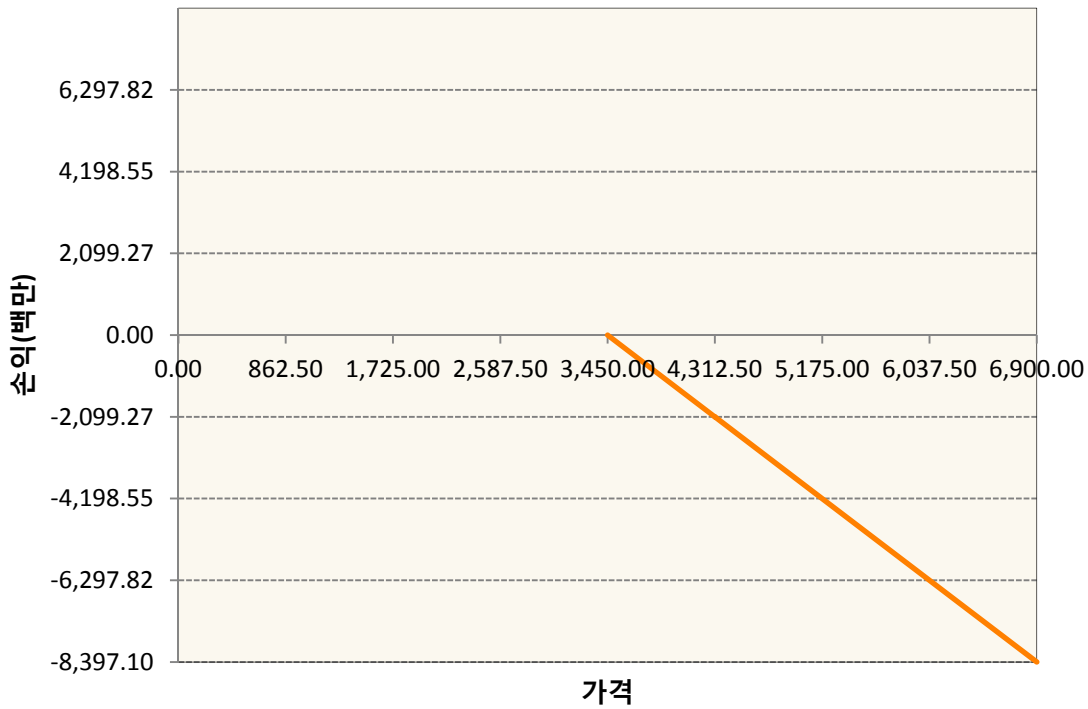
1. 계약금액

(단위:백만원)

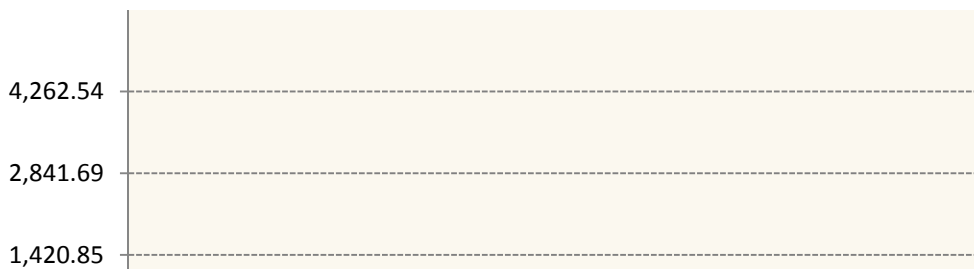
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,808	0	6,808	
누계	유가증권	옵션	0	22,483	-22,483	장내
누계	지수	스왑	86,287	0	86,287	장외

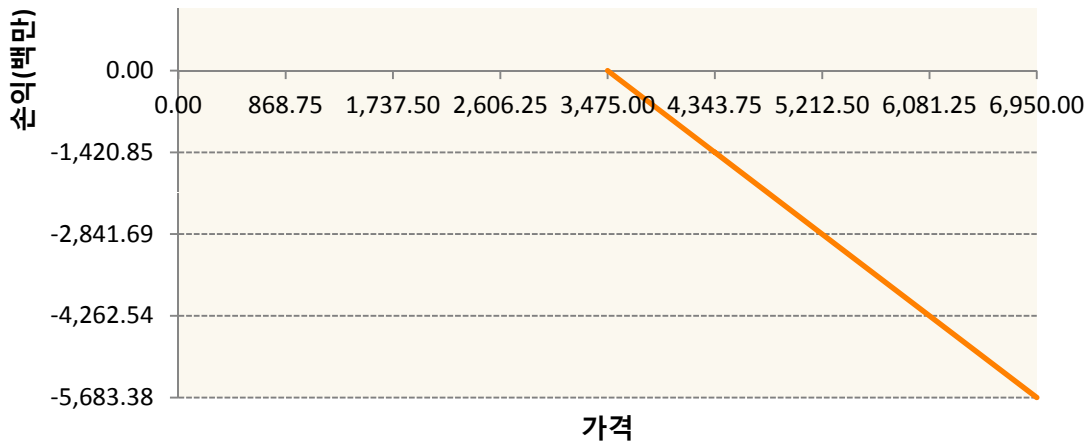
2. 만기시점의 손익구조

OESXQ8-C3450-EURO STOXX 50 OPT

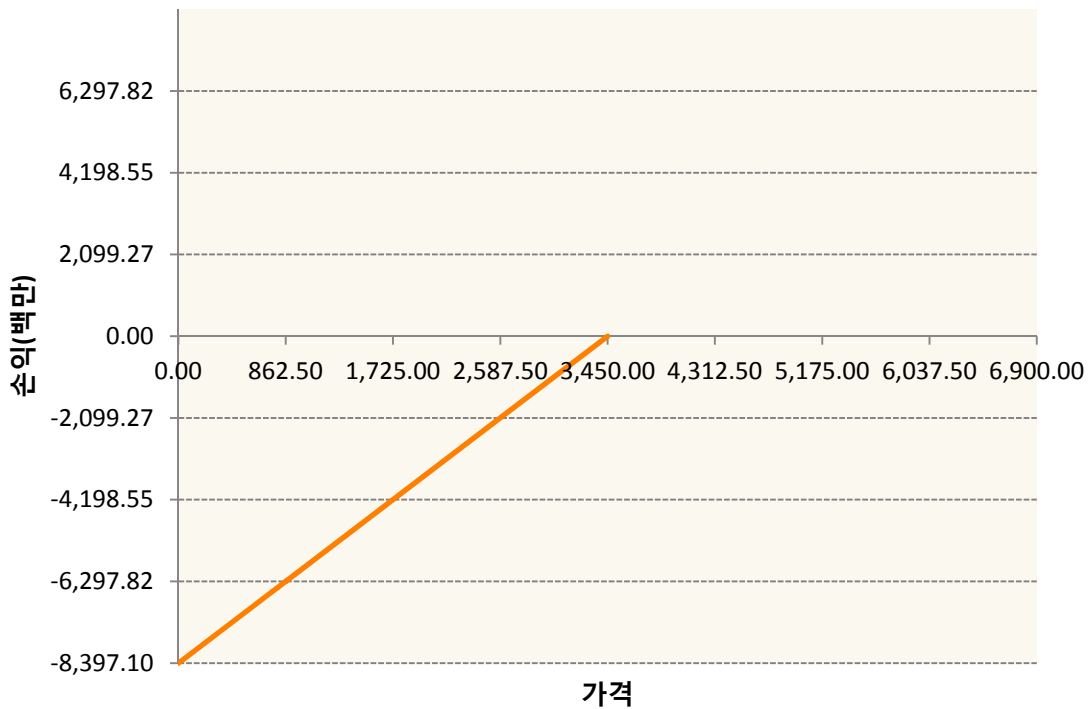


OESXQ8-C3475-EURO STOXX 50 OPT

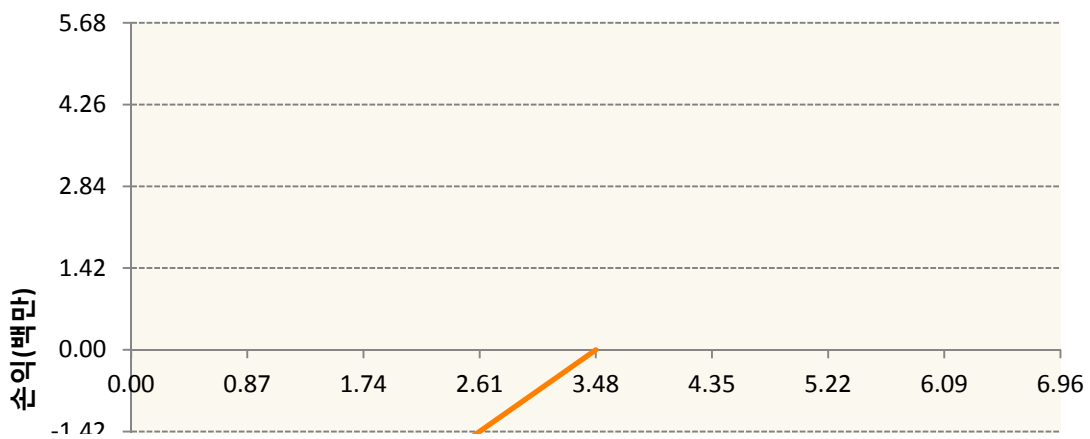


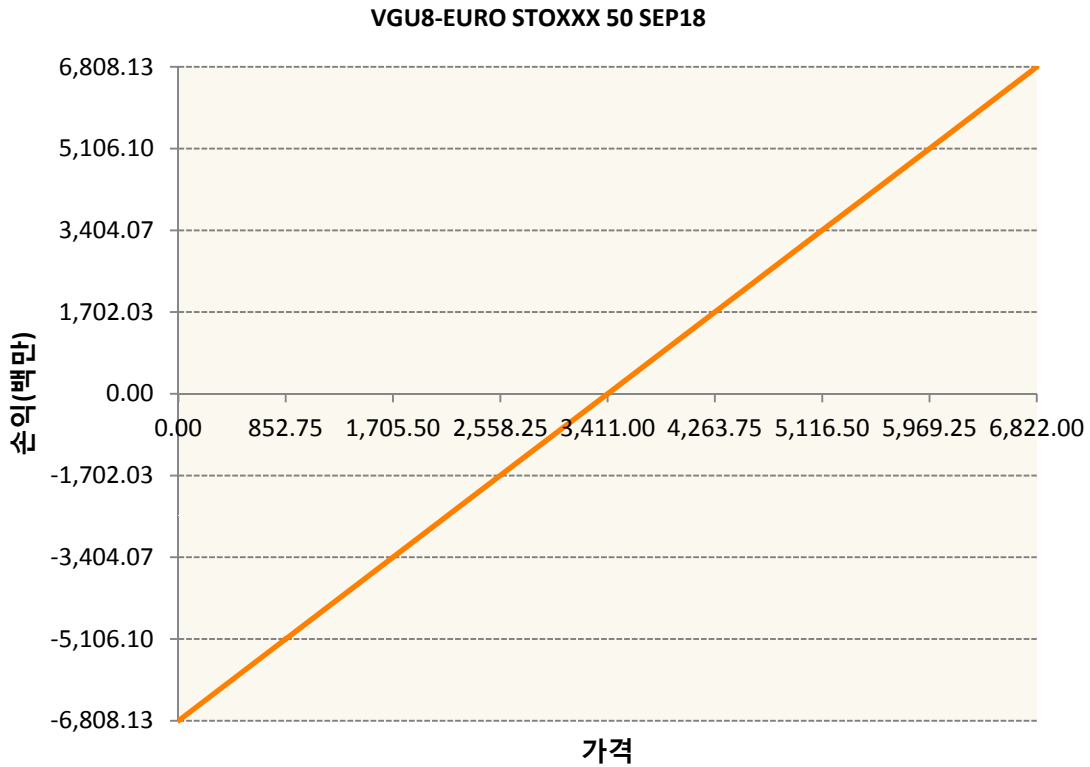


OESXQ8-P3450-EURO STOXX 50



OESXQ8-P3475-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	14
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	9
OESXQ8-C3 EURO STOXX 50 OPT	672
OESXQ8-C3 EURO STOXX 50 OPT	455
OESXQ8-P3 EURO STOXX 50	672
OESXQ8-P3 EURO STOXX 50	0.5
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18	545

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

1,490

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

(단위:백만원)

1,120

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	2018-08-16
기준일	2018-08-14

스마트KRX300인덱스목표전환형1

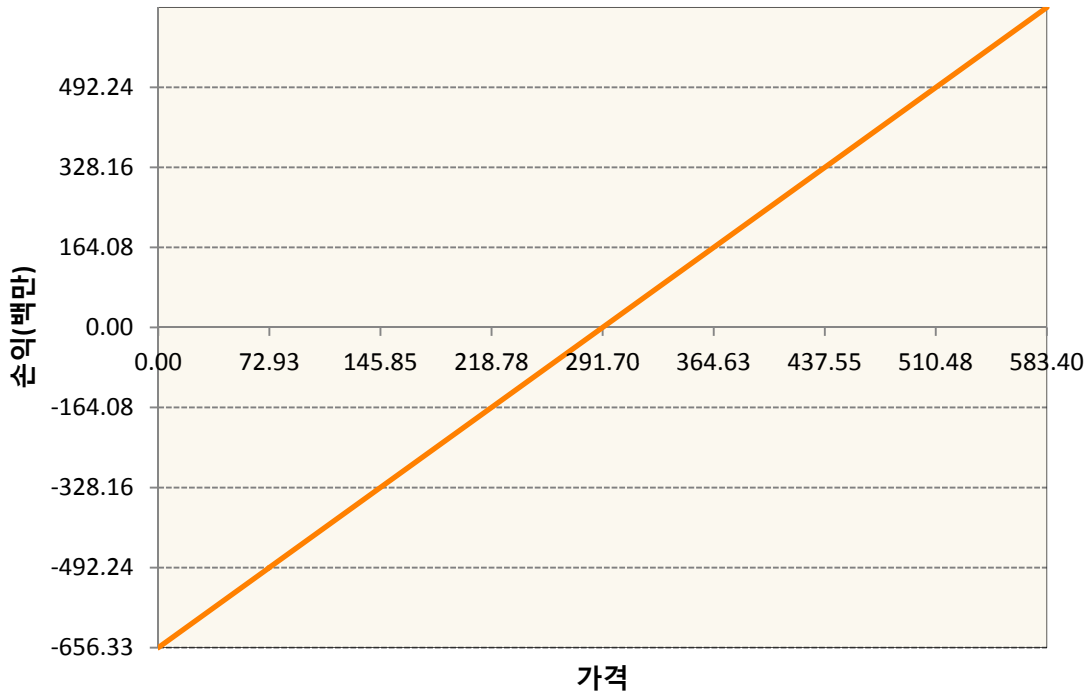
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	656	0	656	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	2018-08-16
기준일	2018-08-14

리디파인K200(주식혼합-파생재간

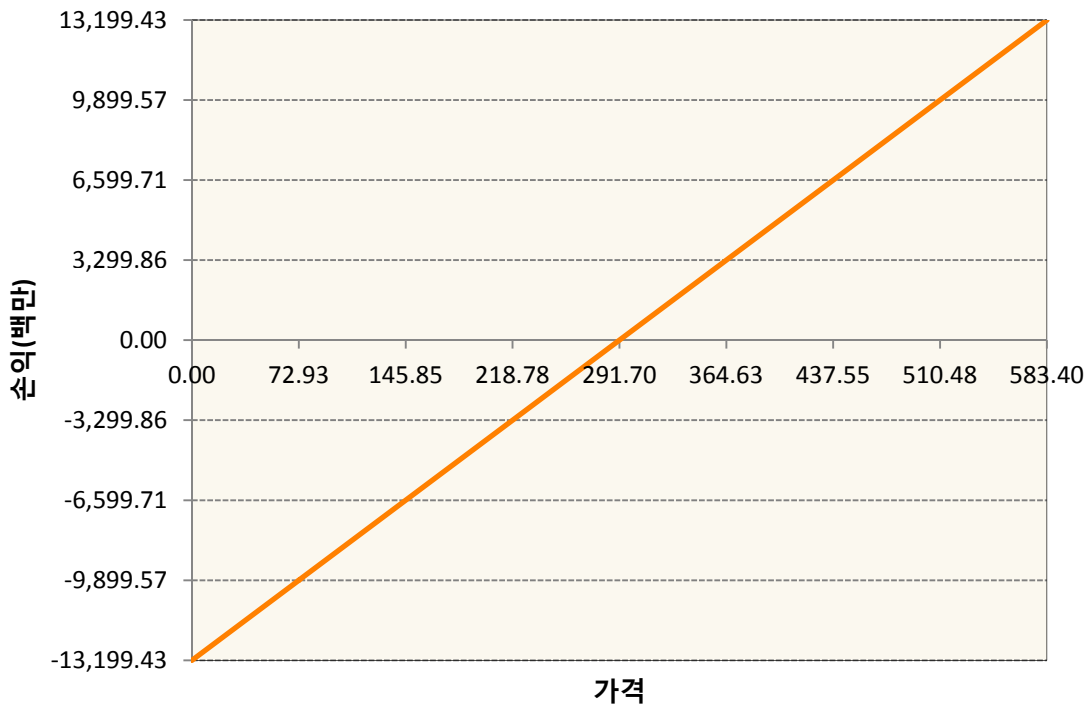
1. 계약금액

(단위:백만원)

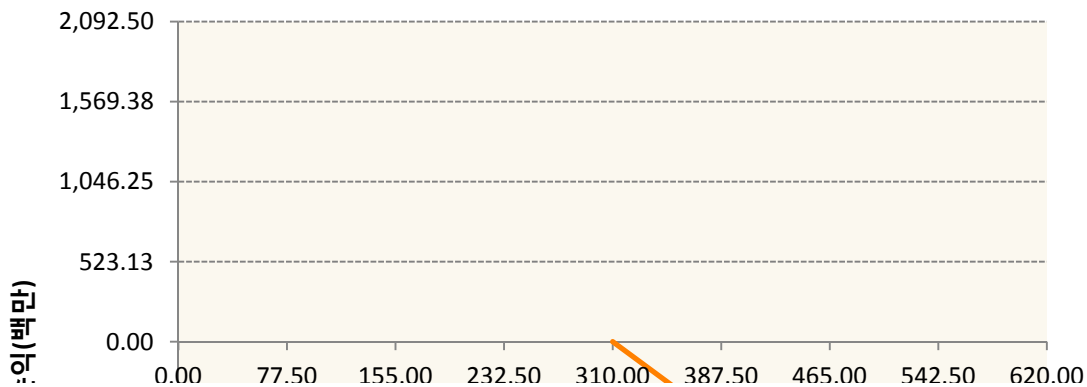
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,199	0	13,199	장내
누계	유가증권	옵션	1,339	24,358	-23,019	장내

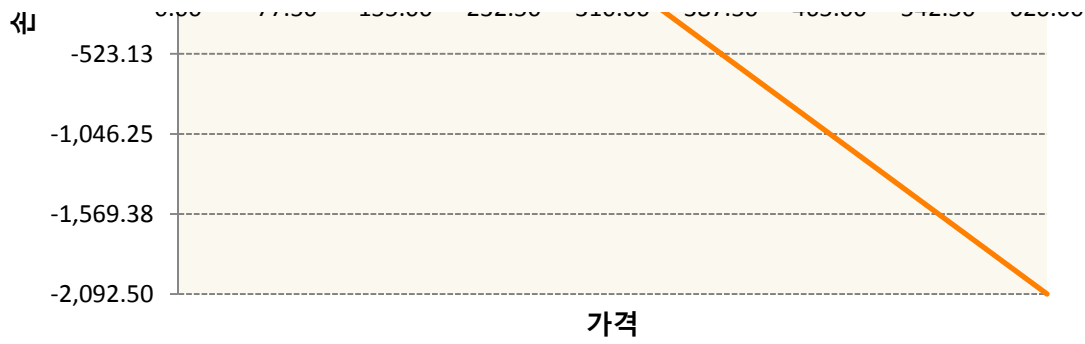
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

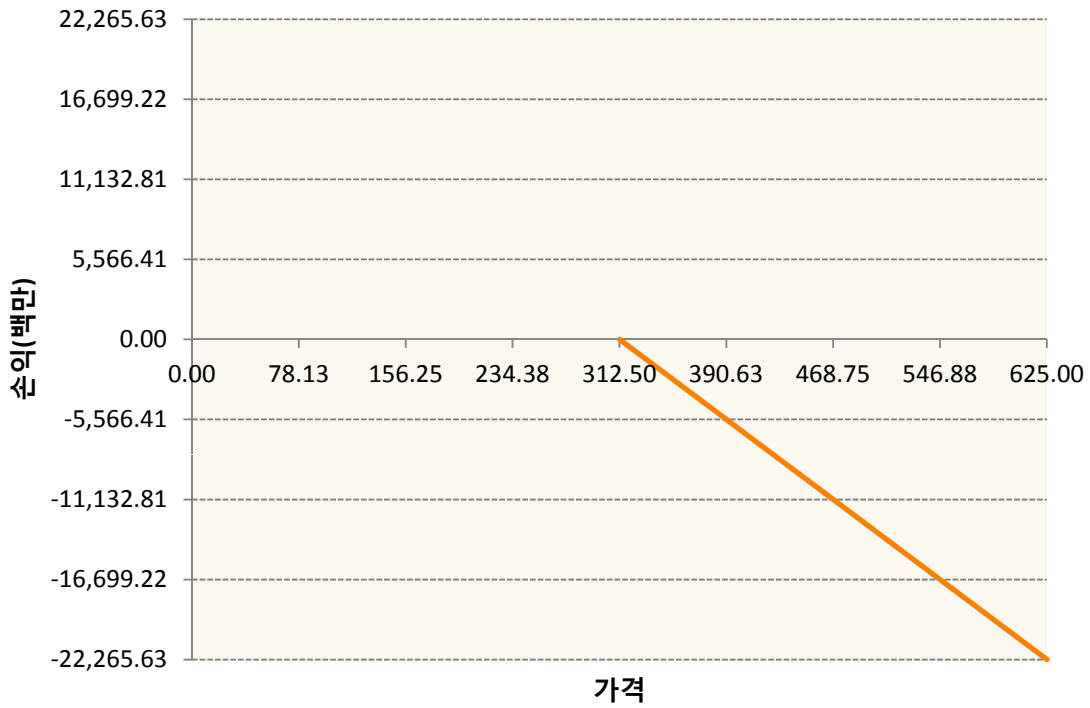


KR4201N93107-2018-09 콜310

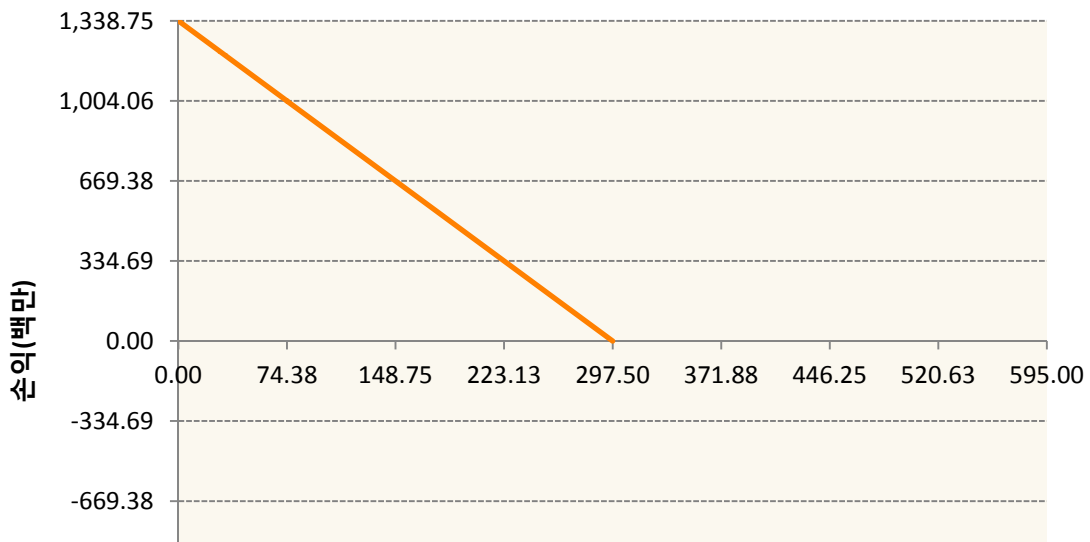


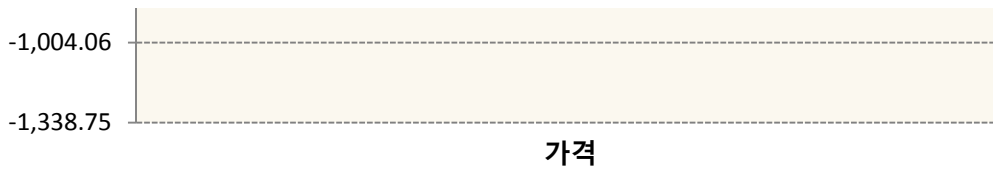


KR4201N93123-2018-09 콜312.5



KR4301N92974-2018-09 풋297.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물							1,054
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,054	-1,054	-1,054	-1,054	-1,054	-1,054	-1,054
-5.33%	-702	-702	-702	-702	-702	-702	-702
-2.67%	-351	-351	-351	-351	-351	-351	-351
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	351	351	351	351	351	351	351
5.33%	702	702	702	702	702	702	702
8.00%	1,054	1,054	1,054	1,054	1,054	1,054	1,054
KR4201N931 2018-09 콜310							79
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19	19	18	17	16	15	13
-5.33%	18	17	16	15	13	11	8
-2.67%	16	14	12	9	6	3	0
0%	10	7	4	0	-4	-8	-12
2.67%	-1	-5	-10	-15	-19	-24	-29
5.33%	-19	-24	-30	-35	-41	-46	-51
8.00%	-46	-52	-57	-63	-68	-73	-79
KR4201N931 2018-09 콜312.5							774
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	168	165	161	154	145	133	119
-5.33%	162	155	145	131	114	94	71
-2.67%	144	128	108	84	57	27	-6
0%	99	69	36	0	-39	-80	-122
2.67%	3	-41	-87	-135	-184	-234	-285
5.33%	-166	-221	-277	-333	-389	-445	-502
8.00%	-423	-482	-540	-599	-657	-715	-774
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	62
-2.67%	27	27	28	28	29	30	31

0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-25	-24	-22	-20	-19	-17	-15
5.33%	-35	-34	-33	-32	-30	-29	-28
8.00%	-37	-37	-37	-36	-35	-35	-34

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

(단위:백만원)

1,492

공시일	2018-08-16
기준일	2018-08-14

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

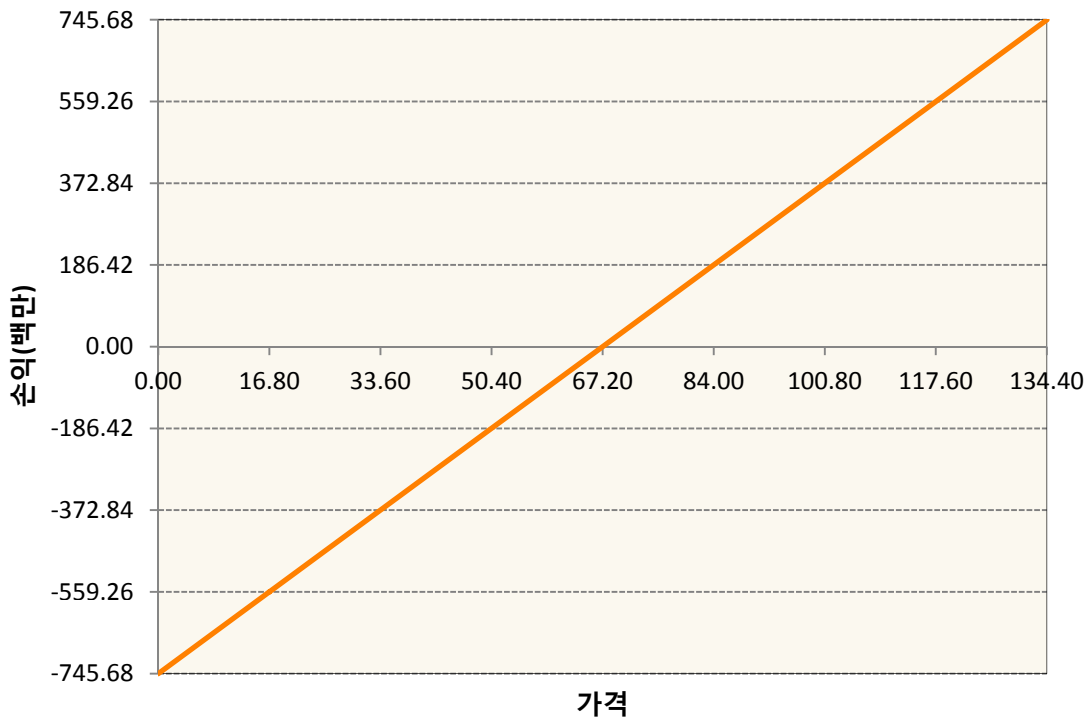
1. 계약금액

(단위:백만원)

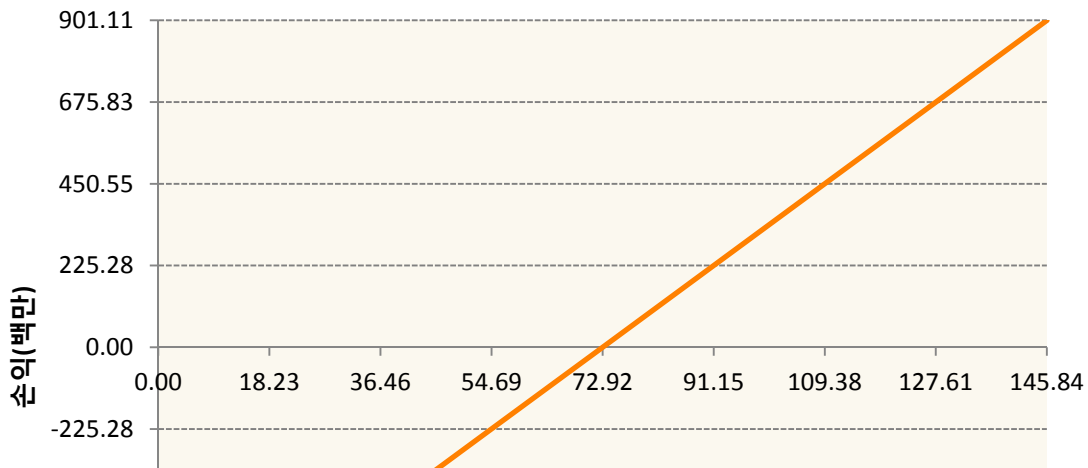
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,654	621	3,033	

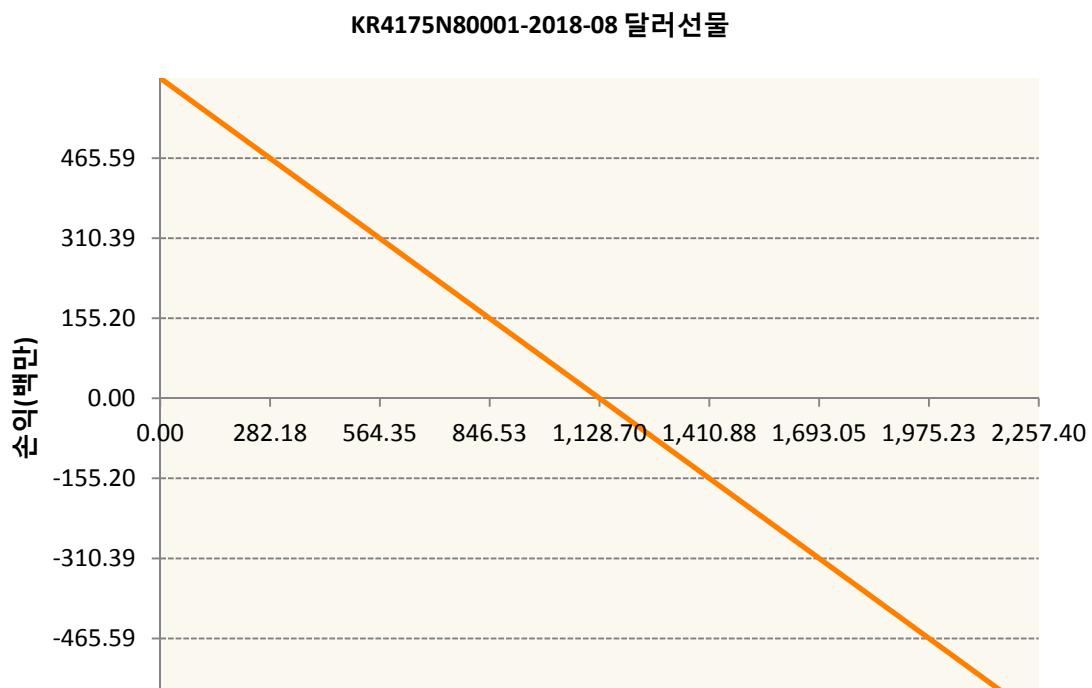
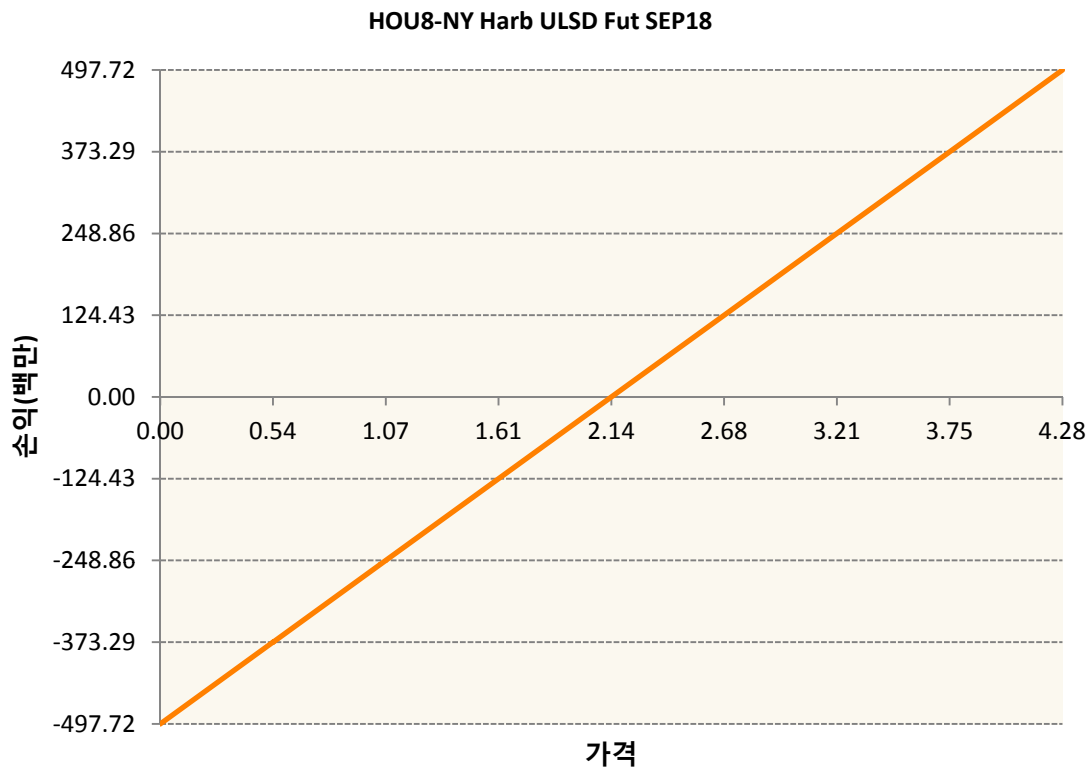
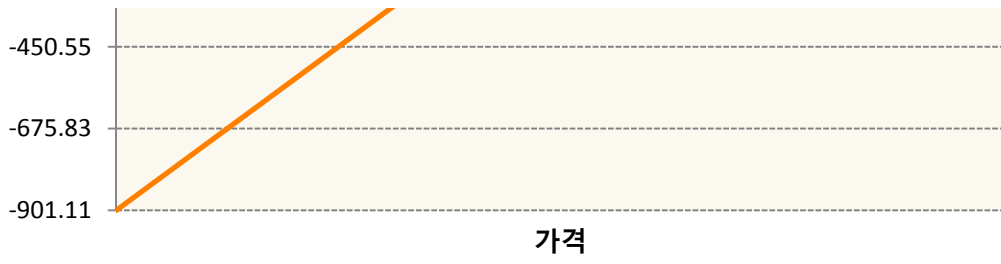
2. 만기시점의 손익구조

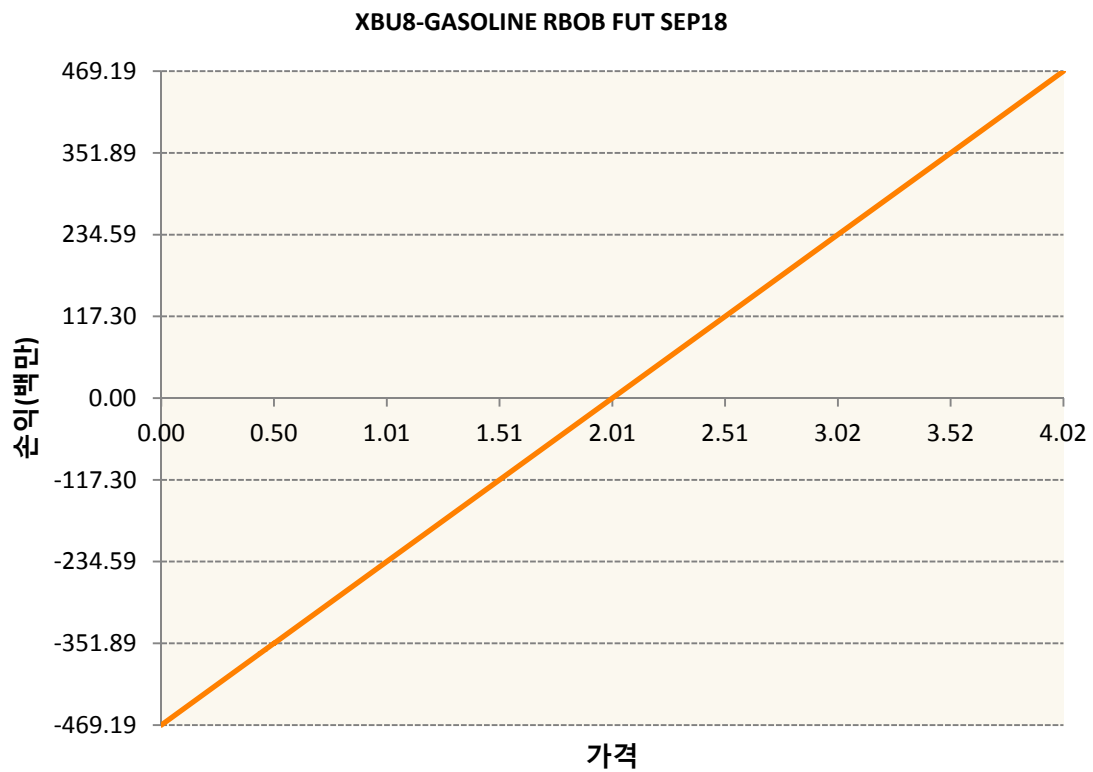
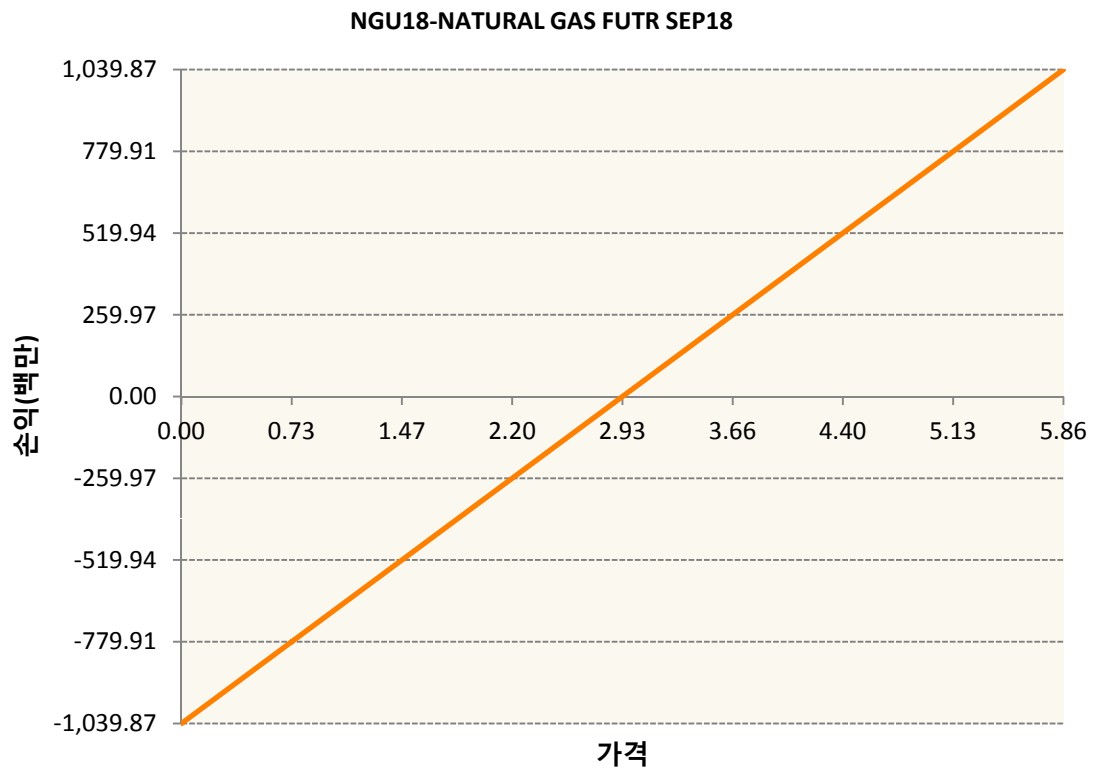
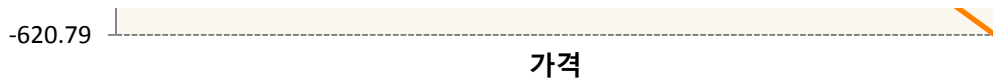
CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18



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	83
XBU8	GASOLINE RBOB FUT SEP18	38

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

447

공시일	2018-08-16
기준일	2018-08-14

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

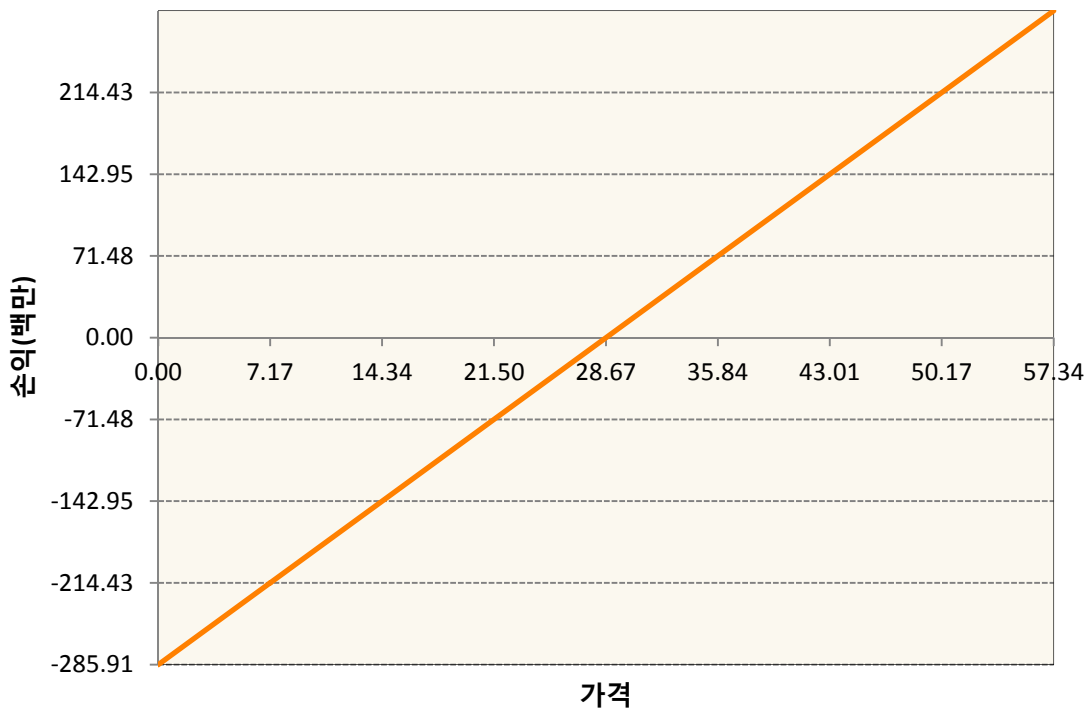
1. 계약금액

(단위:백만원)

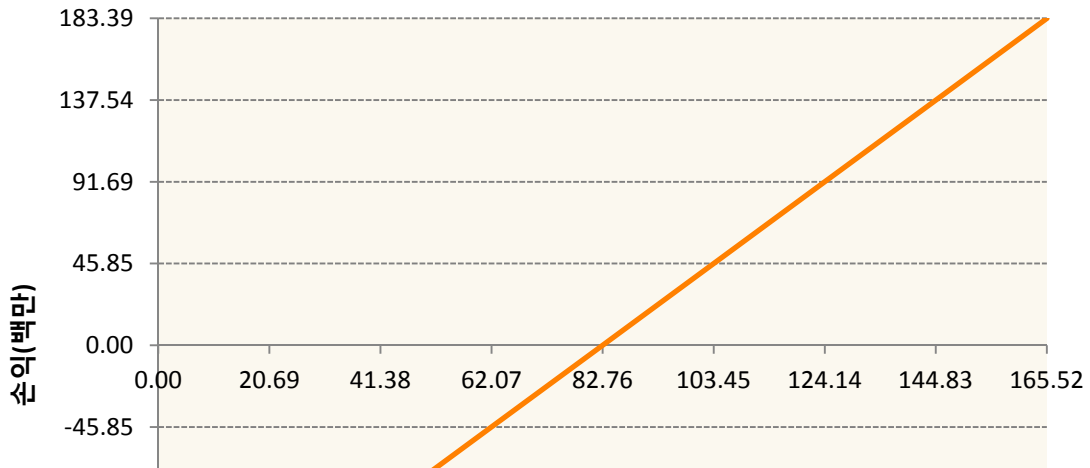
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,611	79	3,532	

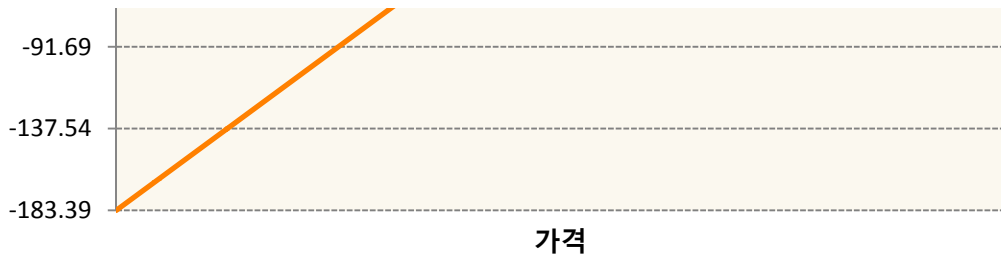
2. 만기시점의 손익구조

BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18

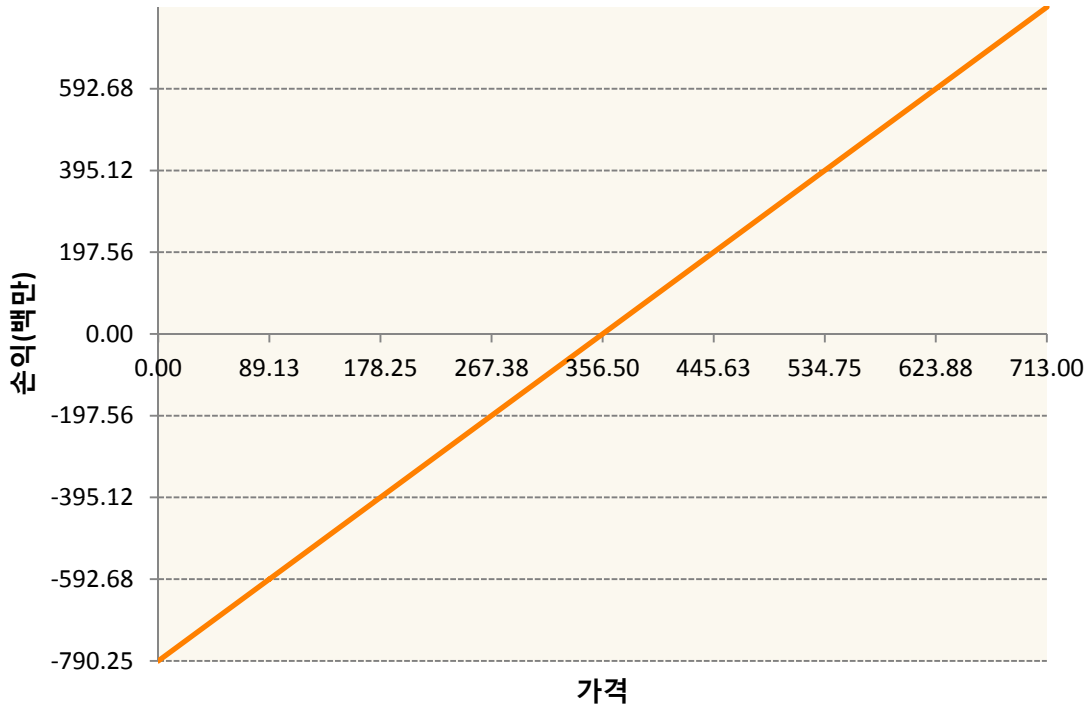


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

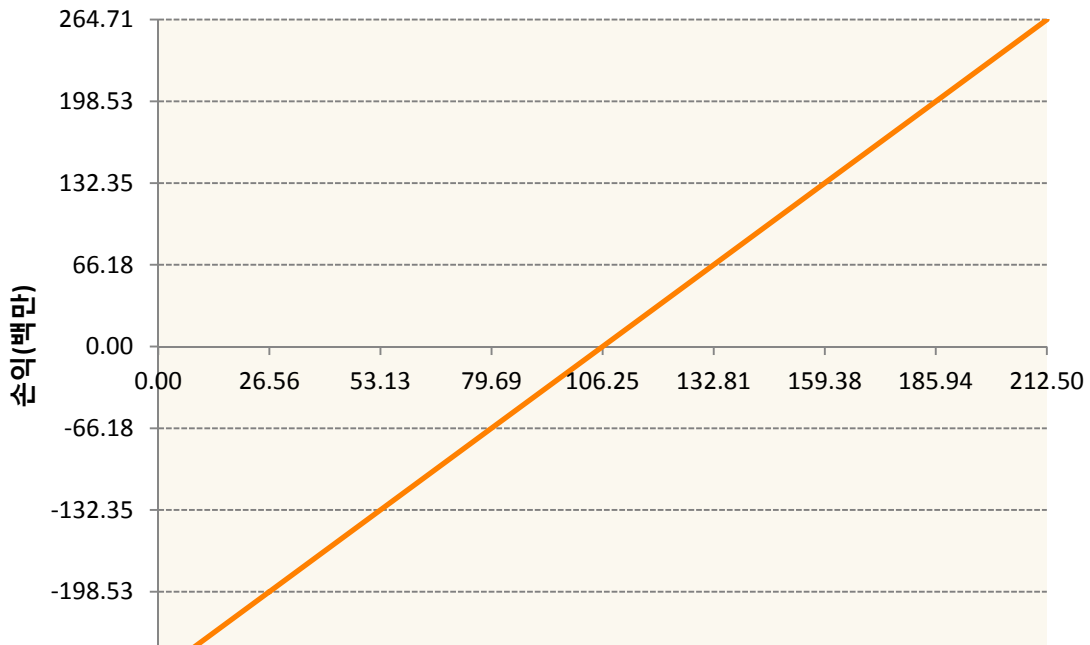


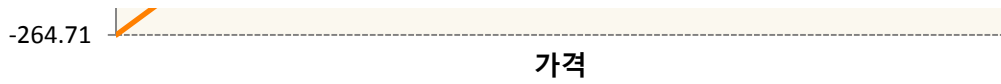


CU8-CORN FUTURE SEP18

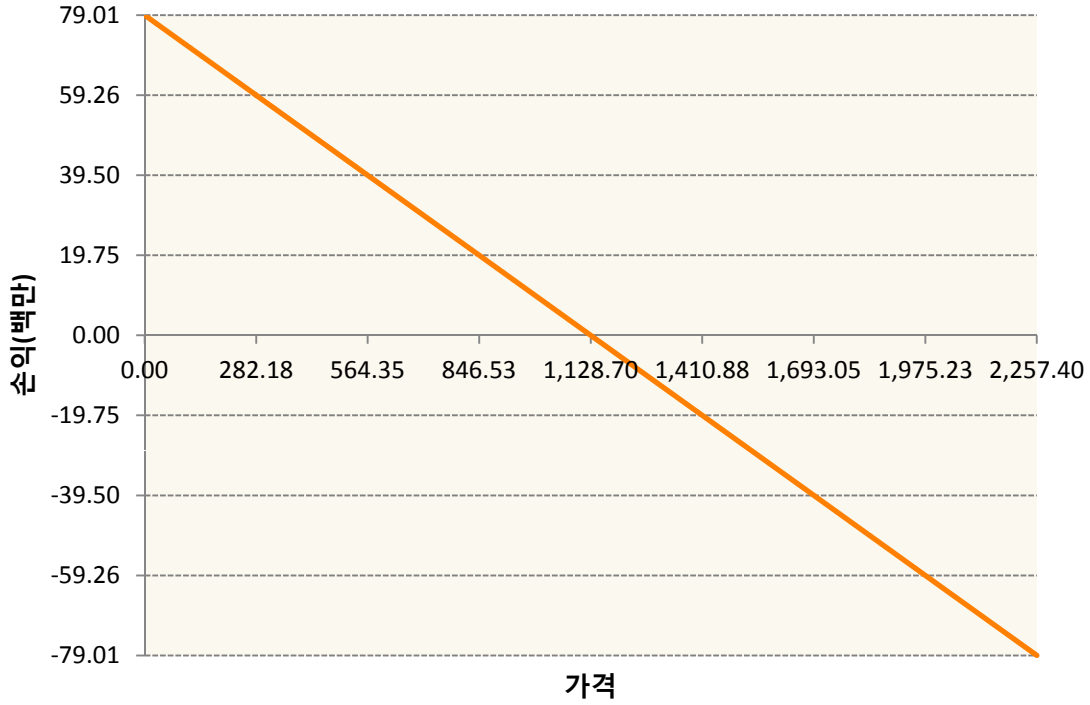


KCU8-COFFEE 'C' FUTURE SEP18

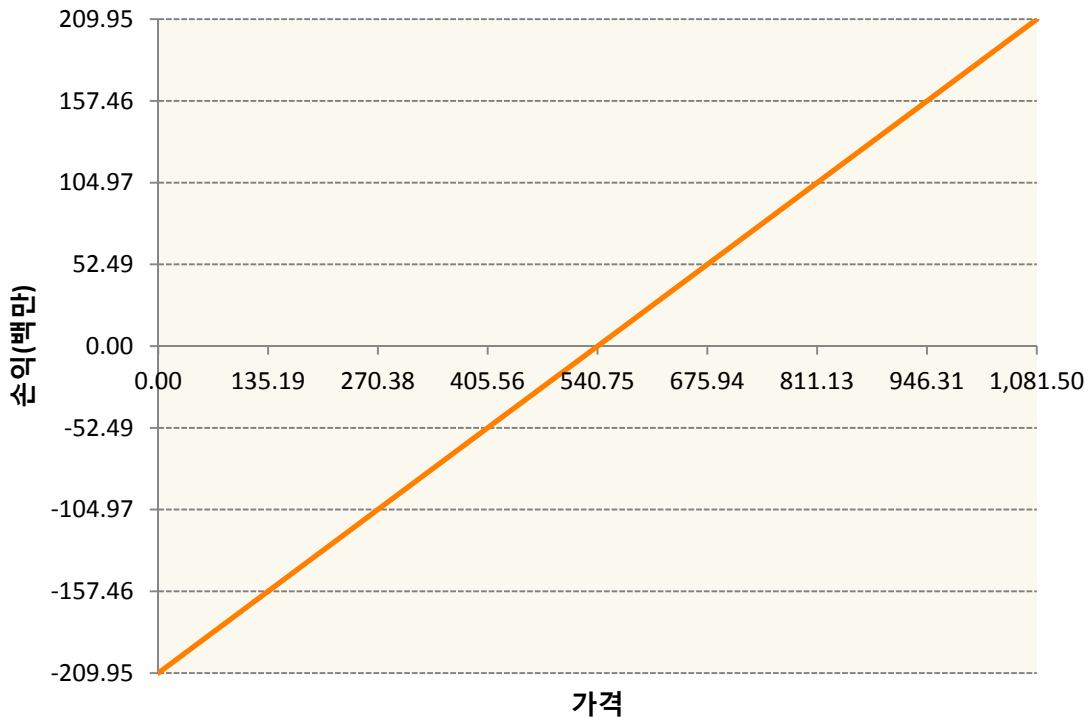




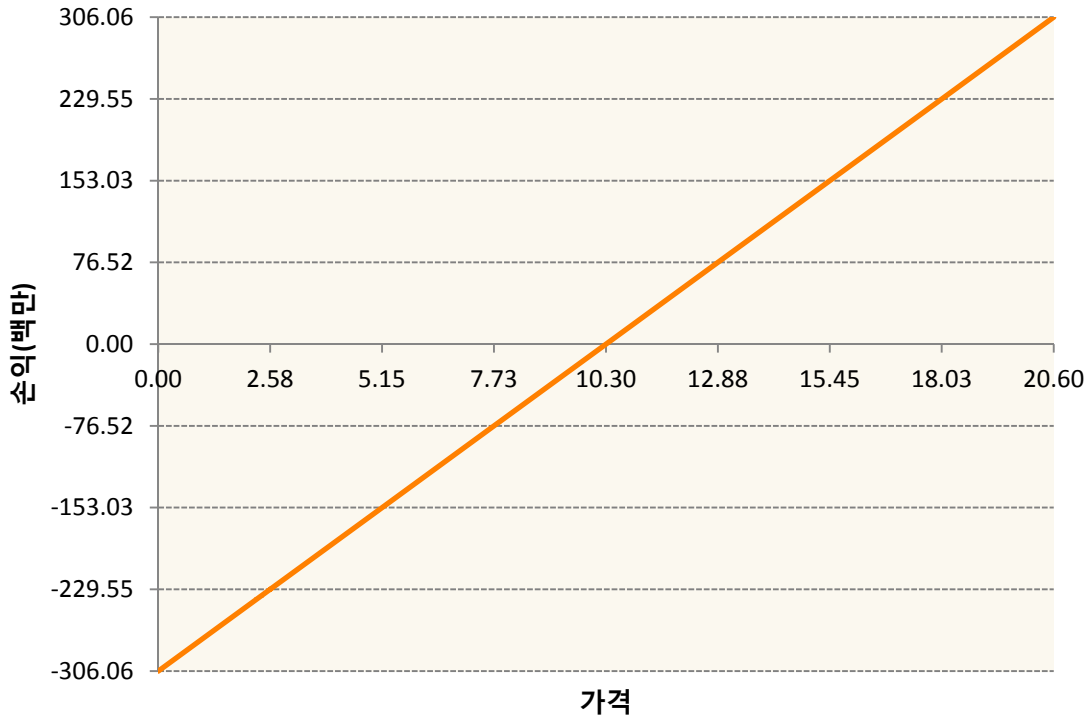
KR4175N80001-2018-08 달러선물



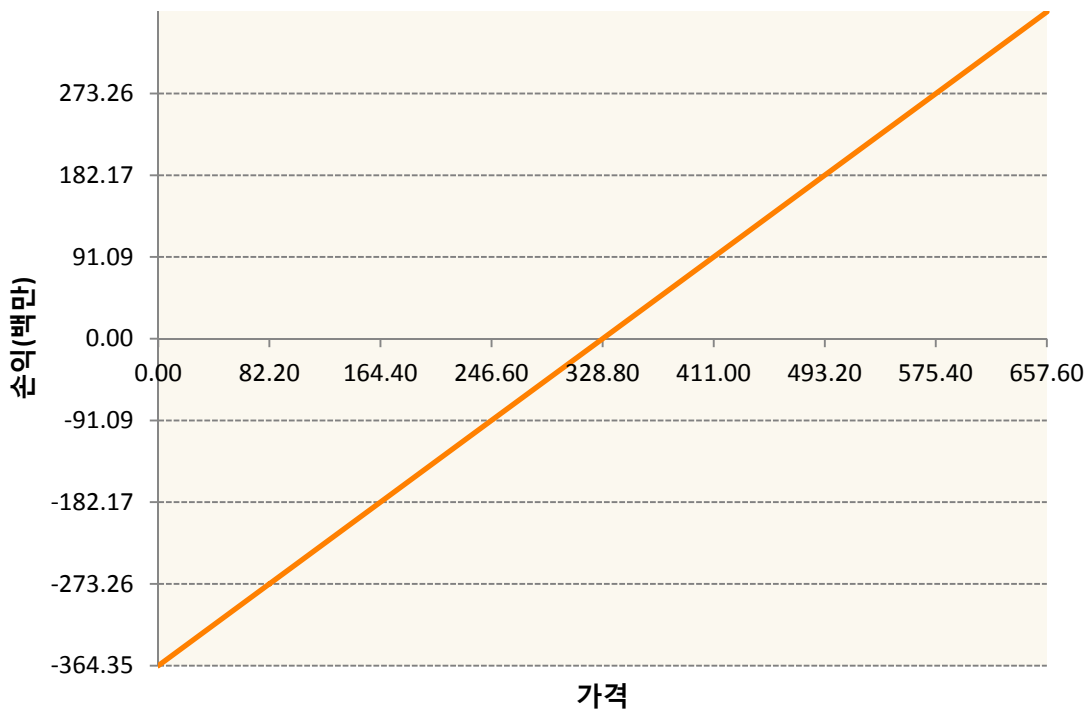
KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

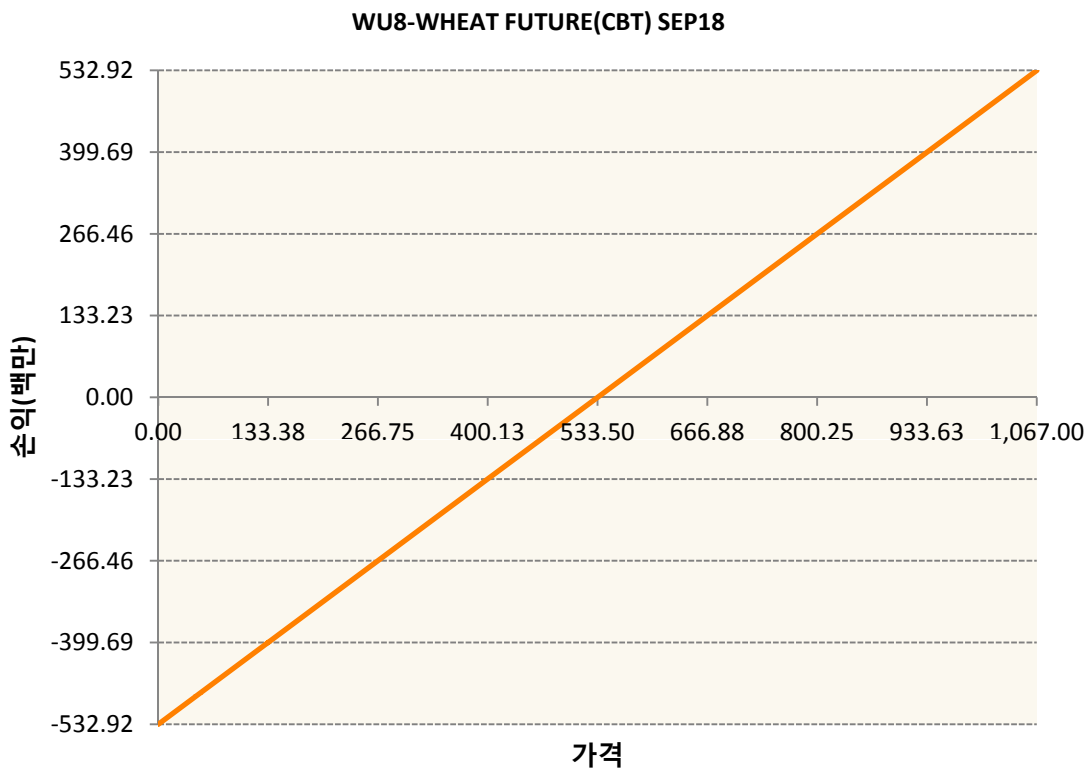
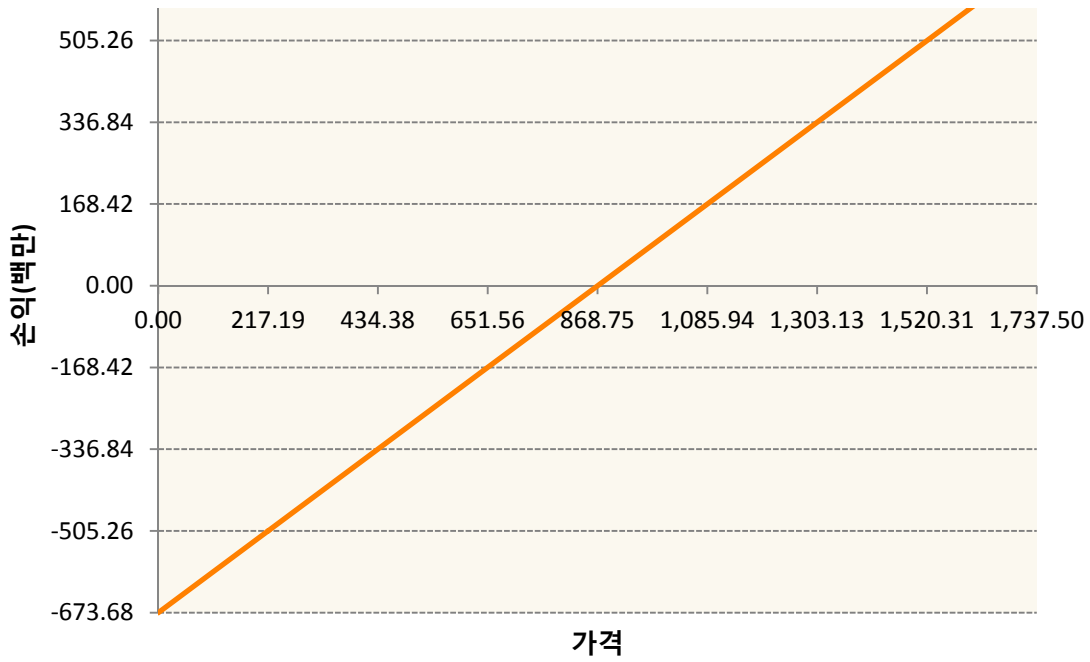


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





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	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)

307