

공시일	2018-08-21
기준일	2018-08-20

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)

65

공시일	2018-08-21
기준일	2018-08-20

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)

483

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-21
기준일	2018-08-20

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

296

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

372

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-21
기준일	2018-08-20

유로인덱스모(주식-파생형)

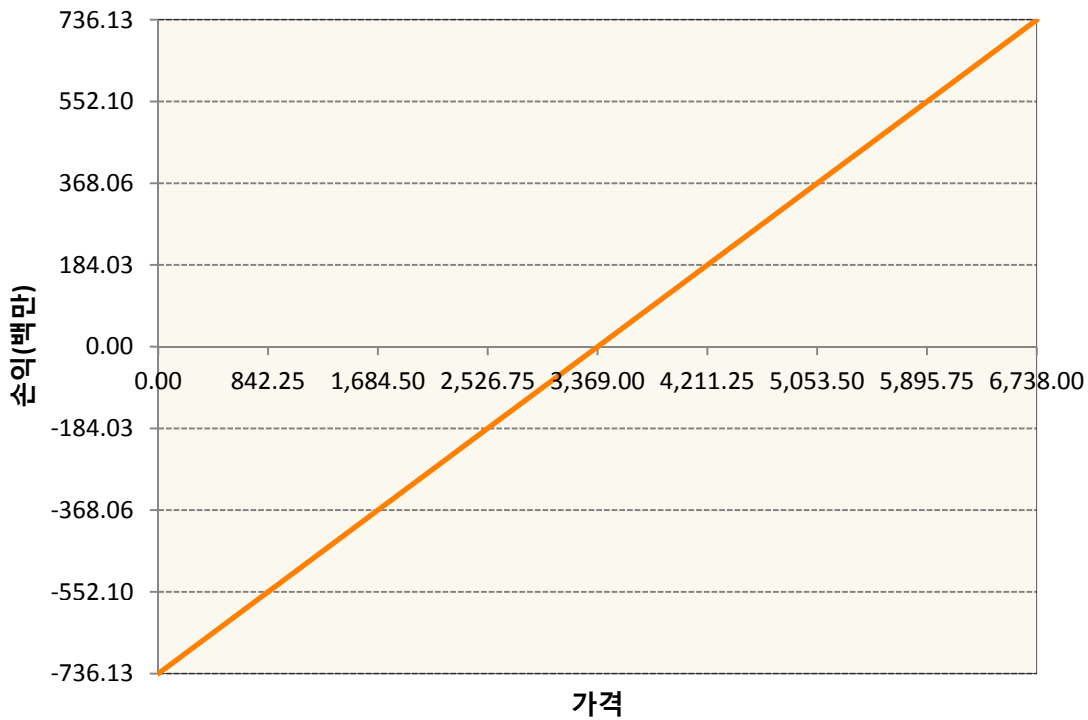
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	736	0	736	

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	2018-08-21
기준일	2018-08-20

차이나인덱스모(주식-파생형)

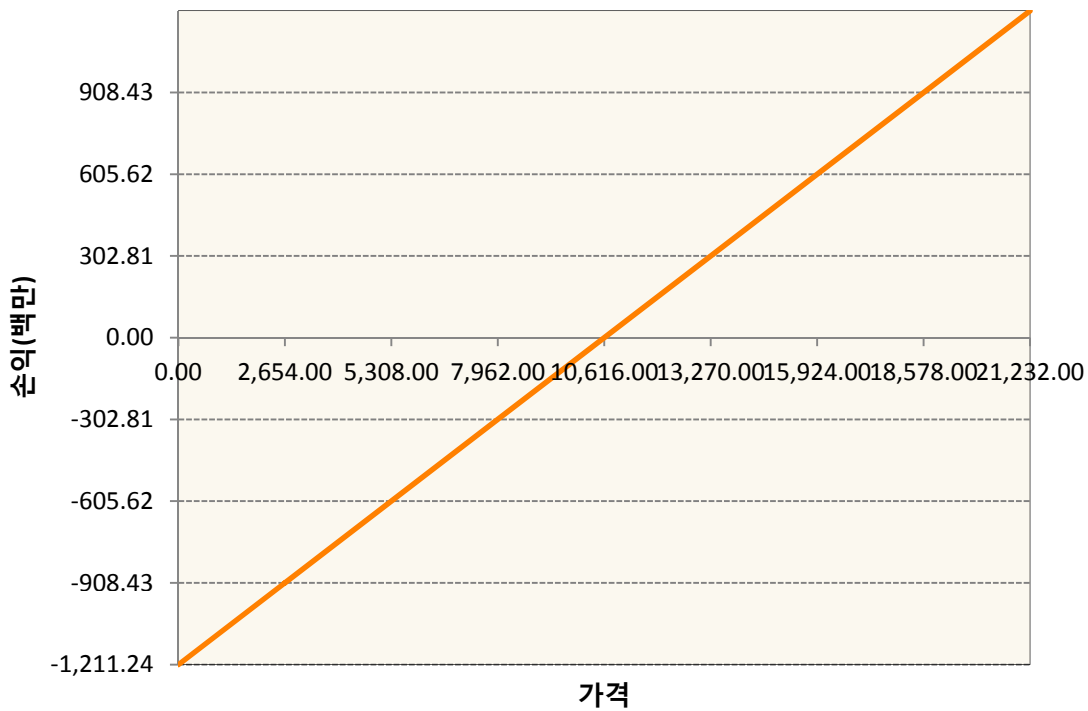
1. 계약금액

(단위:백만원)

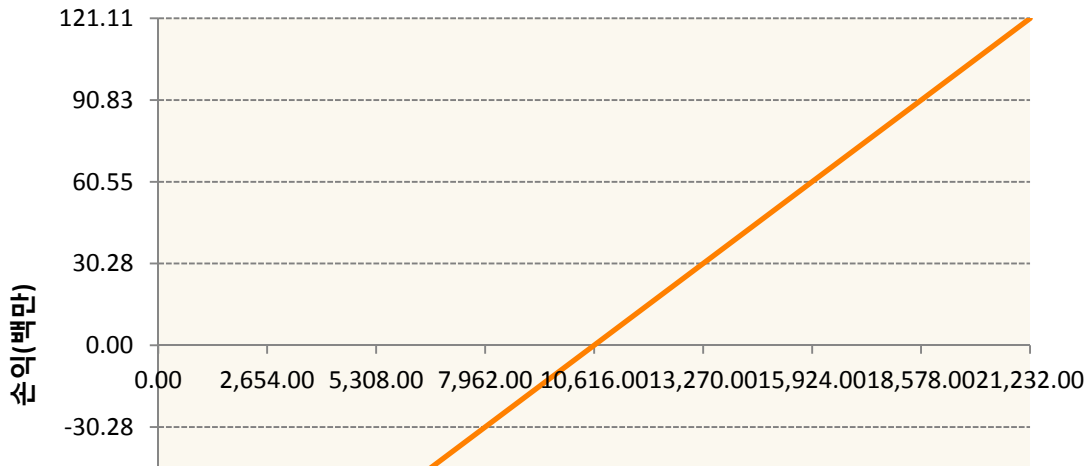
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,332	0	1,332	장내

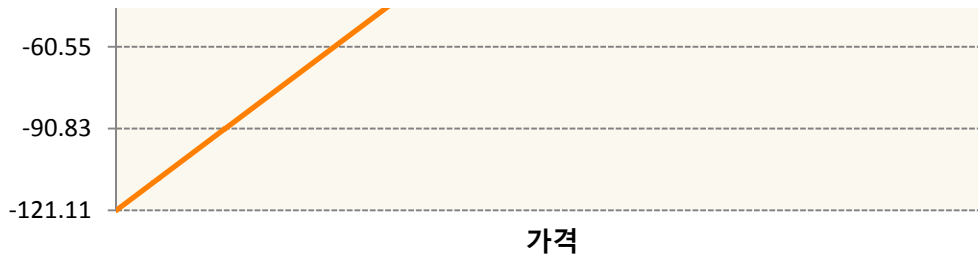
2. 만기시점의 손익구조

HCQ8-HSCEI Futures Aug18



MHCQ8-MINI H-SHR IDX FU Aug18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCQ8	HSCEI Futures Aug18	97
MHCQ8	MINI H-SHR IDX FU Aug18	10

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

98

공시일	2018-08-21
기준일	2018-08-20

커버드콜모(주식혼합-파생형)

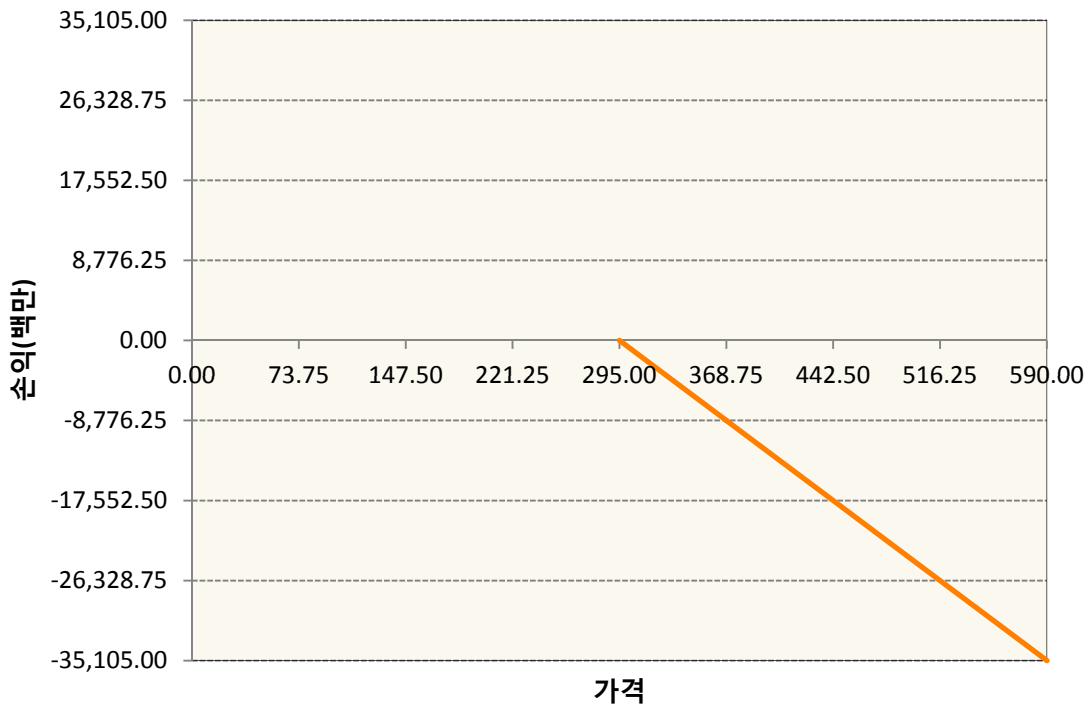
1. 계약금액

(단위:백만원)

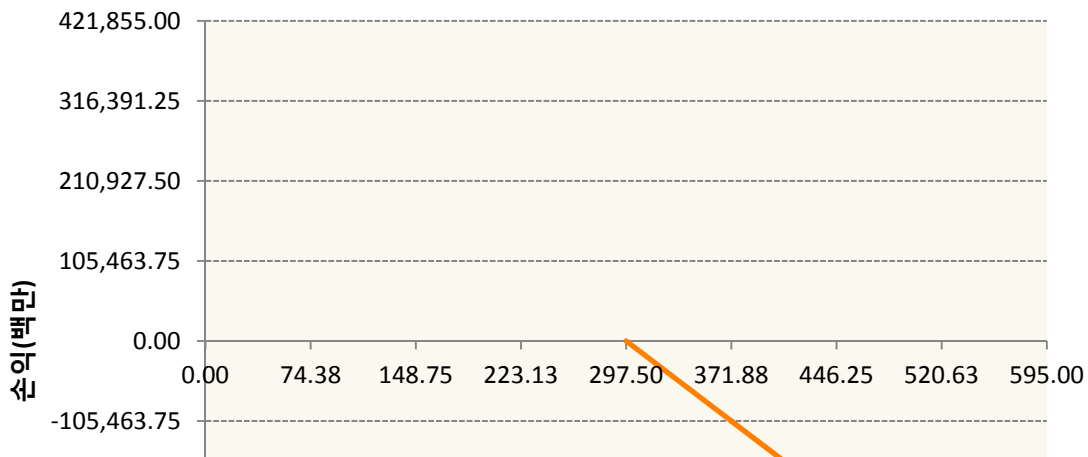
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	19,312	-19,312	장내
누계	유가증권	옵션	0	765,616	-765,616	장내

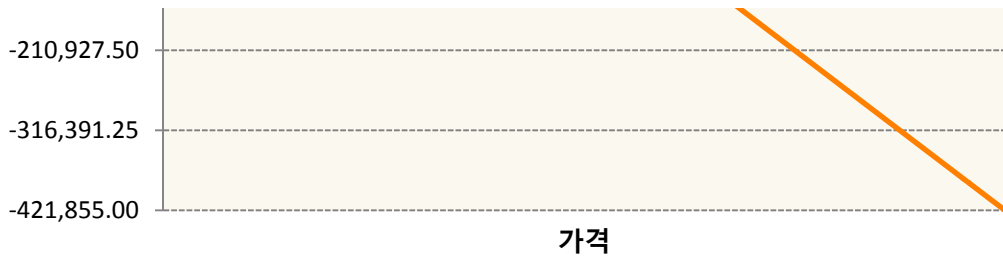
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92950-2018-09 콜295

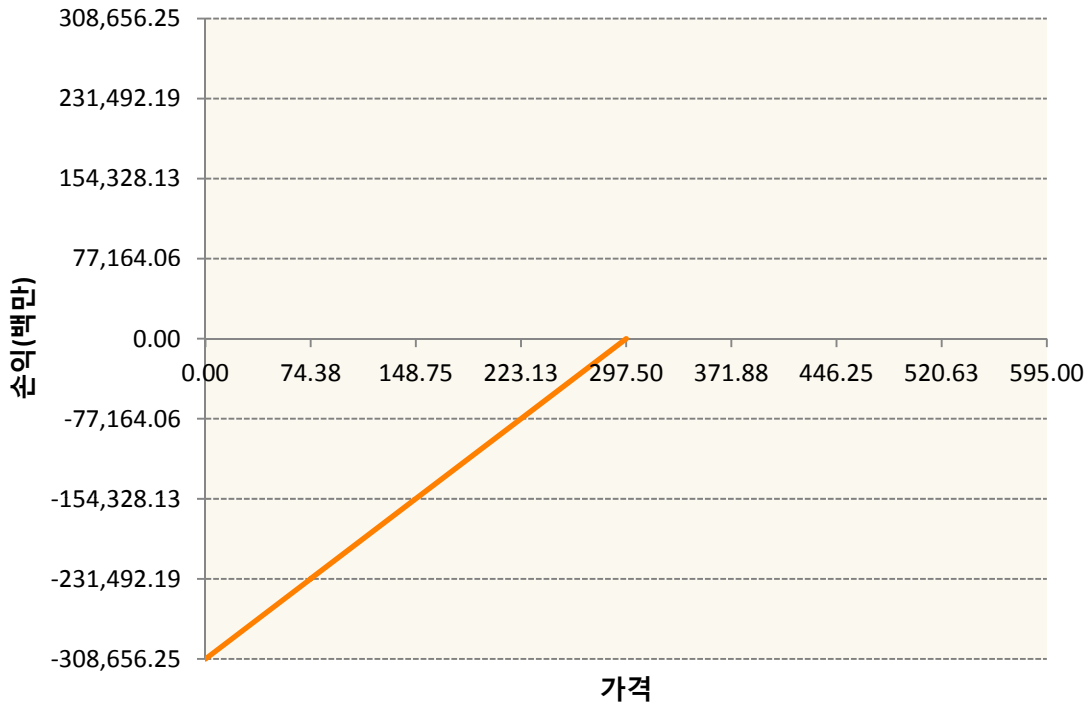


KR4201N92976-2018-09 콜297.5





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N929 2018-09 콜295

1,855

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	630	617	598	575	546	513	477
-5.33%	586	555	518	476	430	380	327
-2.67%	471	416	357	294	230	163	94
0%	230	154	78	0	-78	-157	-236
2.67%	-177	-259	-342	-425	-508	-590	-673
5.33%	-757	-830	-905	-981	-1,058	-1,137	-1,216
8.00%	-1,482	-1,534	-1,592	-1,653	-1,718	-1,785	-1,855

KR4201N929 2018-09 풋297.5

20,830

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,364	6,243	6,068	5,837	5,550	5,210	4,822

-5.33%	5,990	5,689	5,319	4,885	4,396	3,858	3,278
-2.67%	4,934	4,363	3,734	3,059	2,346	1,601	831
0%	2,597	1,753	885	0	-899	-1,809	-2,727
2.67%	-1,584	-2,573	-3,563	-4,553	-5,544	-6,534	-7,525
5.33%	-7,841	-8,775	-9,723	-10,679	-11,643	-12,612	-13,586
8.00%	-15,957	-16,681	-17,450	-18,257	-19,092	-19,951	-20,830

KR4301N929 2018-09 풋 297.5

22,807

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,788	-22,788	-22,788	-22,789	-22,792	-22,798	-22,807
-5.33%	-14,815	-14,819	-14,826	-14,840	-14,863	-14,897	-14,942
-2.67%	-6,881	-6,922	-6,983	-7,064	-7,165	-7,287	-7,426
0%	645	451	235	0	-250	-513	-787
2.67%	6,482	6,127	5,771	5,414	5,057	4,700	4,342
5.33%	9,445	9,174	8,888	8,591	8,284	7,969	7,649
8.00%	10,281	10,189	10,071	9,928	9,763	9,578	9,375

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

(단위:백만원)

45,835

공시일	2018-08-21
기준일	2018-08-20

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

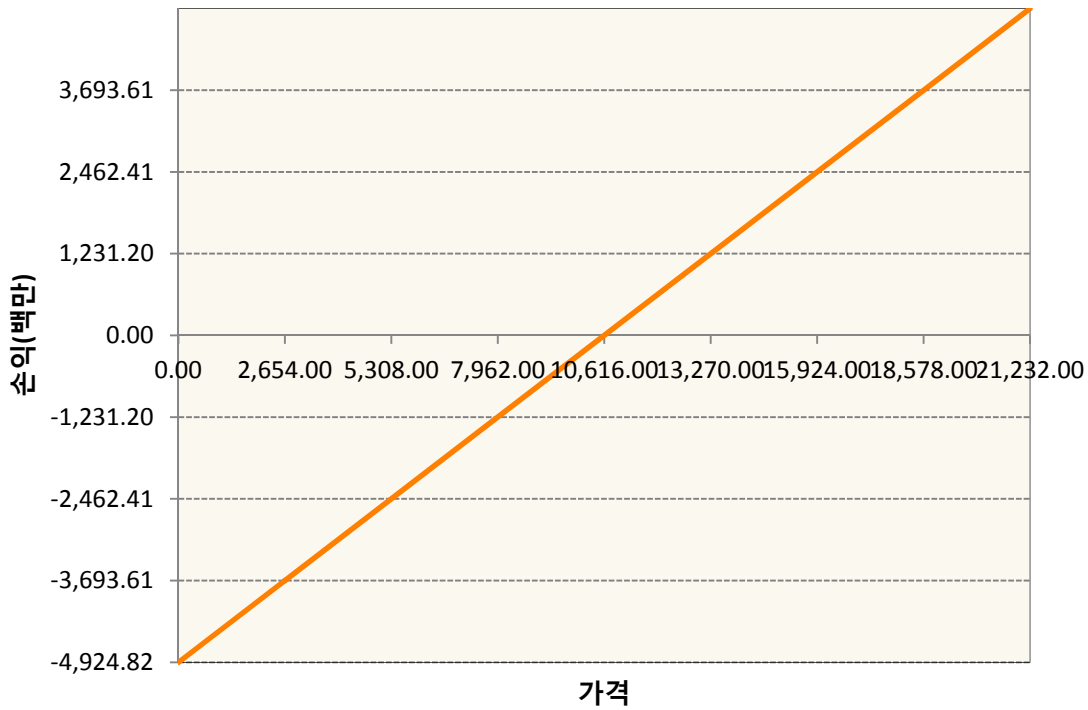
1. 계약금액

(단위:백만원)

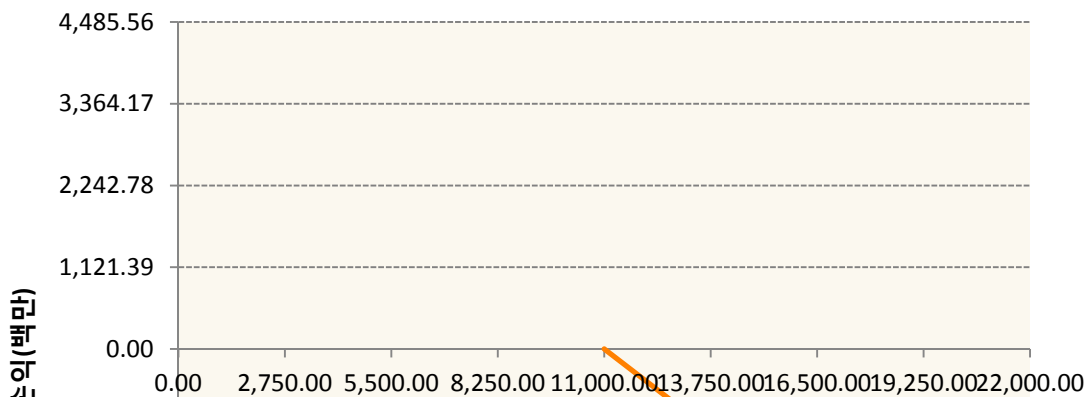
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,925	0	4,925	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,535	-11,535	장내

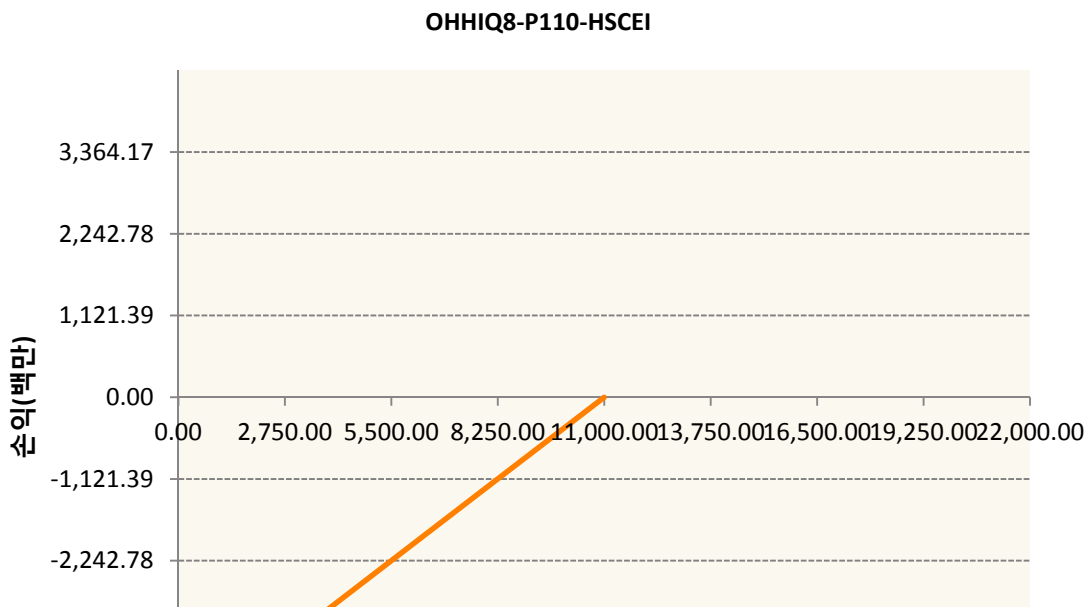
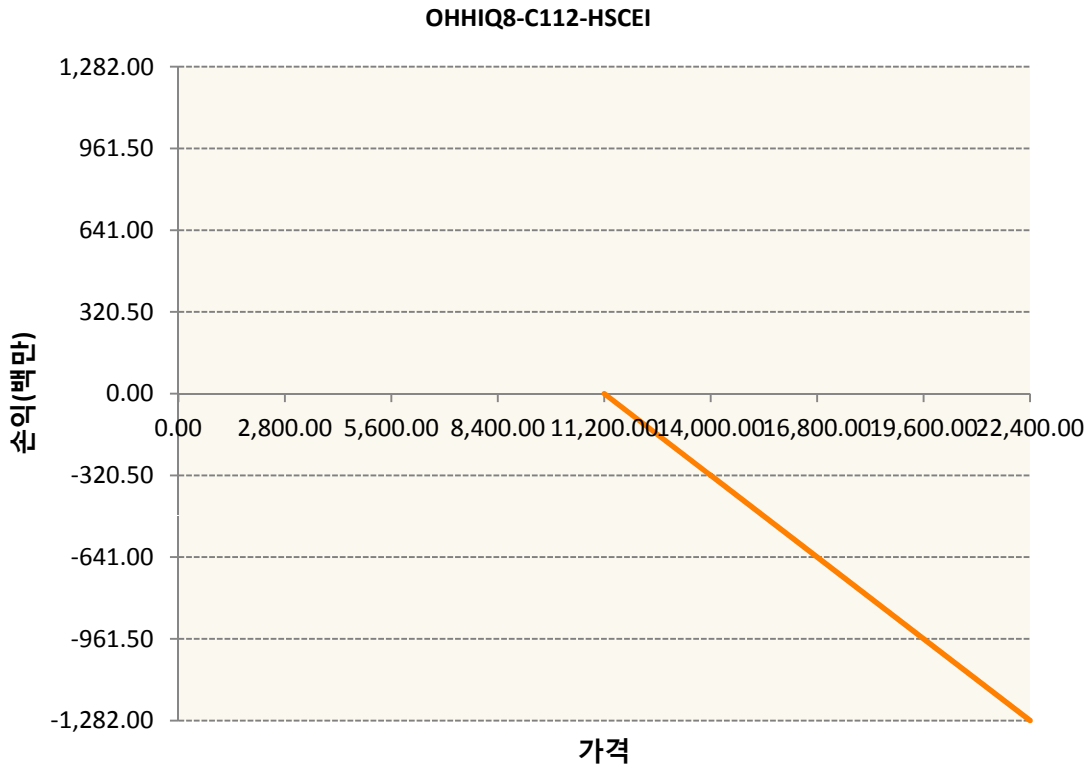
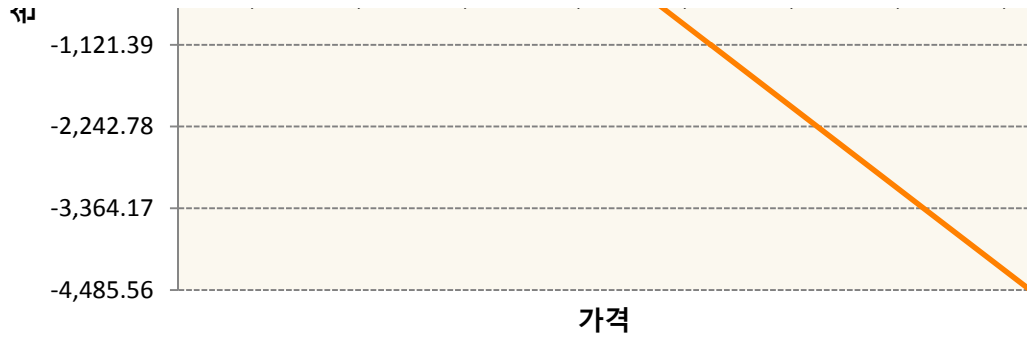
2. 만기시점의 손익구조

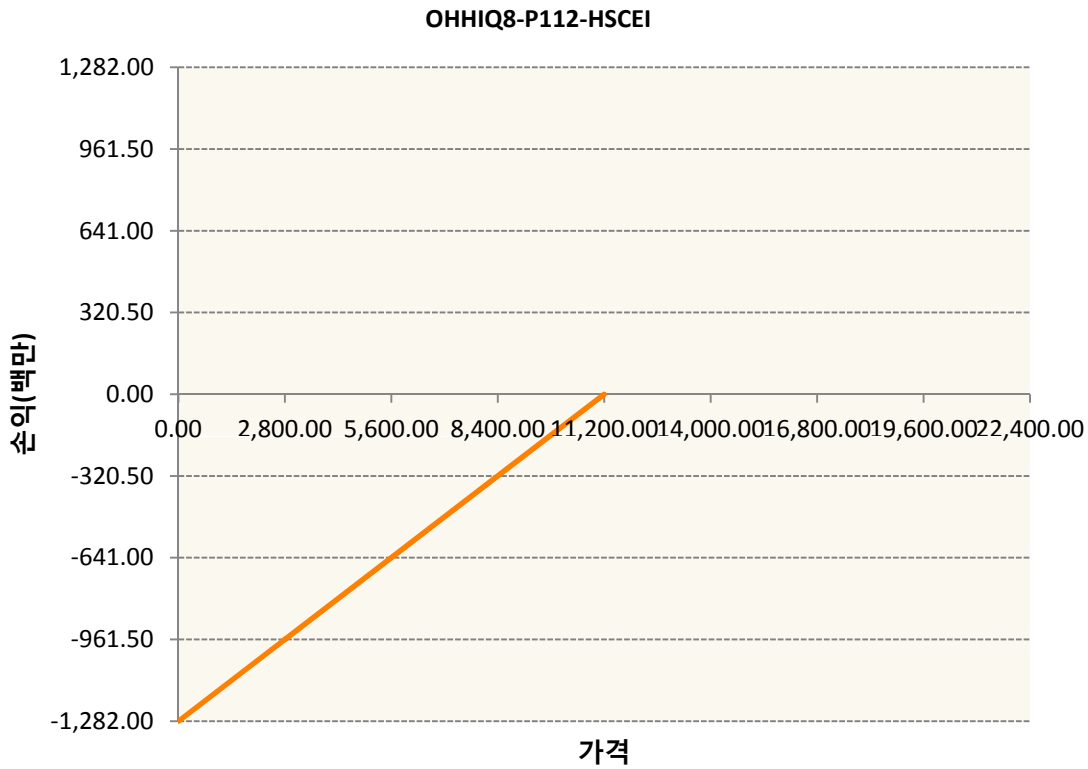
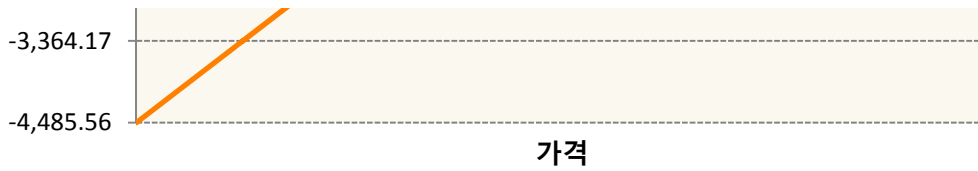
HCQ8-HSCEI Futures Aug18



OHHIQ8-C110-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ8	HSCEI Futures Aug18	394
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)
	1,207

공시일	2018-08-21
기준일	2018-08-20

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

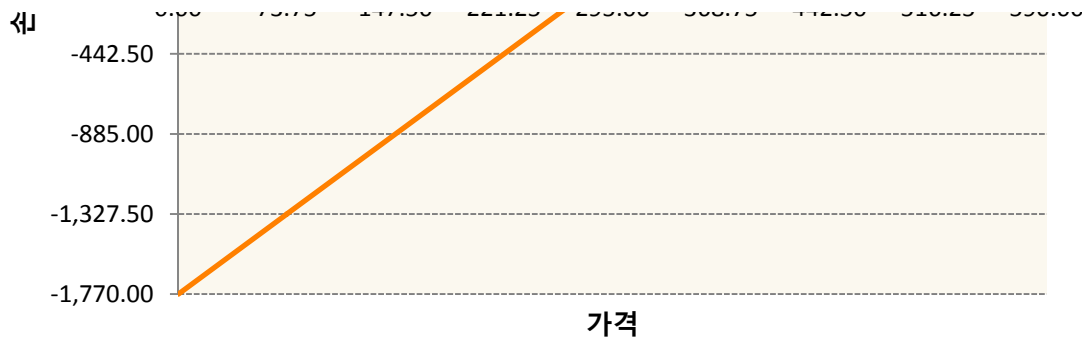
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92976-2018-09 콜297.5

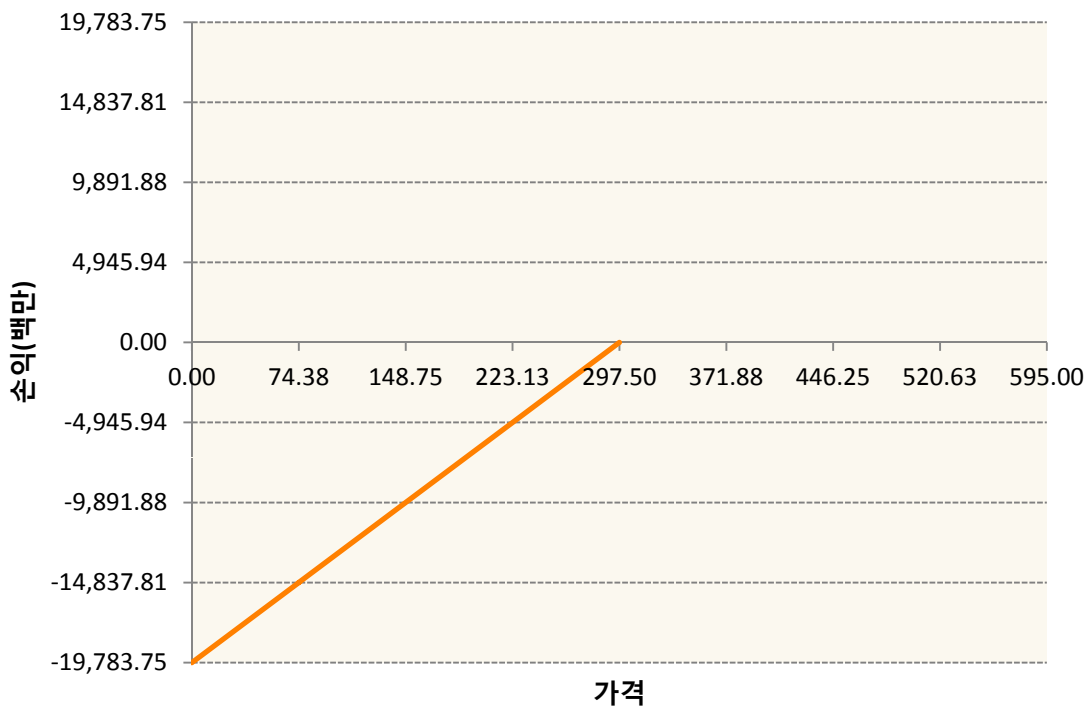


KR4301N92958-2018-09 풋295





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,966
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,966	-3,966	-3,966	-3,966	-3,966	-3,966	-3,966
-5.33%	-2,644	-2,644	-2,644	-2,644	-2,644	-2,644	-2,644
-2.67%	-1,322	-1,322	-1,322	-1,322	-1,322	-1,322	-1,322
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,322	1,322	1,322	1,322	1,322	1,322	1,322
5.33%	2,644	2,644	2,644	2,644	2,644	2,644	2,644
8.00%	3,966	3,966	3,966	3,966	3,966	3,966	3,966
KR4201N92974-2018-09 풋297.5							1,388
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	424	416	404	389	370	347	321
-5.33%	399	379	354	326	293	257	218
-2.67%	329	291	249	204	156	107	55
0%	173	117	59	0	-60	-121	-182
2.67%	-106	-171	-237	-303	-369	-435	-501
5.33%	-523	-585	-648	-712	-776	-840	-905
8.00%	-1,063	-1,112	-1,163	-1,217	-1,272	-1,330	-1,388

KR4301N929 2018-09 풋295

129

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-128	-128	-128	-128	-129	-129	-129
-5.33%	-82	-82	-82	-83	-83	-83	-84
-2.67%	-37	-37	-38	-38	-39	-40	-41
0%	5	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	33	31	29	27	25	23	21
5.33%	46	44	43	42	40	39	37
8.00%	48	48	47	47	46	45	45

KR4301N929 2018-09 풋297.5

1,462

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,461	-1,461	-1,461	-1,461	-1,461	-1,461	-1,462
-5.33%	-950	-950	-950	-951	-953	-955	-958
-2.67%	-441	-444	-448	-453	-459	-467	-476
0%	41	29	15	0	-16	-33	-50
2.67%	415	393	370	347	324	301	278
5.33%	605	588	570	551	531	511	490
8.00%	659	653	645	636	626	614	601

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

(단위:백만원)

6,993

공시일	2018-08-21
기준일	2018-08-20

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

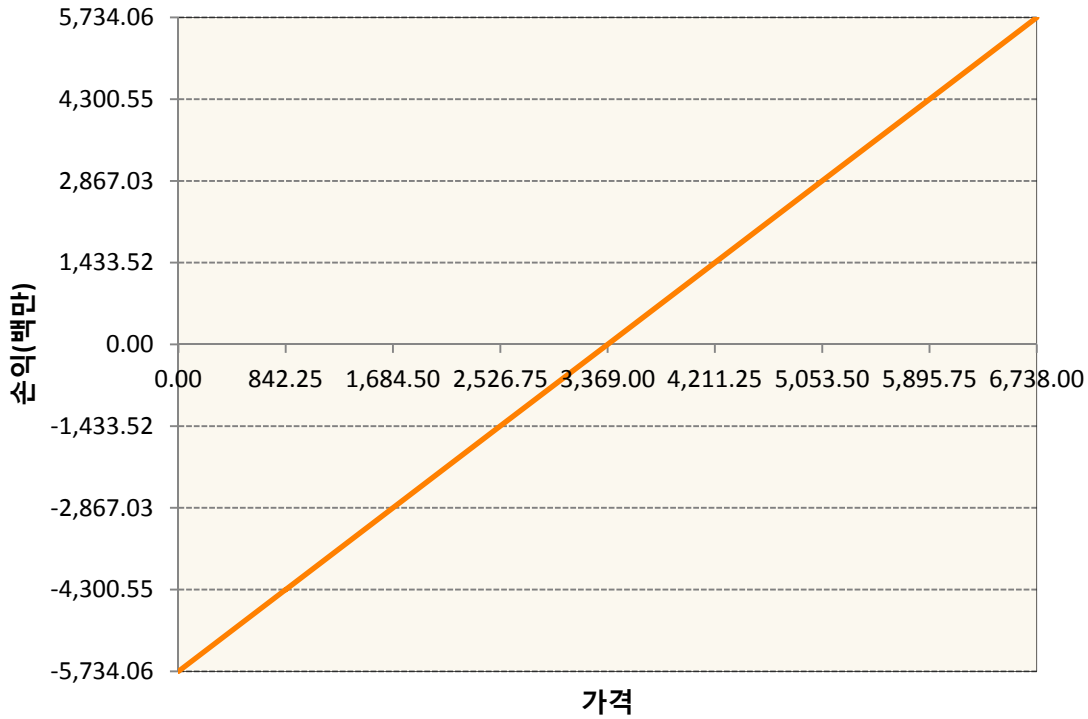
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,734	0	5,734	
누계	지수	스왑	85,931	0	85,931	장외

2. 만기시점의 손익구조

VGU8-EURO STOXXX 50 SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	54
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	35
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18	459

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

(단위:백만원)

344

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

(단위:백만원)

1,109

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

(단위:백만원)

87

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

(단위:백만원)

131

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

(단위:백만원)

157

공시일	2018-08-21
기준일	2018-08-20

스마트KRX300인덱스목표전환형1

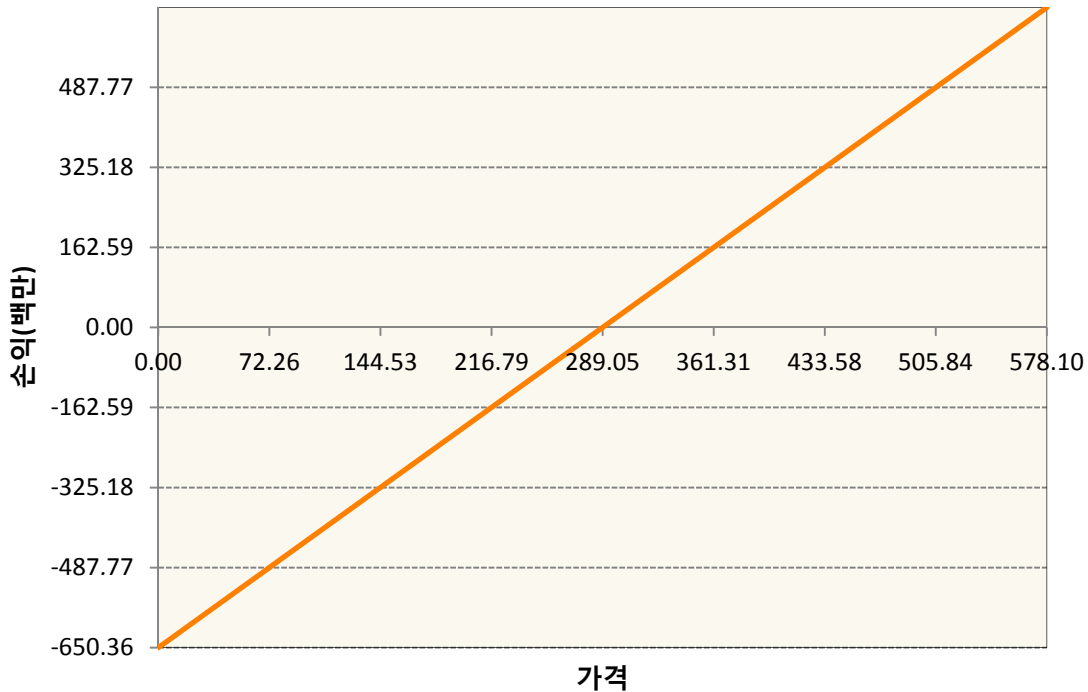
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	650	0	650	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	2018-08-21
기준일	2018-08-20

리디파인K200(주식혼합-파생재간

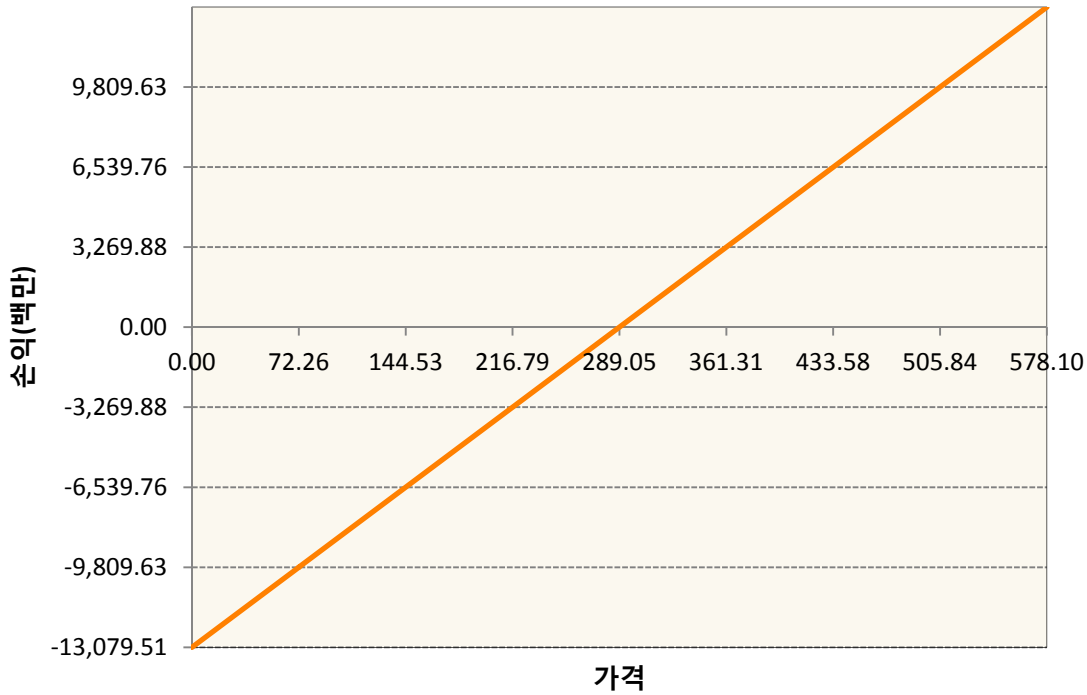
1. 계약금액

(단위:백만원)

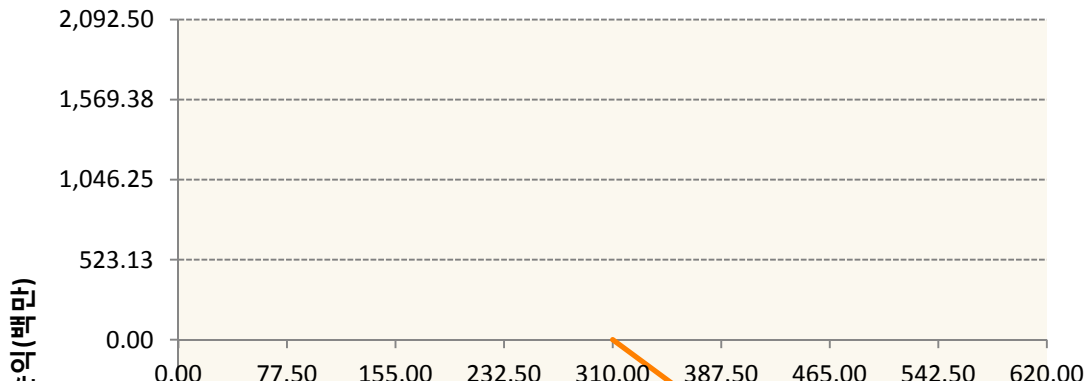
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,080	0	13,080	장내
누계	유가증권	옵션	1,339	24,358	-23,019	장내

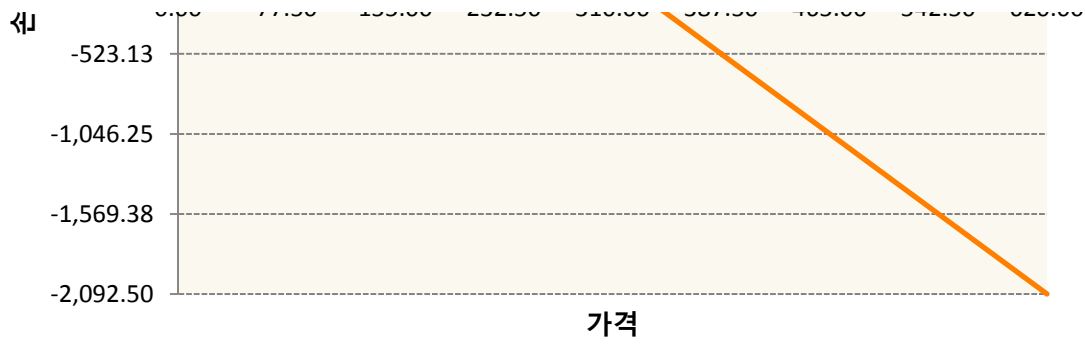
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

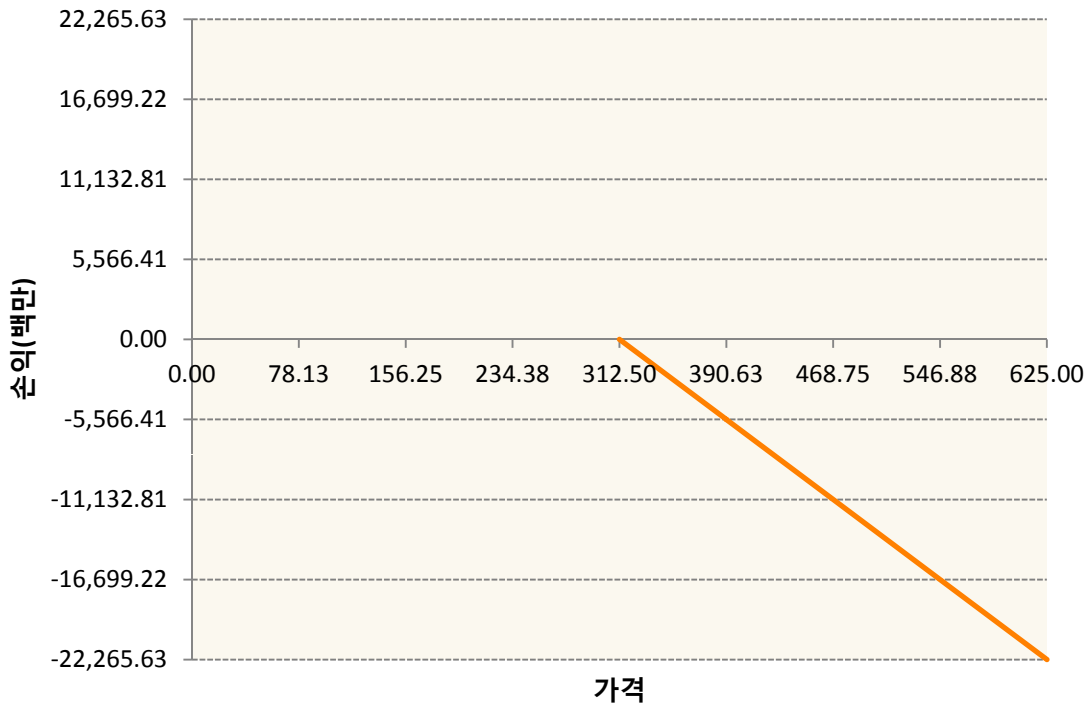


KR4201N93107-2018-09 콜310

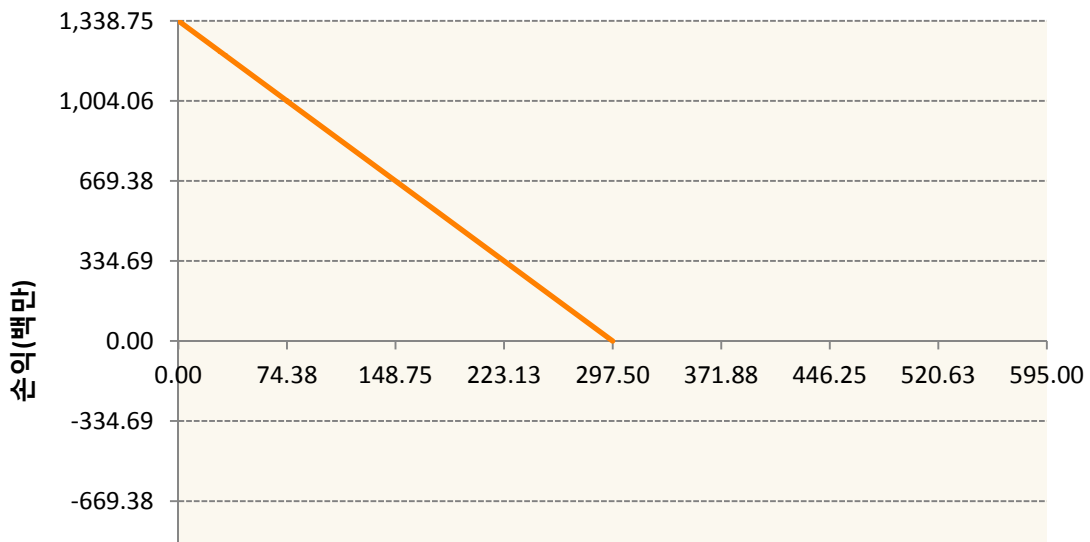


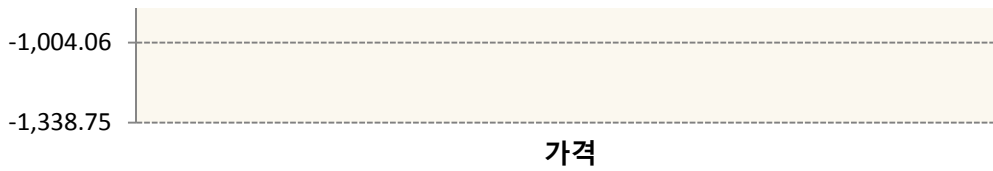


KR4201N93123-2018-09 콜312.5



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%	-697	-697	-697	-697	-697	-697	-697
-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%	697	697	697	697	697	697	697
8.00%	1,045	1,045	1,045	1,045	1,045	1,045	1,045
KR4201N931 2018-09 콜310							68
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12	12	11	11	10	10	9
-5.33%	11	11	10	10	9	7	6
-2.67%	10	9	8	6	4	2	0
0%	7	5	3	0	-3	-6	-10
2.67%	0	-4	-7	-11	-15	-19	-24
5.33%	-15	-19	-24	-29	-33	-38	-43
8.00%	-39	-43	-48	-53	-58	-63	-68
KR4201N931 2018-09 콜312.5							656
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	99	98	97	94	90	84	76
-5.33%	97	95	90	83	74	62	47
-2.67%	90	82	70	56	38	18	-5
0%	66	47	25	0	-28	-59	-92
2.67%	4	-29	-64	-101	-141	-182	-224
5.33%	-124	-170	-216	-264	-312	-361	-410
8.00%	-342	-394	-447	-499	-552	-604	-656
KR4301N92C 2018-09 풋297.5							99
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	99	99	99	99	99	99	99
-5.33%	64	64	64	64	64	65	65
-2.67%	30	30	30	31	31	32	32

0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-28	-27	-25	-23	-22	-20	-19
5.33%	-41	-40	-39	-37	-36	-35	-33
8.00%	-45	-44	-44	-43	-42	-42	-41

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

(단위:백만원)

1,363

공시일	2018-08-21
기준일	2018-08-20

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

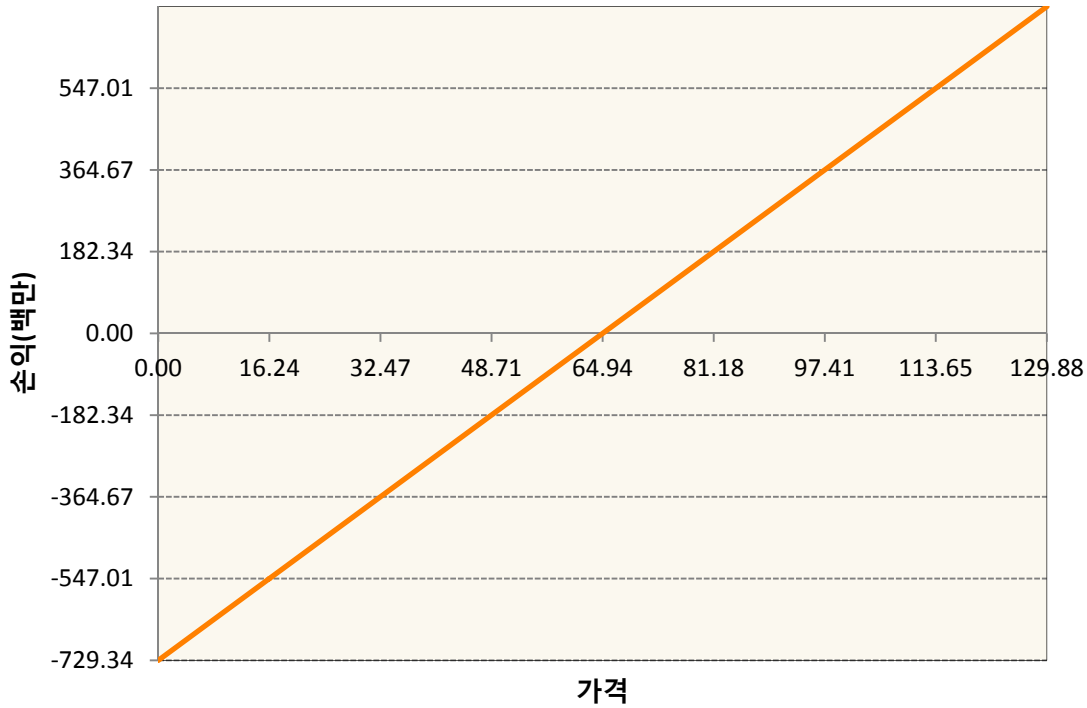
1. 계약금액

(단위:백만원)

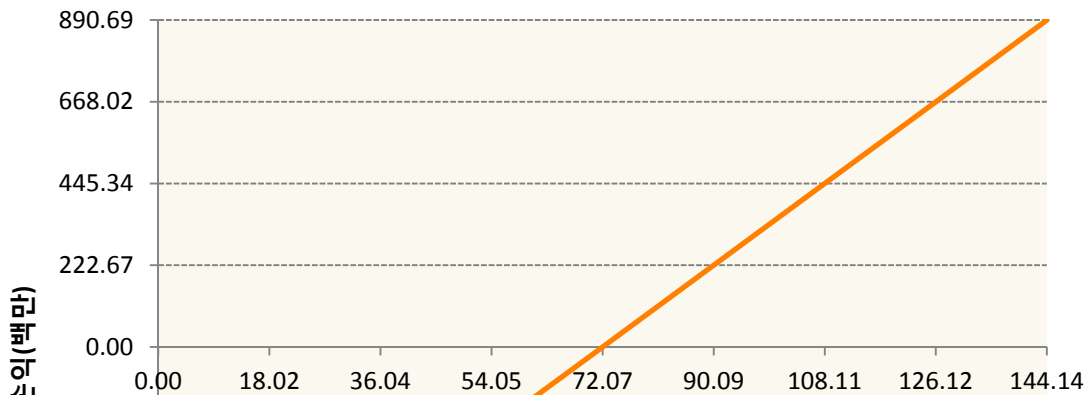
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,065	617	2,447	
누계	유가증권	선물	497	0	497	장내

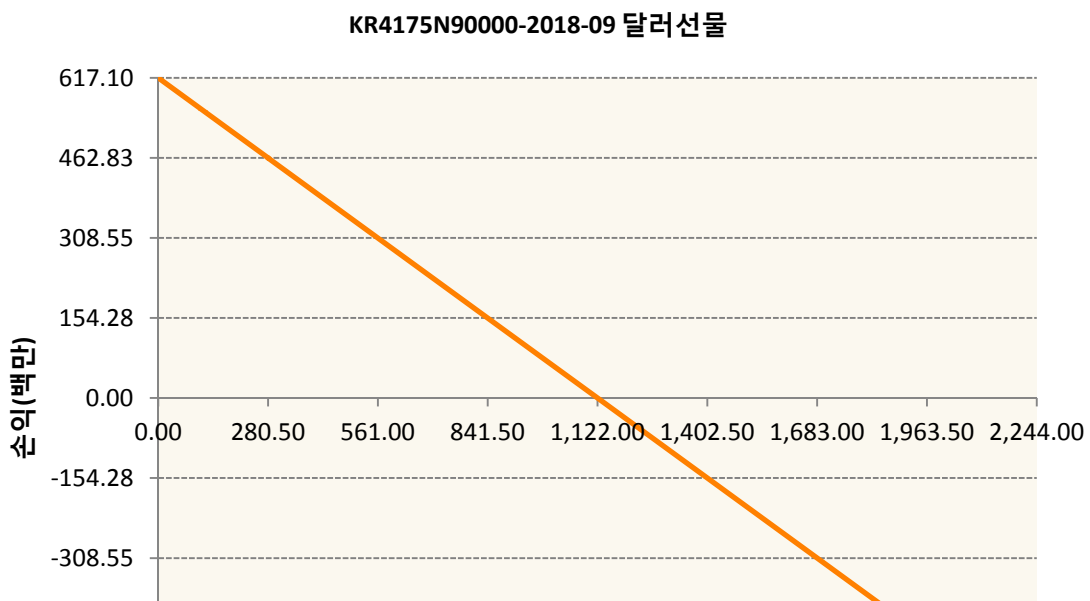
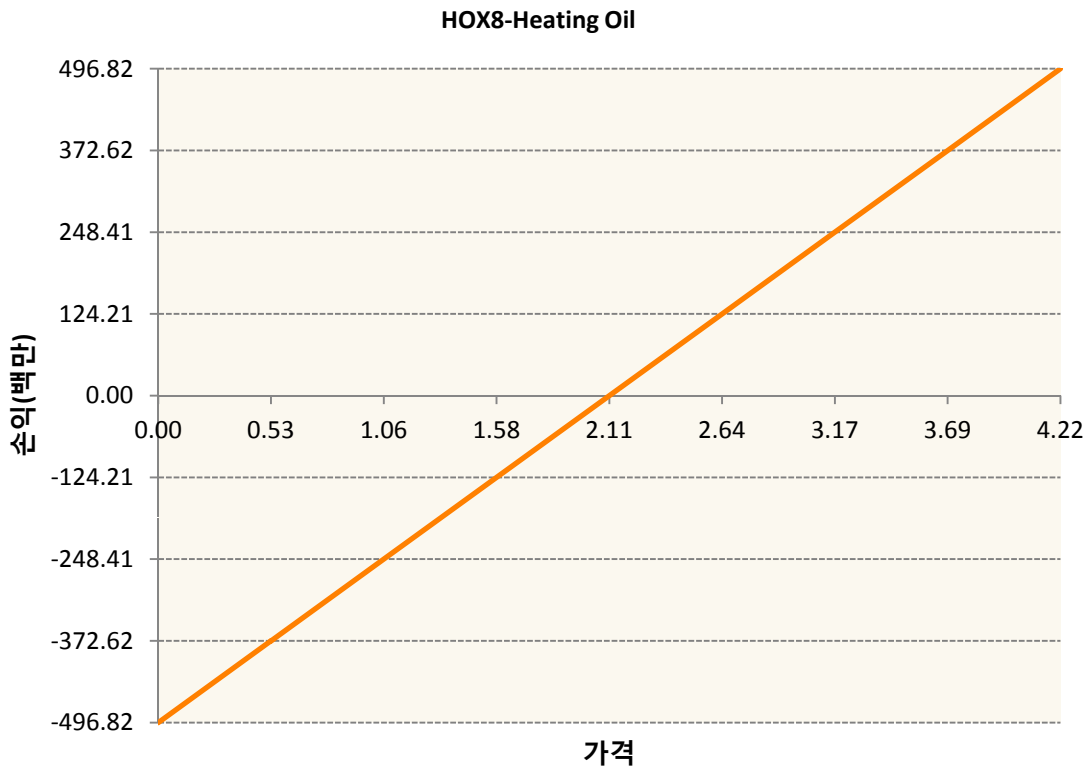
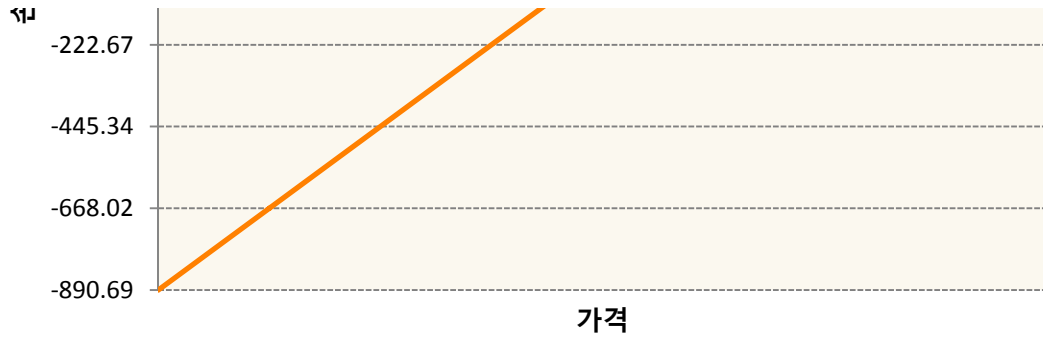
2. 만기시점의 손익구조

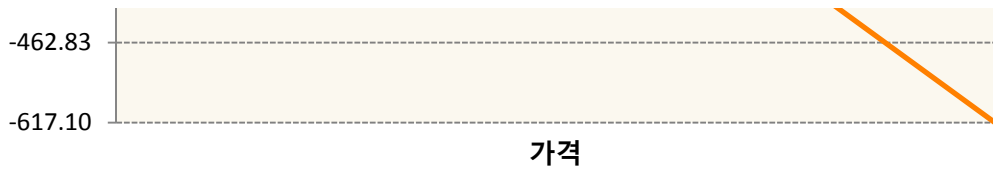
CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18



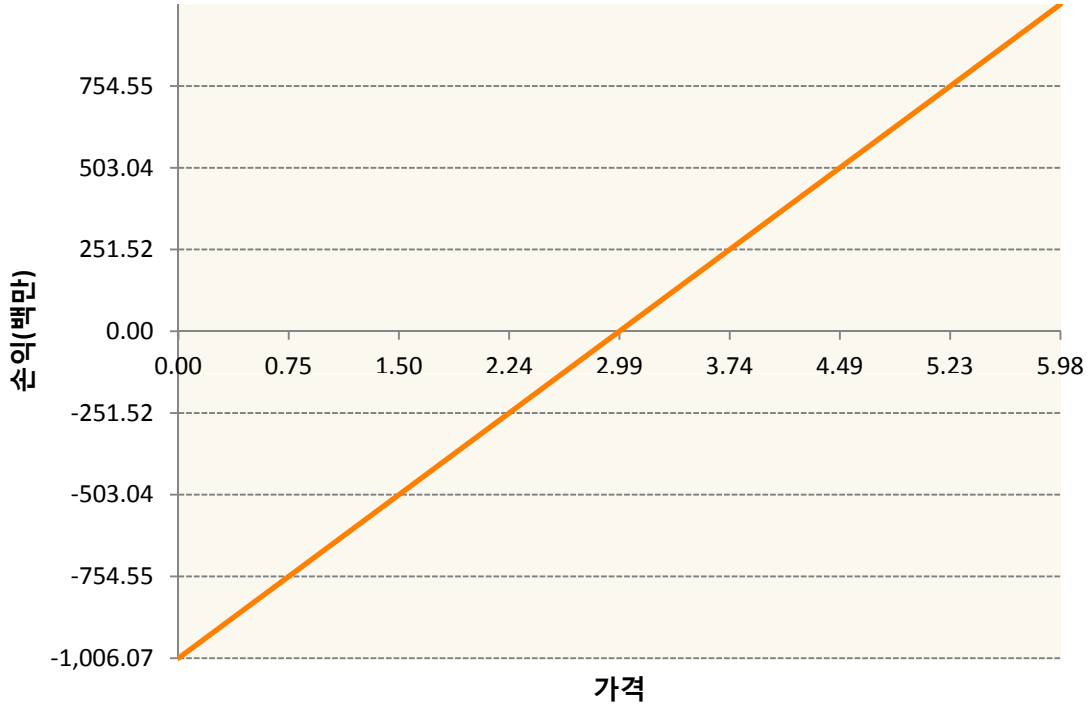
COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18



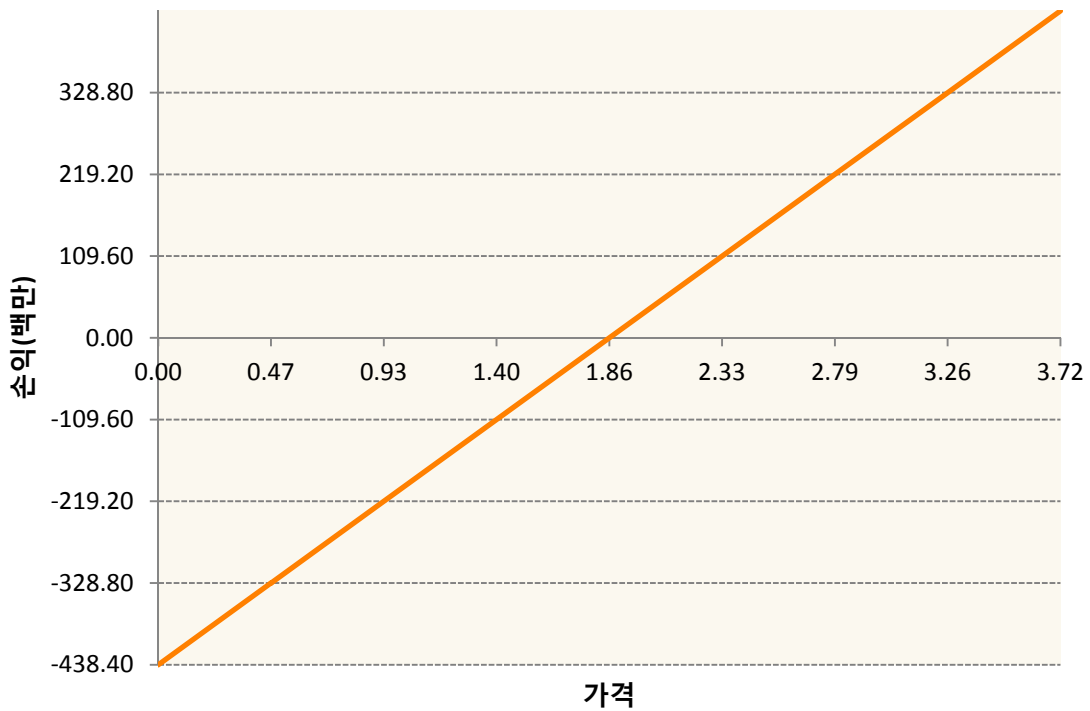




NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18



XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	58
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	71
HOX8	Heating Oil	40
	KR4175N90C 2018-09 달러선물	49
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	80
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	35

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	435

공시일	2018-08-21
기준일	2018-08-20

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

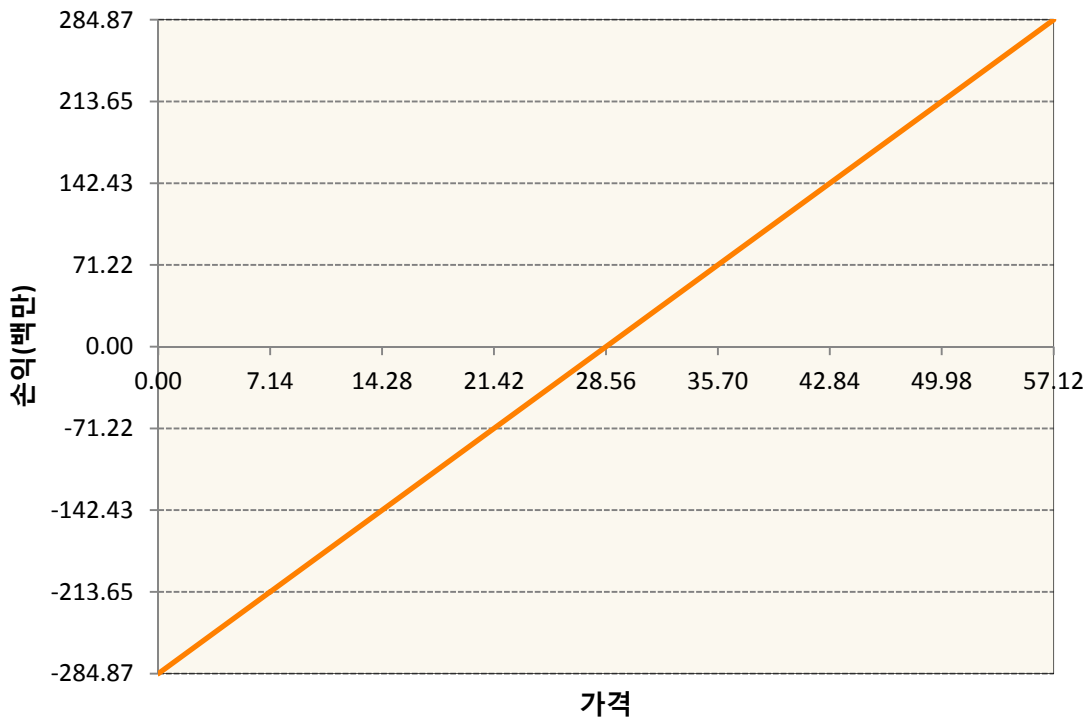
1. 계약금액

(단위:백만원)

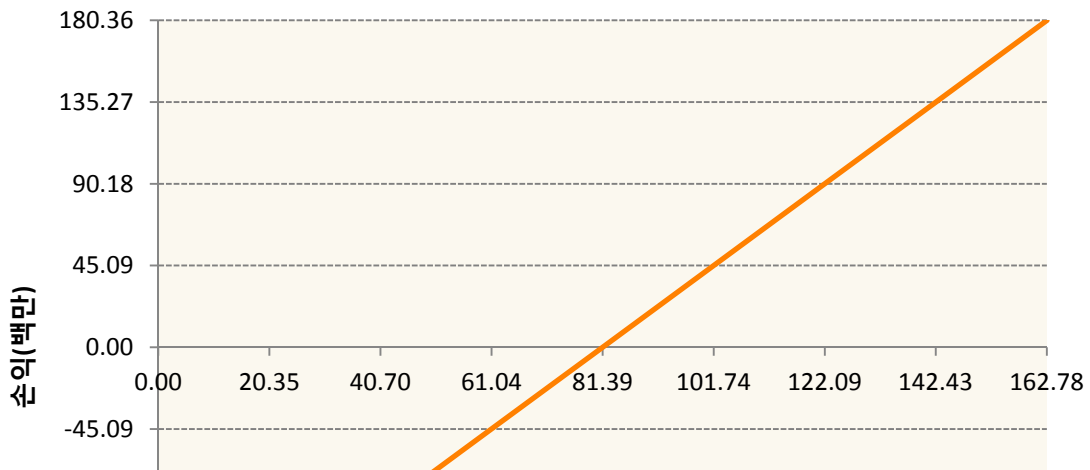
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,763	79	3,685	

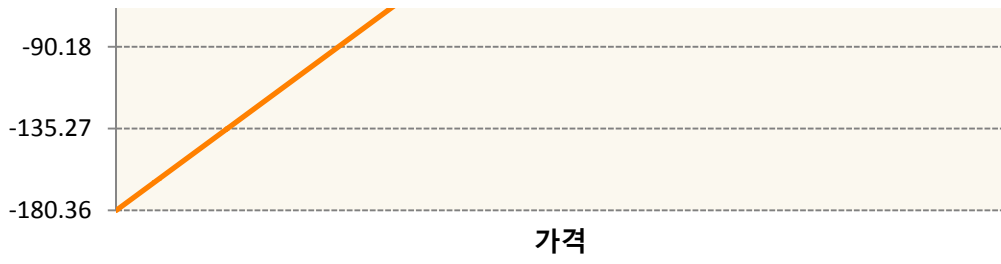
2. 만기시점의 손익구조

BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18

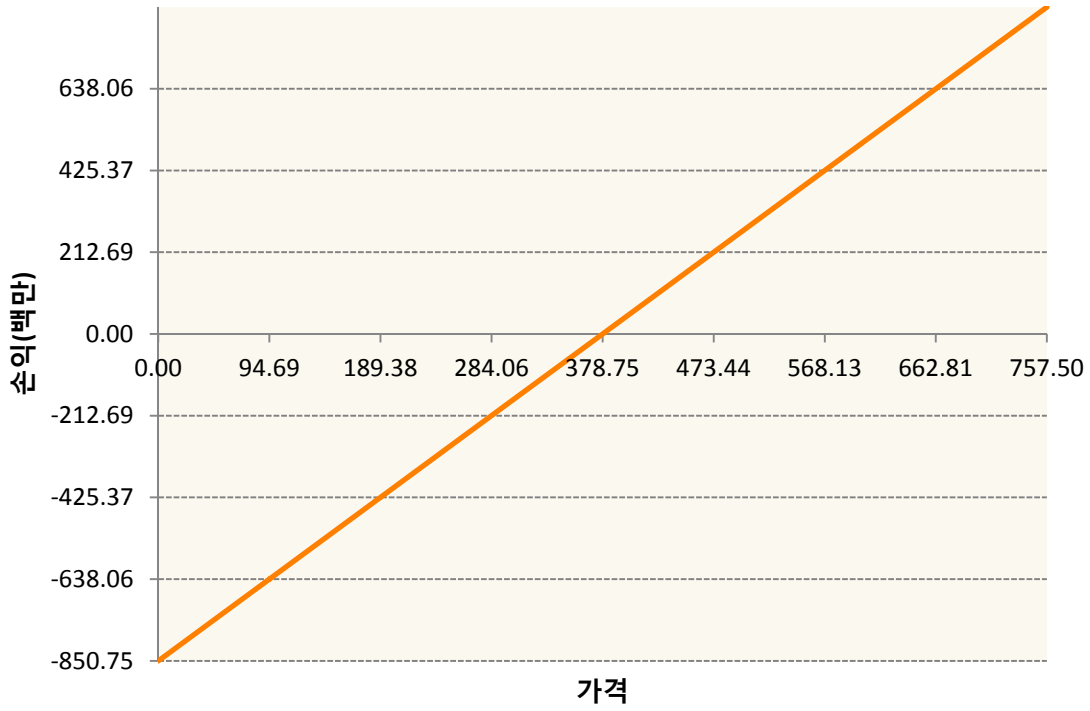


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

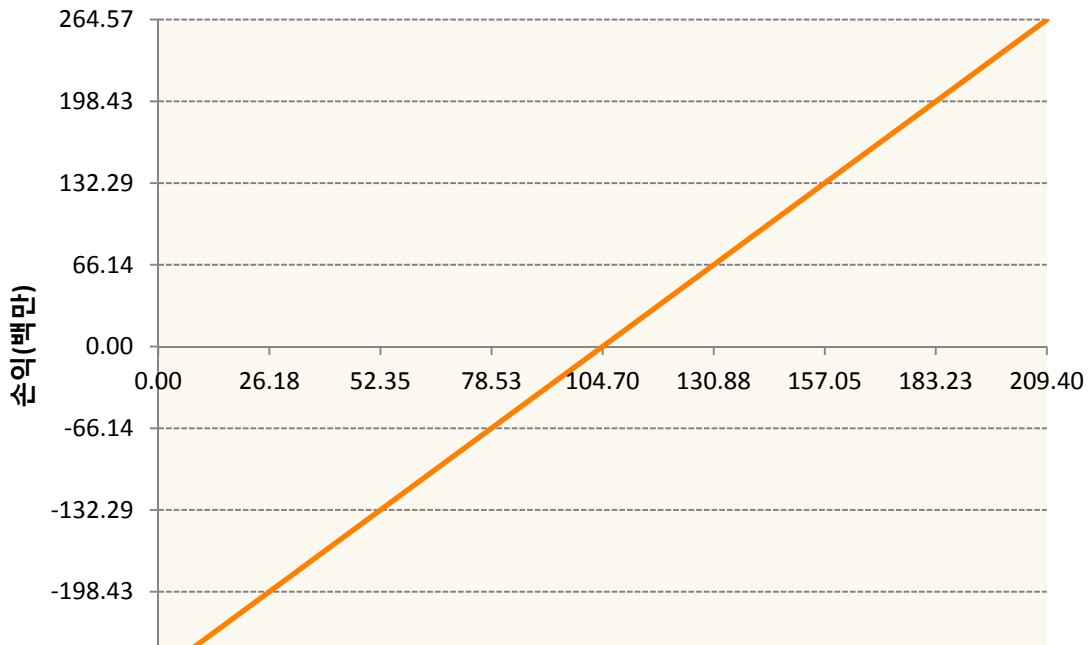


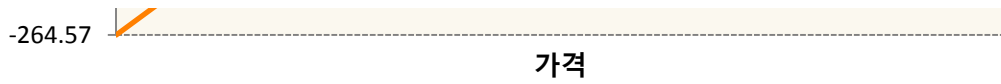


CZ8-CORN FUTURE DEC18

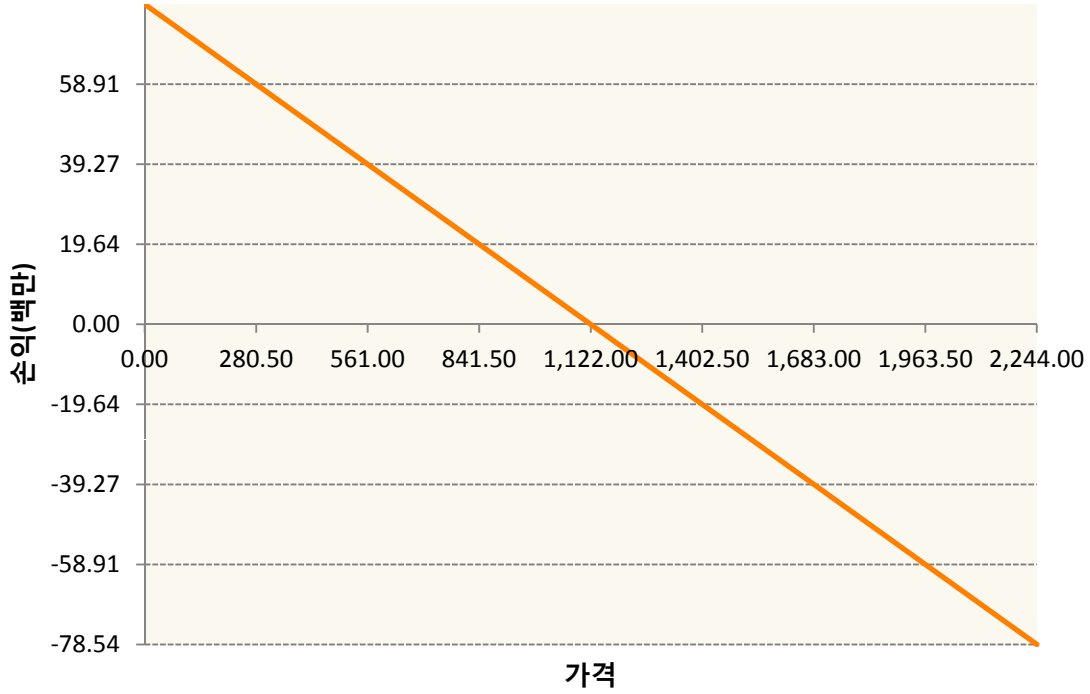


KCZ8-COFFEE 'C' FUTURE Dec18

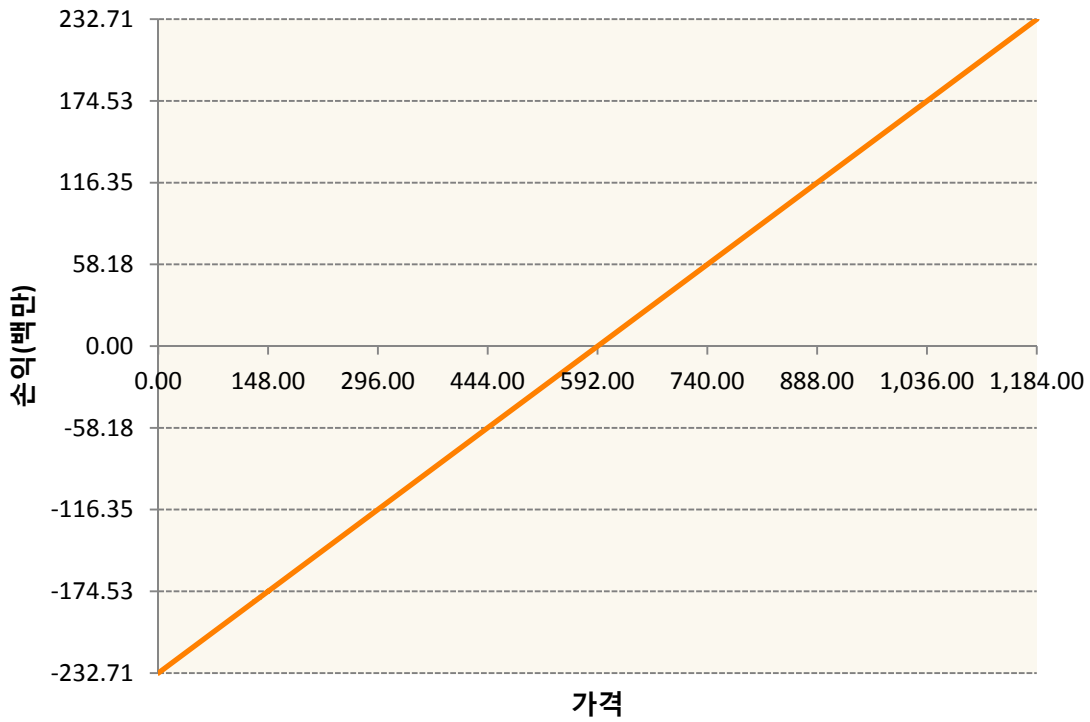




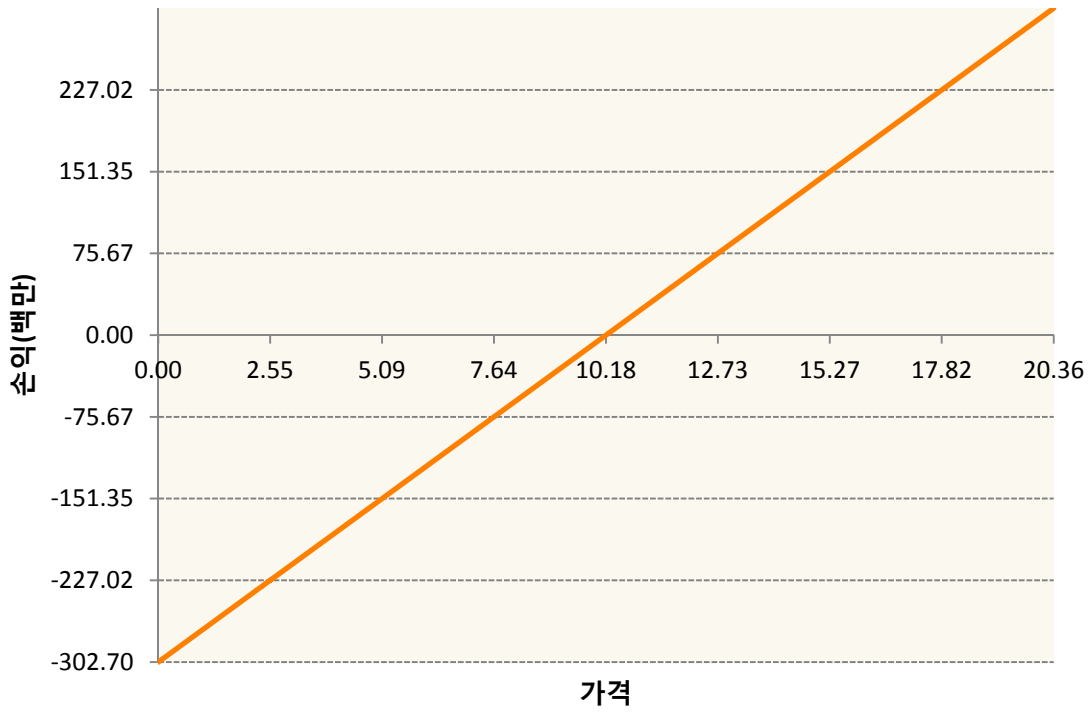
KR4175N90000-2018-09 달러선물



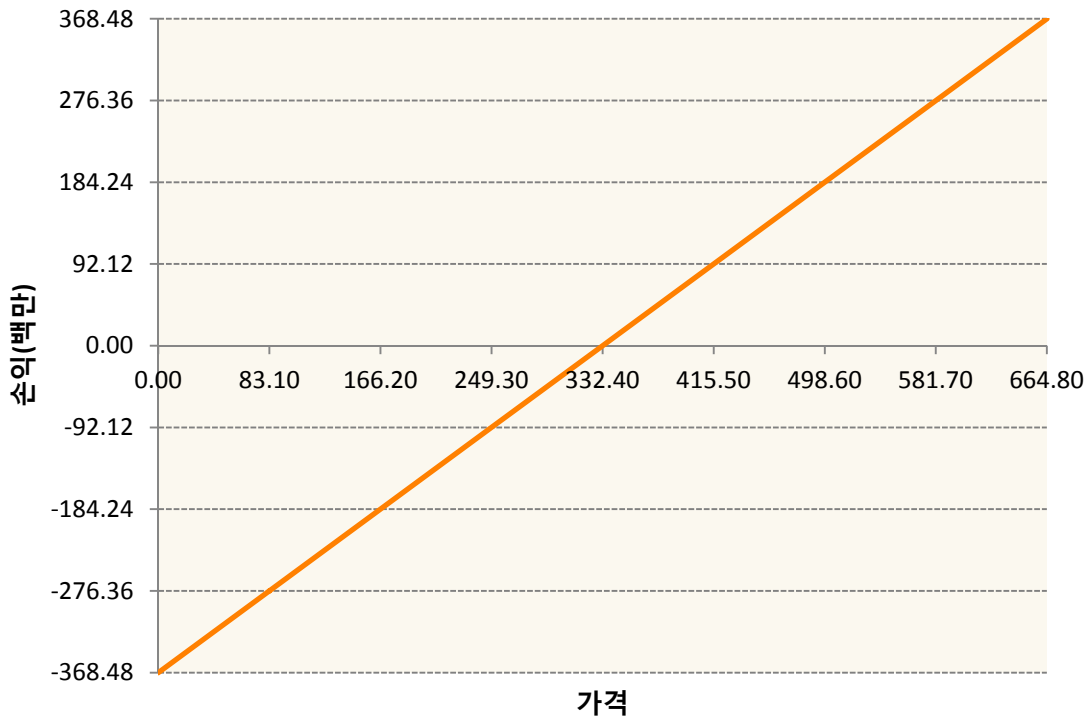
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



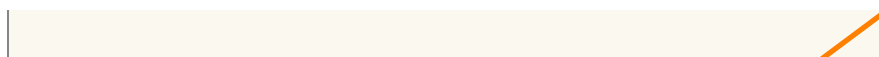
SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

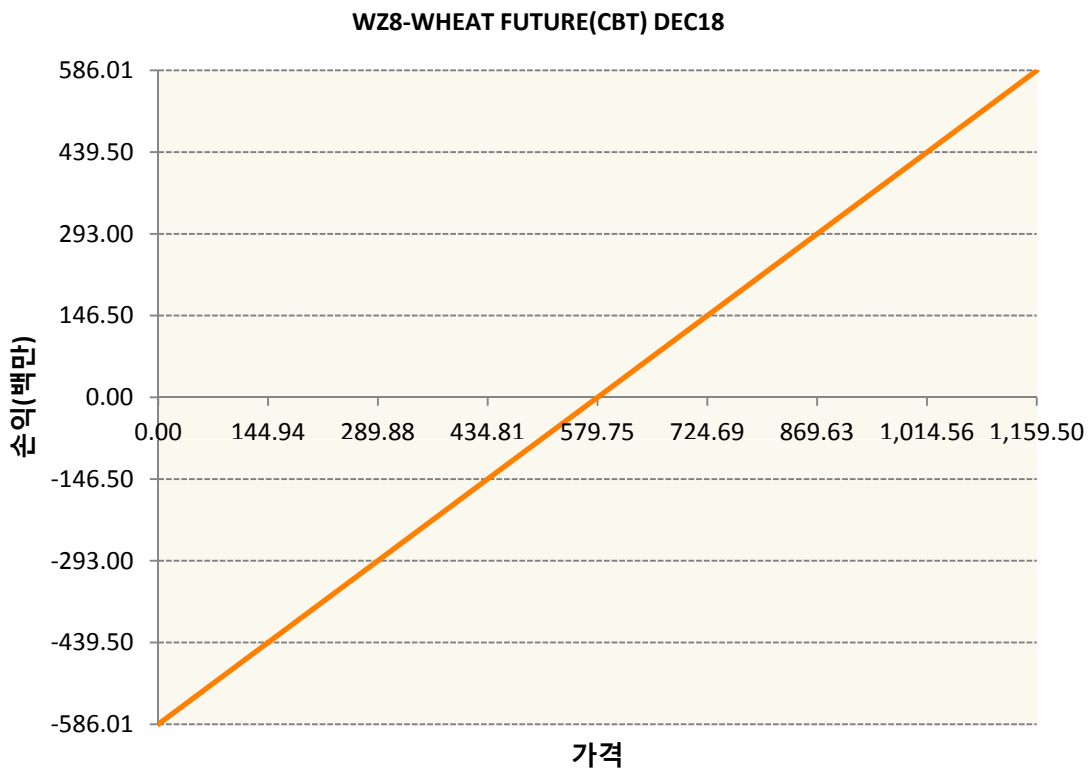
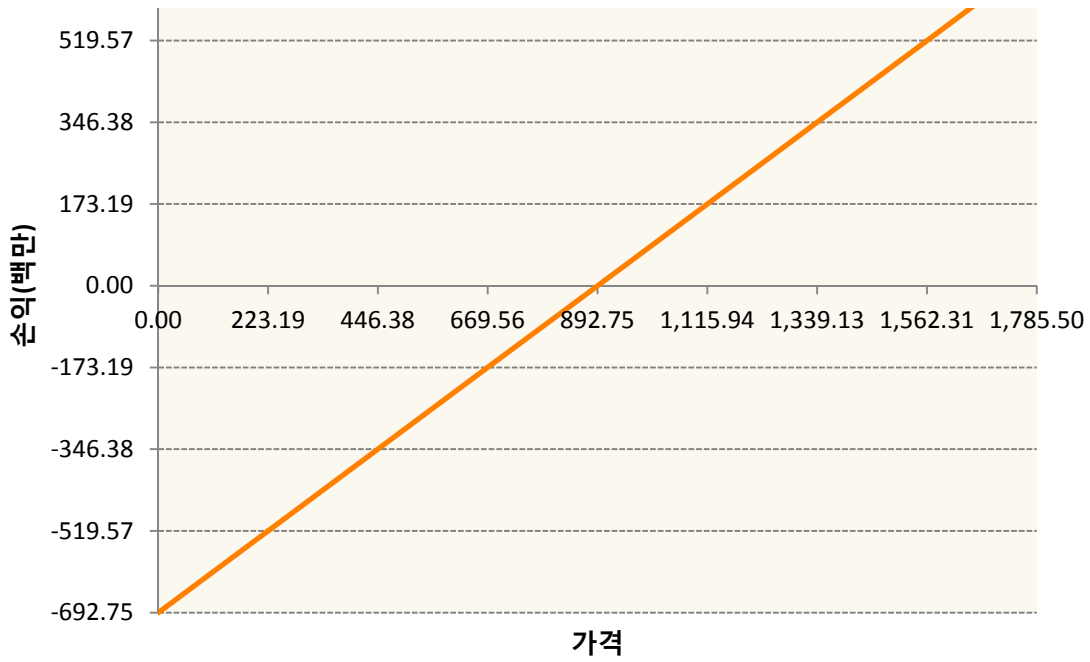


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	23
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	14
CZ8	CORN FUTURE DEC18	68
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	21
KR4175N90C	2018-09 달러선물	6

KWZ8	KC HRW WHEAT FUT DEC18	19
SBV8	SUGAR #11 (WORLD) OCT18	24
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	29
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	55
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	47

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

(단위:백만원)

321