

공시일	2018-08-22
기준일	2018-08-21

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	2018-08-22
기준일	2018-08-21

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

1,138

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

486

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-22
기준일	2018-08-21

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)

SWCSI50000 신한CSI500미래S180608

301

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

379

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-22
기준일	2018-08-21

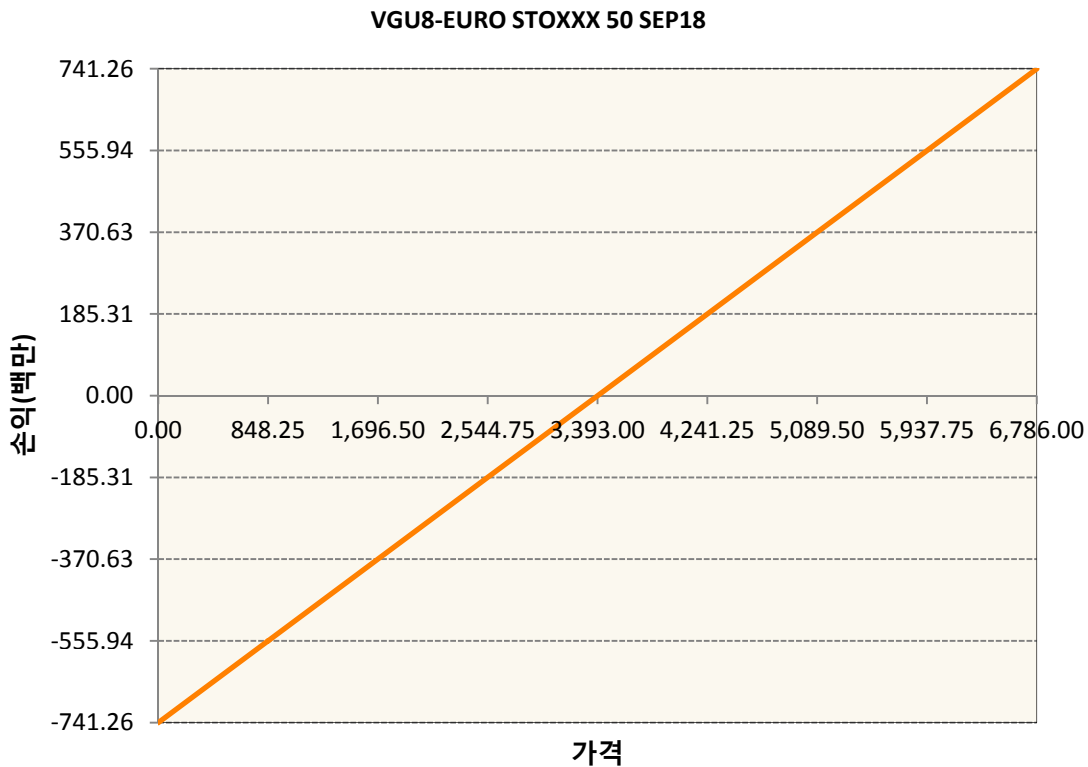
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	741	0	741	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

37

공시일	2018-08-22
기준일	2018-08-21

차이나인덱스모(주식-파생형)

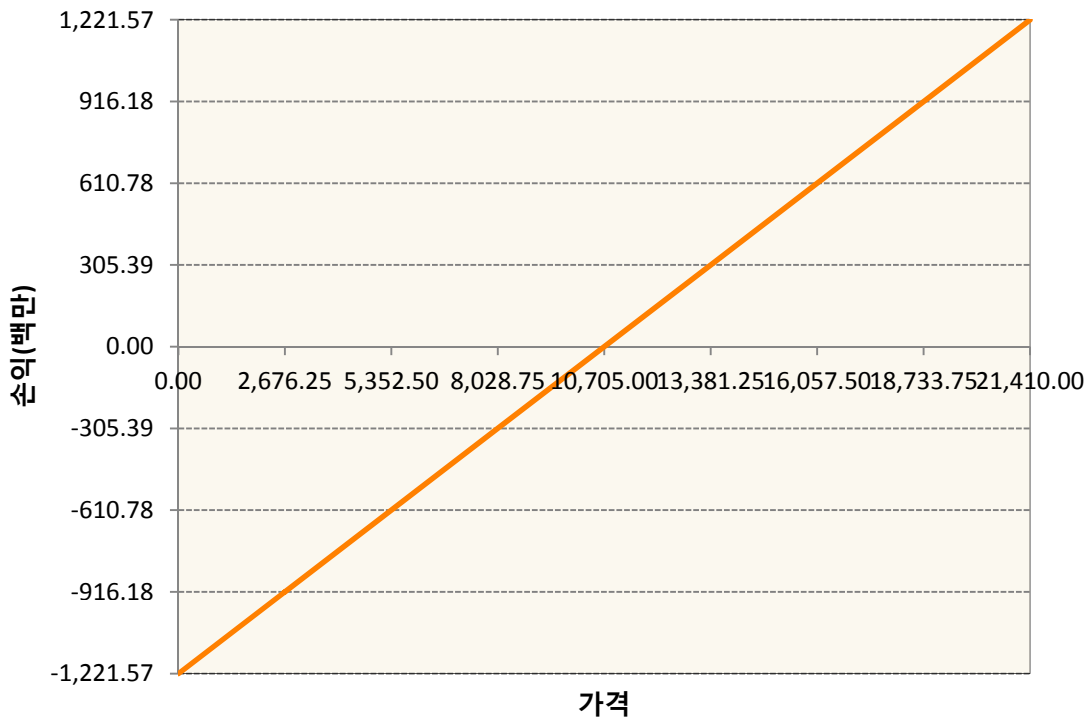
1. 계약금액

(단위:백만원)

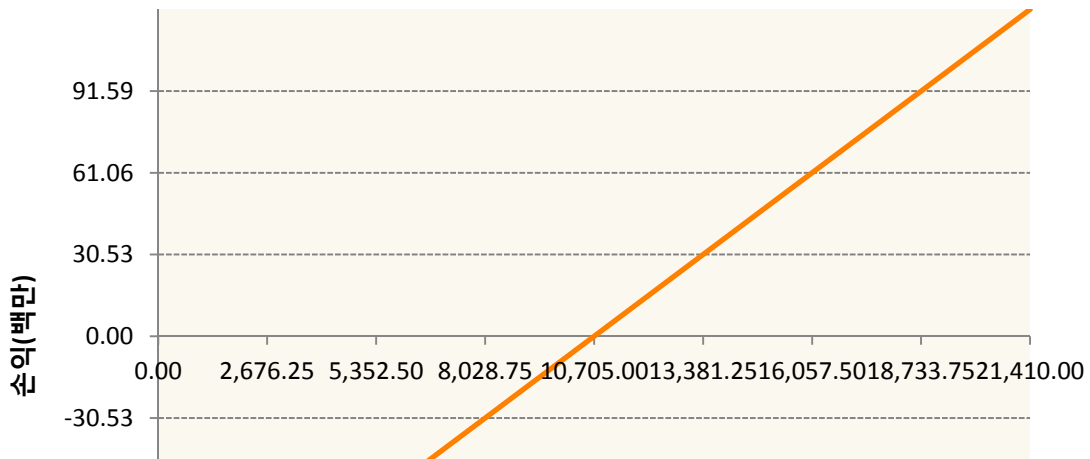
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,344	0	1,344	장내

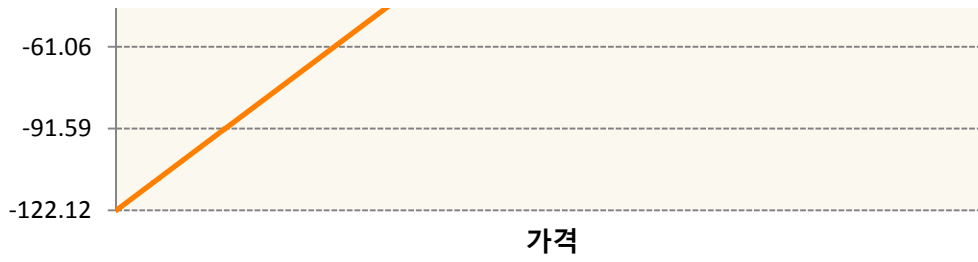
2. 만기시점의 손익구조

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	2018-08-22
기준일	2018-08-21

커버드콜모(주식혼합-파생형)

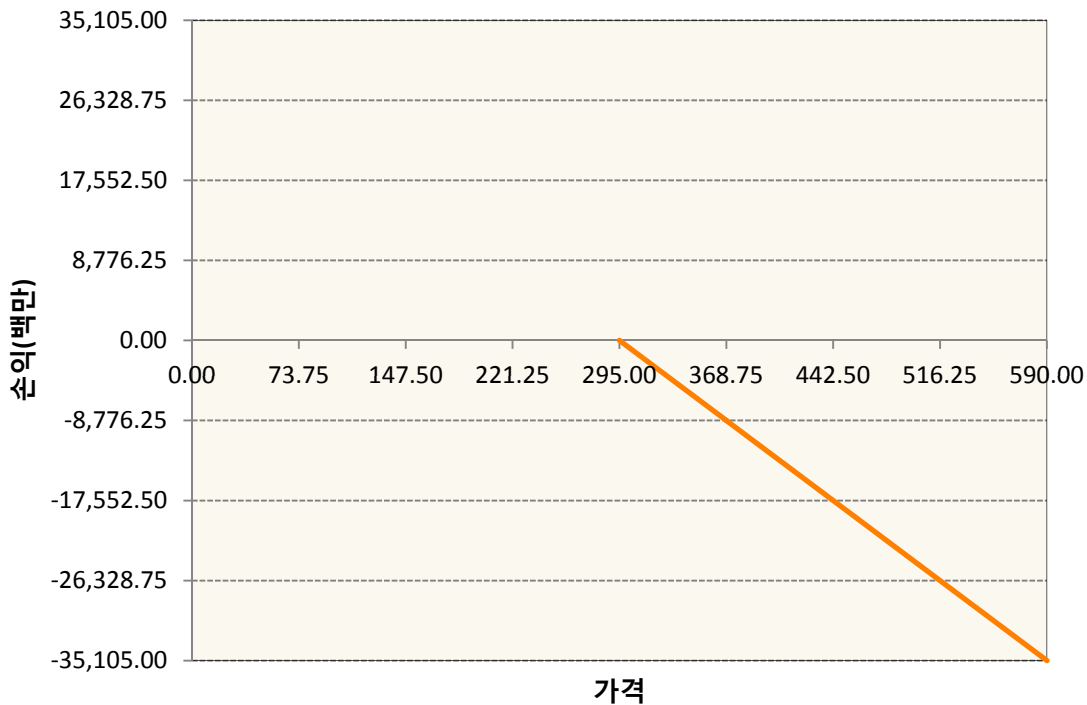
1. 계약금액

(단위:백만원)

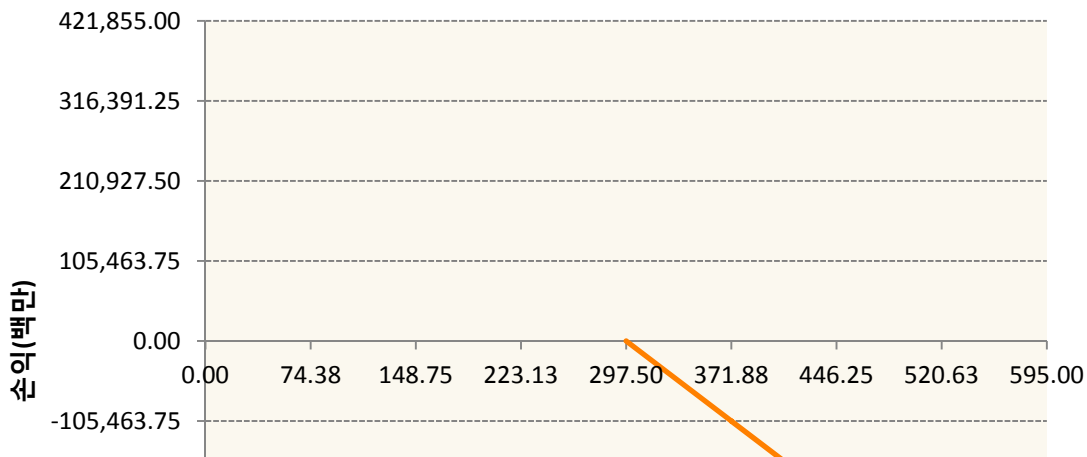
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	765,616	-765,616	장내

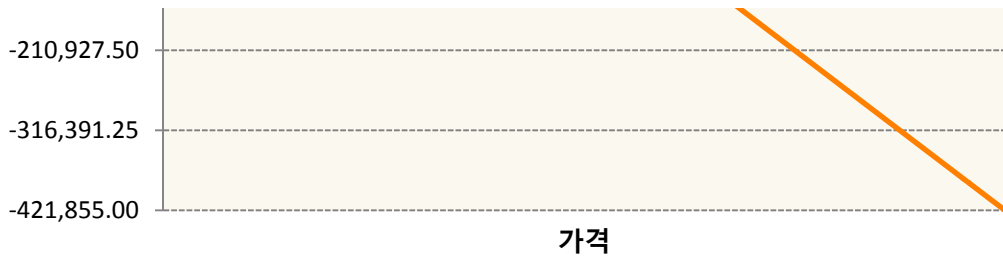
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92950-2018-09 콜295

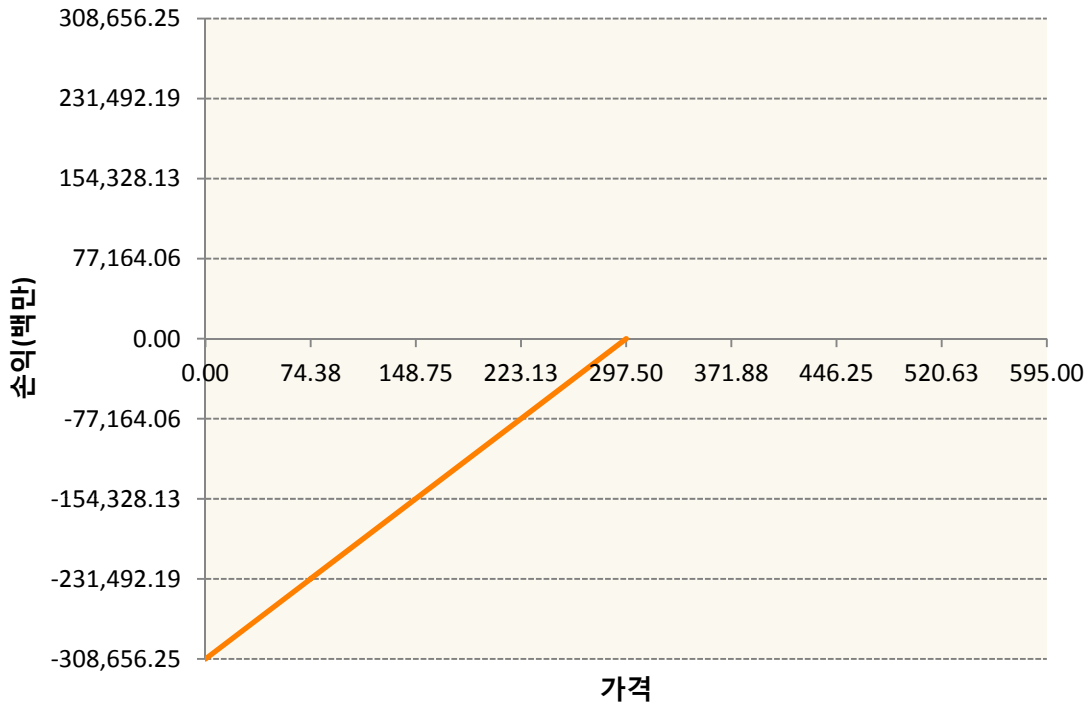


KR4201N92976-2018-09 콜297.5





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N929 2018-09 콜295

2,015

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	757	740	717	690	658	622	582
-5.33%	695	658	615	568	518	464	407
-2.67%	541	479	415	348	280	210	140
0%	235	157	78	0	-79	-157	-236
2.67%	-255	-333	-410	-489	-567	-646	-725
5.33%	-919	-980	-1,044	-1,111	-1,180	-1,251	-1,323
8.00%	-1,710	-1,750	-1,794	-1,844	-1,898	-1,955	-2,015

KR4201N929 2018-09 풋297.5

22,766

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,692	7,539	7,326	7,056	6,730	6,353	5,928

-5.33%	7,165	6,799	6,366	5,874	5,333	4,748	4,127
-2.67%	5,732	5,078	4,380	3,647	2,885	2,101	1,297
0%	2,710	1,816	912	0	-918	-1,840	-2,766
2.67%	-2,415	-3,371	-4,328	-5,286	-6,245	-7,205	-8,164
5.33%	-9,688	-10,501	-11,342	-12,203	-13,082	-13,973	-14,875
8.00%	-18,682	-19,242	-19,863	-20,533	-21,245	-21,992	-22,766
KR4301N929 2018-09 풋297.5							22,544
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,524	-22,524	-22,524	-22,526	-22,529	-22,534	-22,544
-5.33%	-14,460	-14,465	-14,475	-14,493	-14,521	-14,561	-14,613
-2.67%	-6,470	-6,532	-6,616	-6,722	-6,847	-6,990	-7,149
0%	775	529	270	0	-278	-562	-851
2.67%	5,515	5,197	4,876	4,554	4,231	3,906	3,581
5.33%	7,210	7,064	6,894	6,704	6,496	6,274	6,040
8.00%	7,491	7,465	7,424	7,365	7,289	7,194	7,082

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

(단위:백만원)

49,149

공시일	2018-08-22
기준일	2018-08-21

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

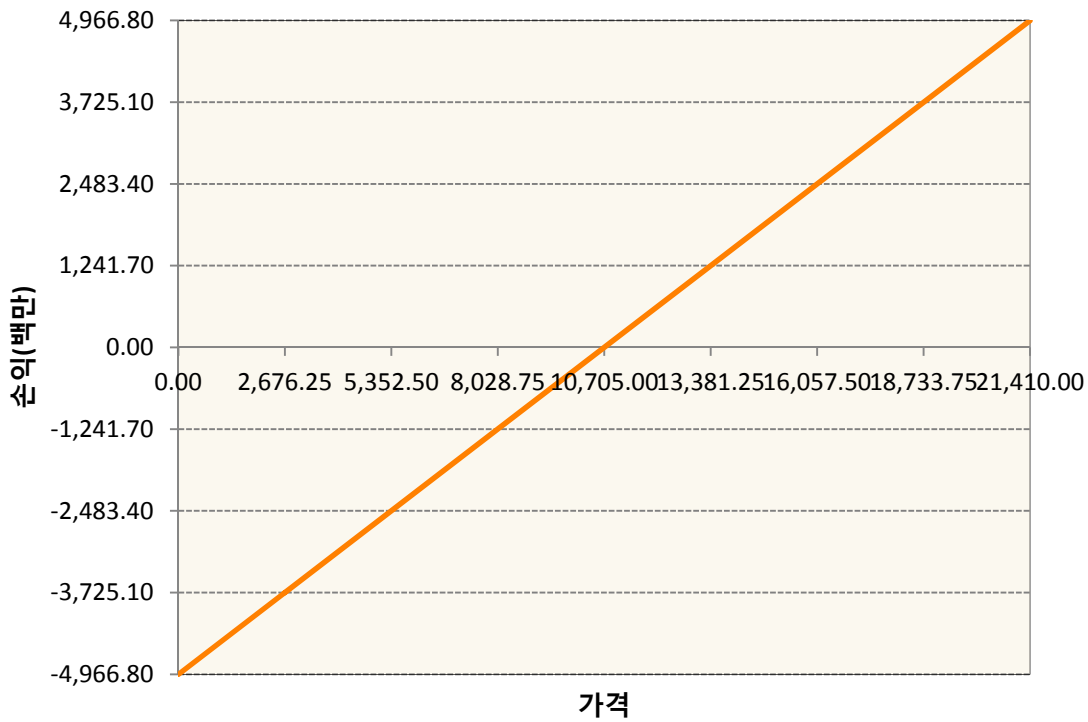
1. 계약금액

(단위:백만원)

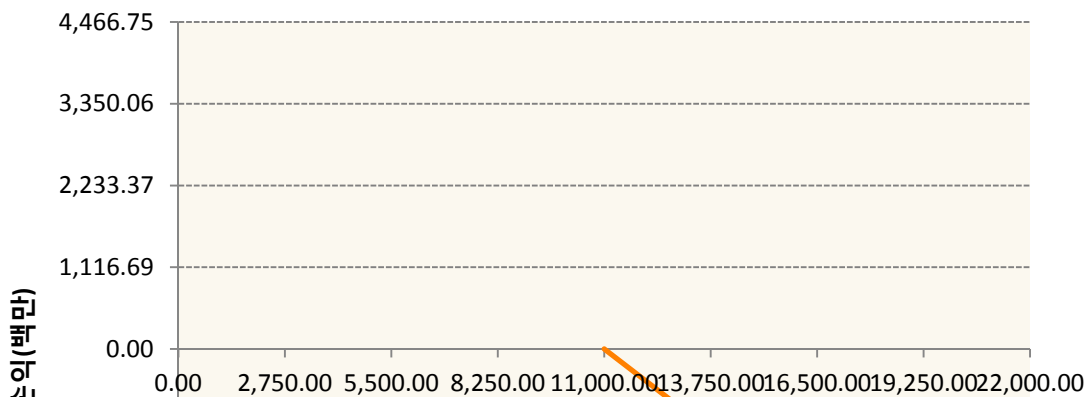
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,967	0	4,967	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,487	-11,487	장내

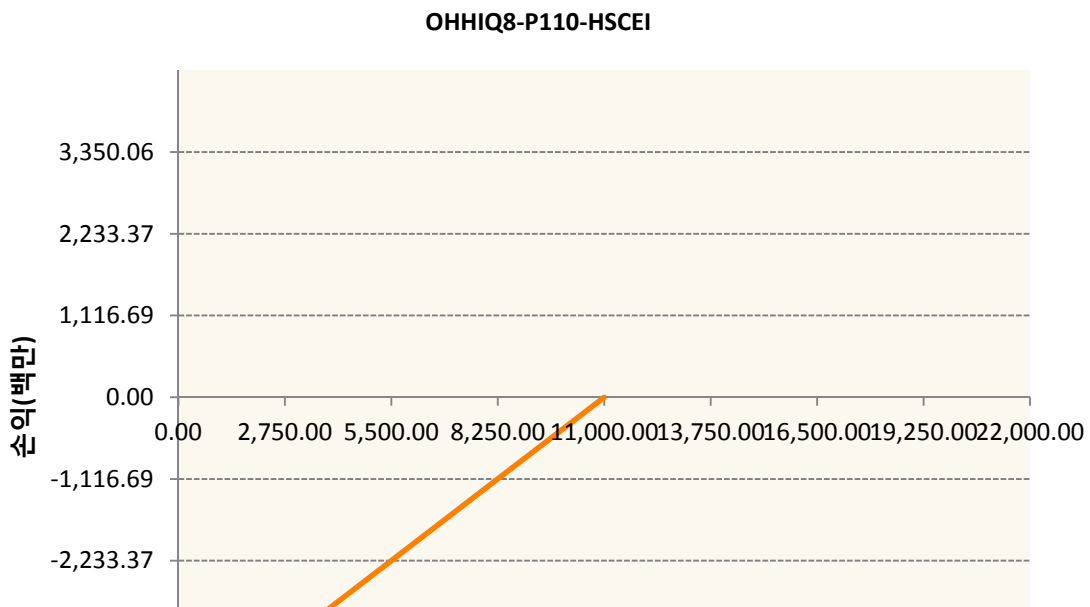
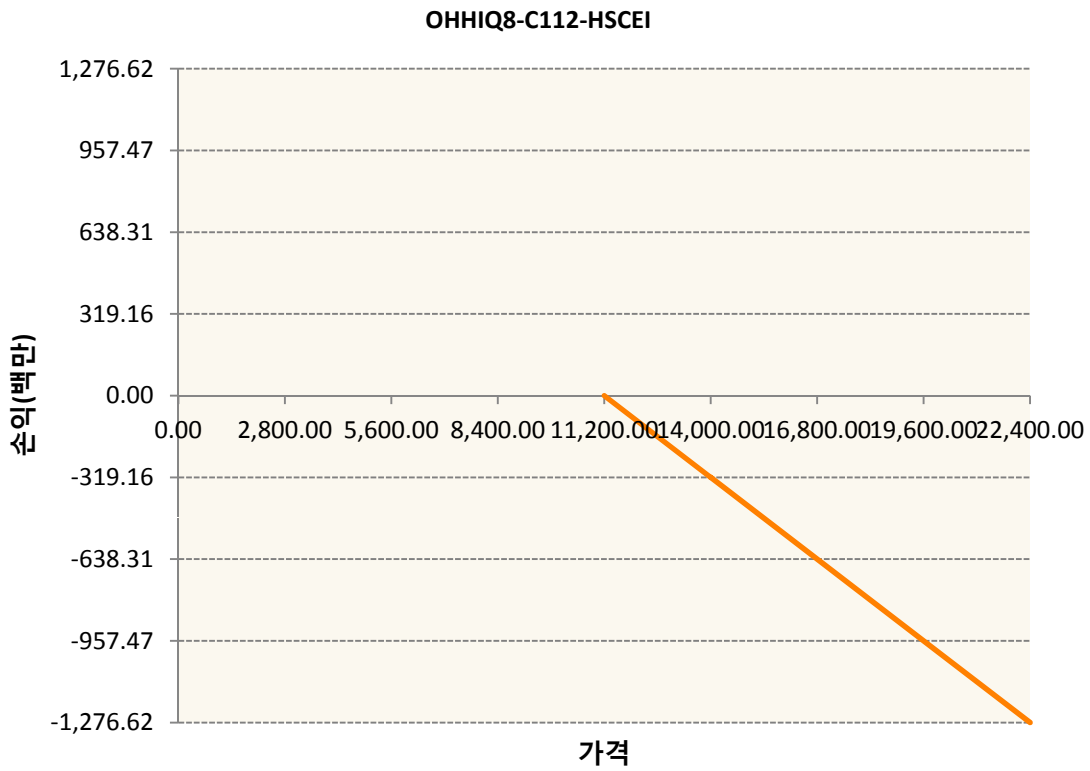
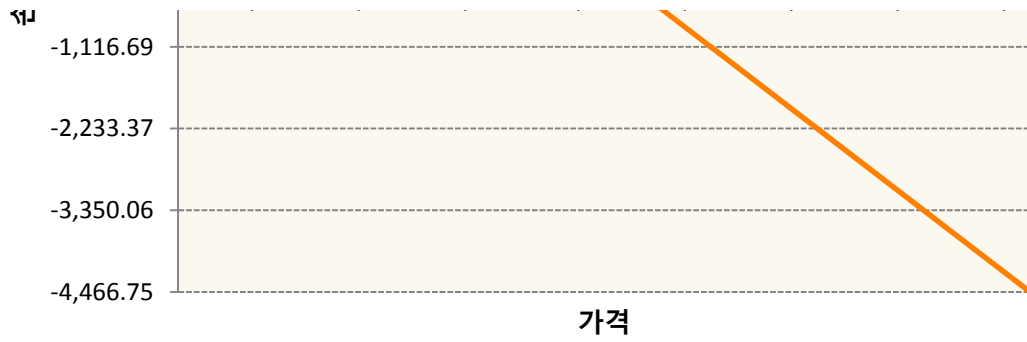
2. 만기시점의 손익구조

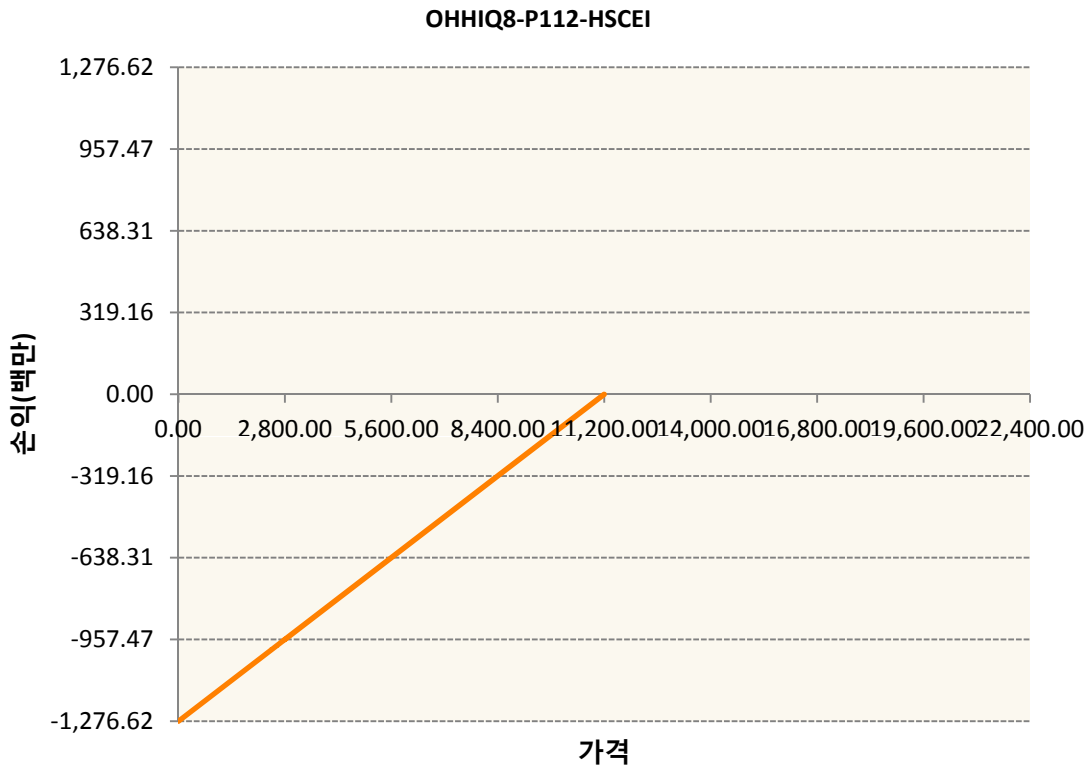
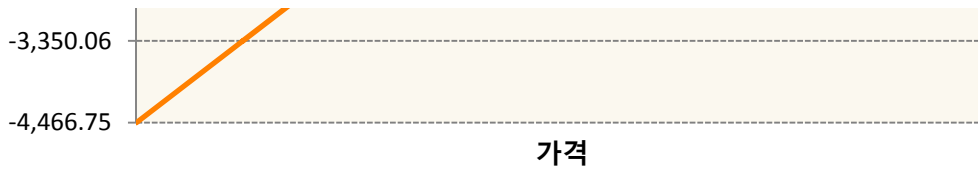
HCQ8-HSCEI Futures Aug18



OHHIQ8-C110-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ8	HSCEI Futures Aug18	397
OHHIQ8-C1	HSCEI	357
OHHIQ8-C1	HSCEI	102
OHHIQ8-P11	HSCEI	357
OHHIQ8-P11	HSCEI	102

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,207

공시일	2018-08-22
기준일	2018-08-21

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

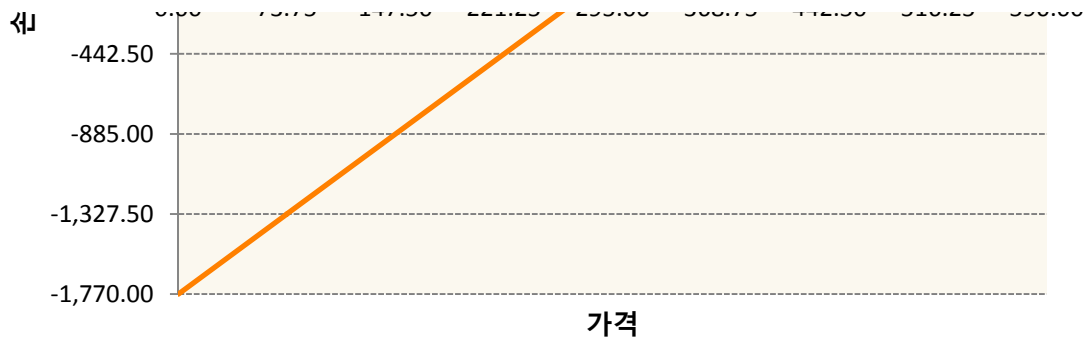
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92976-2018-09 콜297.5

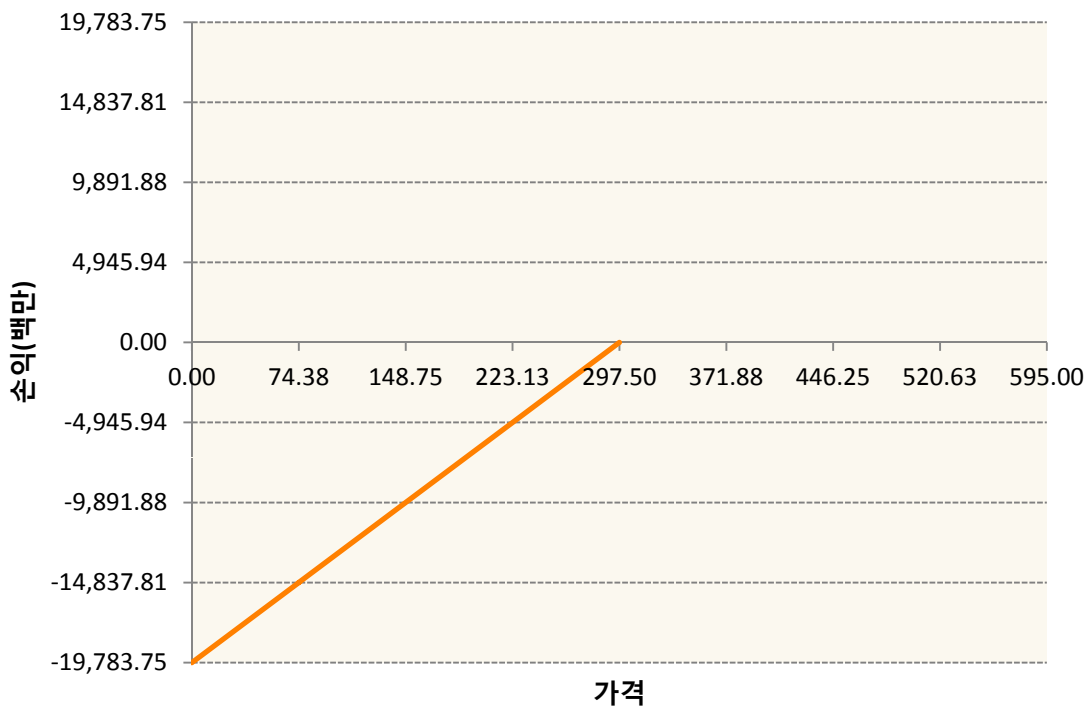


KR4301N92958-2018-09 풋295





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,961
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,961	-3,961	-3,961	-3,961	-3,961	-3,961	-3,961
-5.33%	-2,641	-2,641	-2,641	-2,641	-2,641	-2,641	-2,641
-2.67%	-1,320	-1,320	-1,320	-1,320	-1,320	-1,320	-1,320
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,320	1,320	1,320	1,320	1,320	1,320	1,320
5.33%	2,641	2,641	2,641	2,641	2,641	2,641	2,641
8.00%	3,961	3,961	3,961	3,961	3,961	3,961	3,961
KR4201N92974-2018-09 풋297.5							1,517
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	513	502	488	470	449	423	395
-5.33%	478	453	424	391	355	316	275
-2.67%	382	338	292	243	192	140	86
0%	181	121	61	0	-61	-123	-184
2.67%	-161	-225	-288	-352	-416	-480	-544
5.33%	-646	-700	-756	-813	-872	-931	-991
8.00%	-1,245	-1,282	-1,324	-1,368	-1,416	-1,466	-1,517
KR4301N92☞ 2018-09 풋295							126

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
-5.33%	-79	-79	-79	-79	-80	-80	-80
-2.67%	-33	-34	-35	-36	-37	-38	-39
0%	5	4	2	0	-2	-4	-5
2.67%	26	25	23	22	20	18	16
5.33%	32	32	31	30	30	29	27
8.00%	33	33	33	33	32	32	32
KR4301N92☞ 2018-09 풋297.5							1,445

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,444	-1,444	-1,444	-1,444	-1,444	-1,444	-1,445
-5.33%	-927	-927	-928	-929	-931	-933	-937
-2.67%	-415	-419	-424	-431	-439	-448	-458
0%	50	34	17	0	-18	-36	-55
2.67%	353	333	313	292	271	250	230
5.33%	462	453	442	430	416	402	387
8.00%	480	478	476	472	467	461	454

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

(단위:백만원)

7,193

공시일	2018-08-22
기준일	2018-08-21

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

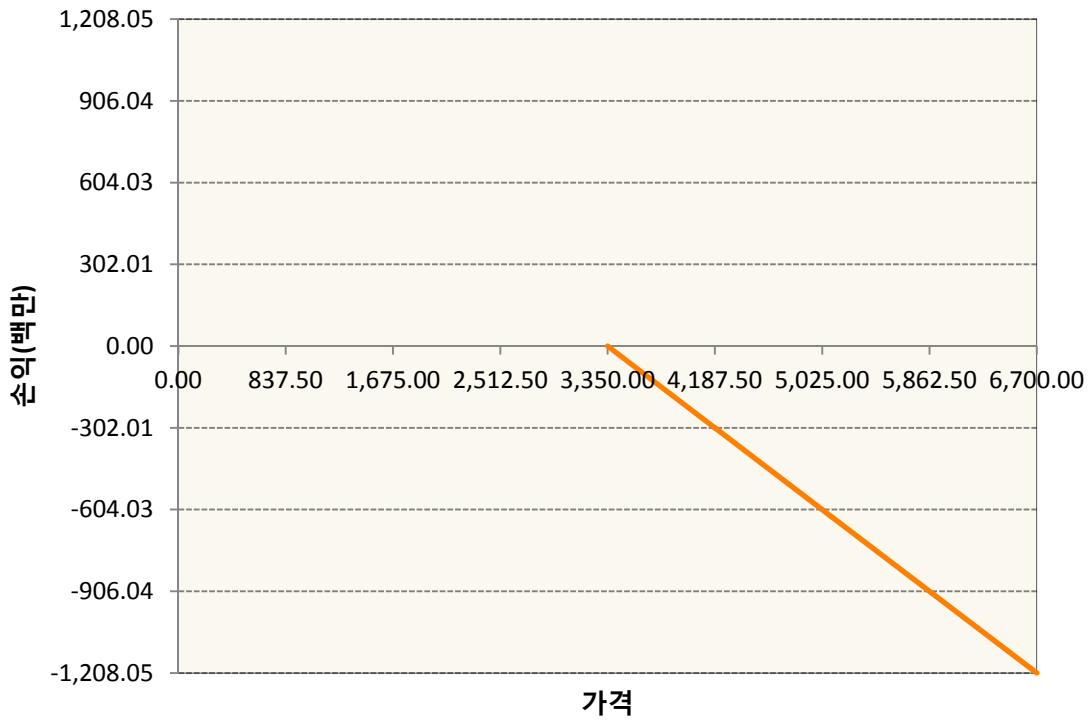
1. 계약금액

(단위:백만원)

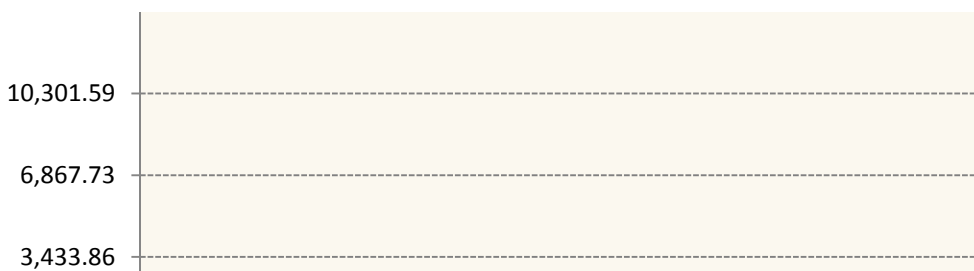
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	8,090	0	8,090	
누계	유가증권	옵션	0	29,887	-29,887	장내
누계	지수	스왑	86,299	0	86,299	장외

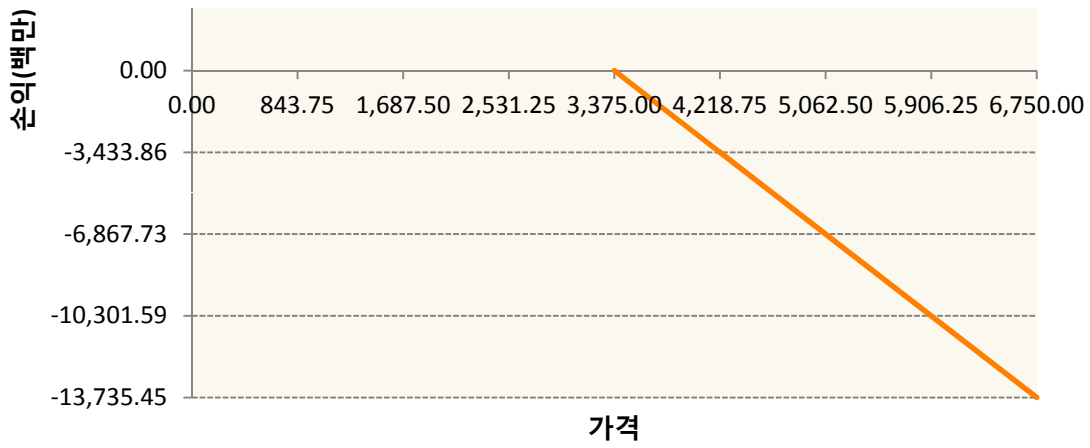
2. 만기시점의 손익구조

OESXU8-C3350-EURO STOXX 50

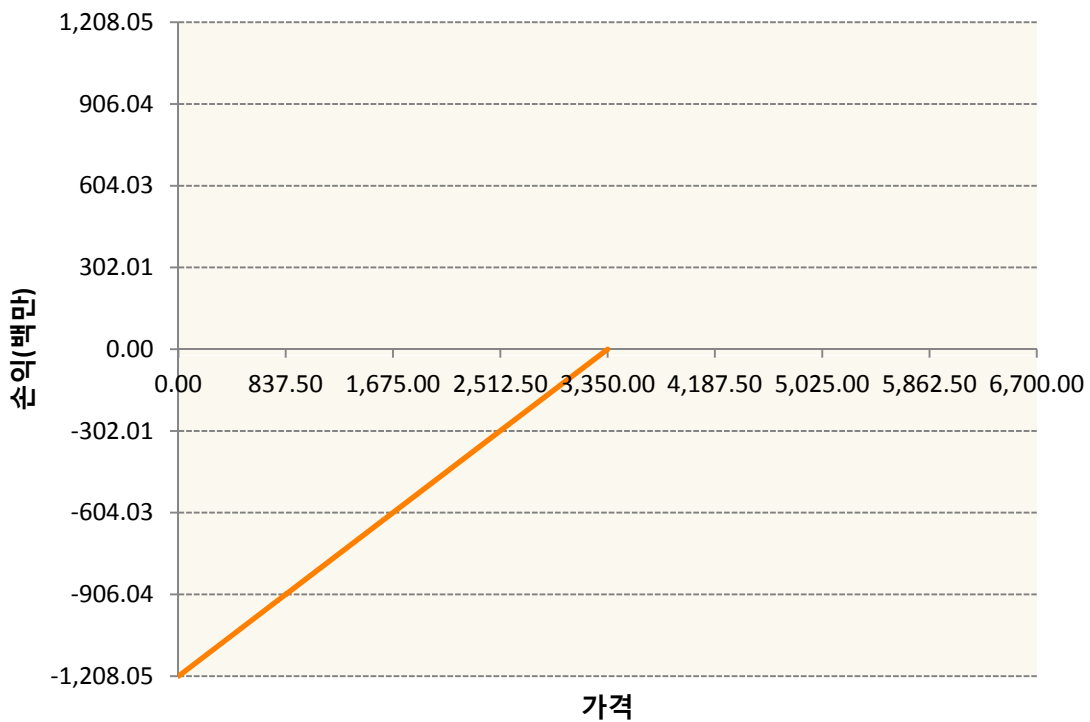


OESXU8-C3375-EURO STOXX 50

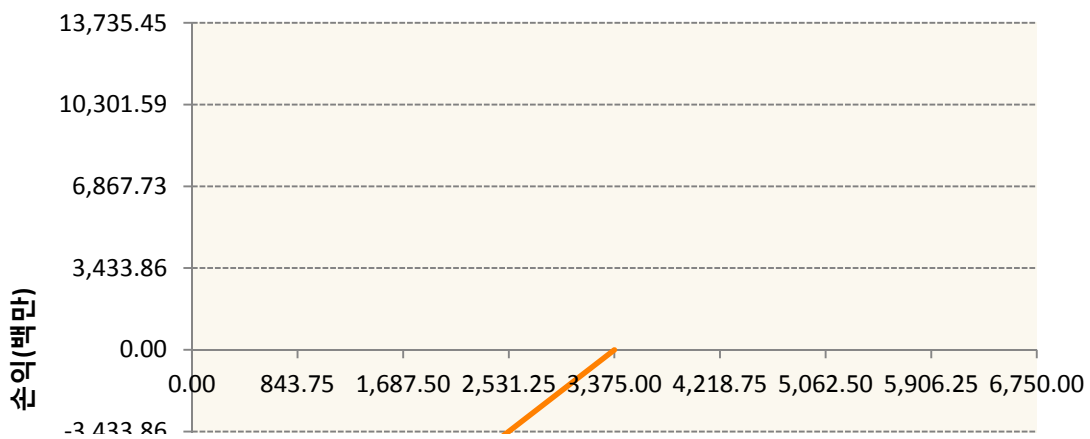


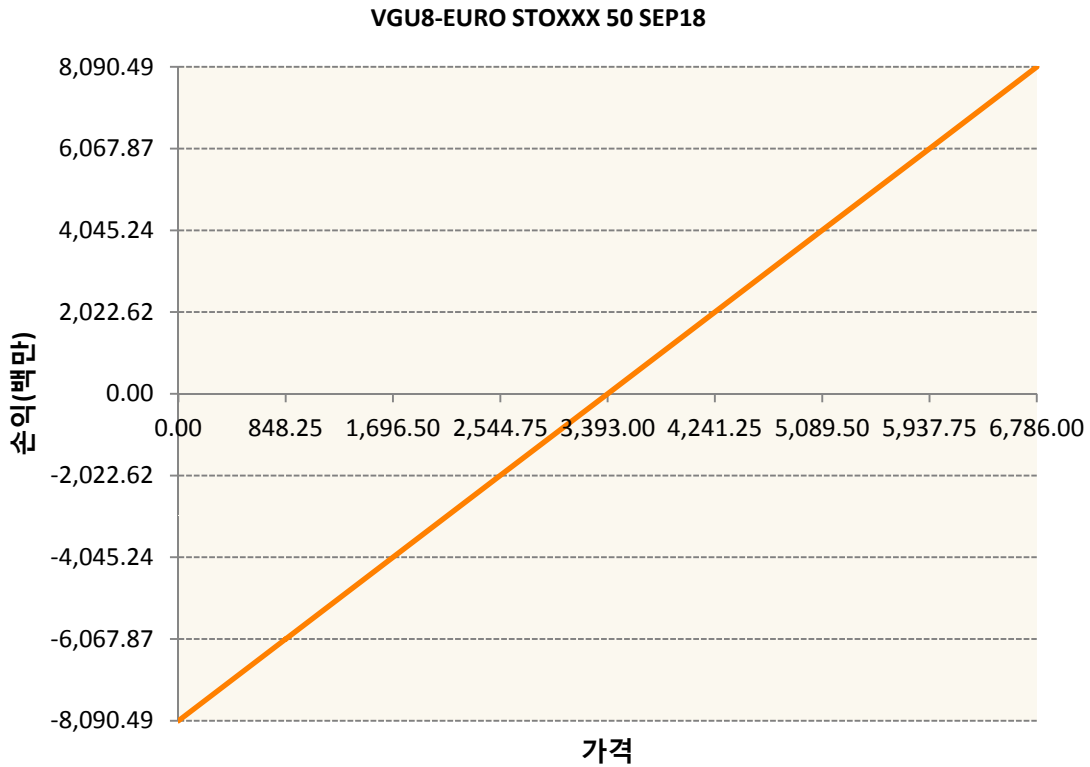
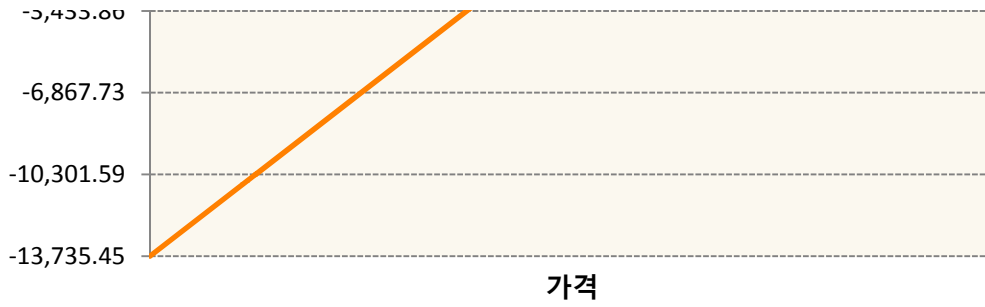


OESXU8-P3350-EURO STOXX 50



OESXU8-P3375-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	36
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY	24
OESXU8-C33 EURO STOXX 50	97
OESXU8-C33 EURO STOXX 50	1,099
OESXU8-P33 EURO STOXX 50	97
OESXU8-P33 EURO STOXX 50	1,099
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18	647

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

1,940

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

(단위:백만원)

1,126

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

(단위:백만원)

89

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

(단위:백만원)

133

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

(단위:백만원)

158

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-08-22
기준일	2018-08-21

리디파인K200(주식혼합-파생재간

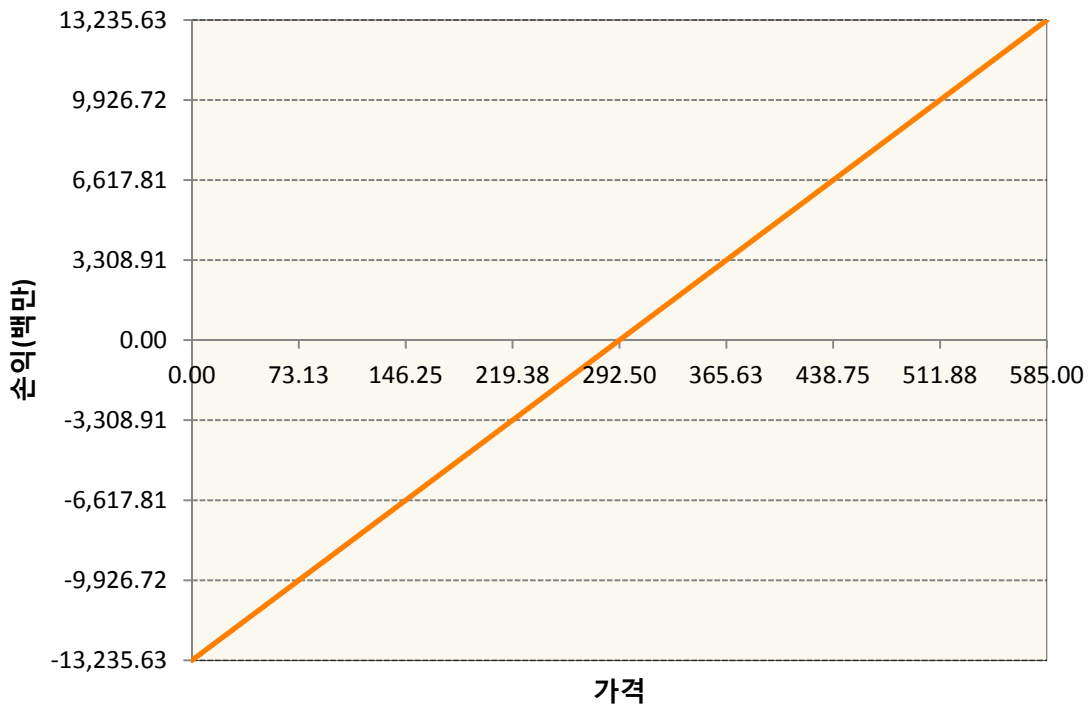
1. 계약금액

(단위:백만원)

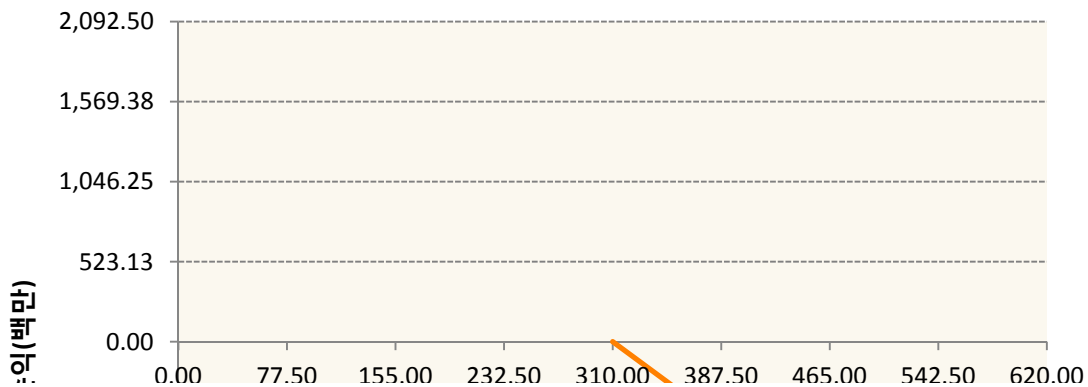
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,236	0	13,236	장내
누계	유가증권	옵션	1,339	24,358	-23,019	장내

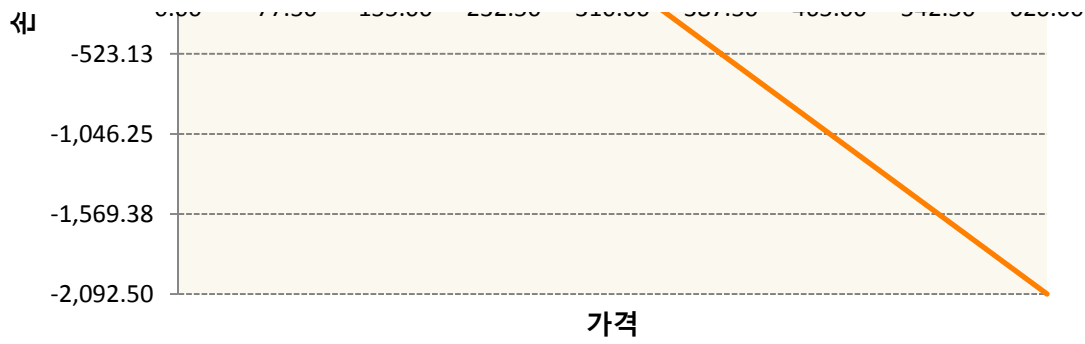
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

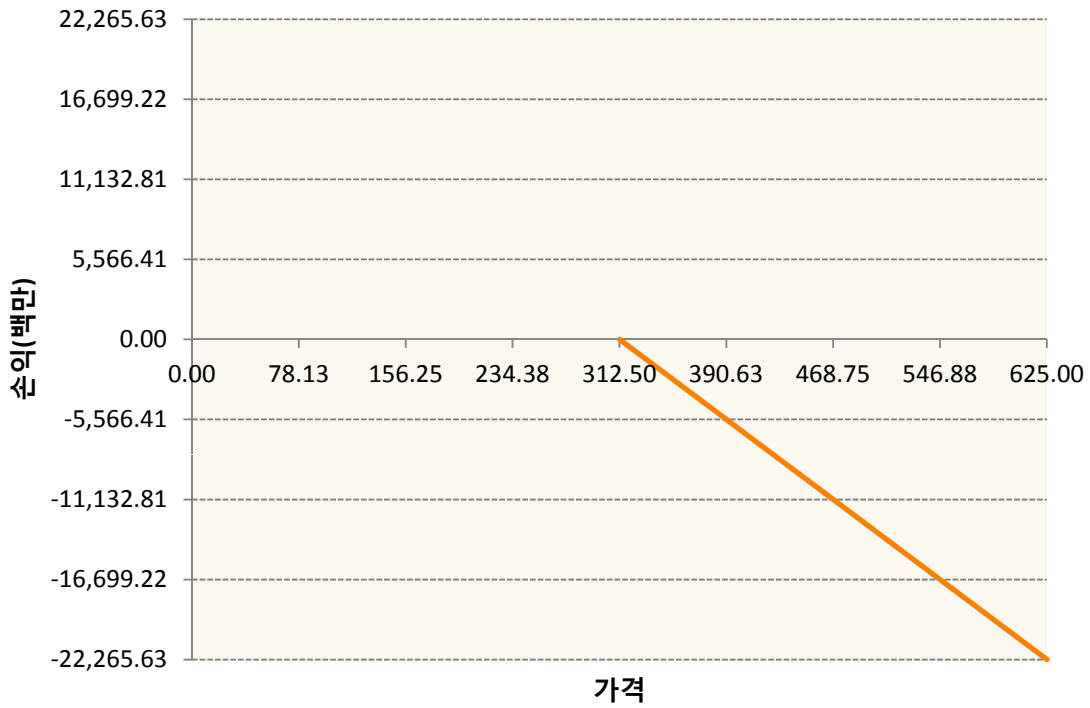


KR4201N93107-2018-09 콜310

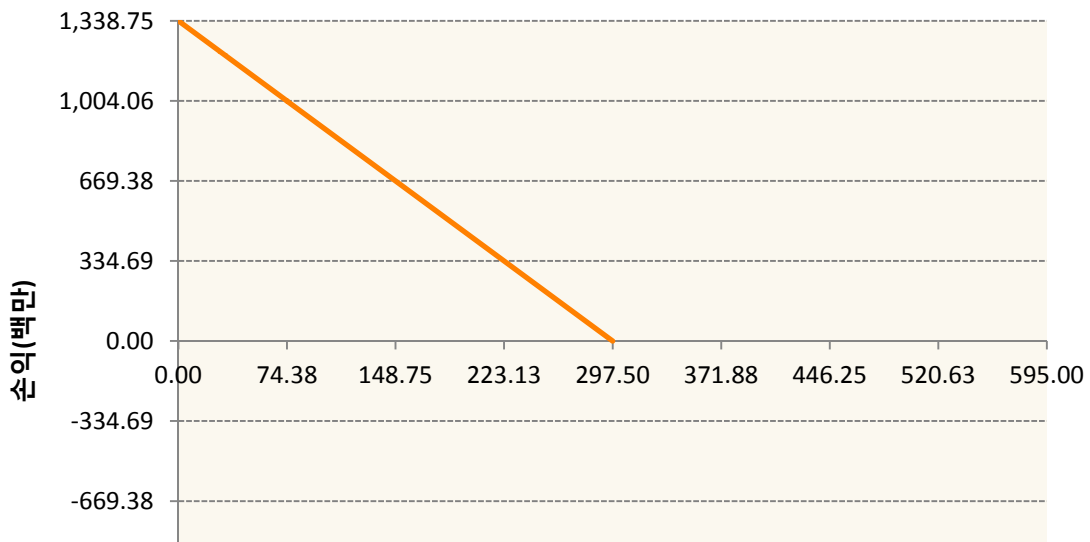


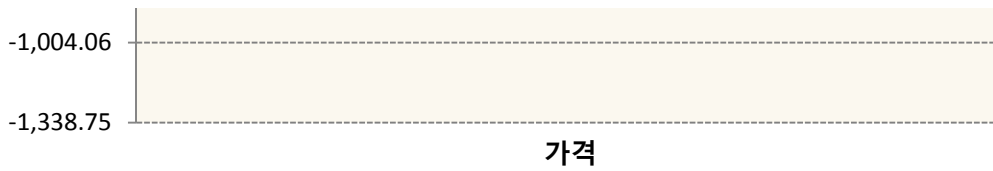


KR4201N93123-2018-09 콜312.5



KR4301N92974-2018-09 풋297.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물							1,057
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,057	-1,057	-1,057	-1,057	-1,057	-1,057	-1,057
-5.33%	-705	-705	-705	-705	-705	-705	-705
-2.67%	-352	-352	-352	-352	-352	-352	-352
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	352	352	352	352	352	352	352
5.33%	705	705	705	705	705	705	705
8.00%	1,057	1,057	1,057	1,057	1,057	1,057	1,057
KR4201N9312018-09 콜310							77
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	14	14	14	14	13	12	11
-5.33%	14	14	13	12	11	9	7
-2.67%	13	11	10	8	6	3	1
0%	8	6	3	0	-3	-7	-10
2.67%	-2	-5	-9	-14	-18	-22	-26
5.33%	-20	-25	-29	-34	-39	-44	-48
8.00%	-49	-53	-58	-62	-67	-72	-77
KR4201N9312018-09 콜312.5							741
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	123	122	120	117	112	105	97
-5.33%	121	117	111	103	92	79	63
-2.67%	110	100	86	69	49	27	2
0%	76	54	29	0	-31	-64	-99
2.67%	-7	-44	-83	-123	-165	-208	-251
5.33%	-171	-219	-268	-317	-366	-415	-464
8.00%	-438	-488	-538	-589	-639	-690	-741
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	63	63	63	63
-2.67%	28	28	29	29	30	30	31

0%	-3	-2	-1	0	1	2	4
2.67%	-24	-23	-21	-20	-18	-17	-16
5.33%	-31	-31	-30	-29	-28	-27	-26
8.00%	-32	-32	-32	-32	-32	-31	-31

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

(단위:백만원)

1,468

공시일	2018-08-22
기준일	2018-08-21

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

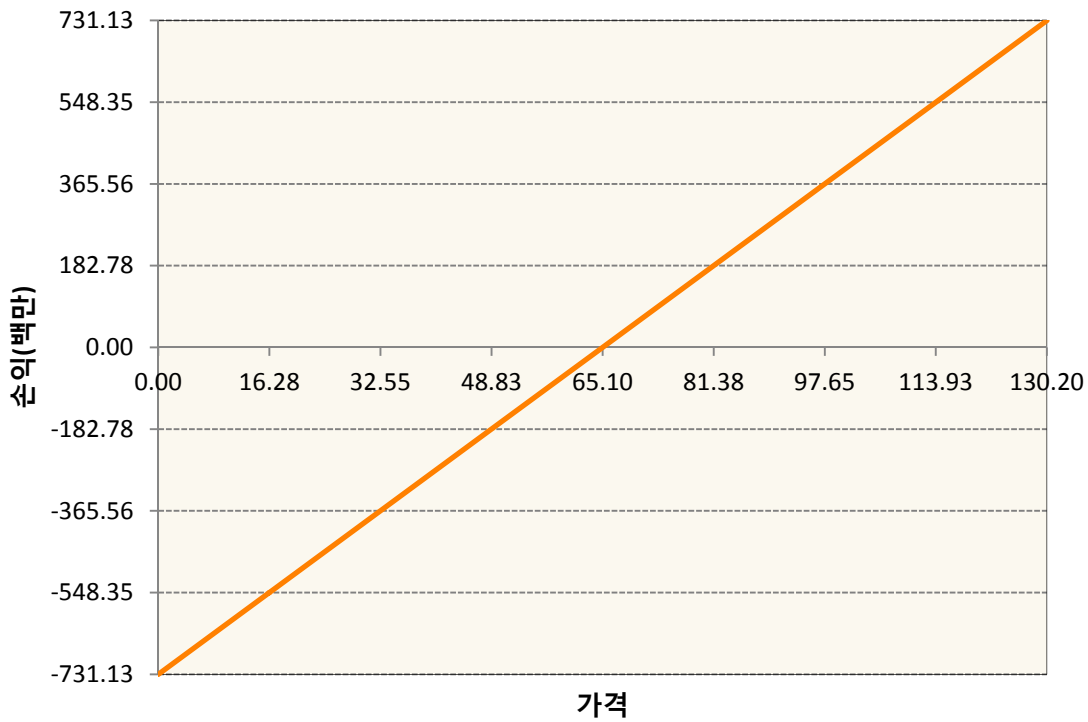
1. 계약금액

(단위:백만원)

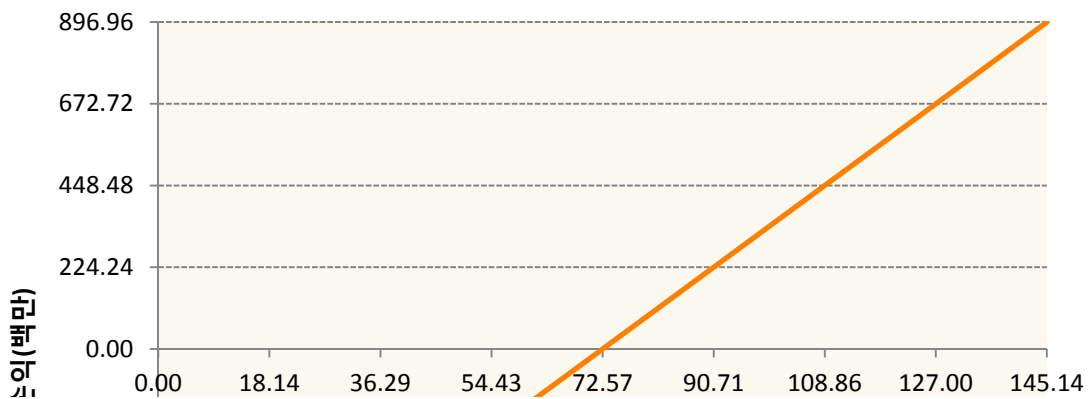
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,071	615	2,456	
누계	유가증권	선물	500	0	500	장내

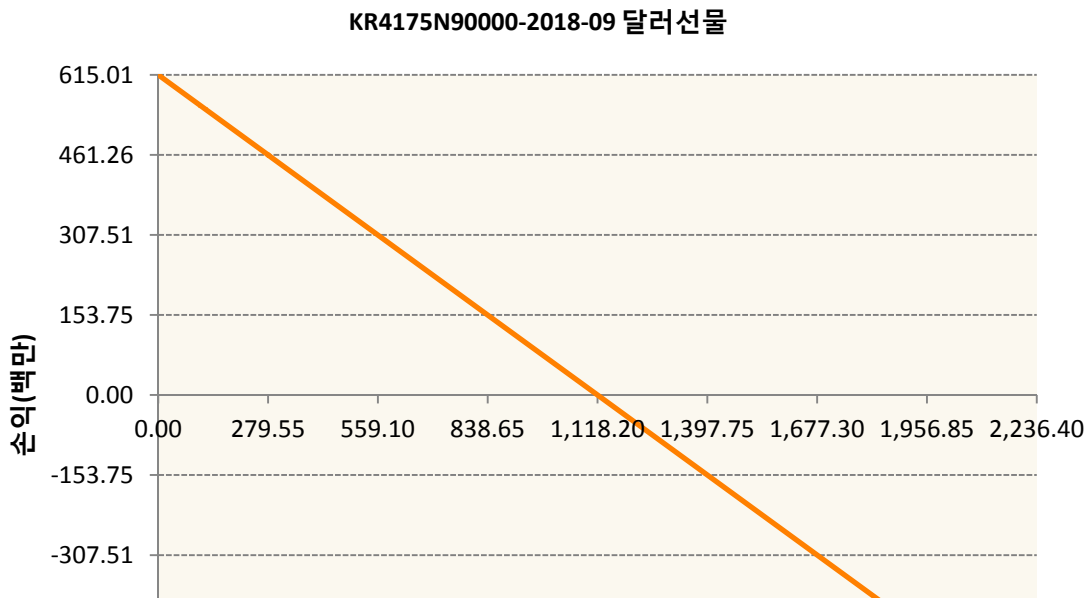
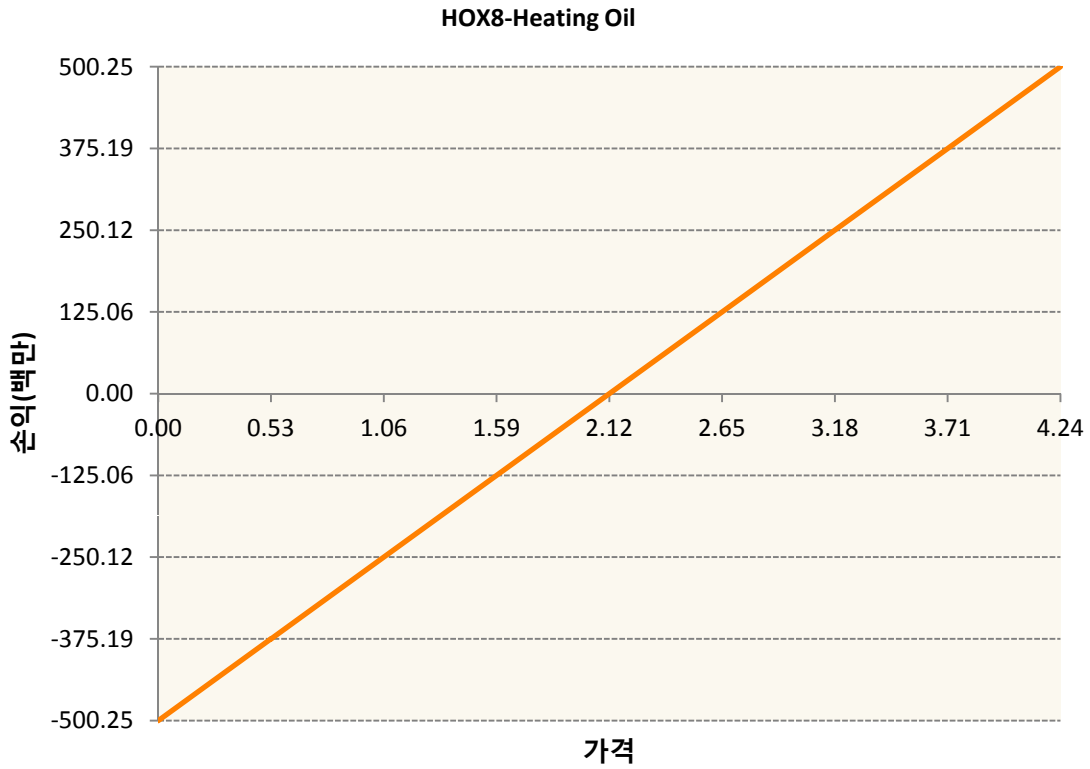
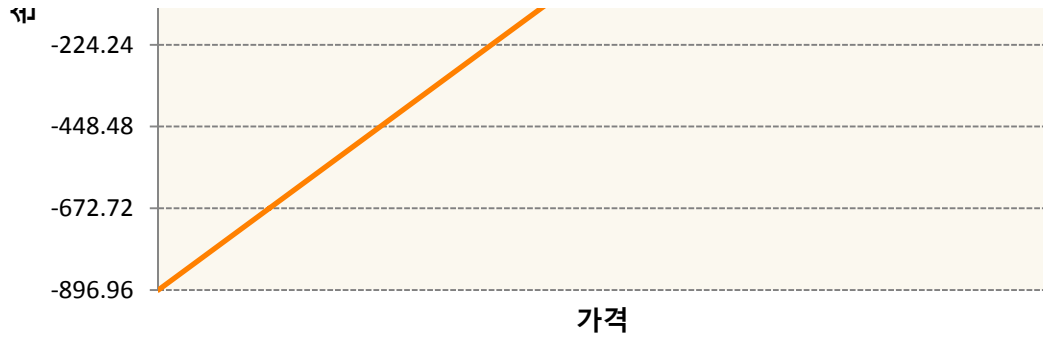
2. 만기시점의 손익구조

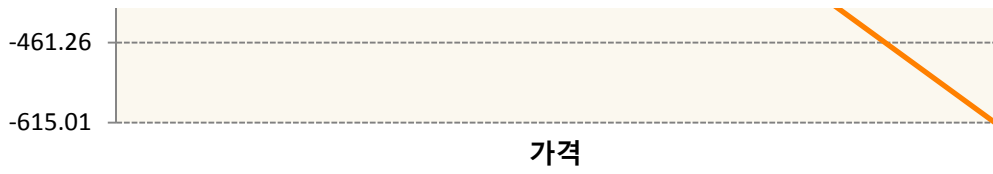
CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18



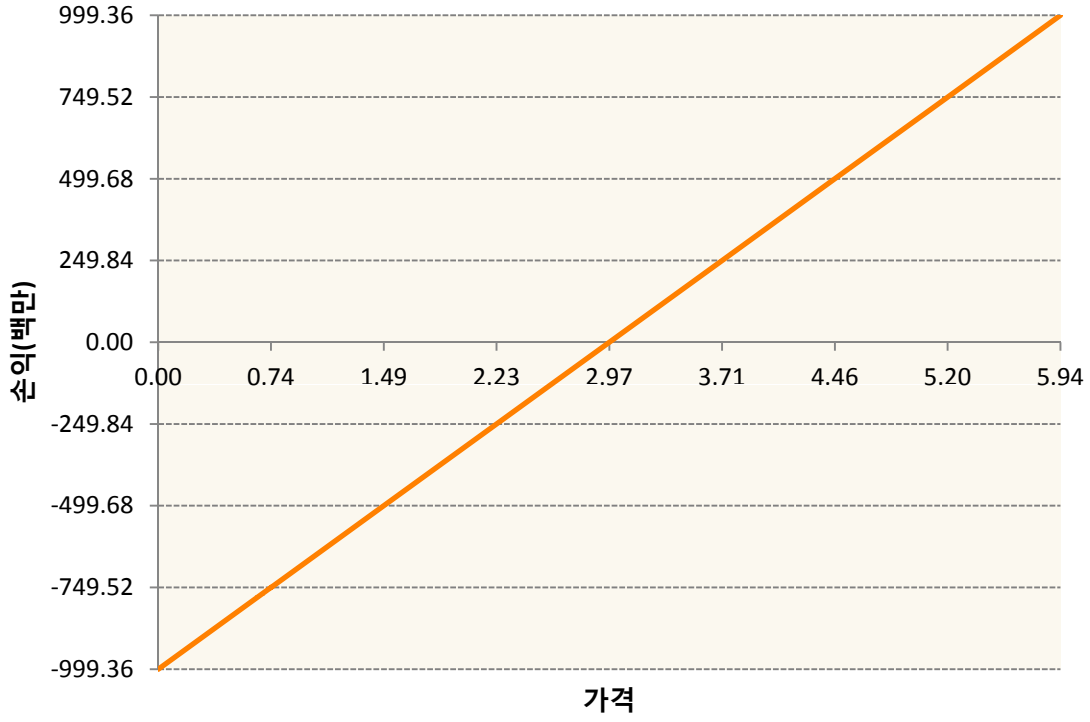
COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18



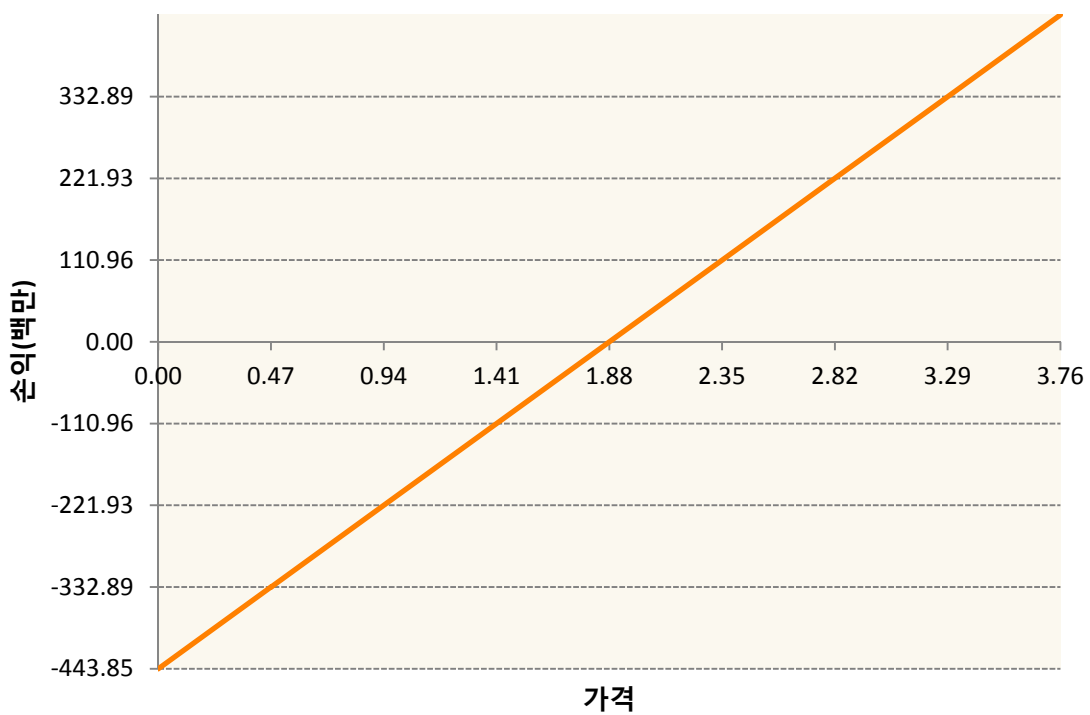




NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18



XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	58
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	72
HOX8	Heating Oil	40
	KR4175N90C 2018-09 달러선물	49
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	80
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	36

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

공시일	2018-08-22
기준일	2018-08-21

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

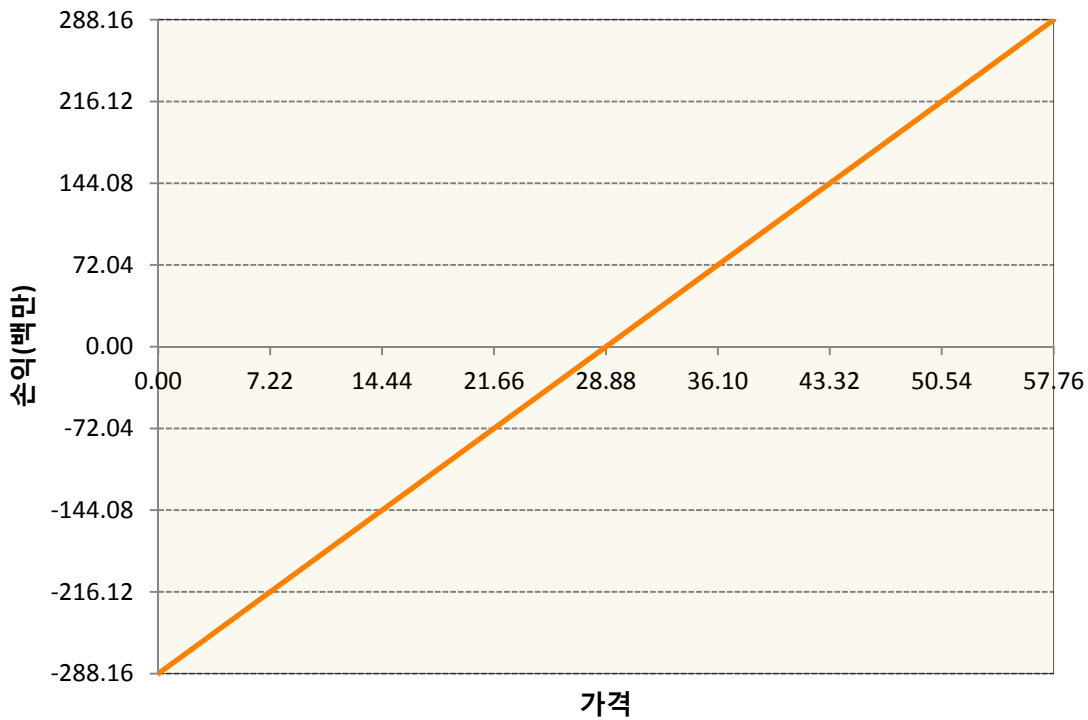
1. 계약금액

(단위:백만원)

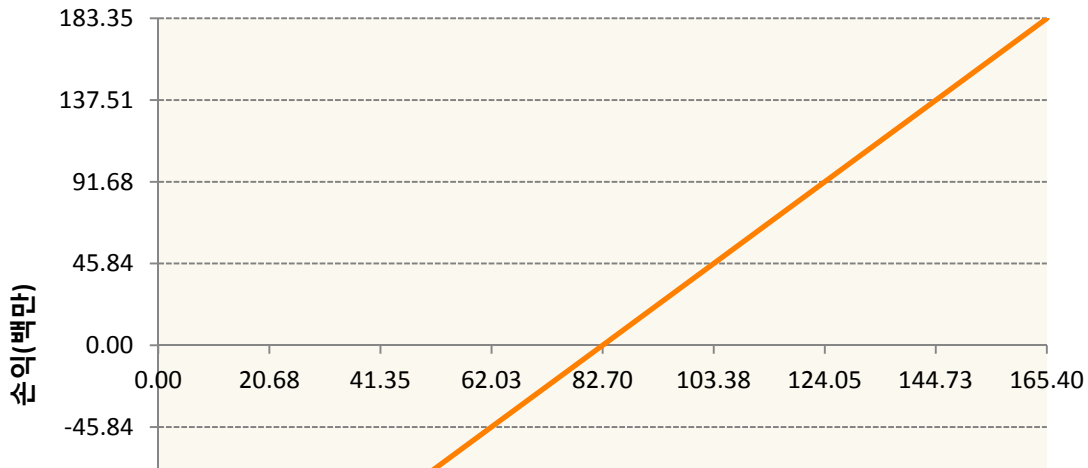
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,727	78	3,649	

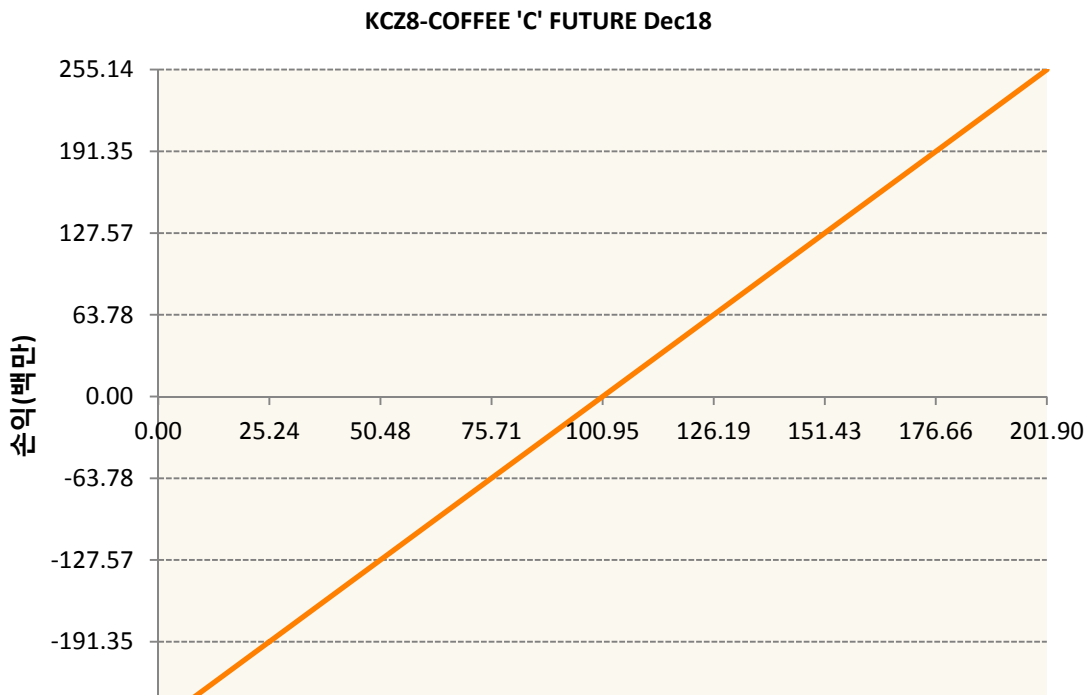
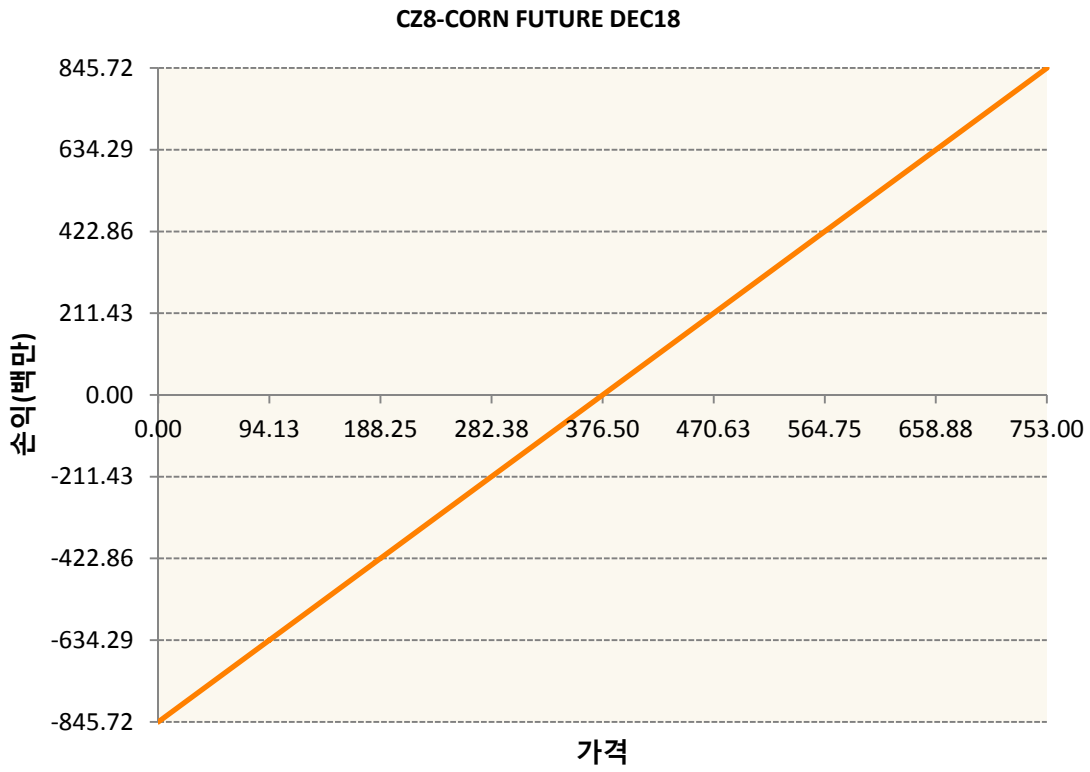
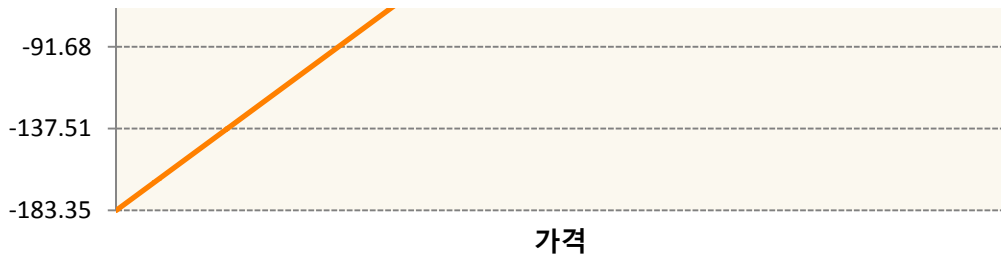
2. 만기시점의 손익구조

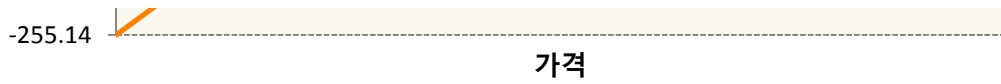
BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18



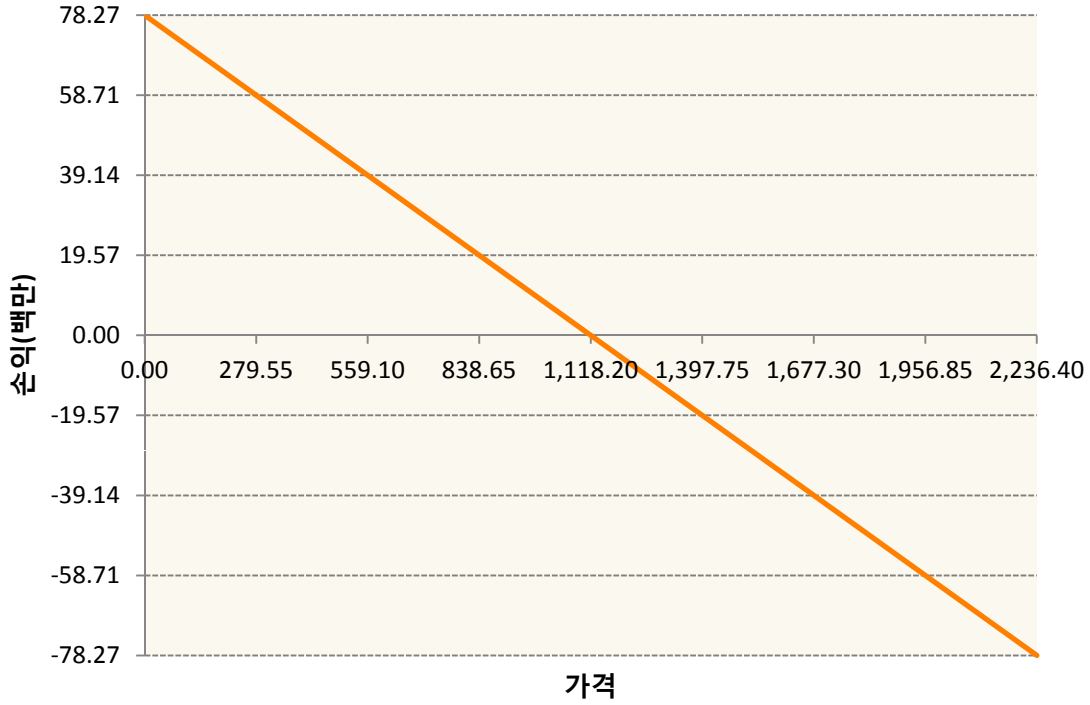
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



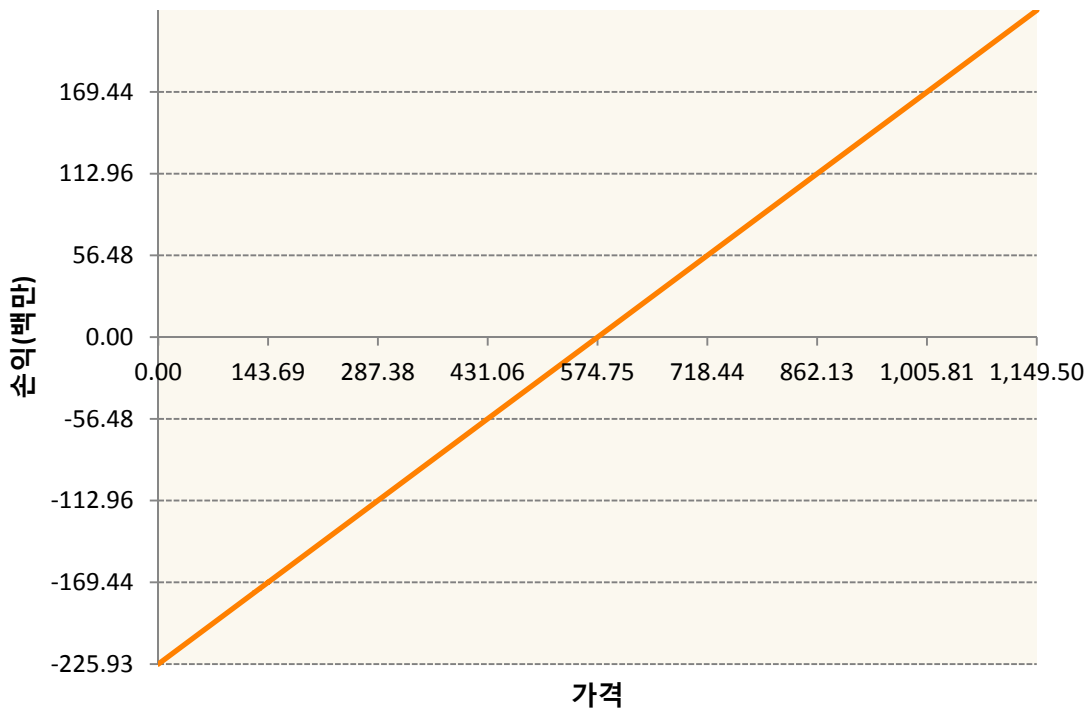




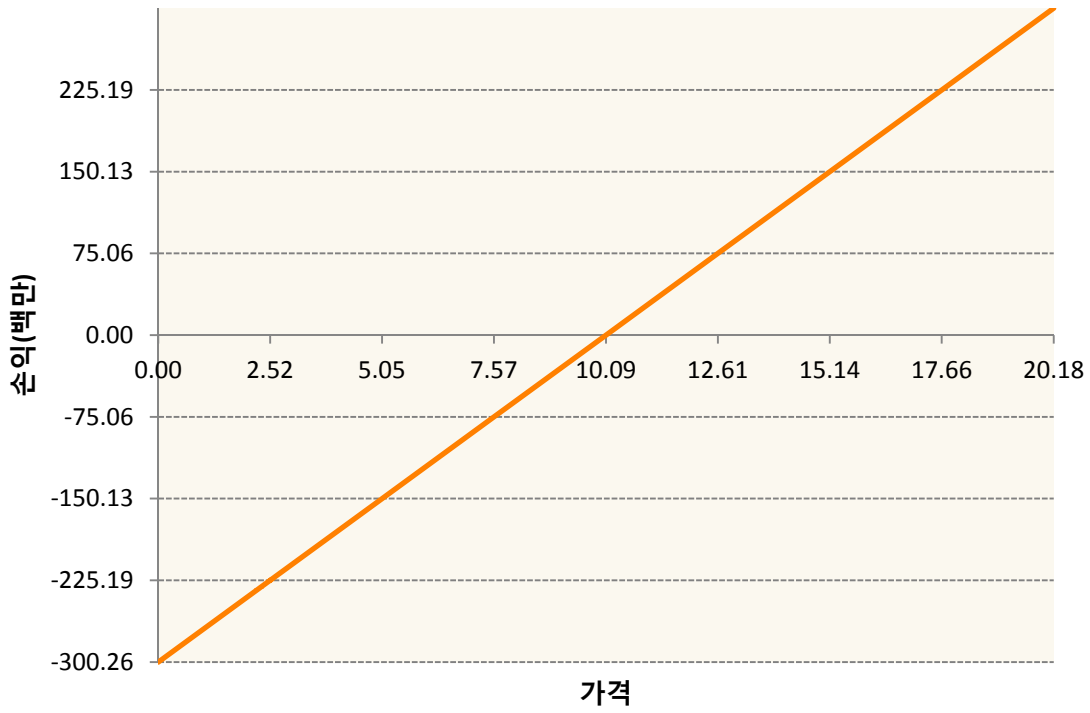
KR4175N90000-2018-09 달러선물



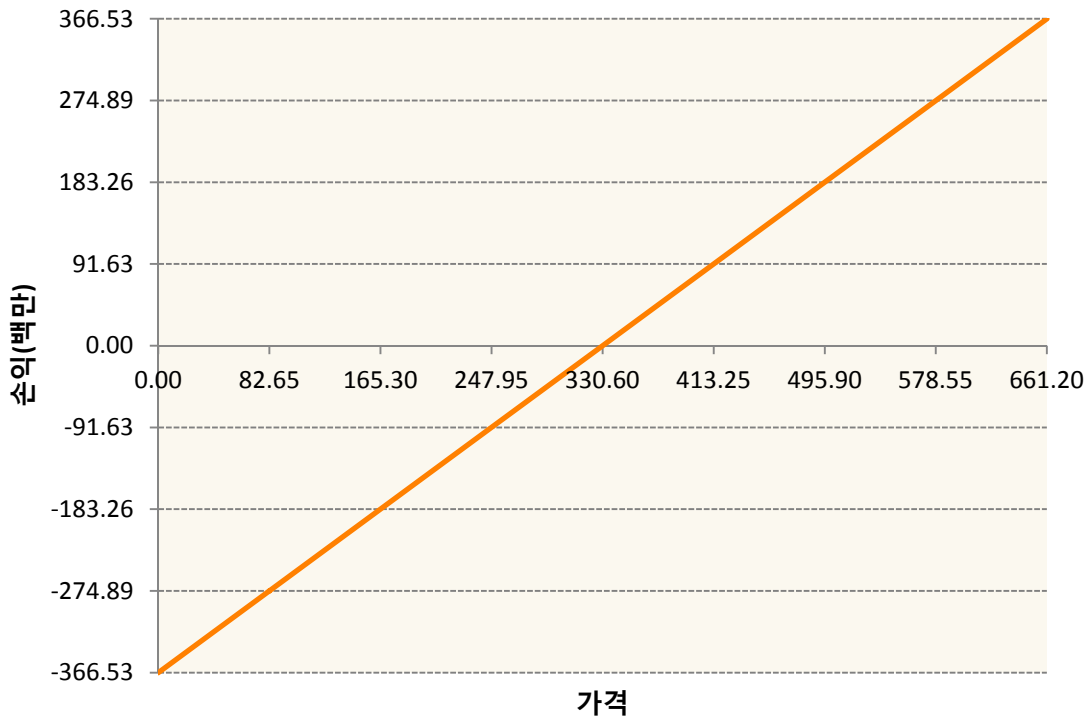
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

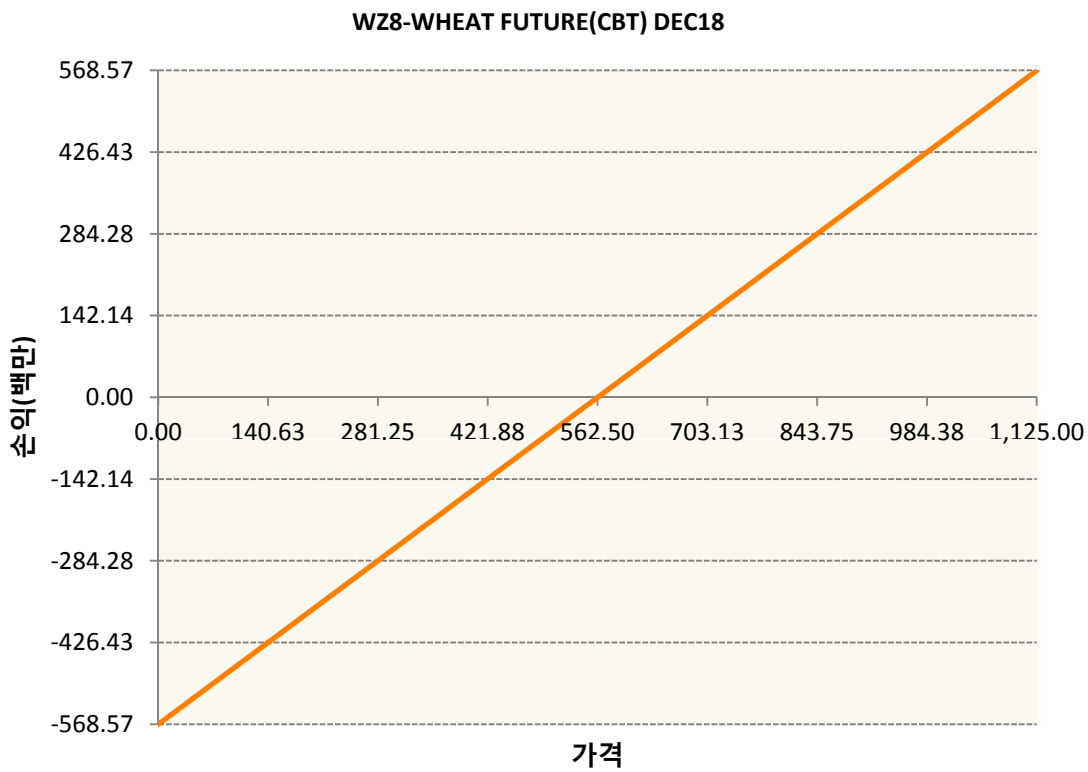
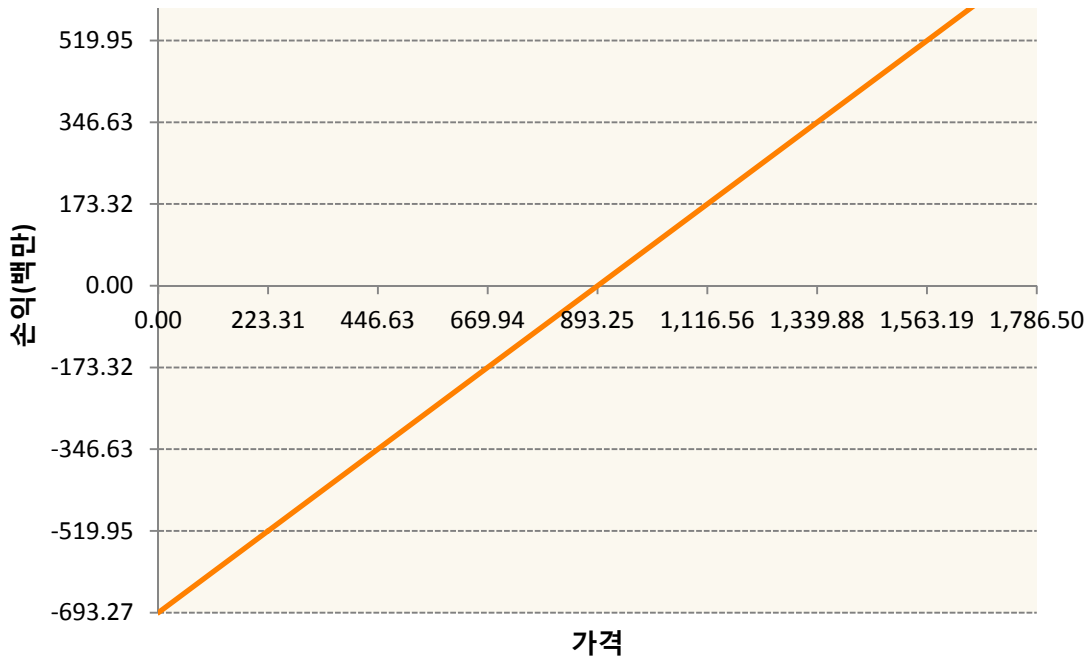


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	23
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	15
CZ8	CORN FUTURE DEC18	68
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	20
KR4175N90C	2018-09 달러선물	6

KWZ8	KC HRW WHEAT FUT DEC18	18
SBV8	SUGAR #11 (WORLD) OCT18	24
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	29
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	55
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	45

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

(단위:백만원)

317