

공시일	2018-08-23
기준일	2018-08-22

## 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	2018-08-23
기준일	2018-08-22

## SMART합성-MSCI선진국증권상장지

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	14,259	0	14,259	장외
누계	지수	스왑	14,259	0	14,259	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

#### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0( 신한MXWO 미래S180822

1,141

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

487

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-23
기준일	2018-08-22

## 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

298

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

374

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-23
기준일	2018-08-22

## 유로인덱스모(주식-파생형)

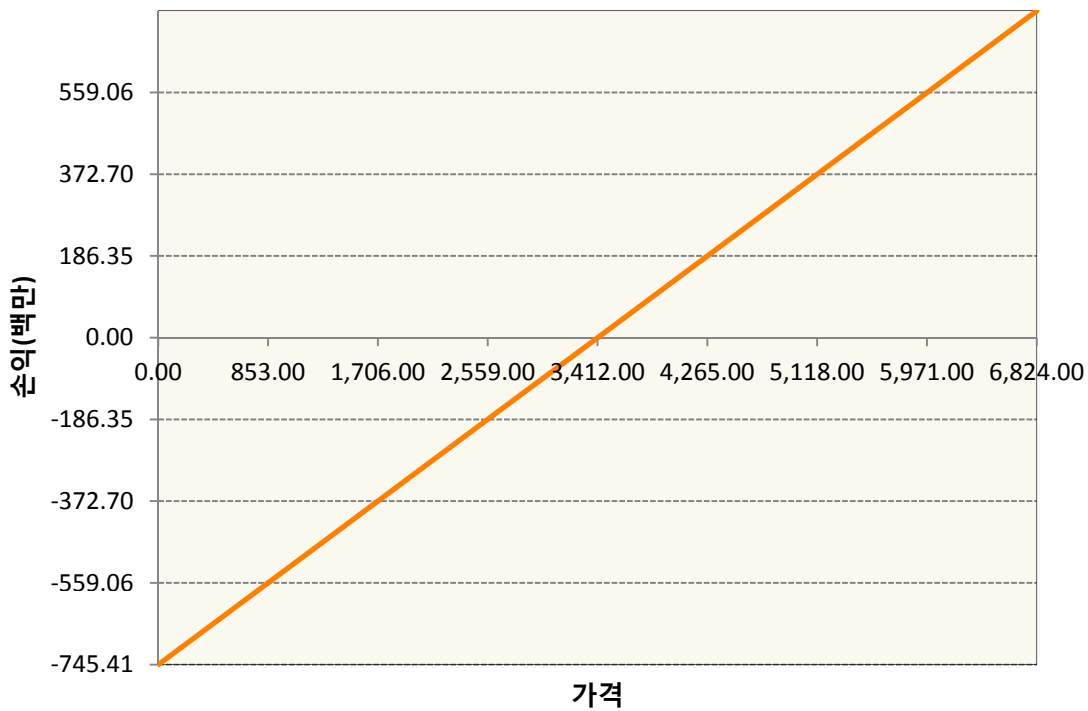
### 1. 계약금액

(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)

37
----

공시일	2018-08-23
기준일	2018-08-22

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

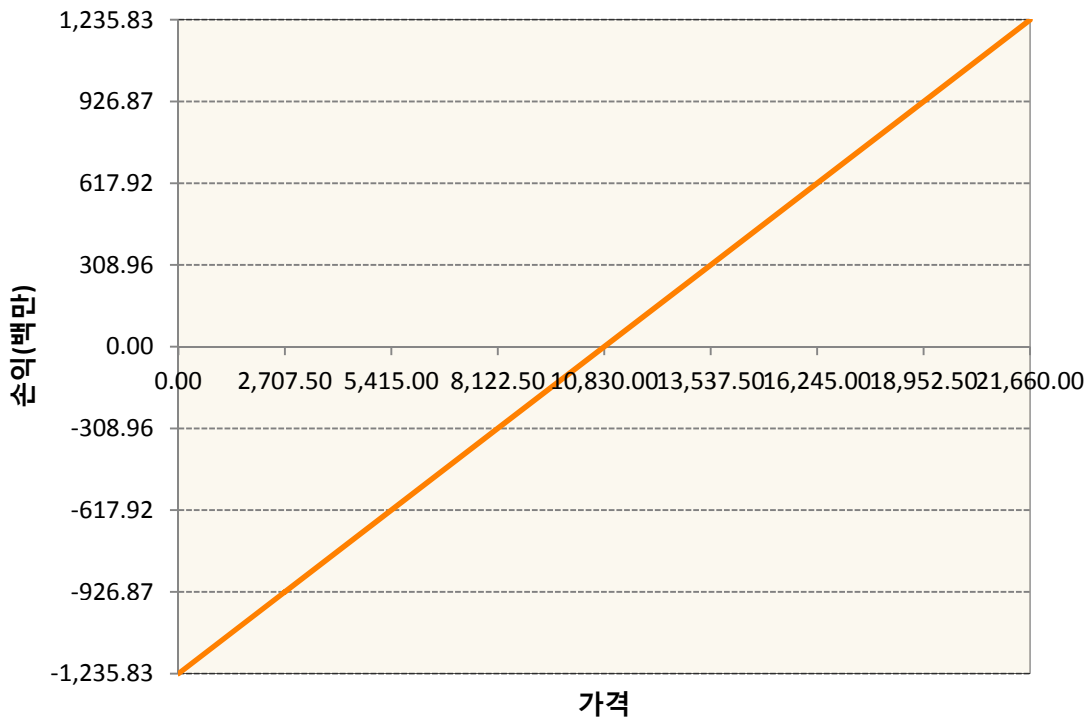
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

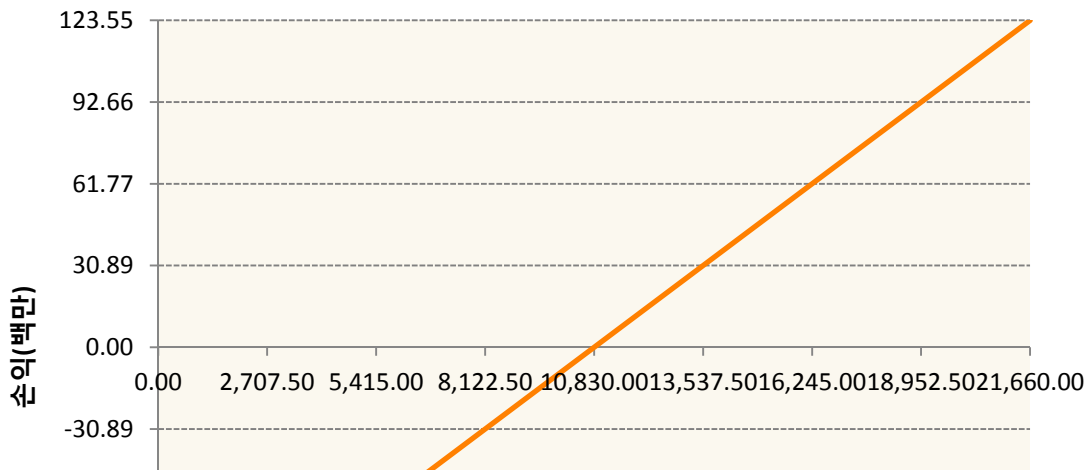
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,359	0	1,359	장내

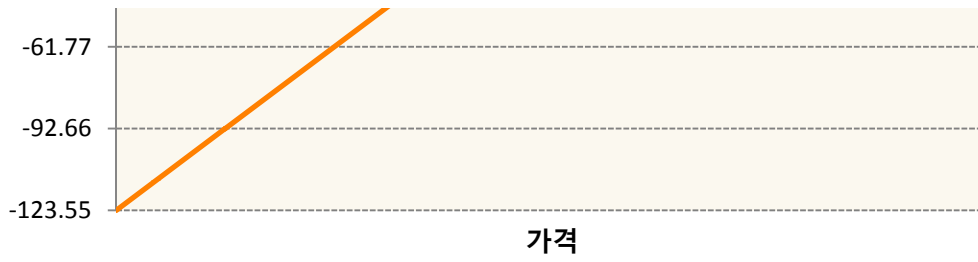
### 2. 만기시점의 손익구조

HCQ8-HSCEI Futures Aug18



MHCQ8-MINI H-SHR IDX FU Aug18





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

HCQ8	HSCEI Futures Aug18	99
MHCQ8	MINI H-SHR IDX FU Aug18	10

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

<b>100</b>
------------

공시일	2018-08-23
기준일	2018-08-22

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

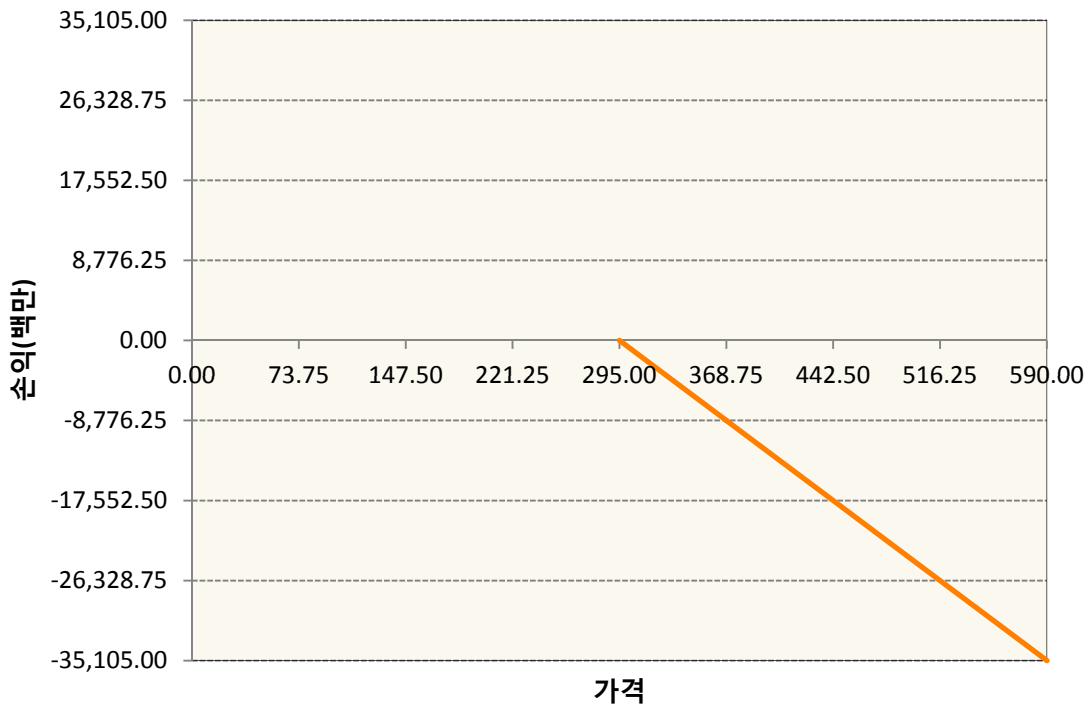
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

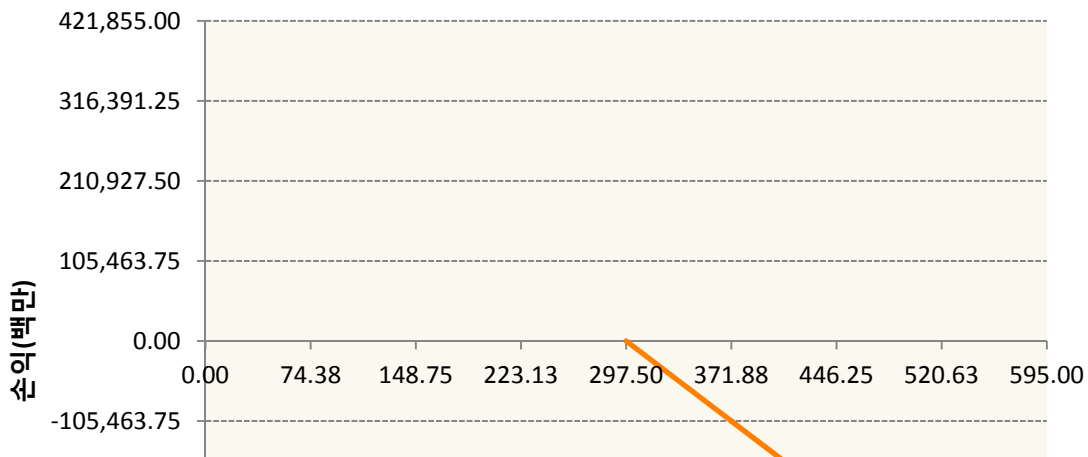
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	765,616	-765,616	장내

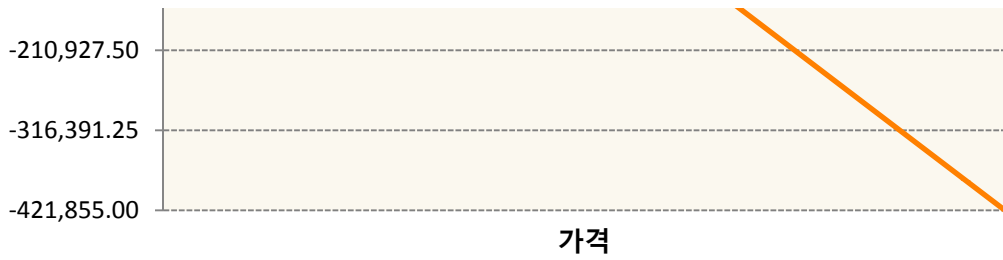
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92950-2018-09 콜295

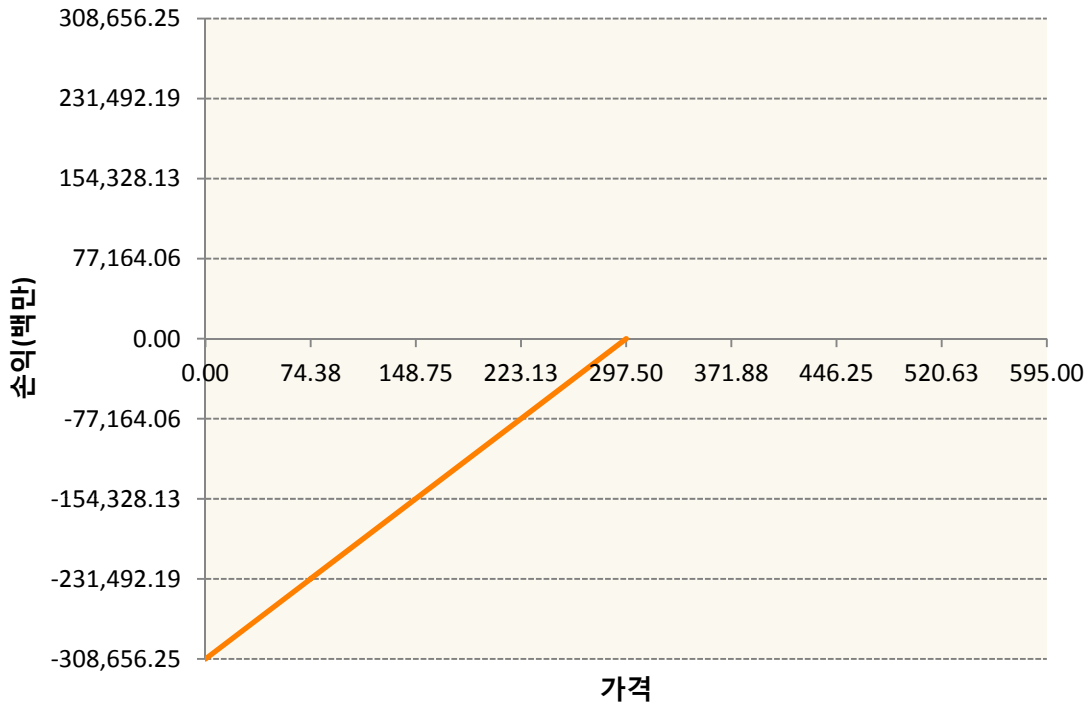


KR4201N92976-2018-09 콜297.5





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N929 2018-09 콜295

2,068

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	792	774	752	724	692	656	616
-5.33%	726	688	644	597	546	492	435
-2.67%	559	497	432	365	297	228	158
0%	232	154	77	0	-77	-155	-232
2.67%	-287	-361	-435	-511	-586	-663	-739
5.33%	-979	-1,035	-1,094	-1,156	-1,221	-1,288	-1,356
8.00%	-1,793	-1,827	-1,866	-1,911	-1,960	-2,012	-2,068

KR4201N929 2018-09 풋297.5

23,396

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,048	7,891	7,676	7,403	7,077	6,700	6,277

-5.33%	7,483	7,108	6,667	6,170	5,626	5,040	4,420
-2.67%	5,939	5,274	4,568	3,831	3,069	2,287	1,487
0%	2,694	1,802	904	0	-908	-1,818	-2,731
2.67%	-2,755	-3,678	-4,604	-5,534	-6,465	-7,397	-8,331
5.33%	-10,378	-11,131	-11,917	-12,728	-13,561	-14,409	-15,271
8.00%	-19,666	-20,159	-20,716	-21,326	-21,980	-22,673	-23,396
KR4301N929 2018-09 풋297.5							22,412
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,391	-22,391	-22,392	-22,393	-22,396	-22,402	-22,412
-5.33%	-14,298	-14,303	-14,314	-14,334	-14,364	-14,405	-14,459
-2.67%	-6,295	-6,366	-6,459	-6,572	-6,705	-6,855	-7,020
0%	807	547	277	0	-283	-570	-861
2.67%	5,111	4,820	4,524	4,223	3,920	3,614	3,306
5.33%	6,436	6,328	6,195	6,042	5,869	5,680	5,477
8.00%	6,612	6,597	6,572	6,532	6,478	6,407	6,321

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

(단위:백만원)

50,232

공시일	2018-08-23
기준일	2018-08-22

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

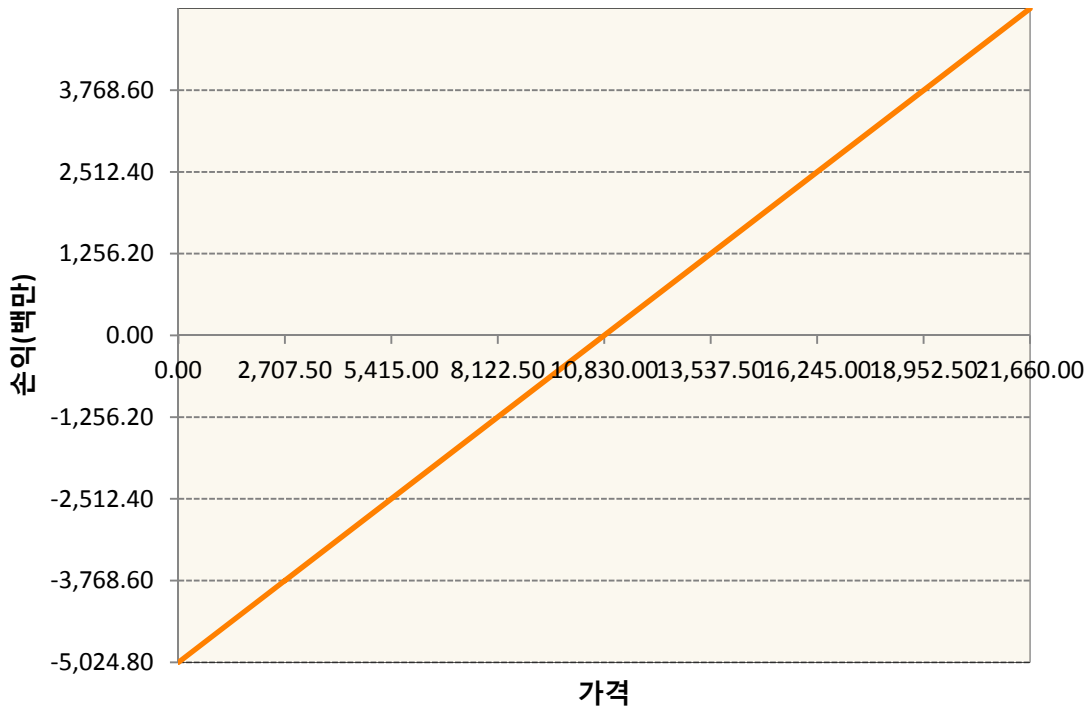
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

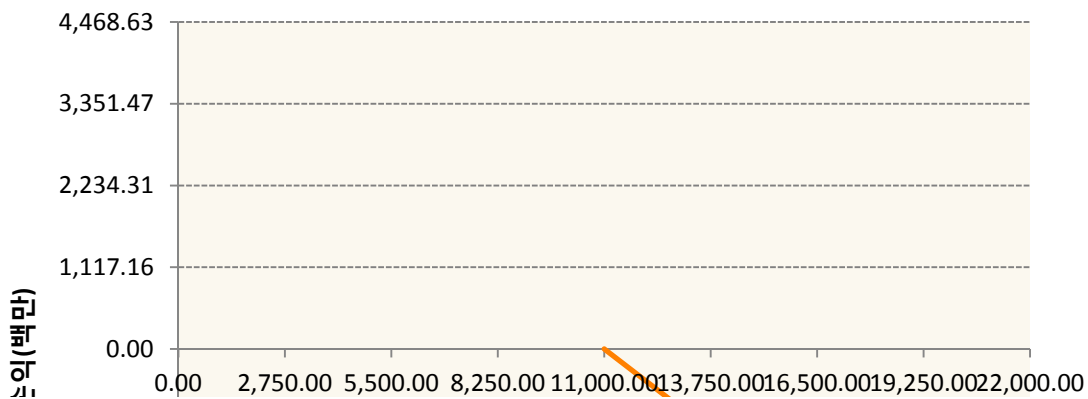
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,025	0	5,025	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,492	-11,492	장내

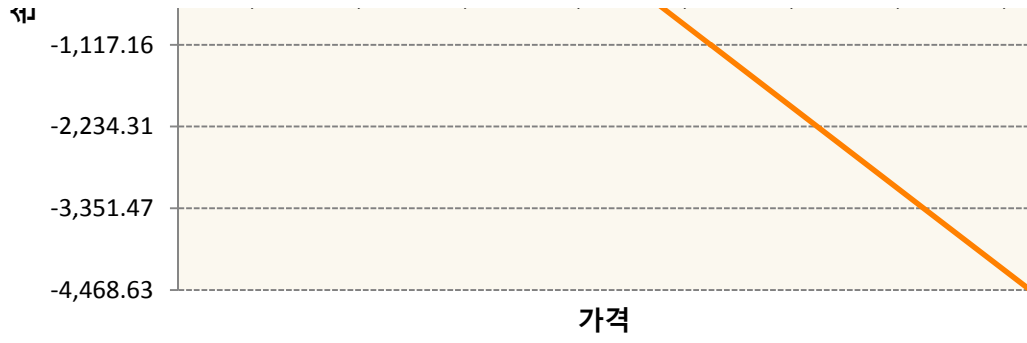
### 2. 만기시점의 손익구조

HCQ8-HSCEI Futures Aug18

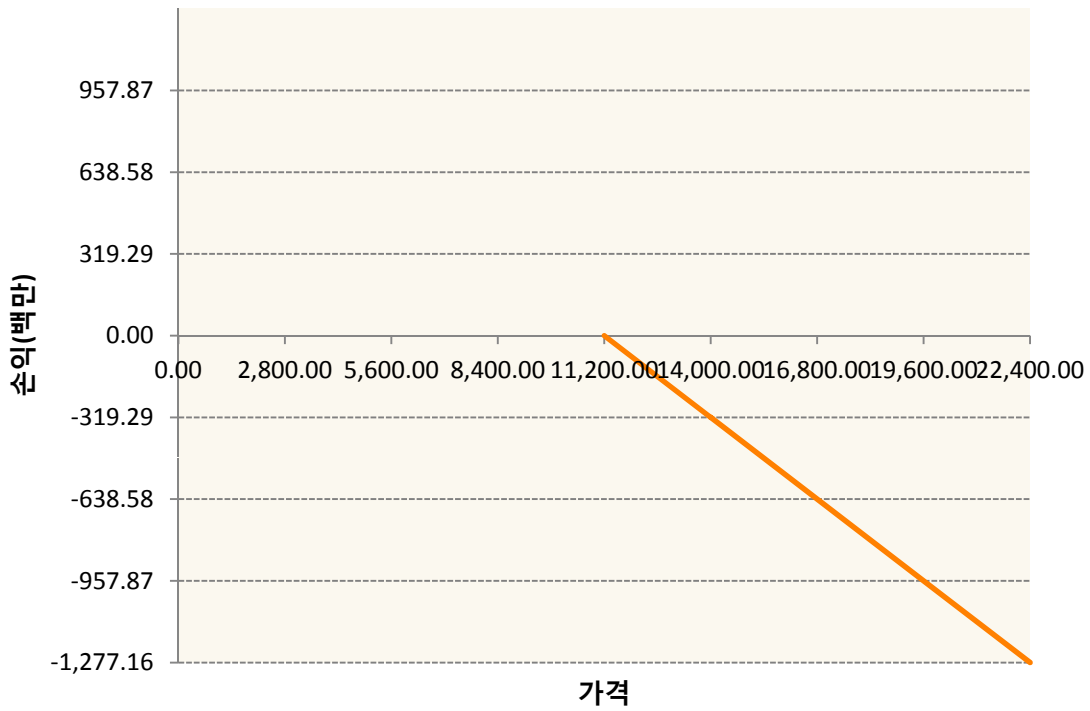


OHHIQ8-C110-HSCEI

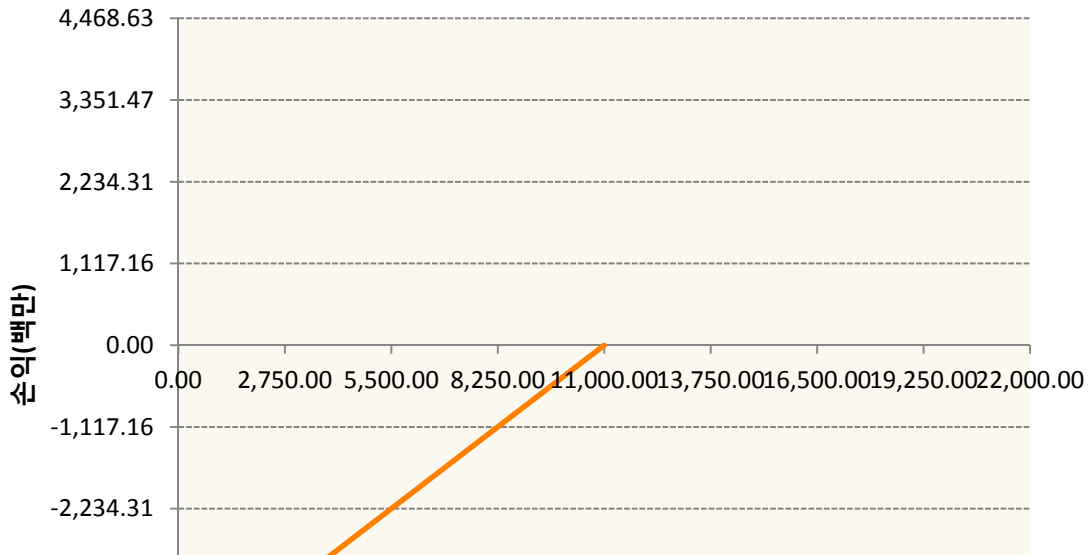


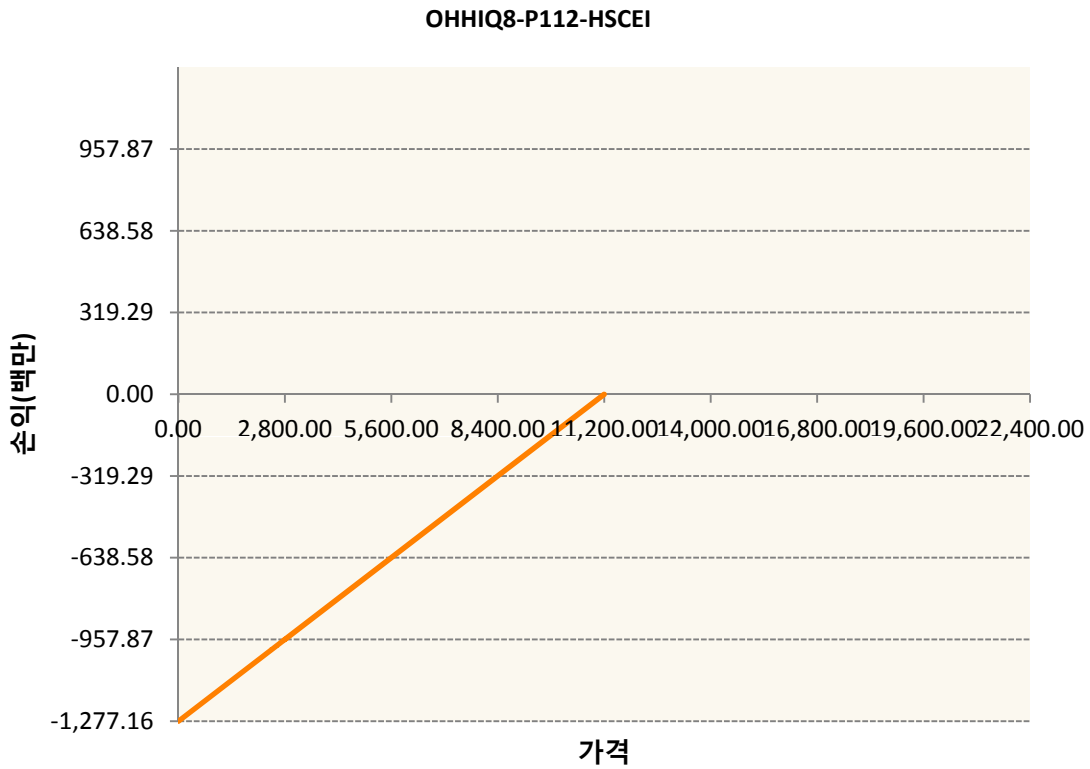
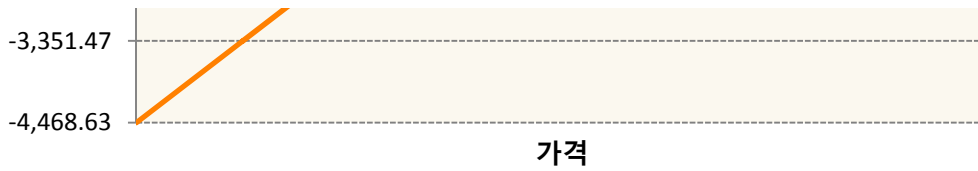


OHHIQ8-C112-HSCEI



OHHIQ8-P110-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ8	HSCEI Futures Aug18	402
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)
	1,212

공시일	2018-08-23
기준일	2018-08-22

## 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

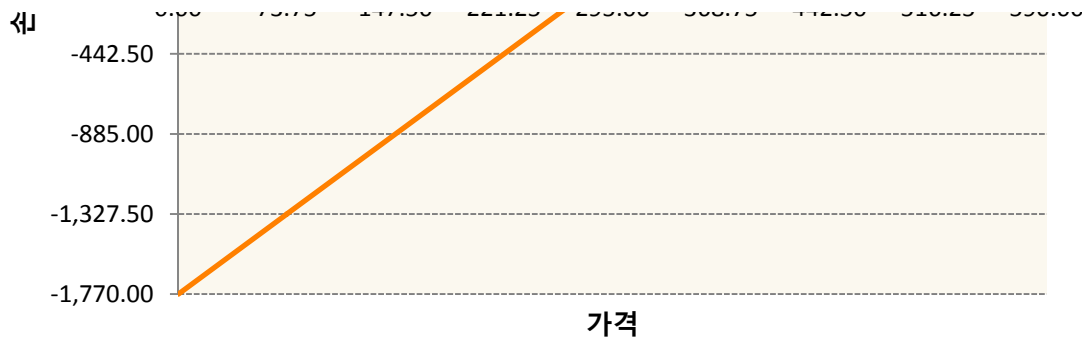
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92976-2018-09 콜297.5

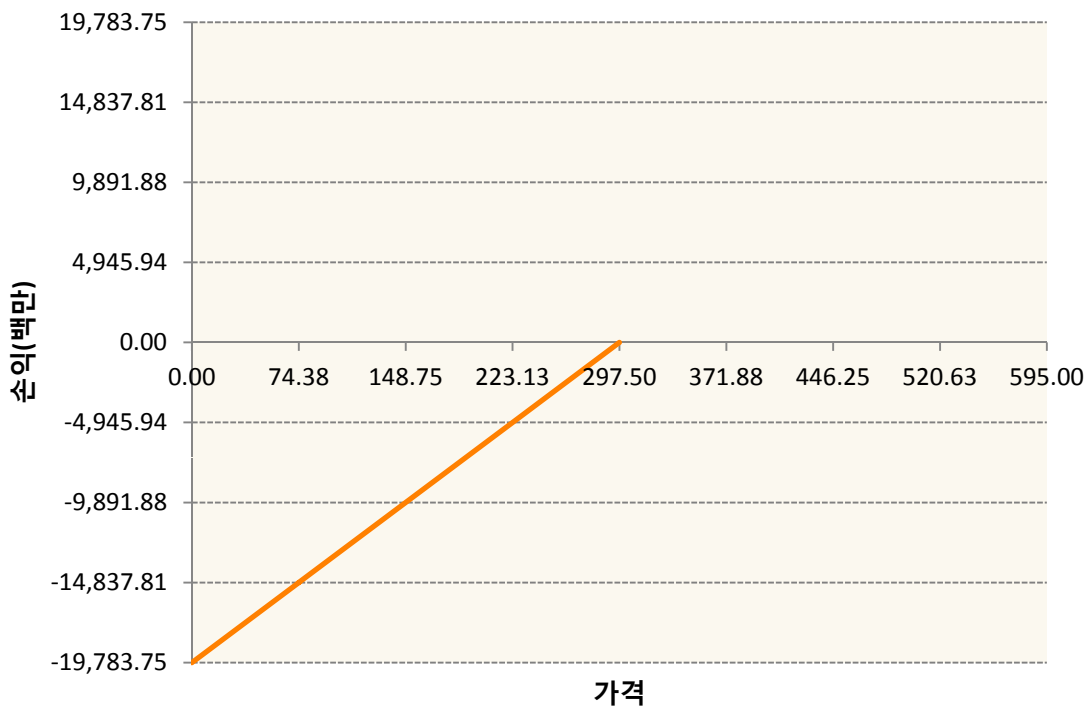


KR4301N92958-2018-09 풋295





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,962
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,962	-3,962	-3,962	-3,962	-3,962	-3,962	-3,962
-5.33%	-2,641	-2,641	-2,641	-2,641	-2,641	-2,641	-2,641
-2.67%	-1,321	-1,321	-1,321	-1,321	-1,321	-1,321	-1,321
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,321	1,321	1,321	1,321	1,321	1,321	1,321
5.33%	2,641	2,641	2,641	2,641	2,641	2,641	2,641
8.00%	3,962	3,962	3,962	3,962	3,962	3,962	3,962
KR4201N92974-2018-09 풋297.5							1,559
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	536	526	512	493	472	446	418
-5.33%	499	474	444	411	375	336	295
-2.67%	396	351	304	255	205	152	99
0%	180	120	60	0	-60	-121	-182
2.67%	-184	-245	-307	-369	-431	-493	-555
5.33%	-692	-742	-794	-848	-904	-960	-1,018
8.00%	-1,311	-1,343	-1,381	-1,421	-1,465	-1,511	-1,559

KR4301N929 2018-09 풋295

124

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124
-5.33%	-77	-77	-78	-78	-78	-79	-79
-2.67%	-32	-33	-33	-34	-35	-36	-38
0%	5	4	2	0	-2	-4	-5
2.67%	24	22	21	20	18	16	15
5.33%	28	28	27	27	26	25	24
8.00%	29	29	28	28	28	28	28

KR4301N929 2018-09 풋297.5

1,437

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,435	-1,435	-1,435	-1,435	-1,436	-1,436	-1,437
-5.33%	-916	-917	-918	-919	-921	-923	-927
-2.67%	-404	-408	-414	-421	-430	-439	-450
0%	52	35	18	0	-18	-37	-55
2.67%	328	309	290	271	251	232	212
5.33%	413	406	397	387	376	364	351
8.00%	424	423	421	419	415	411	405

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

(단위:백만원)

7,259

공시일	2018-08-23
기준일	2018-08-22

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

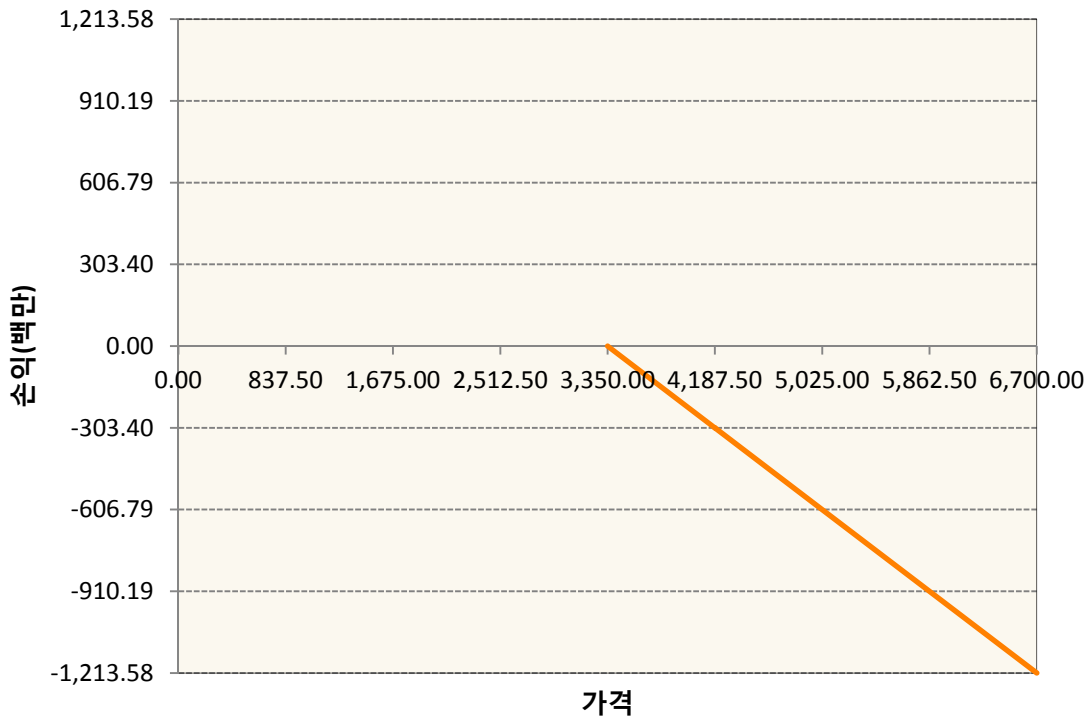
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

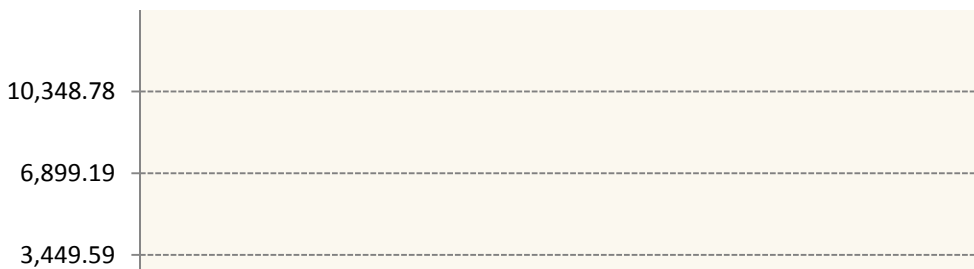
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	8,136	0	8,136	
누계	유가증권	옵션	0	30,024	-30,024	장내
누계	지수	스왑	86,693	0	86,693	장외

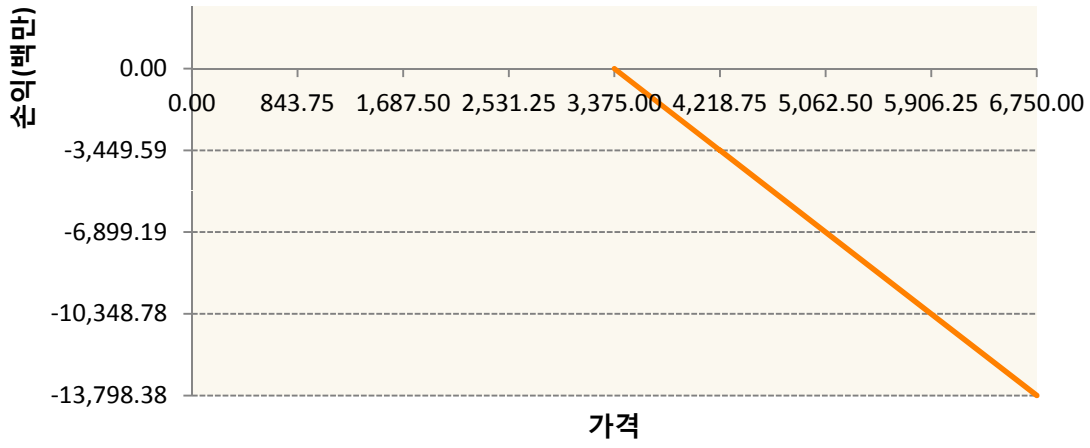
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXU8-C3350-EURO STOXX 50**

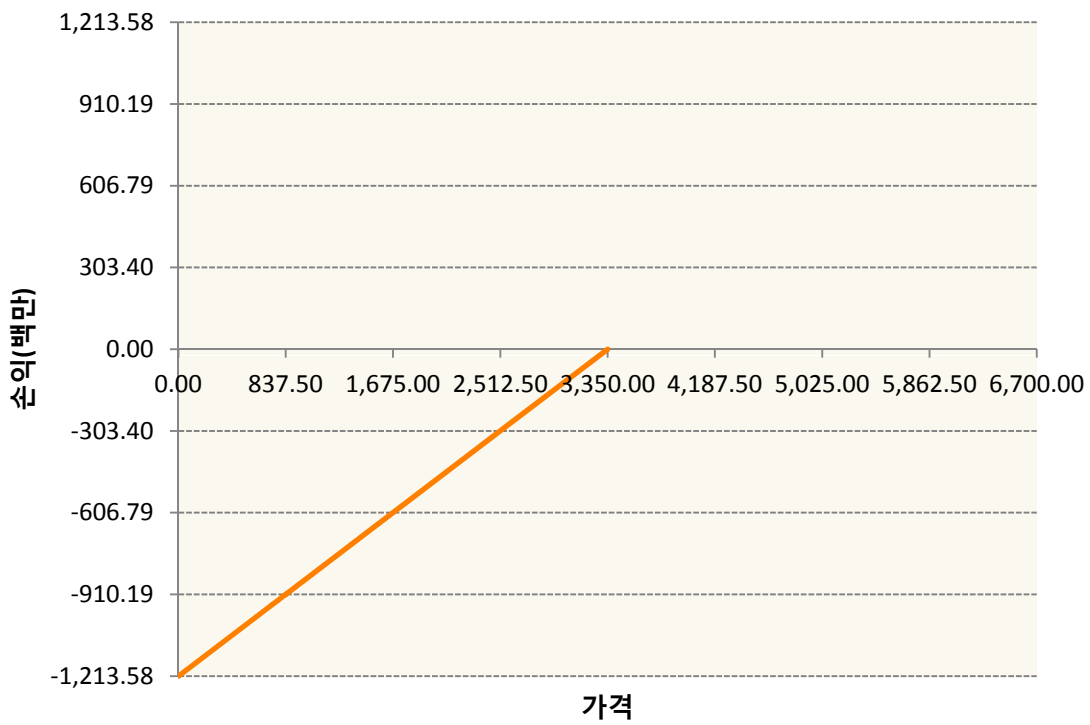


**OESXU8-C3375-EURO STOXX 50**

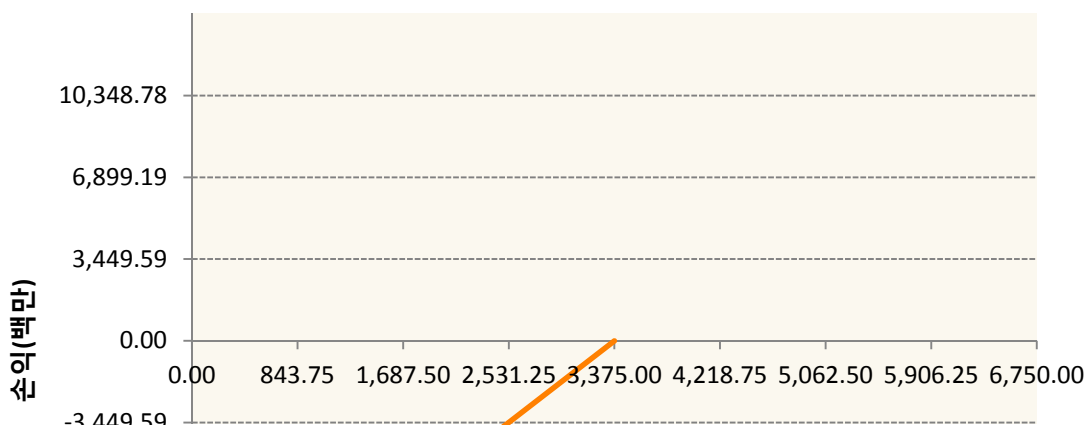


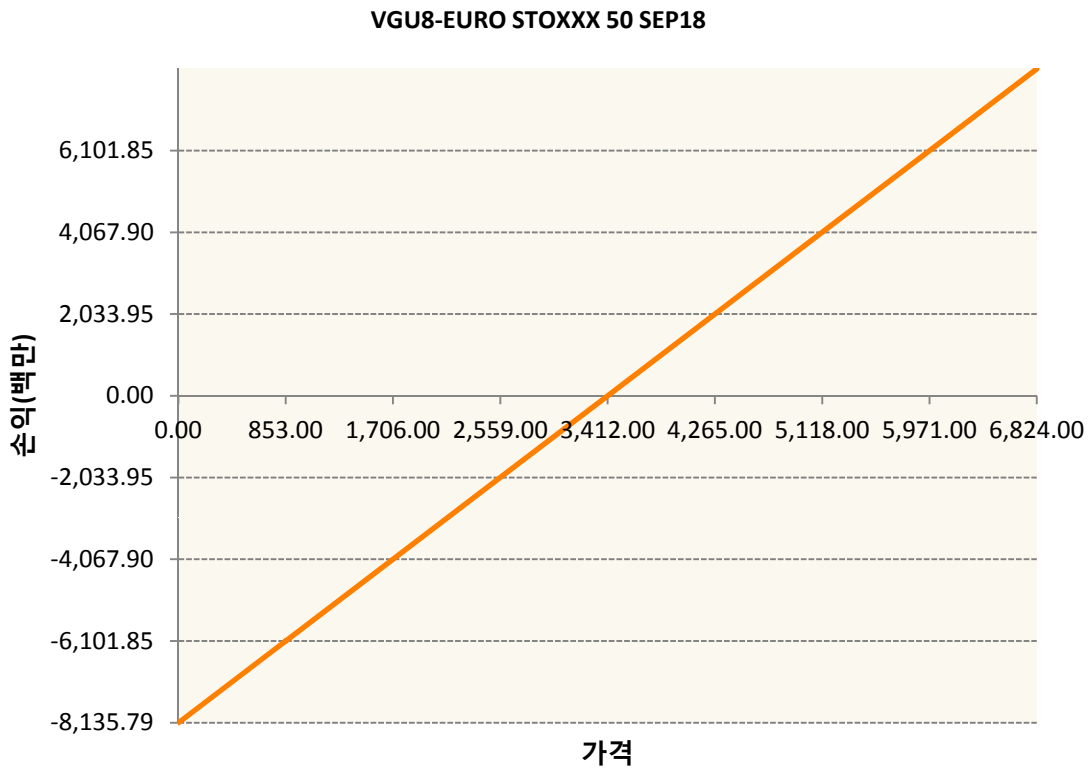
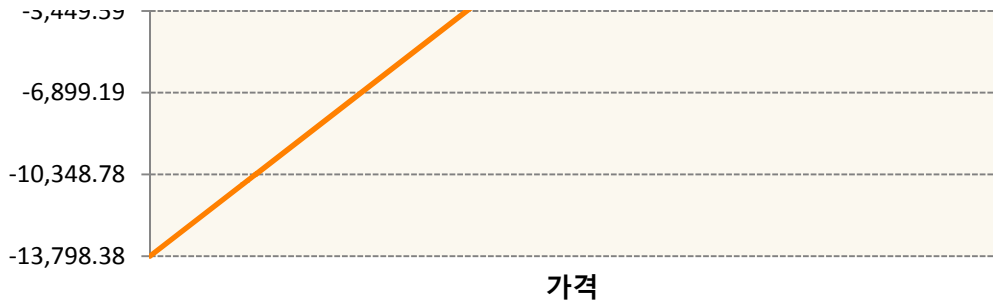


OESXU8-P3350-EURO STOXX 50



OESXU8-P3375-EURO STOXX 50





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)**

260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	26
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY	17
OESXU8-C33 EURO STOXX 50	97
OESXU8-C33 EURO STOXX 50	1,104
OESXU8-P33 EURO STOXX 50	97
OESXU8-P33 EURO STOXX 50	1,104
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18	651

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

**1,937**



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

(단위:백만원)

1,119



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



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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-08-23
기준일	2018-08-22

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

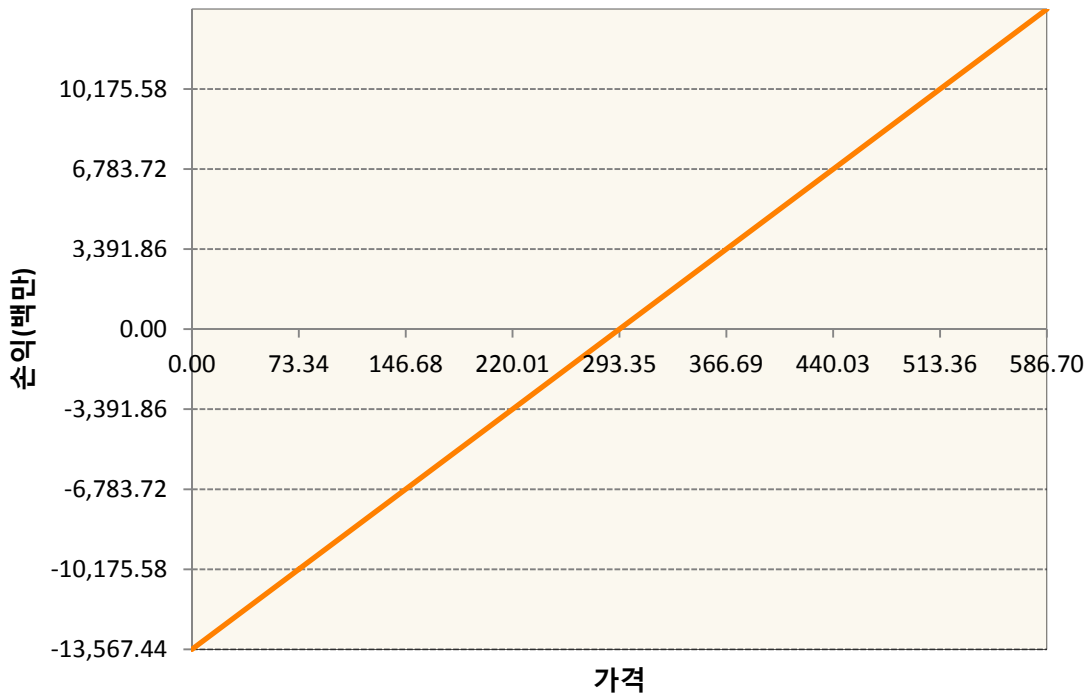
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

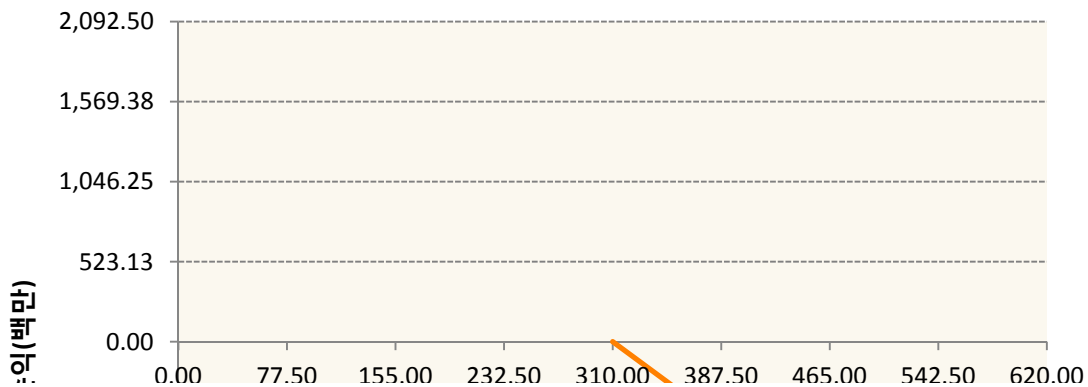
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	293	0	293	장내
신규	유가증권	옵션	0	313	-313	장내
누계	유가증권	선물	13,567	0	13,567	장내
누계	유가증권	옵션	1,339	24,671	-23,332	장내

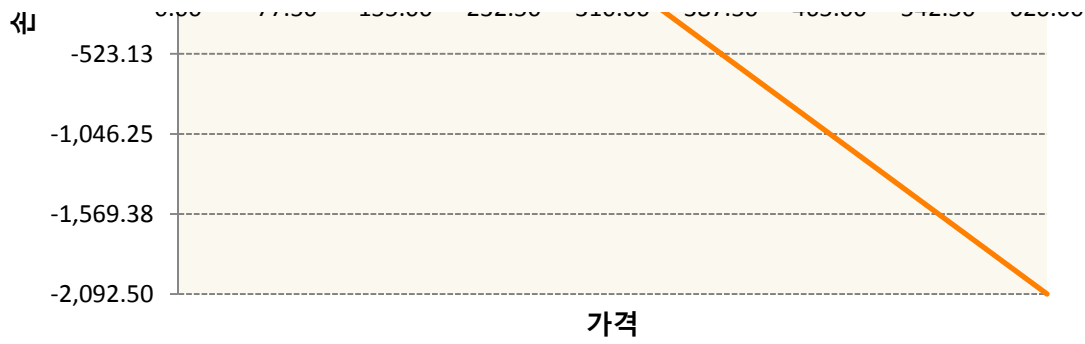
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

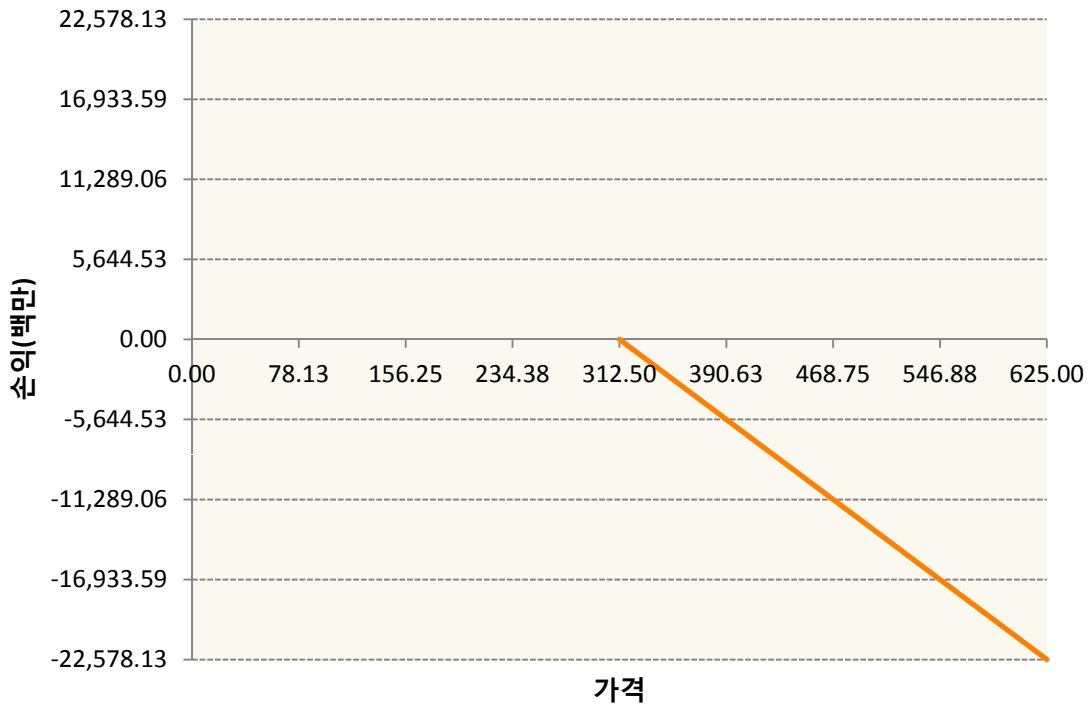


KR4201N93107-2018-09 콜310

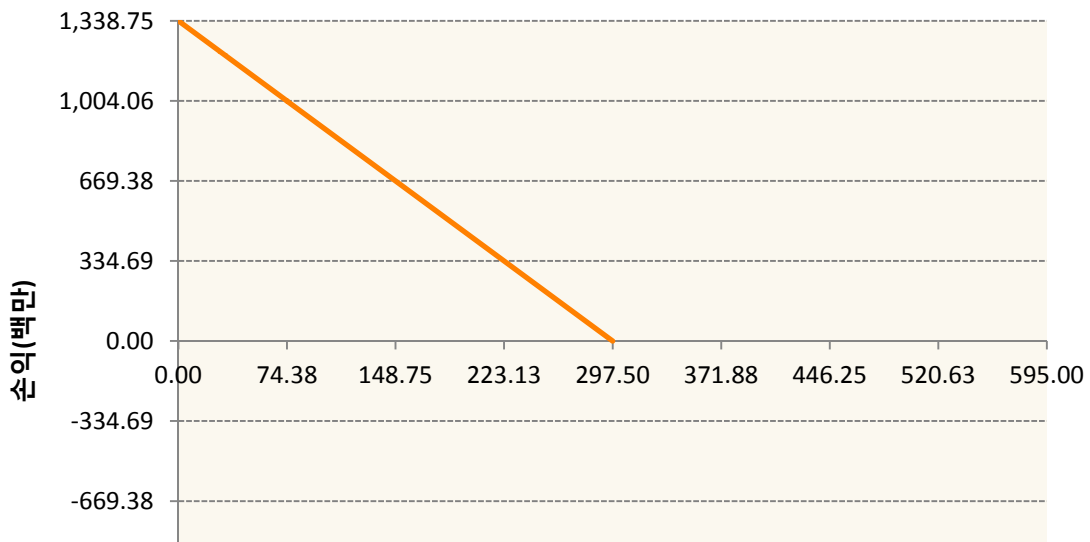


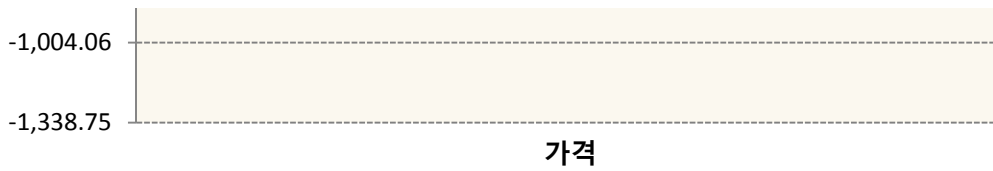


**KR4201N93123-2018-09 콜312.5**



**KR4301N92974-2018-09 풋297.5**





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물								1,084
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,084	-1,084	-1,084	-1,084	-1,084	-1,084	-1,084	-1,084
-5.33%	-723	-723	-723	-723	-723	-723	-723	-723
-2.67%	-361	-361	-361	-361	-361	-361	-361	-361
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	361	361	361	361	361	361	361	361
5.33%	723	723	723	723	723	723	723	723
8.00%	1,084	1,084	1,084	1,084	1,084	1,084	1,084	1,084
KR4201N931 2018-09 콜310								79
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	15	15	15	14	14	13	12	
-5.33%	15	14	13	12	11	10	8	
-2.67%	13	12	10	8	6	4	1	
0%	8	6	3	0	-3	-7	-10	
2.67%	-2	-6	-10	-14	-18	-23	-27	
5.33%	-22	-27	-31	-36	-41	-45	-50	
8.00%	-52	-57	-61	-65	-70	-74	-79	
KR4201N931 2018-09 콜312.5								776
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	130	129	127	123	118	112	103	
-5.33%	127	123	117	109	98	85	69	
-2.67%	116	105	91	73	53	30	5	
0%	79	56	29	0	-32	-65	-100	
2.67%	-12	-50	-90	-131	-174	-217	-261	
5.33%	-191	-240	-288	-337	-386	-435	-485	
8.00%	-478	-527	-577	-626	-676	-726	-776	
KR4301N92C 2018-09 풋297.5								97
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	97	97	97	97	97	97	97	
-5.33%	62	62	62	62	62	62	63	
-2.67%	27	28	28	29	29	30	30	

0%	-3	-2	-1	0	1	2	4
2.67%	-22	-21	-20	-18	-17	-16	-14
5.33%	-28	-27	-27	-26	-25	-25	-24
8.00%	-29	-29	-29	-28	-28	-28	-27

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

(단위:백만원)

**1,516**

공시일	2018-08-23
기준일	2018-08-22

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

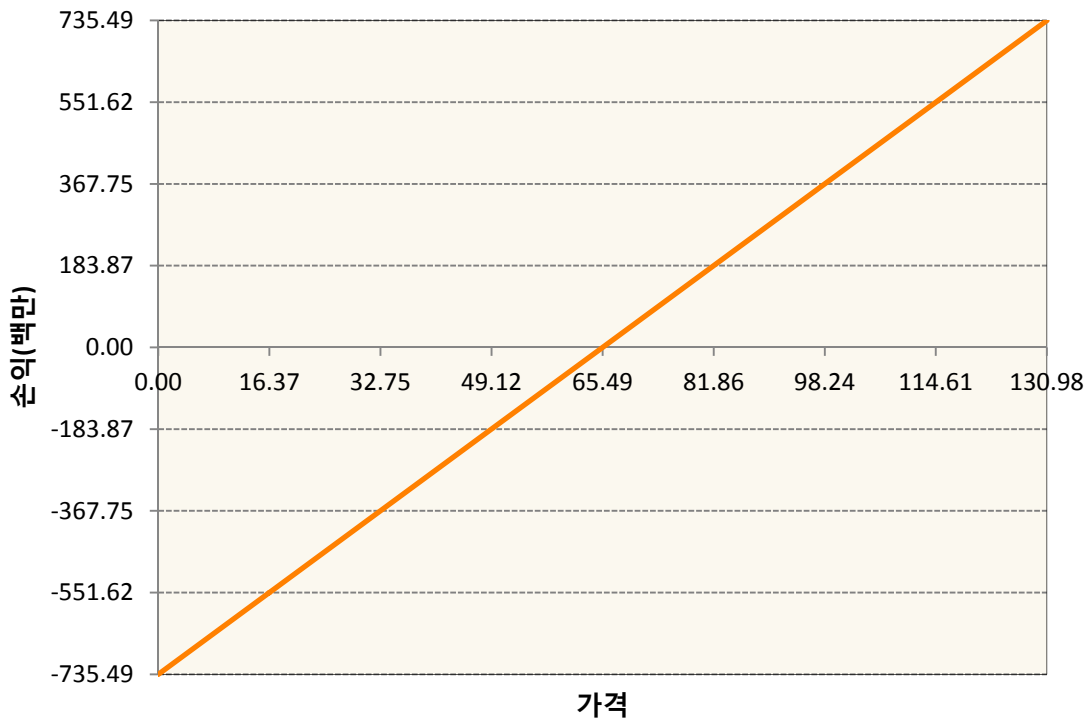
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

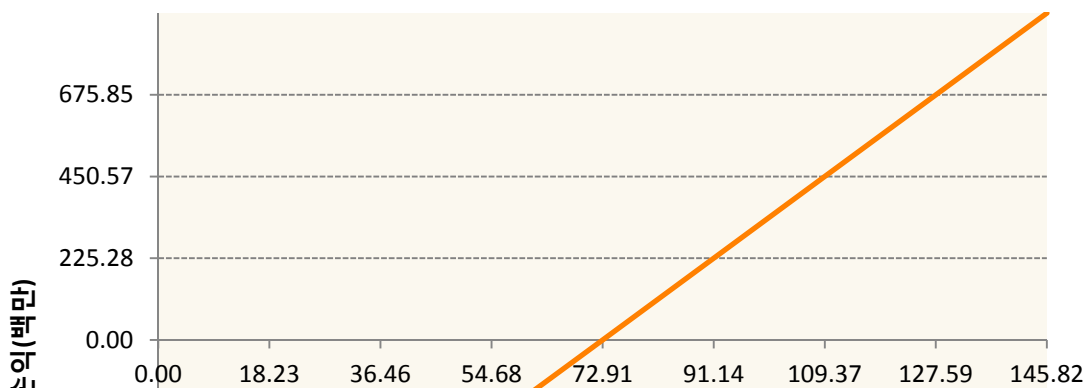
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,089	615	2,474	
누계	유가증권	선물	503	0	503	장내

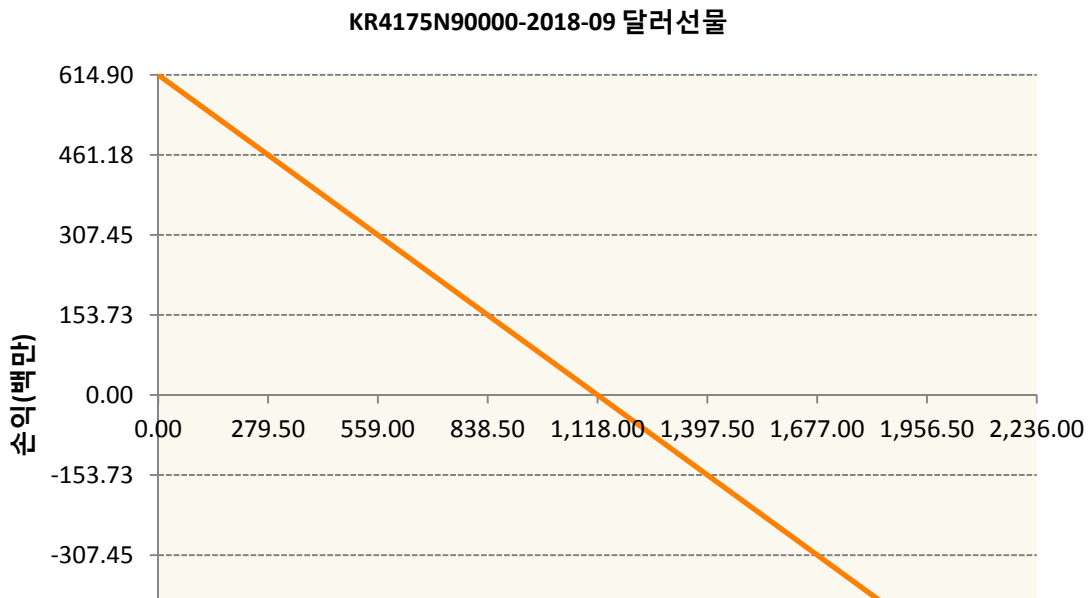
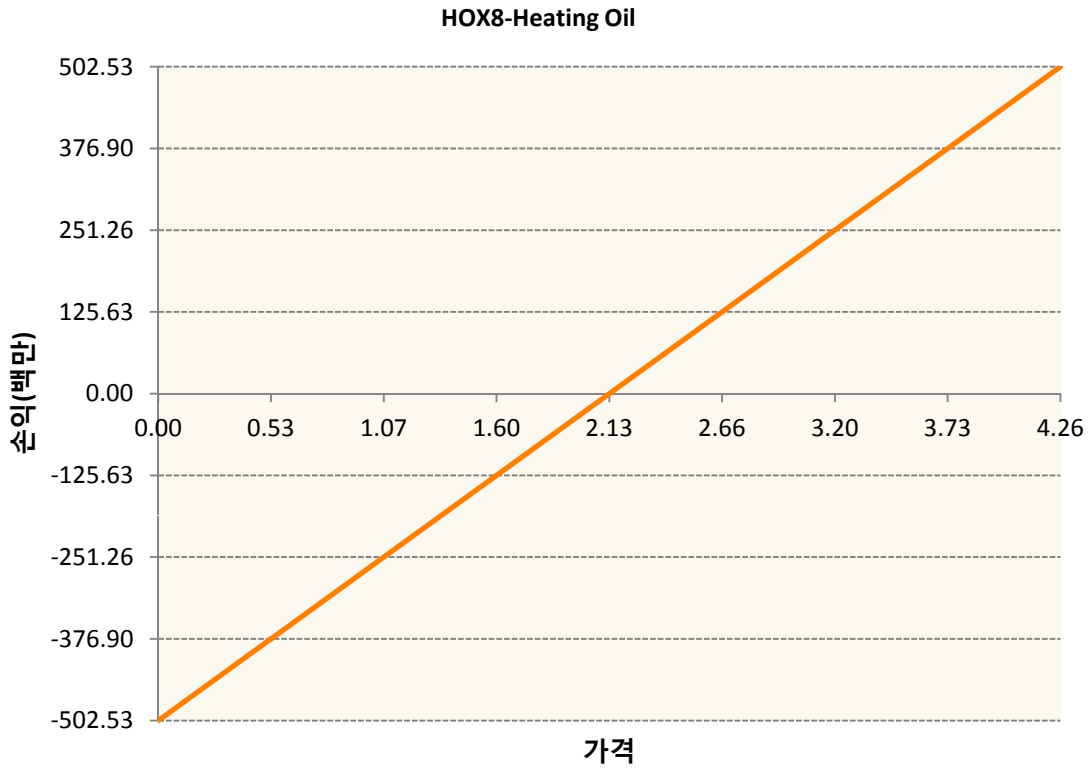
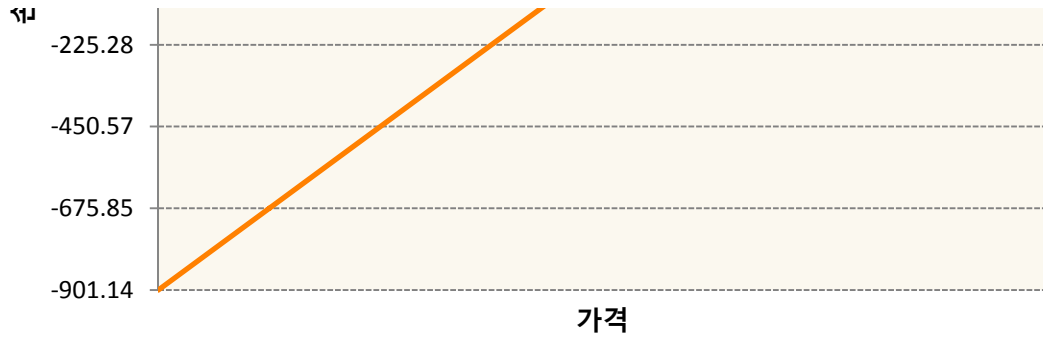
### 2. 만기시점의 손익구조

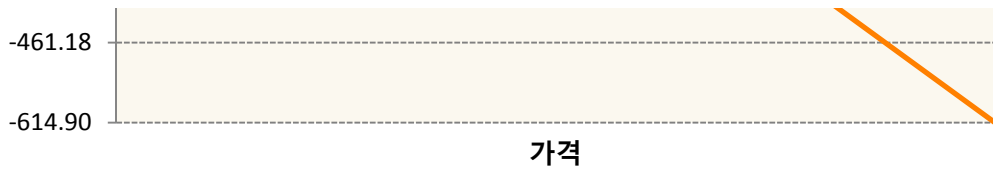
CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18



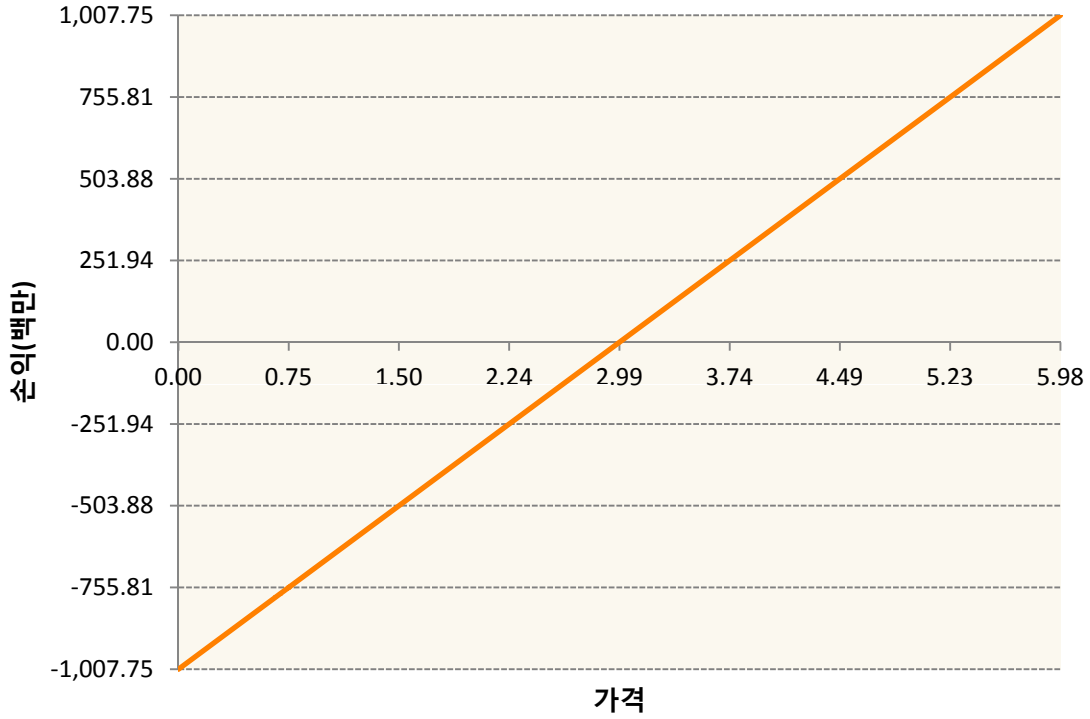
COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18



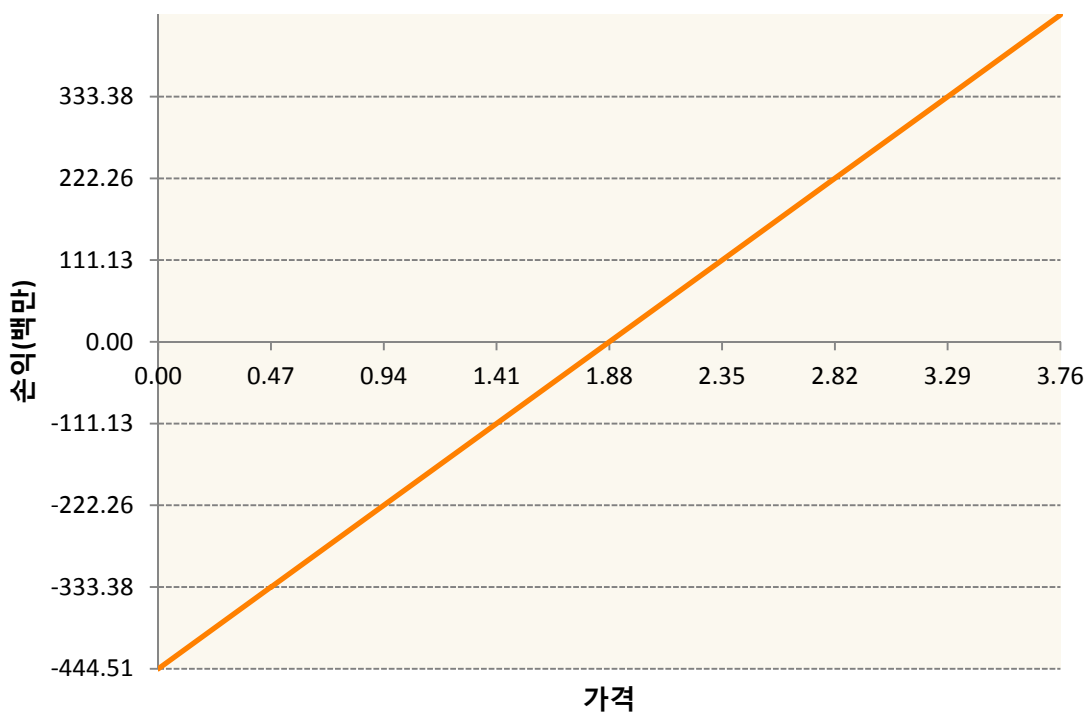




**NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18**



**XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18**



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	59
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	72
HOX8	Heating Oil	40
	KR4175N90C 2018-09 달러선물	49
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	81
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	36

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	437

공시일	2018-08-23
기준일	2018-08-22

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

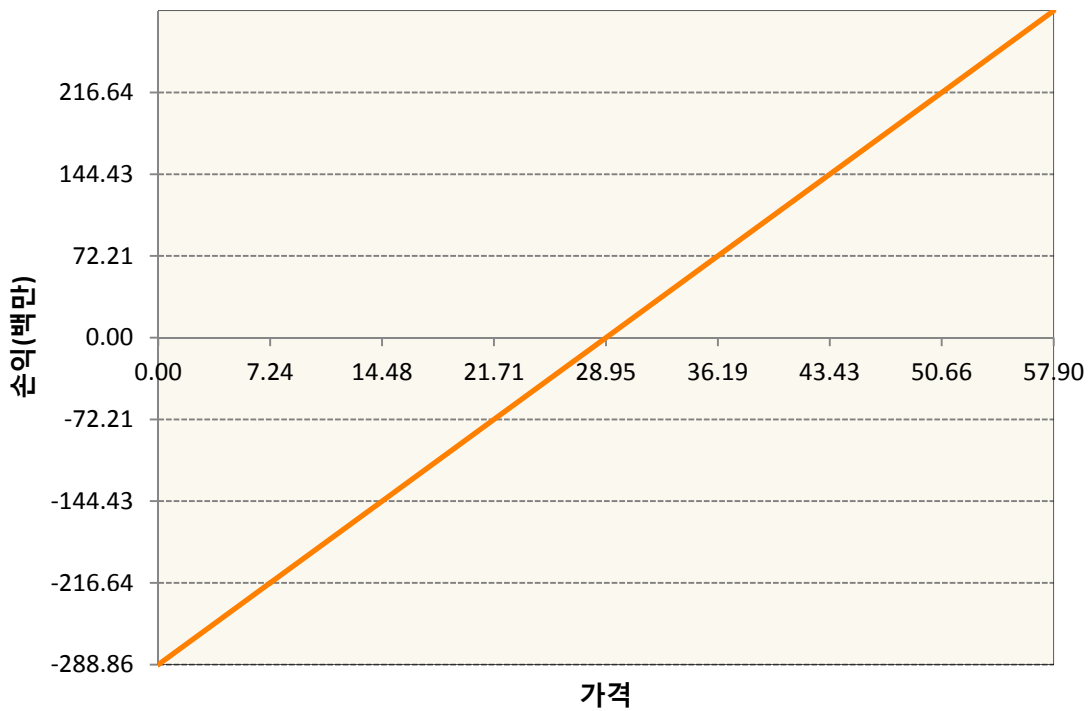
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

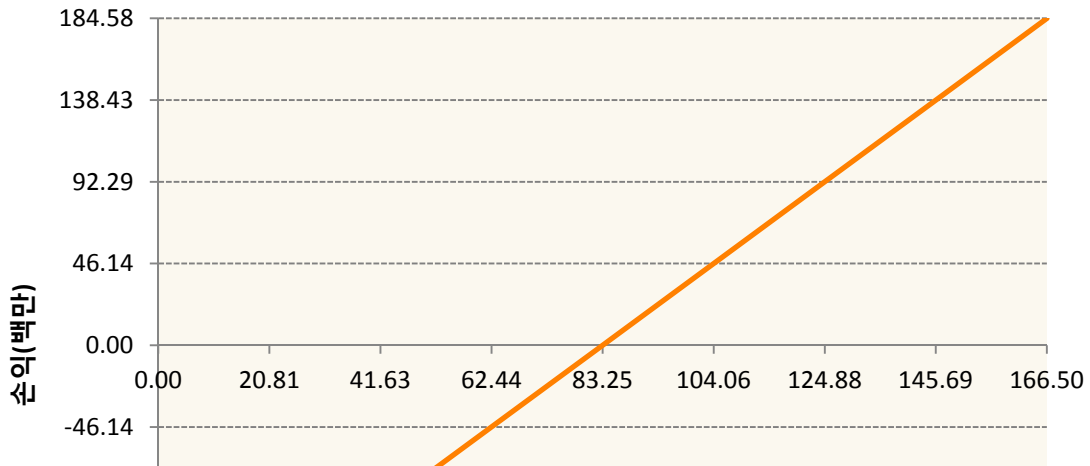
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,699	78	3,621	

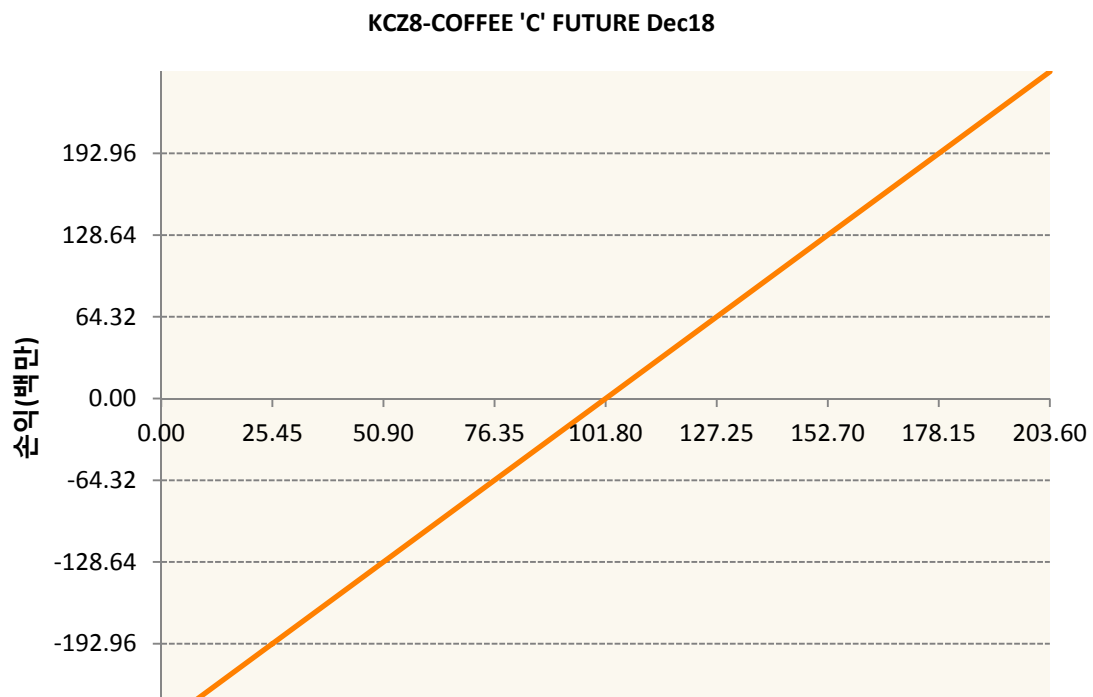
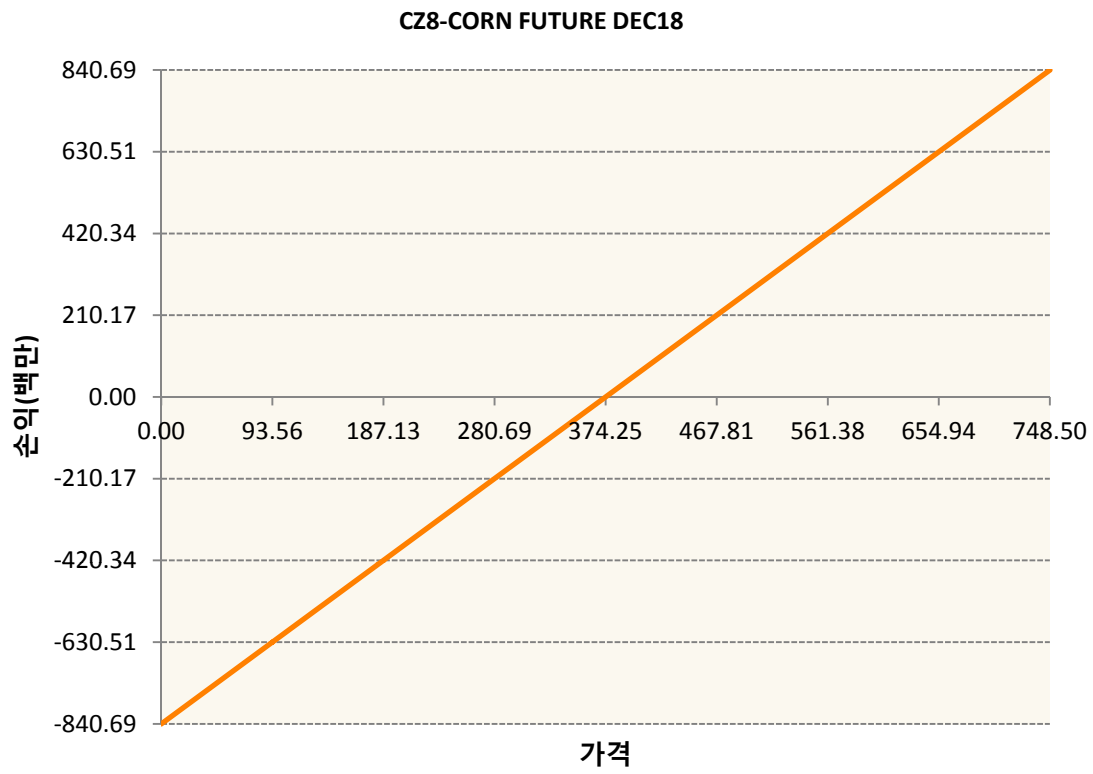
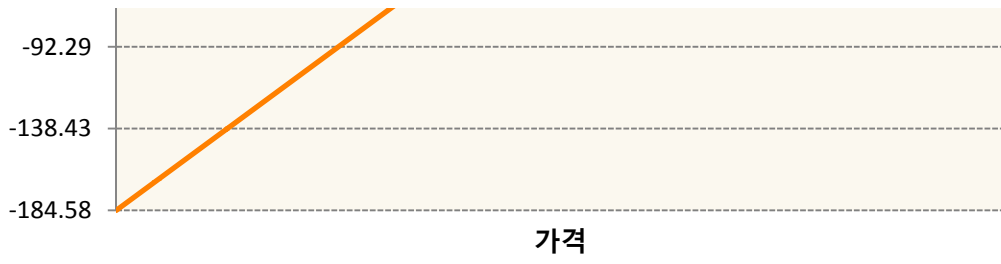
### 2. 만기시점의 손익구조

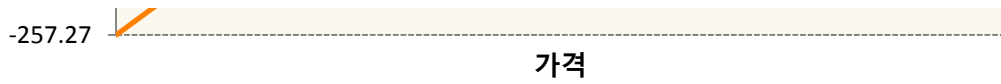
**BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18**



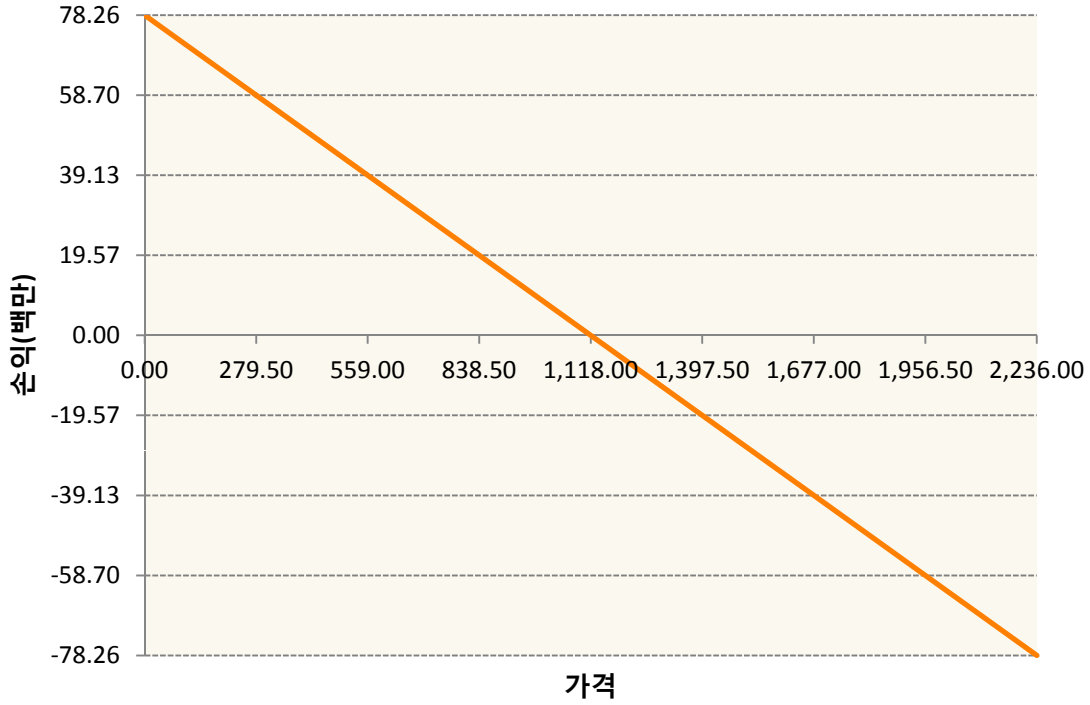
**CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18**



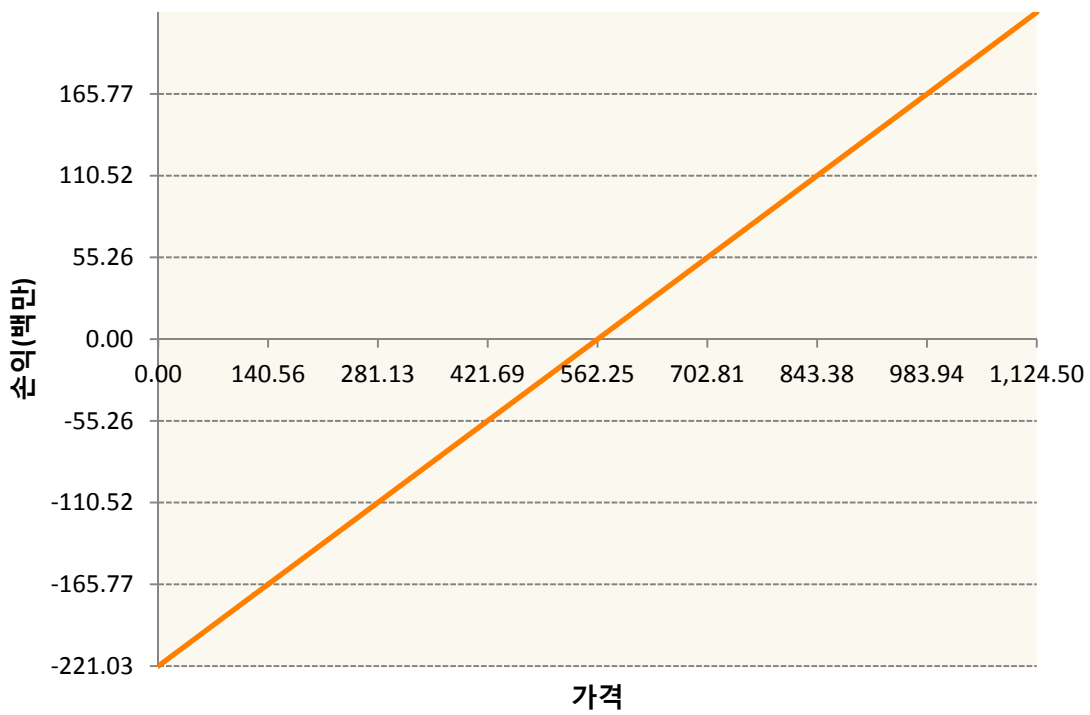




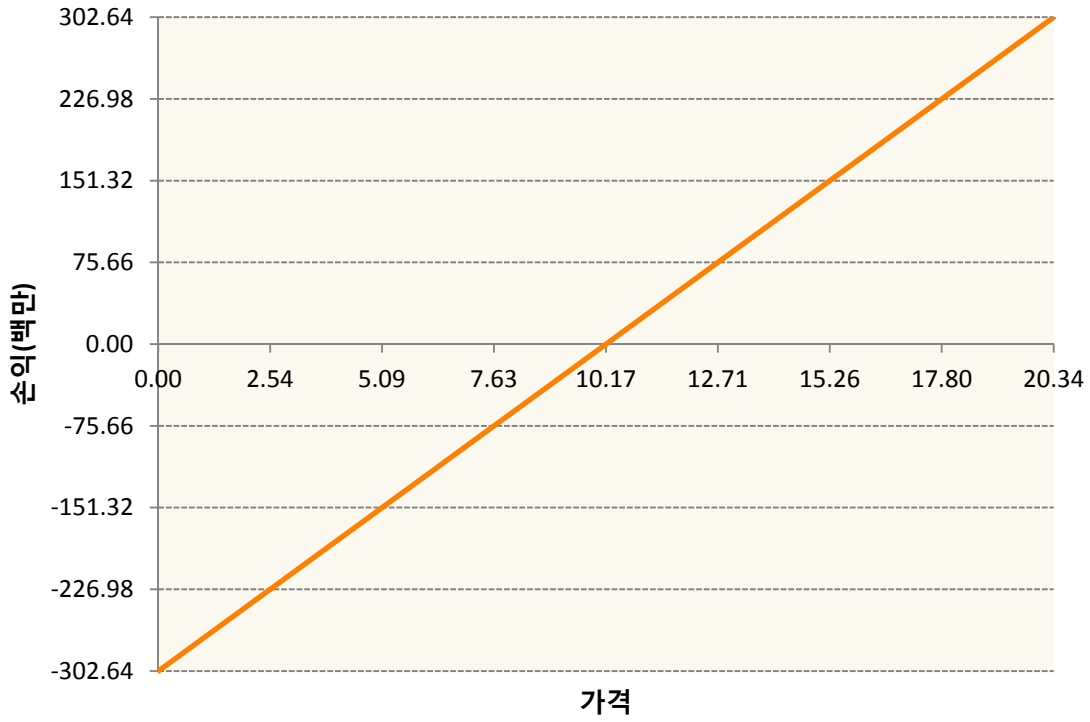
**KR4175N90000-2018-09 달러선물**



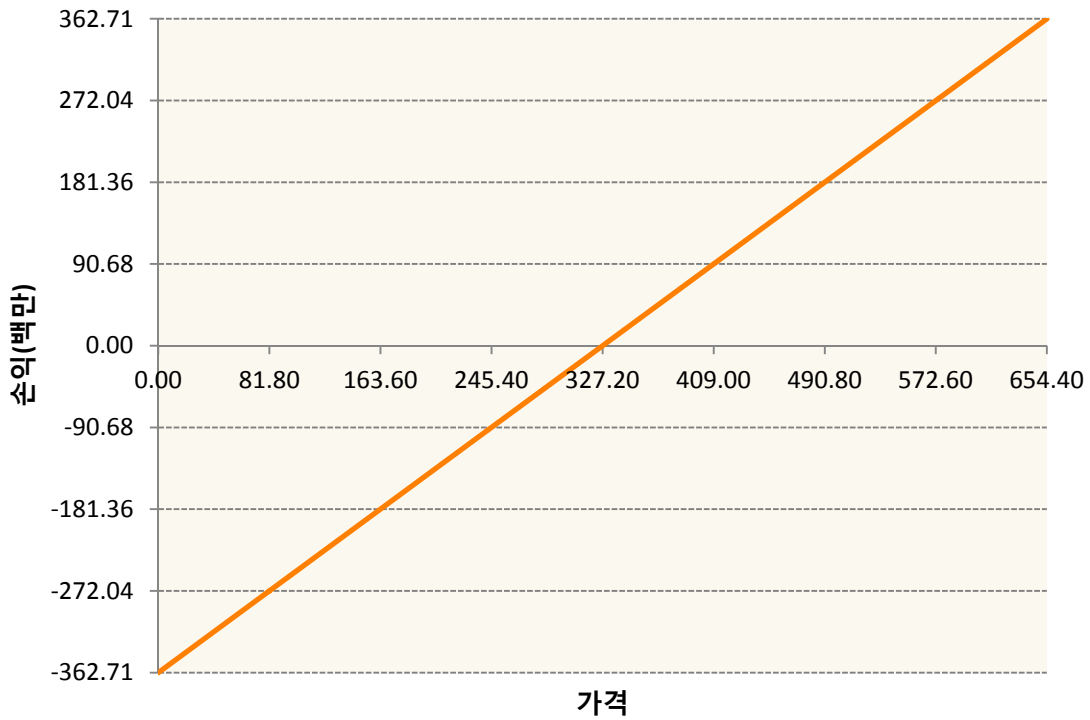
**KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18**



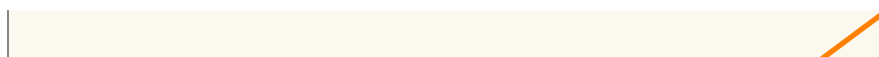
SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

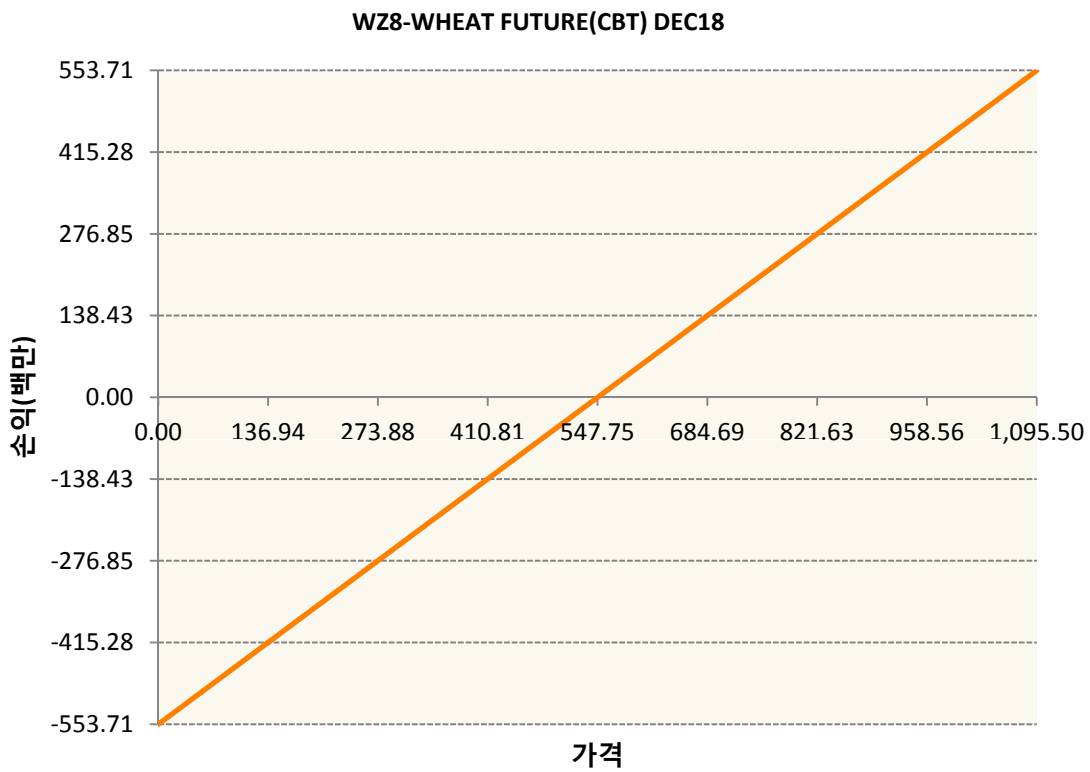
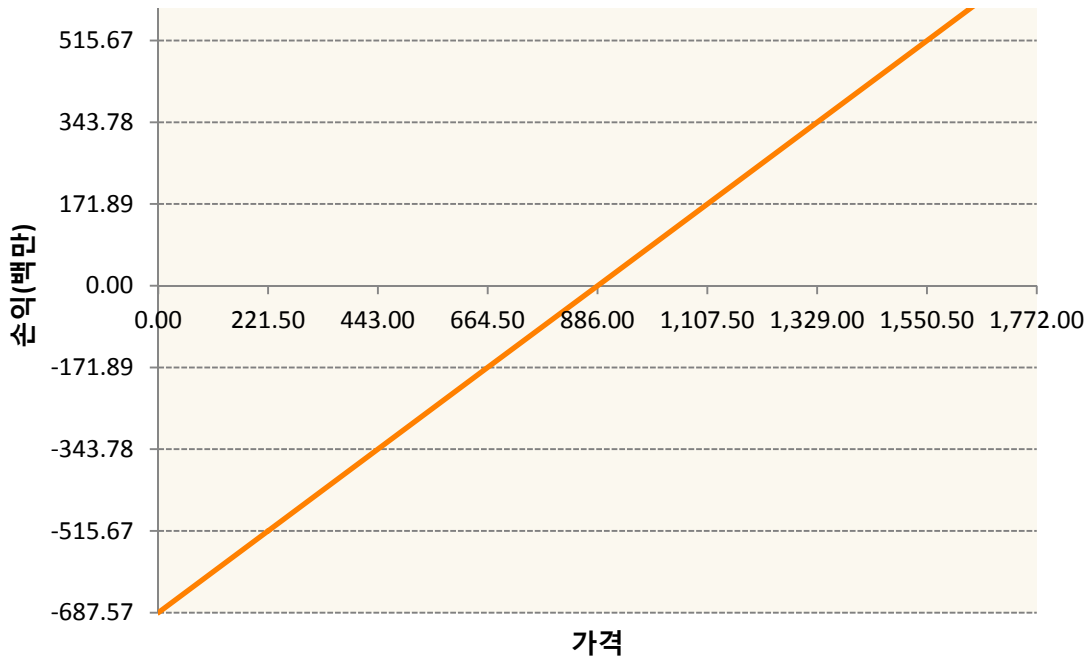


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



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	67
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	21
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	44

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

(단위:백만원)

**315**