

공시일	2018-08-24
기준일	2018-08-23

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

공시일	2018-08-24
기준일	2018-08-23

스마트인덱스모

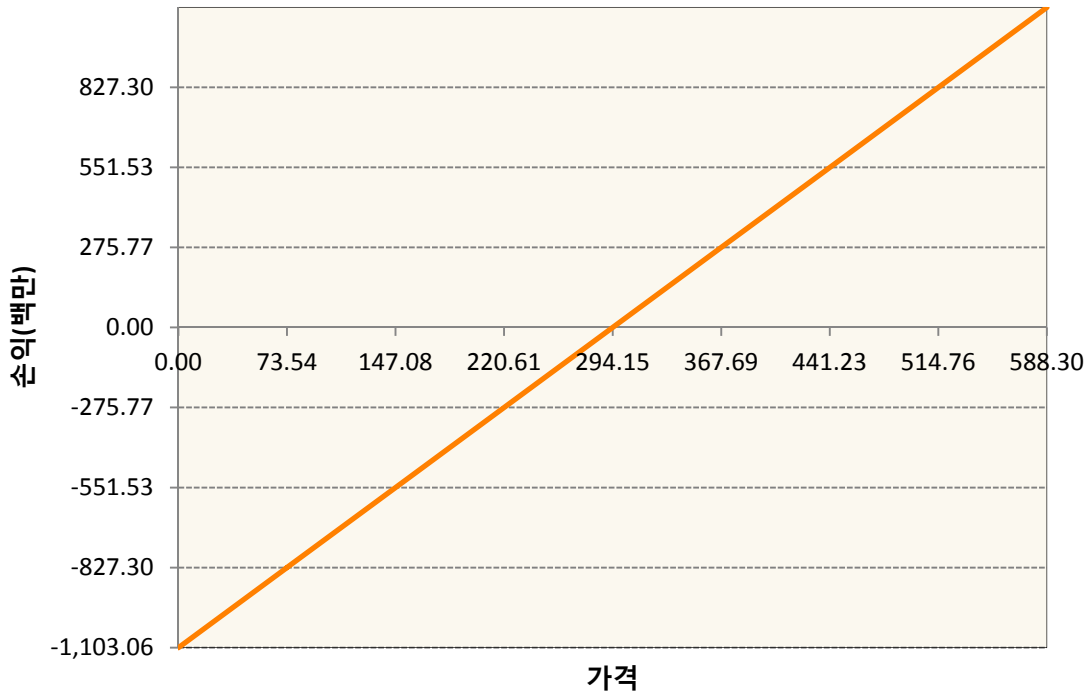
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,103	0	1,103	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물

88

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-5.33%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
-2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	29	29	29	29	29	29	29
5.33%	59	59	59	59	59	59	59
8.00%	88	88	88	88	88	88	88

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

(단위:백만원)

66

공시일	2018-08-24
기준일	2018-08-23

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	14,259	0	14,259	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S180822

1,143

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

488

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-24
기준일	2018-08-23

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

298

* 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	2018-08-24
기준일	2018-08-23

유로인덱스모(주식-파생형)

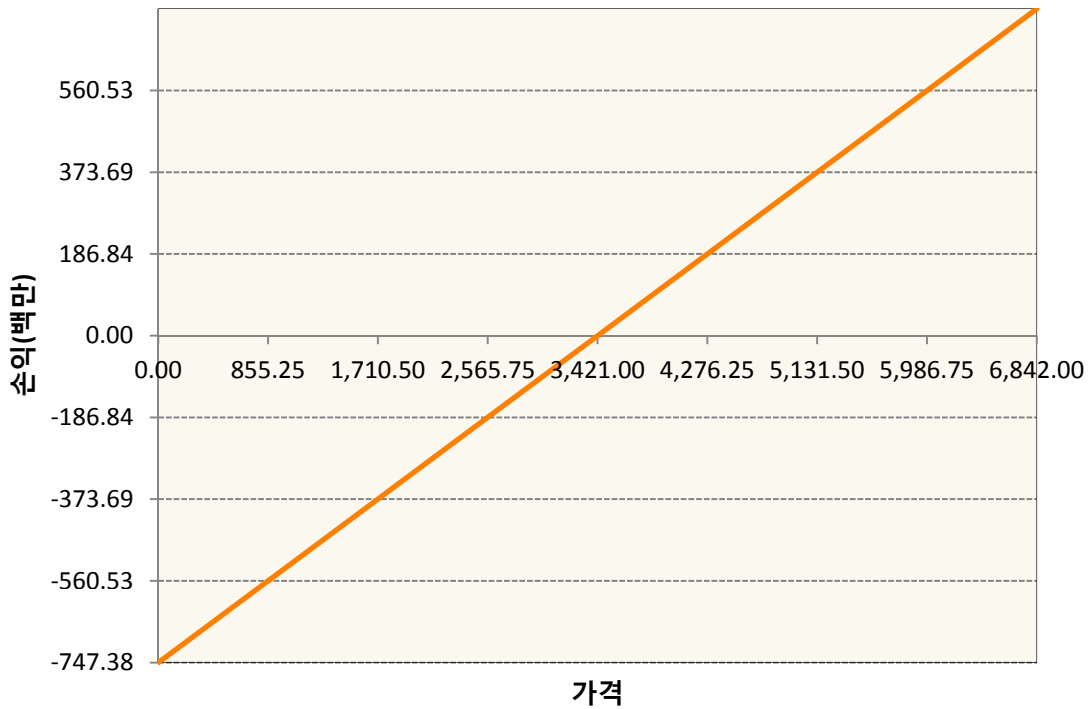
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	747	0	747	

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	2018-08-24
기준일	2018-08-23

차이나인덱스모(주식-파생형)

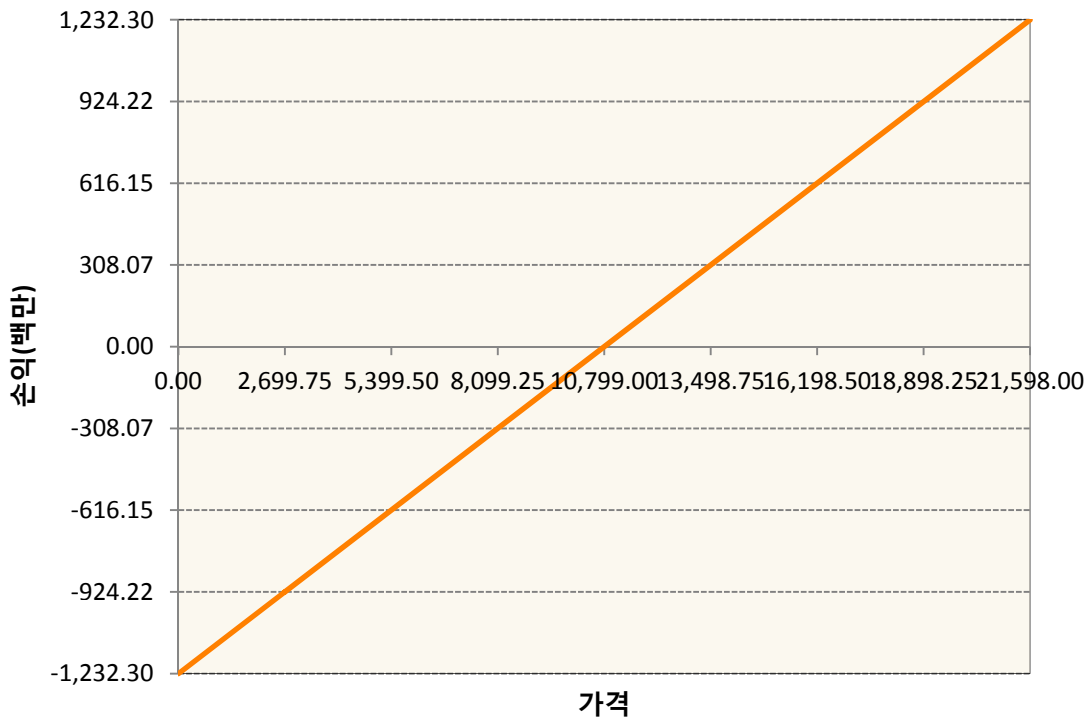
1. 계약금액

(단위:백만원)

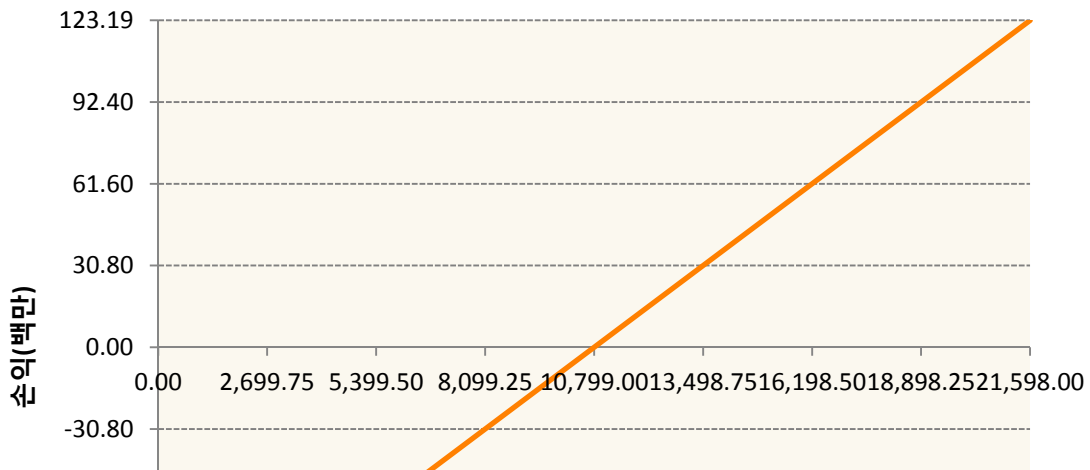
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,355	0	1,355	장내

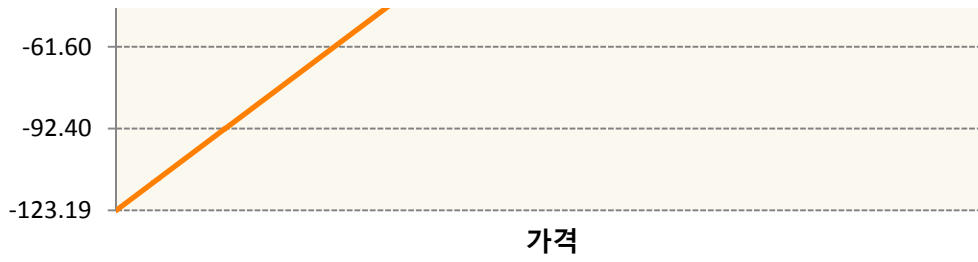
2. 만기시점의 손익구조

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)

99

공시일	2018-08-24
기준일	2018-08-23

커버드콜모(주식혼합-파생형)

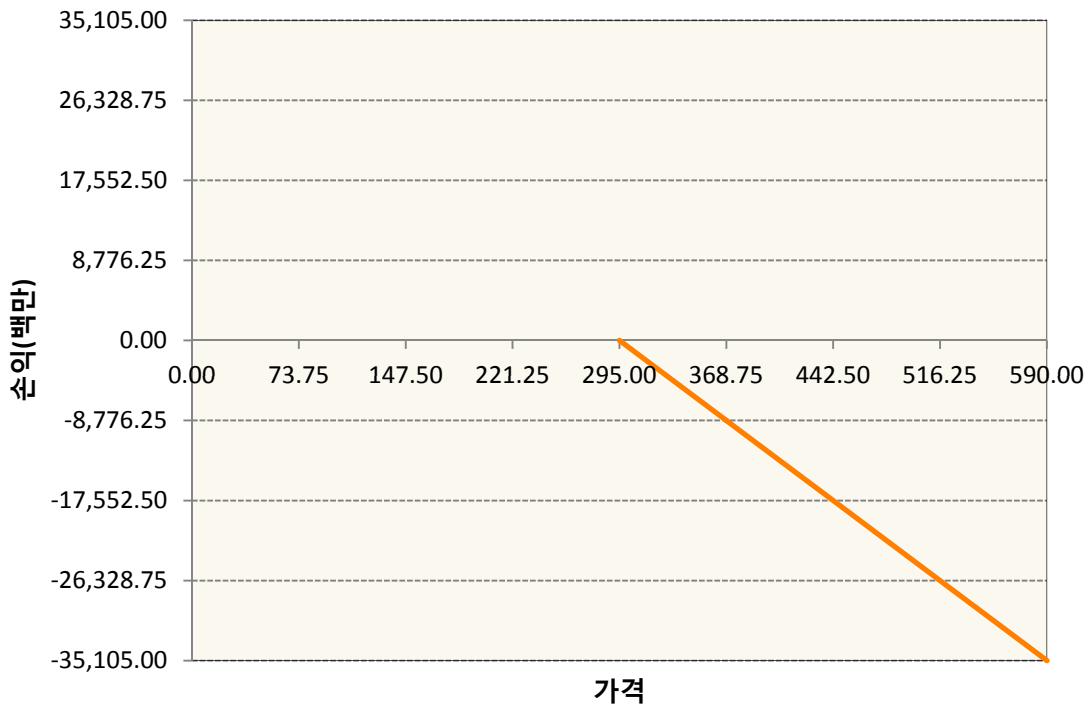
1. 계약금액

(단위:백만원)

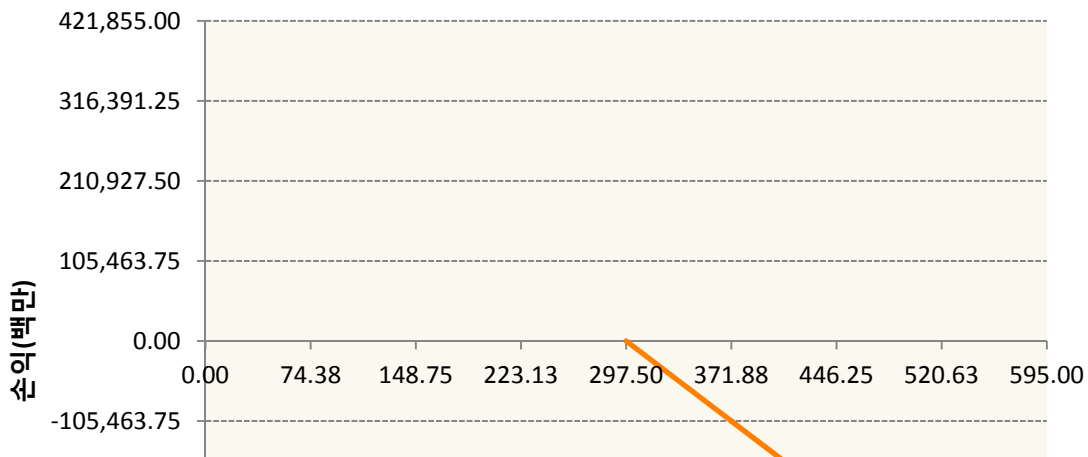
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	765,616	-765,616	장내

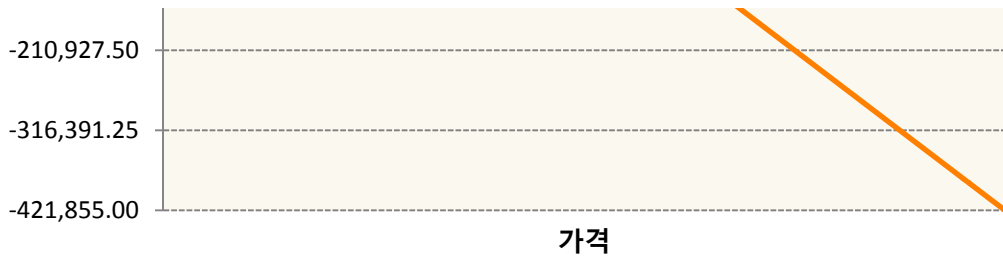
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92950-2018-09 콜295

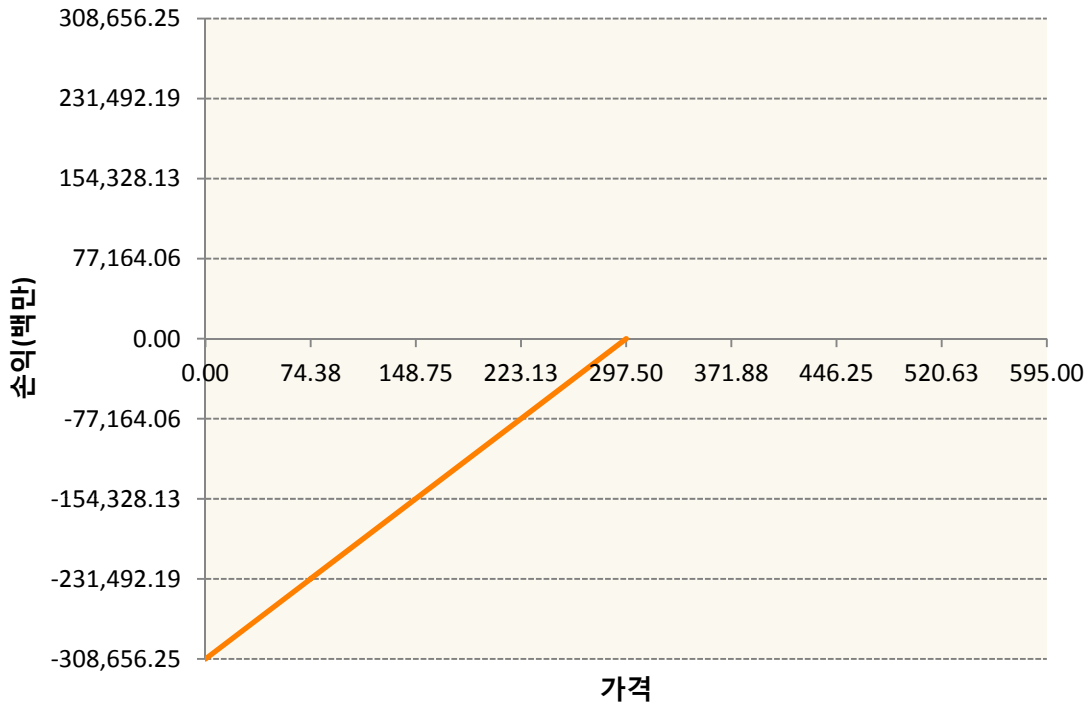


KR4201N92976-2018-09 콜297.5





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N929 2018-09 콜295

2,132

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	840	822	799	770	738	701	661
-5.33%	768	728	683	635	583	529	472
-2.67%	584	520	455	388	320	251	181
0%	228	152	76	0	-76	-152	-228
2.67%	-327	-396	-467	-538	-610	-683	-757
5.33%	-1,052	-1,101	-1,155	-1,212	-1,272	-1,334	-1,398
8.00%	-1,890	-1,918	-1,952	-1,991	-2,034	-2,082	-2,132

KR4201N929 2018-09 풋297.5

24,173

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,545	8,381	8,159	7,881	7,549	7,169	6,744

-5.33%	7,923	7,531	7,077	6,570	6,018	5,428	4,804
-2.67%	6,220	5,537	4,820	4,076	3,310	2,527	1,730
0%	2,674	1,786	894	0	-896	-1,794	-2,694
2.67%	-3,185	-4,066	-4,954	-5,847	-6,745	-7,645	-8,548
5.33%	-11,225	-11,906	-12,627	-13,379	-14,157	-14,955	-15,769
8.00%	-20,845	-21,263	-21,747	-22,288	-22,877	-23,508	-24,173
KR4301N929 2018-09 풋 297.5							22,200
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,179	-22,179	-22,180	-22,181	-22,184	-22,190	-22,200
-5.33%	-14,050	-14,057	-14,069	-14,091	-14,123	-14,167	-14,224
-2.67%	-6,041	-6,124	-6,229	-6,354	-6,497	-6,656	-6,829
0%	837	563	284	0	-287	-576	-868
2.67%	4,573	4,321	4,060	3,792	3,517	3,238	2,955
5.33%	5,510	5,439	5,346	5,233	5,100	4,950	4,784
8.00%	5,602	5,595	5,581	5,559	5,524	5,478	5,417

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

(단위:백만원)

51,432

공시일	2018-08-24
기준일	2018-08-23

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

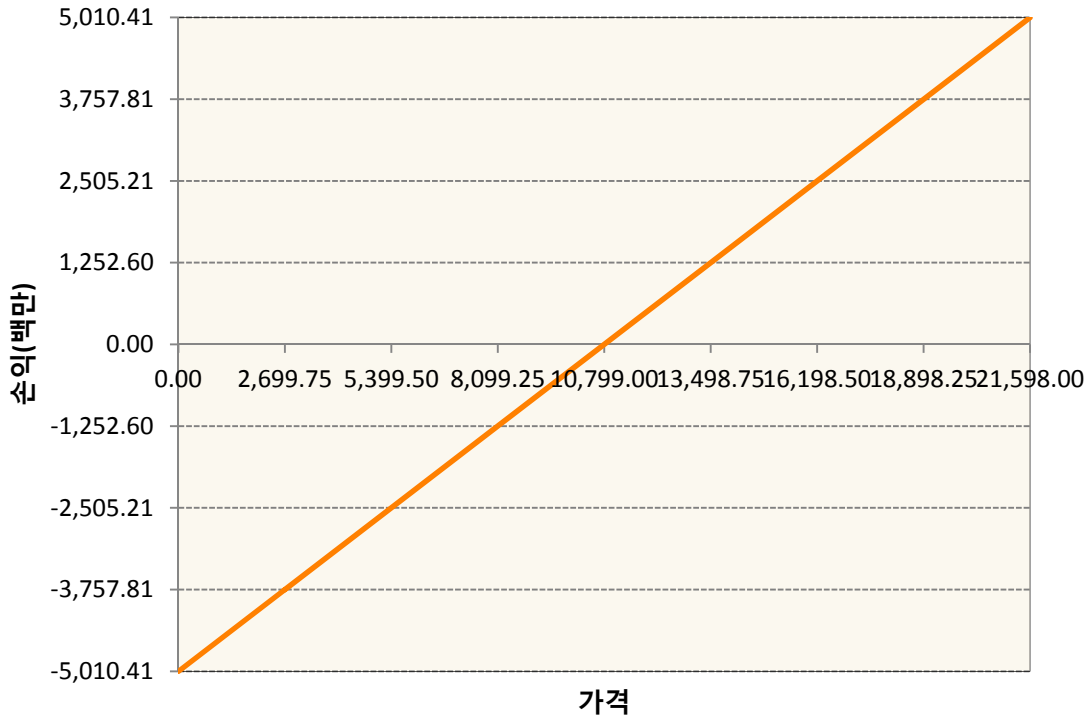
1. 계약금액

(단위:백만원)

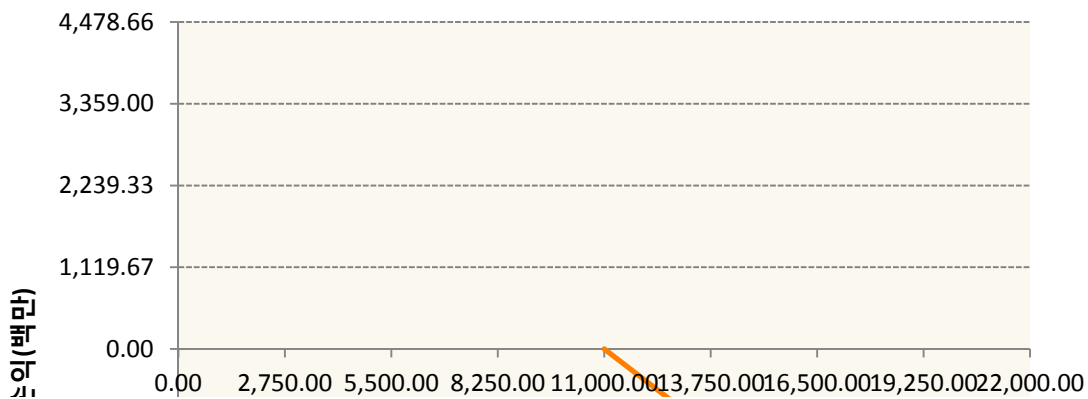
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,010	0	5,010	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,517	-11,517	장내

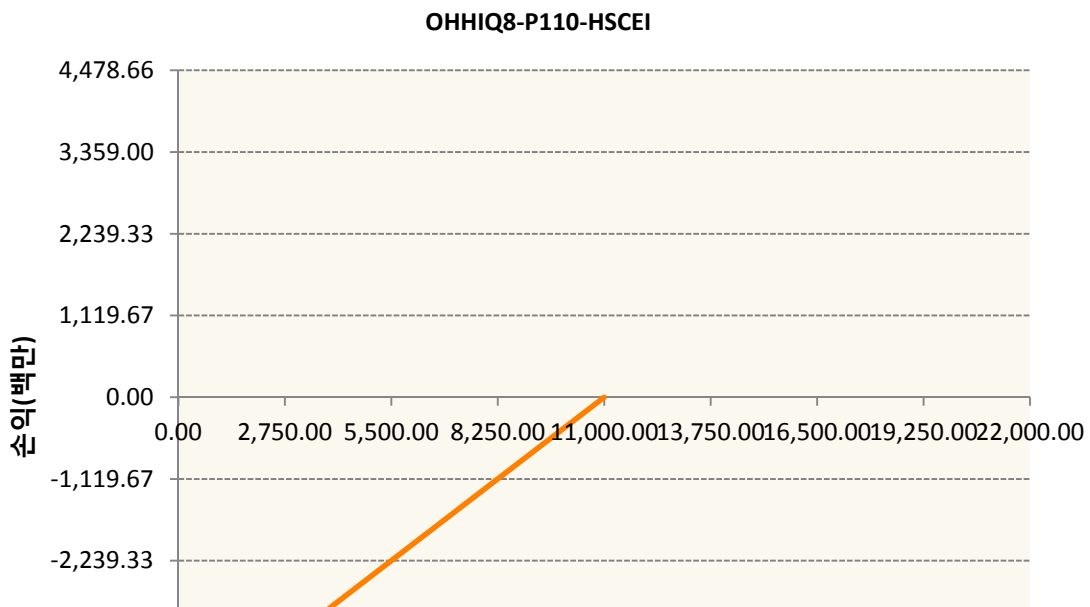
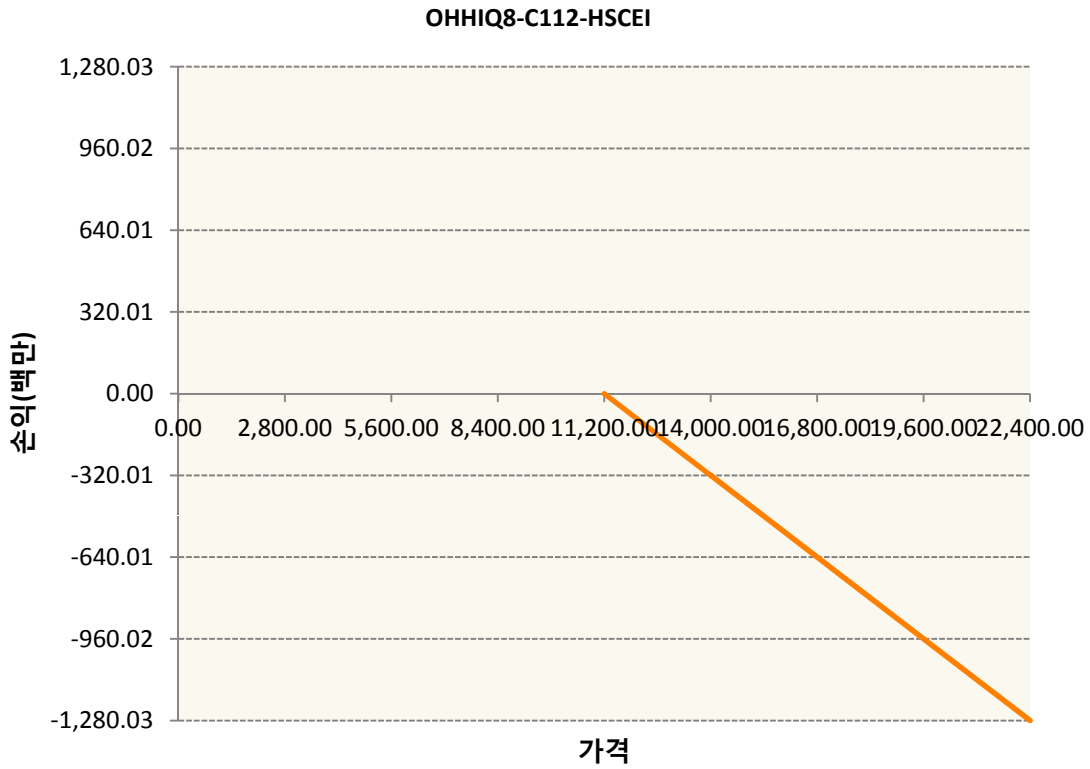
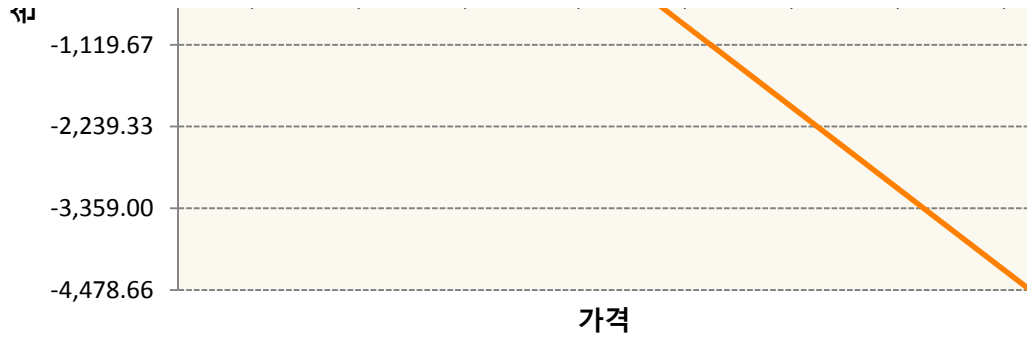
2. 만기시점의 손익구조

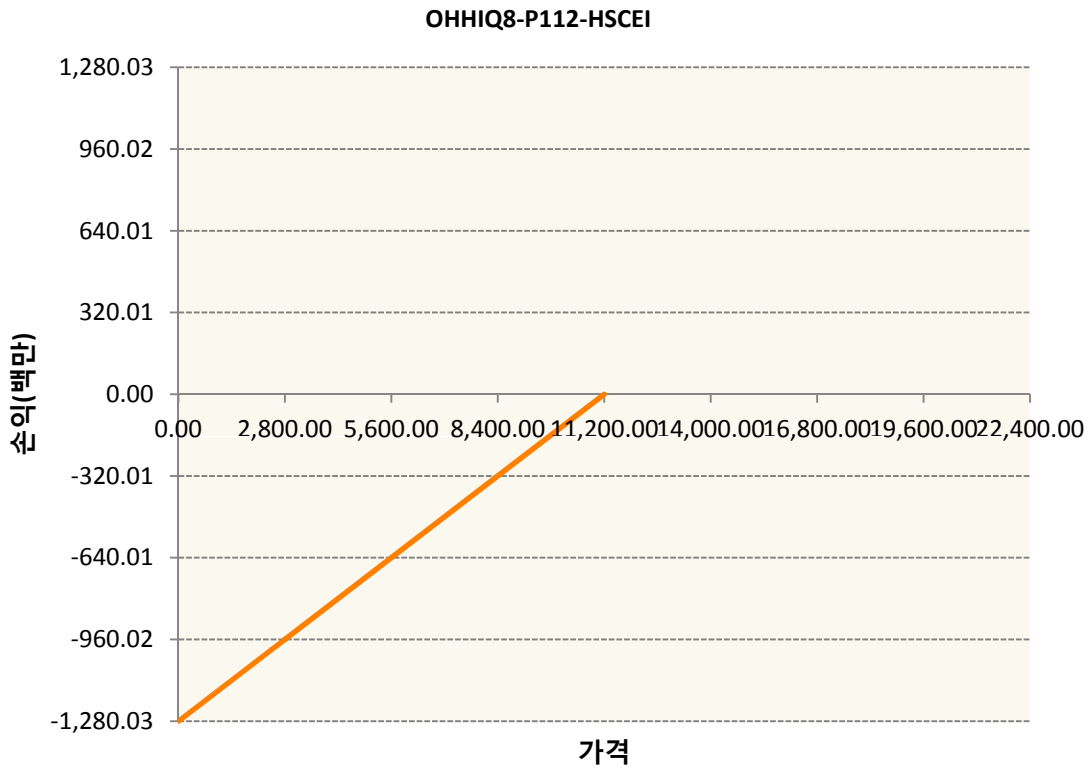
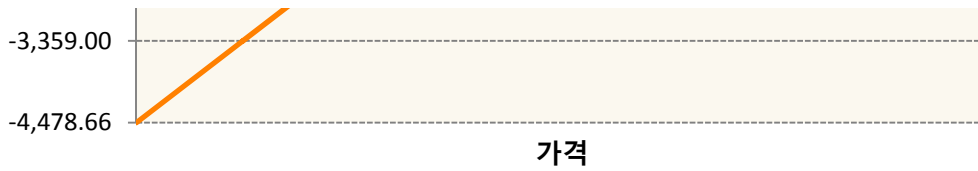
HCQ8-HSCEI Futures Aug18



OHHIQ8-C110-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ8	HSCEI Futures Aug18	401
OHHIQ8-C1	HSCEI	358
OHHIQ8-C1	HSCEI	102
OHHIQ8-P11	HSCEI	358
OHHIQ8-P11	HSCEI	102

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,211

공시일	2018-08-24
기준일	2018-08-23

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

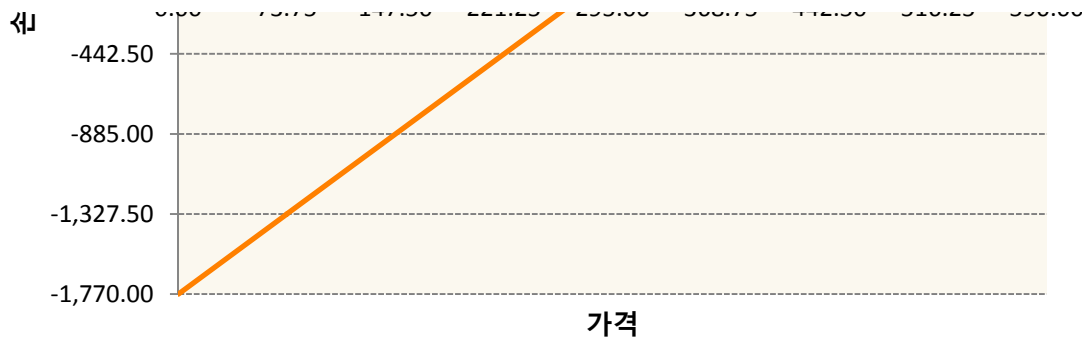
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92976-2018-09 콜297.5

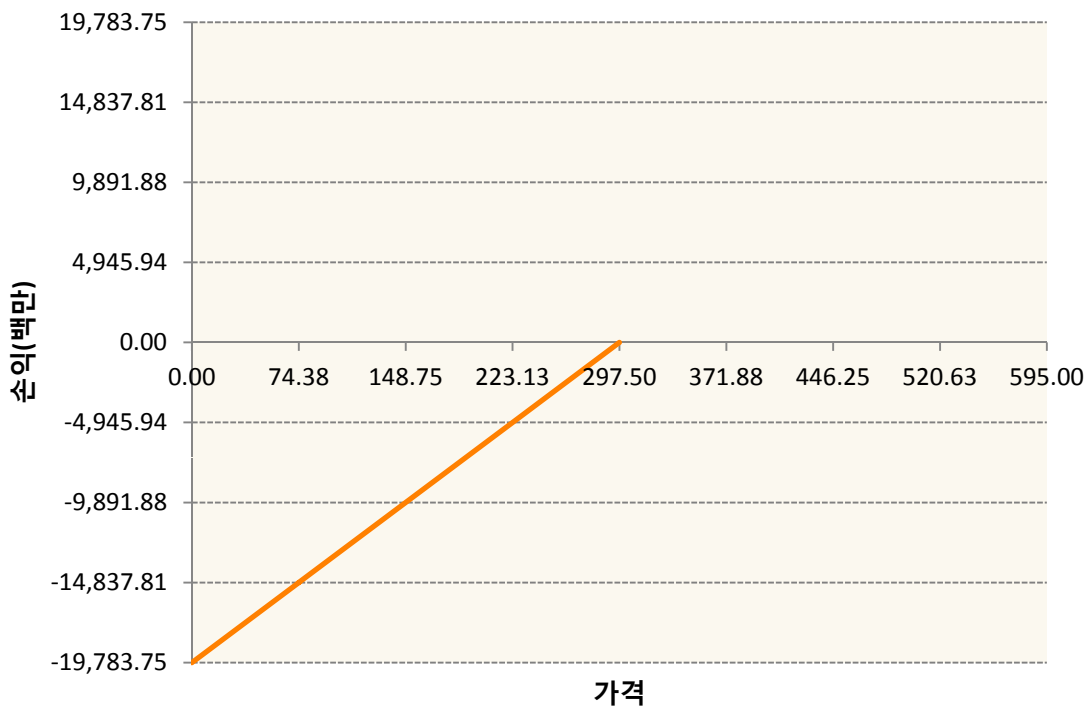


KR4301N92958-2018-09 풋295





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,967	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,967	-3,967	-3,967	-3,967	-3,967	-3,967	-3,967	
-5.33%	-2,645	-2,645	-2,645	-2,645	-2,645	-2,645	-2,645	
-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%	2,645	2,645	2,645	2,645	2,645	2,645	2,645	
8.00%	3,967	3,967	3,967	3,967	3,967	3,967	3,967	
KR4201N92974-2018-09 풋297.5							1,611	
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	569	559	544	525	503	478	449
-5.33%	528	502	472	438	401	362	320
-2.67%	415	369	321	272	221	168	115
0%	178	119	60	0	-60	-120	-180
2.67%	-212	-271	-330	-390	-449	-509	-570
5.33%	-748	-793	-841	-892	-943	-997	-1,051
8.00%	-1,389	-1,417	-1,449	-1,485	-1,525	-1,567	-1,611

KR4301N929 2018-09 풋295

122

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-122	-122	-122	-122	-122	-122	-122
-5.33%	-75	-75	-75	-76	-76	-76	-77
-2.67%	-30	-31	-32	-33	-34	-35	-36
0%	5	4	2	0	-2	-4	-5
2.67%	20	19	18	17	16	14	13
5.33%	23	23	23	22	22	21	21
8.00%	23	23	23	23	23	23	23

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%	-1,422	-1,422	-1,422	-1,422	-1,422	-1,422	-1,423
-5.33%	-901	-901	-902	-903	-905	-908	-912
-2.67%	-387	-393	-399	-407	-416	-427	-438
0%	54	36	18	0	-18	-37	-56
2.67%	293	277	260	243	225	208	189
5.33%	353	349	343	335	327	317	307
8.00%	359	359	358	356	354	351	347

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

(단위:백만원)

7,336

공시일	2018-08-24
기준일	2018-08-23

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

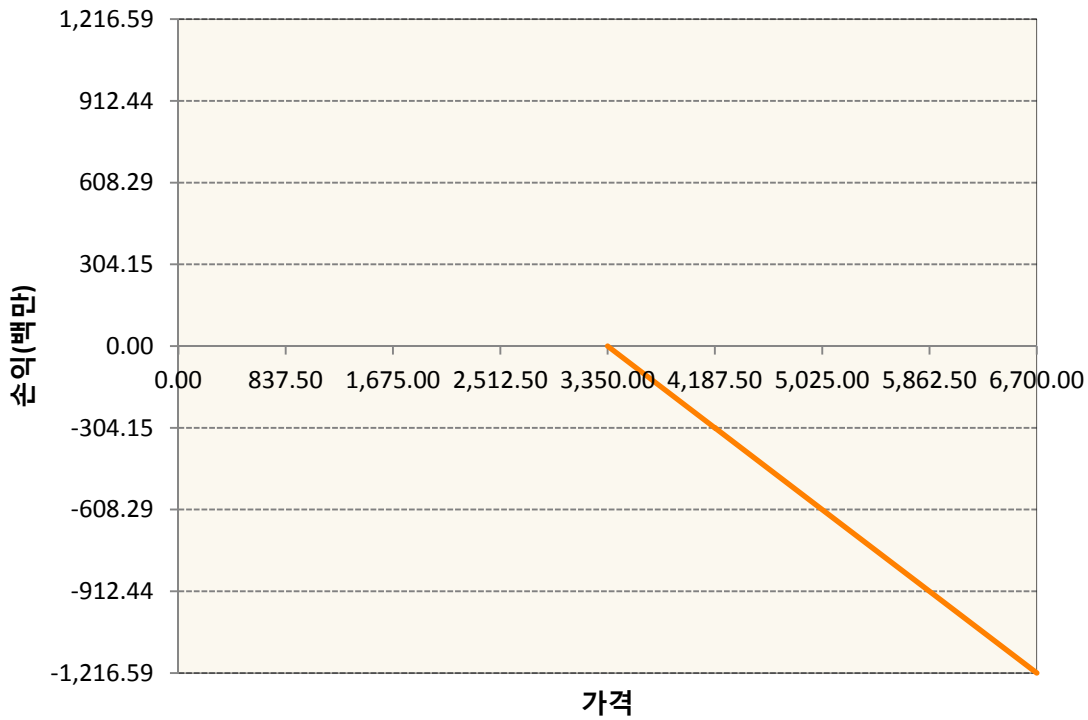
1. 계약금액

(단위:백만원)

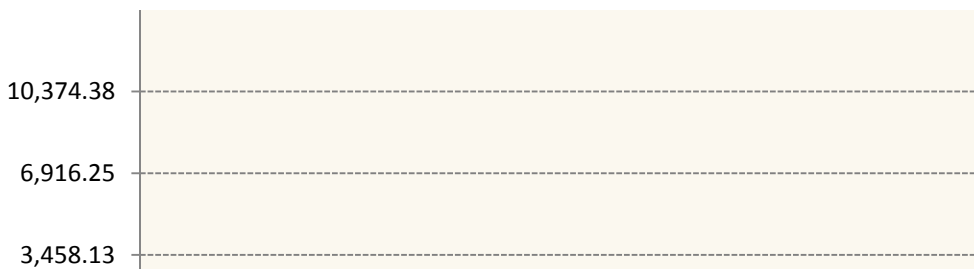
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	8,157	0	8,157	
누계	유가증권	옵션	0	30,098	-30,098	장내
누계	지수	스왑	86,906	0	86,906	장외

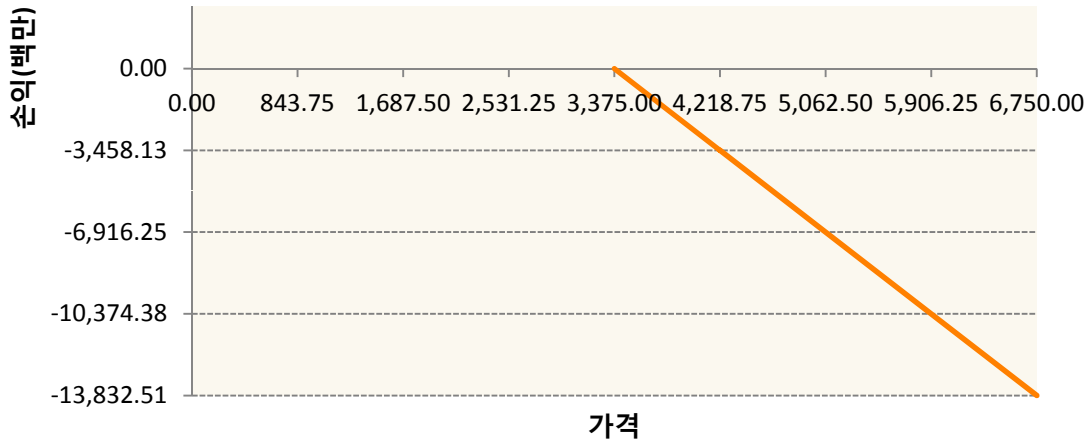
2. 만기시점의 손익구조

OESXU8-C3350-EURO STOXX 50

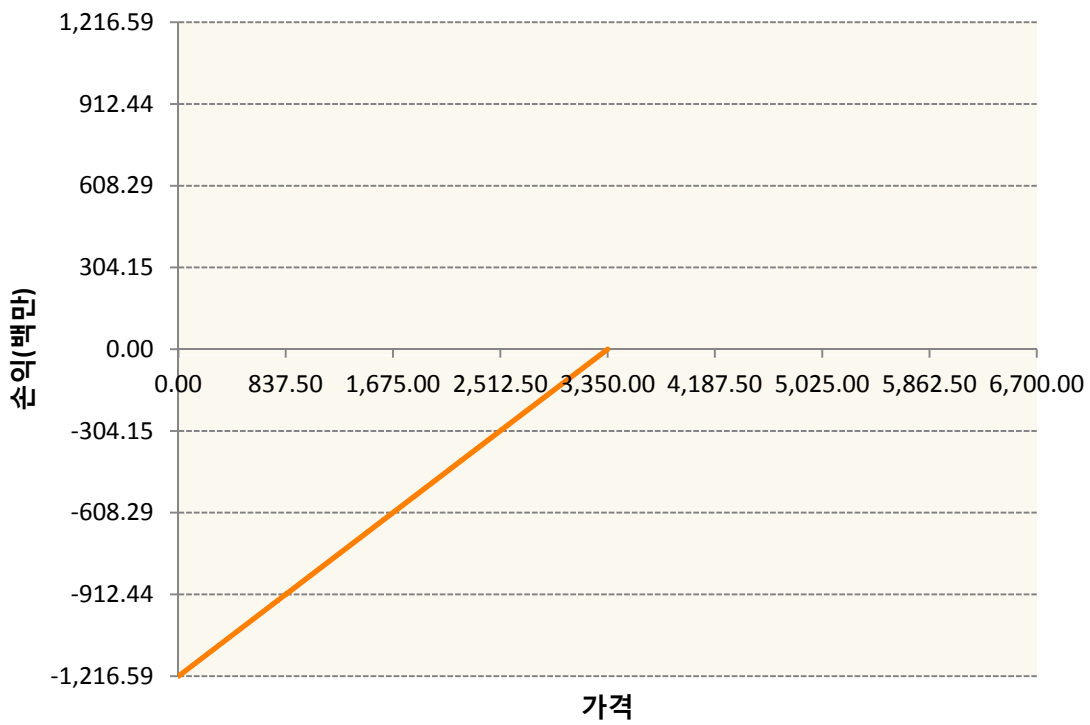


OESXU8-C3375-EURO STOXX 50

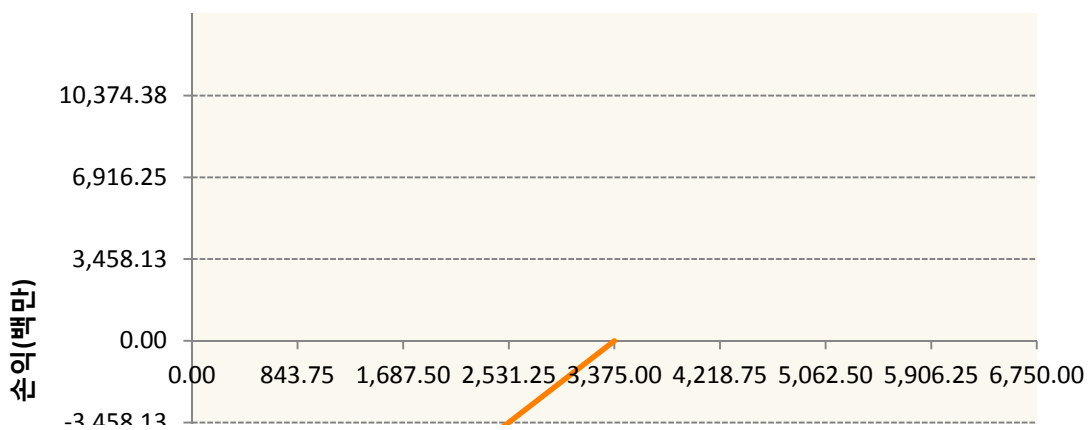


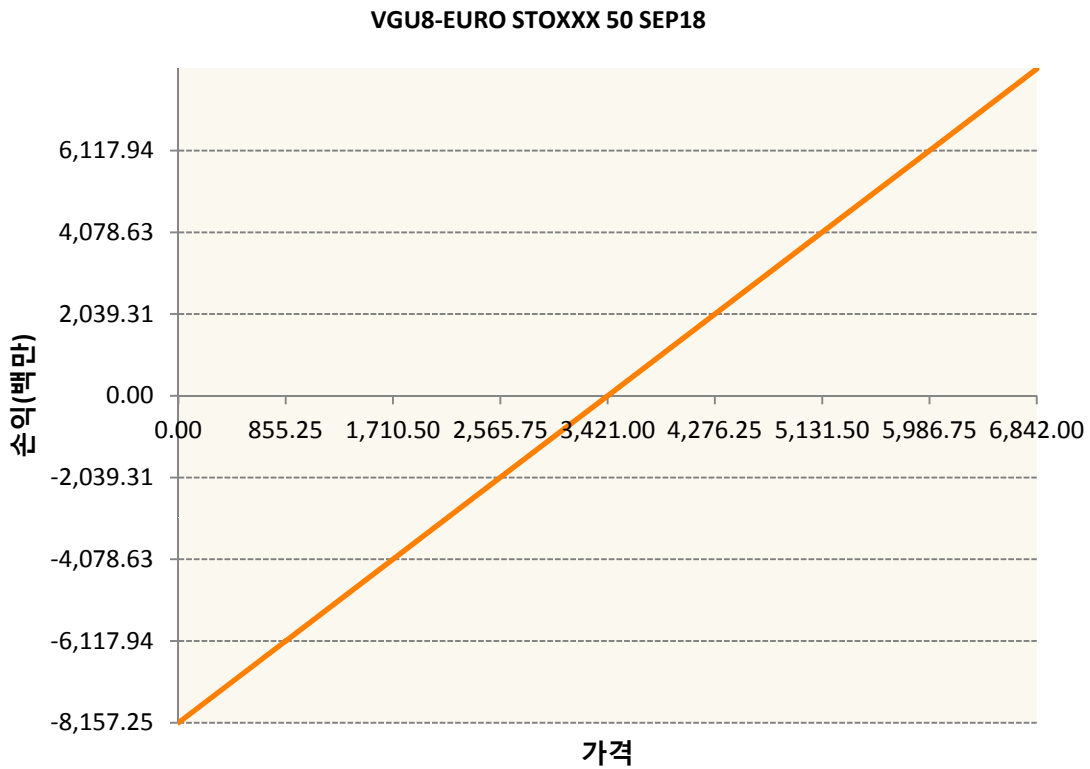
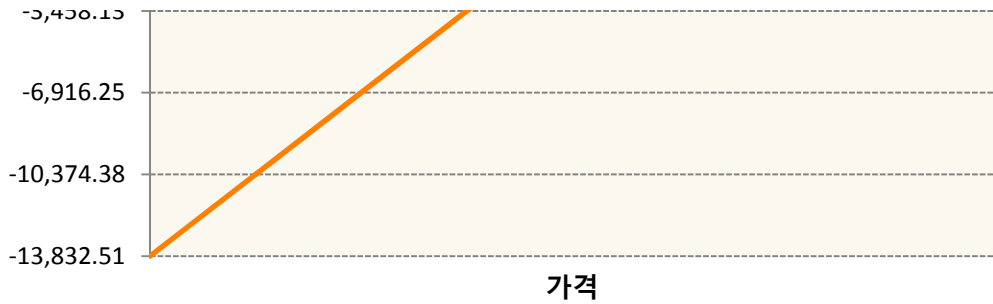


OESXU8-P3350-EURO STOXX 50



OESXU8-P3375-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	23
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY	15
OESXU8-C33 EURO STOXX 50	97
OESXU8-C33 EURO STOXX 50	1,107
OESXU8-P33 EURO STOXX 50	97
OESXU8-P33 EURO STOXX 50	1,107
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18	653

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

1,938

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

(단위:백만원)

1,123

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

(단위:백만원)

88

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

(단위:백만원)

133

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

(단위:백만원)

162

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-08-24
기준일	2018-08-23

리디파인K200(주식혼합-파생재간

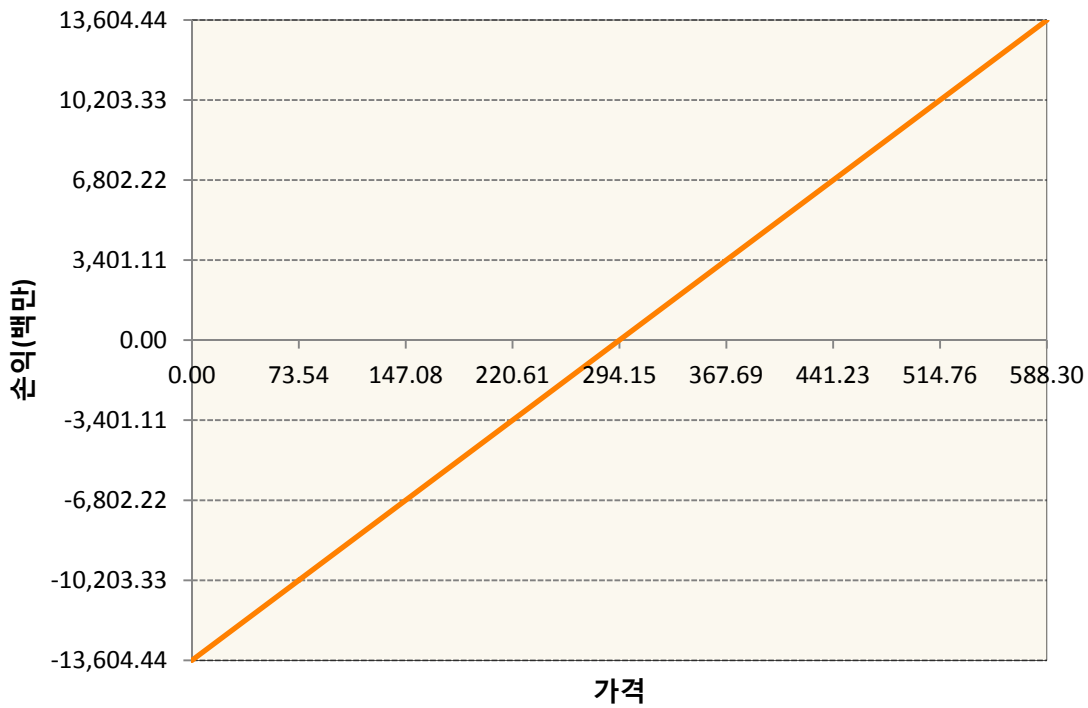
1. 계약금액

(단위:백만원)

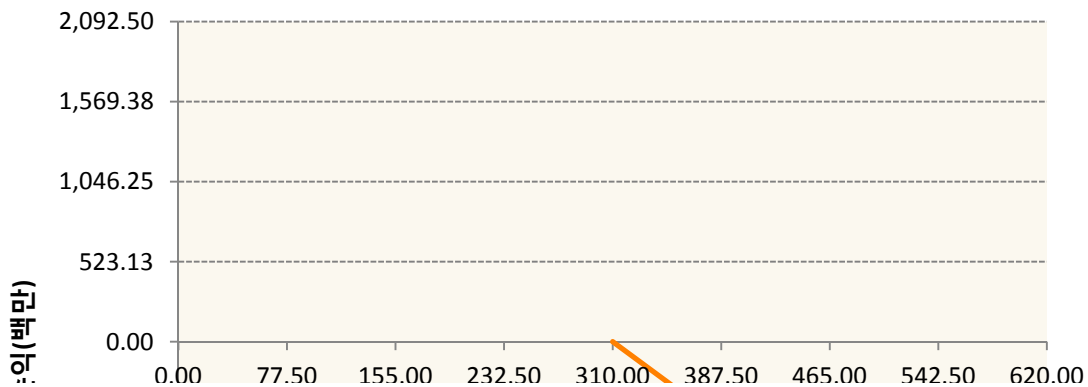
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,604	0	13,604	장내
누계	유가증권	옵션	1,339	24,671	-23,332	장내

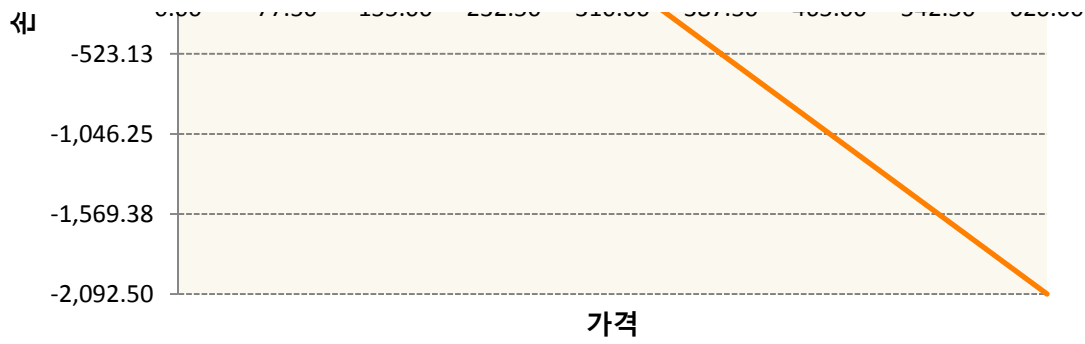
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

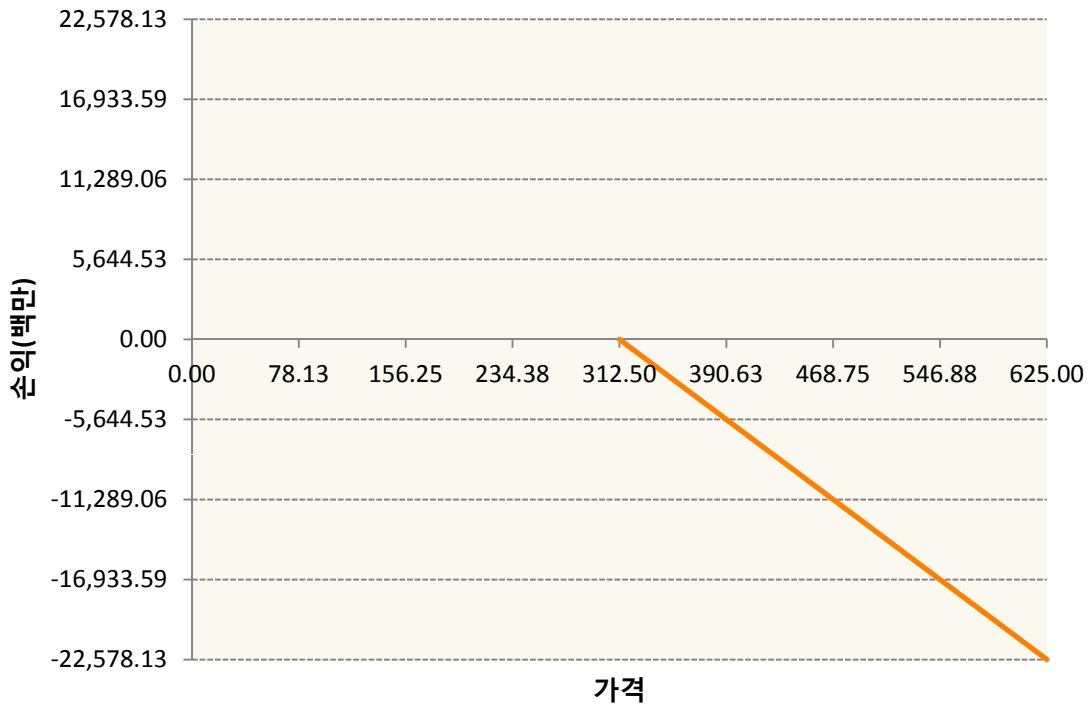


KR4201N93107-2018-09 콜310

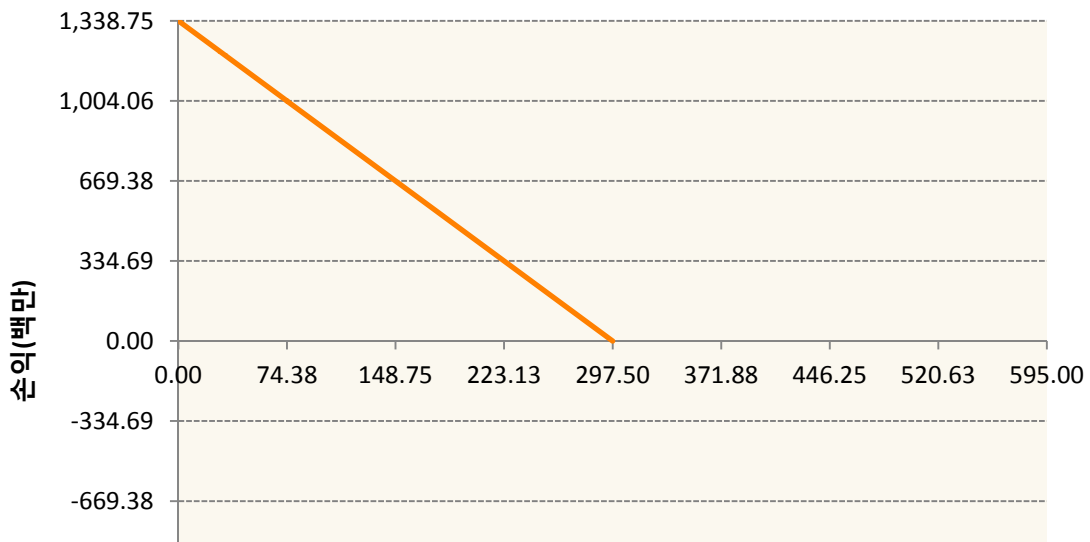


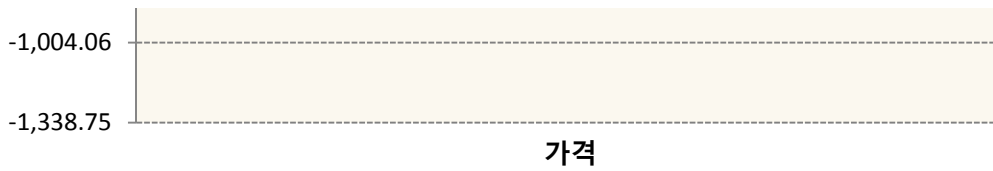


KR4201N93123-2018-09 콜312.5



KR4301N92974-2018-09 풋297.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물								1,089
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,089	-1,089	-1,089	-1,089	-1,089	-1,089	-1,089	-1,089
-5.33%	-726	-726	-726	-726	-726	-726	-726	-726
-2.67%	-363	-363	-363	-363	-363	-363	-363	-363
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	363	363	363	363	363	363	363	363
5.33%	726	726	726	726	726	726	726	726
8.00%	1,089	1,089	1,089	1,089	1,089	1,089	1,089	1,089
KR4201N9312018-09 콜310								82
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	16	16	15	15	15	14	13	
-5.33%	15	15	14	13	12	11	9	
-2.67%	14	12	11	9	7	4	2	
0%	9	6	3	0	-3	-7	-10	
2.67%	-3	-7	-11	-15	-19	-24	-28	
5.33%	-25	-29	-34	-38	-43	-47	-52	
8.00%	-57	-61	-65	-69	-74	-78	-82	
KR4201N9312018-09 콜312.5								808
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	137	136	134	131	126	119	110	
-5.33%	134	130	124	116	105	91	75	
-2.67%	122	110	96	78	58	35	9	
0%	81	57	30	0	-32	-66	-101	
2.67%	-19	-58	-98	-140	-182	-226	-269	
5.33%	-214	-262	-311	-359	-407	-456	-504	
8.00%	-522	-569	-616	-664	-712	-760	-808	
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	61	61	61	62	
-2.67%	26	27	27	28	28	29	30	

0%	-4	-2	-1	0	1	2	4
2.67%	-20	-19	-18	-16	-15	-14	-13
5.33%	-24	-24	-23	-23	-22	-21	-21
8.00%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-23

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

(단위:백만원)

1,557

공시일	2018-08-24
기준일	2018-08-23

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

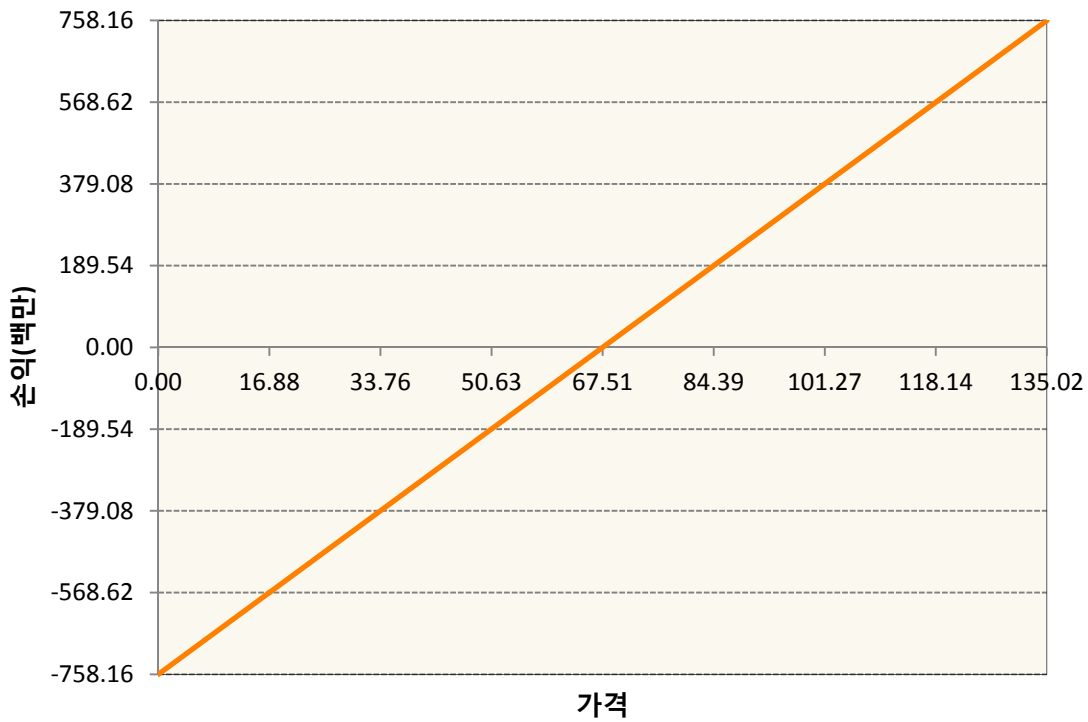
1. 계약금액

(단위:백만원)

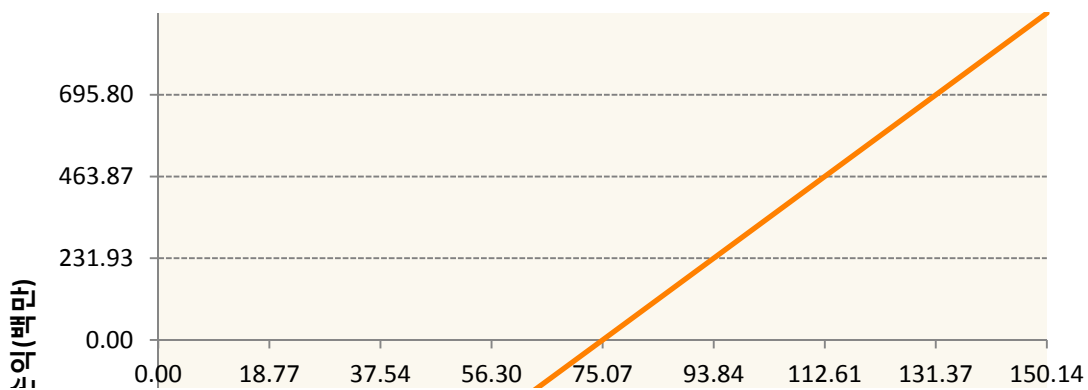
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,145	616	2,528	
누계	유가증권	선물	514	0	514	장내

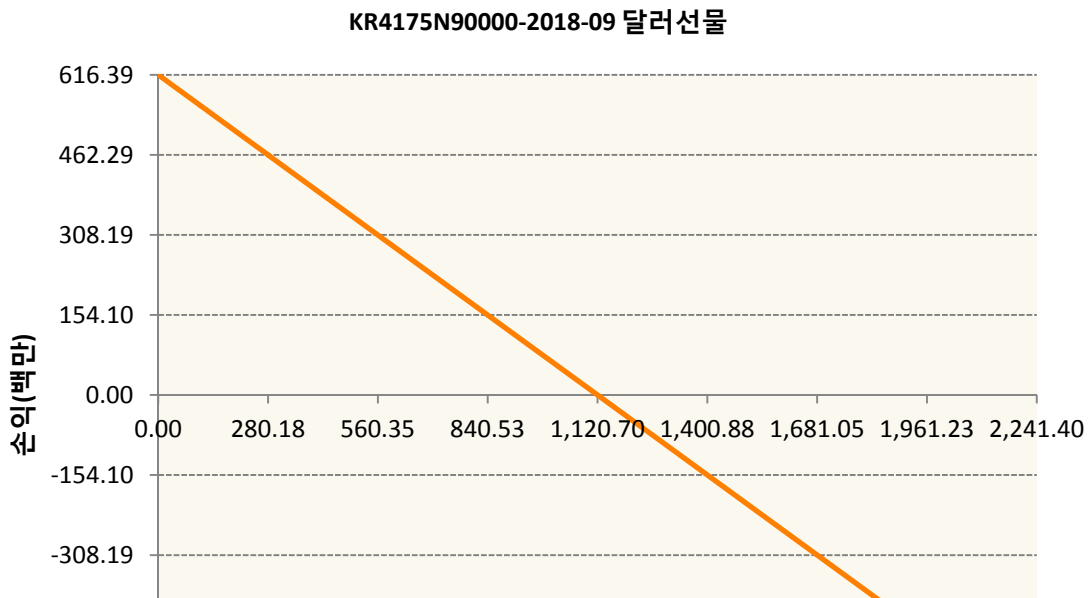
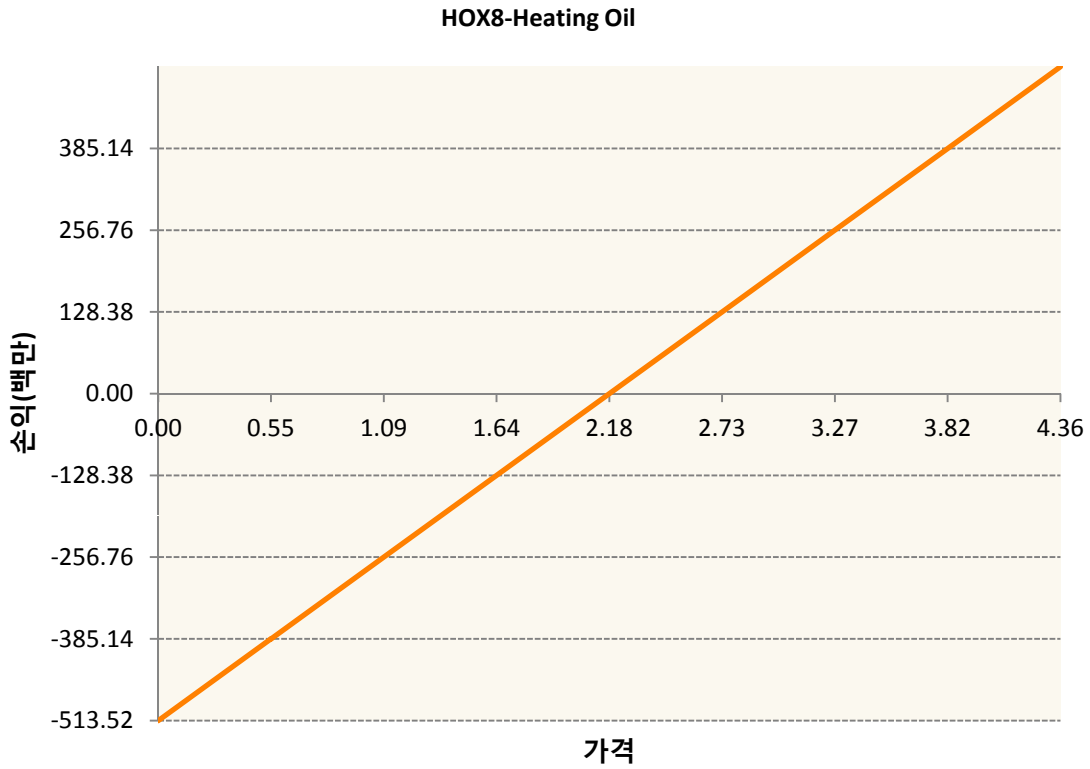
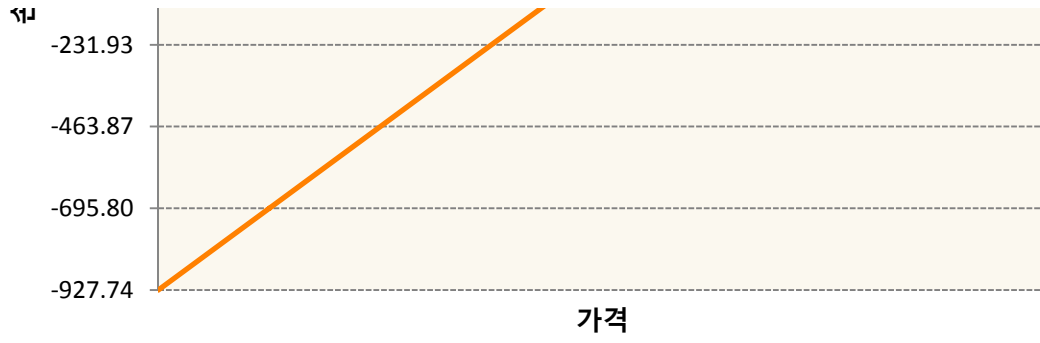
2. 만기시점의 손익구조

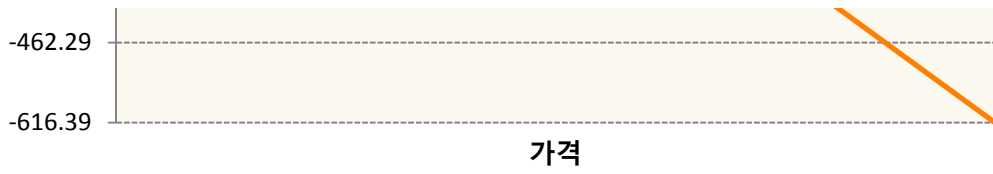
CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18



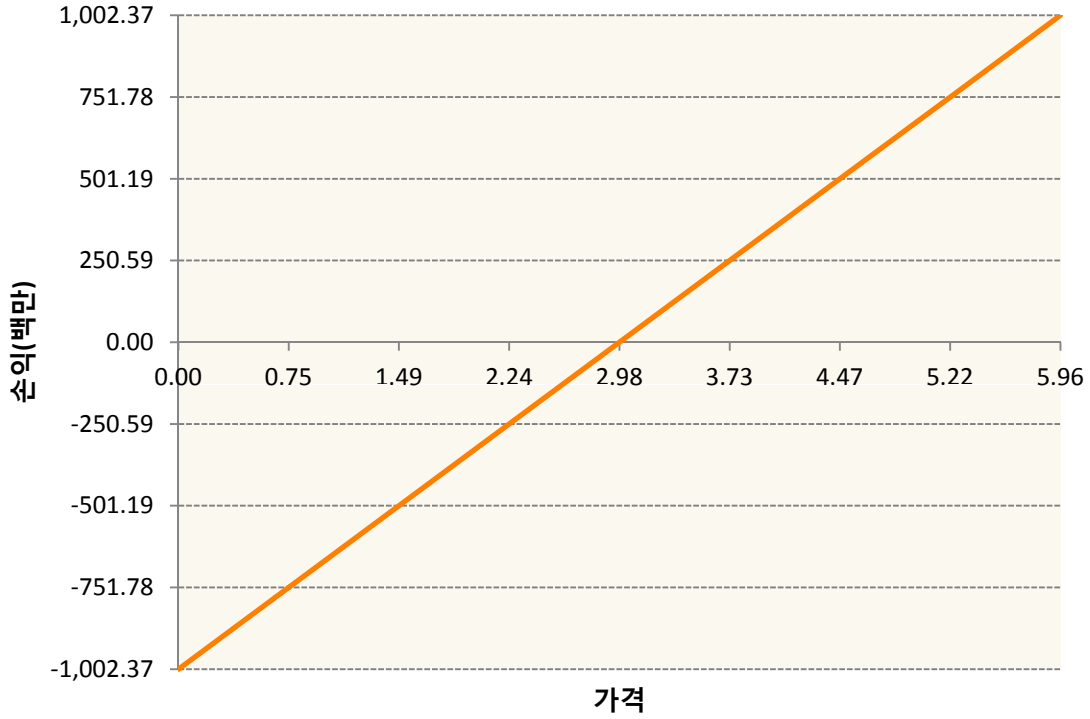
COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18



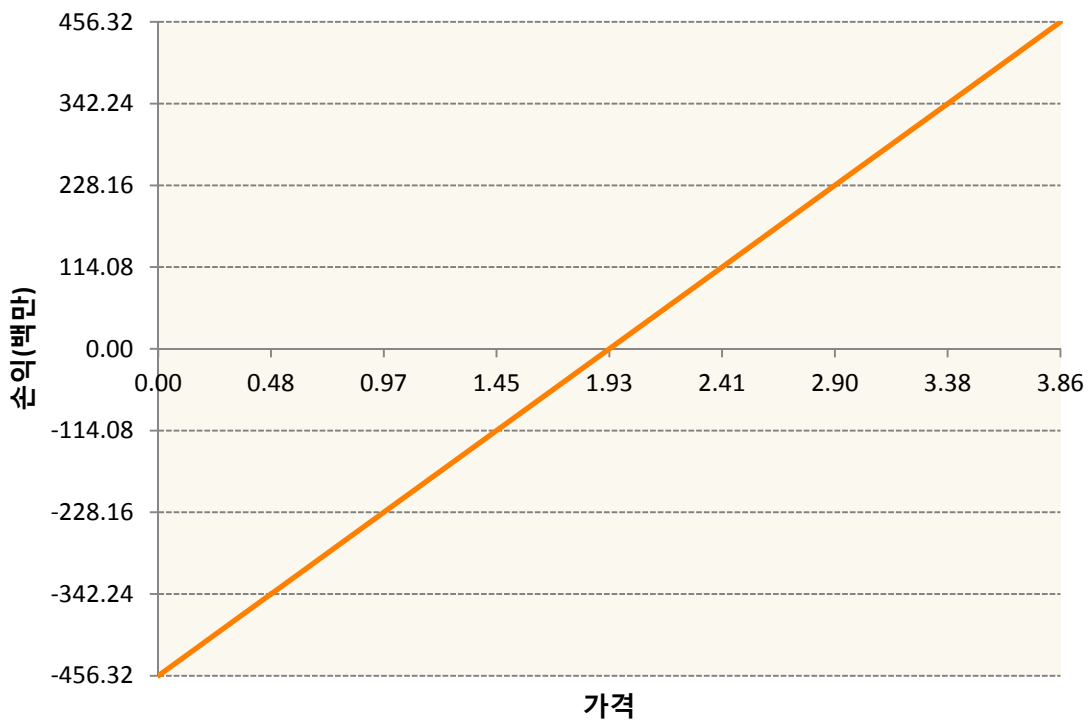




NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18



XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	61
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	74
HOX8	Heating Oil	41
	KR4175N90C 2018-09 달러선물	49
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	80
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	37

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	444

공시일	2018-08-24
기준일	2018-08-23

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

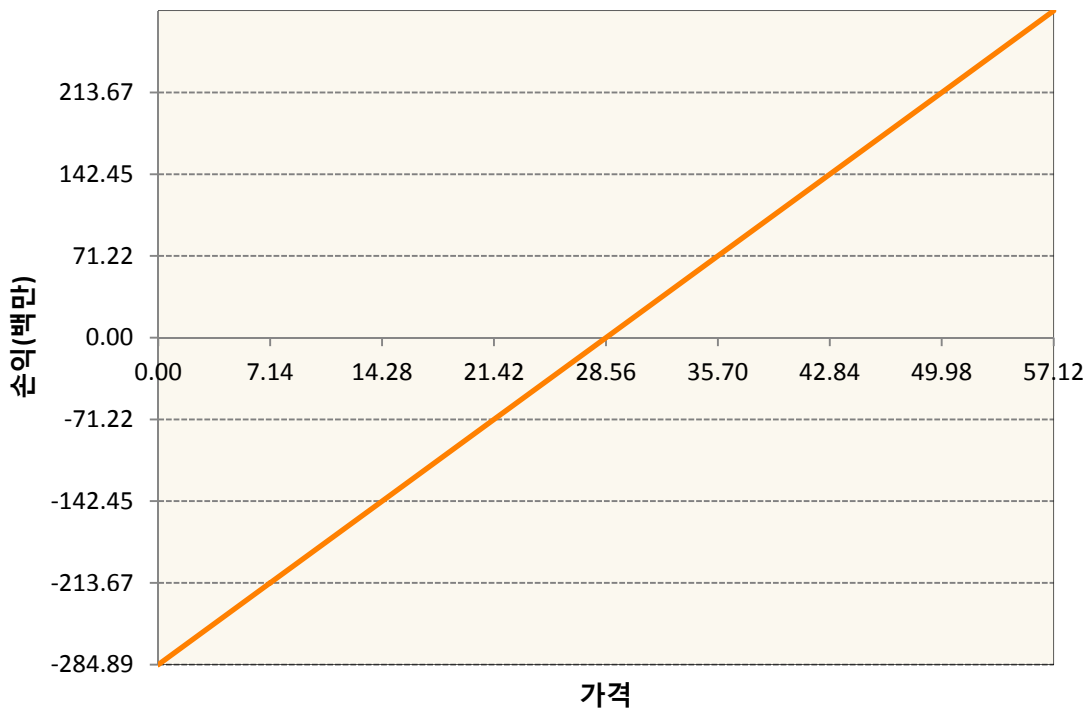
1. 계약금액

(단위:백만원)

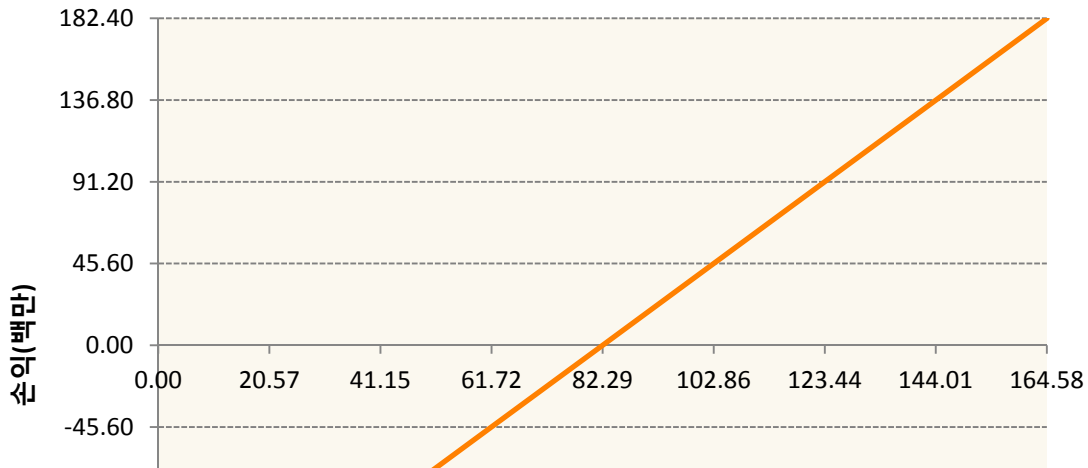
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,652	78	3,574	

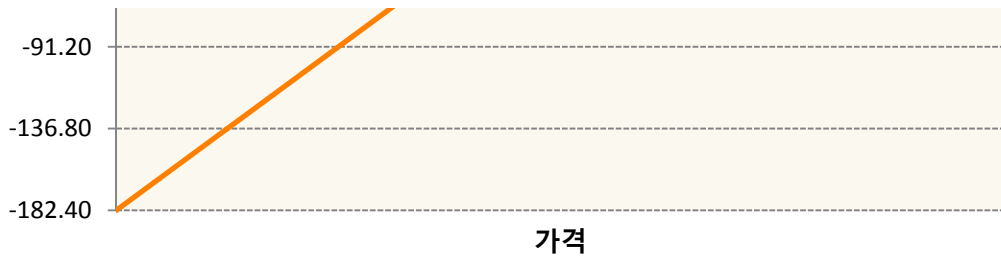
2. 만기시점의 손익구조

BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18

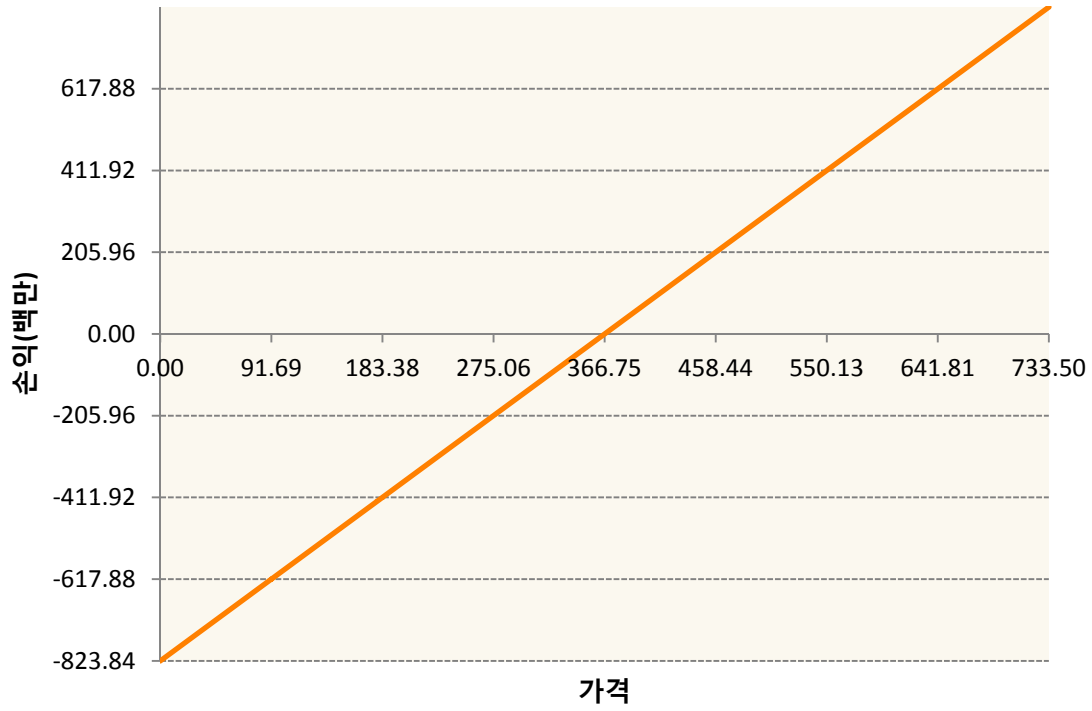


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

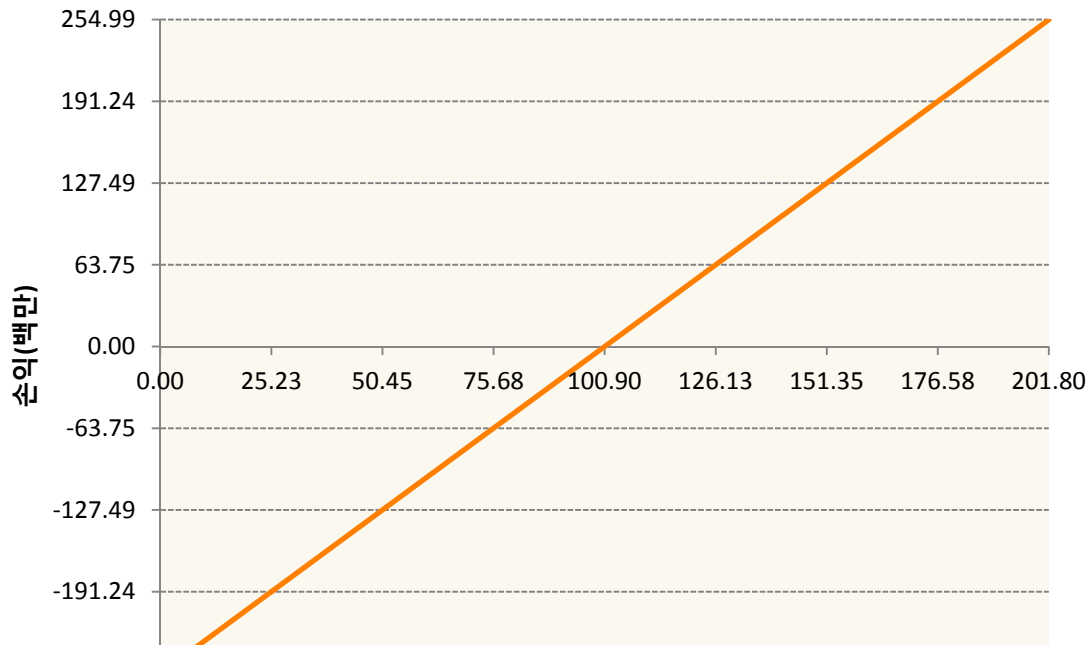


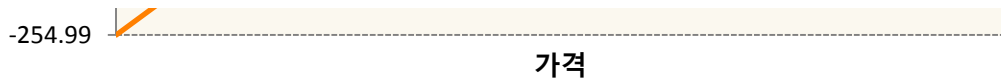


CZ8-CORN FUTURE DEC18

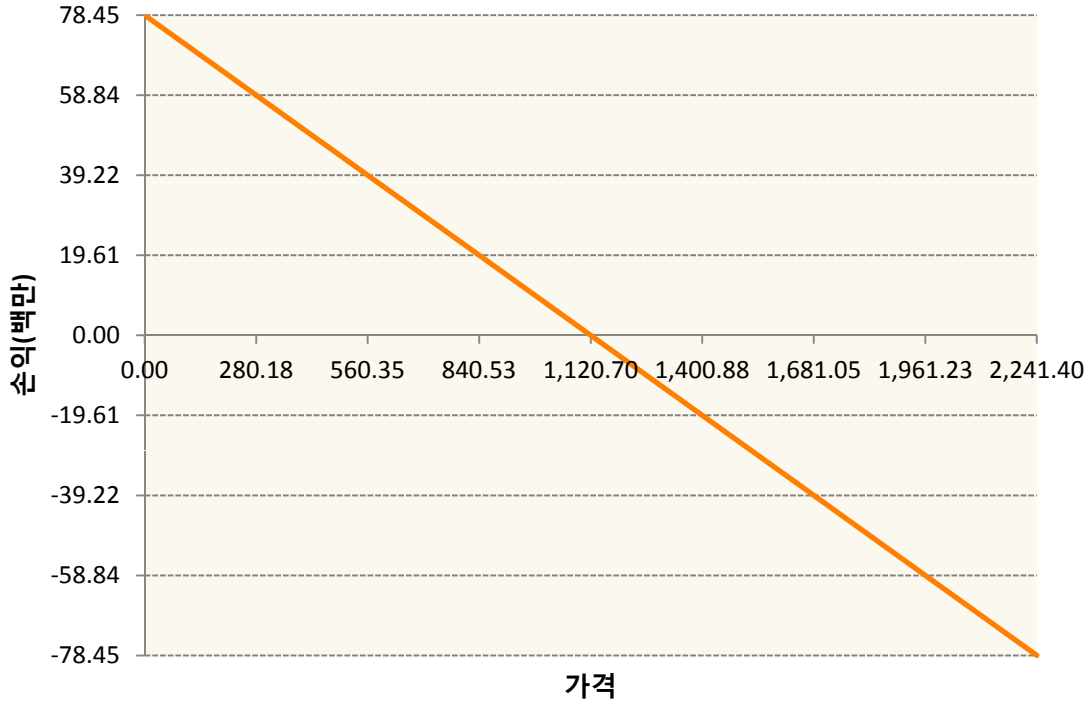


KCZ8-COFFEE 'C' FUTURE Dec18

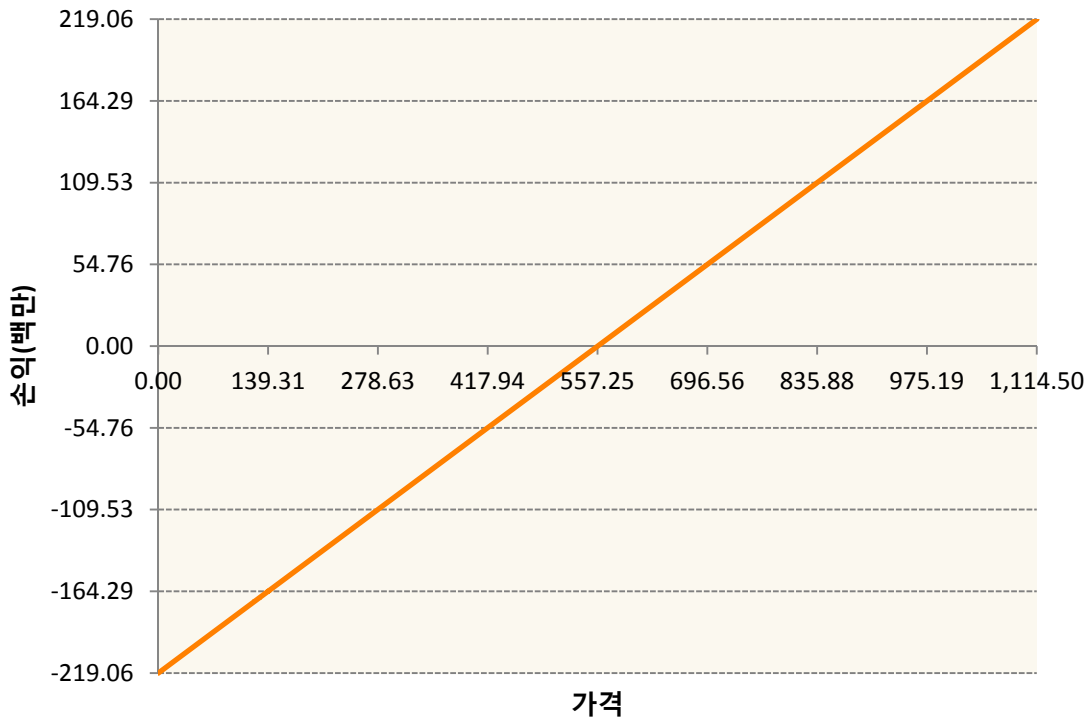




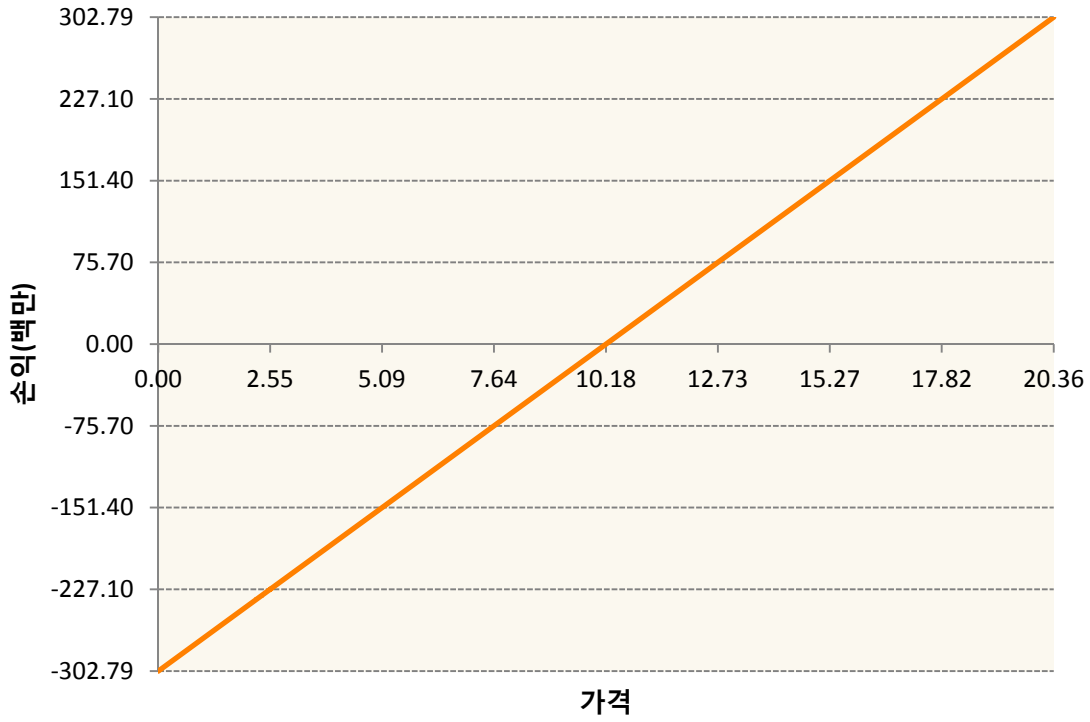
KR4175N90000-2018-09 달러선물



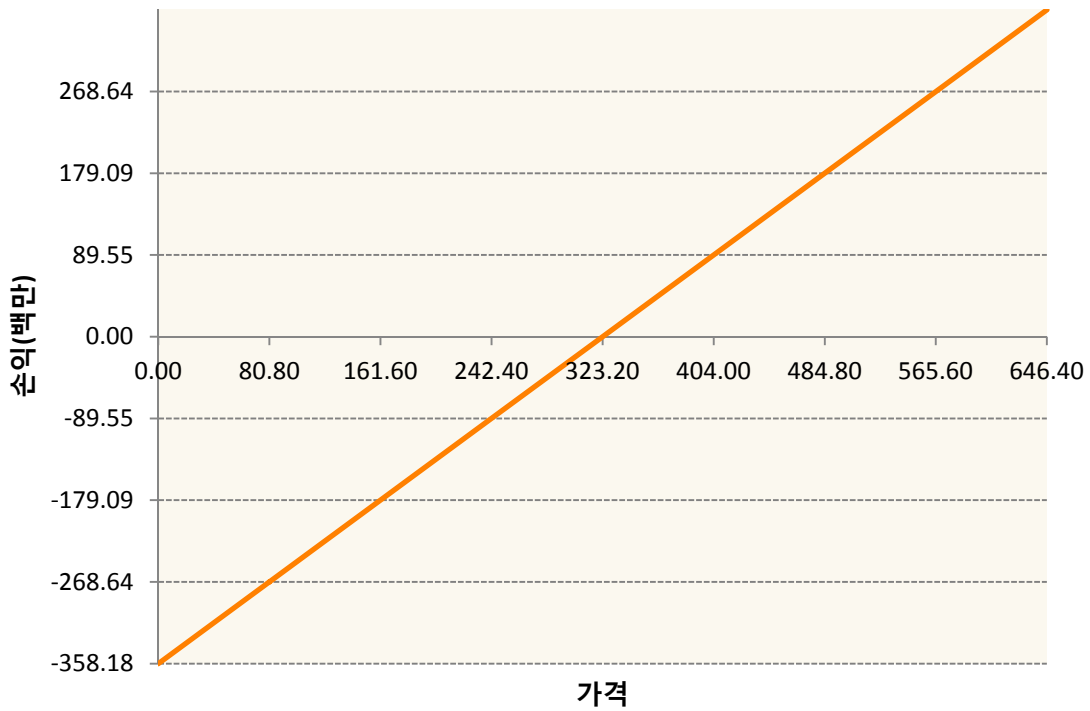
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

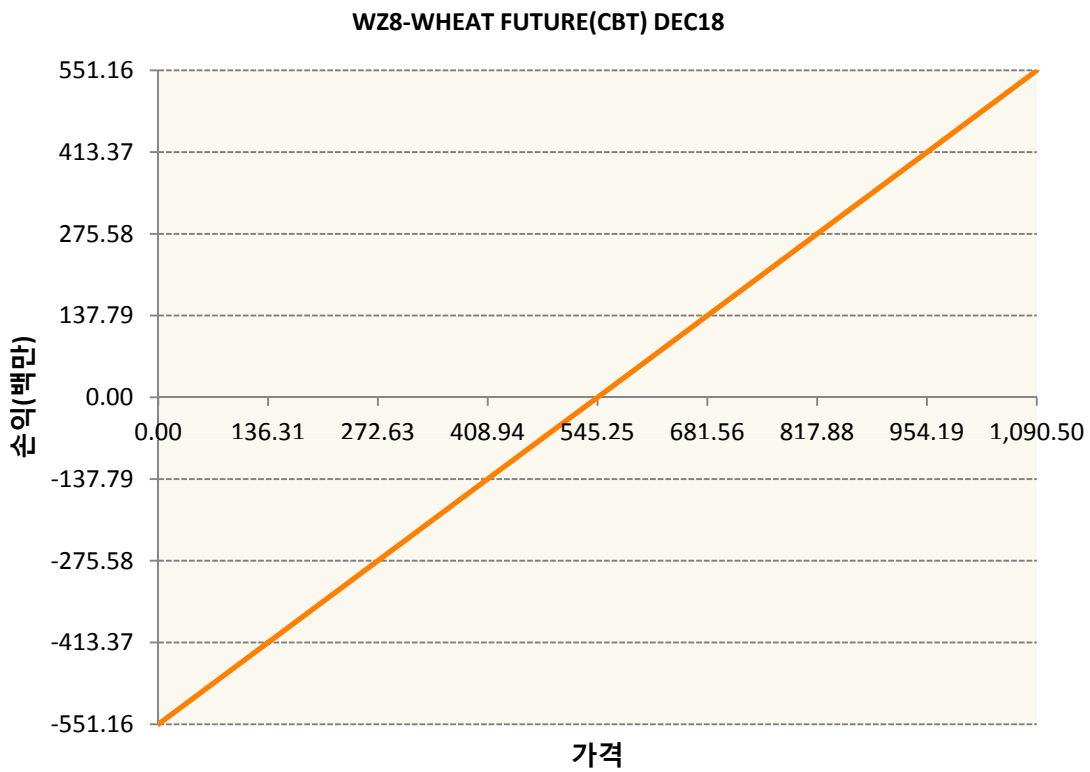
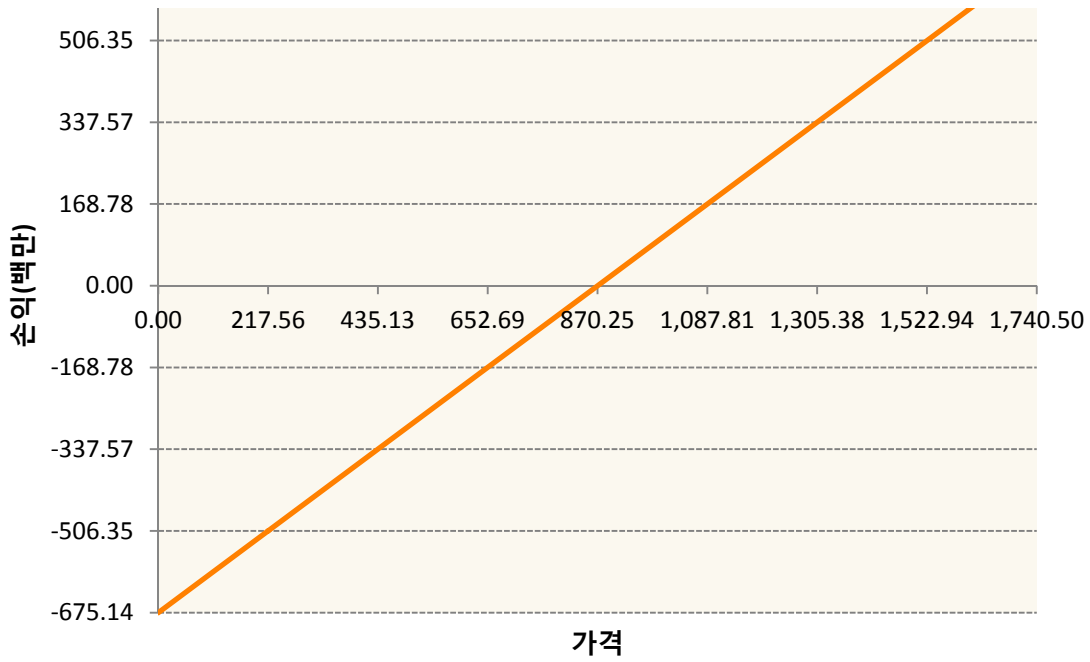


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	23
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	15
CZ8	CORN FUTURE DEC18	66
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	54
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	44

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

(단위:백만원)

312