

공시일	2018-08-27
기준일	2018-08-24

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)

67

공시일	2018-08-27
기준일	2018-08-24

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

1,140

* 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	2018-08-27
기준일	2018-08-24

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

297

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

371

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-27
기준일	2018-08-24

유로인덱스모(주식-파생형)

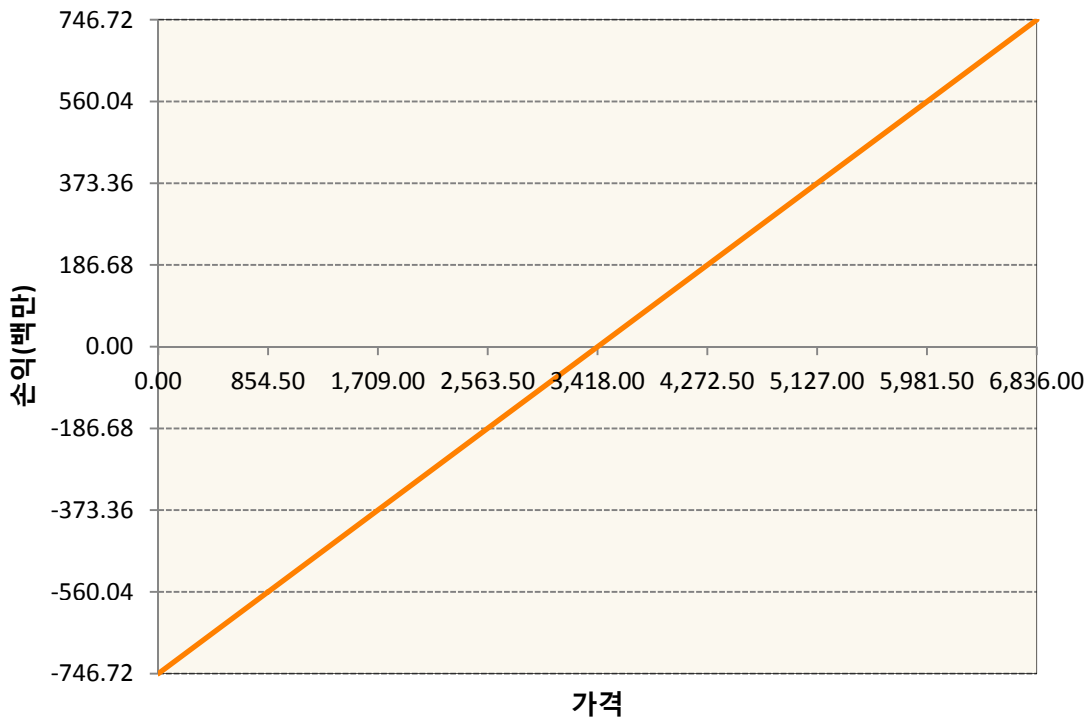
1. 계약금액

(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	2018-08-27
기준일	2018-08-24

차이나인덱스모(주식-파생형)

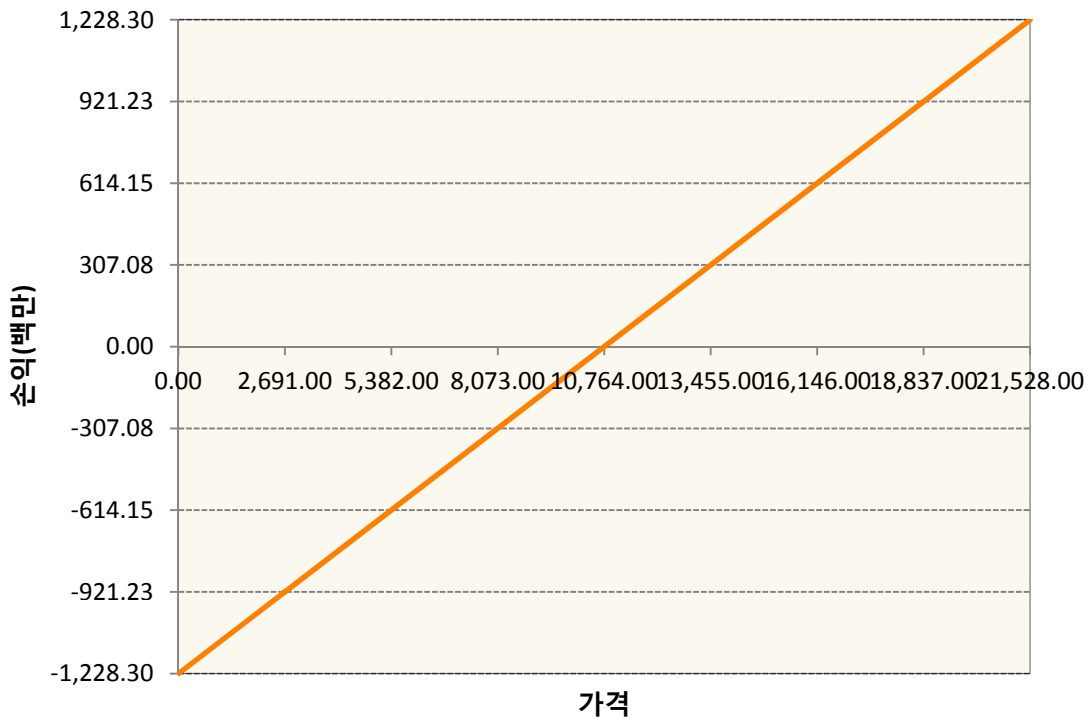
1. 계약금액

(단위:백만원)

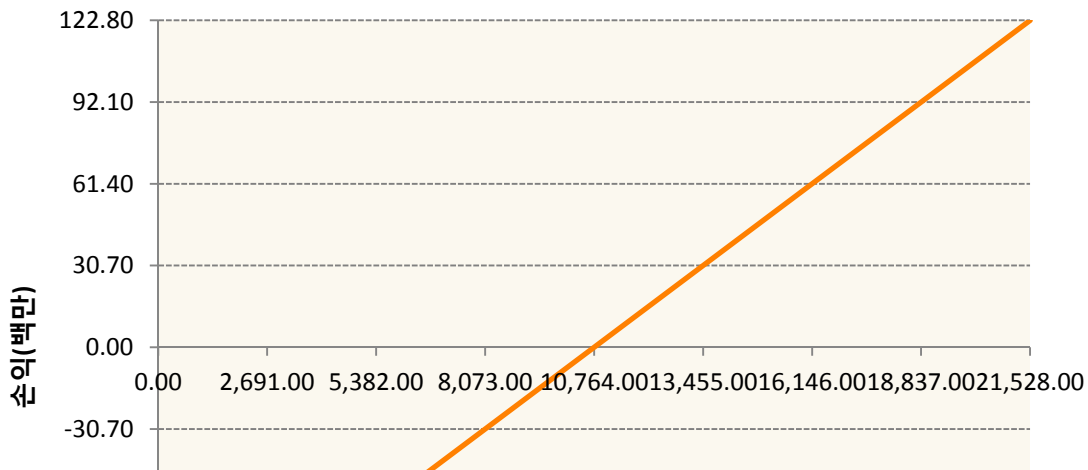
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,351	0	1,351	장내

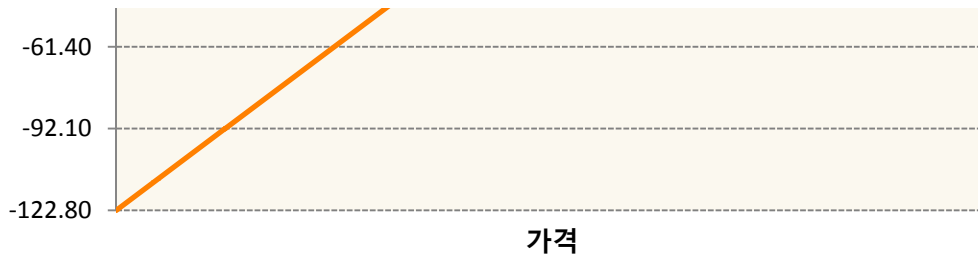
2. 만기시점의 손익구조

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	2018-08-27
기준일	2018-08-24

커버드콜모(주식혼합-파생형)

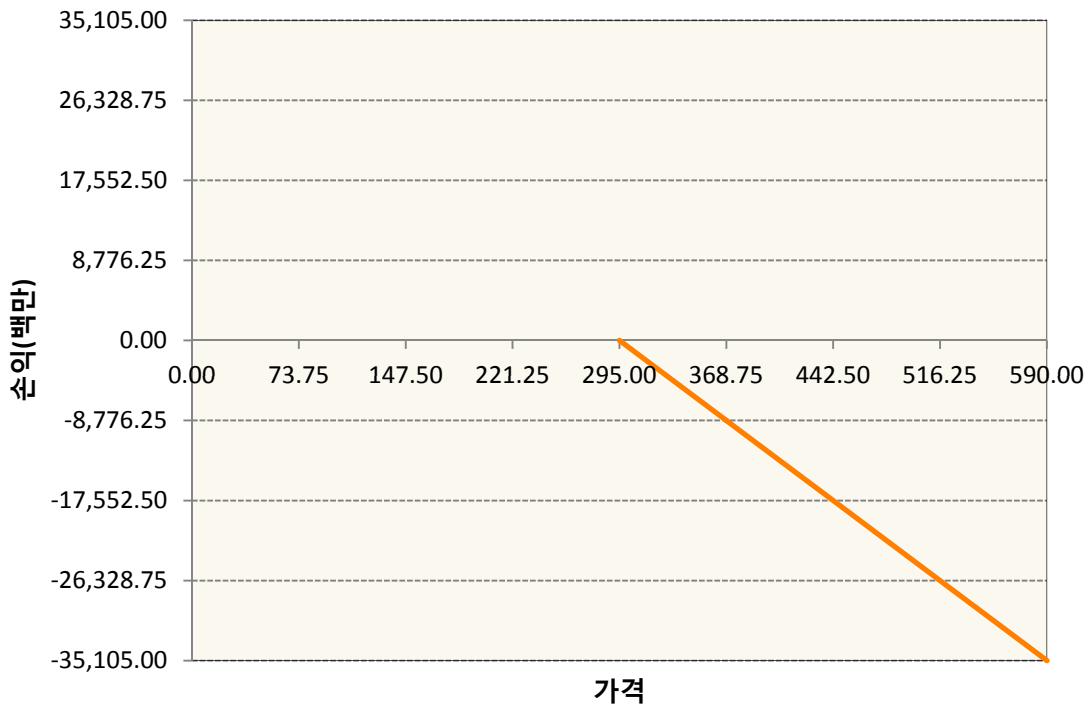
1. 계약금액

(단위:백만원)

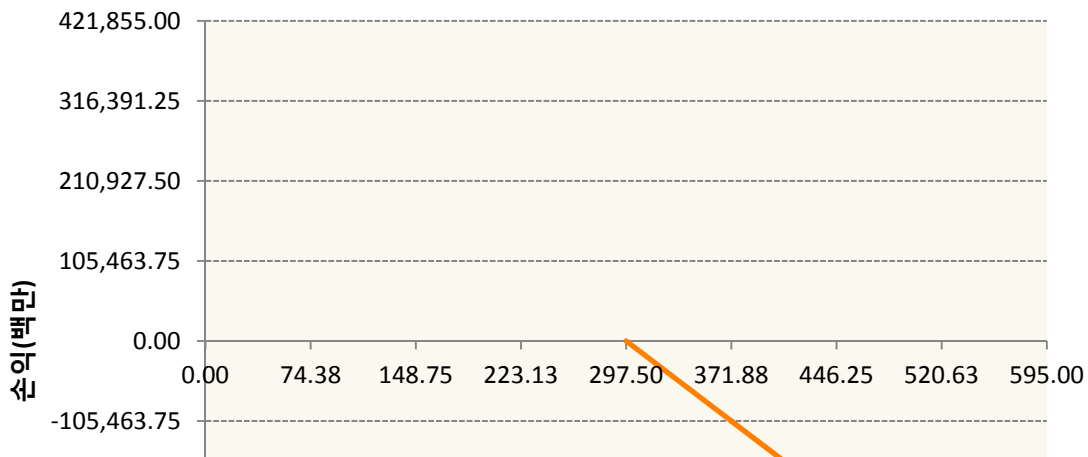
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	765,616	-765,616	장내

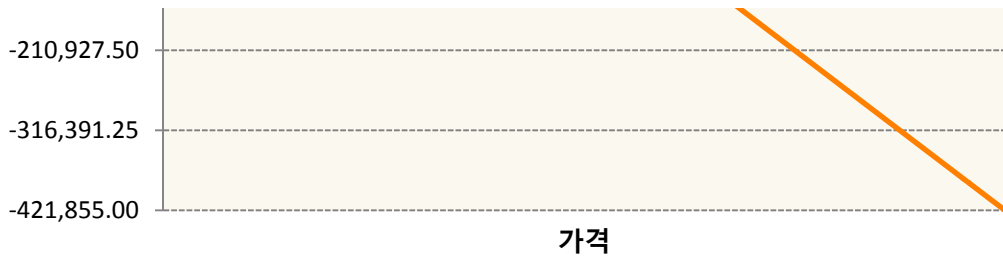
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92950-2018-09 콜295

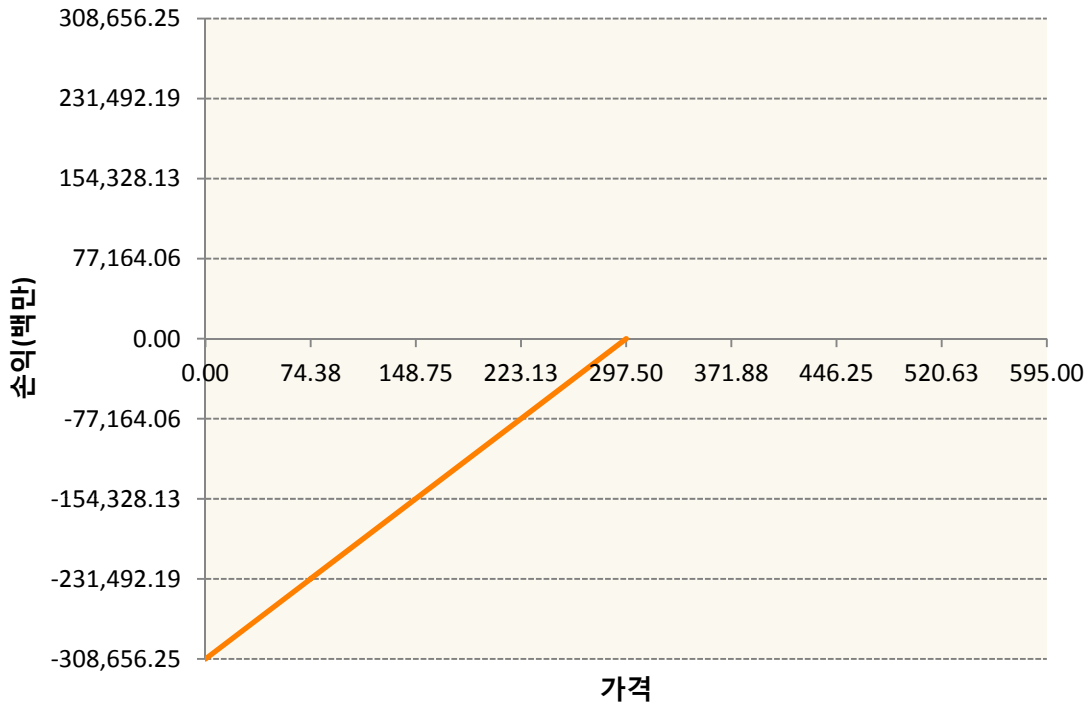


KR4201N92976-2018-09 콜297.5





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N929 2018-09 콜295

2,196

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	886	867	843	815	783	746	706
-5.33%	807	766	721	673	621	567	511
-2.67%	607	543	477	411	344	275	207
0%	221	147	74	0	-74	-147	-221
2.67%	-370	-434	-499	-566	-634	-703	-773
5.33%	-1,128	-1,170	-1,218	-1,269	-1,323	-1,380	-1,439
8.00%	-1,990	-2,012	-2,040	-2,073	-2,110	-2,152	-2,196

KR4201N929 2018-09 풋297.5

24,949

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,001	8,835	8,612	8,334	8,004	7,627	7,207

-5.33%	8,331	7,930	7,470	6,960	6,408	5,820	5,202
-2.67%	6,475	5,784	5,063	4,320	3,559	2,783	1,996
0%	2,623	1,750	875	0	-876	-1,753	-2,630
2.67%	-3,655	-4,483	-5,321	-6,169	-7,023	-7,882	-8,746
5.33%	-12,115	-12,716	-13,363	-14,047	-14,761	-15,499	-16,258
8.00%	-22,054	-22,395	-22,803	-23,270	-23,788	-24,350	-24,949

KR4301N929 2018-09 풋 297.5

22,038

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,023	-22,023	-22,023	-22,024	-22,026	-22,031	-22,038
-5.33%	-13,858	-13,864	-13,876	-13,895	-13,925	-13,965	-14,018
-2.67%	-5,830	-5,917	-6,025	-6,152	-6,295	-6,452	-6,622
0%	823	551	276	0	-278	-556	-836
2.67%	3,952	3,756	3,546	3,325	3,094	2,856	2,611
5.33%	4,533	4,496	4,443	4,373	4,285	4,181	4,061
8.00%	4,568	4,566	4,561	4,552	4,536	4,511	4,477

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

(단위:백만원)

52,877

공시일	2018-08-27
기준일	2018-08-24

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

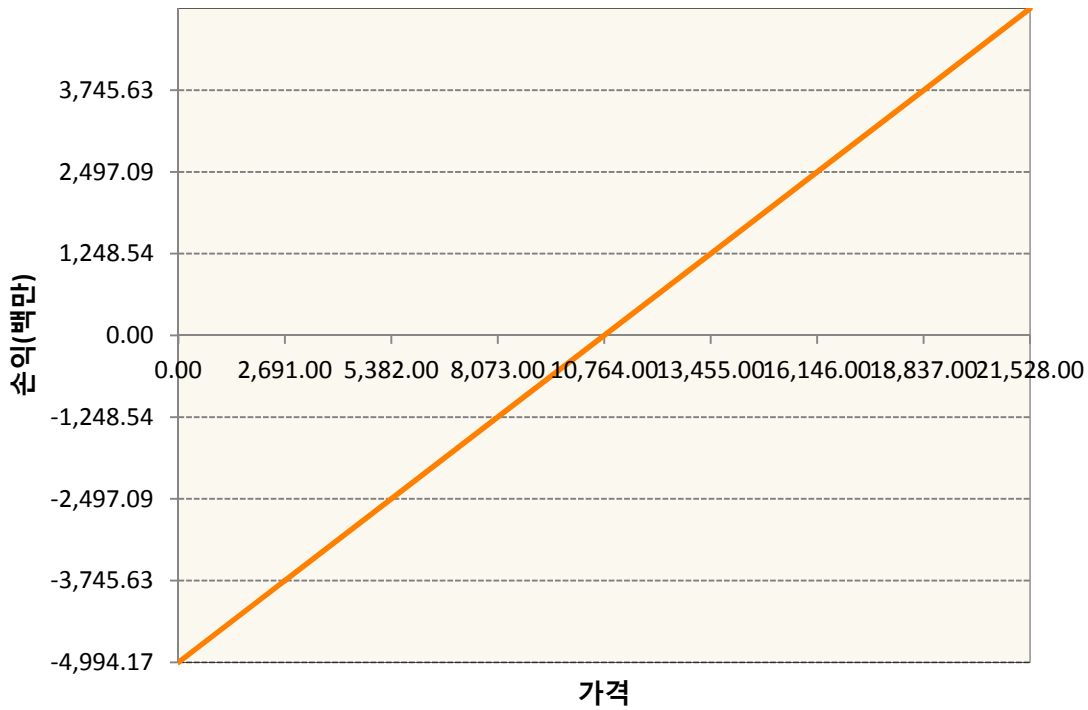
1. 계약금액

(단위:백만원)

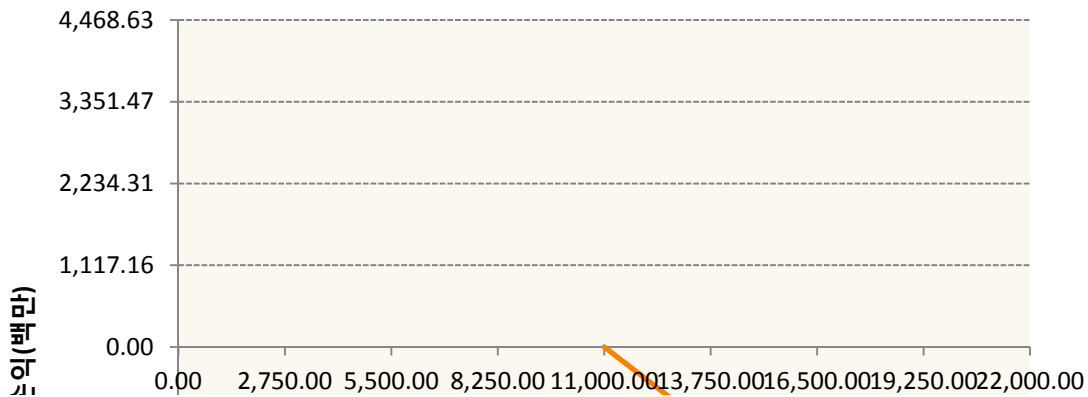
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,994	0	4,994	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,492	-11,492	장내

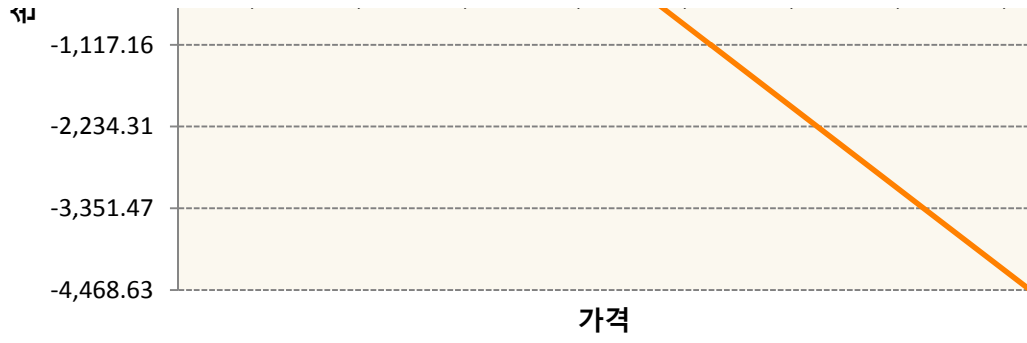
2. 만기시점의 손익구조

HCQ8-HSCEI Futures Aug18

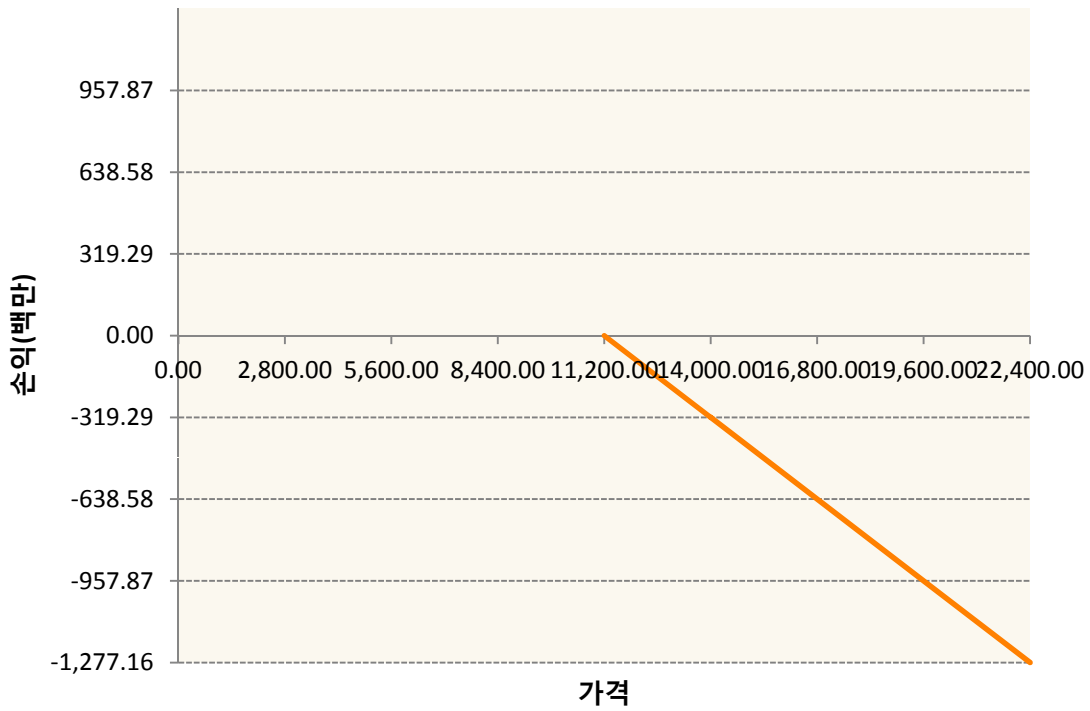


OHHIQ8-C110-HSCEI

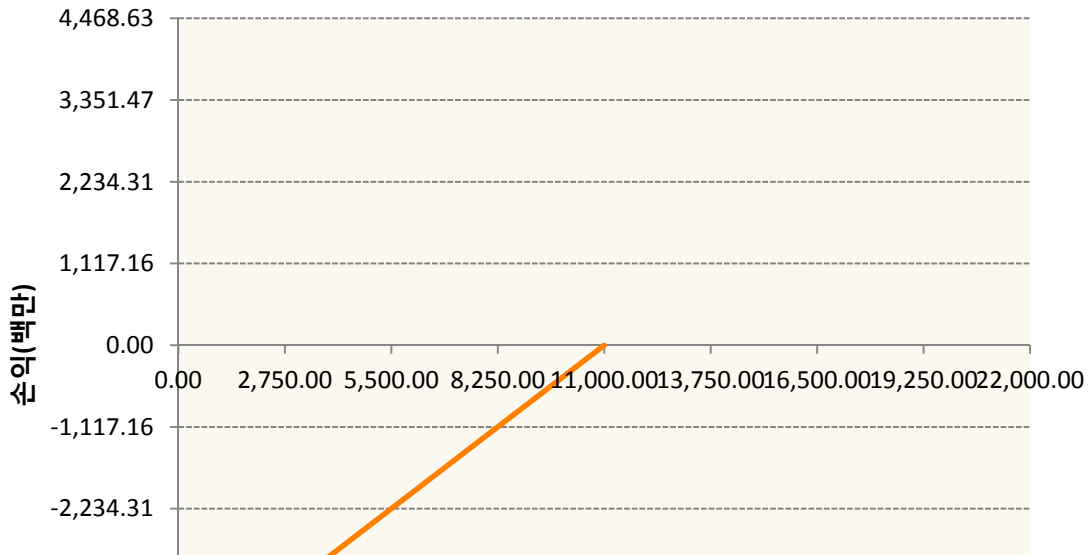


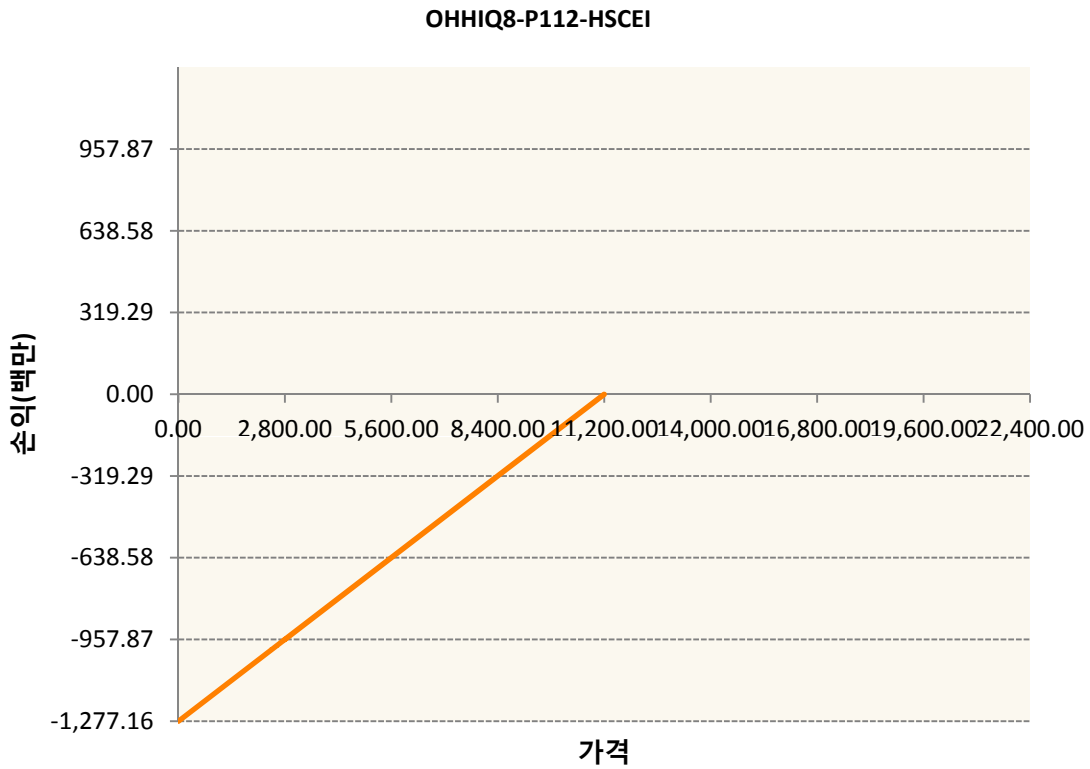
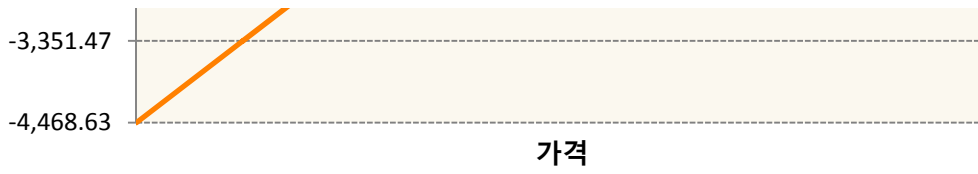


OHHIQ8-C112-HSCEI



OHHIQ8-P110-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ8	HSCEI Futures Aug18	400
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)
	1,208

공시일	2018-08-27
기준일	2018-08-24

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

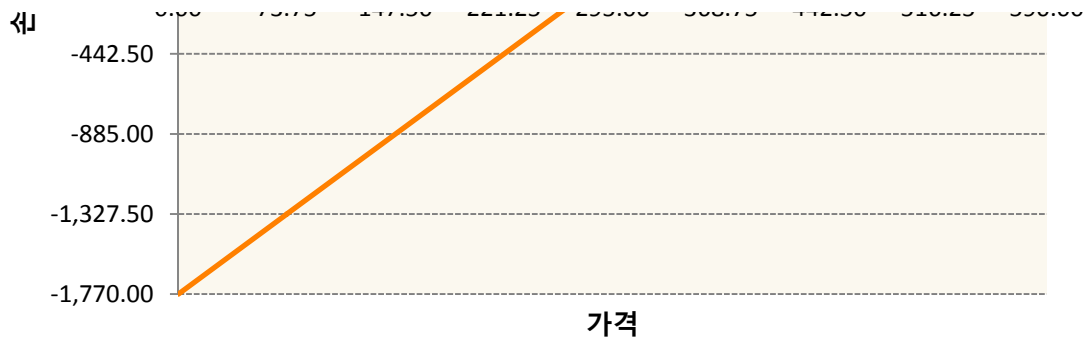
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92976-2018-09 콜297.5

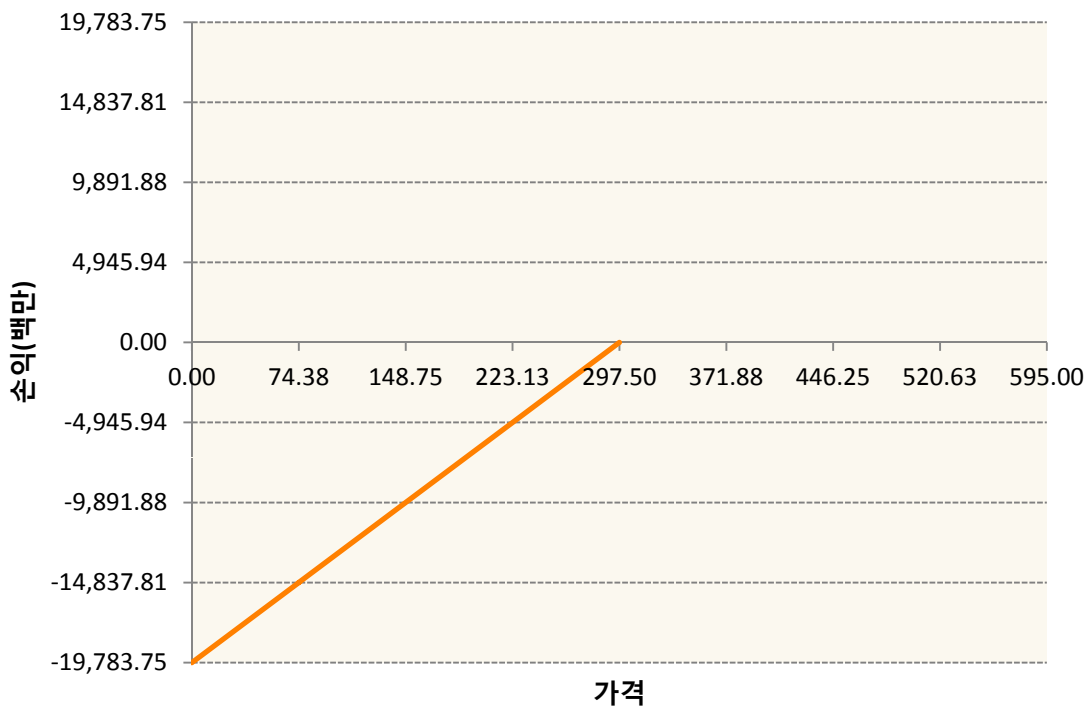


KR4301N92958-2018-09 풋295





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,969
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,969	-3,969	-3,969	-3,969	-3,969	-3,969	-3,969
-5.33%	-2,646	-2,646	-2,646	-2,646	-2,646	-2,646	-2,646
-2.67%	-1,323	-1,323	-1,323	-1,323	-1,323	-1,323	-1,323
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,323	1,323	1,323	1,323	1,323	1,323	1,323
5.33%	2,646	2,646	2,646	2,646	2,646	2,646	2,646
8.00%	3,969	3,969	3,969	3,969	3,969	3,969	3,969
KR4201N92974-2018-09 풋297.5							1,663
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	600	589	574	555	533	508	480
-5.33%	555	528	498	464	427	388	347
-2.67%	431	385	337	288	237	185	133
0%	175	117	58	0	-58	-117	-175
2.67%	-244	-299	-355	-411	-468	-525	-583
5.33%	-807	-847	-891	-936	-984	-1,033	-1,083
8.00%	-1,470	-1,492	-1,520	-1,551	-1,585	-1,623	-1,663

KR4301N929 2018-09 풋295

121

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-121	-121	-121	-121	-121	-121	-121
-5.33%	-73	-73	-74	-74	-74	-74	-75
-2.67%	-28	-29	-30	-31	-32	-33	-34
0%	5	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	17	16	15	14	13	12	11
5.33%	18	18	18	18	17	17	17
8.00%	18	18	18	18	18	18	18

KR4301N929 2018-09 풋297.5

1,413

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,412	-1,412	-1,412	-1,412	-1,412	-1,412	-1,413
-5.33%	-888	-889	-889	-891	-893	-895	-898
-2.67%	-374	-379	-386	-394	-403	-414	-424
0%	53	35	18	0	-18	-36	-54
2.67%	253	241	227	213	198	183	167
5.33%	291	288	285	280	275	268	260
8.00%	293	293	292	292	291	289	287

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

(단위:백만원)

7,425

공시일	2018-08-27
기준일	2018-08-24

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

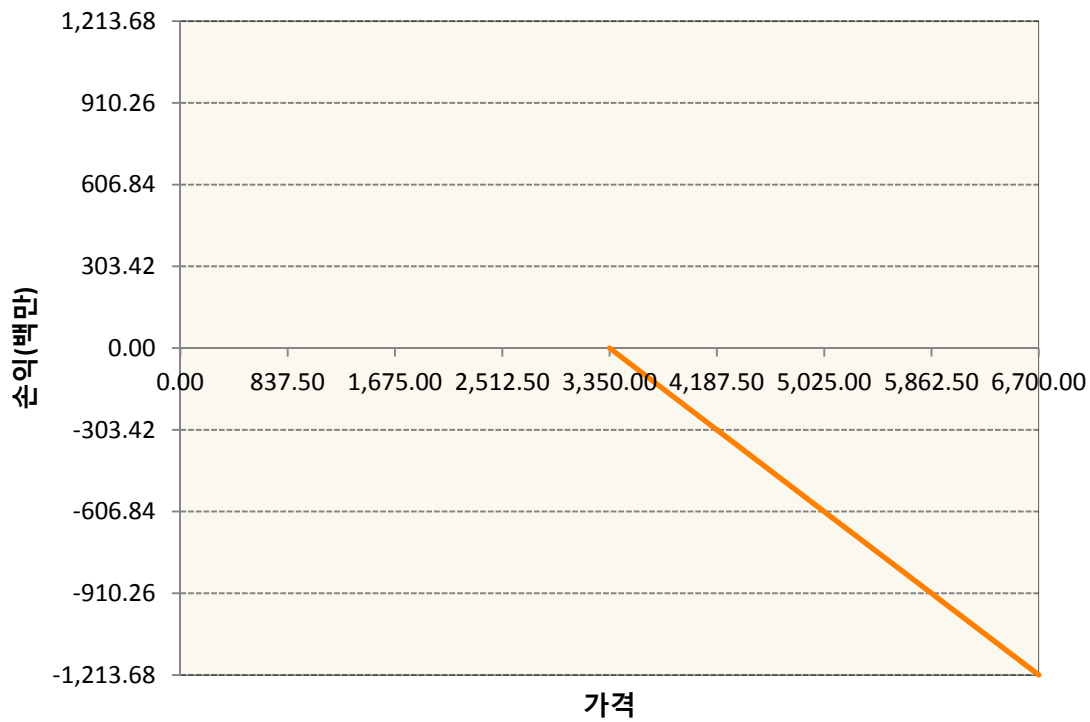
1. 계약금액

(단위:백만원)

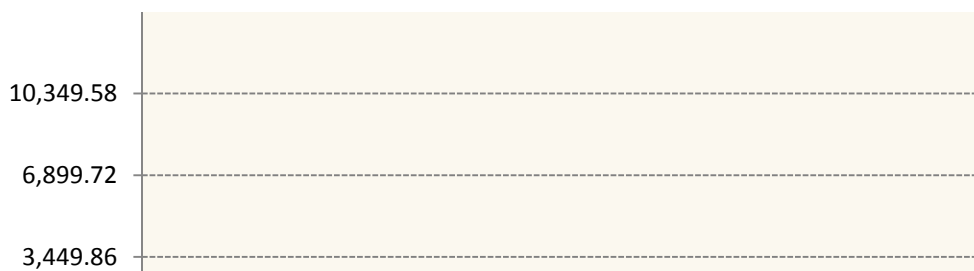
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	8,150	0	8,150	
누계	유가증권	옵션	0	30,026	-30,026	장내
누계	지수	스왑	86,697	0	86,697	장외

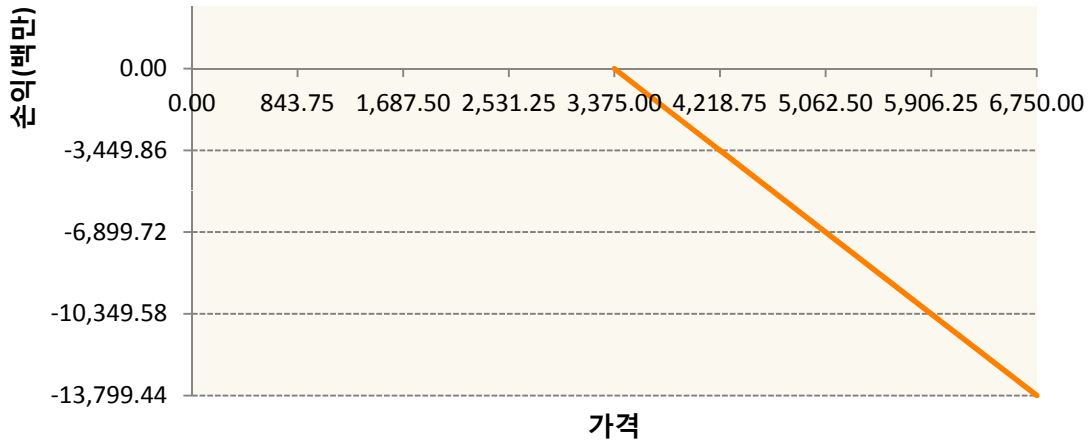
2. 만기시점의 손익구조

OESXU8-C3350-EURO STOXX 50

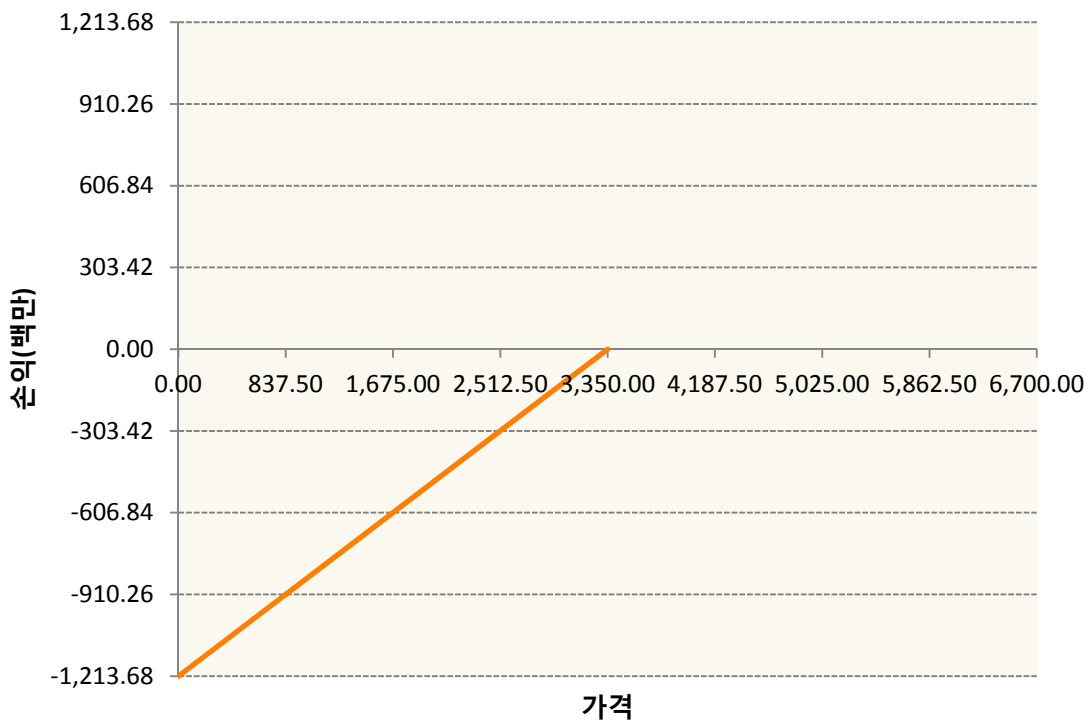


OESXU8-C3375-EURO STOXX 50

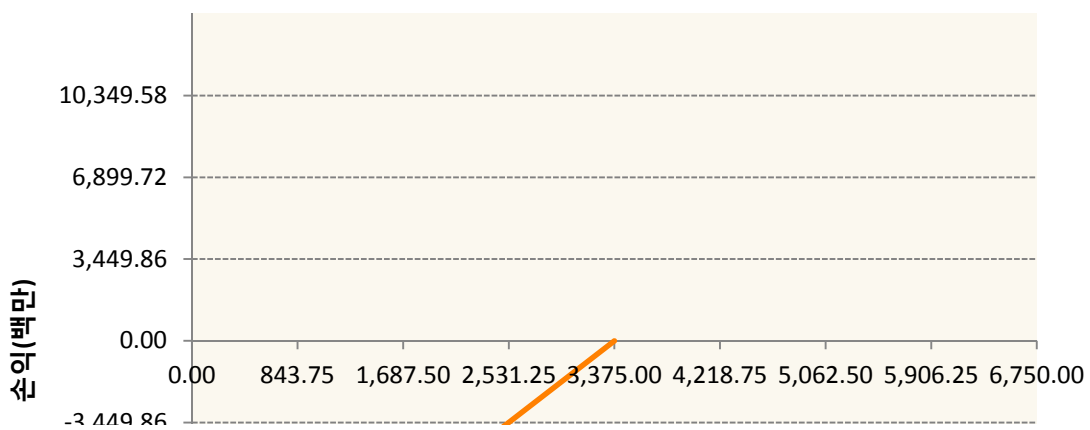


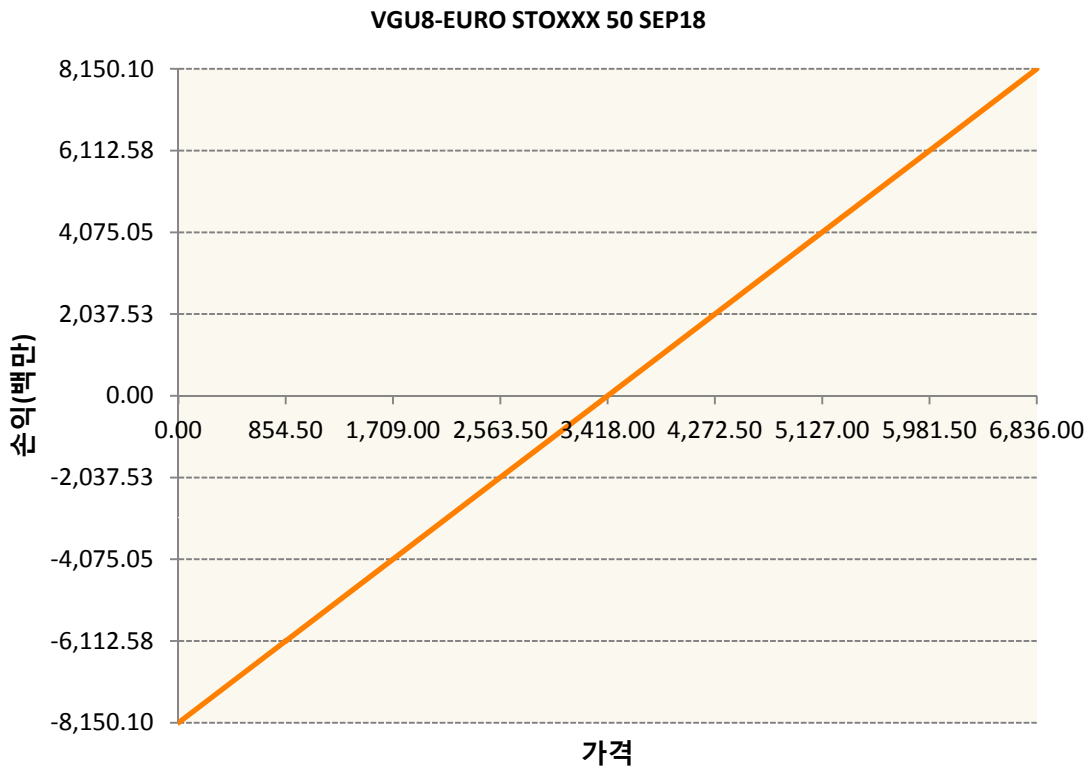
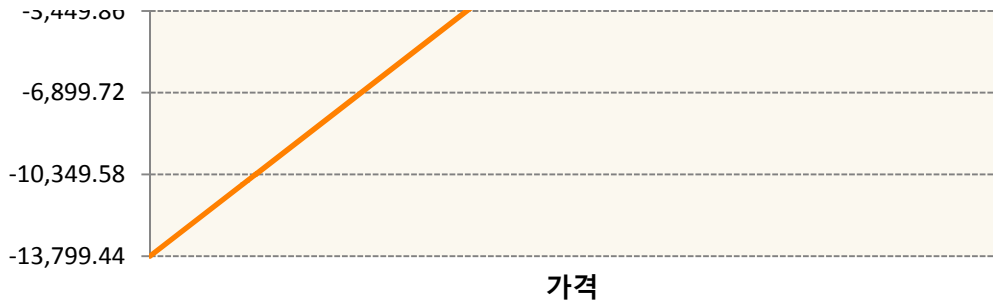


OESXU8-P3350-EURO STOXX 50



OESXU8-P3375-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	21
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY	14
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	652

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

1,932

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

(단위:백만원)

1,127

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)

160

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-08-27
기준일	2018-08-24

리디파인K200(주식혼합-파생재간

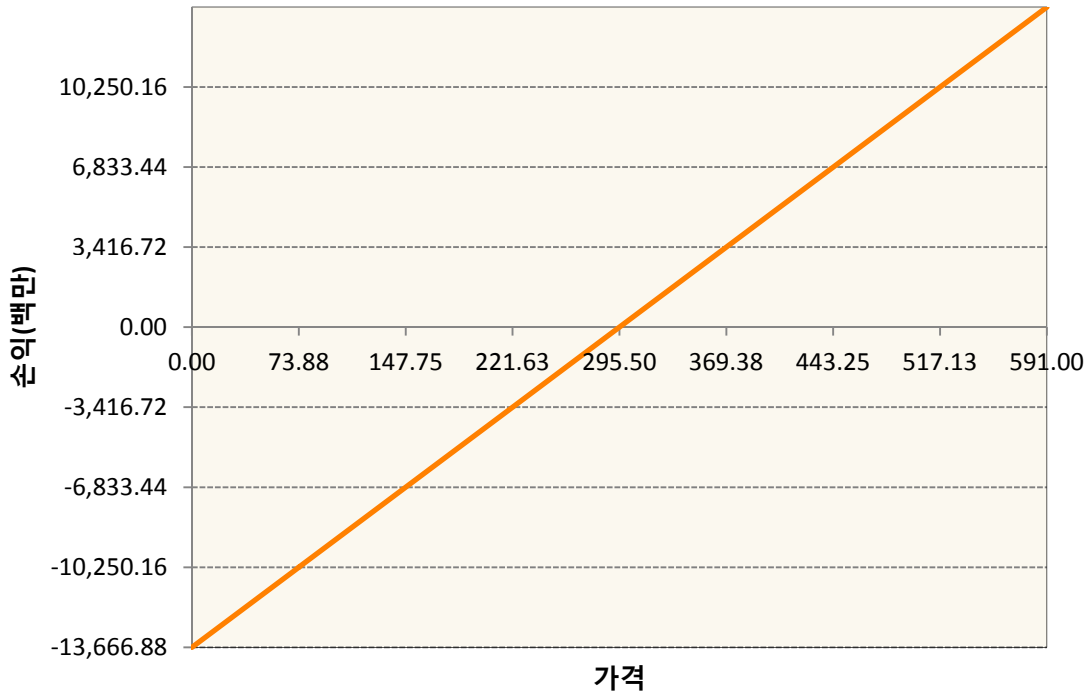
1. 계약금액

(단위:백만원)

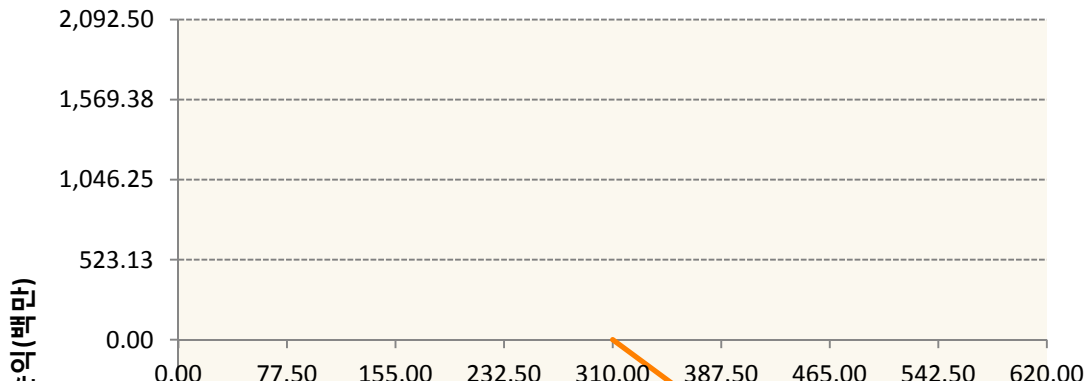
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,667	0	13,667	장내
누계	유가증권	옵션	1,339	24,671	-23,332	장내

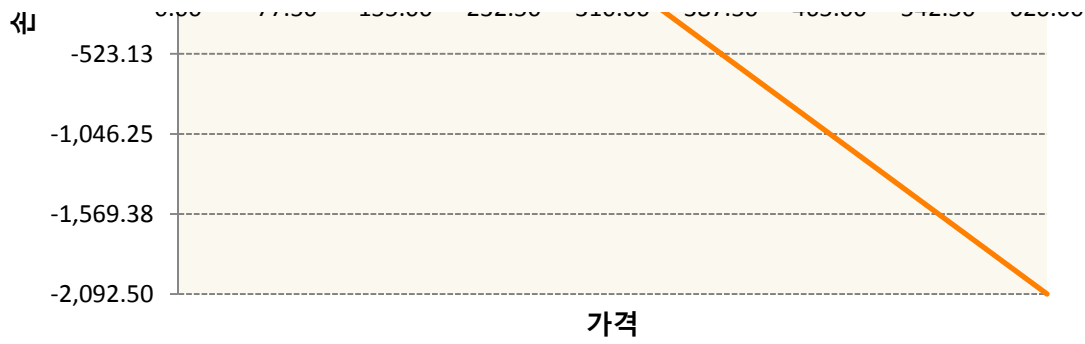
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

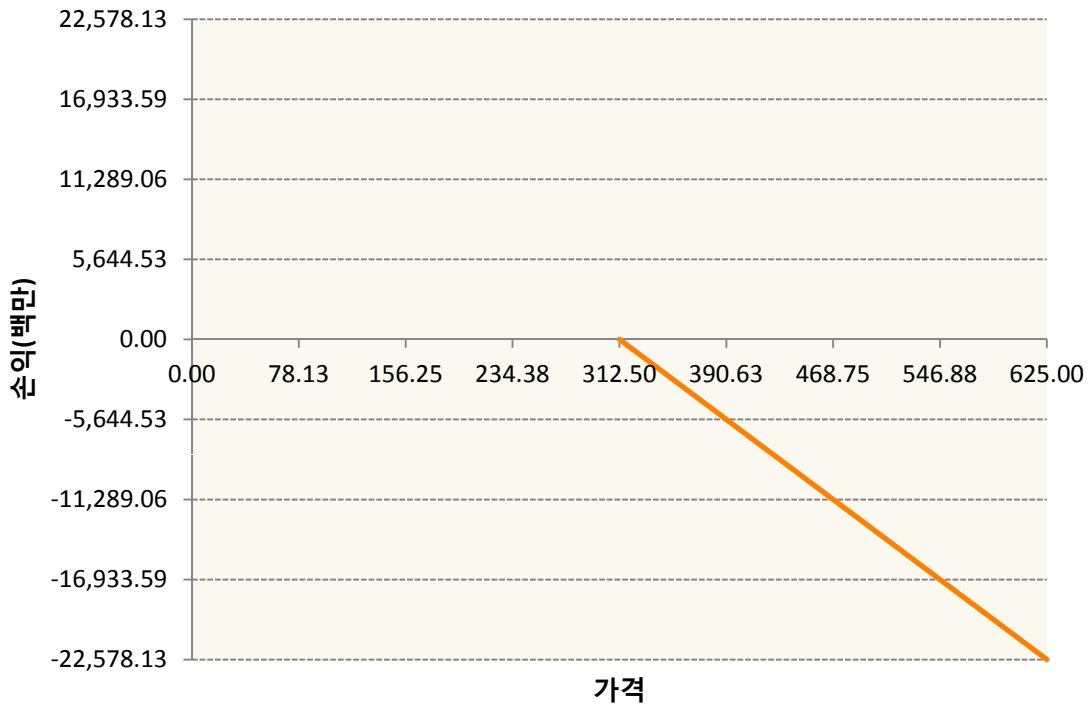


KR4201N93107-2018-09 콜310

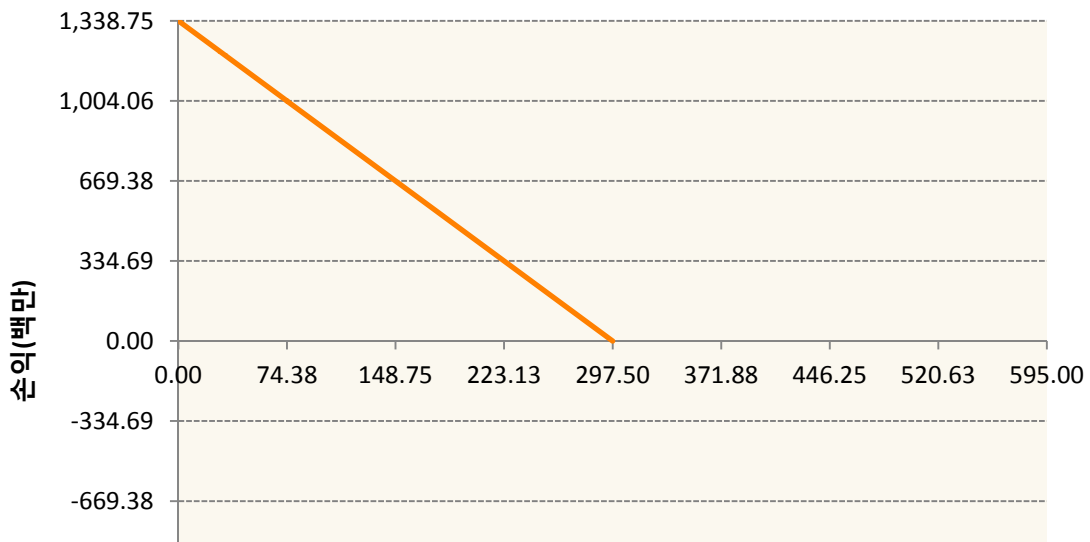


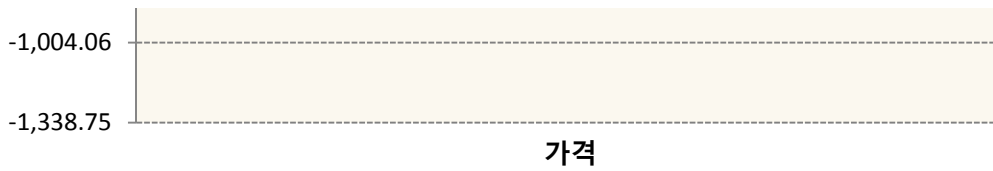


KR4201N93123-2018-09 콜312.5



KR4301N92974-2018-09 풋297.5





가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물							1,093
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,093	-1,093	-1,093	-1,093	-1,093	-1,093	-1,093
-5.33%	-729	-729	-729	-729	-729	-729	-729
-2.67%	-364	-364	-364	-364	-364	-364	-364
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	364	364	364	364	364	364	364
5.33%	729	729	729	729	729	729	729
8.00%	1,093	1,093	1,093	1,093	1,093	1,093	1,093
KR4201N9312018-09 콜310							85
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17	16	16	16	15	14	14
-5.33%	16	16	15	14	13	11	10
-2.67%	14	13	11	9	7	5	2
0%	9	6	3	0	-3	-7	-10
2.67%	-4	-8	-12	-16	-20	-24	-29
5.33%	-27	-32	-36	-40	-45	-49	-54
8.00%	-61	-65	-69	-73	-77	-81	-85
KR4201N9312018-09 콜312.5							839
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	142	141	139	136	131	125	117
-5.33%	139	135	129	121	110	97	81
-2.67%	126	115	100	82	62	39	14
0%	82	57	30	0	-32	-66	-101
2.67%	-27	-67	-107	-148	-190	-233	-276
5.33%	-239	-286	-333	-380	-427	-475	-522
8.00%	-569	-612	-657	-702	-747	-793	-839
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%	60	60	60	60	60	61	61
-2.67%	25	26	26	27	27	28	29

0%	-4	-2	-1	0	1	2	4
2.67%	-17	-16	-15	-14	-13	-12	-11
5.33%	-20	-20	-19	-19	-19	-18	-18
8.00%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-19

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

(단위:백만원)

1,597

공시일	2018-08-27
기준일	2018-08-24

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

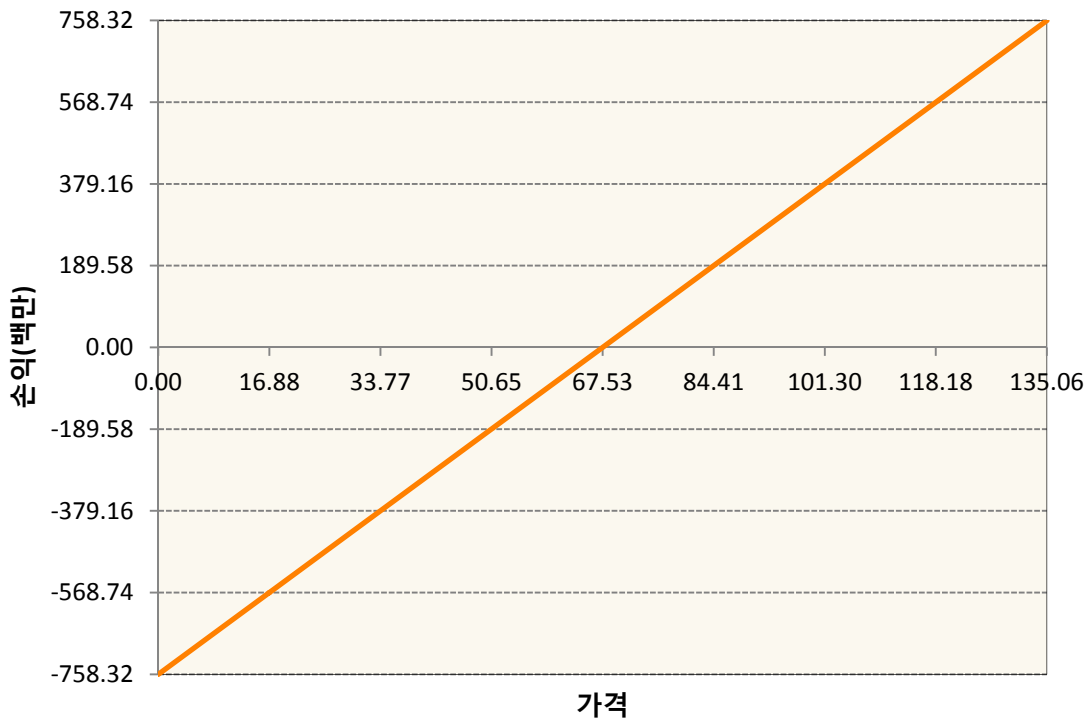
1. 계약금액

(단위:백만원)

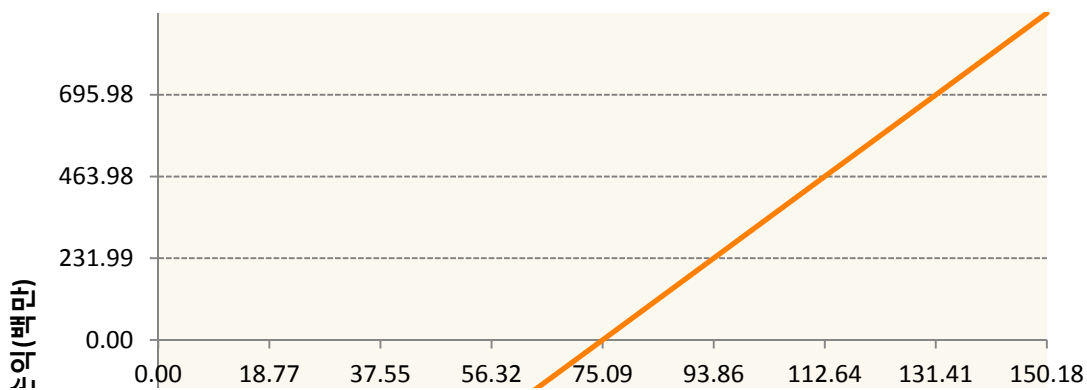
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,148	615	2,533	
누계	유가증권	선물	515	0	515	장내

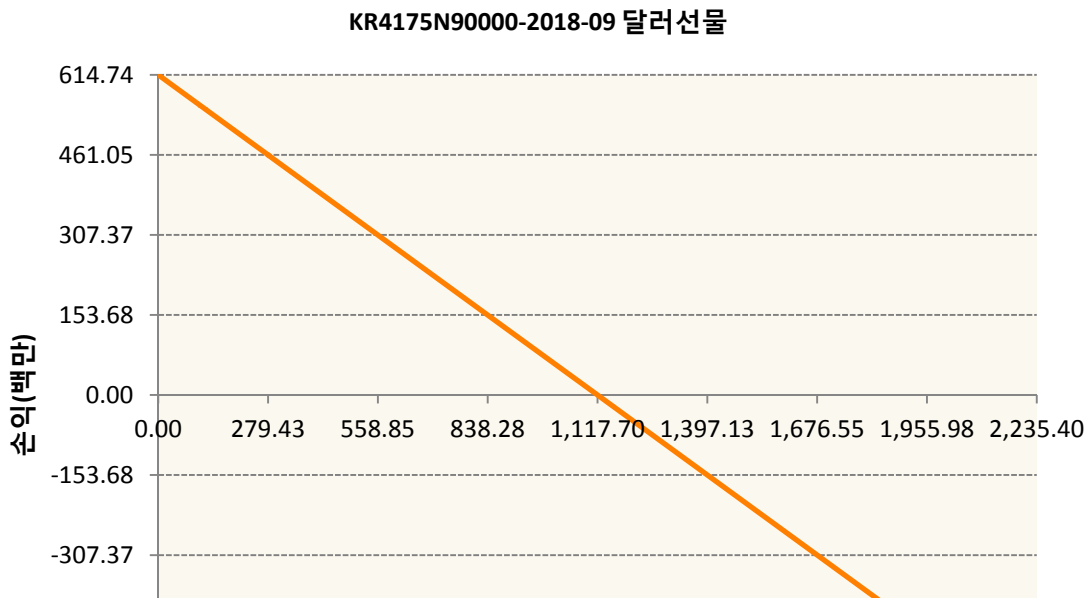
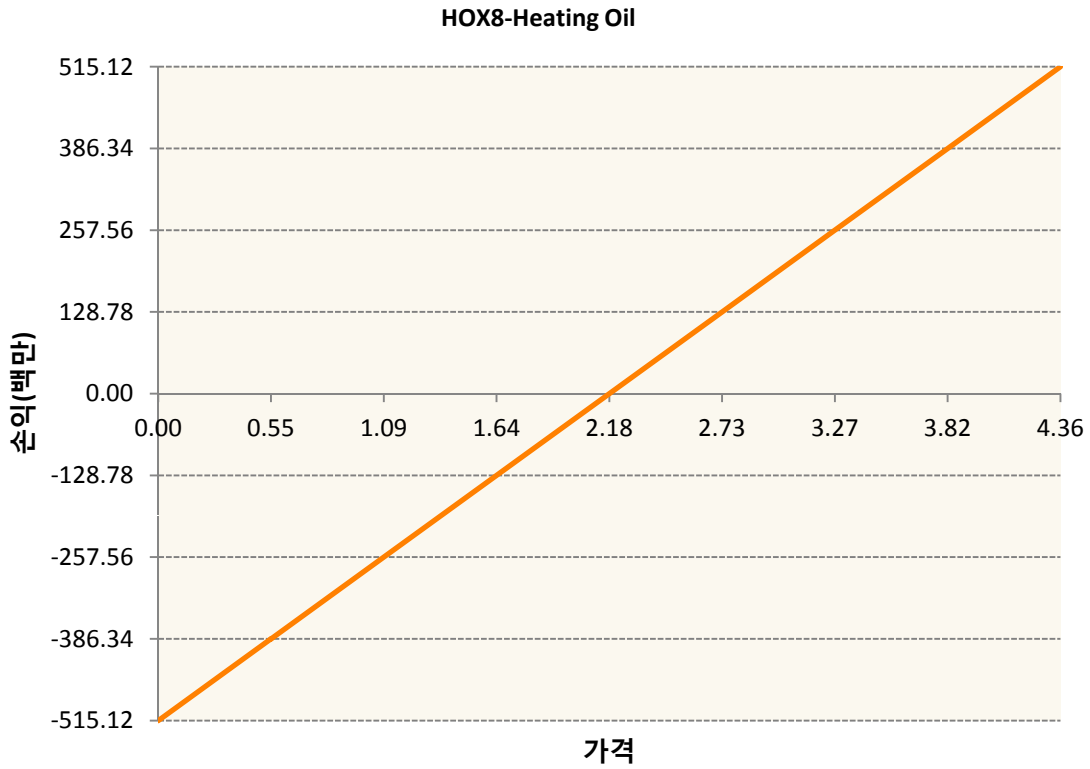
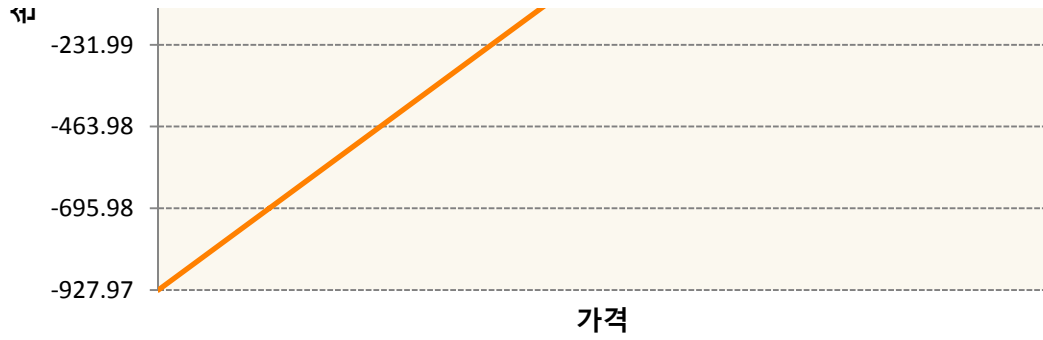
2. 만기시점의 손익구조

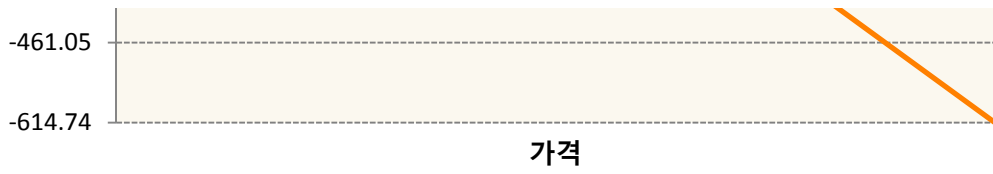
CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18



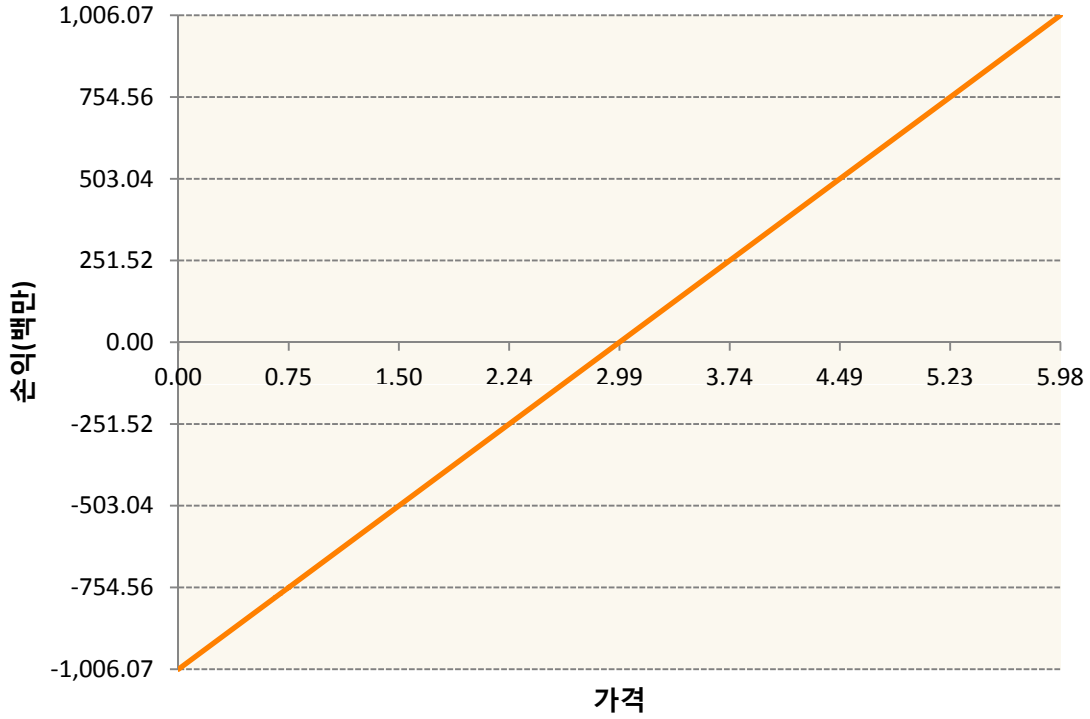
COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18



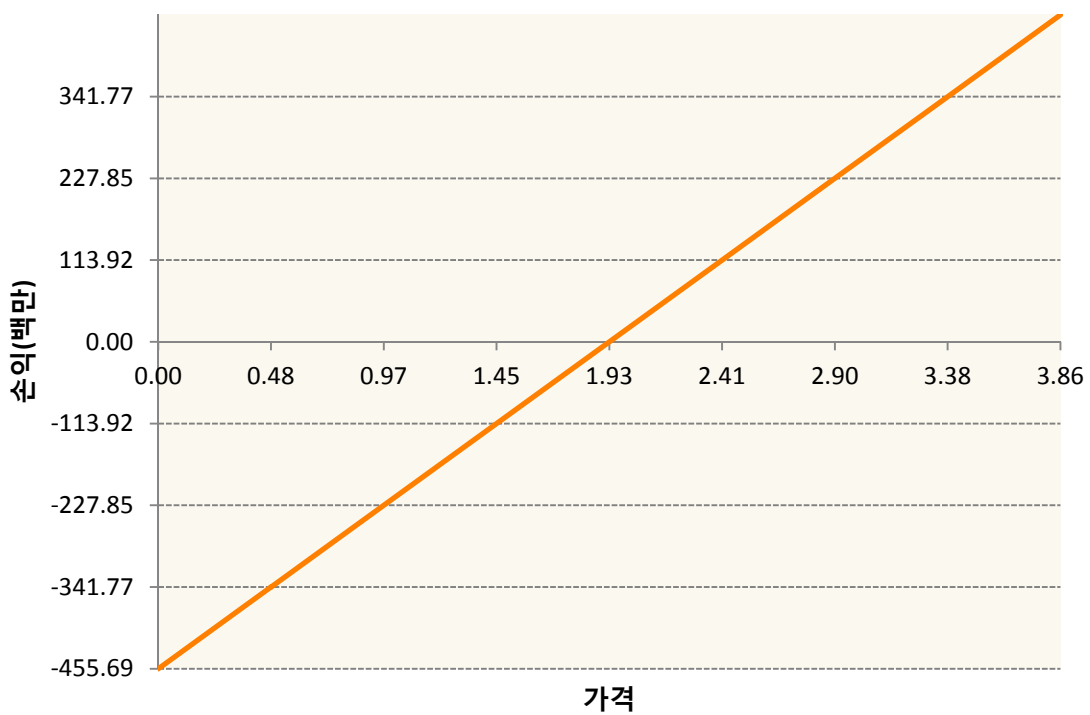




NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18



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	36

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

공시일	2018-08-27
기준일	2018-08-24

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

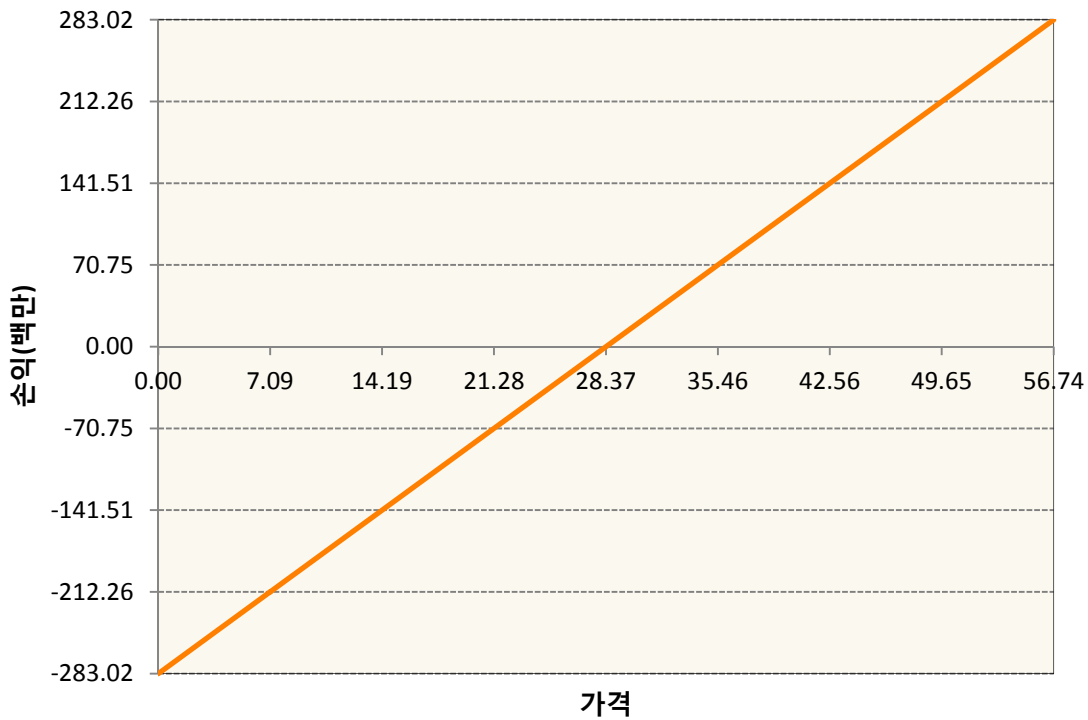
1. 계약금액

(단위:백만원)

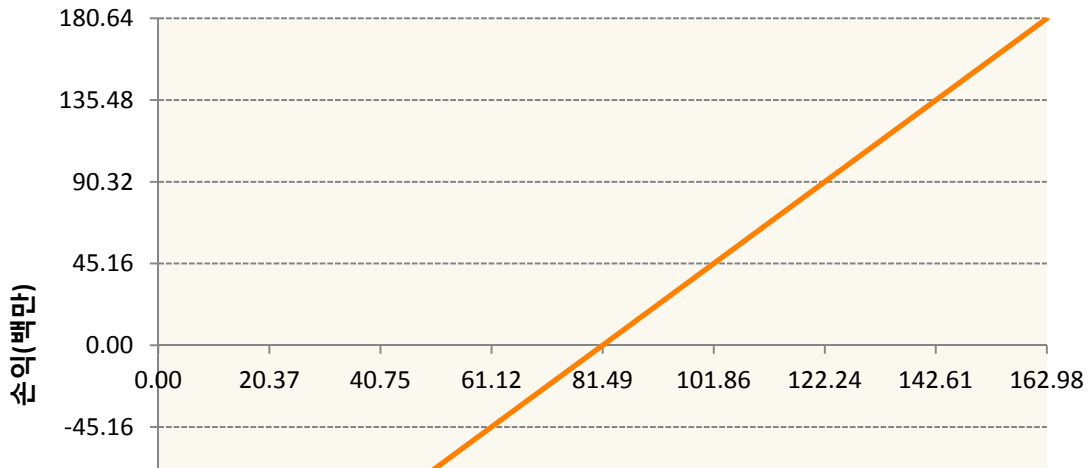
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,611	78	3,533	

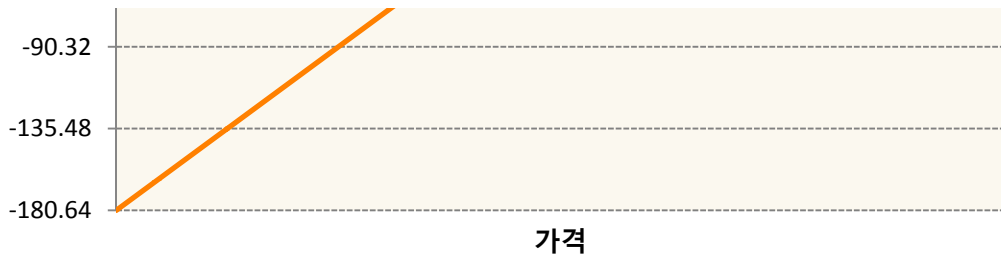
2. 만기시점의 손익구조

BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18

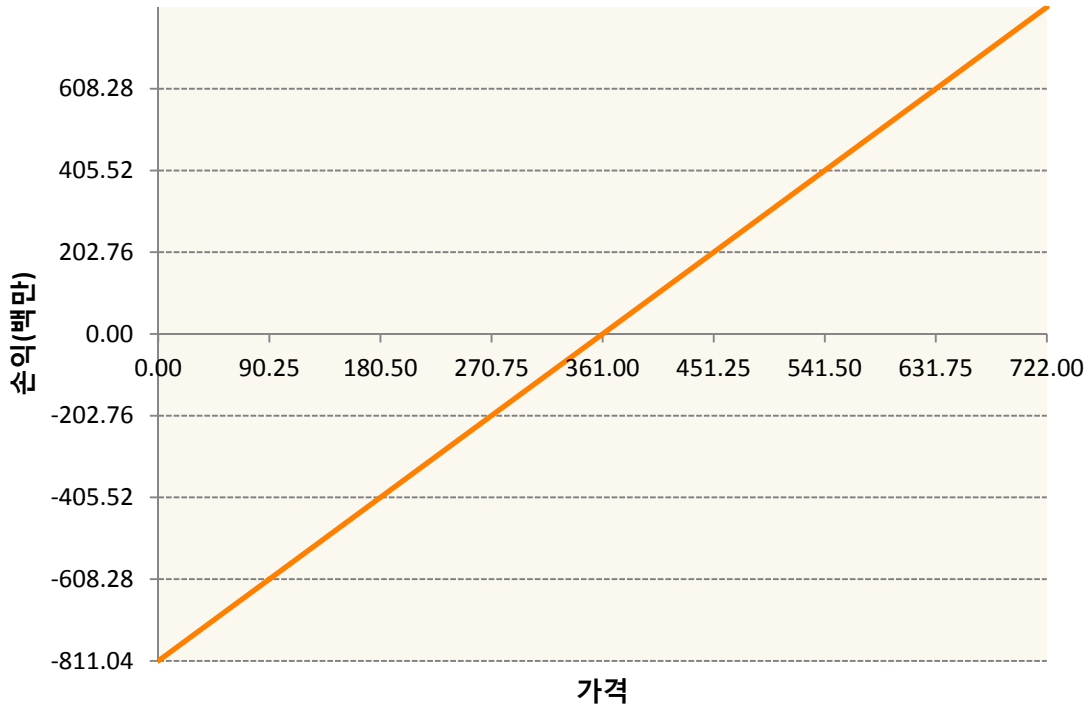


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

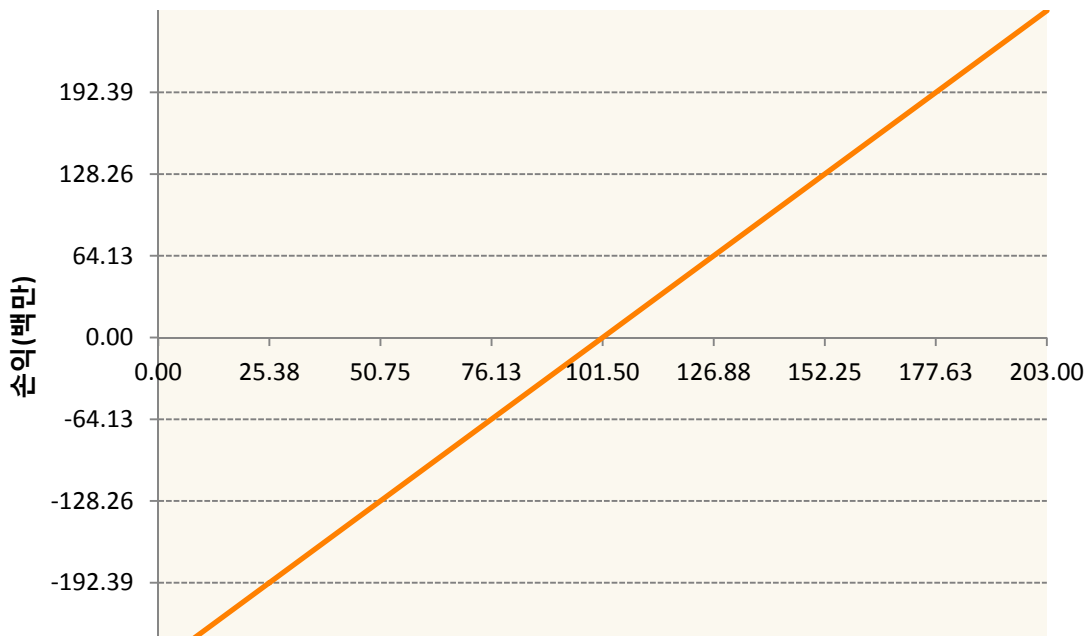


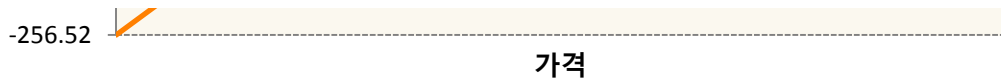


CZ8-CORN FUTURE DEC18



KCZ8-COFFEE 'C' FUTURE Dec18

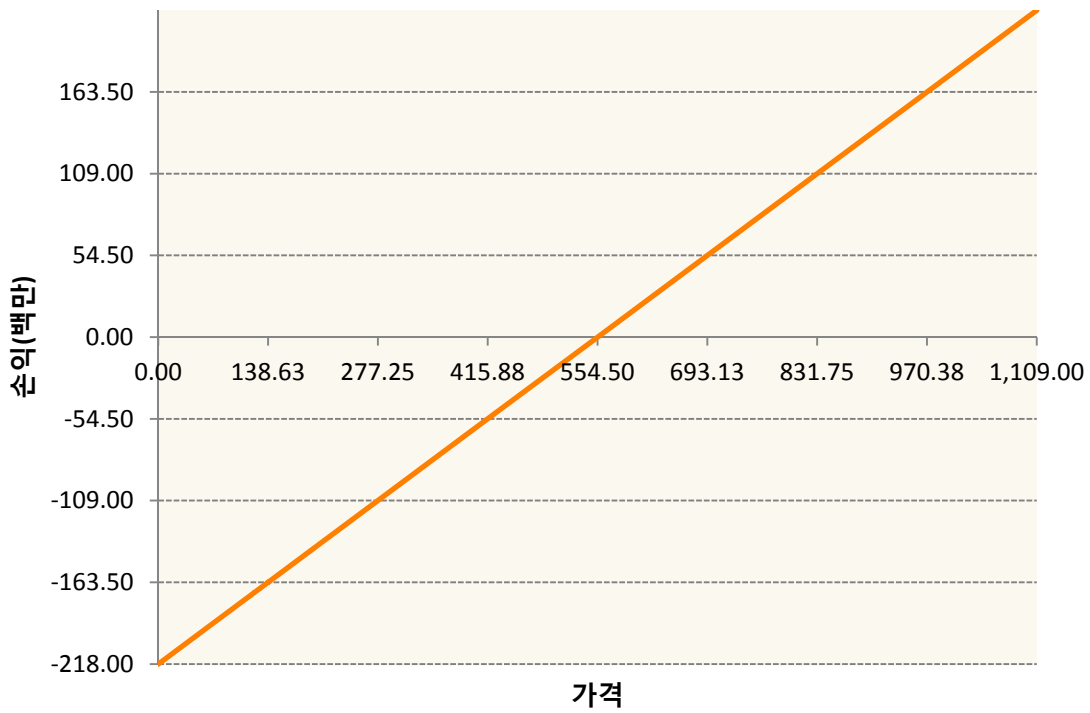




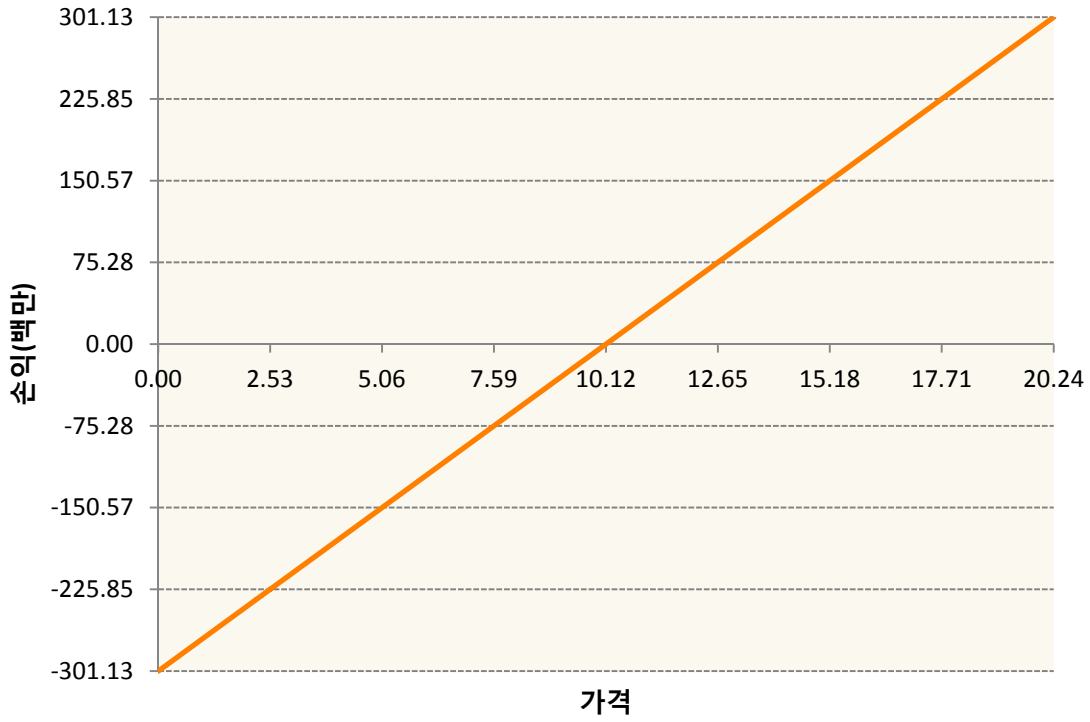
KR4175N90000-2018-09 달러선물



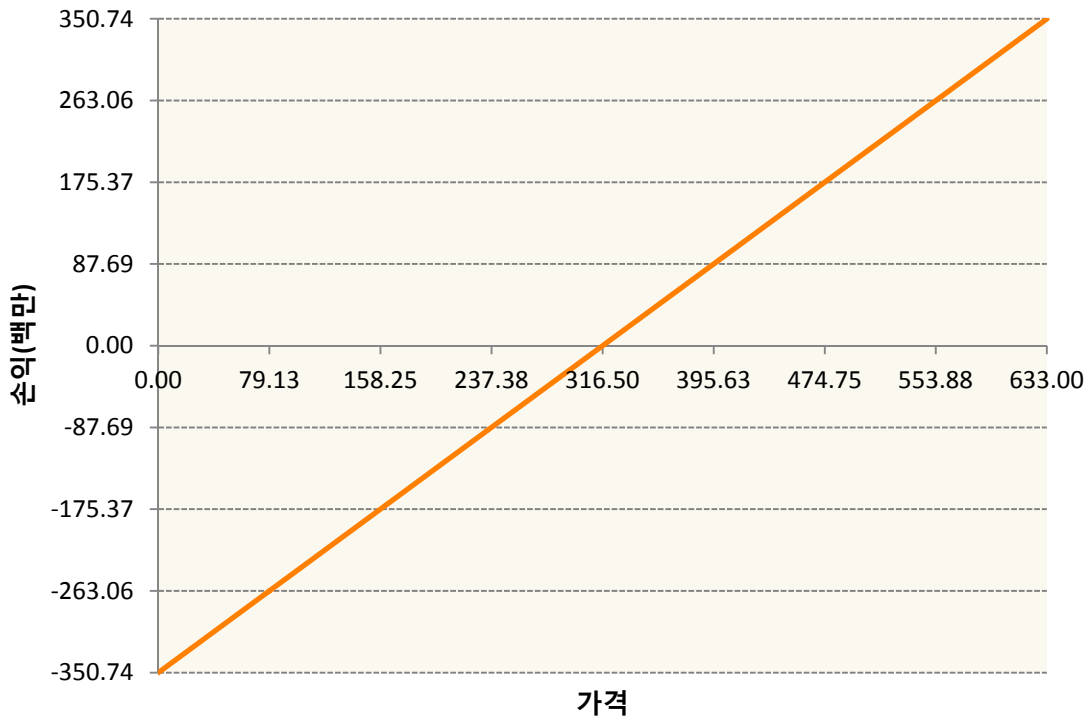
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



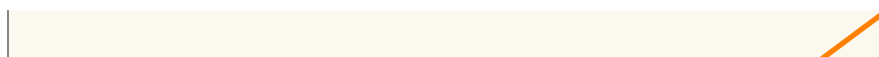
SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

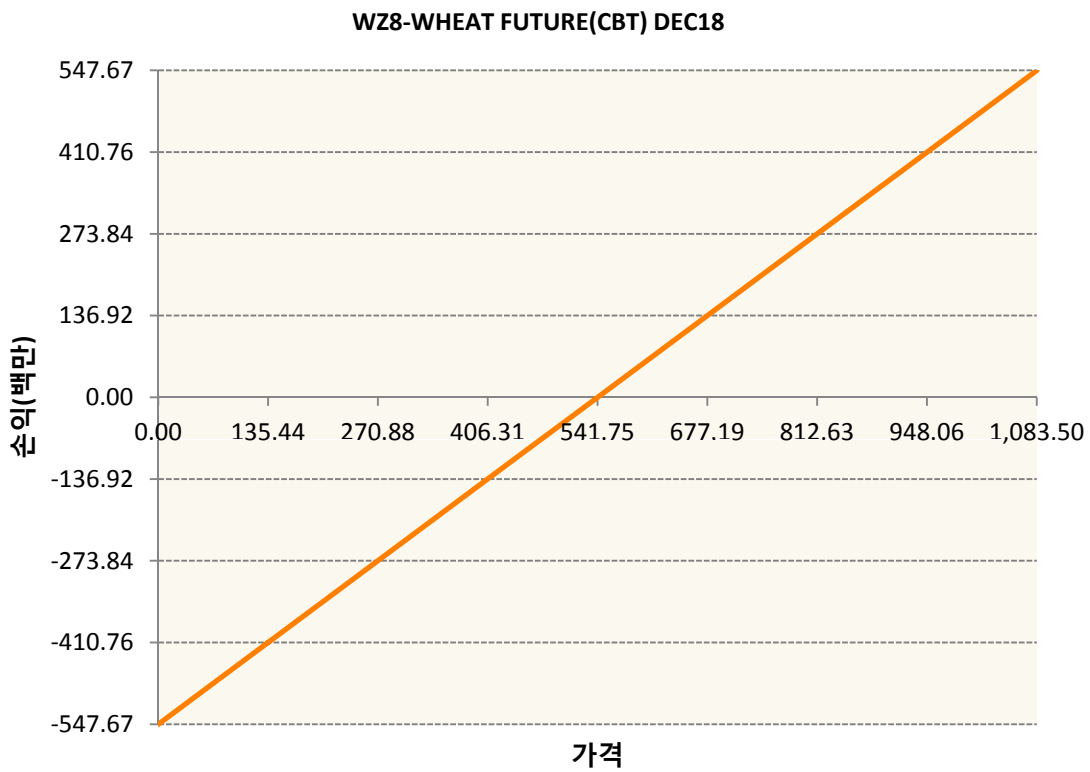
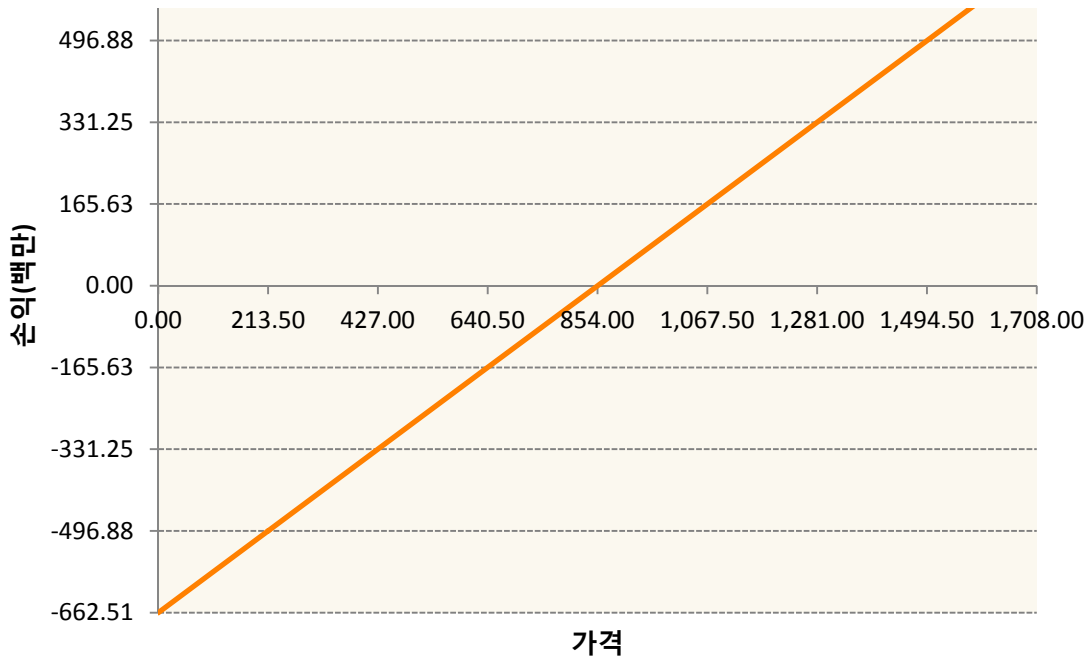


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



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	65
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	21
KR4175N90C	2018-09 달러선물	6

KWZ8	KC HRW WHEAT FUT DEC18	17
SBV8	SUGAR #11 (WORLD) OCT18	24
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	28
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	53
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	44

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

(단위:백만원)

309