

공시일	2018-08-28
기준일	2018-08-27

## 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	2018-08-28
기준일	2018-08-27

## 스마트인덱스모

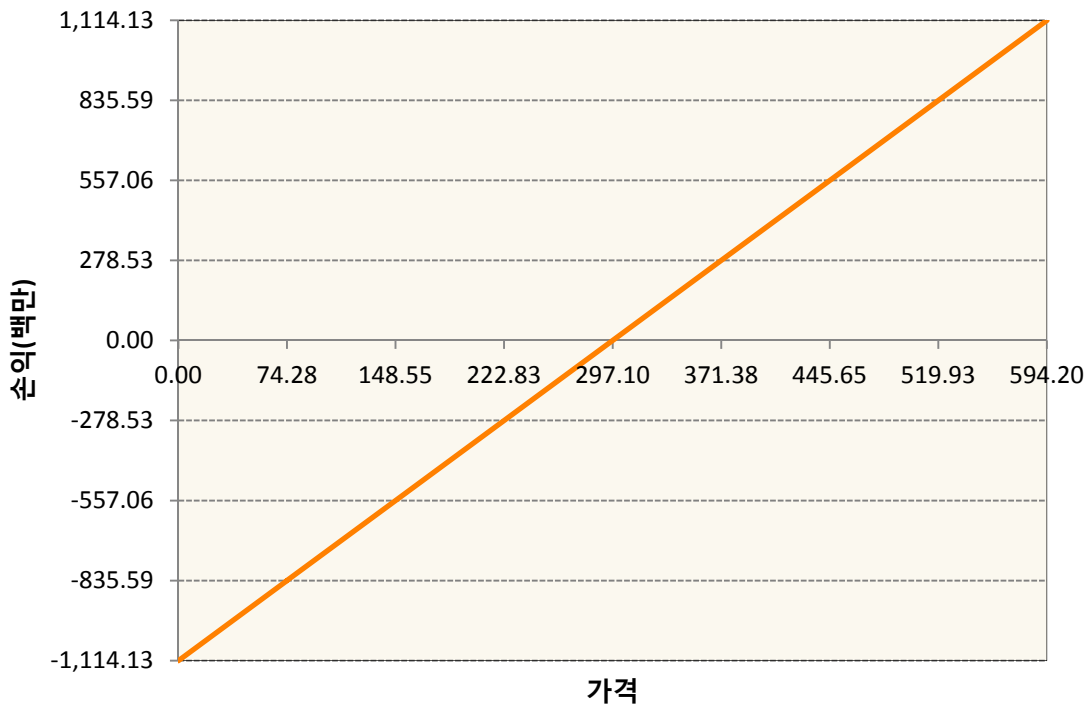
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,114	0	1,114	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물

89

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-5.33%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	30	30	30	30	30	30	30
5.33%	59	59	59	59	59	59	59
8.00%	89	89	89	89	89	89	89

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

(단위:백만원)

67

공시일	2018-08-28
기준일	2018-08-27

## 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

1,146

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

490

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-28
기준일	2018-08-27

## 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

304

\* 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	2018-08-28
기준일	2018-08-27

## 유로인덱스모(주식-파생형)

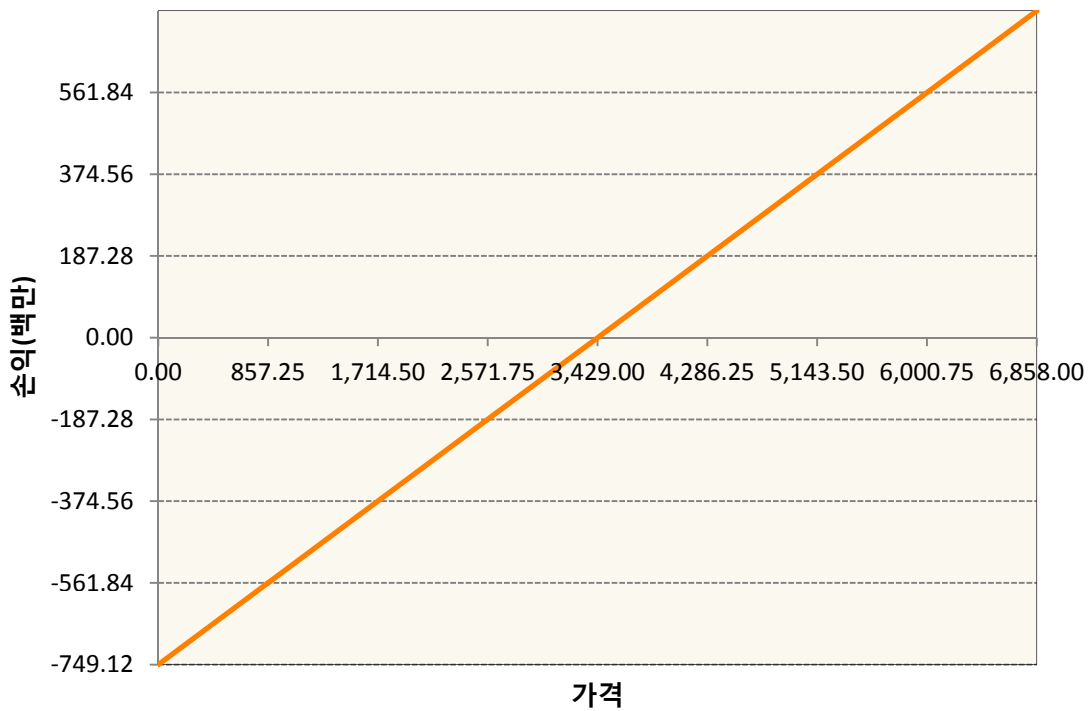
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	749	0	749	

### 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	2018-08-28
기준일	2018-08-27

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

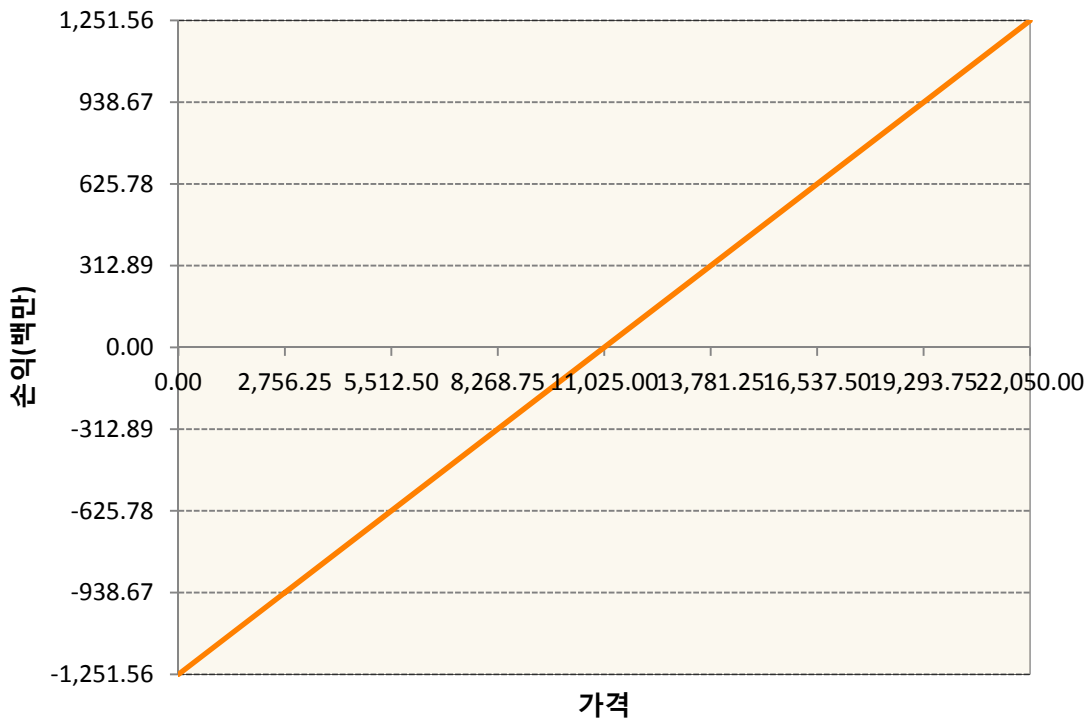
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

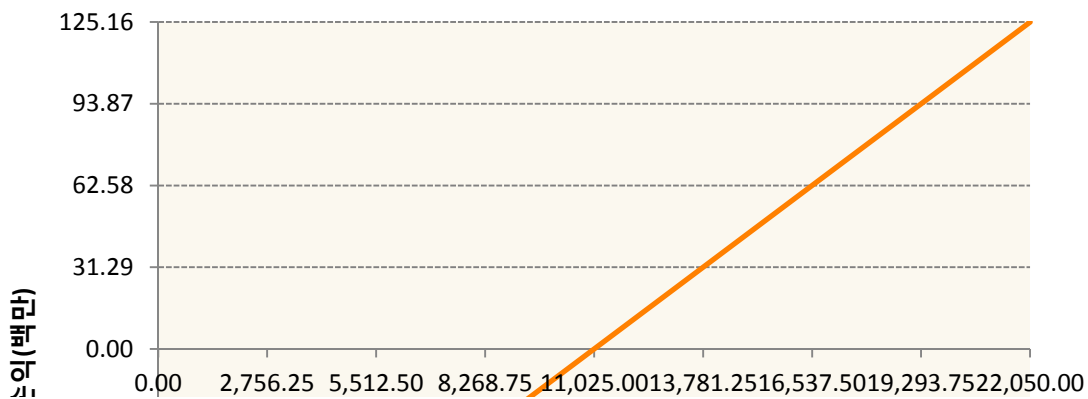
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	125	0	125	
누계	유가증권	선물	1,252	0	1,252	장내

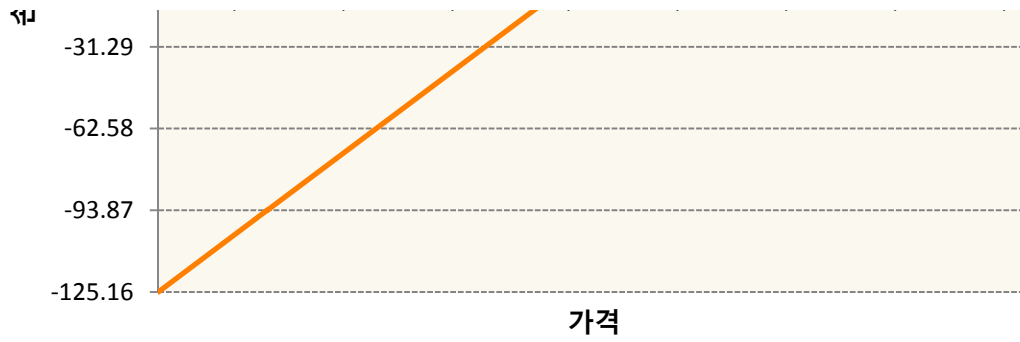
### 2. 만기시점의 손익구조

**HCU8-H-SHARES IDX FUT Sep18**



**MHCU8-MINI H-SHR IDX Fut Sep18**





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

HCU8	H-SHARES IDX FUT Sep18	100
MHCU8	MINI H-SHR IDX Fut Sep18	10

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

<b>101</b>
------------

공시일	2018-08-28
기준일	2018-08-27

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

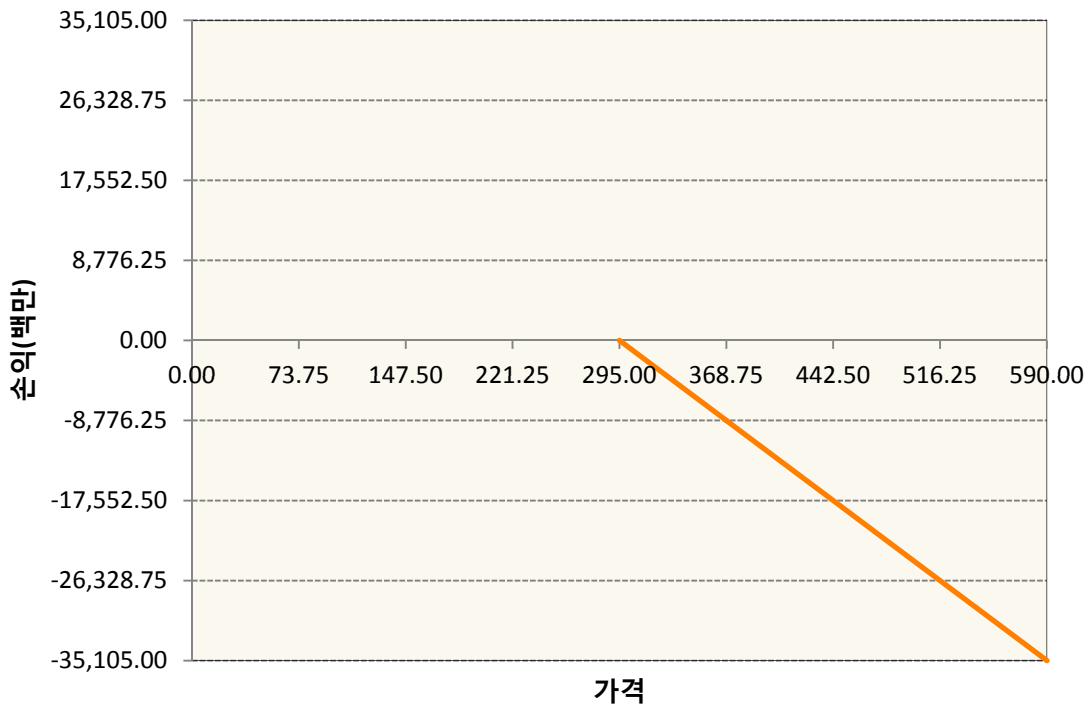
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

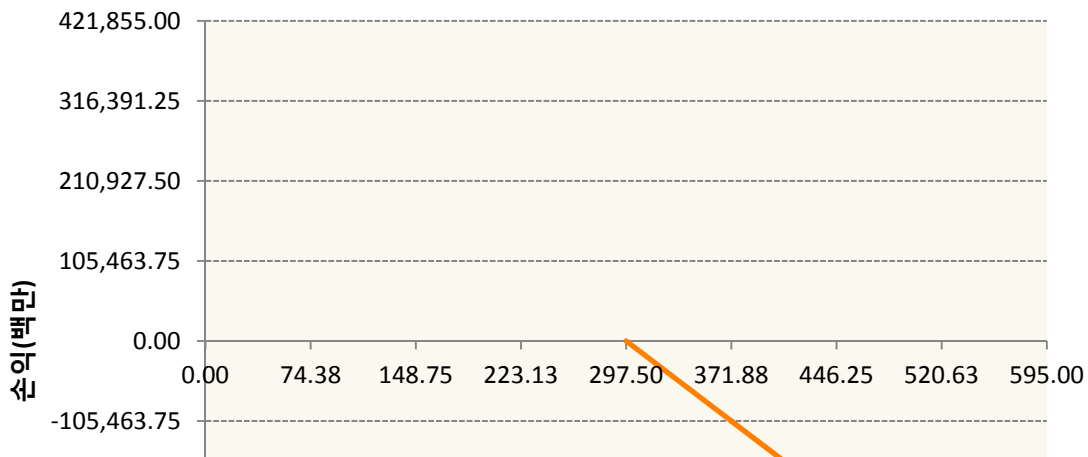
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	3,678	0	3,678	장내
누계	유가증권	옵션	0	761,898	-761,898	장내

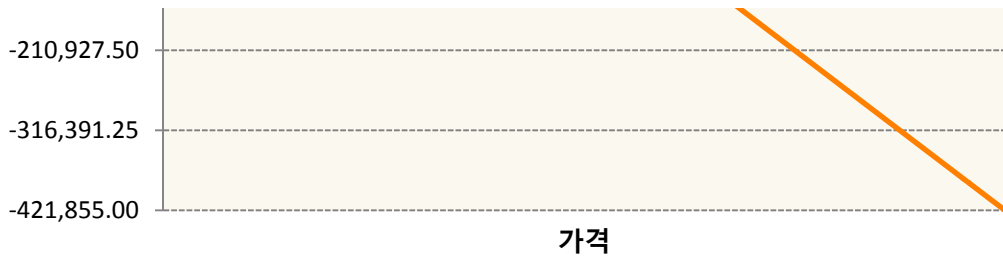
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92950-2018-09 콜295

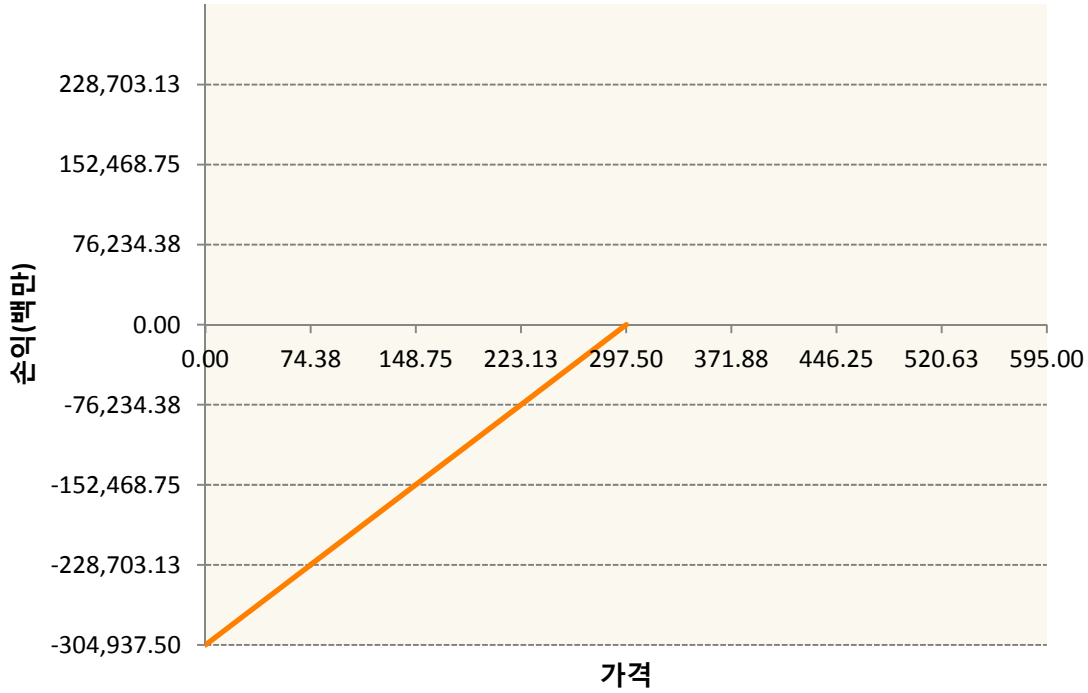


KR4201N92976-2018-09 콜297.5





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N929 2018-09 콜295

2,277

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	903	887	867	842	813	781	746
-5.33%	827	789	748	703	655	605	553
-2.67%	618	558	496	434	371	307	243
0%	202	135	68	0	-68	-135	-203
2.67%	-434	-488	-544	-602	-661	-722	-784
5.33%	-1,236	-1,267	-1,303	-1,344	-1,388	-1,435	-1,484
8.00%	-2,127	-2,141	-2,159	-2,183	-2,210	-2,242	-2,277

KR4201N929 2018-09 풋297.5

25,883

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,091	8,954	8,767	8,529	8,244	7,915	7,547

-5.33%	8,464	8,100	7,681	7,215	6,710	6,172	5,605
-2.67%	6,561	5,909	5,231	4,534	3,823	3,099	2,365
0%	2,435	1,623	812	0	-812	-1,624	-2,435
2.67%	-4,347	-5,066	-5,803	-6,553	-7,315	-8,084	-8,861
5.33%	-13,356	-13,822	-14,340	-14,901	-15,497	-16,122	-16,771
8.00%	-23,709	-23,936	-24,224	-24,568	-24,963	-25,403	-25,883

KR4301N929 2018-09 풋 297.5

21,493

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21,480	-21,480	-21,480	-21,481	-21,483	-21,486	-21,493
-5.33%	-13,377	-13,383	-13,395	-13,415	-13,444	-13,484	-13,535
-2.67%	-5,445	-5,541	-5,656	-5,789	-5,936	-6,096	-6,266
0%	793	529	265	0	-265	-530	-795
2.67%	3,240	3,101	2,944	2,772	2,588	2,394	2,191
5.33%	3,560	3,544	3,517	3,478	3,425	3,358	3,277
8.00%	3,572	3,571	3,570	3,566	3,560	3,548	3,530

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

(단위:백만원)

**54,139**

공시일	2018-08-28
기준일	2018-08-27

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

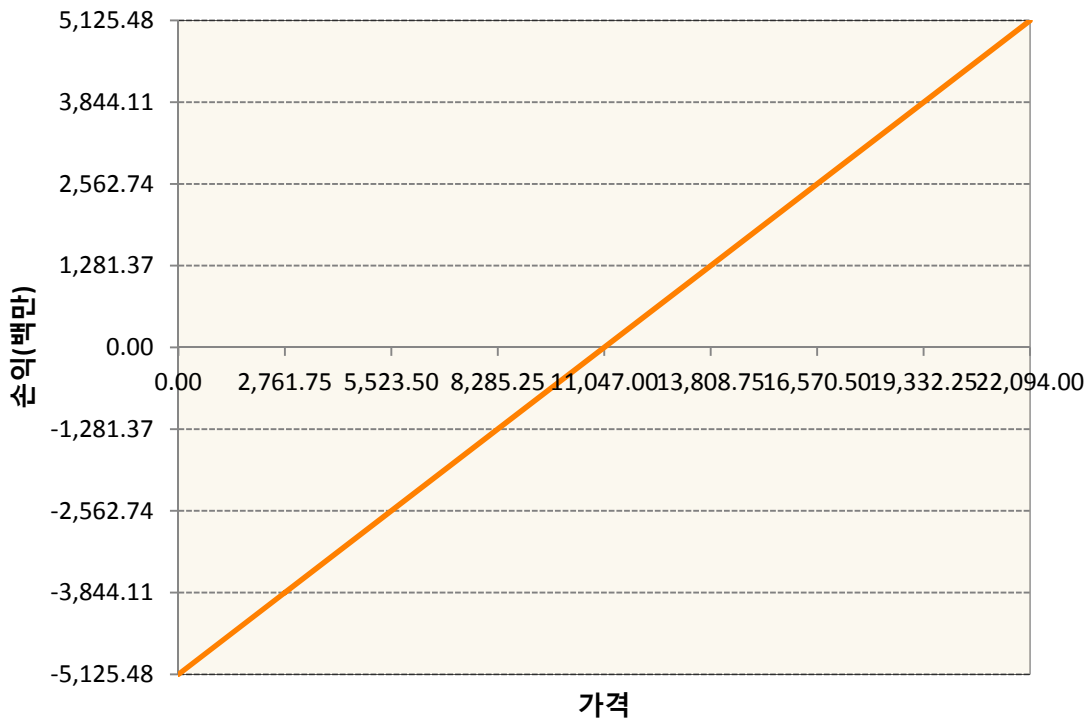
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

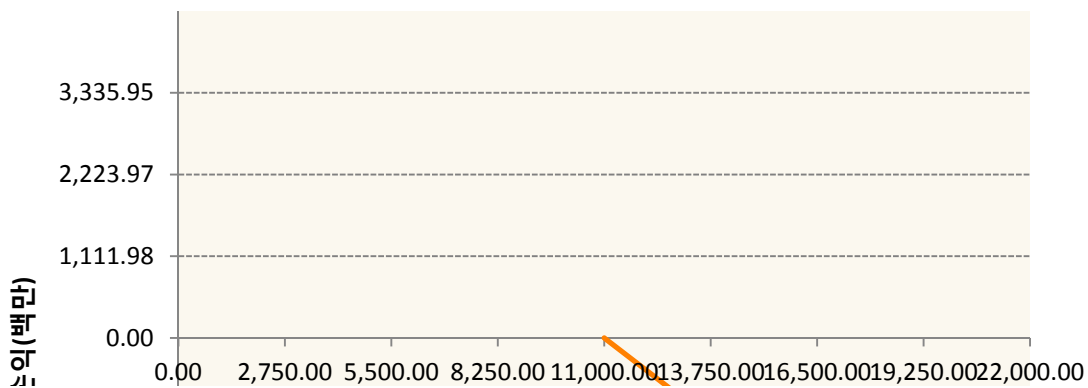
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,125	0	5,125	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,438	-11,438	장내

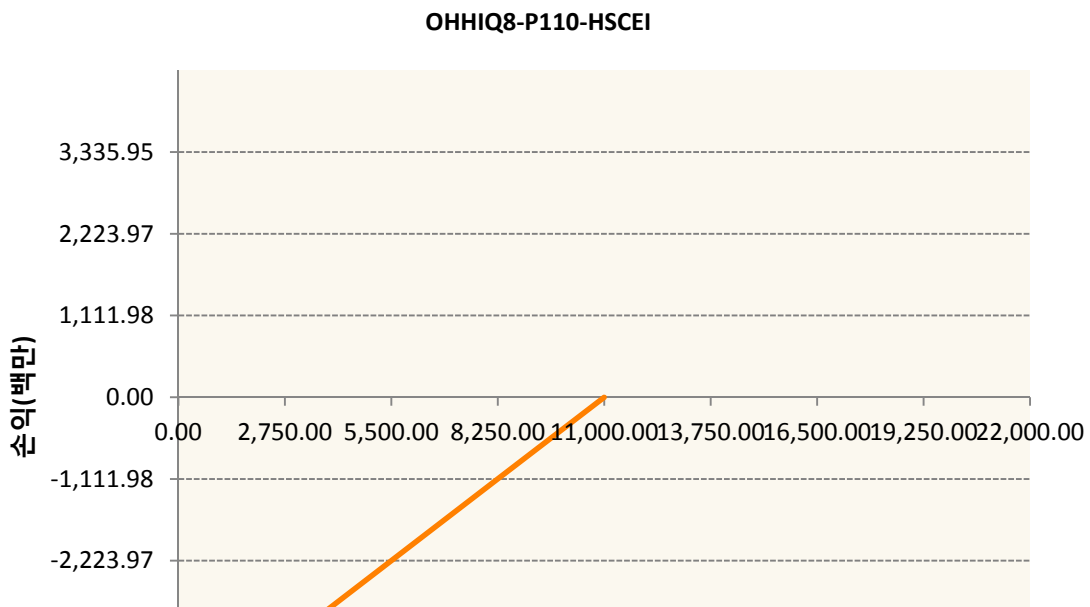
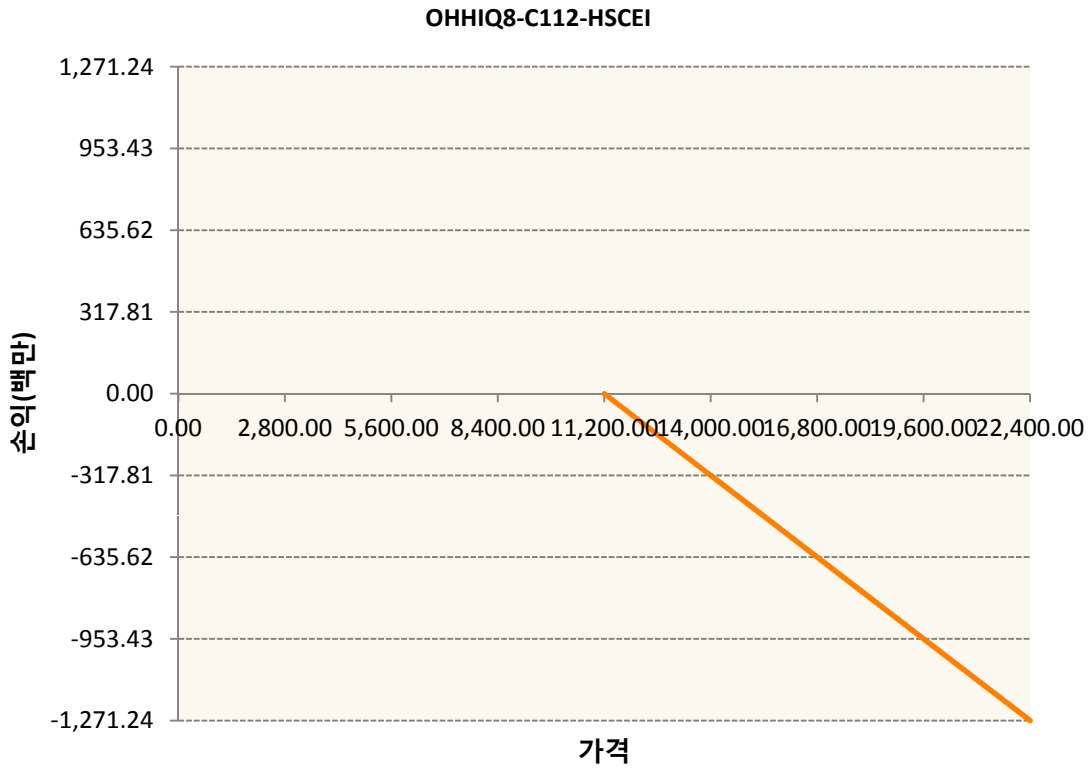
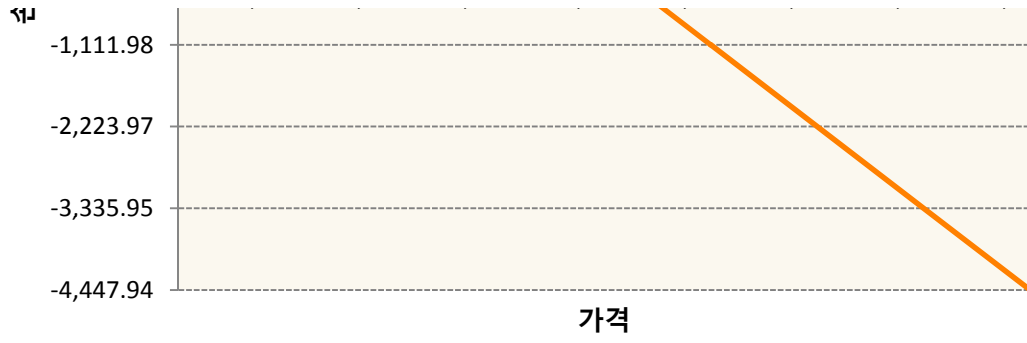
### 2. 만기시점의 손익구조

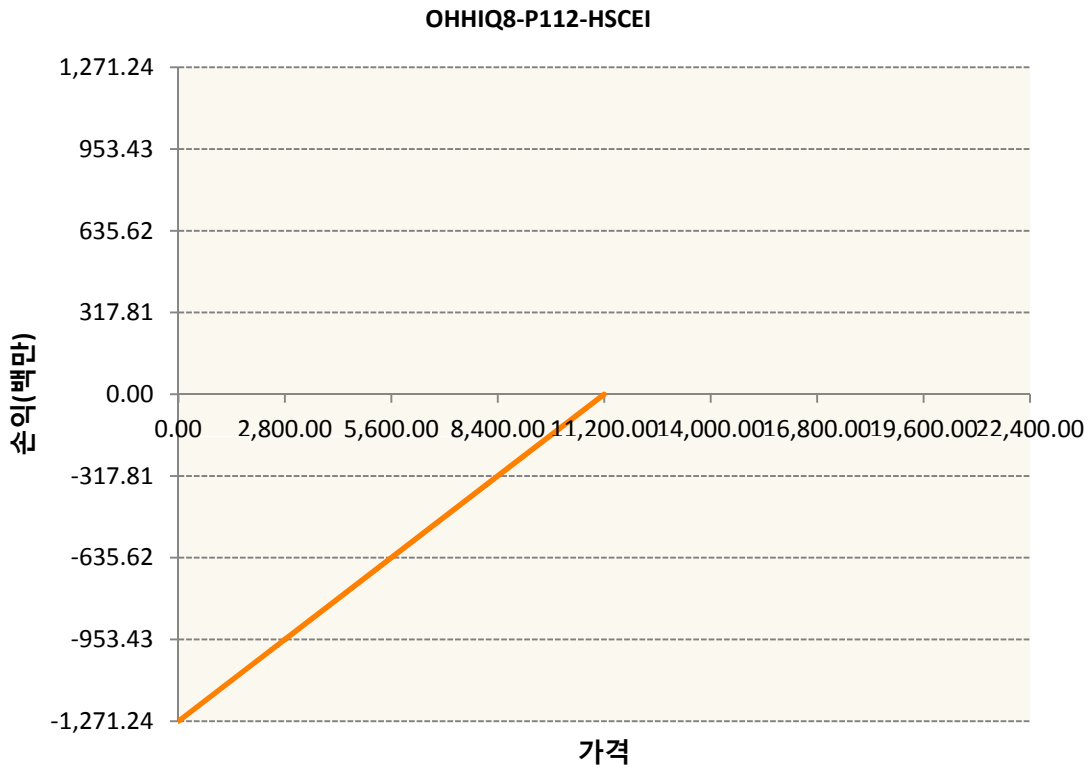
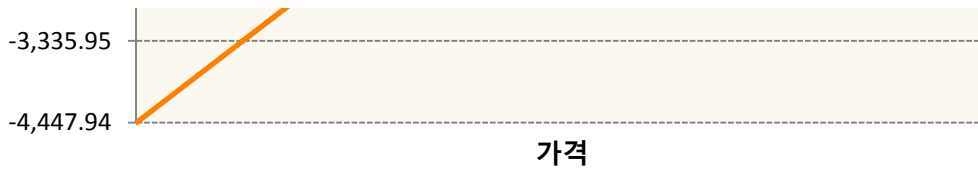
HCQ8-HSCEI Futures Aug18



OHHIQ8-C110-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ8	HSCEI Futures Aug18	410
OHHIQ8-C1	HSCEI	356
OHHIQ8-C1	HSCEI	102
OHHIQ8-P11	HSCEI	356
OHHIQ8-P11	HSCEI	102

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

공시일	2018-08-28
기준일	2018-08-27

## 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

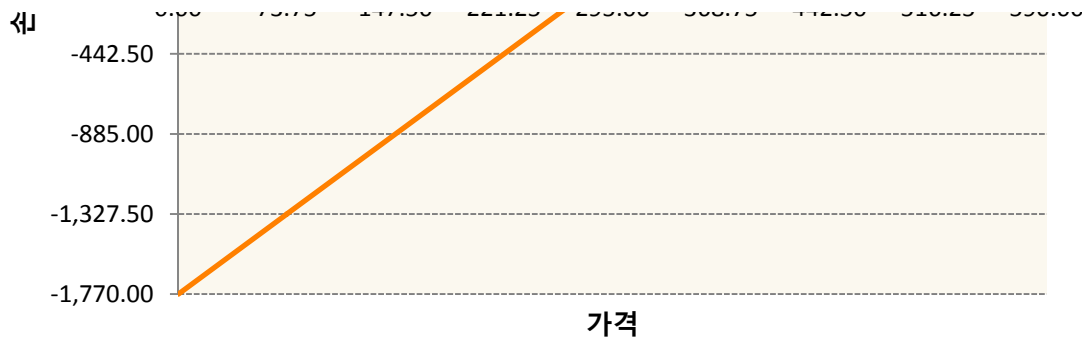
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92976-2018-09 콜297.5

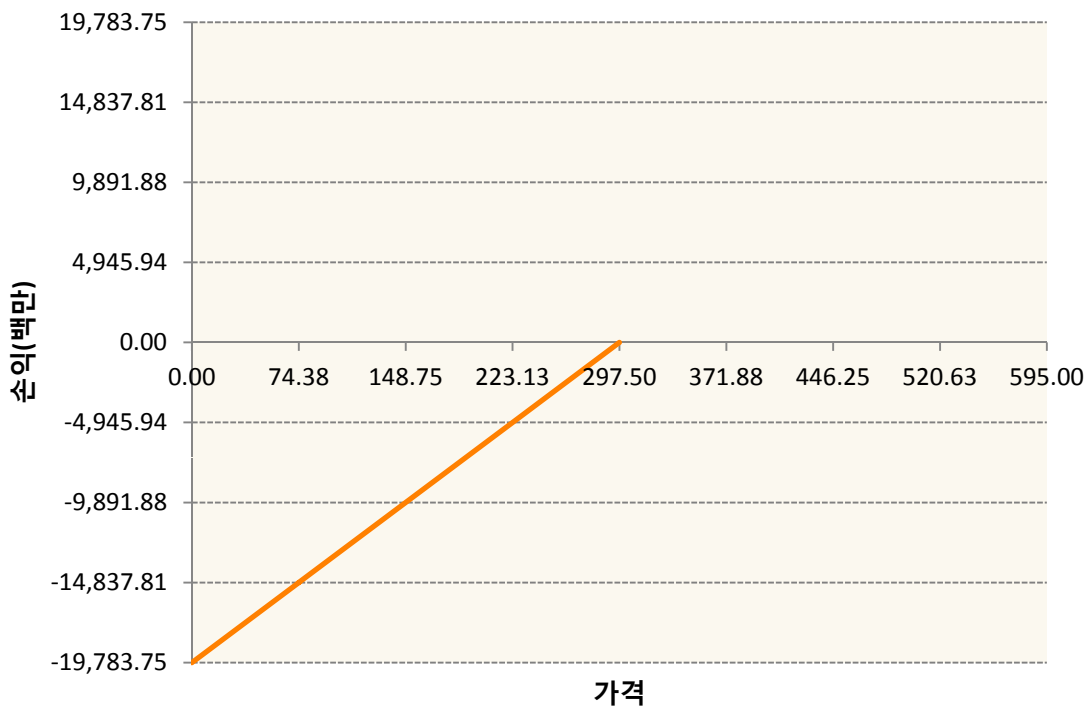


KR4301N92958-2018-09 풋295





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,958
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,958	-3,958	-3,958	-3,958	-3,958	-3,958	-3,958
-5.33%	-2,638	-2,638	-2,638	-2,638	-2,638	-2,638	-2,638
-2.67%	-1,319	-1,319	-1,319	-1,319	-1,319	-1,319	-1,319
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,319	1,319	1,319	1,319	1,319	1,319	1,319
5.33%	2,638	2,638	2,638	2,638	2,638	2,638	2,638
8.00%	3,958	3,958	3,958	3,958	3,958	3,958	3,958
KR4201N92974-2018-09 풋297.5							1,725
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	606	597	584	568	549	528	503
-5.33%	564	540	512	481	447	411	374
-2.67%	437	394	349	302	255	206	158
0%	162	108	54	0	-54	-108	-162
2.67%	-290	-338	-387	-437	-487	-539	-591
5.33%	-890	-921	-956	-993	-1,033	-1,074	-1,118
8.00%	-1,580	-1,595	-1,614	-1,637	-1,664	-1,693	-1,725

KR4301N929 2018-09 풋295

118

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118
-5.33%	-71	-71	-71	-71	-71	-72	-72
-2.67%	-26	-26	-27	-29	-30	-31	-32
0%	4	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	13	13	12	11	10	10	9
5.33%	14	14	14	14	13	13	13
8.00%	14	14	14	14	14	14	14

KR4301N929 2018-09 풋297.5

1,394

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,394	-1,394	-1,394	-1,394	-1,394	-1,394	-1,394
-5.33%	-868	-868	-869	-870	-872	-875	-878
-2.67%	-353	-359	-367	-376	-385	-395	-407
0%	51	34	17	0	-17	-34	-52
2.67%	210	201	191	180	168	155	142
5.33%	231	230	228	226	222	218	213
8.00%	232	232	232	231	231	230	229

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

(단위:백만원)

7,505

공시일	2018-08-28
기준일	2018-08-27

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

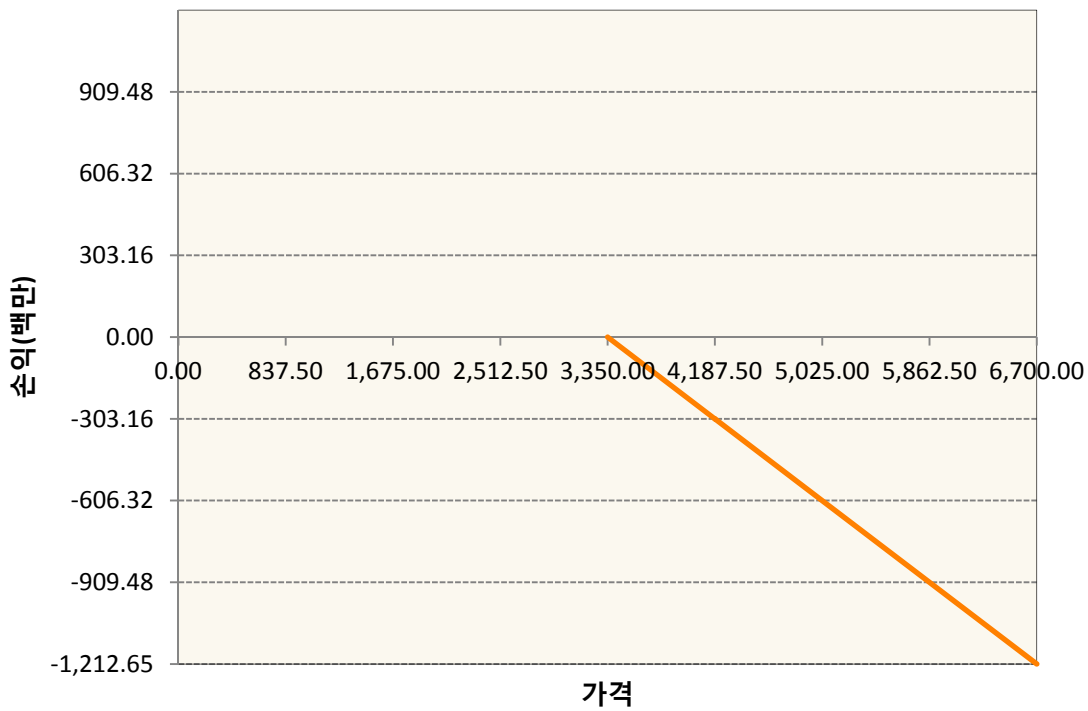
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

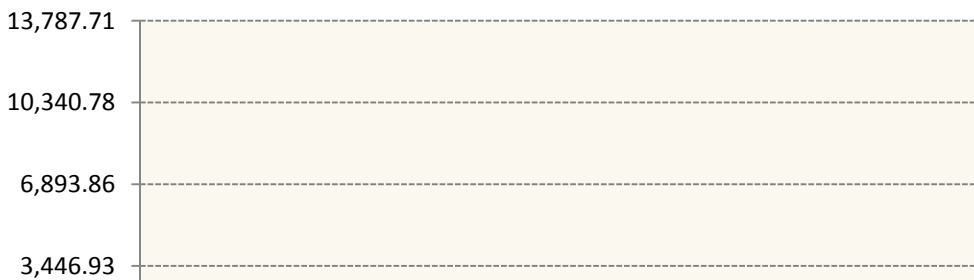
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	8,176	0	8,176	
누계	유가증권	옵션	0	30,001	-30,001	장내
누계	지수	스왑	86,626	0	86,626	장외

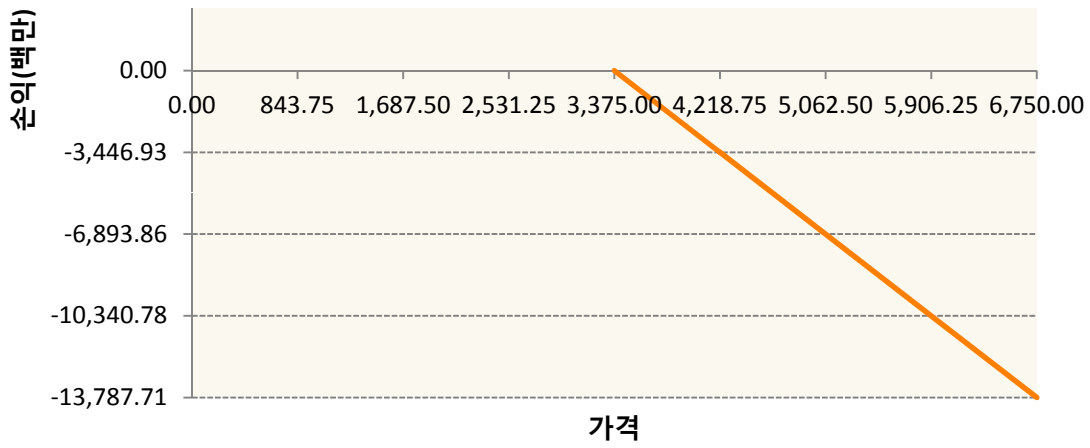
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXU8-C3350-EURO STOXX 50**

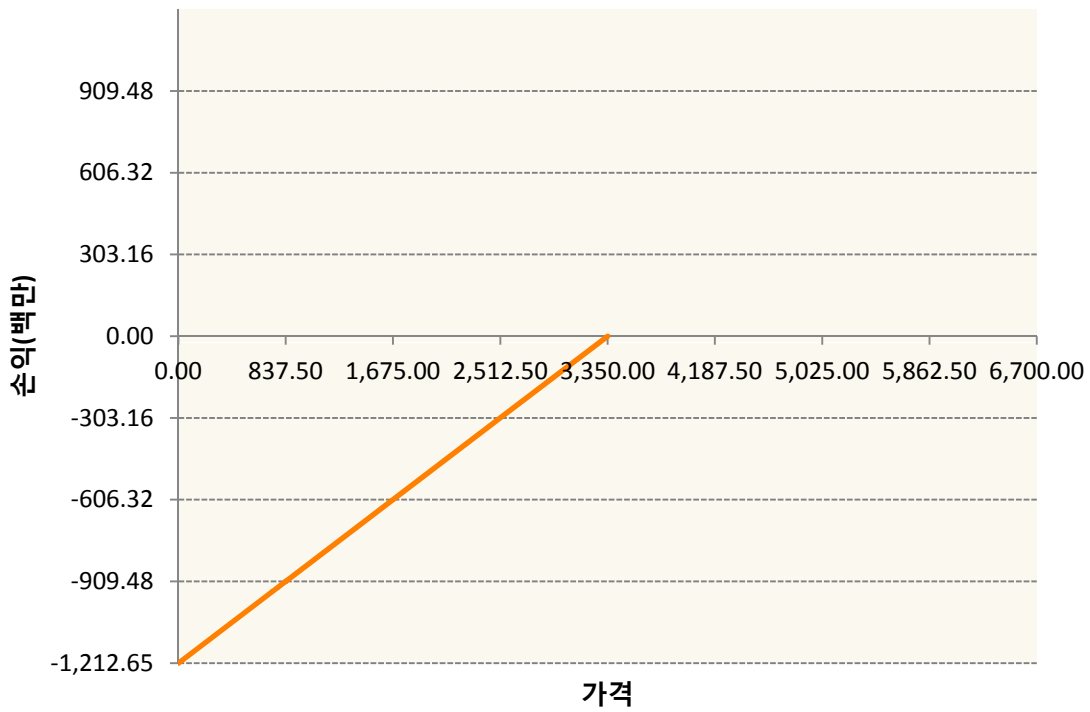


**OESXU8-C3375-EURO STOXX 50**

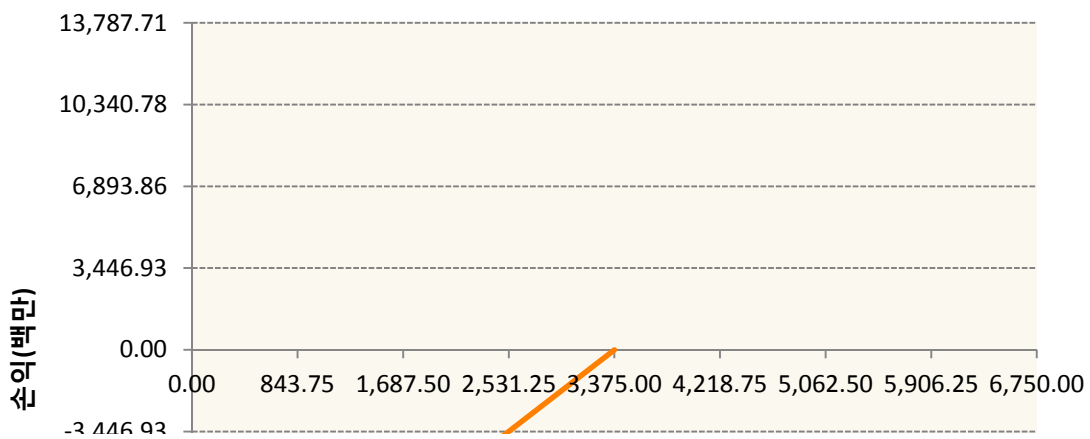


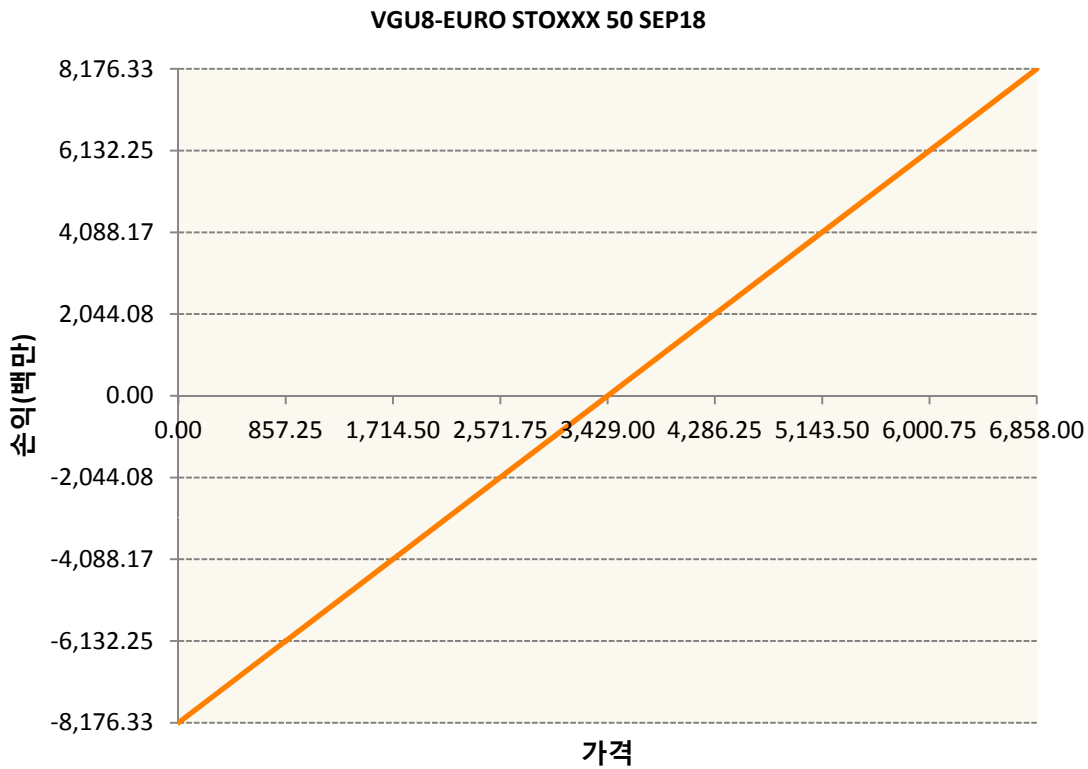


OESXU8-P3350-EURO STOXX 50



OESXU8-P3375-EURO STOXX 50





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

260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	17
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY	11
OESXU8-C33 EURO STOXX 50	97
OESXU8-C33 EURO STOXX 50	1,103
OESXU8-P33 EURO STOXX 50	97
OESXU8-P33 EURO STOXX 50	1,103
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18	654

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

**1,924**



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

(단위:백만원)

1,131



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

(단위:백만원)

89



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

(단위:백만원)

134



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

(단위:백만원)

160



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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-08-28
기준일	2018-08-27

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

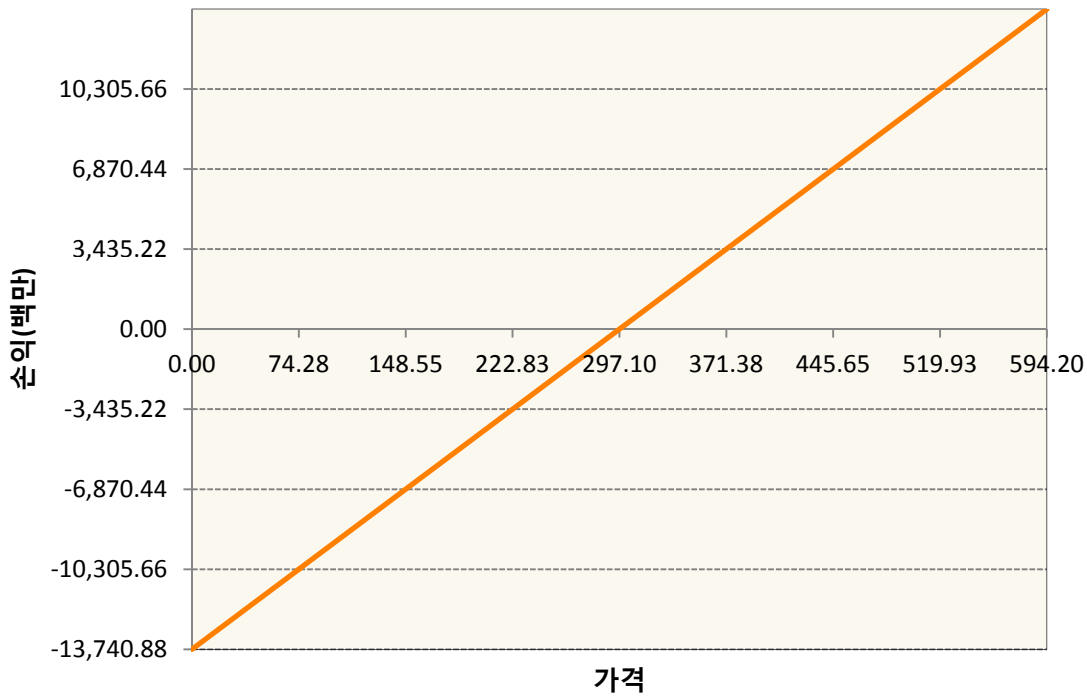
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

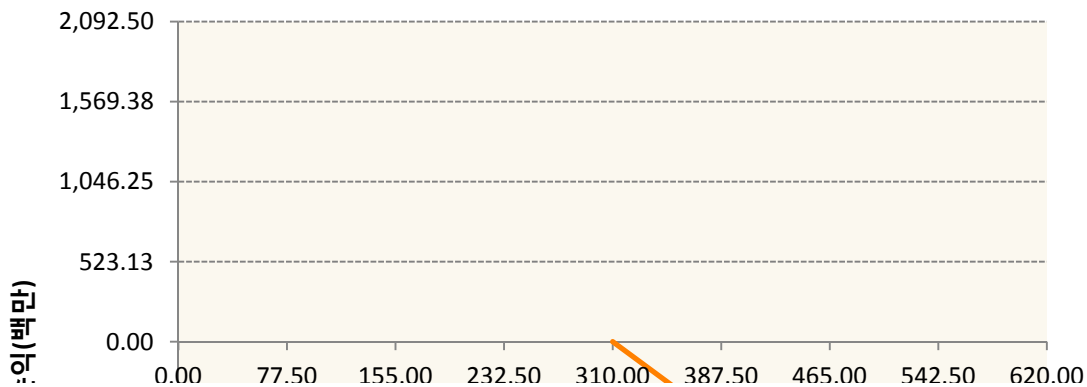
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,741	0	13,741	장내
누계	유가증권	옵션	1,339	24,671	-23,332	장내

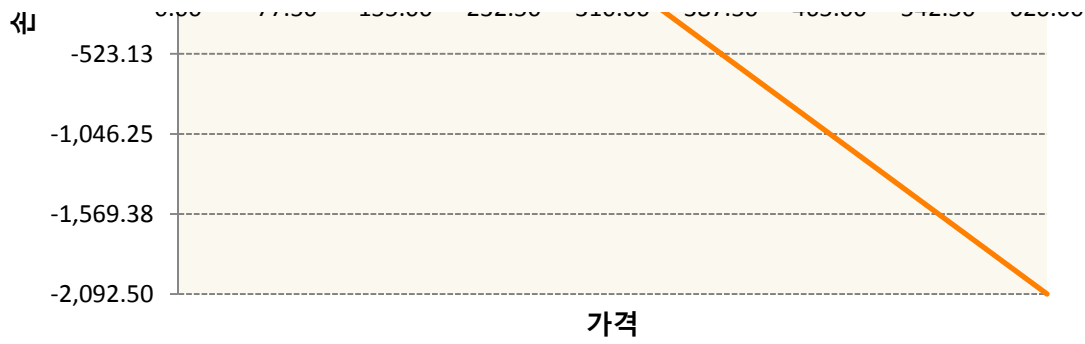
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

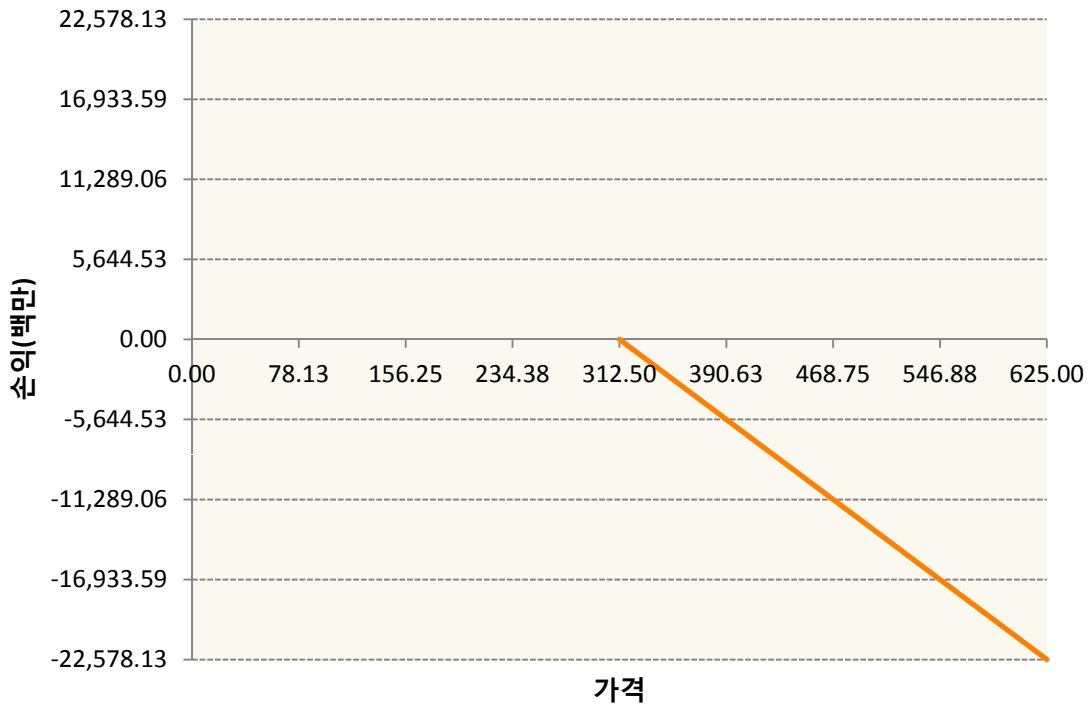


KR4201N93107-2018-09 콜310

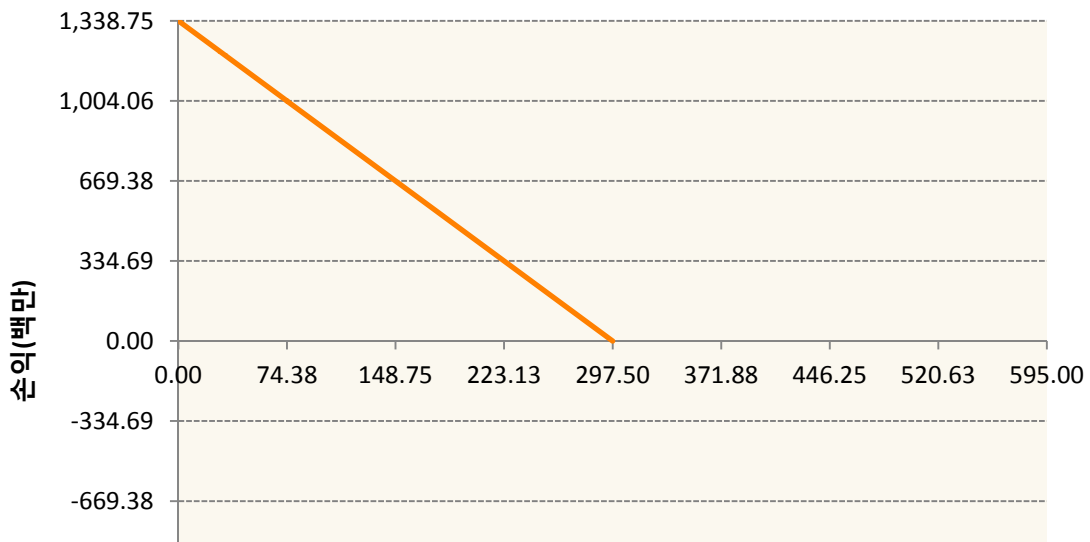


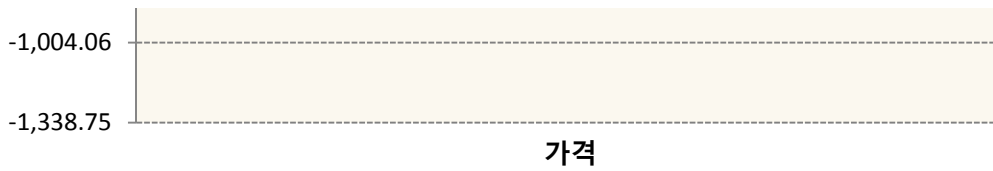


**KR4201N93123-2018-09 콜312.5**



**KR4301N92974-2018-09 풋297.5**





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

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물							1,098
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,098	-1,098	-1,098	-1,098	-1,098	-1,098	-1,098
-5.33%	-732	-732	-732	-732	-732	-732	-732
-2.67%	-366	-366	-366	-366	-366	-366	-366
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	366	366	366	366	366	366	366
5.33%	732	732	732	732	732	732	732
8.00%	1,098	1,098	1,098	1,098	1,098	1,098	1,098
KR4201N931 2018-09 콜310							88
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	16	15	15	15	15	14	13
-5.33%	15	15	14	13	12	11	10
-2.67%	14	12	11	9	7	5	3
0%	8	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	-5	-9	-13	-17	-21	-24	-28
5.33%	-30	-34	-38	-42	-46	-50	-54
8.00%	-67	-70	-74	-77	-81	-84	-88
KR4201N931 2018-09 콜312.5							860
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	131	130	129	127	123	119	112
-5.33%	129	126	121	115	106	95	82
-2.67%	118	108	95	80	62	42	19
0%	75	53	28	0	-29	-61	-93
2.67%	-38	-75	-113	-152	-191	-231	-271
5.33%	-265	-309	-352	-396	-439	-483	-526
8.00%	-621	-659	-698	-738	-778	-819	-860
KR4301N92C 2018-09 풋297.5							94
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	94	94	94	94	94	94	94
-5.33%	59	59	59	59	59	59	59
-2.67%	24	24	25	25	26	27	28

0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-14	-14	-13	-12	-11	-11	-10
5.33%	-16	-16	-15	-15	-15	-15	-14
8.00%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-15

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

(단위:백만원)

**1,627**

공시일	2018-08-28
기준일	2018-08-27

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

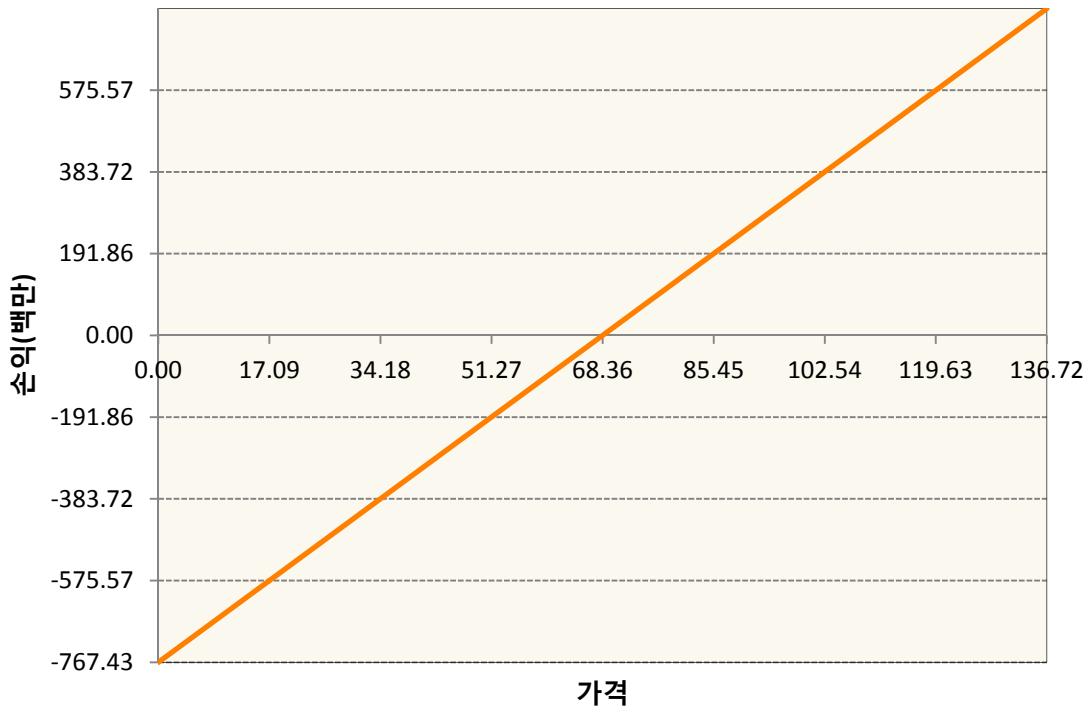
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

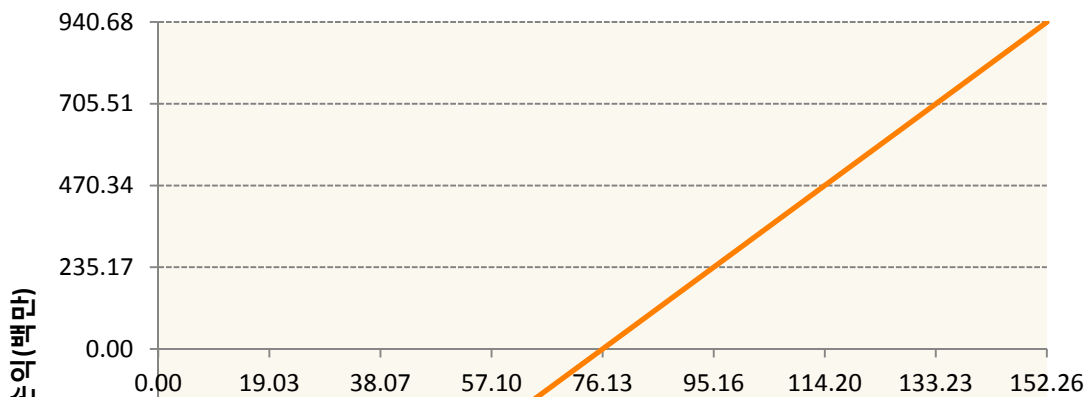
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,161	612	2,549	
누계	유가증권	선물	521	0	521	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18

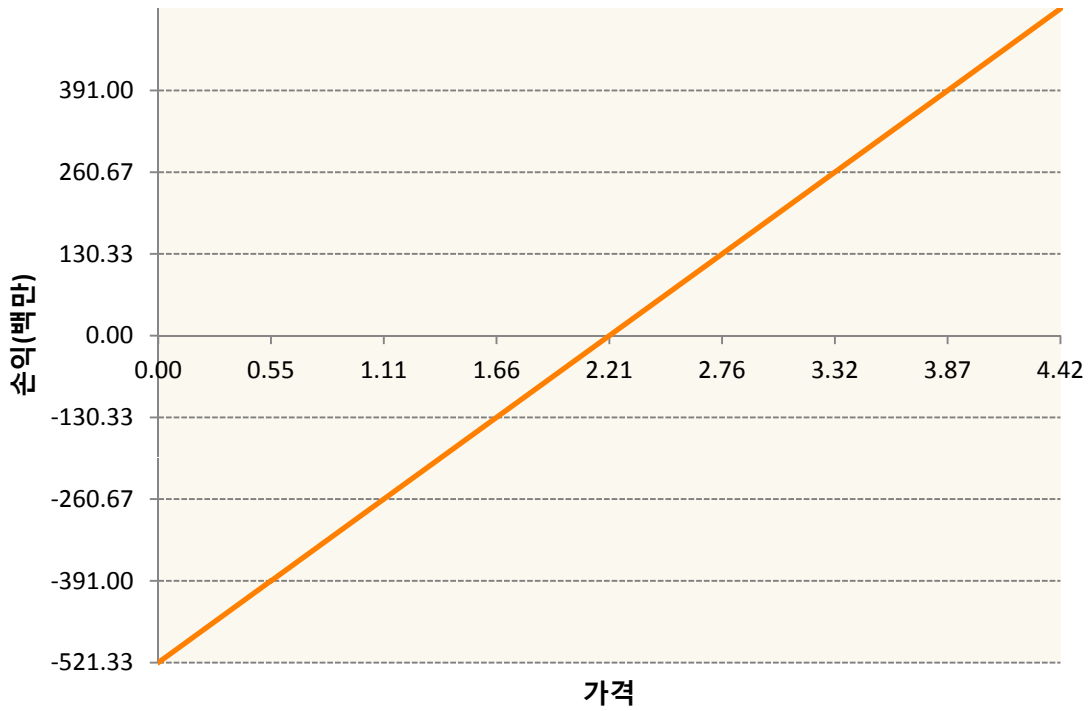


COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18

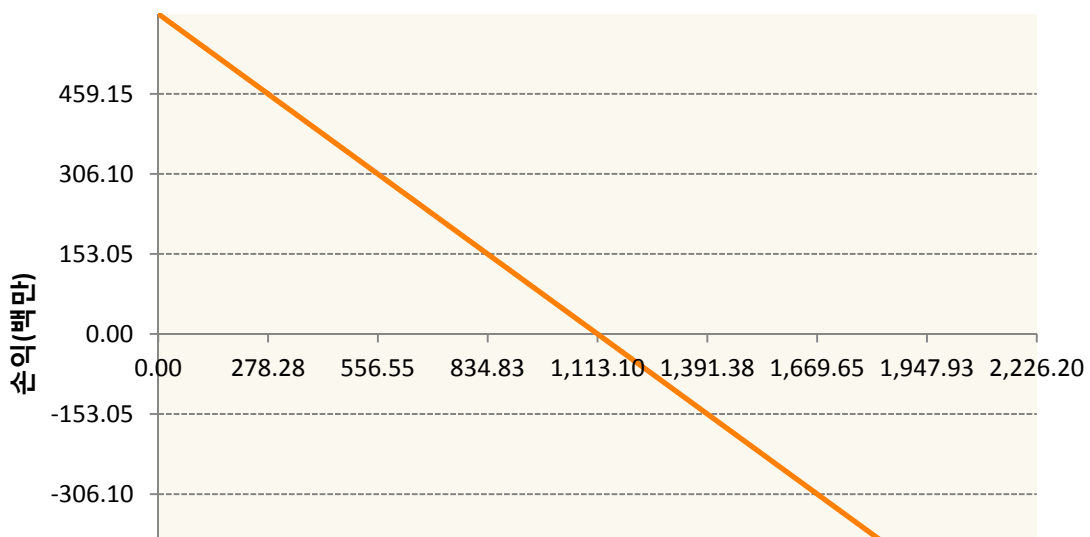


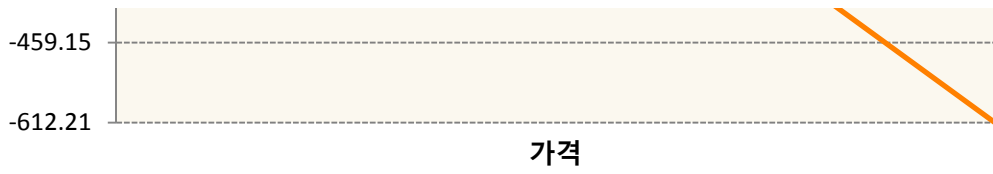


HOX8-Heating Oil

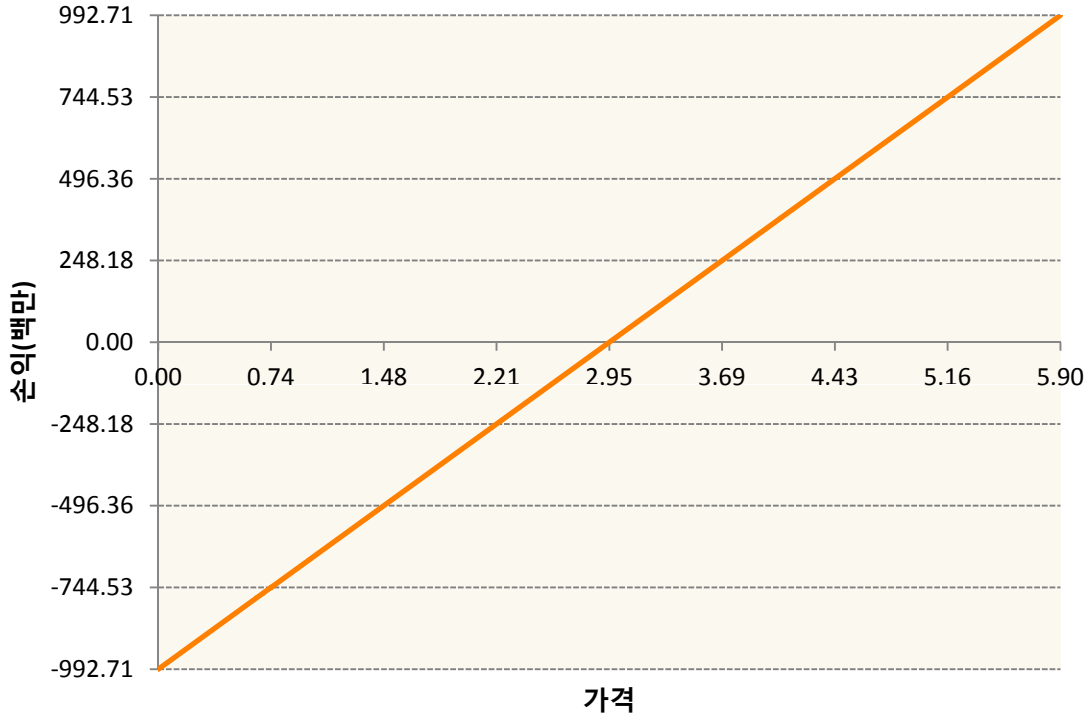


KR4175N90000-2018-09 달러선물

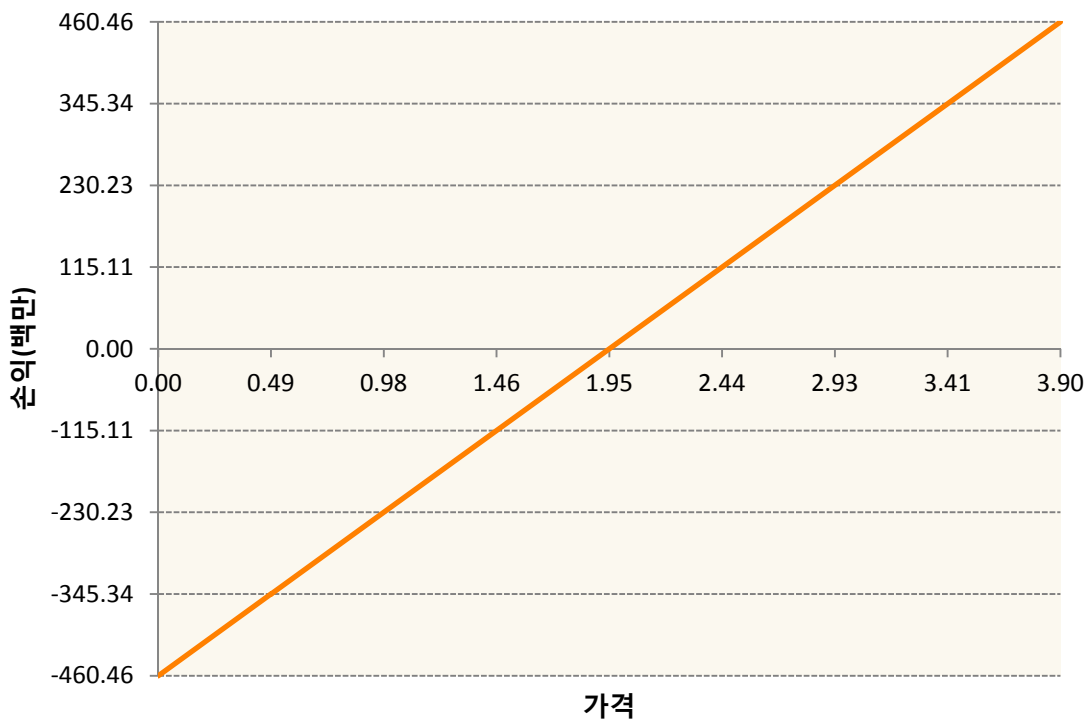




**NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18**



**XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18**



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	61
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	75
HOX8	Heating Oil	42
	KR4175N90C 2018-09 달러선물	49
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	79
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	37

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	445

공시일	2018-08-28
기준일	2018-08-27

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

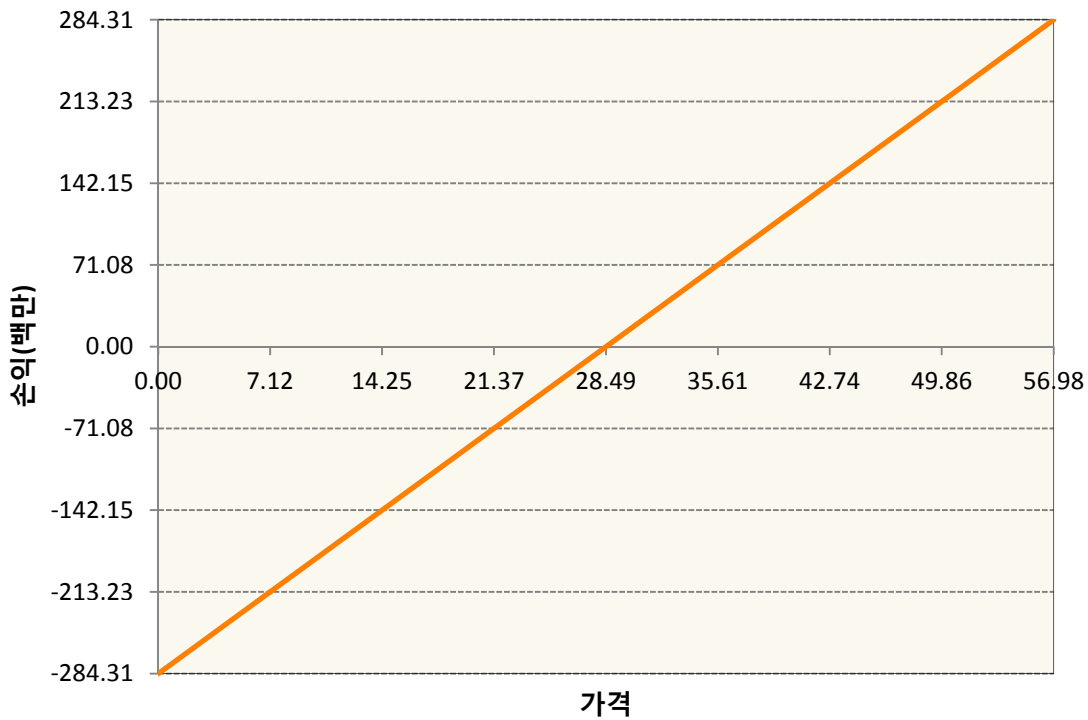
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

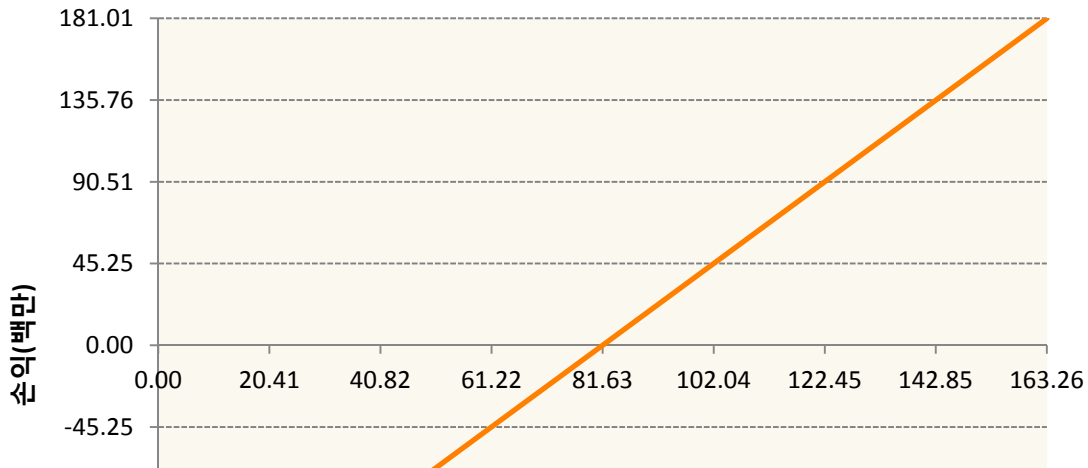
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,622	78	3,544	

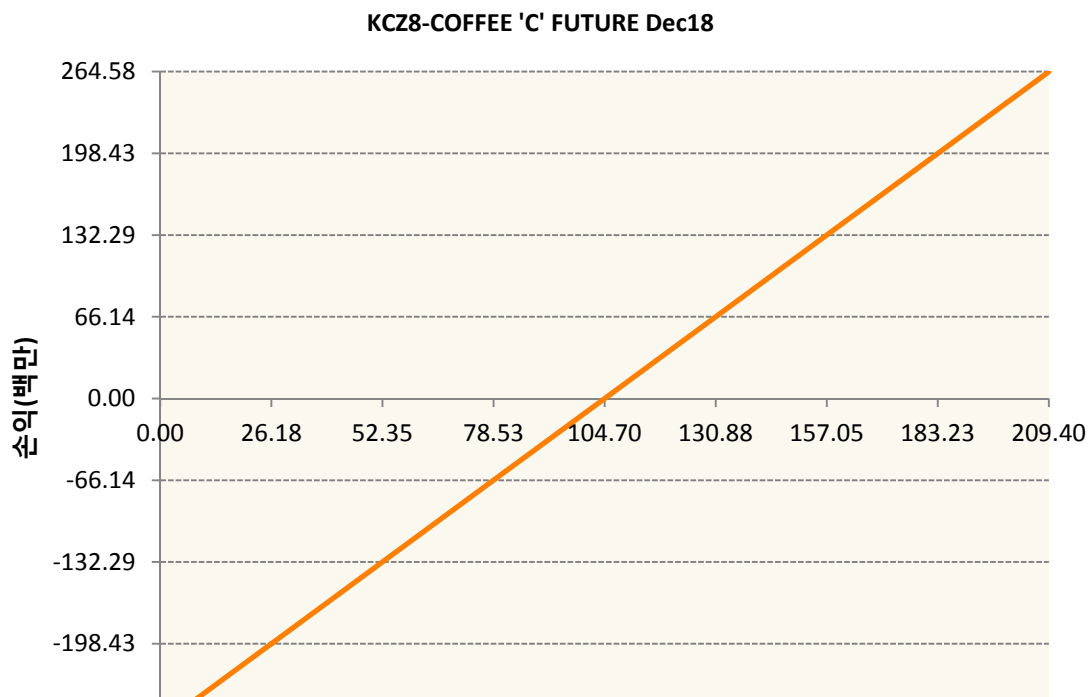
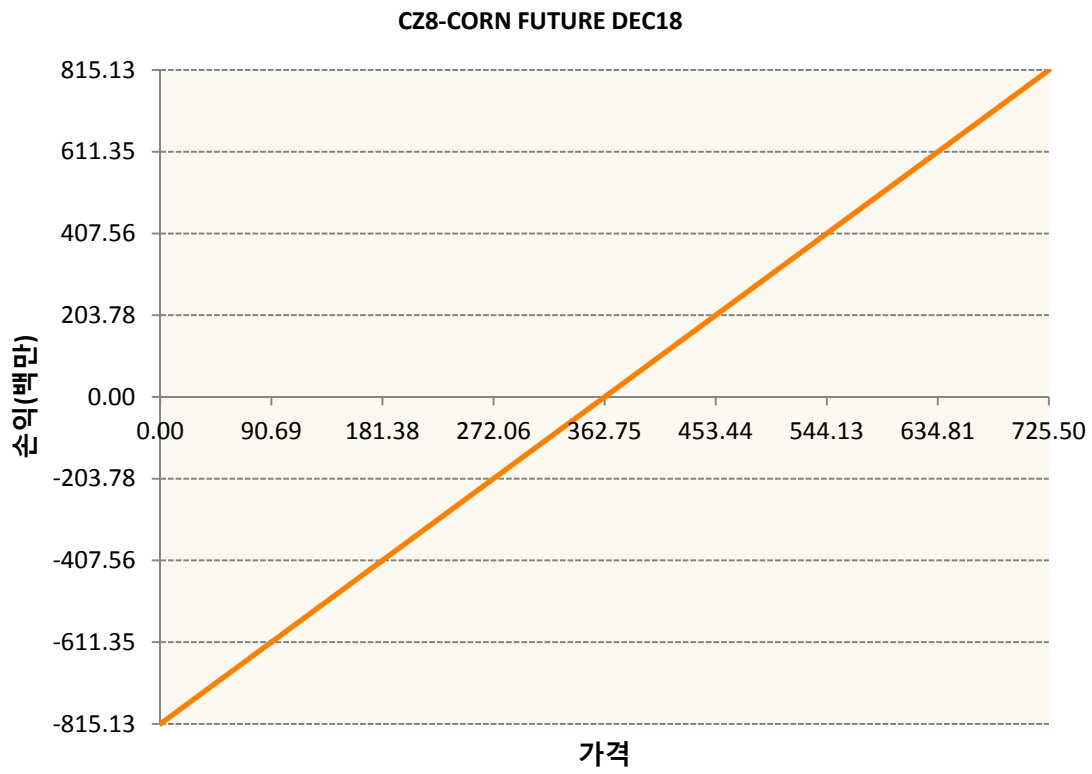
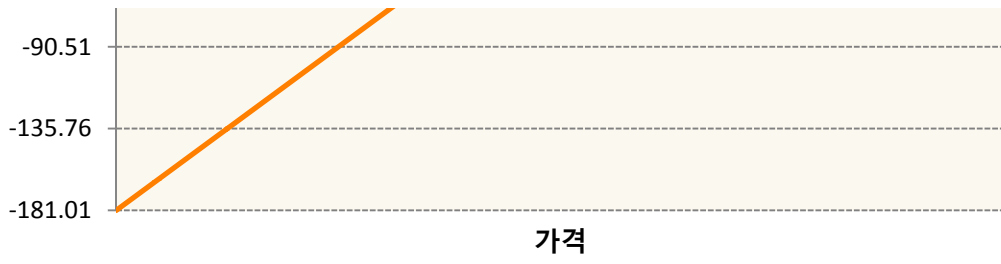
### 2. 만기시점의 손익구조

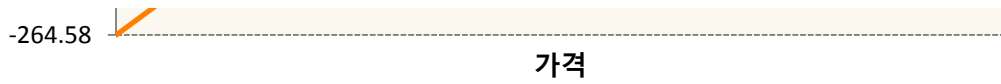
**BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18**



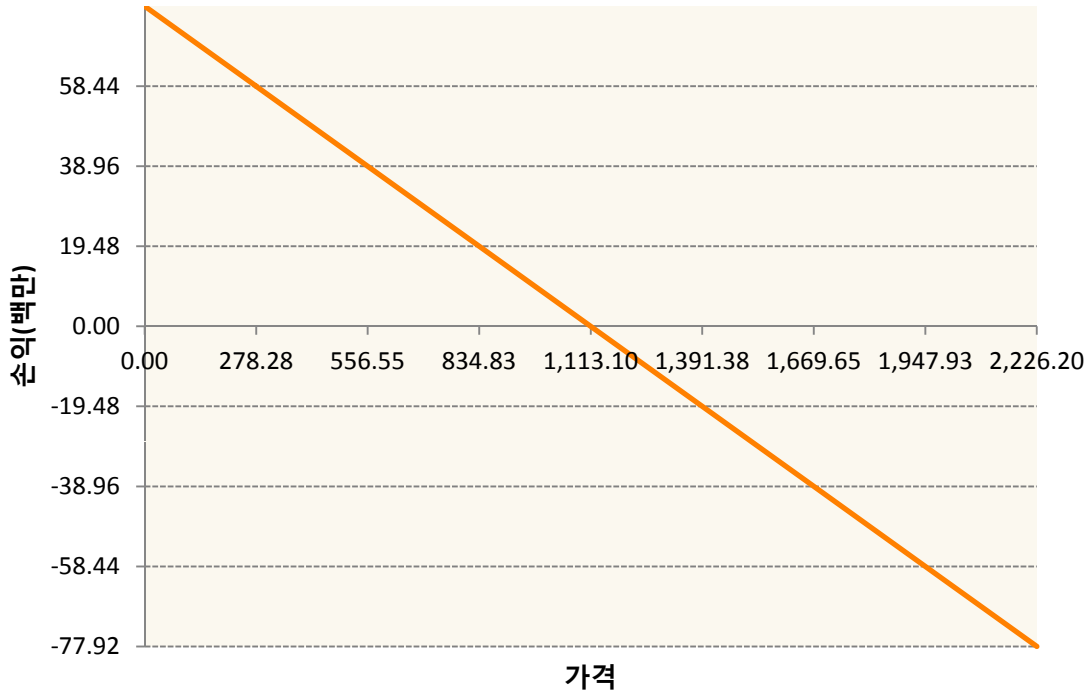
**CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18**



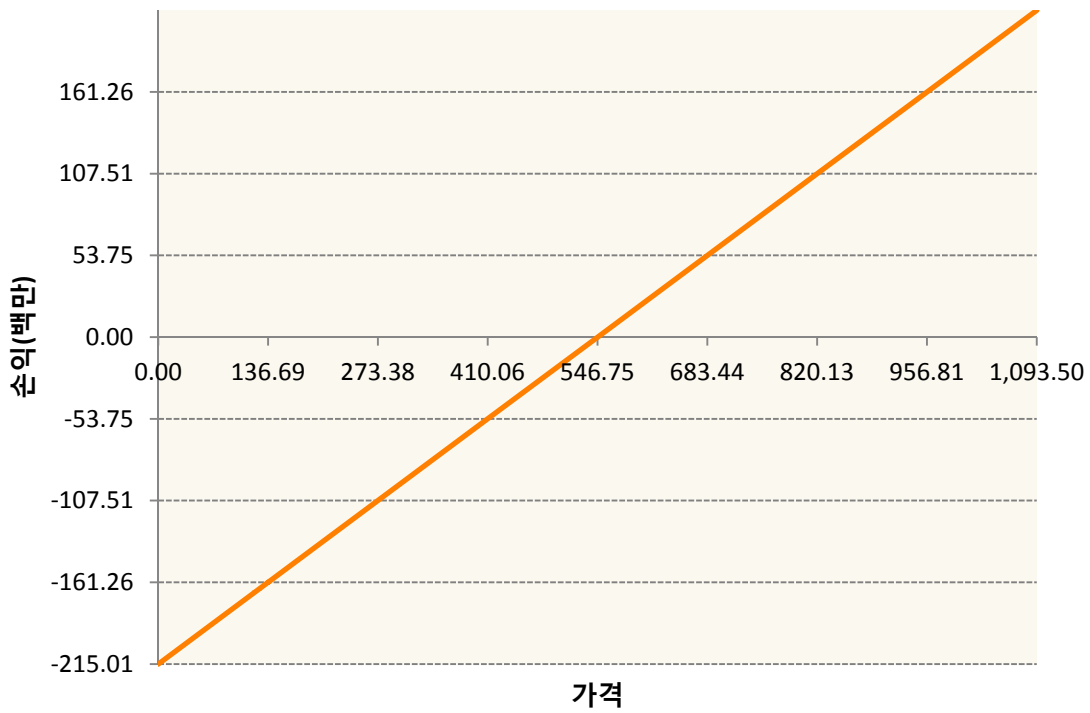




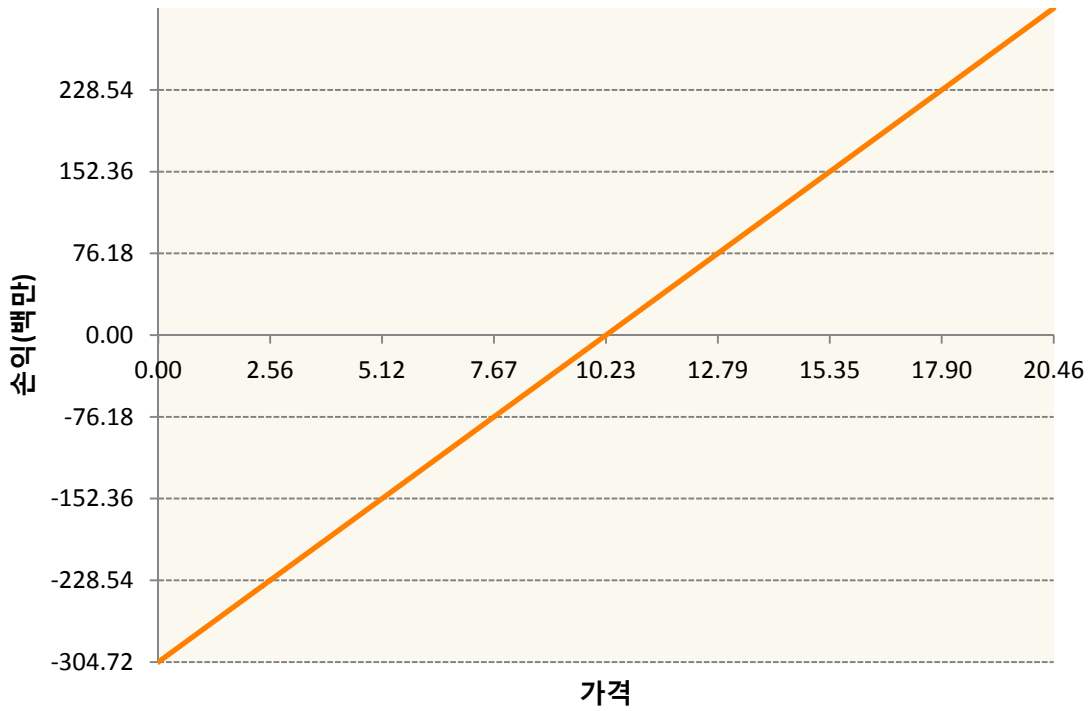
KR4175N90000-2018-09 달러선물



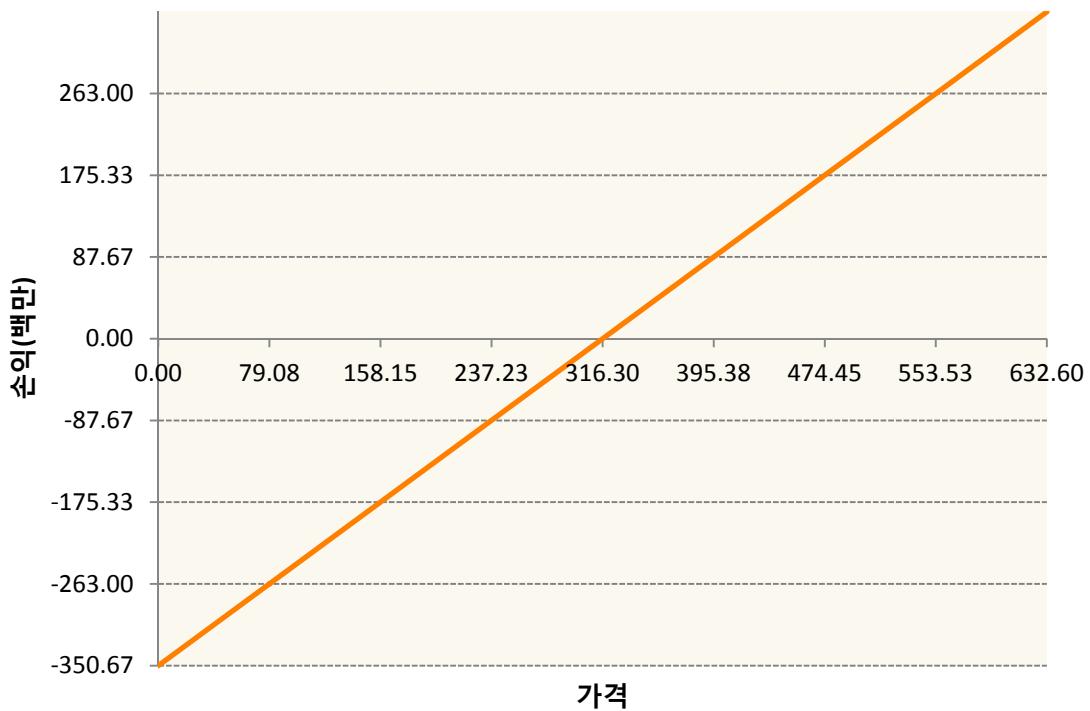
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

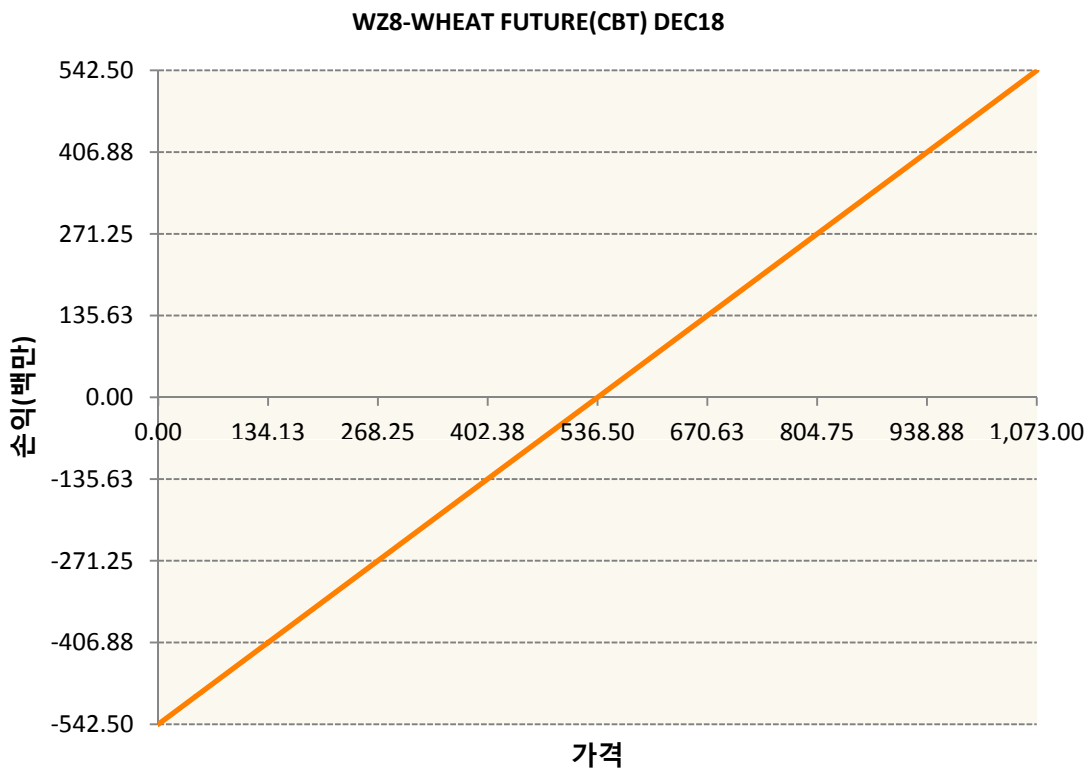
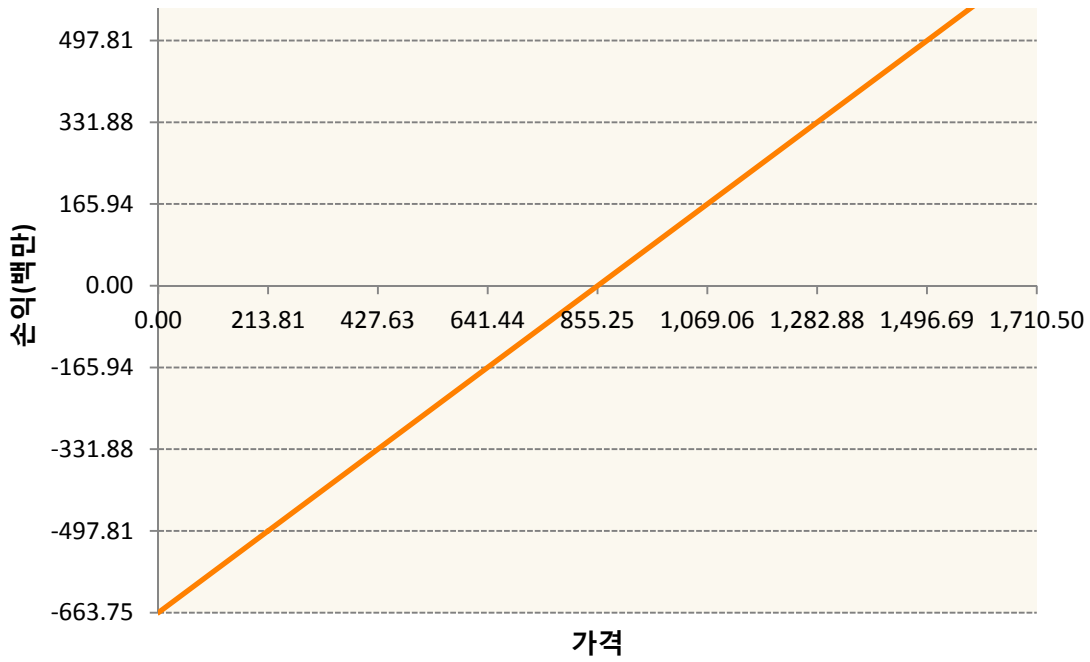


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	23
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	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	43

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

(단위:백만원)

**310**