

공시일	2018-08-29
기준일	2018-08-28

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	2018-08-29
기준일	2018-08-28

스마트인덱스모

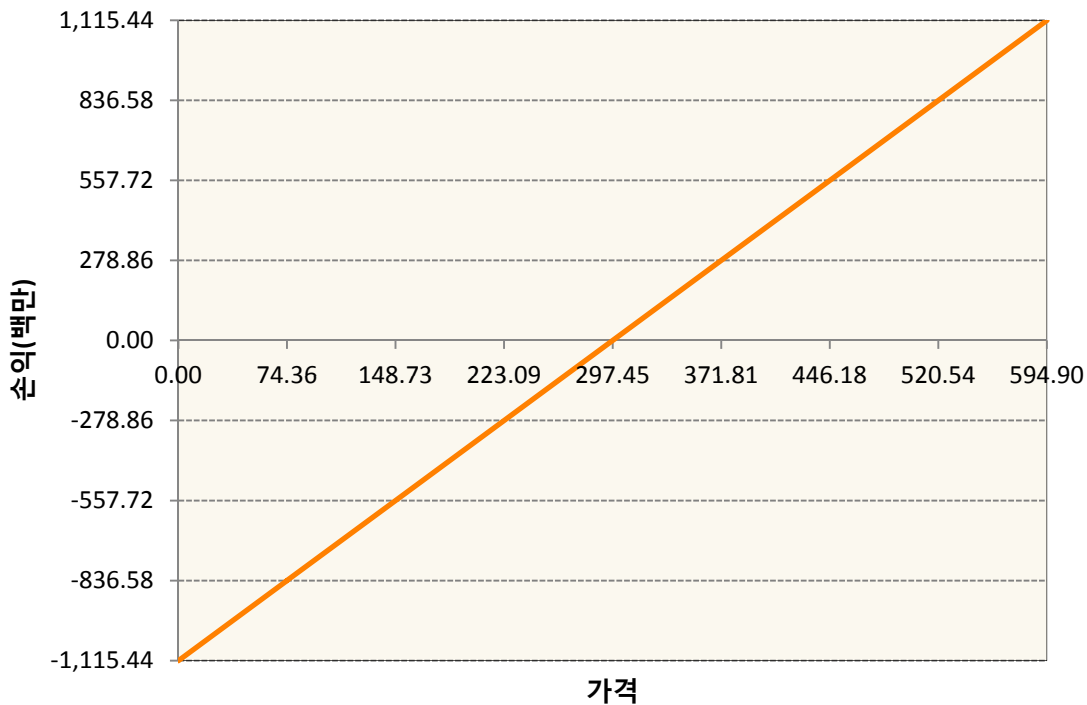
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,115	0	1,115	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	2018-08-29
기준일	2018-08-28

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

1,156

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

495

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-29
기준일	2018-08-28

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

309

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

390

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-29
기준일	2018-08-28

유로인덱스모(주식-파생형)

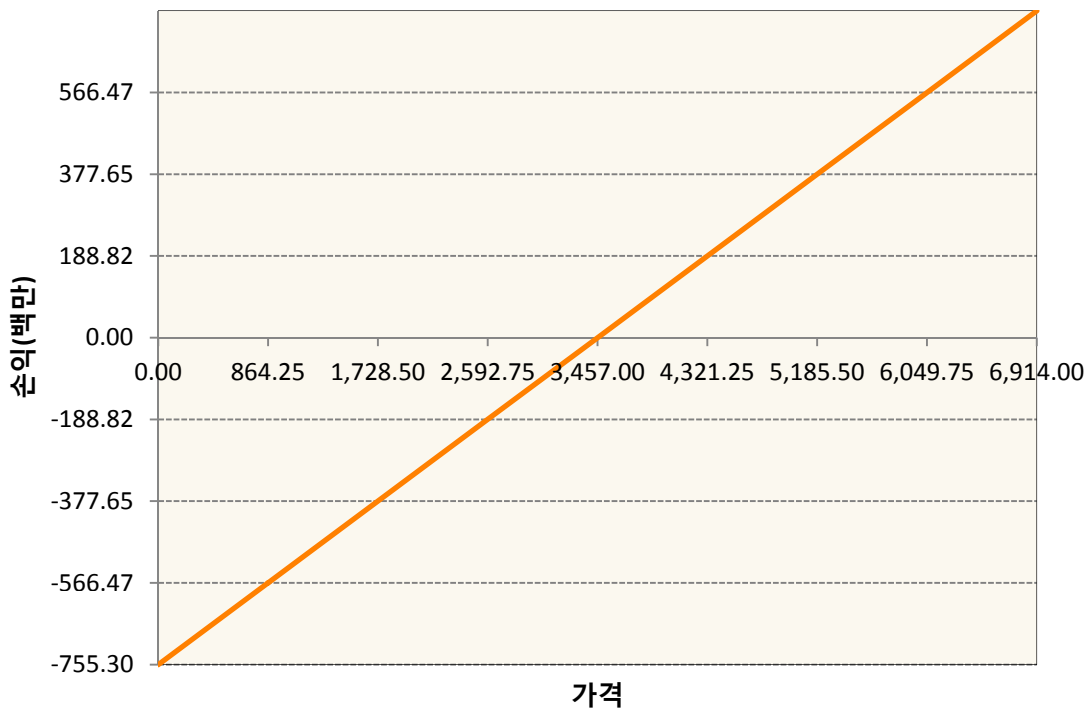
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	755	0	755	

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)

38

공시일	2018-08-29
기준일	2018-08-28

차이나인덱스모(주식-파생형)

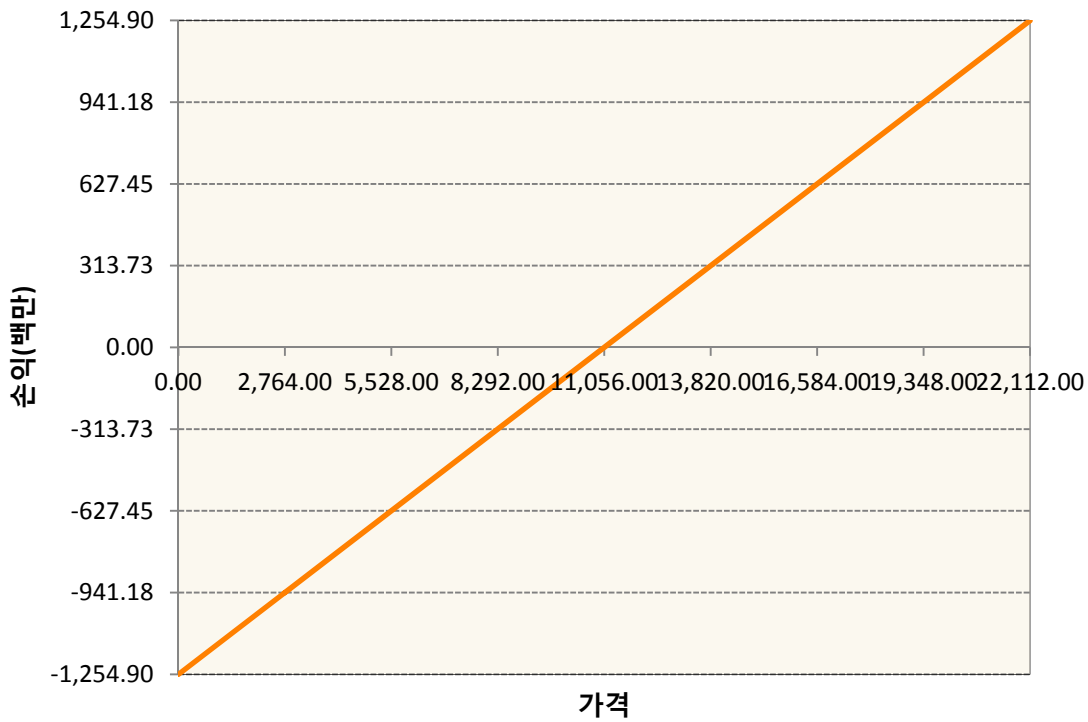
1. 계약금액

(단위:백만원)

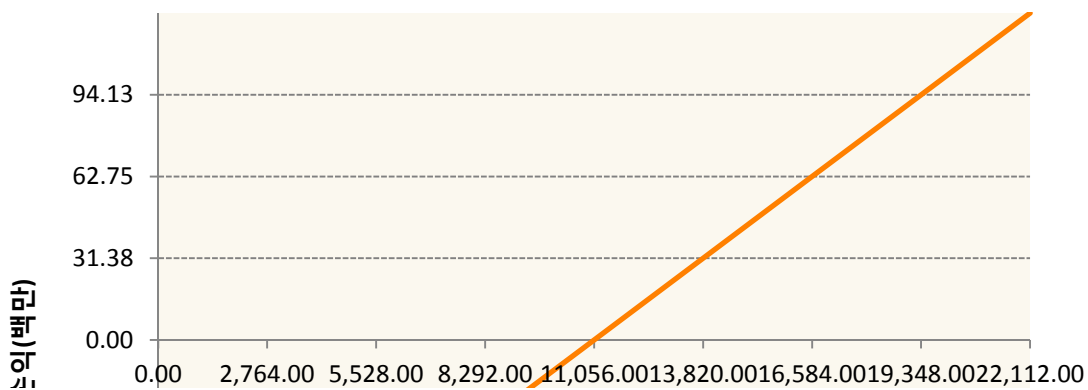
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	126	0	126	
누계	유가증권	선물	1,255	0	1,255	장내

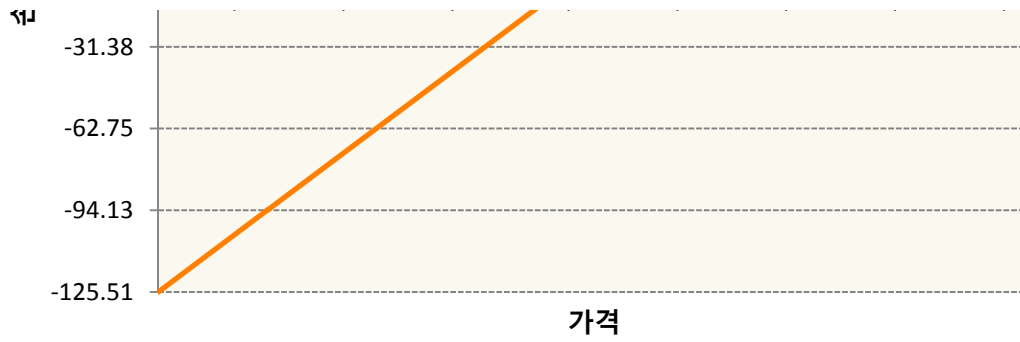
2. 만기시점의 손익구조

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)

102

공시일	2018-08-29
기준일	2018-08-28

커버드콜모(주식혼합-파생형)

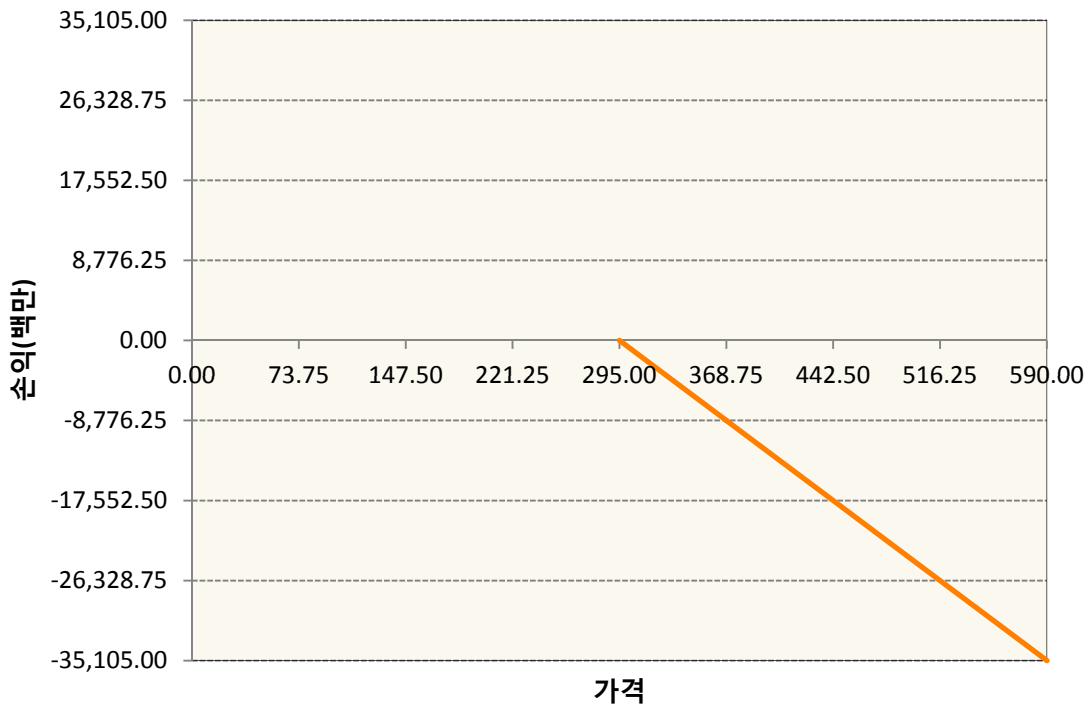
1. 계약금액

(단위:백만원)

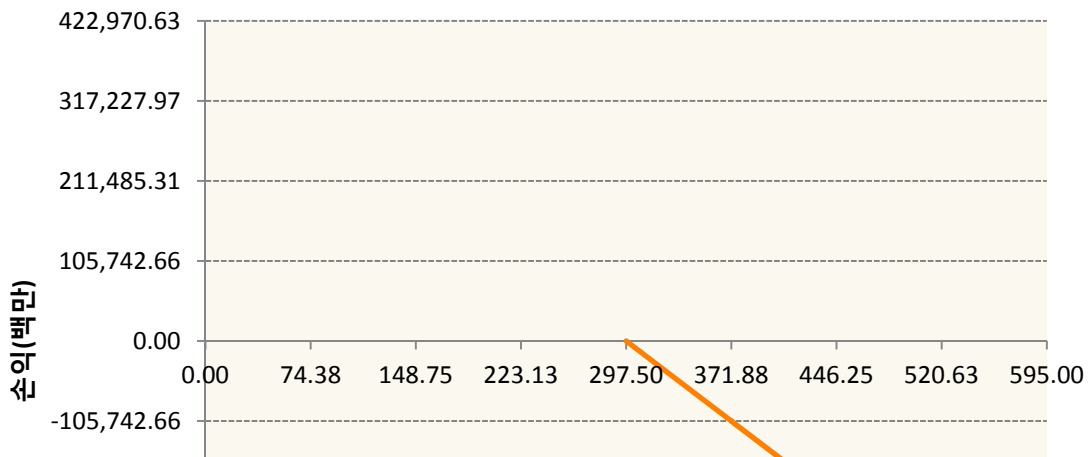
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	3,687	1,127	2,560	장내
누계	유가증권	옵션	0	759,294	-759,294	장내

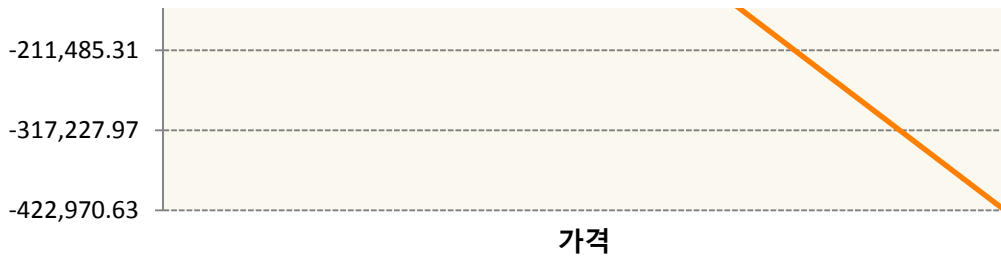
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92950-2018-09 콜295

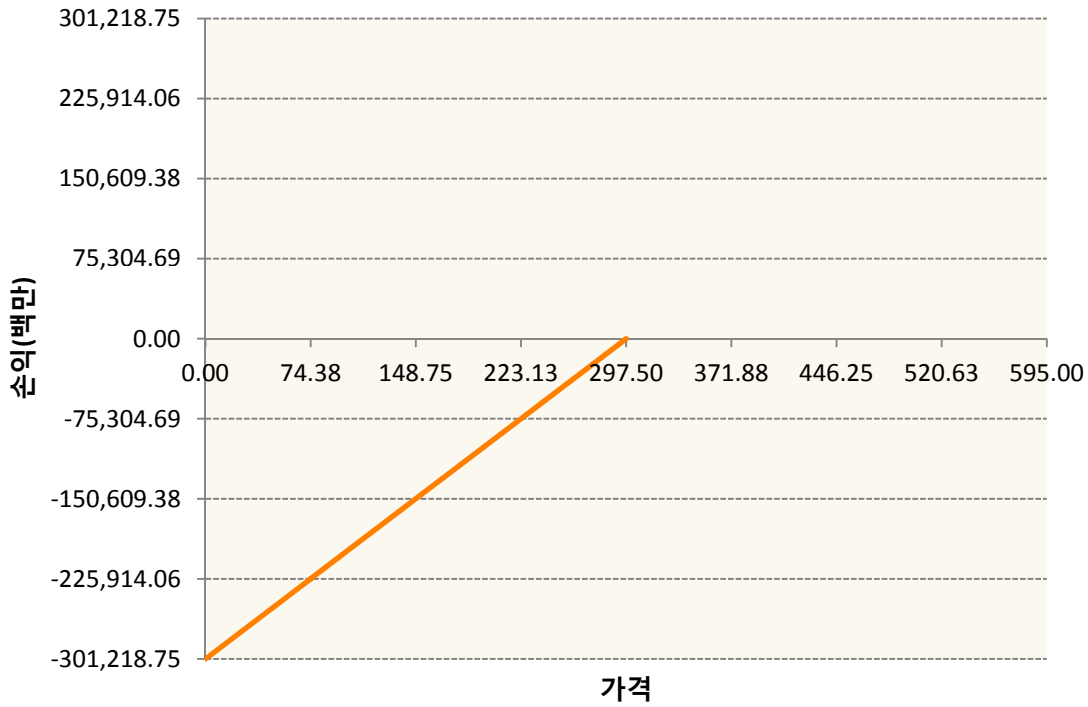


KR4201N92976-2018-09 콜297.5





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N929 2018-09 콜295

2,304

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	907	893	873	850	822	792	758
-5.33%	833	796	756	712	666	618	567
-2.67%	621	562	502	441	380	318	255
0%	196	131	65	0	-65	-131	-197
2.67%	-456	-506	-559	-614	-671	-729	-788
5.33%	-1,271	-1,299	-1,332	-1,369	-1,410	-1,453	-1,500
8.00%	-2,171	-2,183	-2,199	-2,219	-2,243	-2,272	-2,304

KR4201N929 2018-09 풋297.5

26,265

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,126	8,999	8,824	8,600	8,330	8,018	7,666

-5.33%	8,517	8,166	7,761	7,310	6,821	6,299	5,749
-2.67%	6,602	5,961	5,298	4,616	3,920	3,212	2,495
0%	2,374	1,583	791	0	-791	-1,583	-2,374
2.67%	-4,595	-5,279	-5,982	-6,702	-7,433	-8,174	-8,922
5.33%	-13,806	-14,230	-14,707	-15,229	-15,787	-16,375	-16,990
8.00%	-24,311	-24,505	-24,757	-25,064	-25,421	-25,823	-26,265

KR4301N929 2018-09 풋 297.5

21,166

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21,155	-21,155	-21,155	-21,156	-21,157	-21,161	-21,166
-5.33%	-13,140	-13,146	-13,156	-13,175	-13,202	-13,239	-13,287
-2.67%	-5,297	-5,393	-5,506	-5,636	-5,779	-5,935	-6,100
0%	764	509	255	0	-255	-509	-764
2.67%	2,971	2,853	2,717	2,566	2,401	2,226	2,041
5.33%	3,219	3,208	3,188	3,158	3,117	3,062	2,995
8.00%	3,226	3,226	3,225	3,223	3,218	3,210	3,197

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

(단위:백만원)

54,521

공시일	2018-08-29
기준일	2018-08-28

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

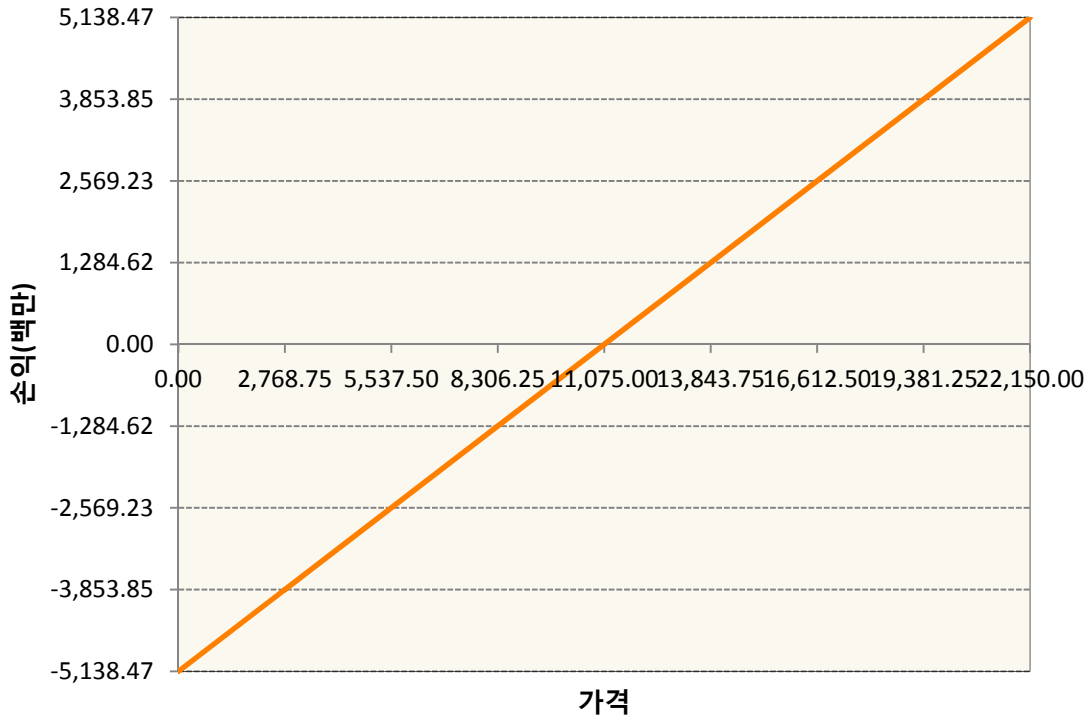
1. 계약금액

(단위:백만원)

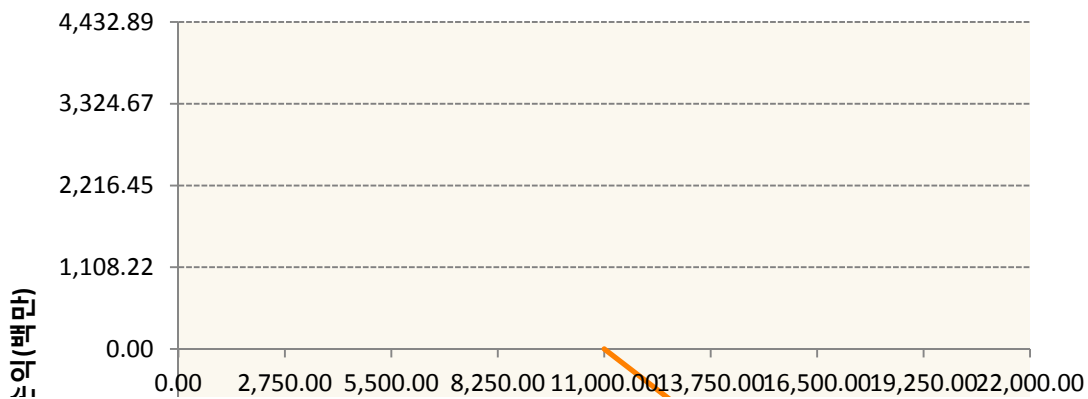
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,138	0	5,138	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,400	-11,400	장내

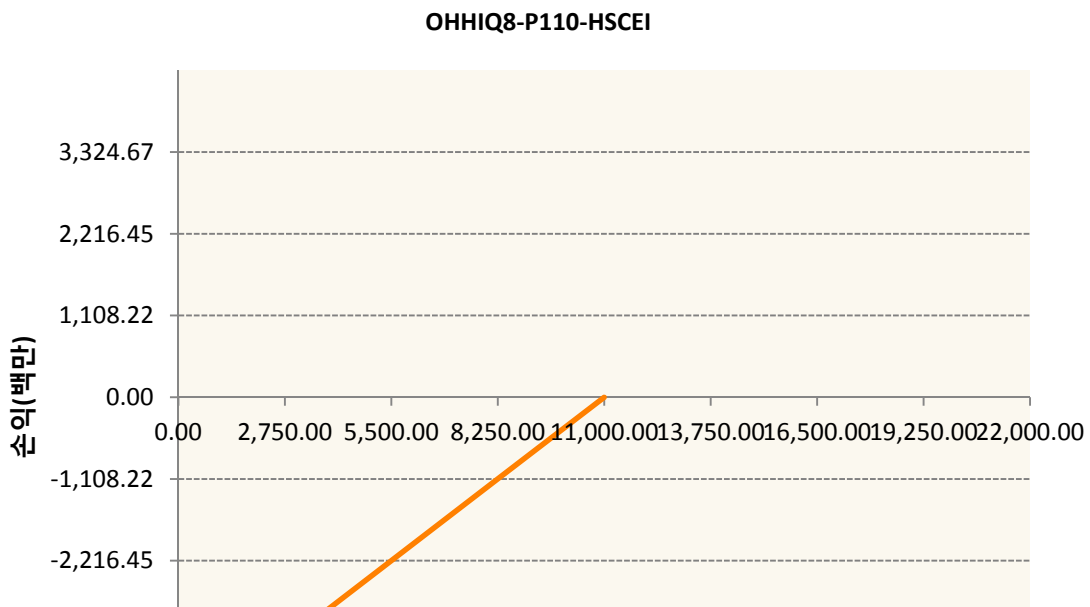
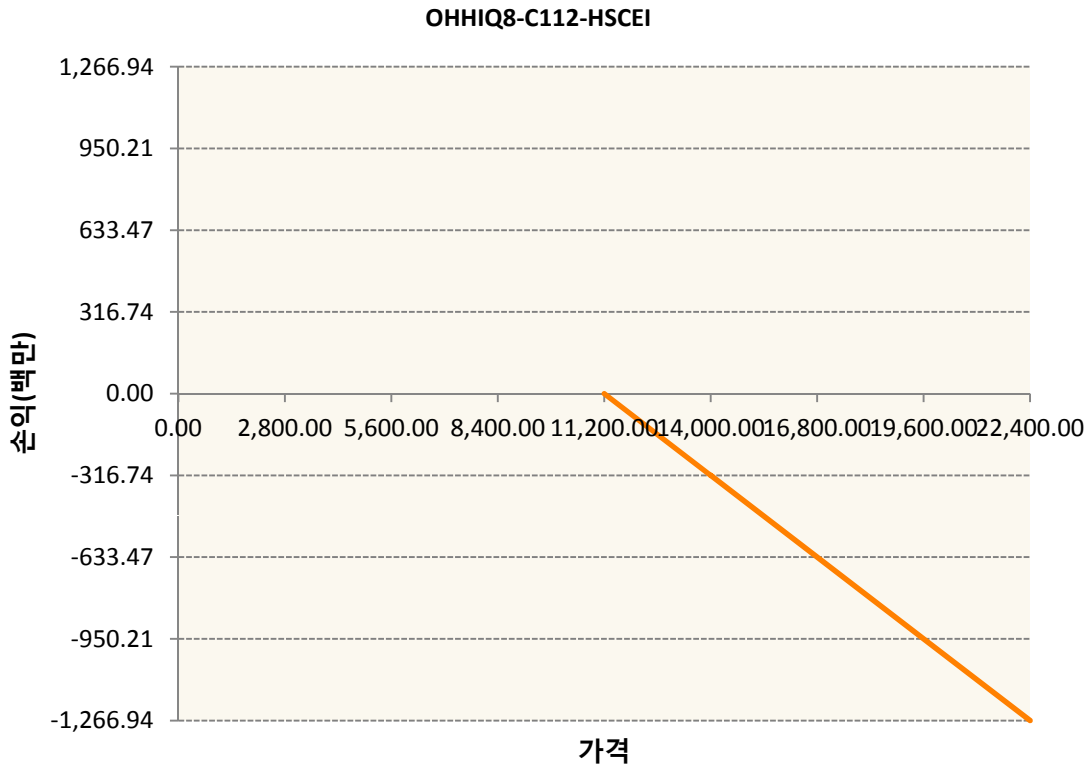
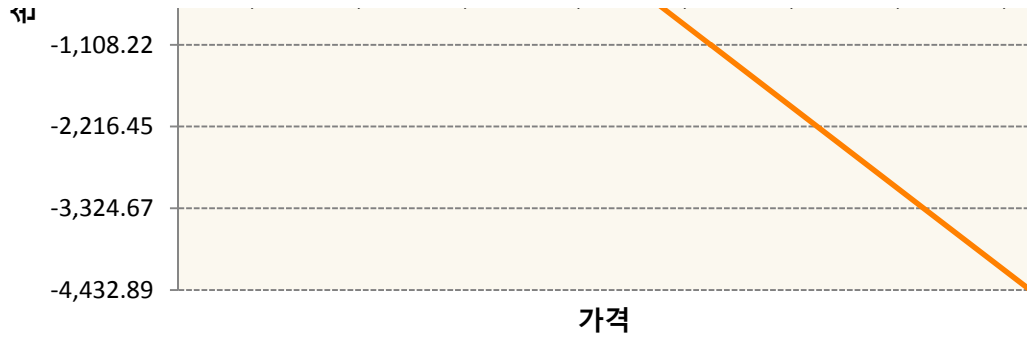
2. 만기시점의 손익구조

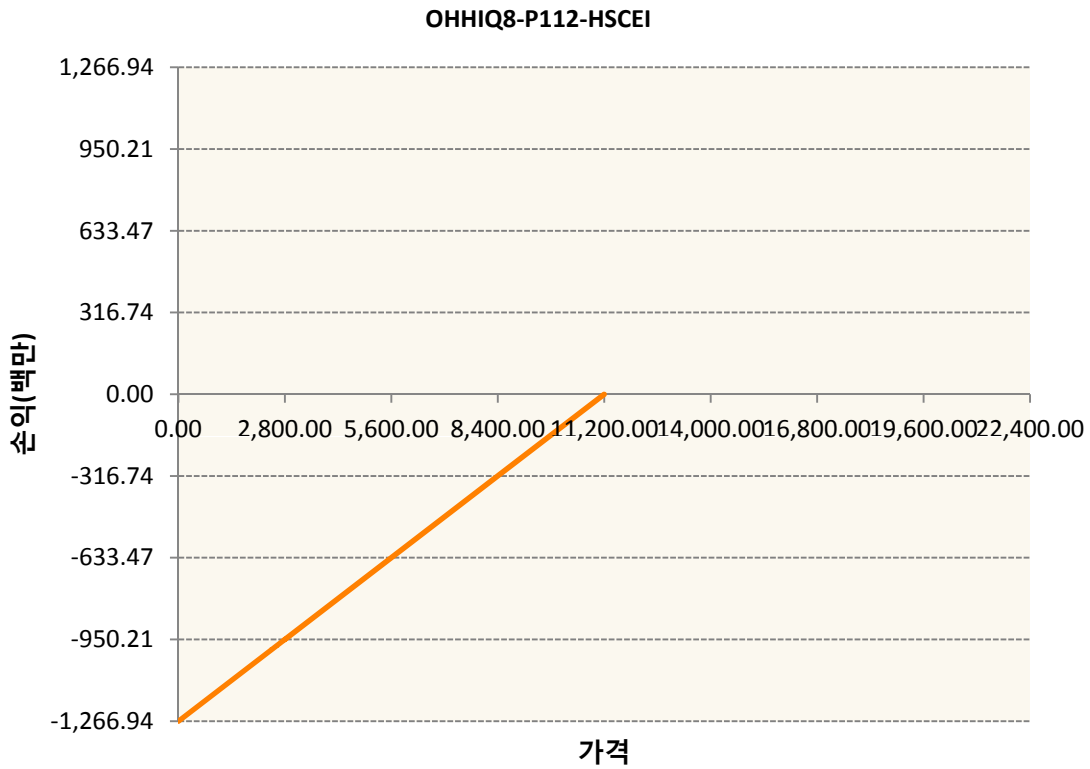
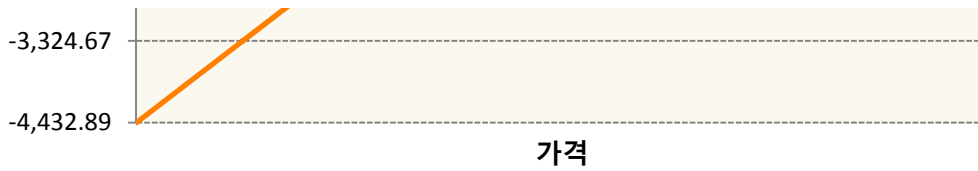
HCQ8-HSCEI Futures Aug18



OHHIQ8-C110-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ8	HSCEI Futures Aug18	411
OHHIQ8-C1	HSCEI	355
OHHIQ8-C1	HSCEI	101
OHHIQ8-P11	HSCEI	355
OHHIQ8-P11	HSCEI	101

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,216

공시일	2018-08-29
기준일	2018-08-28

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

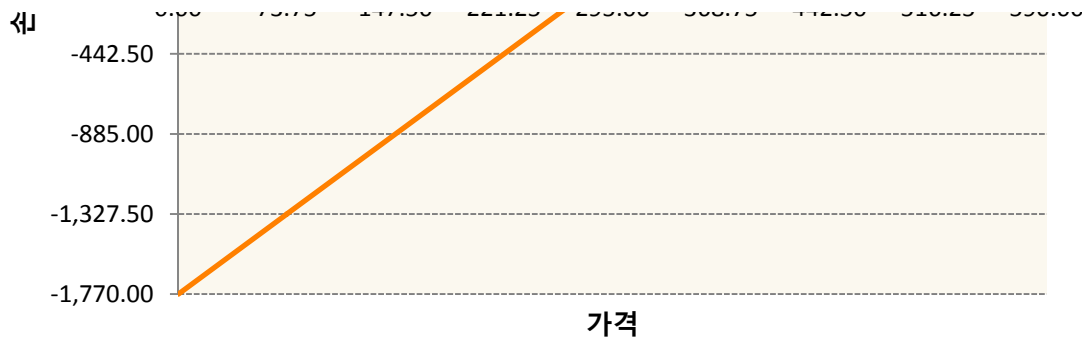
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92976-2018-09 콜297.5

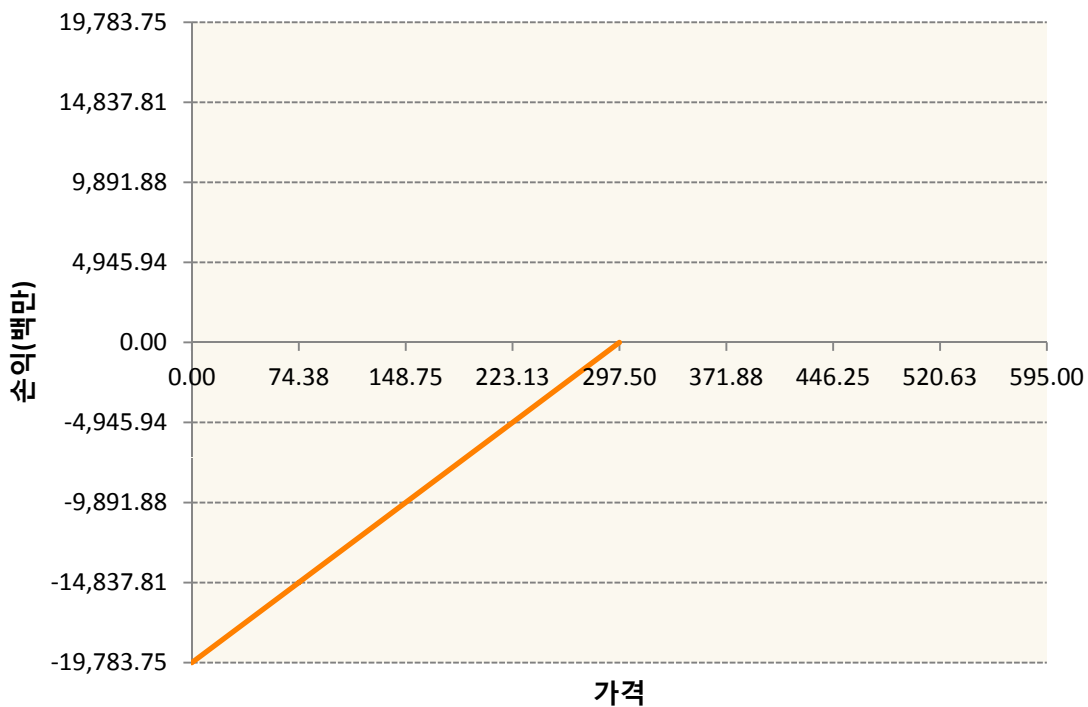


KR4301N92958-2018-09 풋295





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,951
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,951	-3,951	-3,951	-3,951	-3,951	-3,951	-3,951
-5.33%	-2,634	-2,634	-2,634	-2,634	-2,634	-2,634	-2,634
-2.67%	-1,317	-1,317	-1,317	-1,317	-1,317	-1,317	-1,317
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,317	1,317	1,317	1,317	1,317	1,317	1,317
5.33%	2,634	2,634	2,634	2,634	2,634	2,634	2,634
8.00%	3,951	3,951	3,951	3,951	3,951	3,951	3,951
KR4201N92974-2018-09 풋297.5							1,746
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	607	598	586	572	554	533	510
-5.33%	566	543	516	486	453	419	382
-2.67%	439	396	352	307	261	213	166
0%	158	105	53	0	-53	-105	-158
2.67%	-305	-351	-398	-445	-494	-543	-593
5.33%	-918	-946	-978	-1,012	-1,049	-1,088	-1,129
8.00%	-1,616	-1,629	-1,646	-1,666	-1,690	-1,716	-1,746

KR4301N929 2018-09 풋295

117

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117
-5.33%	-70	-70	-70	-70	-71	-71	-71
-2.67%	-25	-26	-27	-28	-29	-30	-31
0%	4	3	1	0	-1	-3	-4
2.67%	12	11	11	10	10	9	8
5.33%	12	12	12	12	12	12	12
8.00%	12	12	12	12	12	12	12

KR4301N929 2018-09 풋297.5

1,390

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,389	-1,389	-1,389	-1,389	-1,390	-1,390	-1,390
-5.33%	-863	-863	-864	-865	-867	-870	-873
-2.67%	-348	-354	-362	-370	-380	-390	-401
0%	50	33	17	0	-17	-33	-50
2.67%	195	187	178	169	158	146	134
5.33%	211	211	209	207	205	201	197
8.00%	212	212	212	212	211	211	210

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

(단위:백만원)

7,535

공시일	2018-08-29
기준일	2018-08-28

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

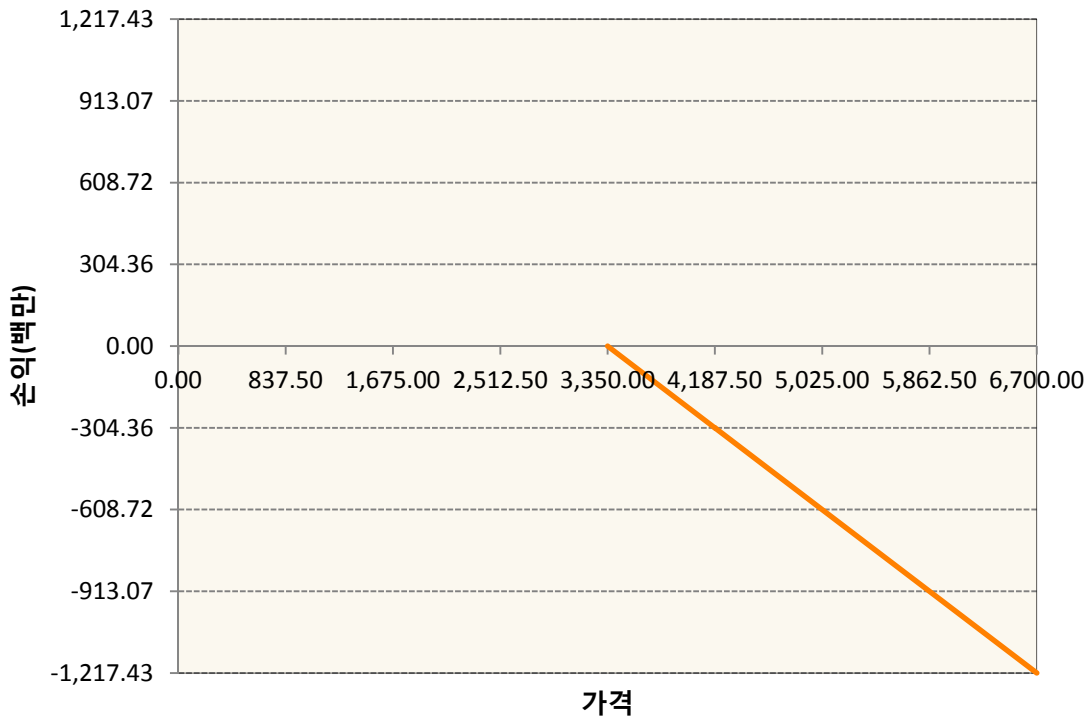
1. 계약금액

(단위:백만원)

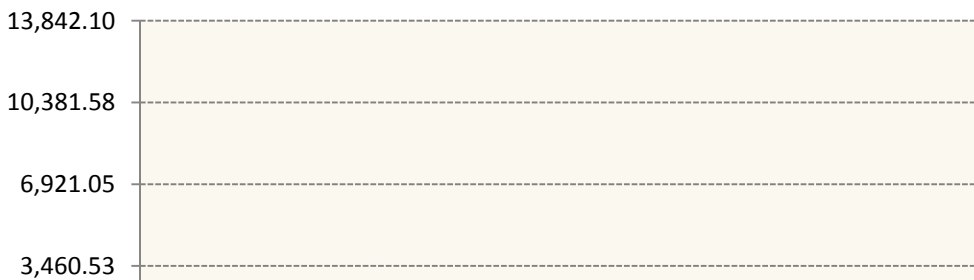
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	8,244	0	8,244	
누계	유가증권	옵션	0	30,119	-30,119	장내
누계	지수	스왑	86,963	0	86,963	장외

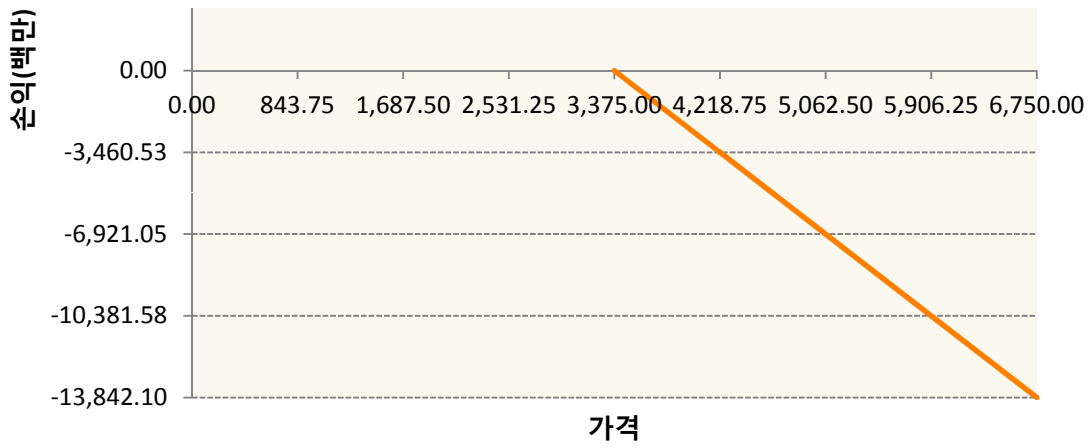
2. 만기시점의 손익구조

OESXU8-C3350-EURO STOXX 50

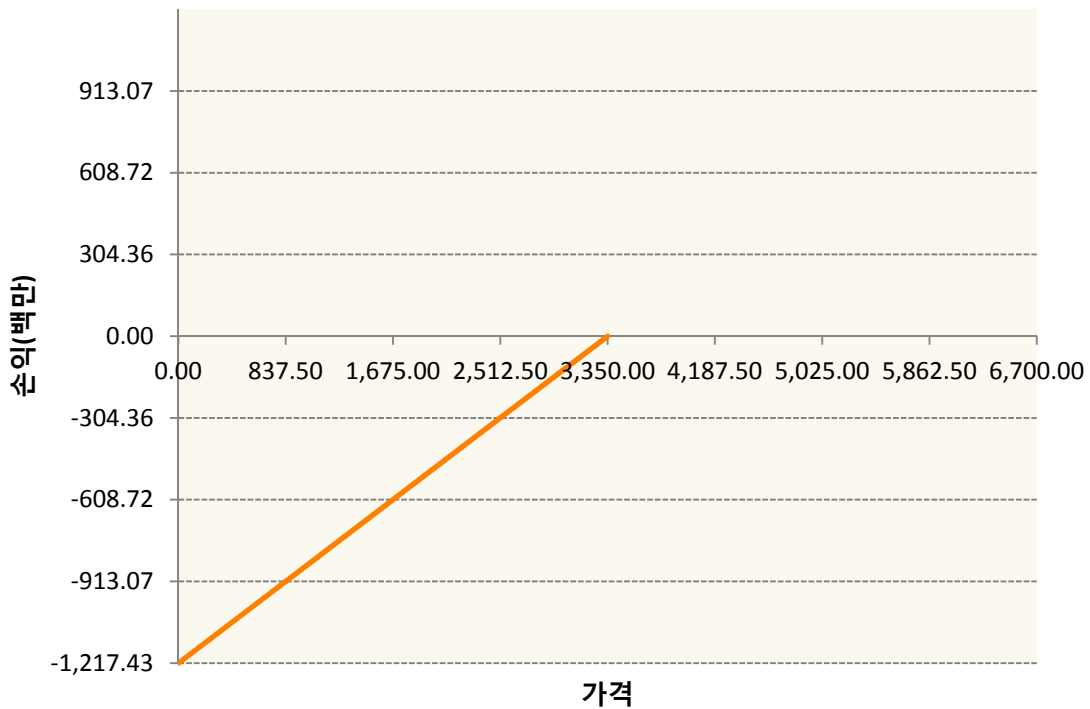


OESXU8-C3375-EURO STOXX 50

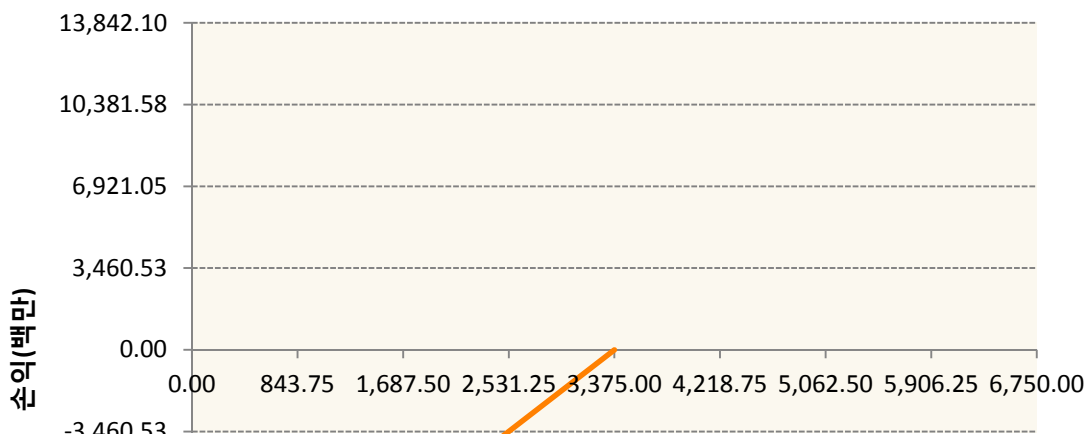


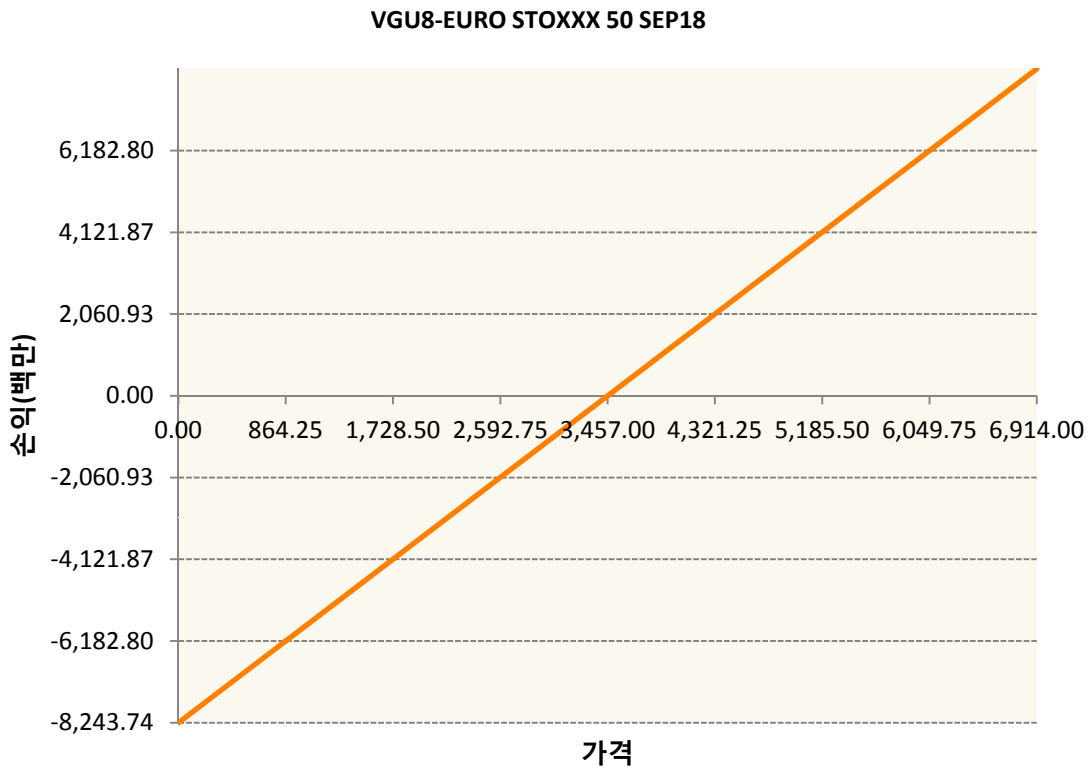
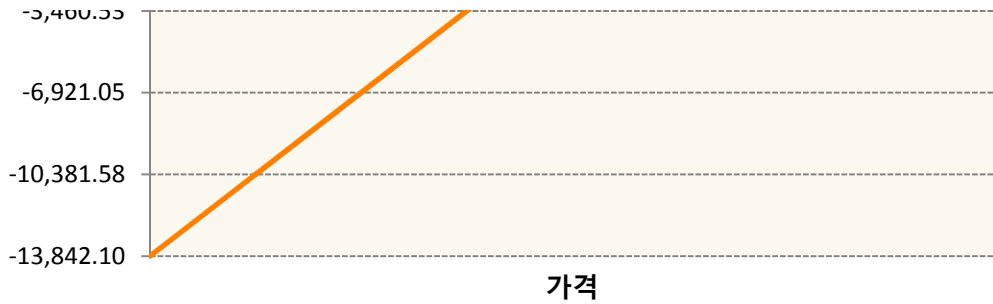


OESXU8-P3350-EURO STOXX 50



OESXU8-P3375-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	6
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY	4
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	659

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

1,925

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

(단위:백만원)

1,132

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)

162

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-08-29
기준일	2018-08-28

리디파인K200(주식혼합-파생재간

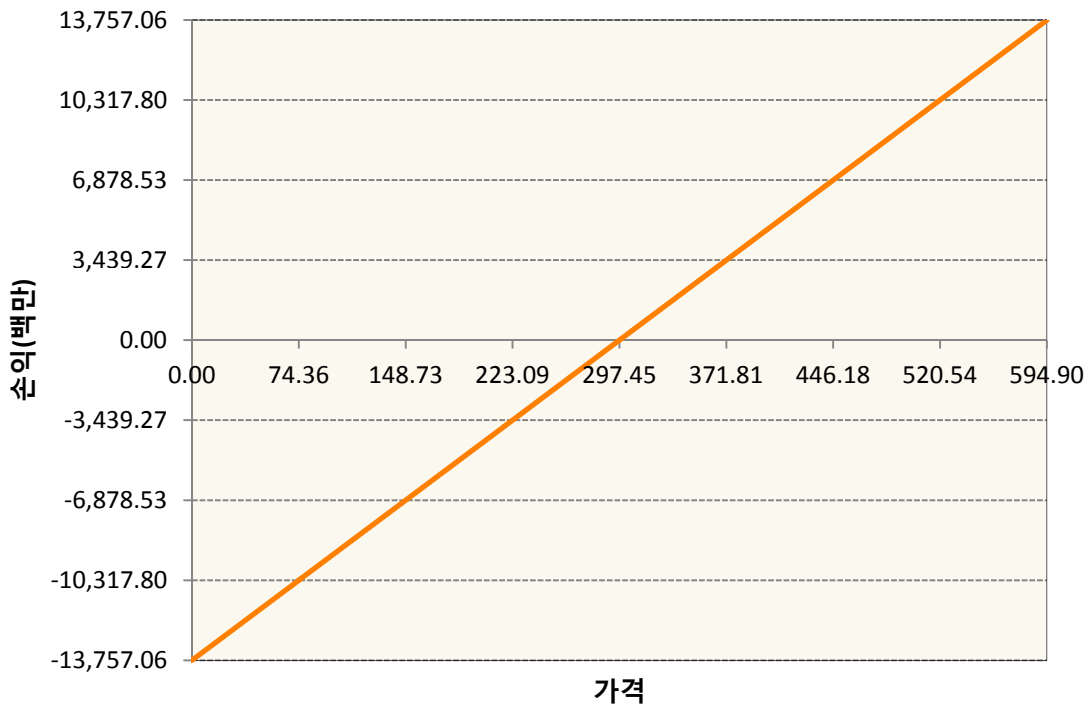
1. 계약금액

(단위:백만원)

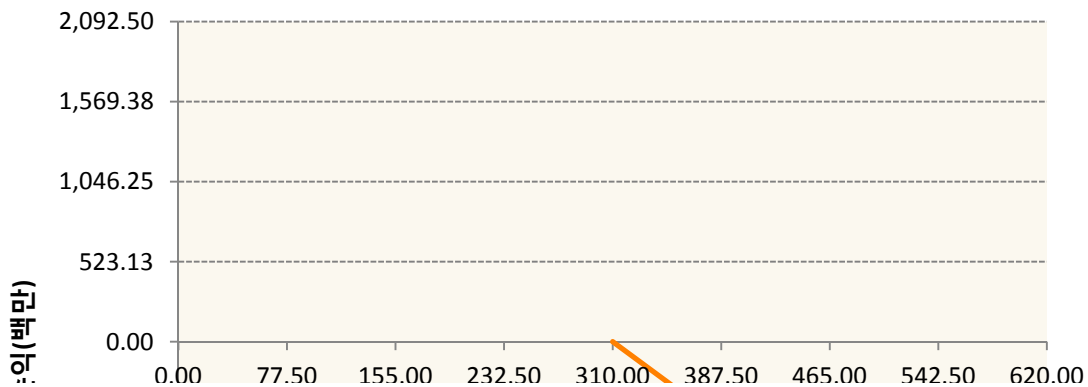
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,757	0	13,757	장내
누계	유가증권	옵션	1,339	24,671	-23,332	장내

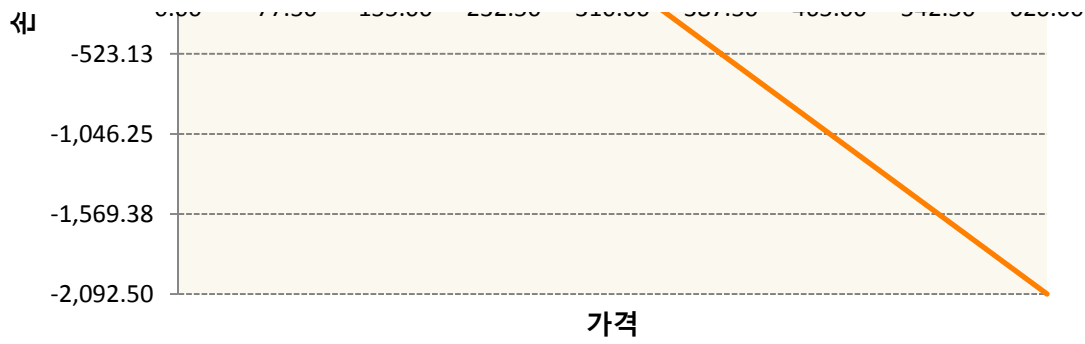
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

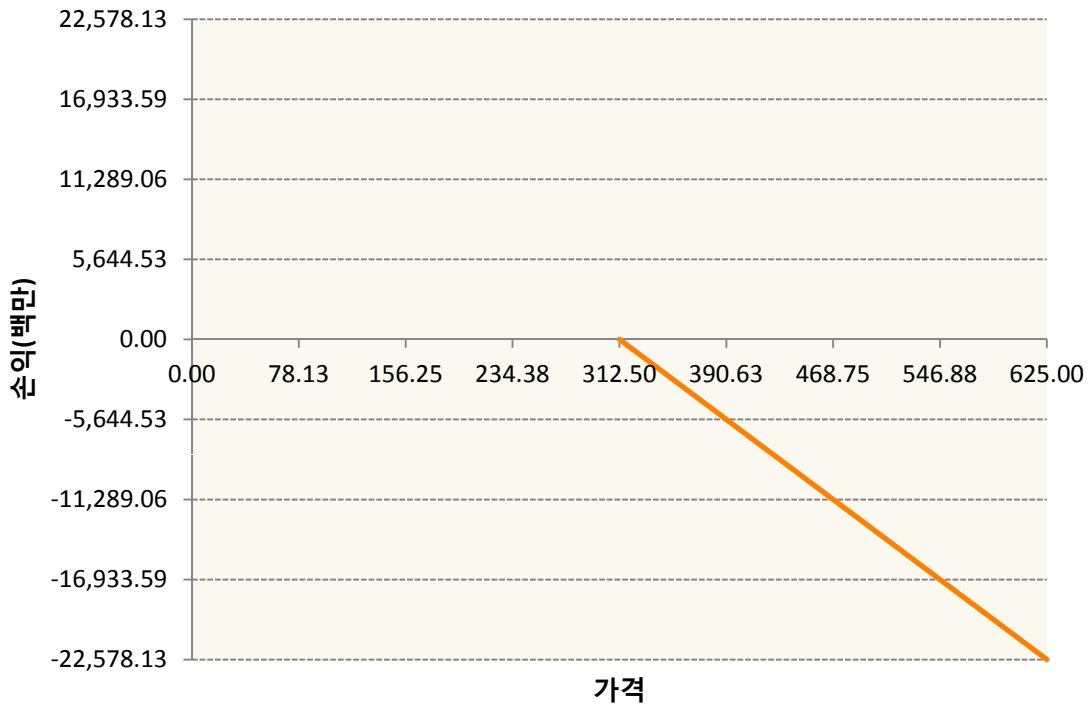


KR4201N93107-2018-09 콜310

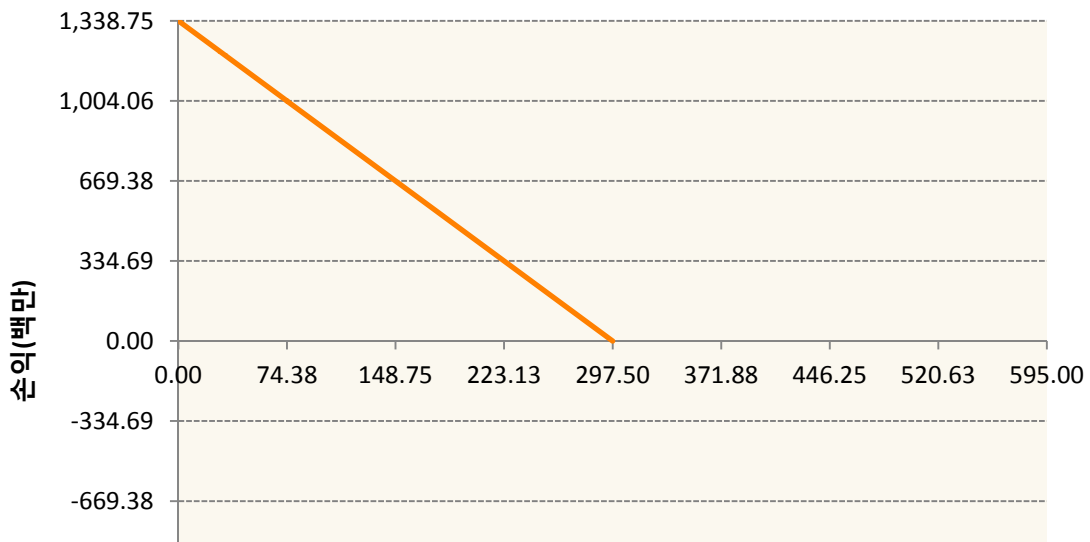


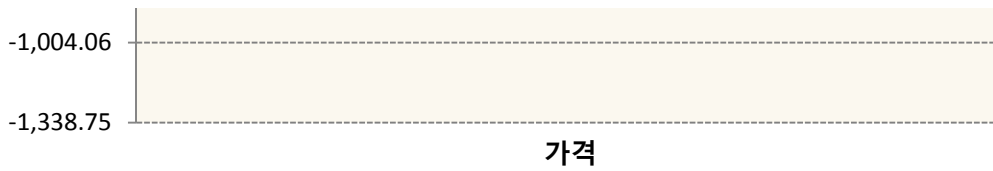


KR4201N93123-2018-09 콜312.5



KR4301N92974-2018-09 풋297.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물							1,100
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,100	-1,100	-1,100	-1,100	-1,100	-1,100	-1,100
-5.33%	-733	-733	-733	-733	-733	-733	-733
-2.67%	-367	-367	-367	-367	-367	-367	-367
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	367	367	367	367	367	367	367
5.33%	733	733	733	733	733	733	733
8.00%	1,100	1,100	1,100	1,100	1,100	1,100	1,100
KR4201N9312018-09 콜310							89
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15	15	15	15	14	14	13
-5.33%	15	14	14	13	12	11	10
-2.67%	13	12	11	9	7	5	3
0%	8	5	3	0	-3	-6	-9
2.67%	-6	-9	-13	-17	-21	-24	-28
5.33%	-31	-35	-39	-43	-47	-51	-55
8.00%	-69	-72	-75	-78	-82	-85	-89
KR4201N9312018-09 콜312.5							867
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	126	126	125	123	120	116	110
-5.33%	125	122	118	112	104	94	81
-2.67%	114	105	93	79	62	42	21
0%	73	51	27	0	-29	-59	-90
2.67%	-41	-77	-115	-152	-191	-230	-269
5.33%	-274	-316	-358	-401	-443	-485	-527
8.00%	-639	-674	-711	-749	-788	-827	-867
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%	58	58	58	59	59	59	59
-2.67%	24	24	24	25	26	26	27

0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-13	-13	-12	-11	-11	-10	-9
5.33%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-13
8.00%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14

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

(단위:백만원)

1,636

공시일	2018-08-29
기준일	2018-08-28

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

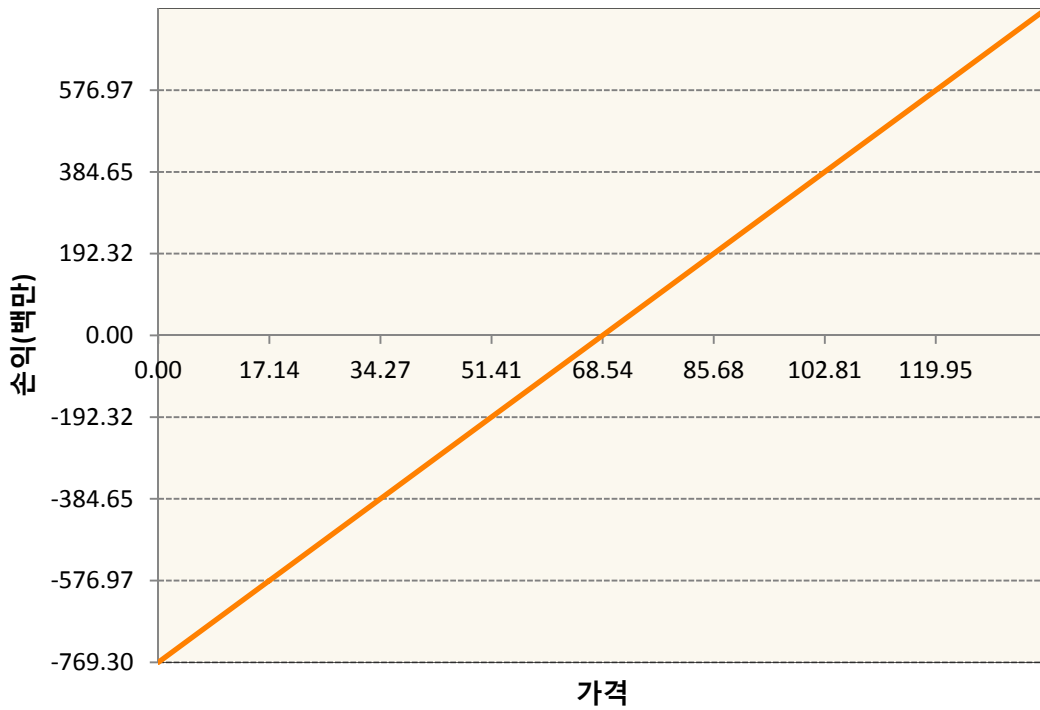
1. 계약금액

(단위:백만원)

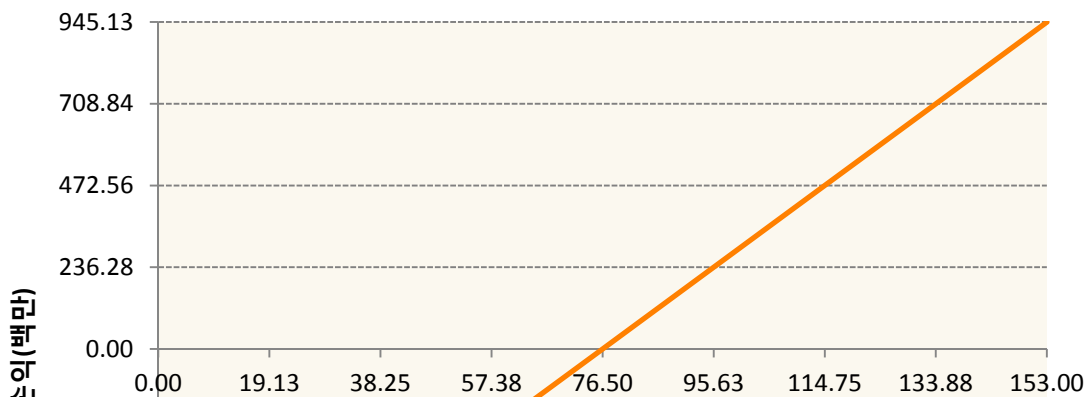
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,155	610	2,544	
누계	유가증권	선물	524	0	524	장내

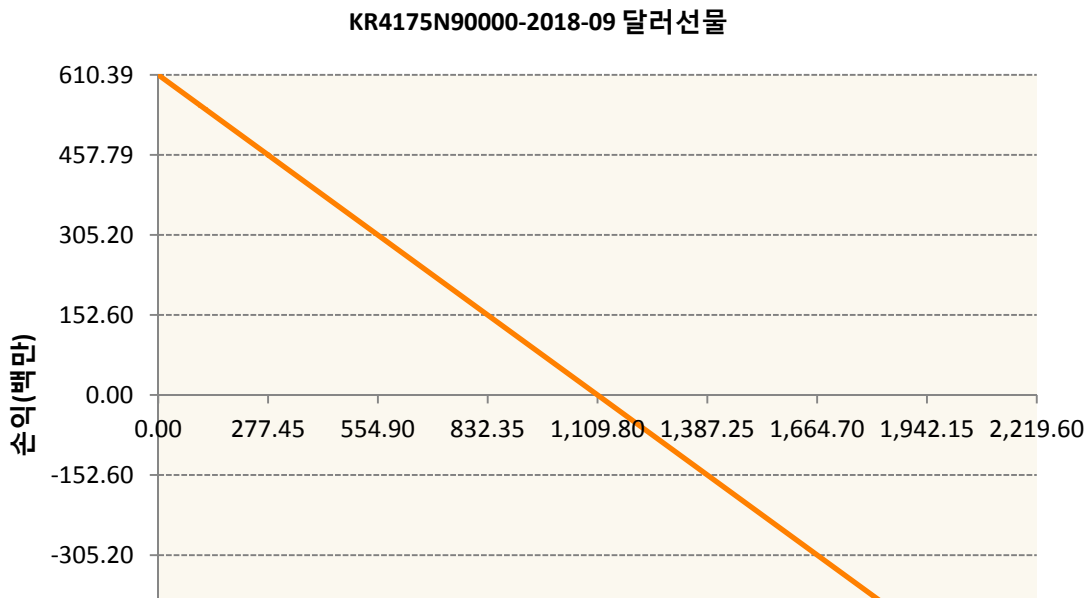
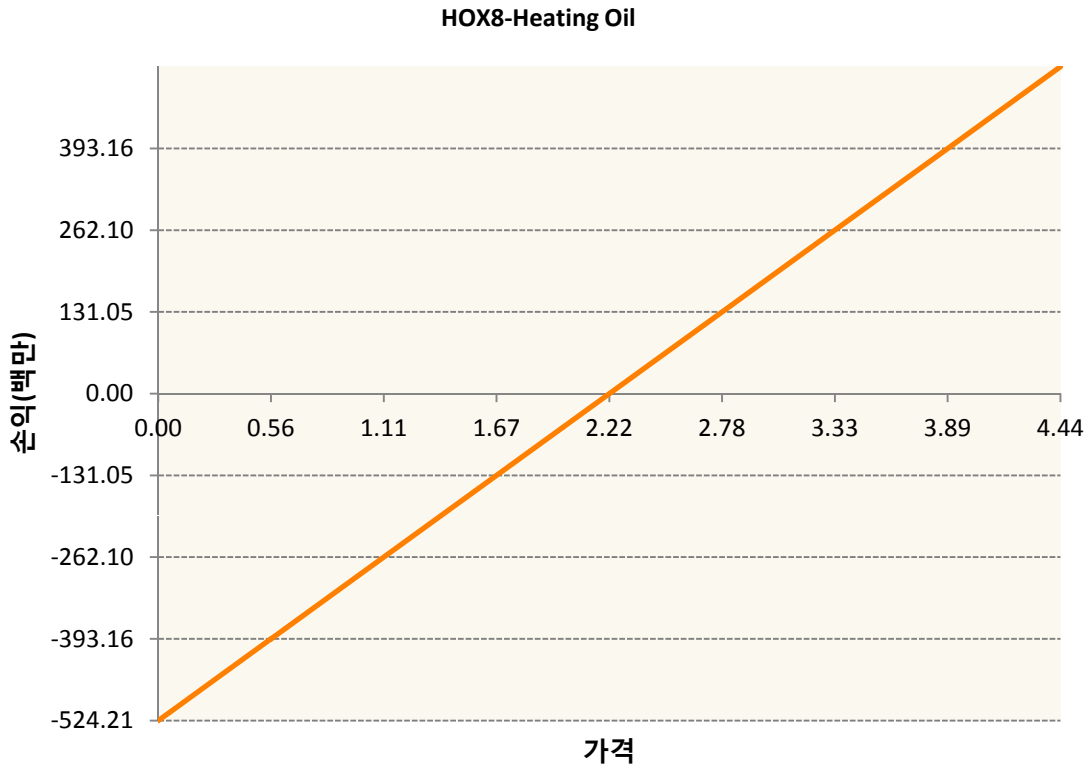
2. 만기시점의 손익구조

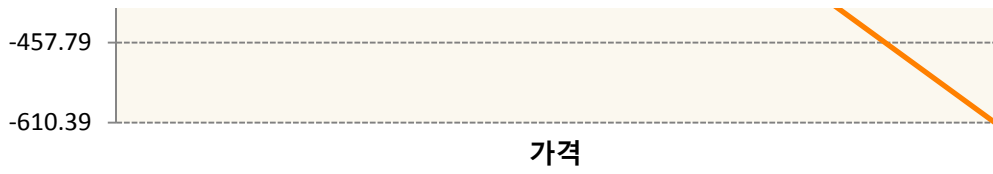
CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18



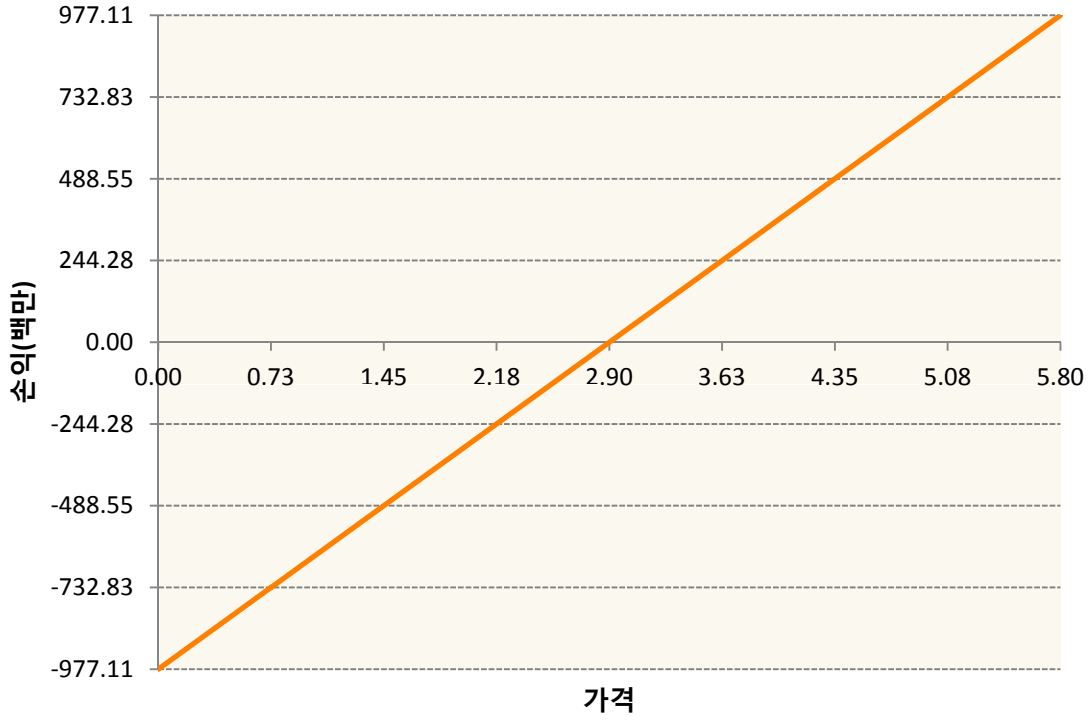
COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18



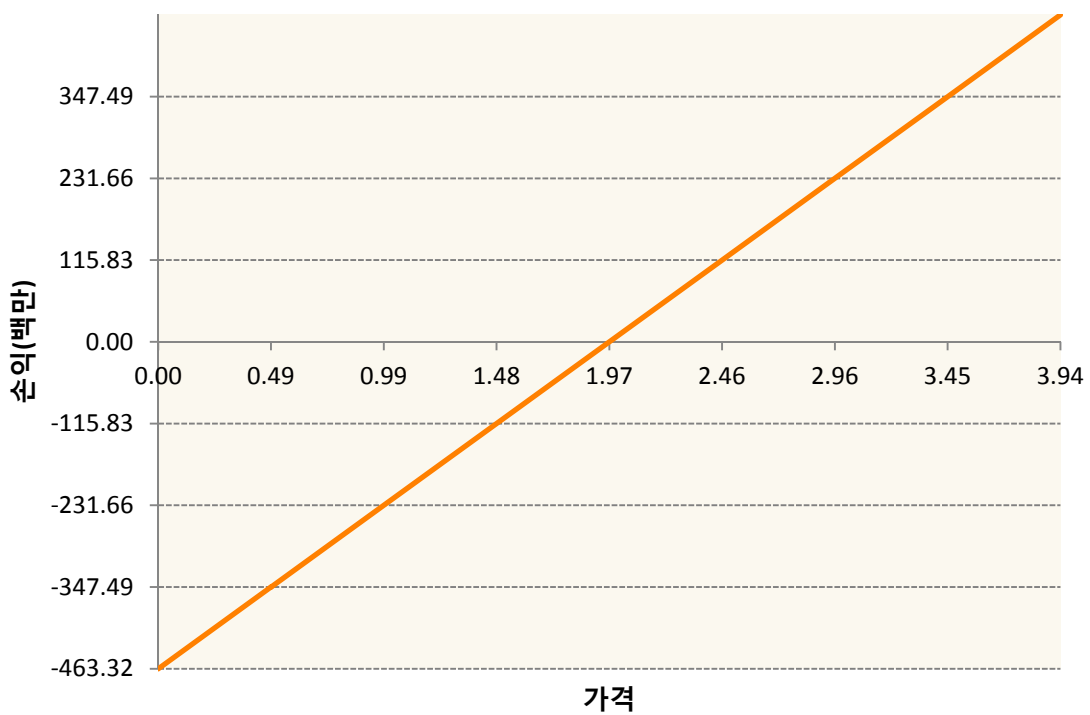




NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18



XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	62
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	76
HOX8	Heating Oil	42
	KR4175N90C 2018-09 달러선물	49
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	78
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	37

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	443

공시일	2018-08-29
기준일	2018-08-28

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

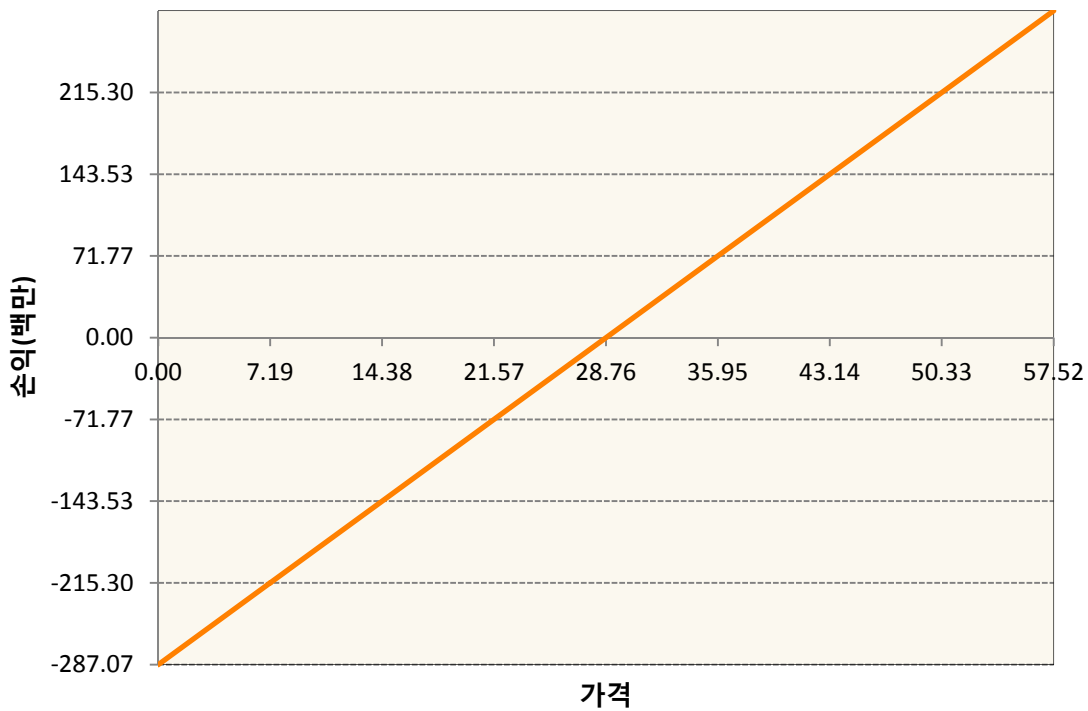
1. 계약금액

(단위:백만원)

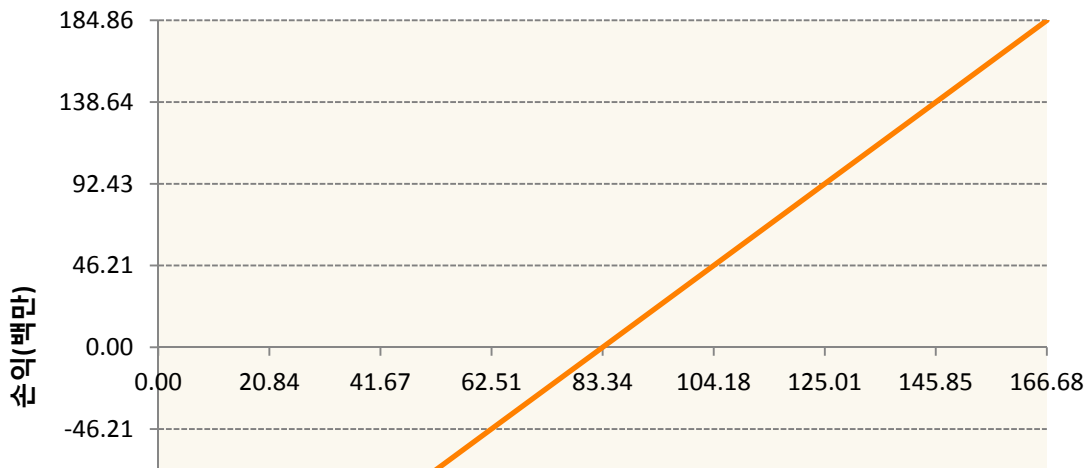
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,605	78	3,527	

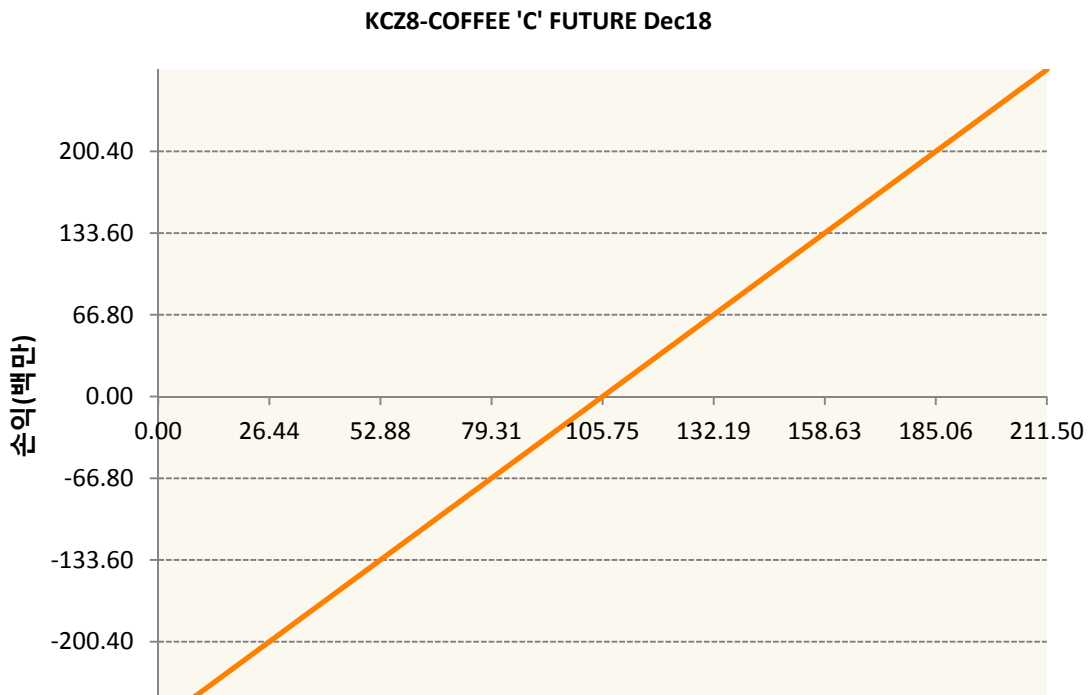
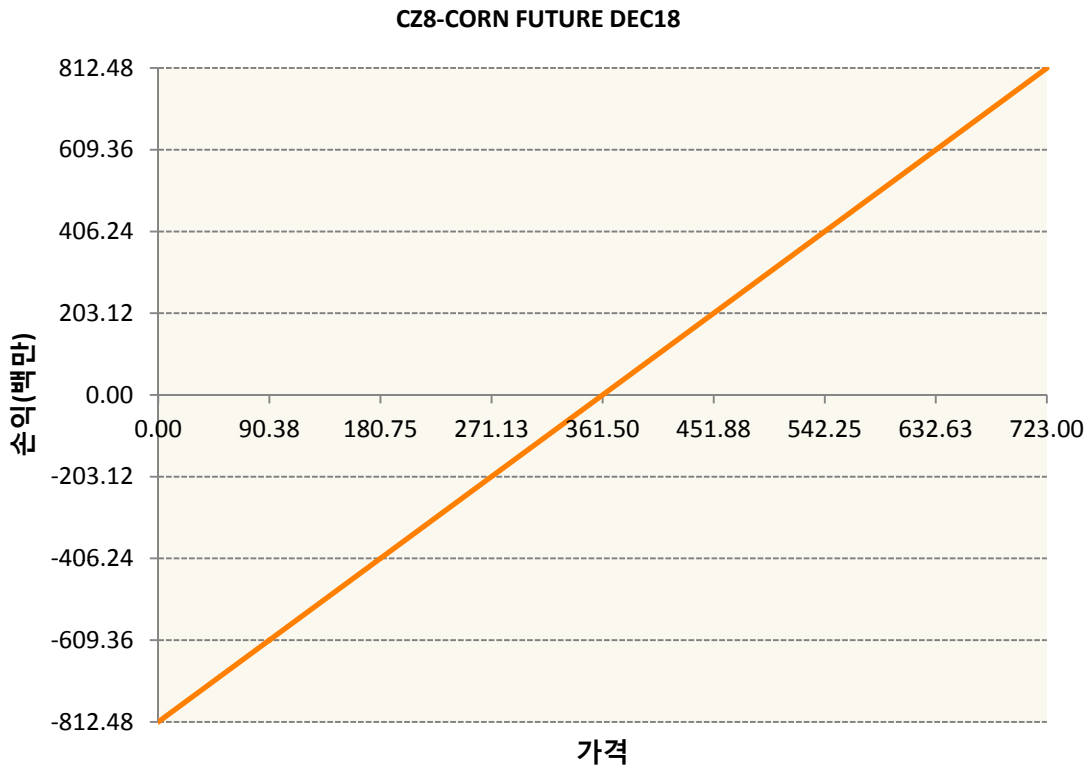
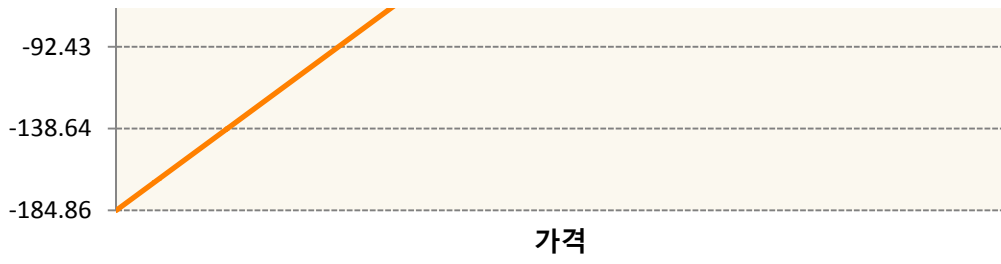
2. 만기시점의 손익구조

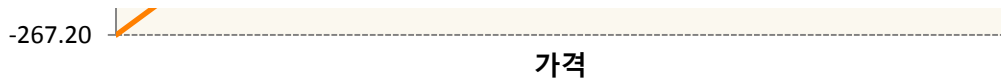
BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18



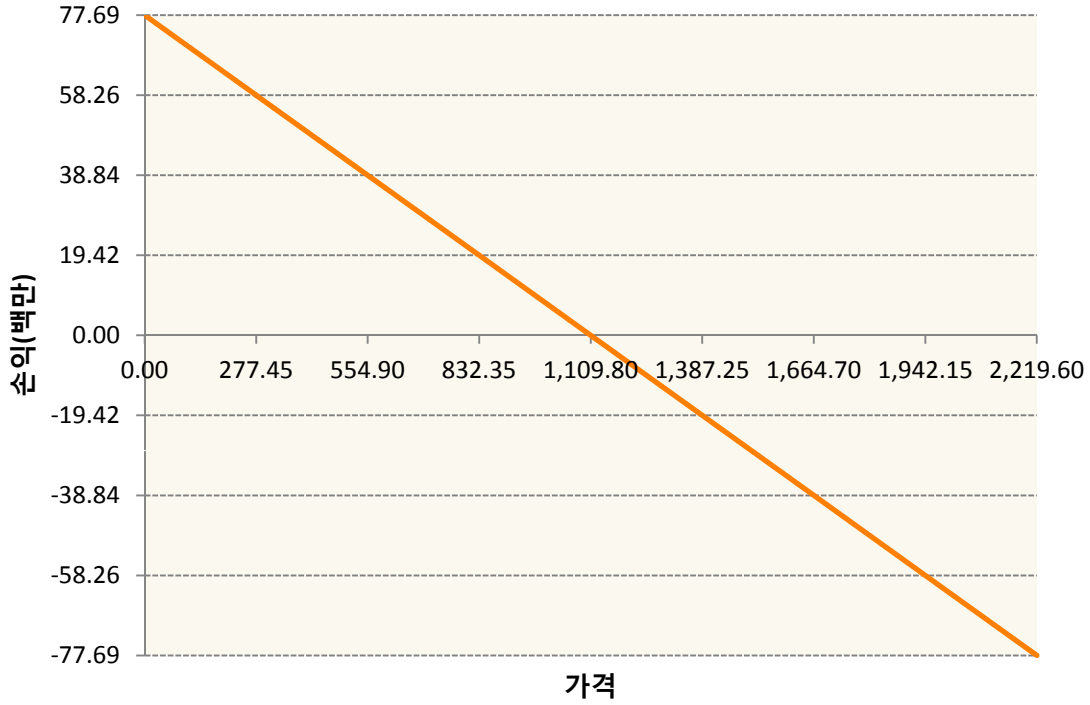
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



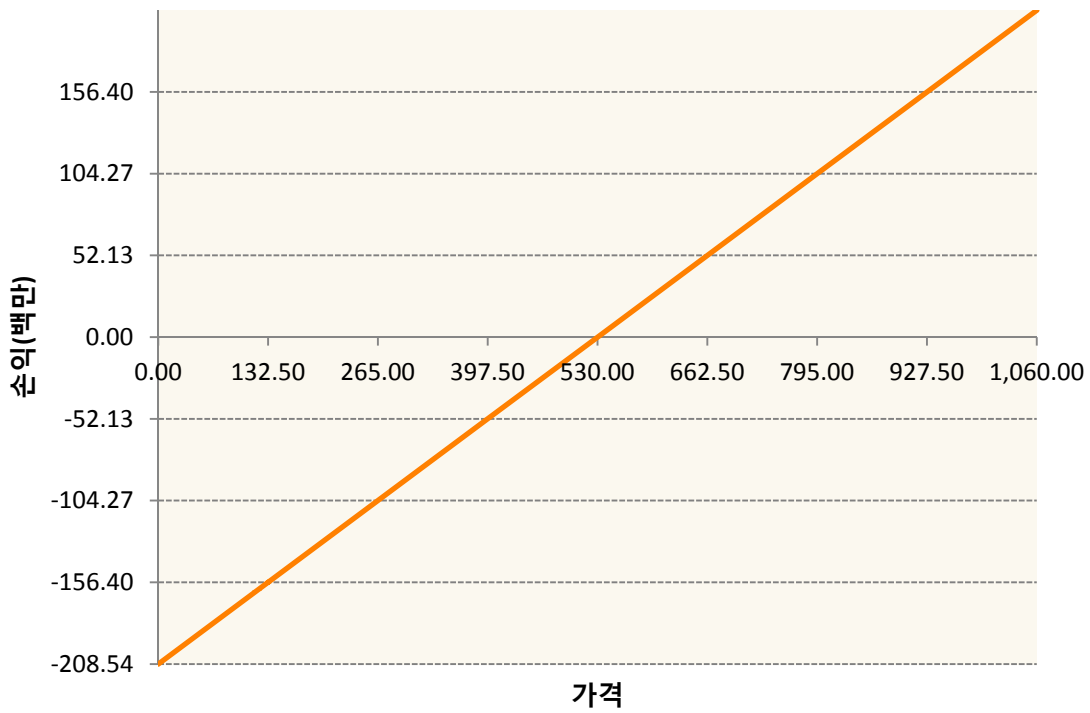




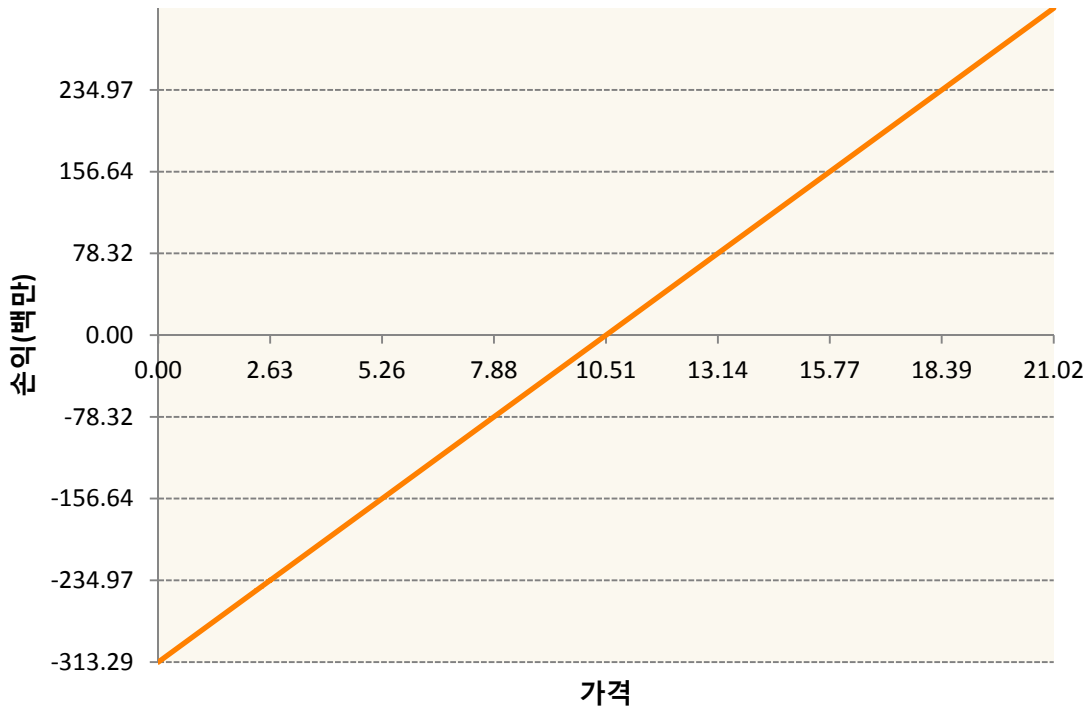
KR4175N90000-2018-09 달러선물



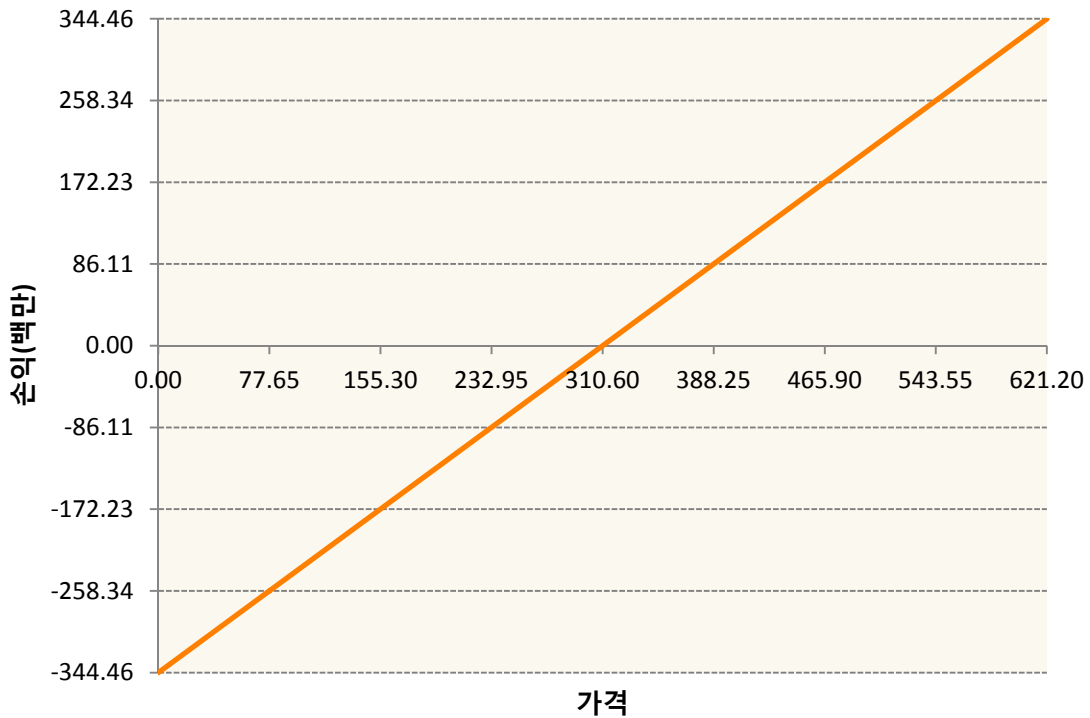
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

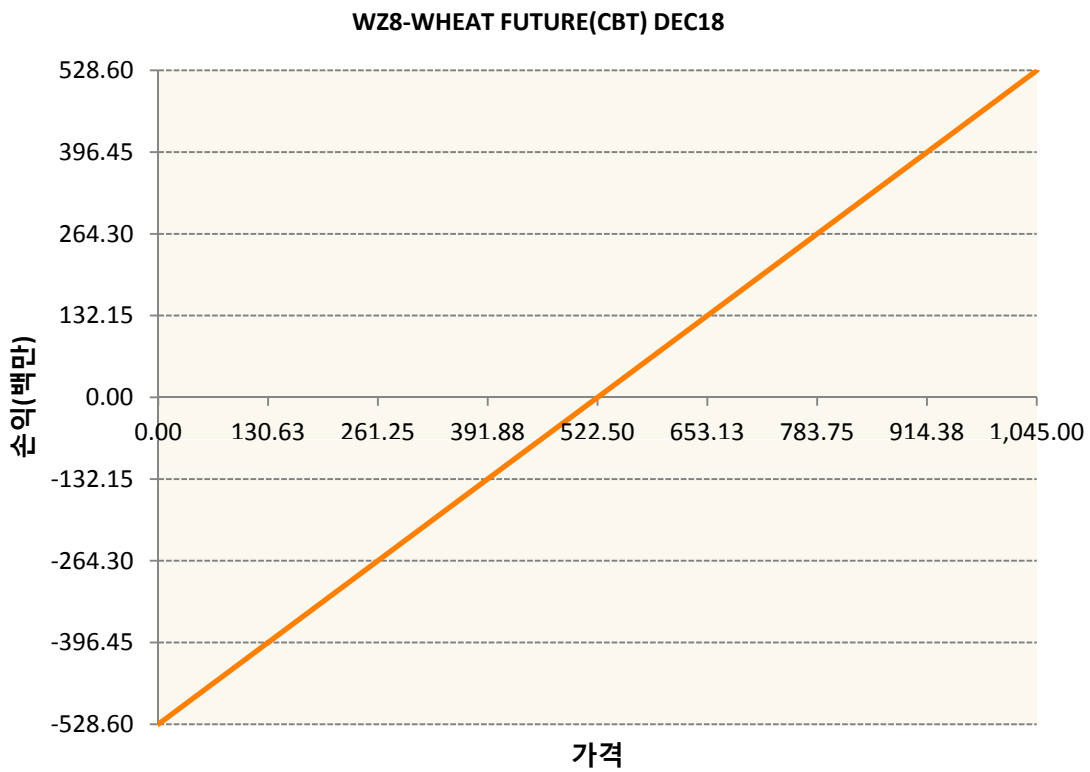
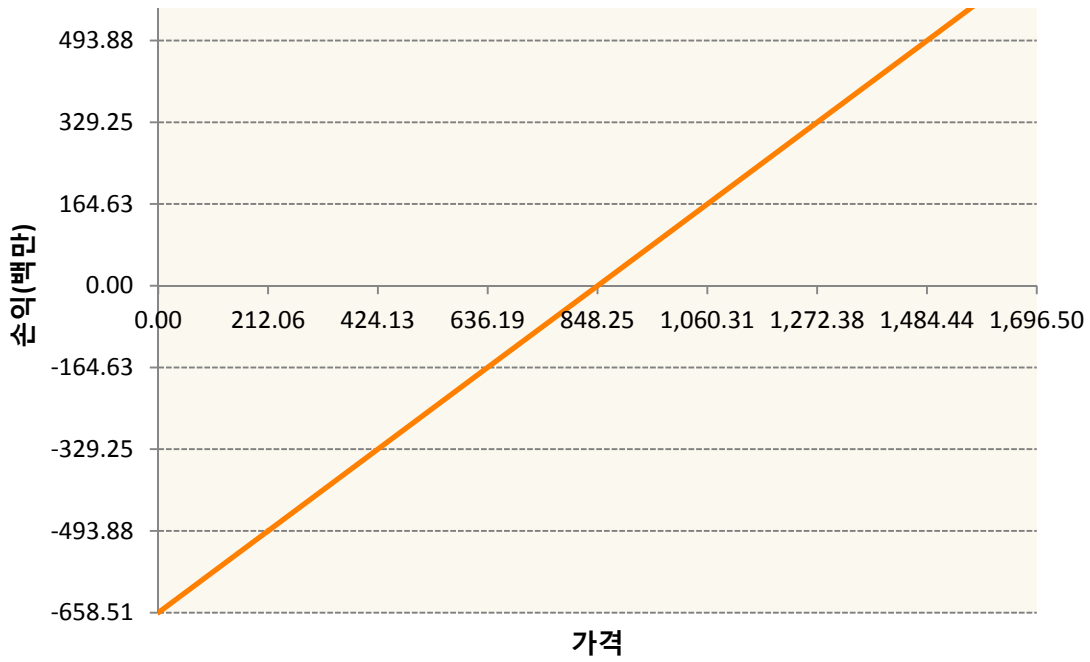


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



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

KWZ8	KC HRW WHEAT FUT DEC18	17
SBV8	SUGAR #11 (WORLD) OCT18	25
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	28
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	53
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	42

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

(단위:백만원)

308