

공시일	2018-08-30
기준일	2018-08-29

## 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	2018-08-30
기준일	2018-08-29

## 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

1,157

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

496

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-30
기준일	2018-08-29

## 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

306

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

386

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-30
기준일	2018-08-29

## 유로인덱스모(주식-파생형)

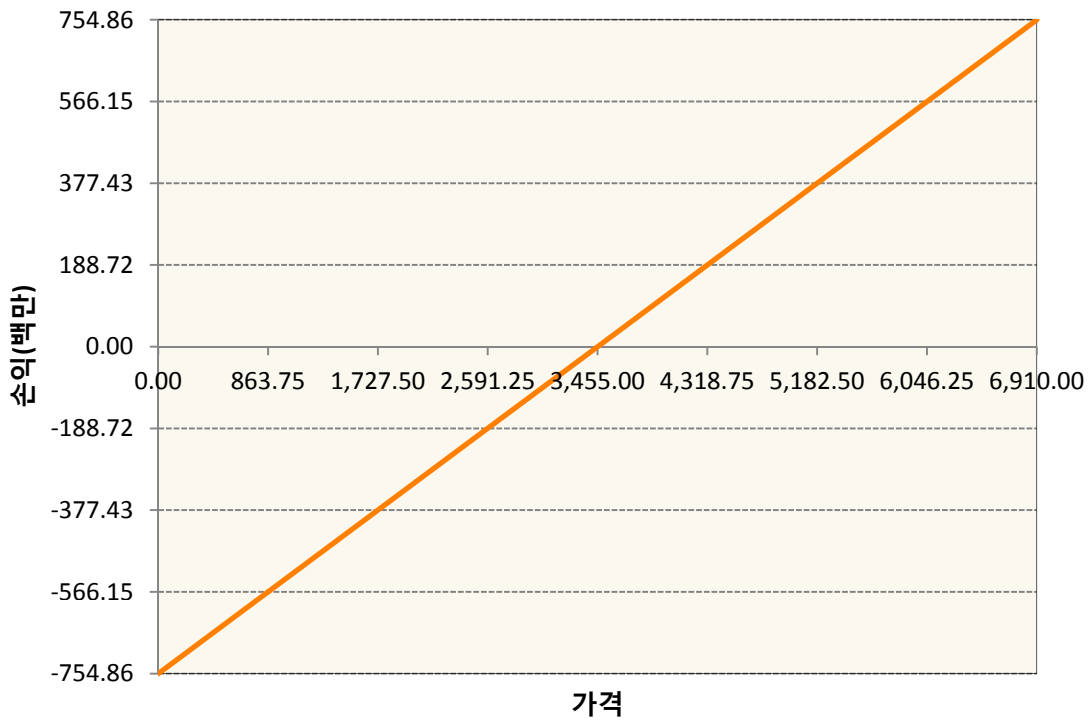
### 1. 계약금액

(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	2018-08-30
기준일	2018-08-29

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

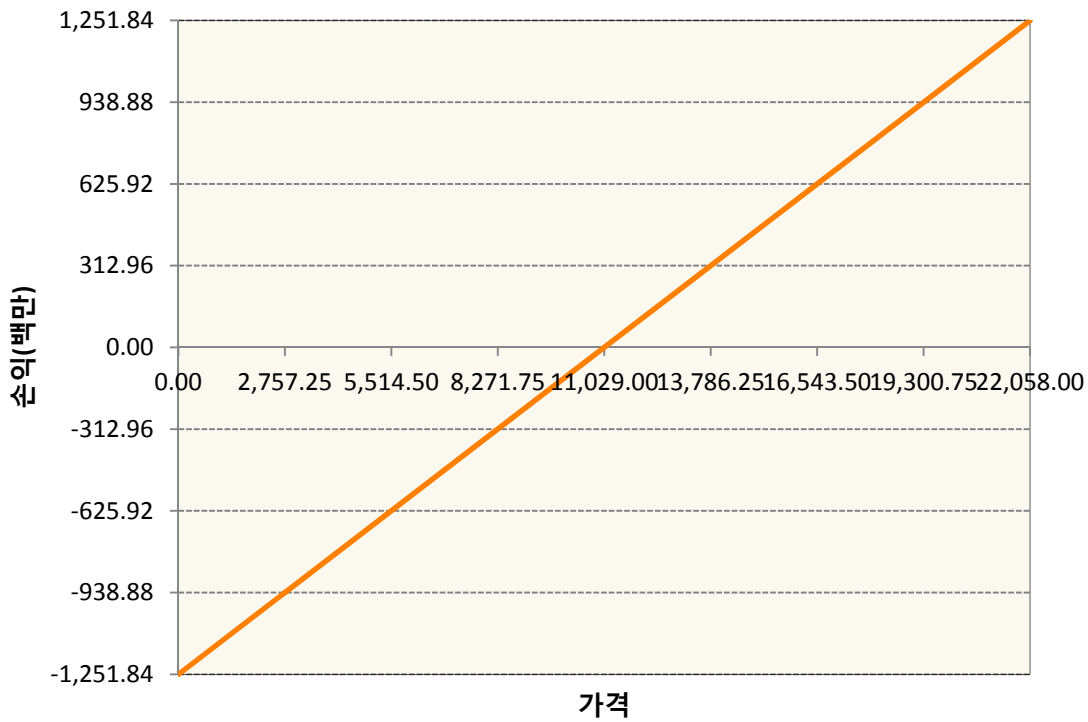
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

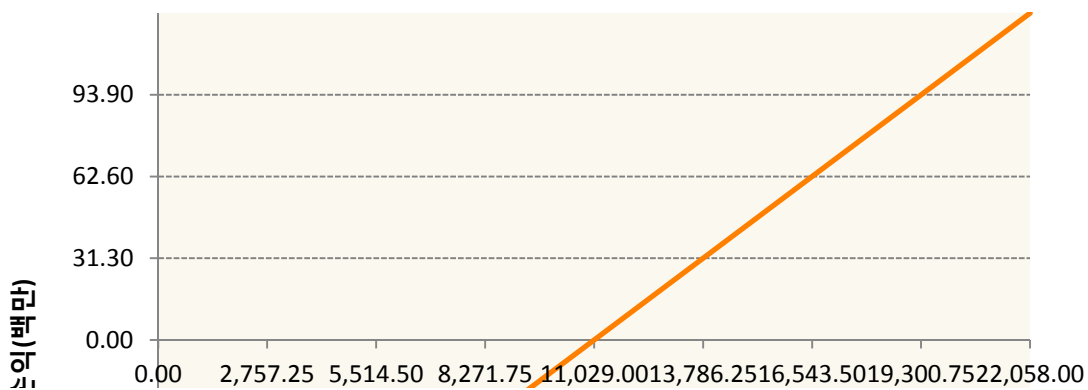
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	125	0	125	
누계	유가증권	선물	1,252	0	1,252	장내

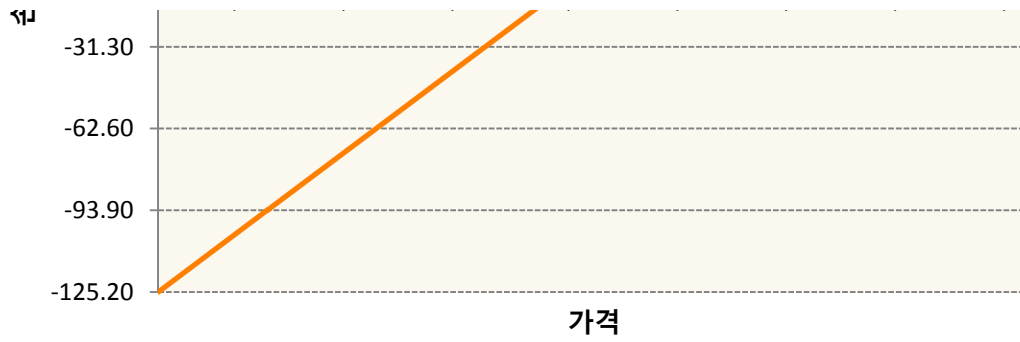
### 2. 만기시점의 손익구조

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	2018-08-30
기준일	2018-08-29

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

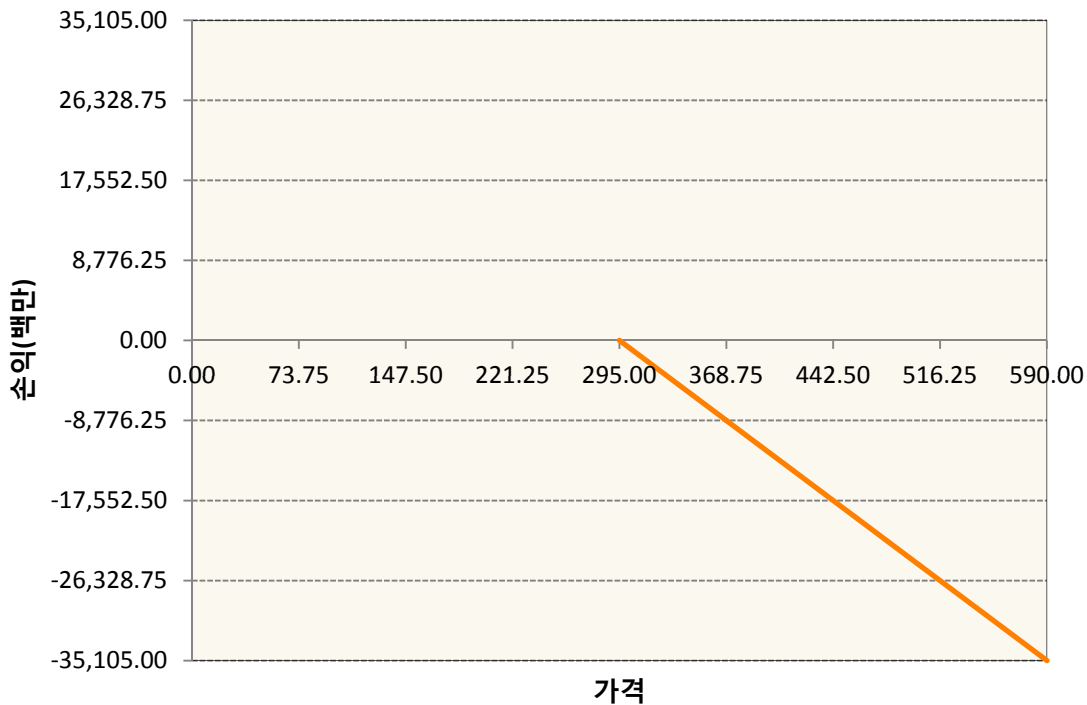
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

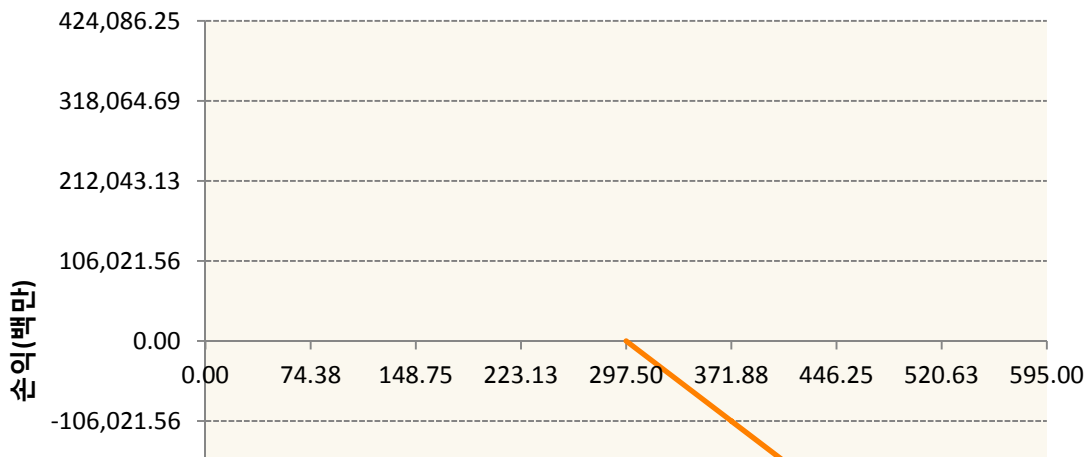
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	3,688	1,126	2,562	장내
누계	유가증권	옵션	0	756,691	-756,691	장내

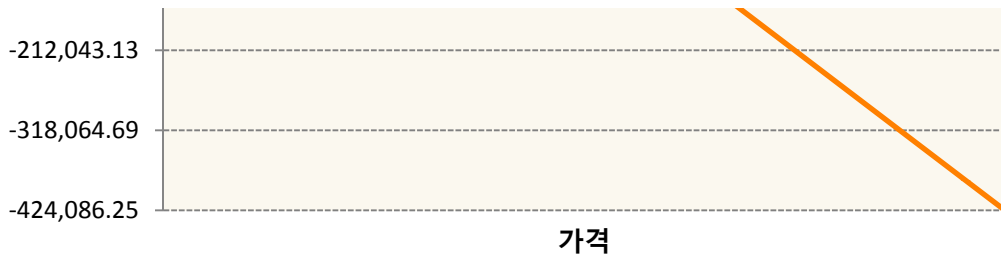
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92950-2018-09 콜295

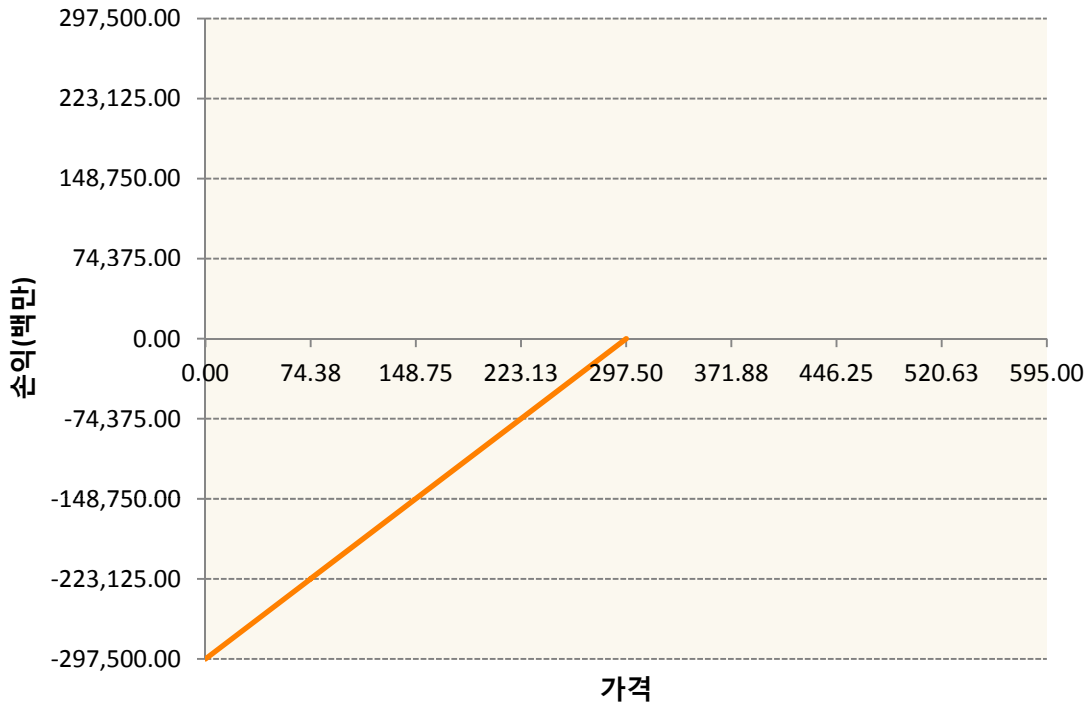


KR4201N92976-2018-09 콜297.5





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N929 2018-09 콜295

2,356

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	933	919	901	878	852	823	791
-5.33%	857	821	782	740	695	648	599
-2.67%	635	578	519	460	400	340	280
0%	186	124	62	0	-62	-125	-187
2.67%	-496	-541	-588	-638	-690	-744	-799
5.33%	-1,335	-1,358	-1,386	-1,417	-1,452	-1,491	-1,532
8.00%	-2,249	-2,257	-2,269	-2,285	-2,305	-2,329	-2,356

KR4201N929 2018-09 풋297.5

26,971

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,374	9,256	9,092	8,881	8,626	8,330	7,997

-5.33%	8,764	8,421	8,027	7,589	7,115	6,609	6,077
-2.67%	6,762	6,132	5,481	4,814	4,135	3,447	2,750
0%	2,284	1,522	761	0	-761	-1,522	-2,284
2.67%	-5,060	-5,682	-6,330	-6,996	-7,678	-8,371	-9,075
5.33%	-14,619	-14,974	-15,384	-15,841	-16,337	-16,866	-17,423
8.00%	-25,354	-25,500	-25,698	-25,948	-26,246	-26,588	-26,971

KR4301N929 2018-09 풋 297.5

20,817

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20,811	-20,811	-20,811	-20,812	-20,812	-20,814	-20,817
-5.33%	-12,872	-12,875	-12,882	-12,895	-12,915	-12,943	-12,980
-2.67%	-5,094	-5,181	-5,284	-5,402	-5,533	-5,674	-5,824
0%	685	457	229	0	-229	-457	-686
2.67%	2,386	2,314	2,225	2,120	2,001	1,871	1,730
5.33%	2,503	2,500	2,492	2,480	2,460	2,431	2,394
8.00%	2,504	2,504	2,504	2,504	2,503	2,500	2,495

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

(단위:백만원)

**55,677**

공시일	2018-08-30
기준일	2018-08-29

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

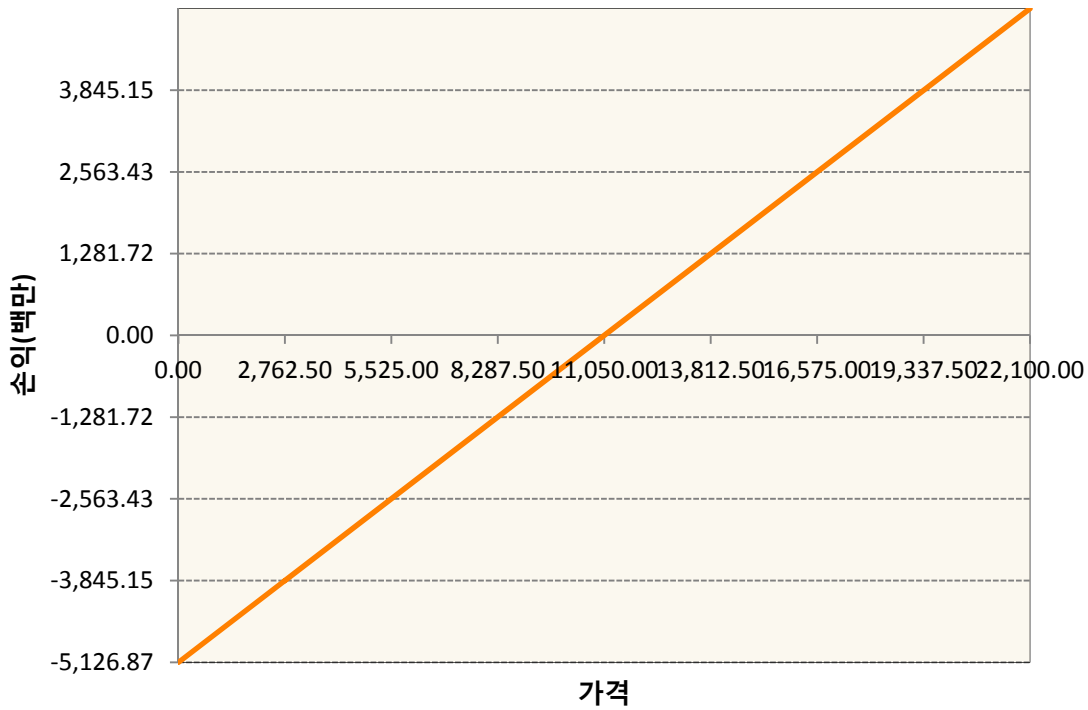
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

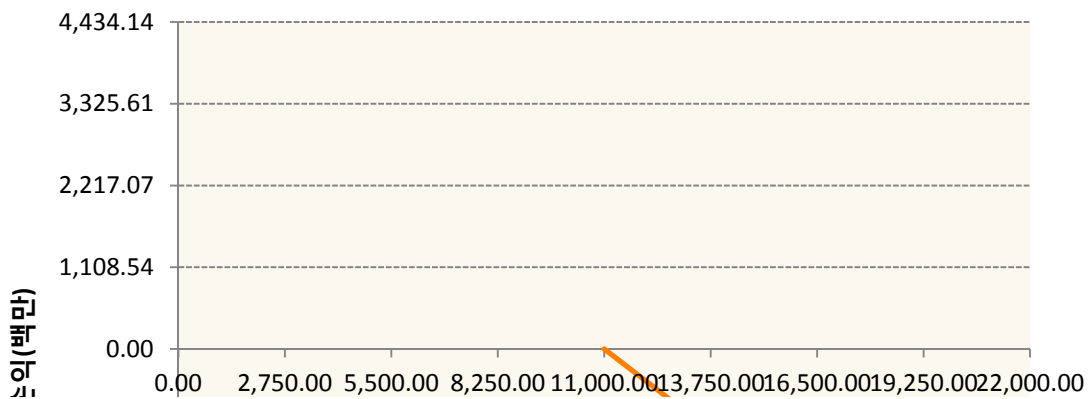
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,127	0	5,127	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,403	-11,403	장내

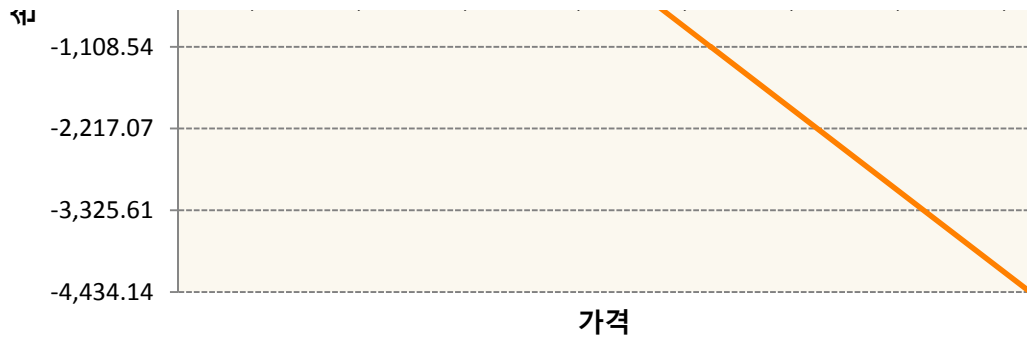
### 2. 만기시점의 손익구조

HCQ8-HSCEI Futures Aug18

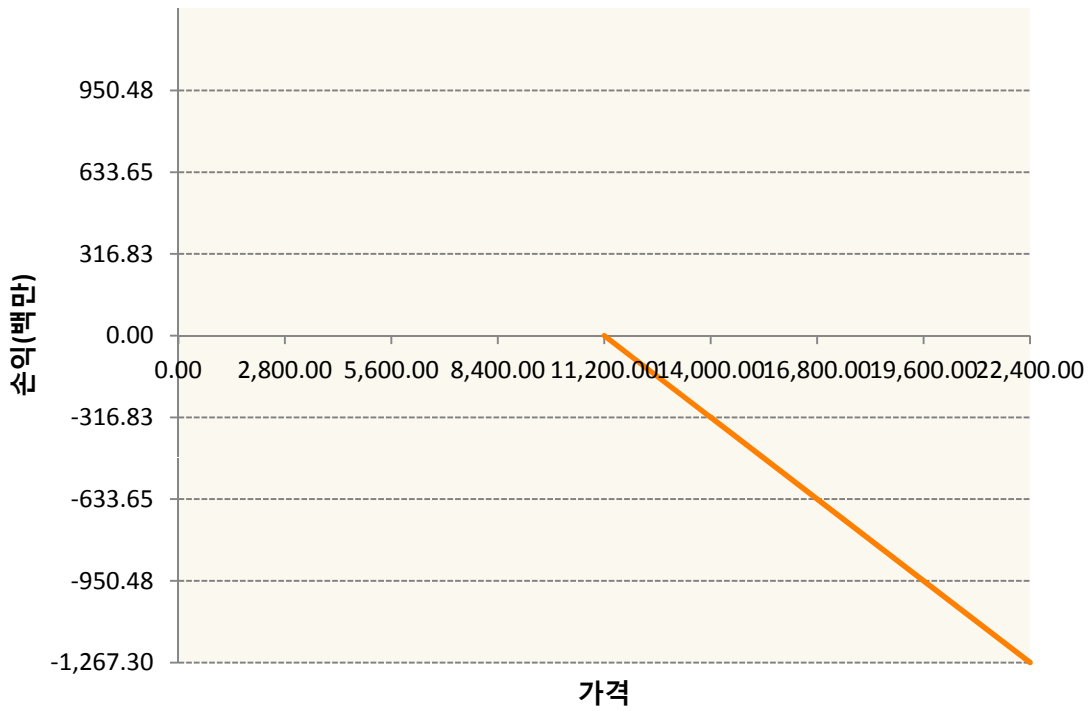


OHHIQ8-C110-HSCEI

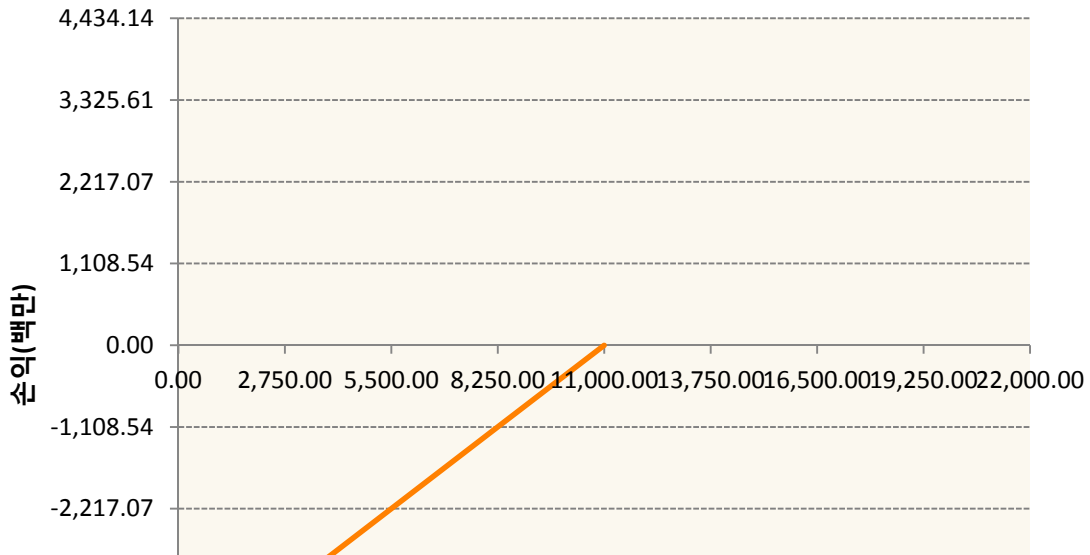


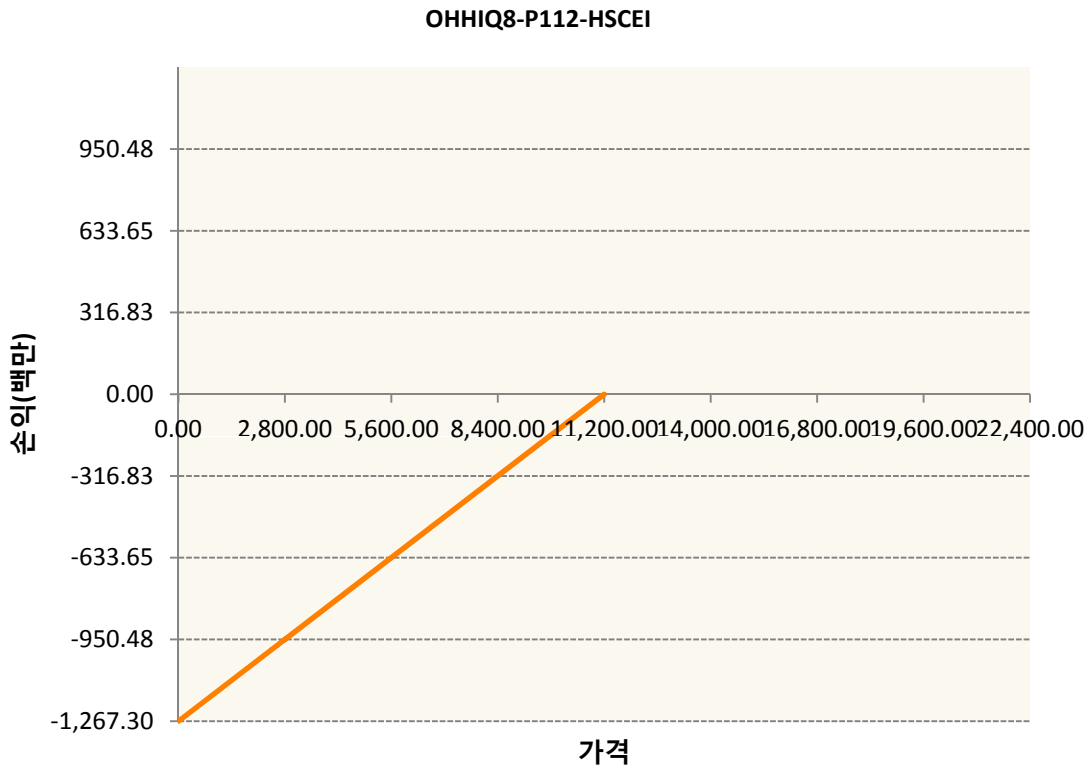
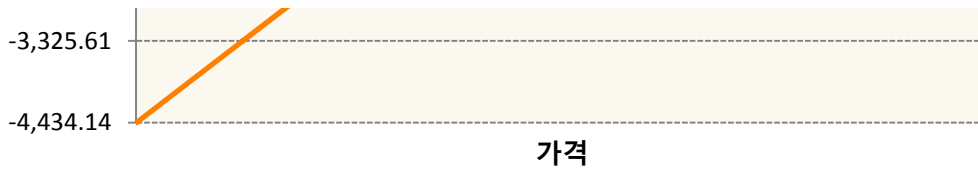


OHHIQ8-C112-HSCEI



OHHIQ8-P110-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ8	HSCEI Futures Aug18	410
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)
	<b>1,216</b>

공시일	2018-08-30
기준일	2018-08-29

## 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

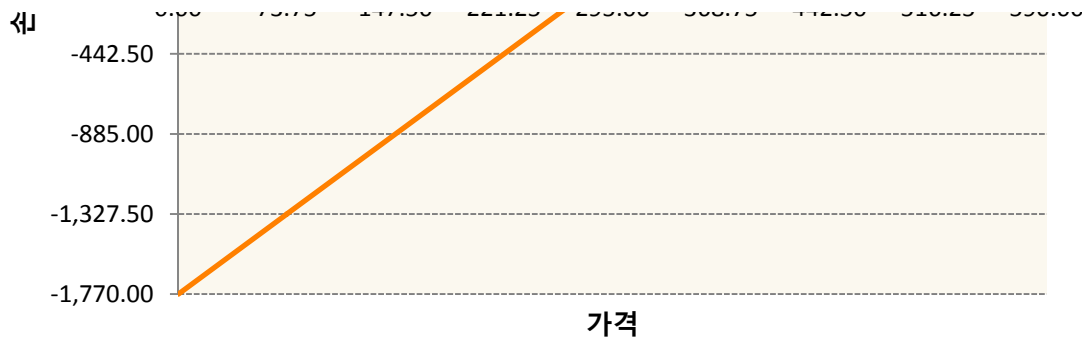
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92976-2018-09 콜297.5

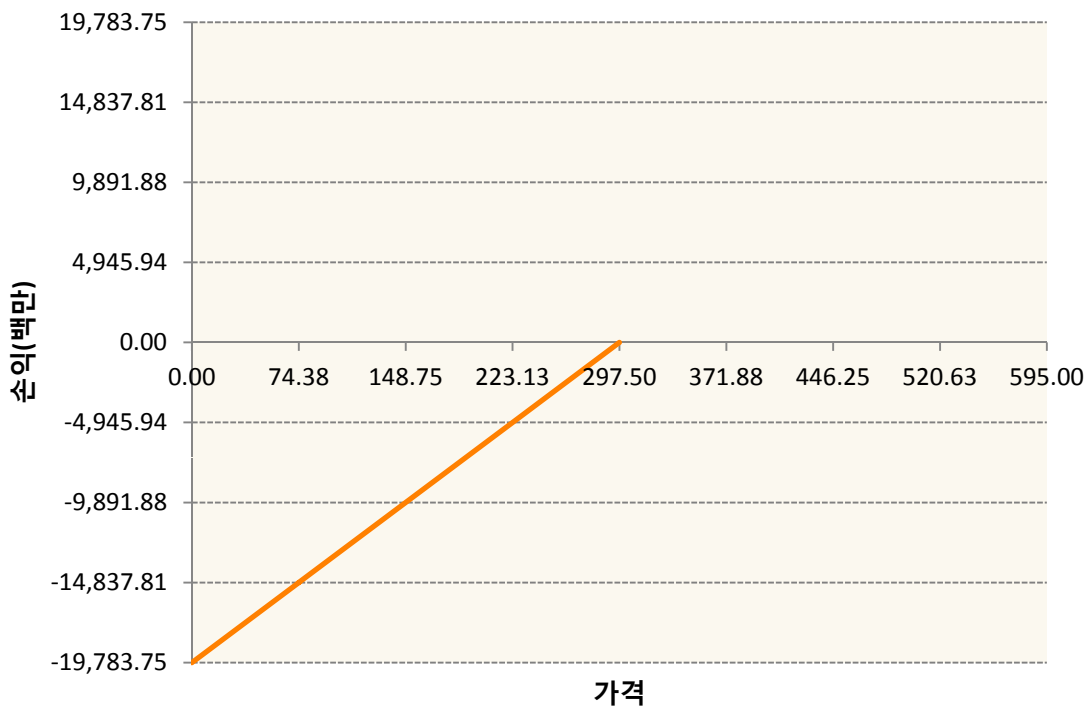


KR4301N92958-2018-09 풋295





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,948
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,948	-3,948	-3,948	-3,948	-3,948	-3,948	-3,948
-5.33%	-2,632	-2,632	-2,632	-2,632	-2,632	-2,632	-2,632
-2.67%	-1,316	-1,316	-1,316	-1,316	-1,316	-1,316	-1,316
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,316	1,316	1,316	1,316	1,316	1,316	1,316
5.33%	2,632	2,632	2,632	2,632	2,632	2,632	2,632
8.00%	3,948	3,948	3,948	3,948	3,948	3,948	3,948
KR4201N92974-2018-09 풋297.5							1,788
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	621	614	603	589	572	552	530
-5.33%	581	558	532	503	472	438	403
-2.67%	448	406	363	319	274	228	182
0%	151	101	50	0	-50	-101	-151
2.67%	-335	-377	-420	-464	-509	-555	-602
5.33%	-969	-993	-1,020	-1,050	-1,083	-1,118	-1,155
8.00%	-1,681	-1,690	-1,704	-1,720	-1,740	-1,763	-1,788

KR4301N929 2018-09 풋295

116

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116
-5.33%	-68	-68	-69	-69	-69	-69	-70
-2.67%	-23	-24	-25	-26	-27	-28	-29
0%	4	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	9	9	8	8	7	7	6
5.33%	9	9	9	9	9	9	9
8.00%	9	9	9	9	9	9	9

KR4301N929 2018-09 풋297.5

1,384

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,384	-1,384	-1,384	-1,384	-1,384	-1,384	-1,384
-5.33%	-856	-856	-857	-858	-859	-861	-863
-2.67%	-339	-345	-351	-359	-368	-377	-387
0%	46	30	15	0	-15	-30	-46
2.67%	159	154	148	141	133	124	115
5.33%	166	166	166	165	164	162	159
8.00%	167	167	167	167	166	166	166

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

(단위:백만원)

7,617

공시일	2018-08-30
기준일	2018-08-29

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

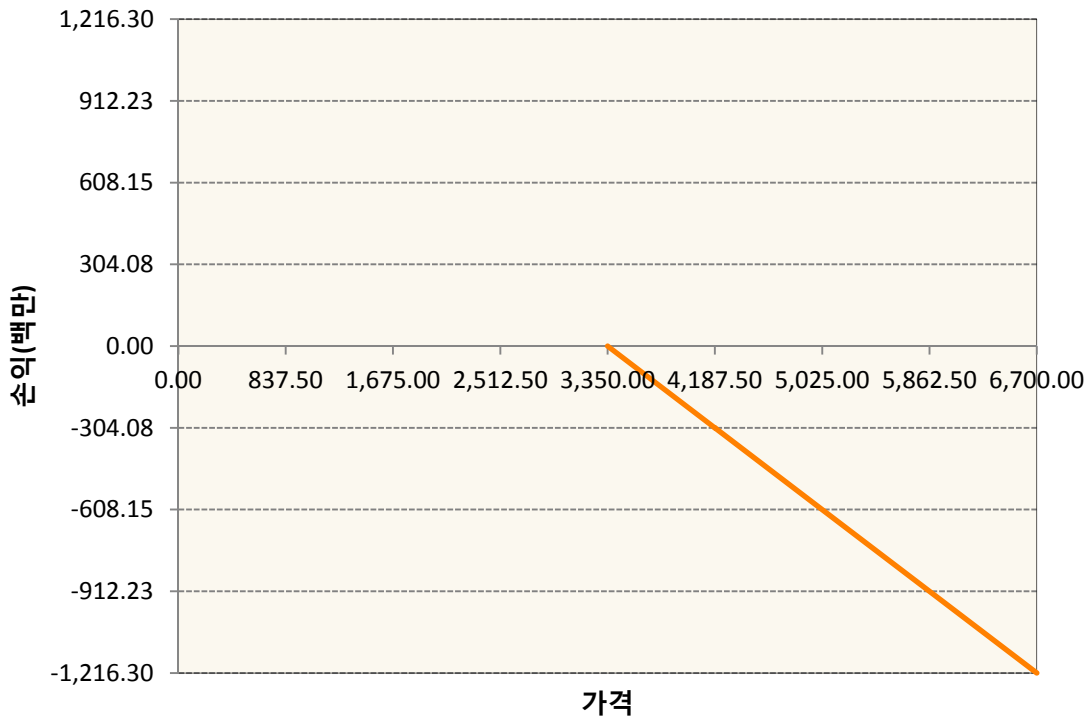
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

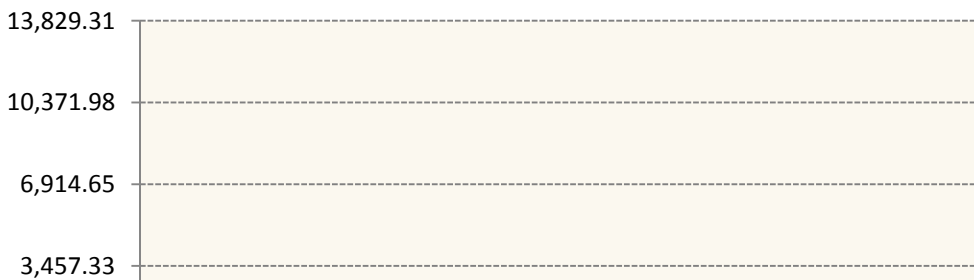
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	8,239	0	8,239	
누계	유가증권	옵션	0	30,091	-30,091	장내
누계	지수	스왑	86,882	0	86,882	장외

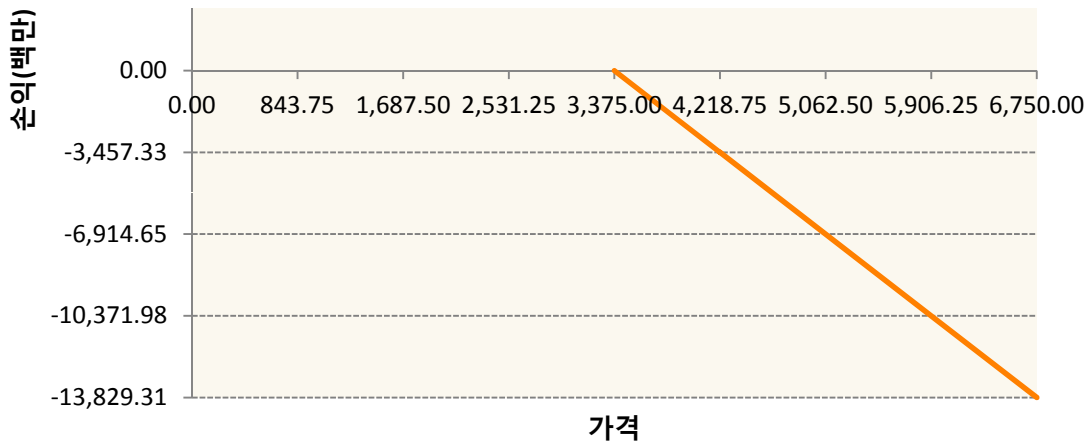
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXU8-C3350-EURO STOXX 50**

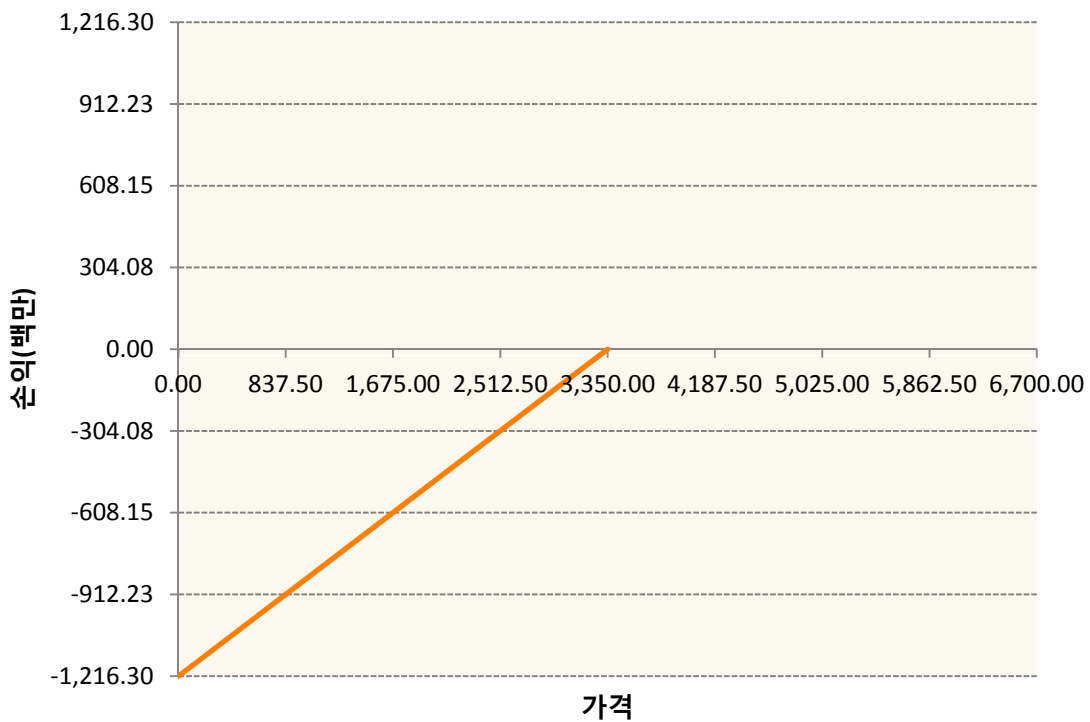


**OESXU8-C3375-EURO STOXX 50**

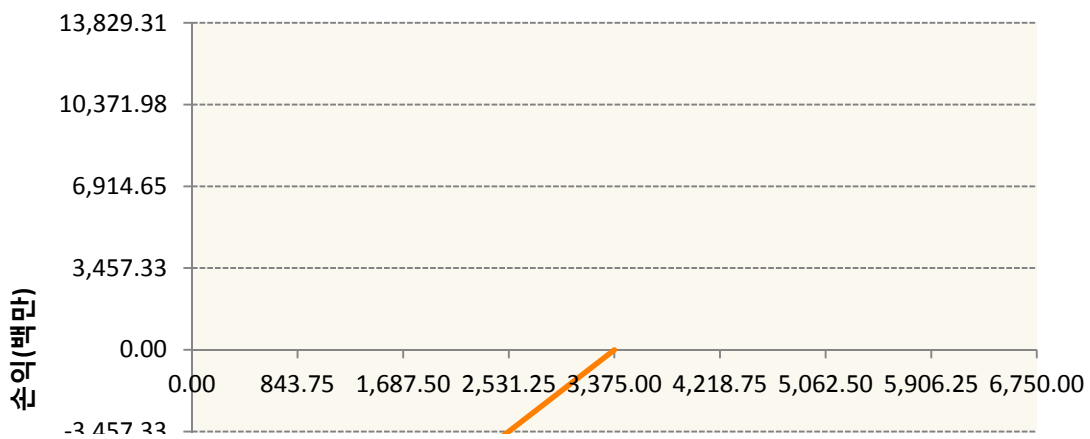


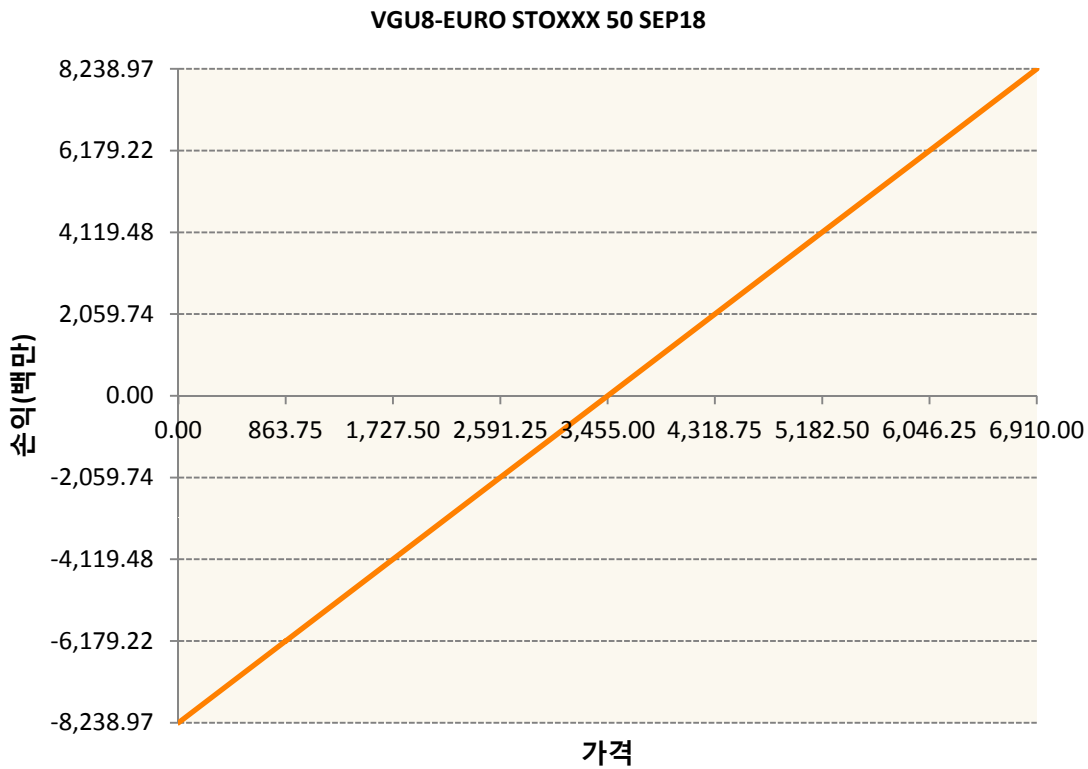


OESXU8-P3350-EURO STOXX 50



OESXU8-P3375-EURO STOXX 50





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

260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	8
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY	5
OESXU8-C33 EURO STOXX 50	97
OESXU8-C33 EURO STOXX 50	1,106
OESXU8-P33 EURO STOXX 50	97
OESXU8-P33 EURO STOXX 50	1,106
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)

1,136



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)

163

공시일	2018-08-30
기준일	2018-08-29

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1

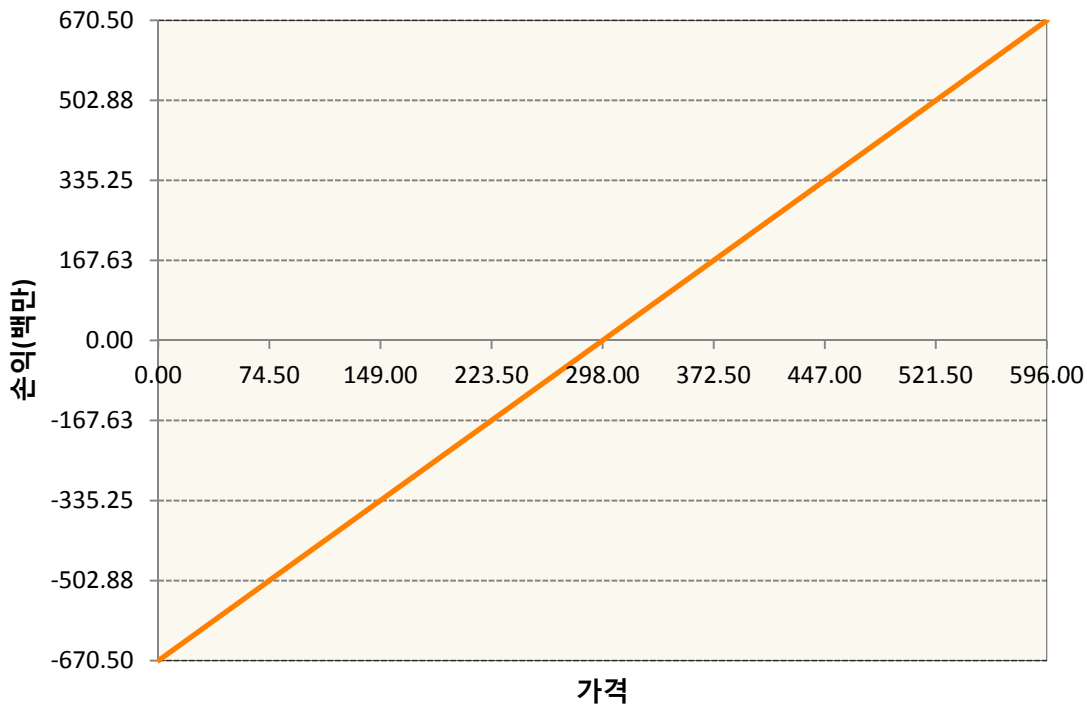
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	671	0	671	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물

54

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	18	18	18	18	18	18	18
5.33%	36	36	36	36	36	36	36
8.00%	54	54	54	54	54	54	54

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-08-30
기준일	2018-08-29

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

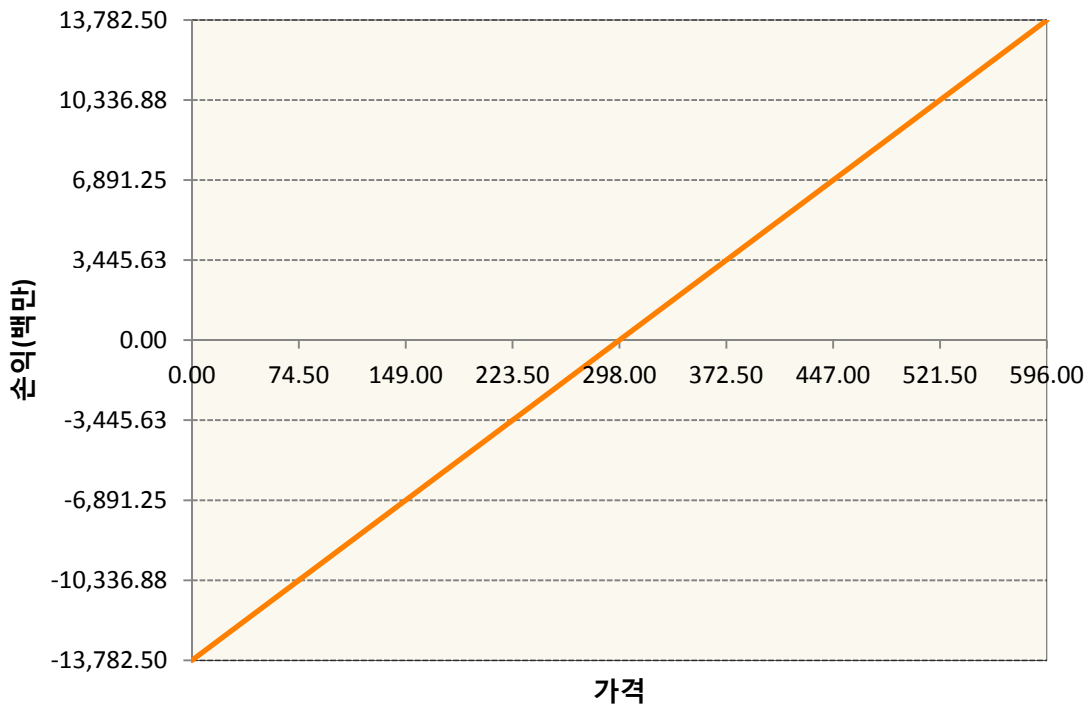
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

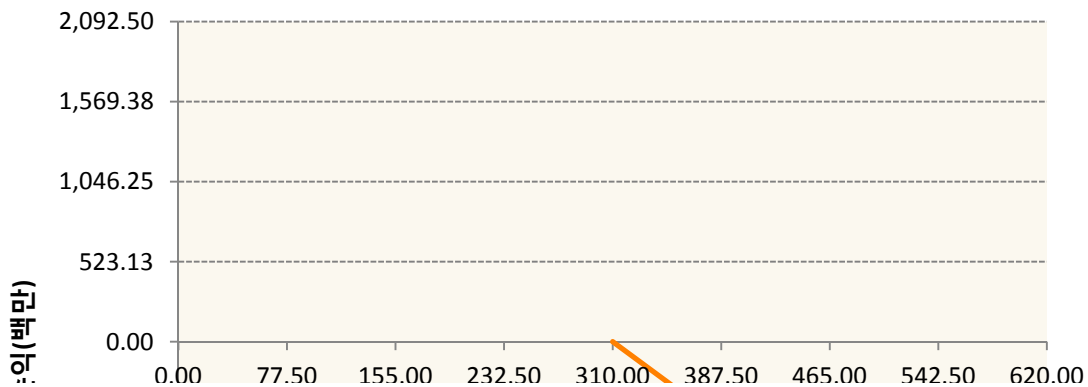
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,783	0	13,783	장내
누계	유가증권	옵션	1,339	24,671	-23,332	장내

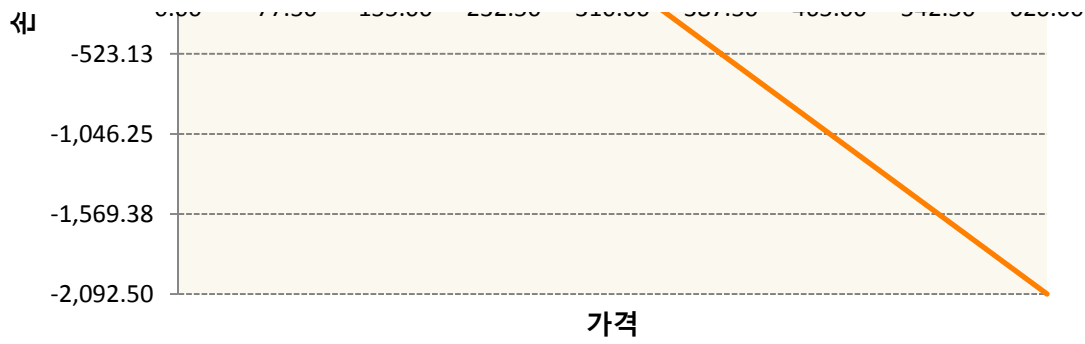
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

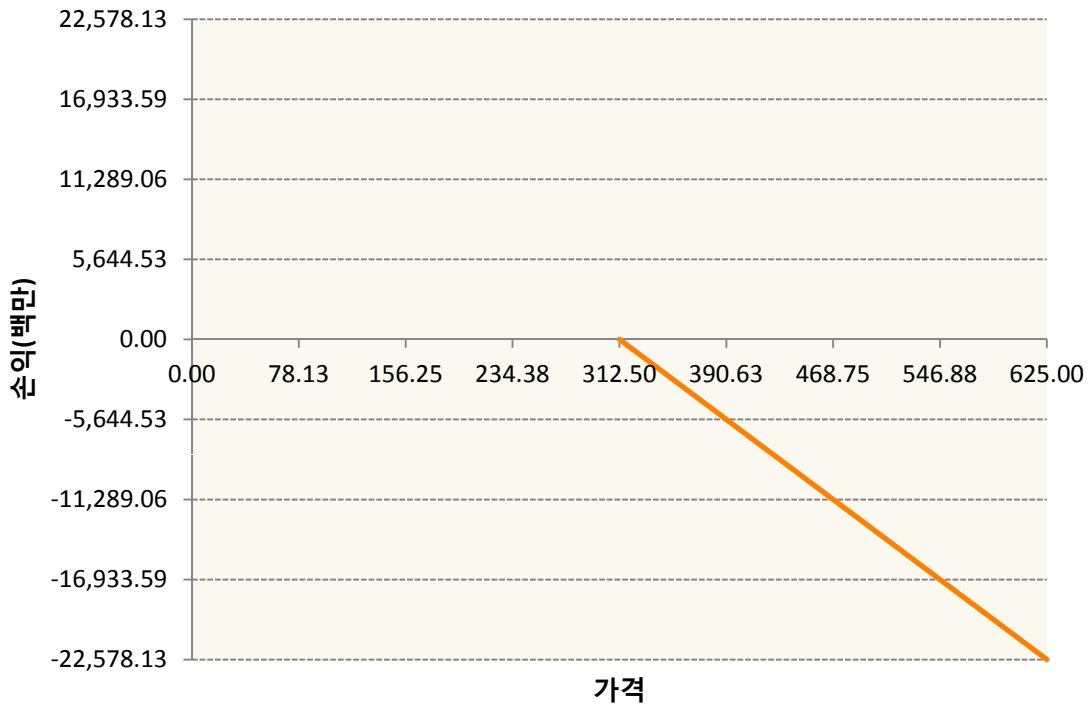


KR4201N93107-2018-09 콜310

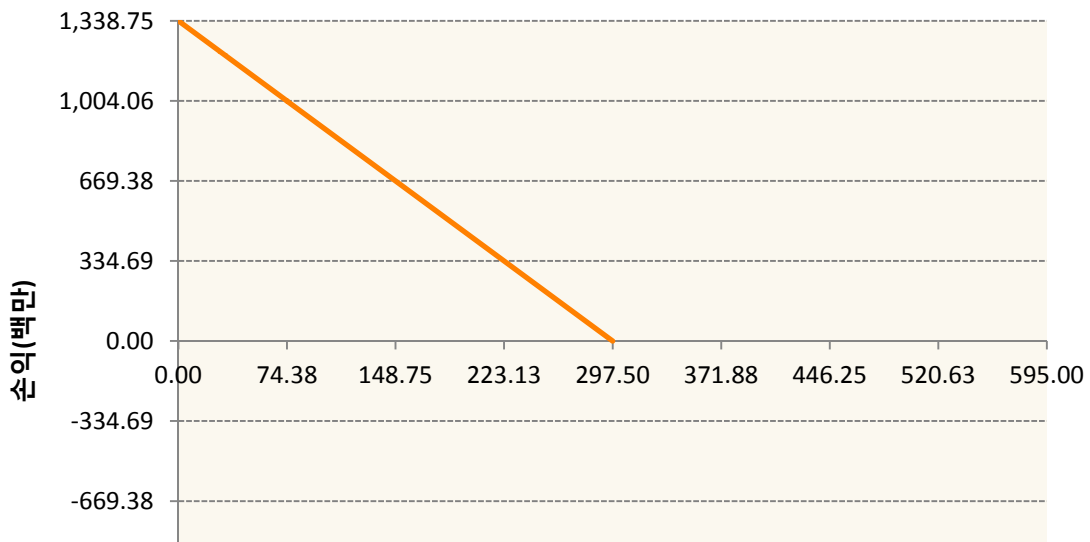


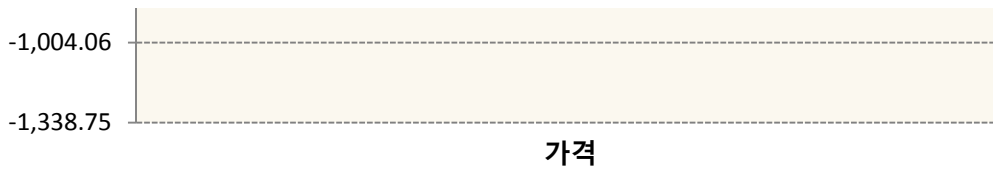


**KR4201N93123-2018-09 콜312.5**



**KR4301N92974-2018-09 풋297.5**





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

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물							1,103
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,103	-1,103	-1,103	-1,103	-1,103	-1,103	-1,103
-5.33%	-735	-735	-735	-735	-735	-735	-735
-2.67%	-368	-368	-368	-368	-368	-368	-368
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	368	368	368	368	368	368	368
5.33%	735	735	735	735	735	735	735
8.00%	1,103	1,103	1,103	1,103	1,103	1,103	1,103
KR4201N9312018-09 콜310							91
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%	-7	-10	-14	-17	-21	-25	-28
5.33%	-34	-37	-41	-45	-48	-52	-56
8.00%	-73	-76	-79	-81	-85	-88	-91
KR4201N9312018-09 콜312.5							888
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	124	124	123	121	119	115	110
-5.33%	123	120	117	111	104	94	83
-2.67%	113	104	93	79	63	45	24
0%	71	50	26	0	-28	-57	-87
2.67%	-49	-84	-120	-157	-194	-232	-270
5.33%	-294	-335	-375	-415	-456	-496	-537
8.00%	-677	-710	-744	-778	-814	-851	-888
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	58	58	58	58
-2.67%	23	23	24	24	25	26	26

0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-11	-10	-10	-10	-9	-8	-8
5.33%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11

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

(단위:백만원)

**1,664**

공시일	2018-08-30
기준일	2018-08-29

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

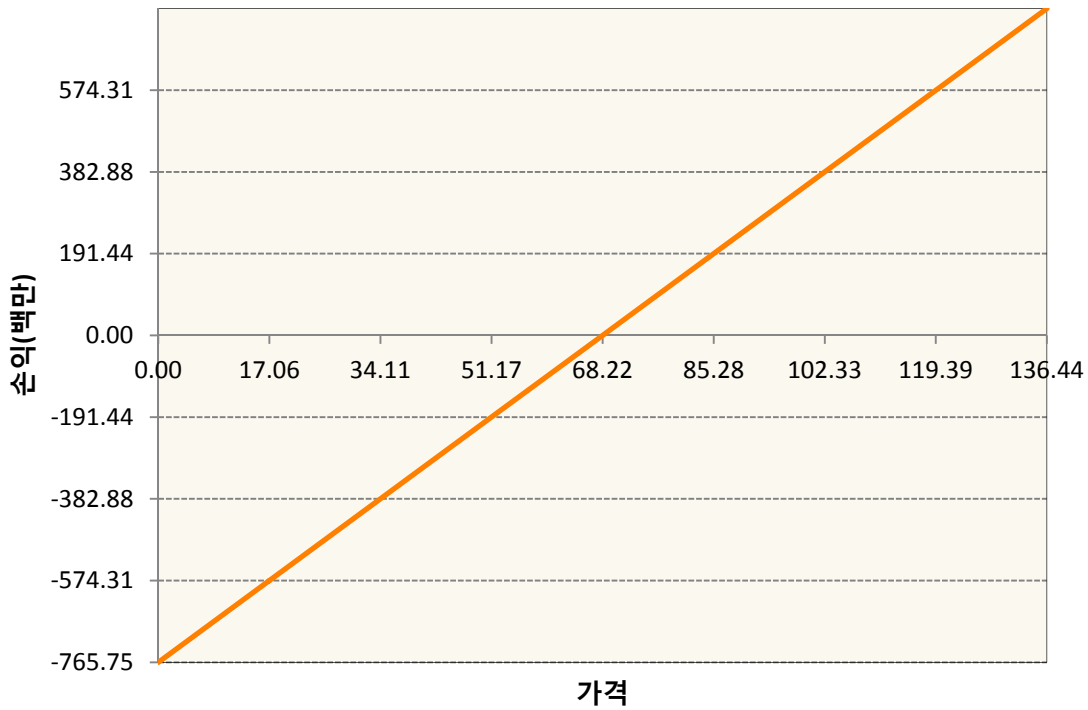
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

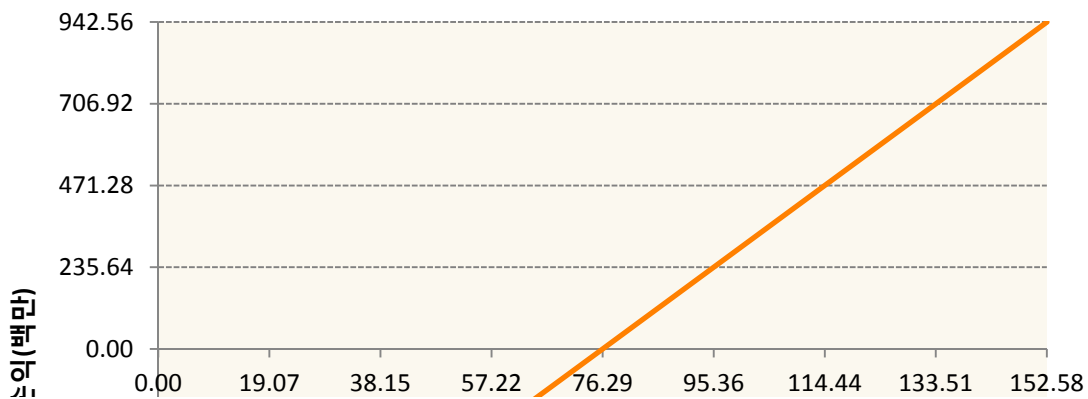
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,138	611	2,527	
누계	유가증권	선물	523	0	523	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18

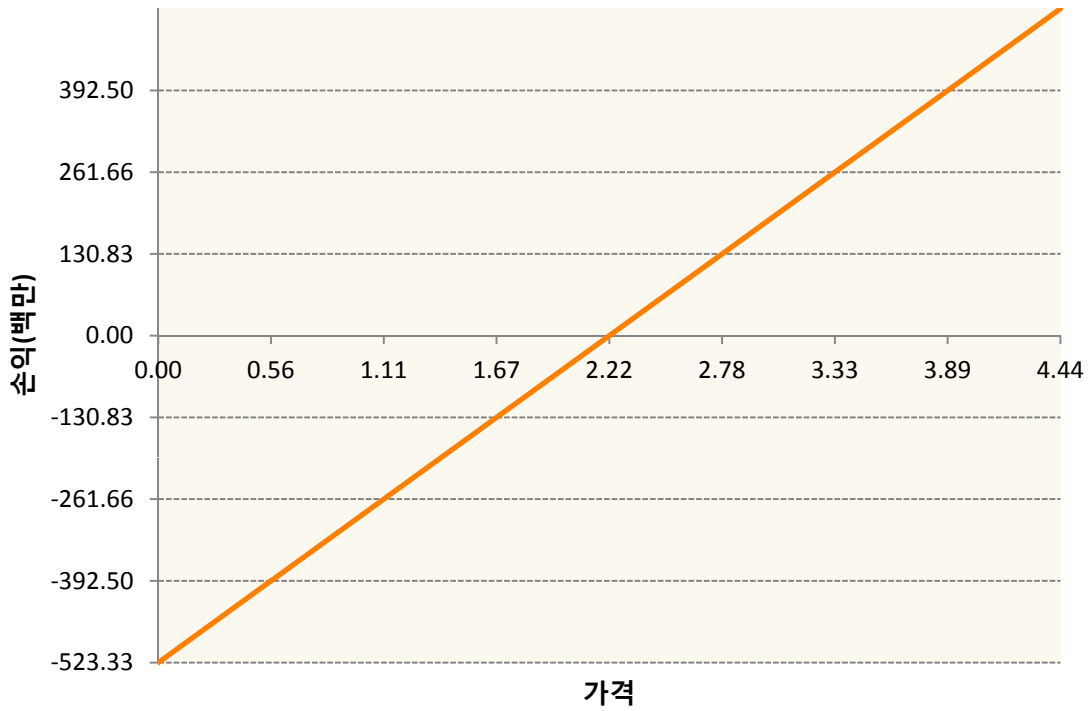


COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18

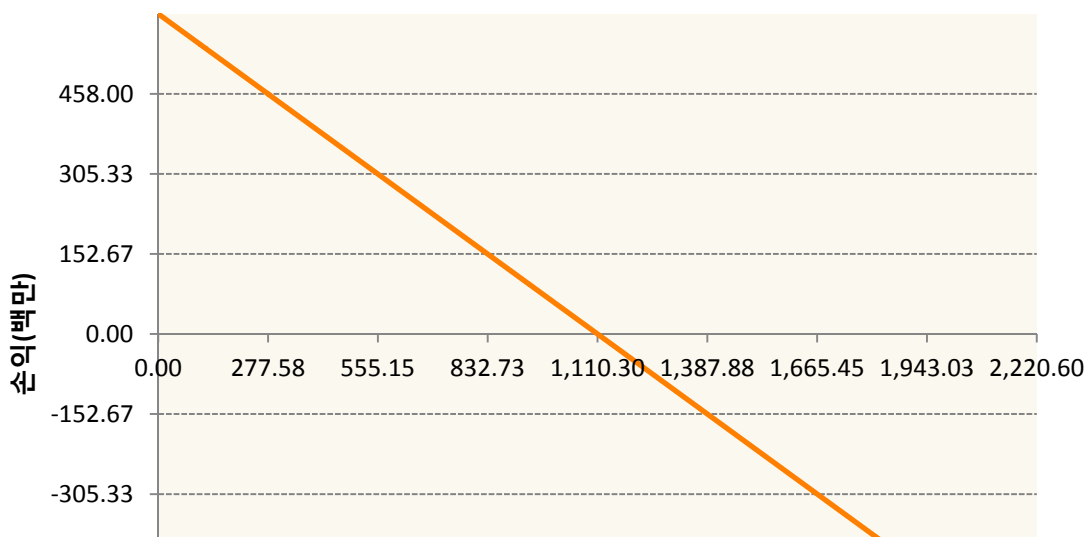


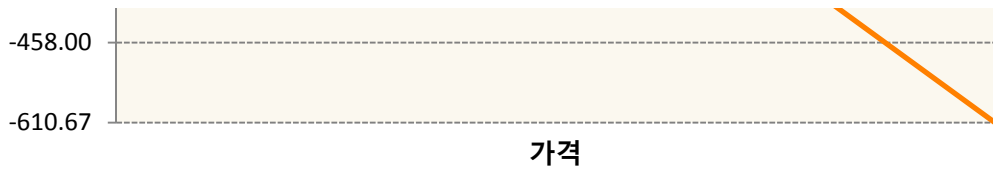


HOX8-Heating Oil

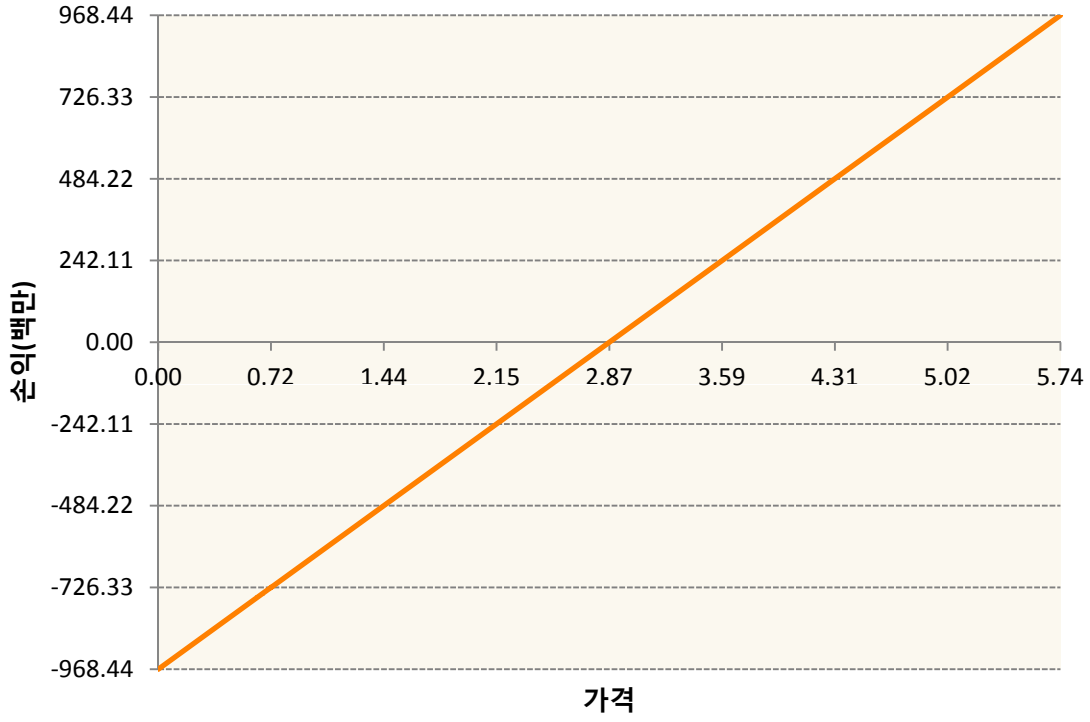


KR4175N90000-2018-09 달러선물

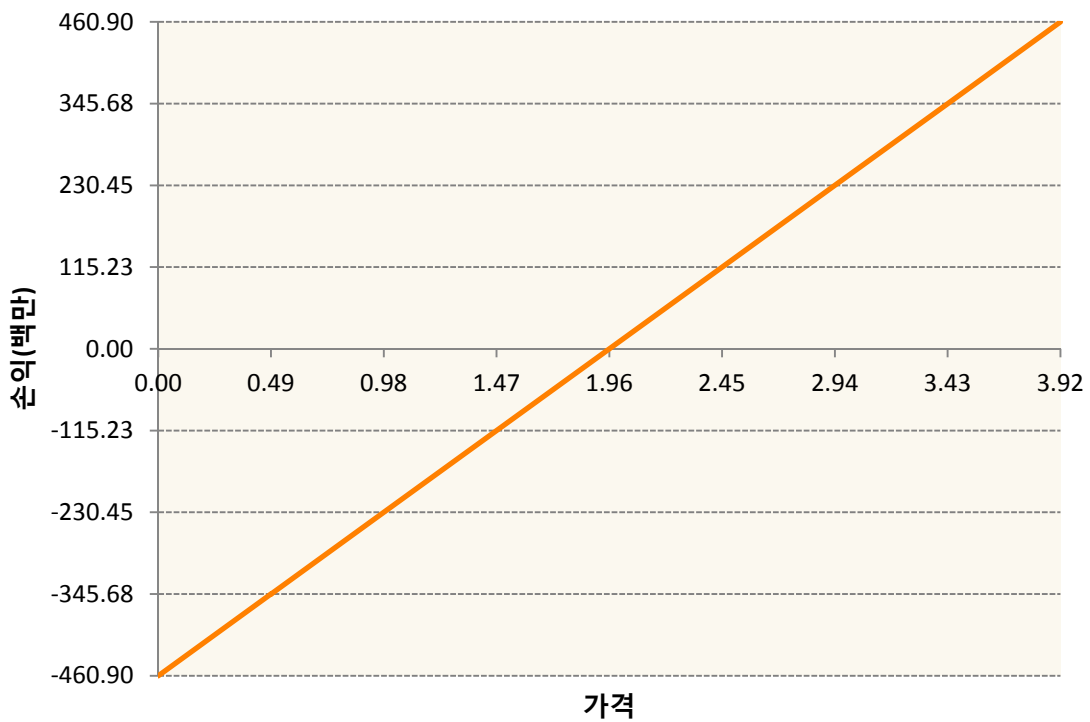




**NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18**



**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	77
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	37

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	440

공시일	2018-08-30
기준일	2018-08-29

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

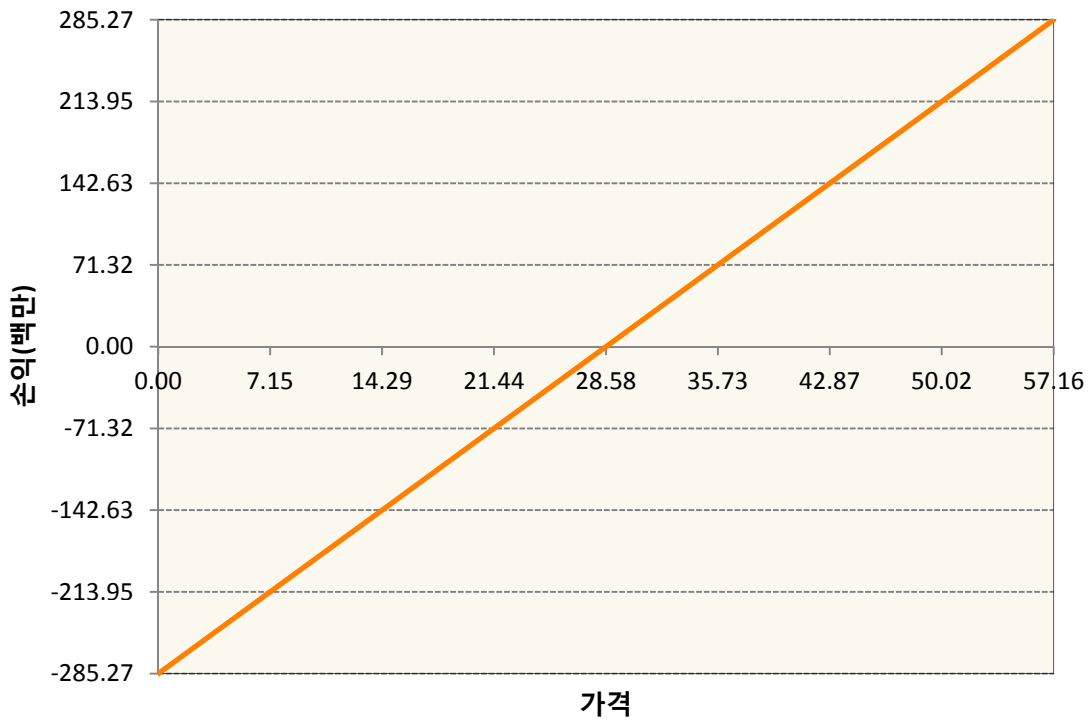
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

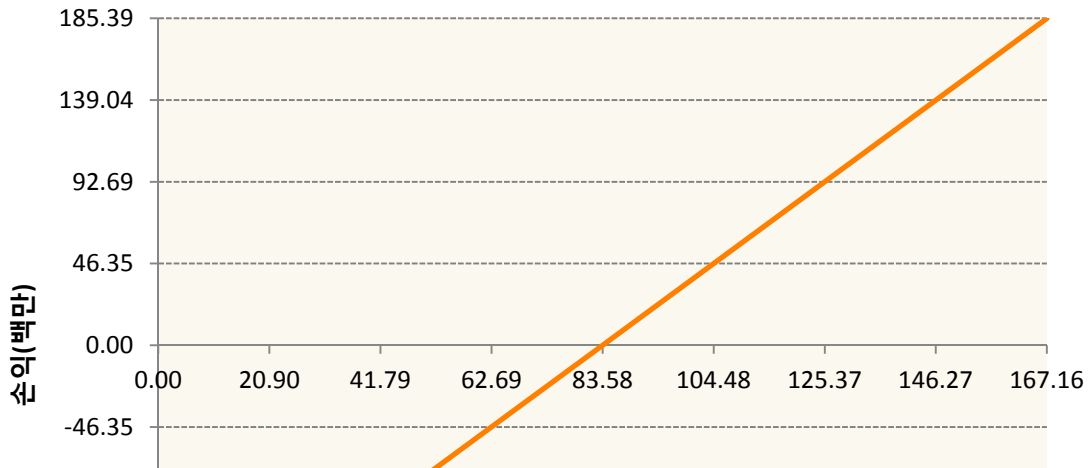
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,561	78	3,483	

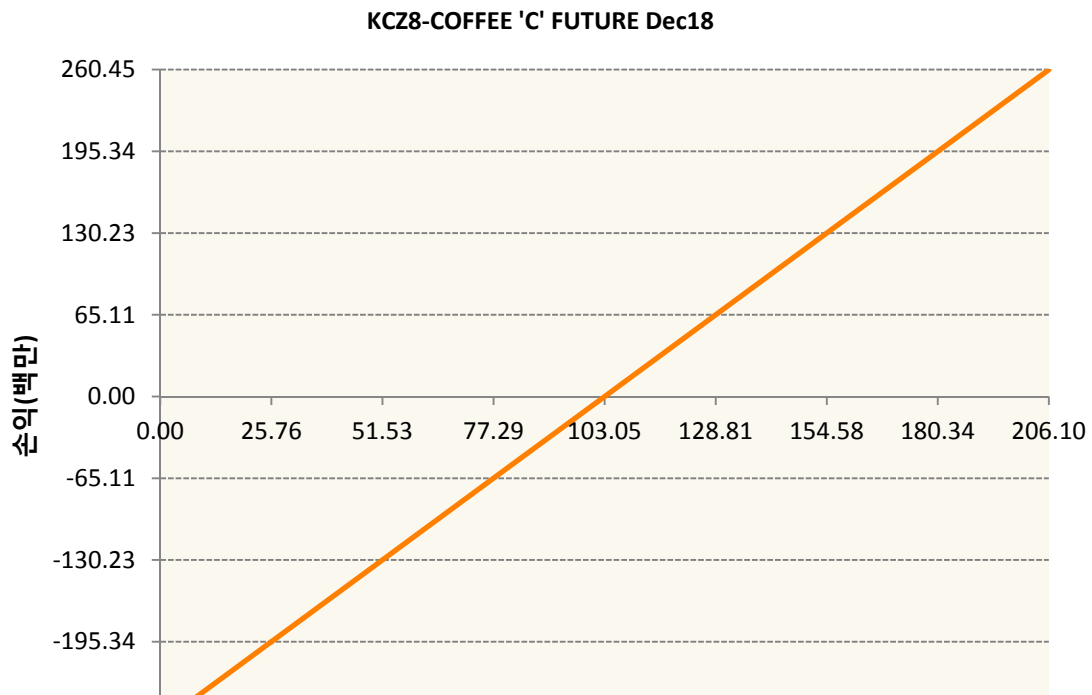
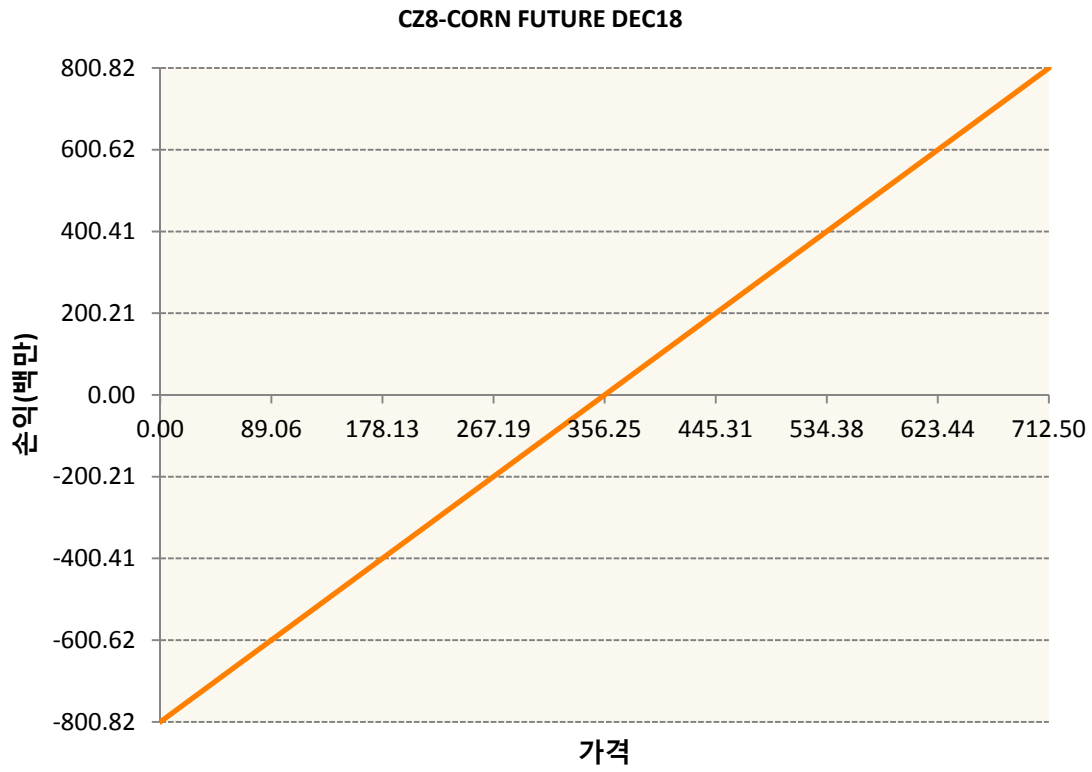
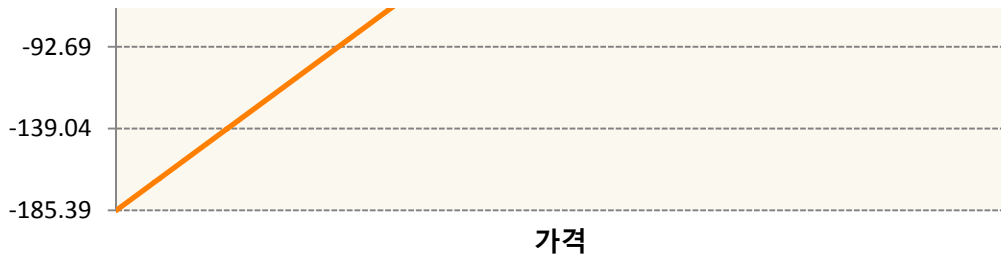
### 2. 만기시점의 손익구조

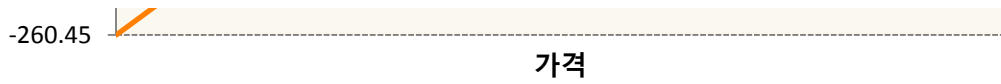
**BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18**



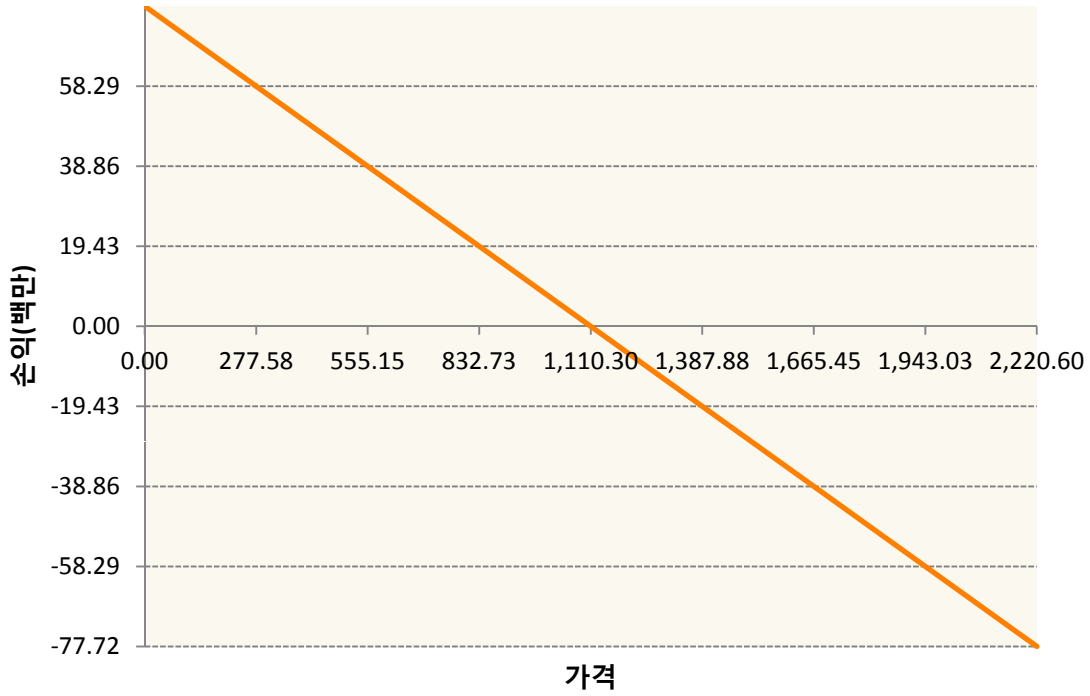
**CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18**



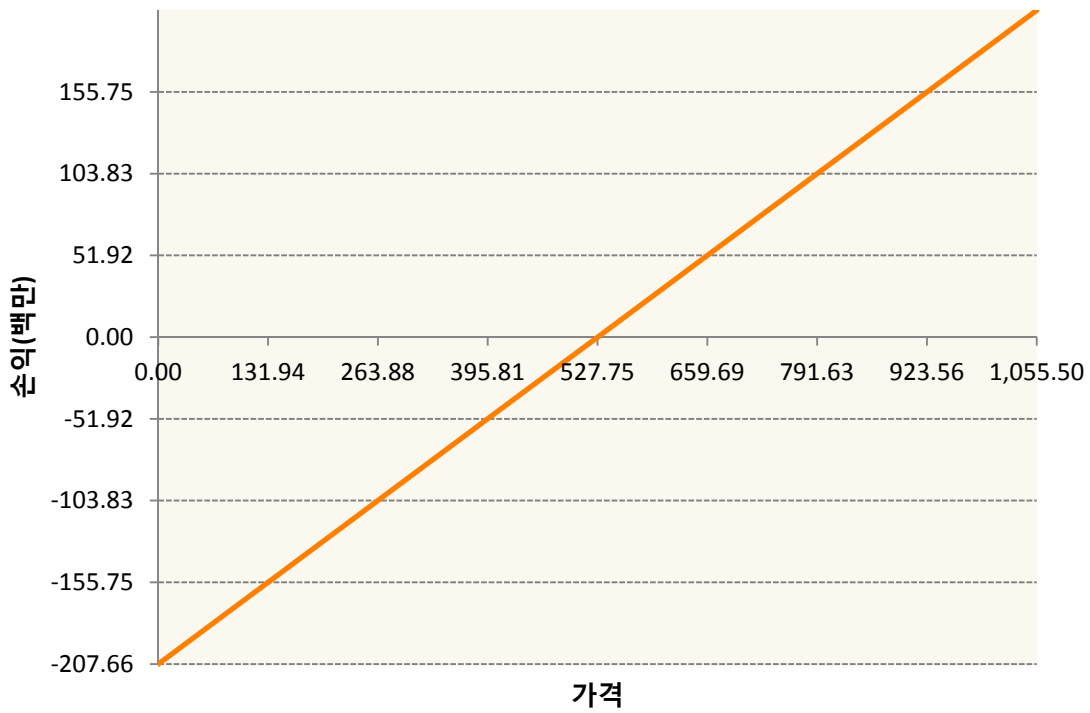




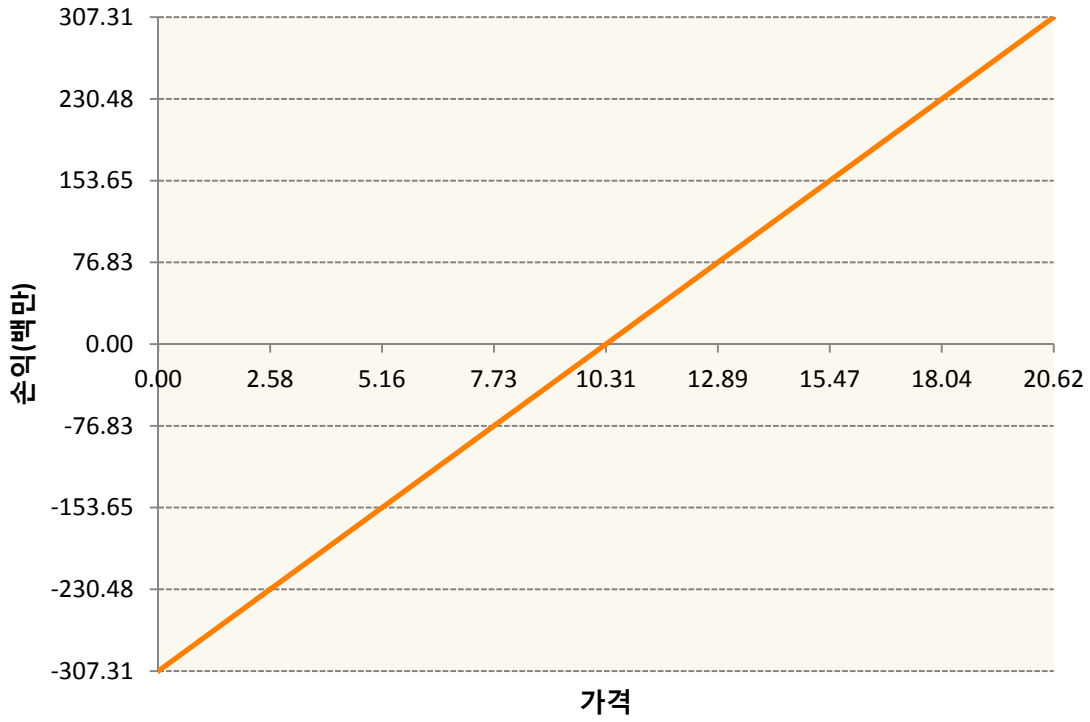
**KR4175N90000-2018-09 달러선물**



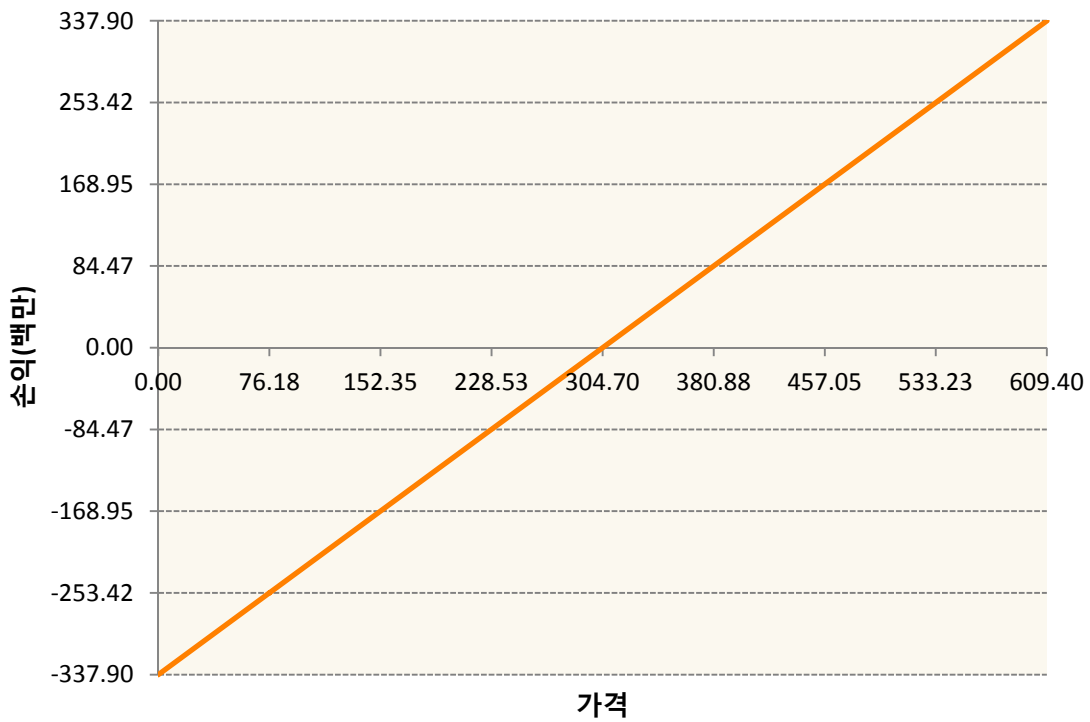
**KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18**



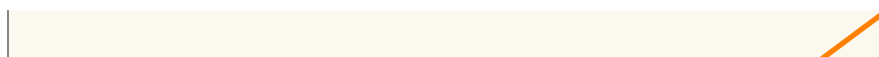
SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

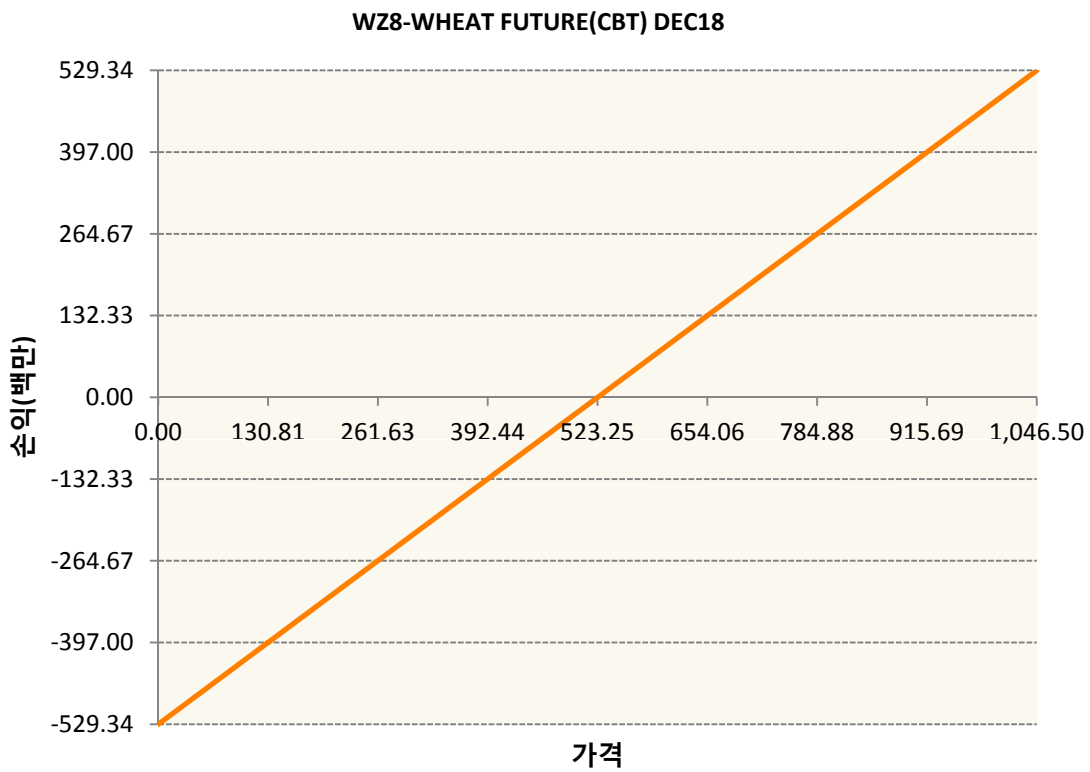
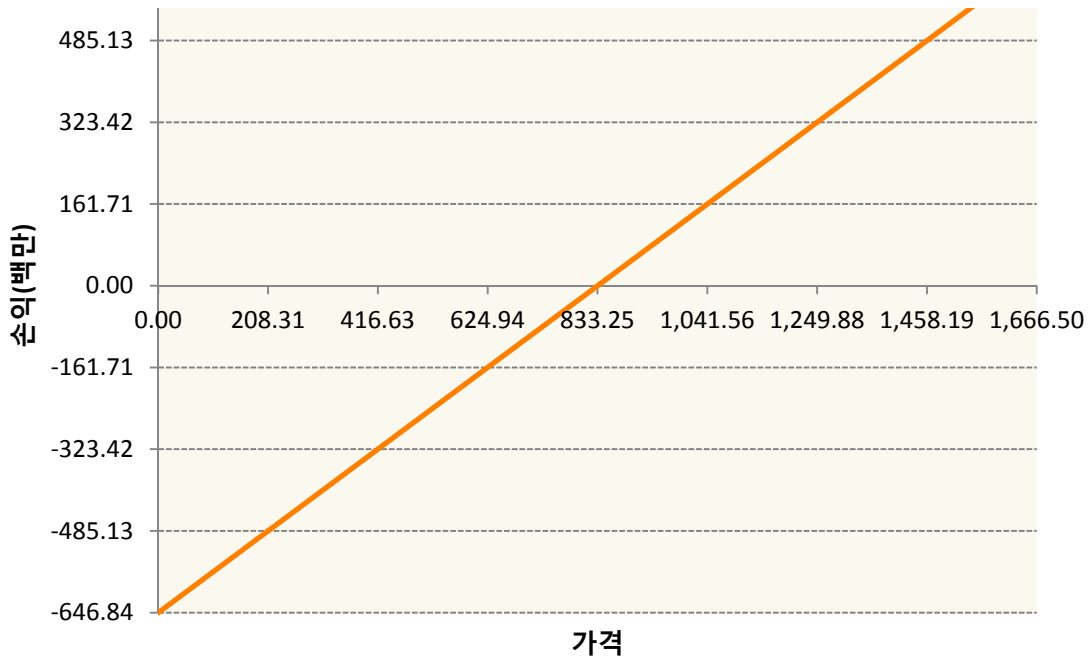


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



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	64
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	27
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	52
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	42

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

(단위:백만원)

**305**