

공시일	2018-08-31
기준일	2018-08-30

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	2018-08-31
기준일	2018-08-30

스마트인덱스모

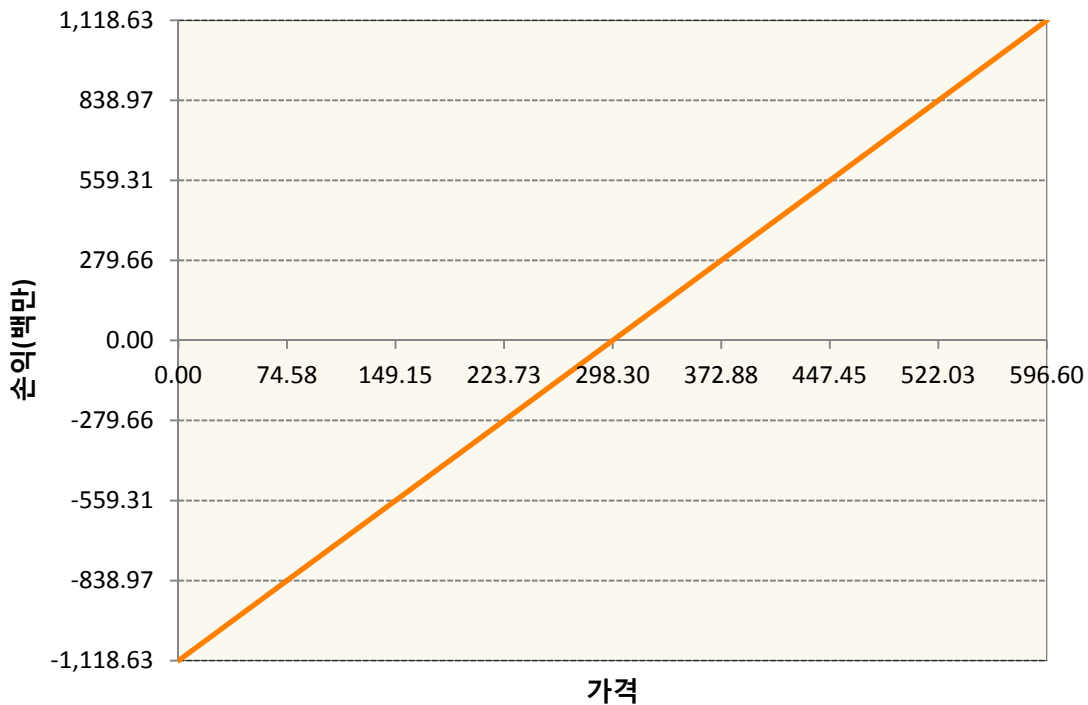
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,119	0	1,119	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%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
-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%	60	60	60	60	60	60	60
8.00%	89	89	89	89	89	89	89

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

(단위:백만원)

67

공시일	2018-08-31
기준일	2018-08-30

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

1,162

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

497

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-08-31
기준일	2018-08-30

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

301

* 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	2018-08-31
기준일	2018-08-30

유로인덱스모(주식-파생형)

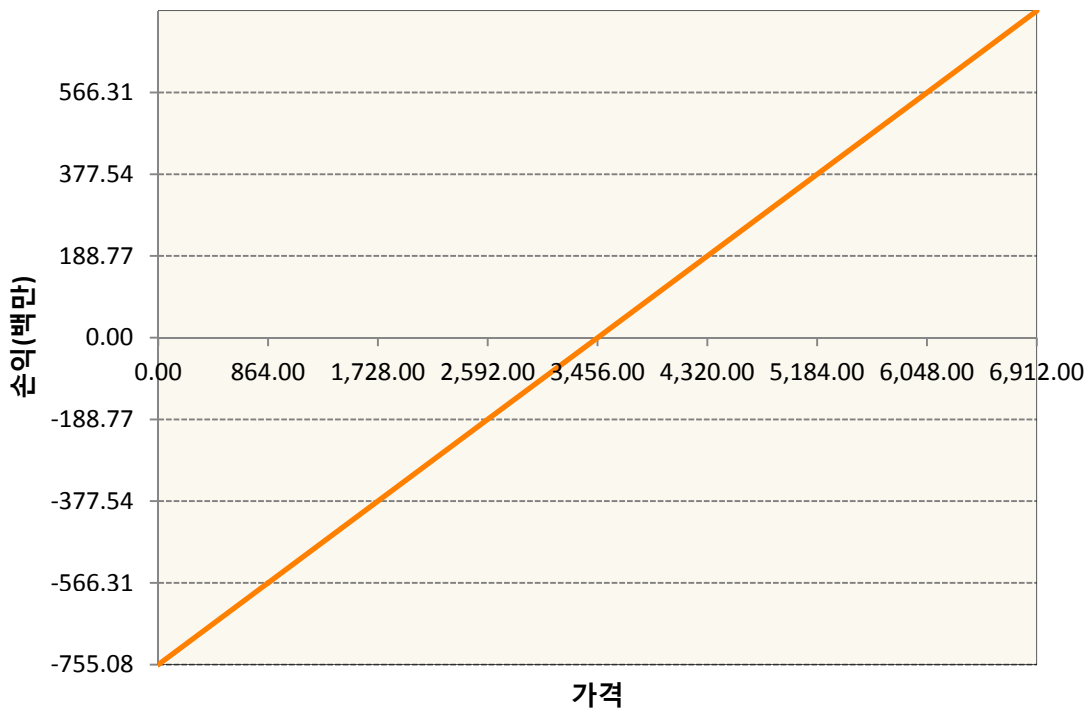
1. 계약금액

(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	2018-08-31
기준일	2018-08-30

차이나인덱스모(주식-파생형)

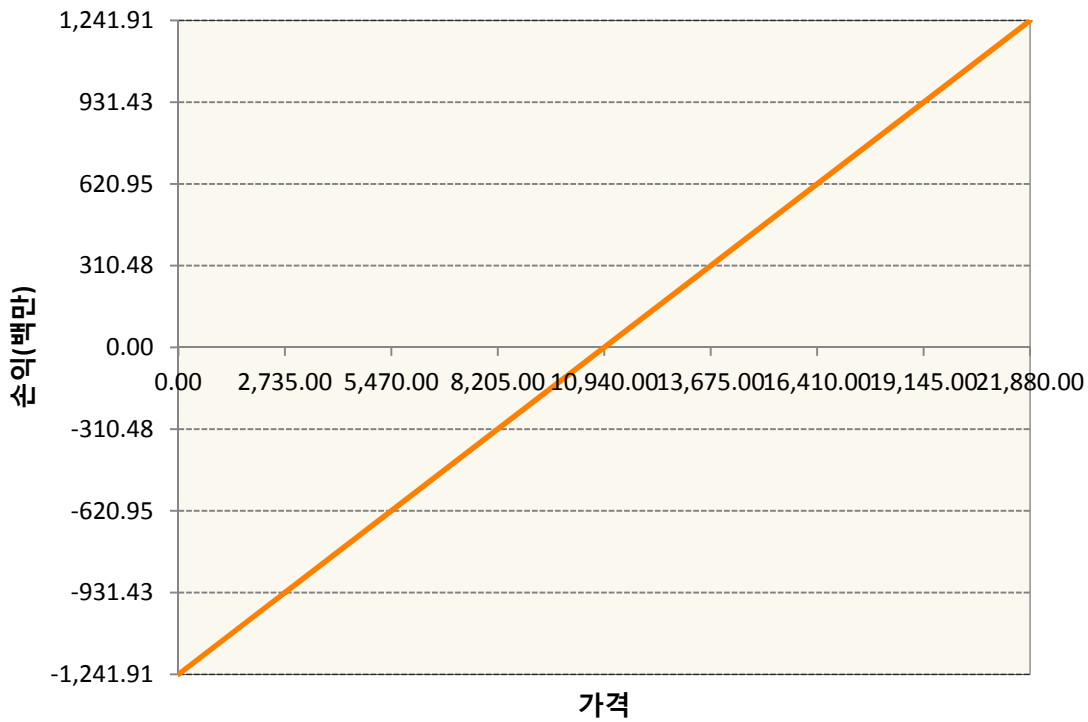
1. 계약금액

(단위:백만원)

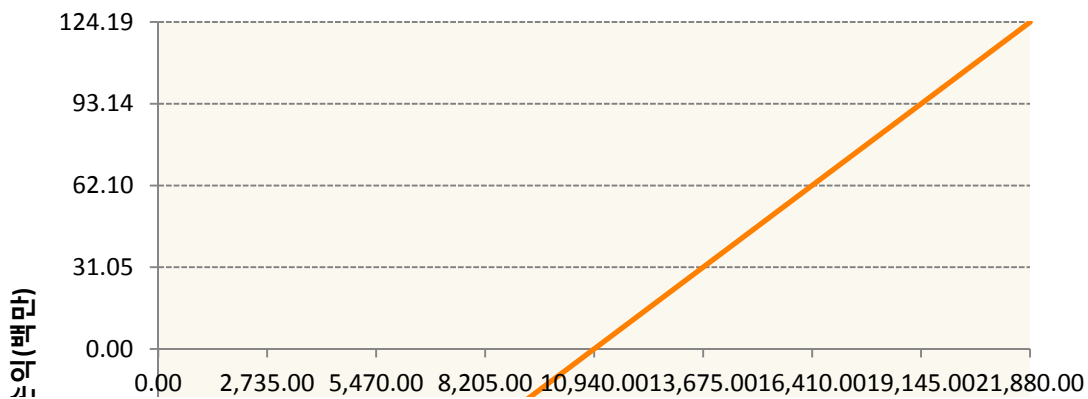
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	124	0	124	
누계	유가증권	선물	1,242	0	1,242	장내

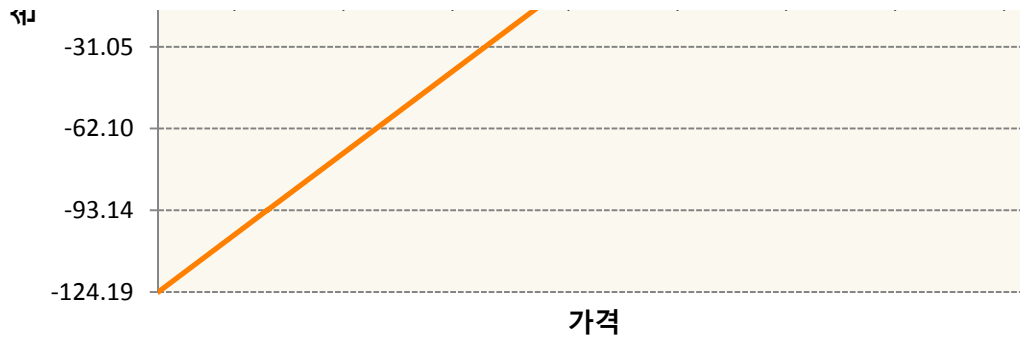
2. 만기시점의 손익구조

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	99
MHCU8	MINI H-SHR IDX Fut Sep18	10

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

100

공시일	2018-08-31
기준일	2018-08-30

커버드콜모(주식혼합-파생형)

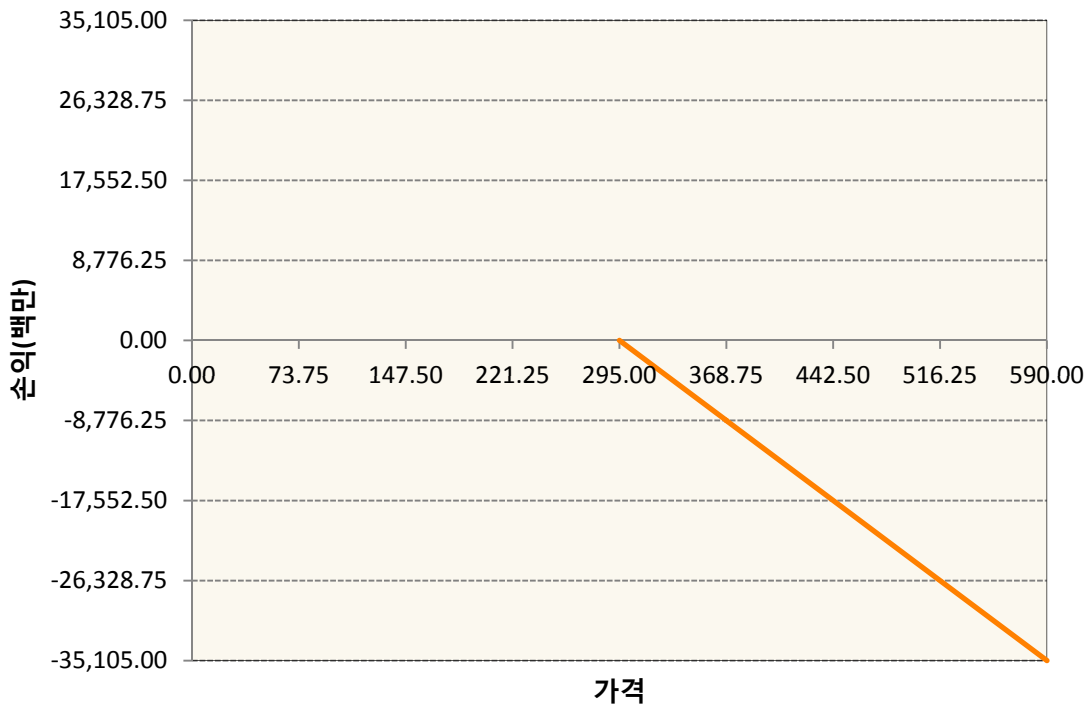
1. 계약금액

(단위:백만원)

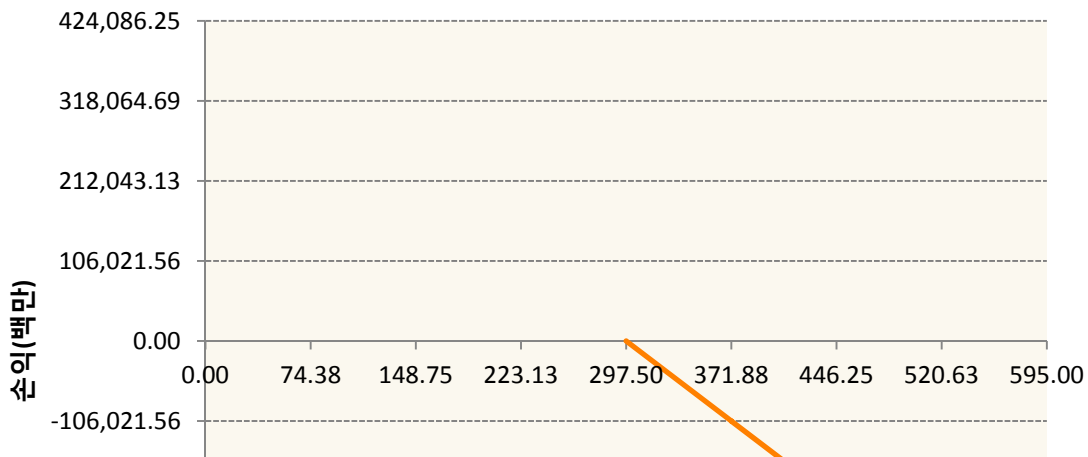
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	756,691	-756,691	장내

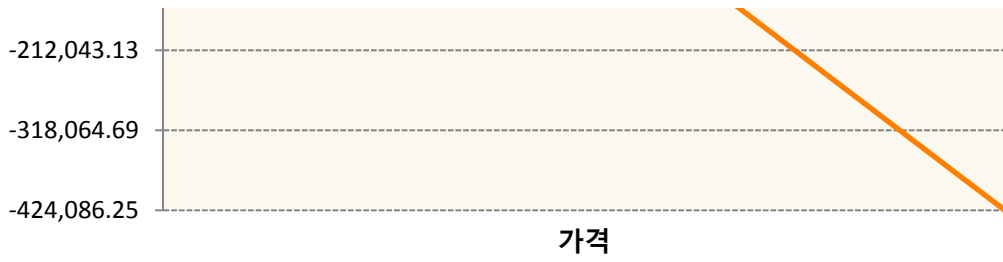
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92950-2018-09 콜295

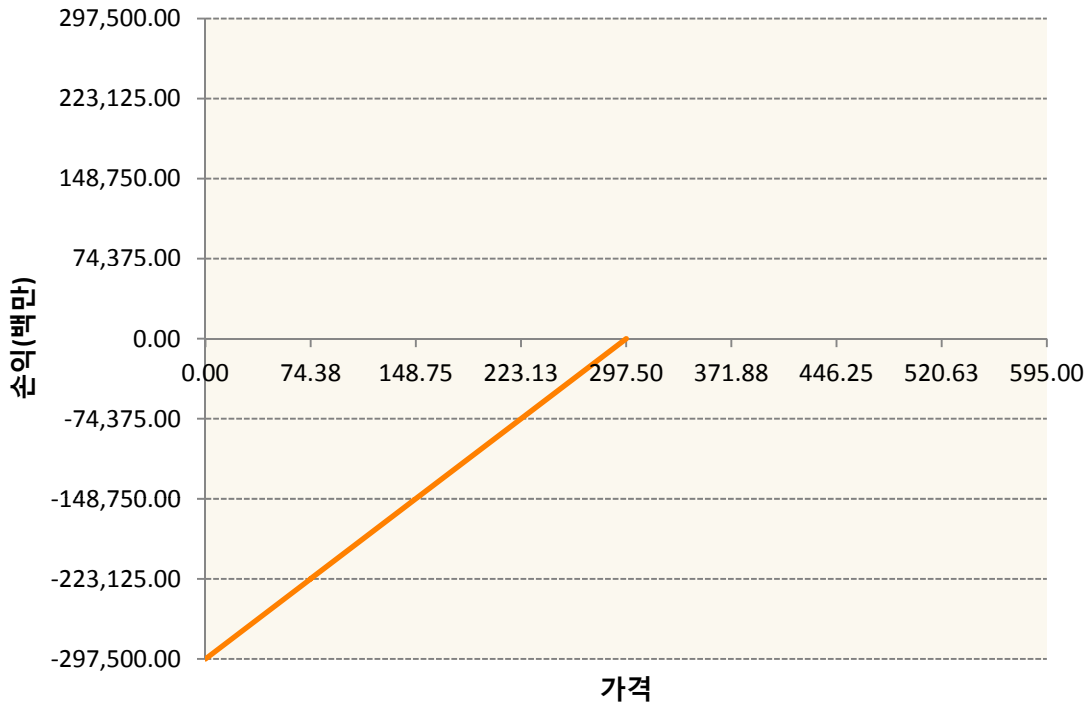


KR4201N92976-2018-09 콜297.5





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N929 2018-09 콜295

2,365

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	916	903	887	866	842	815	784
-5.33%	845	812	774	734	691	646	599
-2.67%	629	573	517	459	401	343	284
0%	180	120	60	0	-61	-121	-182
2.67%	-506	-549	-594	-642	-692	-744	-797
5.33%	-1,351	-1,372	-1,397	-1,427	-1,460	-1,497	-1,536
8.00%	-2,268	-2,275	-2,286	-2,300	-2,318	-2,340	-2,365

KR4201N929 2018-09 풋297.5

27,063

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,154	9,050	8,903	8,712	8,478	8,205	7,894

-5.33%	8,596	8,276	7,906	7,493	7,042	6,560	6,052
-2.67%	6,668	6,060	5,432	4,787	4,130	3,463	2,788
0%	2,222	1,481	741	0	-741	-1,481	-2,222
2.67%	-5,163	-5,761	-6,384	-7,027	-7,686	-8,357	-9,037
5.33%	-14,793	-15,124	-15,508	-15,939	-16,409	-16,913	-17,445
8.00%	-25,579	-25,708	-25,886	-26,114	-26,388	-26,706	-27,063

KR4301N929 2018-09 풋 297.5

20,892

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20,888	-20,888	-20,888	-20,888	-20,889	-20,890	-20,892
-5.33%	-12,947	-12,950	-12,956	-12,966	-12,983	-13,007	-13,039
-2.67%	-5,150	-5,230	-5,326	-5,437	-5,559	-5,693	-5,835
0%	665	444	222	0	-222	-444	-666
2.67%	2,320	2,255	2,173	2,076	1,966	1,844	1,711
5.33%	2,421	2,419	2,413	2,403	2,386	2,362	2,329
8.00%	2,422	2,422	2,422	2,422	2,421	2,419	2,416

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

(단위:백만원)

56,277

공시일	2018-08-31
기준일	2018-08-30

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

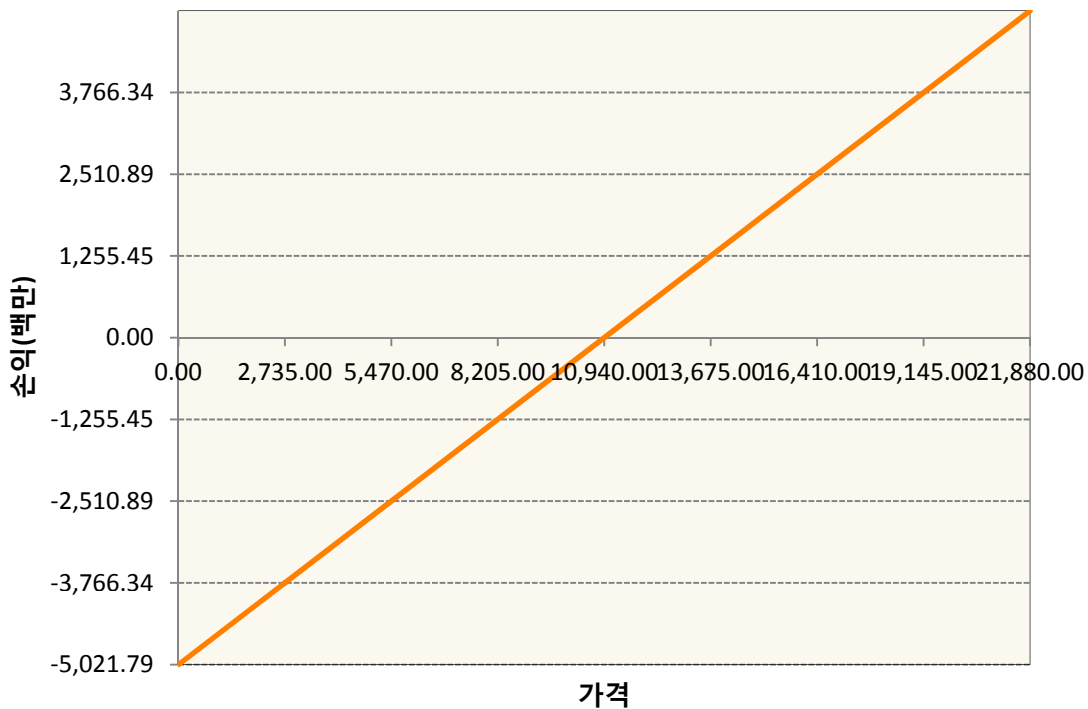
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1	0	1	장내
누계	유가증권	선물	5,022	0	5,022	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCU8-H-SHARES IDX FUT Sep18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU8 H-SHARES IDX FUT Sep18

402

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

(단위:백만원)

367

공시일	2018-08-31
기준일	2018-08-30

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

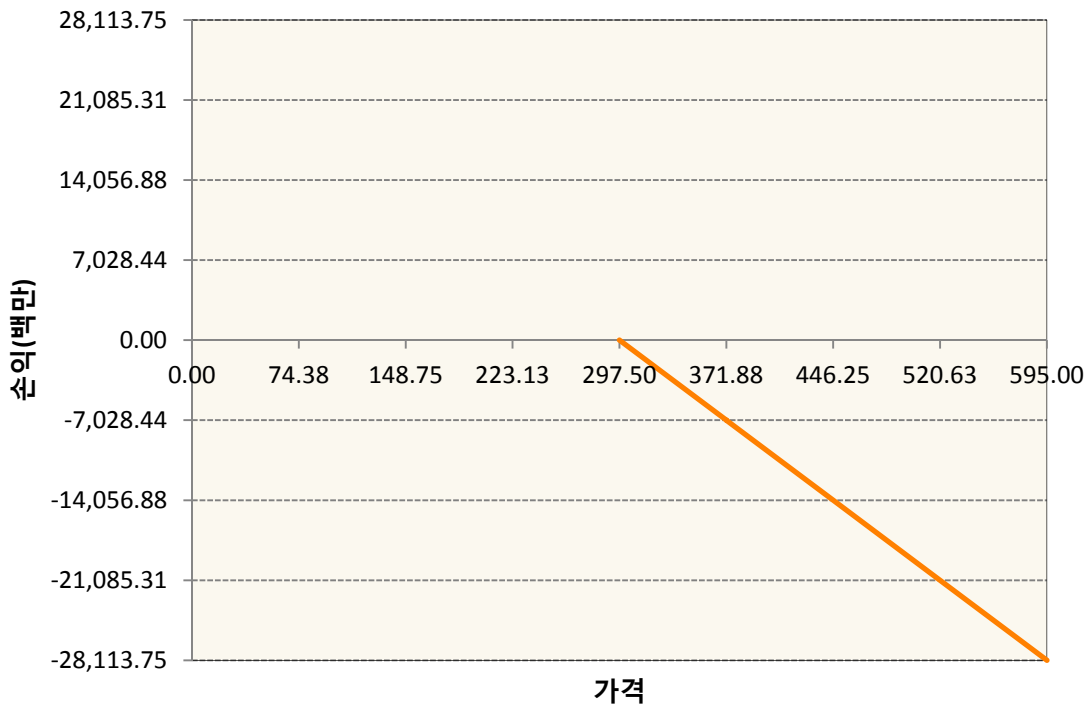
1. 계약금액

(단위:백만원)

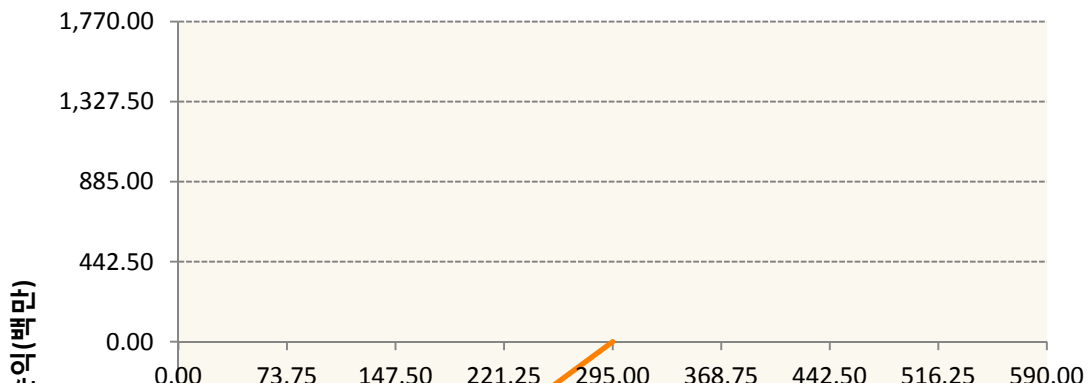
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	49,668	-49,668	장내

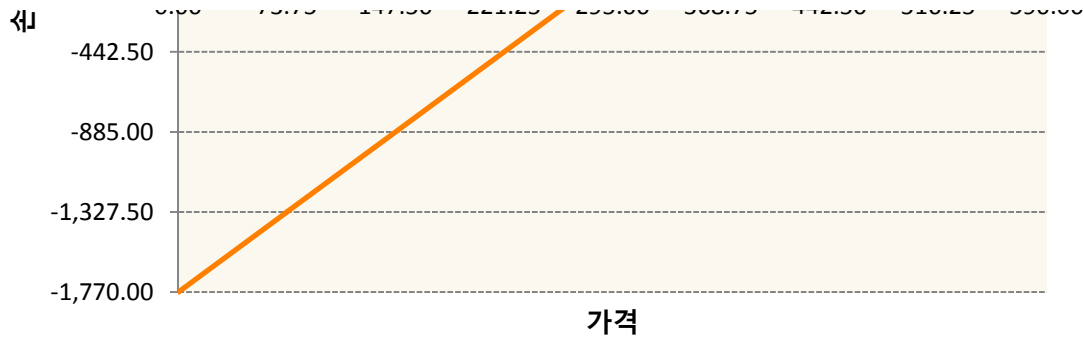
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92976-2018-09 콜297.5

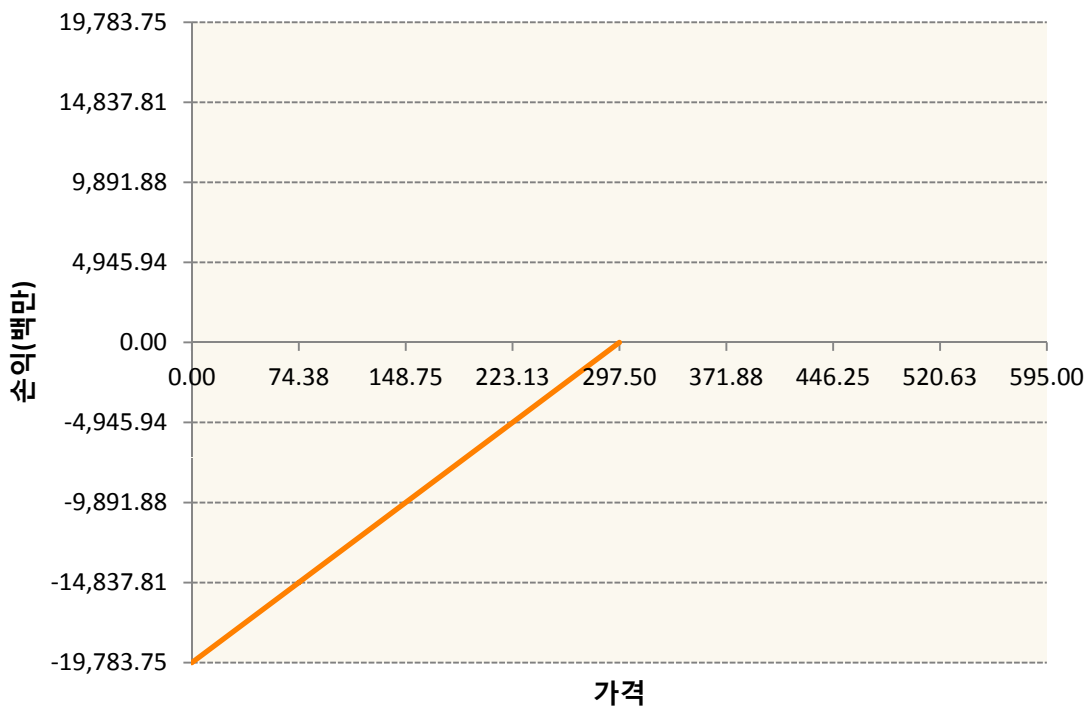


KR4301N92958-2018-09 풋295





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,949
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,949	-3,949	-3,949	-3,949	-3,949	-3,949	-3,949
-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%	3,949	3,949	3,949	3,949	3,949	3,949	3,949
KR4201N92974-2018-09 풋297.5							1,794
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	607	600	590	578	562	544	523
-5.33%	570	549	524	497	467	435	401
-2.67%	442	402	360	317	274	230	185
0%	147	98	49	0	-49	-98	-147
2.67%	-342	-382	-423	-466	-510	-554	-599
5.33%	-981	-1,003	-1,028	-1,057	-1,088	-1,121	-1,156
8.00%	-1,696	-1,704	-1,716	-1,731	-1,749	-1,770	-1,794

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%	-69	-69	-69	-69	-69	-70	-70
-2.67%	-24	-24	-25	-26	-27	-28	-29
0%	3	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	8	8	8	8	7	7	6
5.33%	9	9	9	8	8	8	8
8.00%	9	9	9	9	9	9	9

KR4301N929 2018-09 풋297.5

1,389

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	-1,389	-1,389	-1,389
-5.33%	-861	-861	-862	-862	-863	-865	-867
-2.67%	-342	-348	-354	-362	-370	-379	-388
0%	44	30	15	0	-15	-30	-44
2.67%	154	150	145	138	131	123	114
5.33%	161	161	160	160	159	157	155
8.00%	161	161	161	161	161	161	161

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

(단위:백만원)

7,657

공시일	2018-08-31
기준일	2018-08-30

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

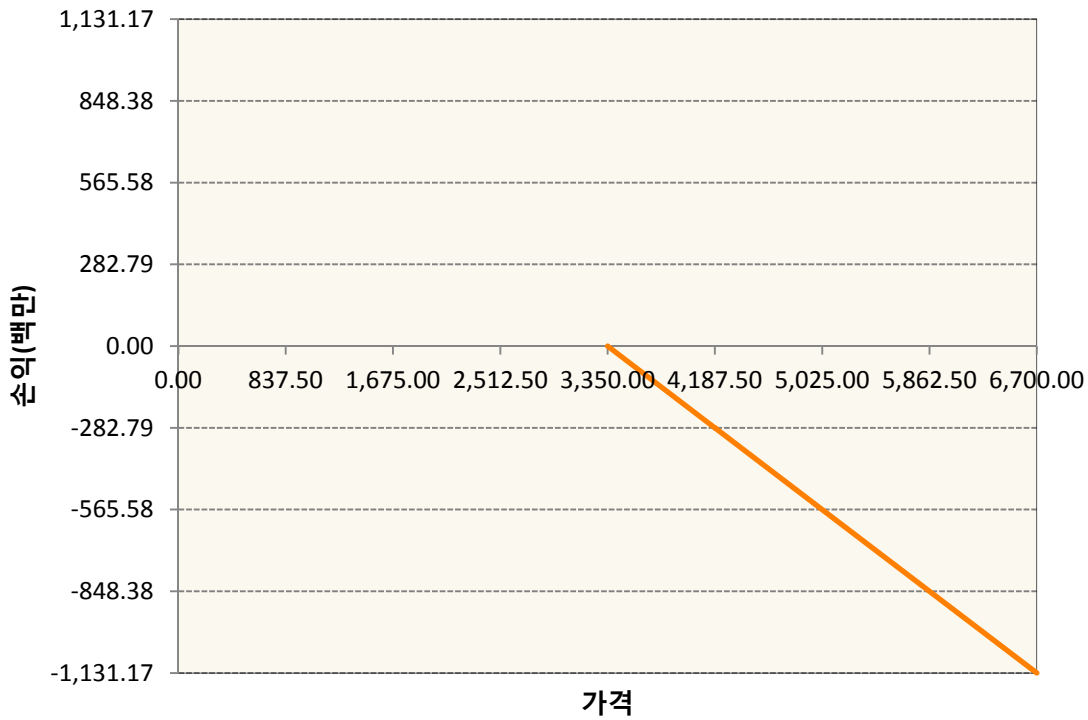
1. 계약금액

(단위:백만원)

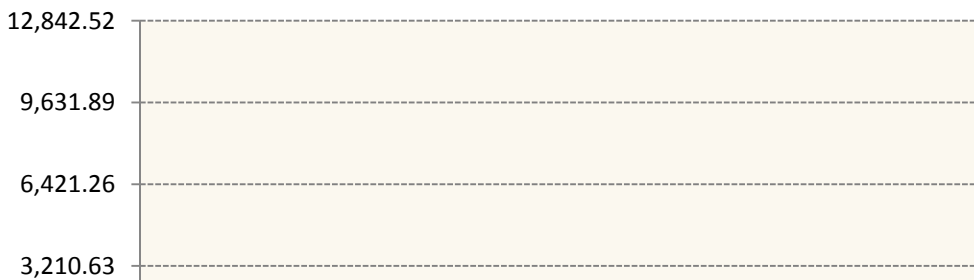
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,135	0	7,135	
누계	유가증권	옵션	0	27,947	-27,947	장내
누계	지수	스왑	87,017	0	87,017	장외

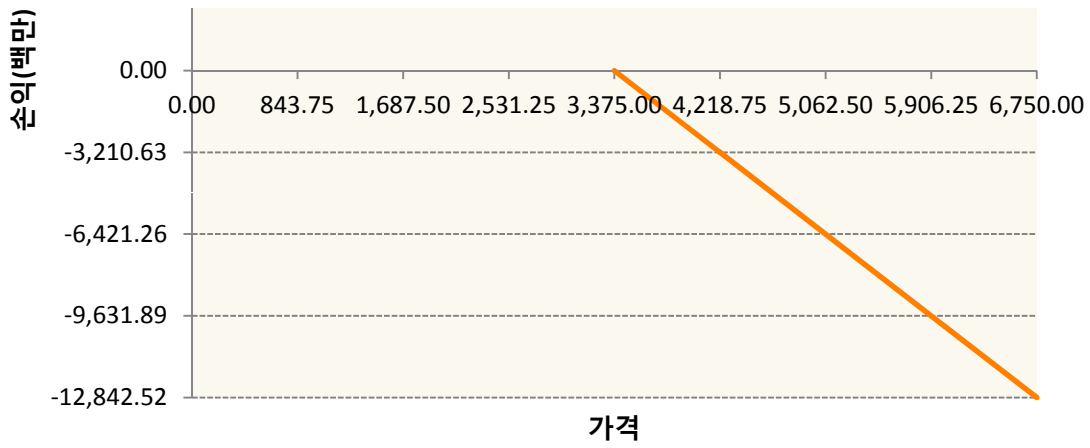
2. 만기시점의 손익구조

OESXU8-C3350-EURO STOXX 50

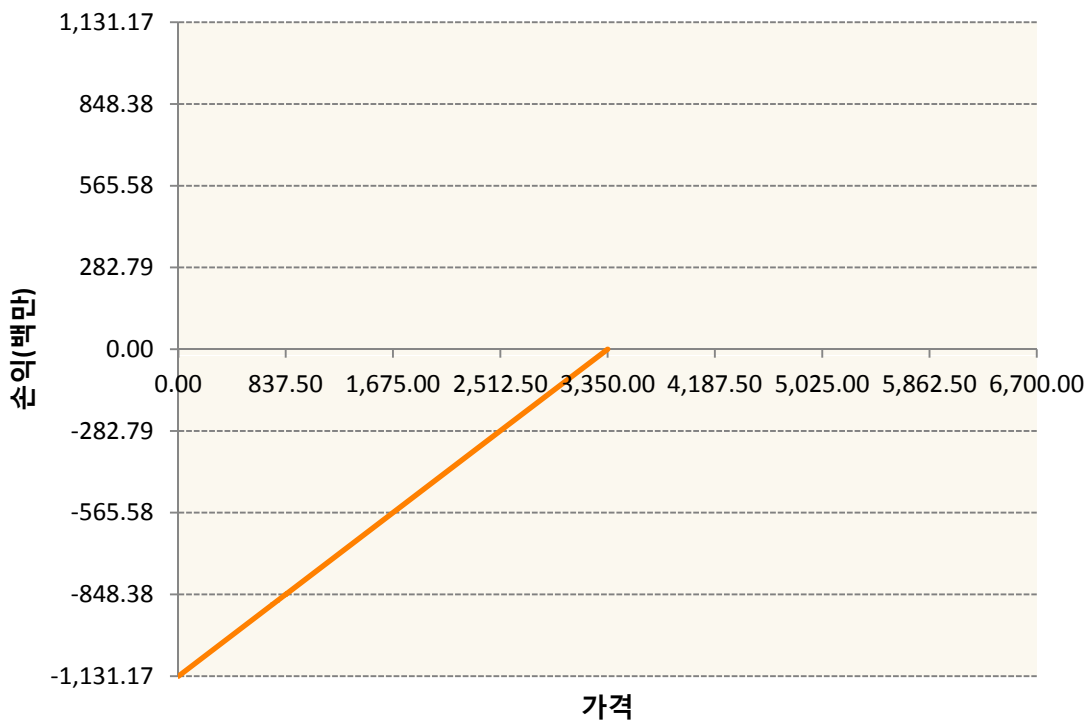


OESXU8-C3375-EURO STOXX 50

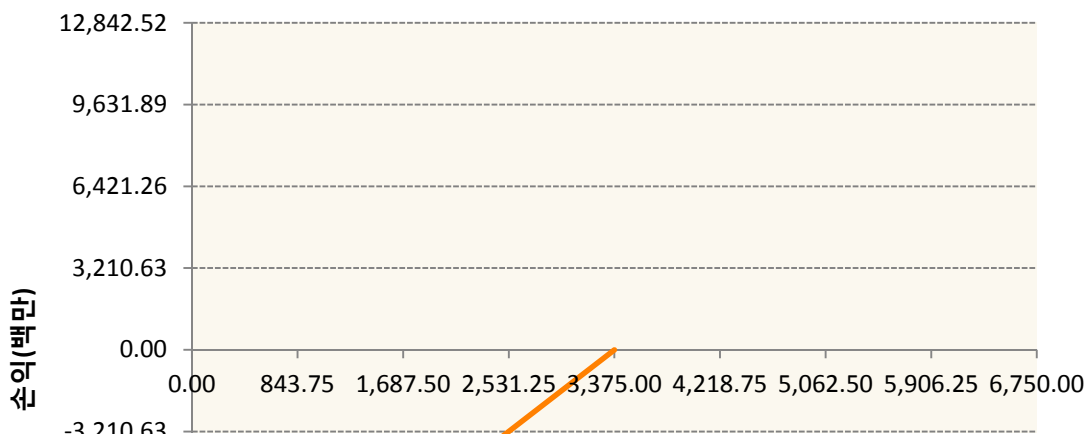


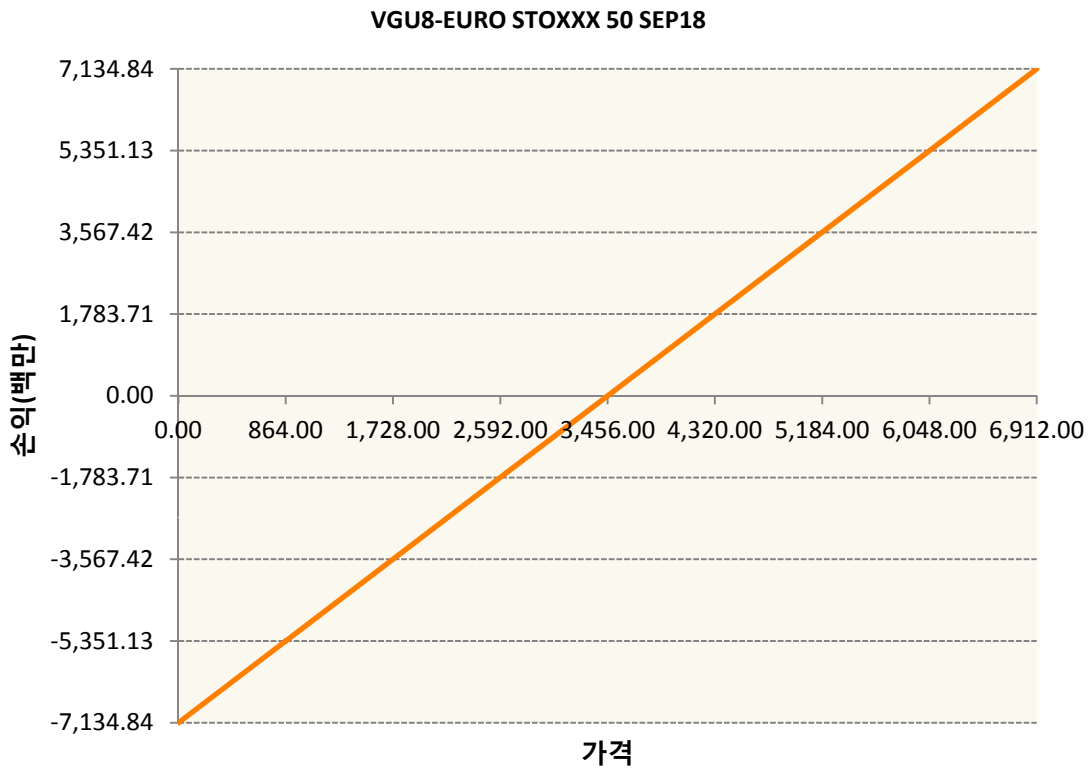
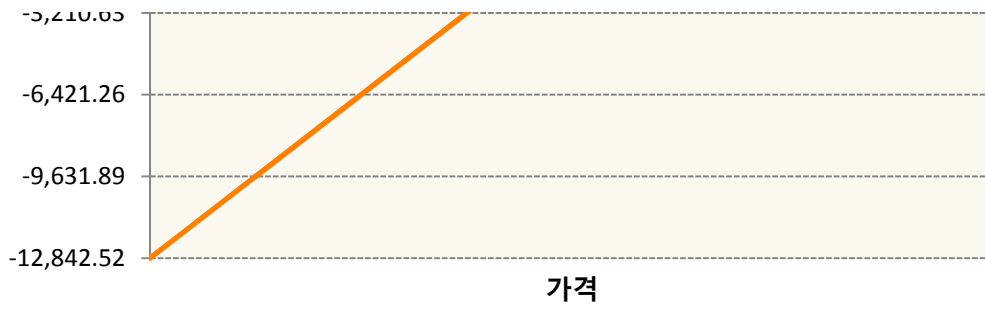


OESXU8-P3350-EURO STOXX 50



OESXU8-P3375-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	4
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY	3
OESXU8-C33 EURO STOXX 50	90
OESXU8-C33 EURO STOXX 50	1,027
OESXU8-P33 EURO STOXX 50	90
OESXU8-P33 EURO STOXX 50	1,027
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18	571

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

1,758

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

(단위:백만원)

1,135

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)

166

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-08-31
기준일	2018-08-30

리디파인K200(주식혼합-파생재간

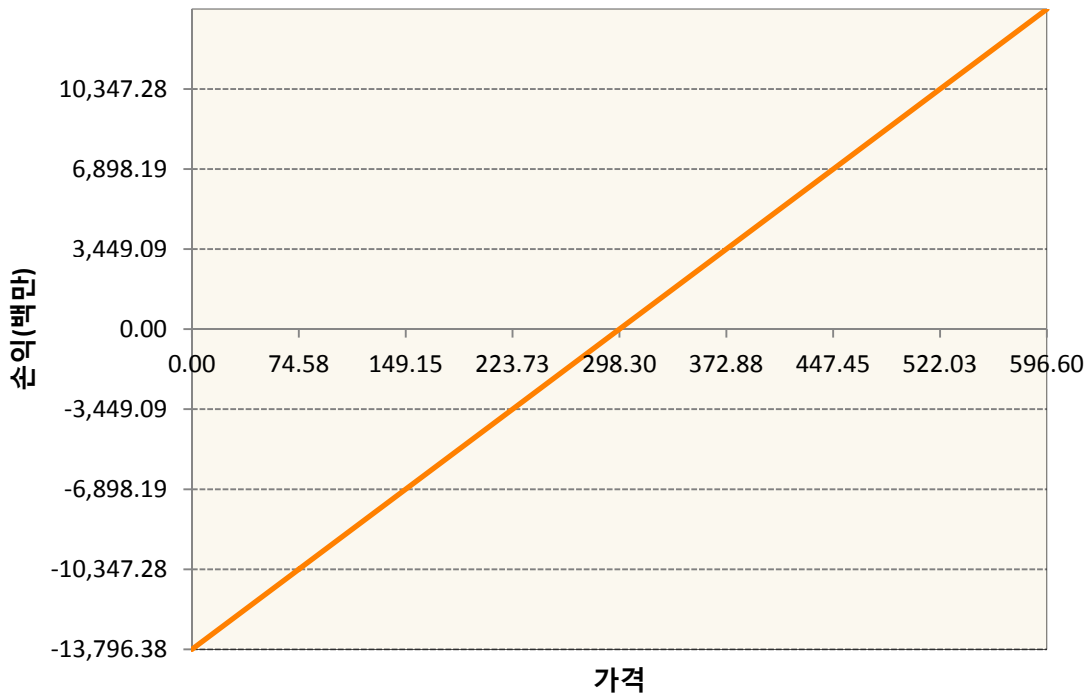
1. 계약금액

(단위:백만원)

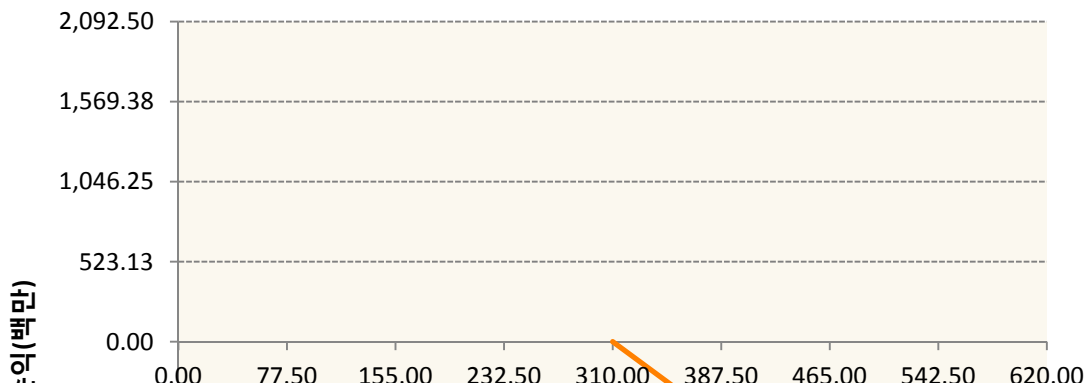
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,796	0	13,796	장내
누계	유가증권	옵션	1,339	24,671	-23,332	장내

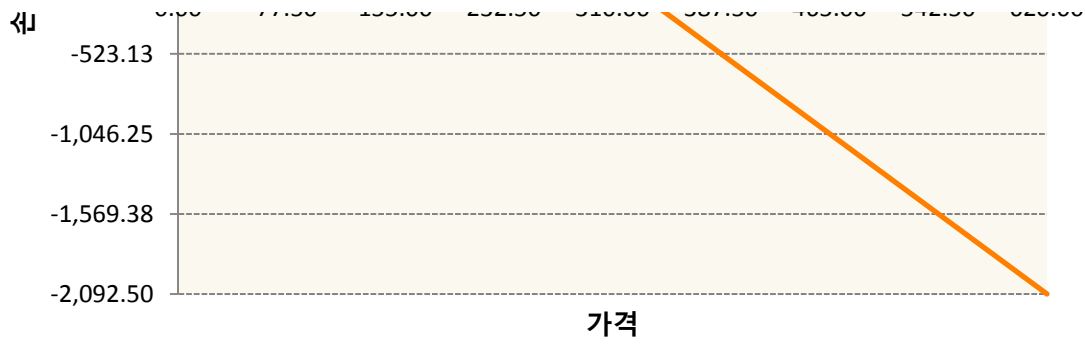
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

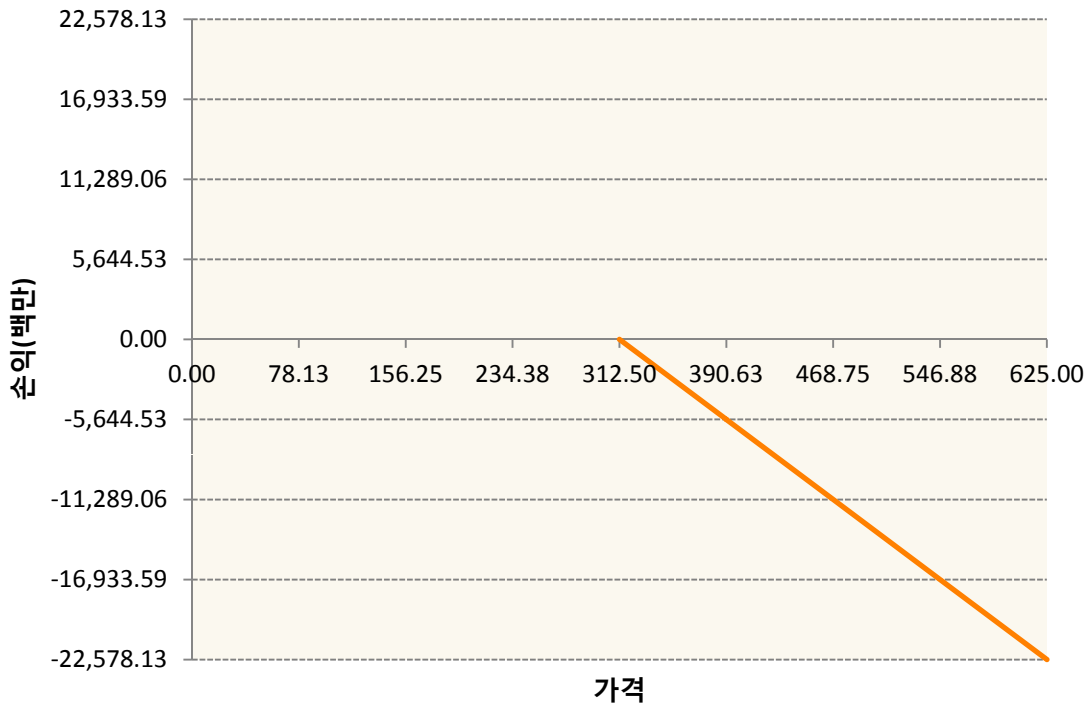


KR4201N93107-2018-09 콜310

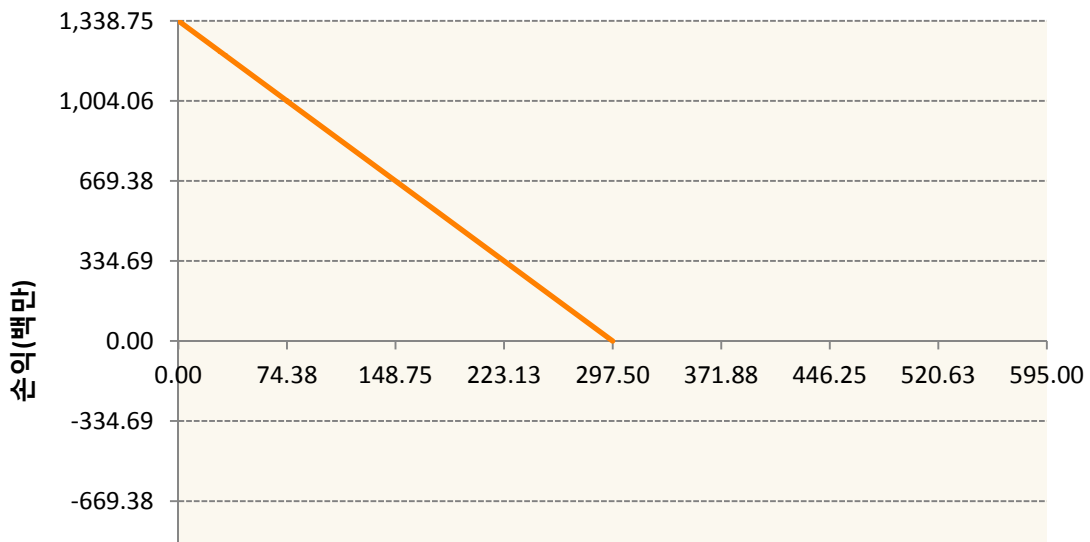


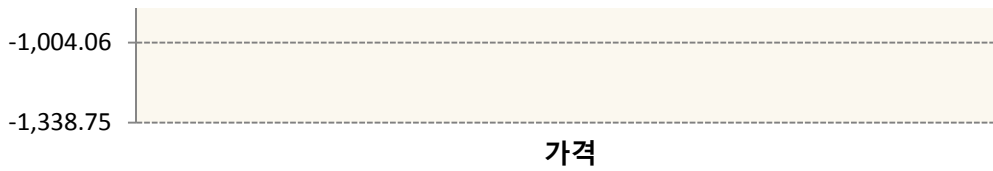


KR4201N93123-2018-09 콜312.5



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%	14	14	14	14	14	13	13
-5.33%	14	14	13	13	12	11	10
-2.67%	13	12	10	9	7	5	3
0%	7	5	3	0	-3	-6	-9
2.67%	-7	-10	-14	-17	-21	-24	-28
5.33%	-34	-37	-41	-44	-48	-52	-55
8.00%	-74	-76	-79	-81	-84	-87	-91
KR4201N9312018-09 콜312.5							882
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	116	115	115	113	111	108	104
-5.33%	114	113	109	105	98	90	79
-2.67%	106	98	88	75	60	43	24
0%	67	47	25	0	-26	-54	-83
2.67%	-49	-83	-118	-154	-190	-227	-264
5.33%	-293	-332	-372	-411	-450	-490	-529
8.00%	-679	-710	-742	-776	-811	-846	-882
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	59	59
-2.67%	23	24	24	24	25	26	26

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

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

(단위:백만원)

1,655

공시일	2018-08-31
기준일	2018-08-30

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

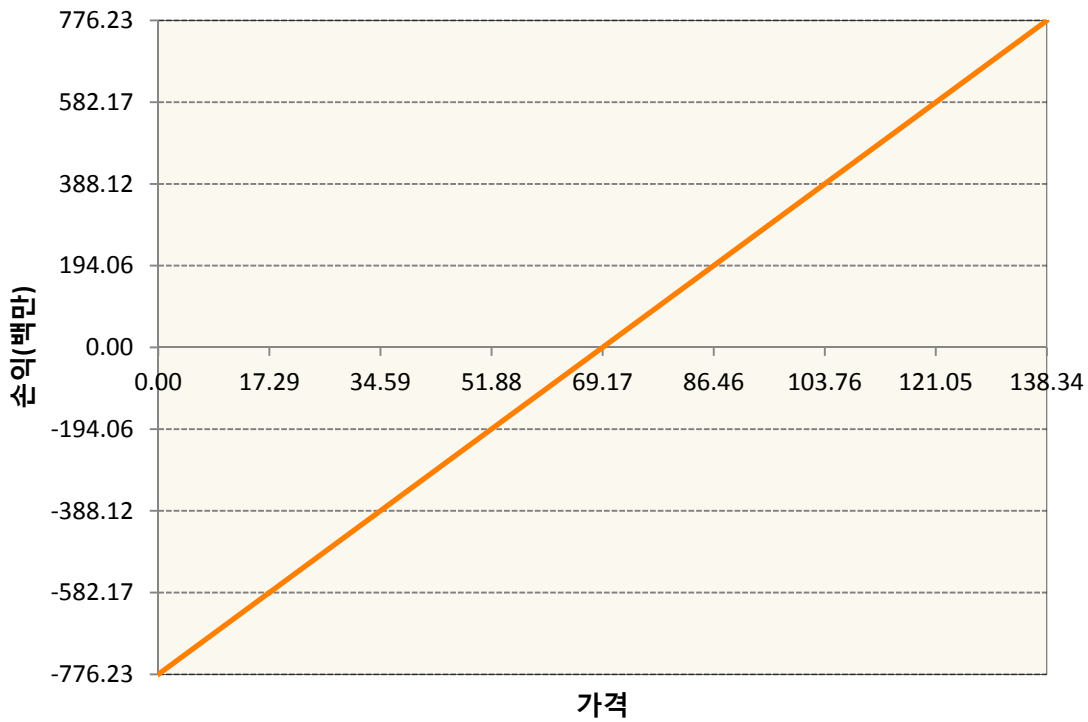
1. 계약금액

(단위:백만원)

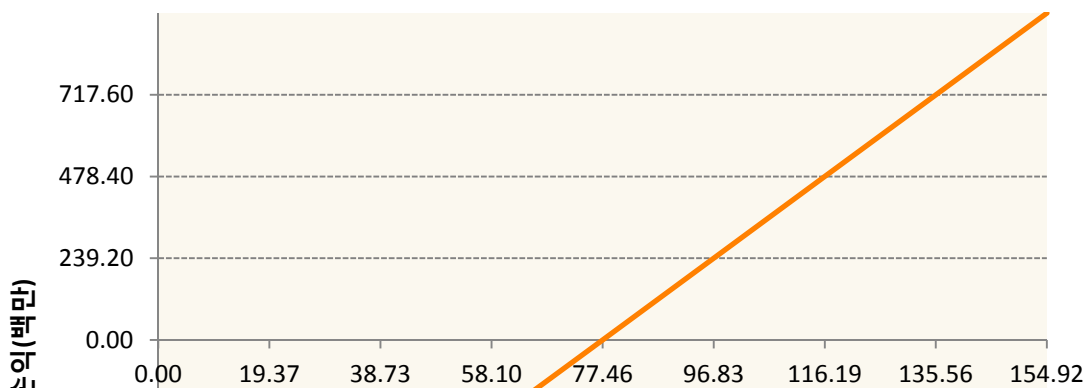
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,174	610	2,564	
누계	유가증권	선물	531	0	531	장내

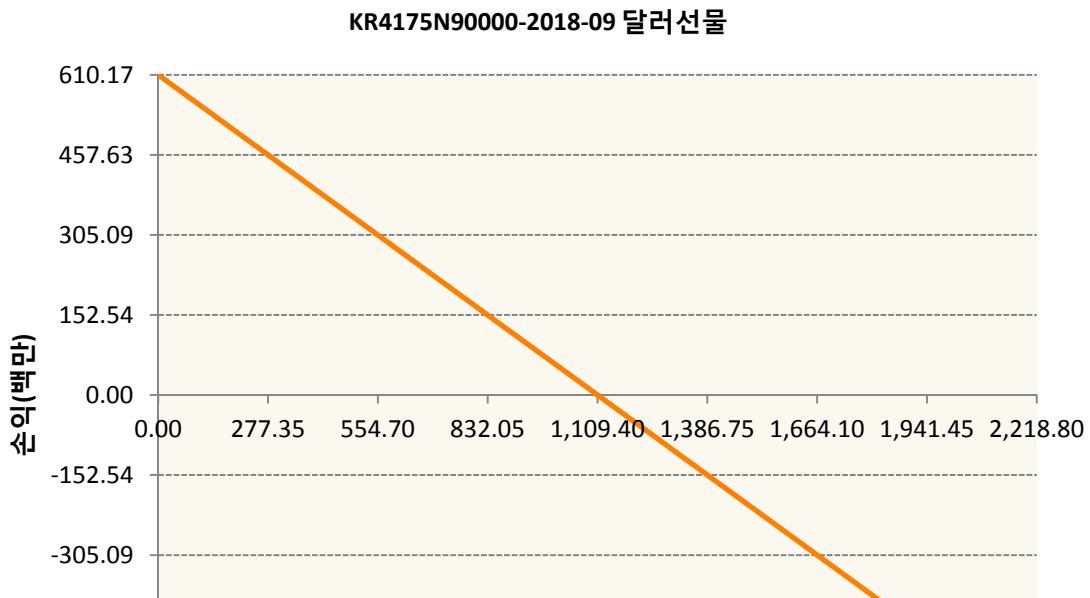
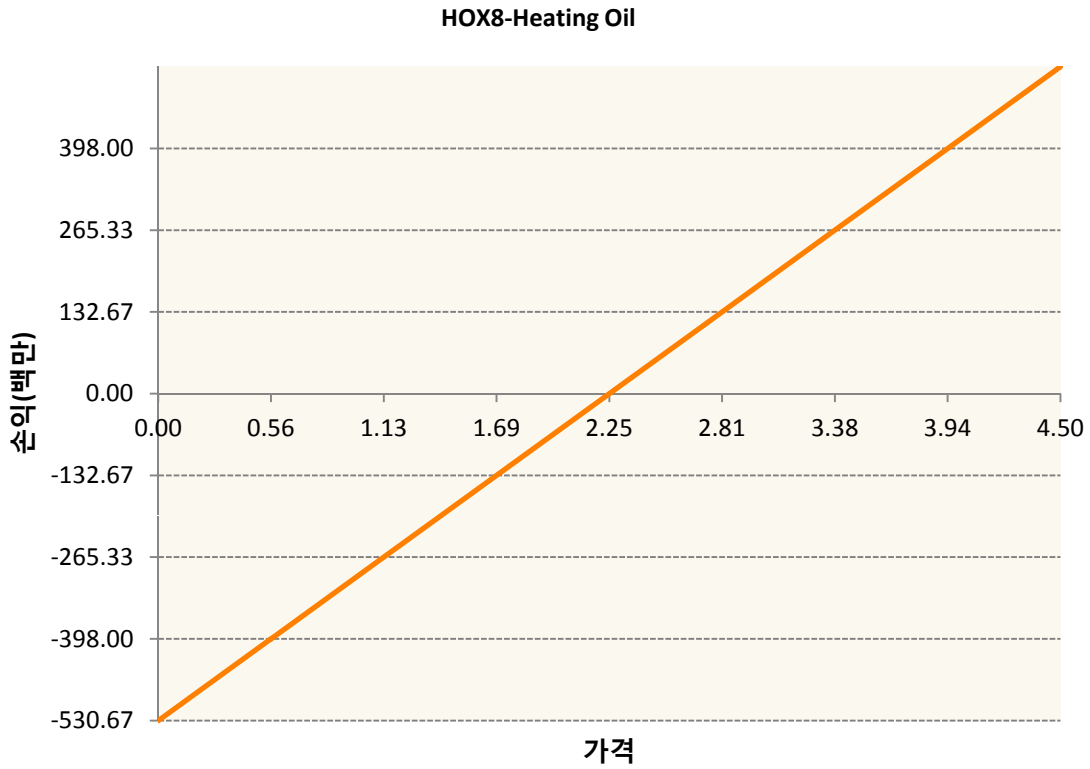
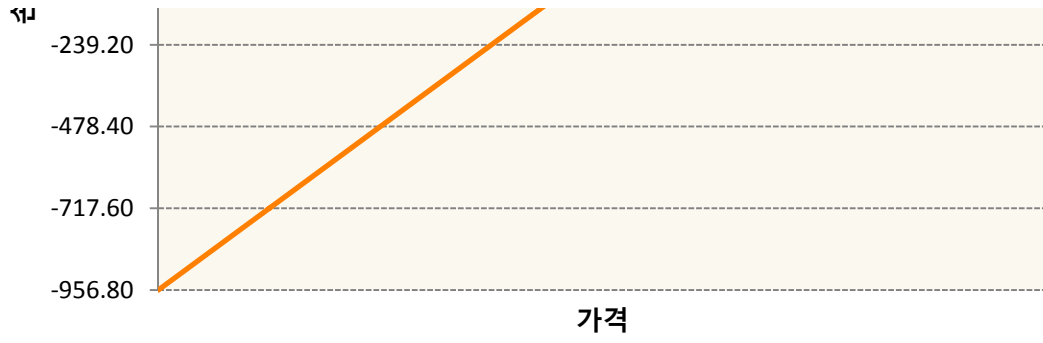
2. 만기시점의 손익구조

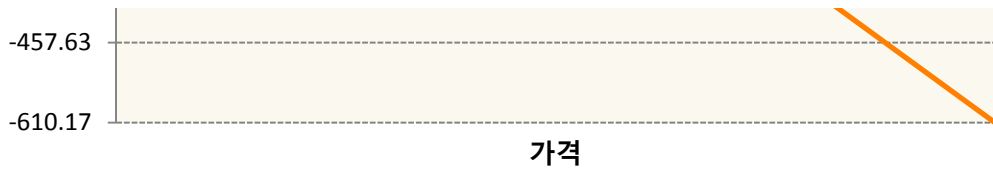
CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18



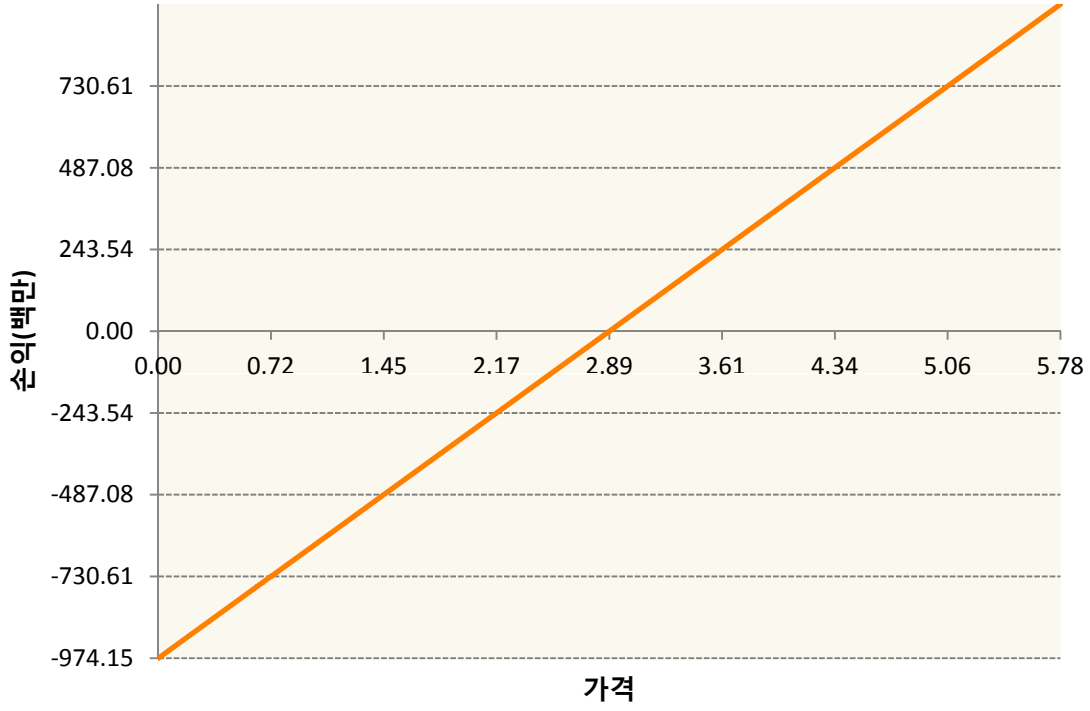
COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18



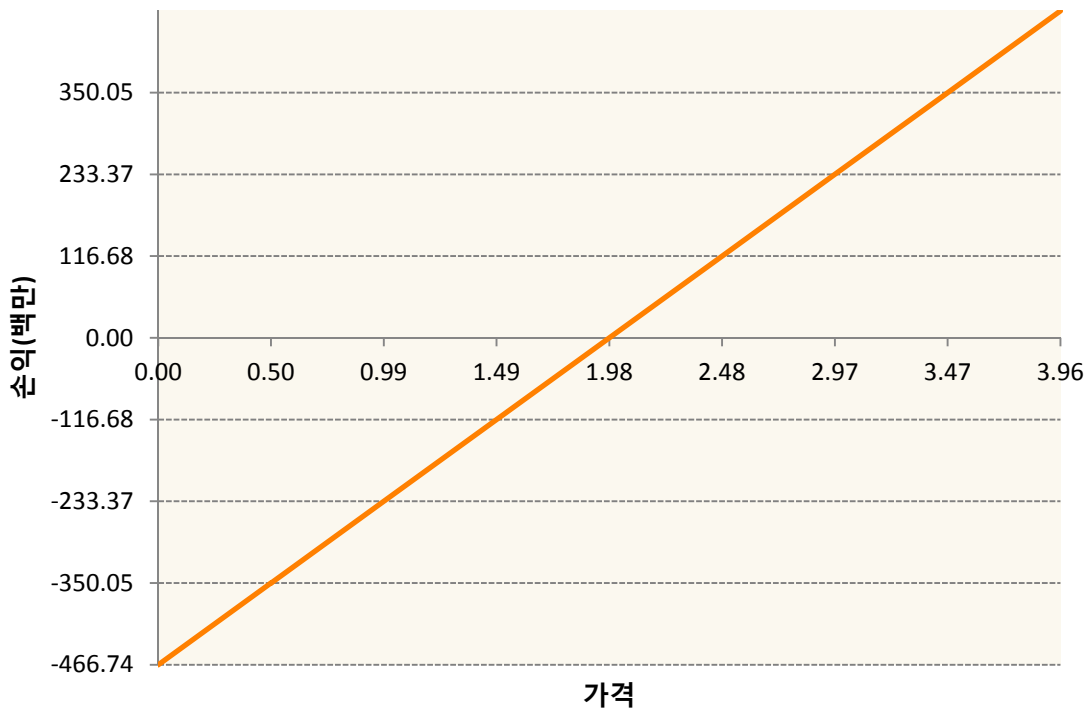




NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18



XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	62
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	77
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)
	445

공시일	2018-08-31
기준일	2018-08-30

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

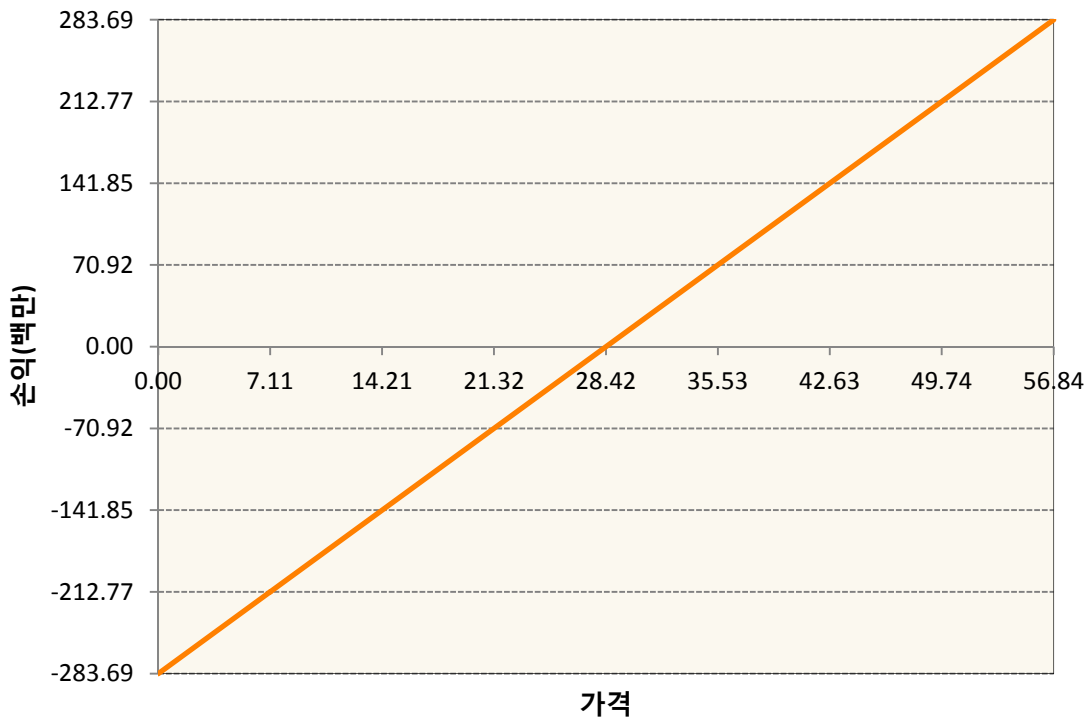
1. 계약금액

(단위:백만원)

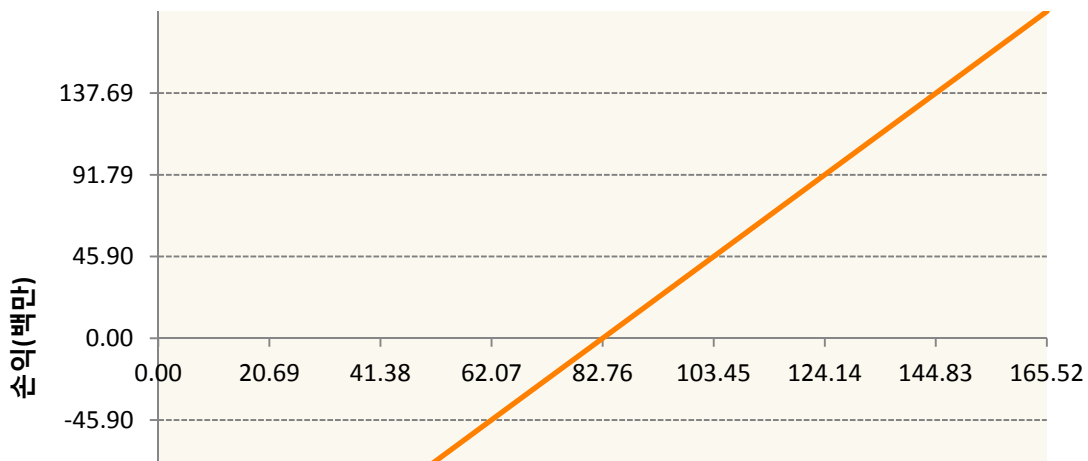
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,589	78	3,512	

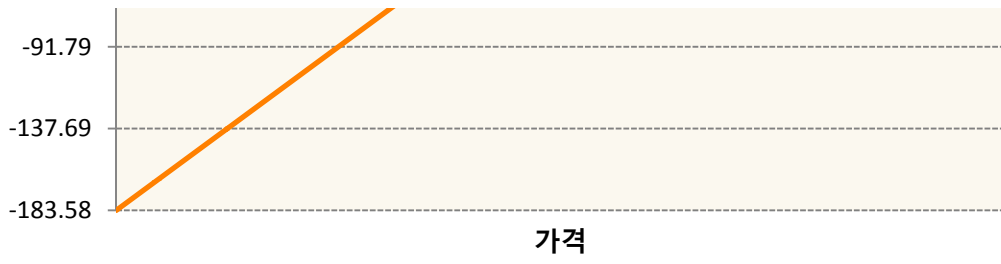
2. 만기시점의 손익구조

BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18

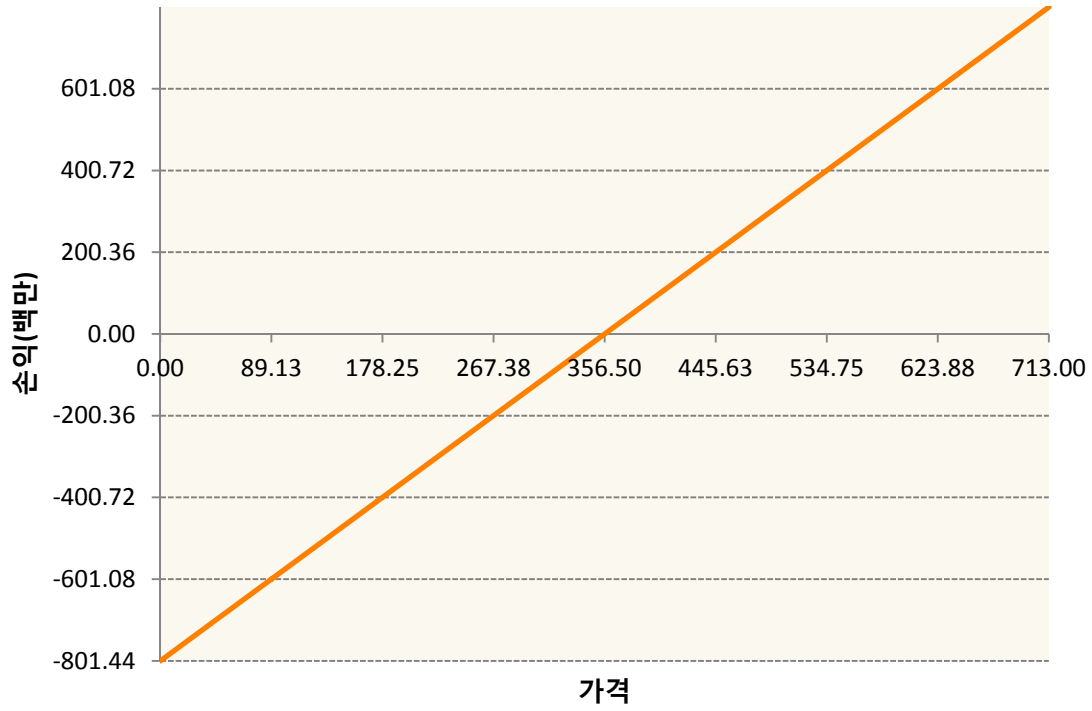


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

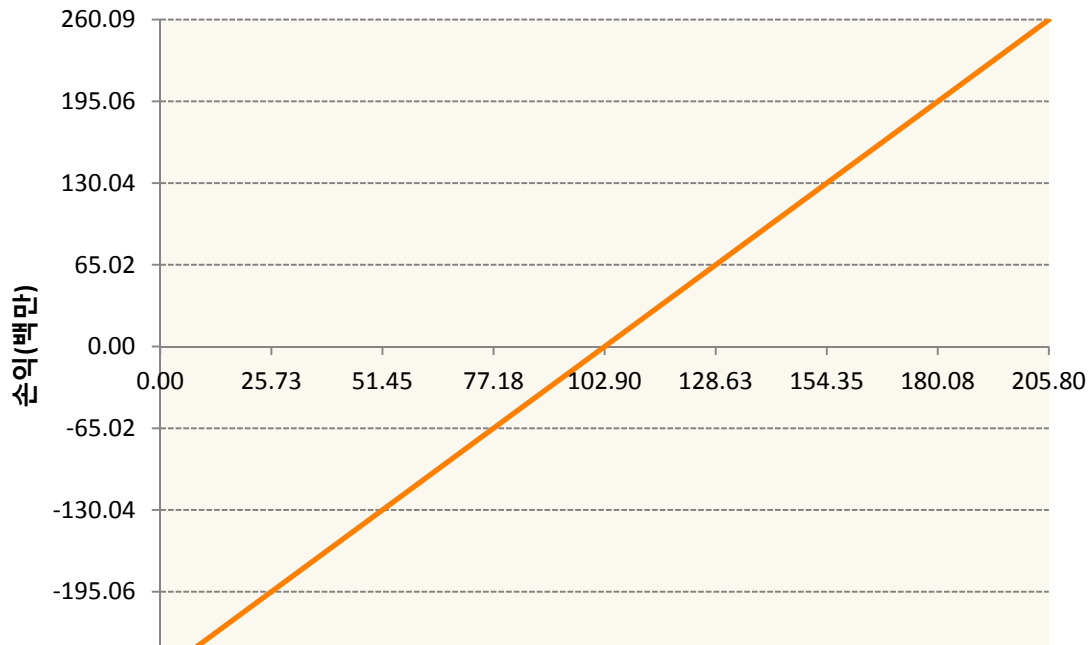


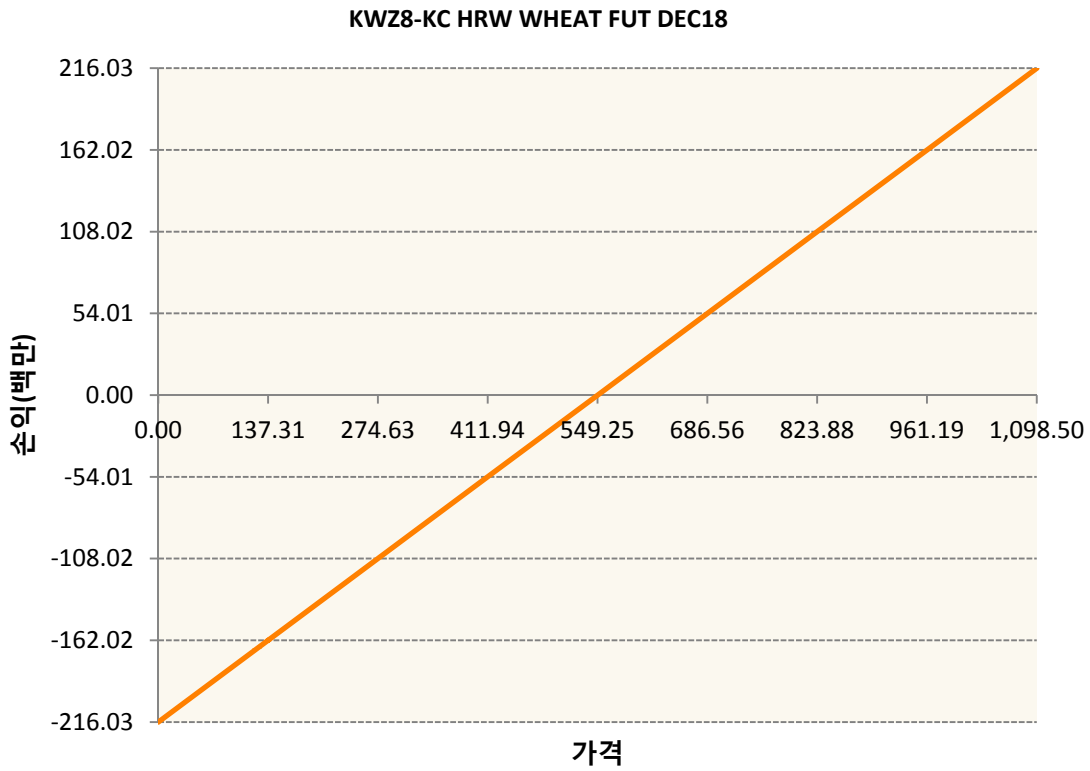
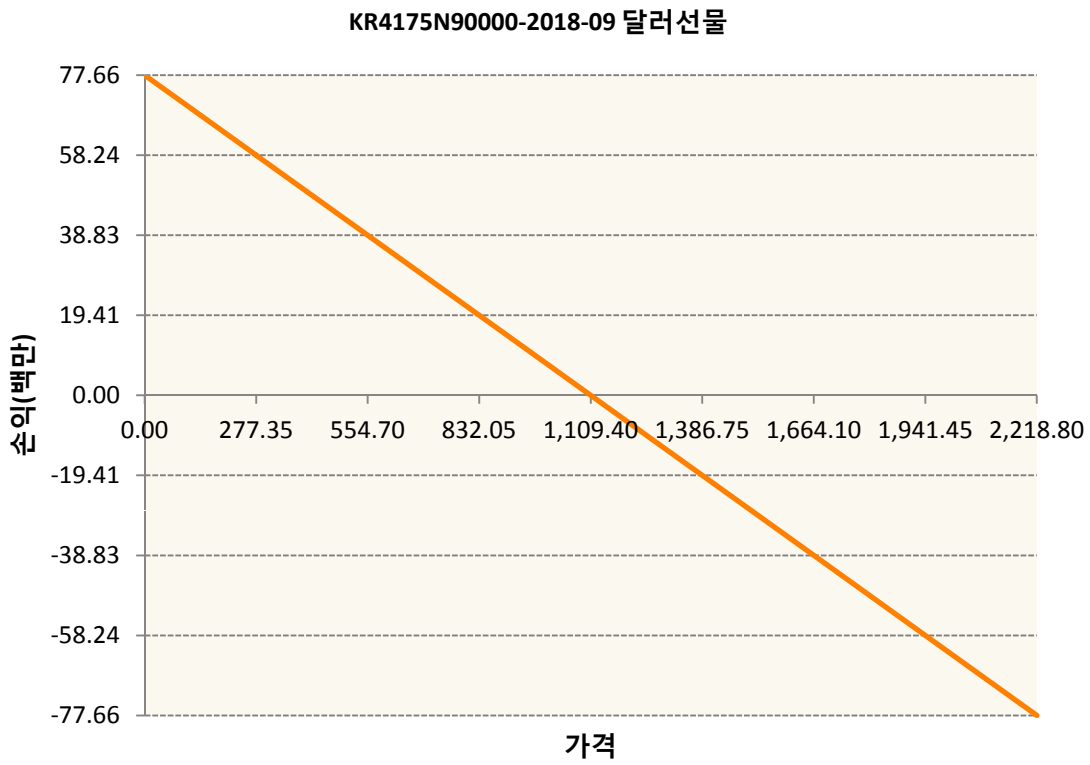
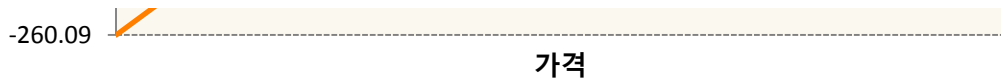


CZ8-CORN FUTURE DEC18

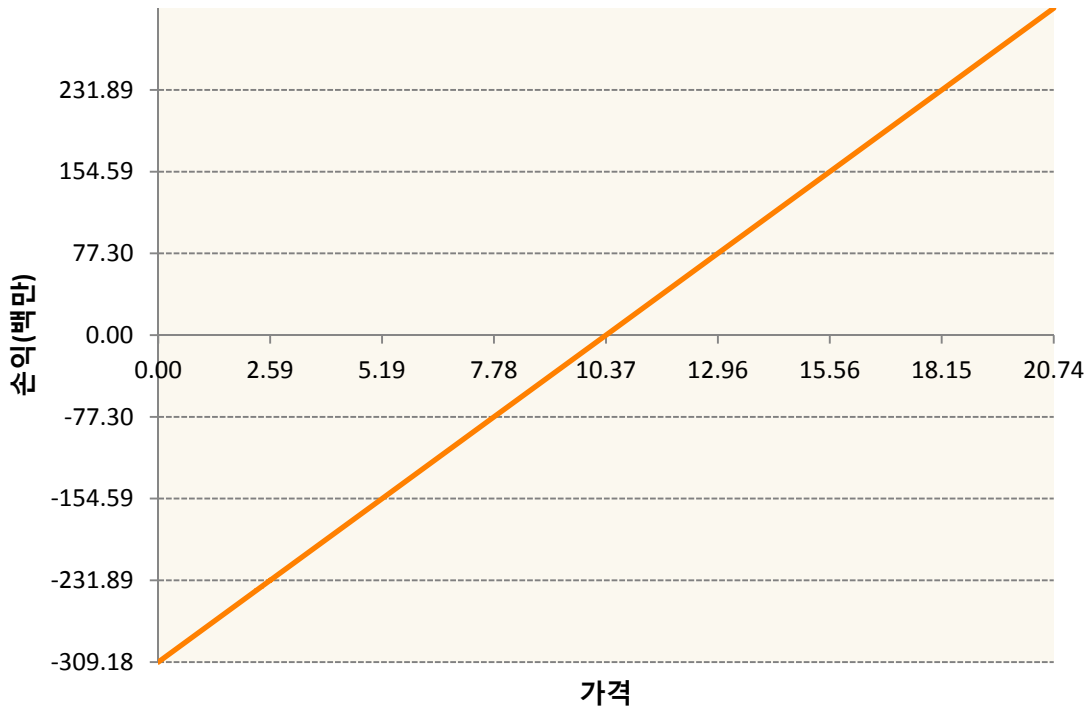


KCZ8-COFFEE 'C' FUTURE Dec18

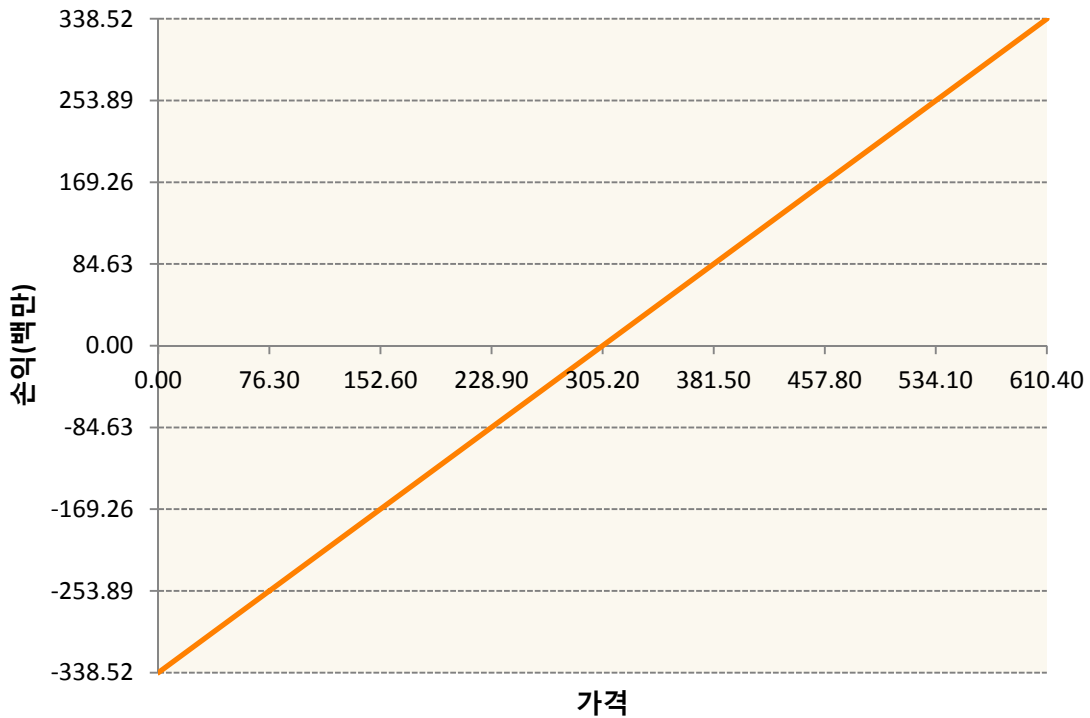




SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

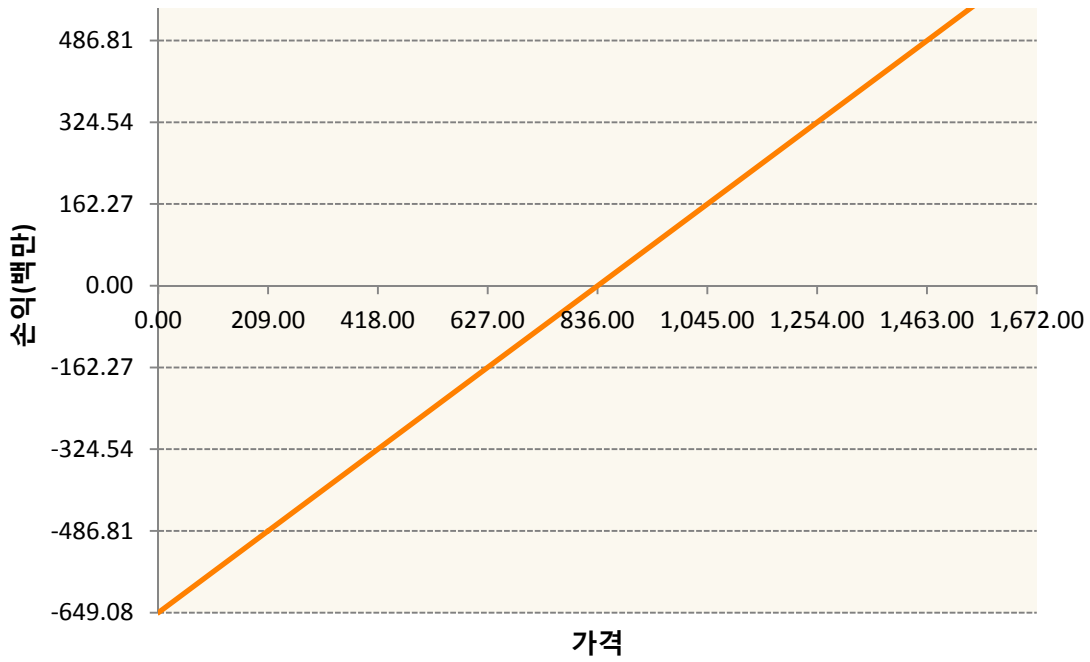


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

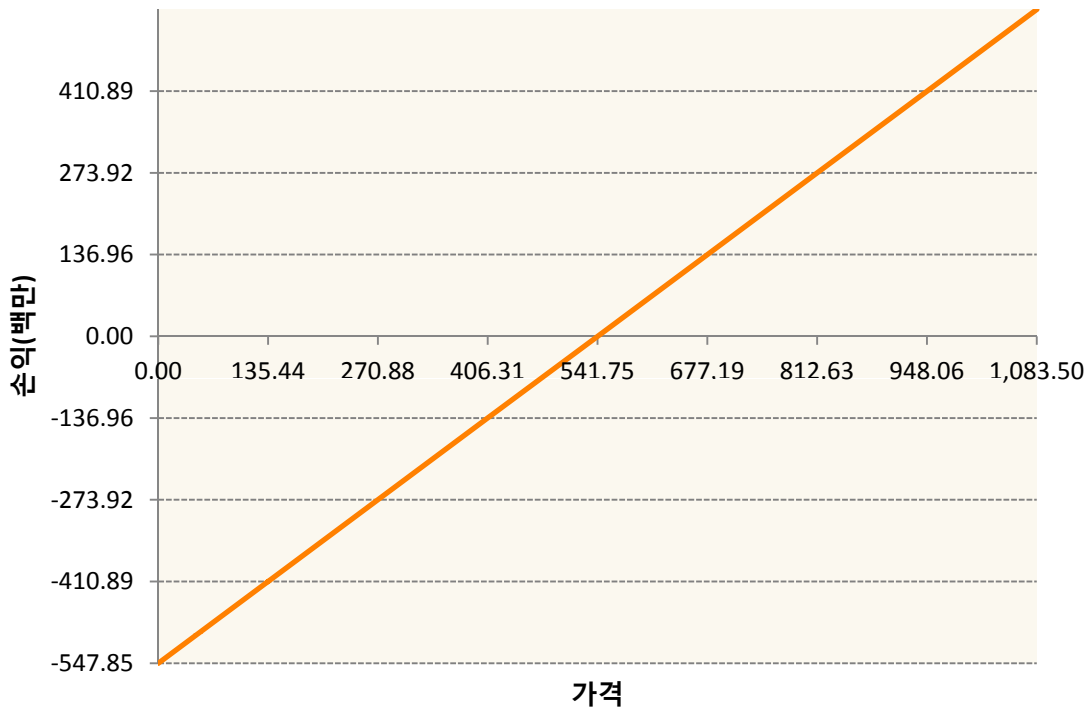


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





WZ8-WHEAT FUTURE(CBT) DEC18



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	44

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

(단위:백만원)

309