

공시일	2018-09-04
기준일	2018-09-03

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	2018-09-04
기준일	2018-09-03

스마트인덱스모

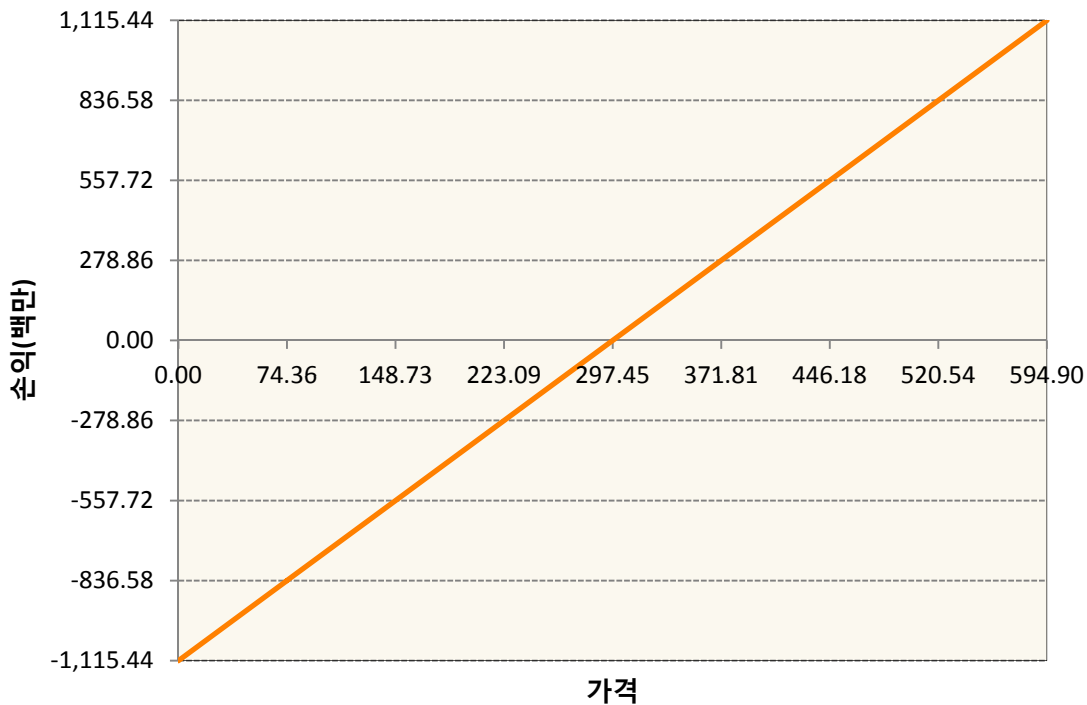
1. 계약금액

(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	2018-09-04
기준일	2018-09-03

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

1,154

* 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	2018-09-04
기준일	2018-09-03

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

300

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

378

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-04
기준일	2018-09-03

유로인덱스모(주식-파생형)

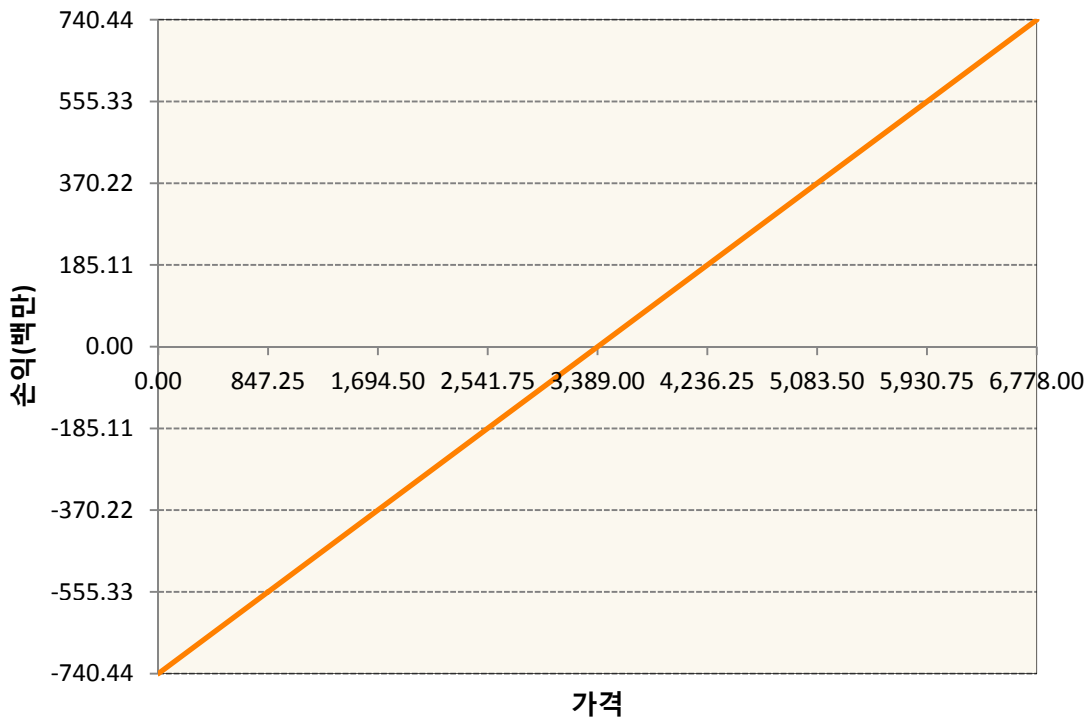
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	740	0	740	

2. 만기시점의 손익구조

VGU8-EURO STOXXX 50 SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU8	EURO STOXXX 50 SEP18	59
------	----------------------	----

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

(단위:백만원)

37

공시일	2018-09-04
기준일	2018-09-03

차이나인덱스모(주식-파생형)

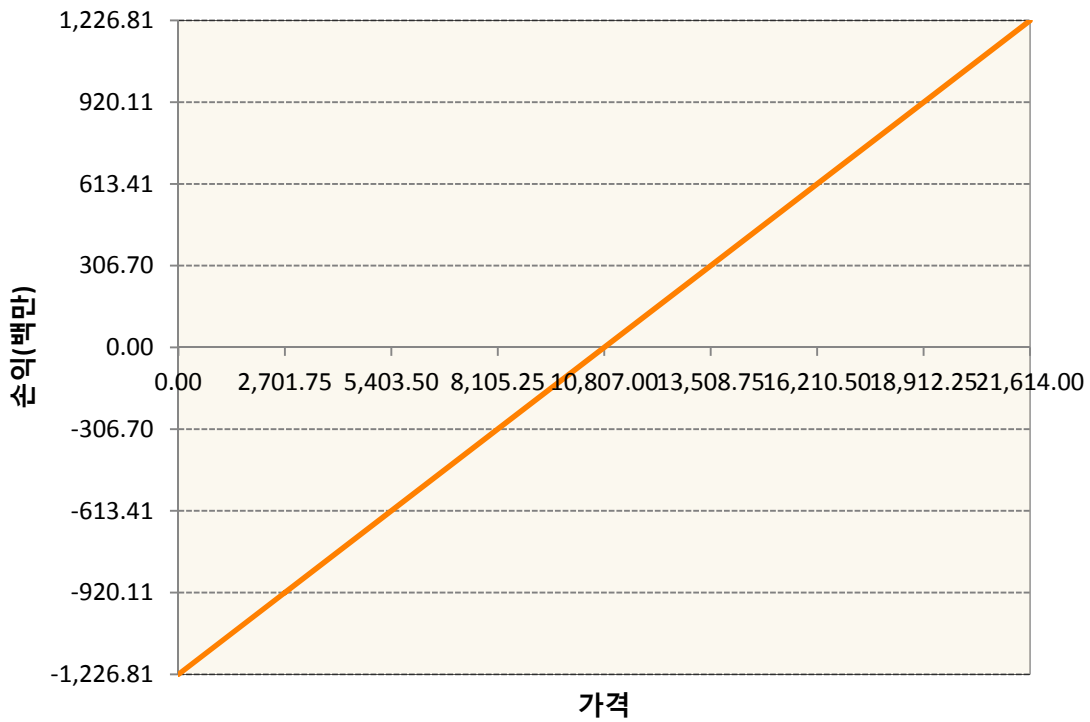
1. 계약금액

(단위:백만원)

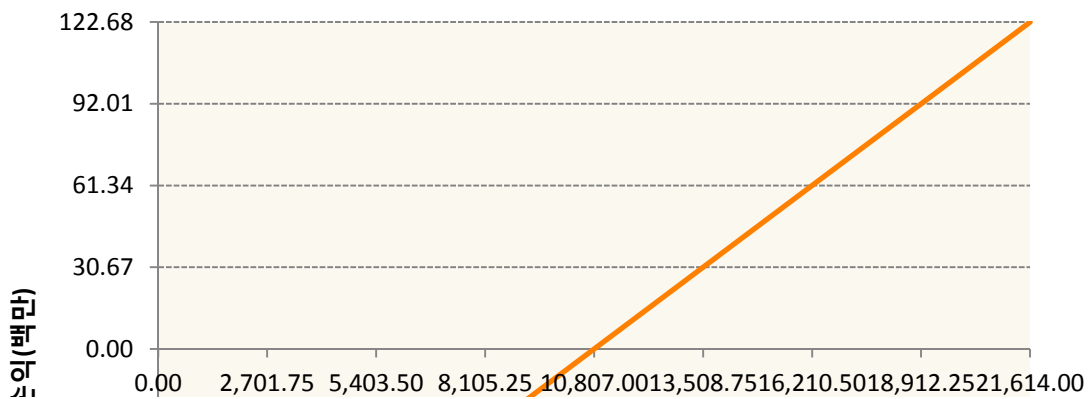
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	123	0	123	
누계	유가증권	선물	1,227	0	1,227	장내

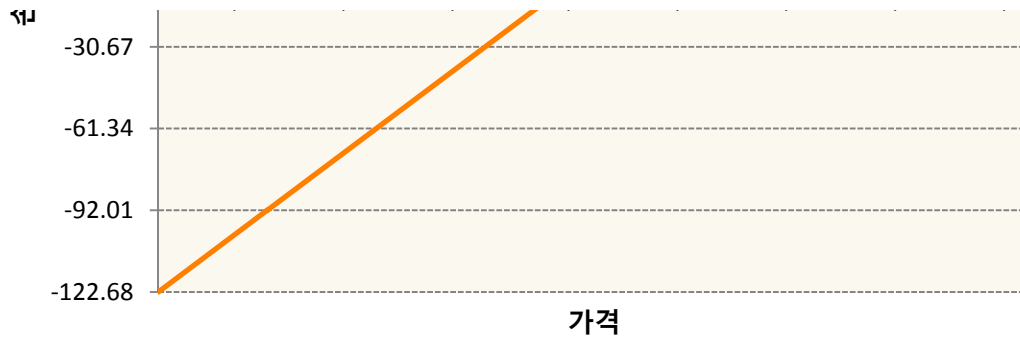
2. 만기시점의 손익구조

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	98
MHCU8	MINI H-SHR IDX Fut Sep18	10

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

99

공시일	2018-09-04
기준일	2018-09-03

커버드콜모(주식혼합-파생형)

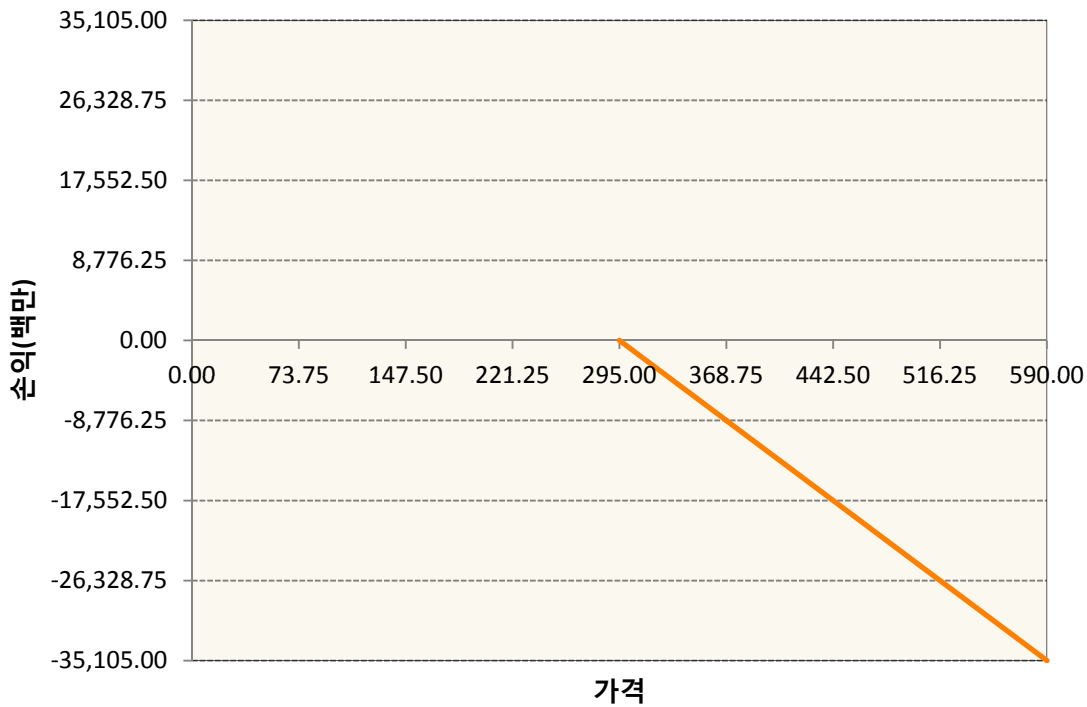
1. 계약금액

(단위:백만원)

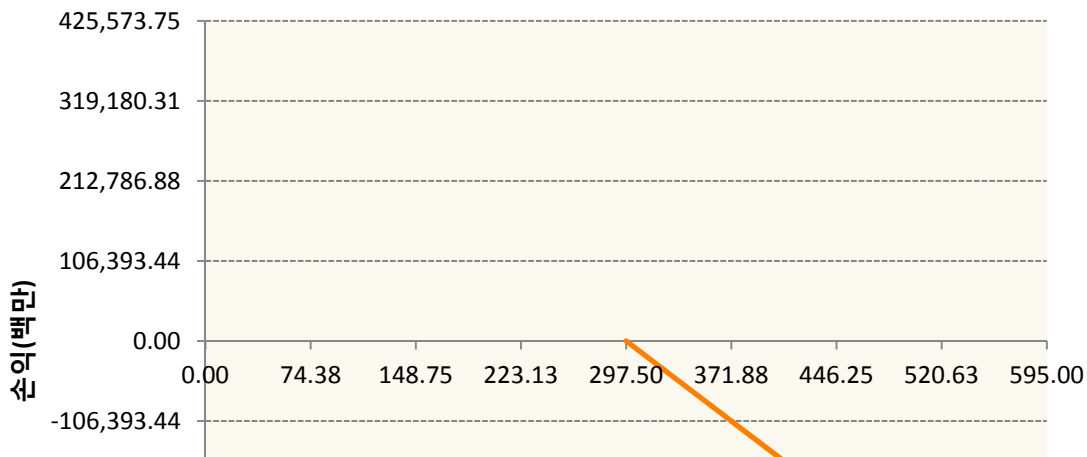
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	758,179	-758,179	장내

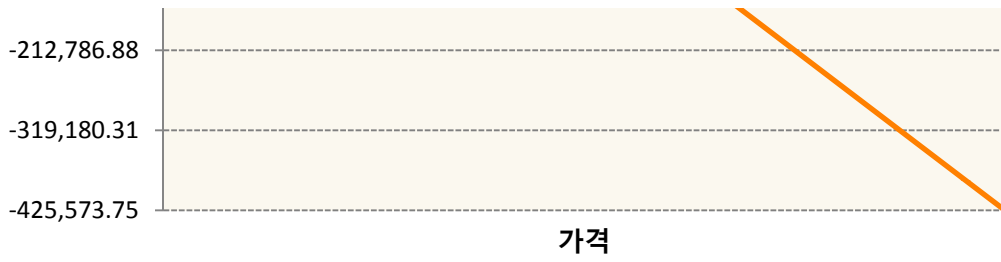
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92950-2018-09 콜295

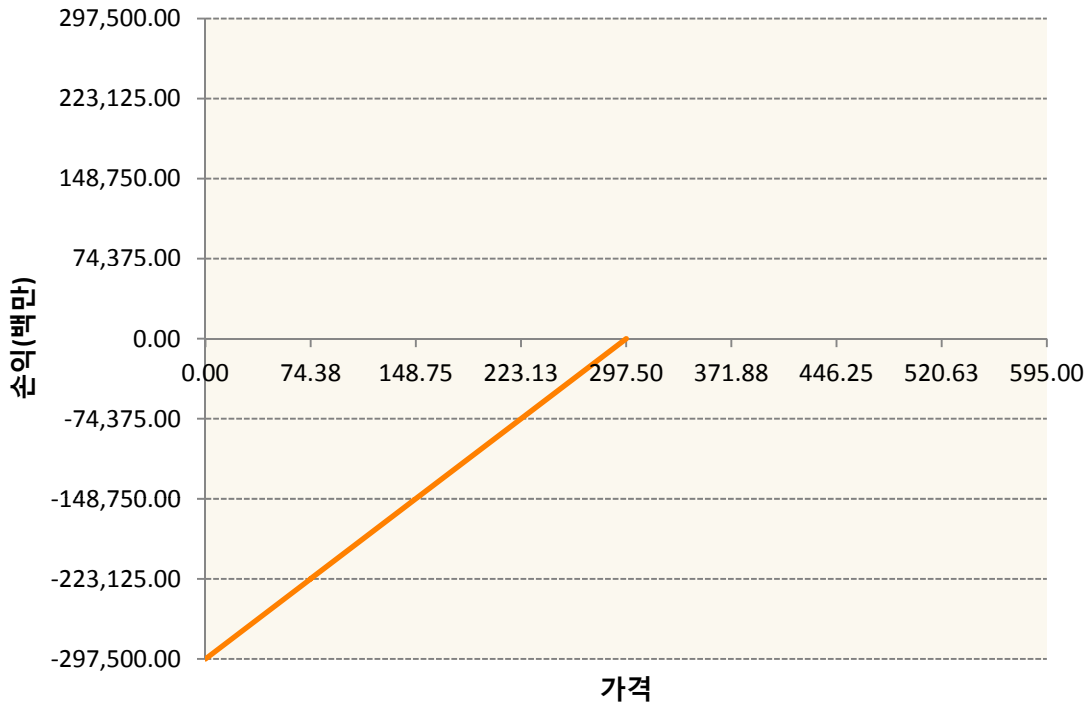


KR4201N92976-2018-09 콜297.5





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N929 2018-09 콜295

2,390

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	787	781	773	761	747	730	710
-5.33%	747	725	699	670	638	605	569
-2.67%	578	532	485	438	390	341	292
0%	155	104	52	0	-52	-104	-157
2.67%	-541	-574	-611	-650	-691	-733	-777
5.33%	-1,406	-1,419	-1,436	-1,457	-1,481	-1,508	-1,537
8.00%	-2,334	-2,337	-2,342	-2,350	-2,361	-2,374	-2,390

KR4201N929 2018-09 풋297.5

27,331

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,605	7,564	7,499	7,403	7,277	7,118	6,928

-5.33%	7,326	7,135	6,899	6,622	6,308	5,962	5,588
-2.67%	5,932	5,461	4,963	4,446	3,913	3,367	2,811
0%	1,916	1,277	639	0	-638	-1,277	-1,915
2.67%	-5,490	-5,985	-6,504	-7,043	-7,597	-8,163	-8,739
5.33%	-15,397	-15,626	-15,903	-16,223	-16,580	-16,969	-17,386
8.00%	-26,394	-26,461	-26,561	-26,698	-26,873	-27,085	-27,331

KR4301N929 2018-09 풋 297.5

21,329

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21,328	-21,328	-21,328	-21,328	-21,328	-21,328	-21,329
-5.33%	-13,400	-13,400	-13,403	-13,407	-13,416	-13,429	-13,448
-2.67%	-5,548	-5,601	-5,668	-5,749	-5,843	-5,947	-6,061
0%	619	413	206	0	-206	-413	-619
2.67%	2,404	2,345	2,270	2,181	2,080	1,968	1,845
5.33%	2,496	2,495	2,491	2,483	2,471	2,452	2,427
8.00%	2,497	2,497	2,497	2,497	2,496	2,495	2,493

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

(단위:백만원)

58,917

공시일	2018-09-04
기준일	2018-09-03

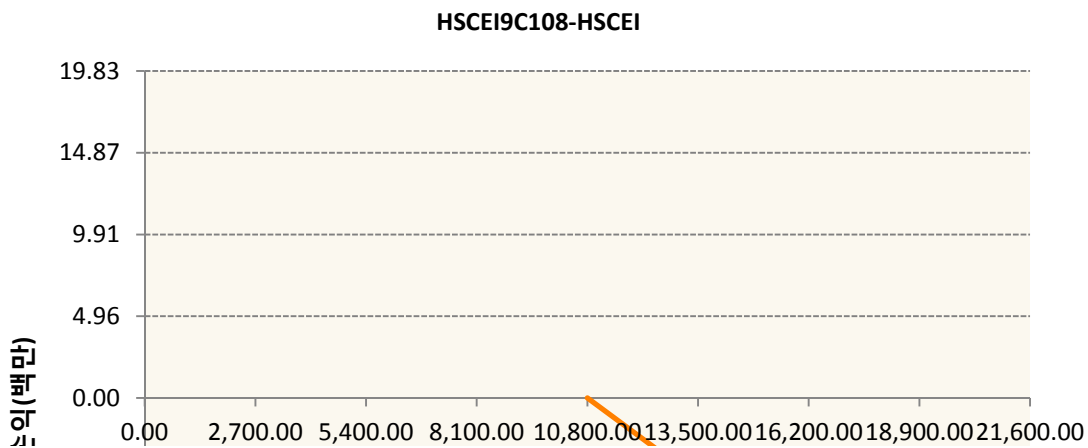
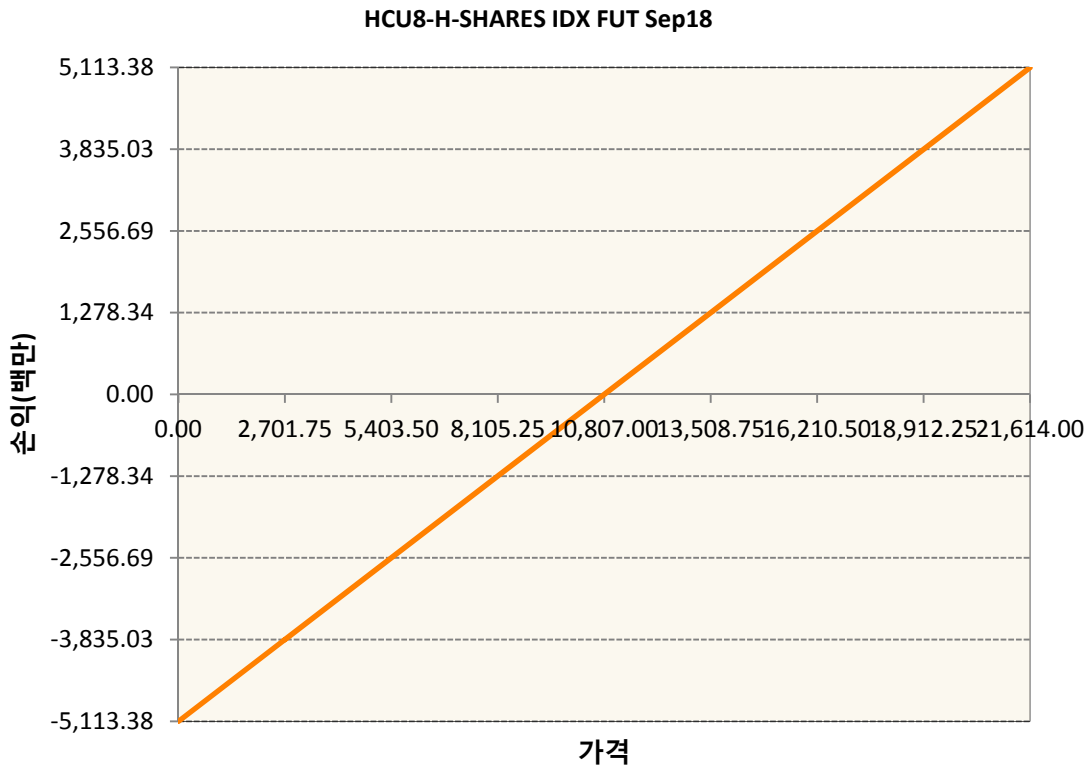
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

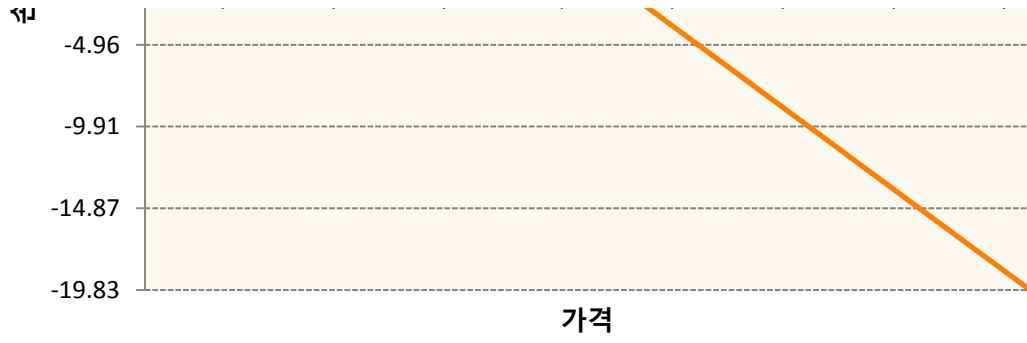
1. 계약금액

(단위:백만원)

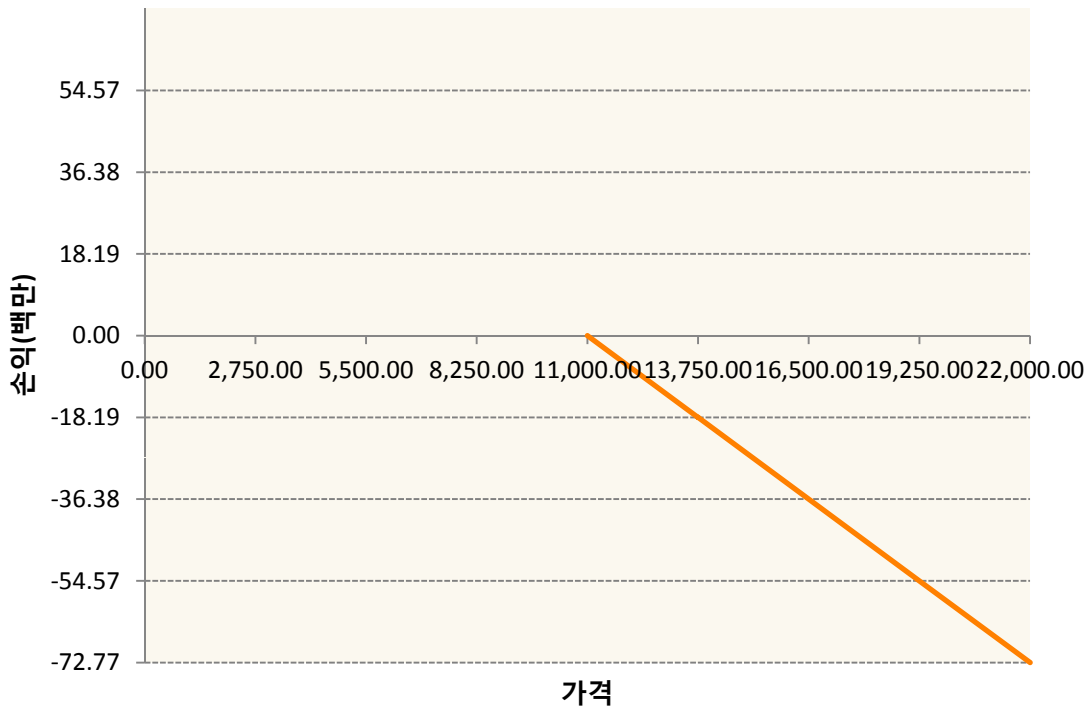
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,113	0	5,113	장내
누계	유가증권	옵션	0	257	-257	장내

2. 만기시점의 손익구조

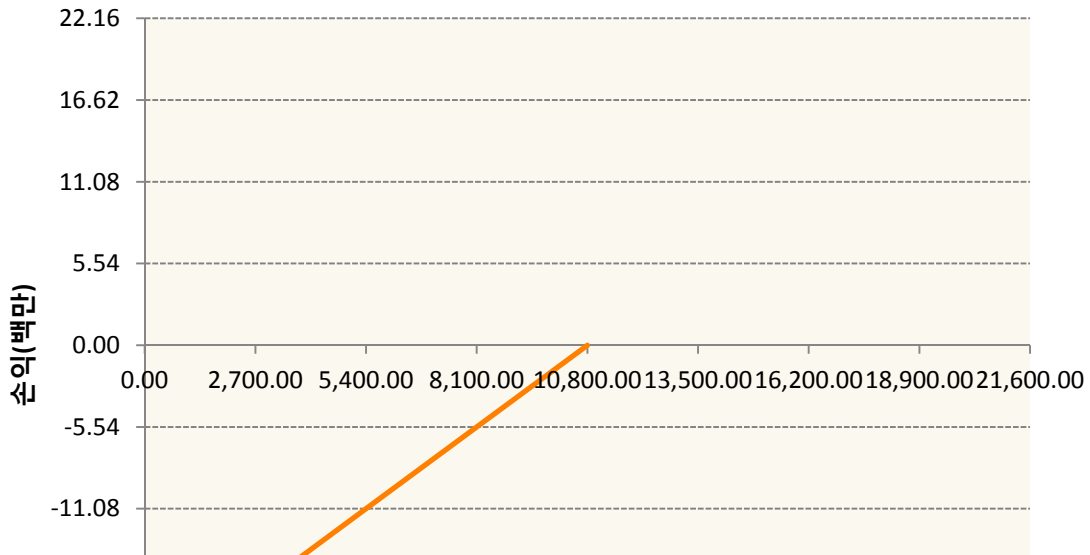


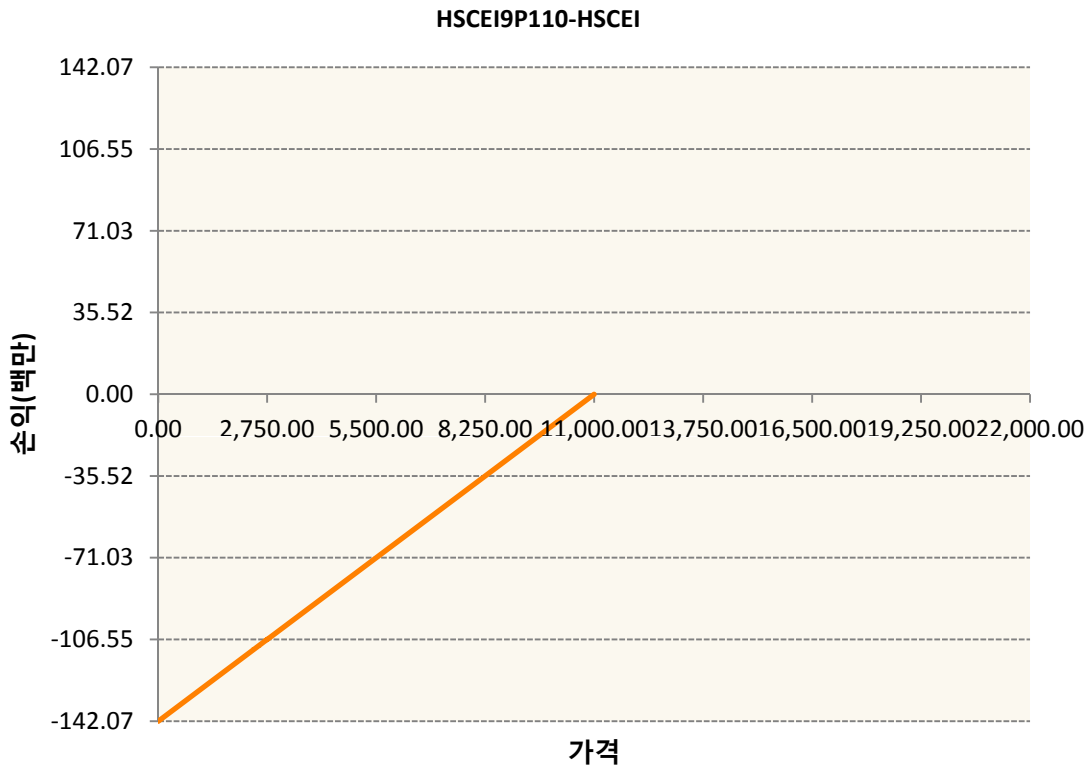
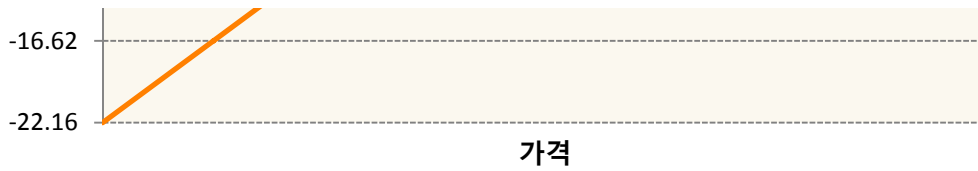


HSCEI9C110-HSCEI



HSCEI9P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU8	H-SHARES IDX FUT Sep18	409
HSCEI9C108	HSCEI	2
HSCEI9C110	HSCEI	6
HSCEI9P108	HSCEI	2
HSCEI9P110	HSCEI	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	392

공시일	2018-09-04
기준일	2018-09-03

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

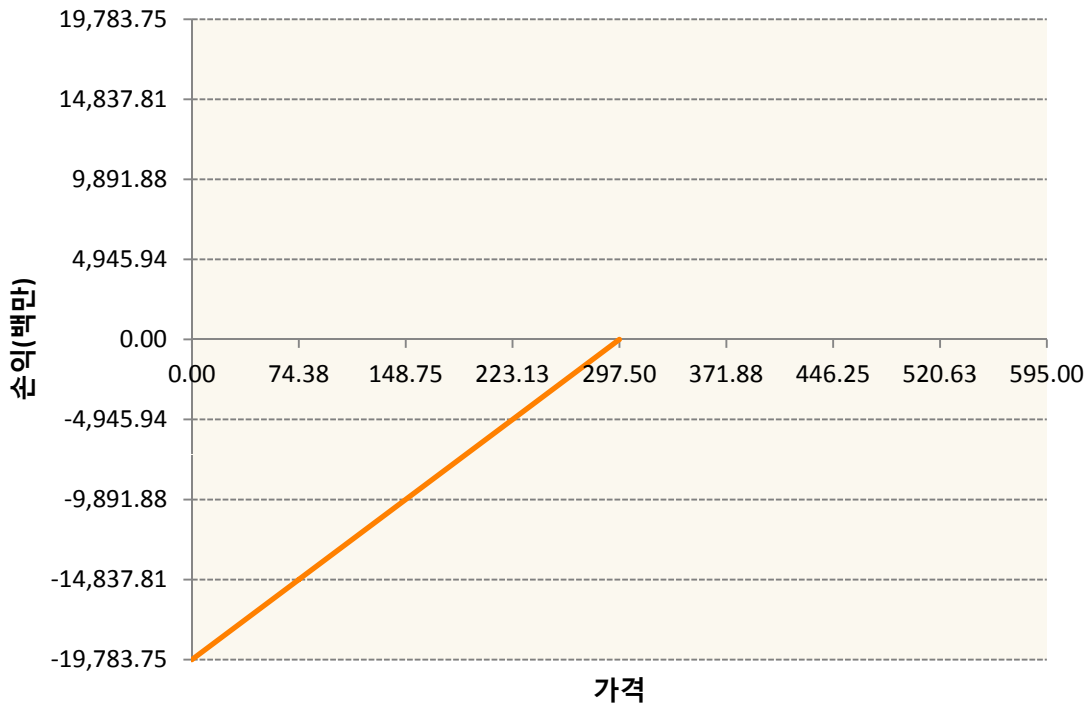


KR4301N92958-2018-09 풋295





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,960
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,960	-3,960	-3,960	-3,960	-3,960	-3,960	-3,960
-5.33%	-2,640	-2,640	-2,640	-2,640	-2,640	-2,640	-2,640
-2.67%	-1,320	-1,320	-1,320	-1,320	-1,320	-1,320	-1,320
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,320	1,320	1,320	1,320	1,320	1,320	1,320
5.33%	2,640	2,640	2,640	2,640	2,640	2,640	2,640
8.00%	3,960	3,960	3,960	3,960	3,960	3,960	3,960
KR4201N92974-2018-09 풋297.5							1,805
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	502	500	495	489	481	470	458
-5.33%	484	471	456	437	417	394	369
-2.67%	392	361	328	294	258	222	186
0%	127	84	42	0	-42	-84	-127
2.67%	-363	-395	-430	-465	-502	-539	-577
5.33%	-1,017	-1,032	-1,051	-1,072	-1,095	-1,121	-1,149
8.00%	-1,744	-1,748	-1,755	-1,764	-1,775	-1,789	-1,805

KR4301N929 2018-09 풋295

119

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119
-5.33%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72
-2.67%	-26	-26	-27	-28	-29	-30	-31
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	8	8	8	8	7	7	7
5.33%	9	9	9	9	9	8	8
8.00%	9	9	9	9	9	9	9

KR4301N929 2018-09 풋297.5

1,418

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,418	-1,418	-1,418	-1,418	-1,418	-1,418	-1,418
-5.33%	-891	-891	-891	-892	-892	-893	-894
-2.67%	-369	-372	-377	-382	-389	-395	-403
0%	41	27	14	0	-14	-27	-41
2.67%	160	156	151	145	138	131	123
5.33%	166	166	166	165	164	163	161
8.00%	166	166	166	166	166	166	166

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

(단위:백만원)

7,839

공시일	2018-09-04
기준일	2018-09-03

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

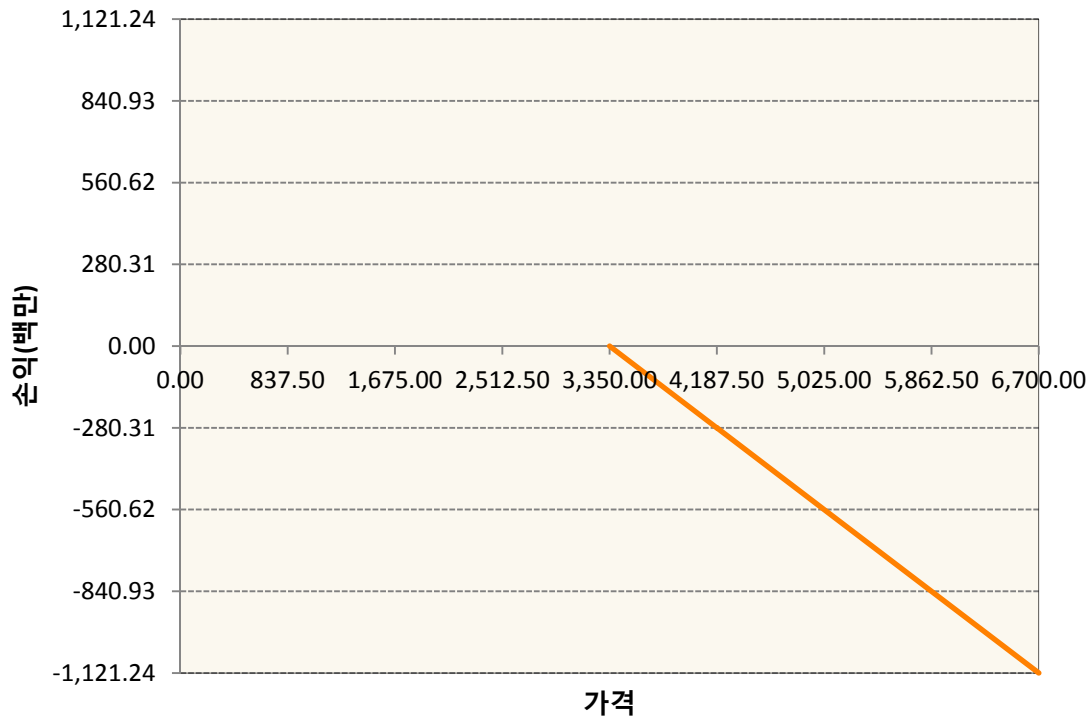
1. 계약금액

(단위:백만원)

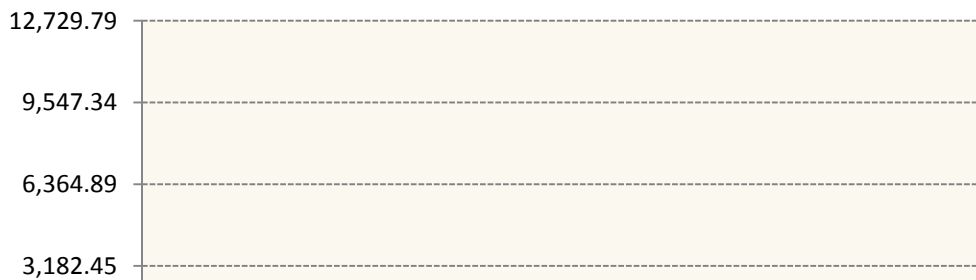
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,996	0	6,996	
누계	유가증권	옵션	0	27,702	-27,702	장내
누계	지수	스왑	86,254	0	86,254	장외

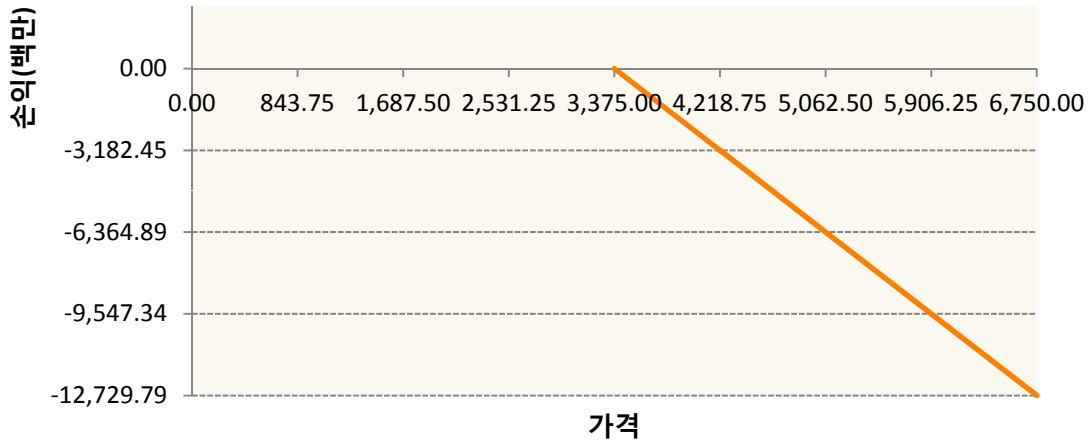
2. 만기시점의 손익구조

OESXU8-C3350-EURO STOXX 50

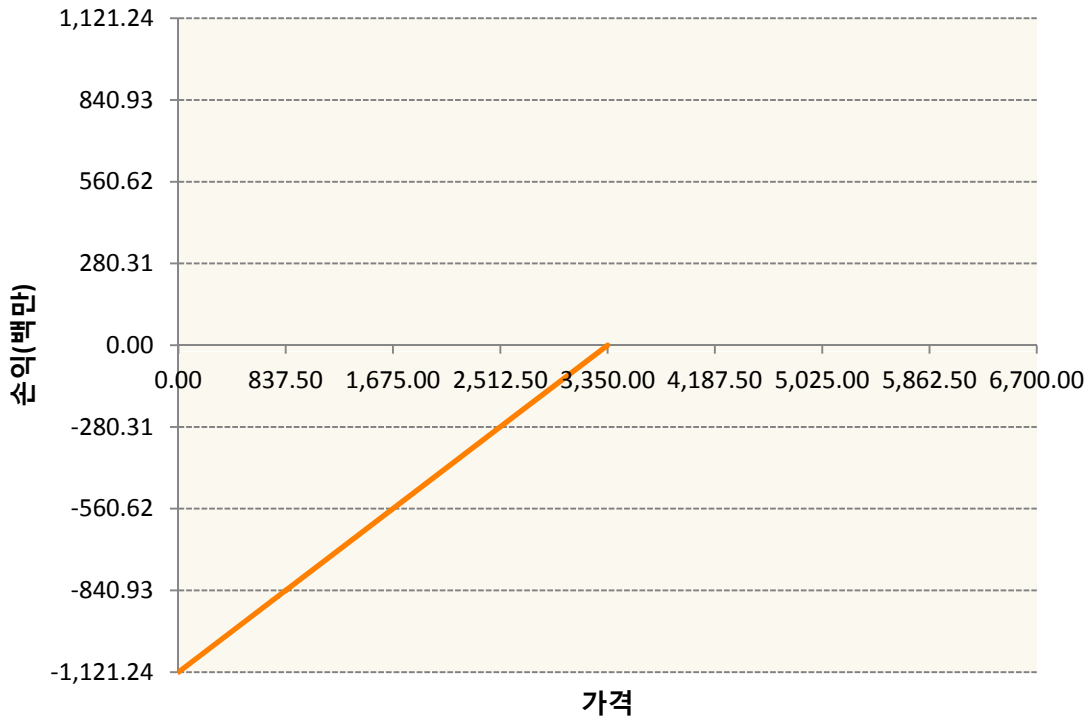


OESXU8-C3375-EURO STOXX 50

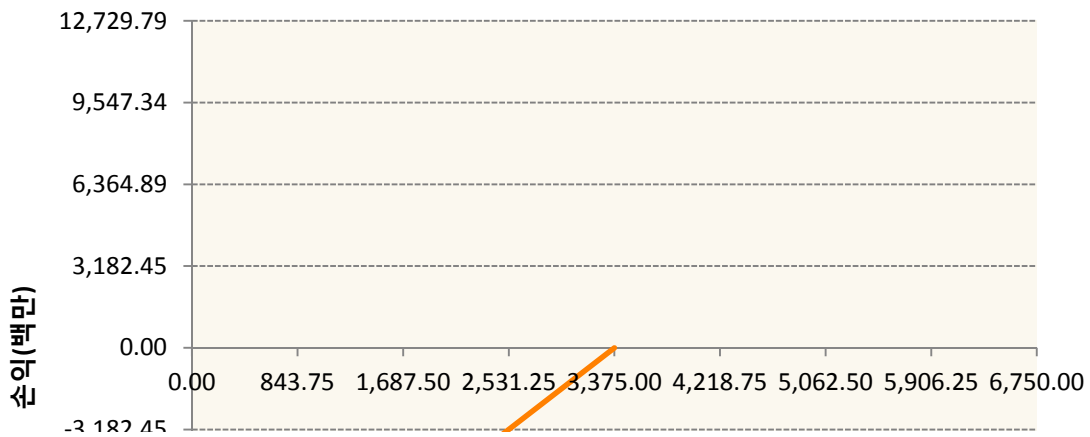


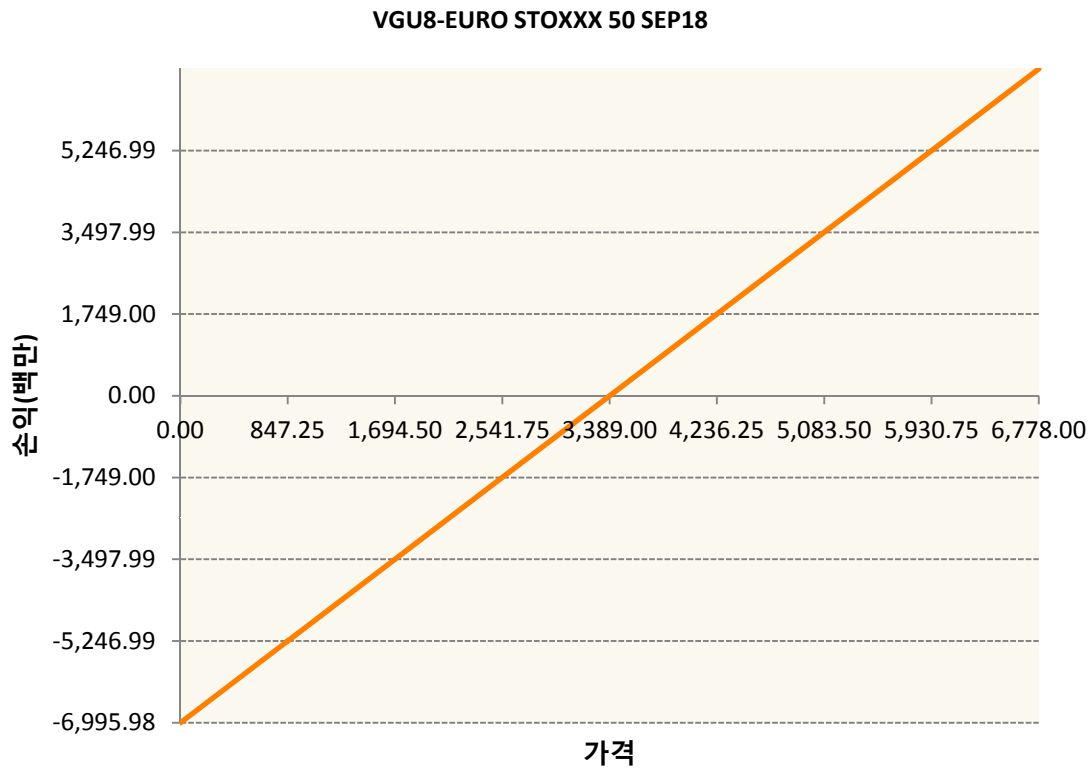
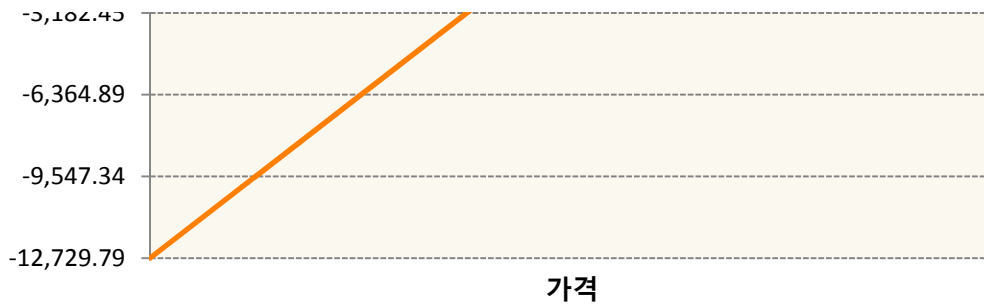


OESXU8-P3350-EURO STOXX 50



OESXU8-P3375-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	28
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY	19
OESXU8-C3E EURO STOXX 50	90
OESXU8-C3E EURO STOXX 50	1,018
OESXU8-P3E EURO STOXX 50	90
OESXU8-P3E EURO STOXX 50	1,018
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18	560

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

1,766

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

(단위:백만원)

1,137

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)

167

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-09-04
기준일	2018-09-03

리디파인K200(주식혼합-파생재간

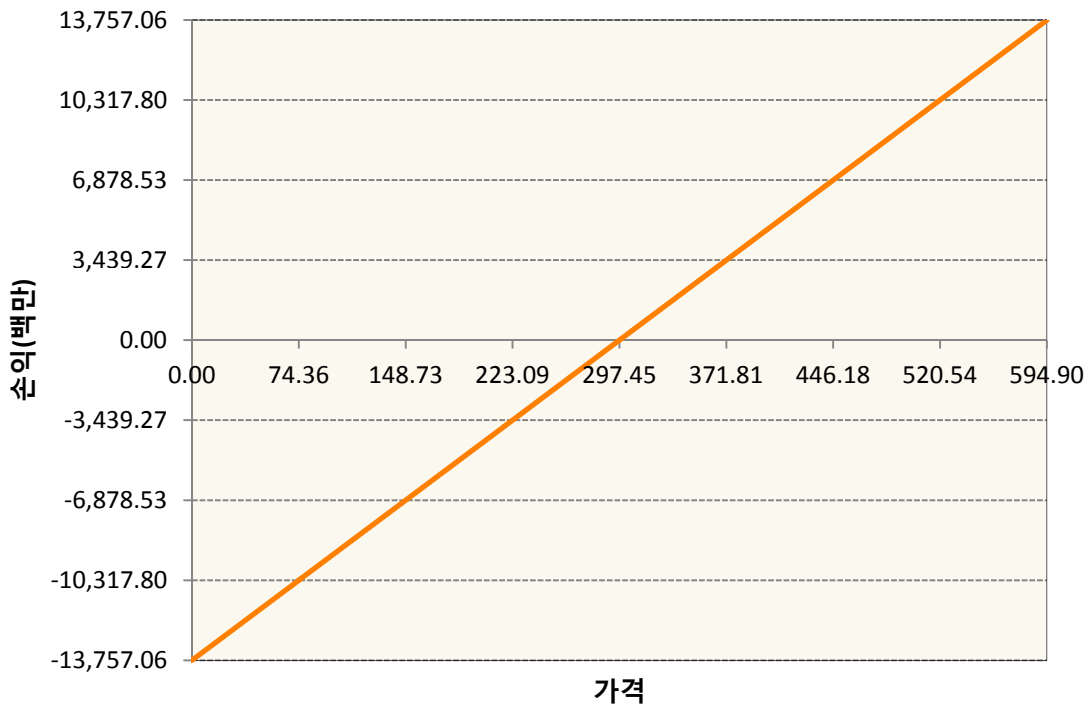
1. 계약금액

(단위:백만원)

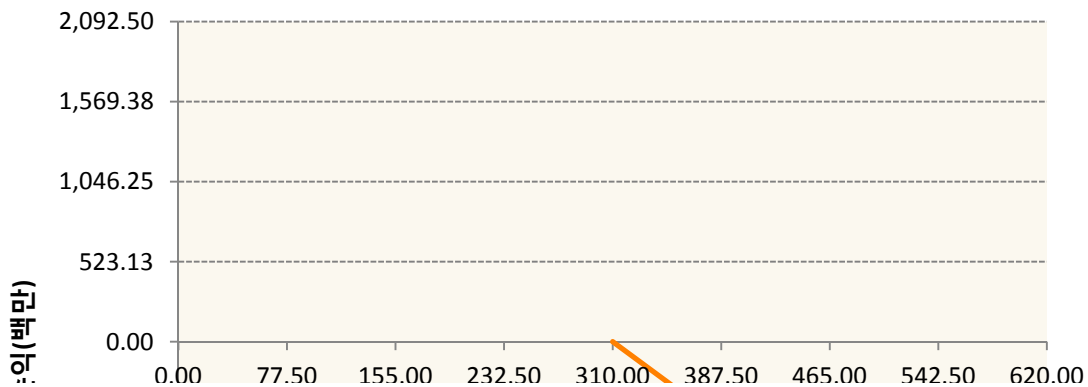
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,757	0	13,757	장내
누계	유가증권	옵션	1,339	24,671	-23,332	장내

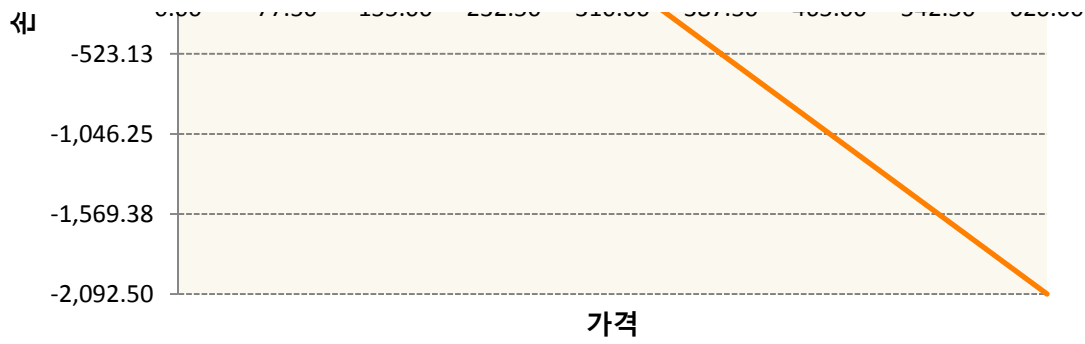
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

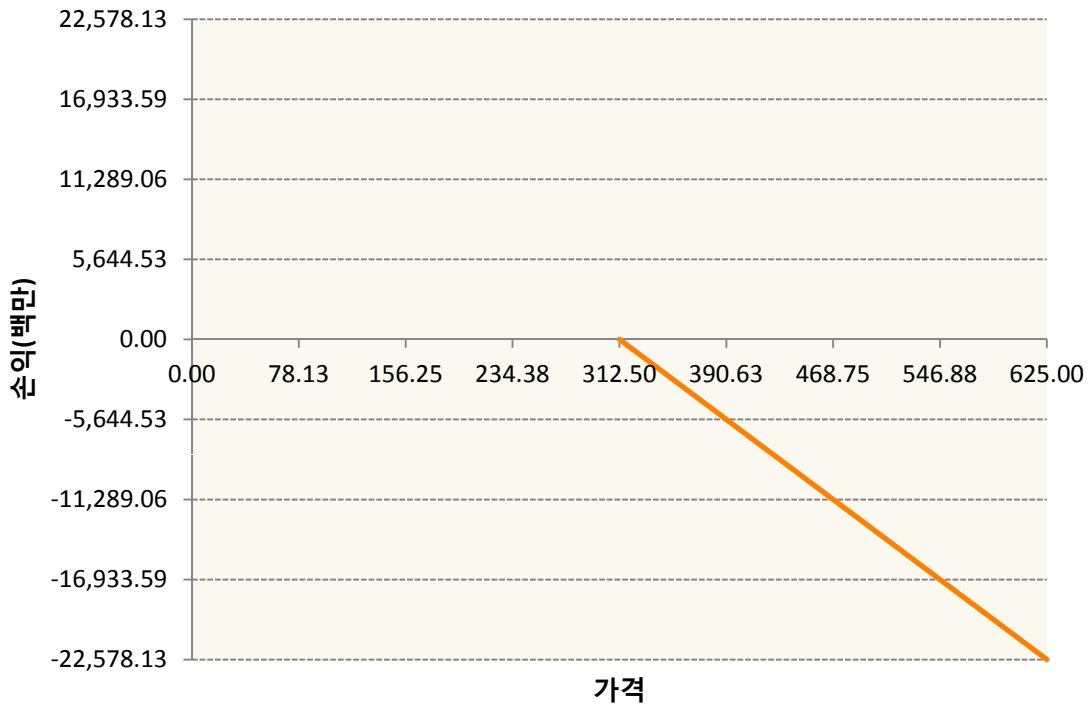


KR4201N93107-2018-09 콜310

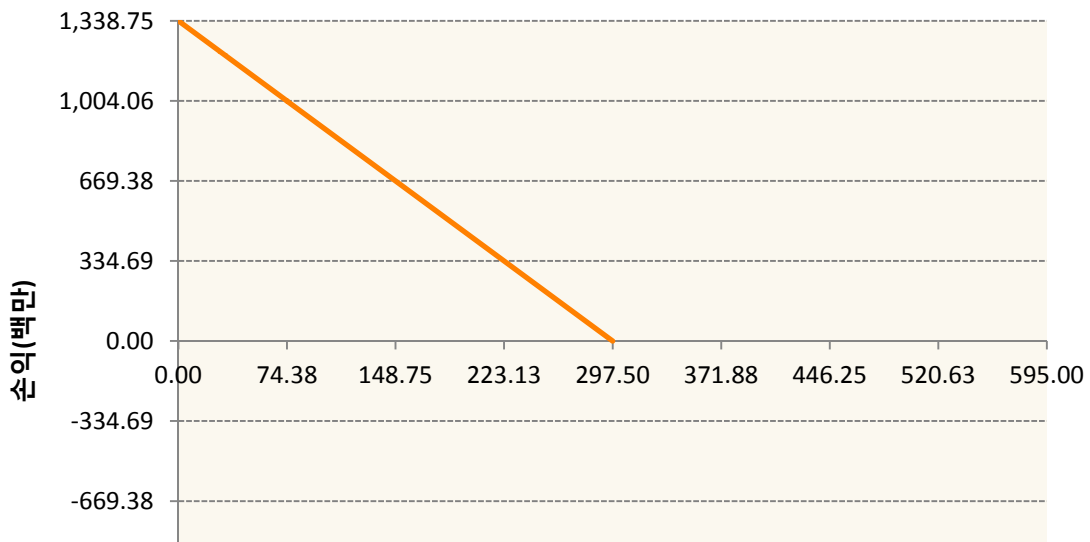


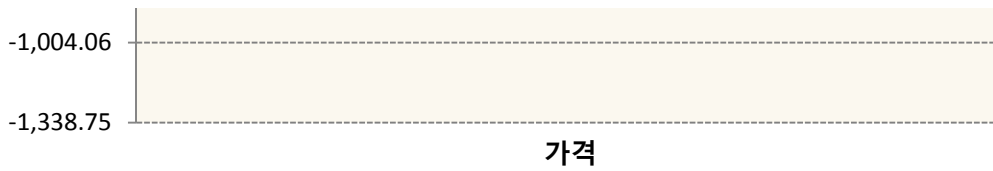


KR4201N93123-2018-09 콜312.5



KR4301N92974-2018-09 풋297.5





가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물								1,101
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,101	-1,101	-1,101	-1,101	-1,101	-1,101	-1,101	-1,101
-5.33%	-734	-734	-734	-734	-734	-734	-734	-734
-2.67%	-367	-367	-367	-367	-367	-367	-367	-367
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	367	367	367	367	367	367	367	367
5.33%	734	734	734	734	734	734	734	734
8.00%	1,101	1,101	1,101	1,101	1,101	1,101	1,101	1,101
KR4201N931 2018-09 콜310								86
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	9	9	9	9	9	9	9	9
-5.33%	9	9	9	9	8	8	7	7
-2.67%	8	8	7	6	5	4	3	3
0%	5	4	2	0	-2	-4	-7	-7
2.67%	-6	-9	-12	-15	-18	-21	-24	-24
5.33%	-32	-35	-38	-41	-44	-47	-50	-50
8.00%	-72	-74	-76	-79	-81	-84	-86	-86
KR4201N931 2018-09 콜312.5								823
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	69	69	69	69	68	67	66	66
-5.33%	69	69	68	66	63	59	54	54
-2.67%	66	63	58	51	42	32	19	19
0%	45	32	17	0	-19	-40	-62	-62
2.67%	-43	-70	-98	-127	-157	-187	-218	-218
5.33%	-267	-301	-334	-368	-402	-436	-470	-470
8.00%	-654	-679	-706	-734	-763	-793	-823	-823
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	96
-5.33%	60	60	60	60	60	60	61	61
-2.67%	25	25	26	26	26	27	27	27

0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-11	-11	-10	-10	-9	-9	-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)

1,567

공시일	2018-09-04
기준일	2018-09-03

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

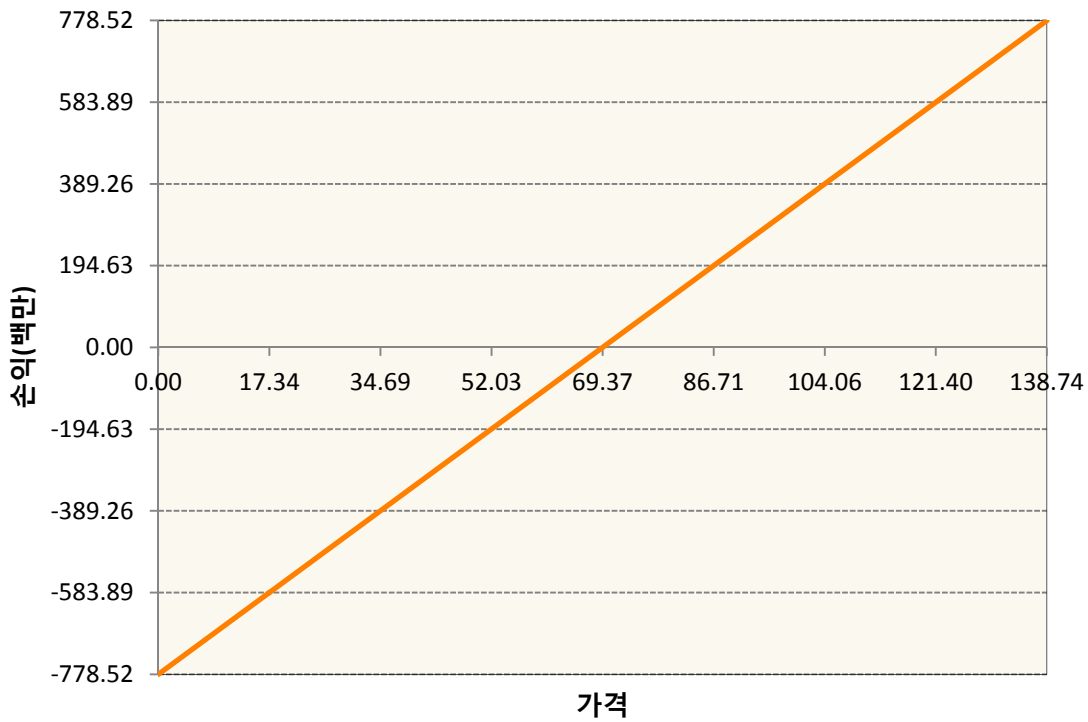
1. 계약금액

(단위:백만원)

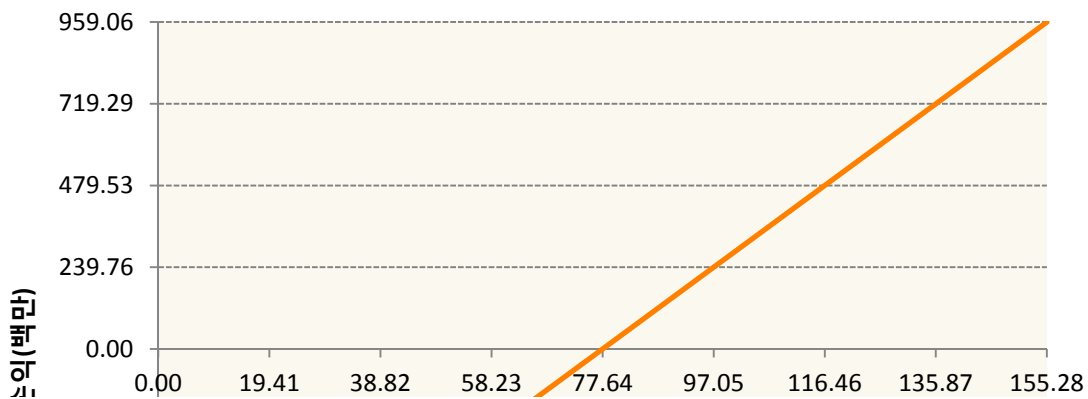
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,194	610	2,584	
누계	유가증권	선물	529	0	529	장내

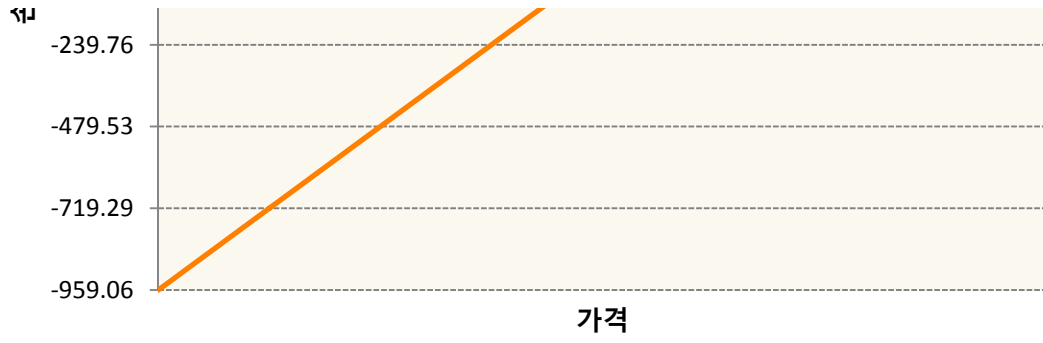
2. 만기시점의 손익구조

CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18

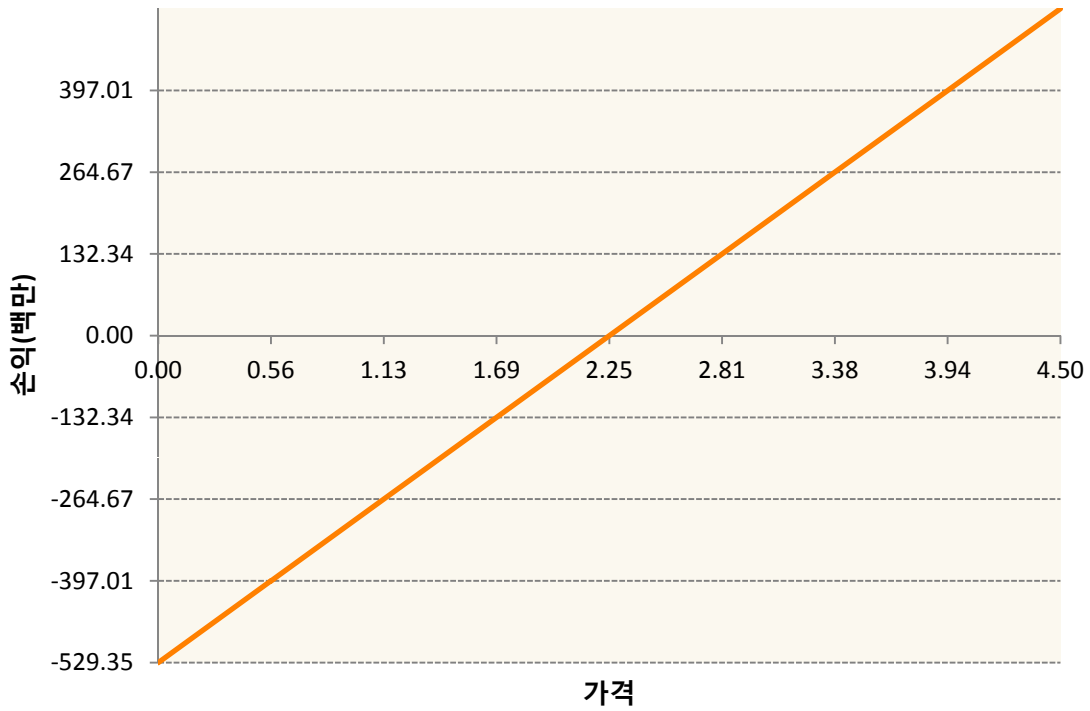


COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18

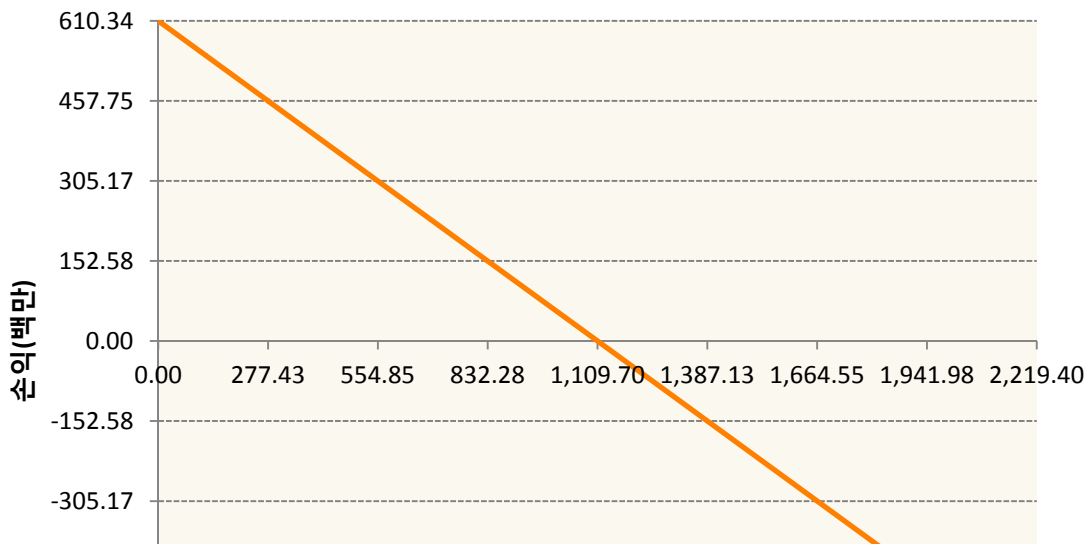


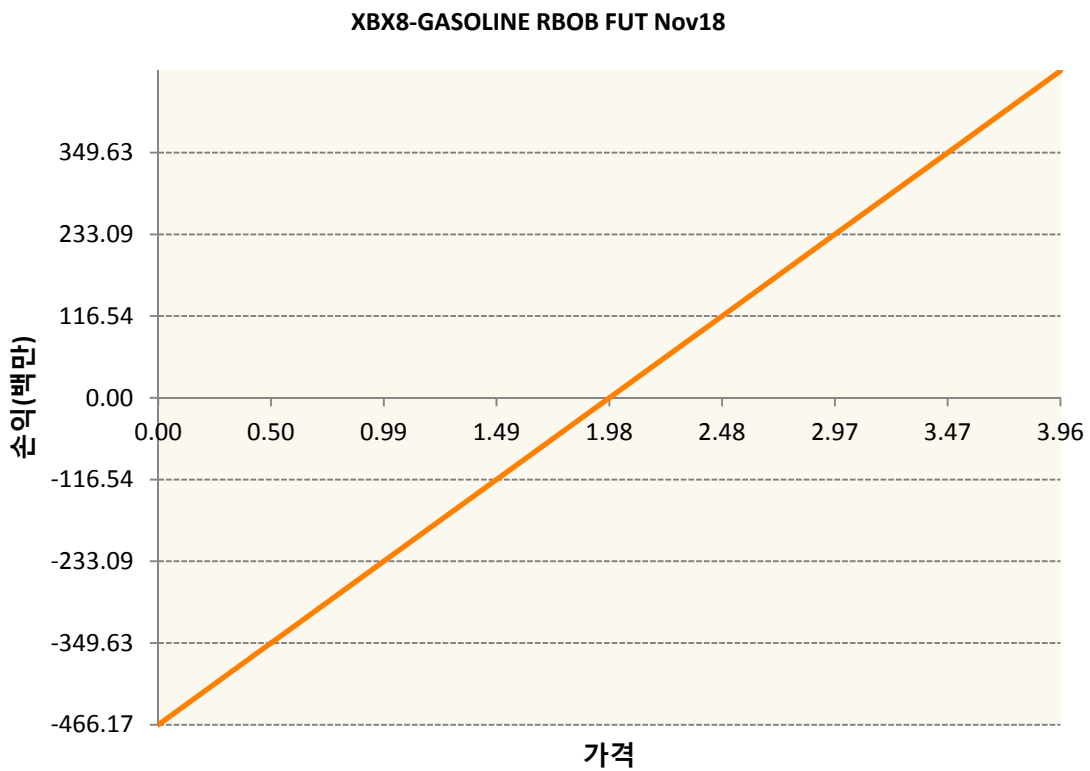
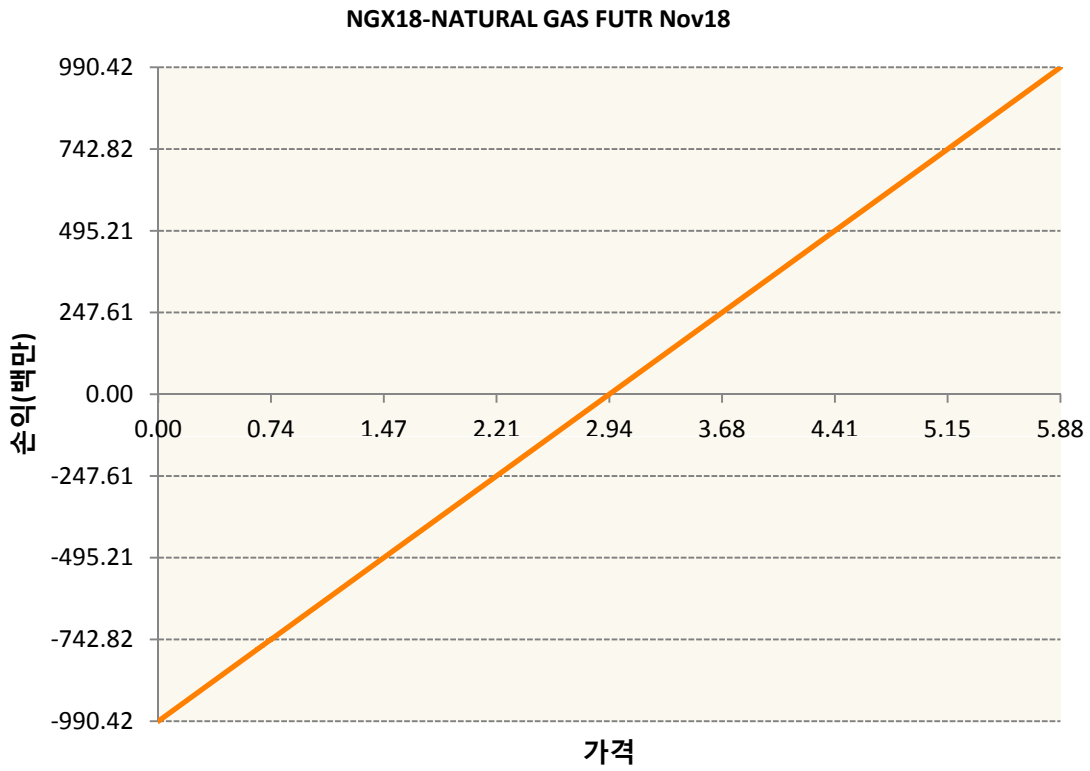
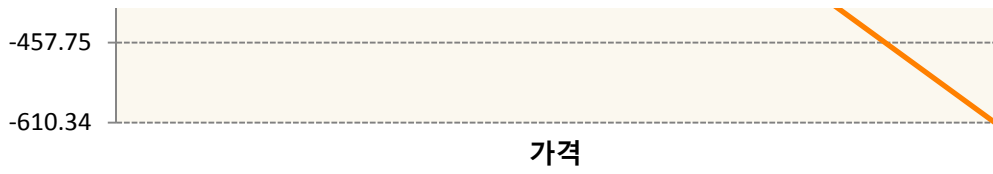


HOX8-Heating Oil



KR4175N90000-2018-09 달러선물





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	79
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	37

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	447

공시일	2018-09-04
기준일	2018-09-03

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

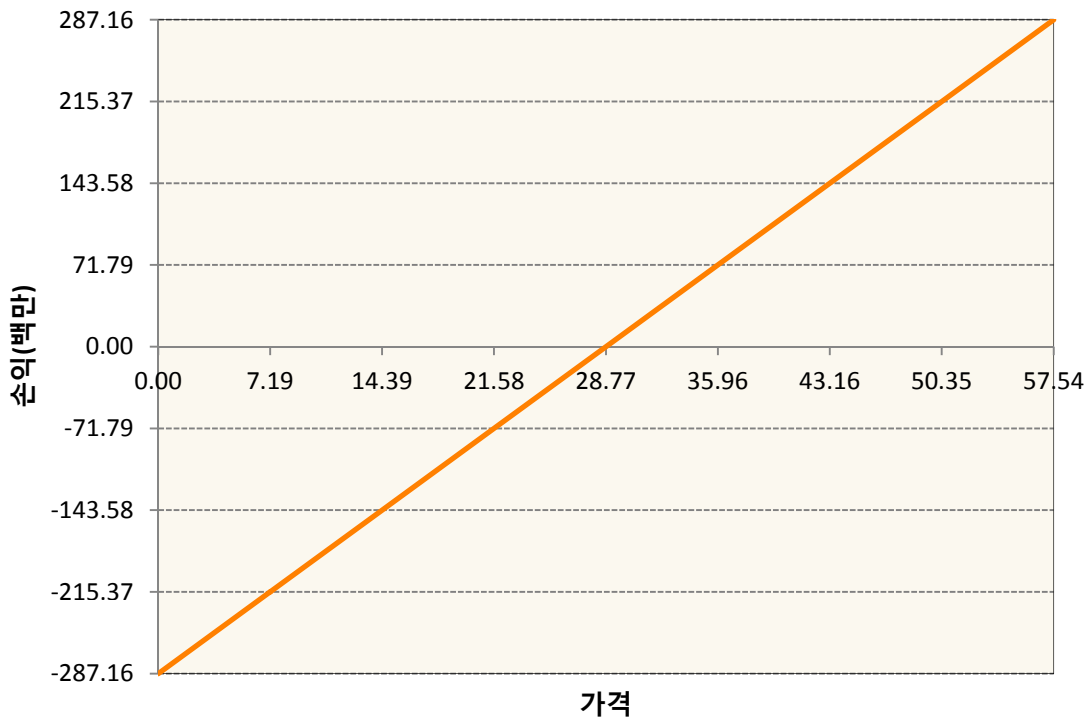
1. 계약금액

(단위:백만원)

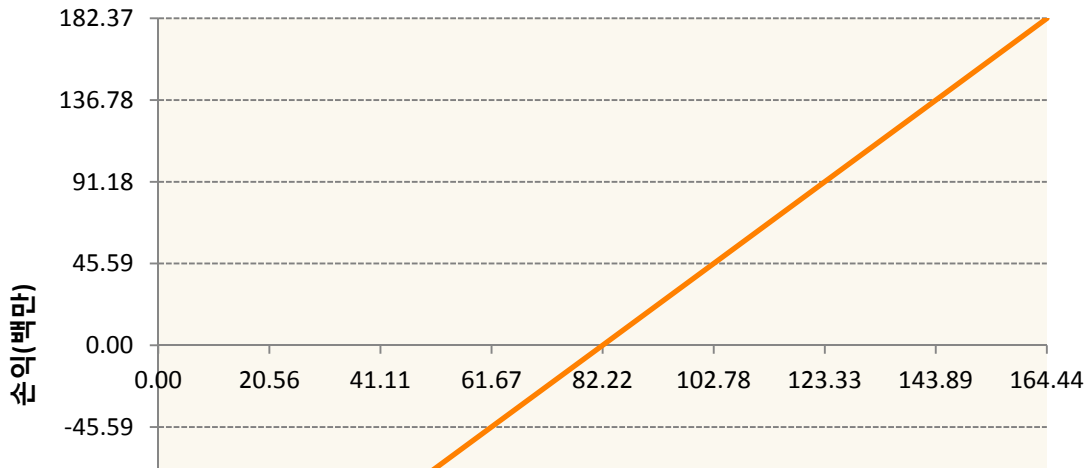
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,628	78	3,550	

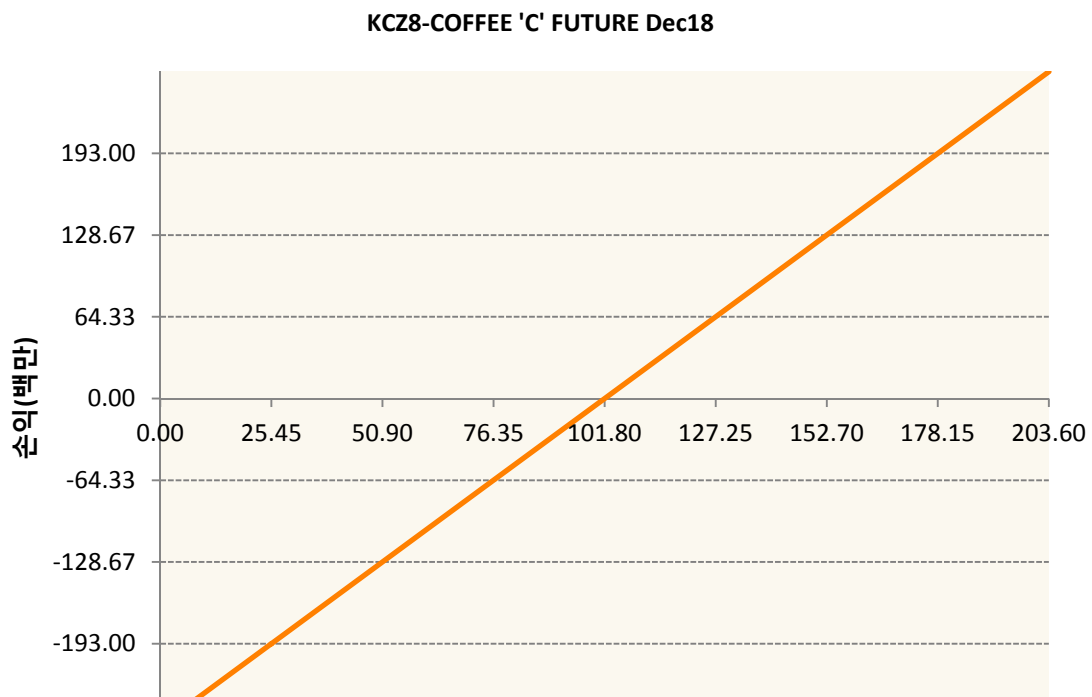
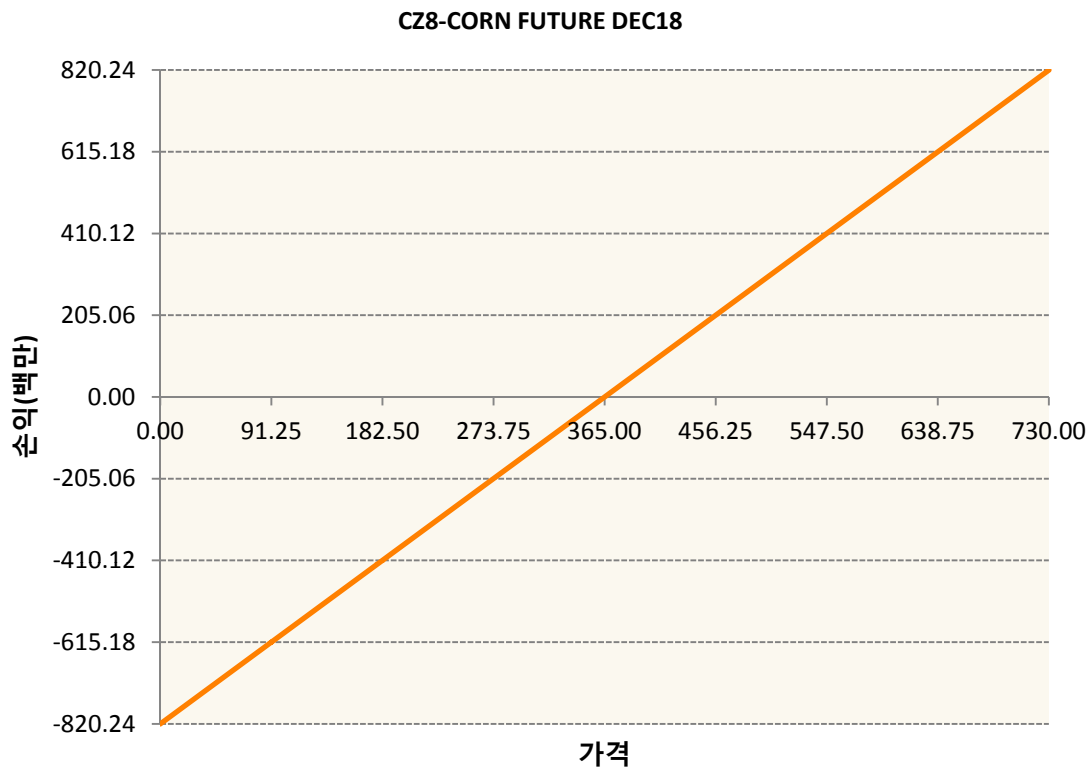
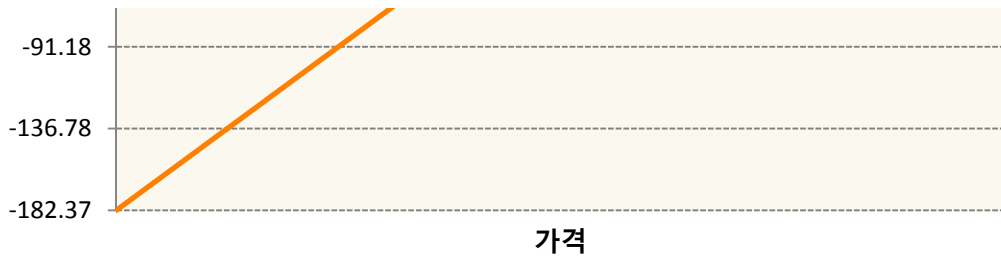
2. 만기시점의 손익구조

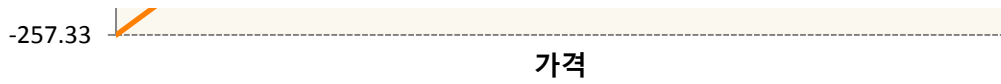
BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18



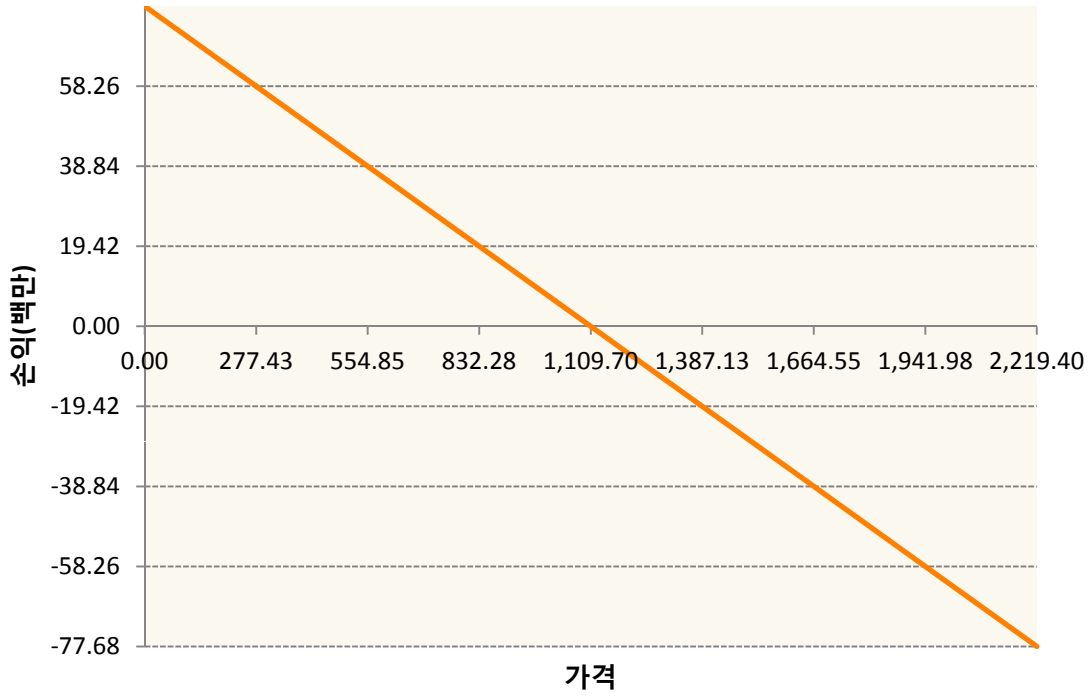
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



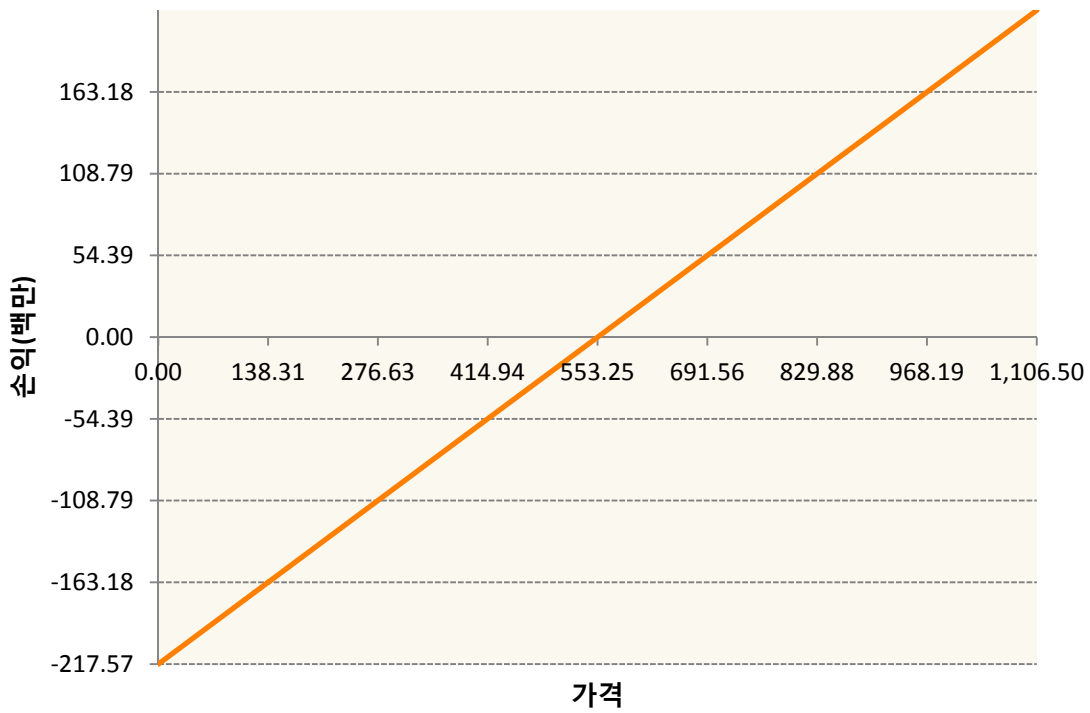




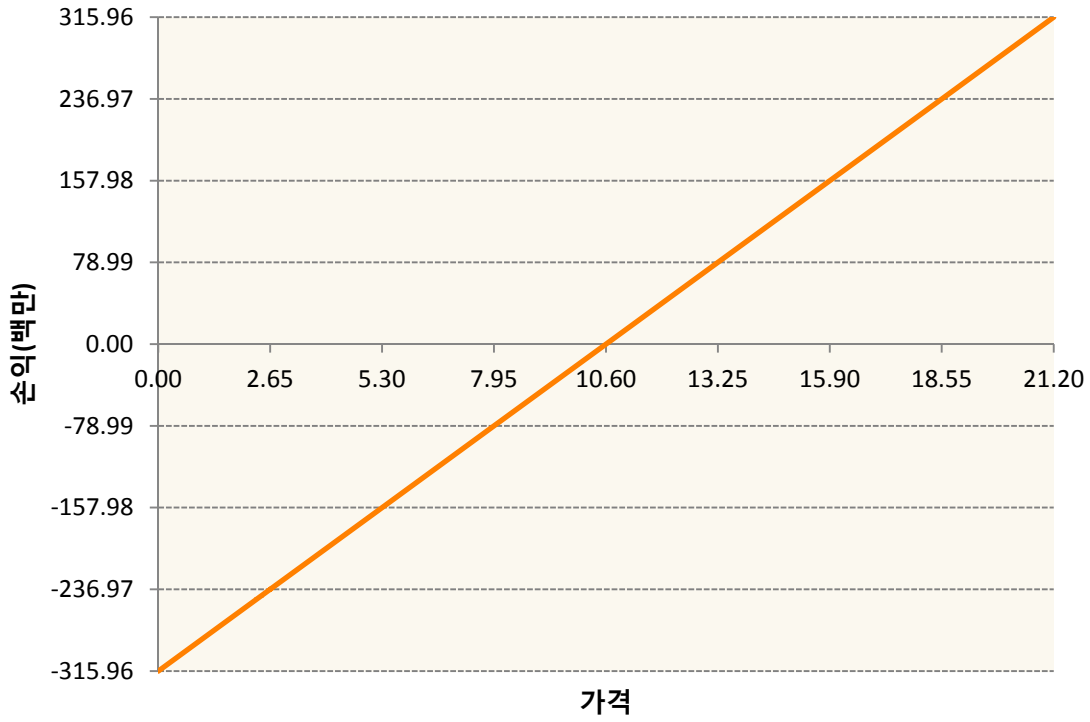
KR4175N90000-2018-09 달러선물



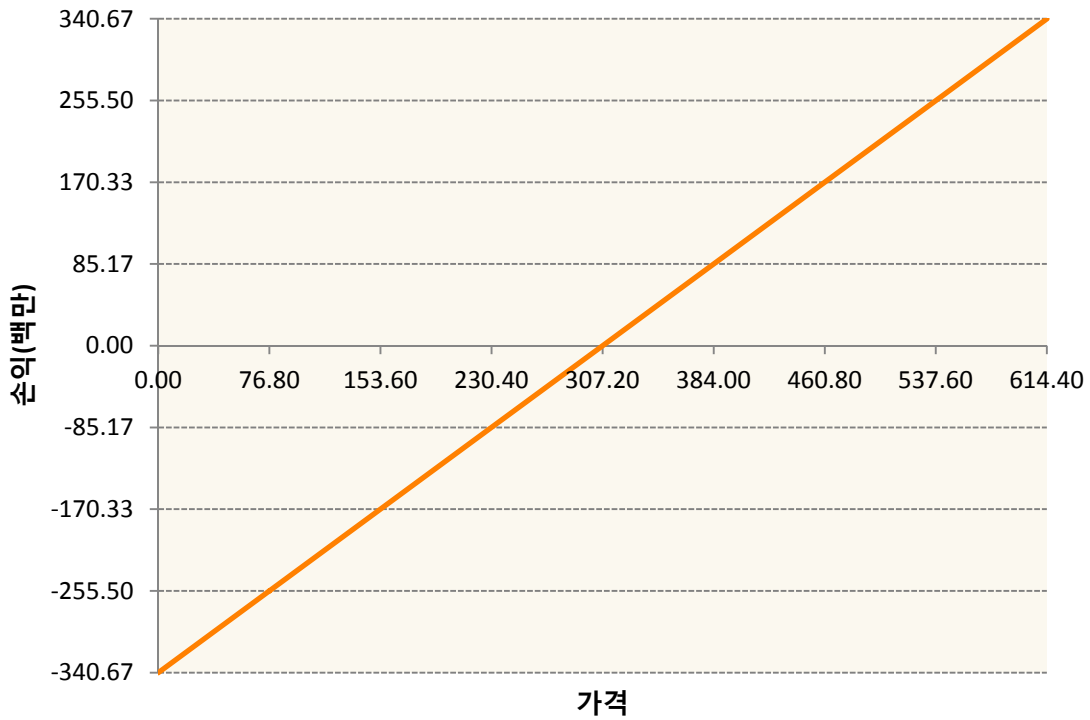
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

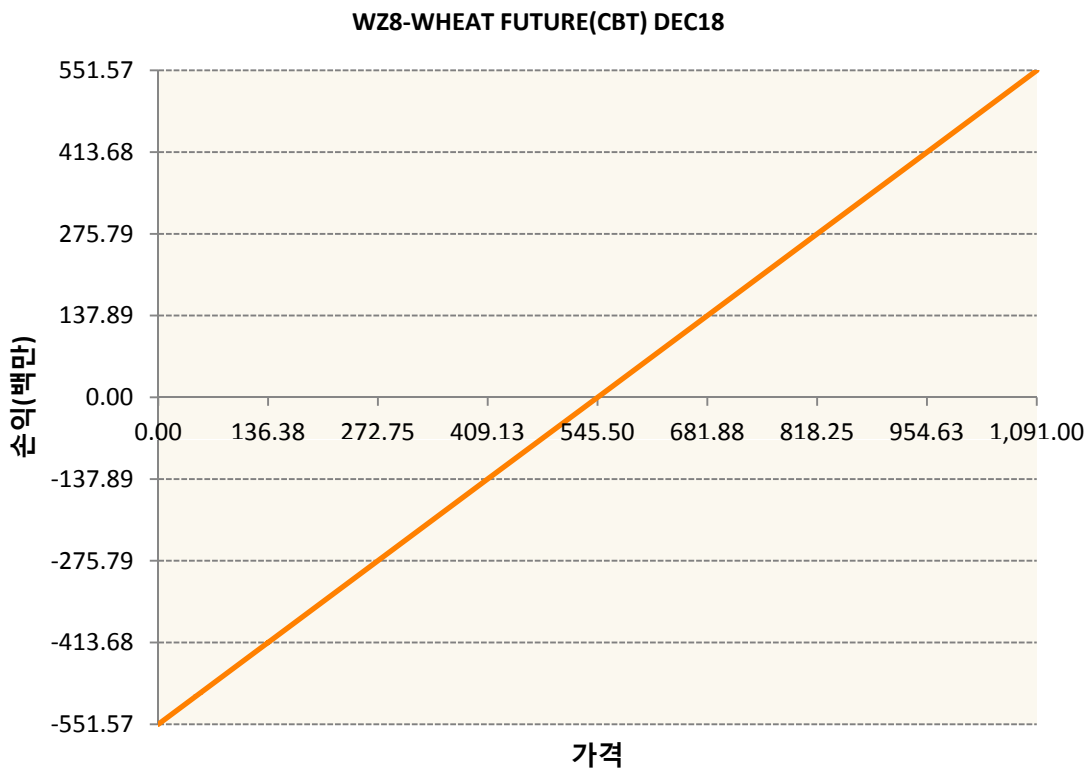
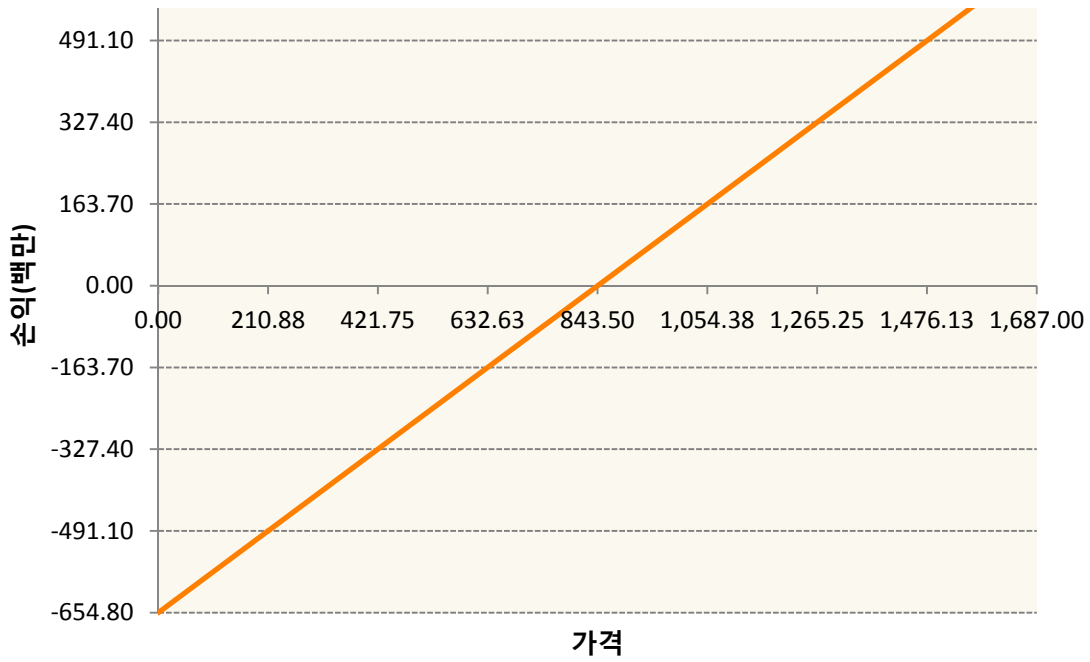


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



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	66
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)

312