

공시일	2018-09-05
기준일	2018-09-04

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	2018-09-05
기준일	2018-09-04

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

1,153

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

492

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-05
기준일	2018-09-04

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

302

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

381

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-05
기준일	2018-09-04

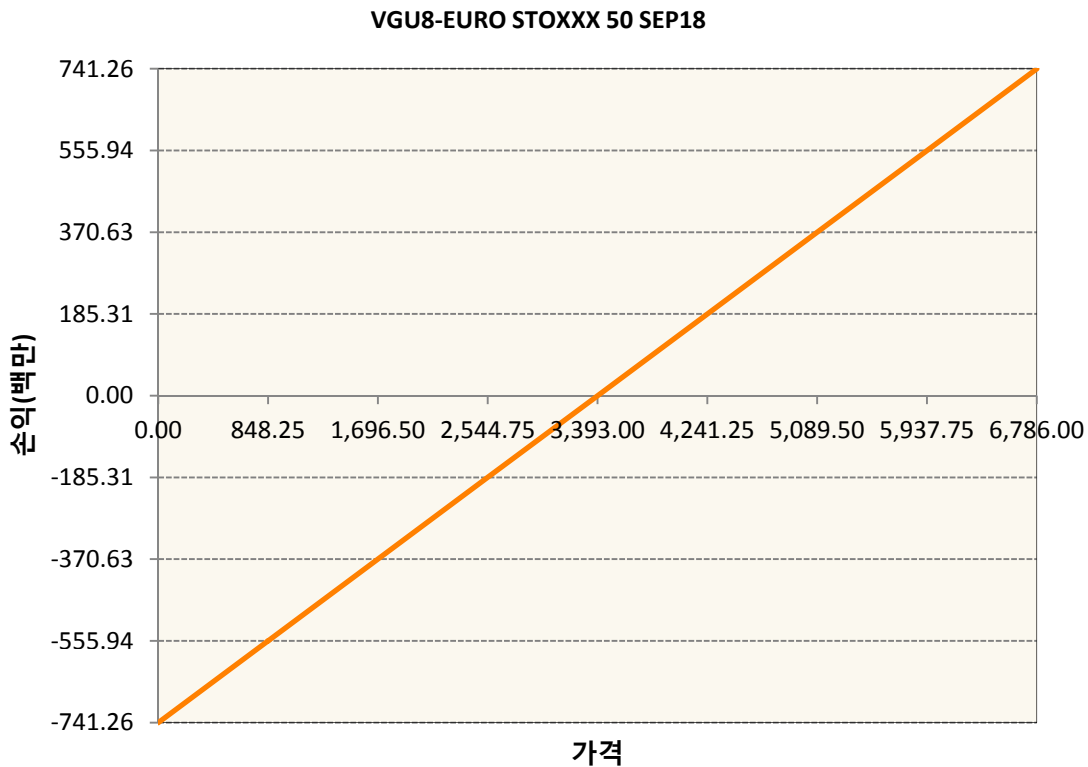
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	741	0	741	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

37

공시일	2018-09-05
기준일	2018-09-04

차이나인덱스모(주식-파생형)

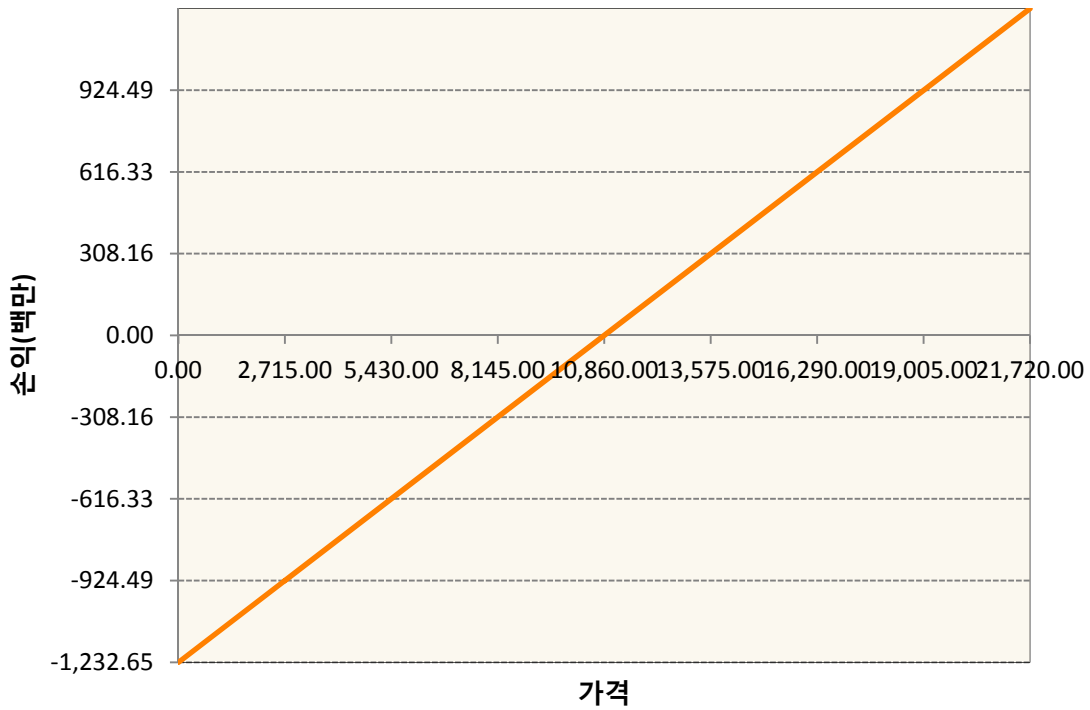
1. 계약금액

(단위:백만원)

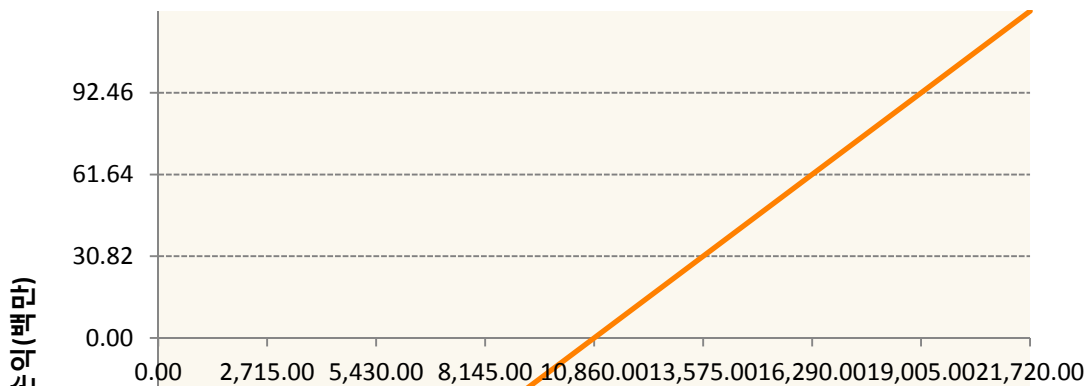
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	123	0	123	
누계	유가증권	선물	1,233	0	1,233	장내

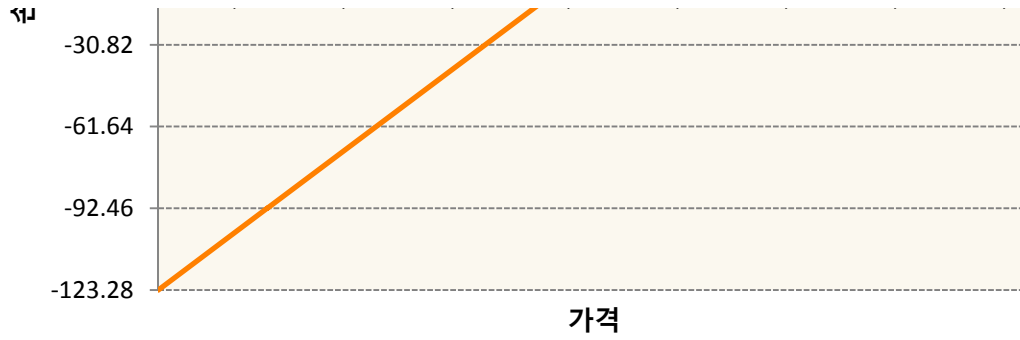
2. 만기시점의 손익구조

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)

99

공시일	2018-09-05
기준일	2018-09-04

커버드콜모(주식혼합-파생형)

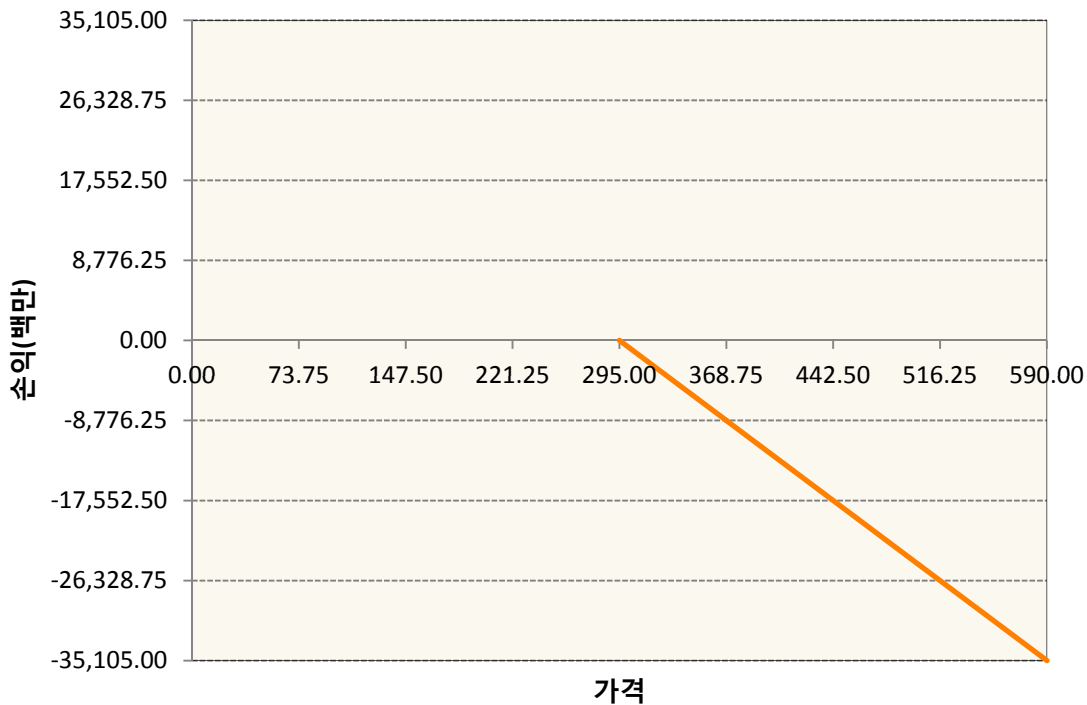
1. 계약금액

(단위:백만원)

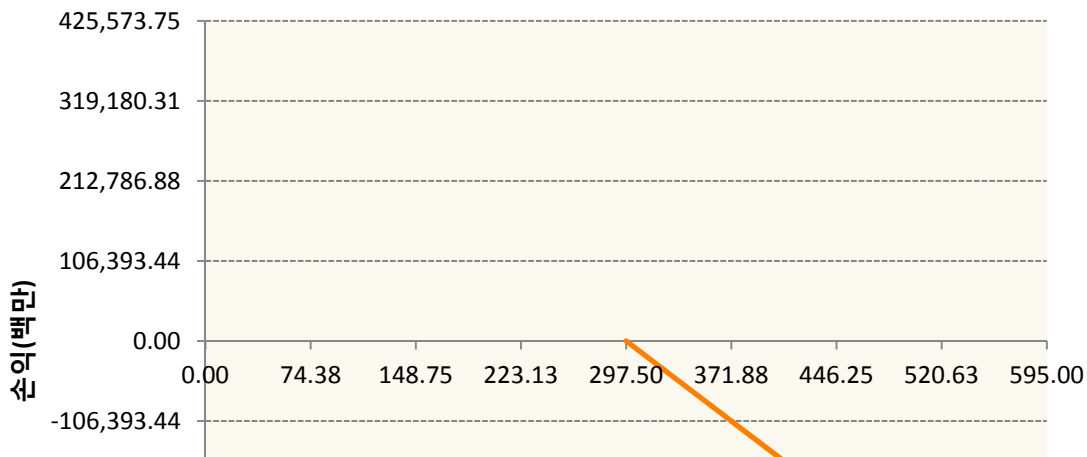
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	758,179	-758,179	장내

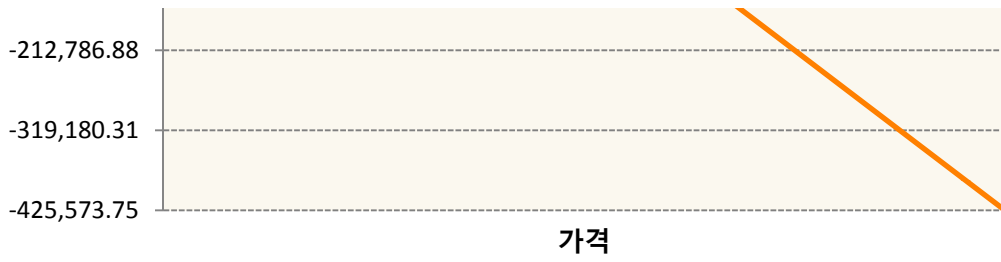
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92950-2018-09 콜295

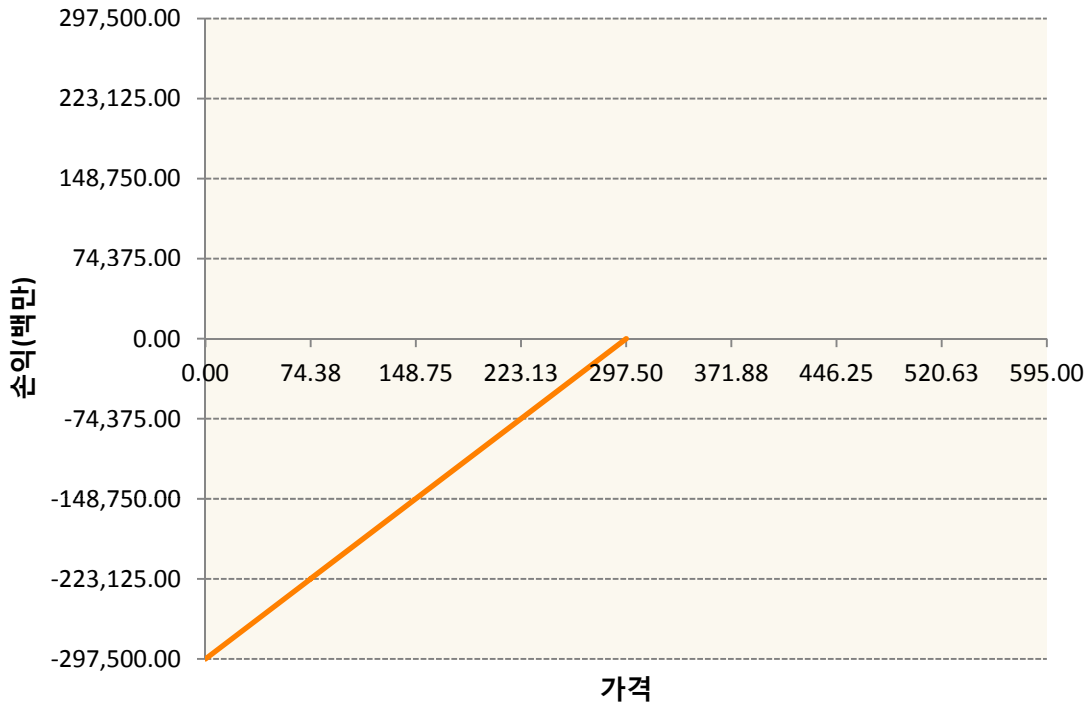


KR4201N92976-2018-09 콜297.5





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N929 2018-09 콜295

2,483

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	839	834	826	816	803	788	770
-5.33%	798	776	751	723	693	661	627
-2.67%	610	566	521	475	429	383	336
0%	139	93	47	0	-47	-95	-143
2.67%	-612	-637	-665	-697	-730	-766	-803
5.33%	-1,510	-1,517	-1,528	-1,542	-1,559	-1,579	-1,601
8.00%	-2,450	-2,451	-2,454	-2,458	-2,464	-2,473	-2,483

KR4201N929 2018-09 풋297.5

28,518

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,068	8,034	7,977	7,894	7,783	7,642	7,472

-5.33%	7,791	7,609	7,384	7,121	6,823	6,497	6,144
-2.67%	6,269	5,805	5,320	4,819	4,306	3,783	3,252
0%	1,774	1,183	592	0	-592	-1,185	-1,779
2.67%	-6,320	-6,715	-7,141	-7,593	-8,065	-8,554	-9,057
5.33%	-16,718	-16,865	-17,054	-17,284	-17,552	-17,853	-18,183
8.00%	-27,928	-27,960	-28,014	-28,095	-28,205	-28,346	-28,518

KR4301N929 2018-09 풋 297.5

21,036

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21,035	-21,035	-21,035	-21,035	-21,035	-21,036	-21,036
-5.33%	-13,072	-13,072	-13,073	-13,076	-13,081	-13,089	-13,101
-2.67%	-5,186	-5,237	-5,301	-5,376	-5,463	-5,558	-5,662
0%	521	348	175	0	-175	-352	-528
2.67%	1,566	1,547	1,518	1,479	1,429	1,370	1,301
5.33%	1,583	1,583	1,583	1,582	1,580	1,575	1,568
8.00%	1,583	1,583	1,583	1,583	1,583	1,583	1,583

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

(단위:백만원)

61,069

공시일	2018-09-05
기준일	2018-09-04

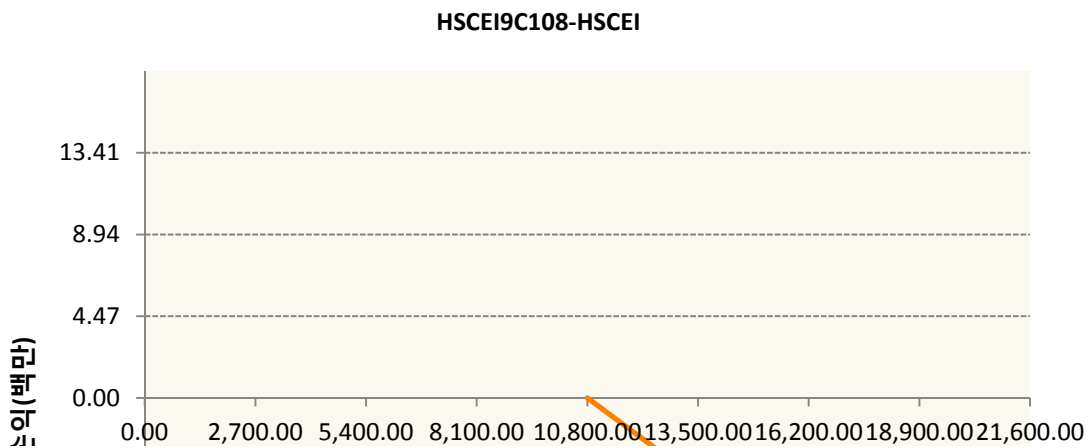
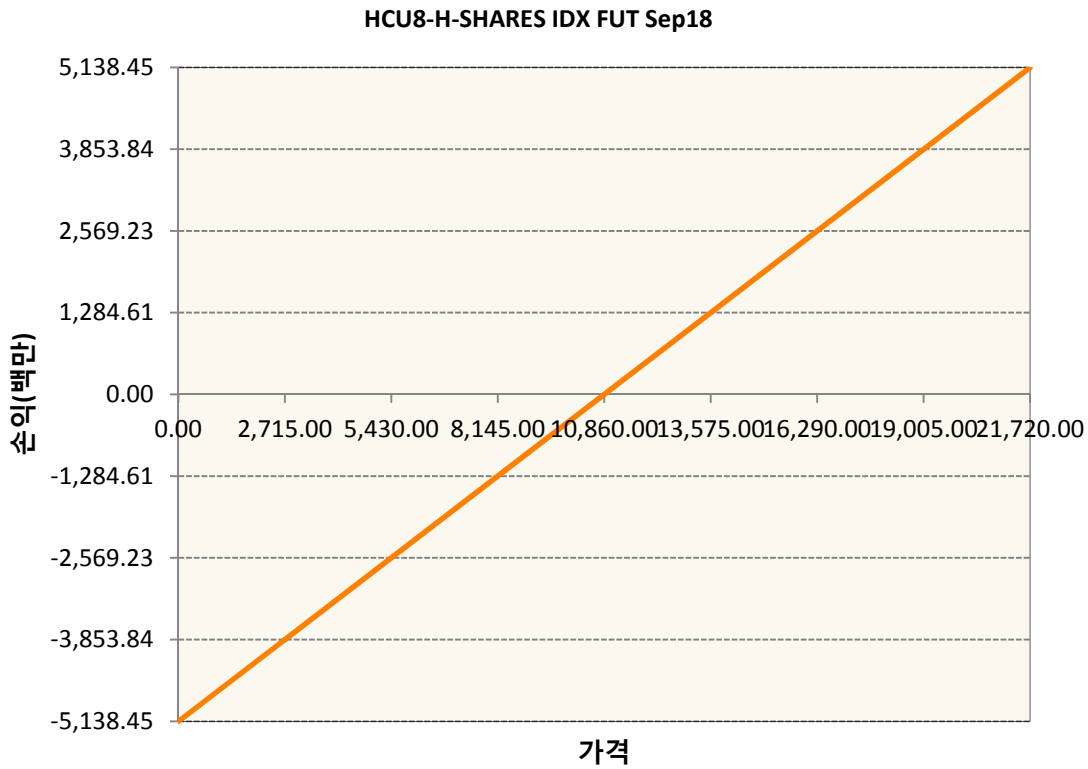
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

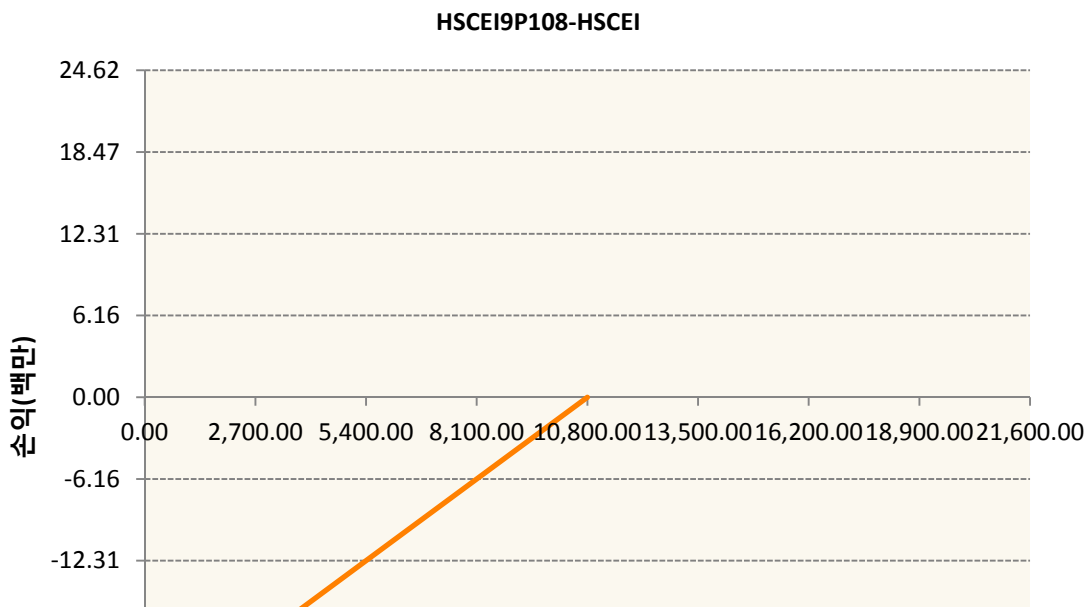
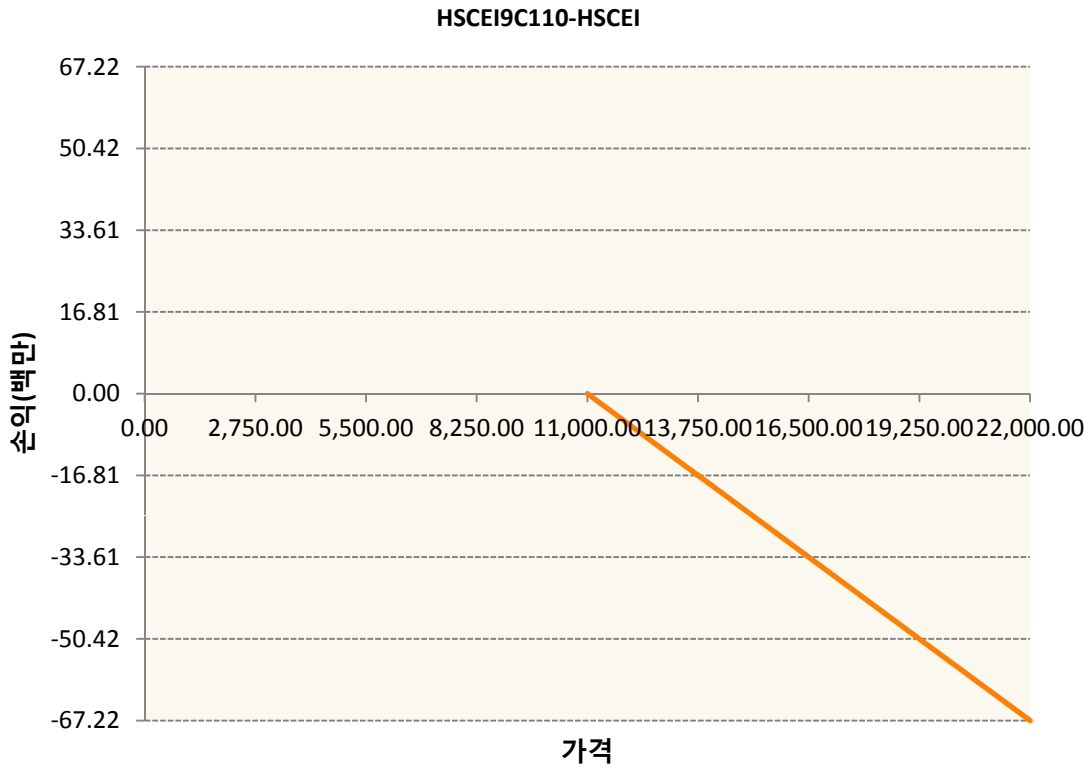
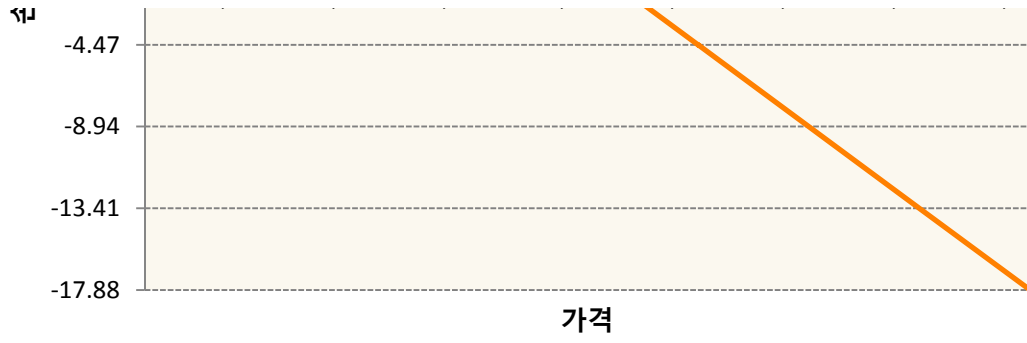
1. 계약금액

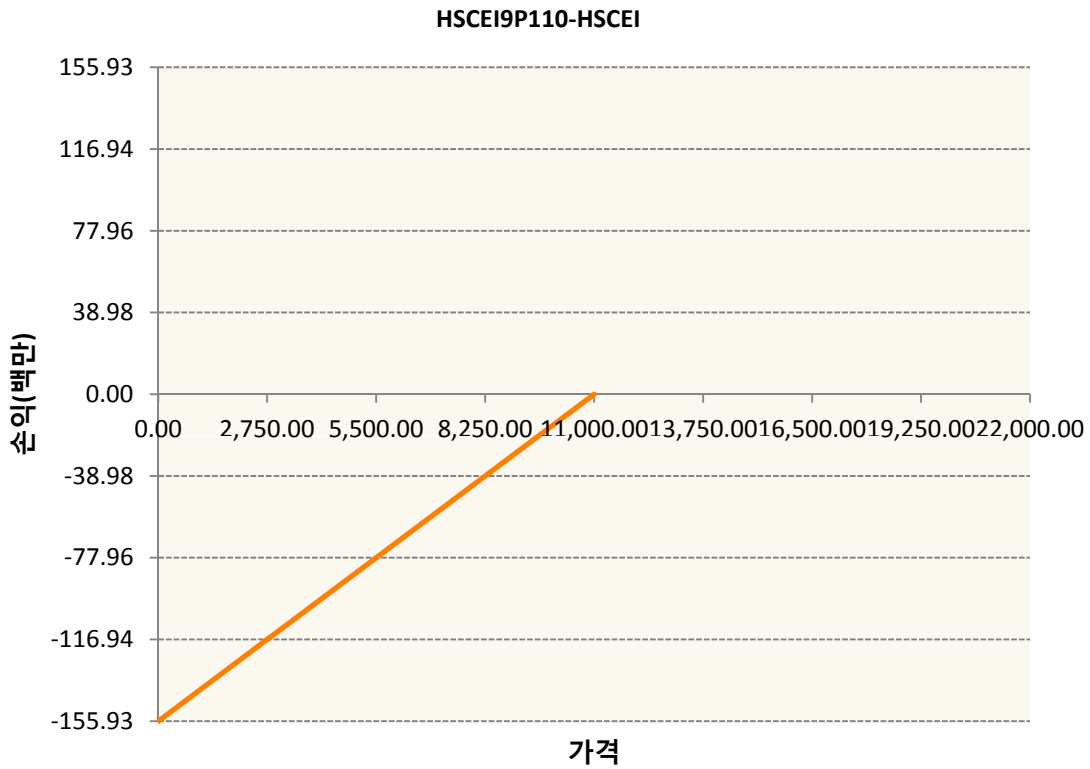
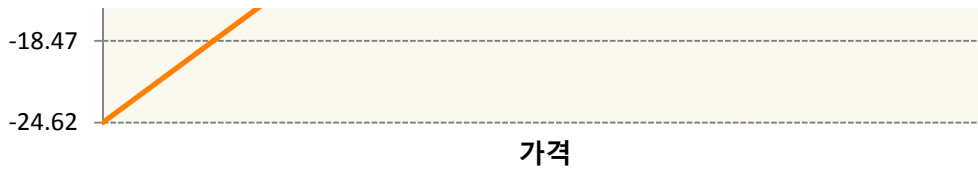
(단위:백만원)

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	266	-266	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU8	H-SHARES IDX FUT Sep18	411
HSCEI9C108	HSCEI	1
HSCEI9C110	HSCEI	5
HSCEI9P108	HSCEI	2
HSCEI9P110	HSCEI	12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	395

공시일	2018-09-05
기준일	2018-09-04

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

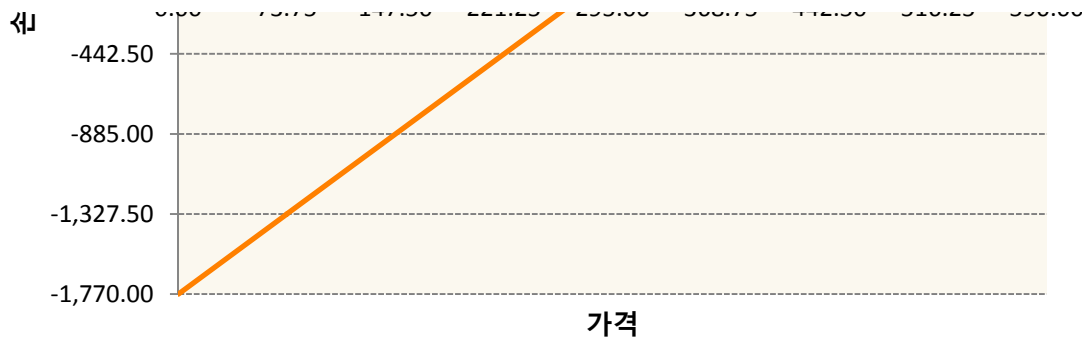
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92976-2018-09 콜297.5

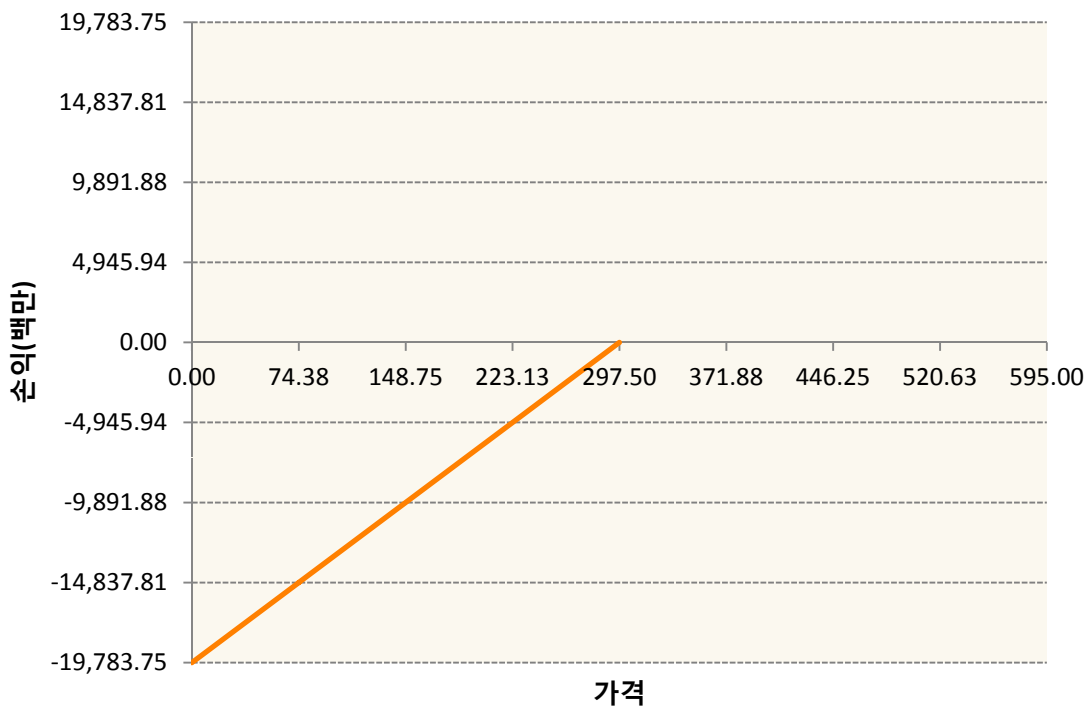


KR4301N92958-2018-09 풋295





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,964
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,964	-3,964	-3,964	-3,964	-3,964	-3,964	-3,964
-5.33%	-2,643	-2,643	-2,643	-2,643	-2,643	-2,643	-2,643
-2.67%	-1,321	-1,321	-1,321	-1,321	-1,321	-1,321	-1,321
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,321	1,321	1,321	1,321	1,321	1,321	1,321
5.33%	2,643	2,643	2,643	2,643	2,643	2,643	2,643
8.00%	3,964	3,964	3,964	3,964	3,964	3,964	3,964
KR4201N92974-2018-09 풋297.5							1,884
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	533	531	527	521	514	505	494
-5.33%	515	503	488	470	451	429	406
-2.67%	414	383	351	318	284	250	215
0%	117	78	39	0	-39	-78	-117
2.67%	-417	-444	-472	-502	-533	-565	-598
5.33%	-1,104	-1,114	-1,127	-1,142	-1,159	-1,179	-1,201
8.00%	-1,845	-1,847	-1,851	-1,856	-1,863	-1,873	-1,884

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	-68	-68	-69	-69	-69
-2.67%	-22	-23	-24	-24	-25	-26	-27
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	5	5	5	4	4	4	4
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

KR4301N929 2018-09 풋297.5

1,399

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,399	-1,399	-1,399	-1,399	-1,399	-1,399	-1,399
-5.33%	-869	-869	-869	-870	-870	-870	-871
-2.67%	-345	-348	-353	-358	-363	-370	-377
0%	35	23	12	0	-12	-23	-35
2.67%	104	103	101	98	95	91	87
5.33%	105	105	105	105	105	105	104
8.00%	105	105	105	105	105	105	105

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

(단위:백만원)

7,965

공시일	2018-09-05
기준일	2018-09-04

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

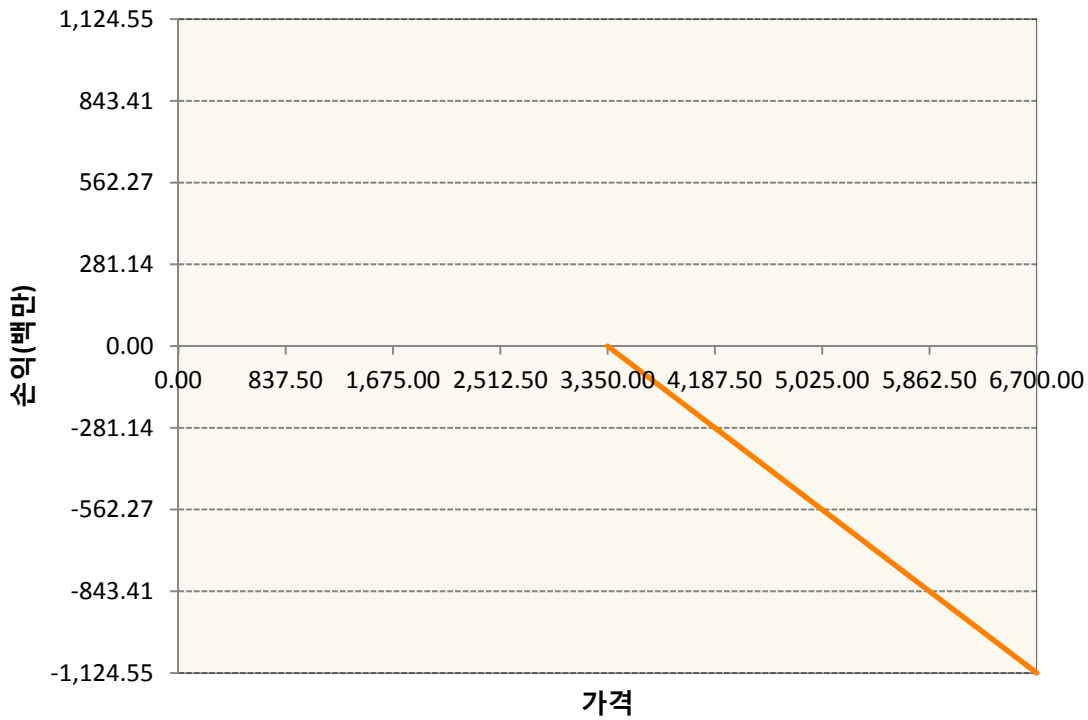
1. 계약금액

(단위:백만원)

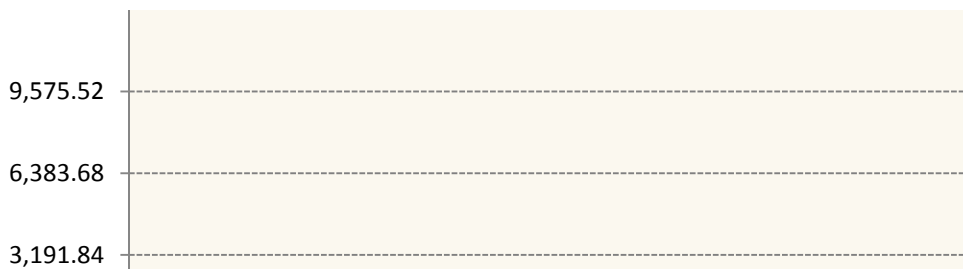
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,004	0	7,004	
누계	유가증권	옵션	0	27,784	-27,784	장내
누계	지수	스왑	86,510	0	86,510	장외

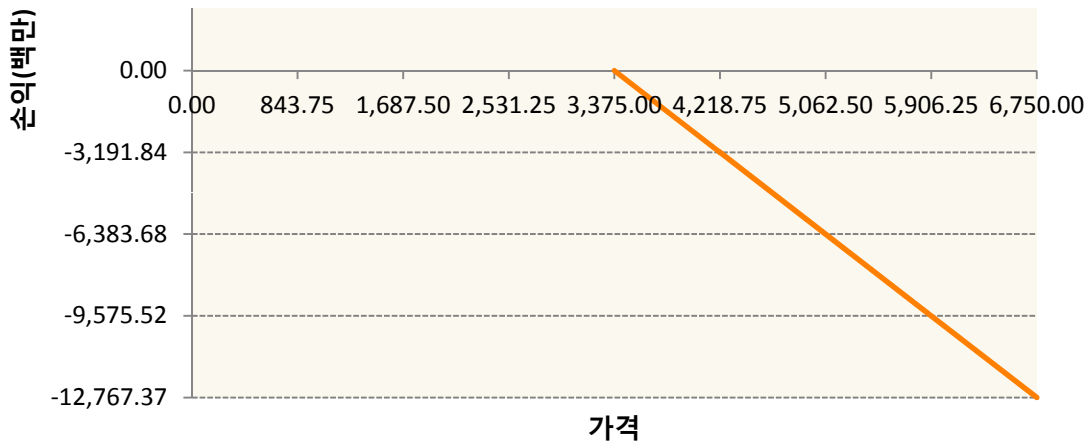
2. 만기시점의 손익구조

OESXU8-C3350-EURO STOXX 50

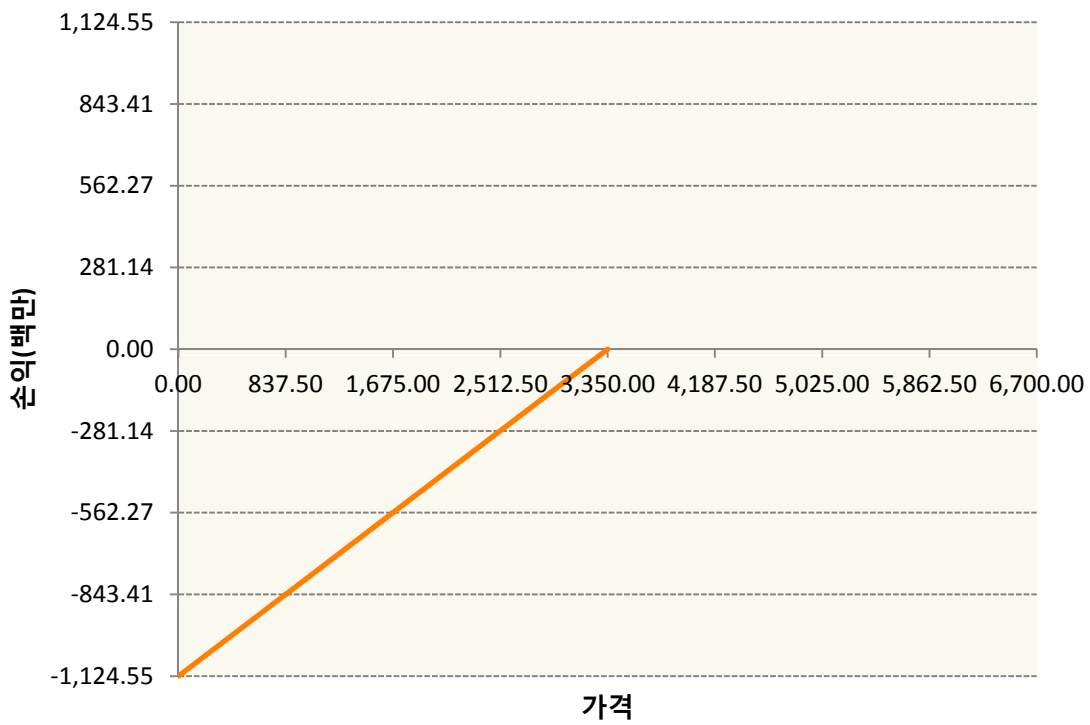


OESXU8-C3375-EURO STOXX 50

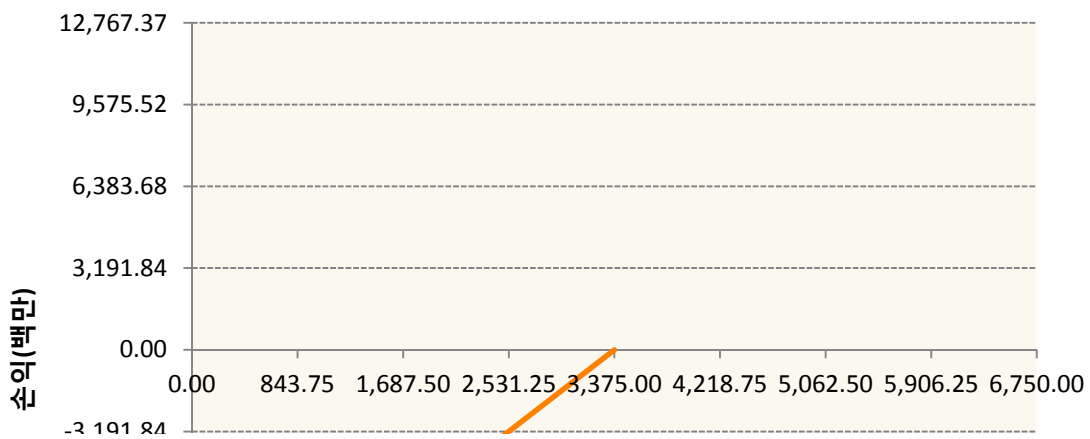


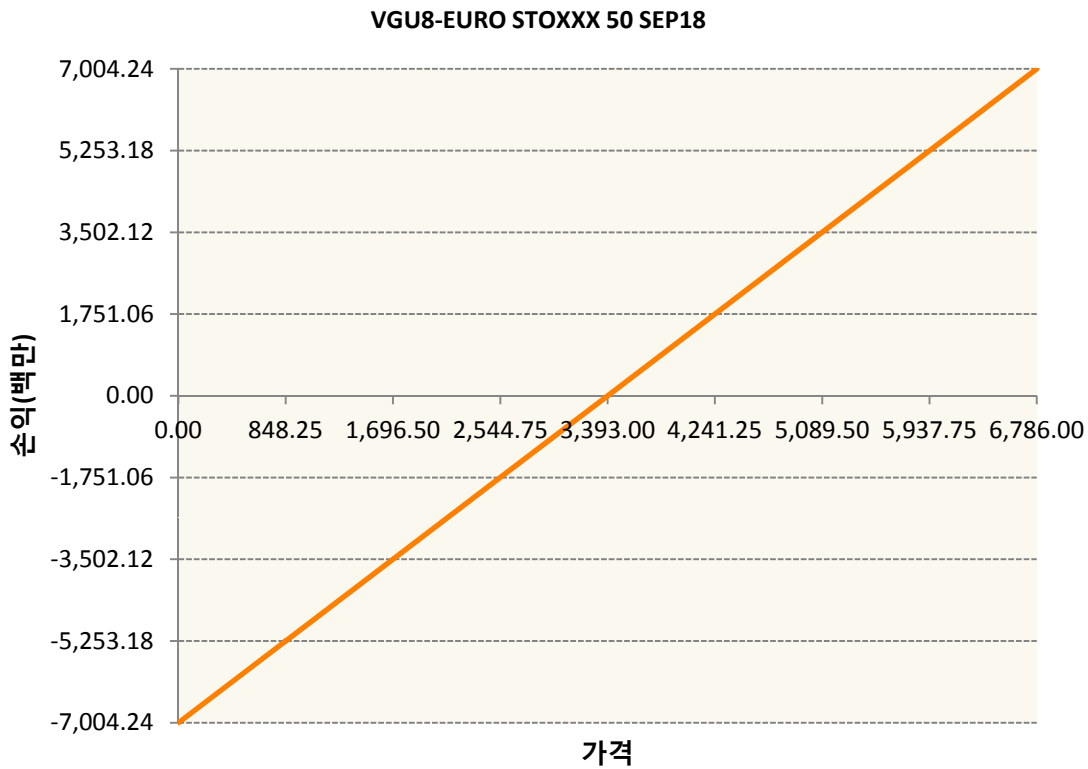
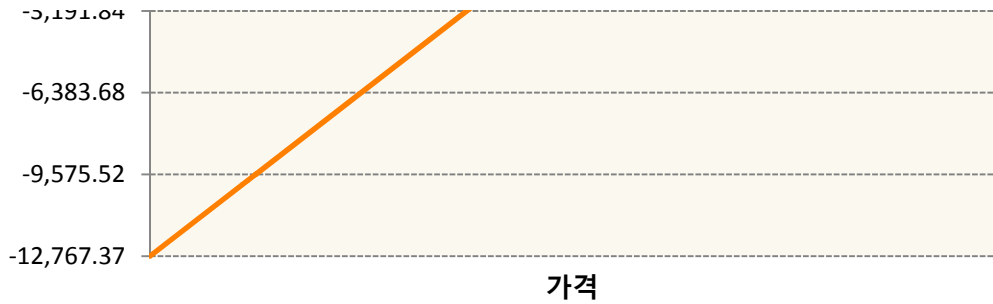


OESXU8-P3350-EURO STOXX 50



OESXU8-P3375-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	23
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	15
OESXU8-C33 EURO STOXX 50	90
OESXU8-C33 EURO STOXX 50	1,021
OESXU8-P33 EURO STOXX 50	90
OESXU8-P33 EURO STOXX 50	1,021
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18	560

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

1,770

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

(단위:백만원)

1,142

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

(단위:백만원)

90

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

(단위:백만원)

135

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

(단위:백만원)

167

공시일	2018-09-05
기준일	2018-09-04

스마트KRX300인덱스목표전환형1

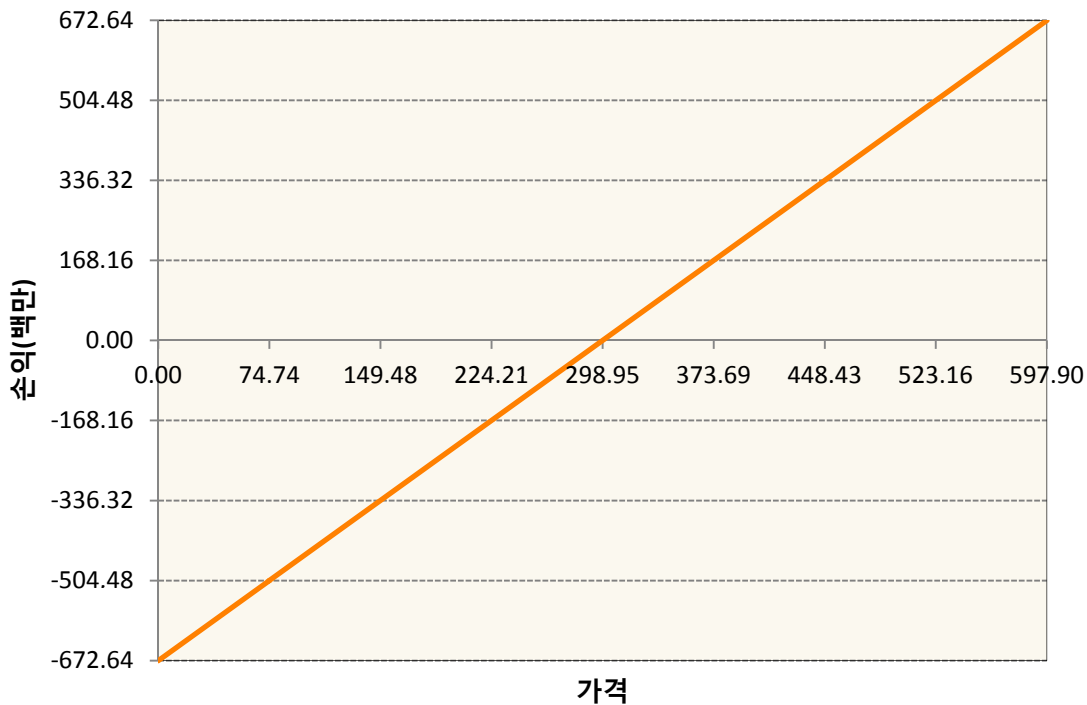
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	673	0	673	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	2018-09-05
기준일	2018-09-04

리디파인K200(주식혼합-파생재간

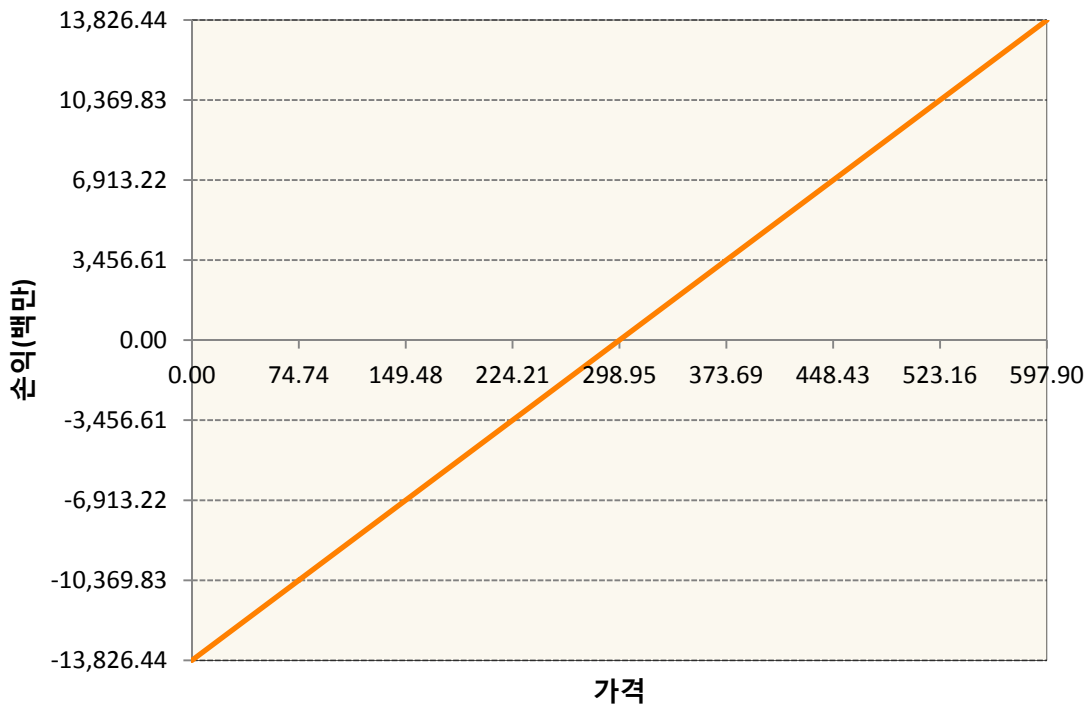
1. 계약금액

(단위:백만원)

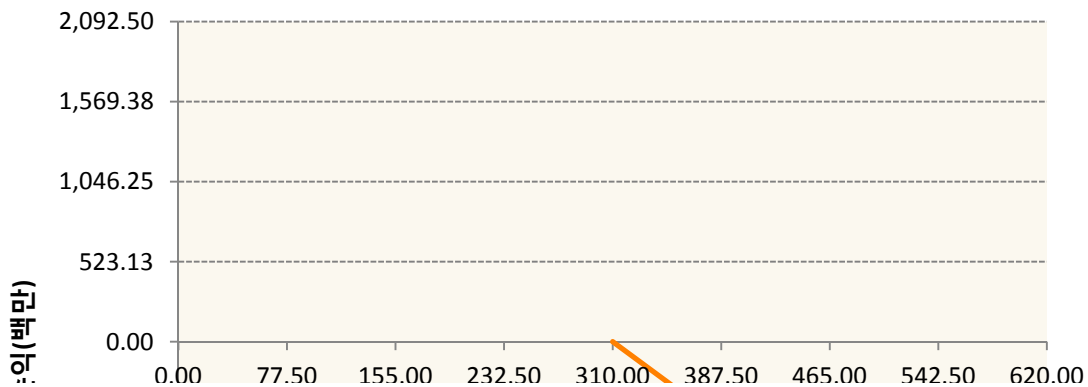
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,826	0	13,826	장내
누계	유가증권	옵션	1,339	24,671	-23,332	장내

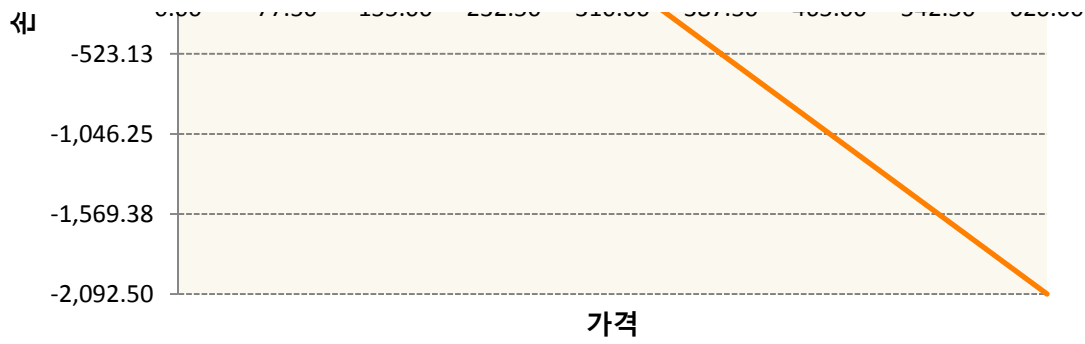
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

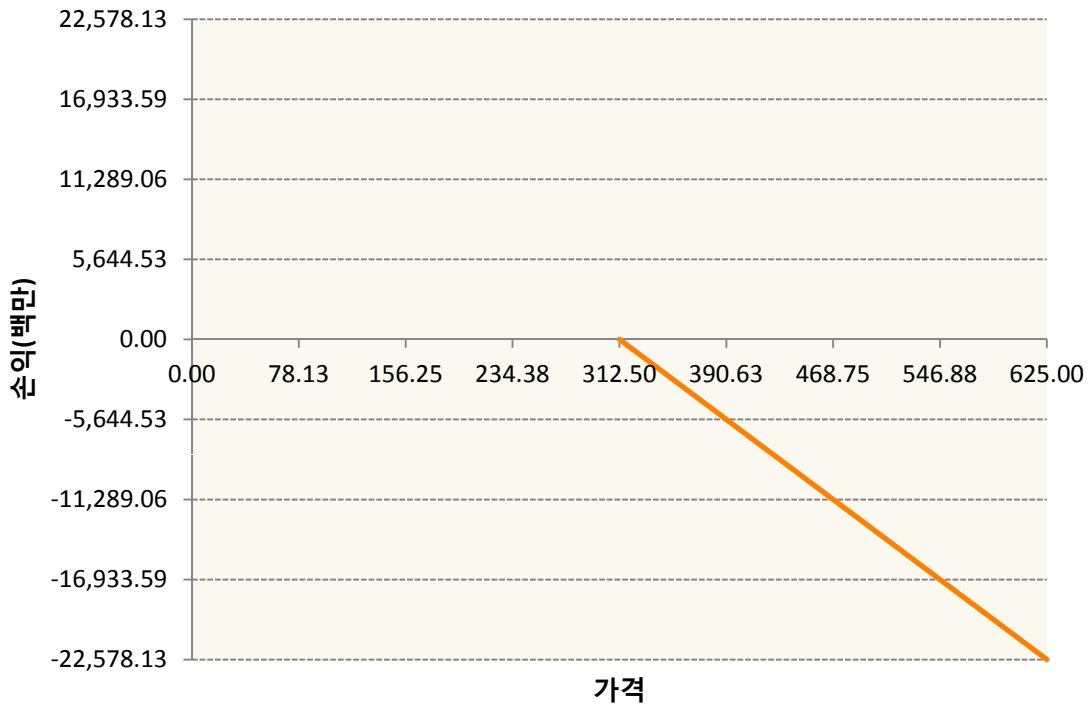


KR4201N93107-2018-09 콜310

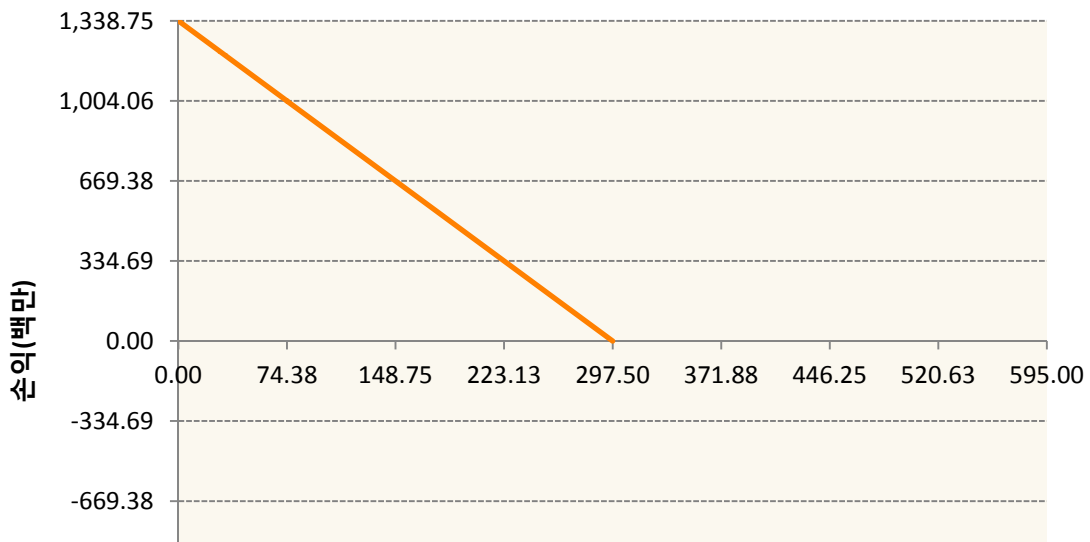


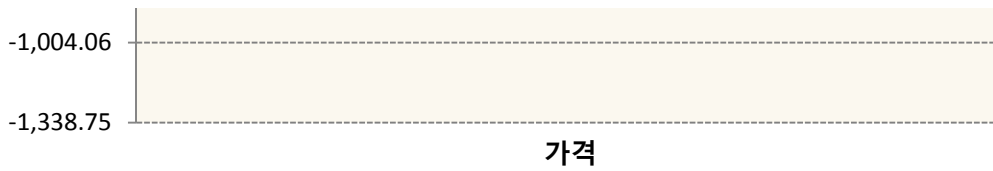


KR4201N93123-2018-09 콜312.5



KR4301N92974-2018-09 풋297.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물							1,106
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,106	-1,106	-1,106	-1,106	-1,106	-1,106	-1,106
-5.33%	-737	-737	-737	-737	-737	-737	-737
-2.67%	-369	-369	-369	-369	-369	-369	-369
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	369	369	369	369	369	369	369
5.33%	737	737	737	737	737	737	737
8.00%	1,106	1,106	1,106	1,106	1,106	1,106	1,106
KR4201N9312018-09 콜310							91
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
-5.33%	9	9	9	9	8	8	7
-2.67%	9	8	7	7	6	5	3
0%	5	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	-8	-10	-13	-16	-19	-22	-24
5.33%	-36	-39	-42	-44	-47	-50	-53
8.00%	-80	-81	-83	-85	-87	-89	-91
KR4201N9312018-09 콜312.5							867
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	68	68	68	67	67	66	65
-5.33%	67	67	66	65	63	59	55
-2.67%	65	62	58	51	43	34	23
0%	43	31	17	0	-18	-38	-59
2.67%	-53	-80	-107	-135	-164	-193	-222
5.33%	-304	-335	-366	-397	-428	-460	-491
8.00%	-726	-746	-768	-791	-815	-841	-867
KR4301N92C 2018-09 풋297.5							95
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	95	95	95	95	95	95	95
-5.33%	59	59	59	59	59	59	59
-2.67%	23	24	24	24	25	25	25

0%	-2	-2	-1	0	1	2	2
2.67%	-7	-7	-7	-7	-6	-6	-6
5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7

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

(단위:백만원)

1,620

공시일	2018-09-05
기준일	2018-09-04

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

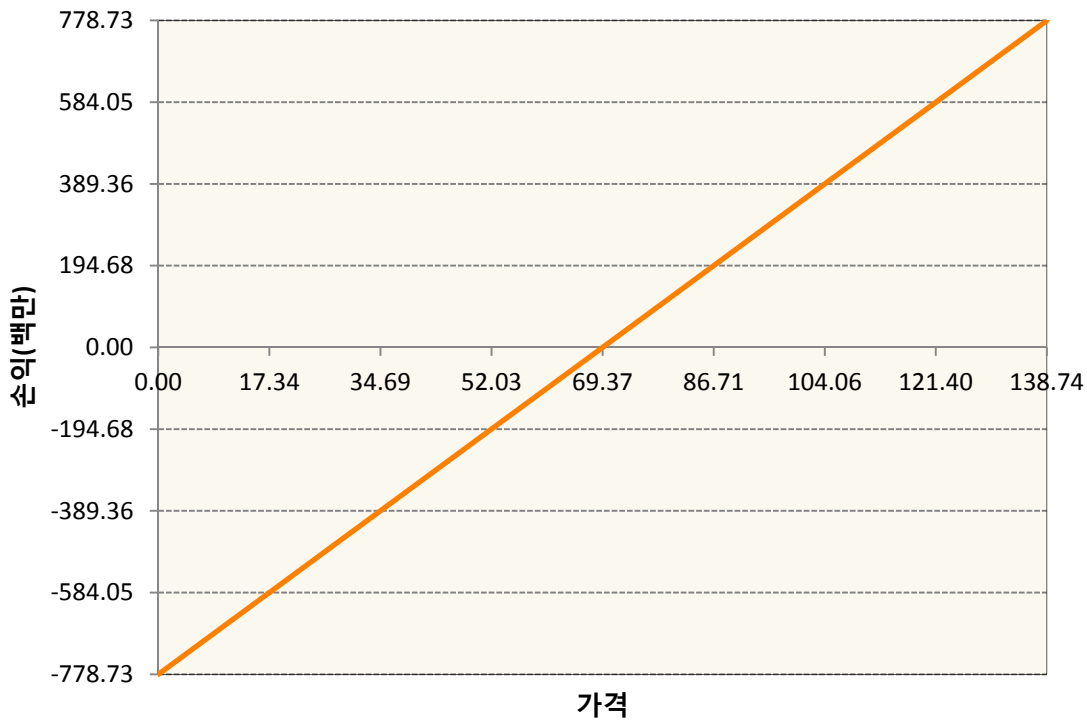
1. 계약금액

(단위:백만원)

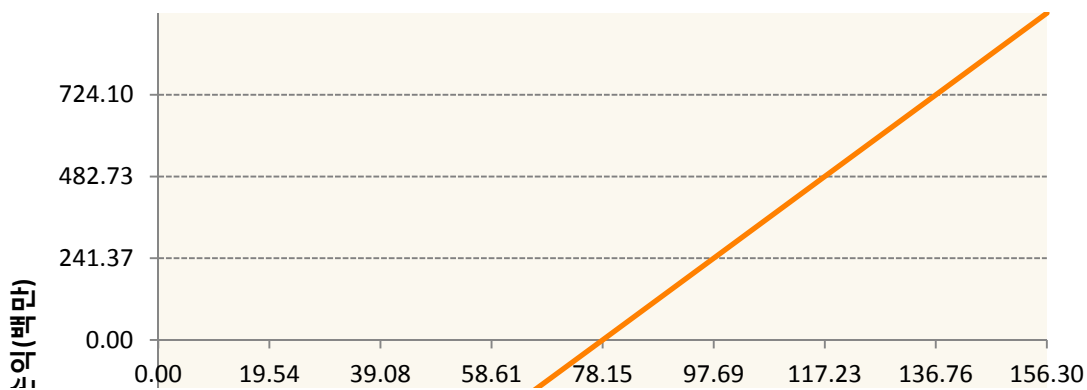
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,201	613	2,588	
누계	유가증권	선물	529	0	529	장내

2. 만기시점의 손익구조

CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18

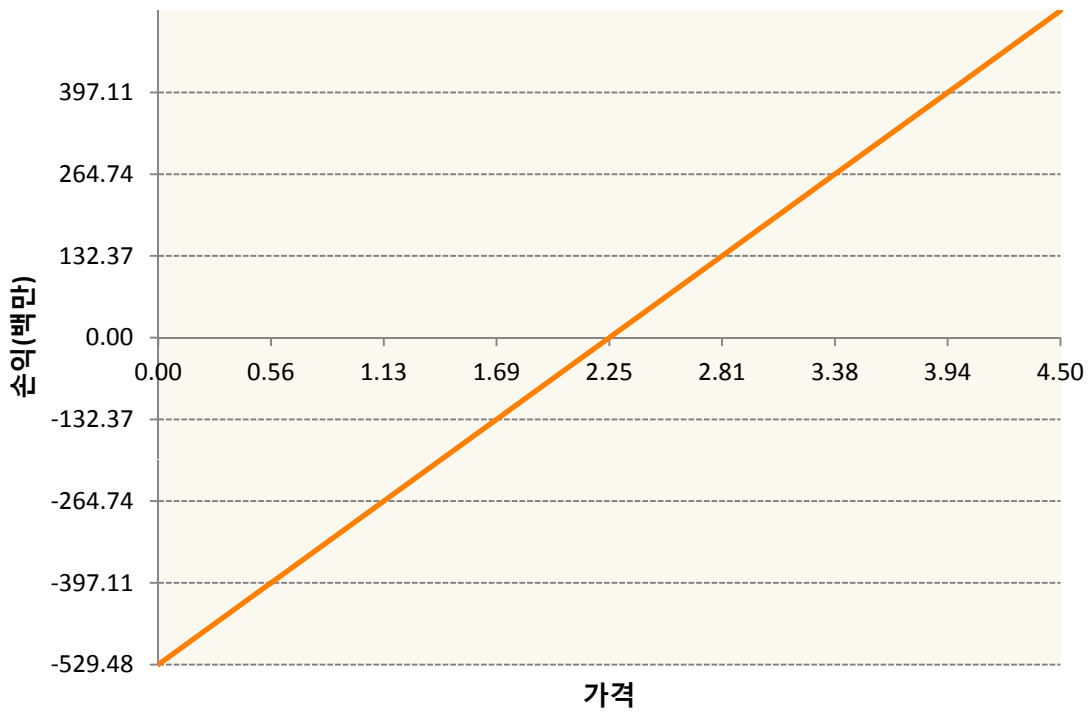


COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18

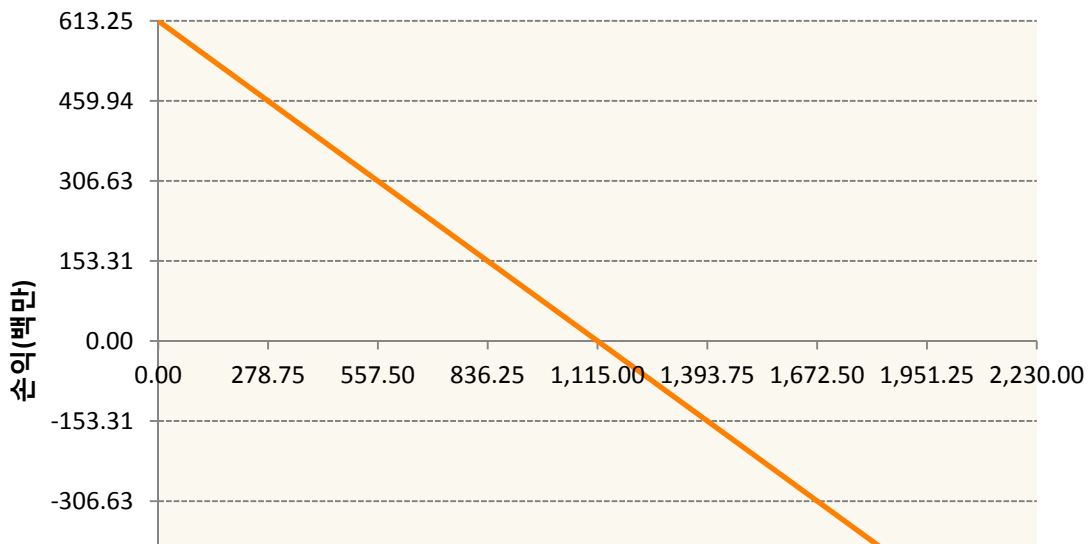


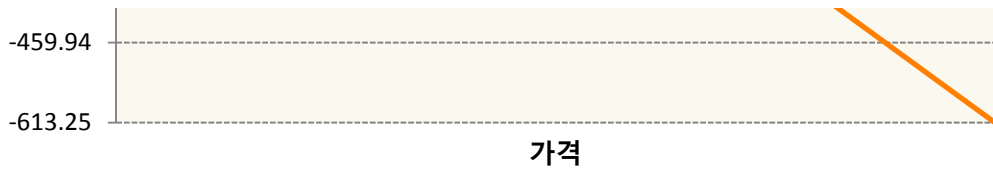


HOX8-Heating Oil

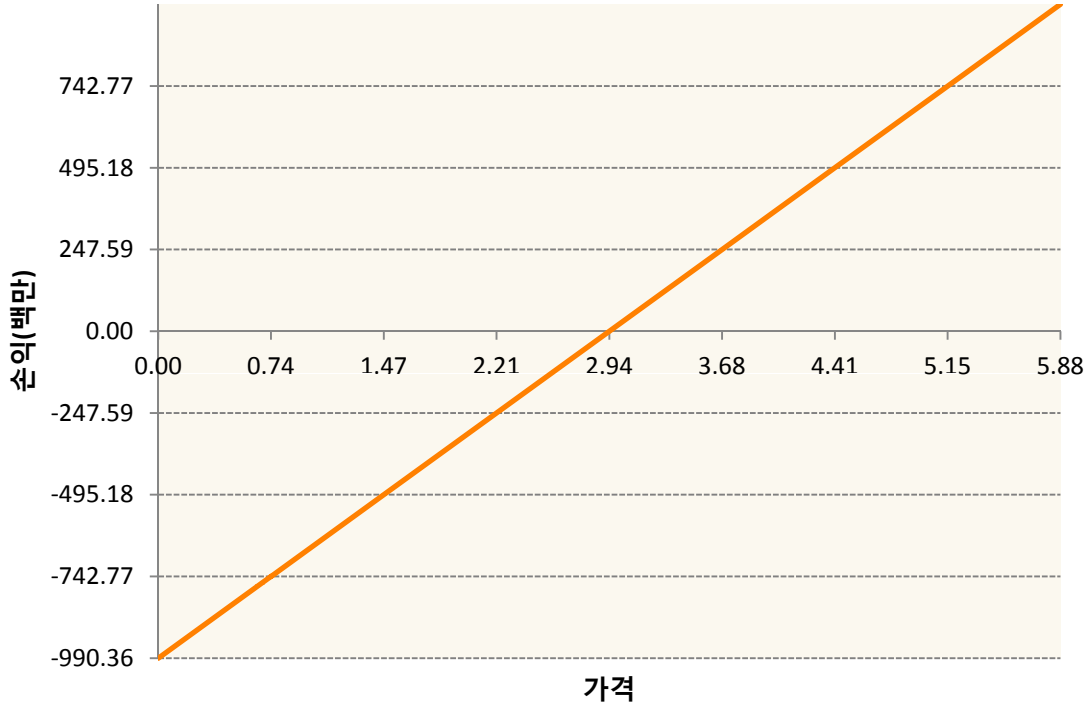


KR4175N90000-2018-09 달러선물

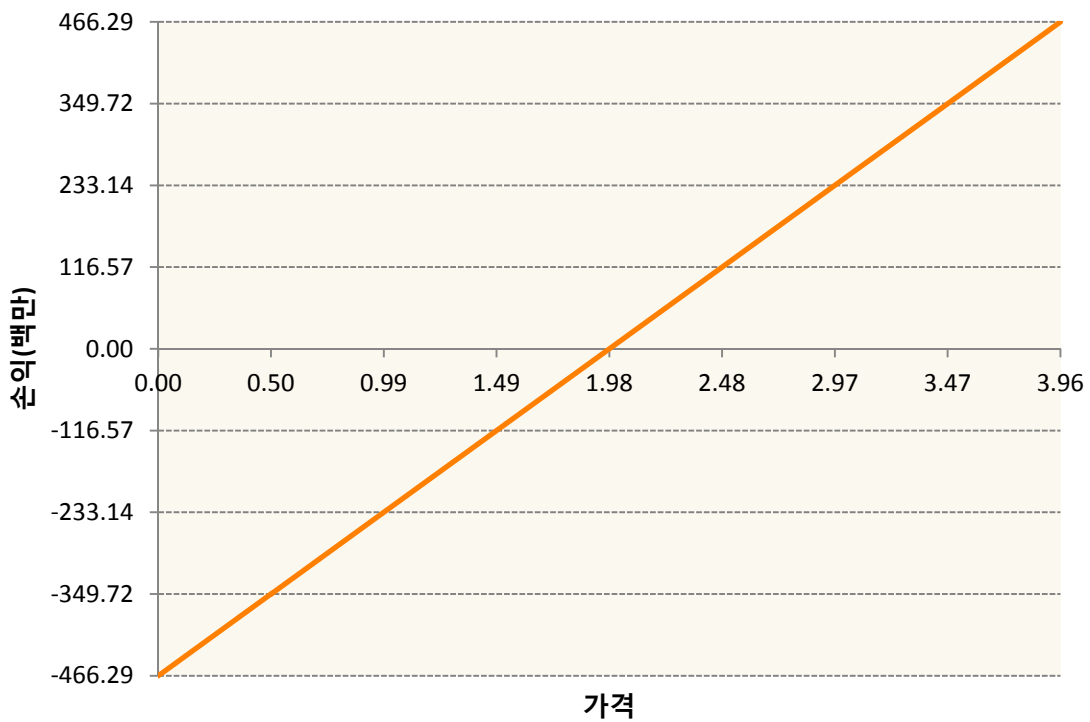




NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18



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	79
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	37

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

공시일	2018-09-05
기준일	2018-09-04

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

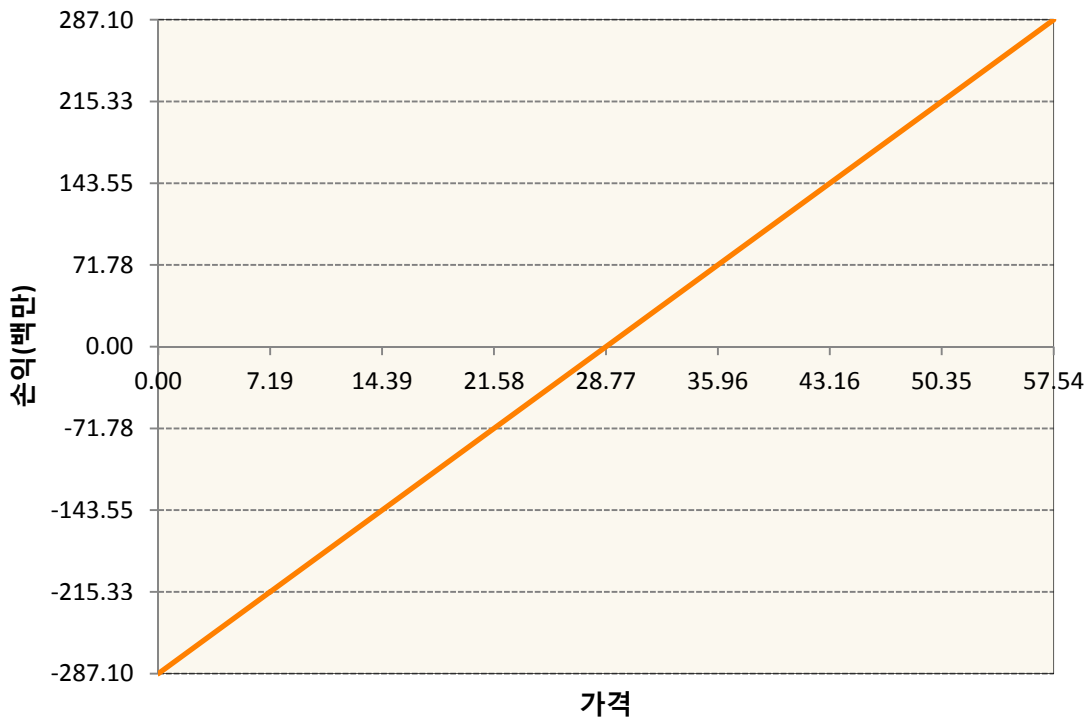
1. 계약금액

(단위:백만원)

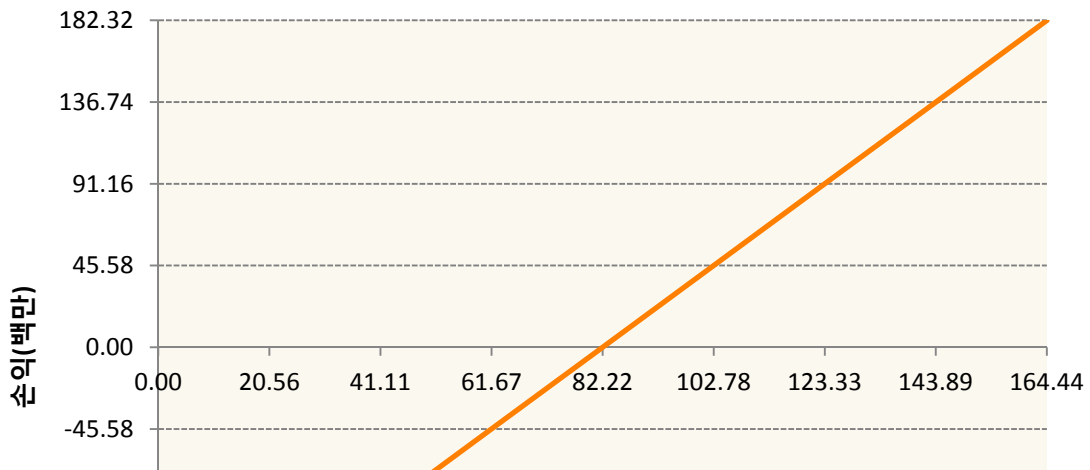
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,627	78	3,549	

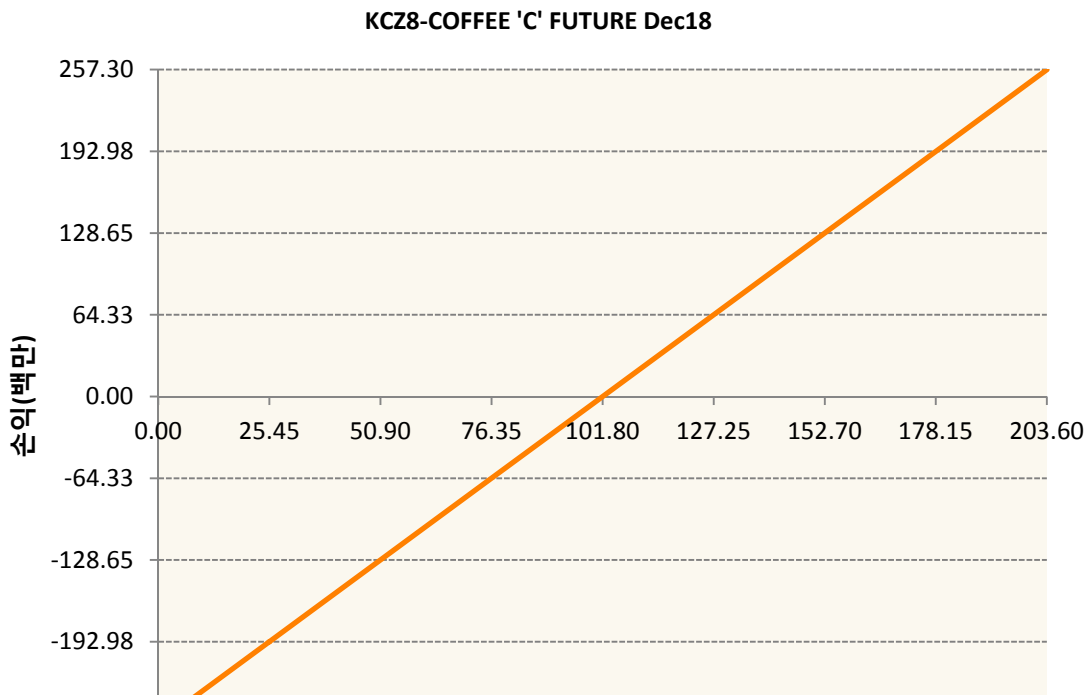
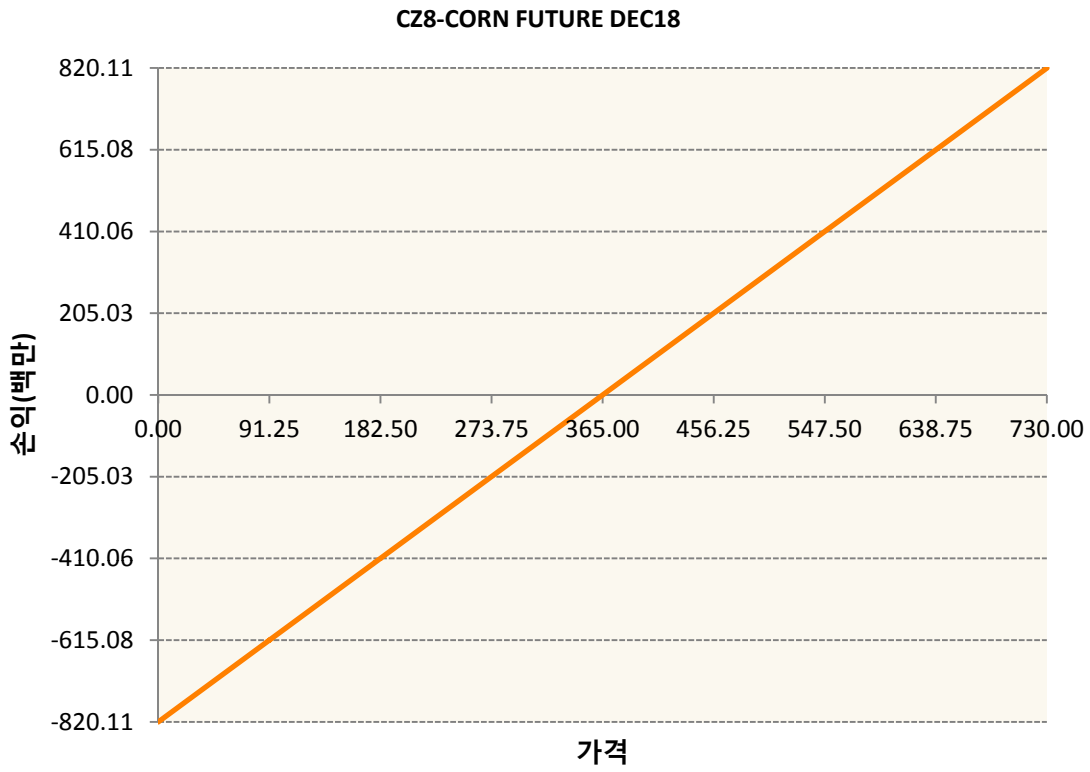
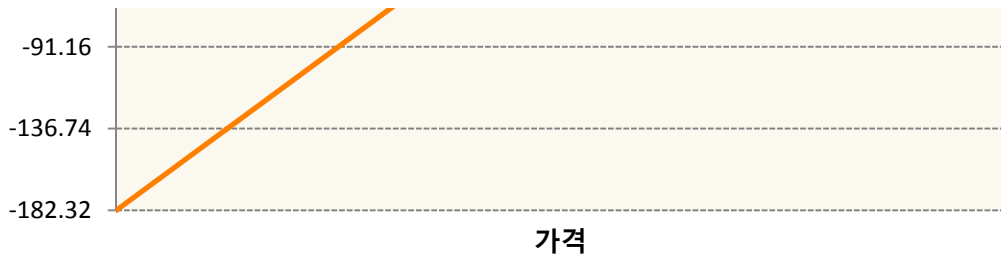
2. 만기시점의 손익구조

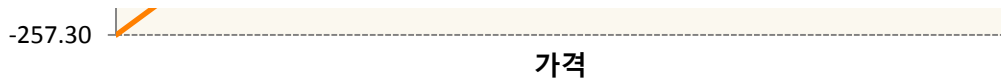
BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18



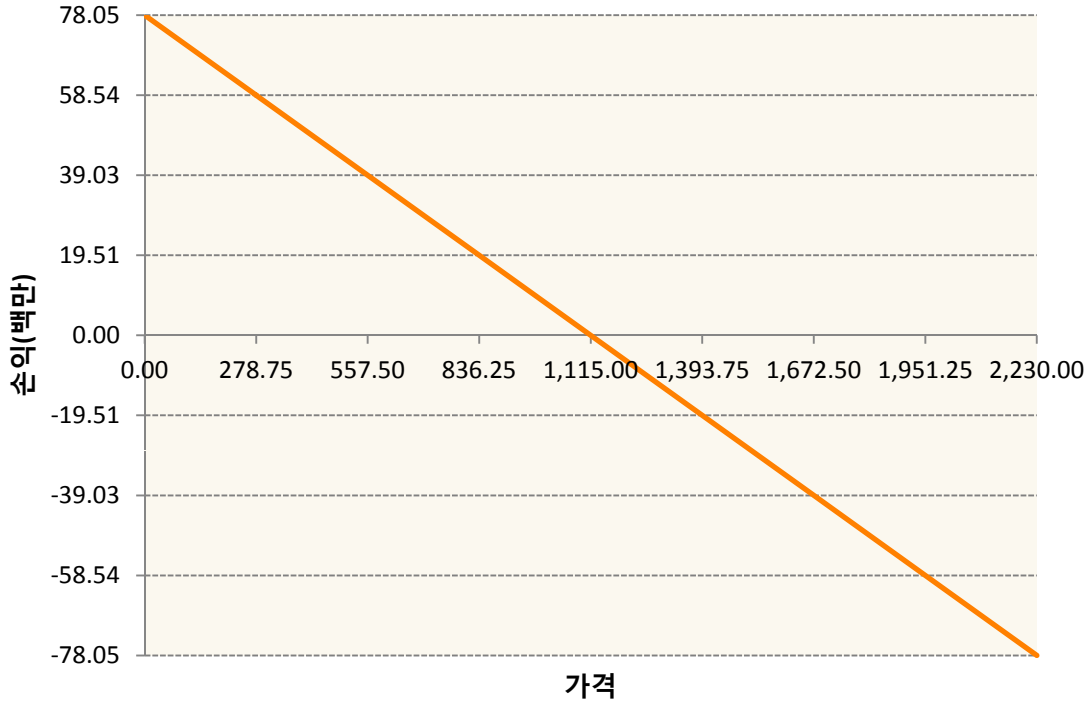
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



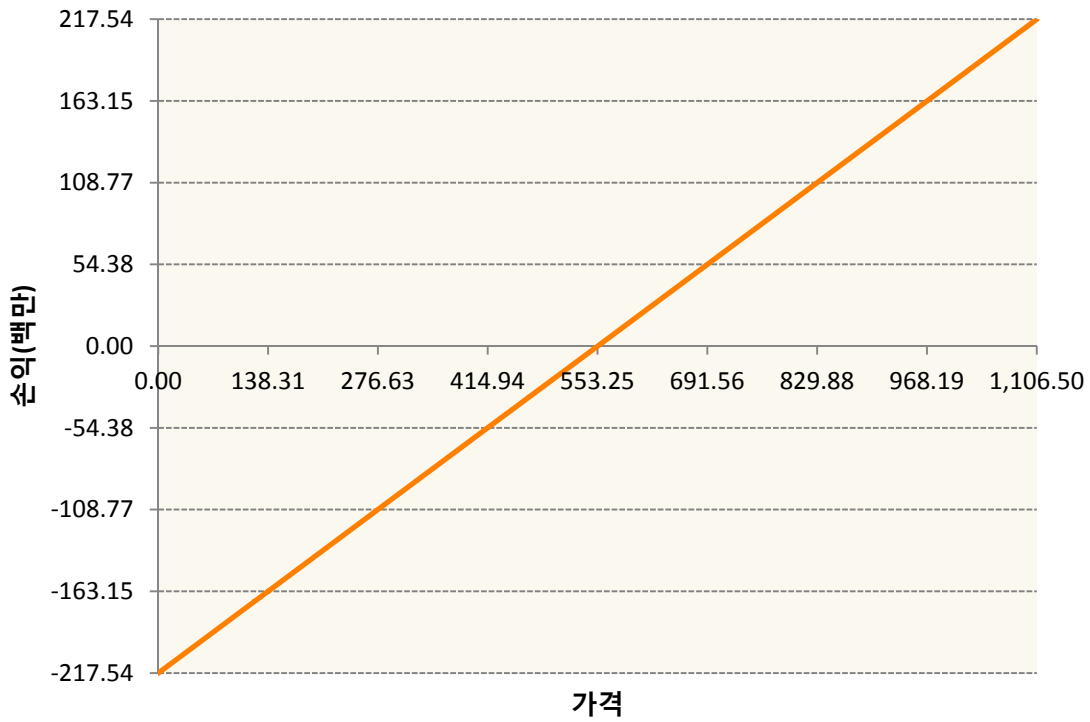




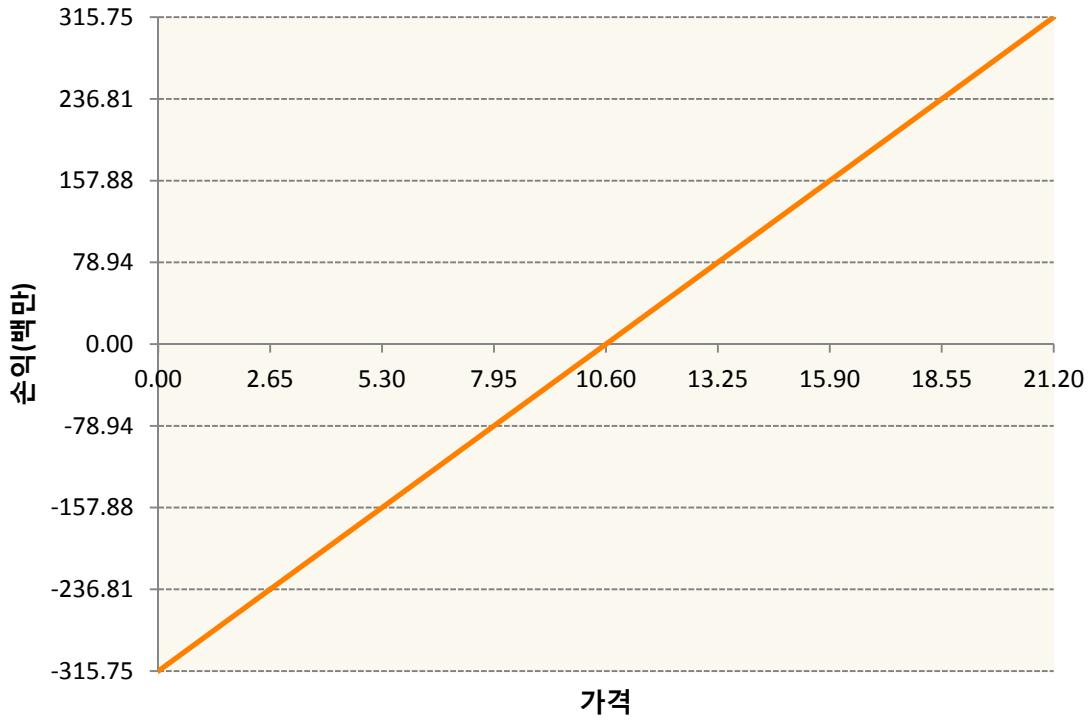
KR4175N90000-2018-09 달러선물



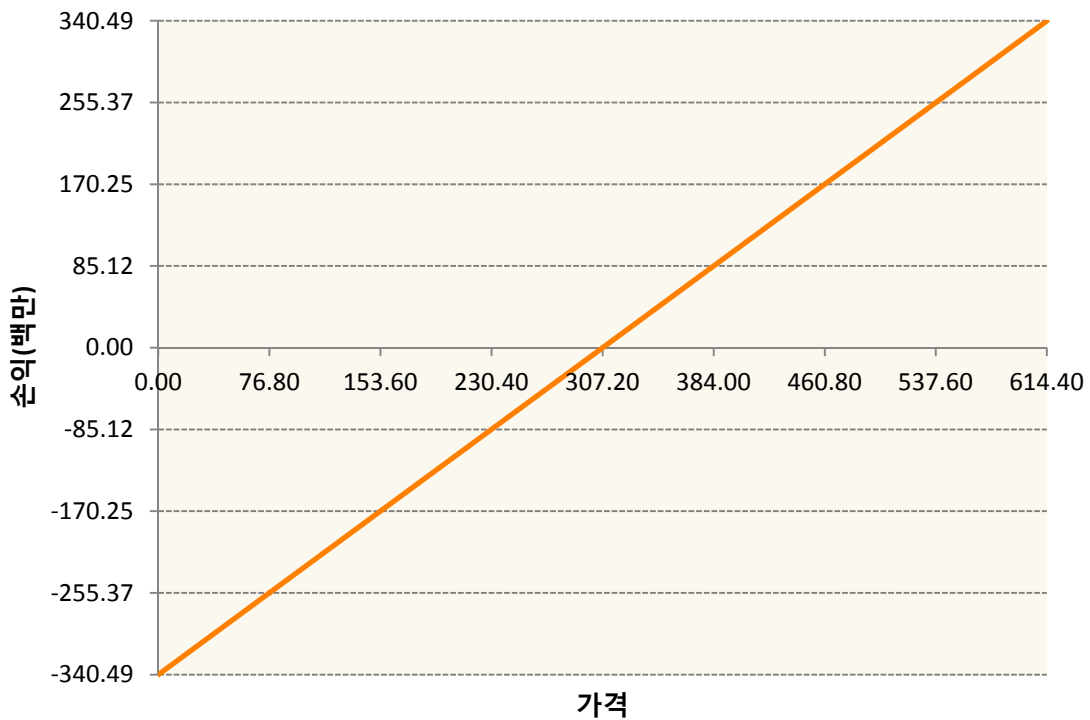
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



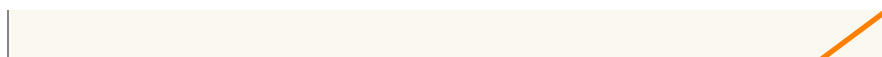
SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

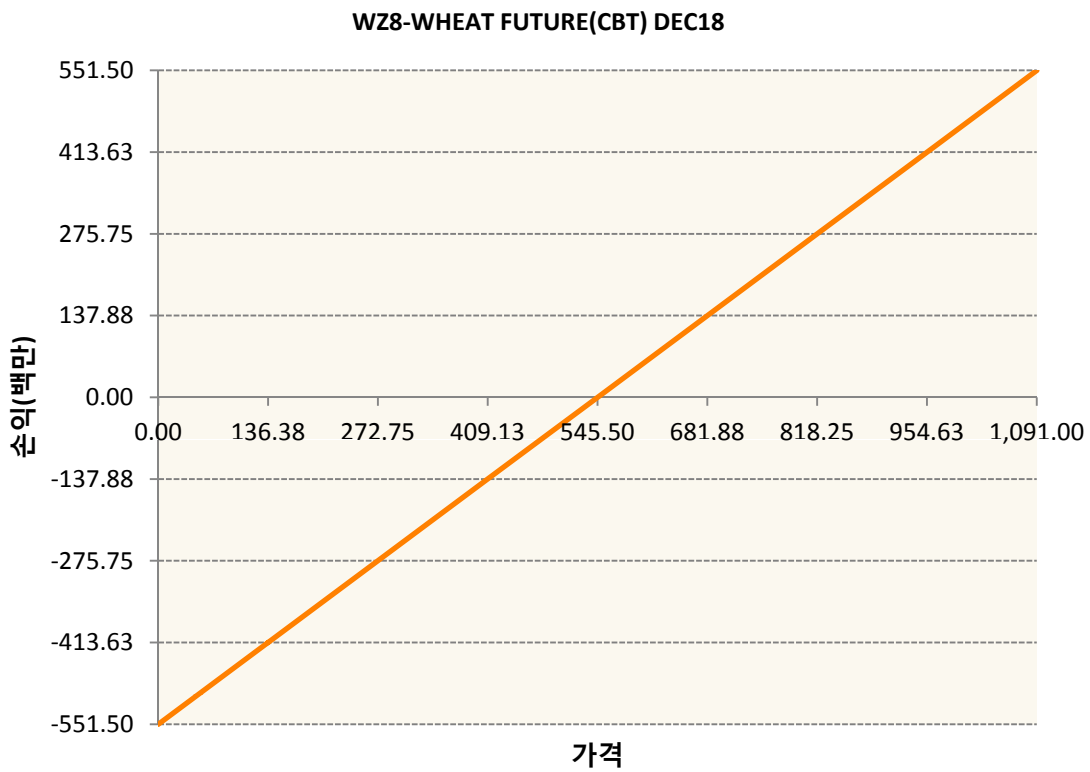
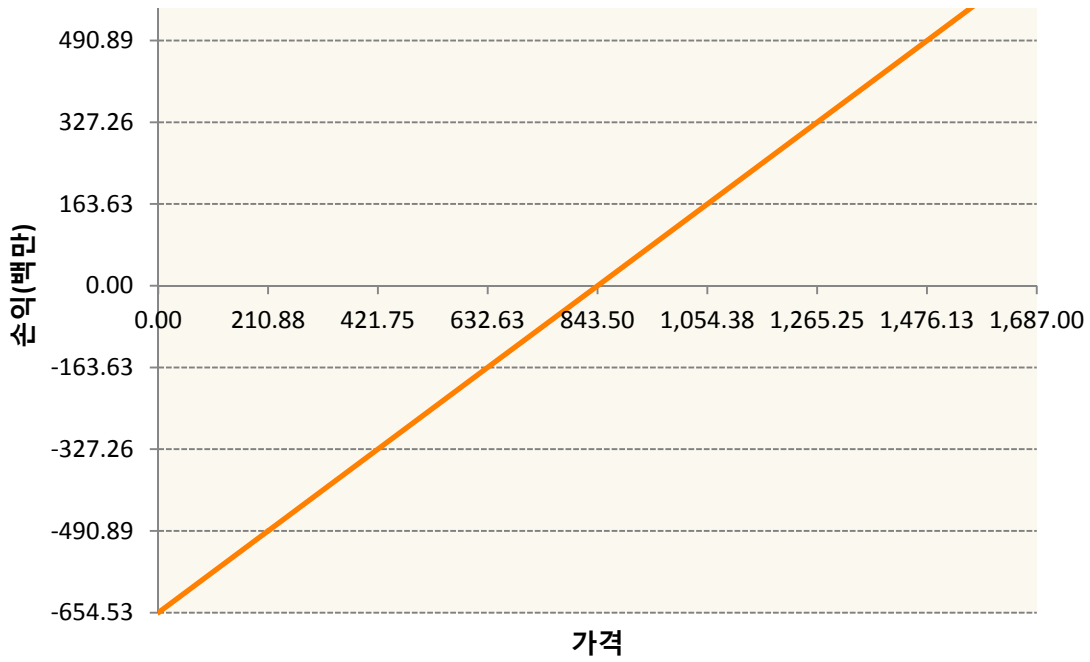


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



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