

공시일	2018-09-06
기준일	2018-09-05

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	2018-09-06
기준일	2018-09-05

스마트인덱스모

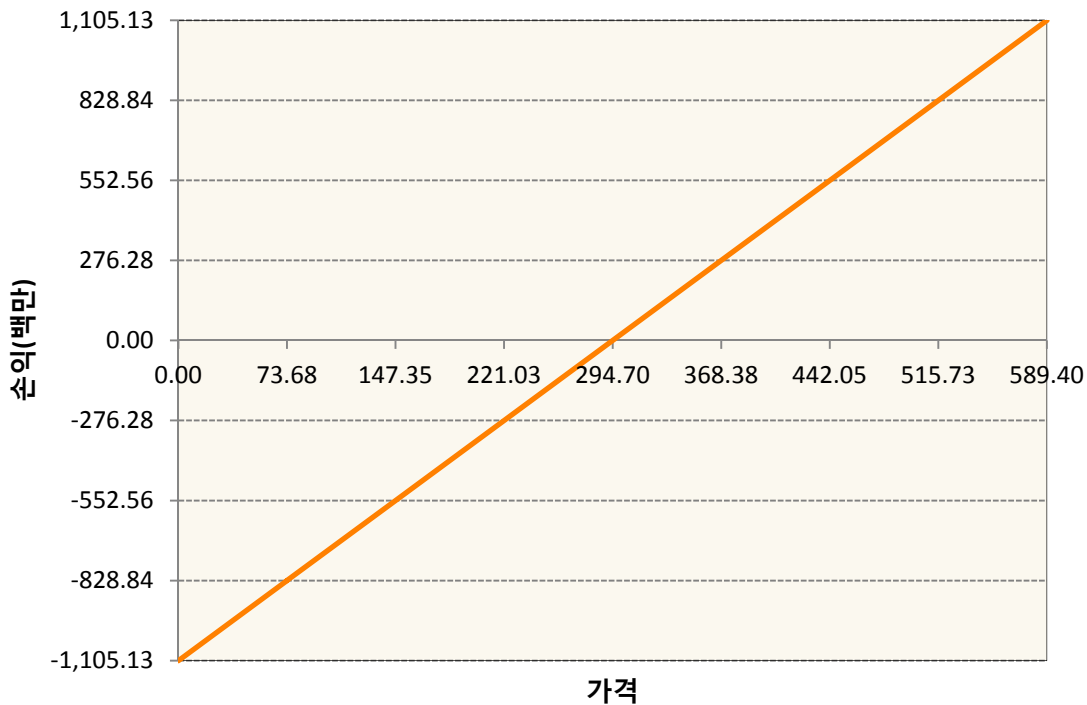
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,105	0	1,105	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물

88

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-5.33%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
-2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	29	29	29	29	29	29	29
5.33%	59	59	59	59	59	59	59
8.00%	88	88	88	88	88	88	88

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

(단위:백만원)

67

공시일	2018-09-06
기준일	2018-09-05

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

1,147

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

491

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-06
기준일	2018-09-05

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

298

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

375

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-06
기준일	2018-09-05

유로인덱스모(주식-파생형)

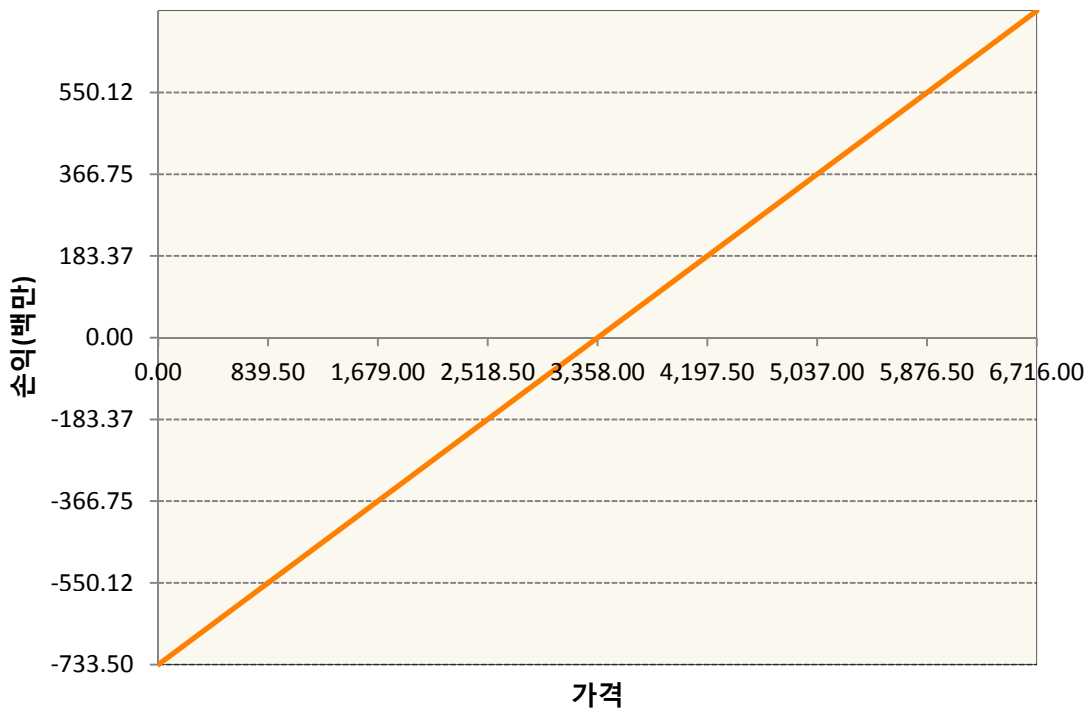
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	733	0	733	

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	2018-09-06
기준일	2018-09-05

차이나인덱스모(주식-파생형)

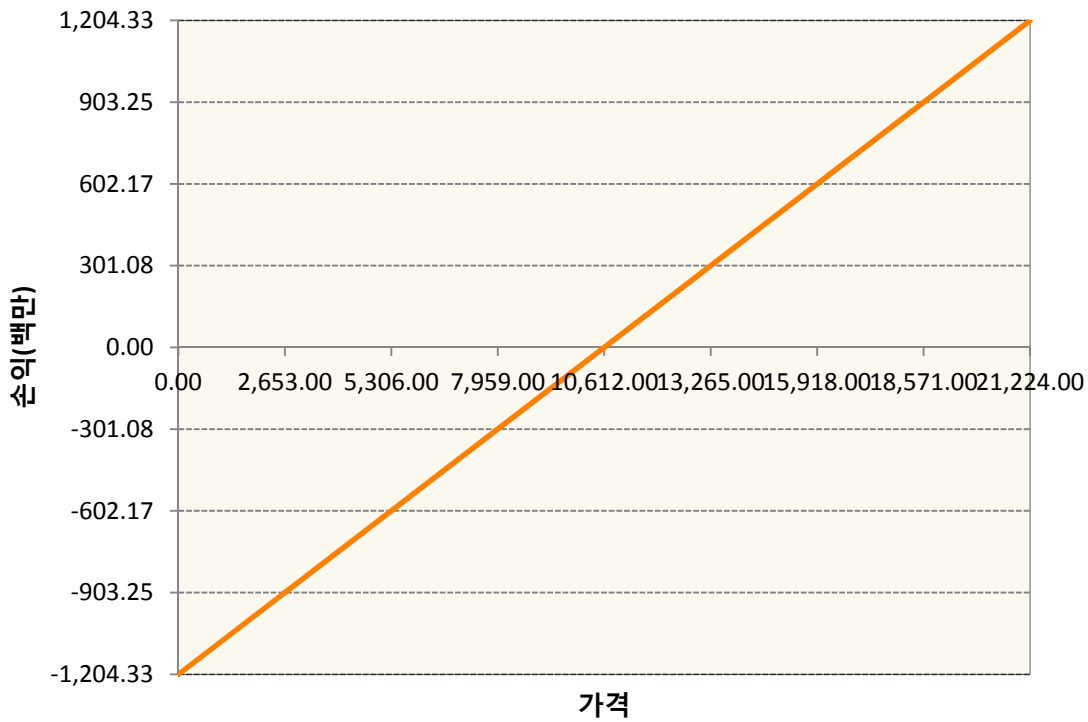
1. 계약금액

(단위:백만원)

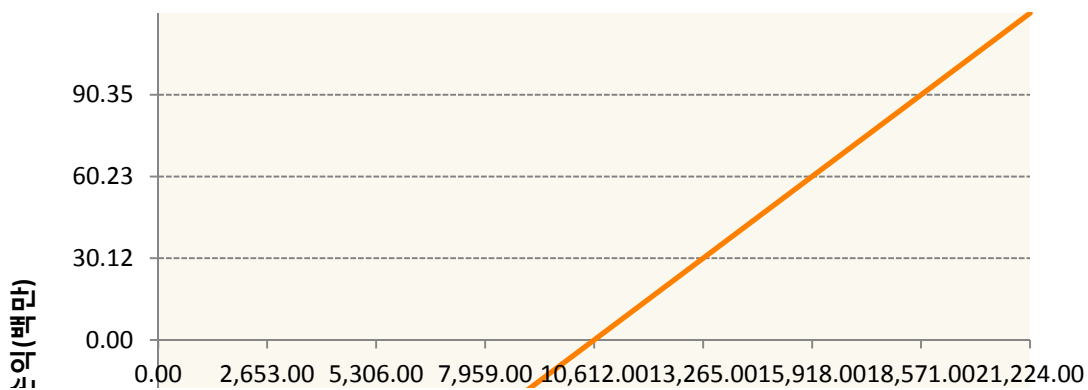
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	120	0	120	
누계	유가증권	선물	1,204	0	1,204	장내

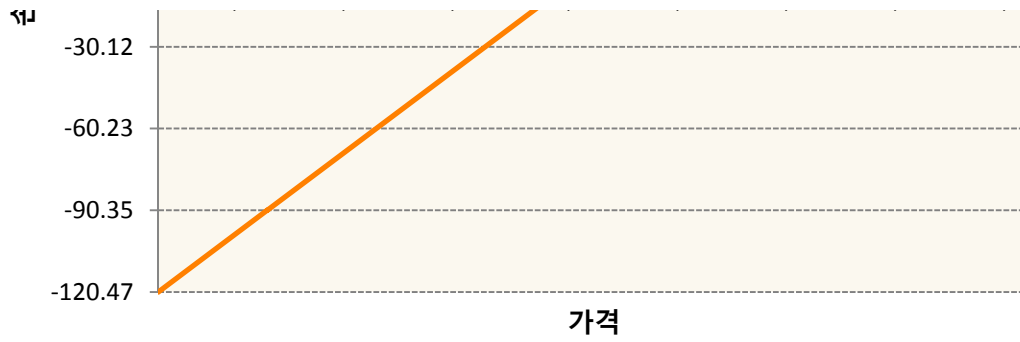
2. 만기시점의 손익구조

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	96
MHCU8	MINI H-SHR IDX Fut Sep18	10

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

97

공시일	2018-09-06
기준일	2018-09-05

커버드콜모(주식혼합-파생형)

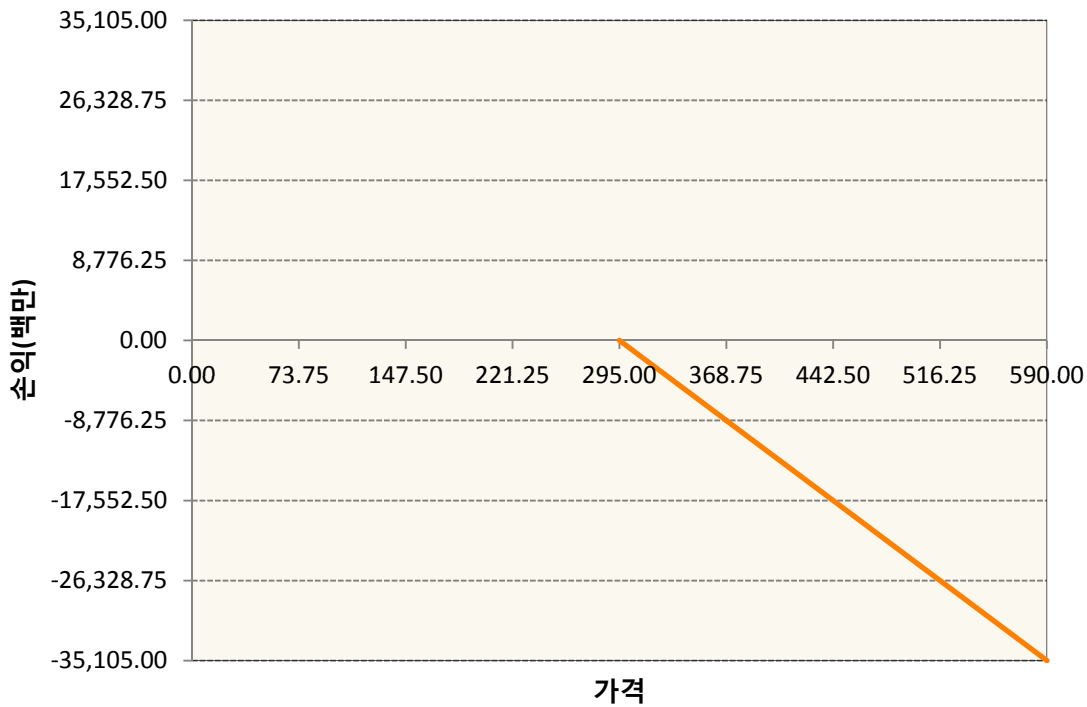
1. 계약금액

(단위:백만원)

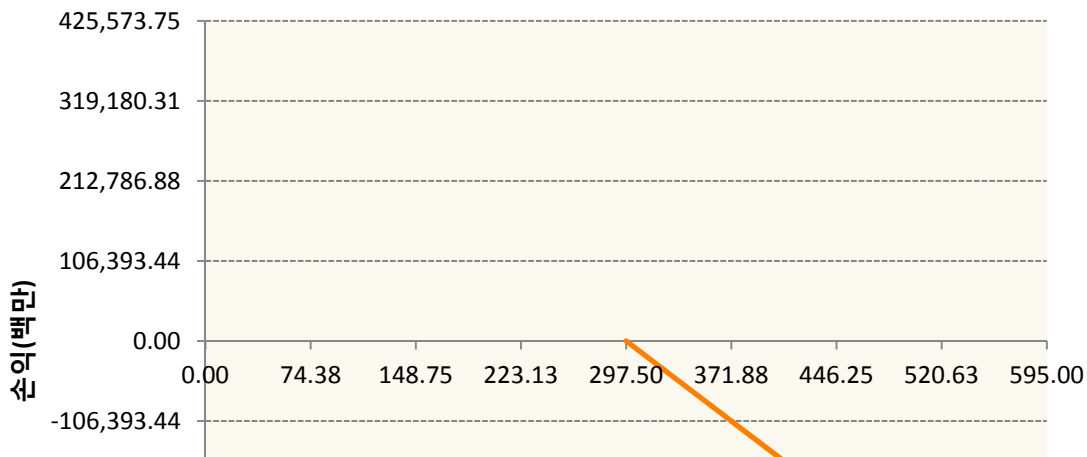
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	758,179	-758,179	장내

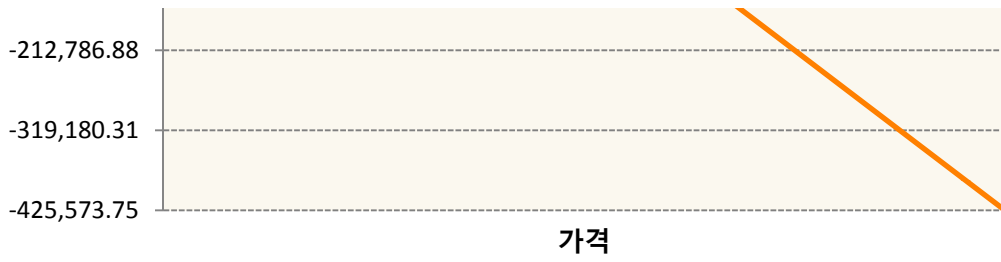
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92950-2018-09 콜295

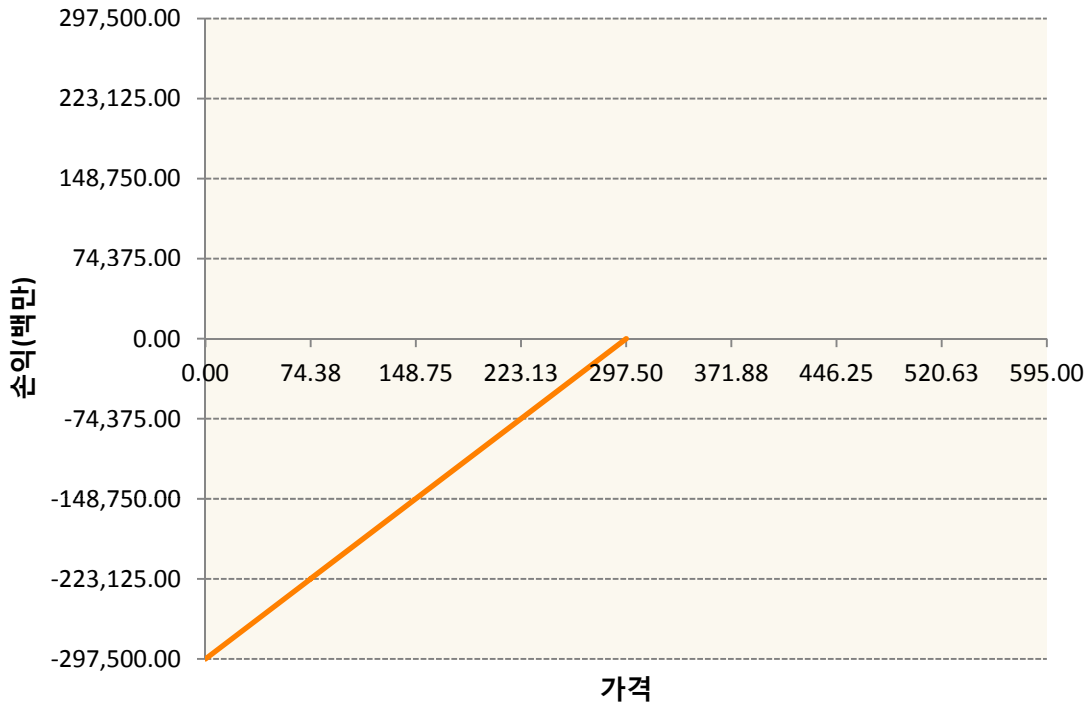


KR4201N92976-2018-09 콜297.5





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N929 2018-09 콜295

2,291

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	557	556	553	549	543	535	525
-5.33%	545	534	521	505	485	464	440
-2.67%	454	423	388	352	315	276	237
0%	141	94	47	0	-47	-94	-141
2.67%	-484	-518	-554	-591	-631	-671	-712
5.33%	-1,324	-1,337	-1,353	-1,373	-1,395	-1,420	-1,447
8.00%	-2,243	-2,245	-2,250	-2,256	-2,265	-2,277	-2,291

KR4201N929 2018-09 풋297.5

25,846

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,106	5,098	5,080	5,049	5,000	4,932	4,842

-5.33%	5,031	4,956	4,848	4,707	4,533	4,328	4,094
-2.67%	4,381	4,084	3,752	3,389	3,001	2,593	2,167
0%	1,645	1,100	551	0	-553	-1,109	-1,665
2.67%	-4,699	-5,190	-5,695	-6,210	-6,734	-7,265	-7,801
5.33%	-14,158	-14,387	-14,658	-14,966	-15,306	-15,672	-16,062
8.00%	-25,016	-25,074	-25,163	-25,285	-25,440	-25,628	-25,846

KR4301N929 2018-09 풋 297.5

22,471

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,471	-22,471	-22,471	-22,471	-22,471	-22,471	-22,471
-5.33%	-14,609	-14,609	-14,609	-14,609	-14,610	-14,611	-14,614
-2.67%	-6,752	-6,761	-6,776	-6,798	-6,829	-6,868	-6,916
0%	465	315	159	0	-162	-327	-494
2.67%	3,487	3,401	3,302	3,192	3,073	2,947	2,815
5.33%	3,678	3,676	3,671	3,663	3,649	3,629	3,601
8.00%	3,679	3,679	3,679	3,679	3,679	3,678	3,676

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

(단위:백만원)

60,053

공시일	2018-09-06
기준일	2018-09-05

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

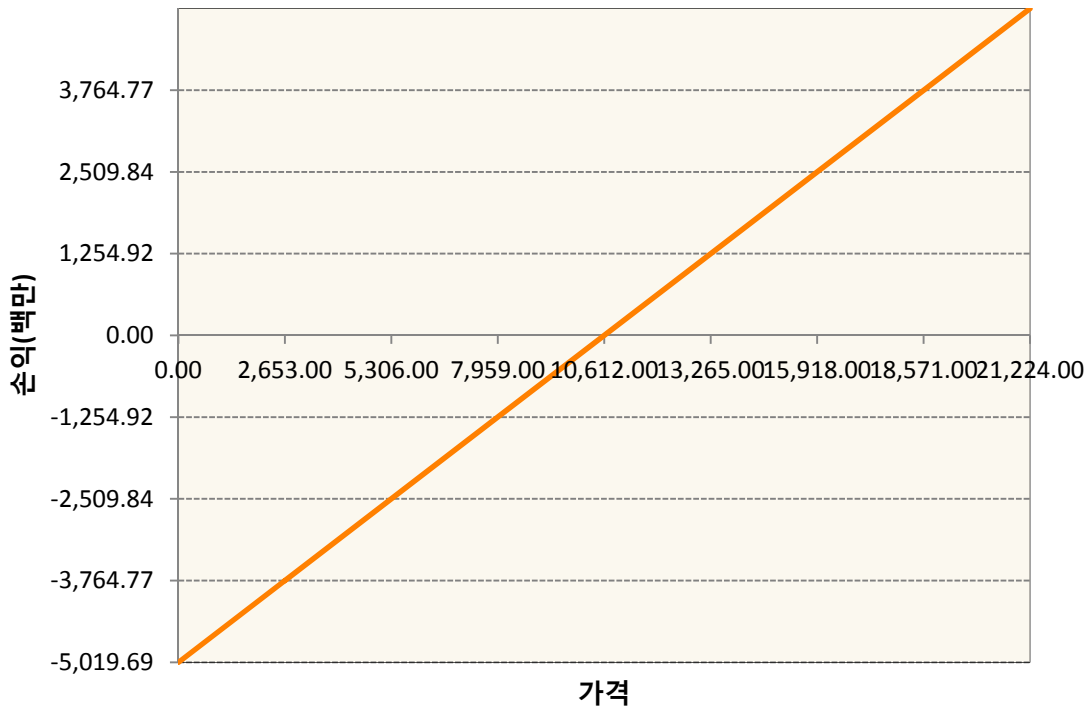
1. 계약금액

(단위:백만원)

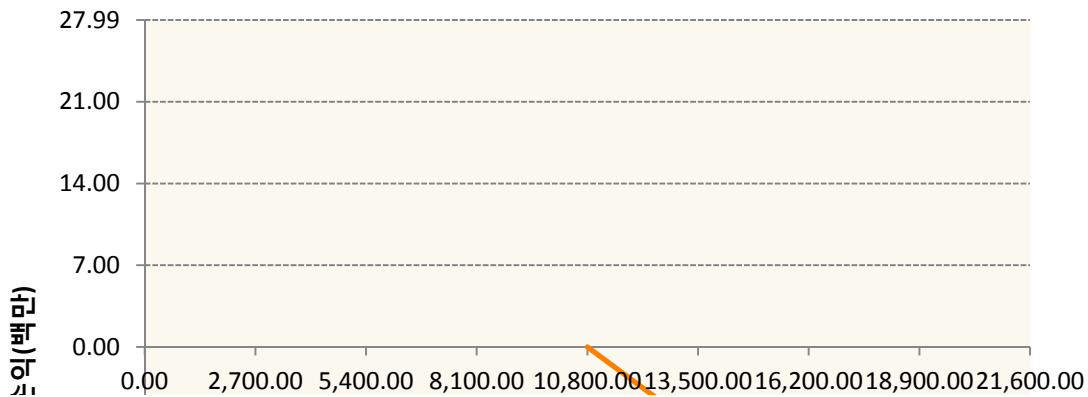
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,020	0	5,020	장내
누계	유가증권	옵션	0	226	-226	장내

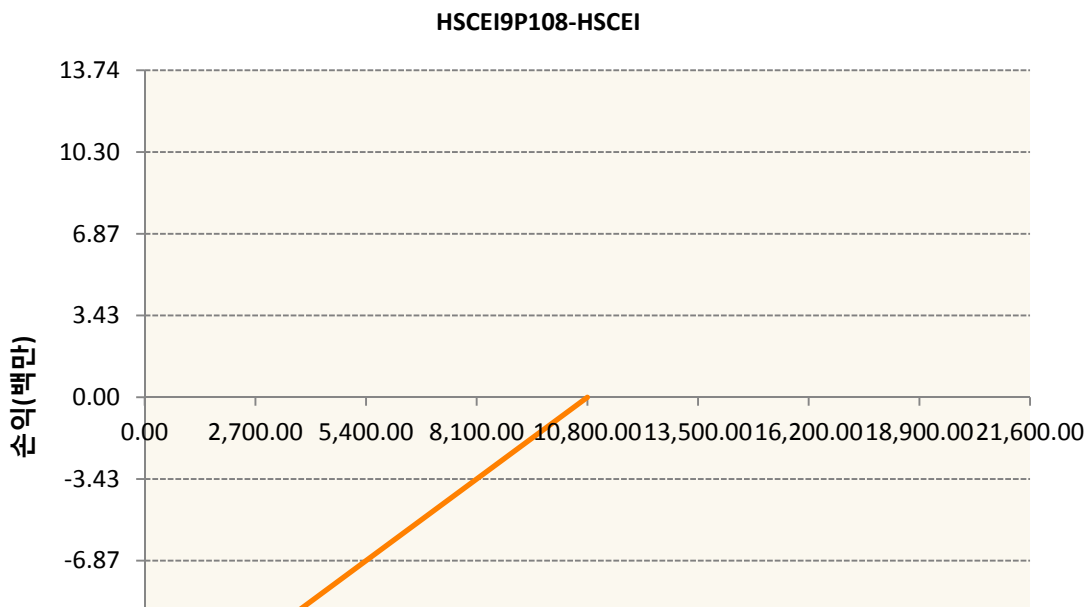
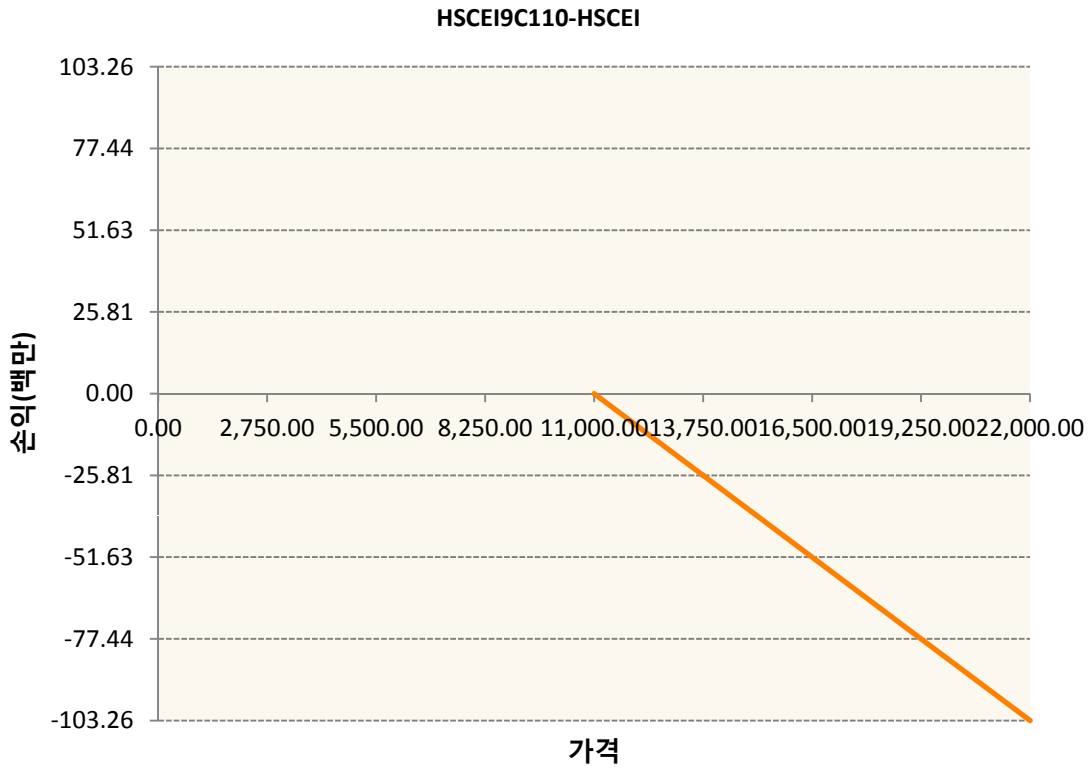
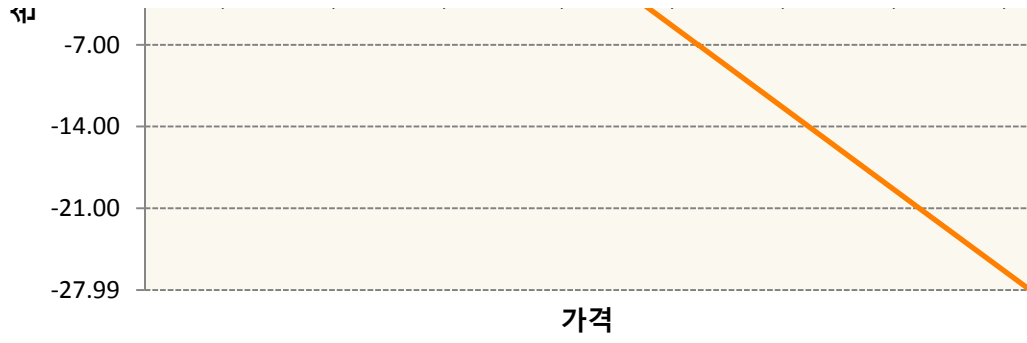
2. 만기시점의 손익구조

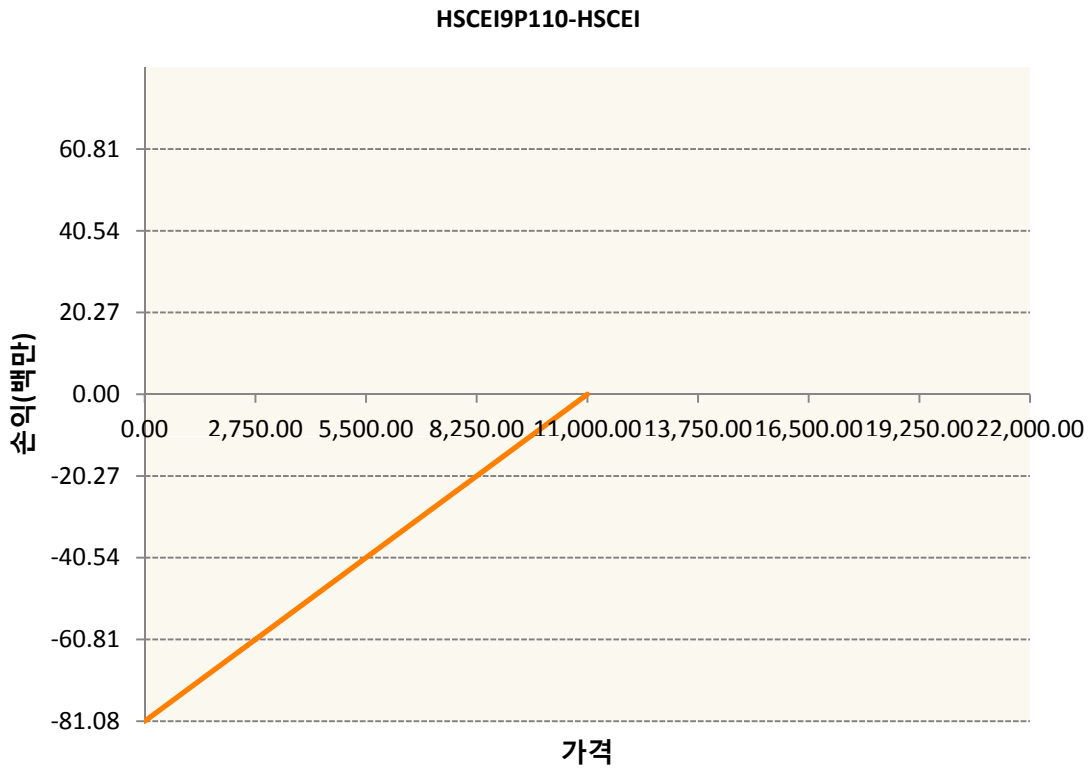
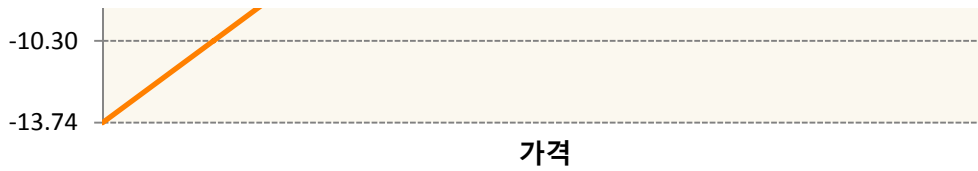
HCU8-H-SHARES IDX FUT Sep18



HSCEI9C108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU8	H-SHARES IDX FUT Sep18	402
HSCEI9C108	HSCEI	2
HSCEI9C110	HSCEI	8
HSCEI9P108	HSCEI	1
HSCEI9P110	HSCEI	6

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	383

공시일	2018-09-06
기준일	2018-09-05

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

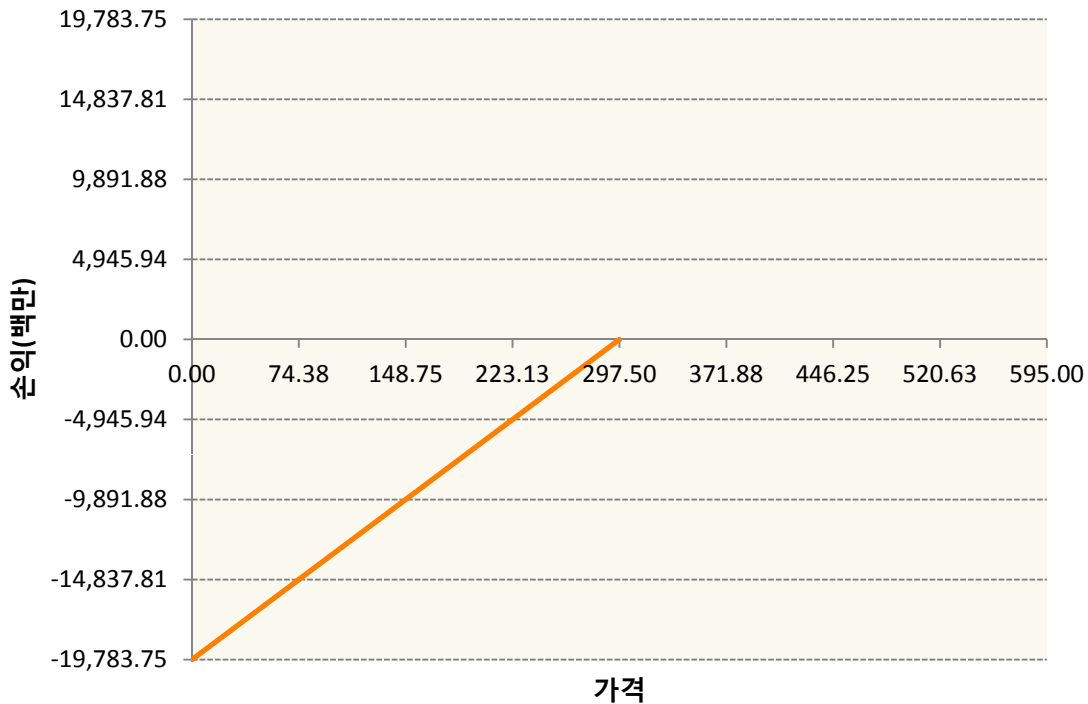


KR4301N92958-2018-09 풋295





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_14 3,972

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,972	-3,972	-3,972	-3,972	-3,972	-3,972	-3,972
-5.33%	-2,648	-2,648	-2,648	-2,648	-2,648	-2,648	-2,648
-2.67%	-1,324	-1,324	-1,324	-1,324	-1,324	-1,324	-1,324
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,324	1,324	1,324	1,324	1,324	1,324	1,324
5.33%	2,648	2,648	2,648	2,648	2,648	2,648	2,648
8.00%	3,972	3,972	3,972	3,972	3,972	3,972	3,972

KR4201N92974-2018-09 풋297.5 1,707

기초자산의 변동성	
-----------	--

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	337	337	336	334	330	326	320
-5.33%	332	327	320	311	299	286	270
-2.67%	289	270	248	224	198	171	143
0%	109	73	36	0	-37	-73	-110
2.67%	-310	-343	-376	-410	-445	-480	-515
5.33%	-935	-950	-968	-989	-1,011	-1,035	-1,061
8.00%	-1,653	-1,656	-1,662	-1,670	-1,681	-1,693	-1,707

KR4301N929 2018-09 풋295

129

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-129	-129	-129	-129	-129	-129	-129
-5.33%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-2.67%	-35	-35	-35	-35	-36	-36	-37
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	13	13	12	12	12	11	11
5.33%	13	13	13	13	13	13	13
8.00%	13	13	13	13	13	13	13

KR4301N929 2018-09 풋297.5

1,494

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,494	-1,494	-1,494	-1,494	-1,494	-1,494	-1,494
-5.33%	-971	-971	-971	-971	-972	-972	-972
-2.67%	-449	-450	-451	-452	-454	-457	-460
0%	31	21	11	0	-11	-22	-33
2.67%	232	226	220	212	204	196	187
5.33%	245	244	244	244	243	241	239
8.00%	245	245	245	245	245	245	244

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

(단위:백만원)

7,964

공시일	2018-09-06
기준일	2018-09-05

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

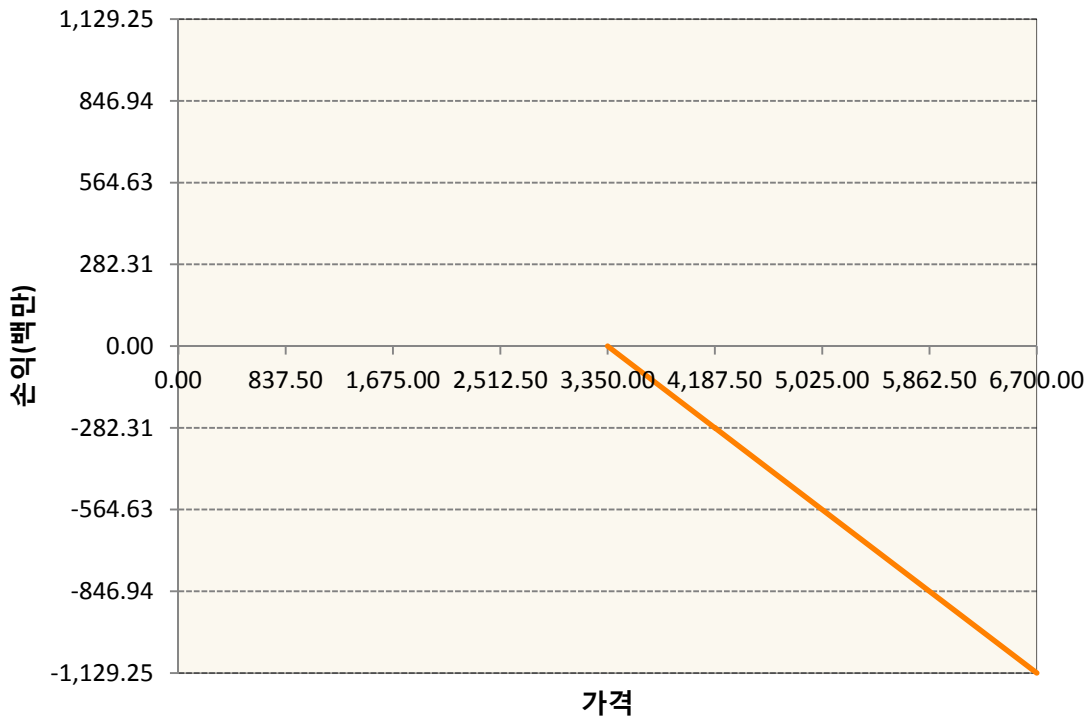
1. 계약금액

(단위:백만원)

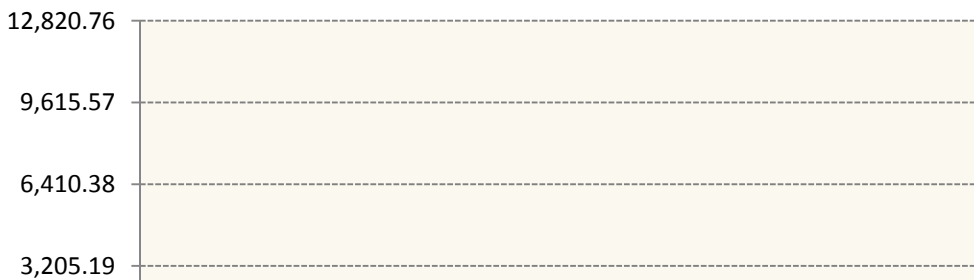
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,931	0	6,931	
누계	유가증권	옵션	0	27,900	-27,900	장내
누계	지수	스왑	86,872	0	86,872	장외

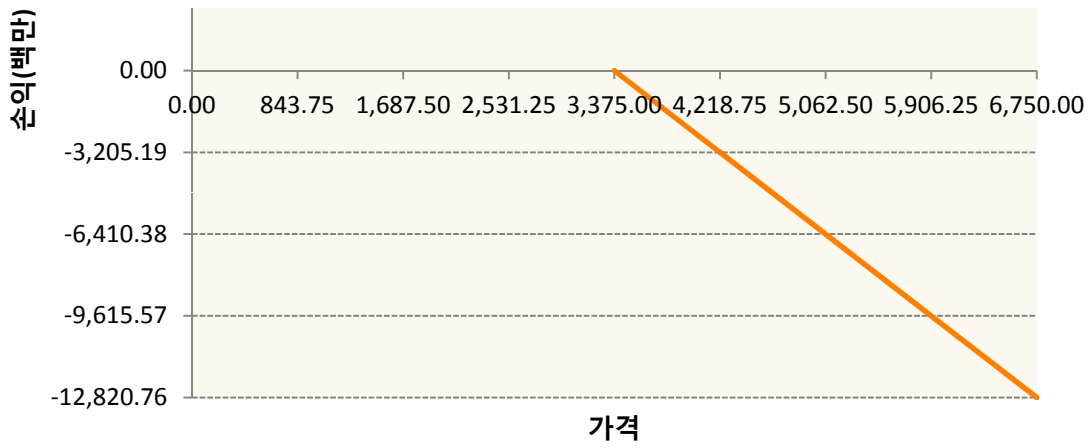
2. 만기시점의 손익구조

OESXU8-C3350-EURO STOXX 50

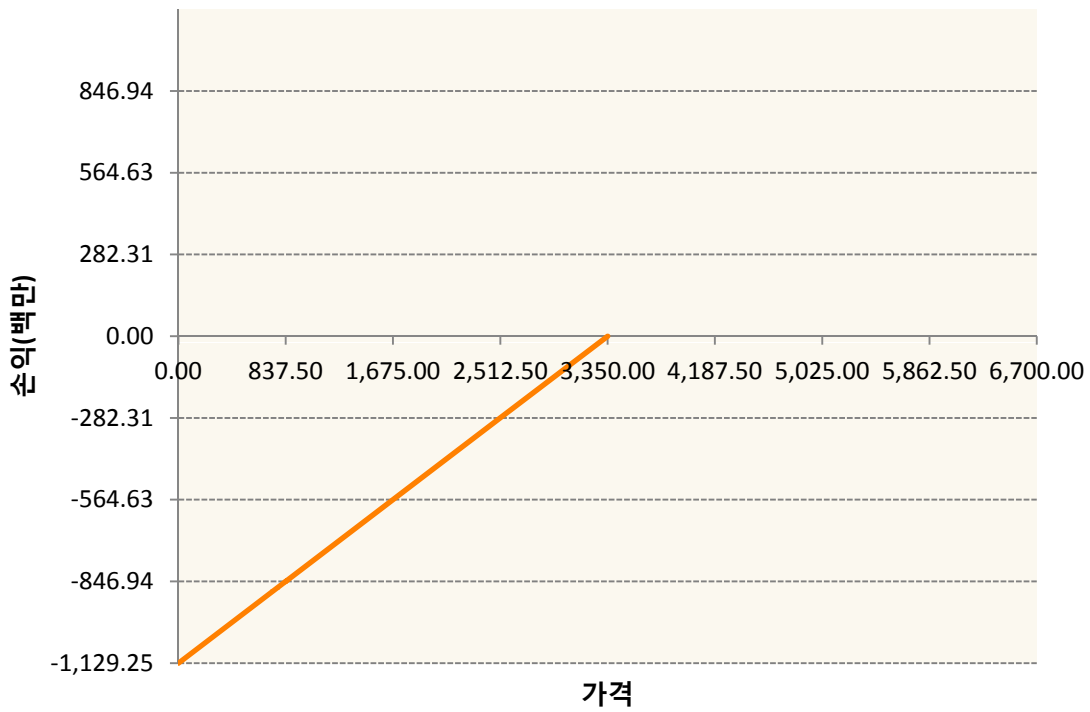


OESXU8-C3375-EURO STOXX 50

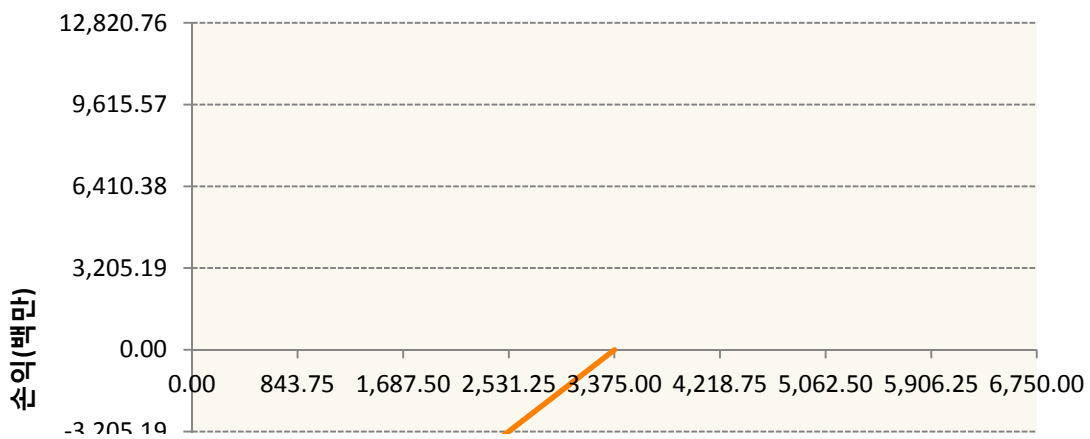


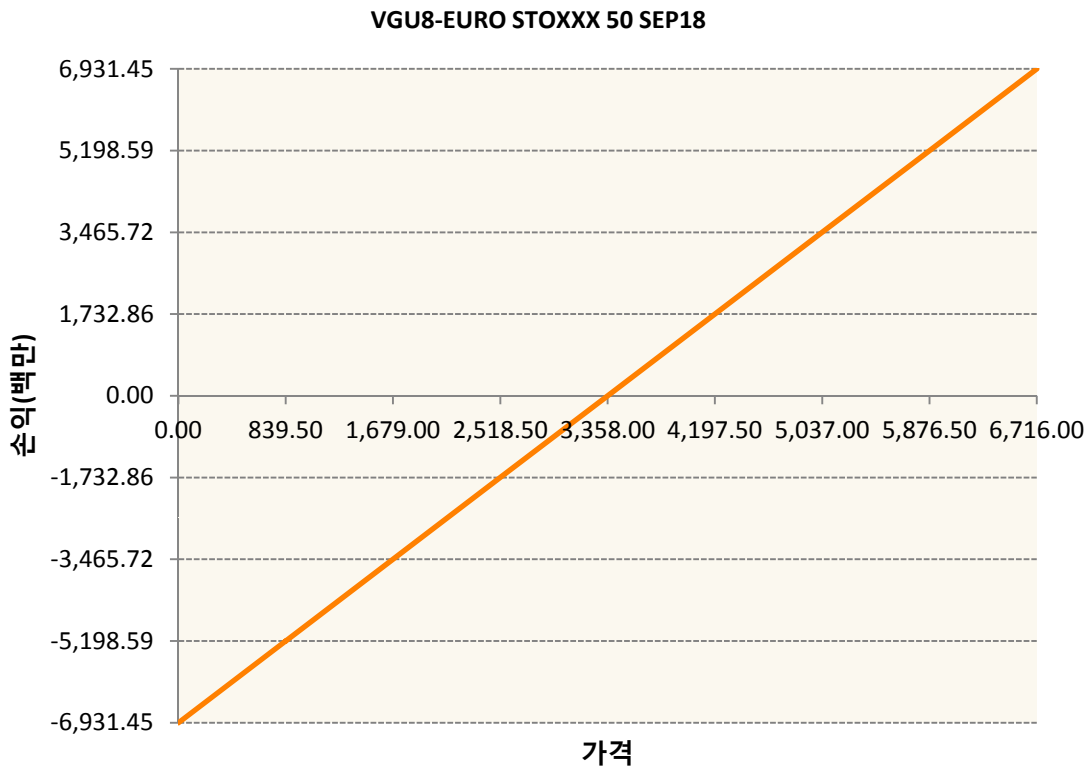


OESXU8-P3350-EURO STOXX 50



OESXU8-P3375-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	24
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY	15
OESXU8-C33 EURO STOXX 50	90
OESXU8-C33 EURO STOXX 50	1,026
OESXU8-P33 EURO STOXX 50	90
OESXU8-P33 EURO STOXX 50	1,026
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18	555

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

1,775

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)

165

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-09-06
기준일	2018-09-05

리디파인K200(주식혼합-파생재간

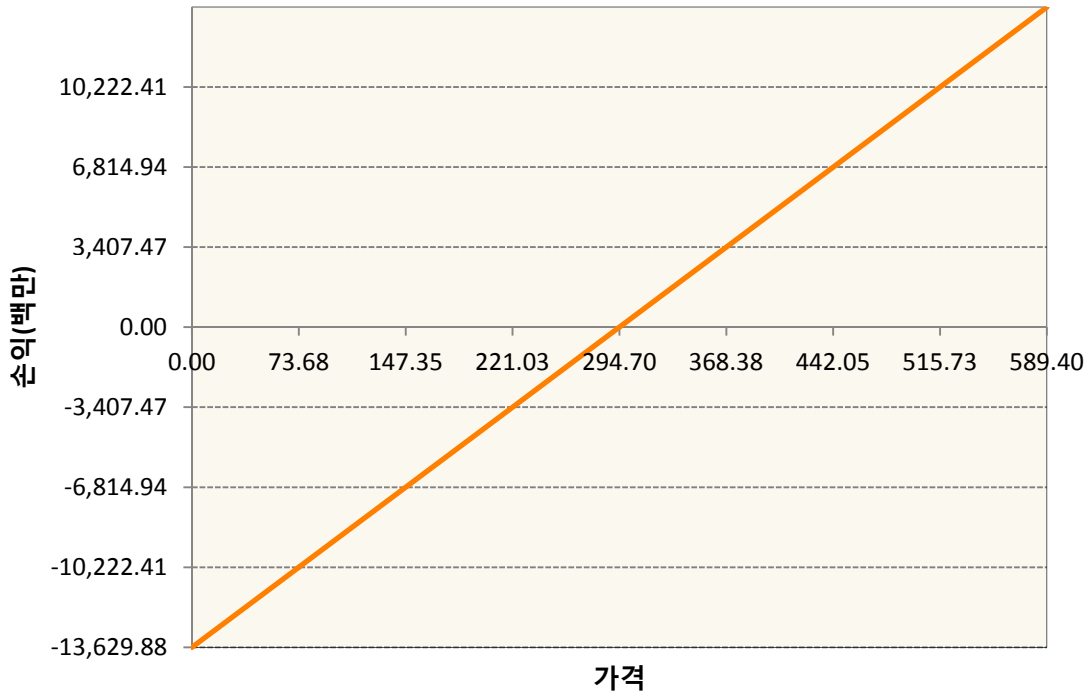
1. 계약금액

(단위:백만원)

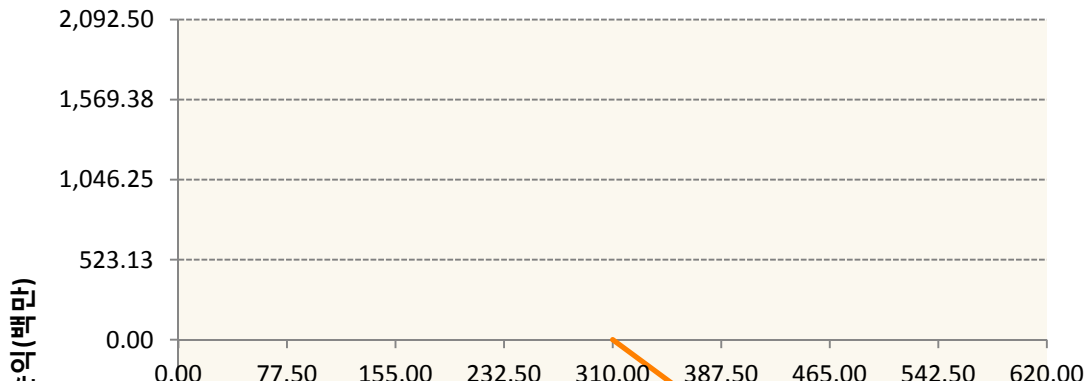
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,630	0	13,630	장내
누계	유가증권	옵션	1,339	24,671	-23,332	장내

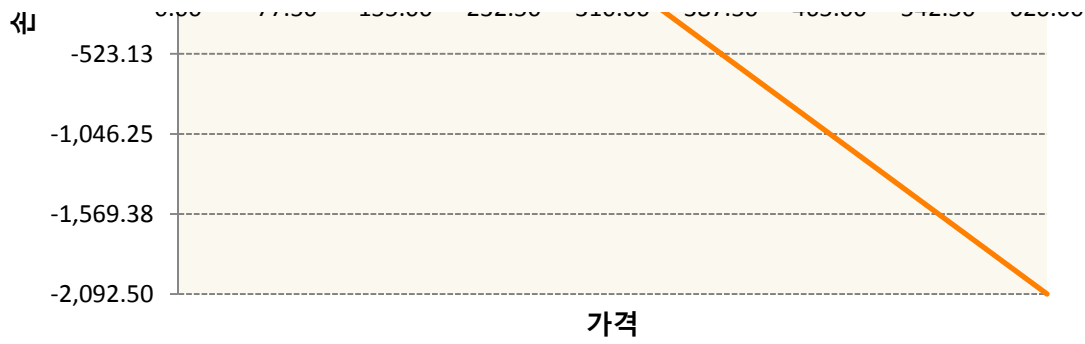
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

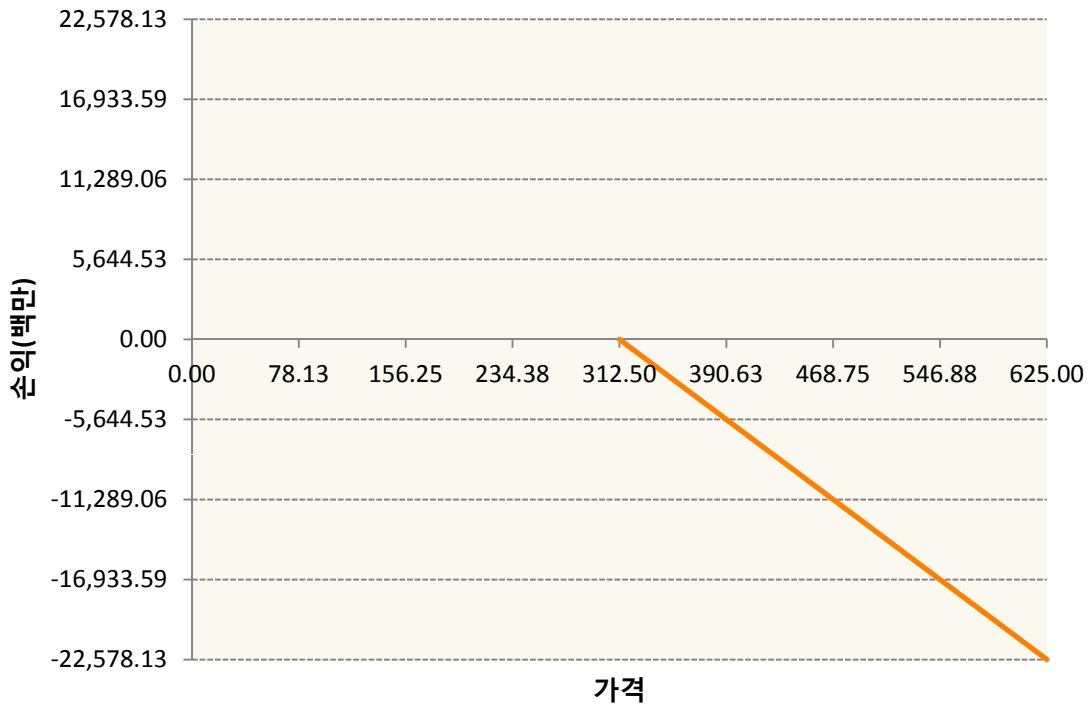


KR4201N93107-2018-09 콜310

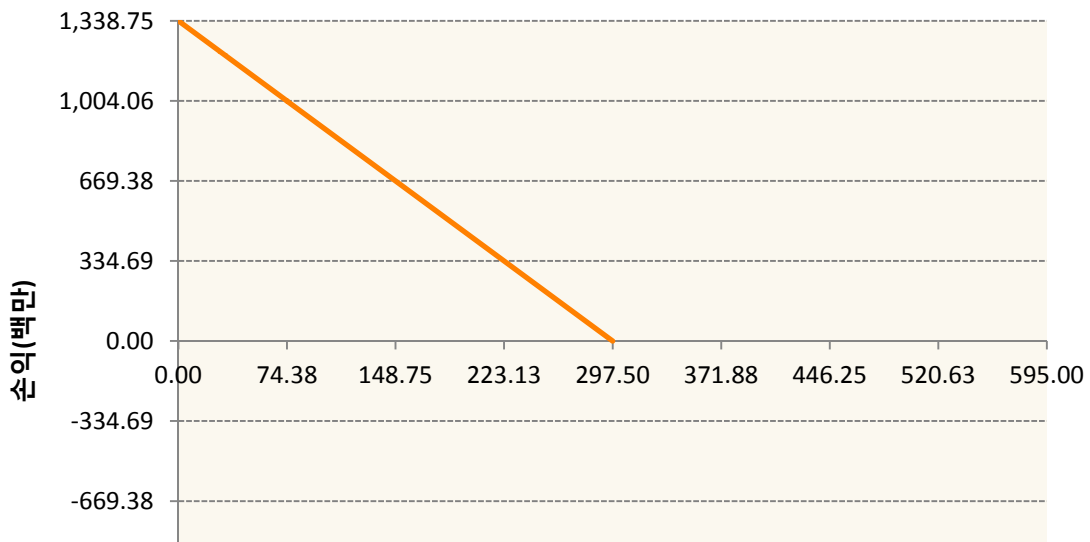


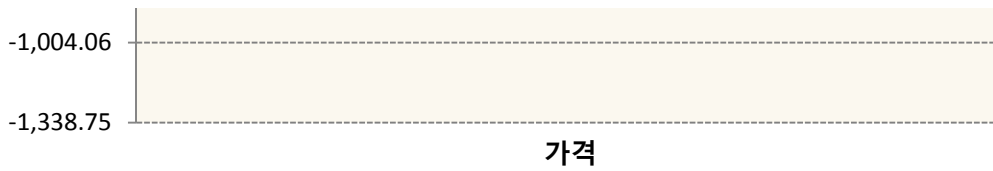


KR4201N93123-2018-09 콜312.5



KR4301N92974-2018-09 풋297.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물								1,091
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,091	-1,091	-1,091	-1,091	-1,091	-1,091	-1,091	-1,091
-5.33%	-728	-728	-728	-728	-728	-728	-728	-728
-2.67%	-364	-364	-364	-364	-364	-364	-364	-364
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	364	364	364	364	364	364	364	364
5.33%	728	728	728	728	728	728	728	728
8.00%	1,091	1,091	1,091	1,091	1,091	1,091	1,091	1,091
KR4201N931 2018-09 콜310								73
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4	4	4	4	4	4	4	4
-5.33%	4	4	4	4	4	4	4	4
-2.67%	4	4	4	3	3	2	1	
0%	3	2	1	0	-1	-3	-4	
2.67%	-4	-6	-8	-10	-12	-15	-17	
5.33%	-23	-26	-29	-32	-34	-37	-40	
8.00%	-60	-62	-64	-66	-68	-71	-73	
KR4201N931 2018-09 콜312.5								677
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	30	30	30	29	29	29	29	
-5.33%	30	29	29	29	28	27	25	
-2.67%	29	28	27	24	20	15	9	
0%	23	17	9	0	-11	-24	-39	
2.67%	-21	-40	-59	-81	-103	-126	-150	
5.33%	-180	-209	-239	-269	-298	-328	-358	
8.00%	-515	-541	-567	-594	-621	-649	-677	
KR4301N92C 2018-09 풋297.5								101
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	101	101	101	101	101	101	101	
-5.33%	66	66	66	66	66	66	66	
-2.67%	30	30	30	31	31	31	31	

0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-16	-15	-15	-14	-14	-13	-13
5.33%	-17	-17	-17	-16	-16	-16	-16
8.00%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17

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

(단위:백만원)

1,362

공시일	2018-09-06
기준일	2018-09-05

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

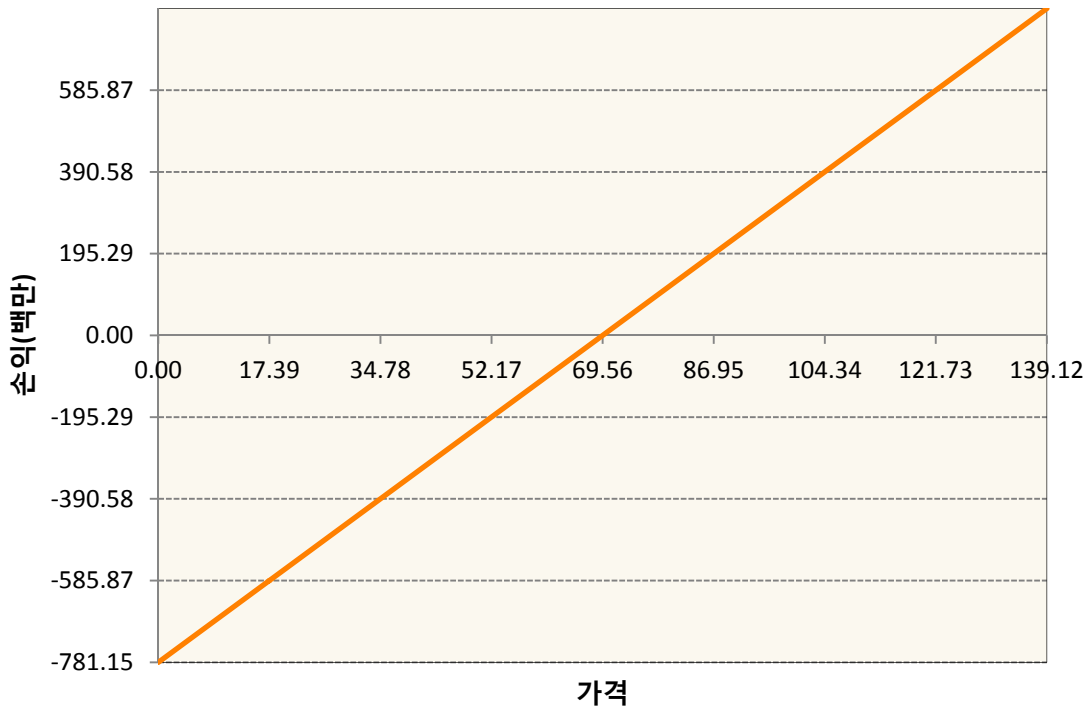
1. 계약금액

(단위:백만원)

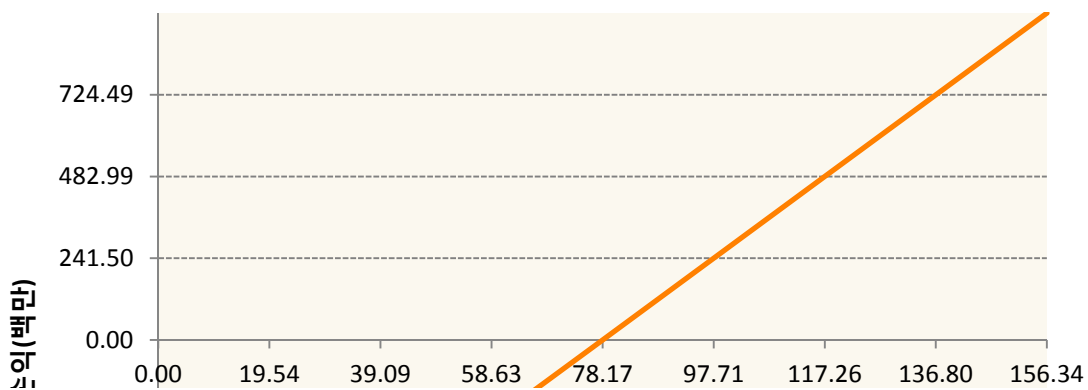
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,171	616	2,555	
누계	유가증권	선물	532	0	532	장내

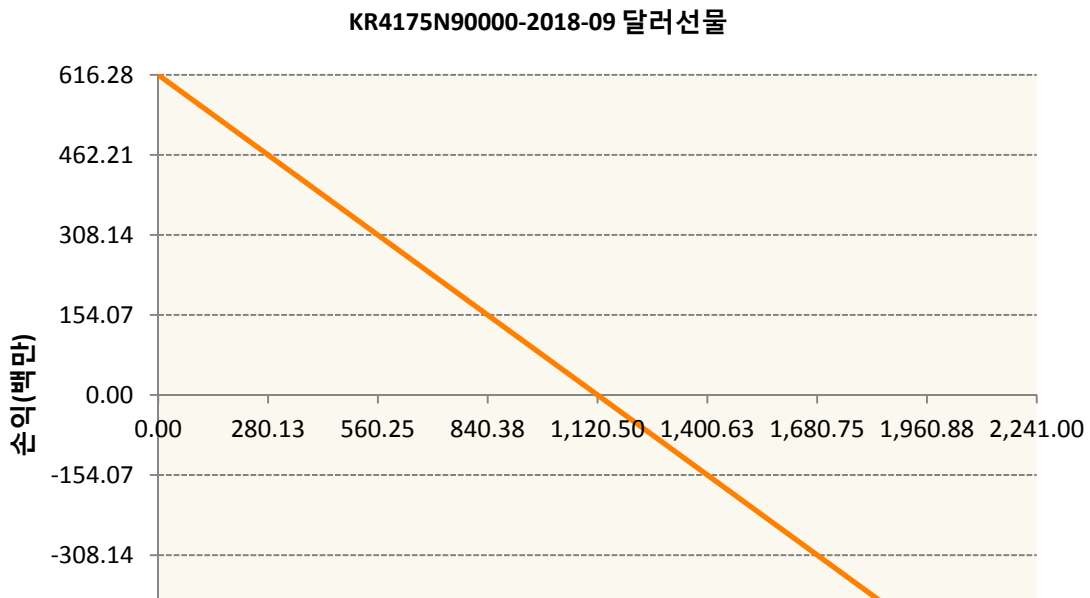
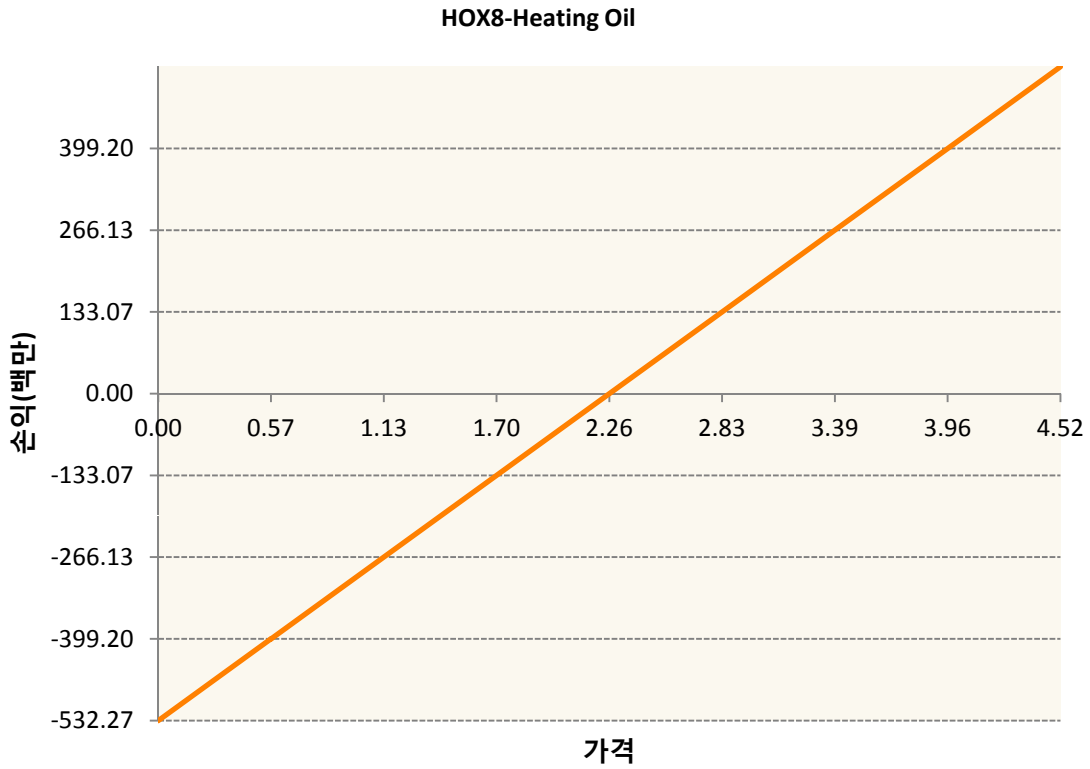
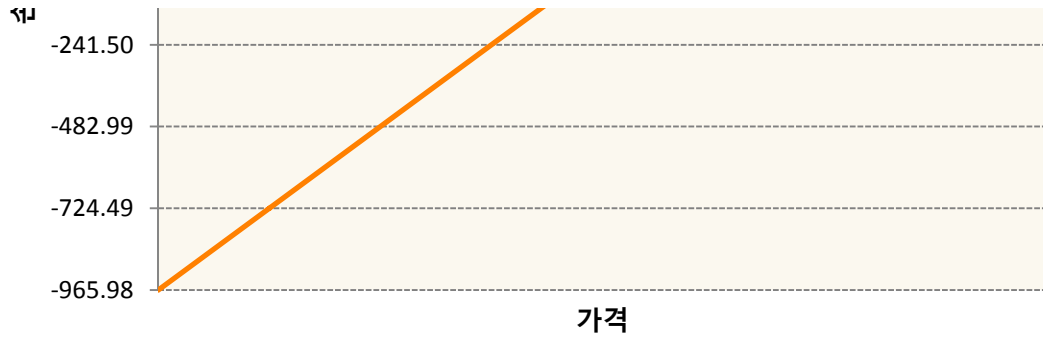
2. 만기시점의 손익구조

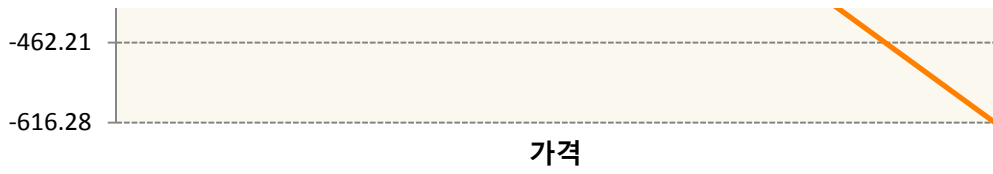
CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18



COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18

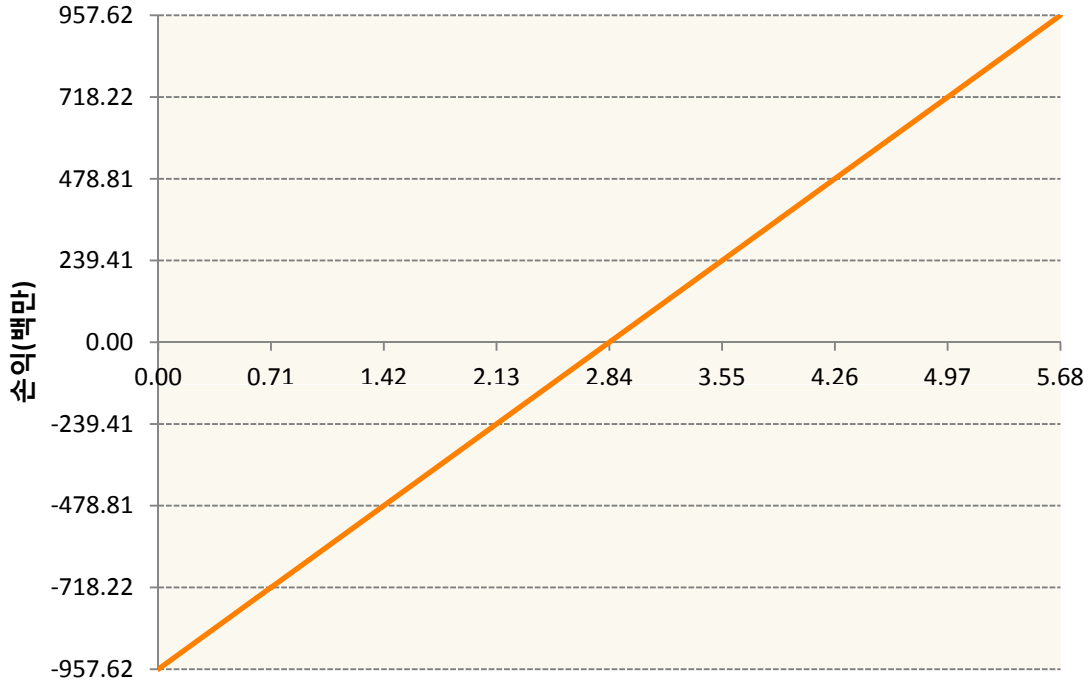






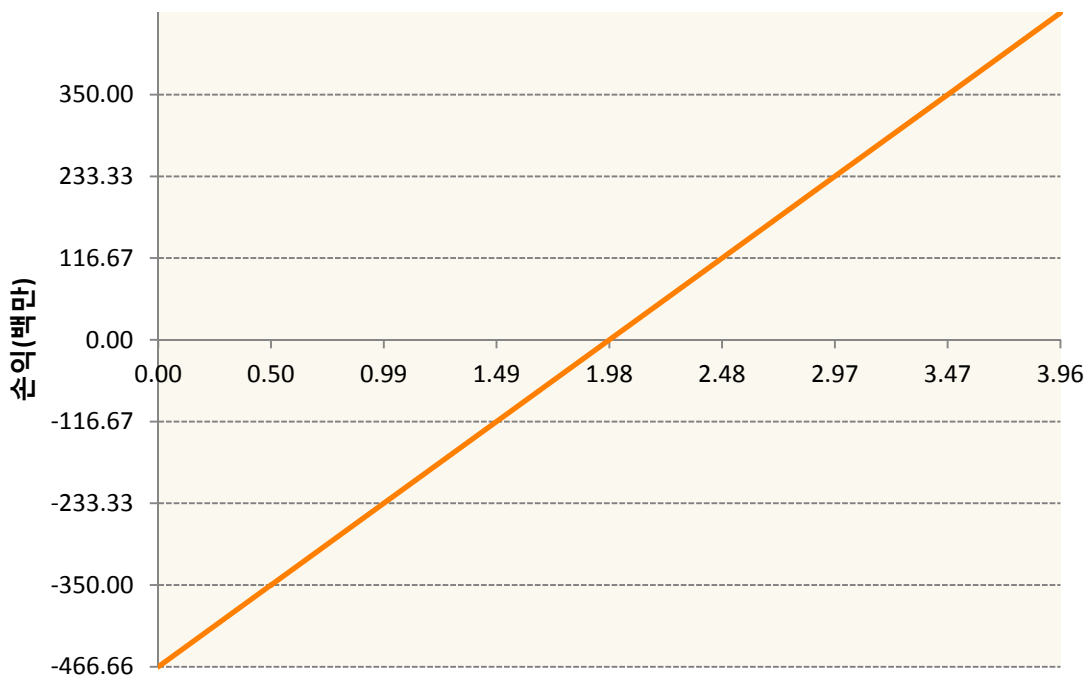
가격

NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18



가격

XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	62
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	77
HOX8	Heating Oil	43
	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)
	444

공시일	2018-09-06
기준일	2018-09-05

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

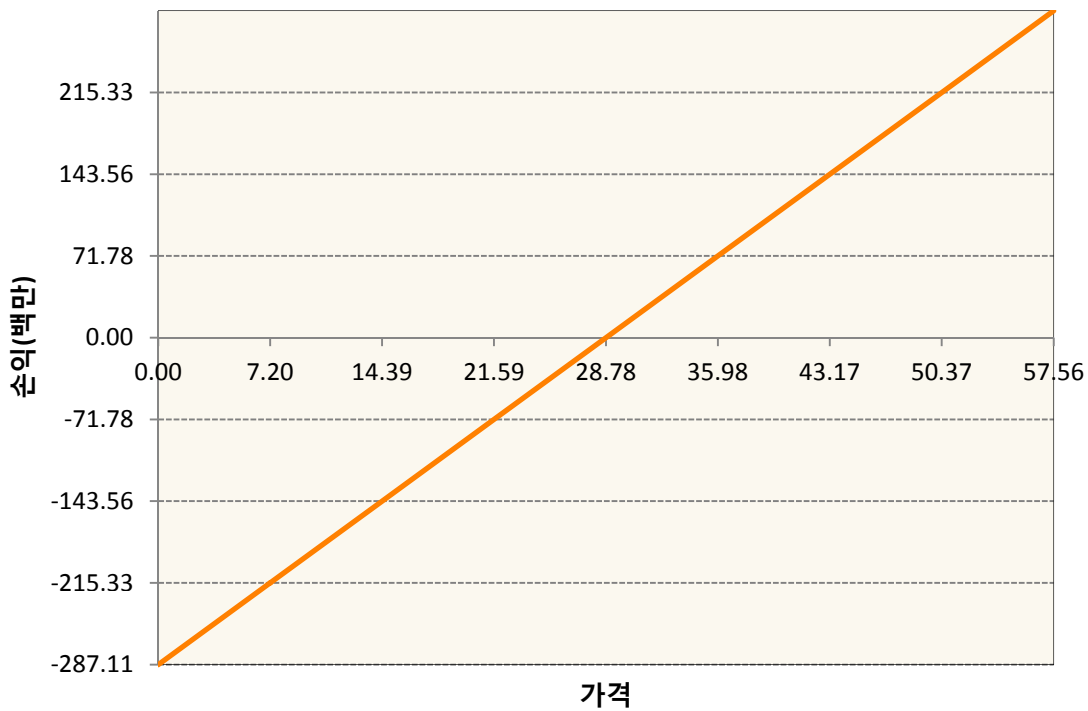
1. 계약금액

(단위:백만원)

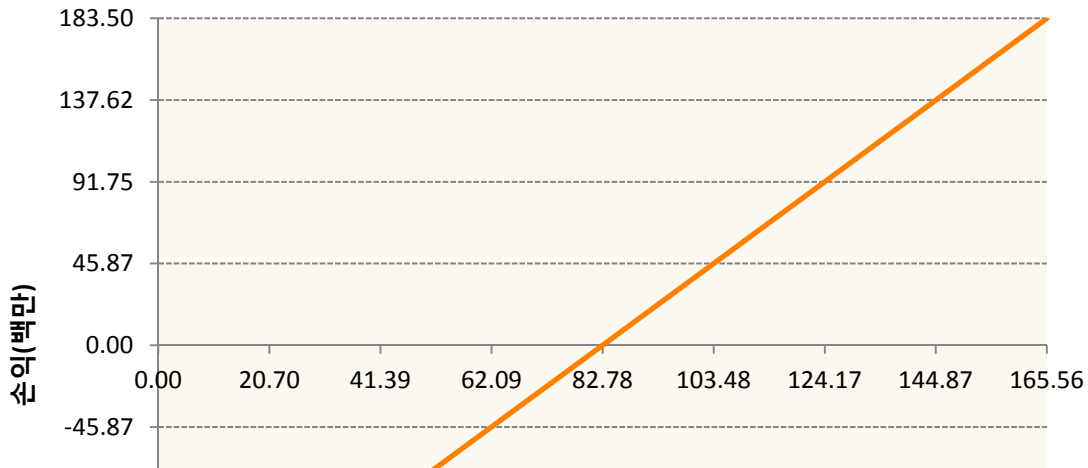
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,619	78	3,540	

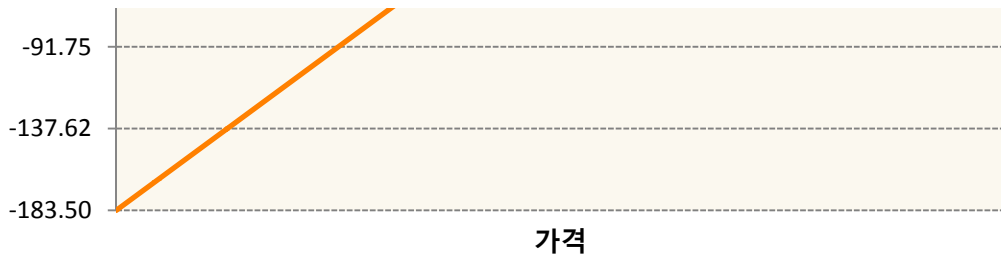
2. 만기시점의 손익구조

BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18

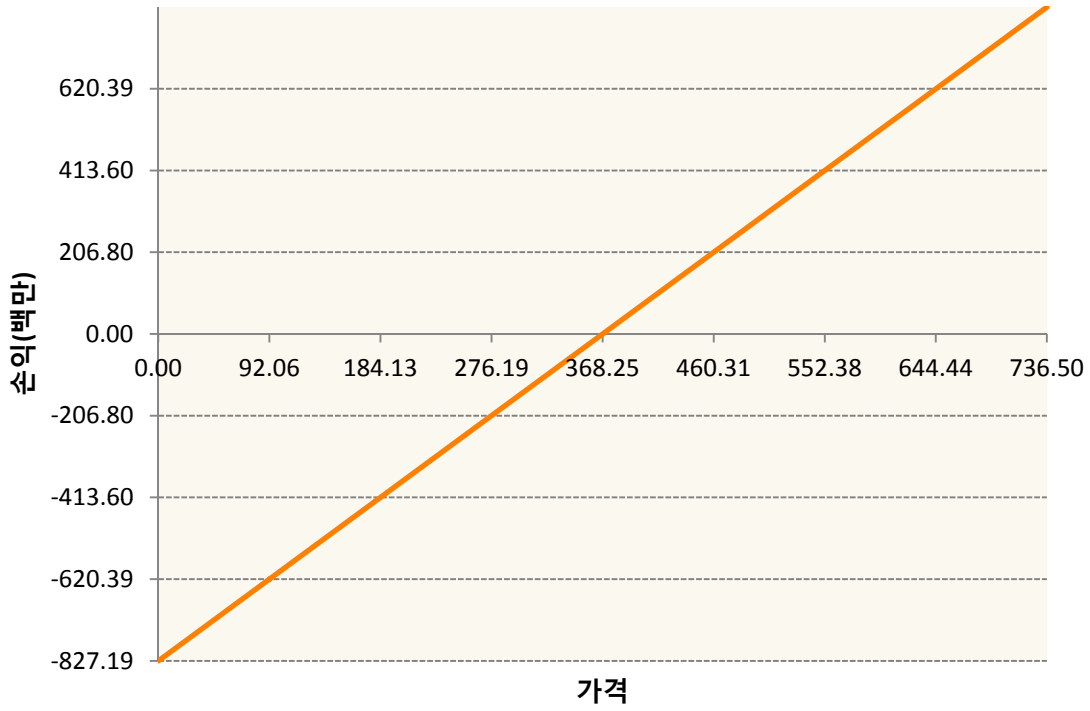


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

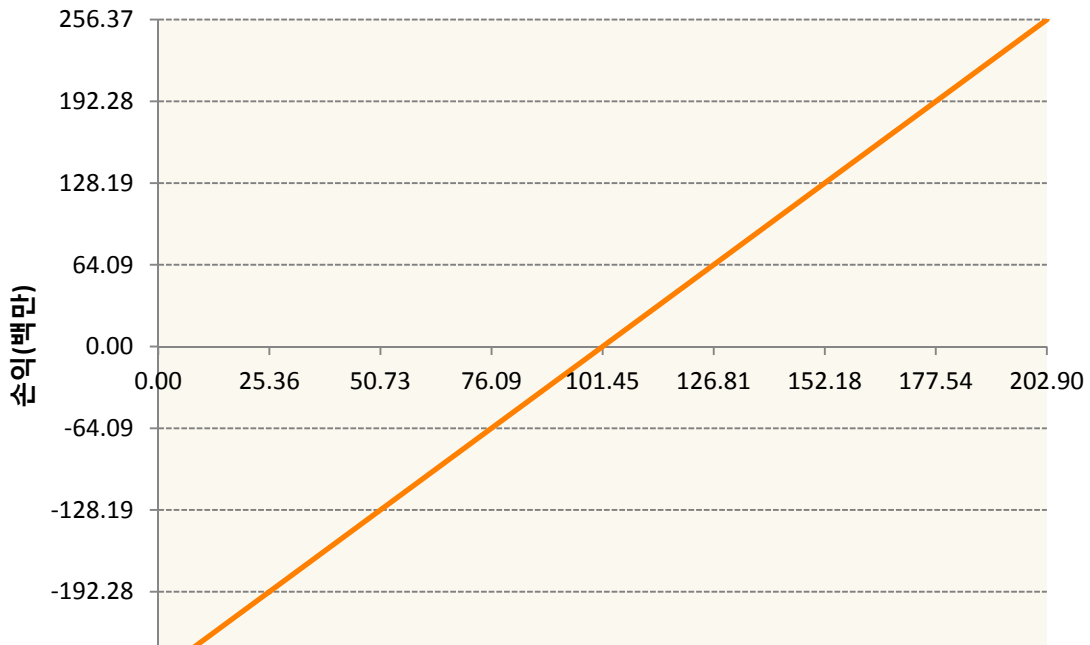


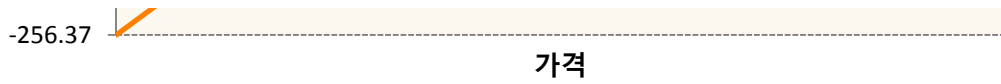


CZ8-CORN FUTURE DEC18

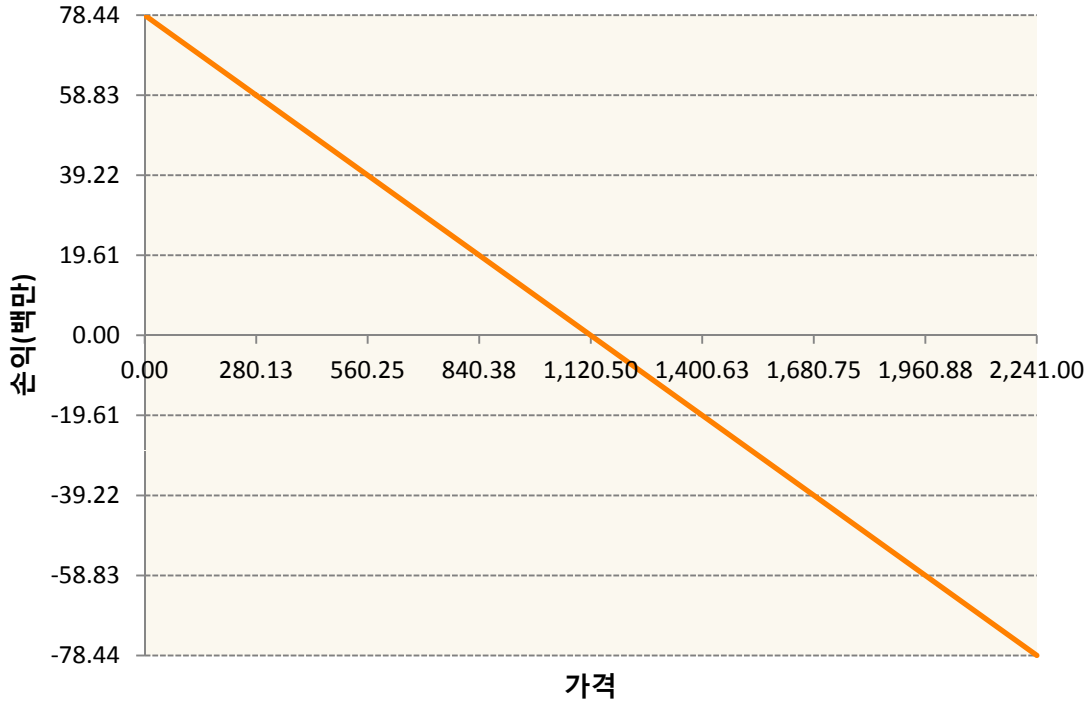


KCZ8-COFFEE 'C' FUTURE Dec18

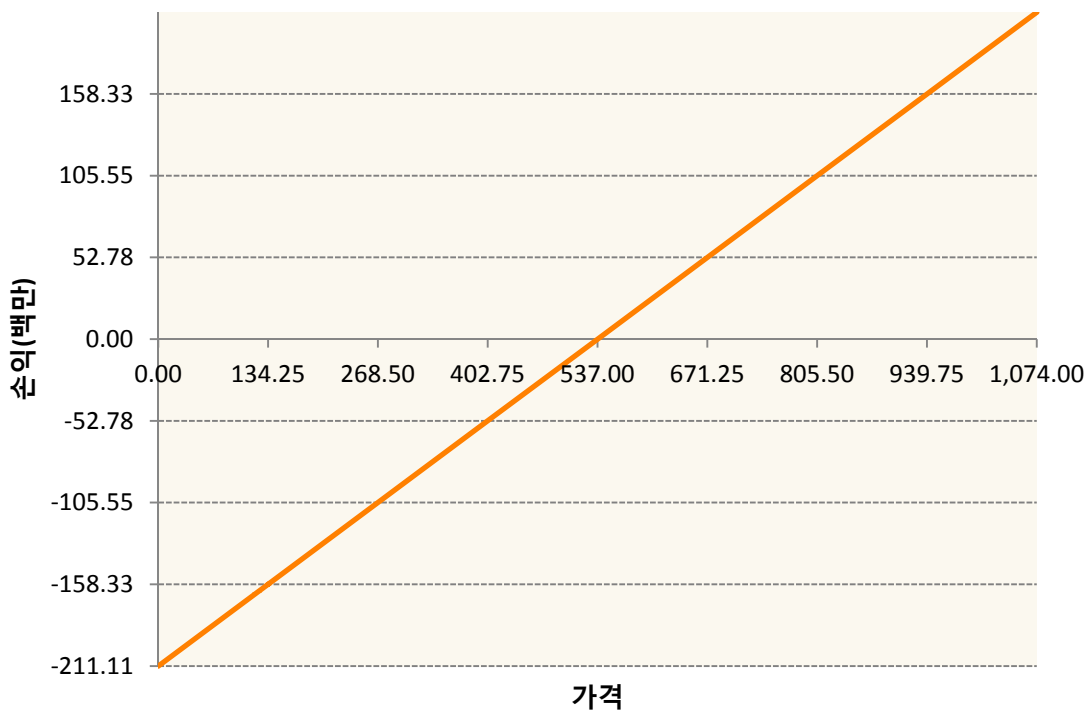




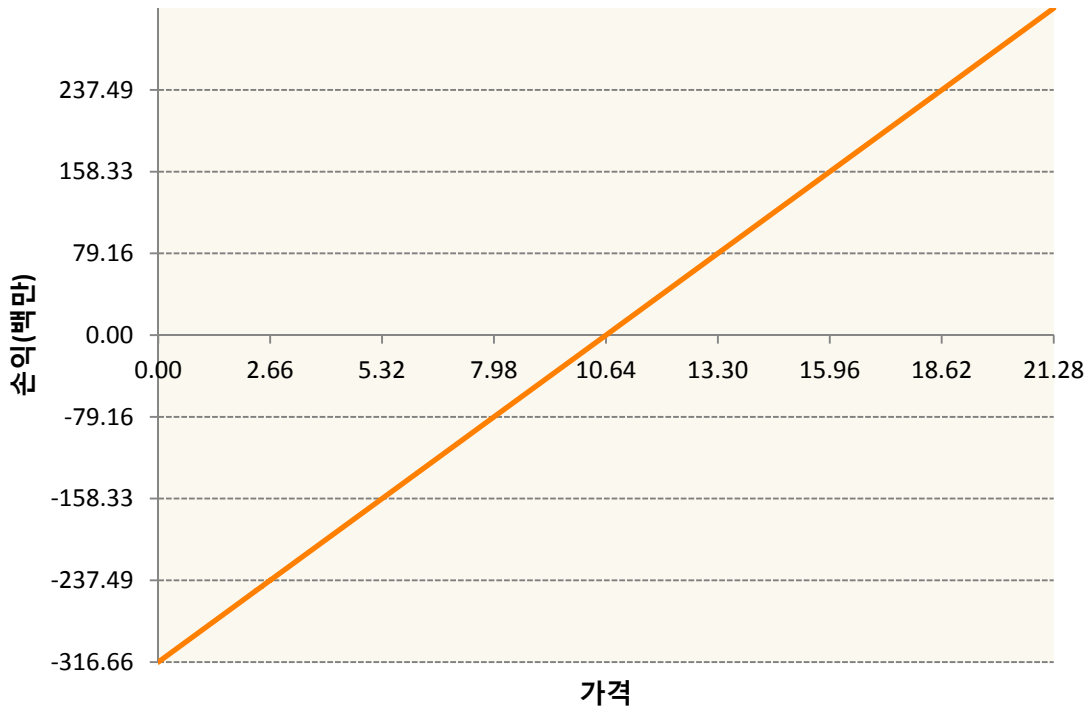
KR4175N90000-2018-09 달러선물



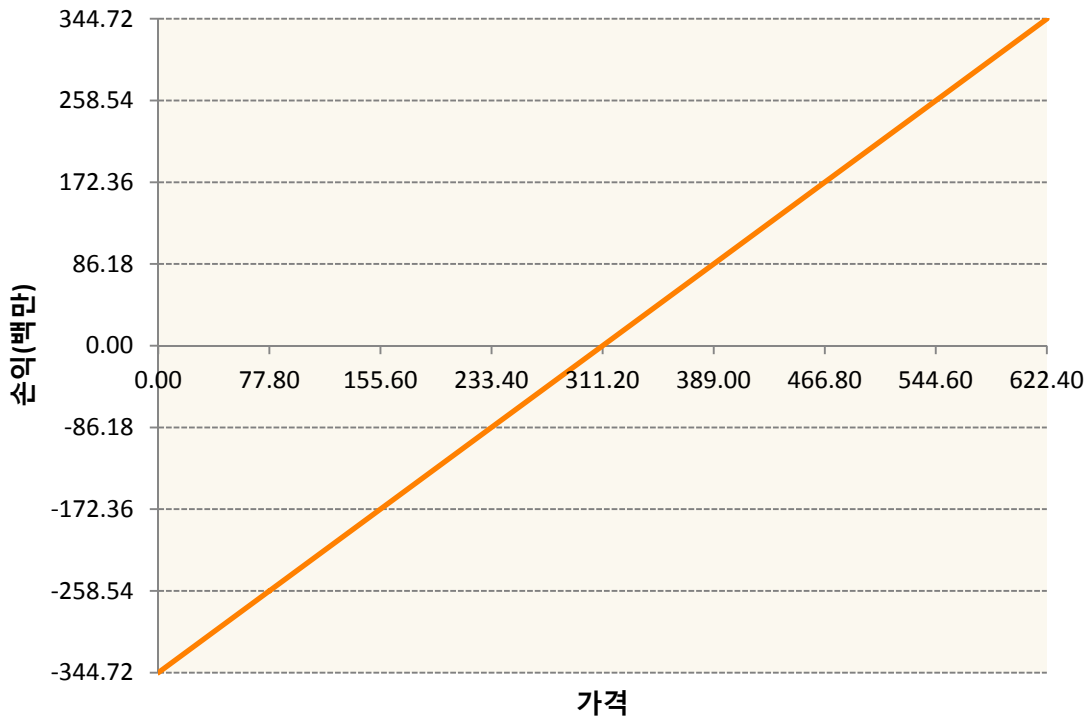
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



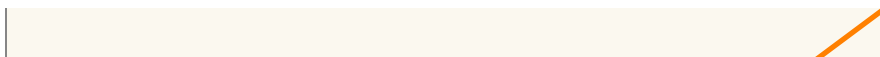
SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

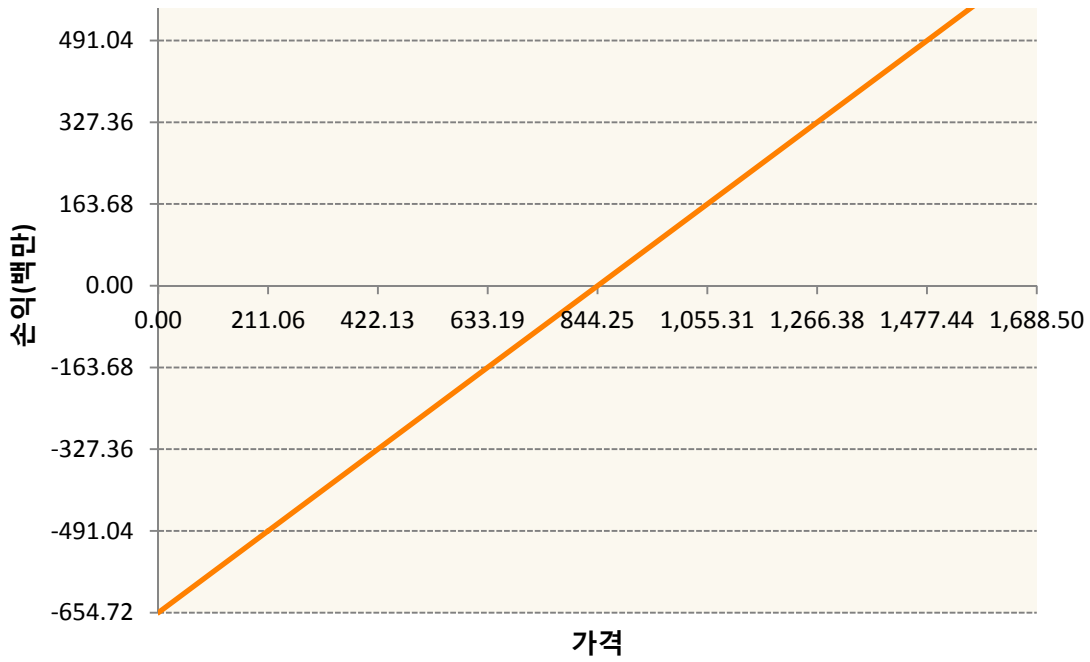


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

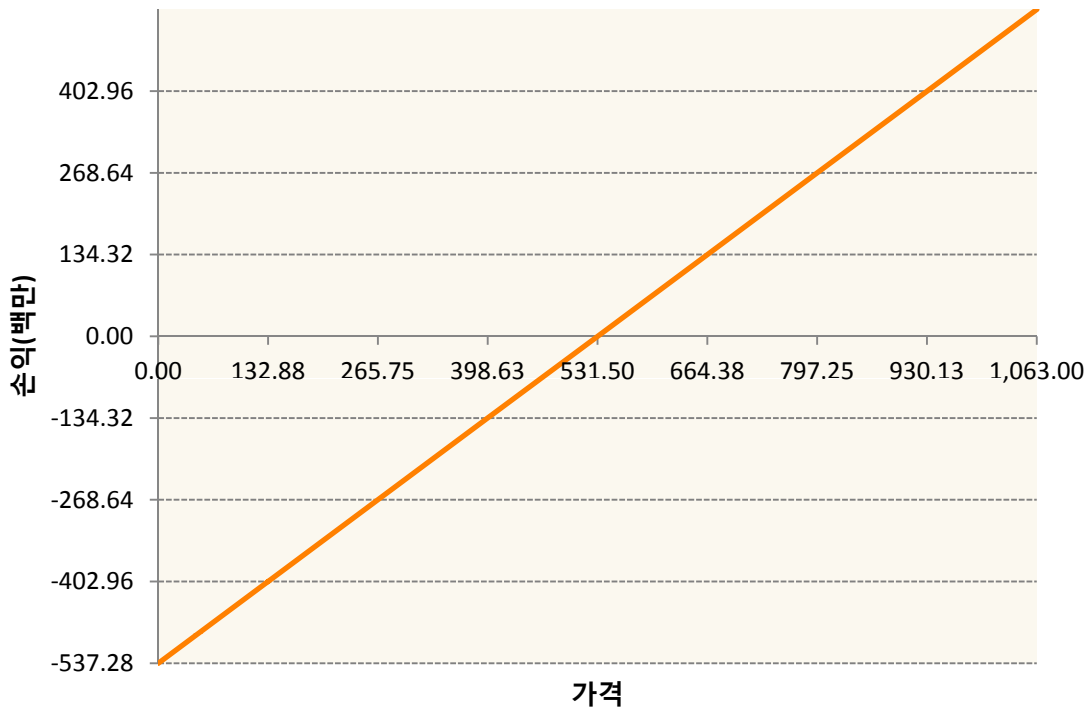


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





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	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	28
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	52
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	43

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

(단위:백만원)

311