

공시일	2018-09-10
기준일	2018-09-07

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)

66

공시일	2018-09-10
기준일	2018-09-07

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

1,138

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

487

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-10
기준일	2018-09-07

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

295

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

372

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-10
기준일	2018-09-07

유로인덱스모(주식-파생형)

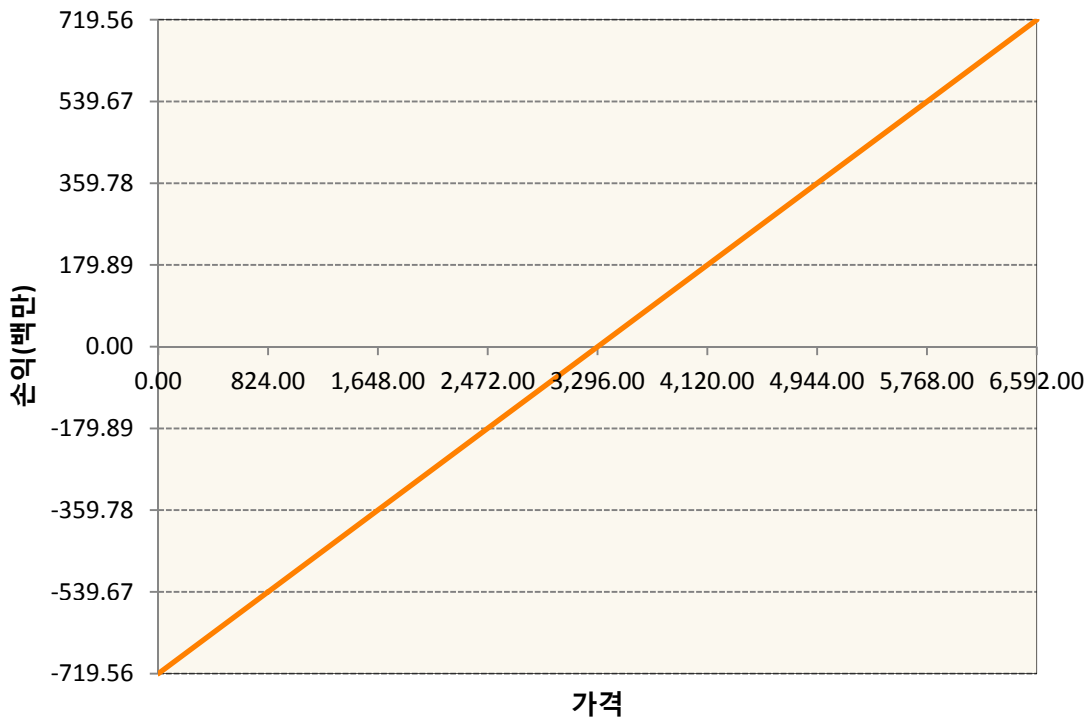
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	720	0	720	

2. 만기시점의 손익구조

VGU8-EURO STOXXX 50 SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU8	EURO STOXXX 50 SEP18	58
------	----------------------	----

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

(단위:백만원)

36

공시일	2018-09-10
기준일	2018-09-07

차이나인덱스모(주식-파생형)

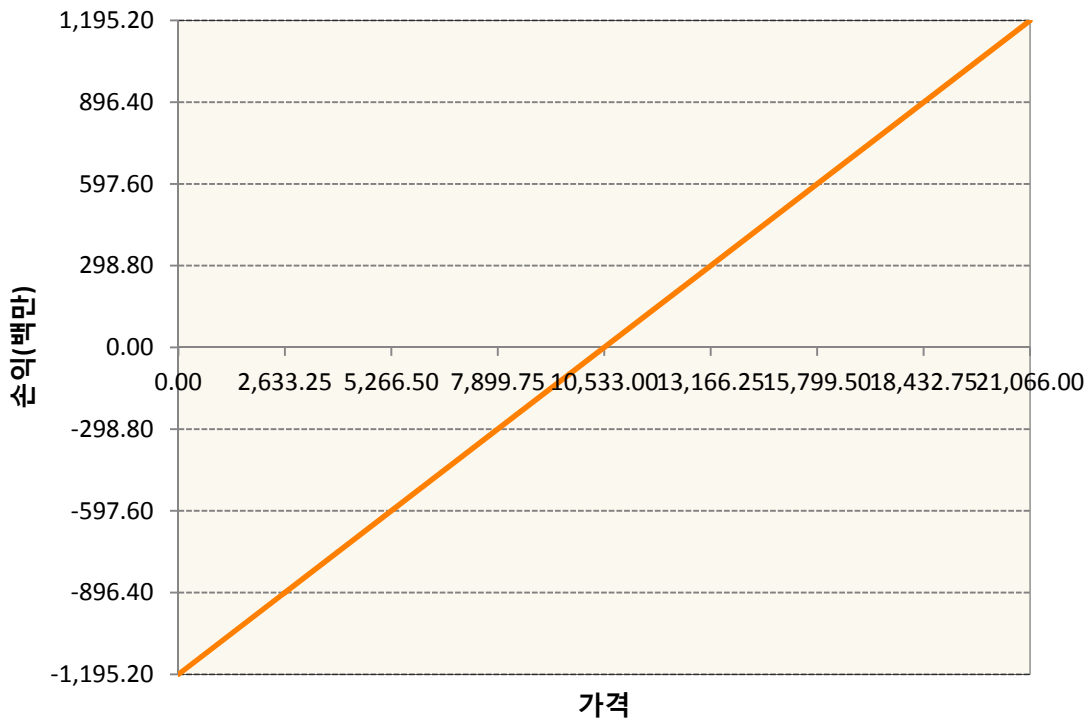
1. 계약금액

(단위:백만원)

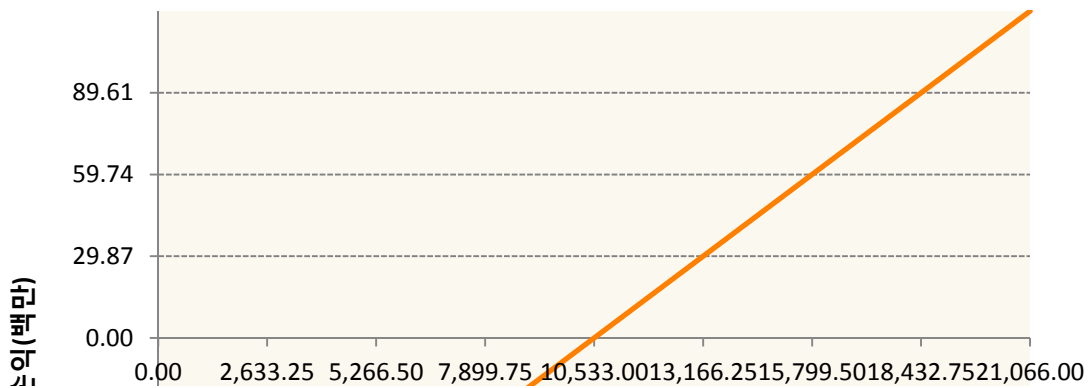
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	119	0	119	
누계	유가증권	선물	1,195	0	1,195	장내

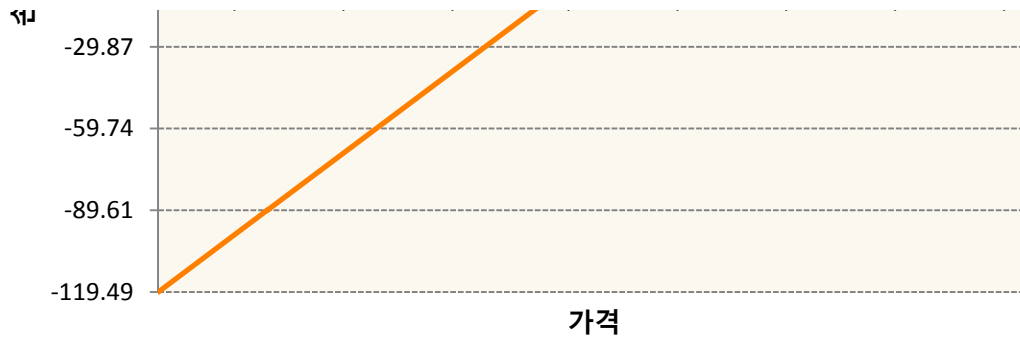
2. 만기시점의 손익구조

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)

96

공시일	2018-09-10
기준일	2018-09-07

커버드콜모(주식혼합-파생형)

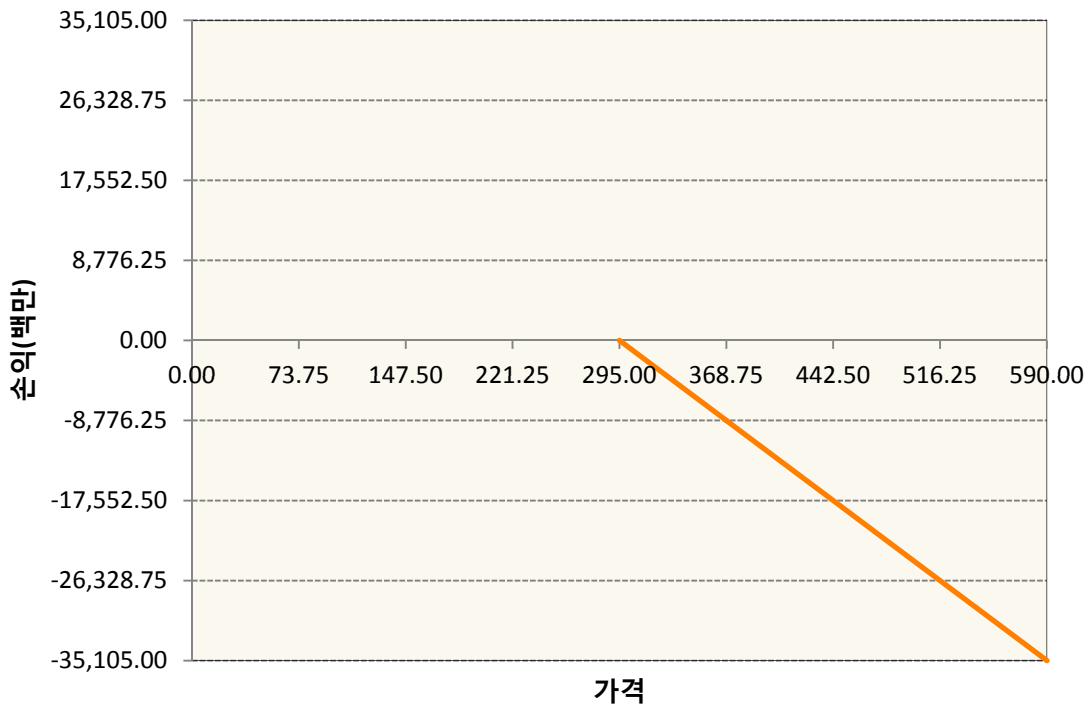
1. 계약금액

(단위:백만원)

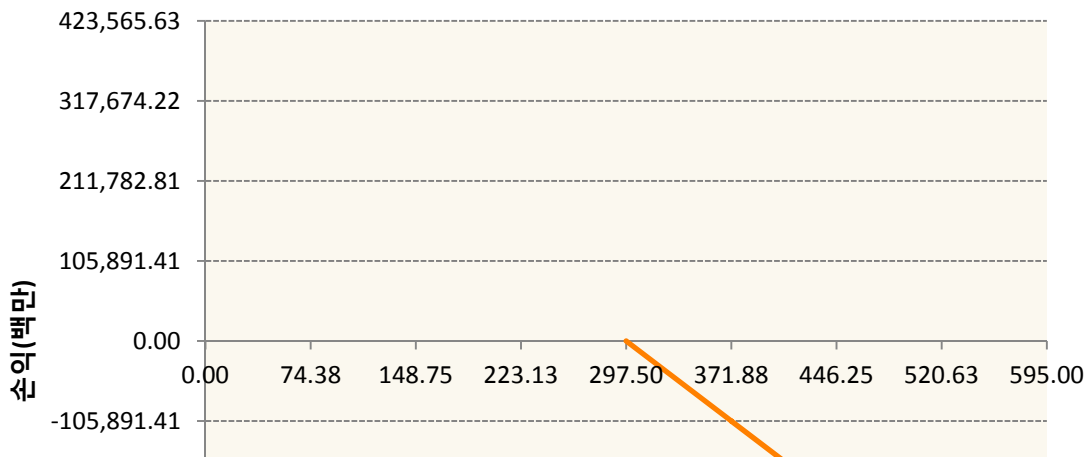
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	2,006	0	2,006	장내
누계	유가증권	옵션	0	756,171	-756,171	장내

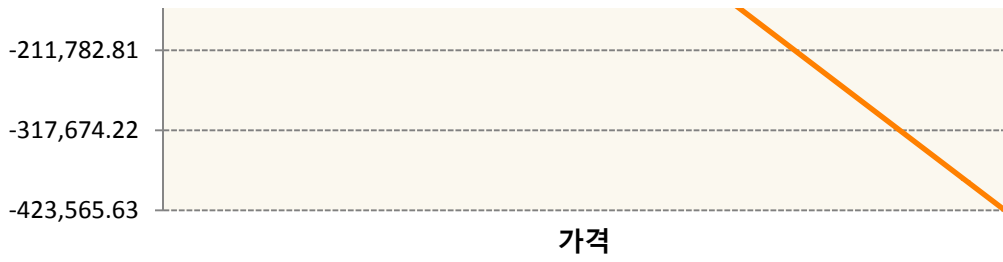
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92950-2018-09 콜295

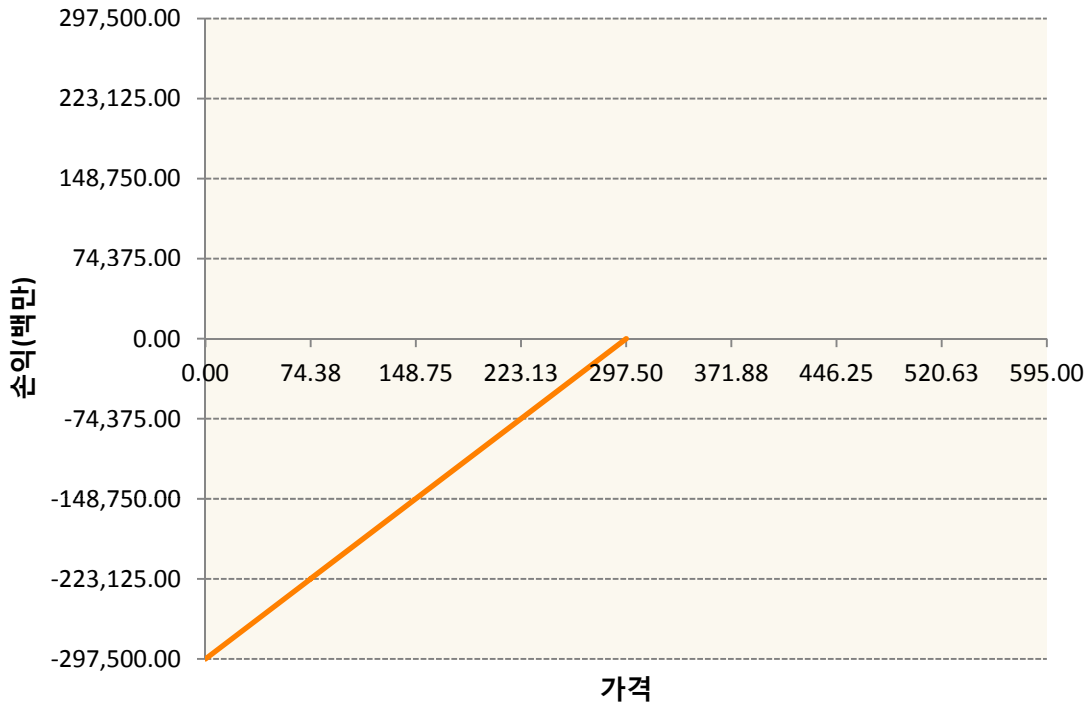


KR4201N92976-2018-09 콜297.5





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N929 2018-09 콜295

2,199

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	368	368	367	367	365	362	358
-5.33%	366	363	358	351	342	330	317
-2.67%	329	310	289	266	240	213	184
0%	118	79	40	0	-40	-79	-119
2.67%	-430	-463	-497	-531	-567	-604	-641
5.33%	-1,250	-1,261	-1,275	-1,292	-1,312	-1,334	-1,357
8.00%	-2,163	-2,165	-2,168	-2,173	-2,180	-2,188	-2,199

KR4201N929 2018-09 풋297.5

24,292

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,111	3,110	3,108	3,102	3,091	3,072	3,043

-5.33%	3,100	3,082	3,049	2,999	2,927	2,834	2,718
-2.67%	2,882	2,738	2,559	2,349	2,110	1,846	1,560
0%	1,273	860	435	0	-442	-891	-1,344
2.67%	-3,923	-4,381	-4,845	-5,314	-5,786	-6,262	-6,739
5.33%	-12,915	-13,126	-13,373	-13,650	-13,953	-14,279	-14,624
8.00%	-23,640	-23,684	-23,751	-23,845	-23,967	-24,117	-24,292
KR4301N929 2018-09 풋 297.5							22,999
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,999	-22,999	-22,999	-22,999	-22,999	-22,999	-22,999
-5.33%	-15,192	-15,192	-15,192	-15,192	-15,192	-15,192	-15,192
-2.67%	-7,385	-7,386	-7,388	-7,391	-7,398	-7,408	-7,423
0%	256	181	95	0	-103	-213	-328
2.67%	4,689	4,573	4,450	4,322	4,189	4,052	3,912
5.33%	5,077	5,074	5,068	5,057	5,040	5,017	4,987
8.00%	5,079	5,079	5,079	5,079	5,079	5,078	5,077

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

(단위:백만원)

58,005

공시일	2018-09-10
기준일	2018-09-07

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

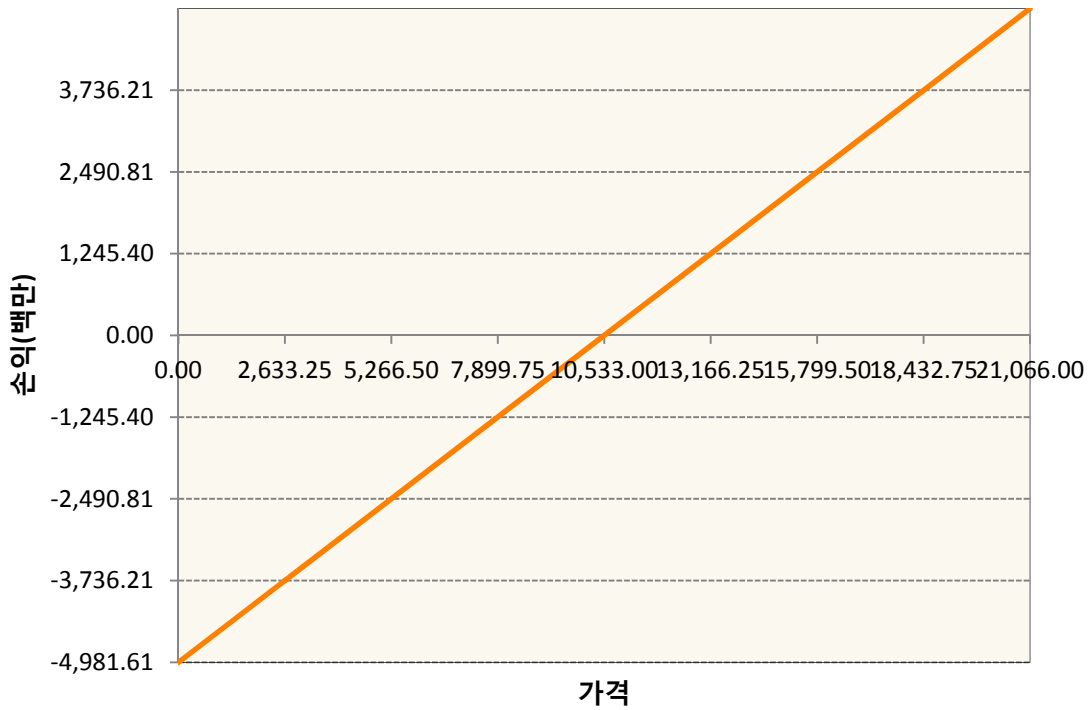
1. 계약금액

(단위:백만원)

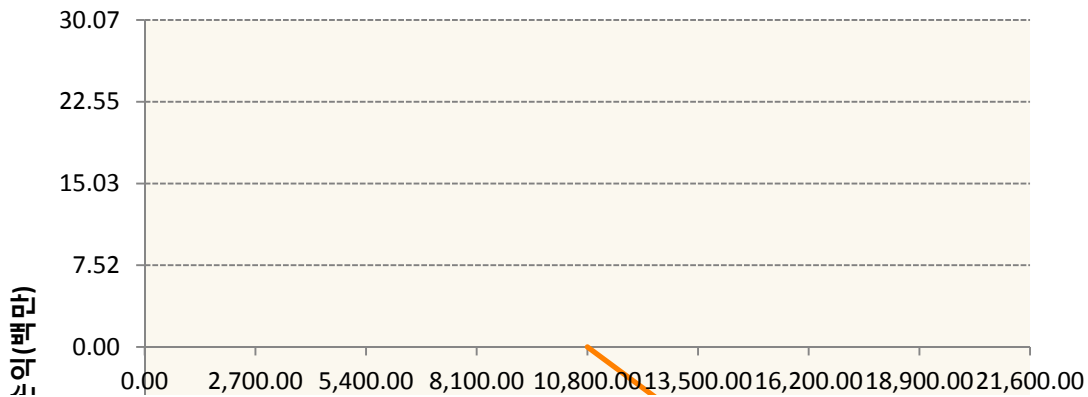
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,982	0	4,982	장내
누계	유가증권	옵션	0	203	-203	장내

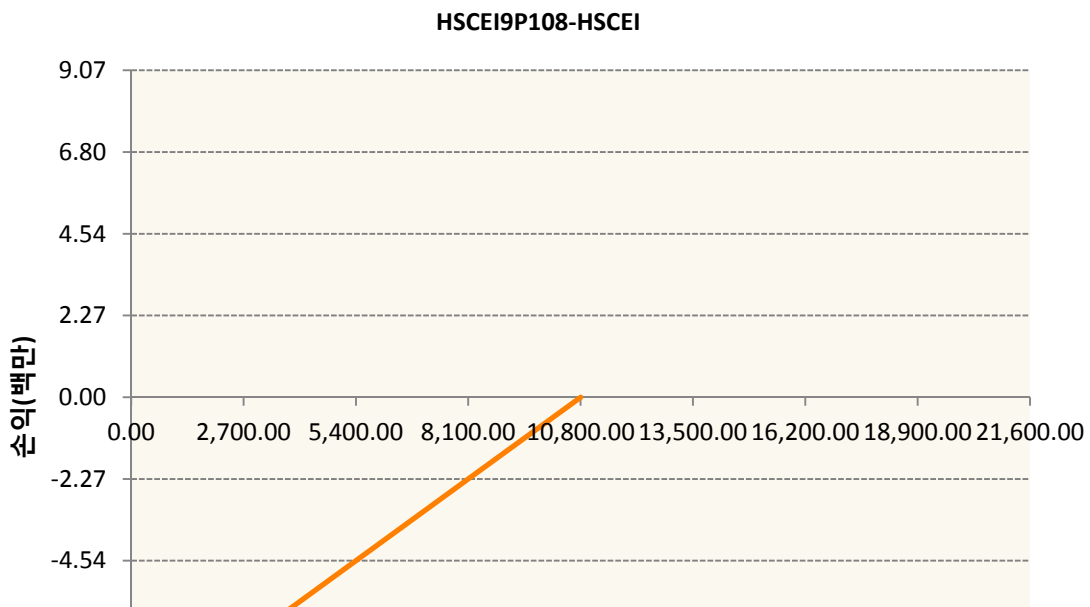
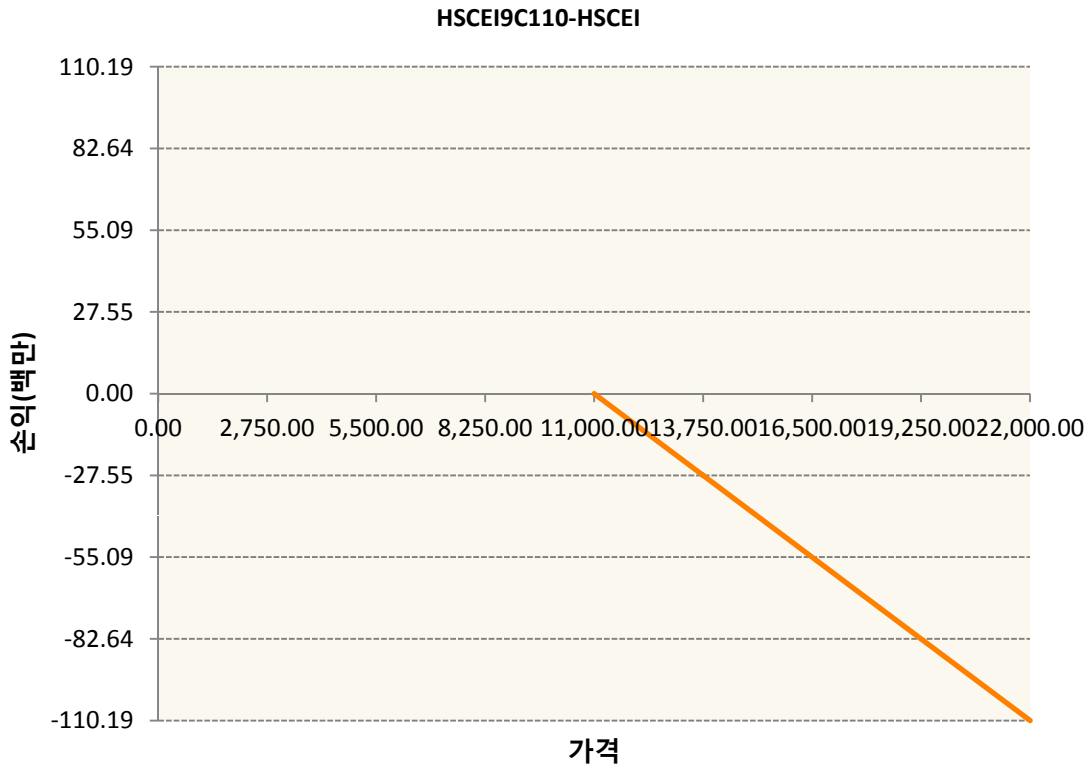
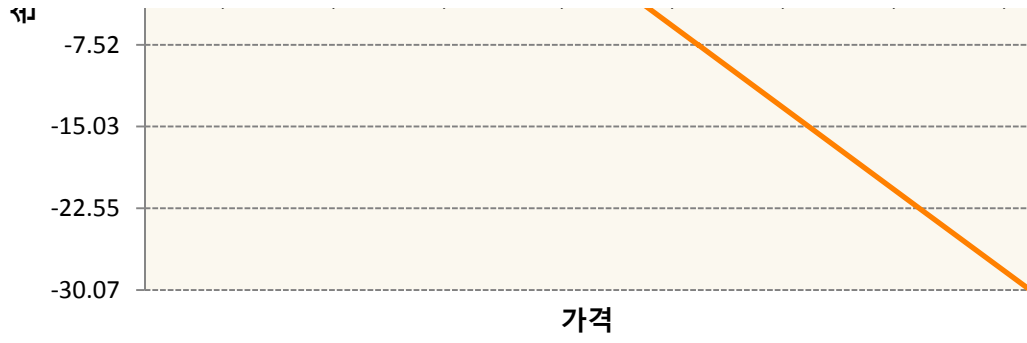
2. 만기시점의 손익구조

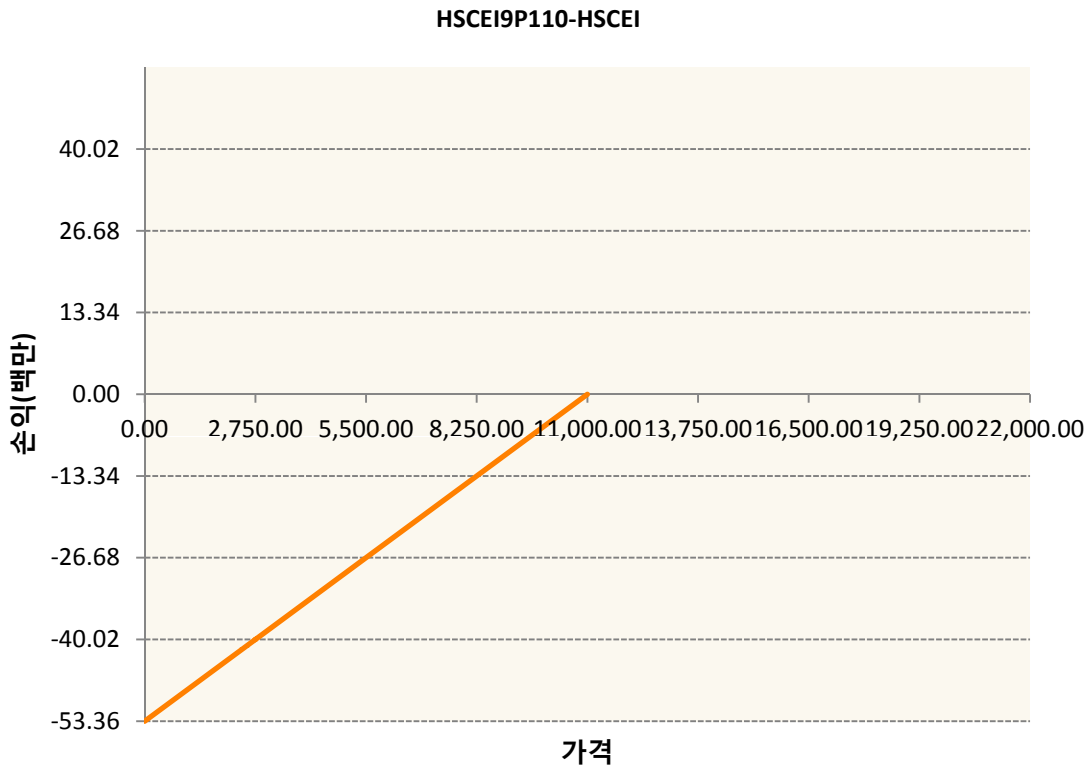
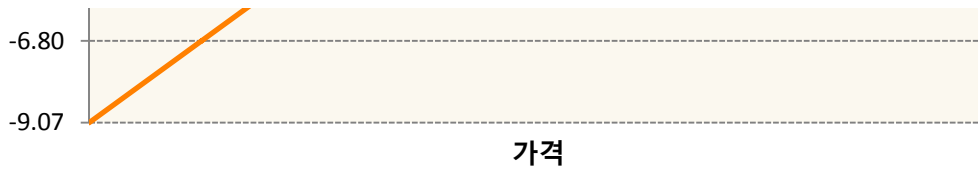
HCU8-H-SHARES IDX FUT Sep18



HSCEI9C108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU8	H-SHARES IDX FUT Sep18	399
HSCEI9C108	HSCEI	2
HSCEI9C110	HSCEI	9
HSCEI9P108	HSCEI	1
HSCEI9P110	HSCEI	4

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	380

공시일	2018-09-10
기준일	2018-09-07

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

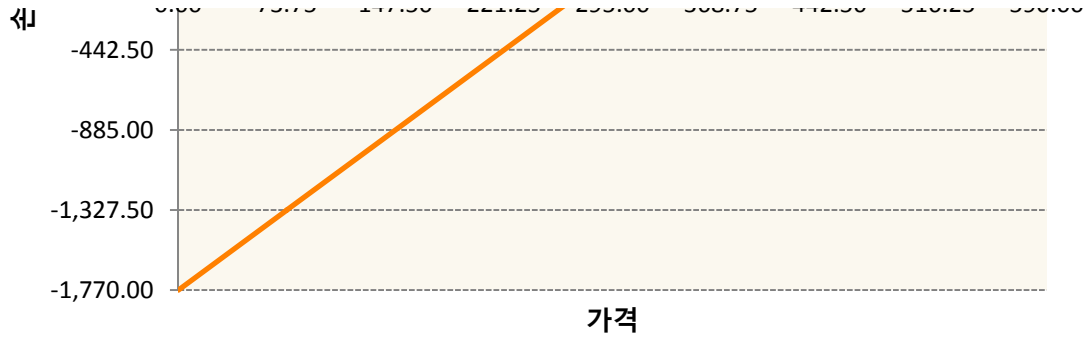
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92976-2018-09 콜297.5

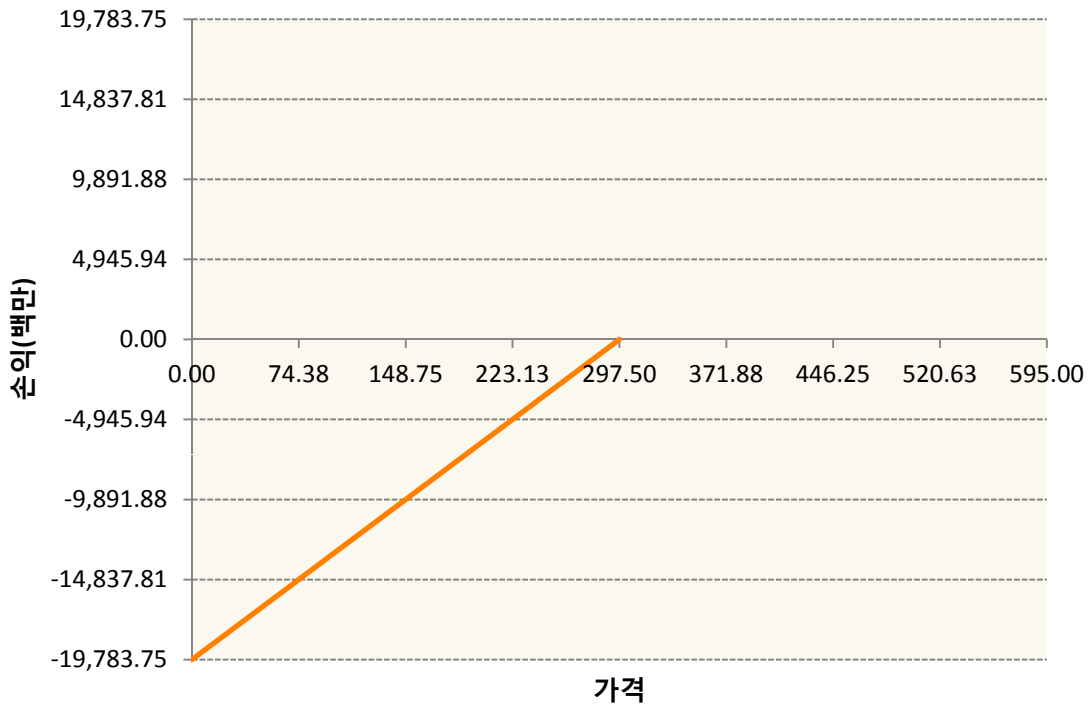


KR4301N92958-2018-09 풋295





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,983
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,983	-3,983	-3,983	-3,983	-3,983	-3,983	-3,983
-5.33%	-2,655	-2,655	-2,655	-2,655	-2,655	-2,655	-2,655
-2.67%	-1,328	-1,328	-1,328	-1,328	-1,328	-1,328	-1,328
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,328	1,328	1,328	1,328	1,328	1,328	1,328
5.33%	2,655	2,655	2,655	2,655	2,655	2,655	2,655
8.00%	3,983	3,983	3,983	3,983	3,983	3,983	3,983
KR4201N92974-2018-09 풋297.5							1,612
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	206	206	206	206	205	204	202
-5.33%	206	205	202	199	194	188	180
-2.67%	191	182	170	156	140	123	104
0%	84	57	29	0	-29	-59	-89
2.67%	-260	-291	-322	-353	-384	-416	-447
5.33%	-857	-871	-888	-906	-926	-948	-971
8.00%	-1,569	-1,572	-1,576	-1,583	-1,591	-1,601	-1,612

KR4301N929 2018-09 풋295

134

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-134	-134	-134	-134	-134	-134	-134
-5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	18	18	18	17	17	16	16
5.33%	19	19	19	19	19	19	19
8.00%	19	19	19	19	19	19	19

KR4301N929 2018-09 풋297.5

1,529

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,529	-1,529	-1,529	-1,529	-1,529	-1,529	-1,529
-5.33%	-1,010	-1,010	-1,010	-1,010	-1,010	-1,010	-1,010
-2.67%	-491	-491	-491	-492	-492	-493	-494
0%	17	12	6	0	-7	-14	-22
2.67%	312	304	296	287	279	269	260
5.33%	338	337	337	336	335	334	332
8.00%	338	338	338	338	338	338	338

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

(단위:백만원)

7,869

공시일	2018-09-10
기준일	2018-09-07

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

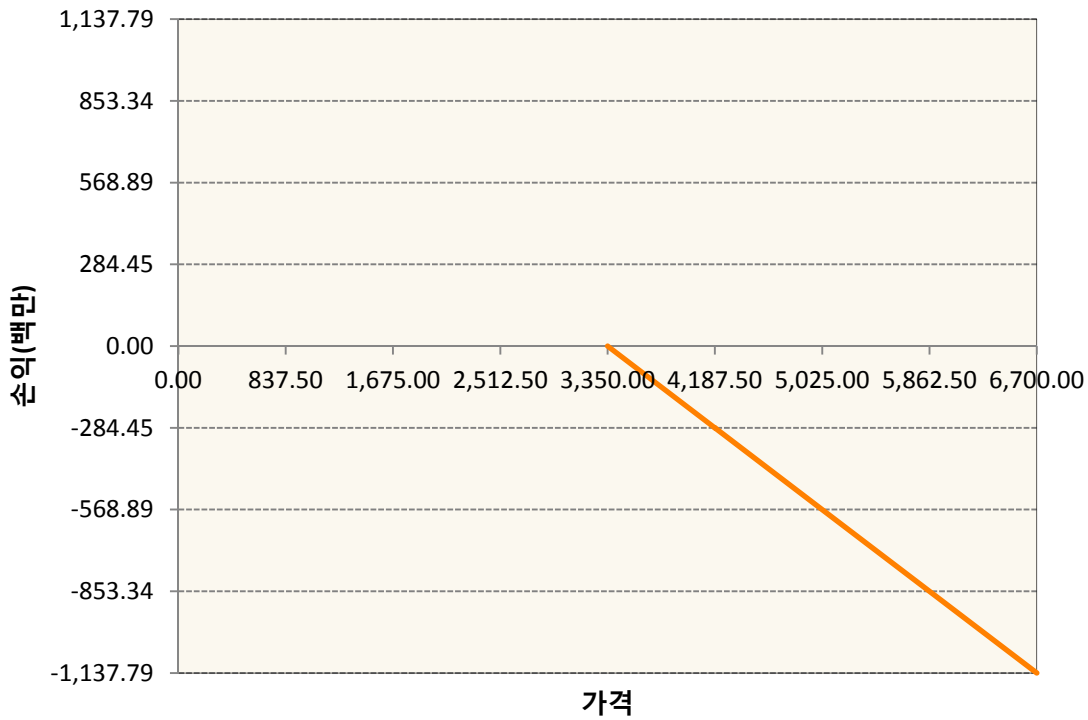
1. 계약금액

(단위:백만원)

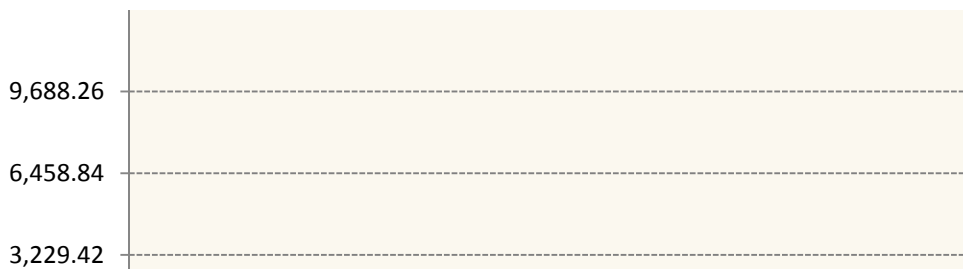
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,801	0	6,801	
누계	유가증권	옵션	0	28,111	-28,111	장내
누계	지수	스왑	87,526	0	87,526	장외

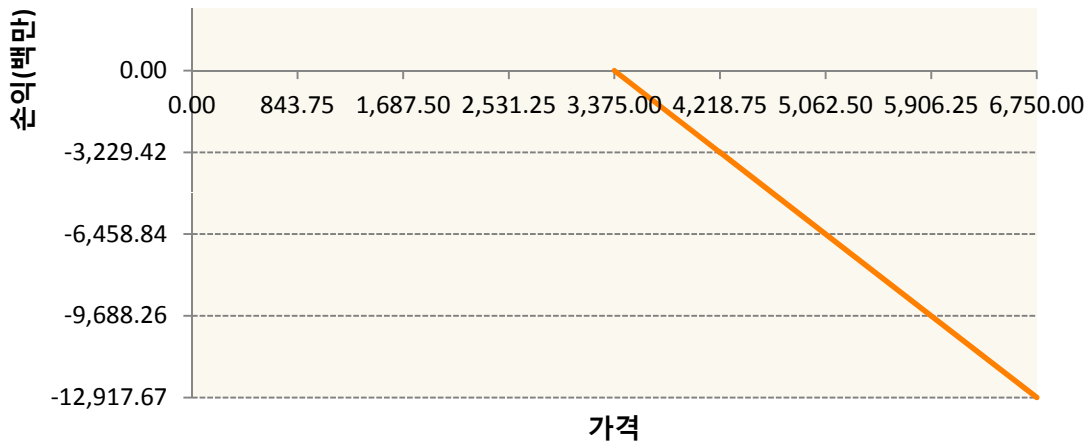
2. 만기시점의 손익구조

OESXU8-C3350-EURO STOXX 50

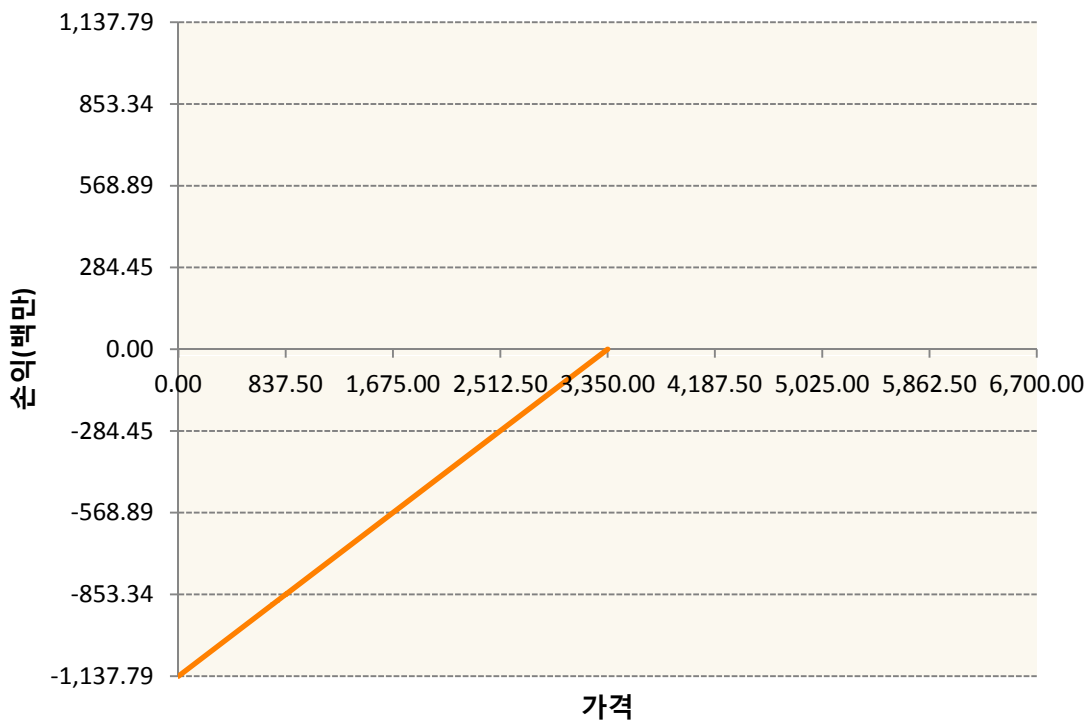


OESXU8-C3375-EURO STOXX 50

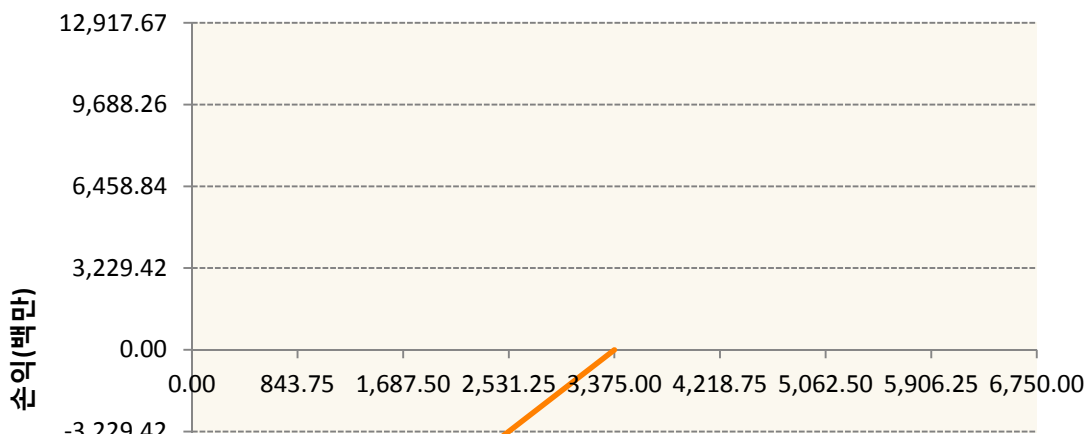


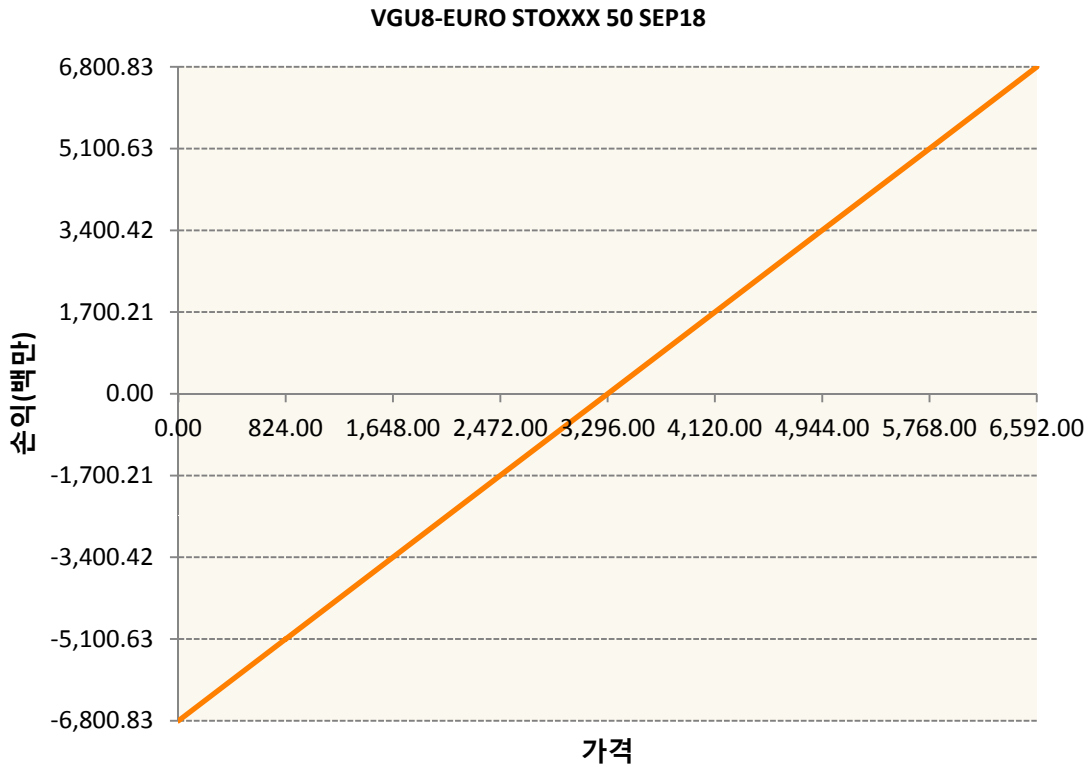
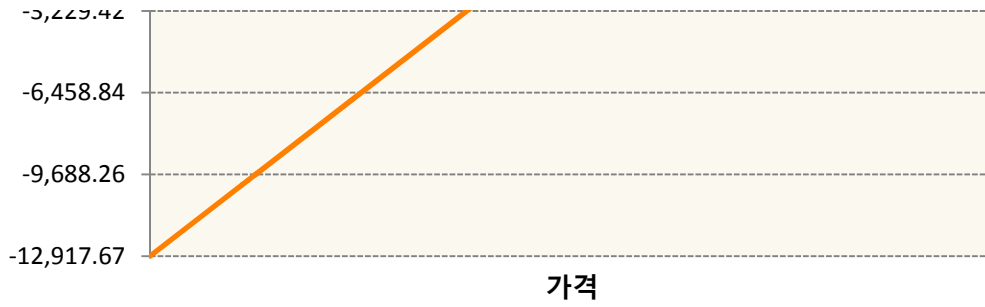


OESXU8-P3350-EURO STOXX 50



OESXU8-P3375-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	94
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY	61
OESXU8-C33 EURO STOXX 50	91
OESXU8-C33 EURO STOXX 50	1,033
OESXU8-P33 EURO STOXX 50	91
OESXU8-P33 EURO STOXX 50	1,033
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18	544

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

1,863

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

(단위:백만원)

1,124

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

(단위:백만원)

89

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

(단위:백만원)

133

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

(단위:백만원)

161

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-09-10
기준일	2018-09-07

리디파인K200(주식혼합-파생재간

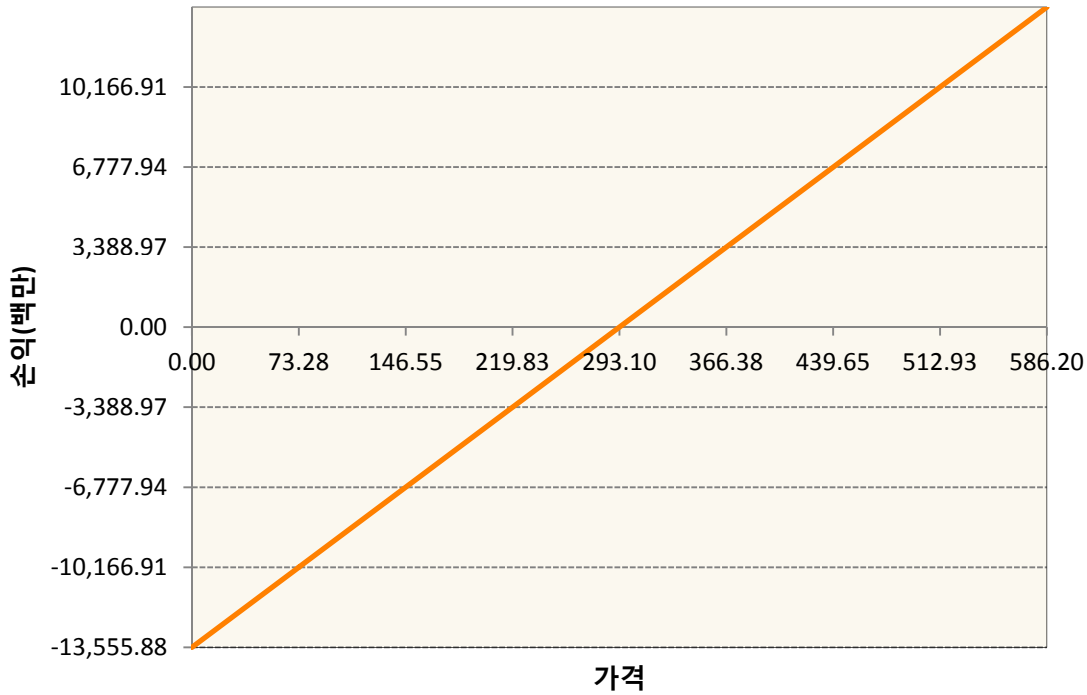
1. 계약금액

(단위:백만원)

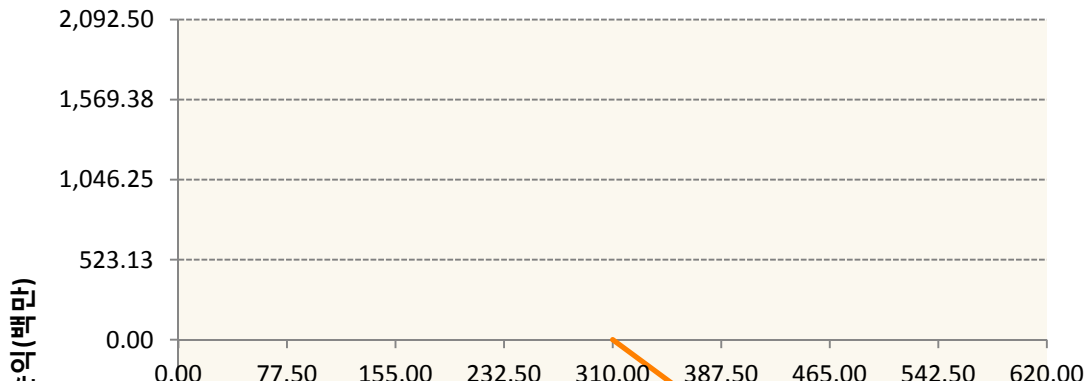
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,556	0	13,556	장내
누계	유가증권	옵션	1,339	24,671	-23,332	장내

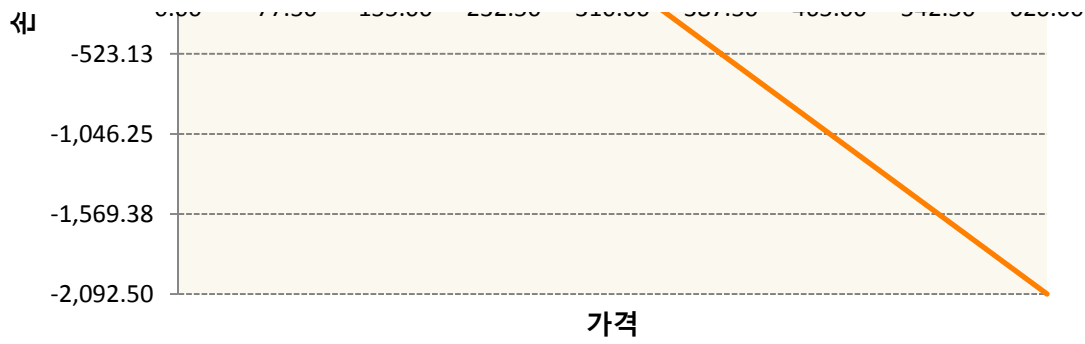
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

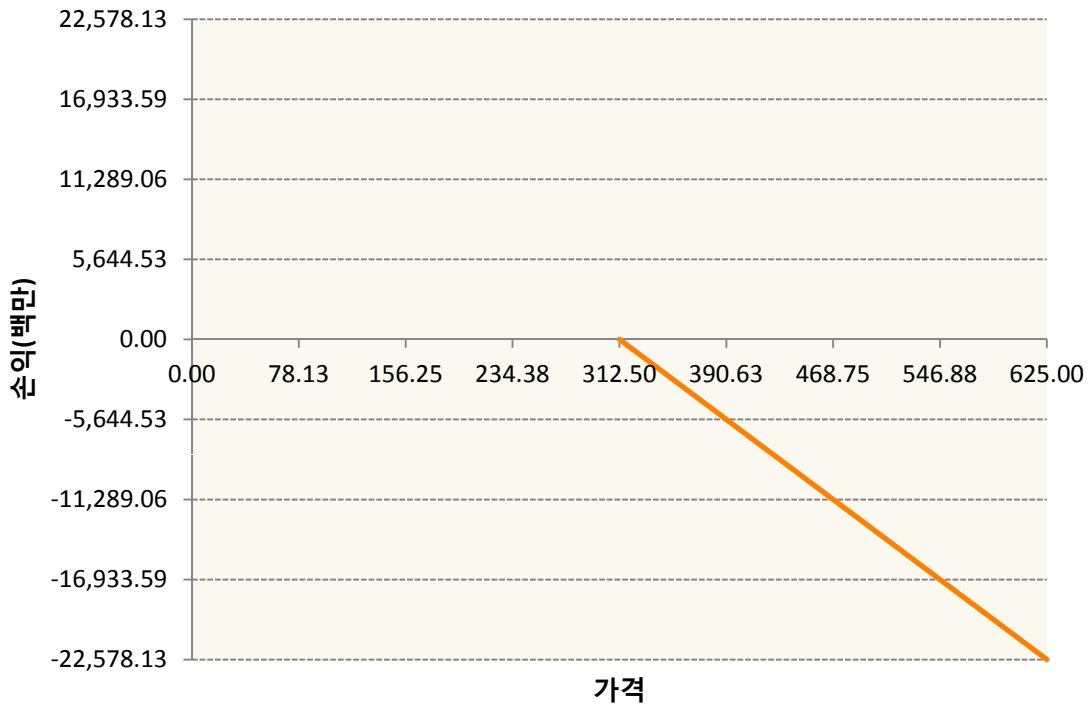


KR4201N93107-2018-09 콜310

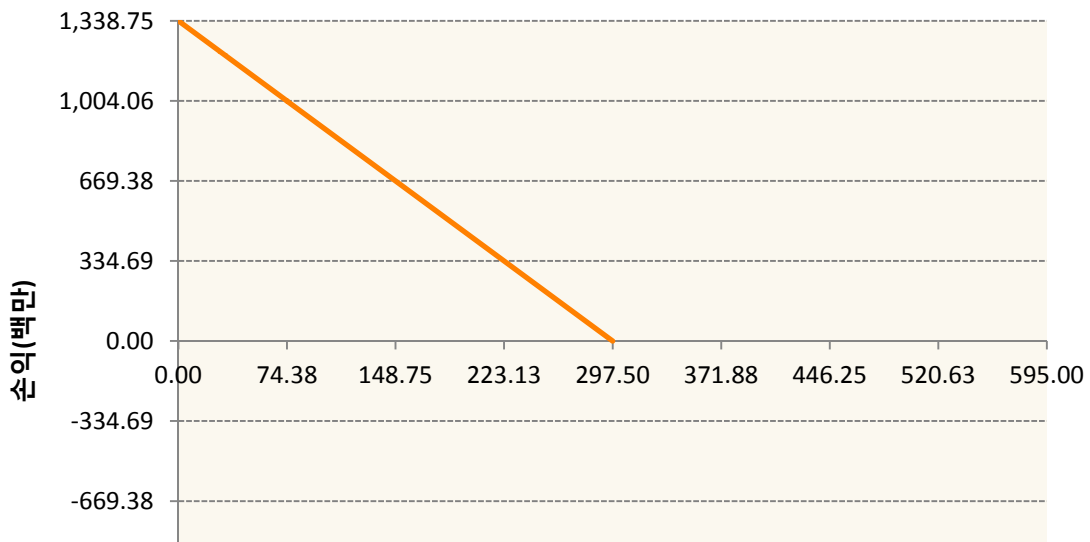


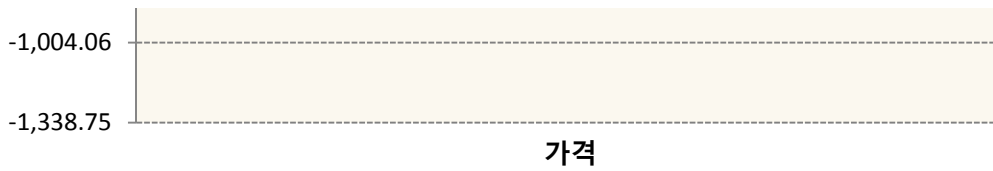


KR4201N93123-2018-09 콜312.5



KR4301N92974-2018-09 풋297.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물							1,084
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,084	-1,084	-1,084	-1,084	-1,084	-1,084	-1,084
-5.33%	-722	-722	-722	-722	-722	-722	-722
-2.67%	-361	-361	-361	-361	-361	-361	-361
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	361	361	361	361	361	361	361
5.33%	722	722	722	722	722	722	722
8.00%	1,084	1,084	1,084	1,084	1,084	1,084	1,084
KR4201N931 2018-09 콜310							60
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2	2	2	2	2	2	2
-5.33%	2	2	2	2	1	1	1
-2.67%	2	1	1	1	1	1	1
0%	1	1	1	0	-1	-2	-2
2.67%	-2	-3	-4	-6	-8	-9	-11
5.33%	-15	-18	-20	-23	-25	-27	-30
8.00%	-48	-50	-52	-54	-56	-58	-60
KR4201N931 2018-09 콜312.5							536
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	9	9	8
-2.67%	9	9	9	8	7	6	3
0%	8	6	4	0	-5	-11	-19
2.67%	-9	-18	-30	-43	-57	-73	-90
5.33%	-107	-130	-154	-178	-202	-227	-252
8.00%	-388	-412	-436	-461	-486	-511	-536
KR4301N92C 2018-09 풋297.5							103
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	103	103	103	103	103	103	103
-5.33%	68	68	68	68	68	68	68
-2.67%	33	33	33	33	33	33	33

0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-21	-21	-20	-19	-19	-18	-18
5.33%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-22
8.00%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23

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

(단위:백만원)

1,170

공시일	2018-09-10
기준일	2018-09-07

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

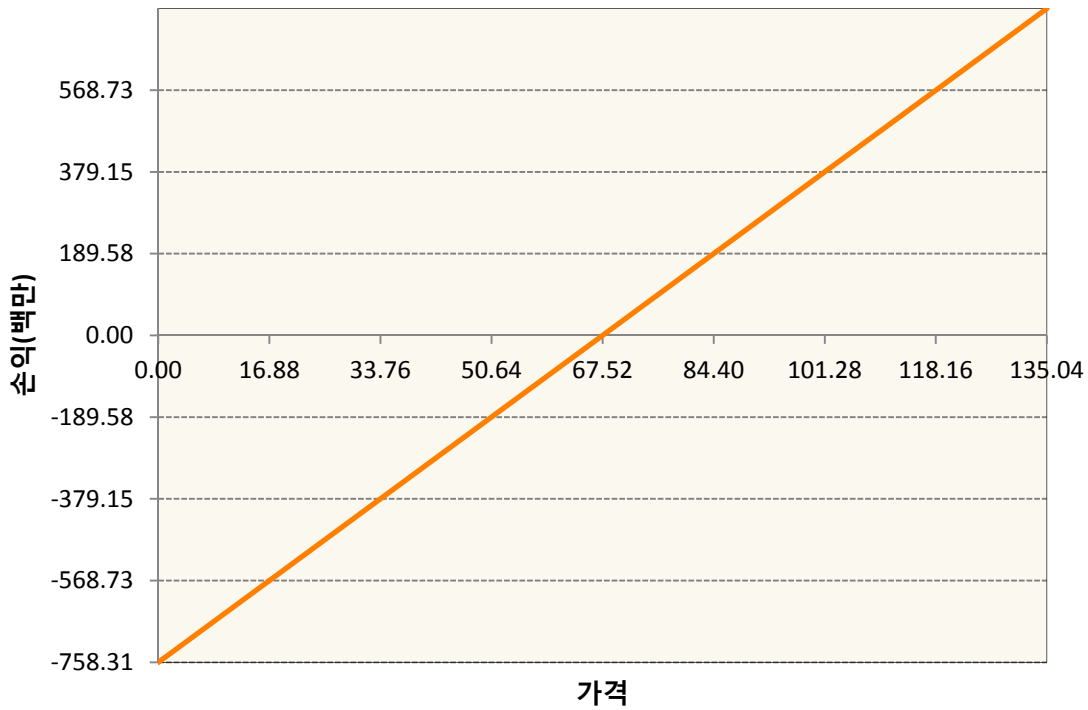
1. 계약금액

(단위:백만원)

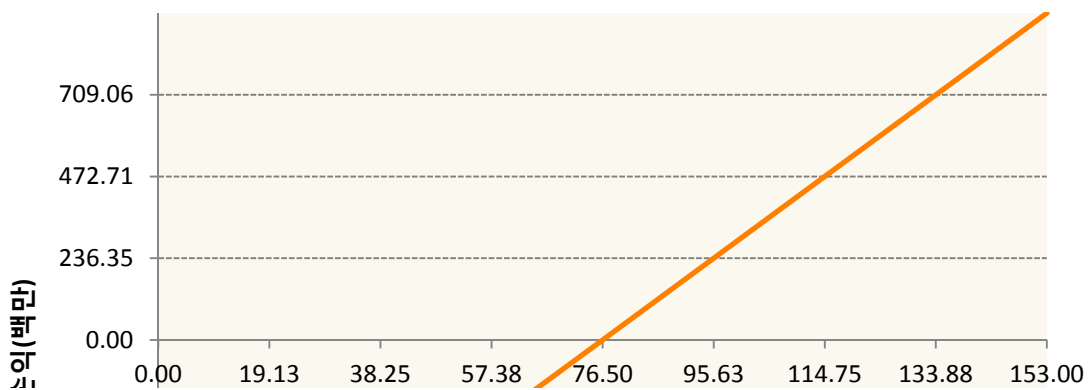
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,101	617	2,484	
누계	유가증권	선물	522	0	522	장내

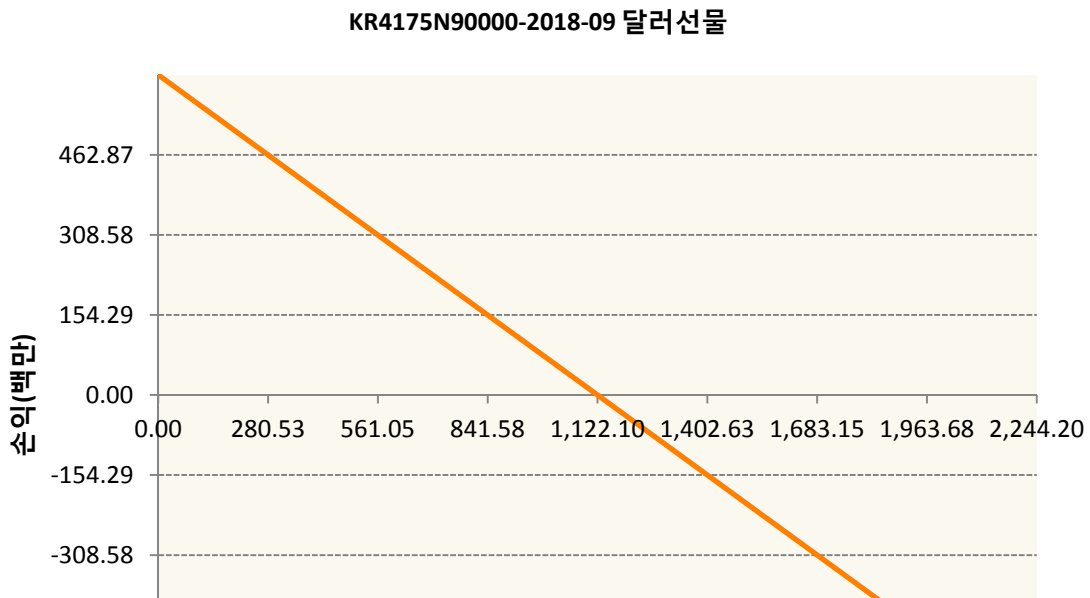
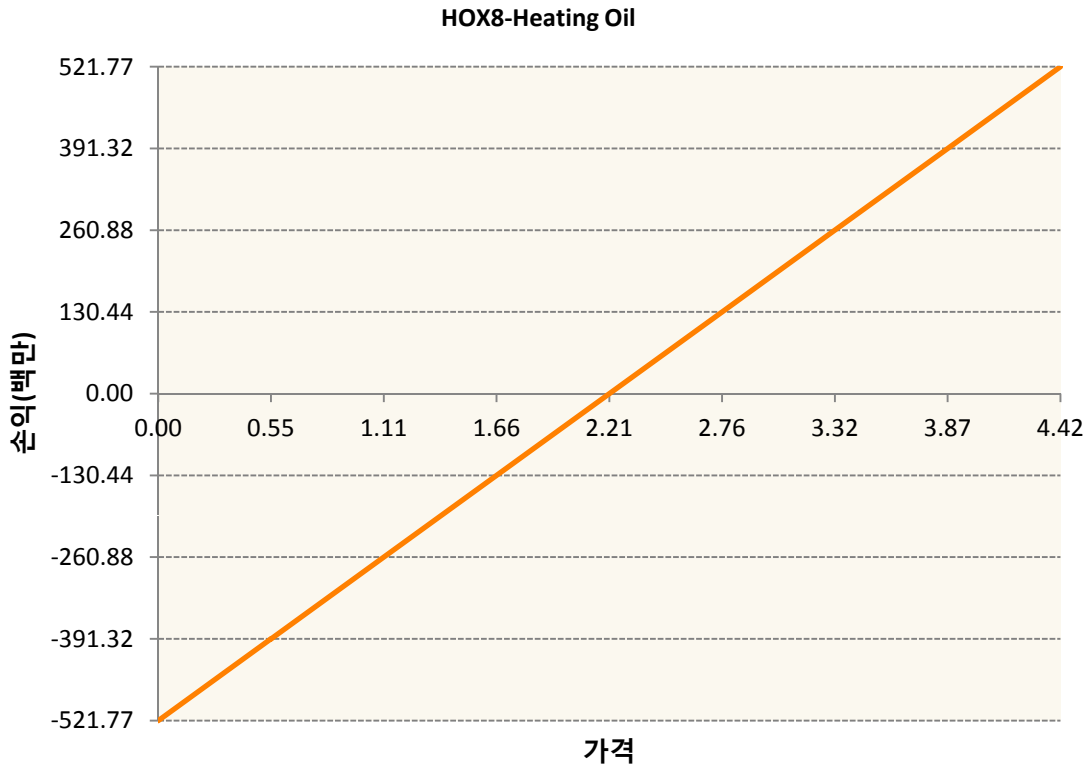
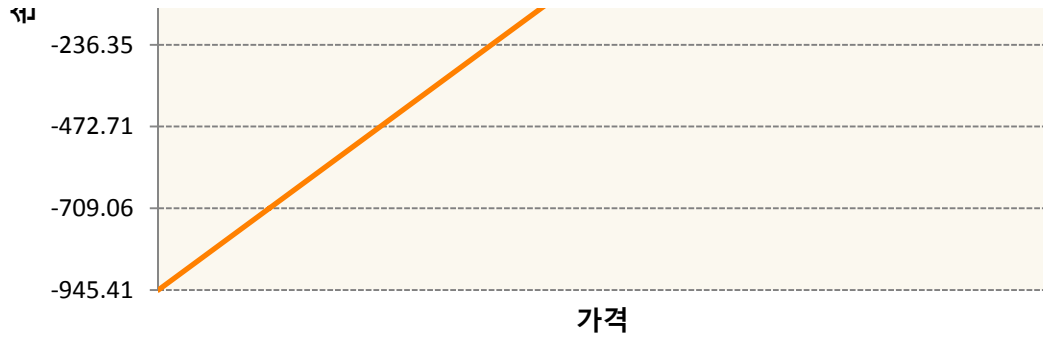
2. 만기시점의 손익구조

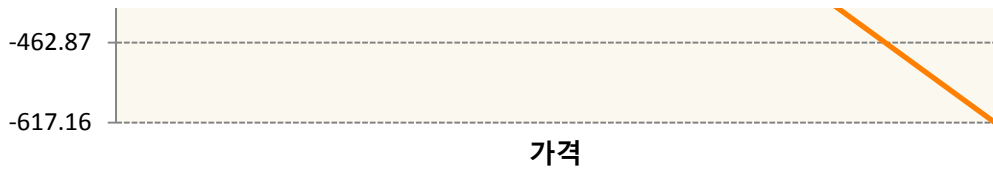
CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18



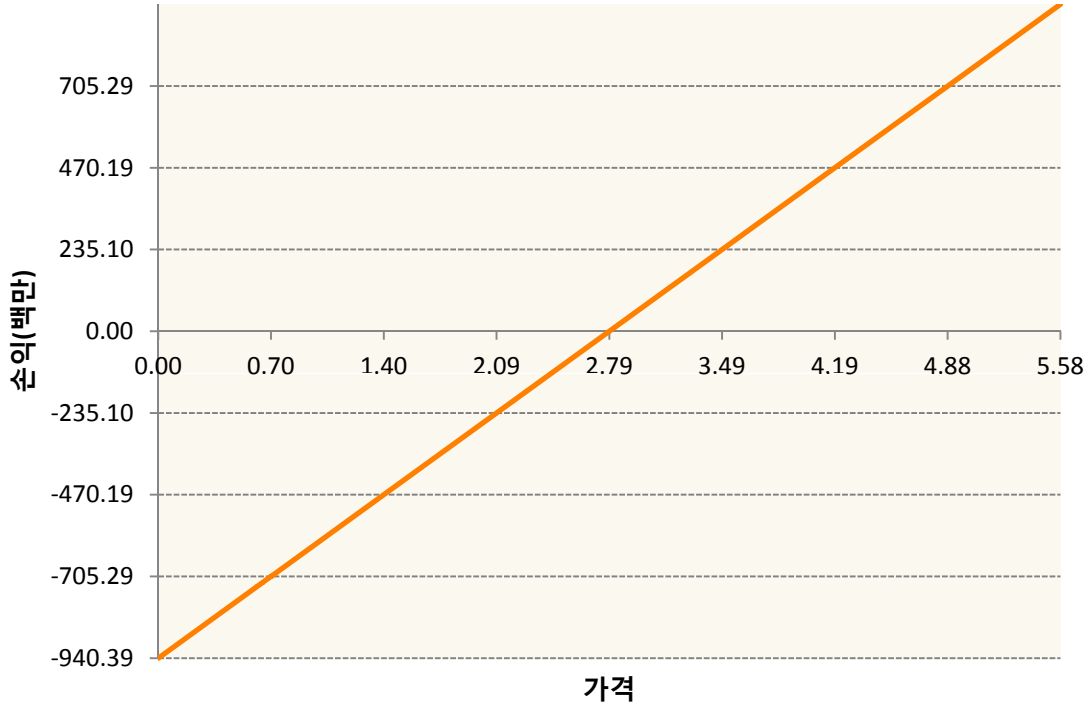
COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18



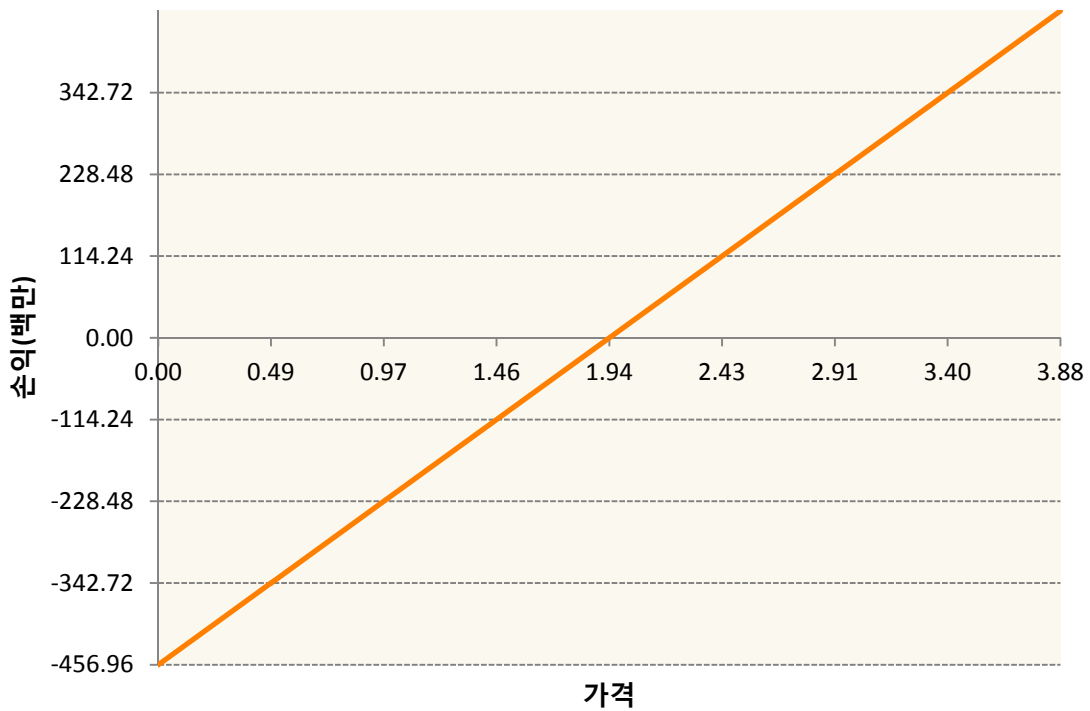




NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18



XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	61
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	76
HOX8	Heating Oil	42
	KR4175N90C 2018-09 달러선물	49
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	75
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	37

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	434

공시일	2018-09-10
기준일	2018-09-07

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

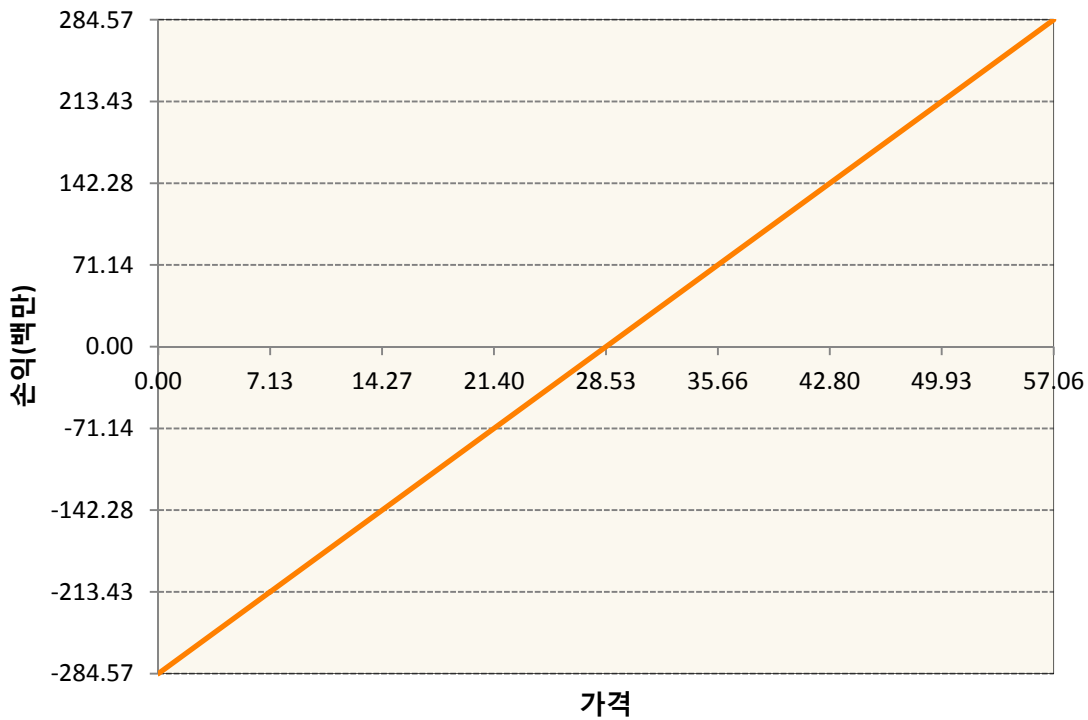
1. 계약금액

(단위:백만원)

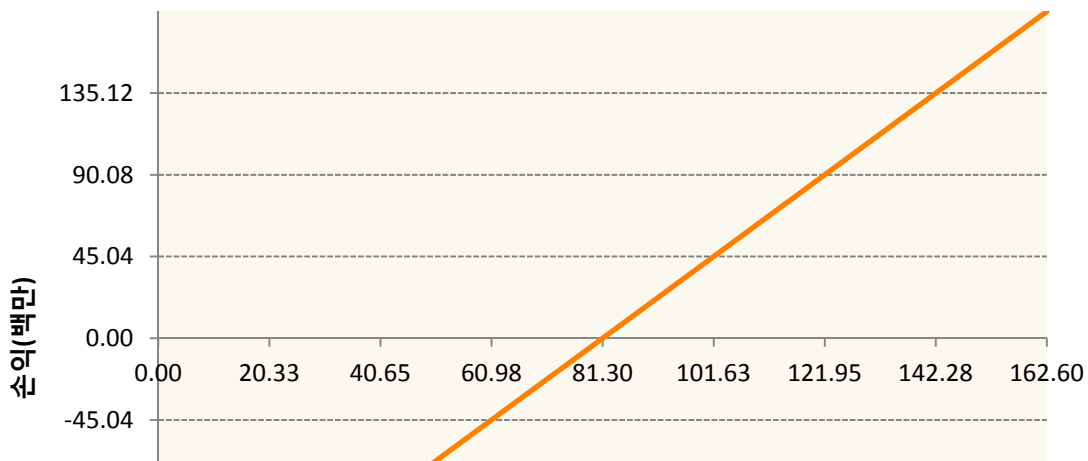
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,588	79	3,510	

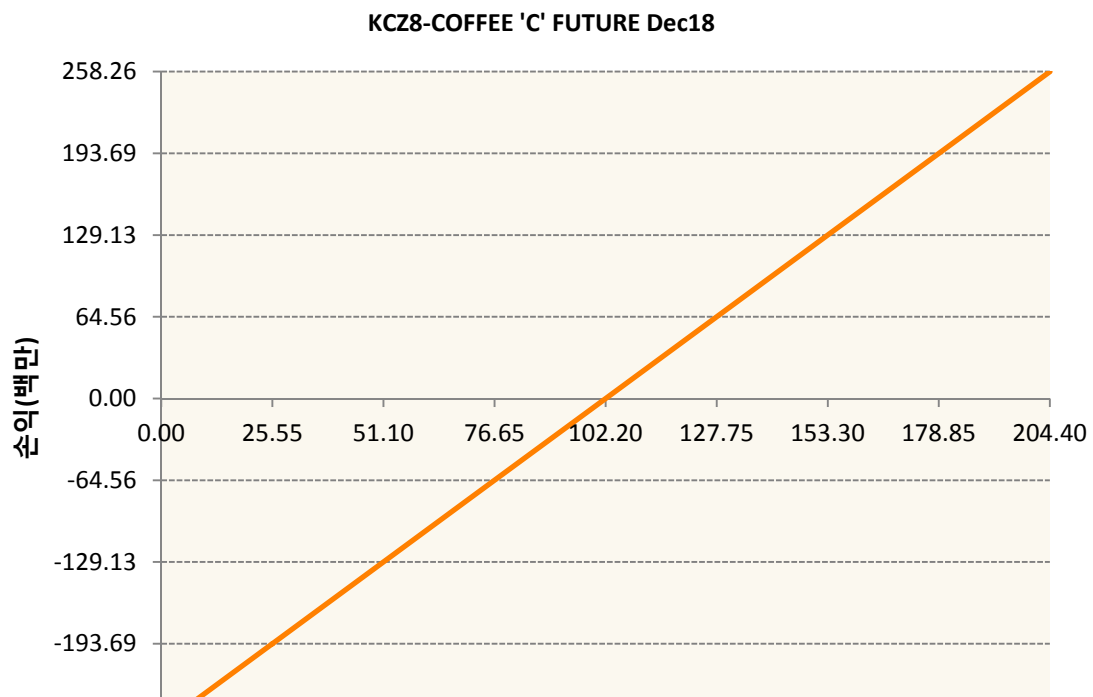
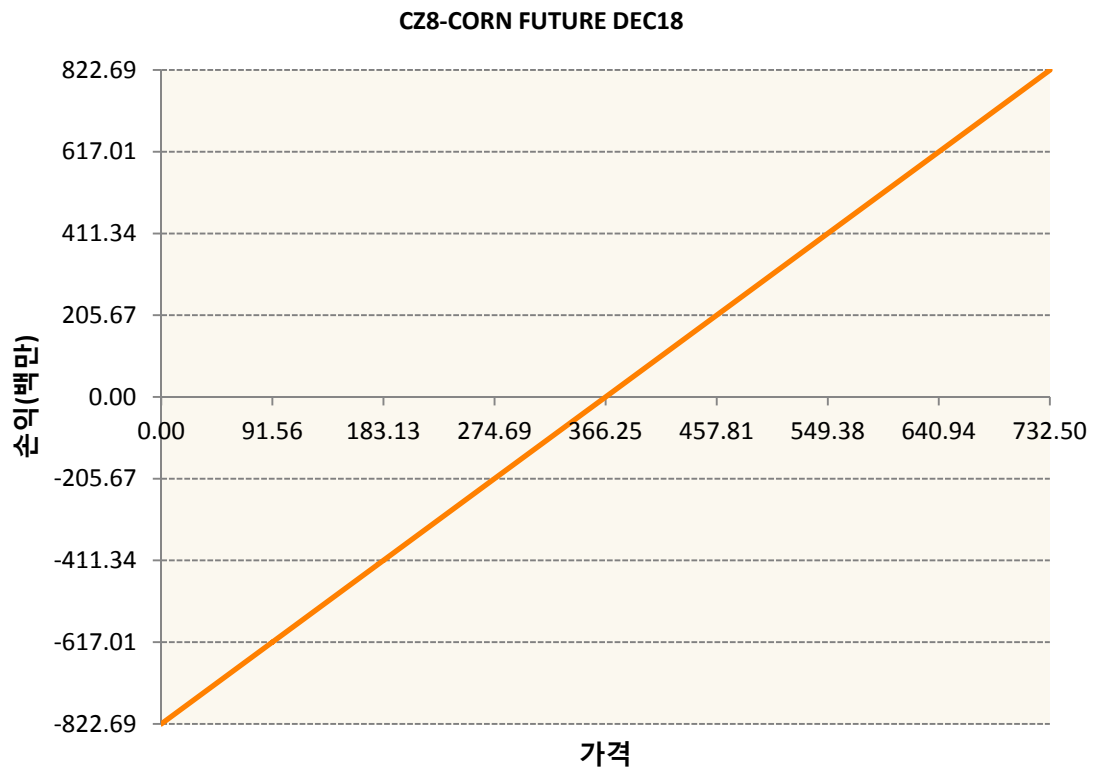
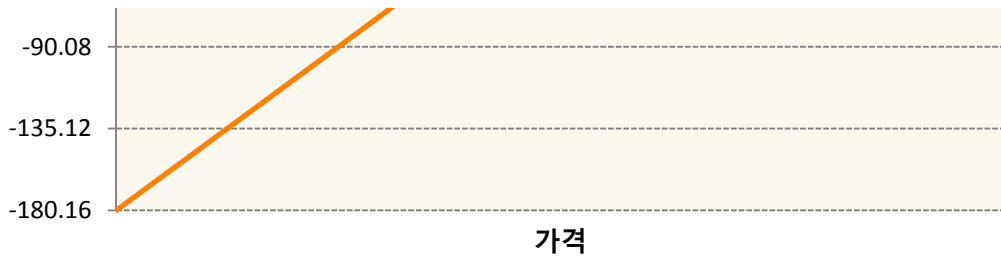
2. 만기시점의 손익구조

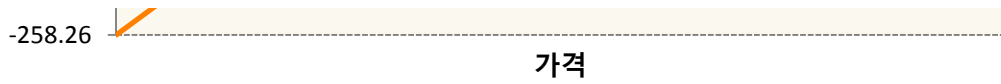
BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18



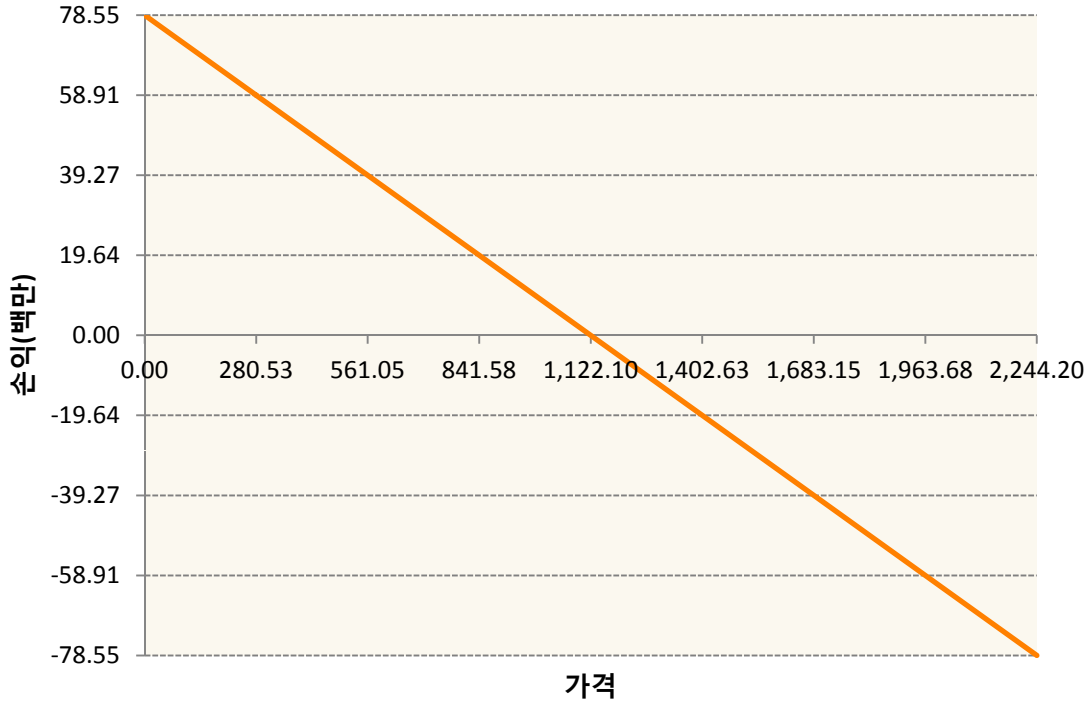
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



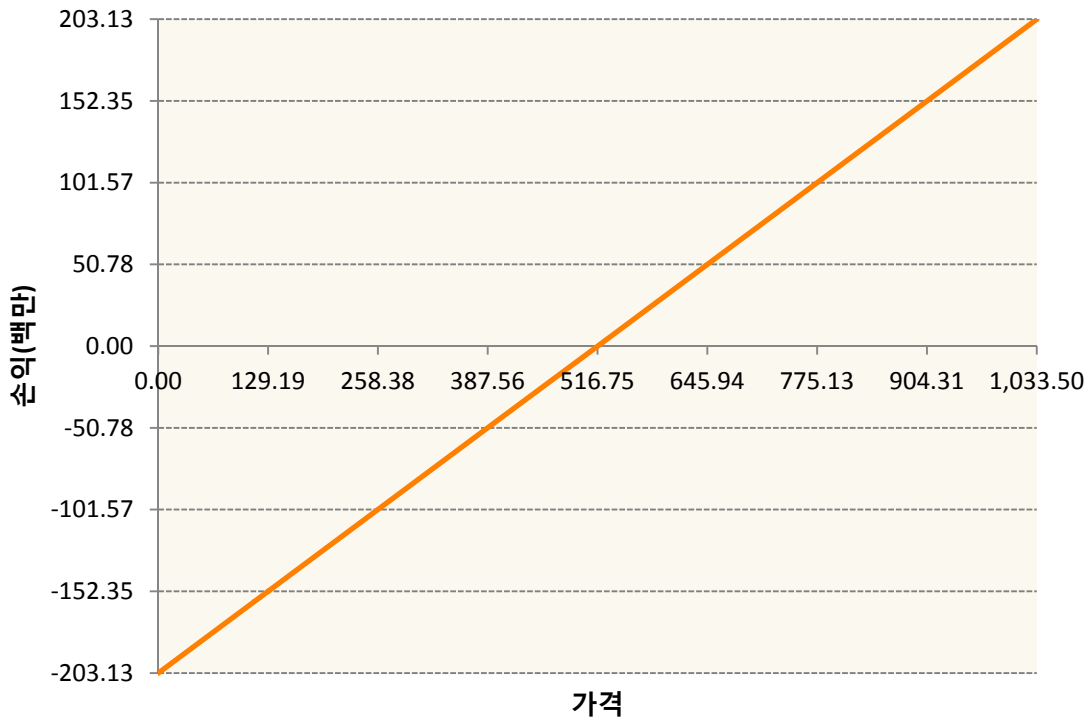




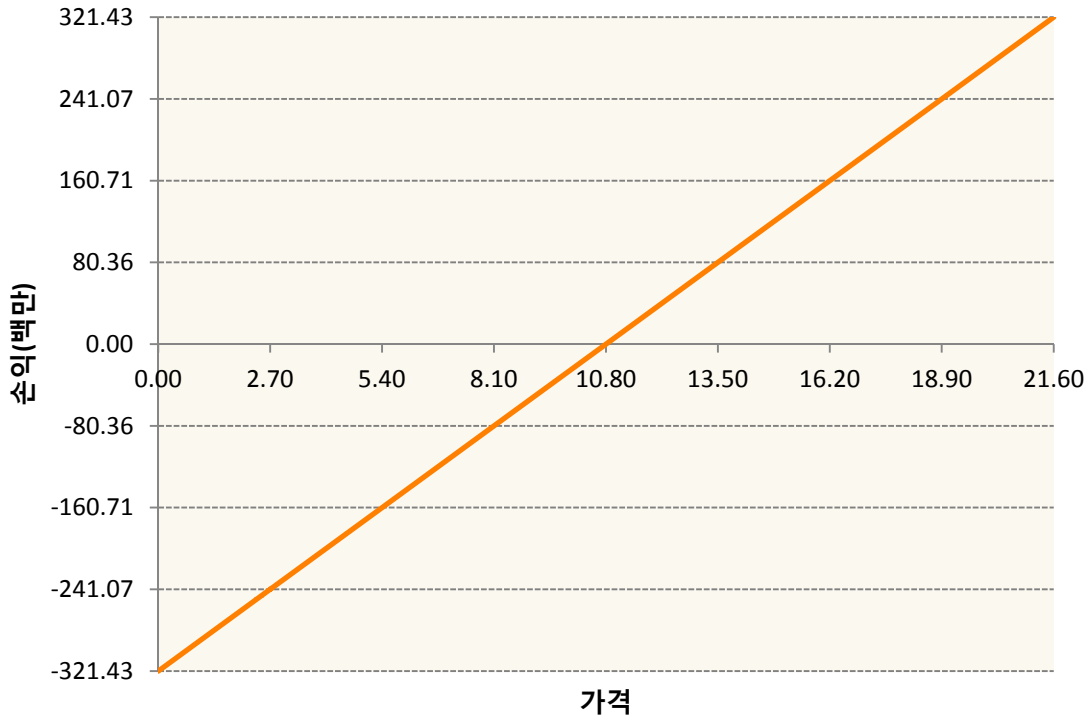
KR4175N90000-2018-09 달러선물



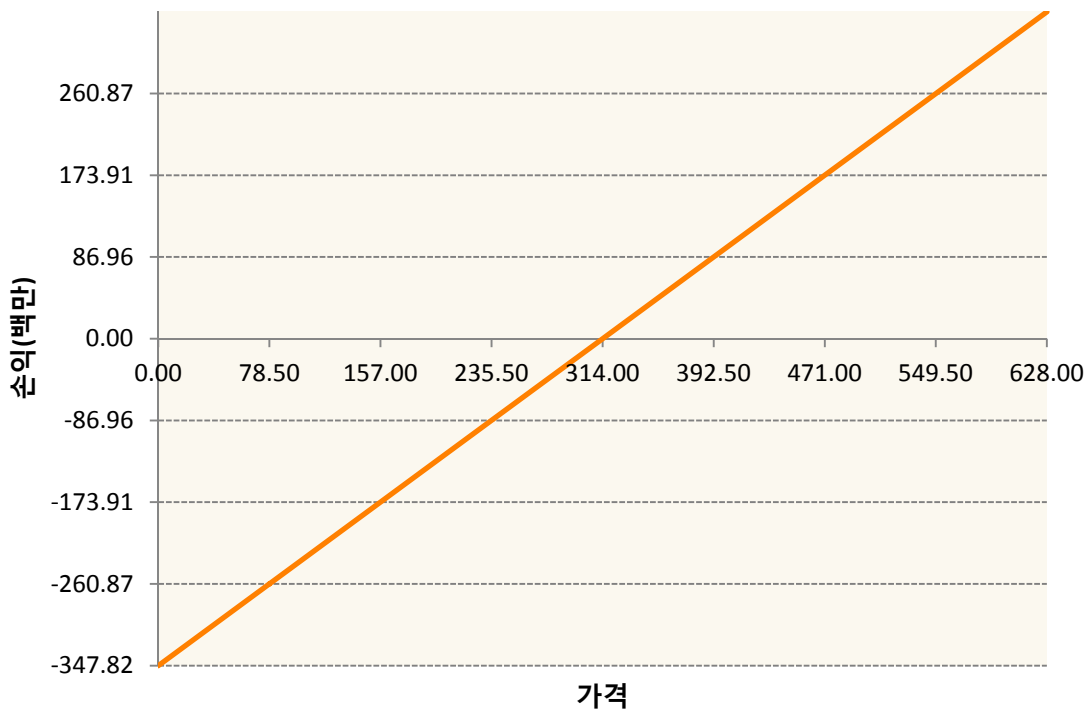
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

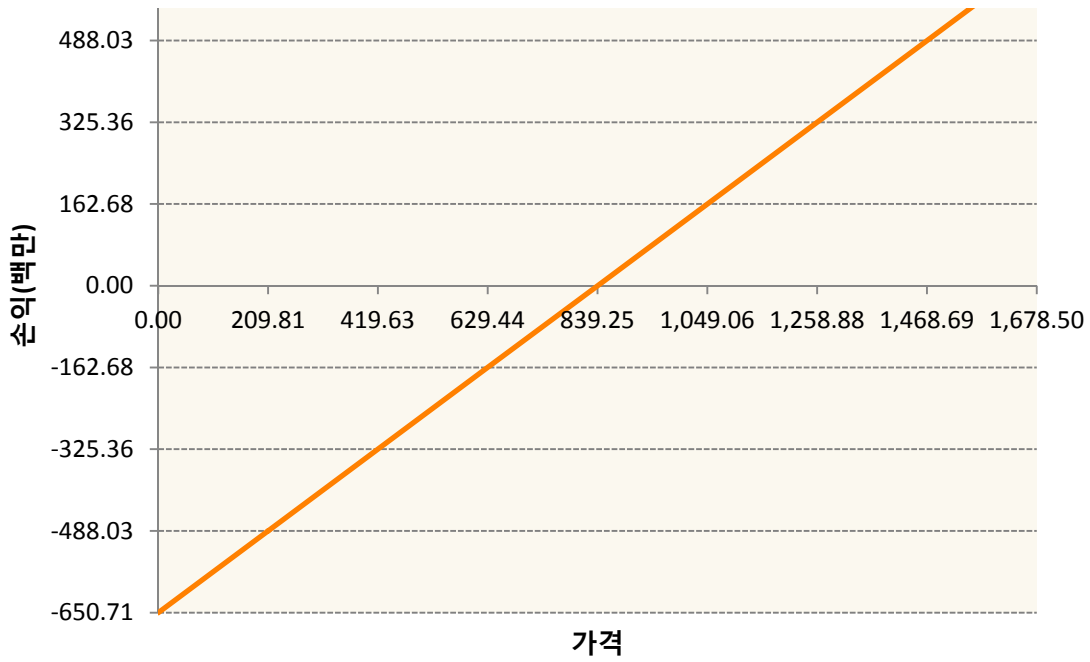


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

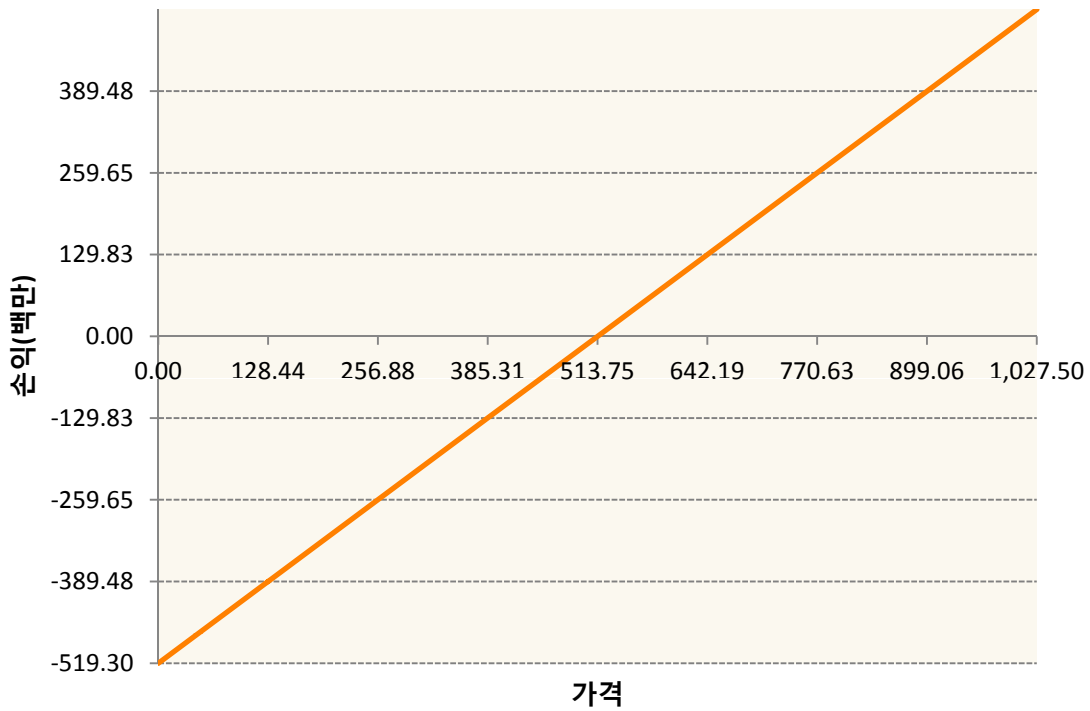


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





WZ8-WHEAT FUTURE(CBT) DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	23
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	14
CZ8	CORN FUTURE DEC18	66
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	21
KR4175N90C	2018-09 달러선물	6

KWZ8	KC HRW WHEAT FUT DEC18	16
SBV8	SUGAR #11 (WORLD) OCT18	26
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	28
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	52
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	42

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

(단위:백만원)

308