

공시일	2018-09-11
기준일	2018-09-10

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	2018-09-11
기준일	2018-09-10

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

1,134

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

480

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-11
기준일	2018-09-10

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	3,685	0	3,685	장외
누계	지수	스왑	3,685	0	3,685	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI500000 신한CSI500미래S180910

289

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

364

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-11
기준일	2018-09-10

유로인덱스모(주식-파생형)

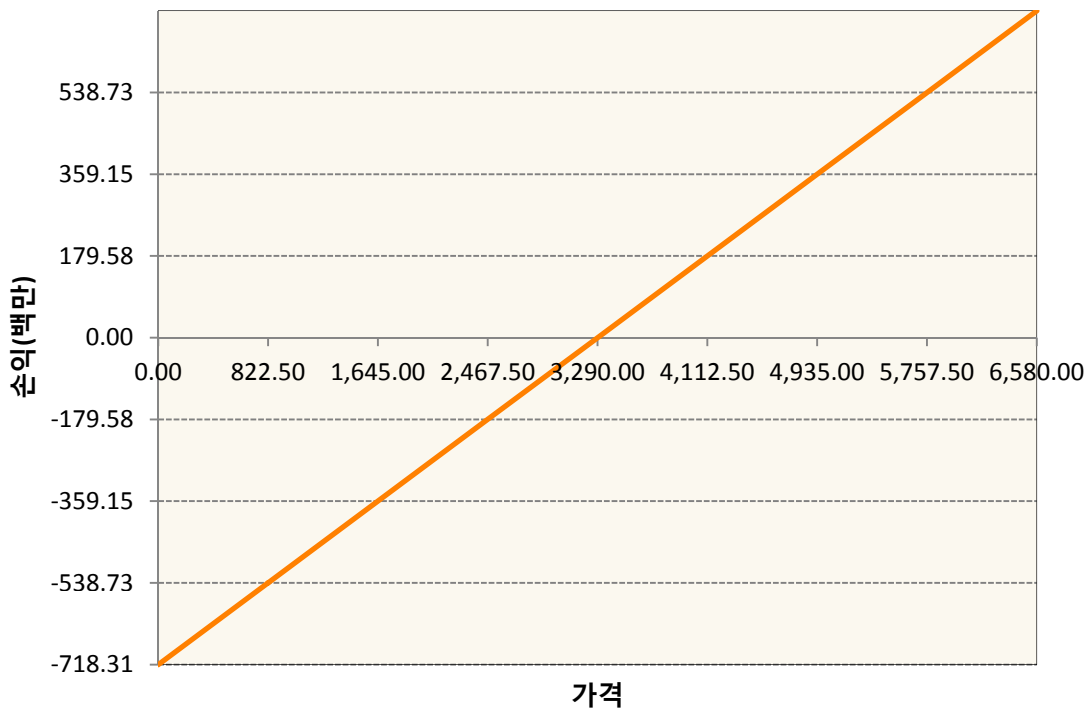
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	718	0	718	

2. 만기시점의 손익구조

VGU8-EURO STOXXX 50 SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU8	EURO STOXXX 50 SEP18	57
------	----------------------	----

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

(단위:백만원)

36

공시일	2018-09-11
기준일	2018-09-10

차이나인덱스모(주식-파생형)

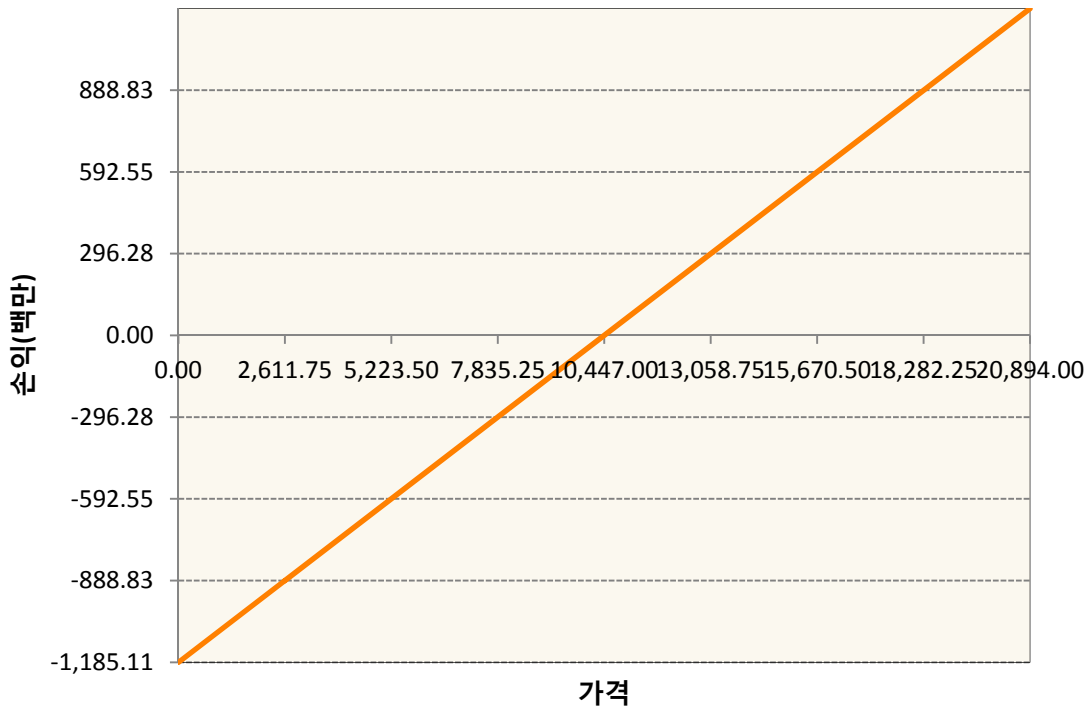
1. 계약금액

(단위:백만원)

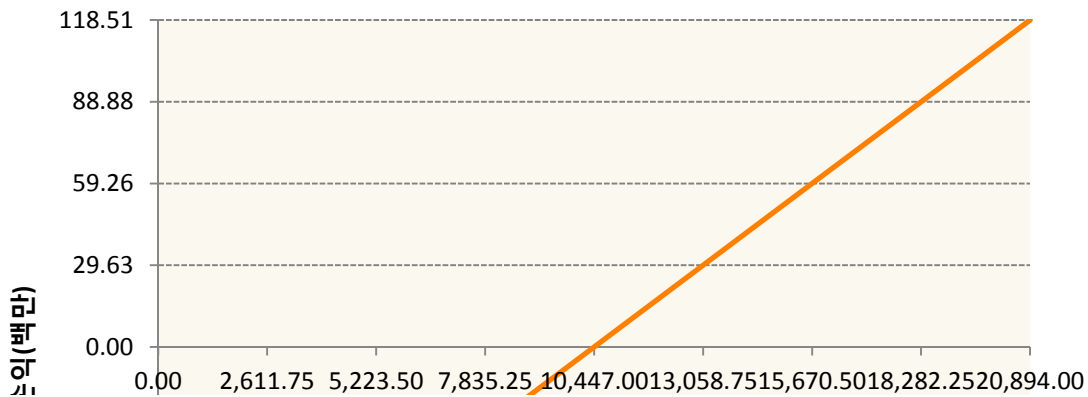
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	119	0	119	
누계	유가증권	선물	1,185	0	1,185	장내

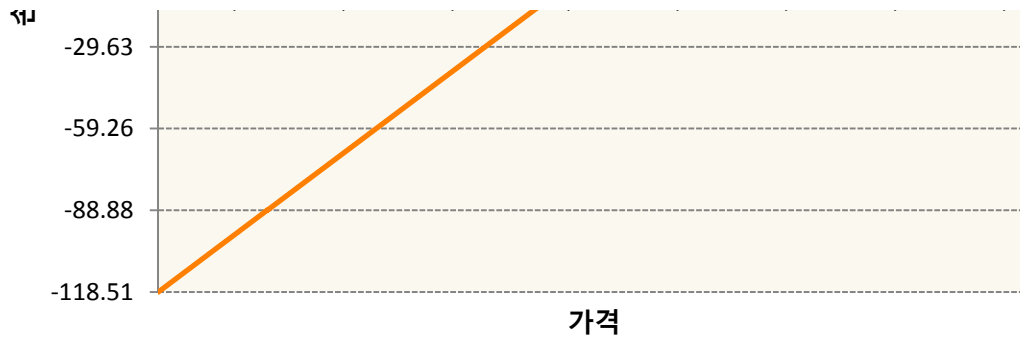
2. 만기시점의 손익구조

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	95
MHCU8	MINI H-SHR IDX Fut Sep18	9

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

96

공시일	2018-09-11
기준일	2018-09-10

커버드콜모(주식혼합-파생형)

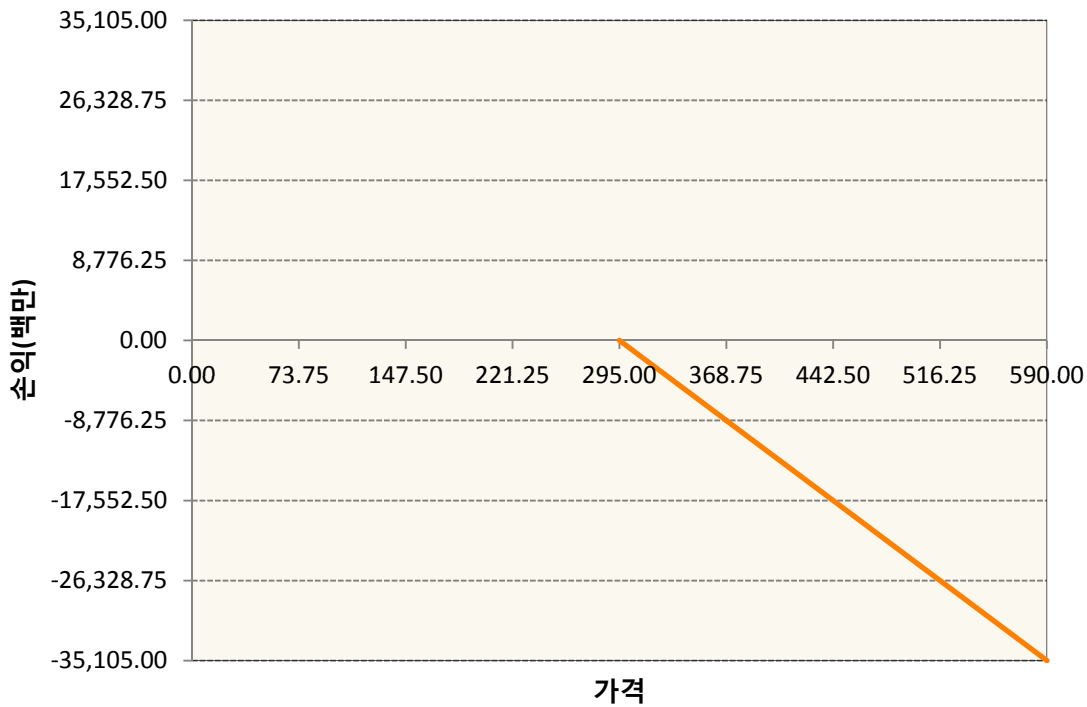
1. 계약금액

(단위:백만원)

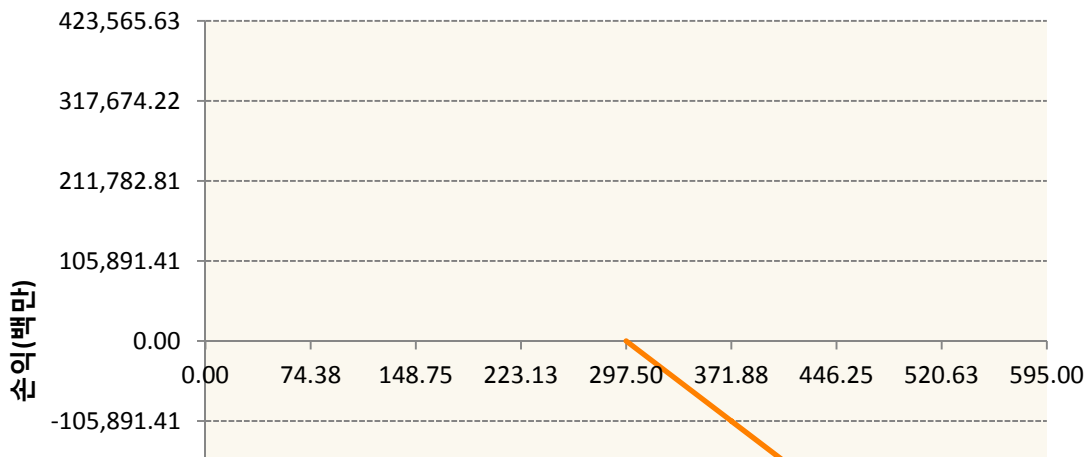
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	756,171	-756,171	장내

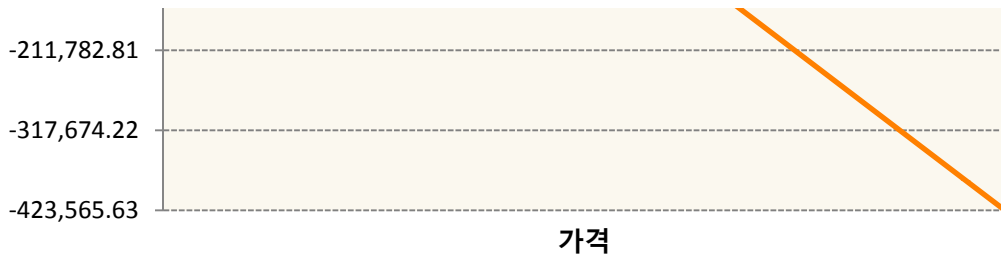
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92950-2018-09 콜295

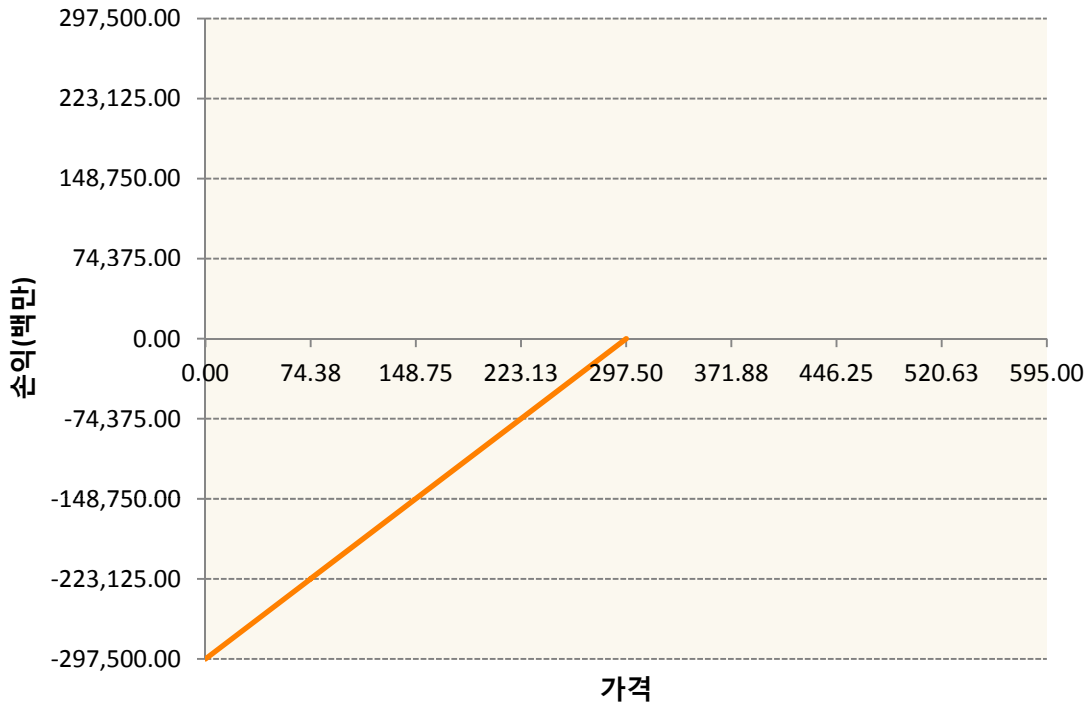


KR4201N92976-2018-09 콜297.5





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N929 2018-09 콜295

2,372

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	271	271	271	271	271	271	271
-5.33%	271	271	270	269	267	264	260
-2.67%	260	252	242	231	218	203	187
0%	84	56	28	0	-28	-56	-85
2.67%	-543	-558	-575	-594	-614	-636	-658
5.33%	-1,438	-1,439	-1,442	-1,446	-1,451	-1,458	-1,466
8.00%	-2,369	-2,369	-2,369	-2,369	-2,370	-2,371	-2,372

KR4201N929 2018-09 풋297.5

26,145

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,970	1,970	1,970	1,970	1,969	1,969	1,967

-5.33%	1,970	1,969	1,966	1,961	1,951	1,934	1,909
-2.67%	1,928	1,887	1,826	1,746	1,645	1,525	1,388
0%	859	583	296	0	-303	-611	-924
2.67%	-4,827	-5,101	-5,388	-5,684	-5,987	-6,297	-6,612
5.33%	-14,955	-15,002	-15,070	-15,159	-15,269	-15,399	-15,547
8.00%	-26,055	-26,057	-26,061	-26,070	-26,086	-26,110	-26,145

KR4301N929 2018-09 풋 297.5

23,270

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-23,270	-23,270	-23,270	-23,270	-23,270	-23,270	-23,270
-5.33%	-15,440	-15,440	-15,440	-15,440	-15,440	-15,440	-15,440
-2.67%	-7,609	-7,609	-7,609	-7,609	-7,609	-7,610	-7,612
0%	147	106	57	0	-63	-131	-204
2.67%	3,965	3,927	3,880	3,826	3,765	3,699	3,628
5.33%	4,030	4,030	4,030	4,030	4,029	4,028	4,026
8.00%	4,030	4,030	4,030	4,030	4,030	4,030	4,030

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

(단위:백만원)

64,896

공시일	2018-09-11
기준일	2018-09-10

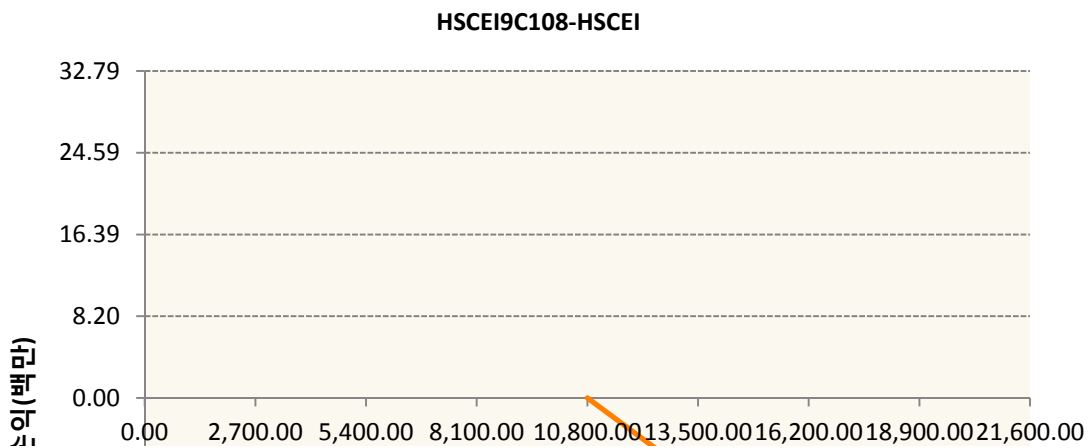
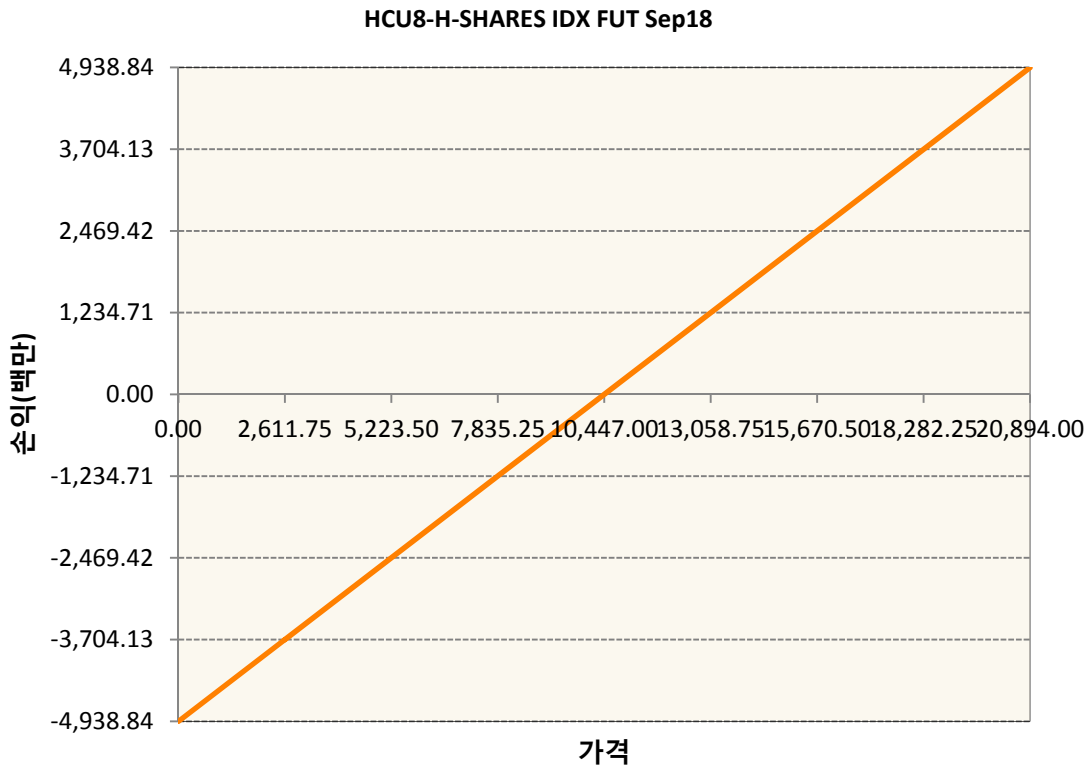
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

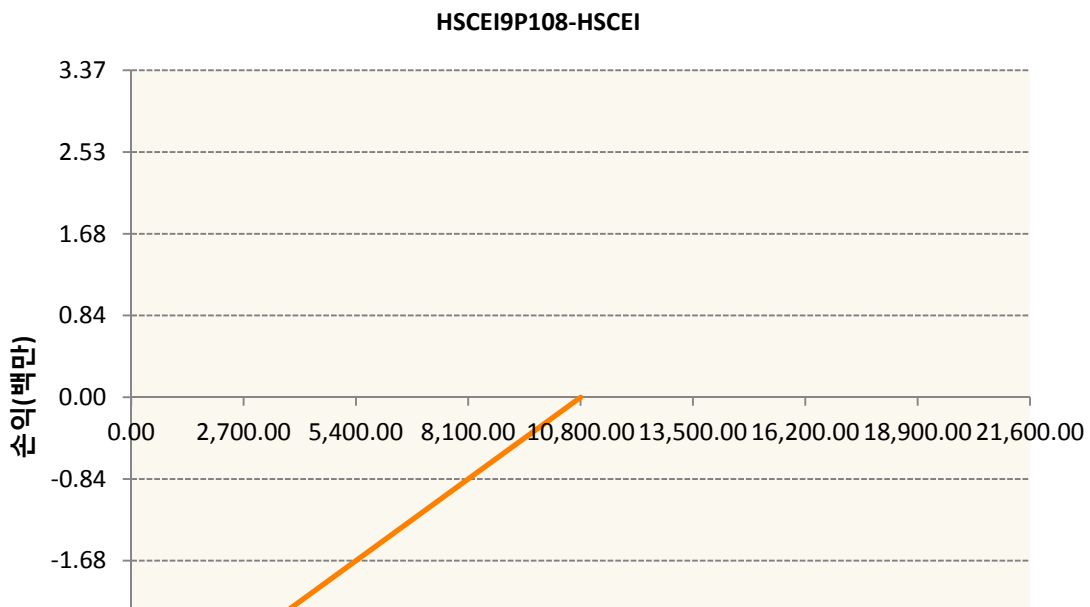
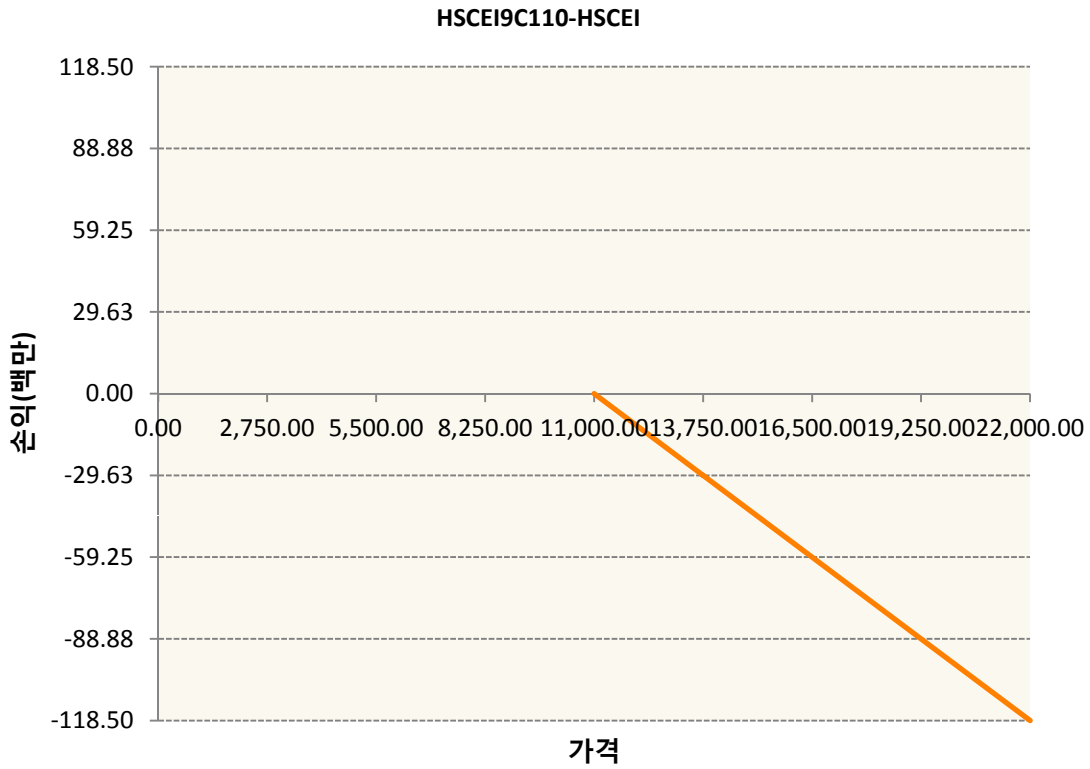
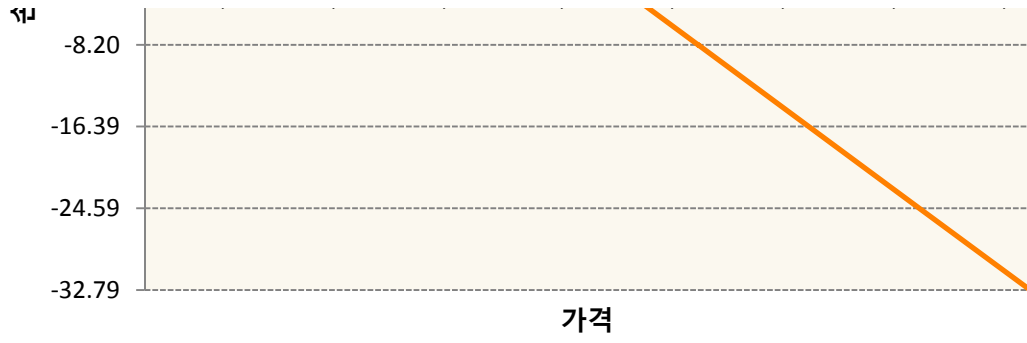
1. 계약금액

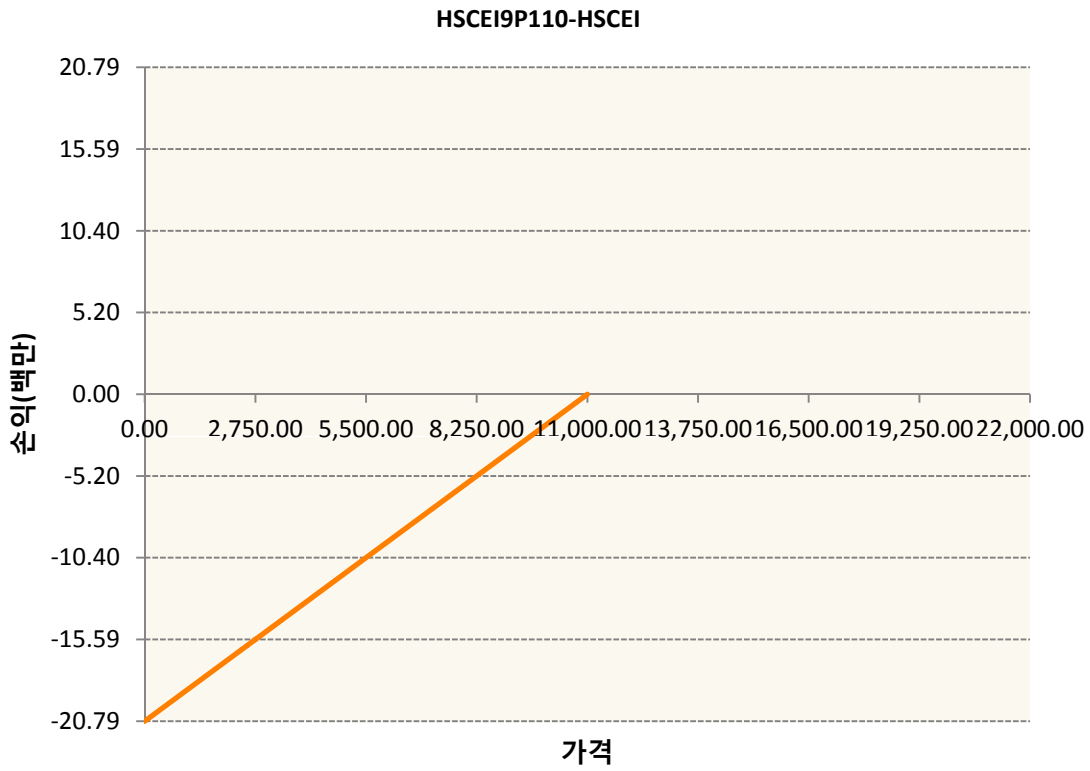
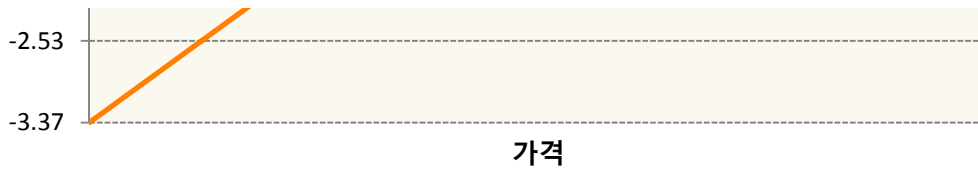
(단위:백만원)

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	4,939	0	4,939	장내
누계	유가증권	옵션	0	175	-175	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU8	H-SHARES IDX FUT Sep18	395
HSCEI9C108	HSCEI	3
HSCEI9C110	HSCEI	9
HSCEI9P108	HSCEI	0.3
HSCEI9P110	HSCEI	2

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	375

공시일	2018-09-11
기준일	2018-09-10

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

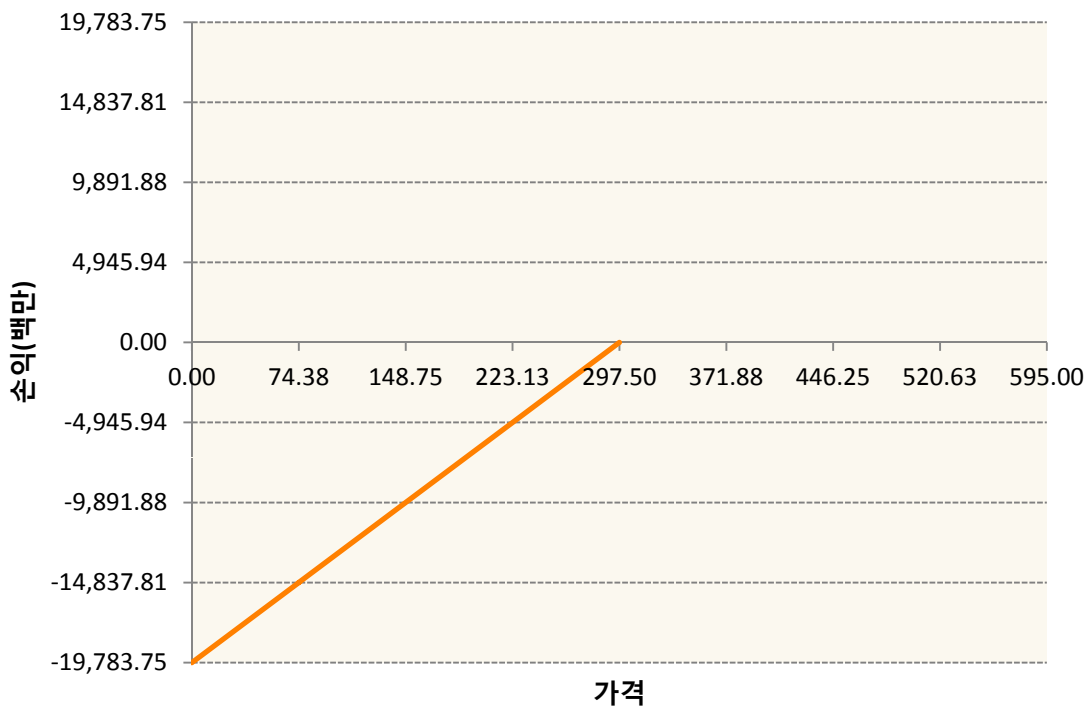


KR4301N92958-2018-09 풋295





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,988
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,988	-3,988	-3,988	-3,988	-3,988	-3,988	-3,988
-5.33%	-2,659	-2,659	-2,659	-2,659	-2,659	-2,659	-2,659
-2.67%	-1,329	-1,329	-1,329	-1,329	-1,329	-1,329	-1,329
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,329	1,329	1,329	1,329	1,329	1,329	1,329
5.33%	2,659	2,659	2,659	2,659	2,659	2,659	2,659
8.00%	3,988	3,988	3,988	3,988	3,988	3,988	3,988
KR4201N92974-2018-09 풋297.5							1,735
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	131	131	131	131	131	131	131
-5.33%	131	131	131	130	129	128	127
-2.67%	128	125	121	116	109	101	92
0%	57	39	20	0	-20	-41	-61
2.67%	-320	-339	-358	-377	-397	-418	-439
5.33%	-993	-996	-1,000	-1,006	-1,013	-1,022	-1,032
8.00%	-1,729	-1,729	-1,730	-1,730	-1,731	-1,733	-1,735

KR4301N929 2018-09 풋295

136

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-136	-136	-136	-136	-136	-136	-136
-5.33%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	13	13	12	12	12	12	12
5.33%	13	13	13	13	13	13	13
8.00%	13	13	13	13	13	13	13

KR4301N929 2018-09 풋297.5

1,547

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,547	-1,547	-1,547	-1,547	-1,547	-1,547	-1,547
-5.33%	-1,027	-1,027	-1,027	-1,027	-1,027	-1,027	-1,027
-2.67%	-506	-506	-506	-506	-506	-506	-506
0%	10	7	4	0	-4	-9	-14
2.67%	264	261	258	254	250	246	241
5.33%	268	268	268	268	268	268	268
8.00%	268	268	268	268	268	268	268

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

(단위:백만원)

8,320

공시일	2018-09-11
기준일	2018-09-10

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

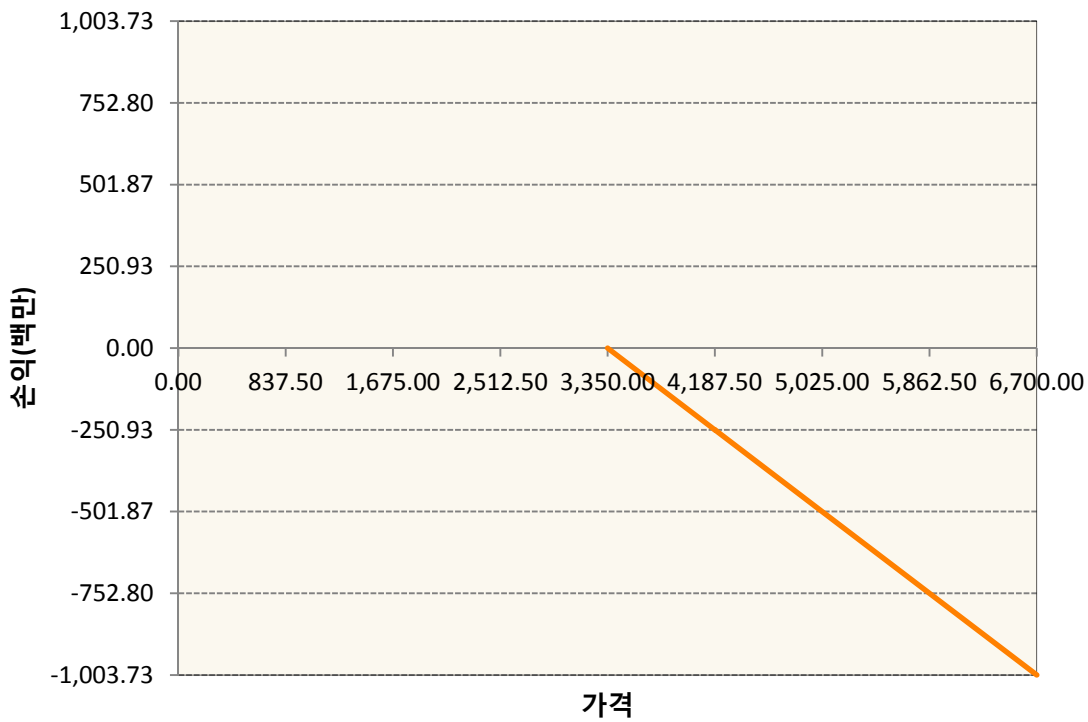
1. 계약금액

(단위:백만원)

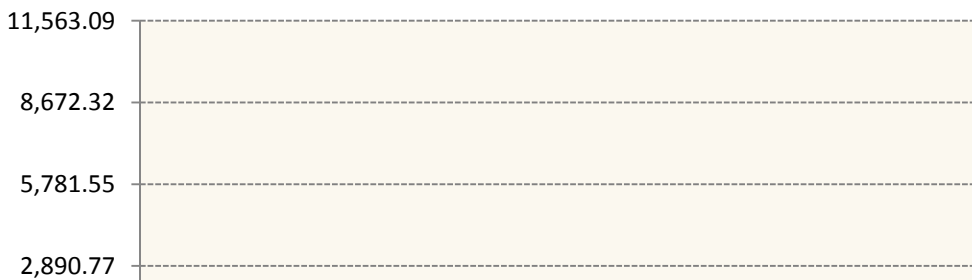
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,388	0	5,388	
누계	유가증권	옵션	0	25,134	-25,134	장내
누계	지수	스왑	87,289	0	87,289	장외

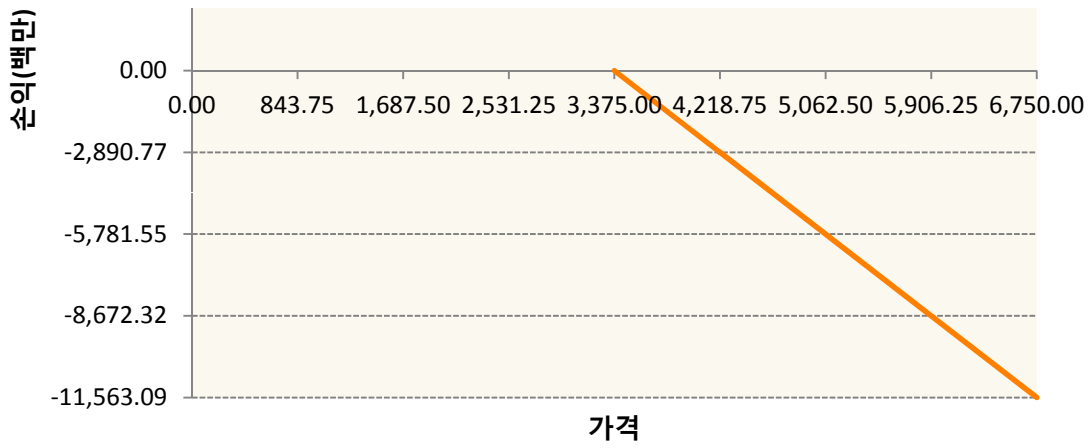
2. 만기시점의 손익구조

OESXU8-C3350-EURO STOXX 50

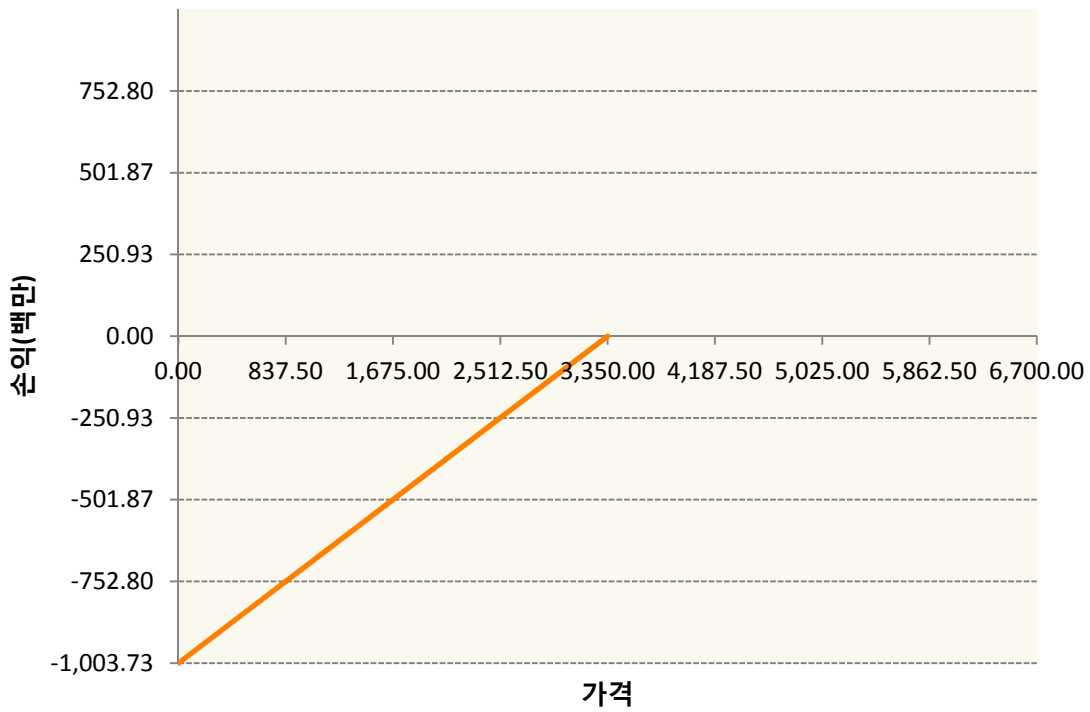


OESXU8-C3375-EURO STOXX 50

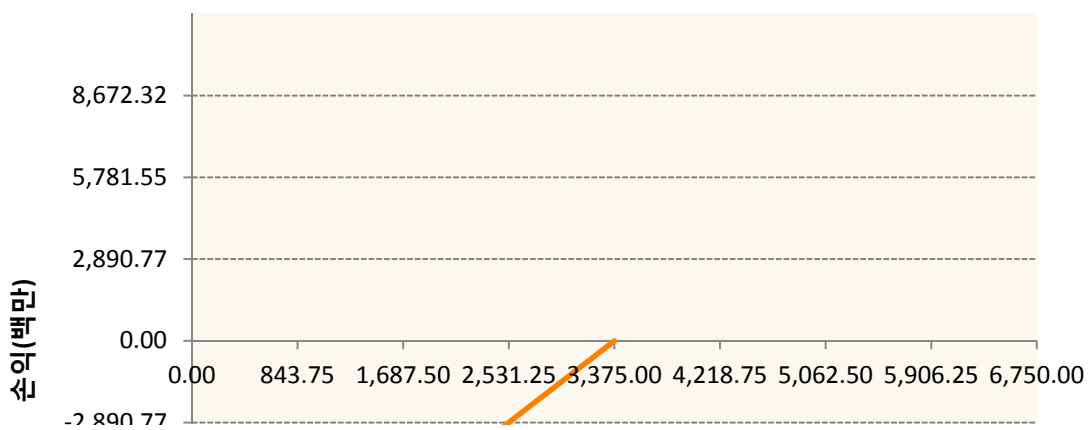


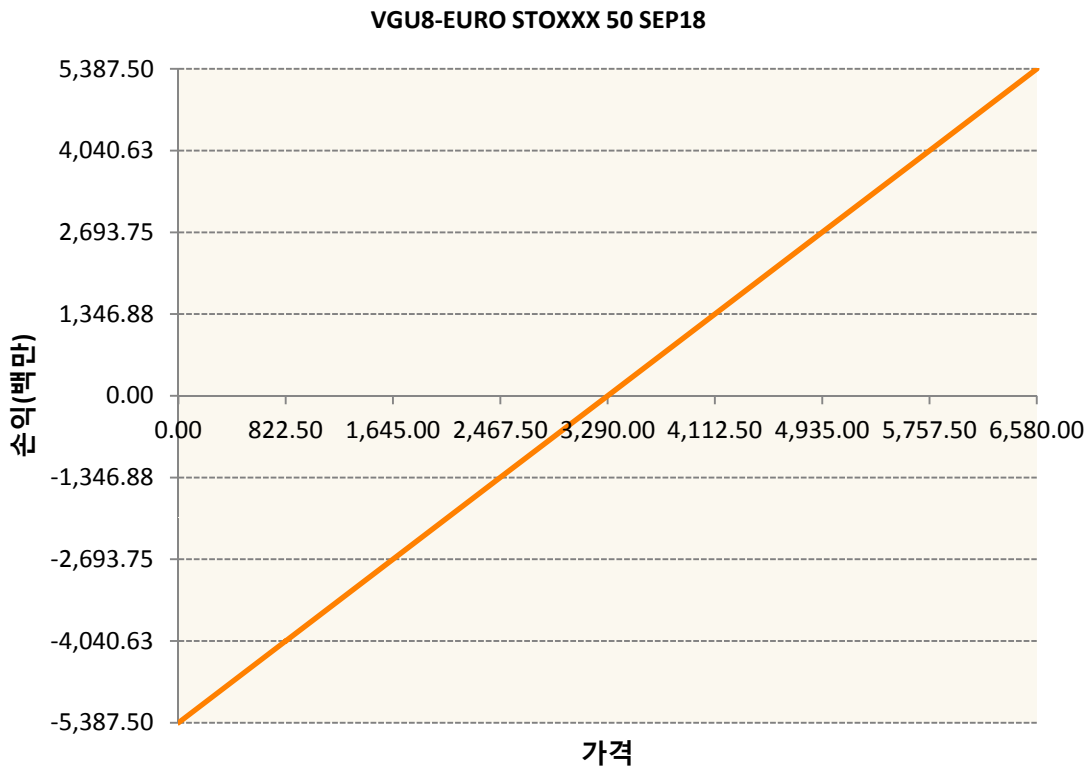
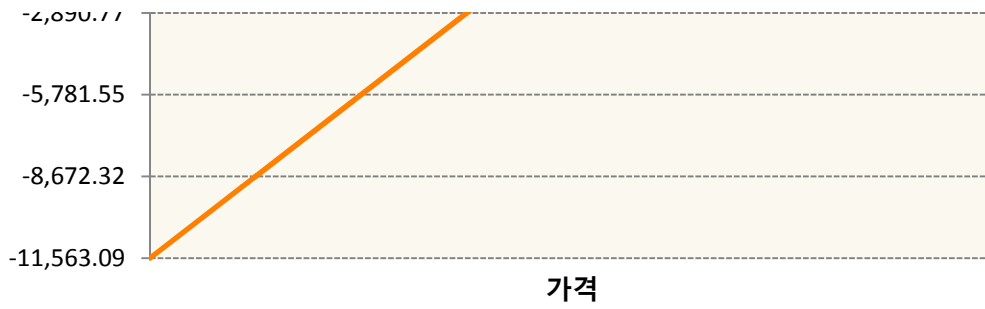


OESXU8-P3350-EURO STOXX 50



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	80
OESXU8-C33 EURO STOXX 50	925
OESXU8-P33 EURO STOXX 50	80
OESXU8-P33 EURO STOXX 50	925
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18	431

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

1,640

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

(단위:백만원)

1,127

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)

164

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-09-11
기준일	2018-09-10

리디파인K200(주식혼합-파생재간

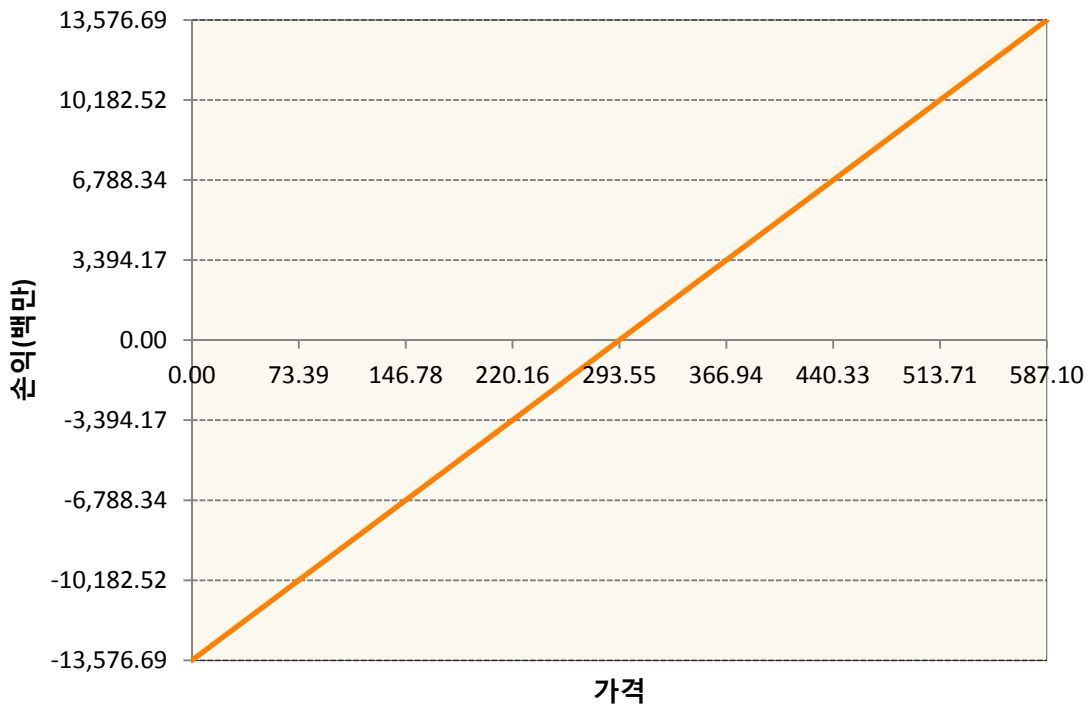
1. 계약금액

(단위:백만원)

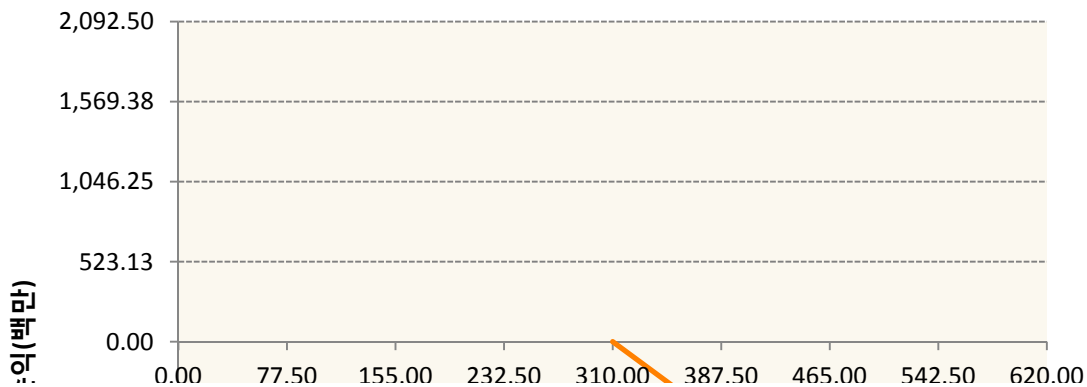
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,577	0	13,577	장내
누계	유가증권	옵션	1,339	24,671	-23,332	장내

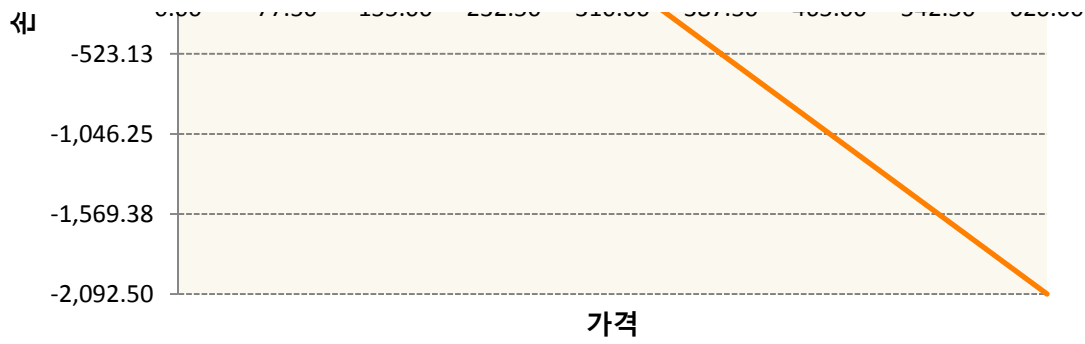
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

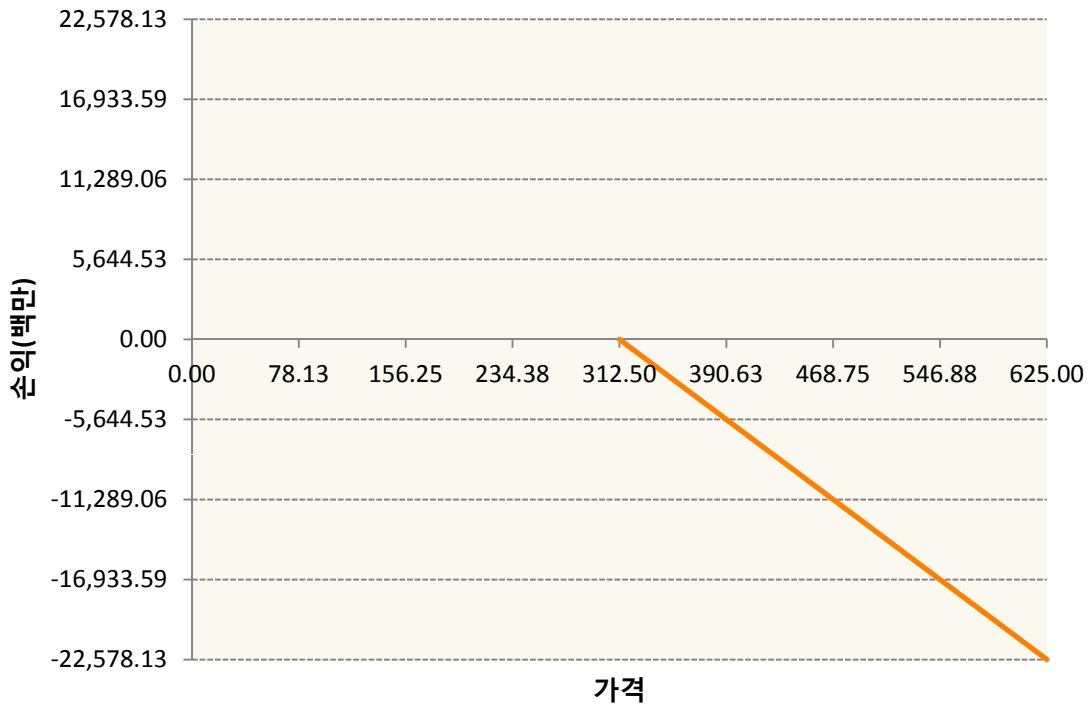


KR4201N93107-2018-09 콜310

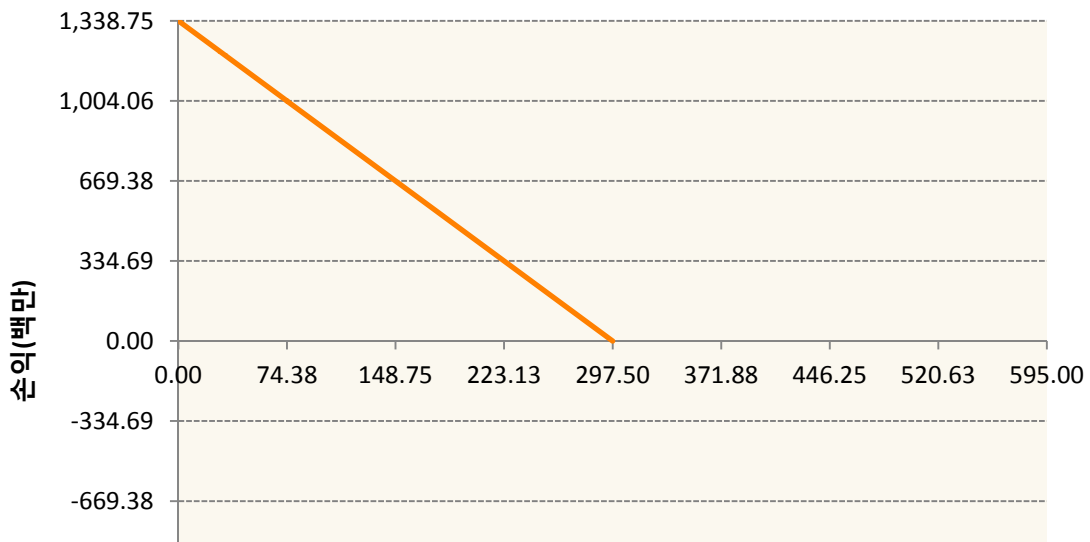


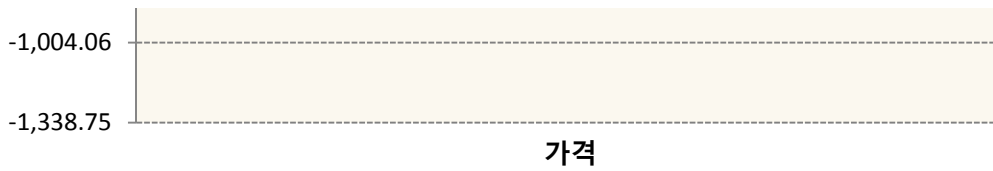


KR4201N93123-2018-09 콜312.5



KR4301N92974-2018-09 풋297.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물							1,087
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,087	-1,087	-1,087	-1,087	-1,087	-1,087	-1,087
-5.33%	-724	-724	-724	-724	-724	-724	-724
-2.67%	-362	-362	-362	-362	-362	-362	-362
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	362	362	362	362	362	362	362
5.33%	724	724	724	724	724	724	724
8.00%	1,087	1,087	1,087	1,087	1,087	1,087	1,087
KR4201N931 2018-09 콜310							57
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	-1	-1	-2	-3	-4	-5	-6
5.33%	-13	-15	-16	-18	-20	-22	-23
8.00%	-50	-51	-52	-53	-54	-56	-57
KR4201N931 2018-09 콜312.5							479
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1
-2.67%	1	1	1	1	1	1	1
0%	1	1	1	0	-1	-2	-4
2.67%	-3	-6	-11	-17	-24	-31	-40
5.33%	-75	-91	-107	-124	-141	-158	-176
8.00%	-387	-401	-416	-431	-447	-463	-479
KR4301N92C 2018-09 풋297.5							105
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	105	105	105	105	105	105	105
-5.33%	69	69	69	69	69	69	69
-2.67%	34	34	34	34	34	34	34

0%	-1	0	0	0	0	1	1
2.67%	-18	-18	-17	-17	-17	-17	-16
5.33%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
8.00%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18

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

(단위:백만원)

1,024

공시일	2018-09-11
기준일	2018-09-10

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

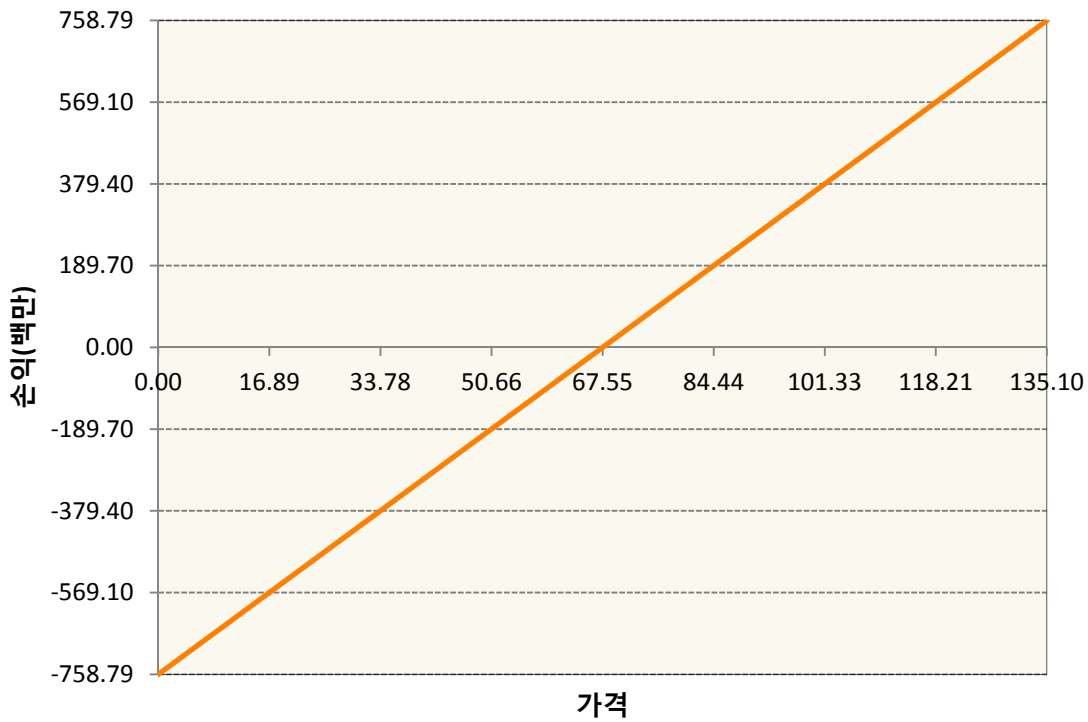
1. 계약금액

(단위:백만원)

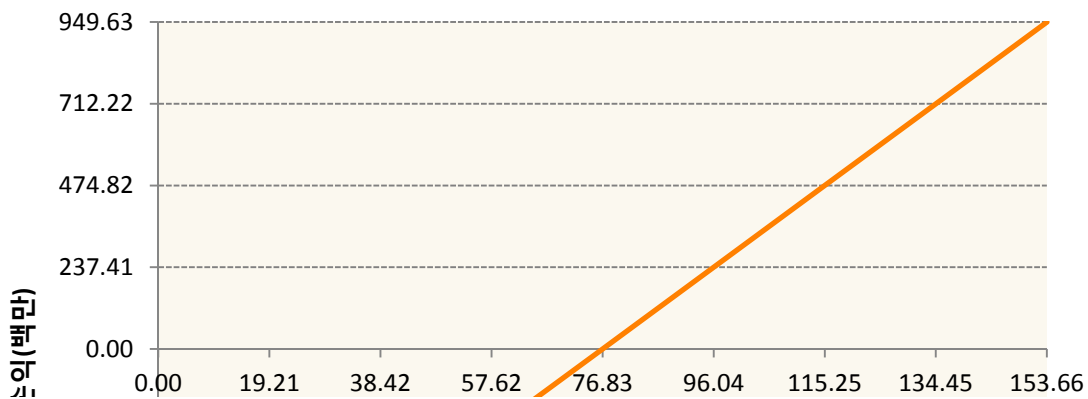
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,108	621	2,487	
누계	유가증권	선물	524	0	524	장내

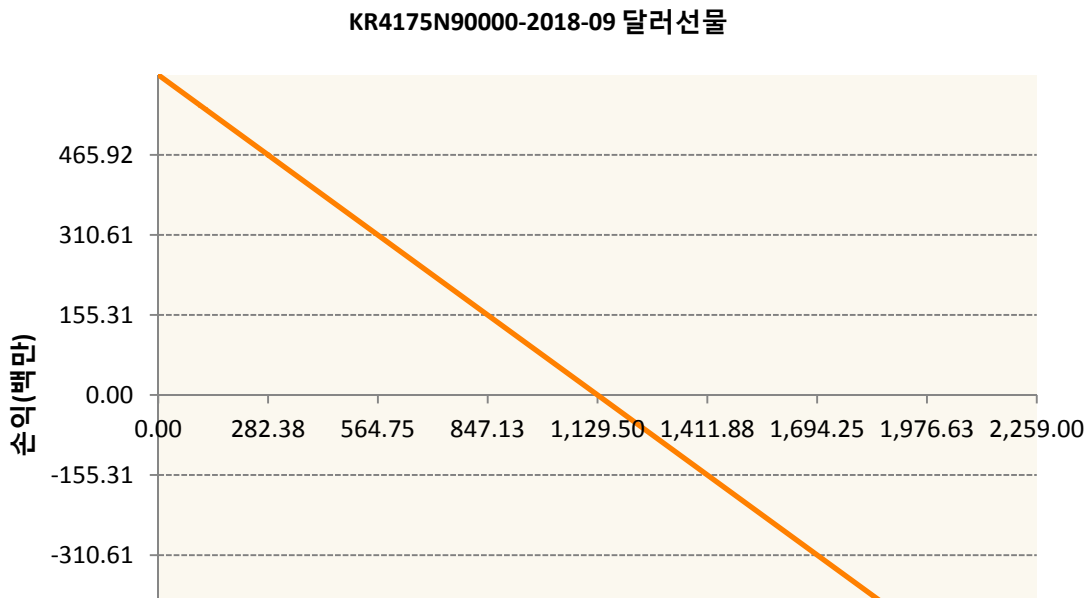
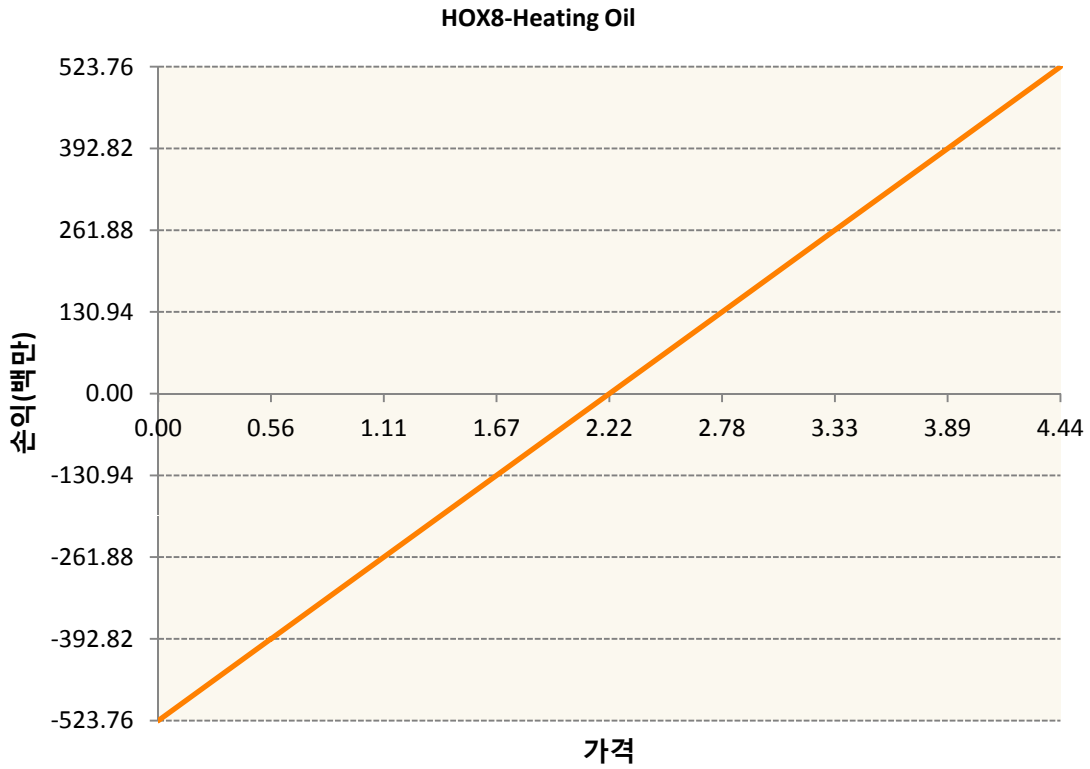
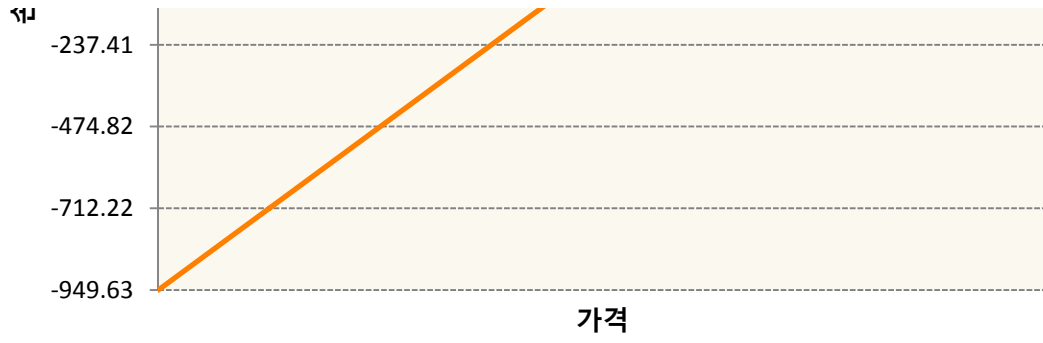
2. 만기시점의 손익구조

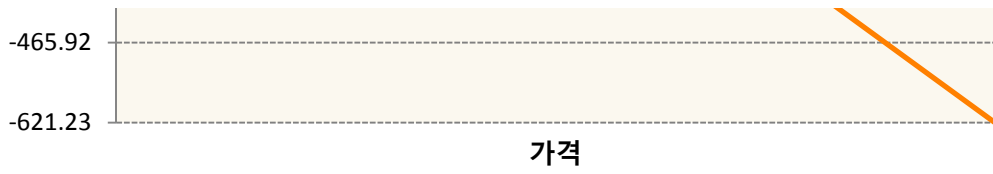
CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18



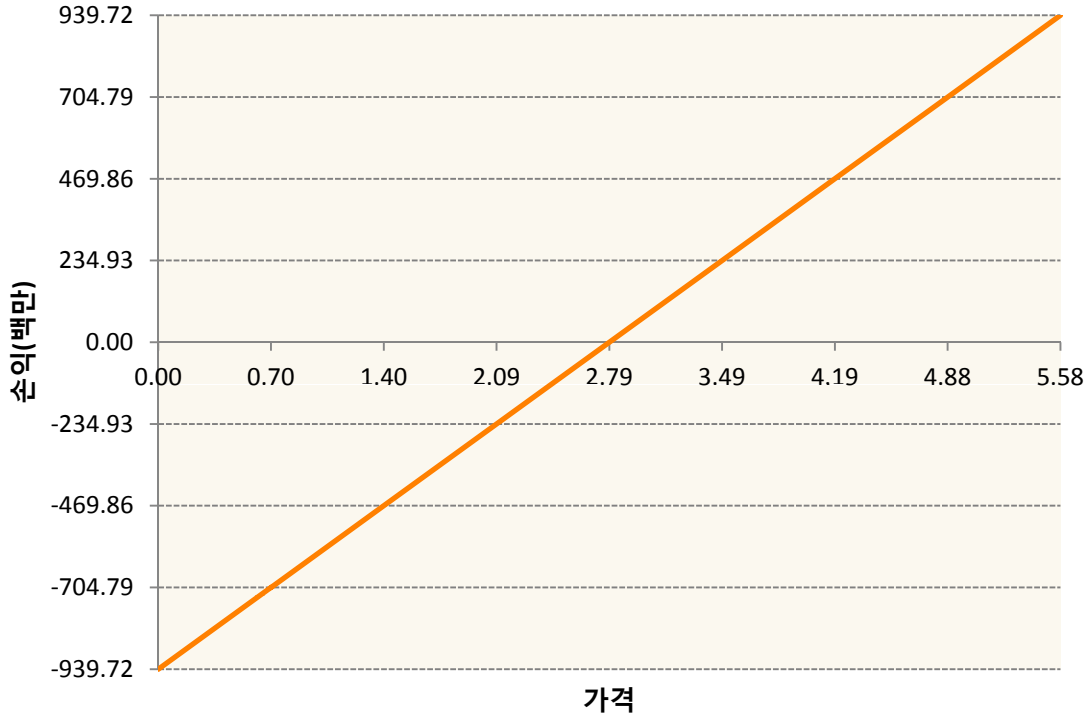
COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18



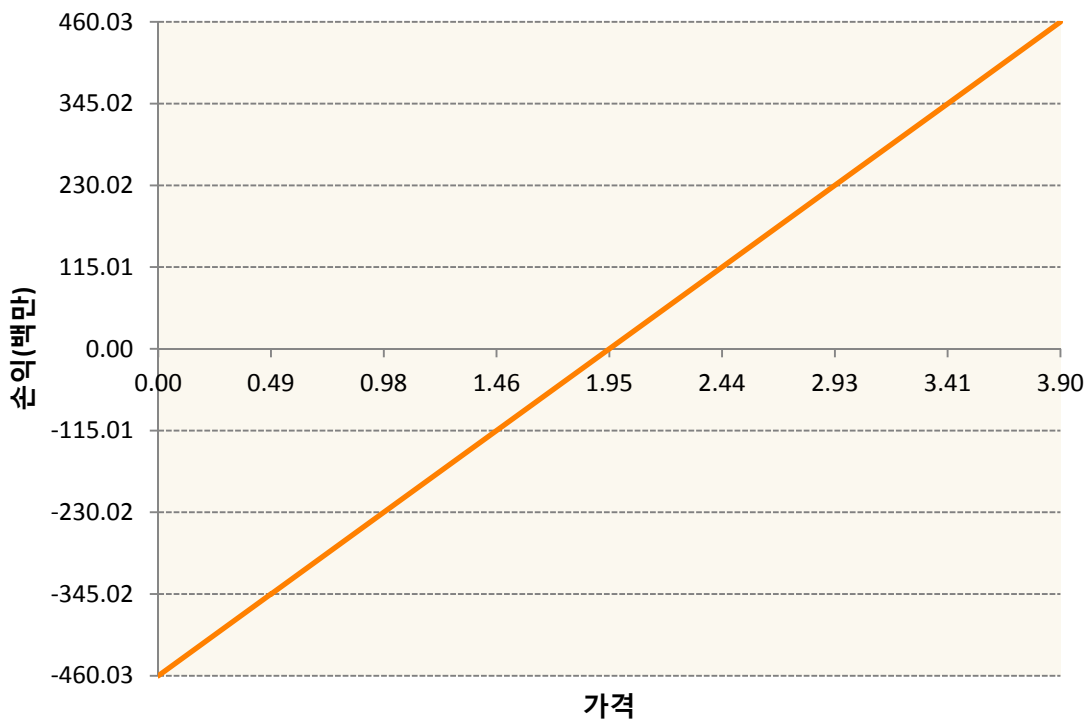




NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18



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	50
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	75
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	37

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	433

공시일	2018-09-11
기준일	2018-09-10

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

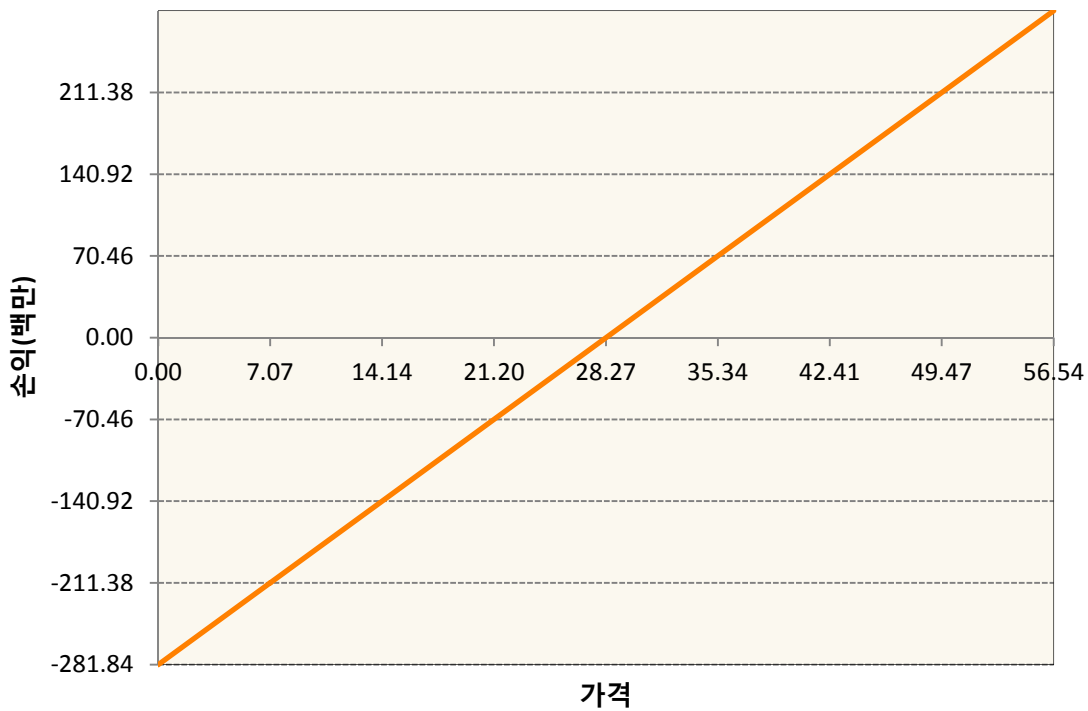
1. 계약금액

(단위:백만원)

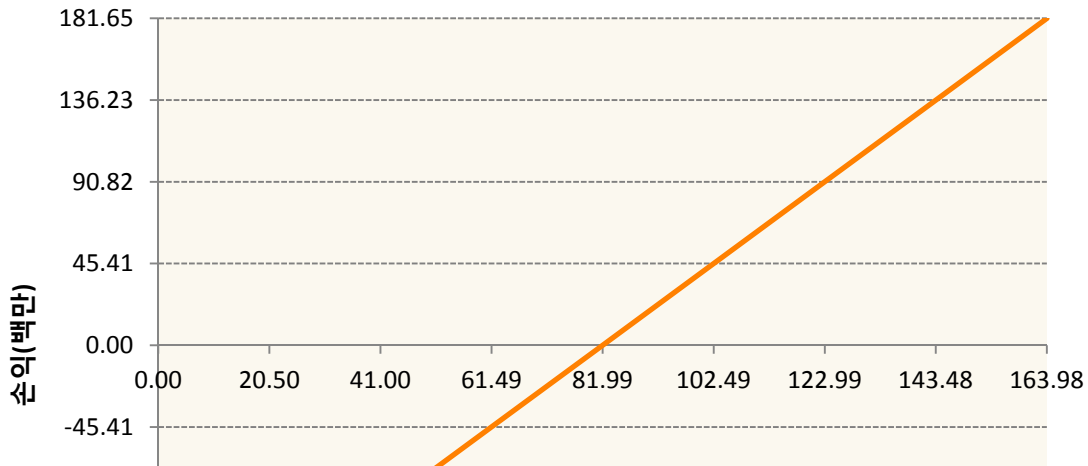
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,598	79	3,519	

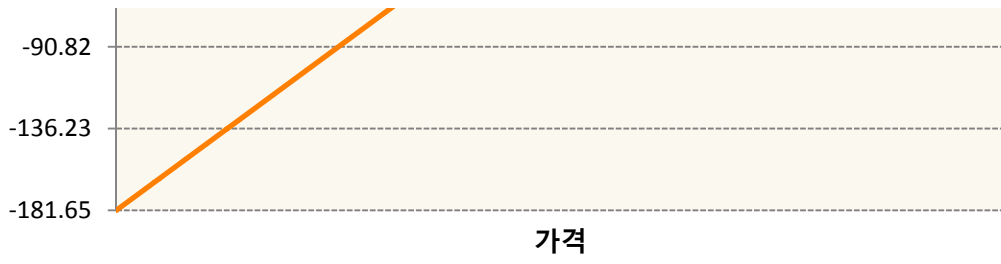
2. 만기시점의 손익구조

BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18

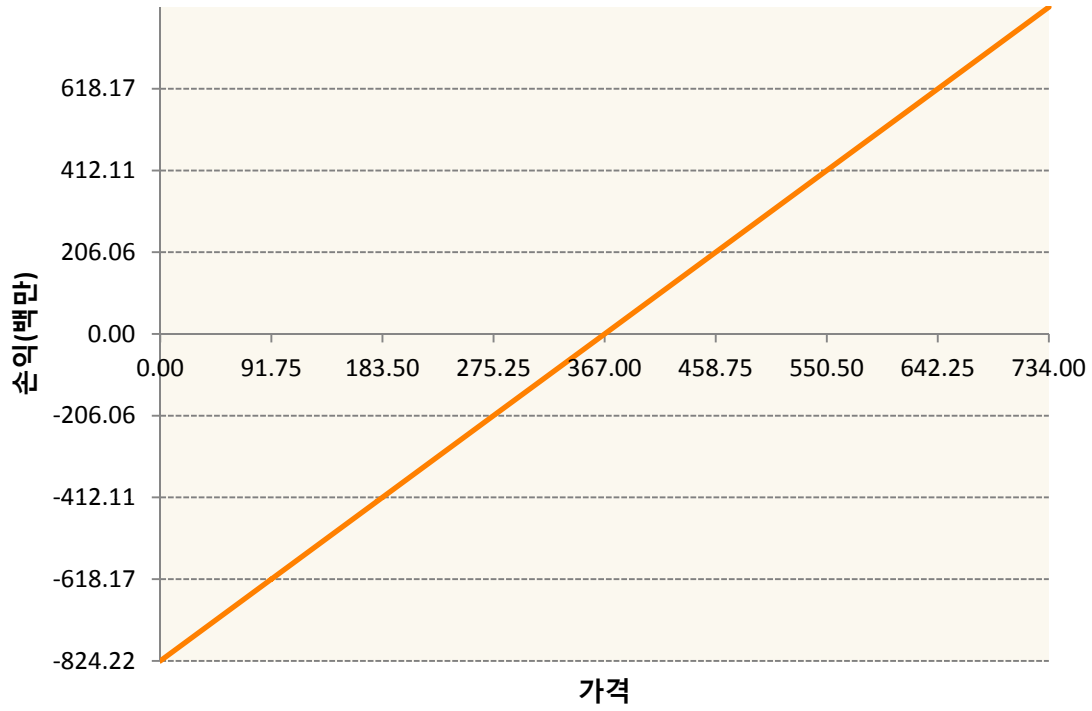


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

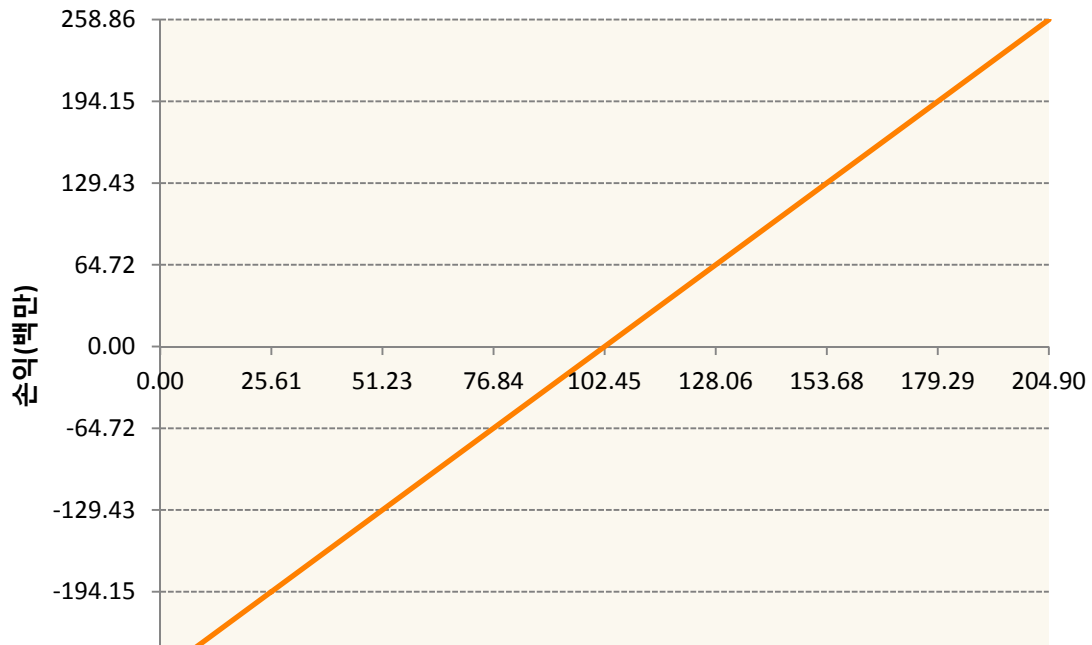


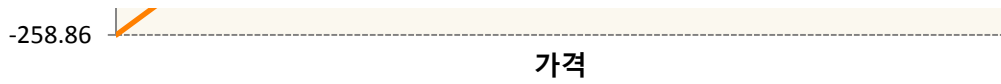


CZ8-CORN FUTURE DEC18

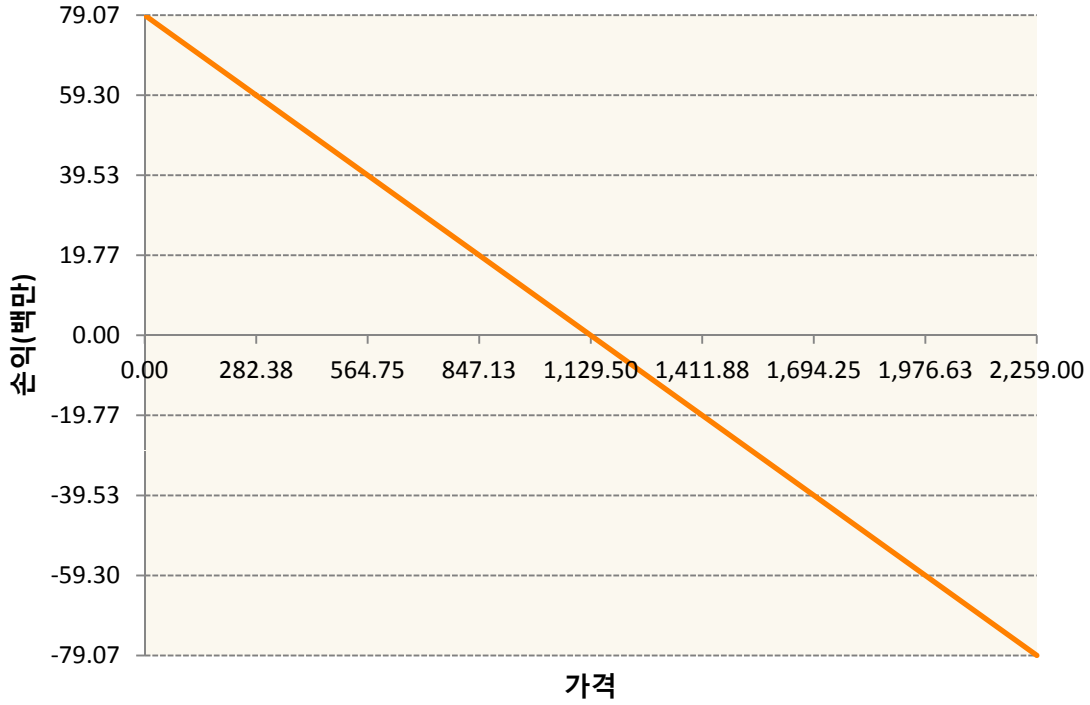


KCZ8-COFFEE 'C' FUTURE Dec18

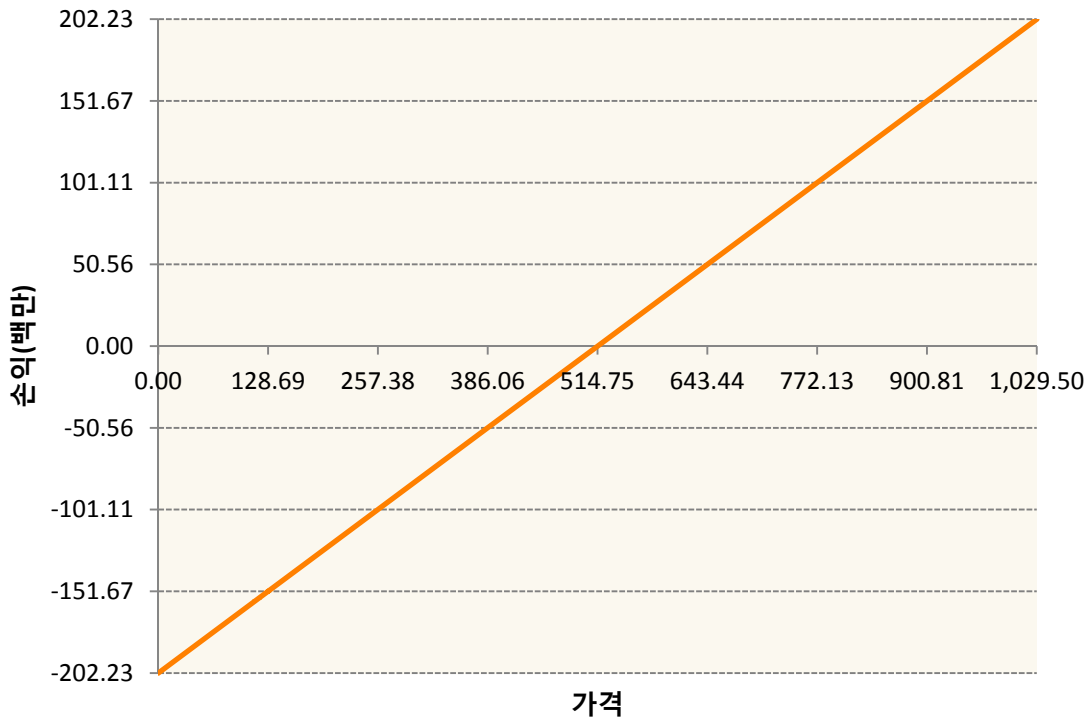




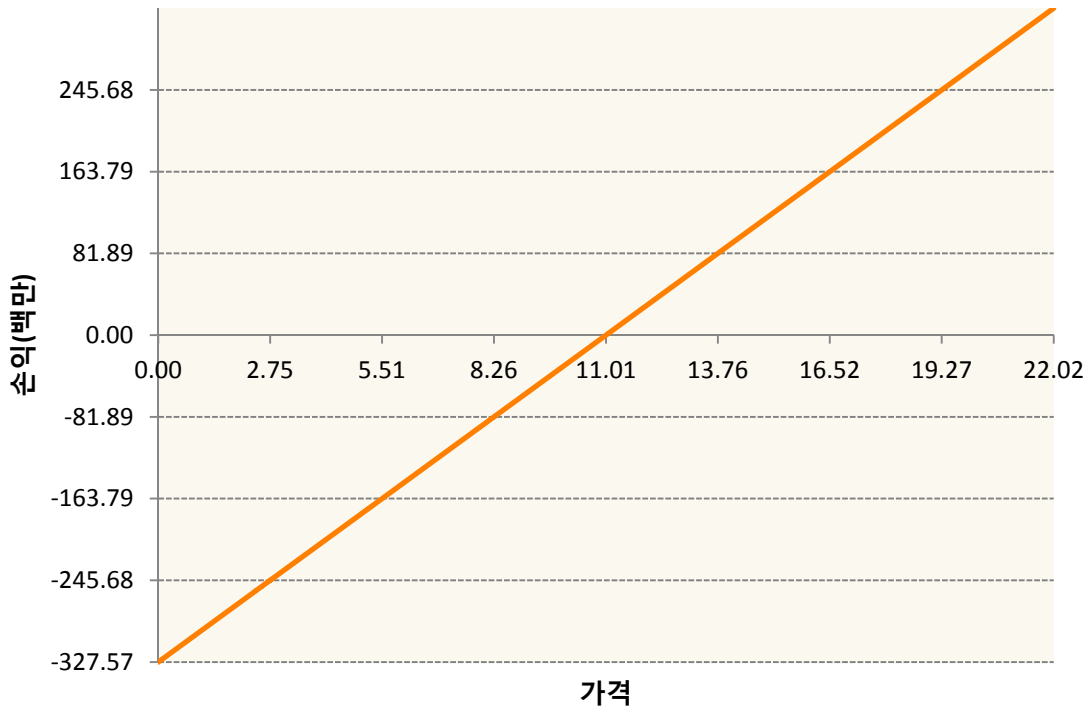
KR4175N90000-2018-09 달러선물



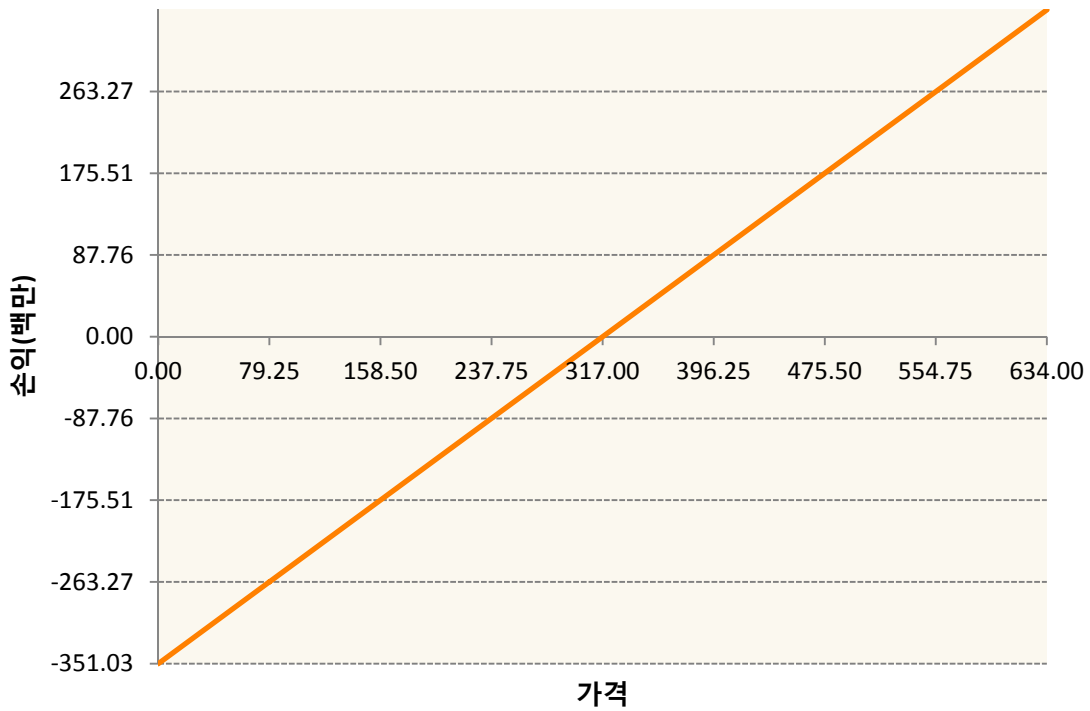
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

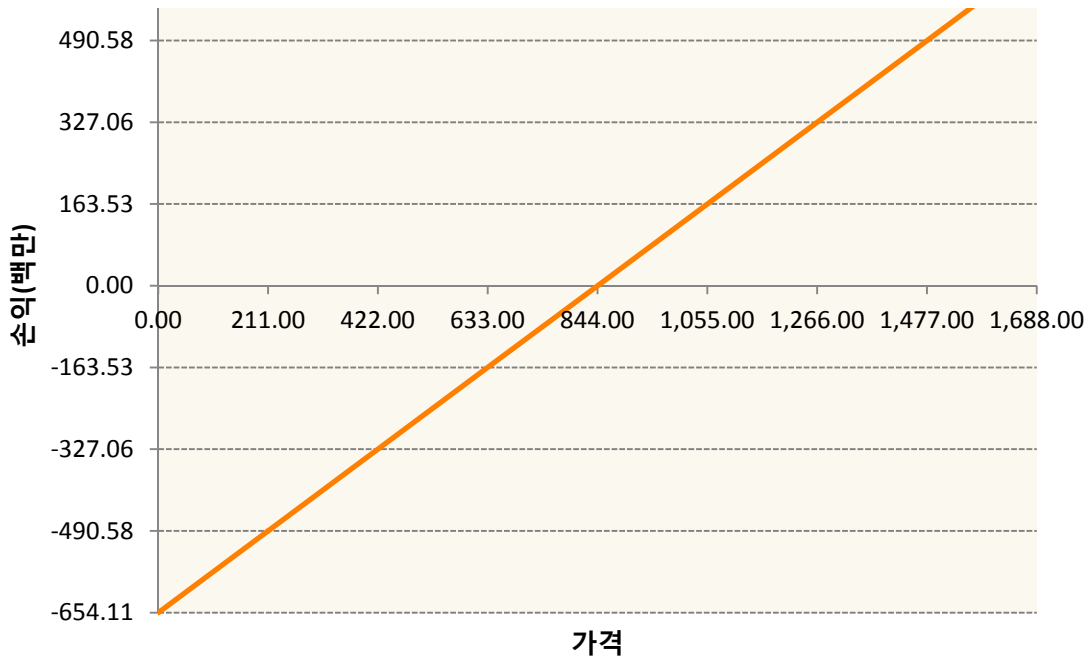


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

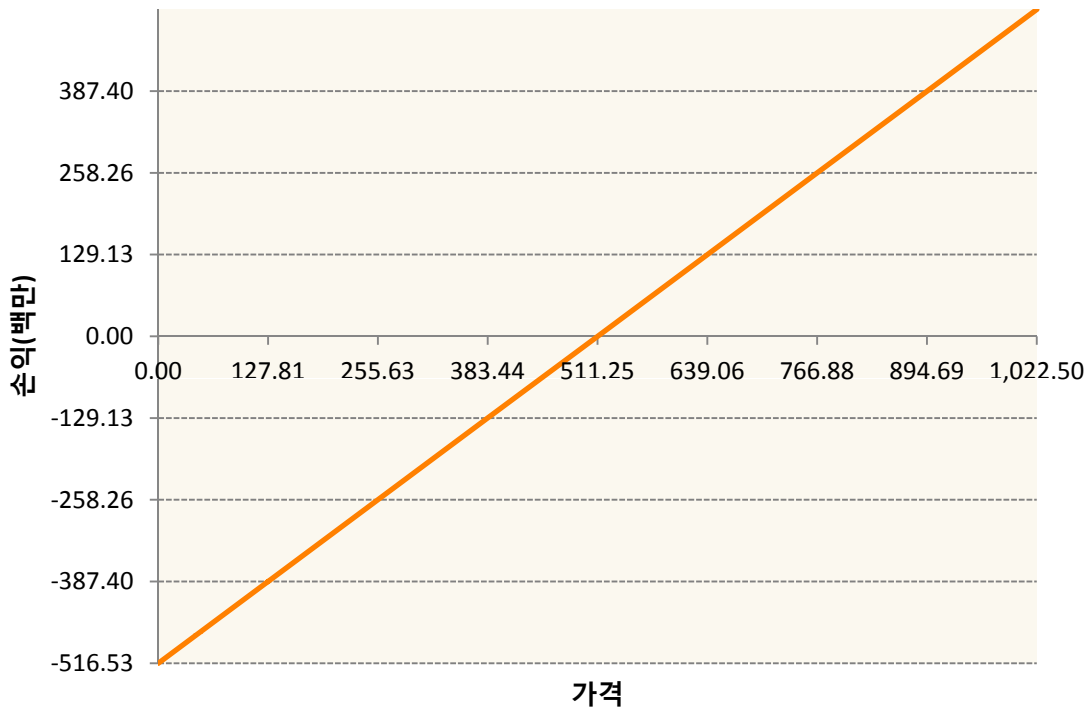


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





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	16
SBV8	SUGAR #11 (WORLD) OCT18	26
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	28
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	52
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	41

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

(단위:백만원)

309