

공시일	2018-09-12
기준일	2018-09-11

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	2018-09-12
기준일	2018-09-11

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

1,137

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

481

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-12
기준일	2018-09-11

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	3,685	0	3,685	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI500000 신한CSI500미래S180910

288

* 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	2018-09-12
기준일	2018-09-11

유로인덱스모(주식-파생형)

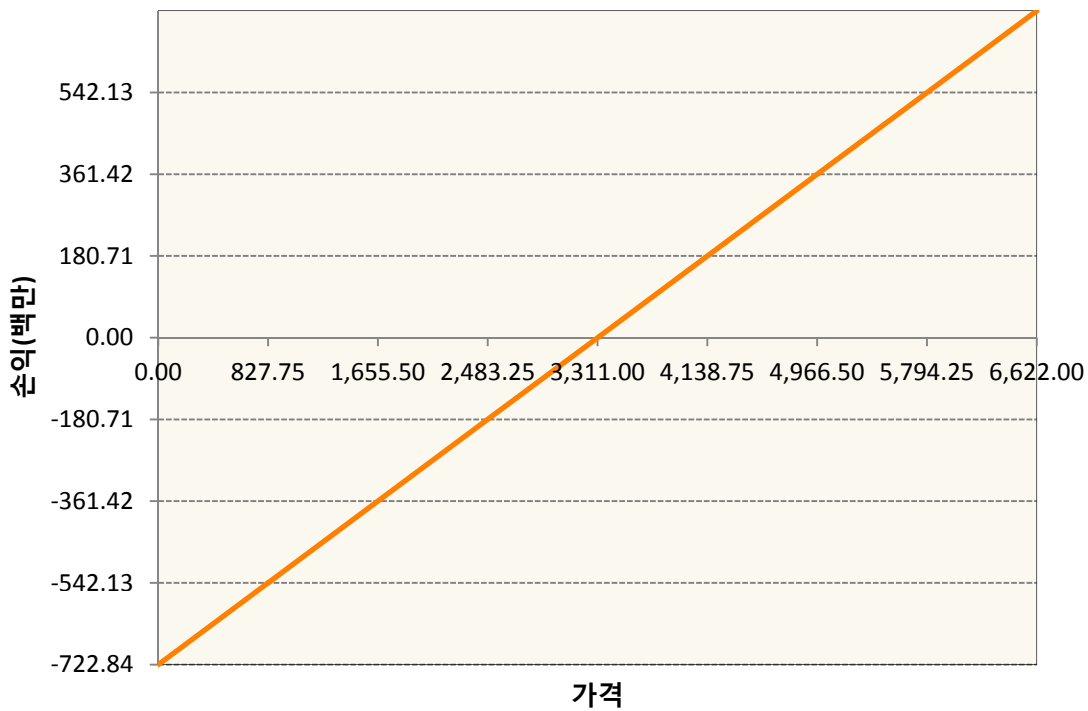
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	723	0	723	

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	2018-09-12
기준일	2018-09-11

차이나인덱스모(주식-파생형)

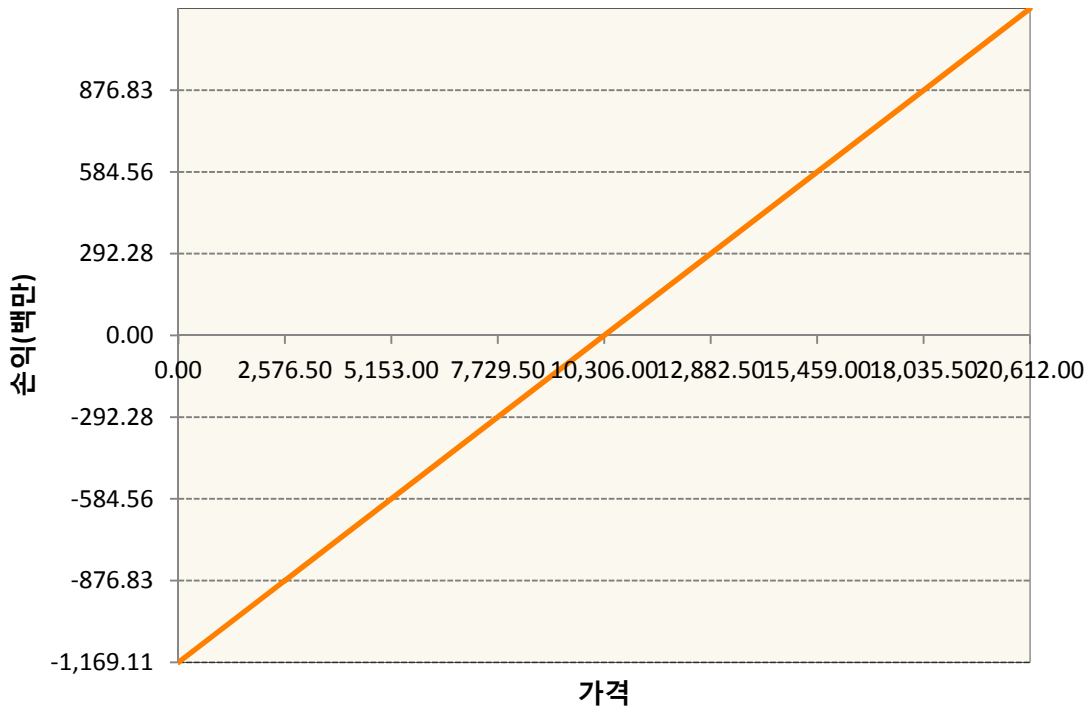
1. 계약금액

(단위:백만원)

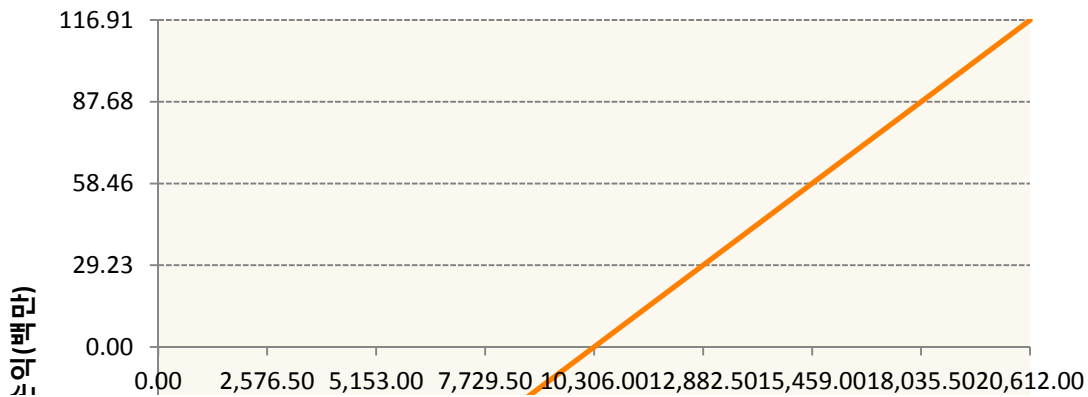
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	117	0	117	
누계	유가증권	선물	1,169	0	1,169	장내

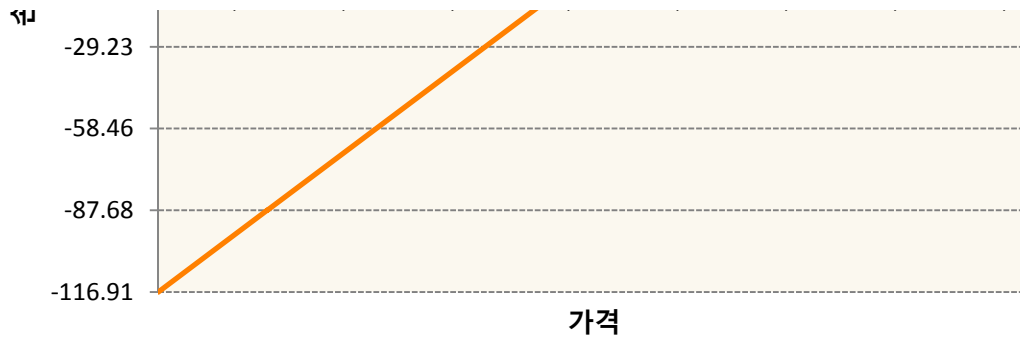
2. 만기시점의 손익구조

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	94
MHCU8	MINI H-SHR IDX Fut Sep18	9

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

94

공시일	2018-09-12
기준일	2018-09-11

커버드콜모(주식혼합-파생형)

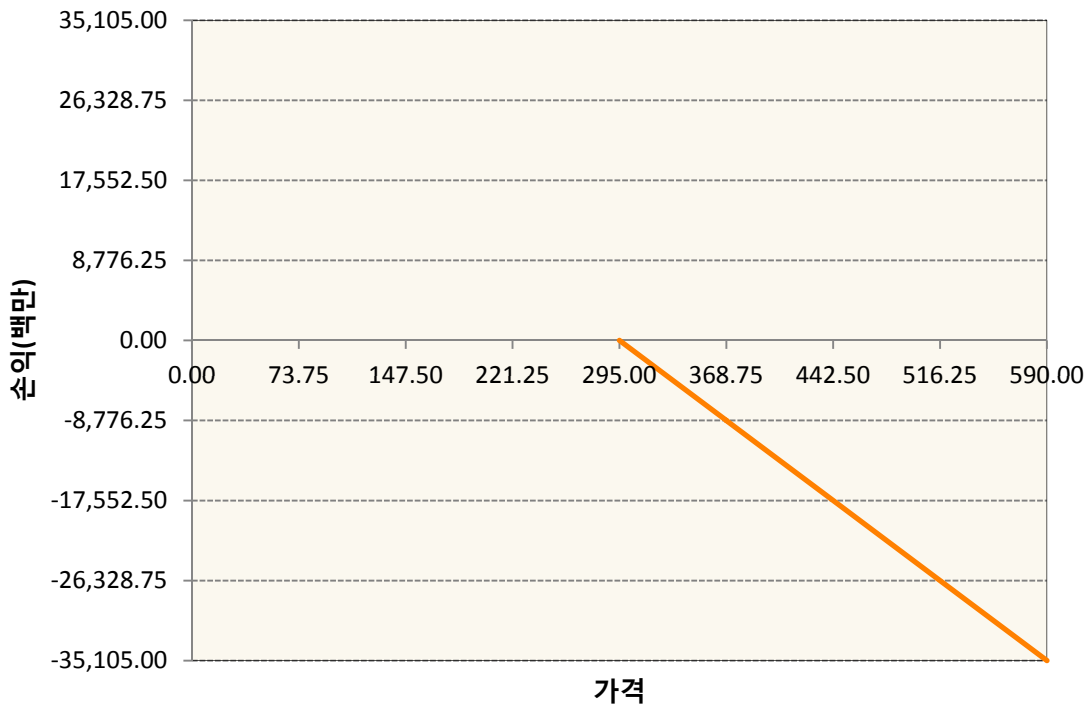
1. 계약금액

(단위:백만원)

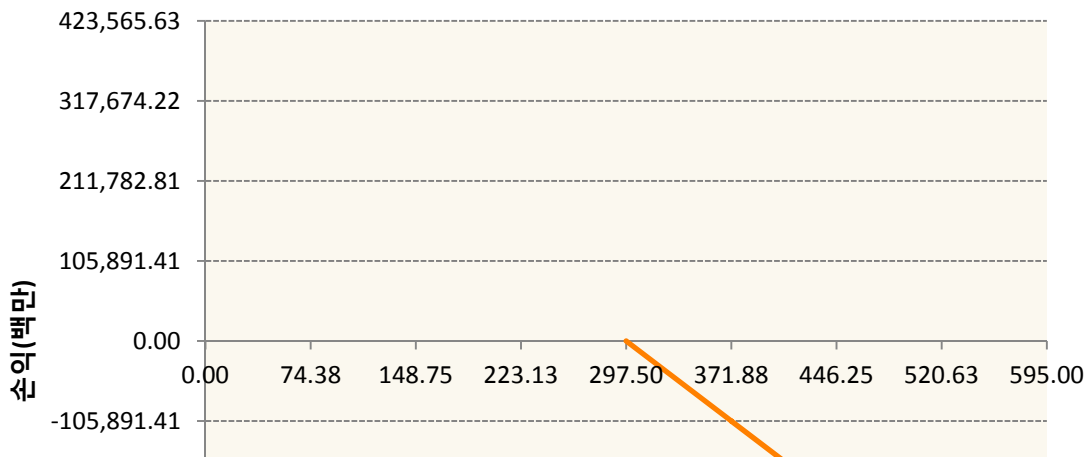
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	756,171	-756,171	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92950-2018-09 콜295



KR4201N92976-2018-09 콜297.5



-5.33%	907	907	907	907	906	905	902
-2.67%	905	899	888	869	840	800	749
0%	513	358	186	0	-198	-406	-622
2.67%	-4,057	-4,295	-4,540	-4,791	-5,047	-5,306	-5,568
5.33%	-14,136	-14,161	-14,199	-14,254	-14,323	-14,409	-14,509
8.00%	-25,216	-25,217	-25,218	-25,220	-25,224	-25,233	-25,246

KR4301N929 2018-09 풋 297.5

23,364

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-23,364	-23,364	-23,364	-23,364	-23,364	-23,364	-23,364
-5.33%	-15,566	-15,566	-15,566	-15,566	-15,566	-15,566	-15,566
-2.67%	-7,768	-7,768	-7,768	-7,768	-7,768	-7,768	-7,768
0%	27	21	13	0	-17	-39	-65
2.67%	4,994	4,954	4,909	4,857	4,802	4,742	4,679
5.33%	5,076	5,076	5,076	5,076	5,076	5,075	5,075
8.00%	5,076	5,076	5,076	5,076	5,076	5,076	5,076

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

(단위:백만원)

60,791

공시일	2018-09-12
기준일	2018-09-11

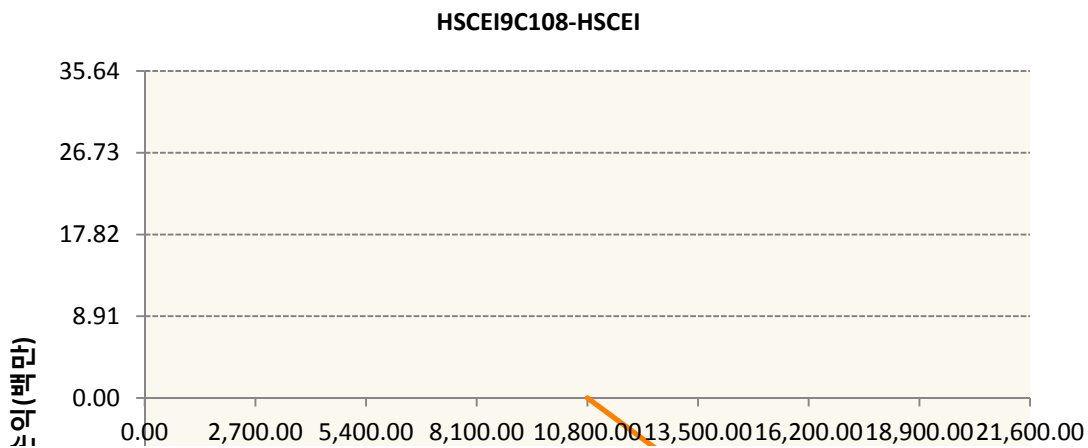
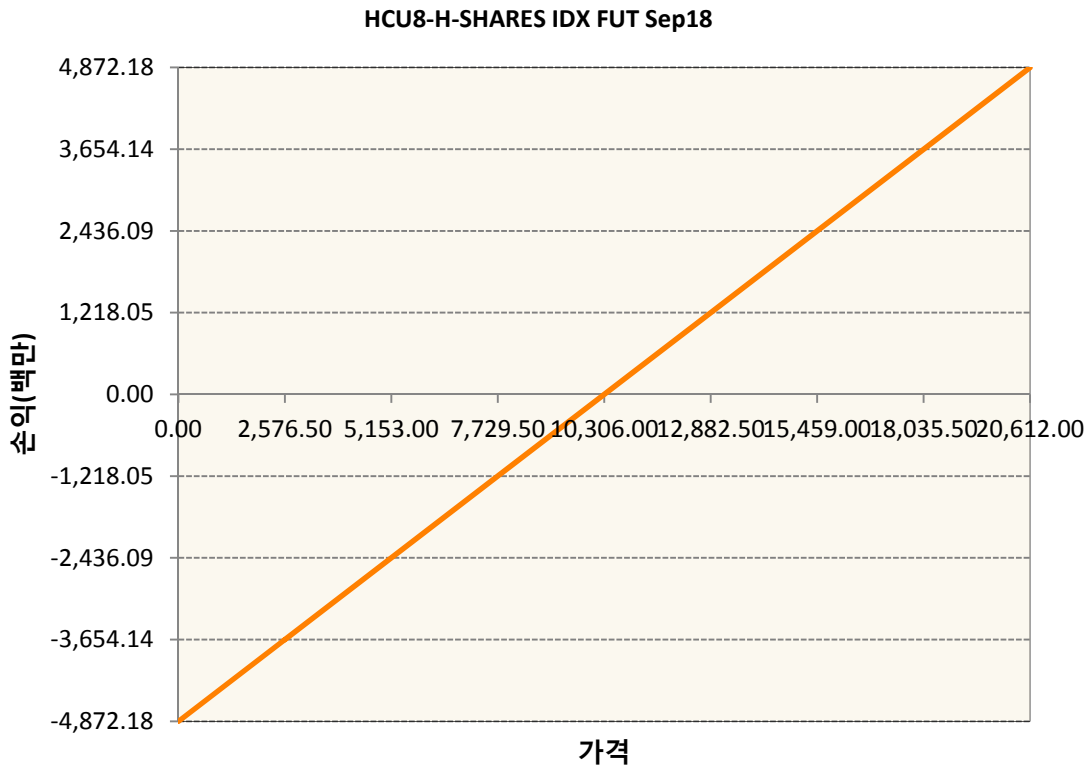
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

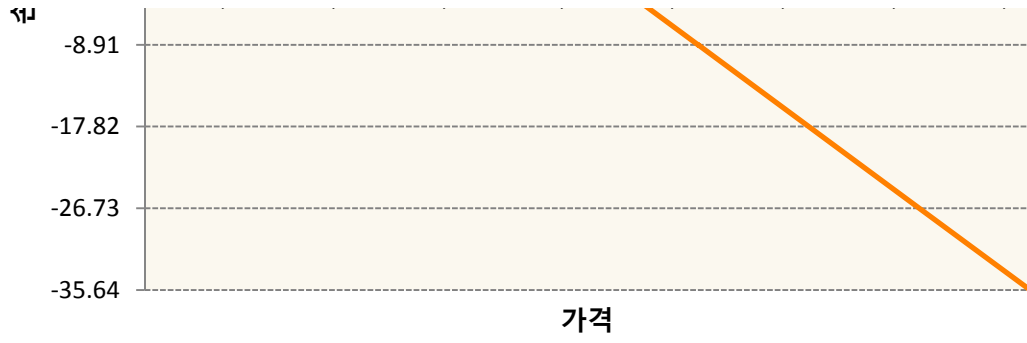
1. 계약금액

(단위:백만원)

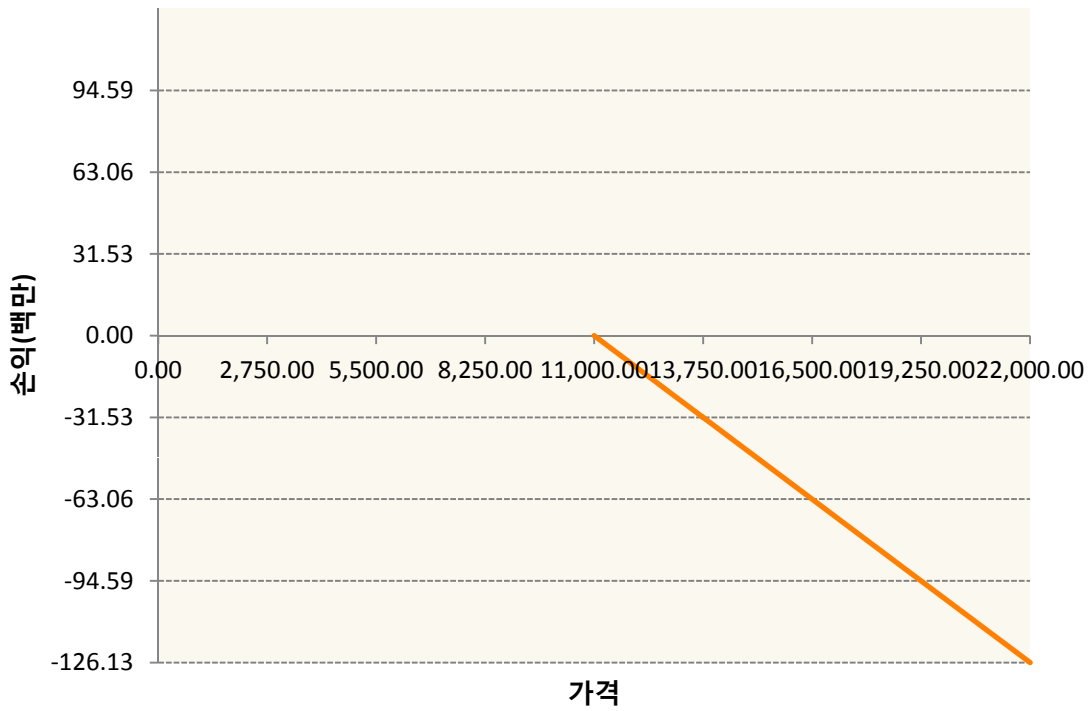
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,872	0	4,872	장내
누계	유가증권	옵션	0	123	-123	장내

2. 만기시점의 손익구조

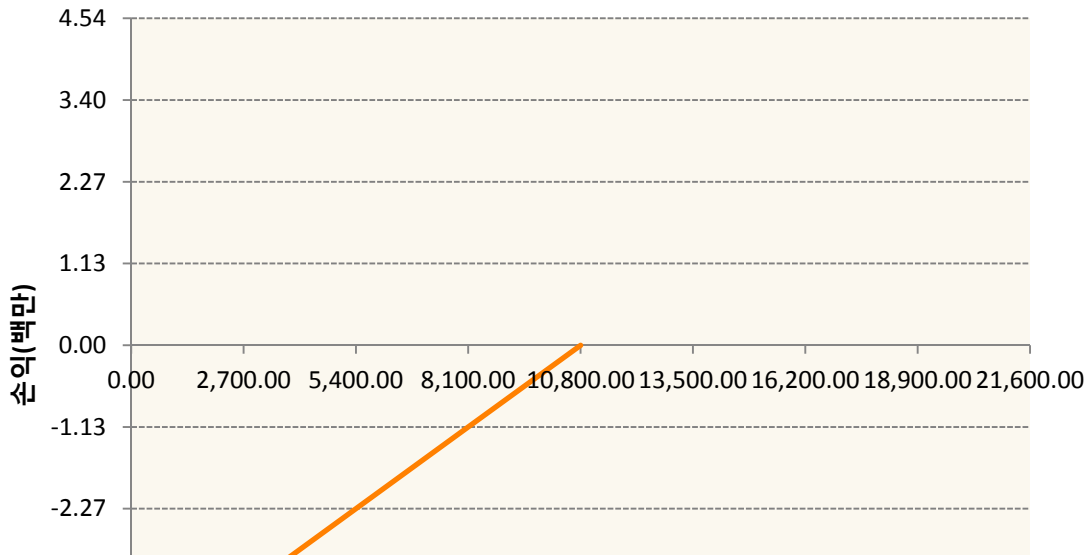


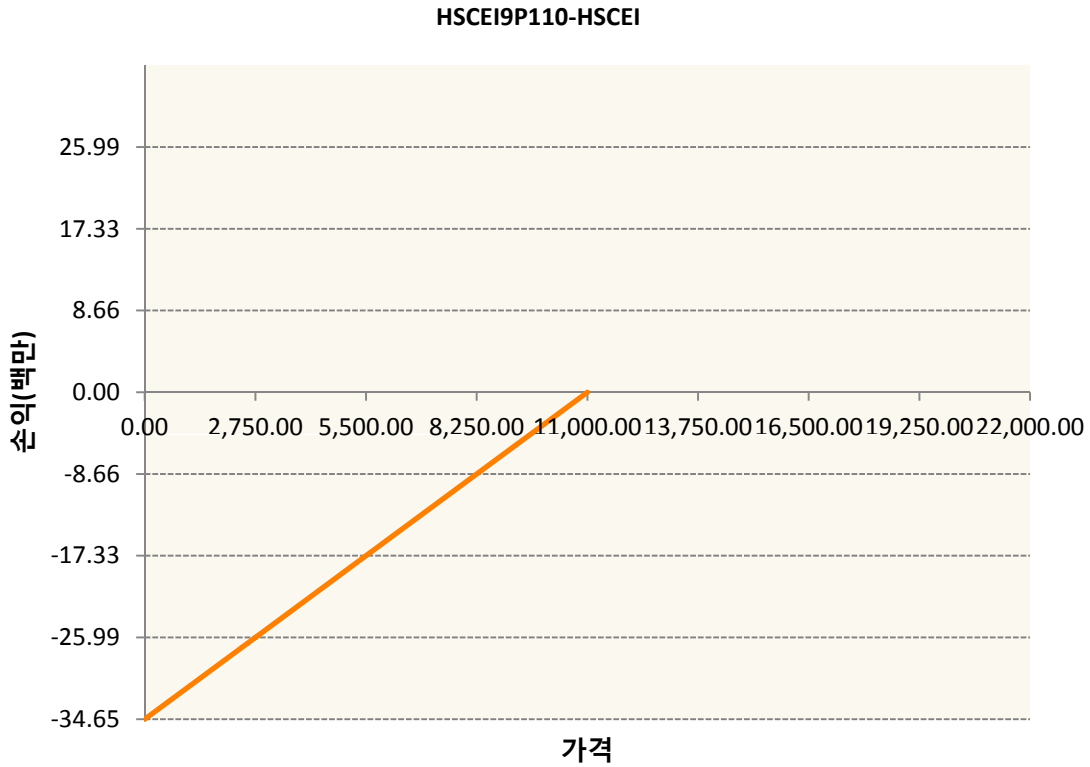
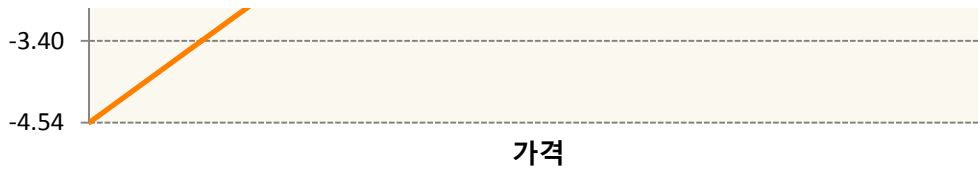


HSCEI9C110-HSCEI



HSCEI9P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU8	H-SHARES IDX FUT Sep18	390
HSCEI9C108	HSCEI	3
HSCEI9C110	HSCEI	10
HSCEI9P108	HSCEI	0.4
HSCEI9P110	HSCEI	3

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	372

공시일	2018-09-12
기준일	2018-09-11

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

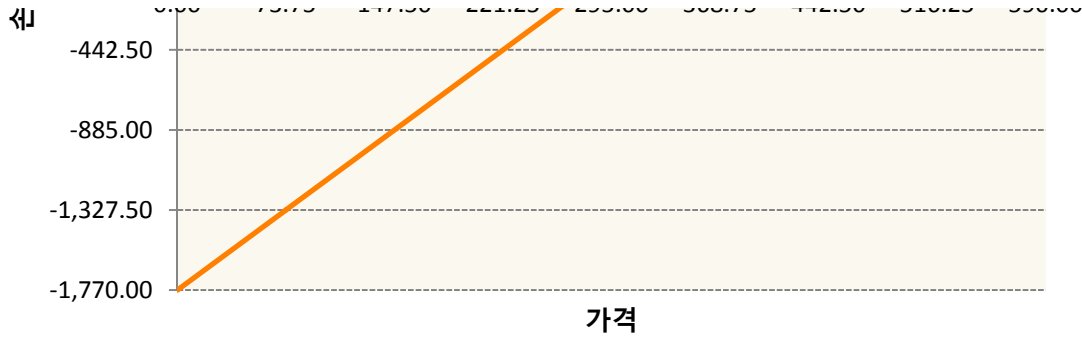
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92976-2018-09 콜297.5

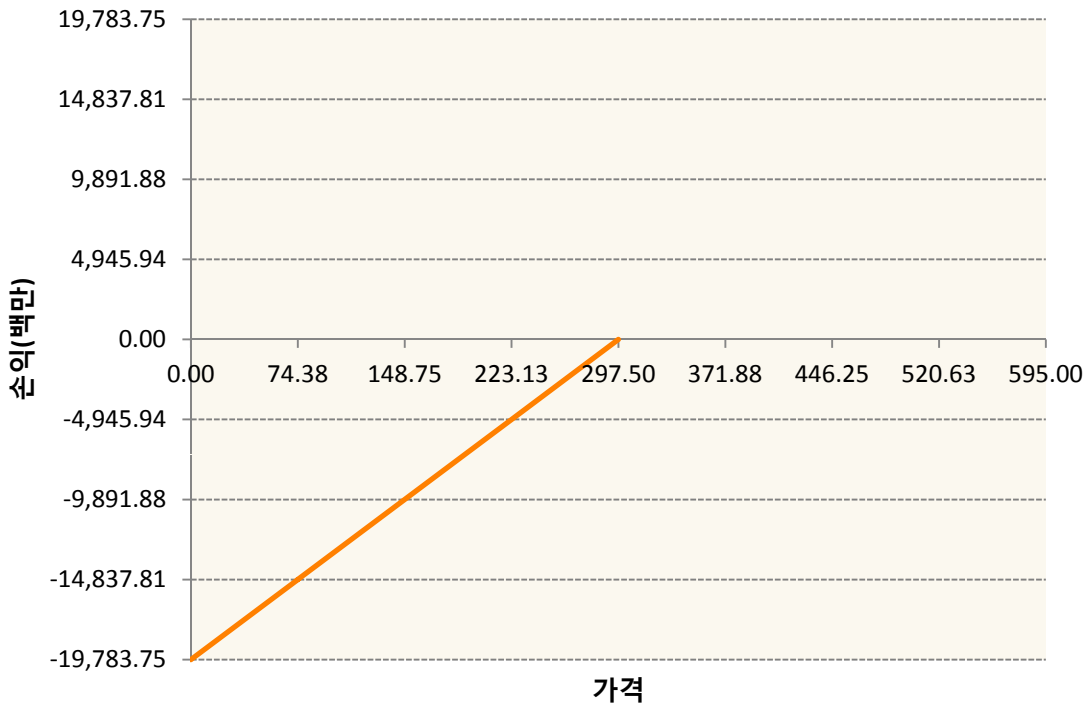


KR4301N92958-2018-09 풋295





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,989
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,989	-3,989	-3,989	-3,989	-3,989	-3,989	-3,989
-5.33%	-2,660	-2,660	-2,660	-2,660	-2,660	-2,660	-2,660
-2.67%	-1,330	-1,330	-1,330	-1,330	-1,330	-1,330	-1,330
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,330	1,330	1,330	1,330	1,330	1,330	1,330
5.33%	2,660	2,660	2,660	2,660	2,660	2,660	2,660
8.00%	3,989	3,989	3,989	3,989	3,989	3,989	3,989
KR4201N92974-2018-09 풋297.5							1,676
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	60	60	60	60	60	60	60
-5.33%	60	60	60	60	60	60	60
-2.67%	60	60	59	58	56	53	50
0%	34	24	12	0	-13	-27	-41
2.67%	-269	-285	-301	-318	-335	-352	-370
5.33%	-938	-940	-942	-946	-951	-956	-963
8.00%	-1,674	-1,674	-1,674	-1,674	-1,674	-1,675	-1,676

KR4301N929 2018-09 풋295

139

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-139	-139	-139	-139	-139	-139	-139
-5.33%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
-2.67%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	17	17	17	17	16	16	16
5.33%	17	17	17	17	17	17	17
8.00%	17	17	17	17	17	17	17

KR4301N929 2018-09 풋297.5

1,554

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,554	-1,554	-1,554	-1,554	-1,554	-1,554	-1,554
-5.33%	-1,035	-1,035	-1,035	-1,035	-1,035	-1,035	-1,035
-2.67%	-517	-517	-517	-517	-517	-517	-517
0%	2	1	1	0	-1	-3	-4
2.67%	332	329	326	323	319	315	311
5.33%	338	338	338	338	338	338	337
8.00%	338	338	338	338	338	338	338

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

(단위:백만원)

8,056

공시일	2018-09-12
기준일	2018-09-11

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

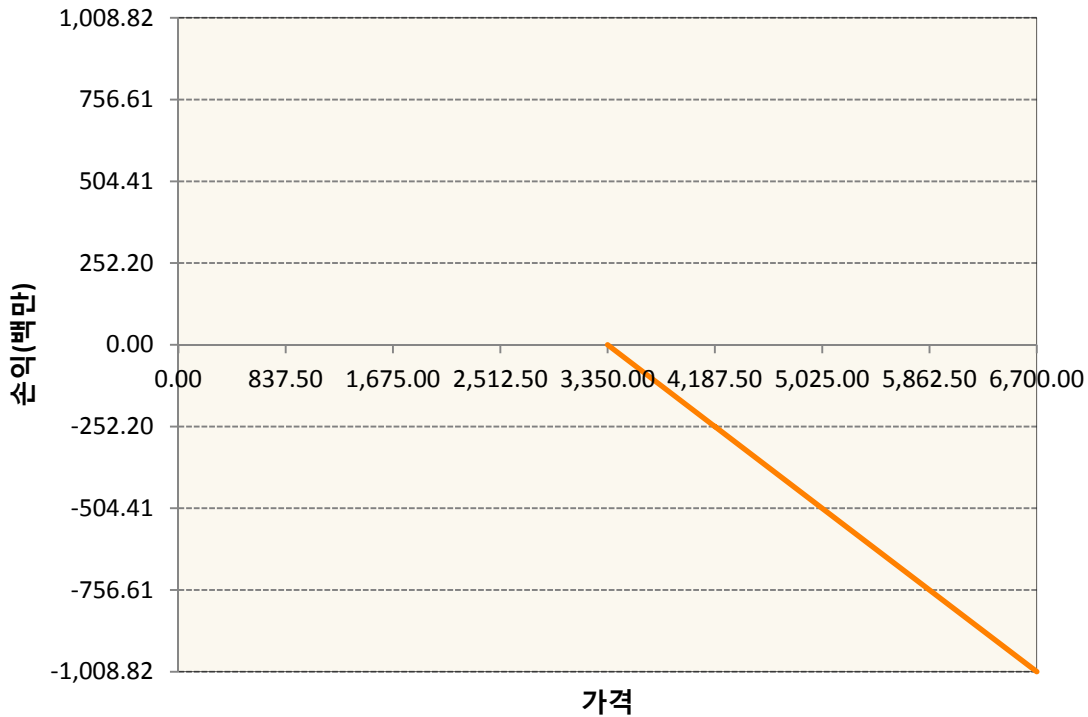
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,421	0	5,421	
누계	유가증권	스왑	34,575	0	34,575	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,261	-25,261	장내
누계	지수	스왑	53,154	0	53,154	장외

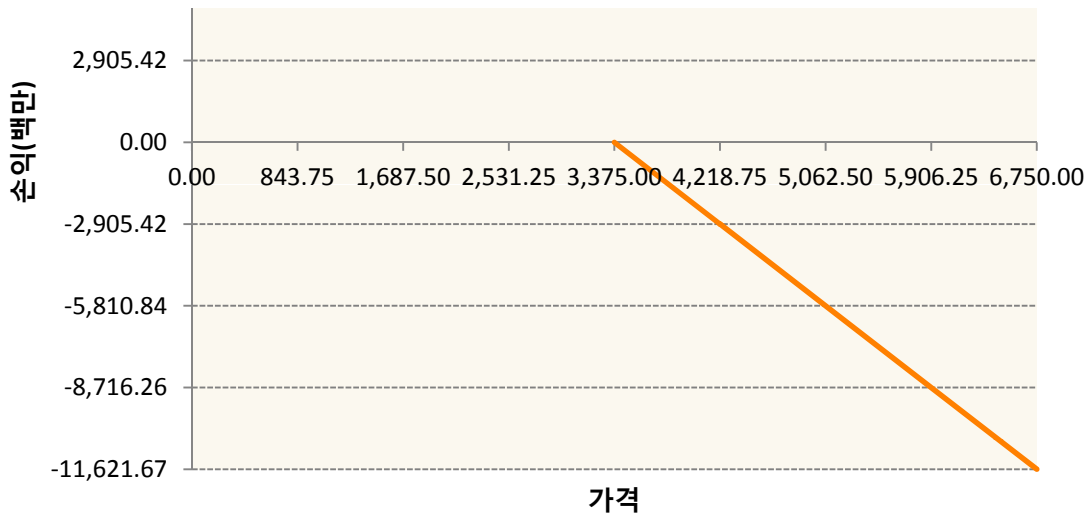
2. 만기시점의 손익구조

OESXU8-C3350-EURO STOXX 50

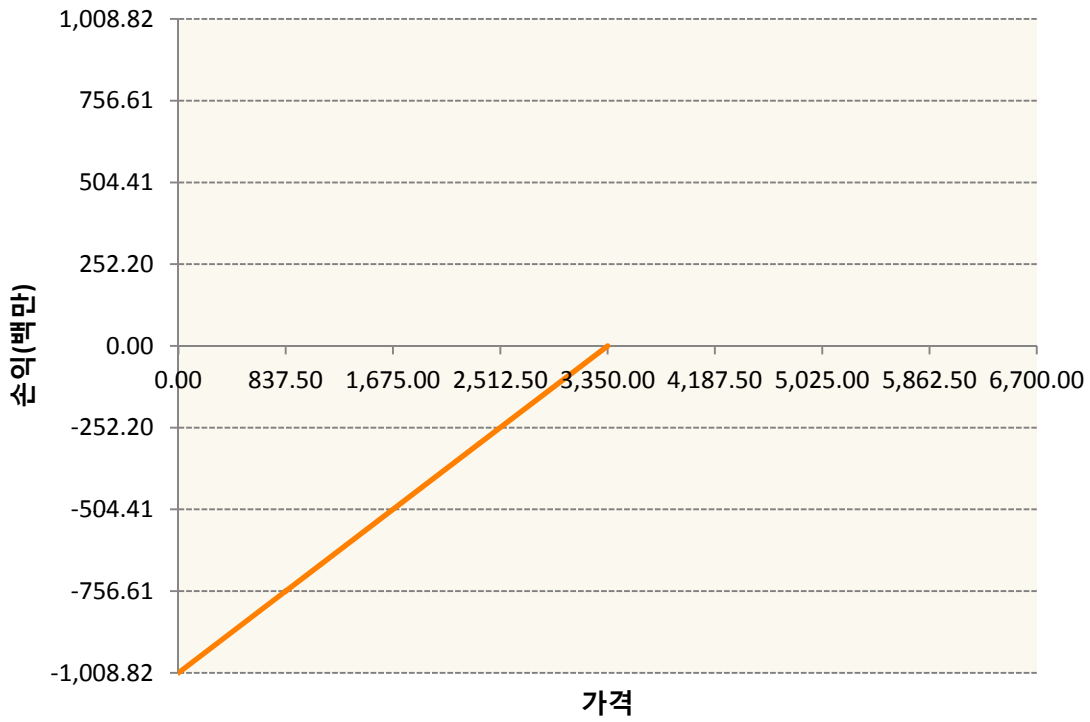


OESXU8-C3375-EURO STOXX 50

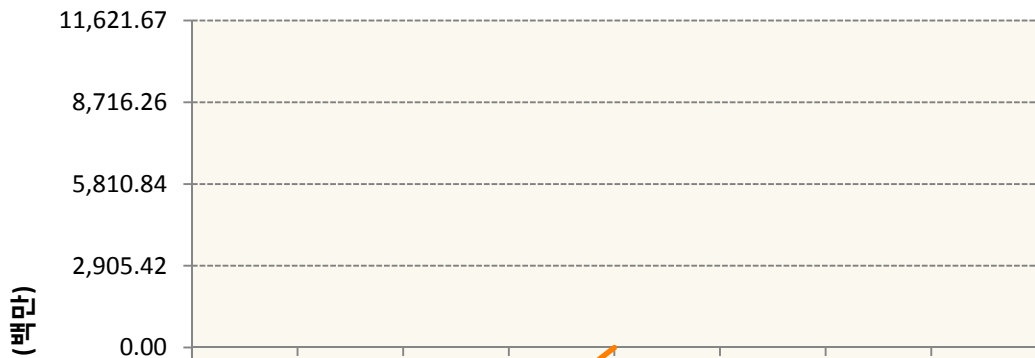


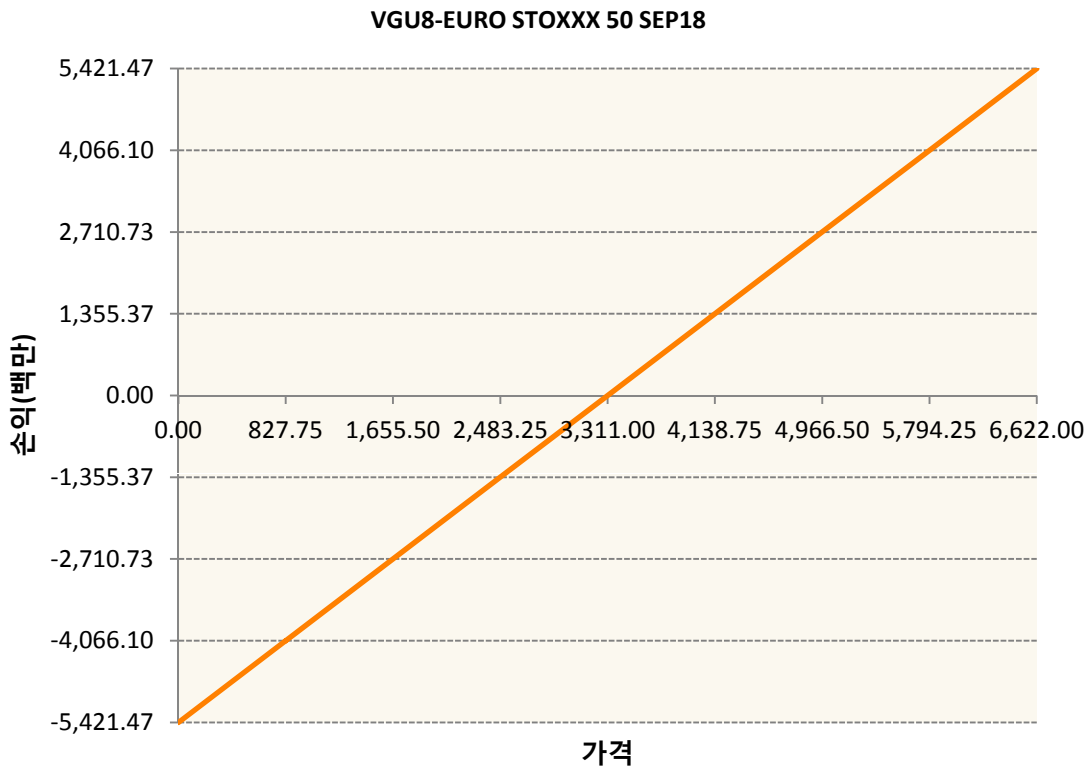
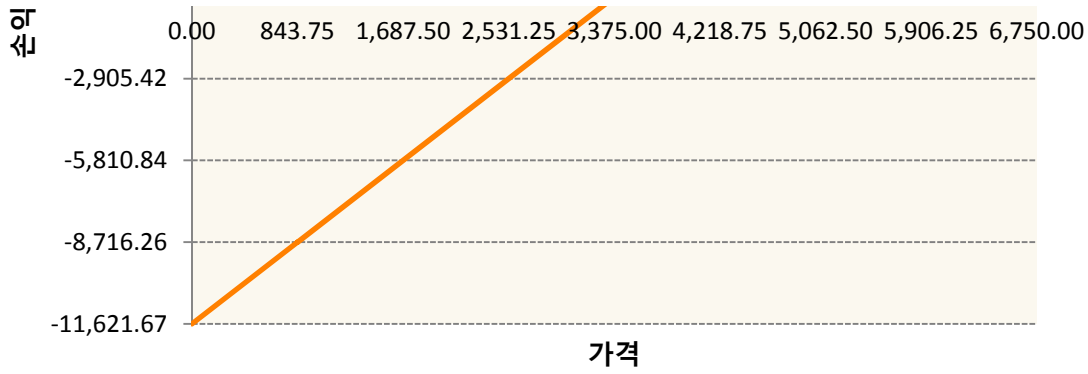


OESXU8-P3350-EURO STOXX 50



OESXU8-P3375-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		76
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY		49
OESXU8-C3E EURO STOXX 50		81
OESXU8-C3E EURO STOXX 50		930
OESXU8-P3E EURO STOXX 50		81
OESXU8-P3E EURO STOXX 50		930
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18		434

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

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

(단위:백만원)

1,123

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

(단위:백만원)

88

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

(단위:백만원)

133

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

(단위:백만원)

162

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-09-12
기준일	2018-09-11

리디파인K200(주식혼합-파생재간

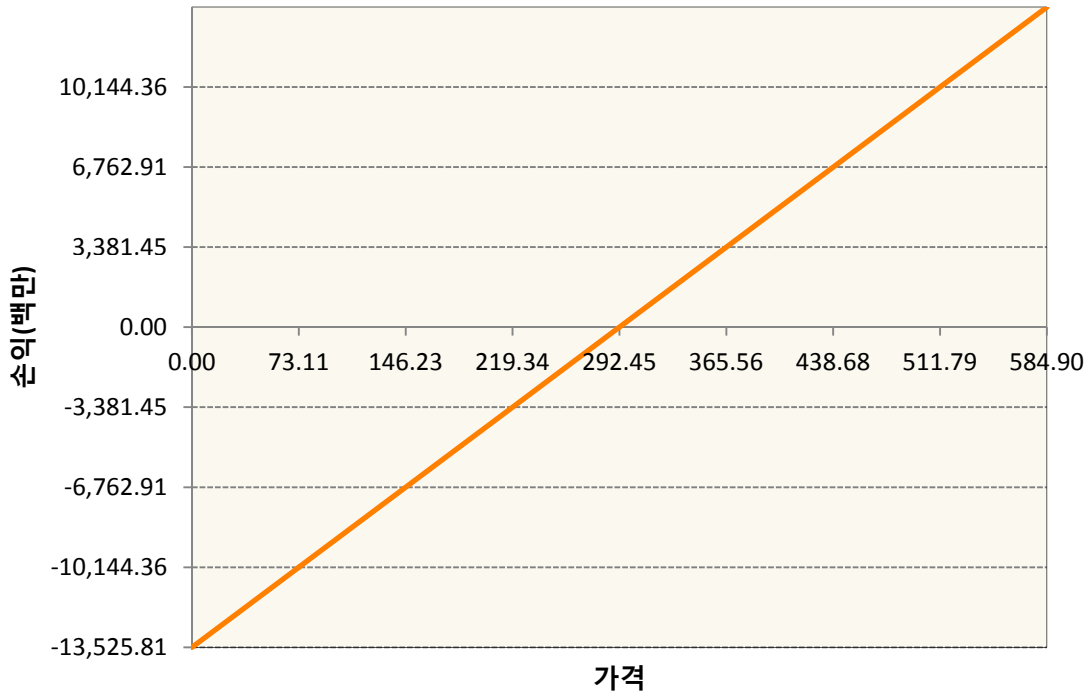
1. 계약금액

(단위:백만원)

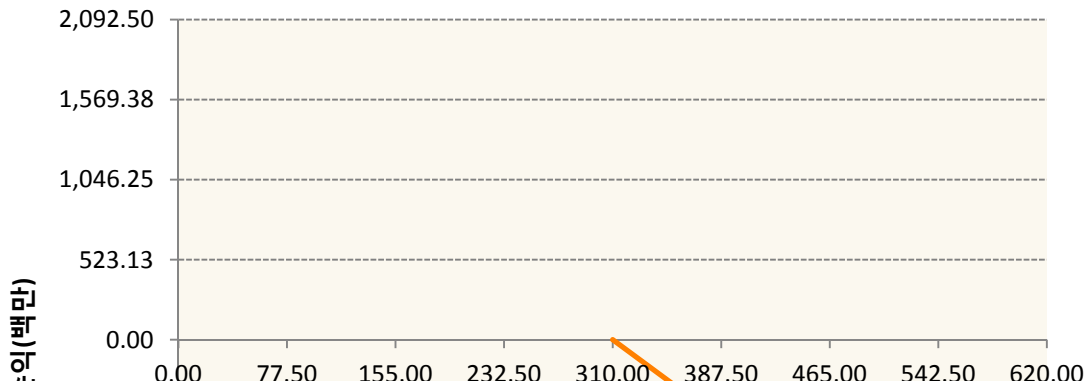
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,526	0	13,526	장내
누계	유가증권	옵션	1,339	24,671	-23,332	장내

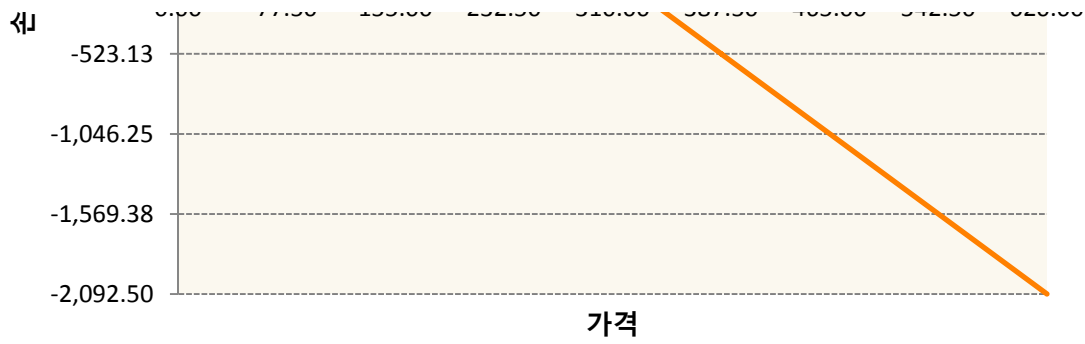
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

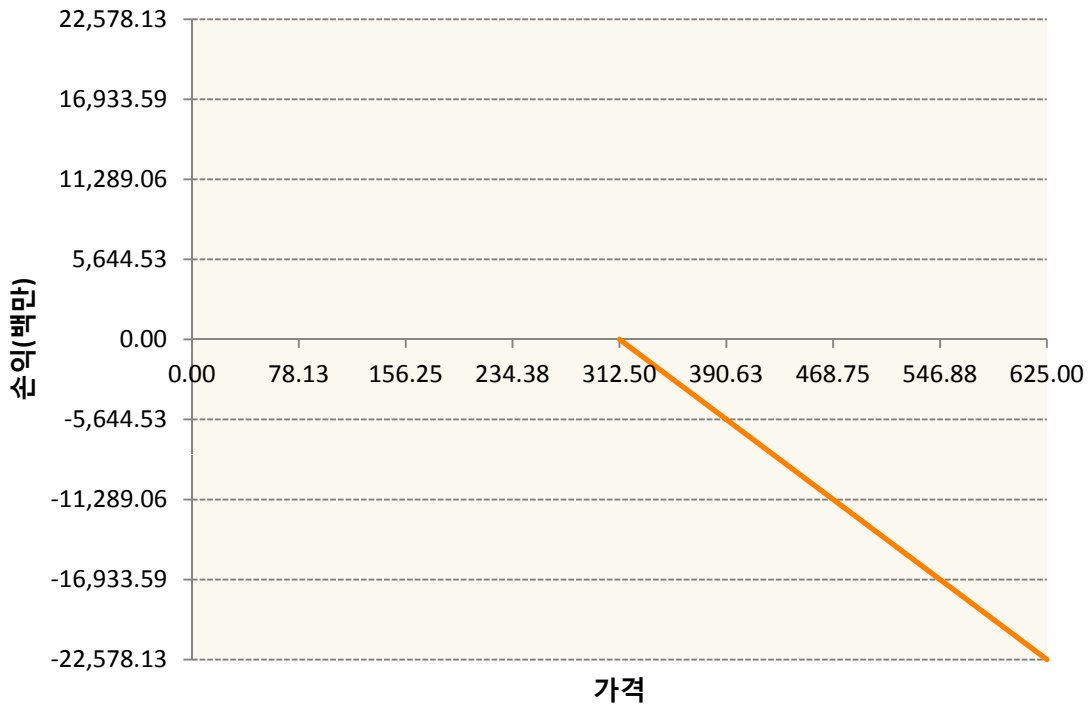


KR4201N93107-2018-09 콜310

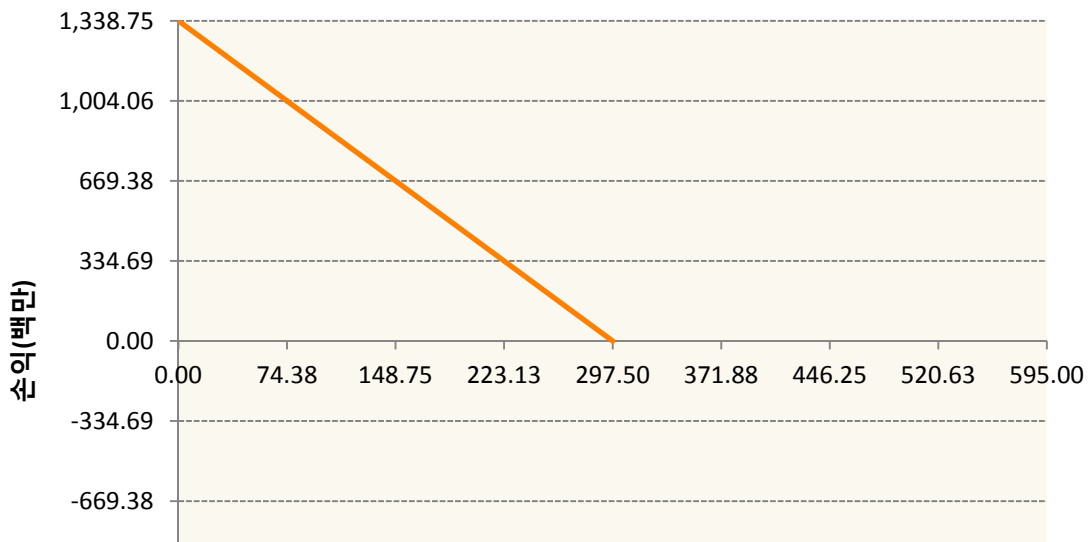


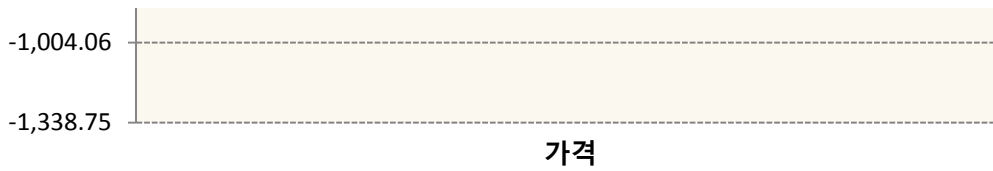


KR4201N93123-2018-09 콜312.5



KR4301N92974-2018-09 풋297.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물							1,082
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,082	-1,082	-1,082	-1,082	-1,082	-1,082	-1,082
-5.33%	-721	-721	-721	-721	-721	-721	-721
-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%	721	721	721	721	721	721	721
8.00%	1,082	1,082	1,082	1,082	1,082	1,082	1,082
KR4201N931 2018-09 콜310							46
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	0
2.67%	0	0	-1	-1	-1	-2	-2
5.33%	-7	-8	-10	-11	-12	-13	-15
8.00%	-41	-42	-43	-43	-44	-45	-46
KR4201N931 2018-09 콜312.5							367
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%	0	-1	-2	-4	-6	-9	-13
5.33%	-30	-40	-51	-62	-73	-86	-98
8.00%	-289	-301	-314	-327	-340	-353	-367
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%	70	70	70	70	70	70	70
-2.67%	35	35	35	35	35	35	35

0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-22	-22	-22	-22	-22	-21	-21
5.33%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
8.00%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23

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

(단위:백만원)

934

공시일	2018-09-12
기준일	2018-09-11

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

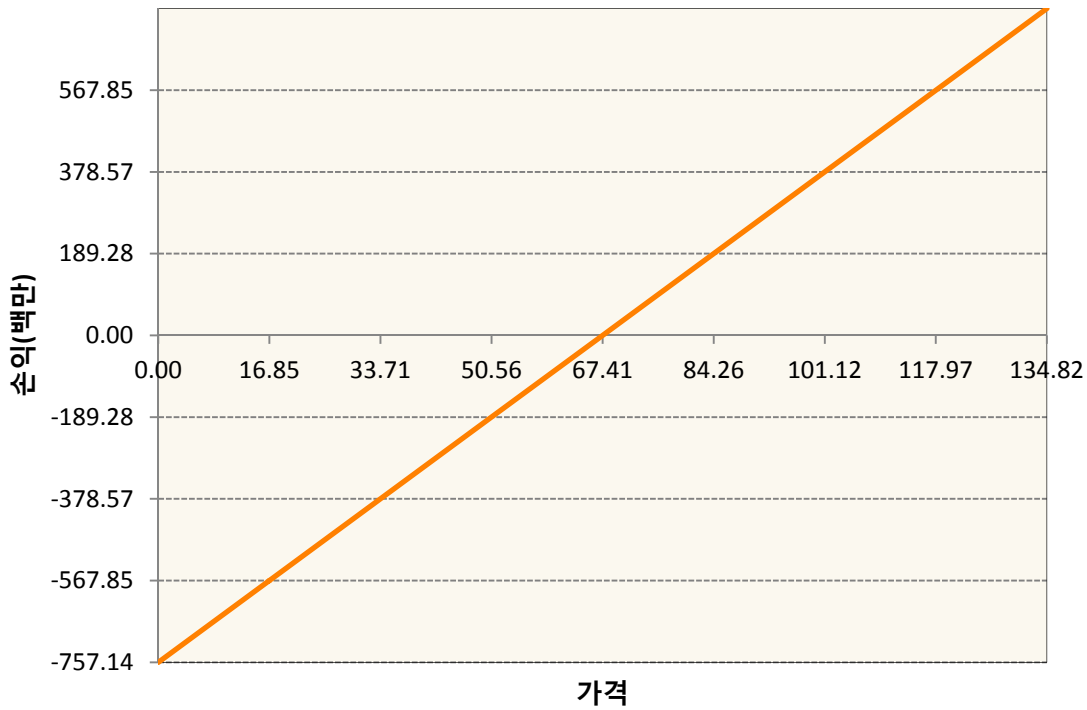
1. 계약금액

(단위:백만원)

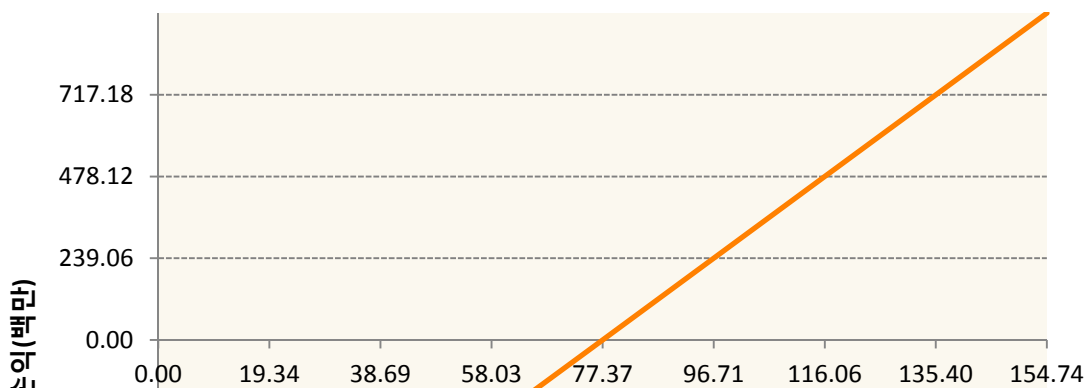
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,118	619	2,499	
누계	유가증권	선물	524	0	524	장내

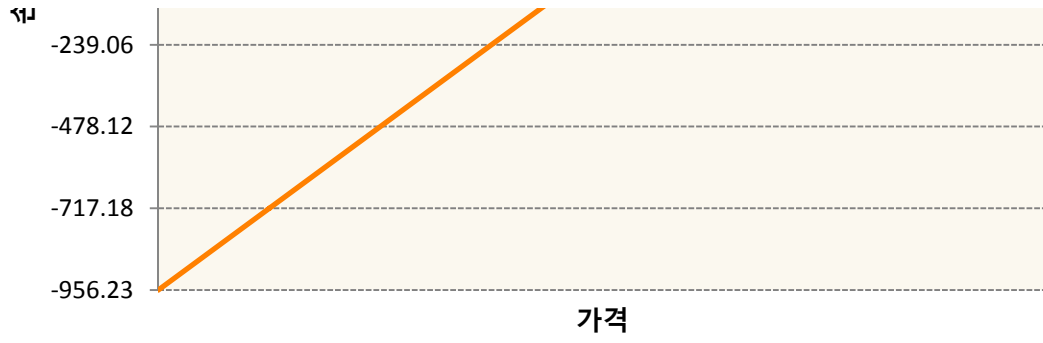
2. 만기시점의 손익구조

CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18

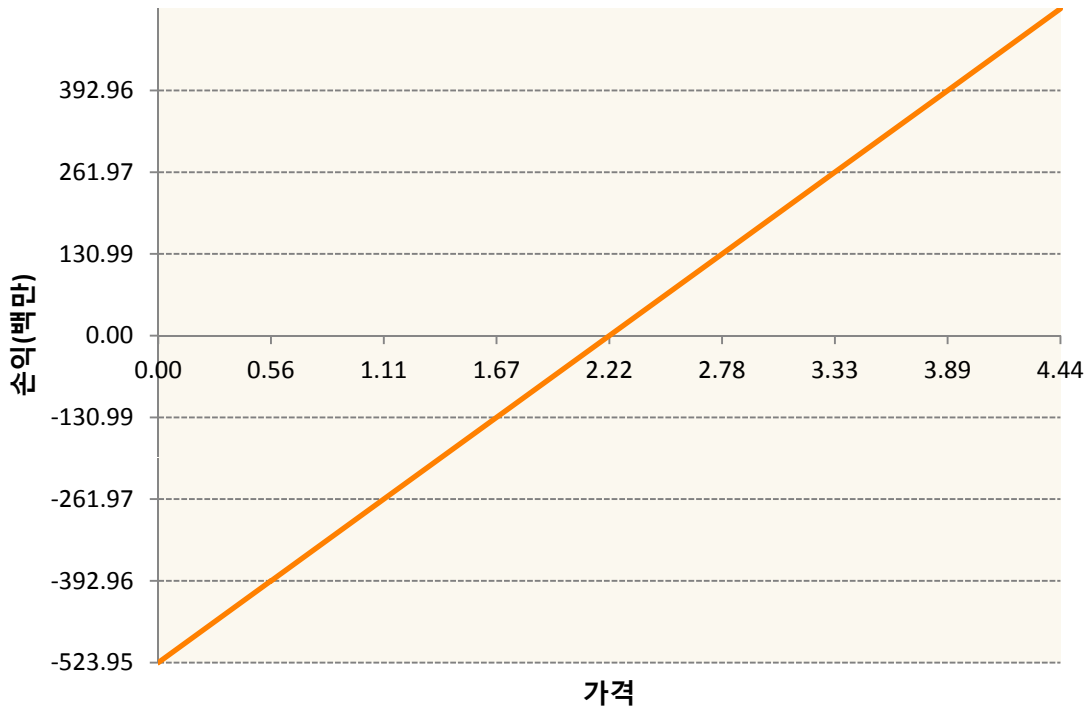


COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18

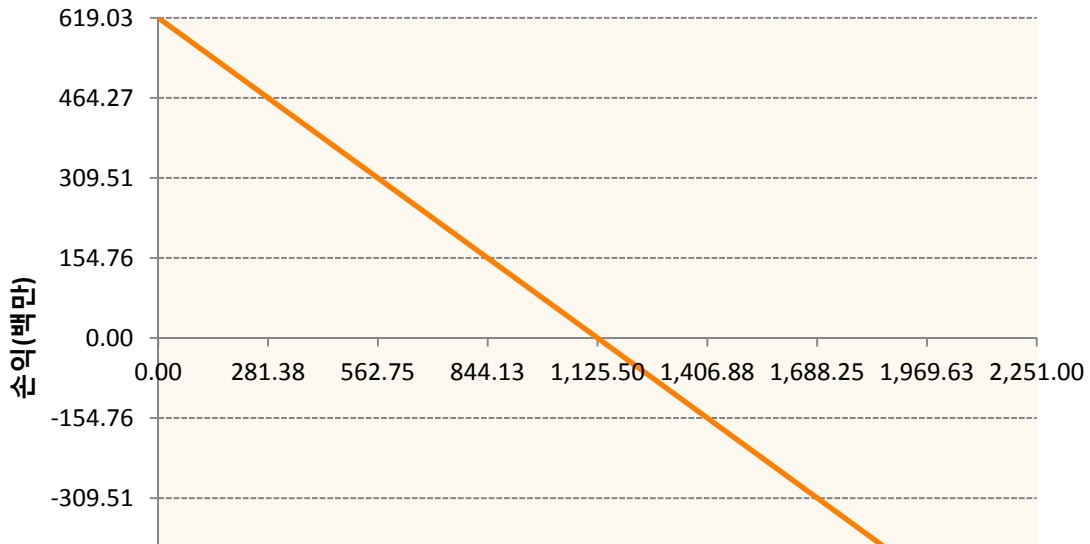


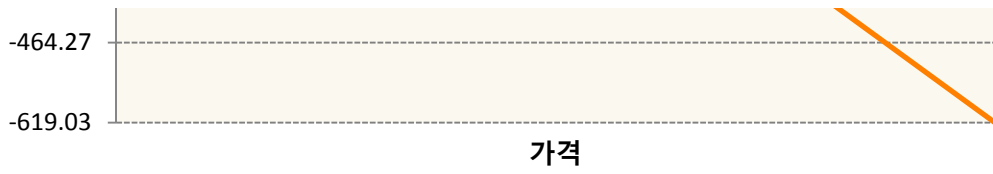


HOX8-Heating Oil

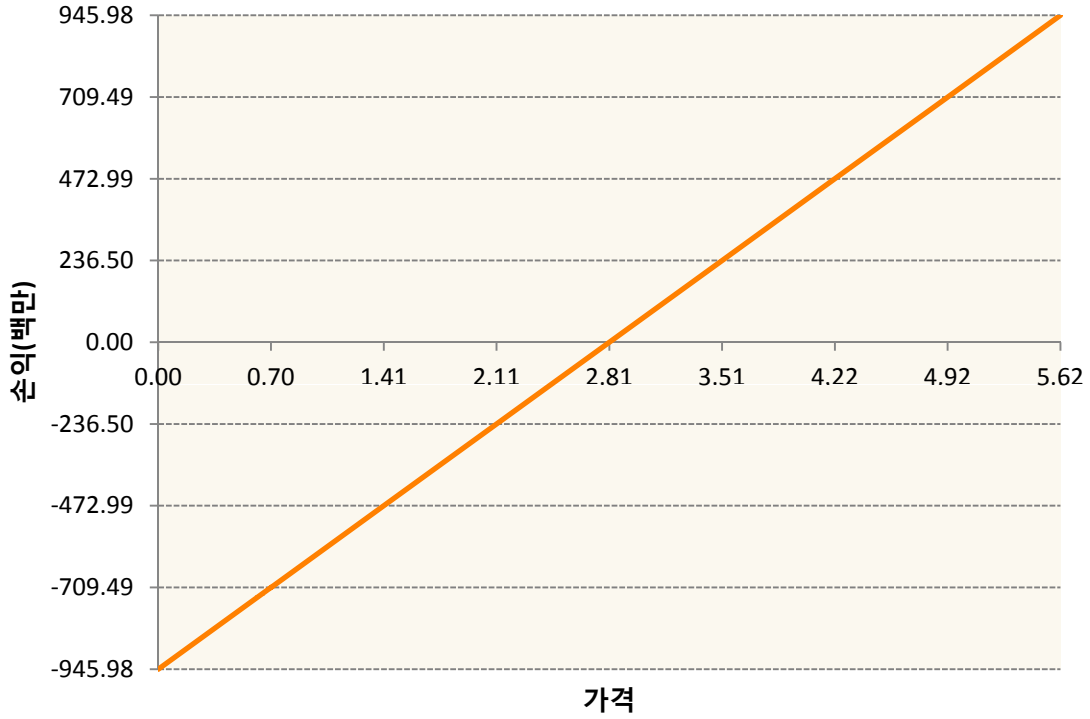


KR4175N90000-2018-09 달러선물

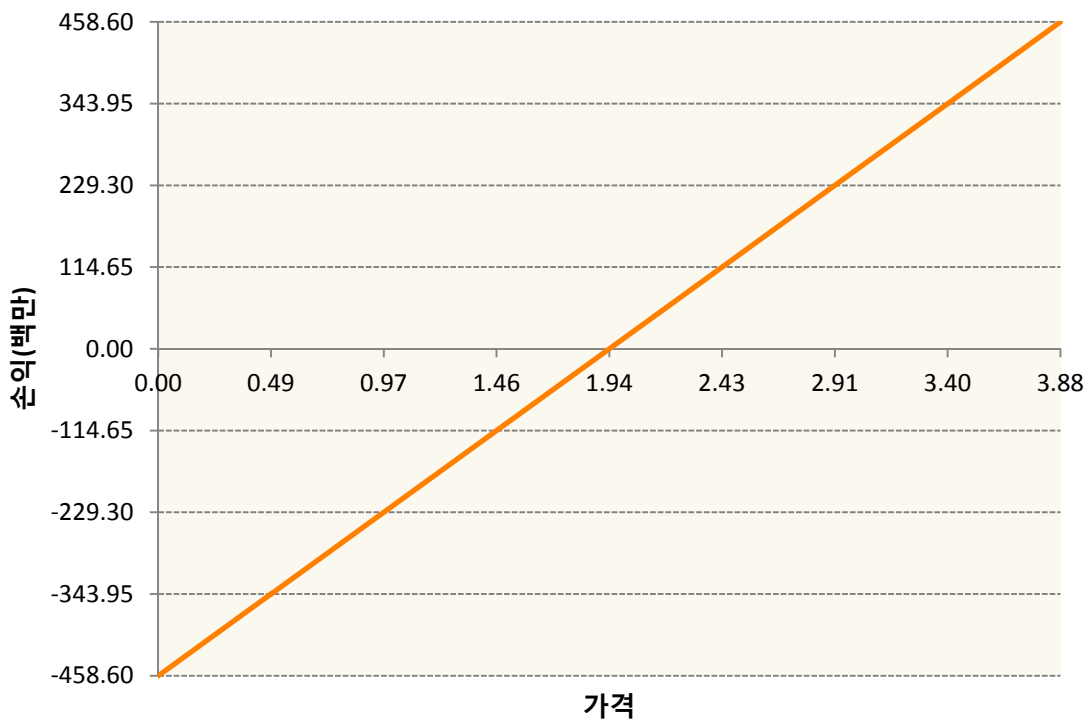




NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18



XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	61
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	76
HOX8	Heating Oil	42
	KR4175N90C 2018-09 달러선물	50
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	76
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	37

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

공시일	2018-09-12
기준일	2018-09-11

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

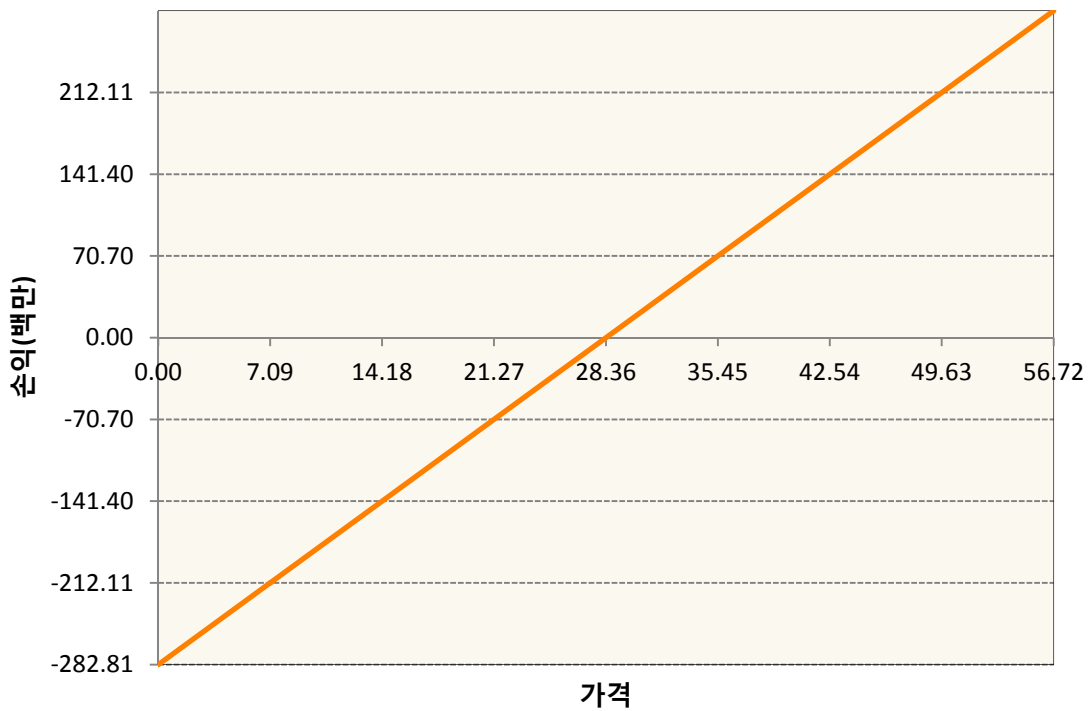
1. 계약금액

(단위:백만원)

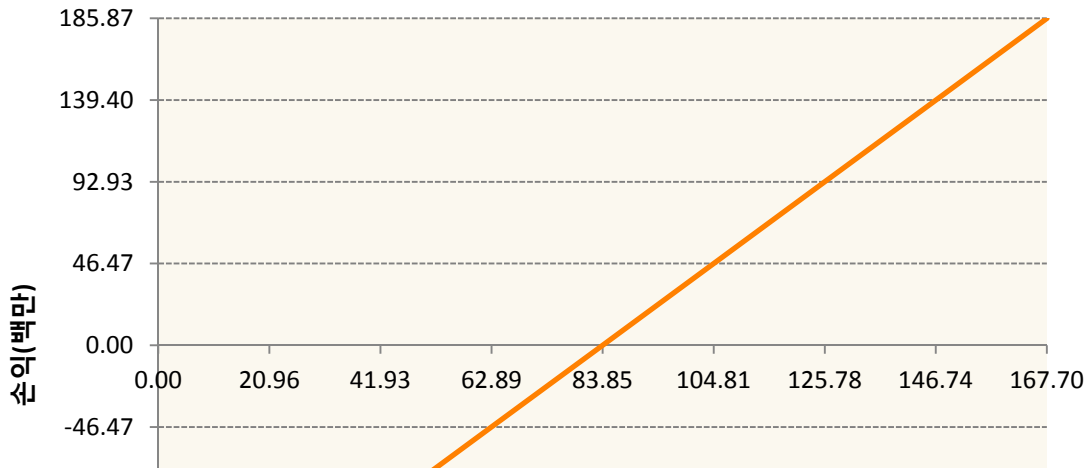
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,633	79	3,555	

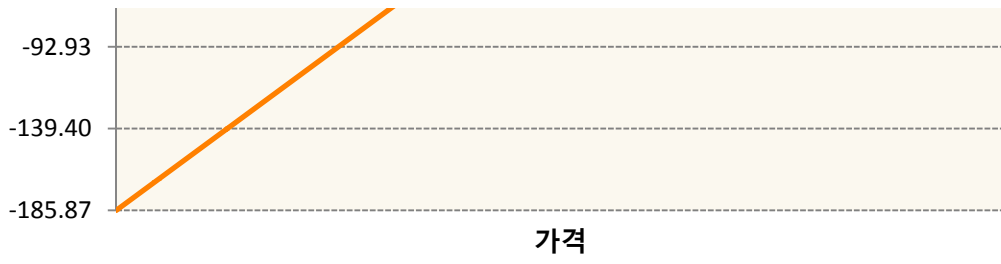
2. 만기시점의 손익구조

BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18

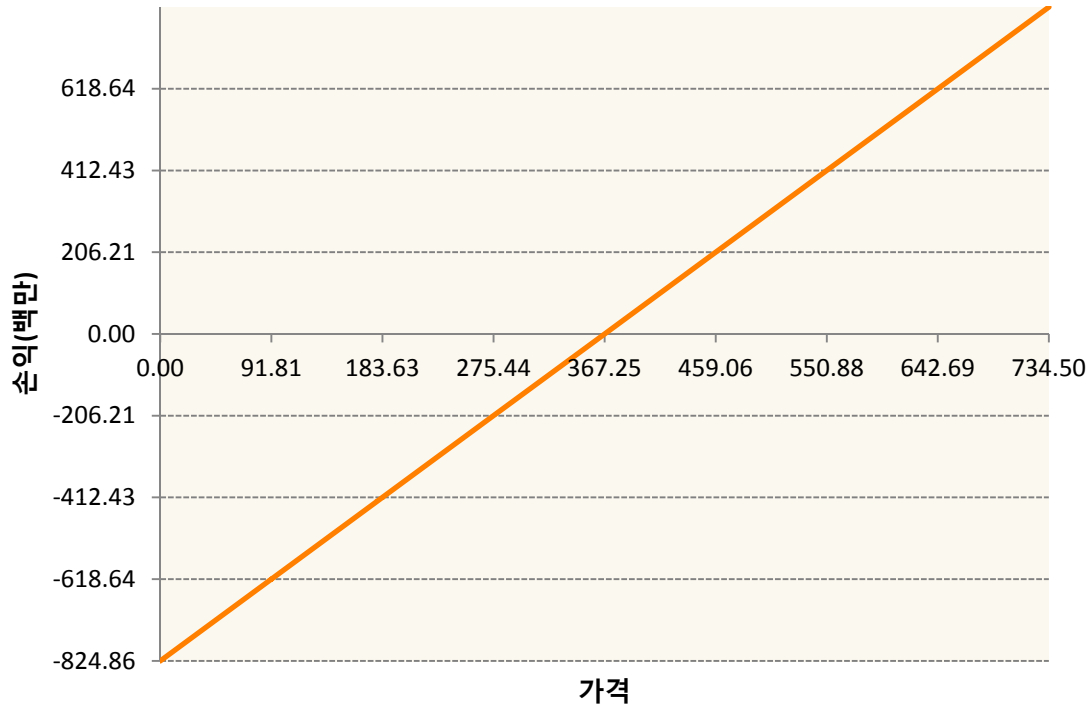


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

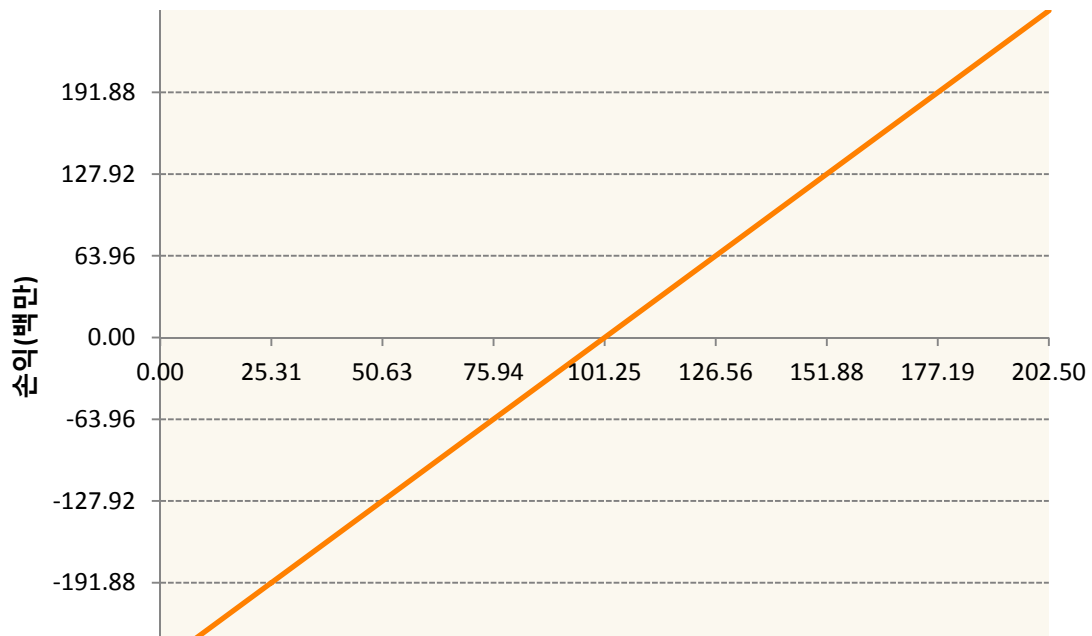


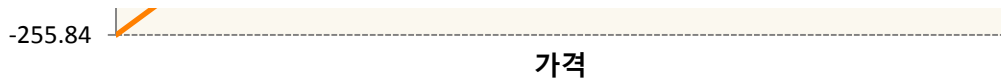


CZ8-CORN FUTURE DEC18

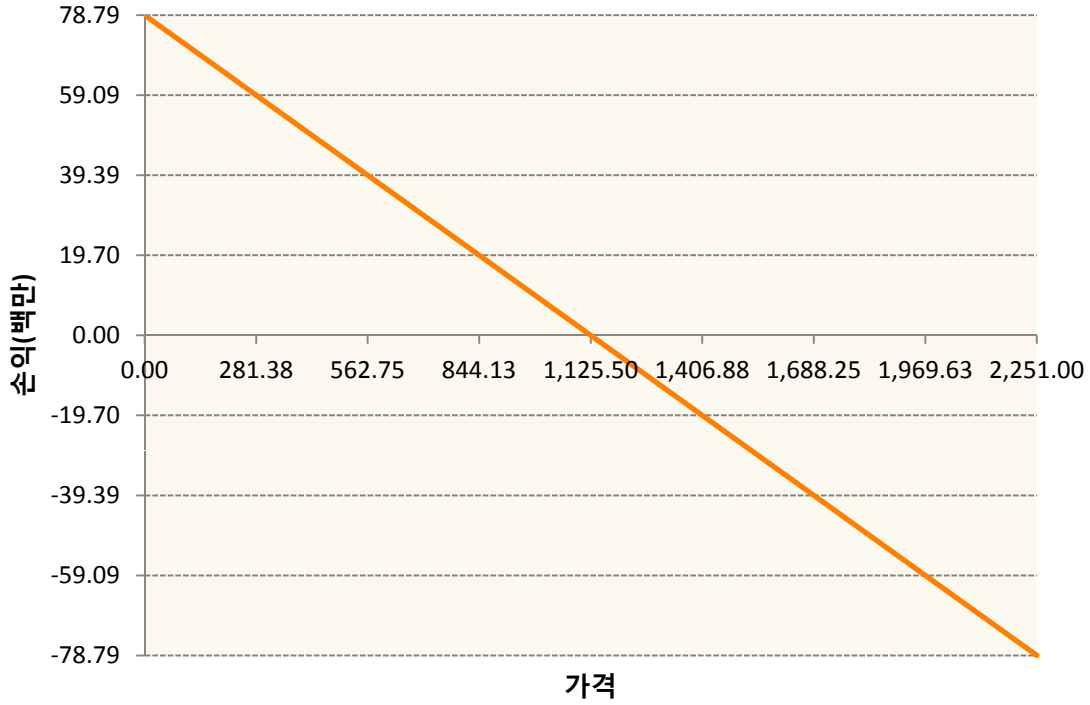


KCZ8-COFFEE 'C' FUTURE Dec18

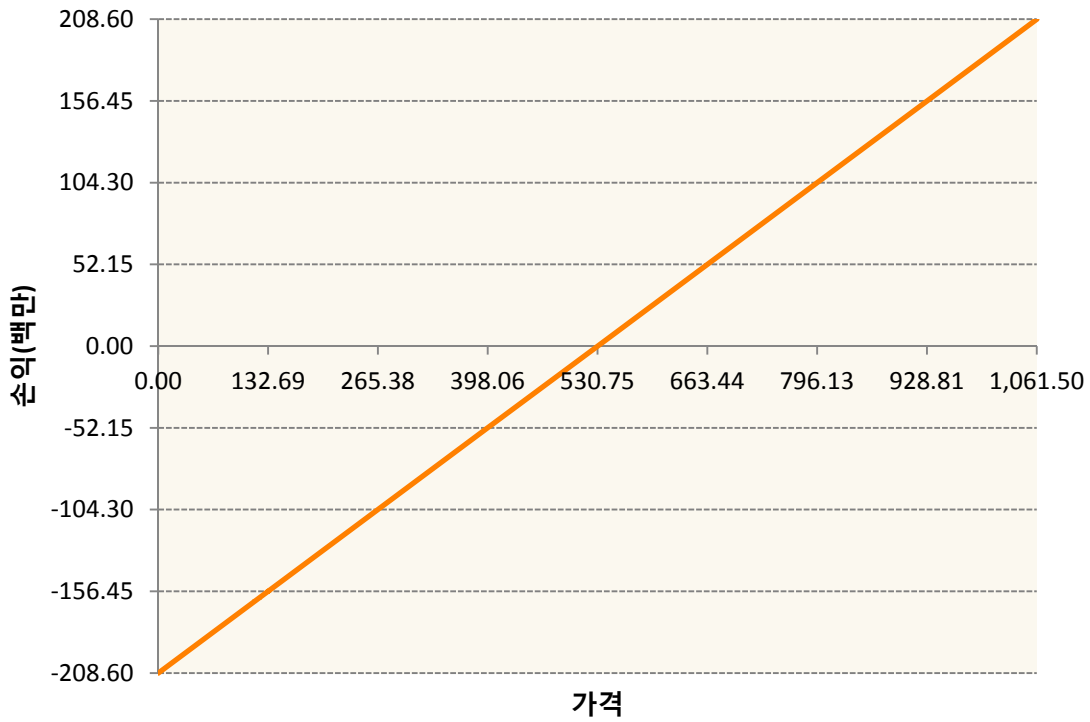




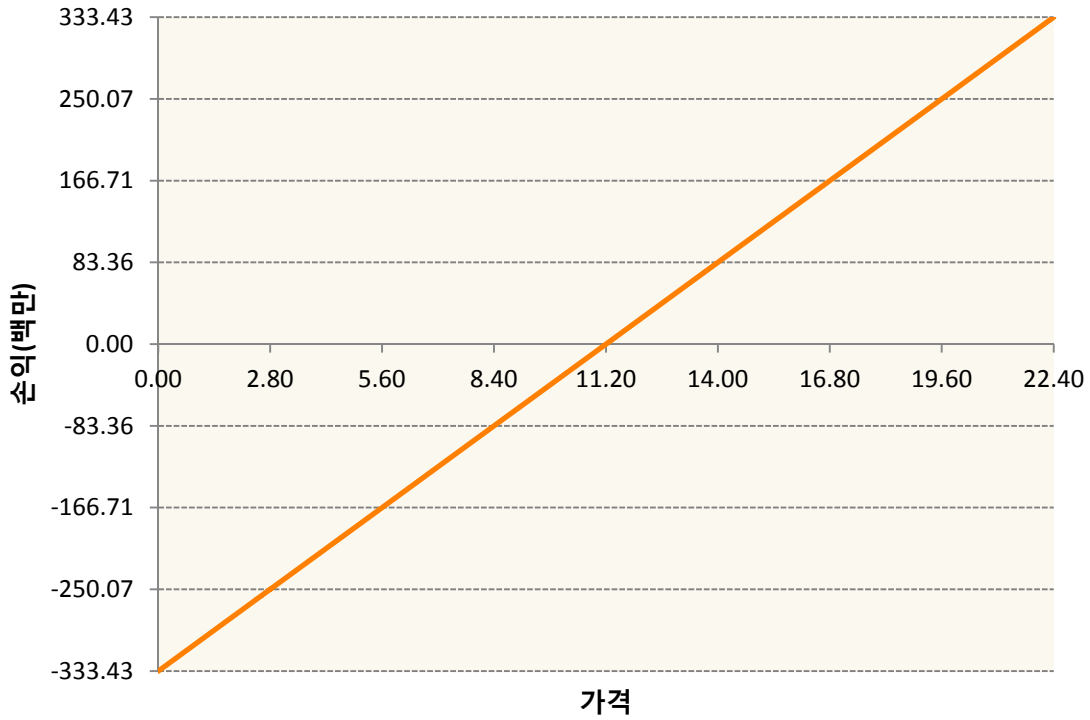
KR4175N90000-2018-09 달러선물



KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

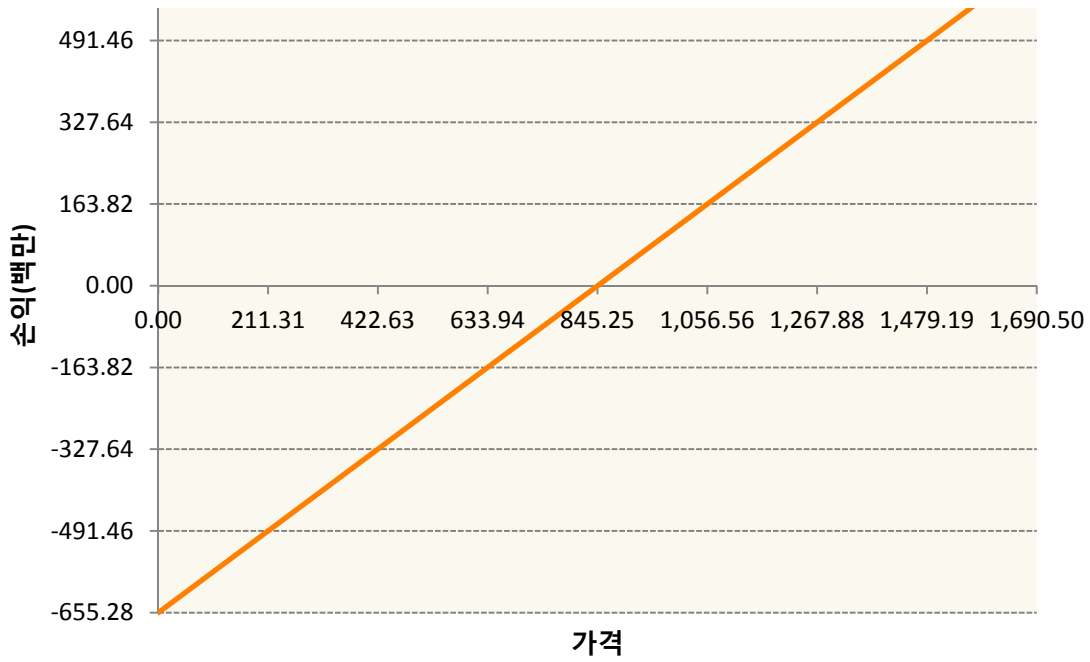


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

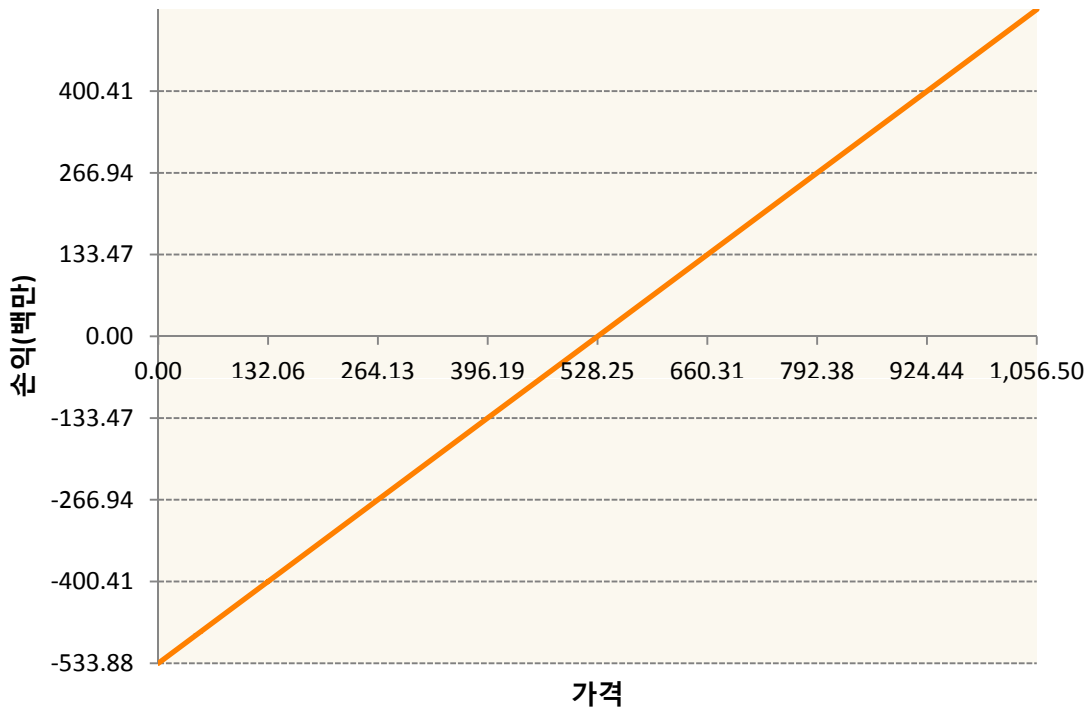


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





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	20
KR4175N90C	2018-09 달러선물	6

KWZ8	KC HRW WHEAT FUT DEC18	17
SBV8	SUGAR #11 (WORLD) OCT18	27
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)

313