

공시일	2018-09-14
기준일	2018-09-13

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	2018-09-14
기준일	2018-09-13

스마트인덱스모

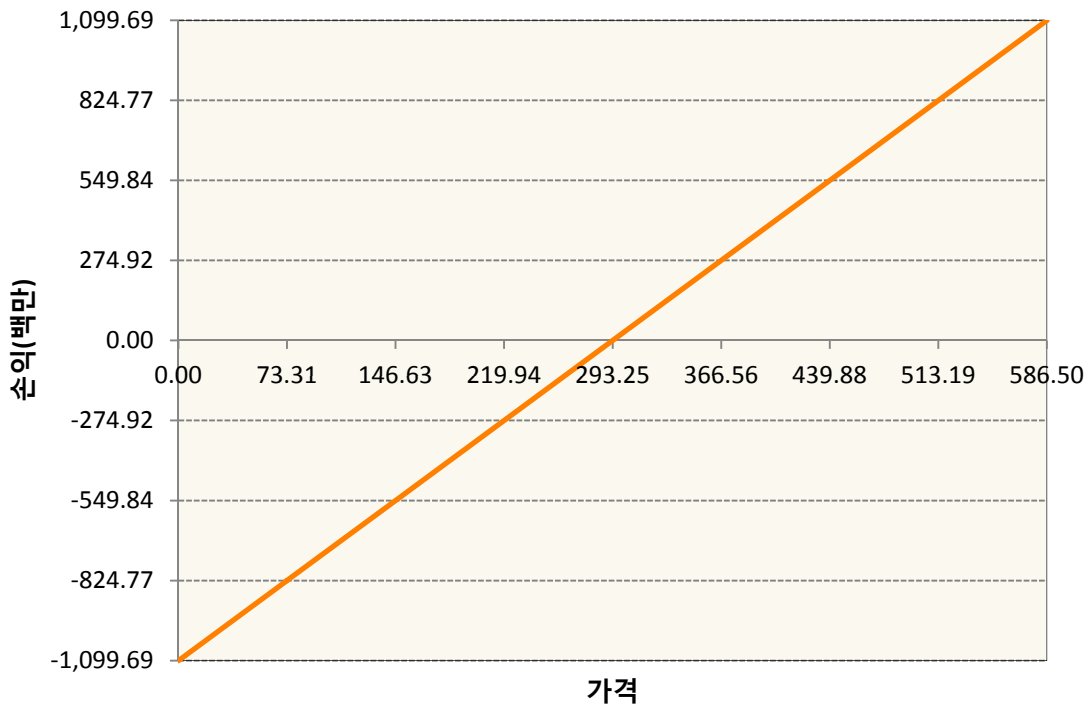
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	586	0	586	장내
누계	유가증권	선물	1,100	0	1,100	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 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%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-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%	58	58	58	58	58	58	58
8.00%	88	88	88	88	88	88	88

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

(단위:백만원)

66

공시일	2018-09-14
기준일	2018-09-13

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

1,143

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

483

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-14
기준일	2018-09-13

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

289

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

365

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-14
기준일	2018-09-13

유로인덱스모(주식-파생형)

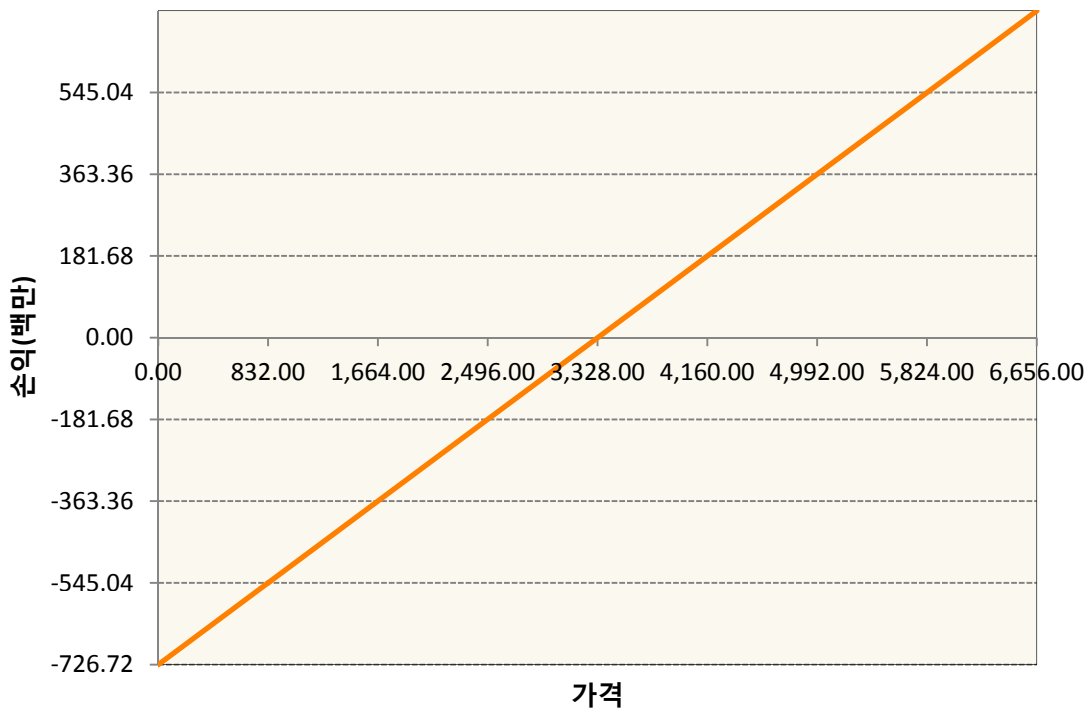
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	727	0	727	

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)

37

공시일	2018-09-14
기준일	2018-09-13

차이나인덱스모(주식-파생형)

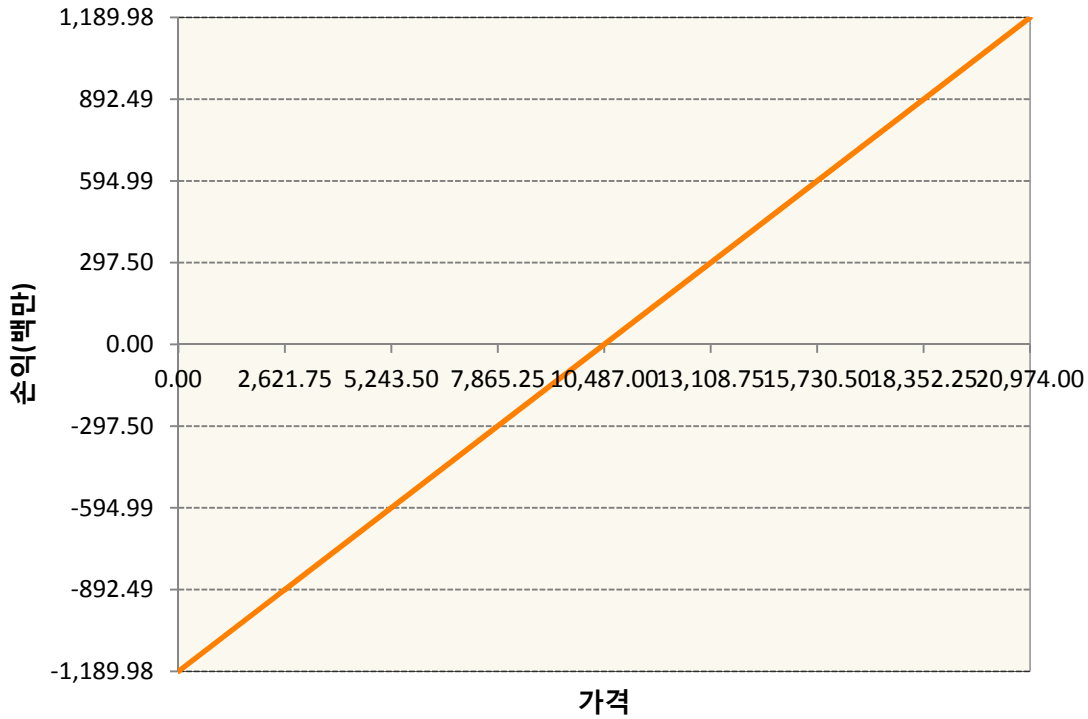
1. 계약금액

(단위:백만원)

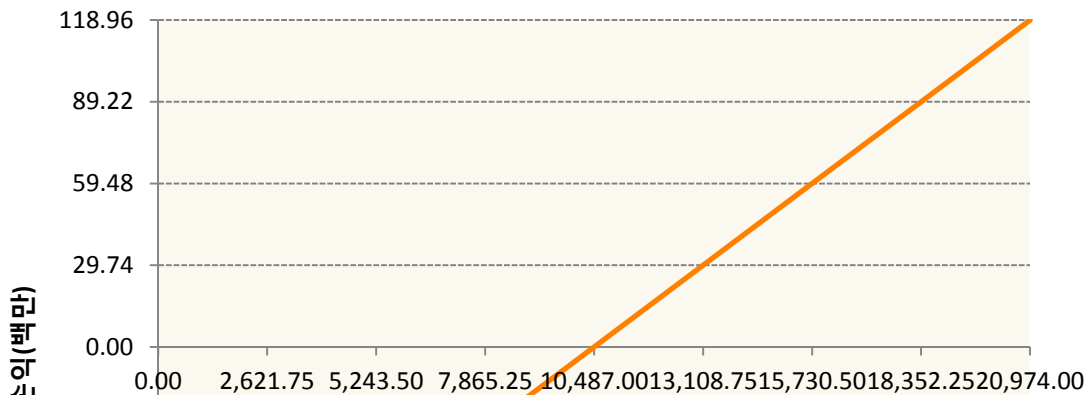
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	119	0	119	
누계	유가증권	선물	1,190	0	1,190	장내

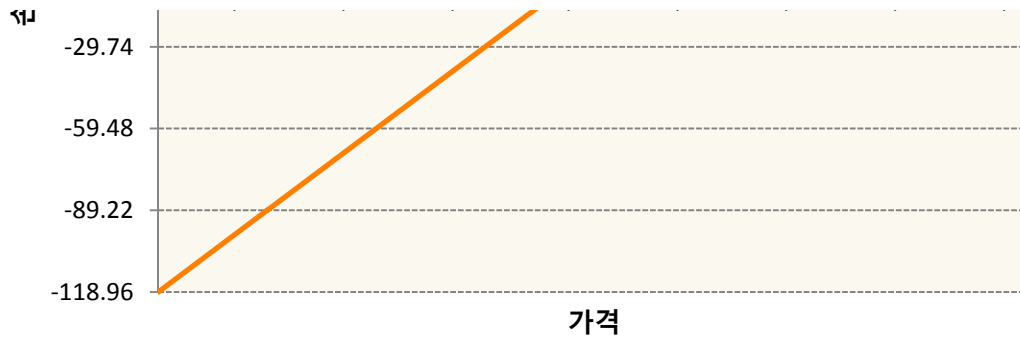
2. 만기시점의 손익구조

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	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	96

공시일	2018-09-14
기준일	2018-09-13

커버드콜모(주식혼합-파생형)

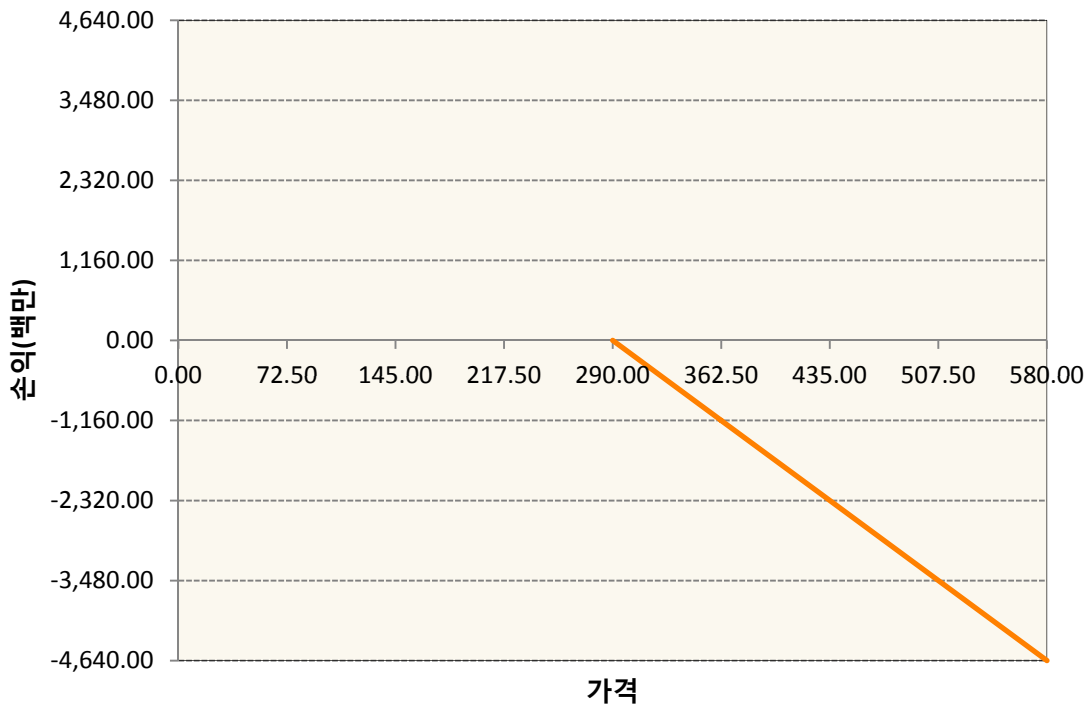
1. 계약금액

(단위:백만원)

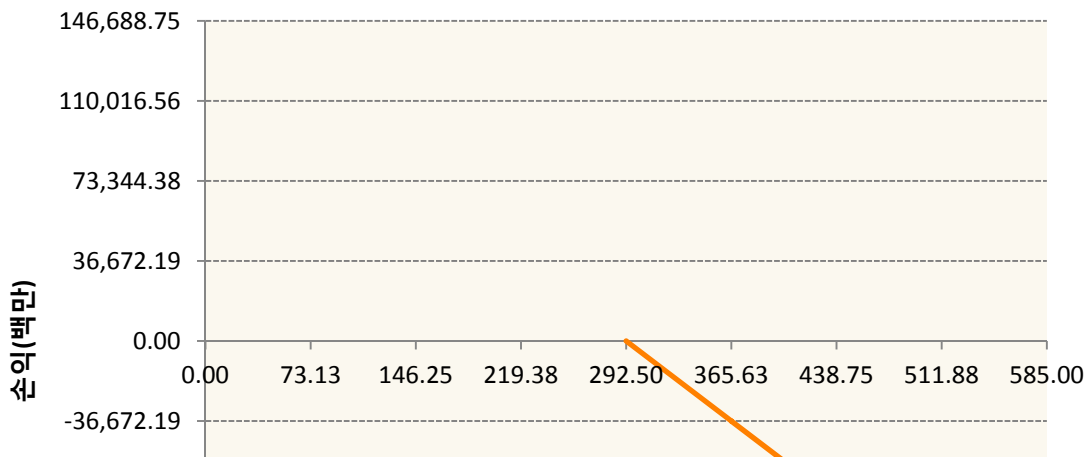
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	152,936	-152,936	장내
누계	유가증권	옵션	0	151,329	-151,329	장내

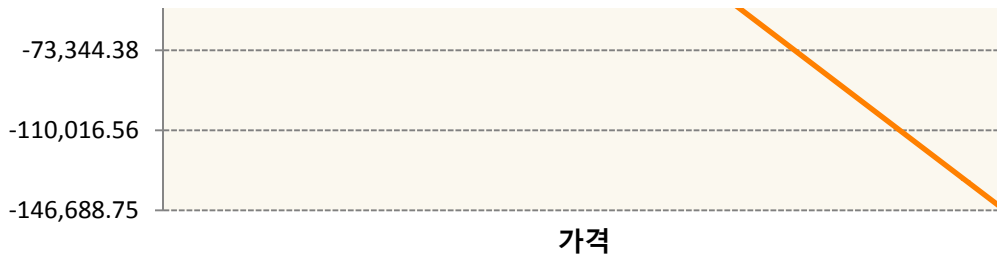
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NA2902-2018-10 콜290



KR4201NA2928-2018-10 콜292.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201NA29 2018-10 콜290 298

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	147	142	137	130	124	116	109
-5.33%	129	121	112	103	94	84	75
-2.67%	93	82	71	61	50	39	27
0%	34	23	11	0	-11	-23	-34
2.67%	-48	-58	-68	-78	-89	-99	-110
5.33%	-148	-155	-163	-171	-180	-189	-198
8.00%	-261	-265	-271	-276	-283	-290	-298

KR4201NA29 2018-10 콜292.5 8,964

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,070	3,945	3,795	3,622	3,431	3,222	2,998
-5.33%	3,627	3,402	3,158	2,899	2,627	2,345	2,055
-2.67%	2,693	2,374	2,049	1,718	1,384	1,047	707
0%	1,083	722	361	0	-361	-722	-1,083
2.67%	-1,259	-1,591	-1,929	-2,272	-2,618	-2,967	-3,318
5.33%	-4,238	-4,490	-4,761	-5,046	-5,343	-5,650	-5,964
8.00%	-7,667	-7,828	-8,016	-8,226	-8,457	-8,703	-8,964

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

8,764

공시일	2018-09-14
기준일	2018-09-13

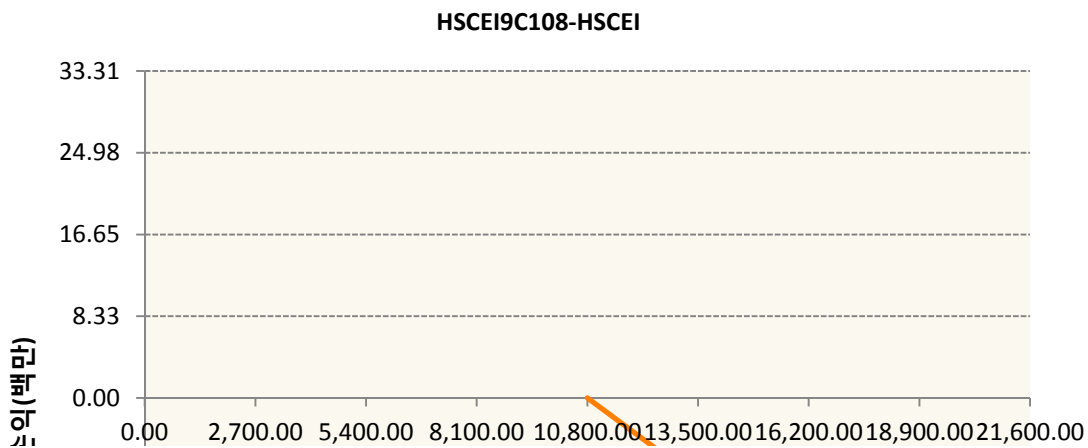
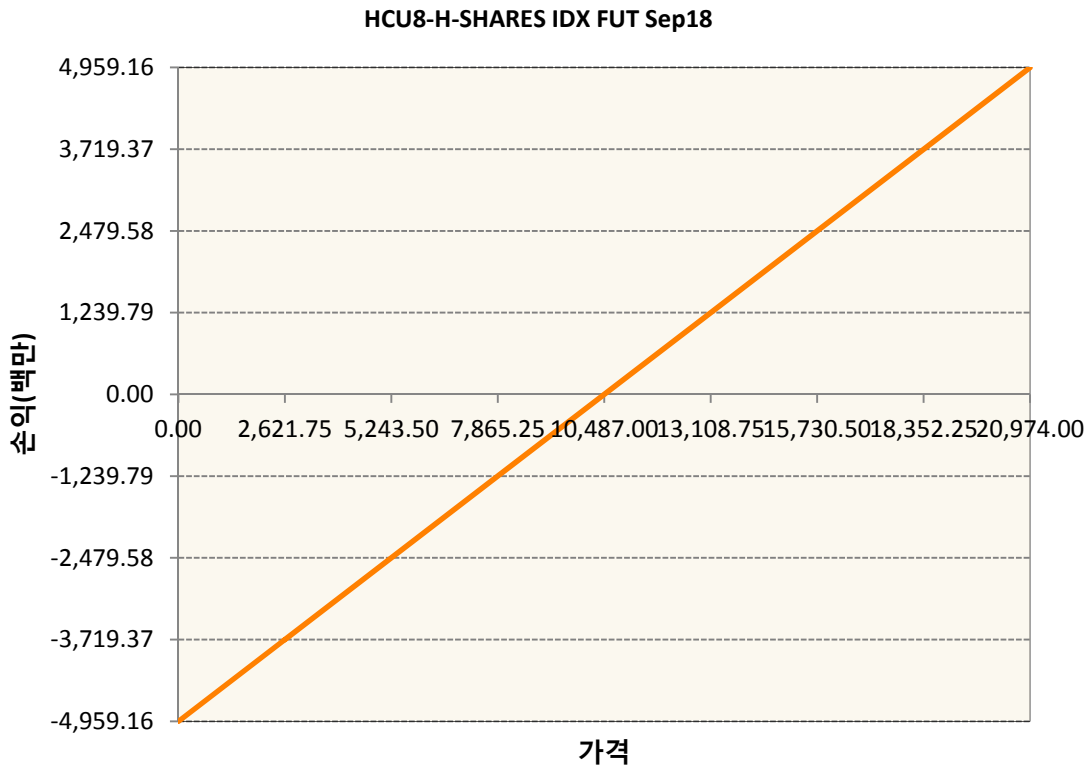
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

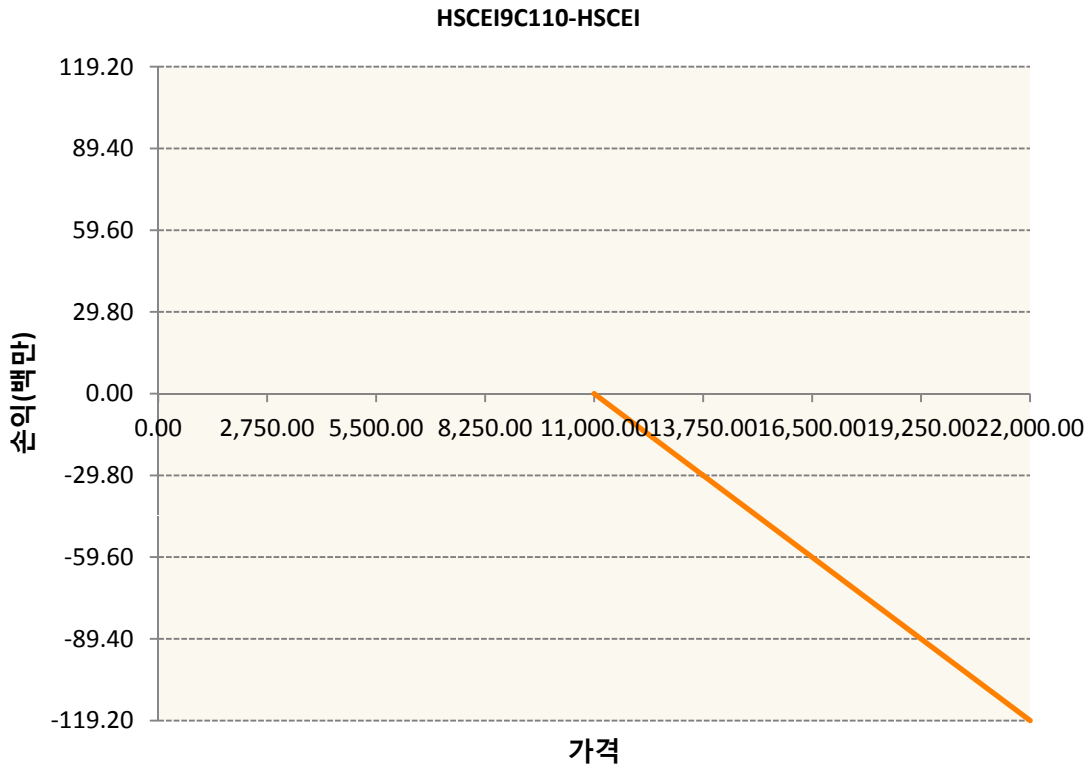
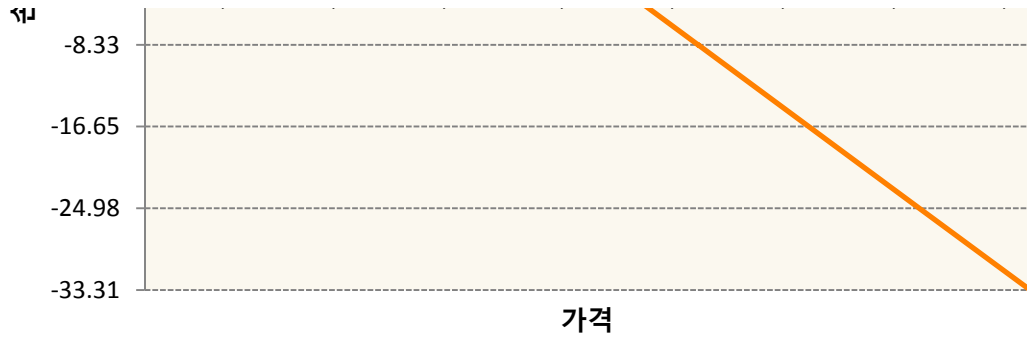
1. 계약금액

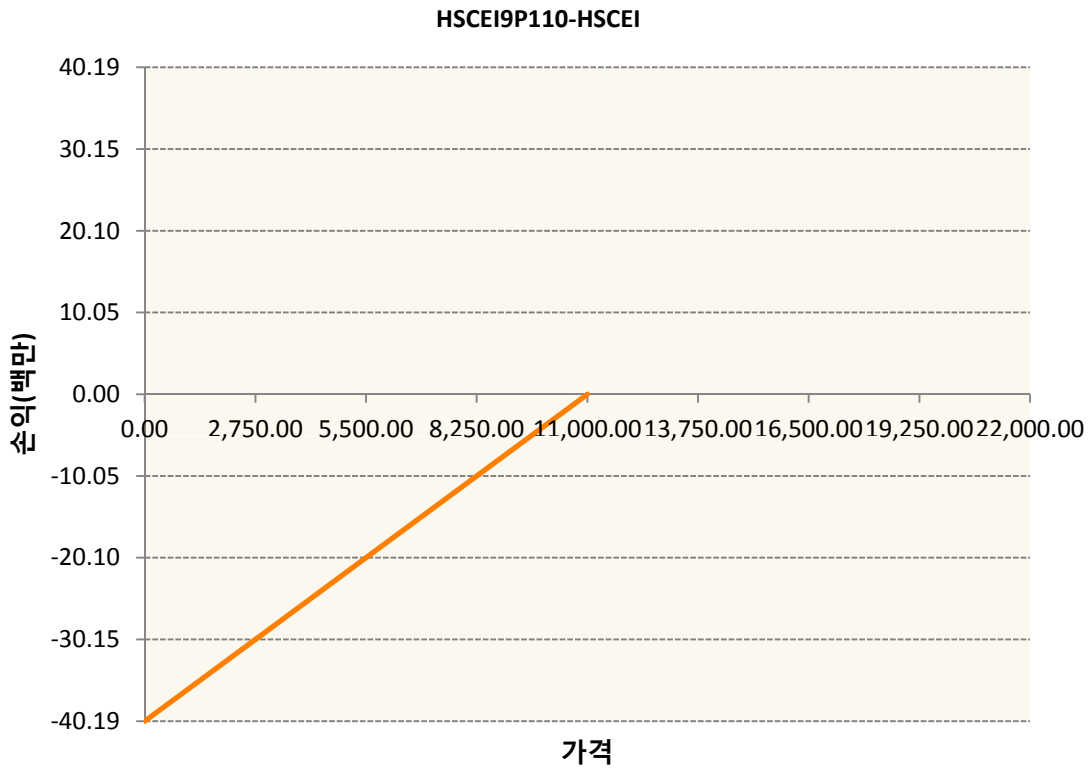
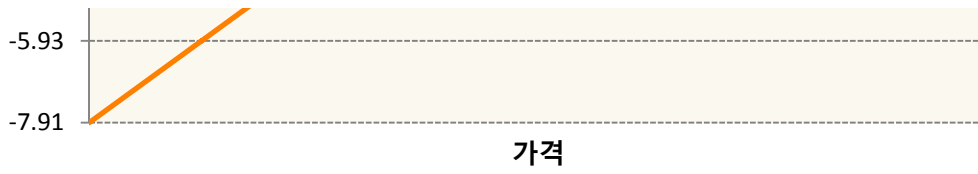
(단위:백만원)

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	4,959	0	4,959	장내
누계	유가증권	옵션	0	201	-201	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU8	H-SHARES IDX FUT Sep18	397
HSCEI9C108	HSCEI	3
HSCEI9C110	HSCEI	10
HSCEI9P108	HSCEI	1
HSCEI9P110	HSCEI	3

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	379

공시일	2018-09-14
기준일	2018-09-13

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14

3,992

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,992	-3,992	-3,992	-3,992	-3,992	-3,992	-3,992
-5.33%	-2,661	-2,661	-2,661	-2,661	-2,661	-2,661	-2,661
-2.67%	-1,331	-1,331	-1,331	-1,331	-1,331	-1,331	-1,331
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,331	1,331	1,331	1,331	1,331	1,331	1,331
5.33%	2,661	2,661	2,661	2,661	2,661	2,661	2,661
8.00%	3,992	3,992	3,992	3,992	3,992	3,992	3,992

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

(단위:백만원)

3,993

공시일	2018-09-14
기준일	2018-09-13

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

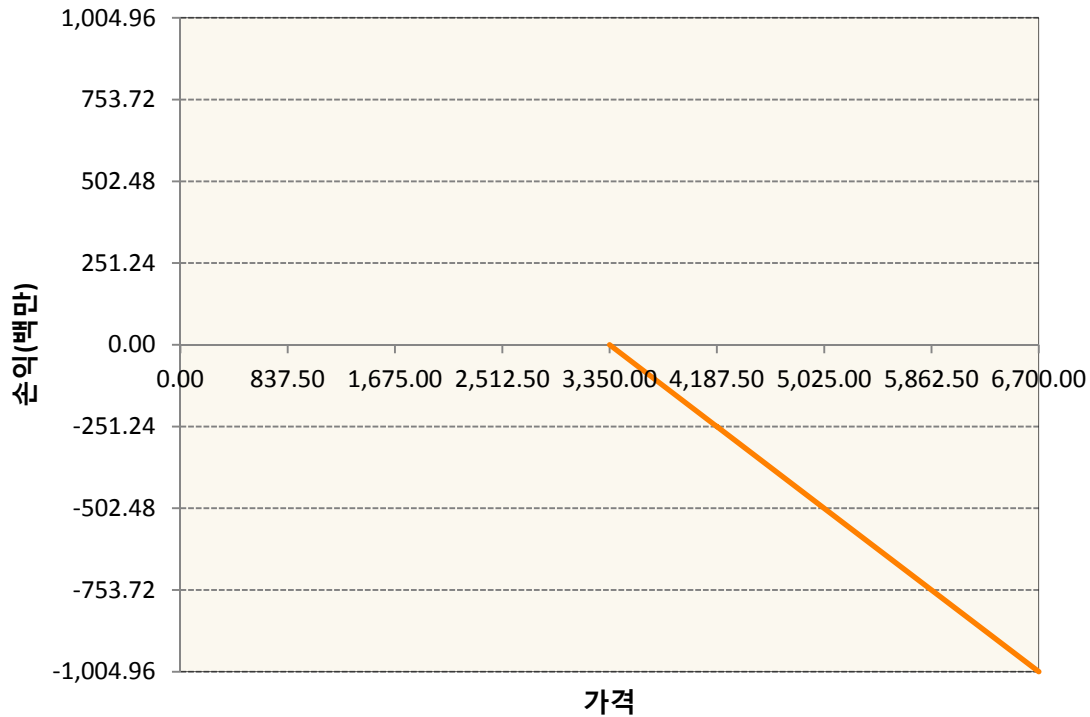
1. 계약금액

(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	5,450	0	5,450	
누계	유가증권	스왑	34,442	0	34,442	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,165	-25,165	장내
누계	지수	스왑	52,951	0	52,951	장외

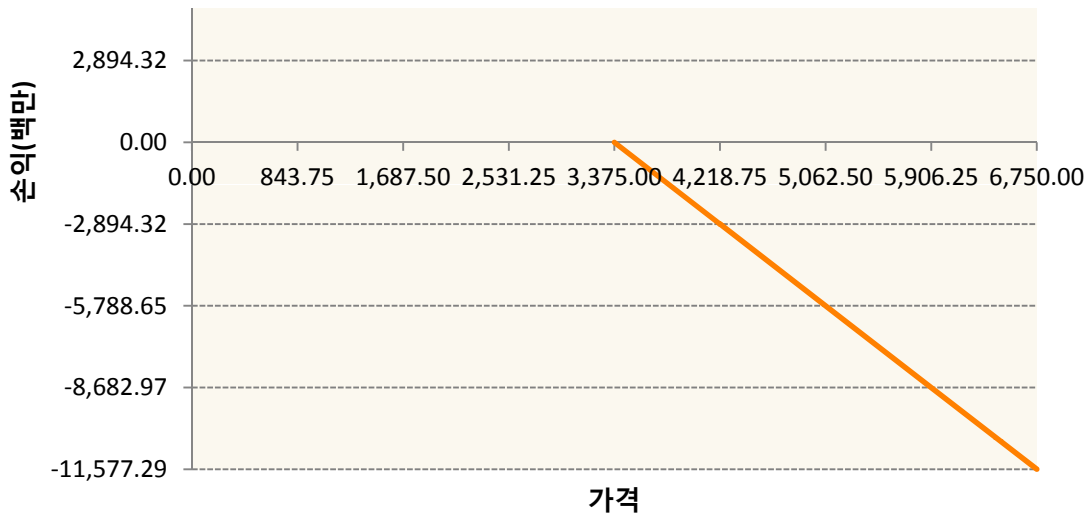
2. 만기시점의 손익구조

OESXU8-C3350-EURO STOXX 50

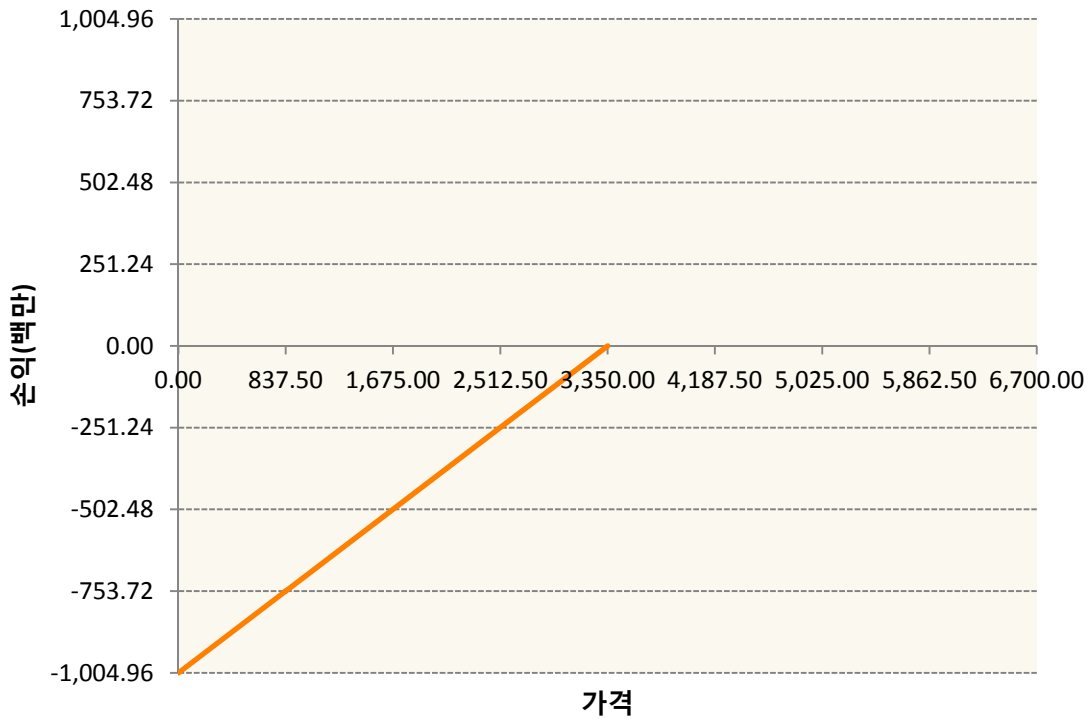


OESXU8-C3375-EURO STOXX 50

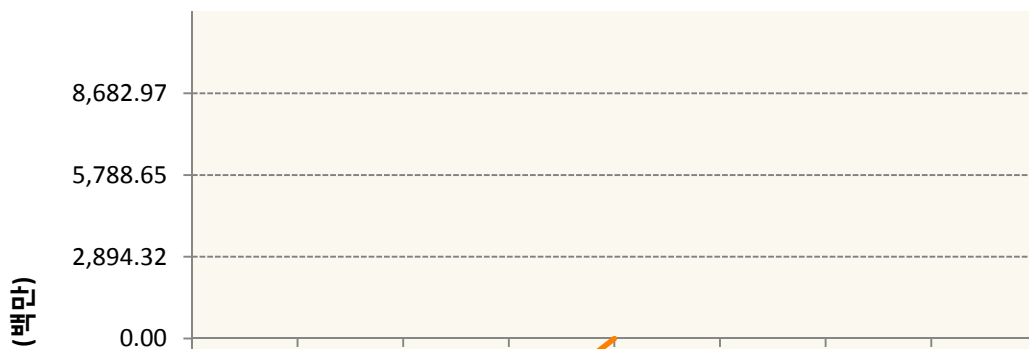


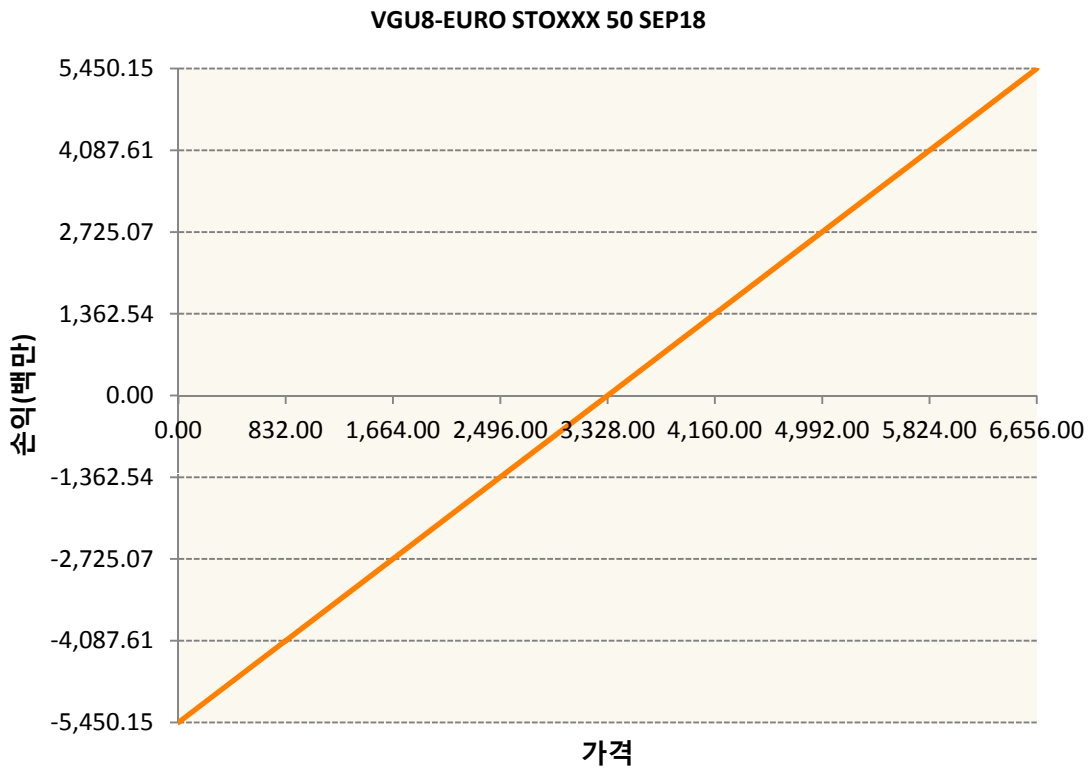
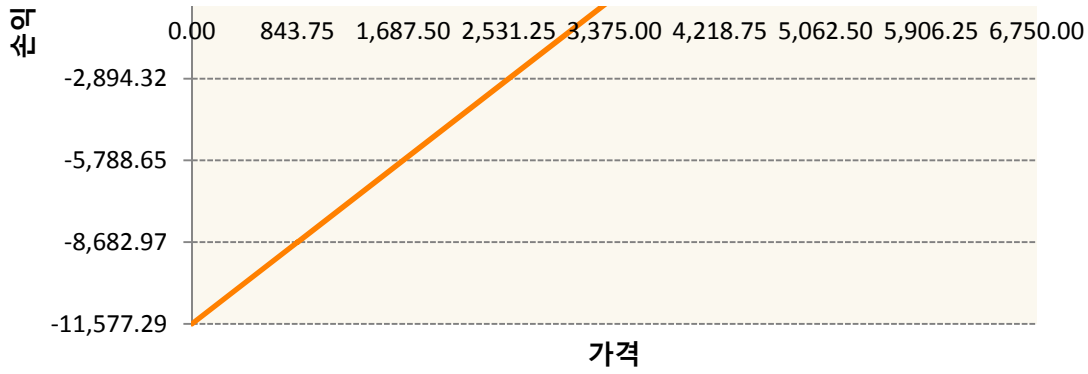


OESXU8-P3350-EURO STOXX 50



OESXU8-P3375-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		55
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY		36
OESXU8-C3E EURO STOXX 50		80
OESXU8-C3E EURO STOXX 50		926
OESXU8-P3E EURO STOXX 50		80
OESXU8-P3E EURO STOXX 50		926
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18		436

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

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

(단위:백만원)

1,118

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

(단위:백만원)

88

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

(단위:백만원)

132

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

(단위:백만원)

158

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-09-14
기준일	2018-09-13

리디파인K200(주식혼합-파생재간

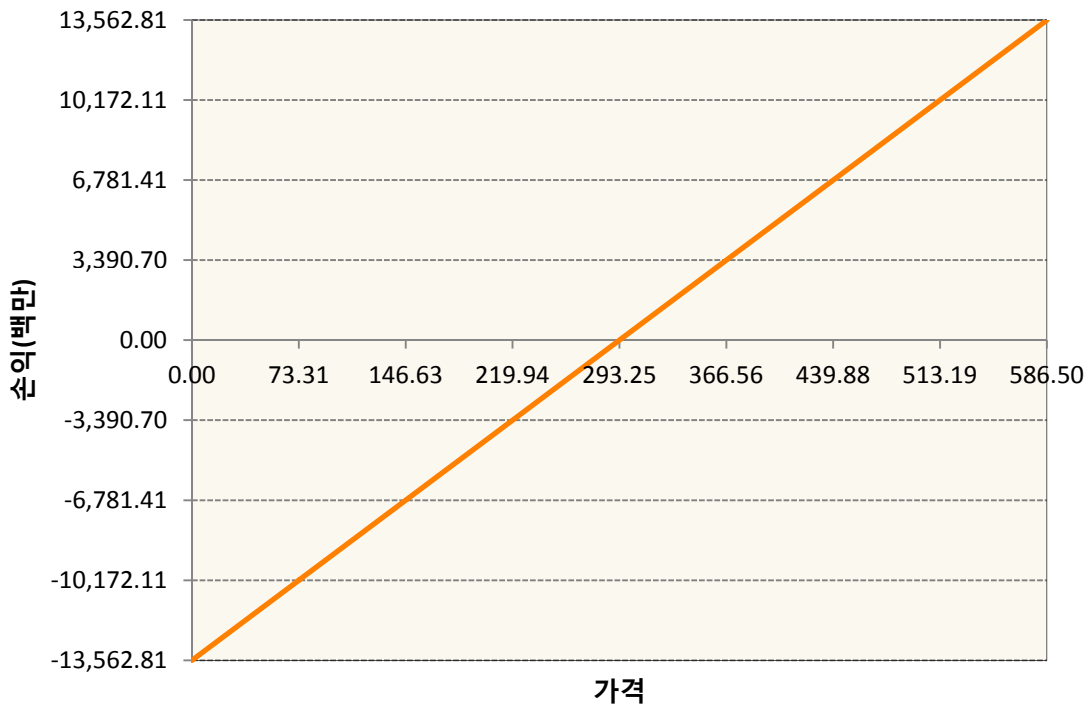
1. 계약금액

(단위:백만원)

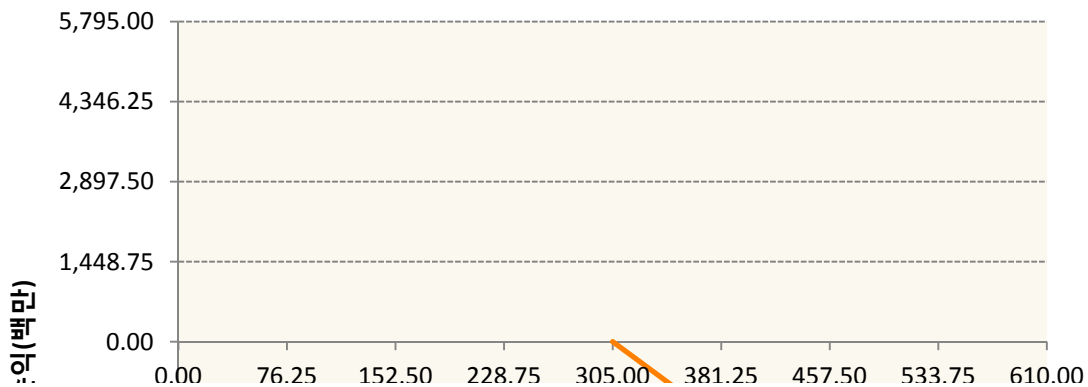
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	6,815	0	6,815	장내
신규	유가증권	옵션	794	24,254	-23,460	장내
누계	유가증권	선물	13,563	0	13,563	장내
누계	유가증권	옵션	803	24,245	-23,442	장내

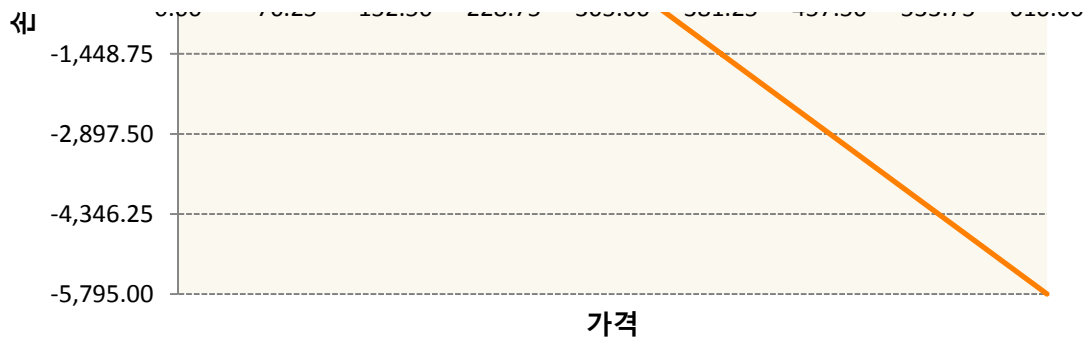
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

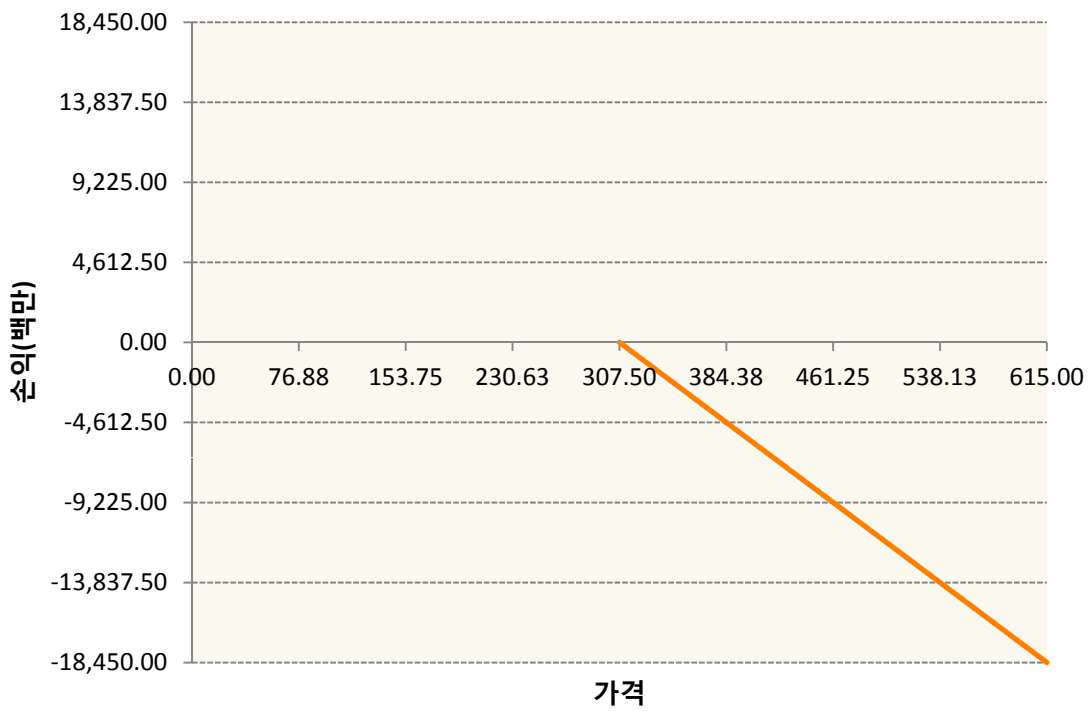


KR4201NA3058-2018-10 콜305

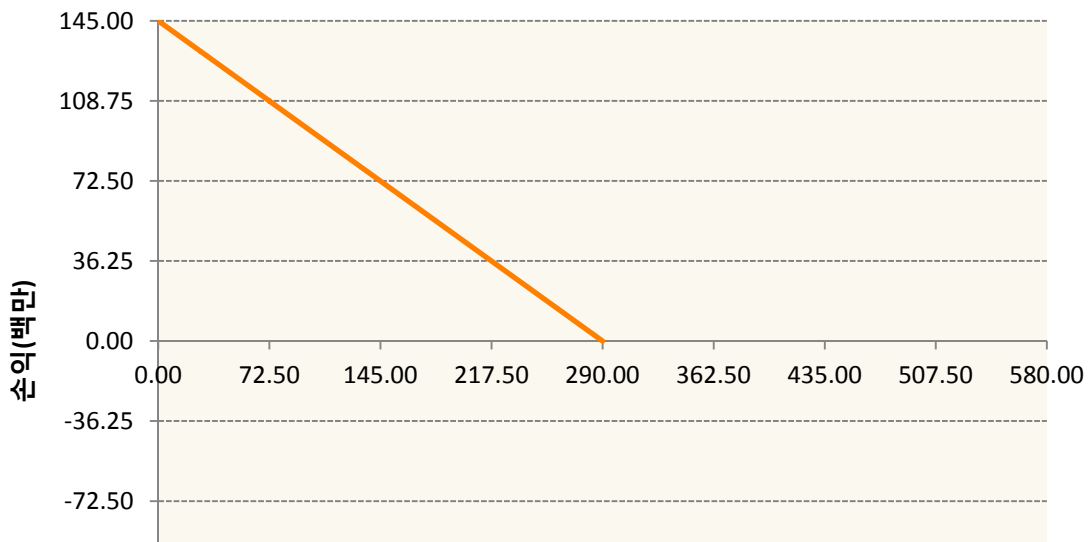


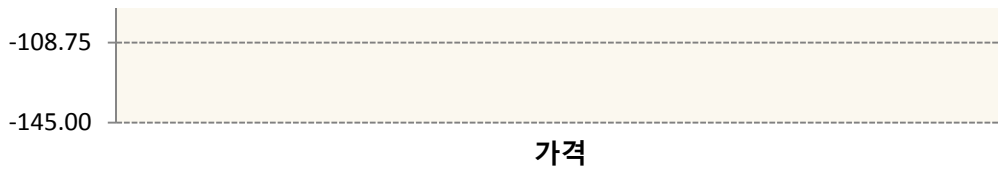


KR4201NA3074-2018-10 콜307.5

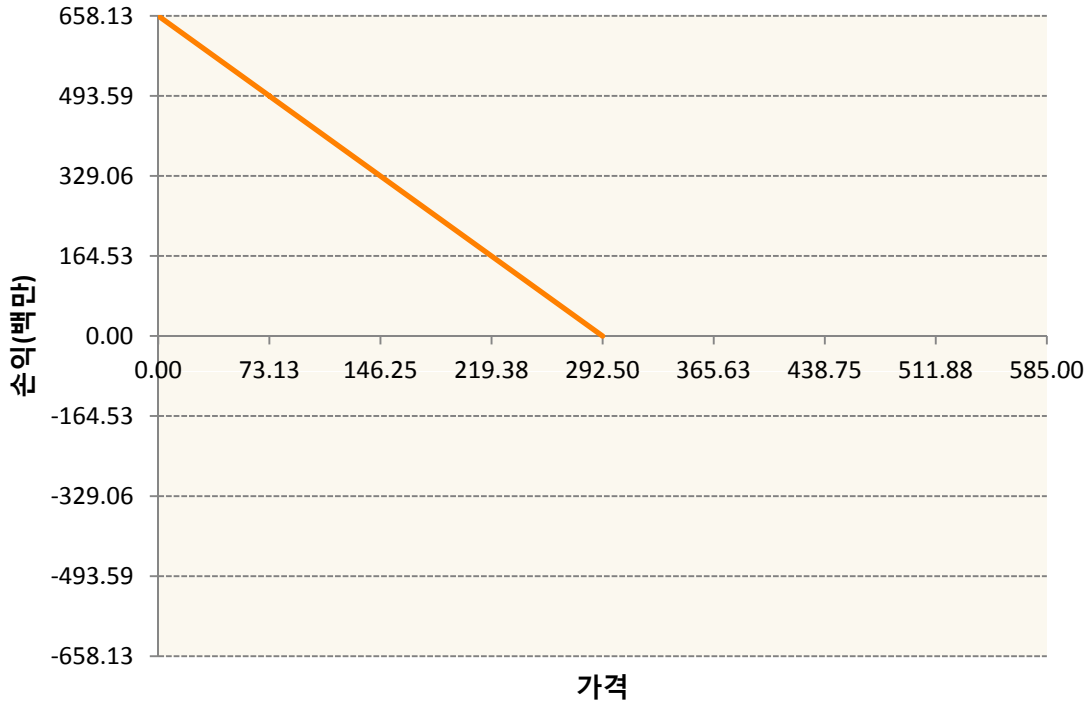


KR4301NA2901-2018-10 풋290





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 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

KR4201NA3(2018-10 콜305) 260

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	73	72	70	67	63	59	54
-5.33%	69	66	61	56	50	43	35
-2.67%	58	52	44	35	26	16	6

0%	34	23	12	0	-12	-24	-37
2.67%	-12	-26	-40	-53	-67	-81	-95
5.33%	-85	-99	-113	-127	-141	-156	-170
8.00%	-183	-195	-207	-220	-234	-247	-260

KR4201NA3(2018-10 콜307.5

768

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	194	191	186	178	169	157	143
-5.33%	186	177	165	151	134	115	93
-2.67%	160	142	120	96	70	41	11
0%	98	67	34	0	-36	-73	-110
2.67%	-25	-66	-108	-150	-193	-236	-279
5.33%	-226	-271	-317	-362	-408	-453	-499
8.00%	-510	-552	-594	-637	-681	-724	-768

KR4301NA2(2018-10 풋290

9

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%	5	5	5	5	5	6	6
-2.67%	2	2	2	2	2	2	3
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1

KR4301NA2(2018-10 풋292.5

44

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	44	44	44	44	44	44	44
-5.33%	27	27	27	27	27	27	28
-2.67%	10	11	11	11	12	13	13
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-8	-7	-7	-6	-6	-5	-4
5.33%	-9	-9	-8	-8	-8	-8	-7
8.00%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-8

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

(단위:백만원)

1,676

공시일	2018-09-14
기준일	2018-09-13

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

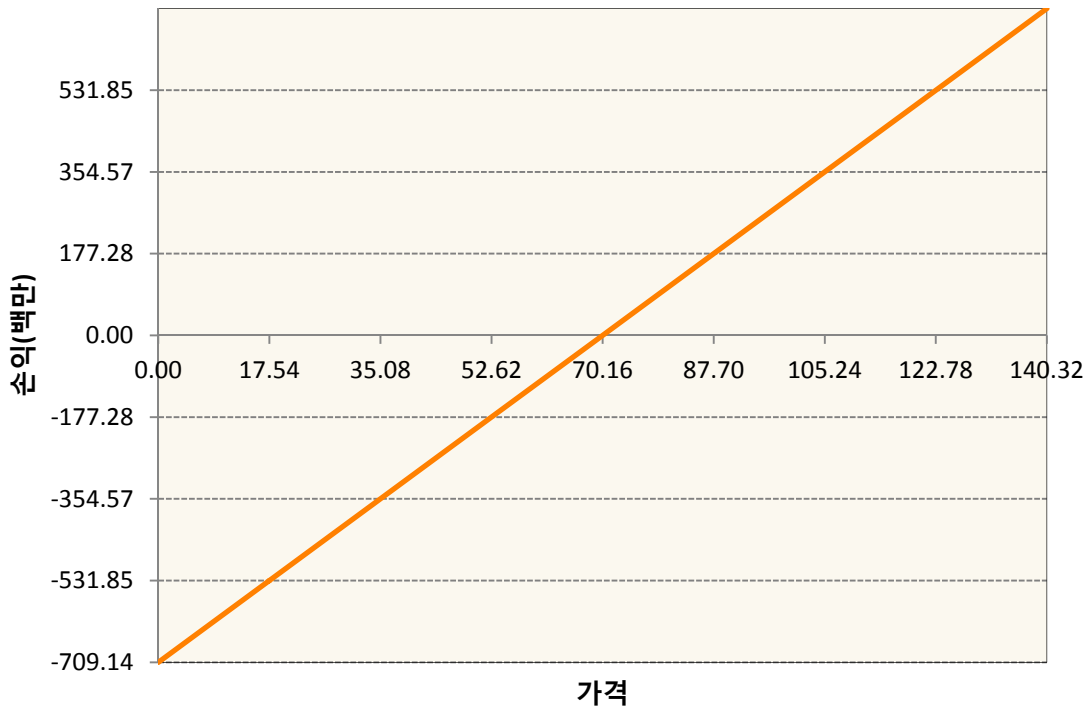
1. 계약금액

(단위:백만원)

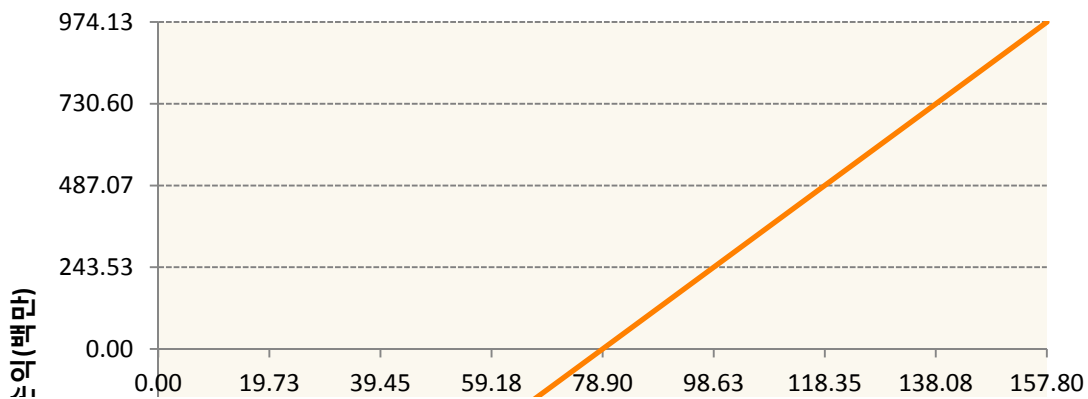
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,077	618	2,459	
누계	유가증권	선물	533	0	533	장내

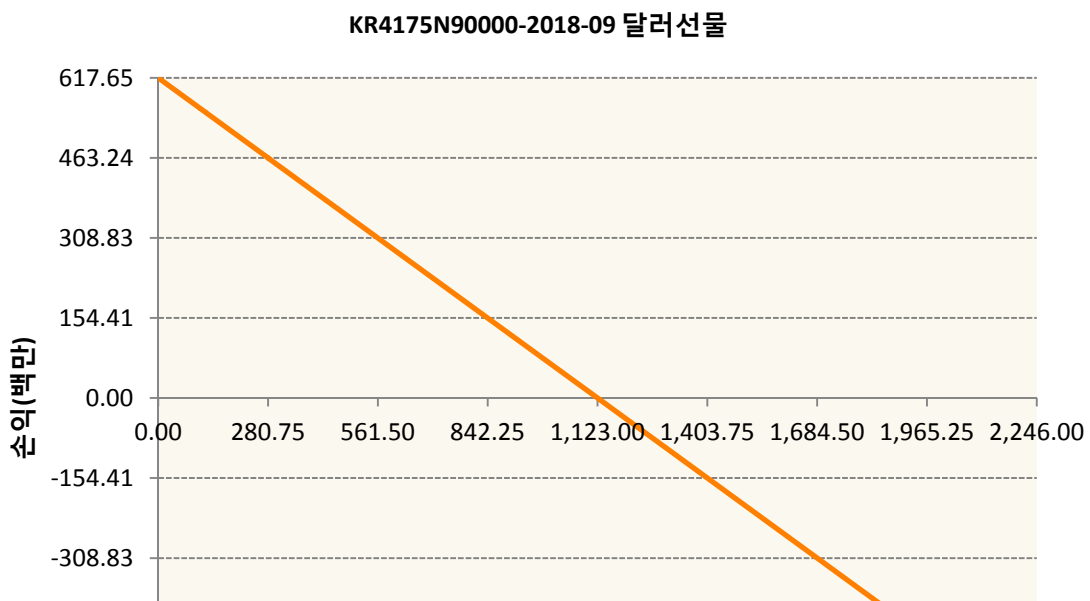
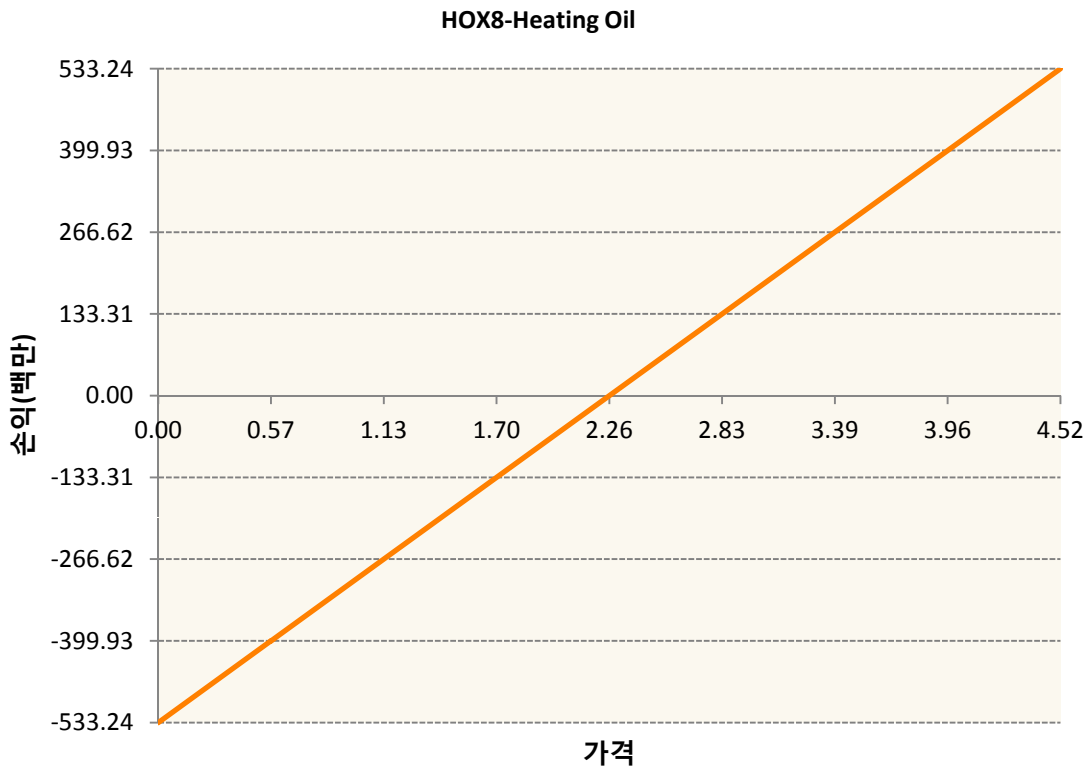
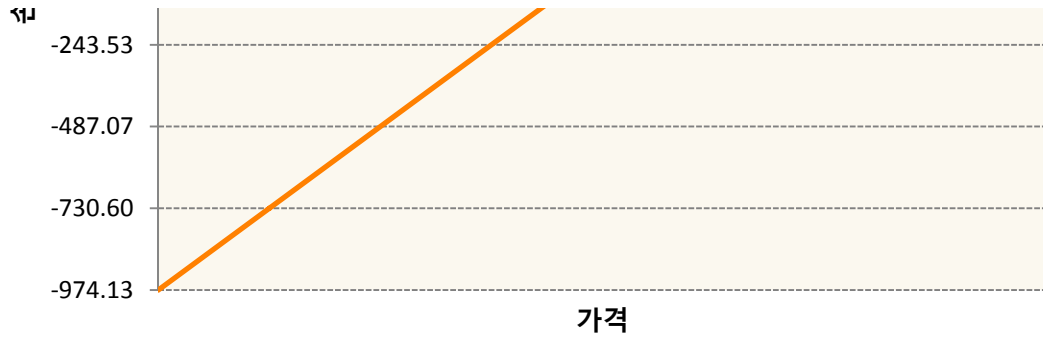
2. 만기시점의 손익구조

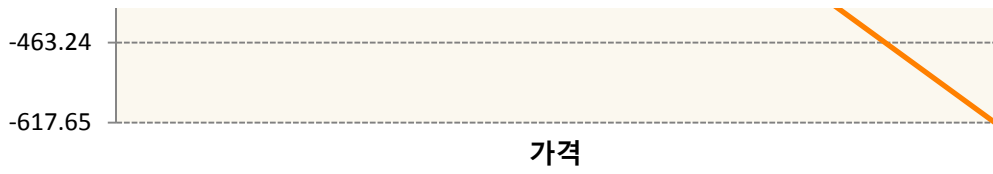
CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18



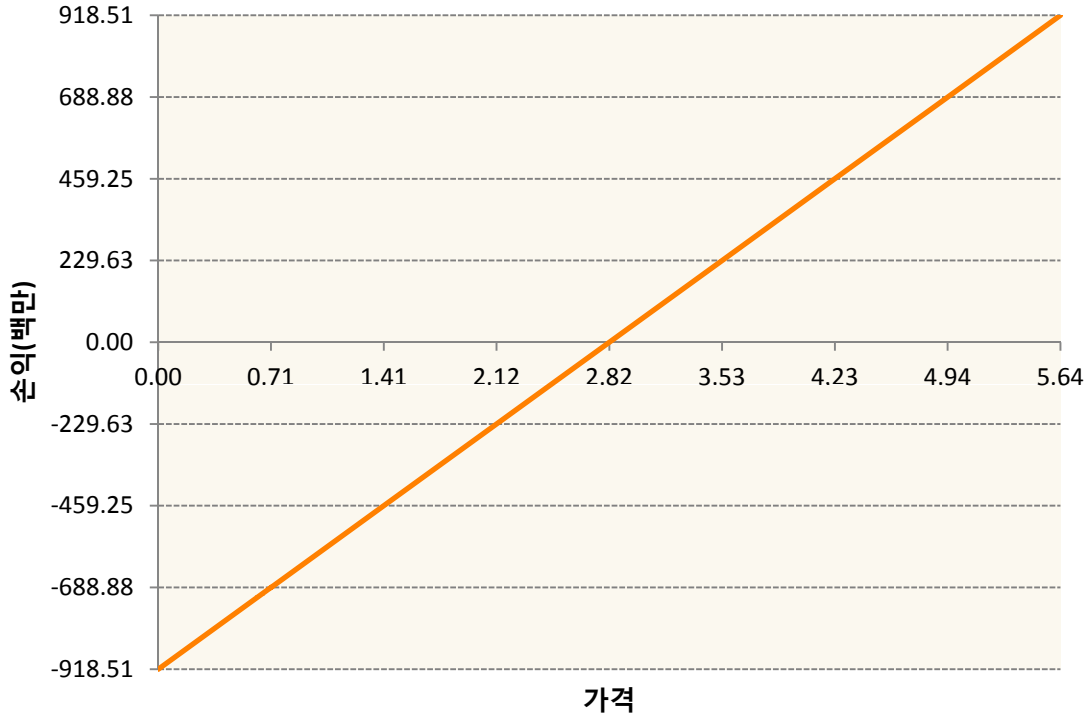
COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19



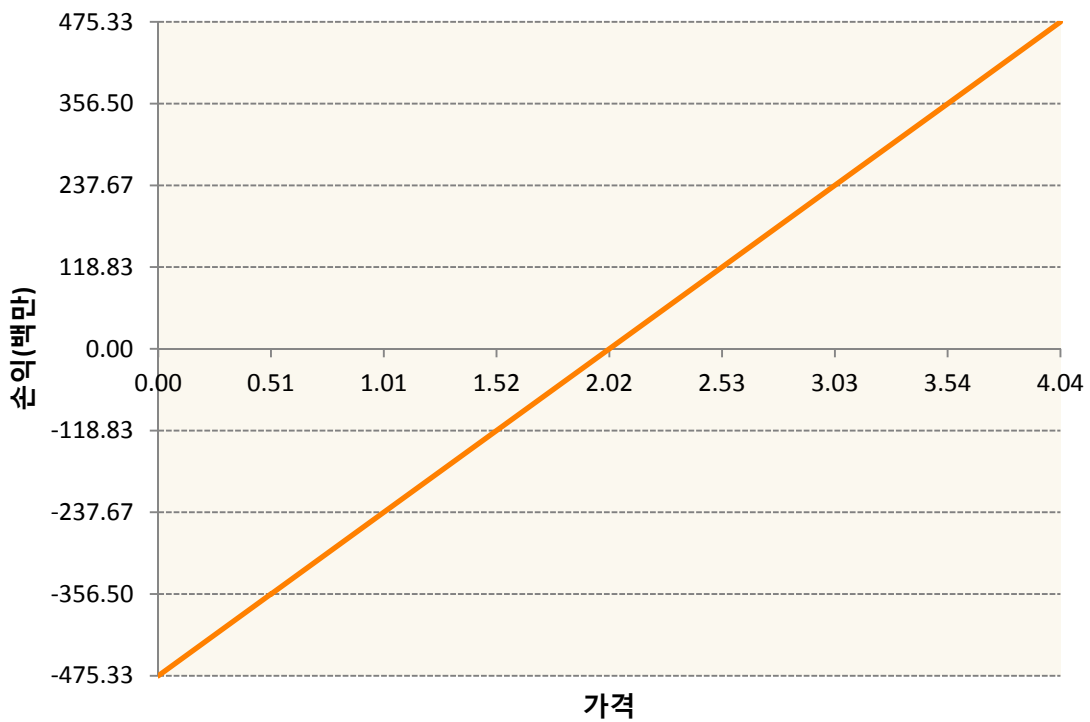




NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18



XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	57
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	78
HOX8	Heating Oil	43
	KR4175N90C 2018-09 달러선물	49
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	73
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	38

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	430

공시일	2018-09-14
기준일	2018-09-13

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

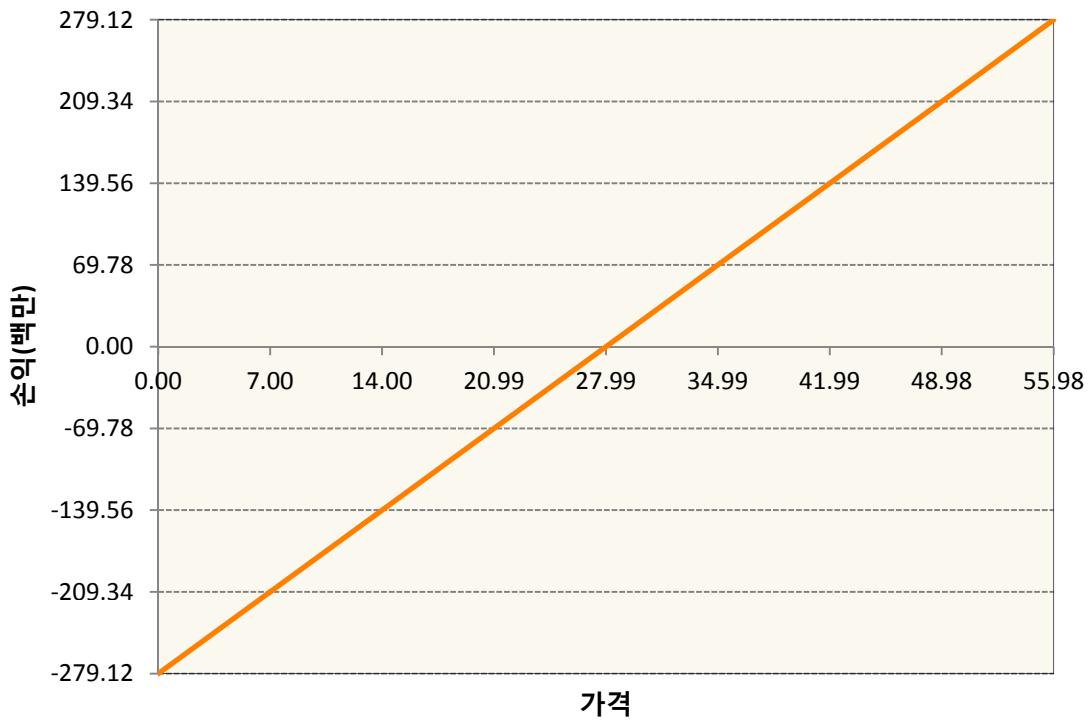
1. 계약금액

(단위:백만원)

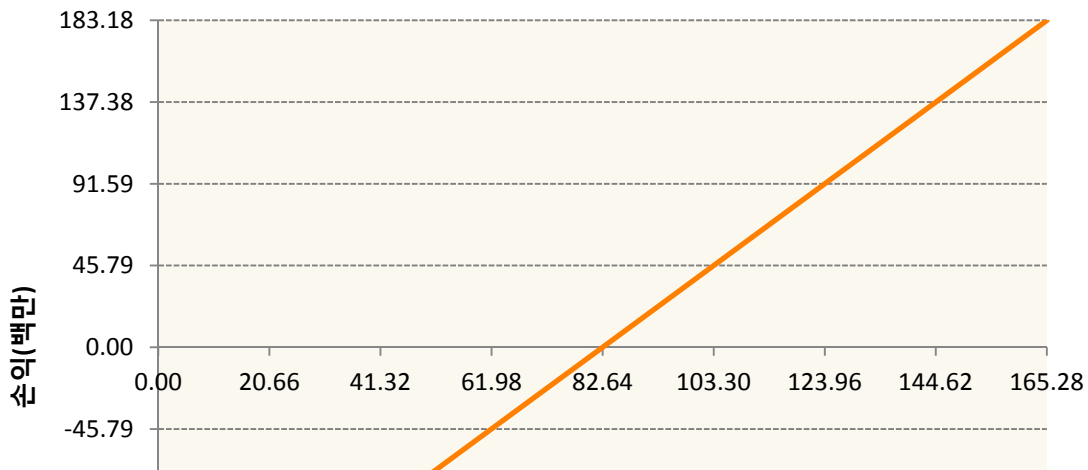
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,544	79	3,466	

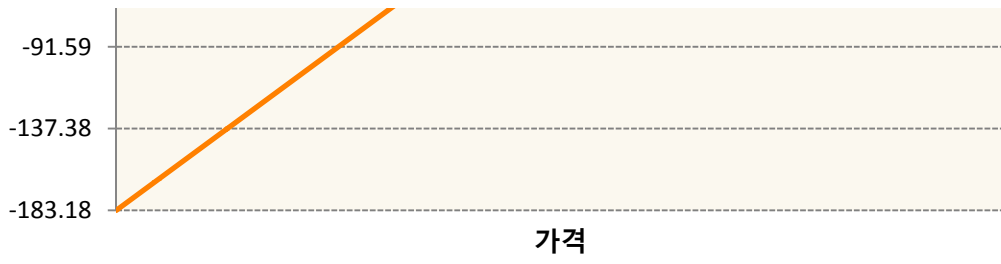
2. 만기시점의 손익구조

BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18

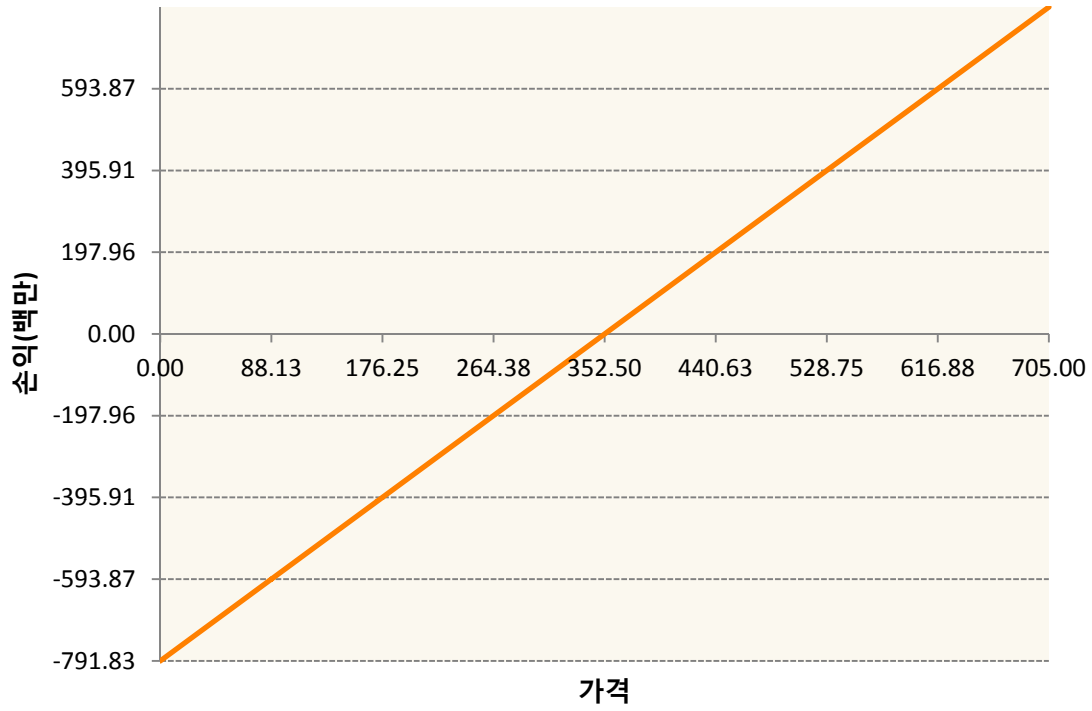


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

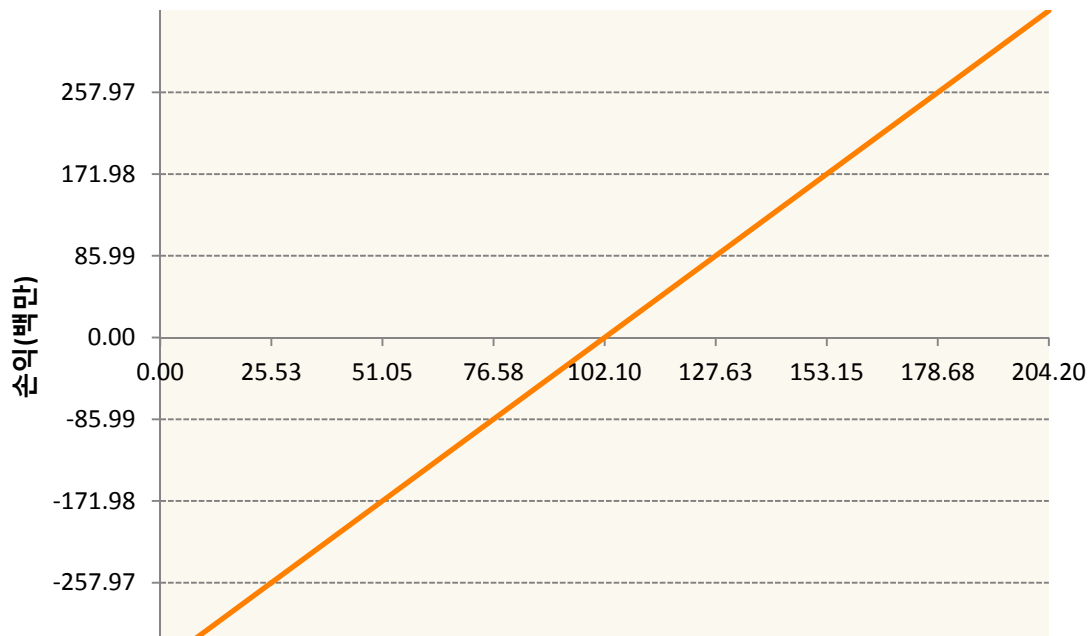


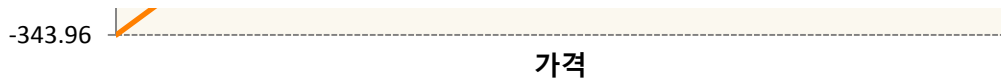


CZ8-CORN FUTURE DEC18

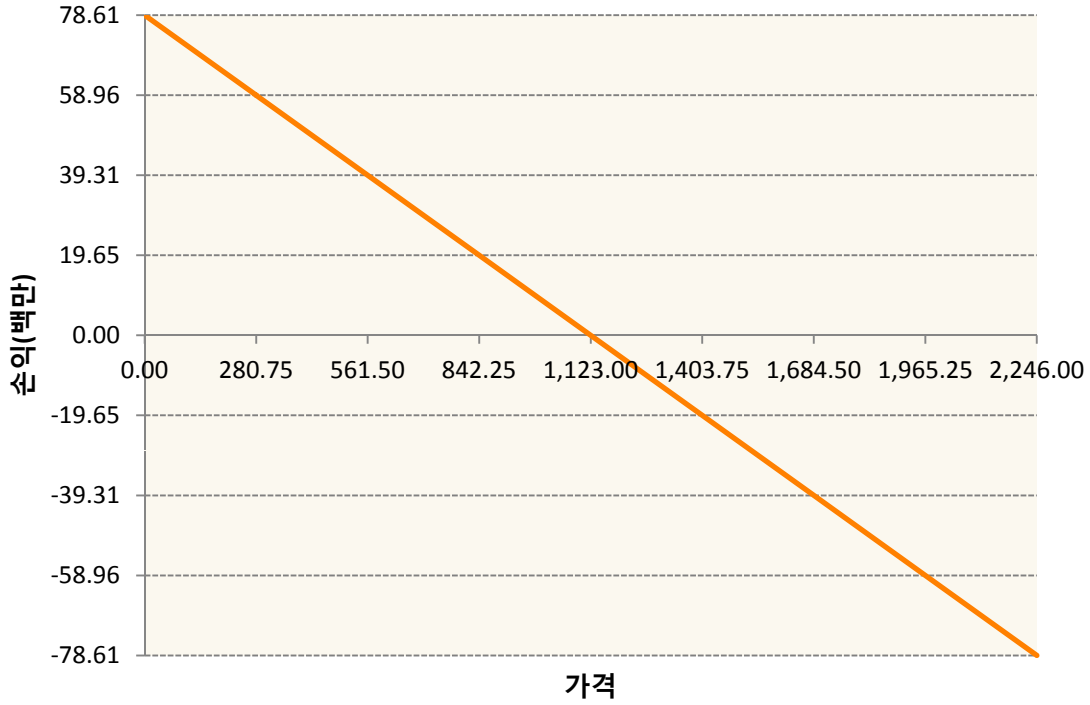


KCZ8-COFFEE 'C' FUTURE Dec18

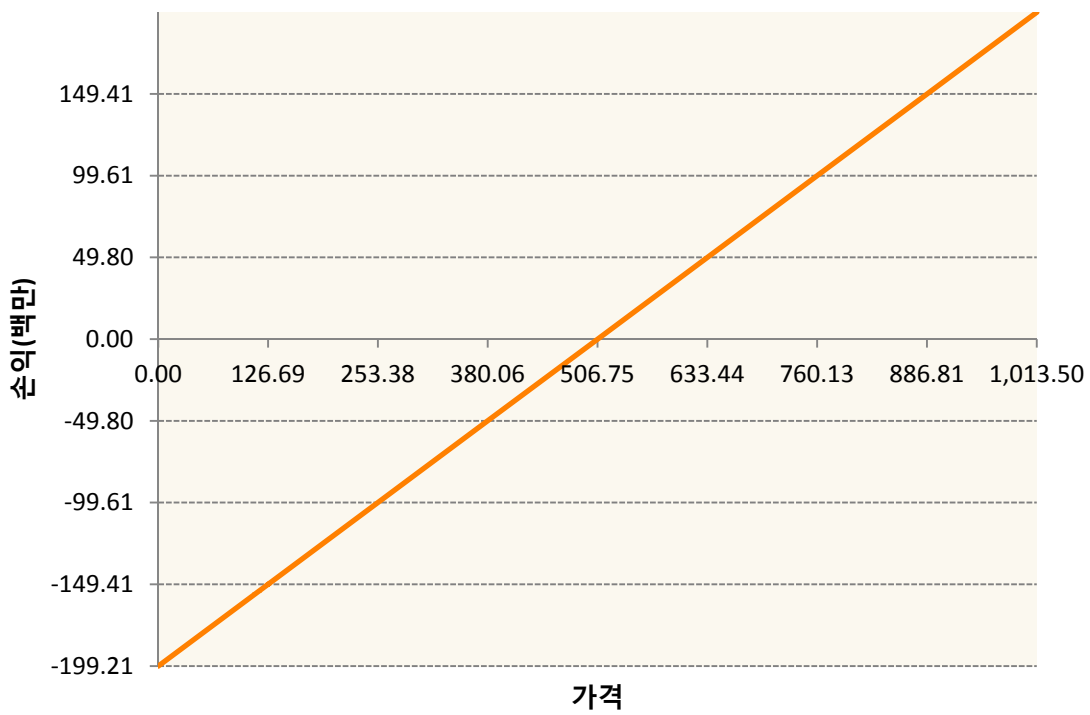




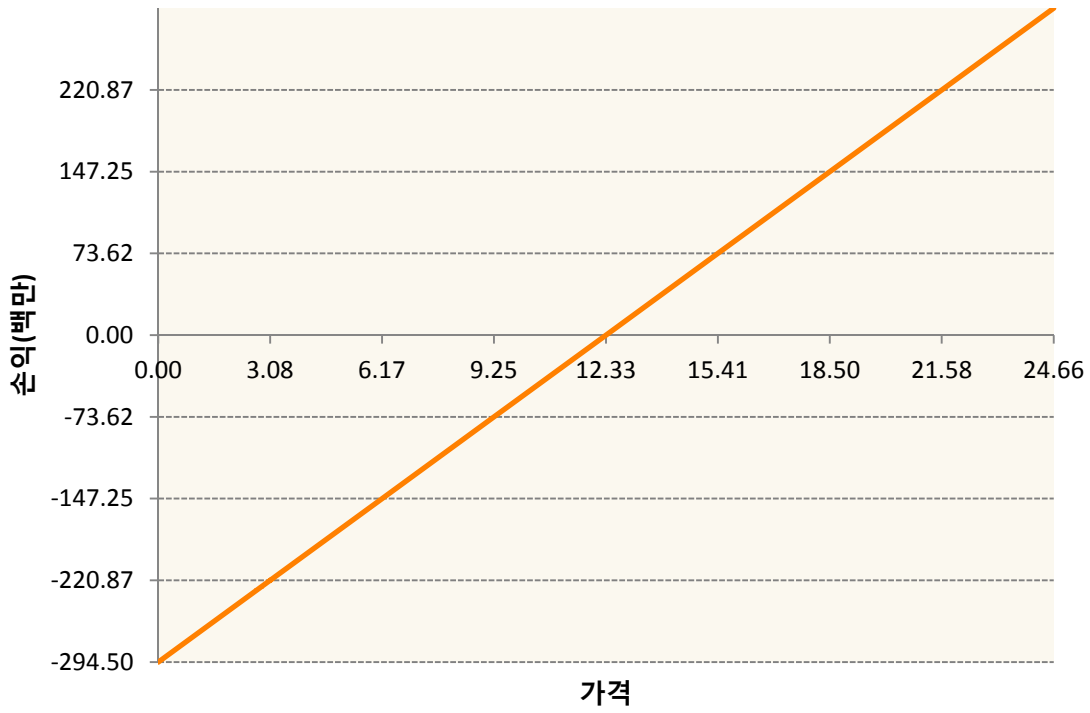
KR4175N90000-2018-09 달러선물



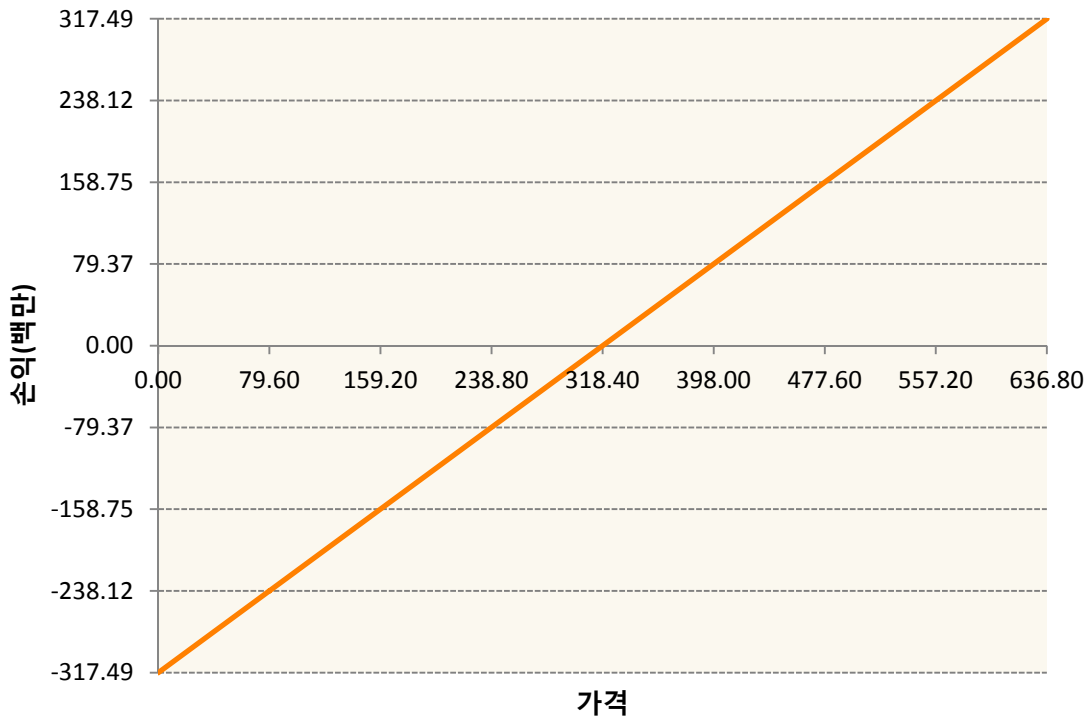
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



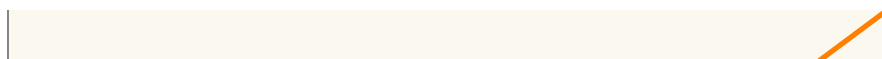
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

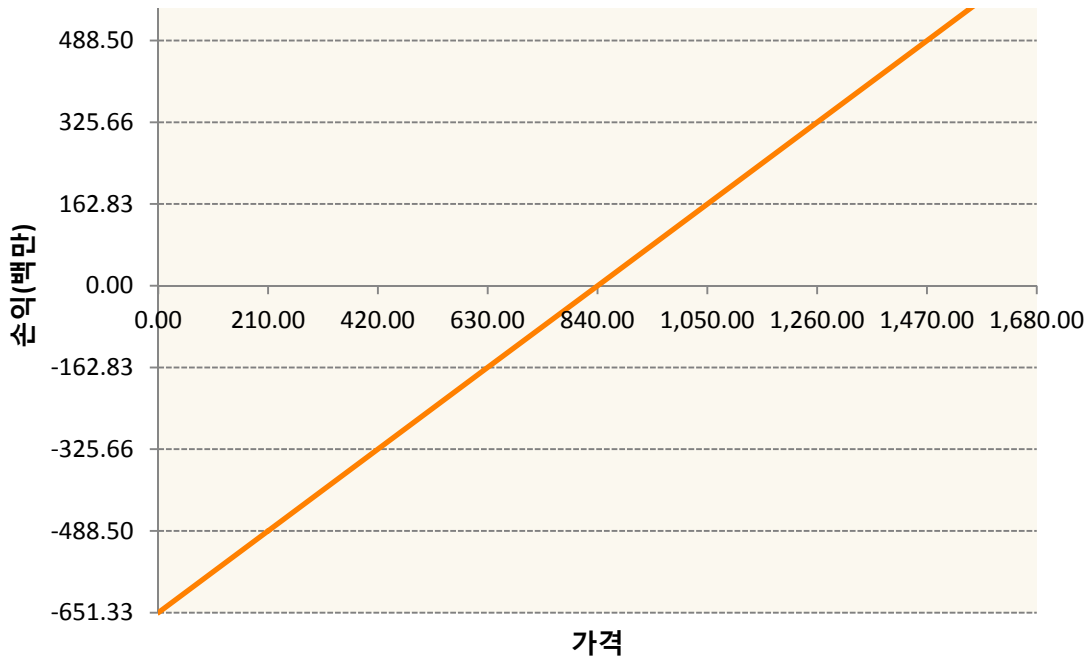


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

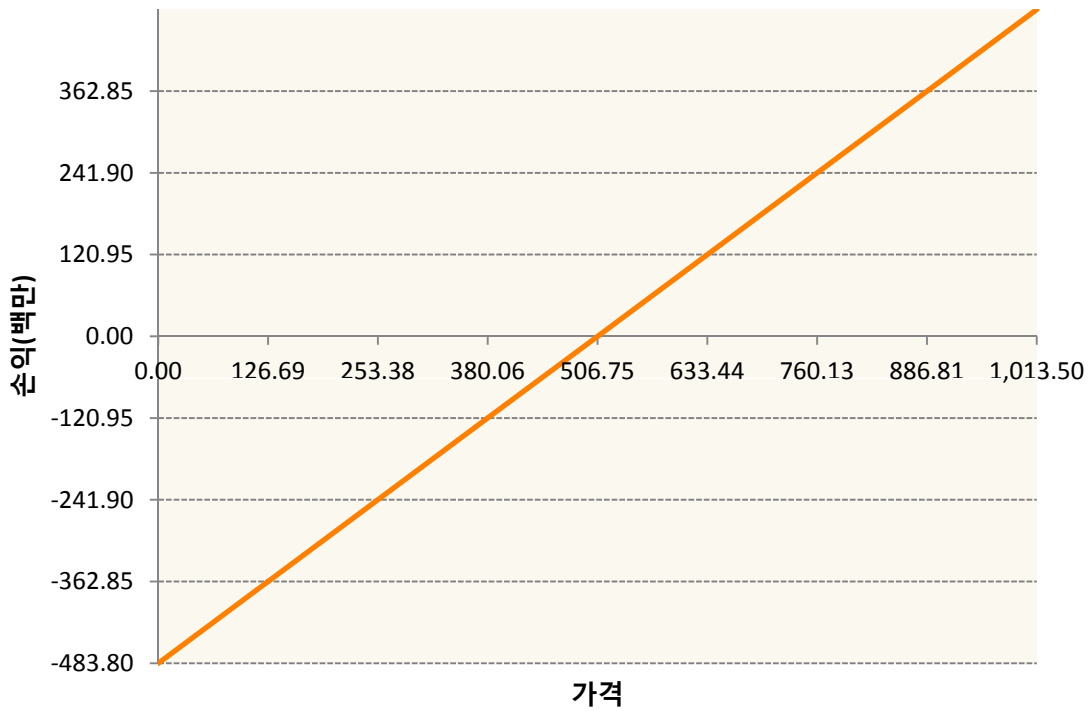


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





WZ8-WHEAT FUTURE(CBT) DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	22
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	15
CZ8	CORN FUTURE DEC18	63
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	28
KR4175N90C	2018-09 달러선물	6

KWZ8	KC HRW WHEAT FUT DEC18	16
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	24
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	25
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	52
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	39

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

(단위:백만원)

306