

공시일	2018-09-19
기준일	2018-09-18

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	2018-09-19
기준일	2018-09-18

스마트인덱스모

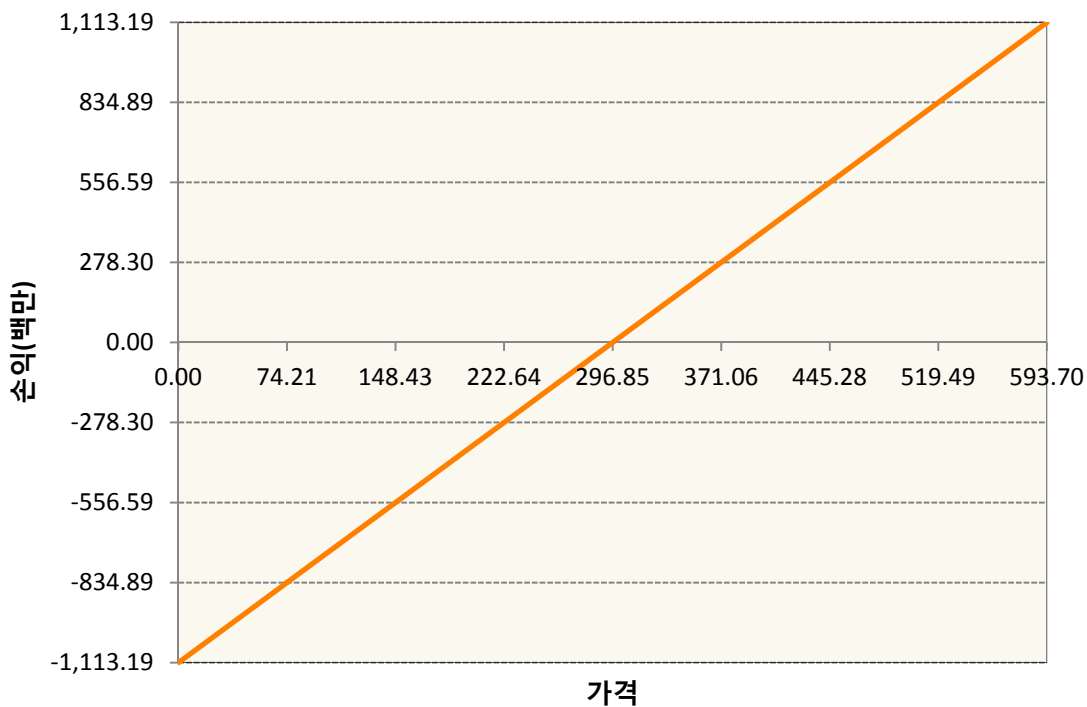
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,113	0	1,113	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물)

89

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-5.33%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	30	30	30	30	30	30	30
5.33%	59	59	59	59	59	59	59
8.00%	89	89	89	89	89	89	89

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

(단위:백만원)

67

공시일	2018-09-19
기준일	2018-09-18

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)

486

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-19
기준일	2018-09-18

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

286

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

362

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-19
기준일	2018-09-18

유로인덱스모(주식-파생형)

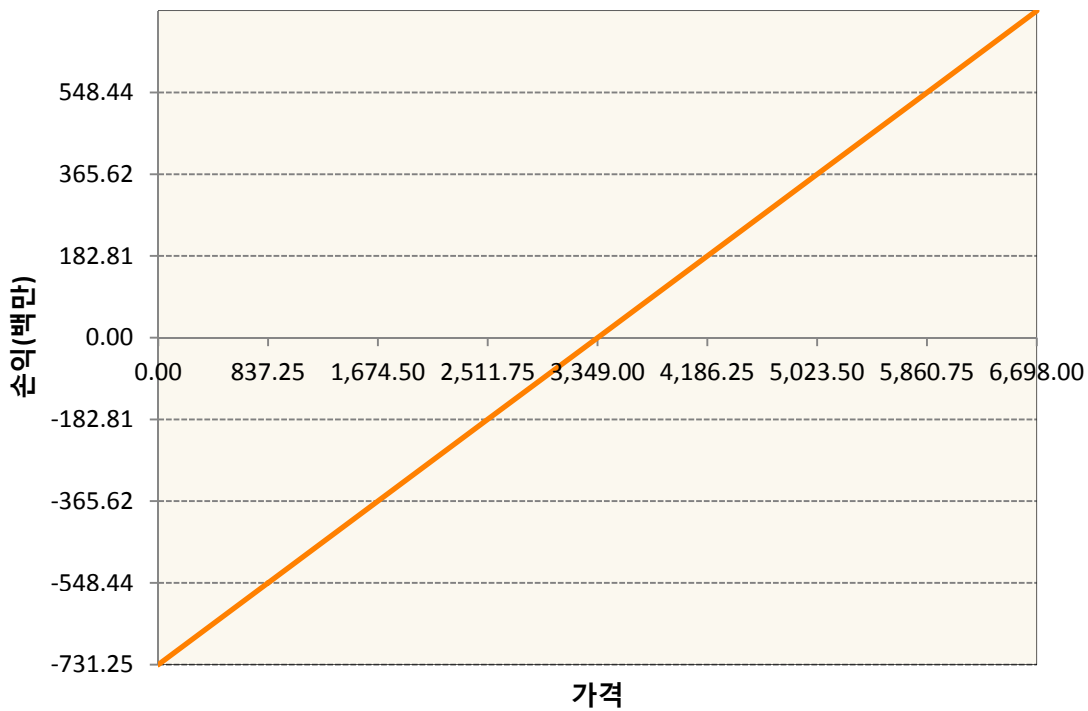
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	731	0	731	

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	2018-09-19
기준일	2018-09-18

차이나인덱스모(주식-파생형)

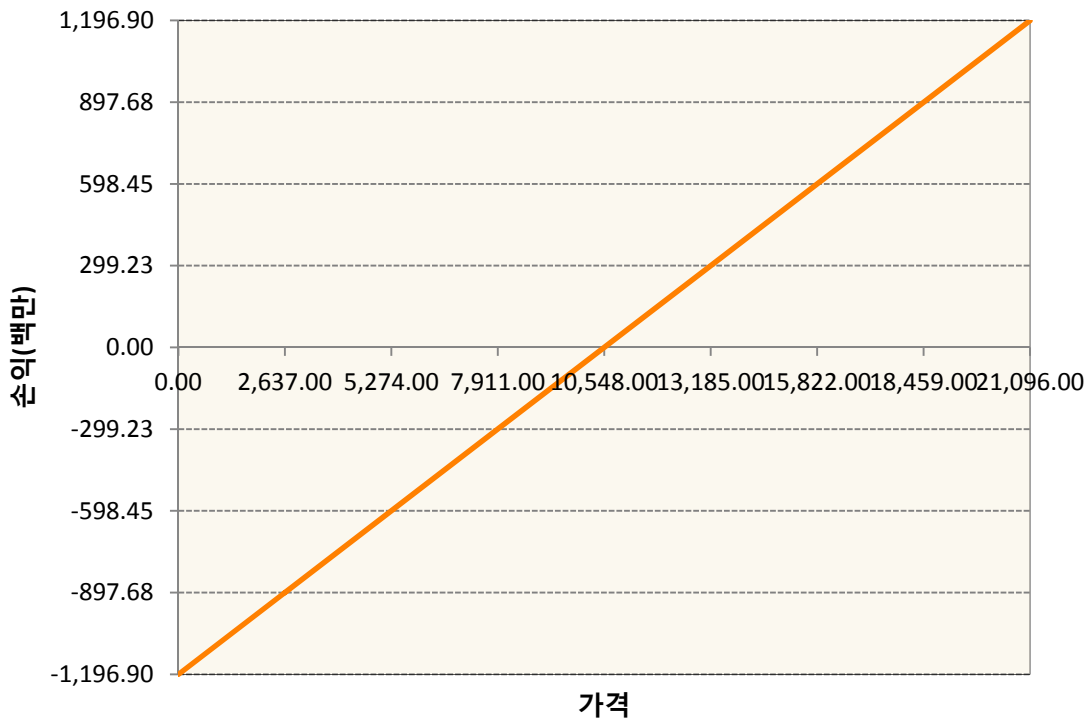
1. 계약금액

(단위:백만원)

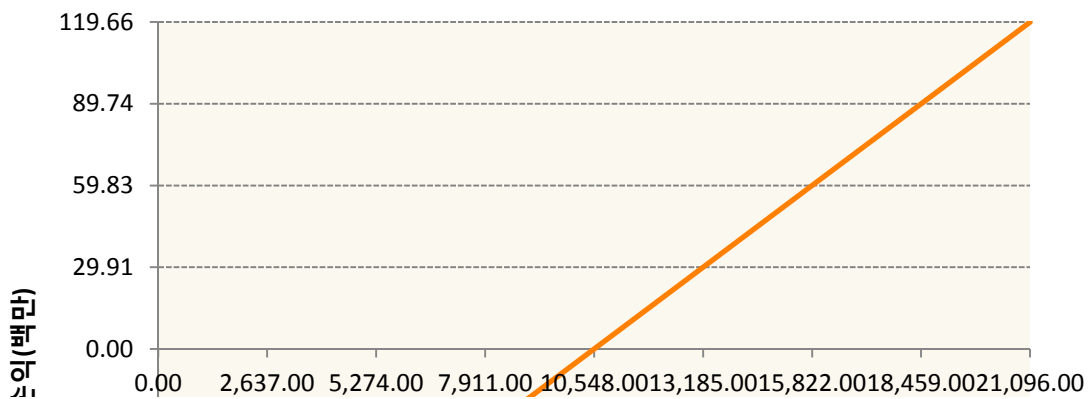
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	120	0	120	
누계	유가증권	선물	1,197	0	1,197	장내

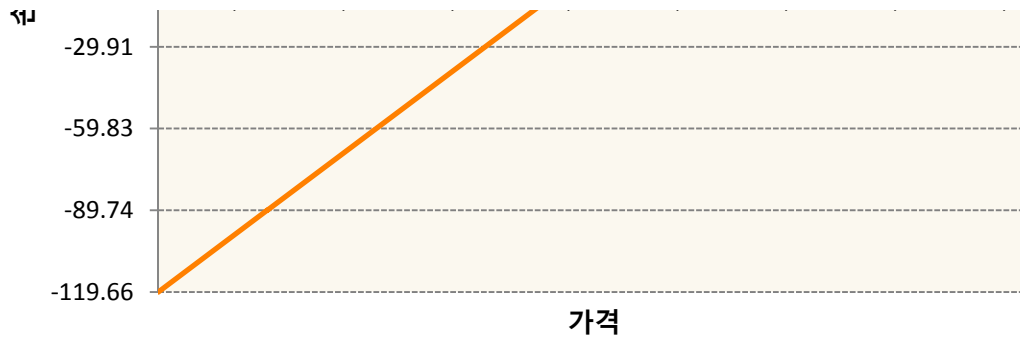
2. 만기시점의 손익구조

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	2018-09-19
기준일	2018-09-18

커버드콜모(주식혼합-파생형)

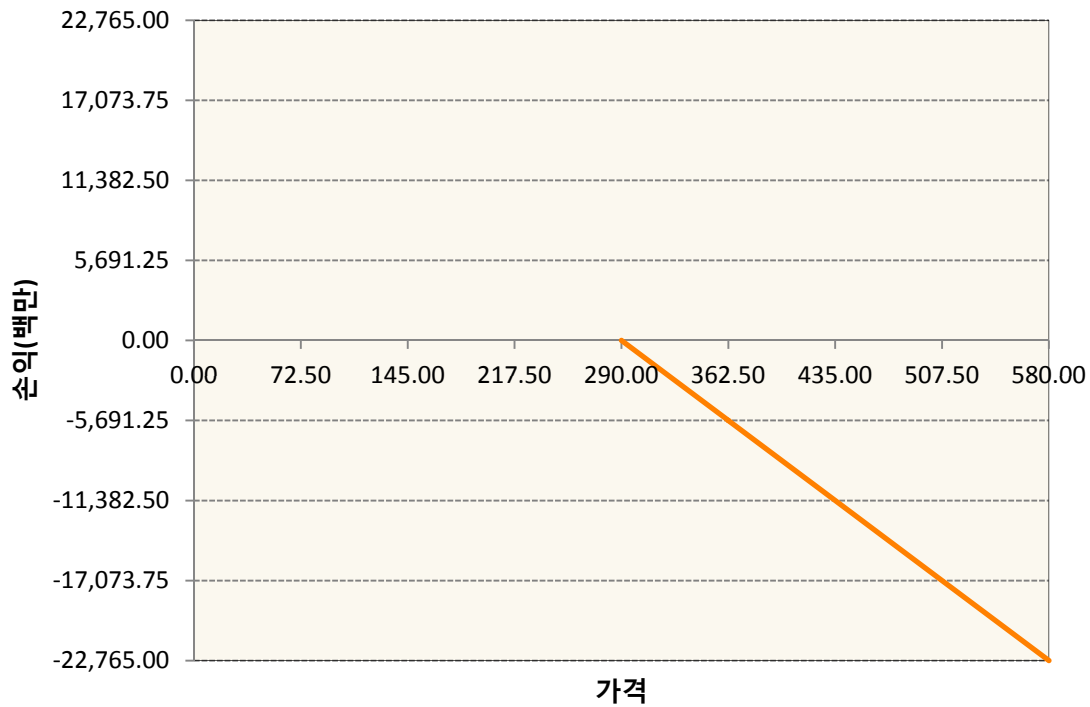
1. 계약금액

(단위:백만원)

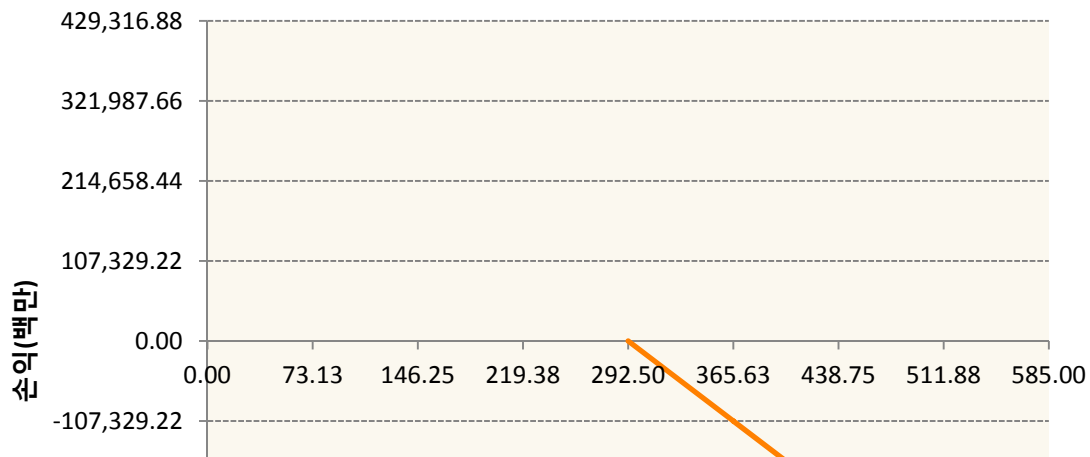
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	737,269	-737,269	장내

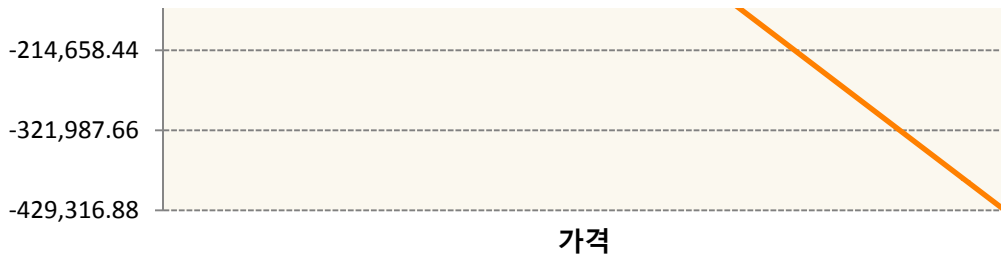
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NA2902-2018-10 콜290

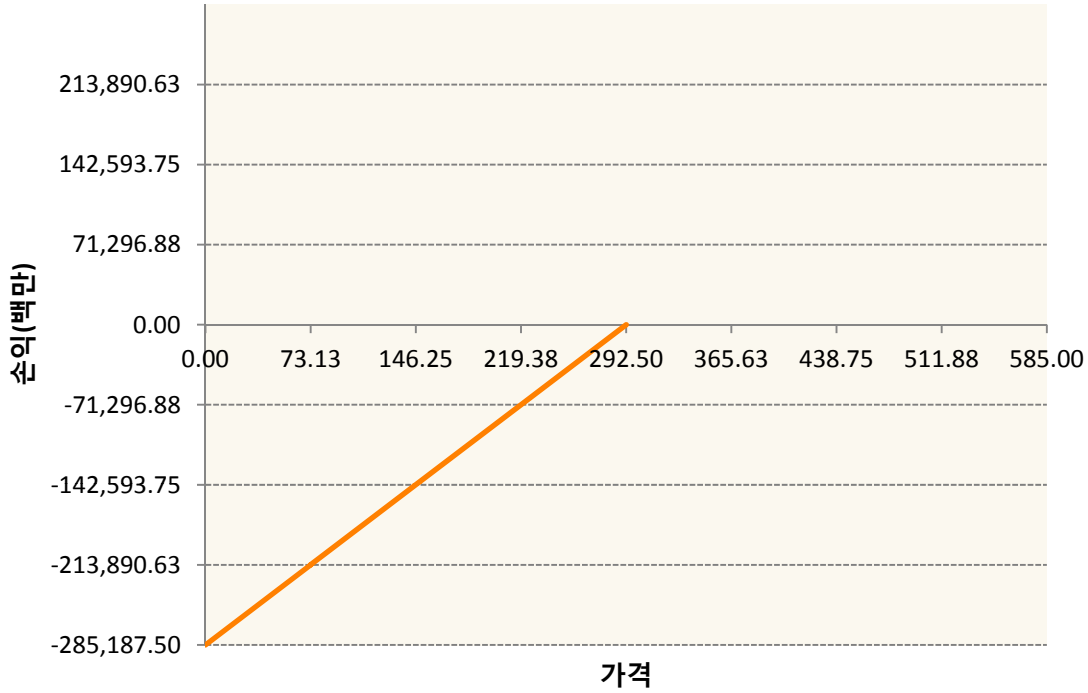


KR4201NA2928-2018-10 콜292.5





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NA2927-2018-10 콜290

1,571

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	826	801	773	743	710	675	638
-5.33%	715	675	632	589	544	499	453
-2.67%	495	445	394	344	293	243	192
0%	145	97	49	0	-49	-99	-149
2.67%	-322	-357	-395	-435	-477	-520	-564
5.33%	-869	-890	-915	-943	-974	-1,007	-1,043
8.00%	-1,460	-1,470	-1,484	-1,501	-1,521	-1,545	-1,571

KR4201NA2927-2018-10 풋292.5

28,362

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13,632	13,254	12,809	12,306	11,753	11,159	10,528

-5.33%	12,031	11,350	10,628	9,873	9,093	8,292	7,473	
-2.67%	8,613	7,697	6,774	5,847	4,915	3,981	3,044	
0%	2,837	1,895	949	0	-952	-1,905	-2,860	
2.67%	-5,246	-6,001	-6,793	-7,613	-8,455	-9,316	-10,191	
5.33%	-15,062	-15,544	-16,094	-16,700	-17,353	-18,047	-18,774	
8.00%	-25,900	-26,150	-26,470	-26,858	-27,307	-27,810	-28,362	
KR4301NA29 2018-10 풋 292.5							17,826	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-17,733	-17,736	-17,741	-17,751	-17,768	-17,792	-17,826	
-5.33%	-10,101	-10,149	-10,215	-10,298	-10,397	-10,512	-10,640	
-2.67%	-3,256	-3,477	-3,707	-3,943	-4,185	-4,431	-4,681	
0%	741	500	252	0	-256	-515	-776	
2.67%	1,778	1,708	1,618	1,510	1,384	1,243	1,089	
5.33%	1,875	1,869	1,857	1,836	1,806	1,764	1,710	
8.00%	1,878	1,878	1,877	1,875	1,871	1,864	1,853	

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

(단위:백만원)

48,794

공시일	2018-09-19
기준일	2018-09-18

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

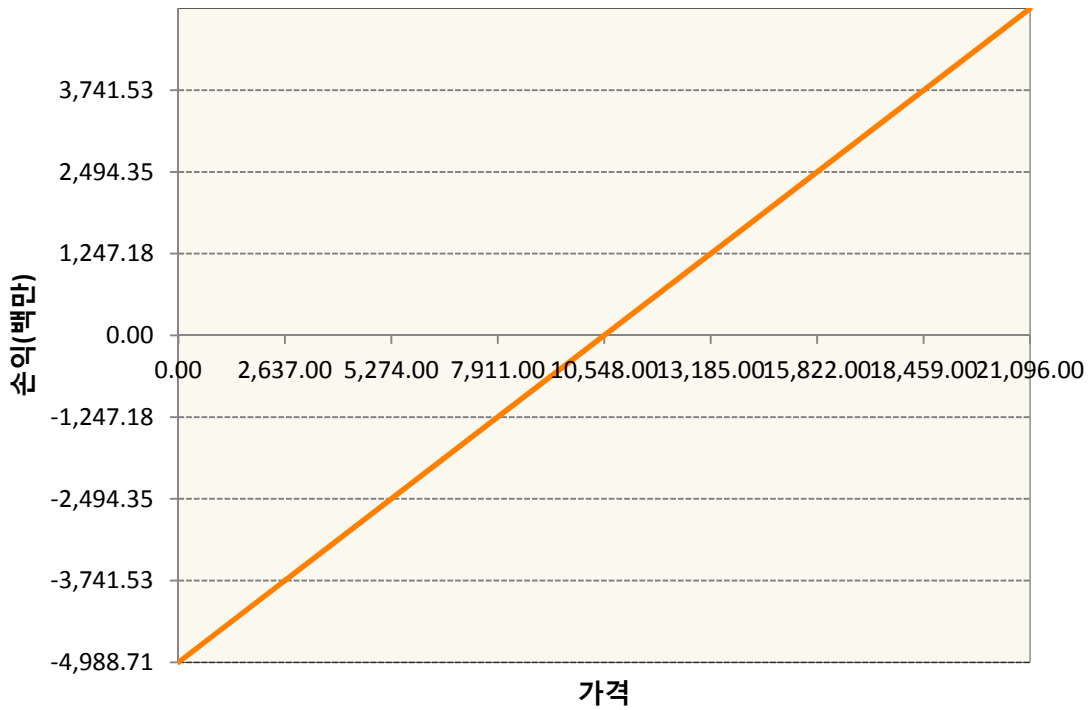
1. 계약금액

(단위:백만원)

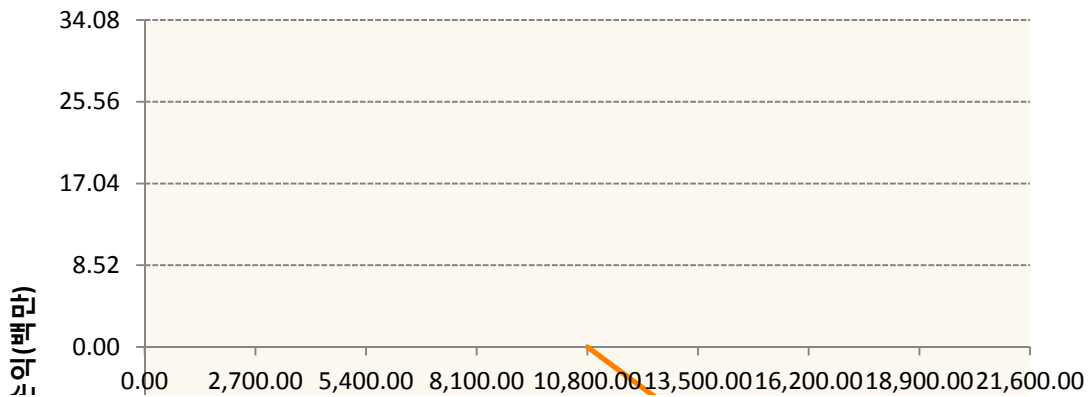
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,989	0	4,989	장내
누계	유가증권	옵션	0	243	-243	장내

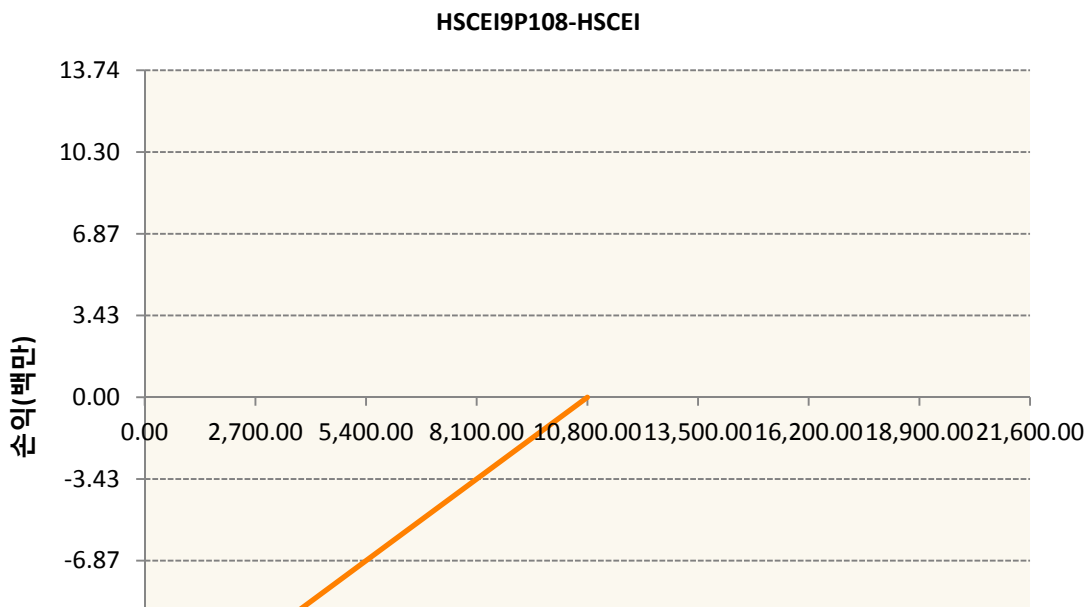
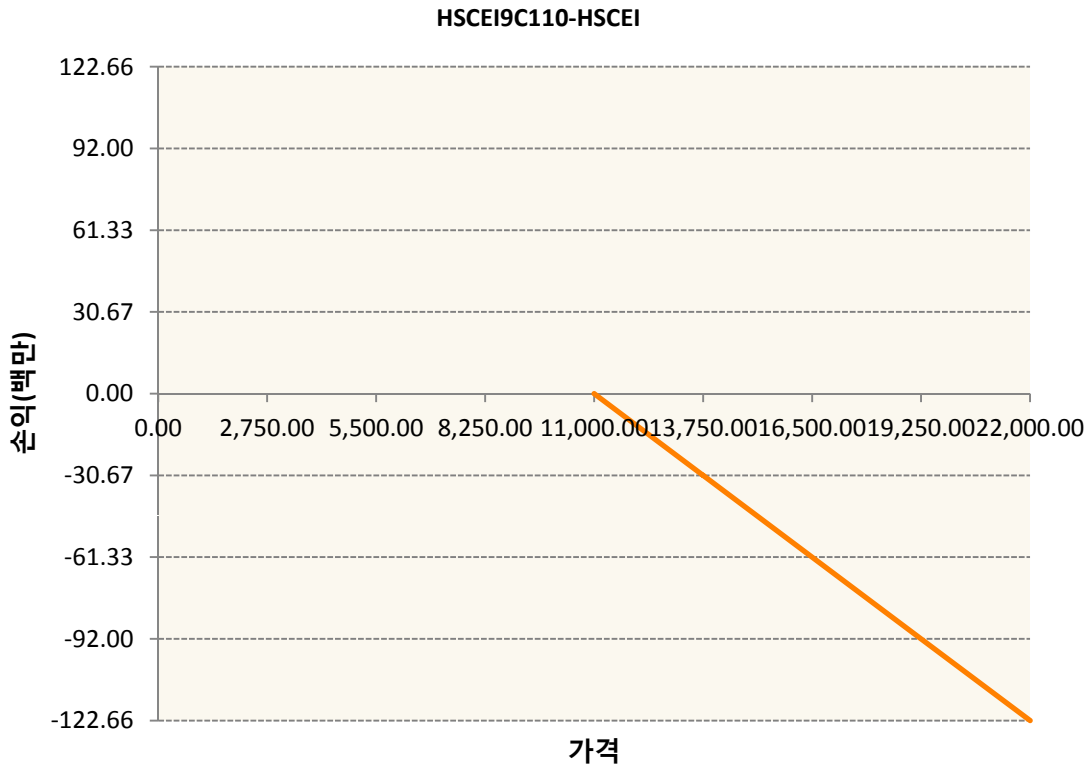
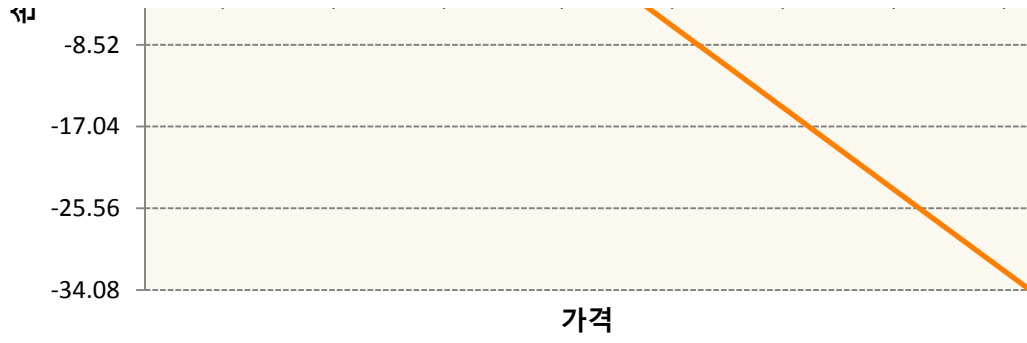
2. 만기시점의 손익구조

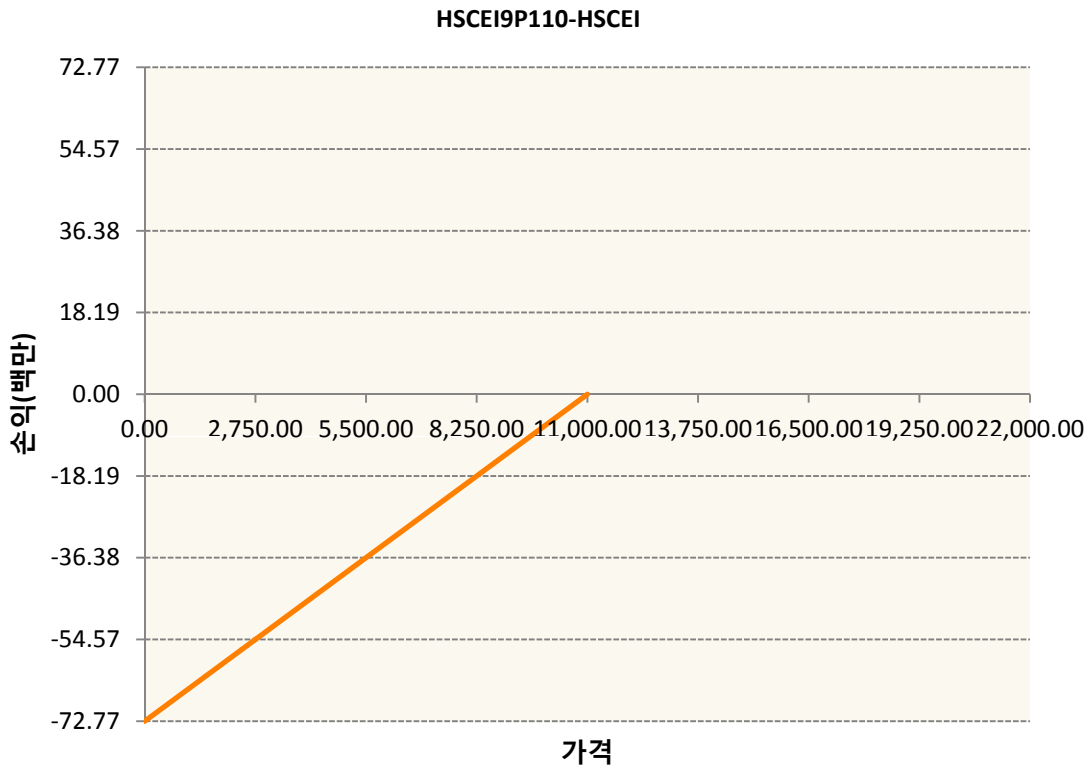
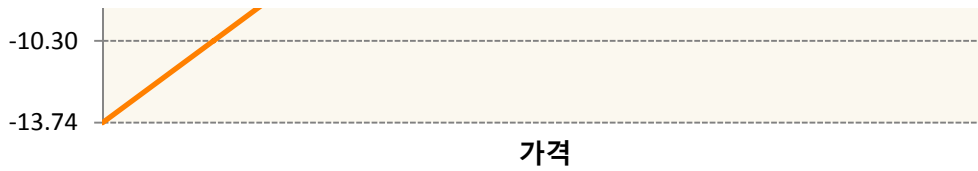
HCU8-H-SHARES IDX FUT Sep18



HSCEI9C108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU8	H-SHARES IDX FUT Sep18	399
HSCEI9C108	HSCEI	3
HSCEI9C110	HSCEI	10
HSCEI9P108	HSCEI	1
HSCEI9P110	HSCEI	6

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	386

공시일	2018-09-19
기준일	2018-09-18

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

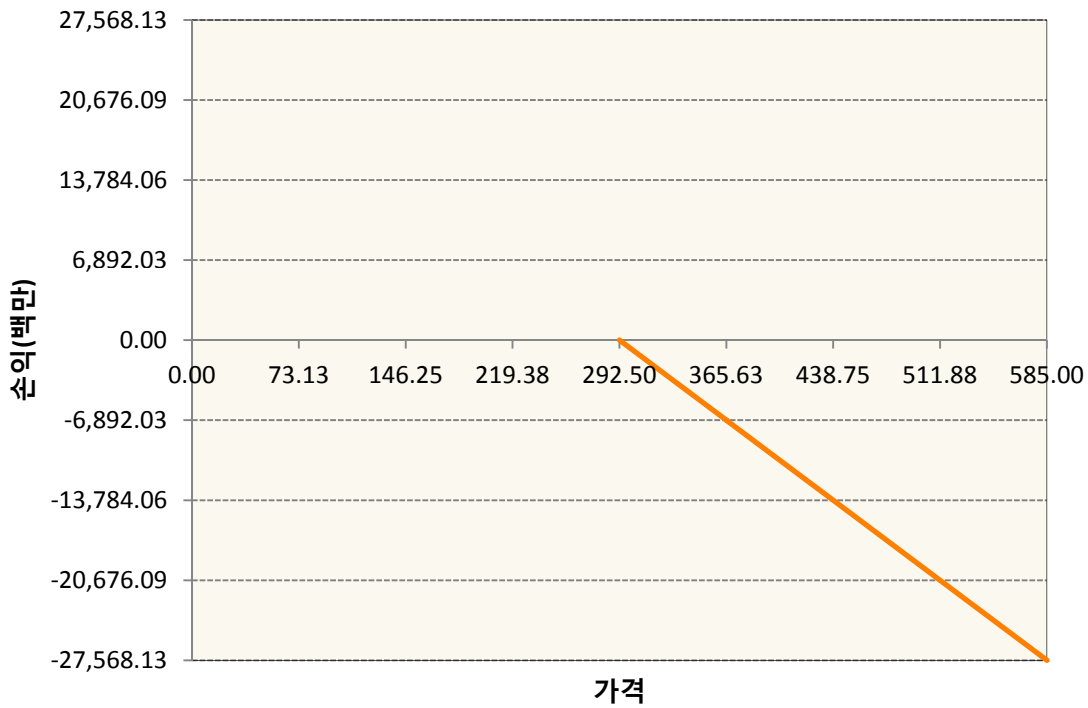
1. 계약금액

(단위:백만원)

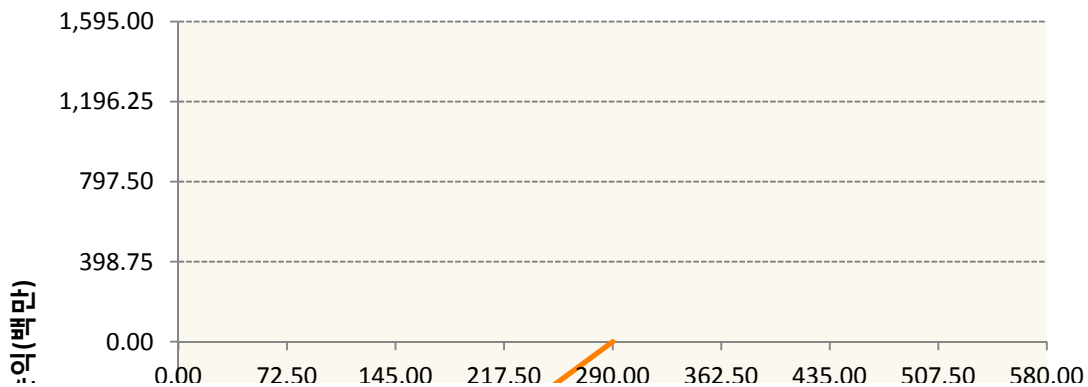
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	48,761	-48,761	장내

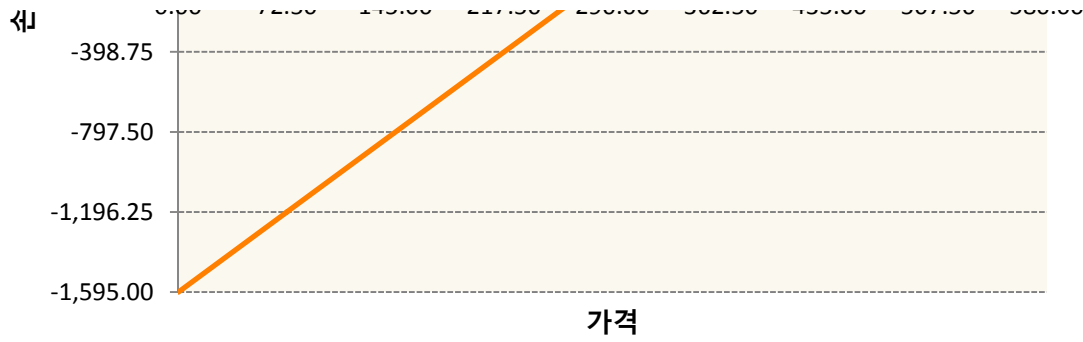
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NA2928-2018-10 콜292.5

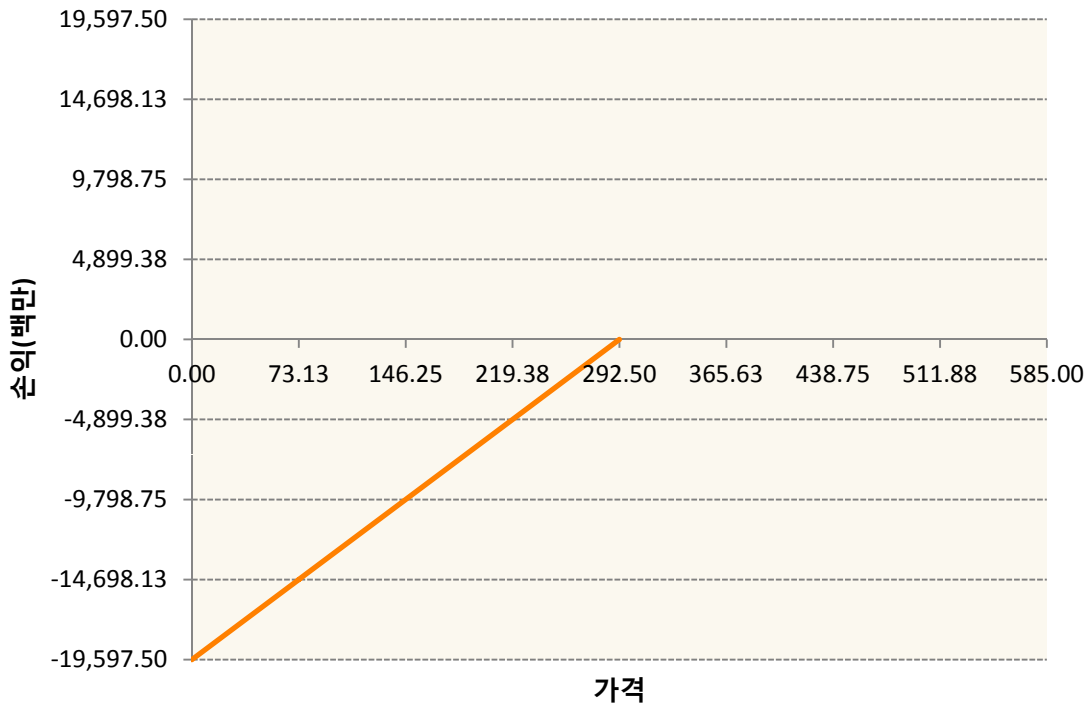


KR4301NA2901-2018-10 풋290





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							4,000
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,000	-4,000	-4,000	-4,000	-4,000	-4,000	-4,000
-5.33%	-2,667	-2,667	-2,667	-2,667	-2,667	-2,667	-2,667
-2.67%	-1,333	-1,333	-1,333	-1,333	-1,333	-1,333	-1,333
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,333	1,333	1,333	1,333	1,333	1,333	1,333
5.33%	2,667	2,667	2,667	2,667	2,667	2,667	2,667
8.00%	4,000	4,000	4,000	4,000	4,000	4,000	4,000
KR4201NA2927-2018-10 콜292.5							1,821
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	875	851	822	790	755	717	676
-5.33%	773	729	682	634	584	532	480
-2.67%	553	494	435	375	316	256	195
0%	182	122	61	0	-61	-122	-184
2.67%	-337	-385	-436	-489	-543	-598	-654
5.33%	-967	-998	-1,033	-1,072	-1,114	-1,159	-1,206
8.00%	-1,663	-1,679	-1,700	-1,725	-1,753	-1,786	-1,821

KR4301NA2 2018-10 풋290

91

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-90	-90	-90	-91	-91	-91	-91
-5.33%	-48	-48	-49	-50	-50	-51	-52
-2.67%	-13	-14	-16	-17	-19	-20	-22
0%	3	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	6	6	6	6	5	4	4
5.33%	7	7	7	6	6	6	6
8.00%	7	7	7	7	7	7	7

KR4301NA2 2018-10 풋292.5

1,225

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,219	-1,219	-1,219	-1,220	-1,221	-1,223	-1,225
-5.33%	-694	-697	-702	-708	-714	-722	-731
-2.67%	-224	-239	-255	-271	-288	-305	-322
0%	51	34	17	0	-18	-35	-53
2.67%	122	117	111	104	95	85	75
5.33%	129	128	128	126	124	121	118
8.00%	129	129	129	129	129	128	127

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

(단위:백만원)

7,207

공시일	2018-09-19
기준일	2018-09-18

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

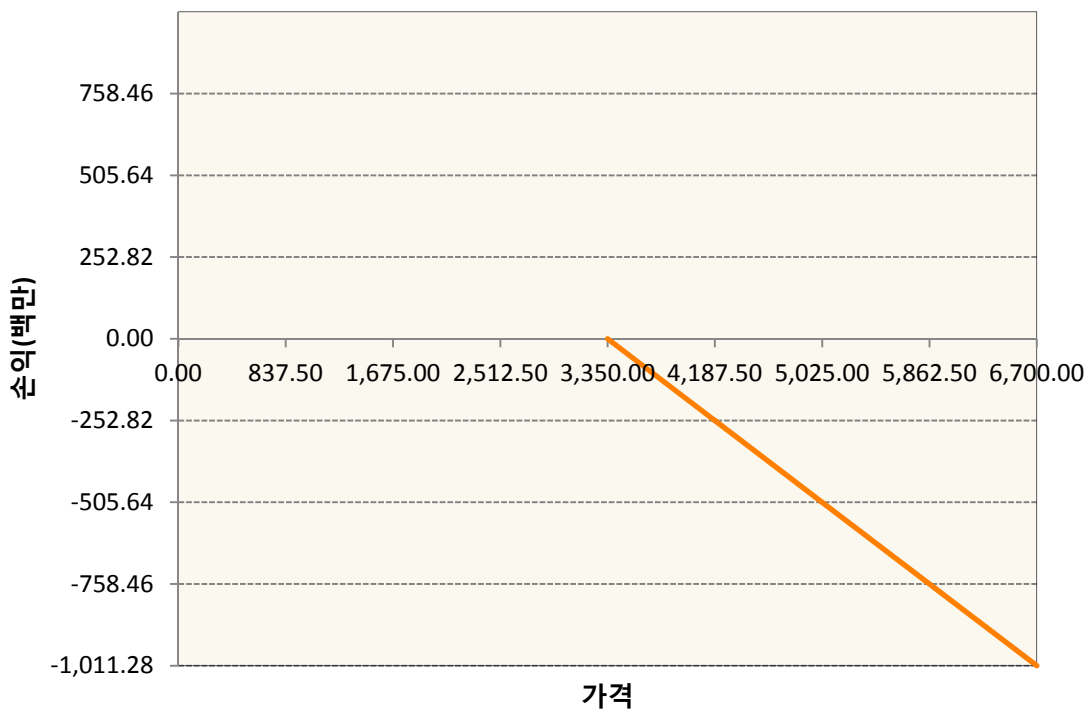
1. 계약금액

(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	5,484	0	5,484	
누계	유가증권	스왑	34,660	0	34,660	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,323	-25,323	장내
누계	지수	스왑	53,285	0	53,285	장외

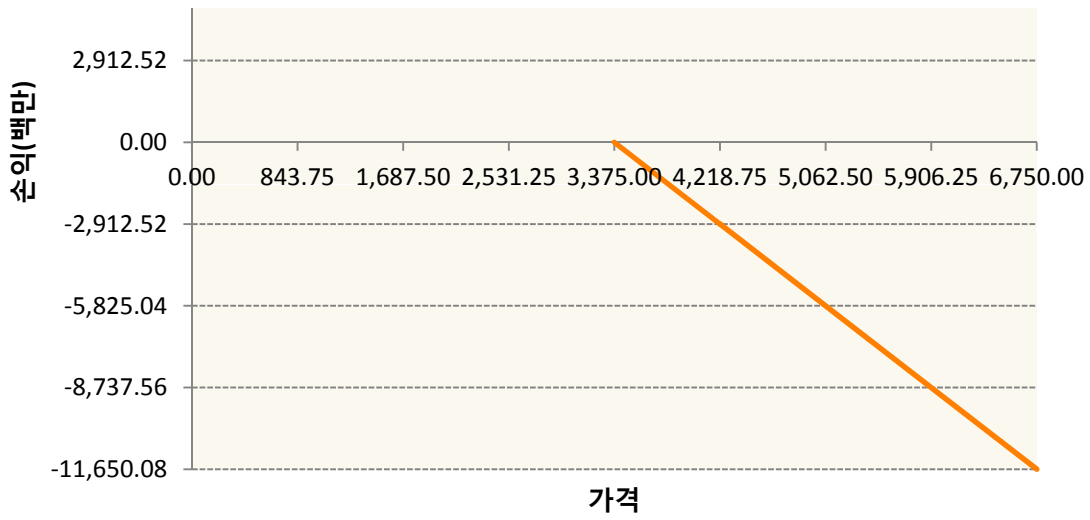
2. 만기시점의 손익구조

OESXU8-C3350-EURO STOXX 50

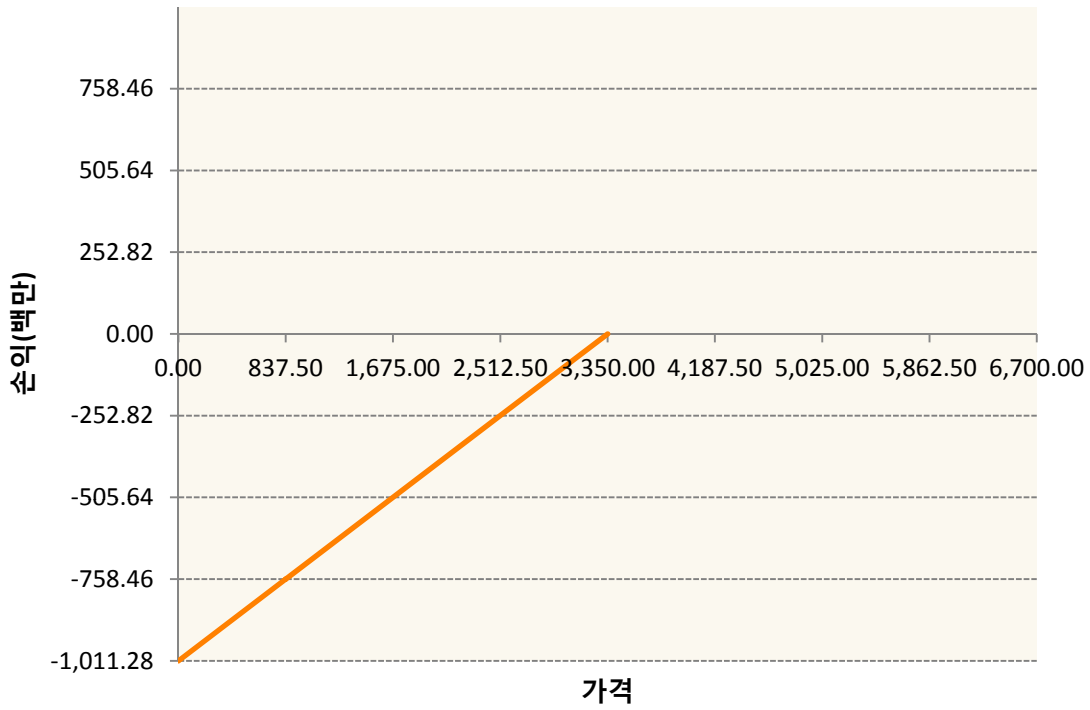


OESXU8-C3375-EURO STOXX 50

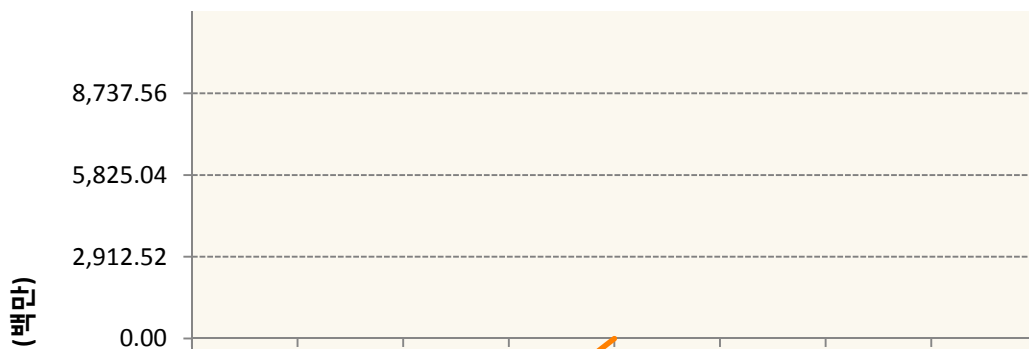


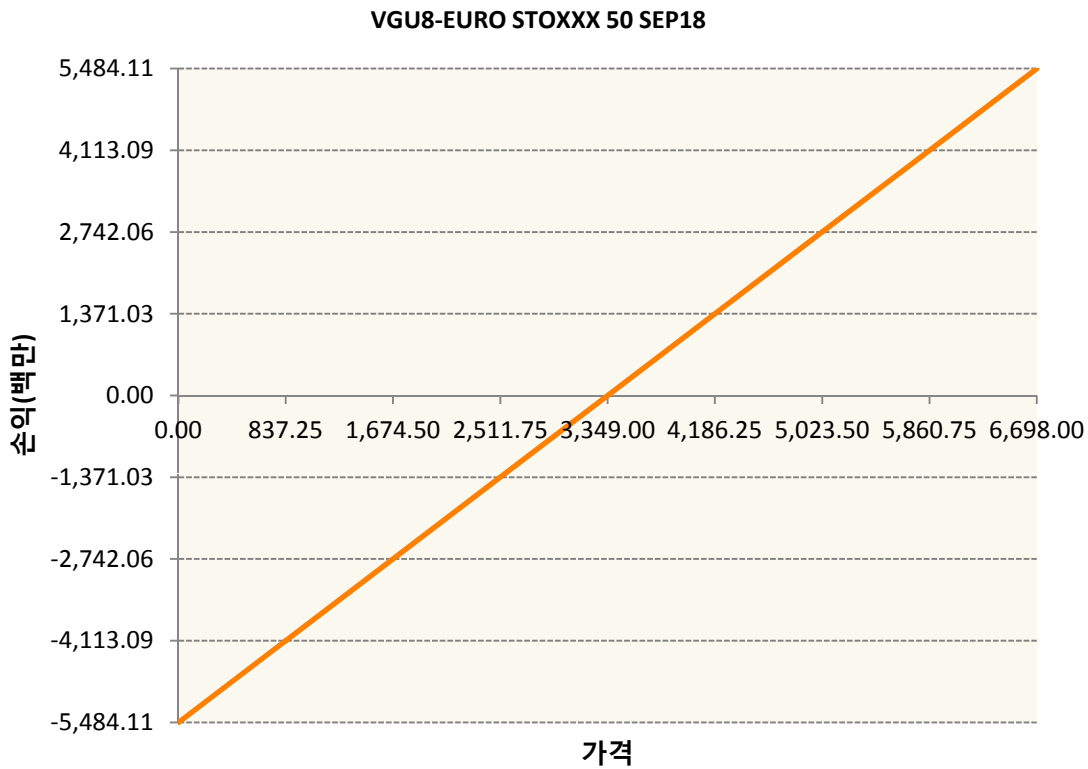
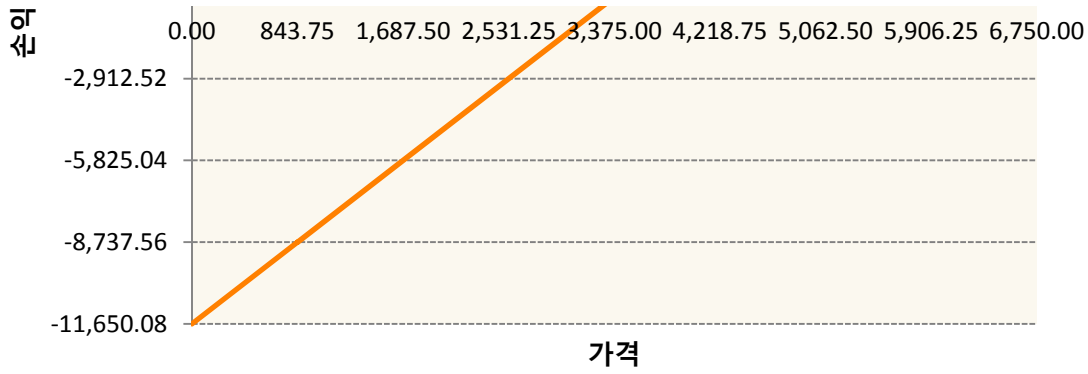


OESXU8-P3350-EURO STOXX 50



OESXU8-P3375-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		29
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY		19
OESXU8-C3E EURO STOXX 50		81
OESXU8-C3E EURO STOXX 50		932
OESXU8-P3E EURO STOXX 50		81
OESXU8-P3E EURO STOXX 50		932
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18		439

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

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

(단위:백만원)

1,138

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

(단위:백만원)

90

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

(단위:백만원)

134

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

(단위:백만원)

164

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-09-19
기준일	2018-09-18

리디파인K200(주식혼합-파생재간

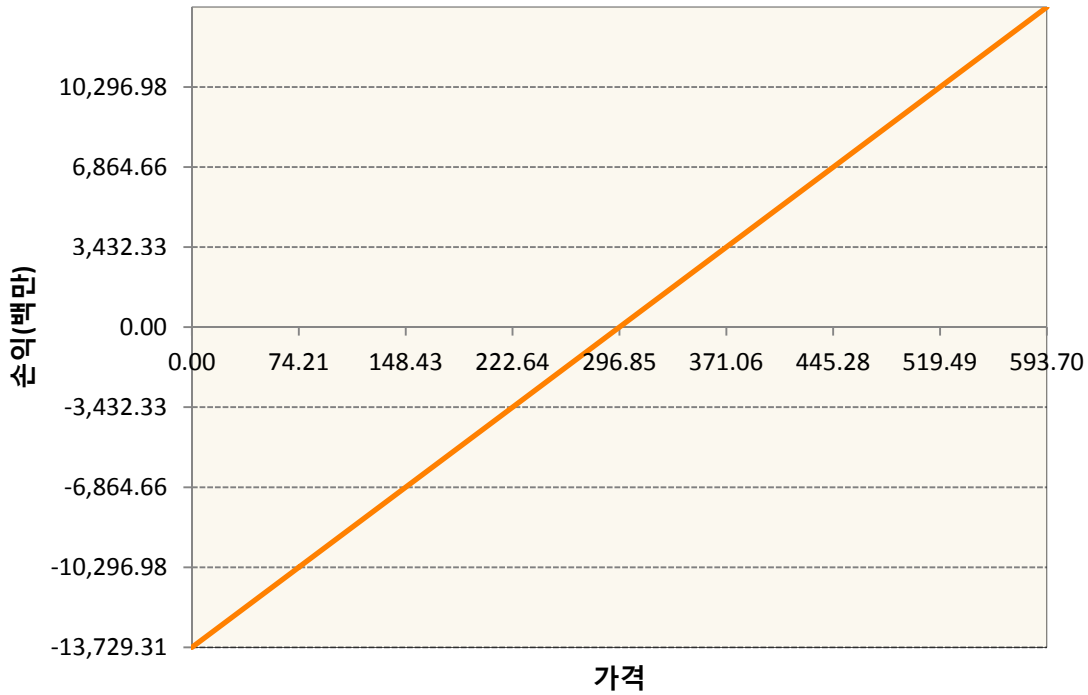
1. 계약금액

(단위:백만원)

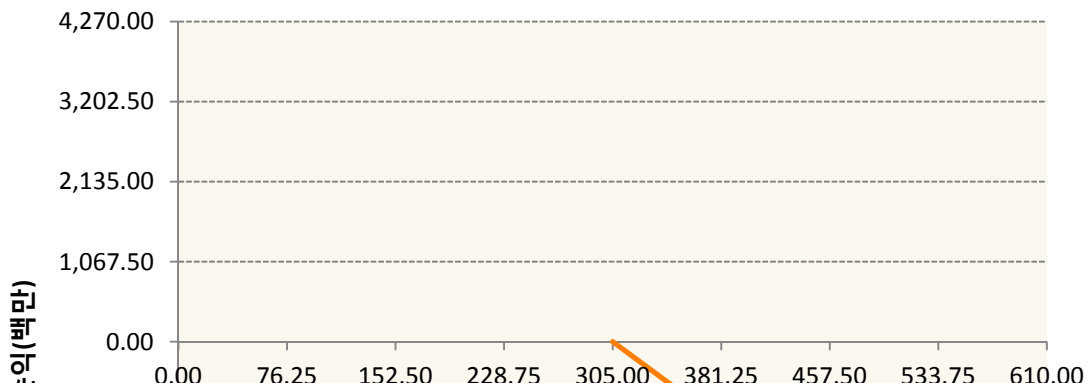
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,729	0	13,729	장내
누계	유가증권	옵션	2,119	24,258	-22,138	장내

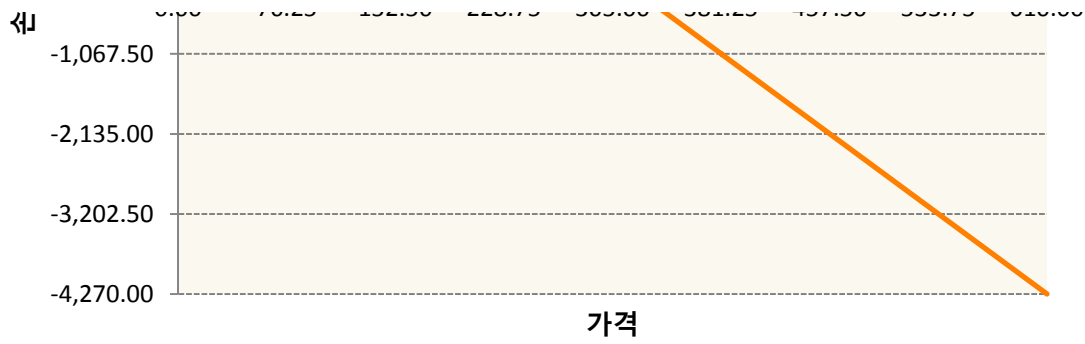
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

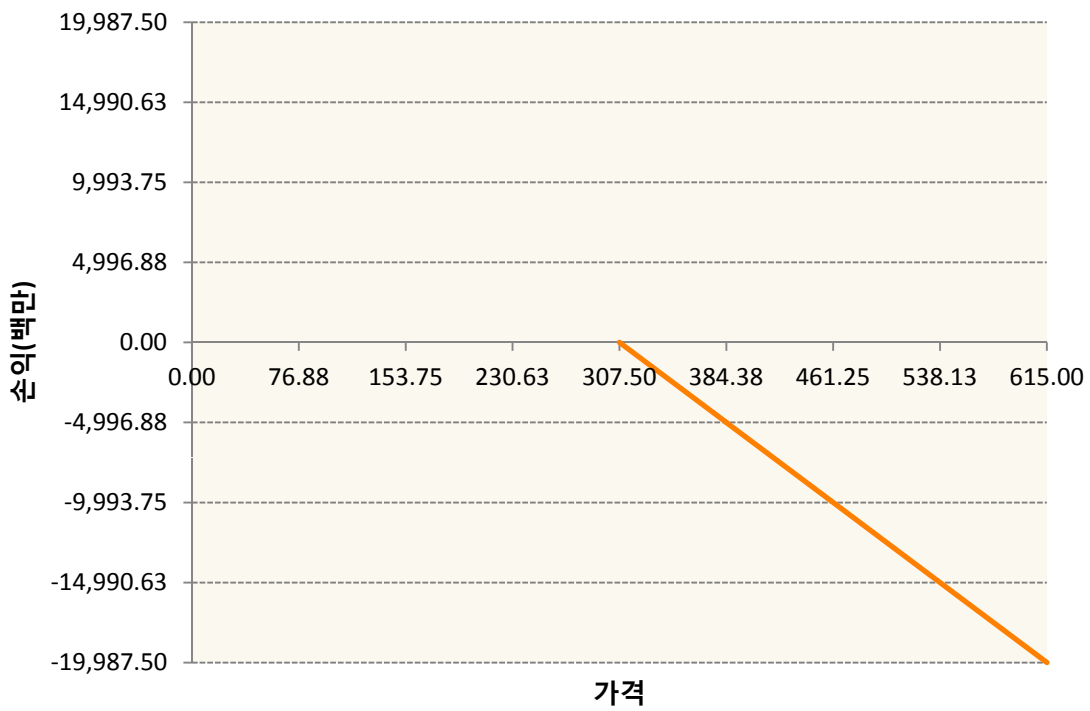


KR4201NA3058-2018-10 콜305

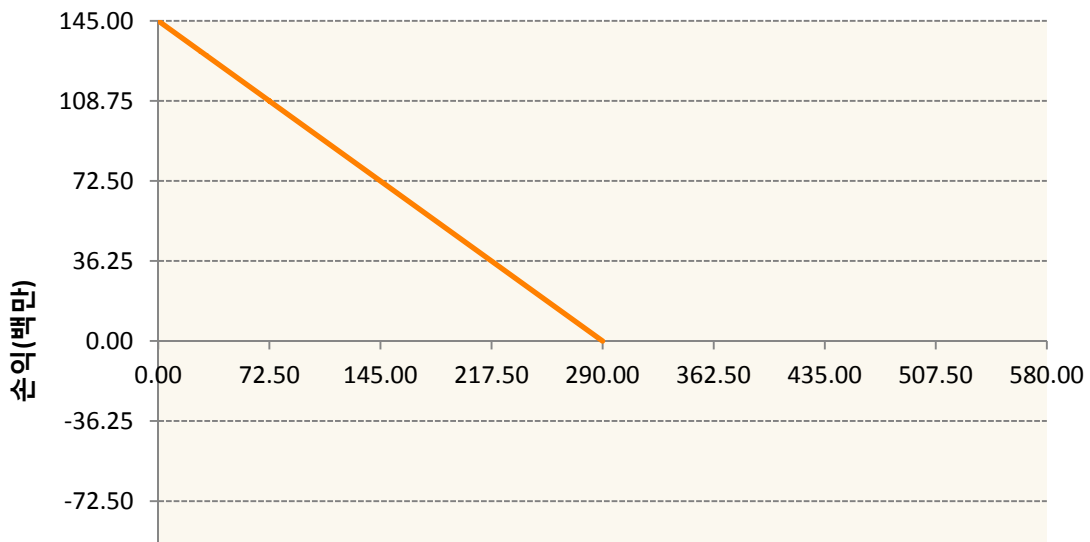


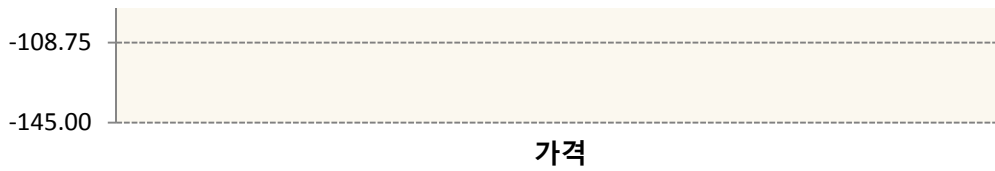


KR4201NA3074-2018-10 콜307.5

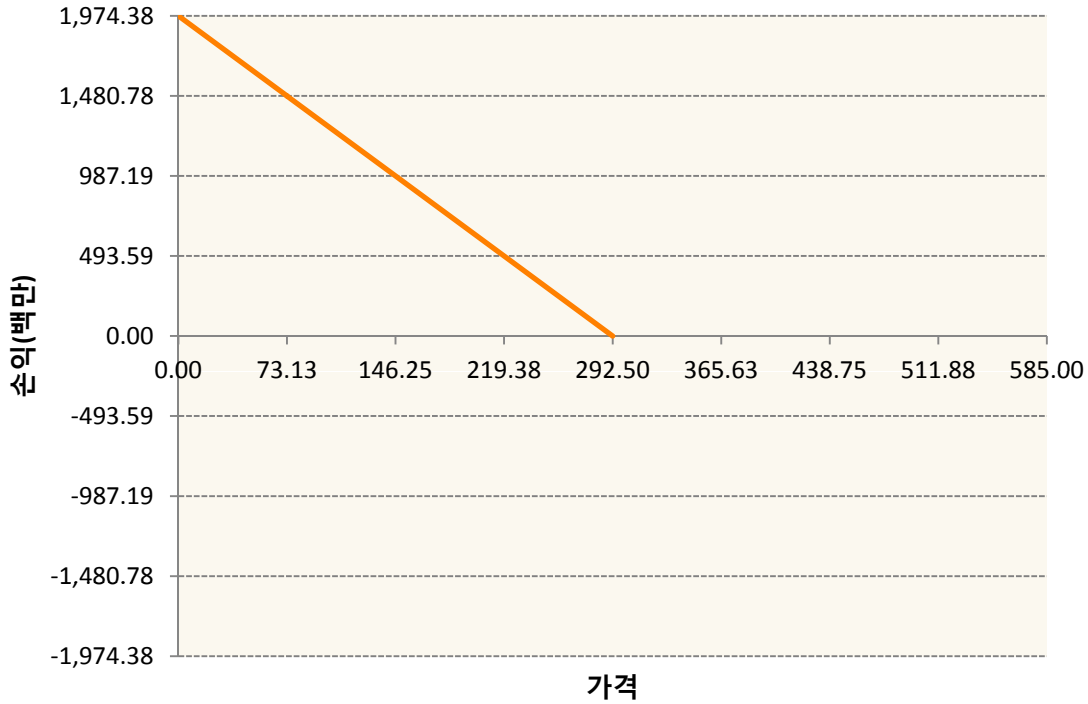


KR4301NA2901-2018-10 풋290





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 1,096

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,096	-1,096	-1,096	-1,096	-1,096	-1,096	-1,096
-5.33%	-730	-730	-730	-730	-730	-730	-730
-2.67%	-365	-365	-365	-365	-365	-365	-365
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	365	365	365	365	365	365	365
5.33%	730	730	730	730	730	730	730
8.00%	1,096	1,096	1,096	1,096	1,096	1,096	1,096

KR4201NA3(2018-10 콜305) 211

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	60	59	58	56	54	51	47
-5.33%	57	55	51	47	43	38	33
-2.67%	48	42	36	30	23	16	9

0%	25	17	8	0	-9	-17	-26
2.67%	-17	-27	-36	-46	-55	-65	-75
5.33%	-82	-91	-100	-109	-118	-127	-136
8.00%	-166	-172	-179	-187	-195	-203	-211

KR4201NA3(2018-10 콜307.5

917

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	234	230	225	218	209	197	183
-5.33%	224	214	202	187	169	149	126
-2.67%	190	170	146	120	92	62	31
0%	107	73	37	0	-38	-77	-116
2.67%	-59	-102	-146	-190	-234	-277	-321
5.33%	-325	-369	-413	-457	-501	-545	-589
8.00%	-688	-723	-759	-797	-836	-876	-917

KR4301NA2(2018-10 풋290

8

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8	8	8	8	8	8	8
-5.33%	4	4	4	5	5	5	5
-2.67%	1	1	1	2	2	2	2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-1	-1	-1	-1	0	0	0
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1

KR4301NA2(2018-10 풋292.5

123

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	123	123	123	123	123	123	123
-5.33%	70	70	71	71	72	73	74
-2.67%	23	24	26	27	29	31	32
0%	-5	-3	-2	0	2	4	5
2.67%	-12	-12	-11	-10	-10	-9	-8
5.33%	-13	-13	-13	-13	-13	-12	-12
8.00%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13

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

(단위:백만원)

1,855

공시일	2018-09-19
기준일	2018-09-18

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

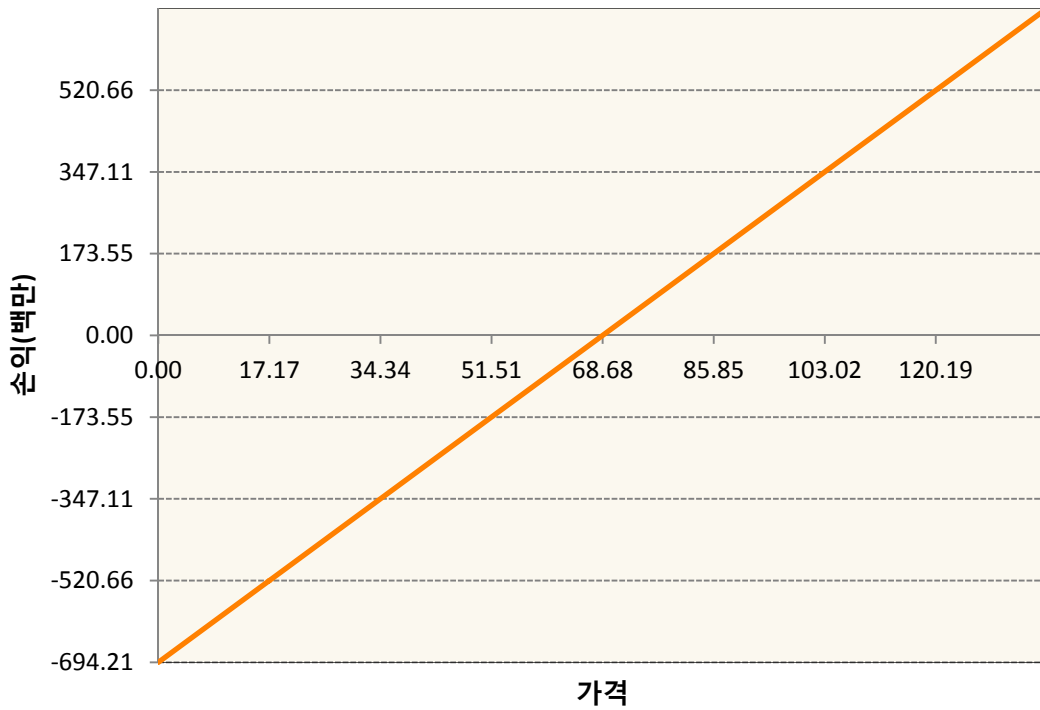
1. 계약금액

(단위:백만원)

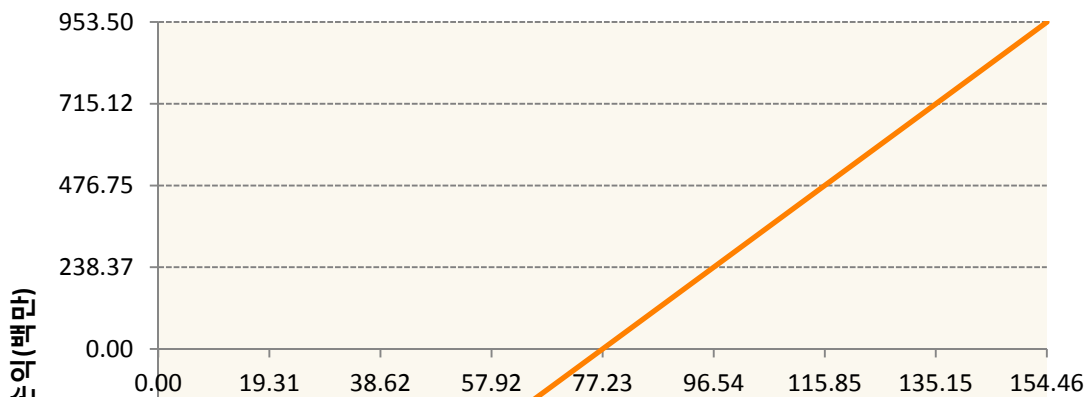
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,016	618	2,399	
누계	유가증권	선물	521	0	521	장내

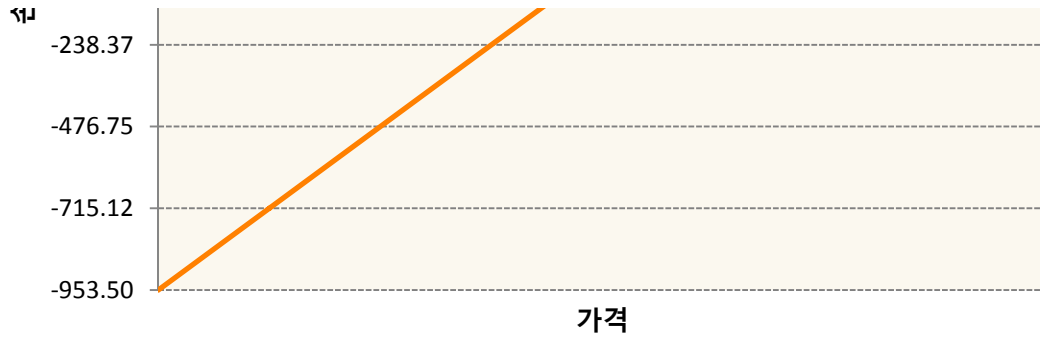
2. 만기시점의 손익구조

CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18

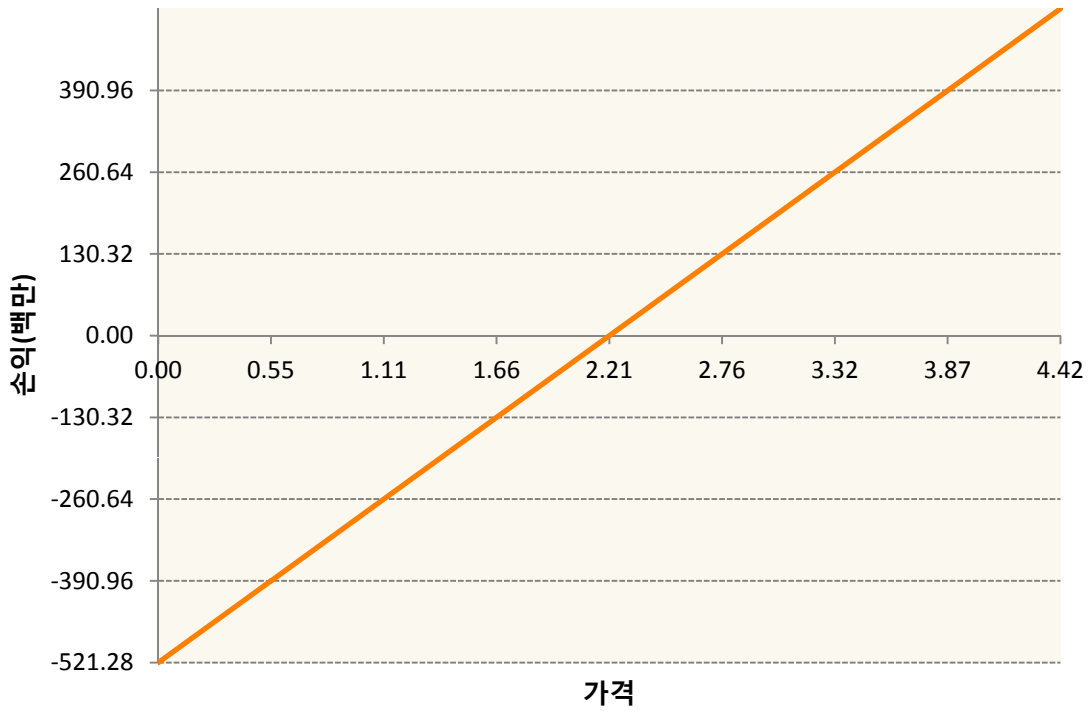


COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19

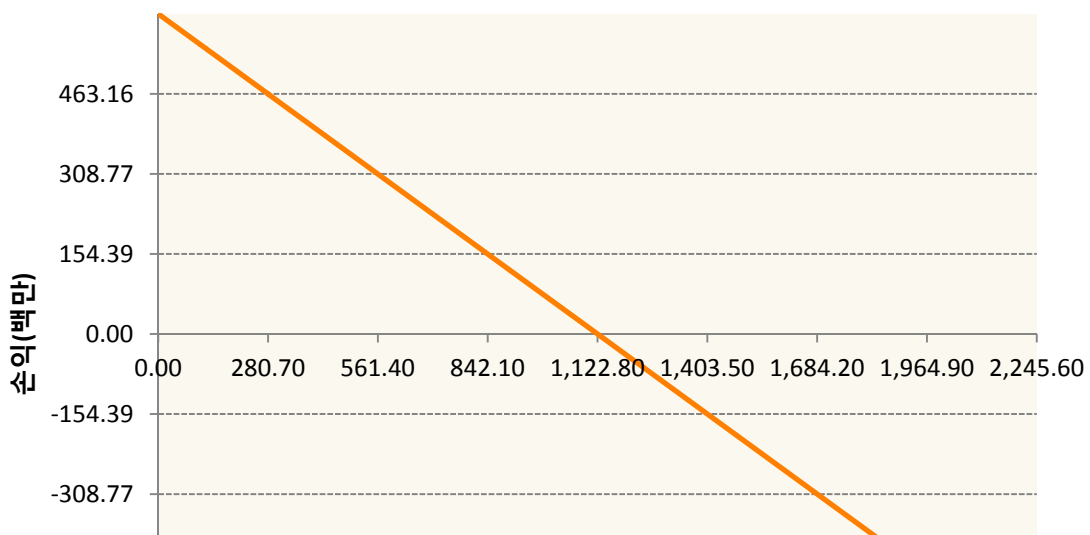


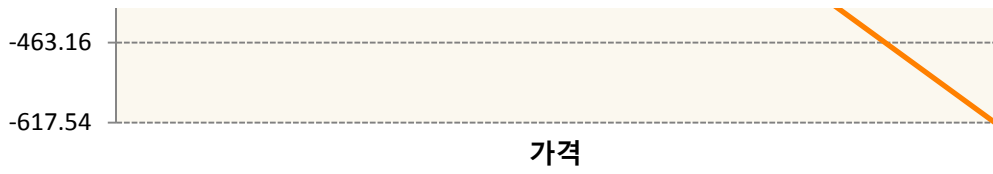


HOX8-Heating Oil

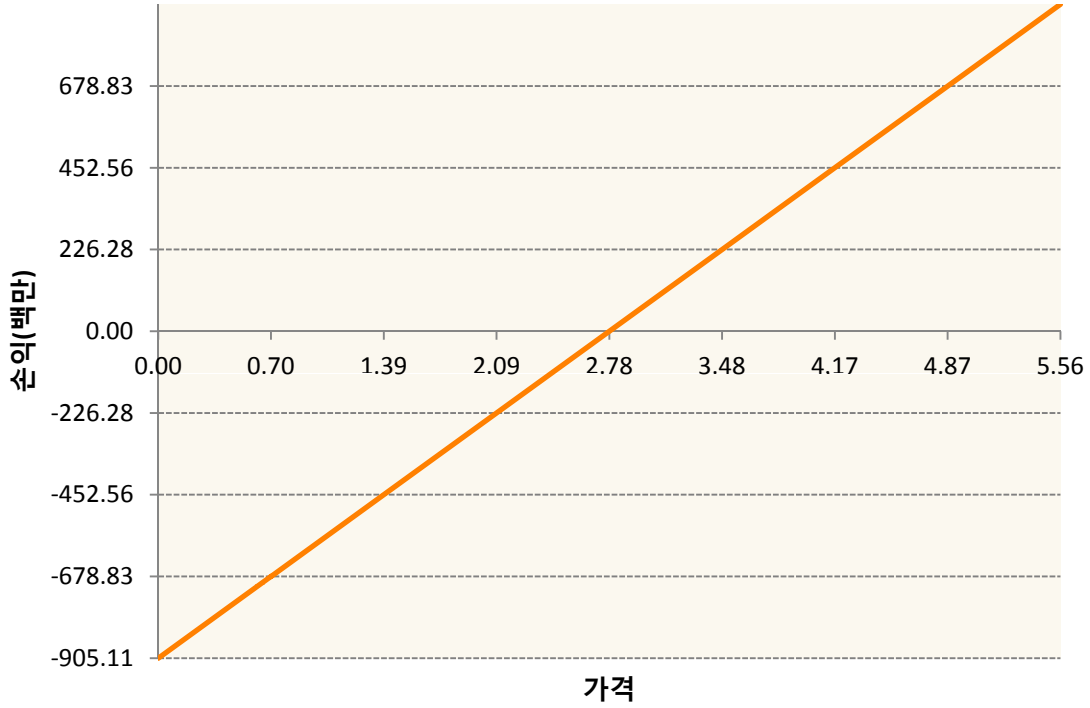


KR4175NA0007-2018-10 달러선물

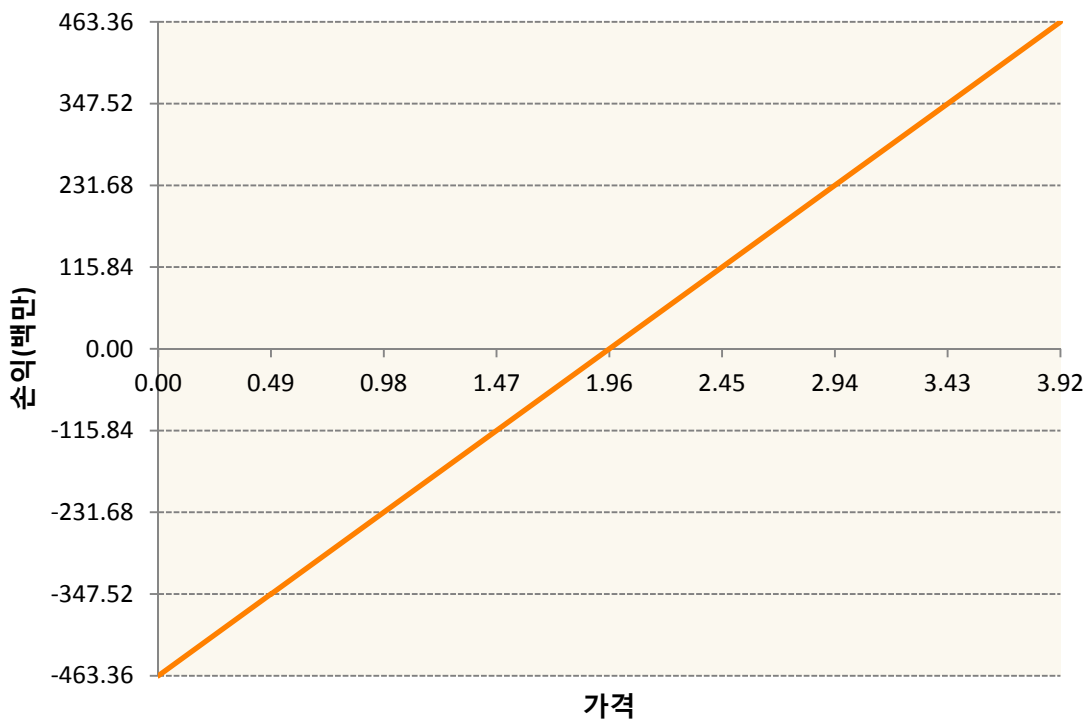




NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18



XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	56
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	76
HOX8	Heating Oil	42
	KR4175NA0(2018-10 달러선물	49
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	72
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	37

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	422

공시일	2018-09-19
기준일	2018-09-18

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

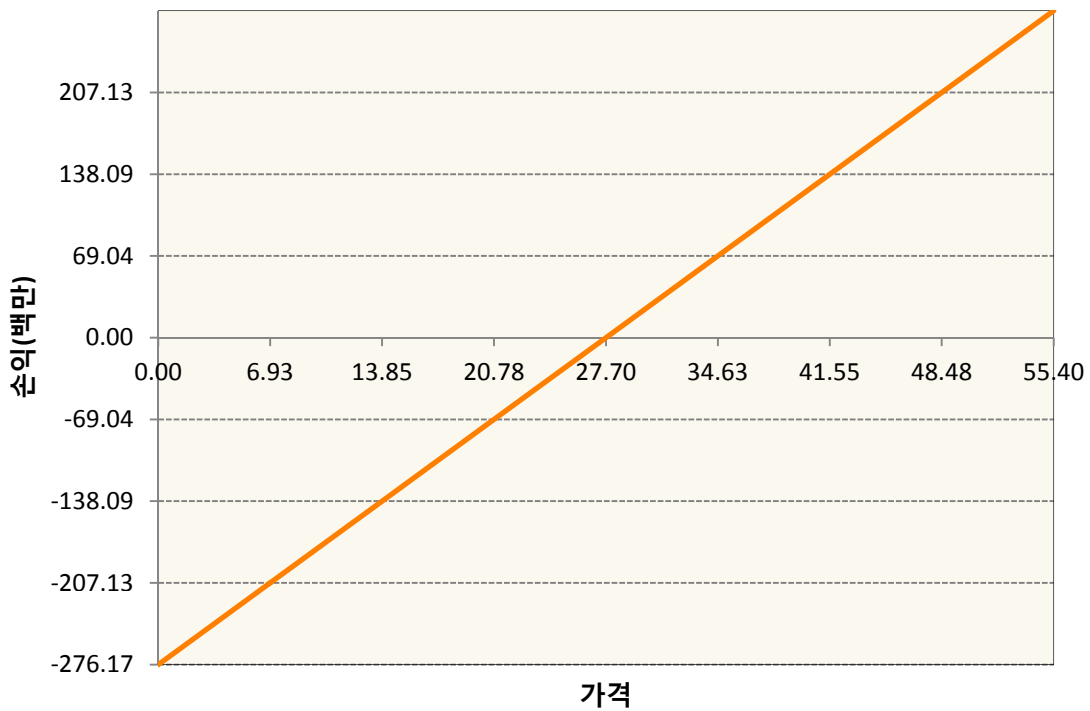
1. 계약금액

(단위:백만원)

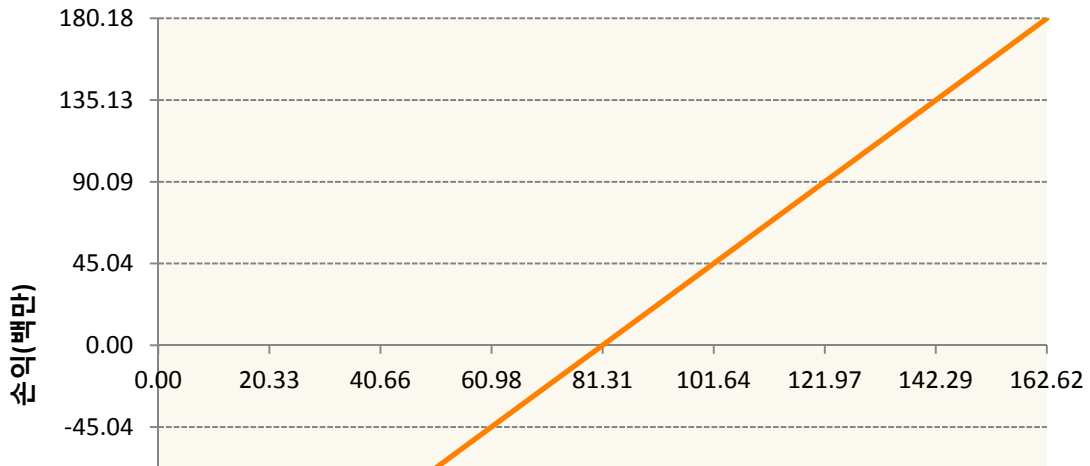
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,470	79	3,392	

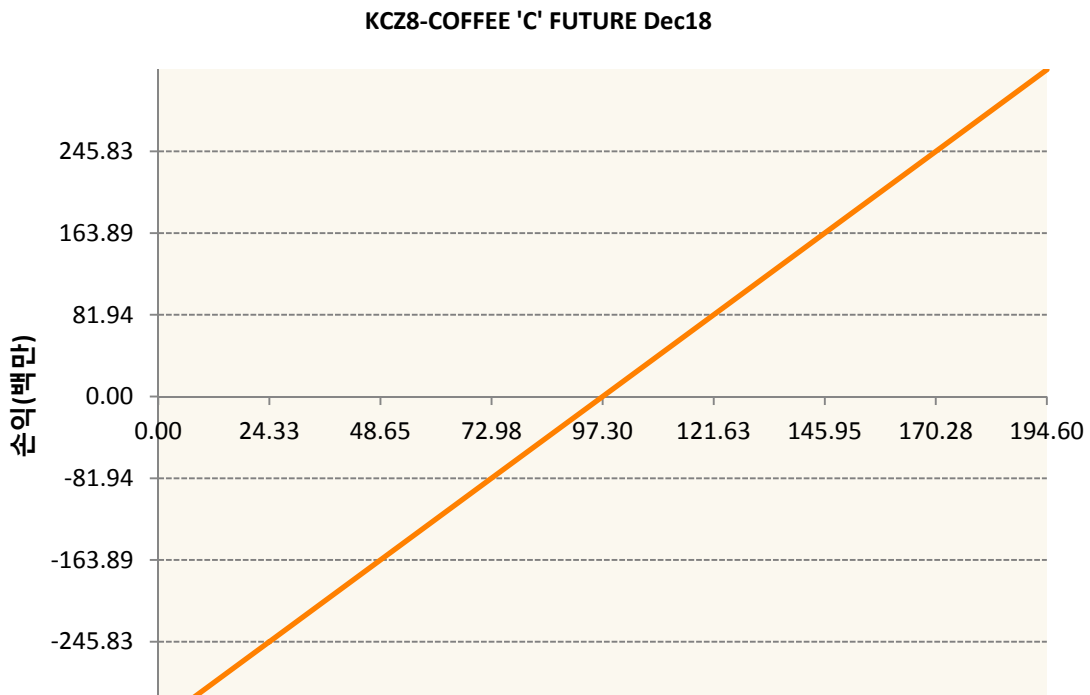
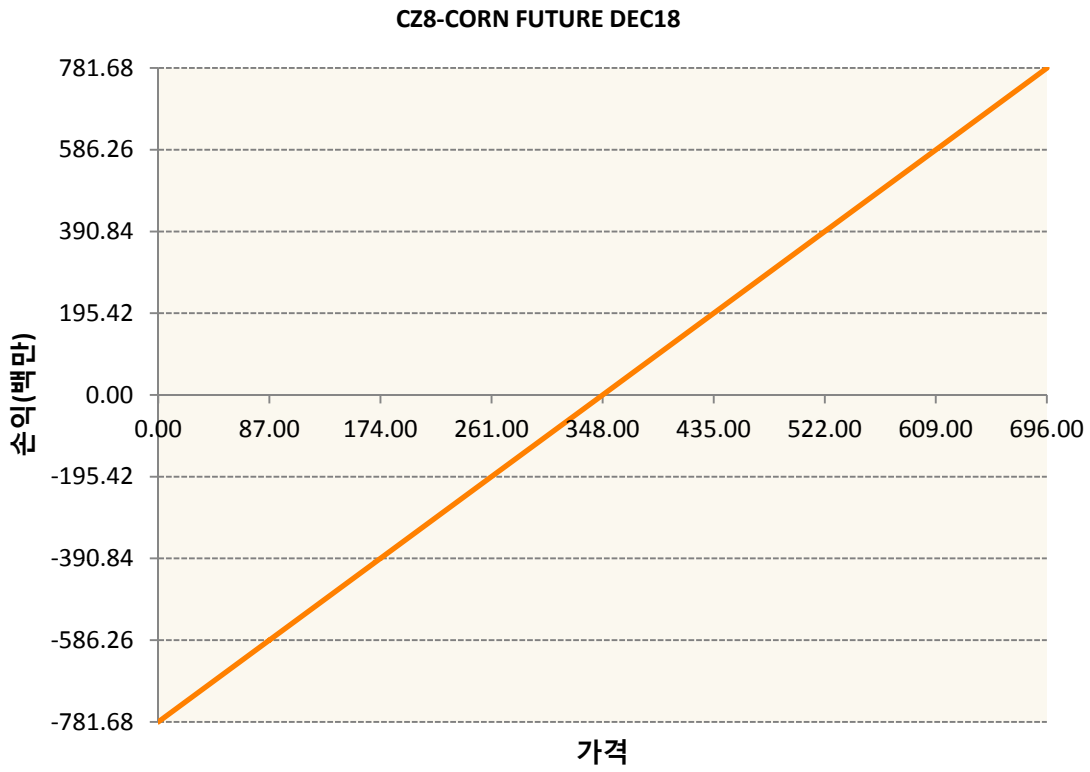
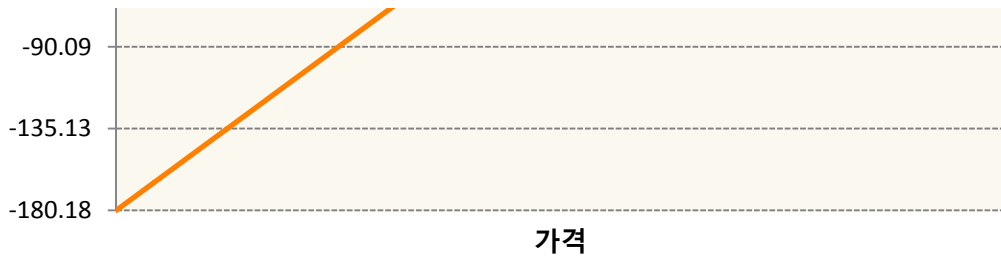
2. 만기시점의 손익구조

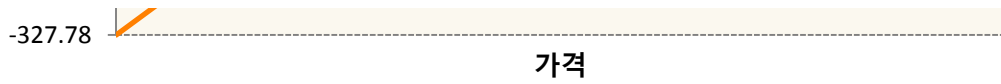
BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18



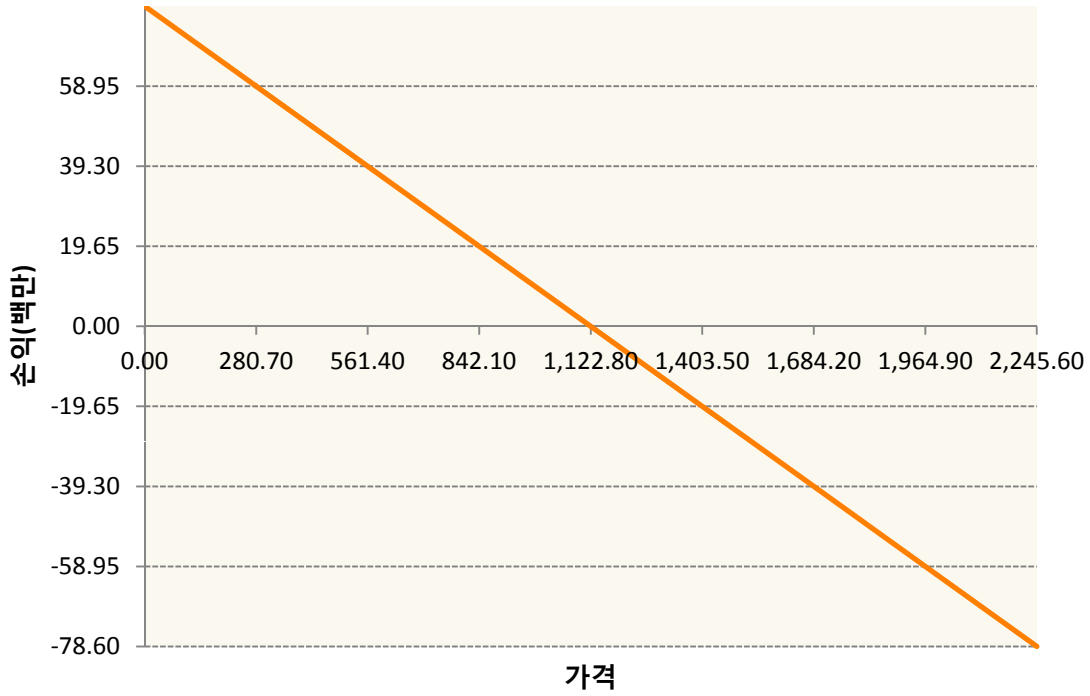
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



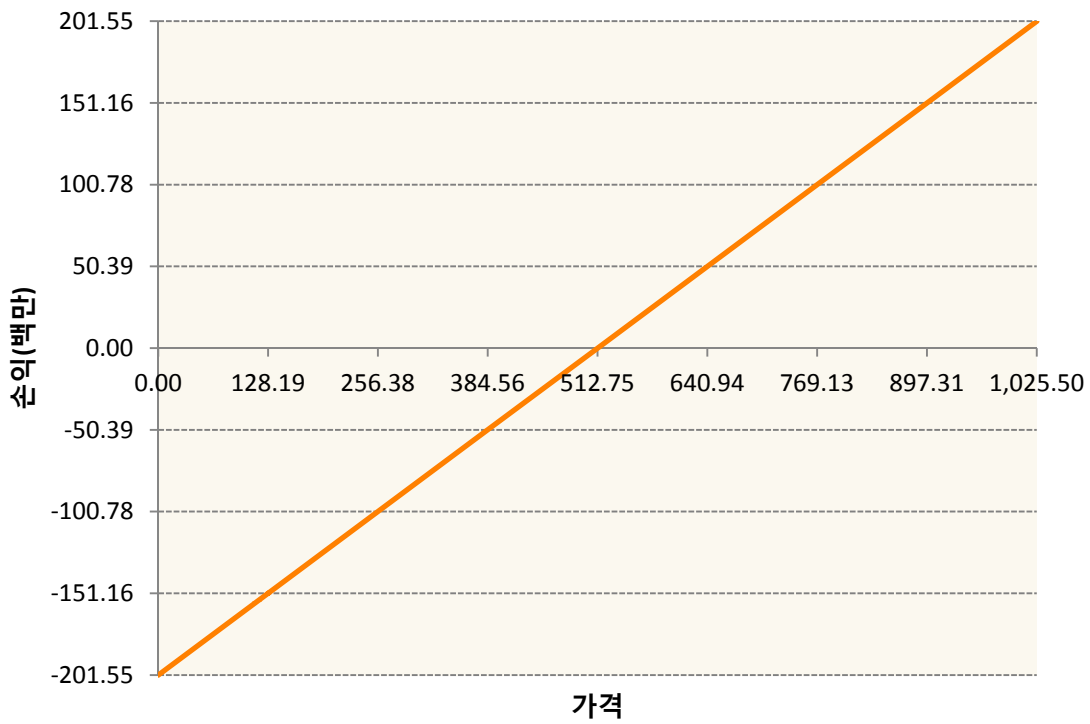




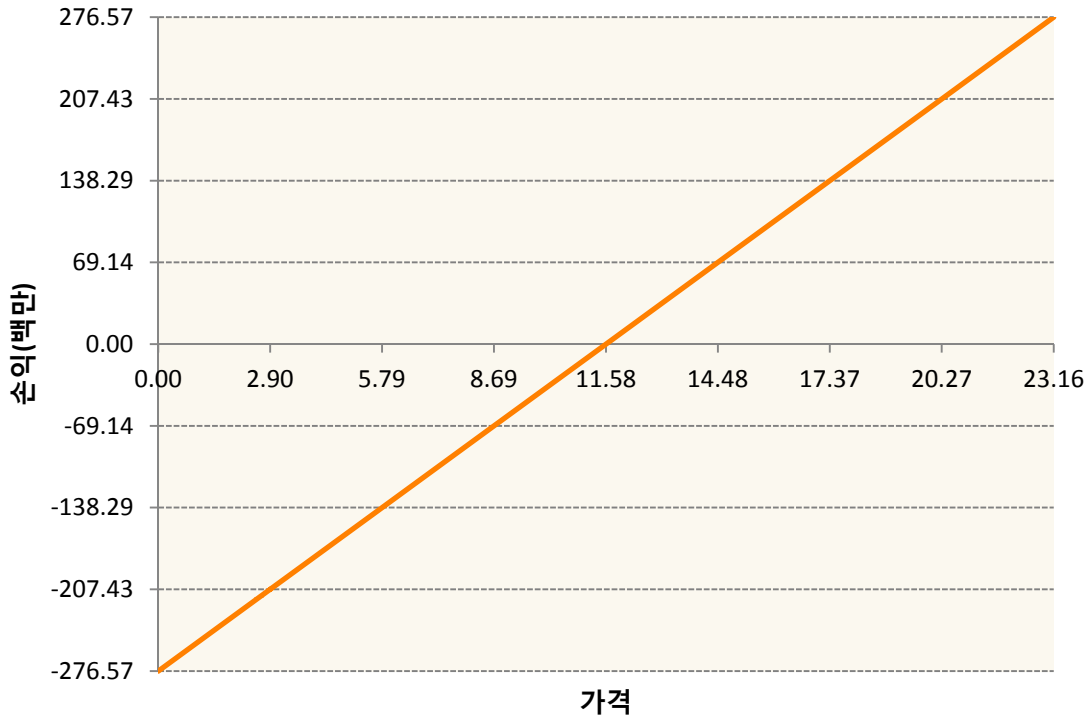
KR4175NA0007-2018-10 달러선물



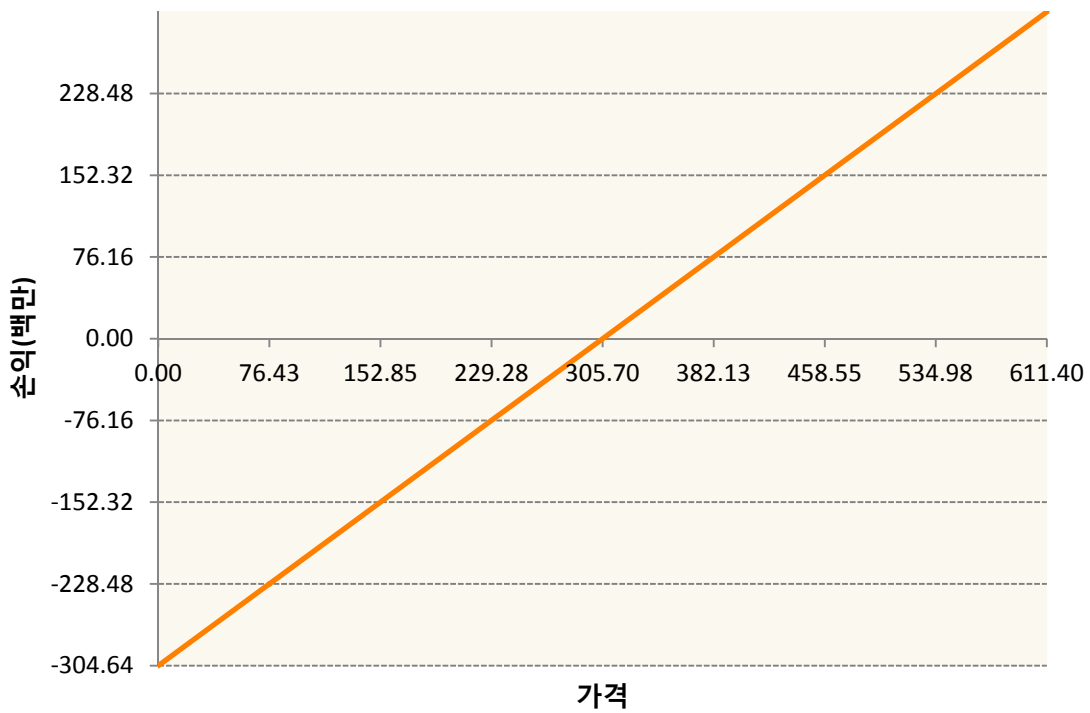
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



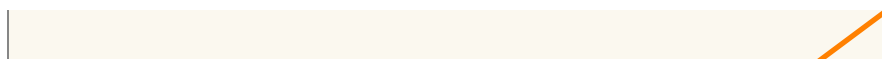
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

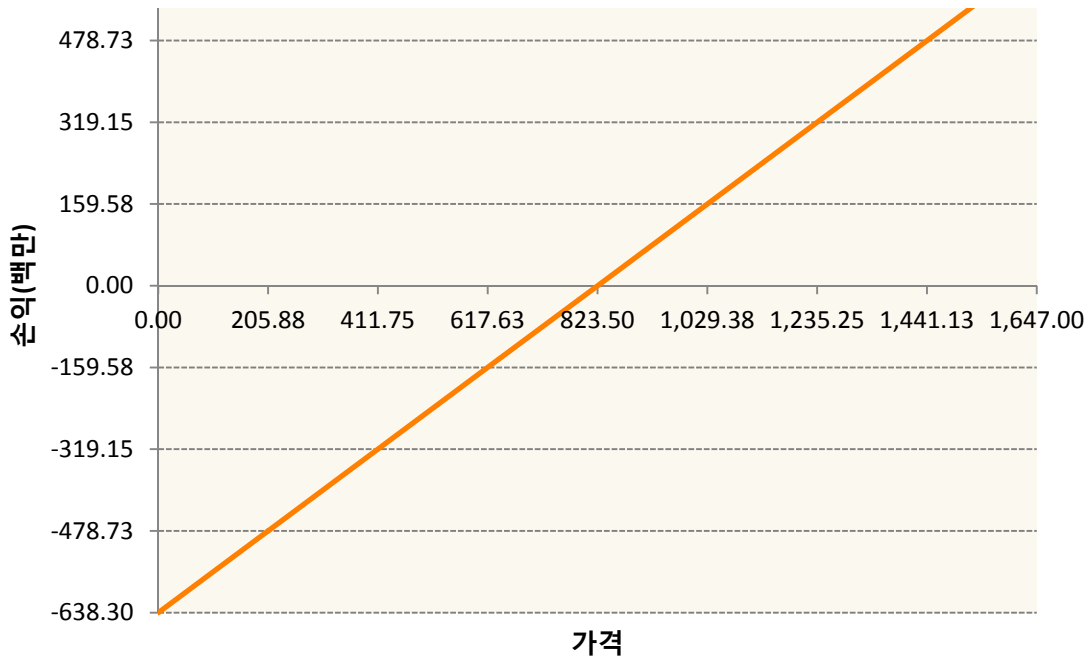


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

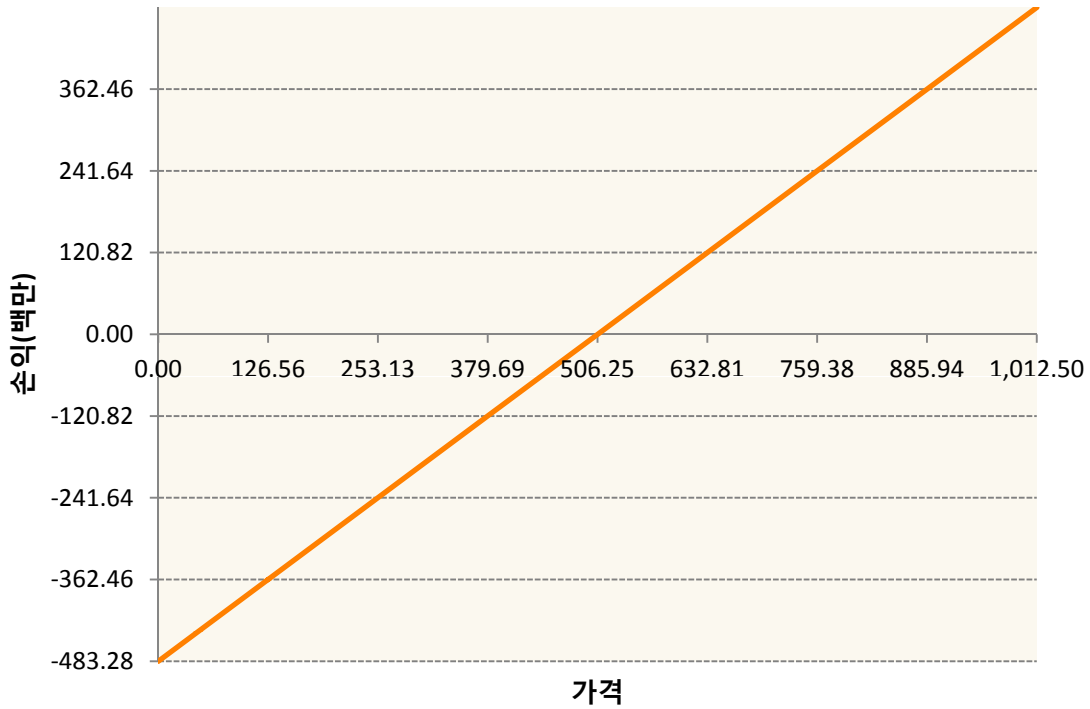


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





WZ8-WHEAT FUTURE(CBT) DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	22
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	14
CZ8	CORN FUTURE DEC18	63
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	26
KR4175NA0(2018-10	달러선물	6

KWZ8	KC HRW WHEAT FUT DEC18	16
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	22
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	24
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	51
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	39

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

(단위:백만원)

303