

공시일	2018-09-20
기준일	2018-09-19

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	2018-09-20
기준일	2018-09-19

스마트인덱스모

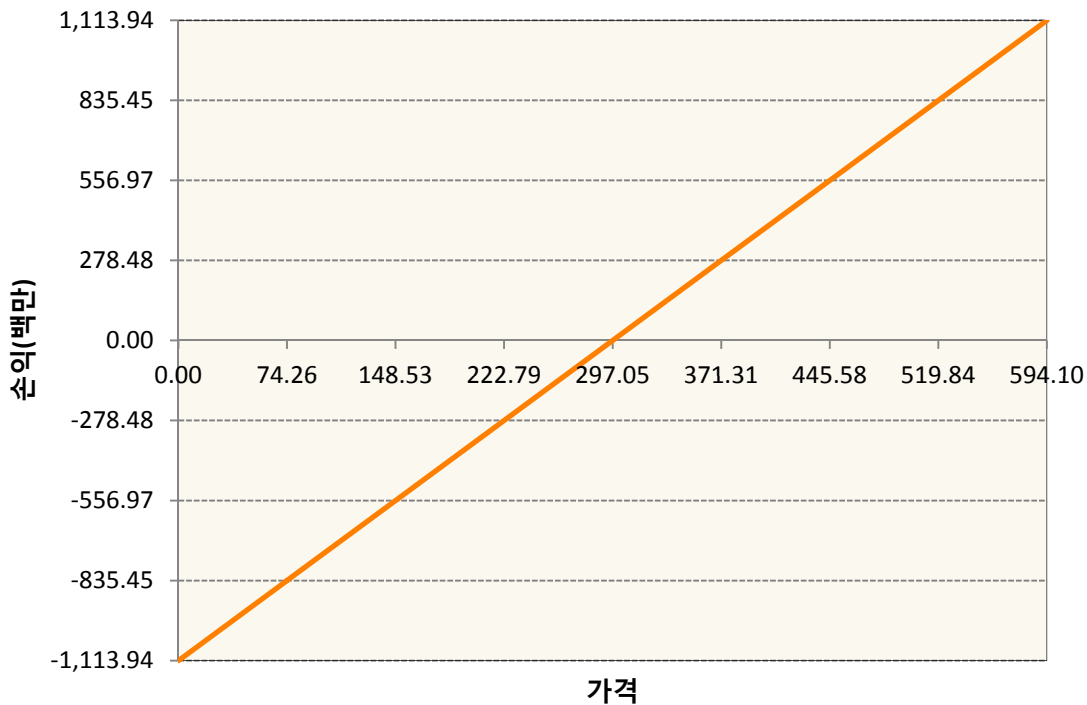
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,114	0	1,114	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	2018-09-20
기준일	2018-09-19

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

1,153

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

489

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-20
기준일	2018-09-19

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

291

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

370

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-20
기준일	2018-09-19

유로인덱스모(주식-파생형)

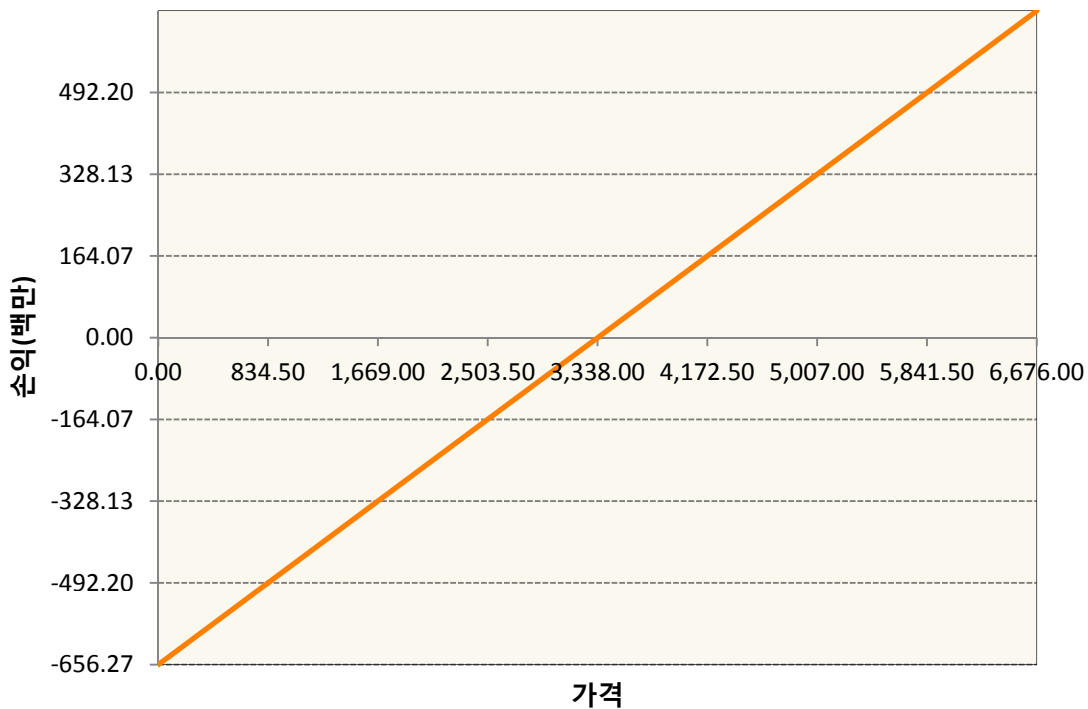
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	656	0	656	

2. 만기시점의 손익구조

VGZ8-EURO STOXX 50 DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ8	EURO STOXX 50 DEC18	53
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

32

공시일	2018-09-20
기준일	2018-09-19

차이나인덱스모(주식-파생형)

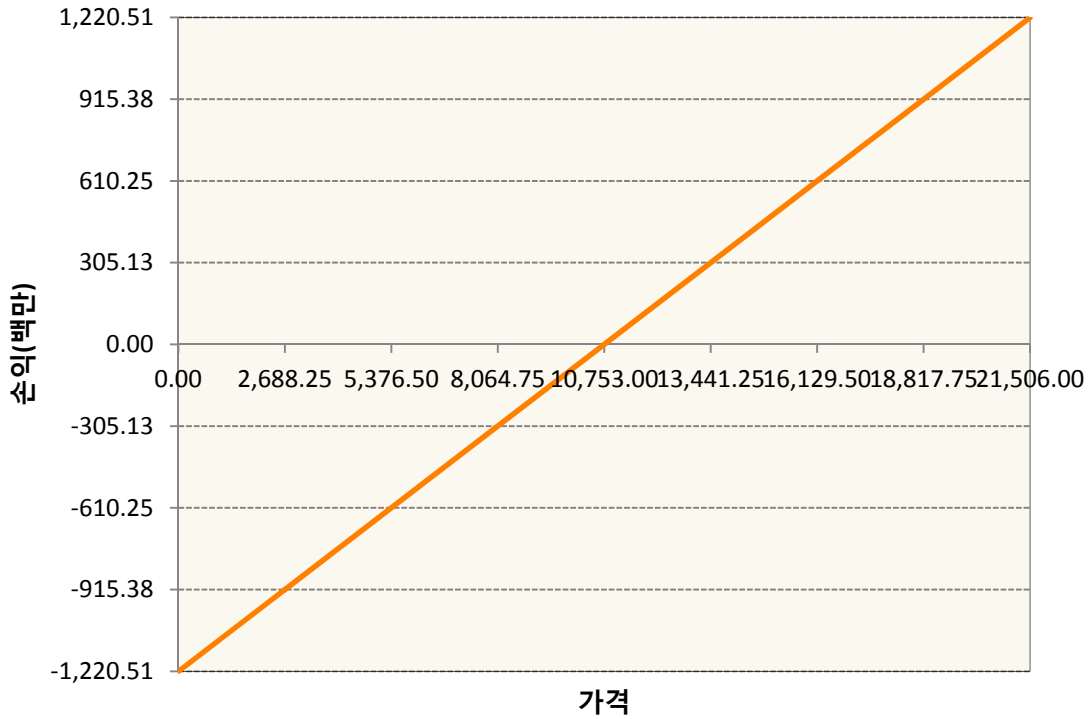
1. 계약금액

(단위:백만원)

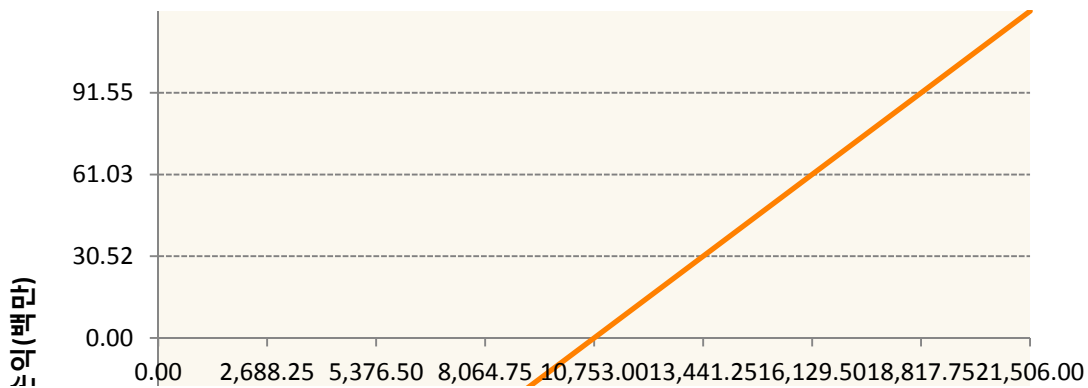
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	122	0	122	
누계	유가증권	선물	1,221	0	1,221	장내

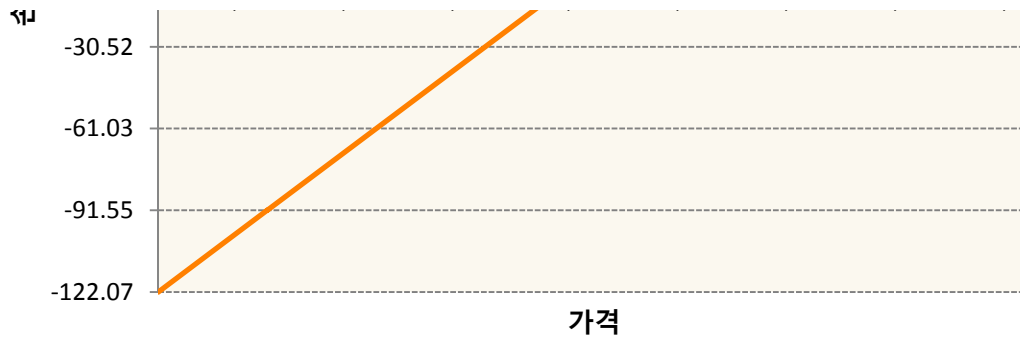
2. 만기시점의 손익구조

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	98
MHCU8	MINI H-SHR IDX Fut Sep18	10

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

99

공시일	2018-09-20
기준일	2018-09-19

커버드콜모(주식혼합-파생형)

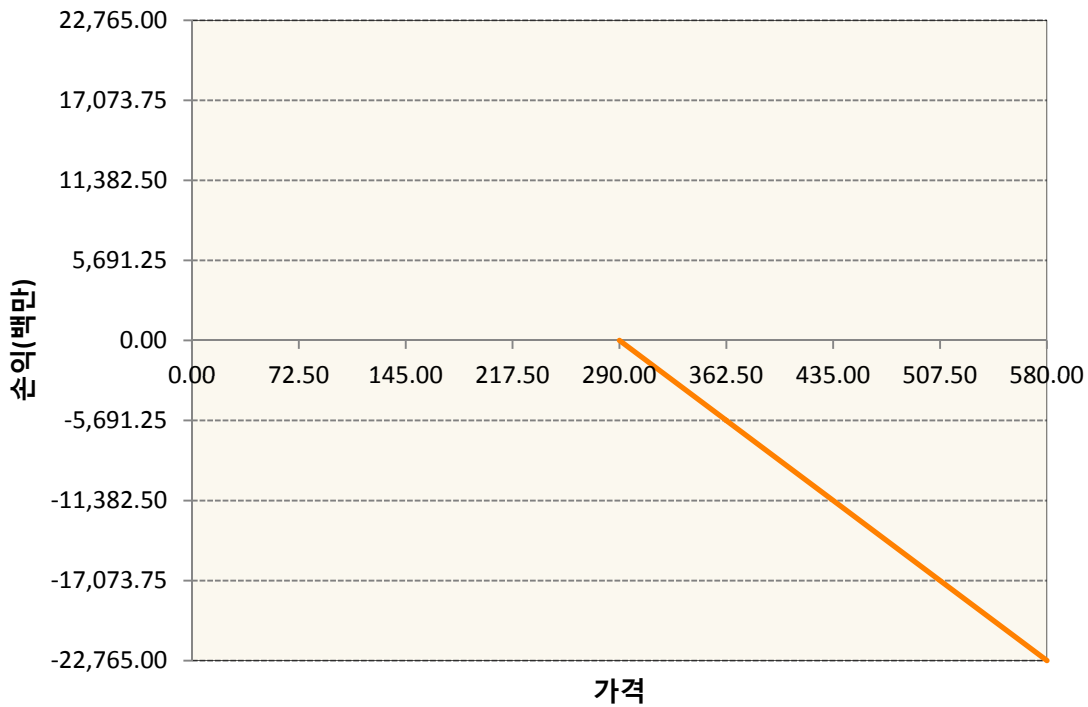
1. 계약금액

(단위:백만원)

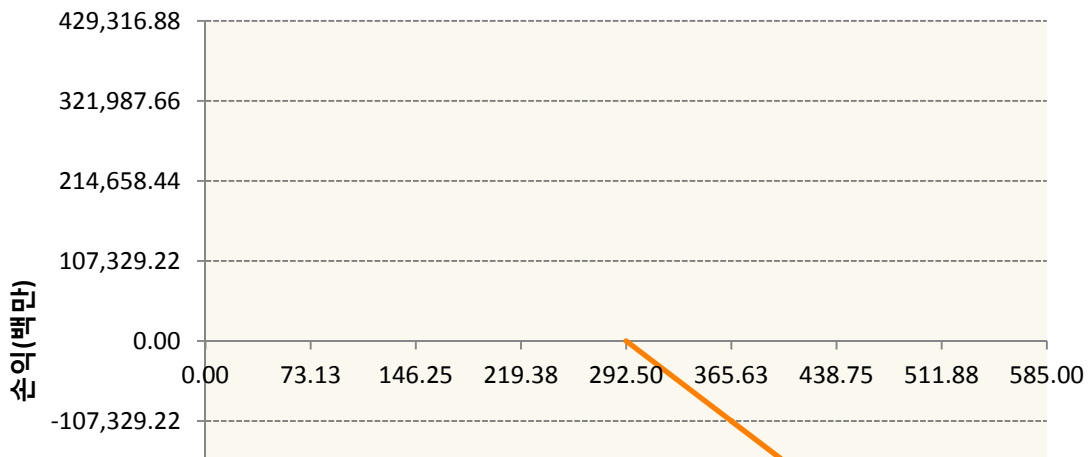
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	737,269	-737,269	장내

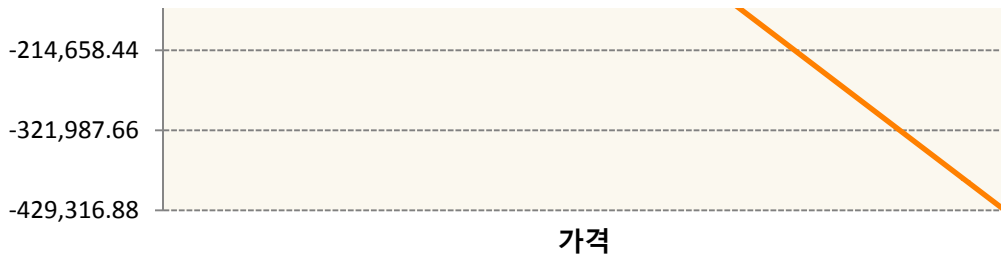
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NA2902-2018-10 콜290

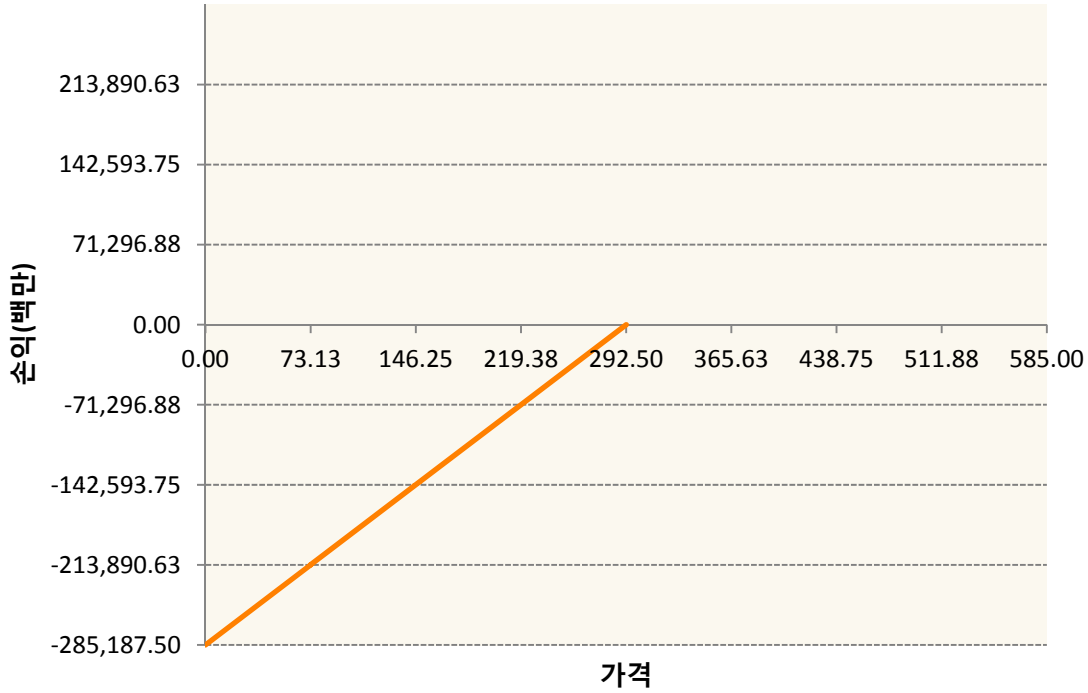


KR4201NA2928-2018-10 콜292.5





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NA2927-2018-10 콜290

1,590

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	837	814	786	757	725	691	655
-5.33%	725	685	644	602	558	514	469
-2.67%	499	450	401	352	303	254	204
0%	138	93	47	0	-47	-95	-143
2.67%	-340	-373	-408	-445	-484	-525	-566
5.33%	-897	-915	-937	-962	-990	-1,021	-1,054
8.00%	-1,494	-1,502	-1,513	-1,528	-1,546	-1,567	-1,590

KR4201NA2927-2018-10 풋292.5

28,734

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13,793	13,429	12,999	12,514	11,980	11,406	10,796

-5.33%	12,182	11,516	10,810	10,073	9,312	8,531	7,734
-2.67%	8,680	7,785	6,884	5,979	5,072	4,162	3,250
0%	2,729	1,825	915	0	-918	-1,839	-2,761
2.67%	-5,574	-6,276	-7,017	-7,789	-8,587	-9,404	-10,238
5.33%	-15,585	-16,013	-16,508	-17,061	-17,663	-18,306	-18,985
8.00%	-26,556	-26,764	-27,039	-27,379	-27,778	-28,232	-28,734
KR4301NA29 2018-10 풋 292.5							17,616
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-17,533	-17,535	-17,540	-17,549	-17,563	-17,586	-17,616
-5.33%	-9,886	-9,933	-9,996	-10,077	-10,173	-10,284	-10,408
-2.67%	-3,083	-3,303	-3,530	-3,763	-4,000	-4,241	-4,484
0%	677	459	233	0	-237	-479	-723
2.67%	1,526	1,474	1,404	1,317	1,214	1,095	963
5.33%	1,588	1,585	1,577	1,564	1,543	1,513	1,472
8.00%	1,589	1,589	1,589	1,588	1,586	1,582	1,574

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

(단위:백만원)

49,004

공시일	2018-09-20
기준일	2018-09-19

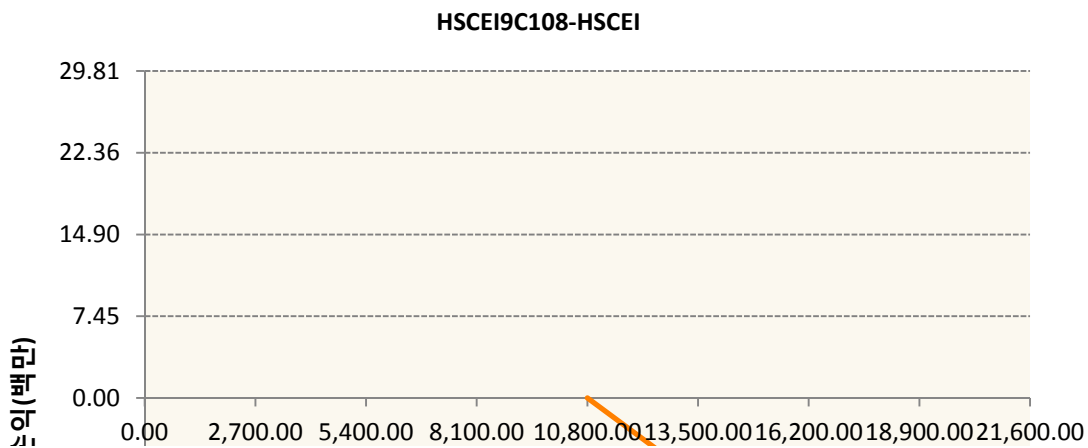
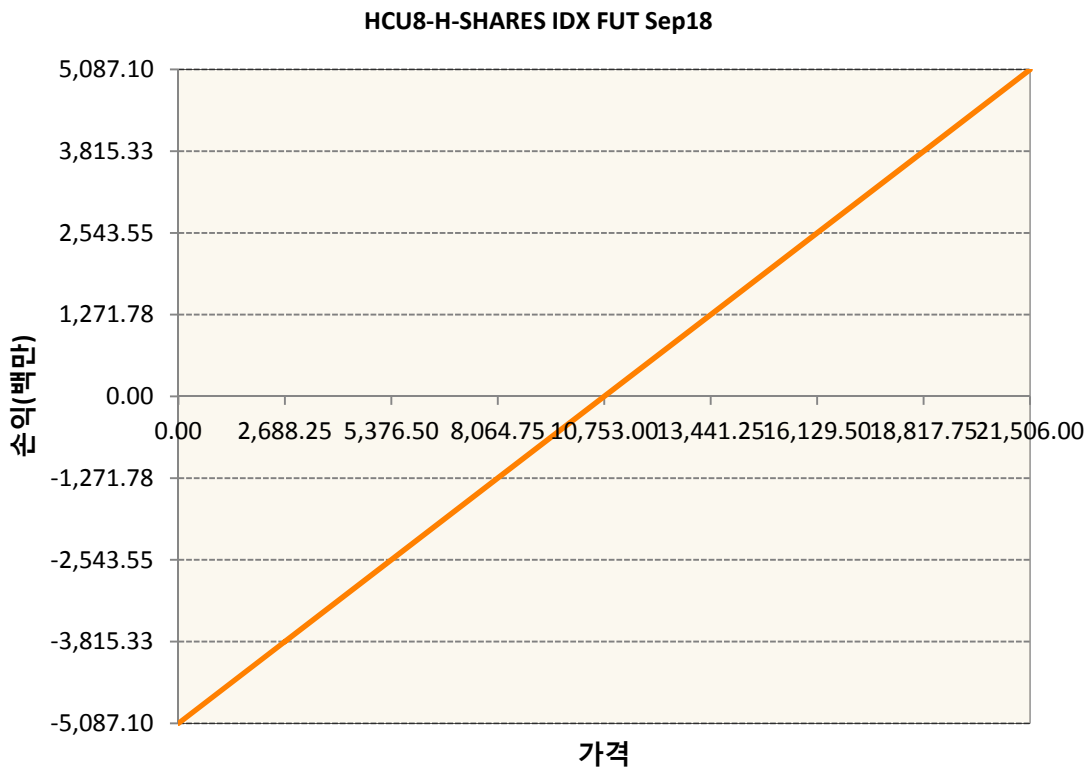
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

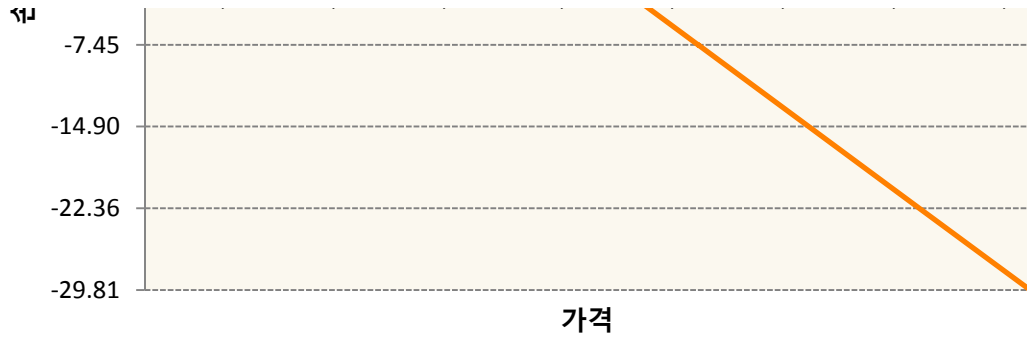
1. 계약금액

(단위:백만원)

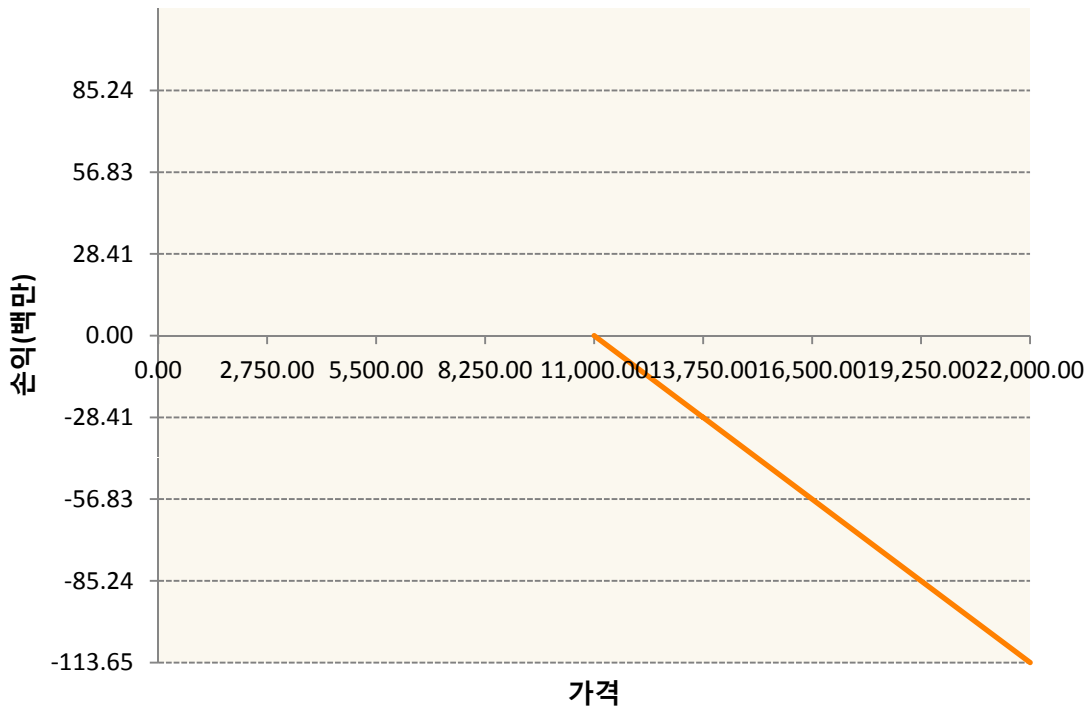
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,087	0	5,087	장내
누계	유가증권	옵션	0	323	-323	장내

2. 만기시점의 손익구조

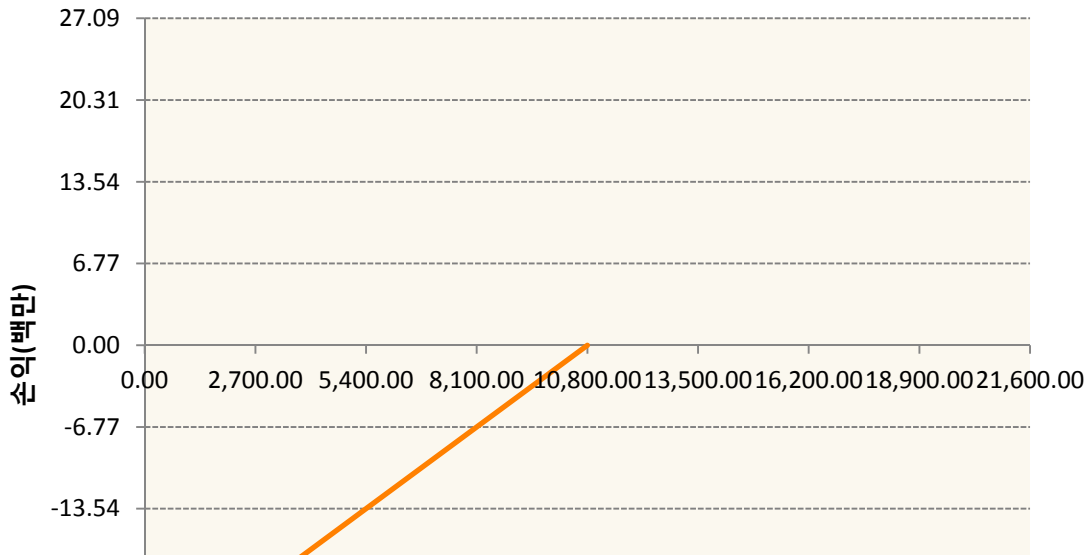


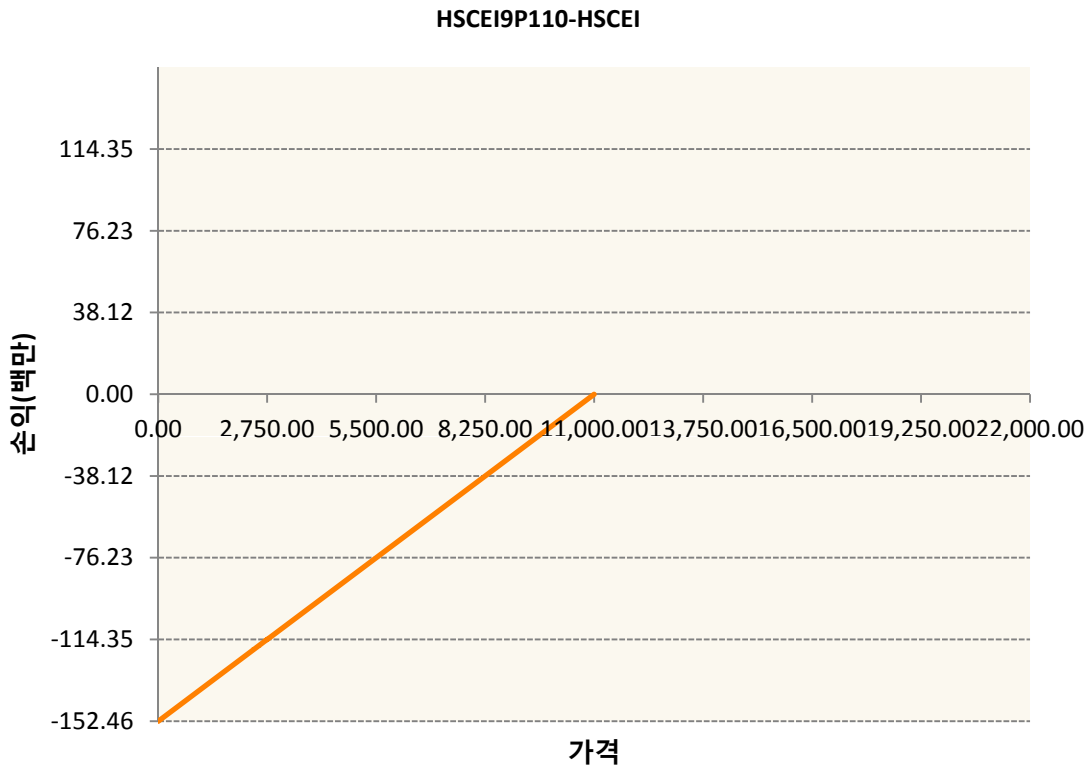
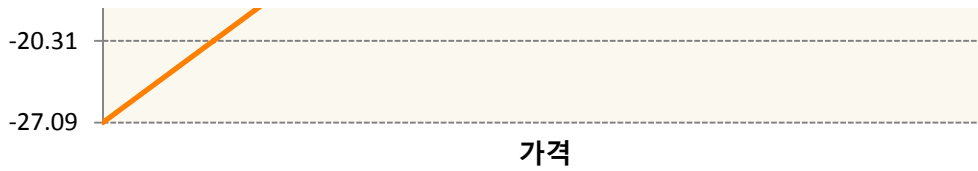


HSCEI9C110-HSCEI



HSCEI9P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU8	H-SHARES IDX FUT Sep18	407
HSCEI9C108	HSCEI	2
HSCEI9C110	HSCEI	9
HSCEI9P108	HSCEI	2
HSCEI9P110	HSCEI	12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	400

공시일	2018-09-20
기준일	2018-09-19

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

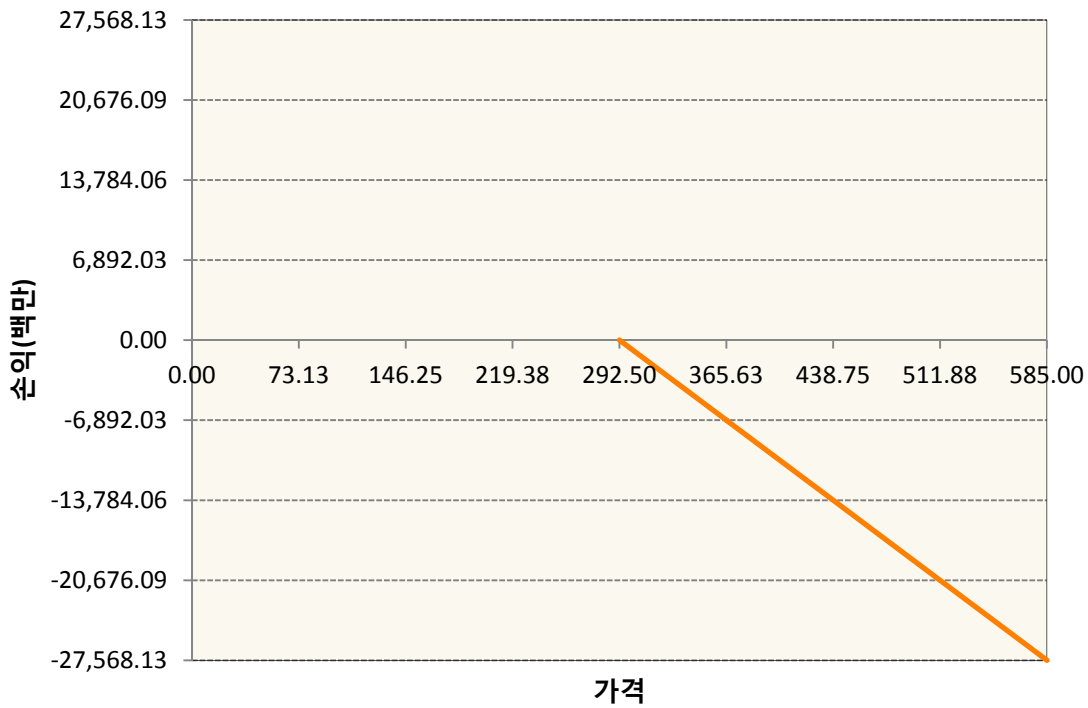
1. 계약금액

(단위:백만원)

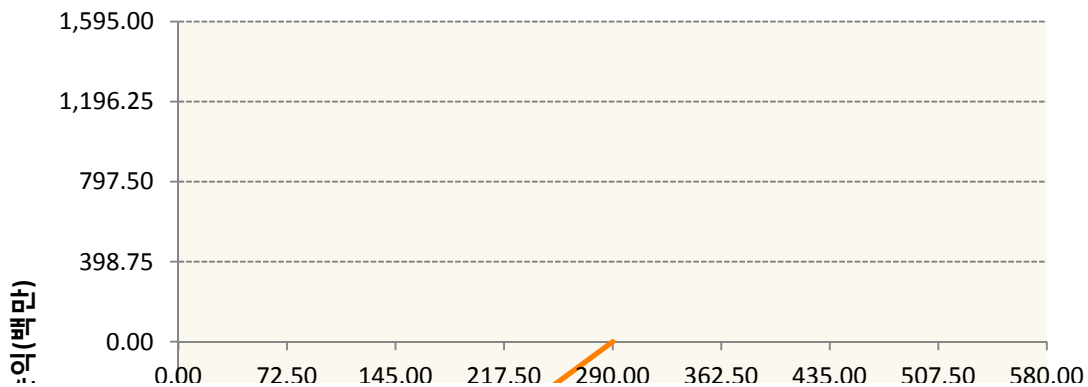
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	48,761	-48,761	장내

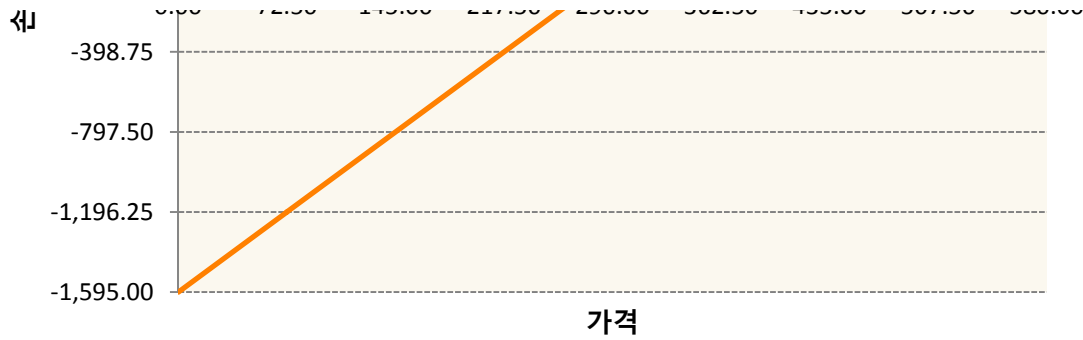
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NA2928-2018-10 콜292.5

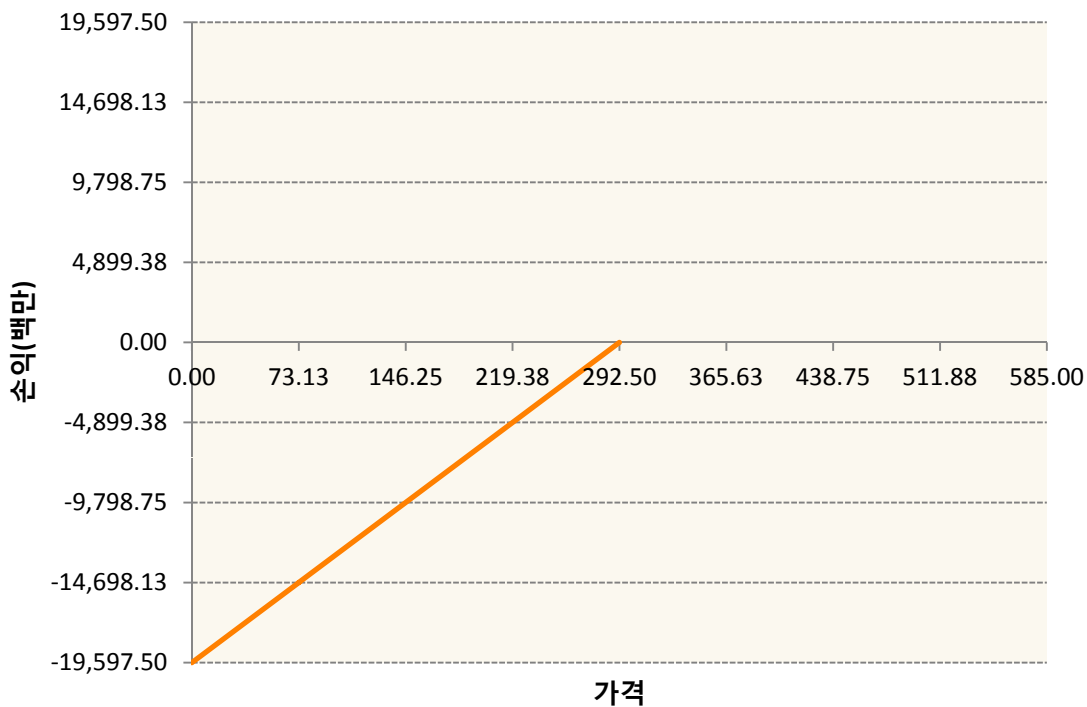


KR4301NA2901-2018-10 풋290





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,995	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,995	-3,995	-3,995	-3,995	-3,995	-3,995	-3,995	
-5.33%	-2,663	-2,663	-2,663	-2,663	-2,663	-2,663	-2,663	
-2.67%	-1,332	-1,332	-1,332	-1,332	-1,332	-1,332	-1,332	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	1,332	1,332	1,332	1,332	1,332	1,332	1,332	
5.33%	2,663	2,663	2,663	2,663	2,663	2,663	2,663	
8.00%	3,995	3,995	3,995	3,995	3,995	3,995	3,995	
KR4201NA2927-2018-10 콜292.5							1,845	
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	886	862	835	804	769	732	693
-5.33%	782	739	694	647	598	548	497
-2.67%	557	500	442	384	326	267	209
0%	175	117	59	0	-59	-118	-177
2.67%	-358	-403	-451	-500	-551	-604	-657
5.33%	-1,001	-1,028	-1,060	-1,096	-1,134	-1,176	-1,219
8.00%	-1,705	-1,719	-1,736	-1,758	-1,784	-1,813	-1,845

KR4301NA2☹ 2018-10 풋290

90

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-90
-5.33%	-46	-47	-47	-48	-49	-50	-51
-2.67%	-12	-13	-15	-16	-18	-19	-21
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	5	5	5	5	4	4	3
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

KR4301NA2☹ 2018-10 풋292.5

1,211

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,205	-1,205	-1,205	-1,206	-1,207	-1,208	-1,211
-5.33%	-679	-683	-687	-692	-699	-707	-715
-2.67%	-212	-227	-243	-259	-275	-291	-308
0%	47	32	16	0	-16	-33	-50
2.67%	105	101	97	91	83	75	66
5.33%	109	109	108	107	106	104	101
8.00%	109	109	109	109	109	109	108

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

(단위:백만원)

7,208

공시일	2018-09-20
기준일	2018-09-19

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

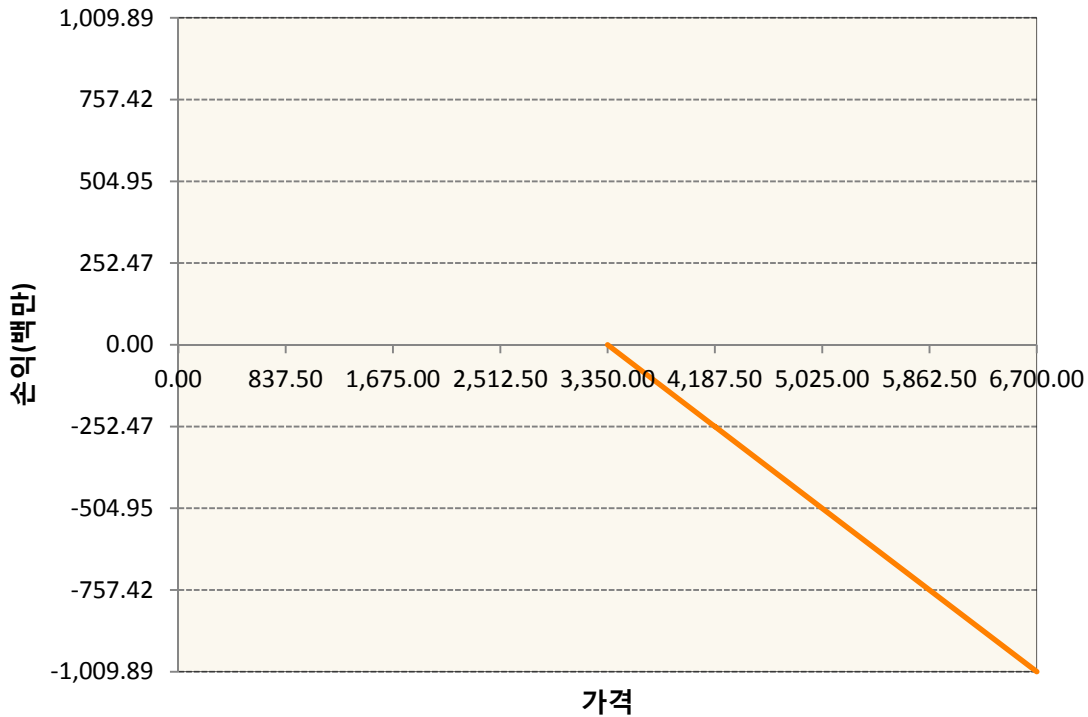
1. 계약금액

(단위:백만원)

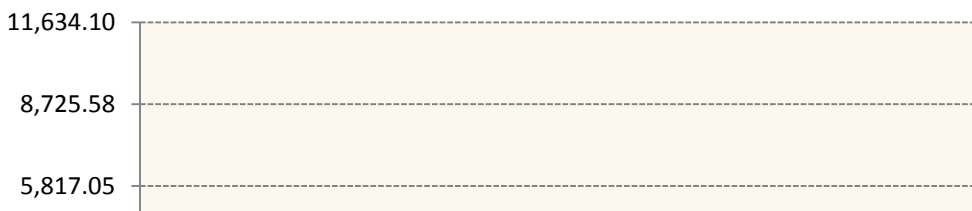
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,496	0	5,496	
누계	유가증권	스왑	34,611	0	34,611	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,288	-25,288	장내
누계	지수	스왑	53,210	0	53,210	장외

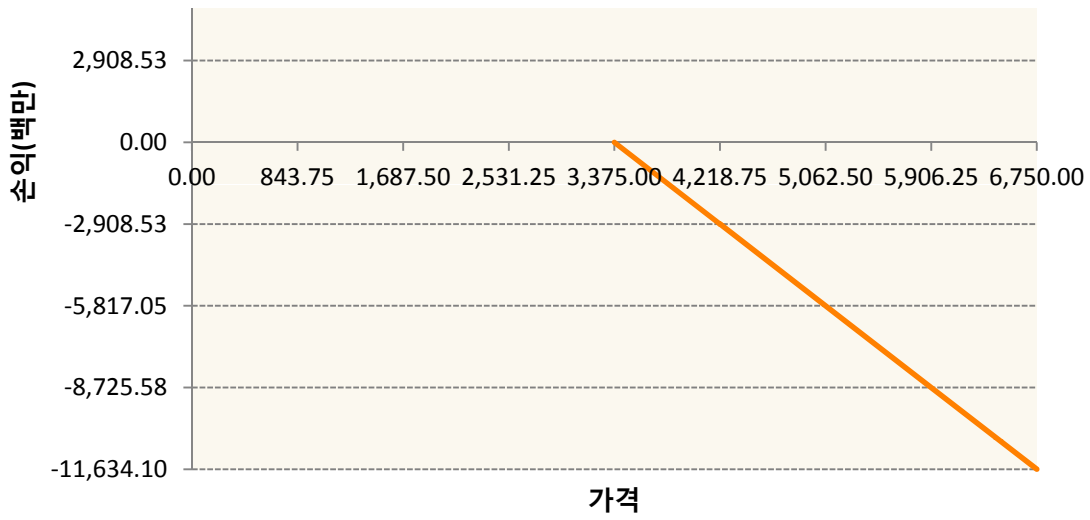
2. 만기시점의 손익구조

OESXU8-C3350-EURO STOXX 50

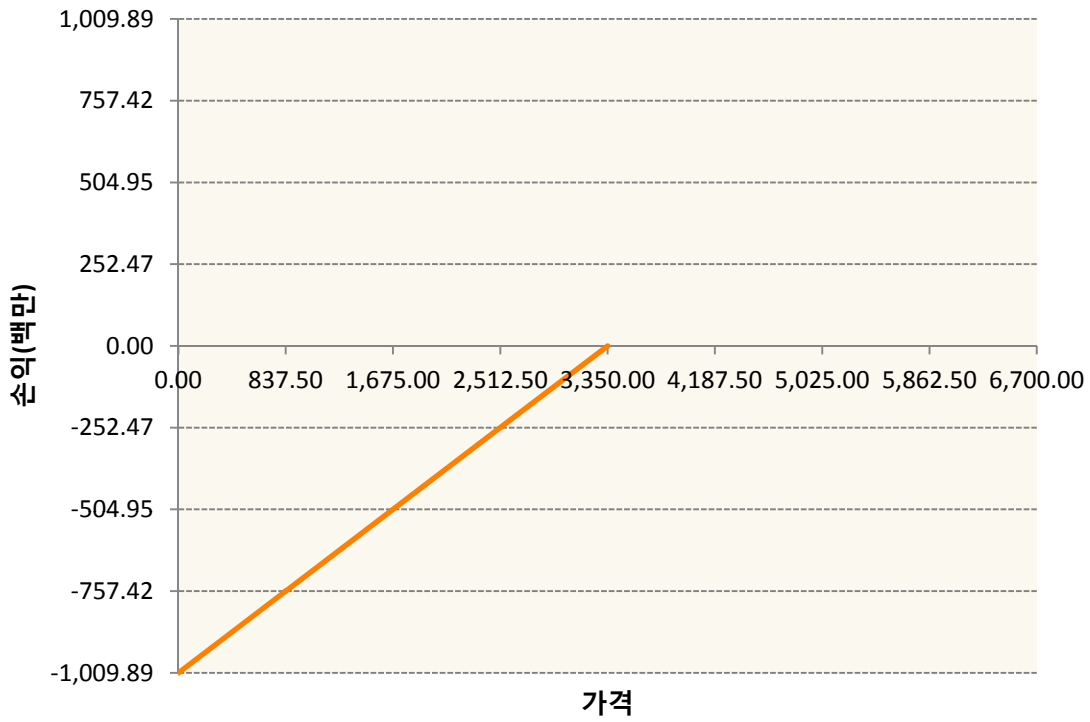


OESXU8-C3375-EURO STOXX 50



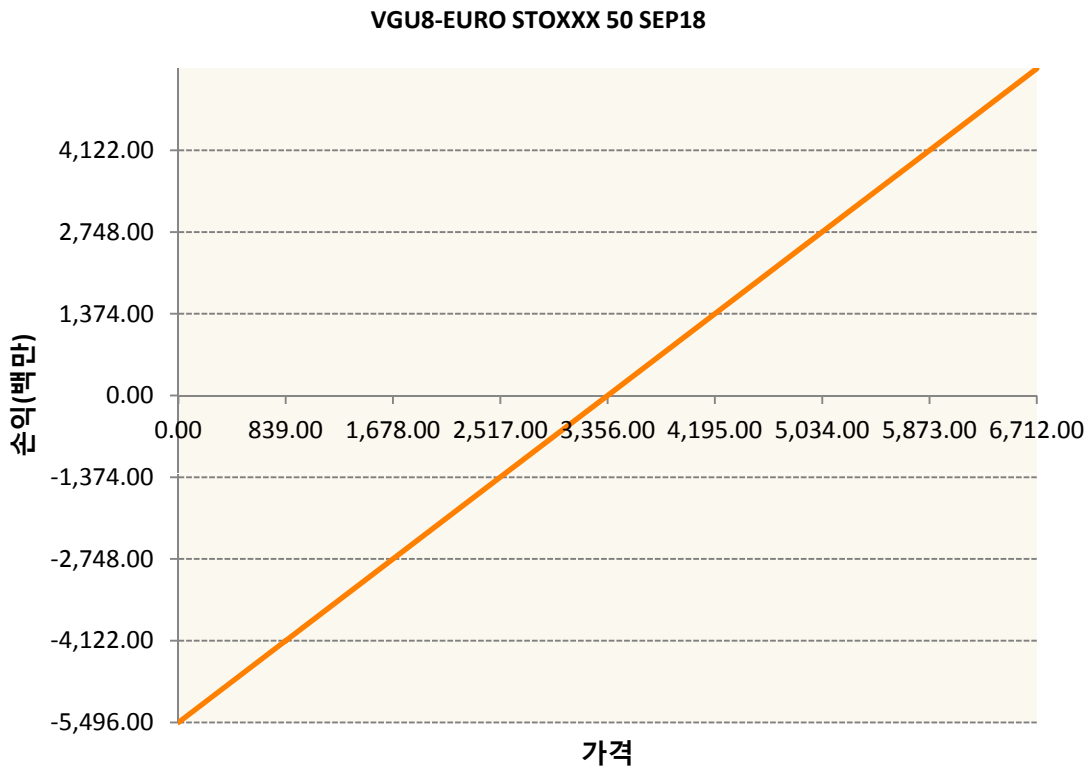
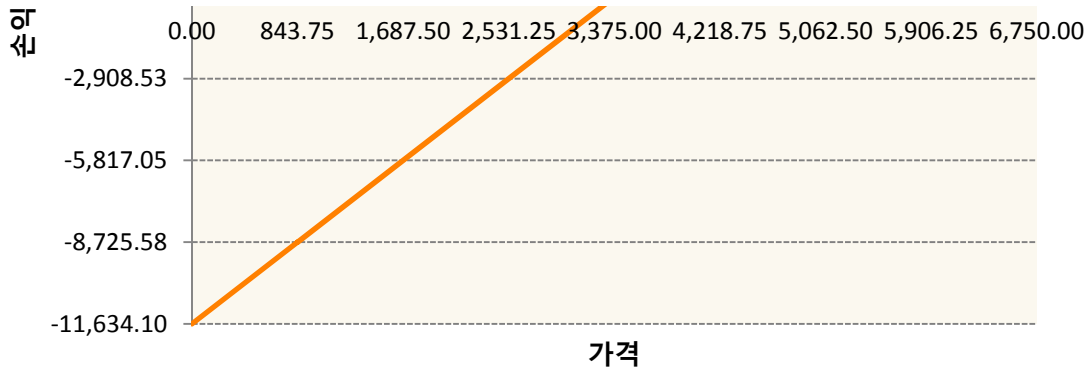


OESXU8-P3350-EURO STOXX 50



OESXU8-P3375-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		15
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY		10
OESXU8-C3E EURO STOXX 50		81
OESXU8-C3E EURO STOXX 50		931
OESXU8-P3E EURO STOXX 50		81
OESXU8-P3E EURO STOXX 50		931
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18		440

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)

166

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-09-20
기준일	2018-09-19

리디파인K200(주식혼합-파생재간

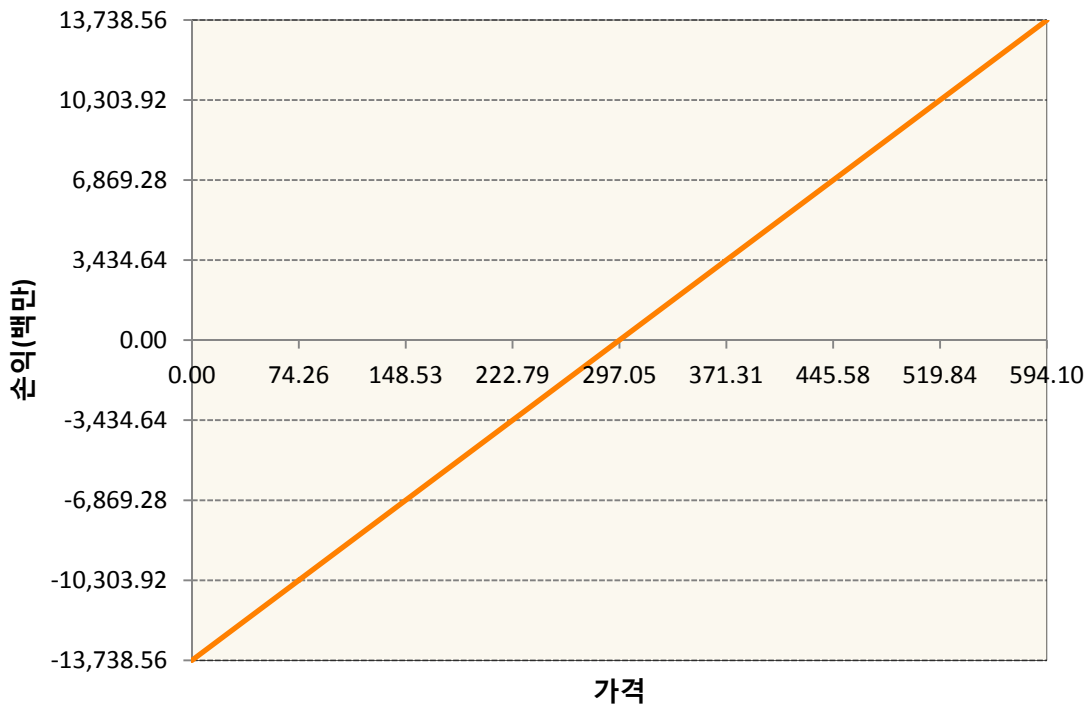
1. 계약금액

(단위:백만원)

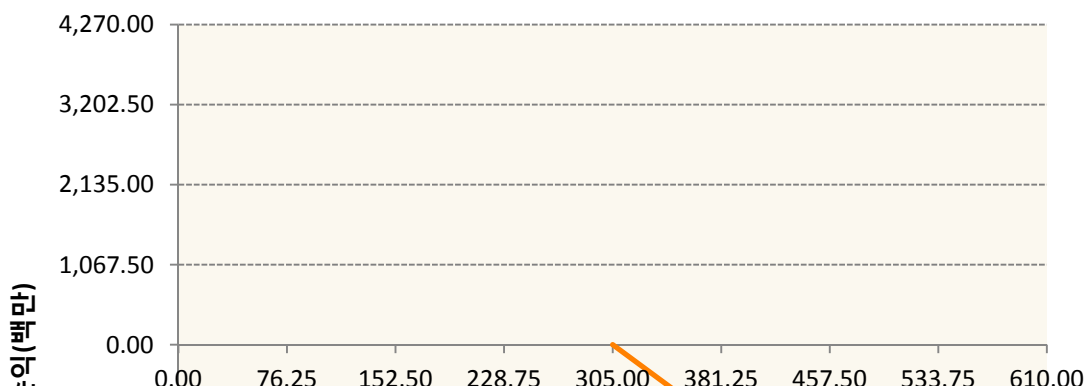
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,739	0	13,739	장내
누계	유가증권	옵션	2,119	24,258	-22,138	장내

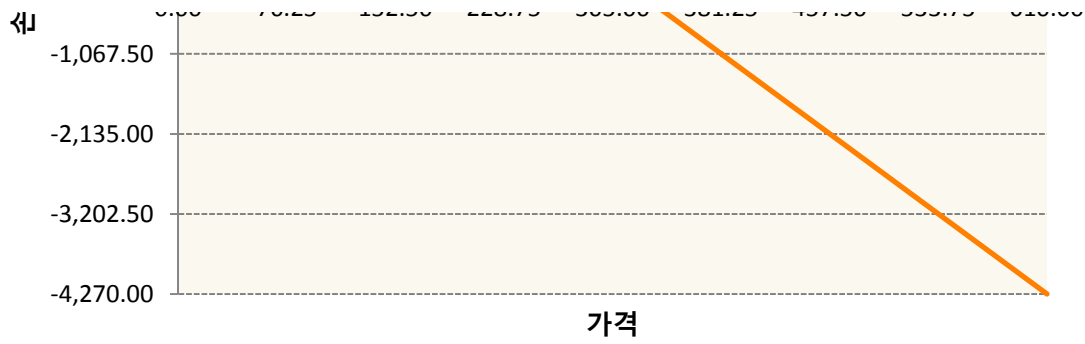
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

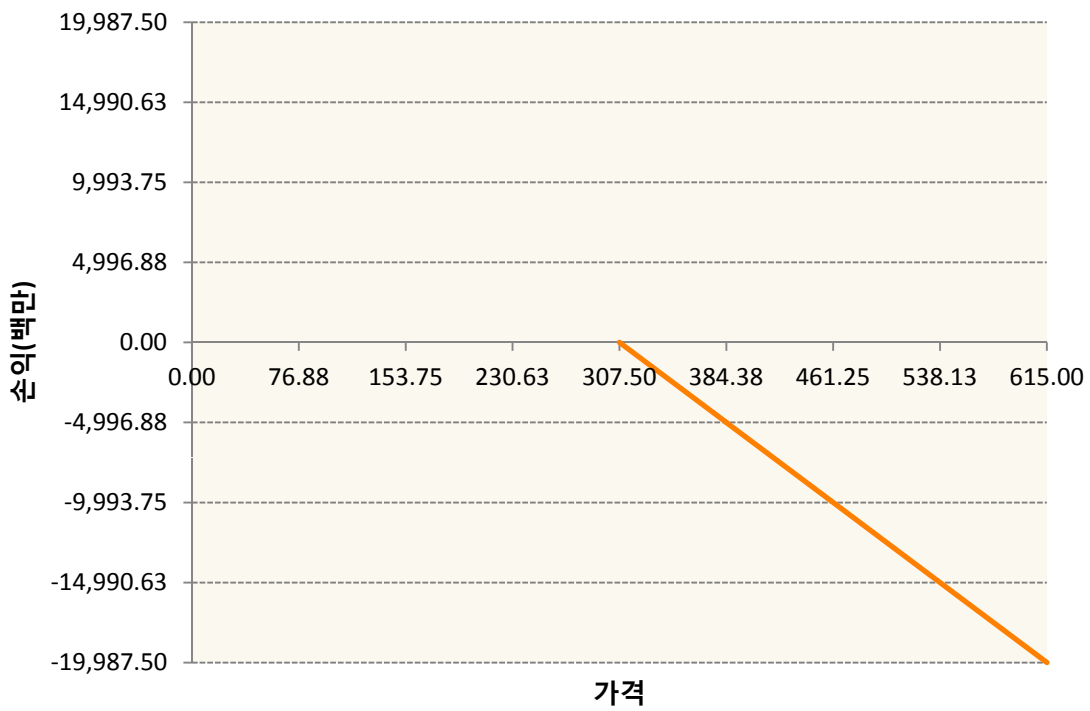


KR4201NA3058-2018-10 콜305

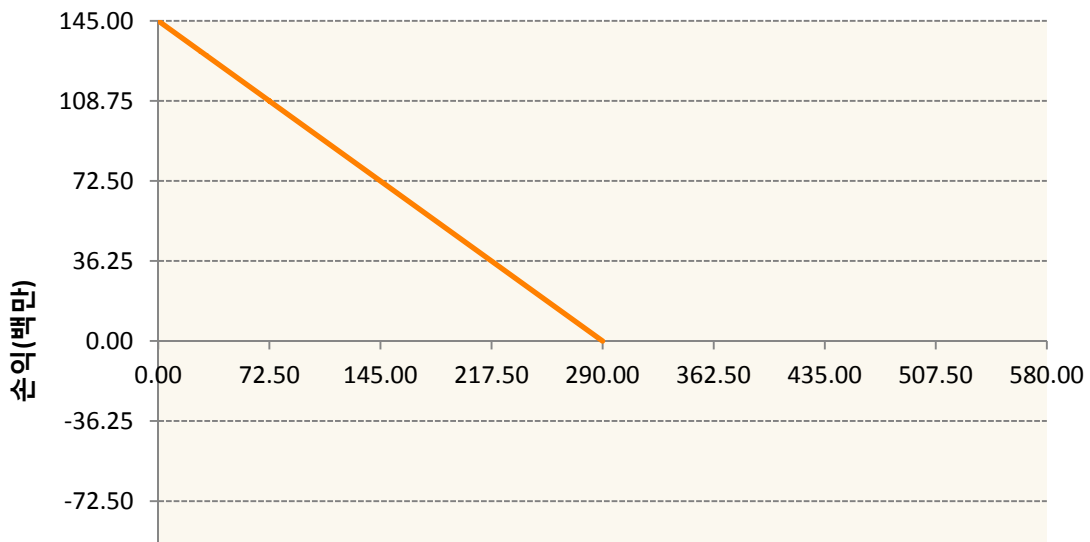


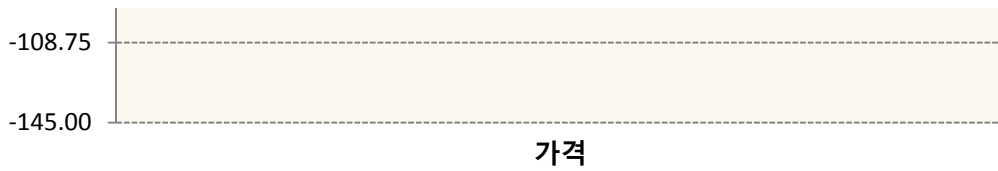


KR4201NA3074-2018-10 콜307.5

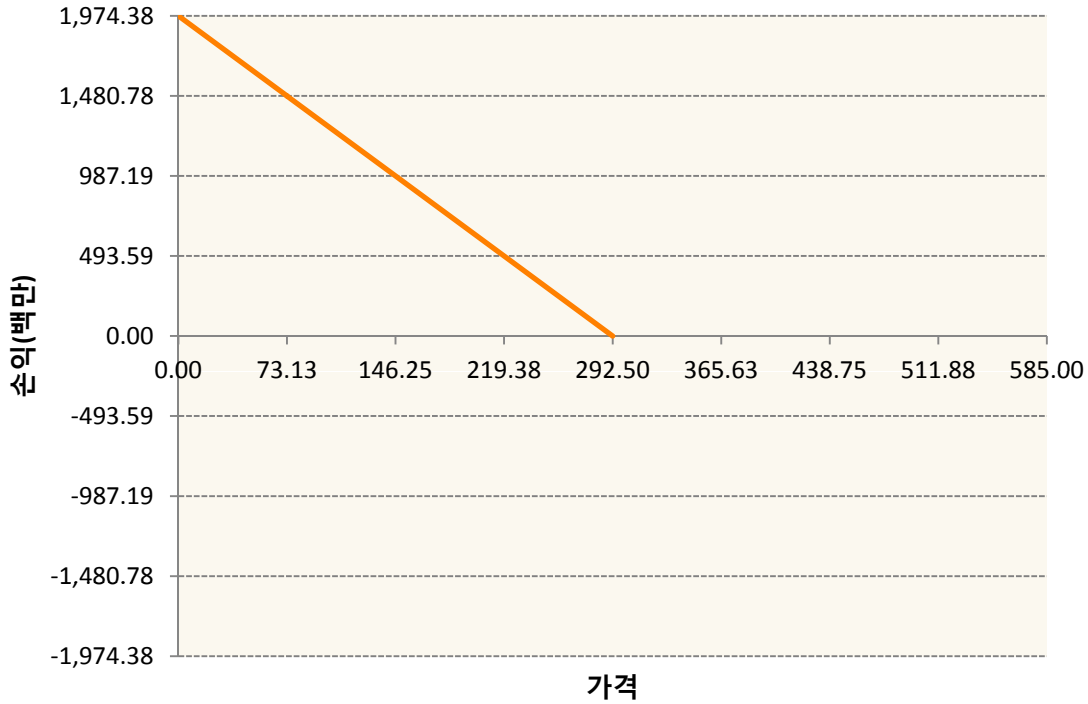


KR4301NA2901-2018-10 풋290





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 1,098

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,098	-1,098	-1,098	-1,098	-1,098	-1,098	-1,098
-5.33%	-732	-732	-732	-732	-732	-732	-732
-2.67%	-366	-366	-366	-366	-366	-366	-366
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	366	366	366	366	366	366	366
5.33%	732	732	732	732	732	732	732
8.00%	1,098	1,098	1,098	1,098	1,098	1,098	1,098

KR4201NA3(2018-10 콜305) 214

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	60	59	58	56	54	51	48
-5.33%	57	54	51	48	43	39	34
-2.67%	47	42	37	30	24	17	10

0%	24	16	8	0	-8	-17	-25
2.67%	-19	-28	-38	-47	-56	-65	-75
5.33%	-85	-94	-102	-111	-120	-129	-138
8.00%	-171	-177	-184	-191	-198	-206	-214

KR4201NA3(2018-10 콜307.5

928

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	231	228	223	217	208	197	184
-5.33%	222	213	201	187	170	150	129
-2.67%	189	169	146	121	94	65	34
0%	104	71	36	0	-37	-75	-113
2.67%	-66	-108	-151	-193	-236	-279	-321
5.33%	-340	-382	-424	-466	-509	-551	-594
8.00%	-712	-745	-779	-815	-852	-890	-928

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	4	4	5	5
-2.67%	1	1	1	1	2	2	2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

KR4301NA2(2018-10 풋292.5

122

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	121	121	121	121	122	122	122
-5.33%	68	69	69	70	70	71	72
-2.67%	21	23	24	26	28	29	31
0%	-5	-3	-2	0	2	3	5
2.67%	-11	-10	-10	-9	-8	-8	-7
5.33%	-11	-11	-11	-11	-11	-10	-10
8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11

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

(단위:백만원)

1,874

공시일	2018-09-20
기준일	2018-09-19

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

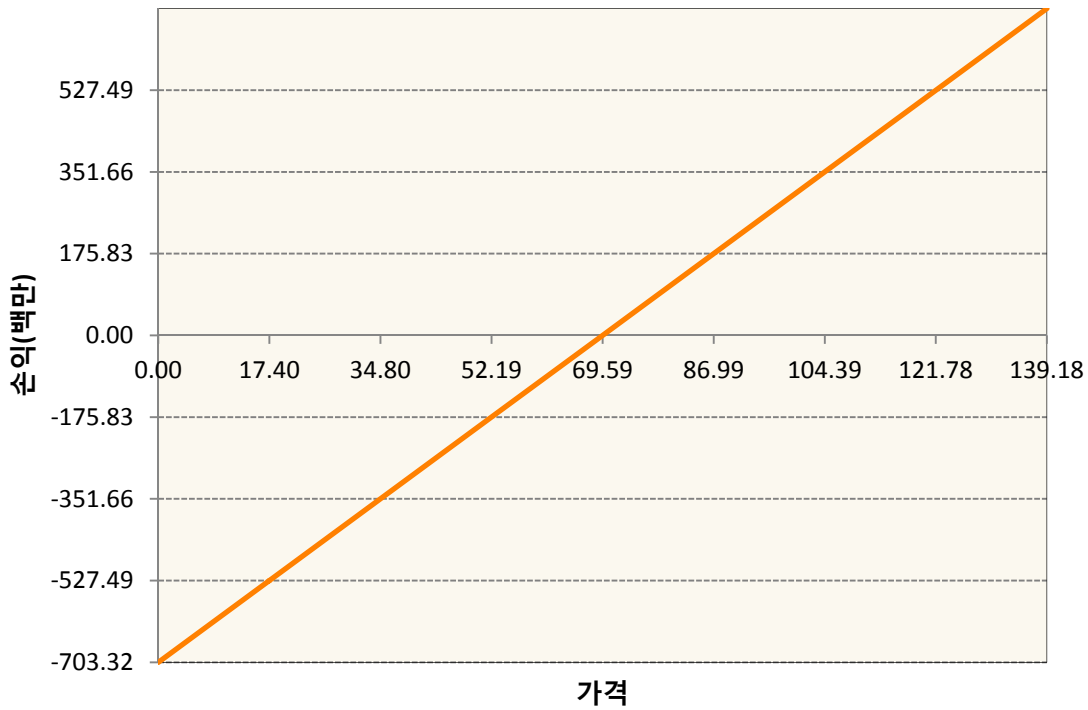
1. 계약금액

(단위:백만원)

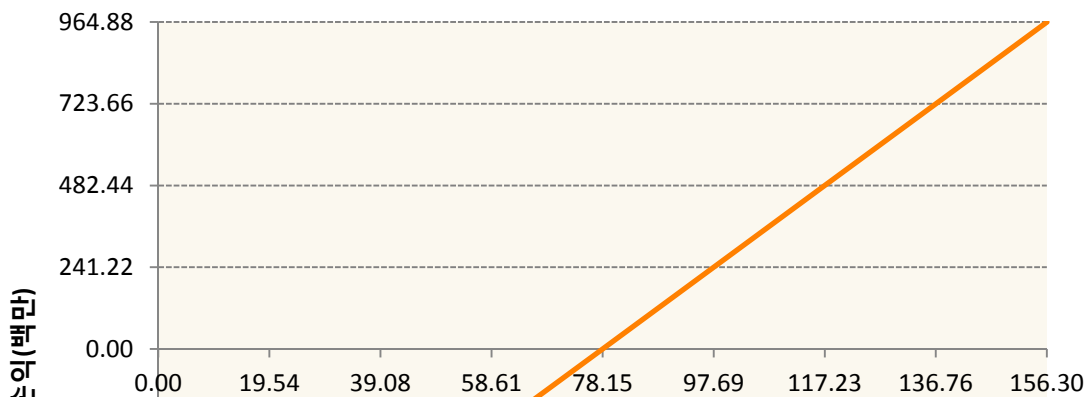
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,081	616	2,465	
누계	유가증권	선물	528	0	528	장내

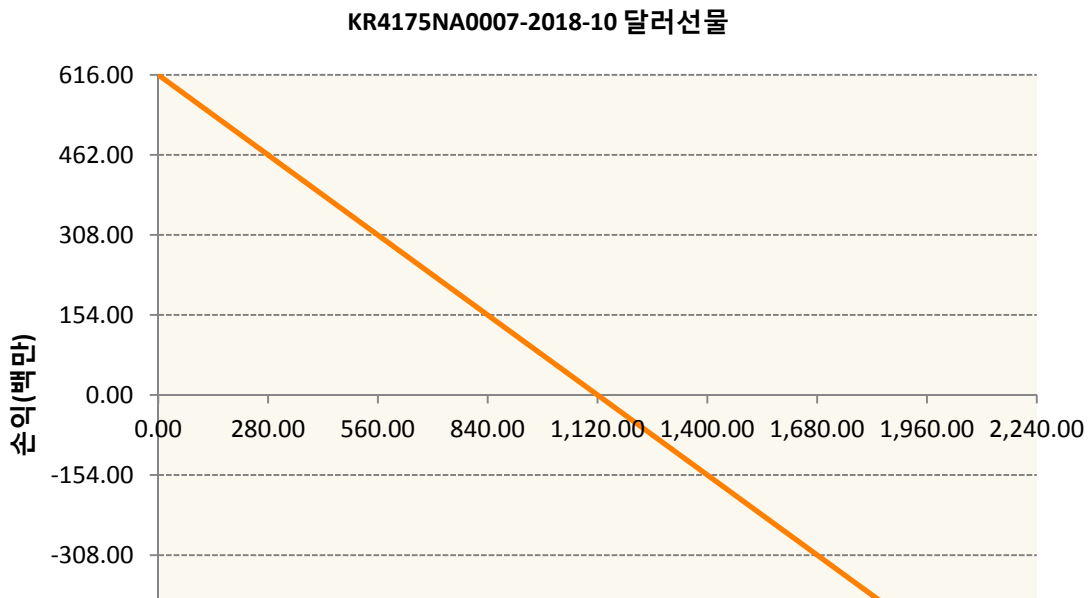
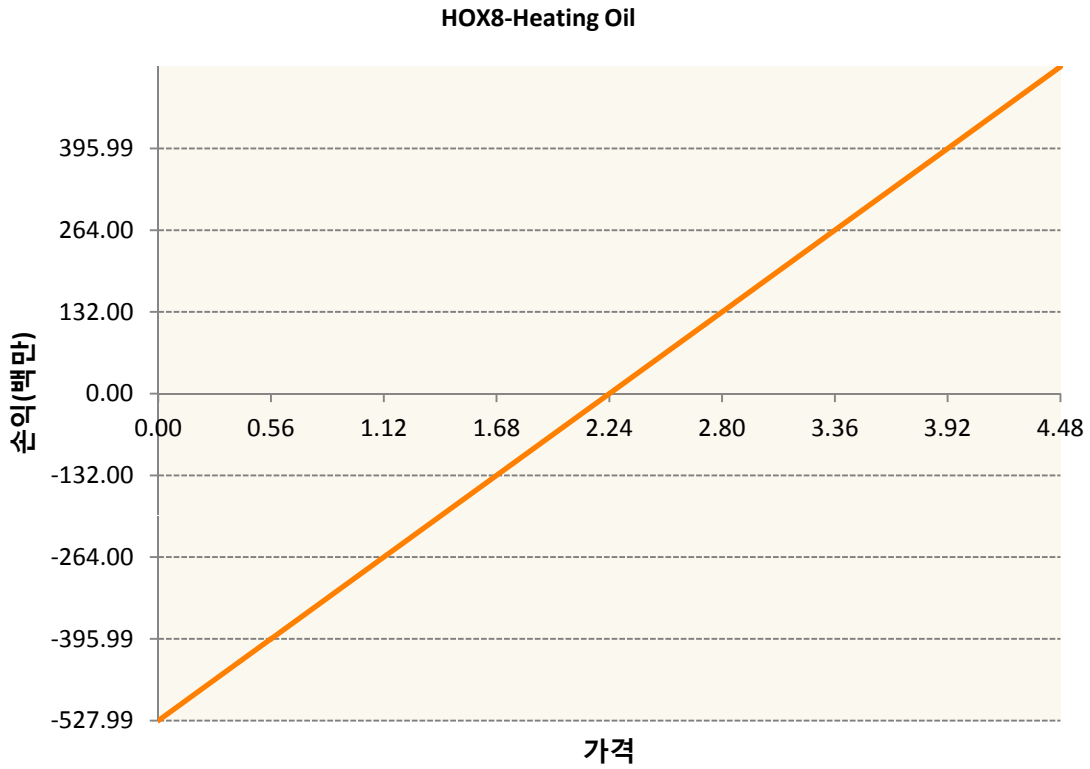
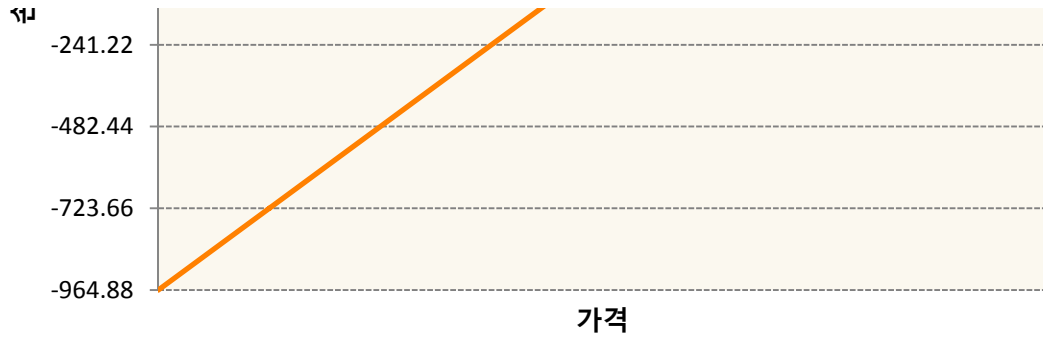
2. 만기시점의 손익구조

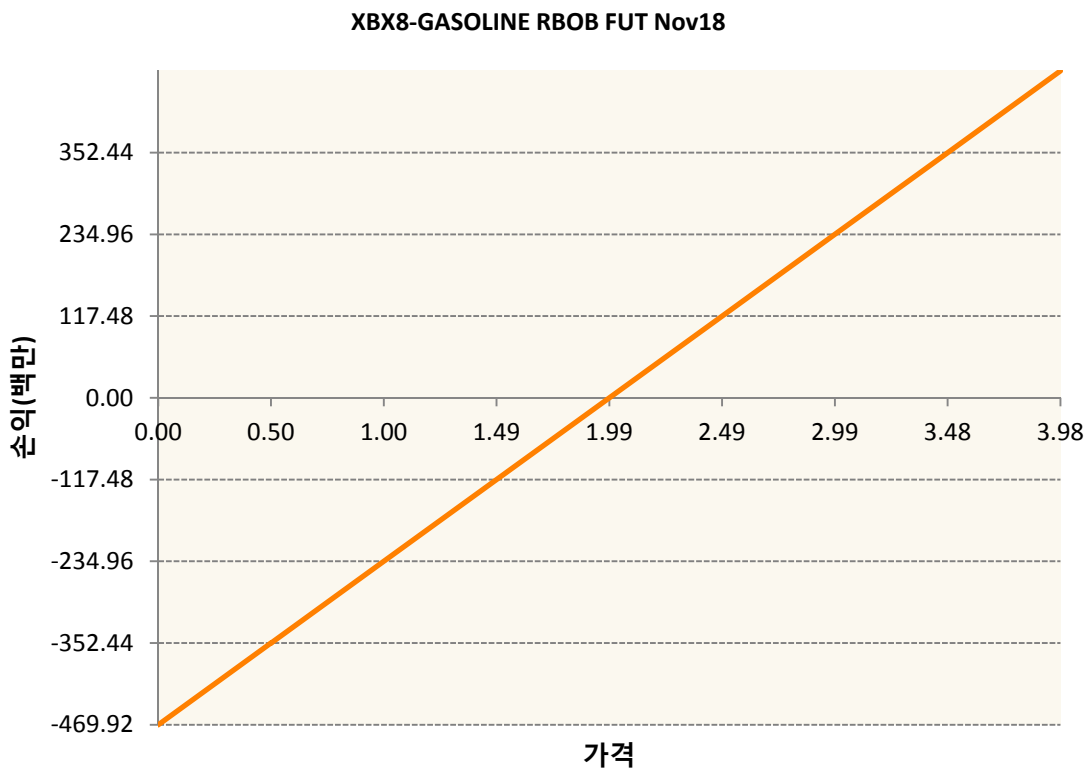
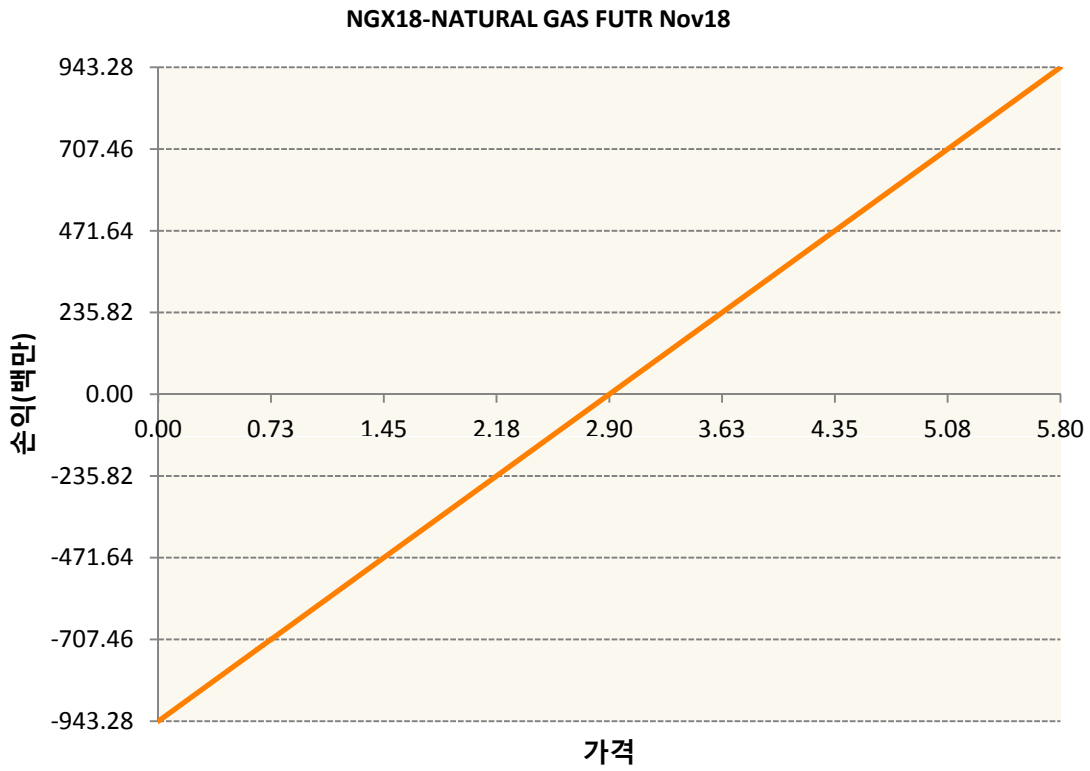
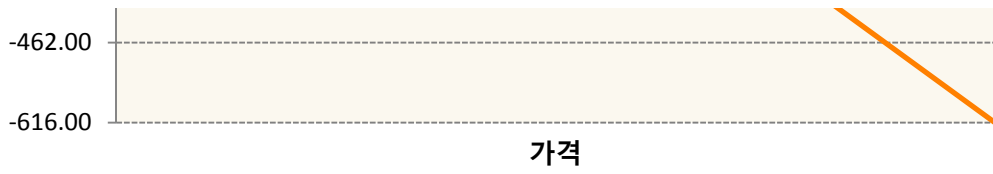
CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18



COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	56
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	77
HOX8	Heating Oil	42
	KR4175NA0(2018-10 달러선물	49
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	75
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	38

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	431

공시일	2018-09-20
기준일	2018-09-19

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

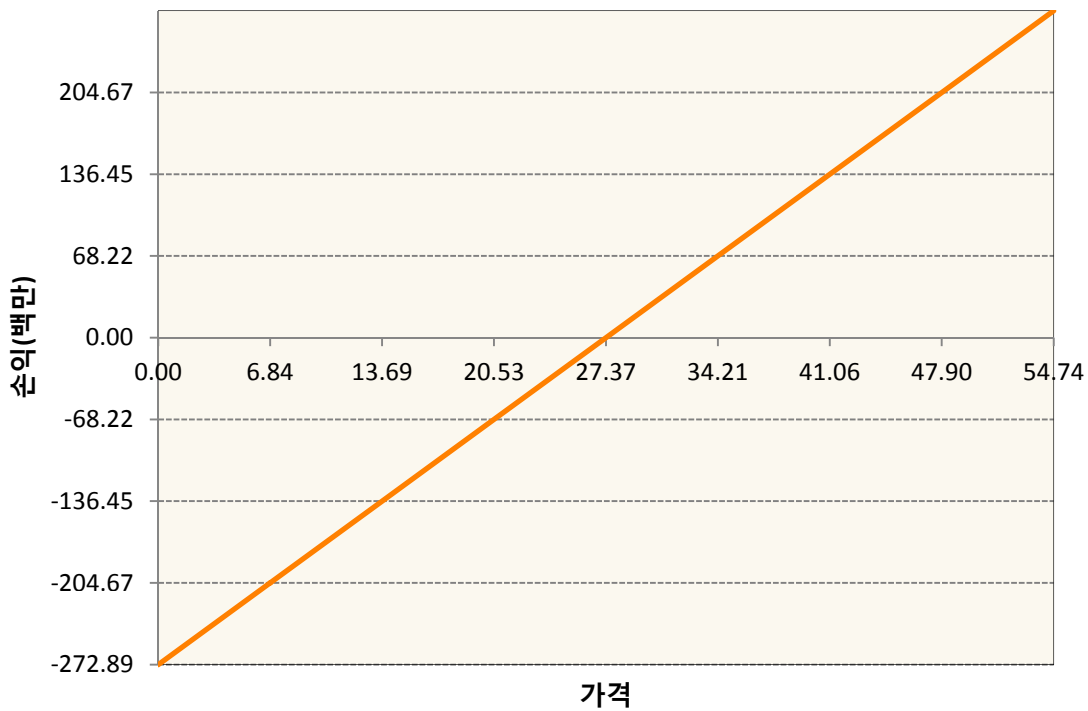
1. 계약금액

(단위:백만원)

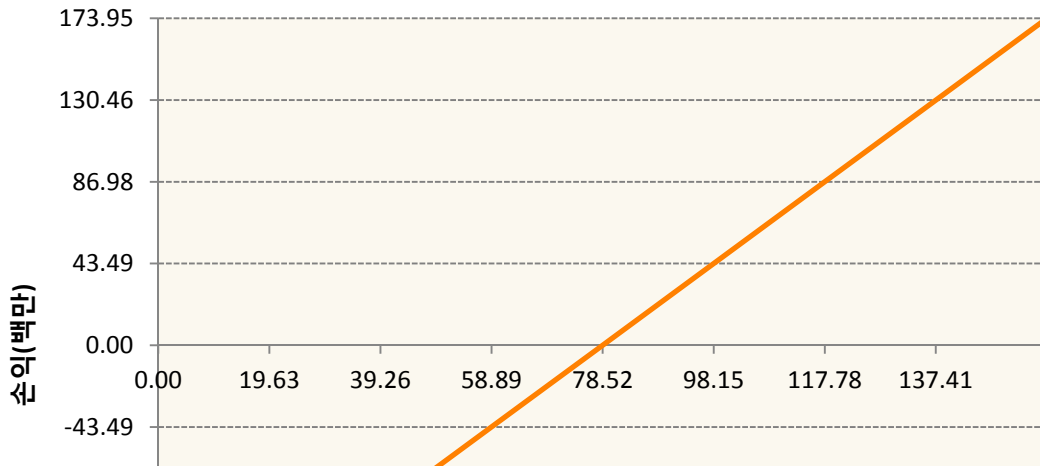
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,439	78	3,361	

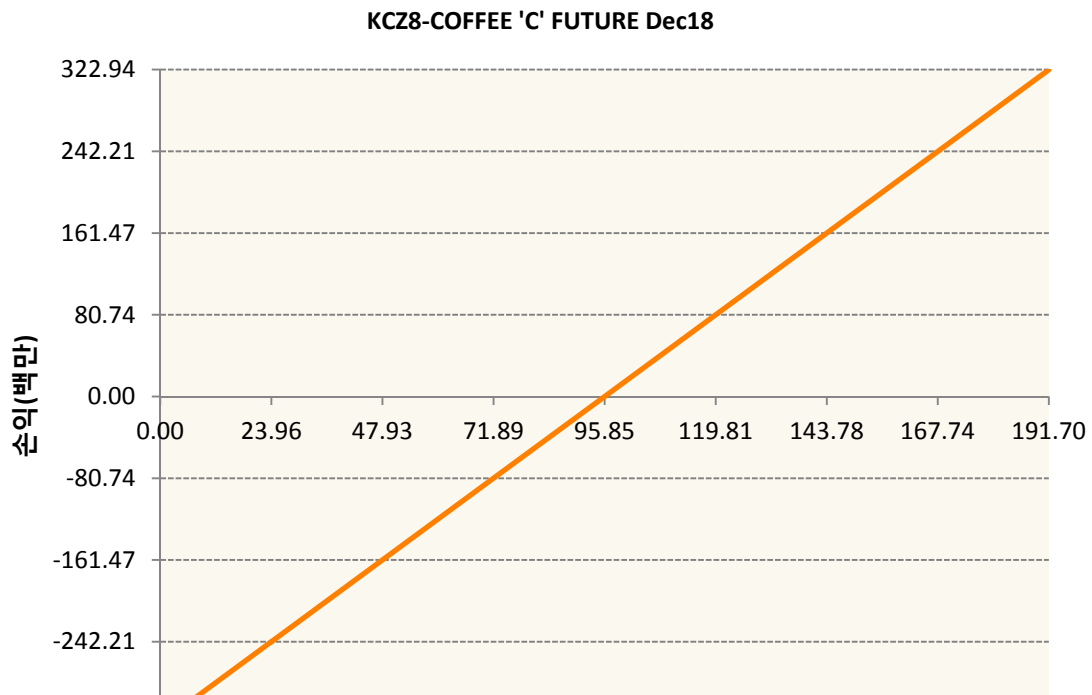
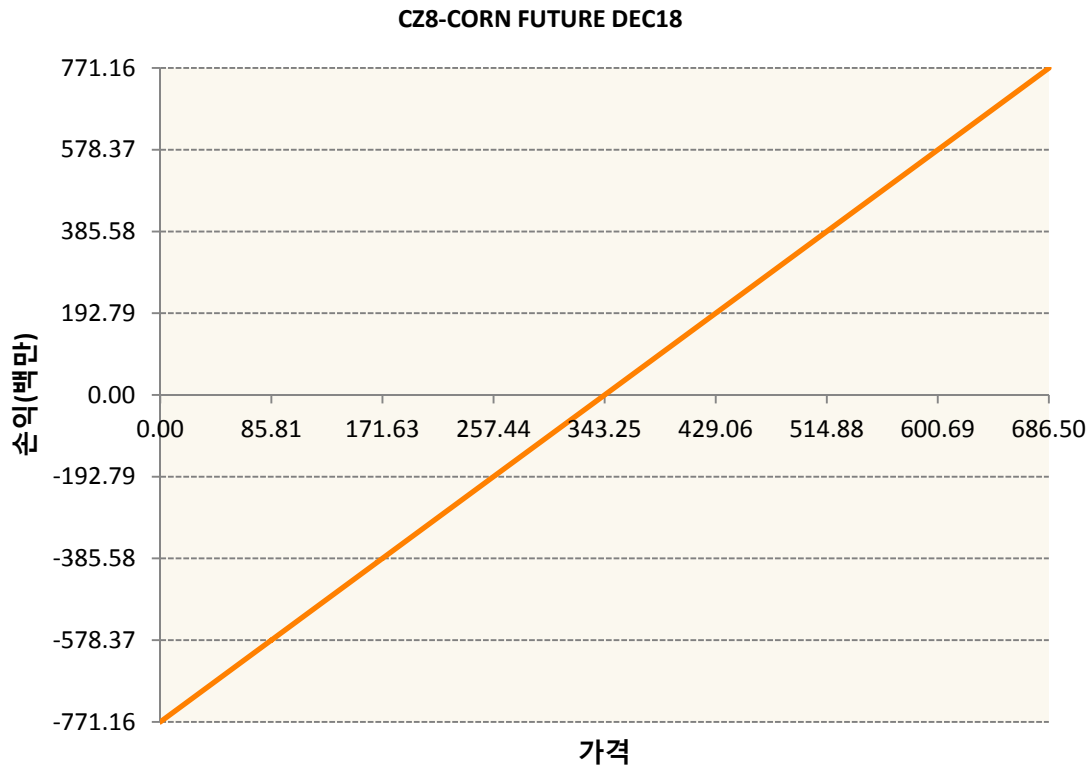
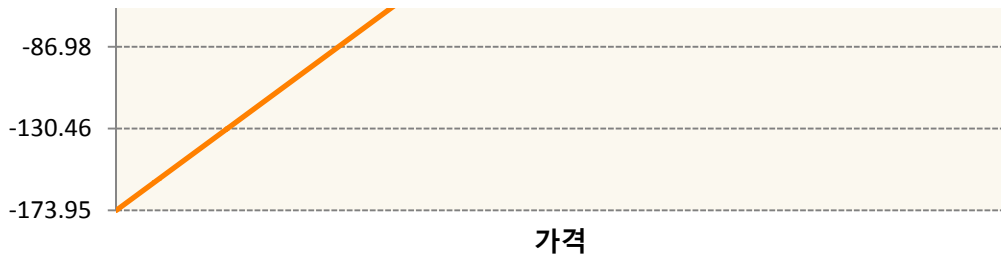
2. 만기시점의 손익구조

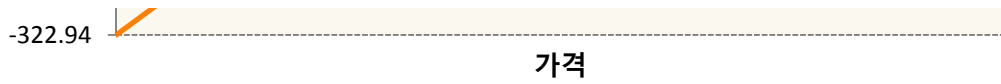
BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18



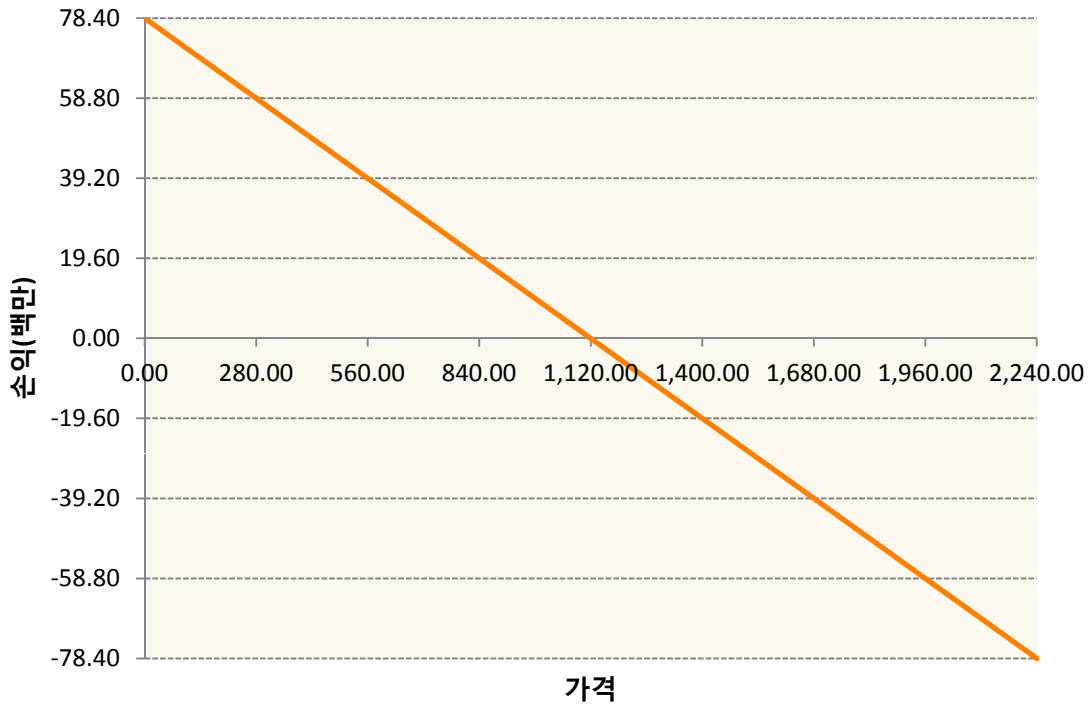
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



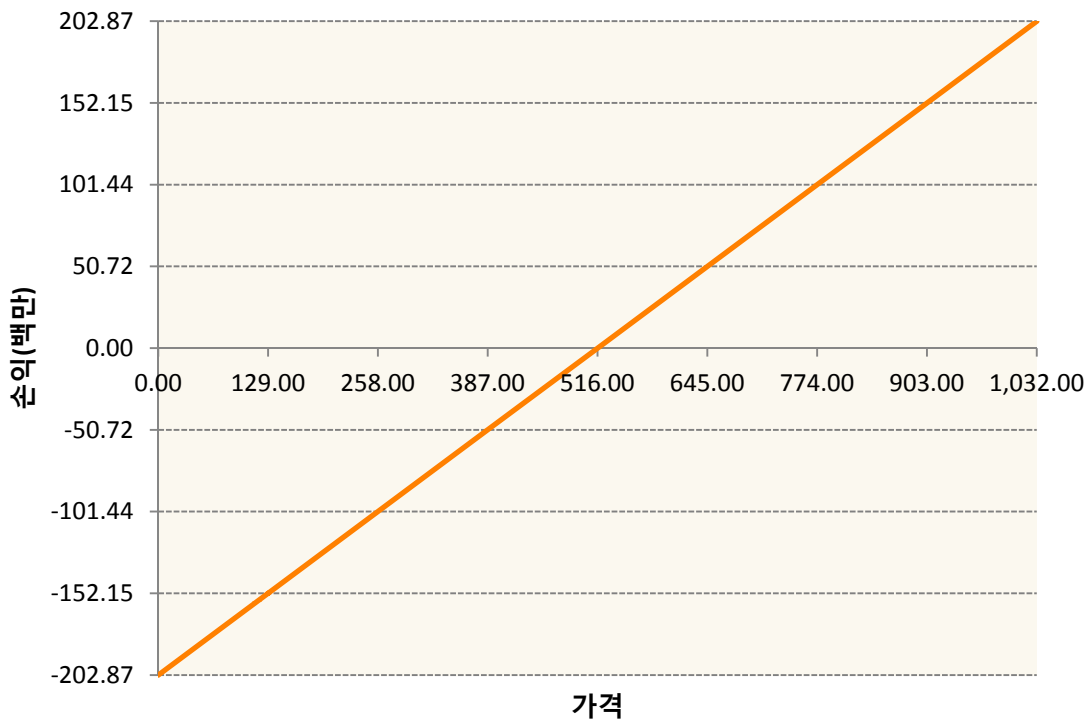




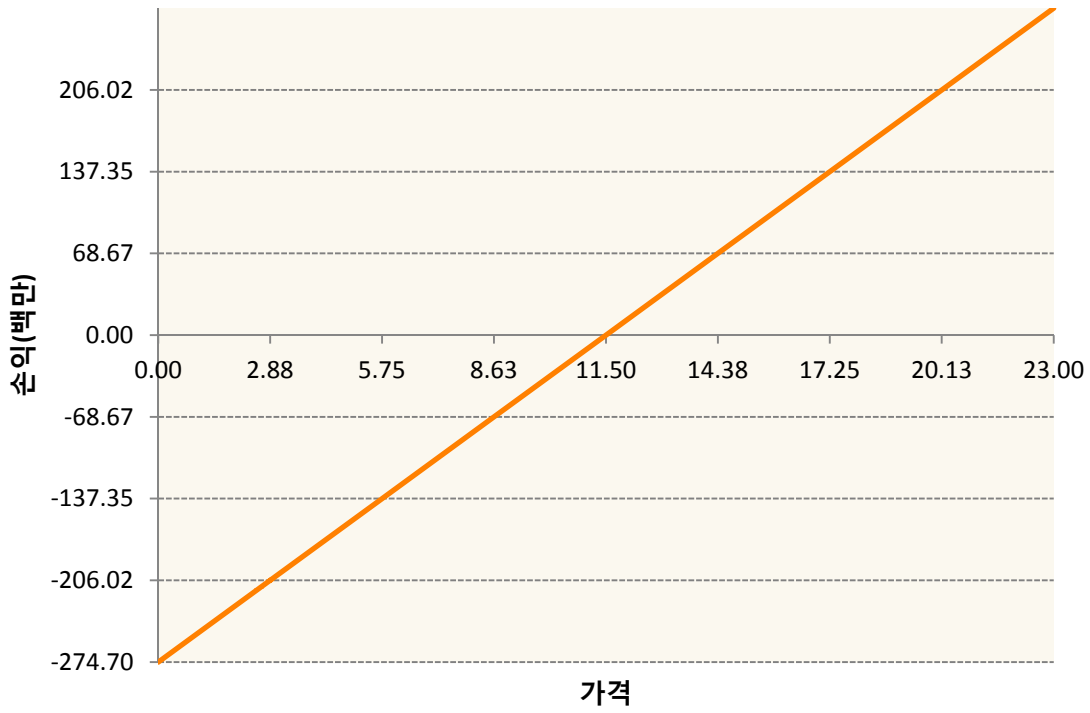
KR4175NA0007-2018-10 달러선물



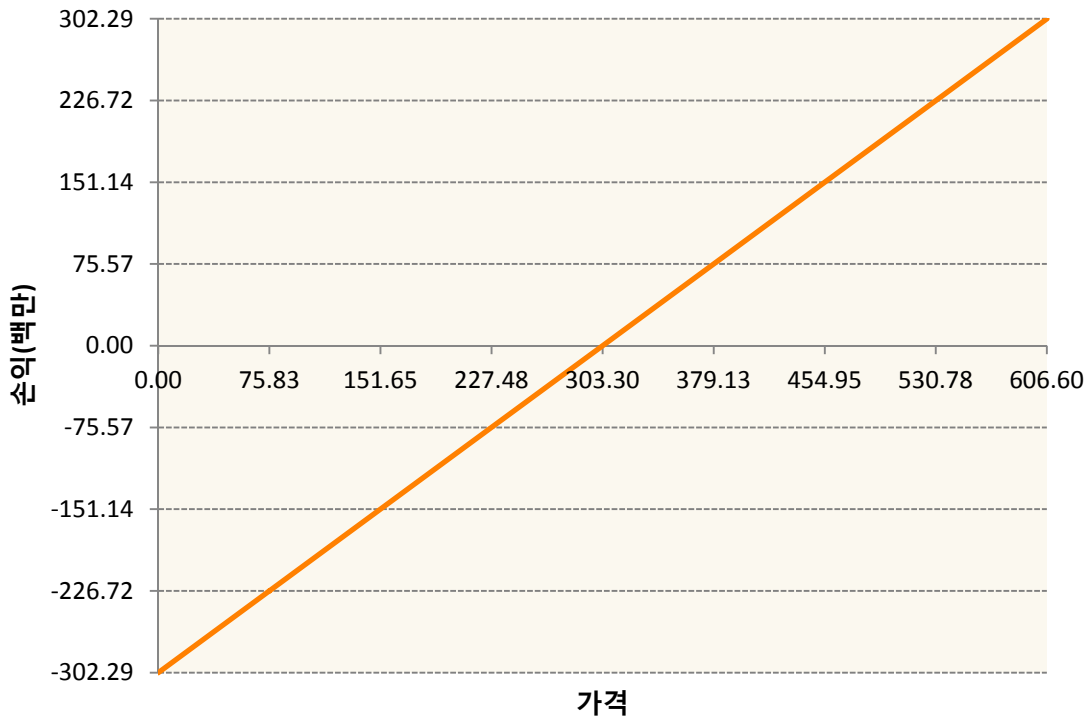
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



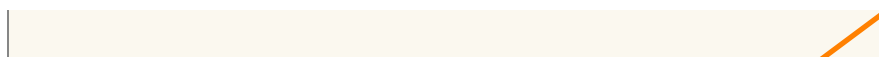
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

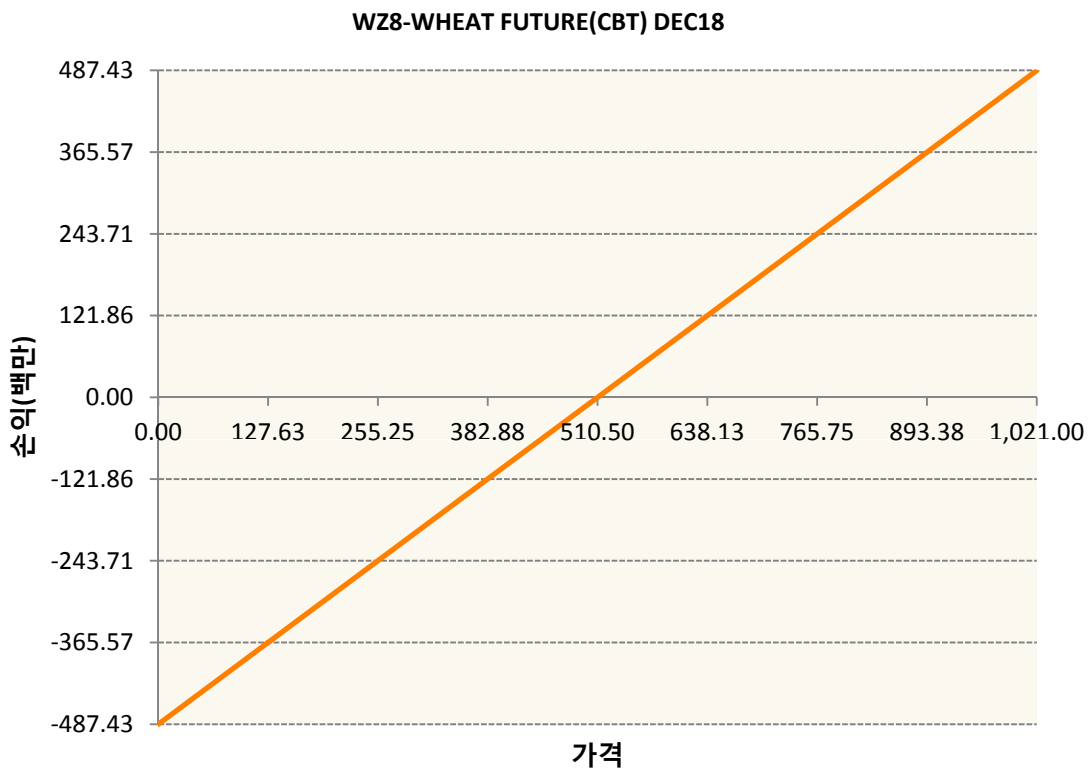
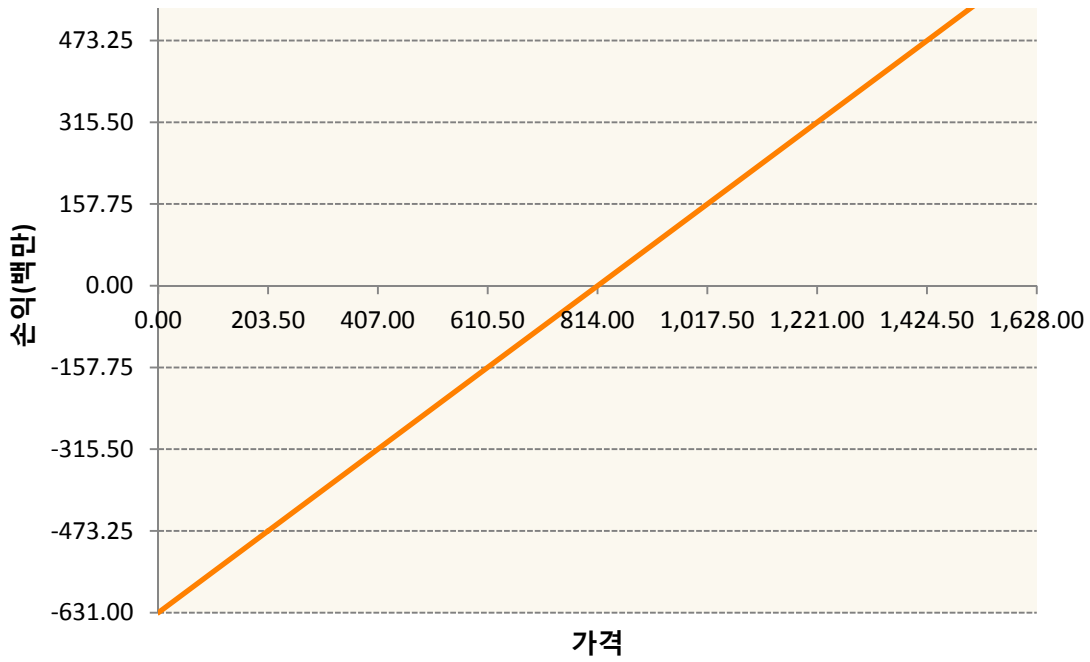


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	22
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	14
CZ8	CORN FUTURE DEC18	62
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	50
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	39

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

(단위:백만원)

300