

공시일	2018-10-04
기준일	2018-10-02

## 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	2018-10-04
기준일	2018-10-02

## 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

1,163

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

493

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-04
기준일	2018-10-02

## 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)

SWCSI50000 신한CSI500미래S180910

293

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

375

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-04
기준일	2018-10-02

## 유로인덱스모(주식-파생형)

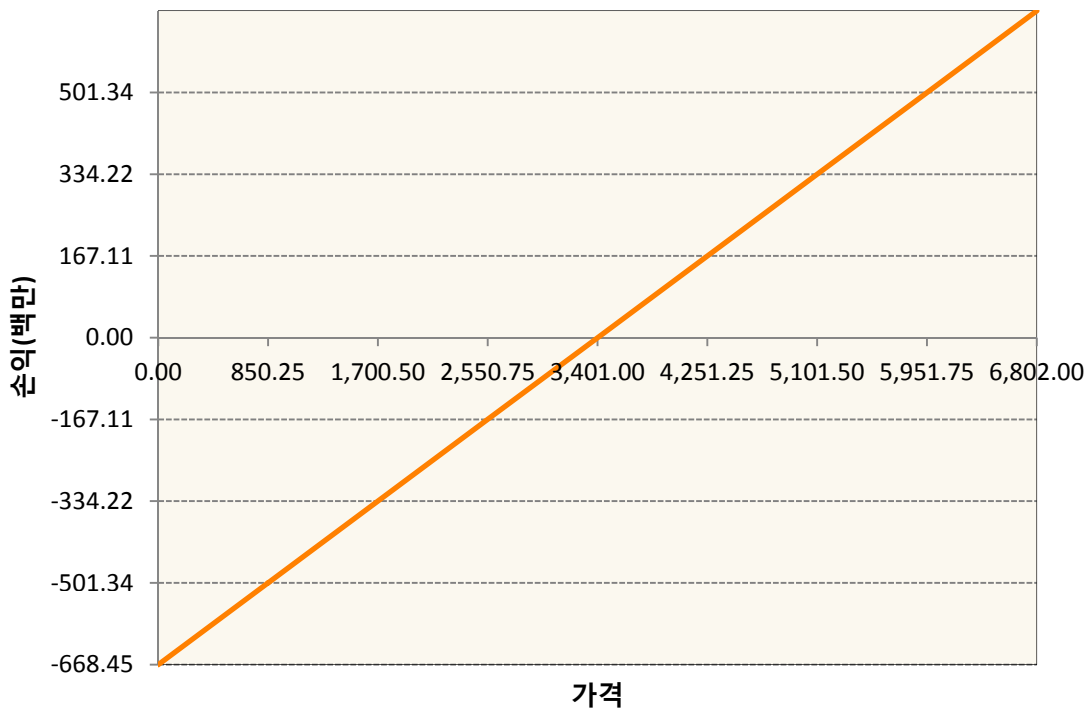
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	668	0	668	

### 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)

33
----

공시일	2018-10-04
기준일	2018-10-02

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

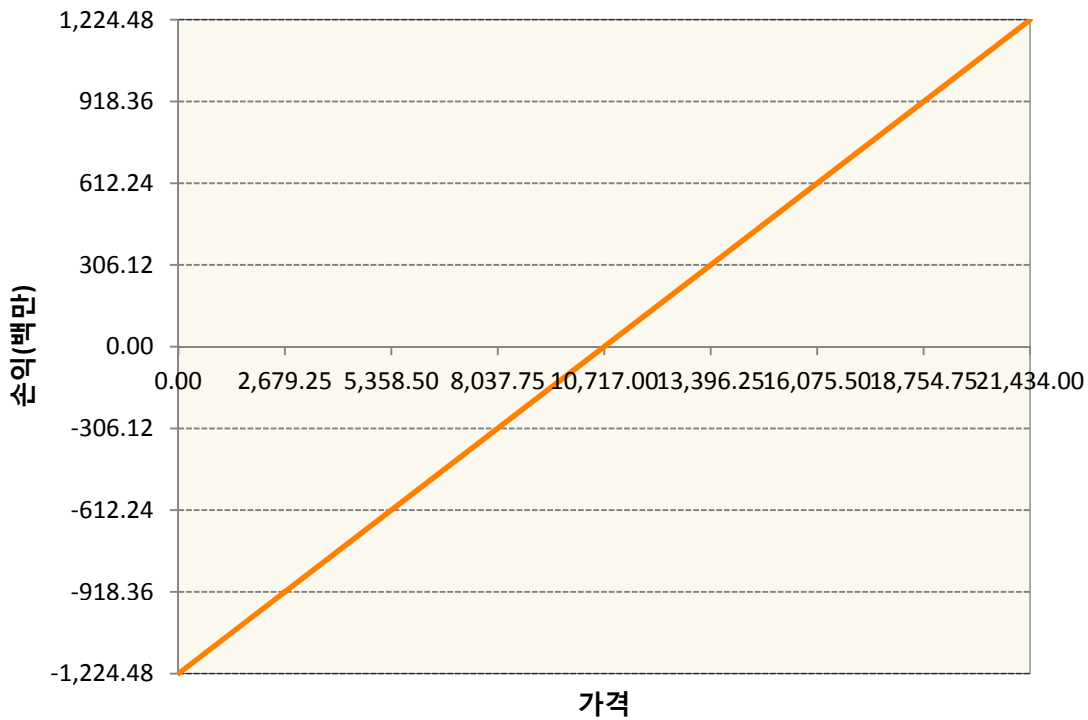
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

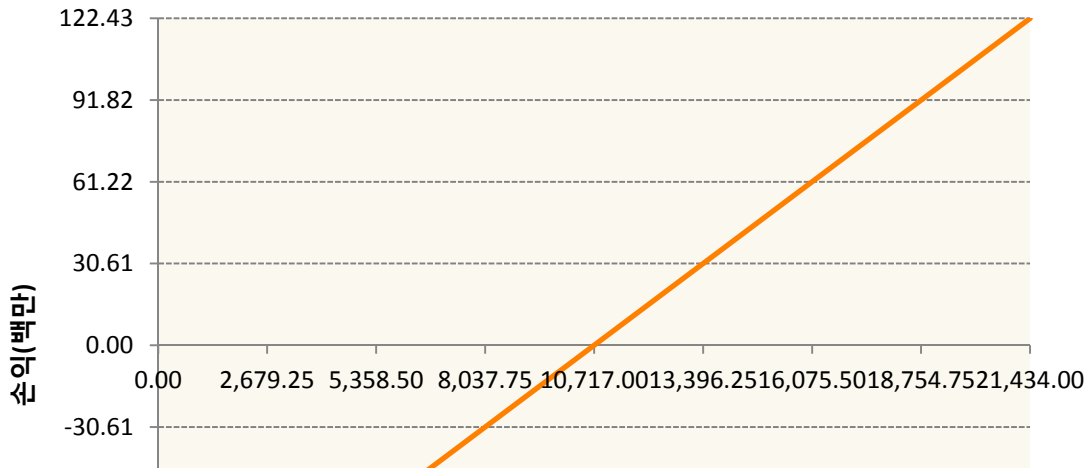
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,347	0	1,347	장내

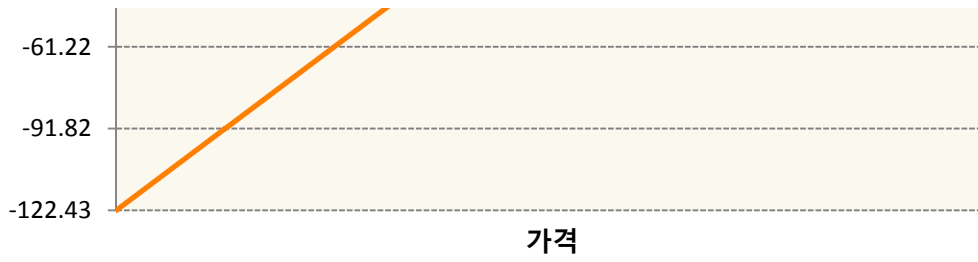
### 2. 만기시점의 손익구조

HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



MHCV8-MINI H-SHR IDX FU OCT 18





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	98
MHCV8	MINI H-SHR IDX FU OCT 18	10

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

<b>101</b>
------------

공시일	2018-10-04
기준일	2018-10-02

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

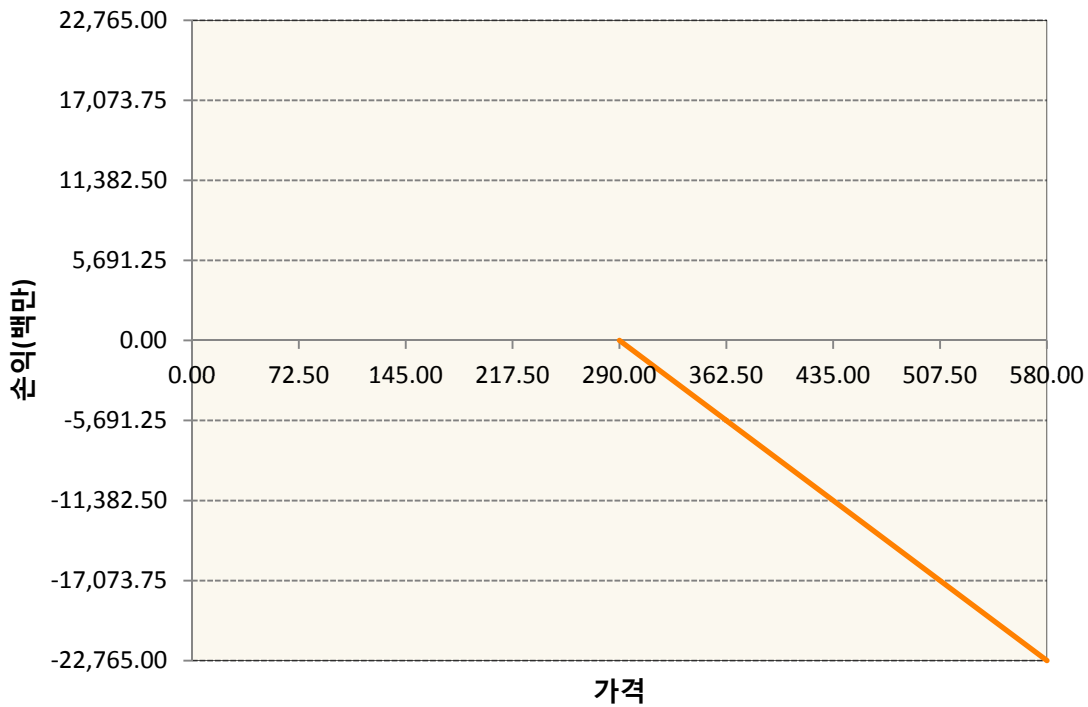
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

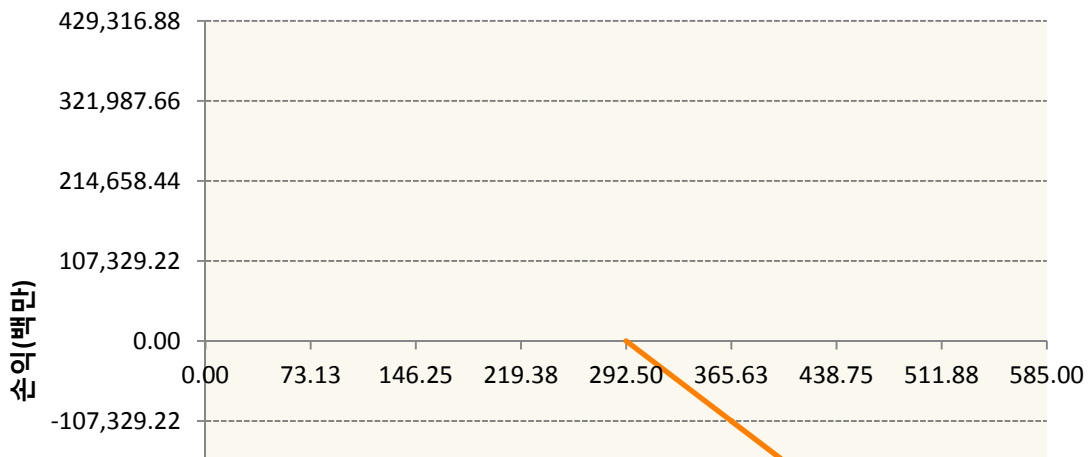
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	727,032	-727,032	장내

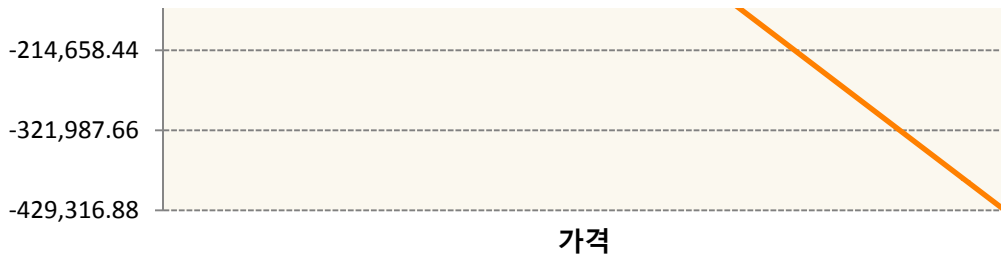
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201NA2902-2018-10 콜290**

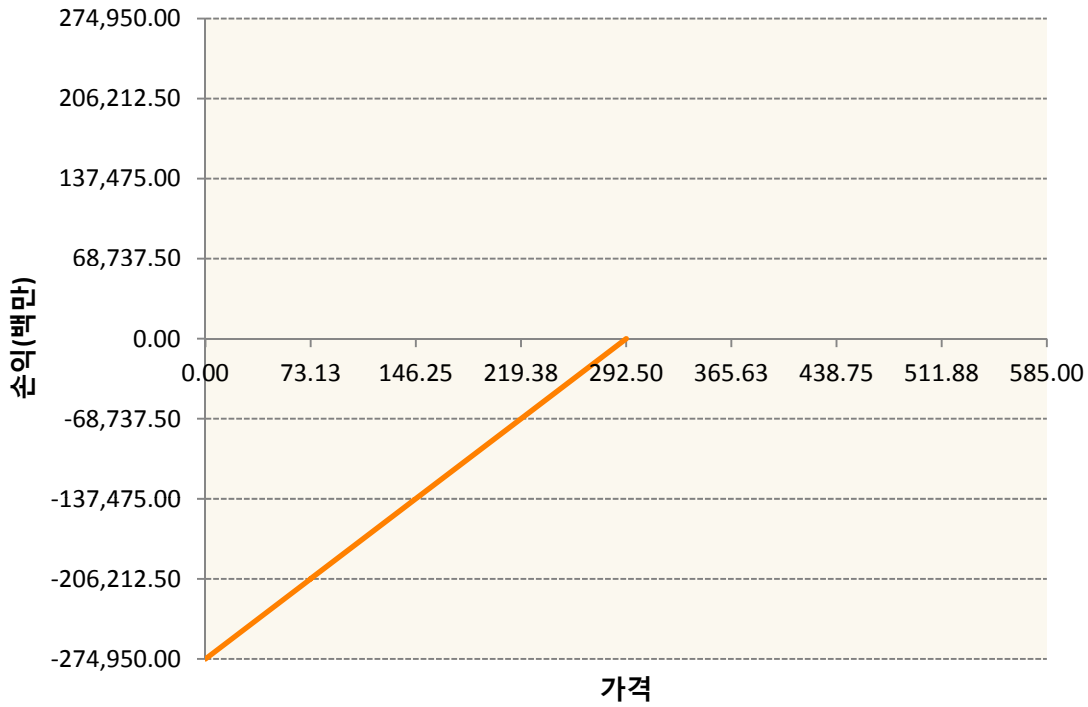


**KR4201NA2928-2018-10 콜292.5**





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NA2927-2018-10 콜290

1,692

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	689	683	675	665	654	640	625
-5.33%	640	621	599	576	553	528	502
-2.67%	460	429	397	365	334	302	270
0%	81	55	28	0	-28	-57	-87
2.67%	-456	-467	-481	-497	-515	-534	-555
5.33%	-1,059	-1,062	-1,066	-1,072	-1,080	-1,090	-1,102
8.00%	-1,677	-1,677	-1,678	-1,680	-1,683	-1,686	-1,692

KR4201NA2927-2018-10 풋292.5

30,509

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,544	10,477	10,379	10,247	10,081	9,883	9,654

-5.33%	10,000	9,723	9,406	9,054	8,673	8,267	7,841	
-2.67%	7,598	7,045	6,484	5,918	5,346	4,771	4,193	
0%	1,698	1,140	573	0	-578	-1,160	-1,746	
2.67%	-7,576	-7,877	-8,219	-8,597	-9,004	-9,435	-9,887	
5.33%	-18,590	-18,681	-18,810	-18,978	-19,182	-19,422	-19,695	
8.00%	-30,101	-30,117	-30,149	-30,201	-30,276	-30,379	-30,509	
KR4301NA29 2018-10 풋 292.5							17,810	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-17,807	-17,807	-17,807	-17,808	-17,808	-17,809	-17,810	
-5.33%	-10,380	-10,383	-10,391	-10,403	-10,421	-10,445	-10,477	
-2.67%	-3,297	-3,410	-3,532	-3,660	-3,794	-3,933	-4,075	
0%	363	250	129	0	-135	-274	-417	
2.67%	701	696	687	673	651	623	586	
5.33%	703	703	703	703	702	701	698	
8.00%	703	703	703	703	703	703	703	

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

(단위:백만원)

**55,510**

공시일	2018-10-04
기준일	2018-10-02

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

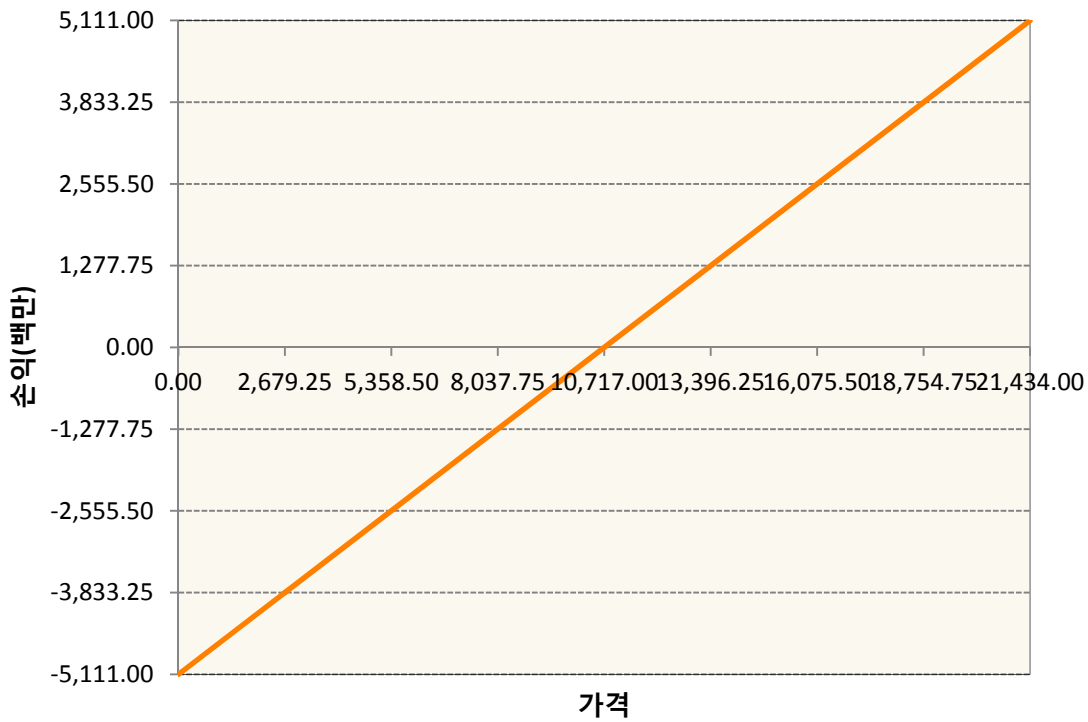
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

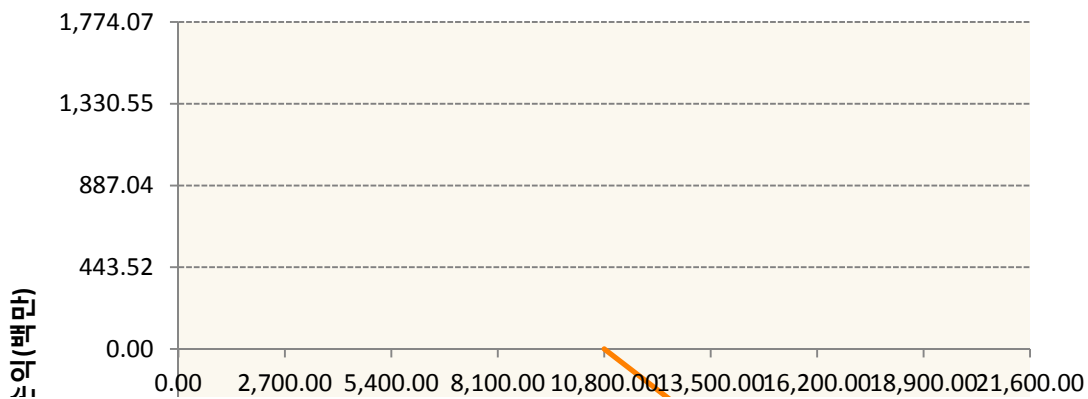
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,111	0	5,111	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,719	-11,719	장내

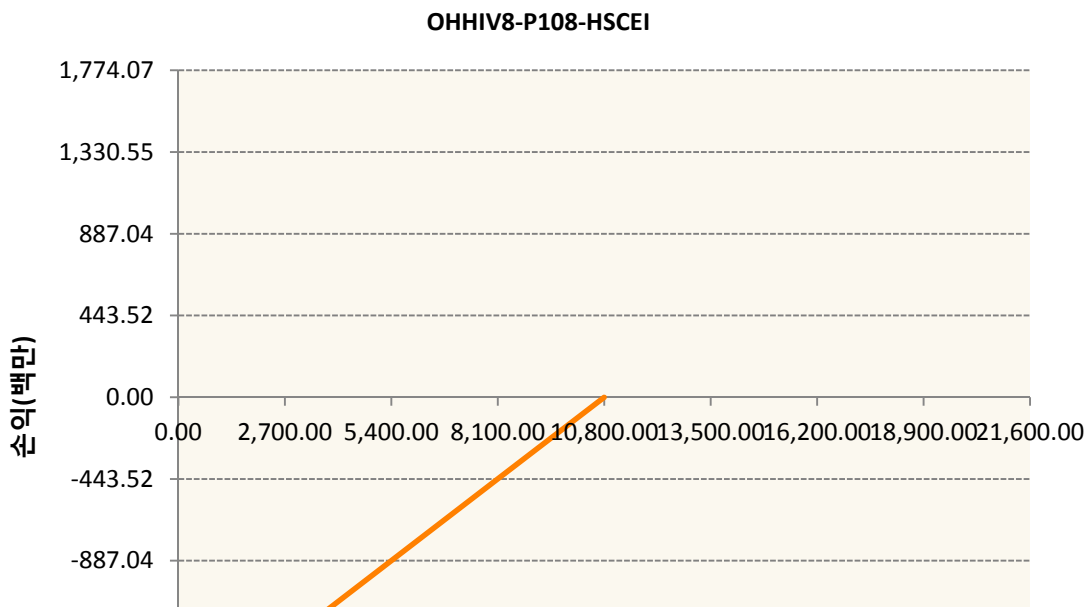
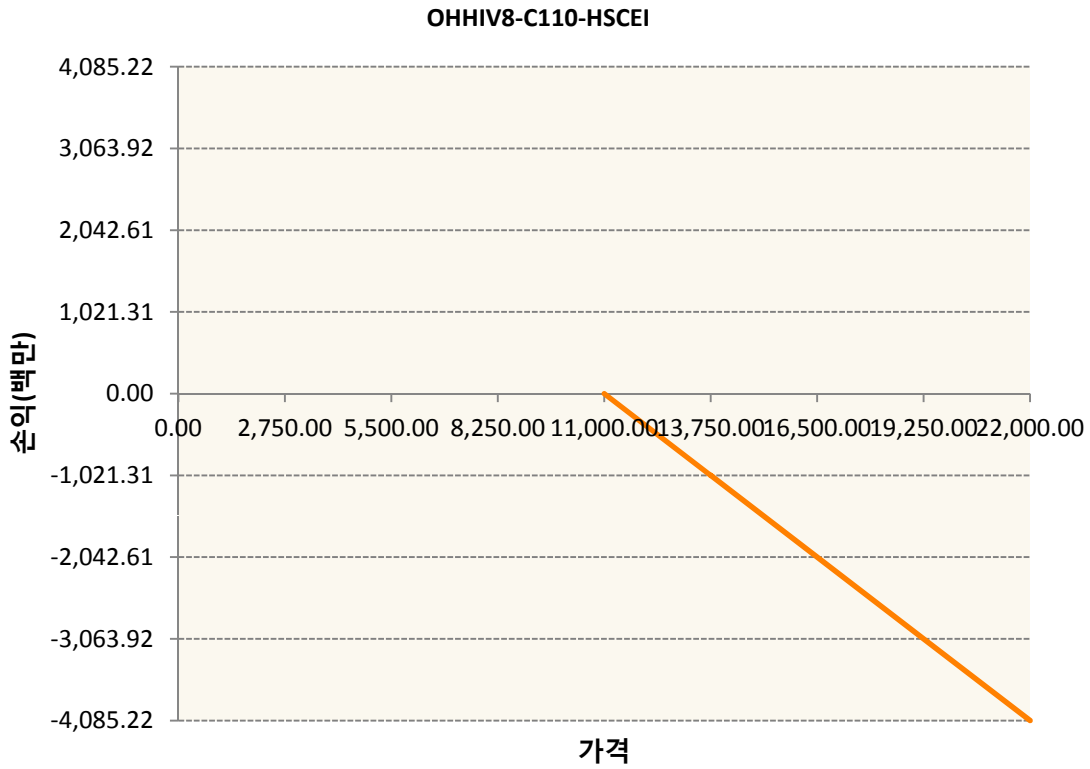
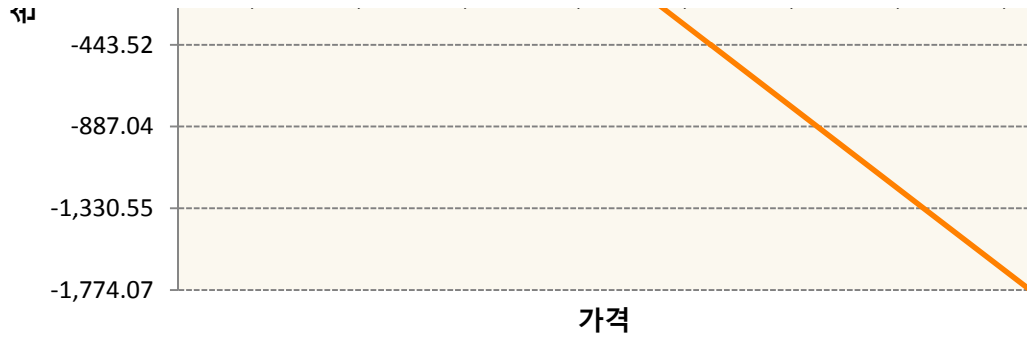
### 2. 만기시점의 손익구조

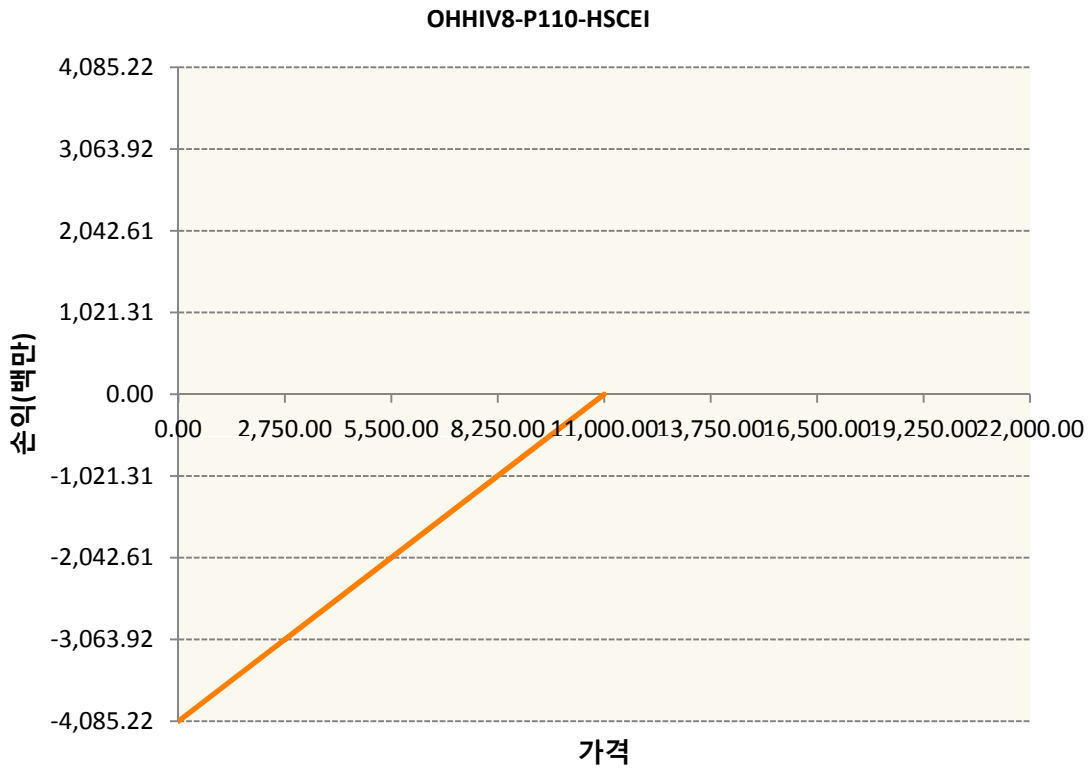
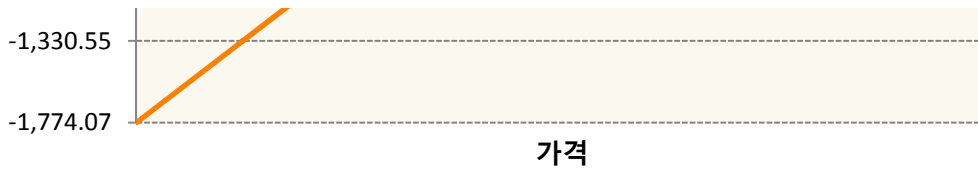
HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



OHHIV8-C108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	409
OHHIV8-C1C	HSCEI	142
OHHIV8-C11	HSCEI	327
OHHIV8-P1C	HSCEI	142
OHHIV8-P11	HSCEI	327

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,257

공시일	2018-10-04
기준일	2018-10-02

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

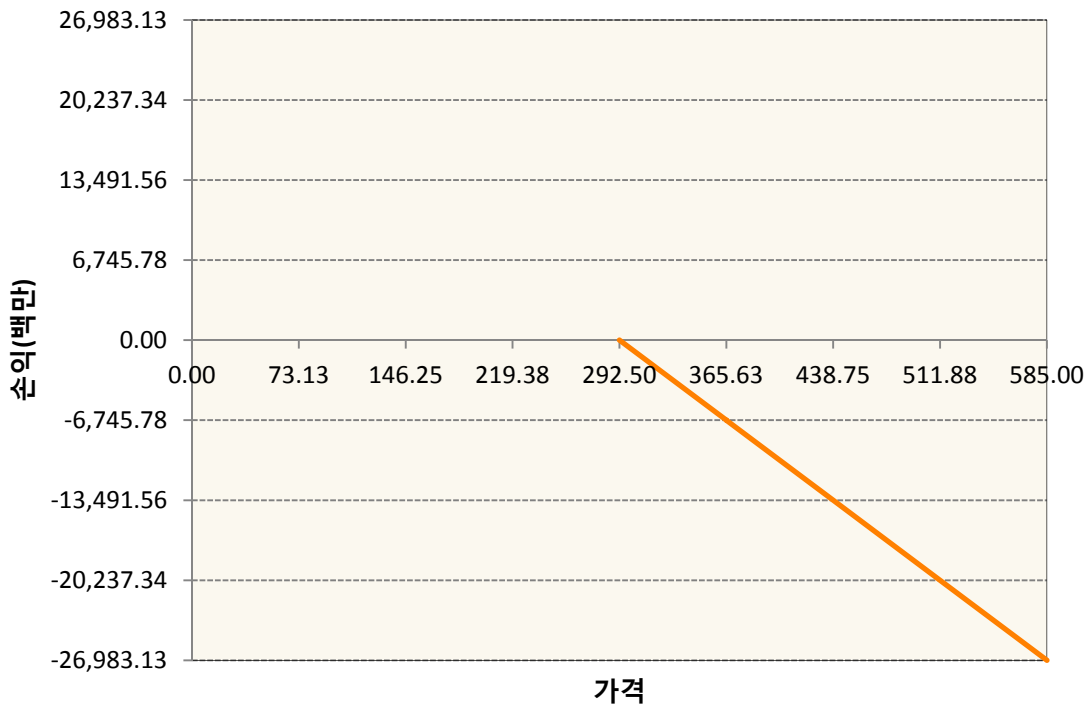
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

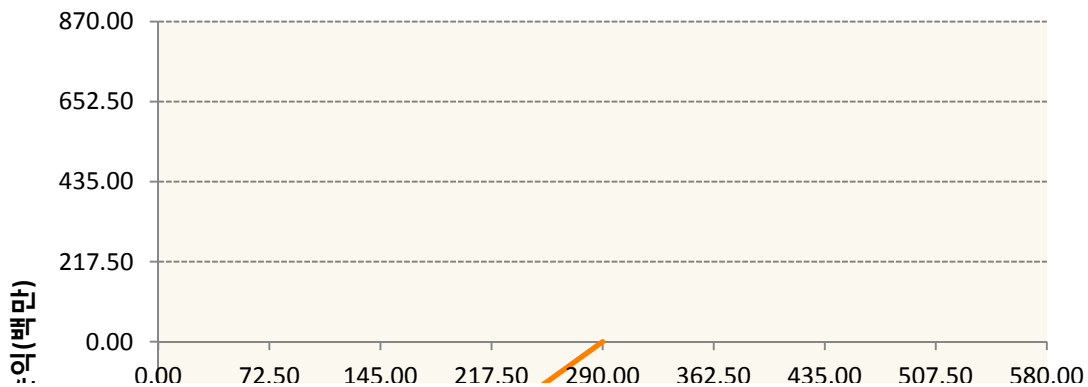
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	572	0	572	장내
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	47,451	-47,451	장내

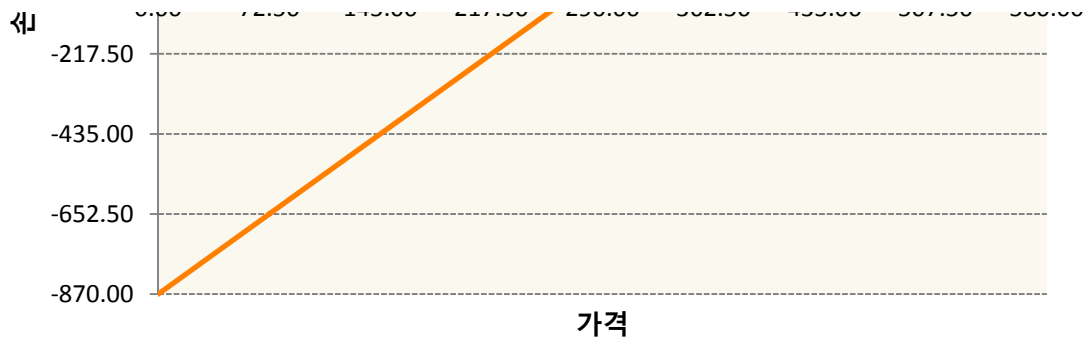
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201NA2928-2018-10 콜292.5

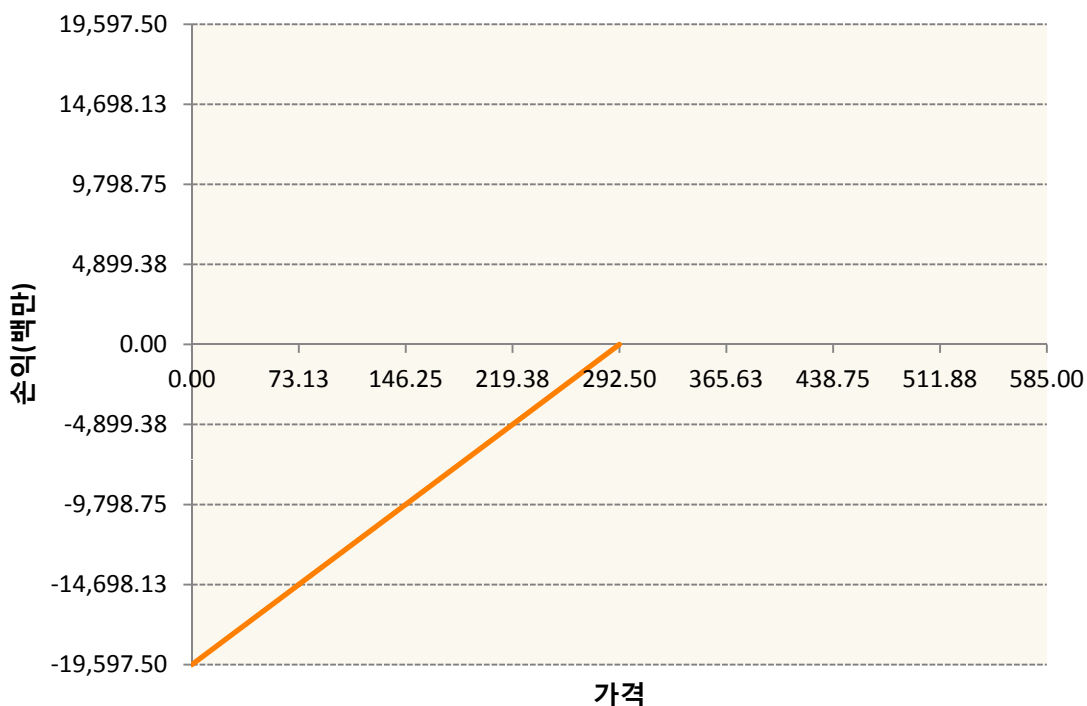


KR4301NA2901-2018-10 풋290





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,998
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,998	-3,998	-3,998	-3,998	-3,998	-3,998	-3,998
-5.33%	-2,666	-2,666	-2,666	-2,666	-2,666	-2,666	-2,666
-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%	2,666	2,666	2,666	2,666	2,666	2,666	2,666
8.00%	3,998	3,998	3,998	3,998	3,998	3,998	3,998
KR4201NA2927-2018-10 풋292.5							1,918
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	663	659	652	644	634	621	607
-5.33%	629	611	591	569	545	520	493
-2.67%	478	443	408	372	336	300	264
0%	107	72	36	0	-36	-73	-110
2.67%	-476	-495	-517	-540	-566	-593	-621
5.33%	-1,168	-1,174	-1,182	-1,193	-1,206	-1,221	-1,238
8.00%	-1,892	-1,893	-1,895	-1,898	-1,903	-1,909	-1,918

KR4301NA2☞ 2018-10 풋290

51

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
-5.33%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-28
-2.67%	-6	-7	-7	-8	-8	-9	-9
0%	1	0	0	0	0	-1	-1
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

1,269

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,269	-1,269	-1,269	-1,269	-1,269	-1,269	-1,269
-5.33%	-740	-740	-741	-741	-743	-745	-747
-2.67%	-235	-243	-252	-261	-270	-280	-290
0%	26	18	9	0	-10	-20	-30
2.67%	50	50	49	48	46	44	42
5.33%	50	50	50	50	50	50	50
8.00%	50	50	50	50	50	50	50

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

(단위:백만원)

7,584

공시일	2018-10-04
기준일	2018-10-02

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

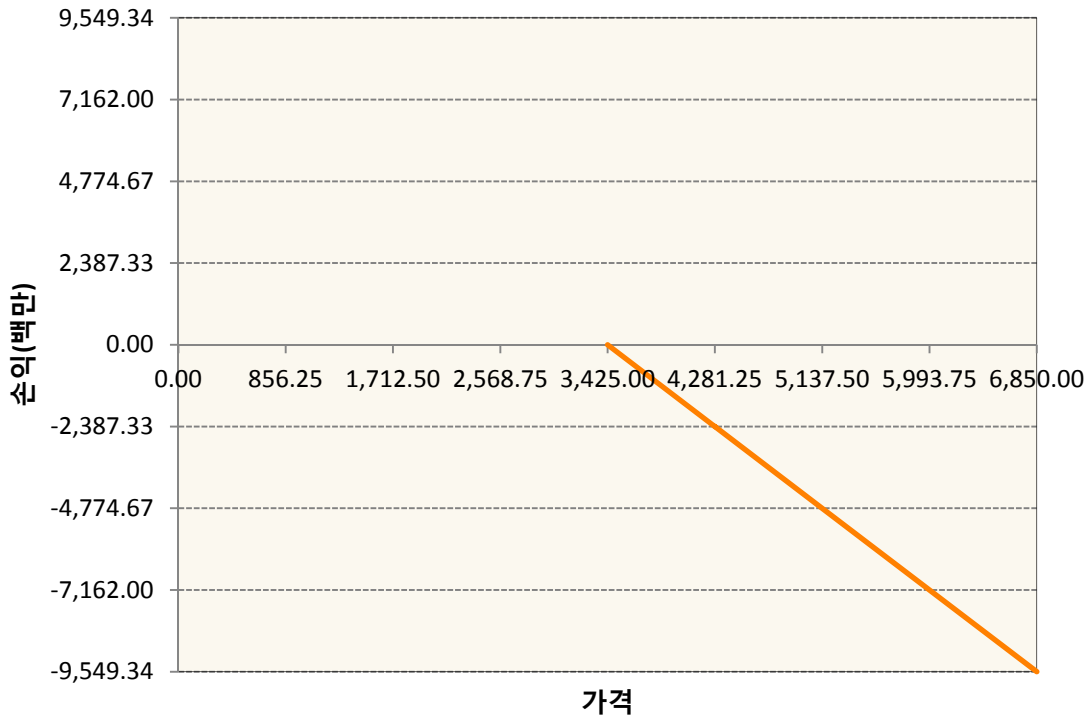
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

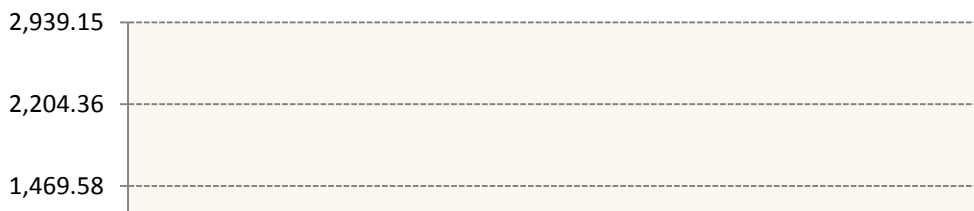
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,620	0	5,620	
누계	유가증권	스왑	34,086	0	34,086	장외
누계	유가증권	옵션	0	24,977	-24,977	장내
누계	지수	스왑	52,402	0	52,402	장외

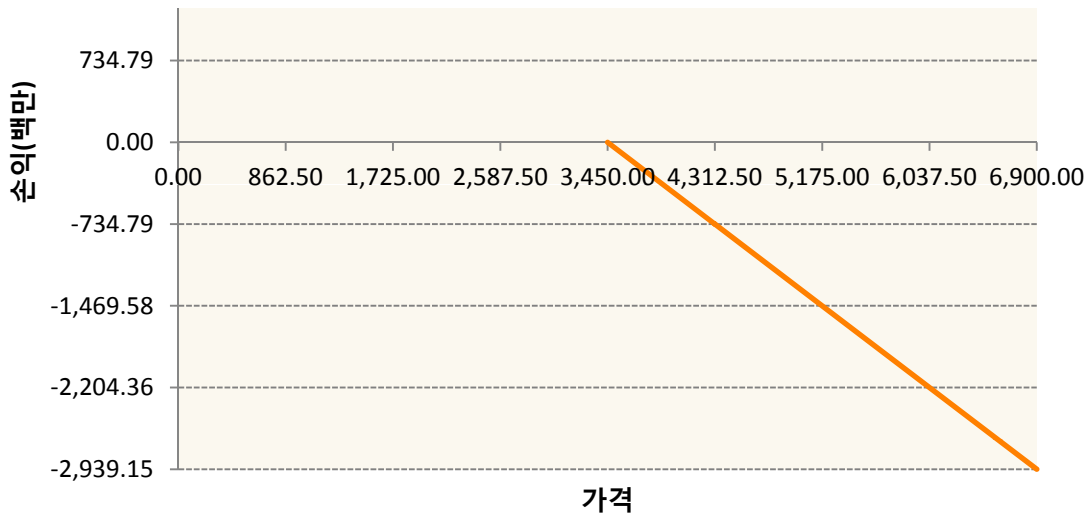
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXV8-C3425-EURO STOXX 50**

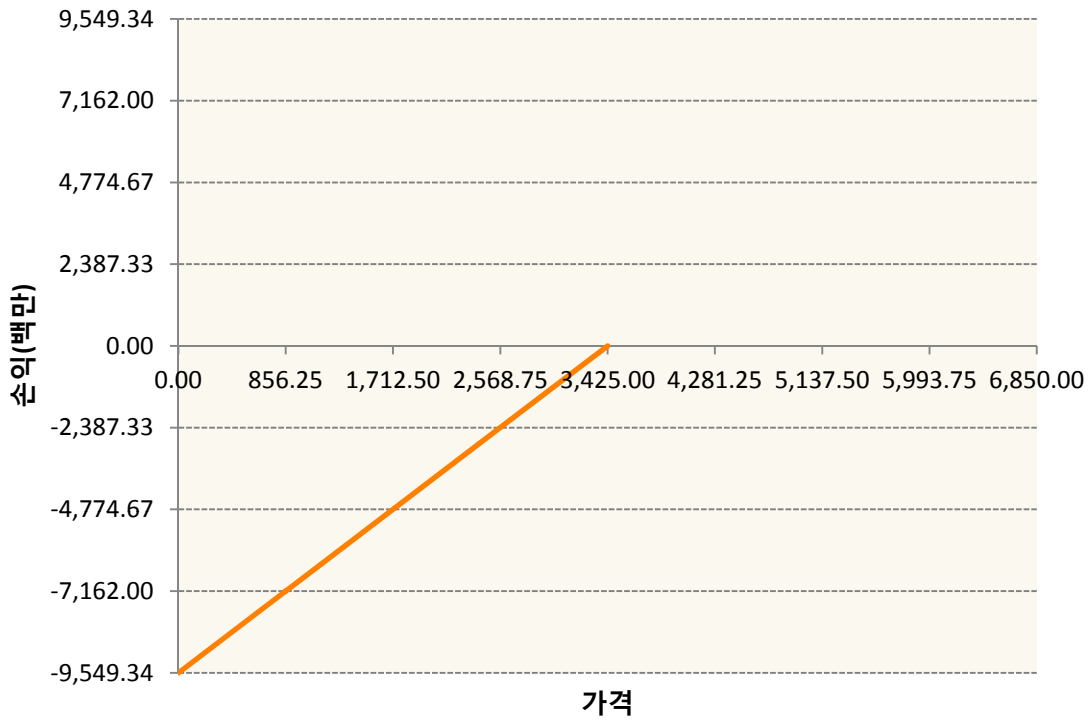


**OESXV8-C3450-EURO STOXX 50**

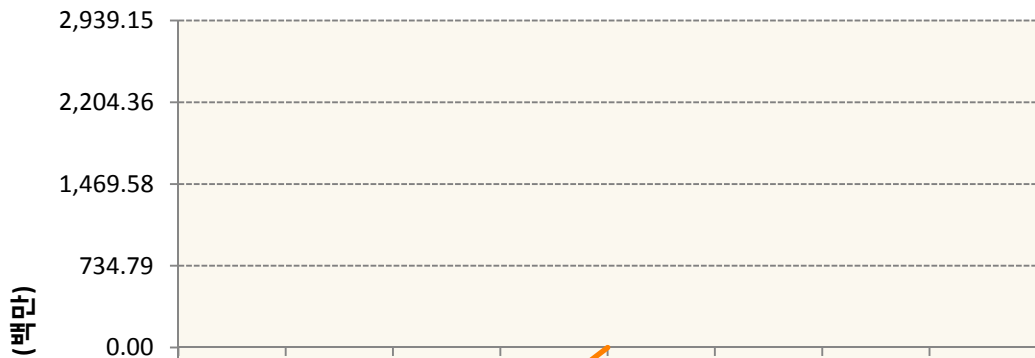


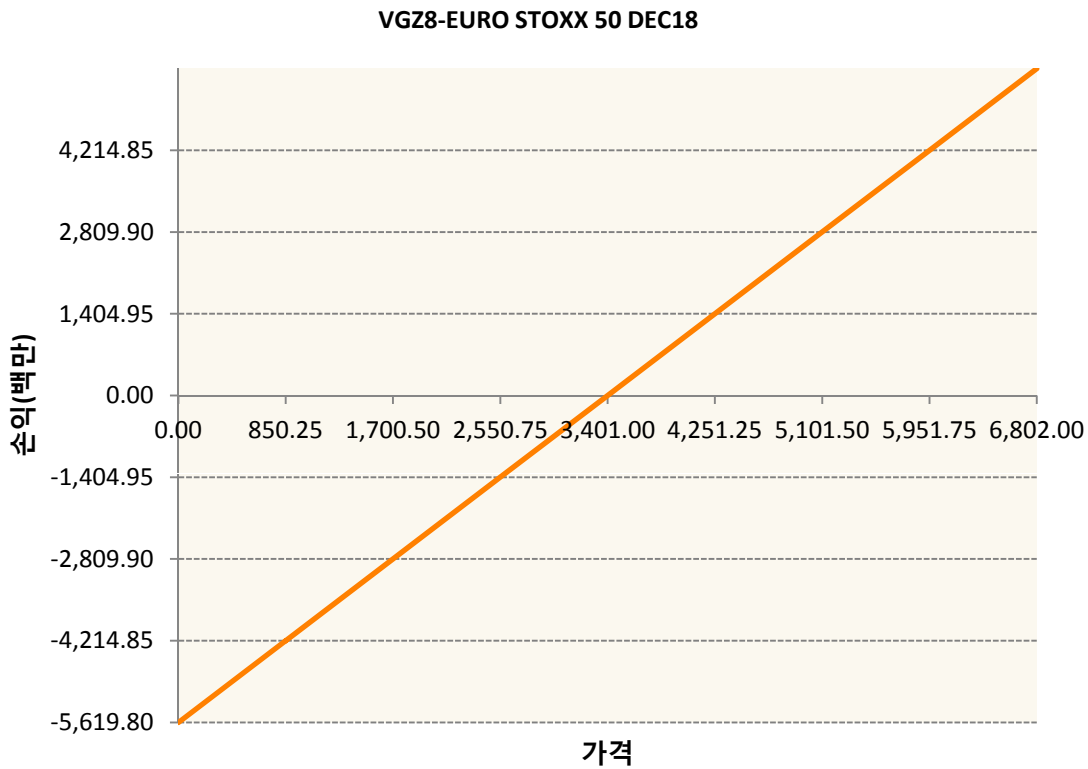
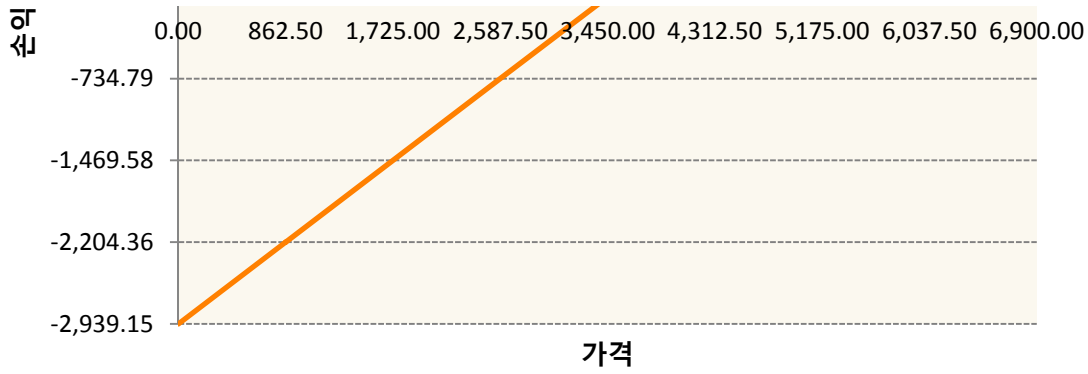


**OESXV8-P3425-EURO STOXX 50**



**OESXV8-P3450-EURO STOXX 50**





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		9
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		6
OESXV8-C34 EURO STOXX 50		764
OESXV8-C34 EURO STOXX 50		235
OESXV8-P34 EURO STOXX 50		764
OESXV8-P34 EURO STOXX 50		235
VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18		450

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





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

(단위:백만원)

1,136



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

(단위:백만원)

89



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

(단위:백만원)

134



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

(단위:백만원)

163



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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-10-04
기준일	2018-10-02

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

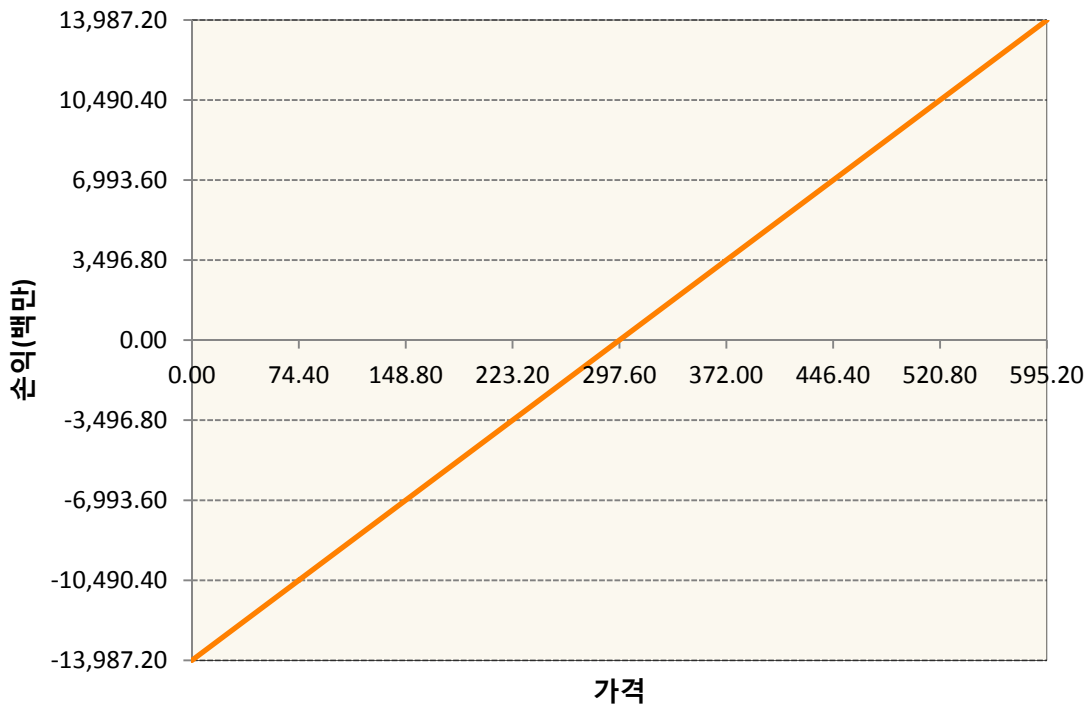
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

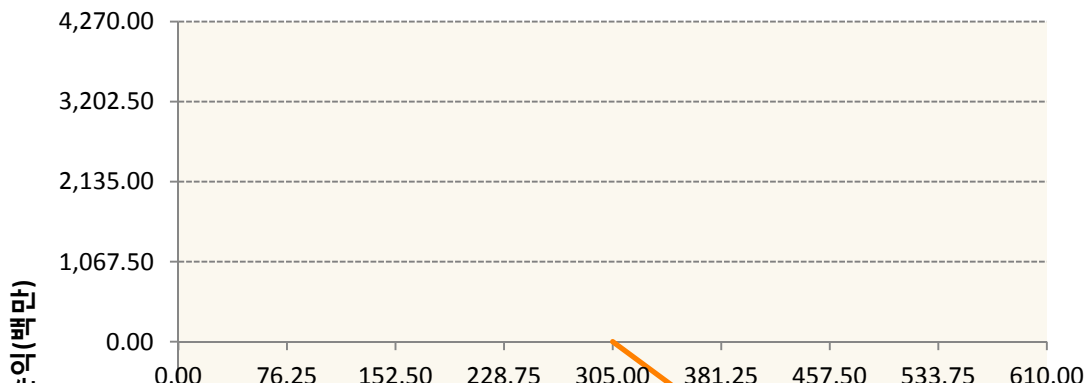
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,987	0	13,987	장내
누계	유가증권	옵션	2,119	24,488	-22,369	장내

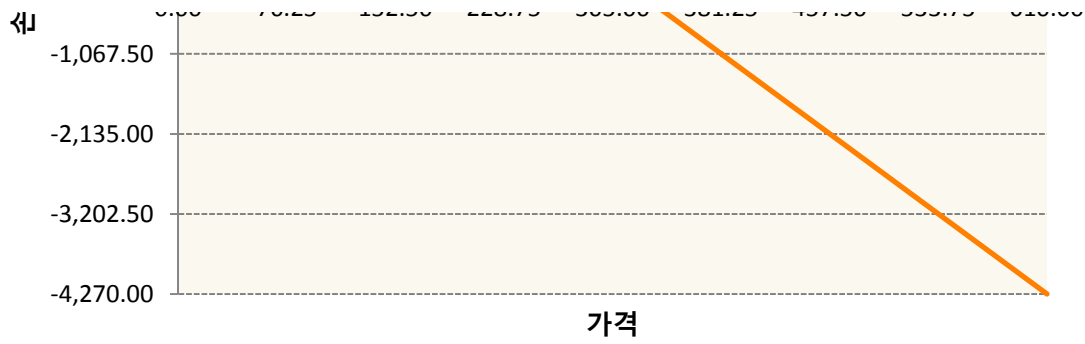
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

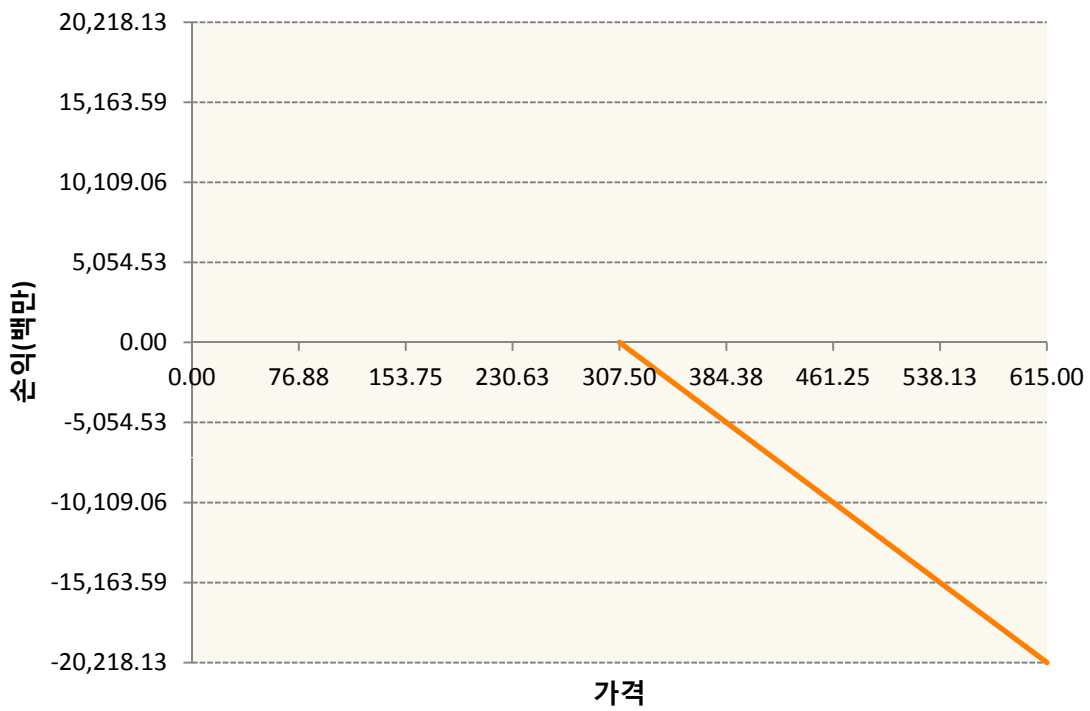


KR4201NA3058-2018-10 콜305

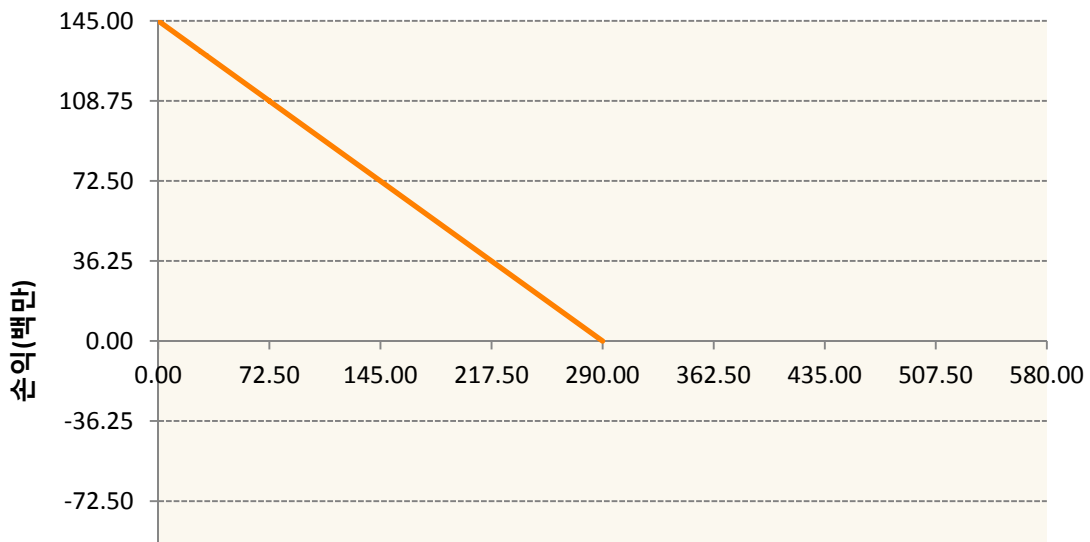


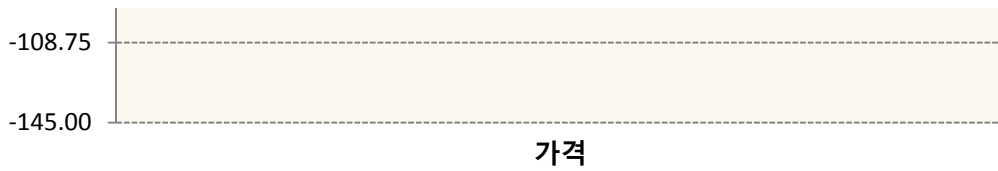


**KR4201NA3074-2018-10 콜307.5**

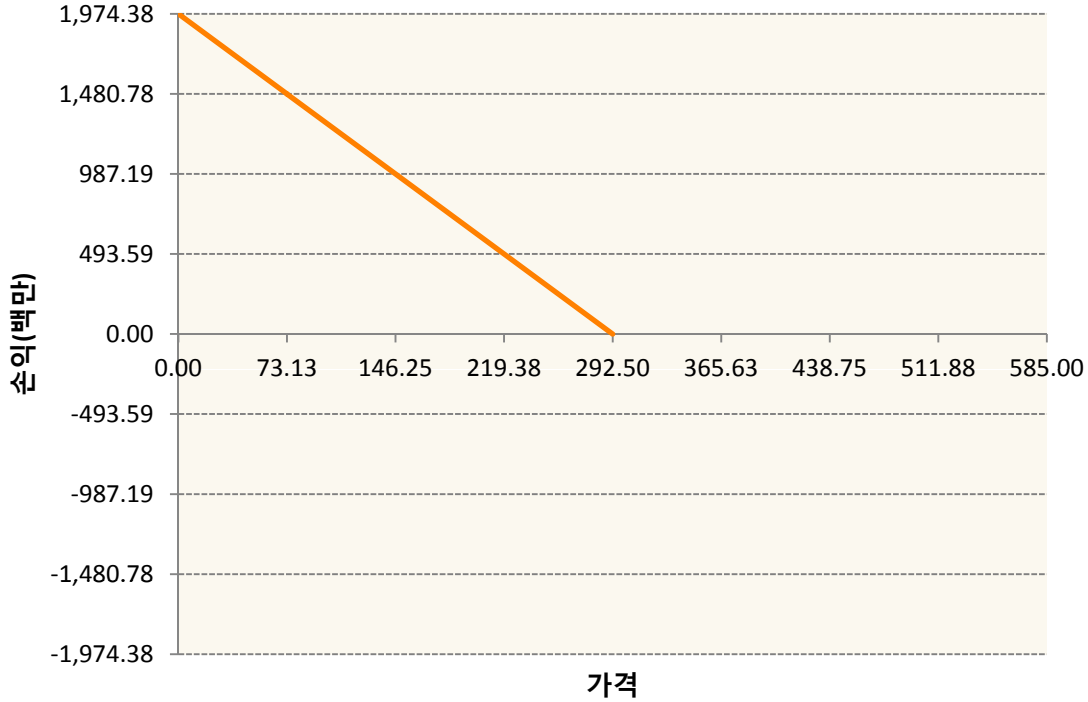


**KR4301NA2901-2018-10 풋290**





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 1,115

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,115	-1,115	-1,115	-1,115	-1,115	-1,115	-1,115
-5.33%	-743	-743	-743	-743	-743	-743	-743
-2.67%	-372	-372	-372	-372	-372	-372	-372
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	372	372	372	372	372	372	372
5.33%	743	743	743	743	743	743	743
8.00%	1,115	1,115	1,115	1,115	1,115	1,115	1,115

KR4201NA3(2018-10 콜305) 209

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	27	27	27	27	26	26	26
-5.33%	27	26	26	25	24	23	21
-2.67%	25	23	21	19	16	13	10

0%	13	9	5	0	-5	-10	-15
2.67%	-23	-29	-35	-41	-47	-53	-59
5.33%	-94	-98	-103	-109	-114	-119	-125
8.00%	-190	-192	-195	-198	-201	-205	-209

KR4201NA3(2018-10 콜307.5

885

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	90	90	90	90	89	88	86
-5.33%	90	89	88	86	83	78	73
-2.67%	85	81	74	66	56	45	32
0%	51	36	19	0	-20	-41	-62
2.67%	-75	-102	-130	-157	-185	-212	-240
5.33%	-356	-382	-408	-435	-462	-489	-516
8.00%	-778	-792	-808	-825	-844	-864	-885

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	5	5	5	5	5	5
-2.67%	1	1	1	1	1	1	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

128

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	128	128	128	128	128	128	128
-5.33%	75	75	75	75	75	75	75
-2.67%	24	24	25	26	27	28	29
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-5	-5	-5	-5	-5	-4	-4
5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5

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

(단위:백만원)

1,830

공시일	2018-10-04
기준일	2018-10-02

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

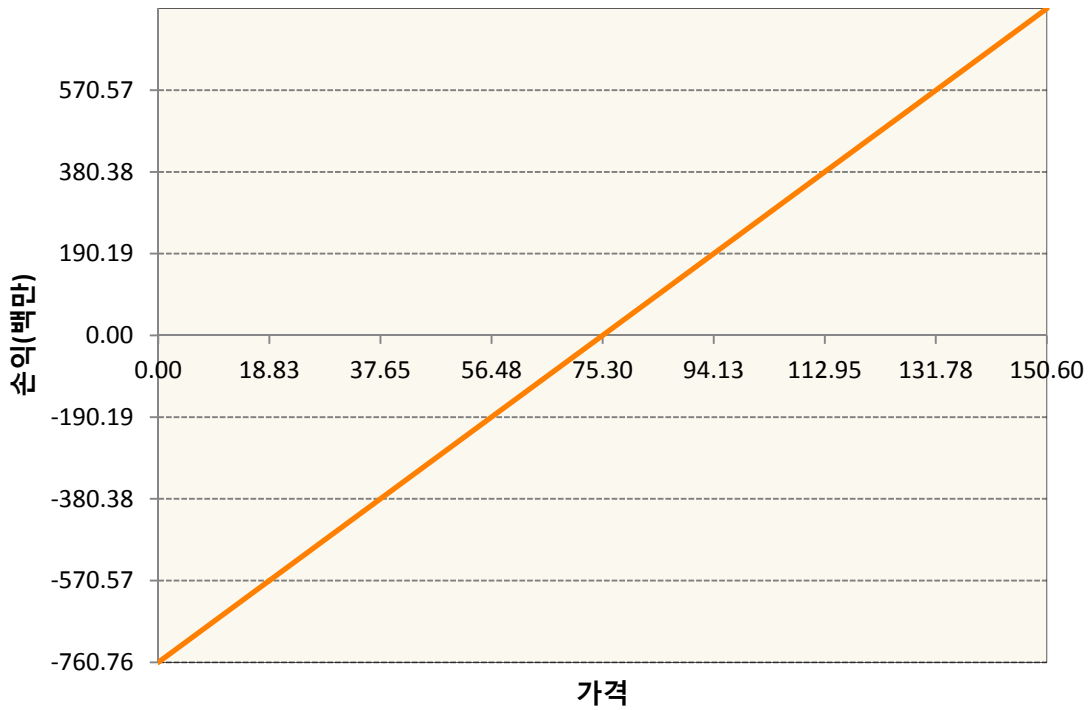
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

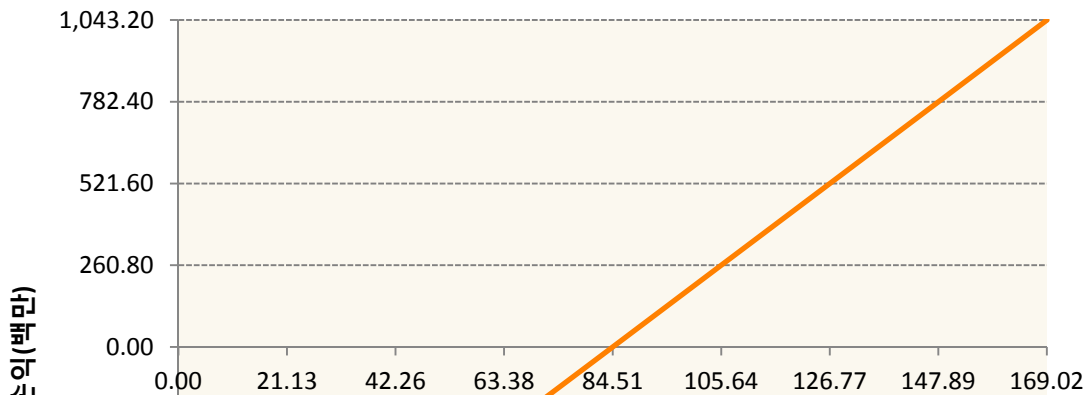
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,313	615	2,698	
누계	유가증권	선물	454	0	454	장내

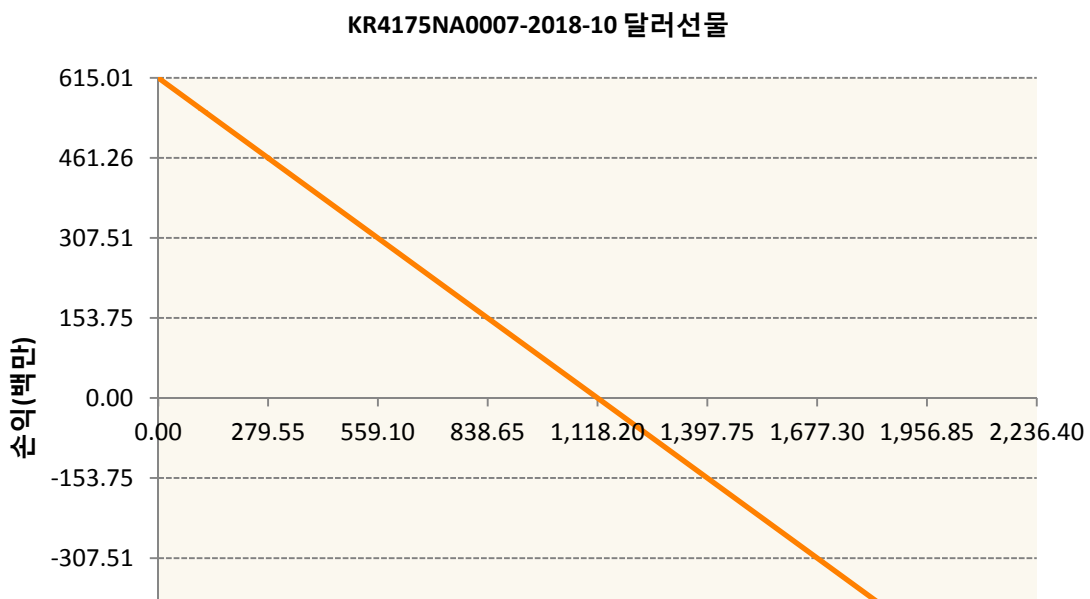
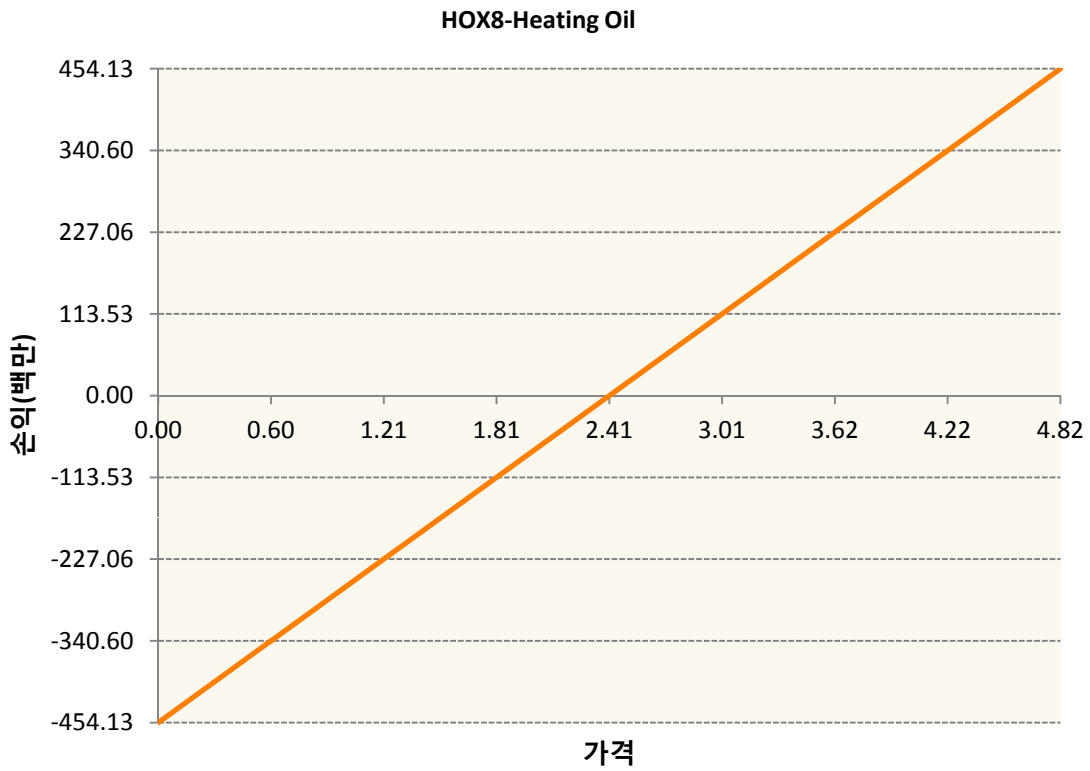
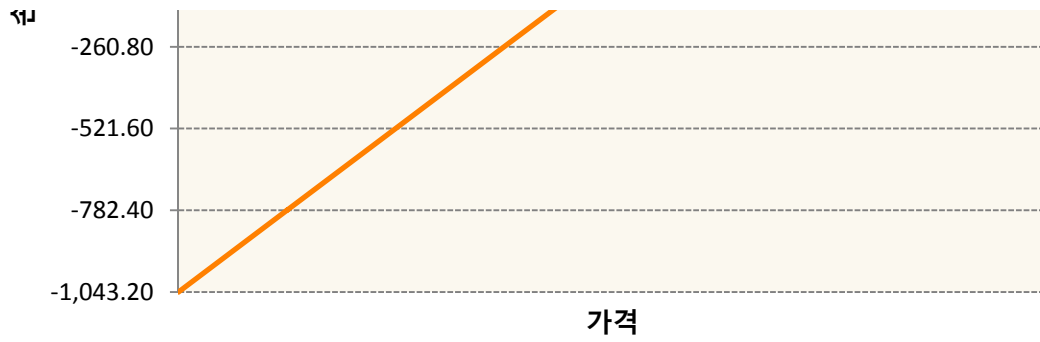
### 2. 만기시점의 손익구조

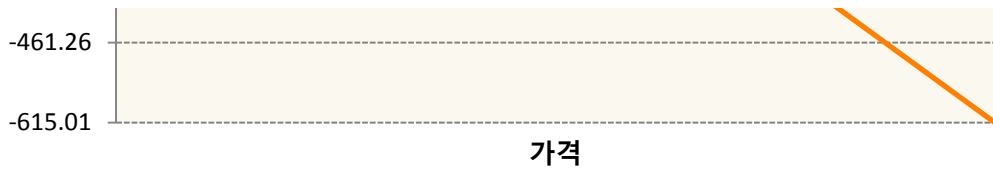
CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18



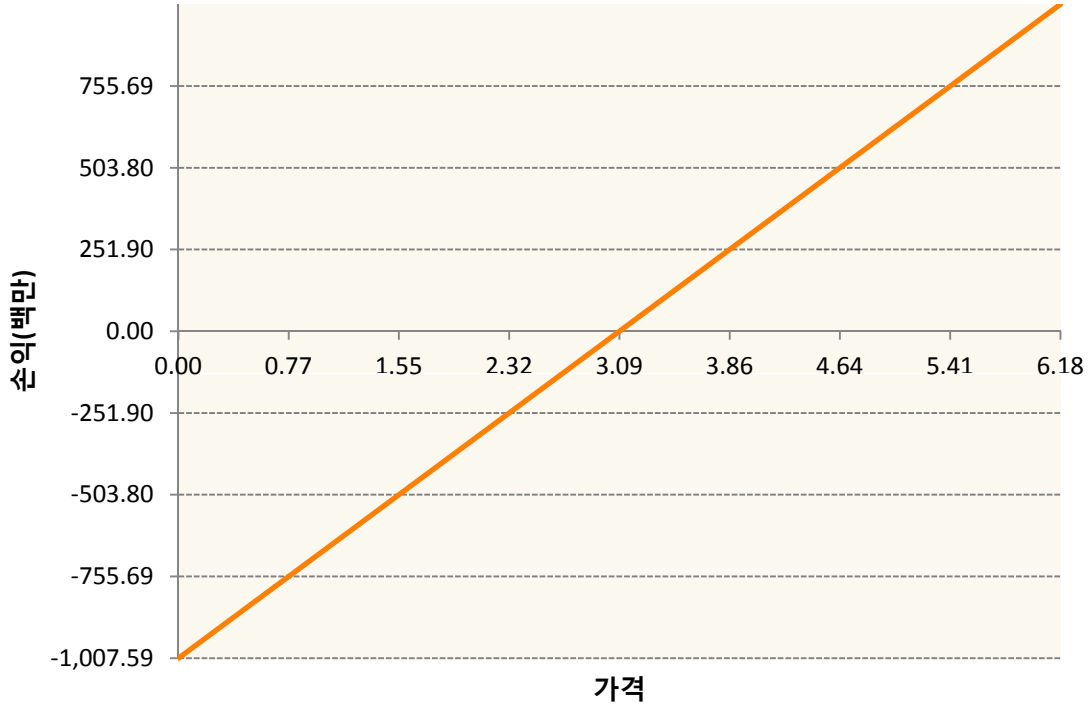
COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19



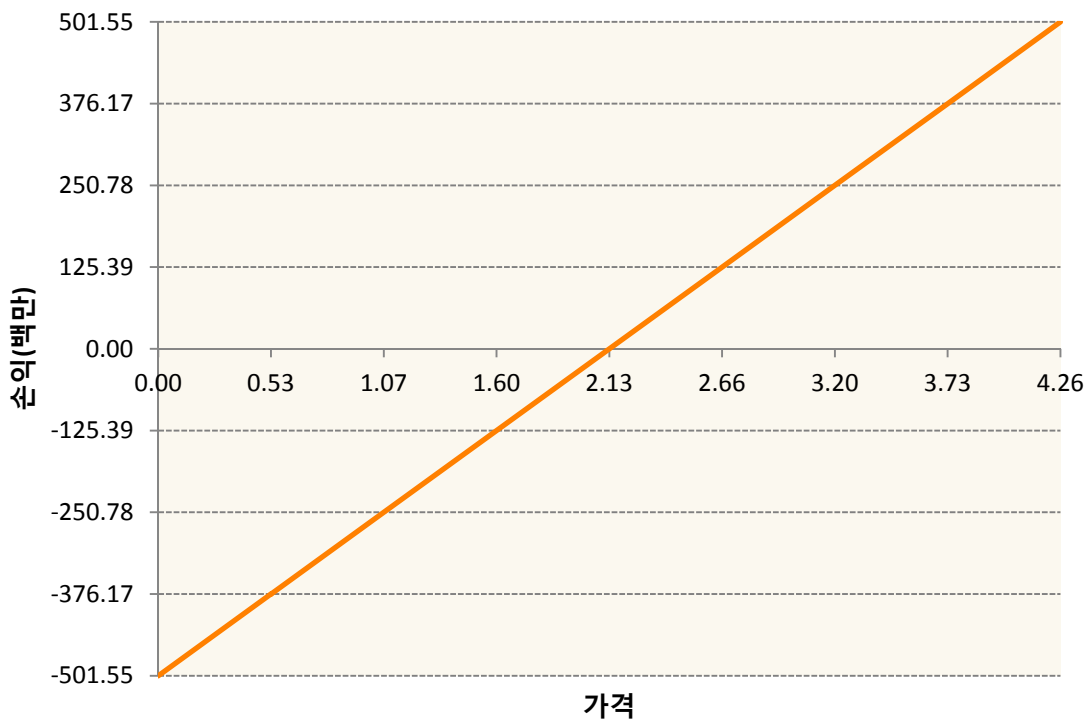




**NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18**



**XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18**



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	61
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	83
HOX8	Heating Oil	36
	KR4175NA0(2018-10 달러선물	49
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	81
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	40

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	454

공시일	2018-10-04
기준일	2018-10-02

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

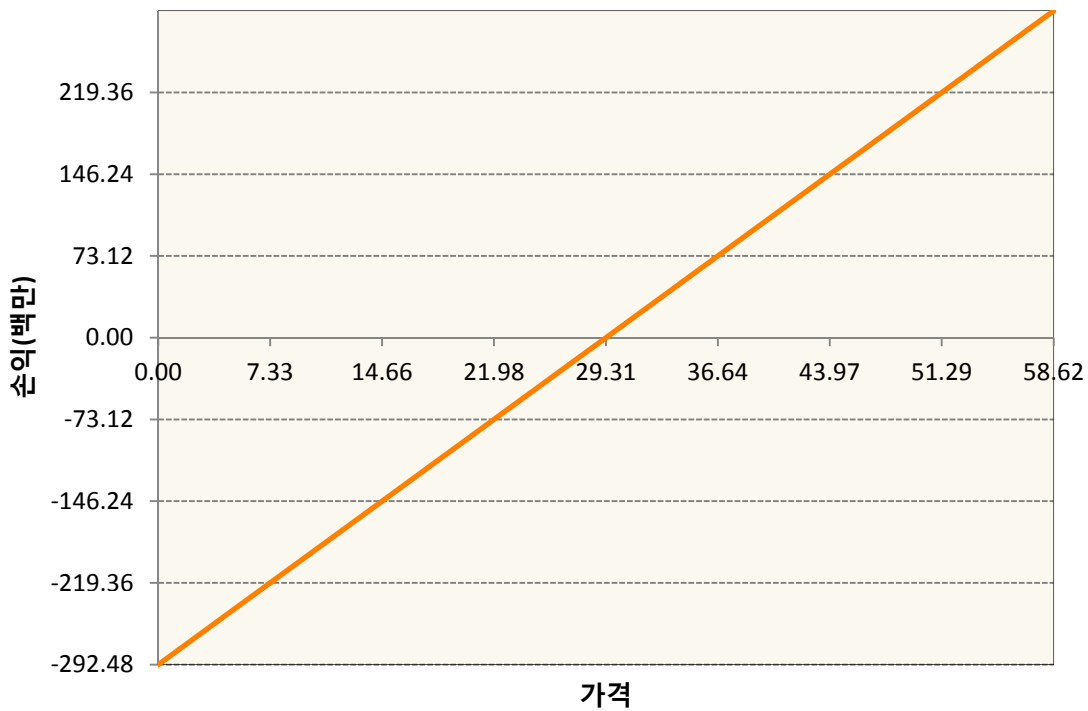
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

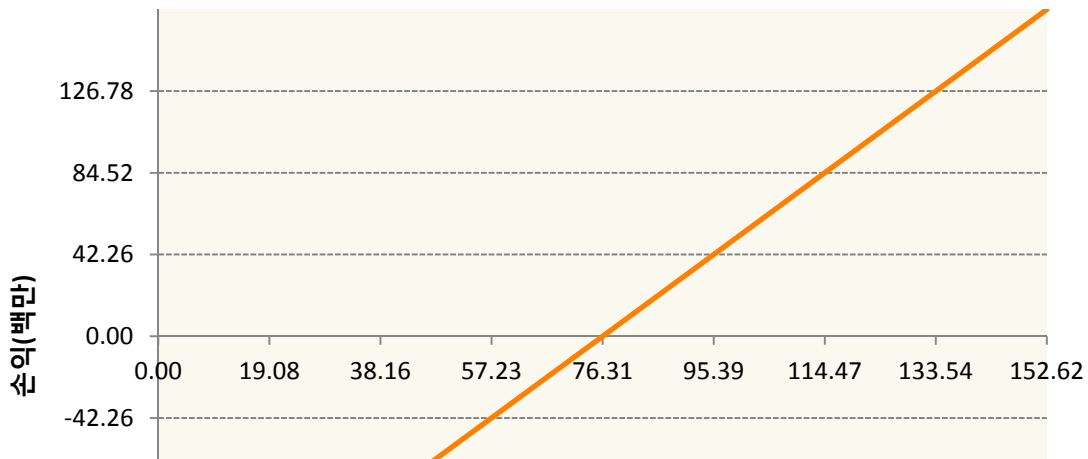
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,528	78	3,450	

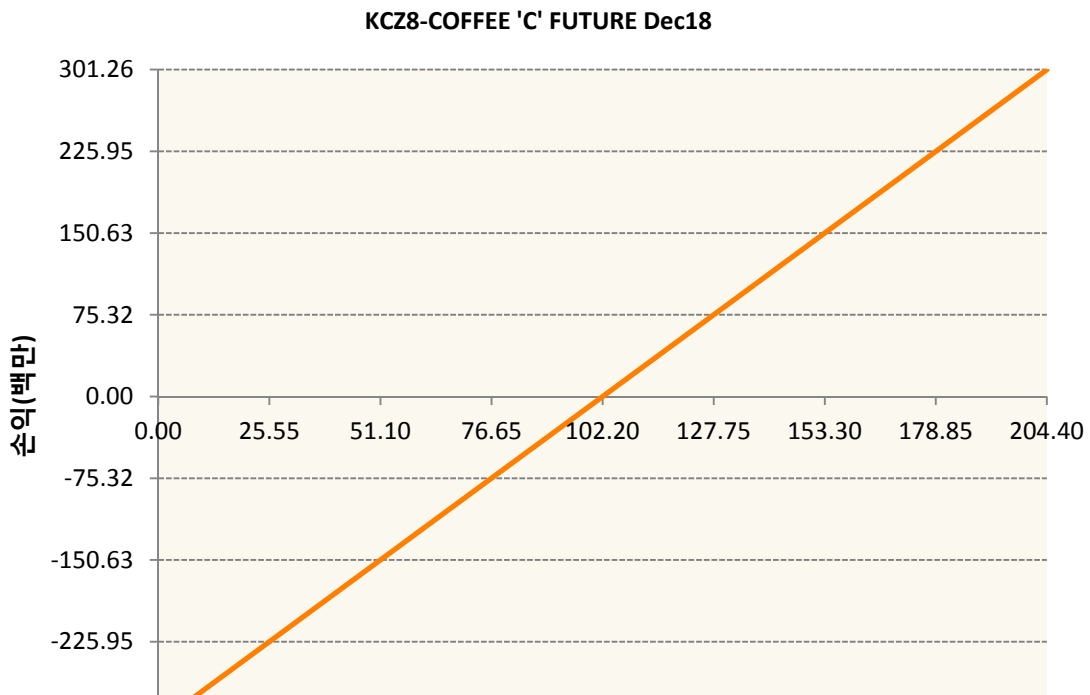
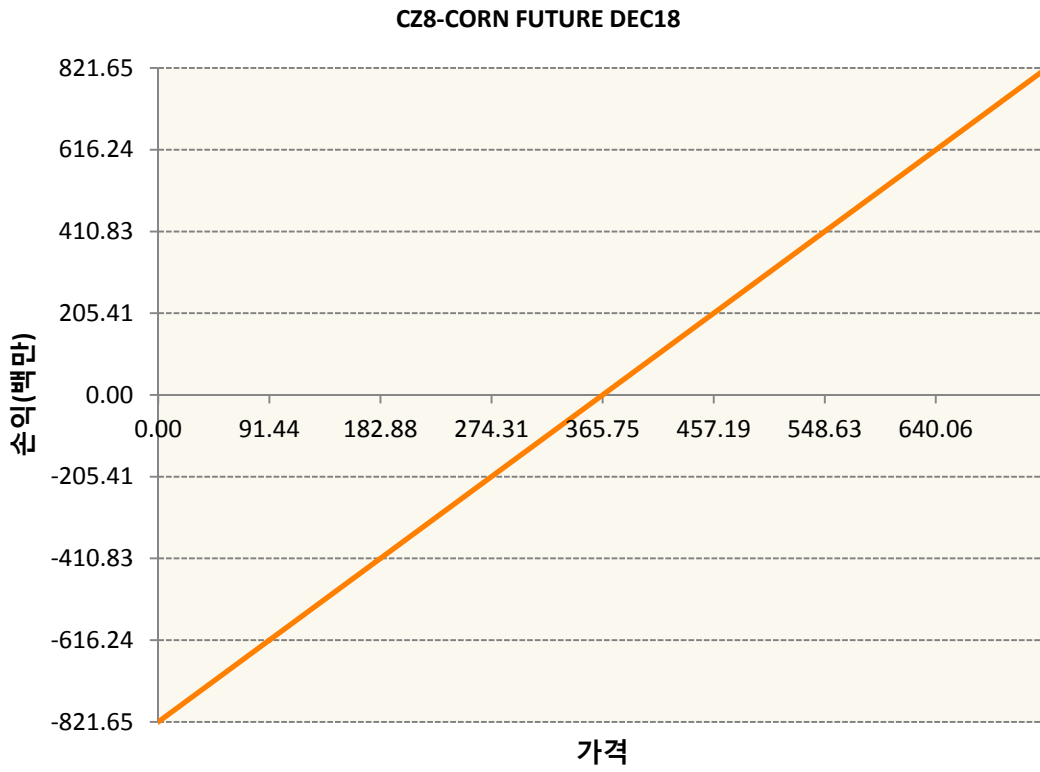
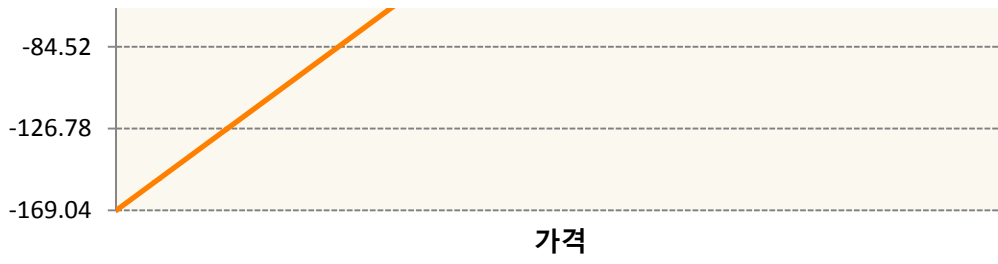
### 2. 만기시점의 손익구조

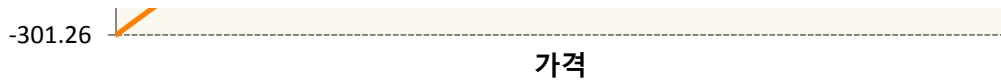
**BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18**



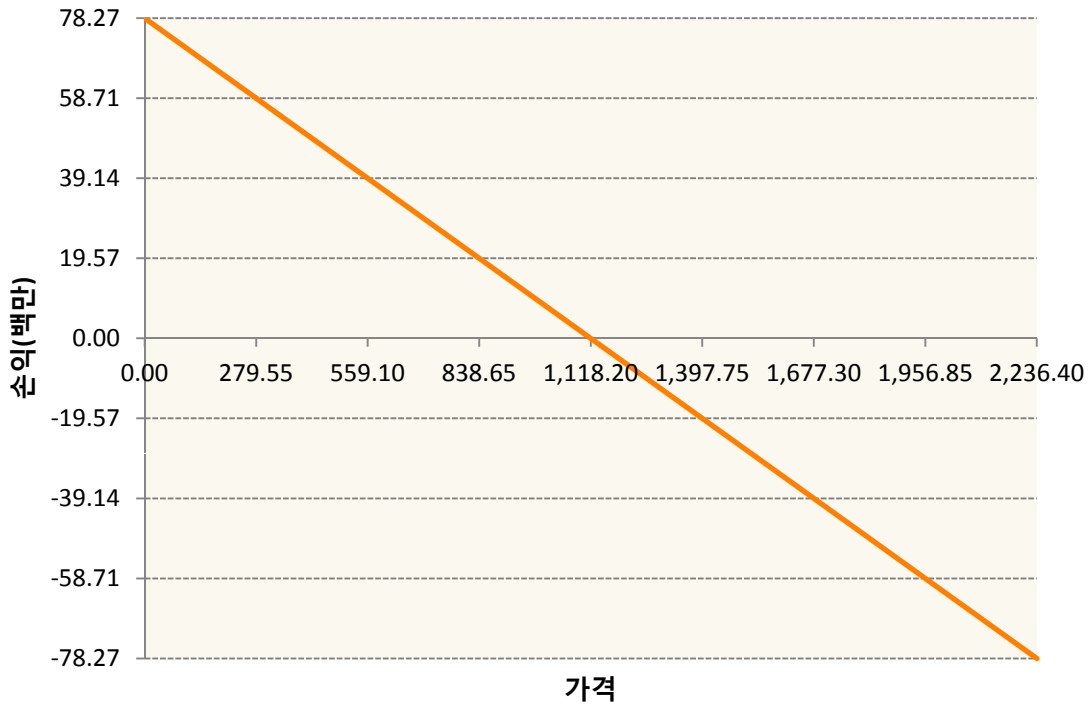
**CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18**



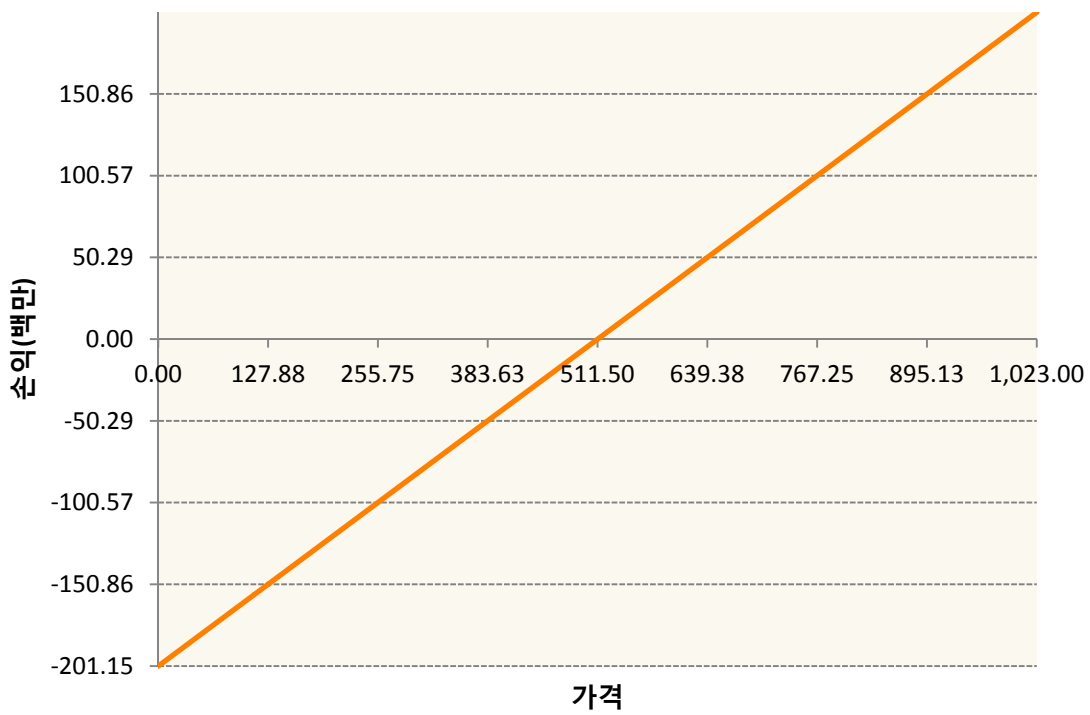




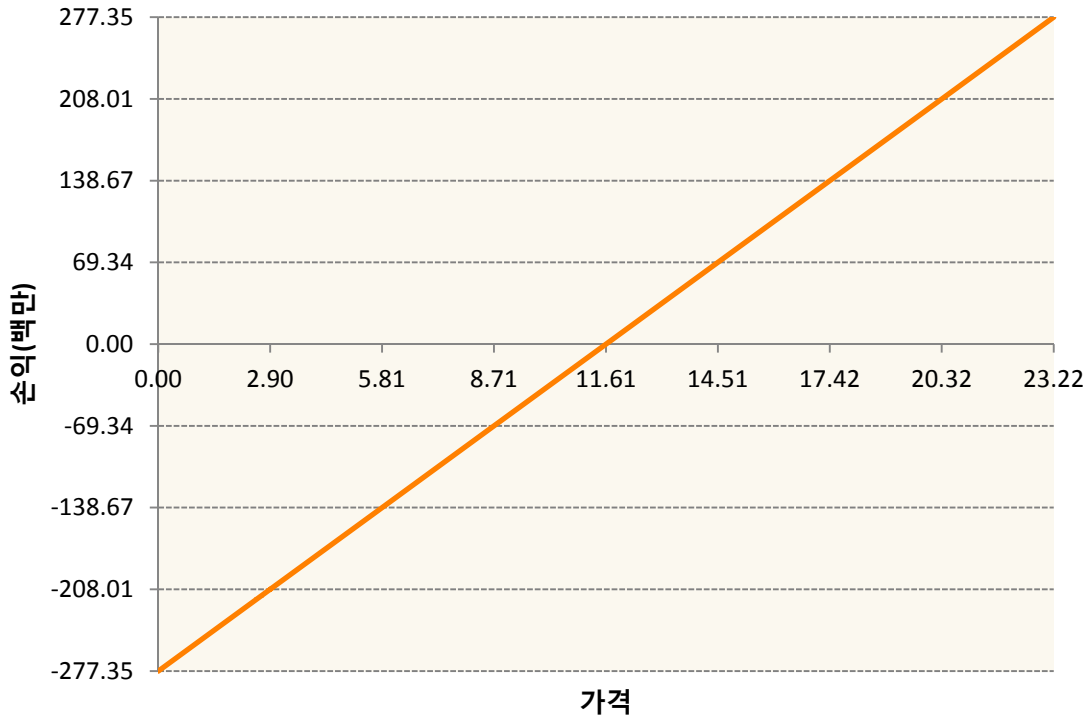
**KR4175NA0007-2018-10 달러선물**



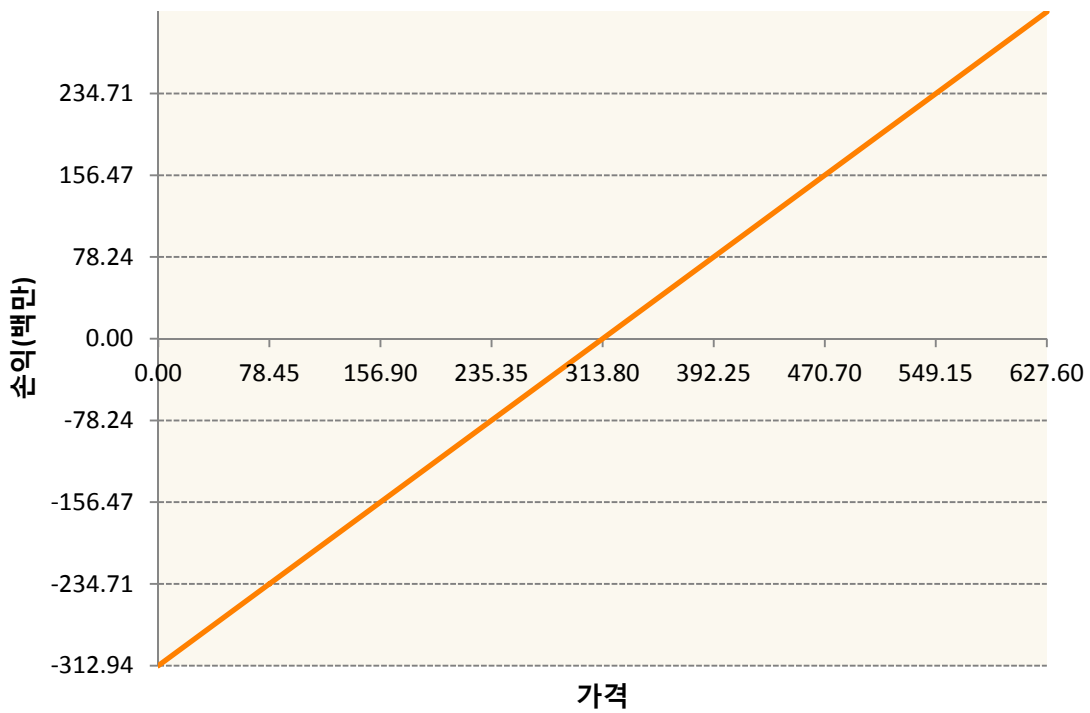
**KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18**



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

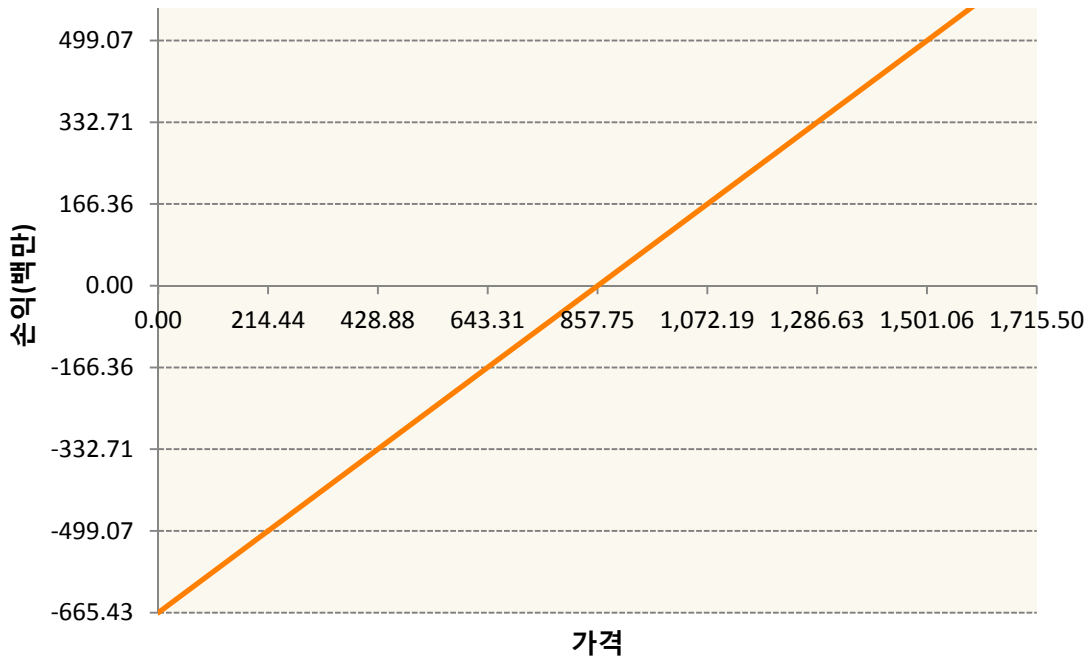


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

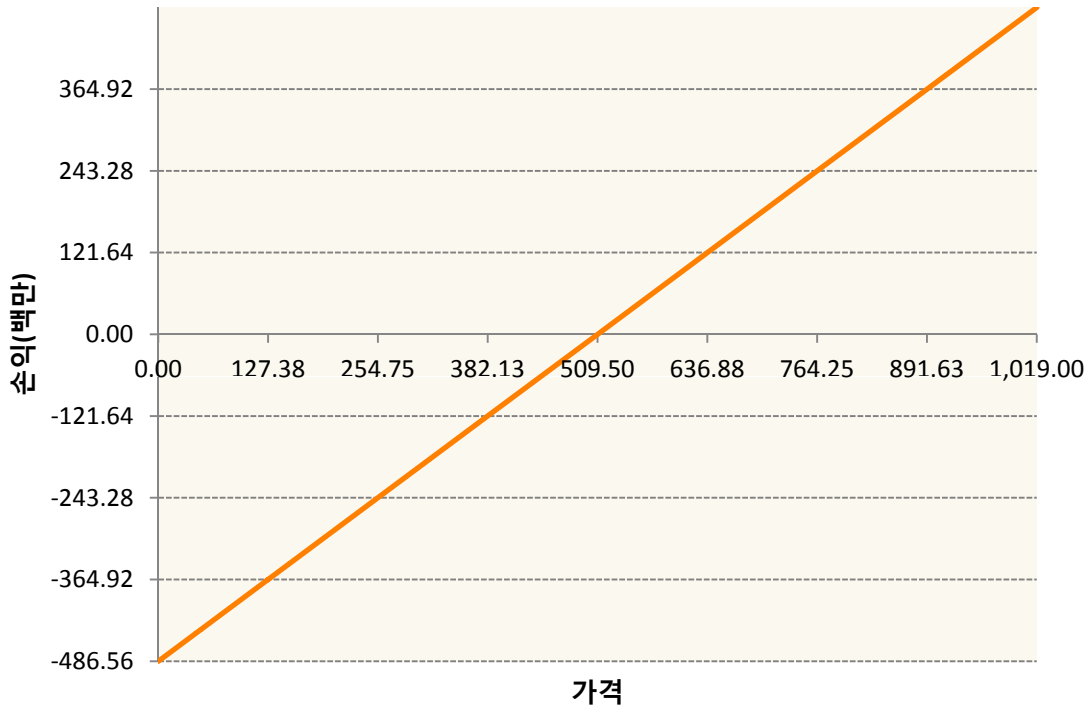


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





WZ8-WHEAT FUTURE(CBT) DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	23
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	14
CZ8	CORN FUTURE DEC18	66
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	24
KR4175NA0	(2018-10 달러선물	6

KWZ8	KC HRW WHEAT FUT DEC18	16
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	22
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	25
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	53
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	39

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

(단위:백만원)

**307**