

공시일	2018-10-08
기준일	2018-10-05

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	2018-10-08
기준일	2018-10-05

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

1,151

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

485

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-08
기준일	2018-10-05

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

293

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

374

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-08
기준일	2018-10-05

유로인덱스모(주식-파생형)

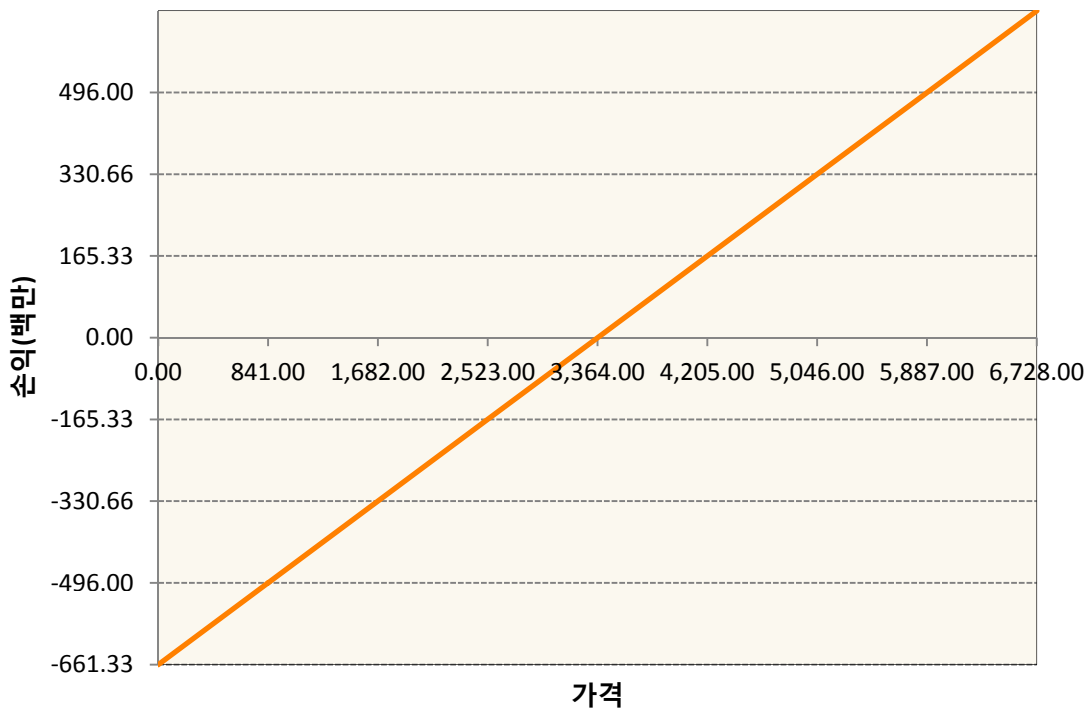
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	661	0	661	

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	2018-10-08
기준일	2018-10-05

차이나인덱스모(주식-파생형)

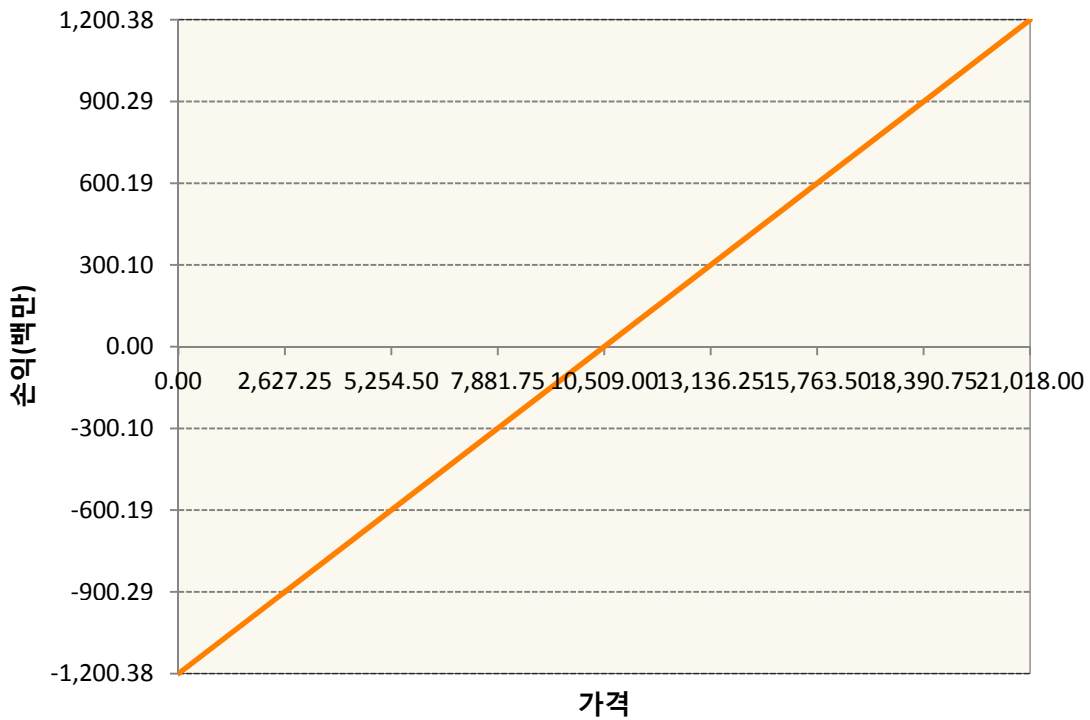
1. 계약금액

(단위:백만원)

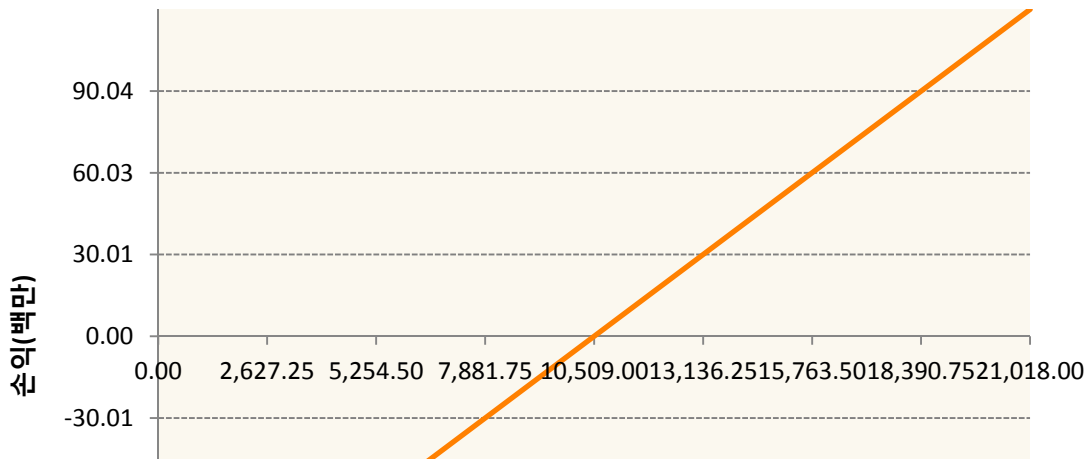
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,320	0	1,320	장내

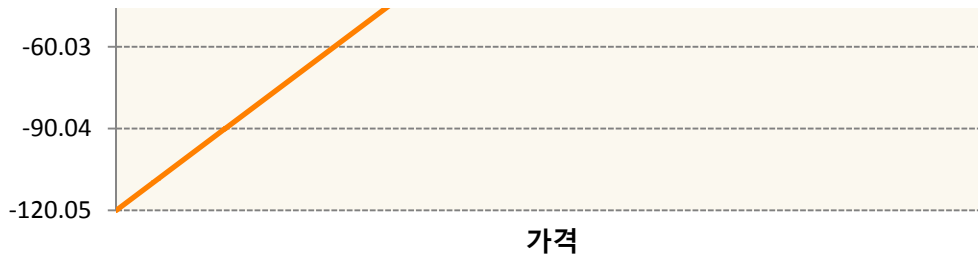
2. 만기시점의 손익구조

HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



MHCV8-MINI H-SHR IDX FU OCT 18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	96
MHCV8	MINI H-SHR IDX FU OCT 18	10

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

100

공시일	2018-10-08
기준일	2018-10-05

커버드콜모(주식혼합-파생형)

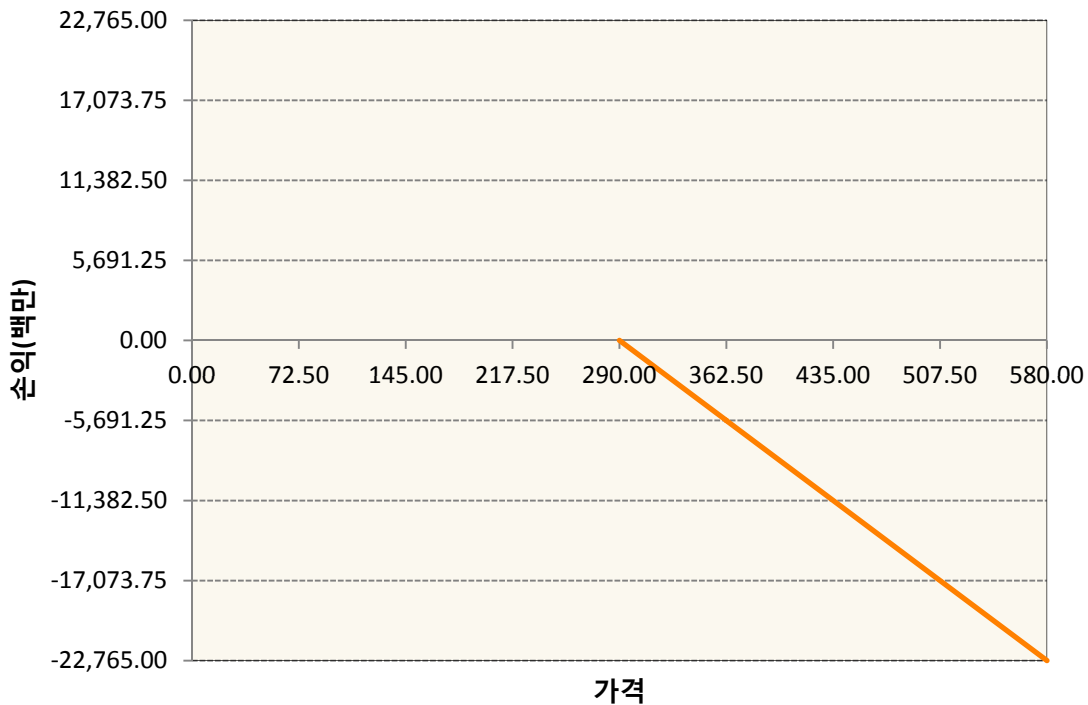
1. 계약금액

(단위:백만원)

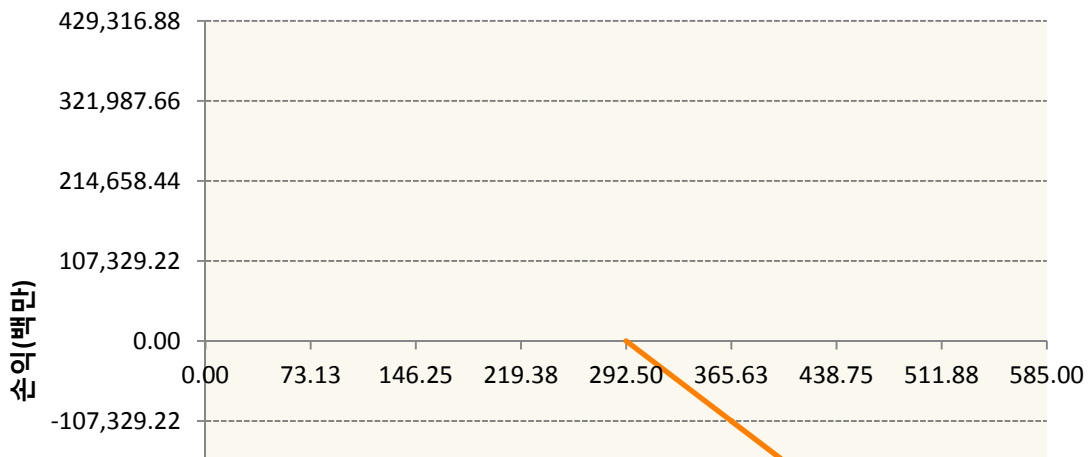
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	727,032	-727,032	장내

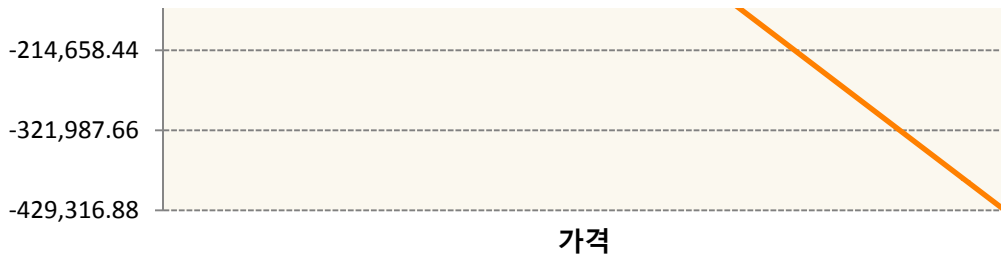
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NA2902-2018-10 콜290

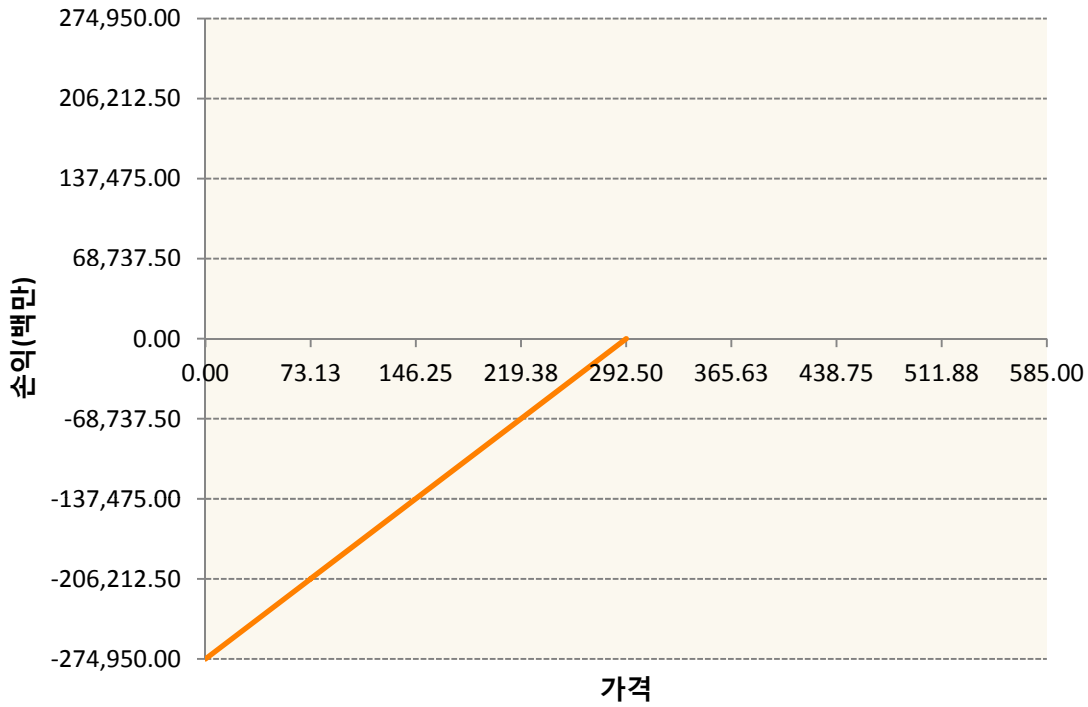


KR4201NA2928-2018-10 콜292.5





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NA2927-2018-10 콜290

1,571

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	370	369	368	367	364	361	357
-5.33%	364	359	352	344	334	323	311
-2.67%	307	288	268	248	226	204	182
0%	79	52	26	0	-26	-53	-79
2.67%	-375	-390	-406	-424	-442	-462	-483
5.33%	-953	-956	-961	-967	-976	-985	-996
8.00%	-1,559	-1,559	-1,560	-1,561	-1,564	-1,567	-1,571

KR4201NA2927-2018-10 풋292.5

27,670

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,102	5,099	5,091	5,075	5,049	5,010	4,954

-5.33%	5,058	5,008	4,934	4,832	4,703	4,547	4,365
-2.67%	4,475	4,217	3,927	3,610	3,272	2,915	2,543
0%	1,476	985	493	0	-493	-987	-1,481
2.67%	-5,753	-6,118	-6,505	-6,909	-7,327	-7,756	-8,194
5.33%	-16,044	-16,159	-16,308	-16,492	-16,707	-16,950	-17,218
8.00%	-27,297	-27,313	-27,343	-27,392	-27,461	-27,554	-27,670

KR4301NA29 2018-10 풋 292.5

20,572

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20,572	-20,572	-20,572	-20,572	-20,572	-20,572	-20,572
-5.33%	-13,273	-13,273	-13,273	-13,273	-13,274	-13,275	-13,277
-2.67%	-5,982	-5,991	-6,008	-6,031	-6,062	-6,101	-6,148
0%	442	296	149	0	-149	-299	-450
2.67%	2,421	2,382	2,331	2,270	2,200	2,121	2,034
5.33%	2,478	2,478	2,477	2,475	2,471	2,464	2,454
8.00%	2,478	2,478	2,478	2,478	2,478	2,478	2,478

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

(단위:백만원)

60,899

공시일	2018-10-08
기준일	2018-10-05

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

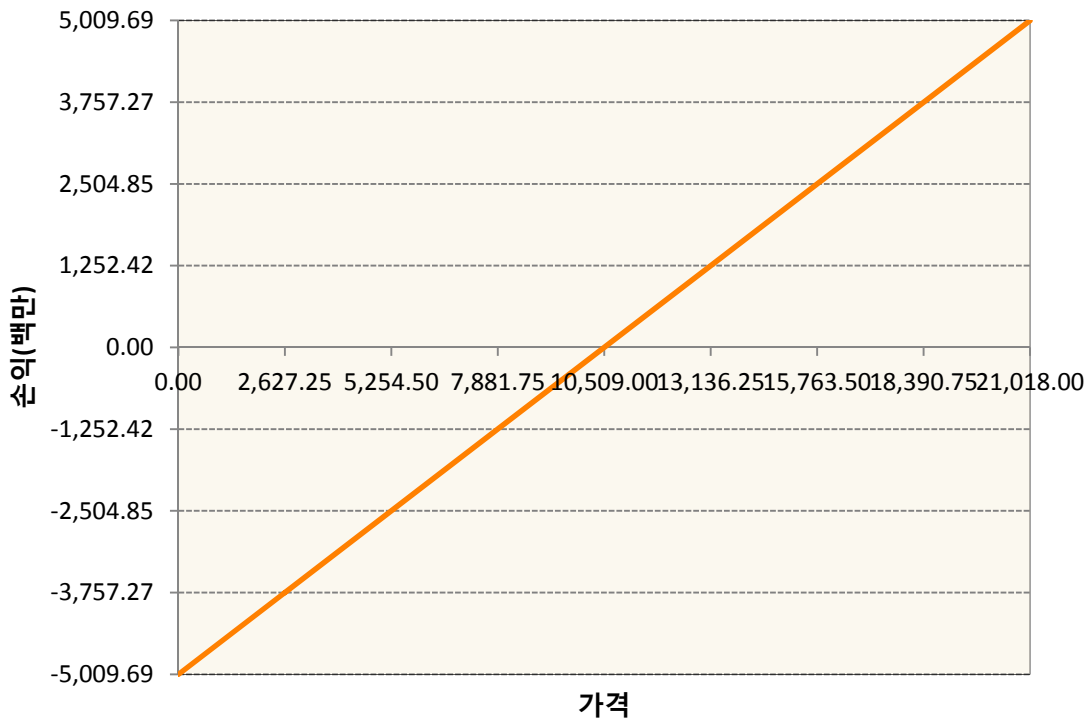
1. 계약금액

(단위:백만원)

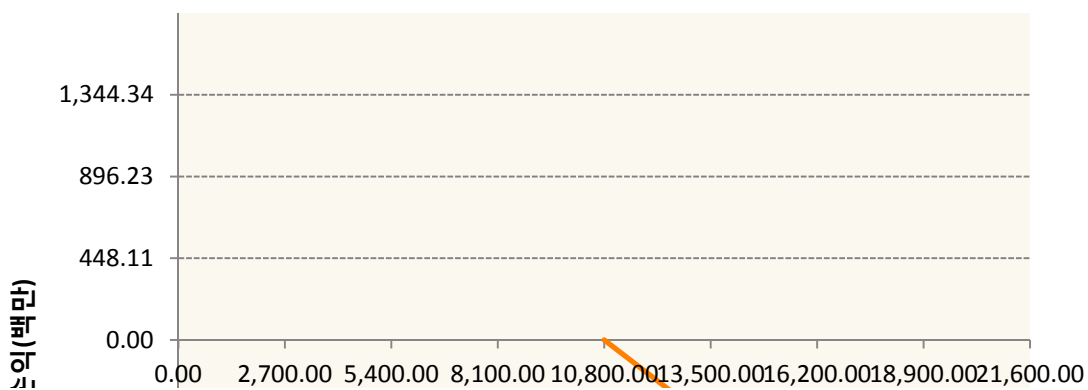
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,010	0	5,010	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,840	-11,840	장내

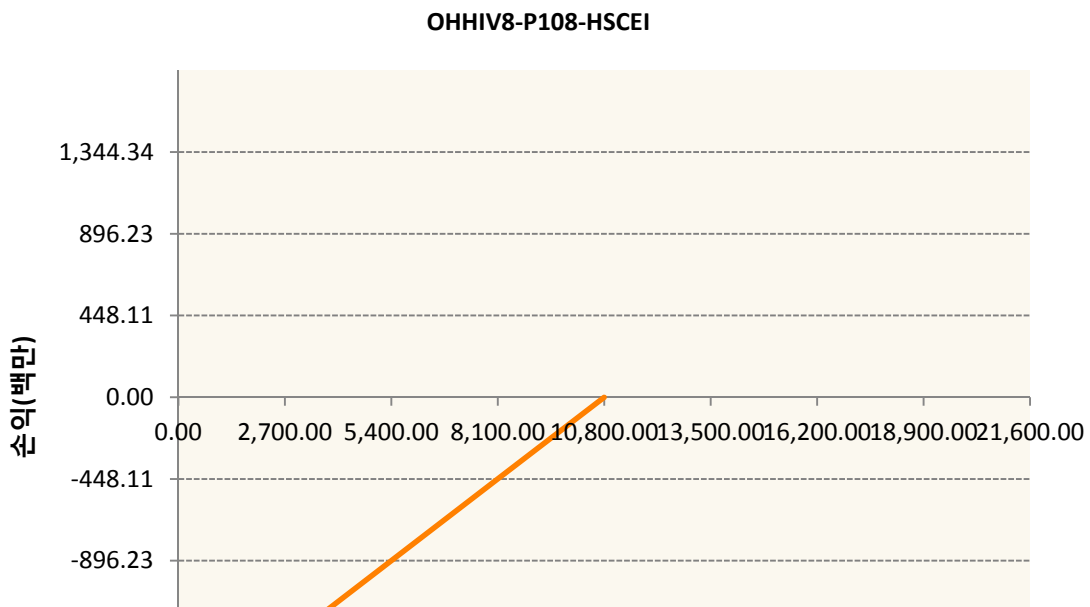
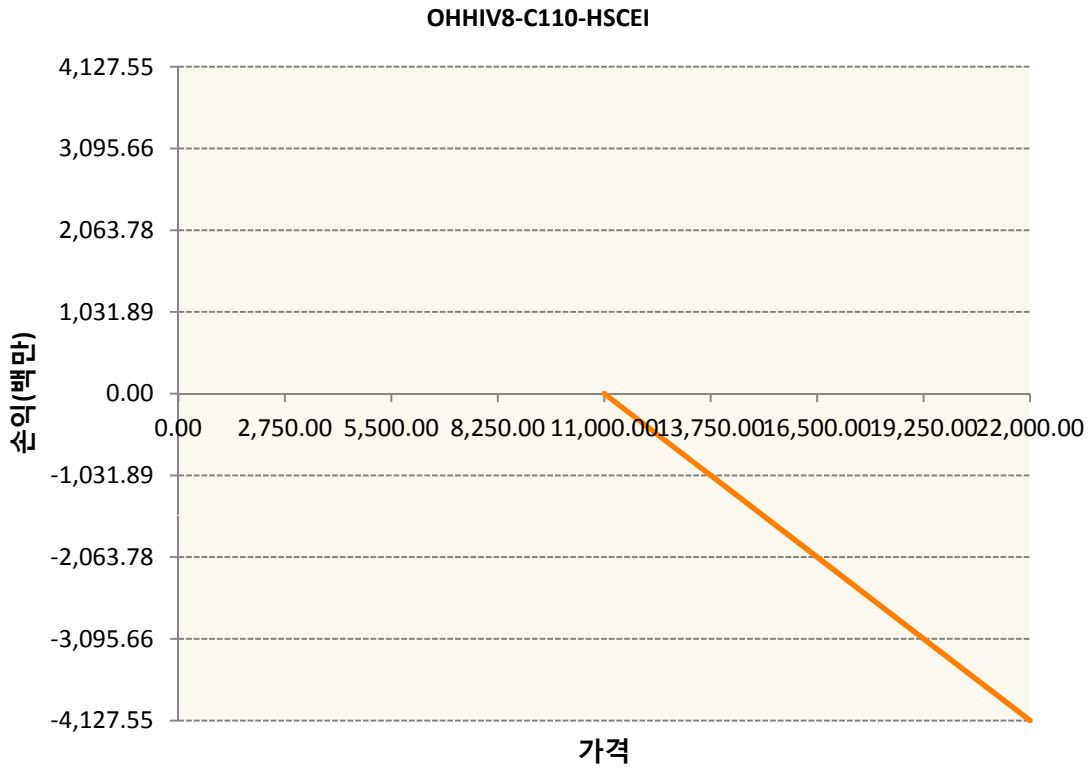
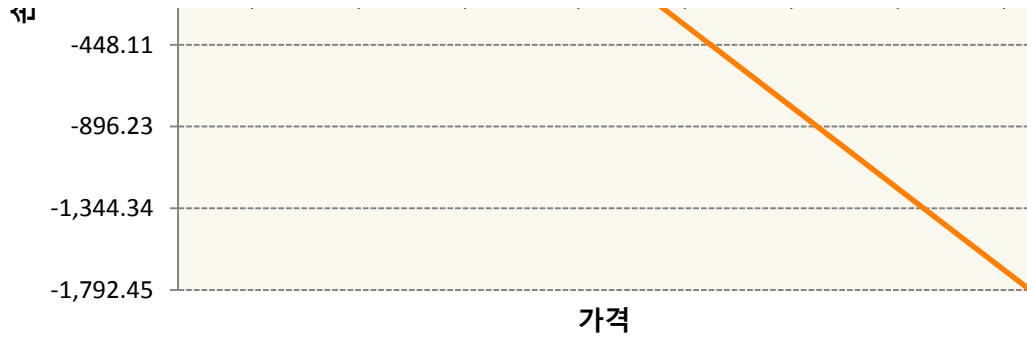
2. 만기시점의 손익구조

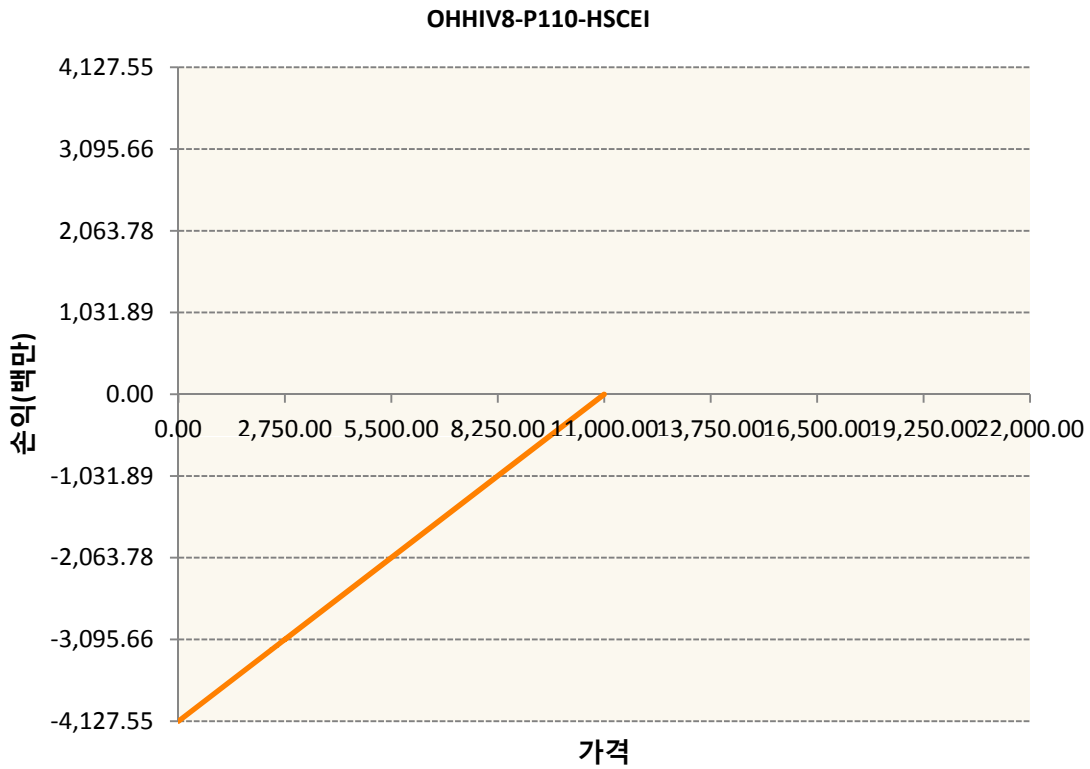
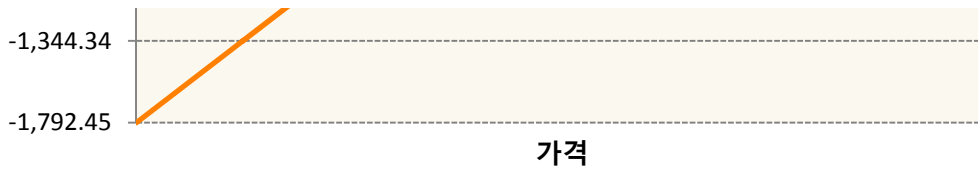
HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



OHHIV8-C108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	401
OHHIV8-C1	HSCEI	143
OHHIV8-C11	HSCEI	330
OHHIV8-P1C	HSCEI	143
OHHIV8-P11	HSCEI	330

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,276

공시일	2018-10-08
기준일	2018-10-05

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

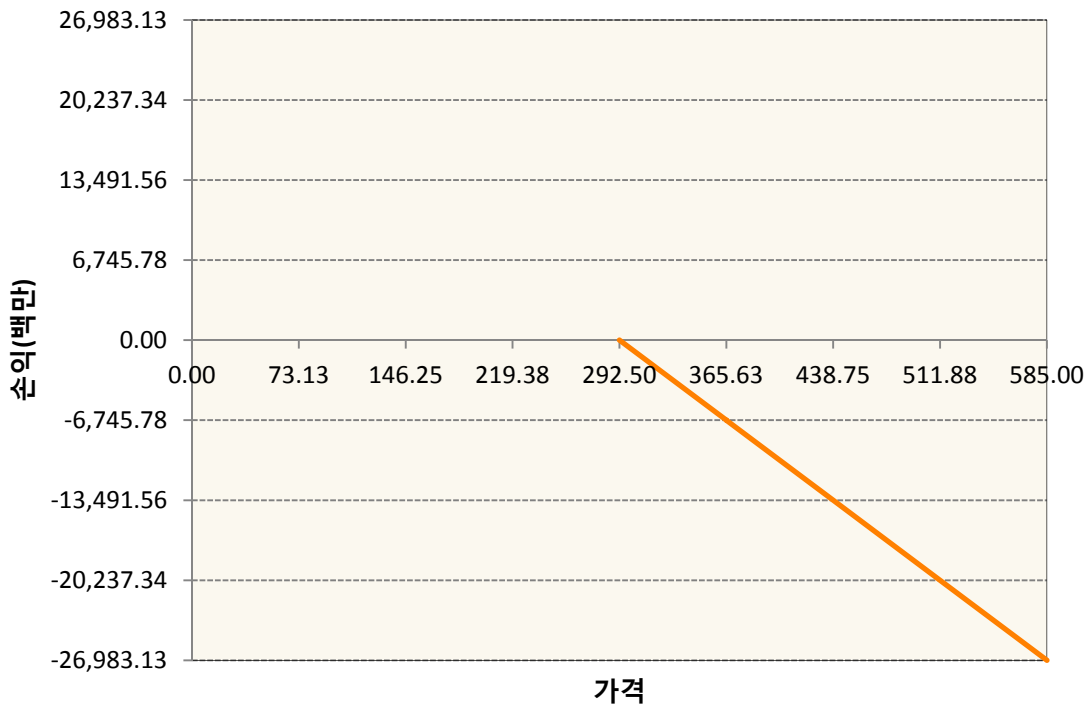
1. 계약금액

(단위:백만원)

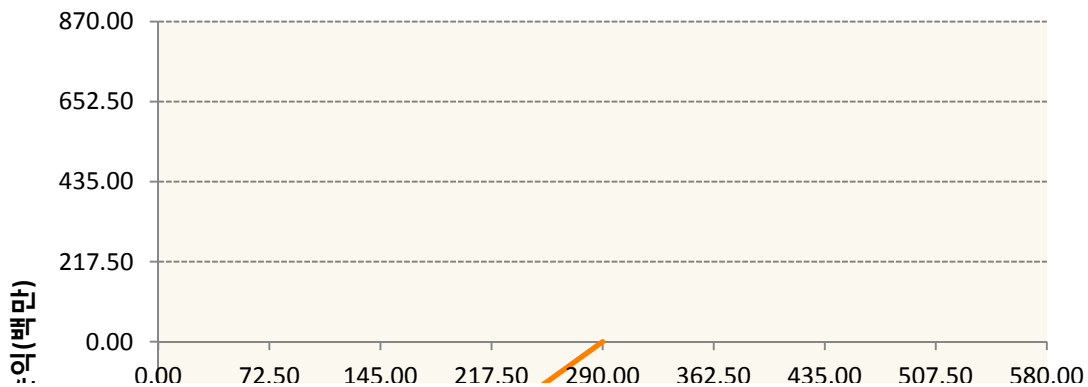
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	47,451	-47,451	장내

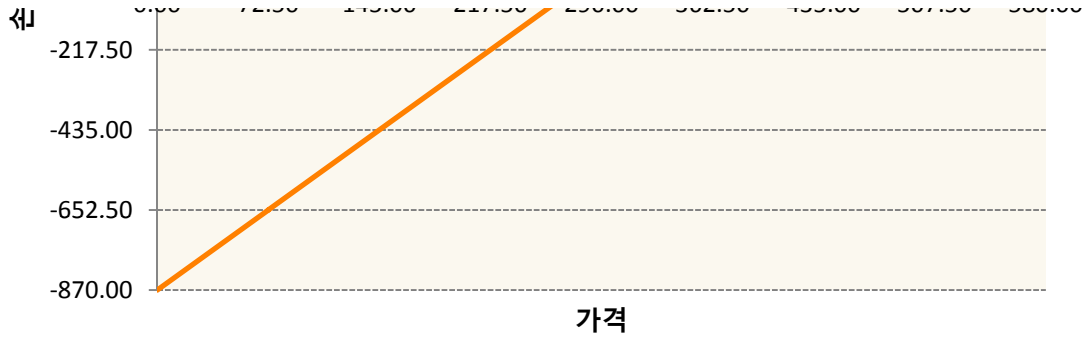
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NA2928-2018-10 콜292.5

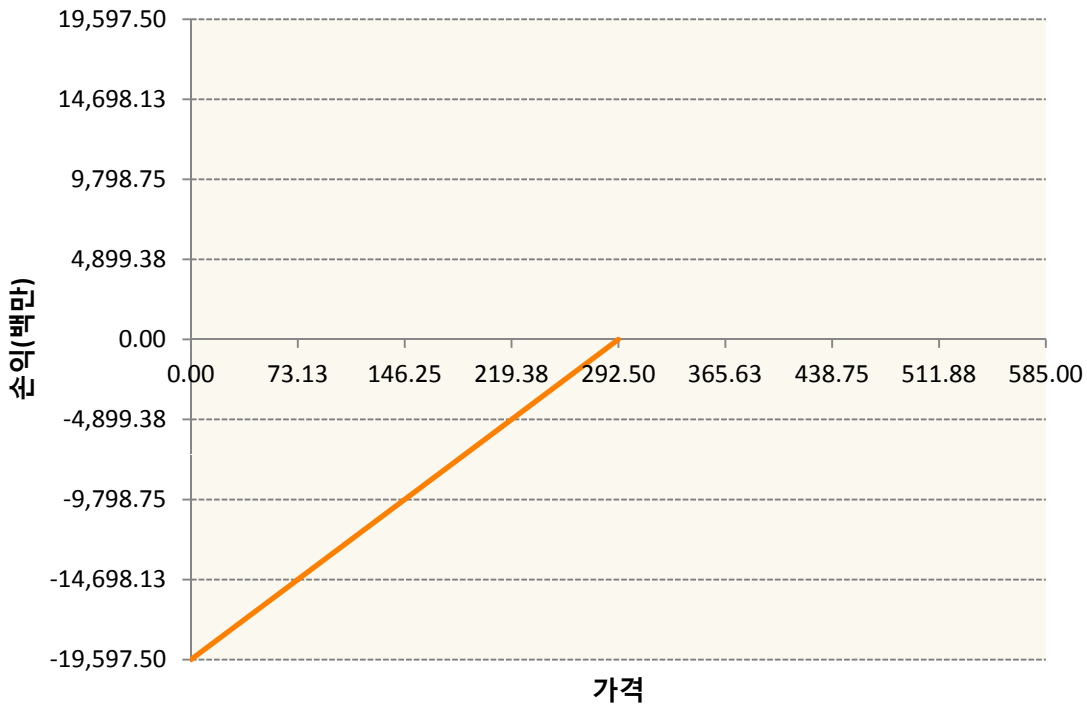


KR4301NA2901-2018-10 풋290





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							4,021
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,021	-4,021	-4,021	-4,021	-4,021	-4,021	-4,021
-5.33%	-2,681	-2,681	-2,681	-2,681	-2,681	-2,681	-2,681
-2.67%	-1,340	-1,340	-1,340	-1,340	-1,340	-1,340	-1,340
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,340	1,340	1,340	1,340	1,340	1,340	1,340
5.33%	2,681	2,681	2,681	2,681	2,681	2,681	2,681
8.00%	4,021	4,021	4,021	4,021	4,021	4,021	4,021
KR4201NA2927-2018-10 풋292.5							1,739
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	321	320	320	319	317	315	311
-5.33%	318	315	310	304	296	286	274
-2.67%	281	265	247	227	206	183	160
0%	93	62	31	0	-31	-62	-93
2.67%	-362	-385	-409	-434	-460	-487	-515
5.33%	-1,008	-1,016	-1,025	-1,037	-1,050	-1,065	-1,082
8.00%	-1,716	-1,717	-1,719	-1,722	-1,726	-1,732	-1,739

KR4301NA2☹ 2018-10 풋290

62

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
-5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-2.67%	-15	-16	-16	-16	-16	-16	-17
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

KR4301NA2☹ 2018-10 풋292.5

1,466

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,466	-1,466	-1,466	-1,466	-1,466	-1,466	-1,466
-5.33%	-946	-946	-946	-946	-946	-946	-946
-2.67%	-426	-427	-428	-430	-432	-435	-438
0%	32	21	11	0	-11	-21	-32
2.67%	173	170	166	162	157	151	145
5.33%	177	177	177	176	176	176	175
8.00%	177	177	177	177	177	177	177

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

(단위:백만원)

8,061

공시일	2018-10-08
기준일	2018-10-05

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

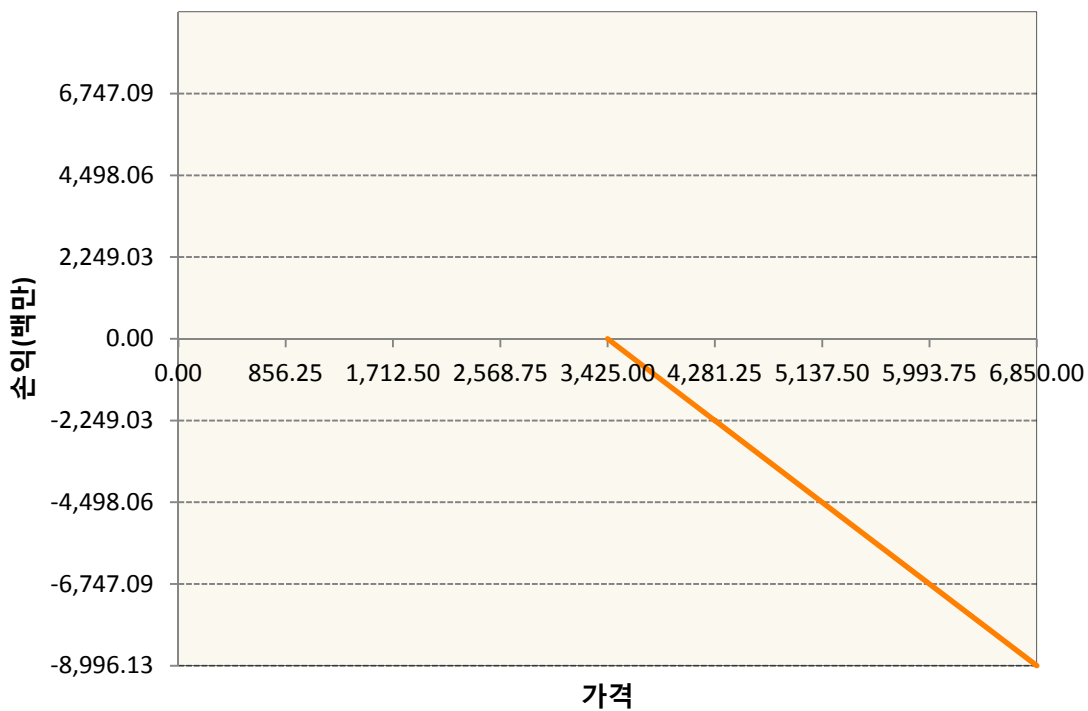
1. 계약금액

(단위:백만원)

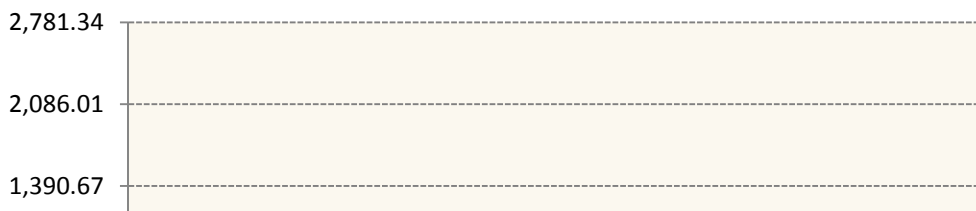
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,771	0	4,771	
누계	유가증권	스왑	34,337	0	34,337	장외
누계	유가증권	옵션	0	23,555	-23,555	장내
누계	지수	스왑	52,789	0	52,789	장외

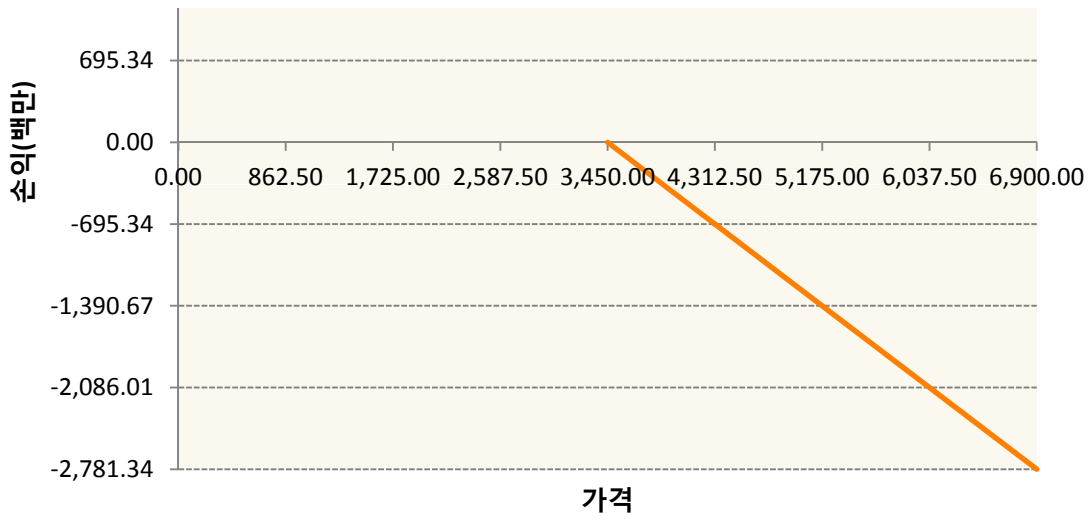
2. 만기시점의 손익구조

OESXV8-C3425-EURO STOXX 50

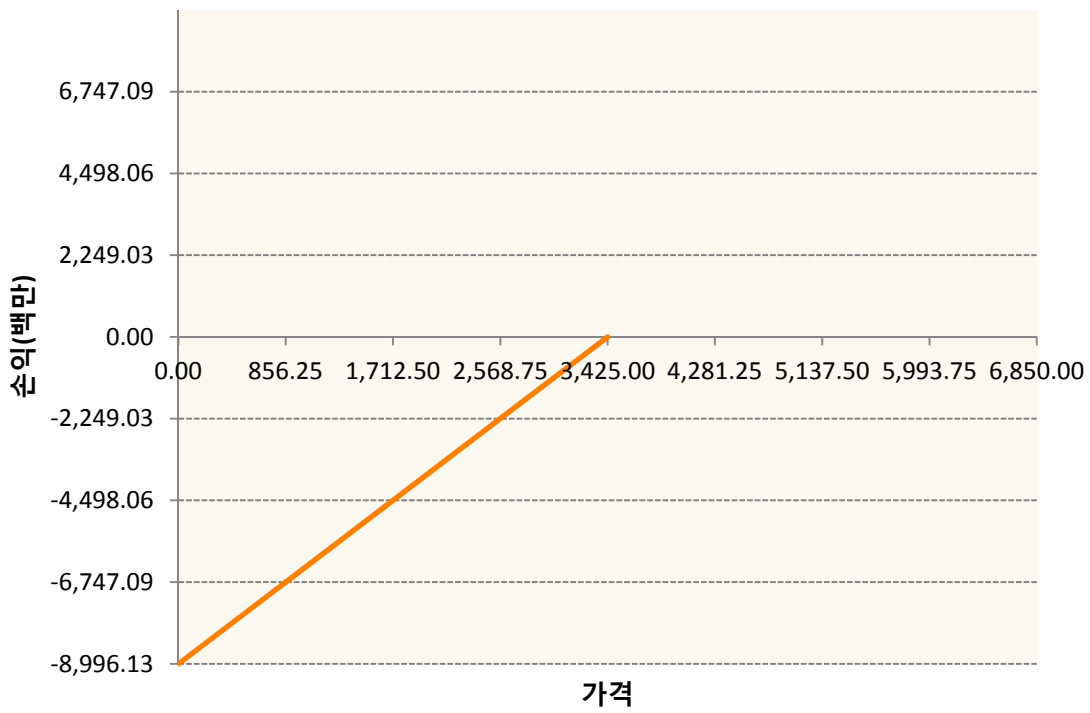


OESXV8-C3450-EURO STOXX 50

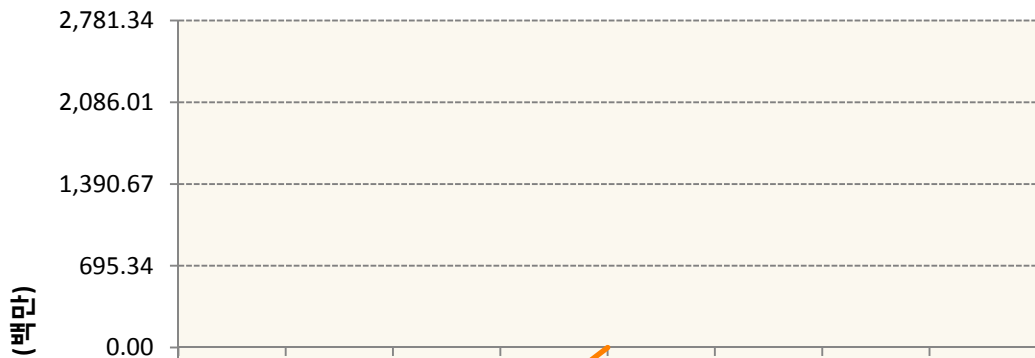


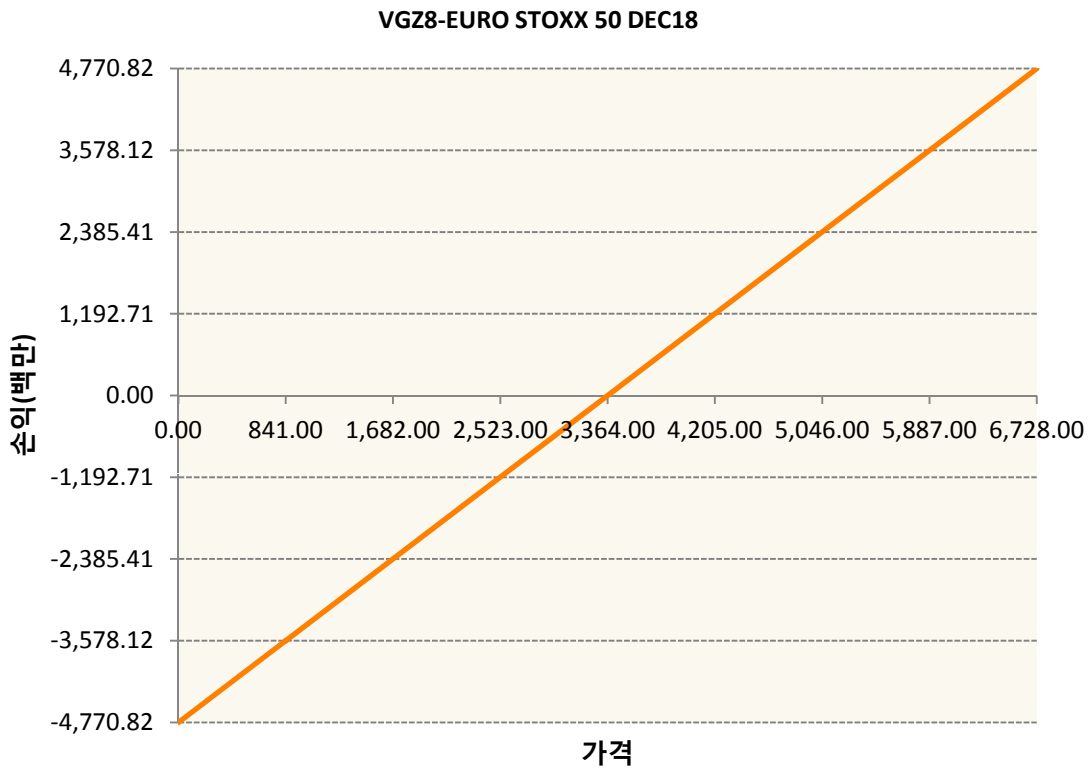
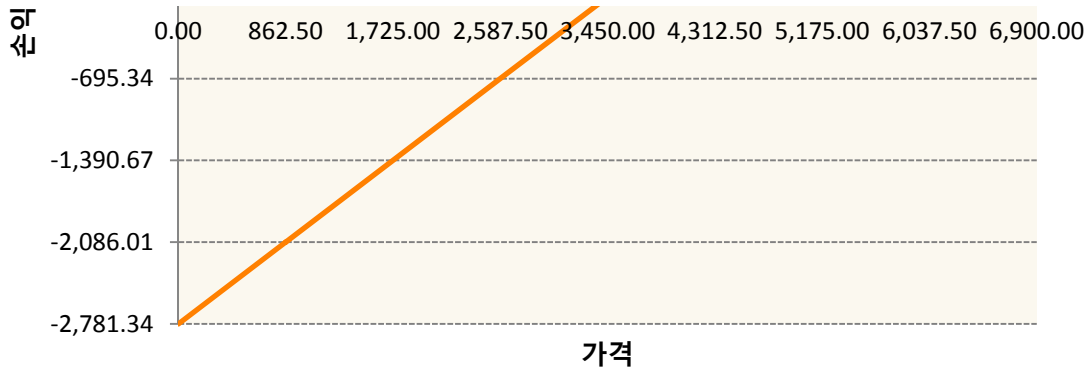


OESXV8-P3425-EURO STOXX 50



OESXV8-P3450-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		24
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		16
OESXV8-C34 EURO STOXX 50		720
OESXV8-C34 EURO STOXX 50		223
OESXV8-P34 EURO STOXX 50		720
OESXV8-P34 EURO STOXX 50		223
VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18		382

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

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

(단위:백만원)

1,124

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

(단위:백만원)

89

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

(단위:백만원)

133

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

(단위:백만원)

161

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-10-08
기준일	2018-10-05

리디파인K200(주식혼합-파생재간

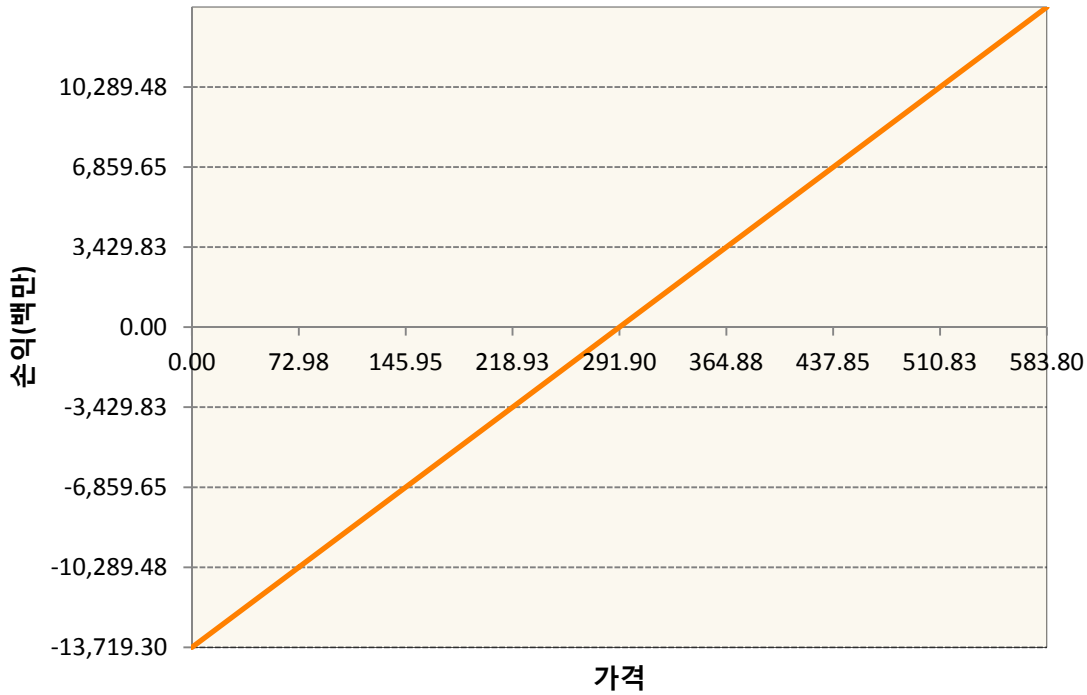
1. 계약금액

(단위:백만원)

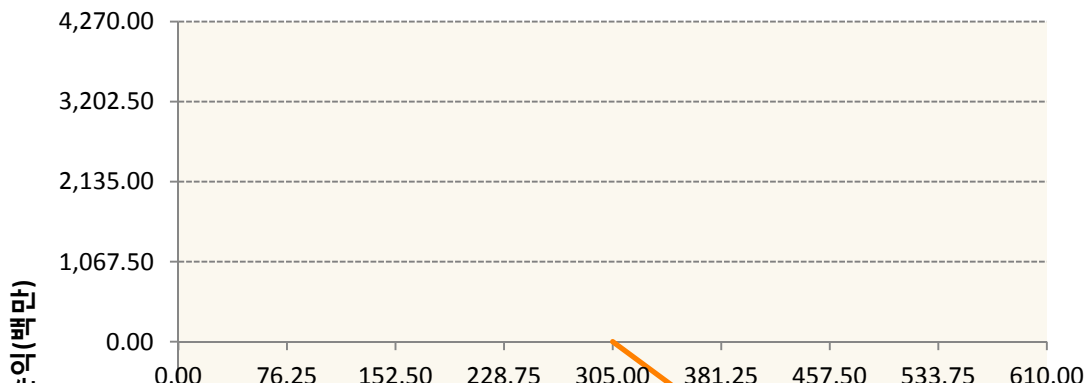
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,719	0	13,719	장내
누계	유가증권	옵션	2,119	24,488	-22,369	장내

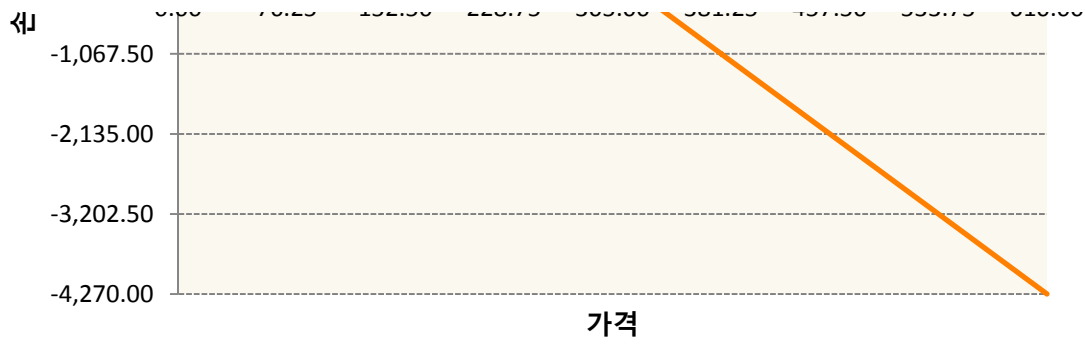
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

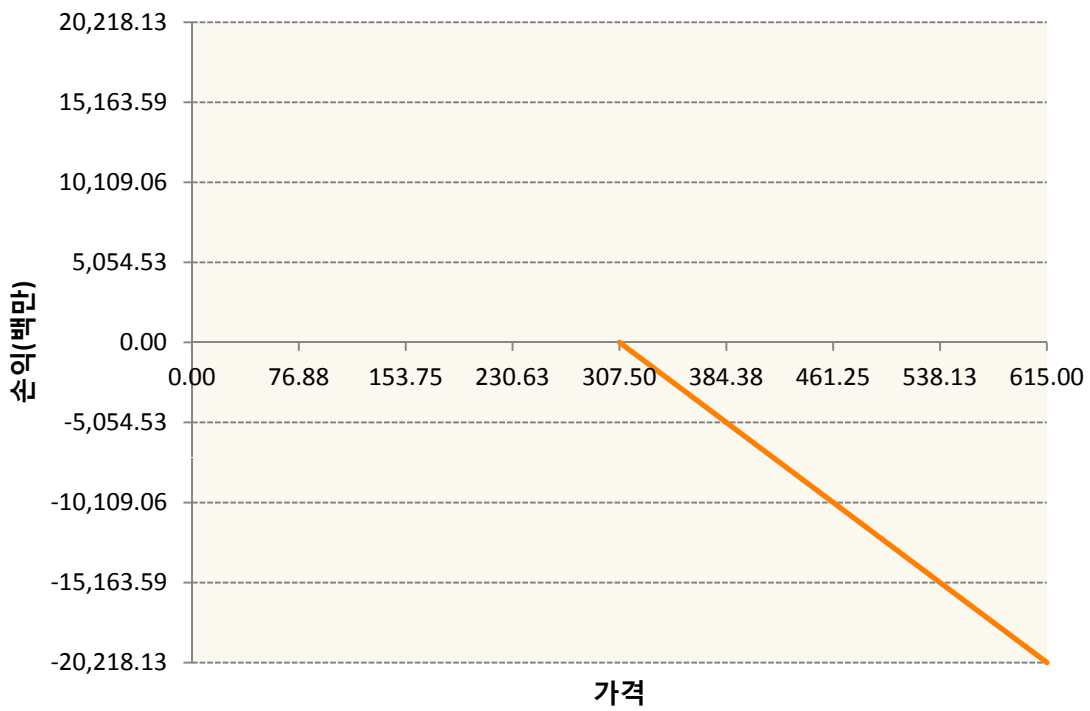


KR4201NA3058-2018-10 콜305

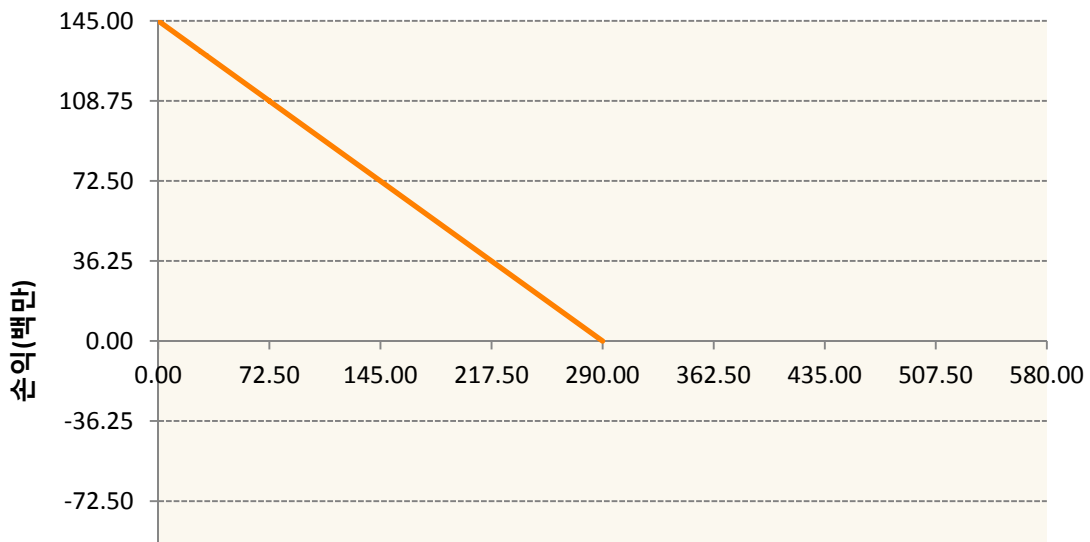


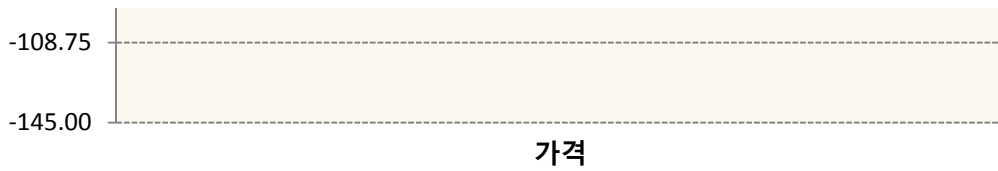


KR4201NA3074-2018-10 콜307.5

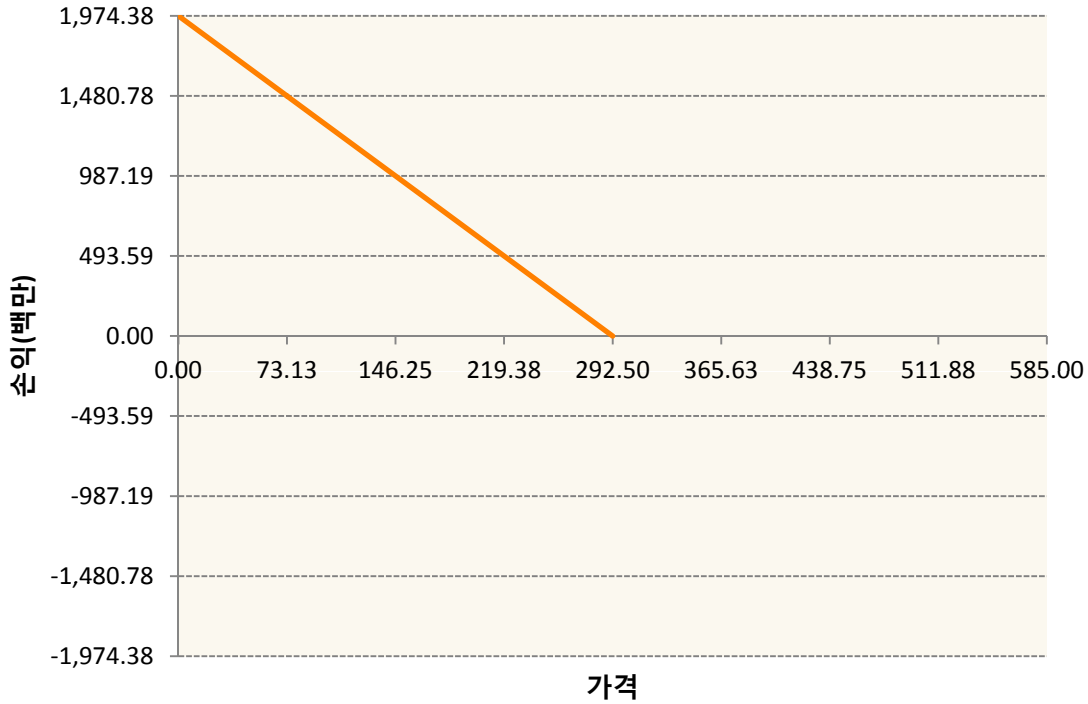


KR4301NA2901-2018-10 풋290





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 1,095

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,095	-1,095	-1,095	-1,095	-1,095	-1,095	-1,095
-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%	1,095	1,095	1,095	1,095	1,095	1,095	1,095

KR4201NA3(2018-10 콜305) 154

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6	6	6	6	6	6	6
-5.33%	6	6	6	6	6	6	6
-2.67%	6	6	6	5	5	4	3

0%	5	3	2	0	-2	-5	-7
2.67%	-8	-12	-16	-20	-24	-28	-33
5.33%	-52	-57	-62	-67	-72	-77	-81
8.00%	-134	-137	-140	-143	-147	-150	-154

KR4201NA3(2018-10 콜307.5

618

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	18	18	18	18	18	18	18
-5.33%	18	18	18	18	17	17	16
-2.67%	18	17	17	15	14	11	7
0%	14	11	6	0	-7	-16	-26
2.67%	-20	-34	-50	-66	-83	-101	-120
5.33%	-171	-194	-218	-241	-264	-288	-311
8.00%	-504	-521	-539	-558	-577	-597	-618

KR4301NA2(2018-10 풋290

10

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10	10	10	10	10	10	10
-5.33%	6	6	6	6	6	6	6
-2.67%	3	3	3	3	3	3	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

148

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	148	148	148	148	148	148	148
-5.33%	95	95	95	95	95	95	95
-2.67%	43	43	43	43	44	44	44
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-17	-17	-17	-16	-16	-15	-15
5.33%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
8.00%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18

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

(단위:백만원)

1,390

공시일	2018-10-08
기준일	2018-10-05

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

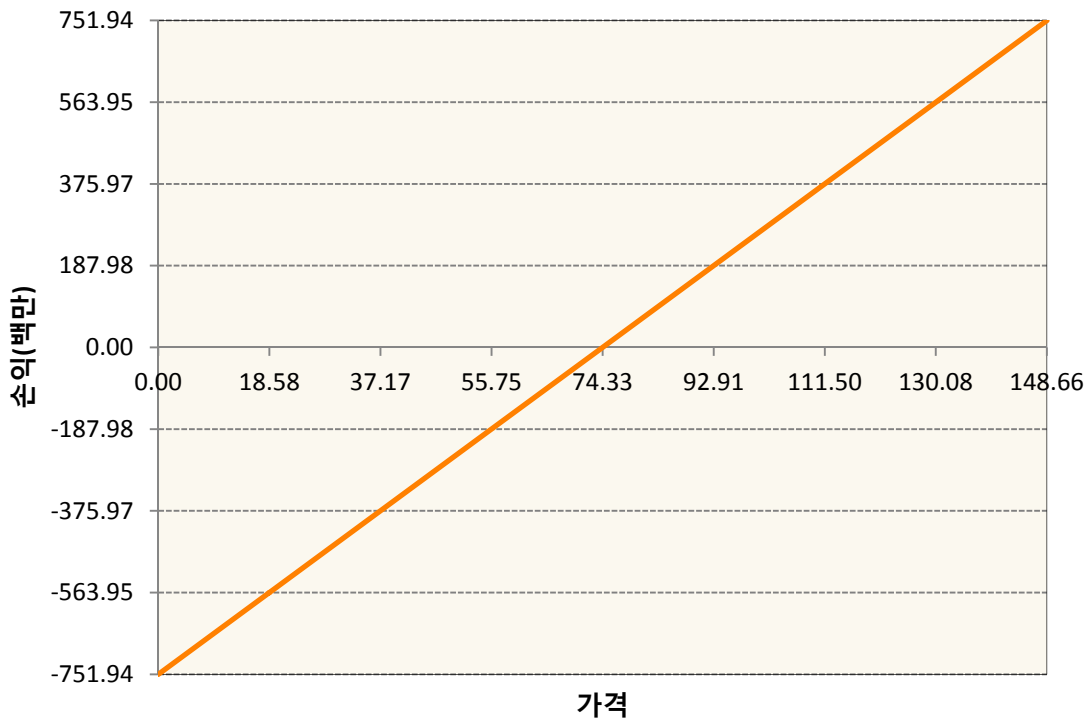
1. 계약금액

(단위:백만원)

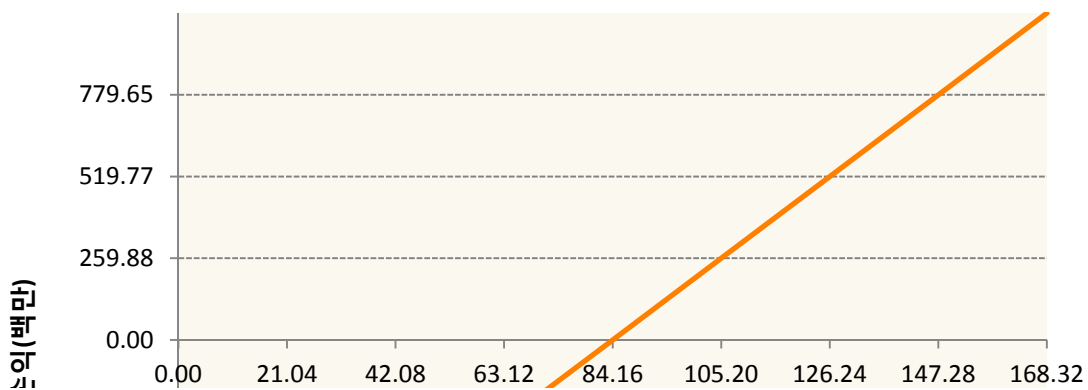
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,318	621	2,697	
누계	유가증권	선물	453	0	453	장내

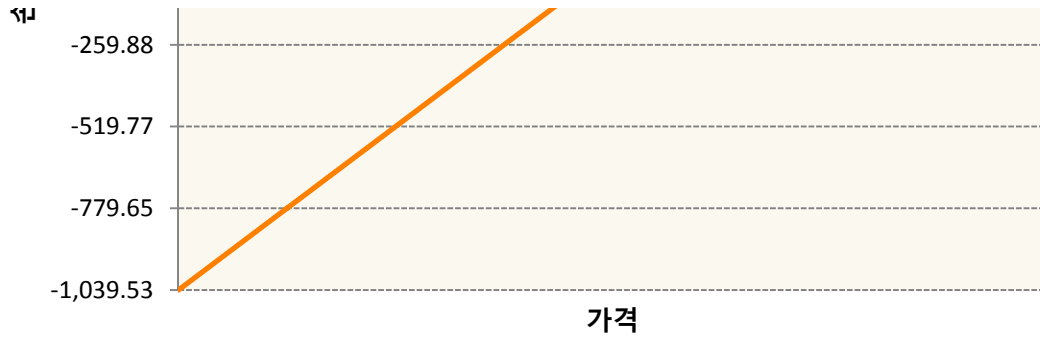
2. 만기시점의 손익구조

CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18

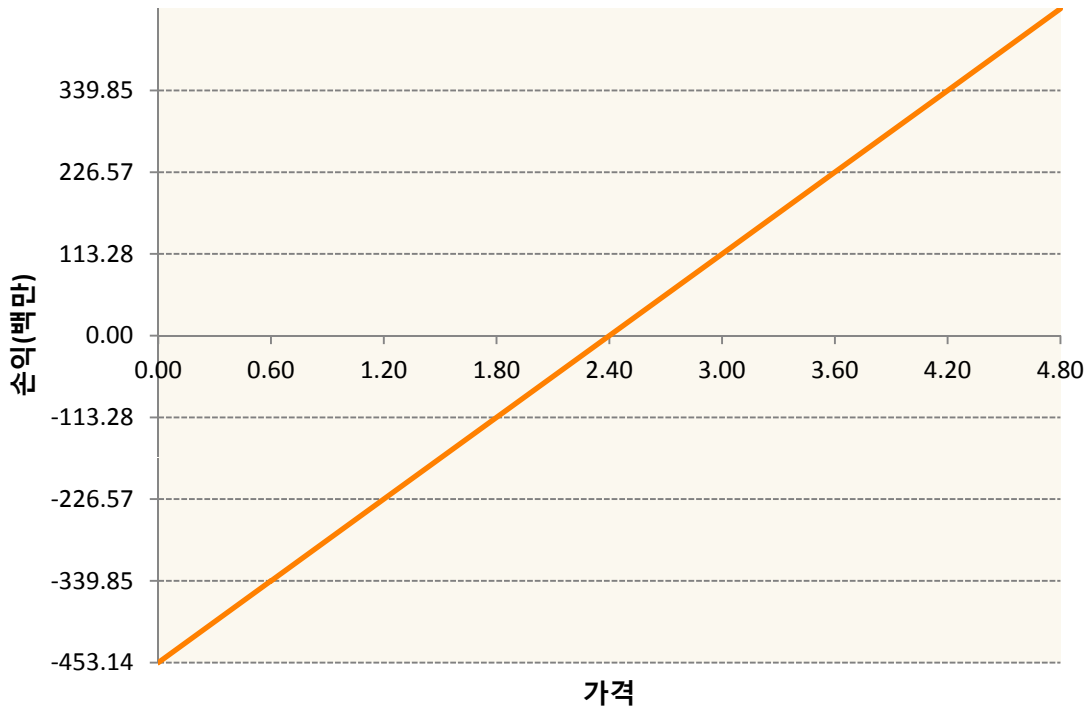


COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19

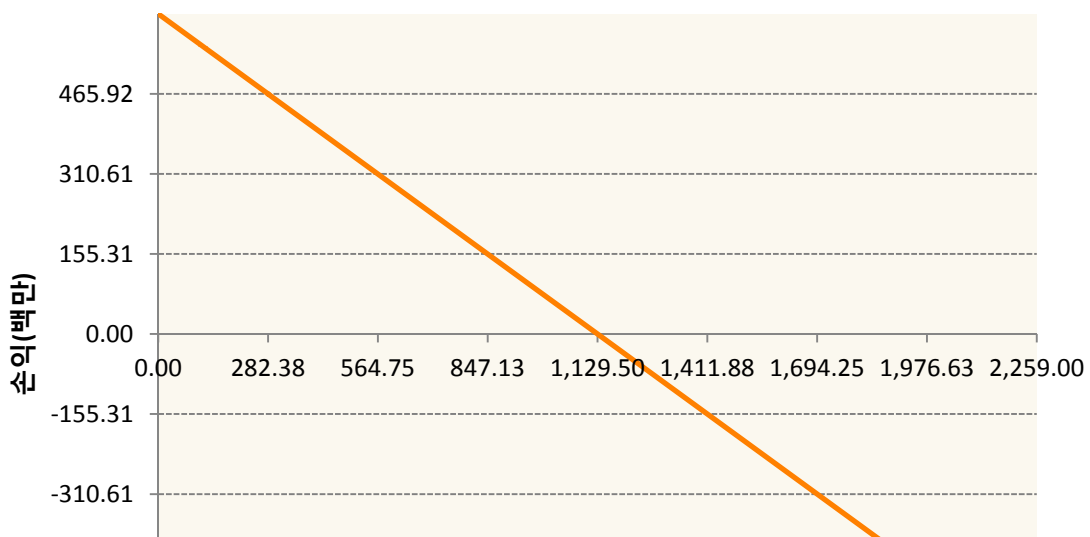


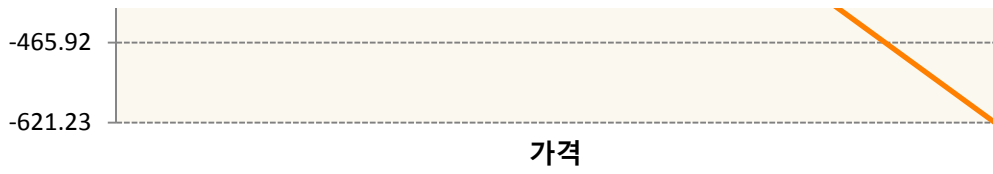


HOX8-Heating Oil

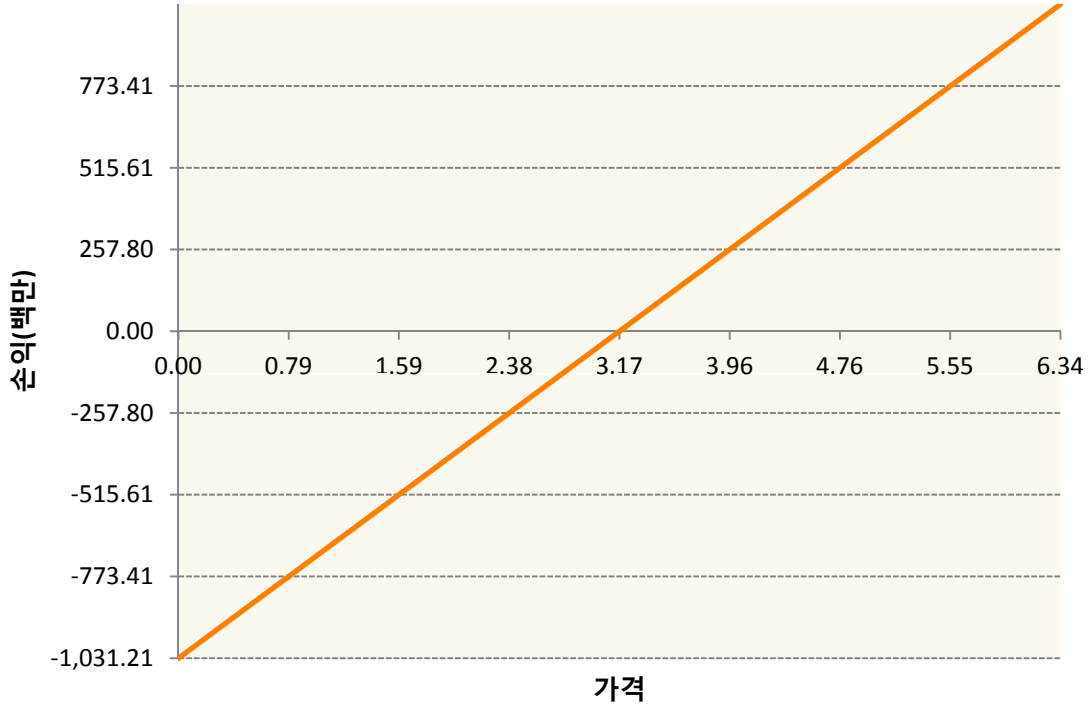


KR4175NA0007-2018-10 달러선물

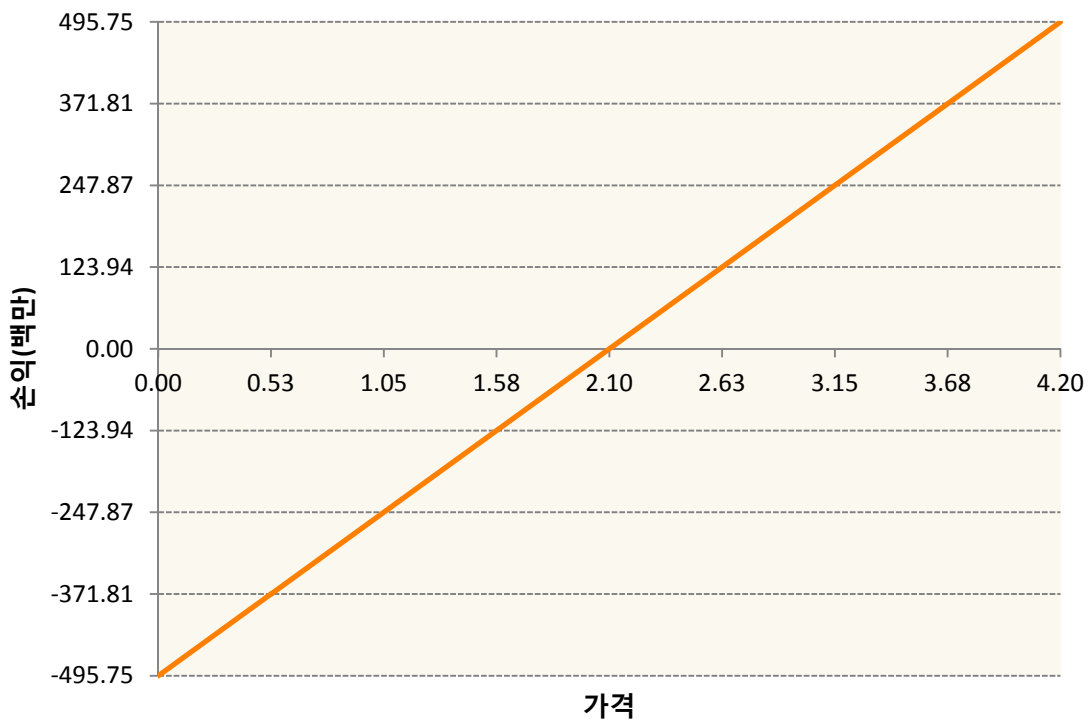




NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18



XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	60
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	83
HOX8	Heating Oil	36
KR4175NA0(2018-10 달러선물		50
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	82
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	40

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	455

공시일	2018-10-08
기준일	2018-10-05

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

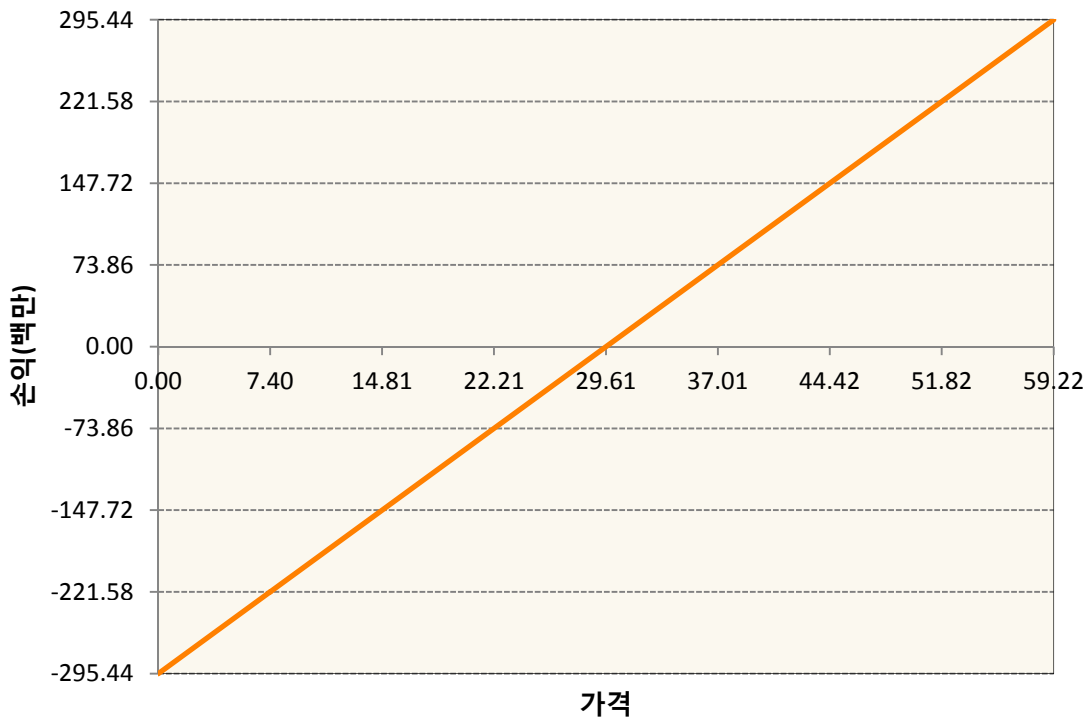
1. 계약금액

(단위:백만원)

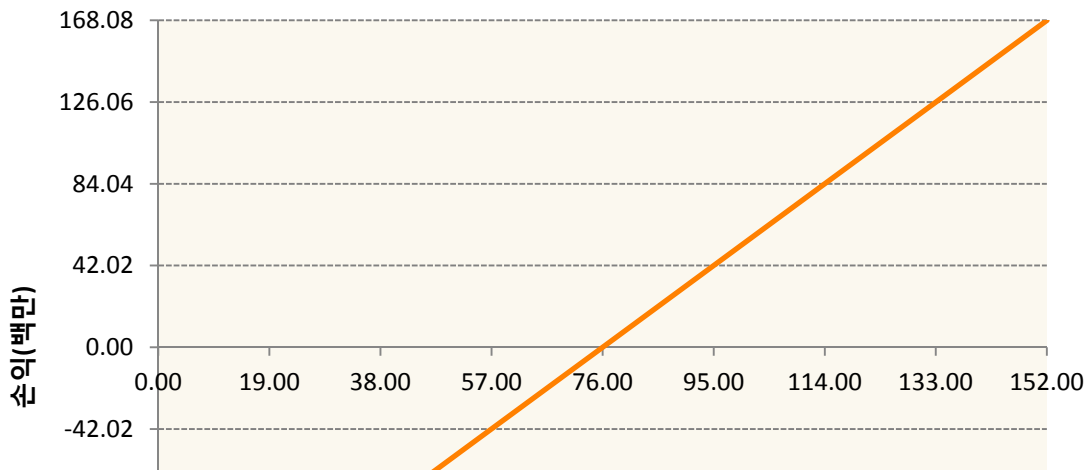
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,575	79	3,496	

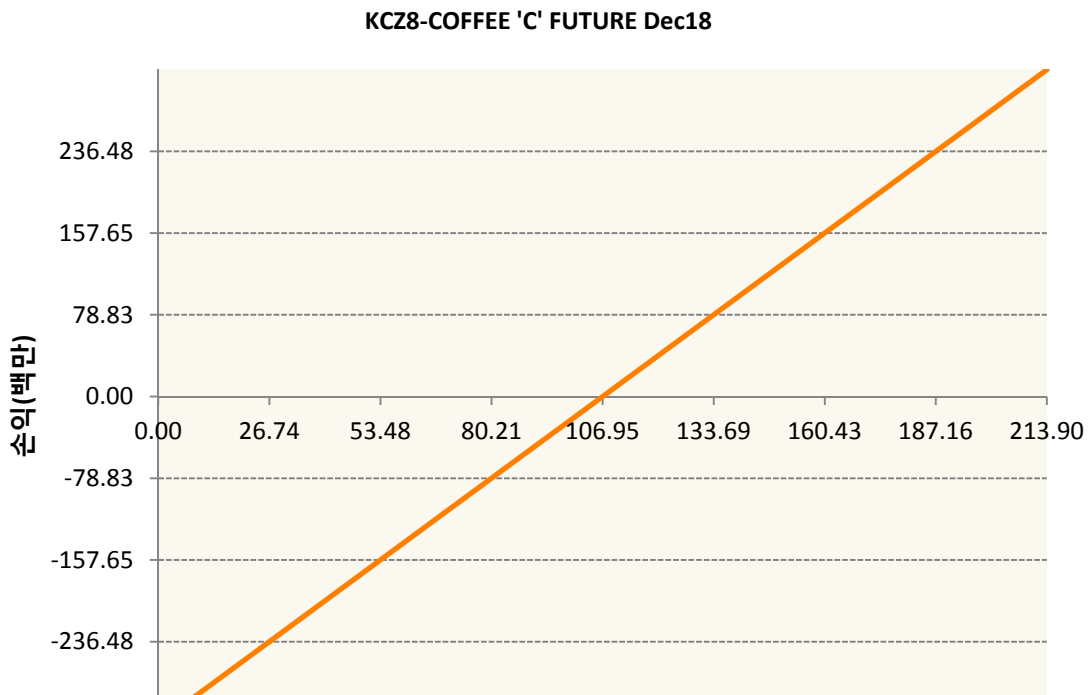
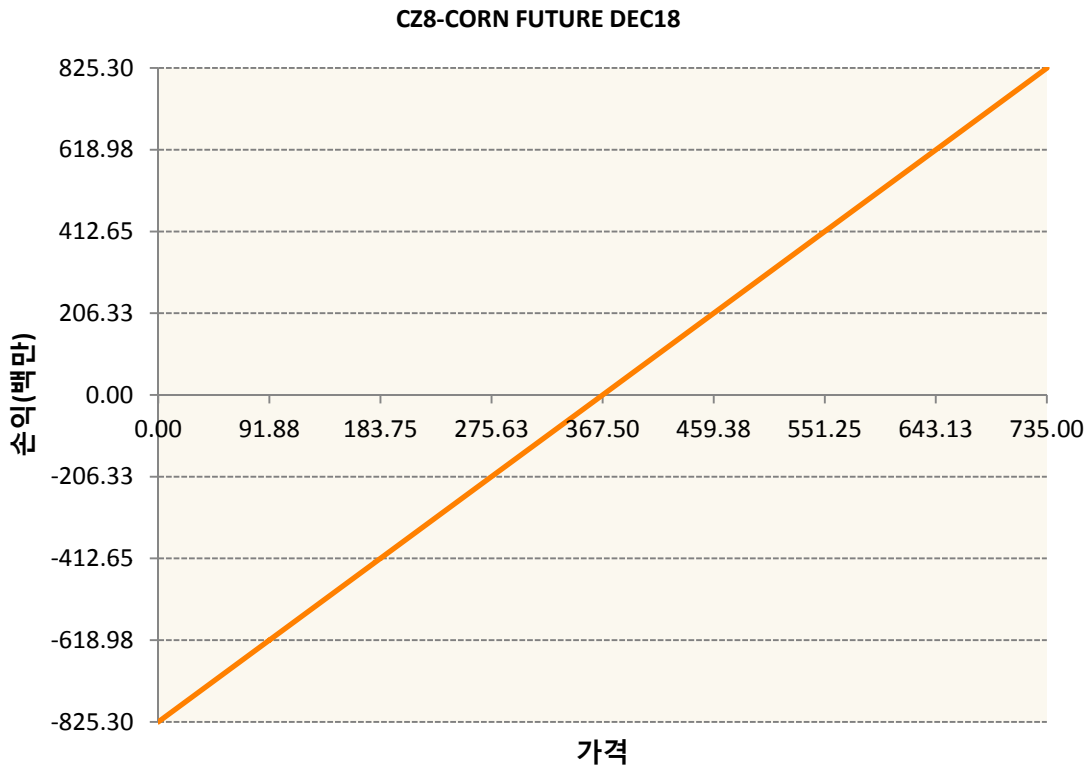
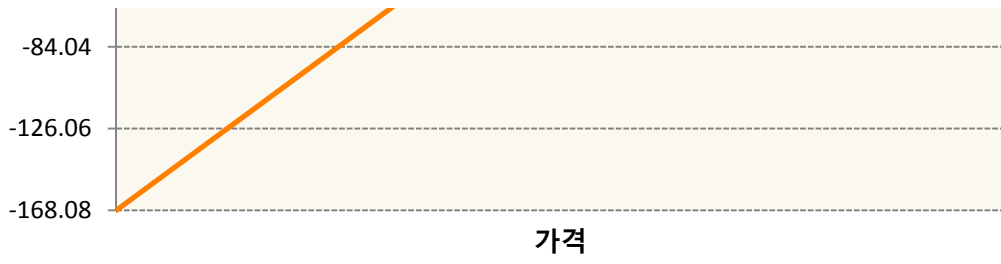
2. 만기시점의 손익구조

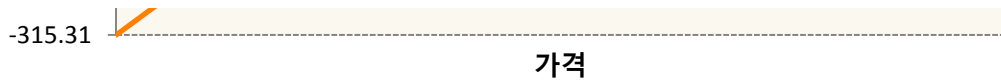
BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18



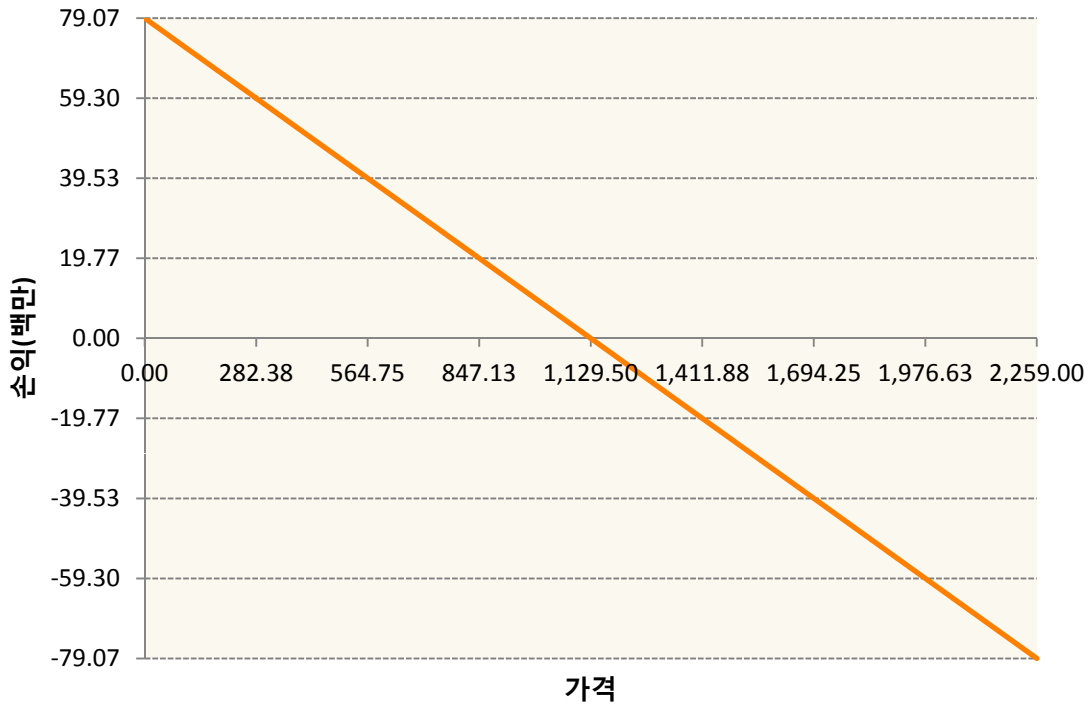
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



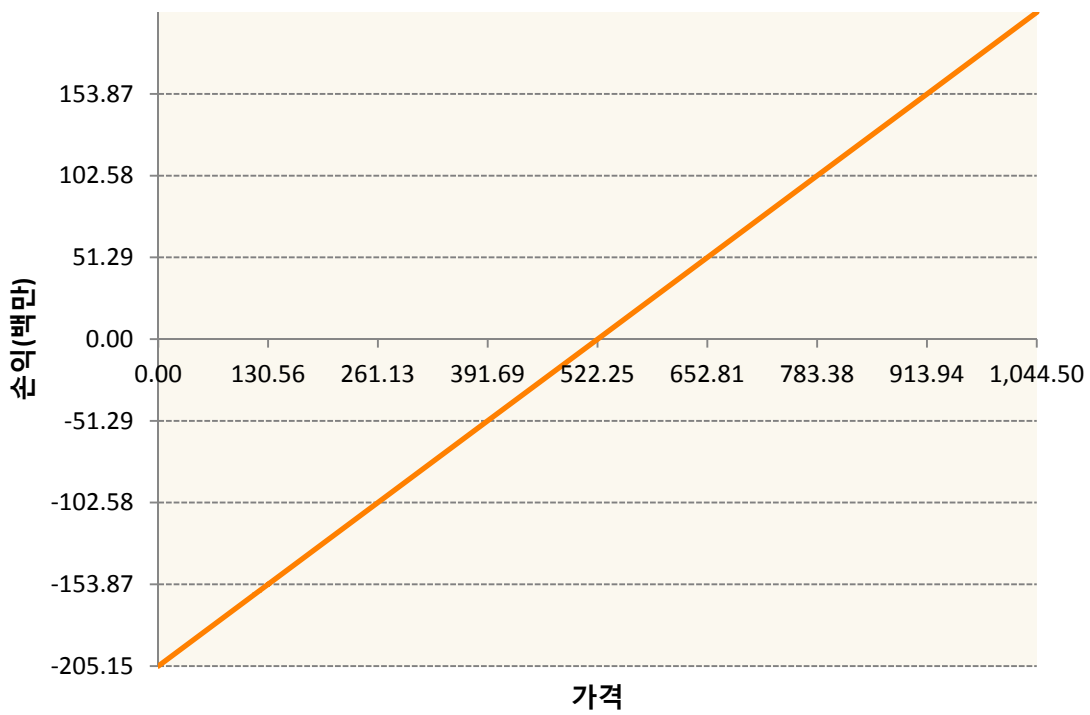




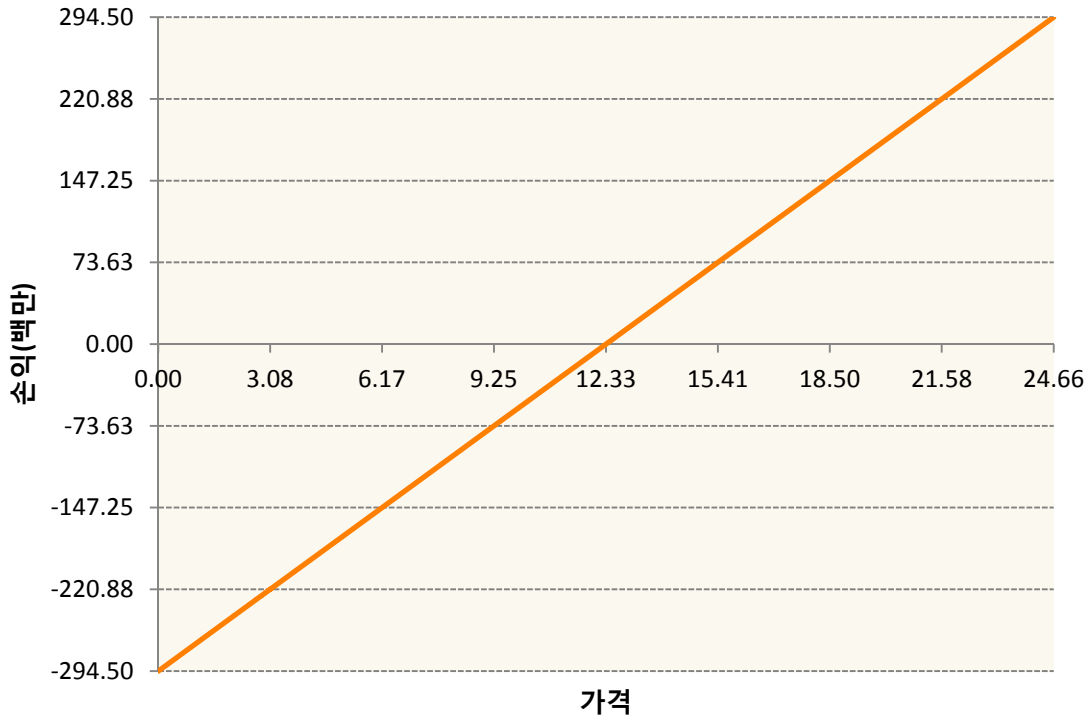
KR4175NA0007-2018-10 달러선물



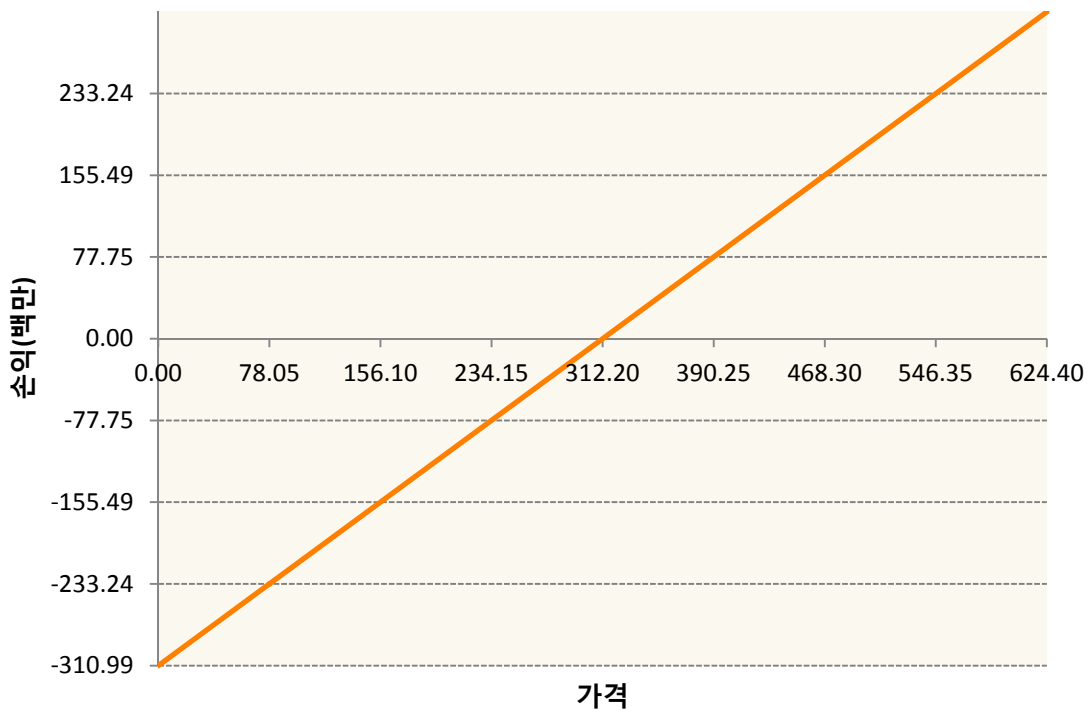
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



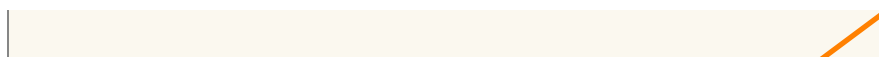
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

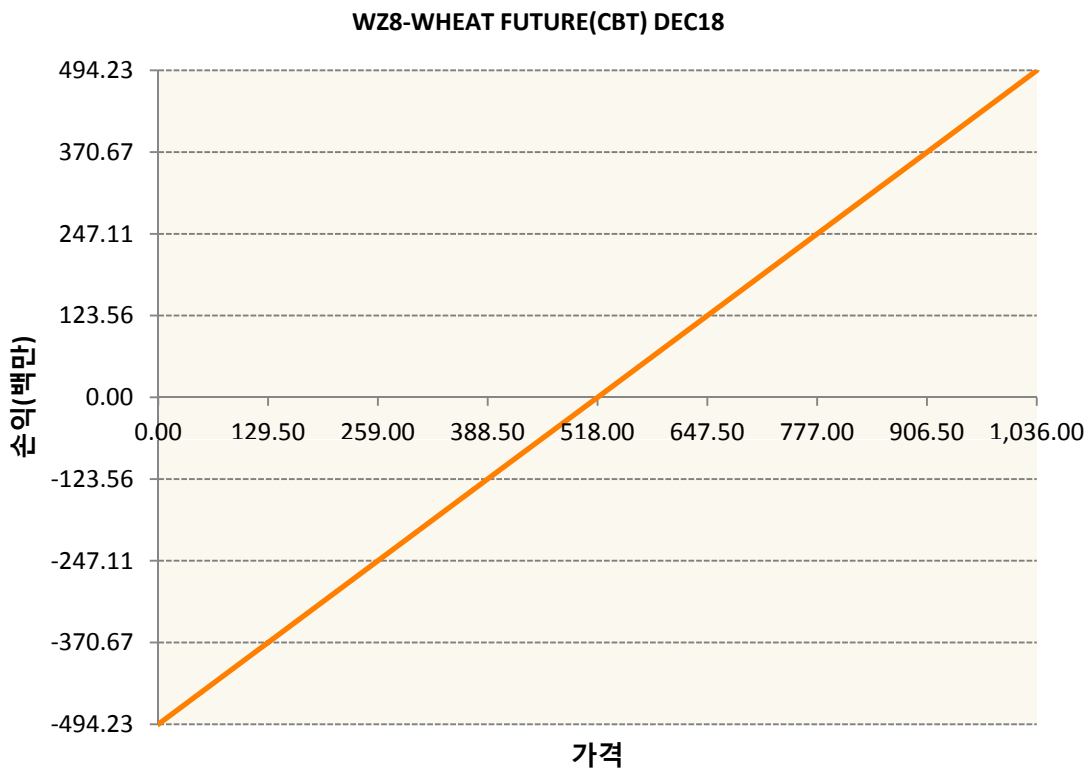
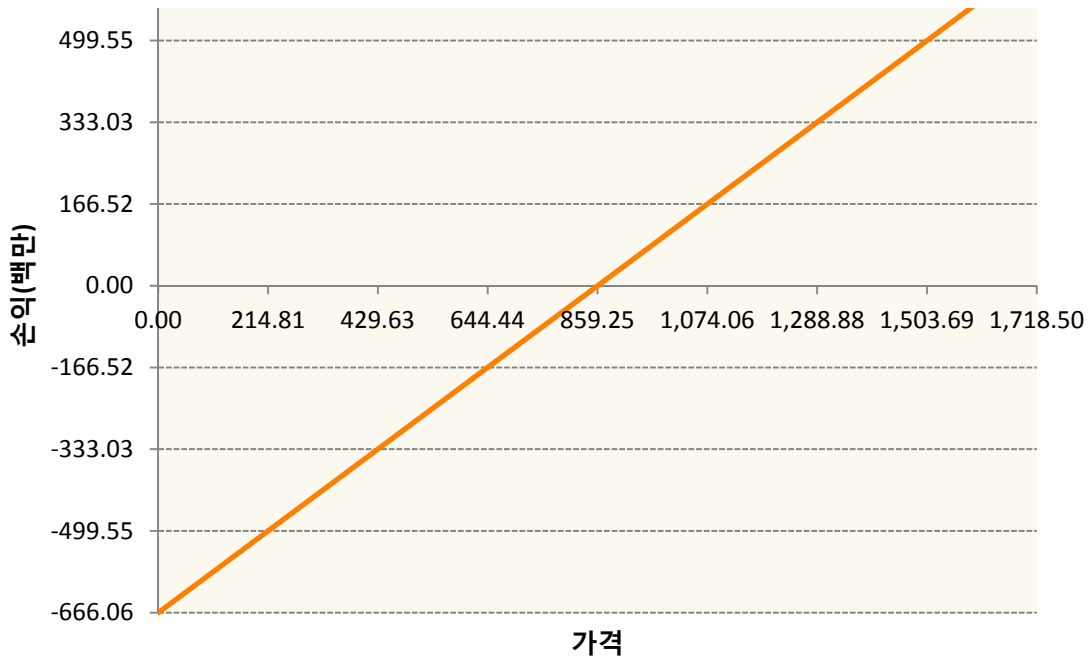


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	24
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	13
CZ8	CORN FUTURE DEC18	66
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	25
KR4175NA0	(2018-10 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	53
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	40

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

(단위:백만원)

312