

공시일	2018-10-11
기준일	2018-10-10

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	2018-10-11
기준일	2018-10-10

스마트인덱스모

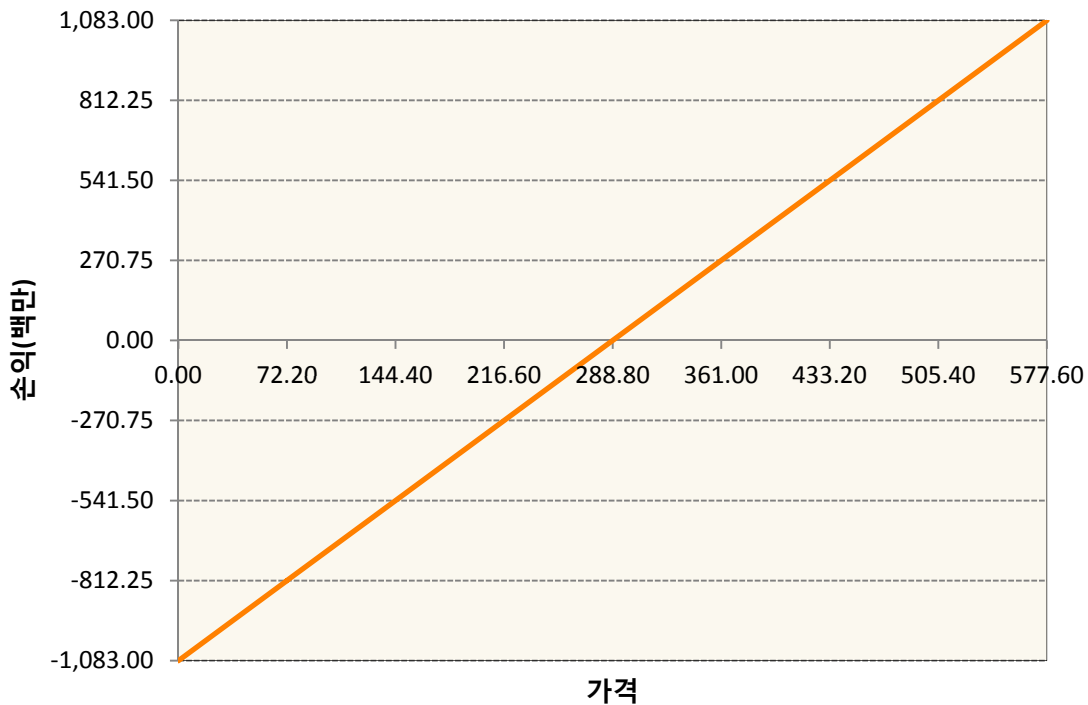
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,083	0	1,083	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물)

86

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
-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%	86	86	86	86	86	86	86

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

(단위:백만원)

66

공시일	2018-10-11
기준일	2018-10-10

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

1,137

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

480

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-11
기준일	2018-10-10

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

281

* 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	2018-10-11
기준일	2018-10-10

유로인덱스모(주식-파생형)

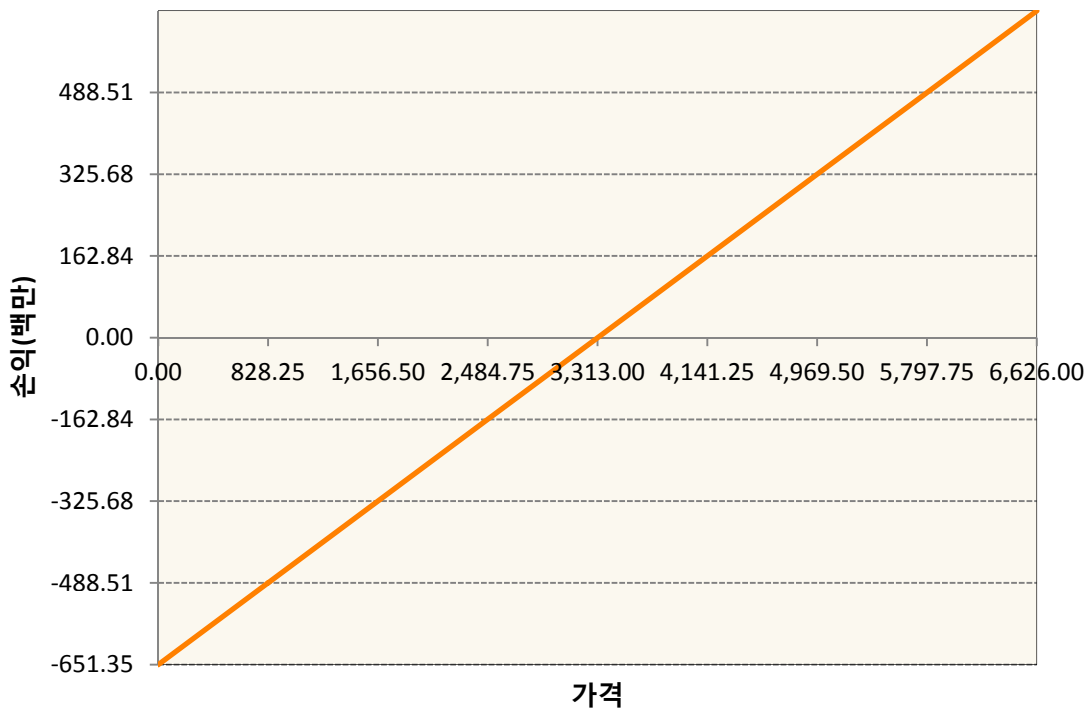
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	651	0	651	

2. 만기시점의 손익구조

VGZ8-EURO STOXX 50 DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ8	EURO STOXX 50 DEC18	52
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

32

공시일	2018-10-11
기준일	2018-10-10

차이나인덱스모(주식-파생형)

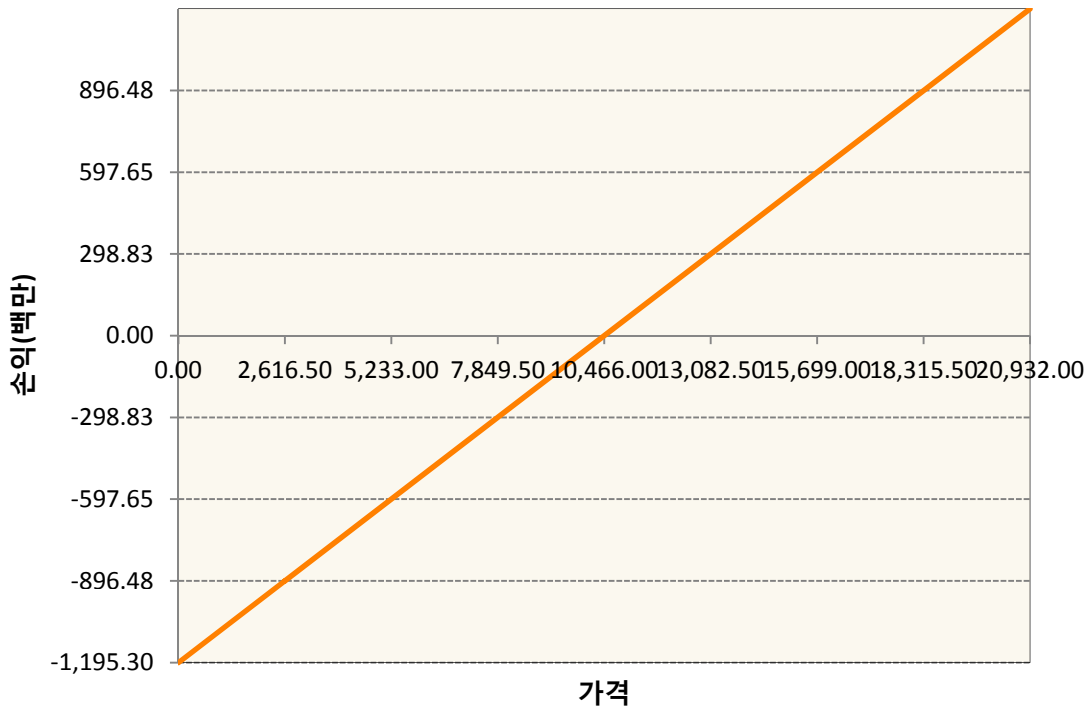
1. 계약금액

(단위:백만원)

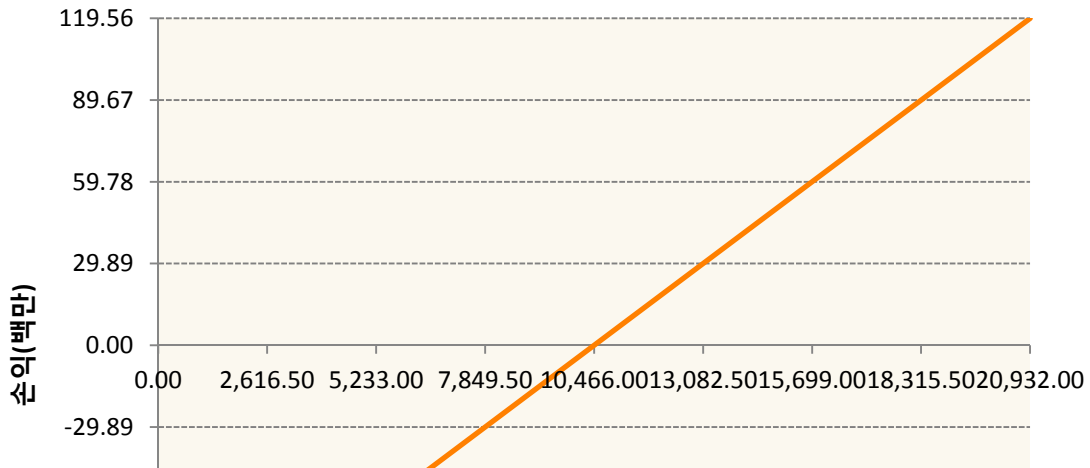
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,315	0	1,315	장내

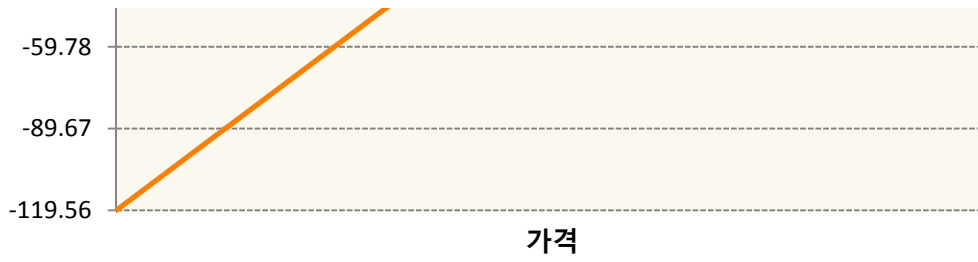
2. 만기시점의 손익구조

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)

99

공시일	2018-10-11
기준일	2018-10-10

커버드콜모(주식혼합-파생형)

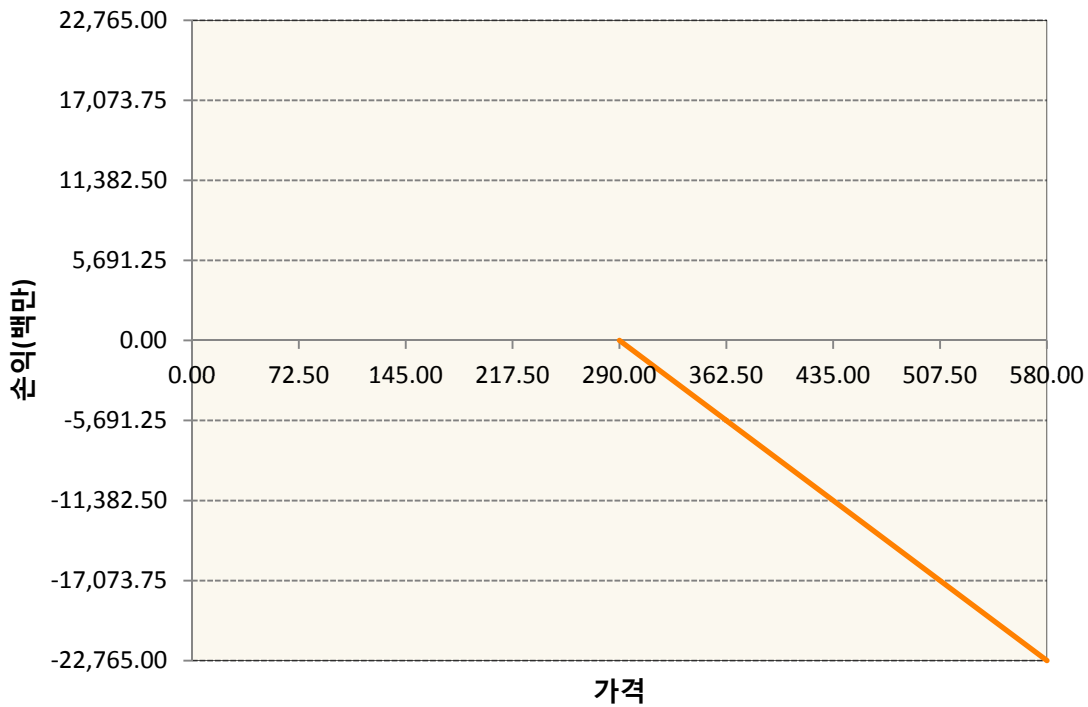
1. 계약금액

(단위:백만원)

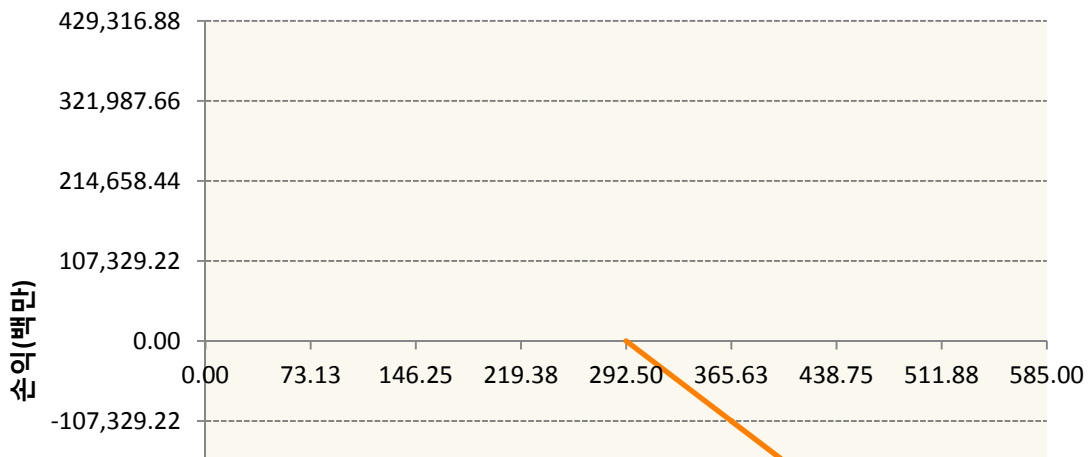
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	727,032	-727,032	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201NA2902-2018-10 콜290



KR4201NA2928-2018-10 콜292.5



-5.33%	378	378	378	378	378	378	378
-2.67%	378	378	378	376	374	369	361
0%	253	183	98	0	-109	-228	-355
2.67%	-4,457	-4,588	-4,730	-4,881	-5,038	-5,201	-5,369
5.33%	-15,327	-15,328	-15,331	-15,337	-15,347	-15,362	-15,384
8.00%	-26,592	-26,592	-26,592	-26,592	-26,592	-26,593	-26,593

KR4301NA29 2018-10 풋 292.5

21,632

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21,632	-21,632	-21,632	-21,632	-21,632	-21,632	-21,632
-5.33%	-14,417	-14,417	-14,417	-14,417	-14,417	-14,417	-14,417
-2.67%	-7,202	-7,202	-7,202	-7,202	-7,202	-7,202	-7,202
0%	12	10	6	0	-9	-21	-36
2.67%	4,363	4,347	4,326	4,300	4,270	4,237	4,200
5.33%	4,385	4,385	4,385	4,385	4,385	4,385	4,385
8.00%	4,385	4,385	4,385	4,385	4,385	4,385	4,385

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

(단위:백만원)

60,599

공시일	2018-10-11
기준일	2018-10-10

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

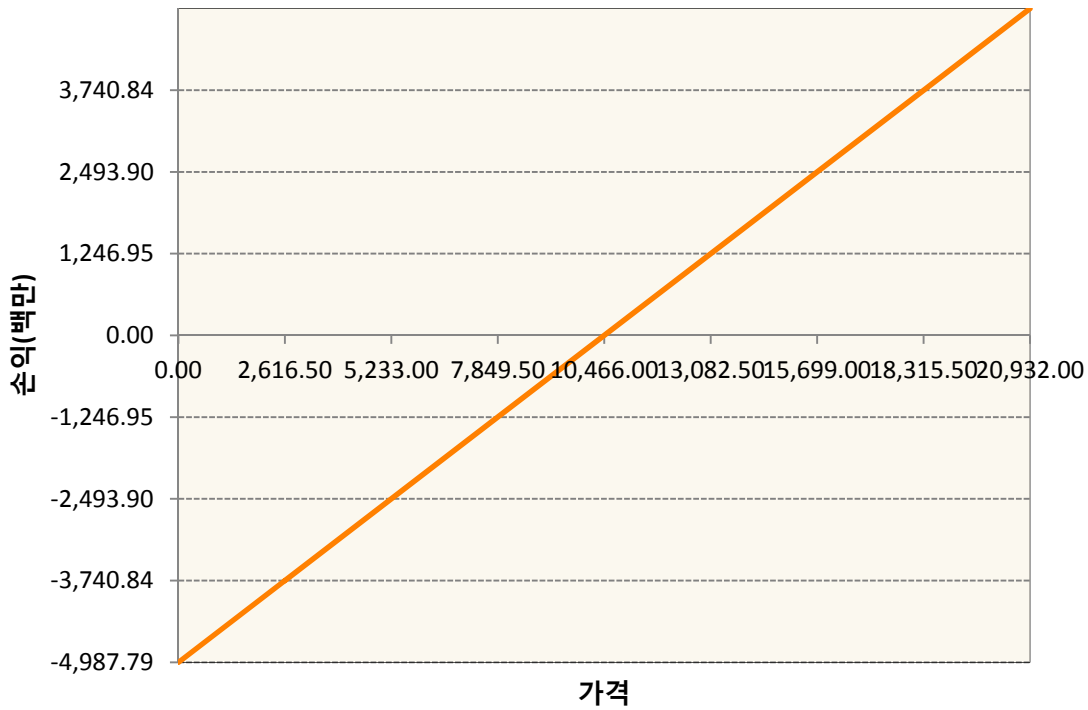
1. 계약금액

(단위:백만원)

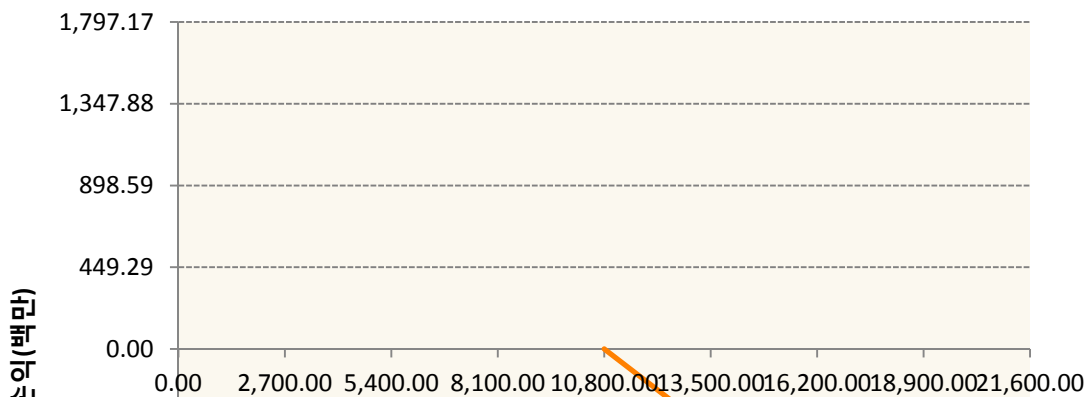
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,988	0	4,988	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,871	-11,871	장내

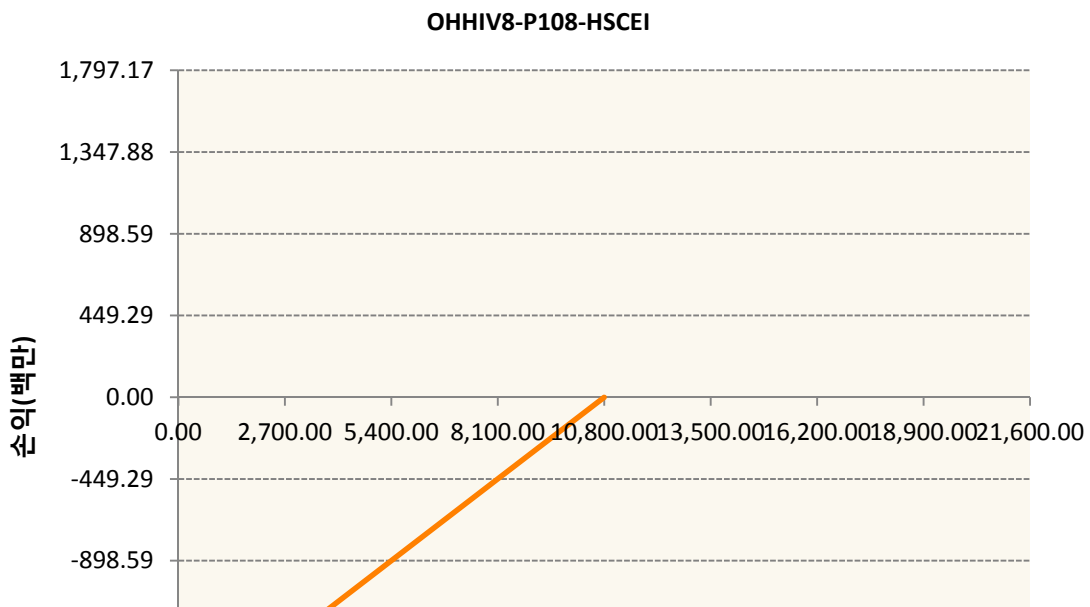
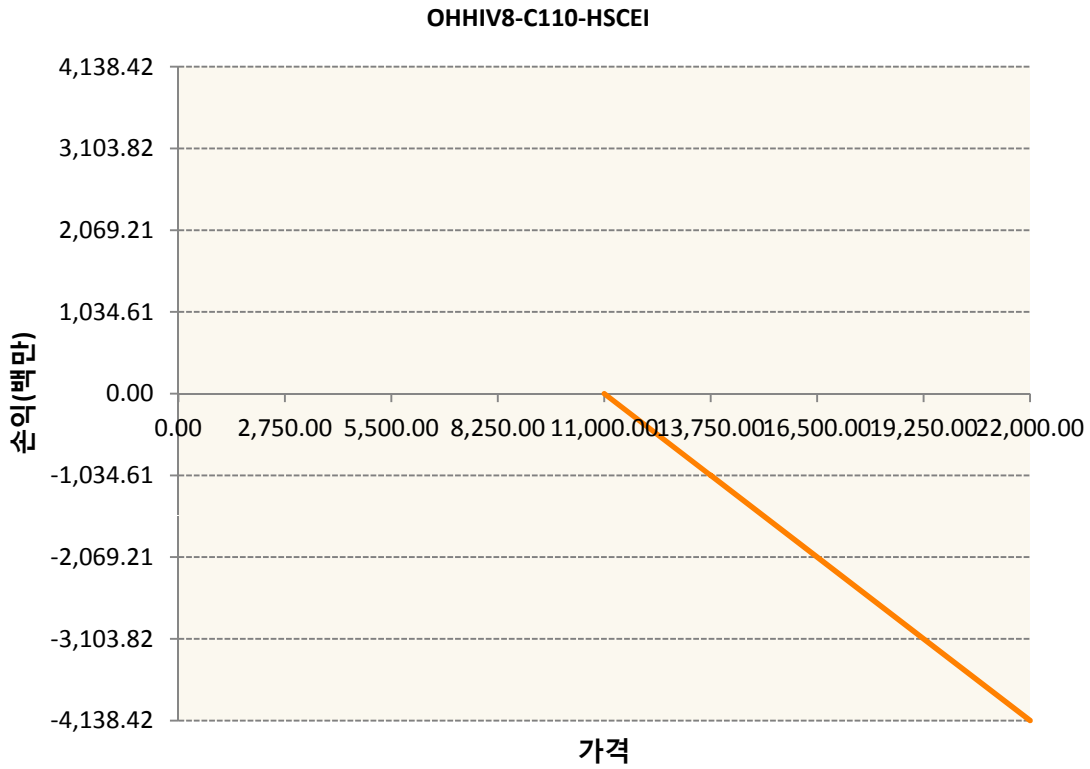
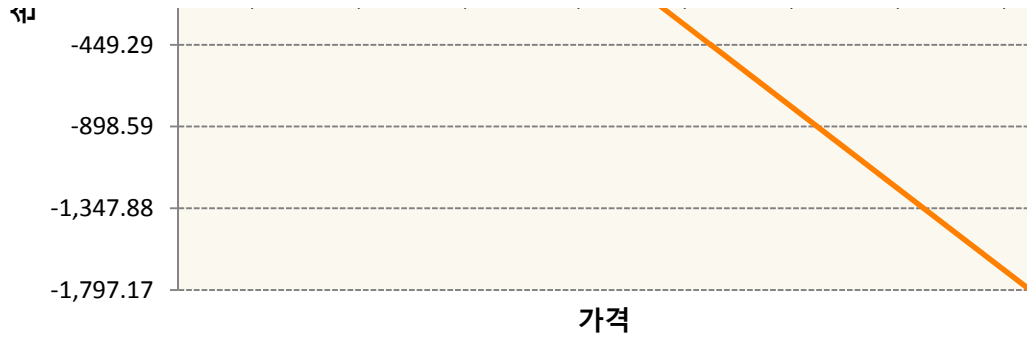
2. 만기시점의 손익구조

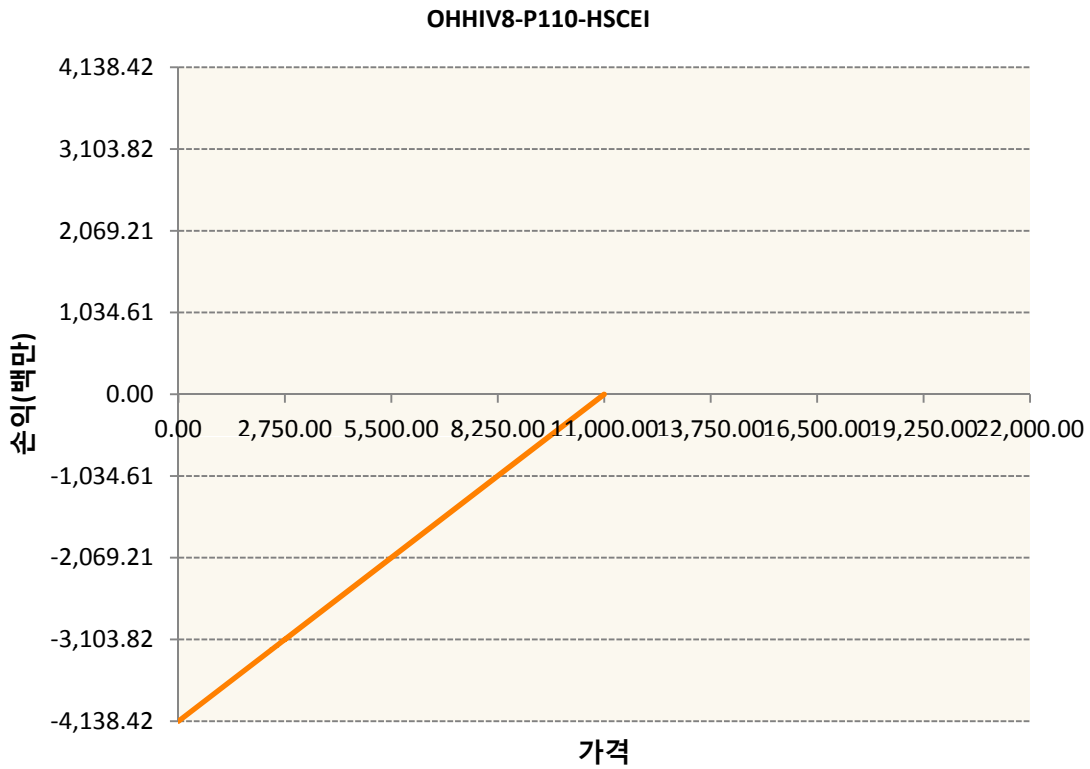
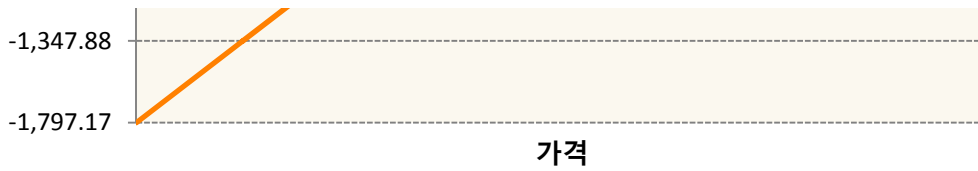
HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



OHHIV8-C108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	399
OHHIV8-C1	HSCEI	144
OHHIV8-C11	HSCEI	331
OHHIV8-P1C	HSCEI	144
OHHIV8-P11	HSCEI	331

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,275

공시일	2018-10-11
기준일	2018-10-10

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

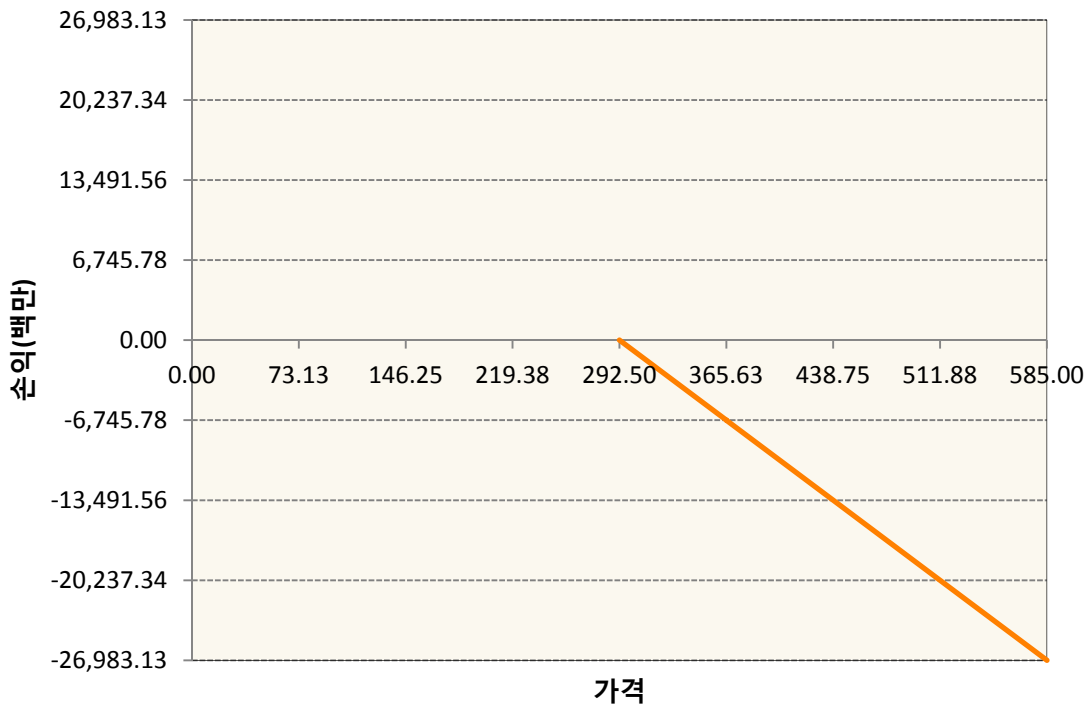
1. 계약금액

(단위:백만원)

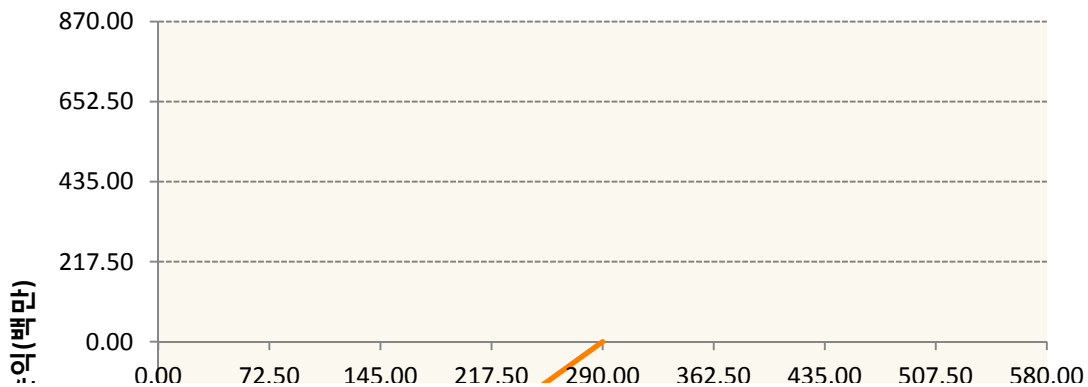
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	47,451	-47,451	장내

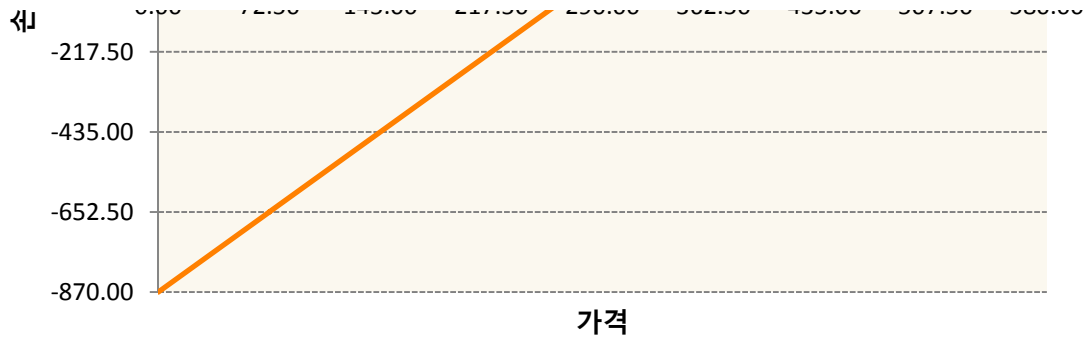
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NA2928-2018-10 콜292.5

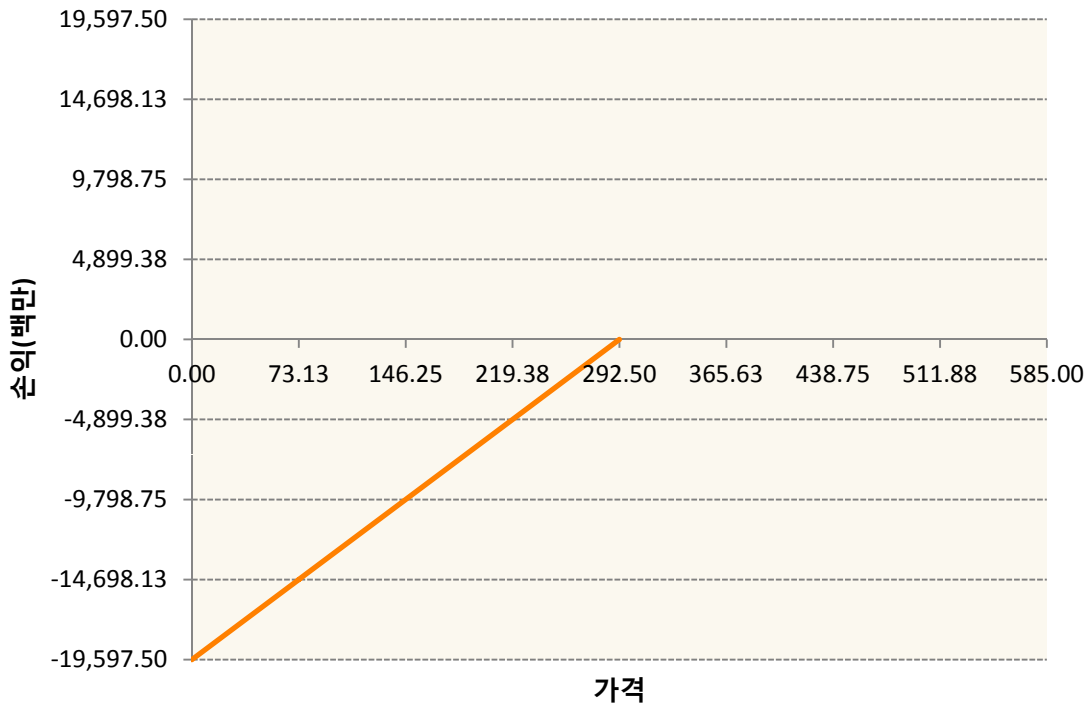


KR4301NA2901-2018-10 풋290





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							4,025
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,025	-4,025	-4,025	-4,025	-4,025	-4,025	-4,025
-5.33%	-2,684	-2,684	-2,684	-2,684	-2,684	-2,684	-2,684
-2.67%	-1,342	-1,342	-1,342	-1,342	-1,342	-1,342	-1,342
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,342	1,342	1,342	1,342	1,342	1,342	1,342
5.33%	2,684	2,684	2,684	2,684	2,684	2,684	2,684
8.00%	4,025	4,025	4,025	4,025	4,025	4,025	4,025
KR4201NA2927-2018-10 풋292.5							1,671
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	24	24	24	24	24	24	24
-5.33%	24	24	24	24	24	24	24
-2.67%	24	24	24	24	23	23	23
0%	16	11	6	0	-7	-14	-22
2.67%	-280	-288	-297	-307	-317	-327	-337
5.33%	-963	-963	-964	-964	-965	-966	-967
8.00%	-1,671	-1,671	-1,671	-1,671	-1,671	-1,671	-1,671

KR4301NA2☹ 2018-10 풋290

69

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69
-5.33%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
-2.67%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	7	7	7	7	7	7	7
5.33%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	7	7	7	7	7	7	7

KR4301NA2☹ 2018-10 풋292.5

1,542

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,542	-1,542	-1,542	-1,542	-1,542	-1,542	-1,542
-5.33%	-1,028	-1,028	-1,028	-1,028	-1,028	-1,028	-1,028
-2.67%	-513	-513	-513	-513	-513	-513	-513
0%	1	1	0	0	-1	-1	-3
2.67%	311	310	308	307	304	302	299
5.33%	313	313	313	313	313	313	313
8.00%	313	313	313	313	313	313	313

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

(단위:백만원)

8,063

공시일	2018-10-11
기준일	2018-10-10

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

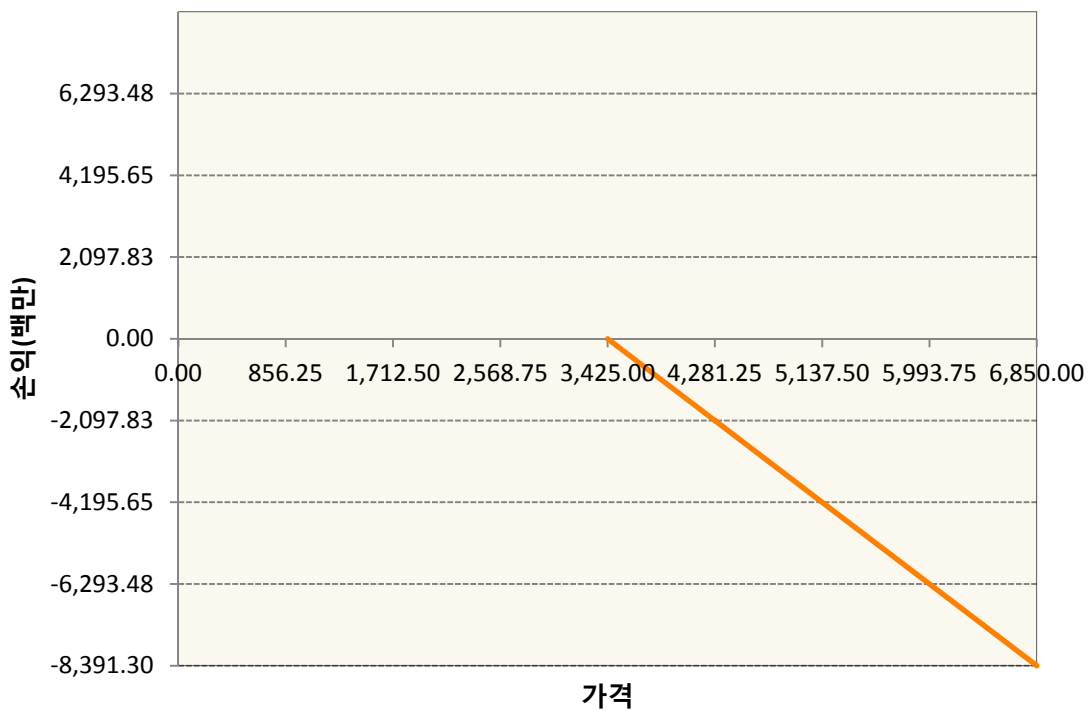
1. 계약금액

(단위:백만원)

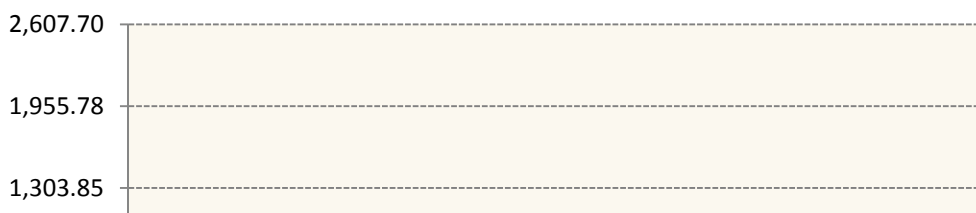
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,922	0	3,922	
누계	유가증권	스왑	34,414	0	34,414	장외
누계	유가증권	옵션	0	21,998	-21,998	장내
누계	지수	스왑	52,906	0	52,906	장외

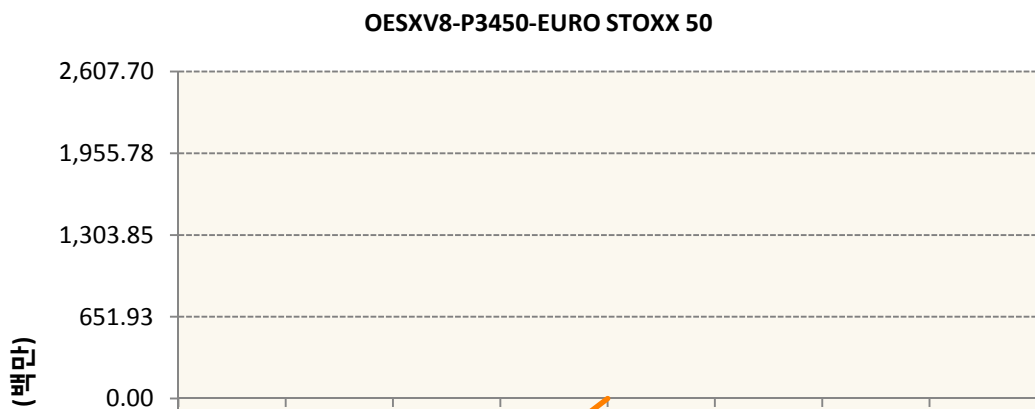
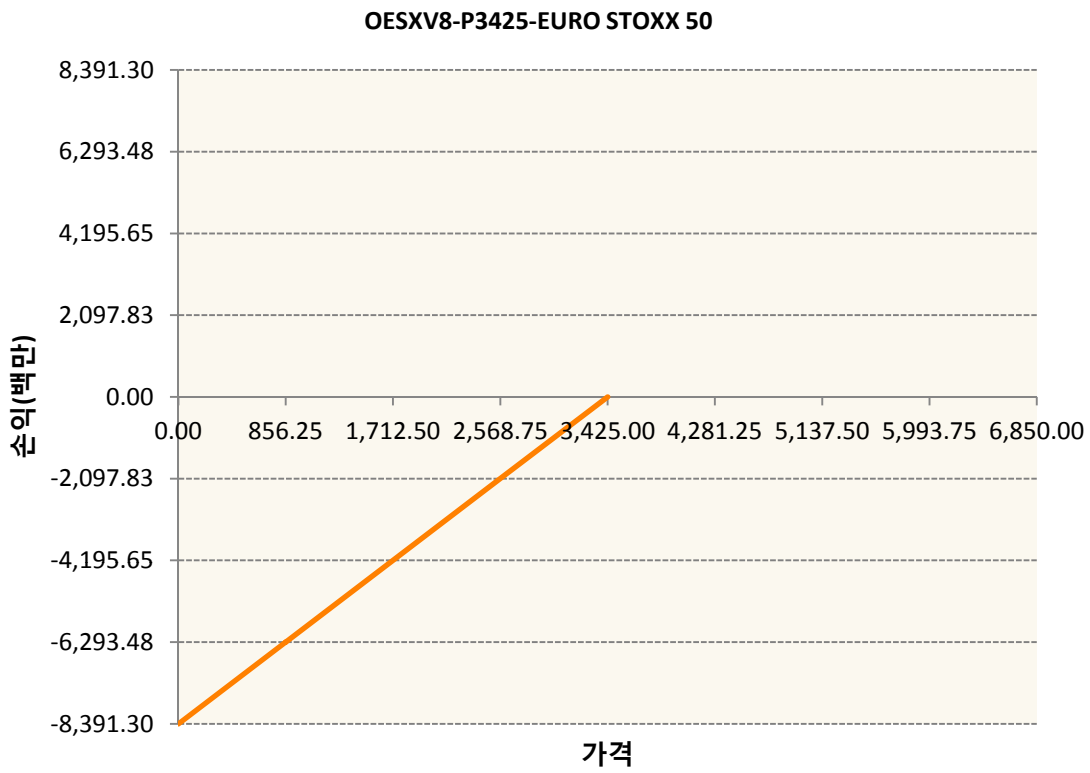
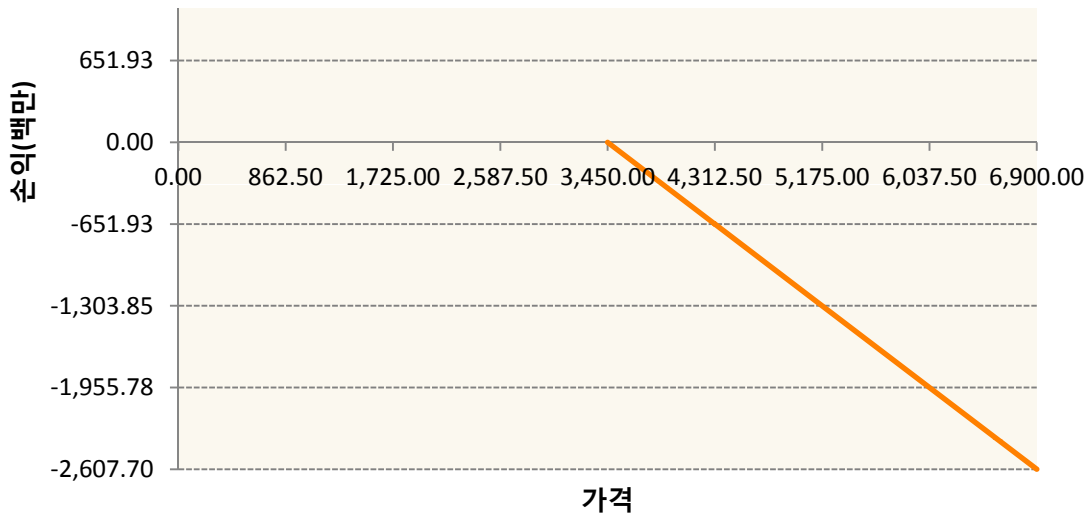
2. 만기시점의 손익구조

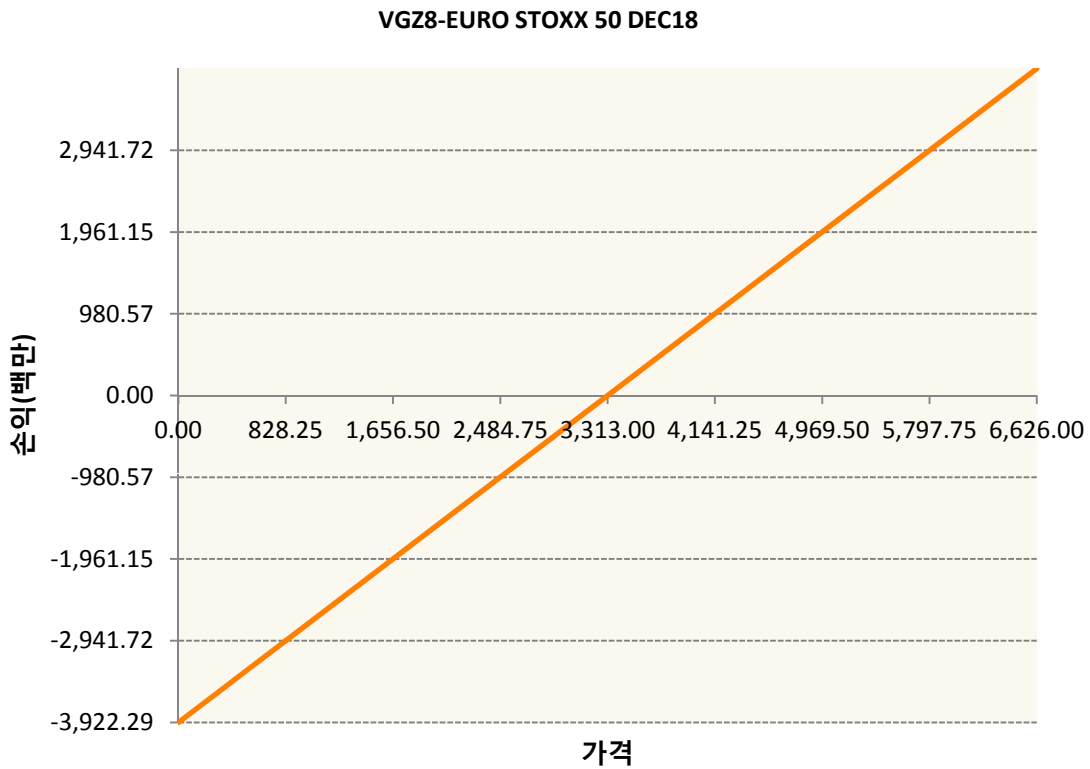
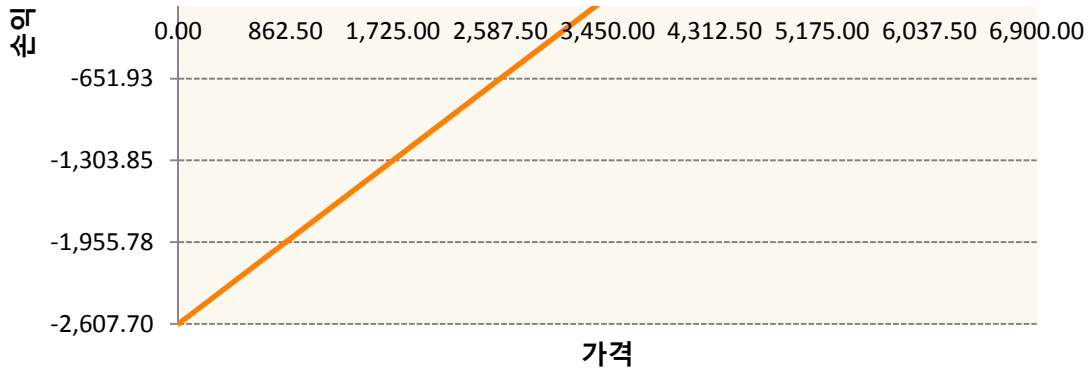
OESXV8-C3425-EURO STOXX 50



OESXV8-C3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		76
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		50
OESXV8-C34 EURO STOXX 50		671
OESXV8-C34 EURO STOXX 50		209
OESXV8-P34 EURO STOXX 50		671
OESXV8-P34 EURO STOXX 50		209
VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18		314

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

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

(단위:백만원)

1,113

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

(단위:백만원)

88

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

(단위:백만원)

131

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

(단위:백만원)

160

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

(단위:백만원)

39

공시일	2018-10-11
기준일	2018-10-10

리디파인K200(주식혼합-파생재간

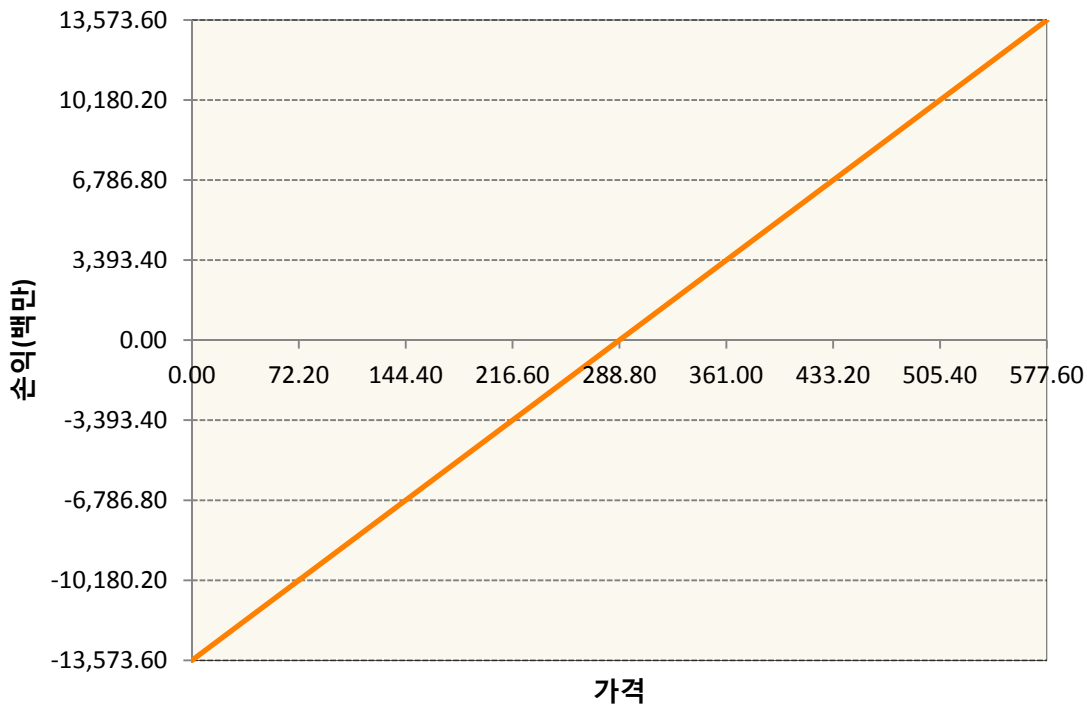
1. 계약금액

(단위:백만원)

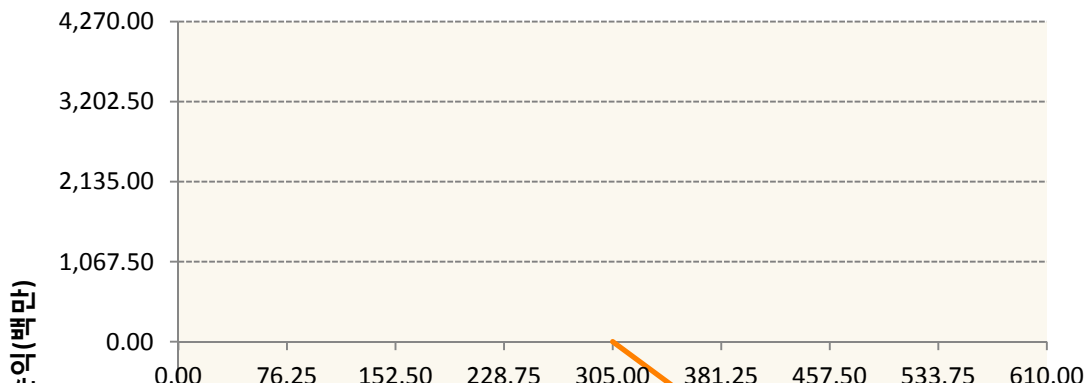
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,574	0	13,574	장내
누계	유가증권	옵션	2,119	24,488	-22,369	장내

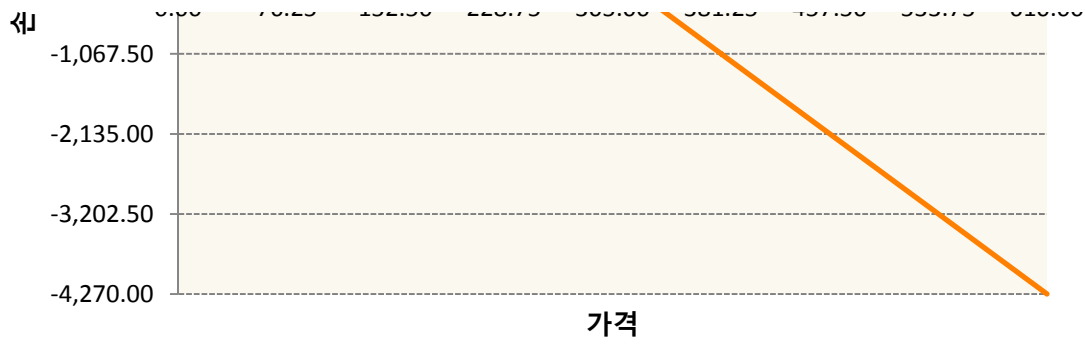
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

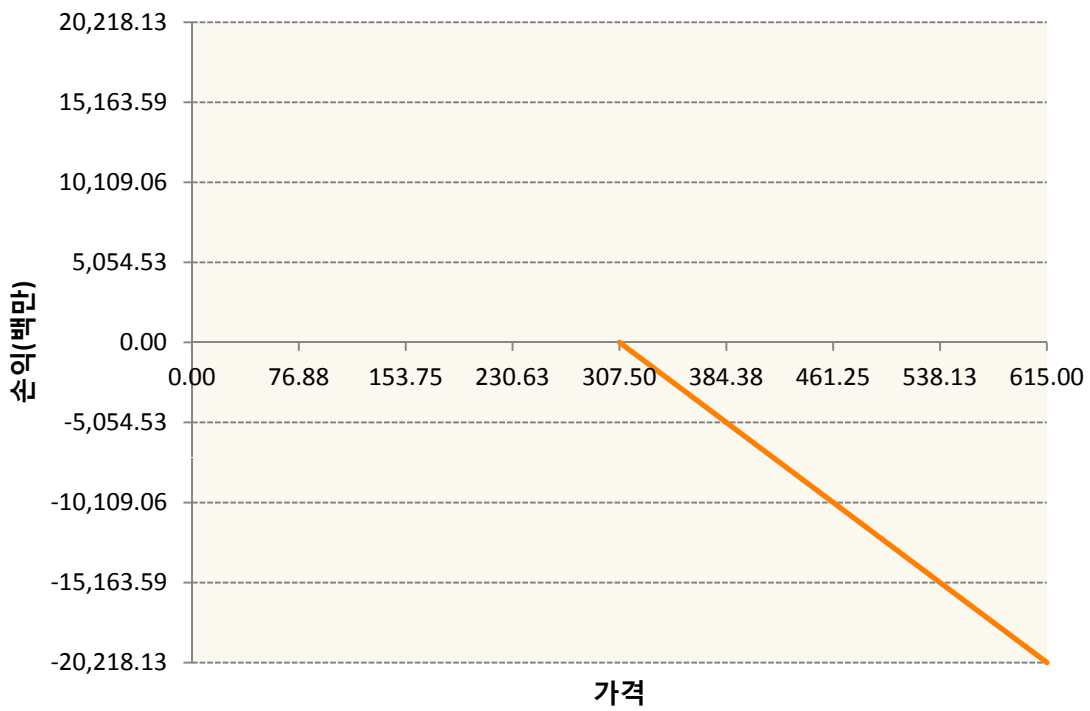


KR4201NA3058-2018-10 콜305

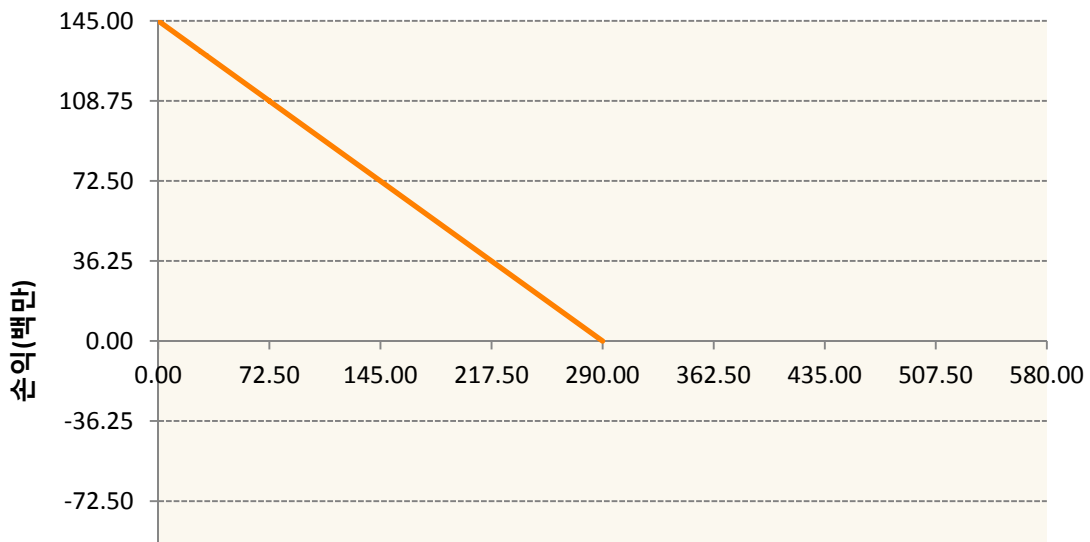


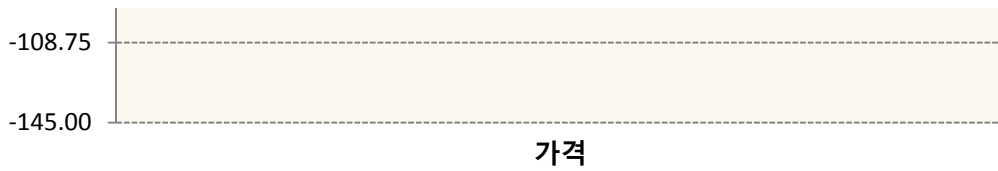


KR4201NA3074-2018-10 콜307.5

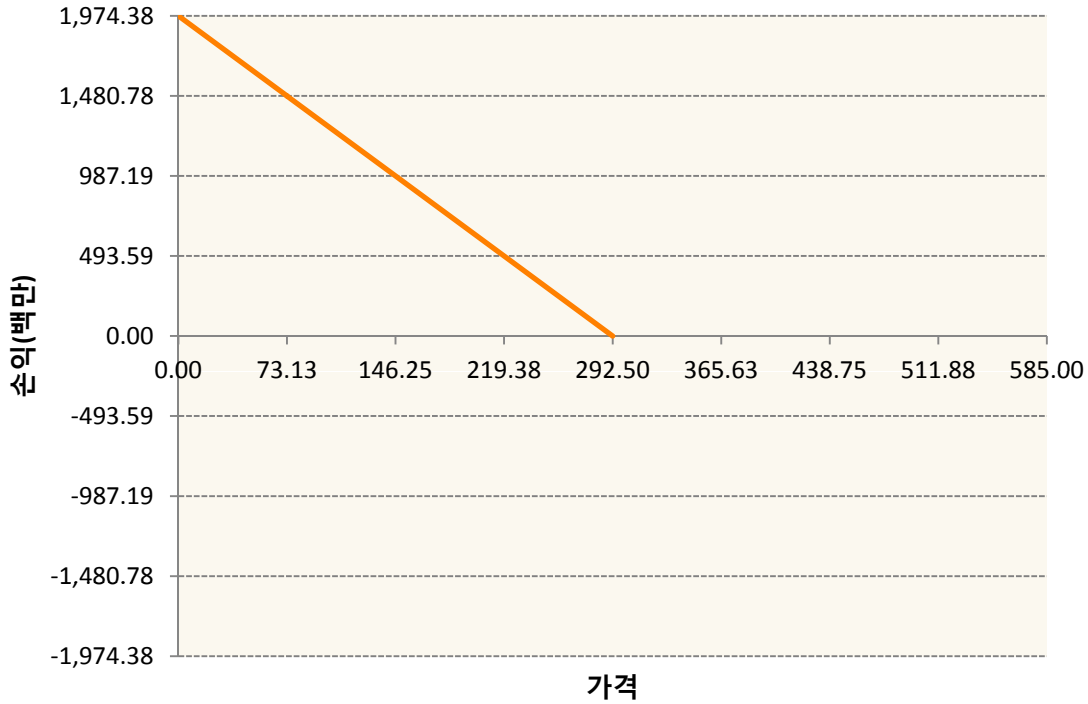


KR4301NA2901-2018-10 풋290





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물)							1,082
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%	-722	-722	-722	-722	-722	-722	-722
-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%	722	722	722	722	722	722	722
8.00%	1,082	1,082	1,082	1,082	1,082	1,082	1,082
KR4201NA3(2018-10 콜305)							88
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0

0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	-1	-1
5.33%	-8	-10	-12	-13	-15	-17	-19
8.00%	-83	-83	-84	-85	-86	-87	-88

KR4201NA3(2018-10 콜307.5

280

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	-1	-1
5.33%	-9	-13	-18	-23	-29	-36	-42
8.00%	-239	-244	-251	-258	-265	-272	-280

KR4301NA2(2018-10 풋290

11

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11	11	11	11	11	11	11
-5.33%	8	8	8	8	8	8	8
-2.67%	4	4	4	4	4	4	4
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

155

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	155	155	155	155	155	155	155
-5.33%	104	104	104	104	104	104	104
-2.67%	52	52	52	52	52	52	52
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-31	-31	-31	-31	-31	-30	-30
5.33%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
8.00%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31

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

(단위:백만원)

954

공시일	2018-10-11
기준일	2018-10-10

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

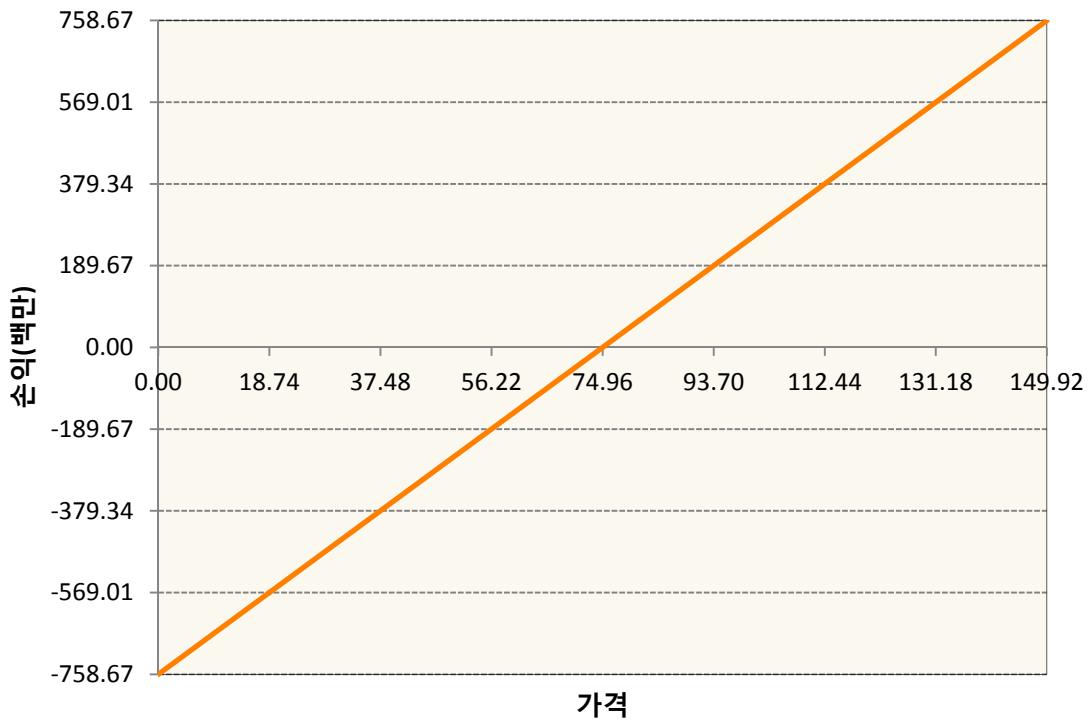
1. 계약금액

(단위:백만원)

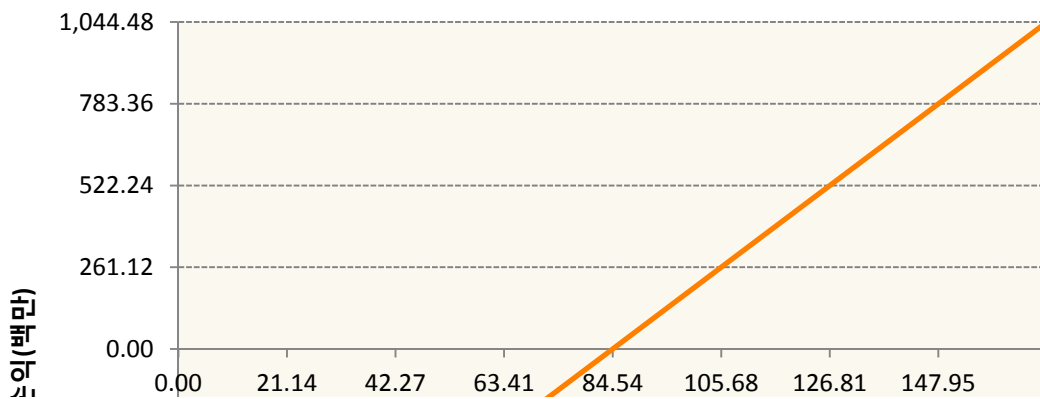
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,358	624	2,734	
누계	유가증권	선물	458	0	458	장내

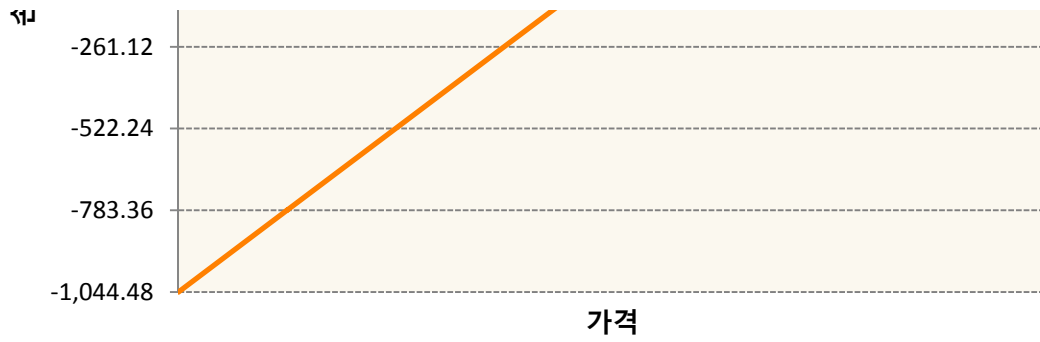
2. 만기시점의 손익구조

CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18

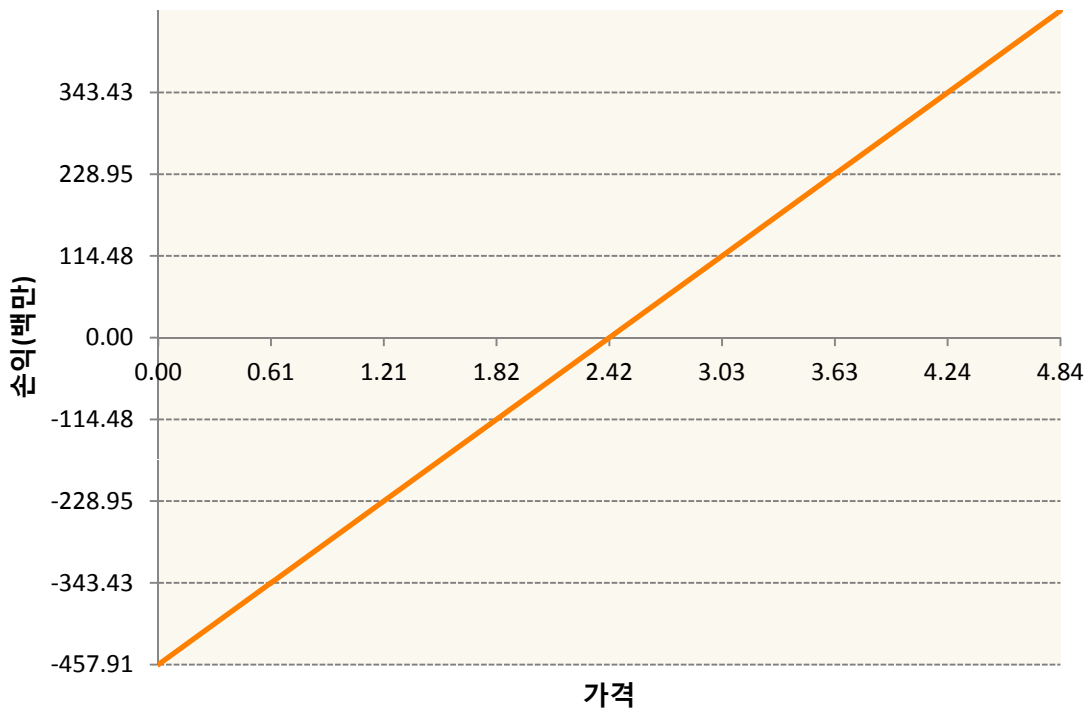


COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19

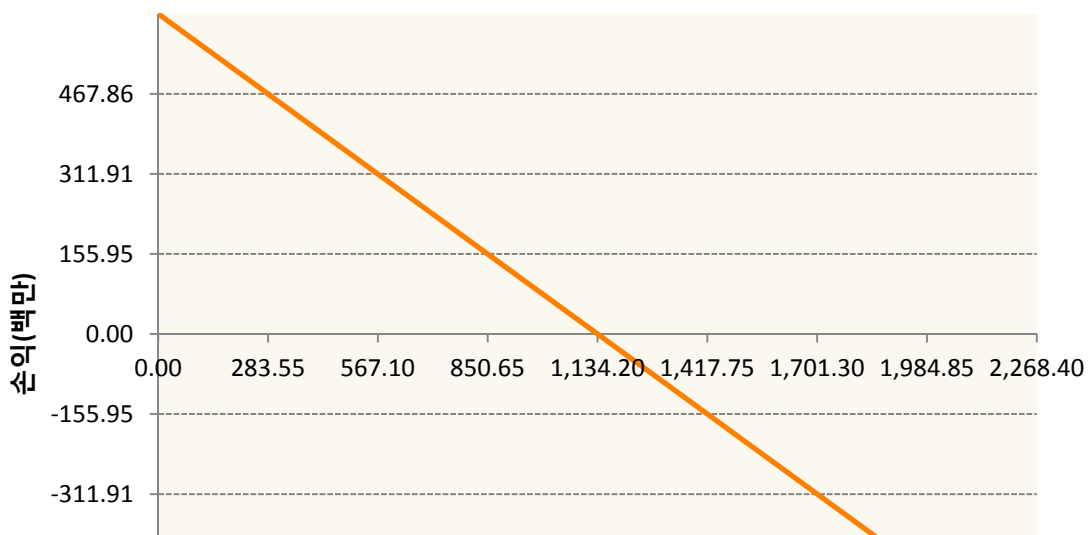


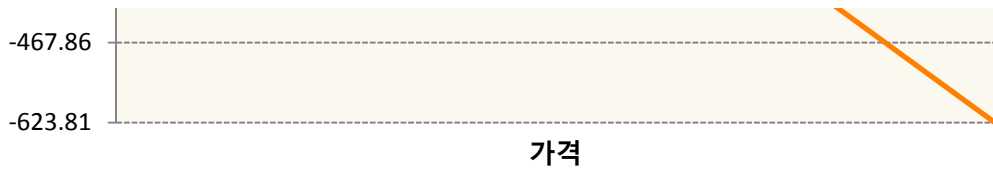


HOX8-Heating Oil

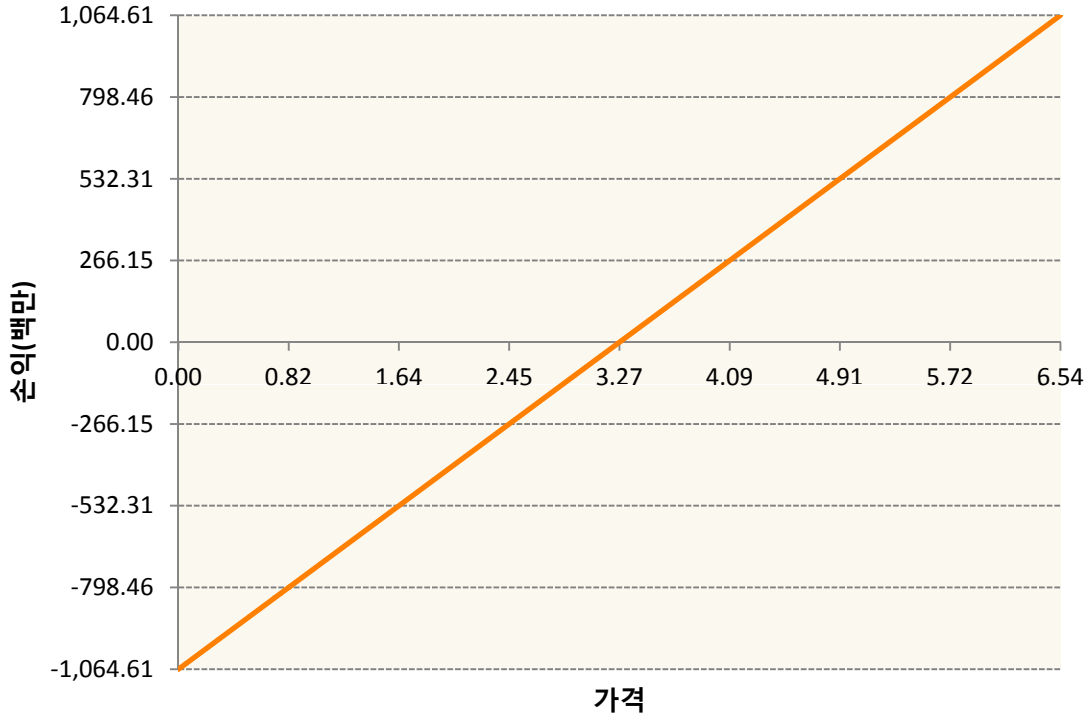


KR4175NA0007-2018-10 달러선물

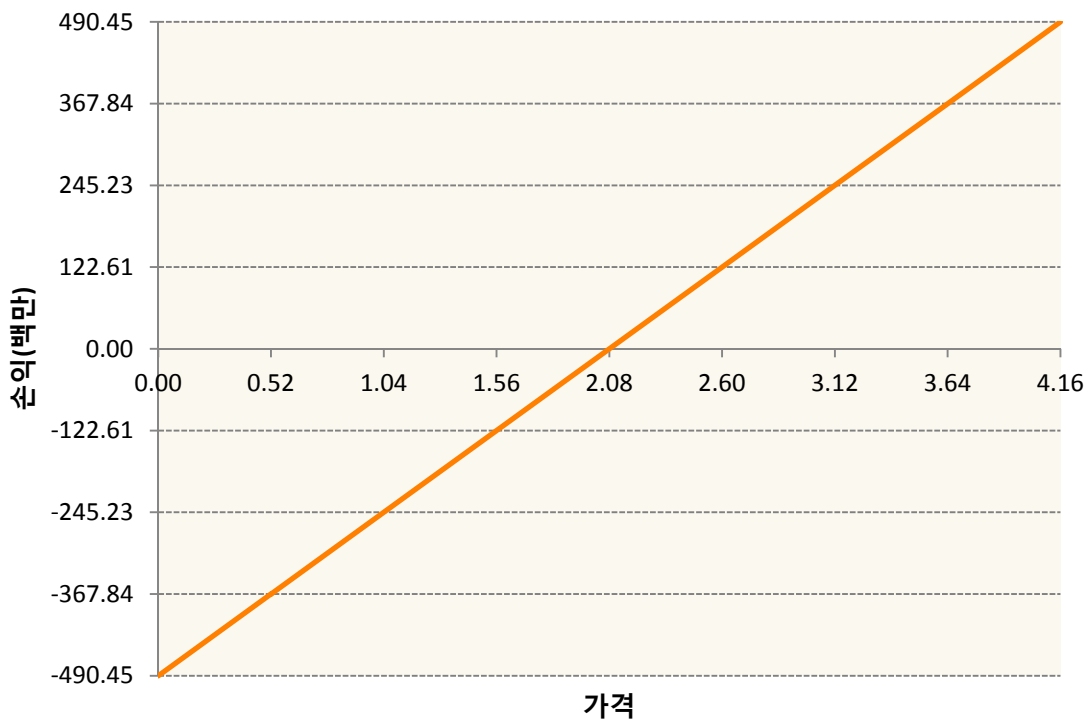




NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18



XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	61
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	84
HOX8	Heating Oil	37
KR4175NA0(2018-10 달러선물		50
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	85
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	39

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	458

공시일	2018-10-11
기준일	2018-10-10

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

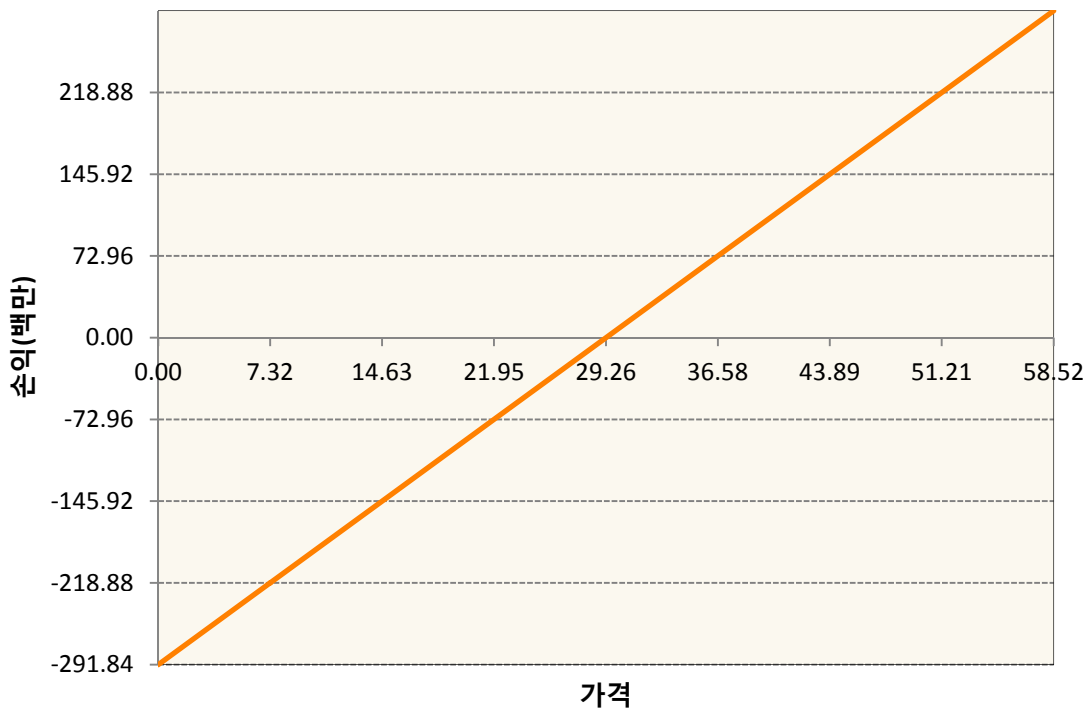
1. 계약금액

(단위:백만원)

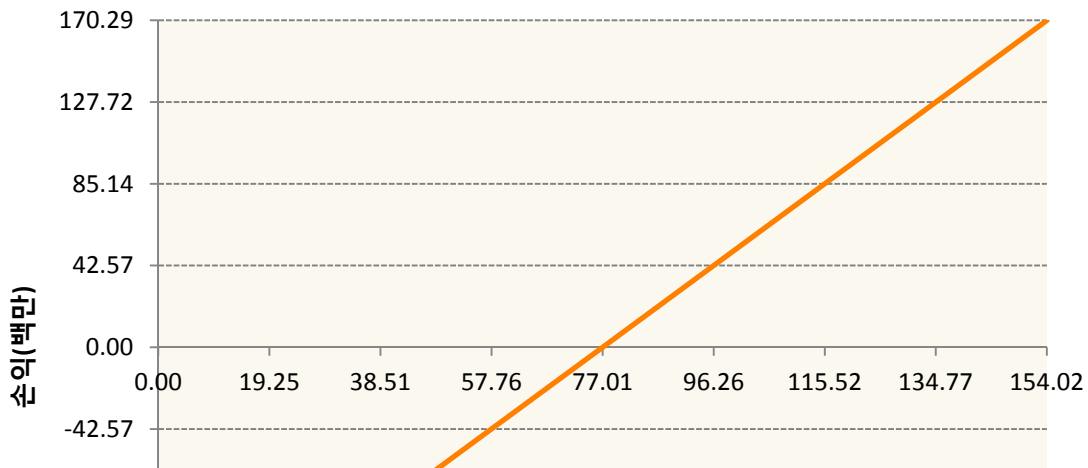
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,605	79	3,526	

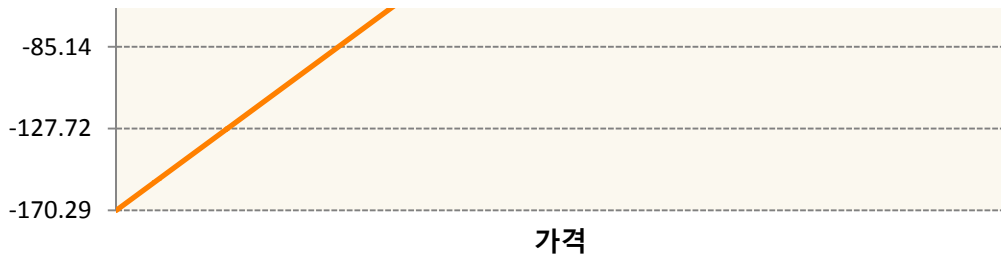
2. 만기시점의 손익구조

BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18

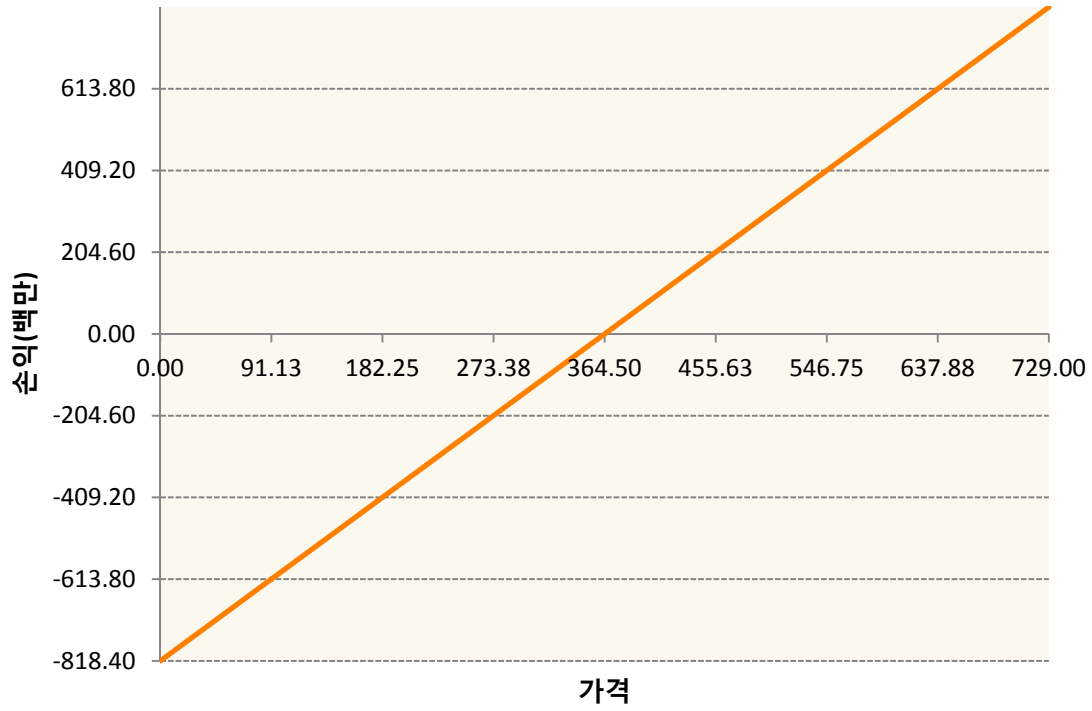


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

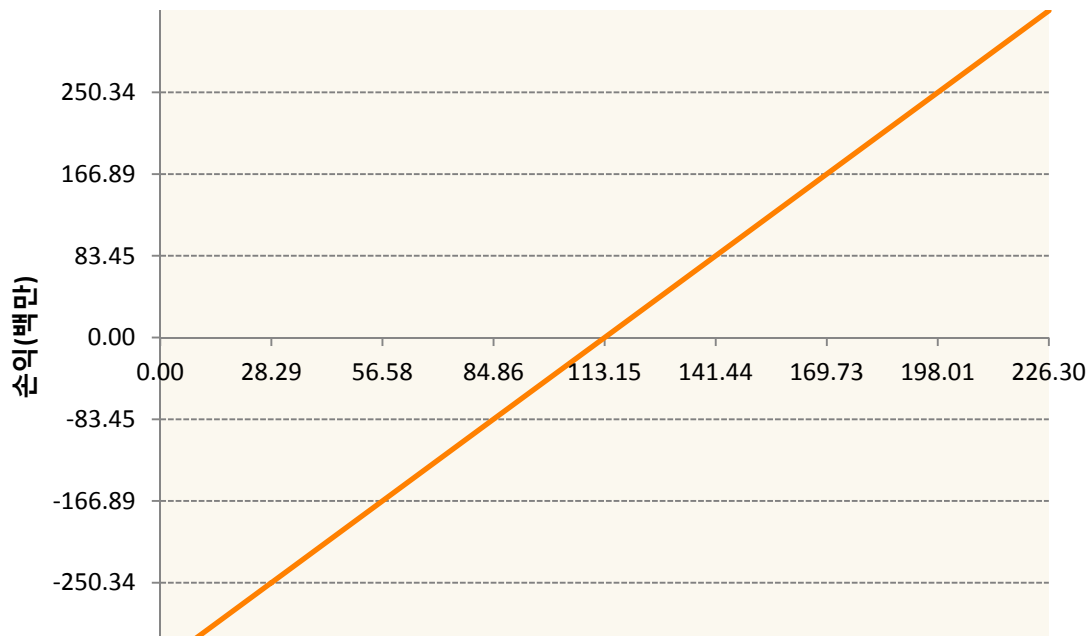


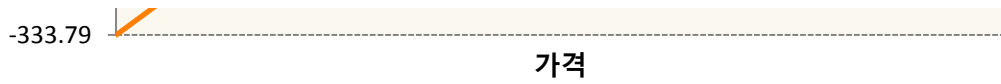


CZ8-CORN FUTURE DEC18

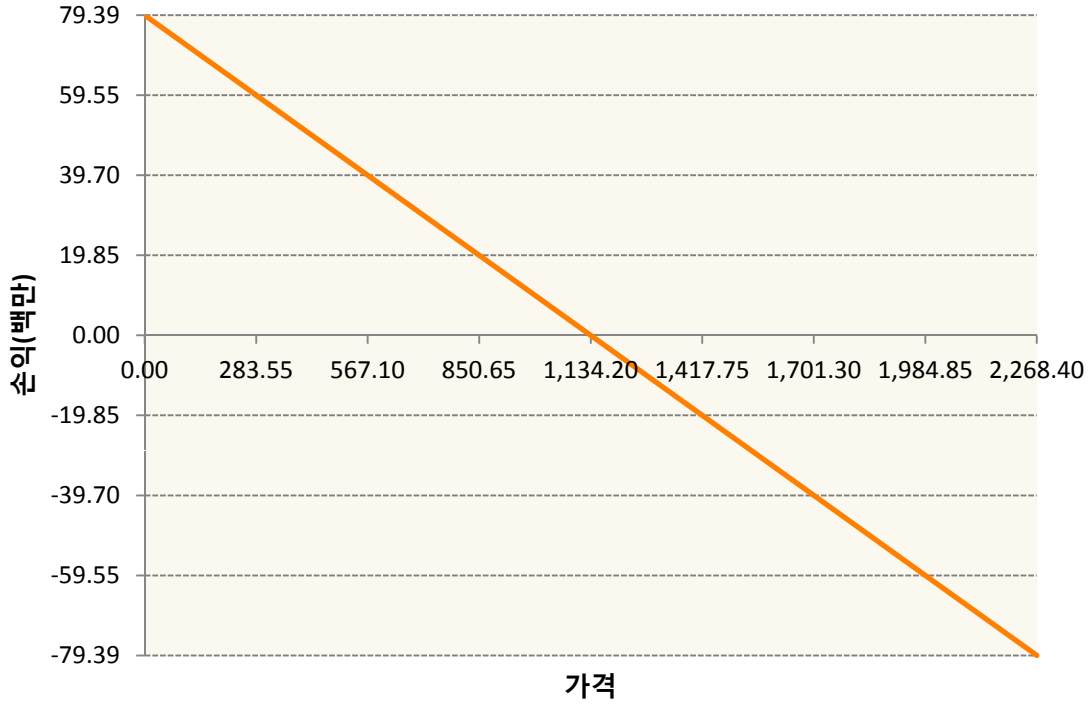


KCZ8-COFFEE 'C' FUTURE Dec18

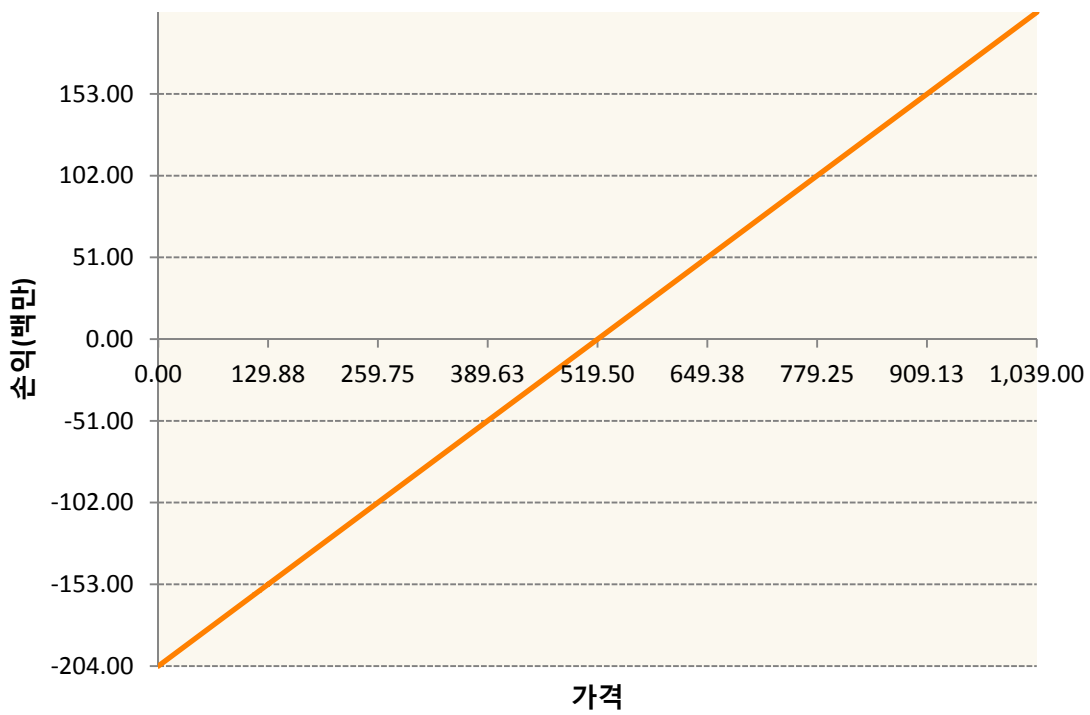




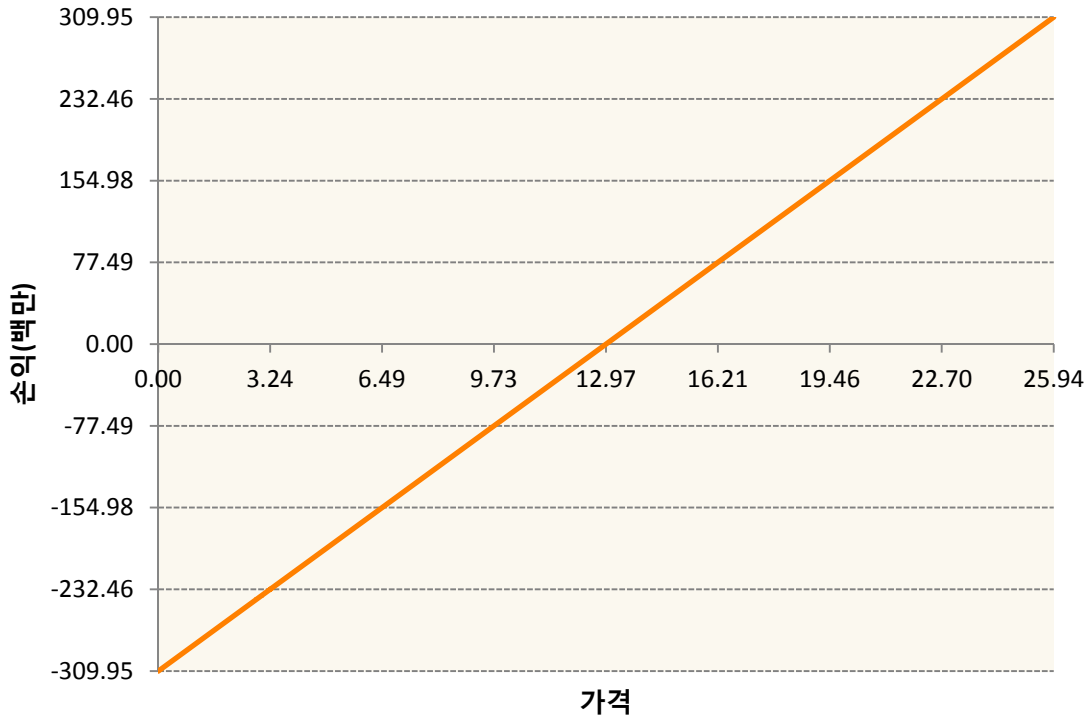
KR4175NA0007-2018-10 달러선물



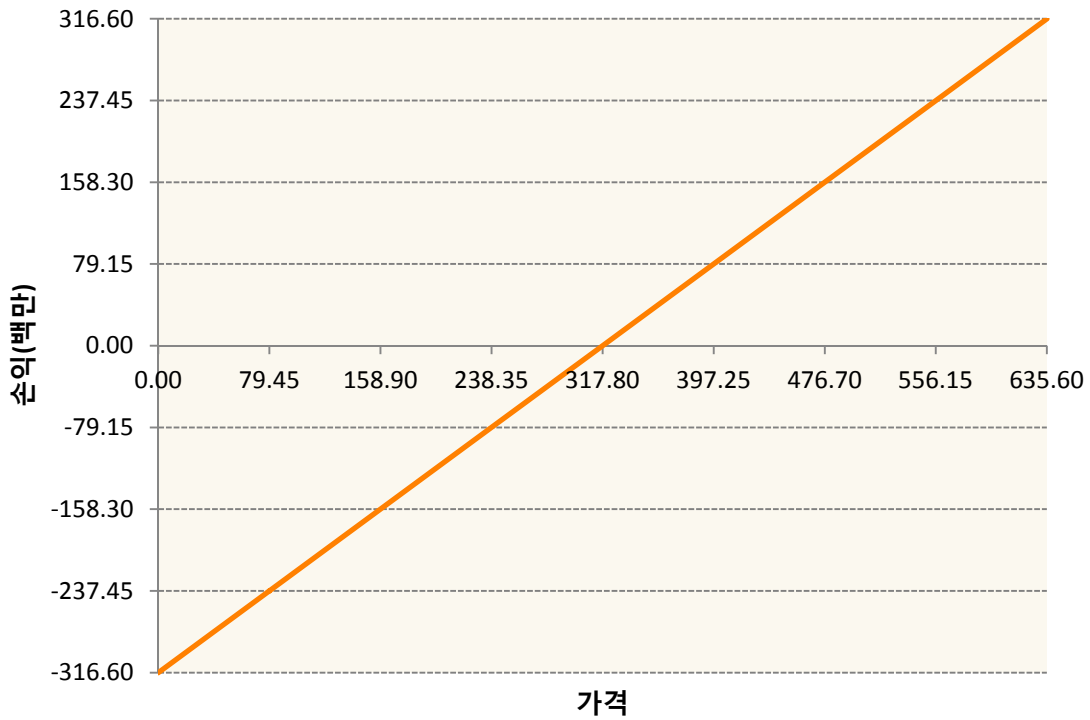
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

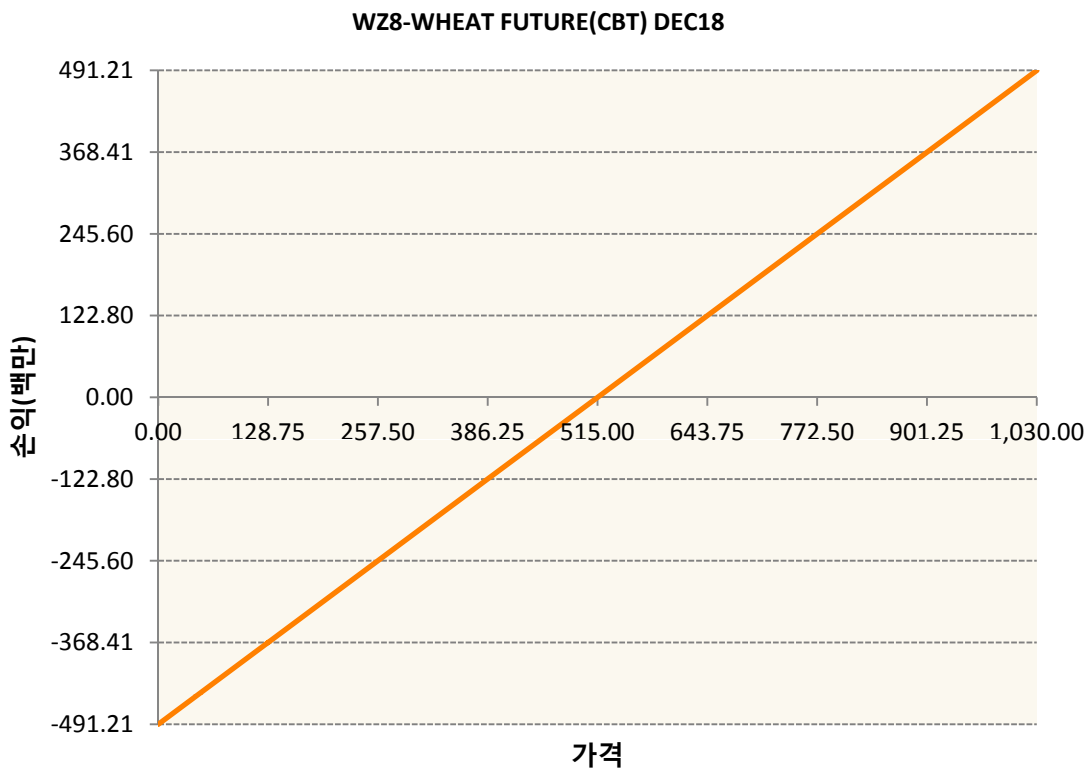
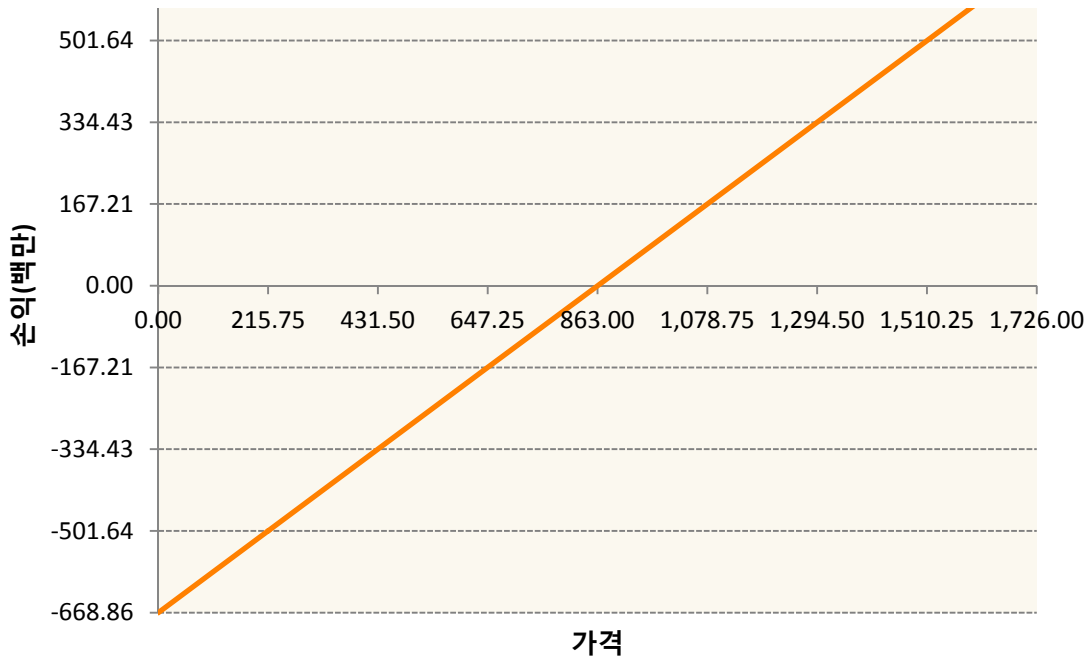


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	23
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	14
CZ8	CORN FUTURE DEC18	65
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	27
KR4175NA0(2018-10 달러선물)		6

KWZ8	KC HRW WHEAT FUT DEC18	16
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	25
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	25
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	54
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	39

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

(단위:백만원)

315