

공시일	2018-10-12
기준일	2018-10-11

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	2018-10-12
기준일	2018-10-11

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

1,110

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

481

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-12
기준일	2018-10-11

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

261

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

336

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-12
기준일	2018-10-11

유로인덱스모(주식-파생형)

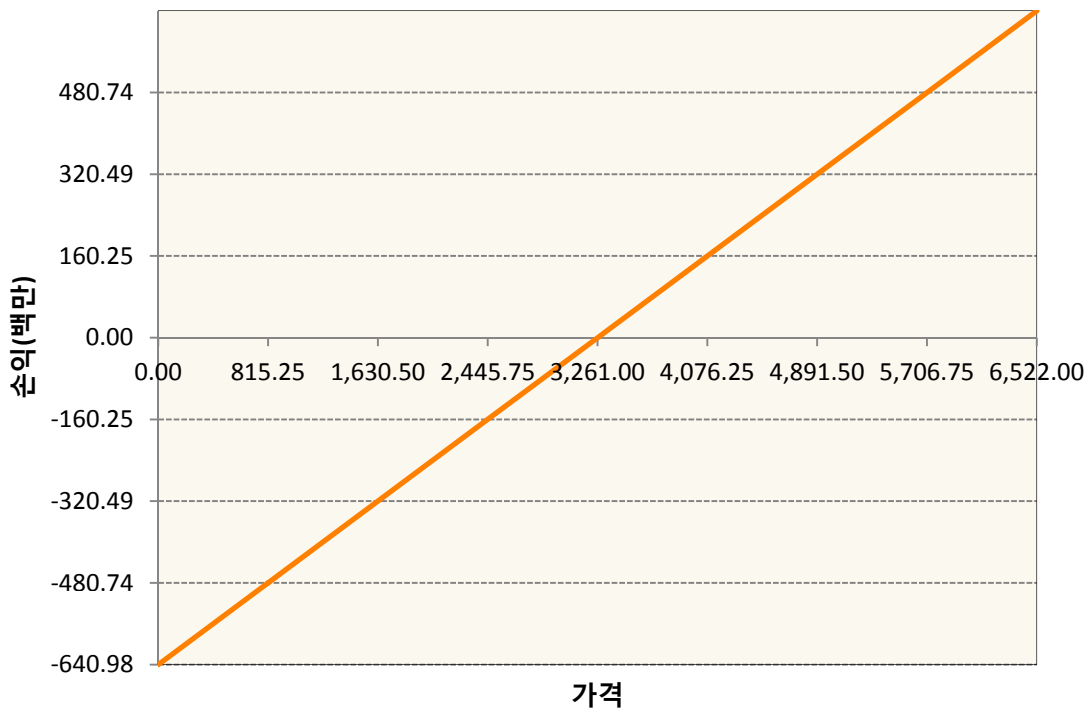
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	641	0	641	

2. 만기시점의 손익구조

VGZ8-EURO STOXX 50 DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ8	EURO STOXX 50 DEC18	51
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

32

공시일	2018-10-12
기준일	2018-10-11

차이나인덱스모(주식-파생형)

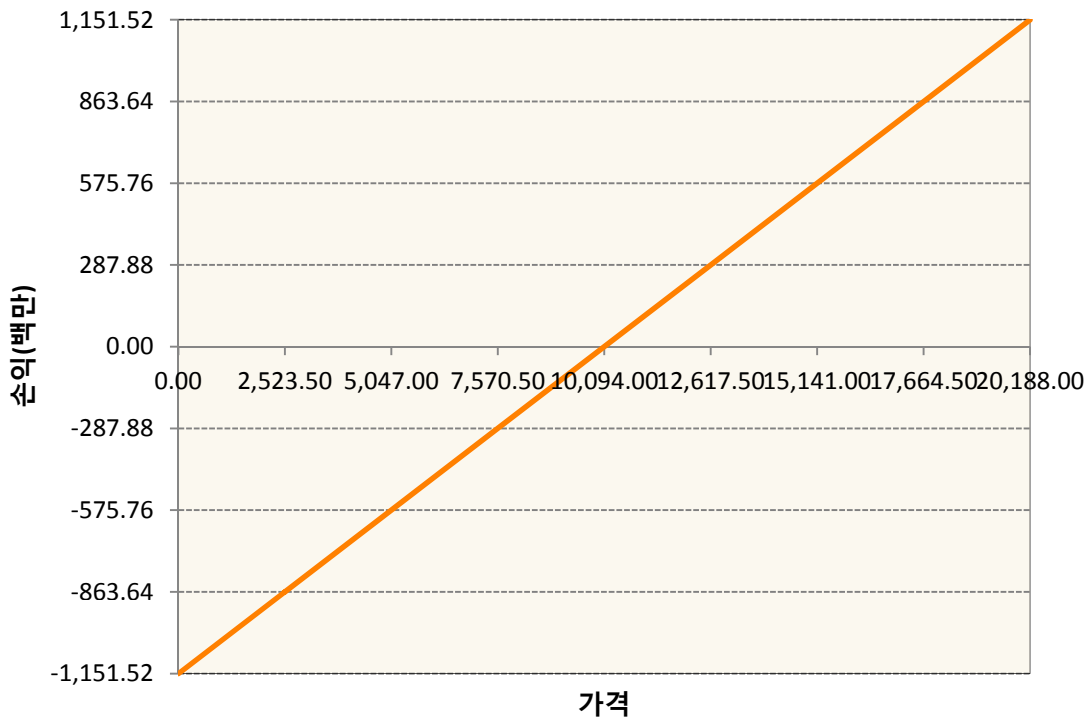
1. 계약금액

(단위:백만원)

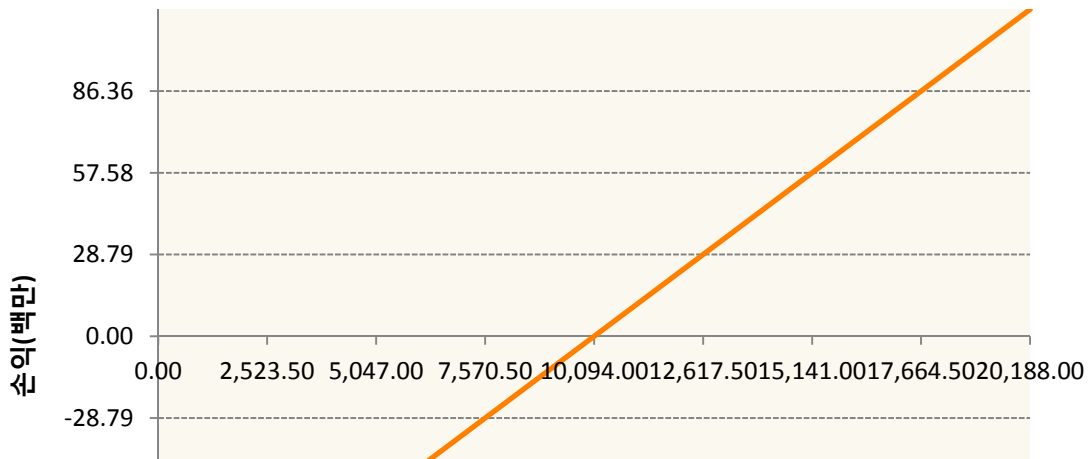
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,267	0	1,267	장내

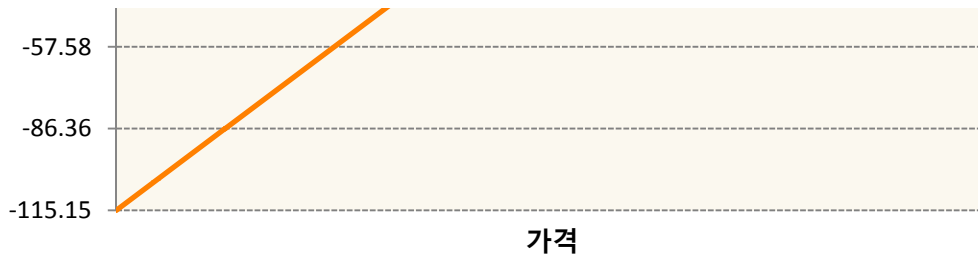
2. 만기시점의 손익구조

HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



MHCV8-MINI H-SHR IDX FU OCT 18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	92
MHCV8	MINI H-SHR IDX FU OCT 18	9

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

96

공시일	2018-10-12
기준일	2018-10-11

커버드콜모(주식혼합-파생형)

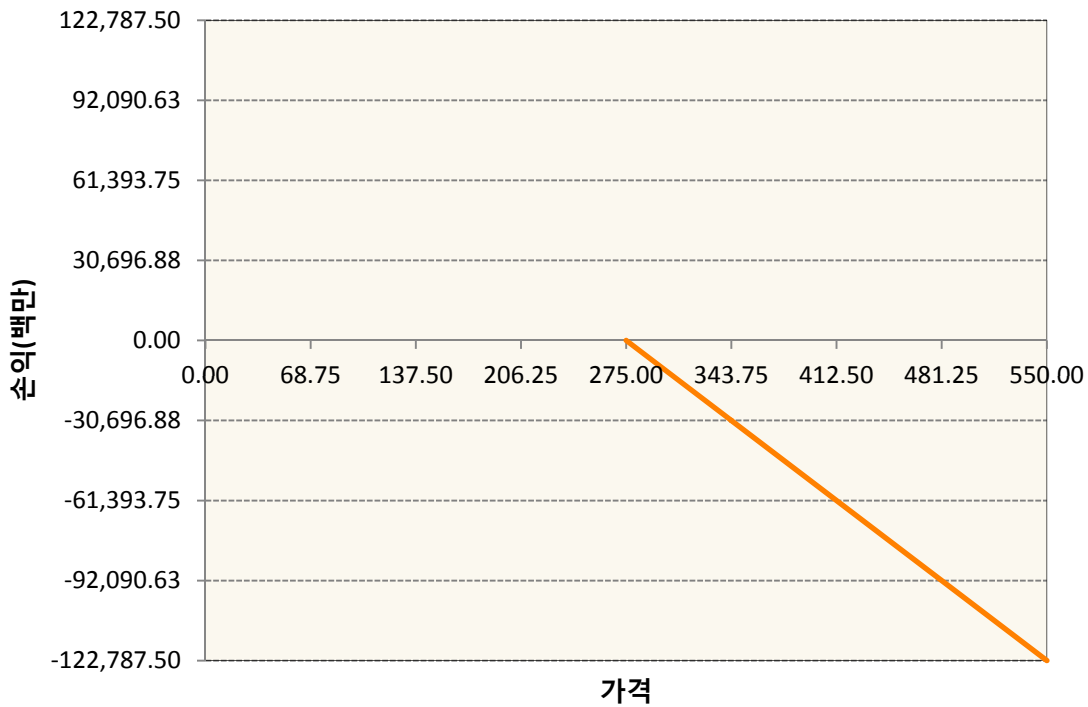
1. 계약금액

(단위:백만원)

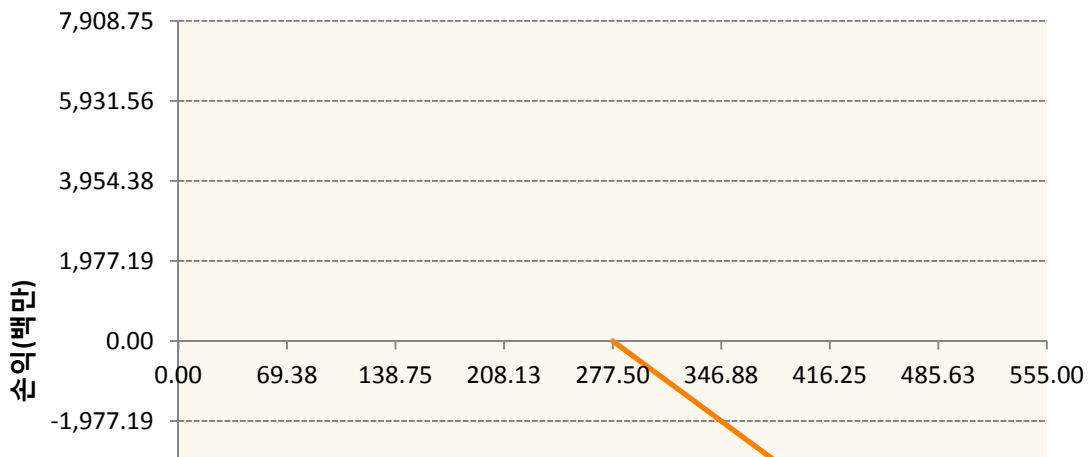
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	133,206	-133,206	장내
누계	유가증권	옵션	0	130,696	-130,696	장내

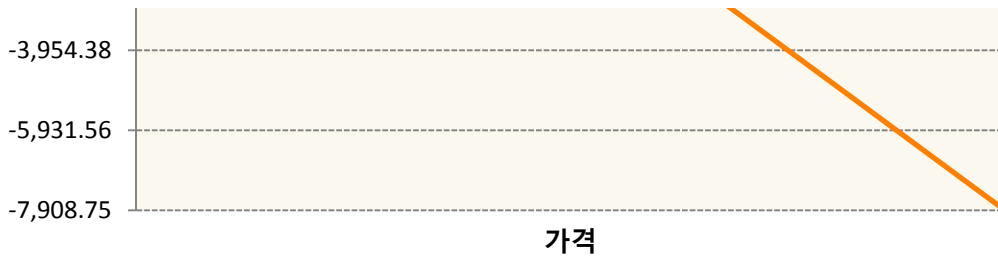
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275



KR4201NB2778-2018-11 콜277.5





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201NB27 2018-11 콜275 7,535

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,511	3,398	3,263	3,109	2,939	2,755	2,559
-5.33%	3,115	2,916	2,702	2,476	2,239	1,994	1,743
-2.67%	2,301	2,025	1,745	1,460	1,173	883	591
0%	926	617	309	0	-309	-617	-926
2.67%	-1,050	-1,334	-1,622	-1,914	-2,210	-2,507	-2,807
5.33%	-3,548	-3,764	-3,996	-4,240	-4,495	-4,757	-5,026
8.00%	-6,416	-6,556	-6,718	-6,900	-7,099	-7,311	-7,535

KR4201NB27 2018-11 콜277.5 460

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	195	190	182	174	164	154	142
-5.33%	176	165	153	140	126	111	96
-2.67%	134	118	101	83	66	48	30
0%	59	39	20	0	-20	-39	-59
2.67%	-54	-74	-93	-112	-132	-152	-171
5.33%	-203	-219	-235	-252	-270	-287	-306
8.00%	-379	-390	-402	-415	-429	-444	-460

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

7,532

공시일	2018-10-12
기준일	2018-10-11

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

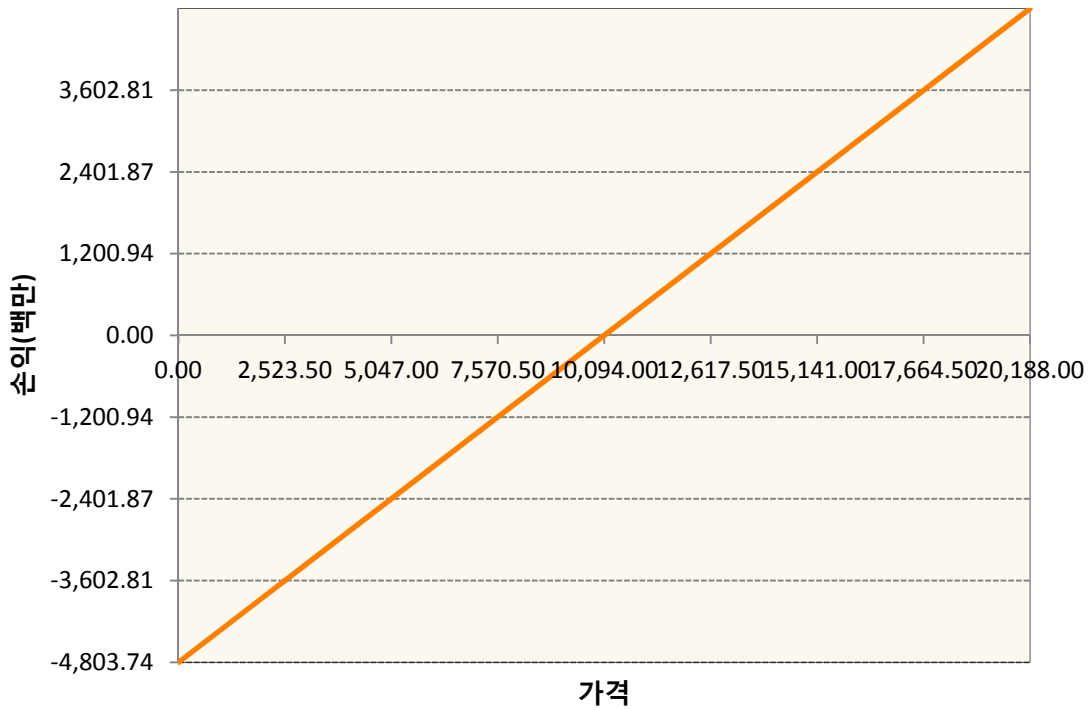
1. 계약금액

(단위:백만원)

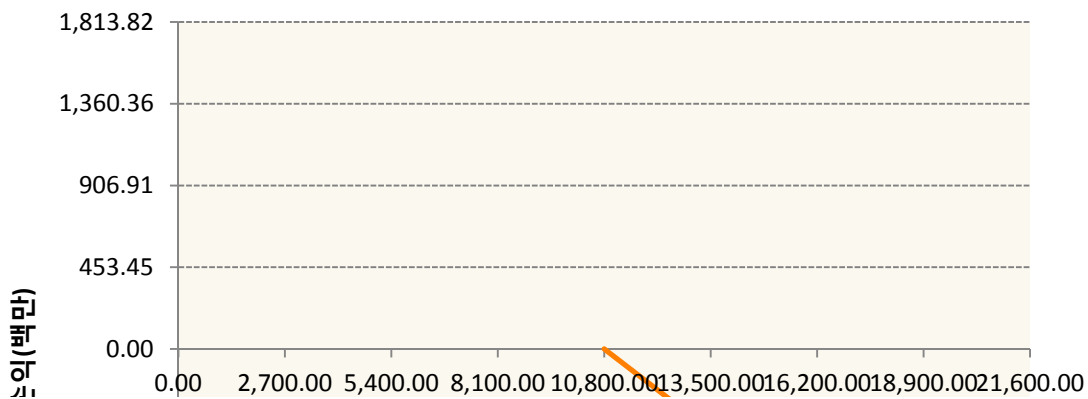
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,804	0	4,804	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,981	-11,981	장내

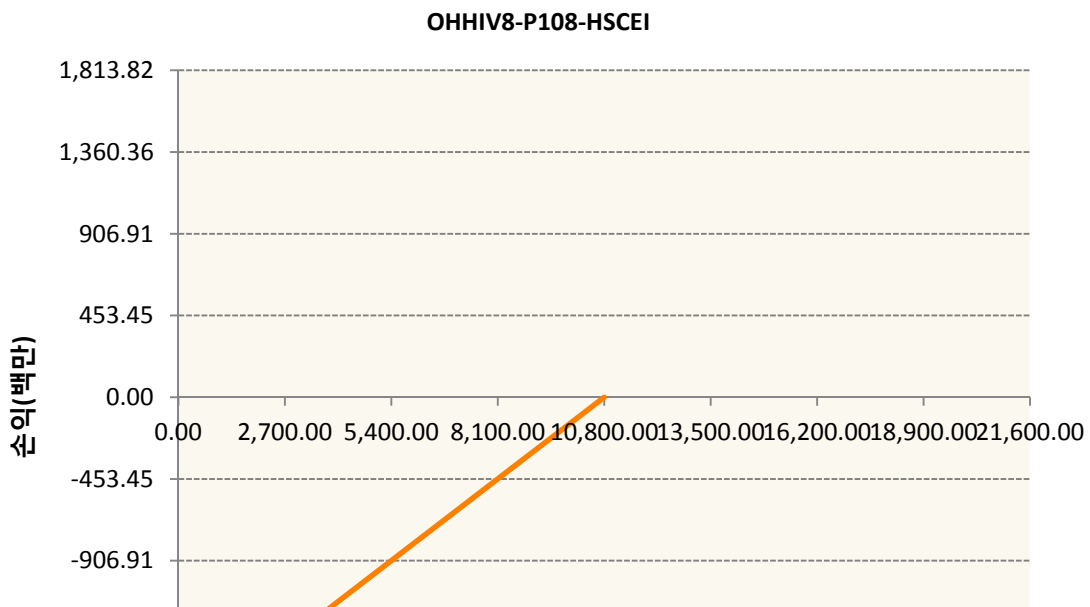
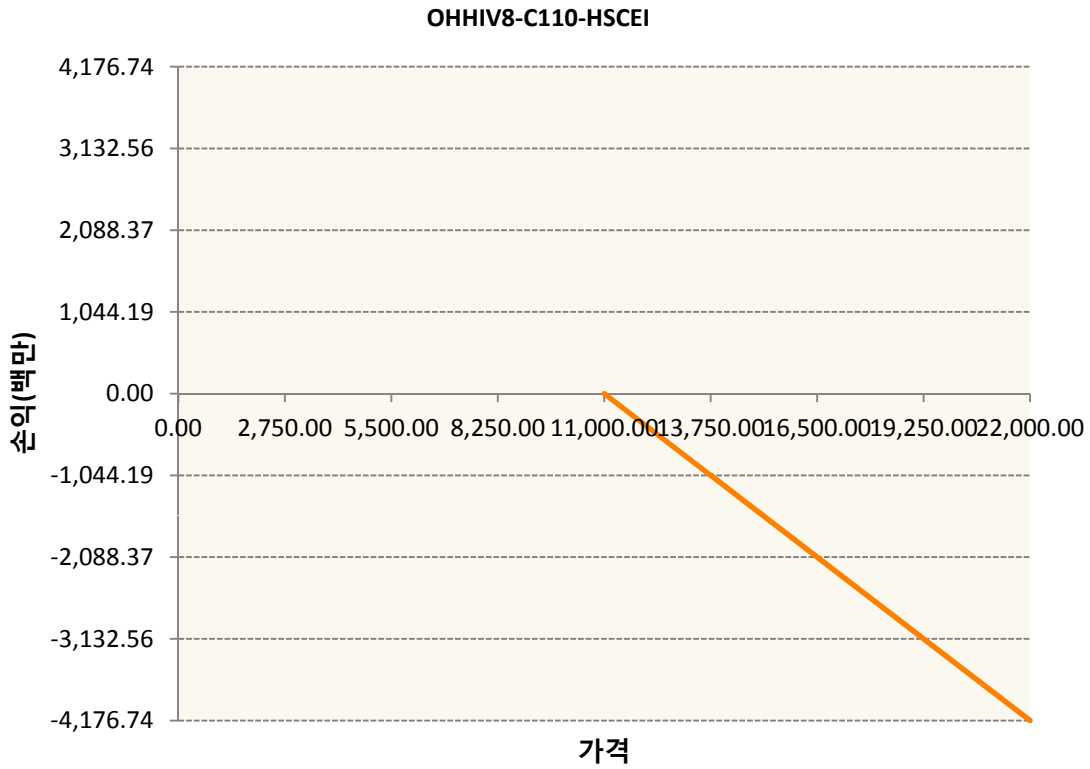
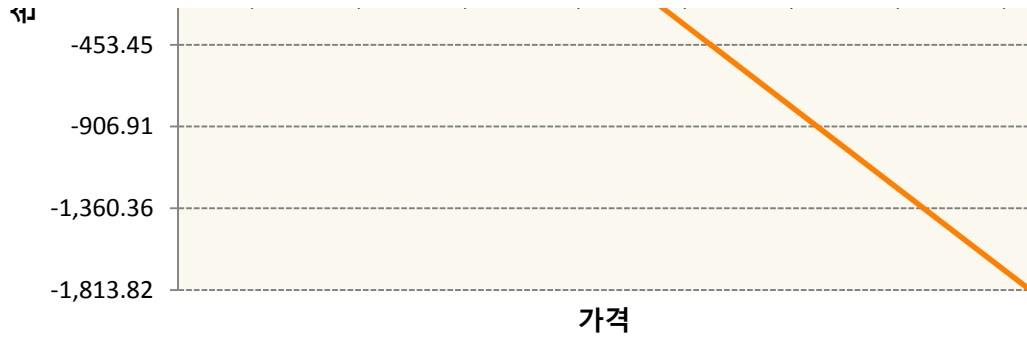
2. 만기시점의 손익구조

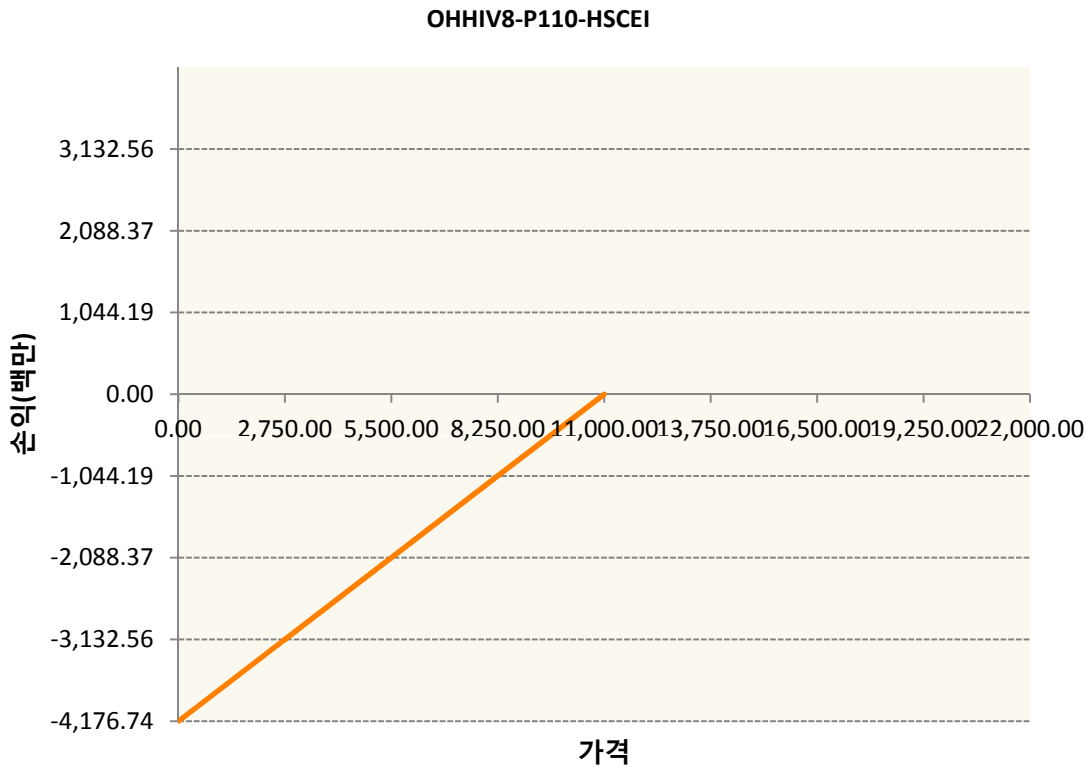
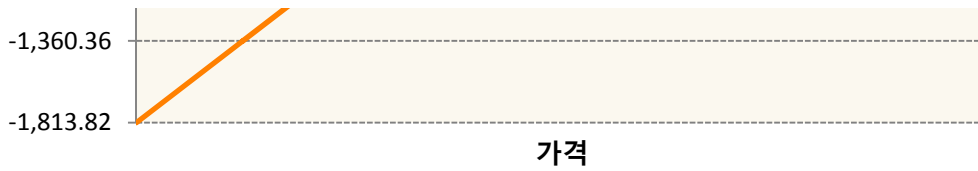
HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



OHHIV8-C108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	384
OHHIV8-C1	HSCEI	145
OHHIV8-C11	HSCEI	334
OHHIV8-P1C	HSCEI	145
OHHIV8-P11	HSCEI	334

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,270

공시일	2018-10-12
기준일	2018-10-11

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14

4,023

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,023	-4,023	-4,023	-4,023	-4,023	-4,023	-4,023
-5.33%	-2,682	-2,682	-2,682	-2,682	-2,682	-2,682	-2,682
-2.67%	-1,341	-1,341	-1,341	-1,341	-1,341	-1,341	-1,341
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,341	1,341	1,341	1,341	1,341	1,341	1,341
5.33%	2,682	2,682	2,682	2,682	2,682	2,682	2,682
8.00%	4,023	4,023	4,023	4,023	4,023	4,023	4,023

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

(단위:백만원)

4,024

공시일	2018-10-12
기준일	2018-10-11

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

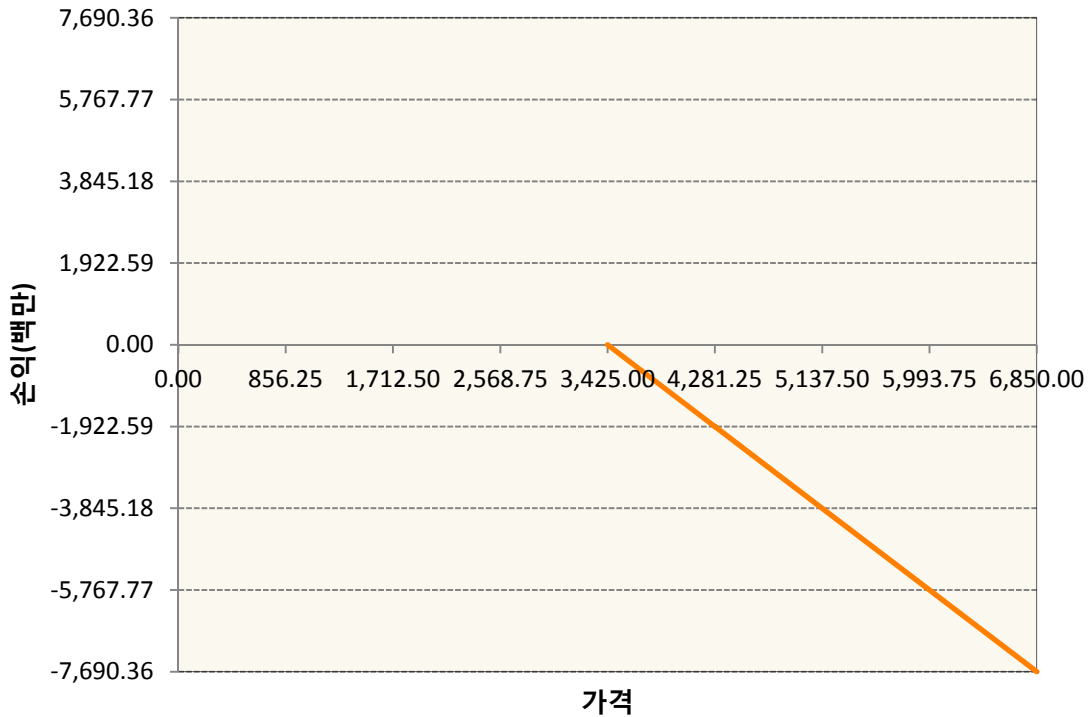
1. 계약금액

(단위:백만원)

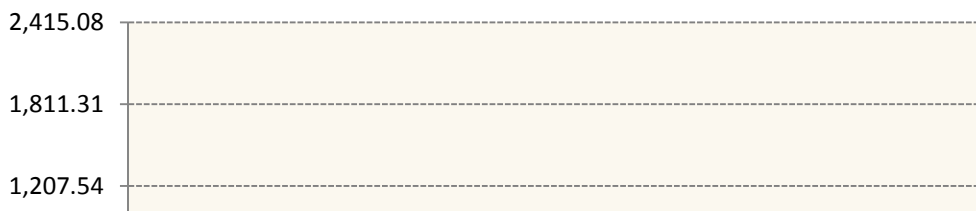
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,883	0	2,883	
누계	유가증권	스왑	34,877	0	34,877	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,211	-20,211	장내
누계	지수	스왑	53,619	0	53,619	장외

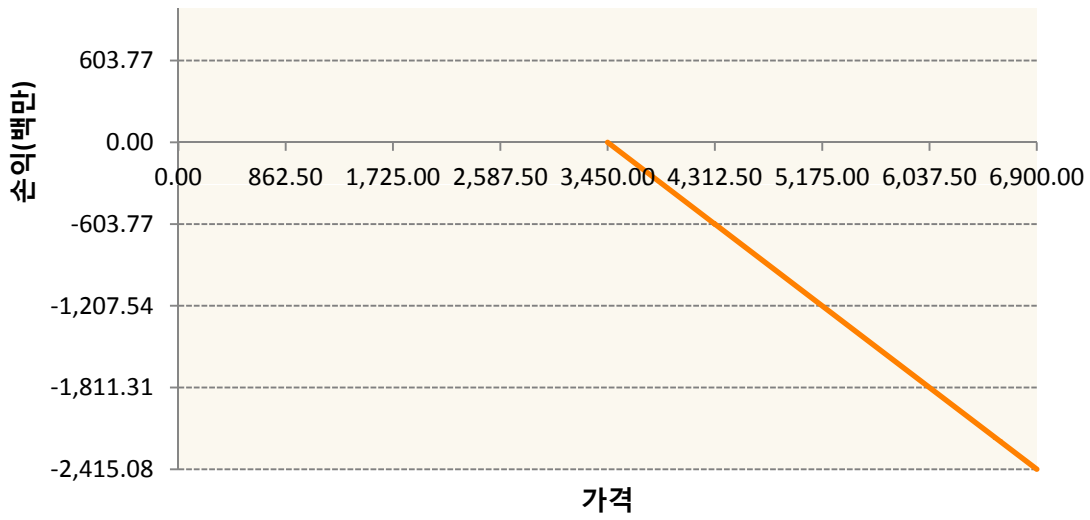
2. 만기시점의 손익구조

OESXV8-C3425-EURO STOXX 50

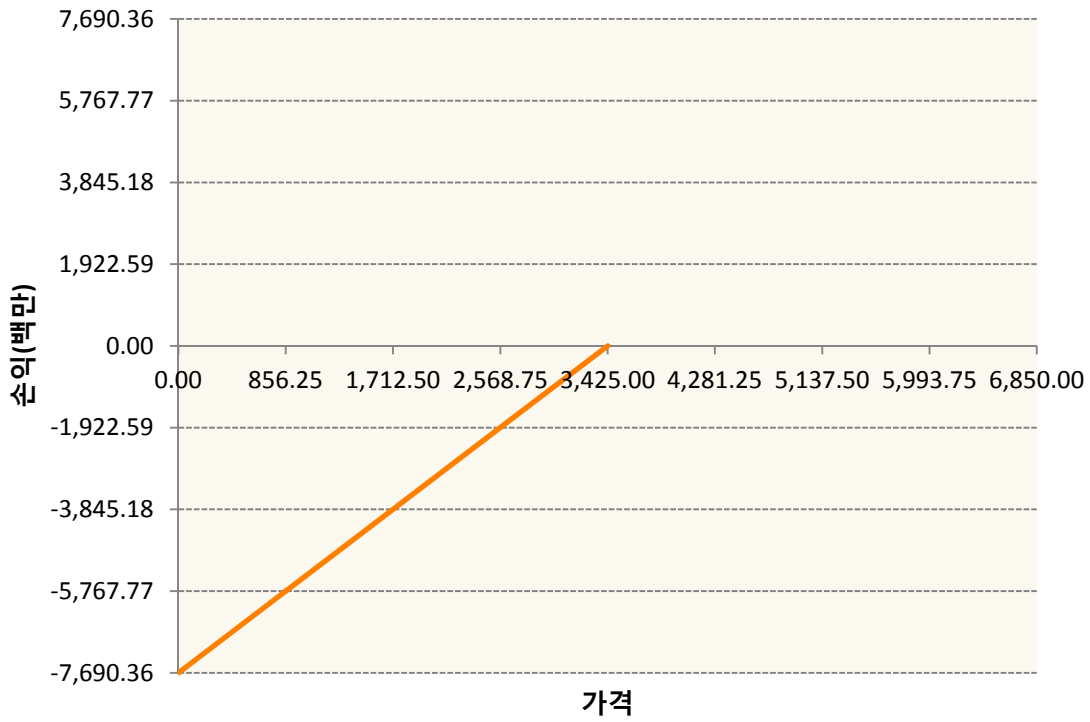


OESXV8-C3450-EURO STOXX 50

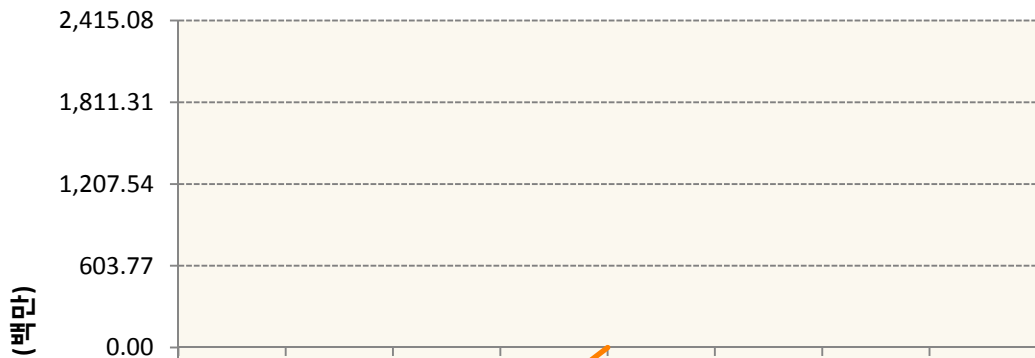


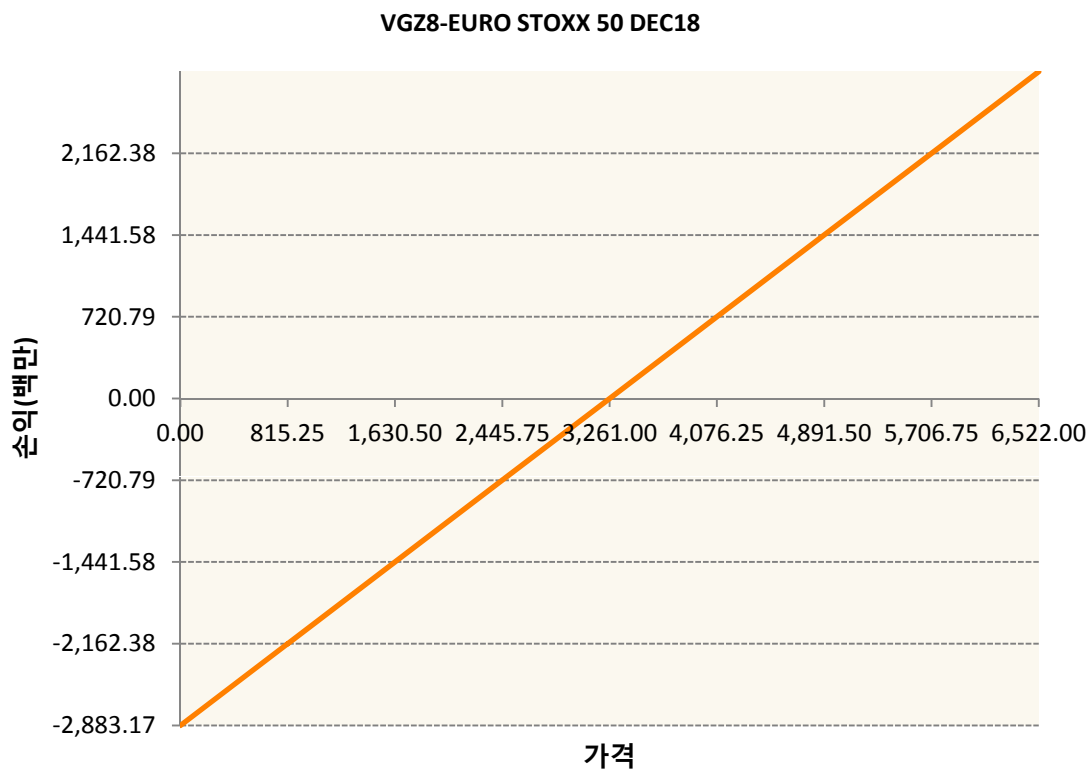
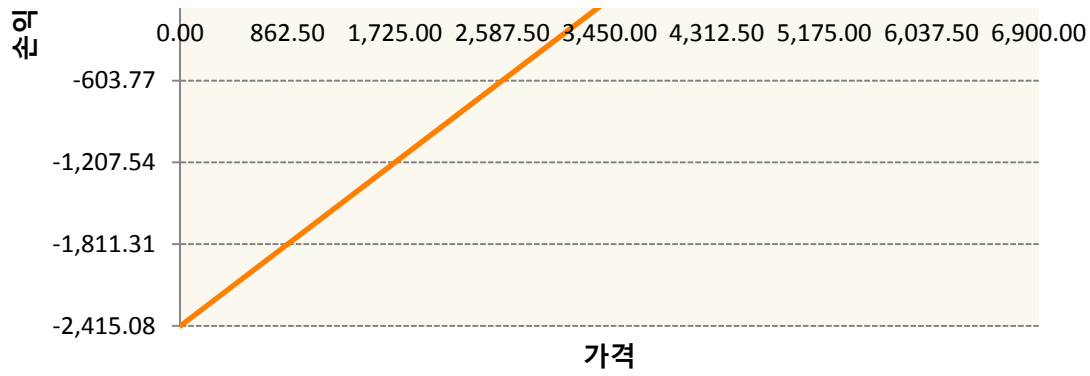


OESXV8-P3425-EURO STOXX 50



OESXV8-P3450-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		144
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		94
OESXV8-C34 EURO STOXX 50		615
OESXV8-C34 EURO STOXX 50		193
OESXV8-P34 EURO STOXX 50		615
OESXV8-P34 EURO STOXX 50		193
VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18		231

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

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

(단위:백만원)

1,123

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

(단위:백만원)

88

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

(단위:백만원)

133

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

(단위:백만원)

156

공시일	2018-10-12
기준일	2018-10-11

스마트KRX300인덱스목표전환형1

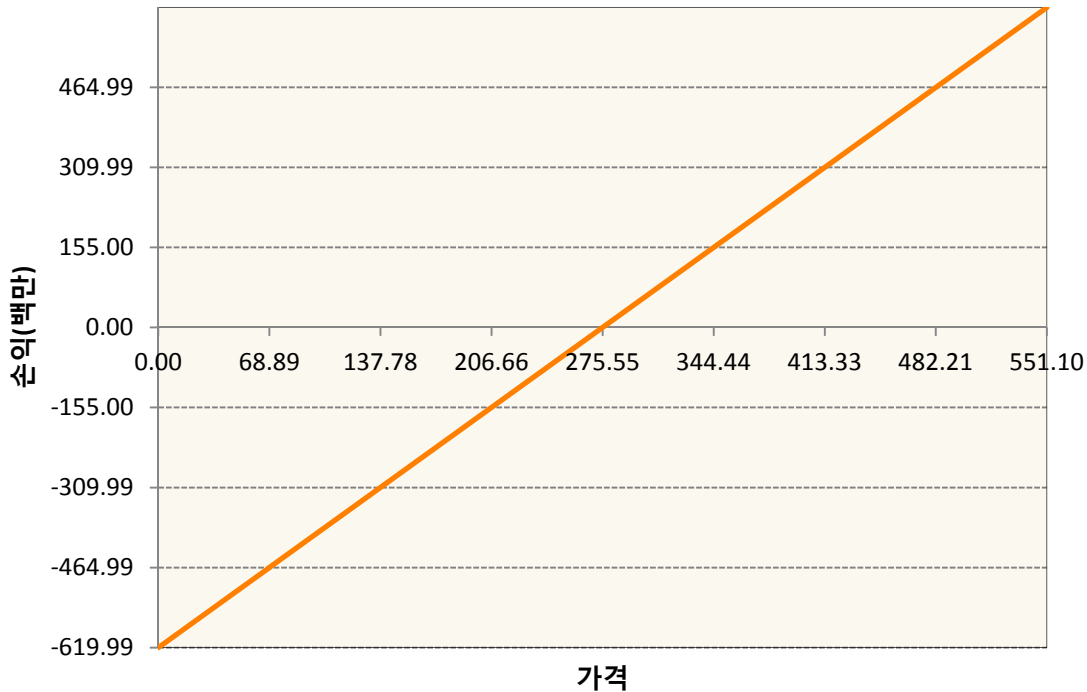
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	620	0	620	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물)

50

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	17	17	17	17	17	17	17
5.33%	33	33	33	33	33	33	33
8.00%	50	50	50	50	50	50	50

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-10-12
기준일	2018-10-11

리디파인K200(주식혼합-파생재간

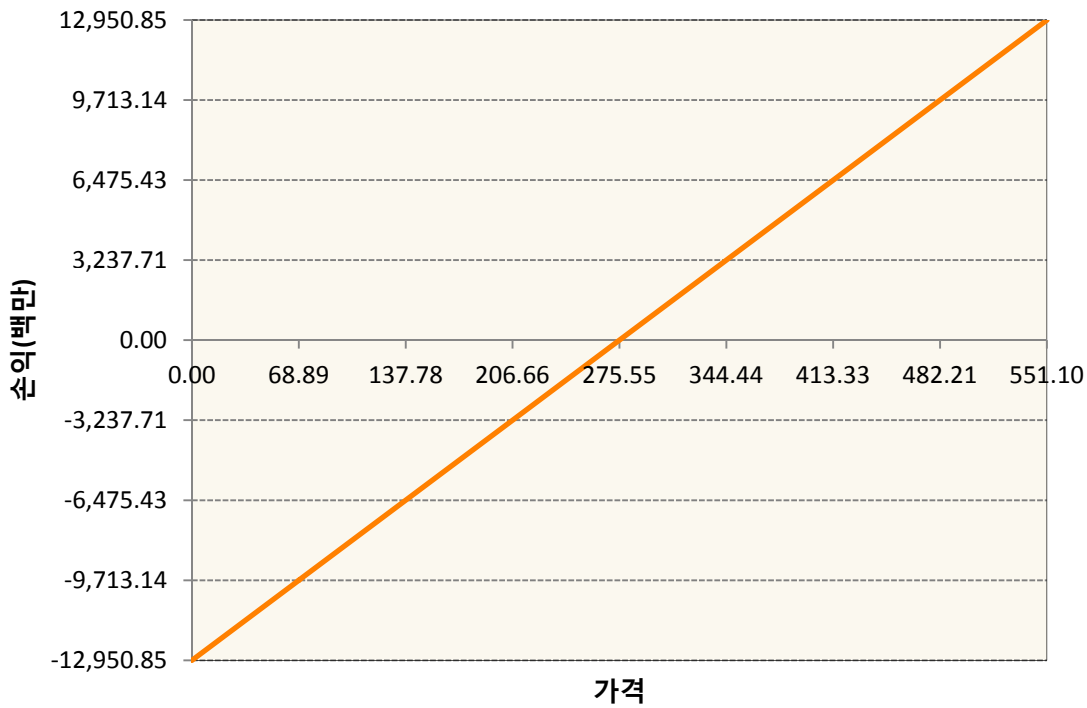
1. 계약금액

(단위:백만원)

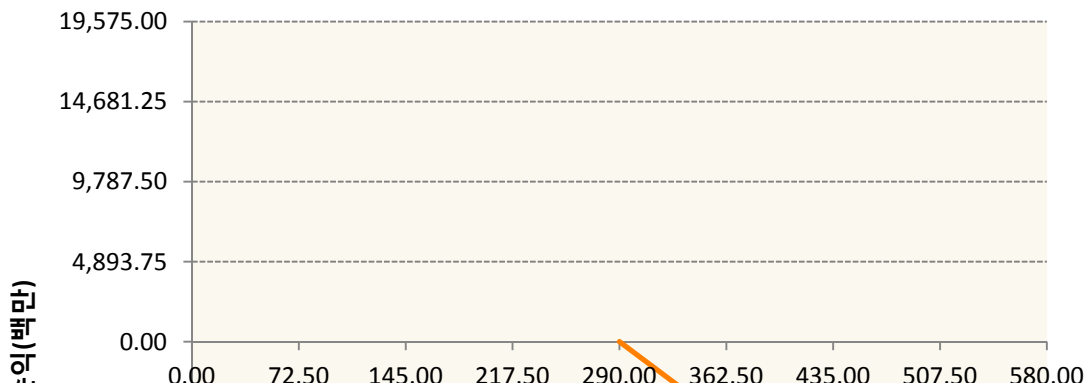
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	3,252	23,303	-20,051	장내
누계	유가증권	선물	12,951	0	12,951	장내
누계	유가증권	옵션	3,319	23,231	-19,913	장내

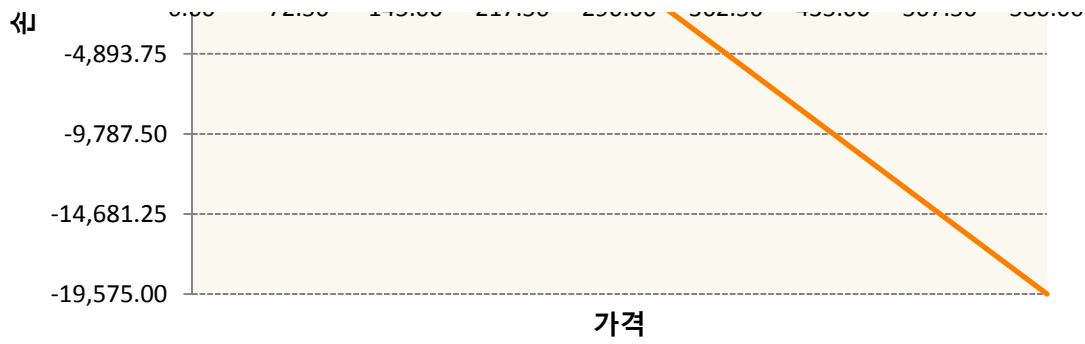
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

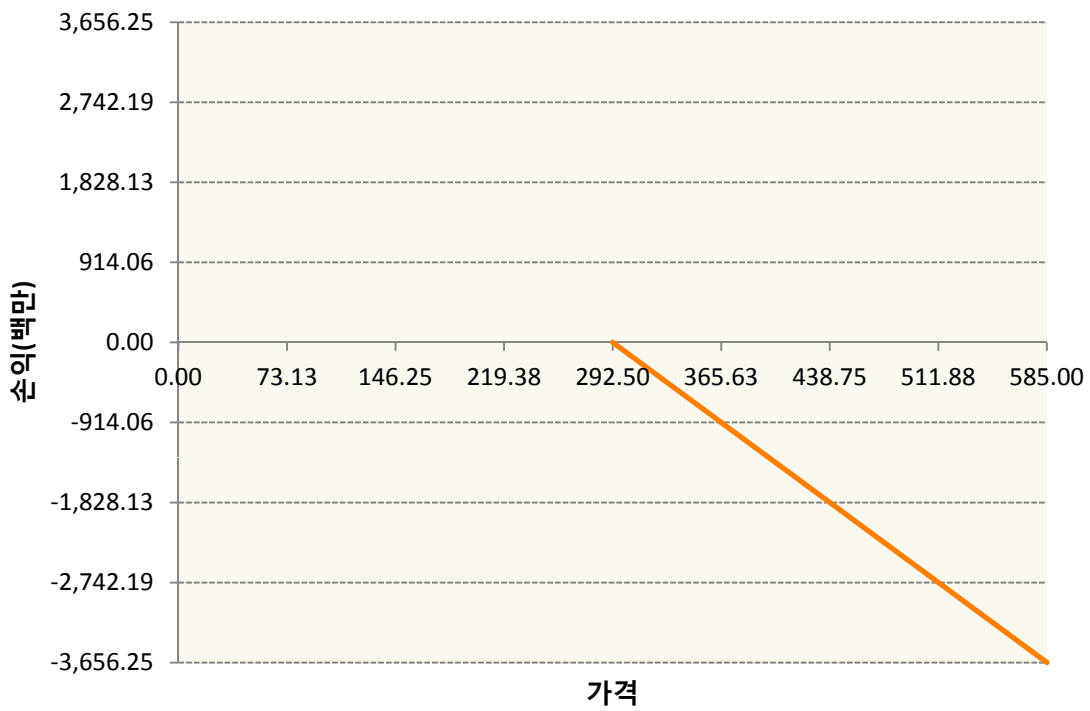


KR4201NB2901-2018-11 콜290

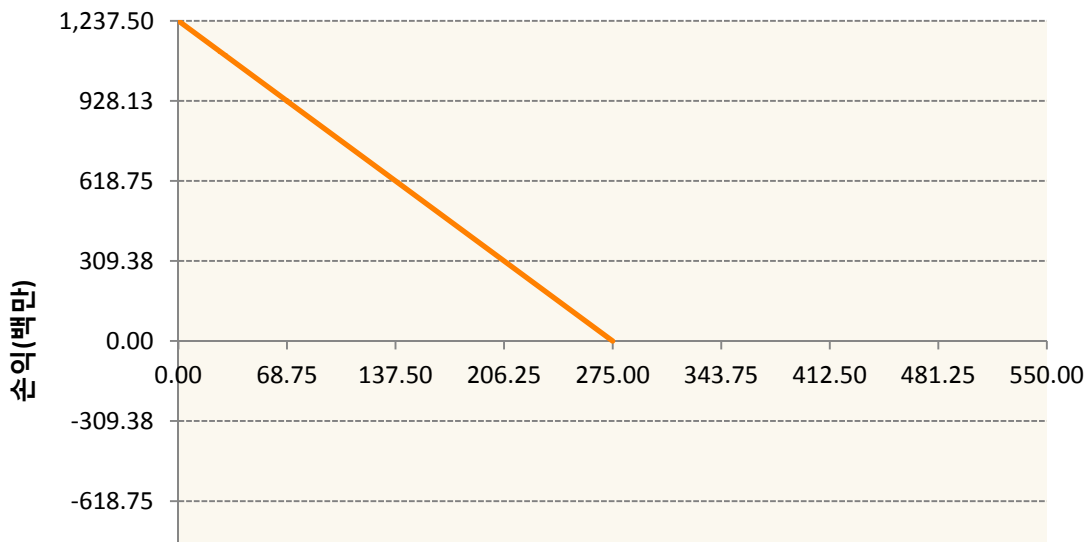


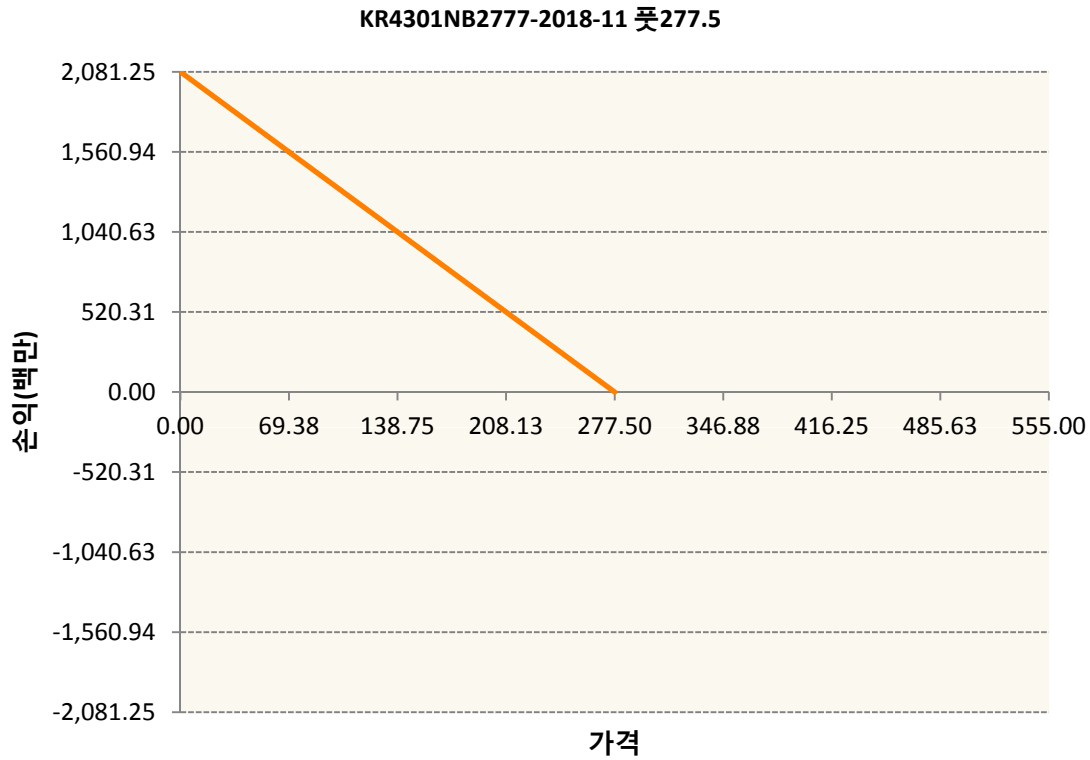
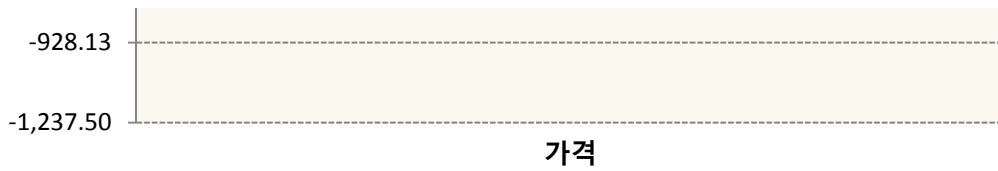


KR4201NB2927-2018-11 콜292.5



KR4301NB2751-2018-11 풋275





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 1,035

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,035	-1,035	-1,035	-1,035	-1,035	-1,035	-1,035
-5.33%	-690	-690	-690	-690	-690	-690	-690
-2.67%	-345	-345	-345	-345	-345	-345	-345
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	345	345	345	345	345	345	345
5.33%	690	690	690	690	690	690	690
8.00%	1,035	1,035	1,035	1,035	1,035	1,035	1,035

KR4201NB29(2018-11 콜290) 803

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	204	201	195	187	177	164	149
-5.33%	195	186	173	158	140	119	95
-2.67%	168	149	126	100	72	41	9

0%	104	72	37	0	-38	-78	-118
2.67%	-21	-65	-110	-156	-202	-248	-294
5.33%	-228	-277	-326	-375	-424	-474	-523
8.00%	-520	-566	-613	-660	-708	-755	-803

KR4201NB27 2018-11 콜292.5

138

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	31	31	30	29	27	25	23
-5.33%	30	29	27	25	22	18	14
-2.67%	27	24	20	16	11	6	0
0%	17	12	6	0	-7	-13	-21
2.67%	-2	-9	-17	-25	-33	-42	-50
5.33%	-35	-44	-53	-62	-71	-80	-89
8.00%	-84	-92	-101	-111	-120	-129	-138

KR4301NB27 2018-11 풋275

78

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	75	75	75	76	76	77	78
-5.33%	43	44	45	46	47	48	49
-2.67%	15	16	18	20	21	23	25
0%	-6	-4	-2	0	2	4	6
2.67%	-18	-16	-14	-13	-11	-9	-7
5.33%	-22	-21	-20	-19	-18	-17	-15
8.00%	-24	-23	-23	-22	-22	-21	-20

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

136

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	133	133	134	134	135	135	136
-5.33%	79	80	81	82	84	86	87
-2.67%	30	32	34	37	39	42	45
0%	-10	-7	-3	0	3	7	10
2.67%	-34	-31	-28	-25	-22	-19	-15
5.33%	-45	-44	-42	-39	-37	-34	-32
8.00%	-49	-48	-47	-46	-45	-43	-41

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

(단위:백만원)

1,712

공시일	2018-10-12
기준일	2018-10-11

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

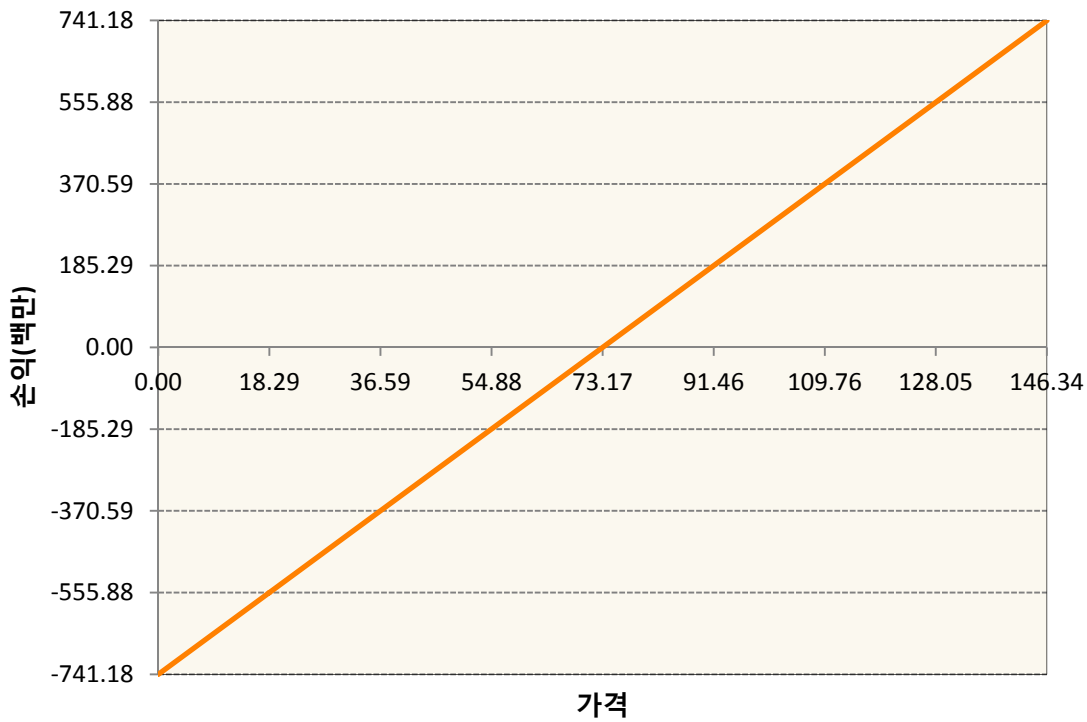
1. 계약금액

(단위:백만원)

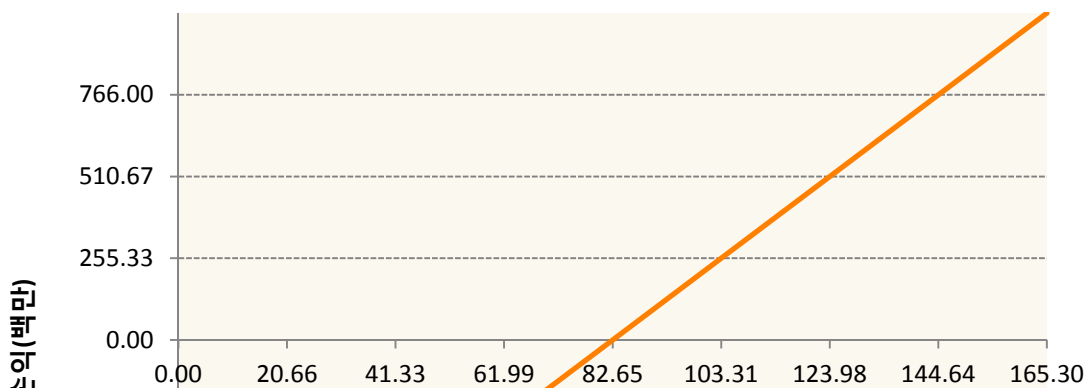
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,237	629	2,608	
누계	유가증권	선물	453	0	453	장내

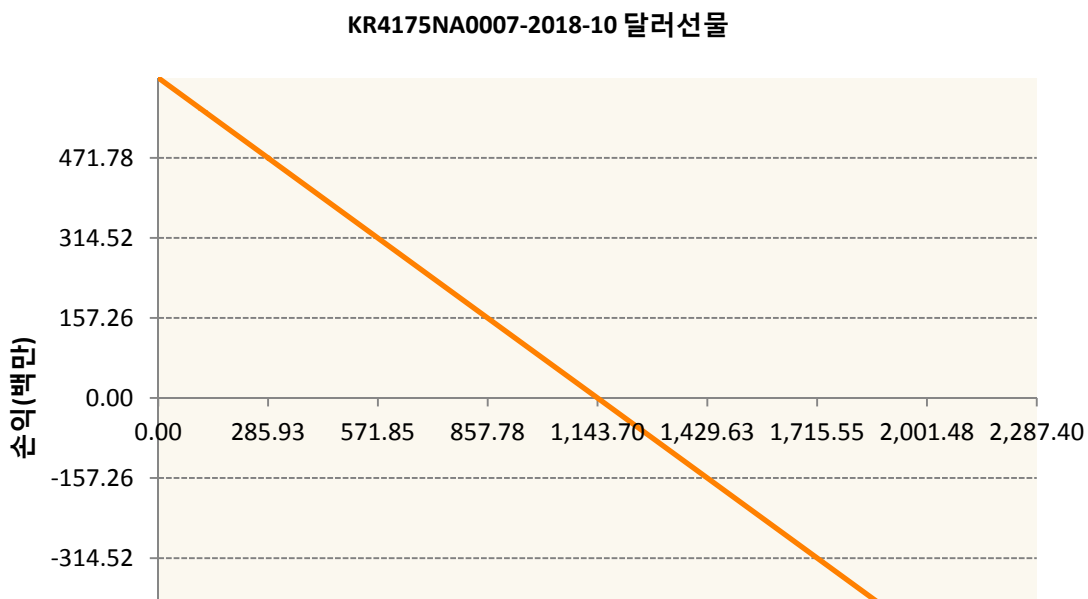
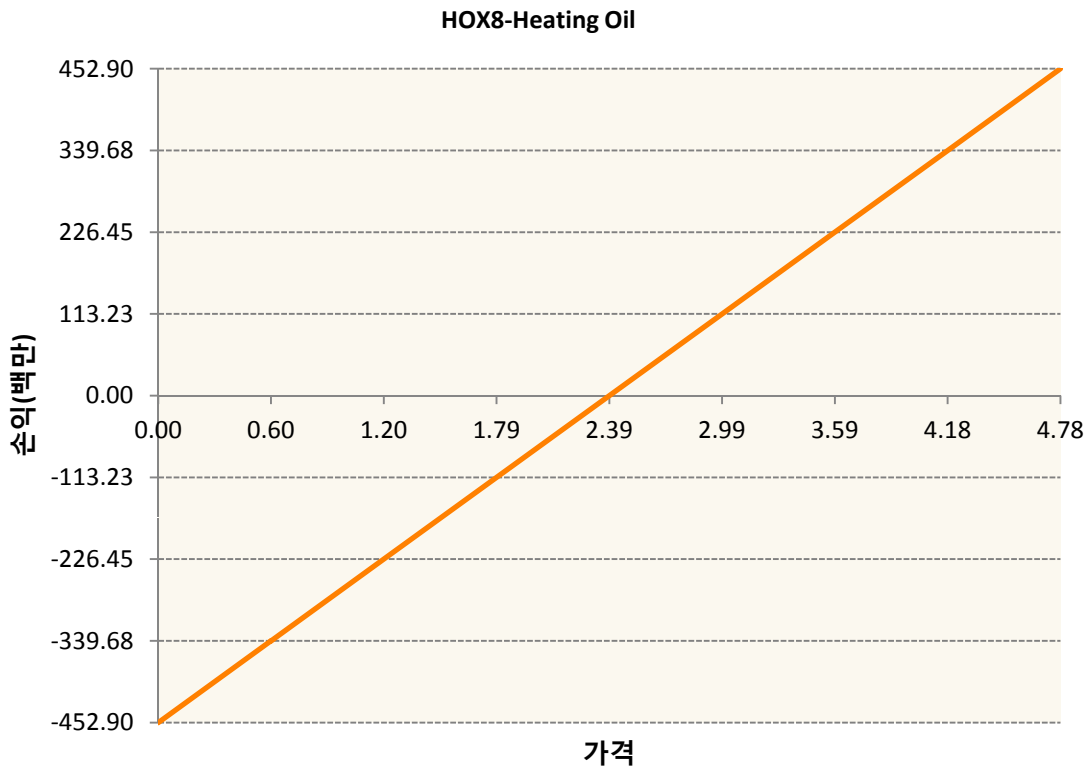
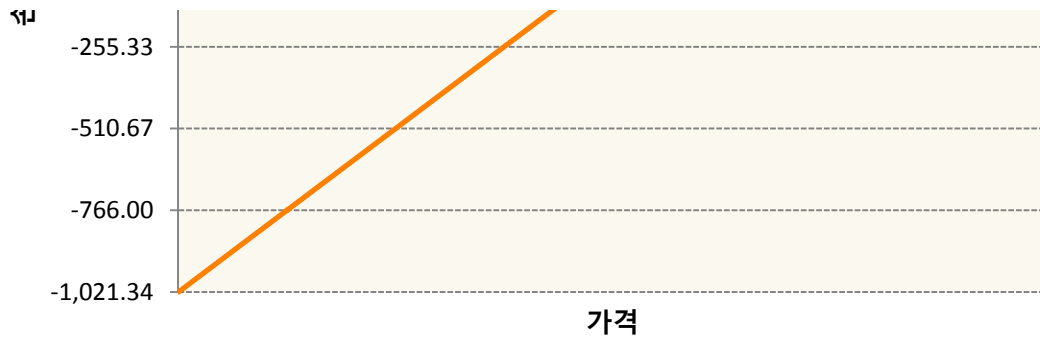
2. 만기시점의 손익구조

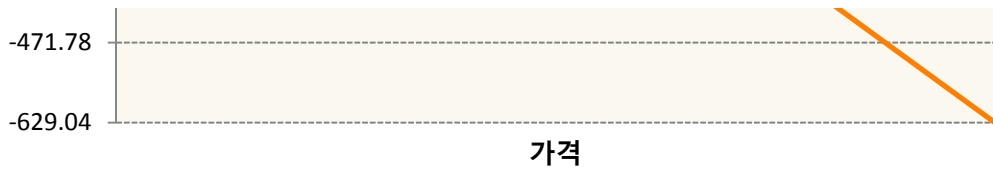
CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18



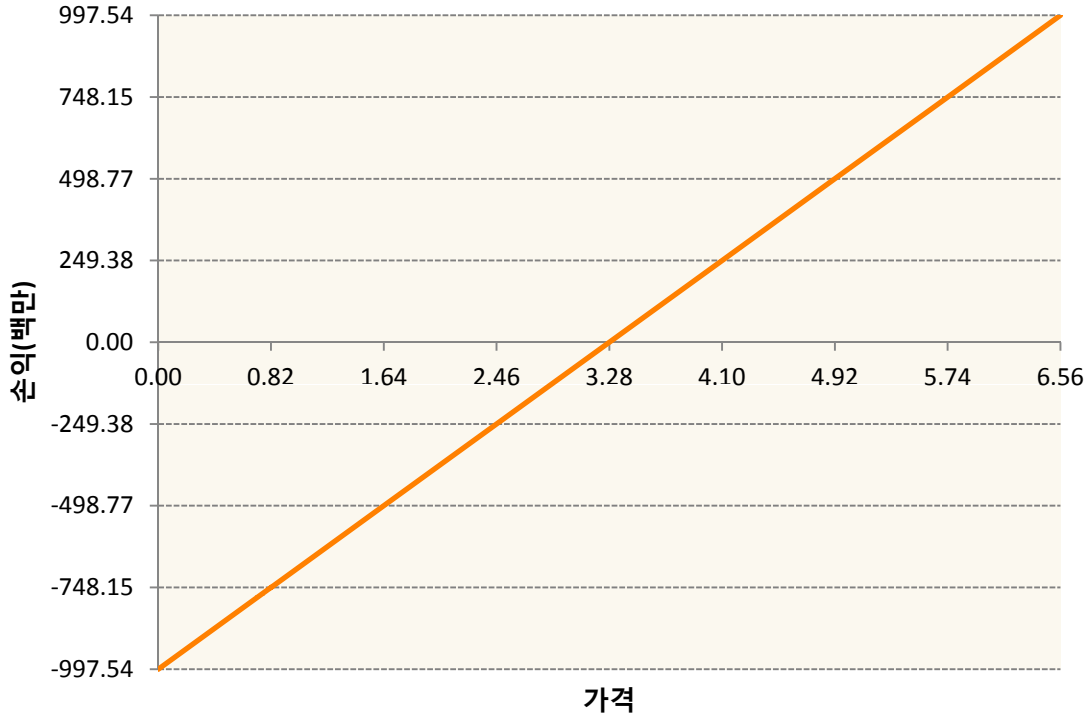
COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19



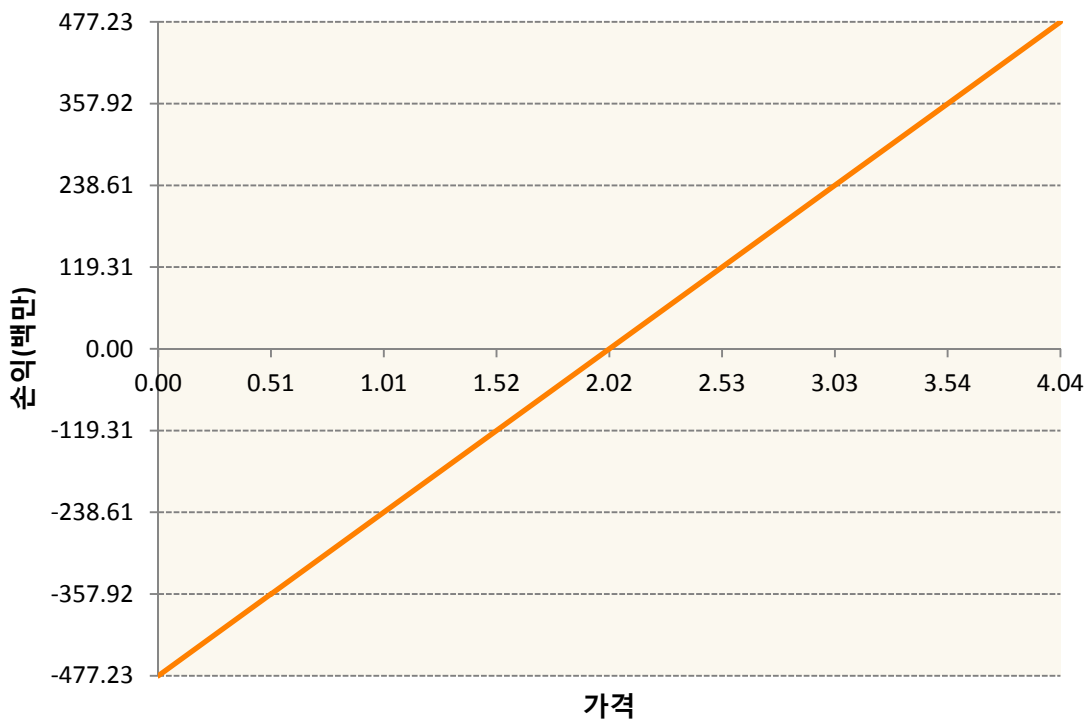




NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18



XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	59
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	82
HOX8	Heating Oil	36
KR4175NA0(2018-10 달러선물		50
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	80
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	38

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	442

공시일	2018-10-12
기준일	2018-10-11

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

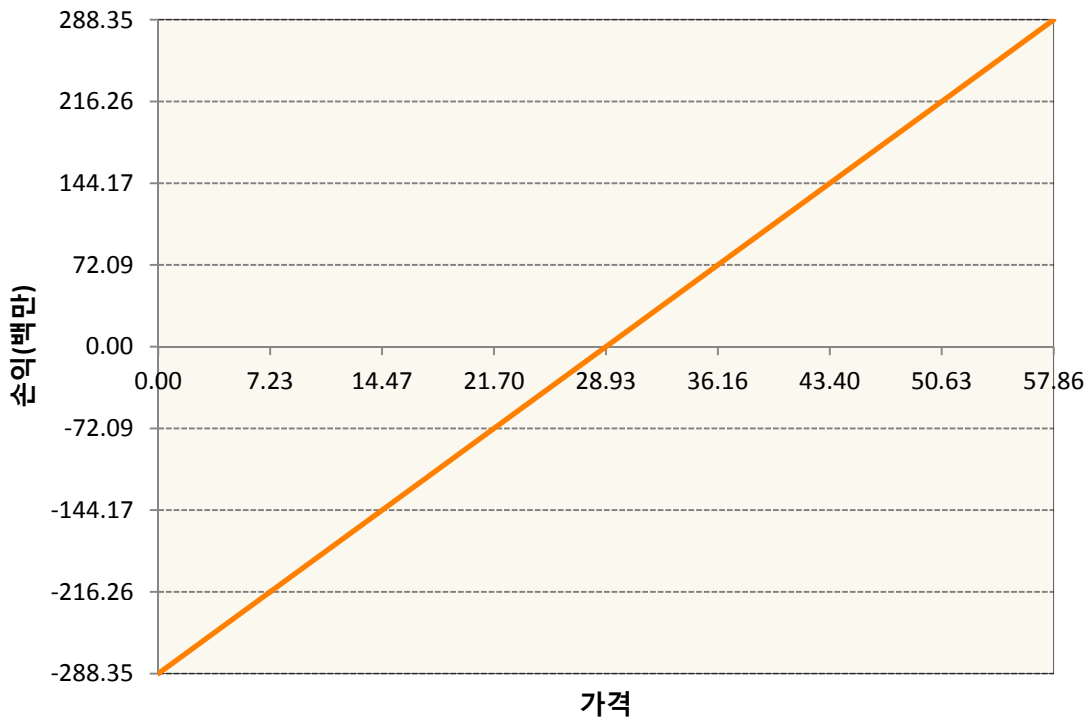
1. 계약금액

(단위:백만원)

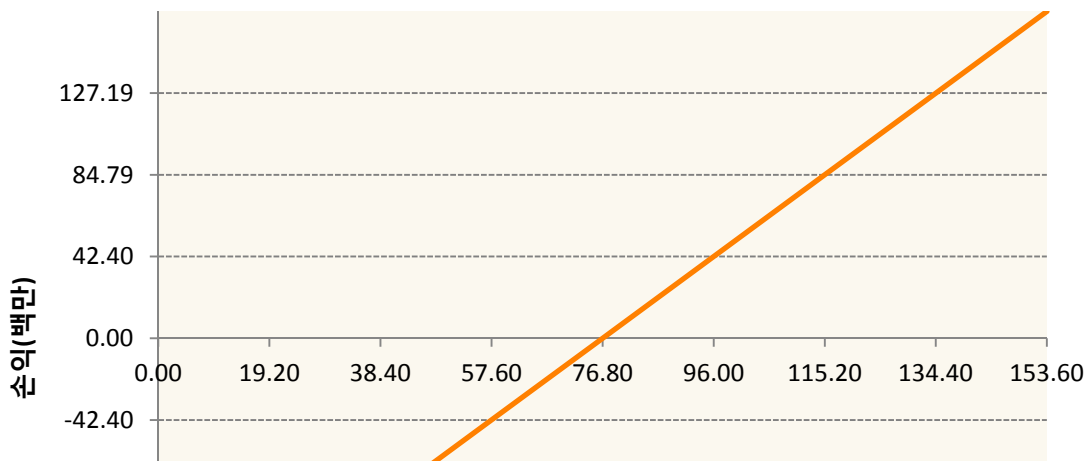
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,525	80	3,445	

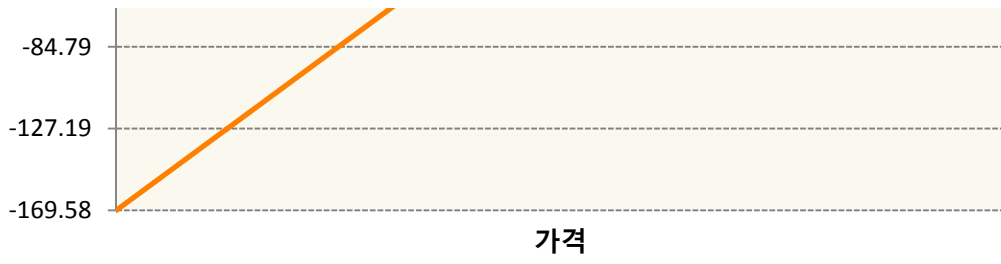
2. 만기시점의 손익구조

BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18

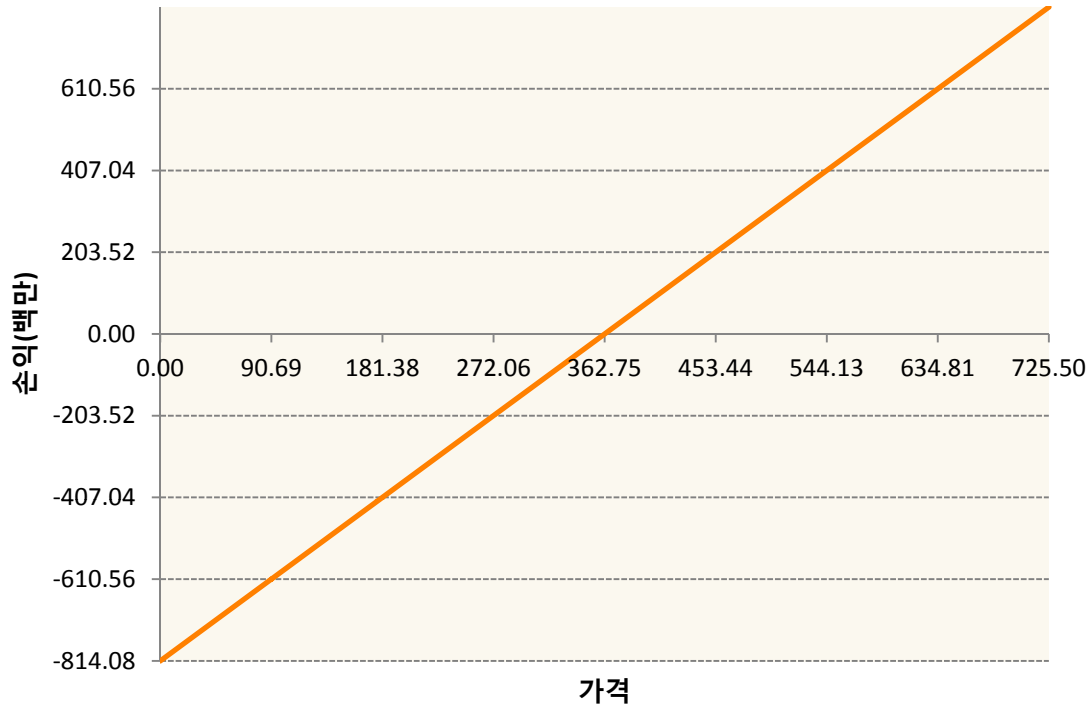


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

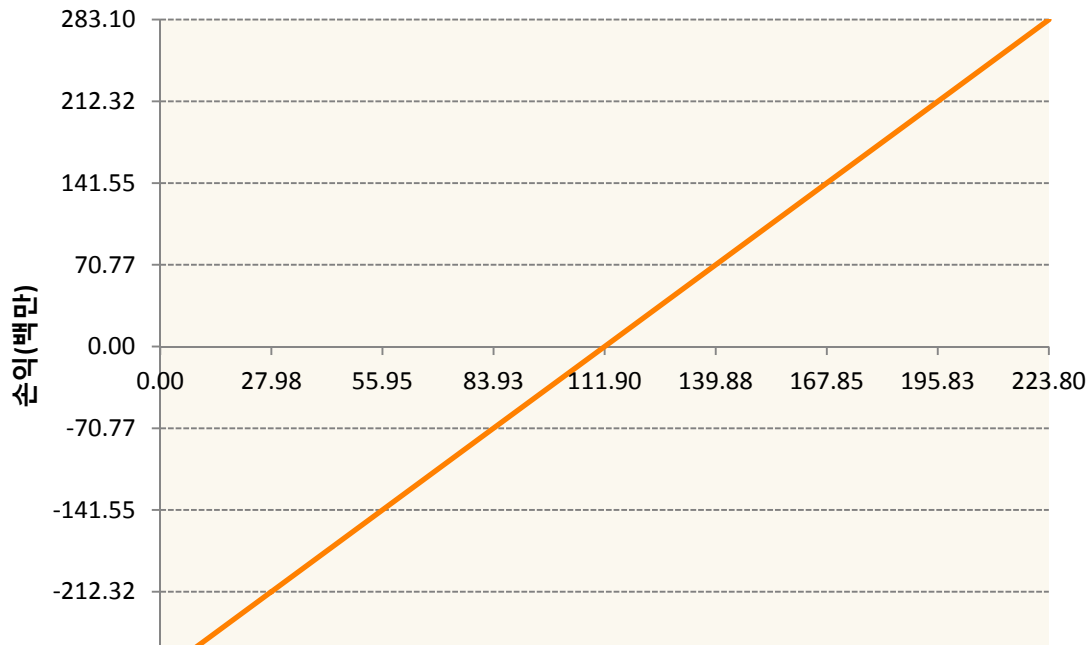


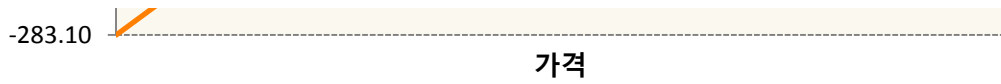


CZ8-CORN FUTURE DEC18

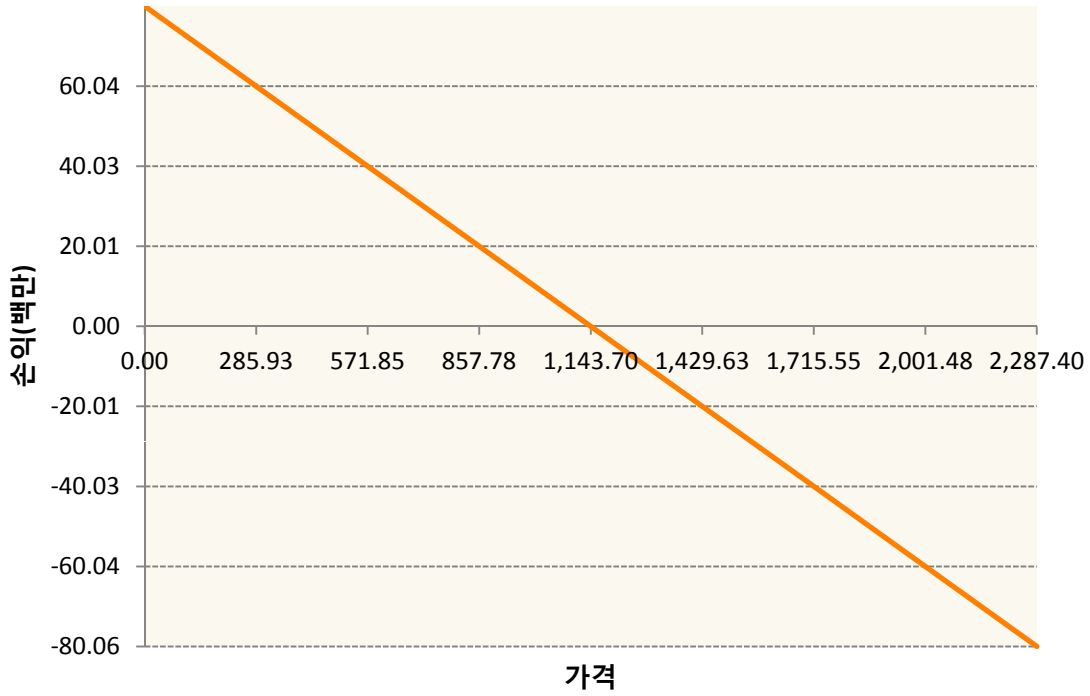


KCZ8-COFFEE 'C' FUTURE Dec18

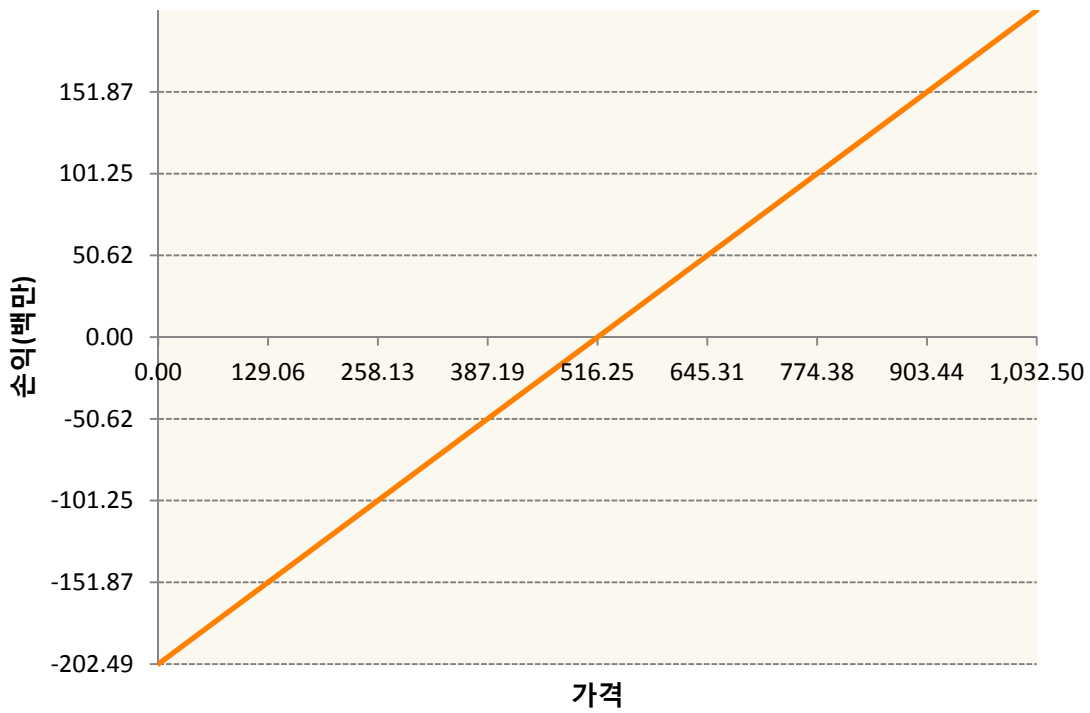




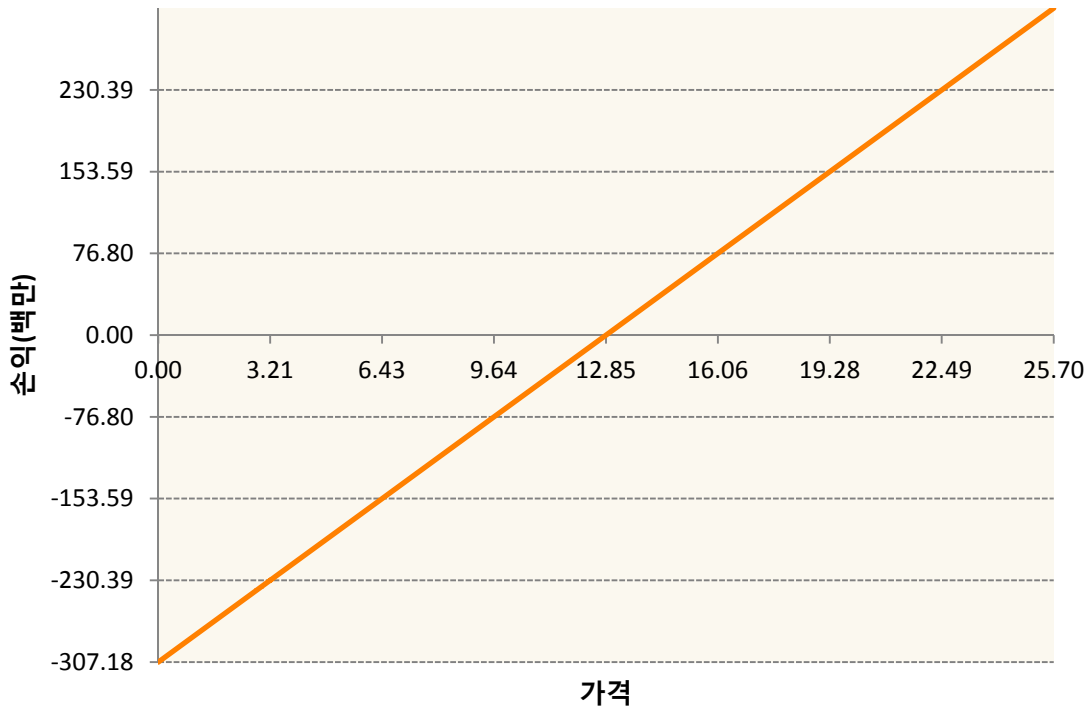
KR4175NA0007-2018-10 달러선물



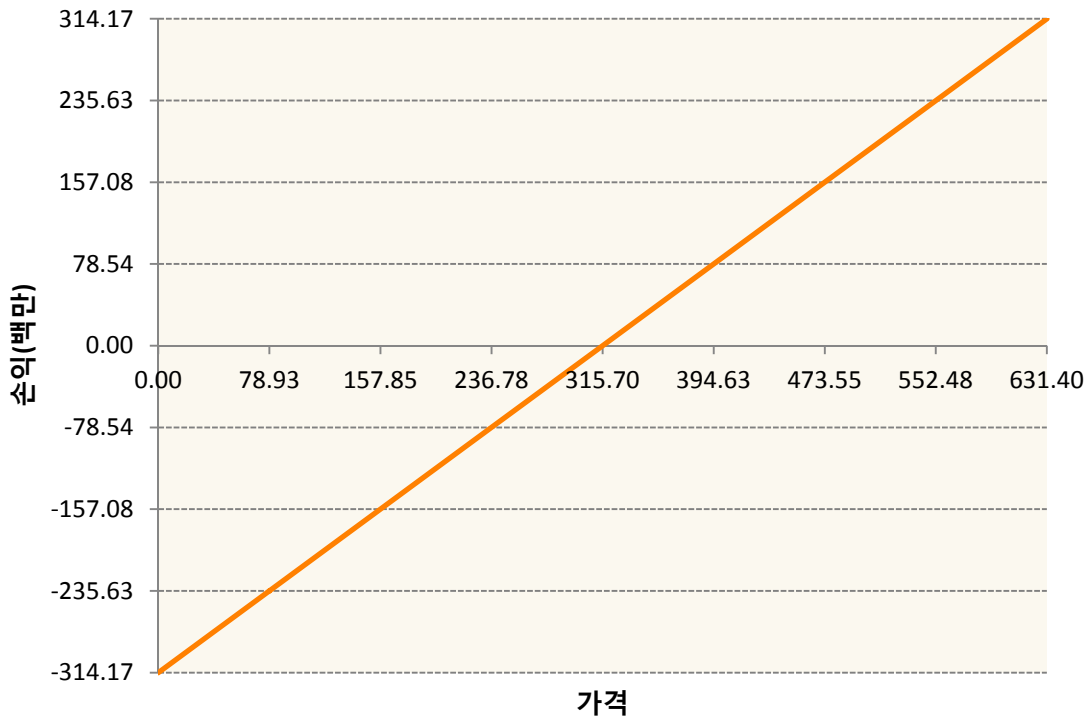
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



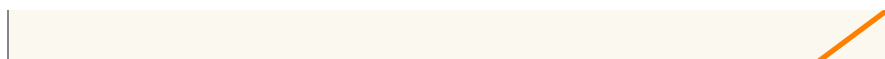
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

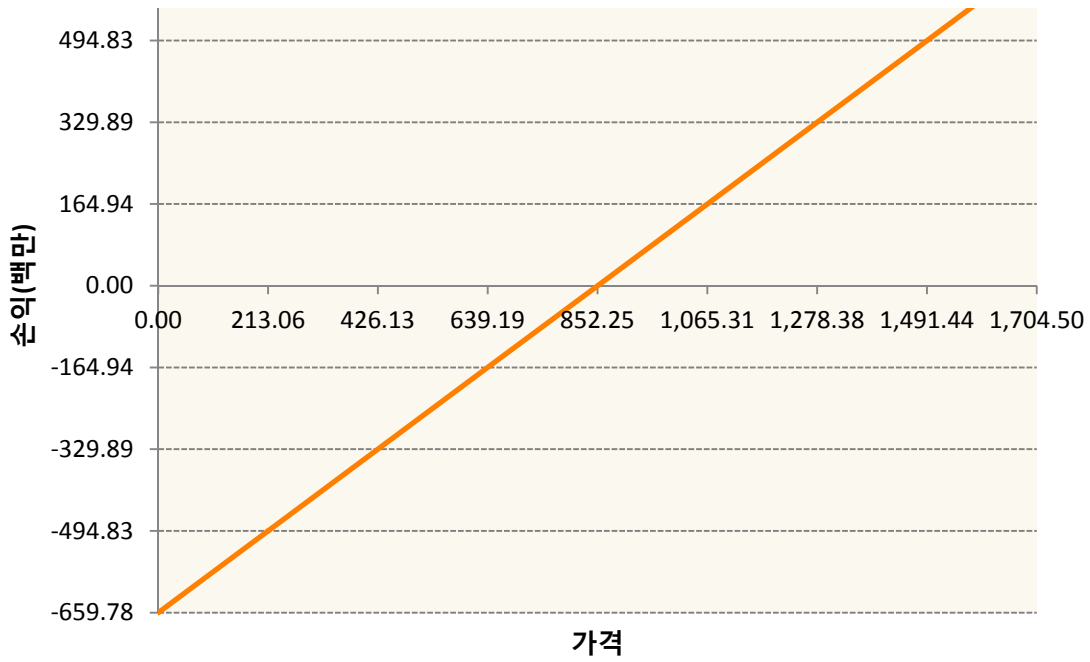


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

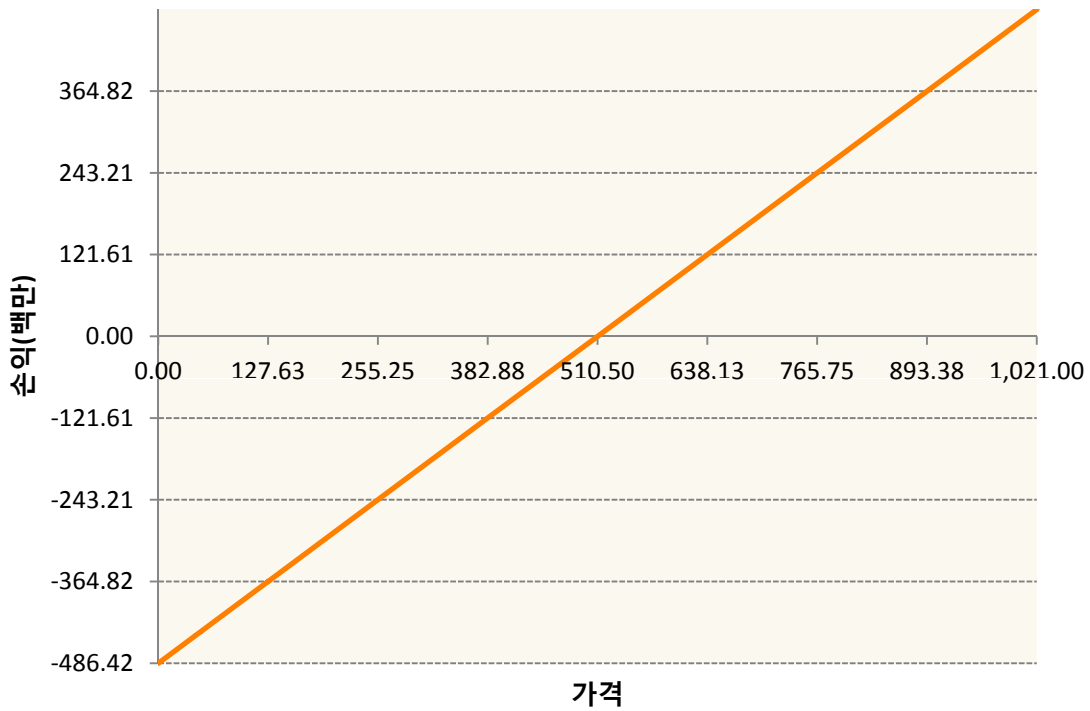


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





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	65
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	23
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	53
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	39

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

(단위:백만원)

307