

공시일	2018-10-16
기준일	2018-10-15

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	2018-10-16
기준일	2018-10-15

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

1,097

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

487

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-16
기준일	2018-10-15

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

255

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

345

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-16
기준일	2018-10-15

유로인덱스모(주식-파생형)

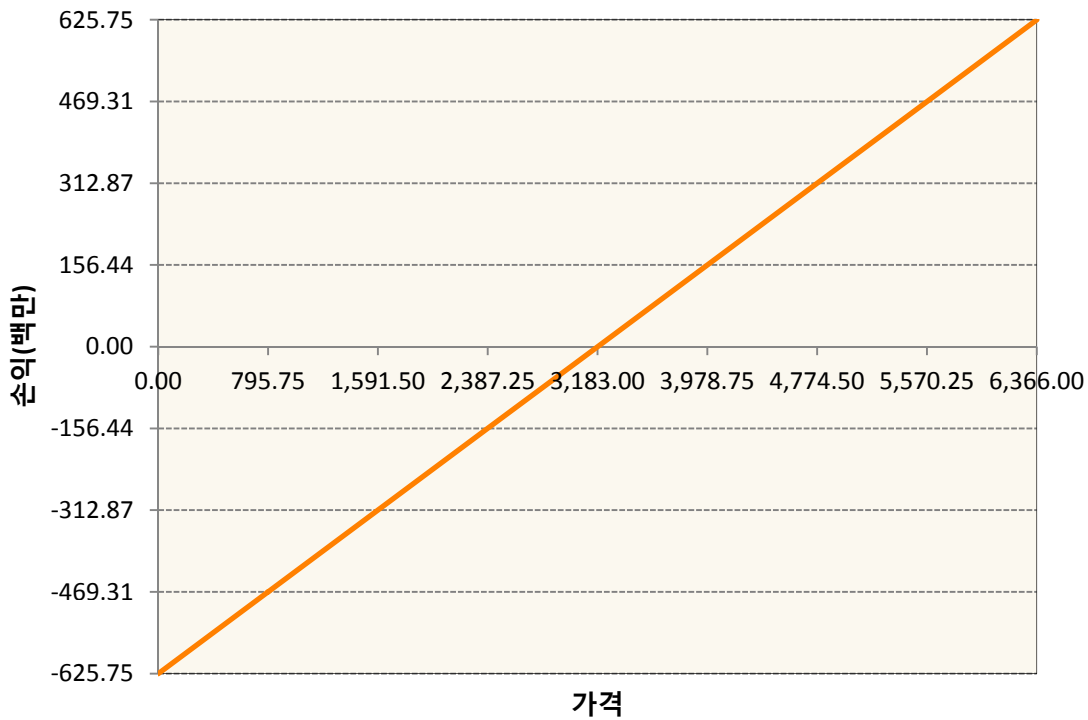
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	626	0	626	

2. 만기시점의 손익구조

VGZ8-EURO STOXX 50 DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

31

공시일	2018-10-16
기준일	2018-10-15

차이나인덱스모(주식-파생형)

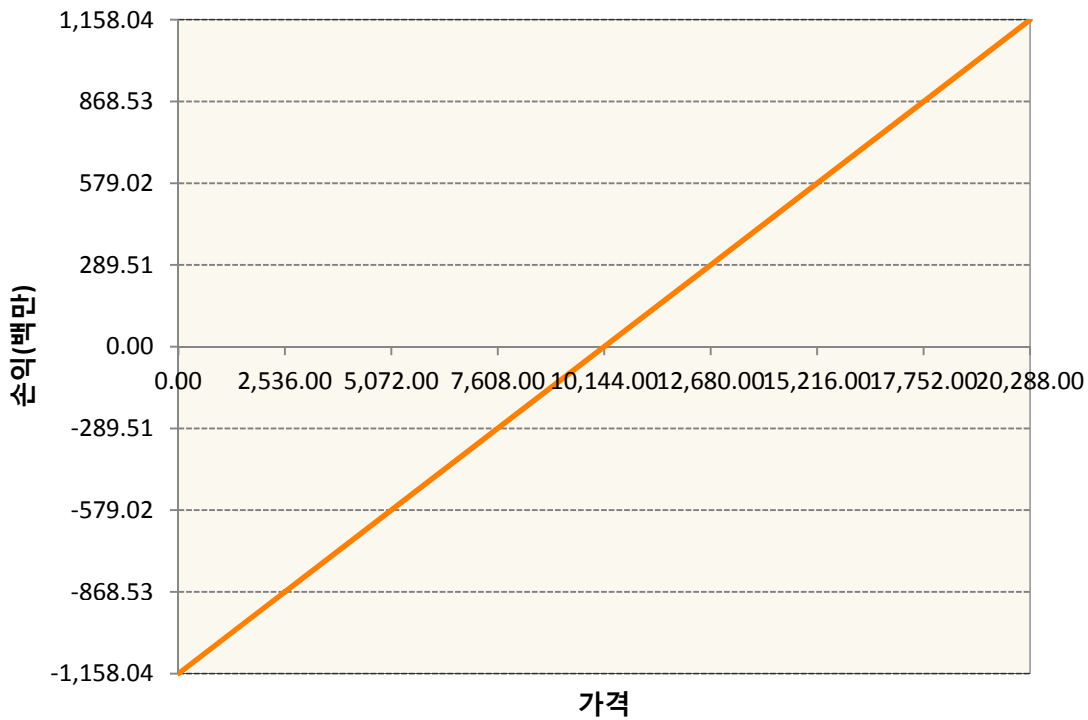
1. 계약금액

(단위:백만원)

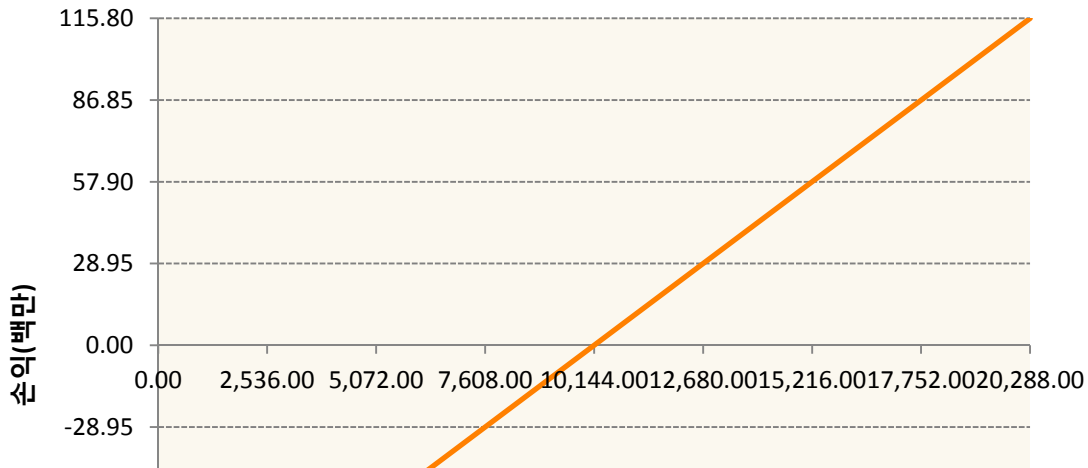
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,274	0	1,274	장내

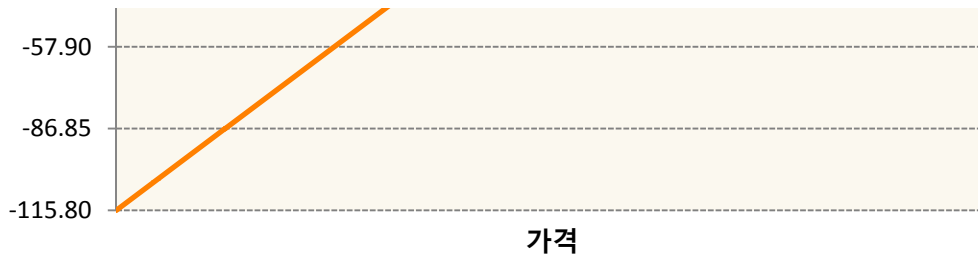
2. 만기시점의 손익구조

HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



MHCV8-MINI H-SHR IDX FU OCT 18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	93
MHCV8	MINI H-SHR IDX FU OCT 18	9

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

98

공시일	2018-10-16
기준일	2018-10-15

커버드콜모(주식혼합-파생형)

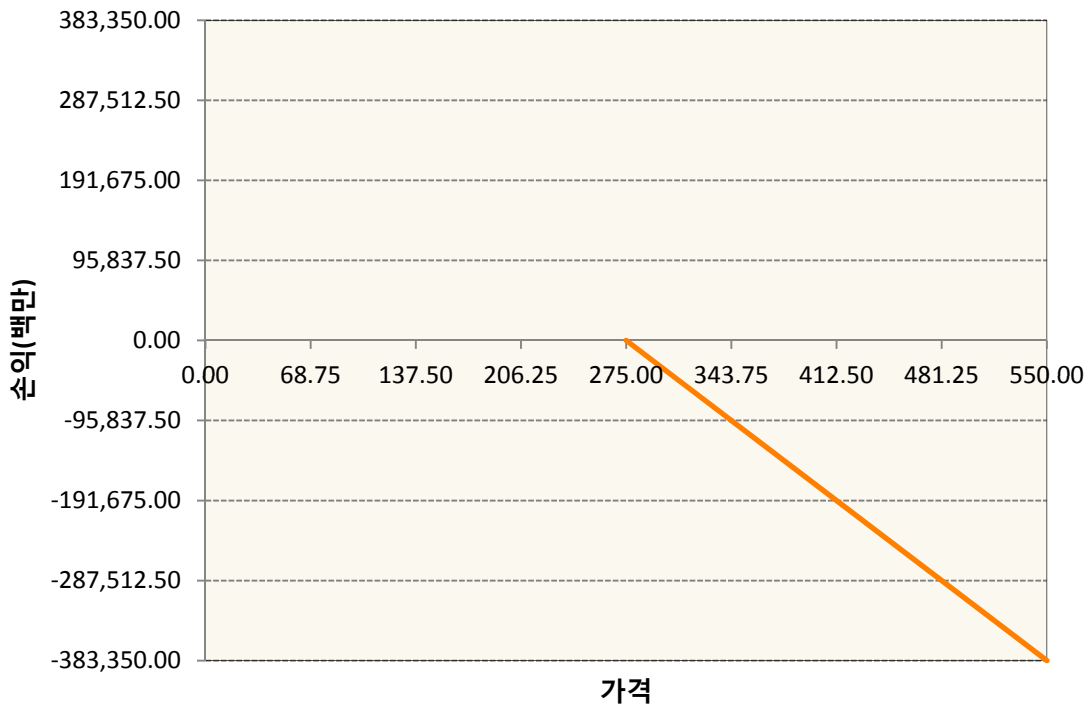
1. 계약금액

(단위:백만원)

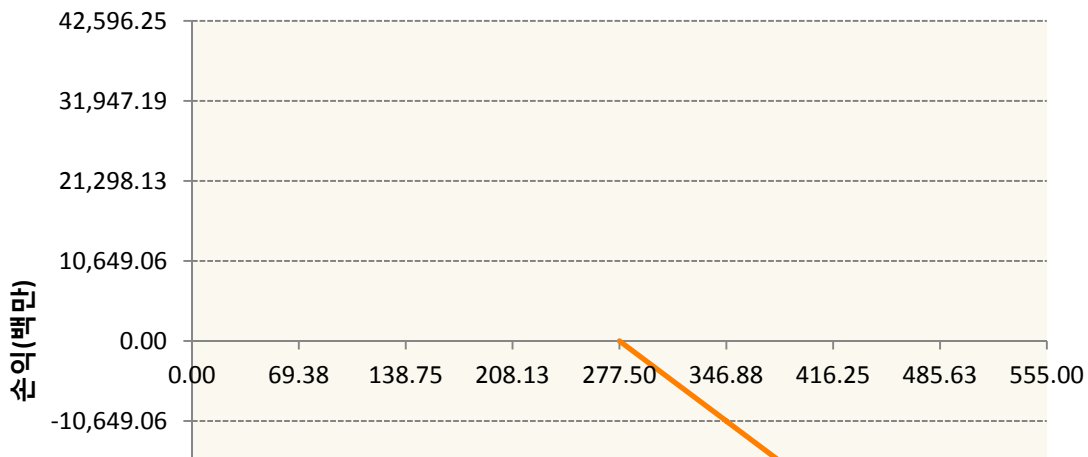
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	6,330	-6,330	장내
누계	유가증권	옵션	0	687,196	-687,196	장내

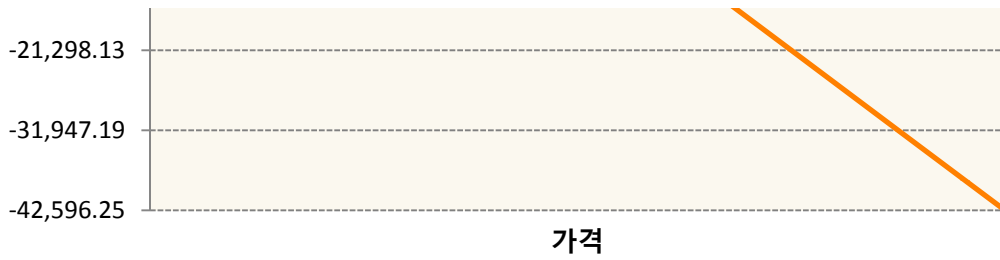
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

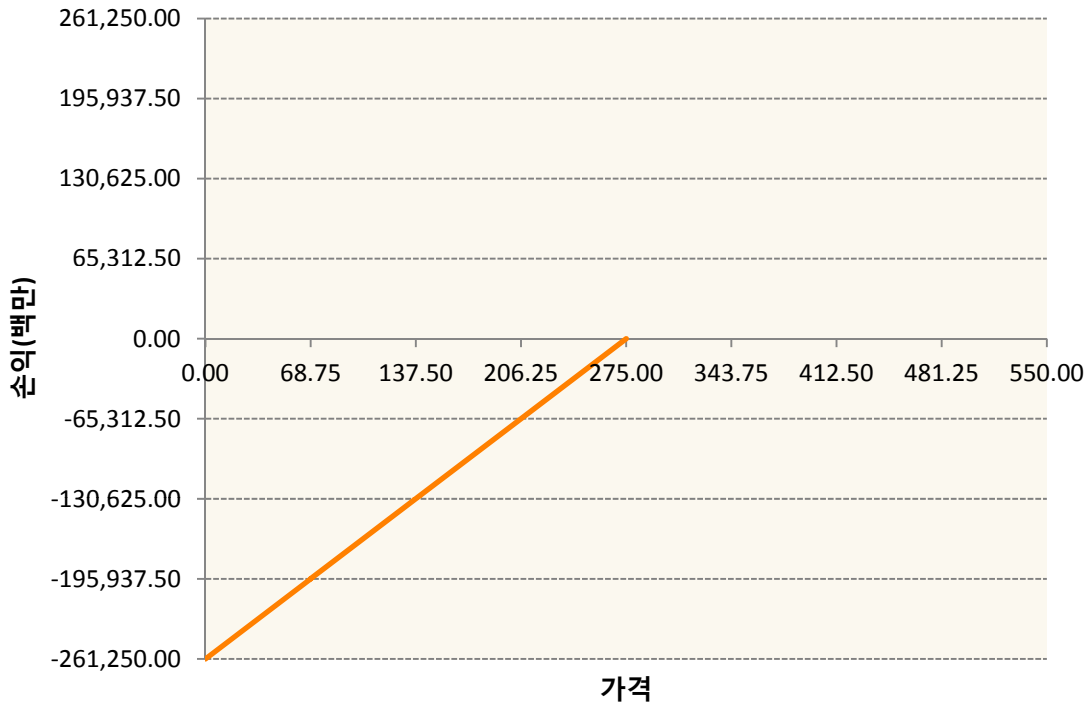


KR4201NB2778-2018-11 콜277.5





KR4301NB2751-2018-11 풋275



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NB27 2018-11 콜275

24,698

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,464	11,148	10,770	10,339	9,861	9,344	8,792
-5.33%	10,183	9,600	8,975	8,318	7,634	6,928	6,205
-2.67%	7,400	6,590	5,771	4,945	4,114	3,278	2,439
0%	2,601	1,735	868	0	-869	-1,739	-2,609
2.67%	-4,255	-4,981	-5,735	-6,509	-7,299	-8,102	-8,915
5.33%	-12,733	-13,221	-13,767	-14,359	-14,991	-15,655	-16,346
8.00%	-22,221	-22,488	-22,822	-23,217	-23,665	-24,161	-24,698

KR4201NB27 2018-11 콜277.5

2,601

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,090	1,063	1,029	989	943	892	837

-5.33%	986	931	870	805	736	664	589
-2.67%	741	658	573	486	397	308	218
0%	290	193	97	0	-97	-193	-290
2.67%	-391	-479	-568	-660	-752	-845	-938
5.33%	-1,269	-1,333	-1,402	-1,476	-1,553	-1,633	-1,715
8.00%	-2,281	-2,319	-2,364	-2,416	-2,473	-2,535	-2,601

KR4301NB27 2018-11 풋275

15,770

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-15,165	-15,211	-15,279	-15,369	-15,481	-15,616	-15,770
-5.33%	-8,464	-8,636	-8,835	-9,058	-9,301	-9,561	-9,836
-2.67%	-2,720	-3,066	-3,420	-3,782	-4,148	-4,519	-4,893
0%	1,186	792	397	0	-397	-796	-1,194
2.67%	3,091	2,827	2,541	2,237	1,920	1,591	1,252
5.33%	3,723	3,613	3,474	3,308	3,116	2,902	2,669
8.00%	3,862	3,833	3,786	3,719	3,630	3,518	3,386

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

(단위:백만원)

42,671

공시일	2018-10-16
기준일	2018-10-15

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

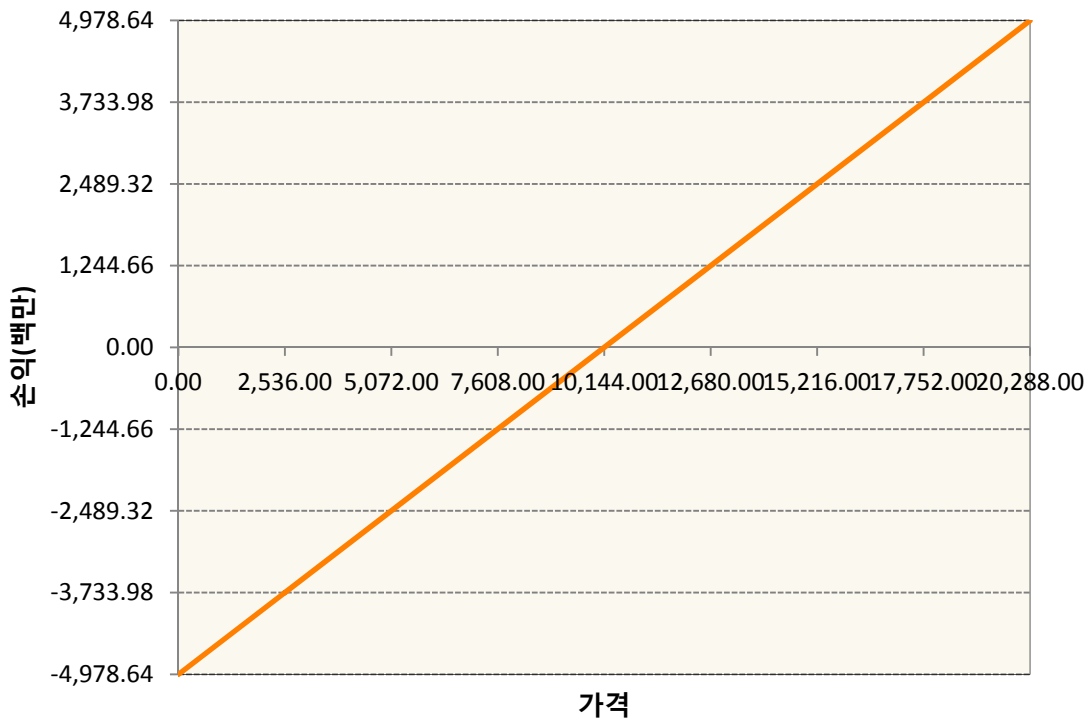
1. 계약금액

(단위:백만원)

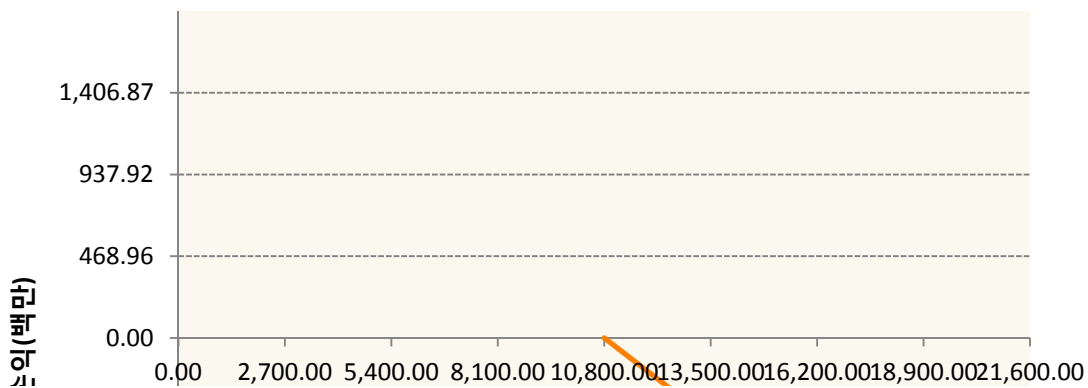
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,979	0	4,979	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,190	-12,190	장내

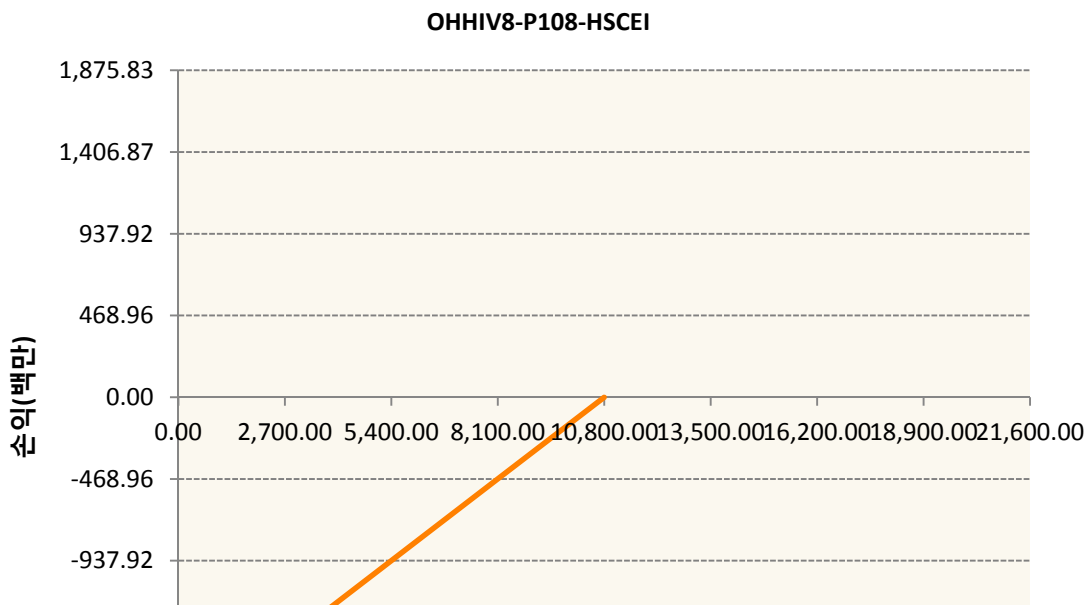
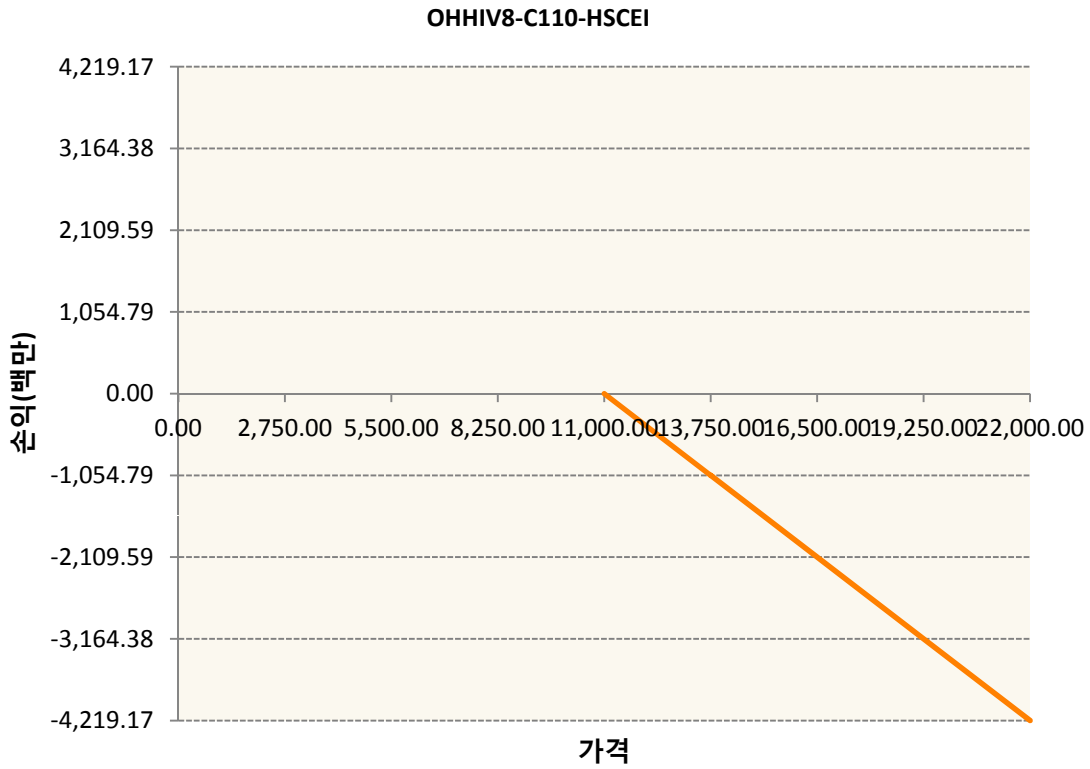
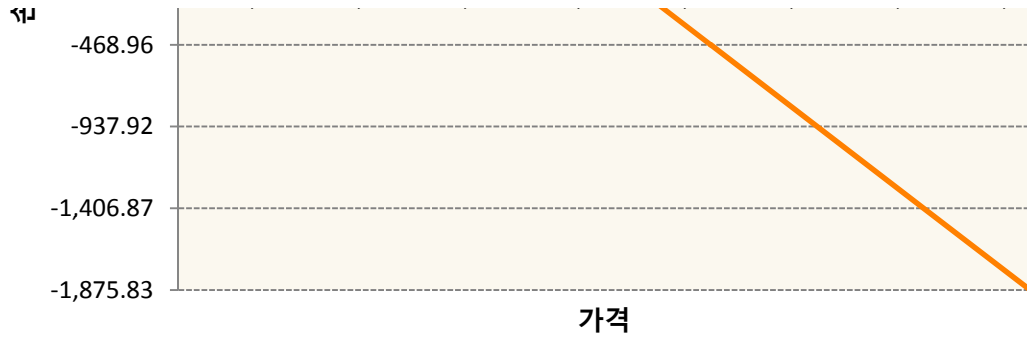
2. 만기시점의 손익구조

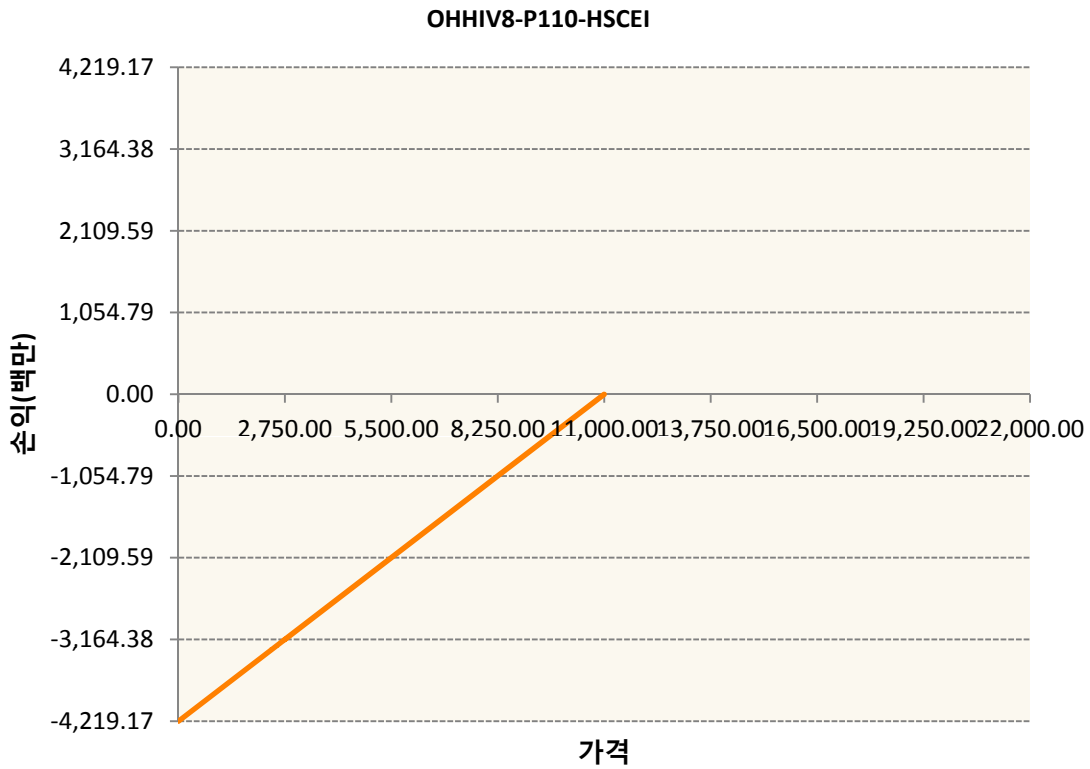
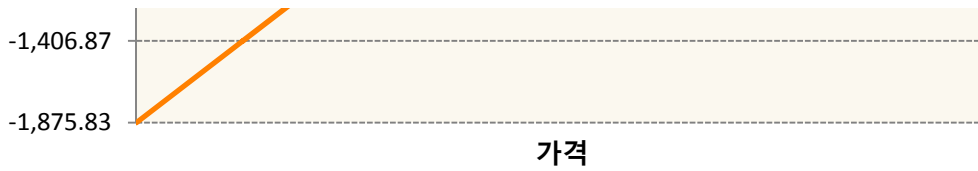
HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



OHHIV8-C108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	398
OHHIV8-C1	HSCEI	150
OHHIV8-C11	HSCEI	338
OHHIV8-P1C	HSCEI	150
OHHIV8-P11	HSCEI	338

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,317

공시일	2018-10-16
기준일	2018-10-15

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

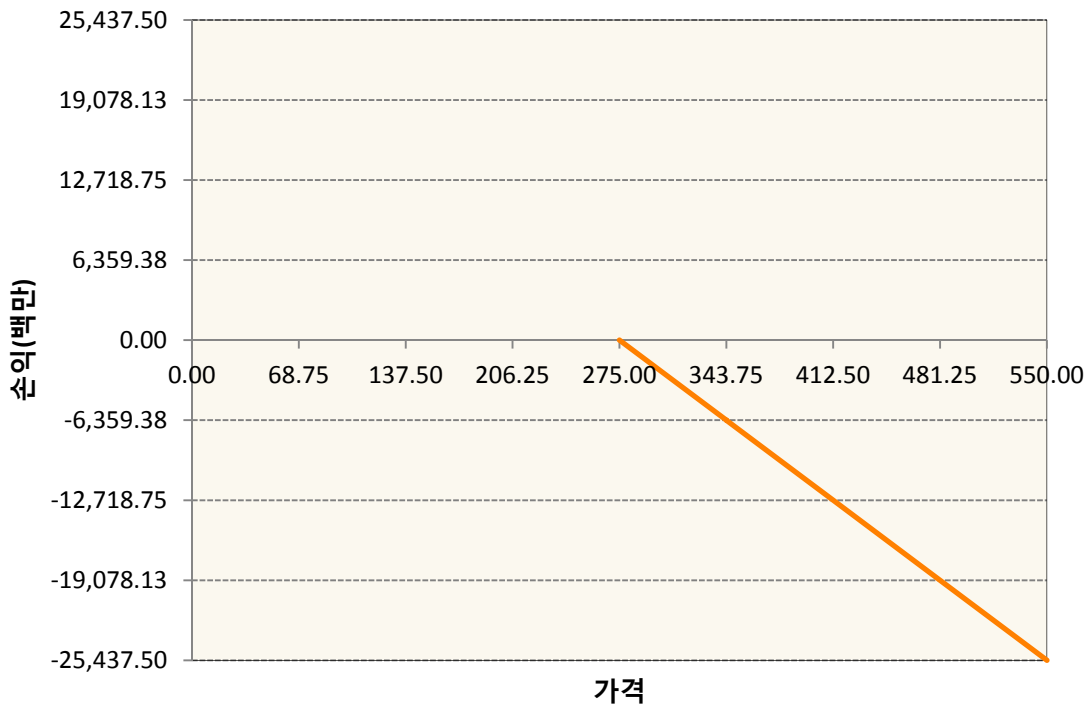
1. 계약금액

(단위:백만원)

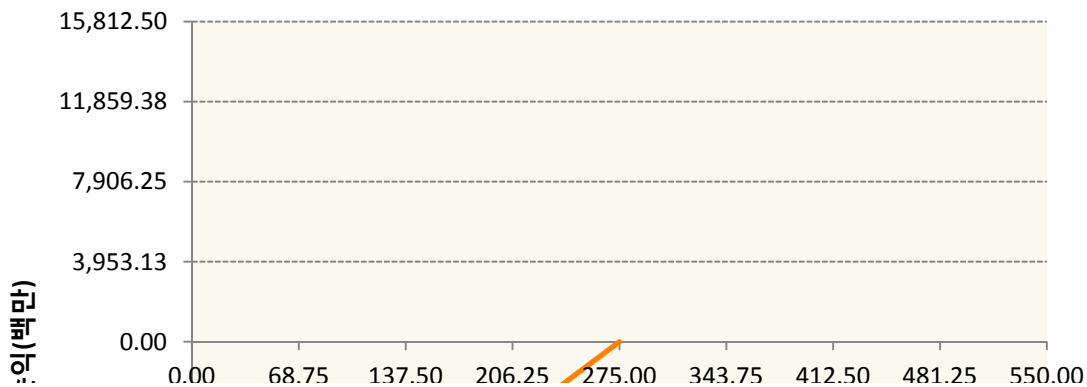
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	44,025	-44,025	장내

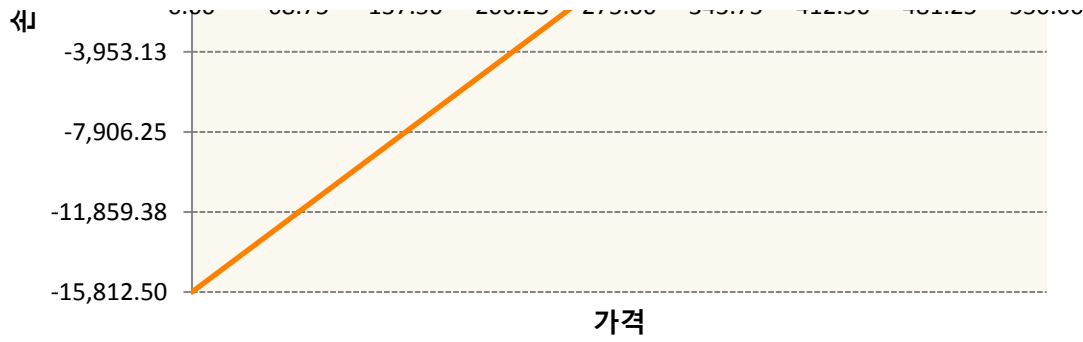
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

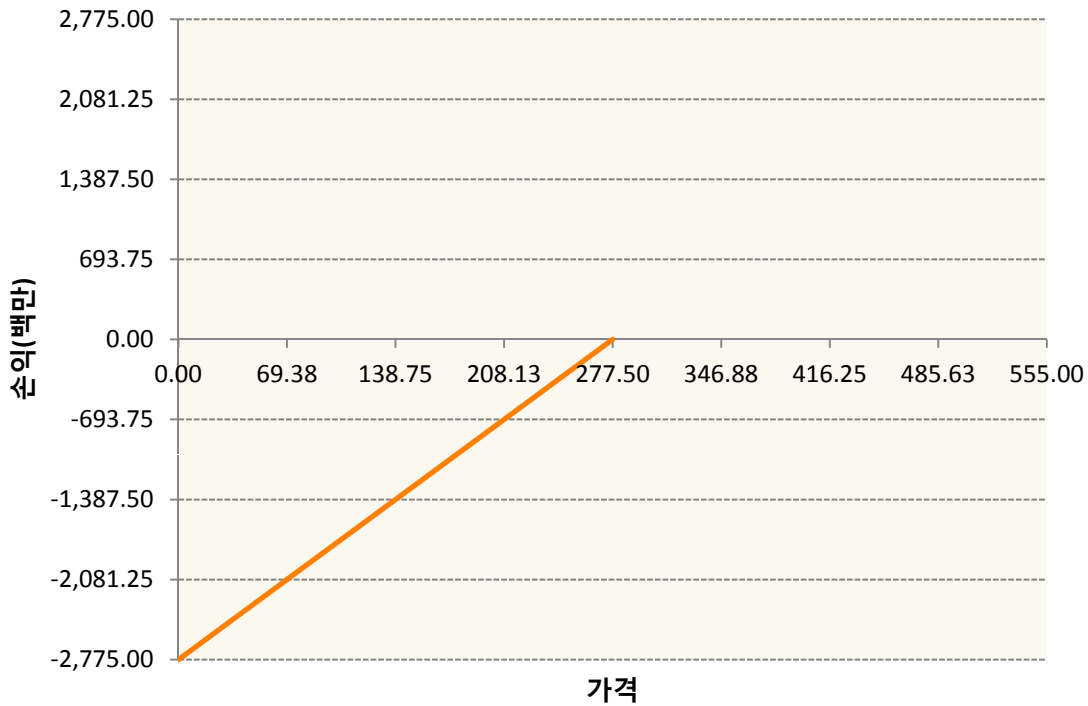


KR4301NB2751-2018-11 풋275





KR4301NB2777-2018-11 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							4,005	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-4,005	-4,005	-4,005	-4,005	-4,005	-4,005	-4,005	
-5.33%	-2,670	-2,670	-2,670	-2,670	-2,670	-2,670	-2,670	
-2.67%	-1,335	-1,335	-1,335	-1,335	-1,335	-1,335	-1,335	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	1,335	1,335	1,335	1,335	1,335	1,335	1,335	
5.33%	2,670	2,670	2,670	2,670	2,670	2,670	2,670	
8.00%	4,005	4,005	4,005	4,005	4,005	4,005	4,005	
KR4201NB27 2018-11 콜275							1,639	
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	761	740	715	686	654	620	583
-5.33%	676	637	596	552	507	460	412
-2.67%	491	437	383	328	273	218	162
0%	173	115	58	0	-58	-115	-173
2.67%	-282	-331	-381	-432	-484	-538	-592
5.33%	-845	-877	-914	-953	-995	-1,039	-1,085
8.00%	-1,474	-1,492	-1,514	-1,541	-1,570	-1,603	-1,639

KR4301NB27 2018-11 풋275

955

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-918	-921	-925	-930	-937	-945	-955
-5.33%	-512	-523	-535	-548	-563	-579	-595
-2.67%	-165	-186	-207	-229	-251	-274	-296
0%	72	48	24	0	-24	-48	-72
2.67%	187	171	154	135	116	96	76
5.33%	225	219	210	200	189	176	162
8.00%	234	232	229	225	220	213	205

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

177

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-172	-173	-173	-174	-175	-176	-177
-5.33%	-100	-102	-103	-105	-107	-110	-112
-2.67%	-36	-39	-42	-45	-49	-53	-56
0%	13	9	4	0	-4	-9	-13
2.67%	40	36	33	29	25	21	17
5.33%	50	48	46	44	41	39	36
8.00%	52	52	51	50	49	47	45

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

(단위:백만원)

6,764

공시일	2018-10-16
기준일	2018-10-15

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

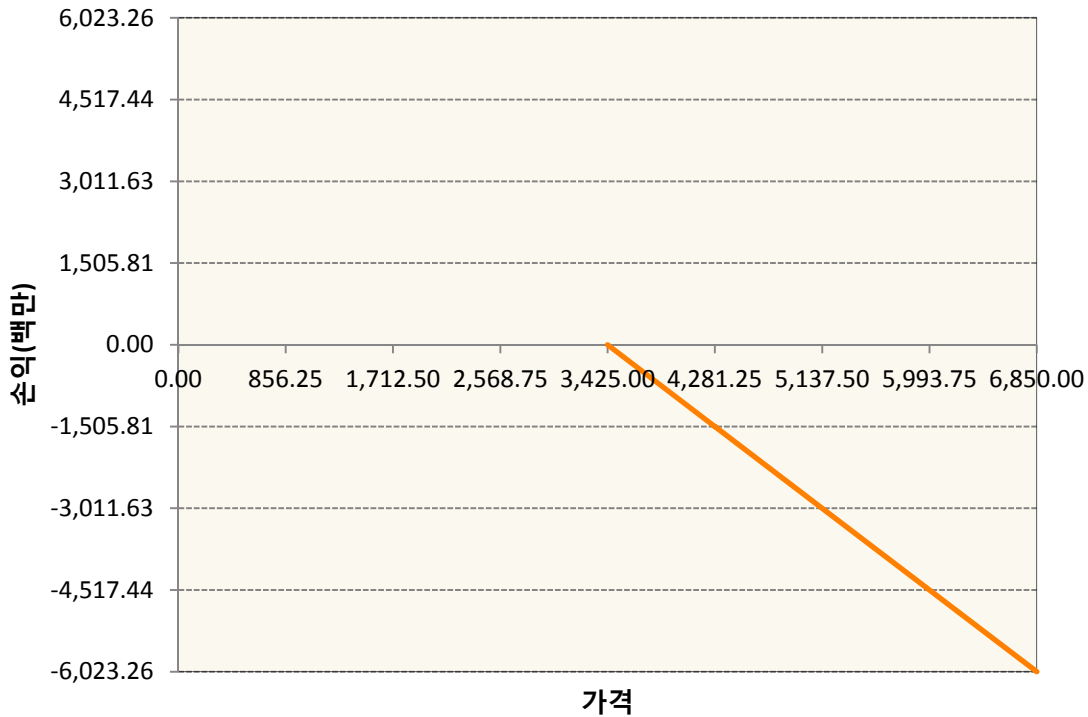
1. 계약금액

(단위:백만원)

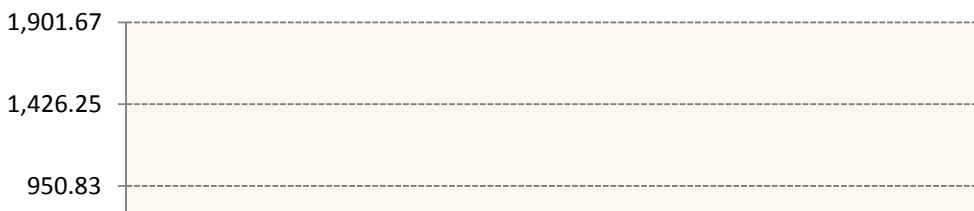
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	869	0	869	
누계	유가증권	스왑	34,656	0	34,656	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,850	-15,850	장내
누계	지수	스왑	53,280	0	53,280	장외

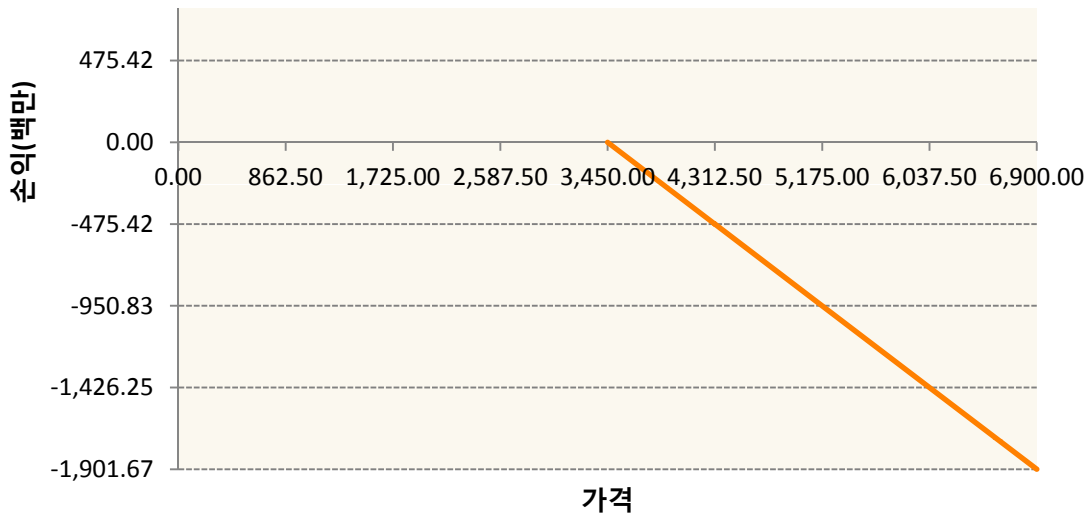
2. 만기시점의 손익구조

OESXV8-C3425-EURO STOXX 50

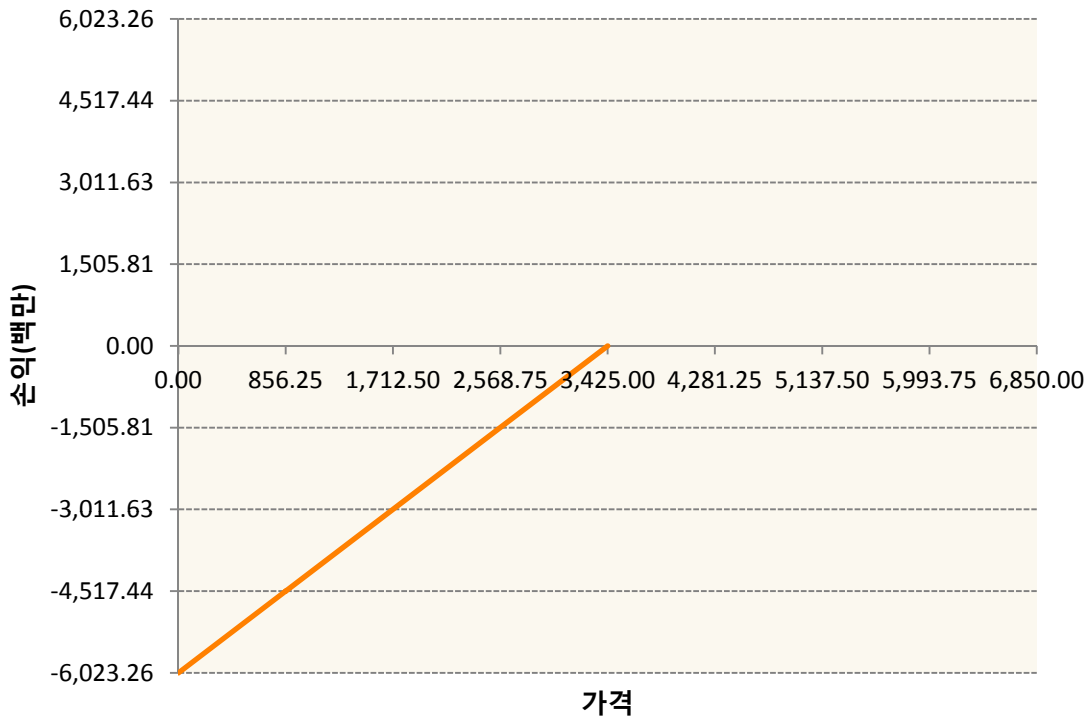


OESXV8-C3450-EURO STOXX 50

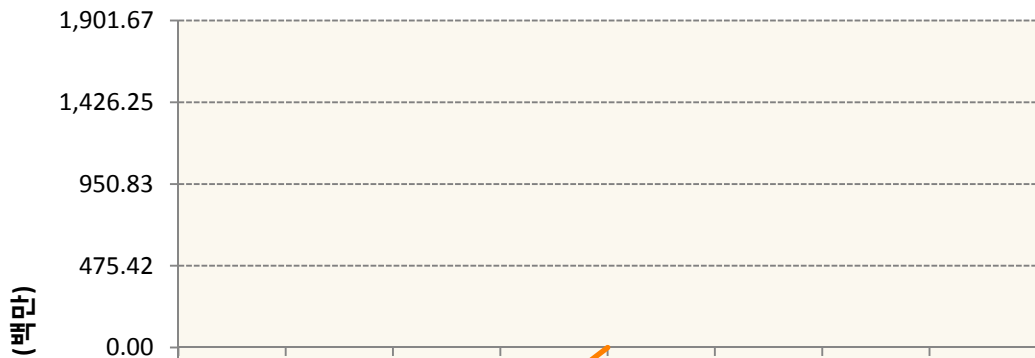


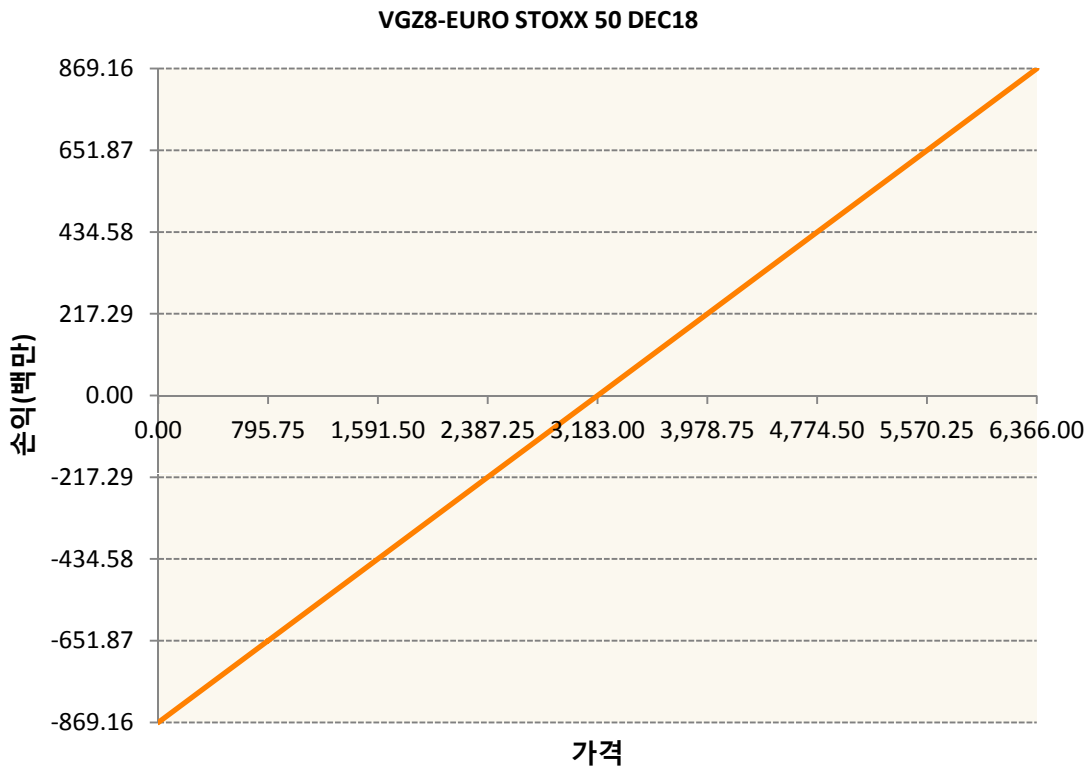
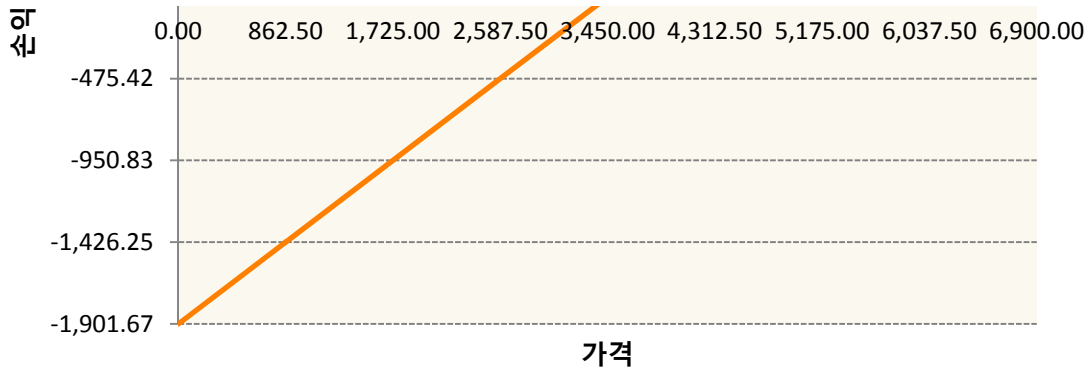


OESXV8-P3425-EURO STOXX 50



OESXV8-P3450-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		234
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		152
OESXV8-C34 EURO STOXX 50		482
OESXV8-C34 EURO STOXX 50		152
OESXV8-P34 EURO STOXX 50		482
OESXV8-P34 EURO STOXX 50		152
VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18		70

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

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

(단위:백만원)

1,140

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

(단위:백만원)

90

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

(단위:백만원)

135

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

(단위:백만원)

158

공시일	2018-10-16
기준일	2018-10-15

스마트KRX300인덱스목표전환형1

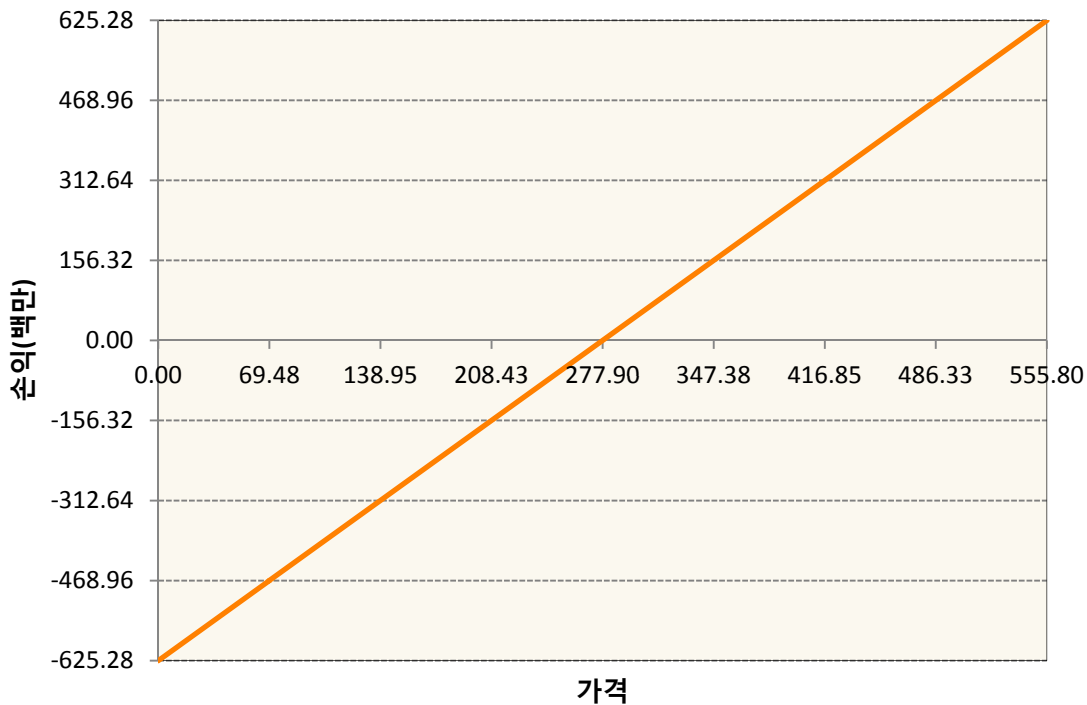
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	625	0	625	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	2018-10-16
기준일	2018-10-15

리디파인K200(주식혼합-파생재간

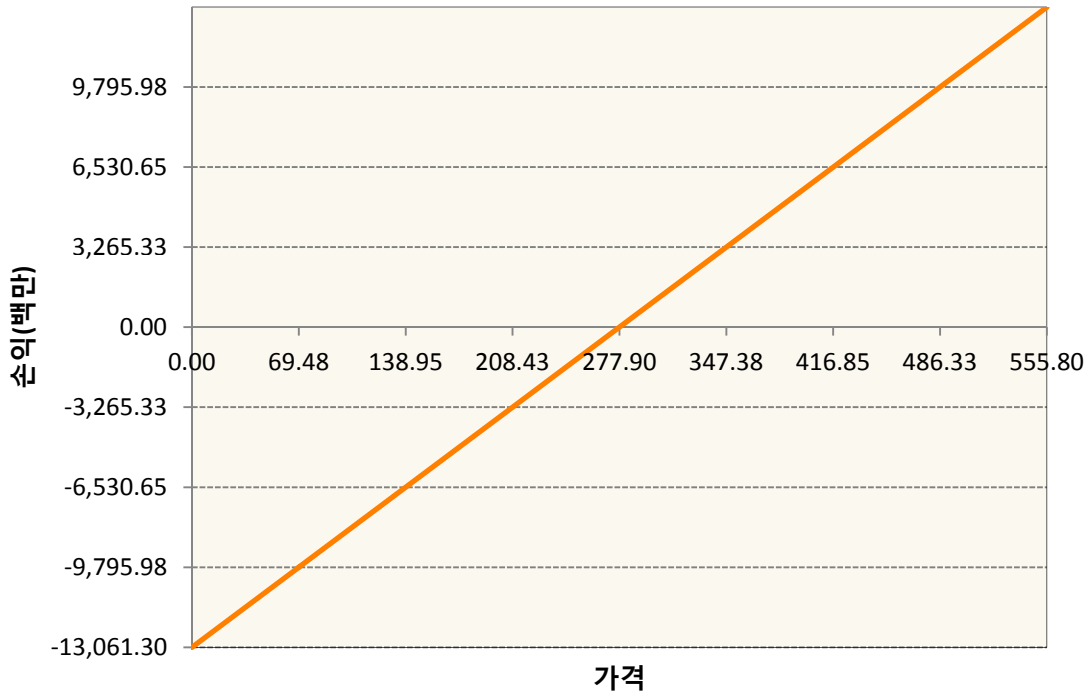
1. 계약금액

(단위:백만원)

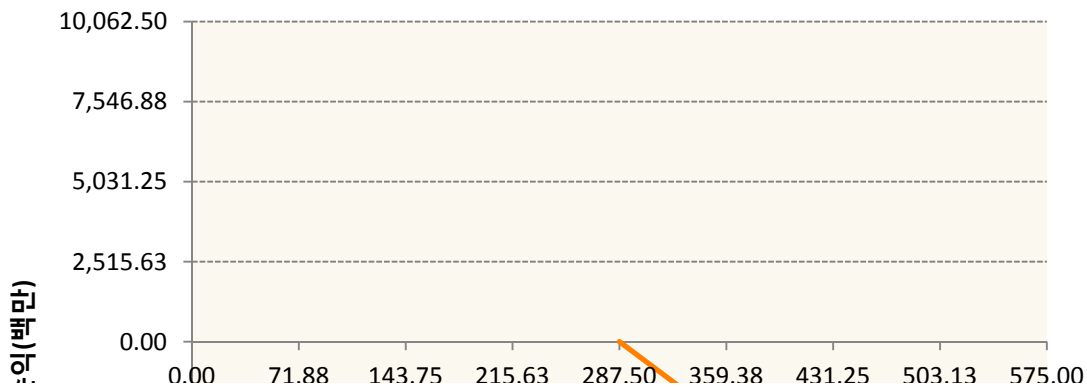
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,061	0	13,061	장내
누계	유가증권	옵션	4,059	23,113	-19,054	장내

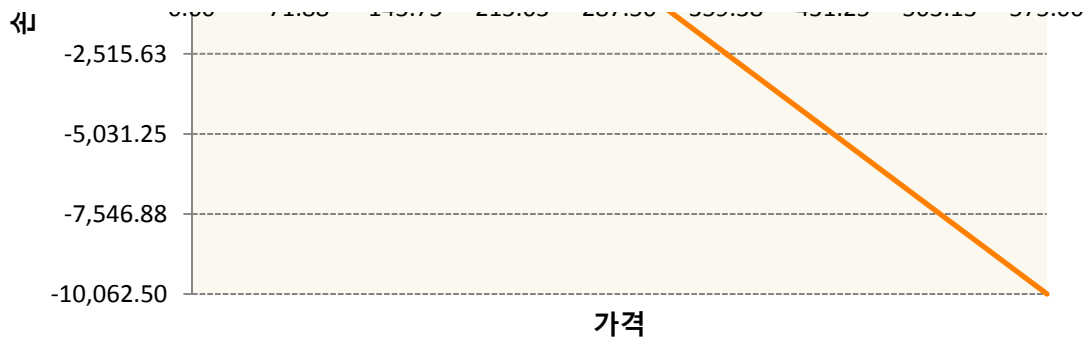
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

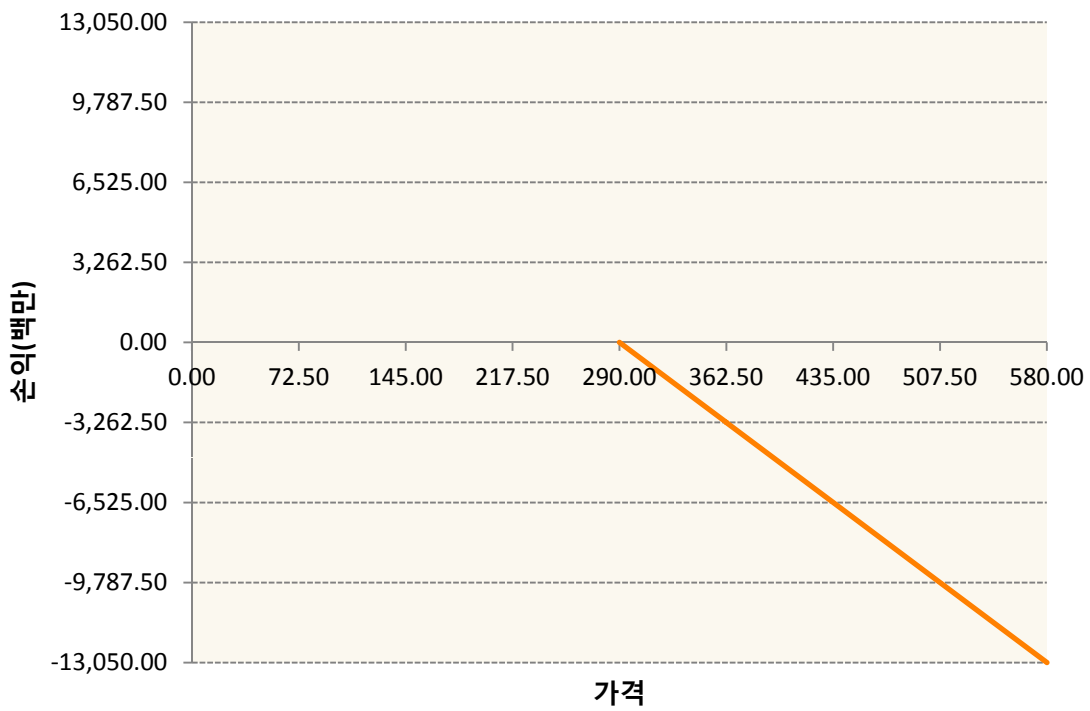


KR4201NB2877-2018-11 콜287.5

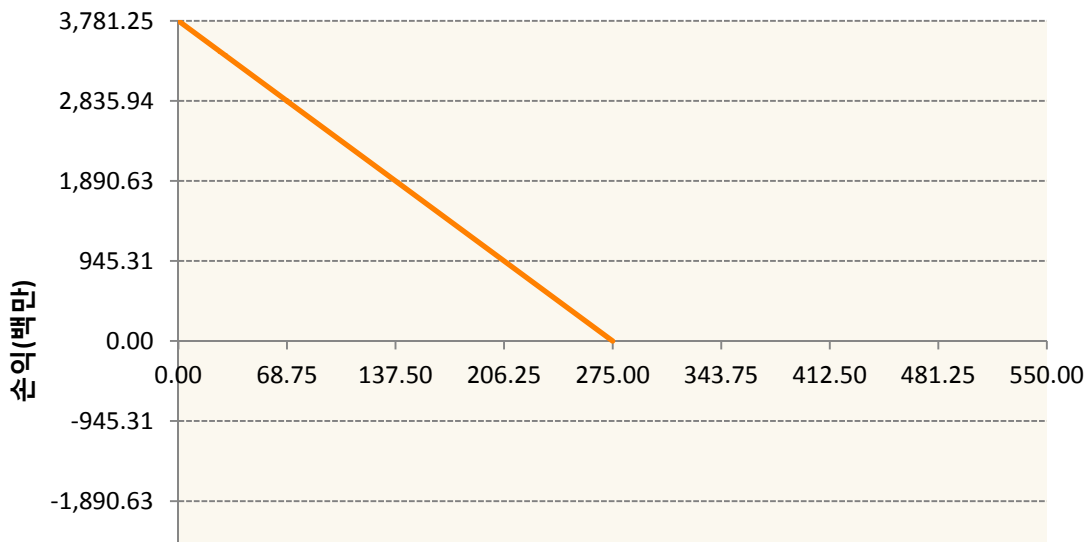


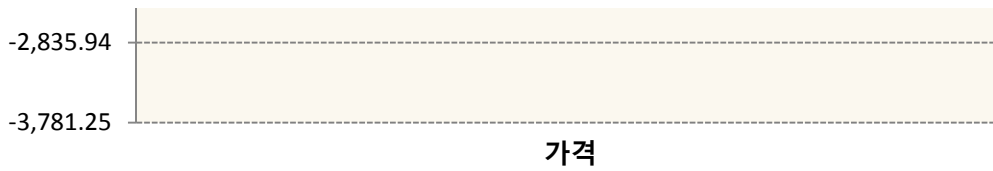


KR4201NB2901-2018-11 콜290

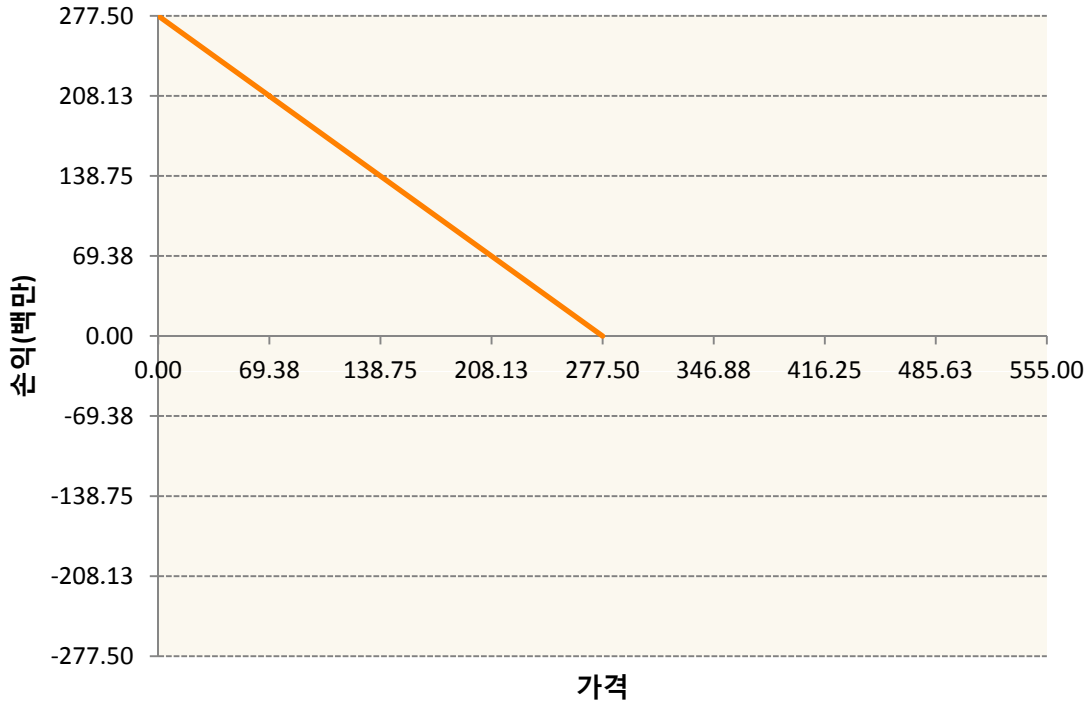


KR4301NB2751-2018-11 풋275





KR4301NB2777-2018-11 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 1,042

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,042	-1,042	-1,042	-1,042	-1,042	-1,042	-1,042
-5.33%	-695	-695	-695	-695	-695	-695	-695
-2.67%	-347	-347	-347	-347	-347	-347	-347
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	347	347	347	347	347	347	347
5.33%	695	695	695	695	695	695	695
8.00%	1,042	1,042	1,042	1,042	1,042	1,042	1,042

KR4201NB28 2018-11 콜287.5 468

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	125	123	120	116	111	104	97
-5.33%	119	114	107	99	89	78	66
-2.67%	100	89	77	63	48	32	16

0%	56	38	19	0	-20	-40	-60
2.67%	-31	-53	-76	-98	-121	-143	-166
5.33%	-168	-190	-212	-234	-257	-280	-302
8.00%	-352	-369	-388	-407	-427	-448	-468

KR4201NB27 2018-11 콜290

559

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	131	130	127	123	118	111	102
-5.33%	127	121	114	106	95	83	70
-2.67%	110	98	84	69	51	33	14
0%	65	45	23	0	-24	-48	-73
2.67%	-27	-54	-82	-111	-139	-167	-196
5.33%	-181	-210	-240	-269	-299	-328	-358
8.00%	-398	-423	-449	-476	-503	-531	-559

KR4301NB27 2018-11 풋275

228

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	219	220	221	222	224	226	228
-5.33%	123	125	128	131	135	138	142
-2.67%	39	44	50	55	60	65	71
0%	-17	-11	-6	0	6	12	17
2.67%	-45	-41	-37	-32	-28	-23	-18
5.33%	-54	-52	-50	-48	-45	-42	-39
8.00%	-56	-55	-55	-54	-53	-51	-49

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

18

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17	17	17	17	17	18	18
-5.33%	10	10	10	11	11	11	11
-2.67%	4	4	4	5	5	5	6
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-4	-4	-3	-3	-3	-2	-2
5.33%	-5	-5	-5	-4	-4	-4	-4
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5

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

(단위:백만원)

1,845

공시일	2018-10-16
기준일	2018-10-15

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

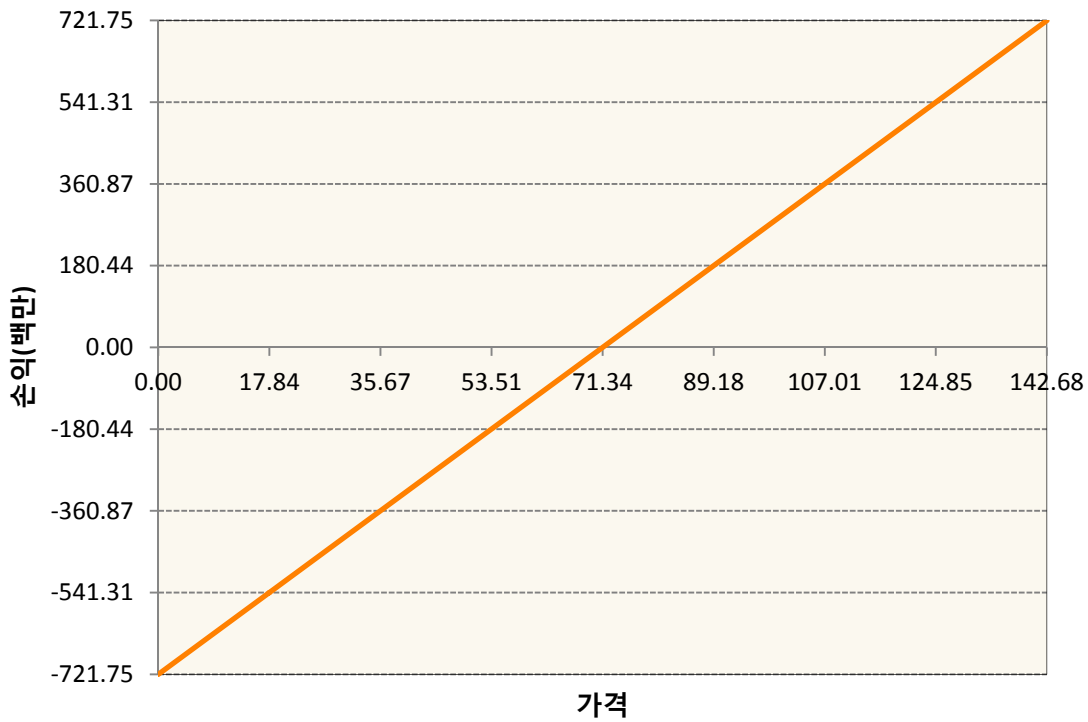
1. 계약금액

(단위:백만원)

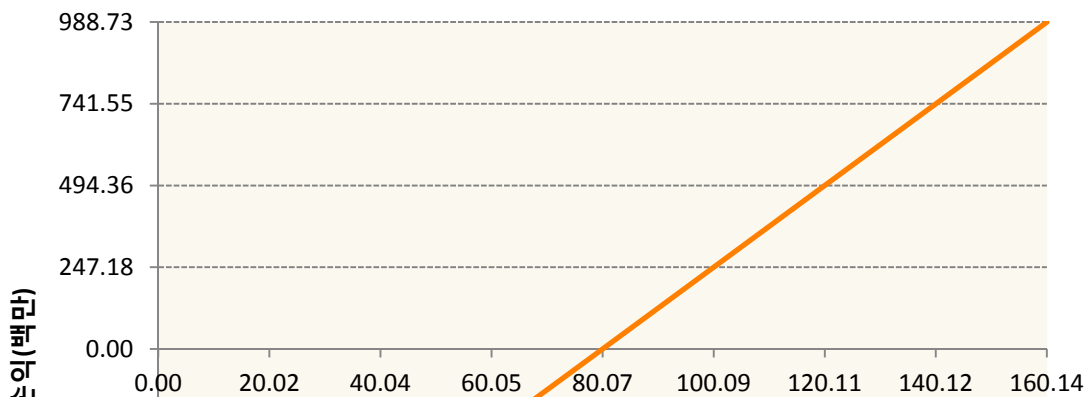
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,128	623	2,504	
누계	유가증권	선물	438	0	438	장내

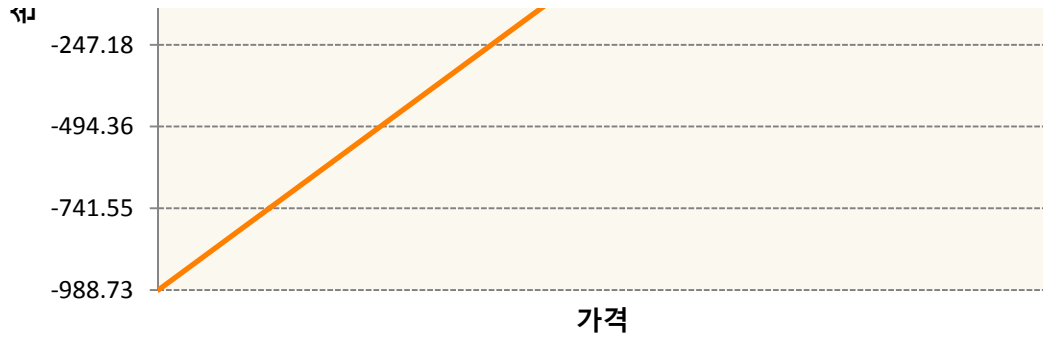
2. 만기시점의 손익구조

CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18

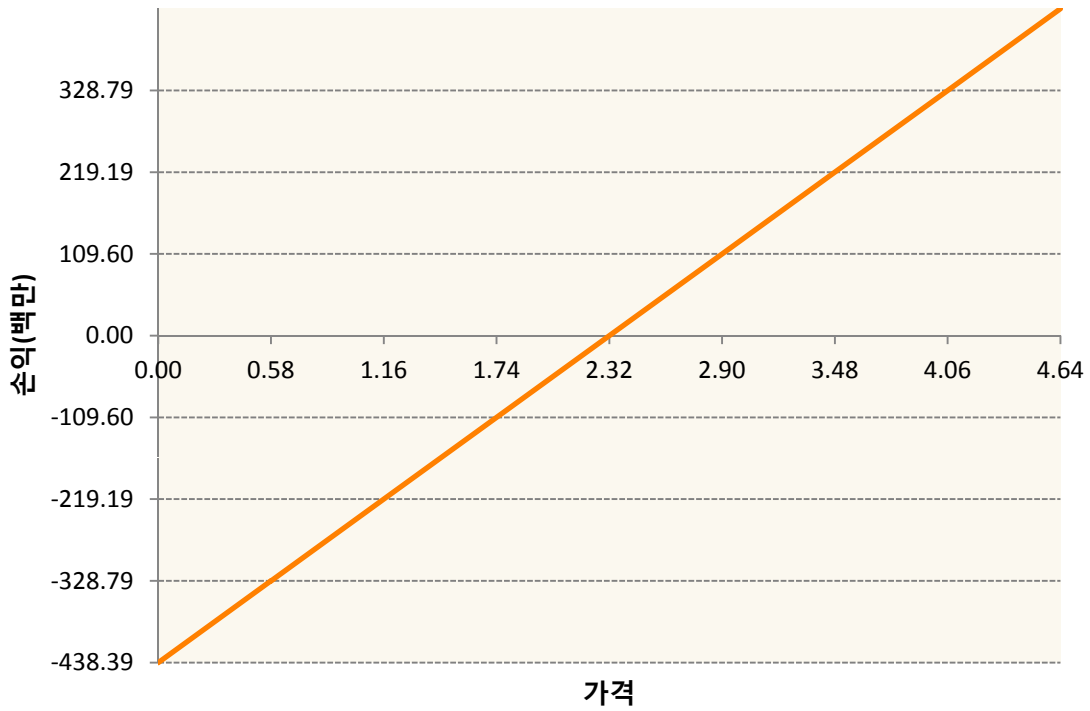


COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19

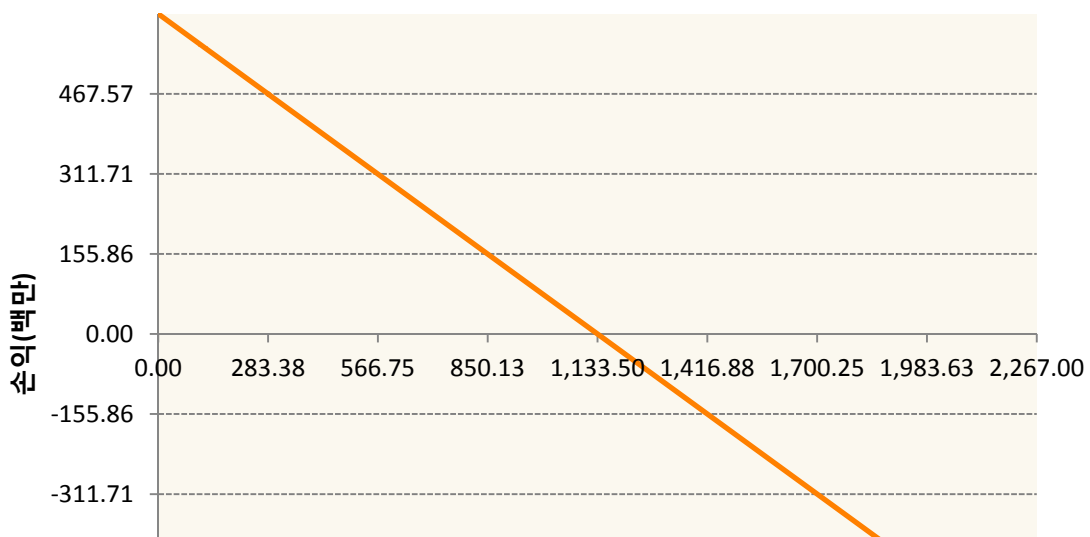


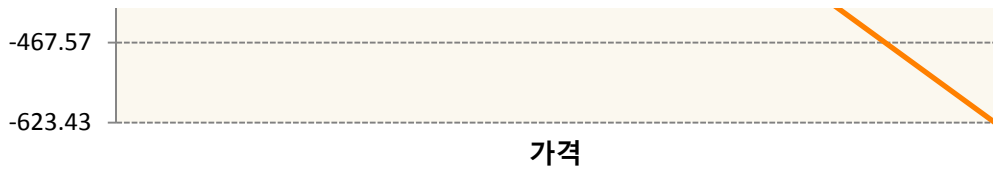


HOX8-Heating Oil

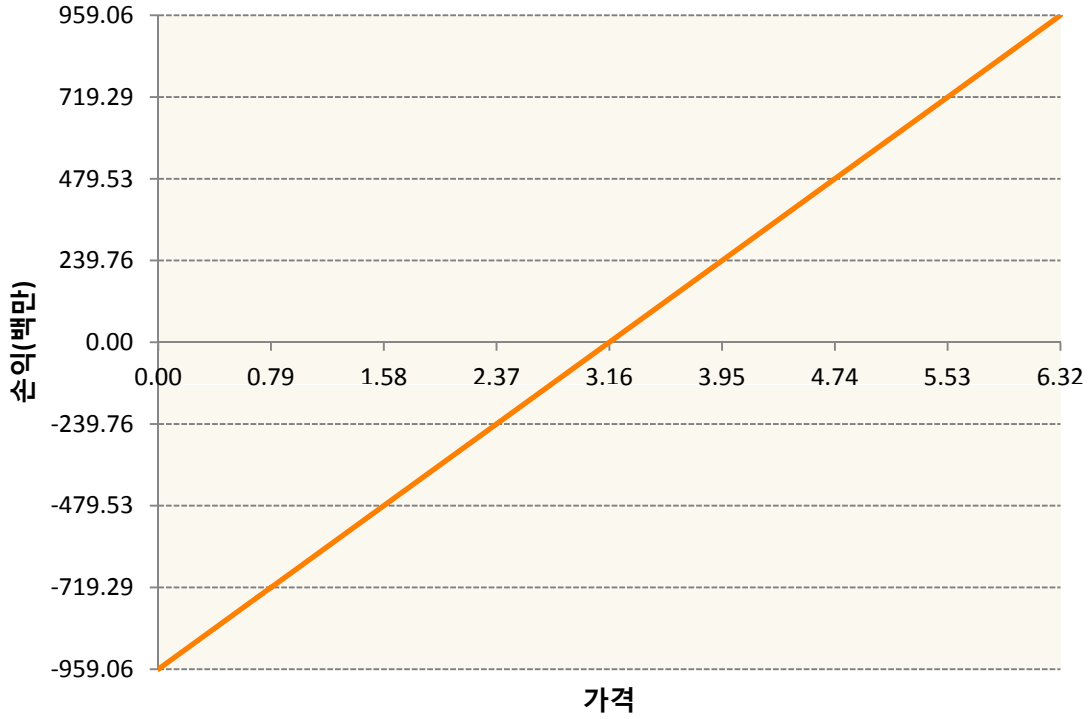


KR4175NB0006-2018-11 달러선물

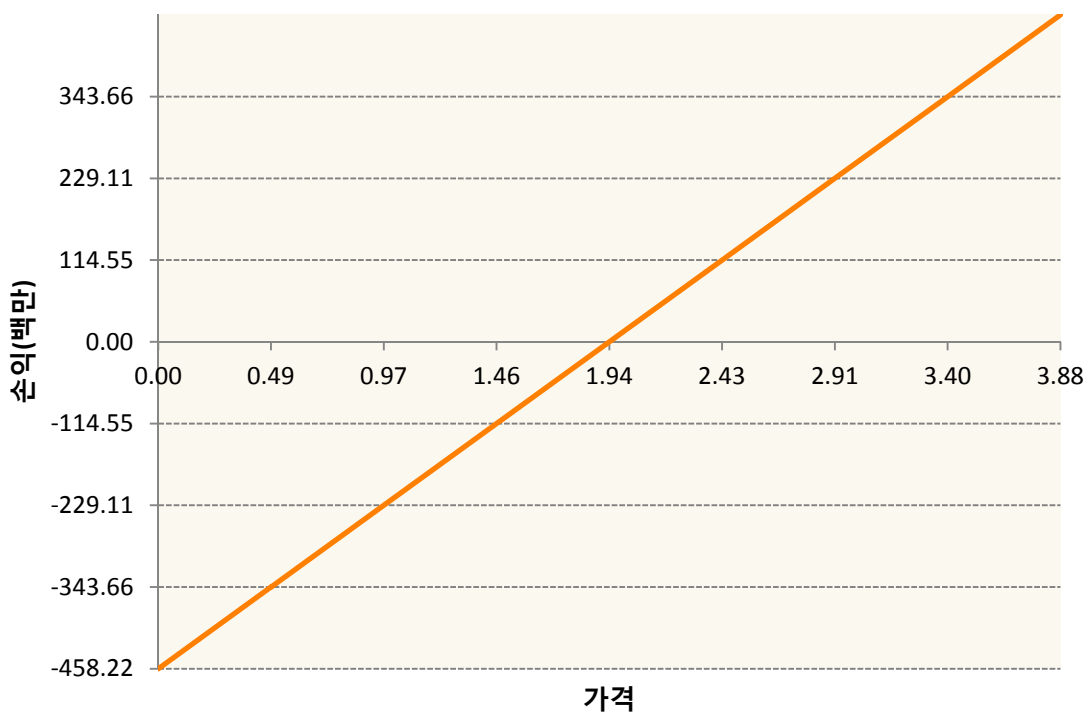




NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18



XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	58
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	79
HOX8	Heating Oil	35
KR4175NB0C	2018-11 달러선물	50
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	77
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	37

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	430

공시일	2018-10-16
기준일	2018-10-15

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

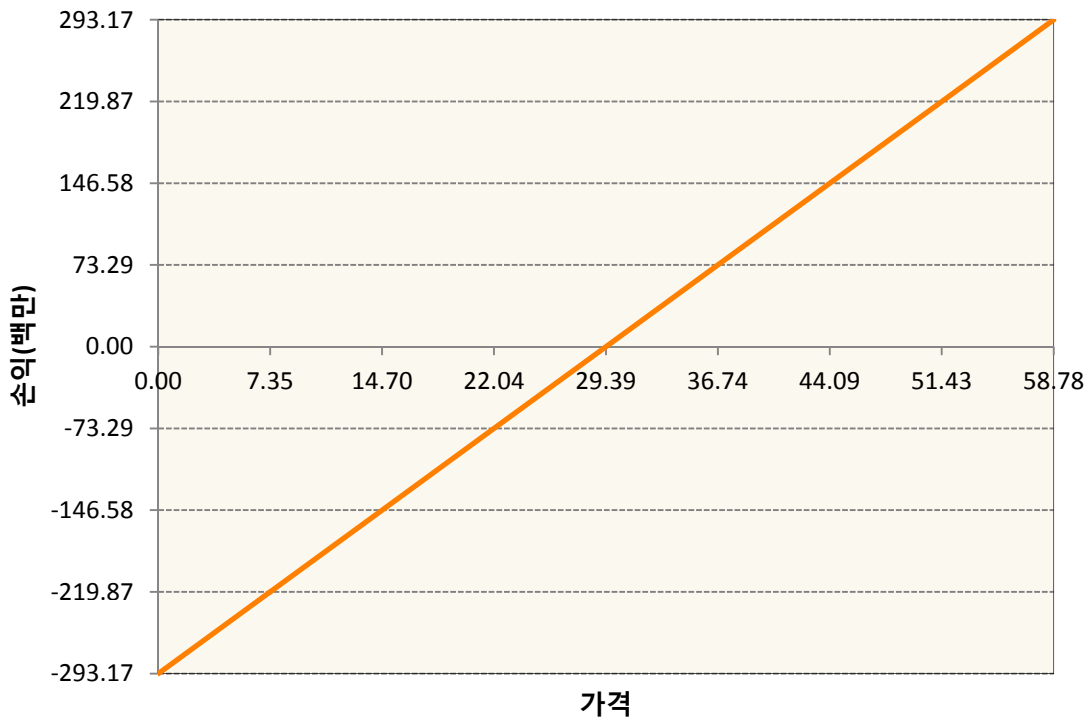
1. 계약금액

(단위:백만원)

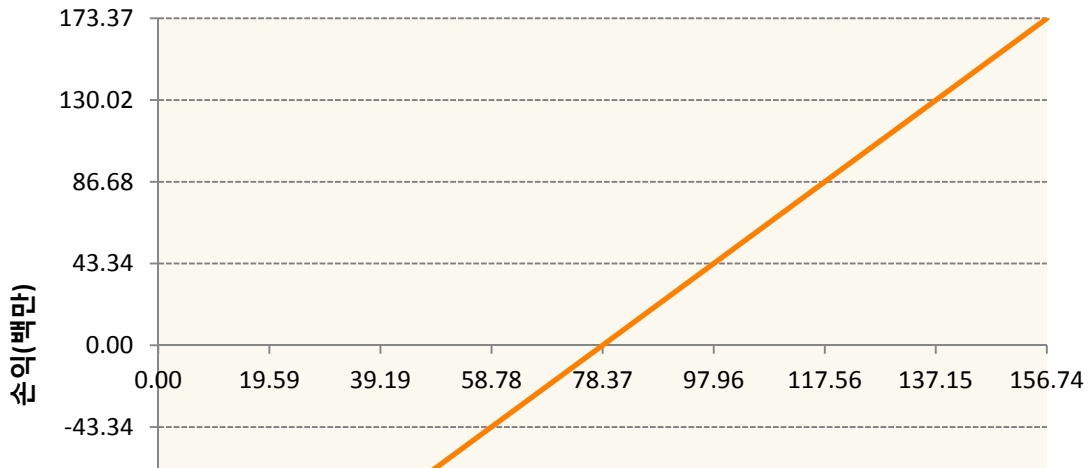
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,600	79	3,521	

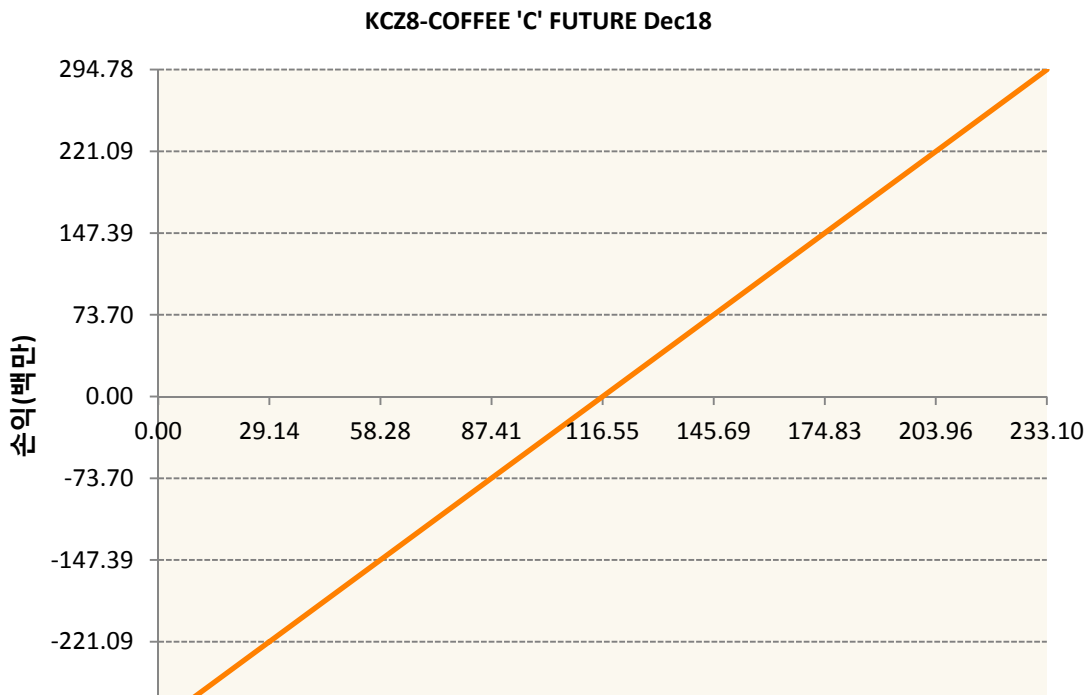
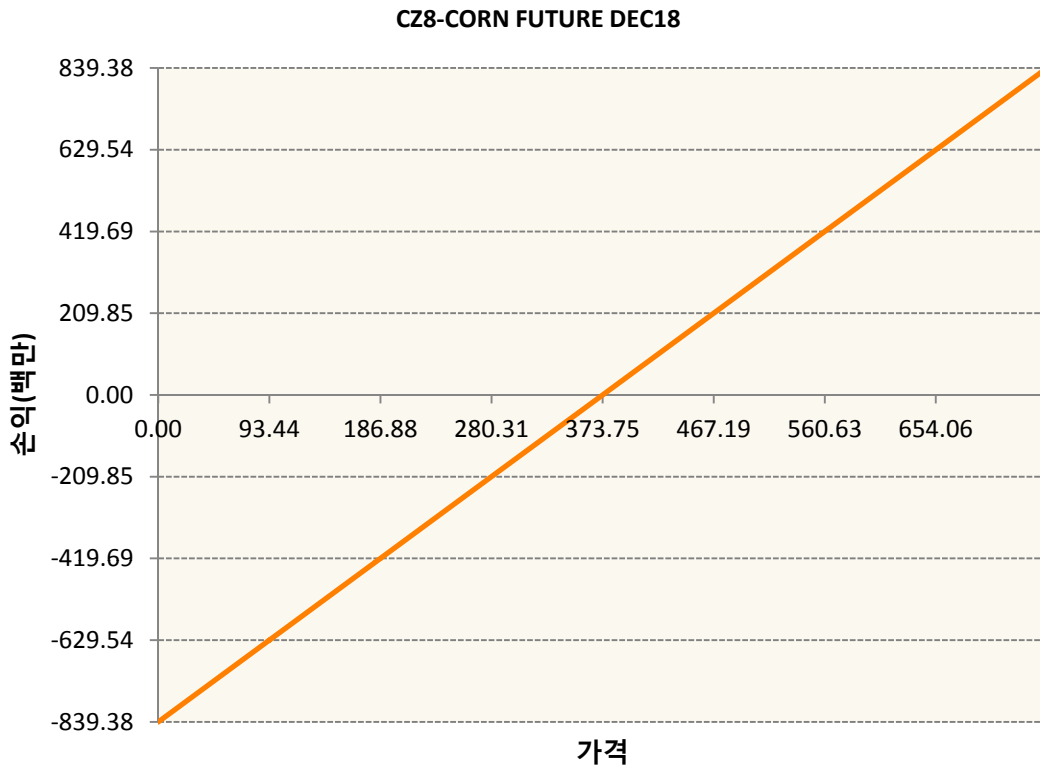
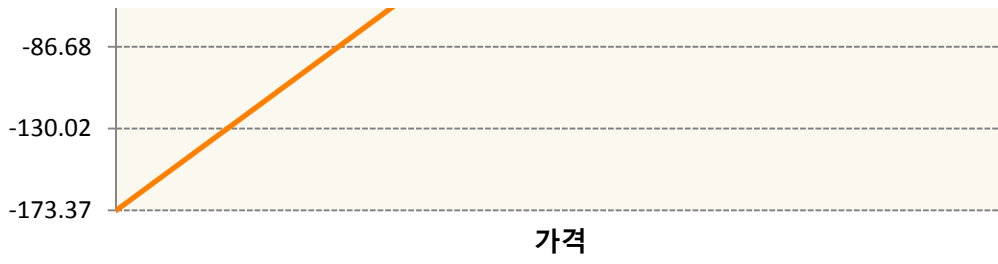
2. 만기시점의 손익구조

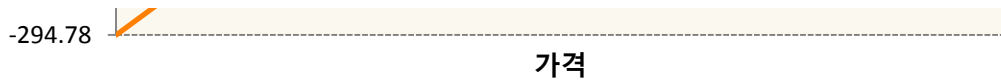
BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18



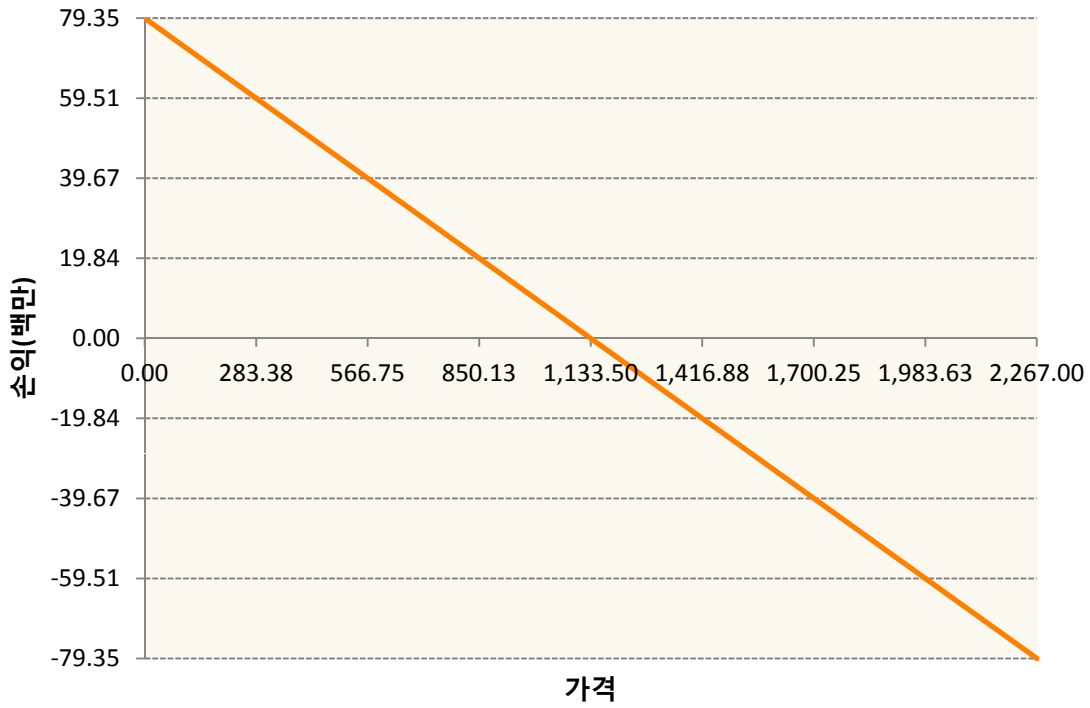
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



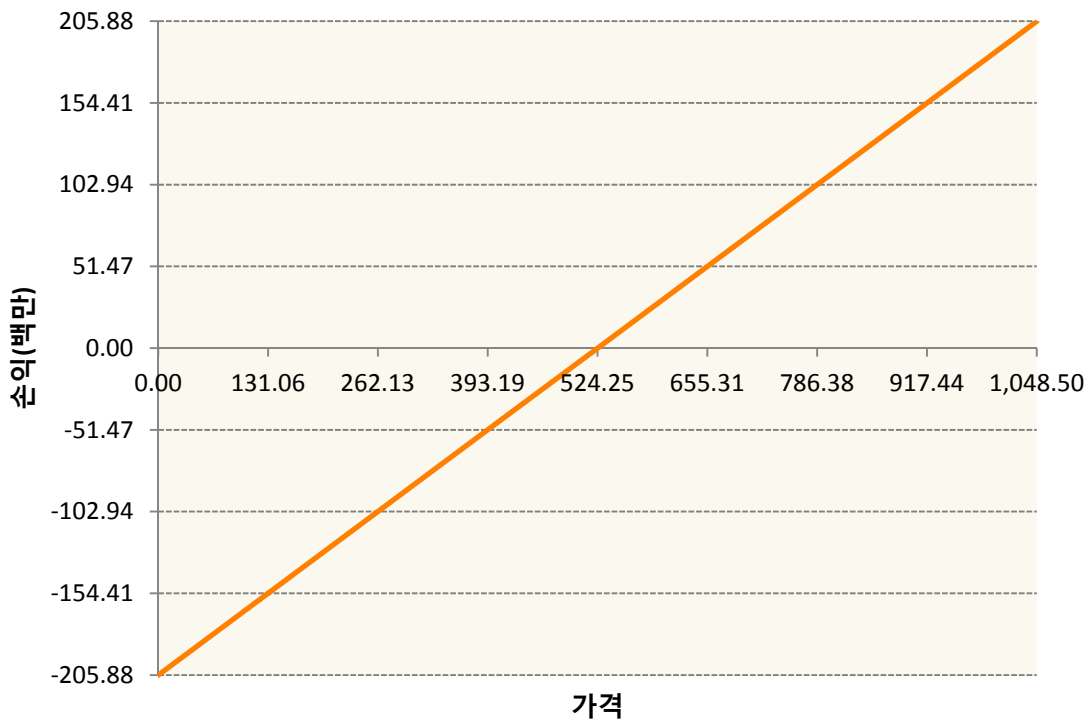




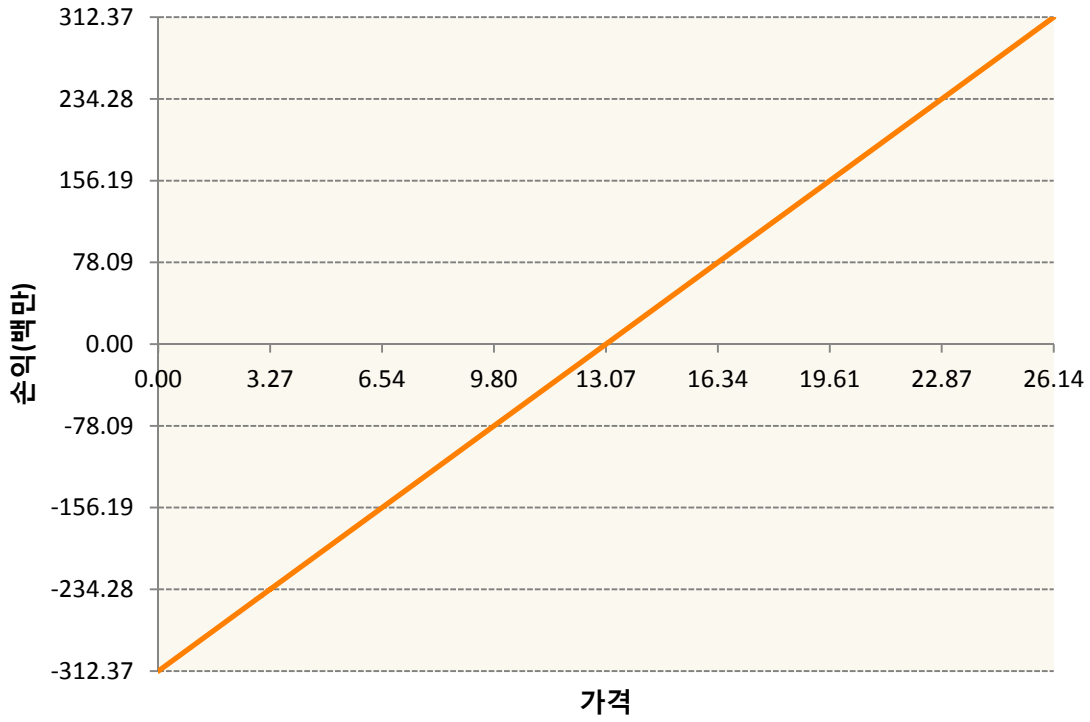
KR4175NB0006-2018-11 달러선물



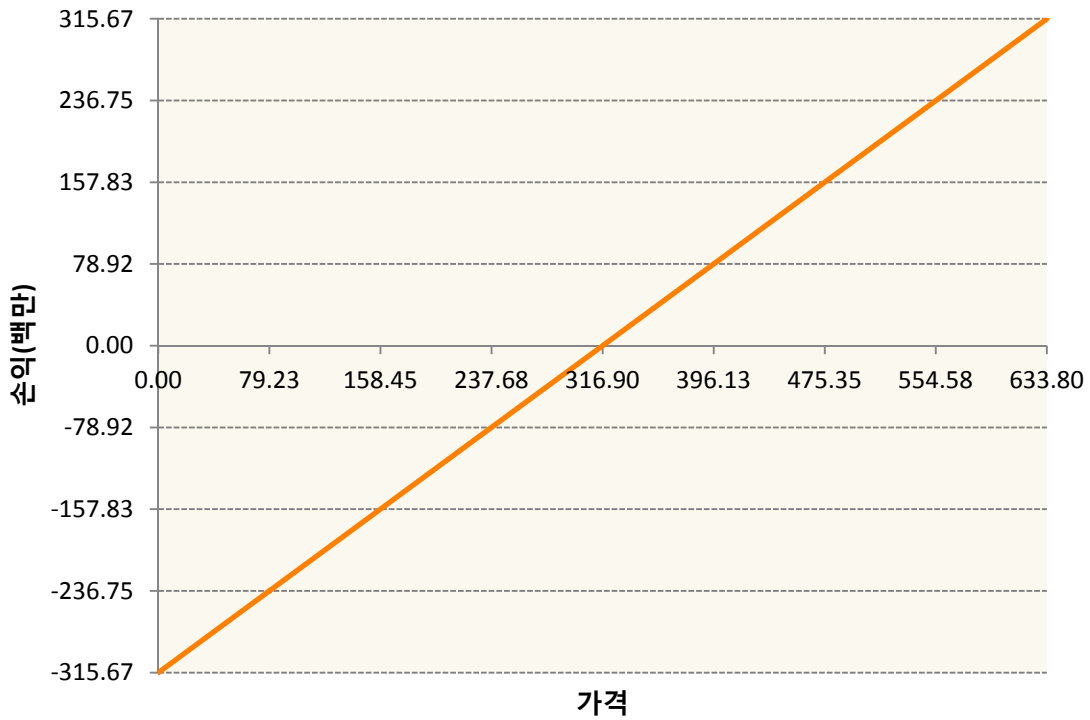
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



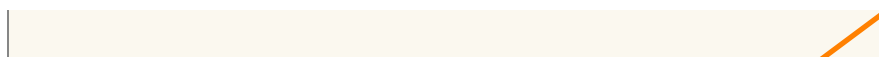
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

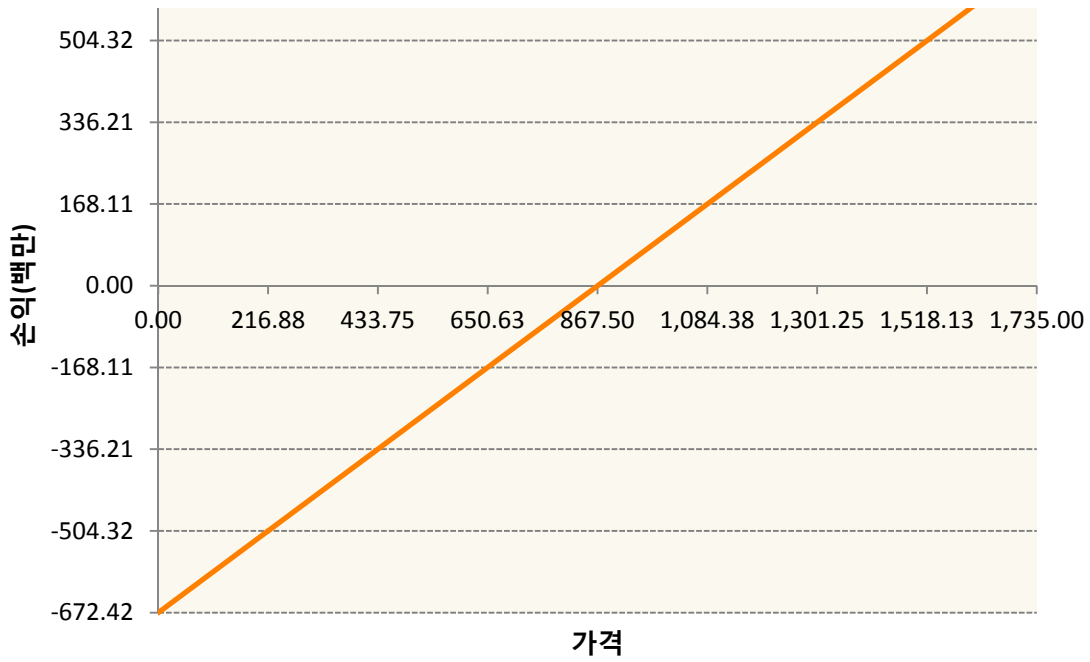


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

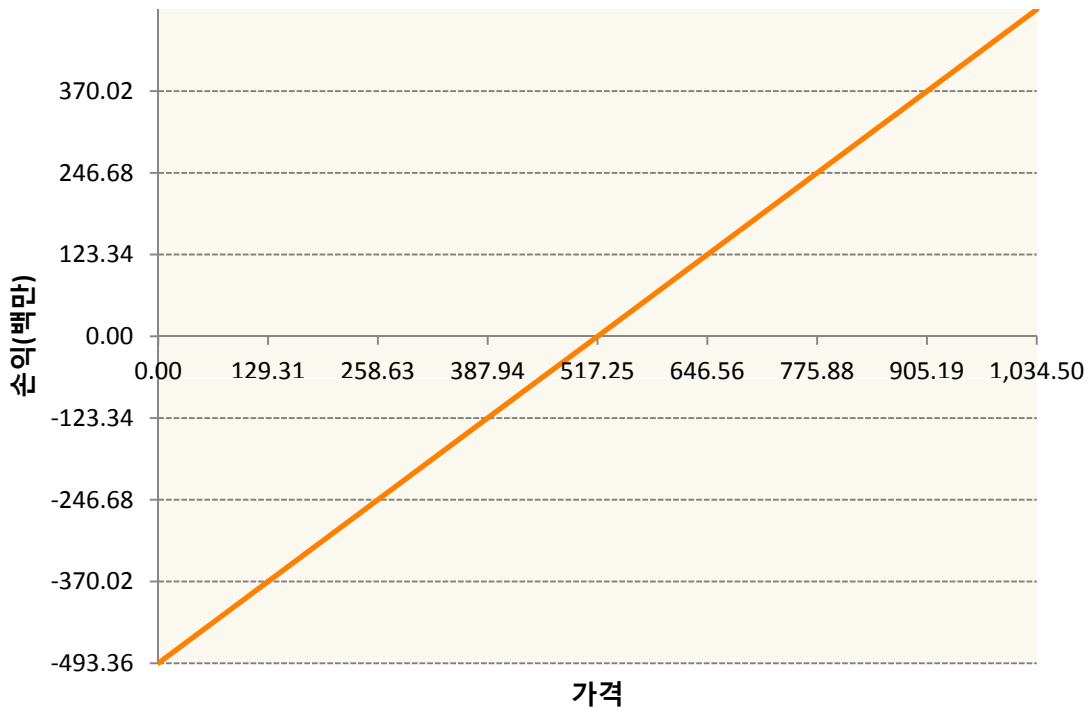


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





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	67
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	24
KR4175NB0(2018-11	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)

314