

공시일	2018-10-18
기준일	2018-10-17

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	2018-10-18
기준일	2018-10-17

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

1,112

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

494

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-18
기준일	2018-10-17

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

251

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

339

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-18
기준일	2018-10-17

유로인덱스모(주식-파생형)

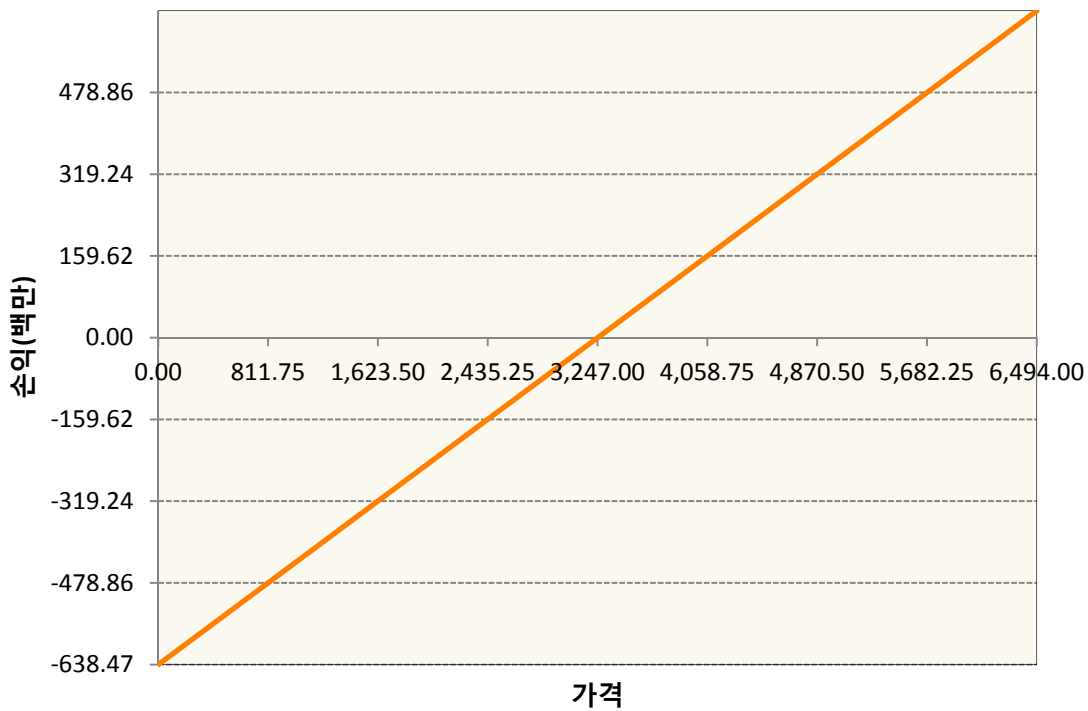
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	638	0	638	

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	2018-10-18
기준일	2018-10-17

차이나인덱스모(주식-파생형)

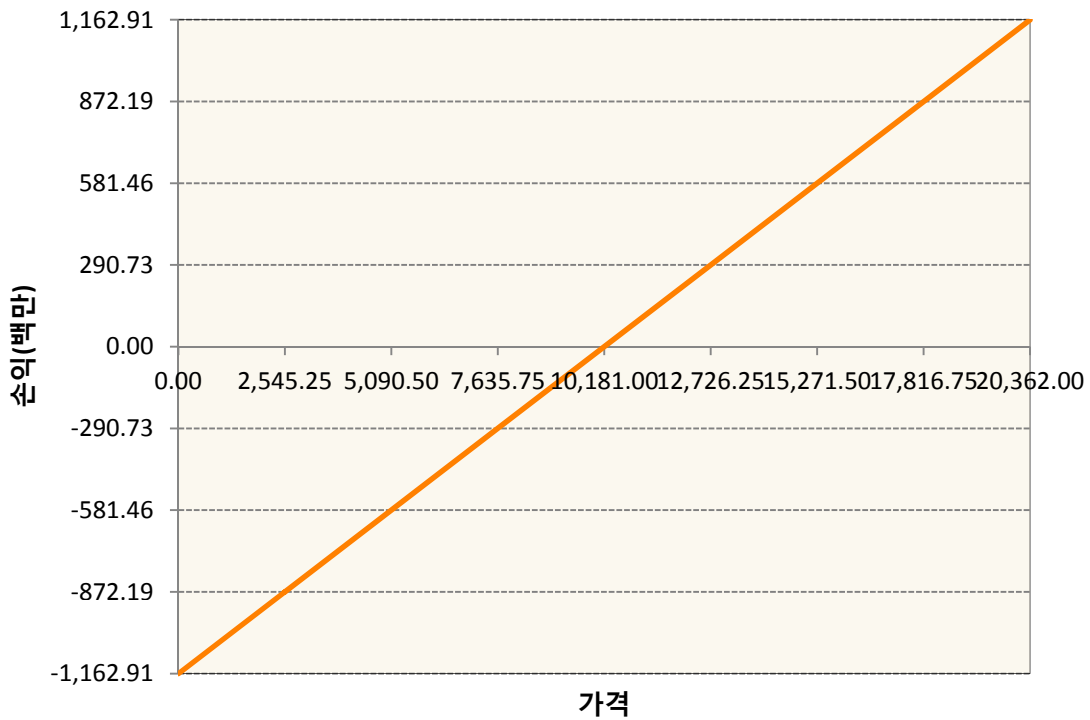
1. 계약금액

(단위:백만원)

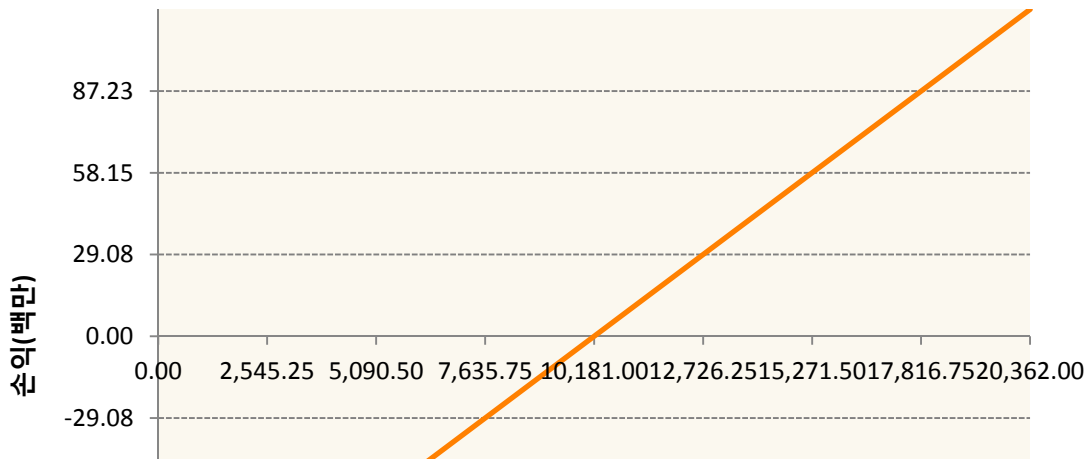
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,279	0	1,279	장내

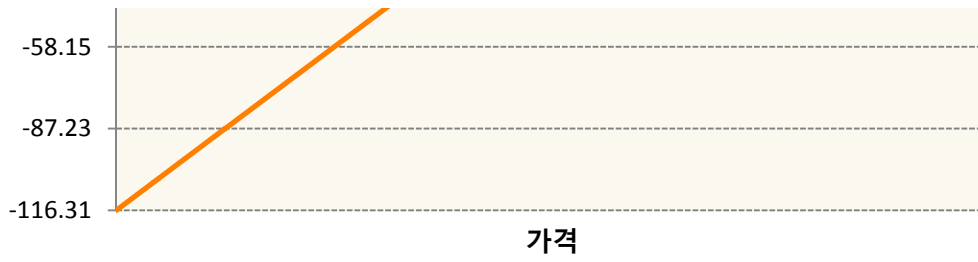
2. 만기시점의 손익구조

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	2018-10-18
기준일	2018-10-17

커버드콜모(주식혼합-파생형)

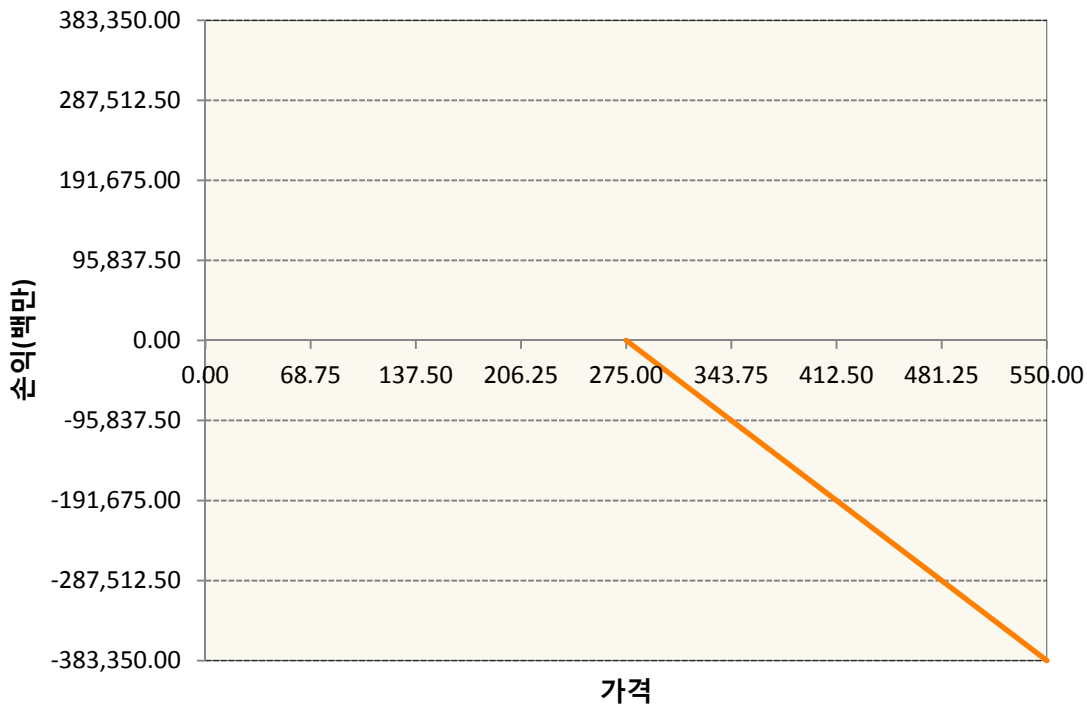
1. 계약금액

(단위:백만원)

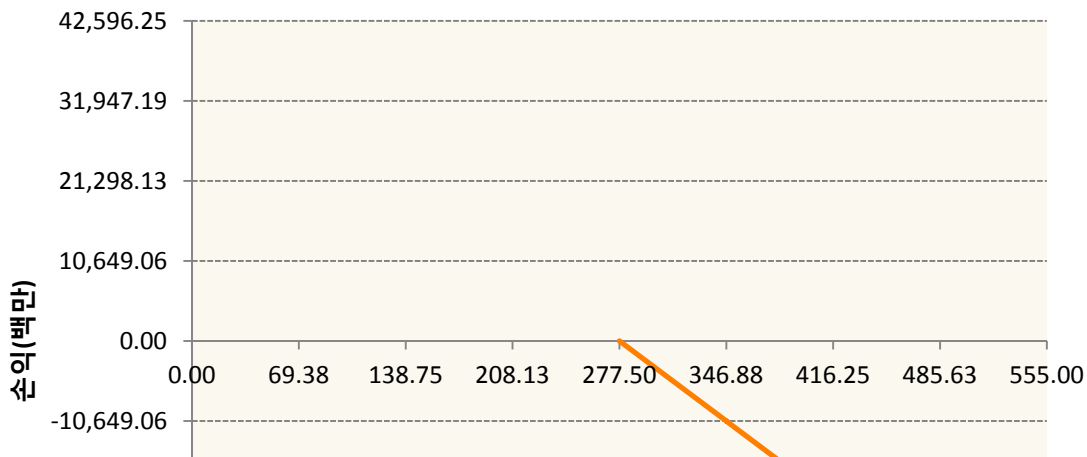
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	707,821	-707,821	장내

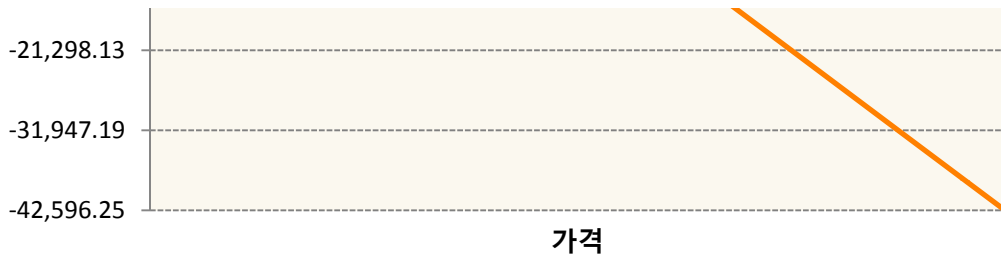
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

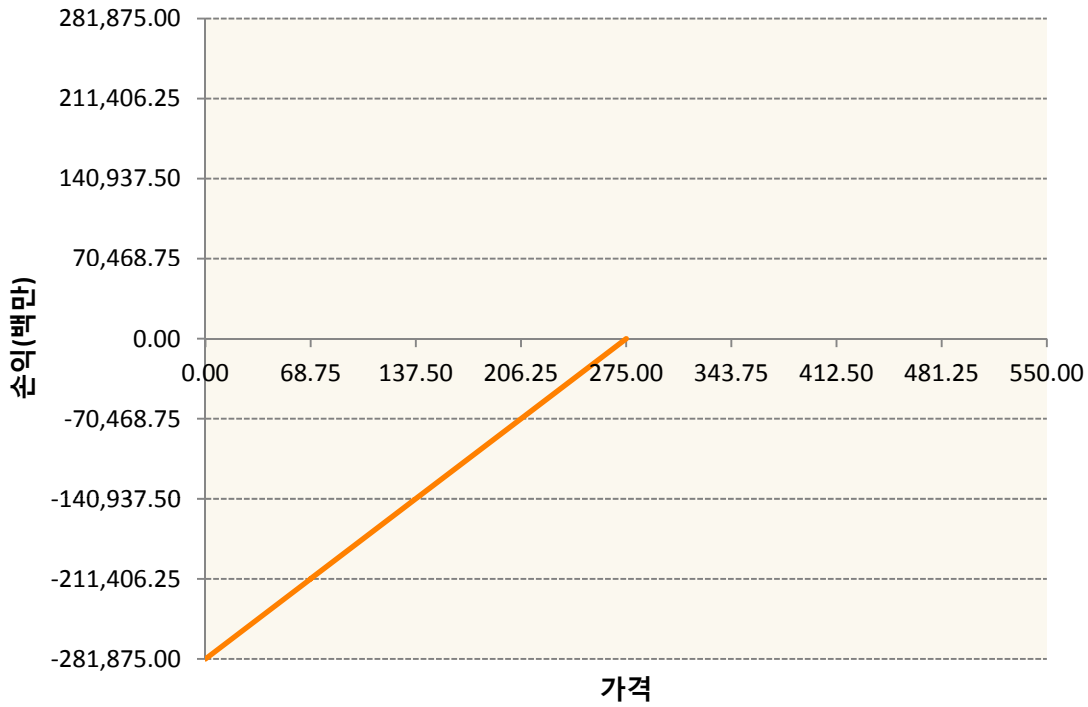


KR4201NB2778-2018-11 콜277.5





KR4301NB2751-2018-11 풋275



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NB27 2018-11 콜275

26,256

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13,071	12,722	12,318	11,866	11,373	10,846	10,289
-5.33%	11,463	10,843	10,194	9,521	8,829	8,122	7,403
-2.67%	8,040	7,237	6,432	5,625	4,817	4,008	3,198
0%	2,353	1,577	792	0	-797	-1,598	-2,402
2.67%	-5,409	-5,982	-6,596	-7,242	-7,915	-8,608	-9,320
5.33%	-14,602	-14,932	-15,323	-15,768	-16,260	-16,791	-17,356
8.00%	-24,551	-24,702	-24,909	-25,171	-25,486	-25,849	-26,256

KR4201NB27 2018-11 콜277.5

2,780

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,248	1,218	1,181	1,139	1,091	1,039	984

-5.33%	1,116	1,057	993	926	855	782	708
-2.67%	813	728	642	556	469	381	294
0%	271	181	90	0	-91	-181	-272
2.67%	-512	-585	-661	-740	-820	-903	-986
5.33%	-1,478	-1,524	-1,576	-1,634	-1,696	-1,762	-1,831
8.00%	-2,551	-2,574	-2,604	-2,640	-2,681	-2,728	-2,780

KR4301NB27 2018-11 풋275

15,994

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-15,425	-15,468	-15,532	-15,617	-15,723	-15,849	-15,994
-5.33%	-8,179	-8,366	-8,578	-8,810	-9,059	-9,322	-9,597
-2.67%	-2,338	-2,696	-3,057	-3,419	-3,783	-4,149	-4,515
0%	989	668	338	0	-344	-692	-1,044
2.67%	2,157	2,014	1,843	1,647	1,430	1,195	944
5.33%	2,393	2,359	2,307	2,234	2,139	2,024	1,888
8.00%	2,420	2,416	2,406	2,388	2,358	2,316	2,259

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

(단위:백만원)

44,918

공시일	2018-10-18
기준일	2018-10-17

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

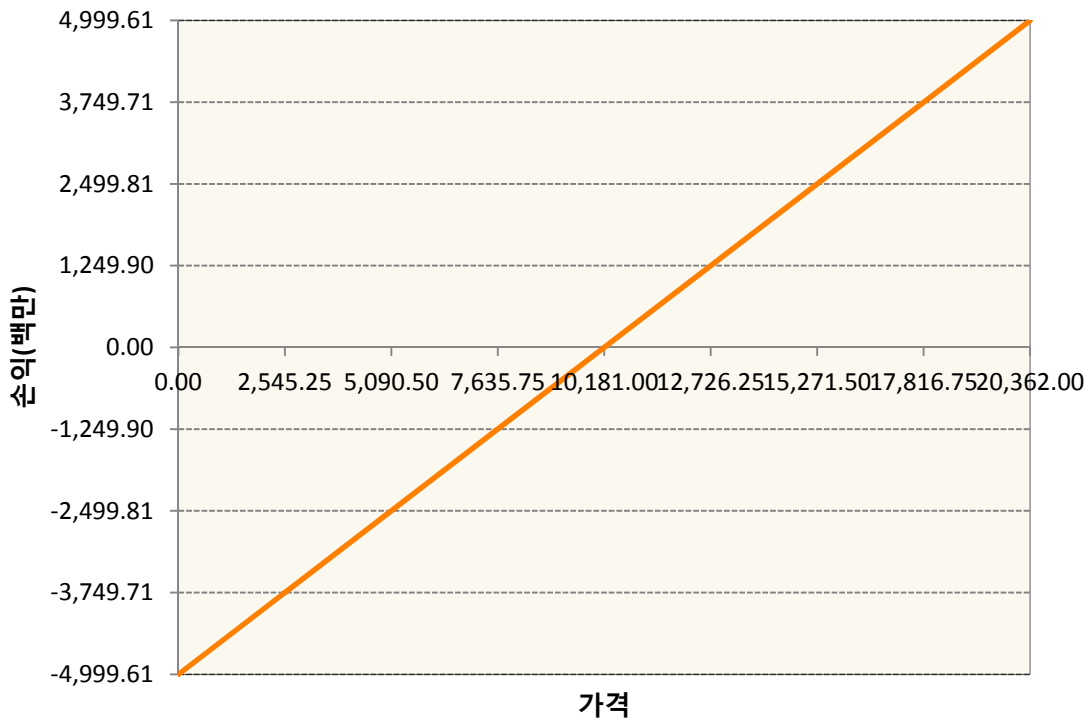
1. 계약금액

(단위:백만원)

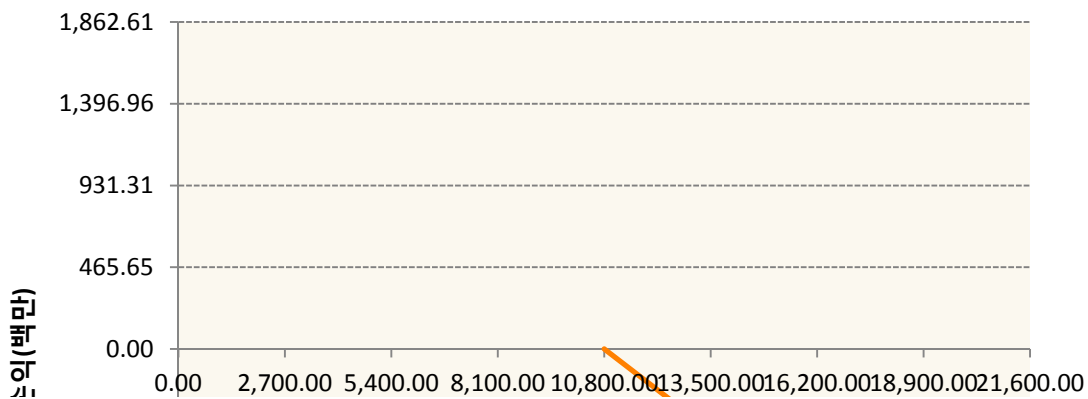
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,104	-12,104	장내

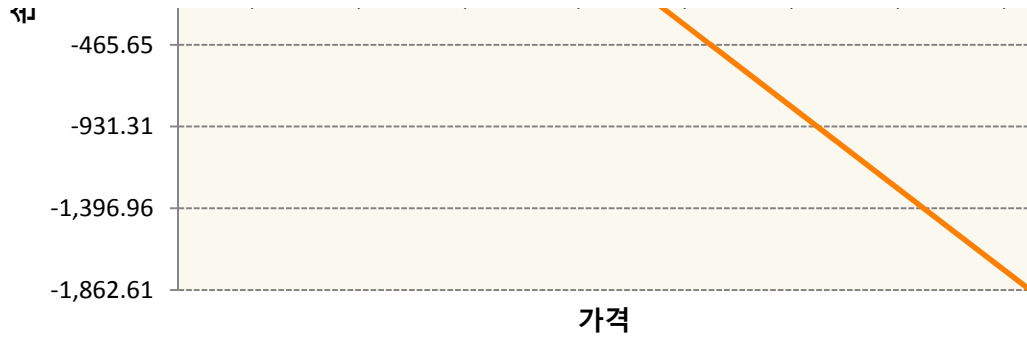
2. 만기시점의 손익구조

HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18

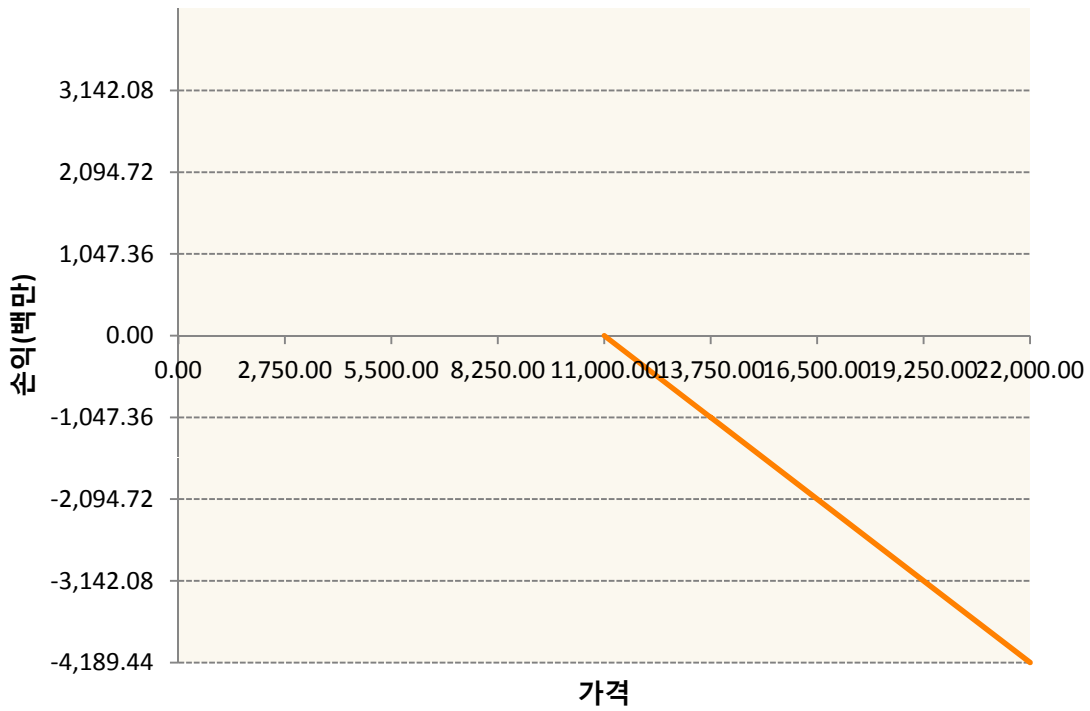


OHHIV8-C108-HSCEI

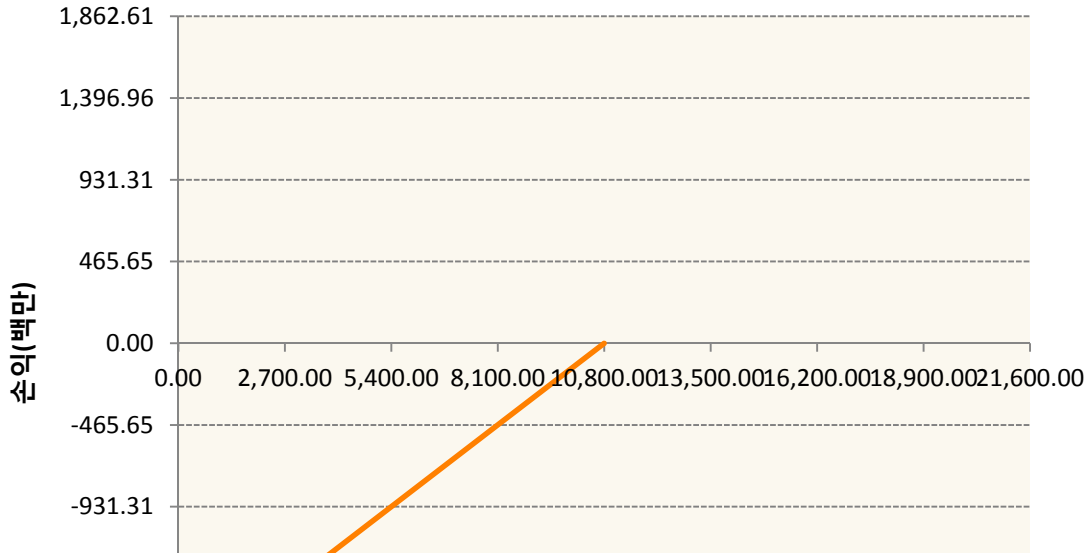


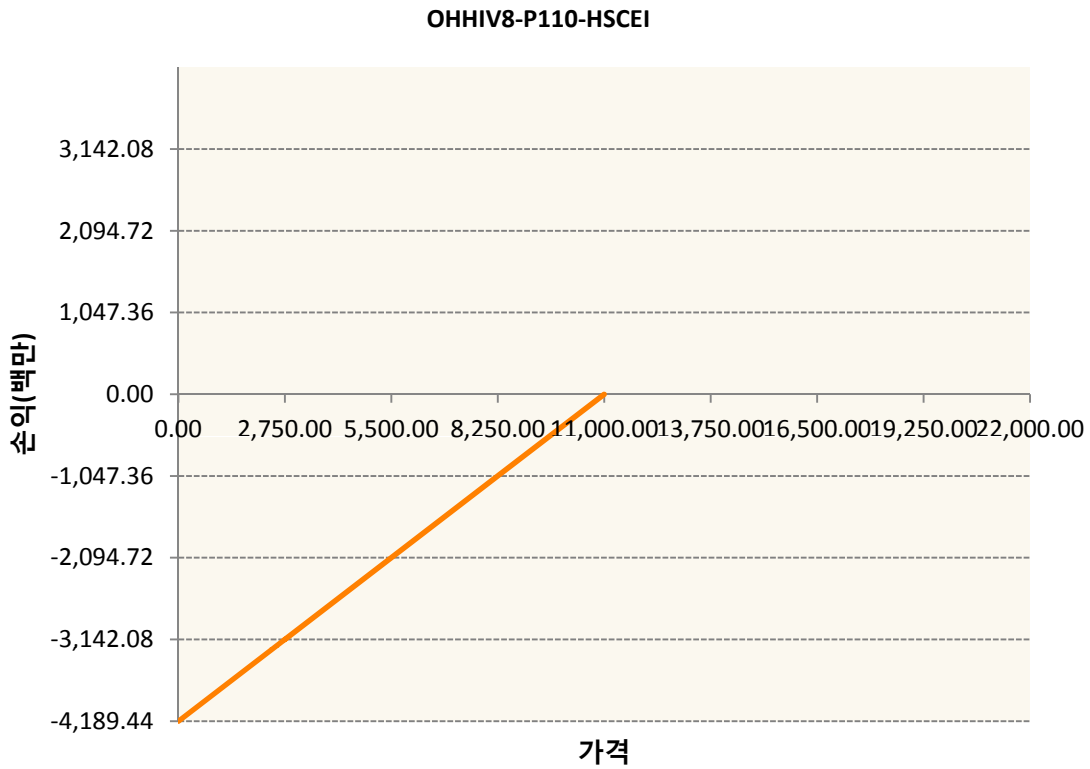
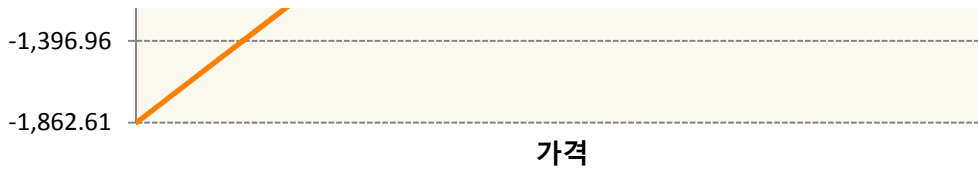


OHHIV8-C110-HSCEI



OHHIV8-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	400
OHHIV8-C1	HSCEI	149
OHHIV8-C11	HSCEI	335
OHHIV8-P1C	HSCEI	149
OHHIV8-P11	HSCEI	335

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,311

공시일	2018-10-18
기준일	2018-10-17

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

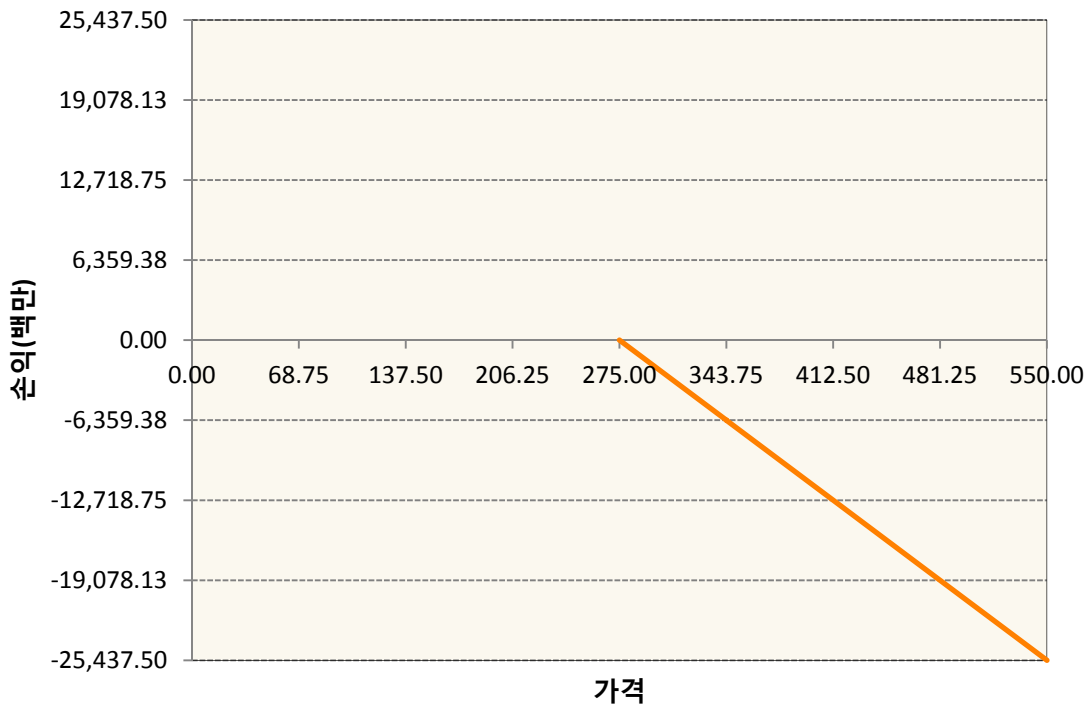
1. 계약금액

(단위:백만원)

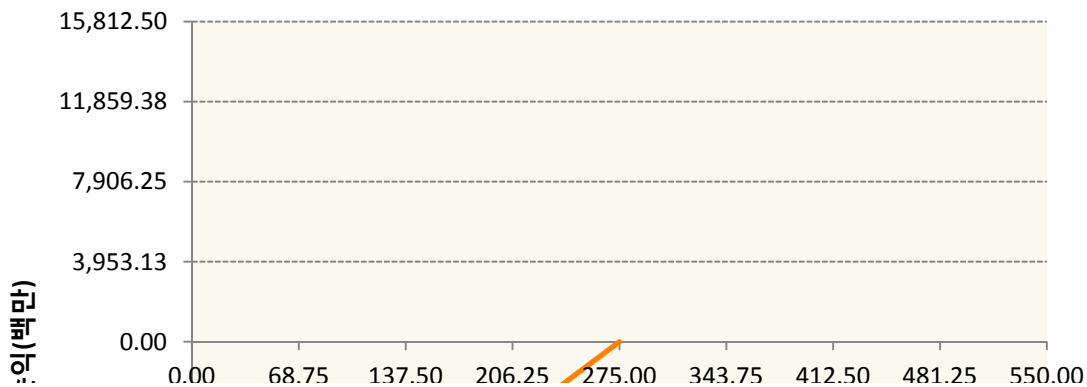
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	44,025	-44,025	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

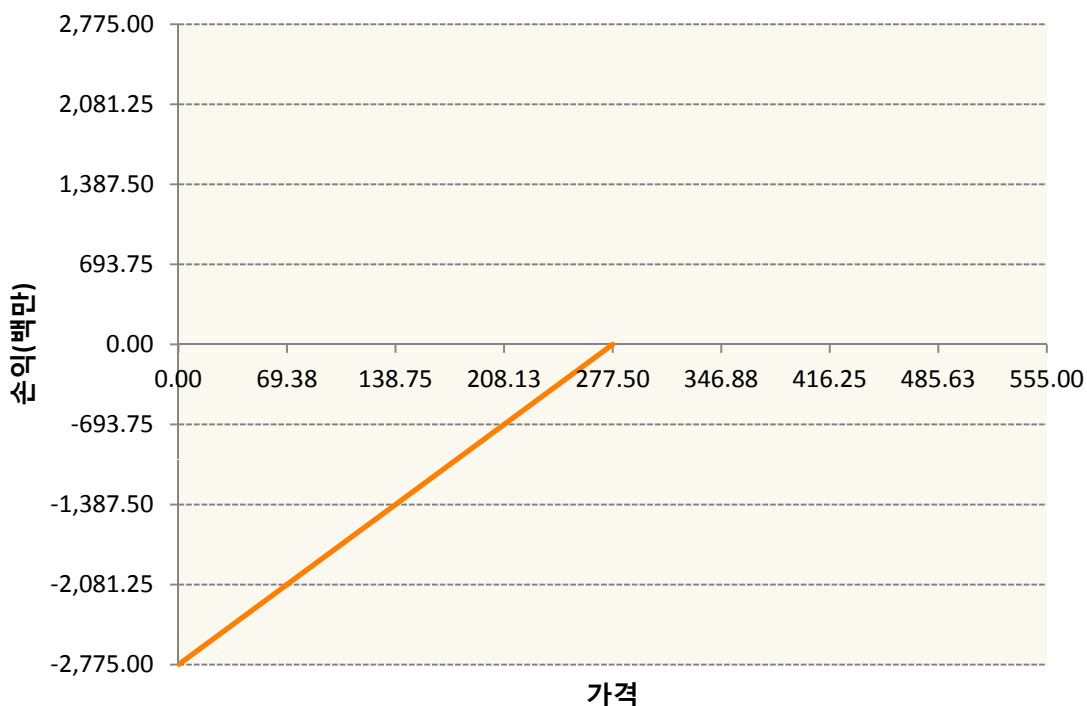


KR4301NB2751-2018-11 풋275





KR4301NB2777-2018-11 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,986
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,986	-3,986	-3,986	-3,986	-3,986	-3,986	-3,986
-5.33%	-2,657	-2,657	-2,657	-2,657	-2,657	-2,657	-2,657
-2.67%	-1,329	-1,329	-1,329	-1,329	-1,329	-1,329	-1,329
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,329	1,329	1,329	1,329	1,329	1,329	1,329
5.33%	2,657	2,657	2,657	2,657	2,657	2,657	2,657
8.00%	3,986	3,986	3,986	3,986	3,986	3,986	3,986
KR4201NB27 2018-11 콜275							1,742
기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	867	844	817	787	755	720	683
-5.33%	761	720	676	632	586	539	491
-2.67%	533	480	427	373	320	266	212
0%	156	105	53	0	-53	-106	-159
2.67%	-359	-397	-438	-481	-525	-571	-618
5.33%	-969	-991	-1,017	-1,046	-1,079	-1,114	-1,152
8.00%	-1,629	-1,639	-1,653	-1,670	-1,691	-1,715	-1,742

KR4301NB27 2018-11 풋275

897

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-865	-868	-871	-876	-882	-889	-897
-5.33%	-459	-469	-481	-494	-508	-523	-538
-2.67%	-131	-151	-171	-192	-212	-233	-253
0%	56	38	19	0	-19	-39	-59
2.67%	121	113	103	92	80	67	53
5.33%	134	132	129	125	120	114	106
8.00%	136	136	135	134	132	130	127

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

170

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-166	-166	-166	-167	-168	-169	-170
-5.33%	-93	-95	-96	-98	-100	-102	-104
-2.67%	-30	-33	-37	-40	-43	-47	-50
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	28	26	24	21	19	16	13
5.33%	32	32	31	30	29	27	25
8.00%	33	33	33	32	32	31	30

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

(단위:백만원)

6,800

공시일	2018-10-18
기준일	2018-10-17

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

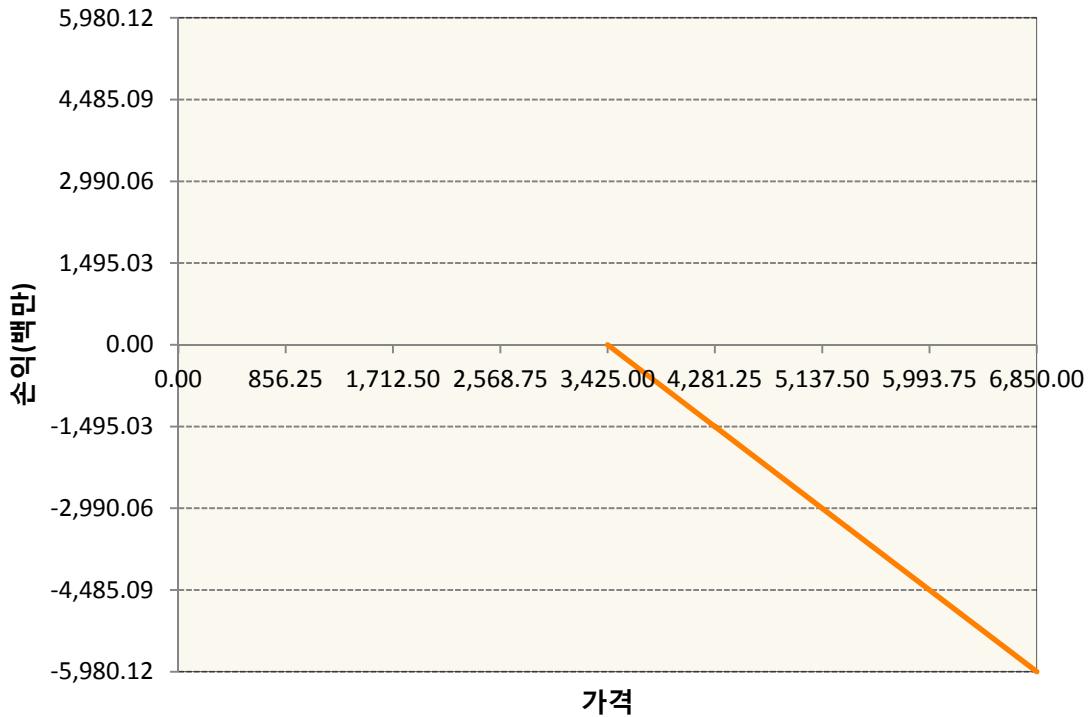
1. 계약금액

(단위:백만원)

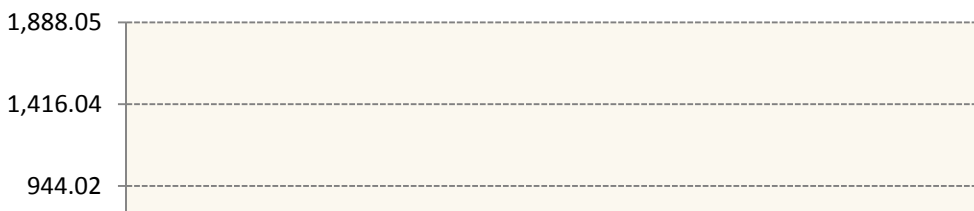
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	887	0	887	
누계	유가증권	스왑	34,408	0	34,408	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,736	-15,736	장내
누계	지수	스왑	52,897	0	52,897	장외

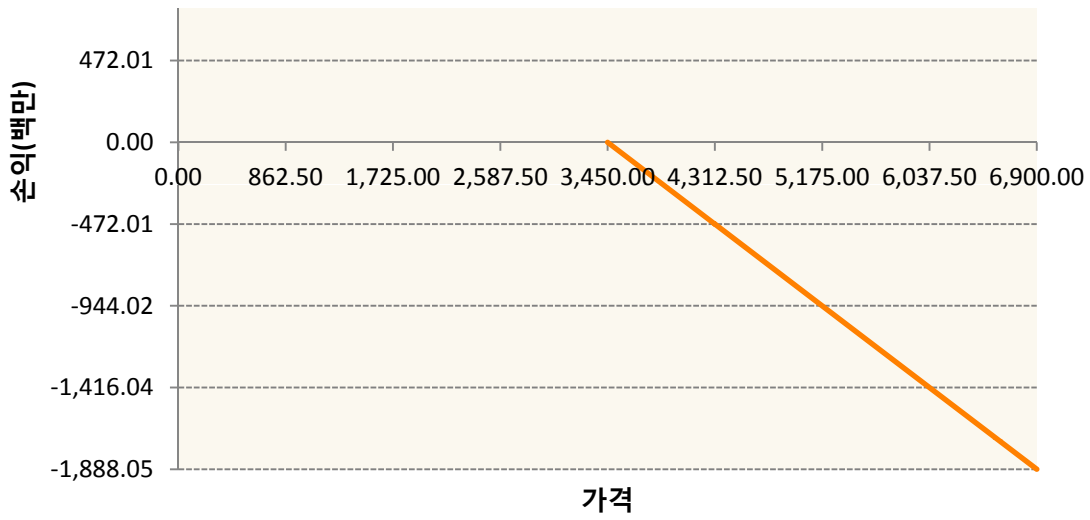
2. 만기시점의 손익구조

OESXV8-C3425-EURO STOXX 50

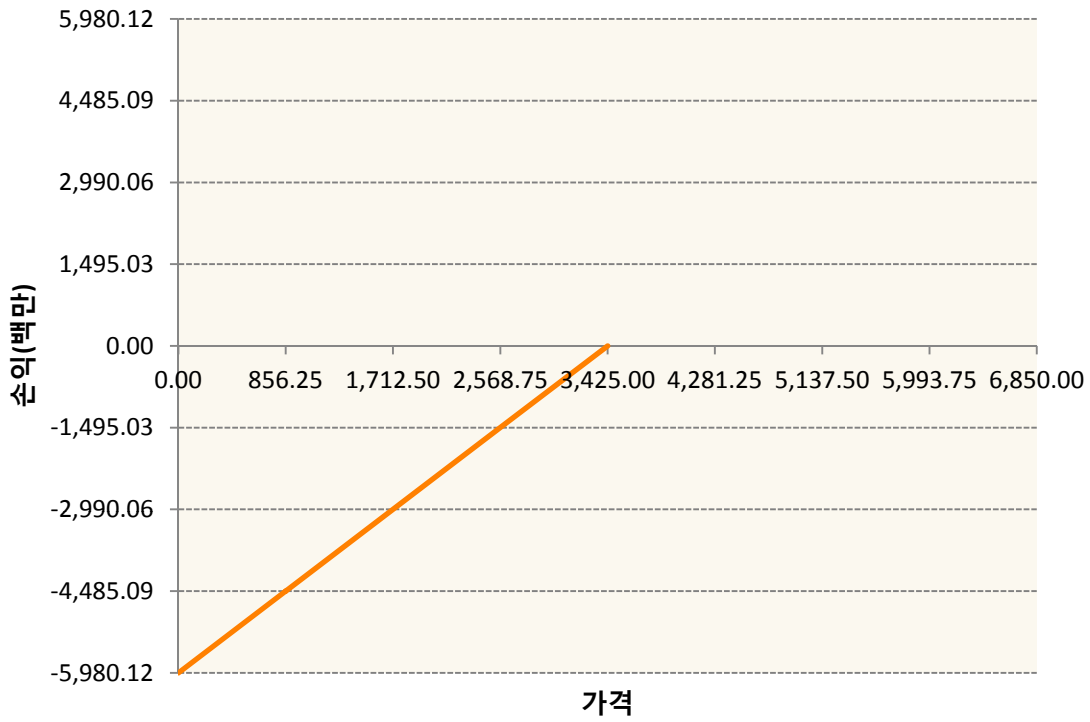


OESXV8-C3450-EURO STOXX 50

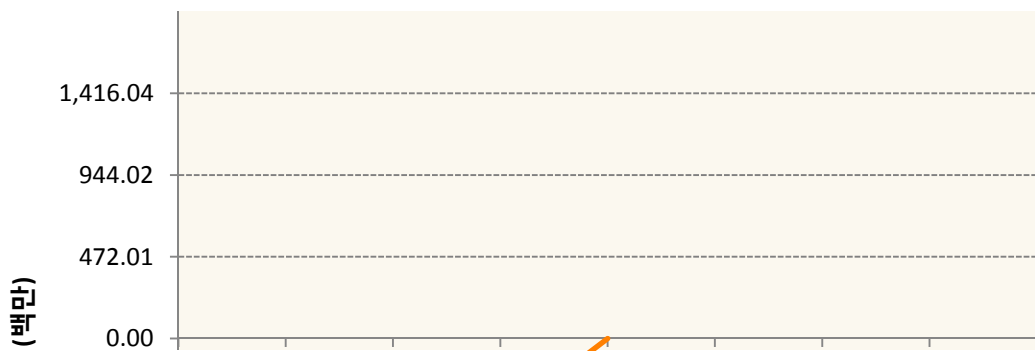


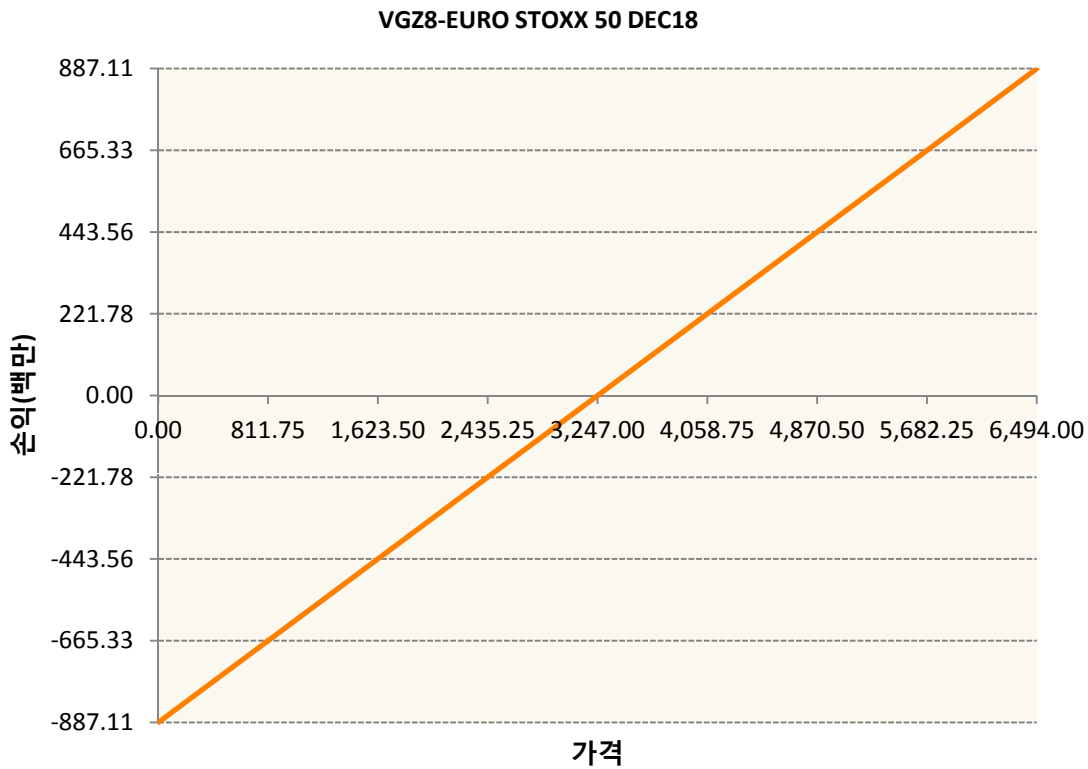
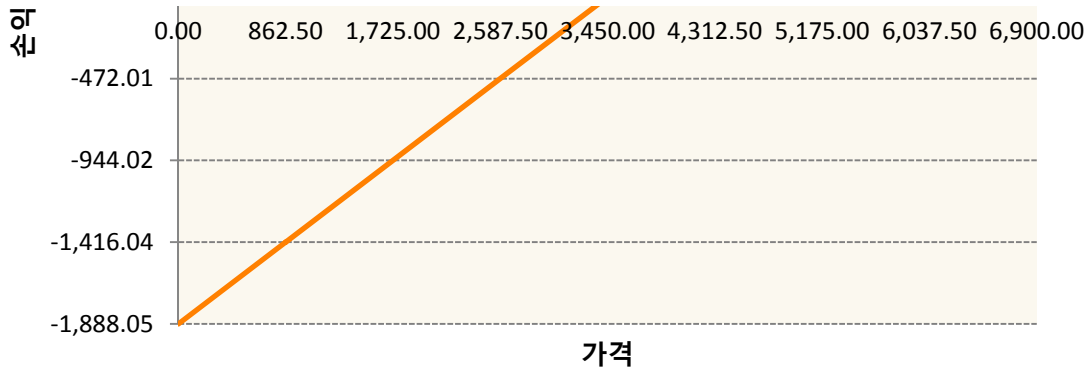


OESXV8-P3425-EURO STOXX 50



OESXV8-P3450-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		154
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		100
OESXV8-C34 EURO STOXX 50		478
OESXV8-C34 EURO STOXX 50		151
OESXV8-P34 EURO STOXX 50		478
OESXV8-P34 EURO STOXX 50		151
VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18		71

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

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

(단위:백만원)

1,142

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)

157

공시일	2018-10-18
기준일	2018-10-17

스마트KRX300인덱스목표전환형1

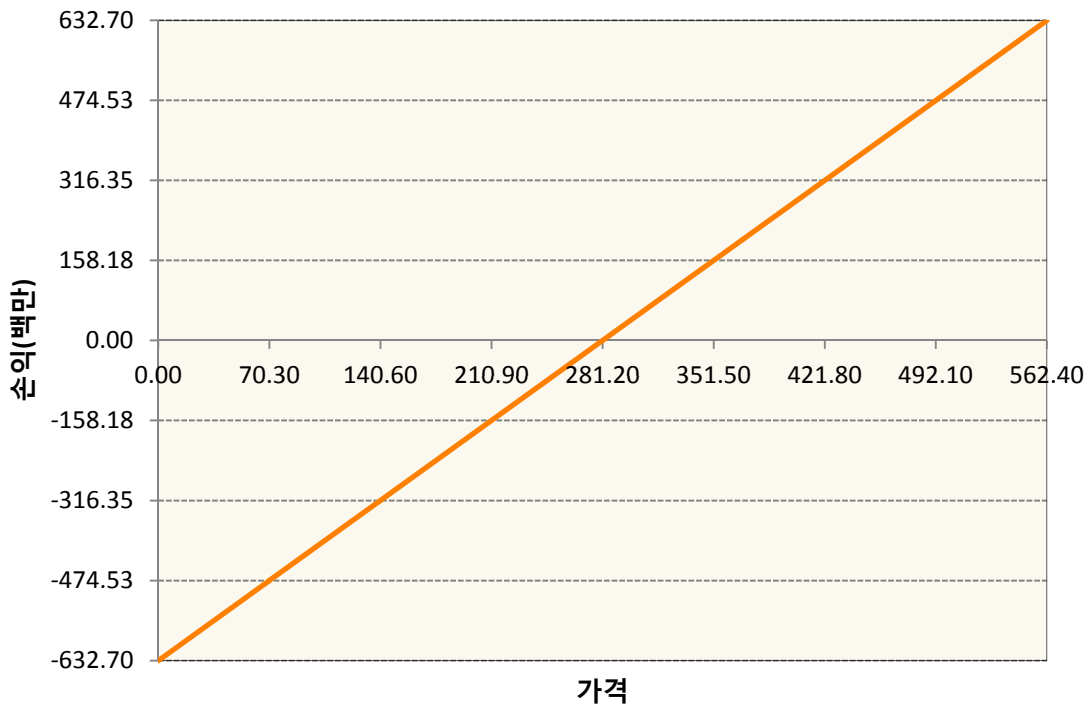
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	633	0	633	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%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
-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%	34	34	34	34	34	34	34
8.00%	50	50	50	50	50	50	50

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-10-18
기준일	2018-10-17

리디파인K200(주식혼합-파생재간

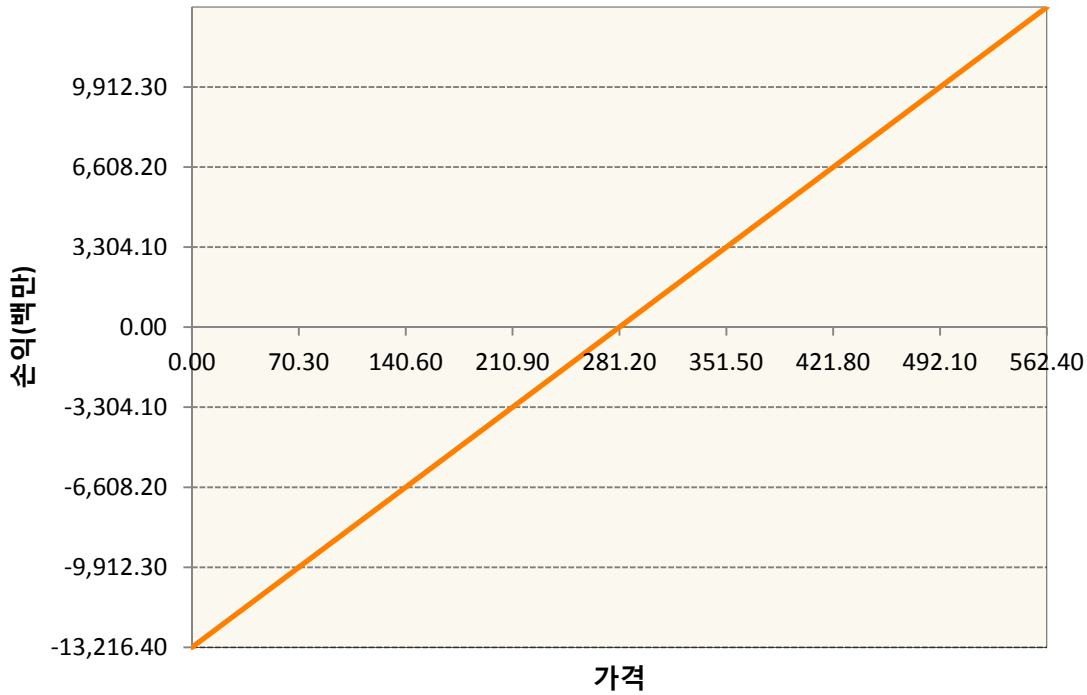
1. 계약금액

(단위:백만원)

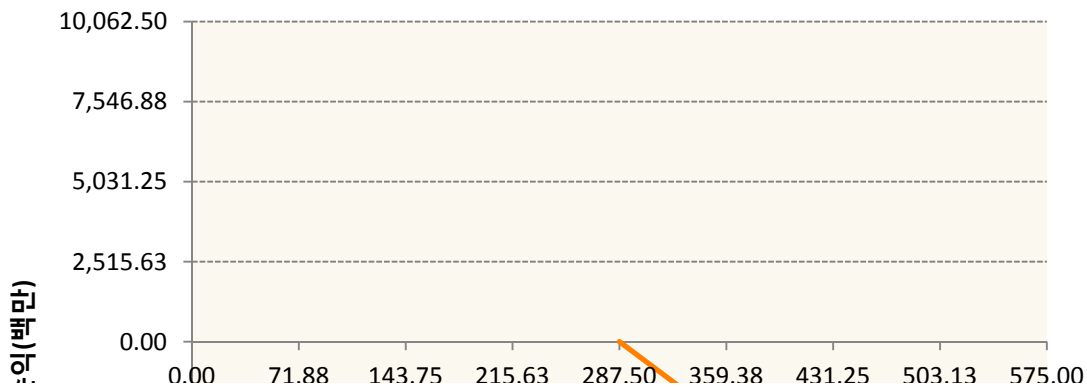
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,216	0	13,216	장내
누계	유가증권	옵션	4,059	23,113	-19,054	장내

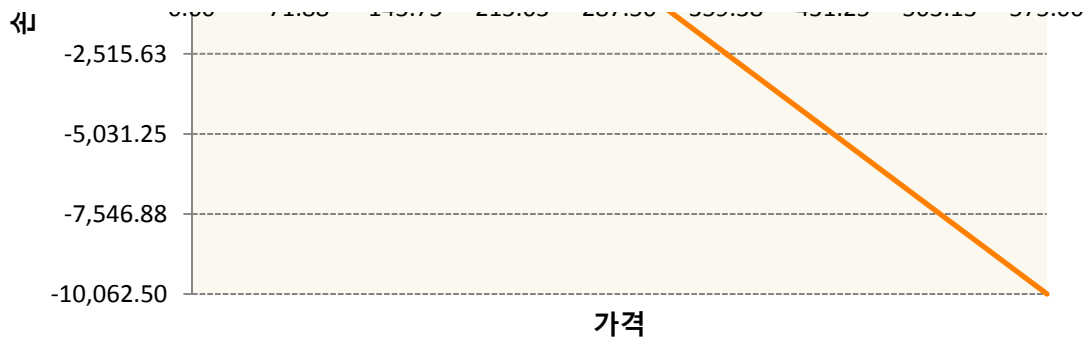
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

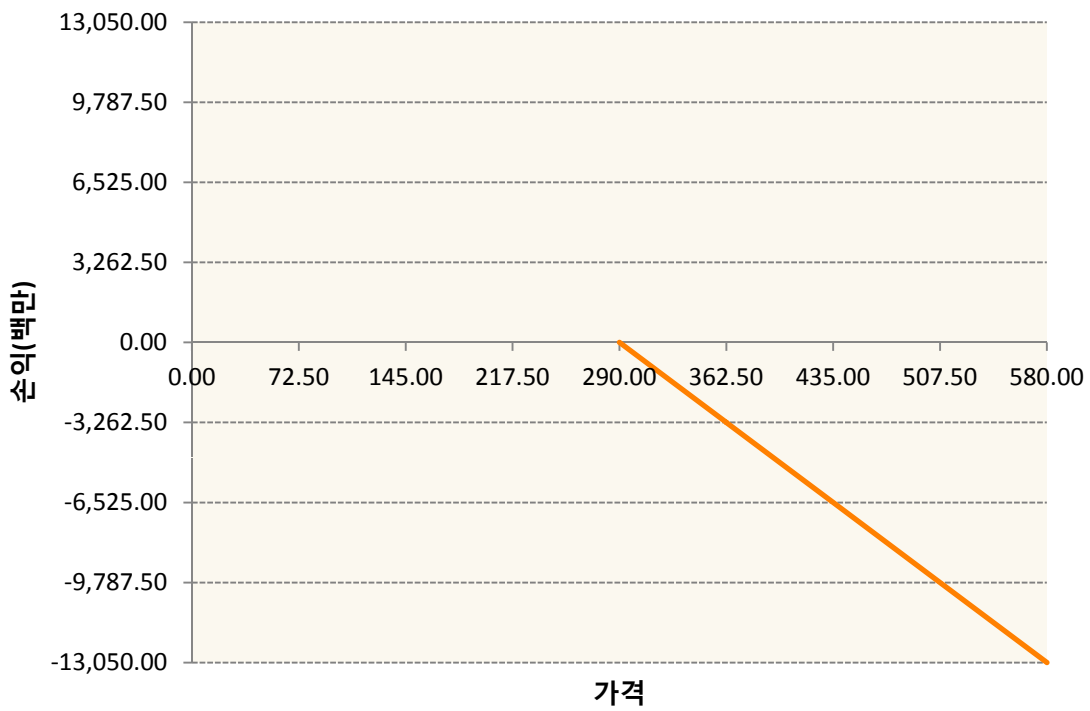


KR4201NB2877-2018-11 콜287.5

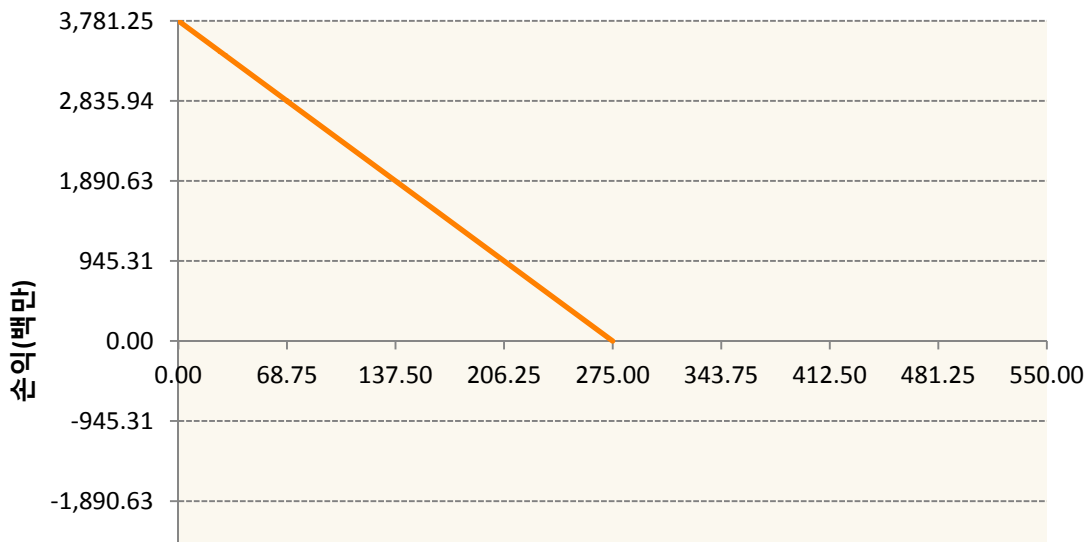


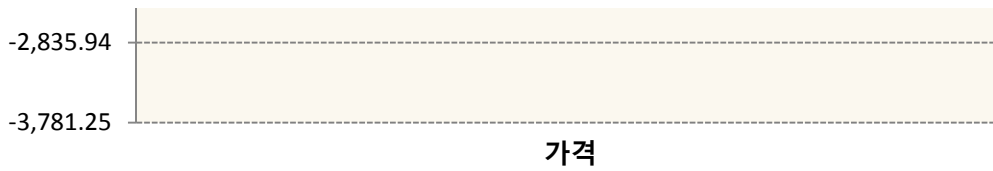


KR4201NB2901-2018-11 콜290

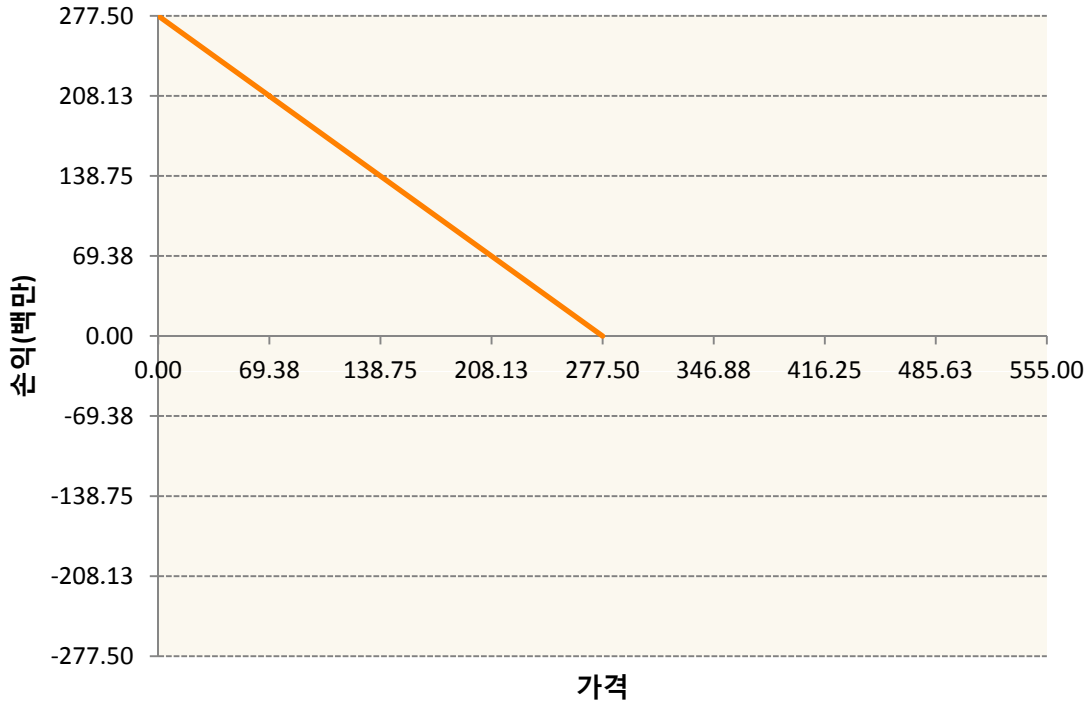


KR4301NB2751-2018-11 풋275





KR4301NB2777-2018-11 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 1,053

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,053	-1,053	-1,053	-1,053	-1,053	-1,053	-1,053
-5.33%	-702	-702	-702	-702	-702	-702	-702
-2.67%	-351	-351	-351	-351	-351	-351	-351
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	351	351	351	351	351	351	351
5.33%	702	702	702	702	702	702	702
8.00%	1,053	1,053	1,053	1,053	1,053	1,053	1,053

KR4201NB282018-11 콜287.5 510

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	143	141	138	134	129	122	115
-5.33%	136	130	123	114	104	93	81
-2.67%	113	101	87	73	58	42	25

0%	57	38	19	0	-20	-39	-60
2.67%	-48	-70	-91	-113	-134	-156	-177
5.33%	-208	-227	-247	-267	-287	-308	-328
8.00%	-414	-428	-442	-458	-475	-492	-510

KR4201NB29 2018-11 콜290

611

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	151	149	146	142	136	129	121
-5.33%	145	139	132	122	111	99	85
-2.67%	123	111	96	80	62	43	24
0%	67	46	23	0	-24	-48	-73
2.67%	-45	-73	-100	-128	-155	-183	-210
5.33%	-228	-254	-281	-308	-335	-363	-390
8.00%	-474	-495	-516	-539	-562	-586	-611

KR4301NB27 2018-11 풋275

215

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	207	208	208	209	211	213	215
-5.33%	110	112	115	118	122	125	129
-2.67%	31	36	41	46	51	56	61
0%	-13	-9	-5	0	5	9	14
2.67%	-29	-27	-25	-22	-19	-16	-13
5.33%	-32	-32	-31	-30	-29	-27	-25
8.00%	-32	-32	-32	-32	-32	-31	-30

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

17

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17	17	17	17	17	17	17
-5.33%	9	9	10	10	10	10	10
-2.67%	3	3	4	4	4	5	5
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-3	-3	-2	-2	-2	-2	-1
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3

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

(단위:백만원)

1,944

공시일	2018-10-18
기준일	2018-10-17

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

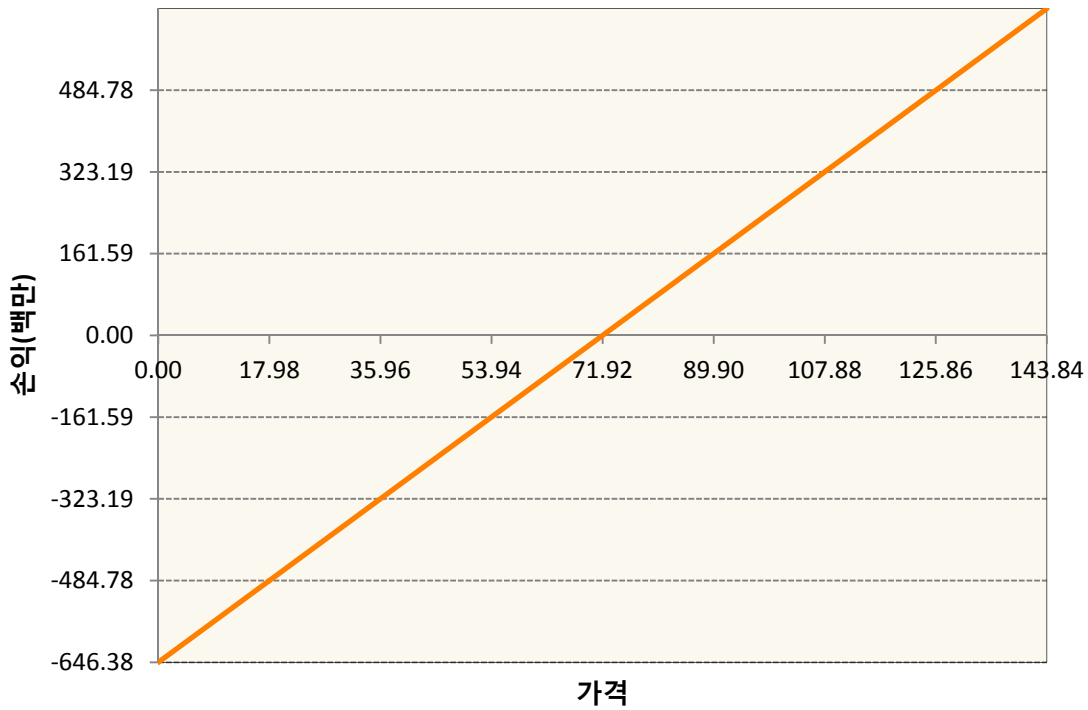
1. 계약금액

(단위:백만원)

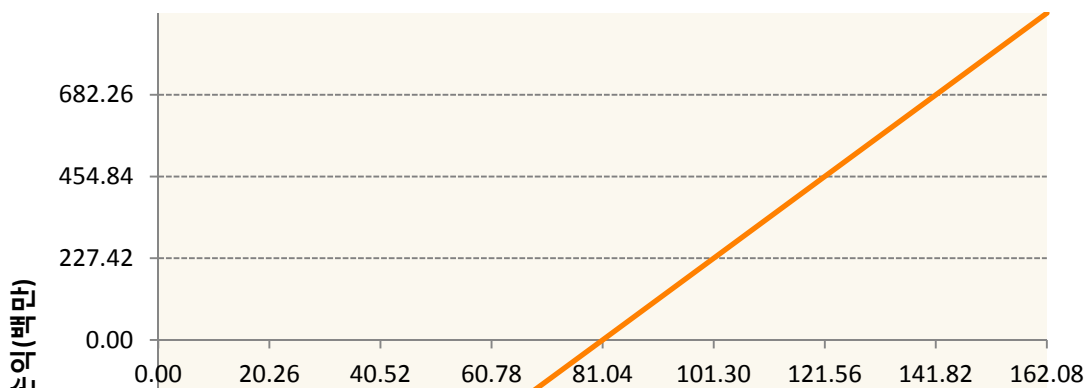
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,005	618	2,386	
누계	유가증권	선물	442	0	442	장내

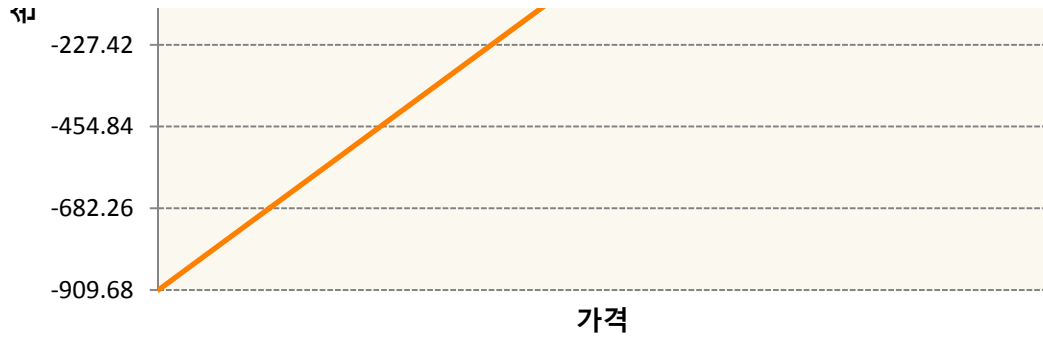
2. 만기시점의 손익구조

CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18

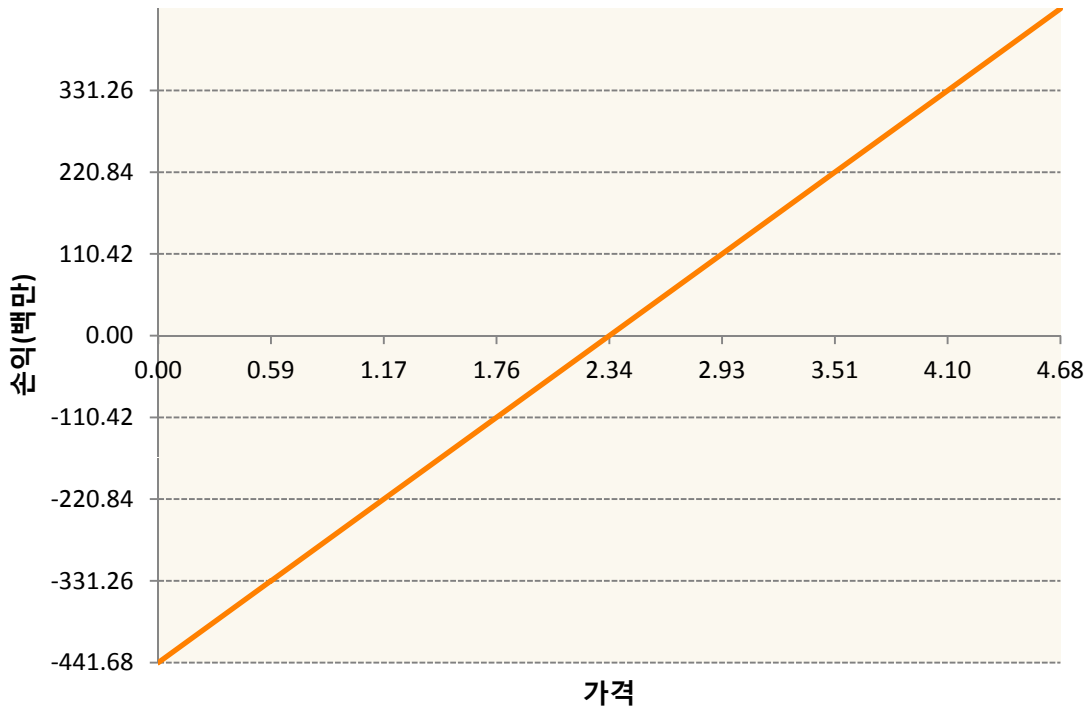


COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19

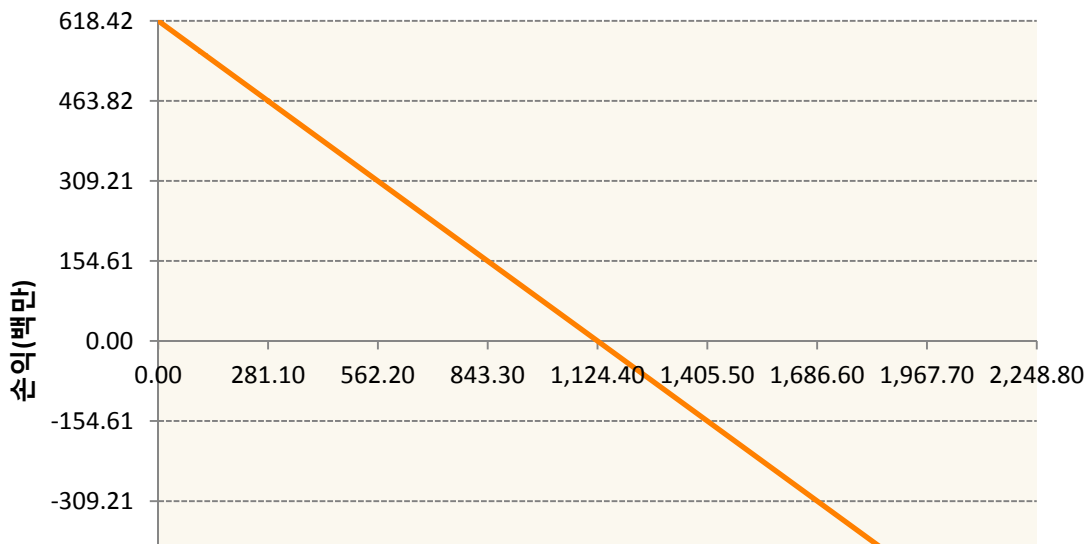


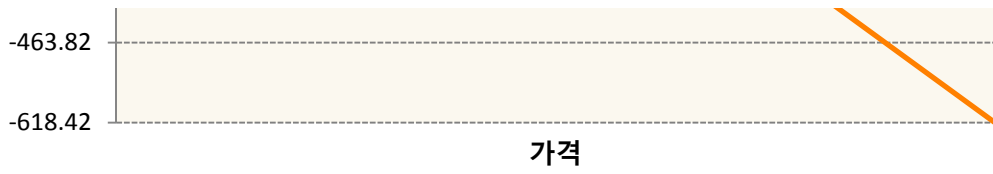


HOX8-Heating Oil

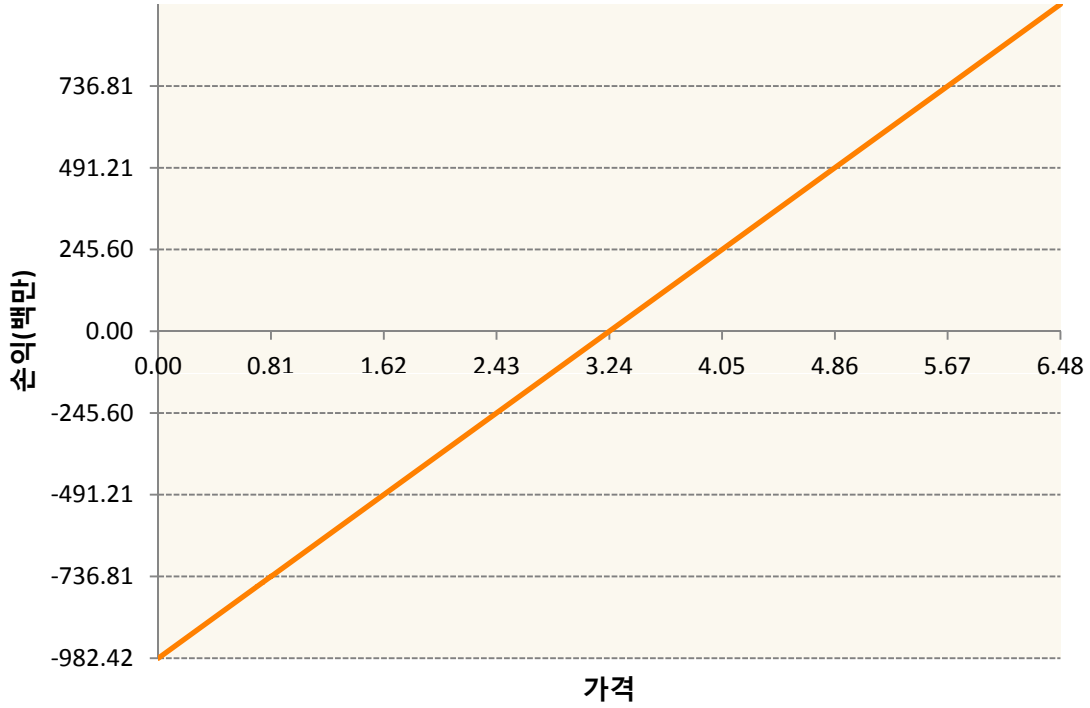


KR4175NB0006-2018-11 달러선물

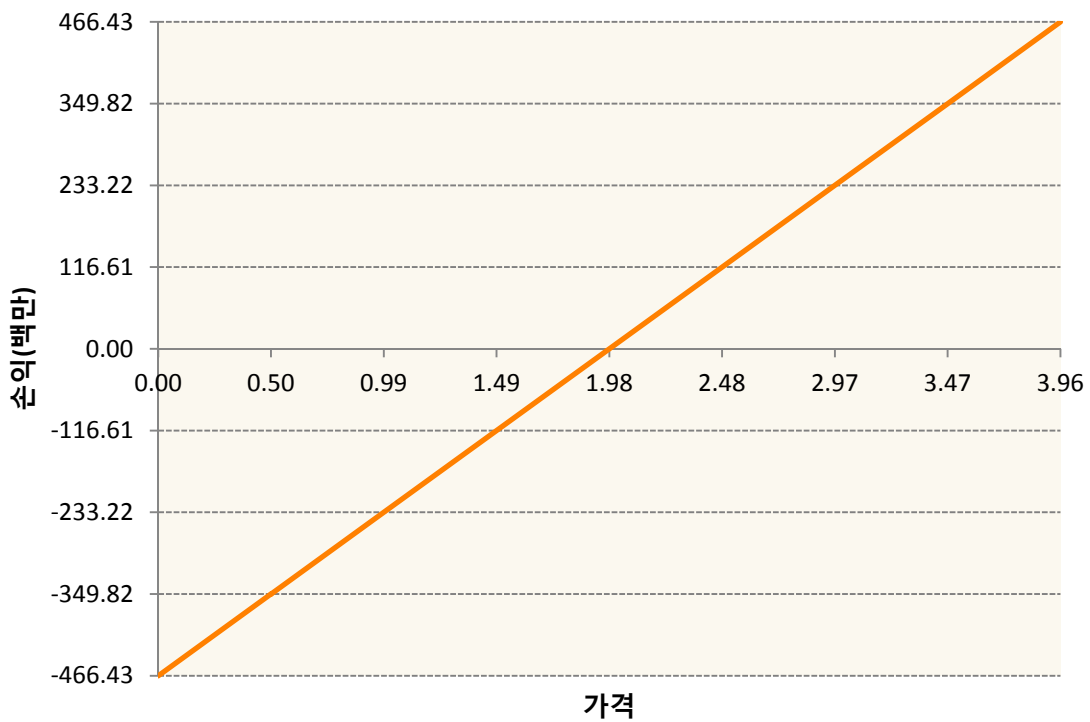




NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18



XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	52
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	73
HOX8	Heating Oil	35
	KR4175NB0(2018-11 달러선물	49
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	79
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	37

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	417

공시일	2018-10-18
기준일	2018-10-17

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

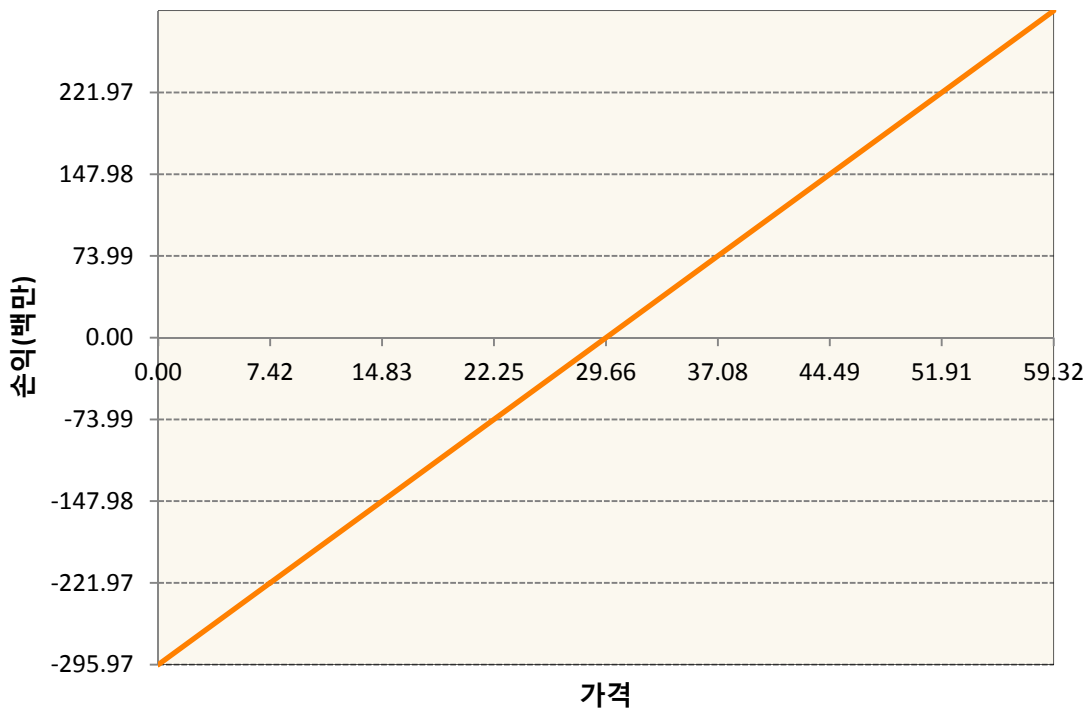
1. 계약금액

(단위:백만원)

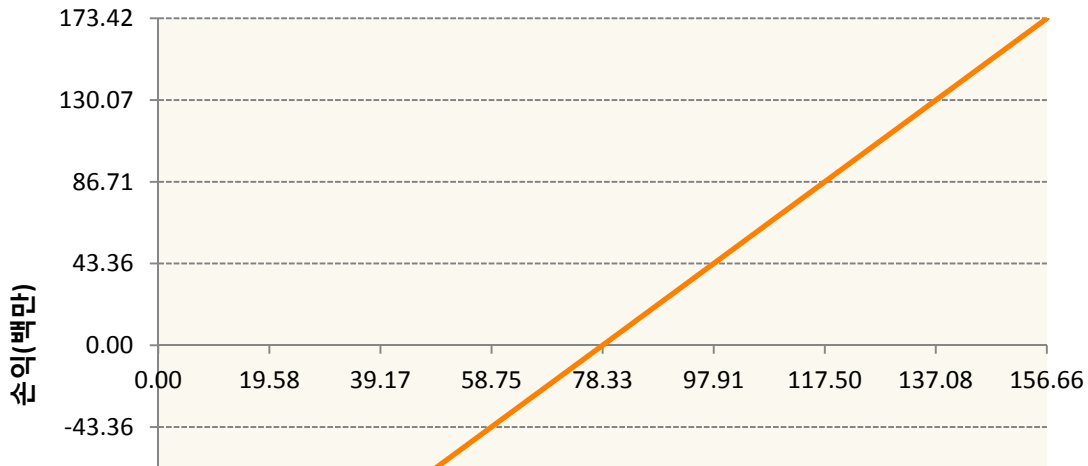
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,641	79	3,562	

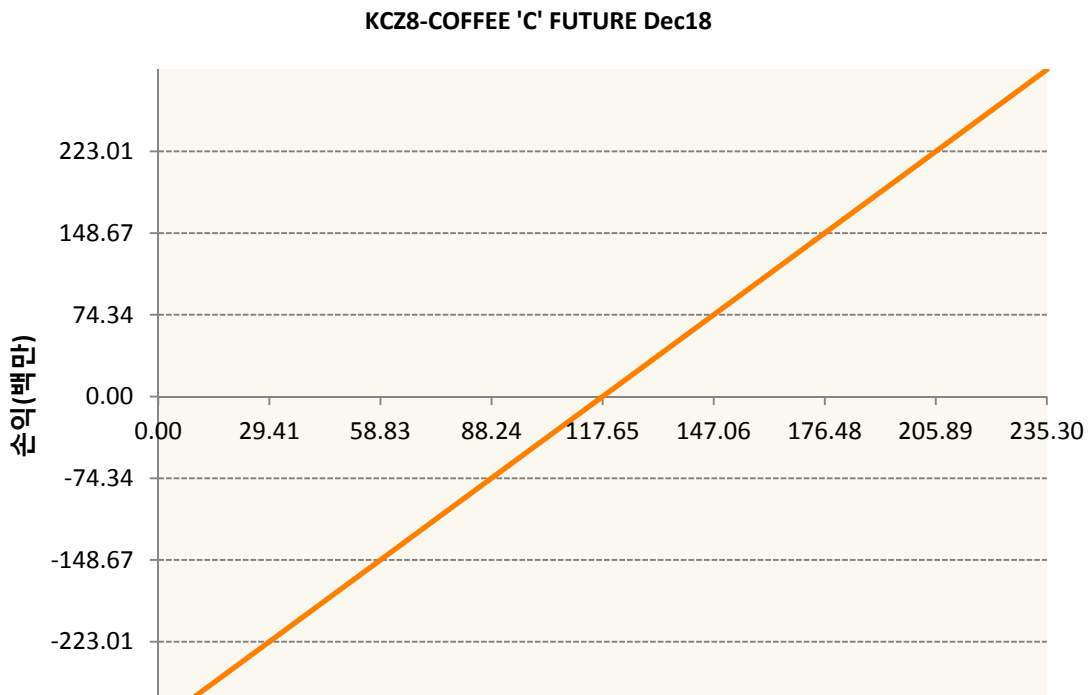
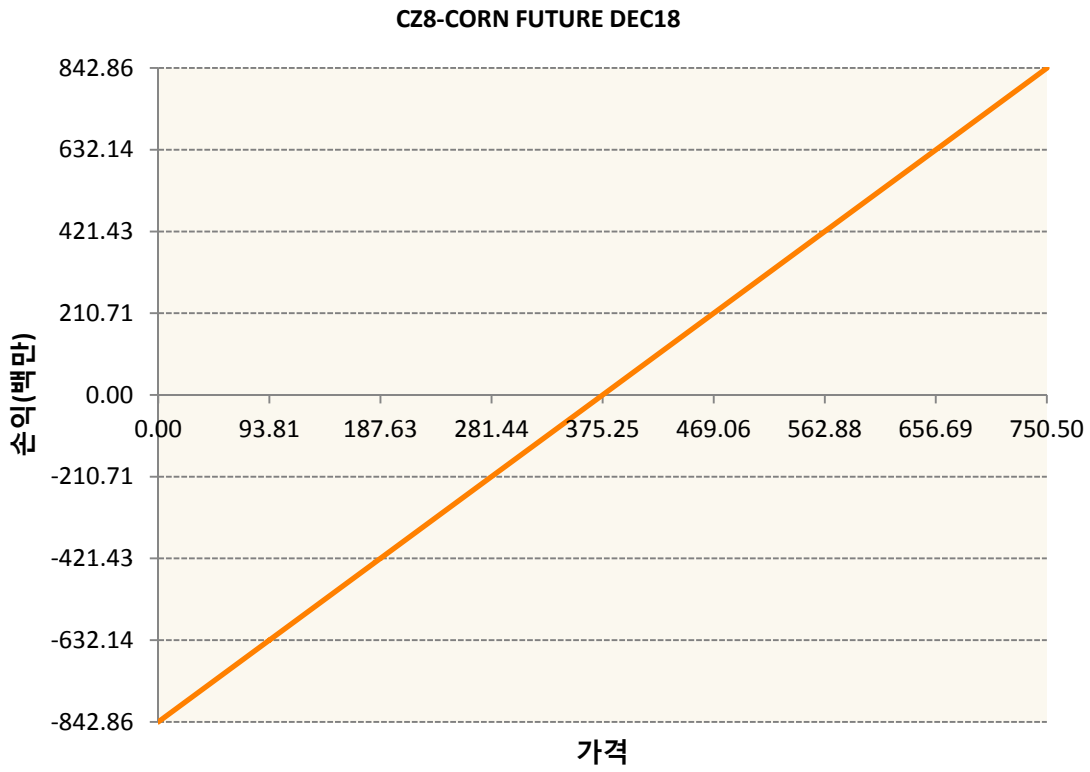
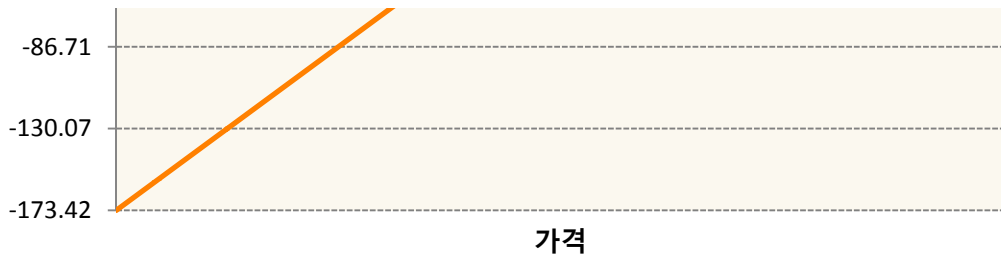
2. 만기시점의 손익구조

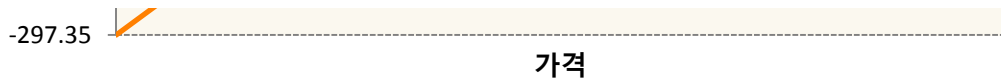
BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18



CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

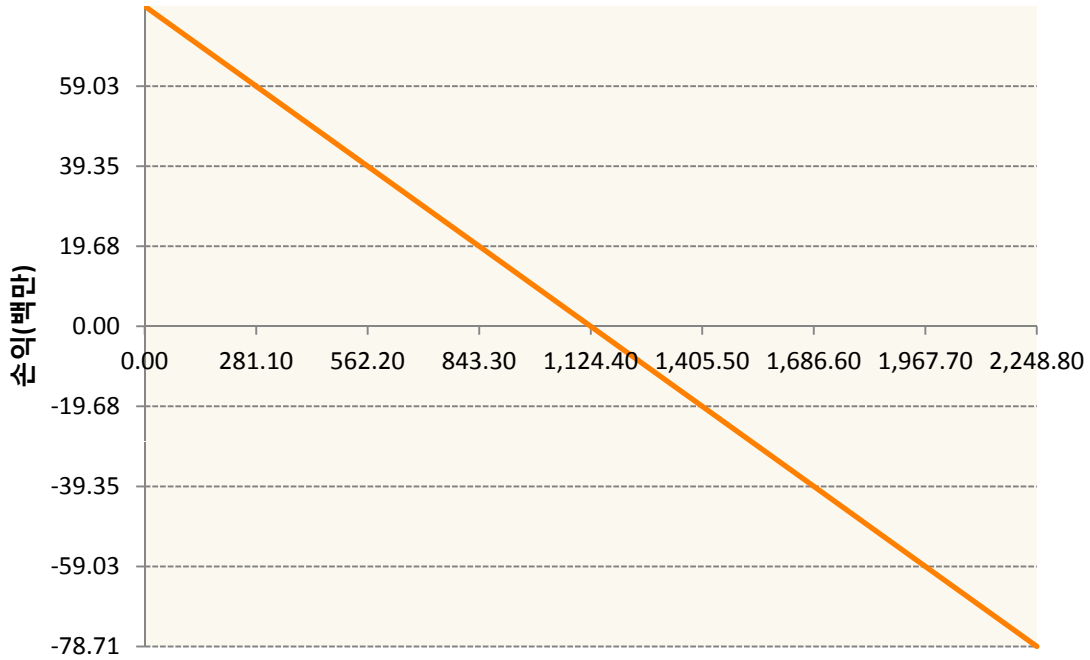






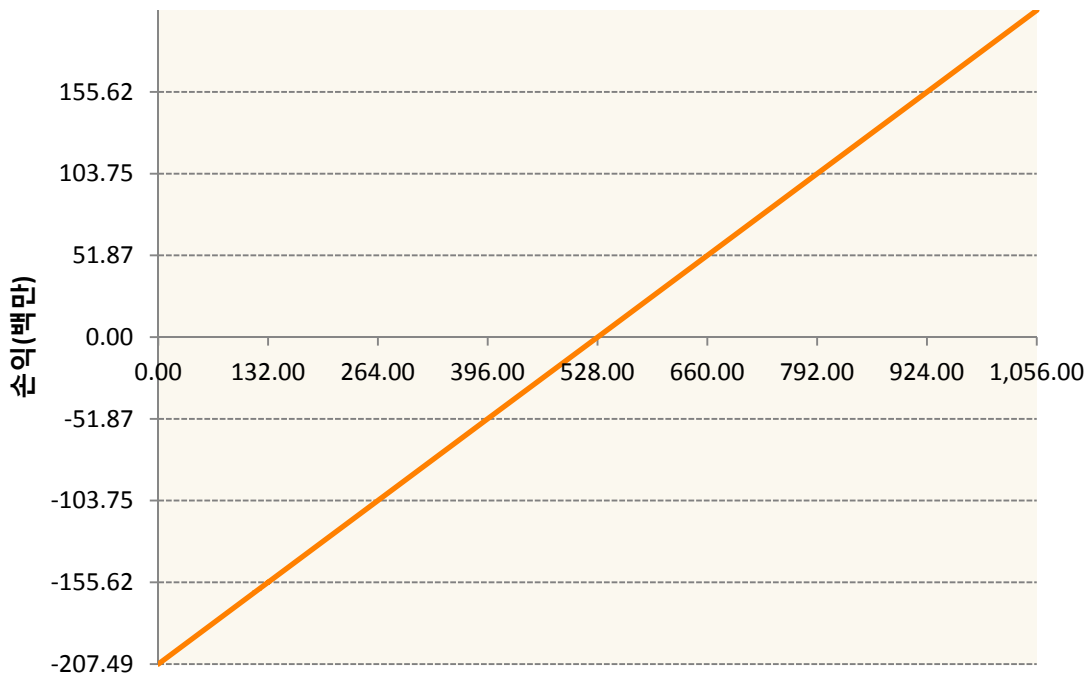
가격

KR4175NB0006-2018-11 달러선물



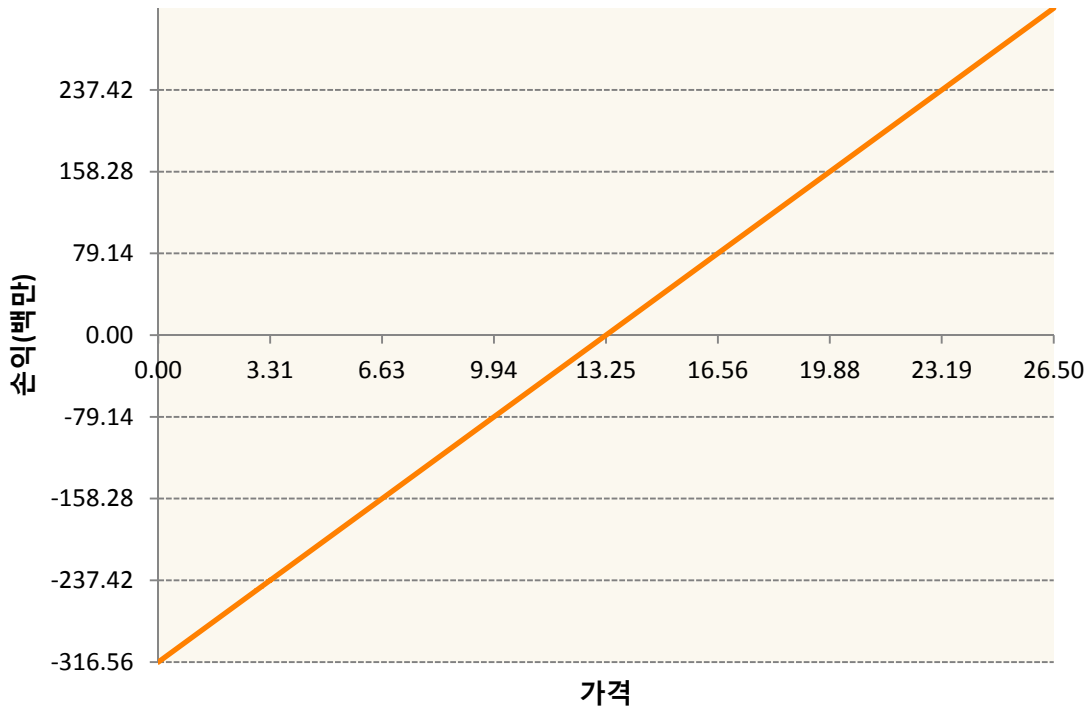
가격

KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18

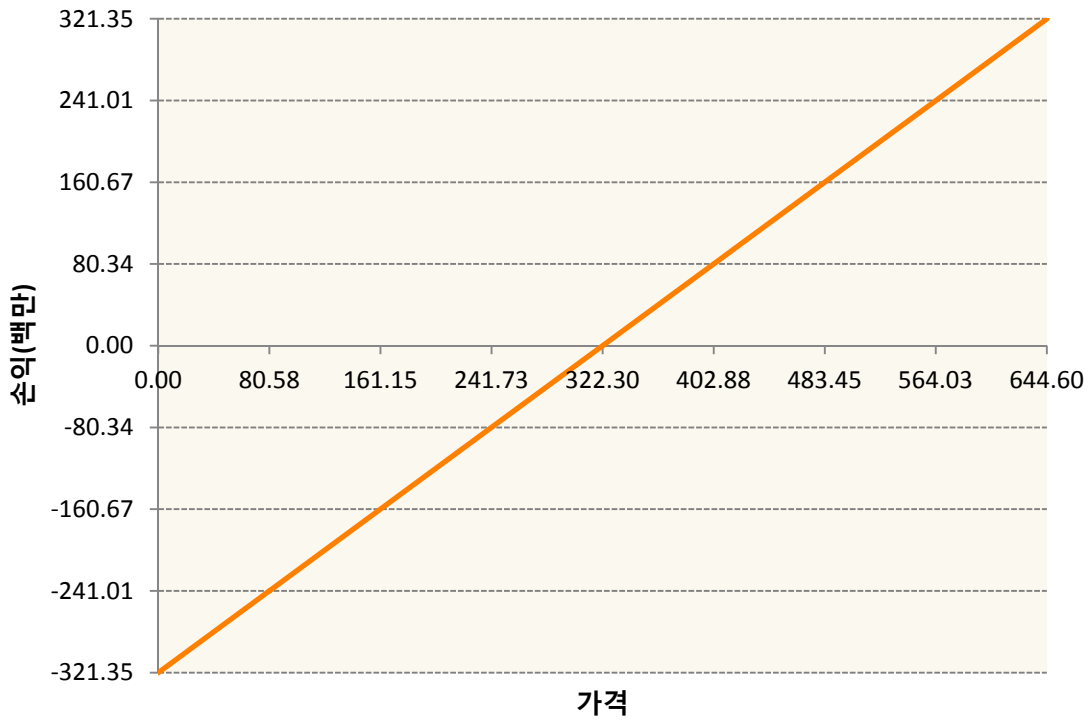


가격

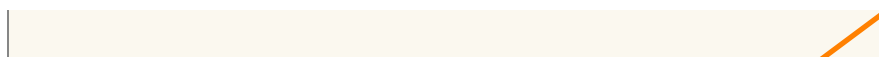
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

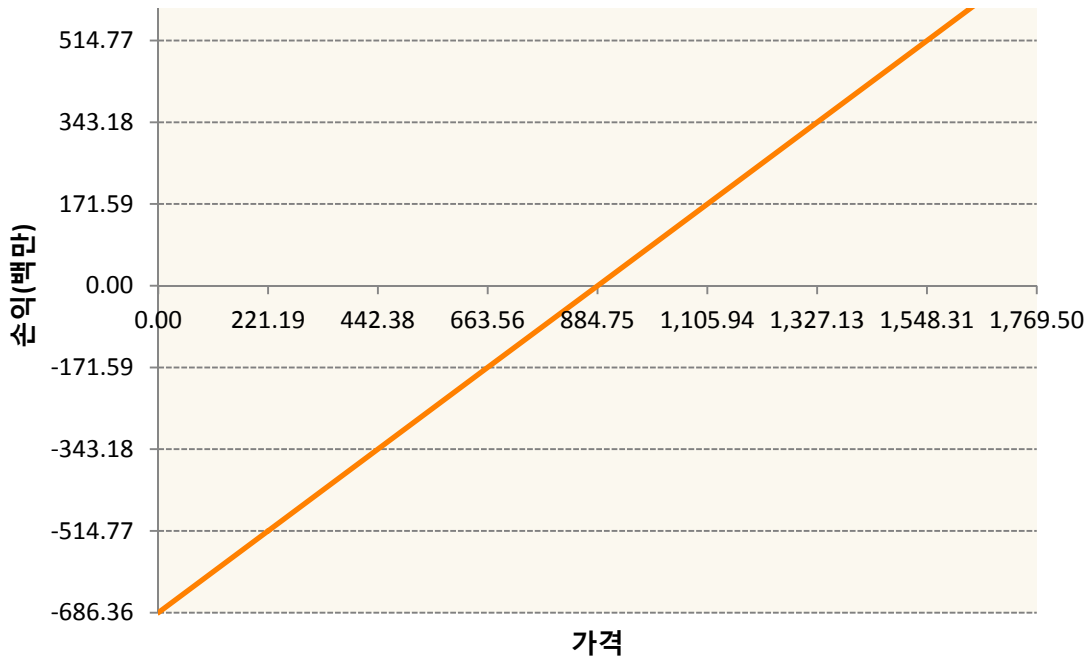


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

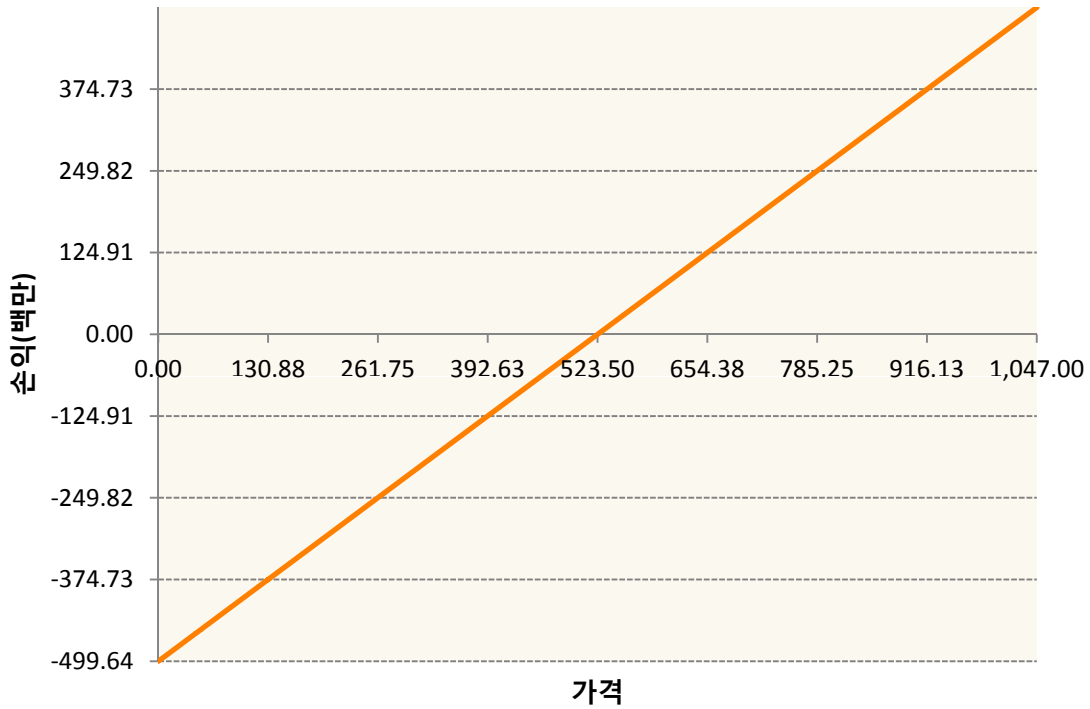


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





WZ8-WHEAT FUTURE(CBT) DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	24
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	17
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	25
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	26
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	55
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	40

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

(단위:백만원)

318