

공시일	2018-10-19
기준일	2018-10-18

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	2018-10-19
기준일	2018-10-18

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

1,111

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

499

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-19
기준일	2018-10-18

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

243

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

329

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-19
기준일	2018-10-18

유로인덱스모(주식-파생형)

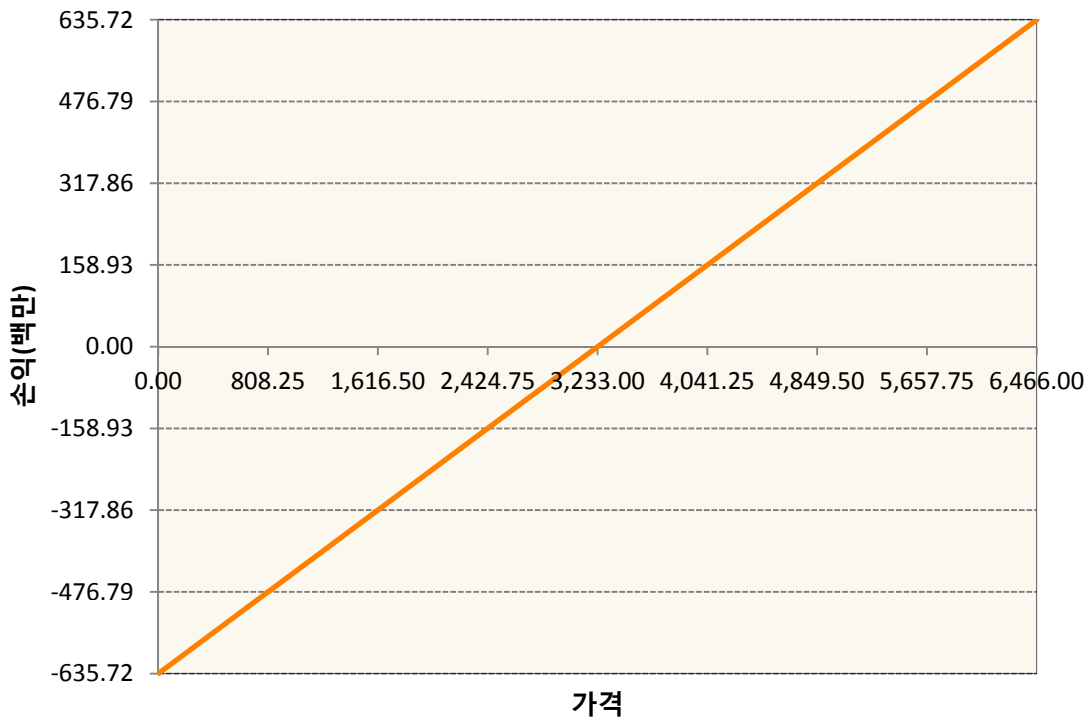
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	636	0	636	

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	2018-10-19
기준일	2018-10-18

차이나인덱스모(주식-파생형)

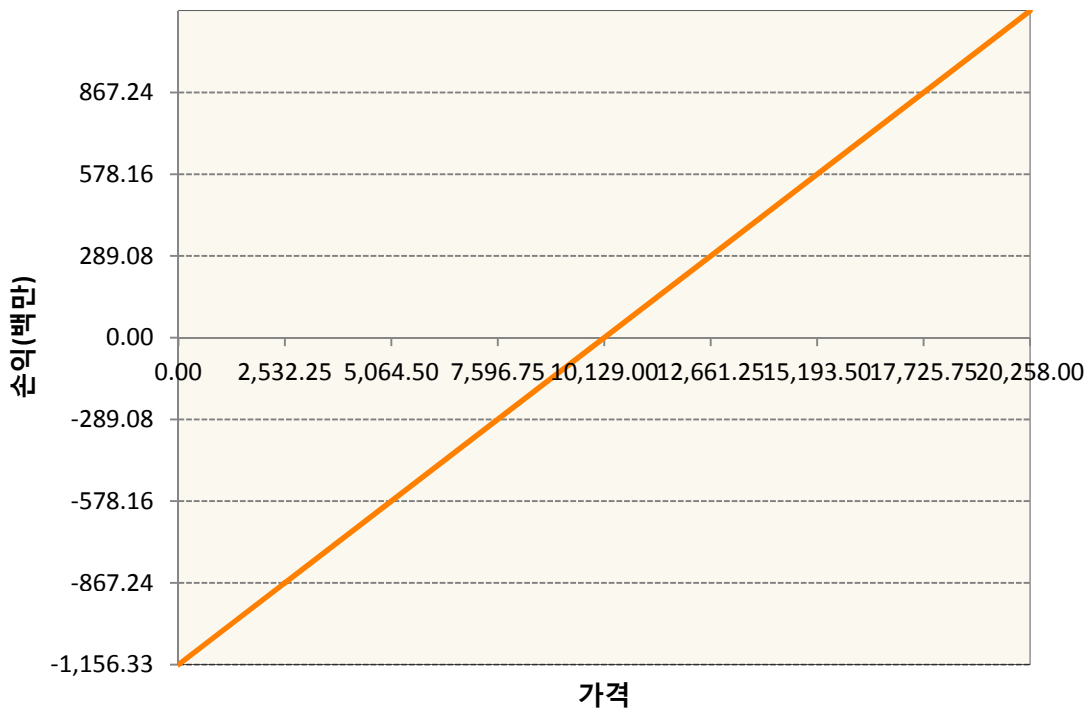
1. 계약금액

(단위:백만원)

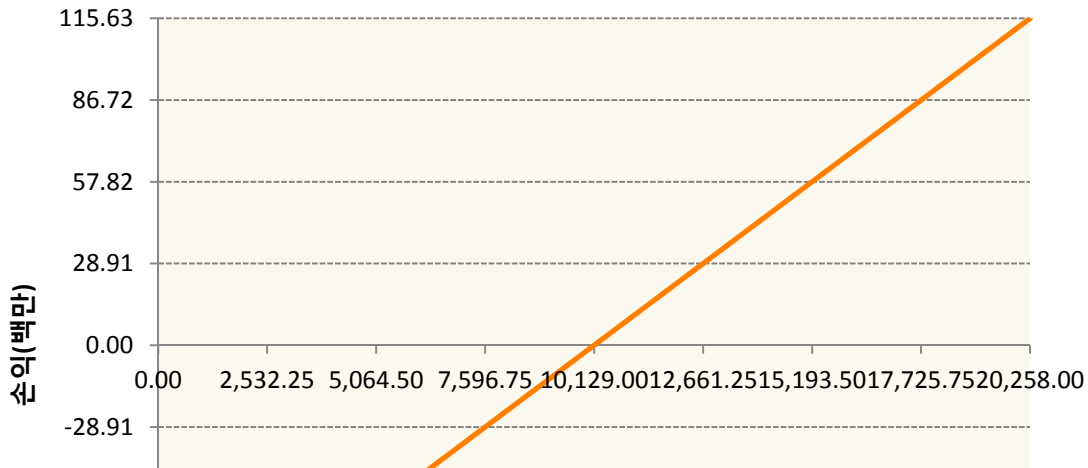
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,272	0	1,272	장내

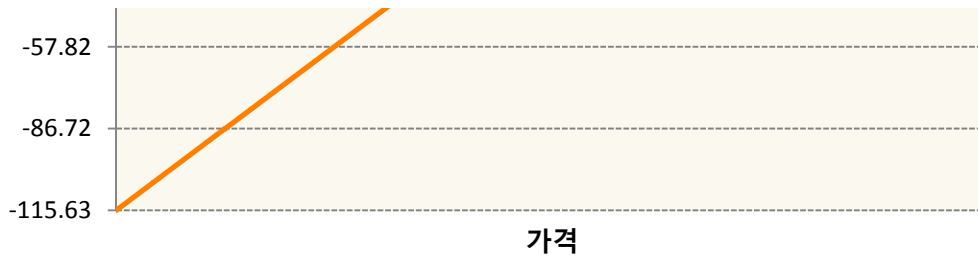
2. 만기시점의 손익구조

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	2018-10-19
기준일	2018-10-18

커버드콜모(주식혼합-파생형)

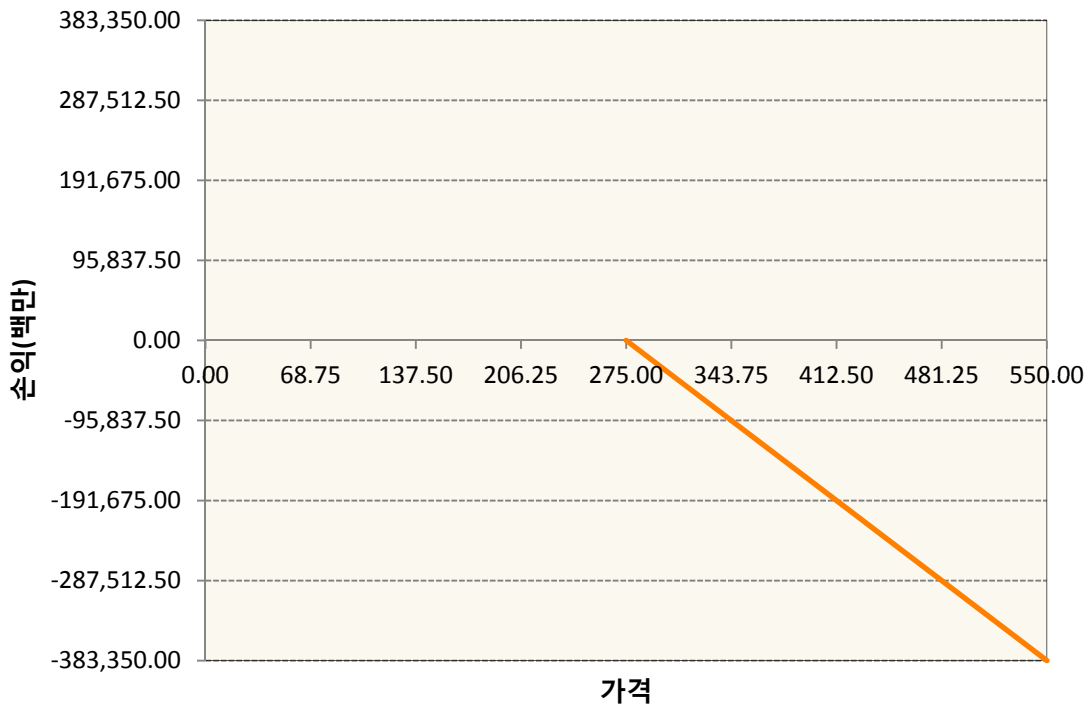
1. 계약금액

(단위:백만원)

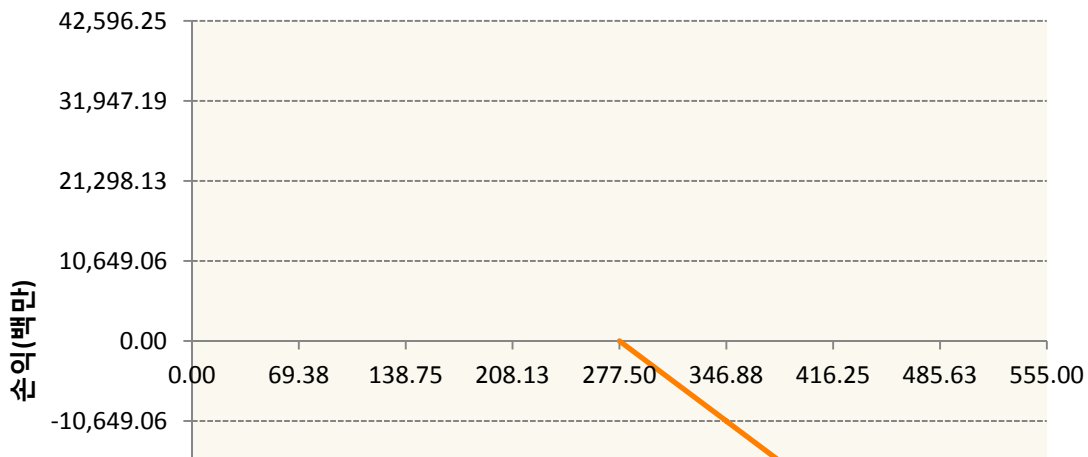
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	707,821	-707,821	장내

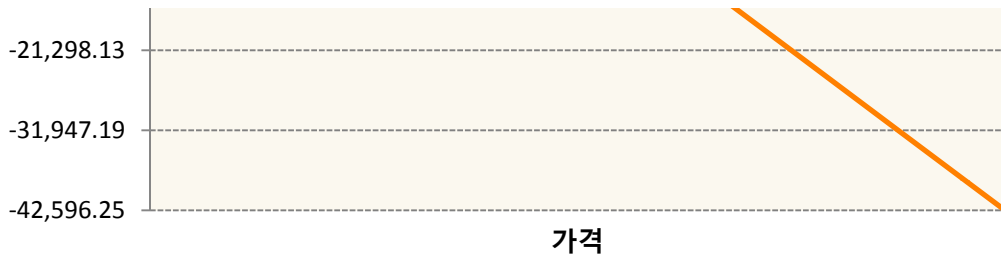
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

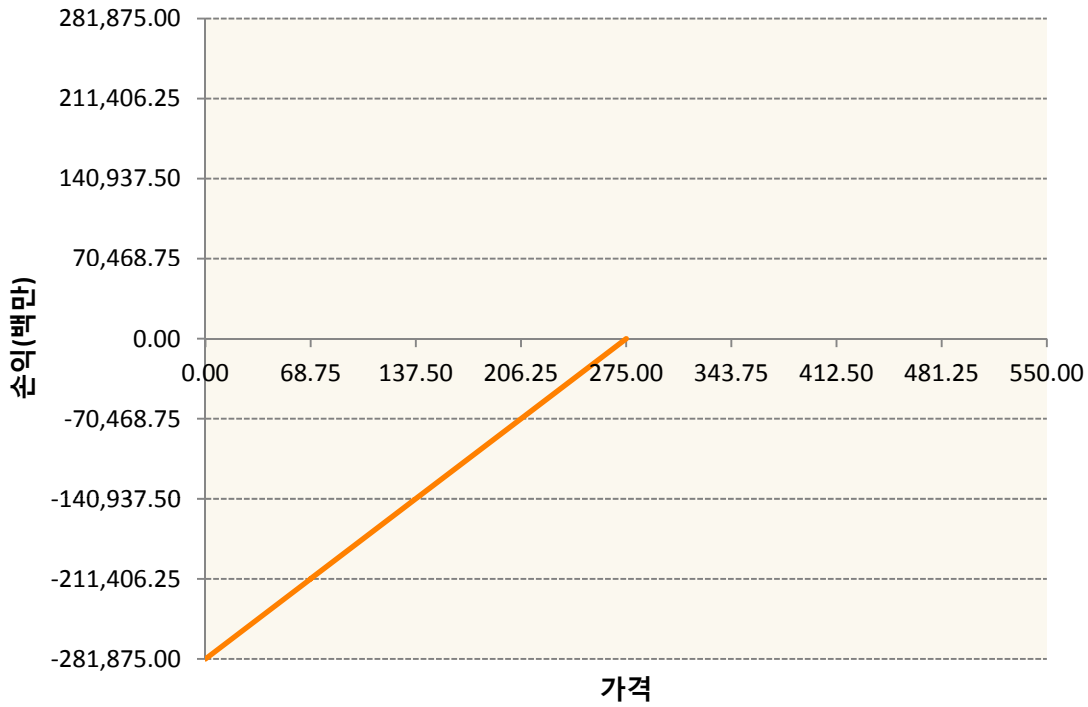


KR4201NB2778-2018-11 콜277.5





KR4301NB2751-2018-11 풋275



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NB27 2018-11 콜275

25,034

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,071	10,814	10,500	10,135	9,725	9,276	8,793
-5.33%	9,935	9,418	8,860	8,269	7,651	7,012	6,355
-2.67%	7,250	6,502	5,745	4,982	4,213	3,440	2,664
0%	2,398	1,601	801	0	-802	-1,606	-2,410
2.67%	-4,658	-5,300	-5,970	-6,664	-7,376	-8,102	-8,840
5.33%	-13,380	-13,778	-14,233	-14,736	-15,280	-15,857	-16,463
8.00%	-23,058	-23,252	-23,506	-23,816	-24,177	-24,585	-25,034

KR4201NB27 2018-11 콜277.5

2,633

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,040	1,018	991	957	919	876	828

-5.33%	950	902	849	791	730	665	598
-2.67%	719	643	565	485	404	322	239
0%	269	179	90	0	-90	-179	-269
2.67%	-429	-509	-590	-673	-756	-841	-927
5.33%	-1,334	-1,388	-1,448	-1,512	-1,579	-1,650	-1,723
8.00%	-2,370	-2,399	-2,435	-2,477	-2,524	-2,576	-2,633

KR4301NB27 2018-11 풋275

17,260

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-16,871	-16,893	-16,931	-16,986	-17,059	-17,150	-17,260
-5.33%	-9,503	-9,631	-9,785	-9,964	-10,163	-10,380	-10,613
-2.67%	-3,101	-3,415	-3,740	-4,071	-4,409	-4,751	-5,097
0%	1,093	731	366	0	-368	-737	-1,107
2.67%	2,866	2,660	2,429	2,179	1,912	1,630	1,338
5.33%	3,309	3,248	3,162	3,052	2,918	2,763	2,588
8.00%	3,373	3,363	3,343	3,311	3,264	3,200	3,119

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

(단위:백만원)

45,465

공시일	2018-10-19
기준일	2018-10-18

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

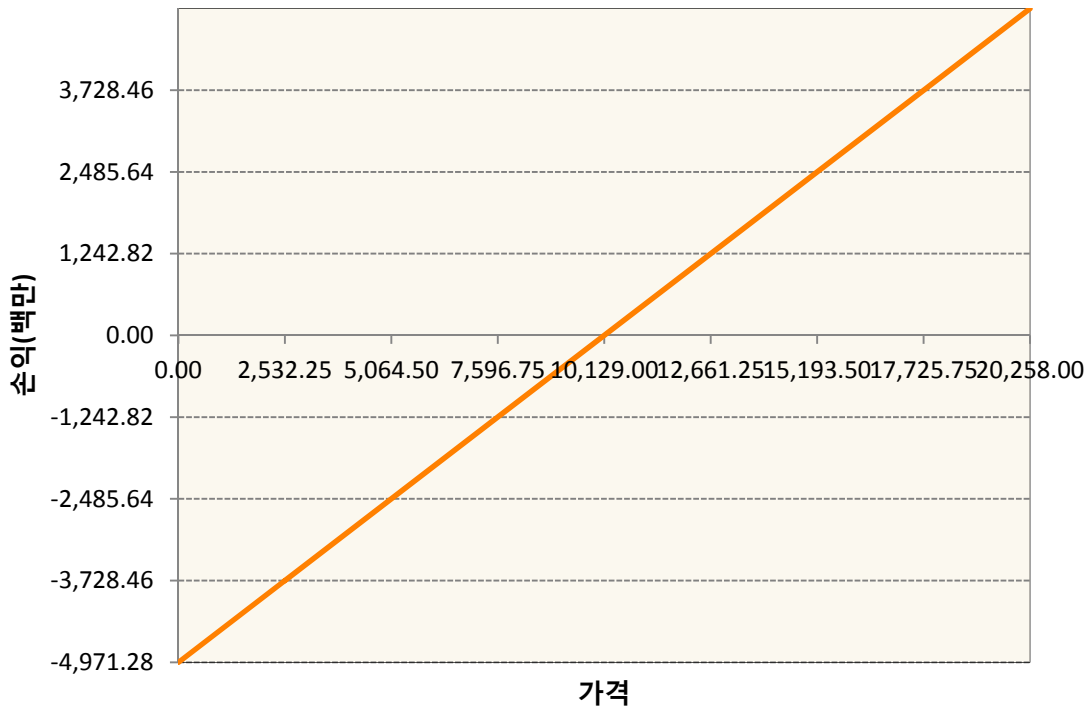
1. 계약금액

(단위:백만원)

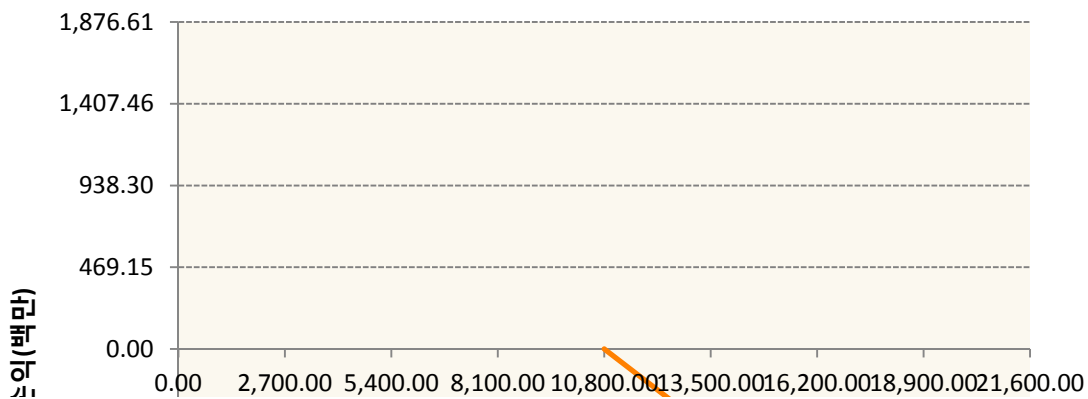
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,971	0	4,971	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,195	-12,195	장내

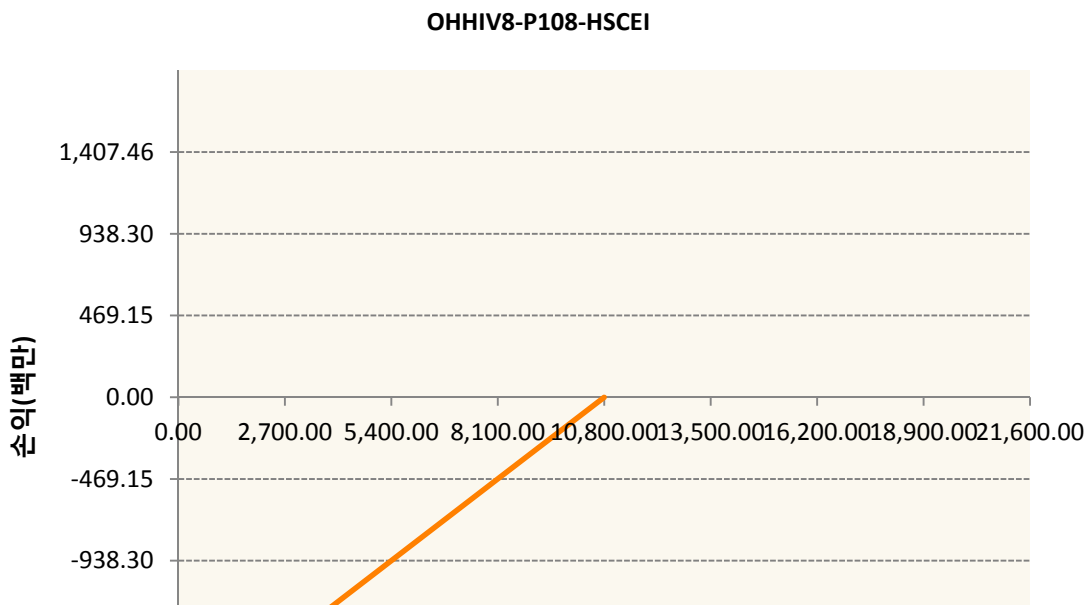
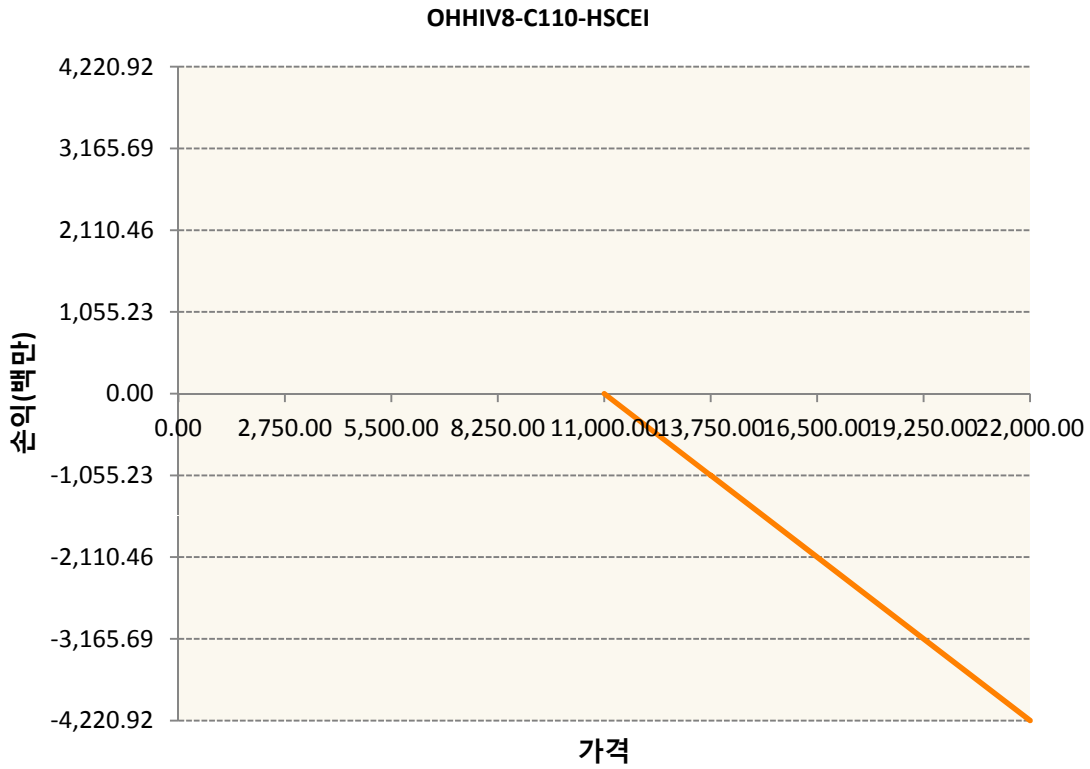
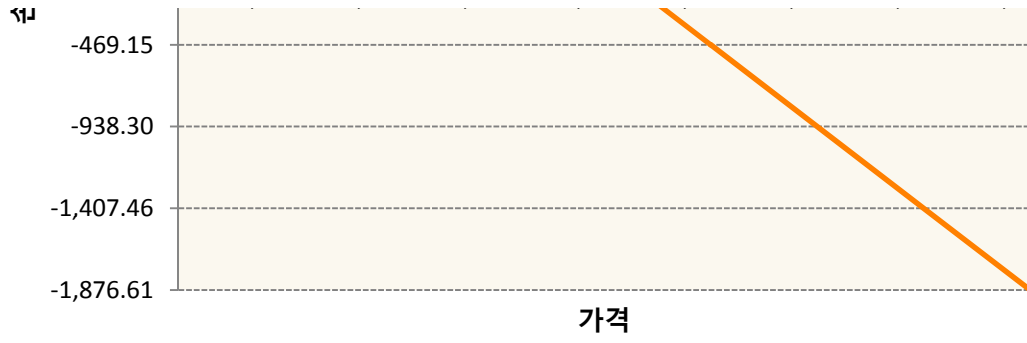
2. 만기시점의 손익구조

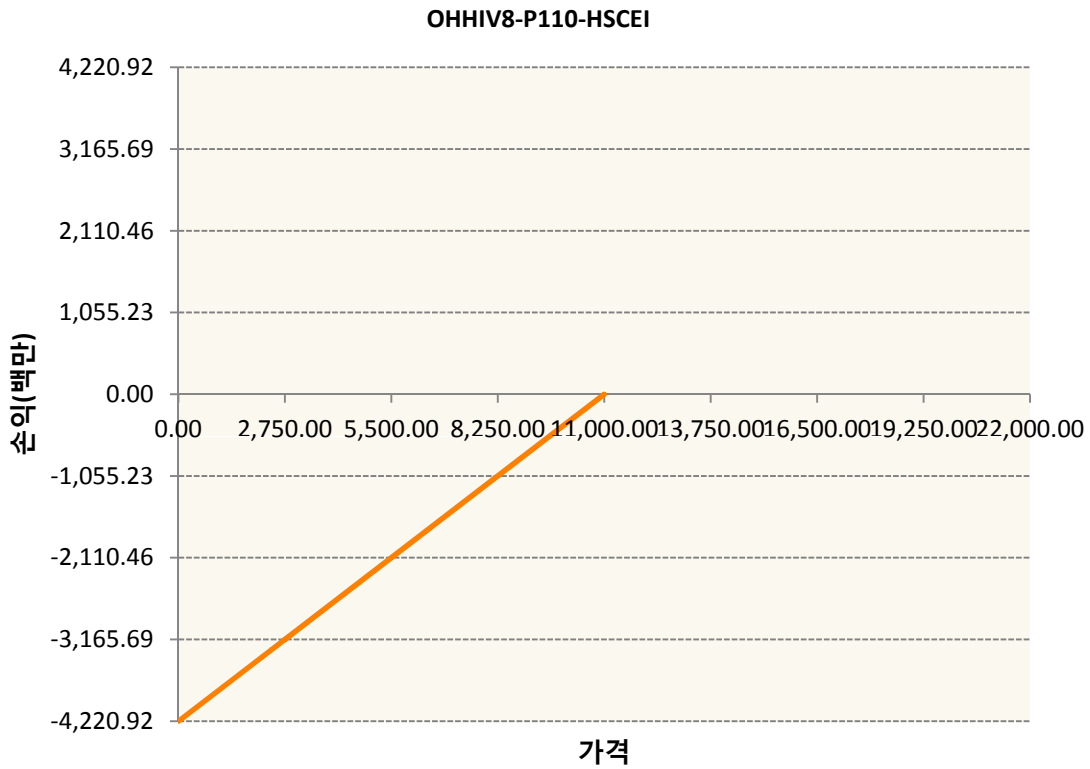
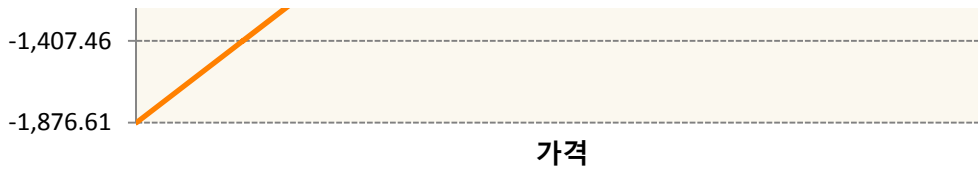
HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



OHHIV8-C108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	398
OHHIV8-C1C	HSCEI	150
OHHIV8-C11	HSCEI	338
OHHIV8-P1C	HSCEI	150
OHHIV8-P11	HSCEI	338

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,316

공시일	2018-10-19
기준일	2018-10-18

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

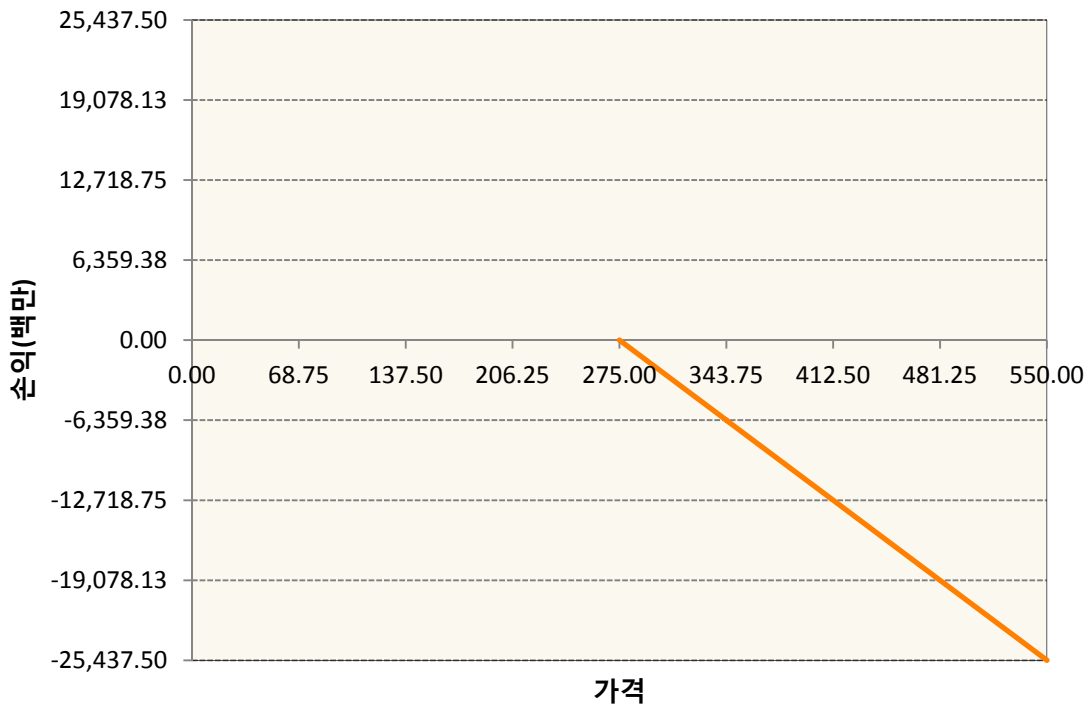
1. 계약금액

(단위:백만원)

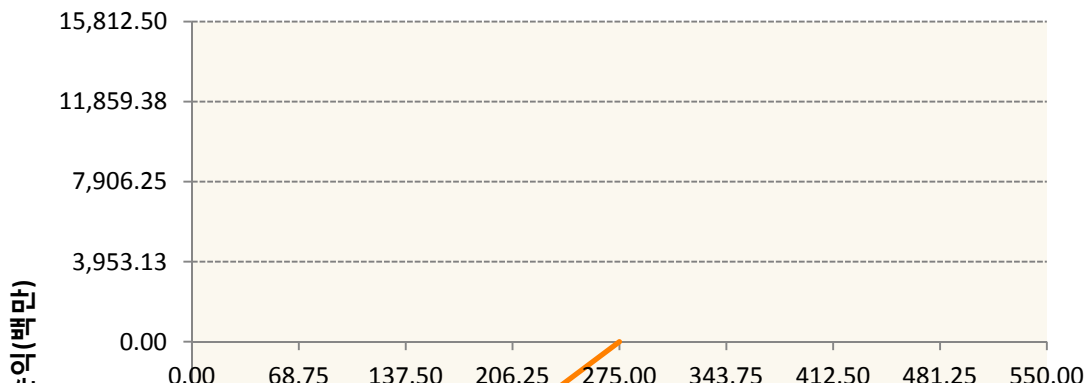
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	44,025	-44,025	장내

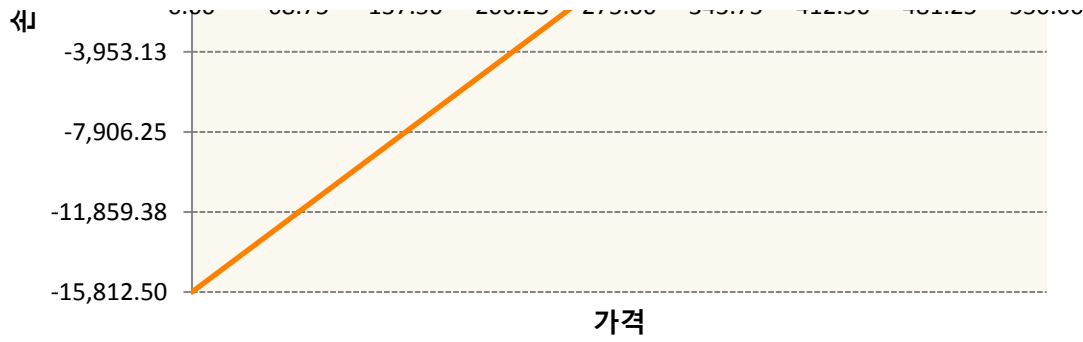
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

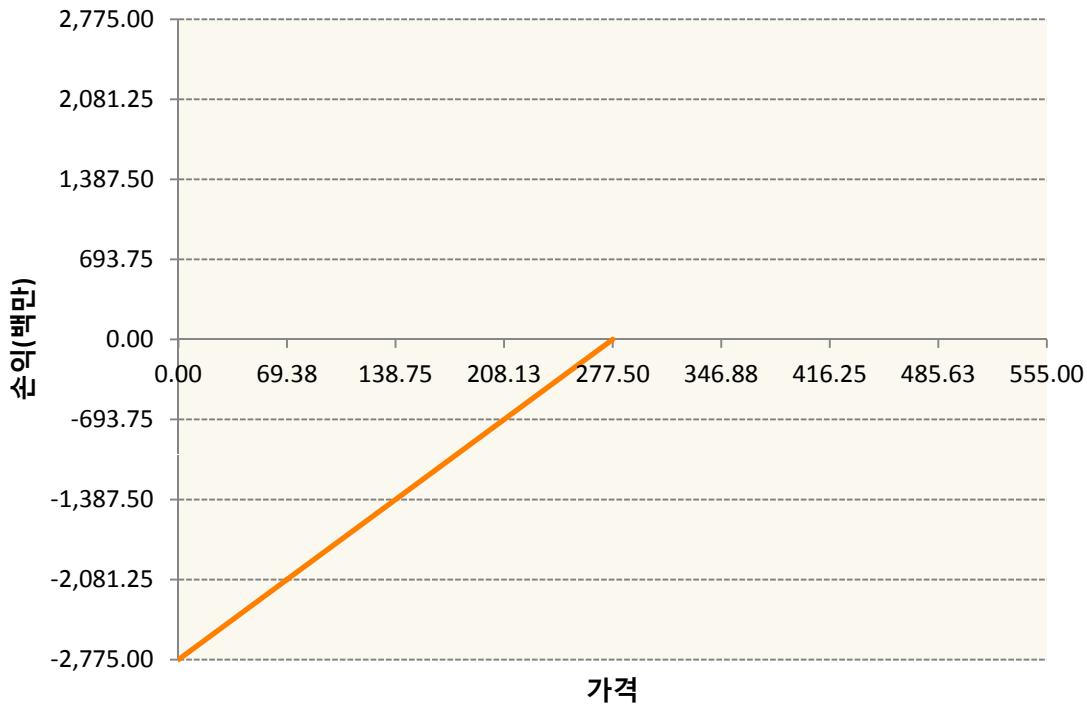


KR4301NB2751-2018-11 풋275





KR4301NB2777-2018-11 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							4,010	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-4,010	-4,010	-4,010	-4,010	-4,010	-4,010	-4,010	
-5.33%	-2,673	-2,673	-2,673	-2,673	-2,673	-2,673	-2,673	
-2.67%	-1,337	-1,337	-1,337	-1,337	-1,337	-1,337	-1,337	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	1,337	1,337	1,337	1,337	1,337	1,337	1,337	
5.33%	2,673	2,673	2,673	2,673	2,673	2,673	2,673	
8.00%	4,010	4,010	4,010	4,010	4,010	4,010	4,010	
KR4201NB27 2018-11 콜275							1,661	
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	735	718	697	673	645	616	583
-5.33%	659	625	588	549	508	465	422
-2.67%	481	431	381	331	280	228	177
0%	159	106	53	0	-53	-107	-160
2.67%	-309	-352	-396	-442	-489	-538	-587
5.33%	-888	-914	-944	-978	-1,014	-1,052	-1,092
8.00%	-1,530	-1,543	-1,560	-1,580	-1,604	-1,631	-1,661

KR4301NB27 2018-11 풋275

968

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-946	-948	-950	-953	-957	-962	-968
-5.33%	-533	-540	-549	-559	-570	-582	-595
-2.67%	-174	-192	-210	-228	-247	-267	-286
0%	61	41	21	0	-21	-41	-62
2.67%	161	149	136	122	107	91	75
5.33%	186	182	177	171	164	155	145
8.00%	189	189	188	186	183	180	175

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

180

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-178	-178	-178	-178	-179	-180	-180
-5.33%	-105	-106	-107	-108	-110	-111	-113
-2.67%	-38	-41	-43	-46	-49	-52	-55
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	36	33	30	27	24	21	18
5.33%	43	42	41	39	38	36	33
8.00%	44	44	44	43	43	42	41

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

(단위:백만원)

6,868

공시일	2018-10-19
기준일	2018-10-18

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

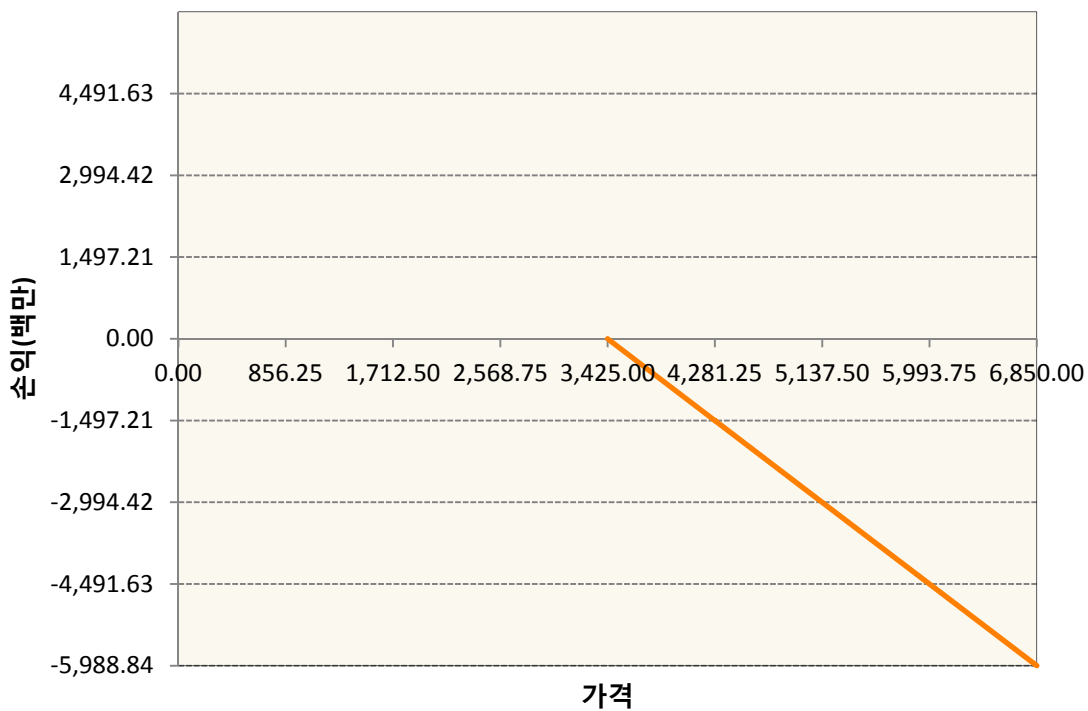
1. 계약금액

(단위:백만원)

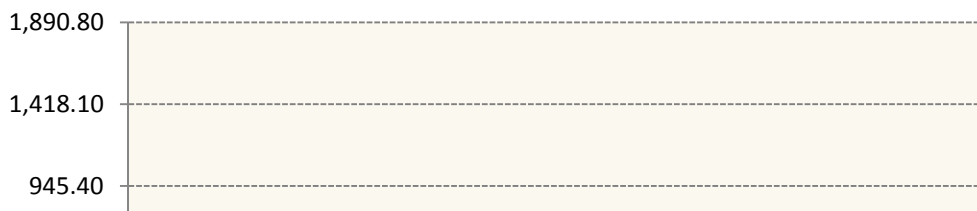
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	883	0	883	
누계	유가증권	스왑	34,458	0	34,458	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,759	-15,759	장내
누계	지수	스왑	52,974	0	52,974	장외

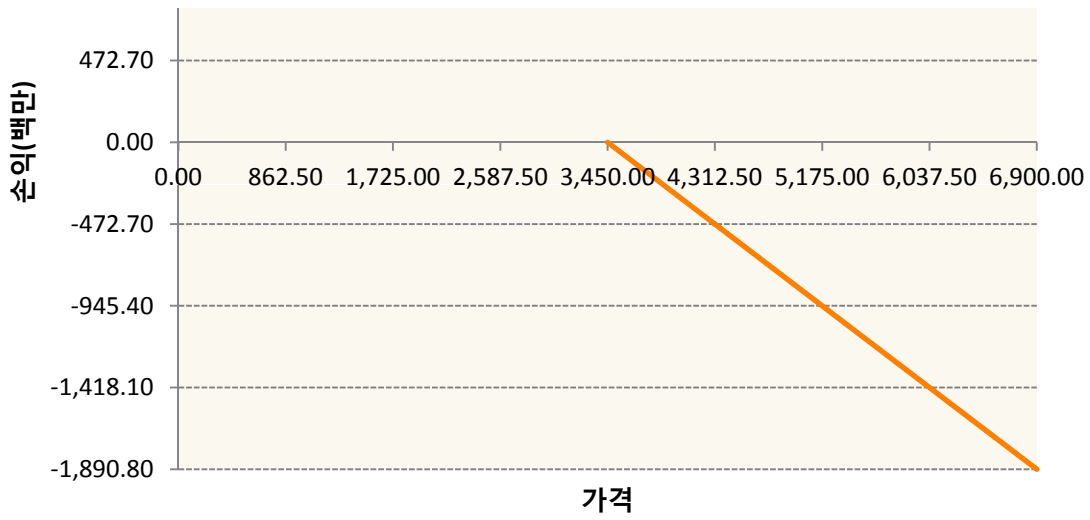
2. 만기시점의 손익구조

OESXV8-C3425-EURO STOXX 50

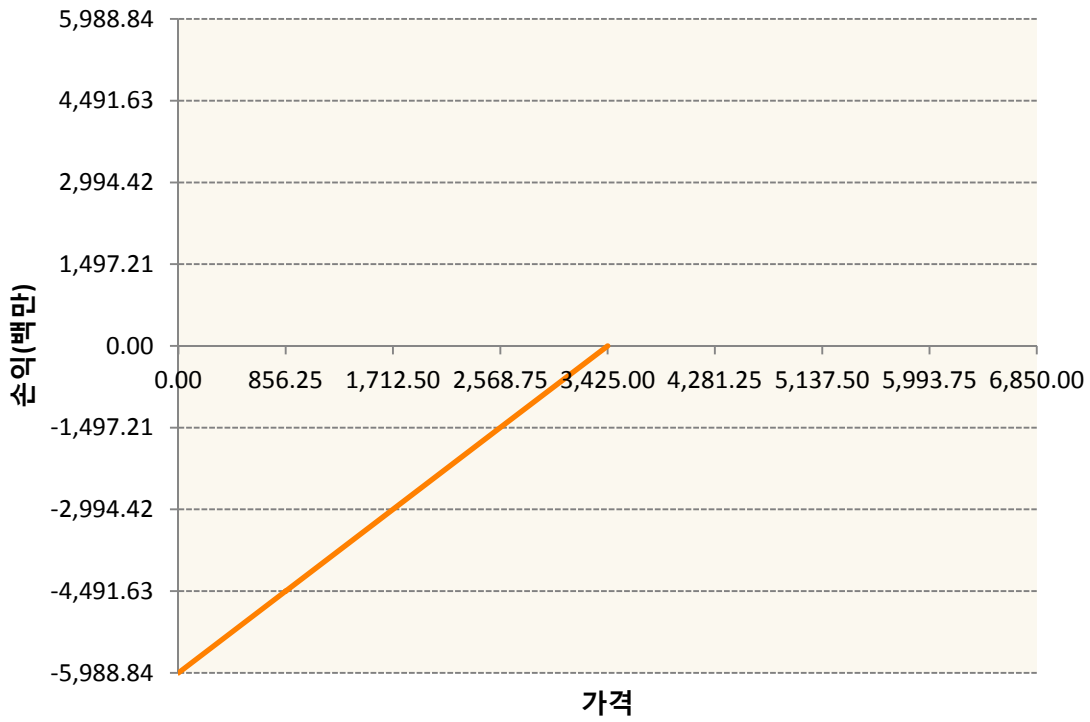


OESXV8-C3450-EURO STOXX 50

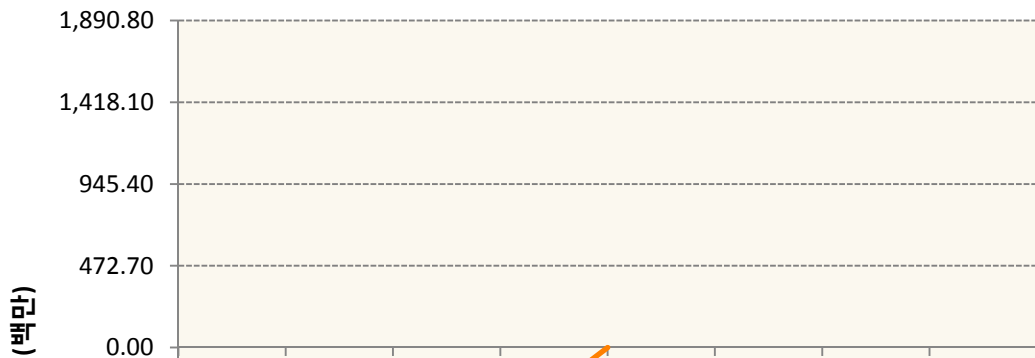


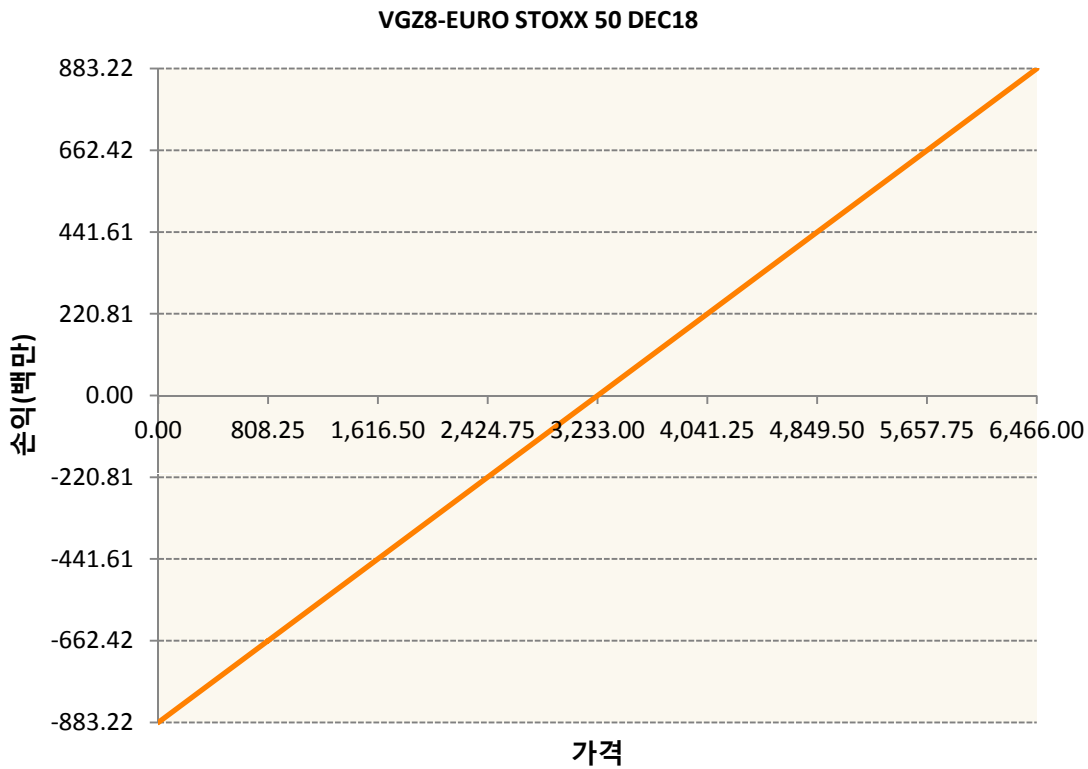
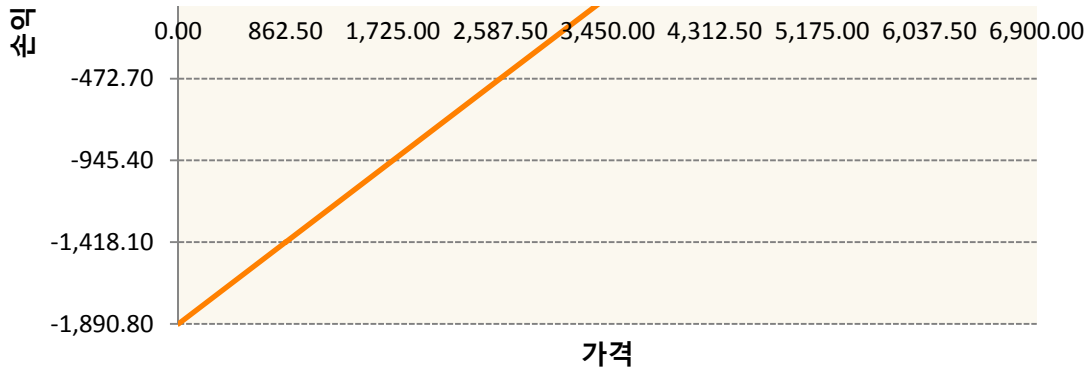


OESXV8-P3425-EURO STOXX 50



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		479
OESXV8-C34 EURO STOXX 50		151
OESXV8-P34 EURO STOXX 50		479
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)

1,130

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)

156

공시일	2018-10-19
기준일	2018-10-18

스마트KRX300인덱스목표전환형1

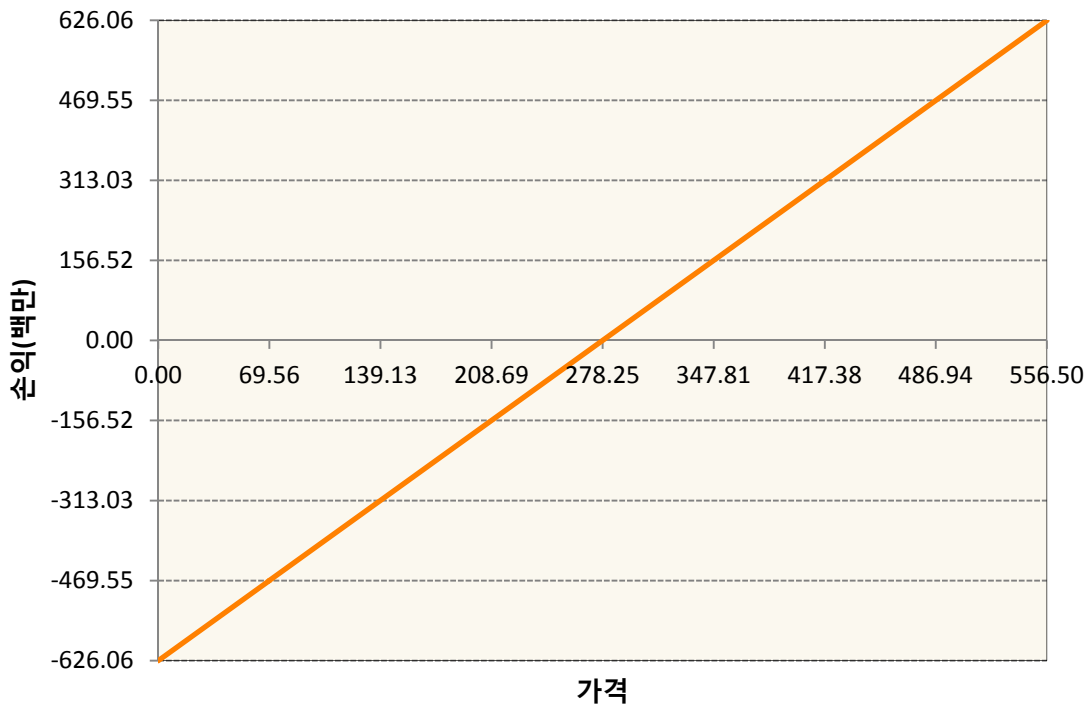
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	626	0	626	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	2018-10-19
기준일	2018-10-18

리디파인K200(주식혼합-파생재간

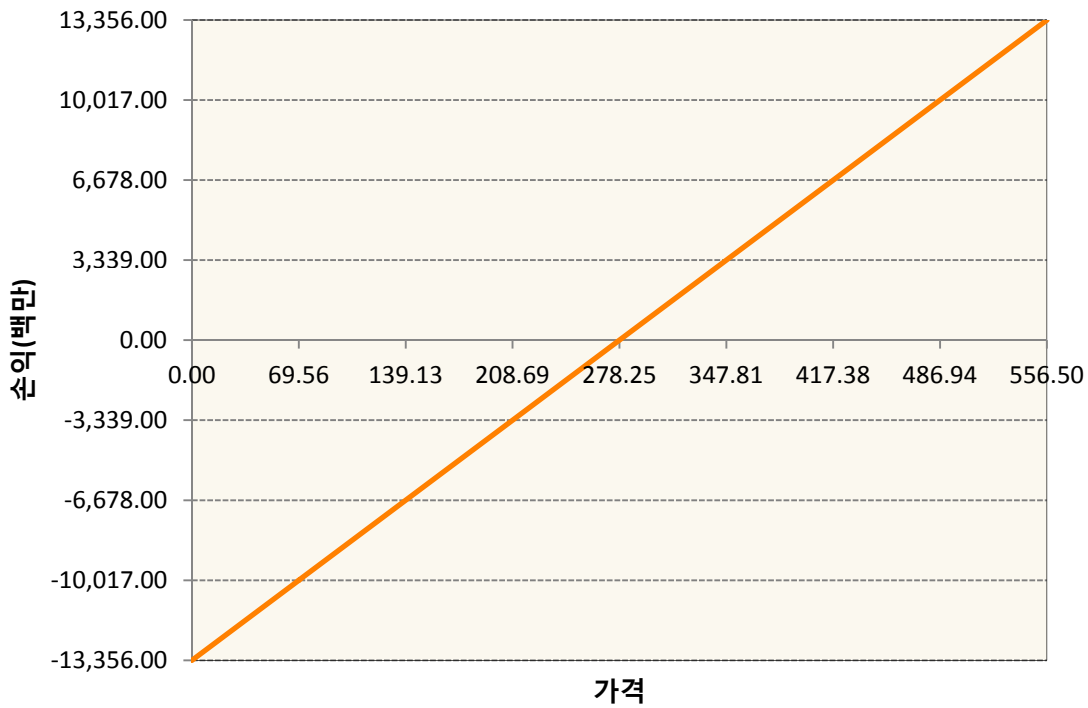
1. 계약금액

(단위:백만원)

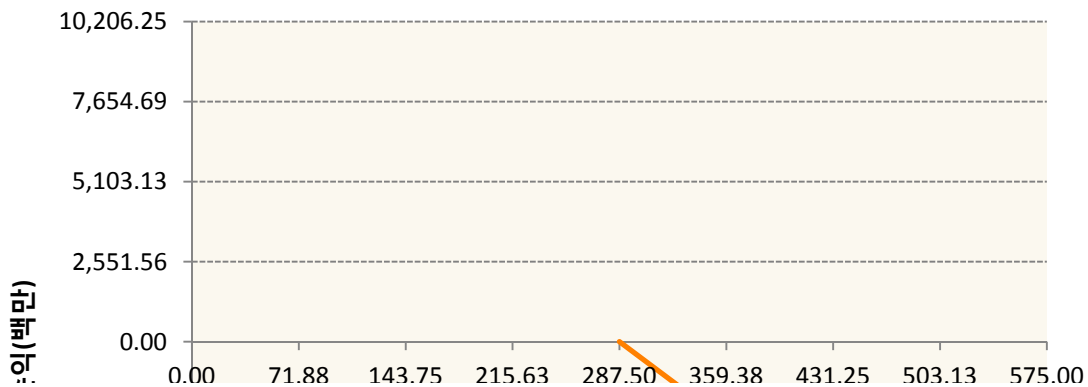
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	279	0	279	장내
신규	유가증권	옵션	0	289	-289	장내
누계	유가증권	선물	13,356	0	13,356	장내
누계	유가증권	옵션	4,059	23,401	-19,343	장내

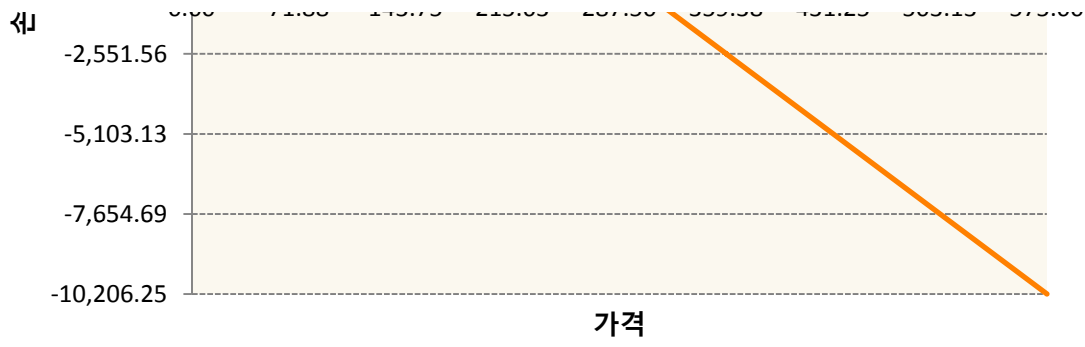
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



KR4201NB2877-2018-11 콜287.5

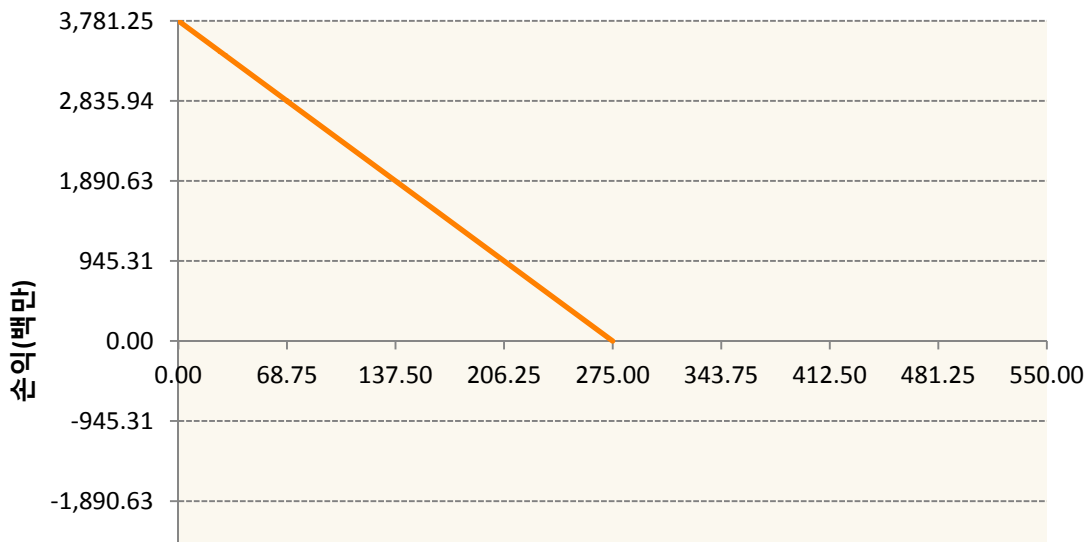


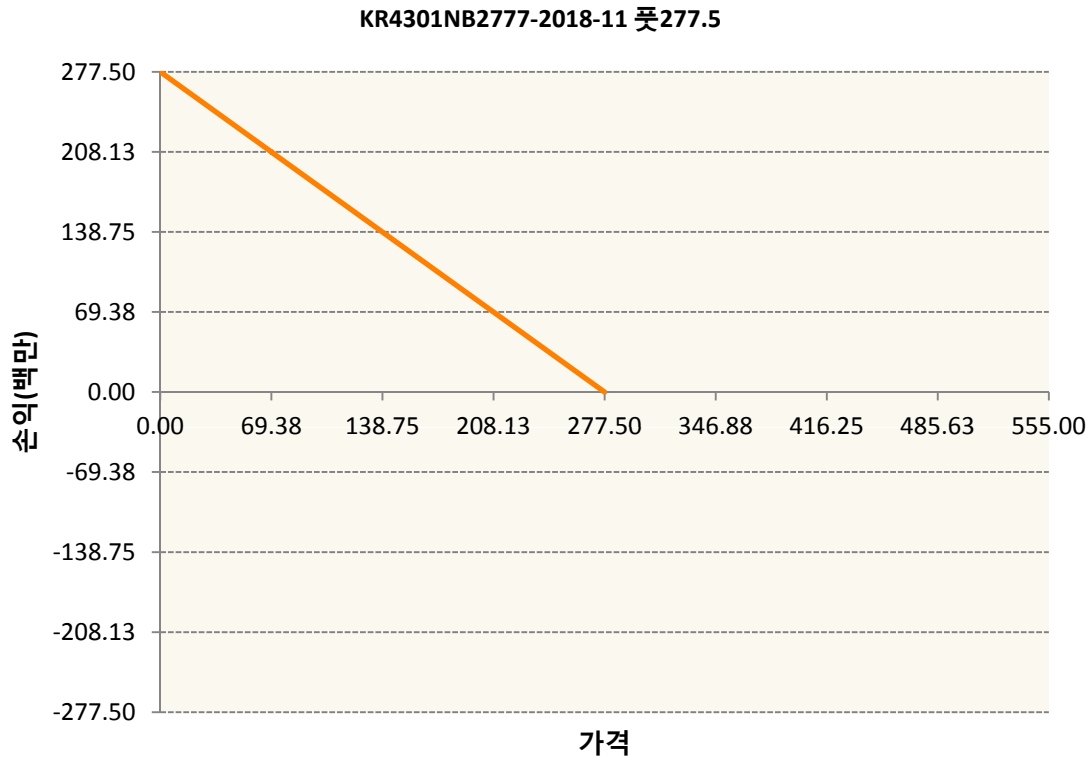
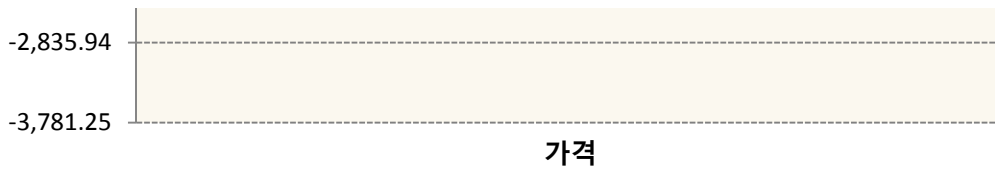


KR4201NB2901-2018-11 콜290



KR4301NB2751-2018-11 풋275





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 1,066

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,066	-1,066	-1,066	-1,066	-1,066	-1,066	-1,066
-5.33%	-710	-710	-710	-710	-710	-710	-710
-2.67%	-355	-355	-355	-355	-355	-355	-355
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	355	355	355	355	355	355	355
5.33%	710	710	710	710	710	710	710
8.00%	1,066	1,066	1,066	1,066	1,066	1,066	1,066

KR4201NB28 2018-11 콜287.5 474

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	113	112	110	107	103	98	92
-5.33%	109	105	99	92	84	75	65
-2.67%	93	84	73	60	47	33	18

0%	51	35	18	0	-18	-37	-56
2.67%	-35	-56	-77	-98	-119	-141	-162
5.33%	-176	-197	-218	-239	-260	-281	-302
8.00%	-369	-385	-401	-419	-437	-455	-474

KR4201NB27 2018-11 콜290

561

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	116	115	113	110	106	101	95
-5.33%	113	109	104	97	88	78	67
-2.67%	99	89	78	64	49	33	16
0%	59	40	21	0	-22	-44	-67
2.67%	-31	-57	-83	-109	-136	-162	-189
5.33%	-188	-215	-243	-271	-298	-326	-354
8.00%	-414	-437	-460	-485	-510	-535	-561

KR4301NB27 2018-11 풋275

232

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	226	227	227	228	229	230	232
-5.33%	127	129	131	134	136	139	142
-2.67%	42	46	50	55	59	64	68
0%	-15	-10	-5	0	5	10	15
2.67%	-38	-36	-33	-29	-26	-22	-18
5.33%	-44	-44	-42	-41	-39	-37	-35
8.00%	-45	-45	-45	-44	-44	-43	-42

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

18

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%	10	11	11	11	11	11	11
-2.67%	4	4	4	5	5	5	6
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-4	-3	-3	-3	-2	-2	-2
5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-3
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4

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

(단위:백만원)

1,864

공시일	2018-10-19
기준일	2018-10-18

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

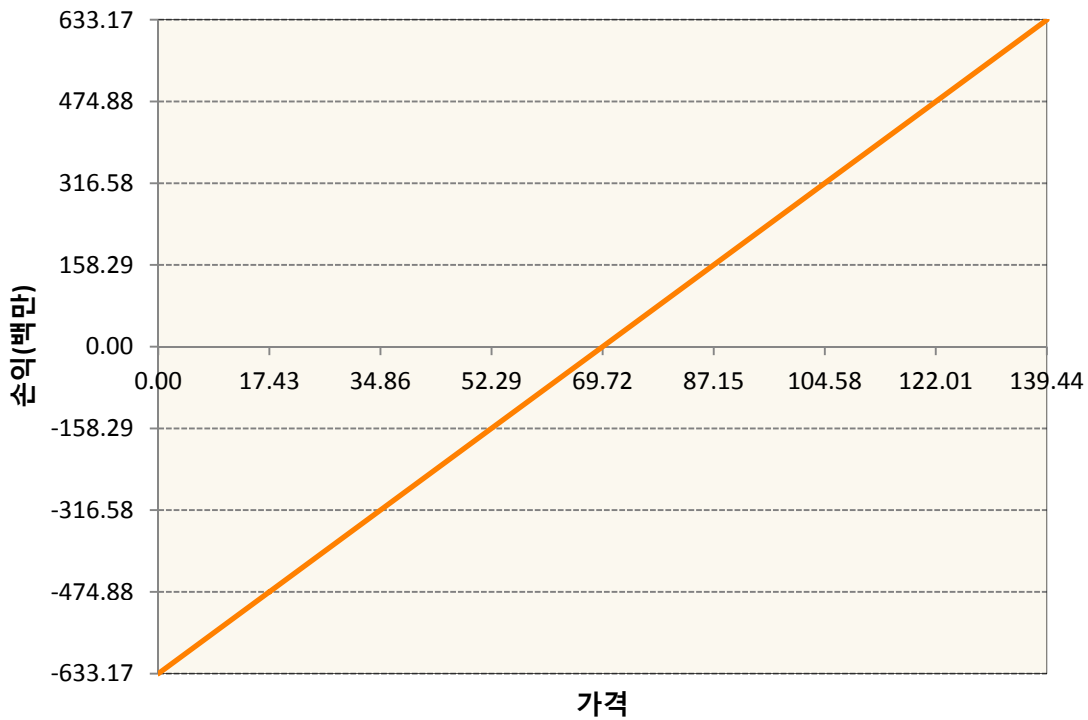
1. 계약금액

(단위:백만원)

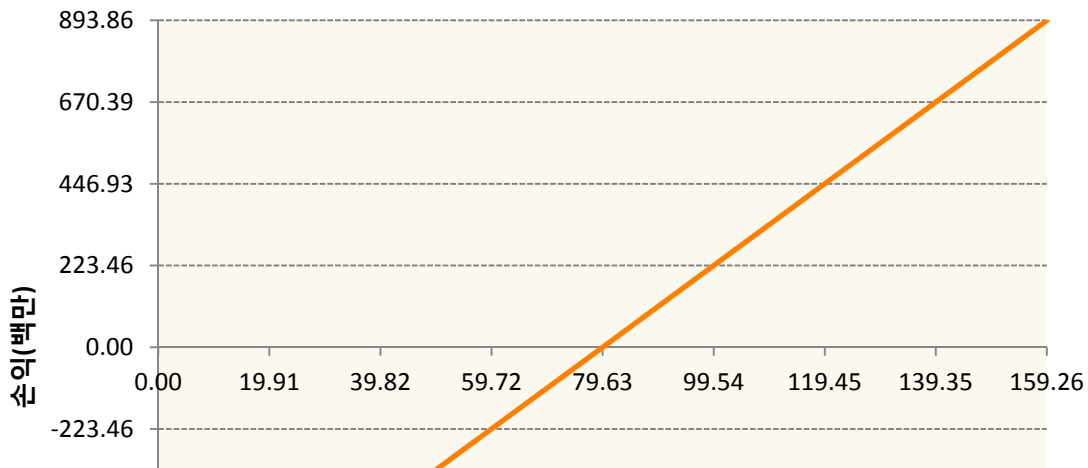
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,480	624	2,857	

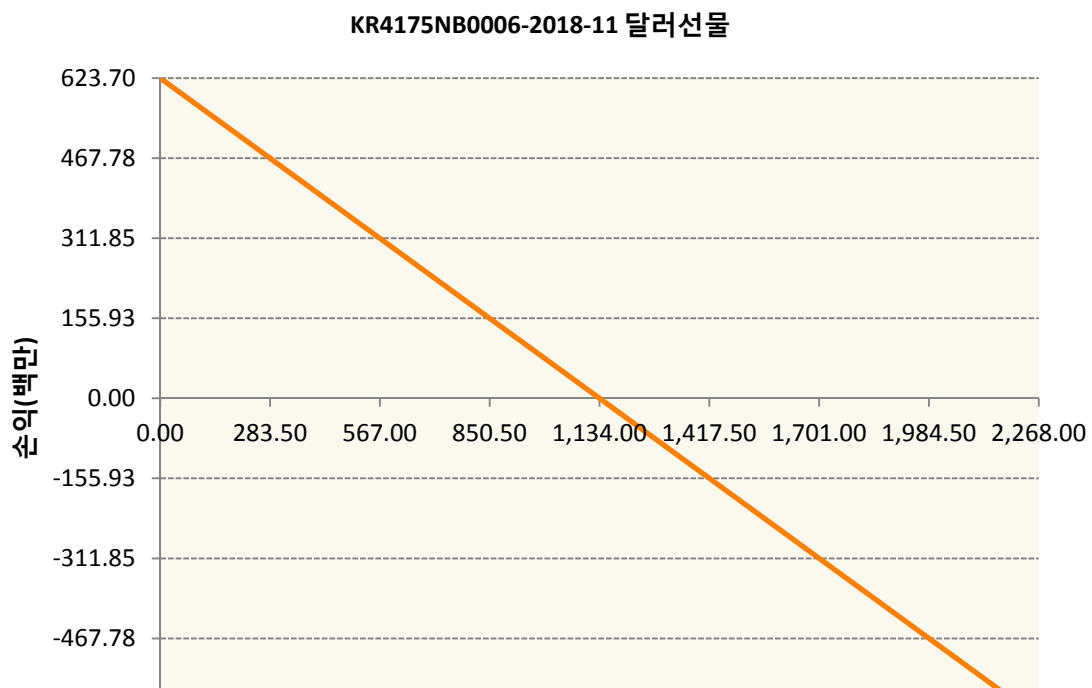
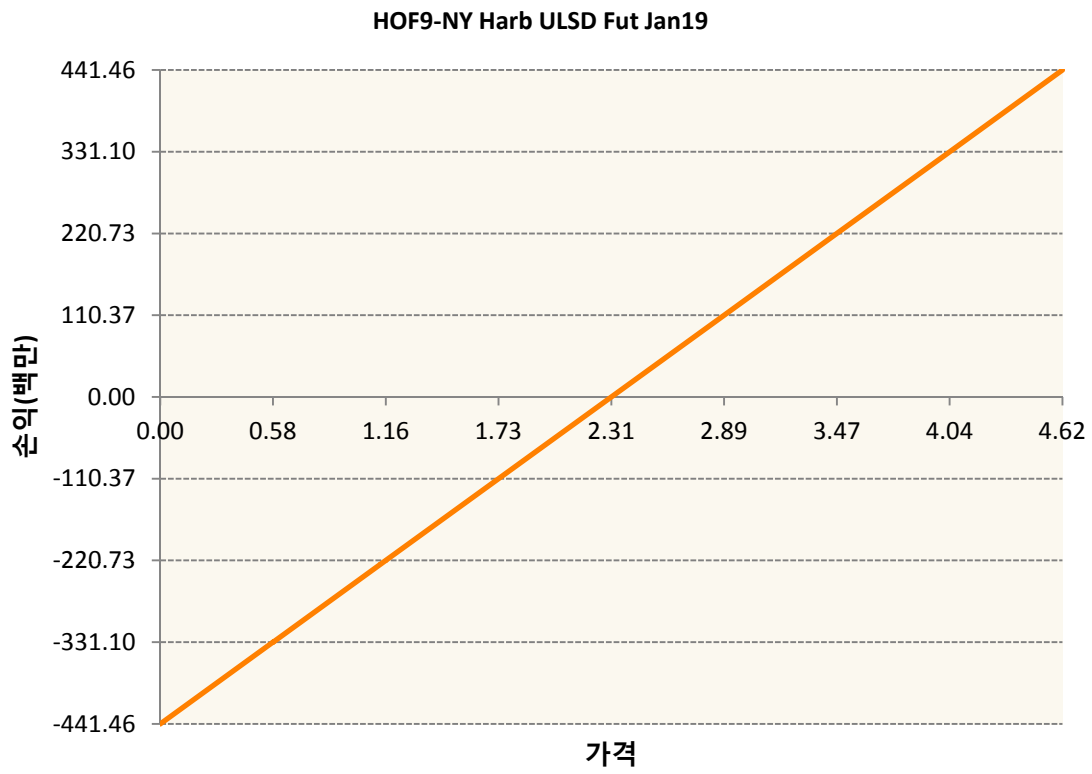
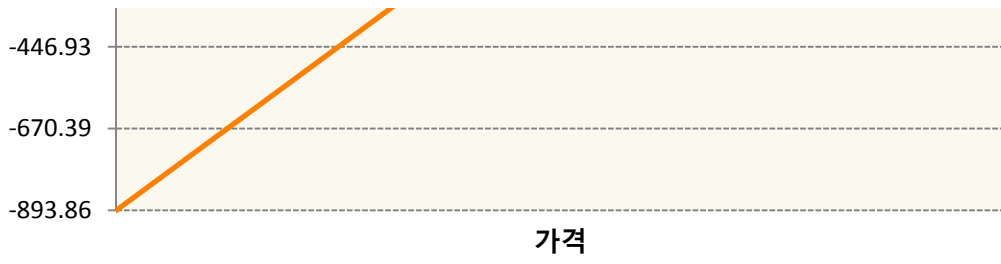
2. 만기시점의 손익구조

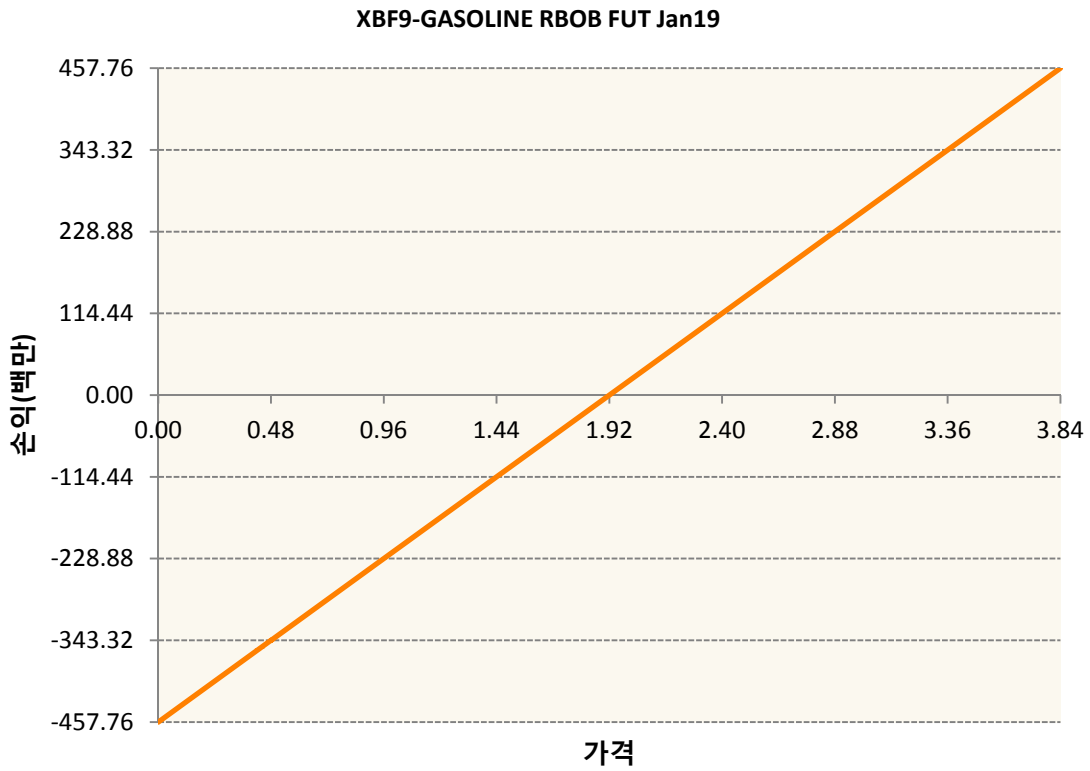
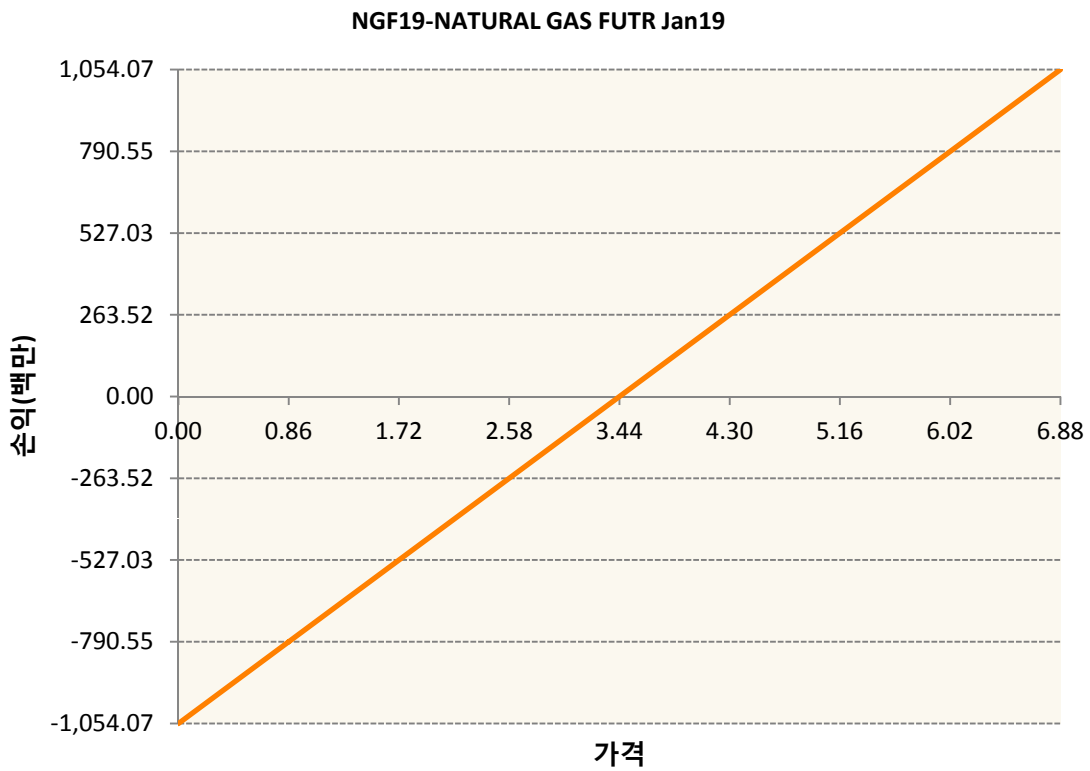
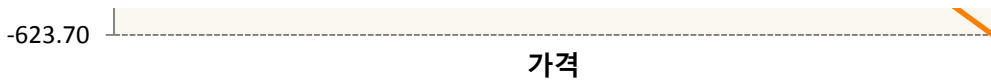
CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19



COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF9	WTI CRUDE FUTURE Jan19	51
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	72
HOF9	NY Harb ULSD Fut Jan19	35
KR4175NB0(2018-11 달러선물		50
NGF19	NATURAL GAS FUTR Jan19	84
XBF9	GASOLINE RBOB FUT Jan19	37

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

423

공시일	2018-10-19
기준일	2018-10-18

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

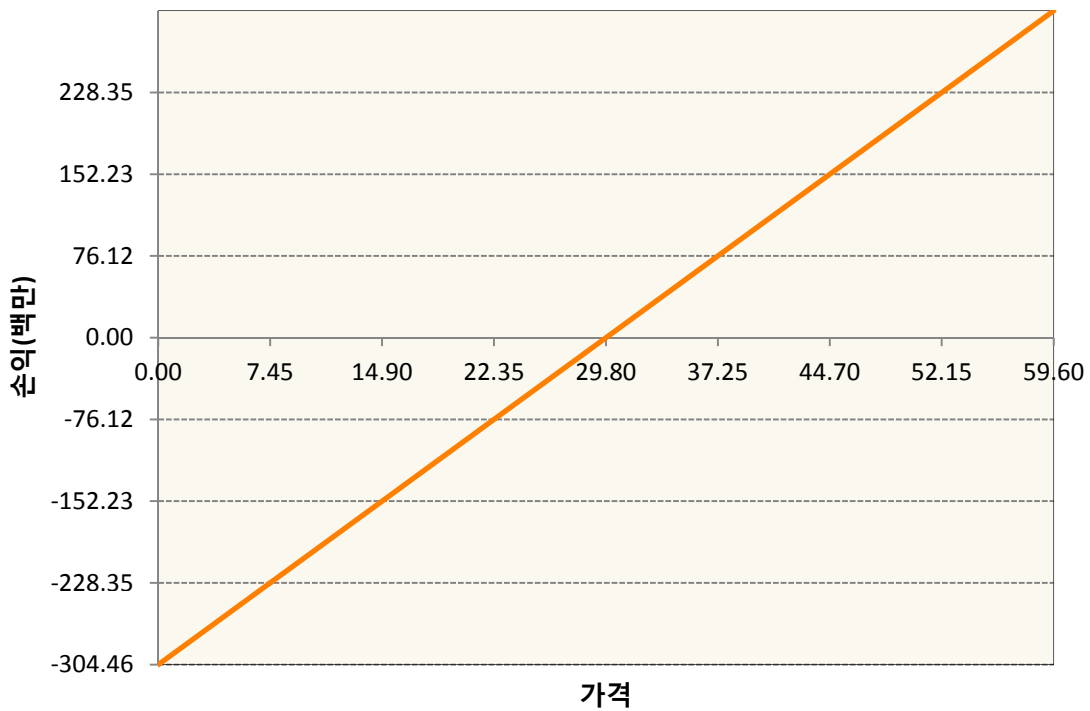
1. 계약금액

(단위:백만원)

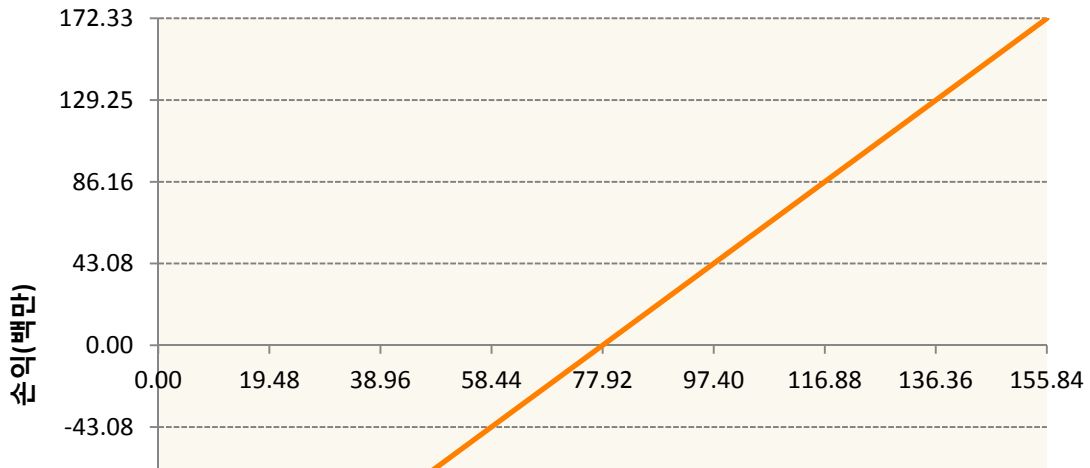
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,701	79	3,622	

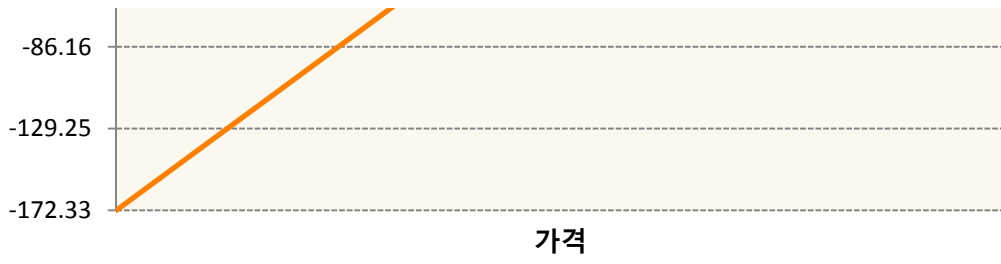
2. 만기시점의 손익구조

BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19

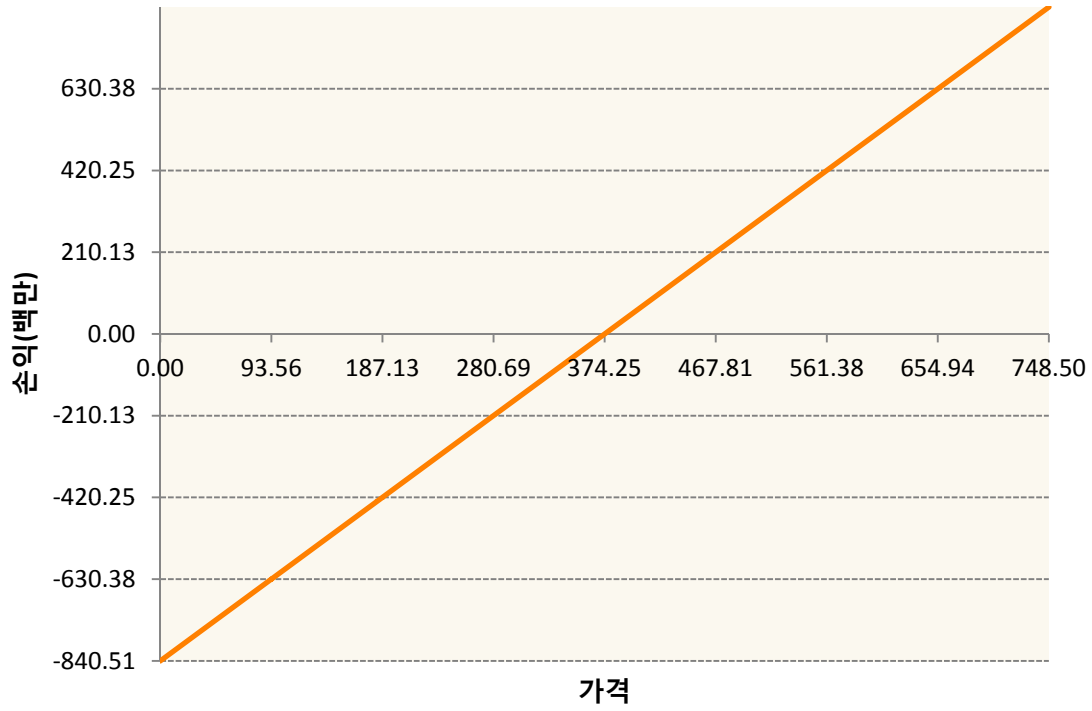


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

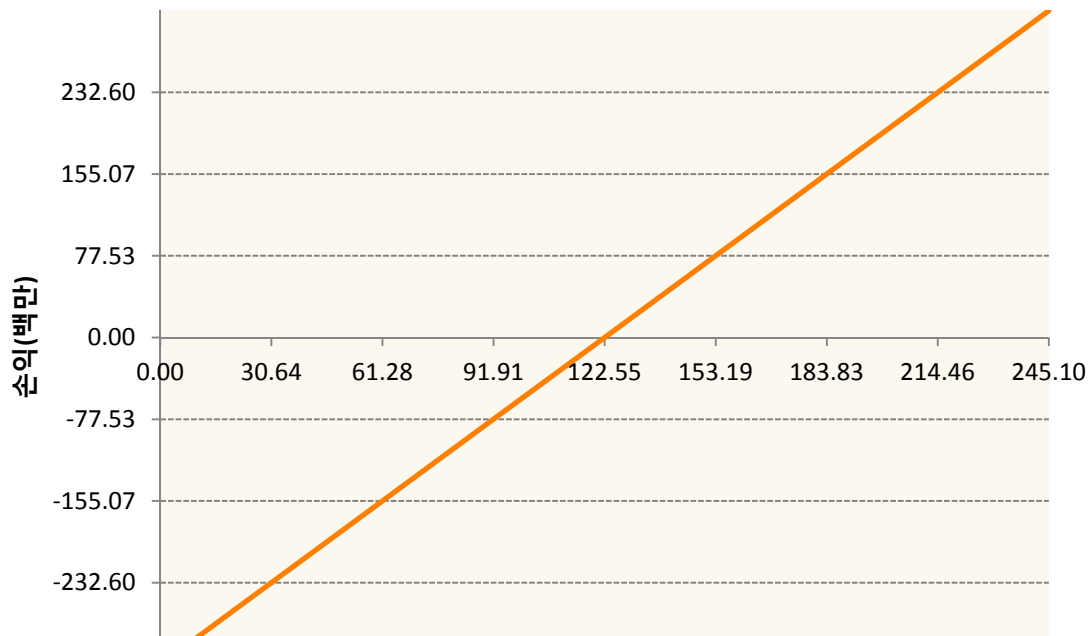


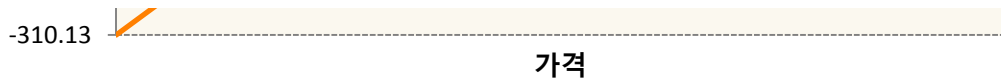


CZ8-CORN FUTURE DEC18

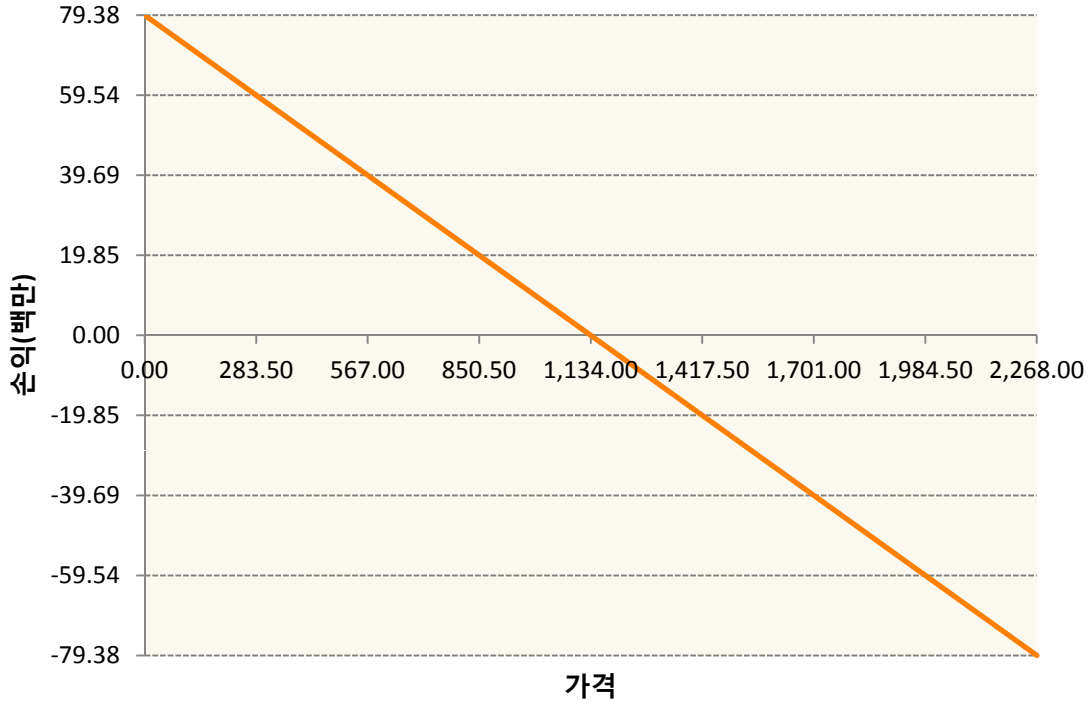


KCZ8-COFFEE 'C' FUTURE Dec18

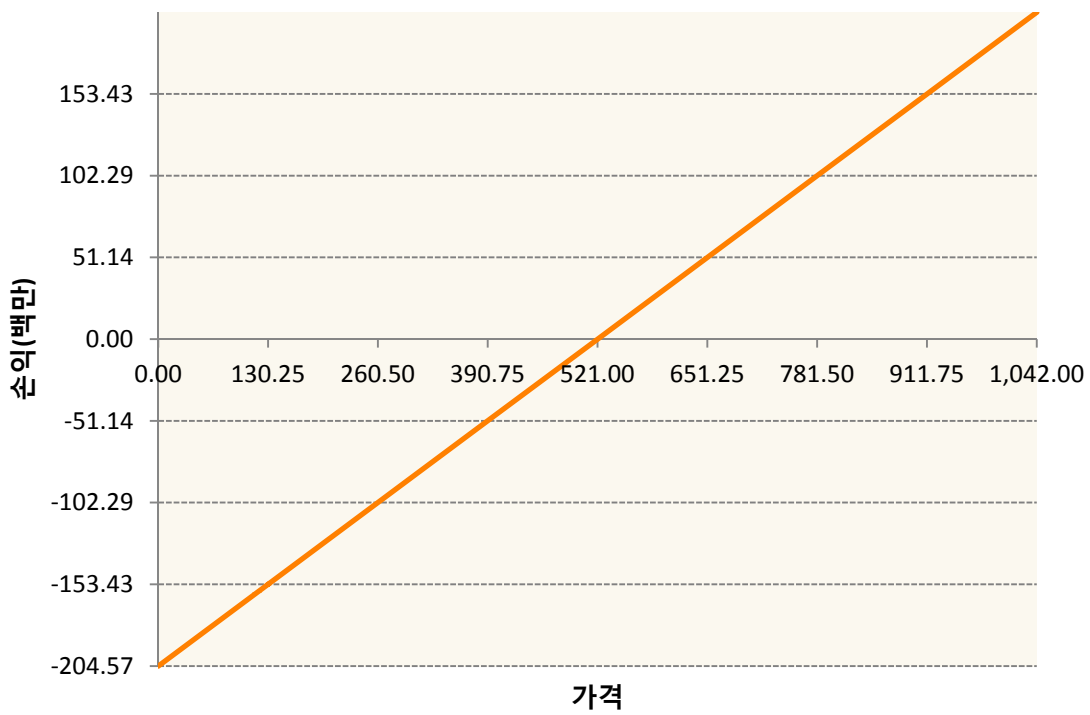




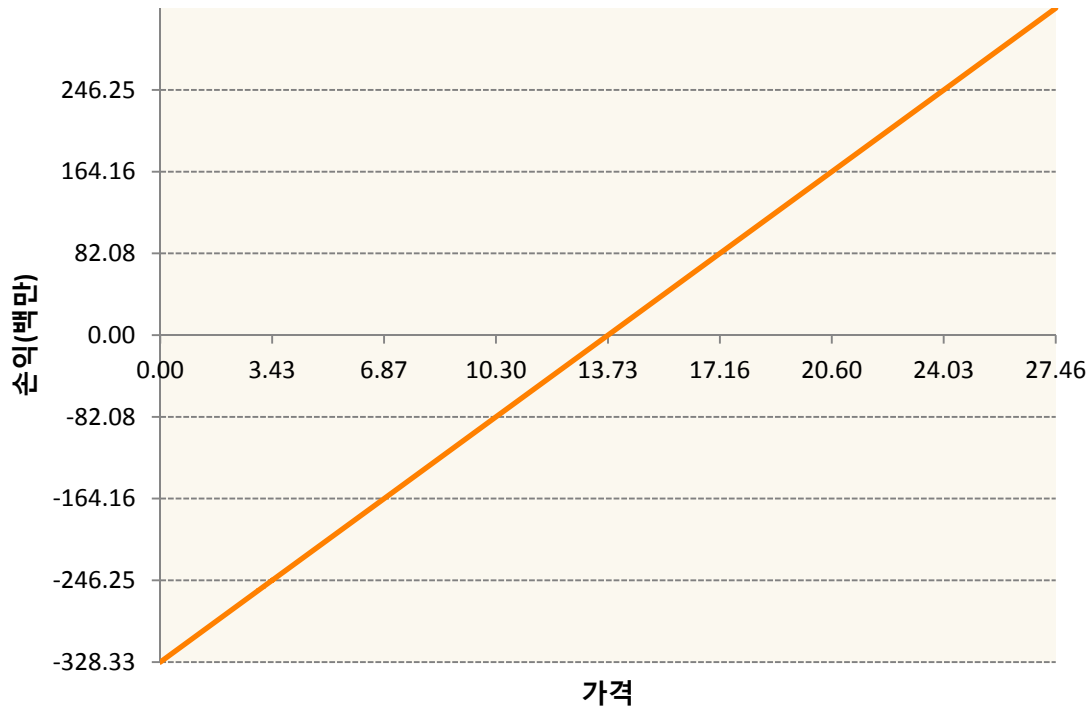
KR4175NB0006-2018-11 달러선물



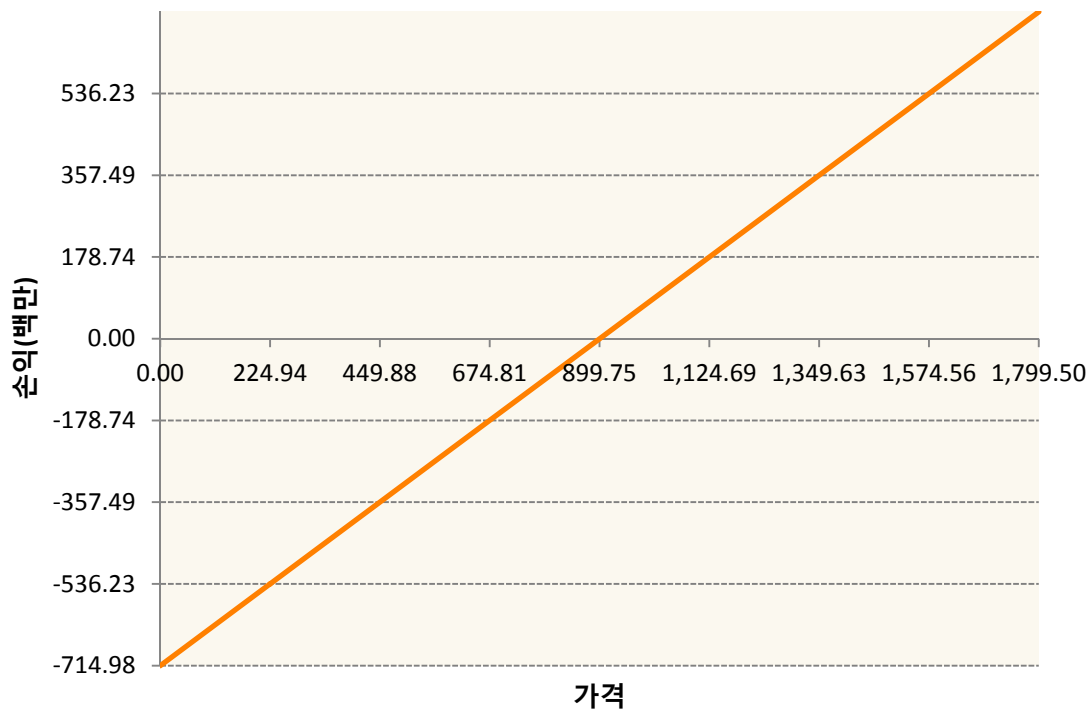
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

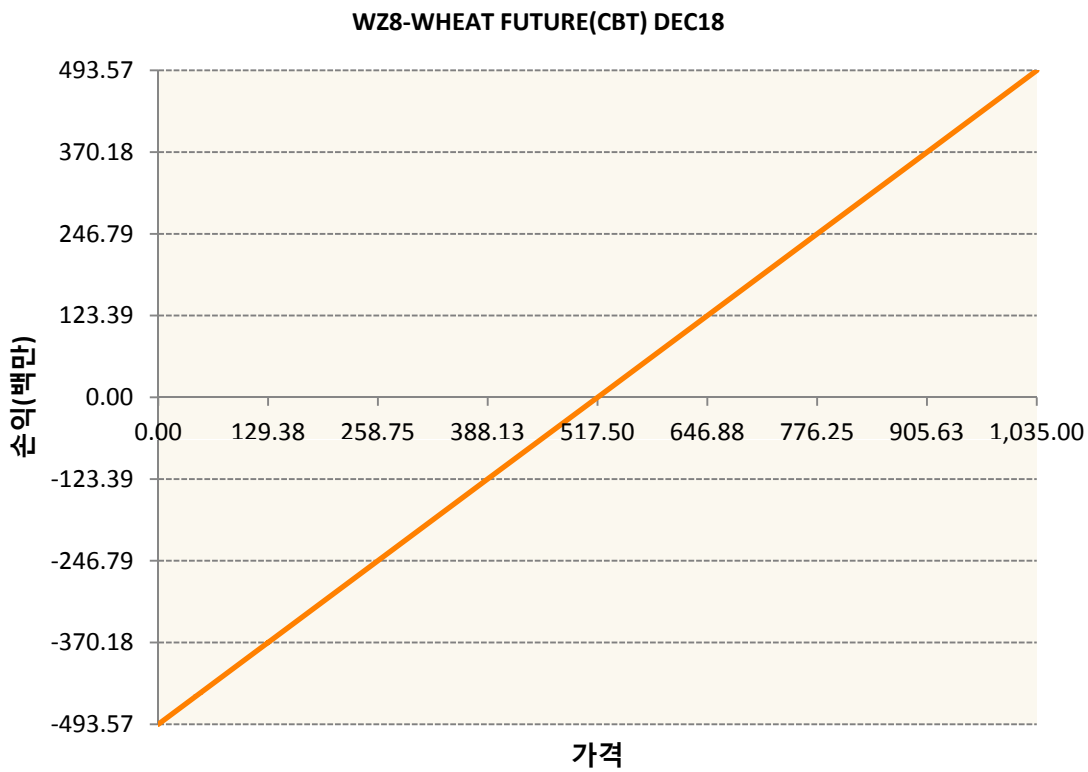
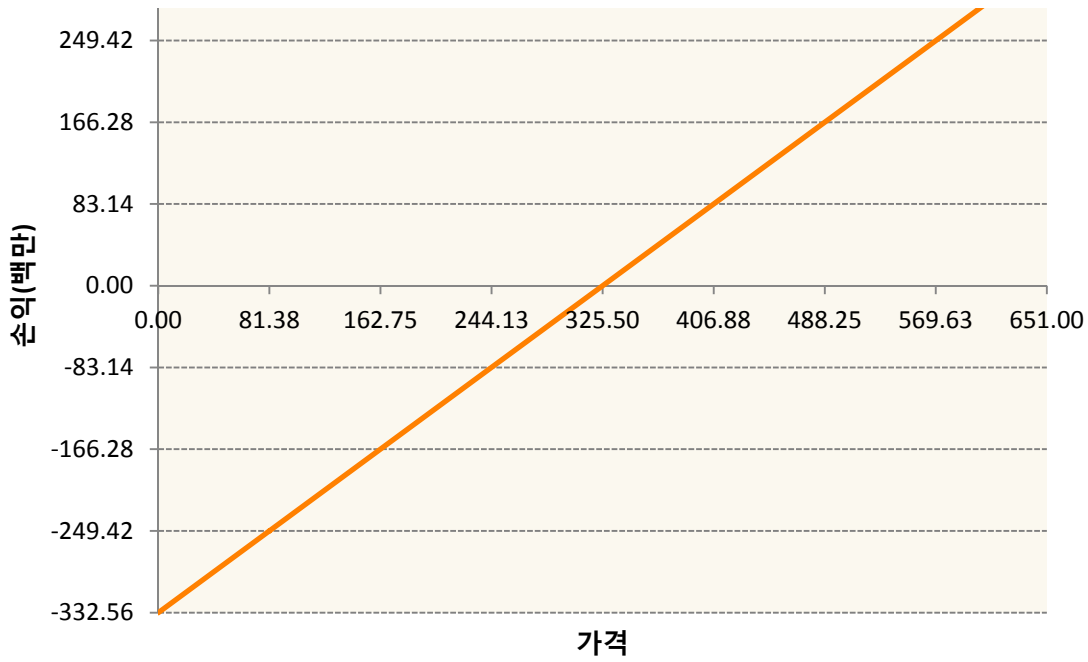


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19



SMF9-SOYBEAN MEAL FUTR Jan19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF9	SOYBEAN OIL FUTR Jan19	24
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	14
CZ8	CORN FUTURE DEC18	67
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	25
KR4175NB0	(2018-11 달러선물)	6

KWZ8	KC HRW WHEAT FUT DEC18	16
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	26
SF9	SOYBEAN FUTURE Jan19	57
SMF9	SOYBEAN MEAL FUTR Jan19	27
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	39

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

(단위:백만원)

323