

공시일	2018-10-22
기준일	2018-10-19

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	2018-10-22
기준일	2018-10-19

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

1,098

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

495

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-22
기준일	2018-10-19

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

250

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

341

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-22
기준일	2018-10-19

유로인덱스모(주식-파생형)

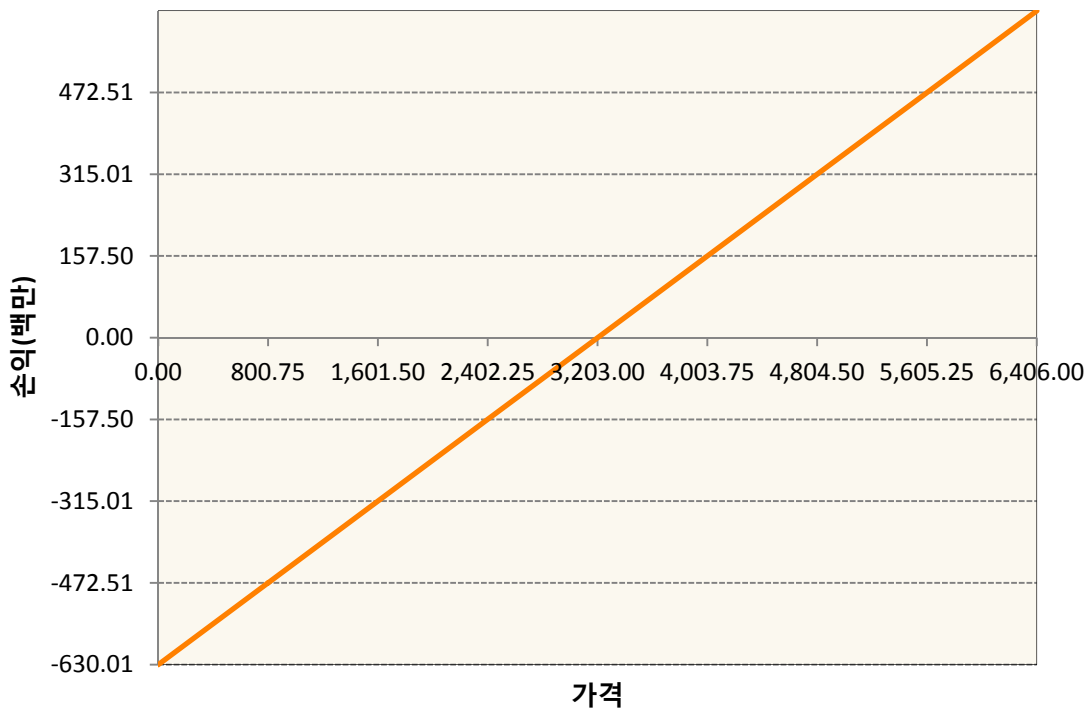
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	630	0	630	

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	2018-10-22
기준일	2018-10-19

차이나인덱스모(주식-파생형)

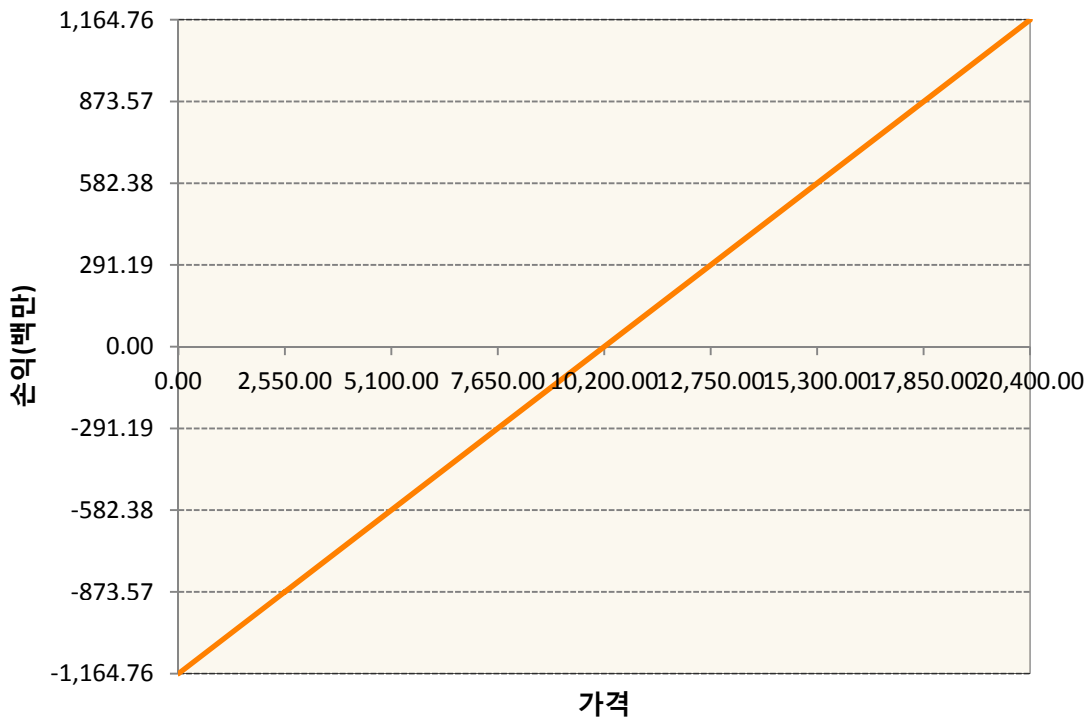
1. 계약금액

(단위:백만원)

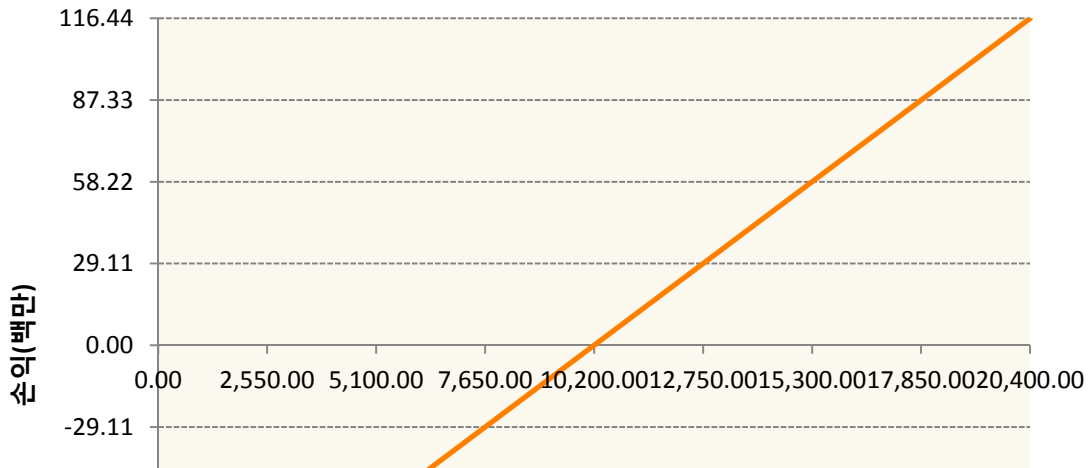
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,281	0	1,281	장내

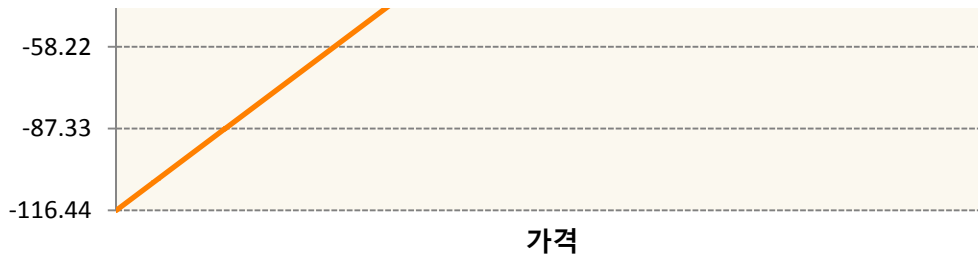
2. 만기시점의 손익구조

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	2018-10-22
기준일	2018-10-19

커버드콜모(주식혼합-파생형)

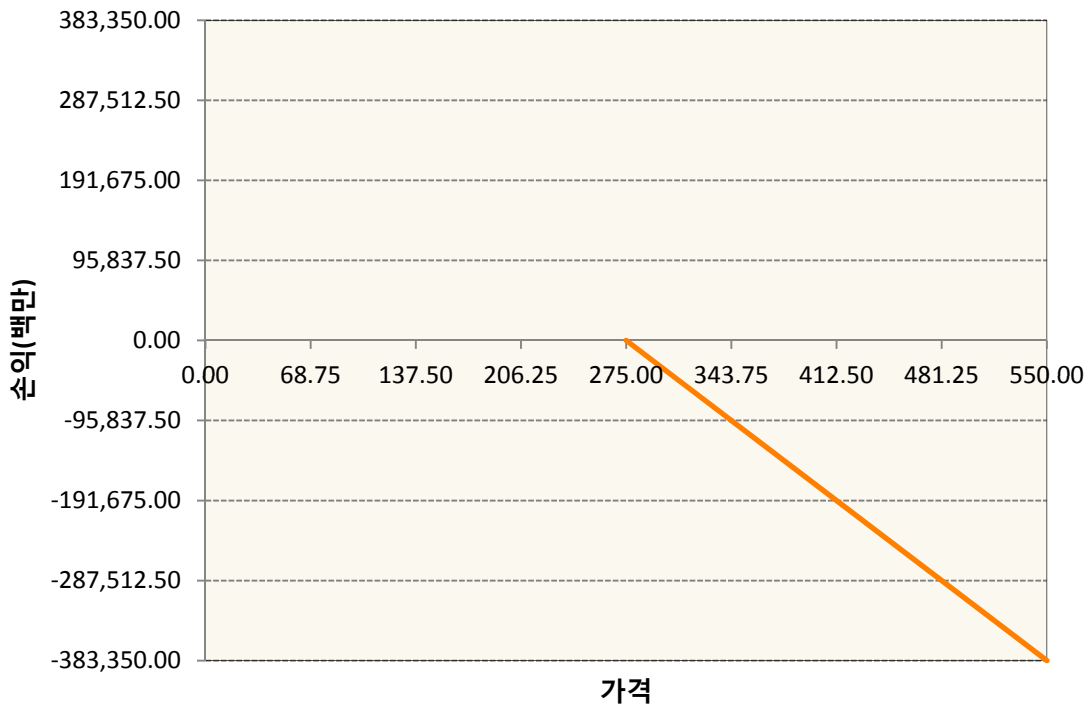
1. 계약금액

(단위:백만원)

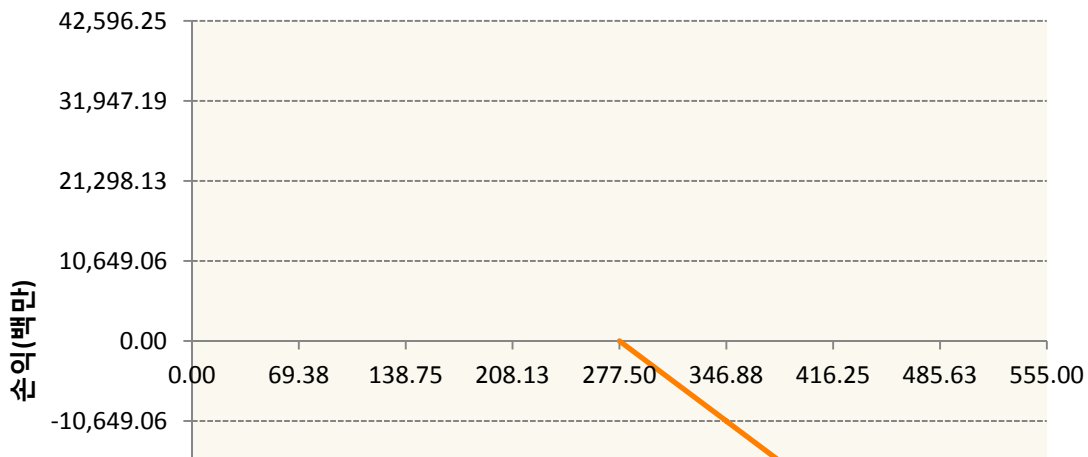
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	707,821	-707,821	장내

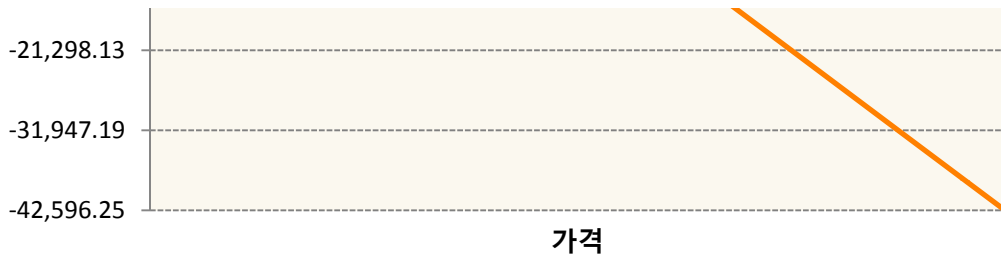
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

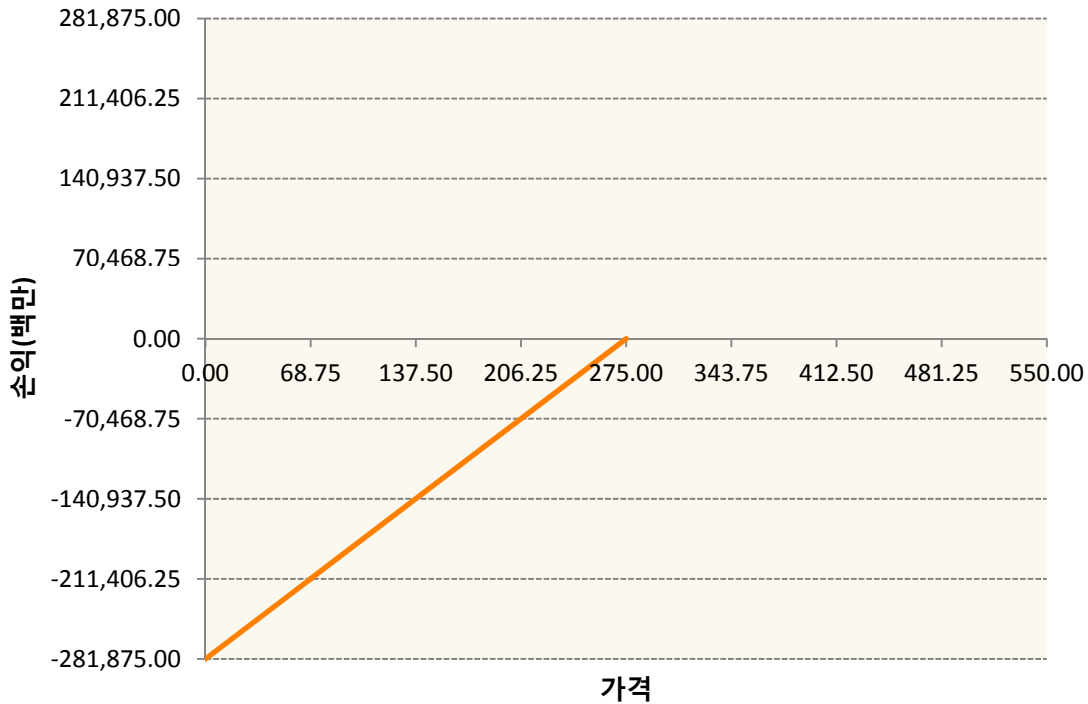


KR4201NB2778-2018-11 콜277.5





KR4301NB2751-2018-11 풋275



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NB27 2018-11 콜275

25,707

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,693	11,427	11,107	10,737	10,324	9,874	9,393
-5.33%	10,449	9,919	9,353	8,758	8,139	7,501	6,847
-2.67%	7,518	6,772	6,021	5,266	4,507	3,746	2,983
0%	2,294	1,534	769	0	-772	-1,546	-2,321
2.67%	-5,154	-5,730	-6,341	-6,980	-7,642	-8,321	-9,014
5.33%	-14,183	-14,515	-14,905	-15,345	-15,829	-16,349	-16,900
8.00%	-24,050	-24,199	-24,401	-24,657	-24,962	-25,314	-25,707

KR4201NB27 2018-11 콜277.5

2,710

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,099	1,077	1,049	1,015	976	933	886

-5.33%	1,001	952	898	839	778	713	646
-2.67%	748	672	593	514	433	352	270
0%	261	174	87	0	-87	-174	-261
2.67%	-481	-554	-630	-707	-786	-866	-947
5.33%	-1,424	-1,471	-1,523	-1,580	-1,641	-1,705	-1,773
8.00%	-2,486	-2,509	-2,538	-2,573	-2,614	-2,660	-2,710

KR4301NB27 2018-11 풋275

16,842

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-16,471	-16,493	-16,528	-16,581	-16,650	-16,737	-16,842
-5.33%	-9,091	-9,222	-9,378	-9,557	-9,754	-9,969	-10,197
-2.67%	-2,823	-3,138	-3,459	-3,786	-4,116	-4,450	-4,785
0%	990	665	335	0	-338	-679	-1,021
2.67%	2,383	2,230	2,051	1,850	1,630	1,394	1,143
5.33%	2,662	2,627	2,573	2,499	2,405	2,290	2,156
8.00%	2,692	2,688	2,678	2,661	2,633	2,593	2,539

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

(단위:백만원)

45,913

공시일	2018-10-22
기준일	2018-10-19

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

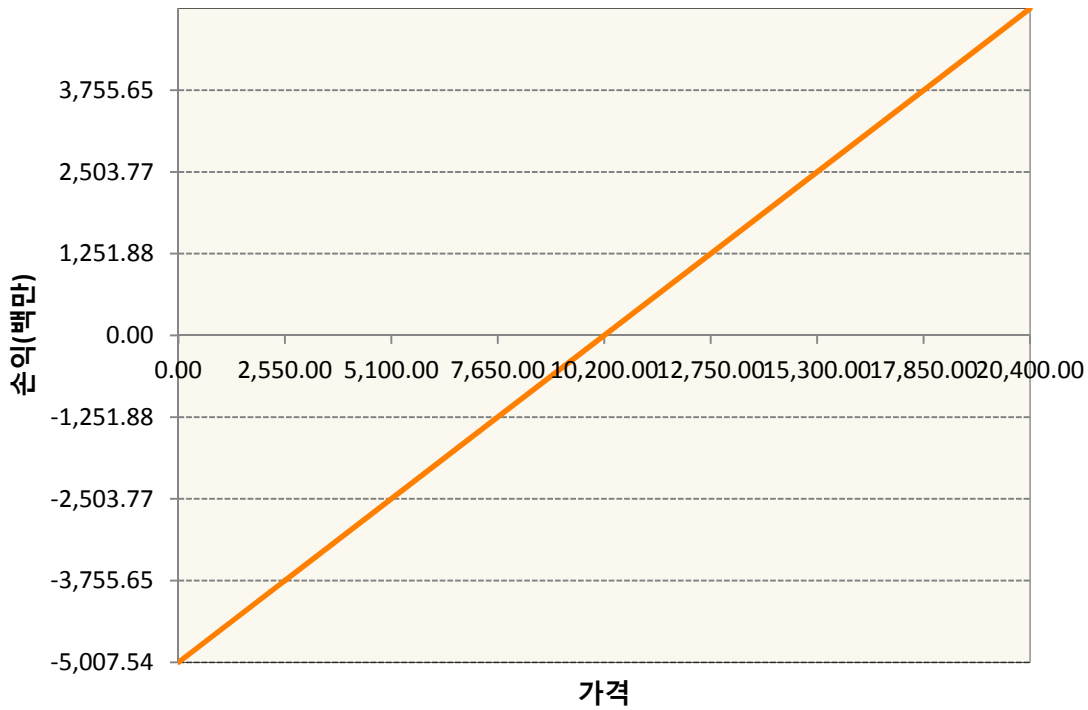
1. 계약금액

(단위:백만원)

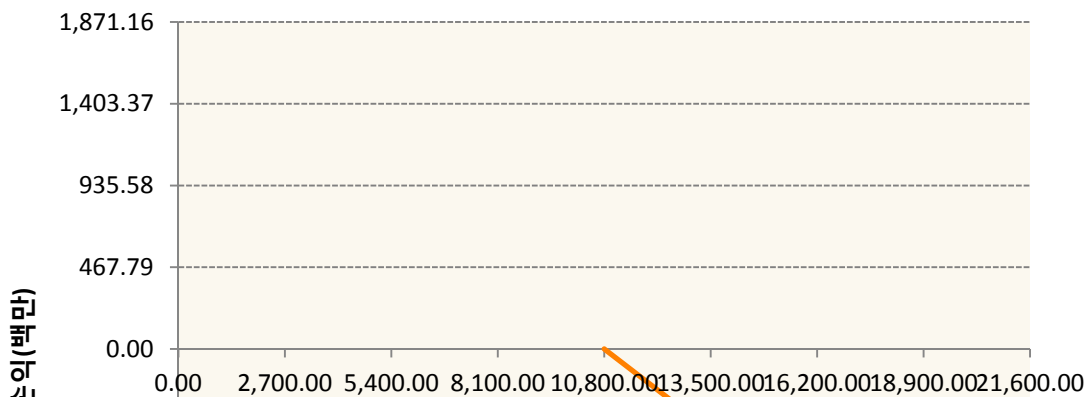
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,008	0	5,008	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,160	-12,160	장내

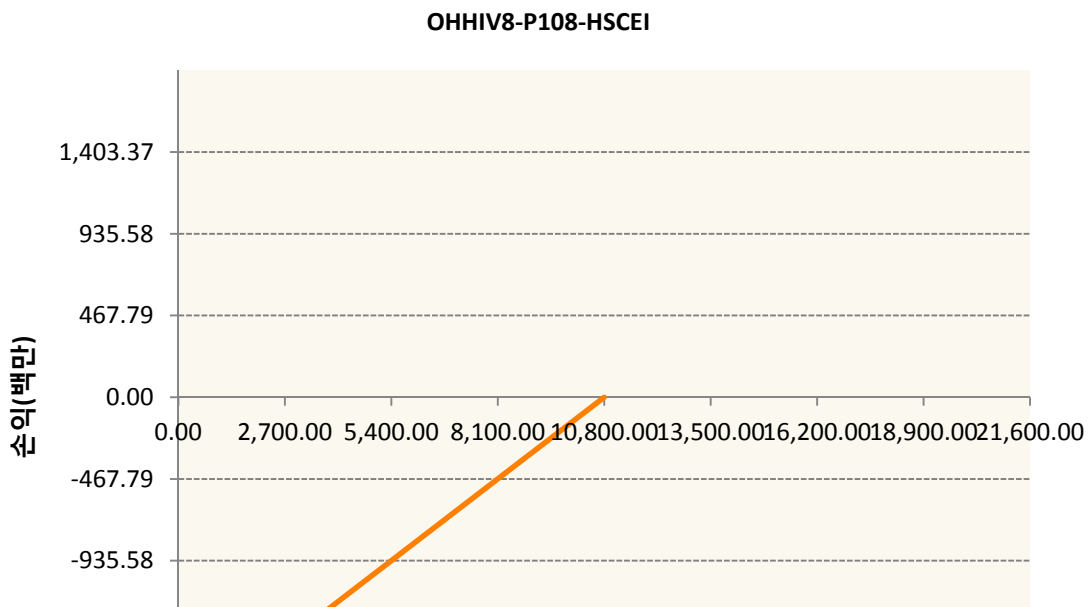
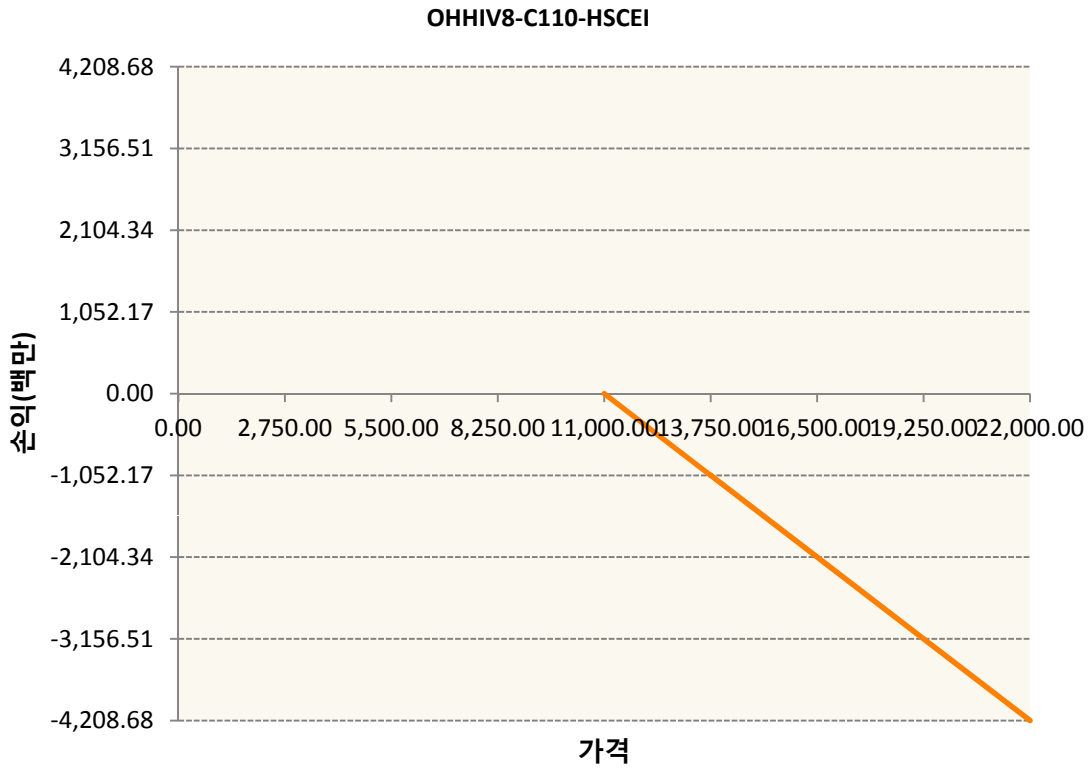
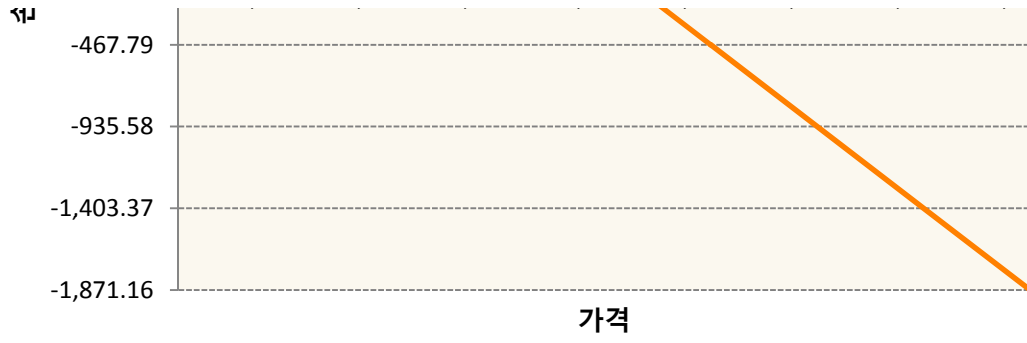
2. 만기시점의 손익구조

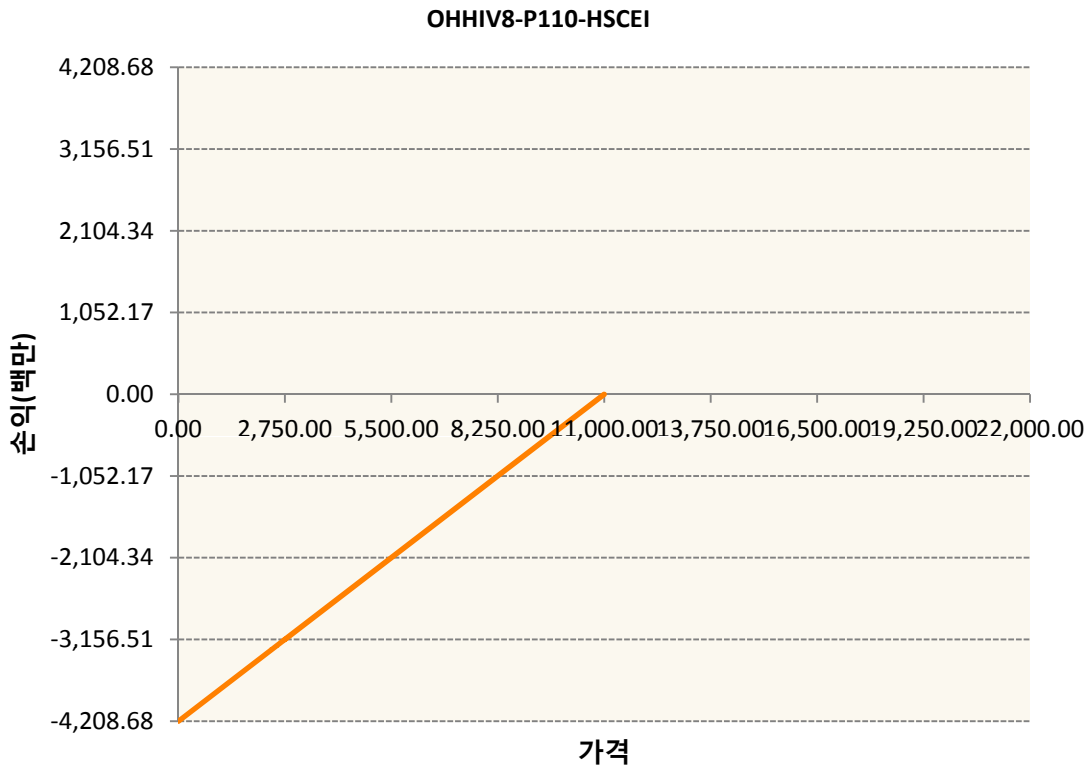
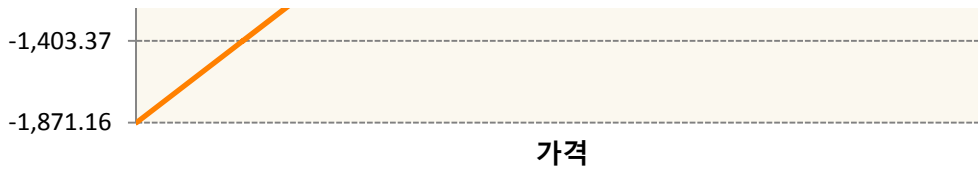
HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



OHHIV8-C108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	401
OHHIV8-C1C	HSCEI	150
OHHIV8-C11	HSCEI	337
OHHIV8-P1C	HSCEI	150
OHHIV8-P11	HSCEI	337

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,314

공시일	2018-10-22
기준일	2018-10-19

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

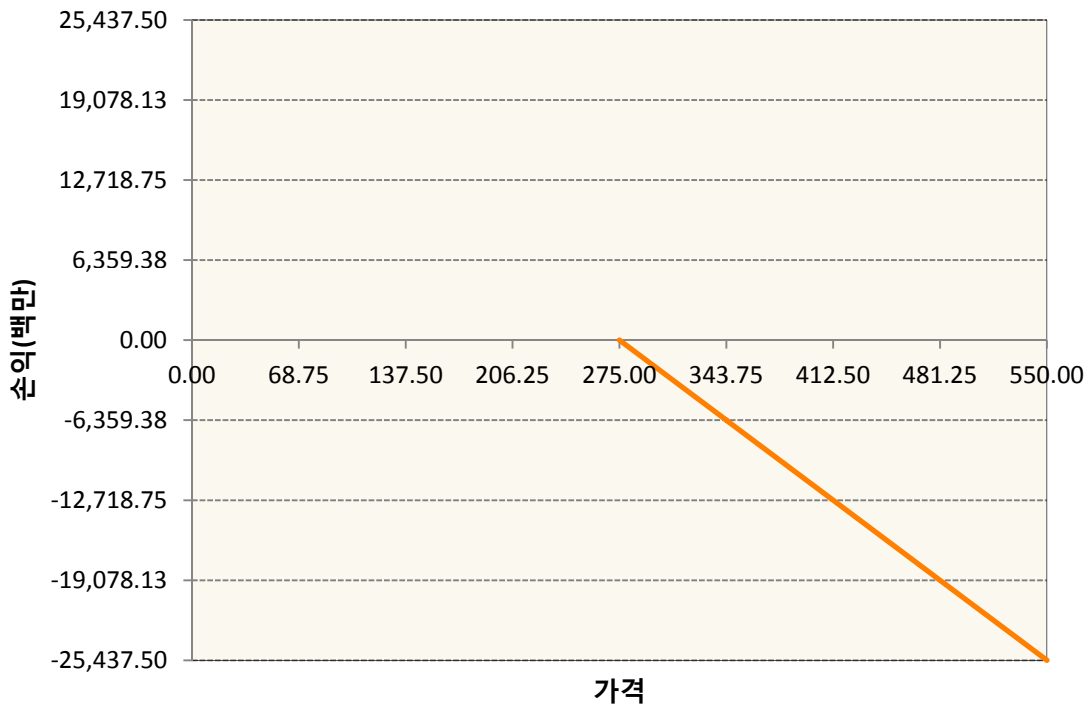
1. 계약금액

(단위:백만원)

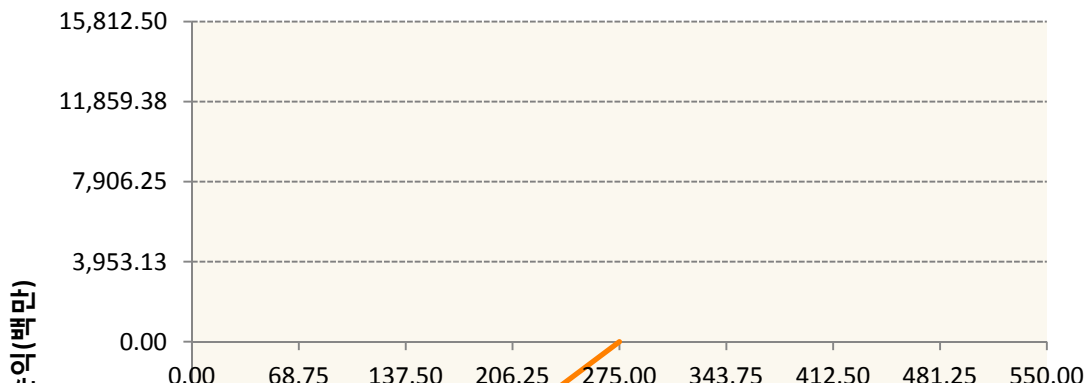
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	44,025	-44,025	장내

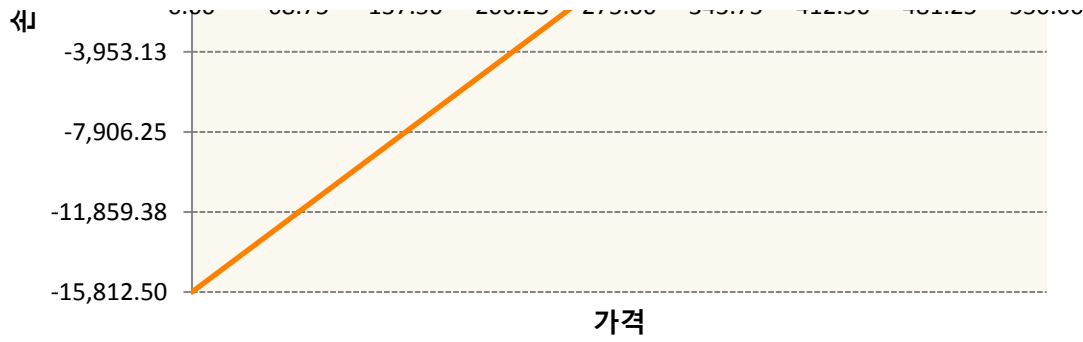
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

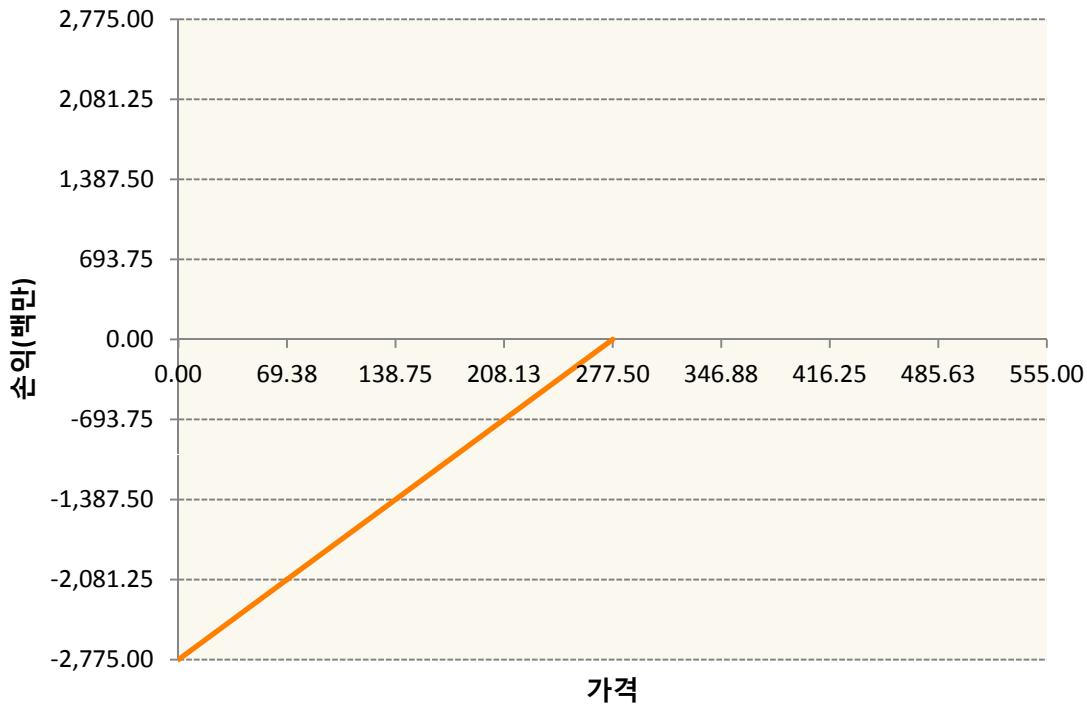


KR4301NB2751-2018-11 풋275





KR4301NB2777-2018-11 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							4,013	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-4,013	-4,013	-4,013	-4,013	-4,013	-4,013	-4,013	
-5.33%	-2,675	-2,675	-2,675	-2,675	-2,675	-2,675	-2,675	
-2.67%	-1,338	-1,338	-1,338	-1,338	-1,338	-1,338	-1,338	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	1,338	1,338	1,338	1,338	1,338	1,338	1,338	
5.33%	2,675	2,675	2,675	2,675	2,675	2,675	2,675	
8.00%	4,013	4,013	4,013	4,013	4,013	4,013	4,013	
KR4201NB27 2018-11 콜275							1,706	
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	776	758	737	712	685	655	623
-5.33%	693	658	621	581	540	498	454
-2.67%	499	449	400	349	299	249	198
0%	152	102	51	0	-51	-103	-154
2.67%	-342	-380	-421	-463	-507	-552	-598
5.33%	-941	-963	-989	-1,018	-1,050	-1,085	-1,121
8.00%	-1,596	-1,606	-1,619	-1,636	-1,656	-1,680	-1,706

KR4301NB27 2018-11 풋275

945

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-924	-925	-927	-930	-934	-939	-945
-5.33%	-510	-517	-526	-536	-547	-559	-572
-2.67%	-158	-176	-194	-212	-231	-250	-268
0%	56	37	19	0	-19	-38	-57
2.67%	134	125	115	104	91	78	64
5.33%	149	147	144	140	135	128	121
8.00%	151	151	150	149	148	145	142

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

177

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-175	-175	-175	-176	-176	-177	-177
-5.33%	-102	-103	-104	-105	-107	-108	-110
-2.67%	-36	-38	-41	-44	-47	-50	-53
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	31	29	26	24	21	19	16
5.33%	36	35	35	33	32	31	29
8.00%	37	37	36	36	36	35	34

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

(단위:백만원)

6,896

공시일	2018-10-22
기준일	2018-10-19

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

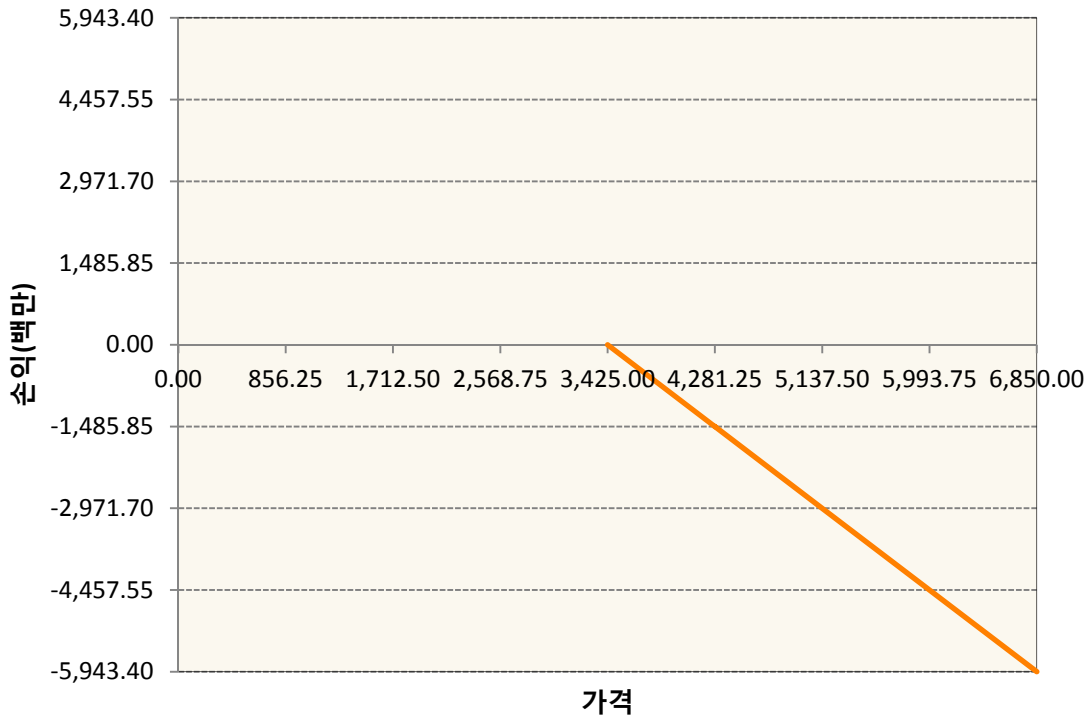
1. 계약금액

(단위:백만원)

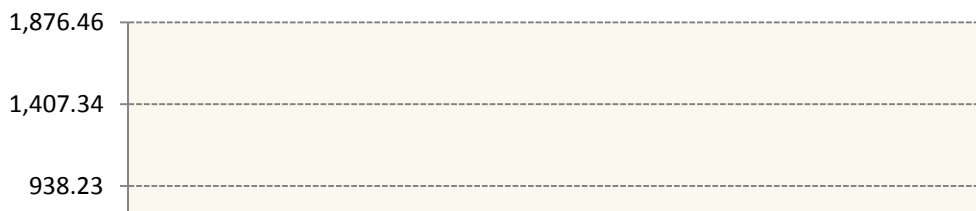
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	875	0	875	
누계	유가증권	스왑	34,198	0	34,198	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,640	-15,640	장내
누계	지수	스왑	52,574	0	52,574	장외

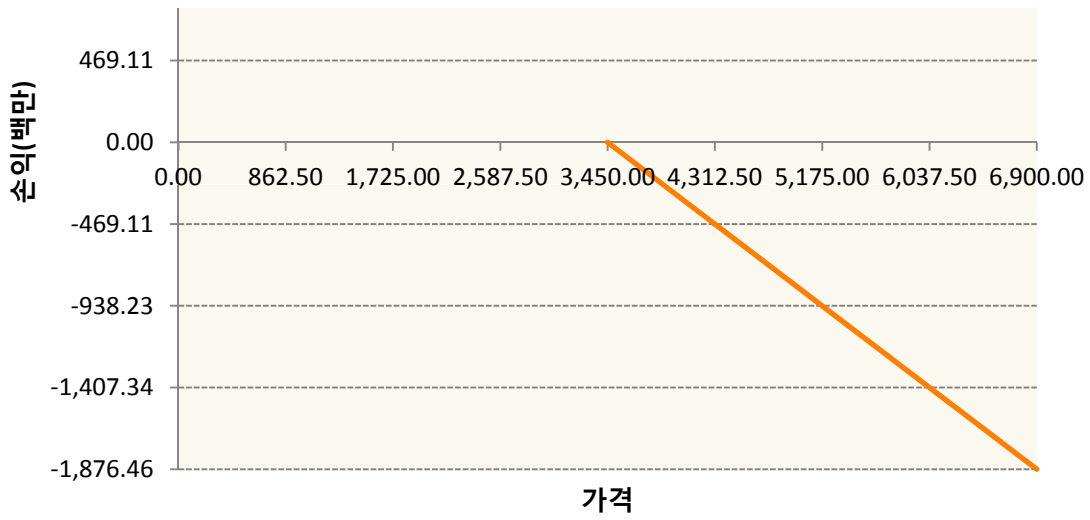
2. 만기시점의 손익구조

OESXV8-C3425-EURO STOXX 50

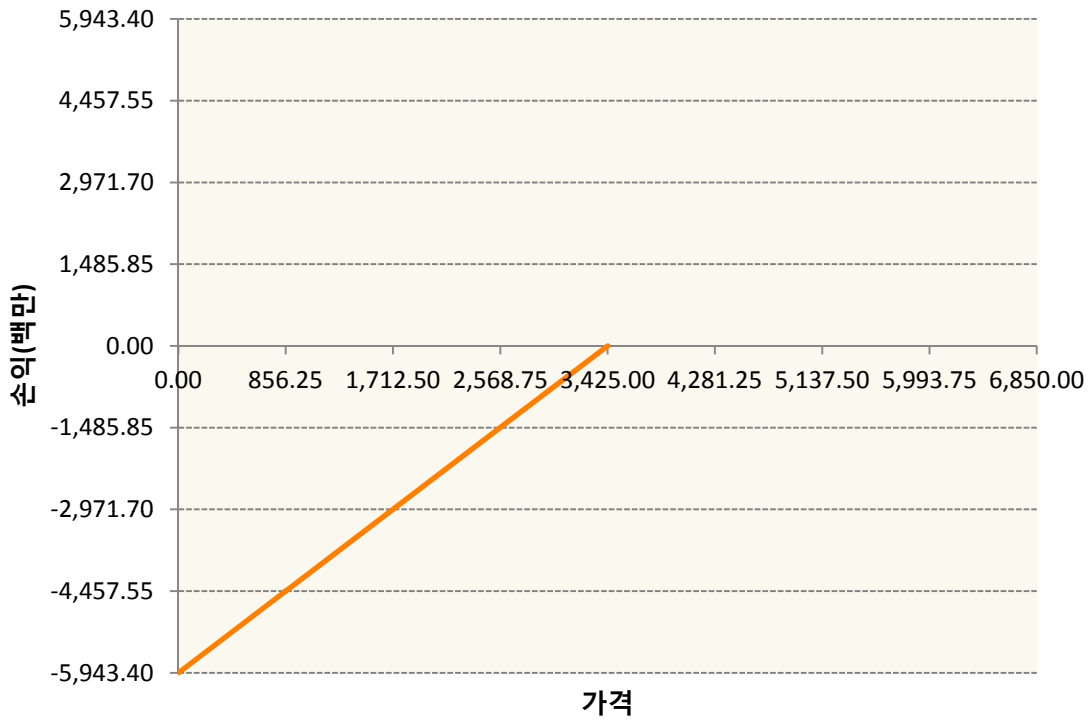


OESXV8-C3450-EURO STOXX 50

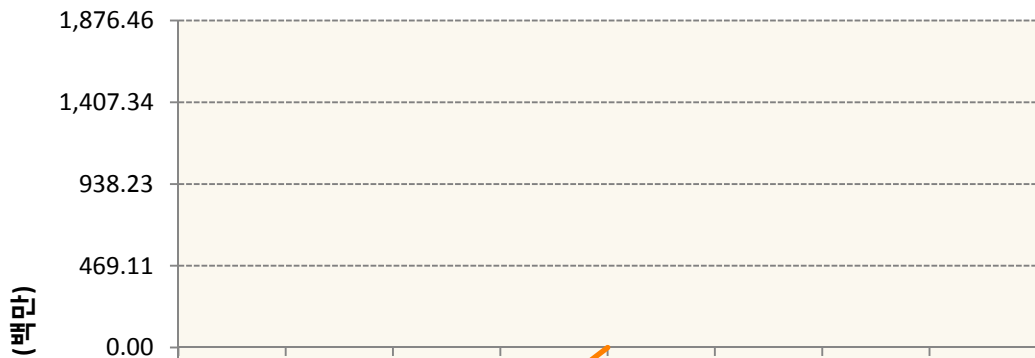


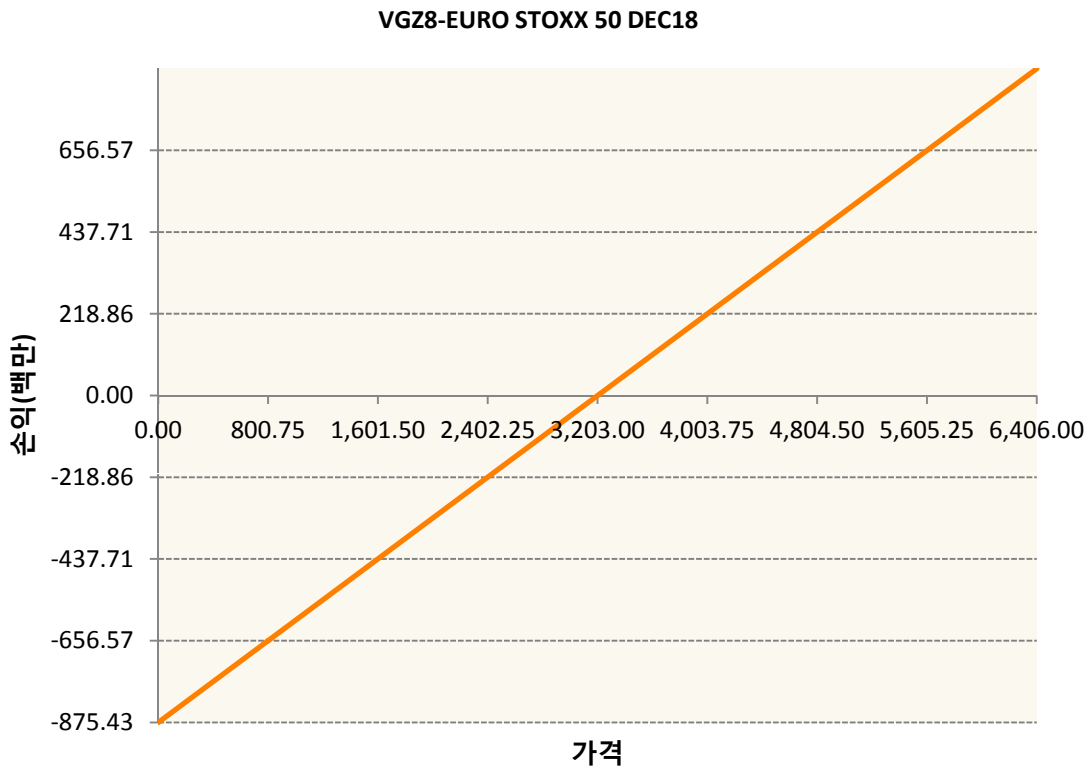
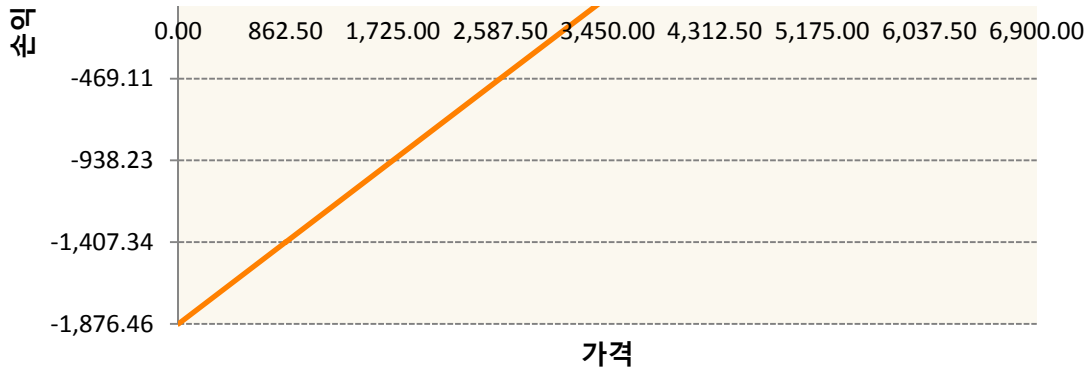


OESXV8-P3425-EURO STOXX 50



OESXV8-P3450-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		165
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		107
OESXV8-C34 EURO STOXX 50		475
OESXV8-C34 EURO STOXX 50		150
OESXV8-P34 EURO STOXX 50		475
OESXV8-P34 EURO STOXX 50		150
VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18		70

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

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

(단위:백만원)

1,134

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

(단위:백만원)

89

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

(단위:백만원)

134

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

(단위:백만원)

155

공시일	2018-10-22
기준일	2018-10-19

스마트KRX300인덱스목표전환형1

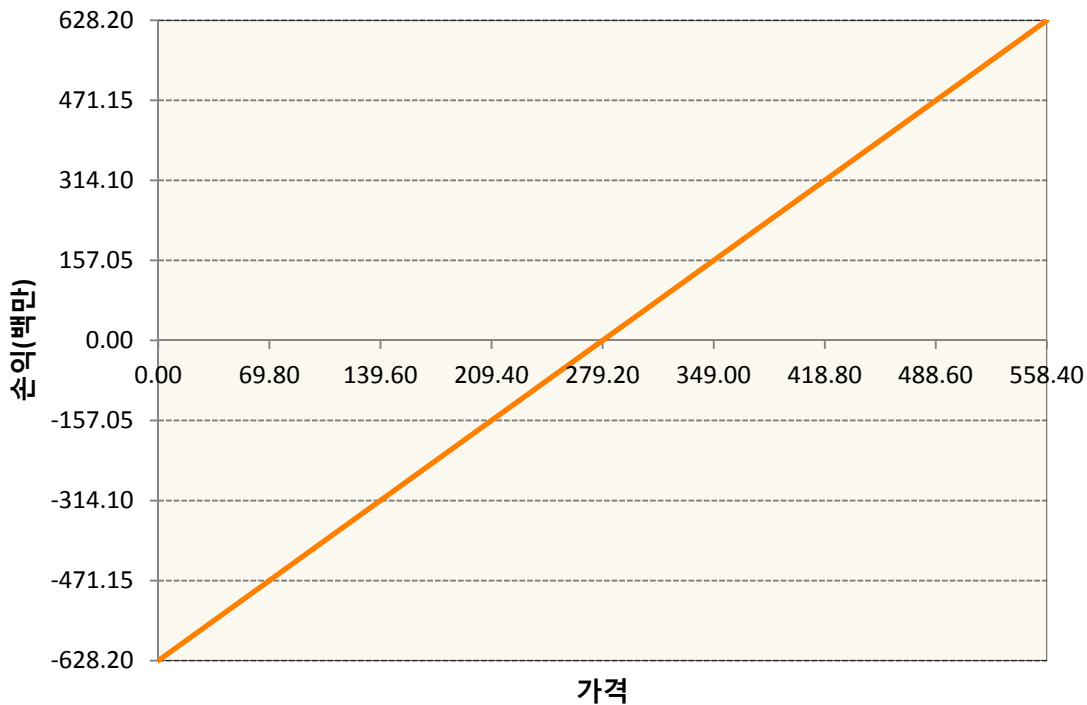
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	628	0	628	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	2018-10-22
기준일	2018-10-19

리디파인K200(주식혼합-파생재간

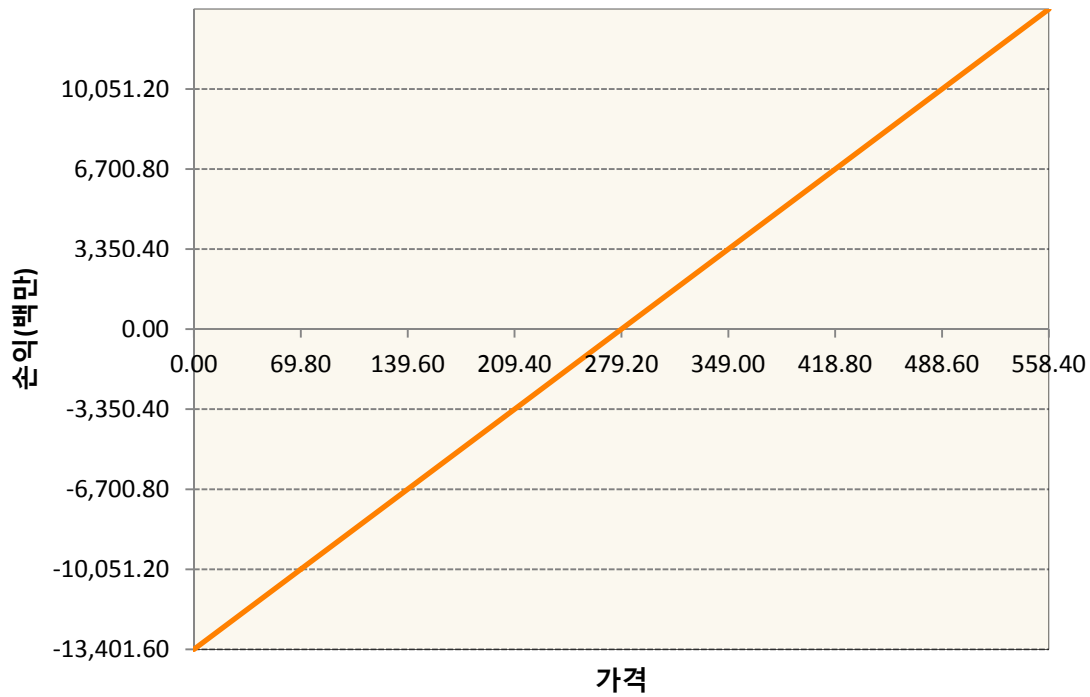
1. 계약금액

(단위:백만원)

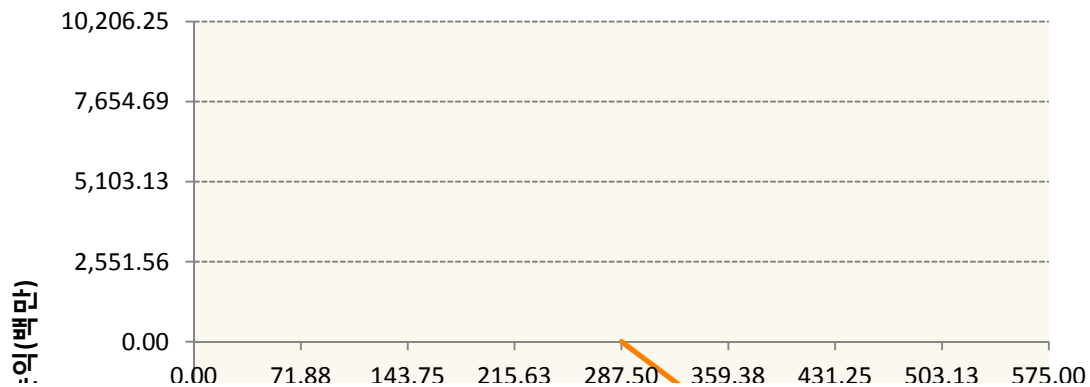
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,402	0	13,402	장내
누계	유가증권	옵션	4,059	23,401	-19,343	장내

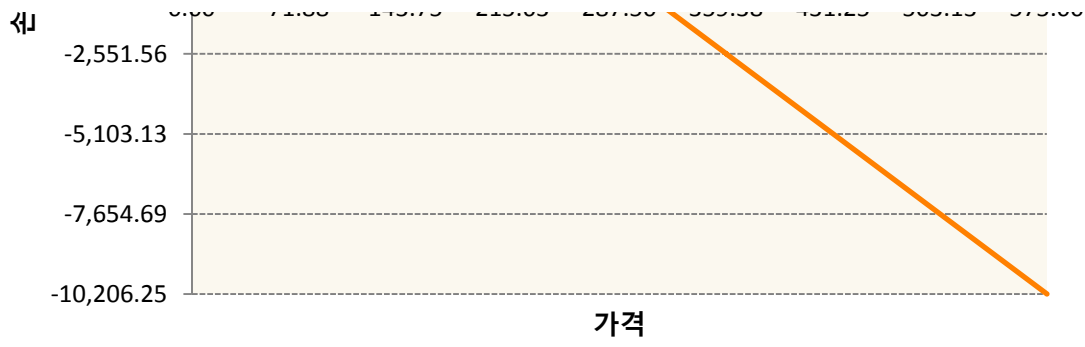
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



KR4201NB2877-2018-11 콜287.5

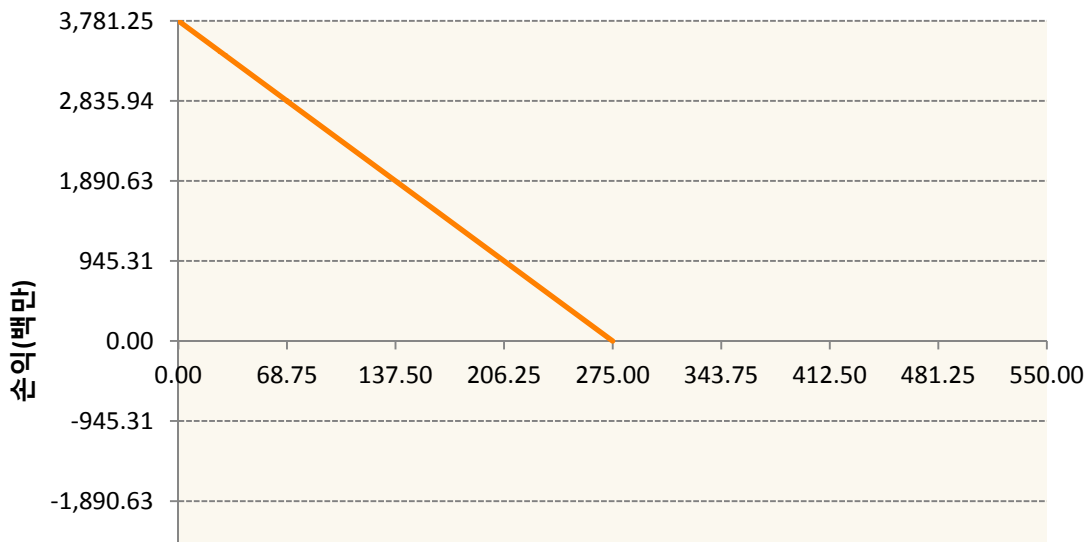


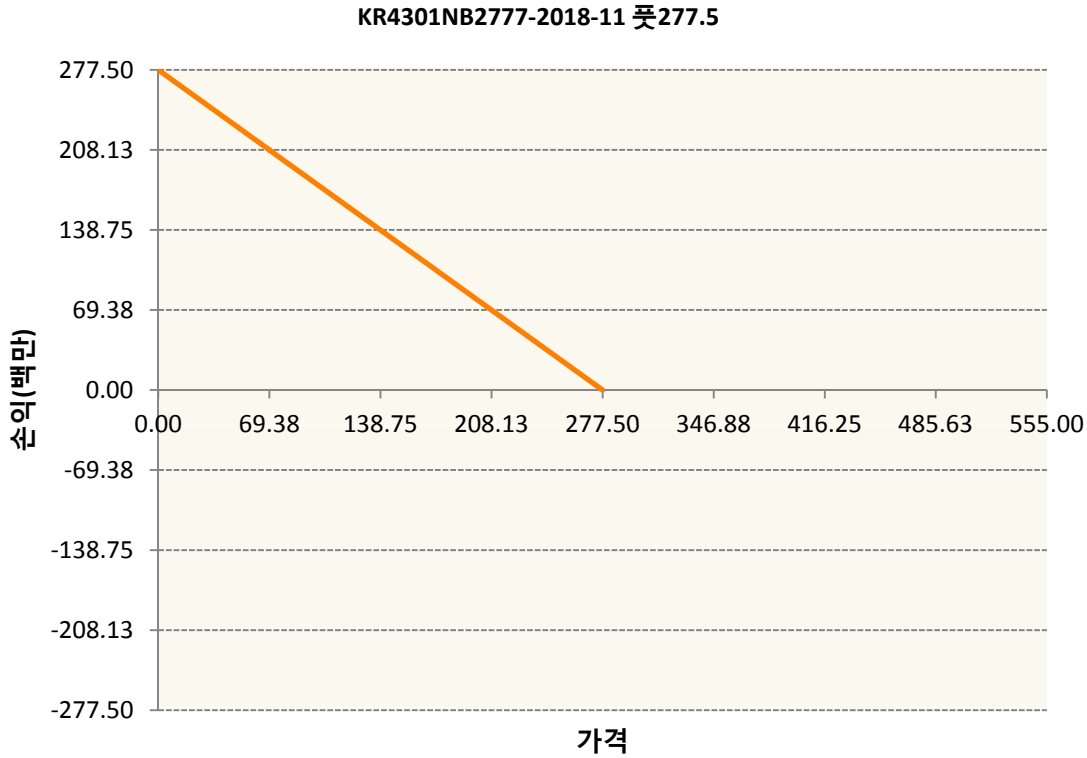
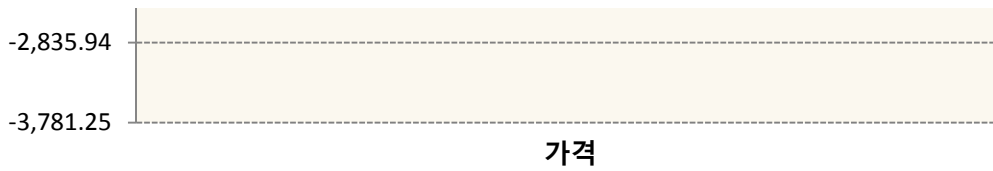


KR4201NB2901-2018-11 콜290



KR4301NB2751-2018-11 풋275





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 1,070

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,070	-1,070	-1,070	-1,070	-1,070	-1,070	-1,070
-5.33%	-713	-713	-713	-713	-713	-713	-713
-2.67%	-357	-357	-357	-357	-357	-357	-357
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	357	357	357	357	357	357	357
5.33%	713	713	713	713	713	713	713
8.00%	1,070	1,070	1,070	1,070	1,070	1,070	1,070

KR4201NB282018-11 콜287.5 492

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	119	118	116	113	109	104	98
-5.33%	114	110	105	98	90	81	71
-2.67%	98	88	77	64	51	37	22

0%	52	35	18	0	-18	-37	-55
2.67%	-42	-63	-84	-104	-125	-146	-166
5.33%	-194	-213	-232	-252	-272	-292	-313
8.00%	-396	-409	-424	-440	-457	-474	-492

KR4201NB29 2018-11 콜290

582

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	122	121	119	117	113	107	101
-5.33%	119	115	109	102	94	84	72
-2.67%	104	94	82	68	53	37	20
0%	60	41	21	0	-22	-44	-67
2.67%	-38	-64	-90	-116	-142	-168	-194
5.33%	-207	-234	-260	-287	-313	-340	-367
8.00%	-446	-467	-488	-511	-534	-558	-582

KR4301NB27 2018-11 풋275

226

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	221	221	222	222	223	225	226
-5.33%	122	124	126	128	131	134	137
-2.67%	38	42	46	51	55	60	64
0%	-13	-9	-4	0	5	9	14
2.67%	-32	-30	-28	-25	-22	-19	-15
5.33%	-36	-35	-35	-34	-32	-31	-29
8.00%	-36	-36	-36	-36	-35	-35	-34

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

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

(단위:백만원)

1,907

공시일	2018-10-22
기준일	2018-10-19

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

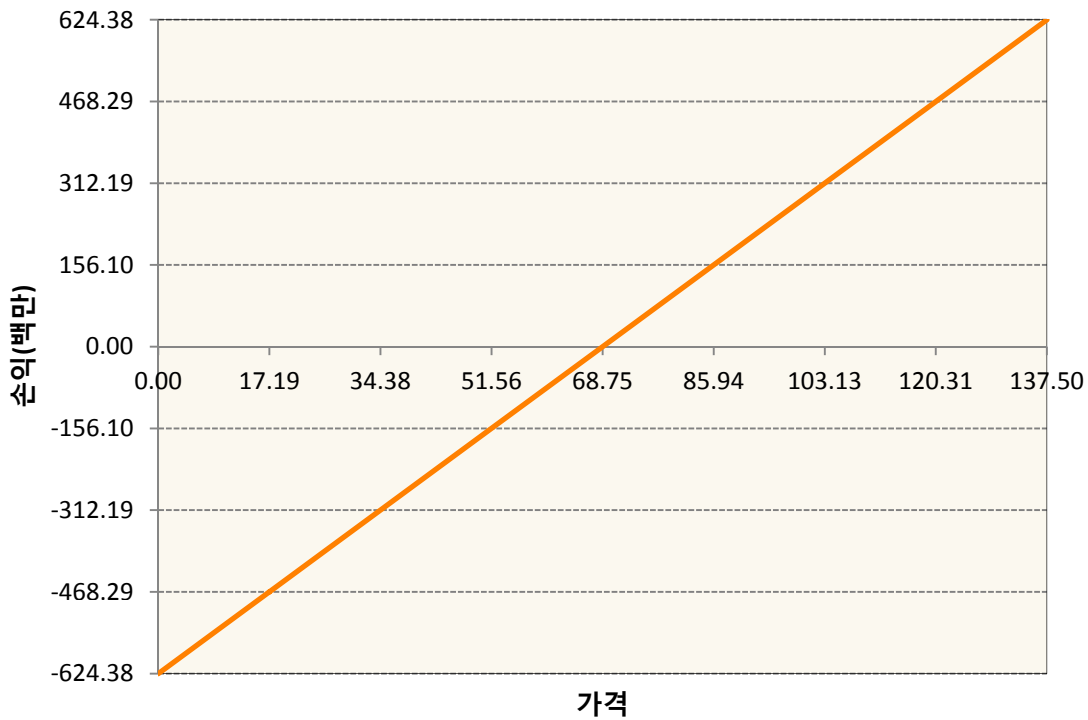
1. 계약금액

(단위:백만원)

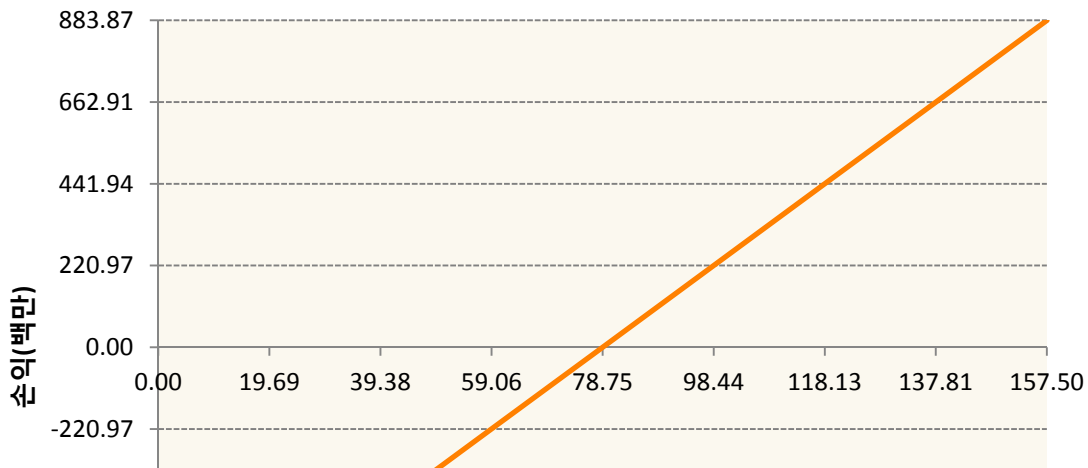
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,417	622	2,795	

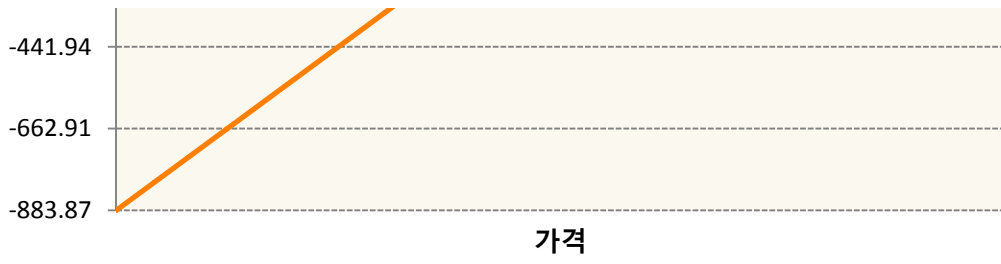
2. 만기시점의 손익구조

CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19

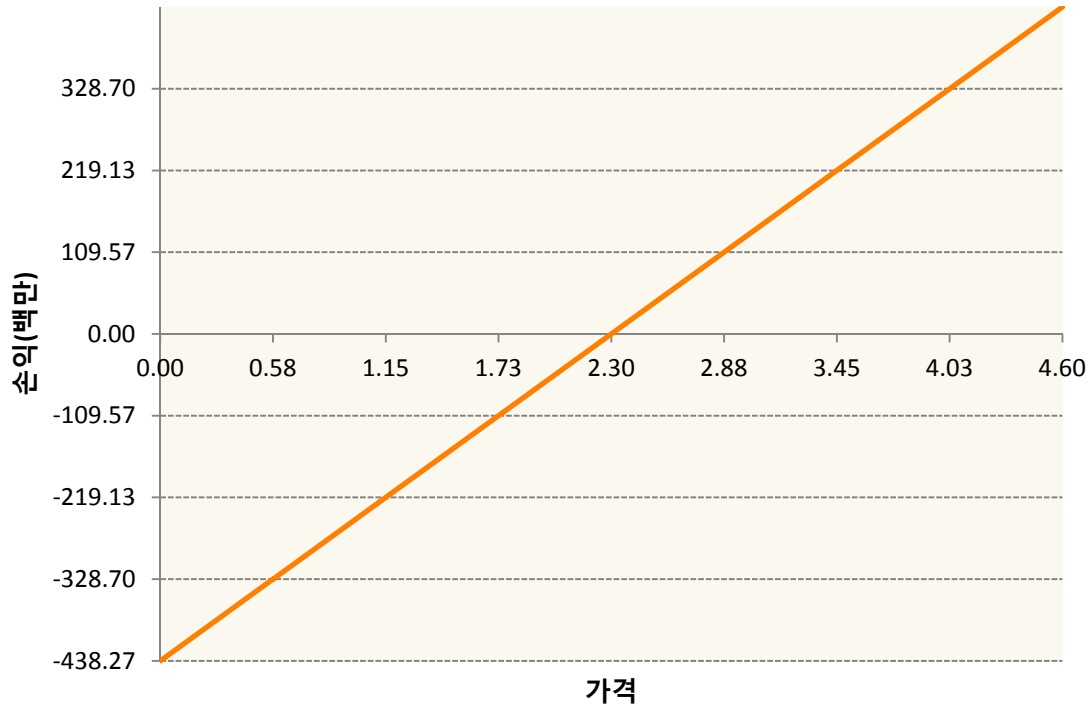


COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19

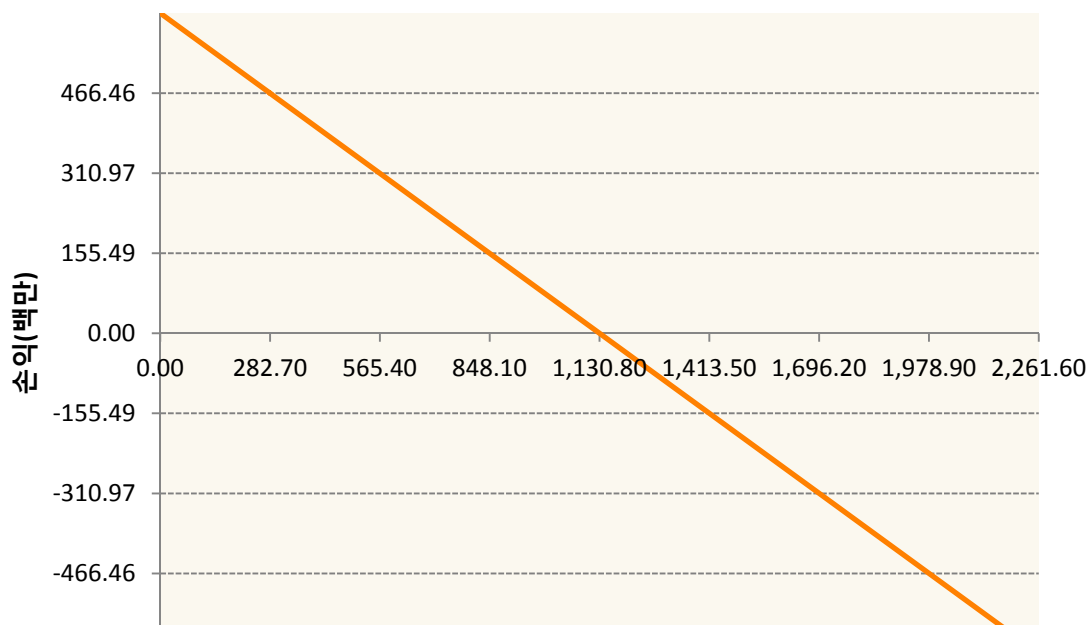


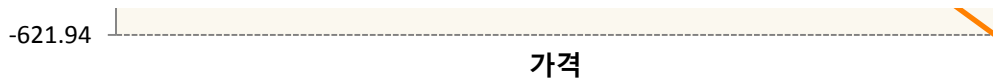


HOF9-NY Harb ULSD Fut Jan19

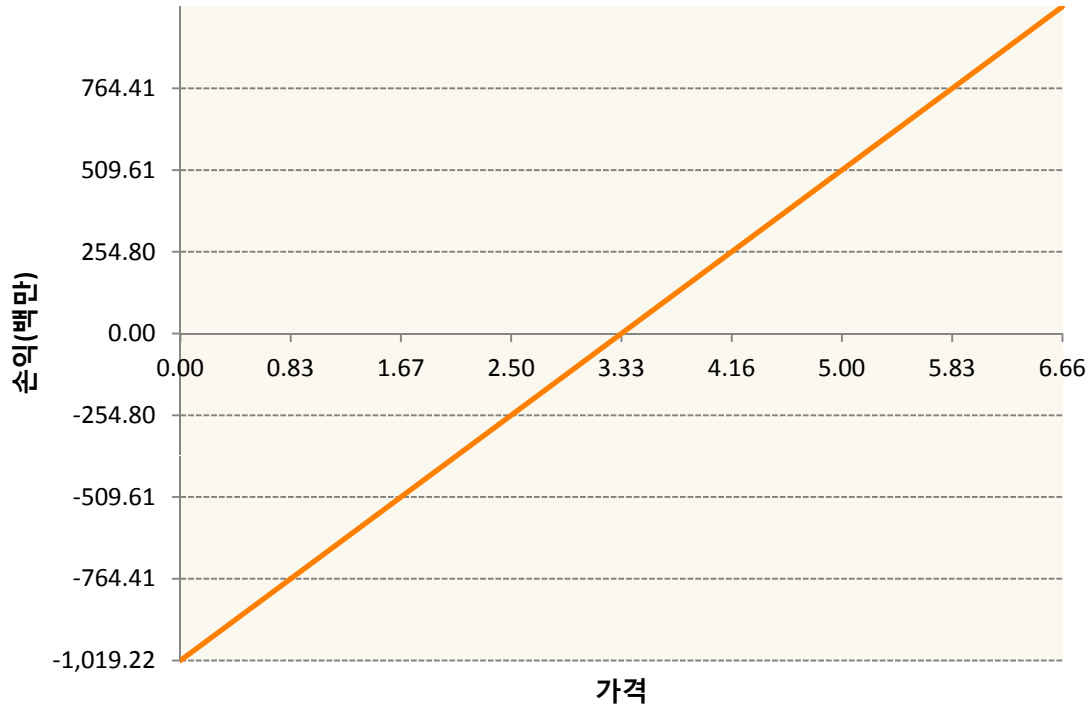


KR4175NB0006-2018-11 달러선물

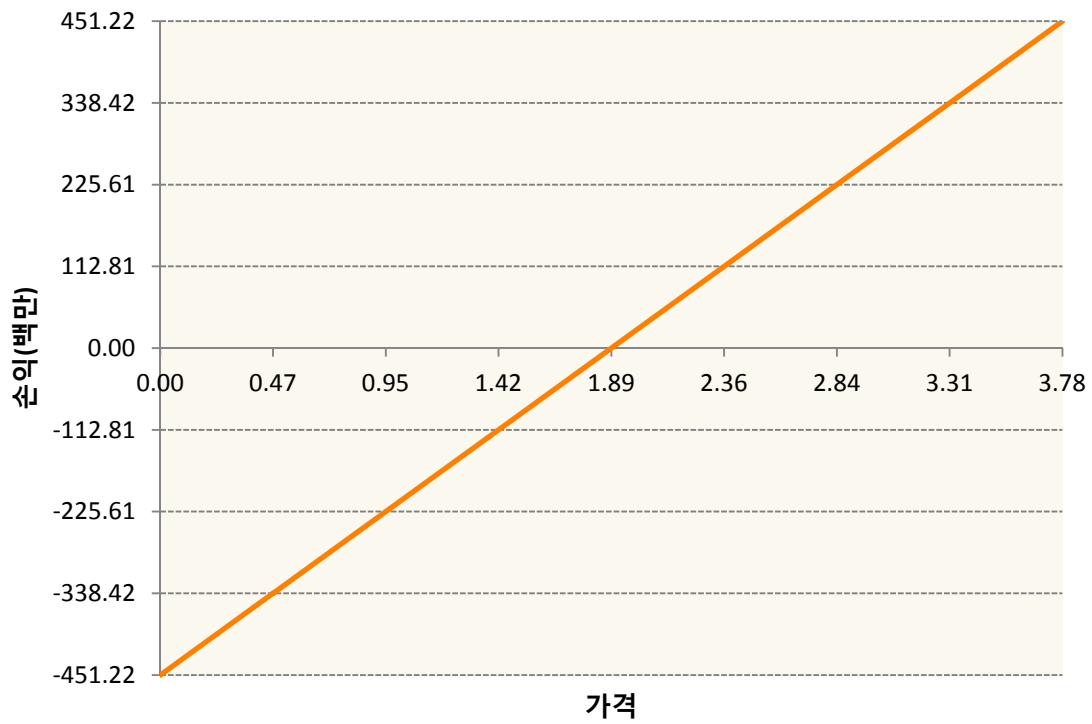




NGF19-NATURAL GAS FUTR Jan19



XBF9-GASOLINE RBOB FUT Jan19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF9	WTI CRUDE FUTURE Jan19	50
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	71
HOF9	NY Harb ULSD Fut Jan19	35
KR4175NB0(2018-11 달러선물		50
NGF19	NATURAL GAS FUTR Jan19	82
XBF9	GASOLINE RBOB FUT Jan19	36

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

416

공시일	2018-10-22
기준일	2018-10-19

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

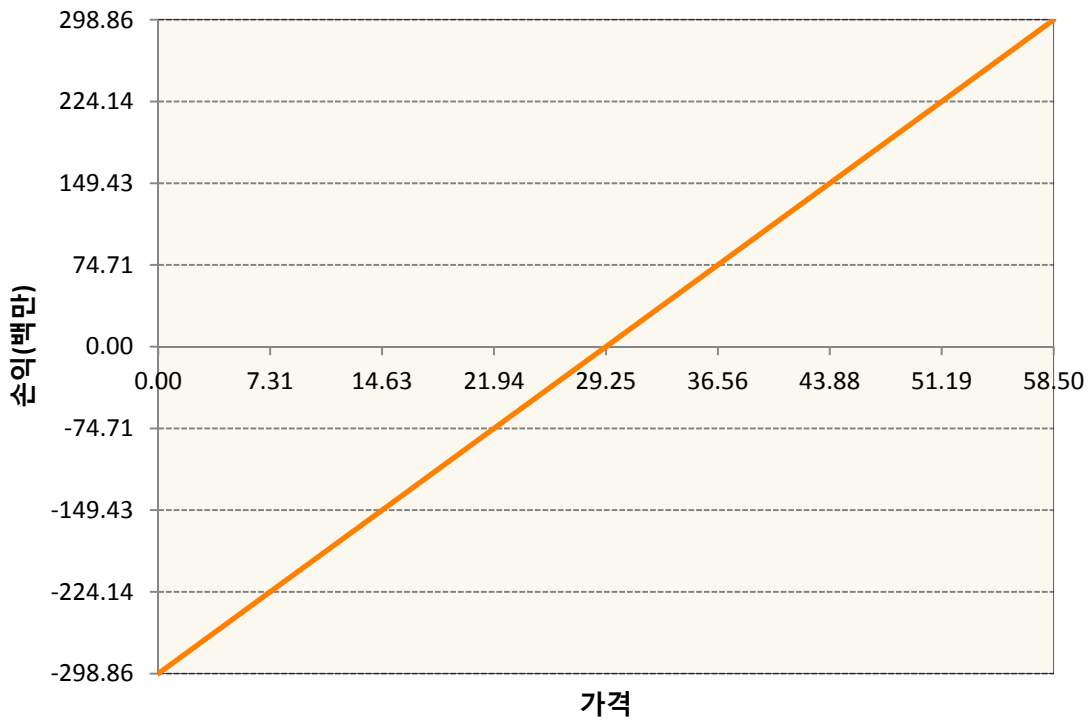
1. 계약금액

(단위:백만원)

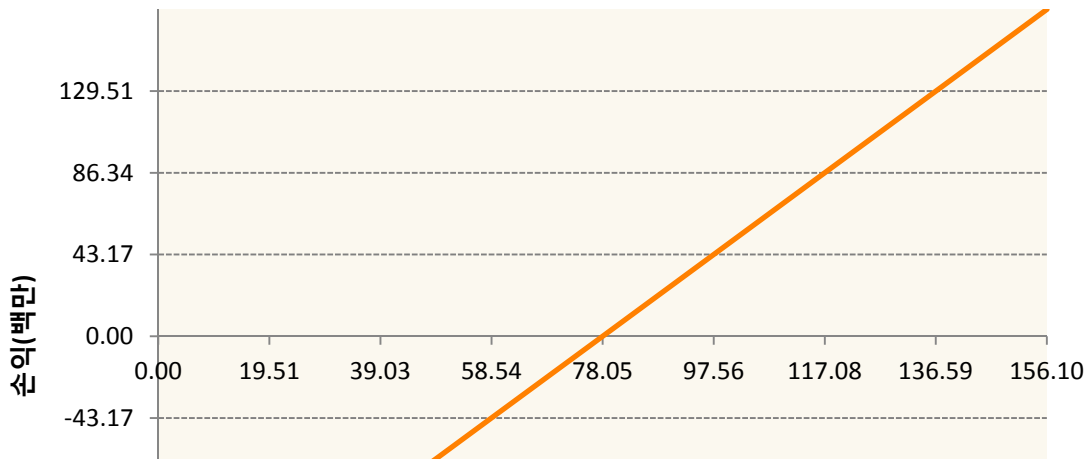
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,659	79	3,580	

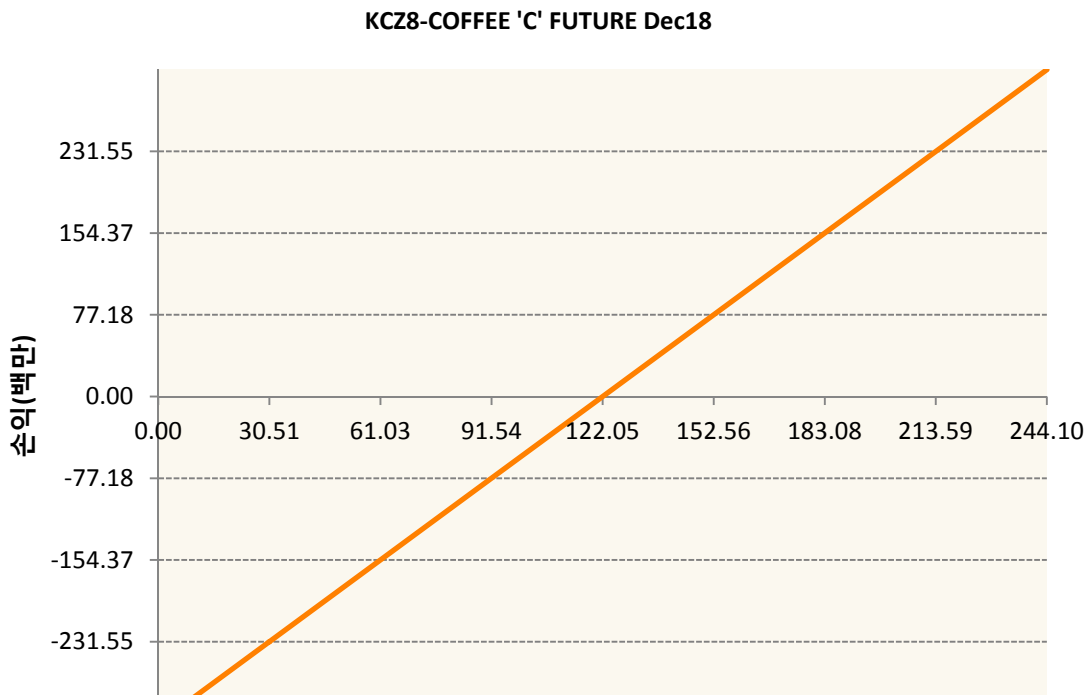
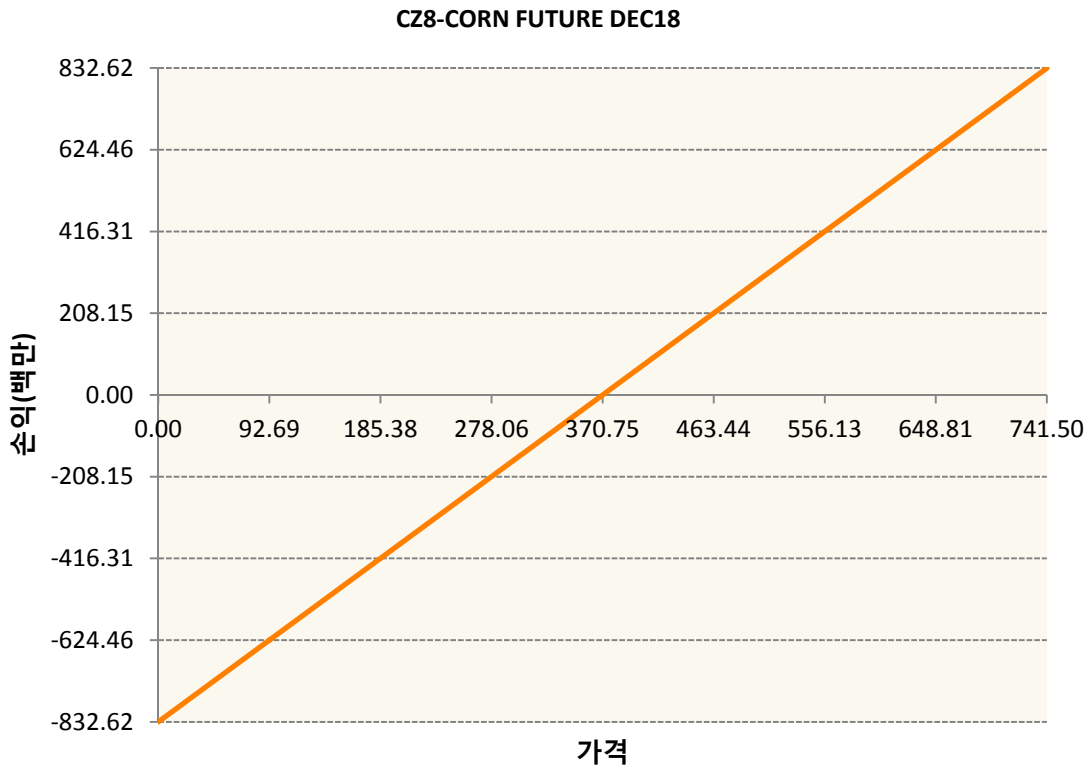
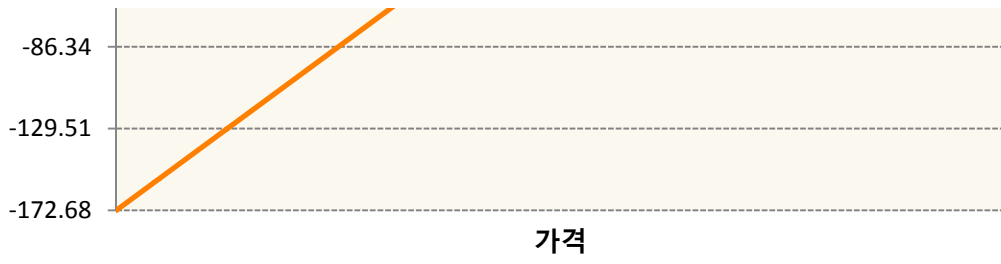
2. 만기시점의 손익구조

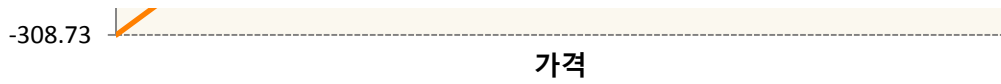
BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19



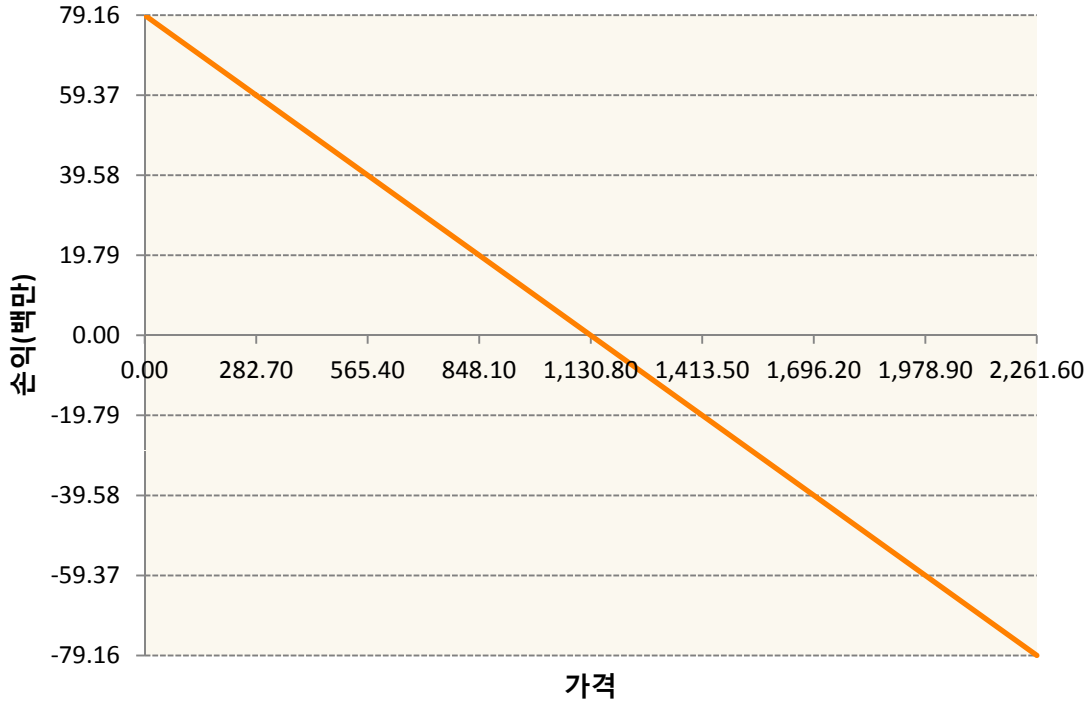
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



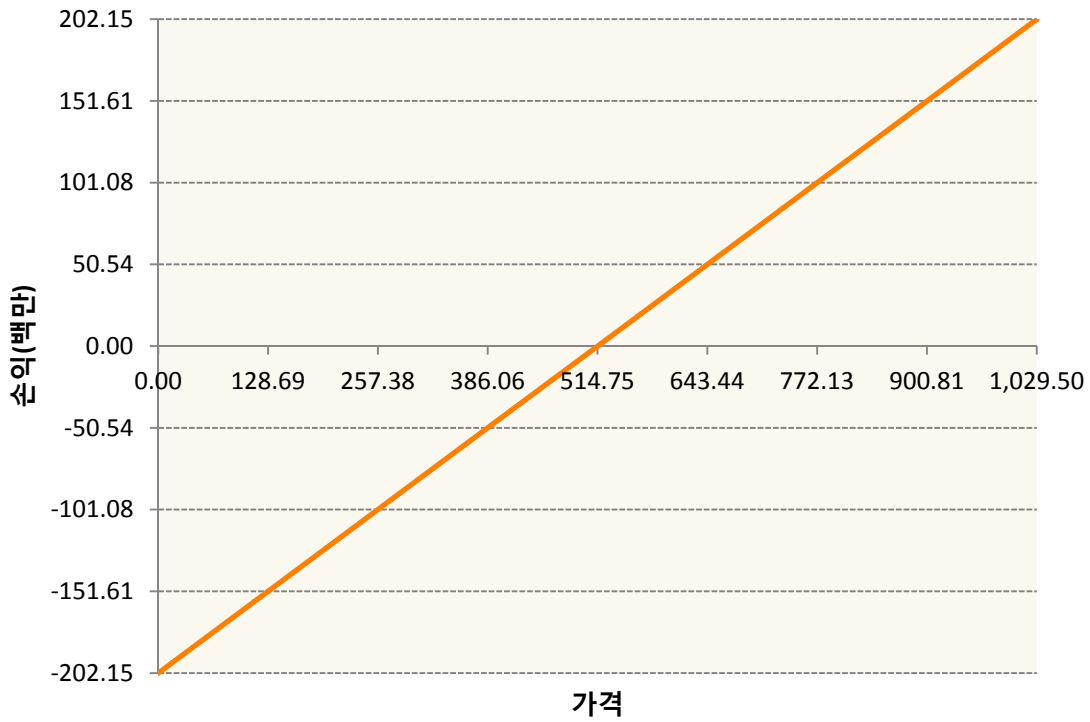




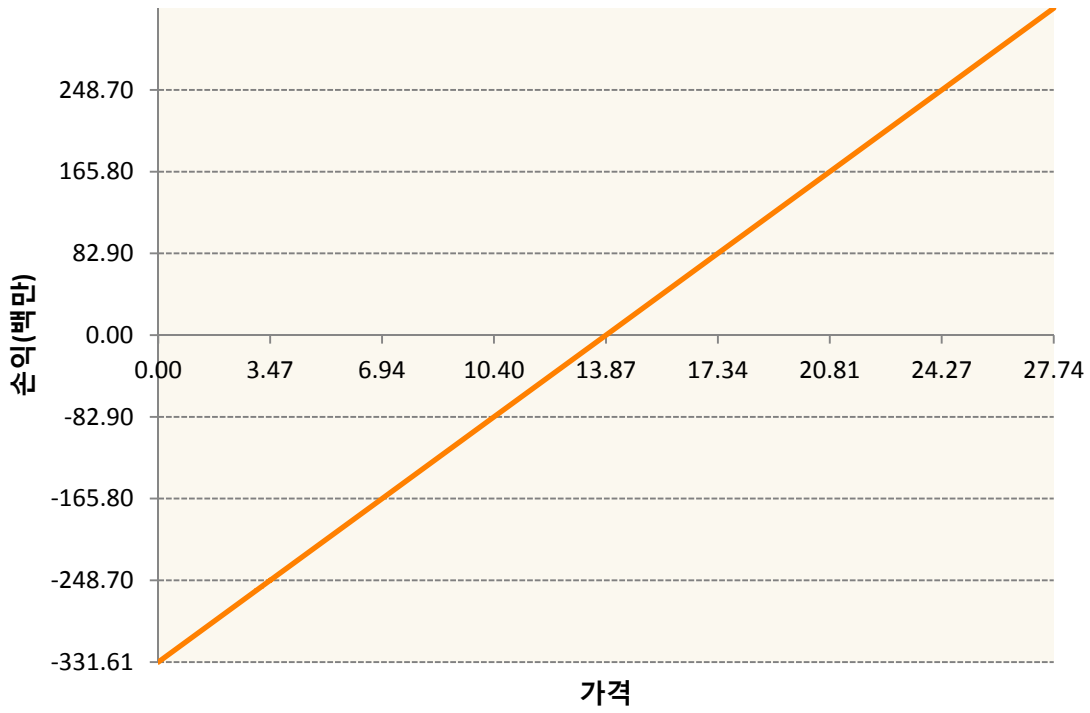
KR4175NB0006-2018-11 달러선물



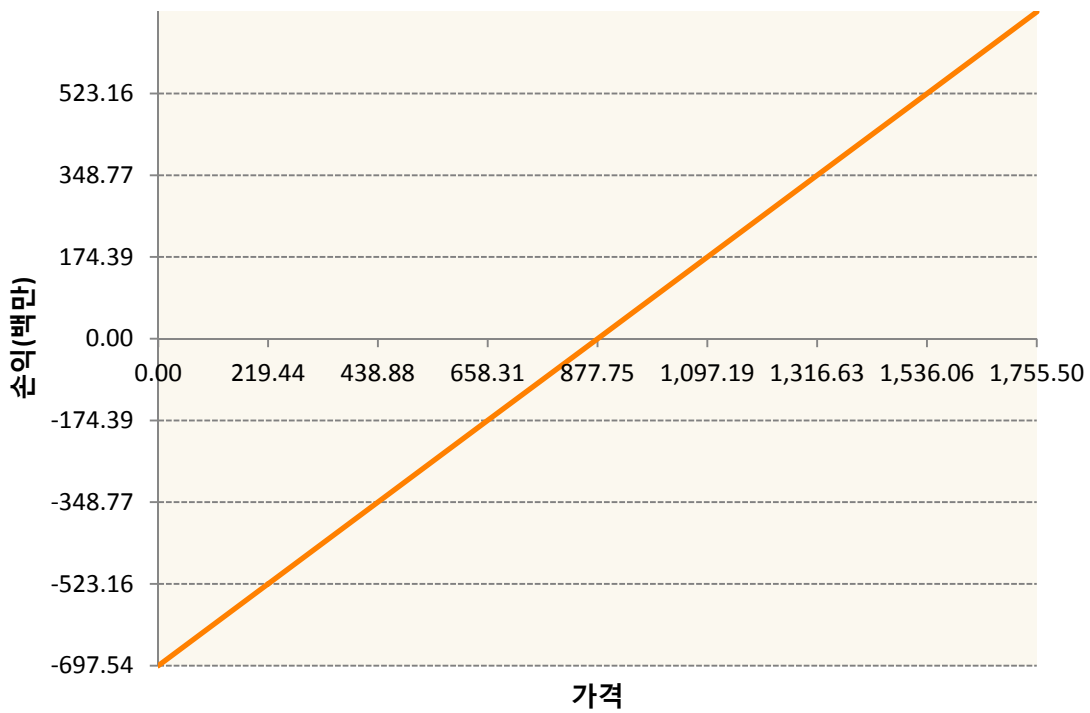
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

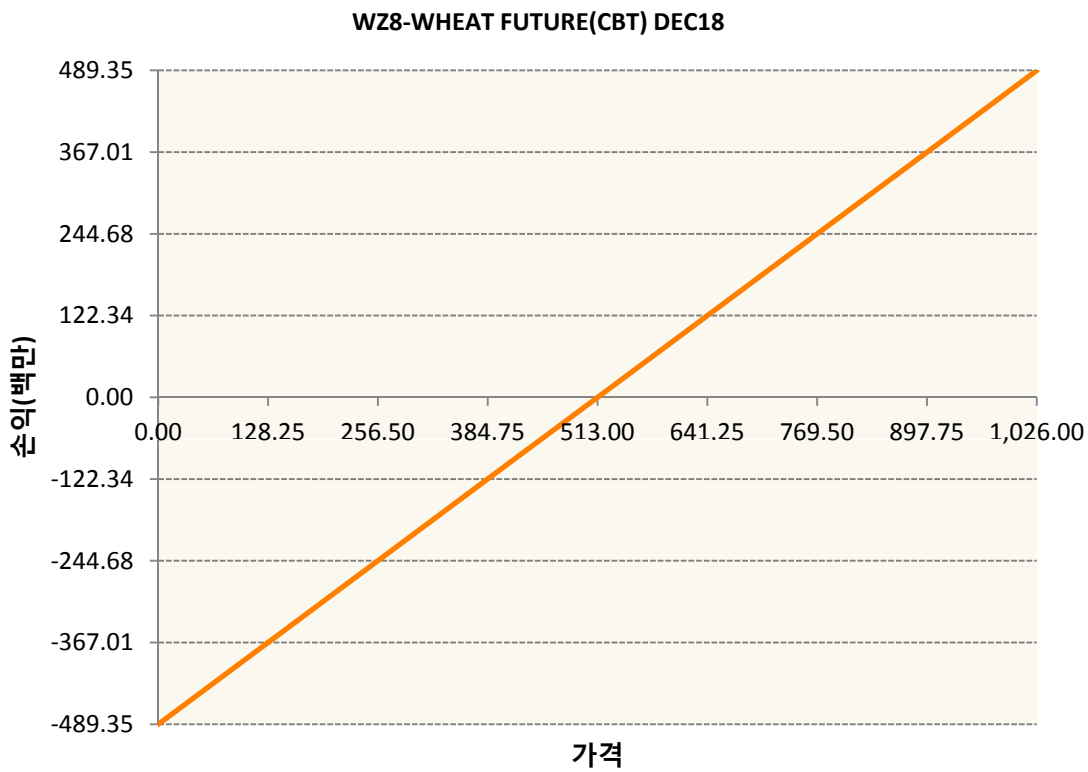
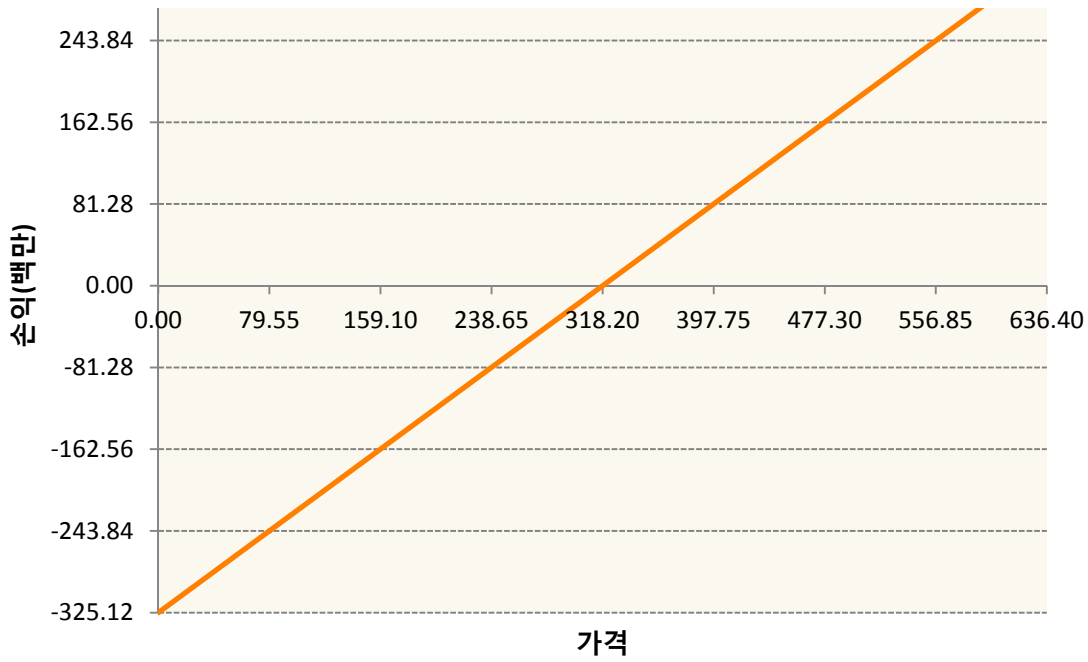


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19



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	27
SF9	SOYBEAN FUTURE Jan19	56
SMF9	SOYBEAN MEAL FUTR Jan19	26
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	39

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

(단위:백만원)

320