

공시일	2018-10-23
기준일	2018-10-22

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	2018-10-23
기준일	2018-10-22

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)

495

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-23
기준일	2018-10-22

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

263

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

360

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-23
기준일	2018-10-22

유로인덱스모(주식-파생형)

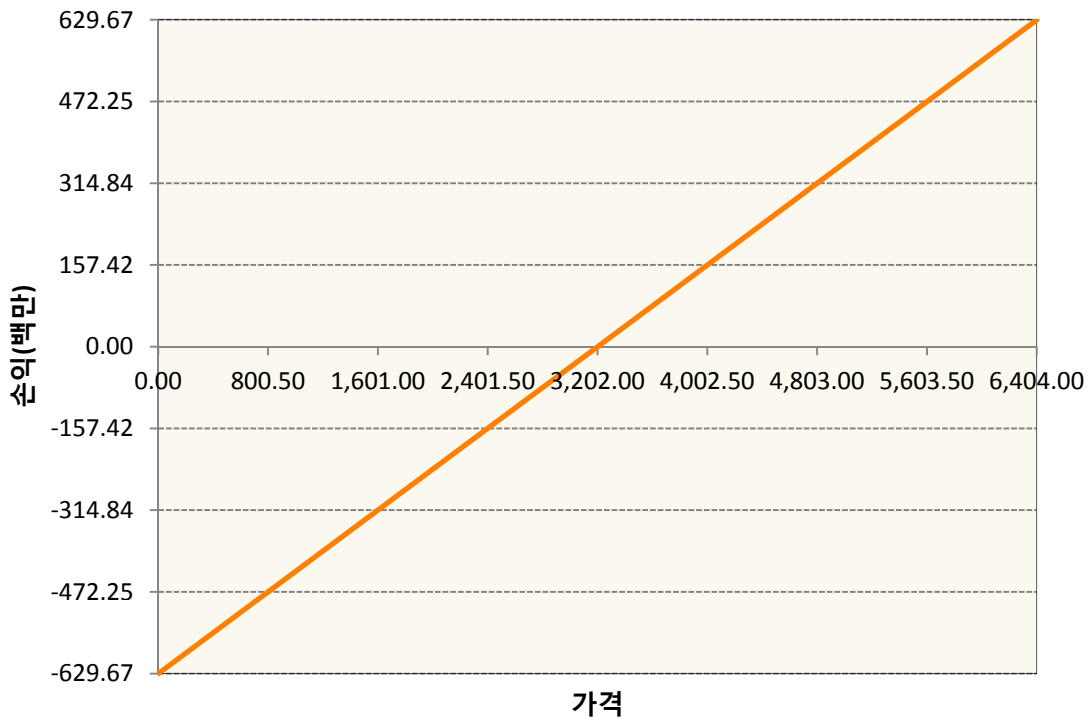
1. 계약금액

(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	2018-10-23
기준일	2018-10-22

차이나인덱스모(주식-파생형)

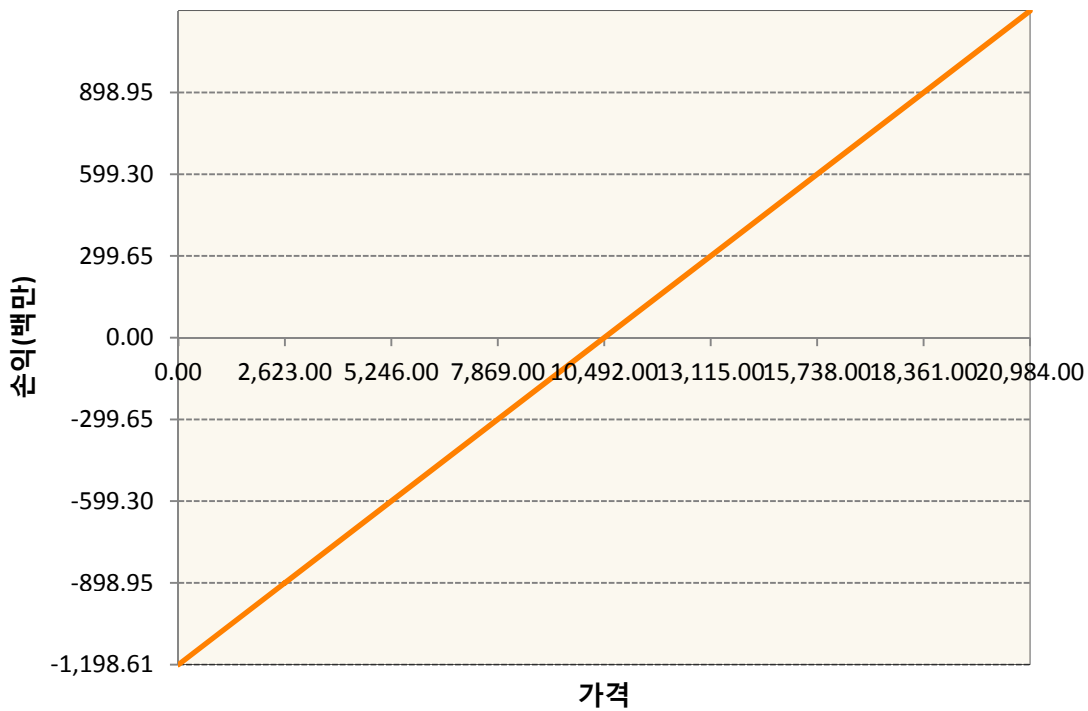
1. 계약금액

(단위:백만원)

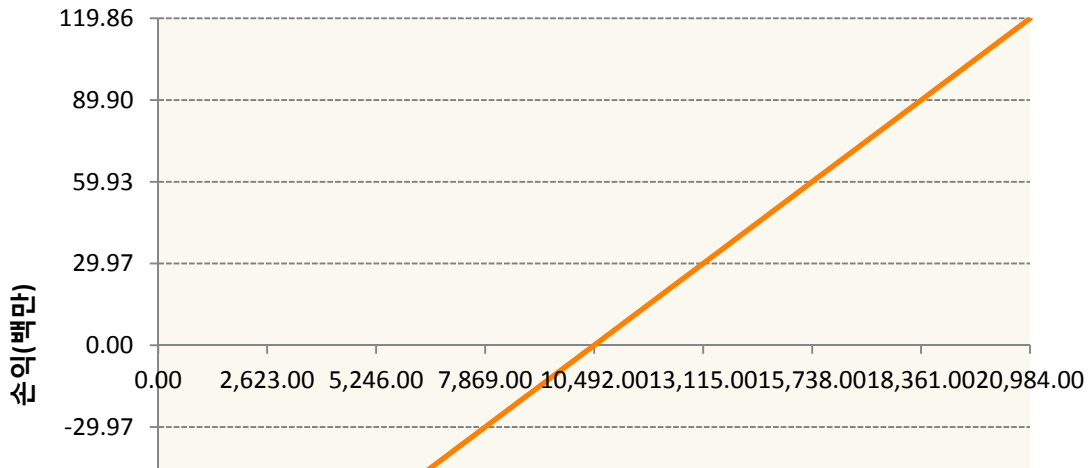
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,318	0	1,318	장내

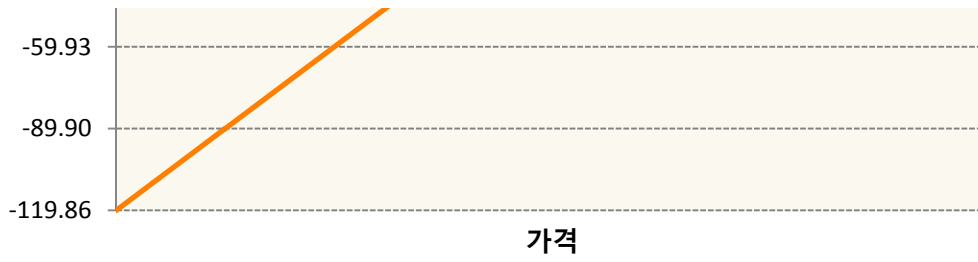
2. 만기시점의 손익구조

HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



MHCV8-MINI H-SHR IDX FU OCT 18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	96
MHCV8	MINI H-SHR IDX FU OCT 18	10

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

101

공시일	2018-10-23
기준일	2018-10-22

커버드콜모(주식혼합-파생형)

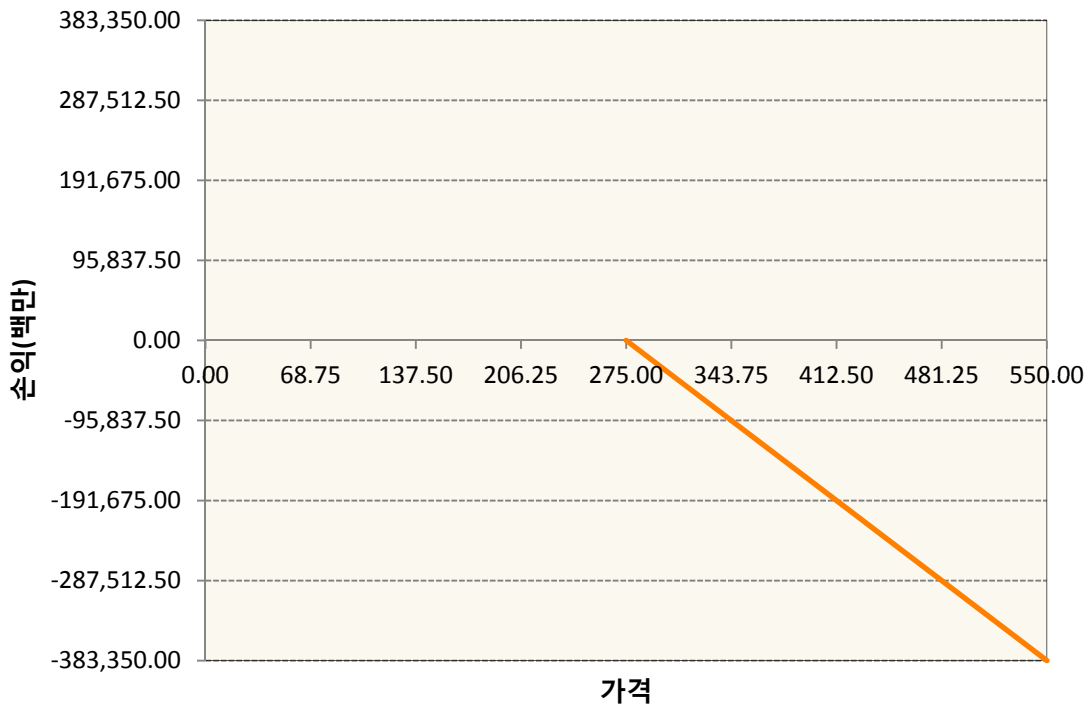
1. 계약금액

(단위:백만원)

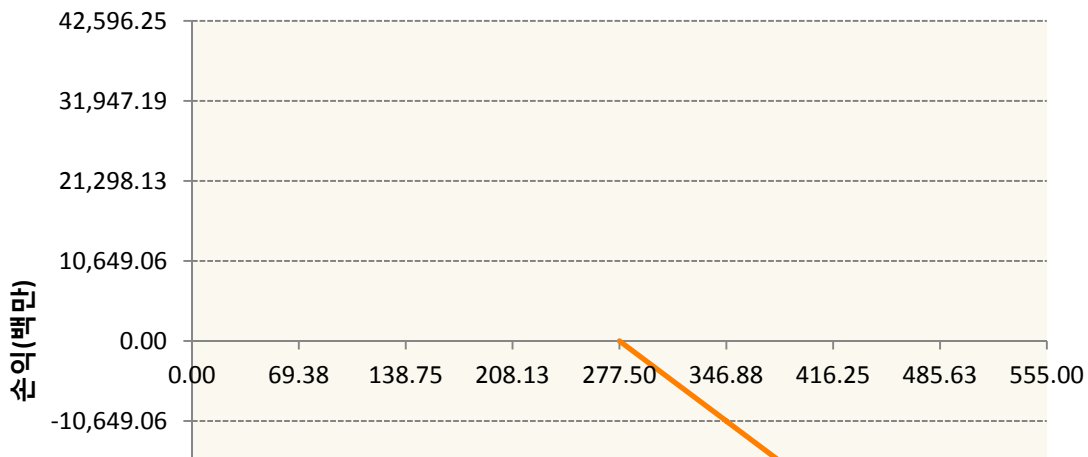
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	707,821	-707,821	장내

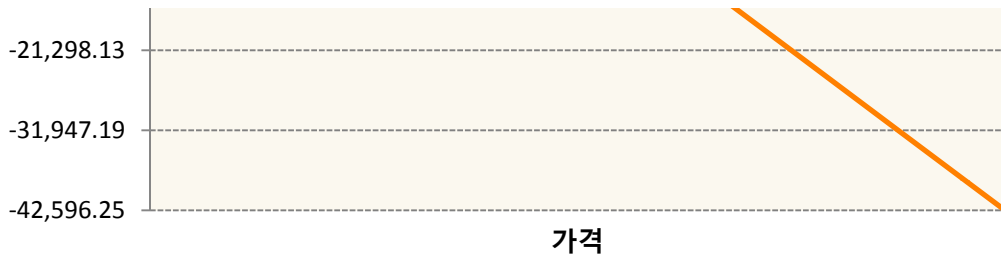
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

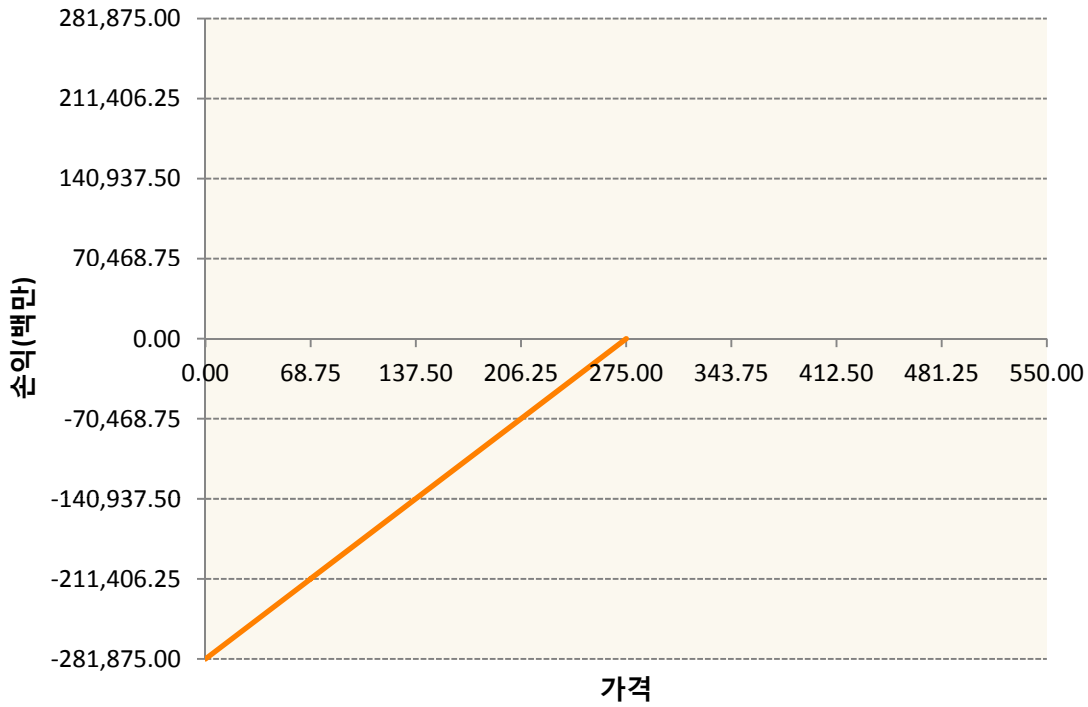


KR4201NB2778-2018-11 콜277.5





KR4301NB2751-2018-11 풋275



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NB27 2018-11 콜275

26,354

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,766	11,538	11,259	10,933	10,567	10,165	9,732
-5.33%	10,578	10,089	9,565	9,015	8,442	7,851	7,245
-2.67%	7,578	6,879	6,176	5,470	4,761	4,051	3,339
0%	2,085	1,397	702	0	-706	-1,415	-2,128
2.67%	-5,741	-6,220	-6,739	-7,290	-7,866	-8,464	-9,078
5.33%	-15,089	-15,333	-15,631	-15,979	-16,371	-16,801	-17,263
8.00%	-25,148	-25,240	-25,376	-25,556	-25,780	-26,047	-26,354

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%	1,095	1,077	1,053	1,024	990	953	911

-5.33%	1,005	960	911	857	801	741	680
-2.67%	751	679	605	531	455	380	303
0%	240	160	80	0	-80	-161	-241
2.67%	-541	-604	-670	-738	-808	-880	-953
5.33%	-1,523	-1,559	-1,601	-1,647	-1,698	-1,753	-1,811
8.00%	-2,611	-2,626	-2,647	-2,673	-2,704	-2,740	-2,780

KR4301NB27 2018-11 풋275

16,549

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-16,207	-16,226	-16,259	-16,307	-16,371	-16,452	-16,549
-5.33%	-8,809	-8,939	-9,092	-9,266	-9,458	-9,666	-9,887
-2.67%	-2,630	-2,940	-3,254	-3,572	-3,893	-4,215	-4,539
0%	898	606	306	0	-311	-626	-944
2.67%	2,028	1,912	1,771	1,607	1,423	1,223	1,007
5.33%	2,212	2,191	2,156	2,105	2,037	1,950	1,846
8.00%	2,227	2,225	2,220	2,210	2,194	2,168	2,131

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

(단위:백만원)

46,741

공시일	2018-10-23
기준일	2018-10-22

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

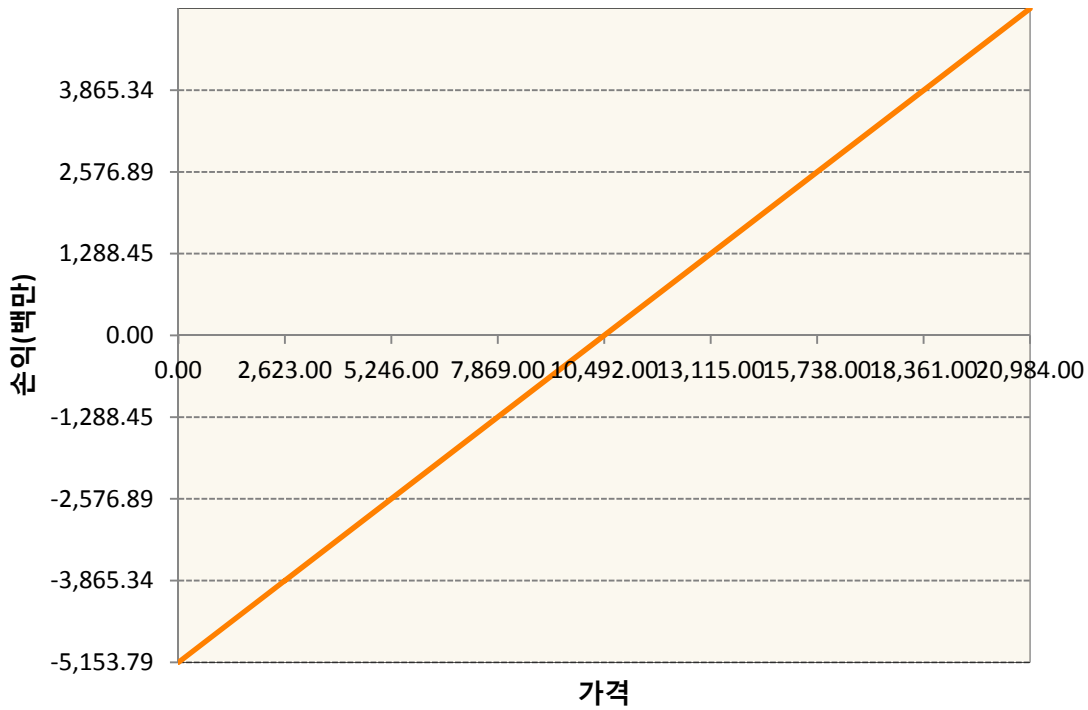
1. 계약금액

(단위:백만원)

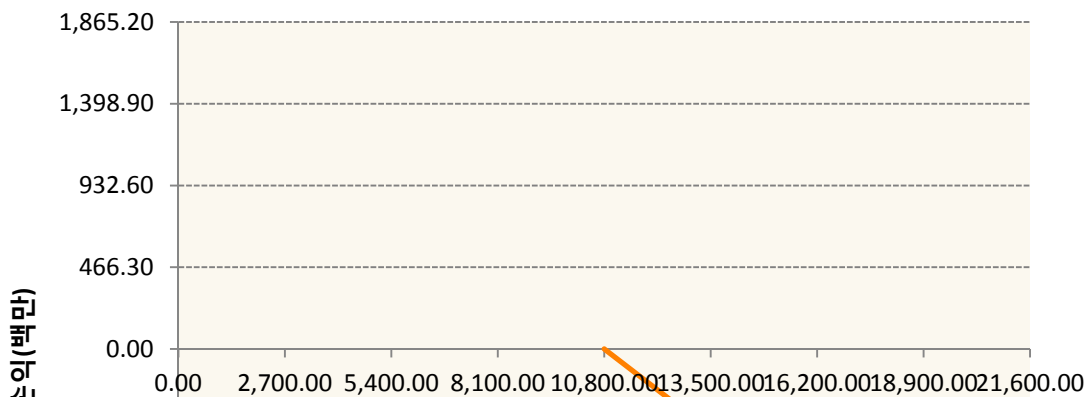
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,154	0	5,154	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,121	-12,121	장내

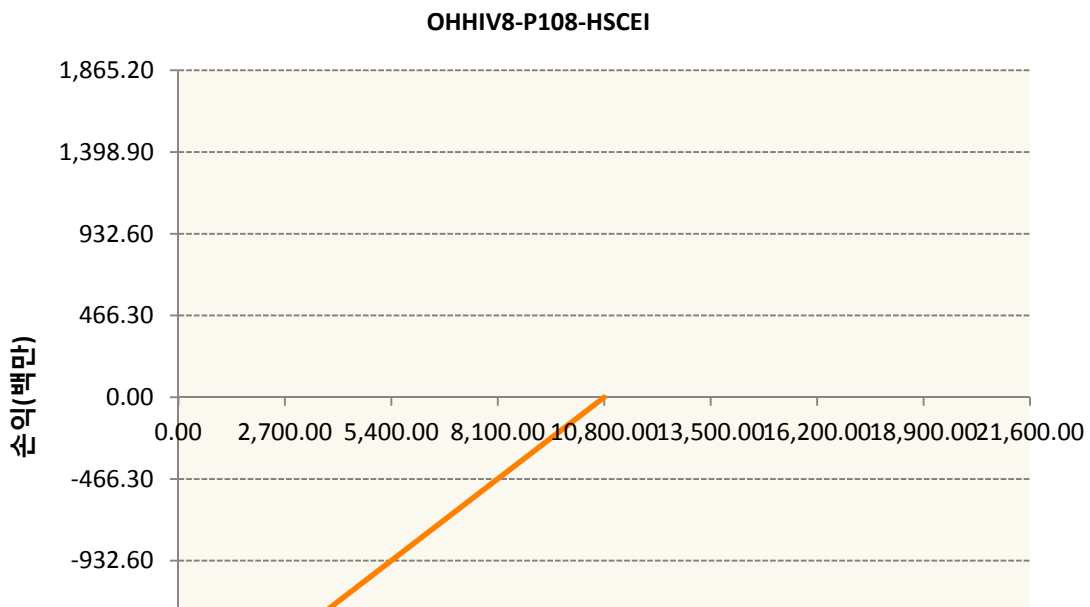
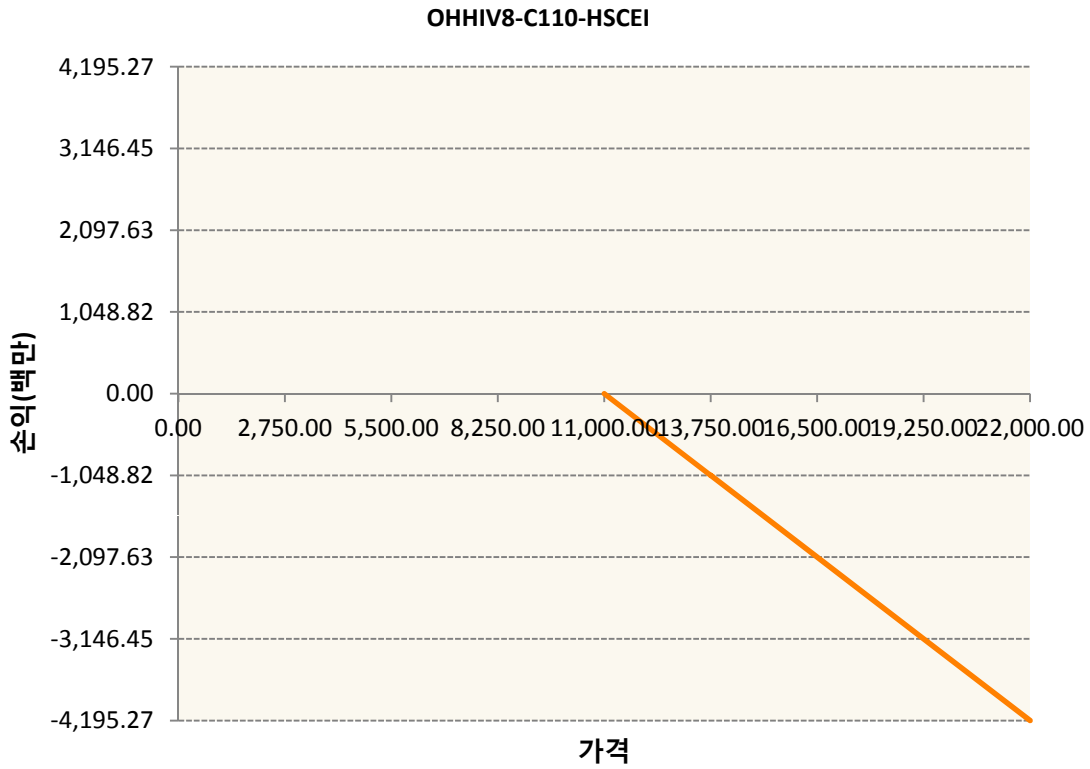
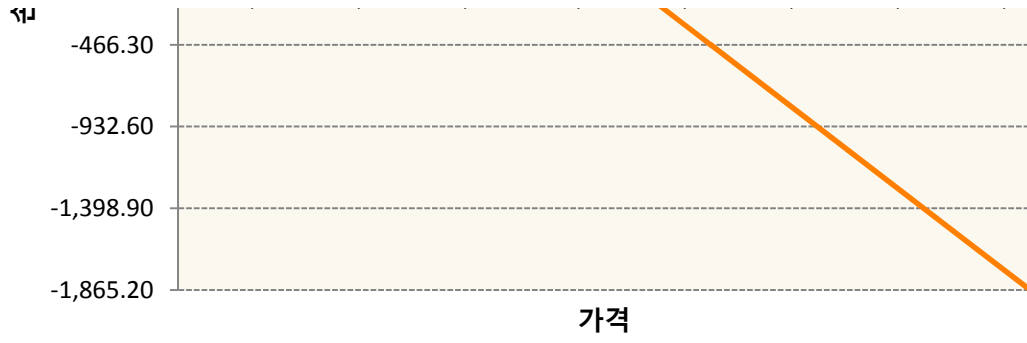
2. 만기시점의 손익구조

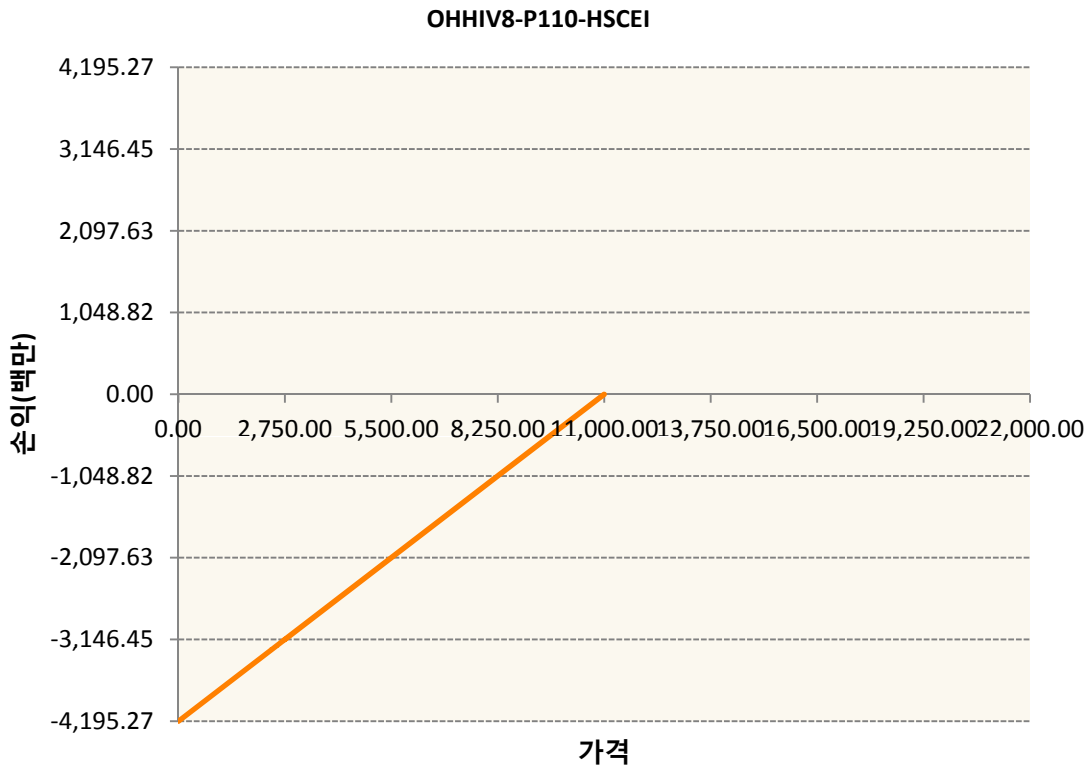
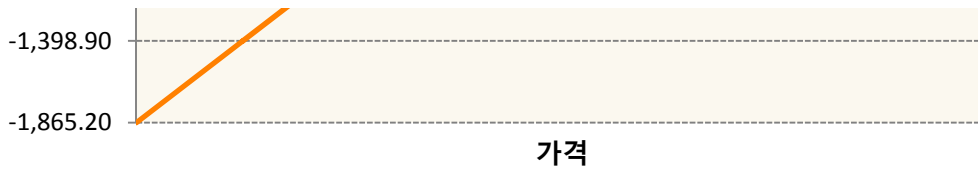
HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



OHHIV8-C108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	412
OHHIV8-C1C	HSCEI	149
OHHIV8-C11	HSCEI	336
OHHIV8-P1C	HSCEI	149
OHHIV8-P11	HSCEI	336

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,322

공시일	2018-10-23
기준일	2018-10-22

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

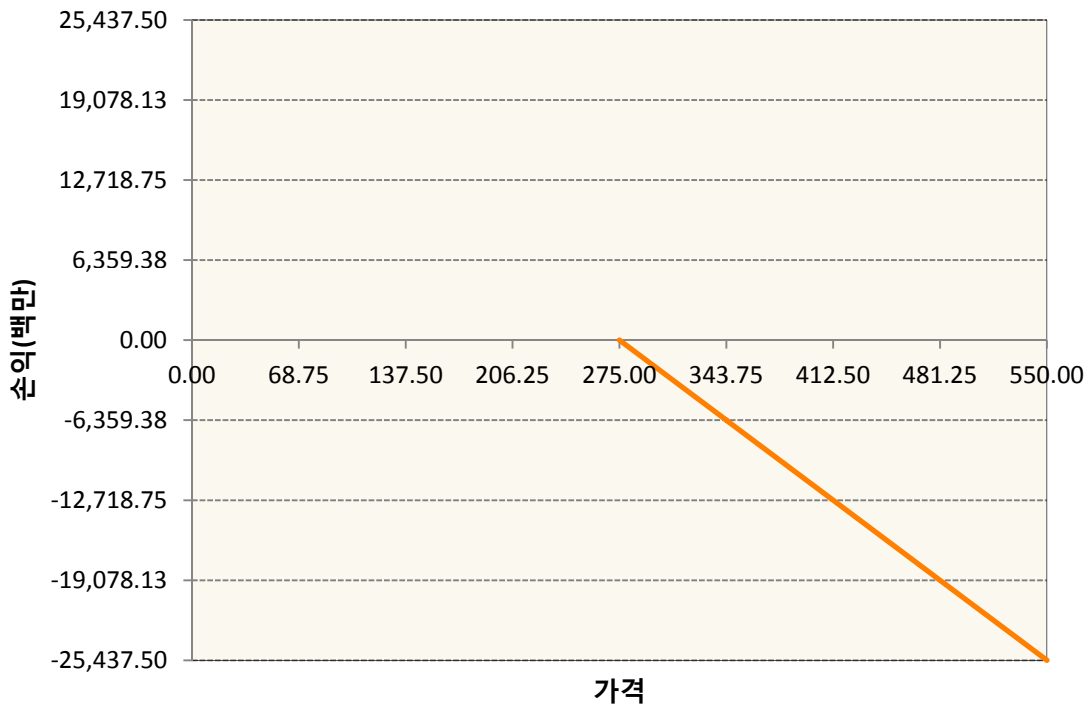
1. 계약금액

(단위:백만원)

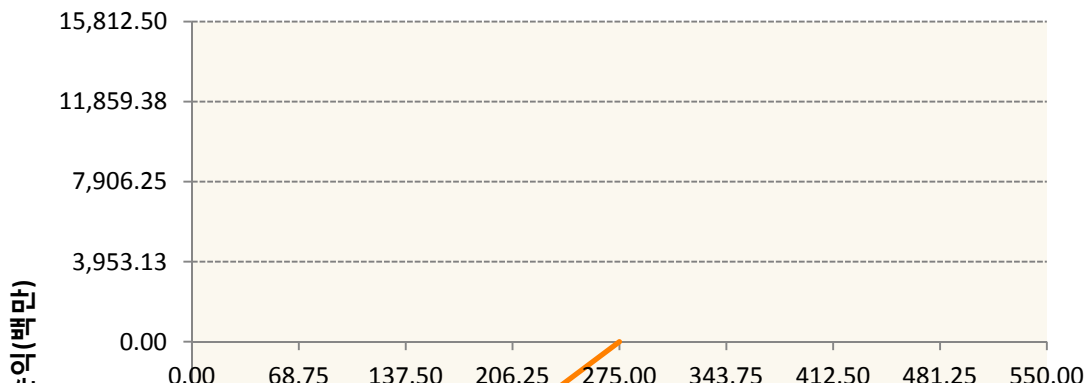
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	44,025	-44,025	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

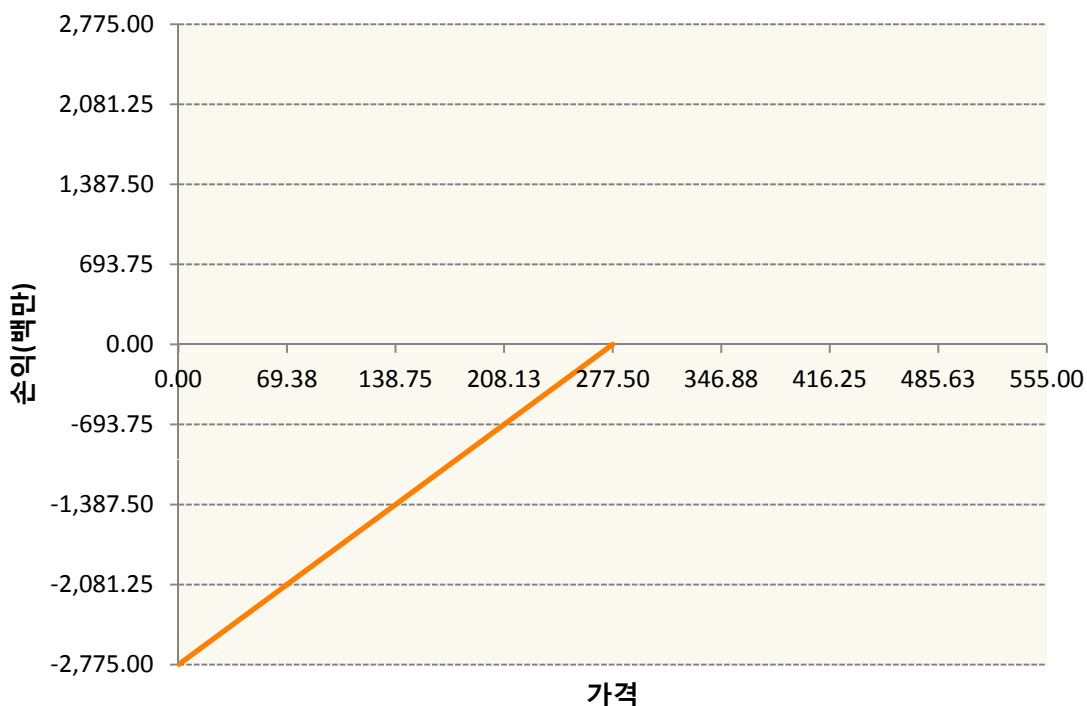


KR4301NB2751-2018-11 풋275





KR4301NB2777-2018-11 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							4,004	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-4,004	-4,004	-4,004	-4,004	-4,004	-4,004	-4,004	
-5.33%	-2,669	-2,669	-2,669	-2,669	-2,669	-2,669	-2,669	
-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%	2,669	2,669	2,669	2,669	2,669	2,669	2,669	
8.00%	4,004	4,004	4,004	4,004	4,004	4,004	4,004	
KR4201NB27 2018-11 콜275							1,749	
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	781	766	747	725	701	674	646
-5.33%	702	669	635	598	560	521	481
-2.67%	503	456	410	363	316	269	222
0%	138	93	47	0	-47	-94	-141
2.67%	-381	-413	-447	-484	-522	-562	-602
5.33%	-1,001	-1,017	-1,037	-1,060	-1,086	-1,115	-1,146
8.00%	-1,669	-1,675	-1,684	-1,696	-1,711	-1,728	-1,749

KR4301NB27 2018-11 풋275

928

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-909	-910	-912	-915	-918	-923	-928
-5.33%	-494	-501	-510	-520	-531	-542	-555
-2.67%	-148	-165	-183	-200	-218	-236	-255
0%	50	34	17	0	-17	-35	-53
2.67%	114	107	99	90	80	69	56
5.33%	124	123	121	118	114	109	104
8.00%	125	125	125	124	123	122	120

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

176

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-173	-173	-174	-174	-174	-175	-176
-5.33%	-100	-101	-102	-103	-104	-106	-108
-2.67%	-34	-37	-39	-42	-45	-48	-51
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	27	26	24	21	19	17	14
5.33%	31	31	30	29	28	27	26
8.00%	31	31	31	31	31	30	30

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

(단위:백만원)

6,936

공시일	2018-10-23
기준일	2018-10-22

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

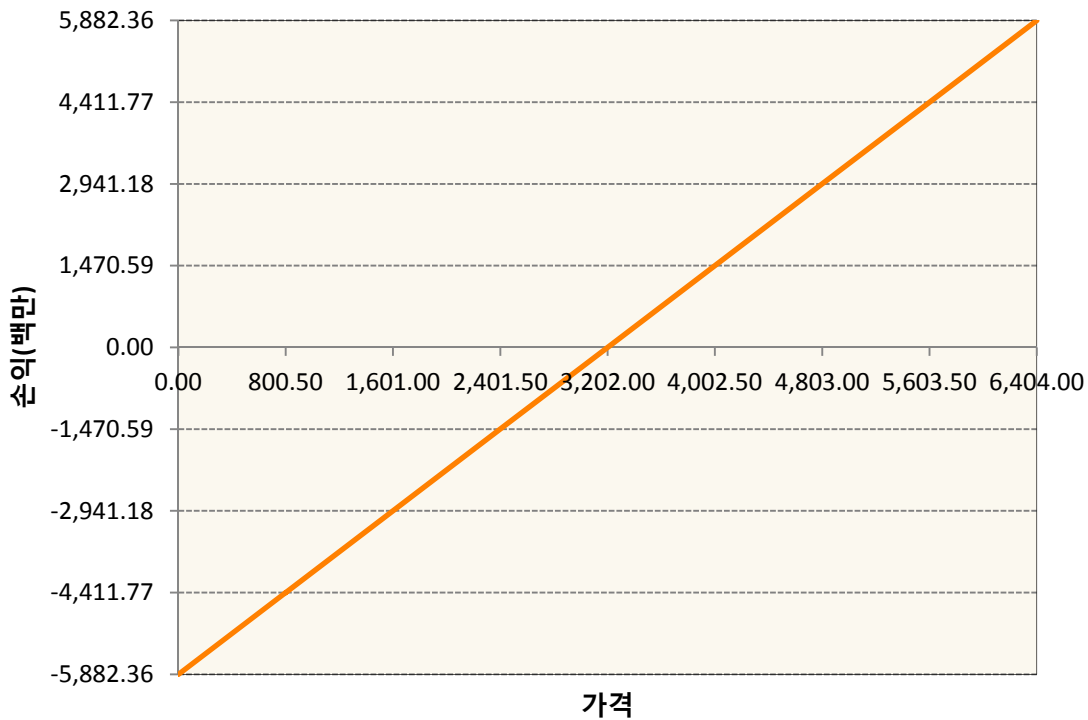
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	56	26	29	장외
누계	유가증권	선물	5,882	0	5,882	
누계	유가증권	스왑	72,790	0	72,790	장외

2. 만기시점의 손익구조

VGZ8-EURO STOXX 50 DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY

0.1

VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18

471

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

(단위:백만원)

294

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

(단위:백만원)

1,137

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

(단위:백만원)

90

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

(단위:백만원)

134

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

(단위:백만원)

153

공시일	2018-10-23
기준일	2018-10-22

스마트KRX300인덱스목표전환형1

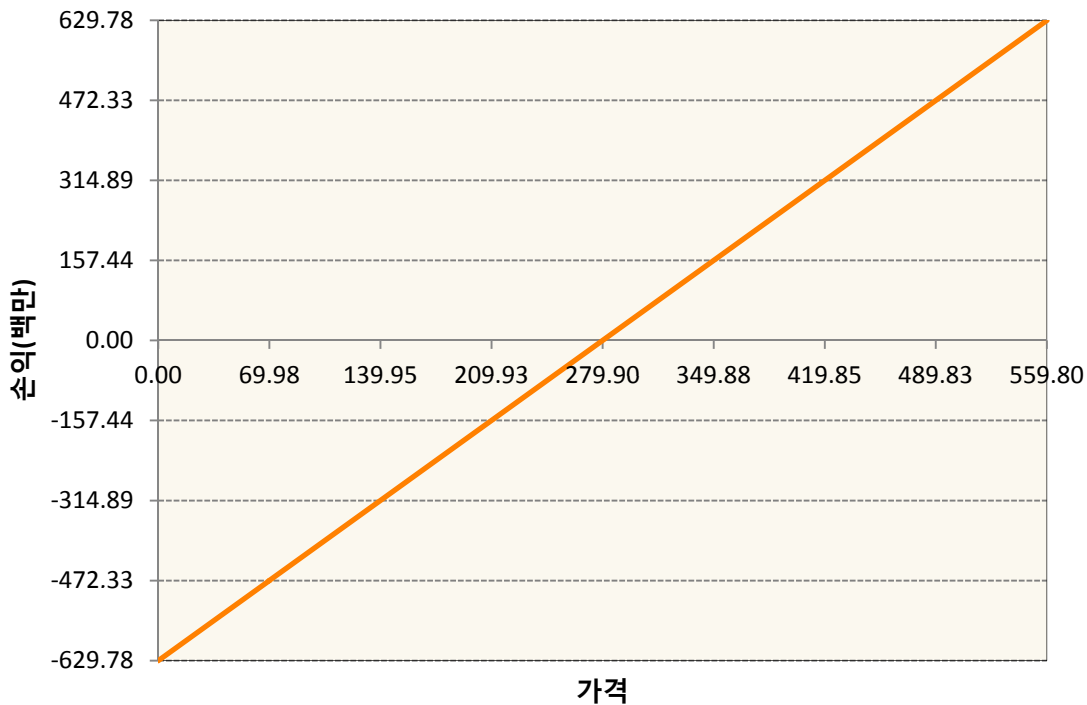
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	630	0	630	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	2018-10-23
기준일	2018-10-22

리디파인K200(주식혼합-파생재간

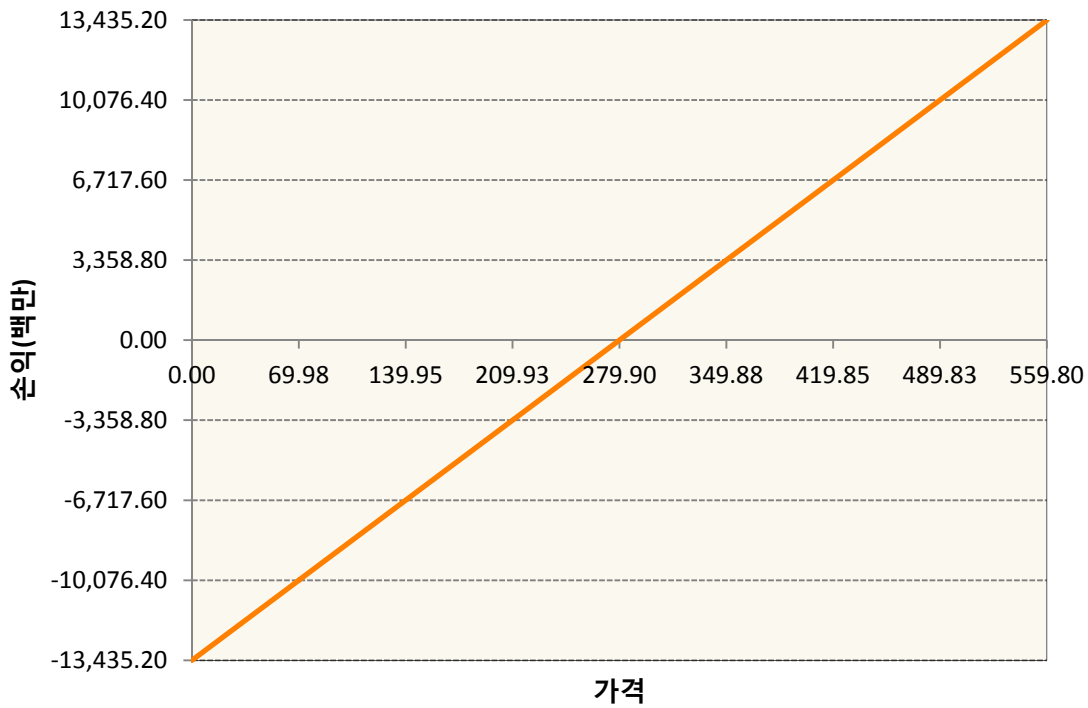
1. 계약금액

(단위:백만원)

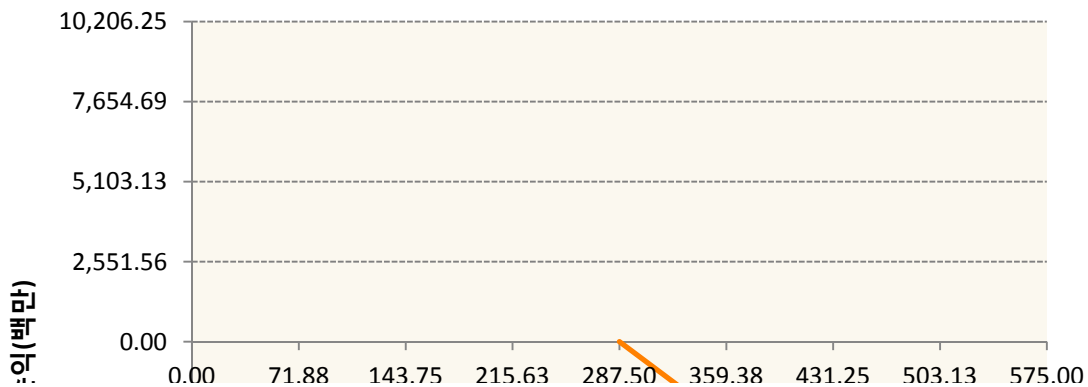
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,435	0	13,435	장내
누계	유가증권	옵션	4,059	23,401	-19,343	장내

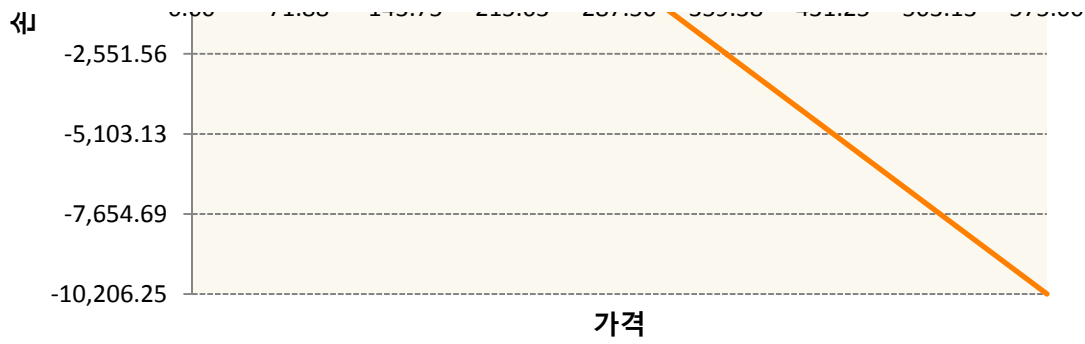
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

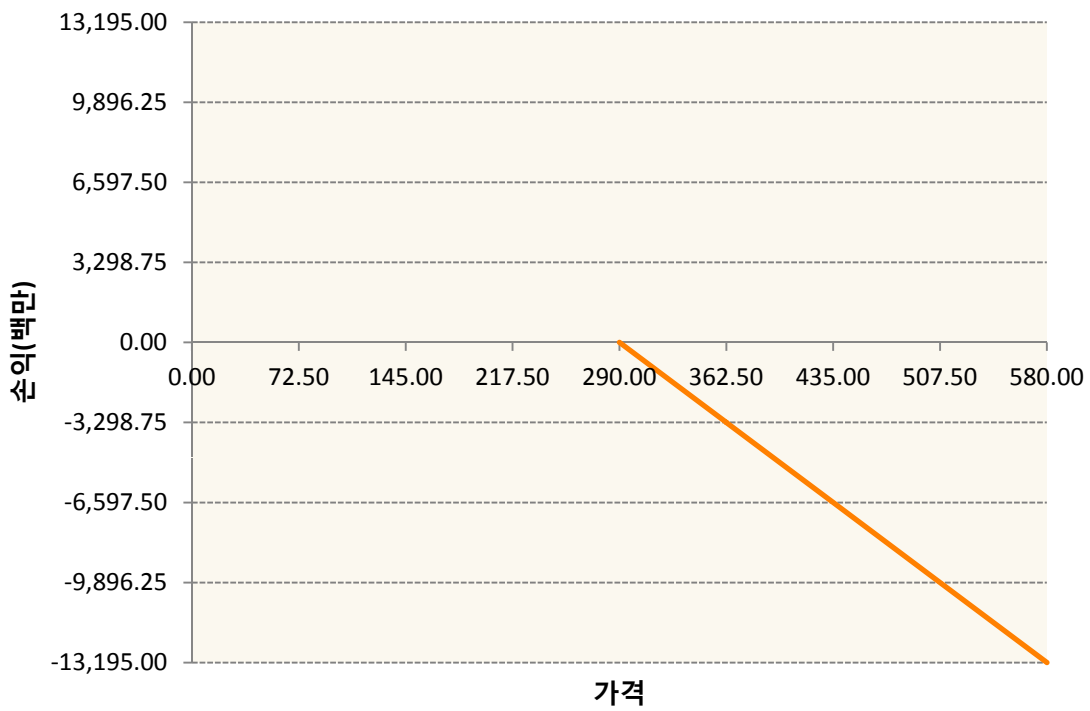


KR4201NB2877-2018-11 콜287.5

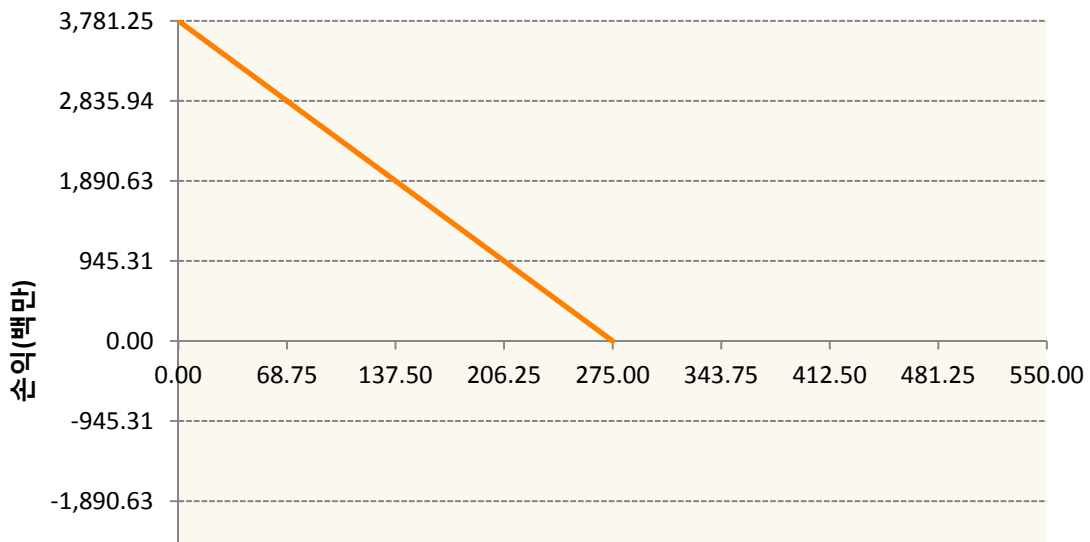


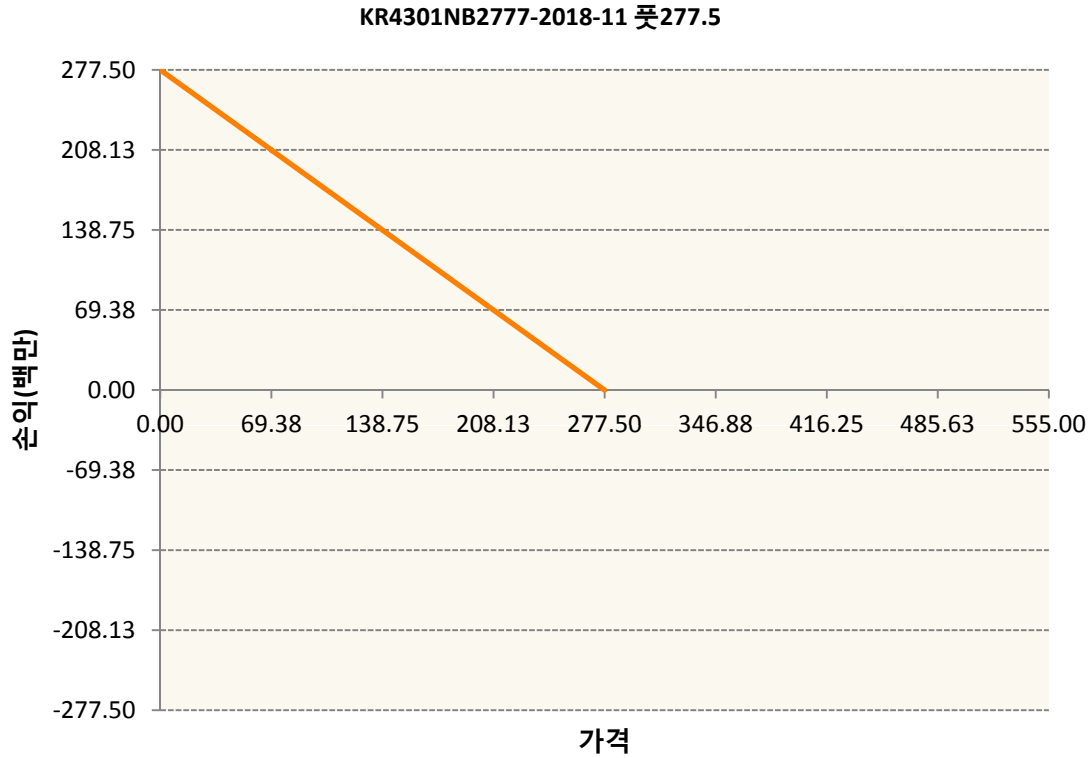
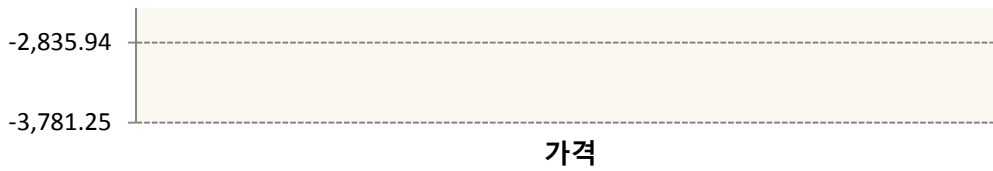


KR4201NB2901-2018-11 콜290



KR4301NB2751-2018-11 풋275





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 1,073

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,073	-1,073	-1,073	-1,073	-1,073	-1,073	-1,073
-5.33%	-715	-715	-715	-715	-715	-715	-715
-2.67%	-358	-358	-358	-358	-358	-358	-358
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	358	358	358	358	358	358	358
5.33%	715	715	715	715	715	715	715
8.00%	1,073	1,073	1,073	1,073	1,073	1,073	1,073

KR4201NB282018-11 콜287.5 502

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	112	111	110	108	104	101	96
-5.33%	109	105	101	95	88	80	71
-2.67%	94	85	75	64	51	39	25

0%	48	33	17	0	-17	-34	-52
2.67%	-49	-68	-88	-107	-126	-146	-165
5.33%	-209	-226	-243	-261	-279	-298	-316
8.00%	-420	-432	-444	-457	-472	-486	-502

KR4201NB27 2018-11 콜290

592

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	113	112	111	109	106	102	97
-5.33%	111	108	103	98	90	82	72
-2.67%	98	89	79	66	53	38	23
0%	55	38	19	0	-20	-41	-62
2.67%	-45	-69	-93	-118	-142	-167	-191
5.33%	-223	-247	-271	-295	-320	-344	-369
8.00%	-474	-491	-510	-529	-550	-571	-592

KR4301NB27 2018-11 풋275

222

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	217	218	218	219	220	221	222
-5.33%	118	120	122	124	127	130	133
-2.67%	35	39	44	48	52	57	61
0%	-12	-8	-4	0	4	8	13
2.67%	-27	-26	-24	-22	-19	-16	-14
5.33%	-30	-29	-29	-28	-27	-26	-25
8.00%	-30	-30	-30	-30	-29	-29	-29

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	17	18
-5.33%	10	10	10	10	10	11	11
-2.67%	3	4	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)

1,935

공시일	2018-10-23
기준일	2018-10-22

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

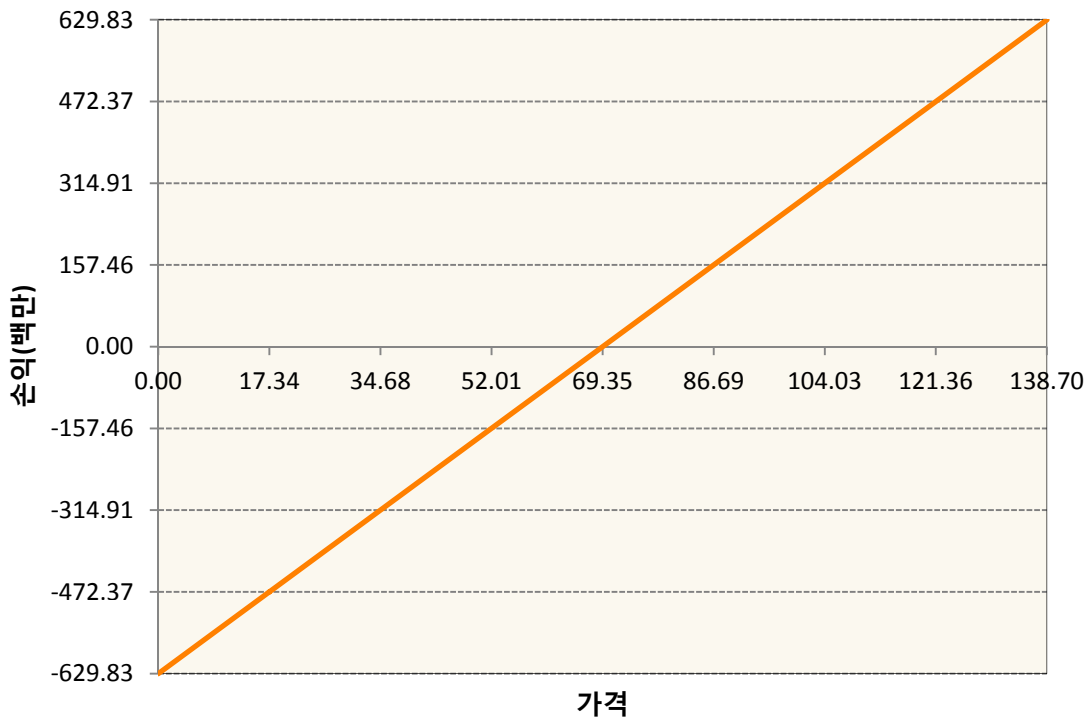
1. 계약금액

(단위:백만원)

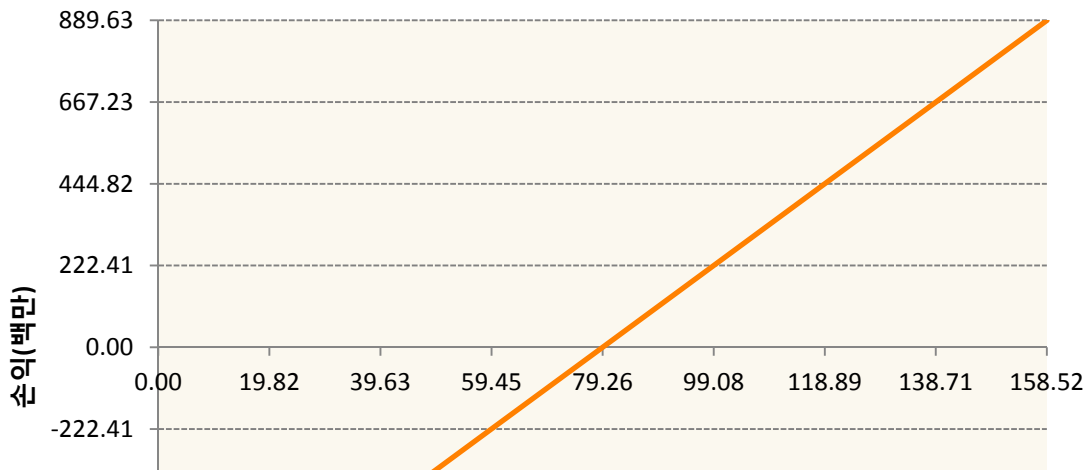
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,453	620	2,833	

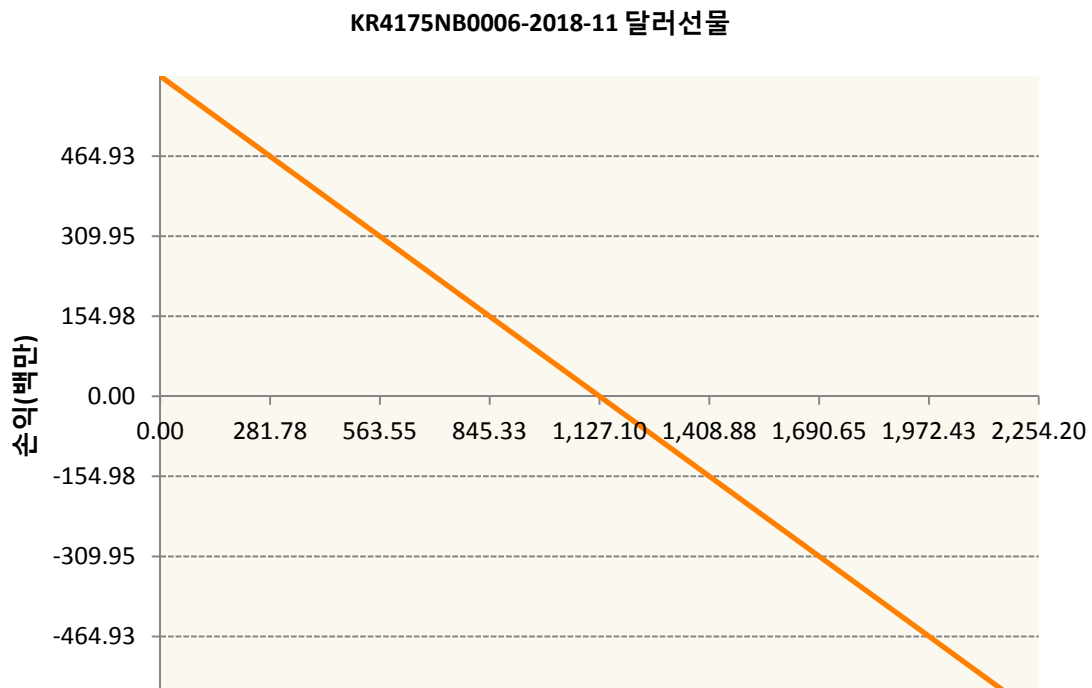
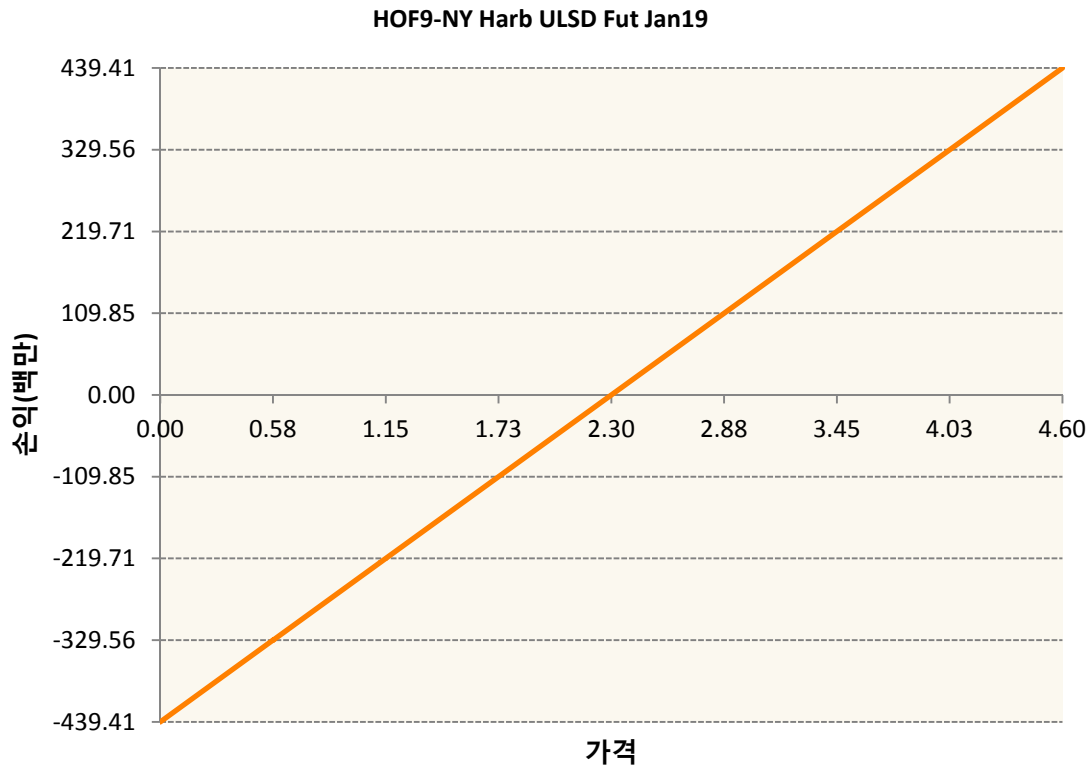
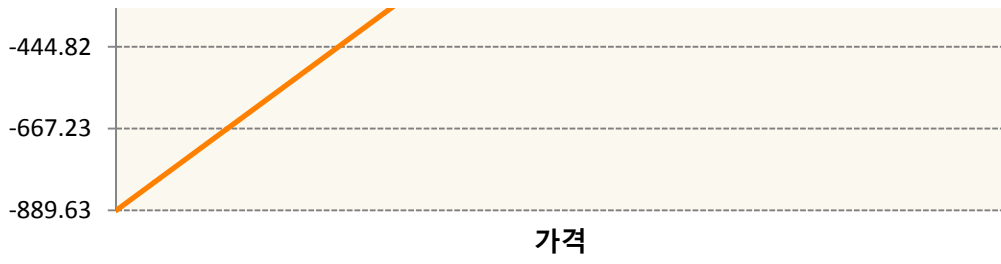
2. 만기시점의 손익구조

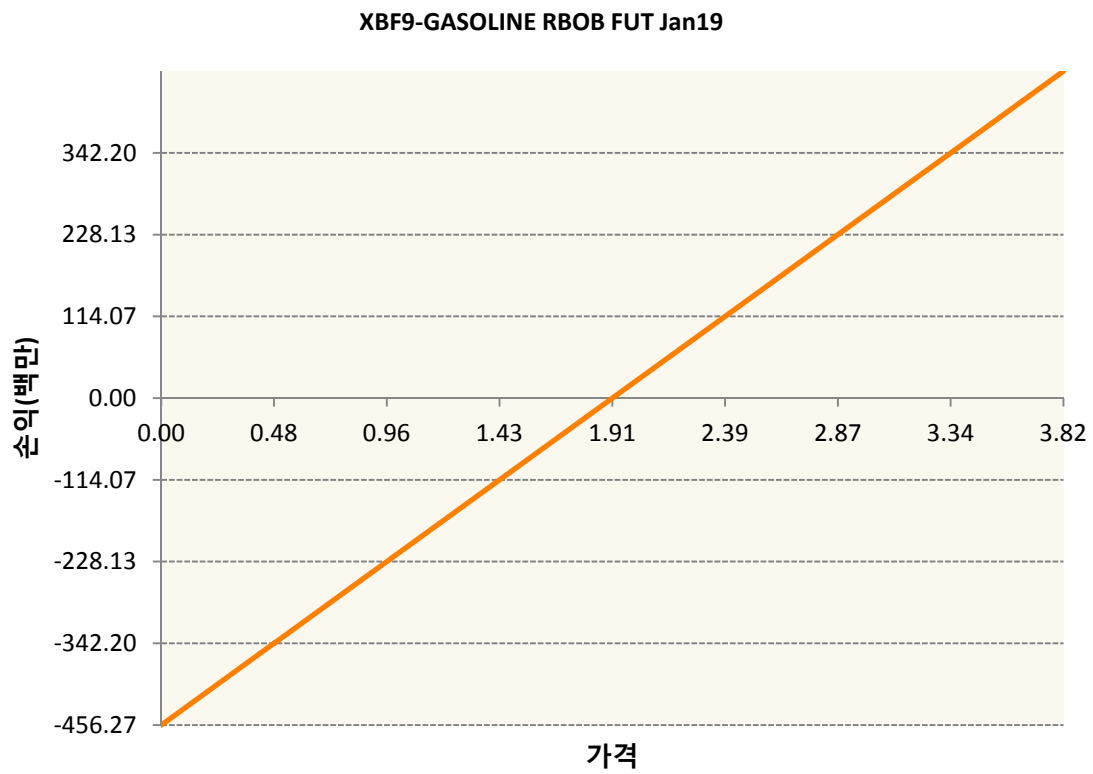
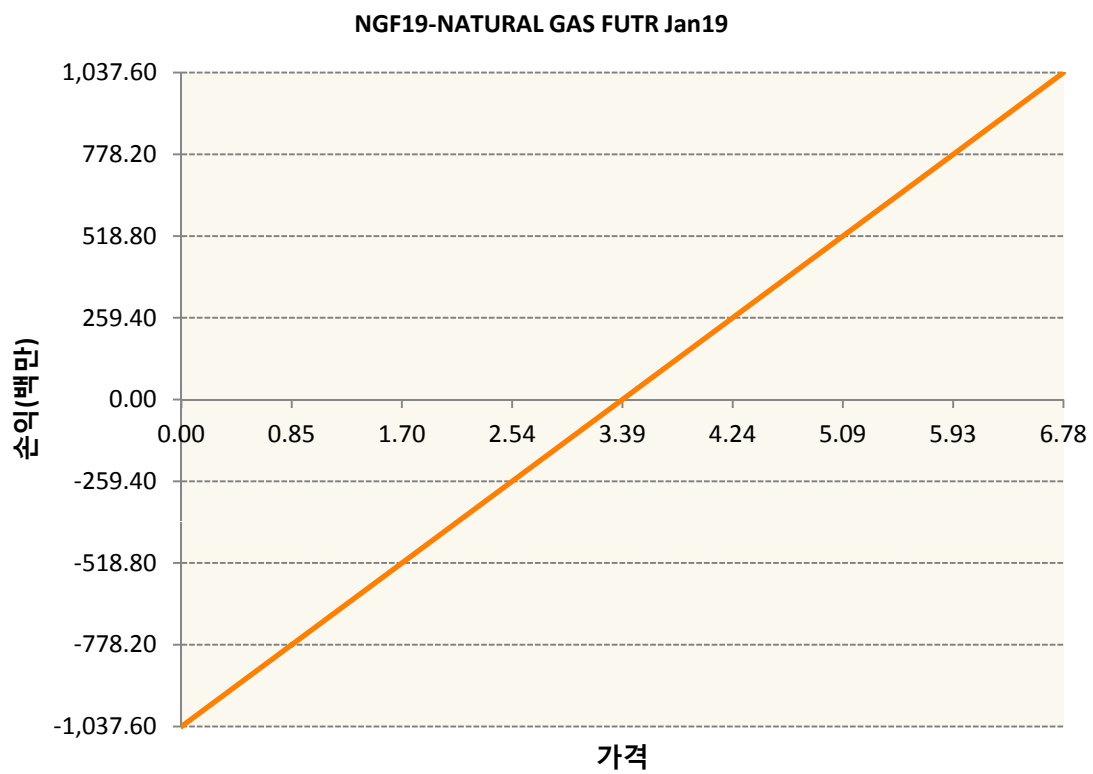
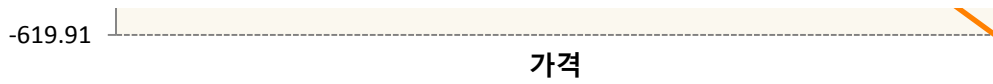
CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19



COF9-BRENT CRUDE FUTR 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	83
XBF9	GASOLINE RBOB FUT Jan19	37

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

420

공시일	2018-10-23
기준일	2018-10-22

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

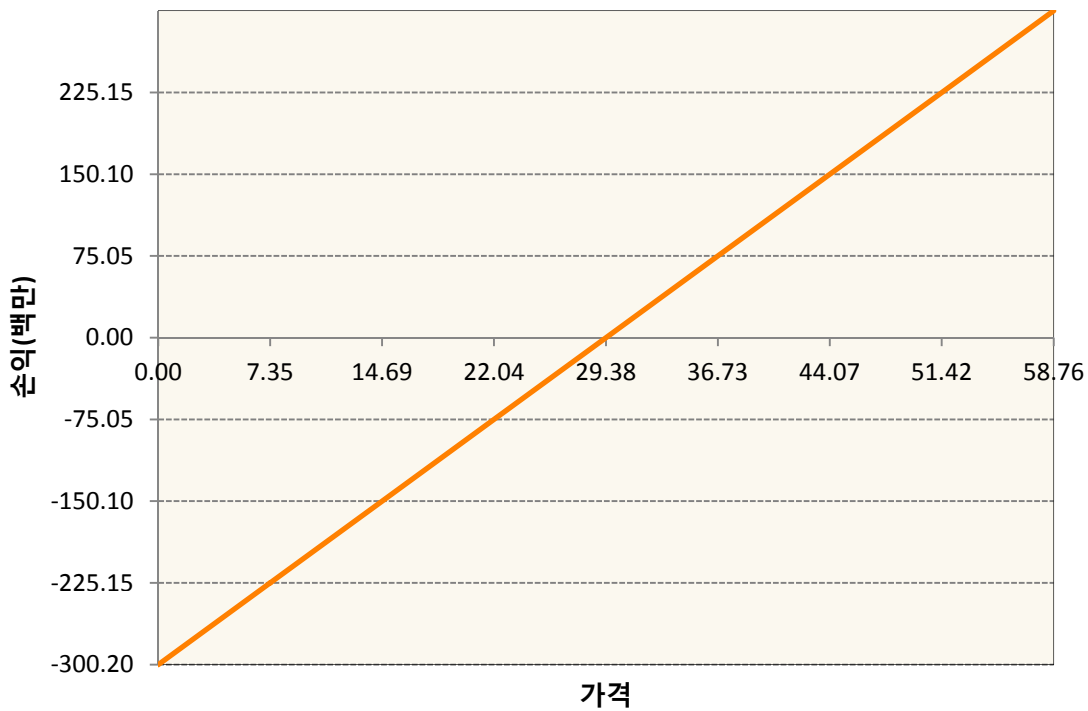
1. 계약금액

(단위:백만원)

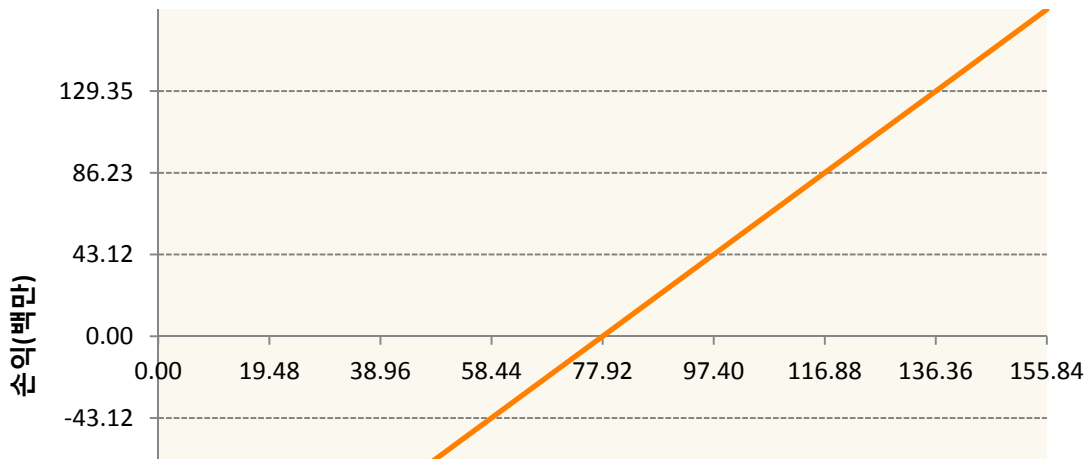
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,645	79	3,567	

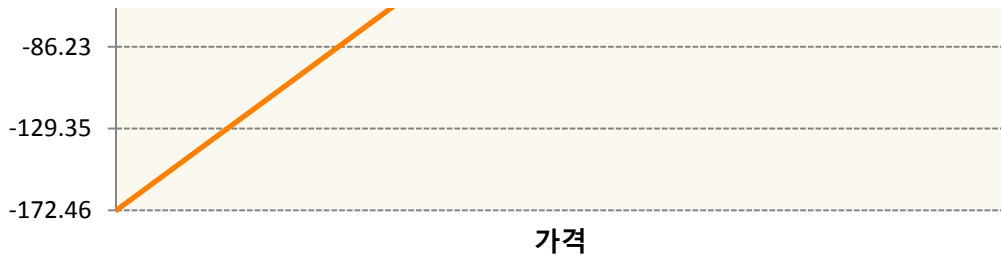
2. 만기시점의 손익구조

BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19

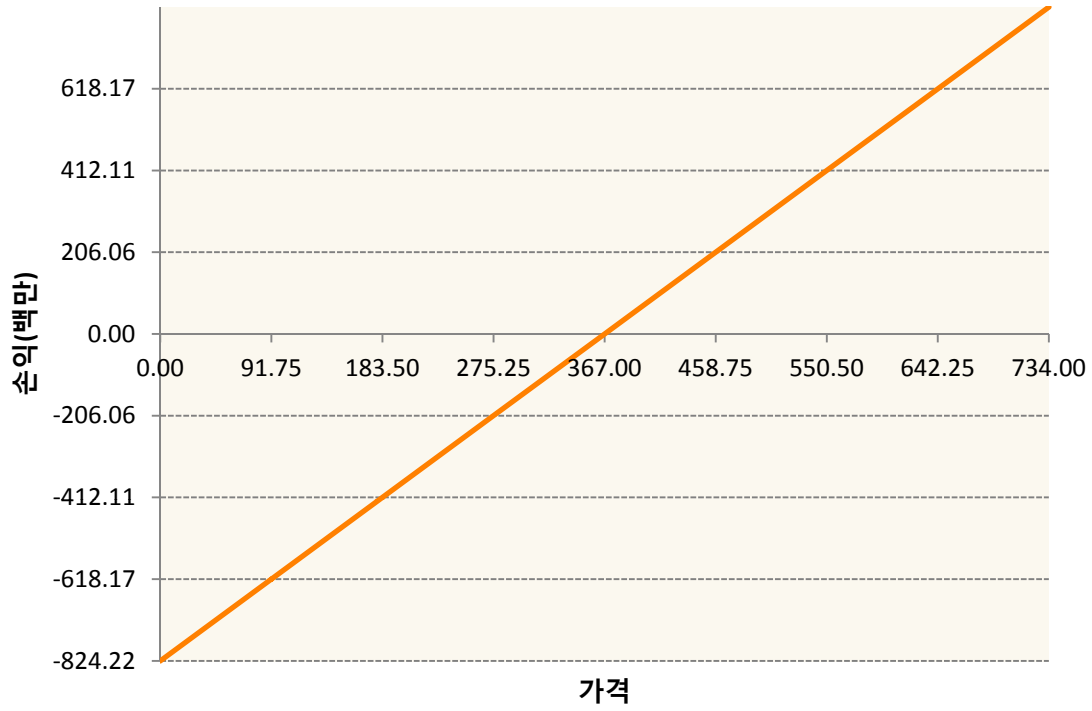


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

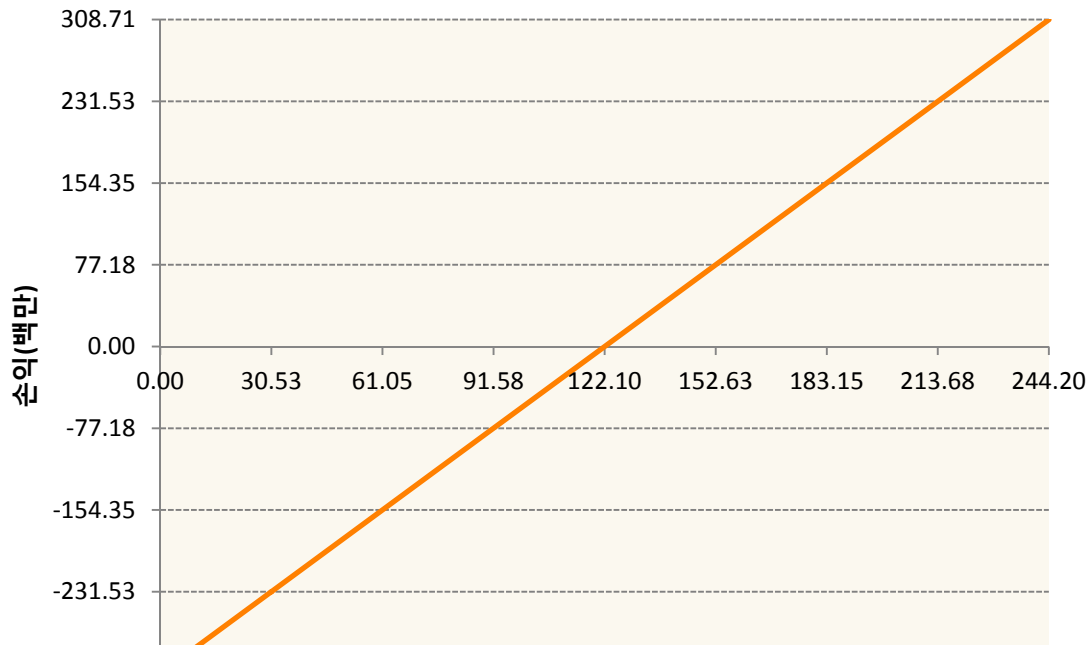


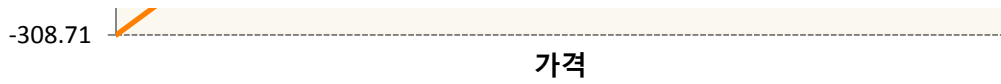


CZ8-CORN FUTURE DEC18

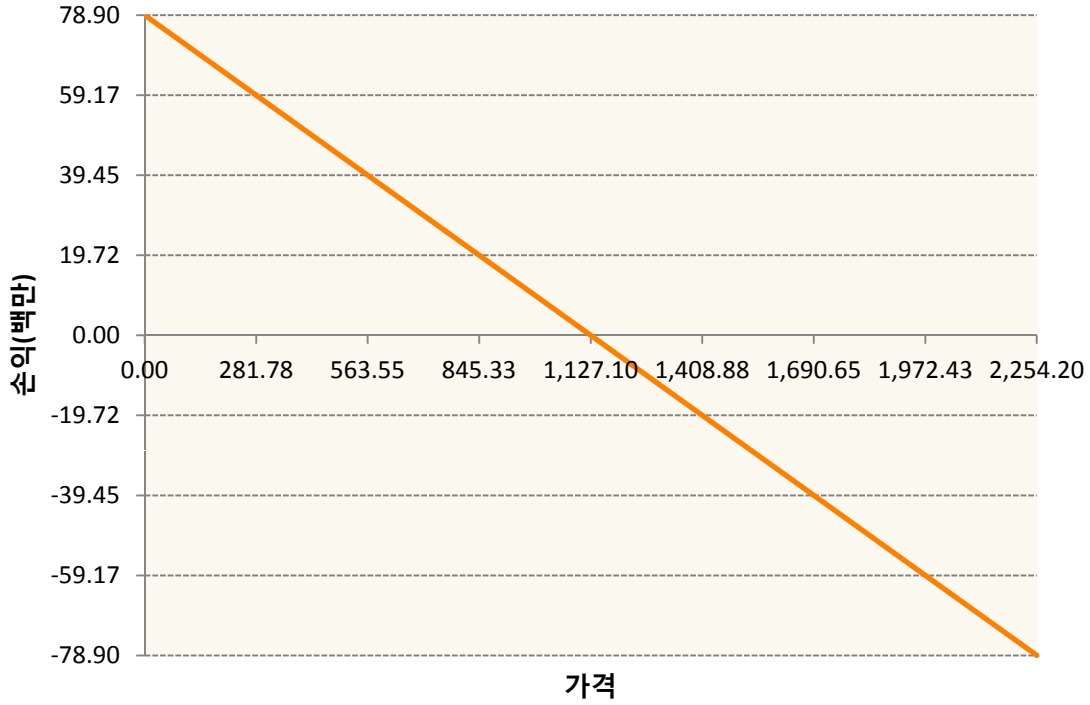


KCZ8-COFFEE 'C' FUTURE Dec18

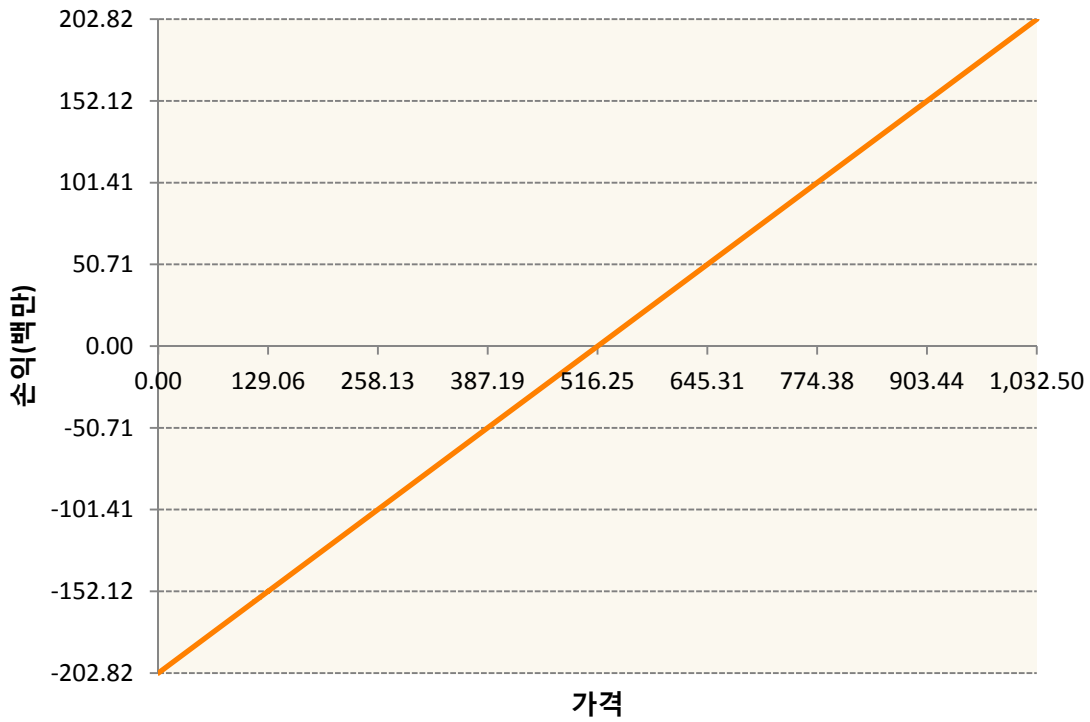




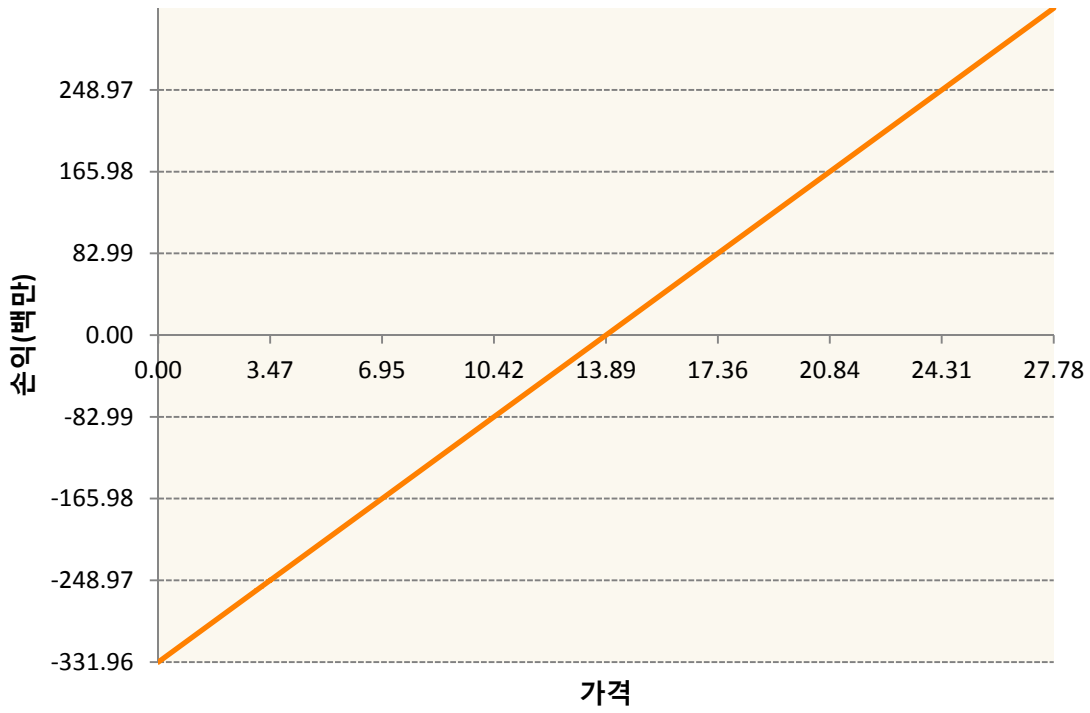
KR4175NB0006-2018-11 달러선물



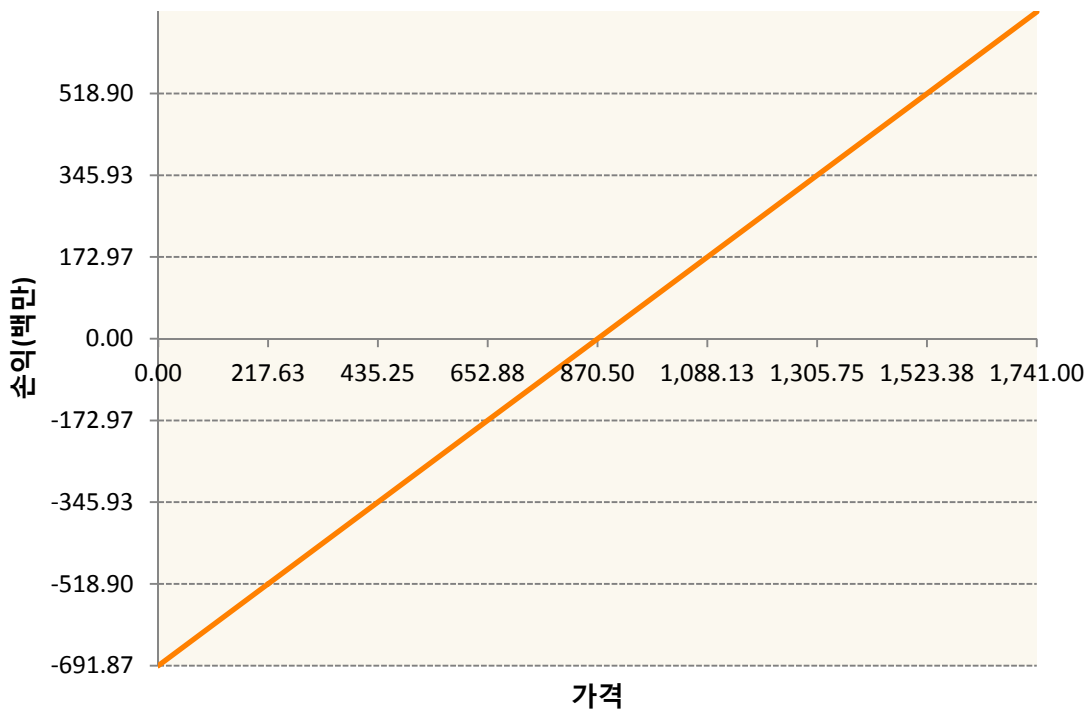
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



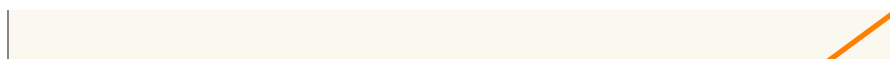
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

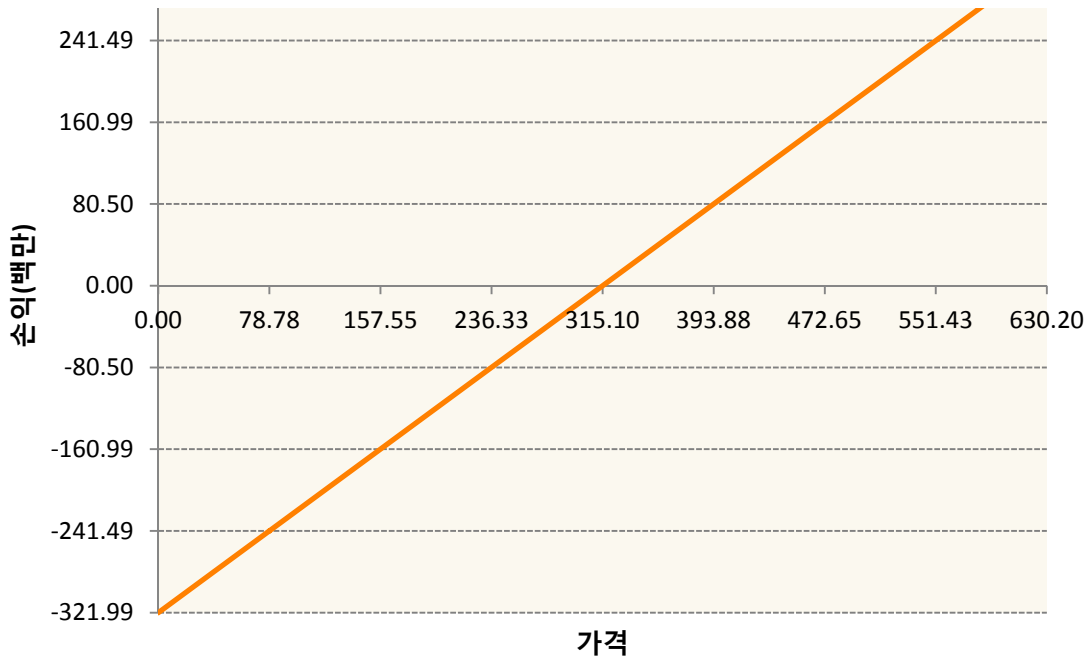


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19

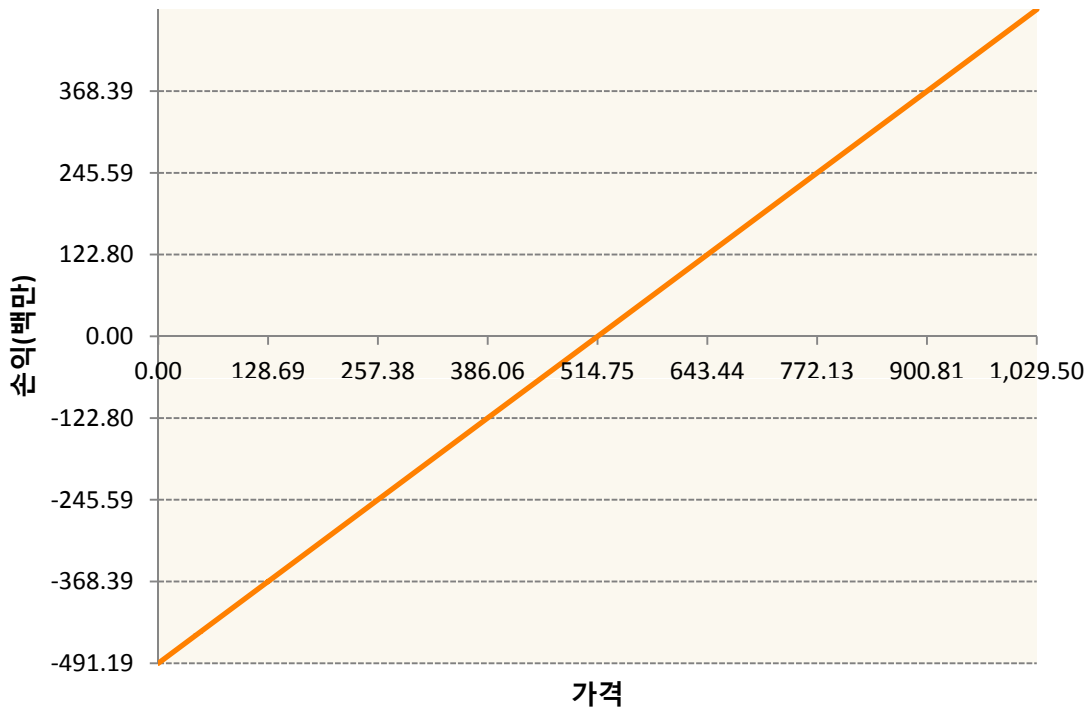


SMF9-SOYBEAN MEAL FUTR Jan19





WZ8-WHEAT FUTURE(CBT) DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF9	SOYBEAN OIL FUTR Jan19	24
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	14
CZ8	CORN FUTURE DEC18	66
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	55
SMF9	SOYBEAN MEAL FUTR Jan19	26
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	39

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

(단위:백만원)

318