

공시일	2018-10-24
기준일	2018-10-23

## 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)

66

공시일	2018-10-24
기준일	2018-10-23

## 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

1,092

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

493

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-24
기준일	2018-10-23

## 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

258

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

362

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-24
기준일	2018-10-23

## 유로인덱스모(주식-파생형)

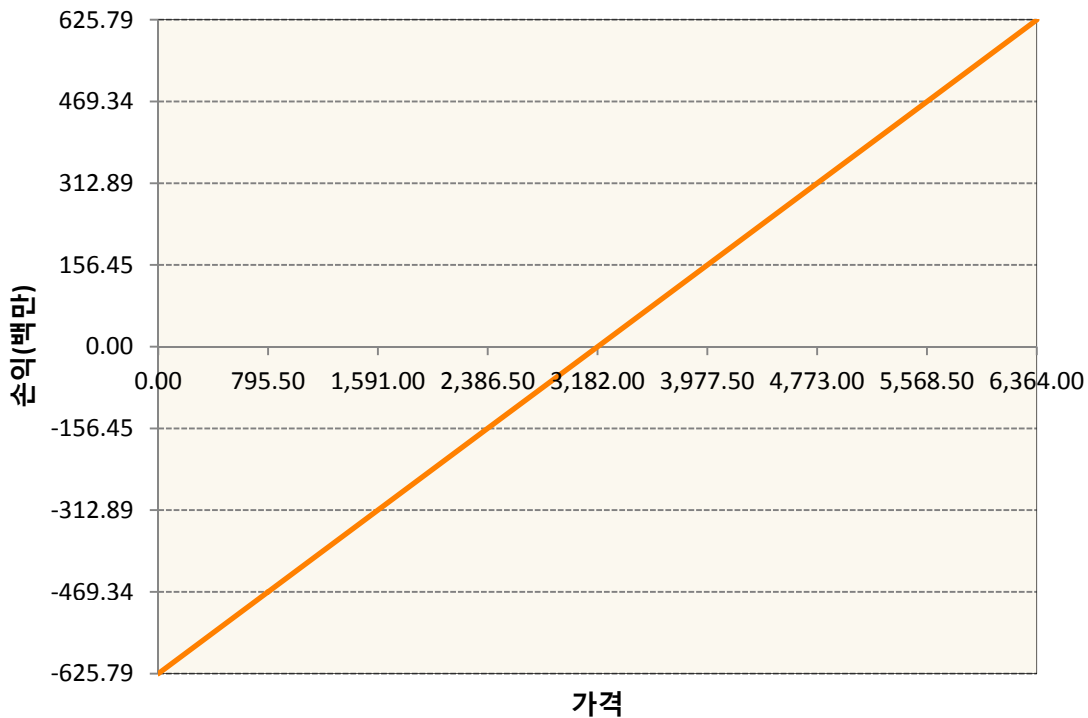
### 1. 계약금액

(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	2018-10-24
기준일	2018-10-23

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

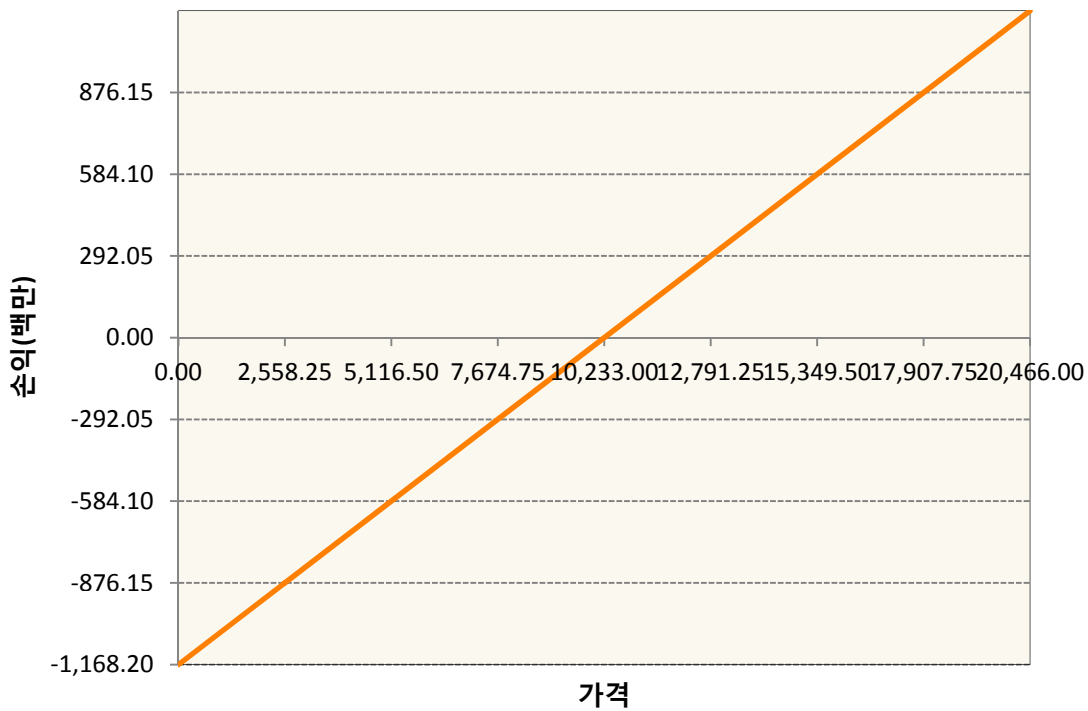
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

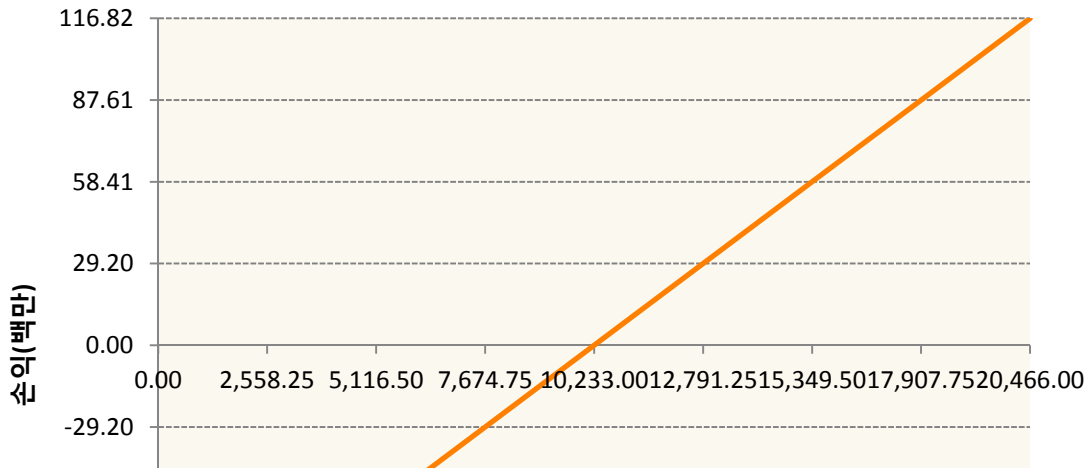
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,285	0	1,285	장내

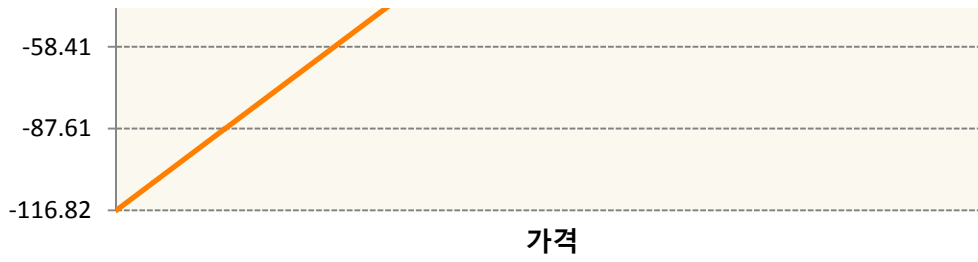
### 2. 만기시점의 손익구조

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)

<b>99</b>
-----------

공시일	2018-10-24
기준일	2018-10-23

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

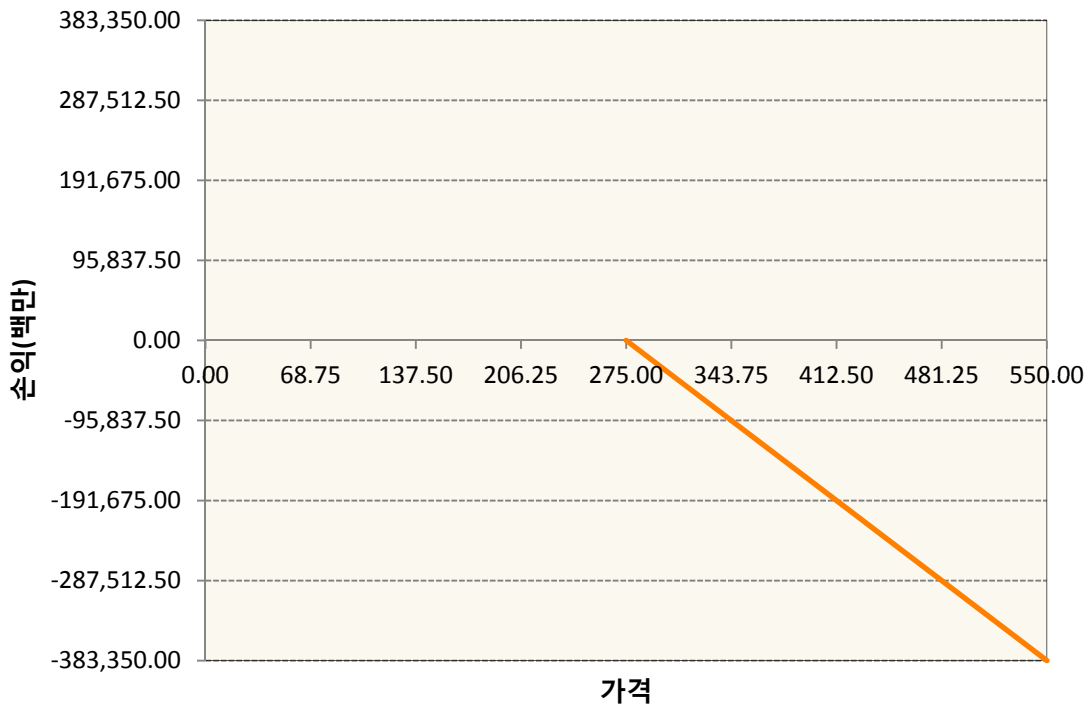
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

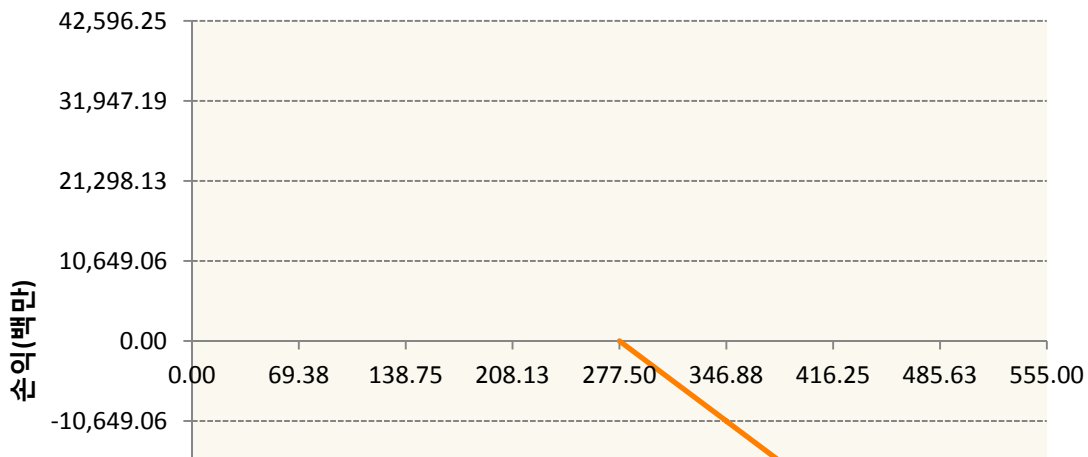
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	6,966	-6,966	장내
누계	유가증권	옵션	0	714,696	-714,696	장내

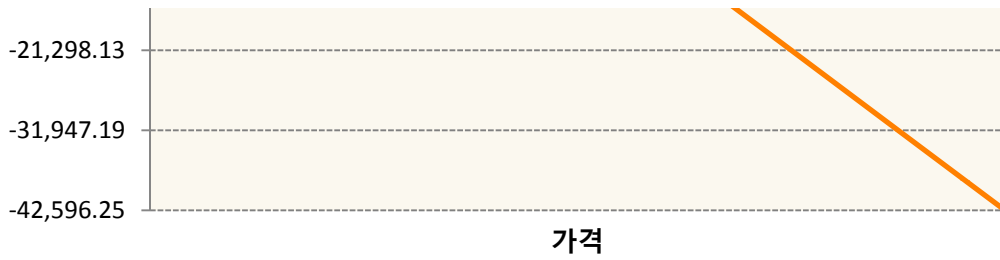
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201NB2752-2018-11 콜275**

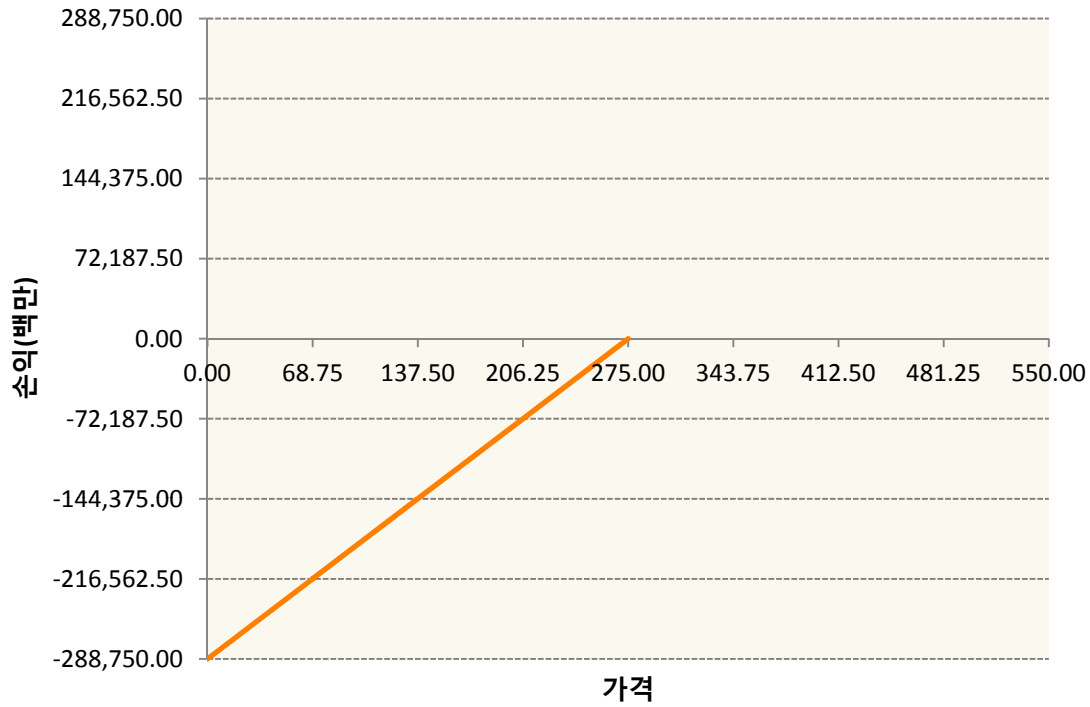


**KR4201NB2778-2018-11 콜277.5**





KR4301NB2751-2018-11 풋275



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NB27 2018-11 콜275

22,423

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,921	6,838	6,716	6,554	6,351	6,110	5,832
-5.33%	6,543	6,289	5,983	5,633	5,243	4,819	4,367
-2.67%	5,241	4,728	4,184	3,615	3,027	2,422	1,805
0%	2,121	1,416	709	0	-711	-1,423	-2,135
2.67%	-3,405	-4,082	-4,768	-5,462	-6,160	-6,863	-7,569
5.33%	-11,129	-11,597	-12,106	-12,647	-13,215	-13,804	-14,412
8.00%	-20,277	-20,516	-20,810	-21,153	-21,540	-21,965	-22,423

KR4201NB27 2018-11 콜277.5

2,312

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	615	609	600	586	569	547	522

-5.33%	589	569	542	511	475	435	391
-2.67%	489	442	390	335	276	215	152
0%	223	150	75	0	-76	-152	-229
2.67%	-293	-372	-452	-531	-611	-691	-771
5.33%	-1,066	-1,128	-1,192	-1,260	-1,329	-1,400	-1,472
8.00%	-2,028	-2,063	-2,104	-2,150	-2,201	-2,255	-2,312

KR4301NB27 2018-11 풋275

19,619

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19,439	-19,444	-19,457	-19,478	-19,511	-19,558	-19,619
-5.33%	-11,865	-11,916	-11,990	-12,086	-12,204	-12,343	-12,503
-2.67%	-4,677	-4,877	-5,103	-5,349	-5,612	-5,889	-6,178
0%	1,119	748	375	0	-377	-755	-1,134
2.67%	4,490	4,152	3,805	3,451	3,091	2,727	2,360
5.33%	5,741	5,580	5,390	5,175	4,939	4,685	4,416
8.00%	6,020	5,977	5,914	5,827	5,718	5,586	5,433

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

(단위:백만원)

45,751

공시일	2018-10-24
기준일	2018-10-23

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

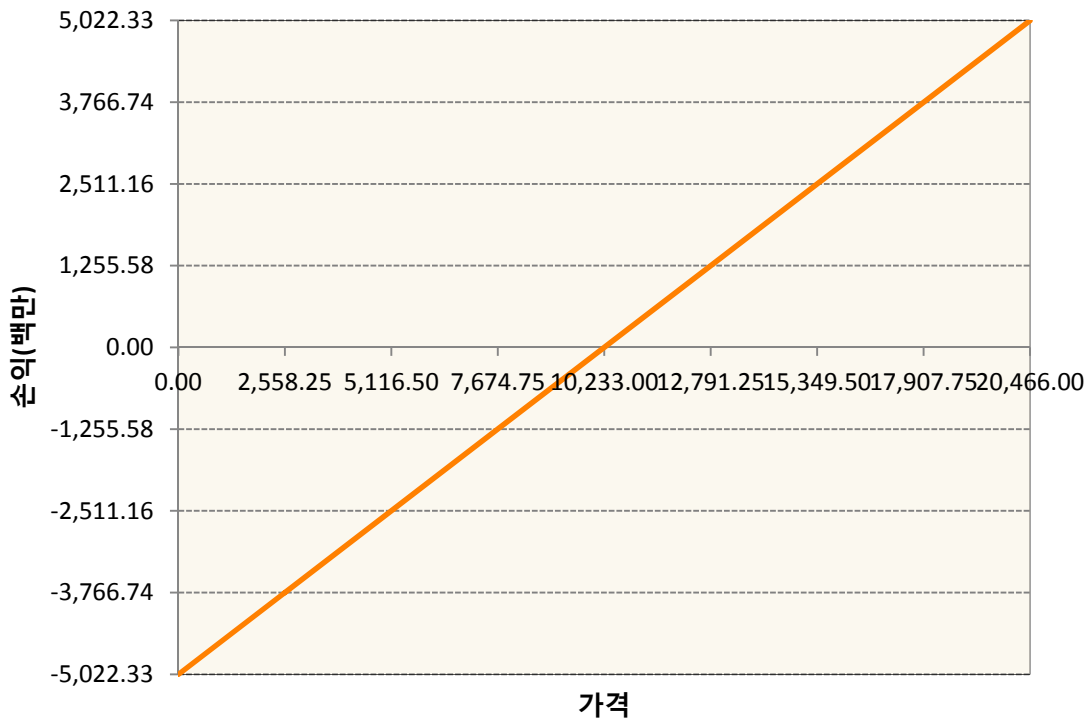
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

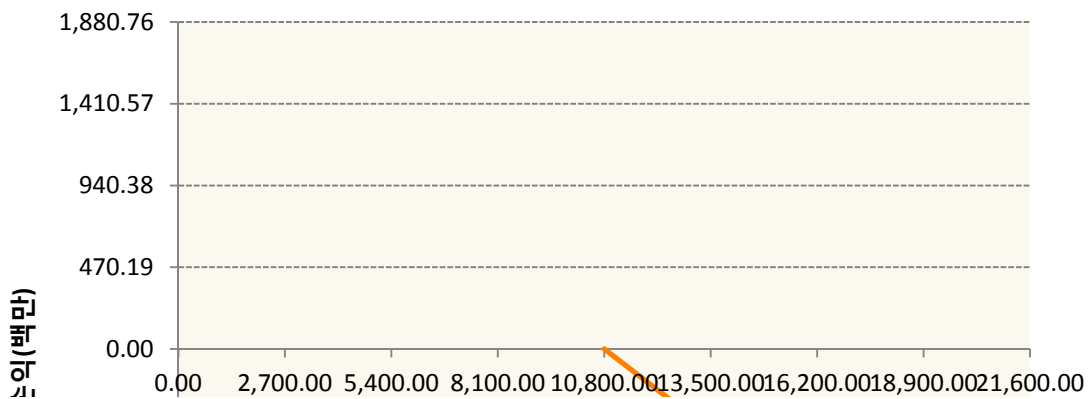
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,022	0	5,022	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,222	-12,222	장내

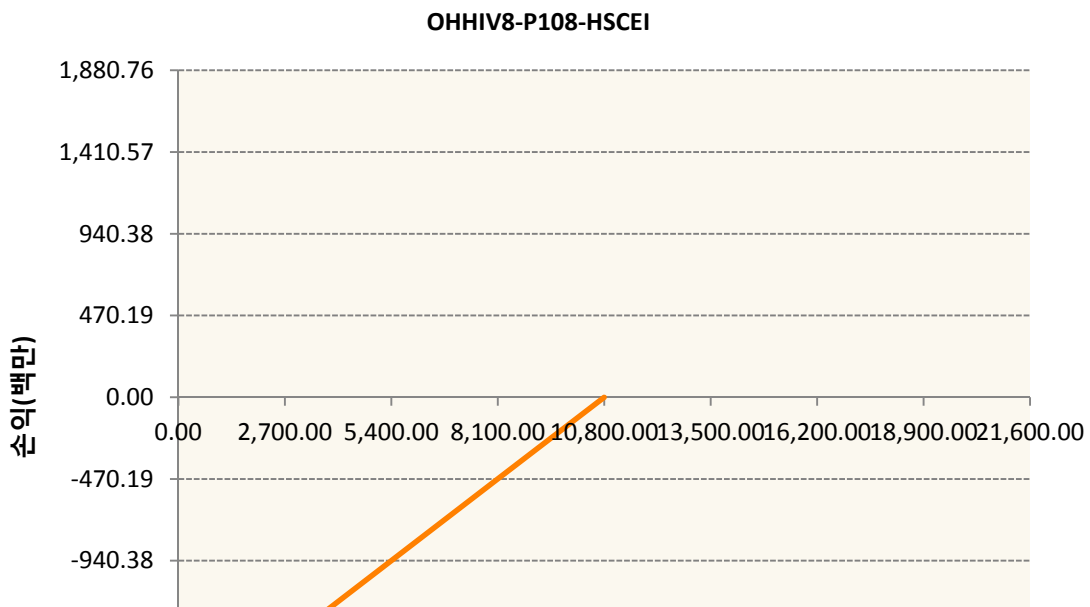
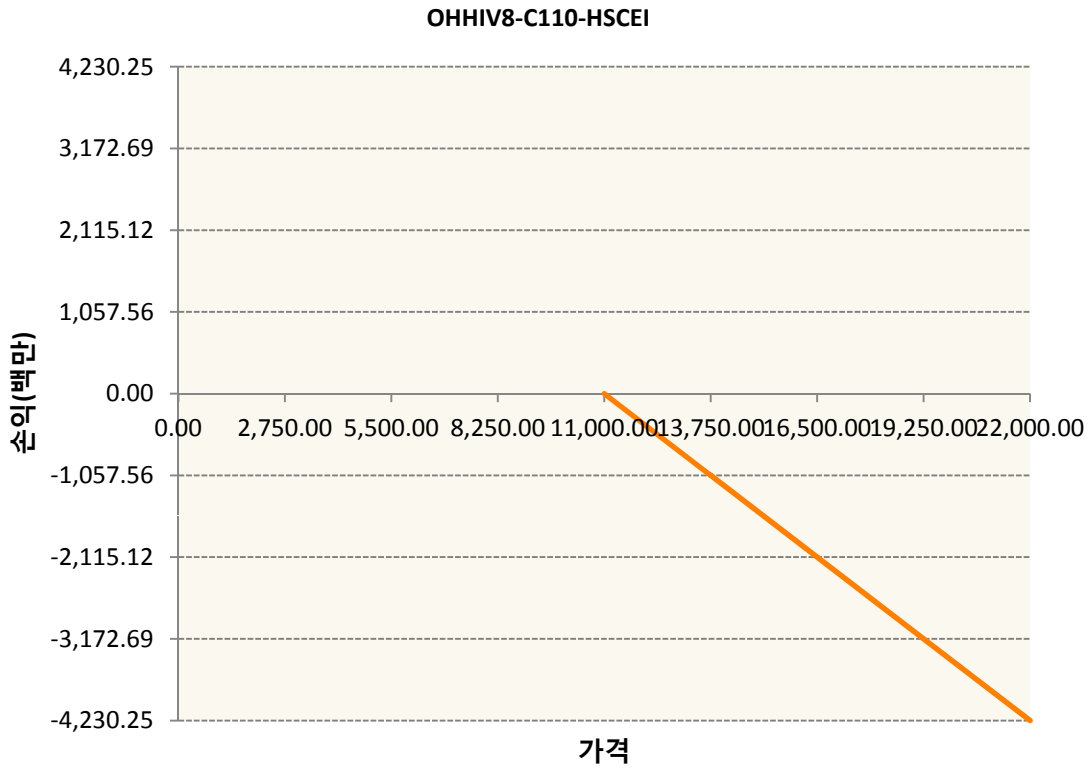
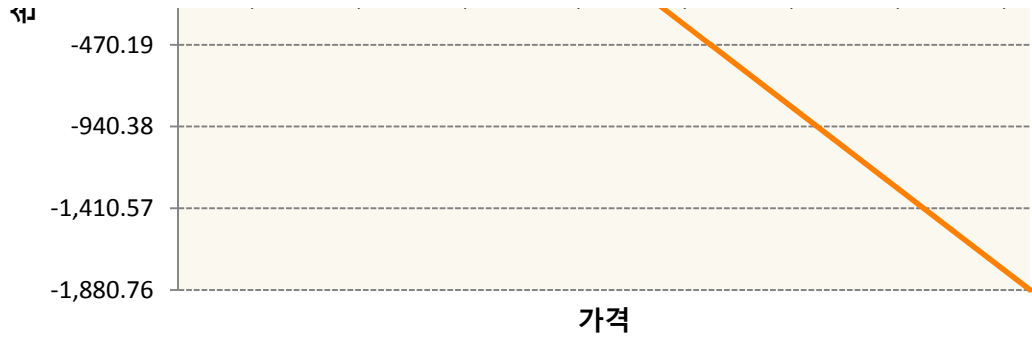
### 2. 만기시점의 손익구조

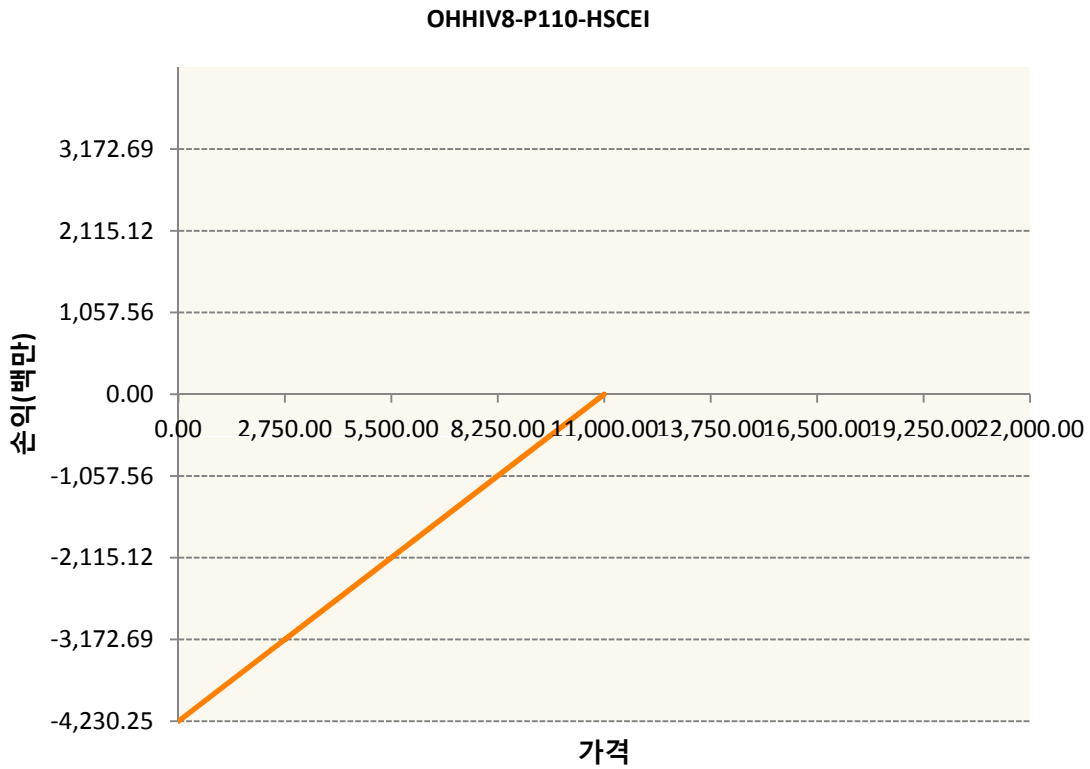
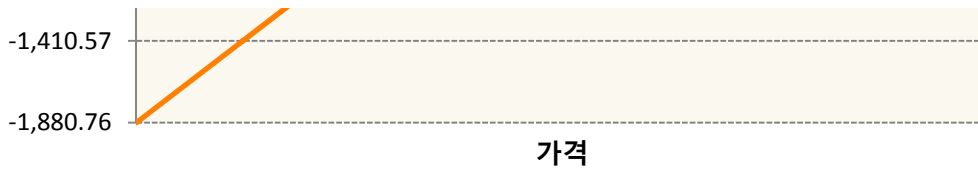
HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



OHHIV8-C108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	402
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)
	<b>1,329</b>

공시일	2018-10-24
기준일	2018-10-23

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

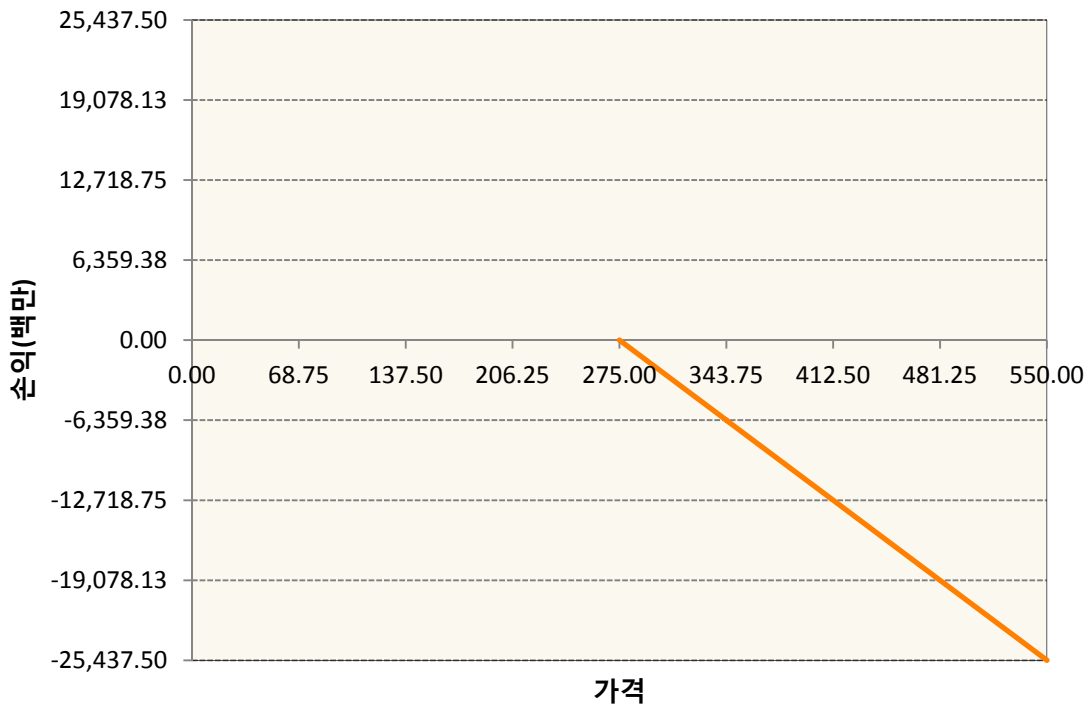
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

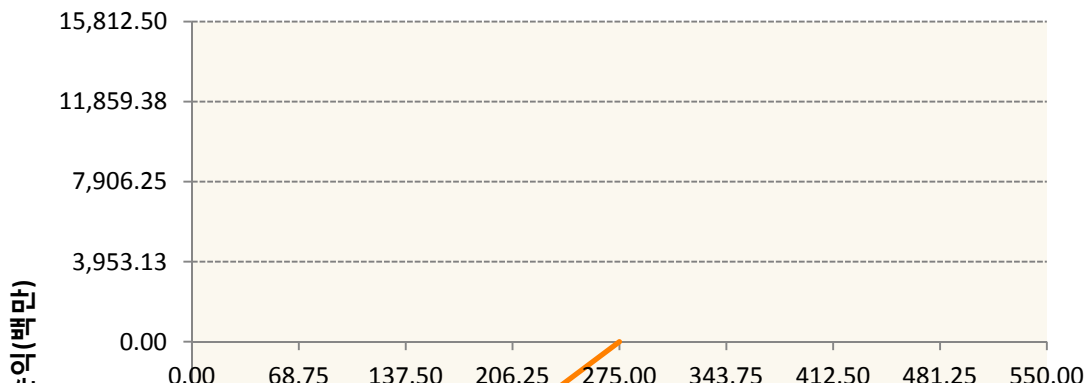
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	44,025	-44,025	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

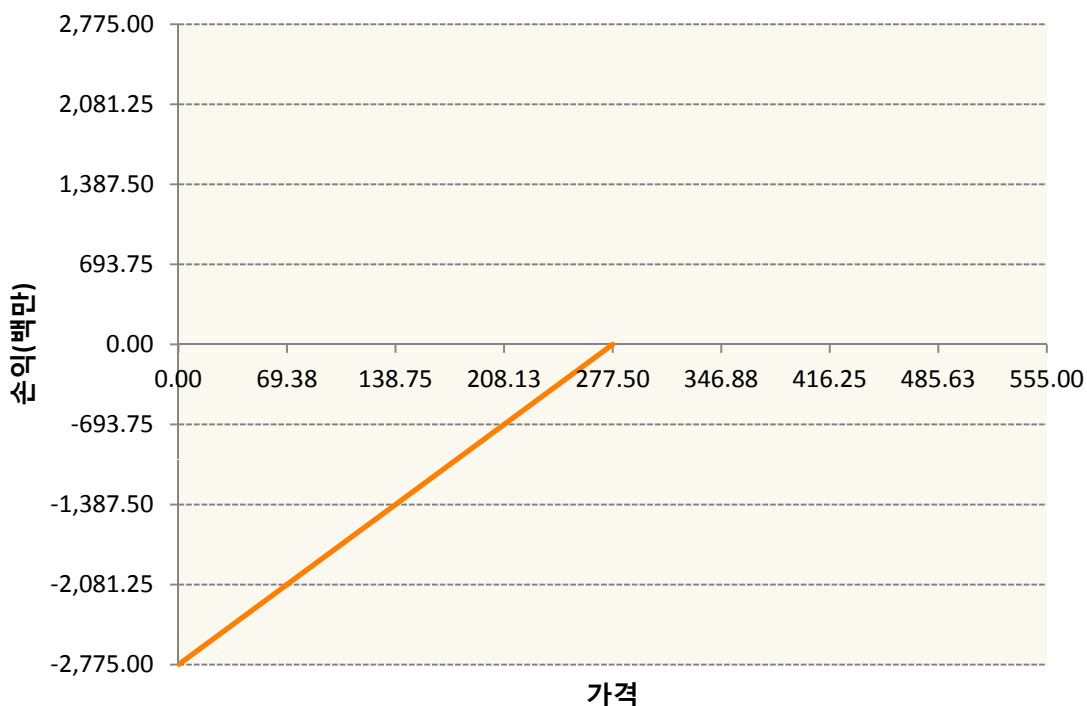


KR4301NB2751-2018-11 풋275





KR4301NB2777-2018-11 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_14							4,019	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-4,019	-4,019	-4,019	-4,019	-4,019	-4,019	-4,019	
-5.33%	-2,679	-2,679	-2,679	-2,679	-2,679	-2,679	-2,679	
-2.67%	-1,340	-1,340	-1,340	-1,340	-1,340	-1,340	-1,340	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	1,340	1,340	1,340	1,340	1,340	1,340	1,340	
5.33%	2,679	2,679	2,679	2,679	2,679	2,679	2,679	
8.00%	4,019	4,019	4,019	4,019	4,019	4,019	4,019	
KR4201NB27 2018-11 콜275							1,488	
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	459	454	446	435	421	405	387
-5.33%	434	417	397	374	348	320	290
-2.67%	348	314	278	240	201	161	120
0%	141	94	47	0	-47	-94	-142
2.67%	-226	-271	-316	-362	-409	-455	-502
5.33%	-738	-770	-803	-839	-877	-916	-956
8.00%	-1,345	-1,361	-1,381	-1,404	-1,429	-1,458	-1,488

KR4301NB27 2018-11 풋275

1,074

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,064	-1,065	-1,065	-1,067	-1,068	-1,071	-1,074
-5.33%	-650	-653	-657	-662	-668	-676	-685
-2.67%	-256	-267	-279	-293	-307	-322	-338
0%	61	41	21	0	-21	-41	-62
2.67%	246	227	208	189	169	149	129
5.33%	314	306	295	283	270	257	242
8.00%	330	327	324	319	313	306	298

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

195

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-194	-194	-194	-194	-195	-195	-195
-5.33%	-122	-122	-122	-123	-124	-125	-126
-2.67%	-51	-53	-54	-56	-58	-60	-63
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	50	47	43	39	36	32	28
5.33%	68	66	63	61	58	55	52
8.00%	73	72	71	70	68	67	65

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

(단위:백만원)

6,878

공시일	2018-10-24
기준일	2018-10-23

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

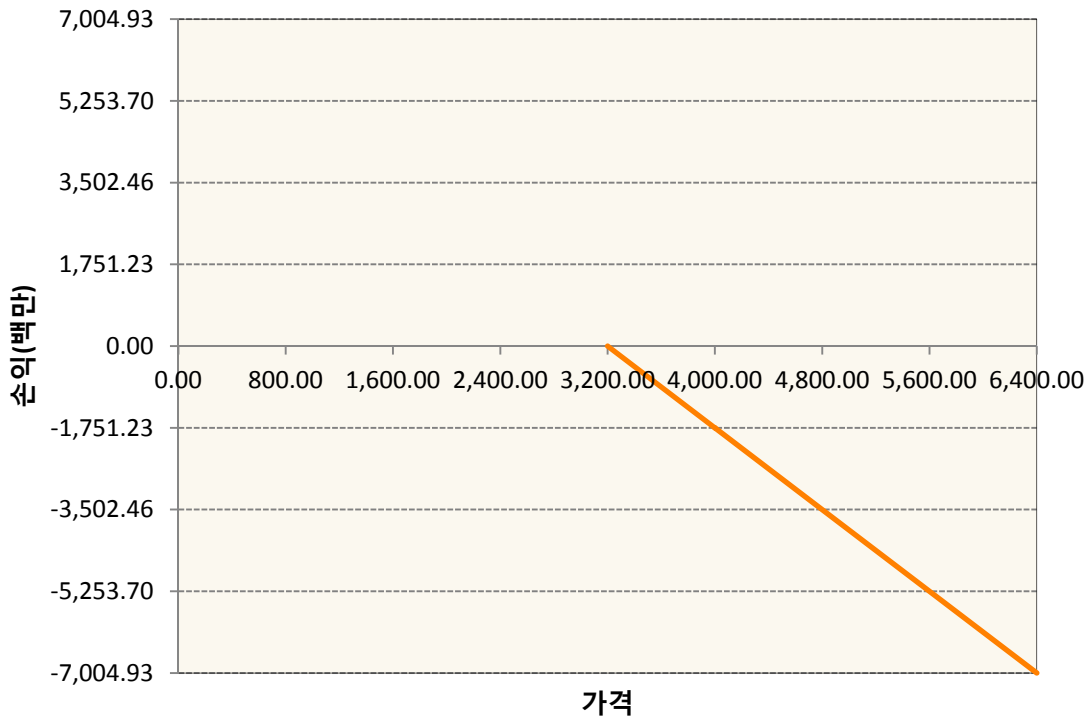
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

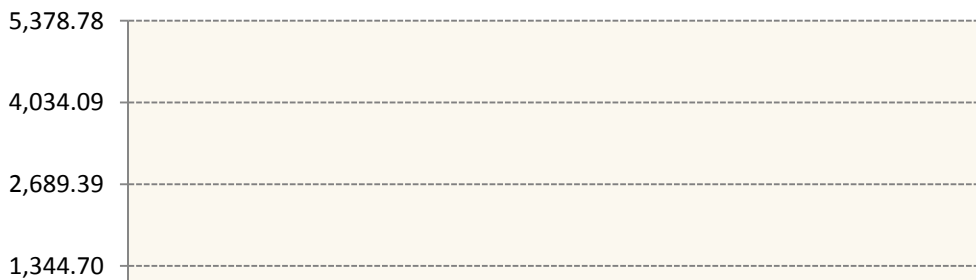
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,846	0	5,846	
누계	유가증권	스왑	72,777	0	72,777	장외
누계	유가증권	옵션	0	24,767	-24,767	장내

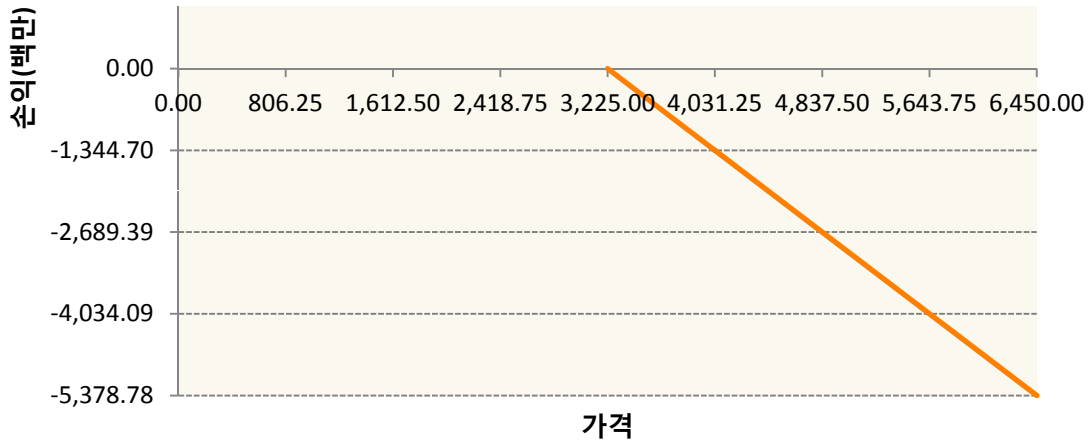
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXX8-C3200-EURO STOXX 50**

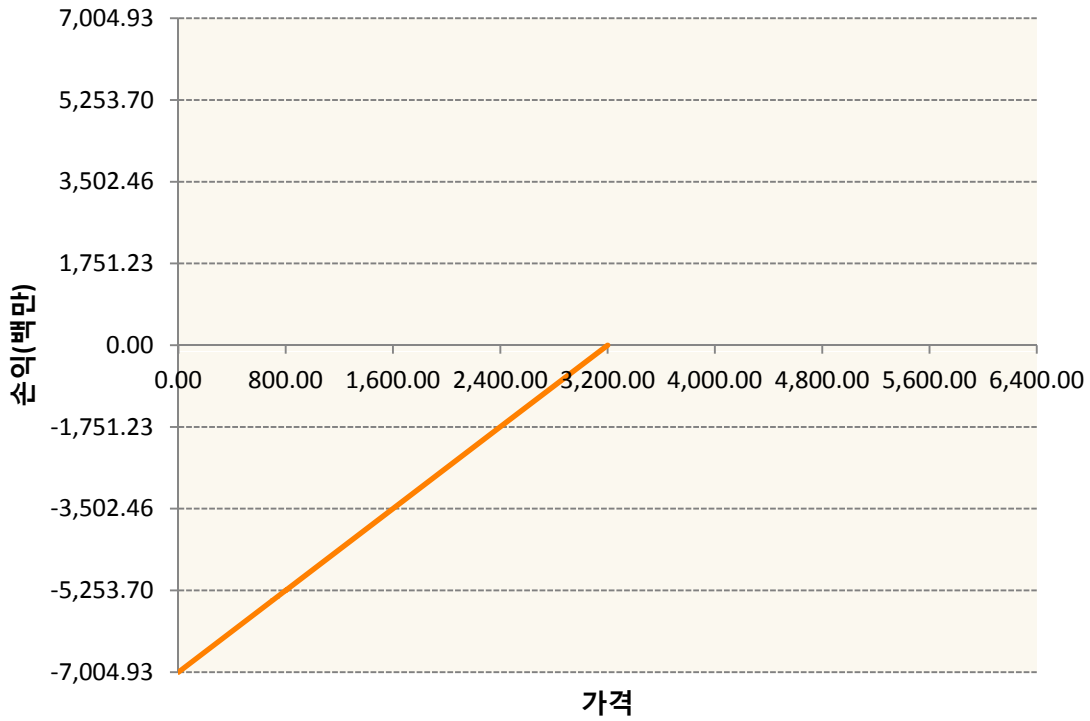


**OESXX8-C3225-EURO STOXX 50**

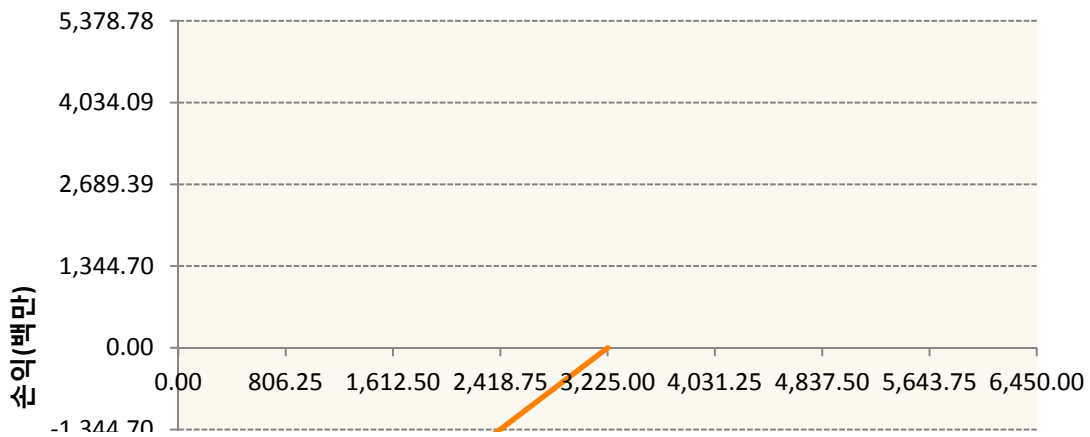


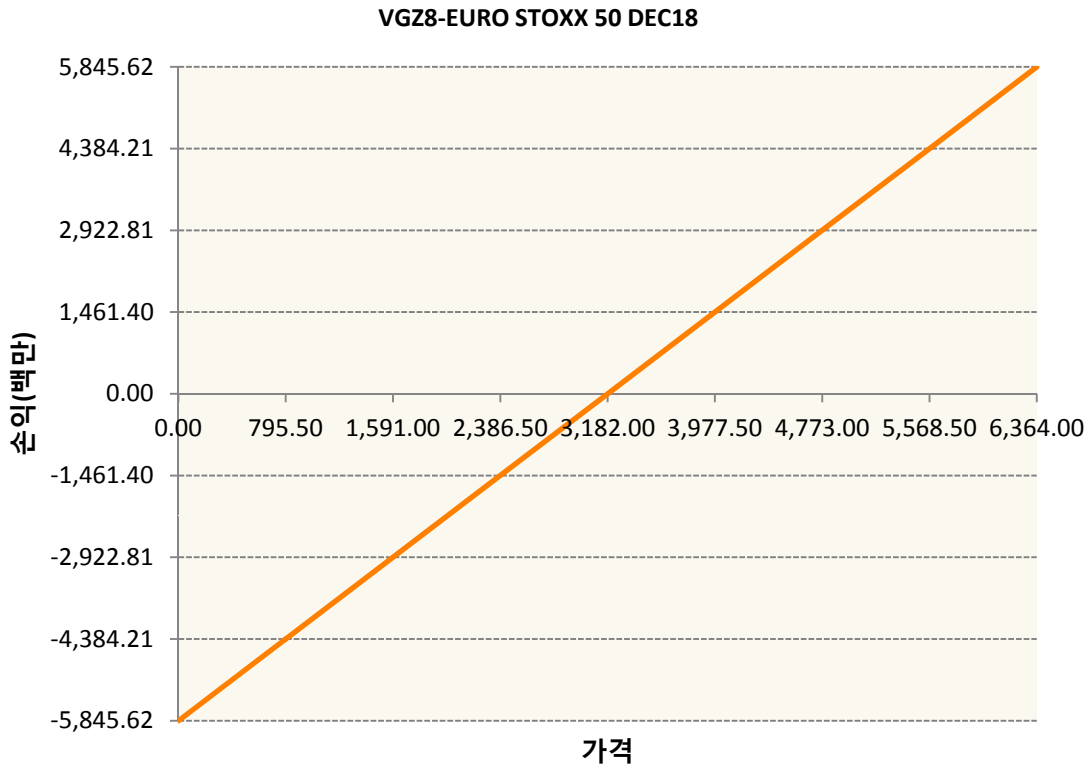


**OESXX8-P3200-EURO STOXX 50**



**OESXX8-P3225-EURO STOXX 50**





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)**

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	0.1
OESXX8-C32 EURO STOXX 50	560
OESXX8-C32 EURO STOXX 50	430
OESXX8-P32 EURO STOXX 50	560
OESXX8-P32 EURO STOXX 50	430
VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18	468

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

**1,530**



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

(단위:백만원)

1,126



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)

150



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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-10-24
기준일	2018-10-23

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

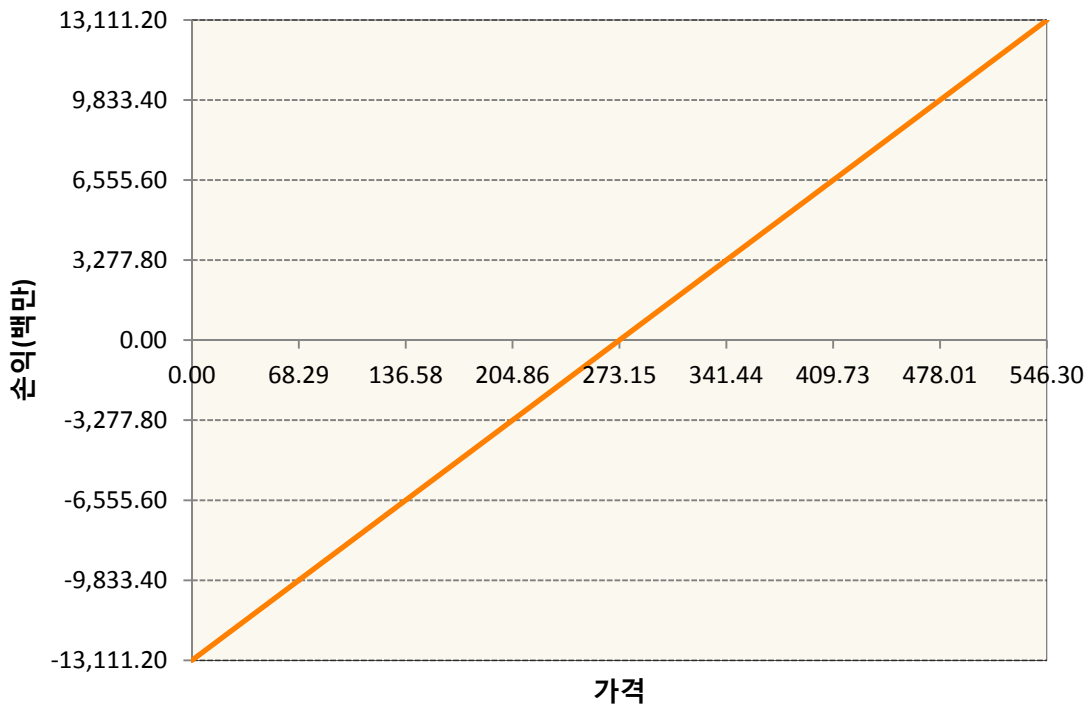
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

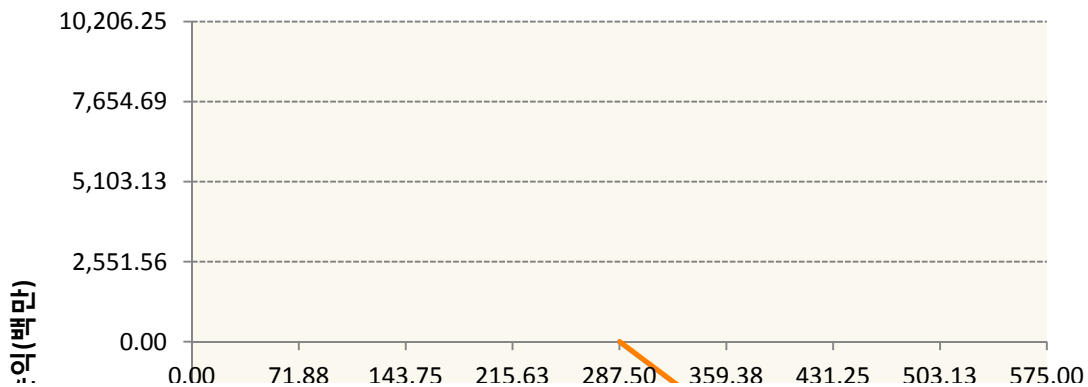
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,111	0	13,111	장내
누계	유가증권	옵션	4,059	23,401	-19,343	장내

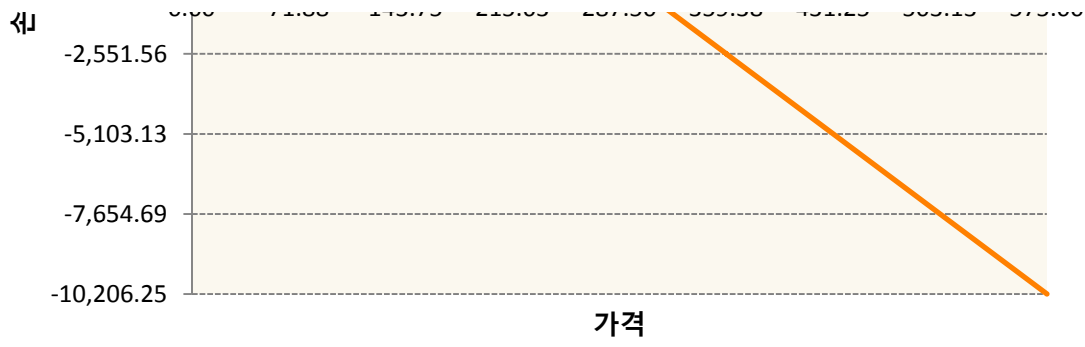
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

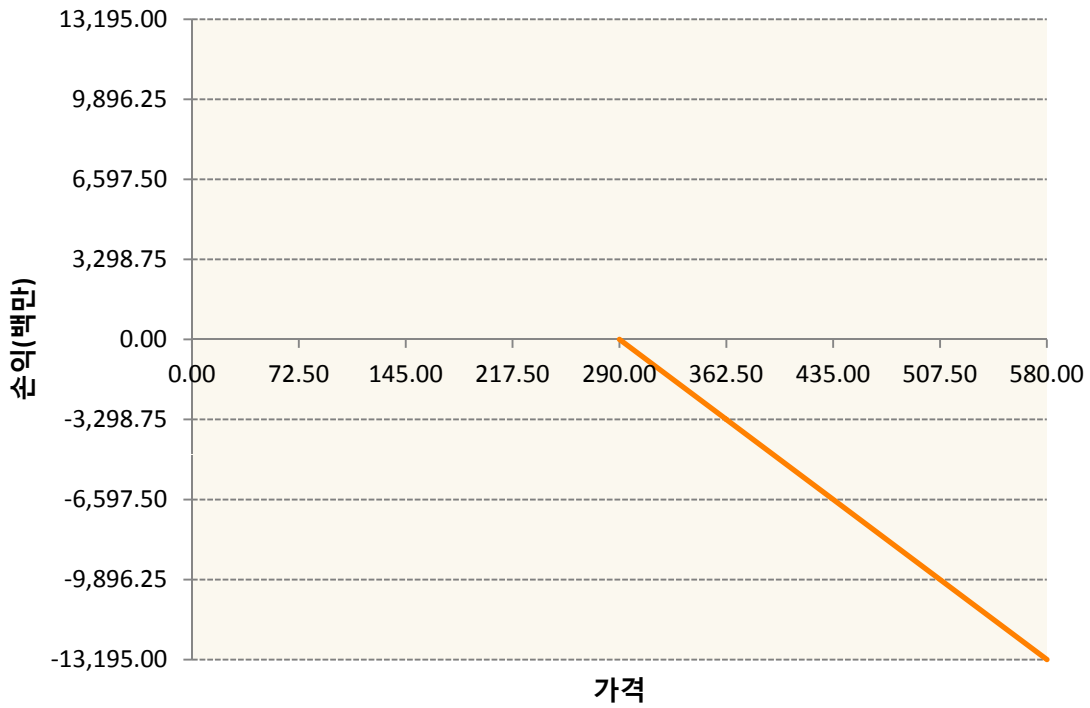


KR4201NB2877-2018-11 콜287.5

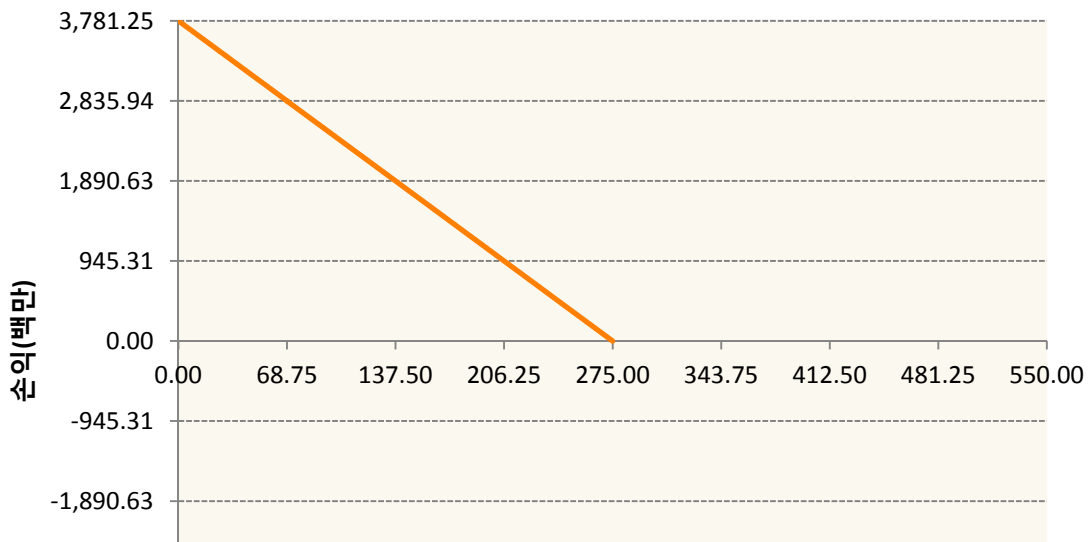


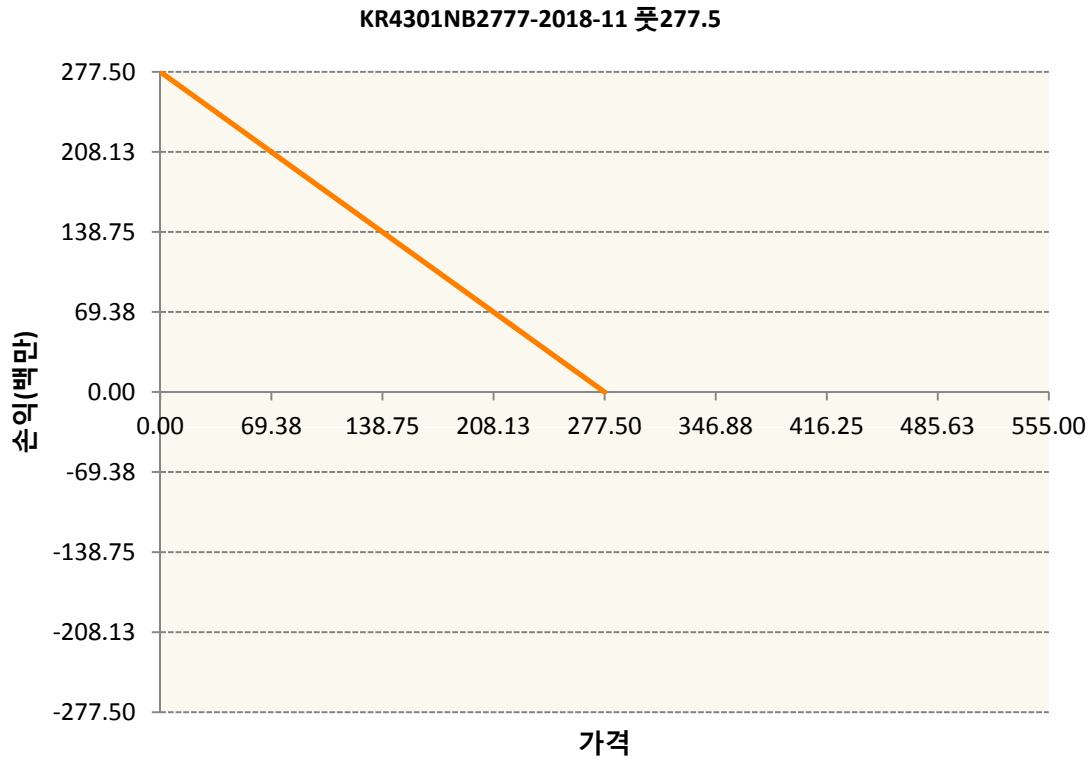
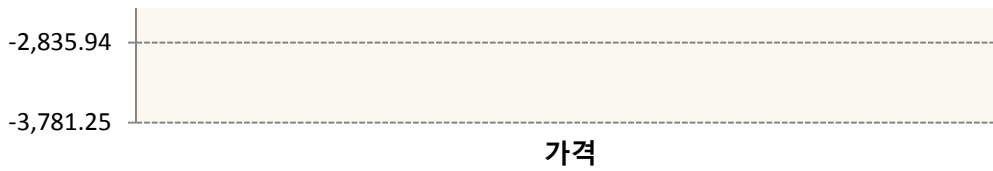


**KR4201NB2901-2018-11 콜290**



**KR4301NB2751-2018-11 풋275**





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101NC0( 2018-12 코스피200지수선물) 1,047

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,047	-1,047	-1,047	-1,047	-1,047	-1,047	-1,047
-5.33%	-698	-698	-698	-698	-698	-698	-698
-2.67%	-349	-349	-349	-349	-349	-349	-349
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	349	349	349	349	349	349	349
5.33%	698	698	698	698	698	698	698
8.00%	1,047	1,047	1,047	1,047	1,047	1,047	1,047

KR4201NB28 2018-11 콜287.5 376

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	52	52	52	51	50	48	45
-5.33%	51	50	49	46	43	39	33
-2.67%	47	44	39	33	25	17	8

0%	31	22	12	0	-12	-26	-39
2.67%	-15	-31	-48	-64	-81	-99	-116
5.33%	-113	-132	-151	-170	-190	-209	-228
8.00%	-269	-286	-304	-322	-340	-358	-376

KR4201NB27 2018-11 콜290

432

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	50	50	50	49	48	46	44
-5.33%	50	49	47	45	42	37	32
-2.67%	47	43	39	32	25	16	6
0%	33	24	13	0	-14	-29	-45
2.67%	-11	-29	-48	-67	-88	-108	-130
5.33%	-112	-136	-160	-184	-209	-233	-258
8.00%	-287	-310	-334	-358	-383	-407	-432

KR4301NB27 2018-11 풋275

257

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	255	255	255	255	256	256	257
-5.33%	155	156	157	158	160	162	164
-2.67%	61	64	67	70	73	77	81
0%	-15	-10	-5	0	5	10	15
2.67%	-59	-54	-50	-45	-40	-36	-31
5.33%	-75	-73	-71	-68	-65	-61	-58
8.00%	-79	-78	-77	-76	-75	-73	-71

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

20

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19	19	19	19	19	19	20
-5.33%	12	12	12	12	12	12	13
-2.67%	5	5	5	6	6	6	6
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-5	-5	-4	-4	-4	-3	-3
5.33%	-7	-7	-6	-6	-6	-6	-5
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-6

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

(단위:백만원)

1,637

공시일	2018-10-24
기준일	2018-10-23

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

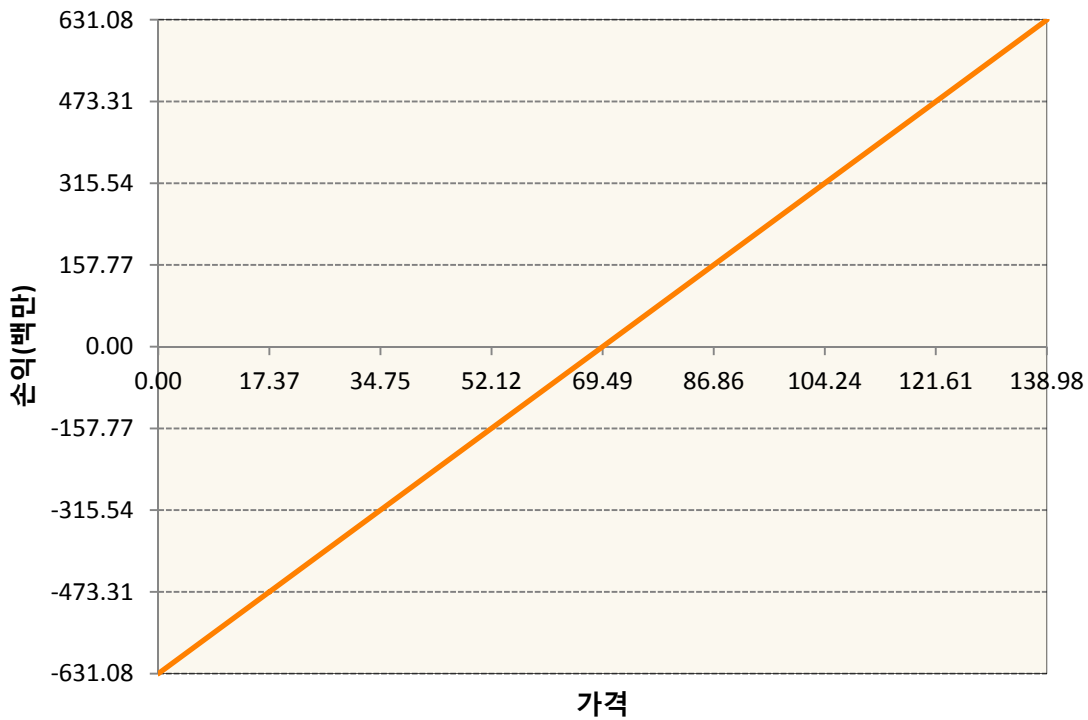
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

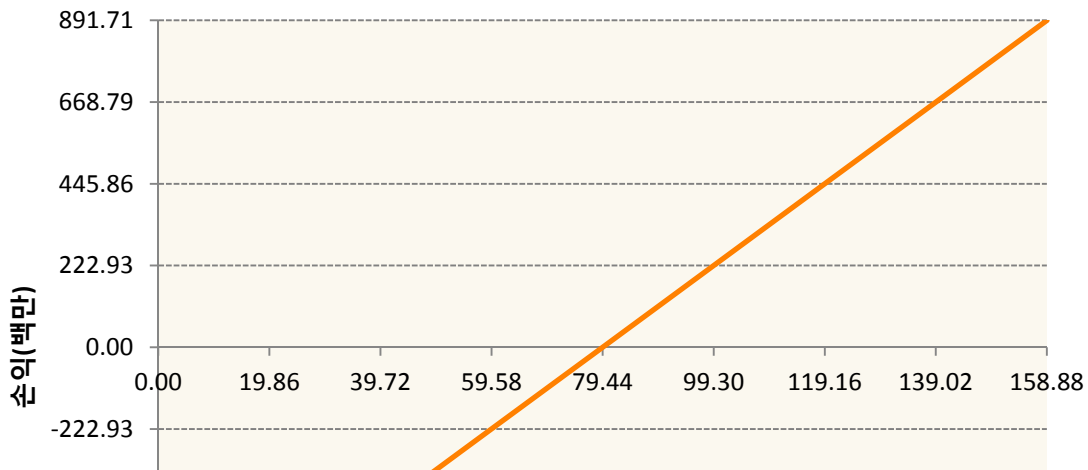
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,429	545	2,883	

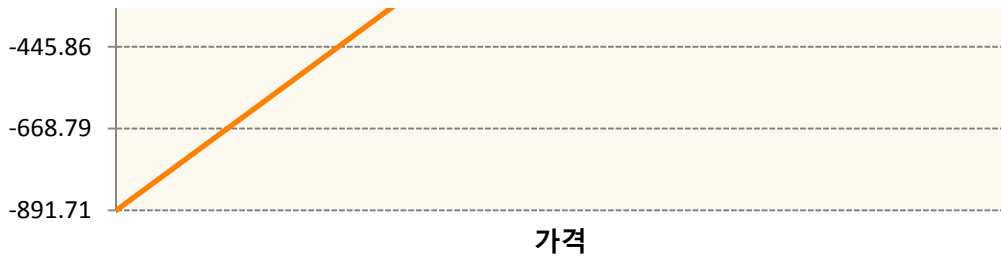
### 2. 만기시점의 손익구조

CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19

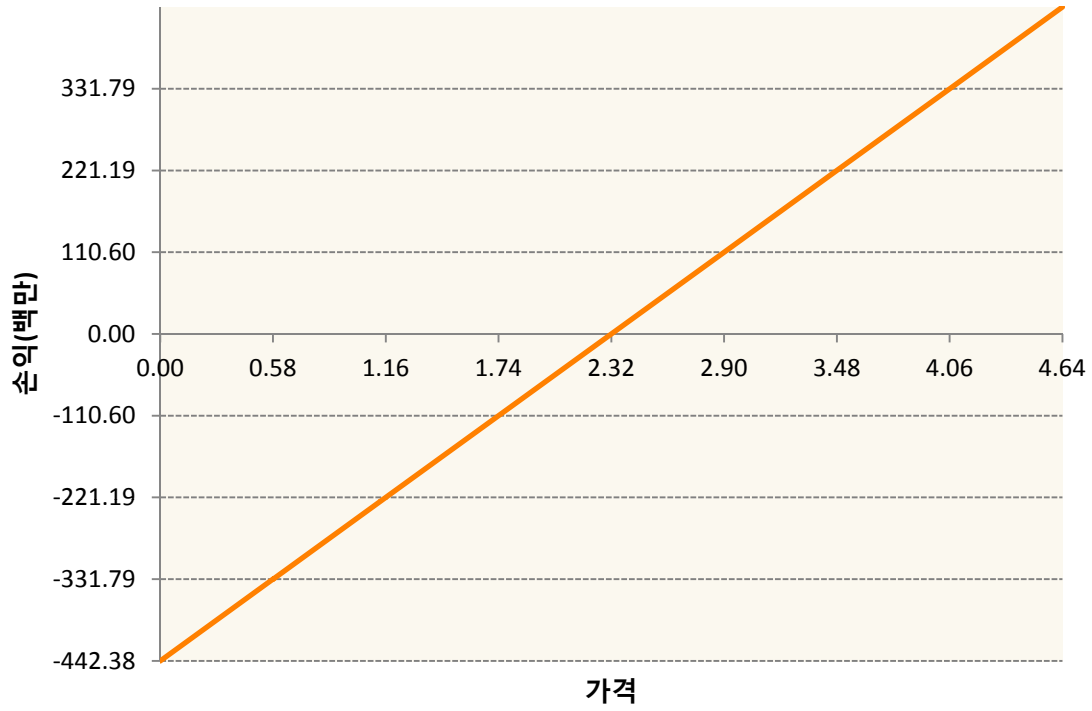


COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19

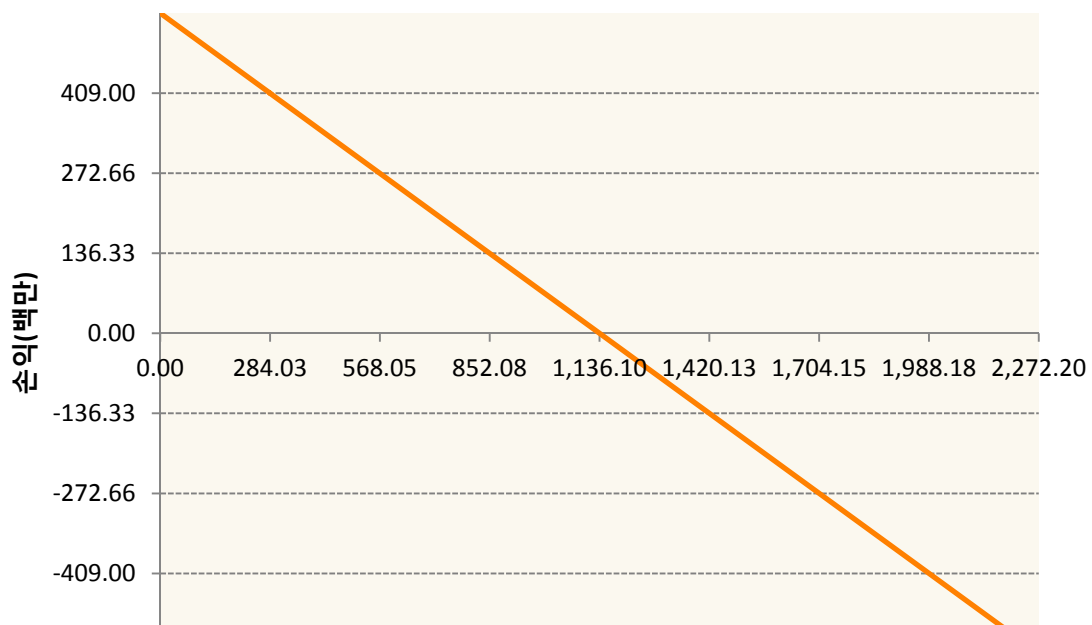


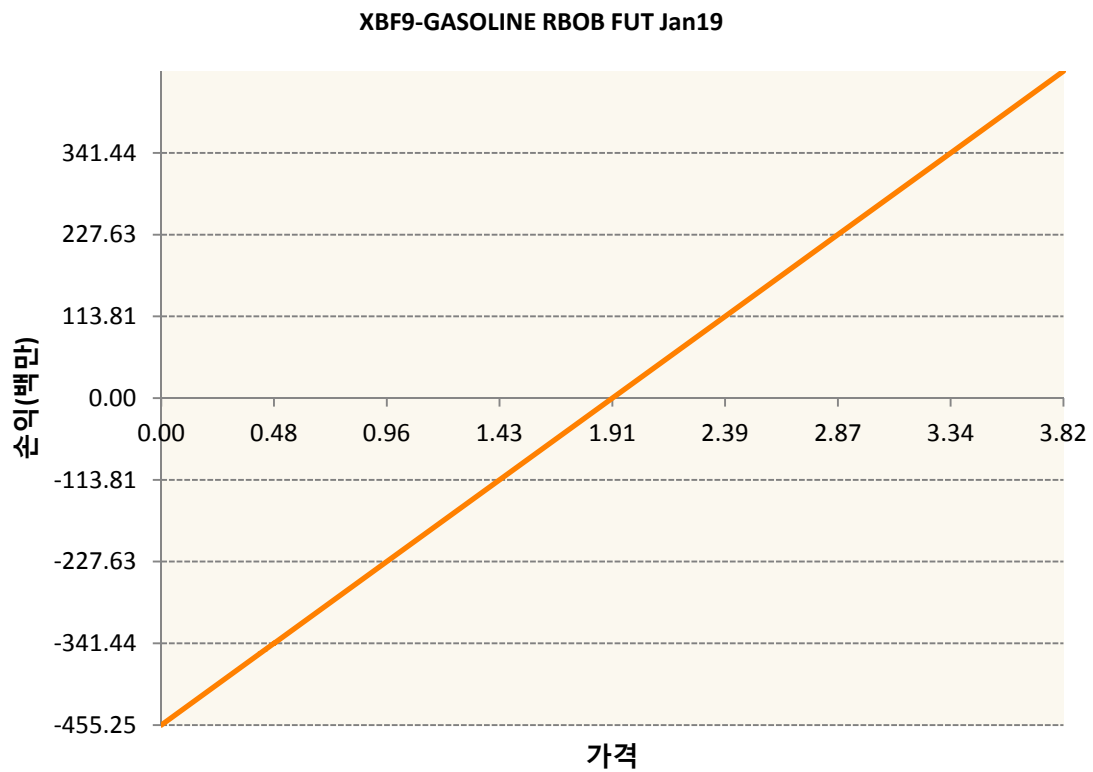
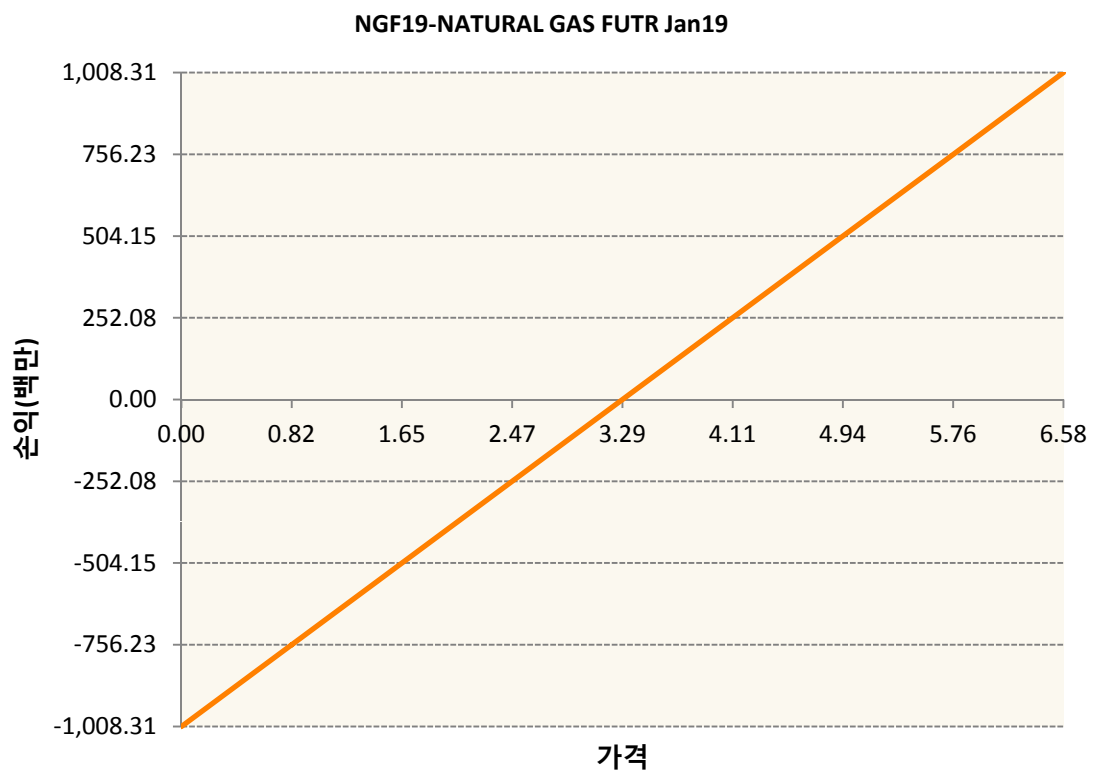
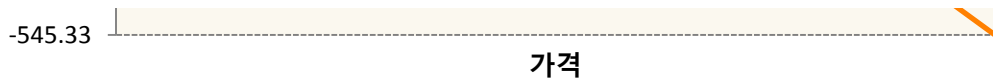


HOF9-NY Harb ULSD Fut Jan19



KR4175NB0006-2018-11 달러선물





**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		44
NGF19	NATURAL GAS FUTR Jan19	81
XBF9	GASOLINE RBOB FUT Jan19	36

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

**415**

공시일	2018-10-24
기준일	2018-10-23

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

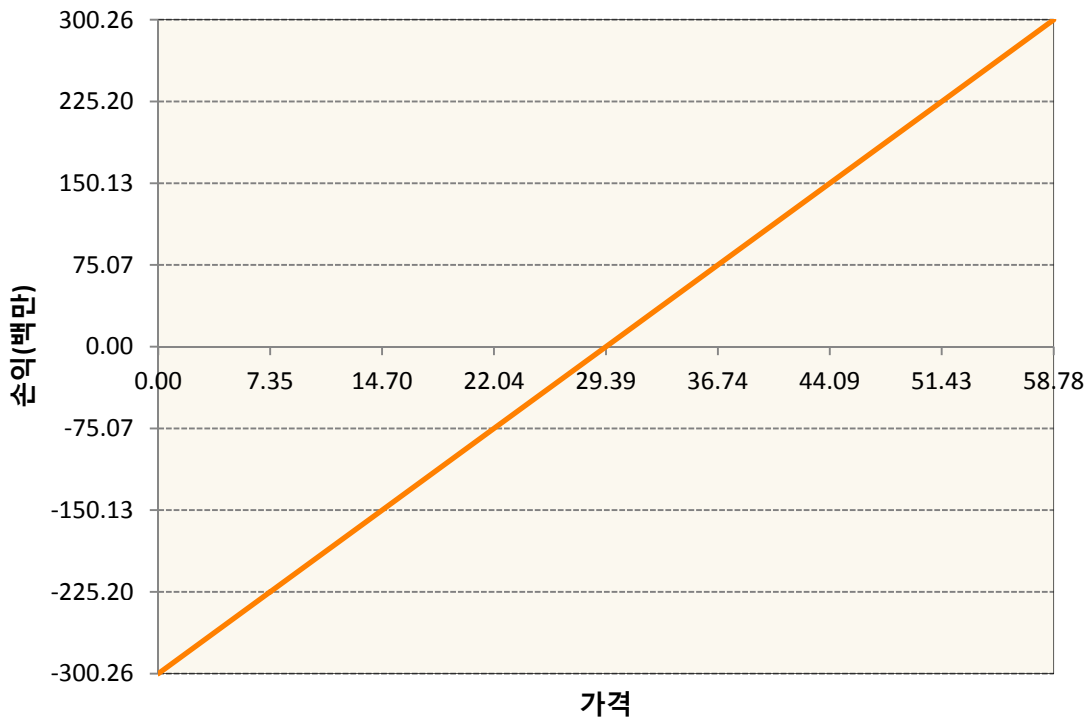
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

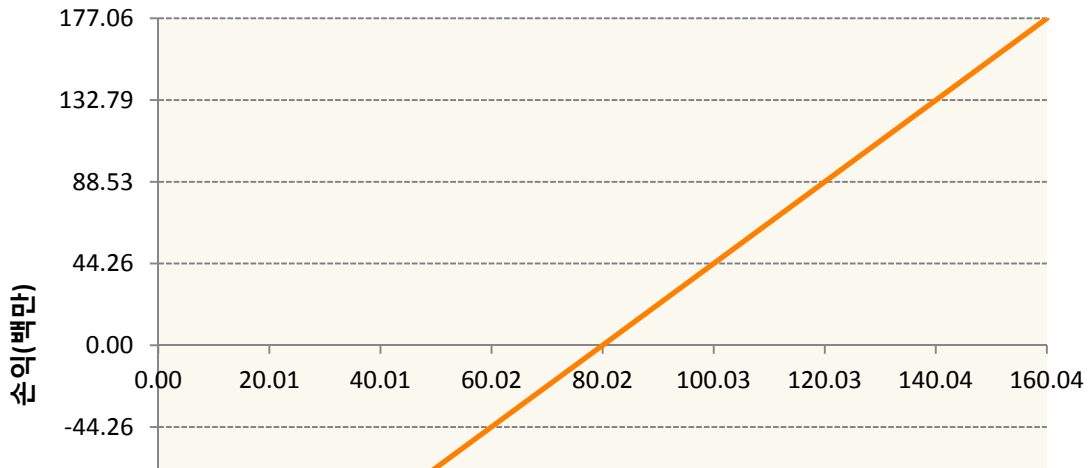
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,634	80	3,554	

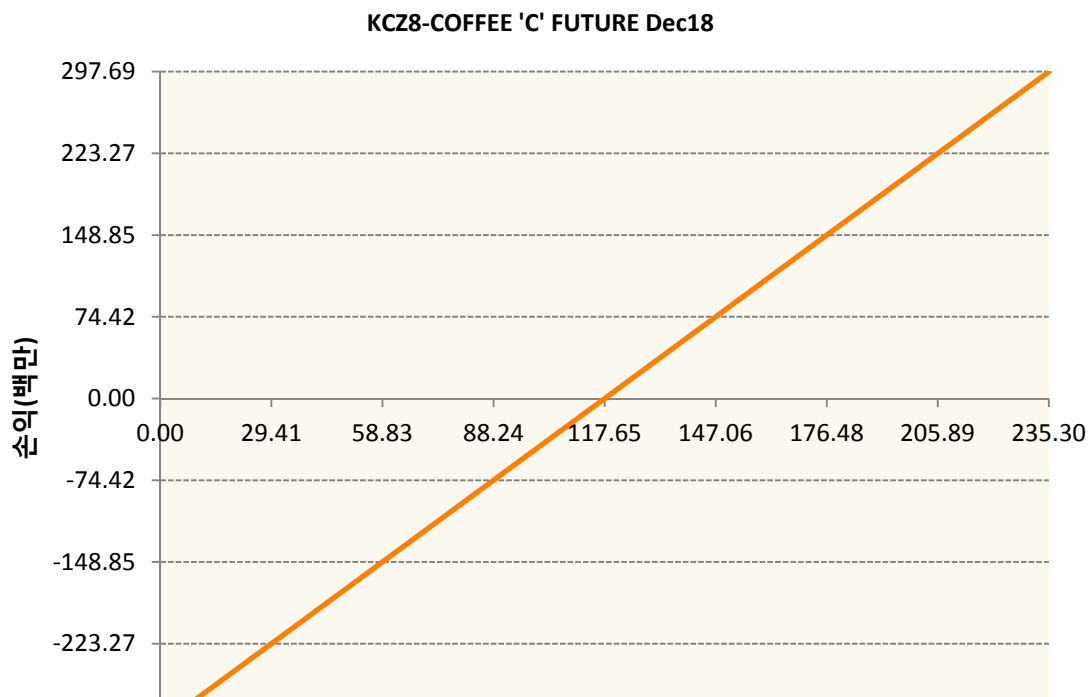
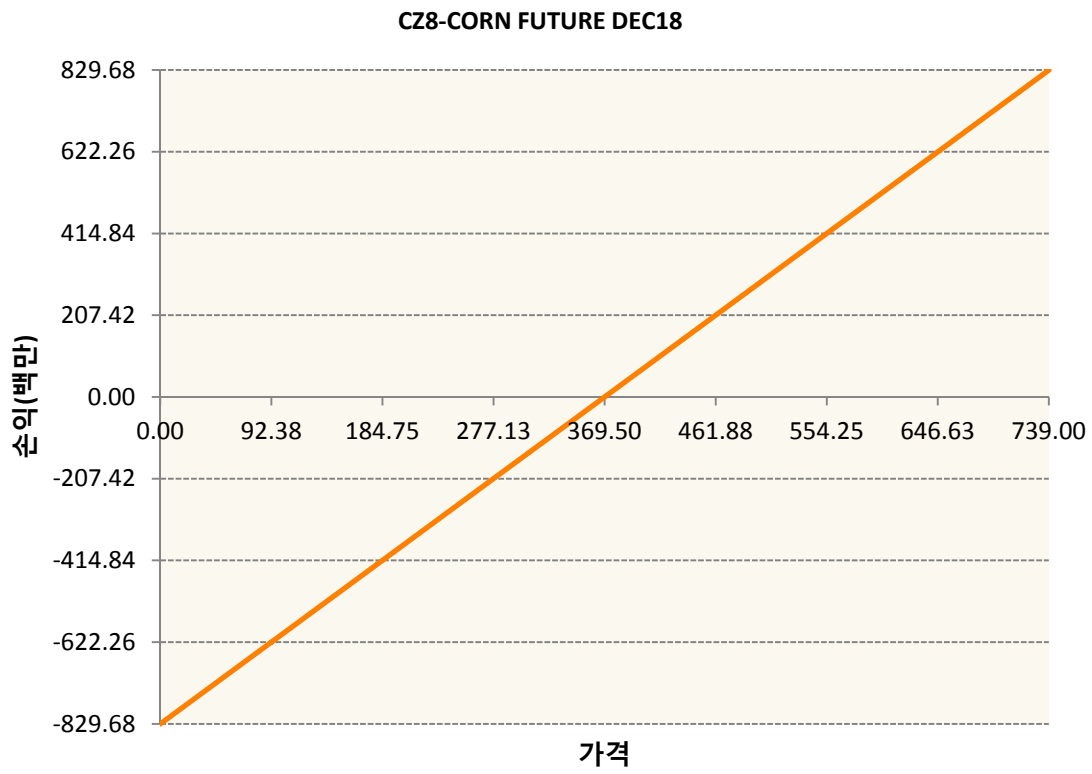
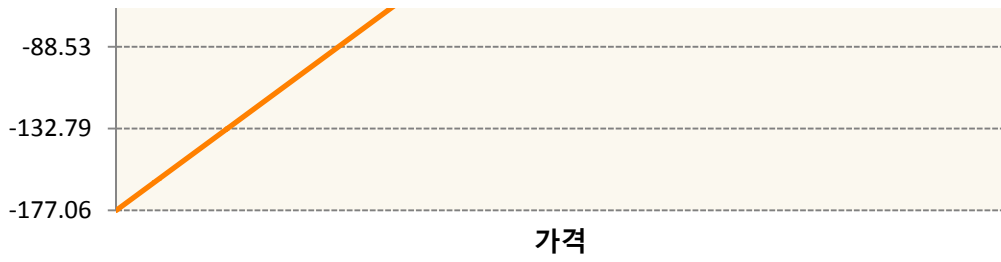
### 2. 만기시점의 손익구조

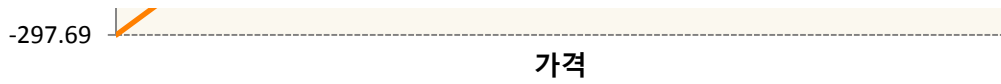
**BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19**



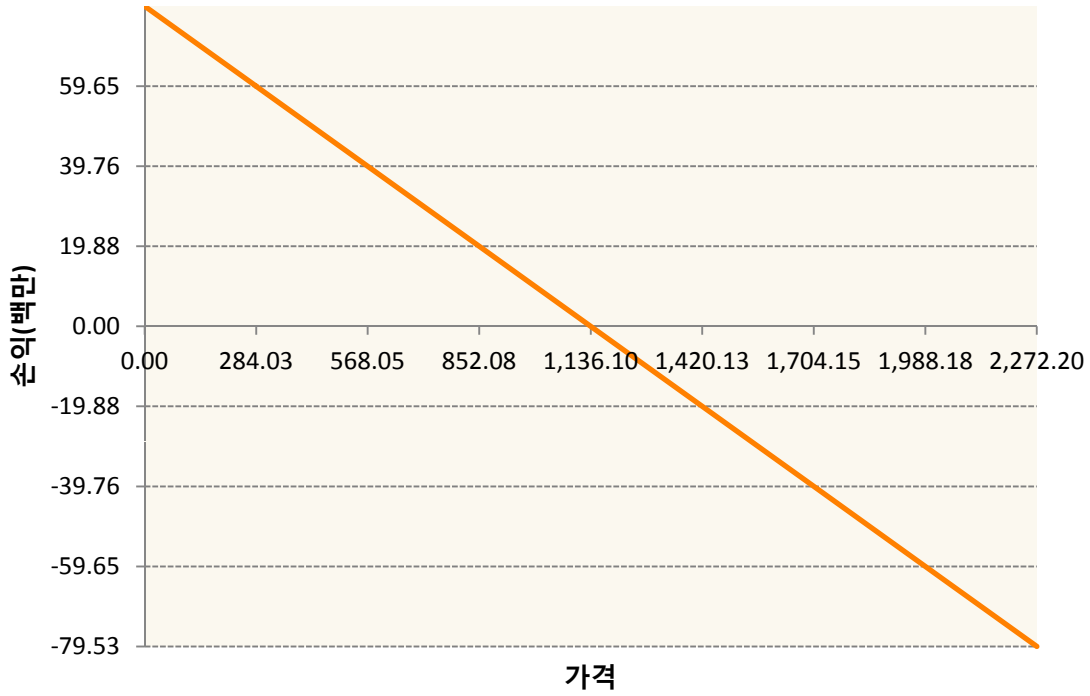
**CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18**



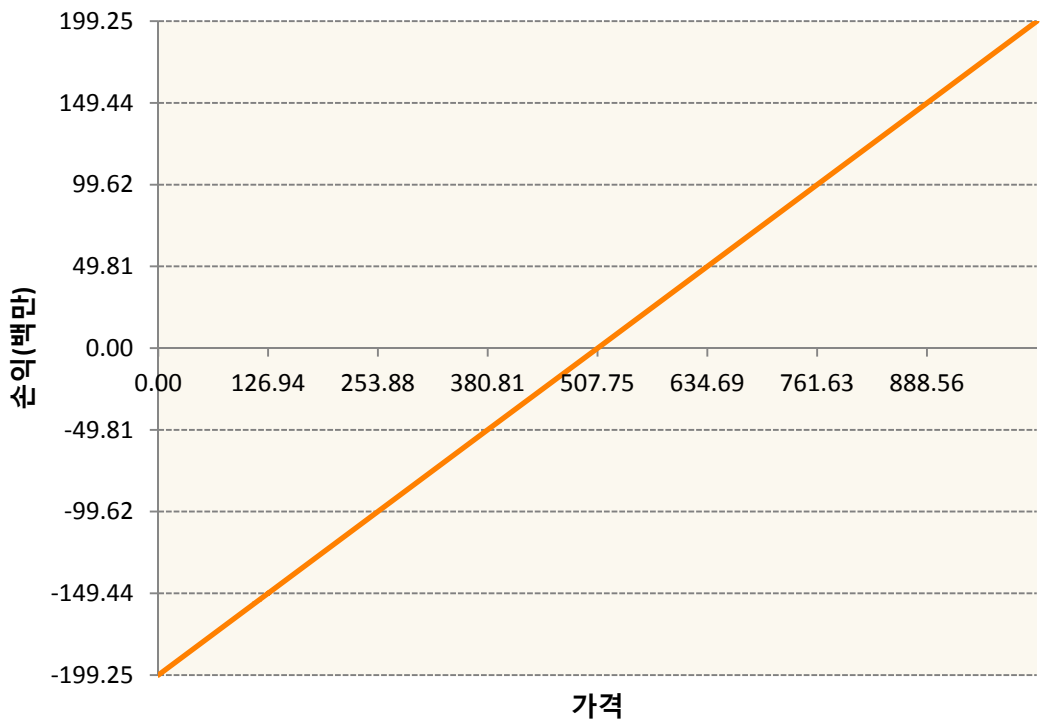




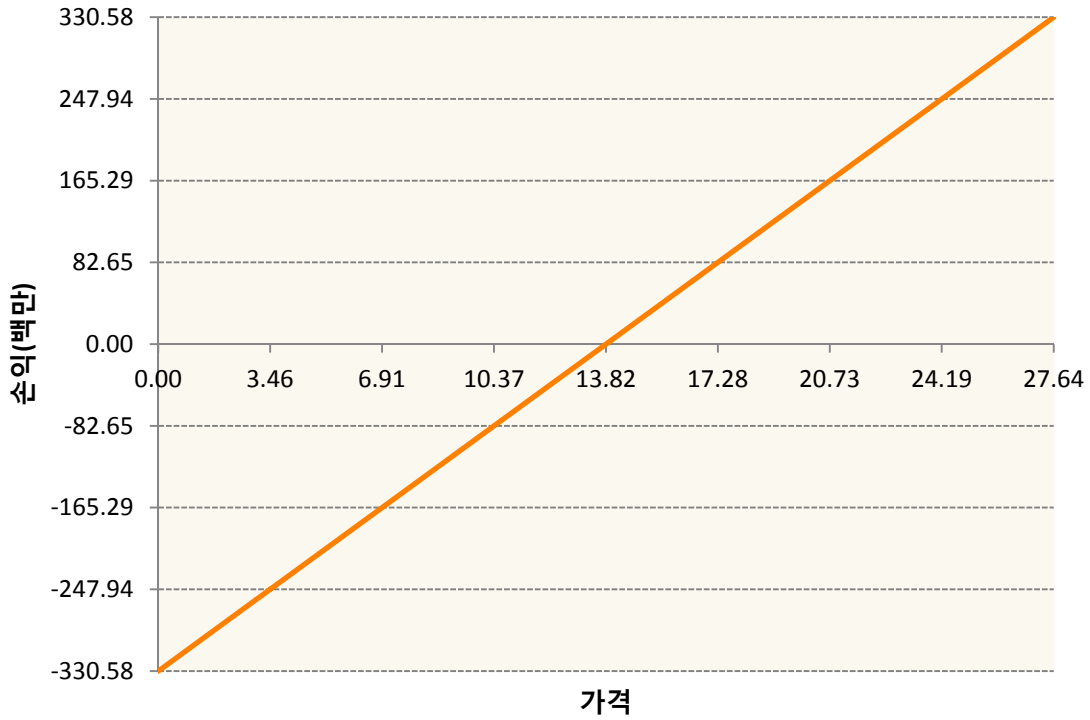
**KR4175NB0006-2018-11 달러선물**



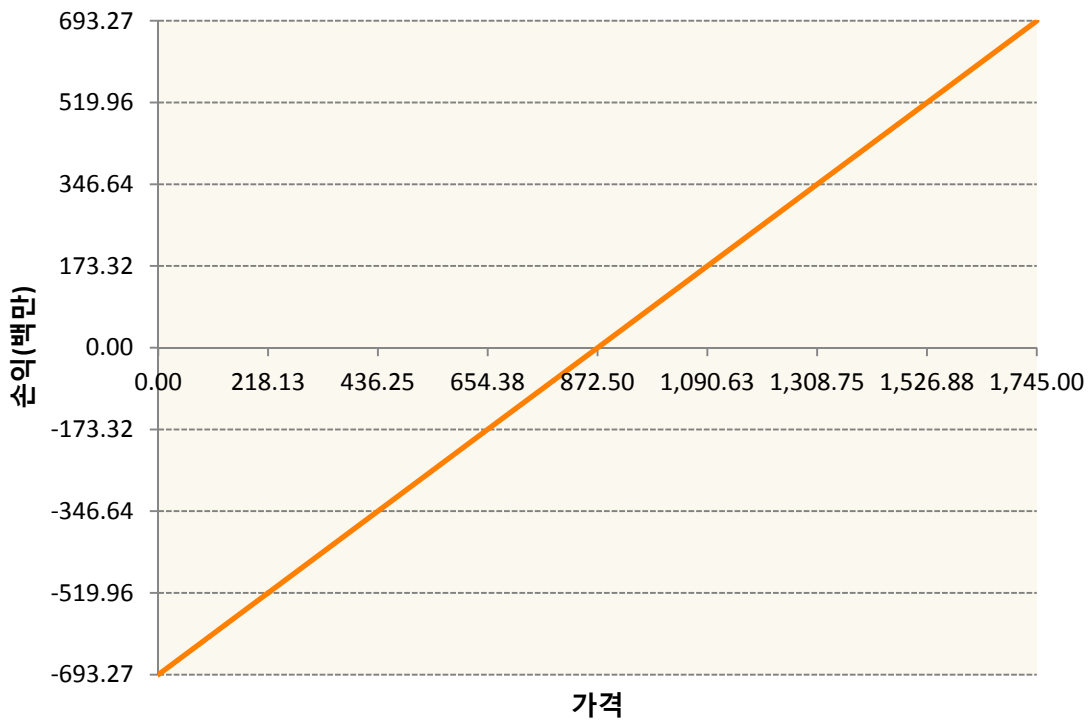
**KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18**



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

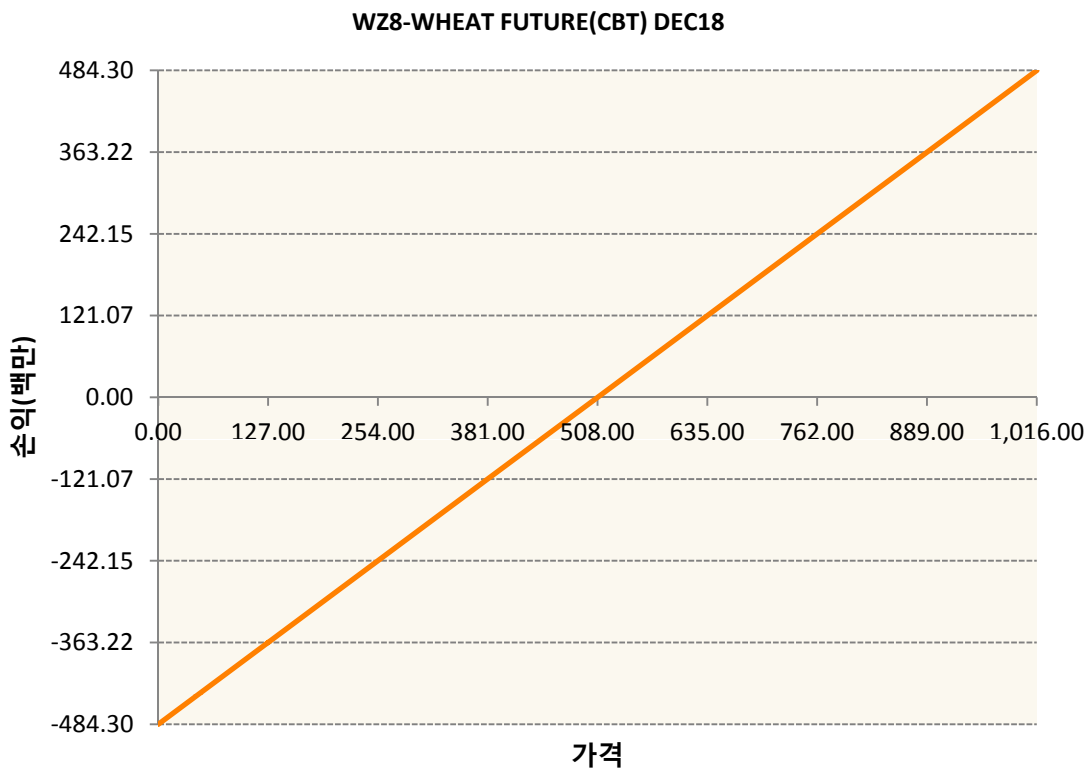
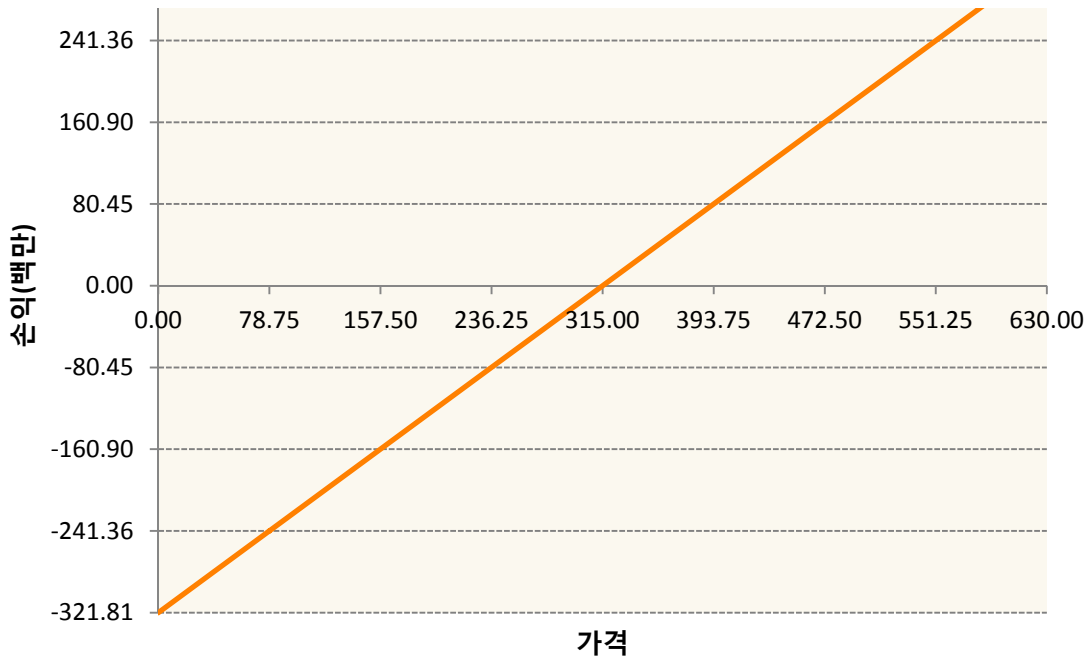


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19



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	66
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	24
KR4175NB0(2018-11	달러선물	6

KWZ8	KC HRW WHEAT FUT DEC18	16
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	26
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)

**316**