

공시일	2018-10-29
기준일	2018-10-26

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

공시일	2018-10-29
기준일	2018-10-26

스마트인덱스모

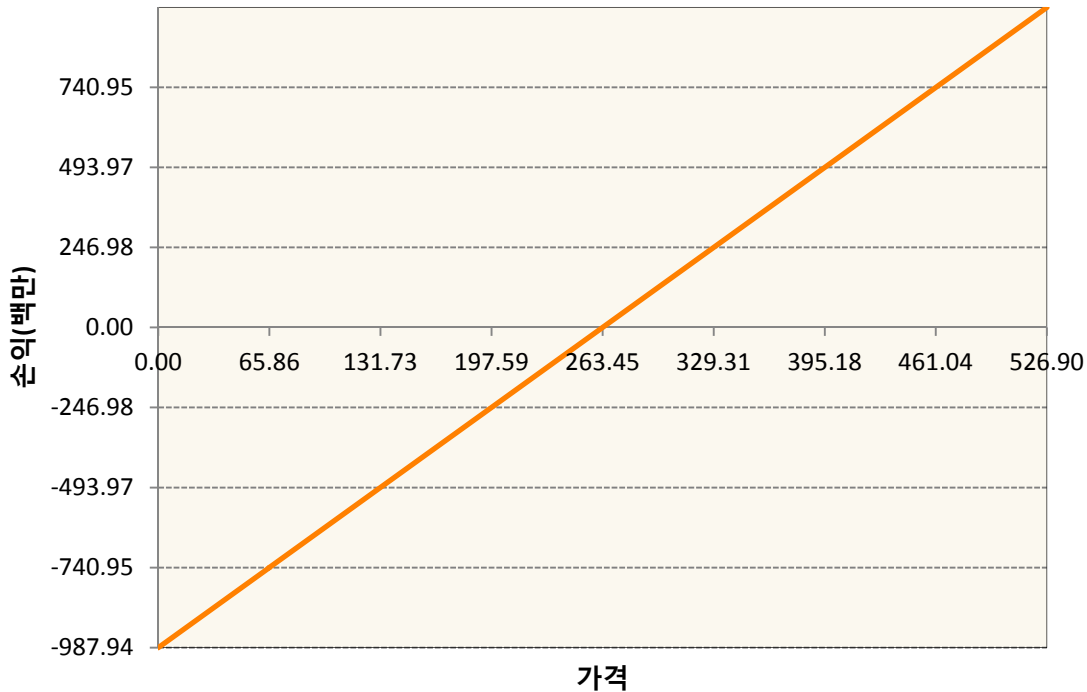
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	988	0	988	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물)

79

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	26	26	26	26	26	26	26
5.33%	53	53	53	53	53	53	53
8.00%	79	79	79	79	79	79	79

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

(단위:백만원)

65

공시일	2018-10-29
기준일	2018-10-26

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

1,066

* 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	2018-10-29
기준일	2018-10-26

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

256

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

359

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-29
기준일	2018-10-26

유로인덱스모(주식-파생형)

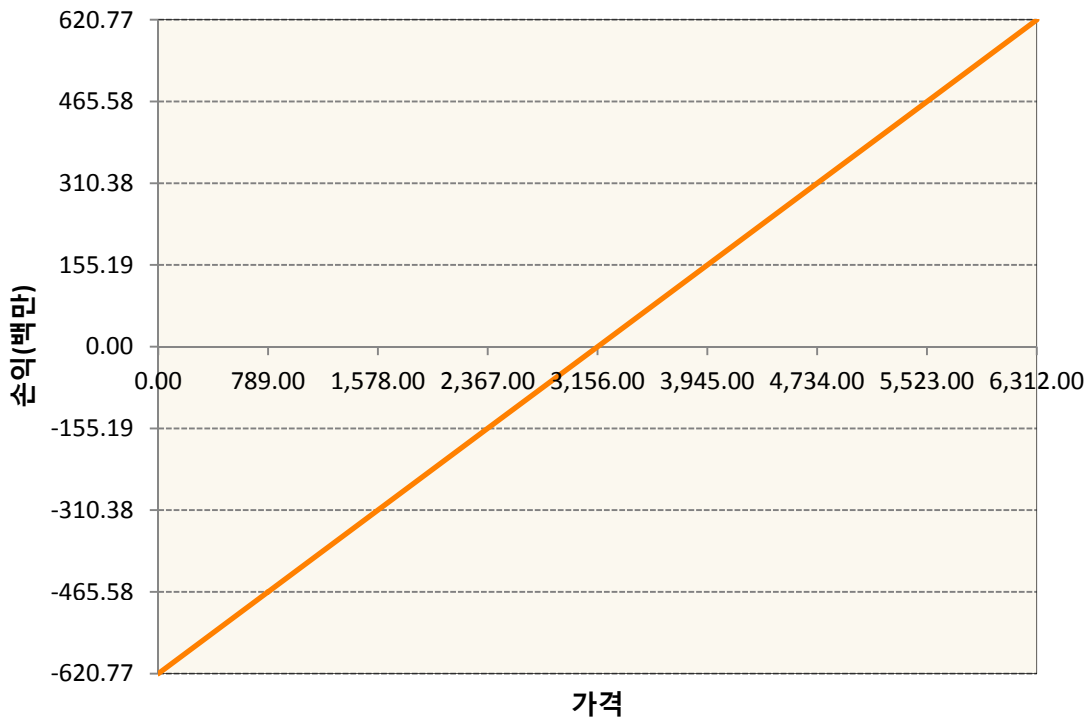
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	621	0	621	

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	2018-10-29
기준일	2018-10-26

차이나인덱스모(주식-파생형)

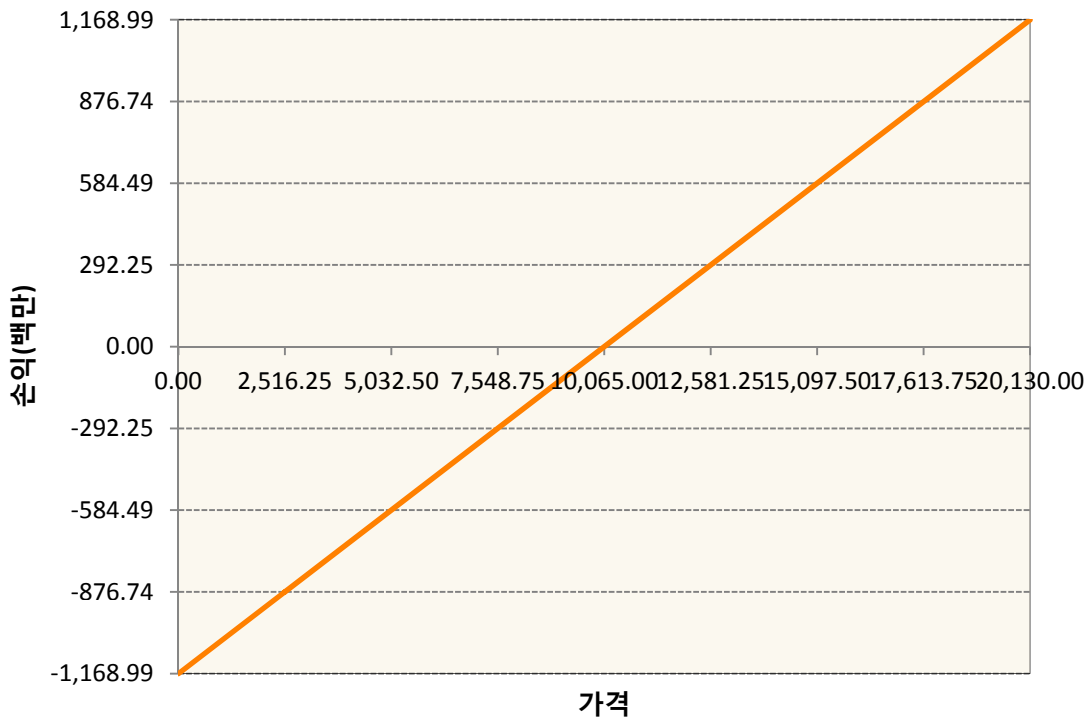
1. 계약금액

(단위:백만원)

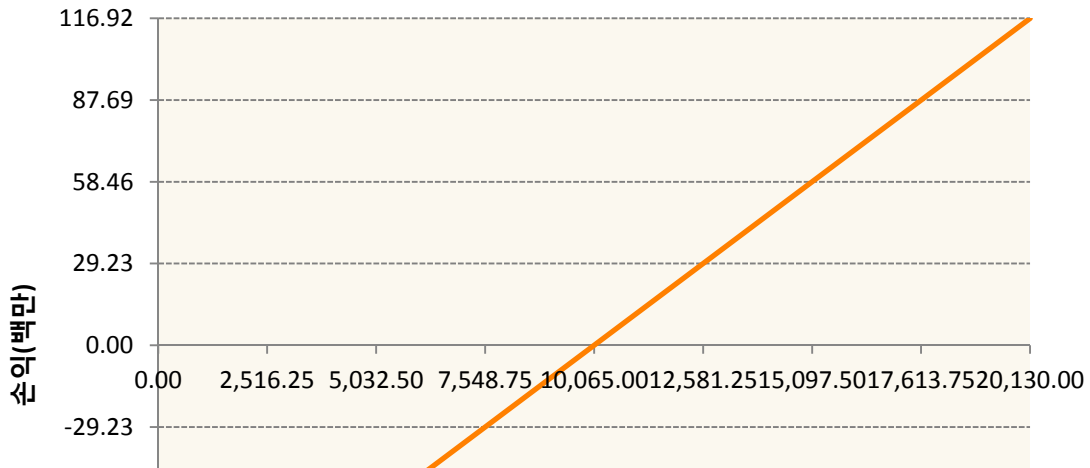
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,286	0	1,286	장내

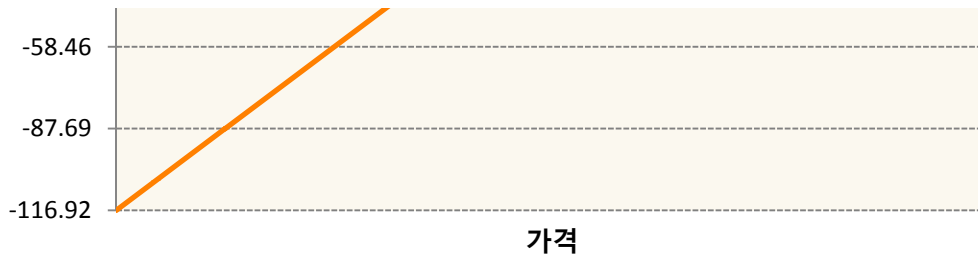
2. 만기시점의 손익구조

HCX8-HSCEI FUTURES NOV 18



MHCX8-MINI H-SHR IDX FU NOV 18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCX8	HSCEI FUTURES NOV 18	94
MHCX8	MINI H-SHR IDX FU NOV 18	9

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

100

공시일	2018-10-29
기준일	2018-10-26

커버드콜모(주식혼합-파생형)

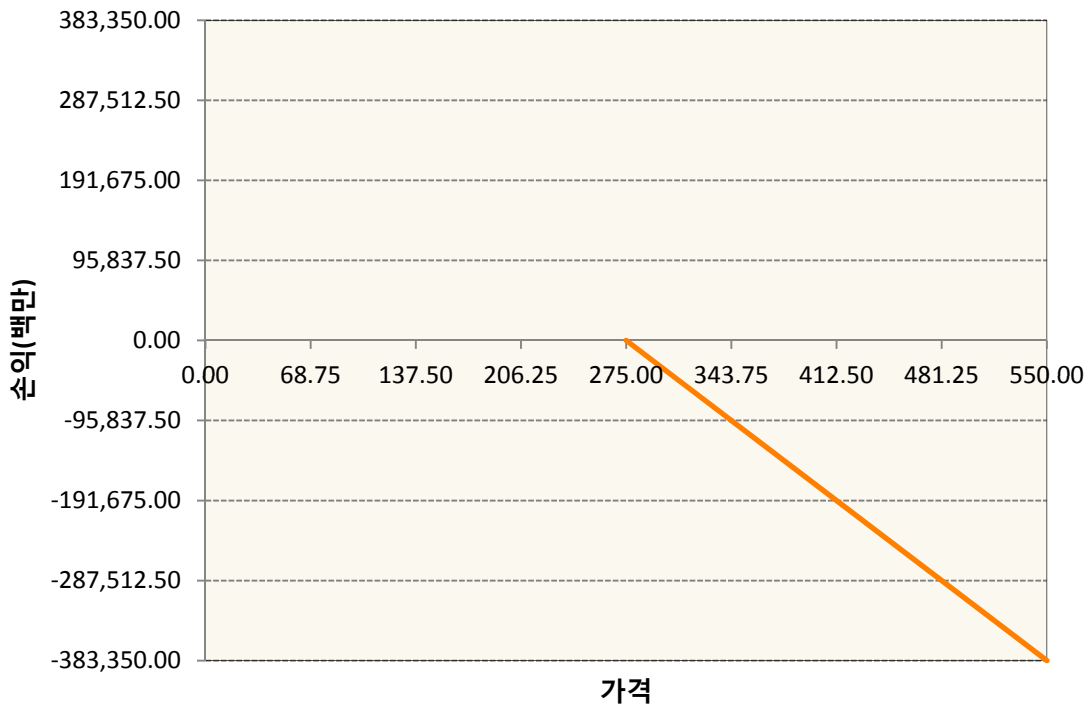
1. 계약금액

(단위:백만원)

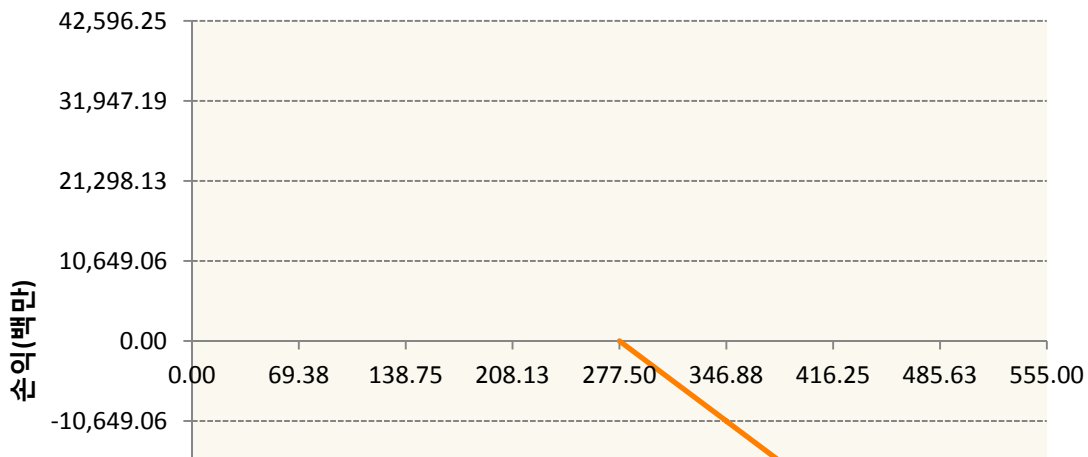
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	721,571	-721,571	장내

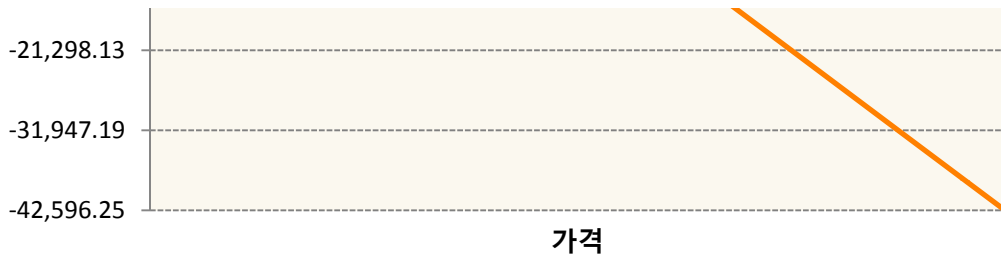
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

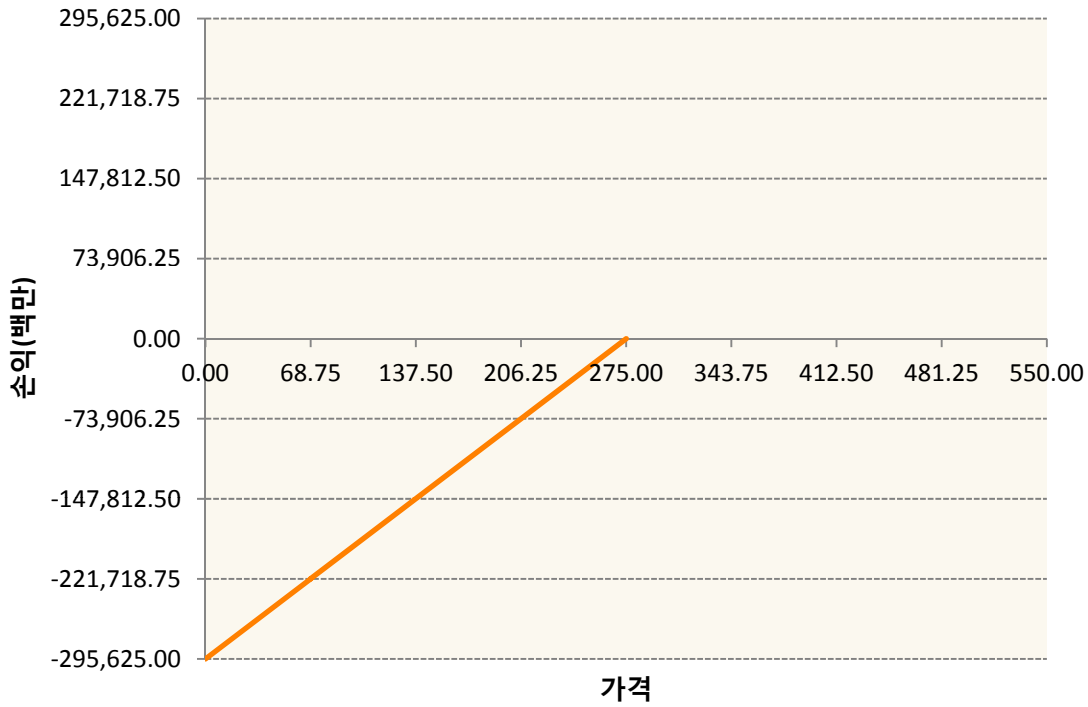


KR4201NB2778-2018-11 콜277.5





KR4301NB2751-2018-11 풋275



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NB27 2018-11 콜275

15,335

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,152	2,146	2,132	2,106	2,063	2,001	1,915
-5.33%	2,127	2,089	2,026	1,933	1,808	1,650	1,459
-2.67%	1,956	1,808	1,615	1,378	1,102	789	444
0%	1,220	852	443	0	-472	-967	-1,482
2.67%	-895	-1,499	-2,114	-2,740	-3,372	-4,009	-4,652
5.33%	-5,207	-5,882	-6,557	-7,234	-7,912	-8,590	-9,268
8.00%	-11,872	-12,398	-12,952	-13,526	-14,116	-14,720	-15,335

KR4201NB27 2018-11 콜277.5

1,506

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	174	173	172	171	167	162	155

-5.33%	172	170	165	158	148	134	118
-2.67%	162	151	135	115	91	62	30
0%	109	78	41	0	-45	-93	-144
2.67%	-60	-119	-180	-244	-309	-376	-443
5.33%	-443	-518	-593	-668	-744	-819	-894
8.00%	-1,087	-1,154	-1,222	-1,292	-1,363	-1,434	-1,506
KR4301NB27 2018-11 풋275							21,756
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21,723	-21,723	-21,724	-21,726	-21,732	-21,741	-21,756
-5.33%	-14,200	-14,204	-14,214	-14,232	-14,260	-14,301	-14,357
-2.67%	-6,706	-6,743	-6,799	-6,877	-6,977	-7,099	-7,242
0%	554	397	211	0	-234	-486	-755
2.67%	6,868	6,524	6,169	5,805	5,434	5,058	4,678
5.33%	11,205	10,796	10,387	9,977	9,566	9,154	8,742
8.00%	13,298	13,026	12,731	12,418	12,091	11,752	11,403

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

(단위:백만원)

37,264

공시일	2018-10-29
기준일	2018-10-26

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

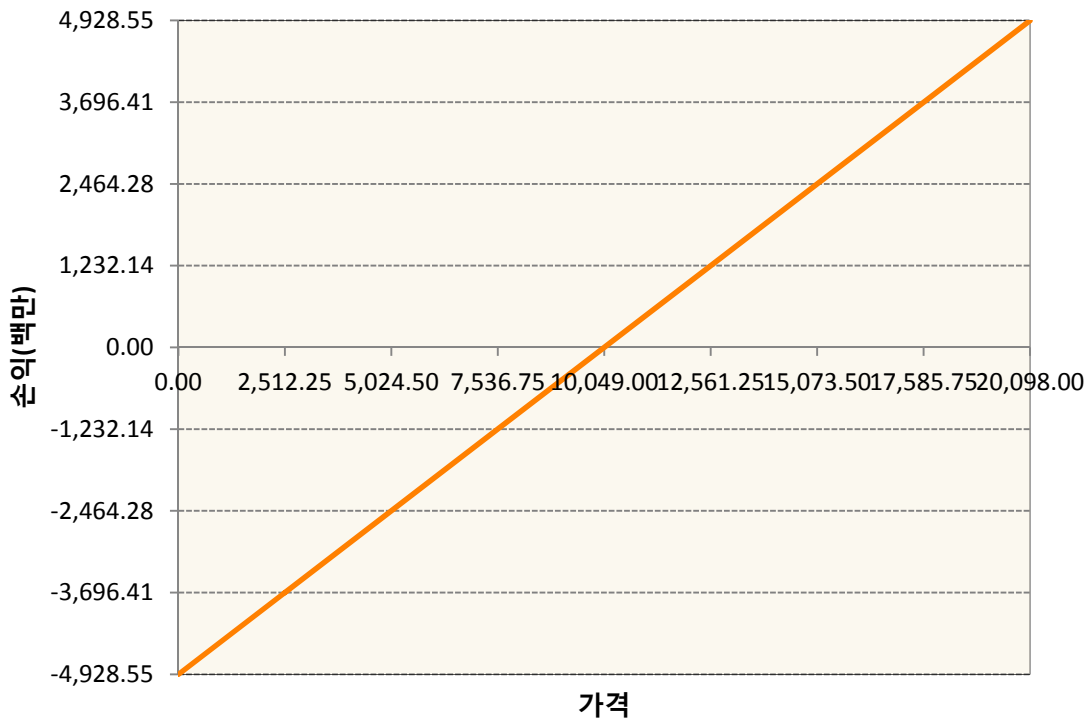
1. 계약금액

(단위:백만원)

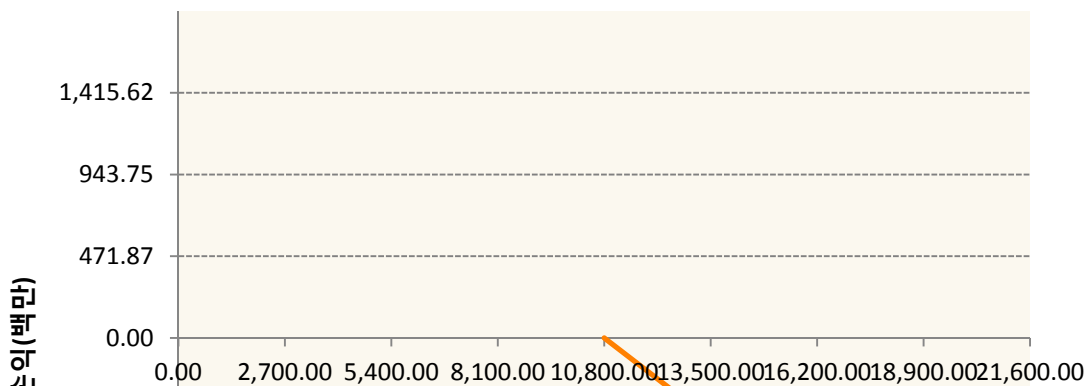
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,929	0	4,929	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,266	-12,266	장내

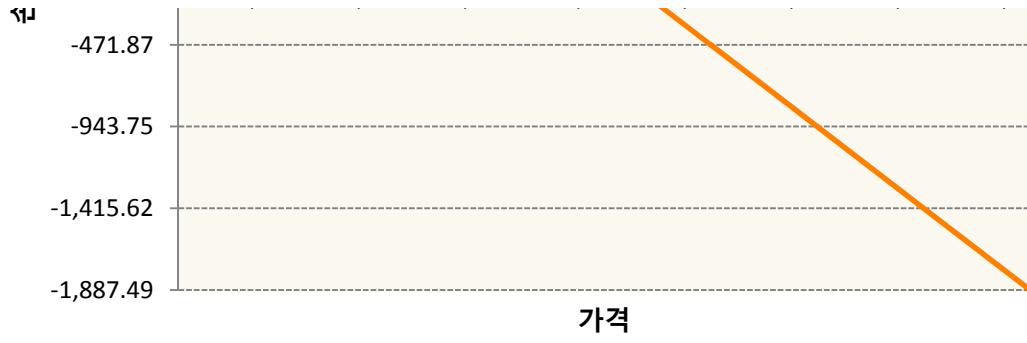
2. 만기시점의 손익구조

HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18

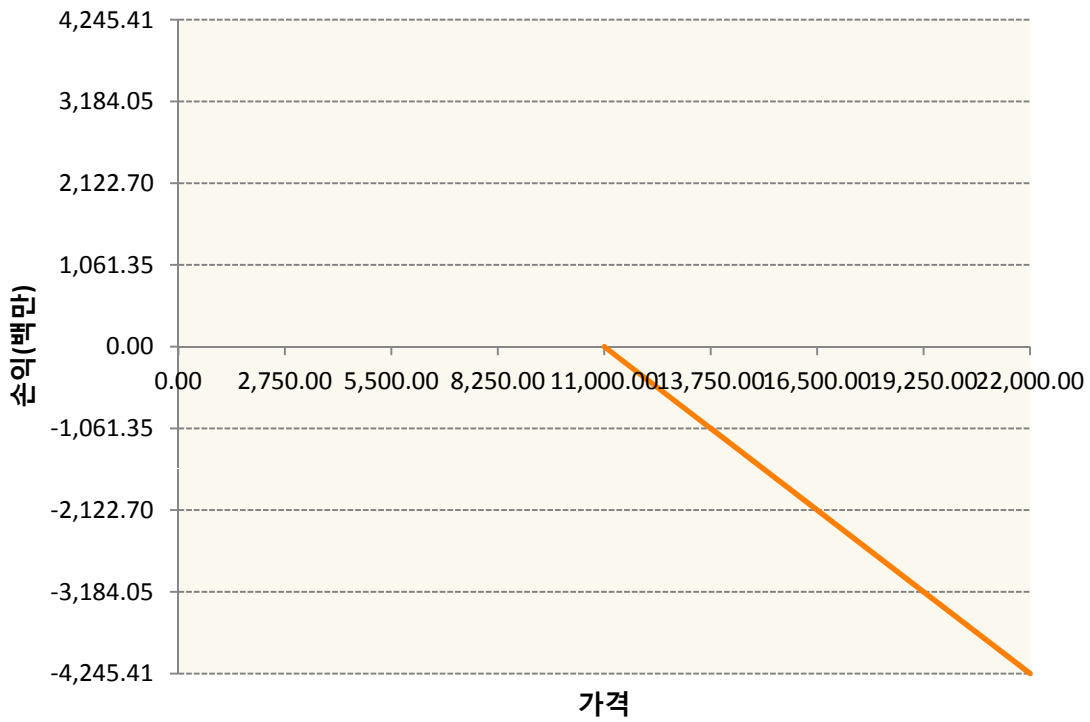


OHHIV8-C108-HSCEI

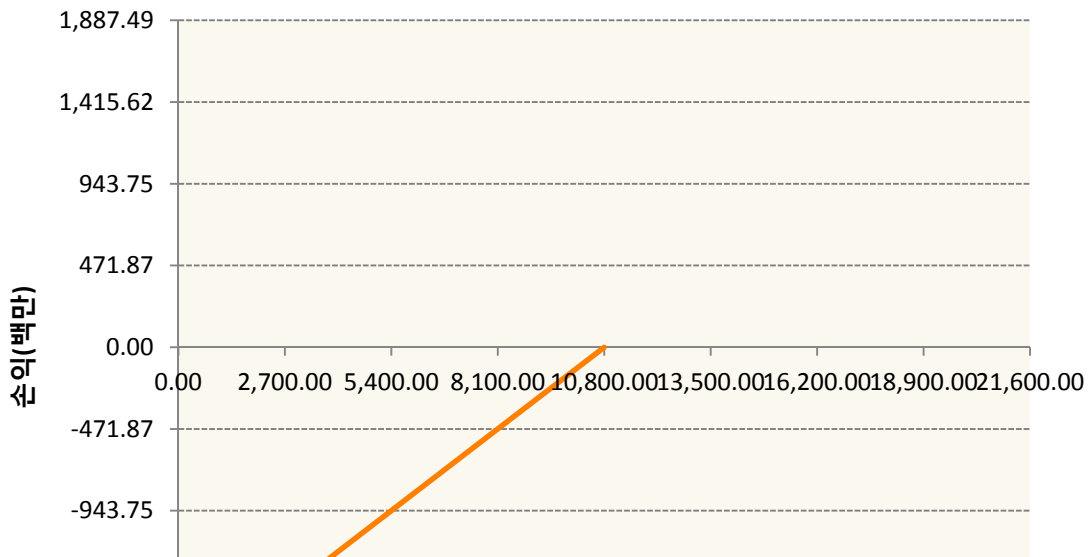


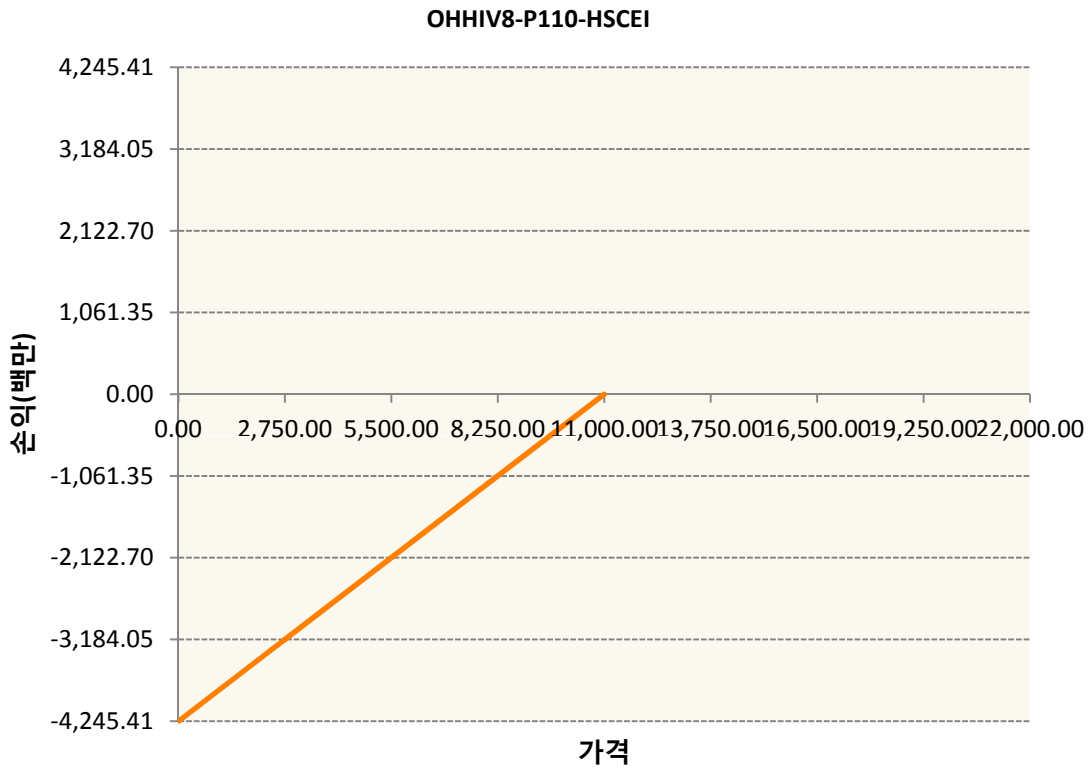
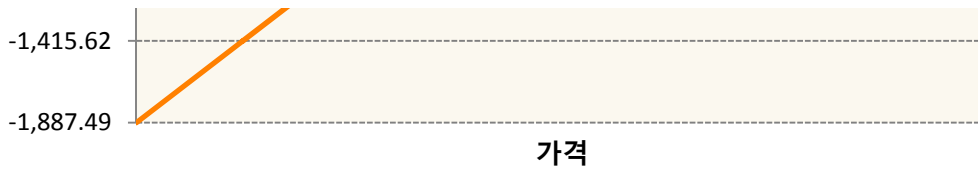


OHHIV8-C110-HSCEI



OHHIV8-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	394
OHHIV8-C1	HSCEI	151
OHHIV8-C11	HSCEI	340
OHHIV8-P1C	HSCEI	151
OHHIV8-P11	HSCEI	340

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,331

공시일	2018-10-29
기준일	2018-10-26

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

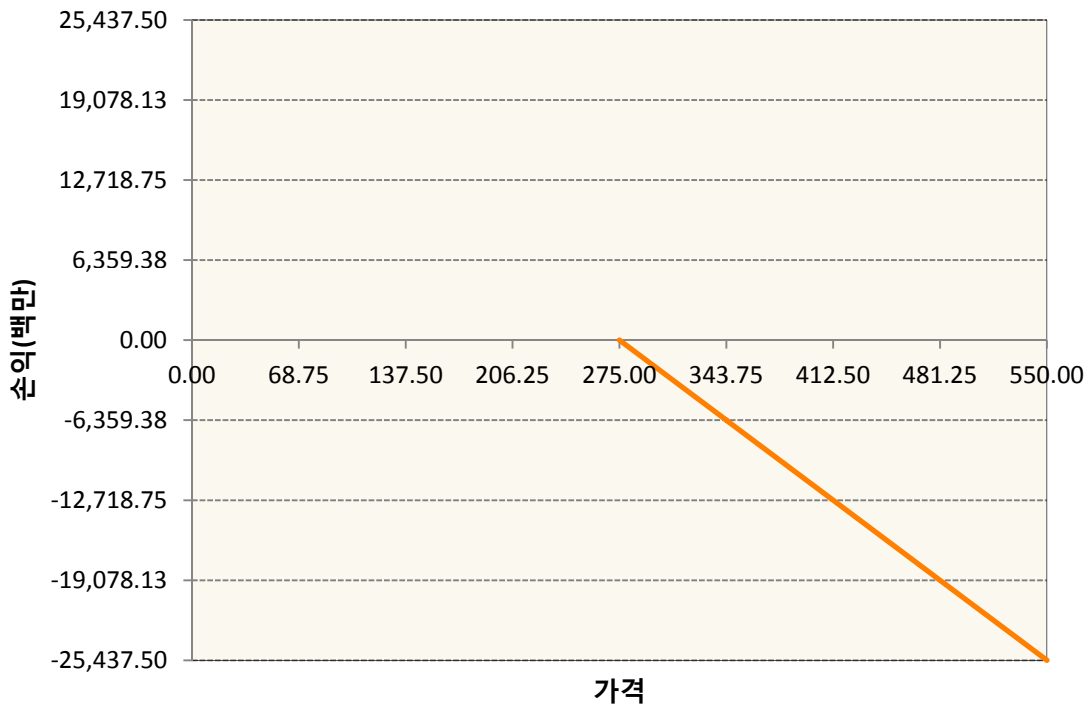
1. 계약금액

(단위:백만원)

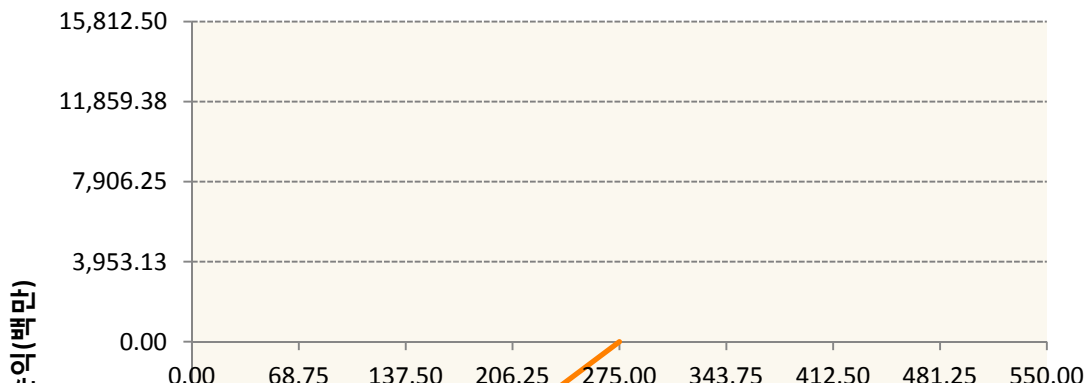
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	44,025	-44,025	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

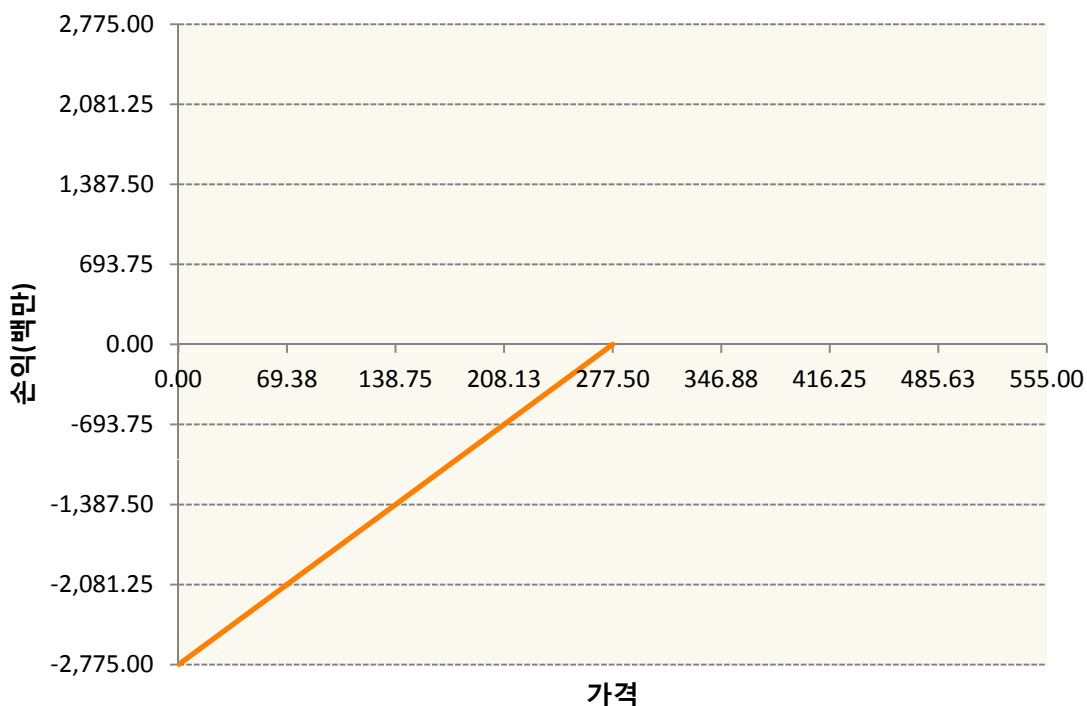


KR4301NB2751-2018-11 풋275





KR4301NB2777-2018-11 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_14							4,032	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-4,032	-4,032	-4,032	-4,032	-4,032	-4,032	-4,032	
-5.33%	-2,688	-2,688	-2,688	-2,688	-2,688	-2,688	-2,688	
-2.67%	-1,344	-1,344	-1,344	-1,344	-1,344	-1,344	-1,344	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	1,344	1,344	1,344	1,344	1,344	1,344	1,344	
5.33%	2,688	2,688	2,688	2,688	2,688	2,688	2,688	
8.00%	4,032	4,032	4,032	4,032	4,032	4,032	4,032	
KR4201NB27 2018-11 콜275							1,018	
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	143	142	141	140	137	133	127
-5.33%	141	139	134	128	120	109	97
-2.67%	130	120	107	91	73	52	29
0%	81	57	29	0	-31	-64	-98
2.67%	-59	-99	-140	-182	-224	-266	-309
5.33%	-346	-390	-435	-480	-525	-570	-615
8.00%	-788	-823	-859	-898	-937	-977	-1,018

KR4301NB27 2018-11 풋275

1,164

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,162	-1,162	-1,162	-1,162	-1,162	-1,163	-1,164
-5.33%	-760	-760	-760	-761	-763	-765	-768
-2.67%	-359	-361	-364	-368	-373	-380	-387
0%	30	21	11	0	-12	-26	-40
2.67%	367	349	330	310	291	271	250
5.33%	599	577	556	534	512	490	468
8.00%	711	697	681	664	647	629	610

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

205

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-205	-205	-205	-205	-205	-205	-205
-5.33%	-135	-135	-135	-135	-135	-135	-136
-2.67%	-65	-65	-66	-66	-67	-67	-68
0%	4	3	1	0	-2	-4	-6
2.67%	67	64	61	58	55	52	49
5.33%	114	110	107	103	99	95	91
8.00%	141	138	134	131	127	124	120

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

(단위:백만원)

6,345

공시일	2018-10-29
기준일	2018-10-26

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

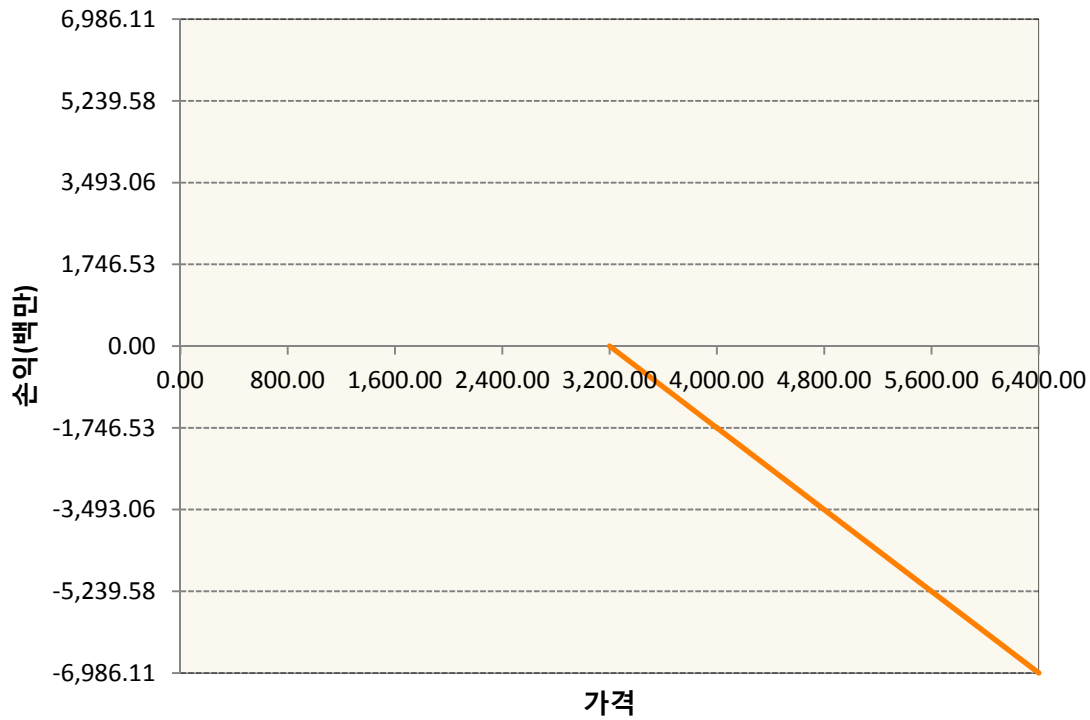
1. 계약금액

(단위:백만원)

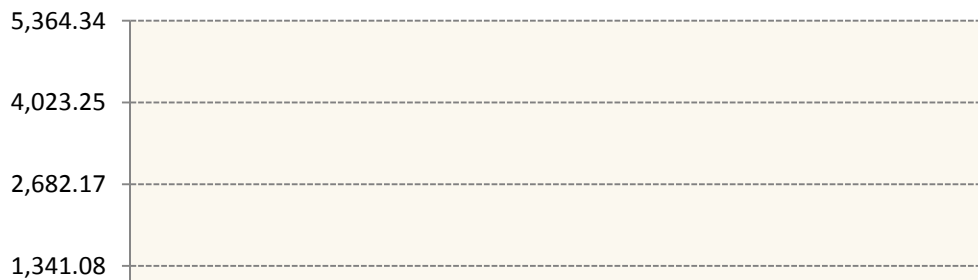
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,798	0	5,798	
누계	유가증권	스왑	72,580	0	72,580	장외
누계	유가증권	옵션	0	24,701	-24,701	장내

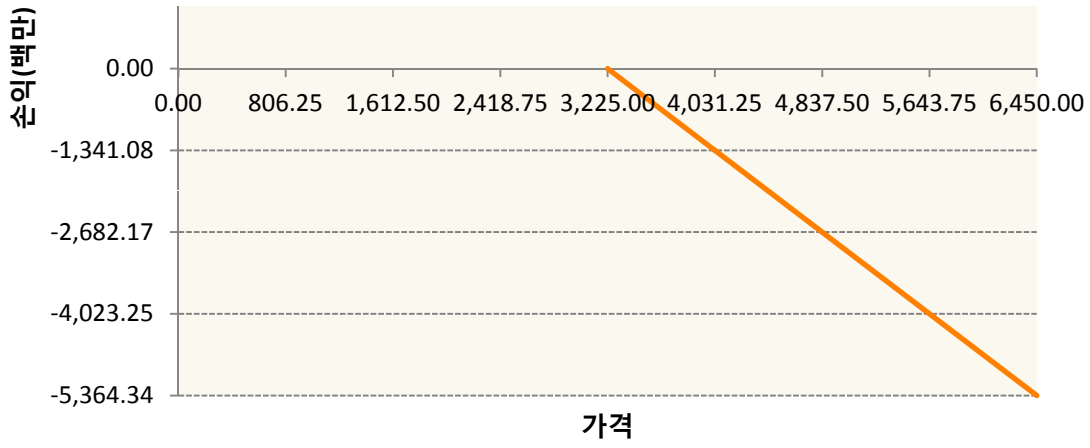
2. 만기시점의 손익구조

OESXX8-C3200-EURO STOXX 50

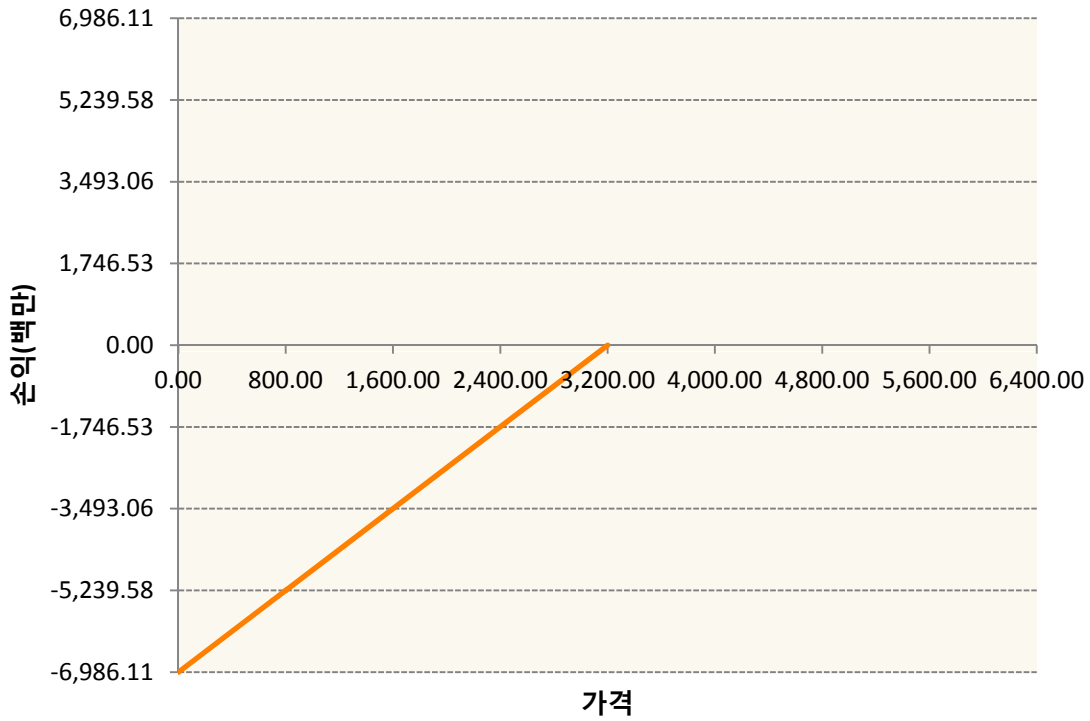


OESXX8-C3225-EURO STOXX 50

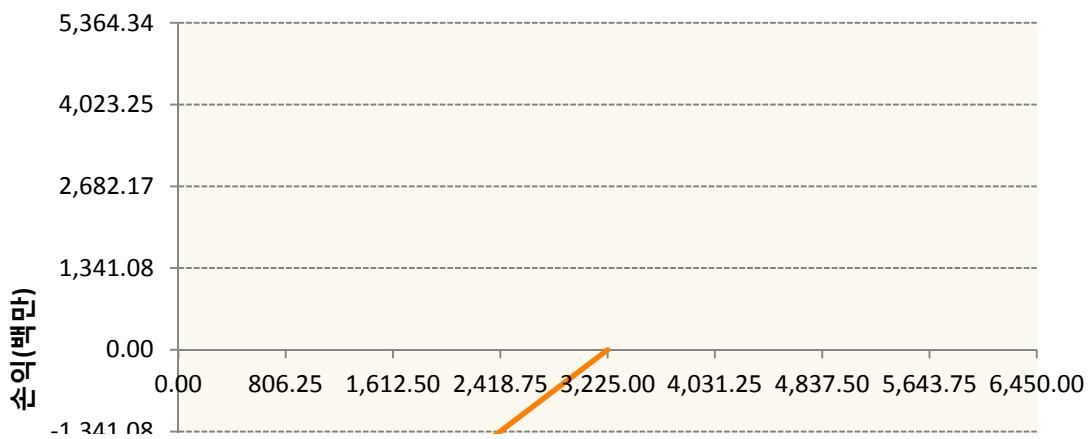


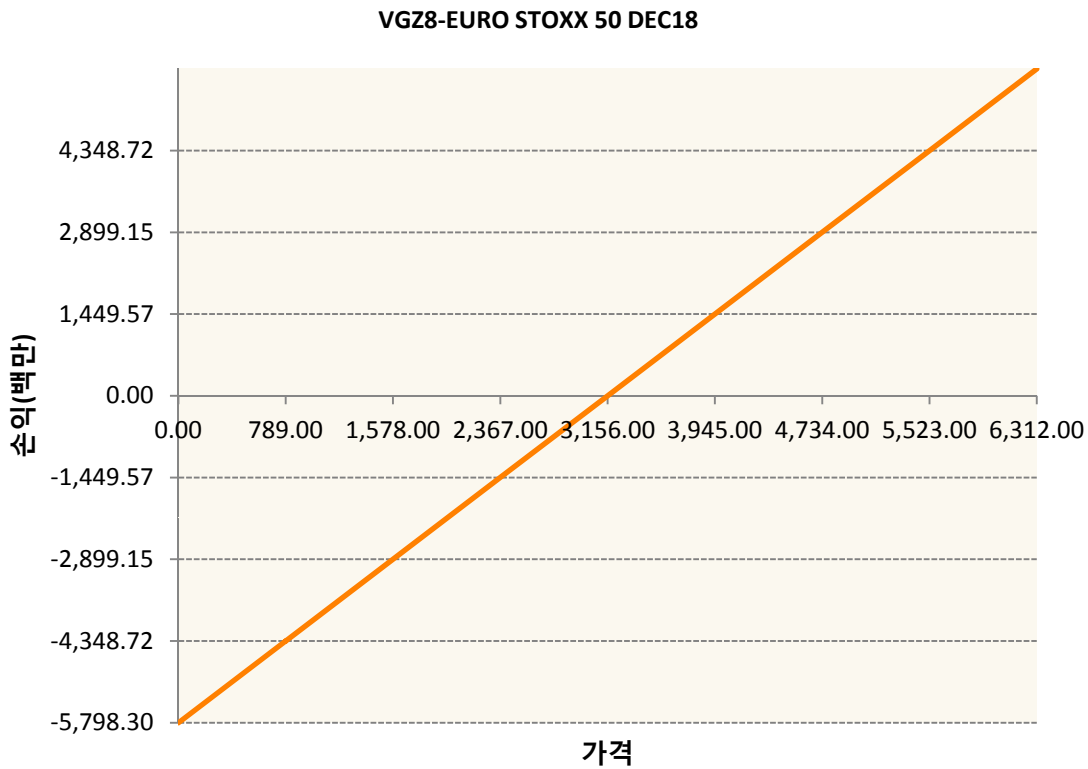
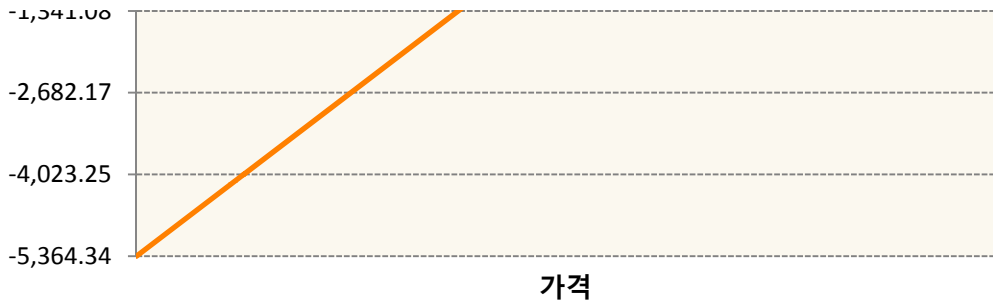


OESXX8-P3200-EURO STOXX 50



OESXX8-P3225-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	47
OESXX8-C32 EURO STOXX 50	559
OESXX8-C32 EURO STOXX 50	429
OESXX8-P32 EURO STOXX 50	559
OESXX8-P32 EURO STOXX 50	429
VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18	464

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

1,584

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

(단위:백만원)

1,098

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

(단위:백만원)

86

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

(단위:백만원)

130

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

(단위:백만원)

144

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

(단위:백만원)

39

공시일	2018-10-29
기준일	2018-10-26

리디파인K200(주식혼합-파생재간

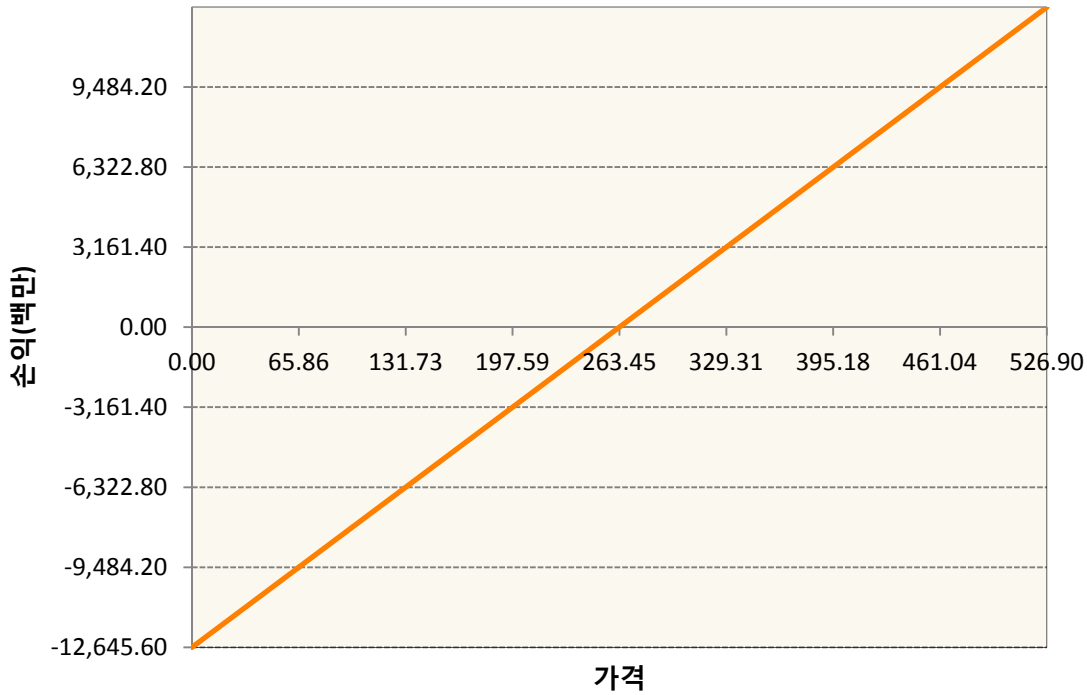
1. 계약금액

(단위:백만원)

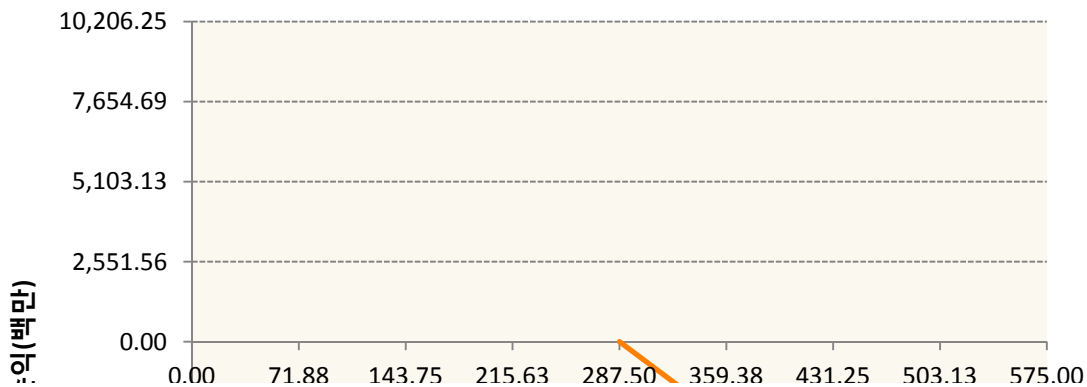
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,646	0	12,646	장내
누계	유가증권	옵션	4,059	23,401	-19,343	장내

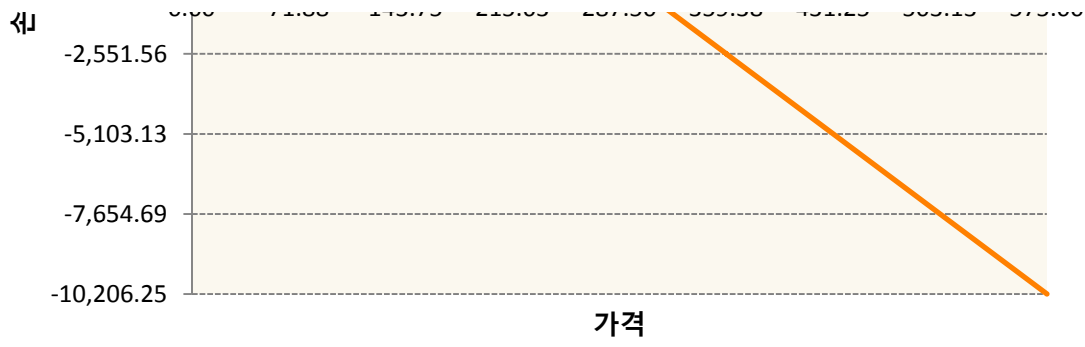
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

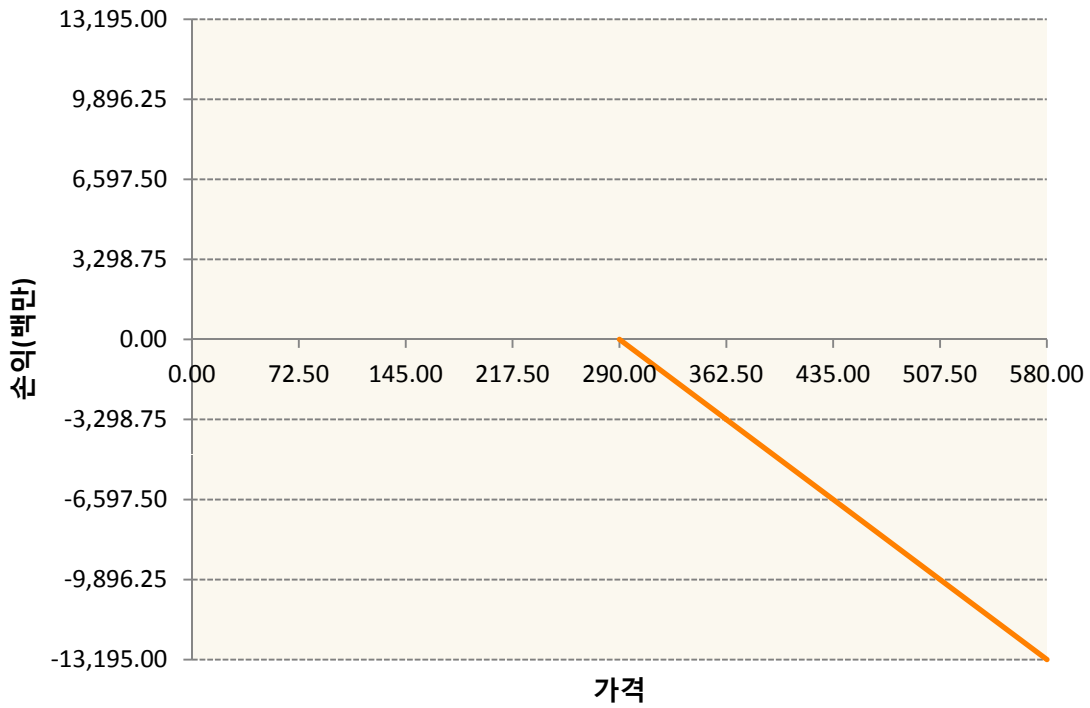


KR4201NB2877-2018-11 콜287.5

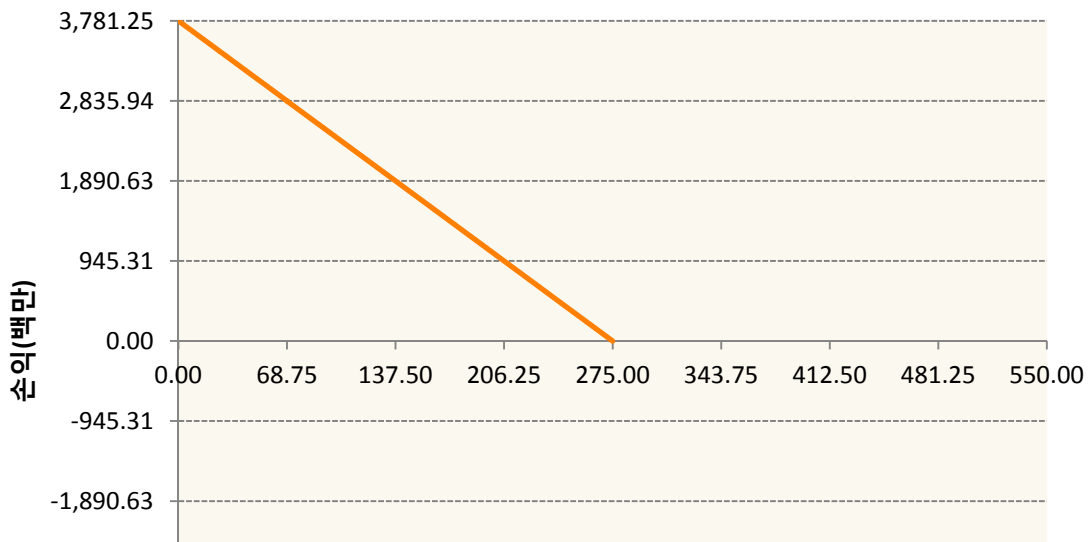


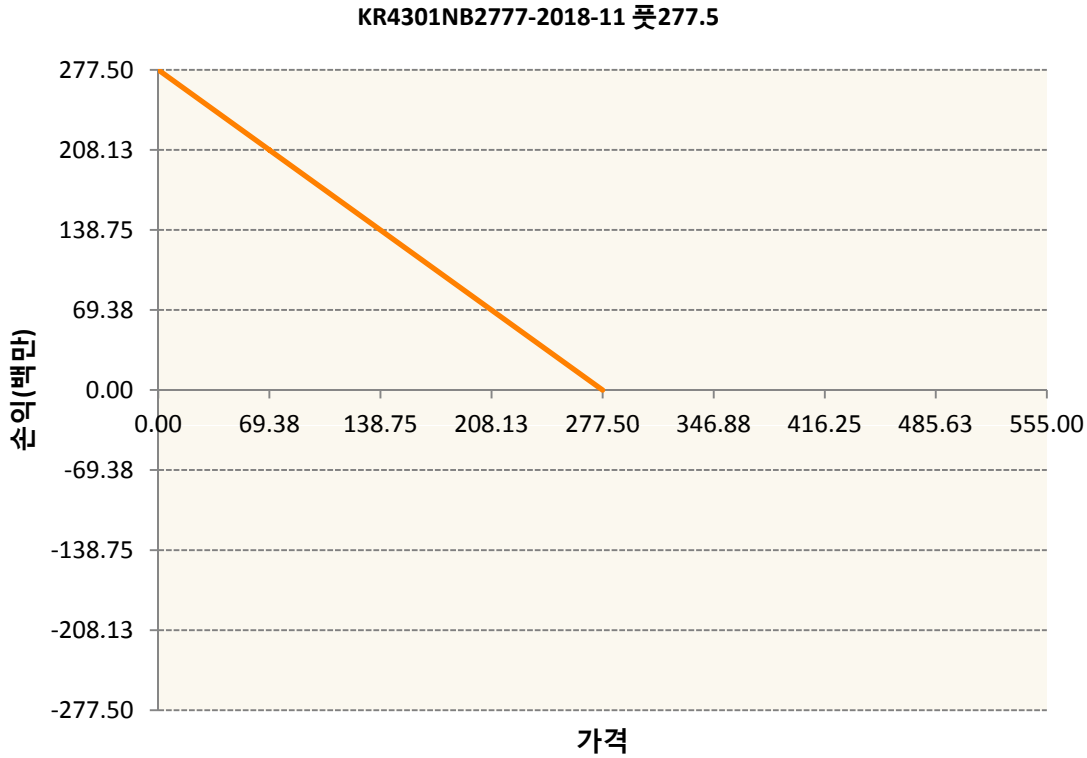
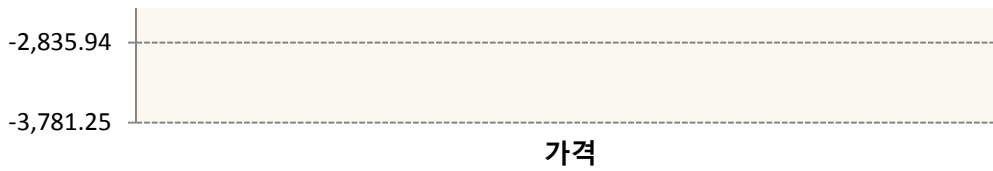


KR4201NB2901-2018-11 콜290



KR4301NB2751-2018-11 풋275





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 1,009

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,009	-1,009	-1,009	-1,009	-1,009	-1,009	-1,009
-5.33%	-672	-672	-672	-672	-672	-672	-672
-2.67%	-336	-336	-336	-336	-336	-336	-336
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	336	336	336	336	336	336	336
5.33%	672	672	672	672	672	672	672
8.00%	1,009	1,009	1,009	1,009	1,009	1,009	1,009

KR4201NB28 2018-11 콜287.5 197

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10	10	10	10	9	9	9
-5.33%	10	10	9	9	9	8	6
-2.67%	9	9	8	7	5	3	0

0%	8	6	4	0	-5	-10	-17
2.67%	0	-5	-12	-20	-29	-39	-49
5.33%	-26	-38	-51	-64	-78	-92	-107
8.00%	-93	-110	-127	-145	-162	-180	-197

KR4201NB27 2018-11 콜290

214

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8	8	8	8	8	8	8
-5.33%	8	8	8	8	7	7	5
-2.67%	8	8	7	6	5	2	-1
0%	7	6	3	0	-5	-10	-17
2.67%	1	-4	-10	-19	-28	-39	-51
5.33%	-22	-34	-48	-63	-79	-96	-113
8.00%	-87	-107	-128	-149	-170	-192	-214

KR4301NB27 2018-11 풋275

278

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	278	278	278	278	278	278	278
-5.33%	182	182	182	182	182	183	184
-2.67%	86	86	87	88	89	91	93
0%	-7	-5	-3	0	3	6	10
2.67%	-88	-83	-79	-74	-70	-65	-60
5.33%	-143	-138	-133	-128	-122	-117	-112
8.00%	-170	-167	-163	-159	-155	-150	-146

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

21

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	20	20	20	20	20	20	21
-5.33%	13	13	13	14	14	14	14
-2.67%	7	7	7	7	7	7	7
0%	0	0	0	0	0	0	1
2.67%	-7	-6	-6	-6	-6	-5	-5
5.33%	-11	-11	-11	-10	-10	-9	-9
8.00%	-14	-14	-13	-13	-13	-12	-12

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

(단위:백만원)

1,286

공시일	2018-10-29
기준일	2018-10-26

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

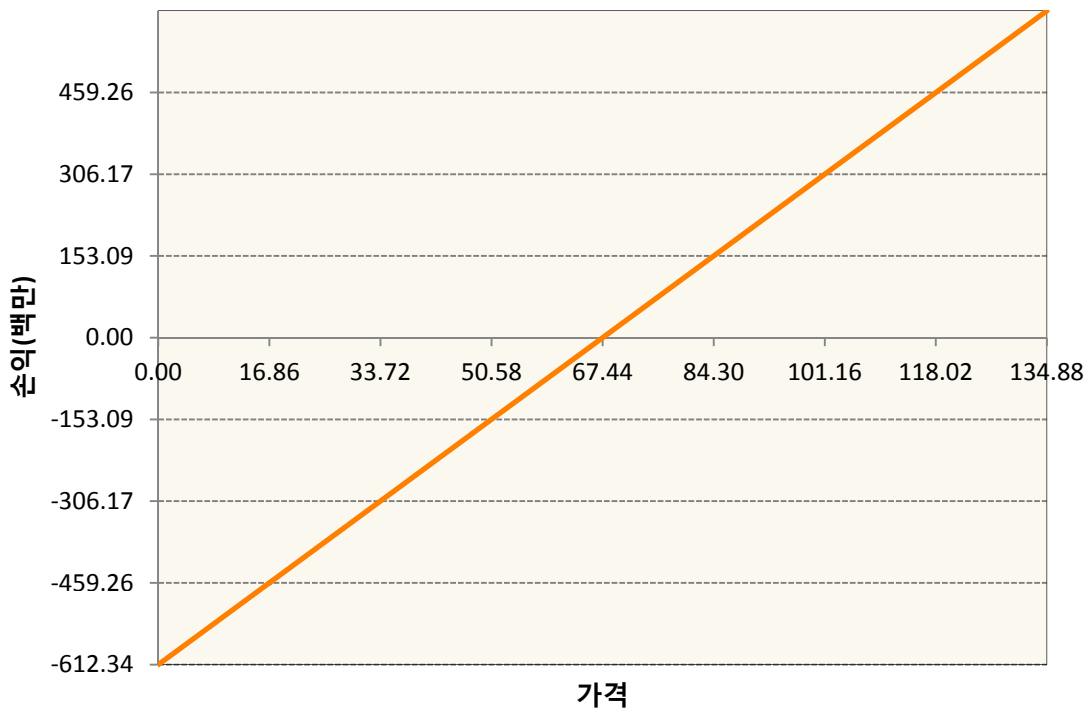
1. 계약금액

(단위:백만원)

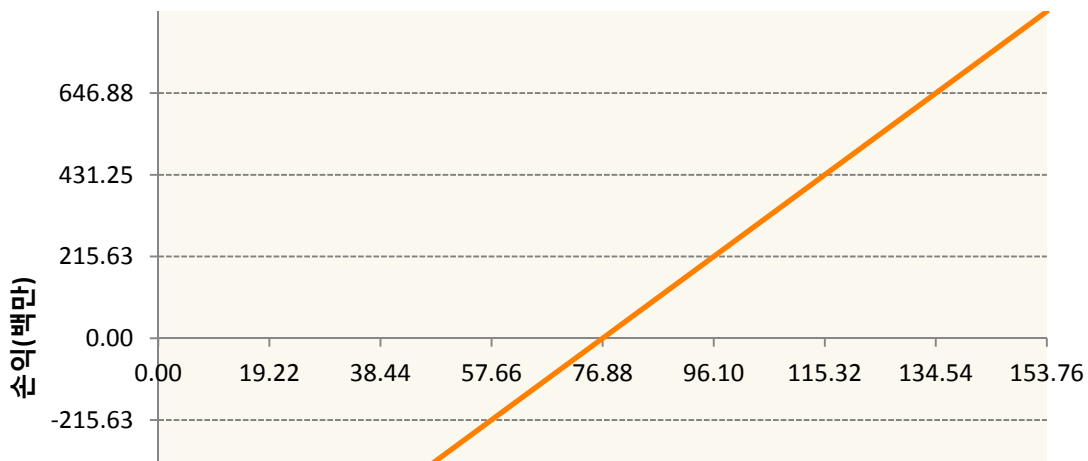
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,358	411	2,947	

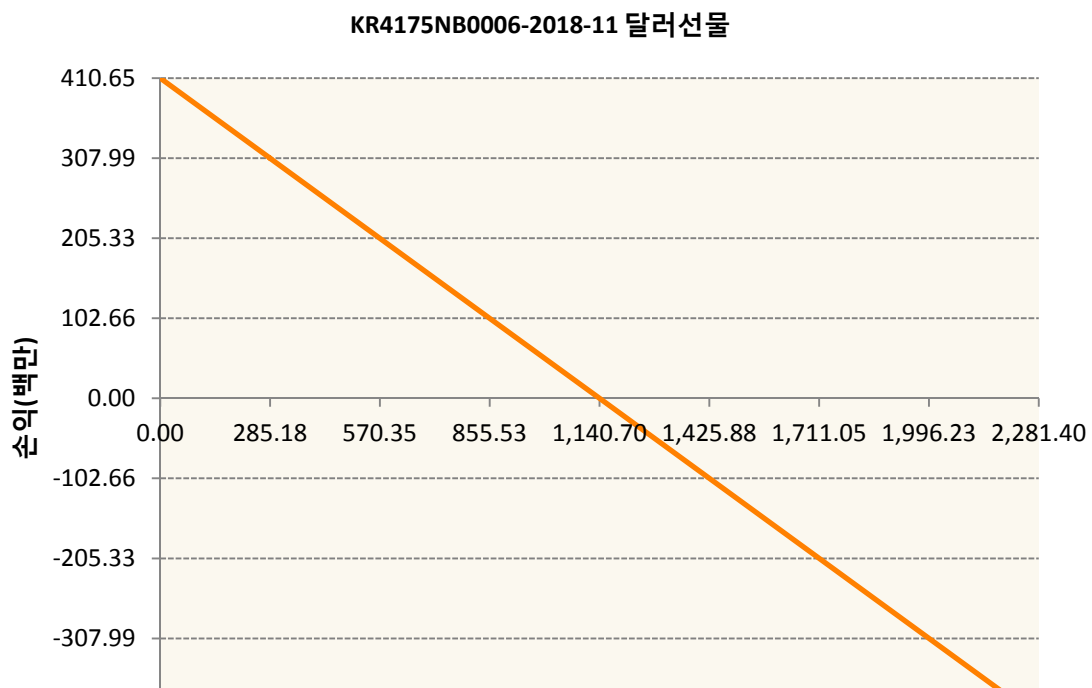
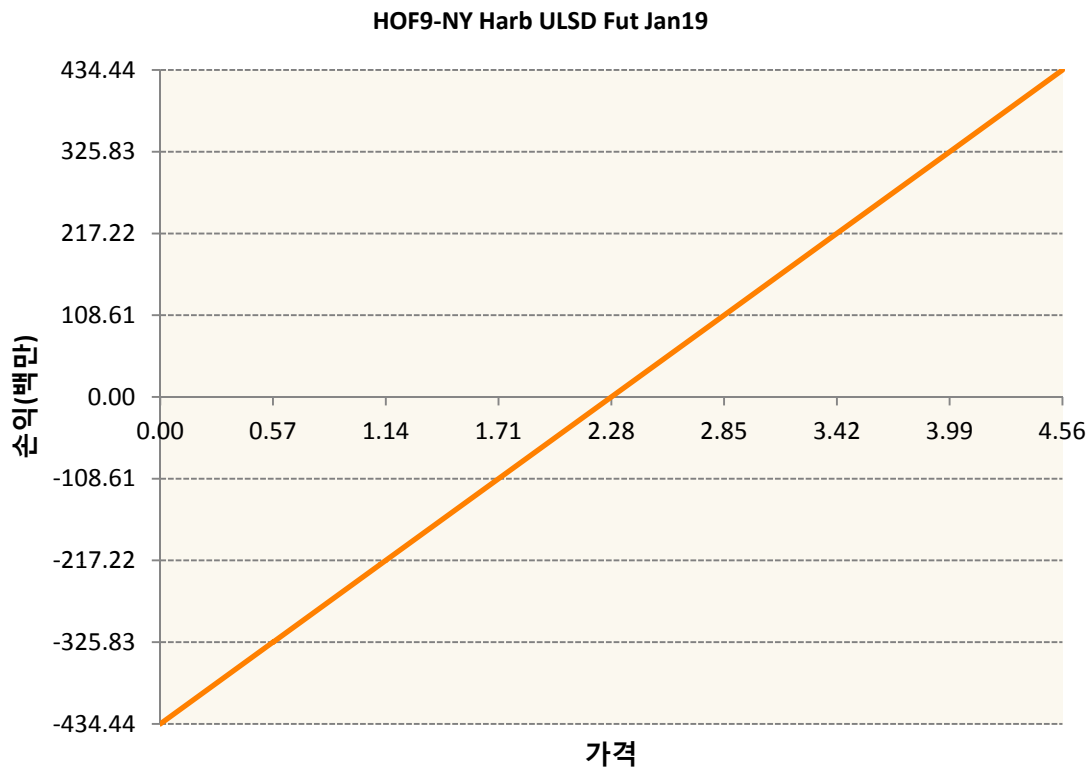
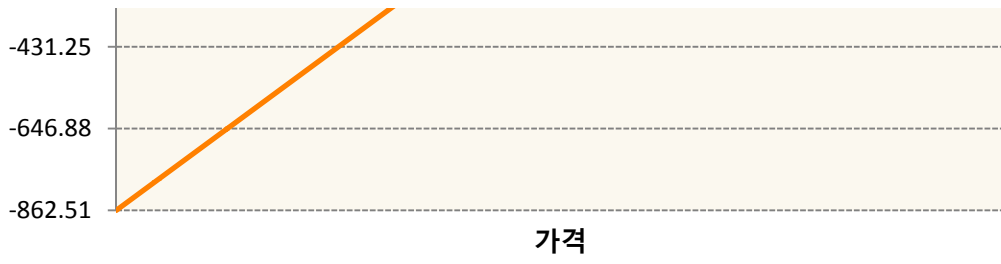
2. 만기시점의 손익구조

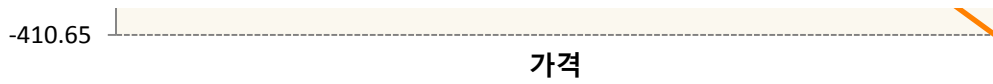
CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19



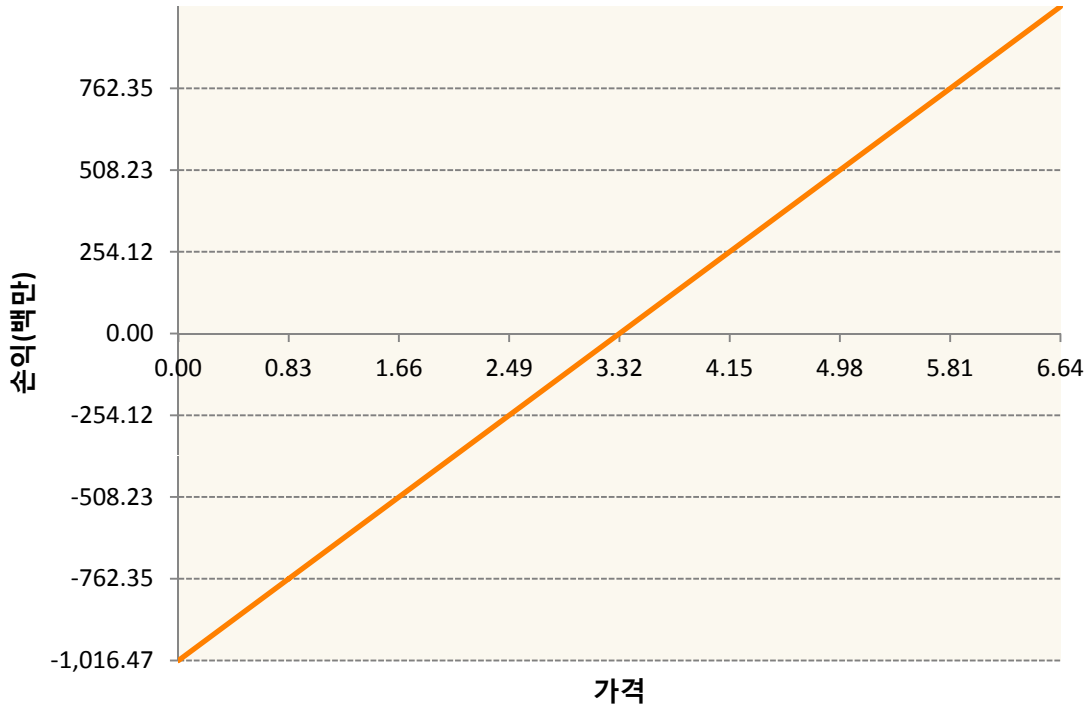
COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19



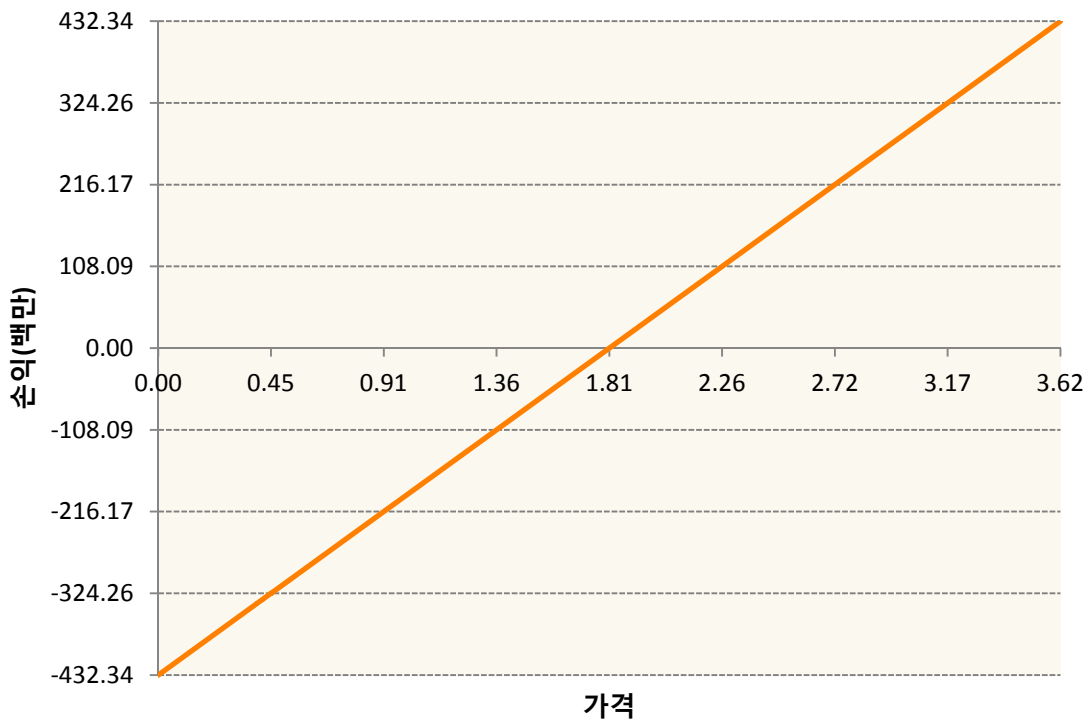




NGF19-NATURAL GAS FUTR Jan19



XBF9-GASOLINE RBOB FUT Jan19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF9	WTI CRUDE FUTURE Jan19	49
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	69
HOF9	NY Harb ULSD Fut Jan19	35
KR4175NB0(2018-11 달러선물		33
NGF19	NATURAL GAS FUTR Jan19	81
XBF9	GASOLINE RBOB FUT Jan19	35

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

406

공시일	2018-10-29
기준일	2018-10-26

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

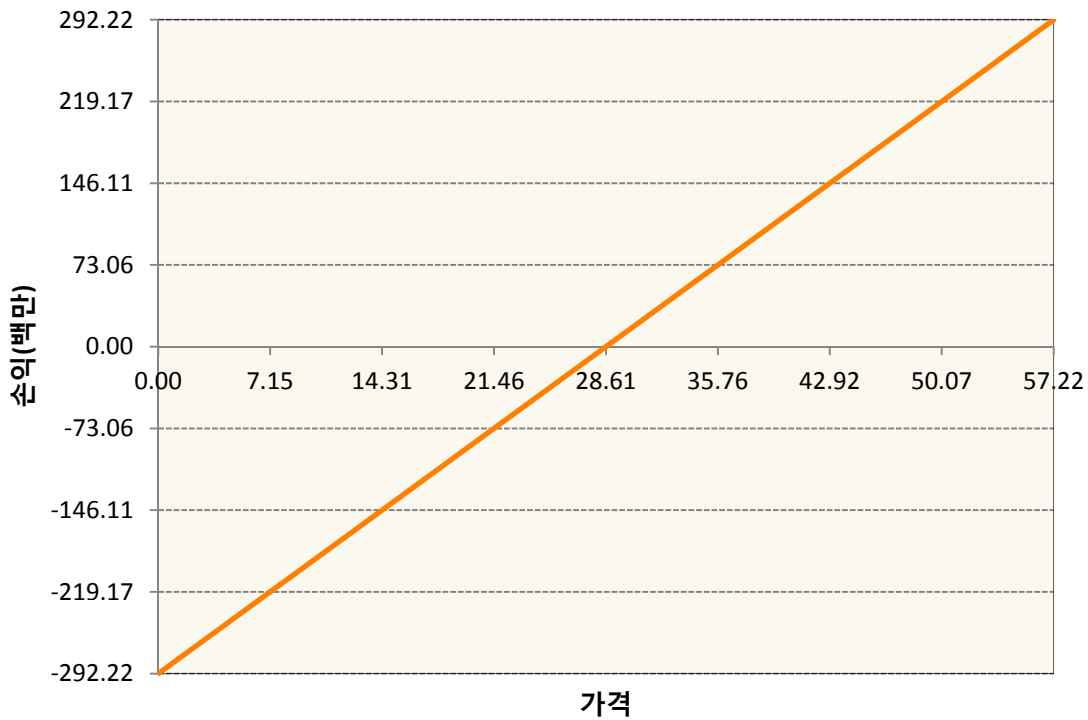
1. 계약금액

(단위:백만원)

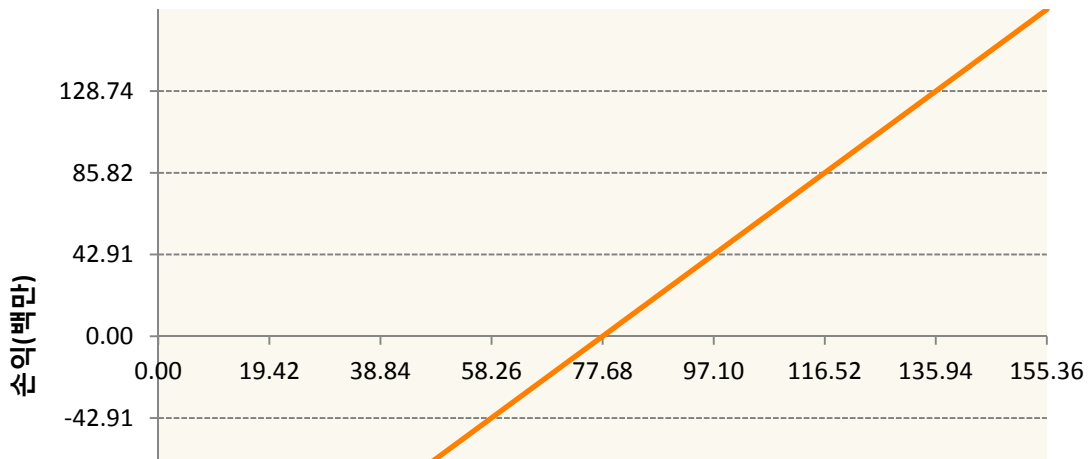
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,562	80	3,482	

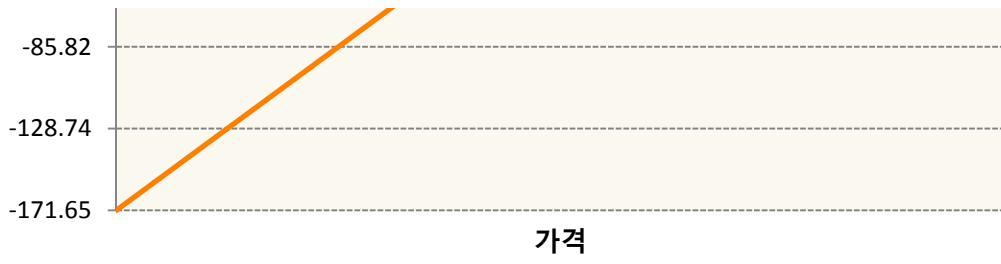
2. 만기시점의 손익구조

BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19

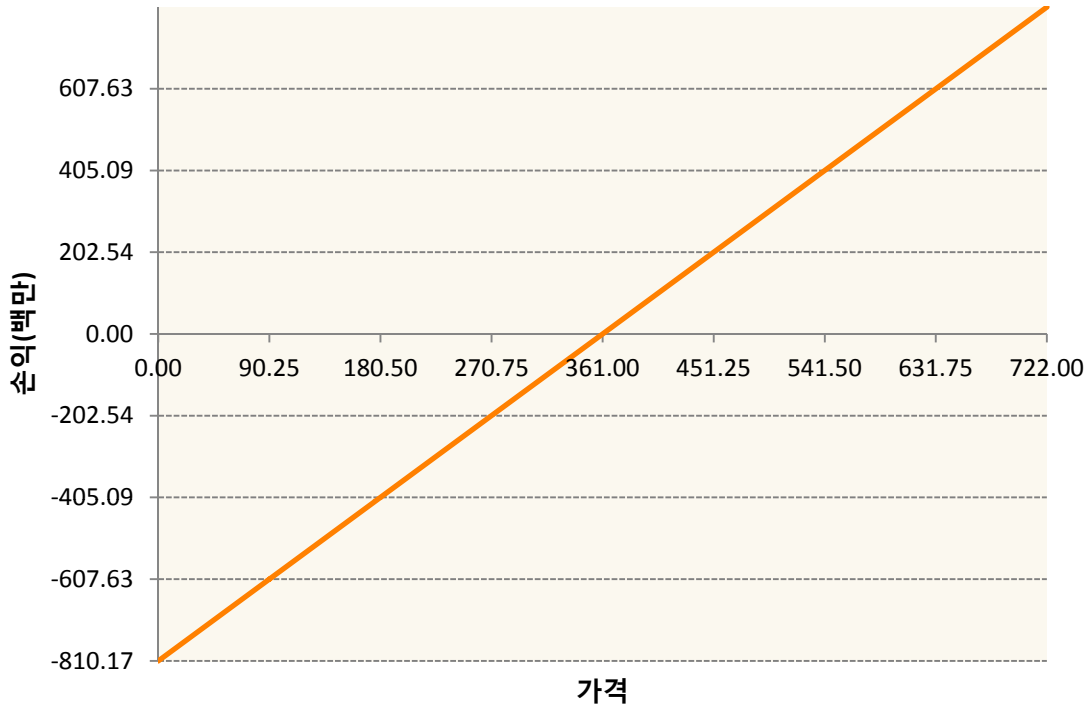


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

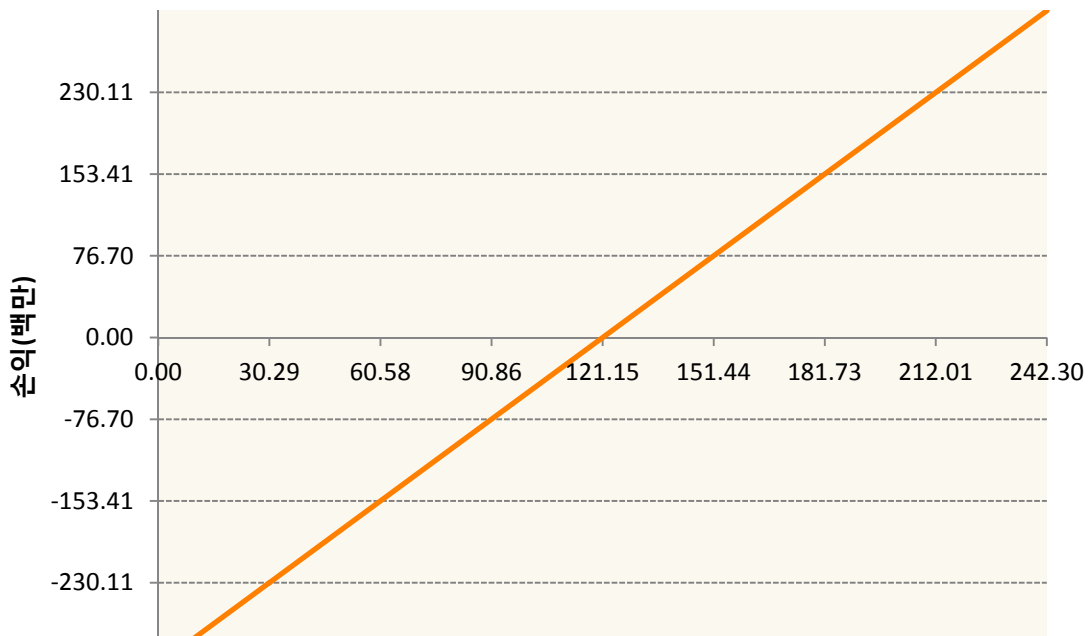


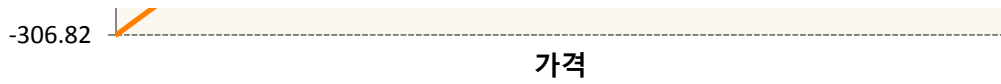


CZ8-CORN FUTURE DEC18

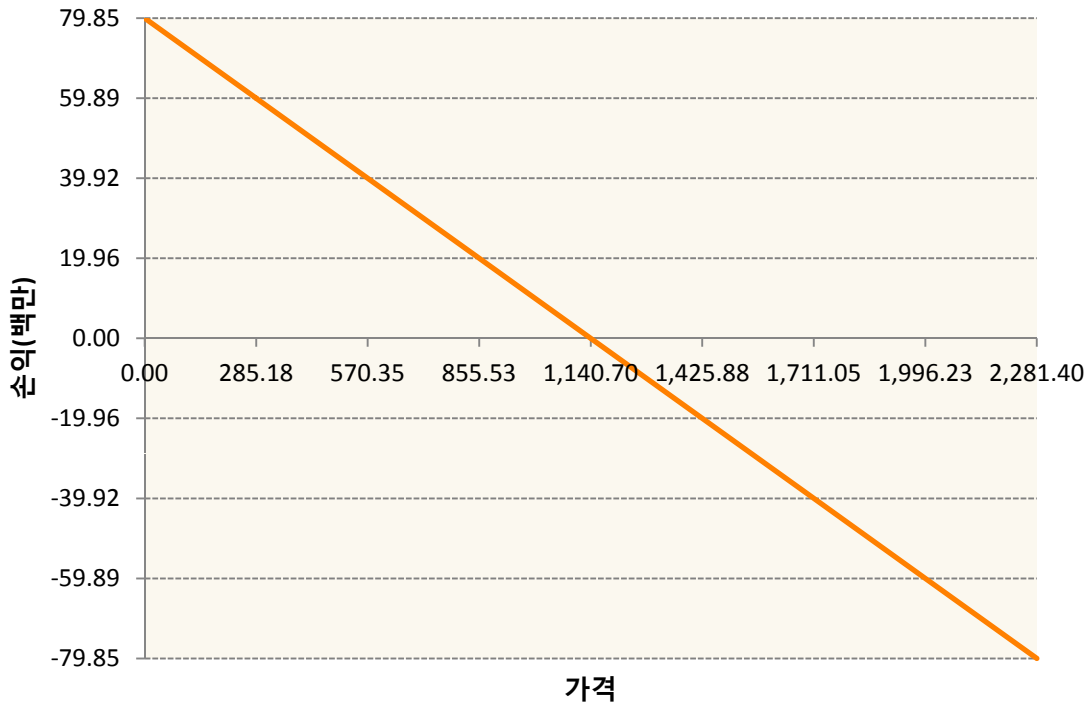


KCZ8-COFFEE 'C' FUTURE Dec18

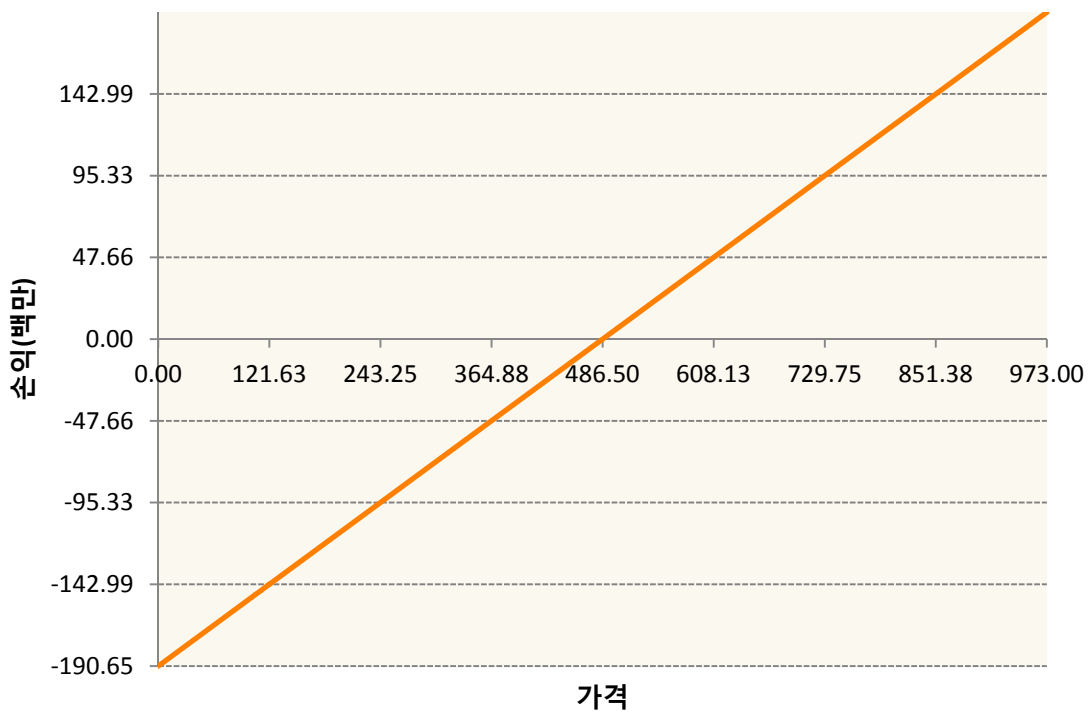




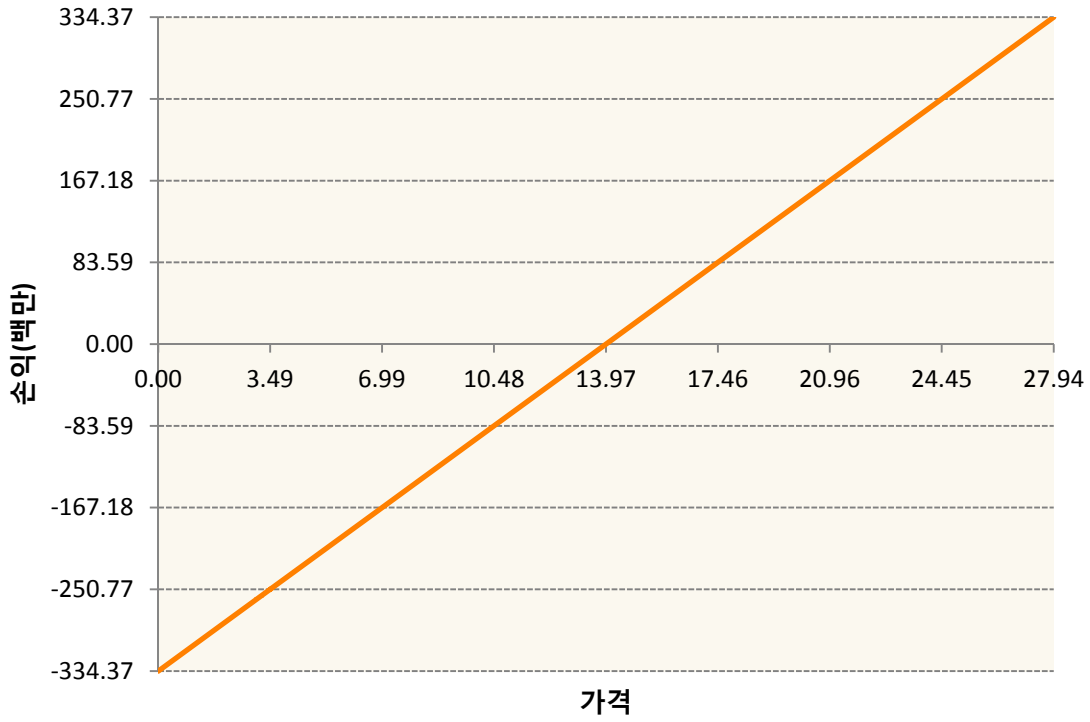
KR4175NB0006-2018-11 달러선물



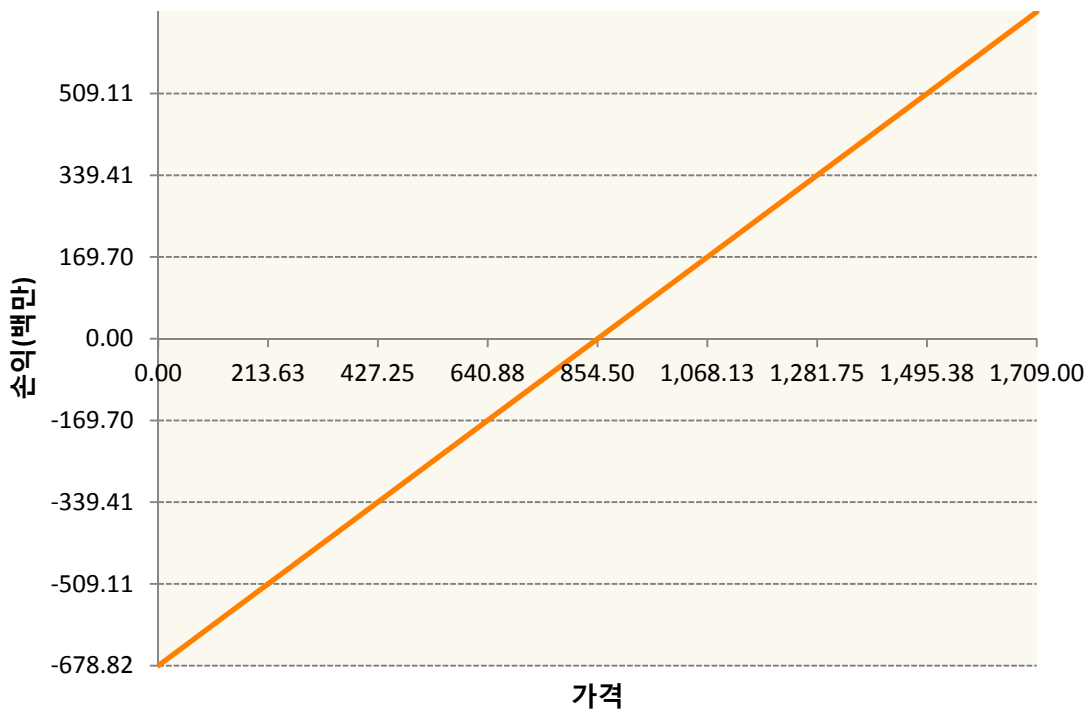
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



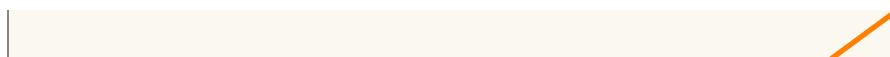
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

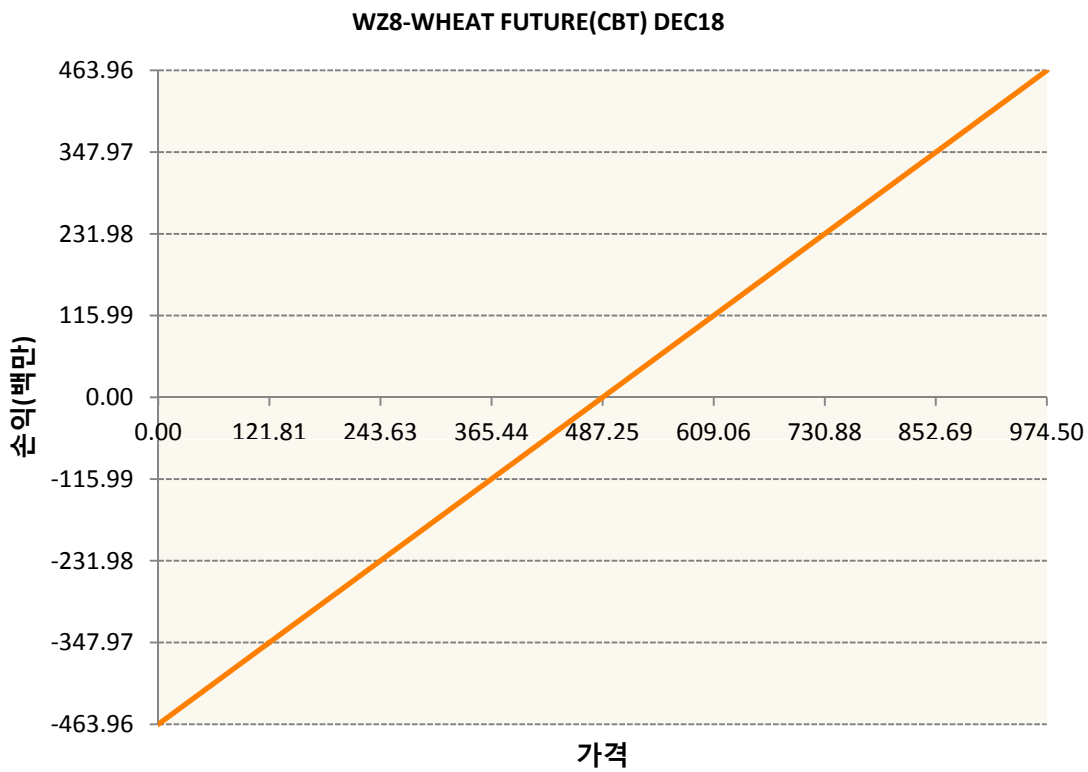
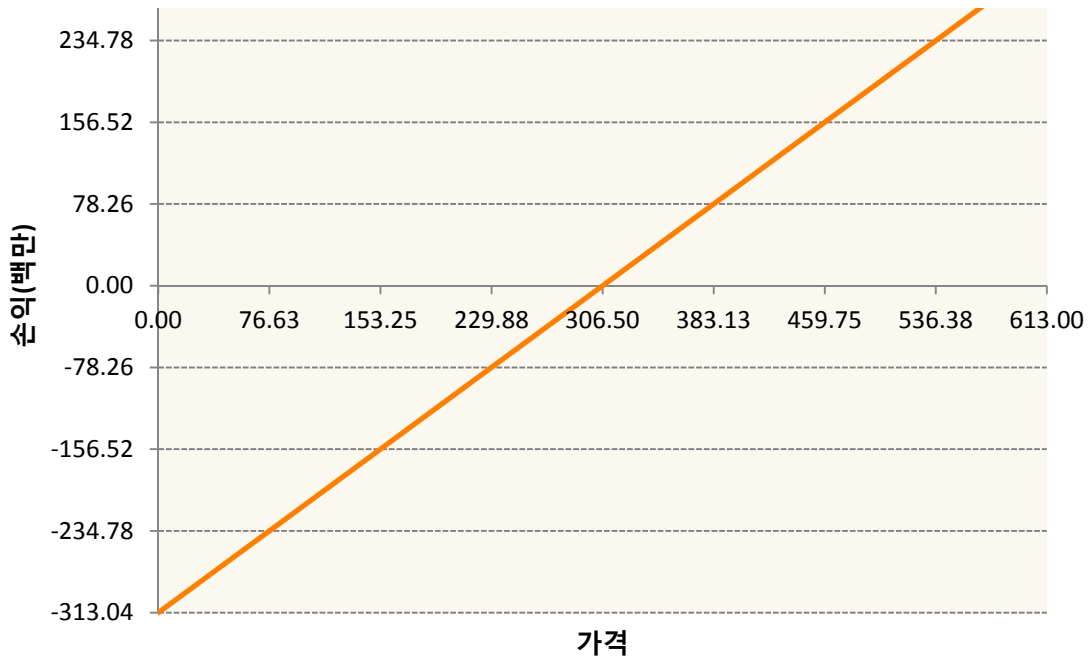


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19



SMF9-SOYBEAN MEAL FUTR Jan19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF9	SOYBEAN OIL FUTR Jan19	23
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	14
CZ8	CORN FUTURE DEC18	65
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	25
KR4175NB0(2018-11 달러선물	6

KWZ8	KC HRW WHEAT FUT DEC18	15
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	27
SF9	SOYBEAN FUTURE Jan19	54
SMF9	SOYBEAN MEAL FUTR Jan19	25
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	37

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

(단위:백만원)

310