

공시일	2018-10-30
기준일	2018-10-29

## 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)

64

공시일	2018-10-30
기준일	2018-10-29

## 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

1,053

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

492

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-30
기준일	2018-10-29

## 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

251

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

352

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-30
기준일	2018-10-29

## 유로인덱스모(주식-파생형)

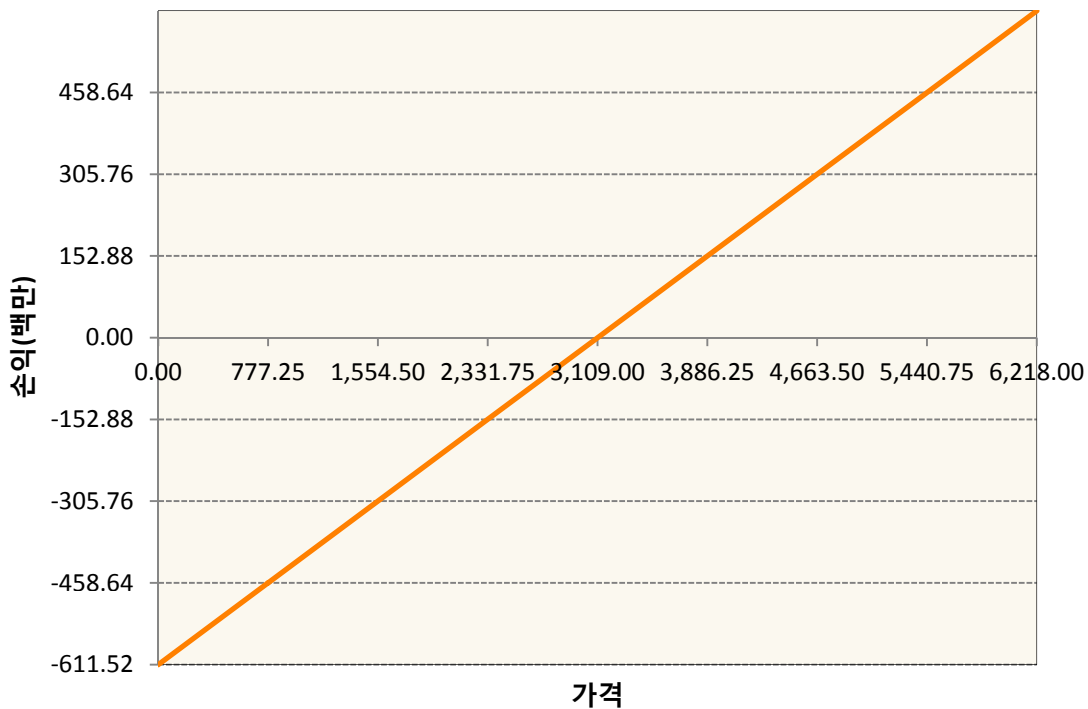
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	612	0	612	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGZ8-EURO STOXX 50 DEC18



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ8	EURO STOXX 50 DEC18	49
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

31
----

공시일	2018-10-30
기준일	2018-10-29

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

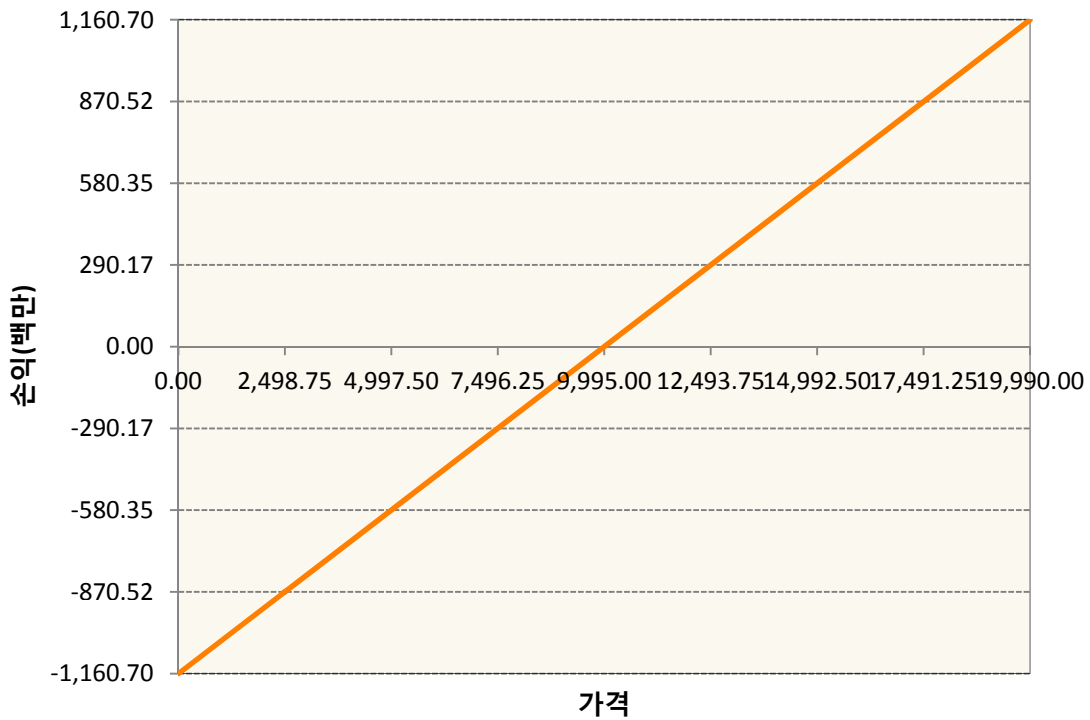
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

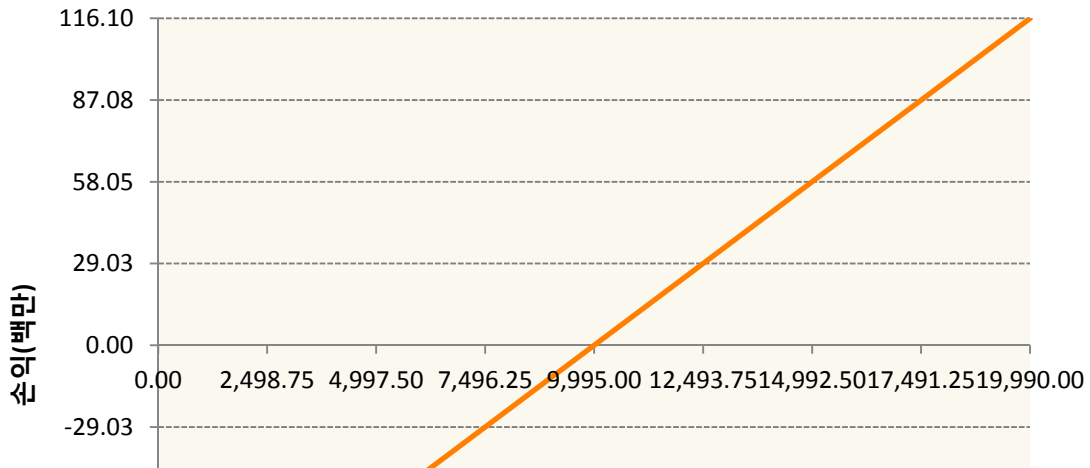
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,277	0	1,277	장내

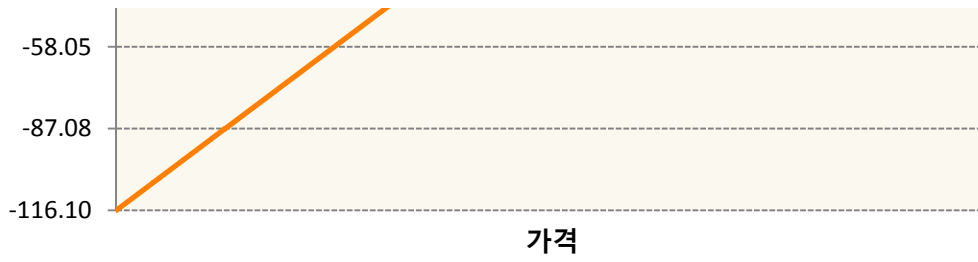
### 2. 만기시점의 손익구조

HCX8-HSCEI FUTURES NOV 18



MHCX8-MINI H-SHR IDX FU NOV 18





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

HCX8	HSCEI FUTURES NOV 18	93
MHCX8	MINI H-SHR IDX FU NOV 18	9

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

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

공시일	2018-10-30
기준일	2018-10-29

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

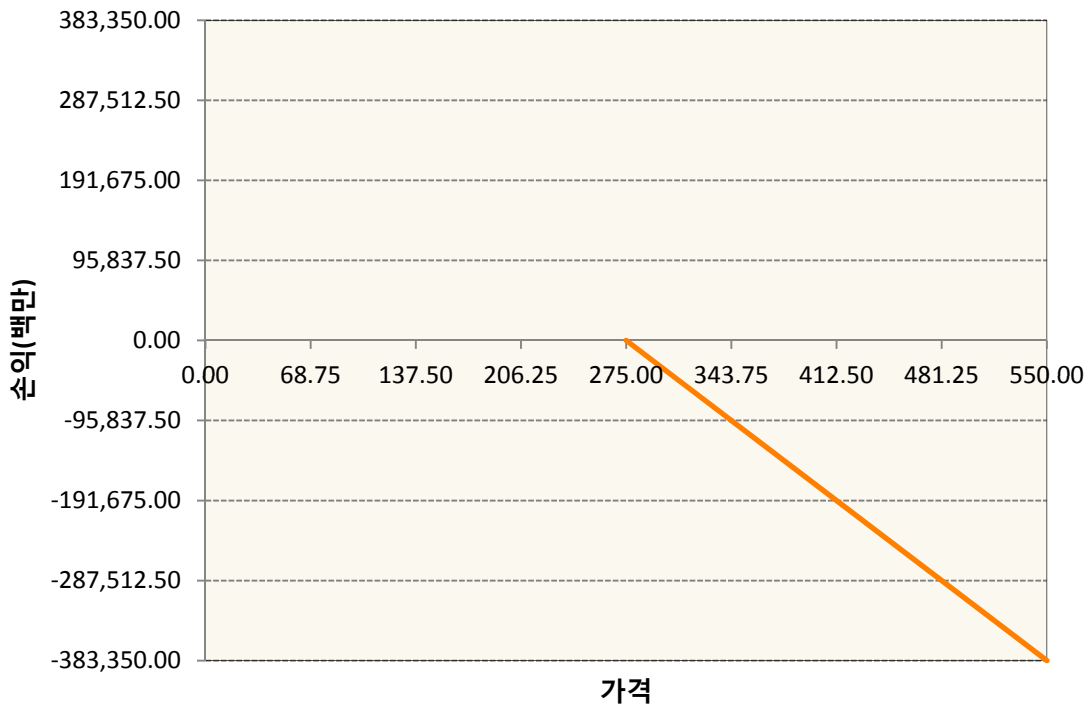
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

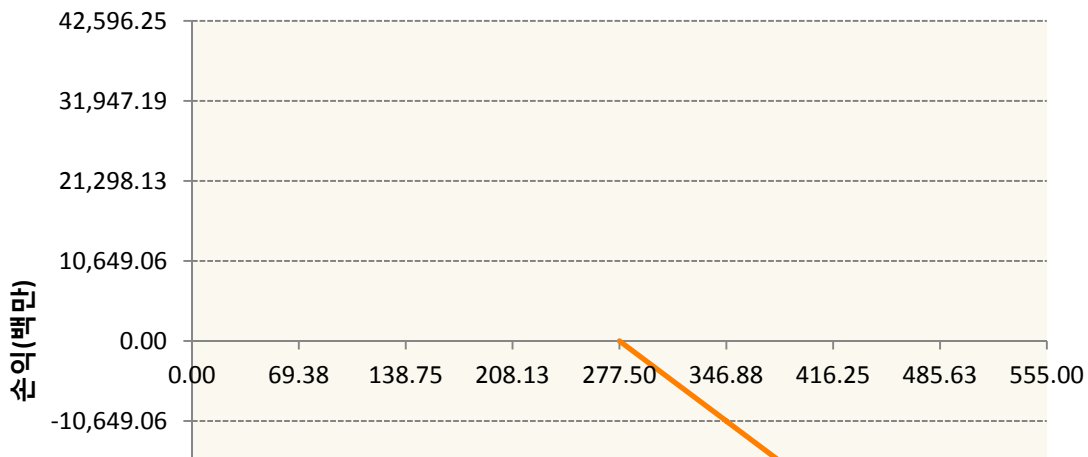
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	721,571	-721,571	장내

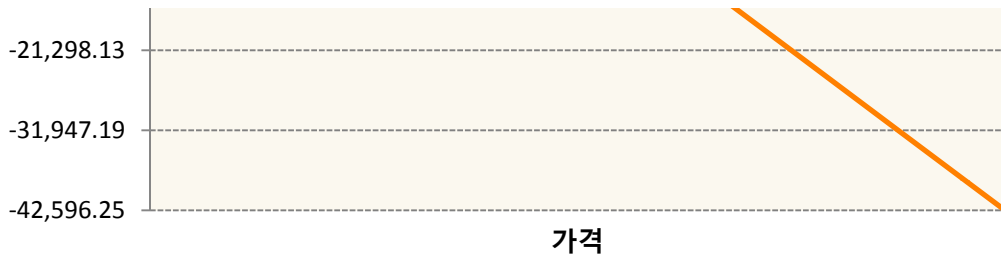
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201NB2752-2018-11 콜275**

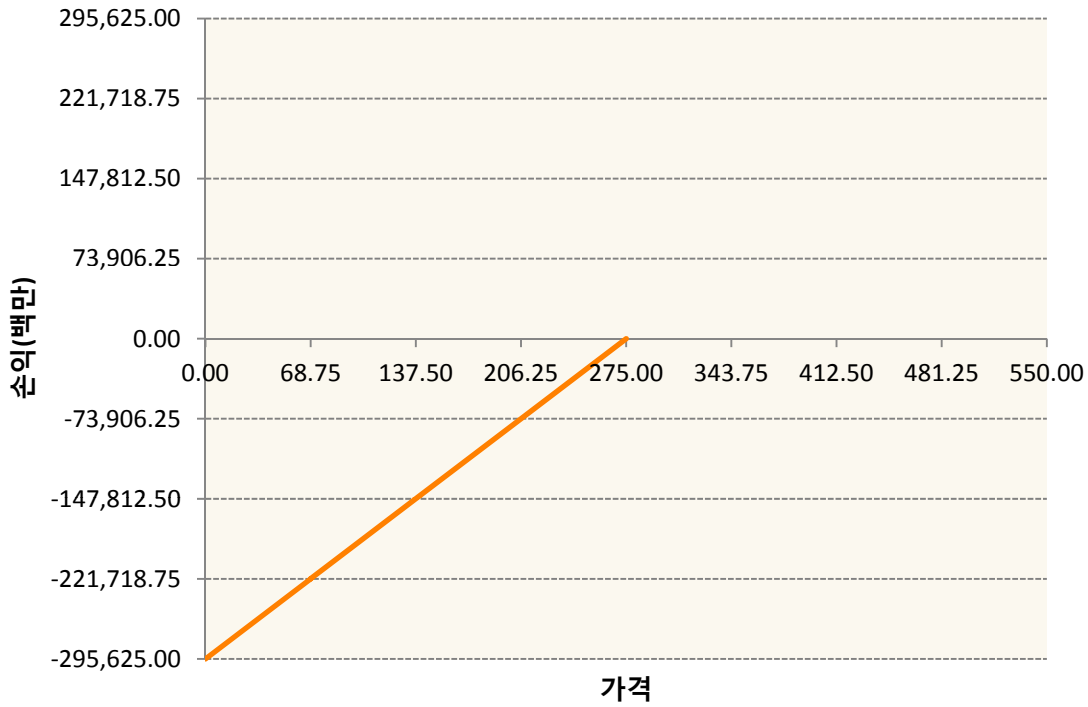


**KR4201NB2778-2018-11 콜277.5**





KR4301NB2751-2018-11 풋275



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NB27 2018-11 콜275

12,860

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,056	1,055	1,053	1,048	1,037	1,018	987
-5.33%	1,053	1,045	1,028	998	950	882	792
-2.67%	1,011	959	878	766	622	447	241
0%	717	520	279	0	-313	-655	-1,023
2.67%	-504	-944	-1,410	-1,894	-2,395	-2,907	-3,431
5.33%	-3,726	-4,327	-4,928	-5,529	-6,131	-6,733	-7,335
8.00%	-9,572	-10,091	-10,625	-11,172	-11,728	-12,291	-12,860

KR4201NB27 2018-11 콜277.5

1,224

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	78	78	78	78	77	76	73

-5.33%	78	78	77	75	71	66	59
-2.67%	76	73	67	59	47	32	14
0%	58	43	24	0	-28	-59	-93
2.67%	-29	-68	-111	-158	-207	-257	-310
5.33%	-293	-357	-420	-485	-549	-614	-679
8.00%	-833	-897	-961	-1,026	-1,092	-1,158	-1,224

KR4301NB27 2018-11 풋275

22,000

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21,992	-21,992	-21,992	-21,993	-21,994	-21,996	-22,000
-5.33%	-14,538	-14,539	-14,540	-14,545	-14,553	-14,567	-14,589
-2.67%	-7,089	-7,098	-7,117	-7,146	-7,190	-7,249	-7,325
0%	284	213	119	0	-141	-303	-483
2.67%	7,137	6,902	6,646	6,373	6,087	5,790	5,484
5.33%	12,376	12,001	11,626	11,250	10,874	10,497	10,121
8.00%	15,176	14,878	14,566	14,243	13,912	13,574	13,231

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

(단위:백만원)

33,647

공시일	2018-10-30
기준일	2018-10-29

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

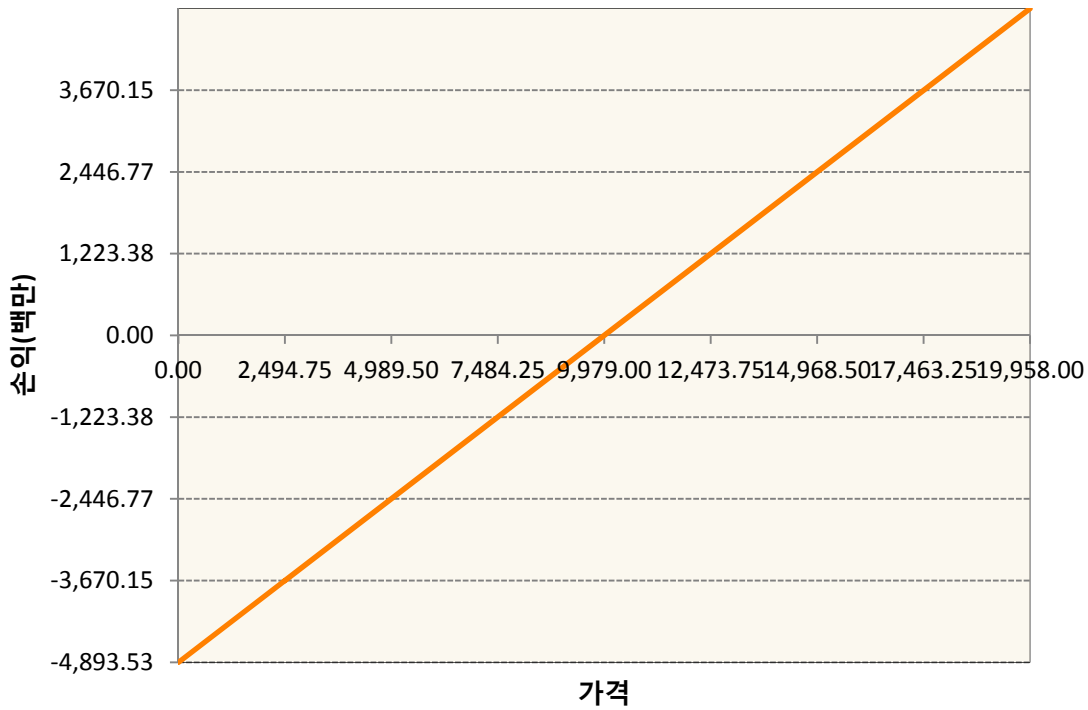
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

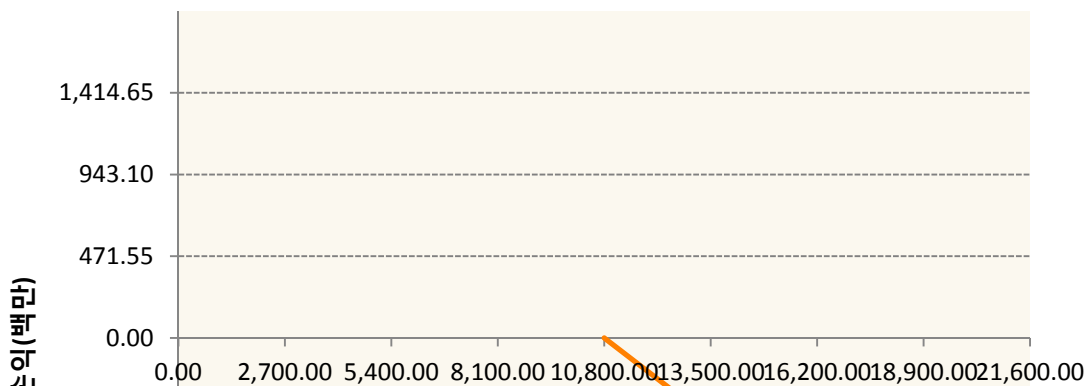
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,894	0	4,894	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,257	-12,257	장내

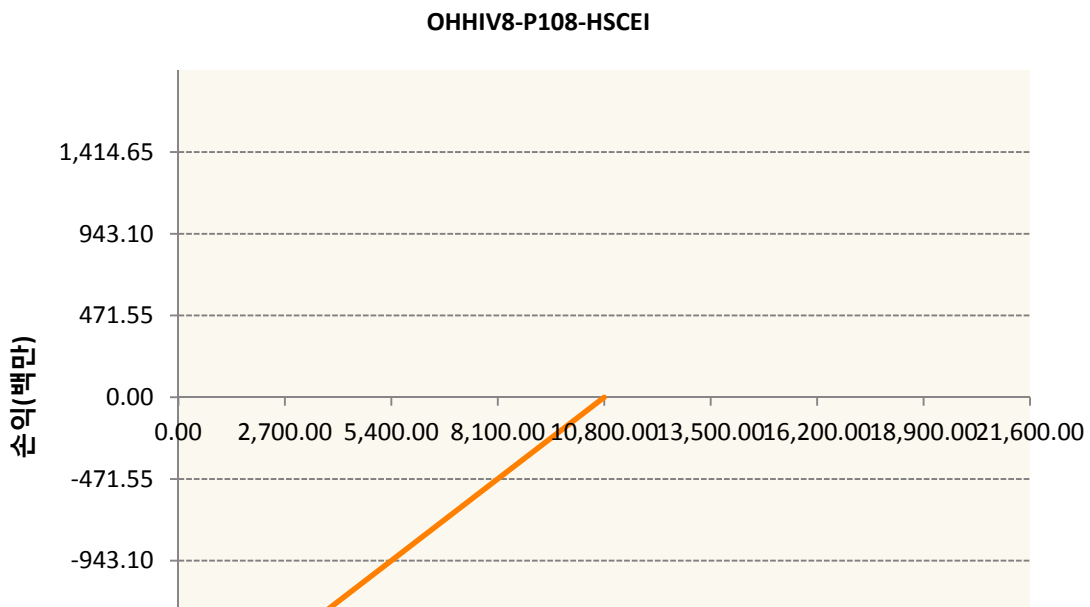
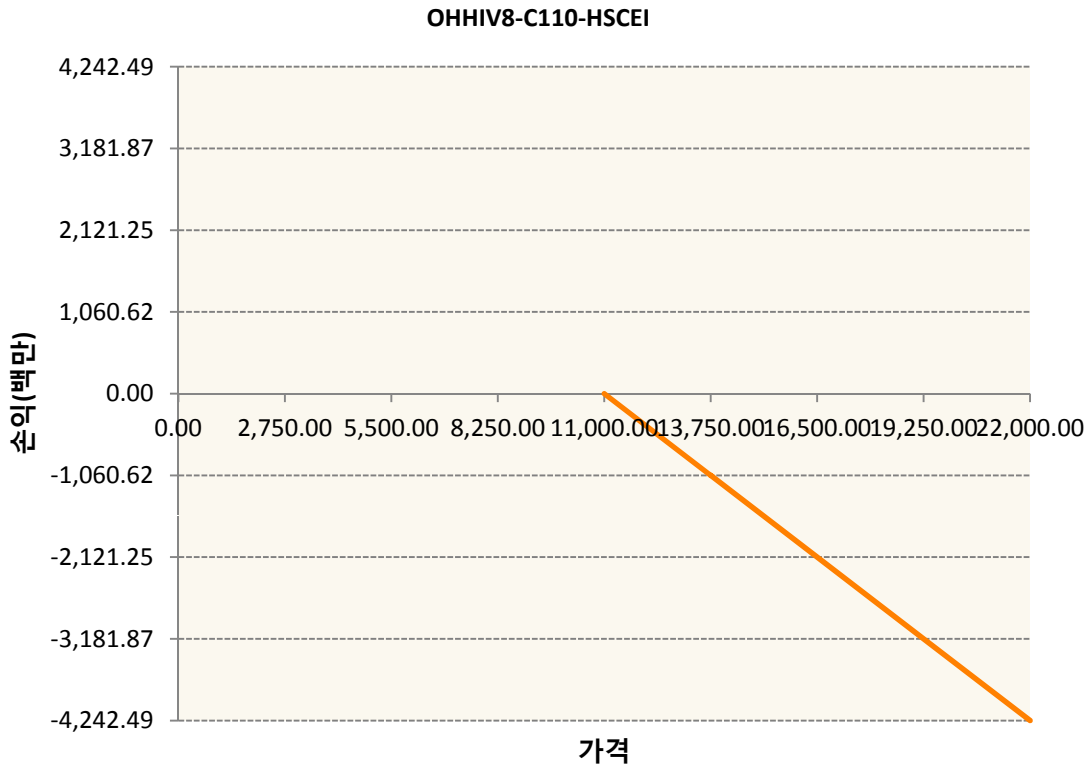
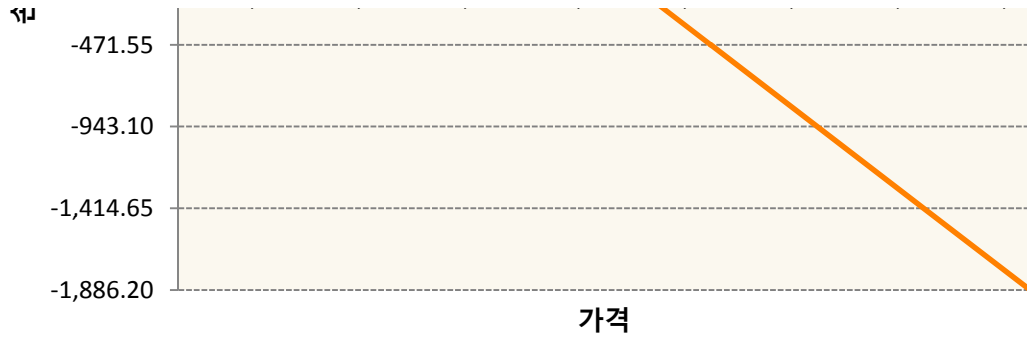
### 2. 만기시점의 손익구조

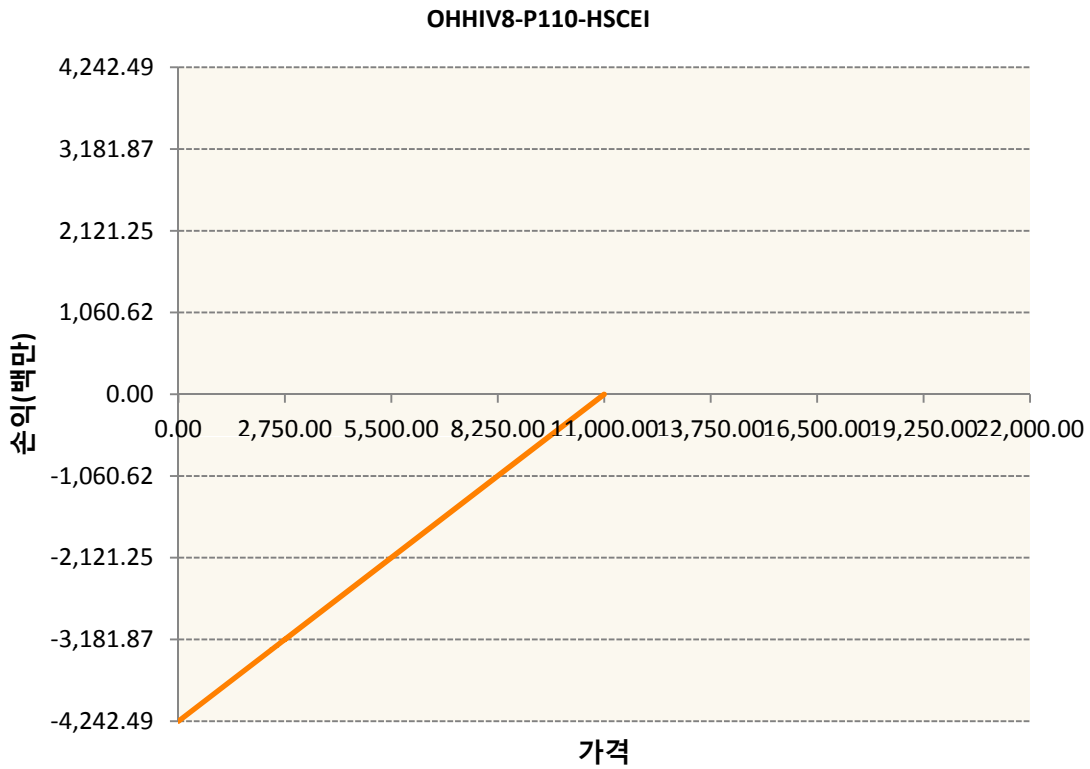
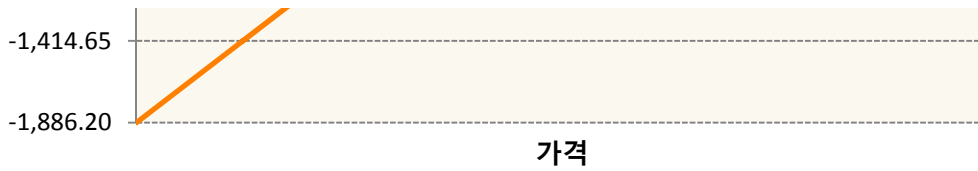
HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



OHHIV8-C108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	391
OHHIV8-C1C	HSCEI	151
OHHIV8-C11	HSCEI	339
OHHIV8-P1C	HSCEI	151
OHHIV8-P11	HSCEI	339

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	<b>1,328</b>

공시일	2018-10-30
기준일	2018-10-29

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

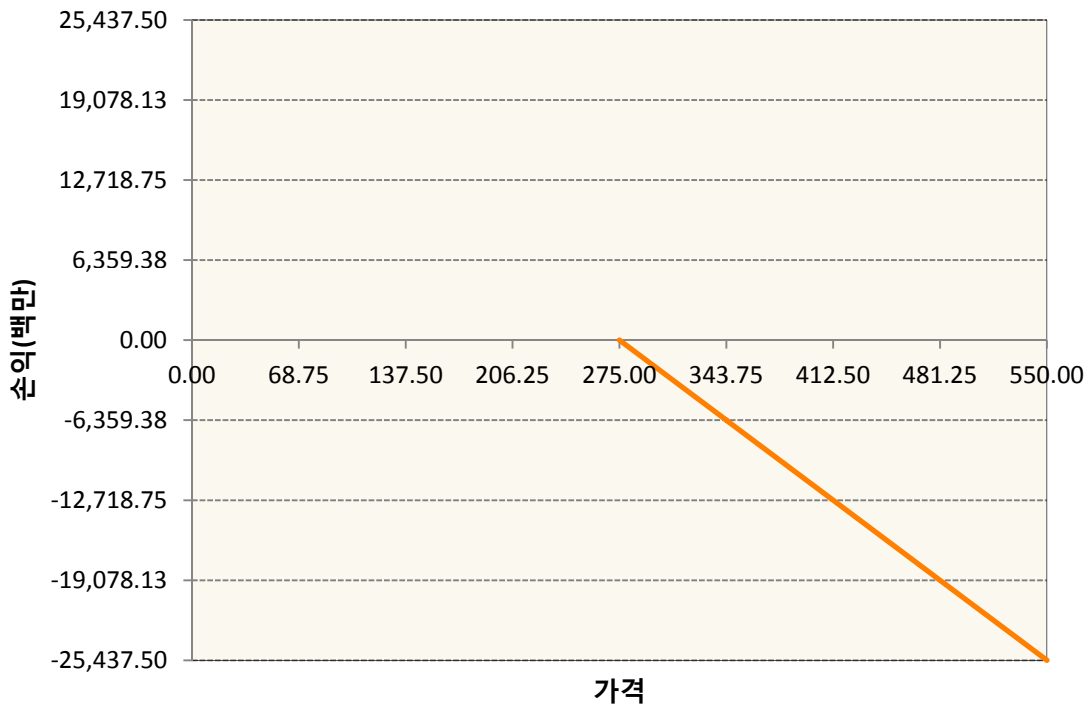
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

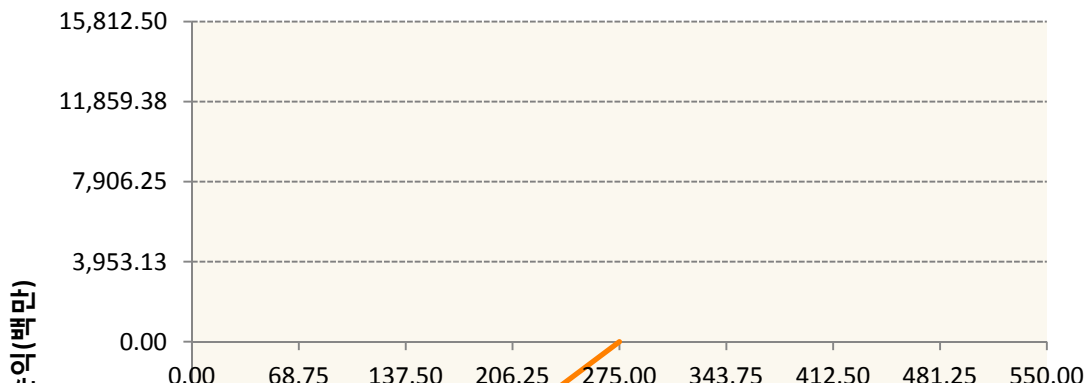
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	44,025	-44,025	장내

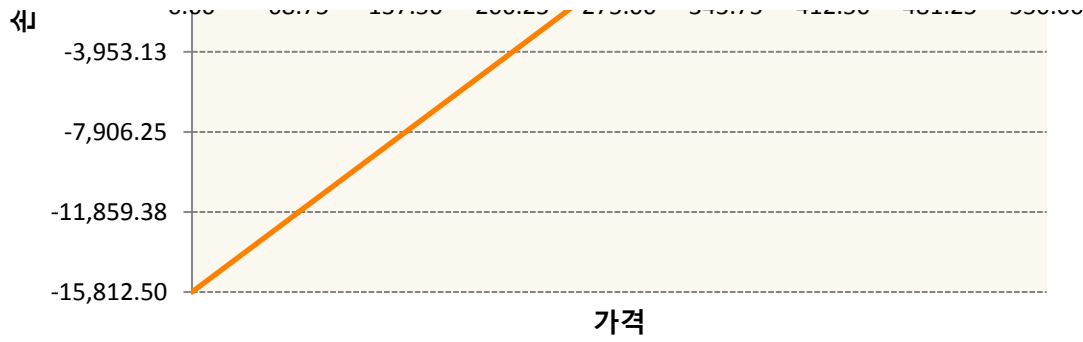
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

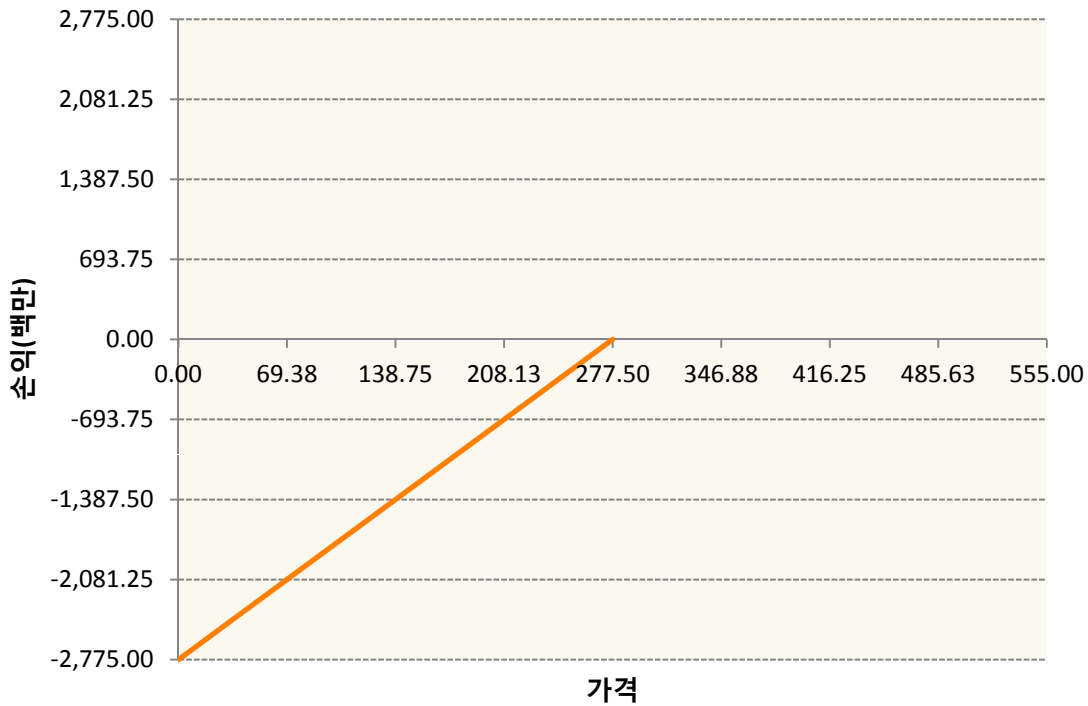


KR4301NB2751-2018-11 풋275





KR4301NB2777-2018-11 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_14							4,026	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-4,026	-4,026	-4,026	-4,026	-4,026	-4,026	-4,026	
-5.33%	-2,684	-2,684	-2,684	-2,684	-2,684	-2,684	-2,684	
-2.67%	-1,342	-1,342	-1,342	-1,342	-1,342	-1,342	-1,342	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	1,342	1,342	1,342	1,342	1,342	1,342	1,342	
5.33%	2,684	2,684	2,684	2,684	2,684	2,684	2,684	
8.00%	4,026	4,026	4,026	4,026	4,026	4,026	4,026	
KR4201NB27 2018-11 콜275							853	
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	70	70	70	70	69	68	66
-5.33%	70	69	68	66	63	59	53
-2.67%	67	64	58	51	41	30	16
0%	48	34	19	0	-21	-43	-68
2.67%	-33	-63	-94	-126	-159	-193	-228
5.33%	-247	-287	-327	-367	-407	-447	-487
8.00%	-635	-670	-705	-741	-778	-816	-853

KR4301NB27 2018-11 풋275

1,177

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,176	-1,176	-1,176	-1,176	-1,176	-1,177	-1,177
-5.33%	-778	-778	-778	-778	-778	-779	-780
-2.67%	-379	-380	-381	-382	-385	-388	-392
0%	15	11	6	0	-8	-16	-26
2.67%	382	369	355	341	326	310	293
5.33%	662	642	622	602	582	561	541
8.00%	812	796	779	762	744	726	708

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

206

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-206	-206	-206	-206	-206	-206	-206
-5.33%	-137	-137	-137	-137	-137	-137	-137
-2.67%	-67	-67	-67	-68	-68	-68	-69
0%	2	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	68	66	65	62	60	58	55
5.33%	123	120	117	113	110	107	103
8.00%	158	154	151	148	144	141	137

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

(단위:백만원)

6,121

공시일	2018-10-30
기준일	2018-10-29

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

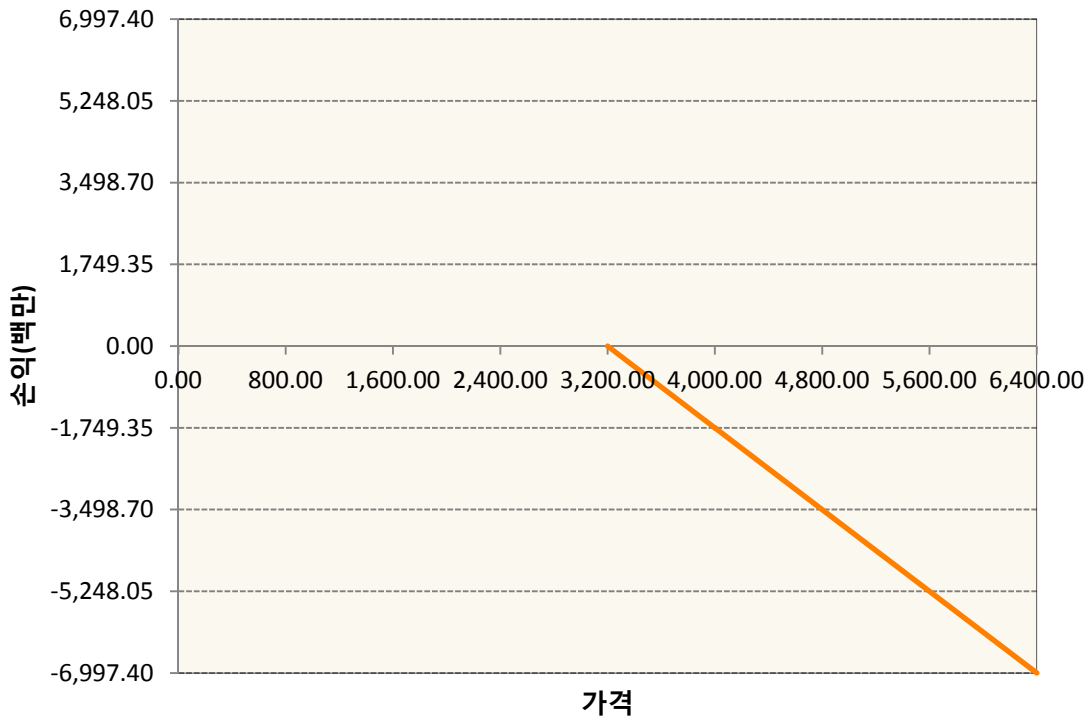
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

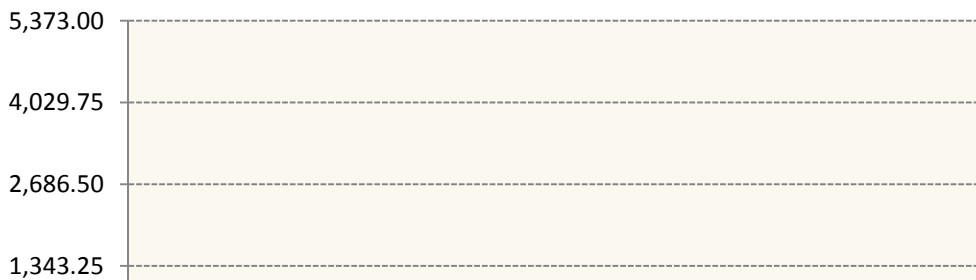
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,712	0	5,712	
누계	유가증권	스왑	72,698	0	72,698	장외
누계	유가증권	옵션	0	24,741	-24,741	장내

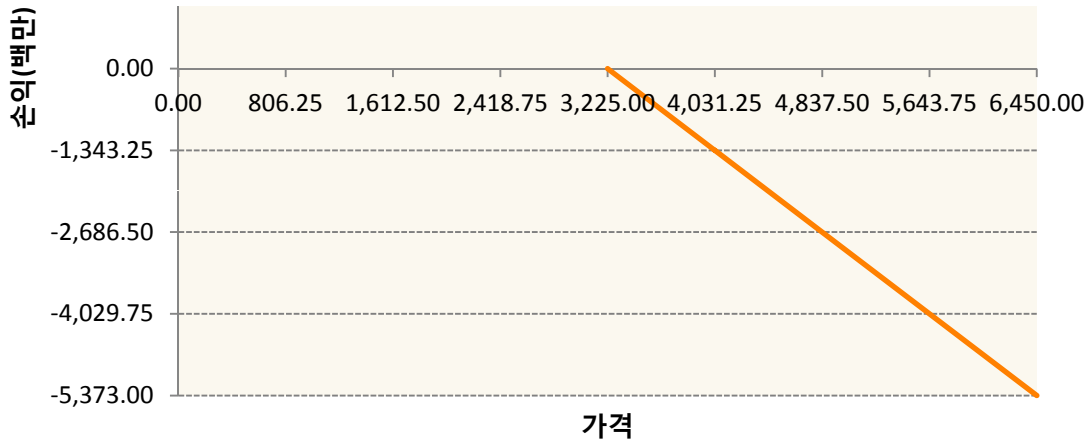
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXX8-C3200-EURO STOXX 50**

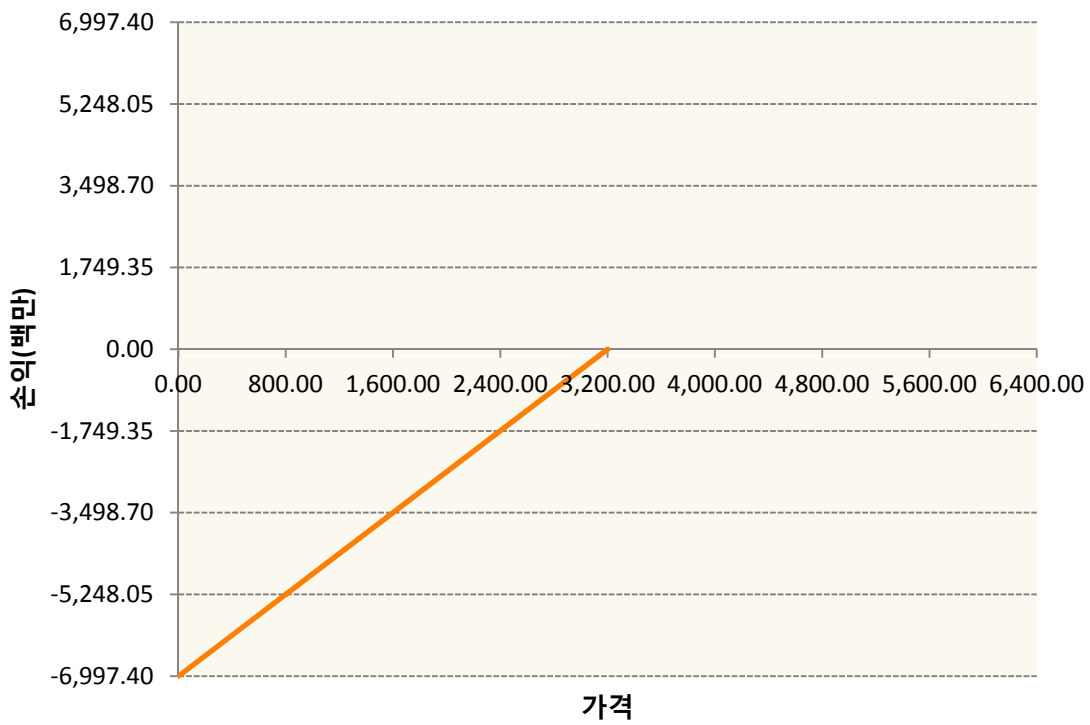


**OESXX8-C3225-EURO STOXX 50**

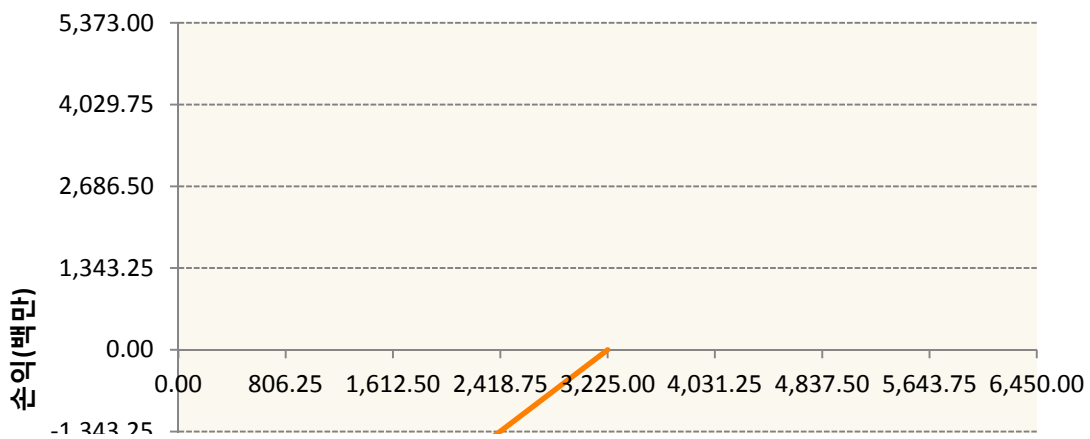


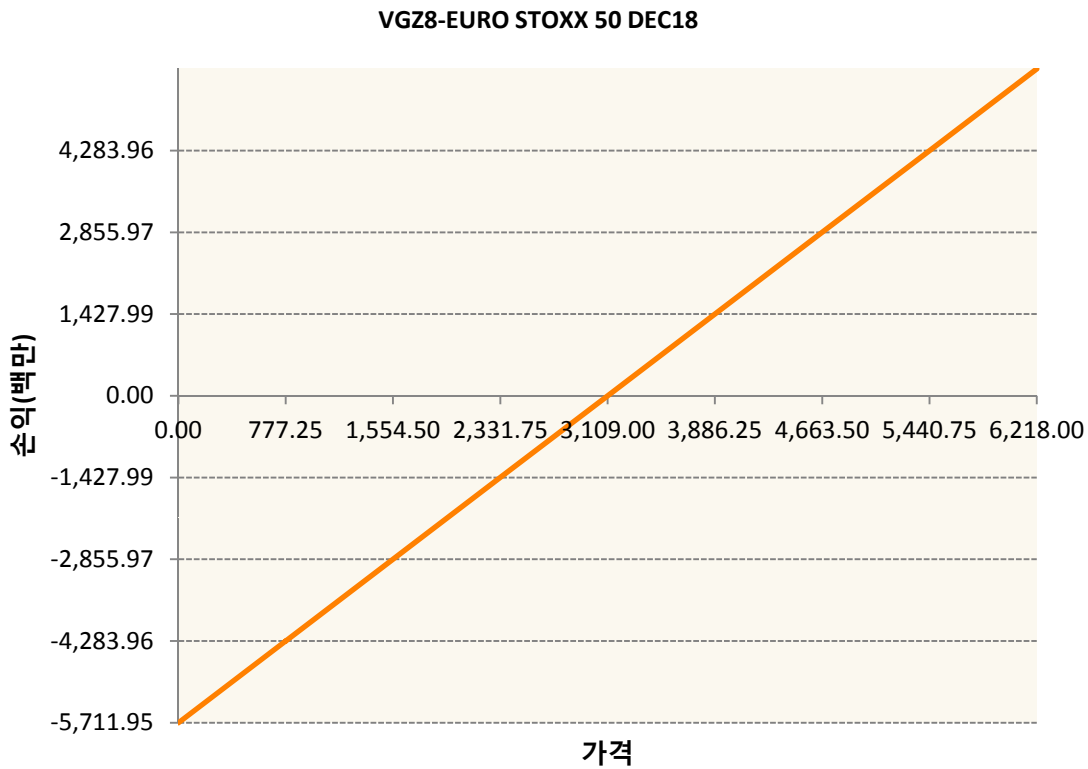
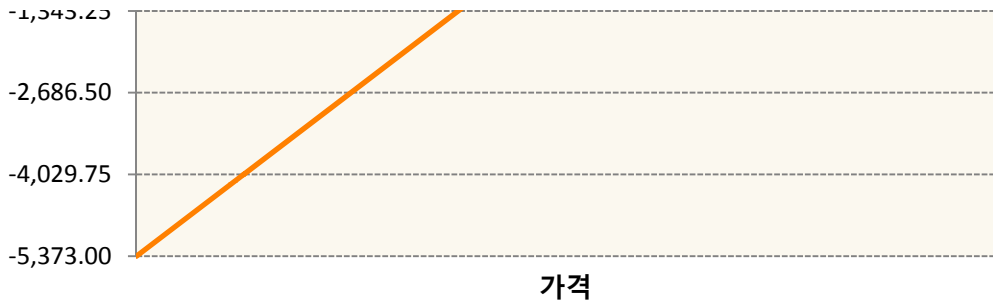


**OESXX8-P3200-EURO STOXX 50**



**OESXX8-P3225-EURO STOXX 50**





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	87
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	457

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,631



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

(단위:백만원)

1,088



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

(단위:백만원)

86



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

(단위:백만원)

128



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

(단위:백만원)

144

공시일	2018-10-30
기준일	2018-10-29

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1

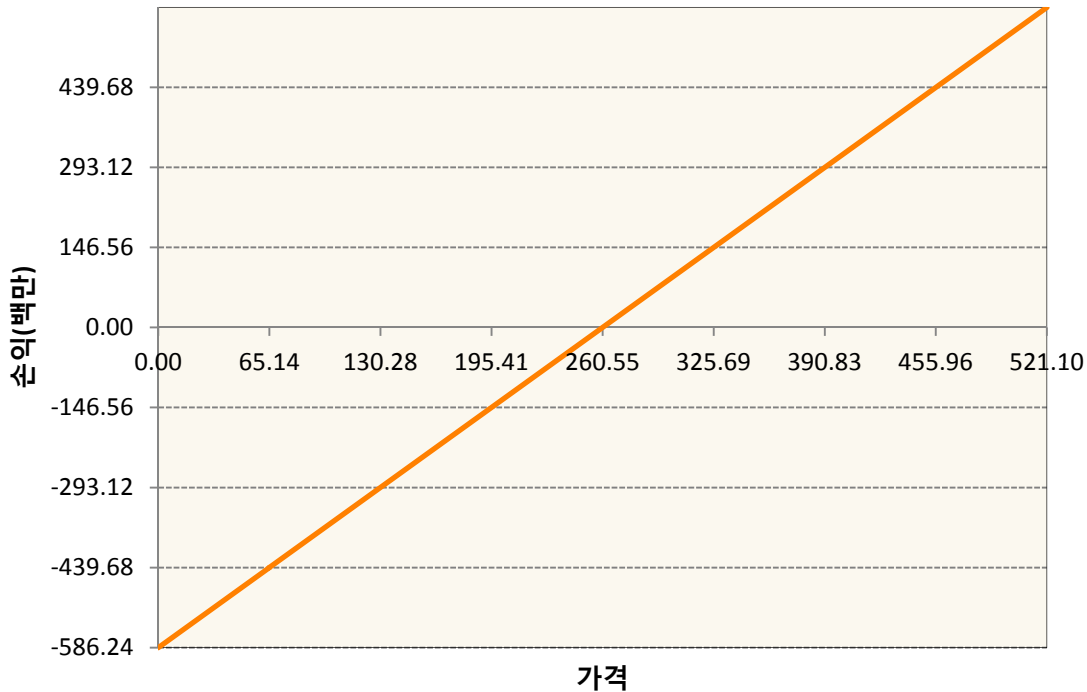
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	586	0	586	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물)

47

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
-5.33%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	16	16	16	16	16	16	16
5.33%	31	31	31	31	31	31	31
8.00%	47	47	47	47	47	47	47

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

(단위:백만원)

39

공시일	2018-10-30
기준일	2018-10-29

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

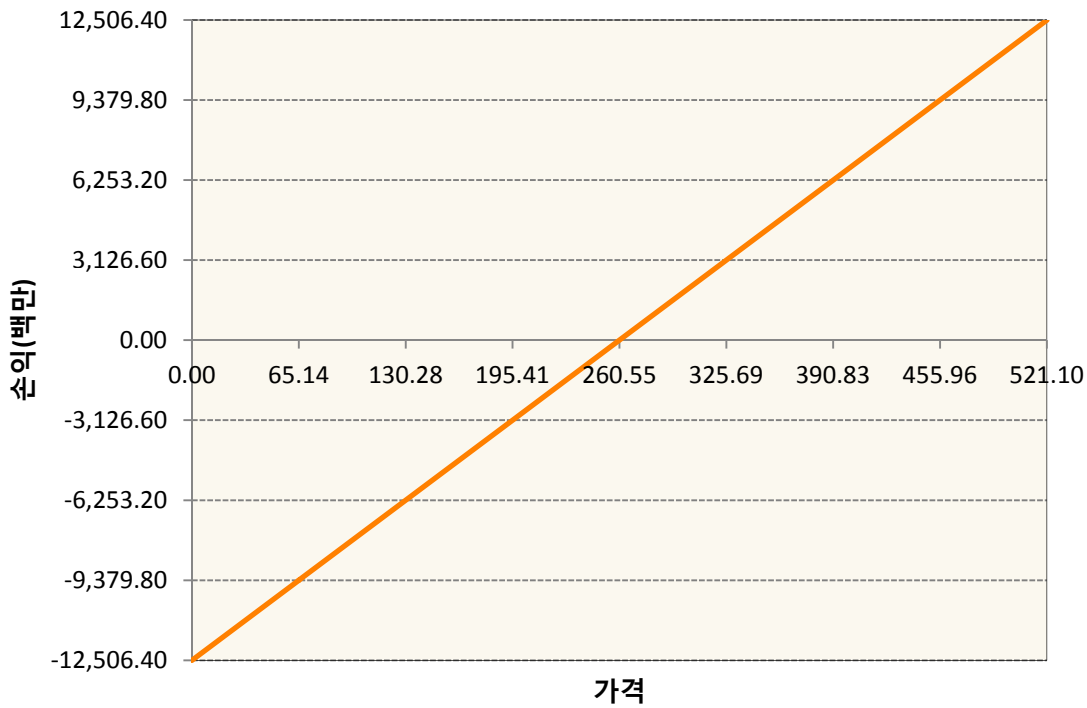
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

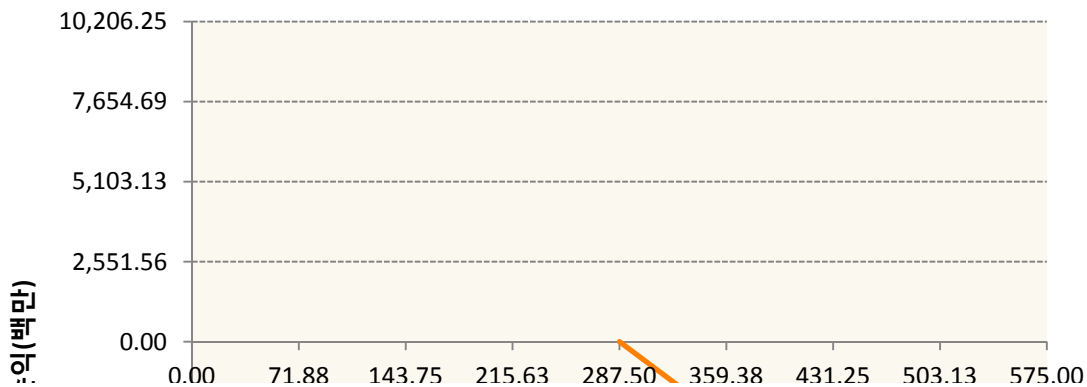
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,506	0	12,506	장내
누계	유가증권	옵션	4,059	23,401	-19,343	장내

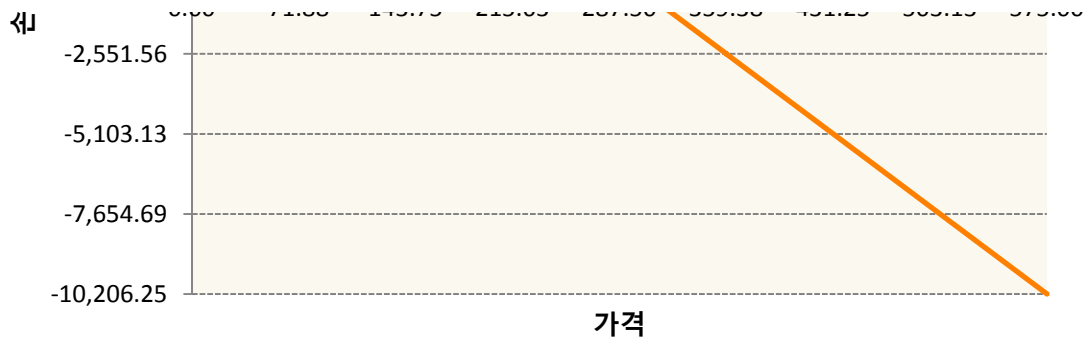
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

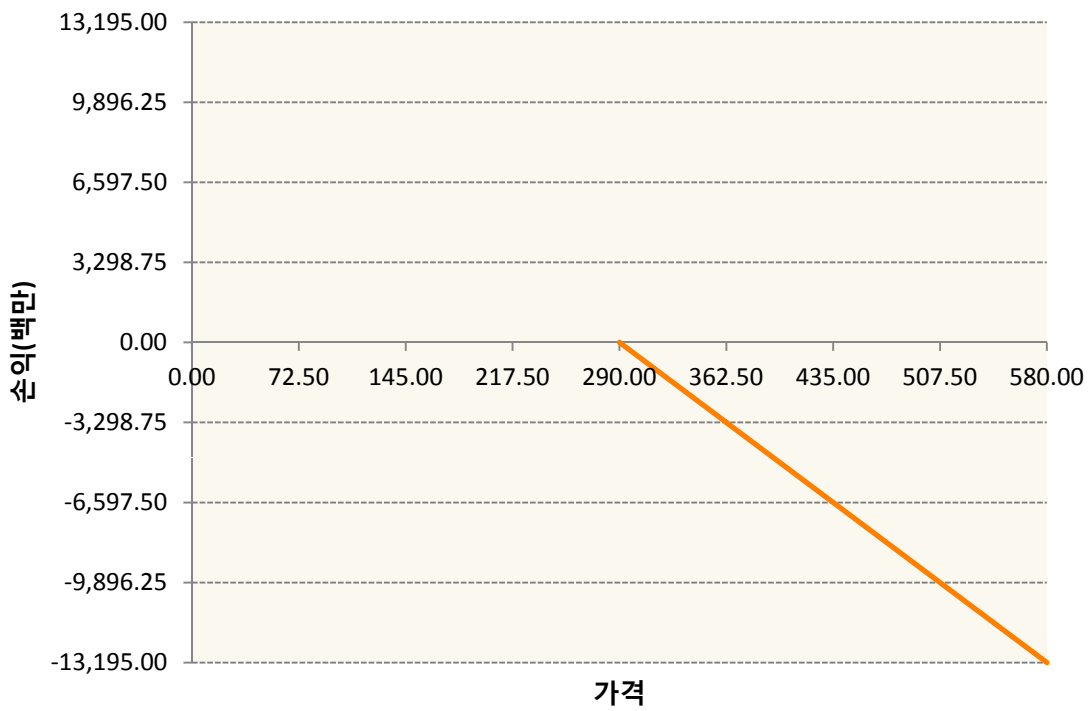


KR4201NB2877-2018-11 콜287.5

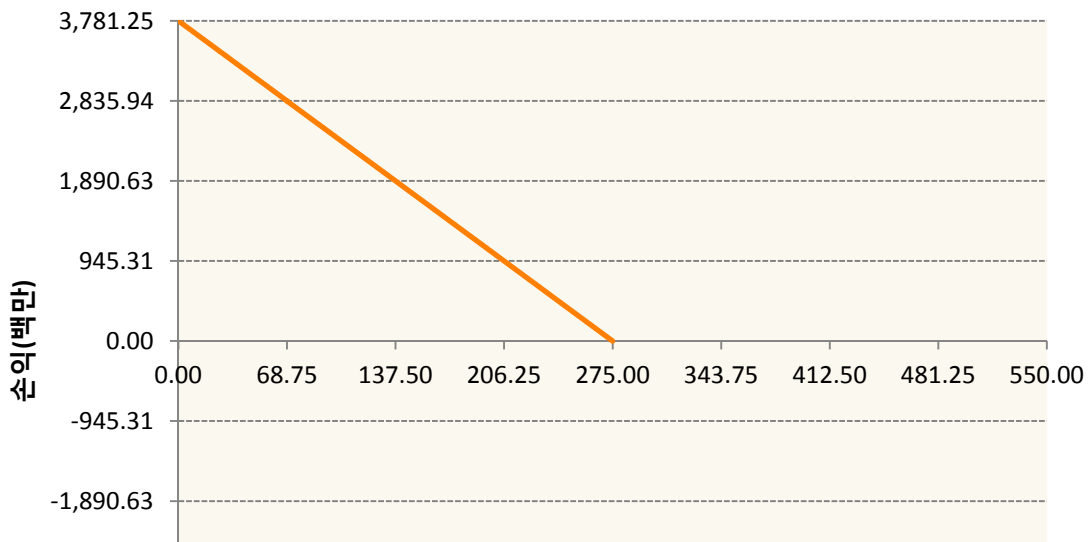


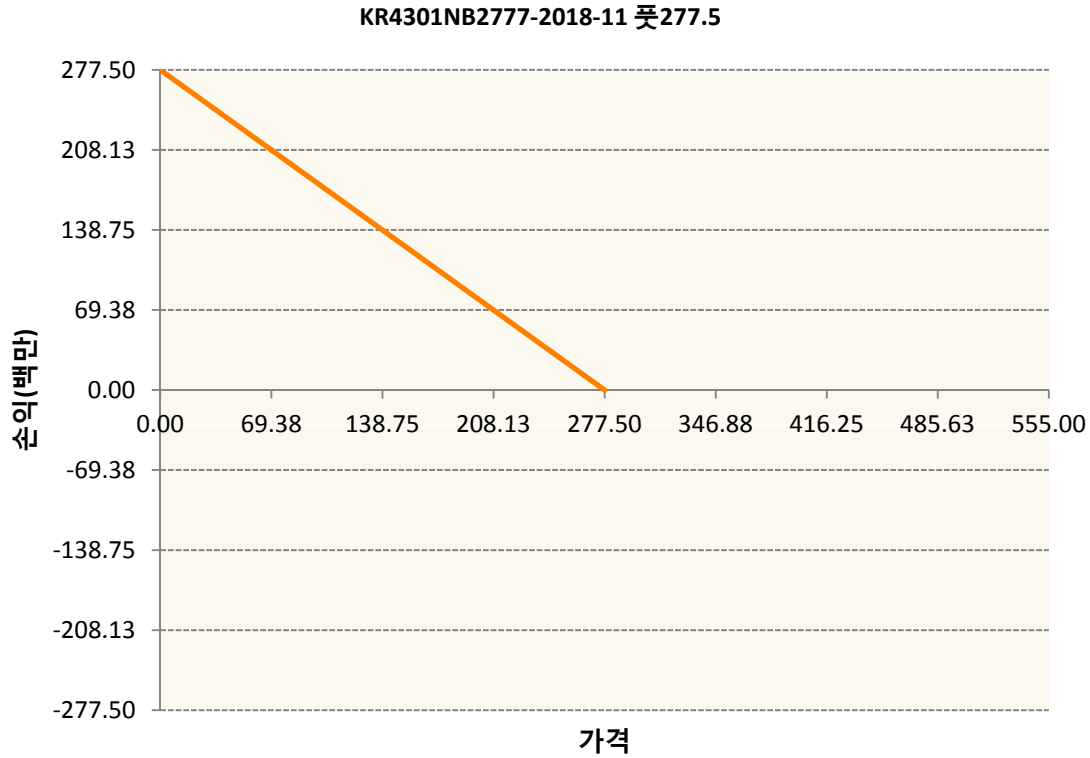
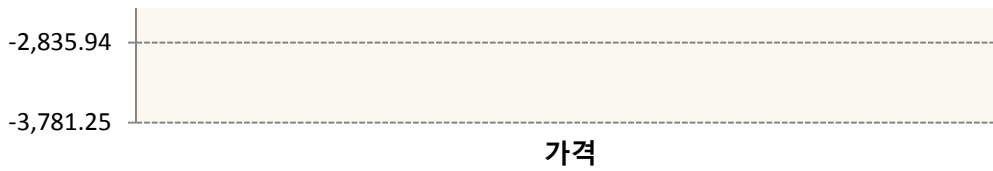


**KR4201NB2901-2018-11 콜290**



**KR4301NB2751-2018-11 풋275**





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

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 999

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-999	-999	-999	-999	-999	-999	-999
-5.33%	-666	-666	-666	-666	-666	-666	-666
-2.67%	-333	-333	-333	-333	-333	-333	-333
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	333	333	333	333	333	333	333
5.33%	666	666	666	666	666	666	666
8.00%	999	999	999	999	999	999	999

KR4201NB282018-11 콜287.5 138

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3	3	3	3	3	3	3
-5.33%	3	3	3	3	3	3	2
-2.67%	3	3	3	2	2	1	0

0%	3	2	1	0	-2	-5	-8
2.67%	0	-2	-5	-9	-14	-20	-27
5.33%	-12	-19	-27	-36	-45	-56	-67
8.00%	-53	-66	-80	-94	-108	-123	-138

KR4201NB27 2018-11 콜290

142

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2	2	2	2	2	2	2
-5.33%	2	2	2	2	2	2	2
-2.67%	2	2	2	2	1	1	-1
0%	2	2	1	0	-2	-4	-8
2.67%	1	-1	-4	-8	-13	-19	-26
5.33%	-9	-15	-23	-32	-43	-54	-67
8.00%	-45	-59	-75	-91	-108	-125	-142

KR4301NB27 2018-11 풋275

281

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	281	281	281	281	281	281	281
-5.33%	186	186	186	186	186	186	187
-2.67%	91	91	91	91	92	93	94
0%	-4	-3	-2	0	2	4	6
2.67%	-91	-88	-85	-82	-78	-74	-70
5.33%	-158	-154	-149	-144	-139	-134	-129
8.00%	-194	-190	-186	-182	-178	-174	-169

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

21

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	21	21	21	21	21	21	21
-5.33%	14	14	14	14	14	14	14
-2.67%	7	7	7	7	7	7	7
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-7	-7	-6	-6	-6	-6	-6
5.33%	-12	-12	-12	-11	-11	-11	-10
8.00%	-16	-15	-15	-15	-14	-14	-14

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

(단위:백만원)

1,193

공시일	2018-10-30
기준일	2018-10-29

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

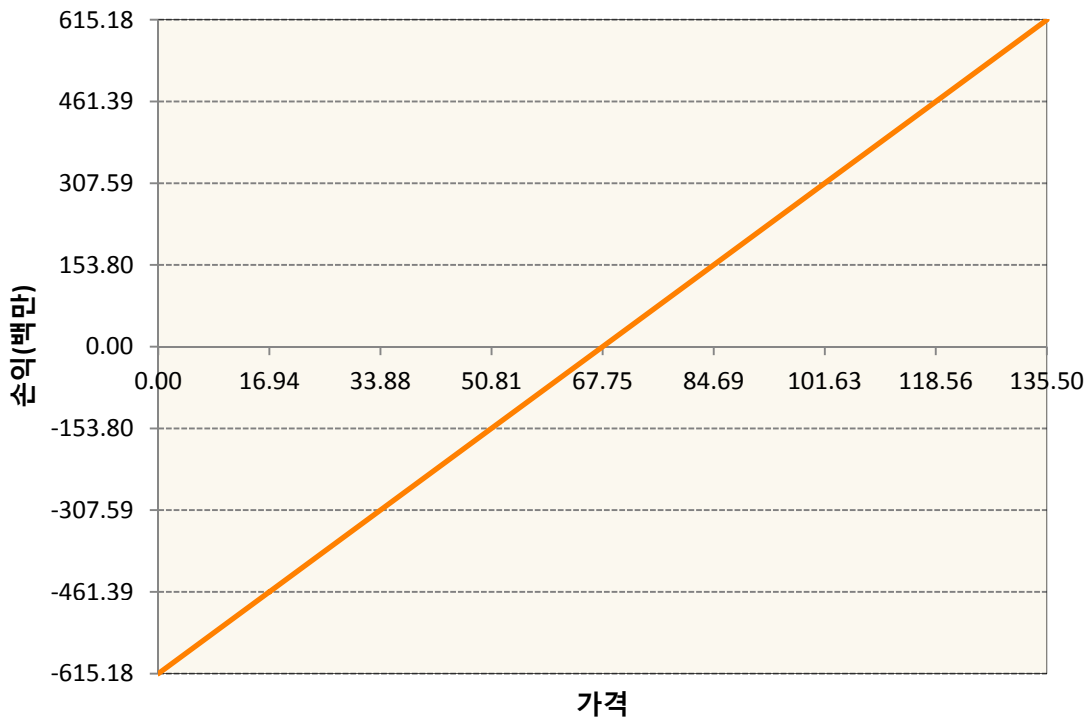
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

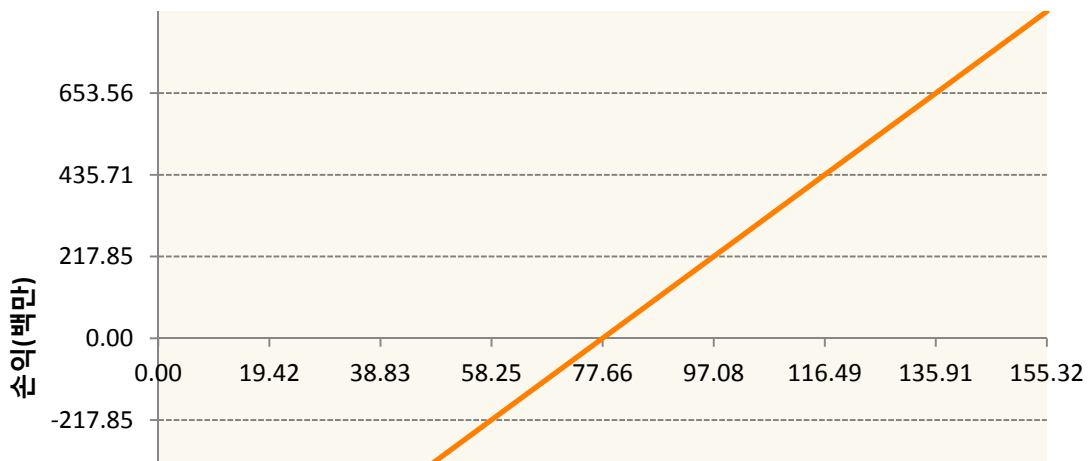
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,366	411	2,956	

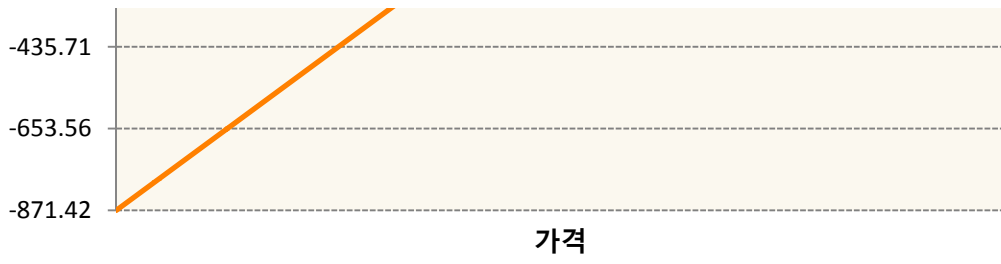
### 2. 만기시점의 손익구조

CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19

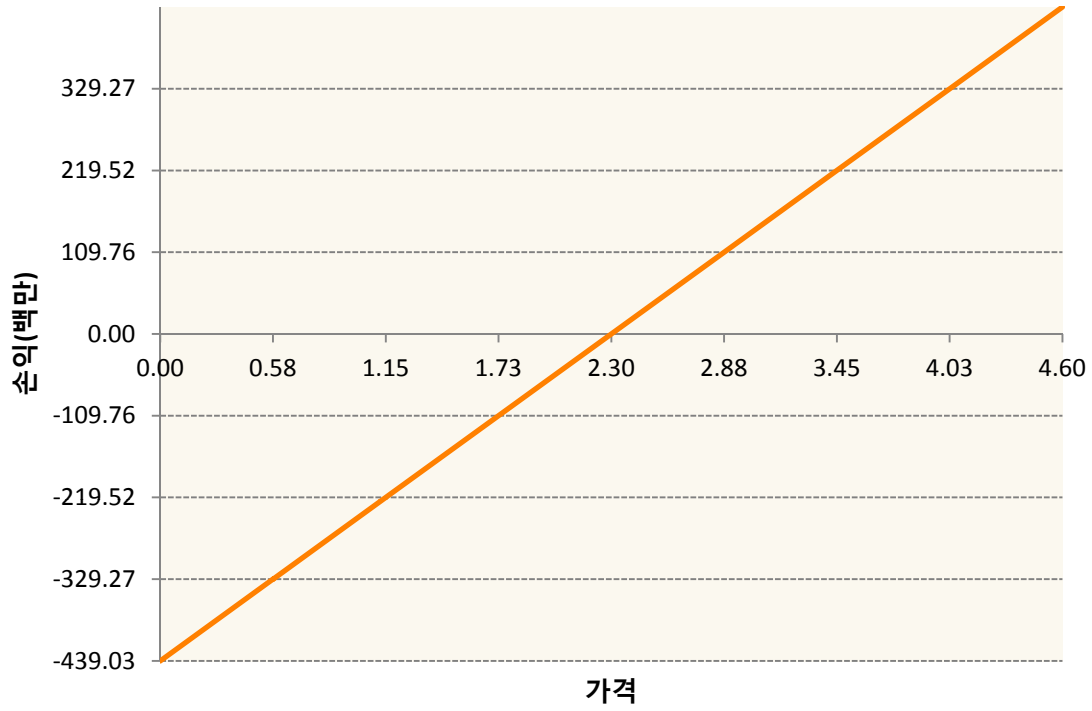


COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19

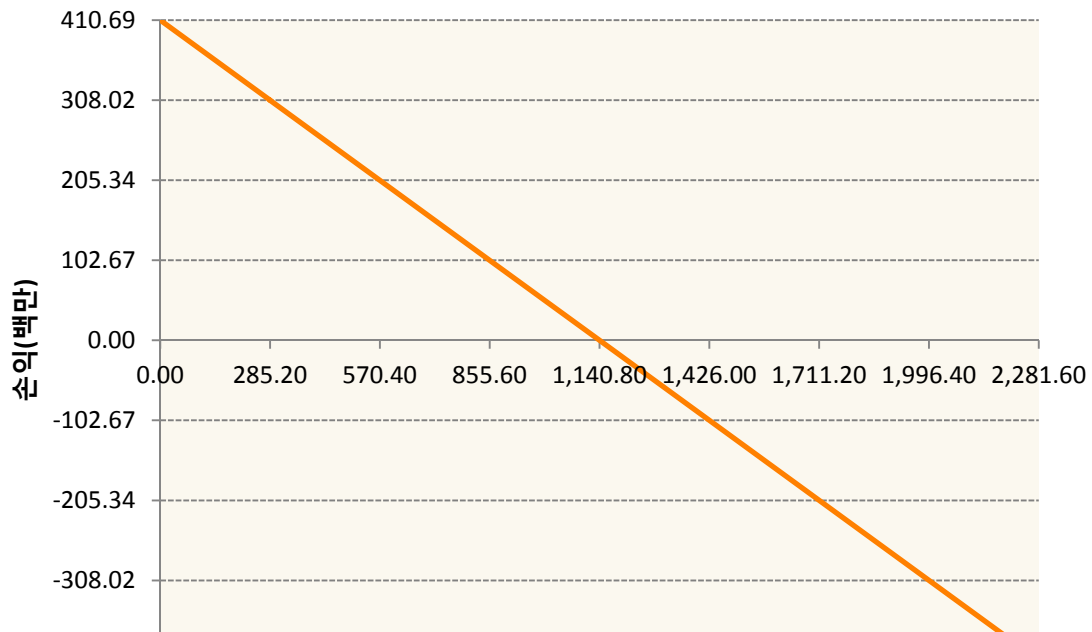


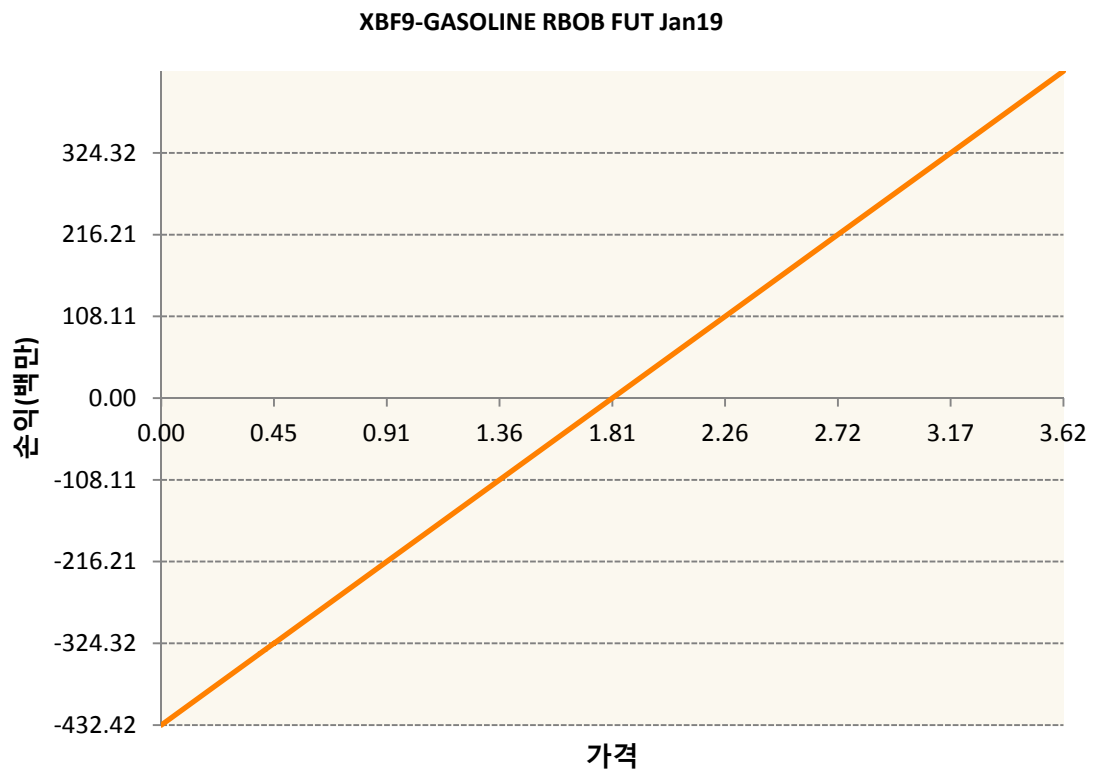
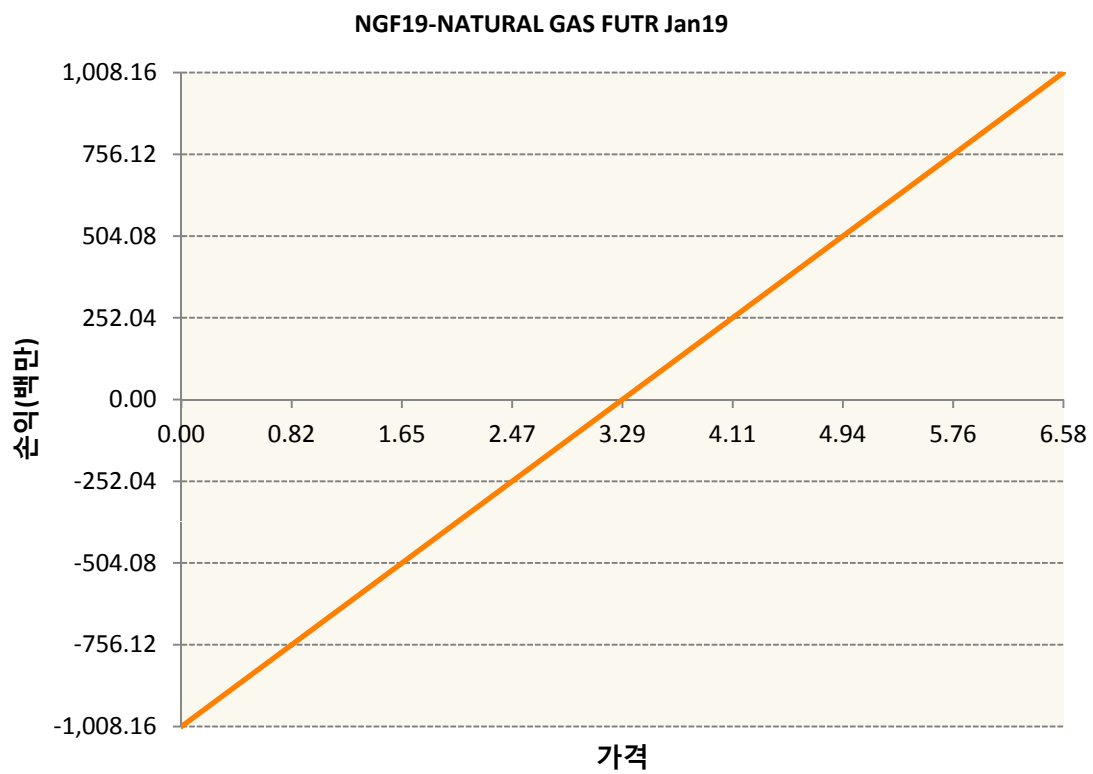
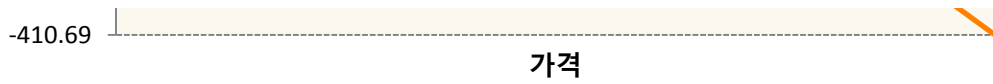


HOF9-NY Harb ULSD Fut Jan19



KR4175NB0006-2018-11 달러선물





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

CLF9	WTI CRUDE FUTURE Jan19	49
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	70
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	2018-10-30
기준일	2018-10-29

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

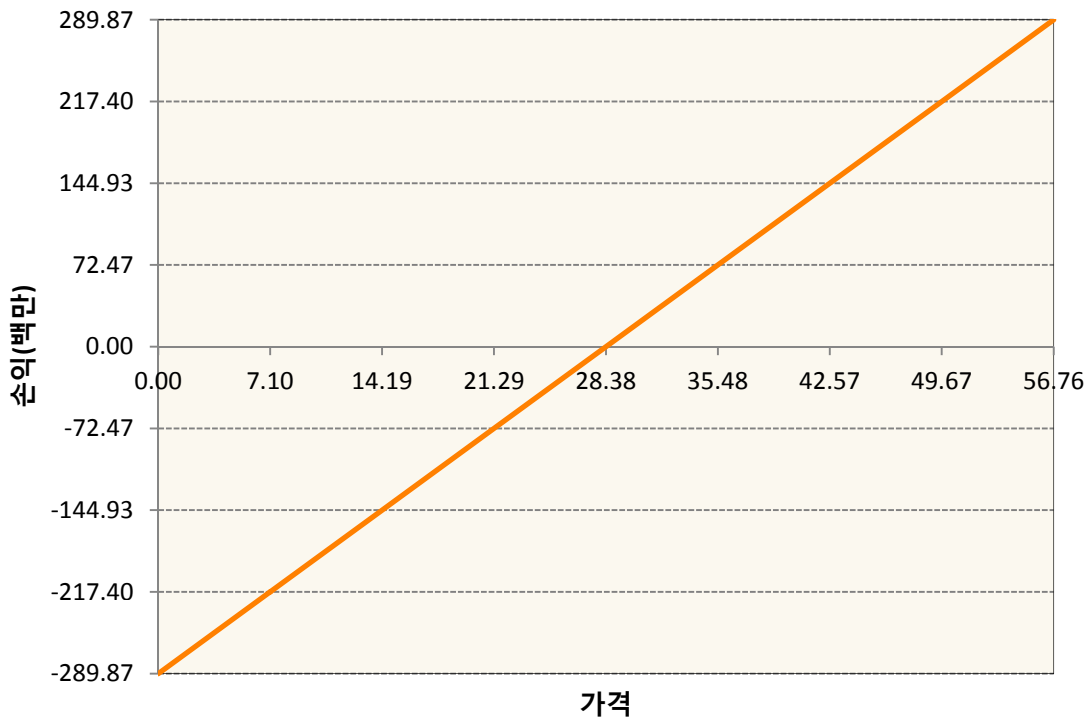
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

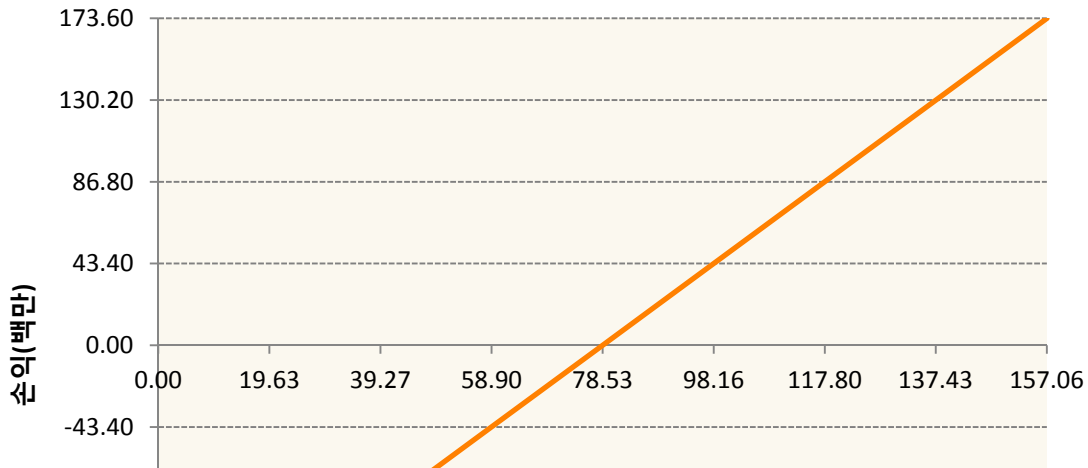
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,598	80	3,519	

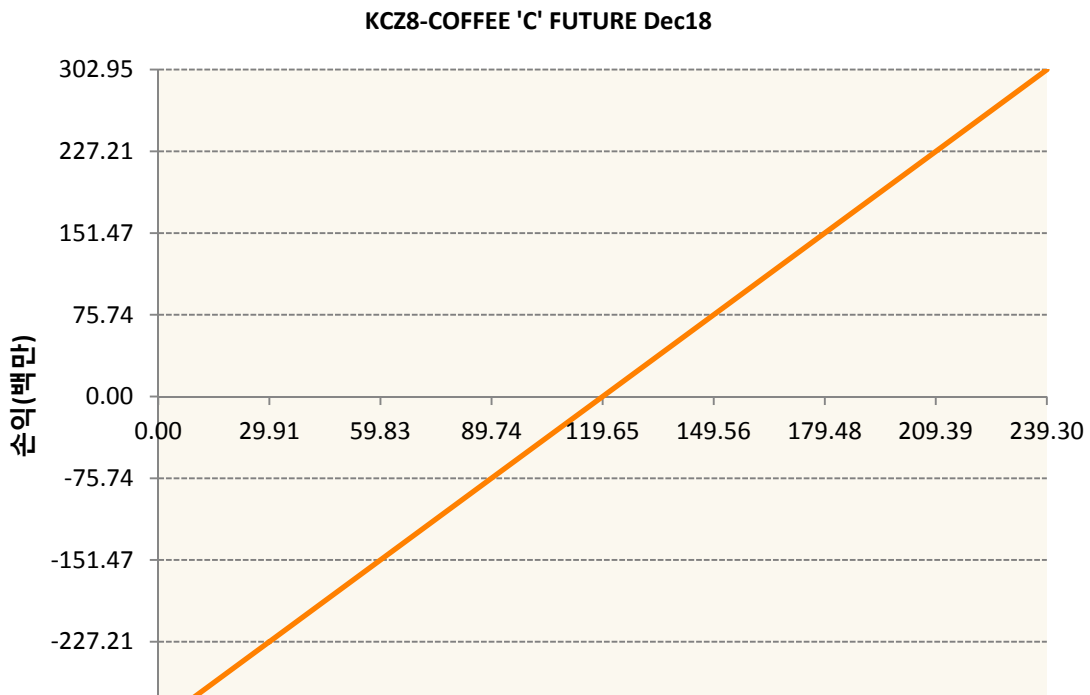
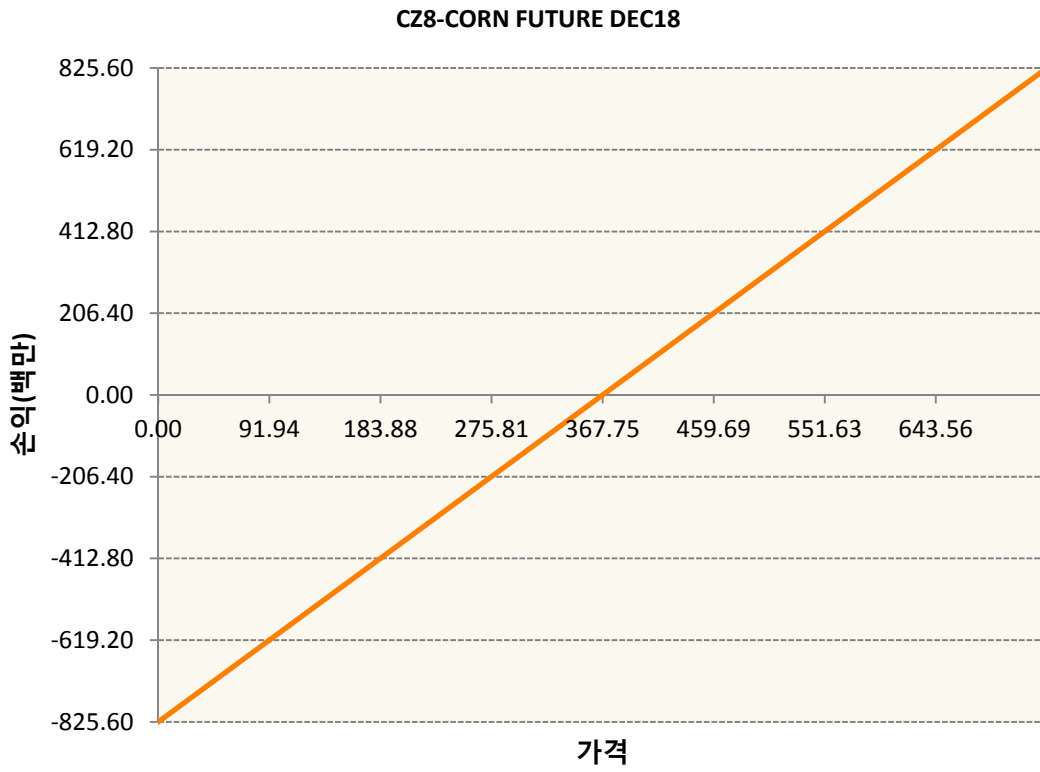
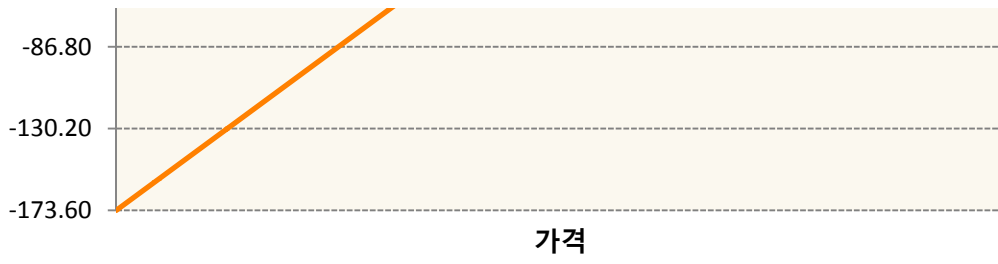
### 2. 만기시점의 손익구조

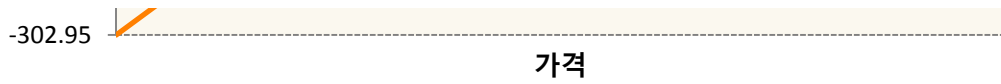
**BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19**



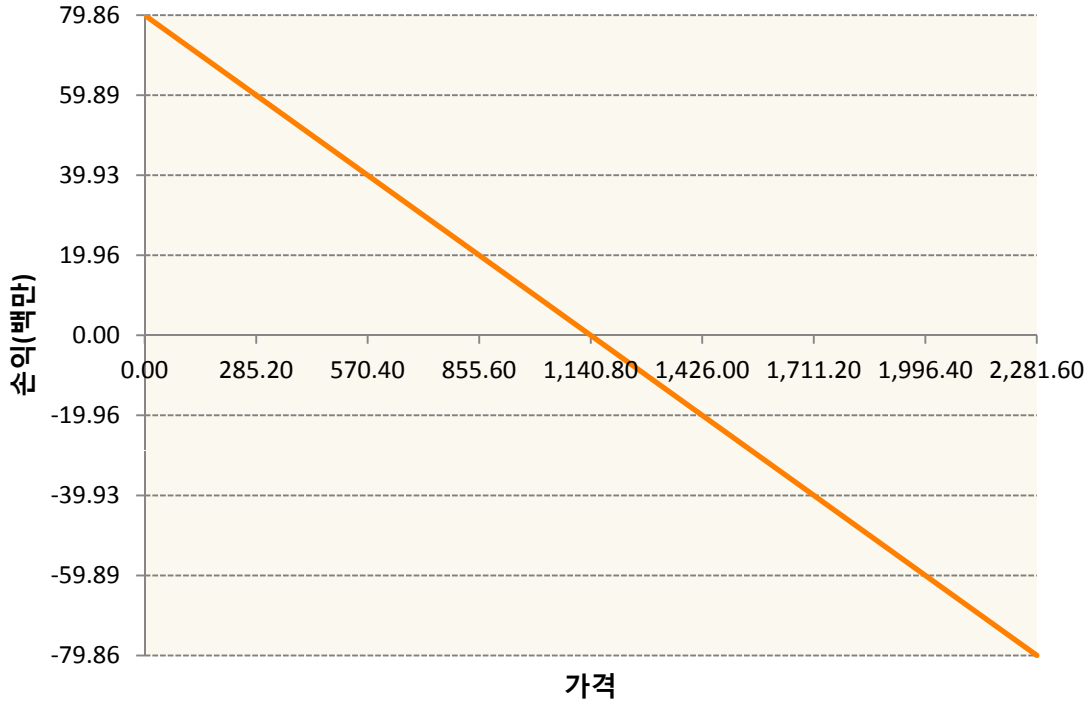
**CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18**



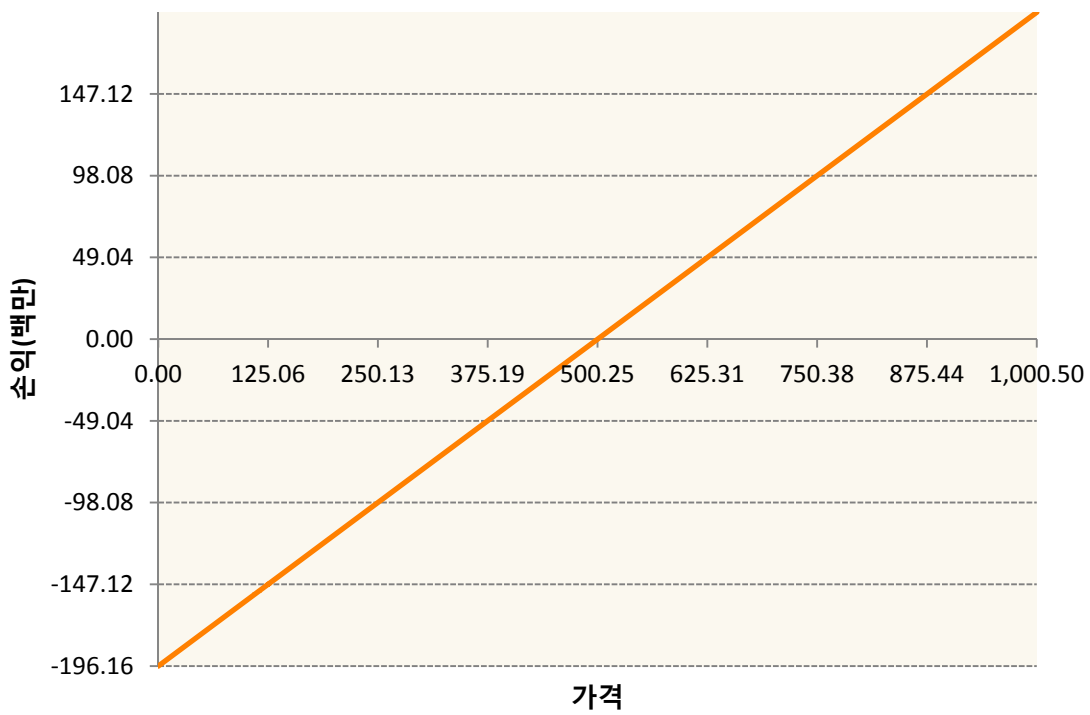




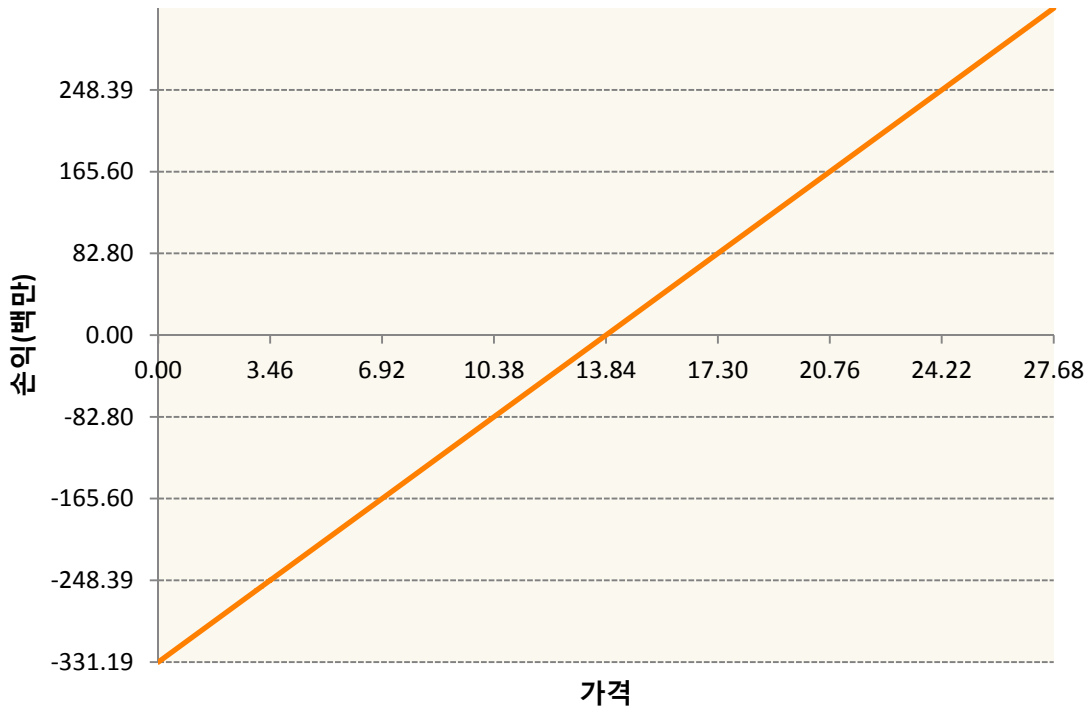
KR4175NB0006-2018-11 달러선물



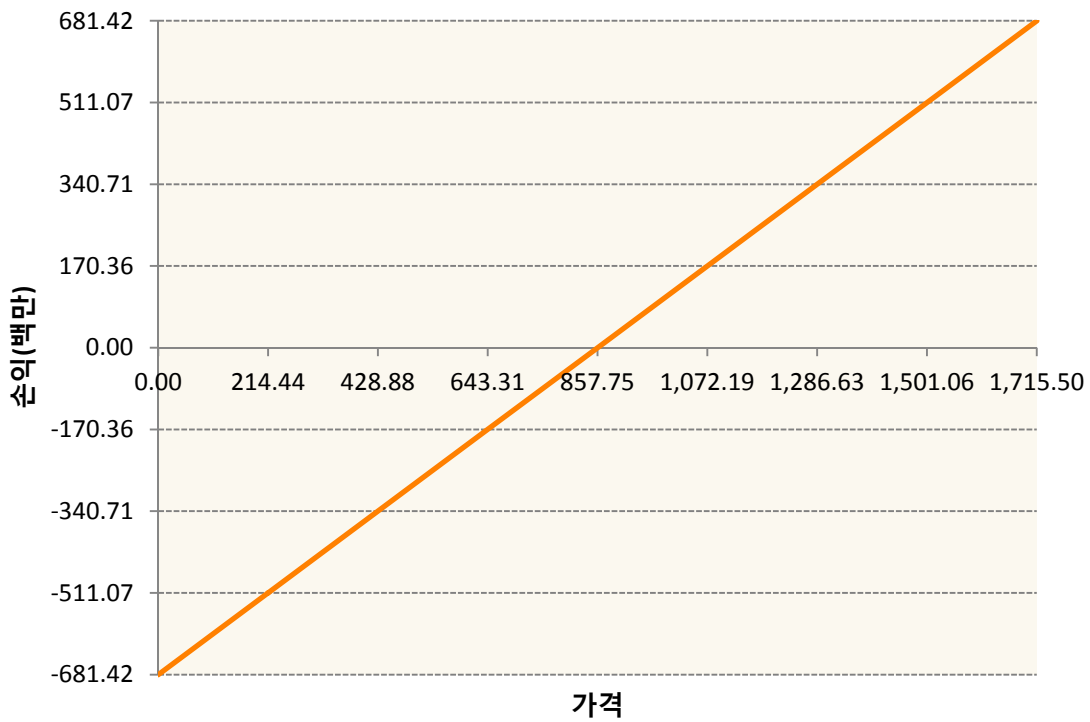
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

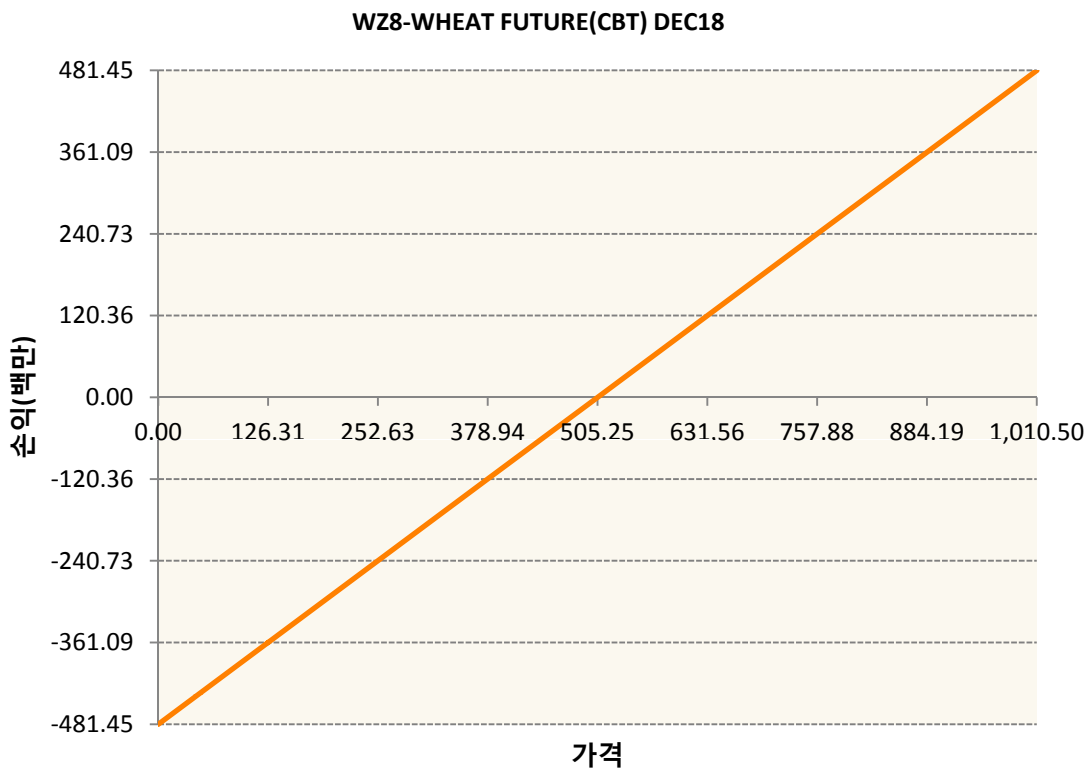
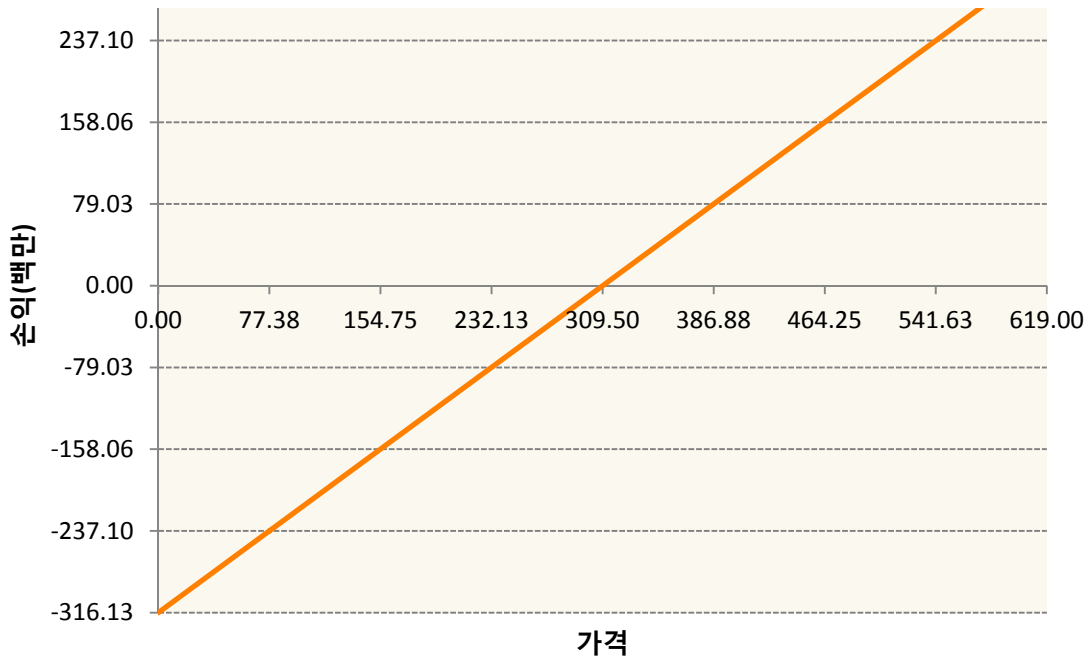


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19



SMF9-SOYBEAN MEAL FUTR Jan19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOF9	SOYBEAN OIL FUTR Jan19	23
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	25
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	39

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

(단위:백만원)

**314**