

공시일	2018-10-31
기준일	2018-10-30

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	2018-10-31
기준일	2018-10-30

스마트인덱스모

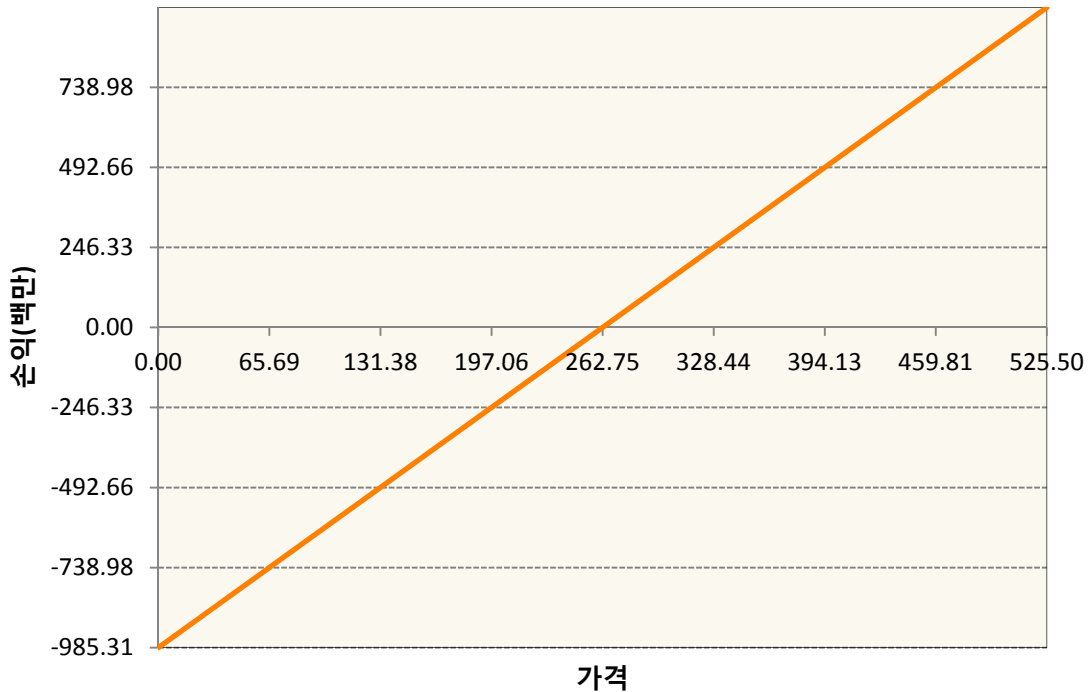
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	985	0	985	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%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
-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%	52	52	52	52	52	52	52
8.00%	79	79	79	79	79	79	79

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

(단위:백만원)

65

공시일	2018-10-31
기준일	2018-10-30

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

1,049

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

490

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-31
기준일	2018-10-30

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

254

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

356

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-31
기준일	2018-10-30

유로인덱스모(주식-파생형)

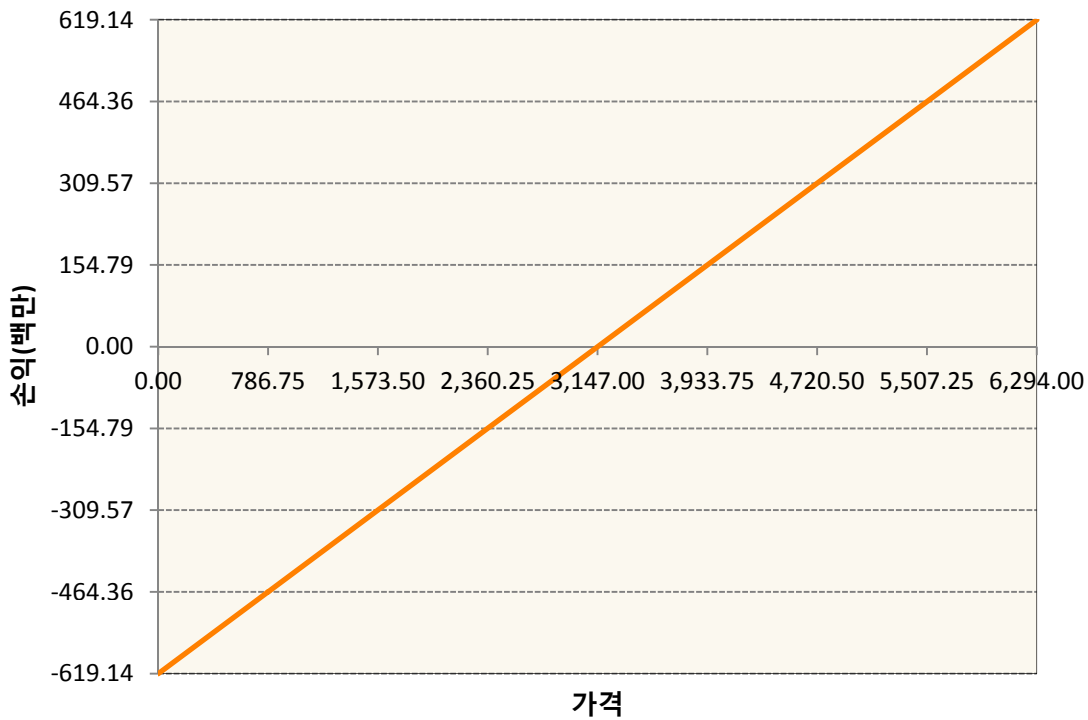
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	619	0	619	

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	2018-10-31
기준일	2018-10-30

차이나인덱스모(주식-파생형)

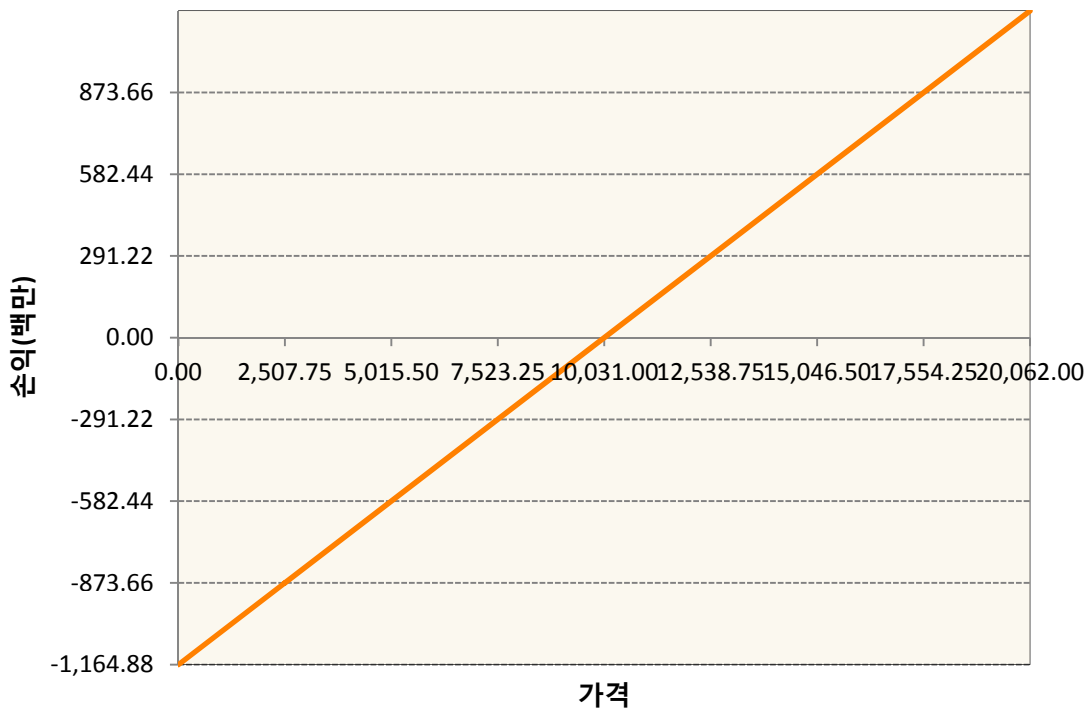
1. 계약금액

(단위:백만원)

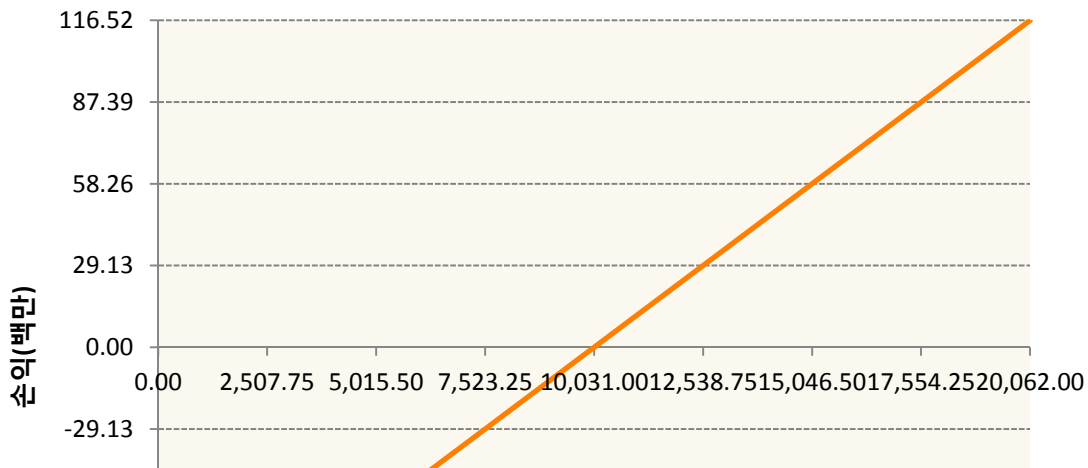
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,281	0	1,281	장내

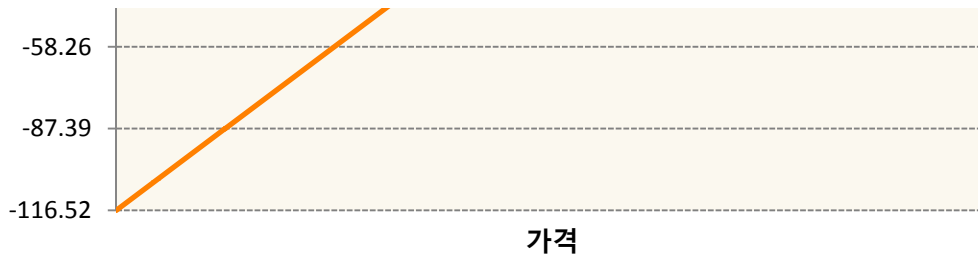
2. 만기시점의 손익구조

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)

99

공시일	2018-10-31
기준일	2018-10-30

커버드콜모(주식혼합-파생형)

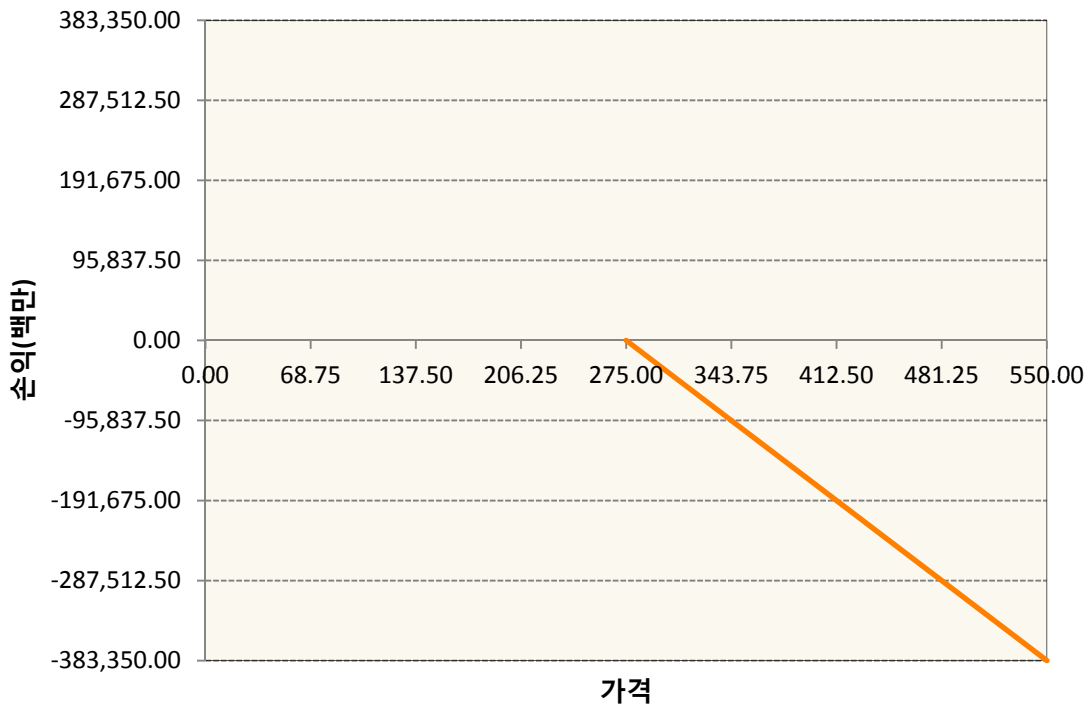
1. 계약금액

(단위:백만원)

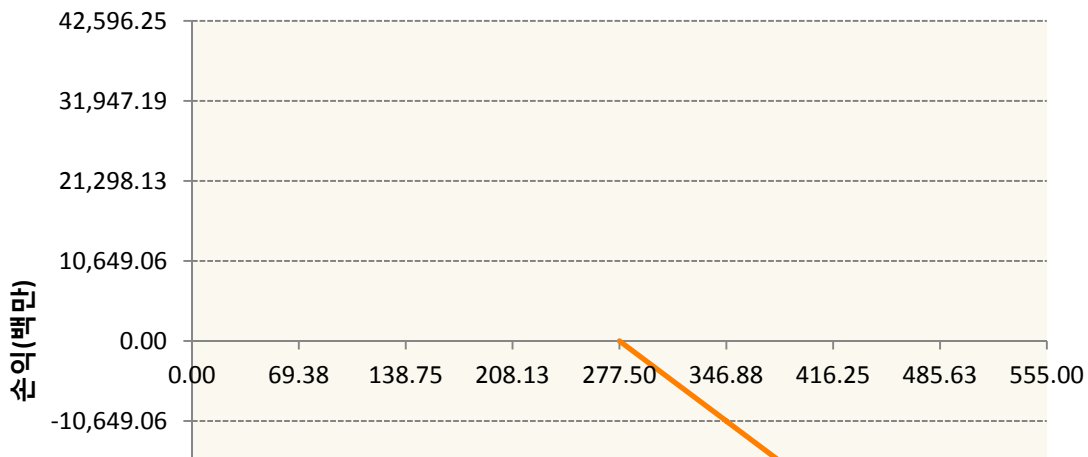
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	721,571	-721,571	장내

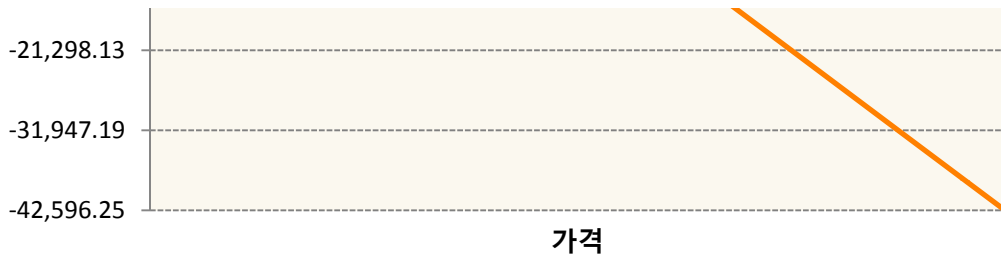
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

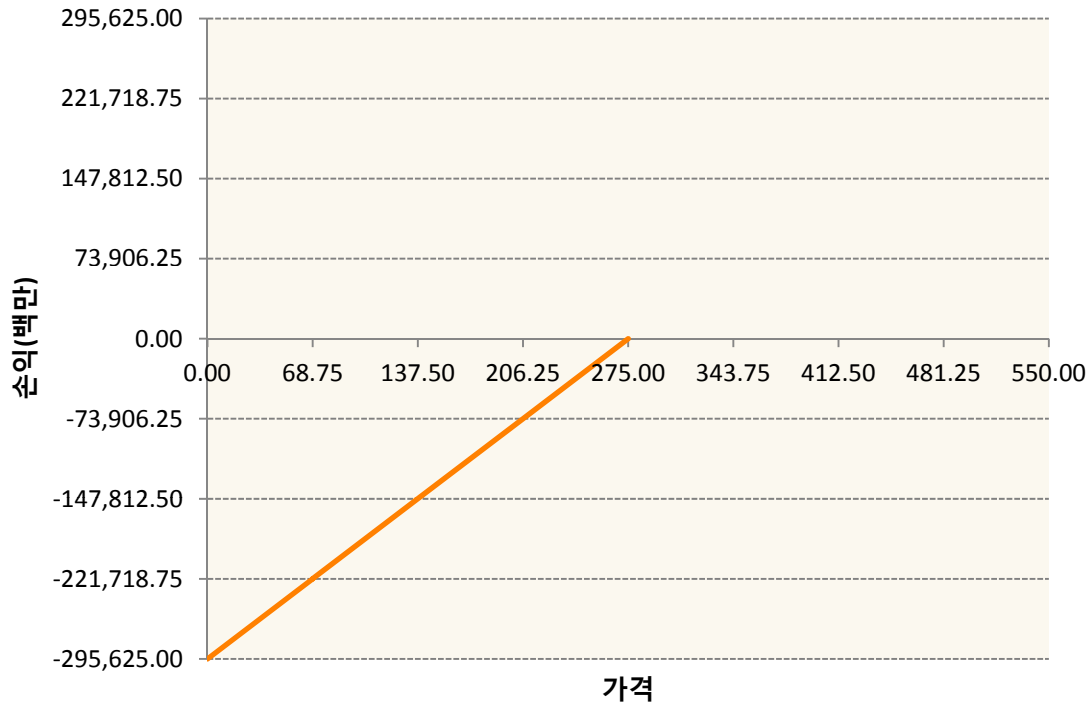


KR4201NB2778-2018-11 콜277.5





KR4301NB2751-2018-11 풋275



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NB27 2018-11 콜275

14,511

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,277	1,276	1,274	1,269	1,258	1,239	1,210
-5.33%	1,273	1,264	1,245	1,212	1,162	1,092	999
-2.67%	1,217	1,154	1,061	937	780	593	377
0%	811	579	307	0	-336	-697	-1,079
2.67%	-836	-1,313	-1,804	-2,307	-2,819	-3,338	-3,863
5.33%	-4,926	-5,490	-6,056	-6,623	-7,190	-7,758	-8,326
8.00%	-11,785	-12,186	-12,615	-13,066	-13,534	-14,016	-14,511

KR4201NB27 2018-11 콜277.5

1,389

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	94	94	94	94	93	92	89

-5.33%	94	93	92	90	87	81	74
-2.67%	91	87	81	71	59	43	24
0%	66	49	26	0	-30	-63	-99
2.67%	-53	-97	-144	-193	-244	-296	-350
5.33%	-397	-459	-522	-585	-648	-711	-774
8.00%	-1,048	-1,101	-1,157	-1,213	-1,271	-1,329	-1,389

KR4301NB27 2018-11 풋275

22,132

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,126	-22,126	-22,126	-22,126	-22,127	-22,129	-22,132
-5.33%	-14,606	-14,607	-14,608	-14,612	-14,619	-14,631	-14,650
-2.67%	-7,092	-7,102	-7,121	-7,151	-7,195	-7,254	-7,327
0%	317	235	129	0	-149	-317	-501
2.67%	6,985	6,724	6,449	6,165	5,873	5,574	5,269
5.33%	11,524	11,184	10,842	10,500	10,157	9,814	9,471
8.00%	13,433	13,239	13,023	12,788	12,539	12,277	12,005

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

(단위:백만원)

36,421

공시일	2018-10-31
기준일	2018-10-30

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

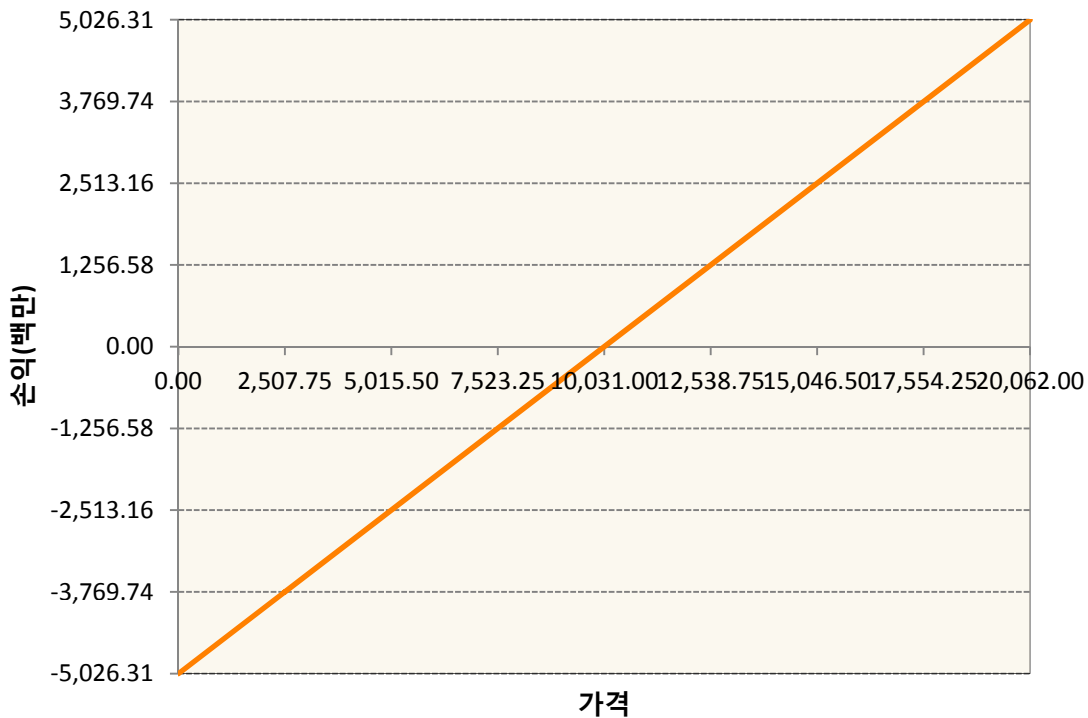
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1	0	1	장내
누계	유가증권	선물	5,026	0	5,026	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCX8-HSCEI FUTURES NOV 18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCX8	HSCEI FUTURES NOV 18	402
------	----------------------	-----

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

(단위:백만원)

389

공시일	2018-10-31
기준일	2018-10-30

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

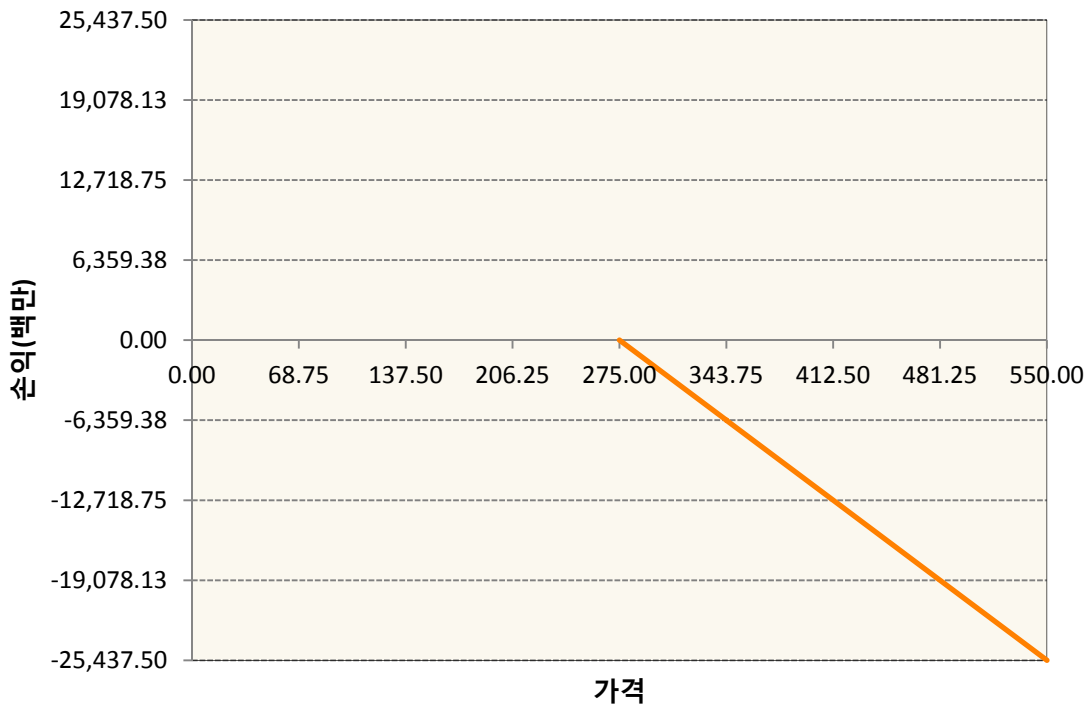
1. 계약금액

(단위:백만원)

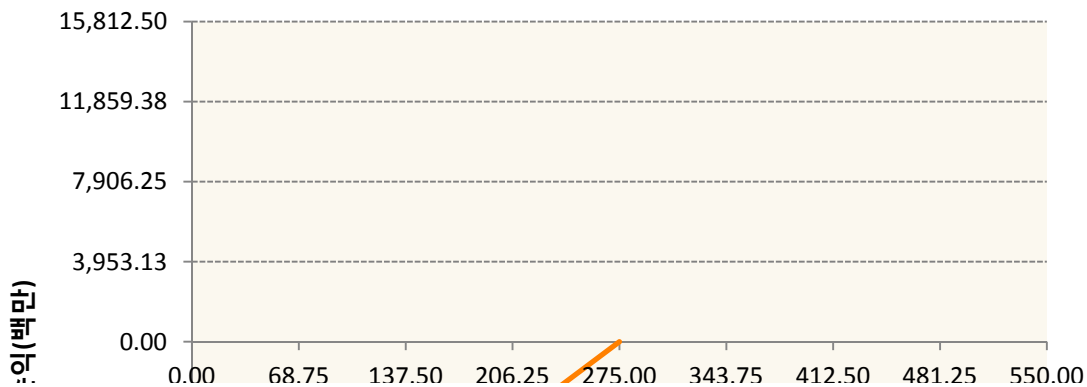
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	44,025	-44,025	장내

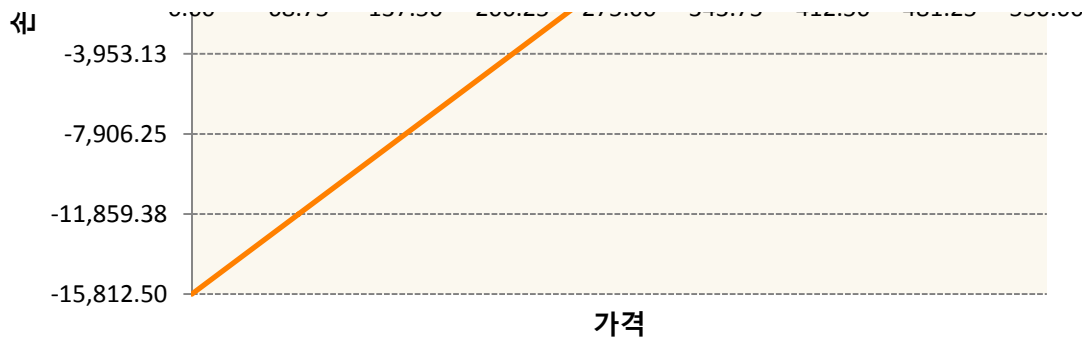
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

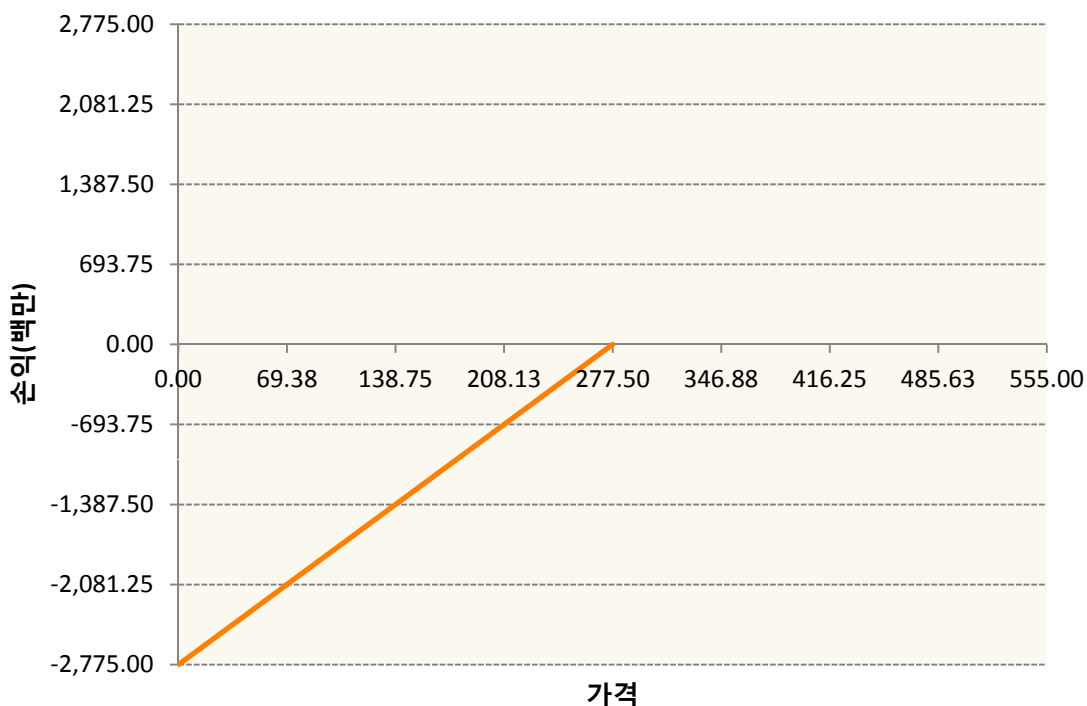


KR4301NB2751-2018-11 풋275





KR4301NB2777-2018-11 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_14							4,033	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-4,033	-4,033	-4,033	-4,033	-4,033	-4,033	-4,033	
-5.33%	-2,689	-2,689	-2,689	-2,689	-2,689	-2,689	-2,689	
-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%	2,689	2,689	2,689	2,689	2,689	2,689	2,689	
8.00%	4,033	4,033	4,033	4,033	4,033	4,033	4,033	
KR4201NB27 2018-11 콜275							963	
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	85	85	85	84	83	82	80
-5.33%	84	84	83	80	77	72	66
-2.67%	81	77	70	62	52	39	25
0%	54	38	20	0	-22	-46	-72
2.67%	-55	-87	-120	-153	-187	-222	-256
5.33%	-327	-364	-402	-439	-477	-515	-552
8.00%	-782	-809	-837	-867	-898	-930	-963

KR4301NB27 2018-11 풋275

1,184

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,183	-1,183	-1,183	-1,184	-1,184	-1,184	-1,184
-5.33%	-781	-781	-781	-782	-782	-783	-784
-2.67%	-379	-380	-381	-383	-385	-388	-392
0%	17	13	7	0	-8	-17	-27
2.67%	374	360	345	330	314	298	282
5.33%	616	598	580	562	543	525	507
8.00%	719	708	697	684	671	657	642

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

208

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-208	-208	-208	-208	-208	-208	-208
-5.33%	-138	-138	-138	-138	-138	-138	-138
-2.67%	-68	-68	-68	-68	-68	-69	-69
0%	2	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	67	66	64	61	59	57	54
5.33%	118	115	112	108	105	102	99
8.00%	144	141	139	136	133	131	128

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

(단위:백만원)

6,298

공시일	2018-10-31
기준일	2018-10-30

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

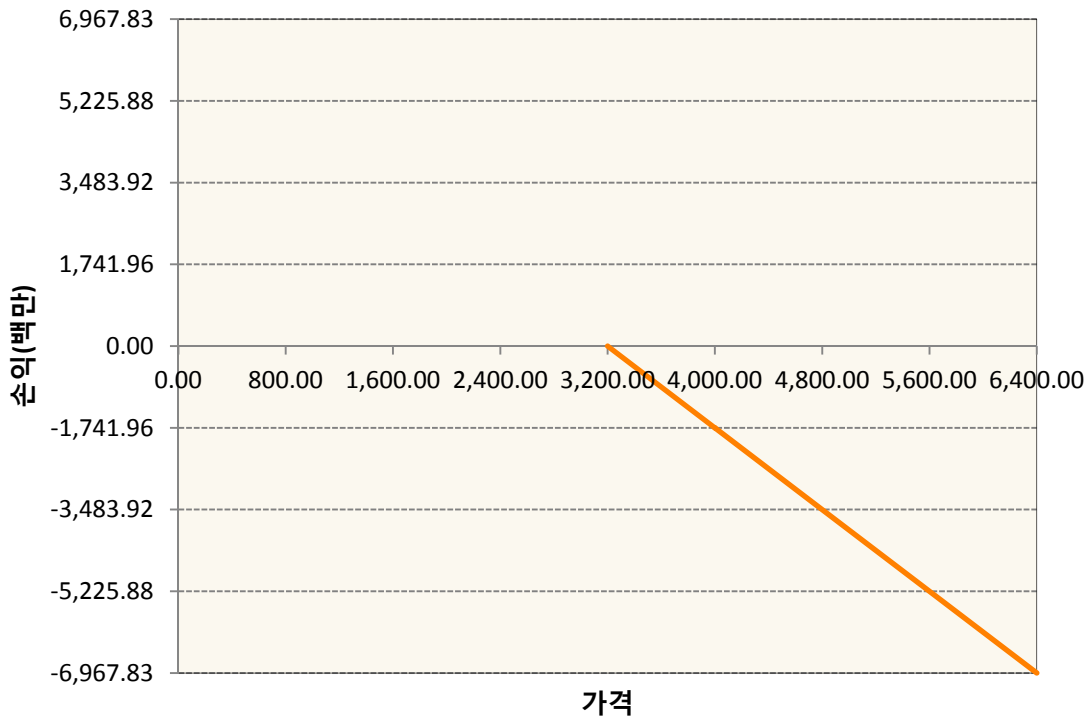
1. 계약금액

(단위:백만원)

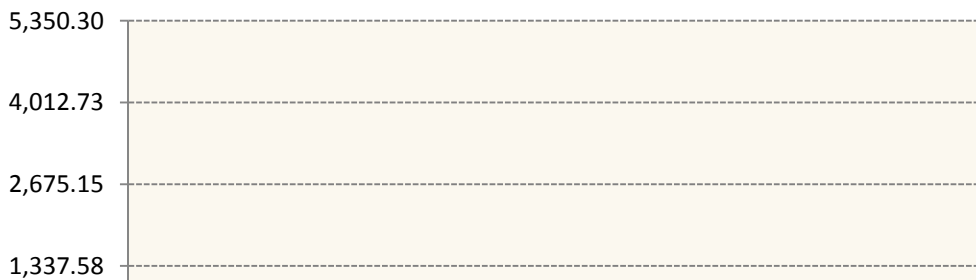
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,782	0	5,782	
누계	유가증권	스왑	72,389	0	72,389	장외
누계	유가증권	옵션	0	24,636	-24,636	장내

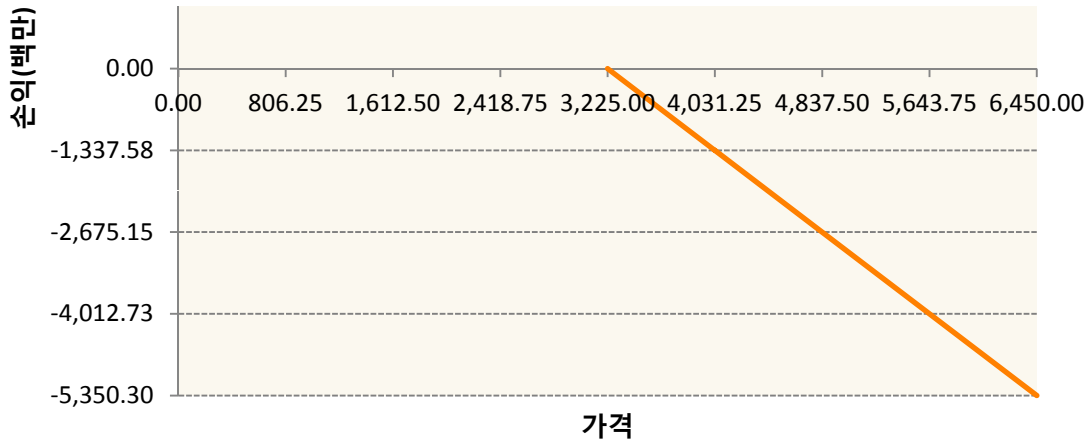
2. 만기시점의 손익구조

OESXX8-C3200-EURO STOXX 50

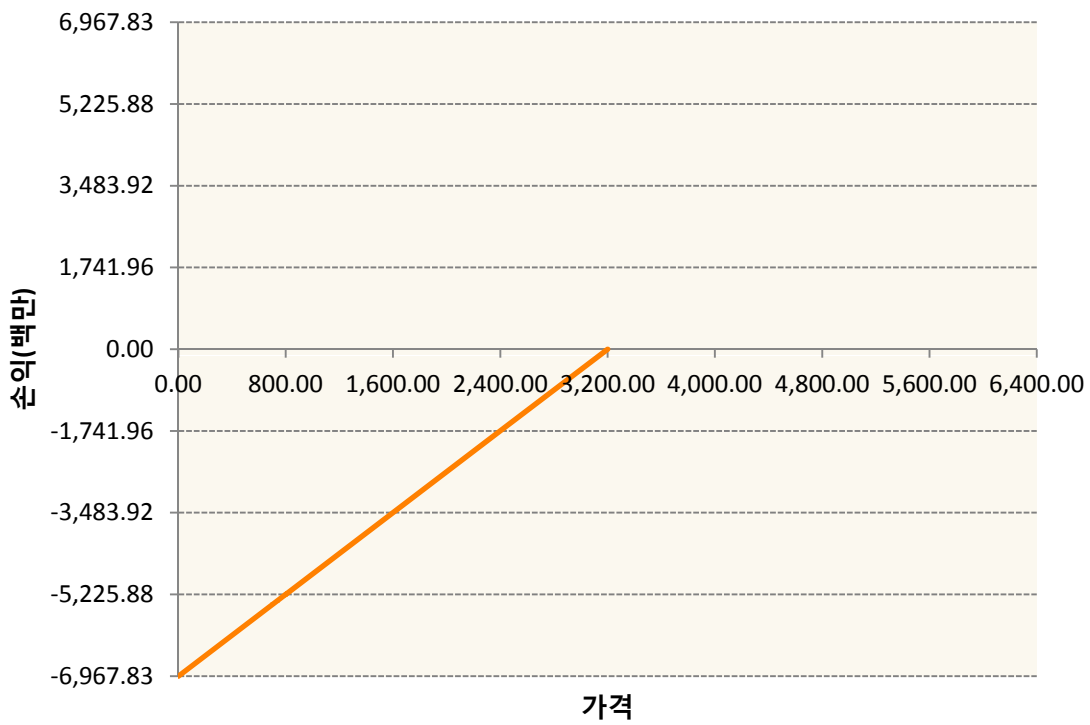


OESXX8-C3225-EURO STOXX 50

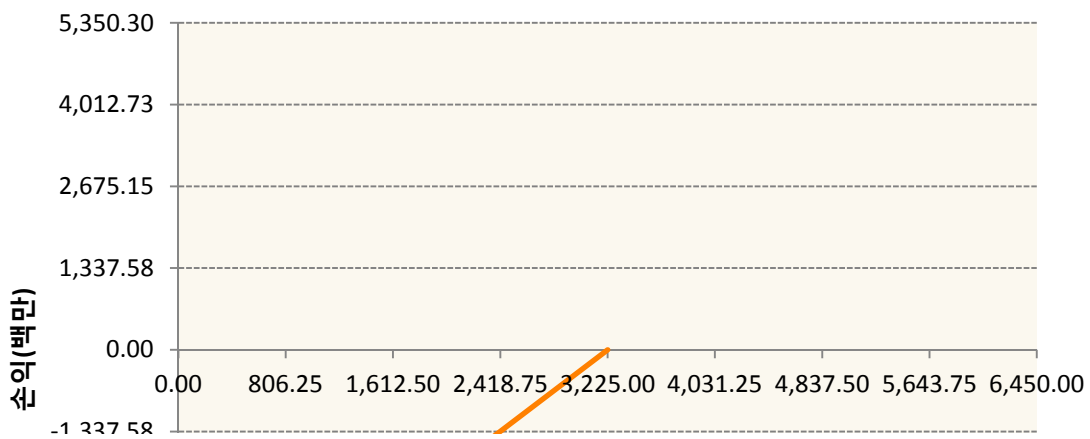


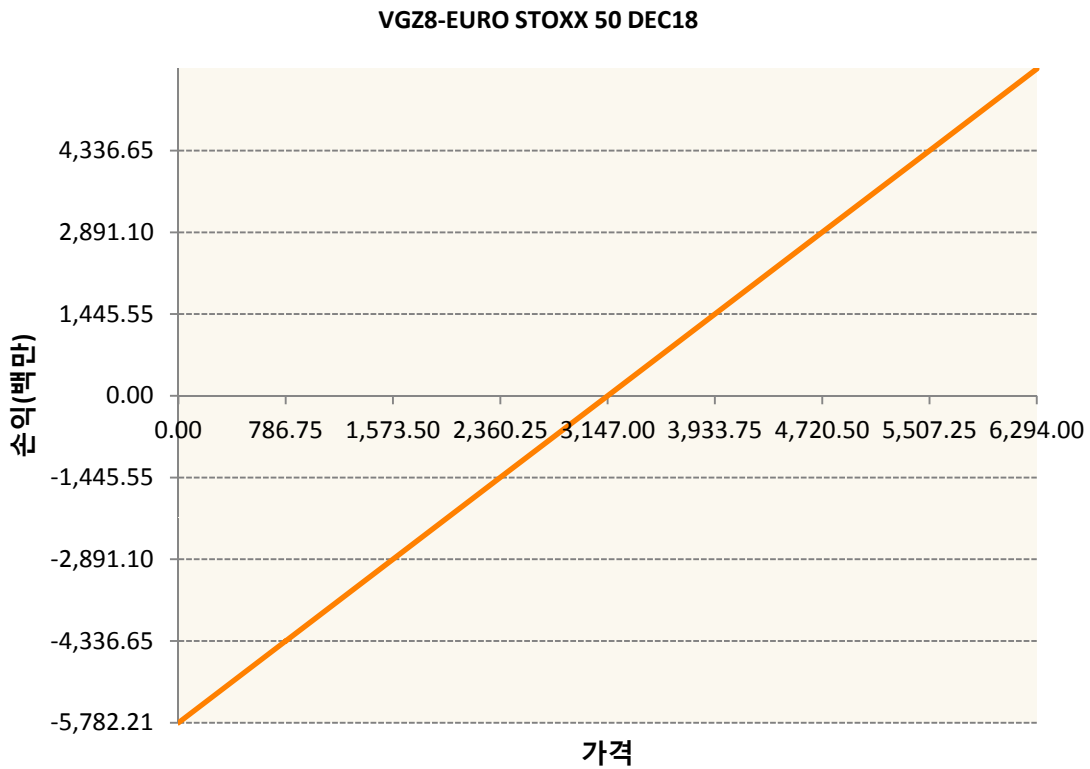
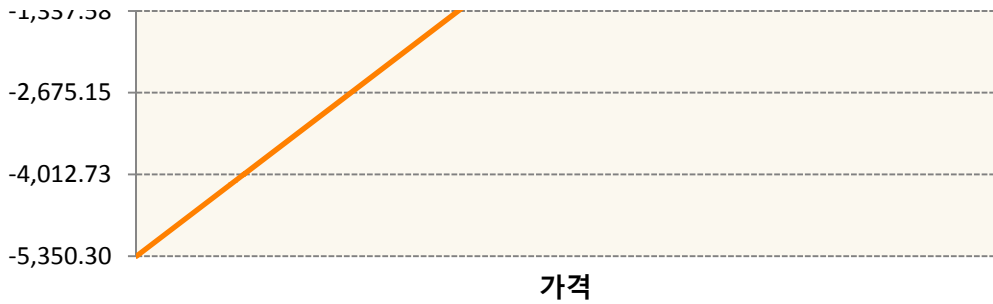


OESXX8-P3200-EURO STOXX 50



OESXX8-P3225-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY		87
OESXX8-C32 EURO STOXX 50		557
OESXX8-C32 EURO STOXX 50		428
OESXX8-P32 EURO STOXX 50		557
OESXX8-P32 EURO STOXX 50		428
VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18		463

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,633

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

(단위:백만원)

1,087

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

(단위:백만원)

87

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

(단위:백만원)

130

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

(단위:백만원)

148

공시일	2018-10-31
기준일	2018-10-30

스마트KRX300인덱스목표전환형1

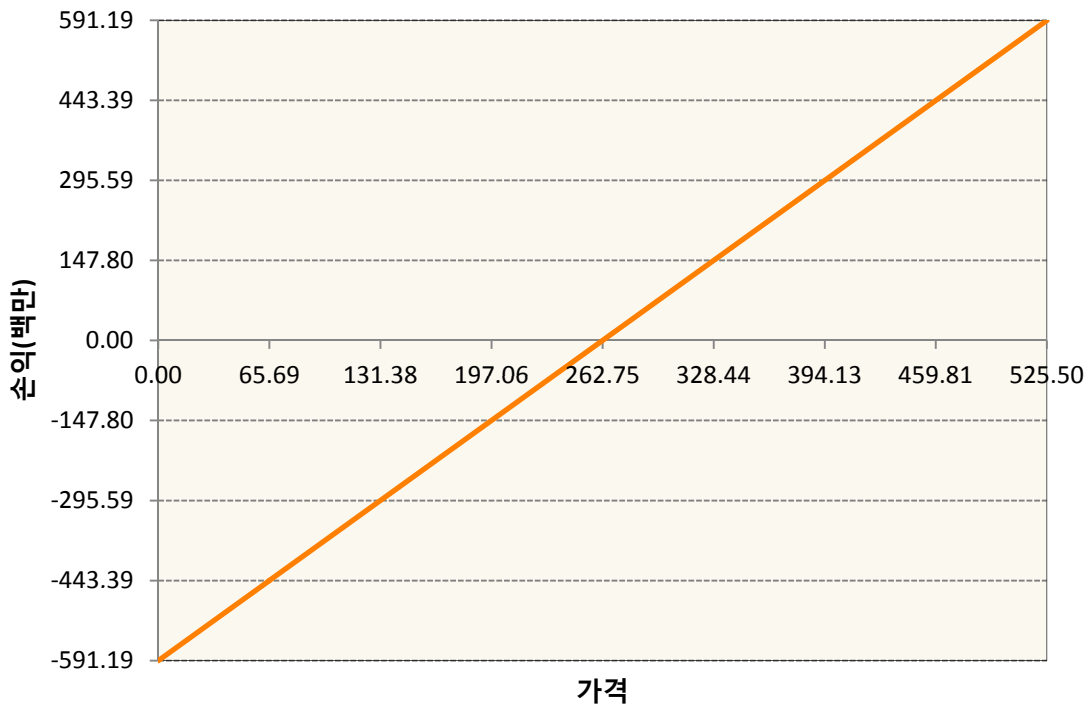
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	591	0	591	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	2018-10-31
기준일	2018-10-30

리디파인K200(주식혼합-파생재간

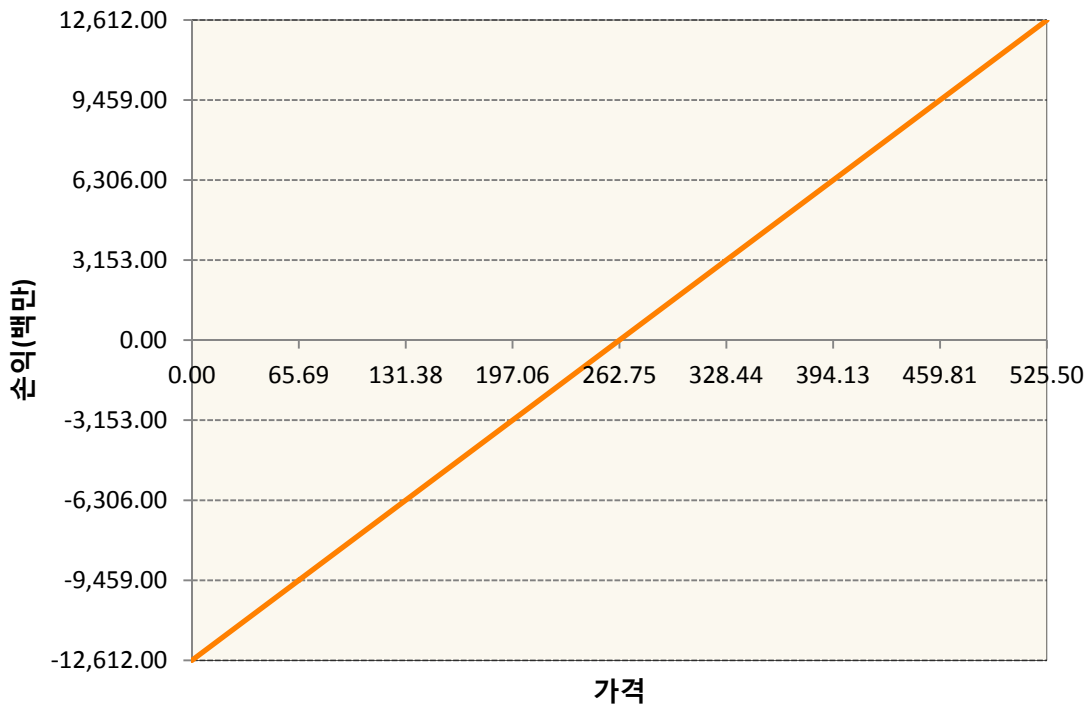
1. 계약금액

(단위:백만원)

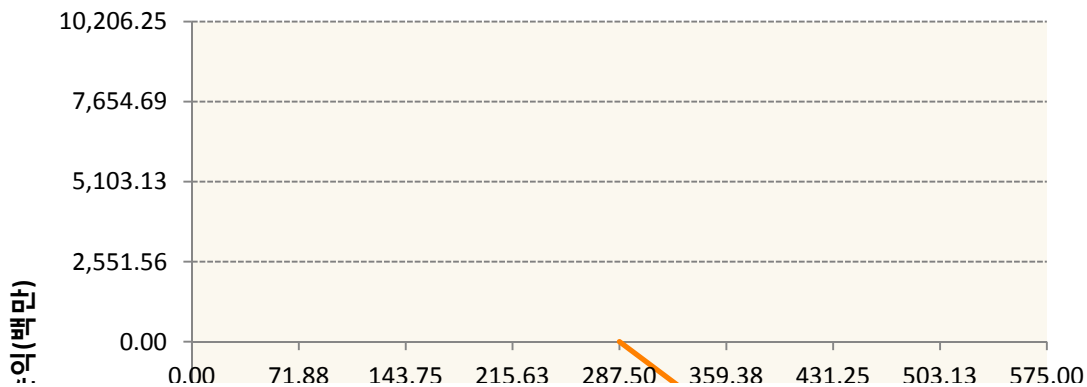
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,612	0	12,612	장내
누계	유가증권	옵션	4,059	23,401	-19,343	장내

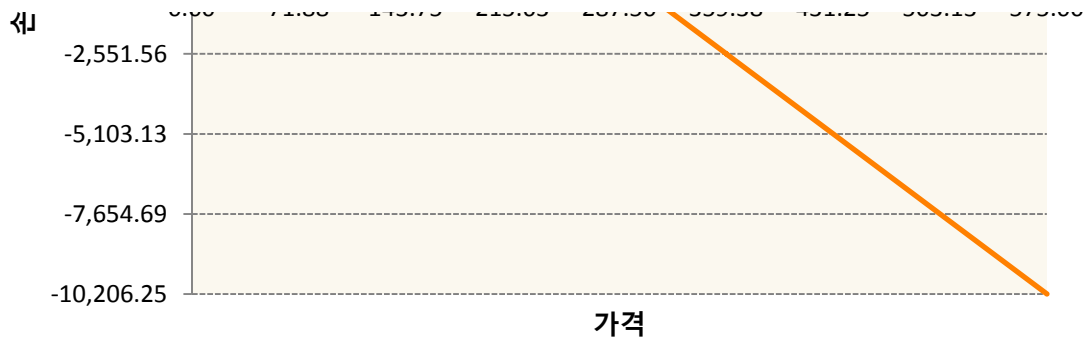
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

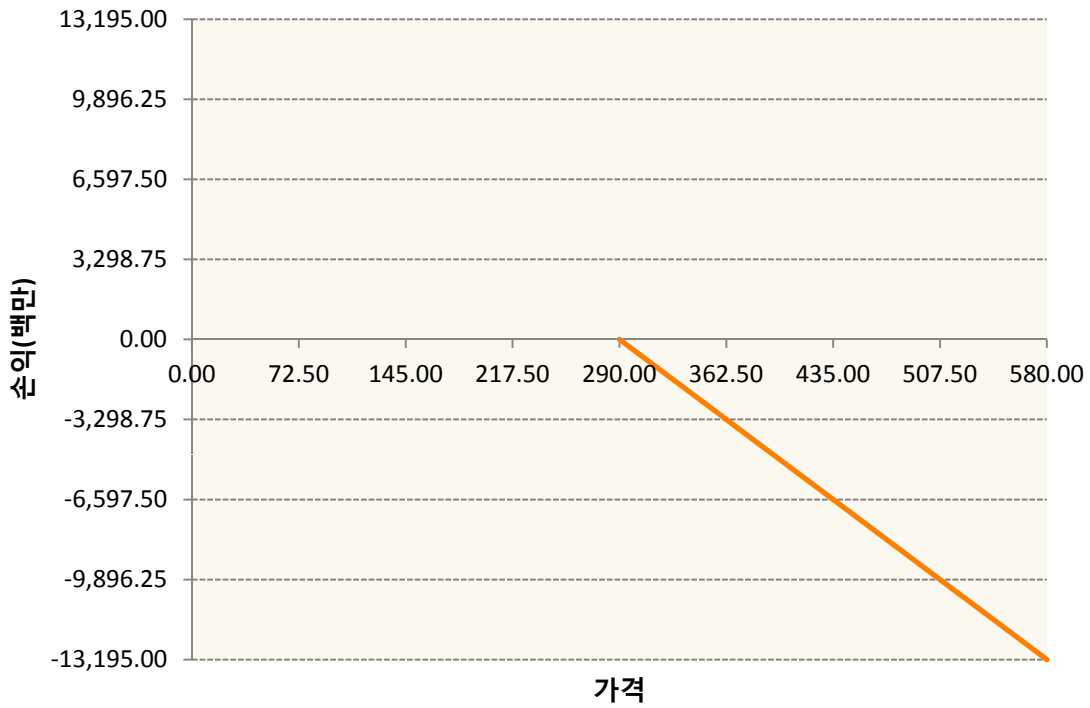


KR4201NB2877-2018-11 콜287.5

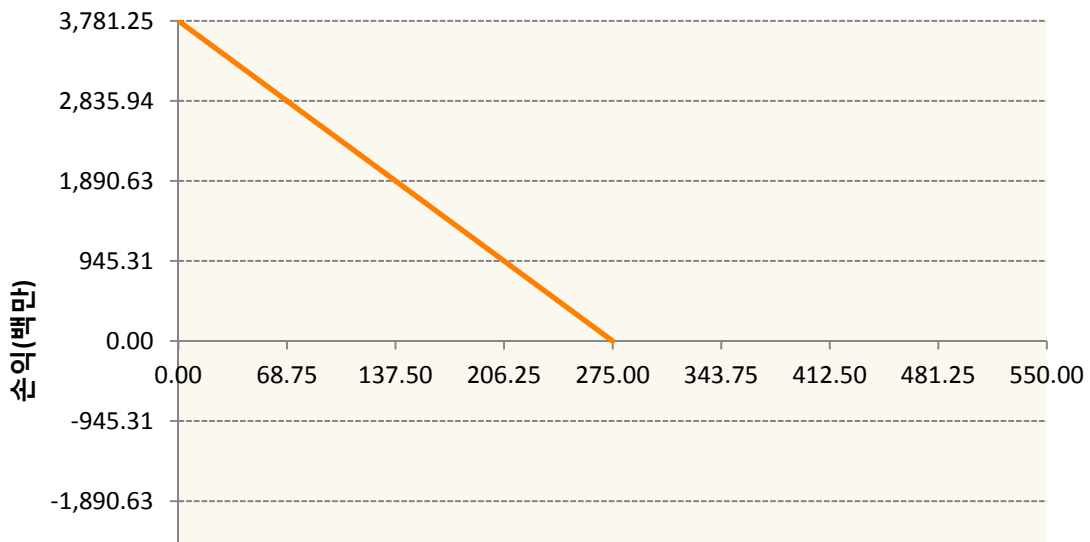


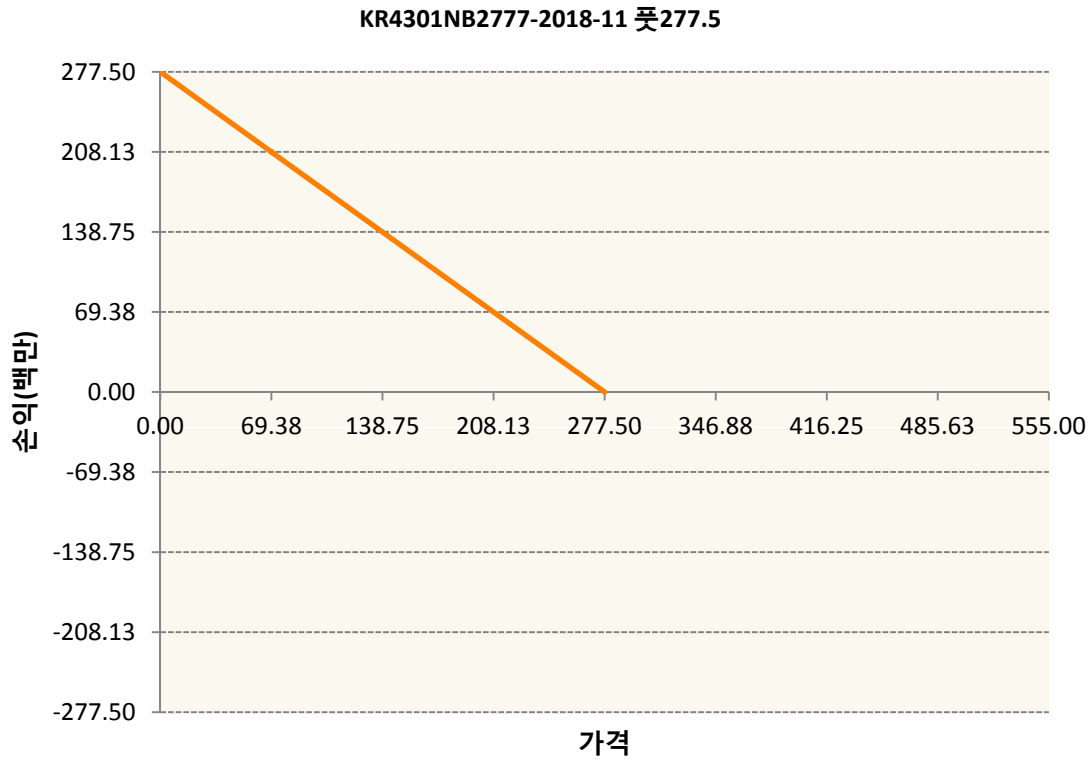
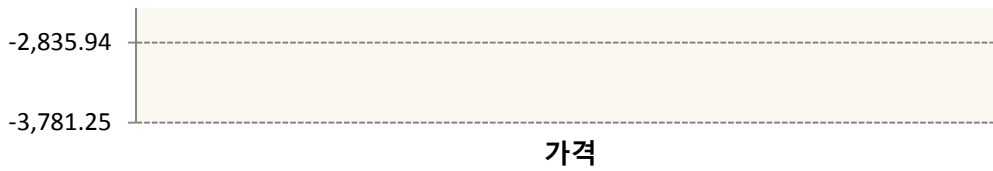


KR4201NB2901-2018-11 콜290



KR4301NB2751-2018-11 풋275





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 1,008

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,008	-1,008	-1,008	-1,008	-1,008	-1,008	-1,008
-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%	1,008	1,008	1,008	1,008	1,008	1,008	1,008

KR4201NB2828 2018-11 콜287.5 158

기초자산의 변동성							
가격	-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	3
-2.67%	3	3	3	3	2	1	0

0%	3	2	2	0	-2	-5	-8
2.67%	0	-3	-6	-11	-17	-23	-30
5.33%	-17	-25	-34	-43	-54	-65	-76
8.00%	-72	-86	-100	-114	-129	-143	-158

KR4201NB27 2018-11 콜290

163

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	2	1	0
0%	2	2	1	0	-2	-4	-8
2.67%	0	-2	-5	-9	-15	-21	-29
5.33%	-12	-20	-29	-39	-51	-63	-76
8.00%	-62	-78	-94	-111	-128	-145	-163

KR4301NB27 2018-11 풋275

283

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	283	283	283	283	283	283	283
-5.33%	187	187	187	187	187	187	187
-2.67%	91	91	91	91	92	93	94
0%	-4	-3	-2	0	2	4	6
2.67%	-89	-86	-82	-79	-75	-71	-67
5.33%	-147	-143	-139	-134	-130	-126	-121
8.00%	-172	-169	-167	-164	-160	-157	-154

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	-5
5.33%	-12	-11	-11	-11	-11	-10	-10
8.00%	-14	-14	-14	-14	-13	-13	-13

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

(단위:백만원)

1,217

공시일	2018-10-31
기준일	2018-10-30

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

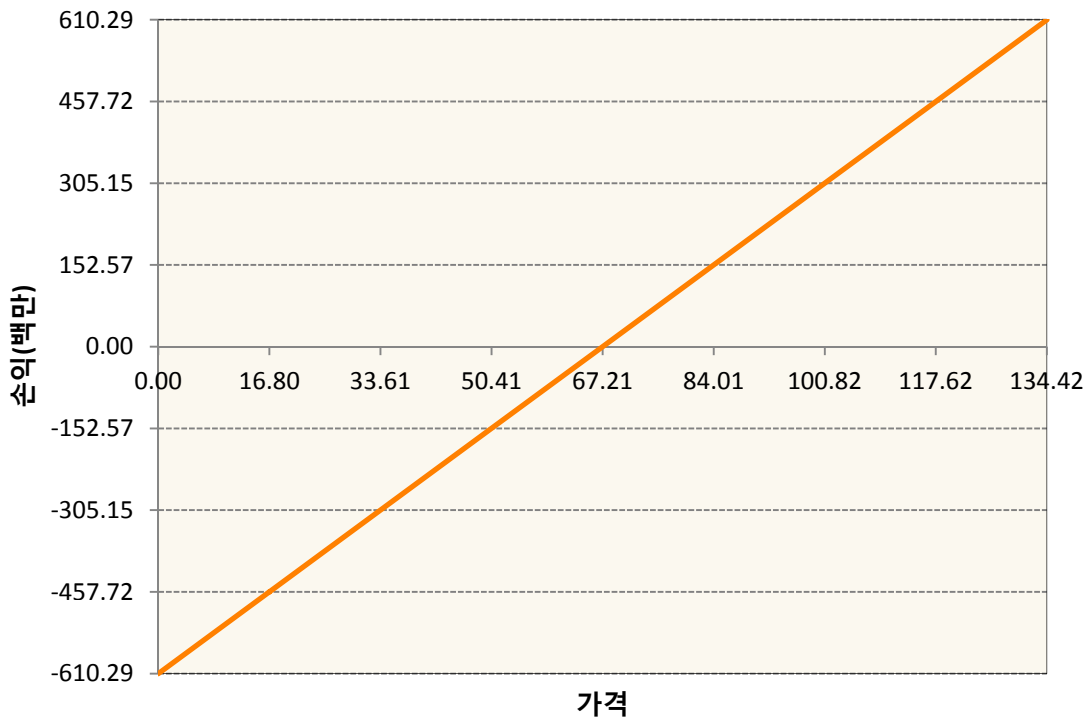
1. 계약금액

(단위:백만원)

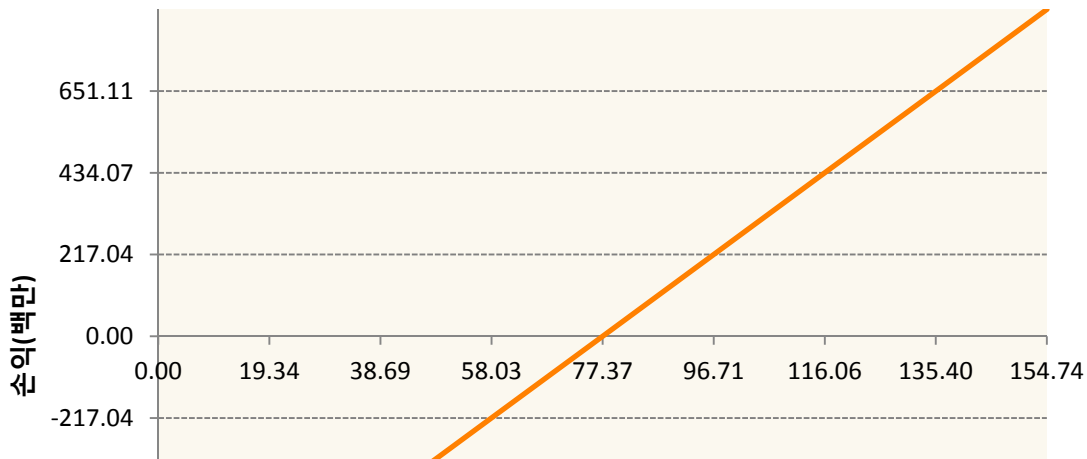
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,347	410	2,938	

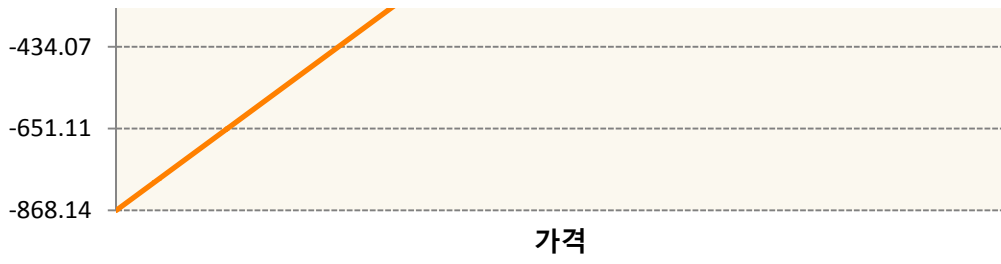
2. 만기시점의 손익구조

CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19

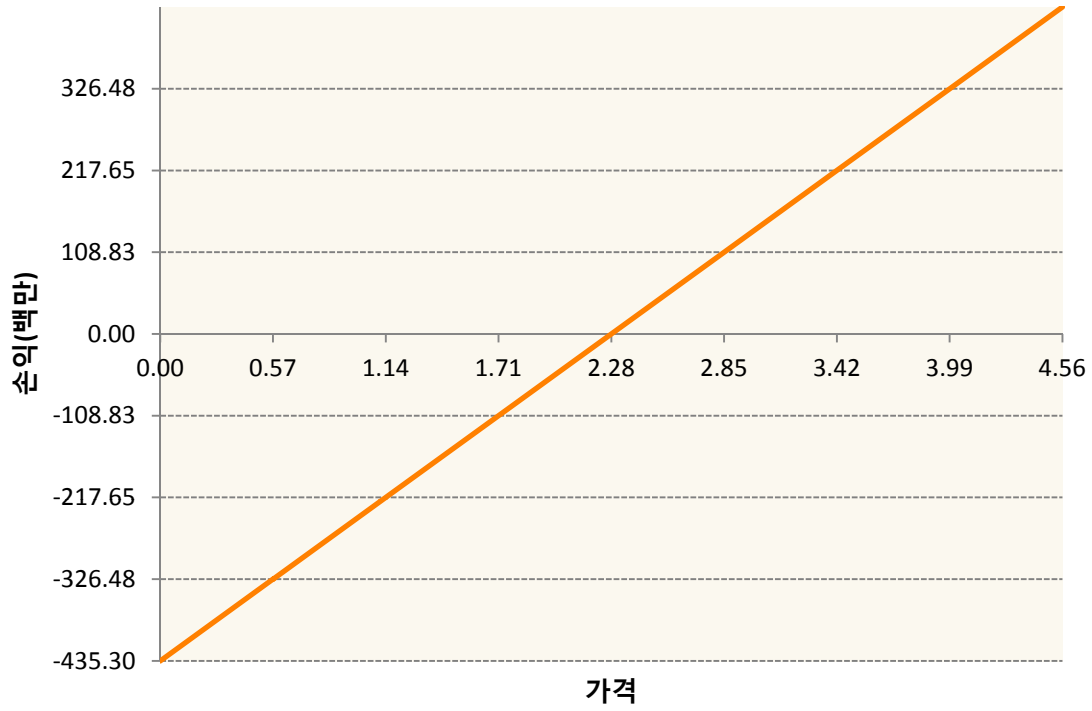


COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19

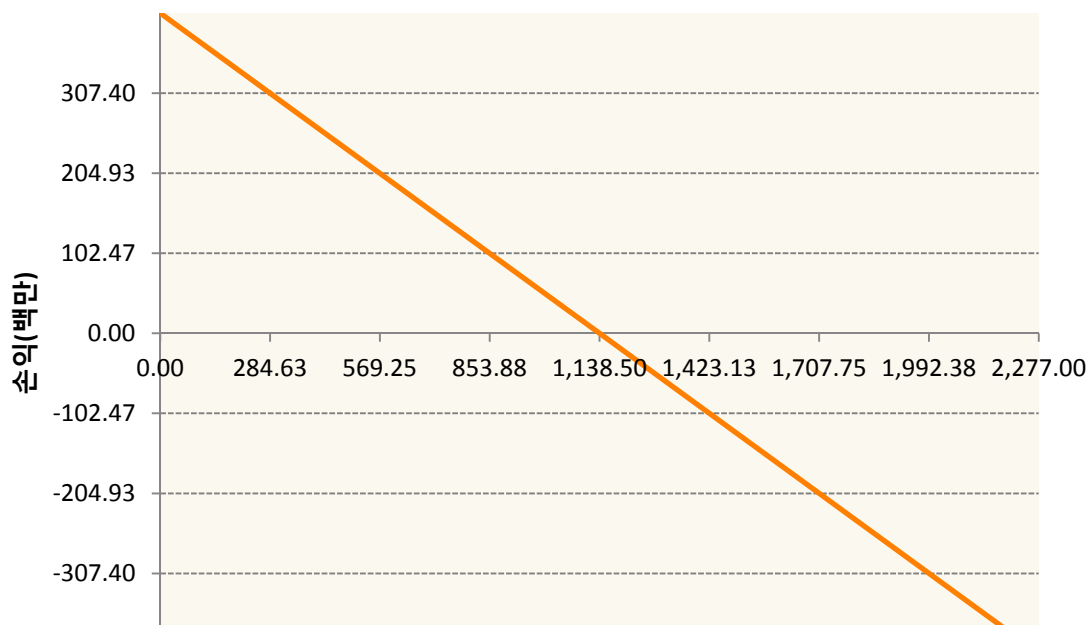


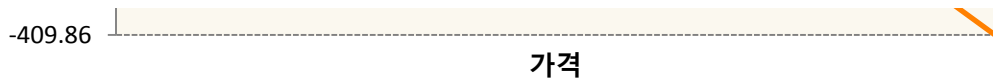


HOF9-NY Harb ULSD Fut Jan19

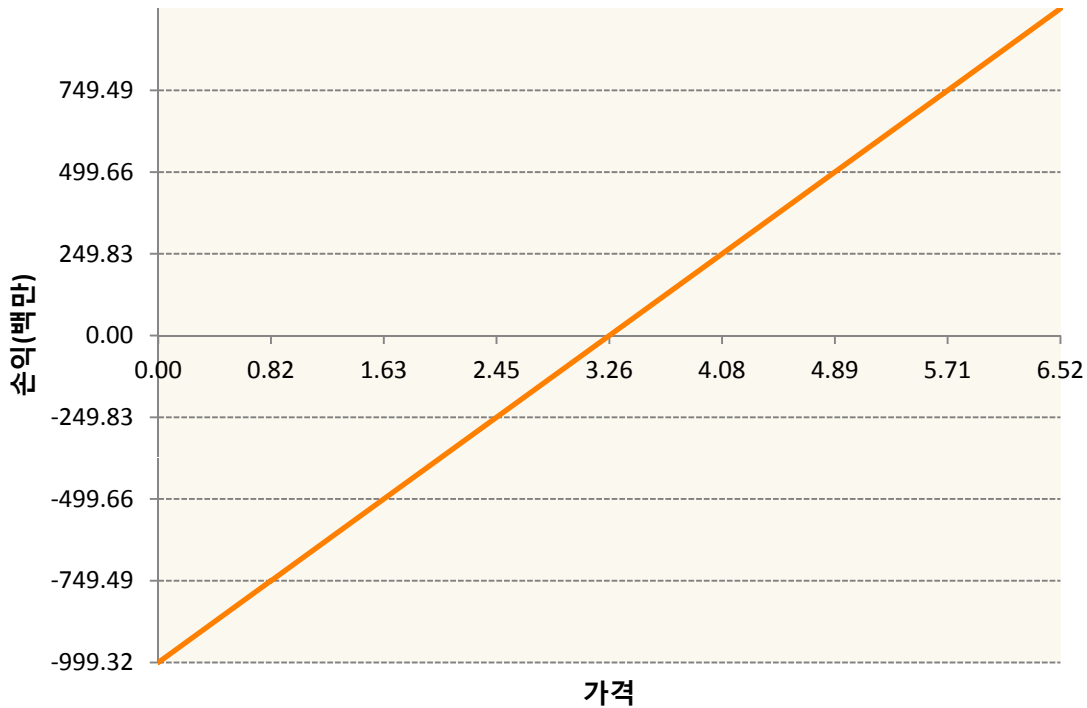


KR4175NB0006-2018-11 달러선물

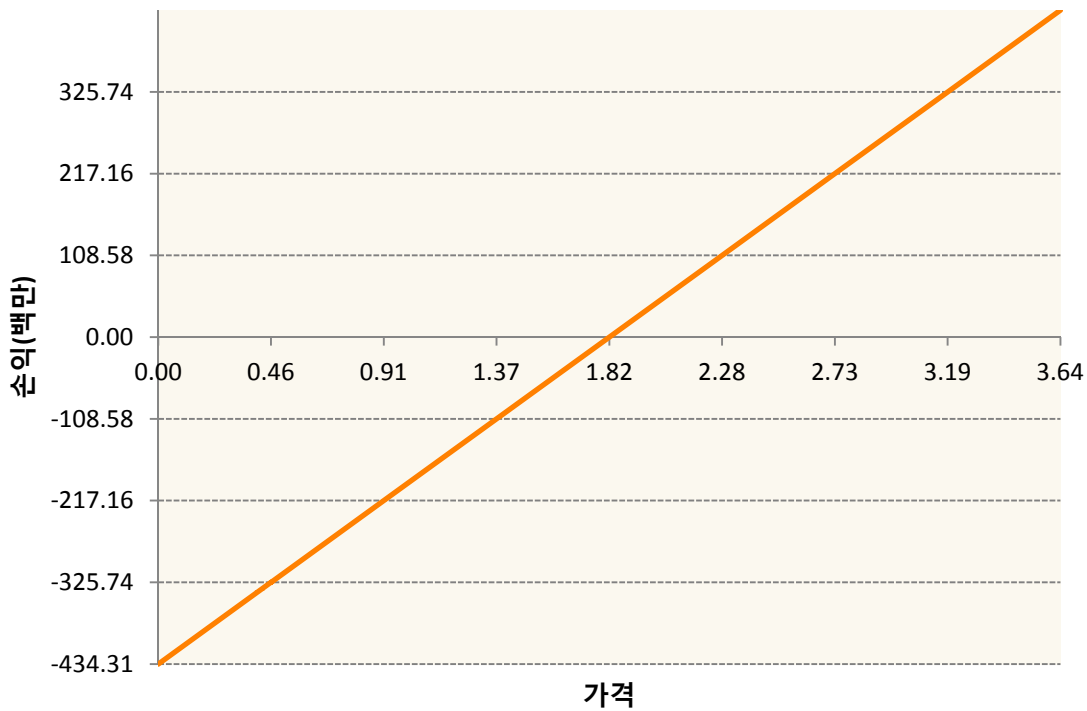




NGF19-NATURAL GAS FUTR Jan19



XBF9-GASOLINE RBOB FUT Jan19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF9	WTI CRUDE FUTURE Jan19	49
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	69
HOF9	NY Harb ULSD Fut Jan19	35
KR4175NB0(2018-11 달러선물		33
NGF19	NATURAL GAS FUTR Jan19	80
XBF9	GASOLINE RBOB FUT Jan19	35

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

403

공시일	2018-10-31
기준일	2018-10-30

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

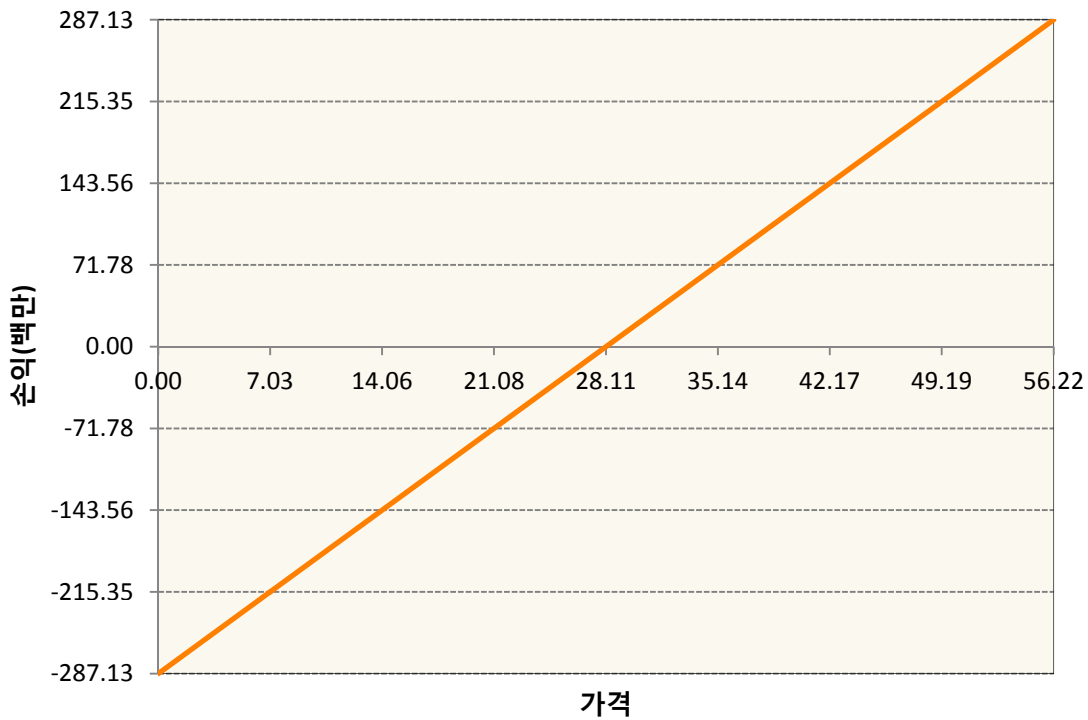
1. 계약금액

(단위:백만원)

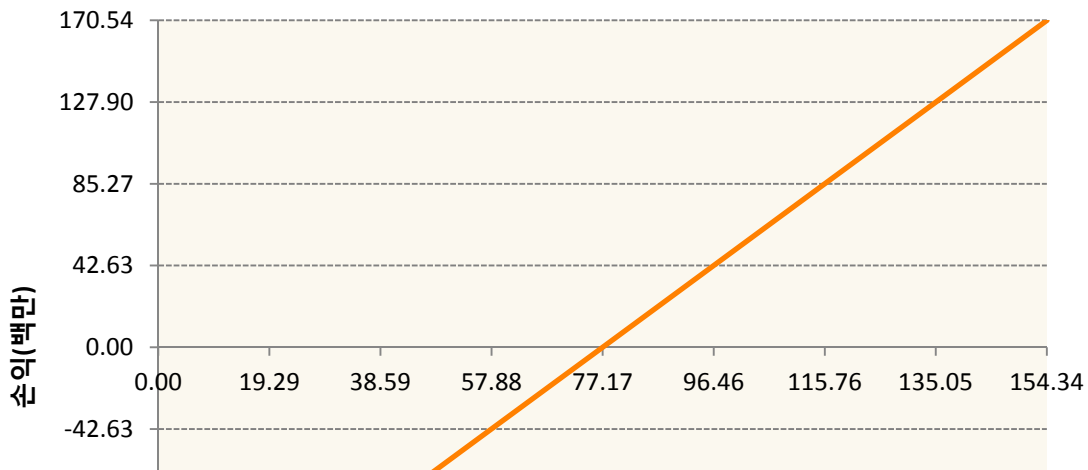
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,567	80	3,487	

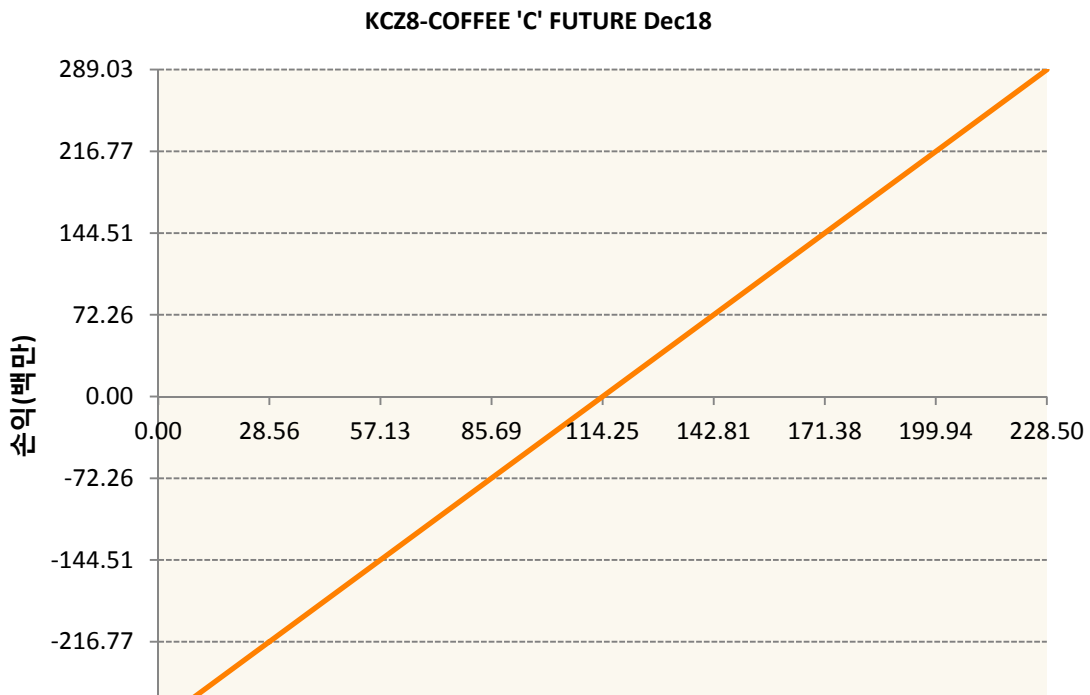
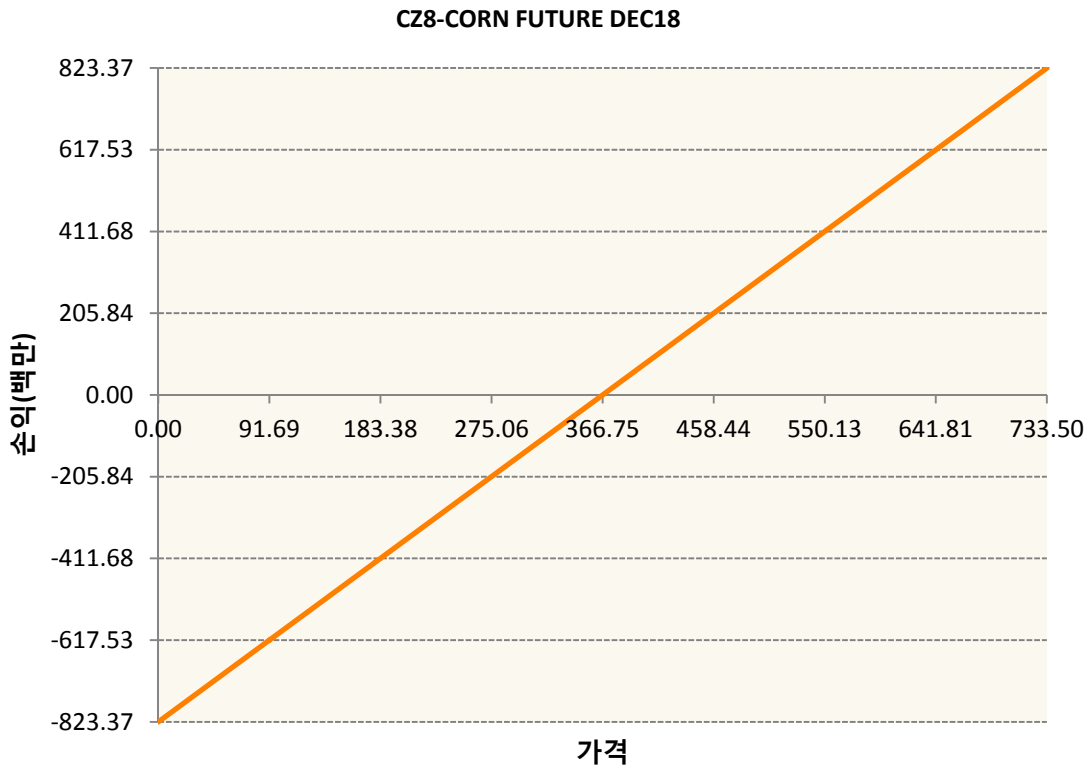
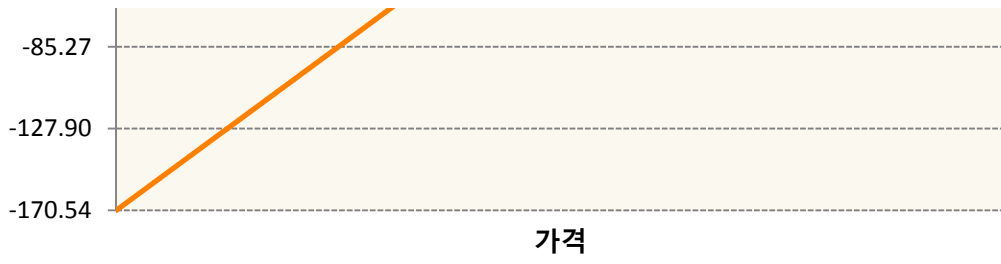
2. 만기시점의 손익구조

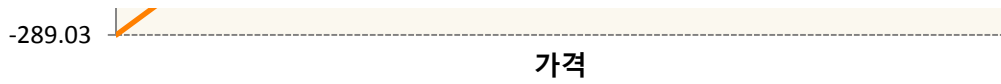
BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19



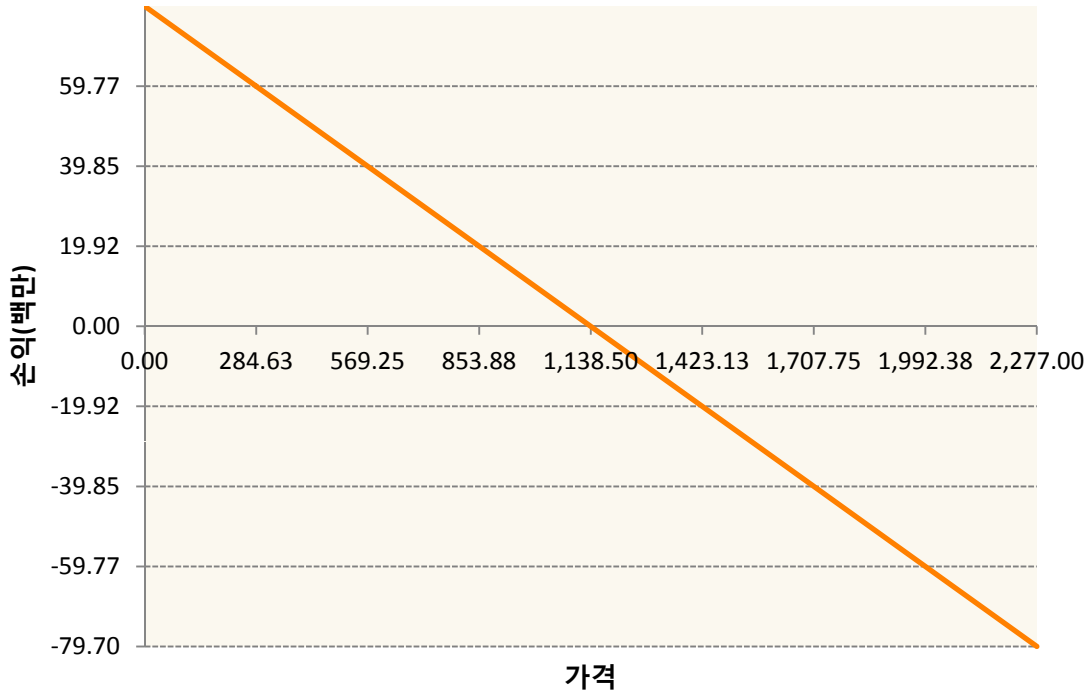
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



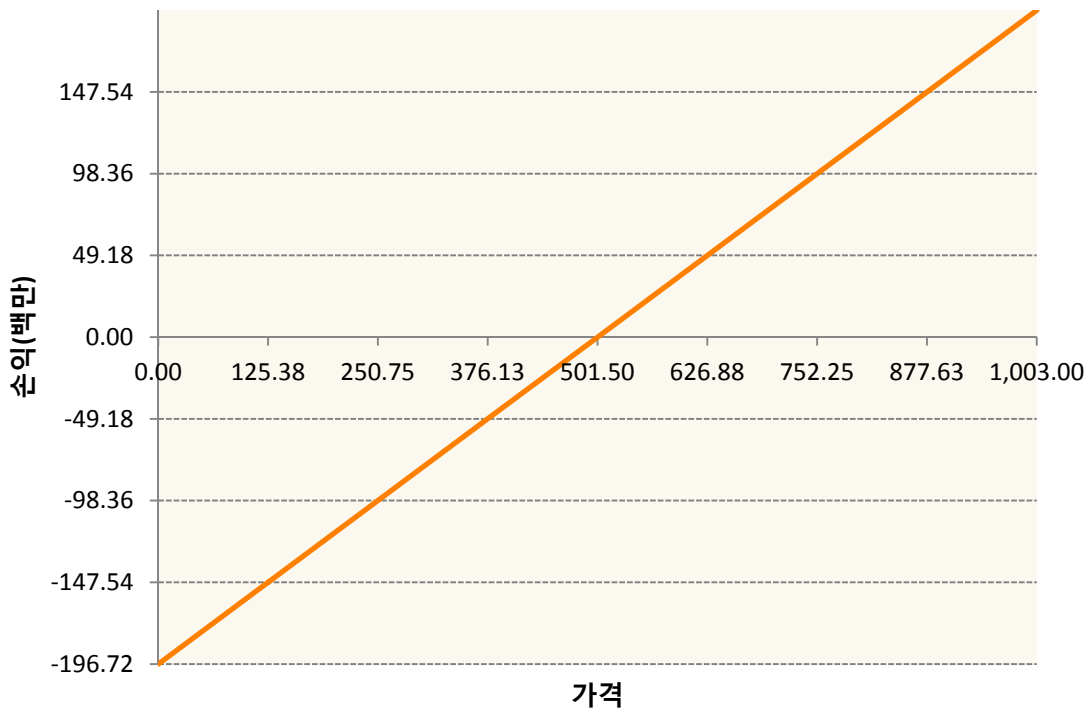




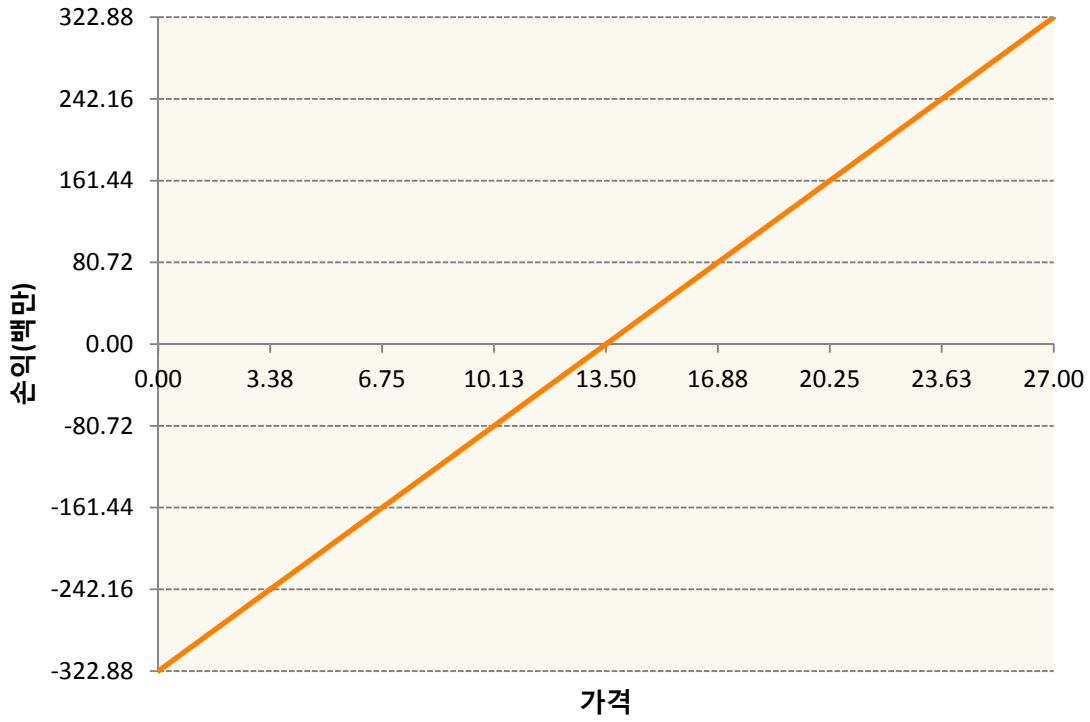
KR4175NB0006-2018-11 달러선물



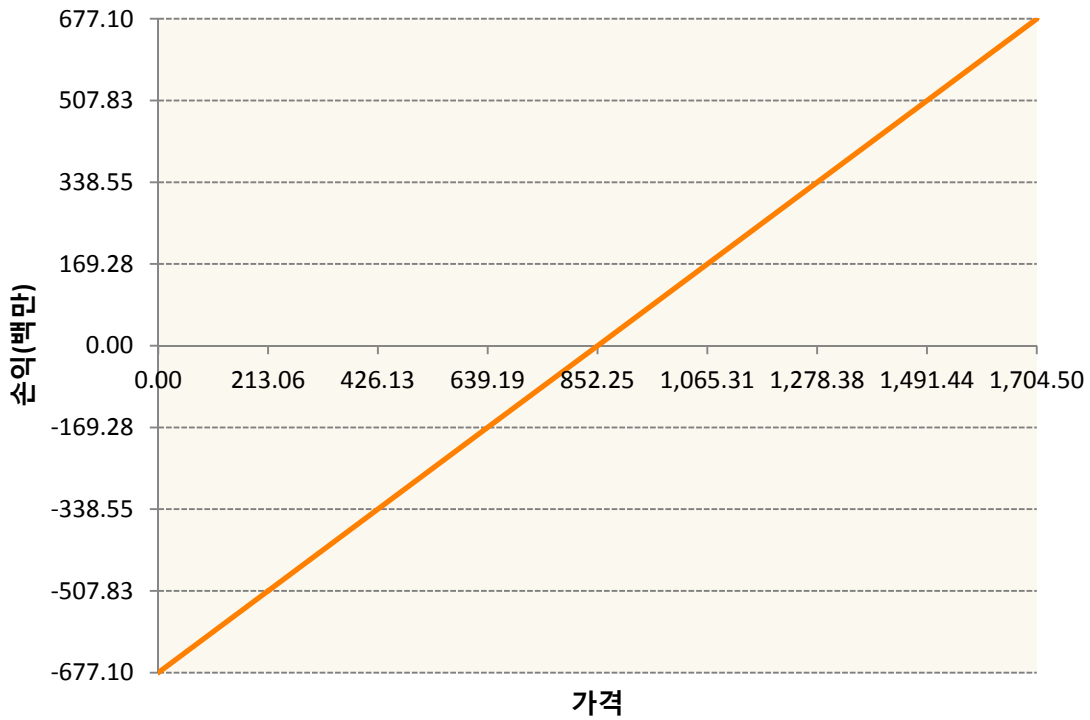
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

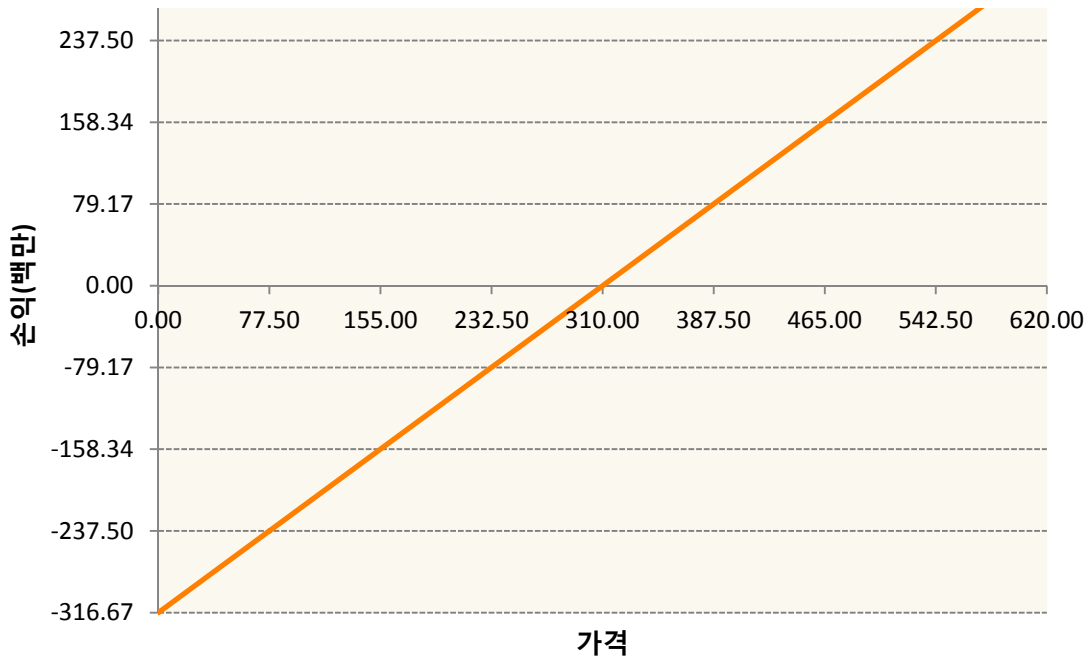


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19

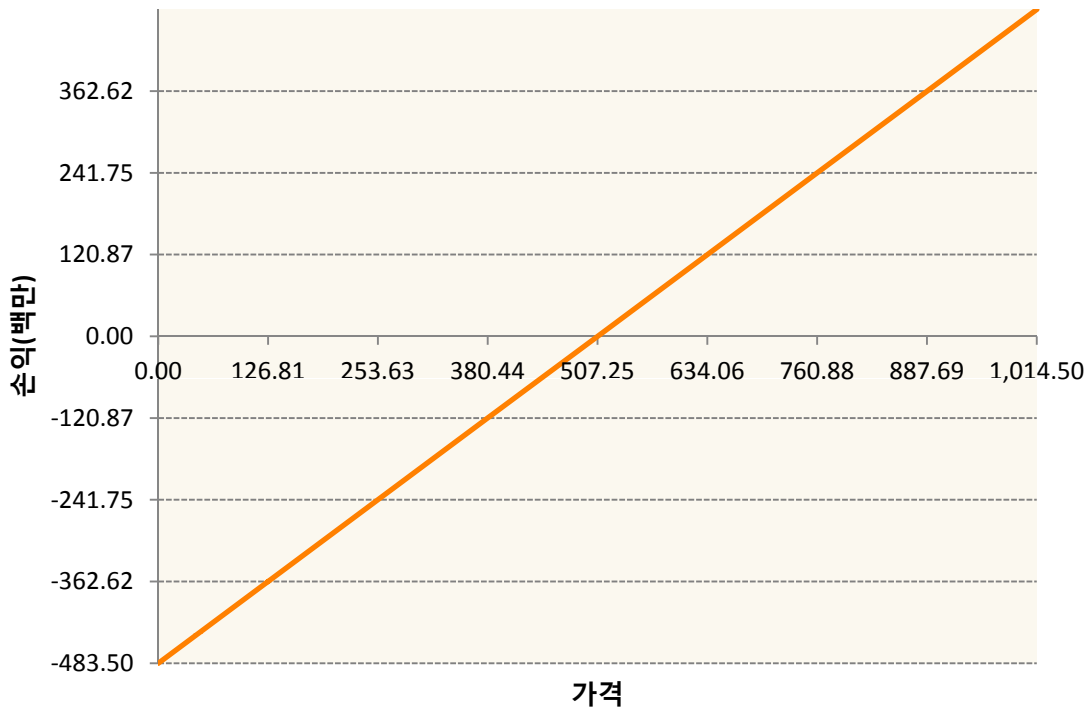


SMF9-SOYBEAN MEAL FUTR Jan19





WZ8-WHEAT FUTURE(CBT) DEC18



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	23
KR4175NB0(2018-11	달러선물	6

KWZ8	KC HRW WHEAT FUT DEC18	16
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	26
SF9	SOYBEAN FUTURE Jan19	54
SMF9	SOYBEAN MEAL FUTR Jan19	25
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	39

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

(단위:백만원)

311