

공시일	2018-11-02
기준일	2018-11-01

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)

65

공시일	2018-11-02
기준일	2018-11-01

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

1,075

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

506

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-11-02
기준일	2018-11-01

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

260

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

366

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-11-02
기준일	2018-11-01

유로인덱스모(주식-파생형)

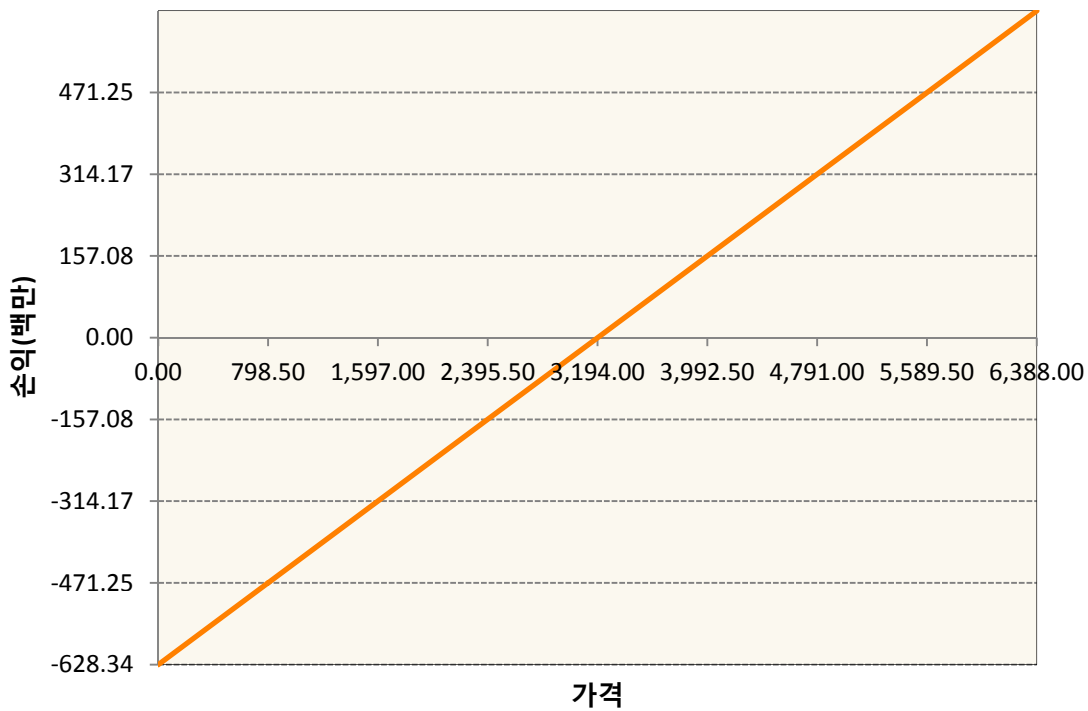
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	628	0	628	

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)

32

공시일	2018-11-02
기준일	2018-11-01

차이나인덱스모(주식-파생형)

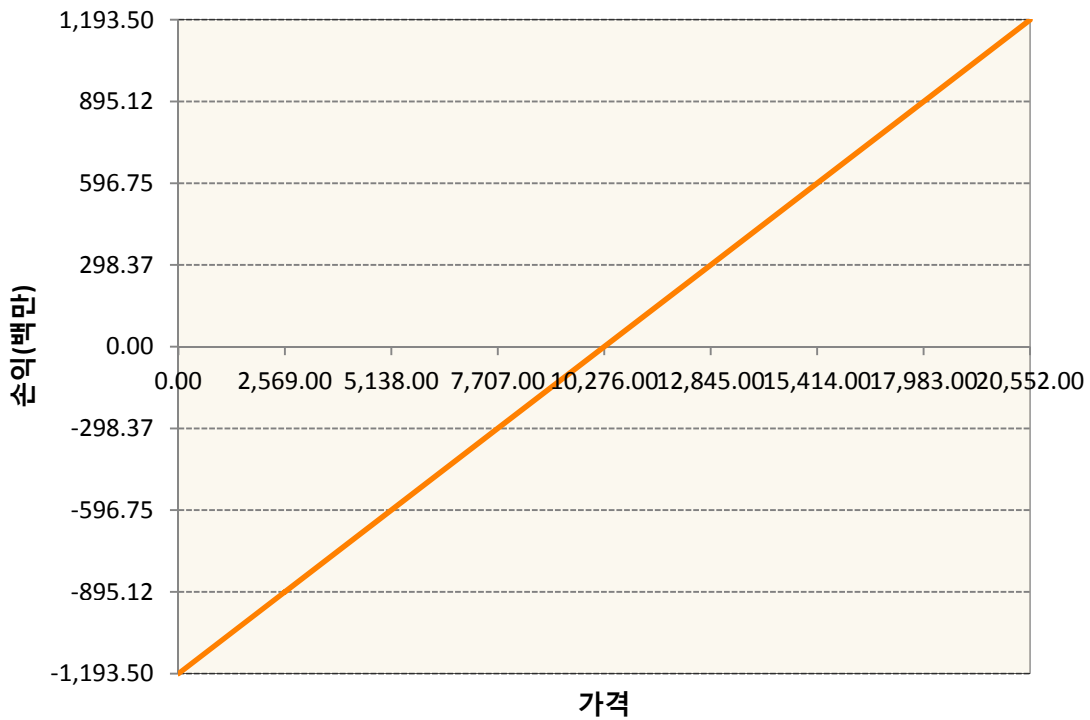
1. 계약금액

(단위:백만원)

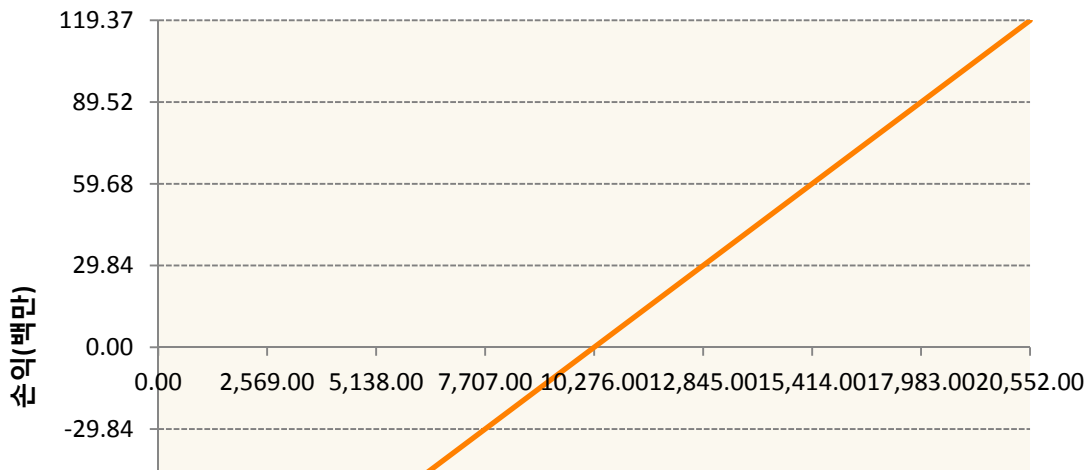
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,313	0	1,313	장내

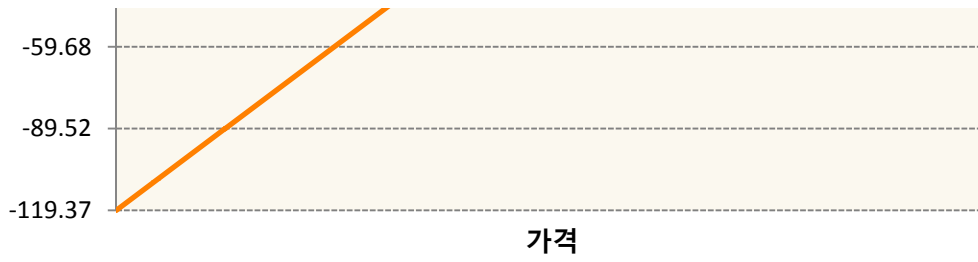
2. 만기시점의 손익구조

HCX8-HSCEI FUTURES NOV 18



MHCX8-MINI H-SHR IDX FU NOV 18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCX8	HSCEI FUTURES NOV 18	95
MHCX8	MINI H-SHR IDX FU NOV 18	10

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

102

공시일	2018-11-02
기준일	2018-11-01

커버드콜모(주식혼합-파생형)

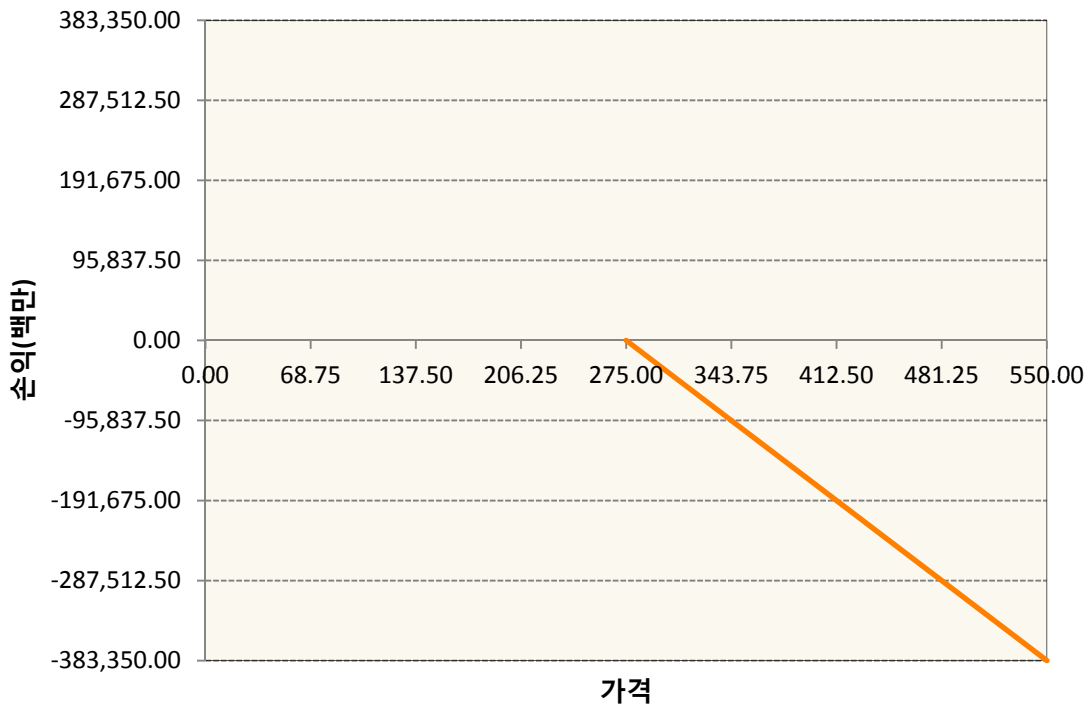
1. 계약금액

(단위:백만원)

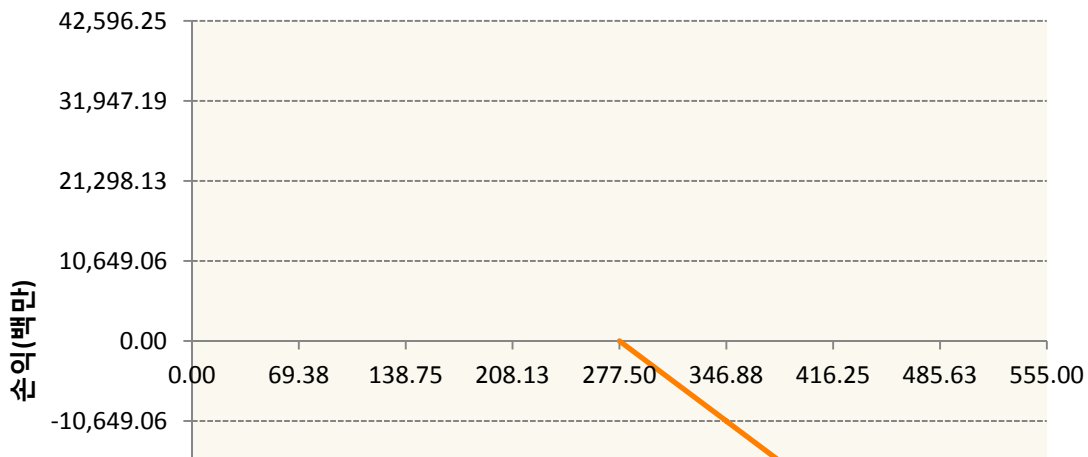
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	721,571	-721,571	장내

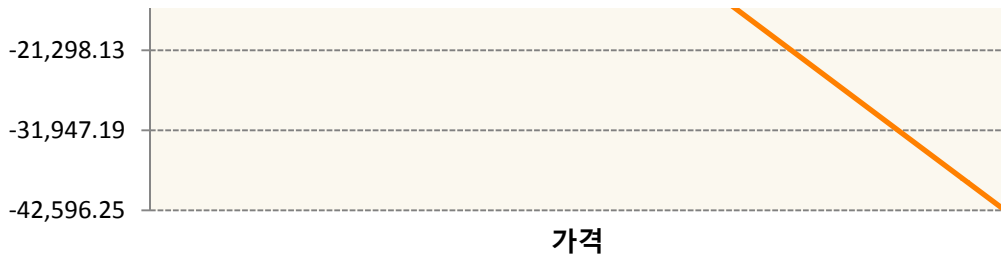
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

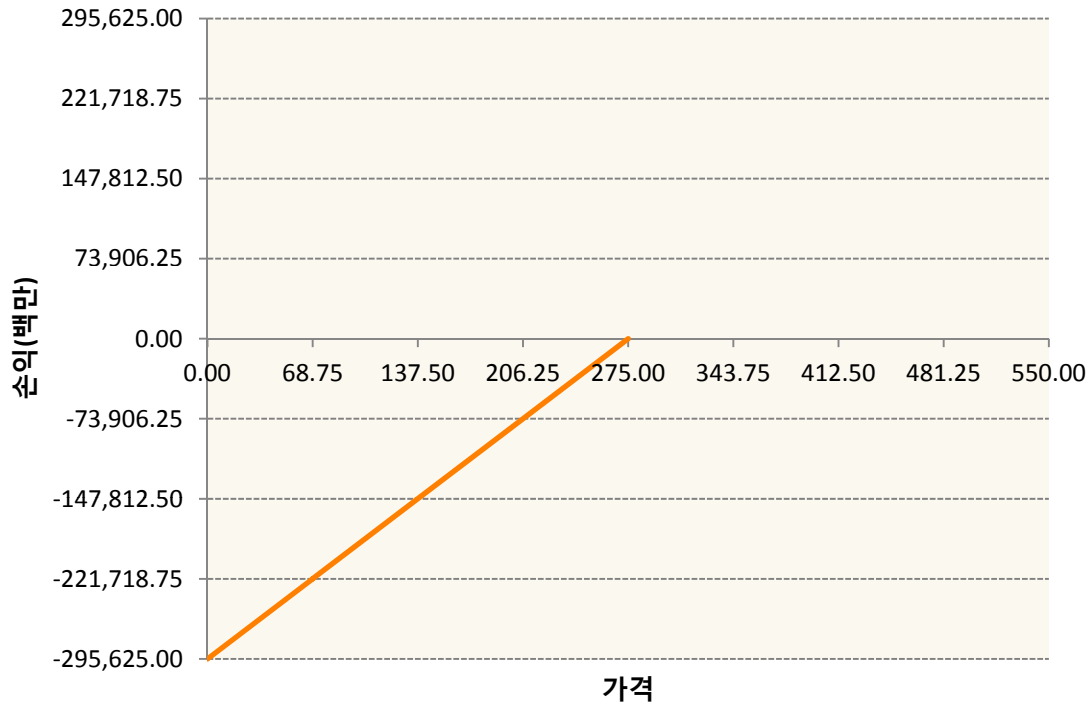


KR4201NB2778-2018-11 콜277.5





KR4301NB2751-2018-11 풋275



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NB27 2018-11 콜275

14,444

		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	866	866	866	865	862	856	846	
-5.33%	865	863	857	845	824	791	744	
-2.67%	844	815	766	696	601	482	339	
0%	587	425	228	0	-256	-536	-837	
2.67%	-853	-1,256	-1,673	-2,101	-2,537	-2,981	-3,429	
5.33%	-5,046	-5,526	-6,007	-6,491	-6,975	-7,461	-7,948	
8.00%	-12,364	-12,651	-12,968	-13,310	-13,672	-14,051	-14,444	

KR4201NB27 2018-11 콜277.5

1,356

		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	58	58	58	58	58	58	57	

-5.33%	58	58	58	57	56	54	50
-2.67%	57	56	53	48	41	32	21
0%	44	33	18	0	-21	-46	-73
2.67%	-51	-87	-125	-166	-208	-252	-297
5.33%	-390	-444	-499	-553	-607	-662	-716
8.00%	-1,082	-1,124	-1,167	-1,213	-1,260	-1,307	-1,356

KR4301NB27 2018-11 풋275

22,418

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,417	-22,417	-22,417	-22,417	-22,417	-22,417	-22,418
-5.33%	-14,883	-14,883	-14,883	-14,883	-14,884	-14,886	-14,889
-2.67%	-7,349	-7,351	-7,354	-7,362	-7,374	-7,394	-7,421
0%	151	116	66	0	-82	-179	-290
2.67%	7,088	6,896	6,692	6,478	6,256	6,027	5,793
5.33%	11,591	11,329	11,064	10,797	10,529	10,260	9,990
8.00%	12,997	12,899	12,780	12,643	12,490	12,324	12,145

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

(단위:백만원)

36,196

공시일	2018-11-02
기준일	2018-11-01

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

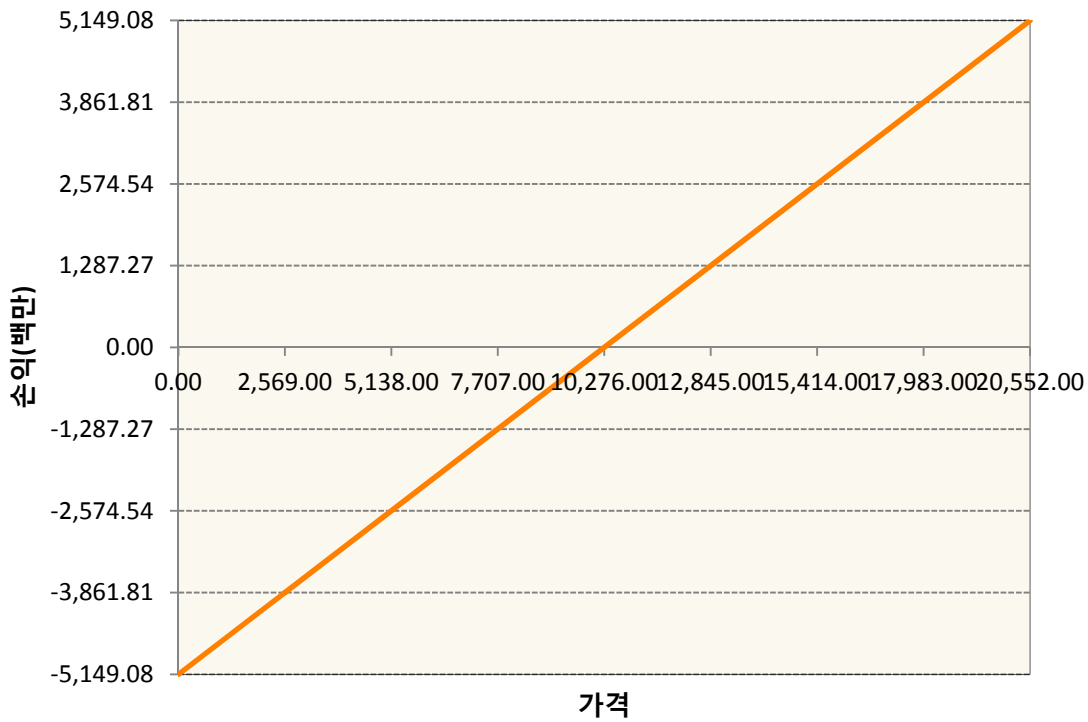
1. 계약금액

(단위:백만원)

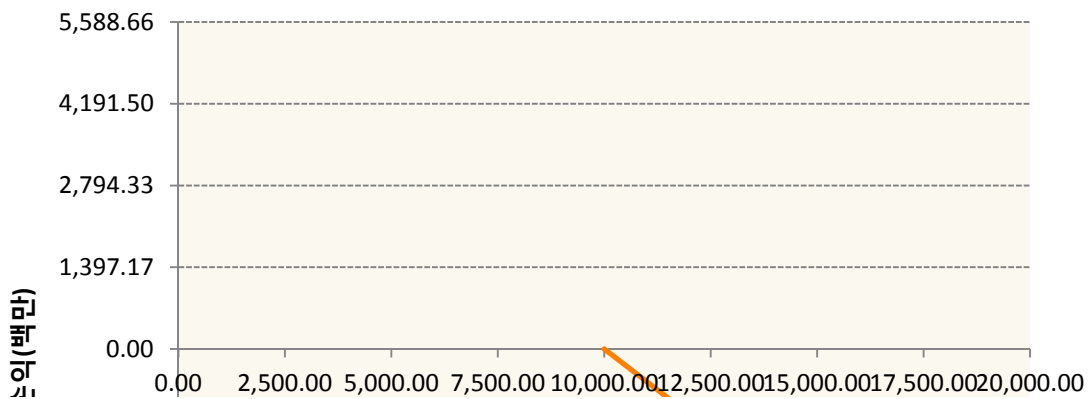
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,149	0	5,149	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,177	-11,177	장내

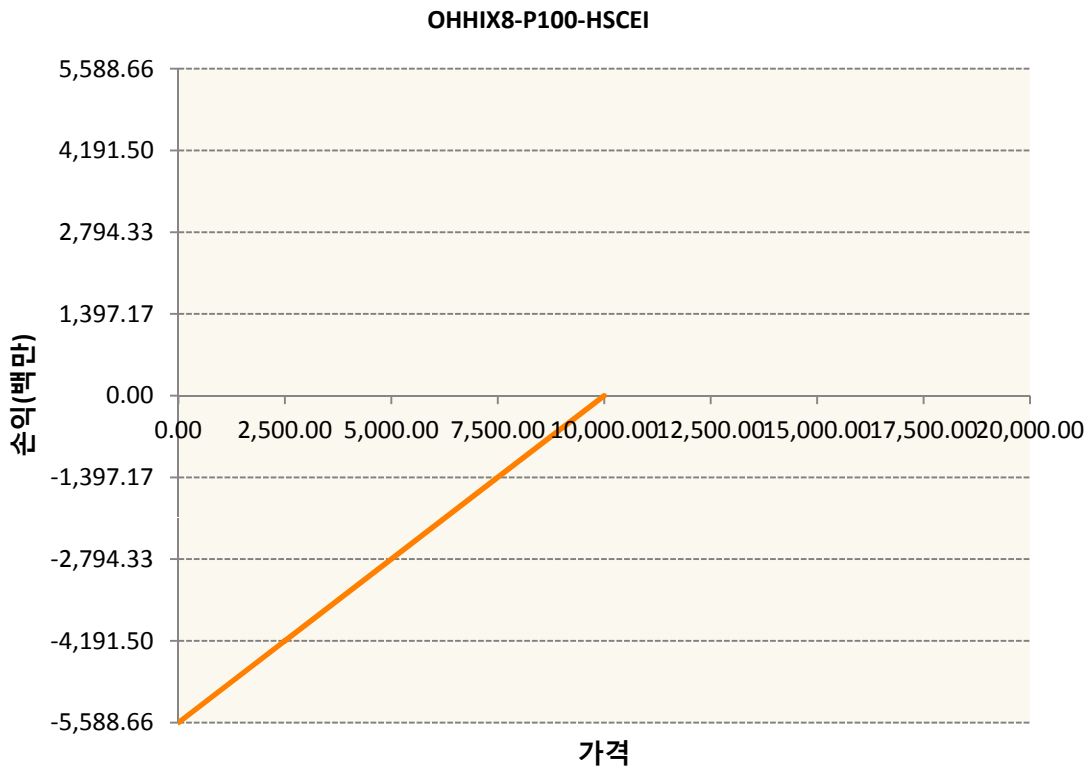
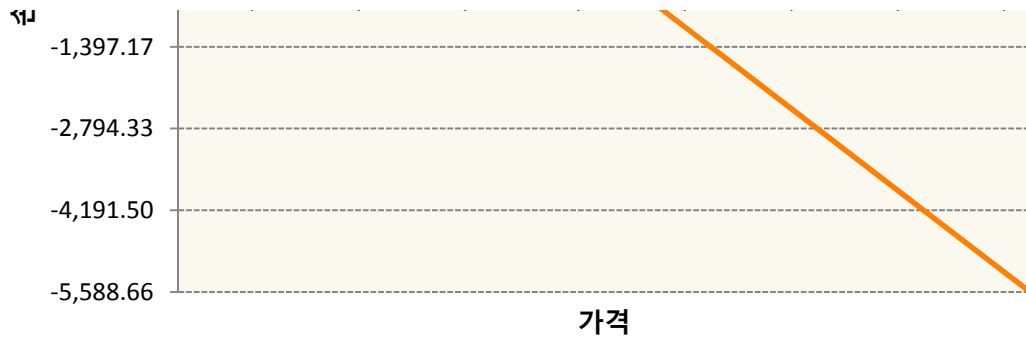
2. 만기시점의 손익구조

HCX8-HSCEI FUTURES NOV 18



OHHIX8-C100-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCX8	HSCEI FUTURES NOV 18	412
	OHHIX8-C1C HSCEI	447
	OHHIX8-P10 HSCEI	447

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,264

공시일	2018-11-02
기준일	2018-11-01

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

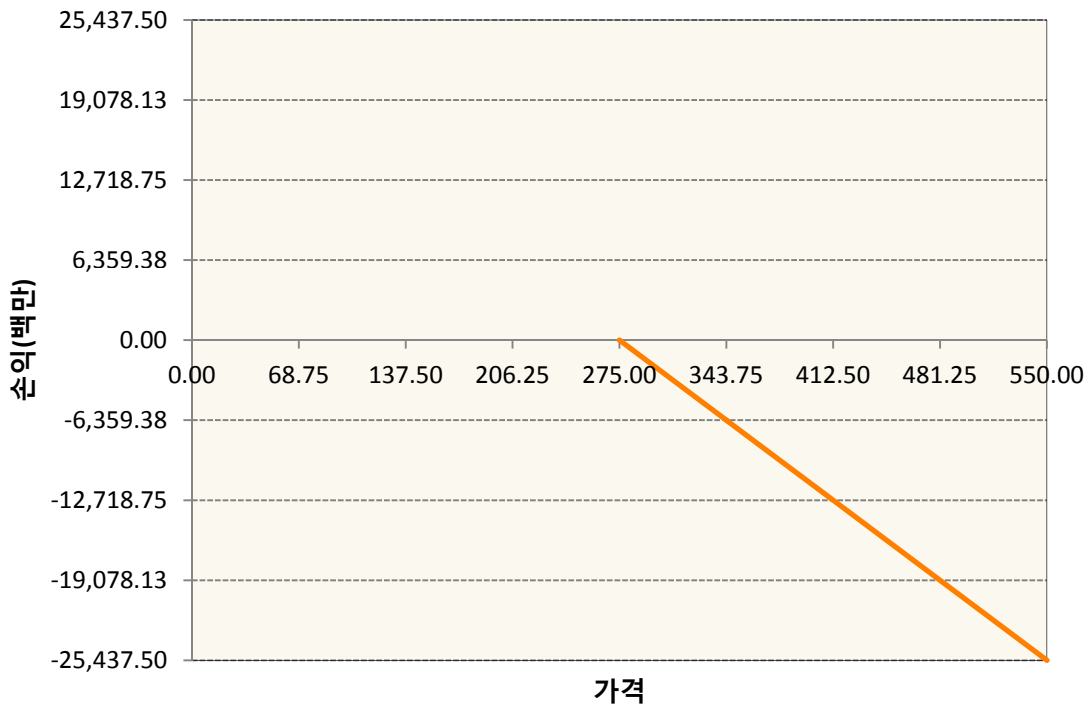
1. 계약금액

(단위:백만원)

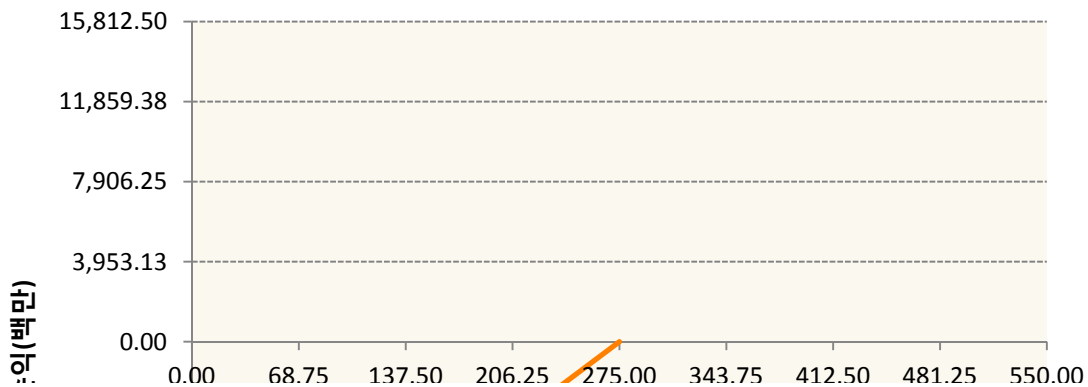
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	43,836	0	43,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	44,025	-44,025	장내

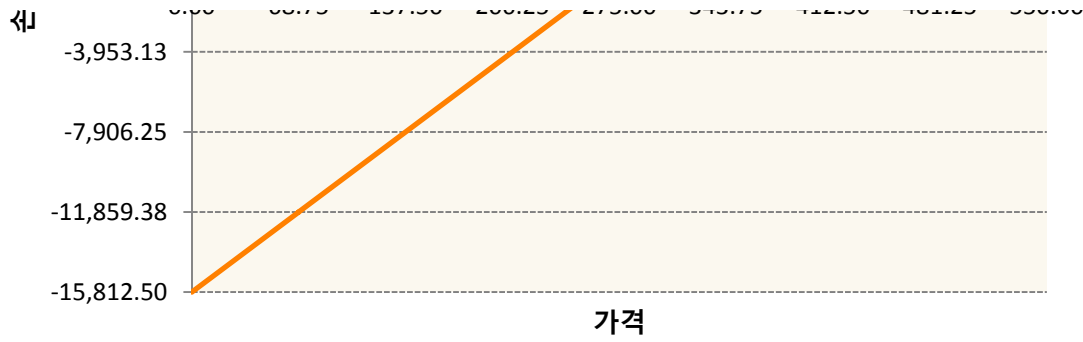
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

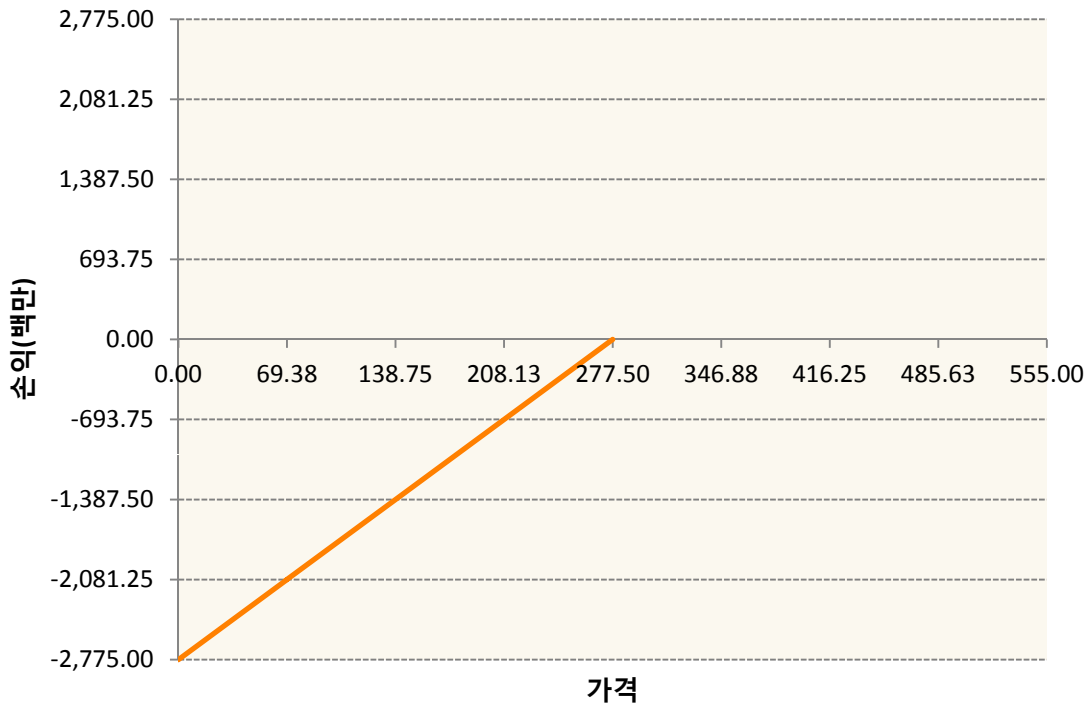


KR4301NB2751-2018-11 풋275





KR4301NB2777-2018-11 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_14

3,619

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,619	-3,619	-3,619	-3,619	-3,619	-3,619	-3,619
-5.33%	-2,413	-2,413	-2,413	-2,413	-2,413	-2,413	-2,413
-2.67%	-1,206	-1,206	-1,206	-1,206	-1,206	-1,206	-1,206
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,206	1,206	1,206	1,206	1,206	1,206	1,206
5.33%	2,413	2,413	2,413	2,413	2,413	2,413	2,413
8.00%	3,619	3,619	3,619	3,619	3,619	3,619	3,619

KR4201NB27 2018-11 콜275

958

기초자산의 변동성							
-----------	--	--	--	--	--	--	--

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	57	57	57	57	57	57	56
-5.33%	57	57	57	56	55	52	49
-2.67%	56	54	51	46	40	32	22
0%	39	28	15	0	-17	-36	-56
2.67%	-57	-83	-111	-139	-168	-198	-228
5.33%	-335	-367	-399	-431	-463	-495	-527
8.00%	-820	-839	-860	-883	-907	-932	-958

KR4301NB27 2018-11 풋275

1,199

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,199	-1,199	-1,199	-1,199	-1,199	-1,199	-1,199
-5.33%	-796	-796	-796	-796	-796	-796	-796
-2.67%	-393	-393	-393	-394	-394	-395	-397
0%	8	6	4	0	-4	-10	-16
2.67%	379	369	358	347	335	322	310
5.33%	620	606	592	578	563	549	534
8.00%	695	690	684	676	668	659	650

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

209

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-209	-209	-209	-209	-209	-209	-209
-5.33%	-139	-139	-139	-139	-139	-139	-139
-2.67%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-70
0%	1	1	0	0	0	-1	-2
2.67%	68	67	66	64	63	61	59
5.33%	120	118	115	113	110	108	105
8.00%	142	141	139	137	136	134	131

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

(단위:백만원)

5,869

공시일	2018-11-02
기준일	2018-11-01

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

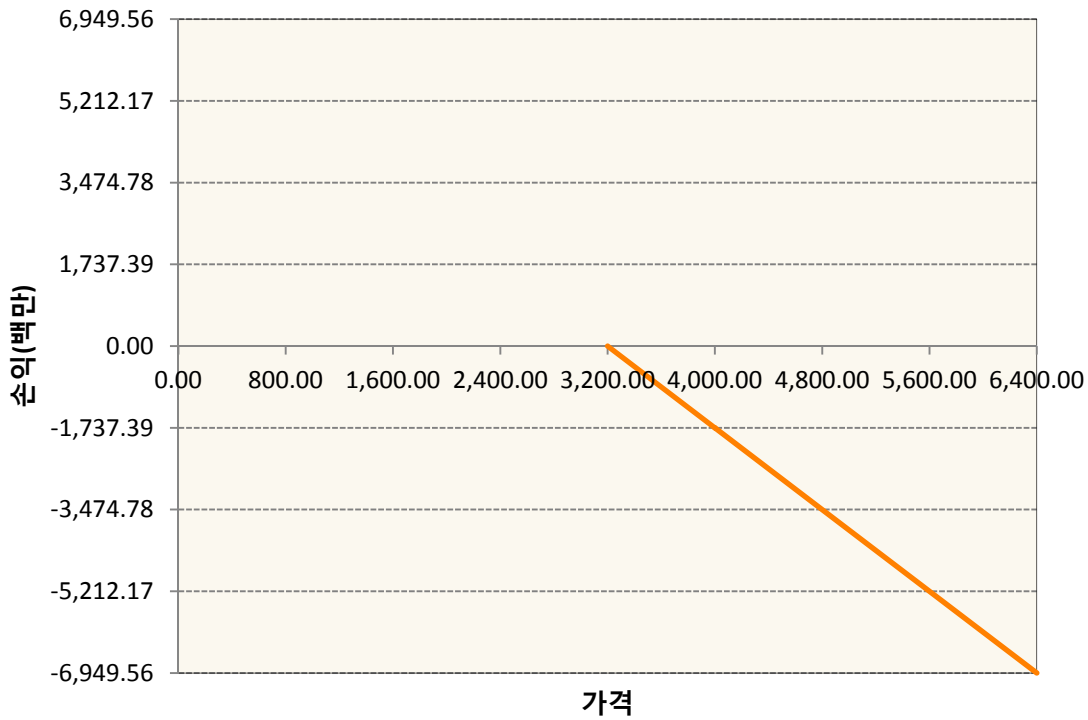
1. 계약금액

(단위:백만원)

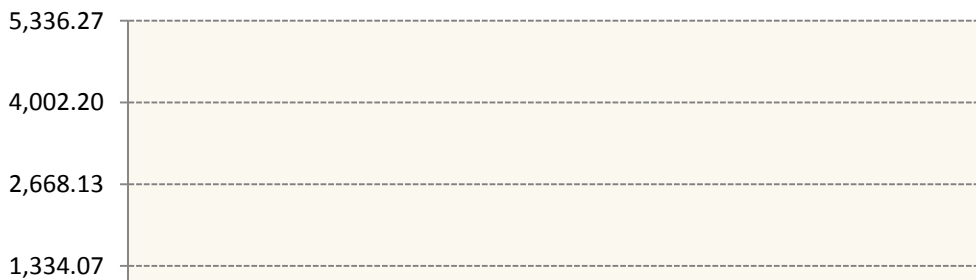
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,868	0	5,868	
누계	유가증권	스왑	72,199	0	72,199	장외
누계	유가증권	옵션	0	24,572	-24,572	장내

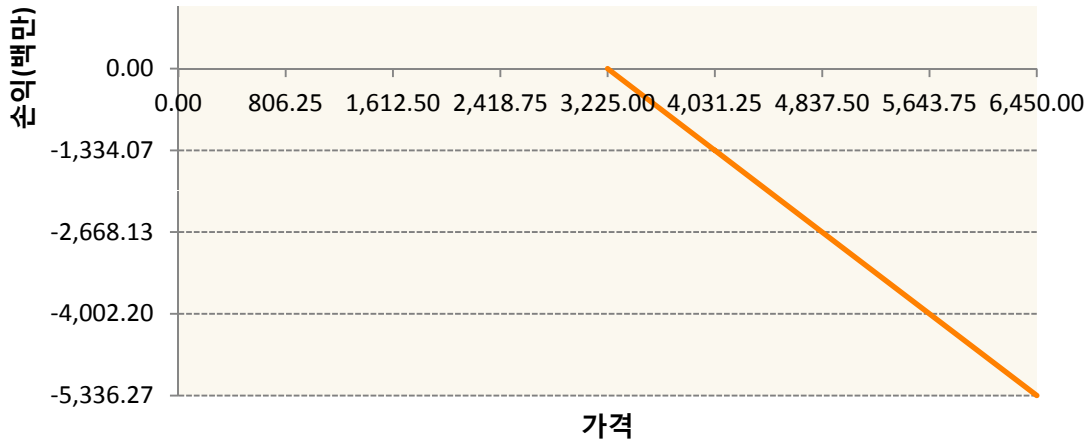
2. 만기시점의 손익구조

OESXX8-C3200-EURO STOXX 50

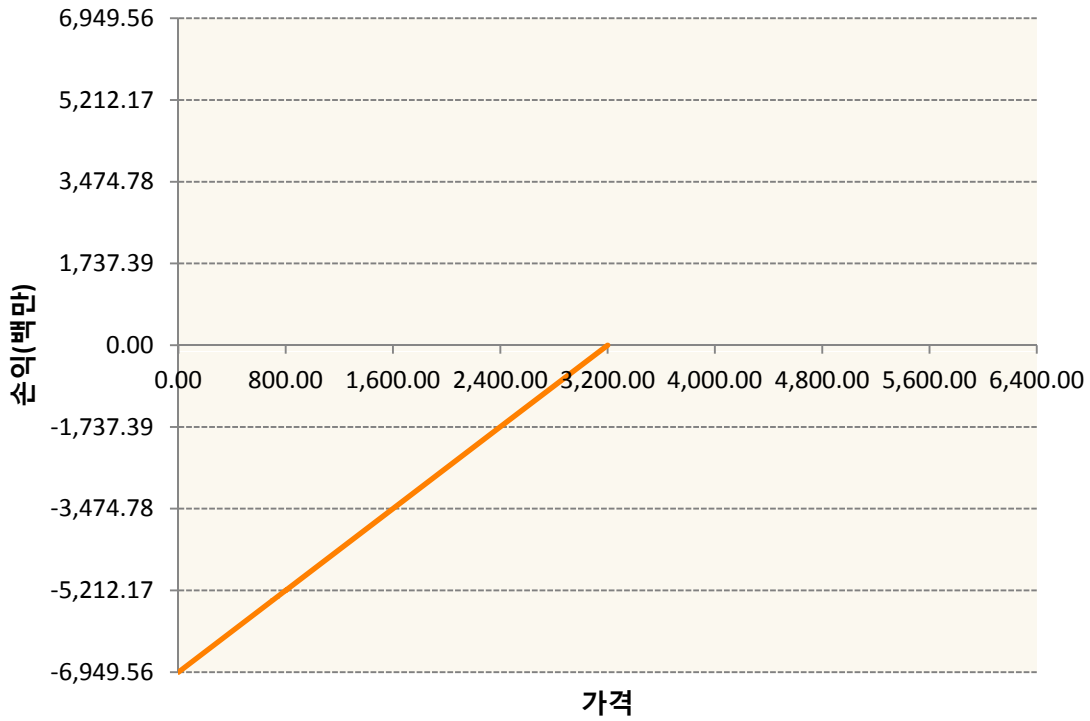


OESXX8-C3225-EURO STOXX 50

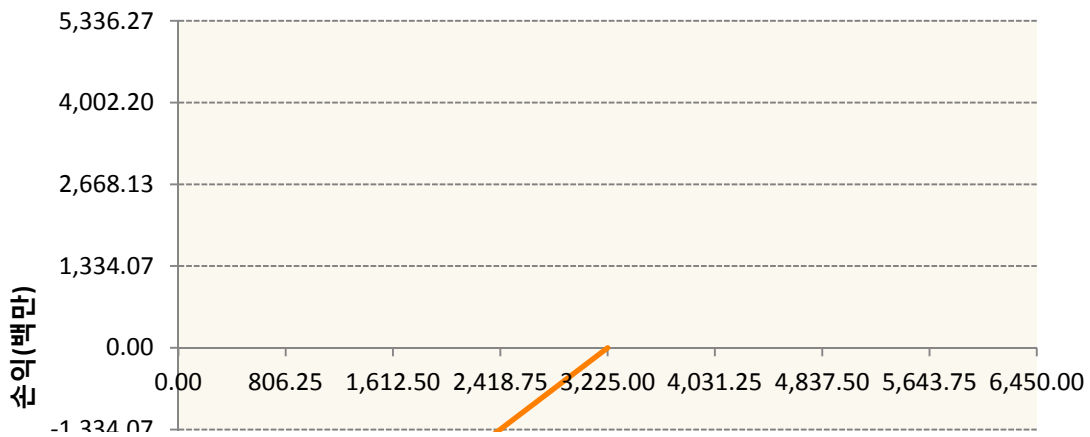


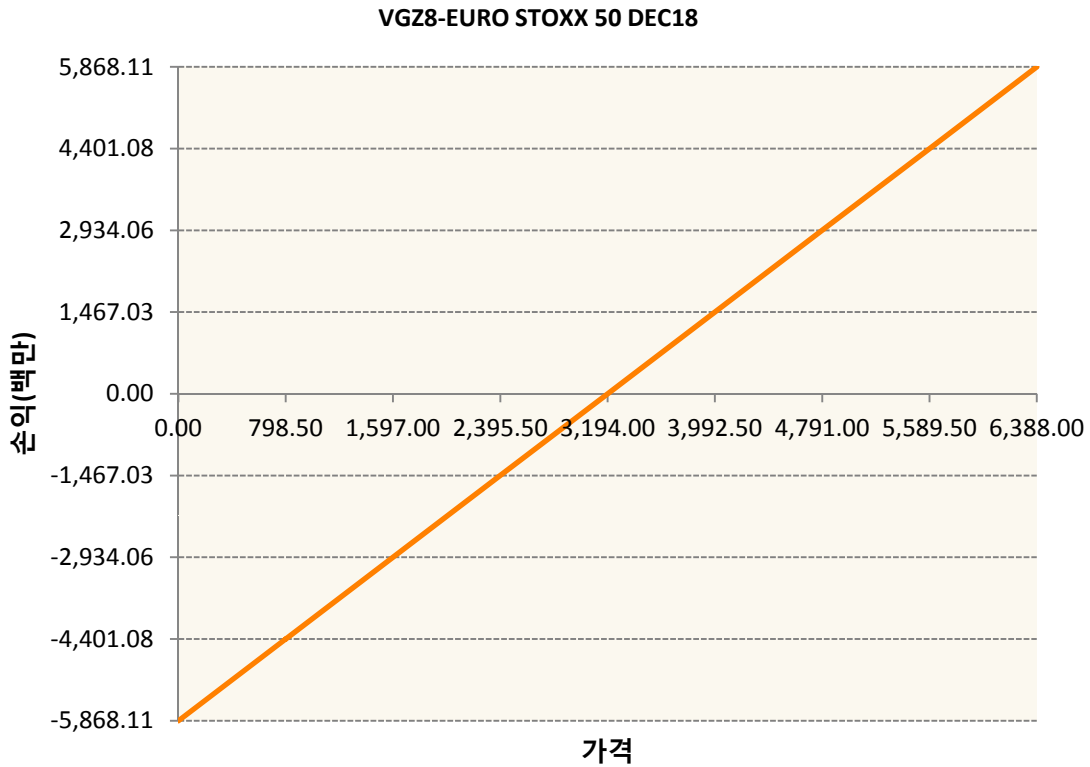


OESXX8-P3200-EURO STOXX 50



OESXX8-P3225-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY		68
OESXX8-C32 EURO STOXX 50		556
OESXX8-C32 EURO STOXX 50		427
OESXX8-P32 EURO STOXX 50		556
OESXX8-P32 EURO STOXX 50		427
VGZ8	EURO STOXX 50 DEC18	469

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,623

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

(단위:백만원)

1,090

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)

145

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

(단위:백만원)

39

공시일	2018-11-02
기준일	2018-11-01

리디파인K200(주식혼합-파생재간

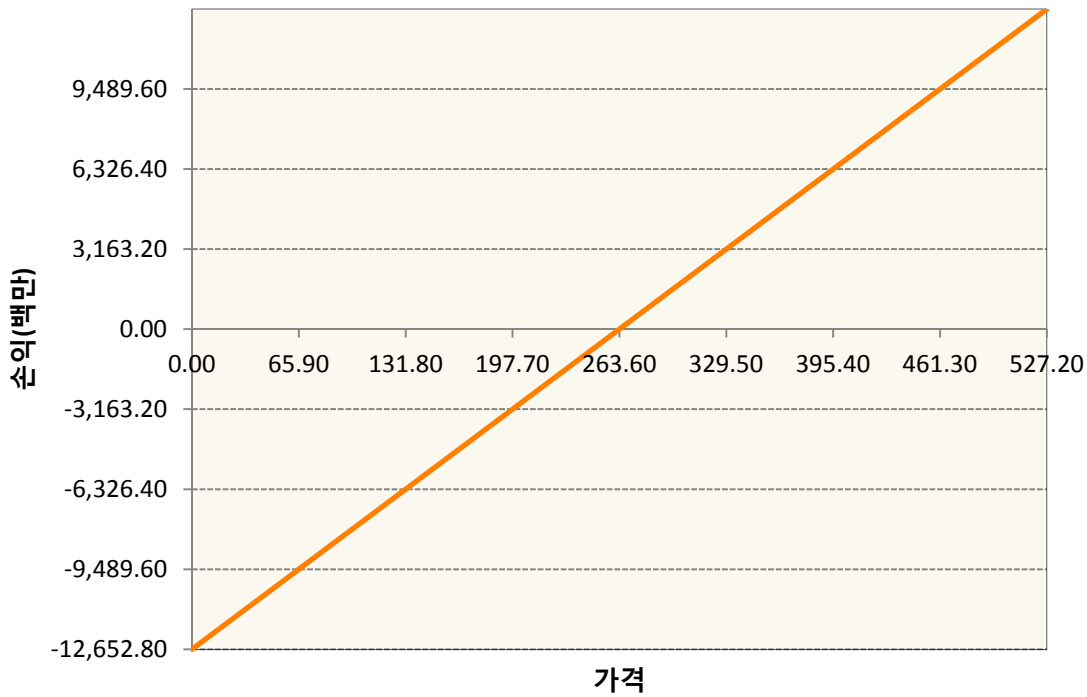
1. 계약금액

(단위:백만원)

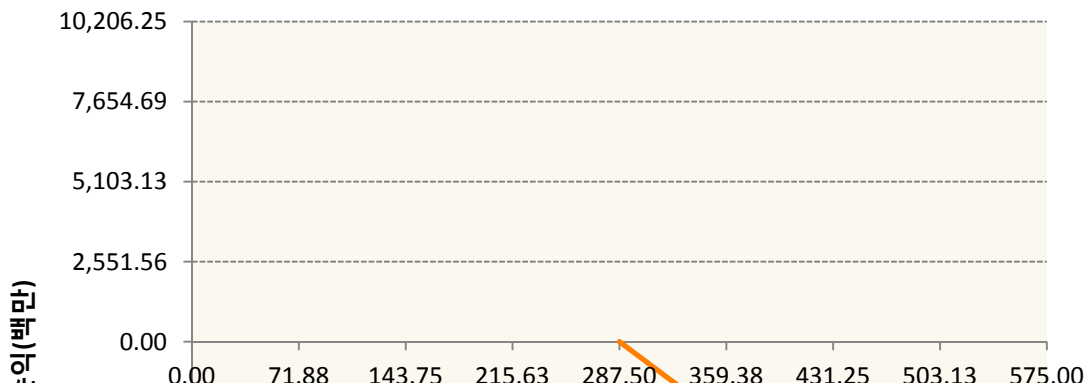
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,653	0	12,653	장내
누계	유가증권	옵션	4,059	23,401	-19,343	장내

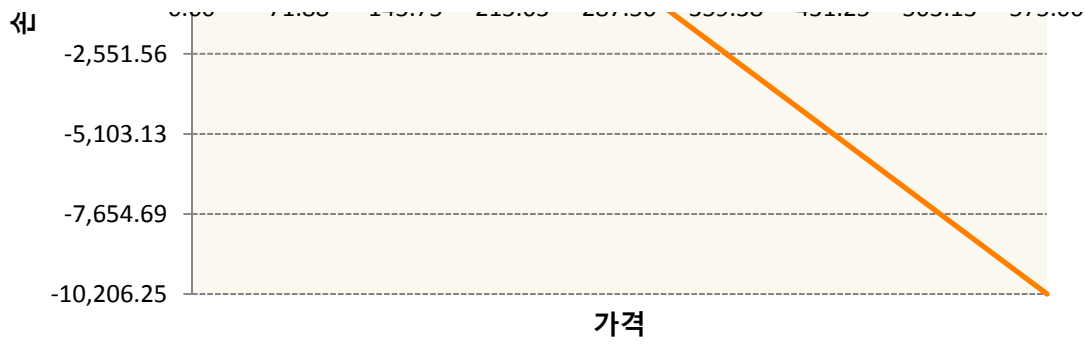
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

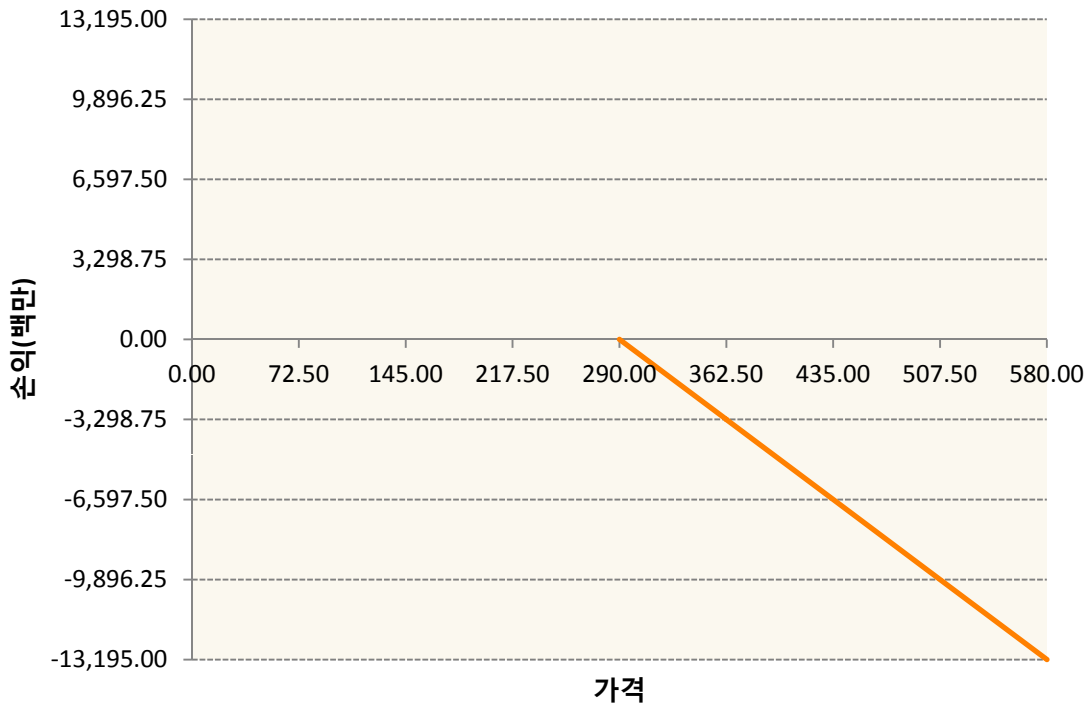


KR4201NB2877-2018-11 콜287.5

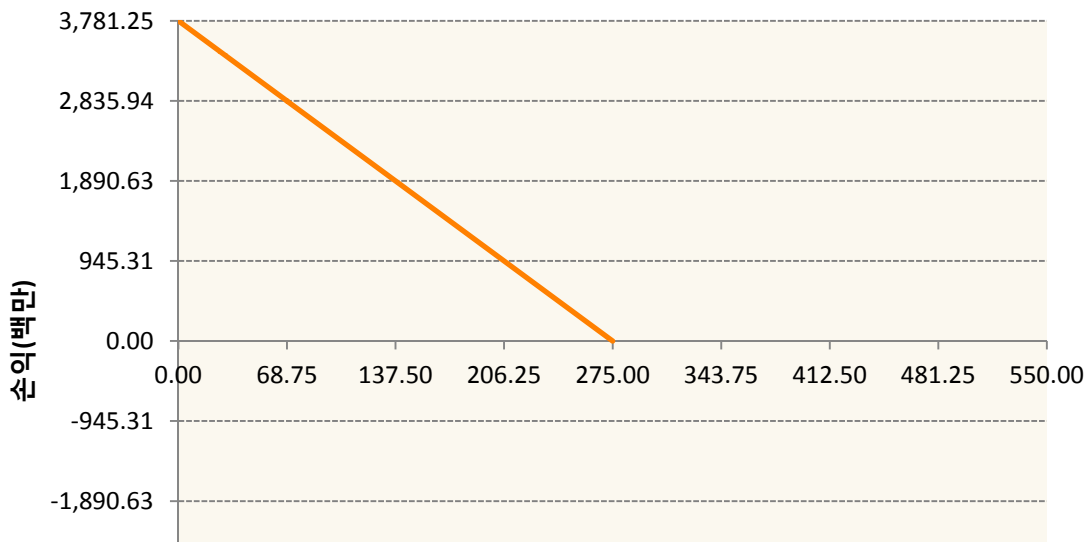


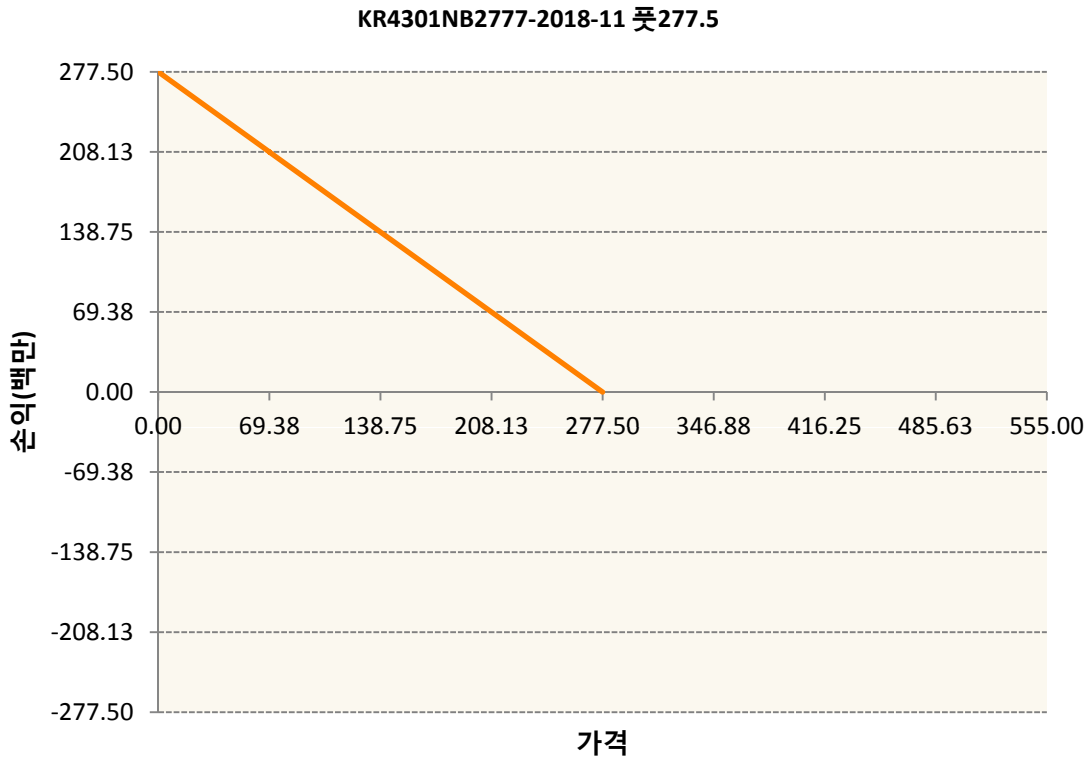
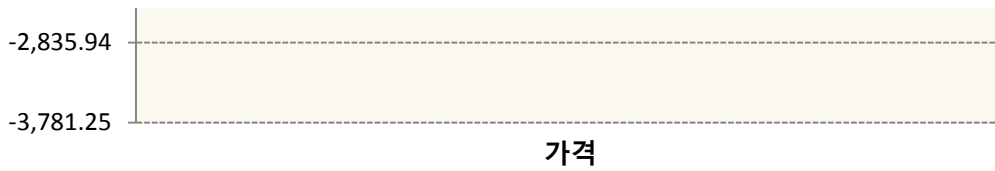


KR4201NB2901-2018-11 콜290



KR4301NB2751-2018-11 풋275





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 1,010

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,010	-1,010	-1,010	-1,010	-1,010	-1,010	-1,010
-5.33%	-673	-673	-673	-673	-673	-673	-673
-2.67%	-337	-337	-337	-337	-337	-337	-337
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	337	337	337	337	337	337	337
5.33%	673	673	673	673	673	673	673
8.00%	1,010	1,010	1,010	1,010	1,010	1,010	1,010

KR4201NB28 2018-11 콜287.5 137

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

0%	1	1	1	0	-1	-3	-5
2.67%	0	-2	-4	-7	-10	-15	-20
5.33%	-12	-18	-25	-33	-41	-50	-59
8.00%	-63	-75	-87	-100	-112	-124	-137

KR4201NB27 2018-11 콜290

136

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1
-2.67%	1	1	1	1	1	0	0
0%	1	1	0	0	-1	-2	-4
2.67%	0	-1	-3	-5	-8	-13	-18
5.33%	-8	-13	-20	-27	-36	-45	-55
8.00%	-50	-63	-77	-91	-106	-121	-136

KR4301NB27 2018-11 풋275

287

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	287	287	287	287	287	287	287
-5.33%	190	190	190	190	190	190	190
-2.67%	94	94	94	94	94	95	95
0%	-2	-1	-1	0	1	2	4
2.67%	-91	-88	-86	-83	-80	-77	-74
5.33%	-148	-145	-142	-138	-135	-131	-128
8.00%	-166	-165	-163	-162	-160	-158	-155

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	-7	-6	-6	-6	-6
5.33%	-12	-12	-12	-11	-11	-11	-11
8.00%	-14	-14	-14	-14	-14	-13	-13

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

(단위:백만원)

1,187

공시일	2018-11-02
기준일	2018-11-01

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

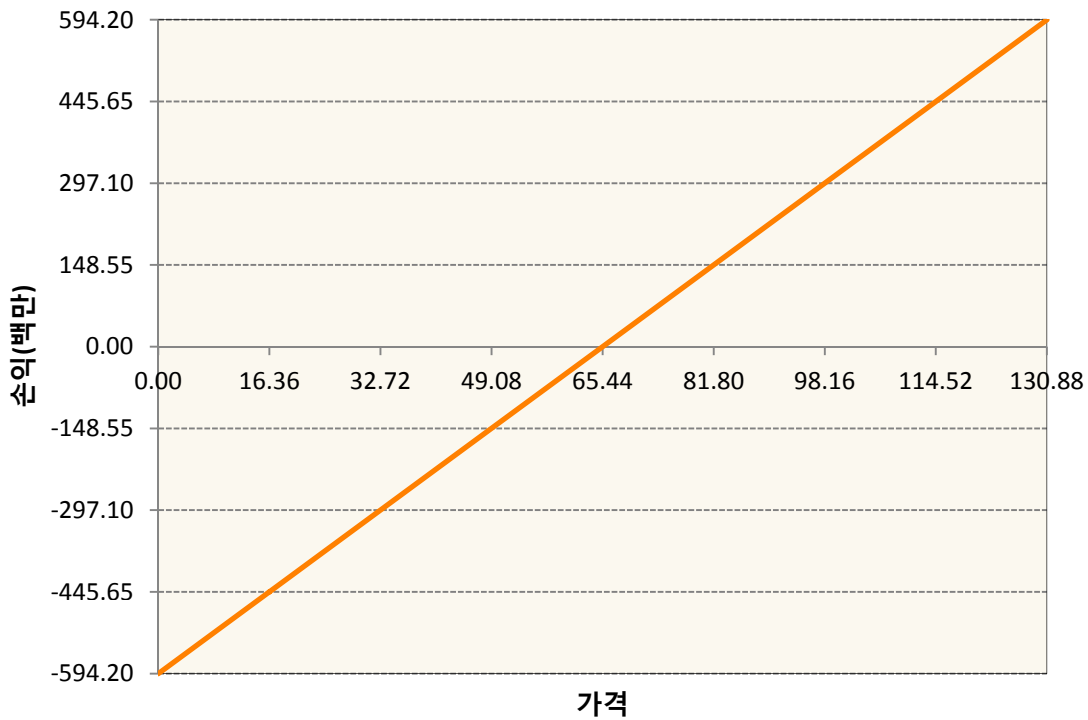
1. 계약금액

(단위:백만원)

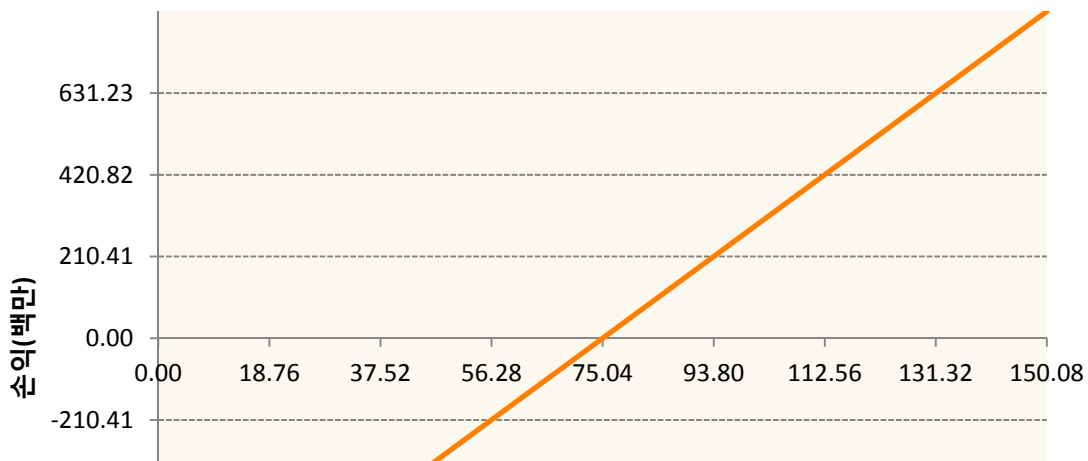
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,294	409	2,885	

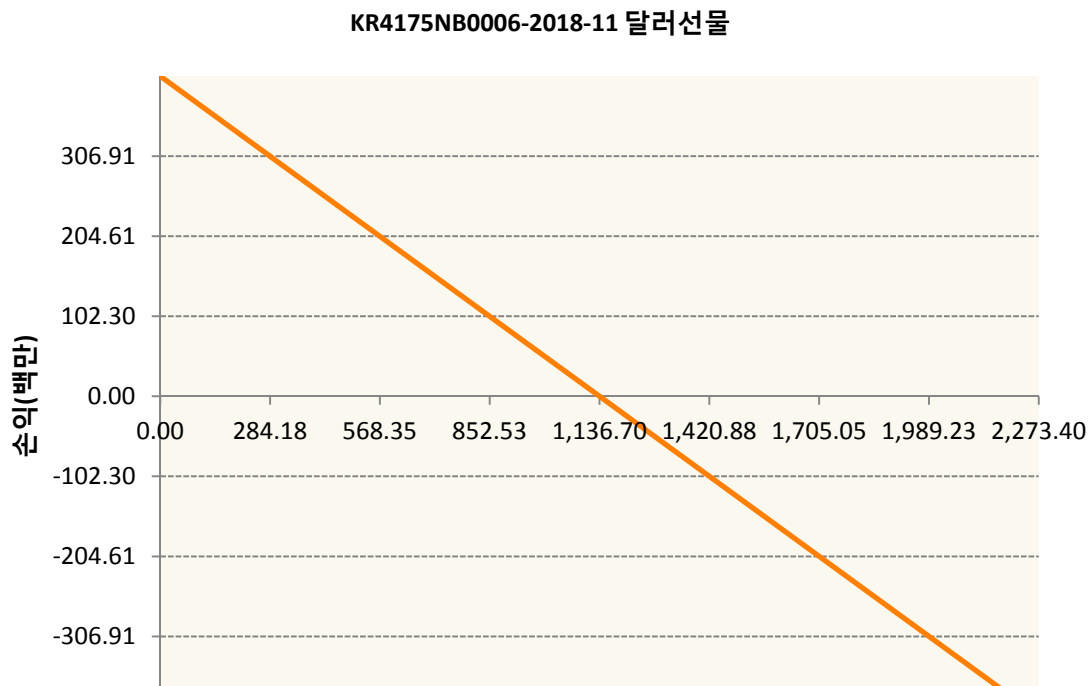
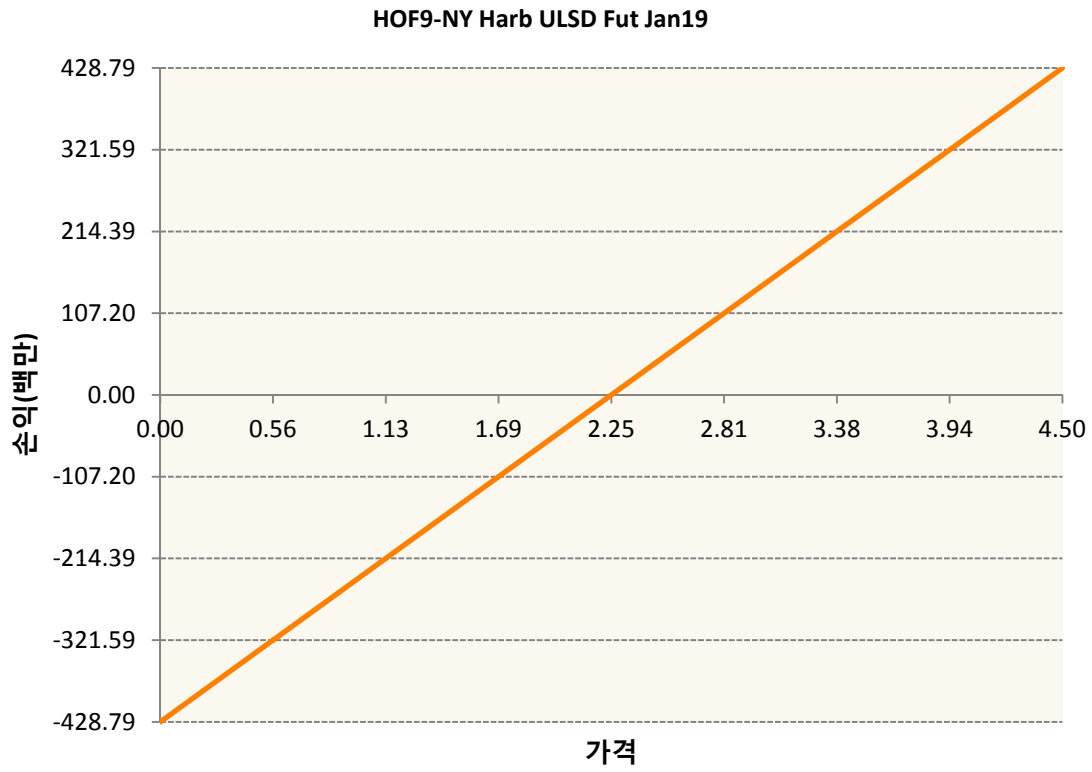
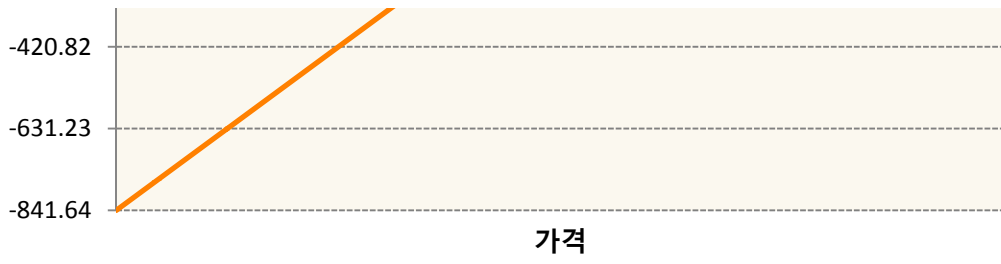
2. 만기시점의 손익구조

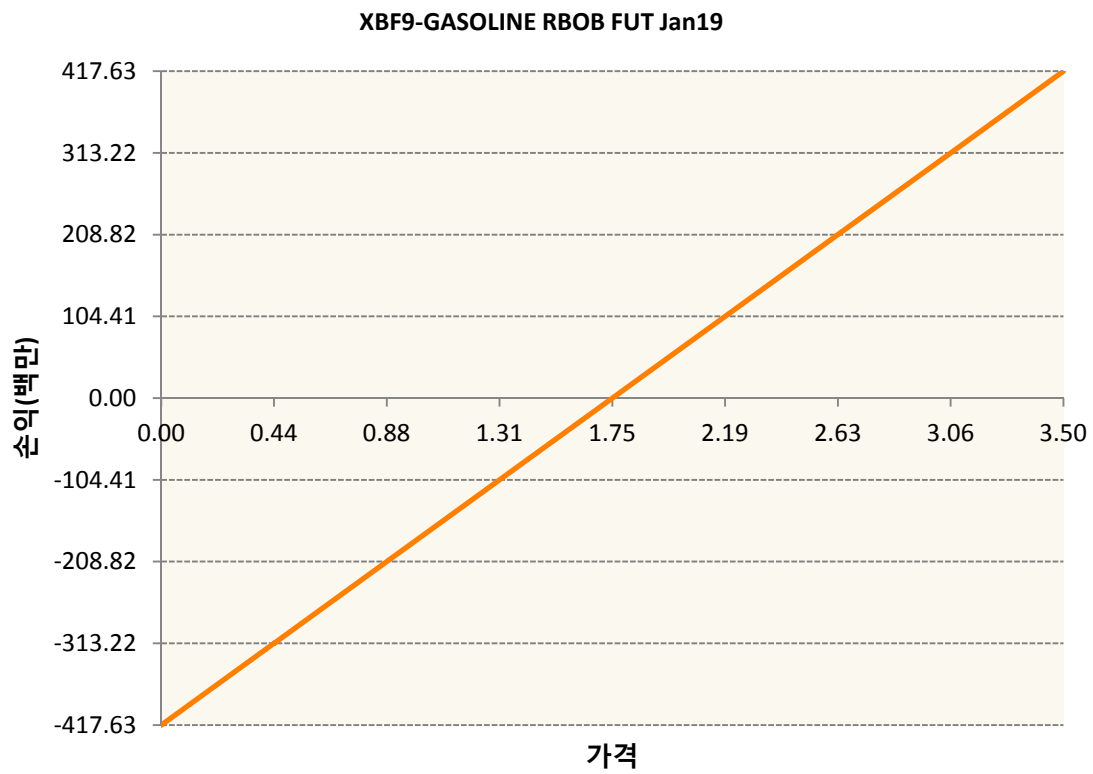
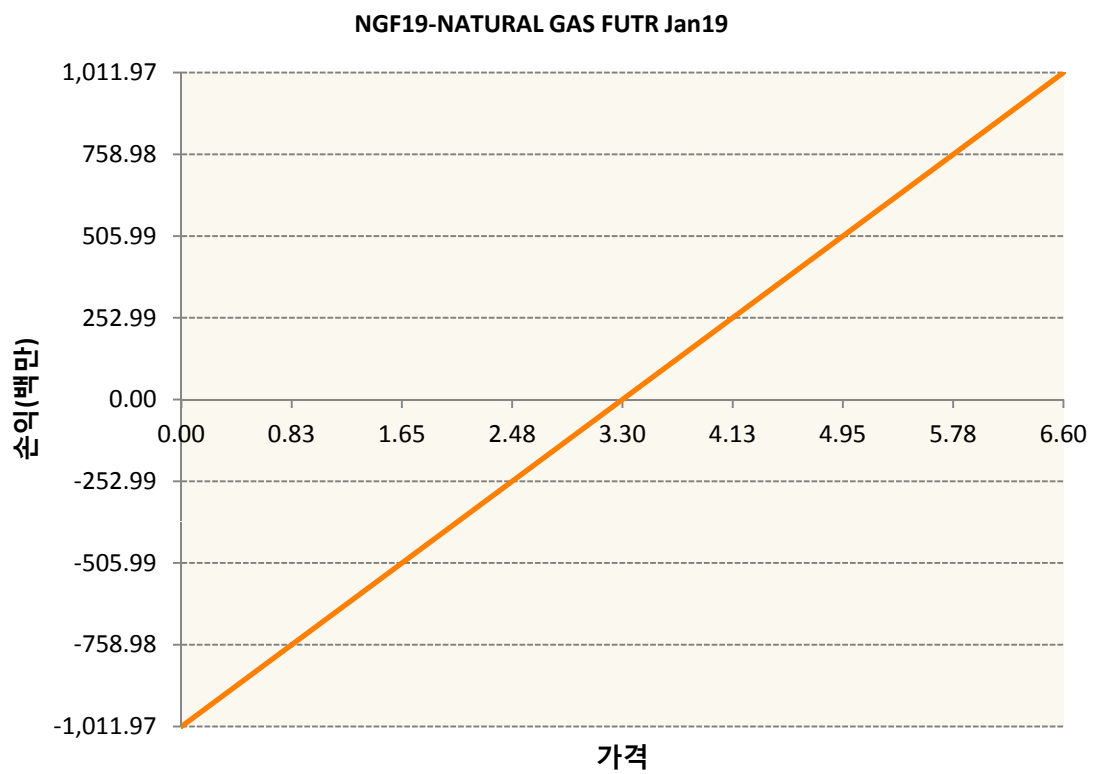
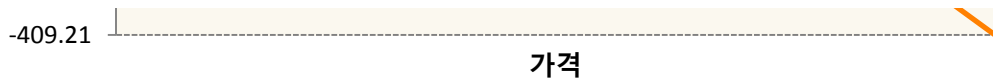
CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19



COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF9	WTI CRUDE FUTURE Jan19	48
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	67
HOF9	NY Harb ULSD Fut Jan19	34
KR4175NB0(2018-11 달러선물		33
NGF19	NATURAL GAS FUTR Jan19	81
XBF9	GASOLINE RBOB FUT Jan19	33

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

397

공시일	2018-11-02
기준일	2018-11-01

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

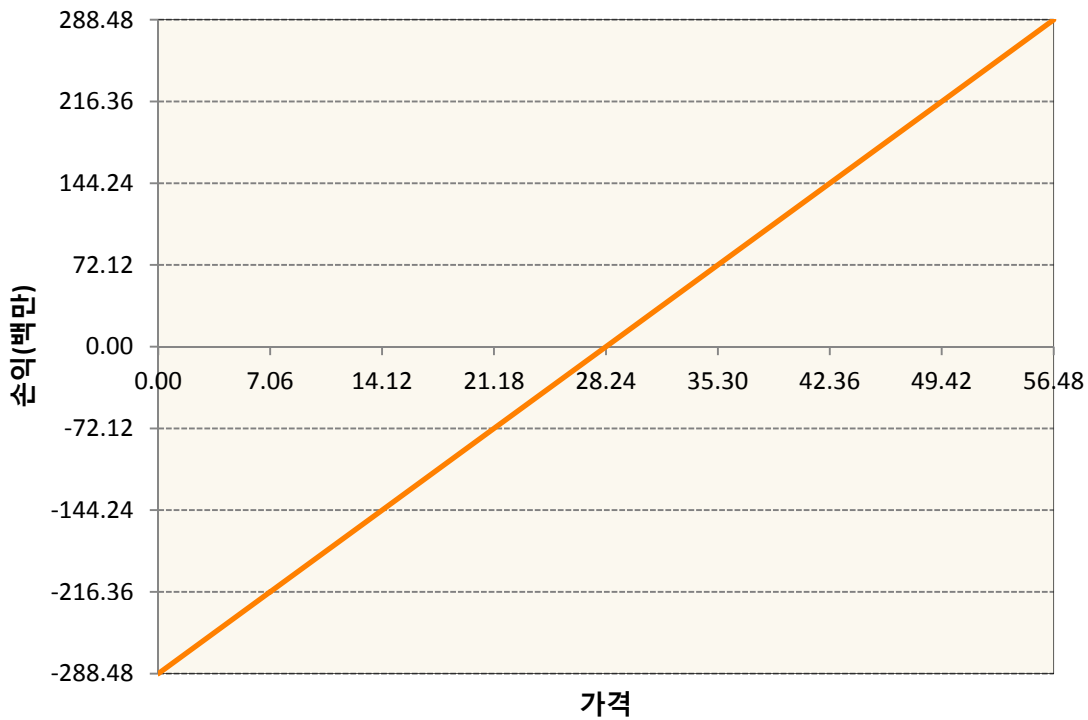
1. 계약금액

(단위:백만원)

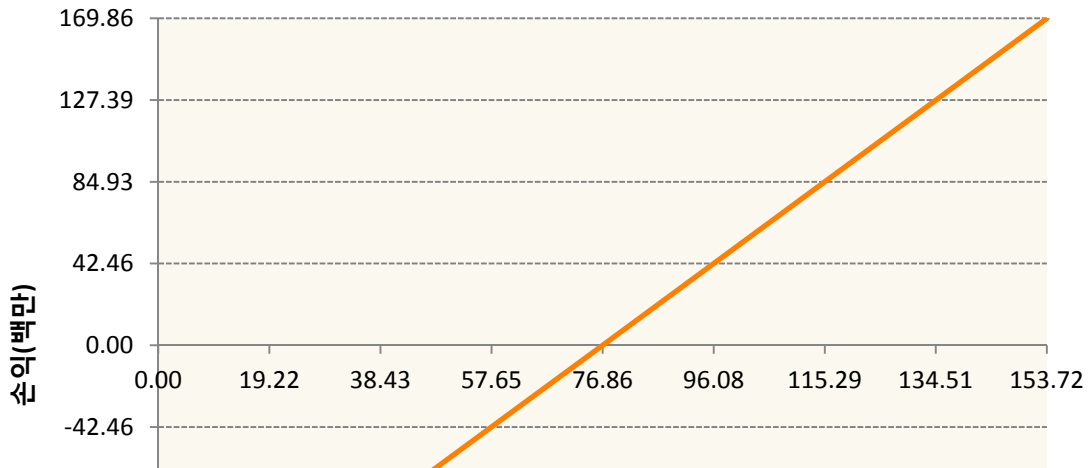
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,536	80	3,457	

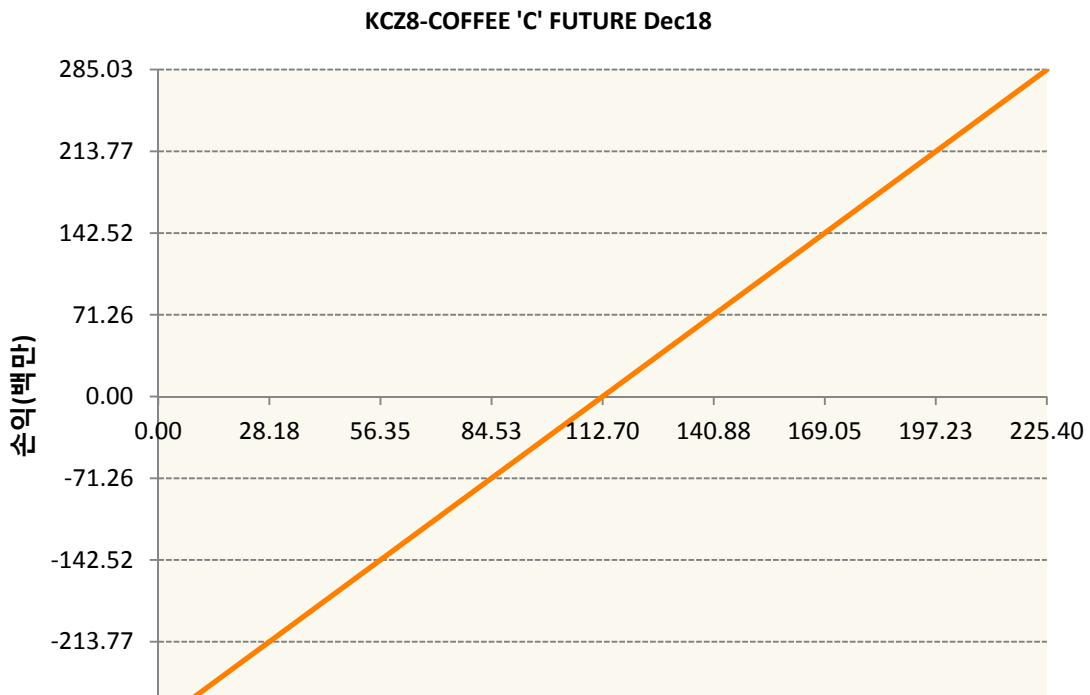
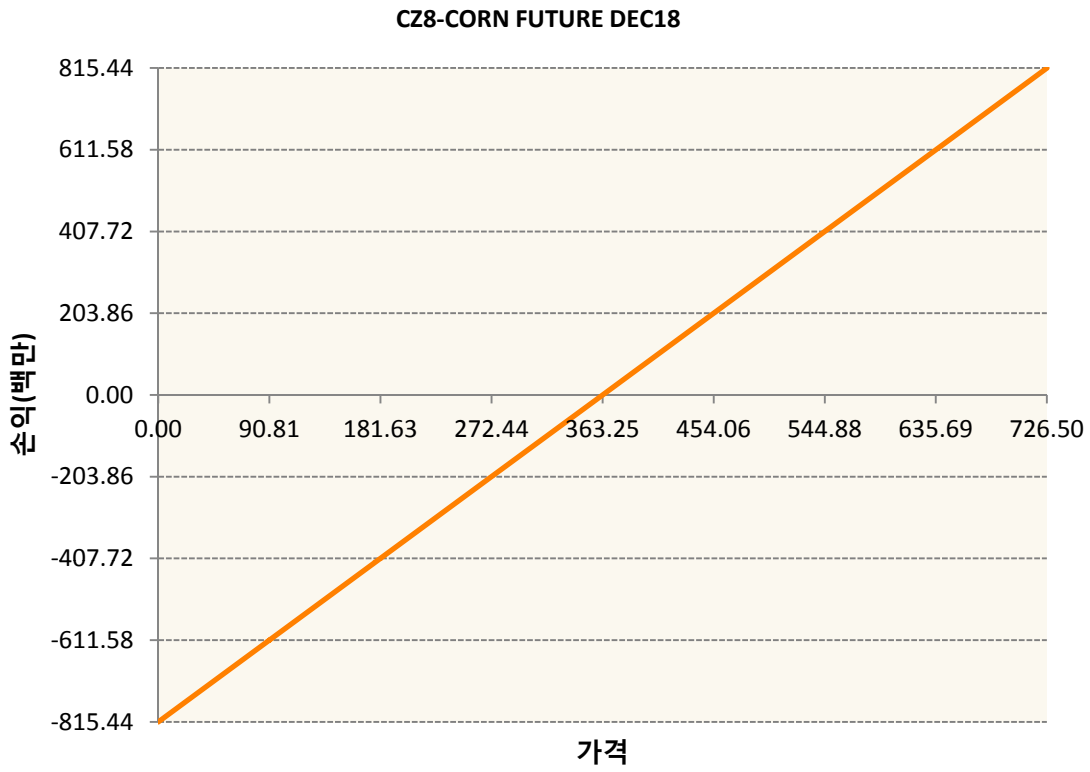
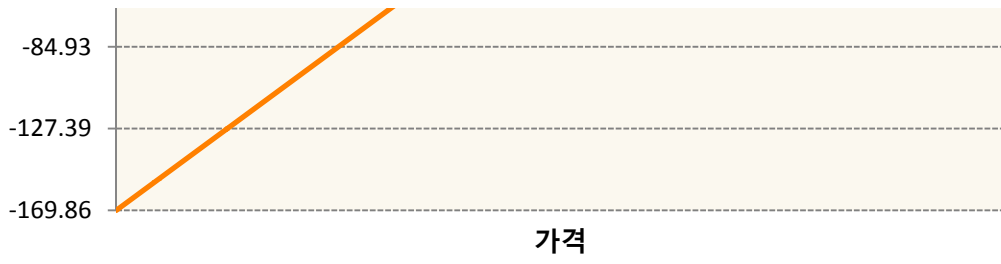
2. 만기시점의 손익구조

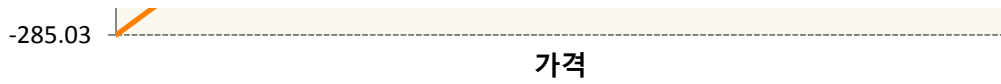
BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19



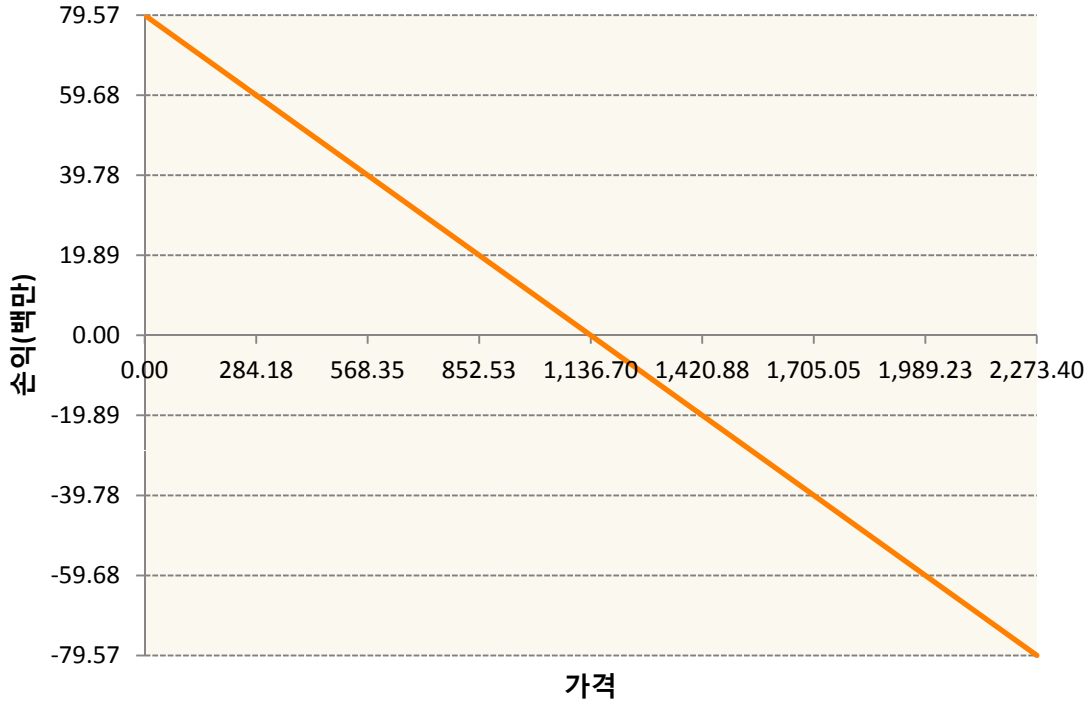
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



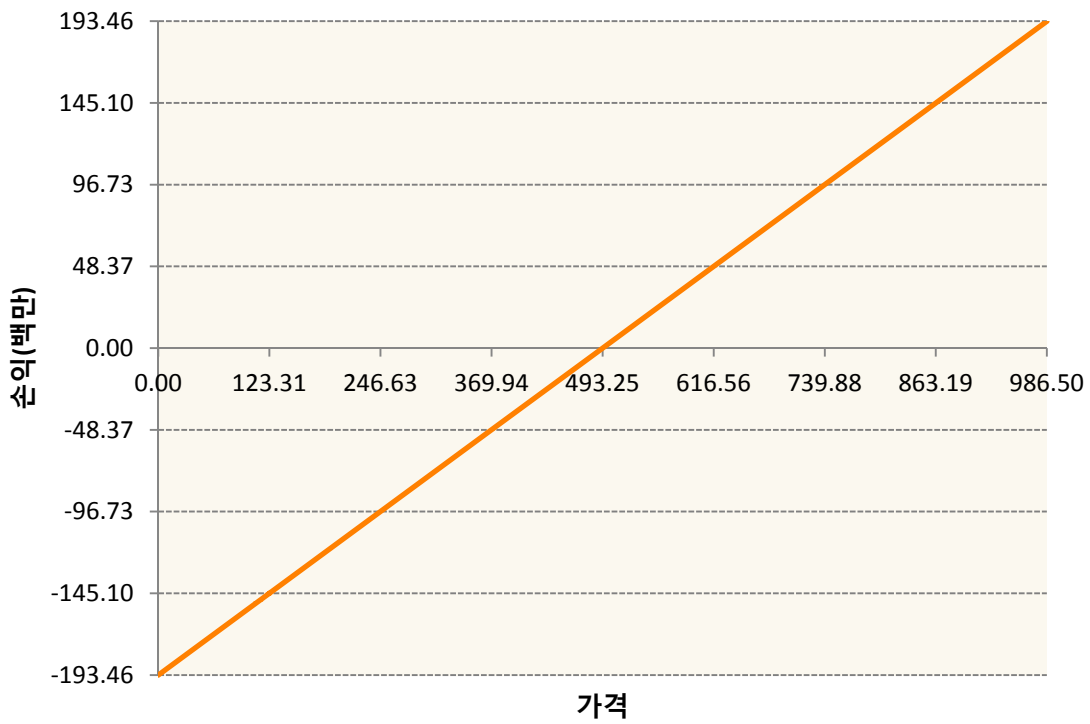




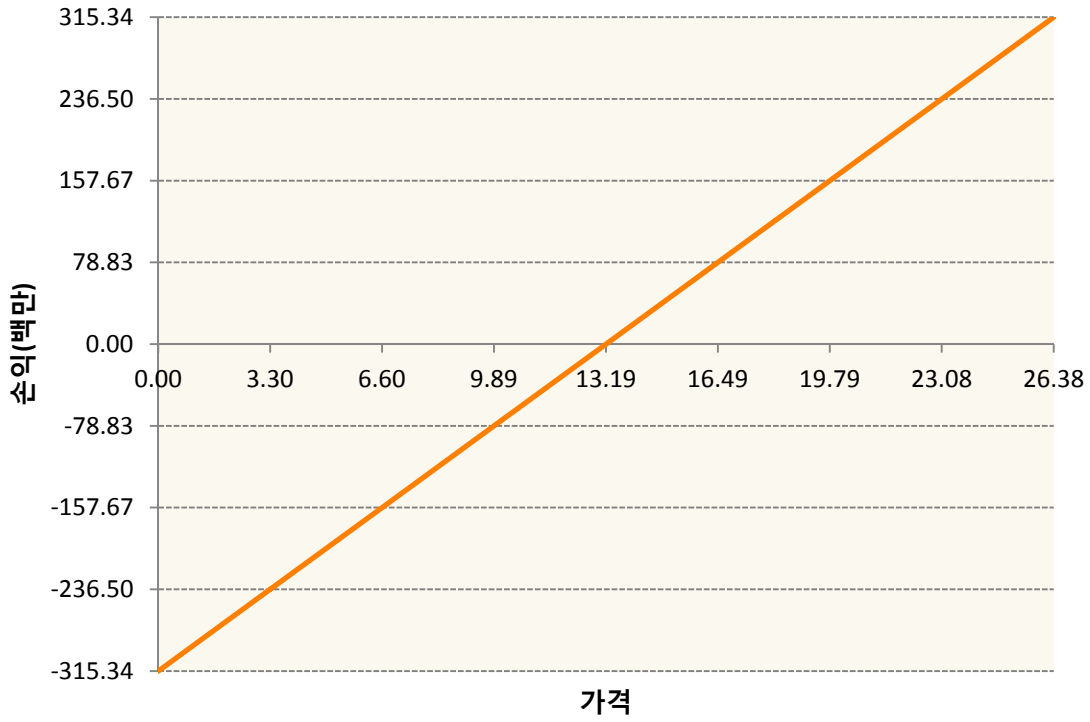
KR4175NB0006-2018-11 달러선물



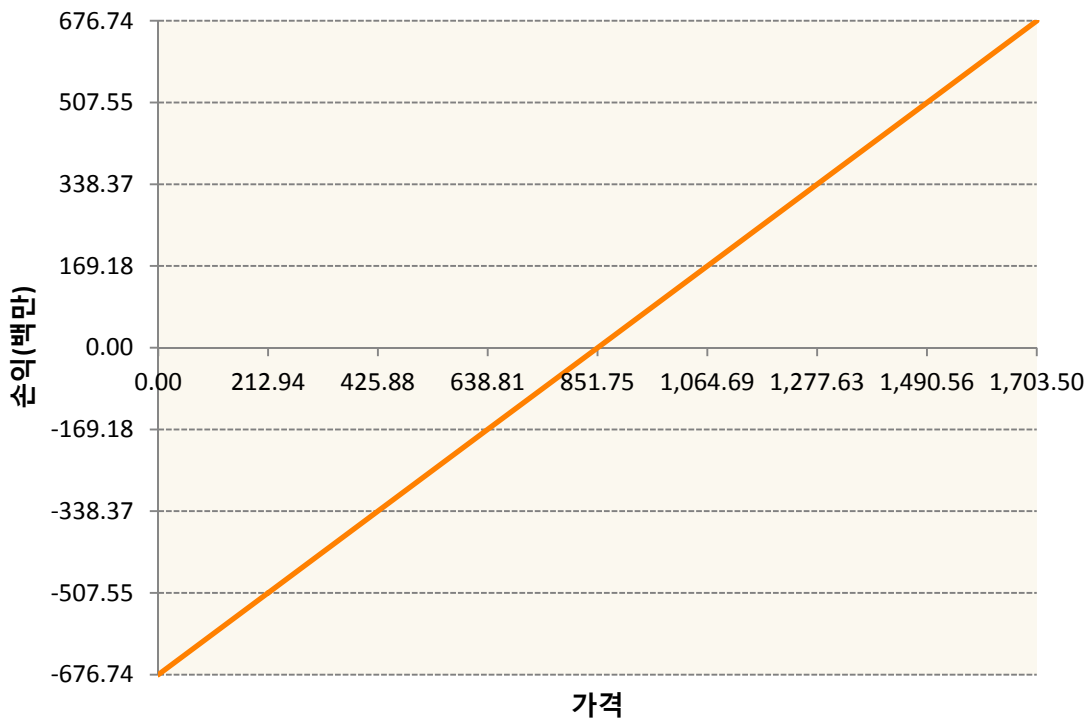
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

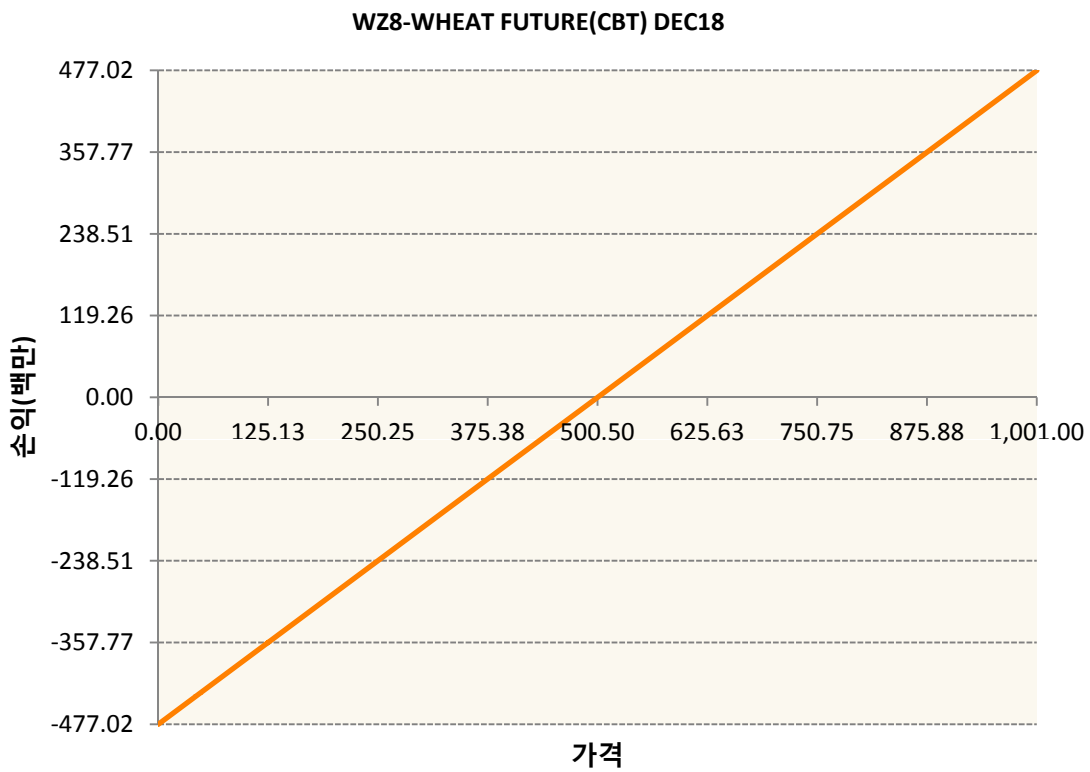
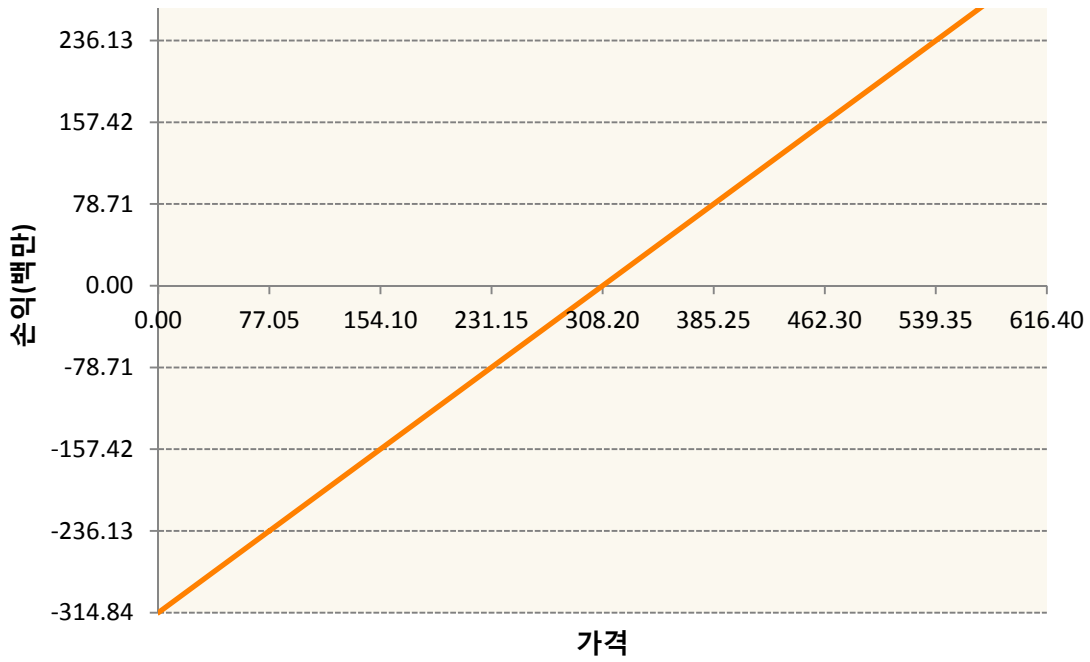


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19



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	65
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	23
KR4175NB0(2018-11 달러선물	6

KWZ8	KC HRW WHEAT FUT DEC18	15
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	25
SF9	SOYBEAN FUTURE Jan19	54
SMF9	SOYBEAN MEAL FUTR Jan19	25
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	38

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

(단위:백만원)

308