

공시일	2018-11-05
기준일	2018-11-02

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)

70

공시일	2018-11-05
기준일	2018-11-02

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

1,086

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

512

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-11-05
기준일	2018-11-02

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

270

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

380

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-11-05
기준일	2018-11-02

유로인덱스모(주식-파생형)

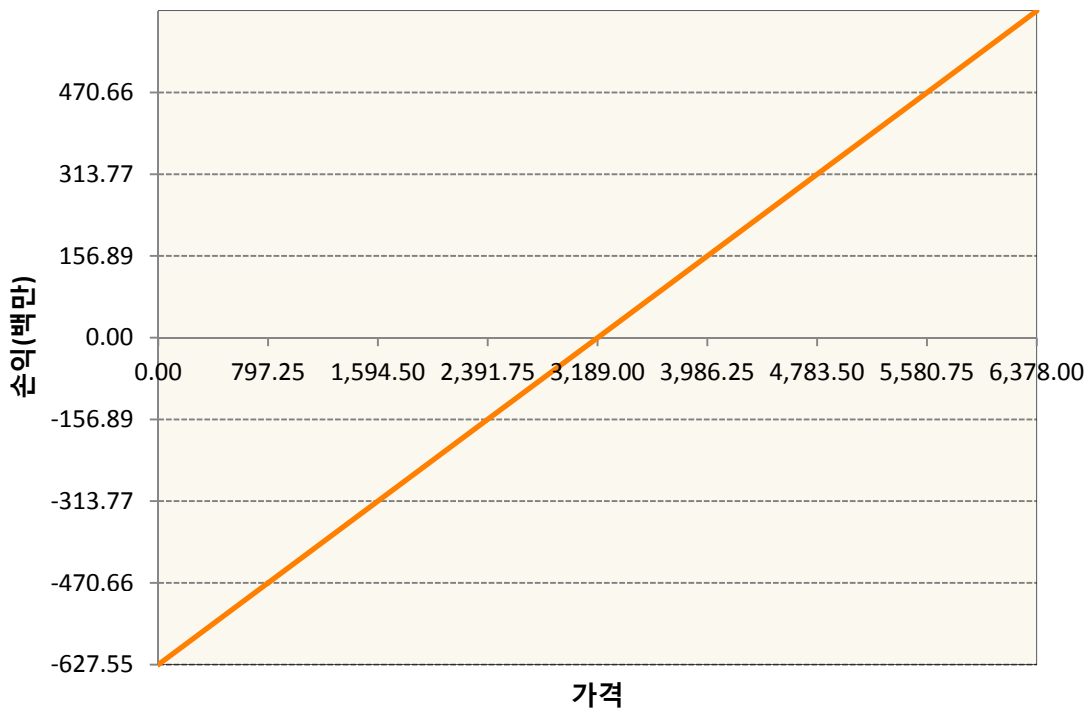
1. 계약금액

(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	2018-11-05
기준일	2018-11-02

차이나인덱스모(주식-파생형)

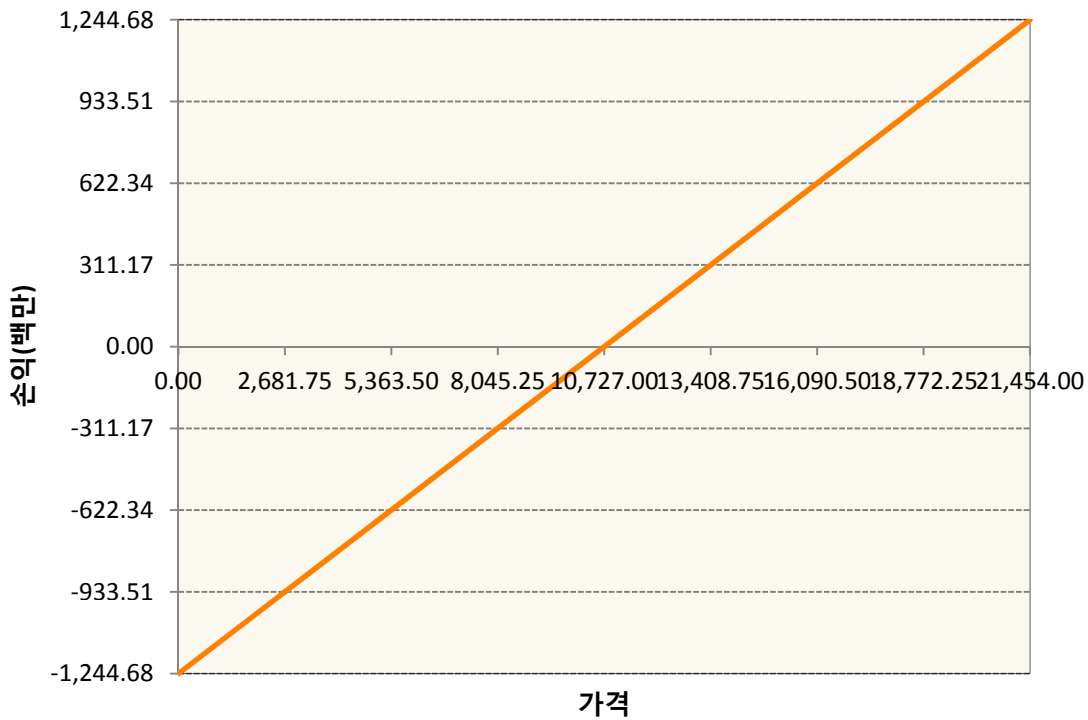
1. 계약금액

(단위:백만원)

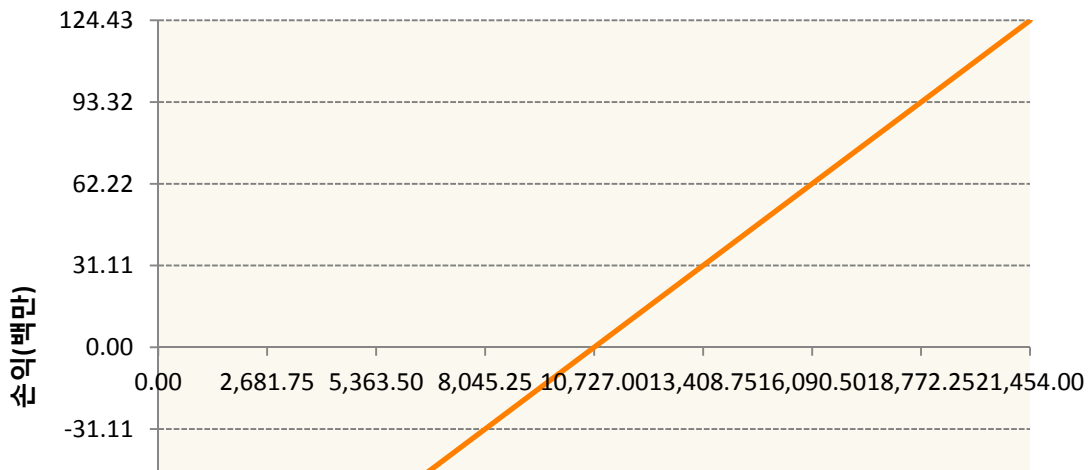
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,369	0	1,369	장내

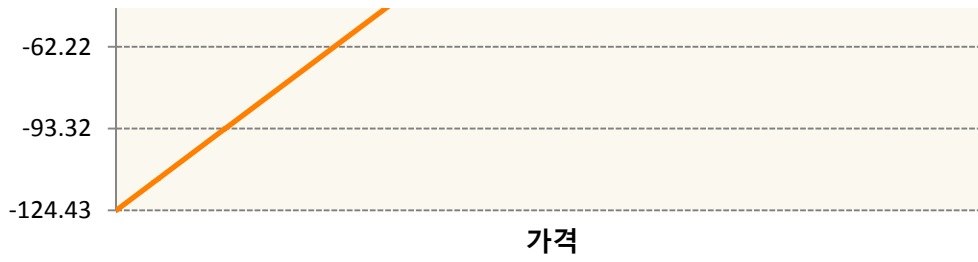
2. 만기시점의 손익구조

HCX8-HSCEI FUTURES NOV 18



MHCX8-MINI H-SHR IDX FU NOV 18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCX8	HSCEI FUTURES NOV 18	100
MHCX8	MINI H-SHR IDX FU NOV 18	10

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

106

공시일	2018-11-05
기준일	2018-11-02

커버드콜모(주식혼합-파생형)

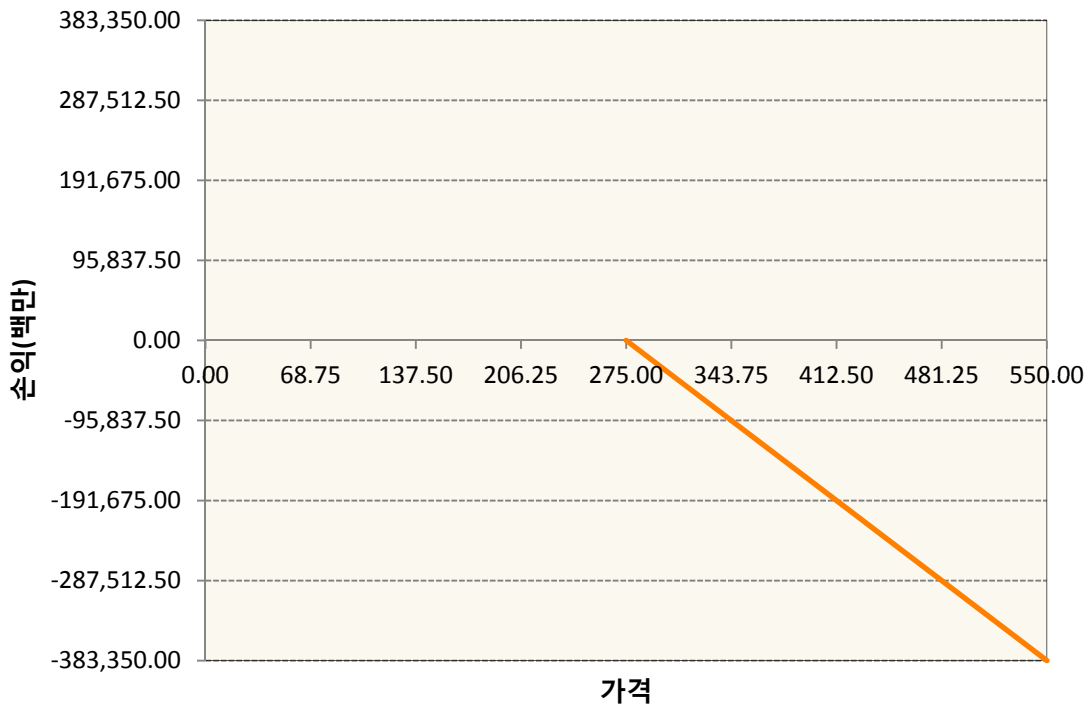
1. 계약금액

(단위:백만원)

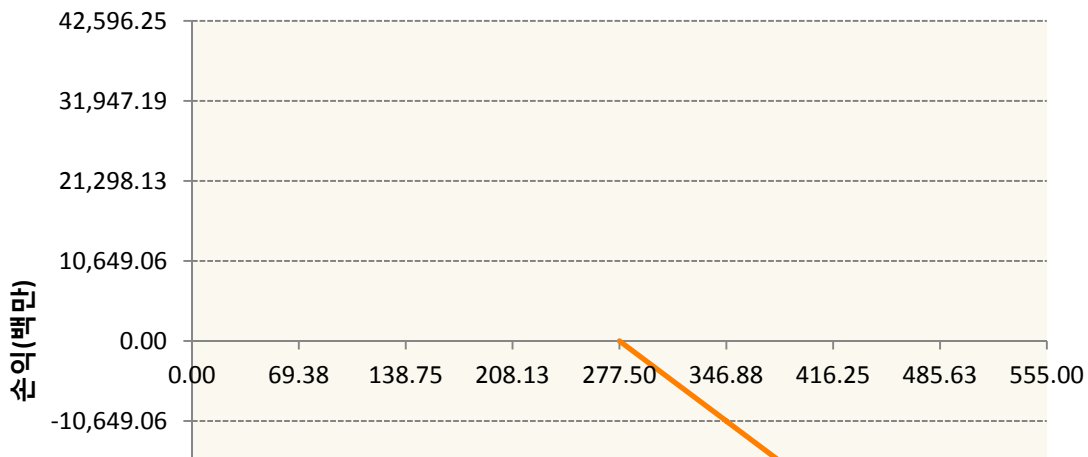
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	721,571	-721,571	장내

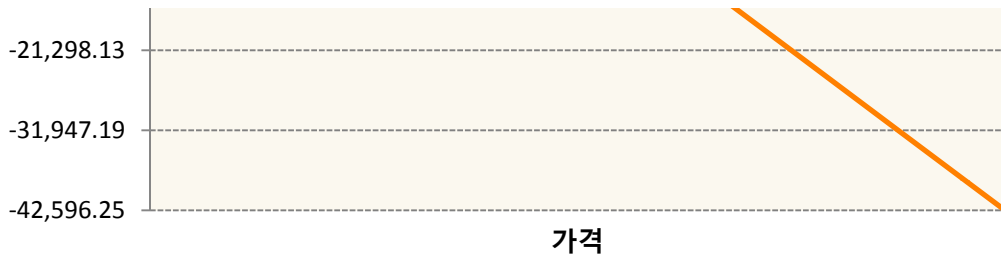
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

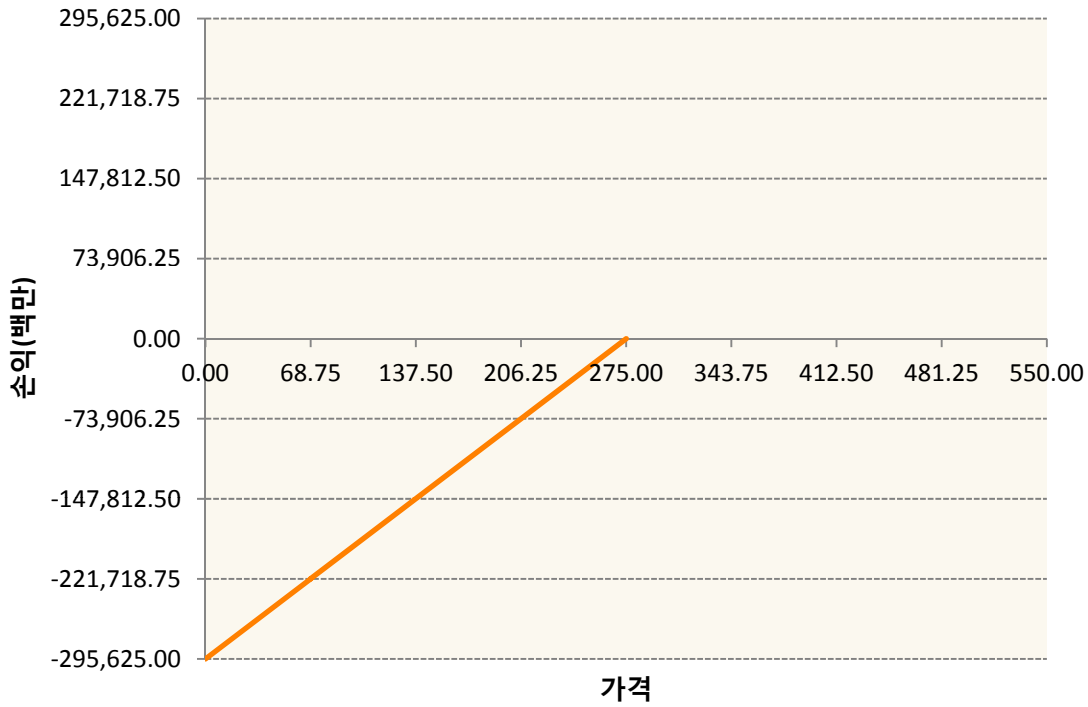


KR4201NB2778-2018-11 콜277.5





KR4301NB2751-2018-11 풋275



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NB27 2018-11 콜275

23,630

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,756	3,755	3,750	3,741	3,724	3,698	3,660
-5.33%	3,734	3,704	3,656	3,587	3,496	3,382	3,246
-2.67%	3,380	3,195	2,979	2,736	2,470	2,185	1,884
0%	1,267	848	426	0	-428	-858	-1,289
2.67%	-4,470	-4,837	-5,218	-5,609	-6,008	-6,413	-6,824
5.33%	-13,277	-13,412	-13,579	-13,777	-14,001	-14,249	-14,518
8.00%	-23,207	-23,229	-23,267	-23,325	-23,404	-23,506	-23,630

KR4201NB27 2018-11 콜277.5

2,379

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	282	282	282	281	281	279	276

-5.33%	281	280	277	273	266	258	247
-2.67%	264	251	235	216	193	168	141
0%	123	83	42	0	-43	-87	-132
2.67%	-362	-409	-457	-505	-553	-602	-650
5.33%	-1,238	-1,261	-1,288	-1,318	-1,351	-1,385	-1,421
8.00%	-2,306	-2,312	-2,319	-2,330	-2,344	-2,360	-2,379

KR4301NB27 2018-11 풋275

21,729

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21,726	-21,726	-21,726	-21,726	-21,726	-21,727	-21,729
-5.33%	-13,916	-13,917	-13,919	-13,924	-13,934	-13,948	-13,969
-2.67%	-6,151	-6,191	-6,245	-6,315	-6,398	-6,495	-6,604
0%	646	435	219	0	-222	-445	-670
2.67%	3,865	3,706	3,535	3,355	3,166	2,970	2,770
5.33%	4,338	4,319	4,288	4,245	4,188	4,119	4,037
8.00%	4,354	4,354	4,352	4,349	4,343	4,332	4,315

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

(단위:백만원)

55,188

공시일	2018-11-05
기준일	2018-11-02

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

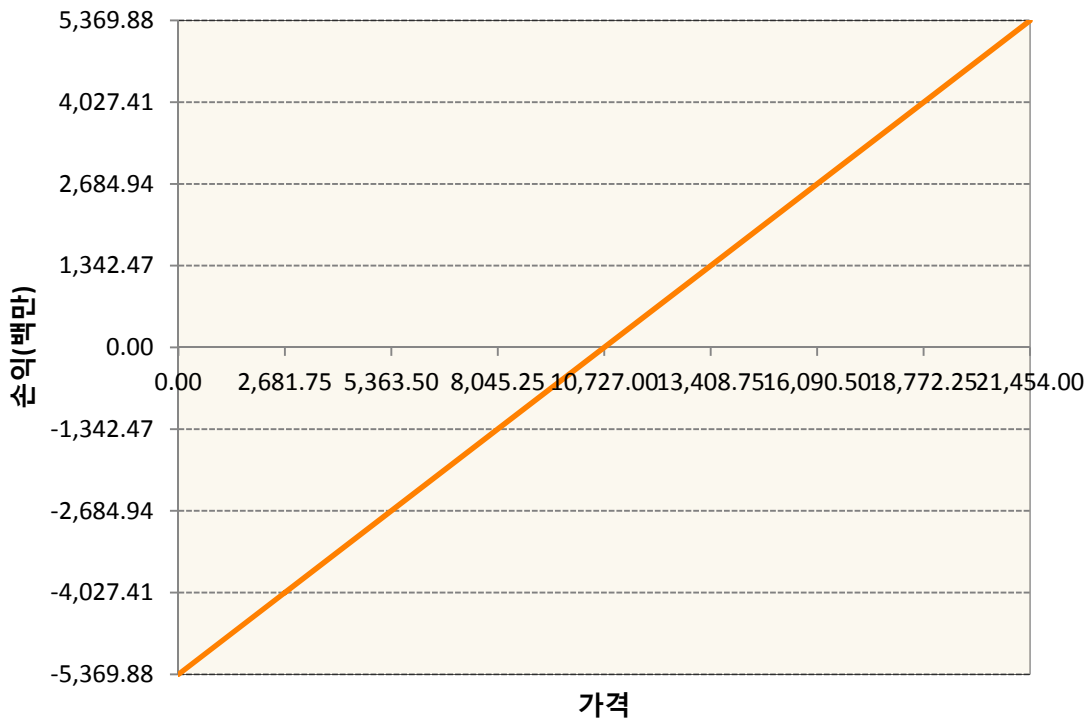
1. 계약금액

(단위:백만원)

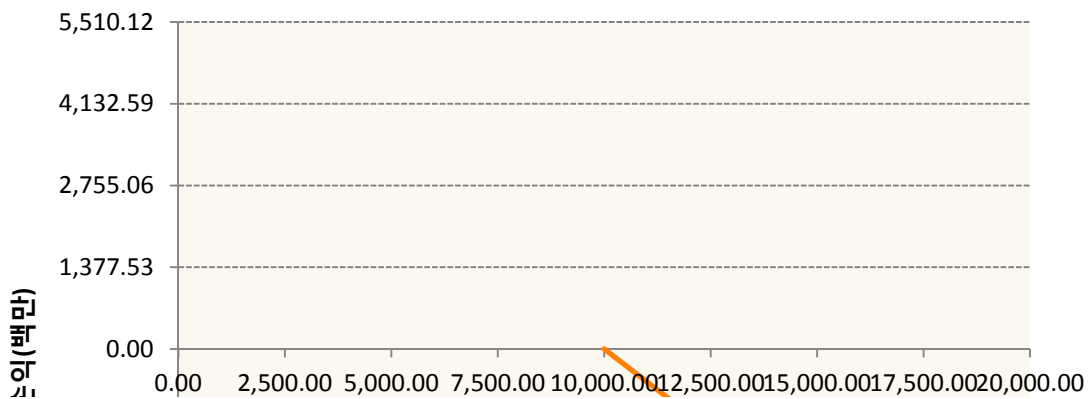
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,370	0	5,370	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,020	-11,020	장내

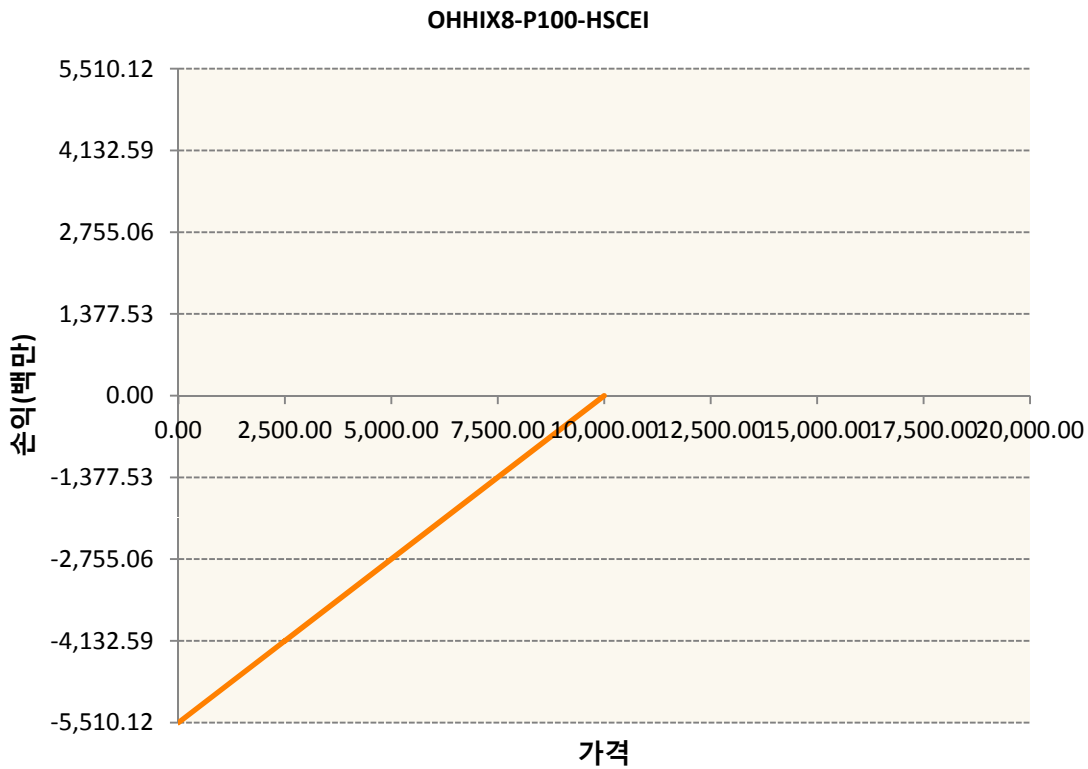
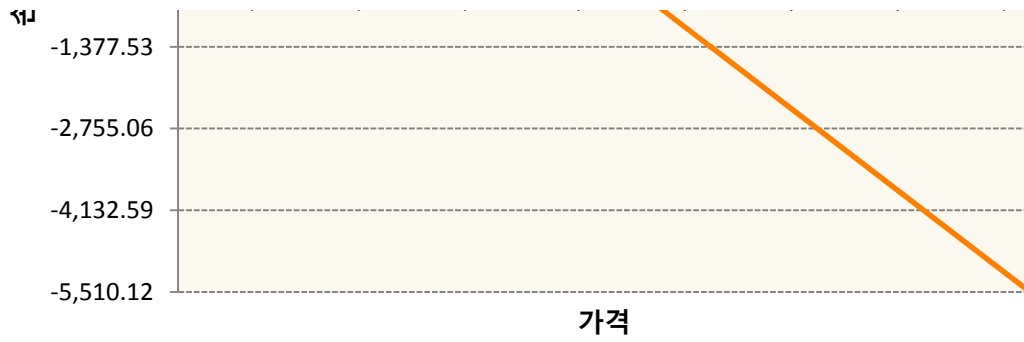
2. 만기시점의 손익구조

HCX8-HSCEI FUTURES NOV 18



OHHIX8-C100-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCX8	HSCEI FUTURES NOV 18	430
OHHIX8-C1C	HSCEI	441
OHHIX8-P10	HSCEI	441

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

1,270

공시일	2018-11-05
기준일	2018-11-02

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

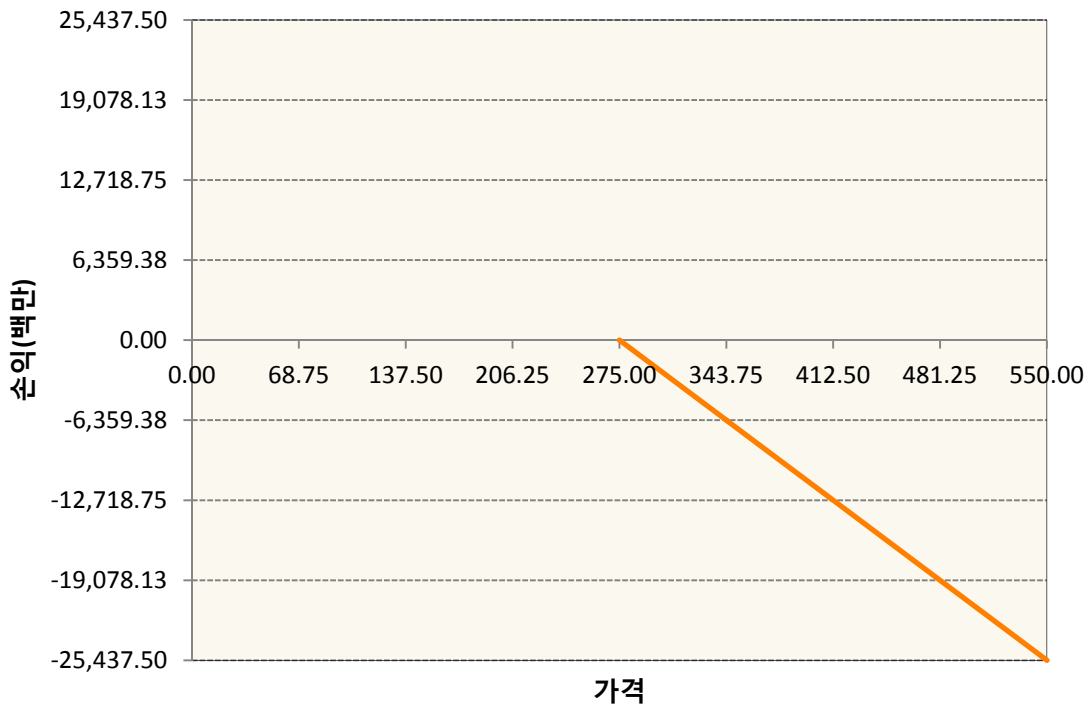
1. 계약금액

(단위:백만원)

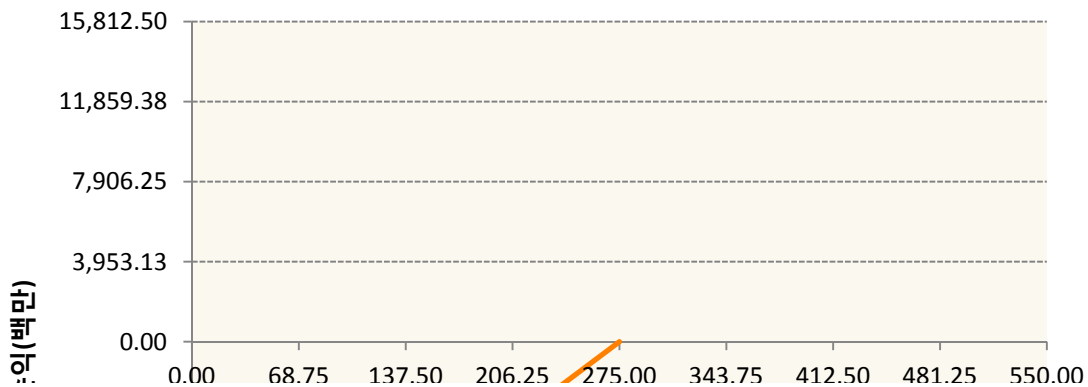
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	43,836	0	43,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	44,025	-44,025	장내

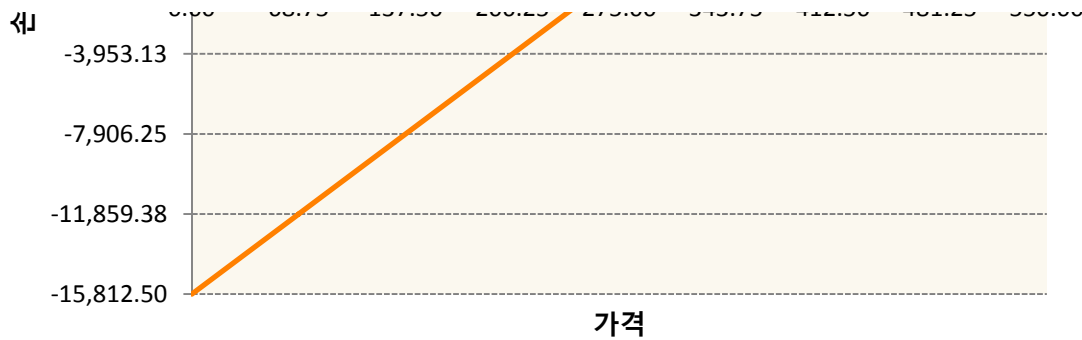
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

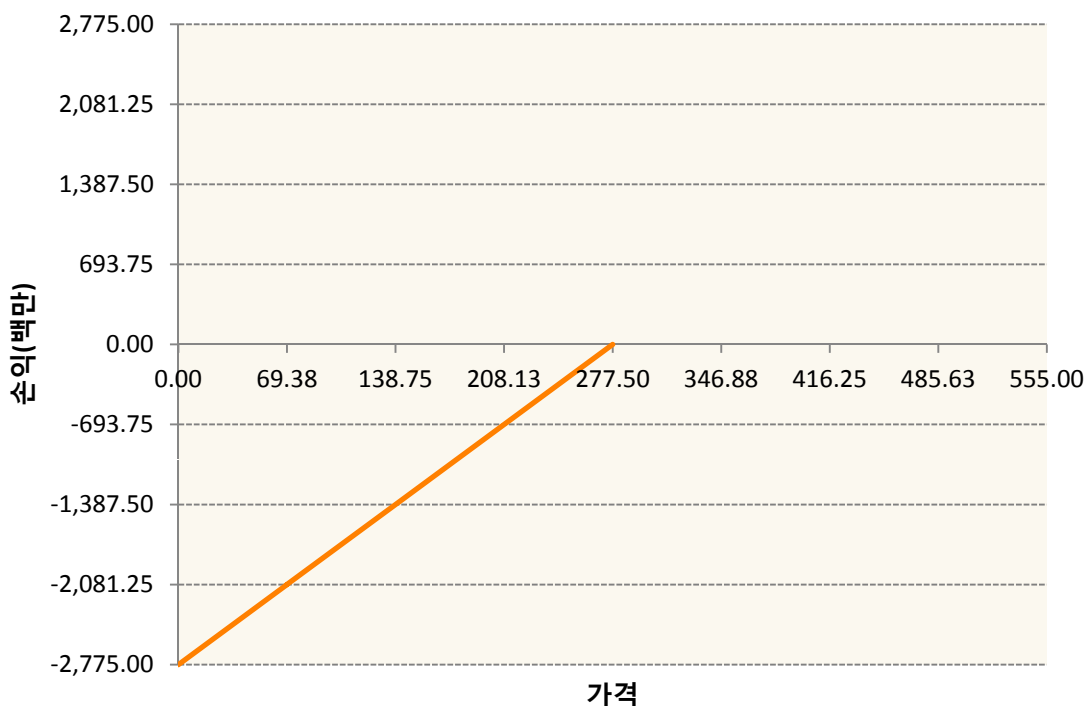


KR4301NB2751-2018-11 풋275





KR4301NB2777-2018-11 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,588
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,588	-3,588	-3,588	-3,588	-3,588	-3,588	-3,588
-5.33%	-2,392	-2,392	-2,392	-2,392	-2,392	-2,392	-2,392
-2.67%	-1,196	-1,196	-1,196	-1,196	-1,196	-1,196	-1,196
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,196	1,196	1,196	1,196	1,196	1,196	1,196
5.33%	2,392	2,392	2,392	2,392	2,392	2,392	2,392
8.00%	3,588	3,588	3,588	3,588	3,588	3,588	3,588
KR4201NB27 2018-11 콜275							1,568
기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	249	249	249	248	247	245	243
-5.33%	248	246	243	238	232	224	215
-2.67%	224	212	198	182	164	145	125
0%	84	56	28	0	-28	-57	-86
2.67%	-297	-321	-346	-372	-399	-426	-453
5.33%	-881	-890	-901	-914	-929	-946	-963
8.00%	-1,540	-1,541	-1,544	-1,548	-1,553	-1,560	-1,568

KR4301NB27 2018-11 풋275

1,162

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	-1,162	-1,162
-5.33%	-744	-744	-745	-745	-745	-746	-747
-2.67%	-329	-331	-334	-338	-342	-347	-353
0%	35	23	12	0	-12	-24	-36
2.67%	207	198	189	179	169	159	148
5.33%	232	231	229	227	224	220	216
8.00%	233	233	233	233	232	232	231

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%	-137	-137	-137	-137	-137	-137	-137
-2.67%	-64	-64	-64	-65	-65	-66	-66
0%	5	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	48	46	44	41	39	37	35
5.33%	58	57	57	56	55	54	53
8.00%	58	58	58	58	58	58	58

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

(단위:백만원)

7,000

공시일	2018-11-05
기준일	2018-11-02

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

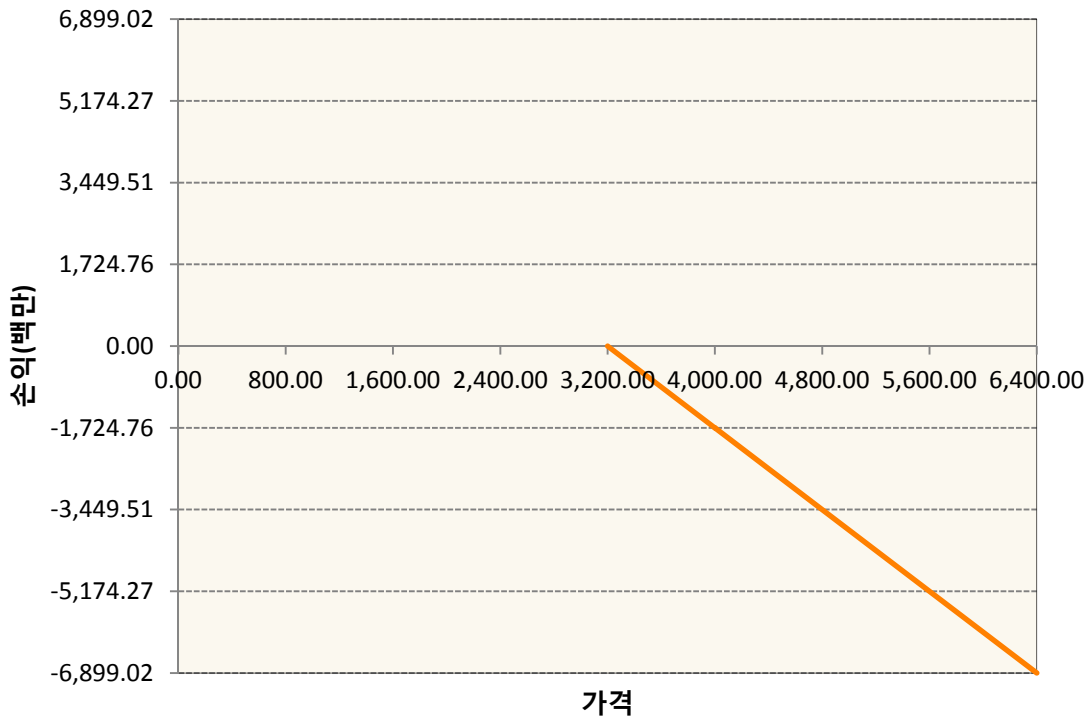
1. 계약금액

(단위:백만원)

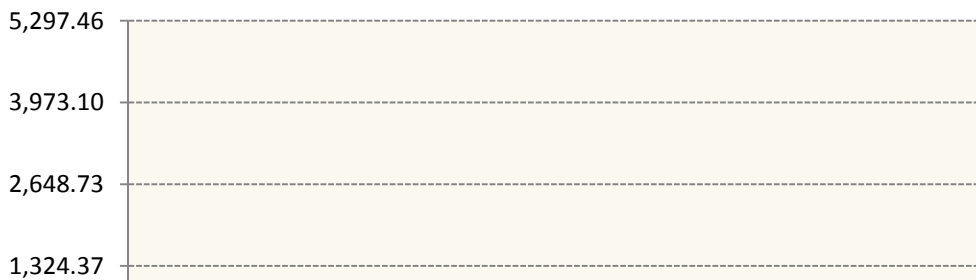
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,860	0	5,860	
누계	유가증권	스왑	71,678	0	71,678	장외
누계	유가증권	옵션	0	24,393	-24,393	장내

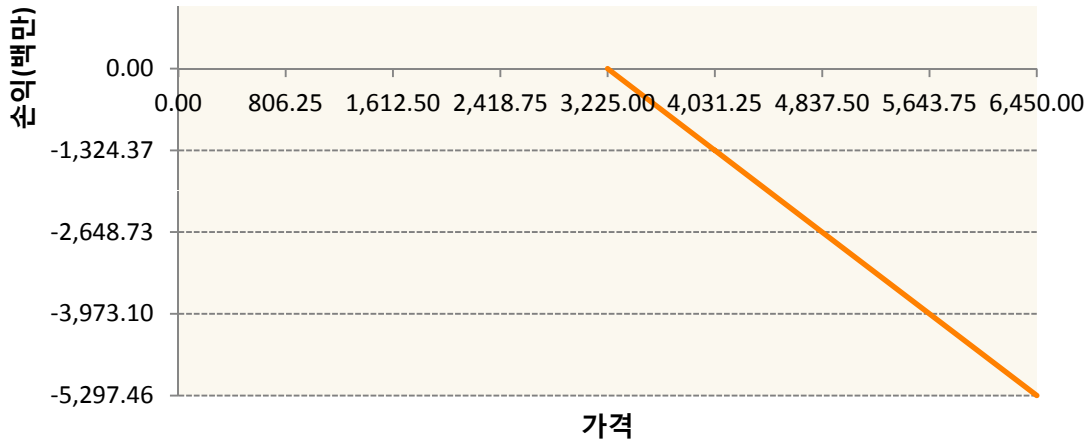
2. 만기시점의 손익구조

OESXX8-C3200-EURO STOXX 50

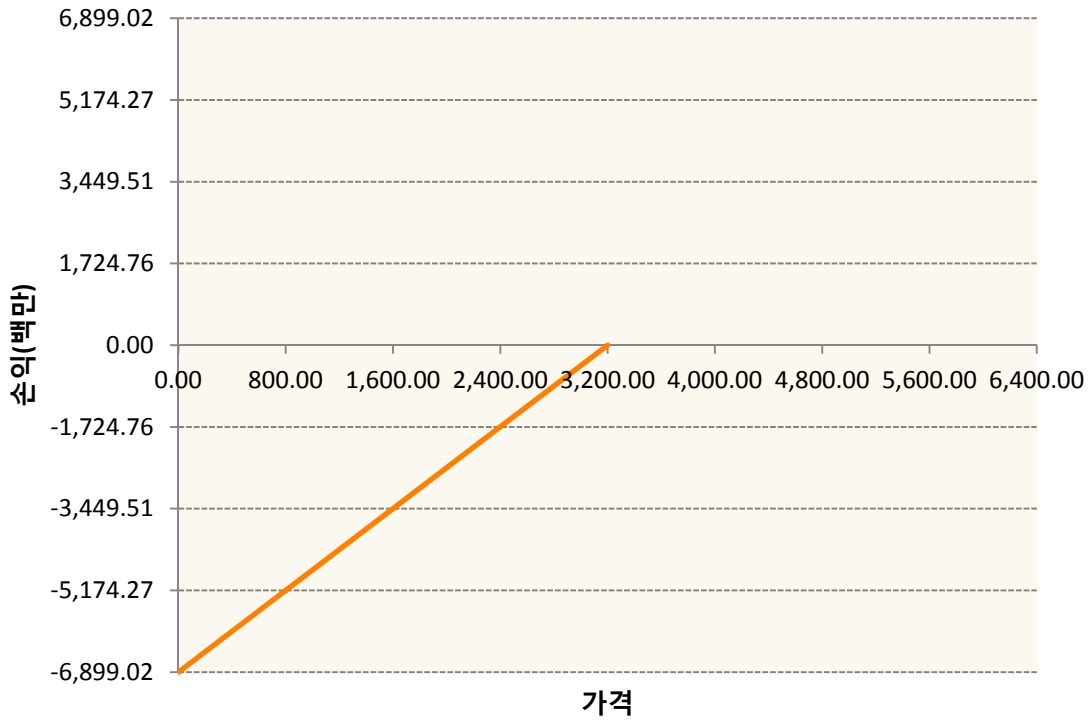


OESXX8-C3225-EURO STOXX 50

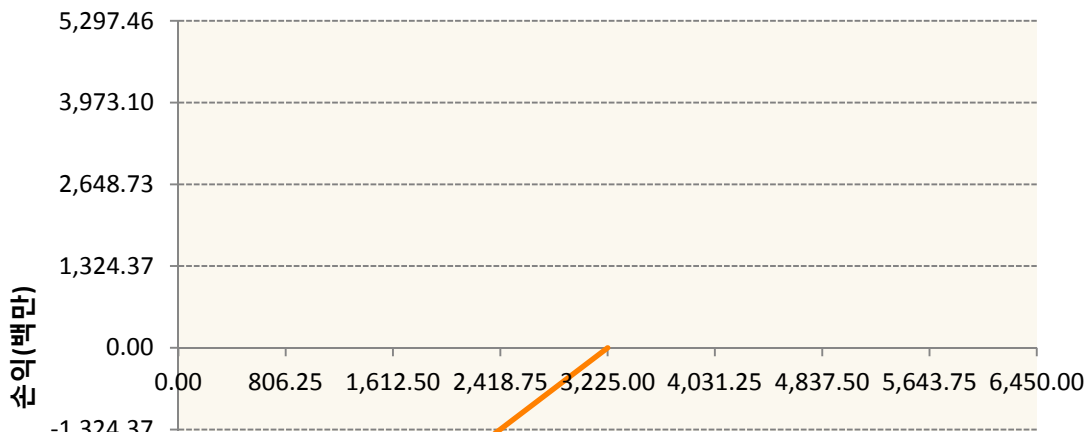


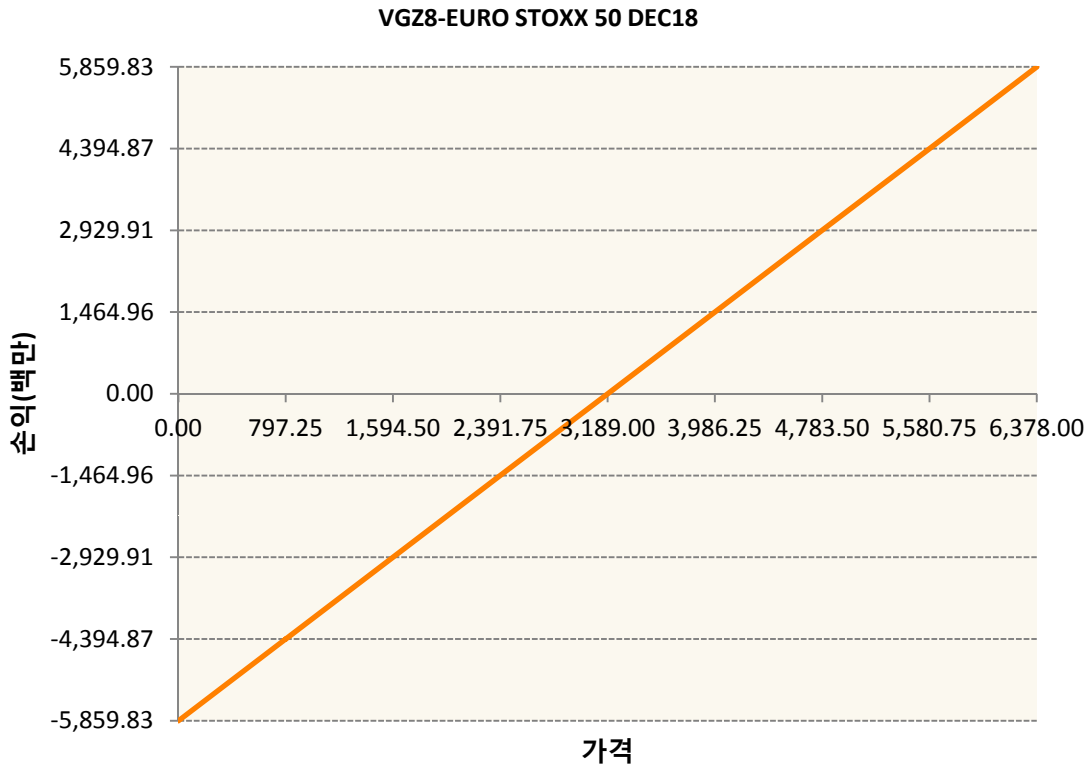


OESXX8-P3200-EURO STOXX 50



OESXX8-P3225-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY		25
OESXX8-C32 EURO STOXX 50		552
OESXX8-C32 EURO STOXX 50		424
OESXX8-P32 EURO STOXX 50		552
OESXX8-P32 EURO STOXX 50		424
VGZ8	EURO STOXX 50 DEC18	469

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,567

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

(단위:백만원)

1,166

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

(단위:백만원)

93

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

(단위:백만원)

139

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

(단위:백만원)

157

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

(단위:백만원)

42

공시일	2018-11-05
기준일	2018-11-02

리디파인K200(주식혼합-파생재간

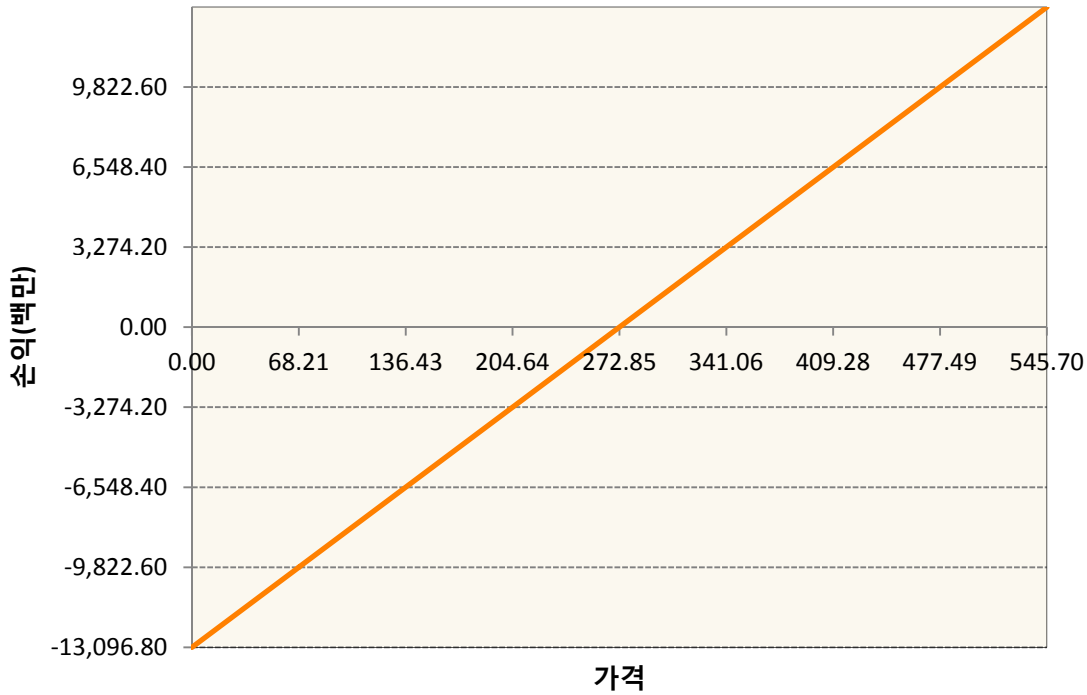
1. 계약금액

(단위:백만원)

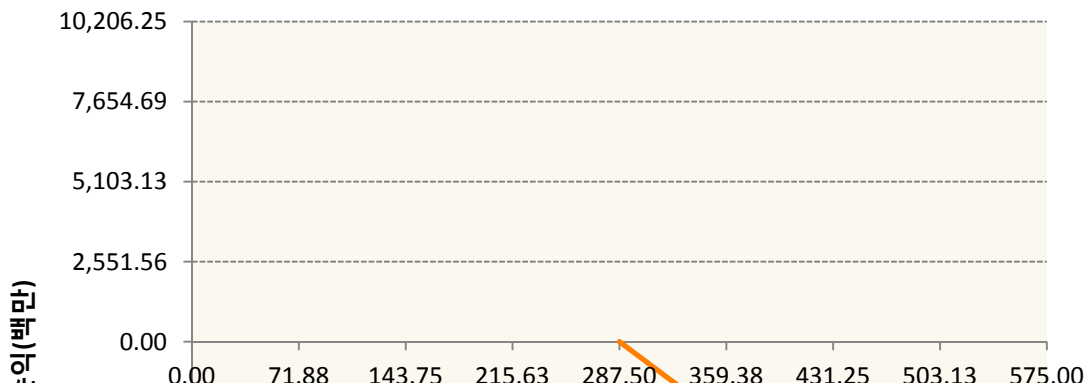
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,097	0	13,097	장내
누계	유가증권	옵션	4,059	23,401	-19,343	장내

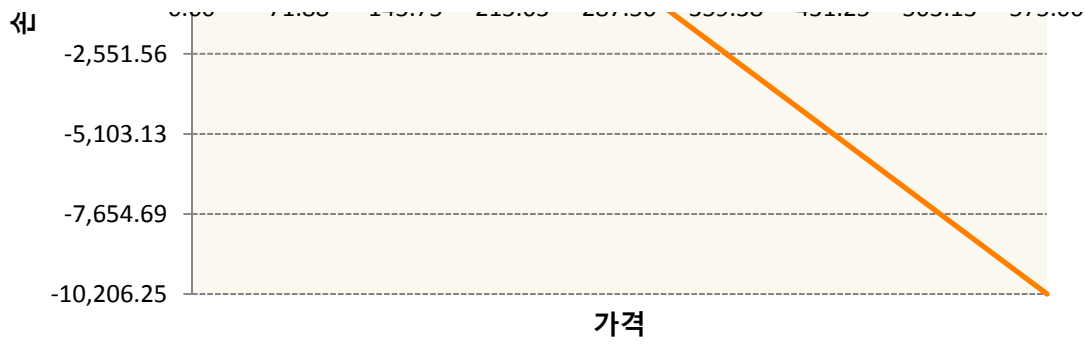
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

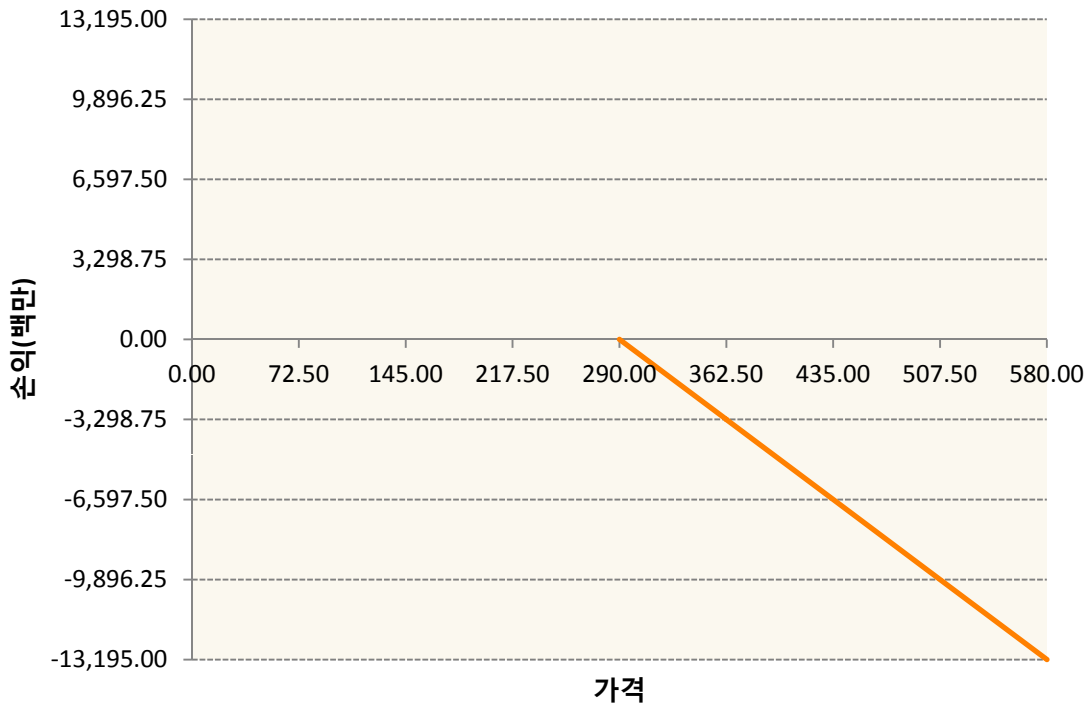


KR4201NB2877-2018-11 콜287.5

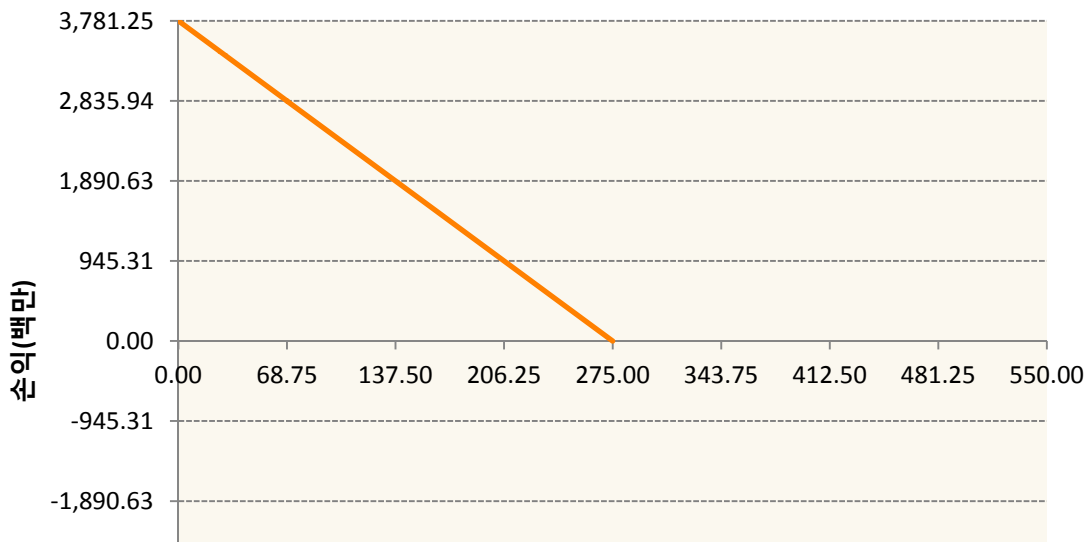


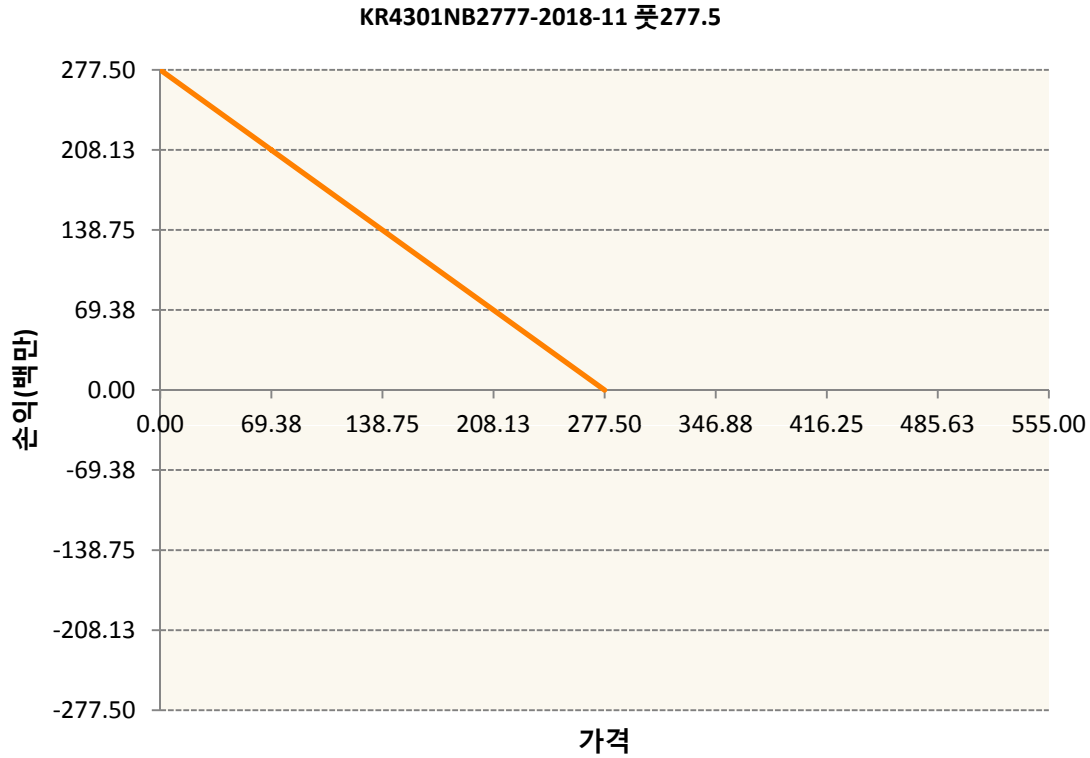
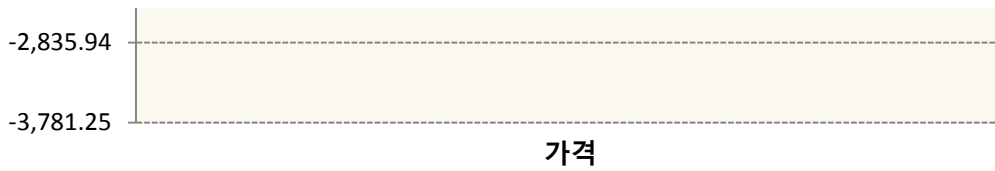


KR4201NB2901-2018-11 콜290



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

KR4201NB2828 2018-11 콜287.5 317

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9	9	9	9	9	9	9
-5.33%	9	9	9	9	9	9	8
-2.67%	9	9	9	8	7	6	4

0%	7	6	3	0	-4	-8	-14
2.67%	-11	-18	-26	-34	-43	-52	-62
5.33%	-89	-101	-113	-125	-137	-148	-160
8.00%	-260	-269	-278	-287	-297	-307	-317

KR4201NB29 2018-11 콜290

336

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7	7	7	7	7	7	7
-5.33%	7	7	7	7	6	6	6
-2.67%	7	7	6	6	5	4	3
0%	6	4	3	0	-3	-8	-13
2.67%	-7	-13	-21	-29	-38	-48	-58
5.33%	-74	-88	-102	-117	-131	-146	-161
8.00%	-252	-266	-279	-293	-307	-322	-336

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%	178	178	178	178	178	178	179
-2.67%	79	79	80	81	82	83	84
0%	-8	-6	-3	0	3	6	9
2.67%	-49	-47	-45	-43	-40	-38	-35
5.33%	-55	-55	-55	-54	-54	-53	-52
8.00%	-56	-56	-56	-56	-56	-55	-55

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%	6	6	6	6	7	7	7
0%	0	0	0	0	0	0	1
2.67%	-5	-5	-4	-4	-4	-4	-4
5.33%	-6	-6	-6	-6	-5	-5	-5
8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6

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

(단위:백만원)

1,440

공시일	2018-11-05
기준일	2018-11-02

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

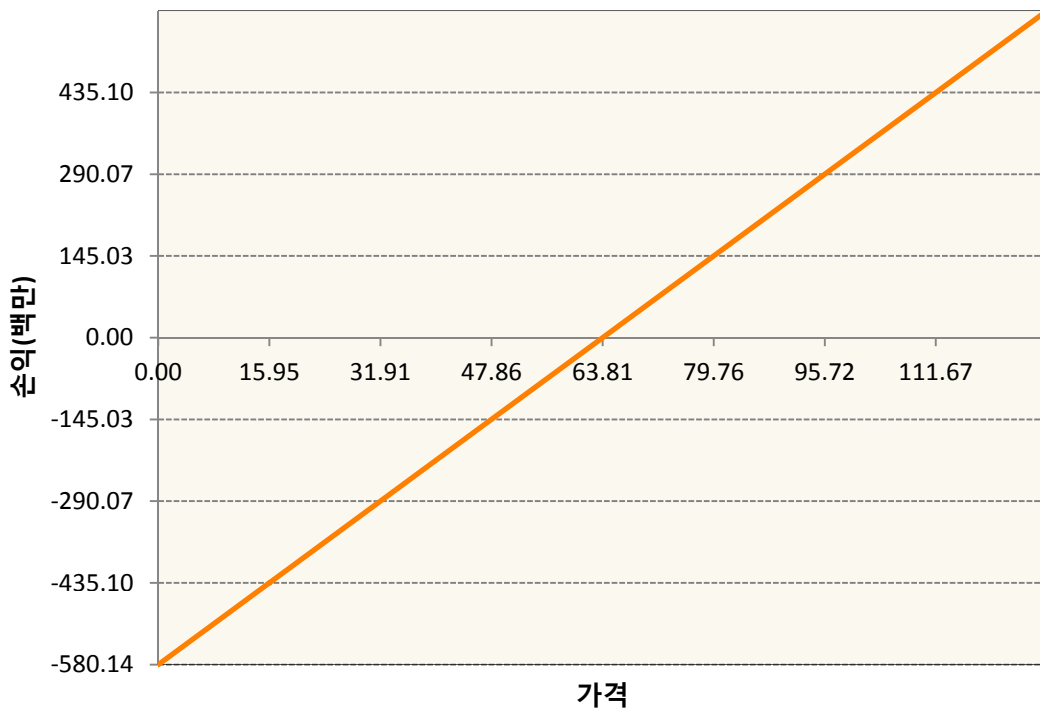
1. 계약금액

(단위:백만원)

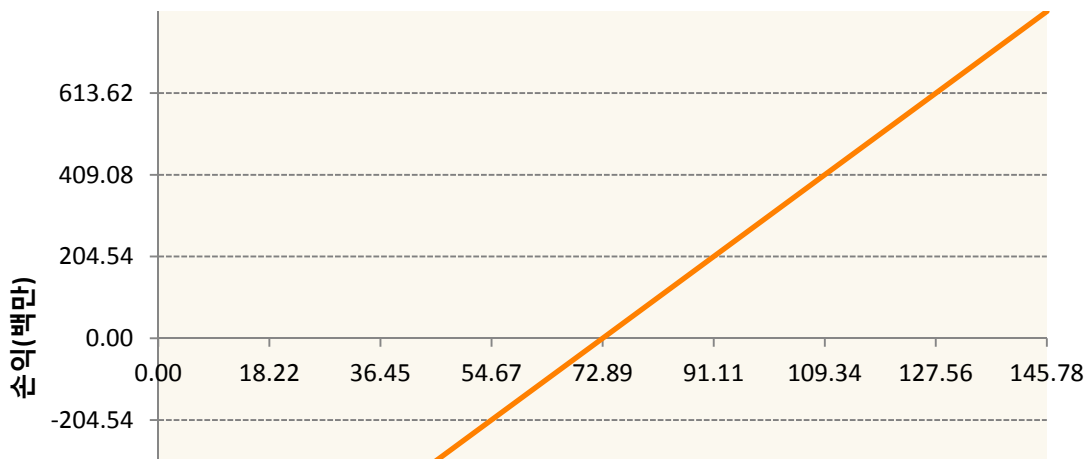
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,231	403	2,828	

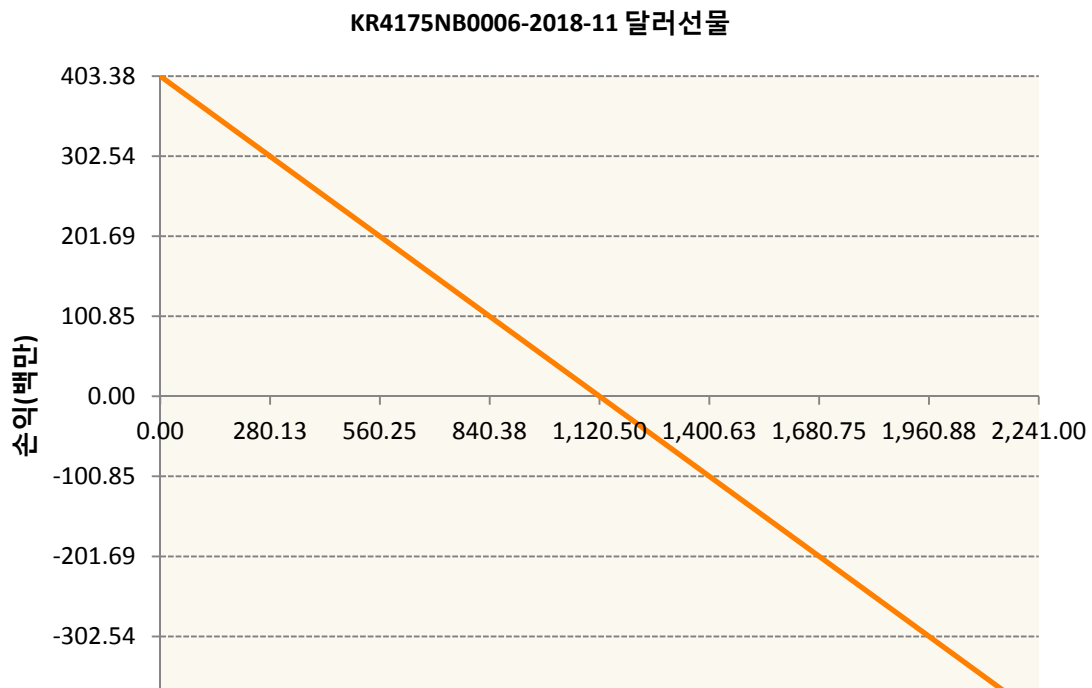
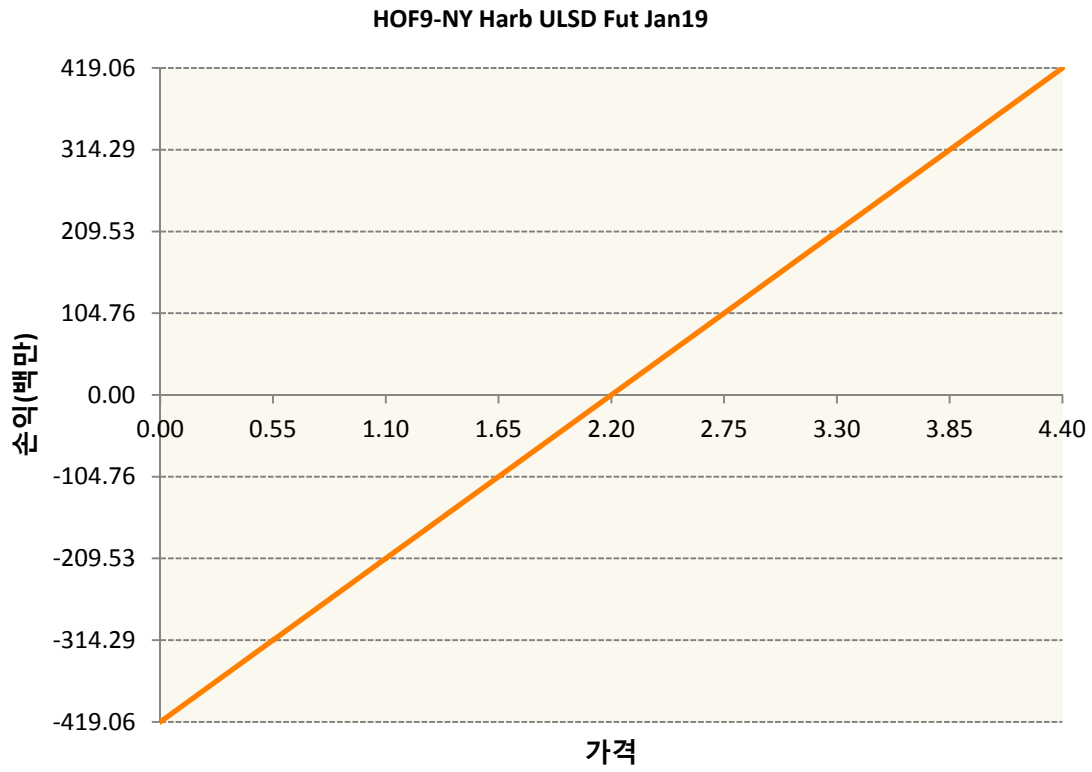
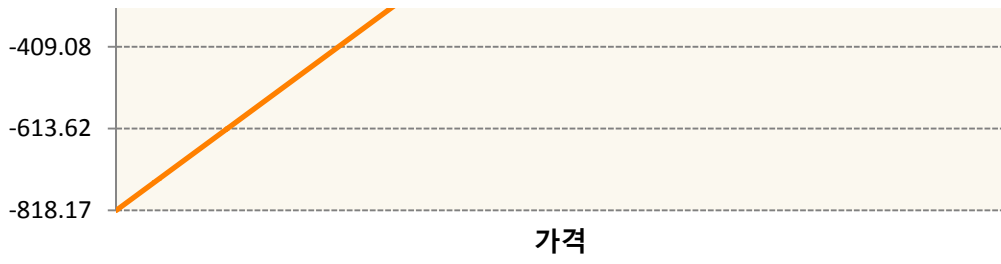
2. 만기시점의 손익구조

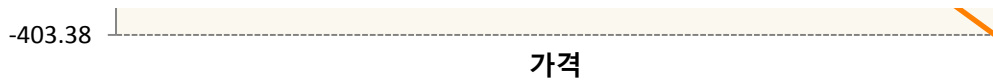
CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19



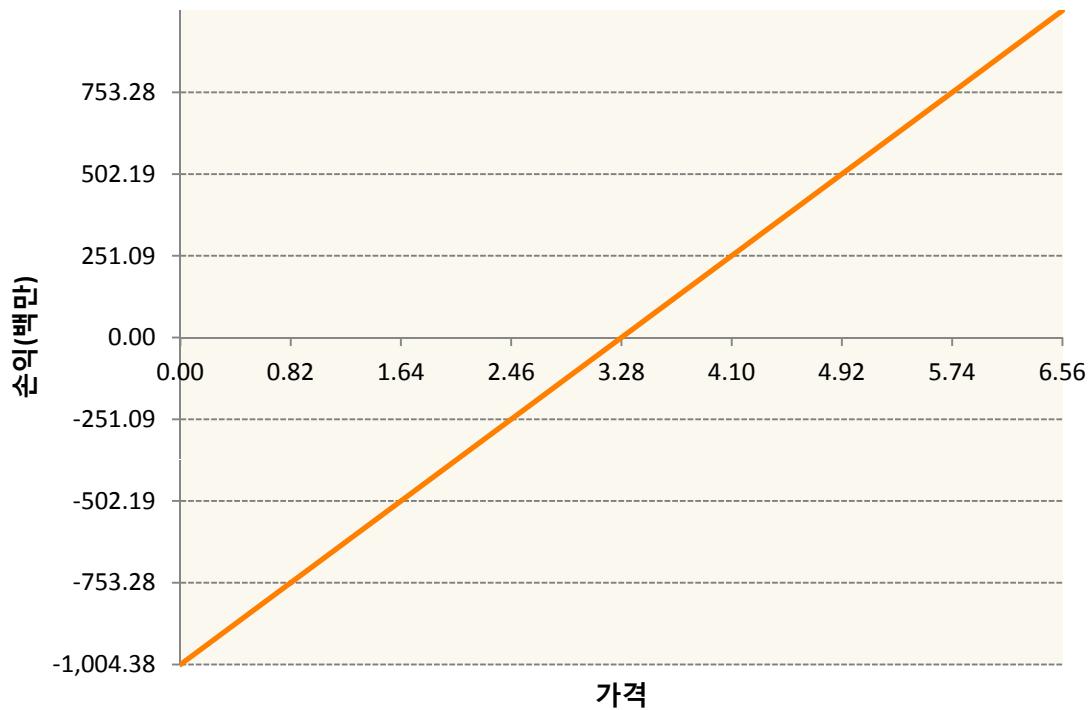
COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19



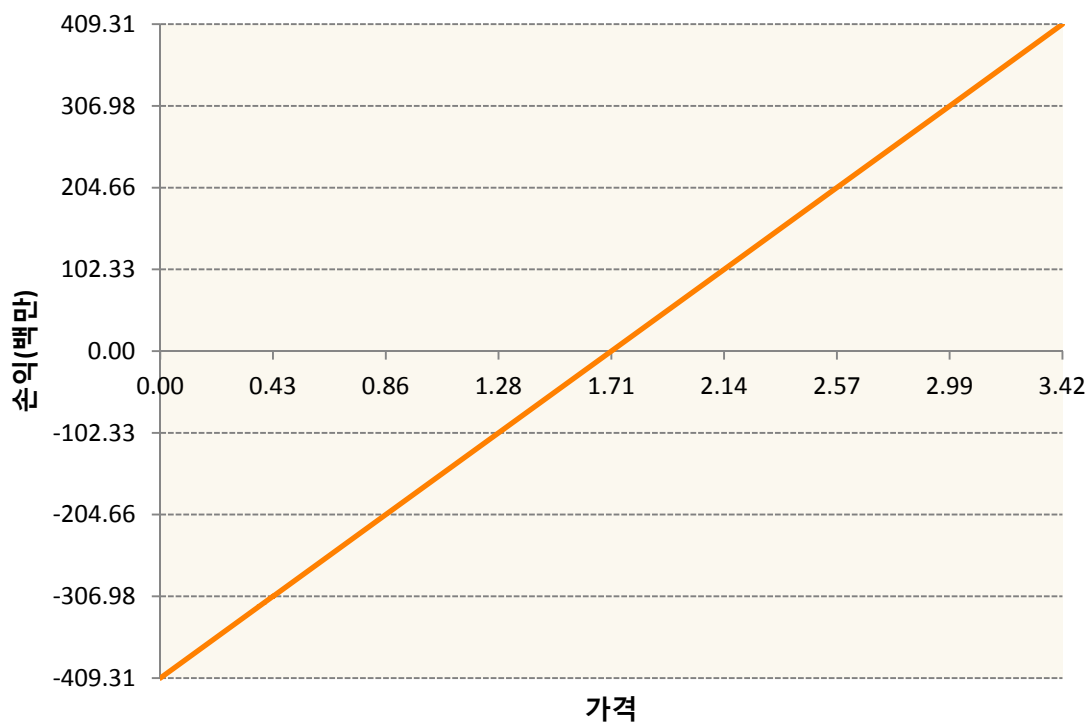




NGF19-NATURAL GAS FUTR Jan19



XBF9-GASOLINE RBOB FUT Jan19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF9	WTI CRUDE FUTURE Jan19	46
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	65
HOF9	NY Harb ULSD Fut Jan19	34
KR4175NB0(2018-11 달러선물		32
NGF19	NATURAL GAS FUTR Jan19	80
XBF9	GASOLINE RBOB FUT Jan19	33

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

392

공시일	2018-11-05
기준일	2018-11-02

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

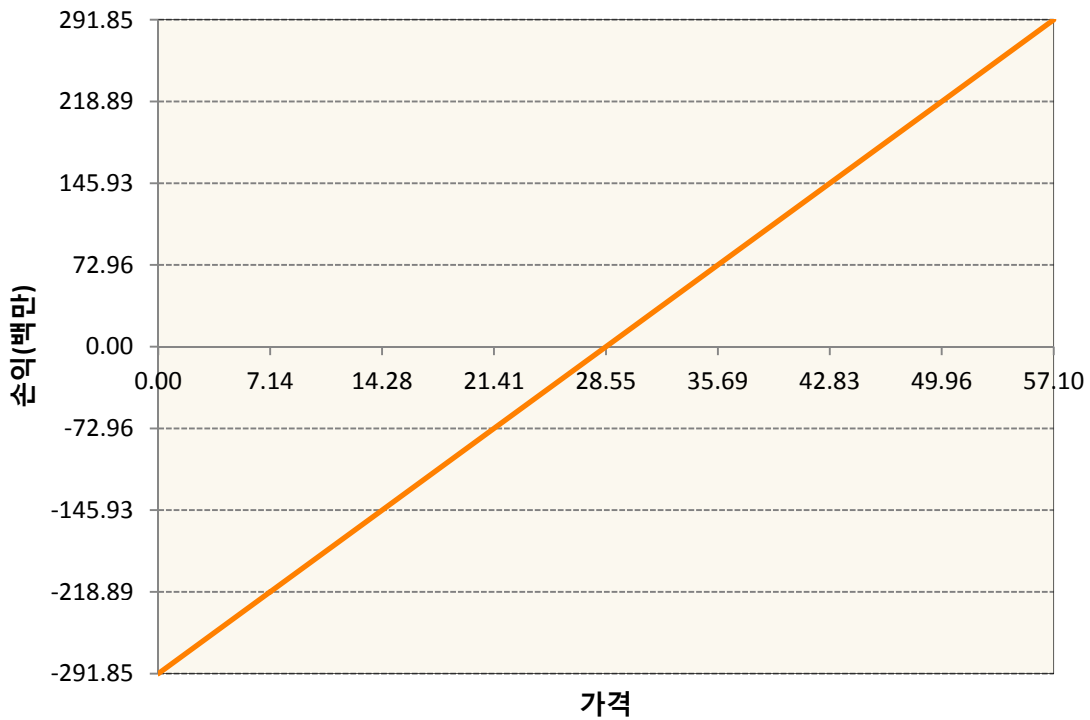
1. 계약금액

(단위:백만원)

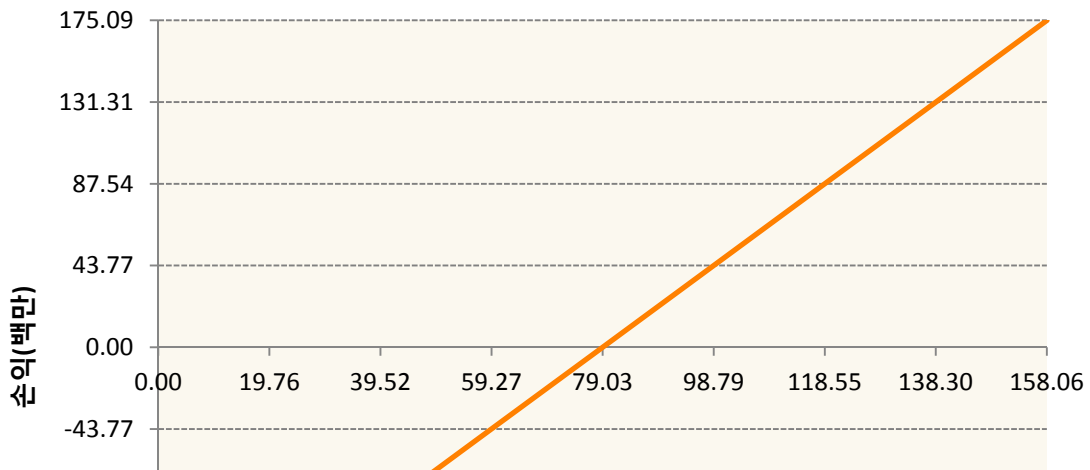
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,608	78	3,530	

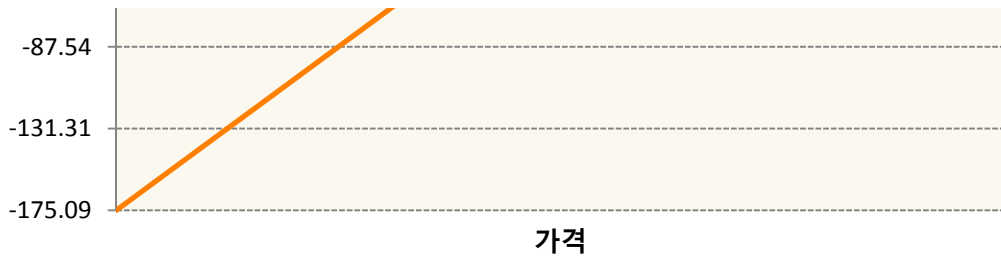
2. 만기시점의 손익구조

BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19

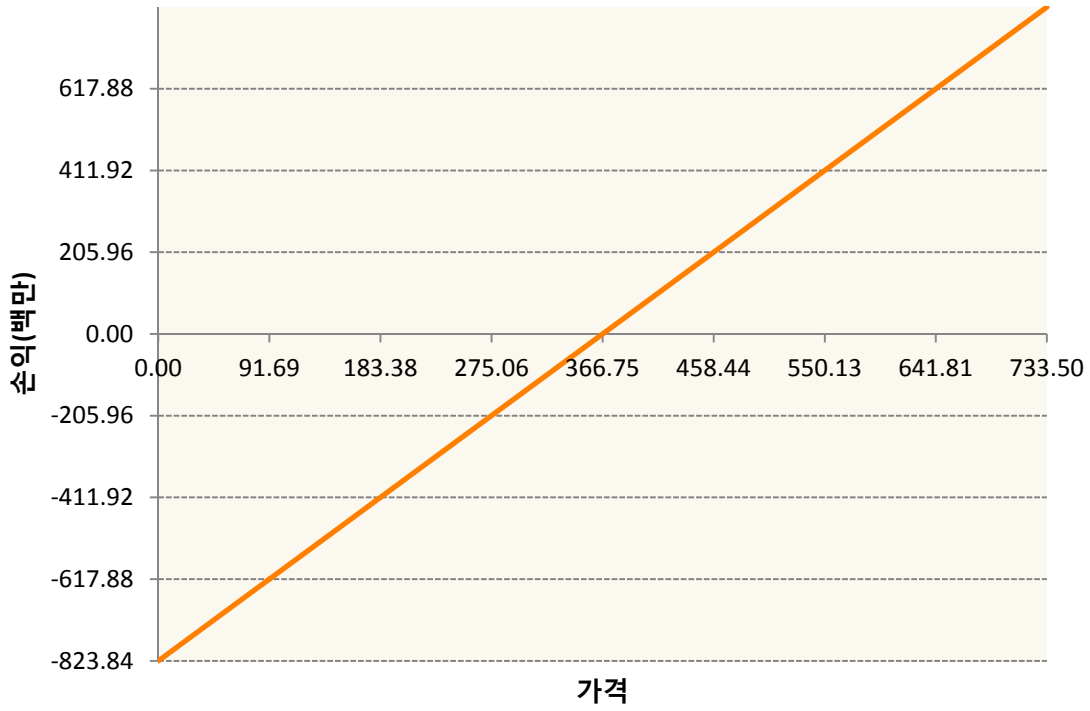


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

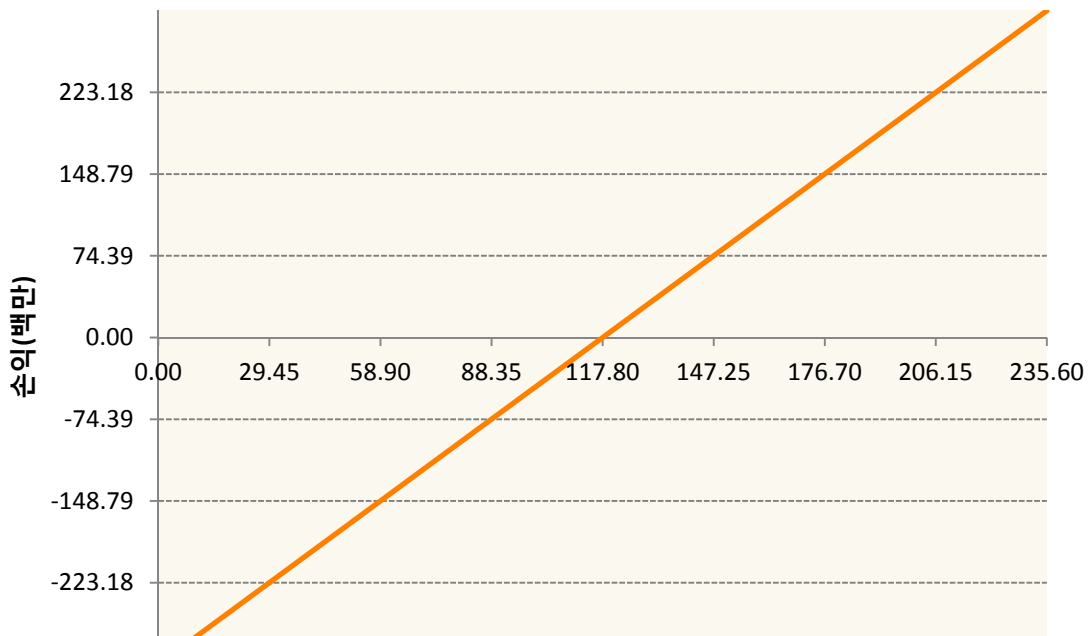


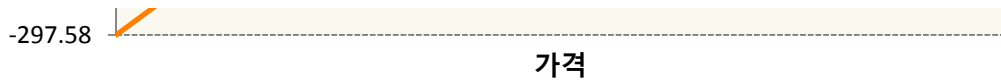


CZ8-CORN FUTURE DEC18

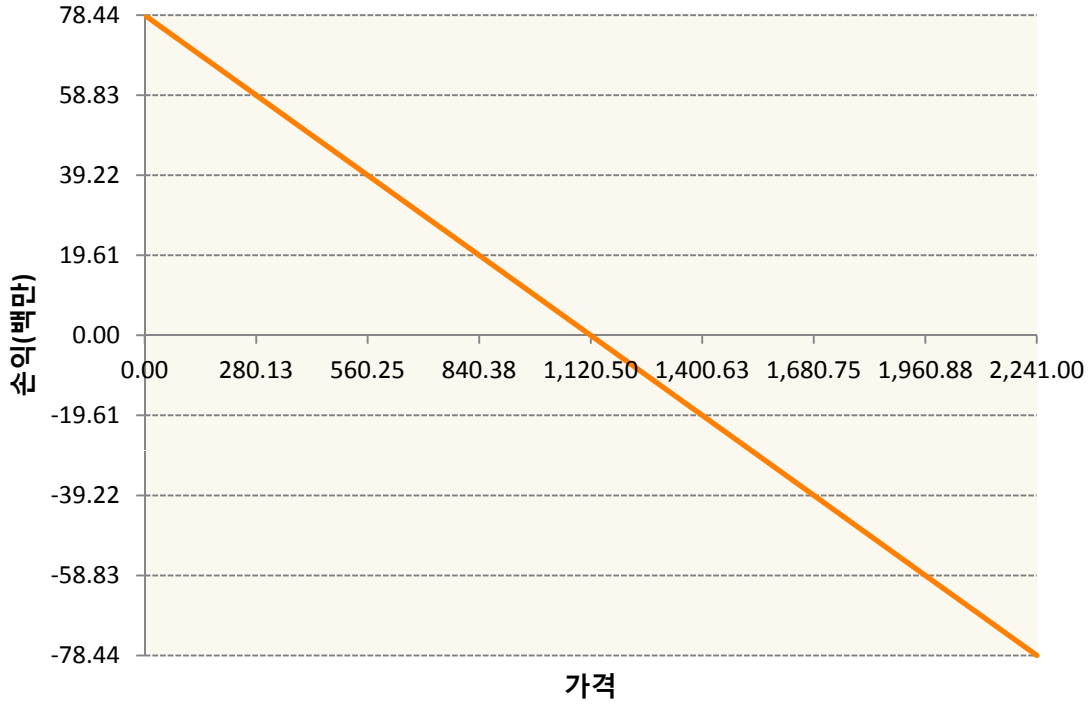


KCZ8-COFFEE 'C' FUTURE Dec18

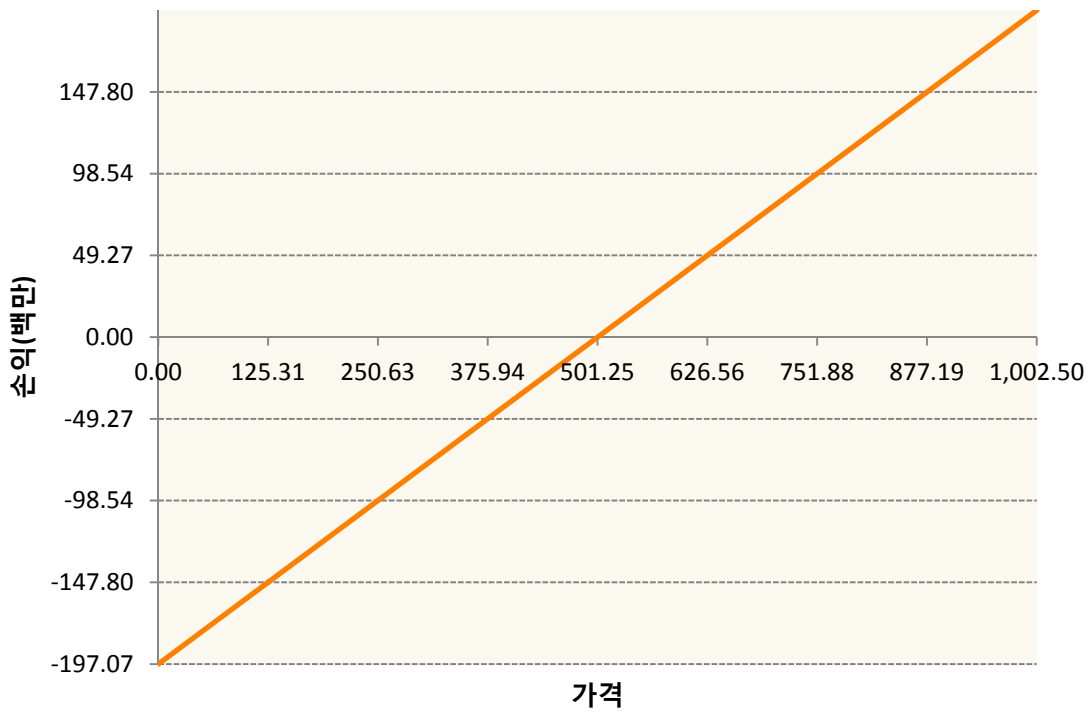




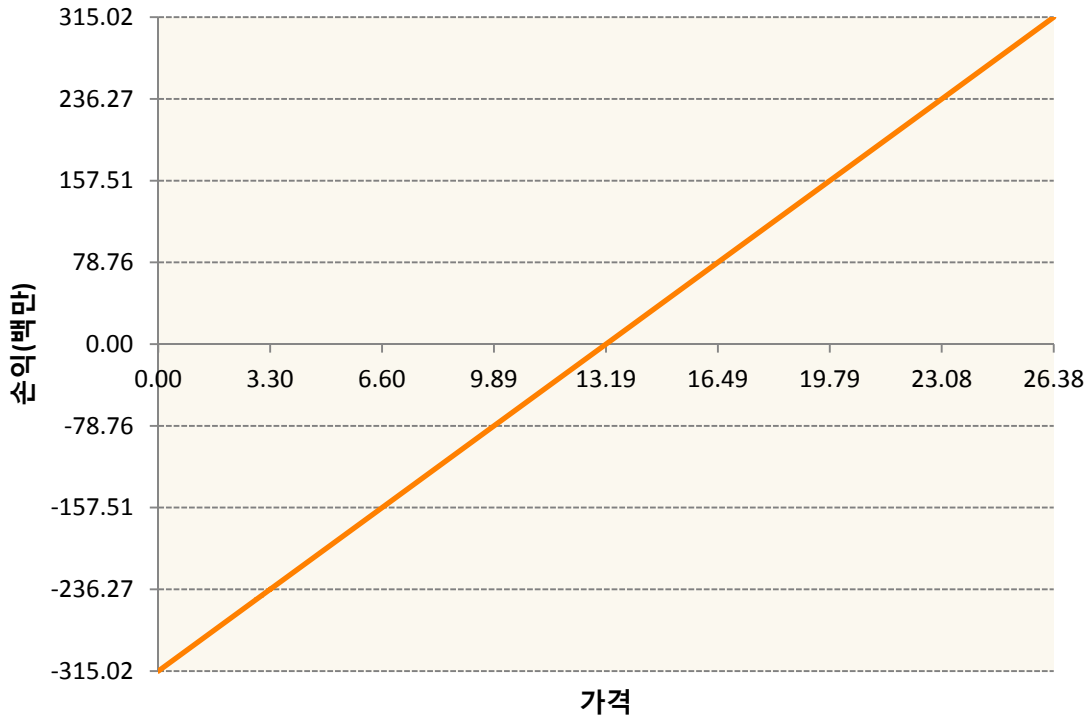
KR4175NB0006-2018-11 달러선물



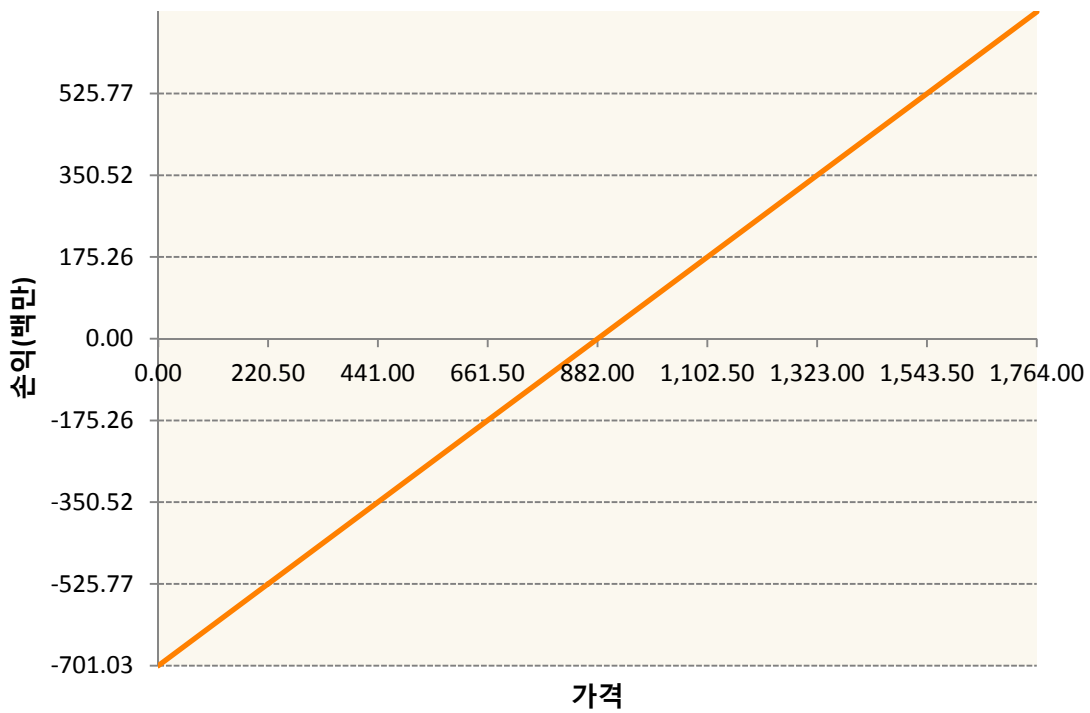
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

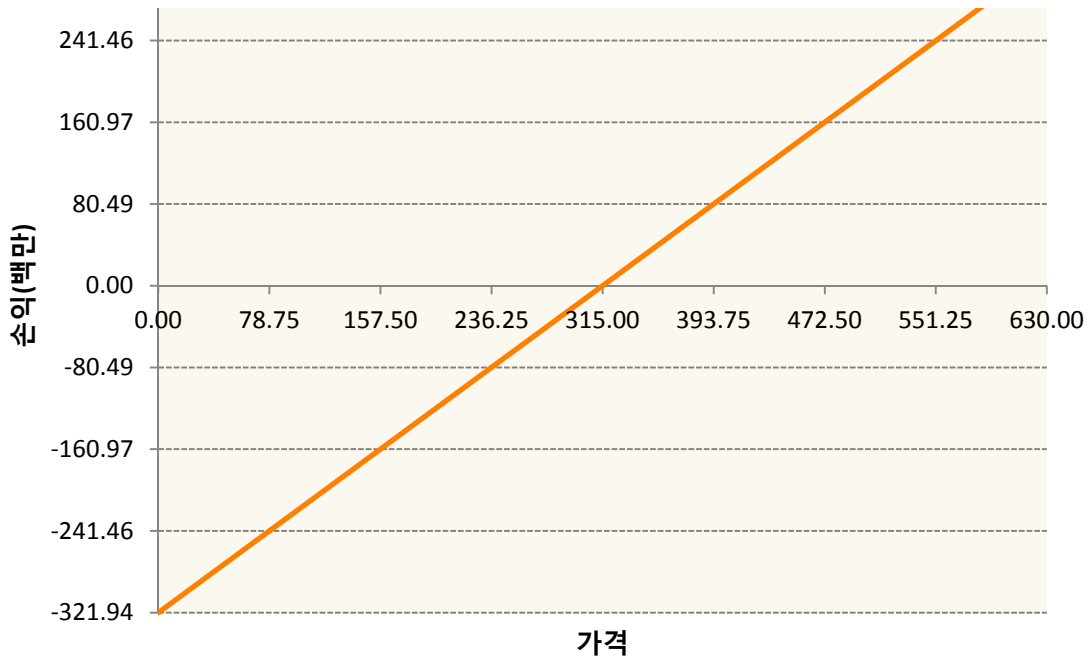


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19

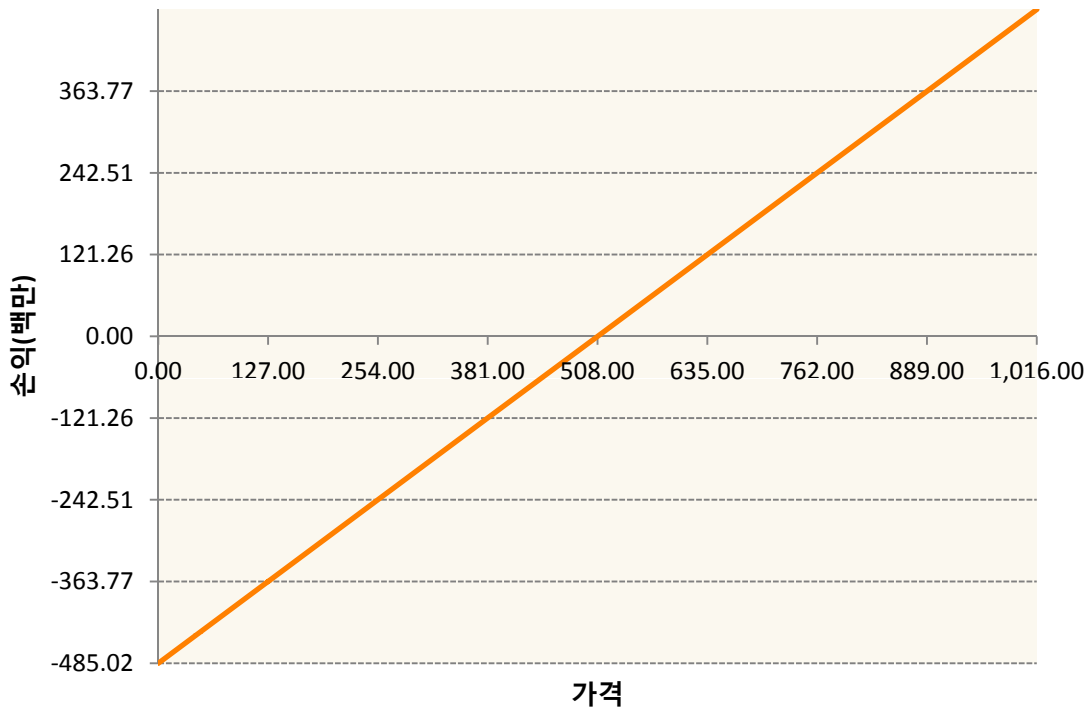


SMF9-SOYBEAN MEAL FUTR Jan19





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	24
KR4175NB0(2018-11 달러선물	6

KWZ8	KC HRW WHEAT FUT DEC18	16
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	25
SF9	SOYBEAN FUTURE Jan19	56
SMF9	SOYBEAN MEAL FUTR Jan19	26
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	39

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

(단위:백만원)

315