

공시일	2018-11-06
기준일	2018-11-05

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	2018-11-06
기준일	2018-11-05

스마트인덱스모

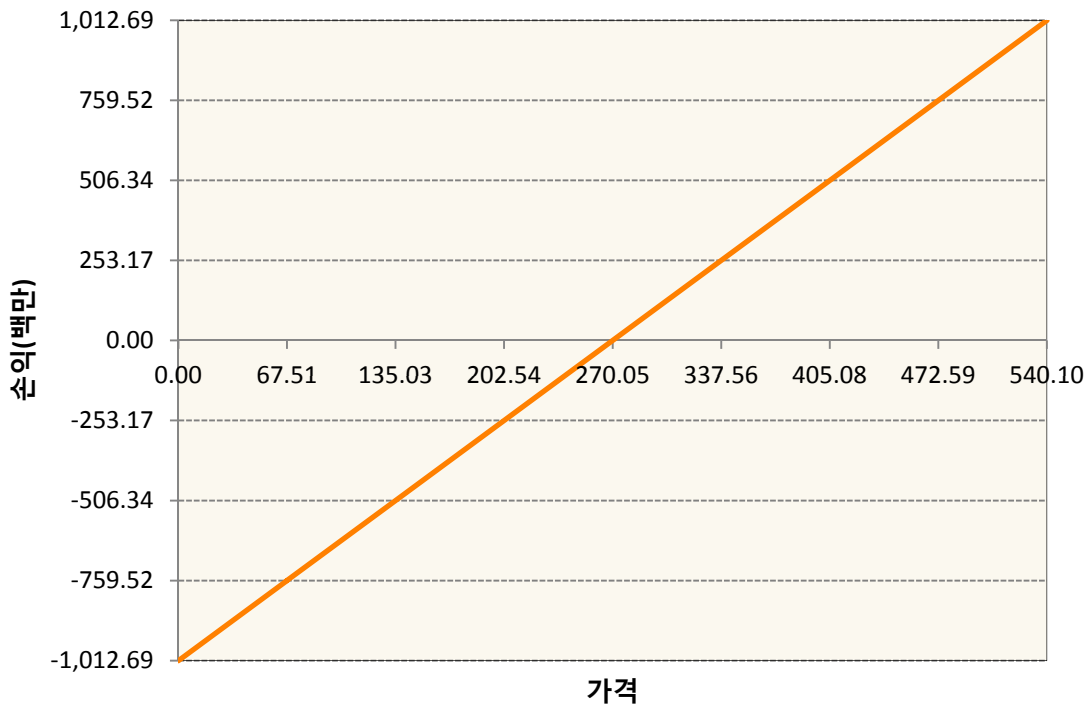
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,013	0	1,013	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물)

81

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
-5.33%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	27	27	27	27	27	27	27
5.33%	54	54	54	54	54	54	54
8.00%	81	81	81	81	81	81	81

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

(단위:백만원)

69

공시일	2018-11-06
기준일	2018-11-05

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

1,084

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

511

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-11-06
기준일	2018-11-05

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

269

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

385

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-11-06
기준일	2018-11-05

유로인덱스모(주식-파생형)

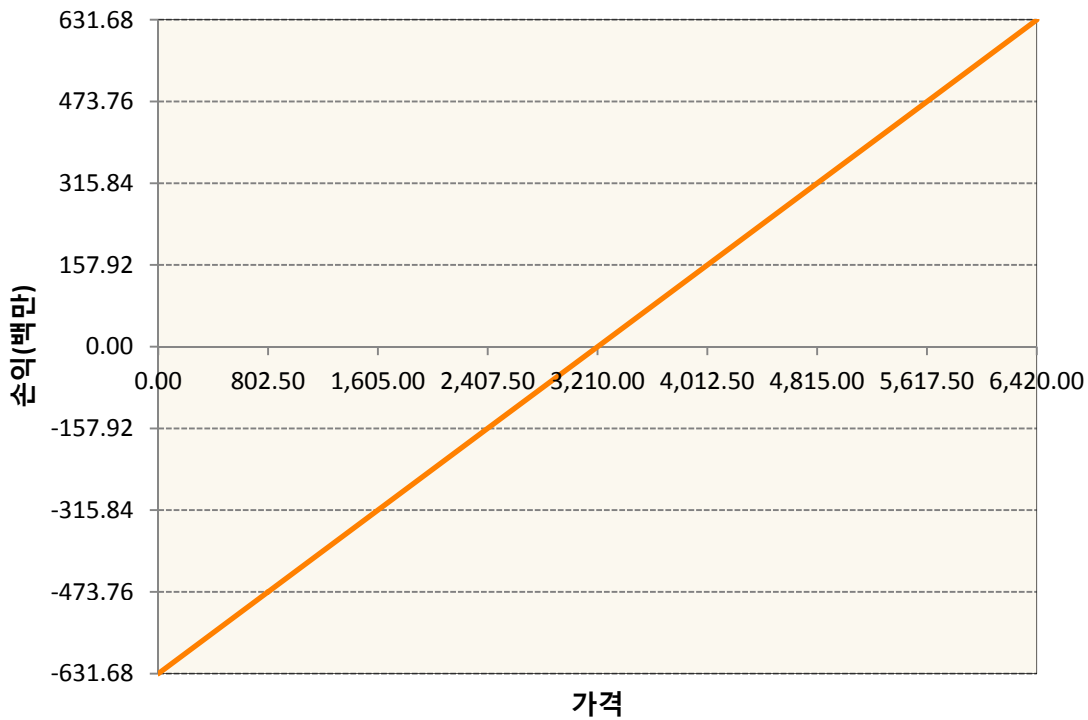
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	632	0	632	

2. 만기시점의 손익구조

VGZ8-EURO STOXX 50 DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ8	EURO STOXX 50 DEC18	51
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

32

공시일	2018-11-06
기준일	2018-11-05

차이나인덱스모(주식-파생형)

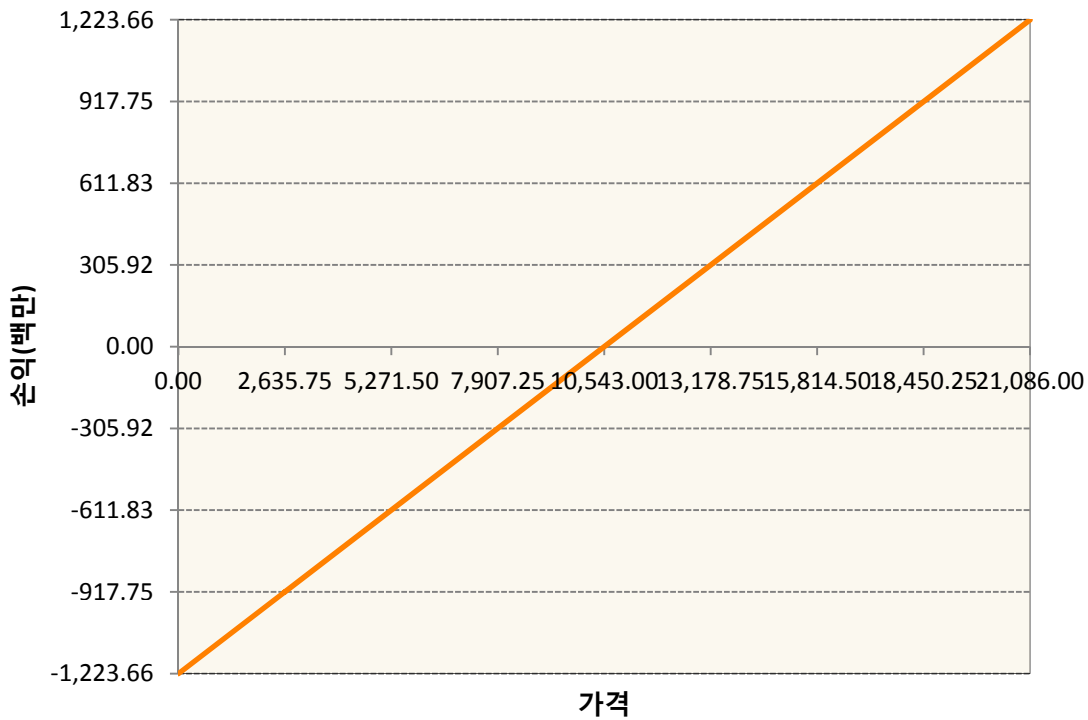
1. 계약금액

(단위:백만원)

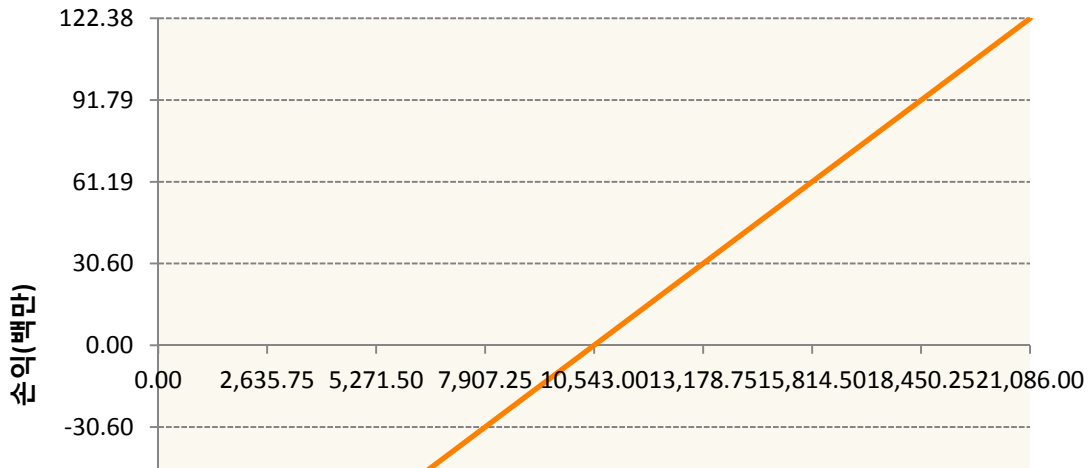
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,346	0	1,346	장내

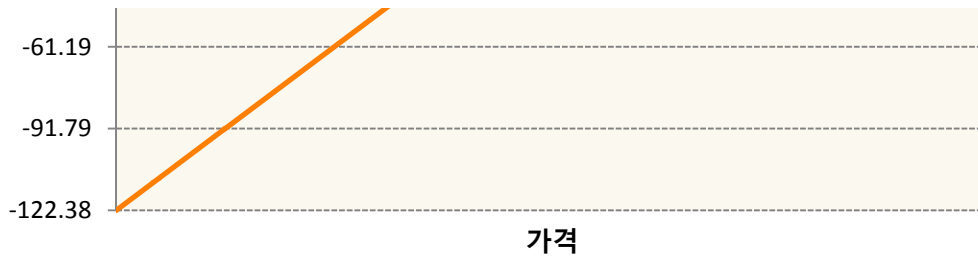
2. 만기시점의 손익구조

HCX8-HSCEI FUTURES NOV 18



MHCX8-MINI H-SHR IDX FU NOV 18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCX8	HSCEI FUTURES NOV 18	98
MHCX8	MINI H-SHR IDX FU NOV 18	10

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

106

공시일	2018-11-06
기준일	2018-11-05

커버드콜모(주식혼합-파생형)

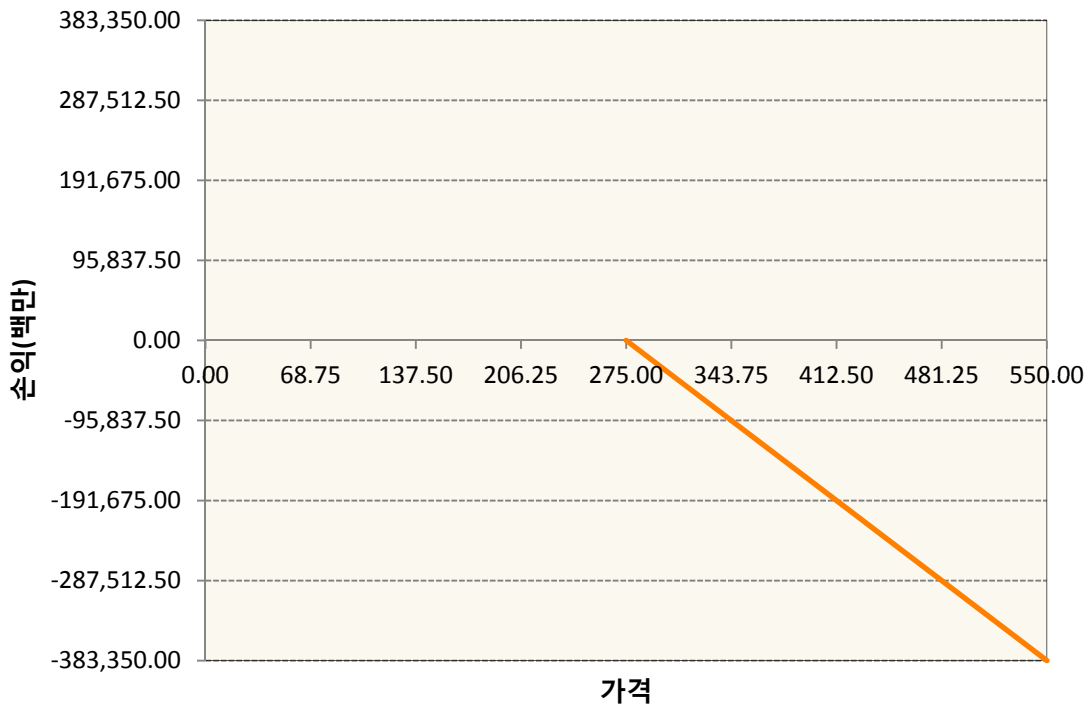
1. 계약금액

(단위:백만원)

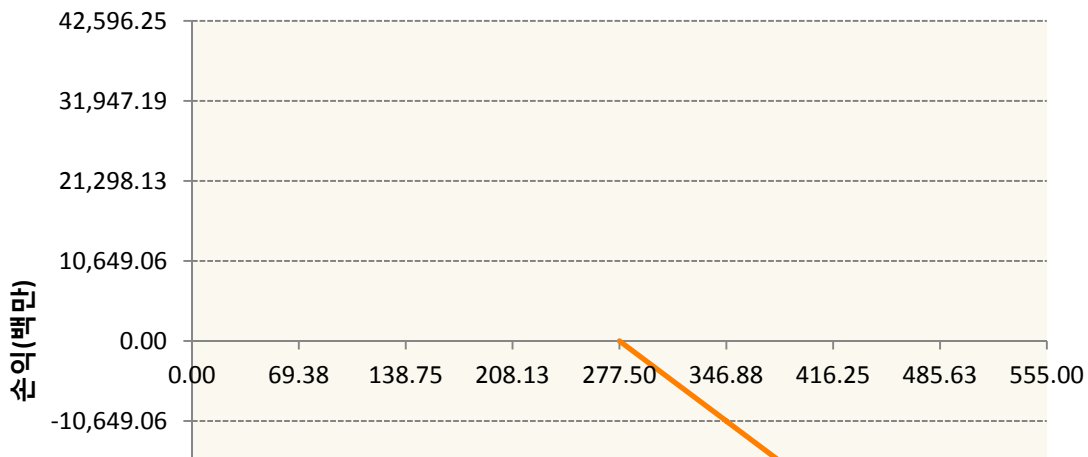
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	721,571	-721,571	장내

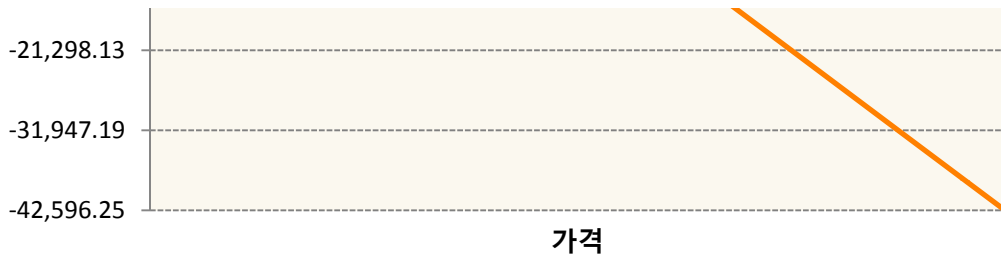
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

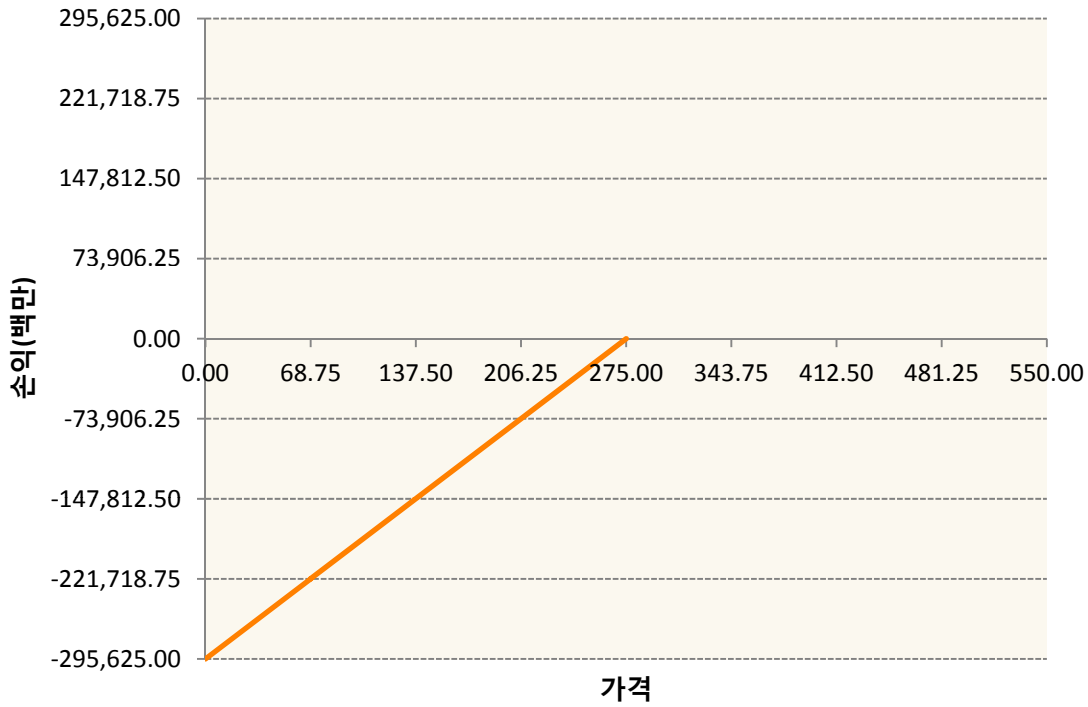


KR4201NB2778-2018-11 콜277.5





KR4301NB2751-2018-11 풋275



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NB27 2018-11 콜275

22,105

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,283	1,283	1,283	1,283	1,283	1,283	1,282
-5.33%	1,283	1,283	1,282	1,279	1,273	1,263	1,247
-2.67%	1,266	1,243	1,208	1,156	1,089	1,005	906
0%	661	456	235	0	-245	-499	-760
2.67%	-3,438	-3,729	-4,024	-4,323	-4,625	-4,928	-5,234
5.33%	-12,030	-12,102	-12,197	-12,313	-12,449	-12,603	-12,773
8.00%	-21,971	-21,975	-21,983	-21,999	-22,023	-22,058	-22,105

KR4201NB27 2018-11 콜277.5

2,135

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	73	73	73	73	73	73	72

-5.33%	73	73	72	72	72	72	71
-2.67%	72	71	70	67	63	58	52
0%	47	34	18	0	-20	-42	-65
2.67%	-227	-262	-297	-332	-367	-402	-437
5.33%	-1,033	-1,049	-1,067	-1,088	-1,110	-1,134	-1,159
8.00%	-2,105	-2,107	-2,109	-2,113	-2,119	-2,126	-2,135

KR4301NB27 2018-11 풋275

22,790

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,790	-22,790	-22,790	-22,790	-22,790	-22,790	-22,790
-5.33%	-15,049	-15,049	-15,049	-15,049	-15,049	-15,049	-15,050
-2.67%	-7,308	-7,309	-7,312	-7,318	-7,327	-7,342	-7,362
0%	269	191	101	0	-110	-227	-350
2.67%	5,064	4,915	4,760	4,602	4,442	4,279	4,114
5.33%	5,717	5,706	5,689	5,663	5,628	5,584	5,531
8.00%	5,724	5,724	5,724	5,724	5,722	5,720	5,715

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

(단위:백만원)

53,991

공시일	2018-11-06
기준일	2018-11-05

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

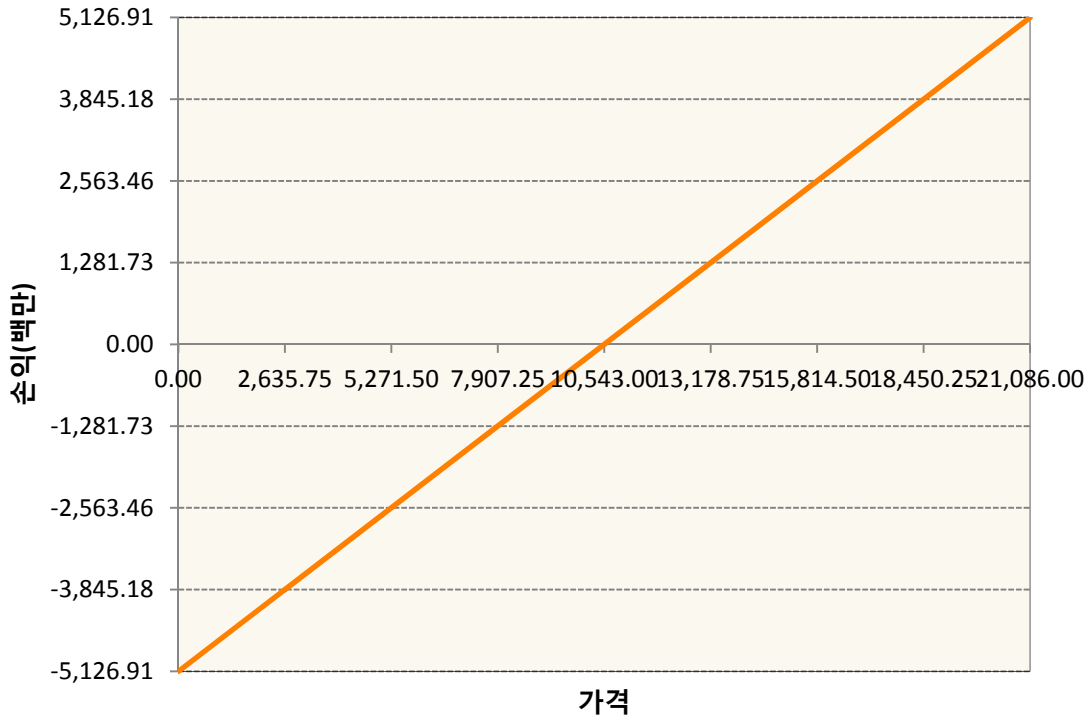
1. 계약금액

(단위:백만원)

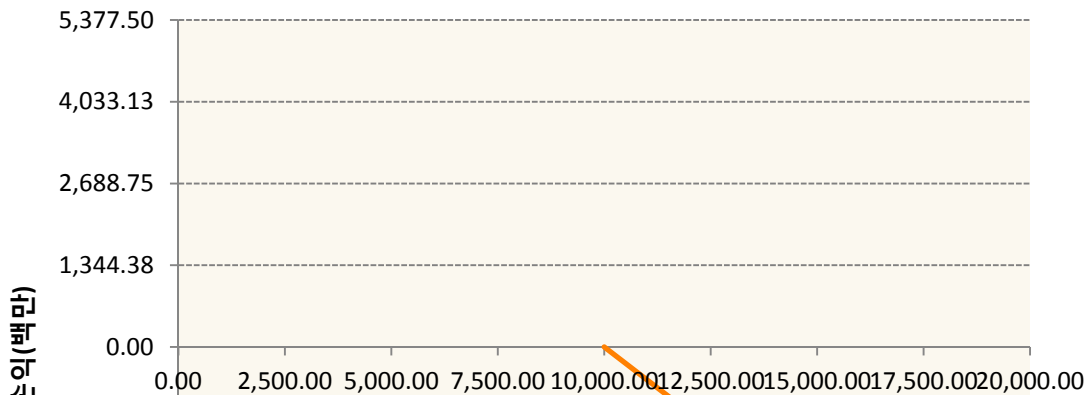
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,127	0	5,127	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,755	-10,755	장내

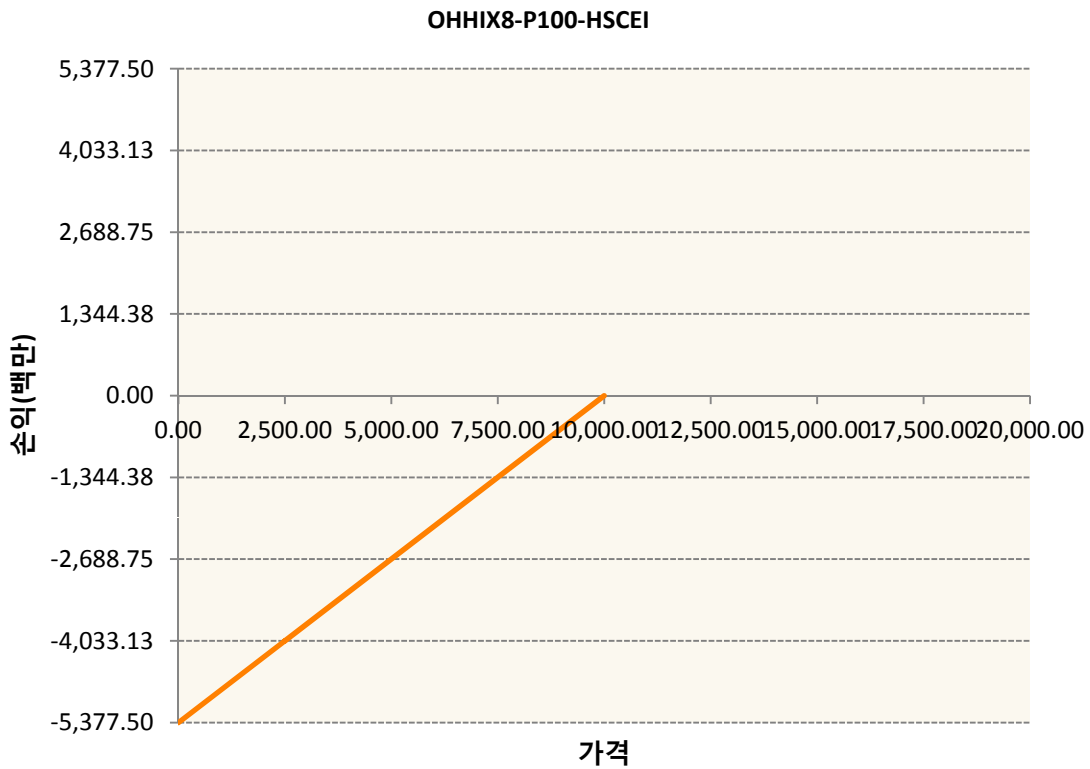
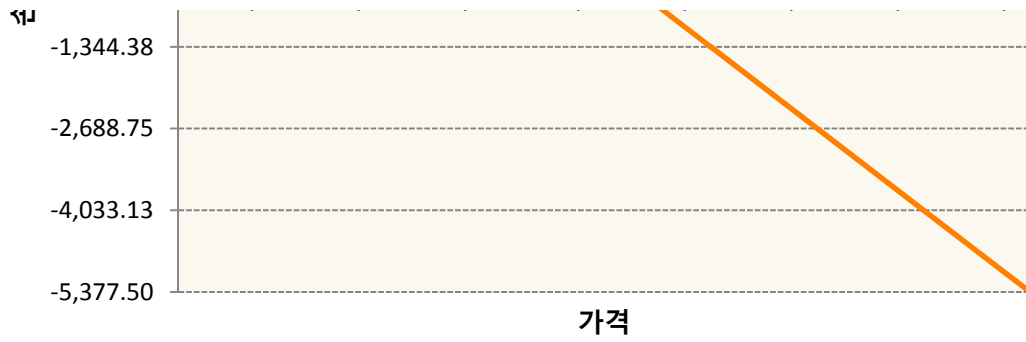
2. 만기시점의 손익구조

HCX8-HSCEI FUTURES NOV 18



OHHIX8-C100-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCX8	HSCEI FUTURES NOV 18	410
	OHHIX8-C1C HSCEI	430
	OHHIX8-P10 HSCEI	430

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,251

공시일	2018-11-06
기준일	2018-11-05

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

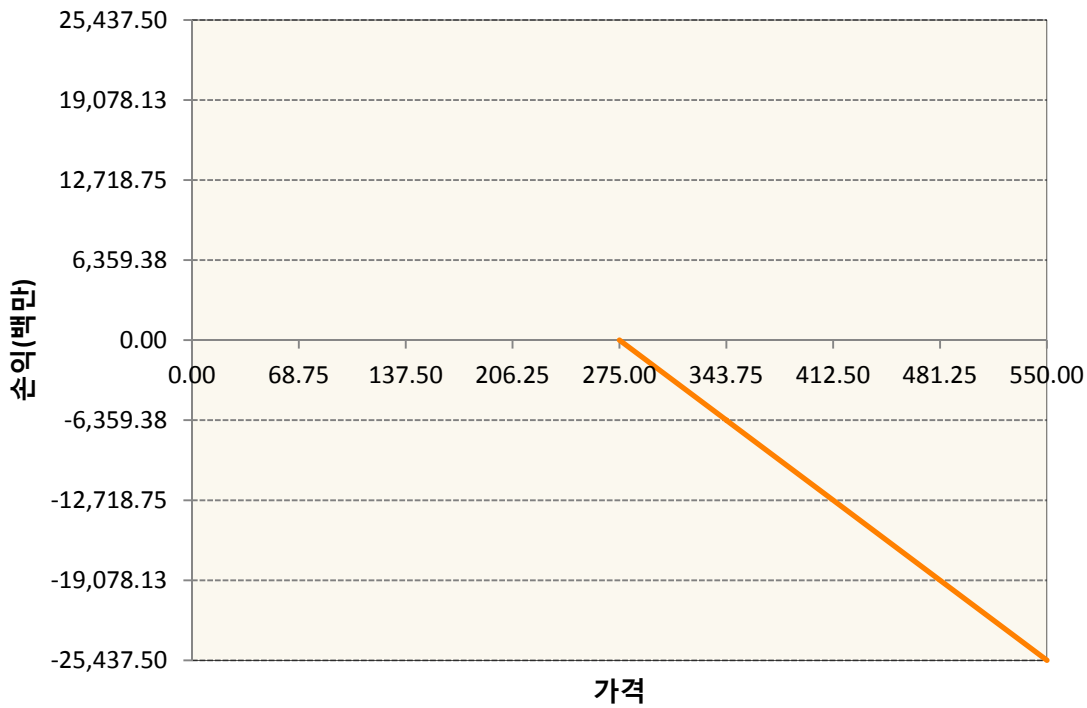
1. 계약금액

(단위:백만원)

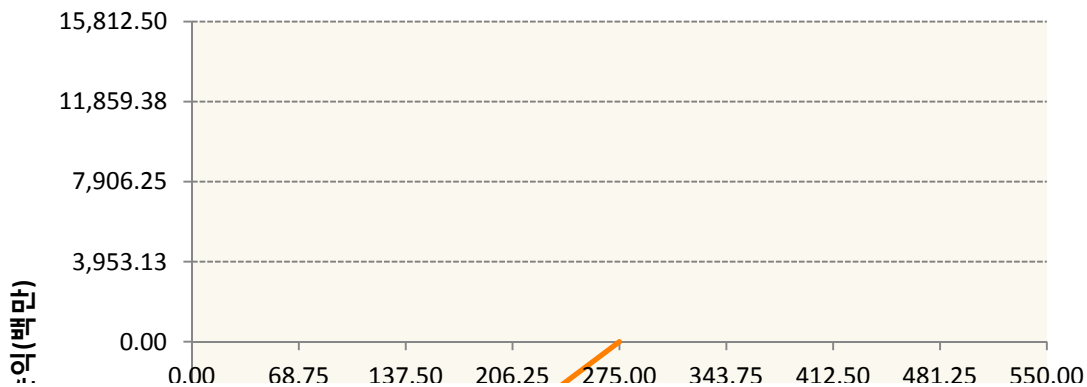
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	43,836	0	43,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	44,025	-44,025	장내

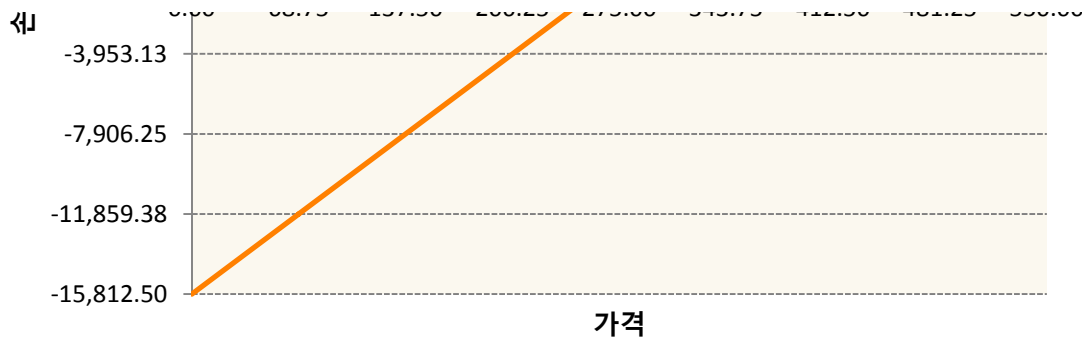
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

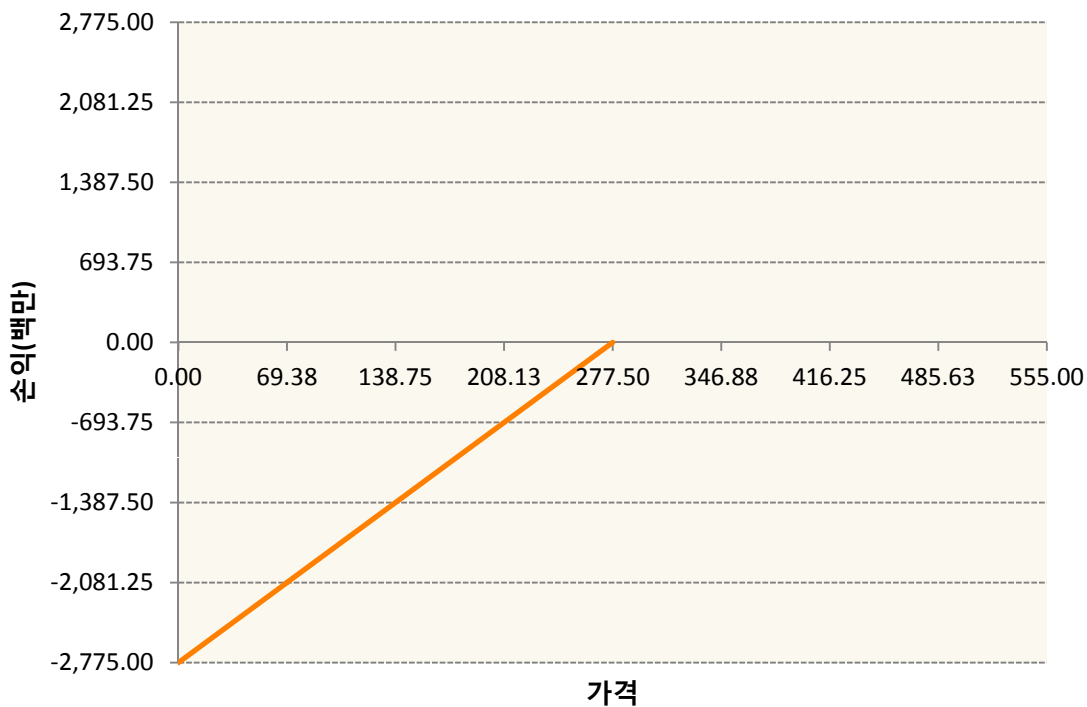


KR4301NB2751-2018-11 풋275





KR4301NB2777-2018-11 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,578
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,578	-3,578	-3,578	-3,578	-3,578	-3,578	-3,578
-5.33%	-2,385	-2,385	-2,385	-2,385	-2,385	-2,385	-2,385
-2.67%	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,193	1,193	1,193	1,193	1,193	1,193	1,193
5.33%	2,385	2,385	2,385	2,385	2,385	2,385	2,385
8.00%	3,578	3,578	3,578	3,578	3,578	3,578	3,578
KR4201NB27 2018-11 콜275							1,467
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	85	85	85	85	85	85	85
-5.33%	85	85	85	85	84	84	83
-2.67%	84	83	80	77	72	67	60
0%	44	30	16	0	-16	-33	-50
2.67%	-228	-247	-267	-287	-307	-327	-347
5.33%	-798	-803	-809	-817	-826	-836	-848
8.00%	-1,458	-1,458	-1,459	-1,460	-1,461	-1,464	-1,467

KR4301NB27 2018-11 풋275

1,219

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,219	-1,219	-1,219	-1,219	-1,219	-1,219	-1,219
-5.33%	-805	-805	-805	-805	-805	-805	-805
-2.67%	-391	-391	-391	-391	-392	-393	-394
0%	14	10	5	0	-6	-12	-19
2.67%	271	263	255	246	238	229	220
5.33%	306	305	304	303	301	299	296
8.00%	306	306	306	306	306	306	306

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

215

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-215	-215	-215	-215	-215	-215	-215
-5.33%	-143	-143	-143	-143	-143	-143	-143
-2.67%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	60	58	56	55	53	51	50
5.33%	75	75	74	74	73	72	71
8.00%	76	76	76	76	76	75	75

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

(단위:백만원)

6,918

공시일	2018-11-06
기준일	2018-11-05

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

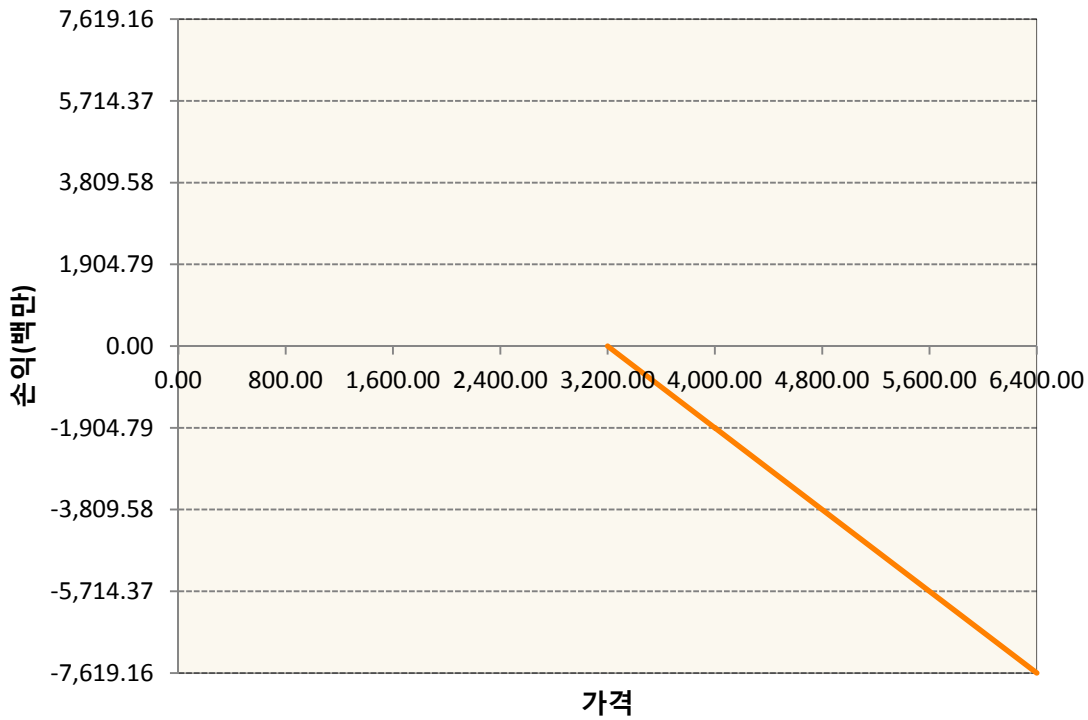
1. 계약금액

(단위:백만원)

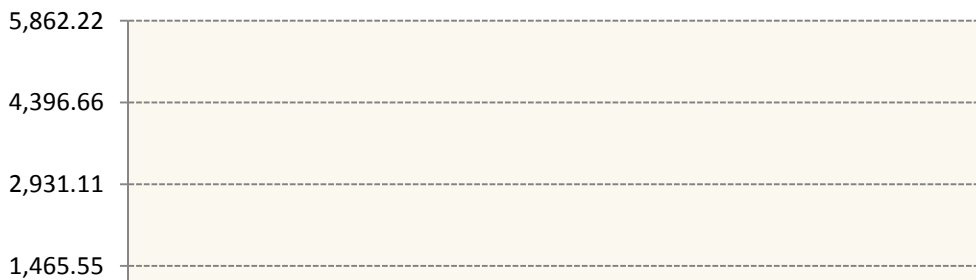
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,213	0	7,213	
누계	유가증권	스왑	71,499	0	71,499	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,963	-26,963	장내

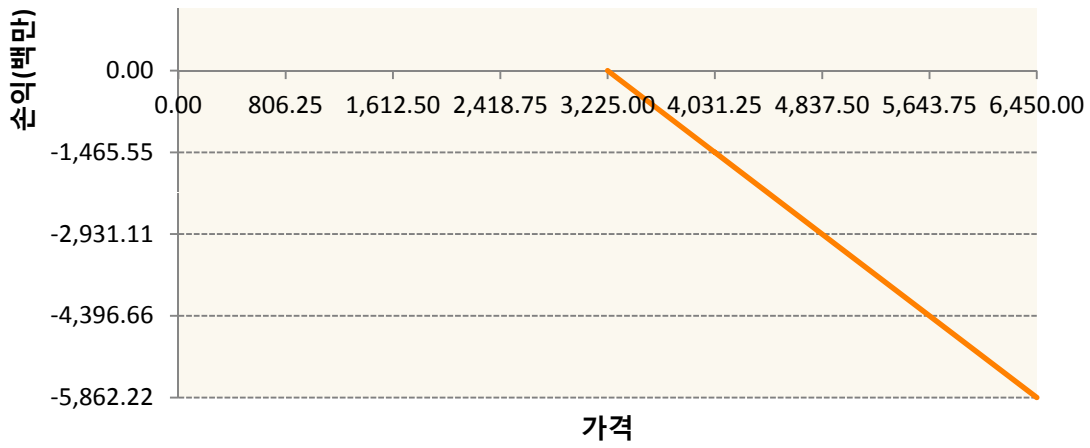
2. 만기시점의 손익구조

OESXX8-C3200-EURO STOXX 50

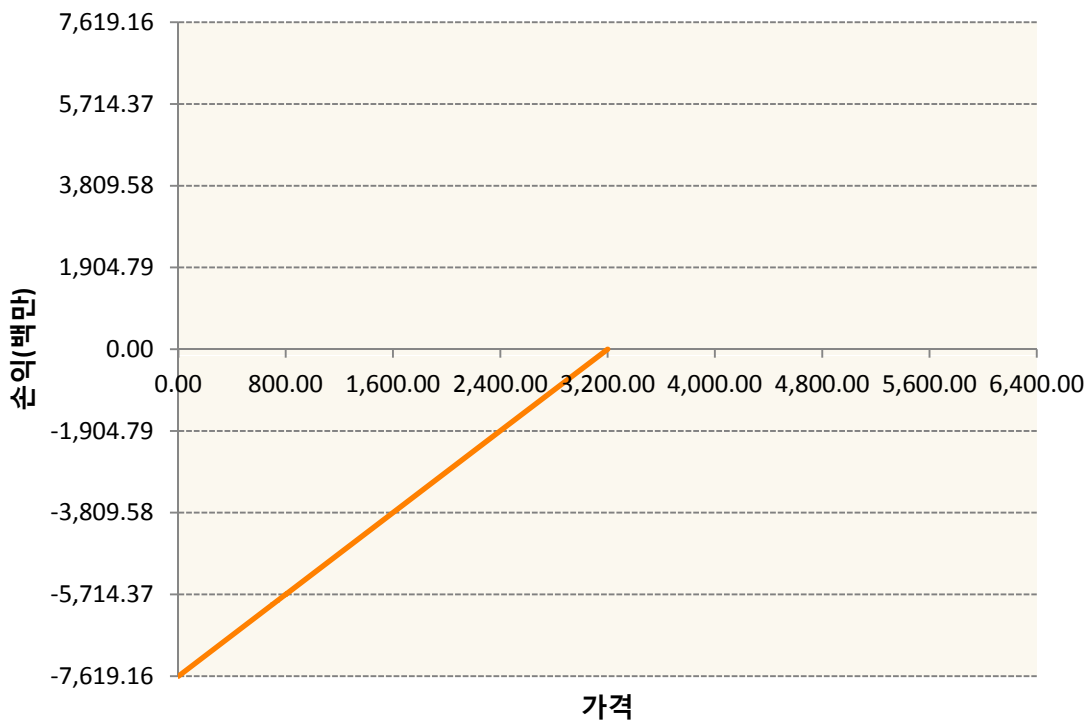


OESXX8-C3225-EURO STOXX 50

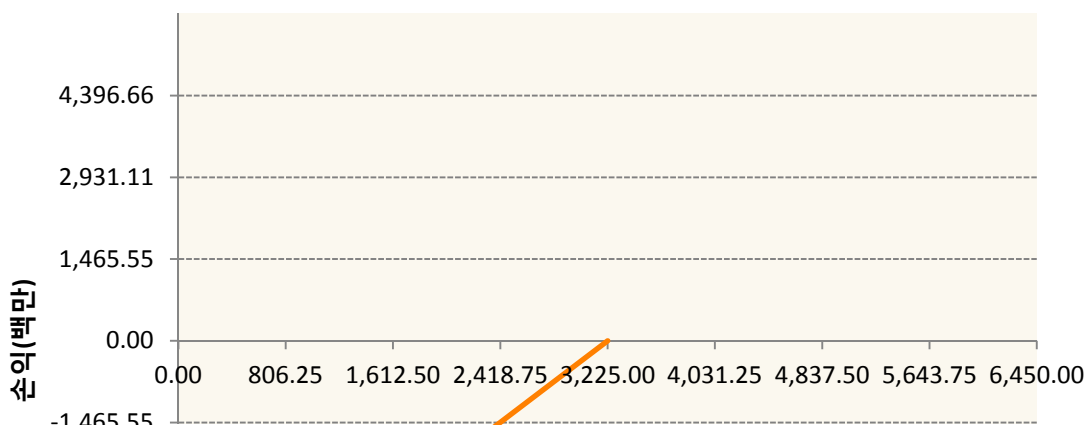


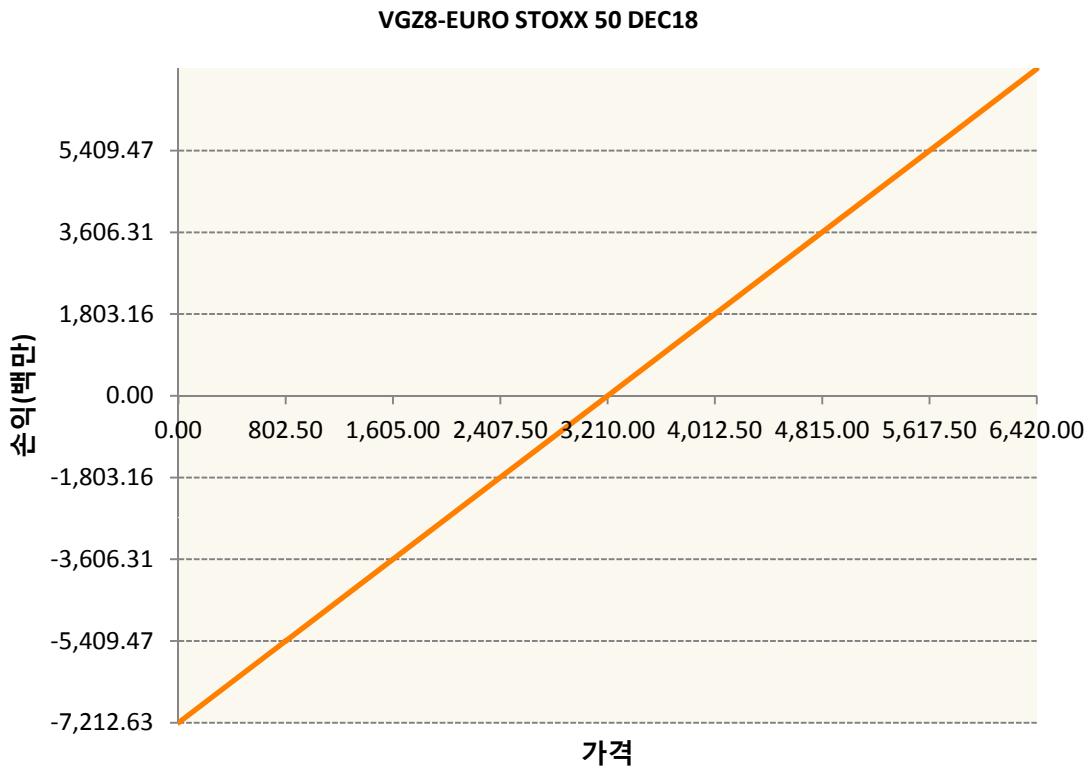
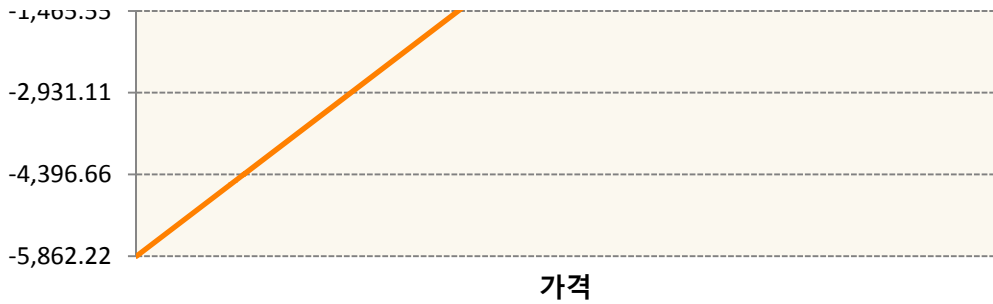


OESXX8-P3200-EURO STOXX 50



OESXX8-P3225-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	31
OESXX8-C32 EURO STOXX 50	610
OESXX8-C32 EURO STOXX 50	469
OESXX8-P32 EURO STOXX 50	610
OESXX8-P32 EURO STOXX 50	469
VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18	577

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

1,773

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

(단위:백만원)

1,156

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

(단위:백만원)

92

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

(단위:백만원)

138

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

(단위:백만원)

157

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

(단위:백만원)

41

공시일	2018-11-06
기준일	2018-11-05

리디파인K200(주식혼합-파생재간

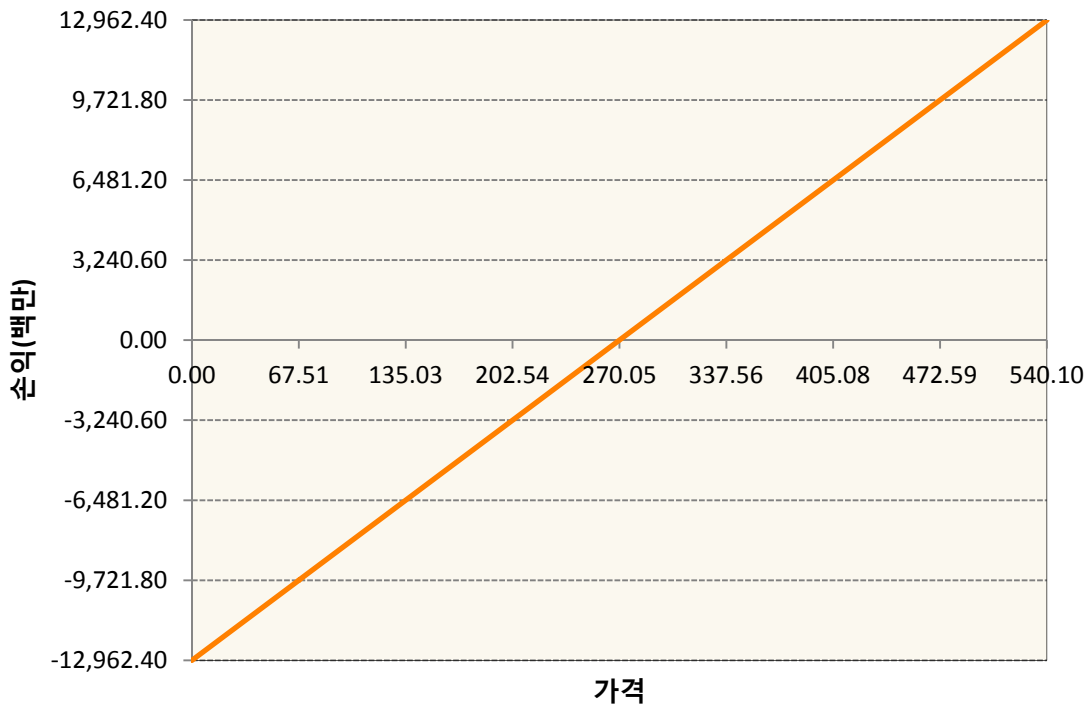
1. 계약금액

(단위:백만원)

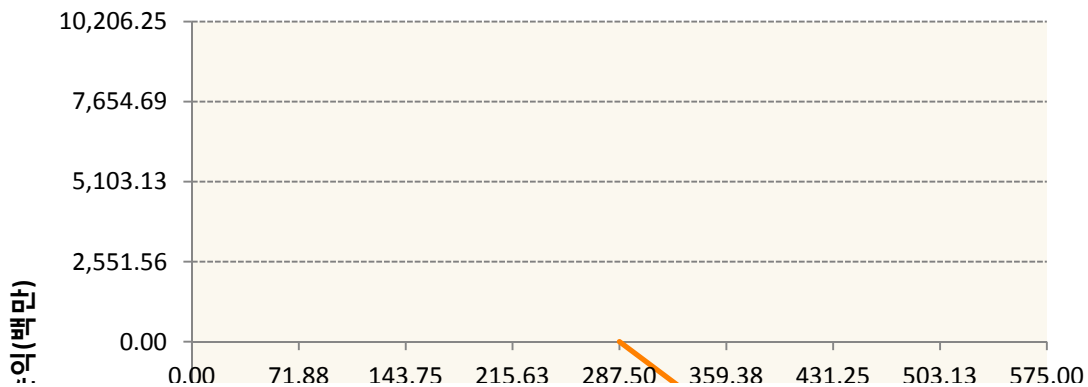
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,962	0	12,962	장내
누계	유가증권	옵션	4,059	23,401	-19,343	장내

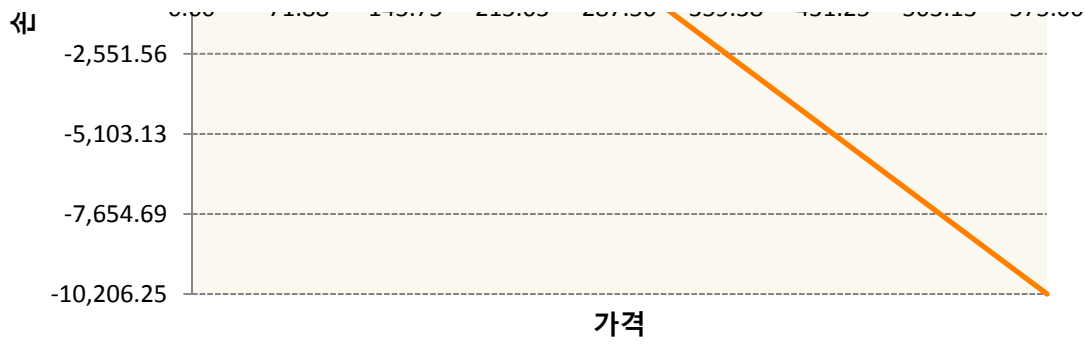
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

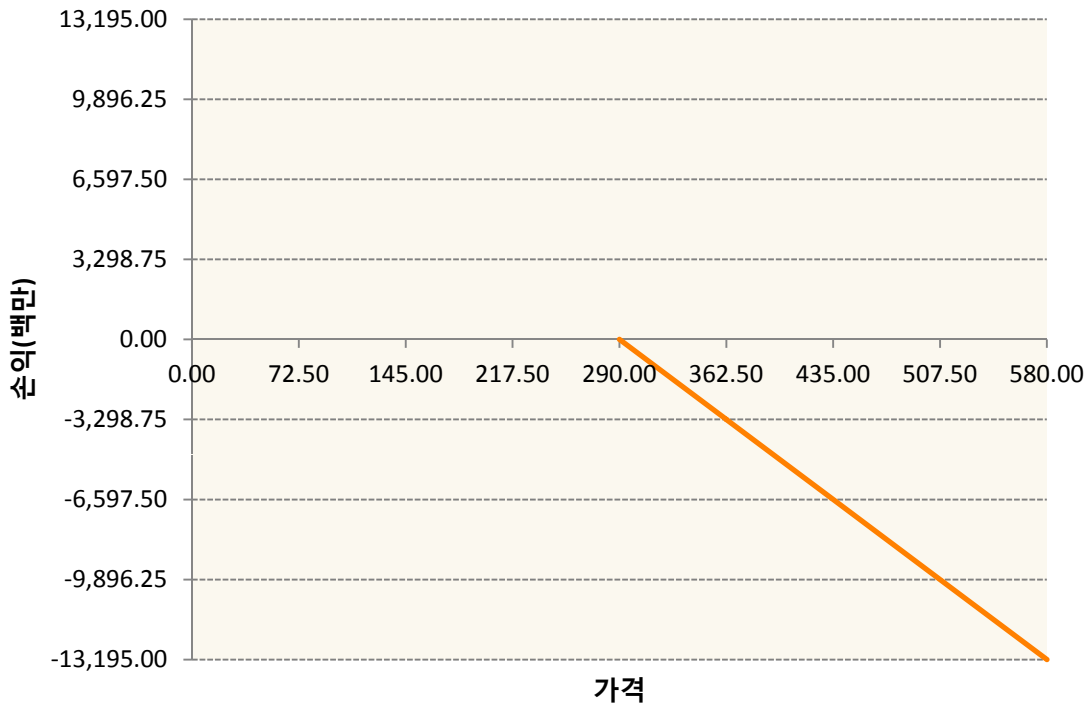


KR4201NB2877-2018-11 콜287.5

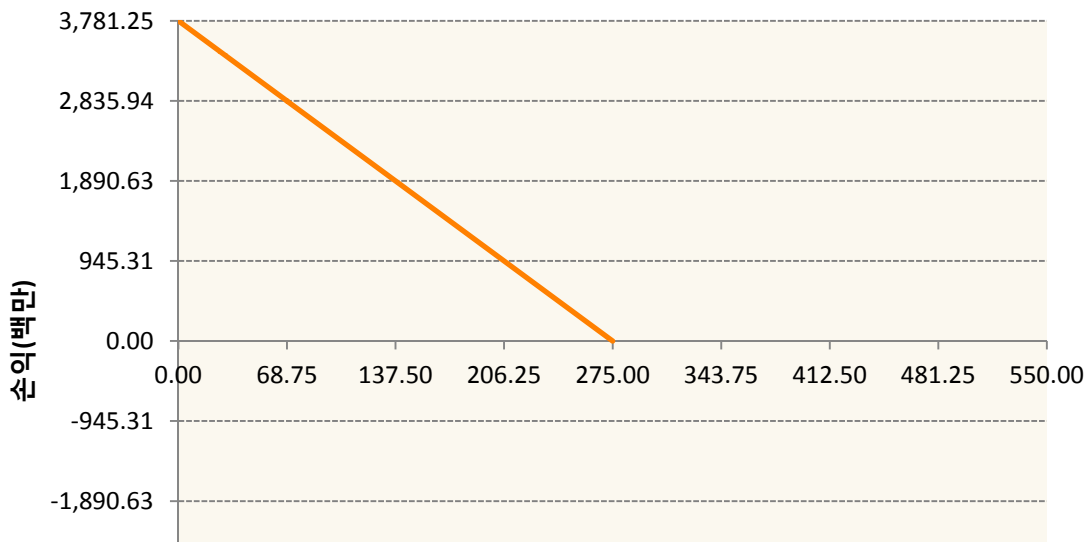


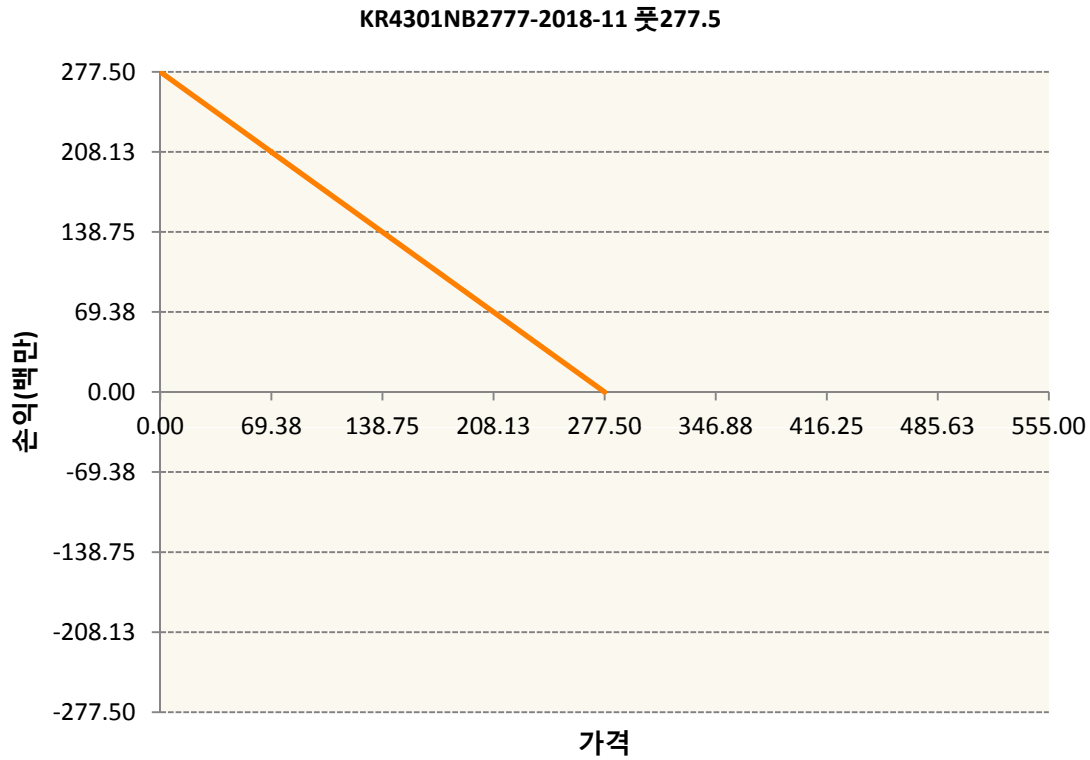
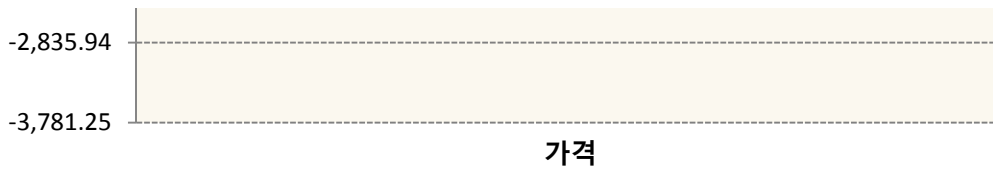


KR4201NB2901-2018-11 콜290



KR4301NB2751-2018-11 풋275





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 1,037

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,037	-1,037	-1,037	-1,037	-1,037	-1,037	-1,037
-5.33%	-691	-691	-691	-691	-691	-691	-691
-2.67%	-346	-346	-346	-346	-346	-346	-346
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	346	346	346	346	346	346	346
5.33%	691	691	691	691	691	691	691
8.00%	1,037	1,037	1,037	1,037	1,037	1,037	1,037

KR4201NB282018-11 콜287.5 214

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

0%	0	0	0	0	0	-1	-2
2.67%	-1	-3	-5	-8	-11	-14	-18
5.33%	-33	-40	-48	-55	-63	-71	-79
8.00%	-172	-178	-185	-192	-200	-207	-214

KR4201NB29 2018-11 콜290

205

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	0	-1	-2	-4	-7	-10	-13
5.33%	-19	-26	-33	-41	-49	-57	-66
8.00%	-141	-151	-162	-173	-183	-194	-205

KR4301NB27 2018-11 풋275

291

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	291	291	291	291	291	291	291
-5.33%	192	192	192	192	192	192	192
-2.67%	93	93	94	94	94	94	94
0%	-3	-2	-1	0	1	3	4
2.67%	-65	-63	-61	-59	-57	-55	-53
5.33%	-73	-73	-73	-72	-72	-71	-71
8.00%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73

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%	-6	-6	-6	-5	-5	-5	-5
5.33%	-8	-7	-7	-7	-7	-7	-7
8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8

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

(단위:백만원)

1,205

공시일	2018-11-06
기준일	2018-11-05

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

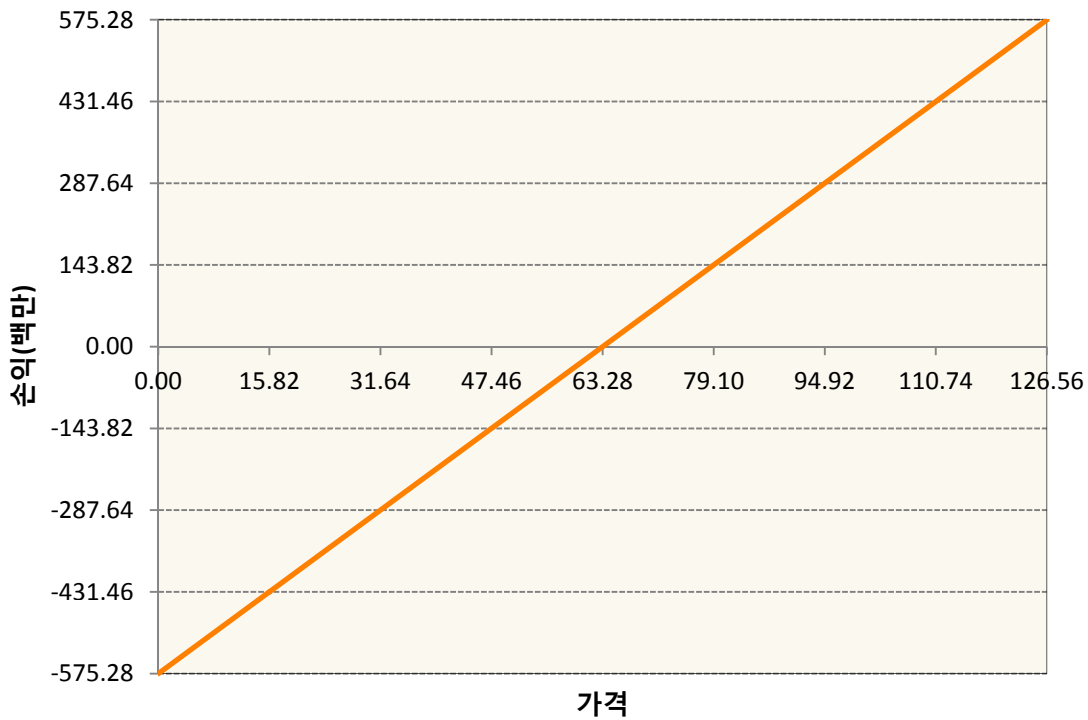
1. 계약금액

(단위:백만원)

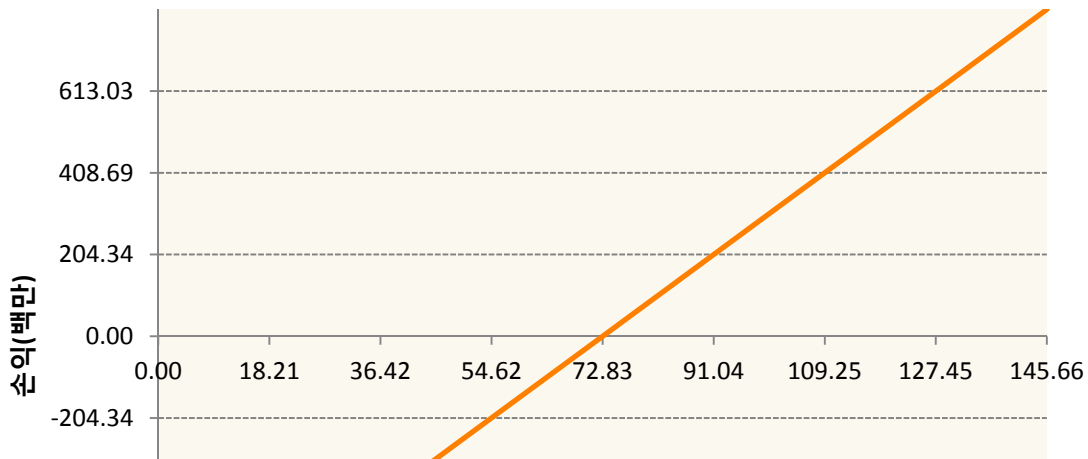
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,153	404	2,749	

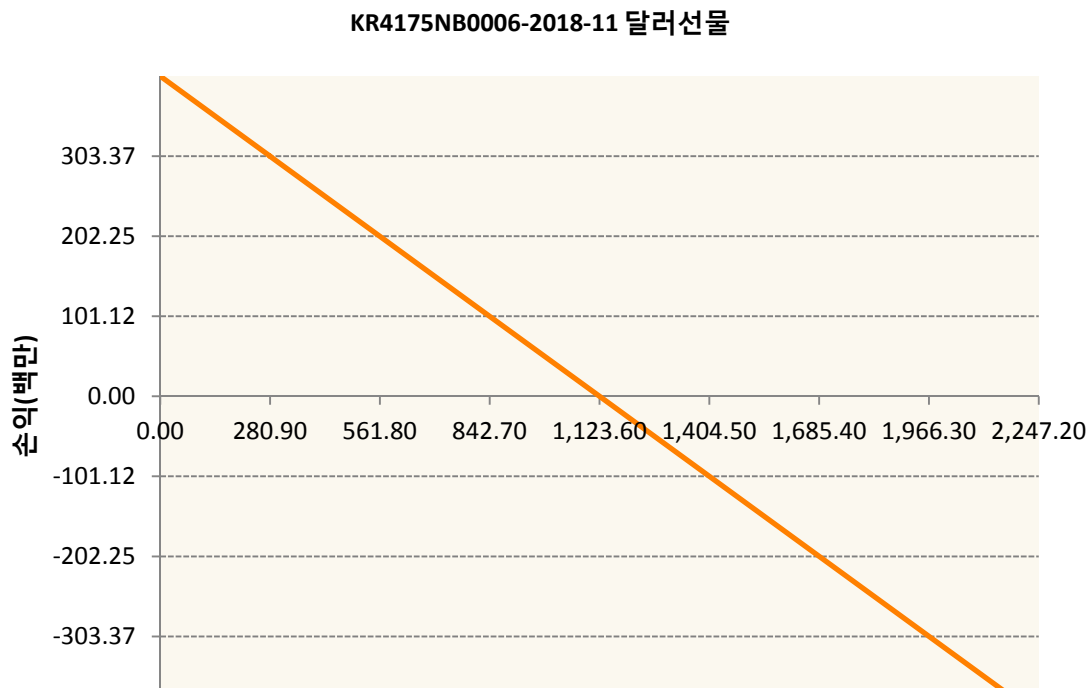
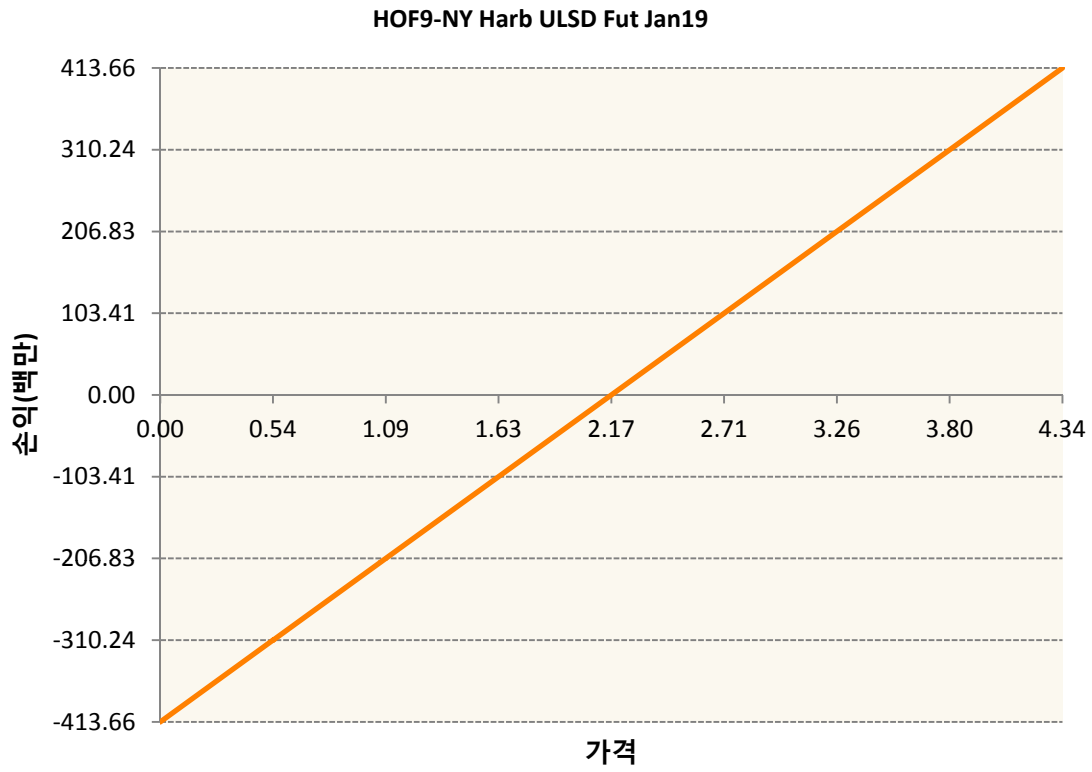
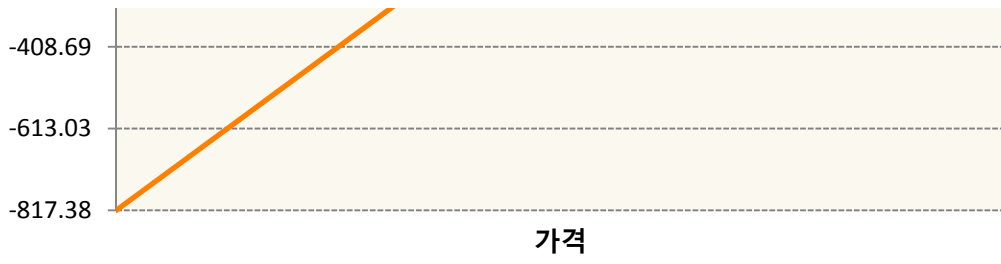
2. 만기시점의 손익구조

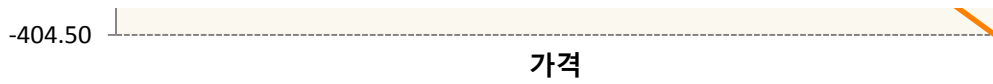
CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19



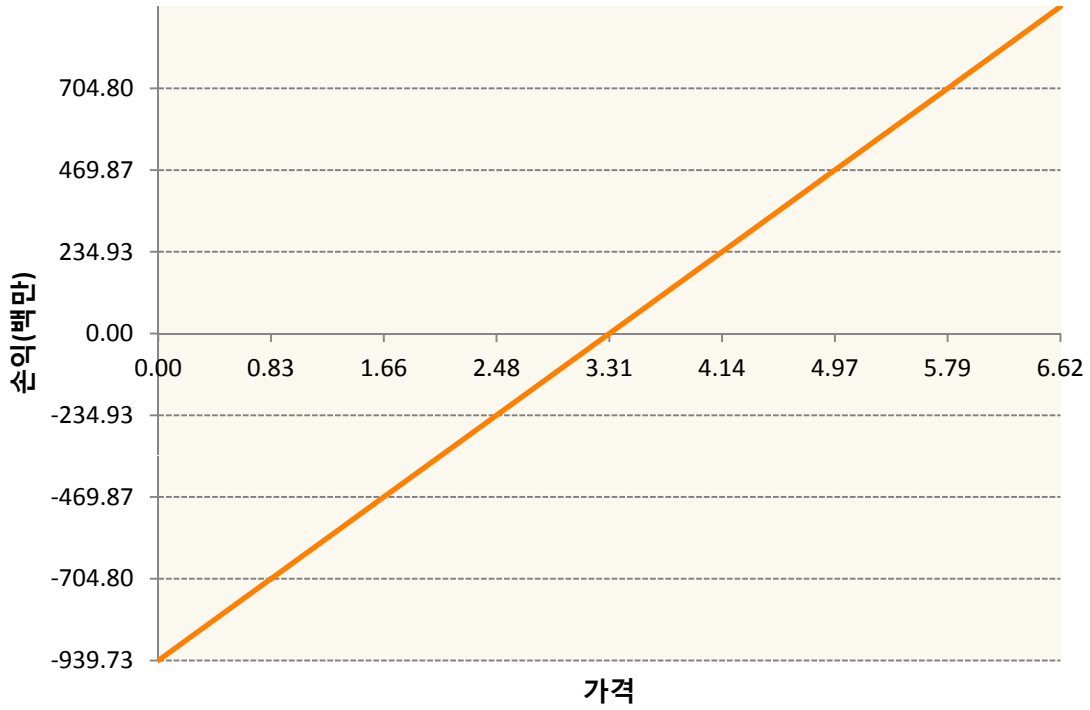
COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19



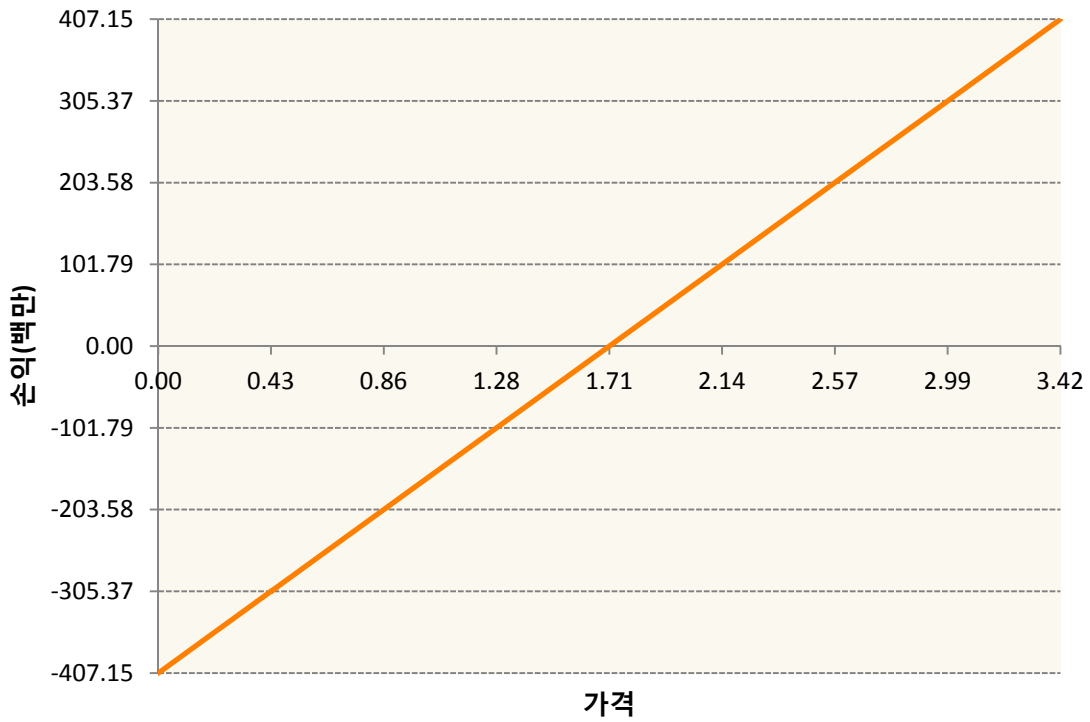




NGF19-NATURAL GAS FUTR Jan19



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	33
KR4175NB0(2018-11 달러선물	32
NGF19	NATURAL GAS FUTR Jan19	75
XBF9	GASOLINE RBOB FUT Jan19	33

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

381

공시일	2018-11-06
기준일	2018-11-05

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

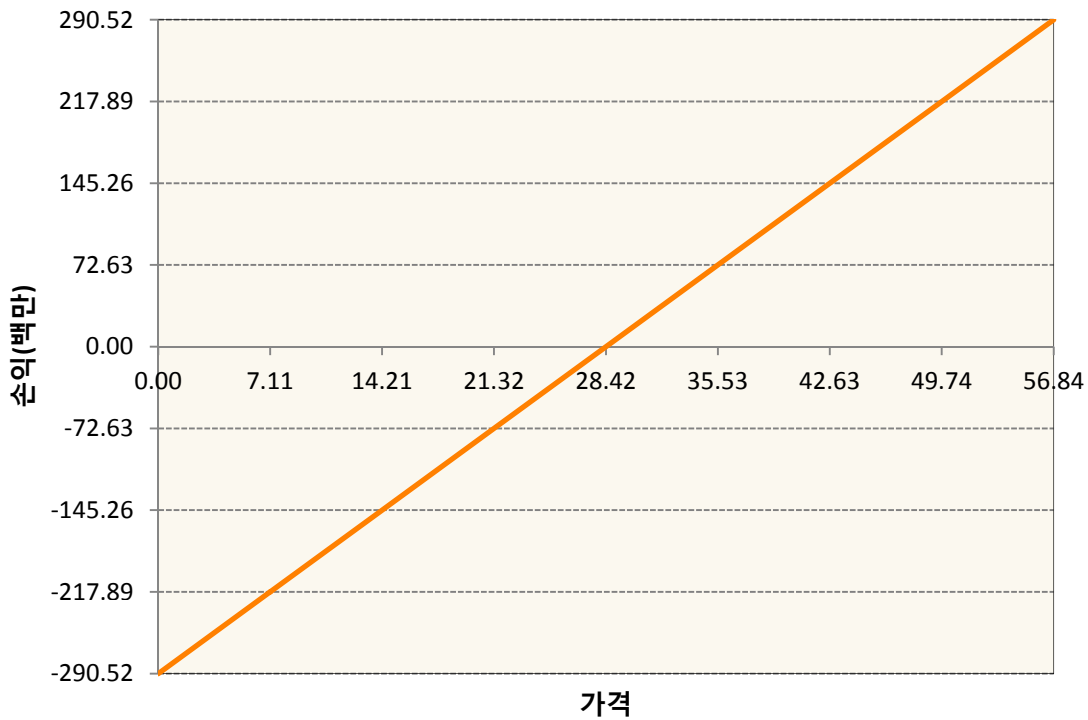
1. 계약금액

(단위:백만원)

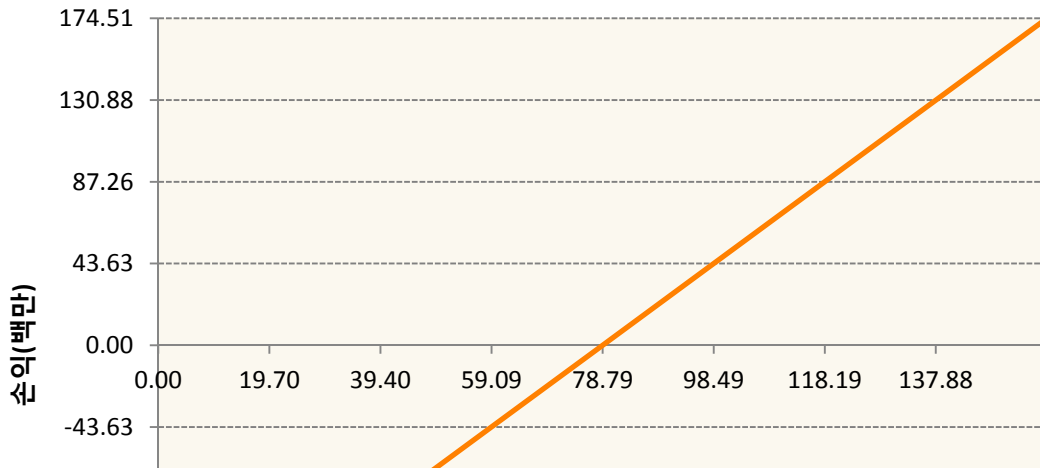
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,632	79	3,554	

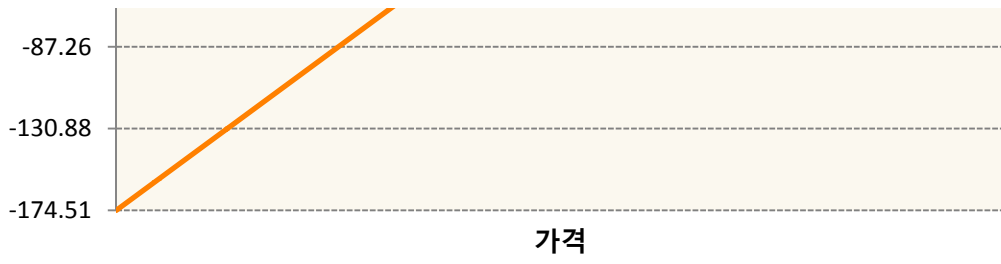
2. 만기시점의 손익구조

BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19

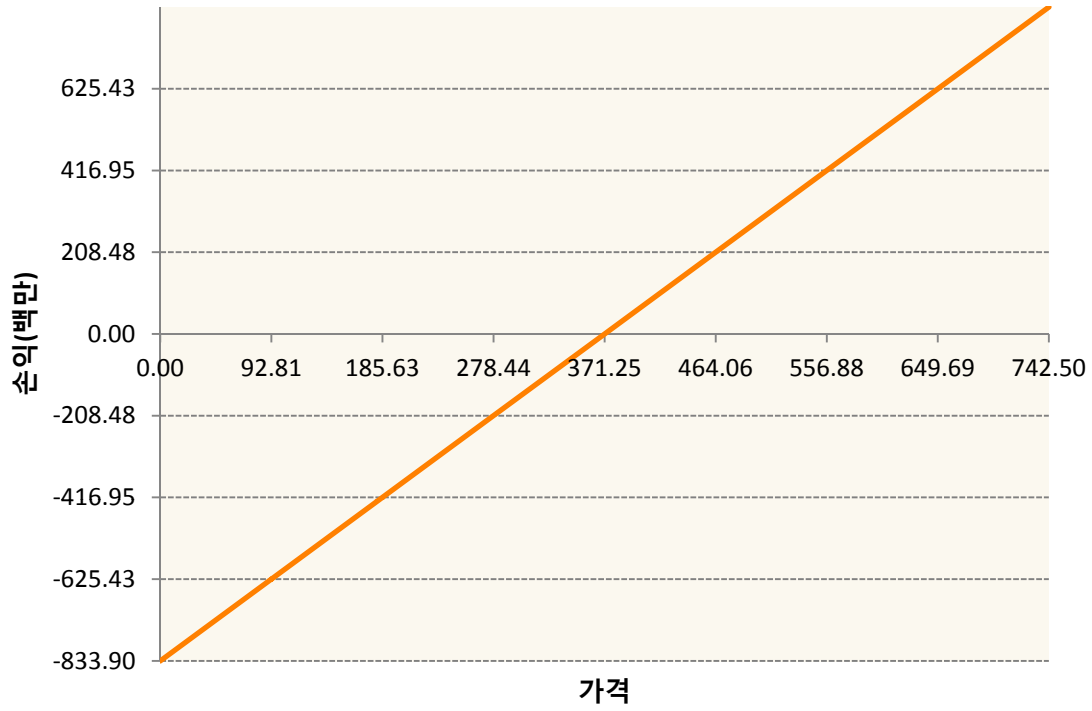


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

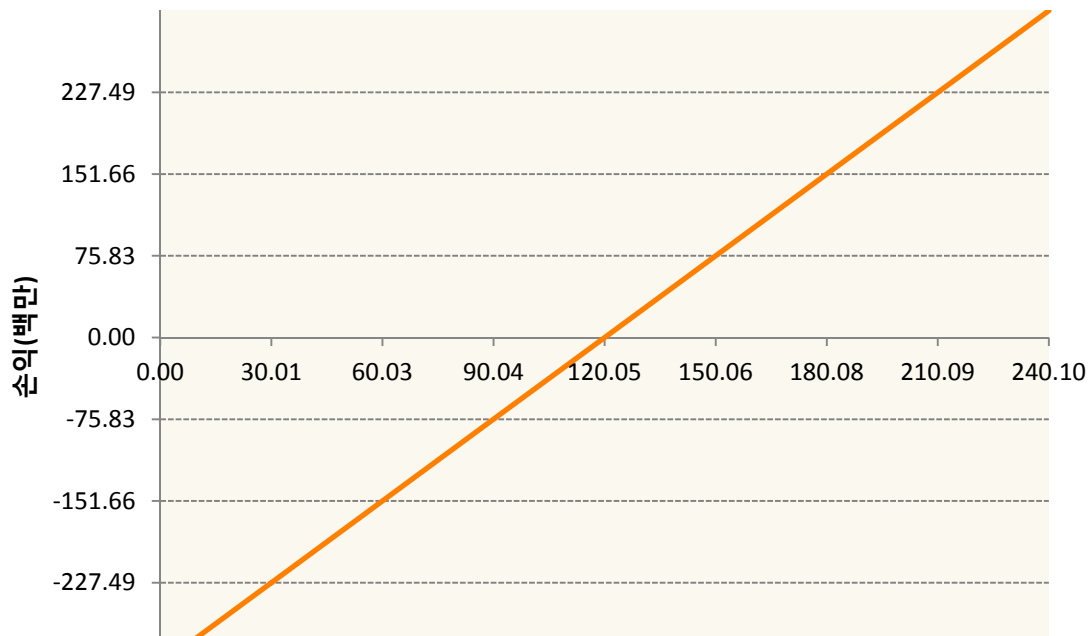


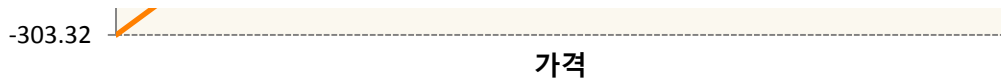


CZ8-CORN FUTURE DEC18

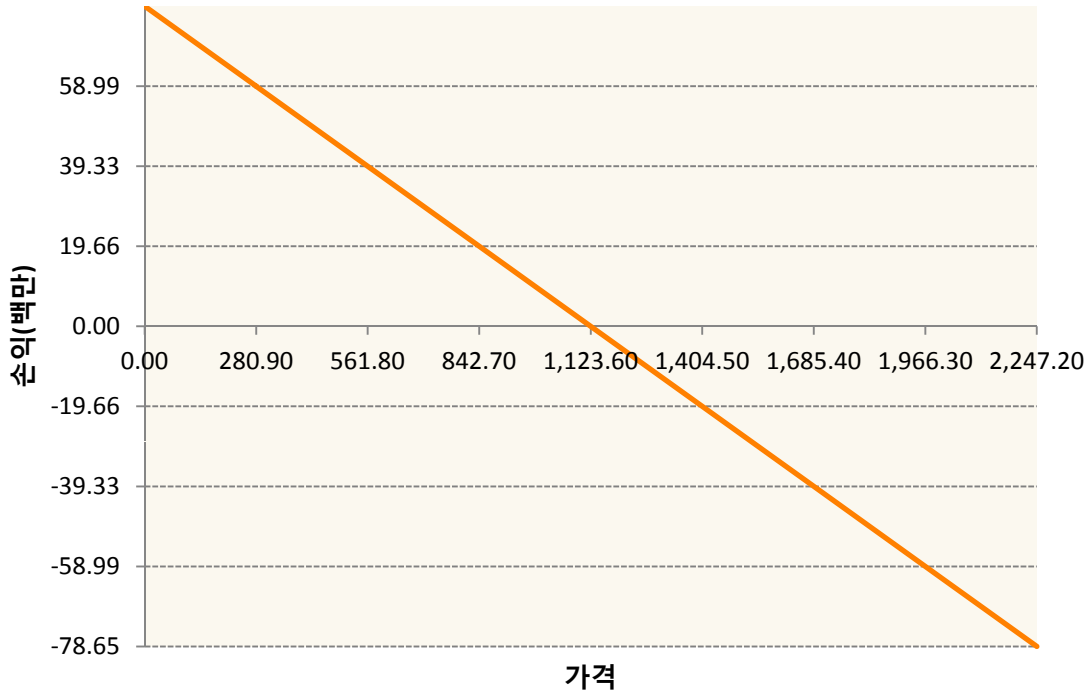


KCZ8-COFFEE 'C' FUTURE Dec18

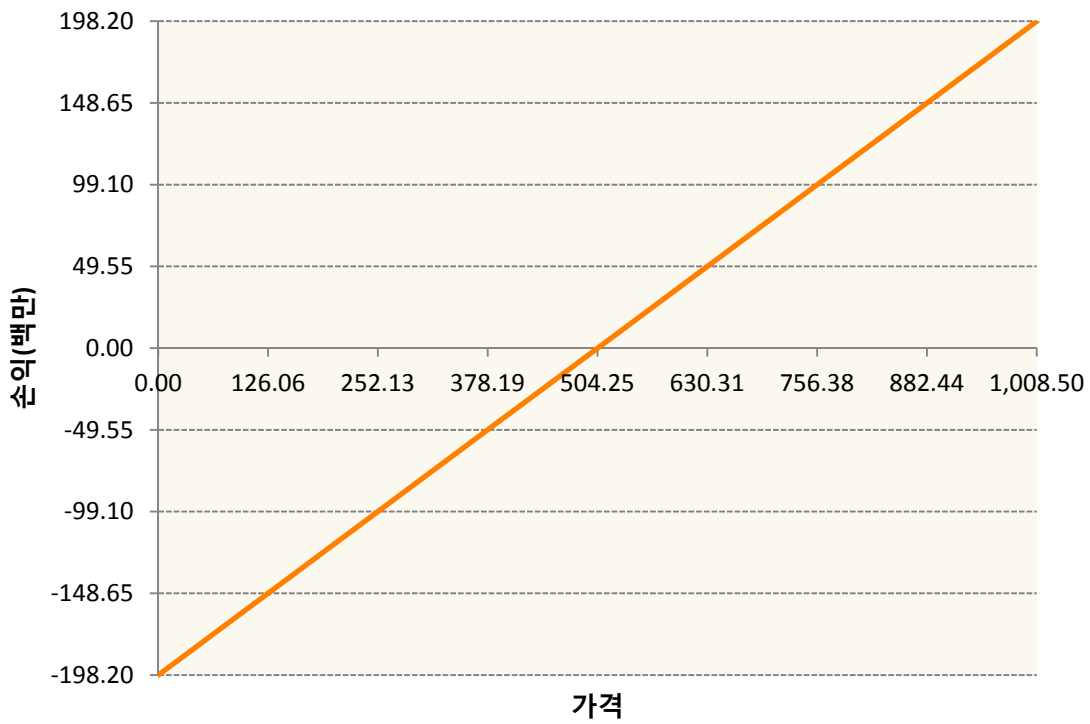




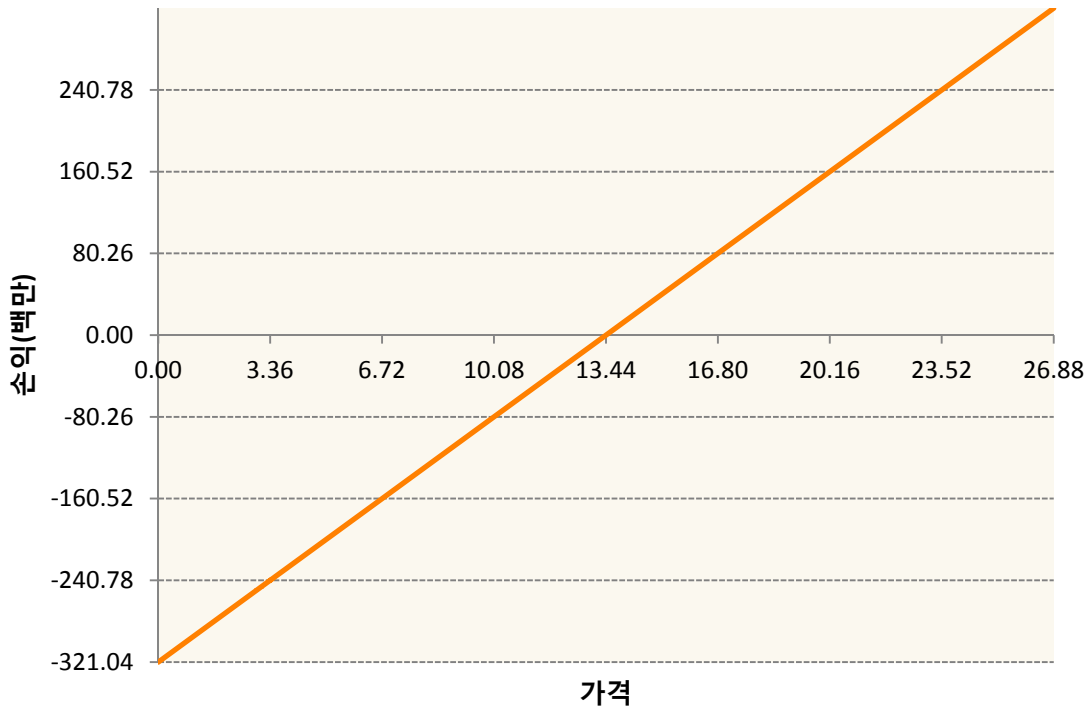
KR4175NB0006-2018-11 달러선물



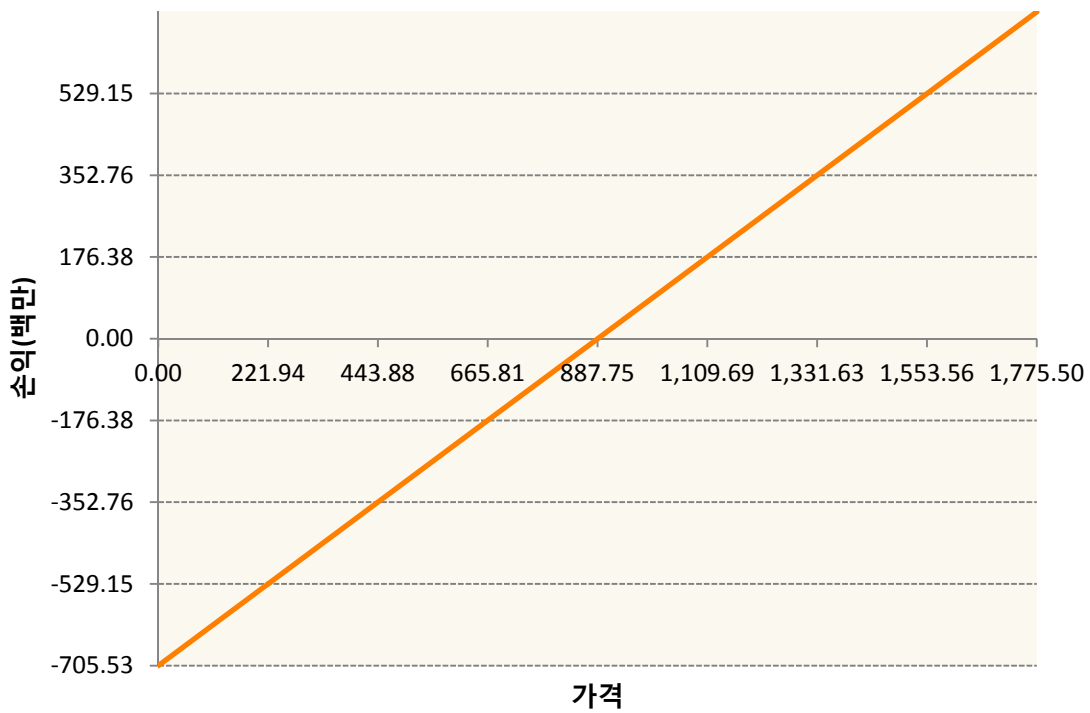
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

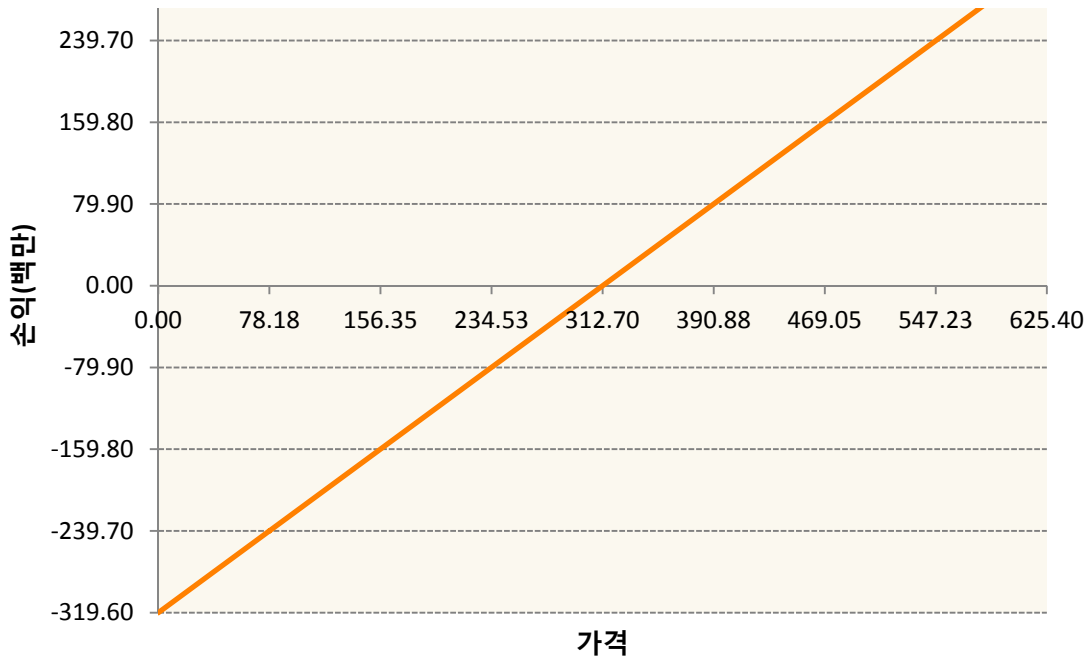


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19

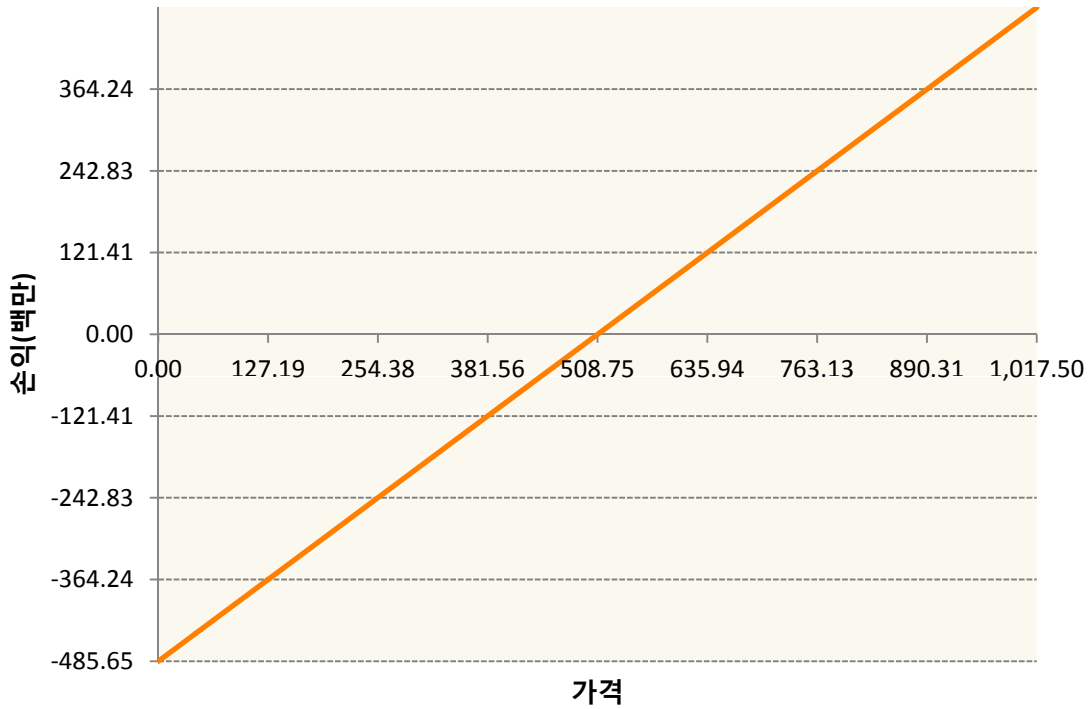


SMF9-SOYBEAN MEAL FUTR Jan19





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	67
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	56
SMF9	SOYBEAN MEAL FUTR Jan19	26
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	39

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

(단위:백만원)

317