

공시일	2018-11-07
기준일	2018-11-06

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	2018-11-07
기준일	2018-11-06

스마트인덱스모

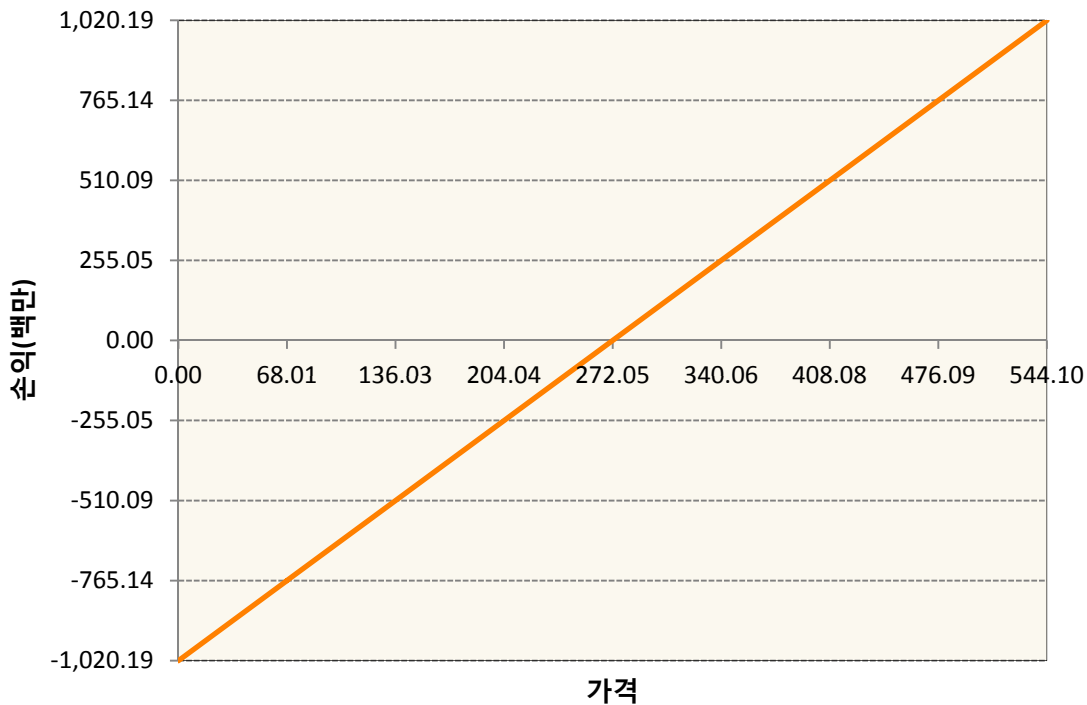
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,020	0	1,020	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	2018-11-07
기준일	2018-11-06

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)

511

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-11-07
기준일	2018-11-06

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

270

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

386

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-11-07
기준일	2018-11-06

유로인덱스모(주식-파생형)

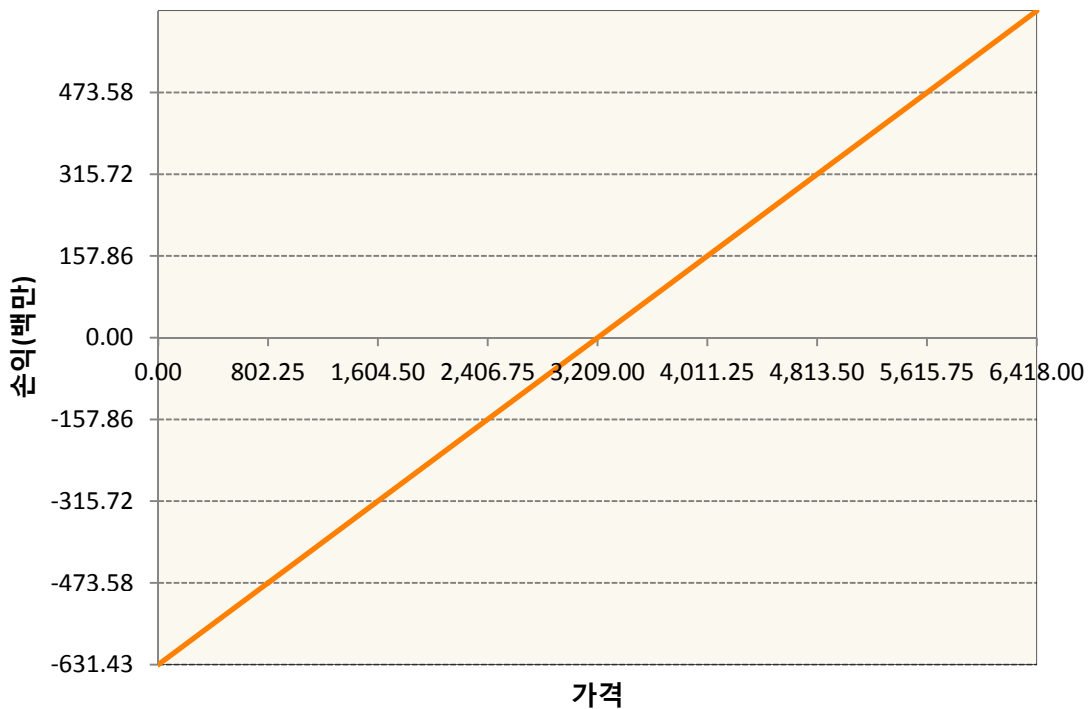
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	631	0	631	

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	2018-11-07
기준일	2018-11-06

차이나인덱스모(주식-파생형)

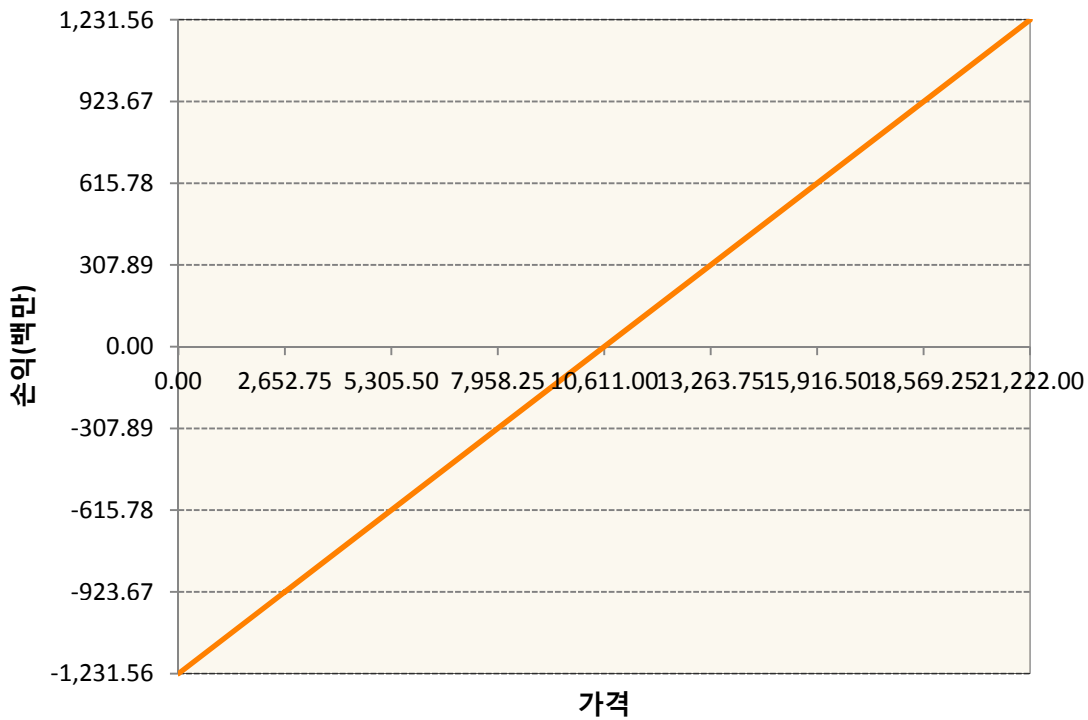
1. 계약금액

(단위:백만원)

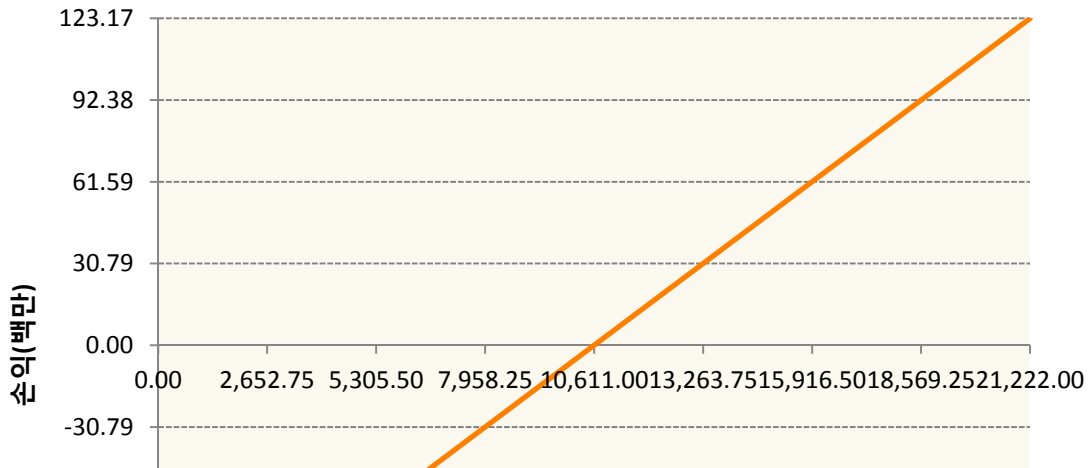
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,355	0	1,355	장내

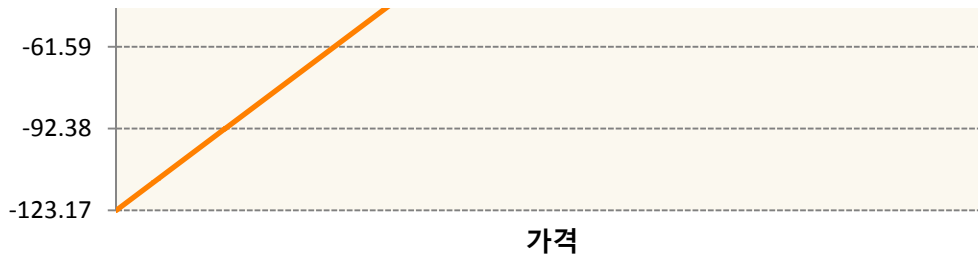
2. 만기시점의 손익구조

HCX8-HSCEI FUTURES NOV 18



MHCX8-MINI H-SHR IDX FU NOV 18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCX8	HSCEI FUTURES NOV 18	99
MHCX8	MINI H-SHR IDX FU NOV 18	10

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

107

공시일	2018-11-07
기준일	2018-11-06

커버드콜모(주식혼합-파생형)

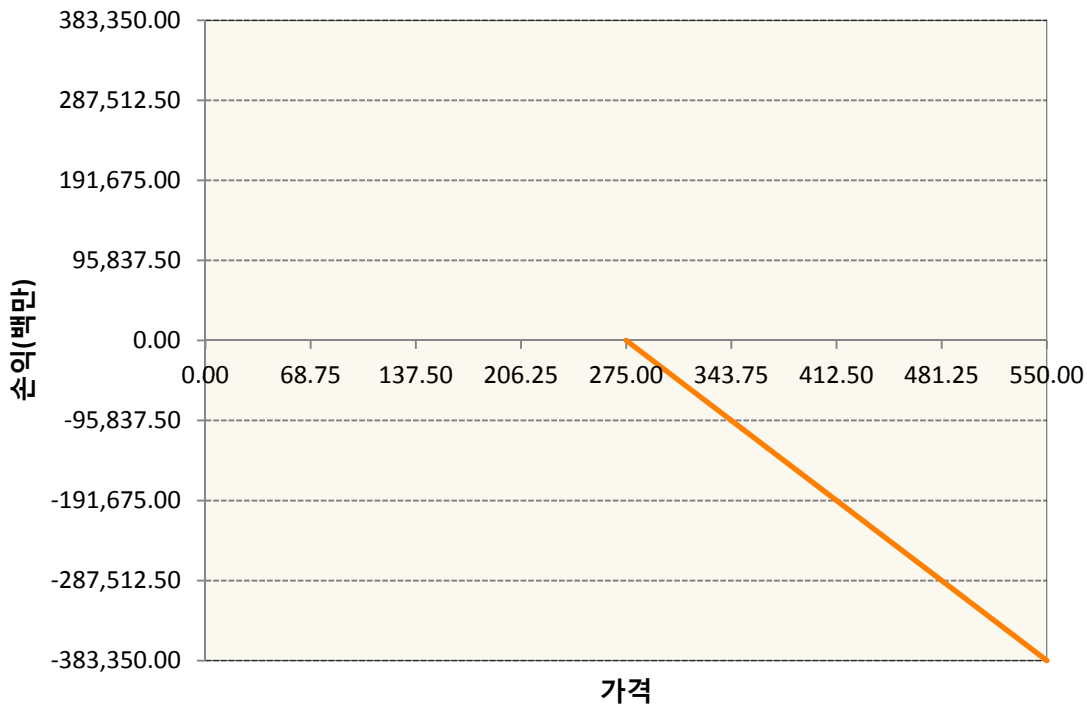
1. 계약금액

(단위:백만원)

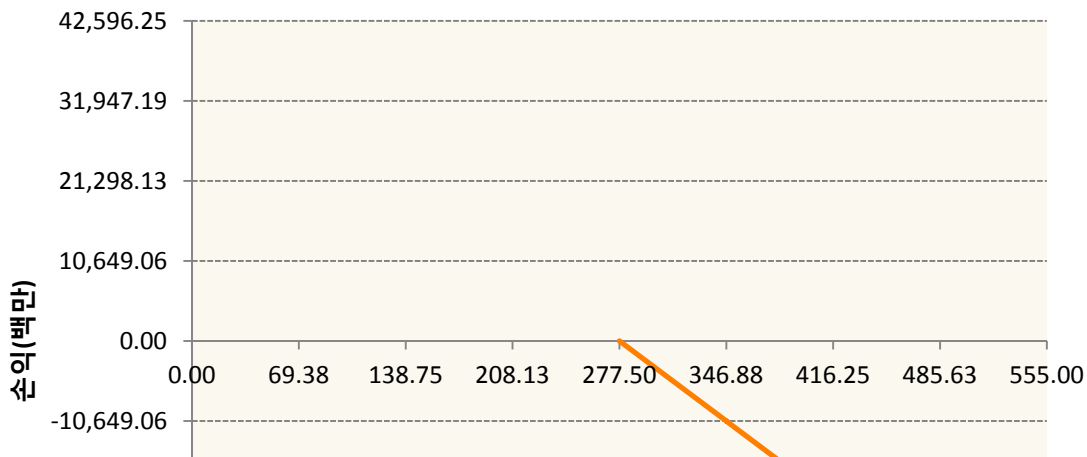
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	721,571	-721,571	장내

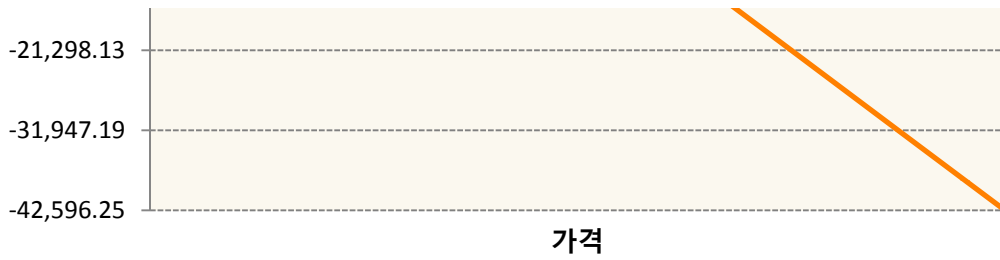
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

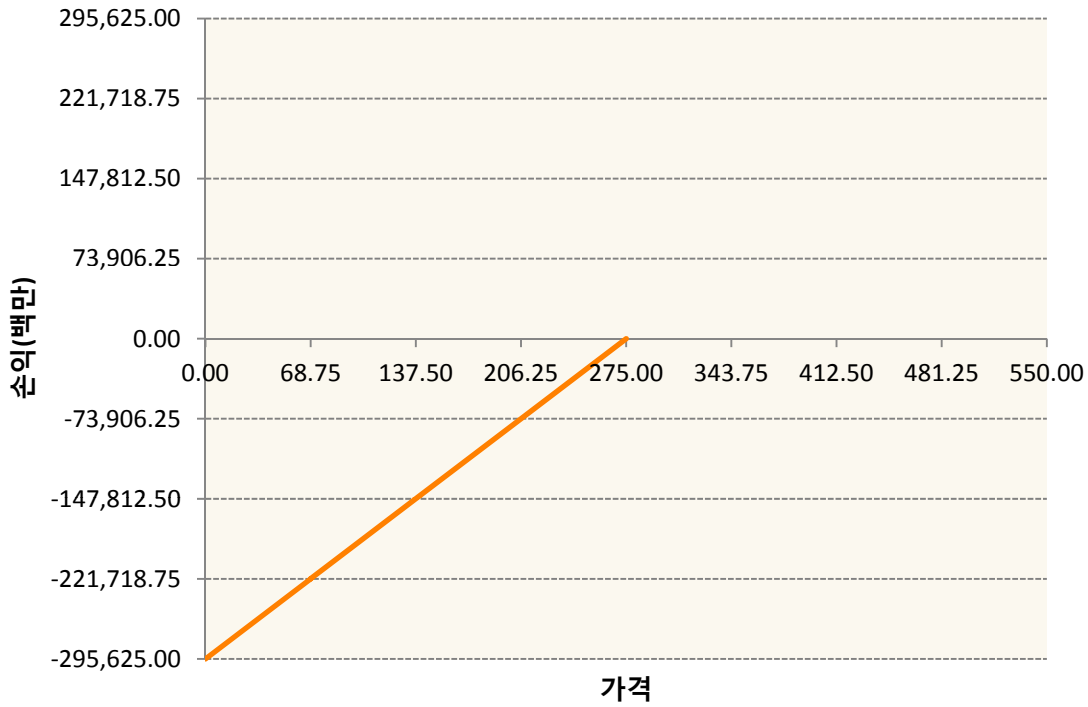


KR4201NB2778-2018-11 콜277.5





KR4301NB2751-2018-11 풋275



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NB27 2018-11 콜275

24,233

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,274	1,274	1,274	1,274	1,274	1,274	1,274
-5.33%	1,274	1,274	1,274	1,273	1,272	1,268	1,262
-2.67%	1,265	1,253	1,231	1,198	1,154	1,096	1,026
0%	602	411	210	0	-217	-439	-665
2.67%	-4,621	-4,803	-4,998	-5,202	-5,414	-5,633	-5,857
5.33%	-14,130	-14,143	-14,167	-14,201	-14,249	-14,310	-14,384
8.00%	-24,214	-24,214	-24,214	-24,216	-24,218	-24,224	-24,233

KR4201NB27 2018-11 콜277.5

2,365

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	64	64	64	64	64	64	64

-5.33%	64	64	64	64	64	63	63
-2.67%	64	63	63	61	59	56	52
0%	41	29	15	0	-17	-35	-55
2.67%	-309	-337	-365	-393	-421	-449	-478
5.33%	-1,254	-1,259	-1,266	-1,274	-1,285	-1,297	-1,311
8.00%	-2,359	-2,359	-2,360	-2,360	-2,361	-2,363	-2,365

KR4301NB27 2018-11 풋275

22,893

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,893	-22,893	-22,893	-22,893	-22,893	-22,893	-22,893
-5.33%	-15,109	-15,109	-15,109	-15,109	-15,109	-15,109	-15,109
-2.67%	-7,325	-7,325	-7,326	-7,329	-7,333	-7,341	-7,352
0%	261	182	95	0	-101	-207	-317
2.67%	3,994	3,923	3,842	3,753	3,657	3,556	3,450
5.33%	4,156	4,155	4,154	4,151	4,146	4,138	4,126
8.00%	4,156	4,156	4,156	4,156	4,156	4,156	4,156

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

(단위:백만원)

61,639

공시일	2018-11-07
기준일	2018-11-06

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

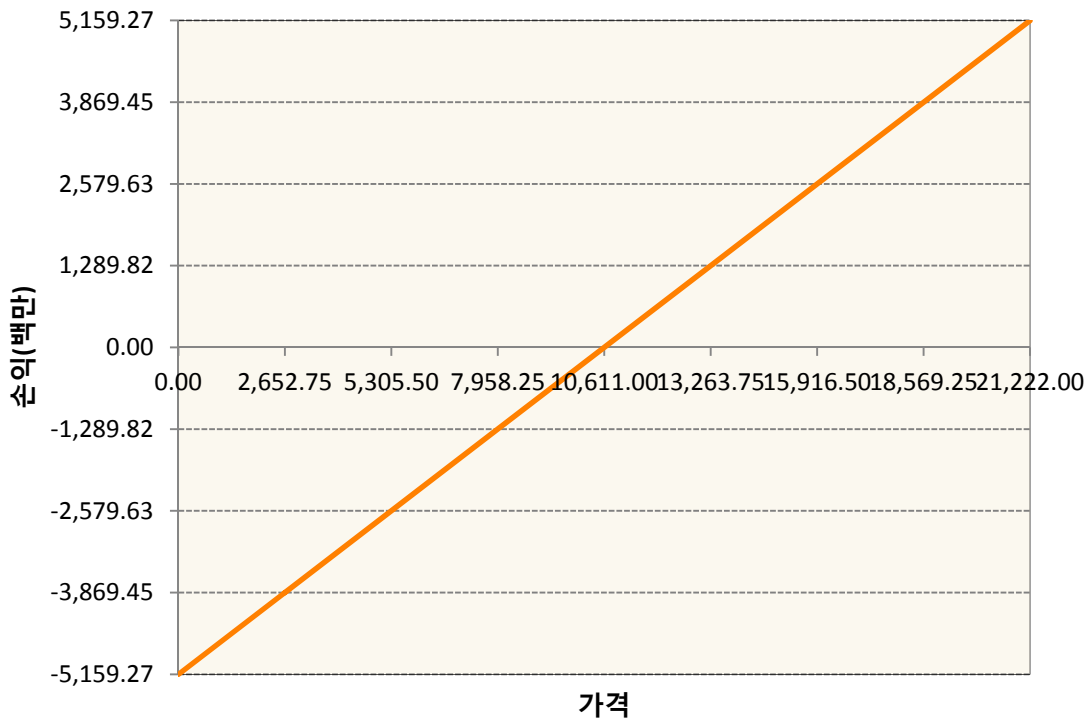
1. 계약금액

(단위:백만원)

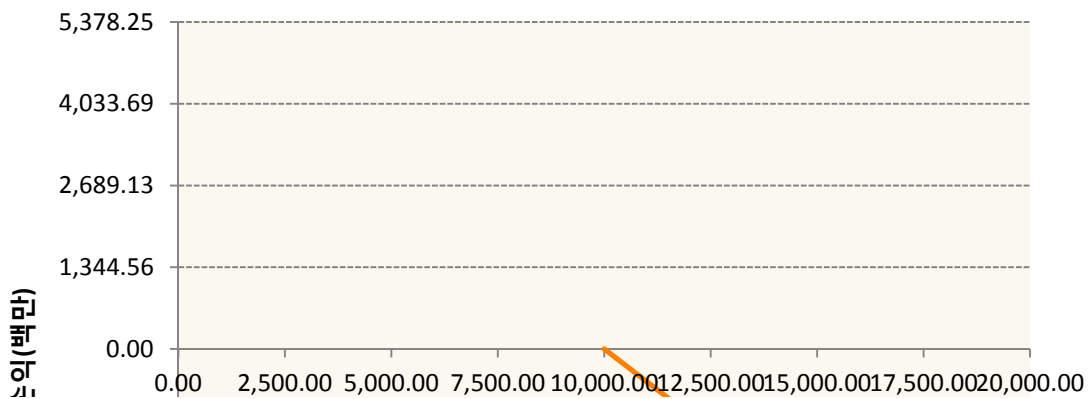
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,159	0	5,159	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,757	-10,757	장내

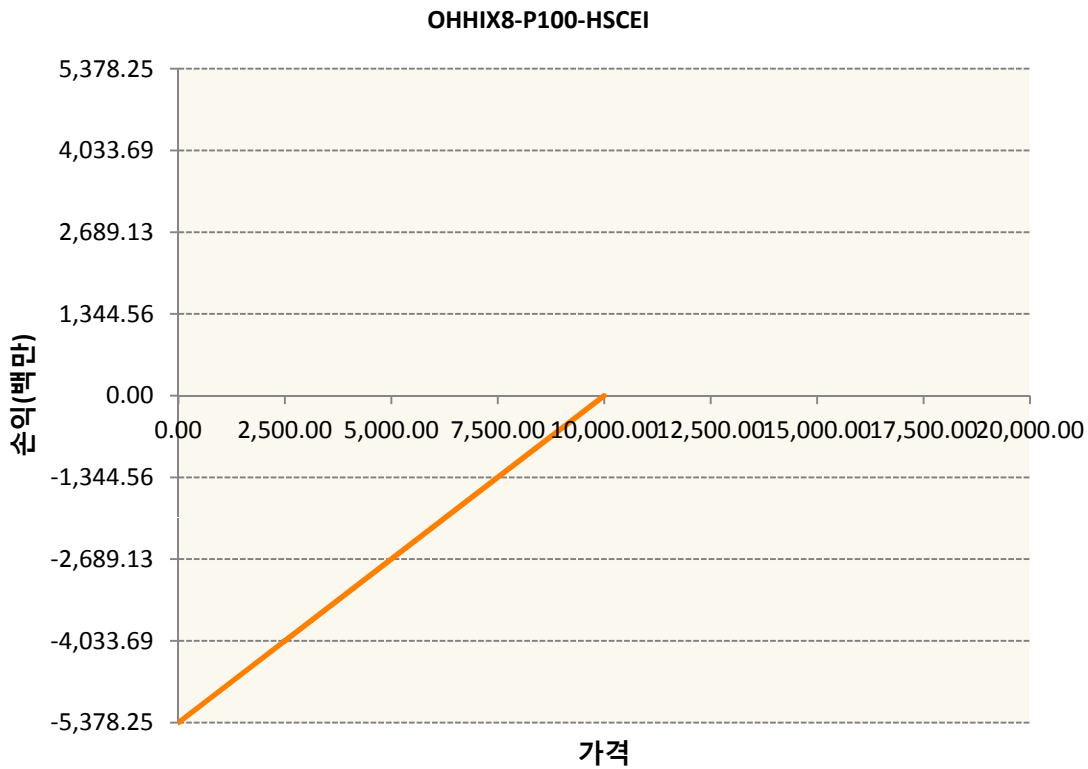
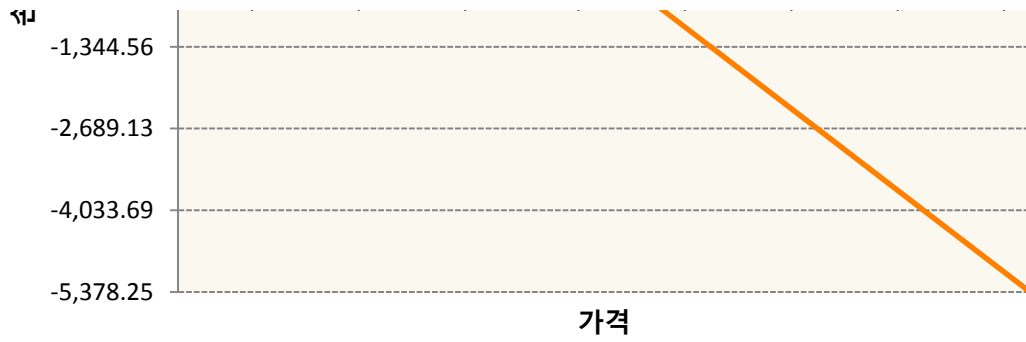
2. 만기시점의 손익구조

HCX8-HSCEI FUTURES NOV 18



OHHIX8-C100-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCX8	HSCEI FUTURES NOV 18	413
	OHHIX8-C1C HSCEI	430
	OHHIX8-P10 HSCEI	430

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,255

공시일	2018-11-07
기준일	2018-11-06

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

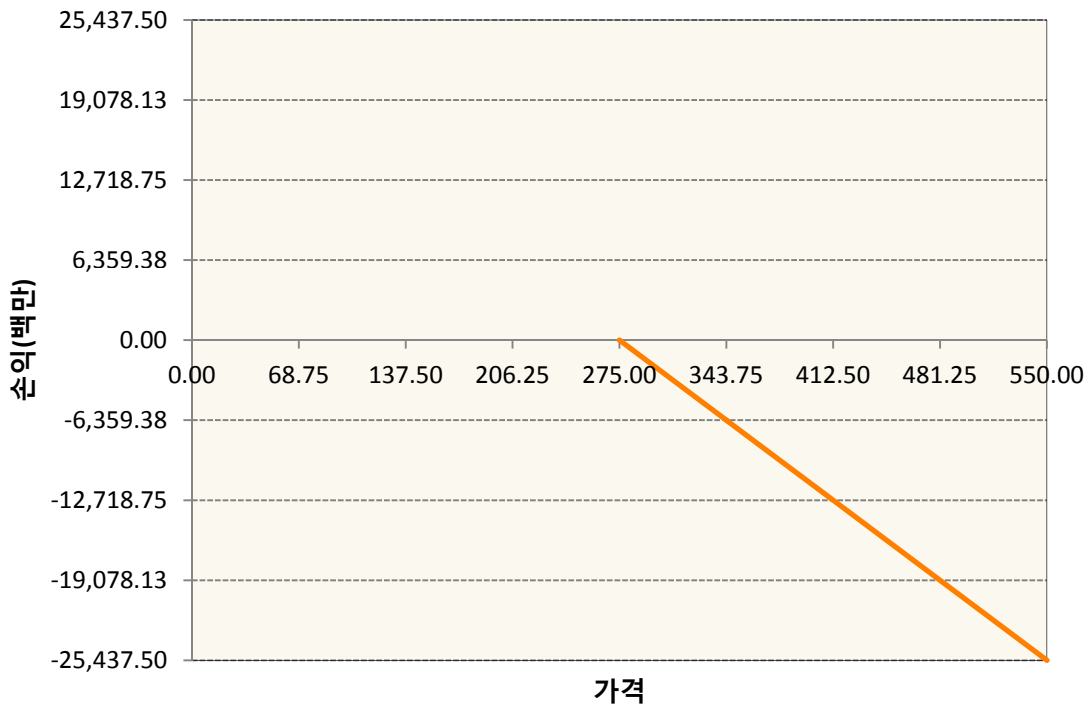
1. 계약금액

(단위:백만원)

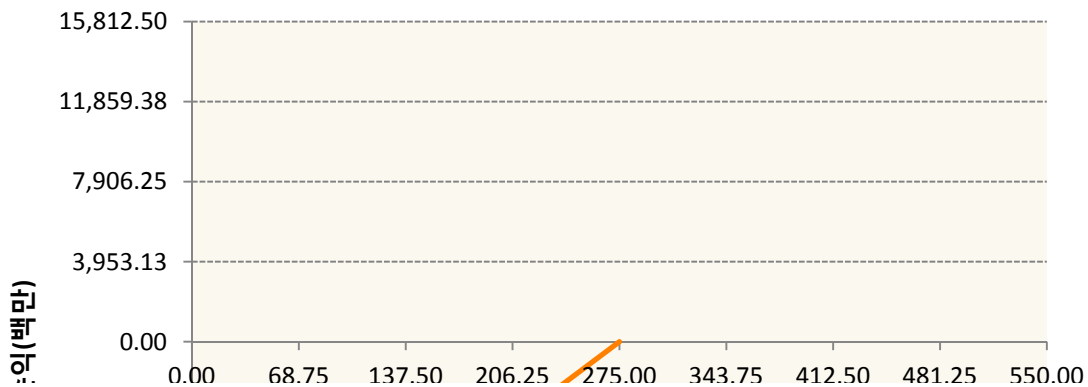
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	43,836	0	43,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	44,025	-44,025	장내

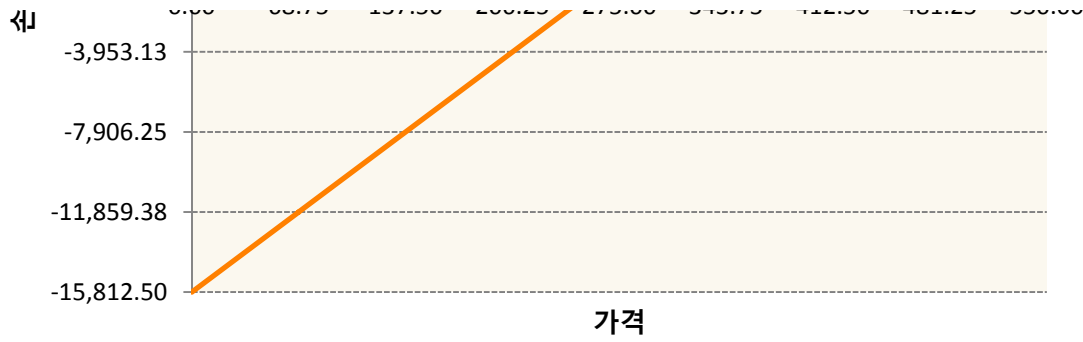
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

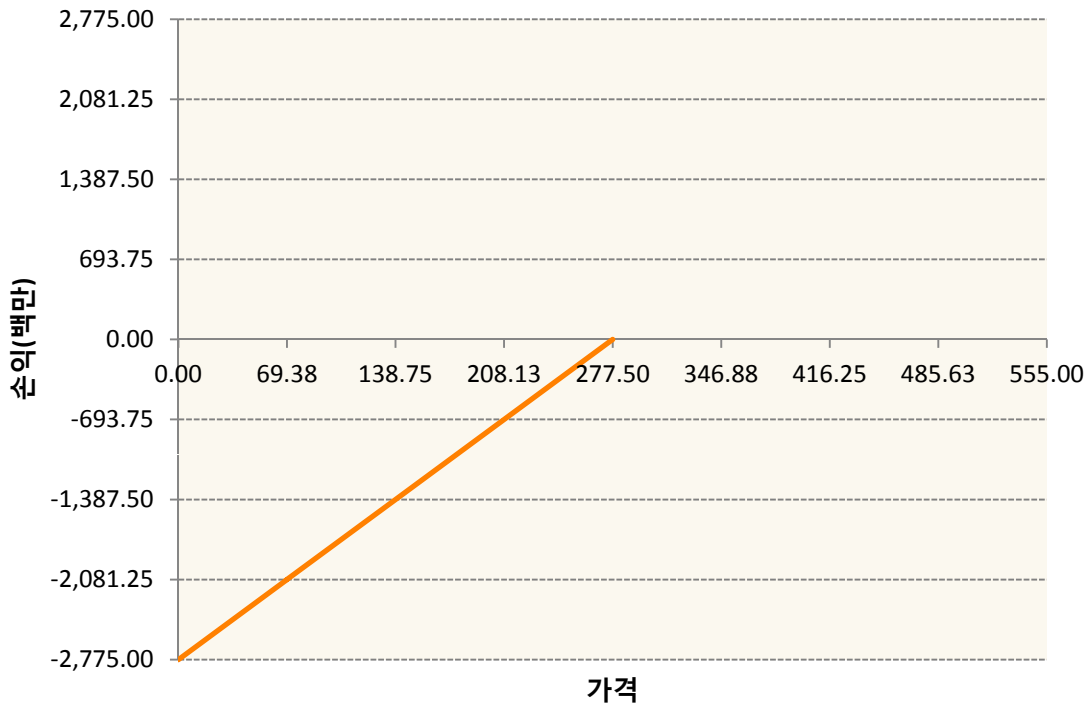


KR4301NB2751-2018-11 풋275





KR4301NB2777-2018-11 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,581	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,581	-3,581	-3,581	-3,581	-3,581	-3,581	-3,581	
-5.33%	-2,387	-2,387	-2,387	-2,387	-2,387	-2,387	-2,387	
-2.67%	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	1,194	1,194	1,194	1,194	1,194	1,194	1,194	
5.33%	2,387	2,387	2,387	2,387	2,387	2,387	2,387	
8.00%	3,581	3,581	3,581	3,581	3,581	3,581	3,581	
KR4201NB27 2018-11 콜275							1,608	
	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	84	84	84	84
-2.67%	84	83	82	80	77	73	68
0%	40	27	14	0	-14	-29	-44
2.67%	-307	-319	-332	-345	-359	-374	-389
5.33%	-938	-938	-940	-942	-946	-950	-954
8.00%	-1,607	-1,607	-1,607	-1,607	-1,607	-1,607	-1,608

KR4301NB27 2018-11 풋275

1,224

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,224	-1,224	-1,224	-1,224	-1,224	-1,224	-1,224
-5.33%	-808	-808	-808	-808	-808	-808	-808
-2.67%	-392	-392	-392	-392	-392	-393	-393
0%	14	10	5	0	-5	-11	-17
2.67%	214	210	206	201	196	190	185
5.33%	222	222	222	222	222	221	221
8.00%	222	222	222	222	222	222	222

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

216

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-216	-216	-216	-216	-216	-216	-216
-5.33%	-144	-144	-144	-144	-144	-144	-144
-2.67%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71
0%	1	1	0	0	0	-1	-2
2.67%	54	53	51	50	49	48	46
5.33%	61	61	60	60	60	60	60
8.00%	61	61	61	61	61	61	61

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

(단위:백만원)

7,390

공시일	2018-11-07
기준일	2018-11-06

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

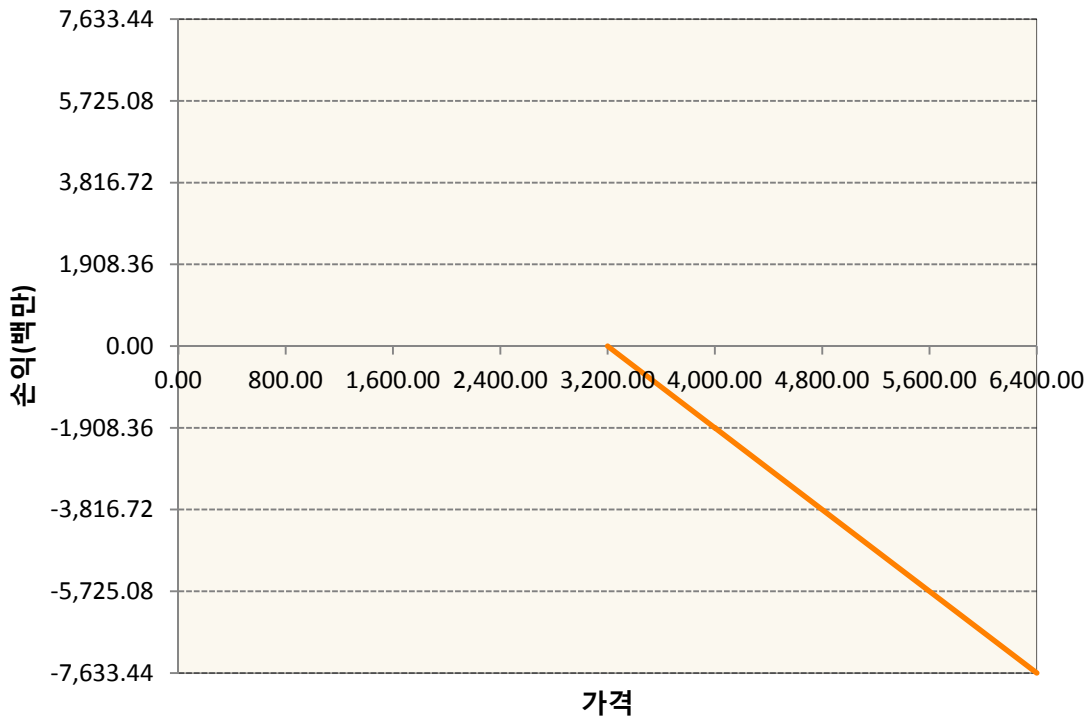
1. 계약금액

(단위:백만원)

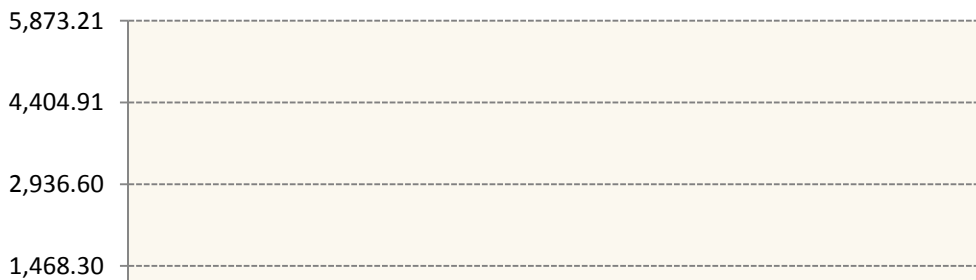
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,210	0	7,210	
누계	유가증권	스왑	71,634	0	71,634	장외
누계	유가증권	옵션	0	27,013	-27,013	장내

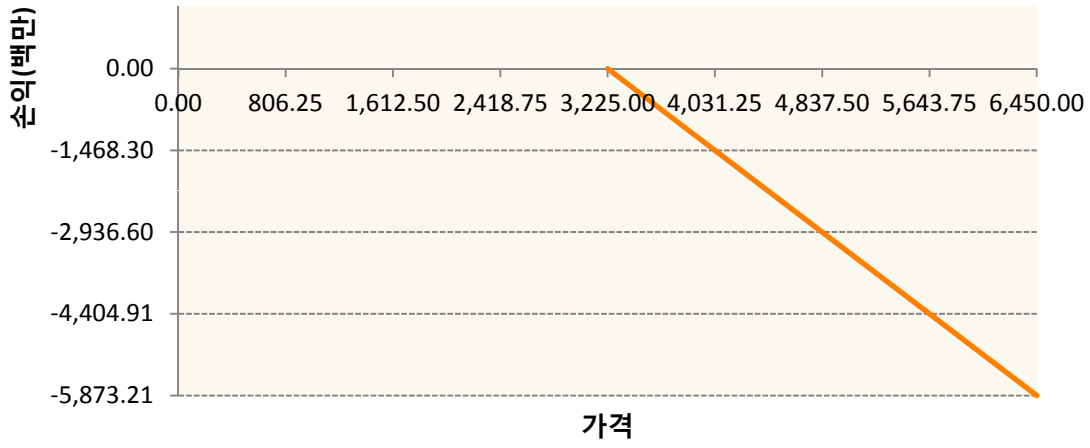
2. 만기시점의 손익구조

OESXX8-C3200-EURO STOXX 50

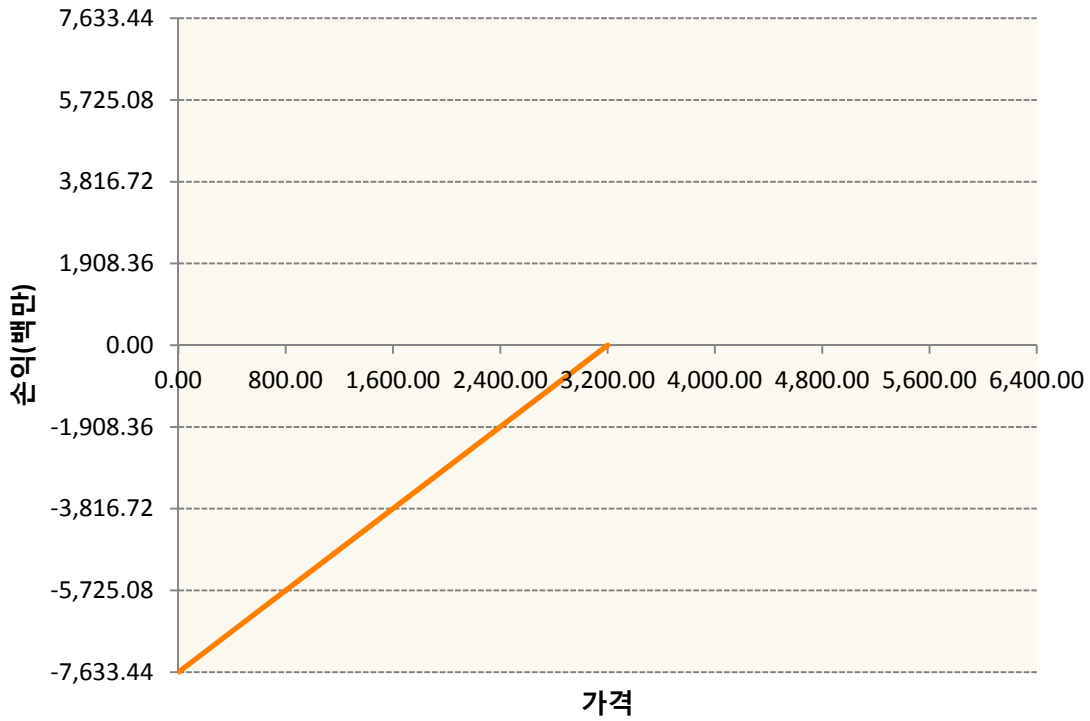


OESXX8-C3225-EURO STOXX 50

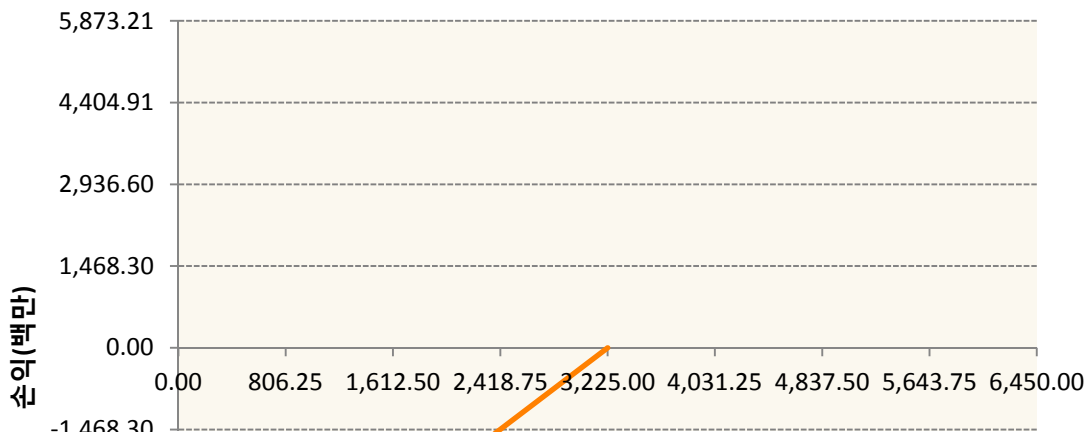


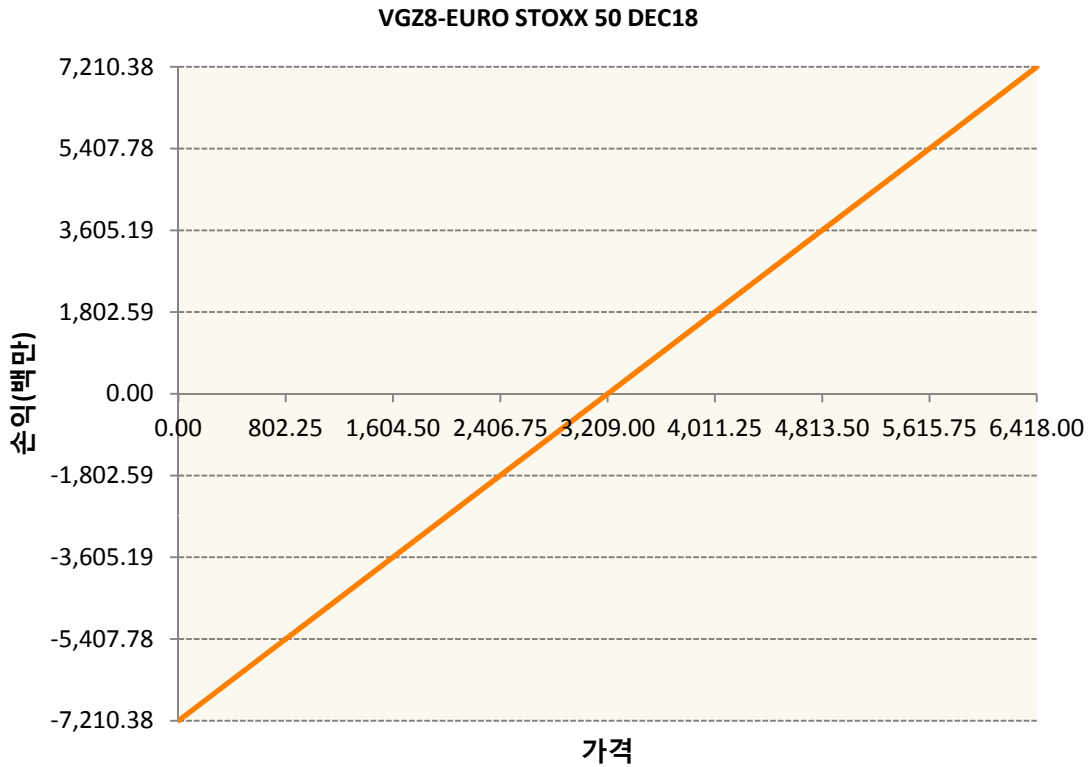


OESXX8-P3200-EURO STOXX 50



OESXX8-P3225-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	31
OESXX8-C32 EURO STOXX 50	611
OESXX8-C32 EURO STOXX 50	470
OESXX8-P32 EURO STOXX 50	611
OESXX8-P32 EURO STOXX 50	470
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)

1,163

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)

156

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

(단위:백만원)

42

공시일	2018-11-07
기준일	2018-11-06

리디파인K200(주식혼합-파생재간

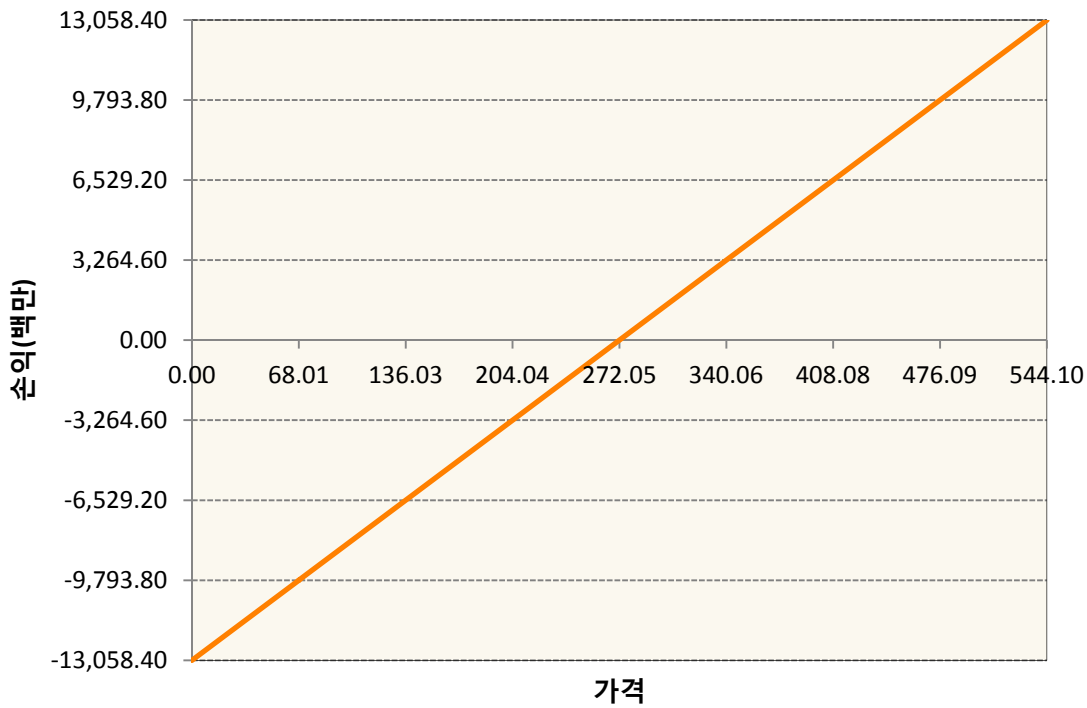
1. 계약금액

(단위:백만원)

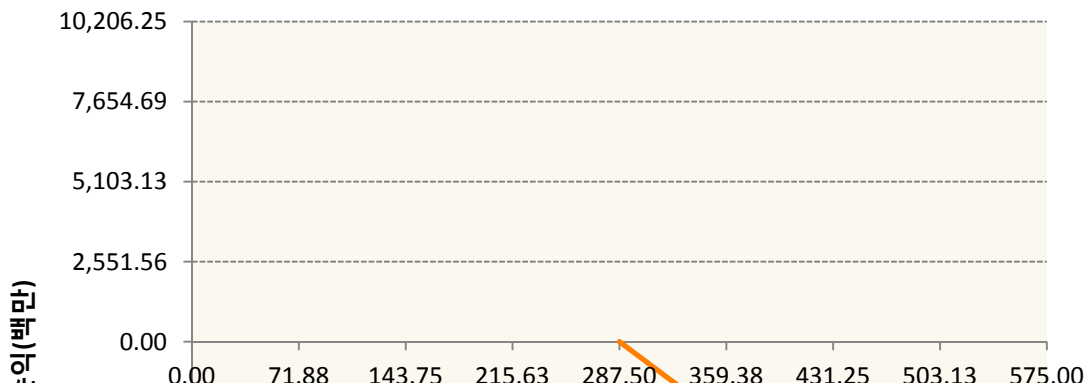
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,058	0	13,058	장내
누계	유가증권	옵션	4,059	23,401	-19,343	장내

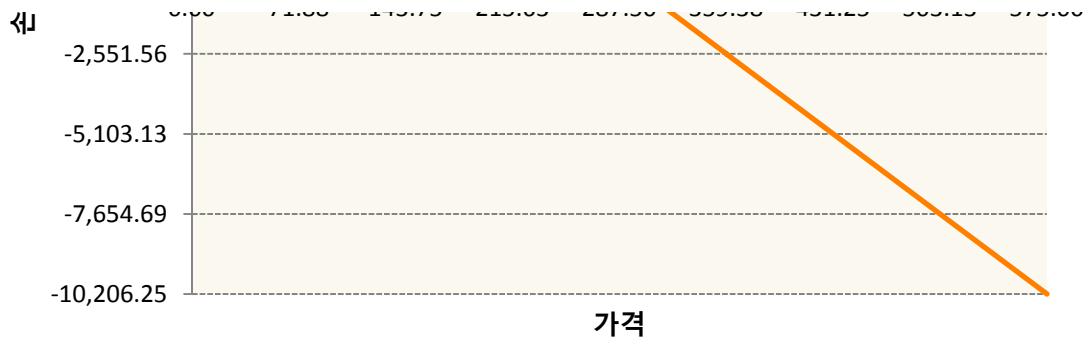
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

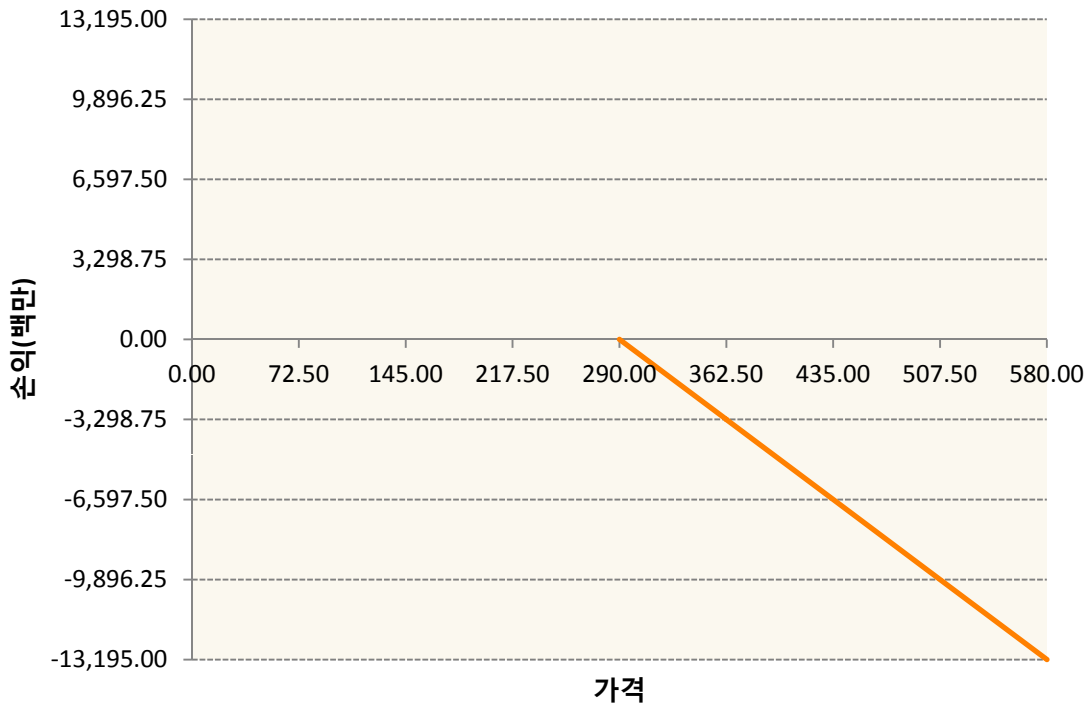


KR4201NB2877-2018-11 콜287.5

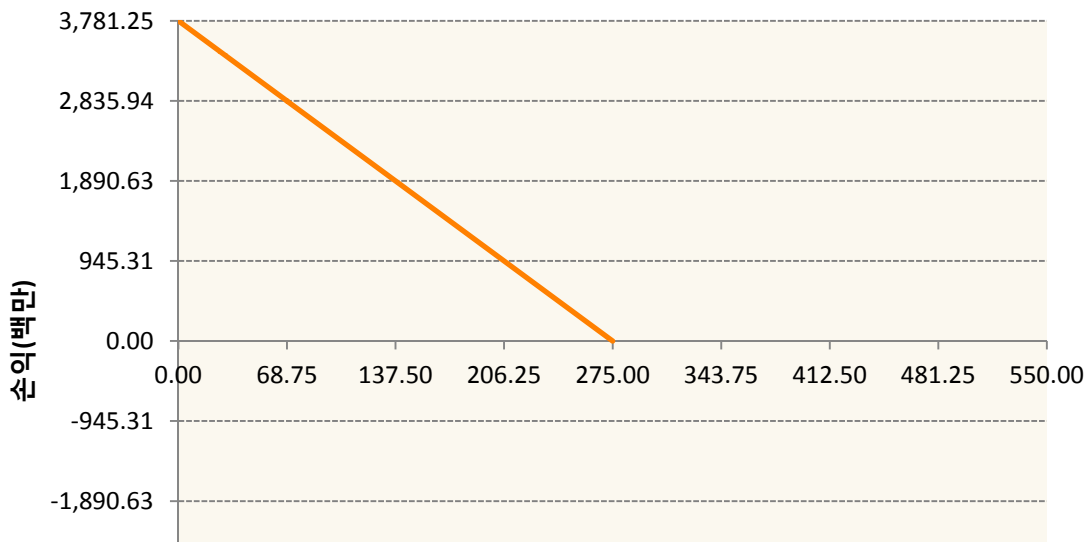


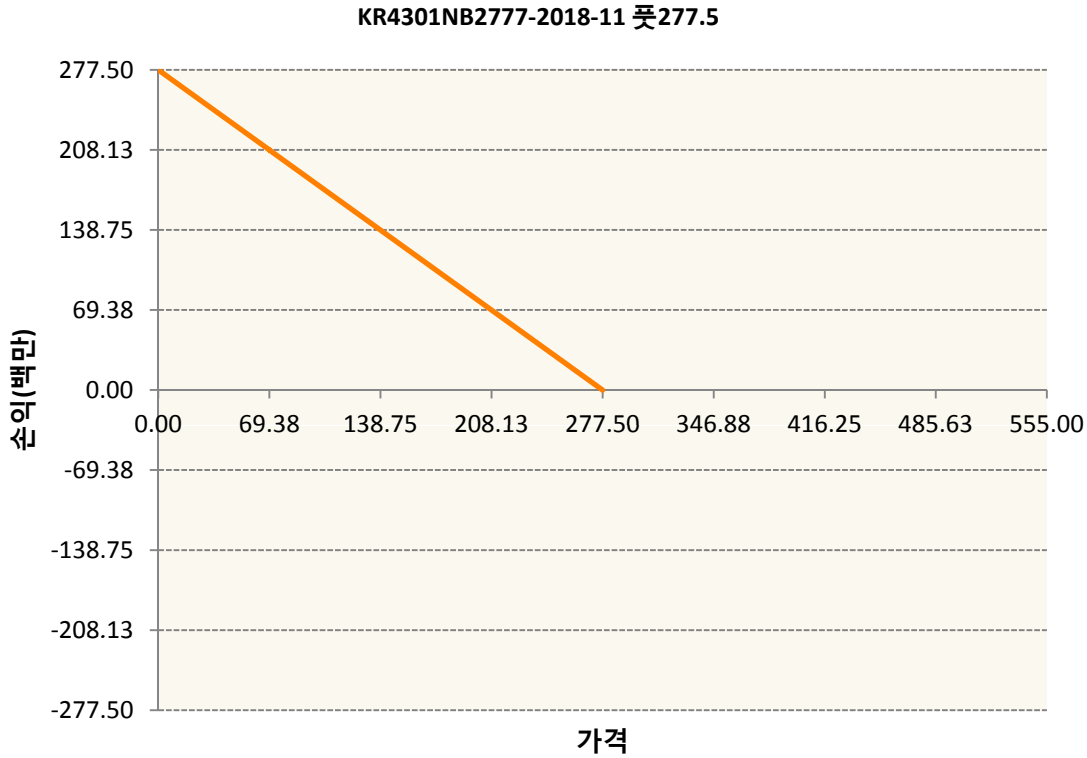
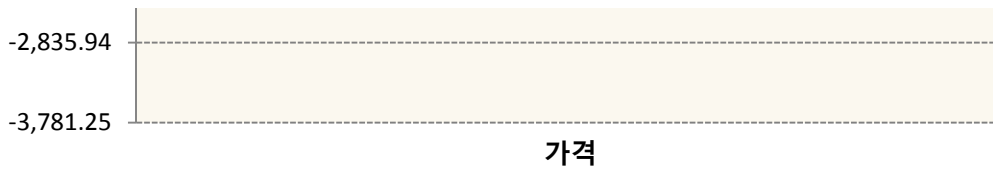


KR4201NB2901-2018-11 콜290



KR4301NB2751-2018-11 풋275





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 1,043

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,043	-1,043	-1,043	-1,043	-1,043	-1,043	-1,043
-5.33%	-695	-695	-695	-695	-695	-695	-695
-2.67%	-348	-348	-348	-348	-348	-348	-348
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	348	348	348	348	348	348	348
5.33%	695	695	695	695	695	695	695
8.00%	1,043	1,043	1,043	1,043	1,043	1,043	1,043

KR4201NB282018-11 콜287.5 238

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	0	-1
2.67%	-1	-2	-4	-6	-8	-11	-14
5.33%	-40	-46	-53	-59	-66	-73	-80
8.00%	-212	-216	-219	-224	-228	-233	-238

KR4201NB29 2018-11 콜290

223

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	0	0
2.67%	0	-1	-1	-3	-4	-6	-9
5.33%	-20	-26	-33	-40	-47	-55	-62
8.00%	-177	-184	-191	-199	-207	-215	-223

KR4301NB27 2018-11 풋275

293

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	293	293	293	293	293	293	293
-5.33%	193	193	193	193	193	193	193
-2.67%	94	94	94	94	94	94	94
0%	-3	-2	-1	0	1	3	4
2.67%	-51	-50	-49	-48	-47	-45	-44
5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

22

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	22	22	22	22	22	22	22
-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%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6

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

(단위:백만원)

1,175

공시일	2018-11-07
기준일	2018-11-06

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

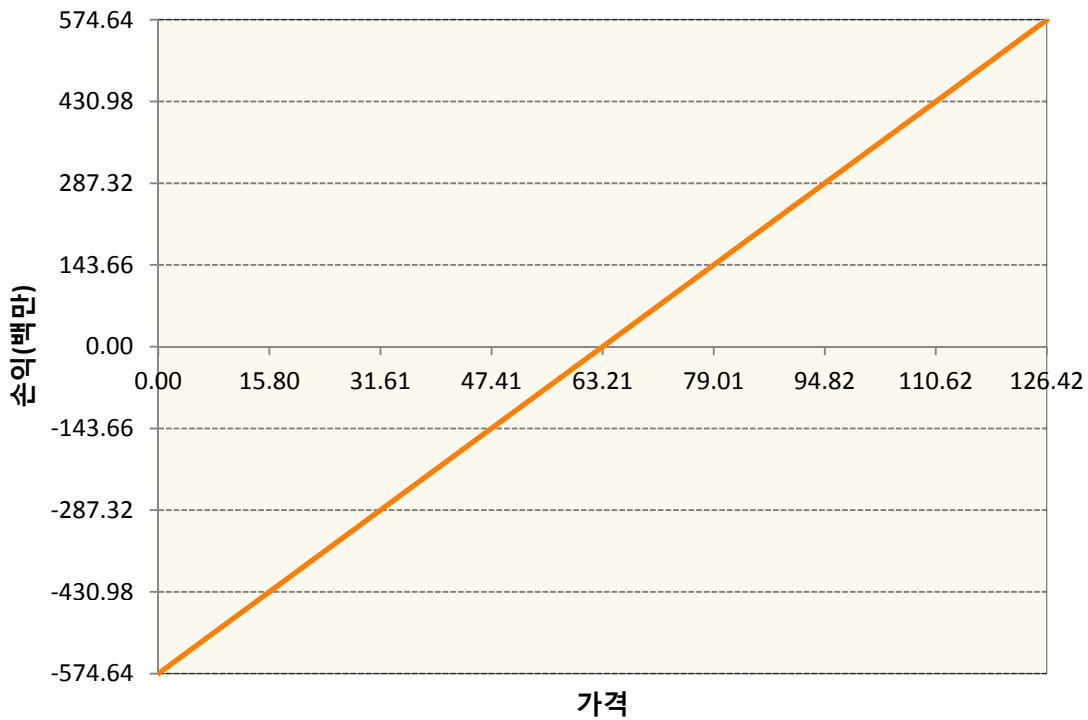
1. 계약금액

(단위:백만원)

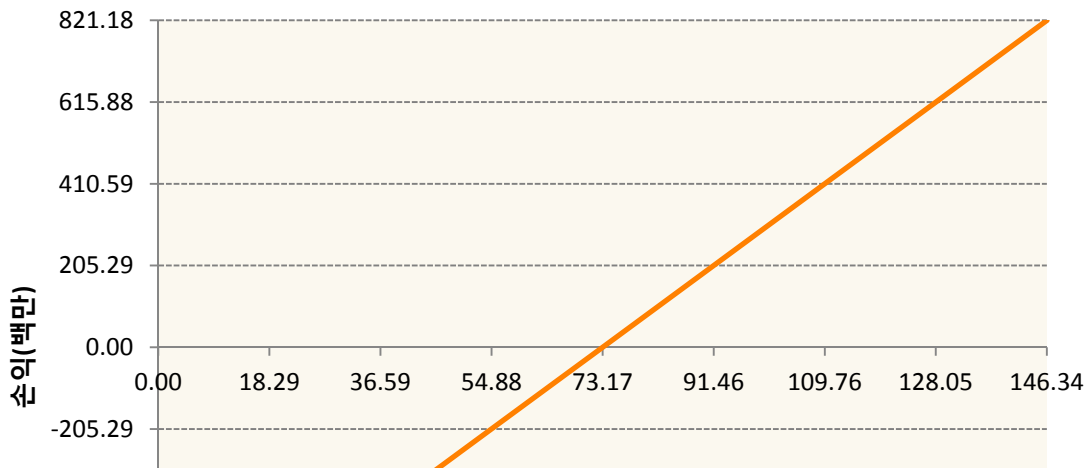
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,231	405	2,826	

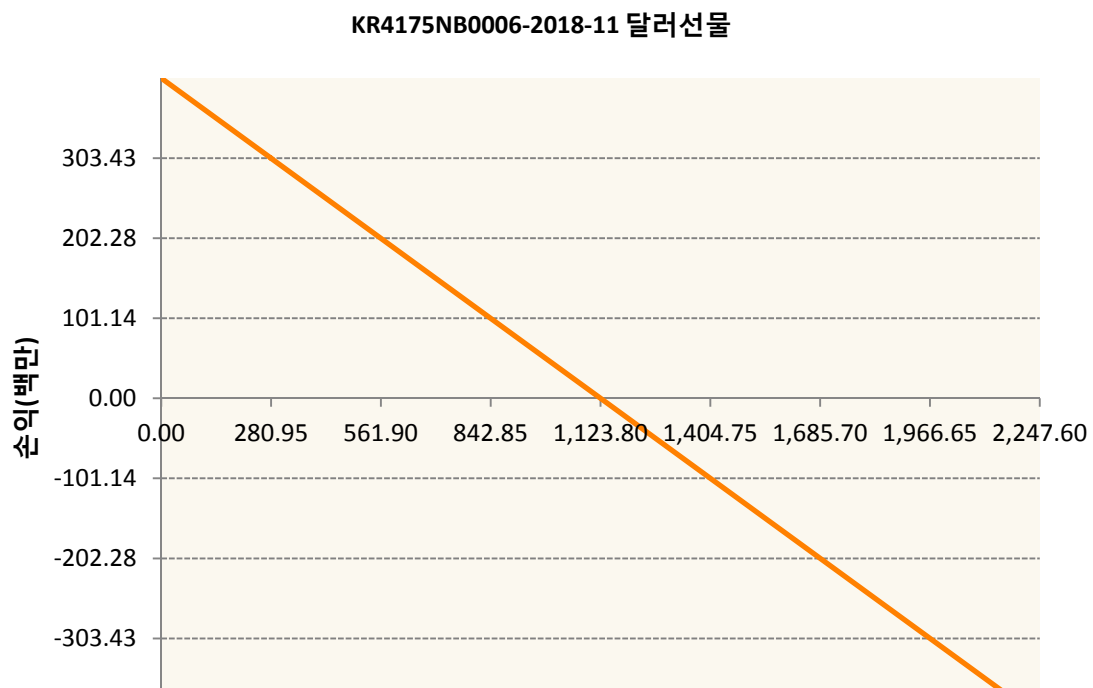
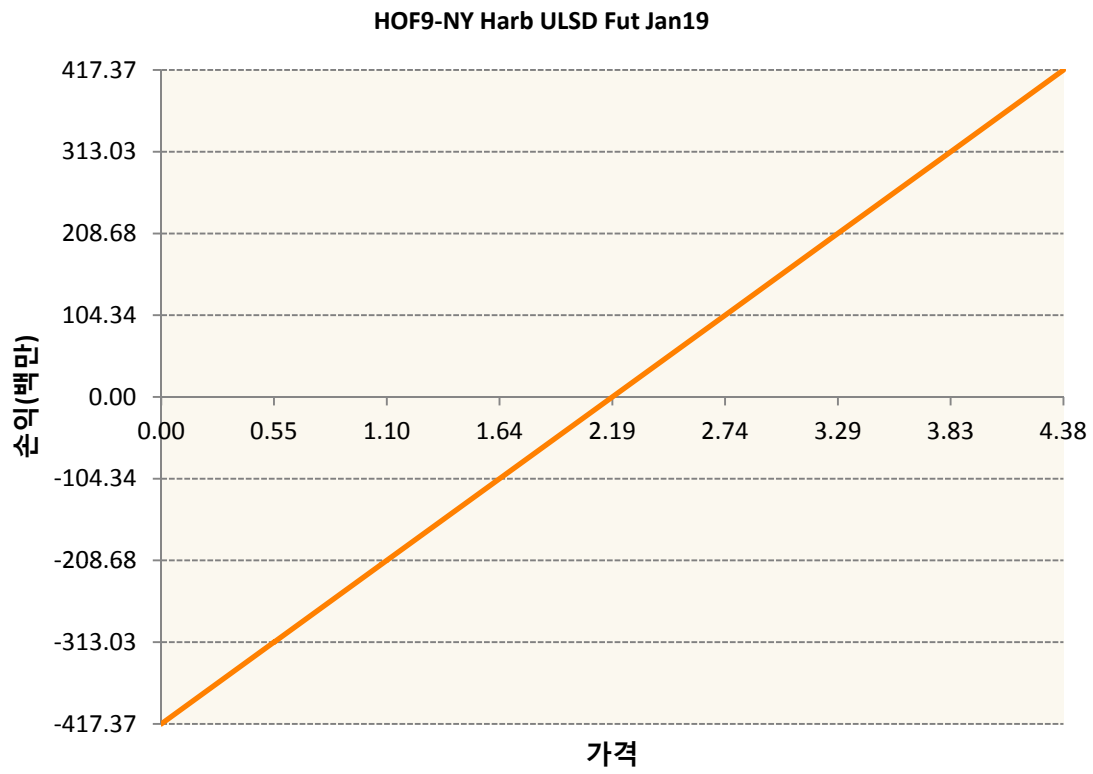
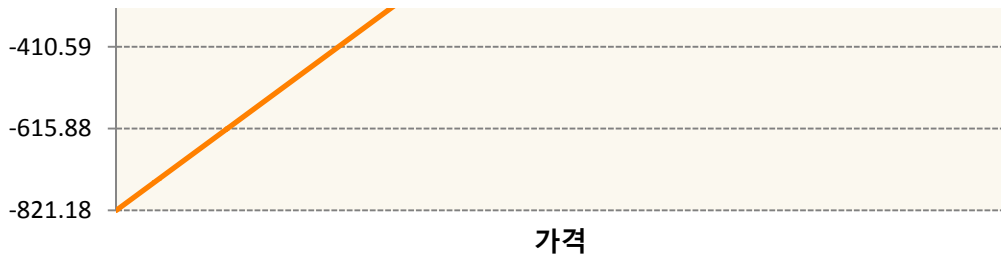
2. 만기시점의 손익구조

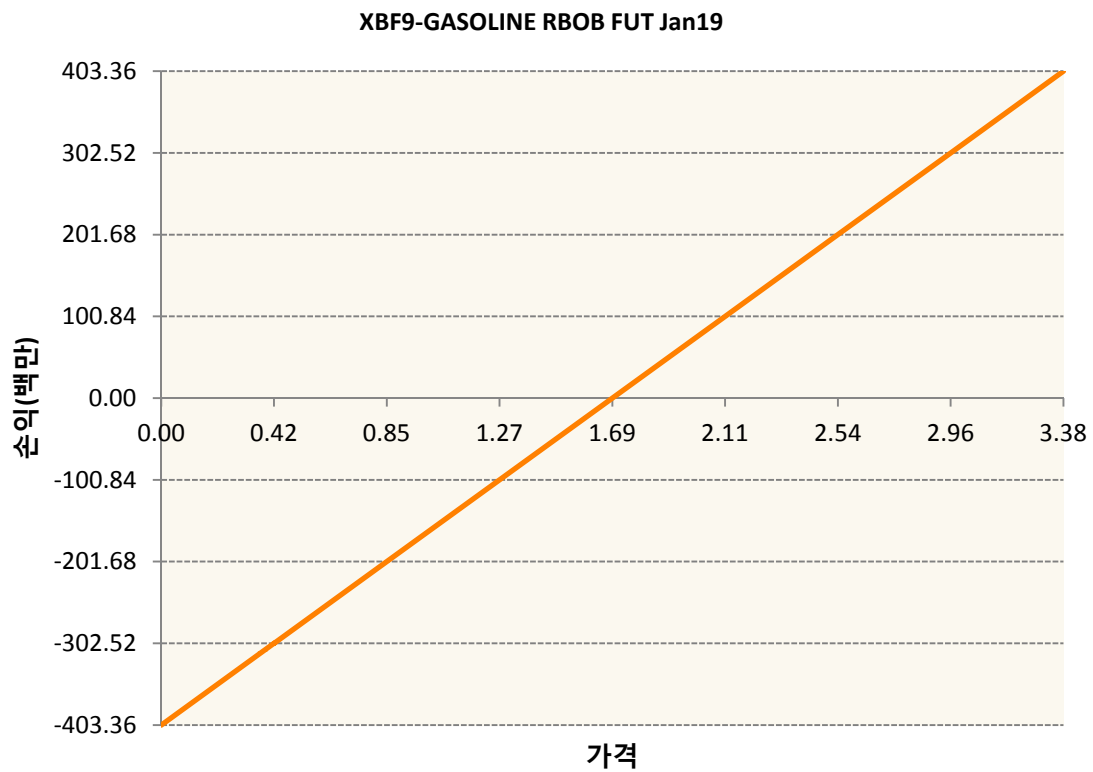
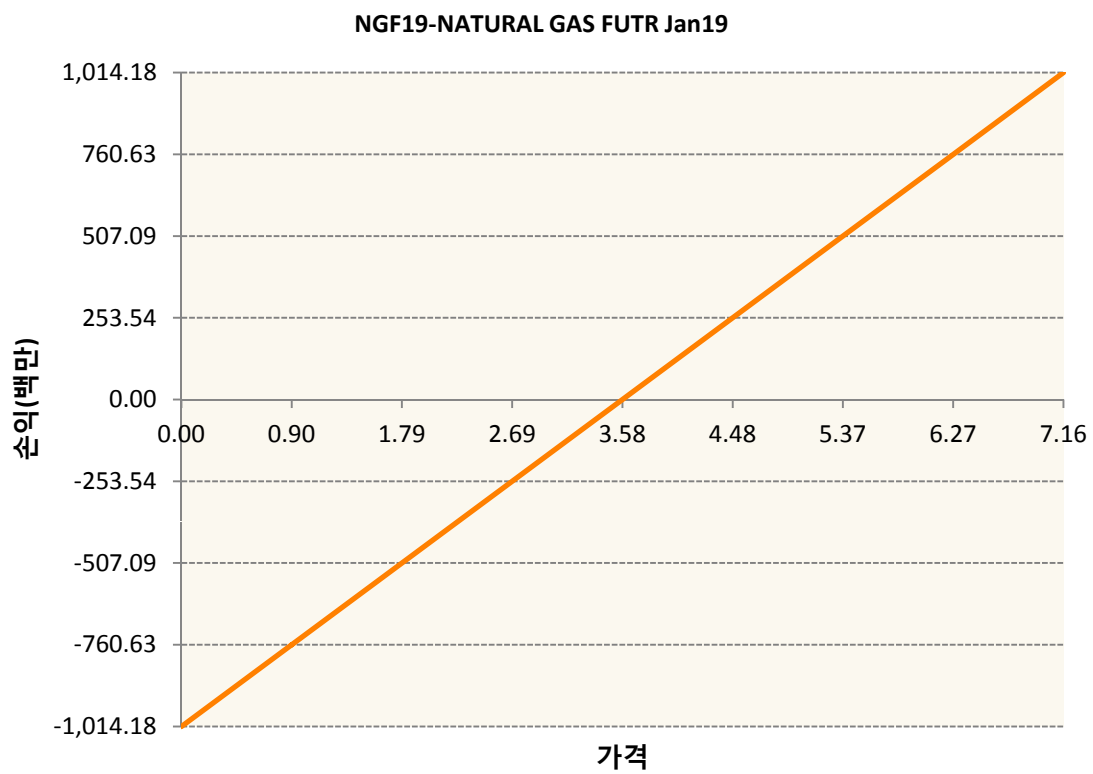
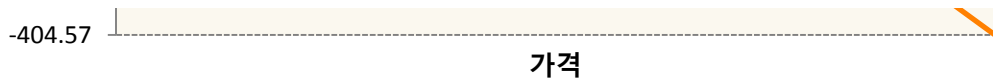
CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19



COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF9	WTI CRUDE FUTURE Jan19	46
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	66
HOF9	NY Harb ULSD Fut Jan19	33
KR4175NB0(2018-11 달러선물		32
NGF19	NATURAL GAS FUTR Jan19	81
XBF9	GASOLINE RBOB FUT Jan19	32

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

394

공시일	2018-11-07
기준일	2018-11-06

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

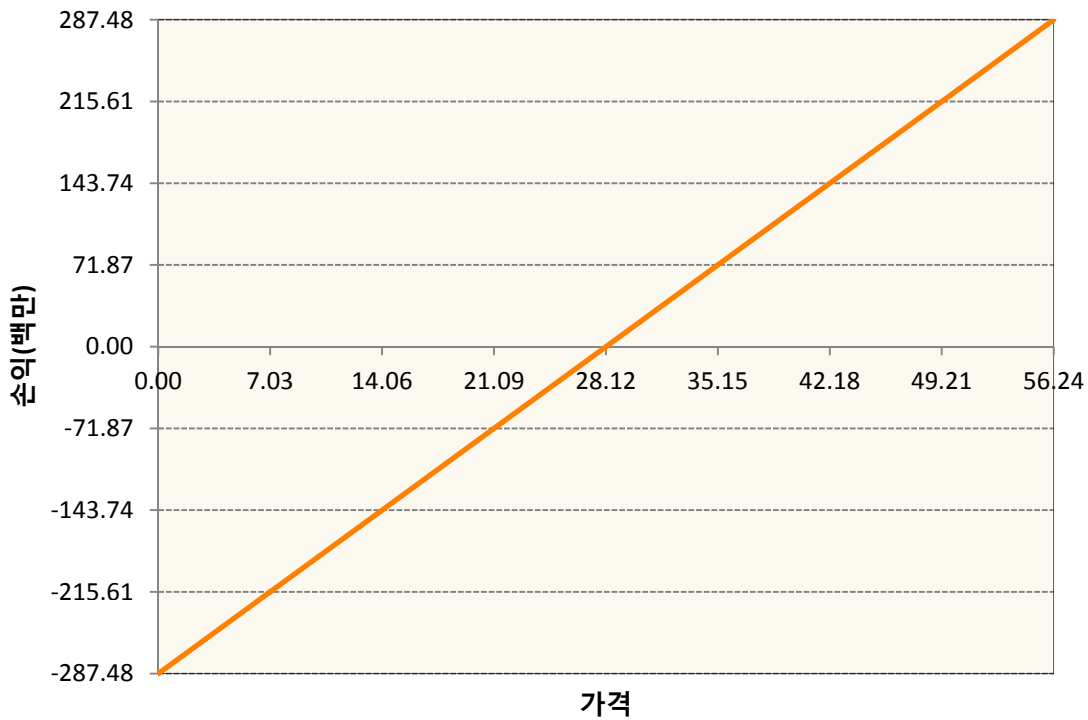
1. 계약금액

(단위:백만원)

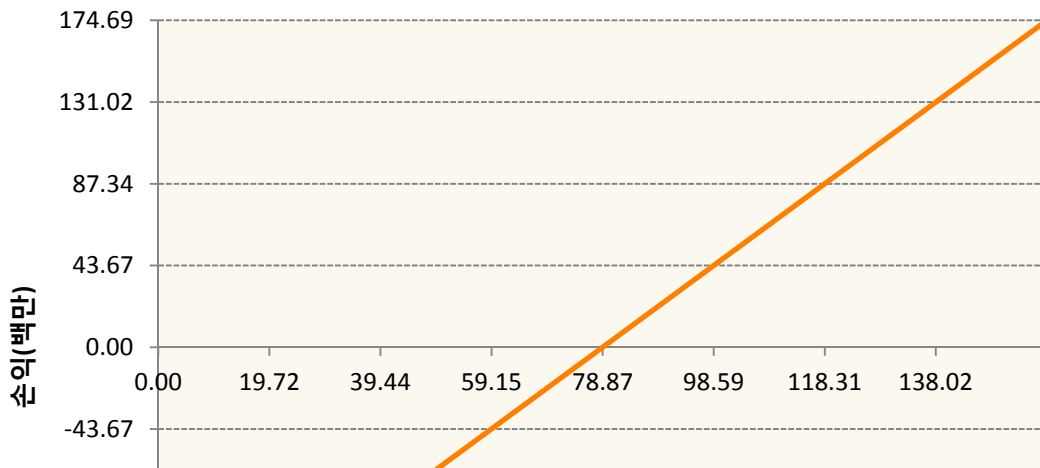
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,618	79	3,539	

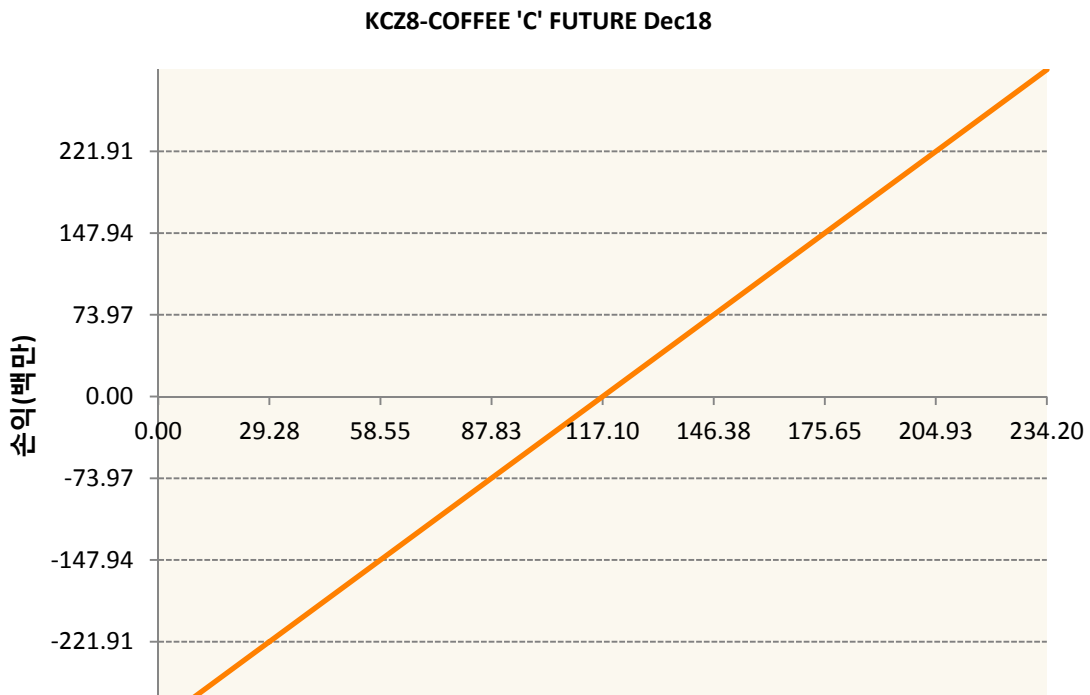
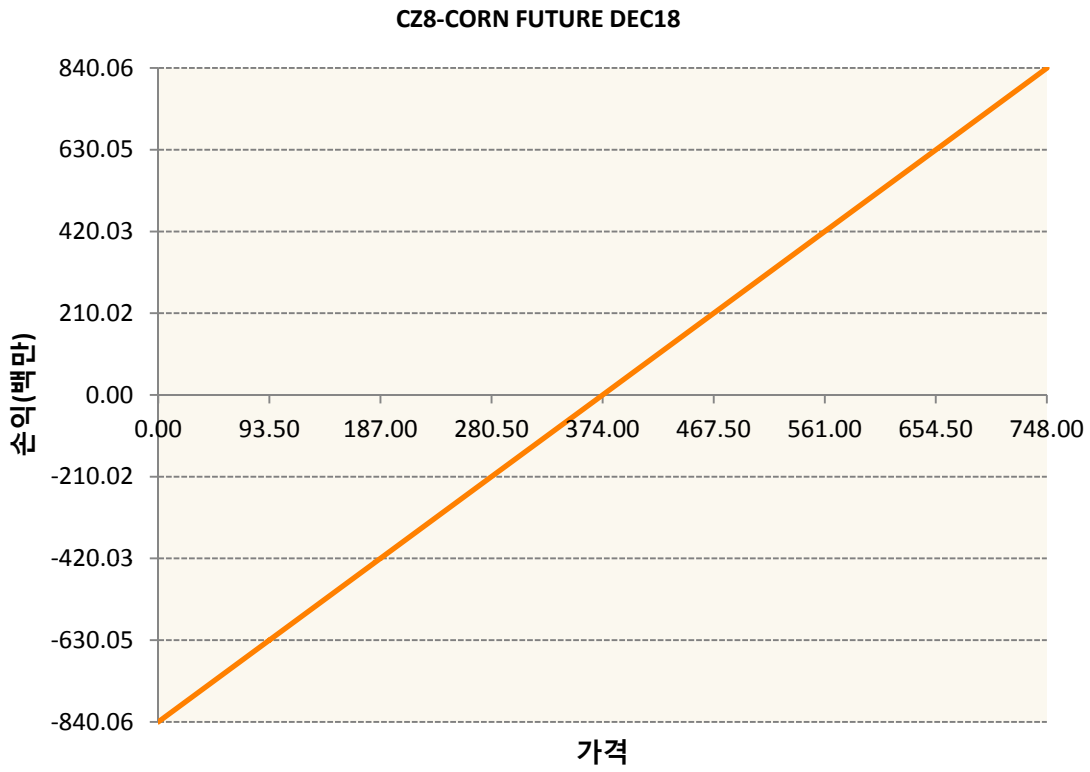
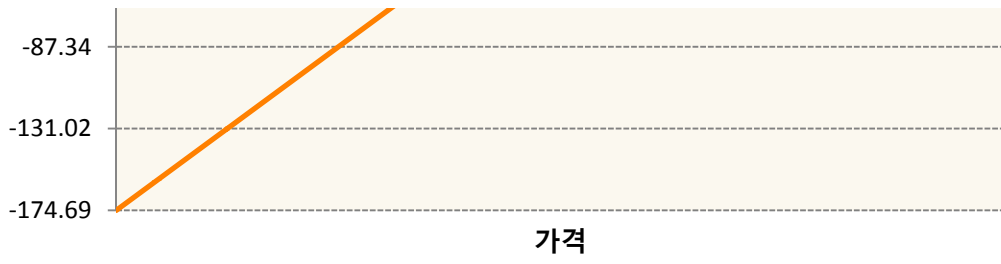
2. 만기시점의 손익구조

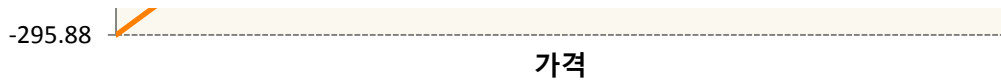
BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19



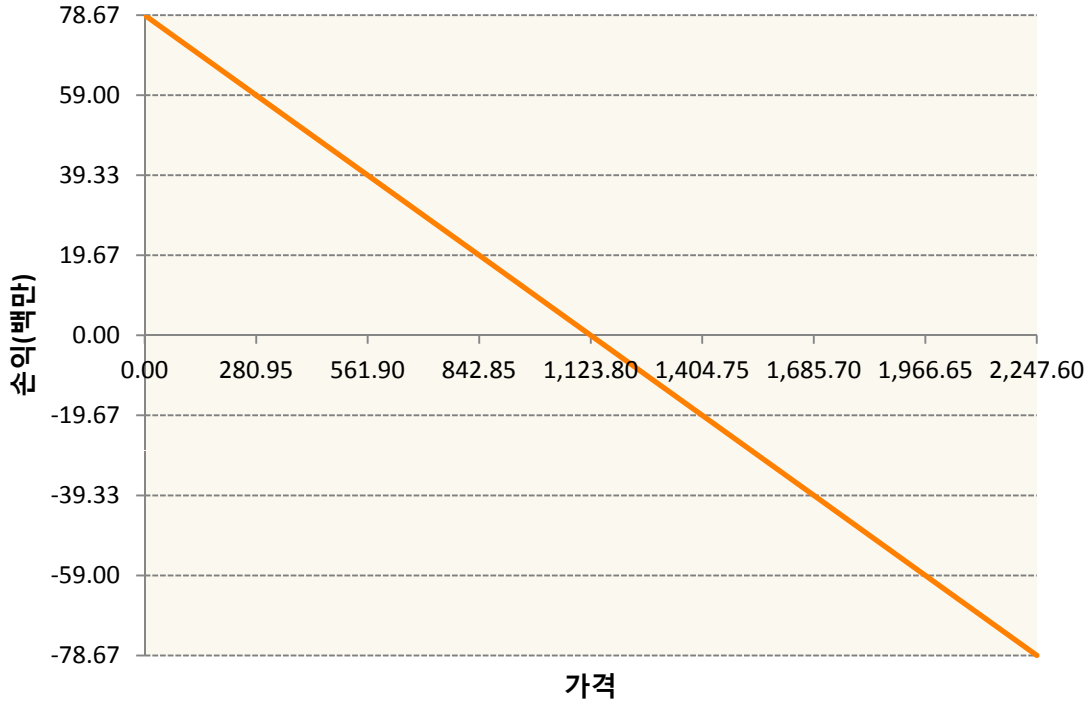
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



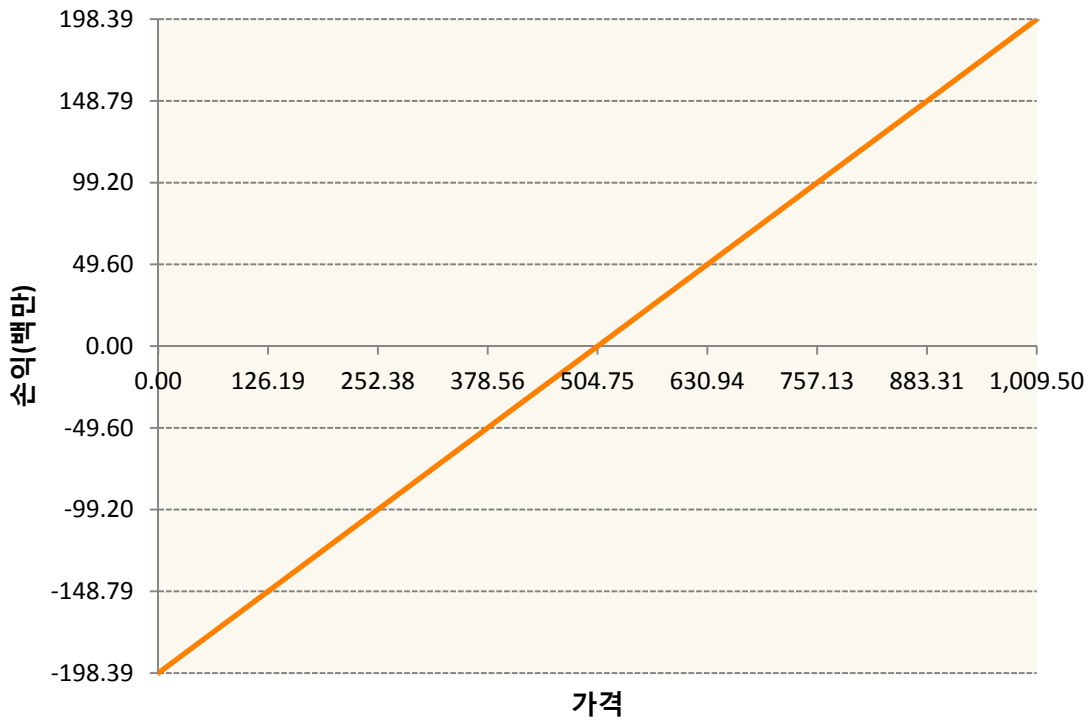




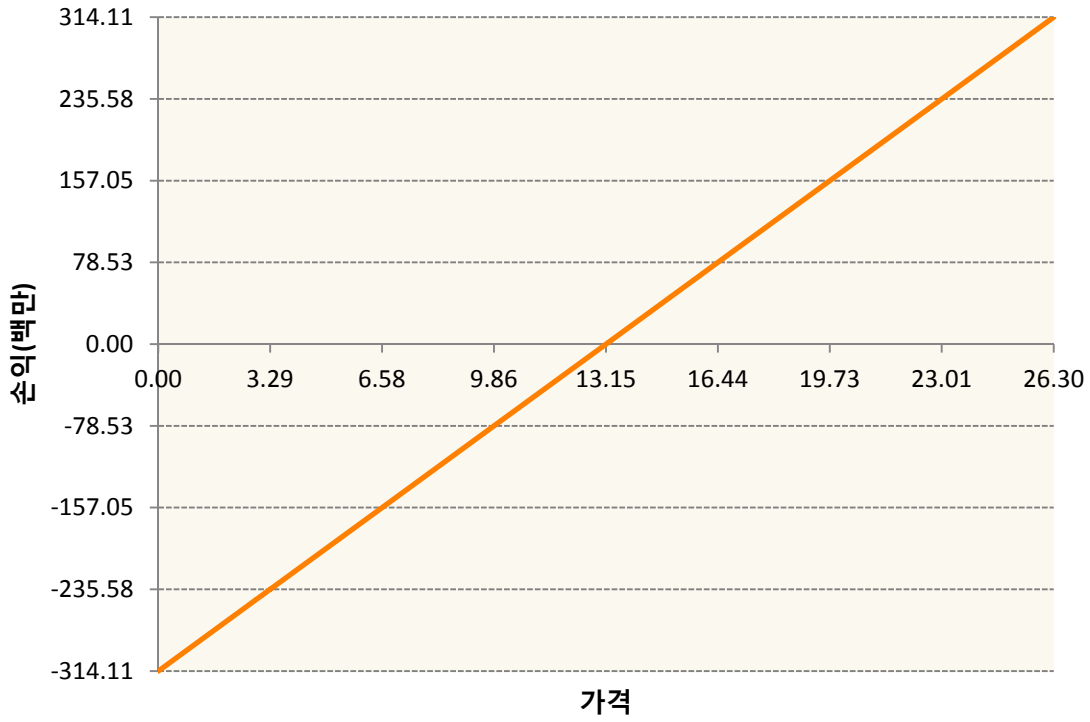
KR4175NB0006-2018-11 달러선물



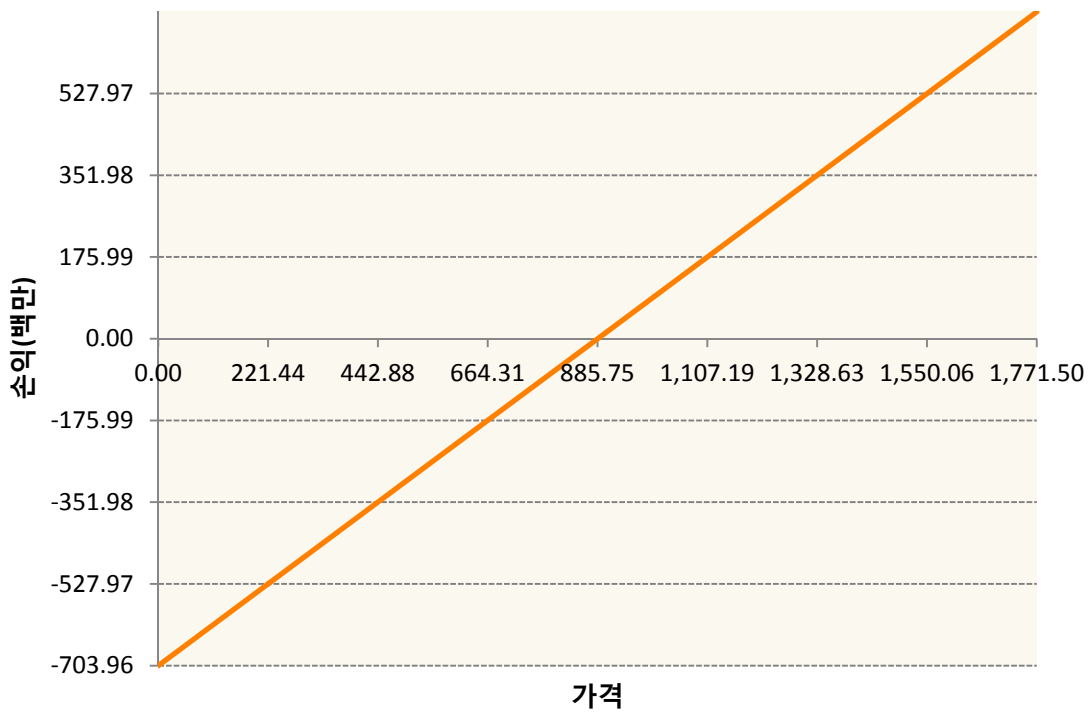
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



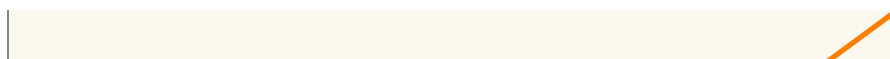
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

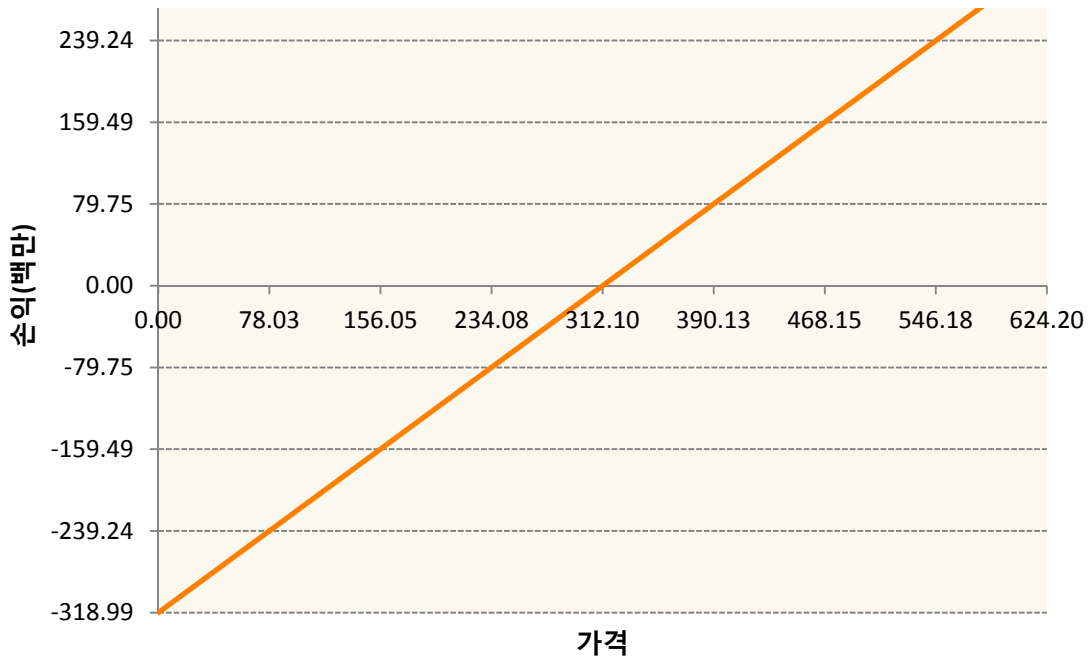


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19

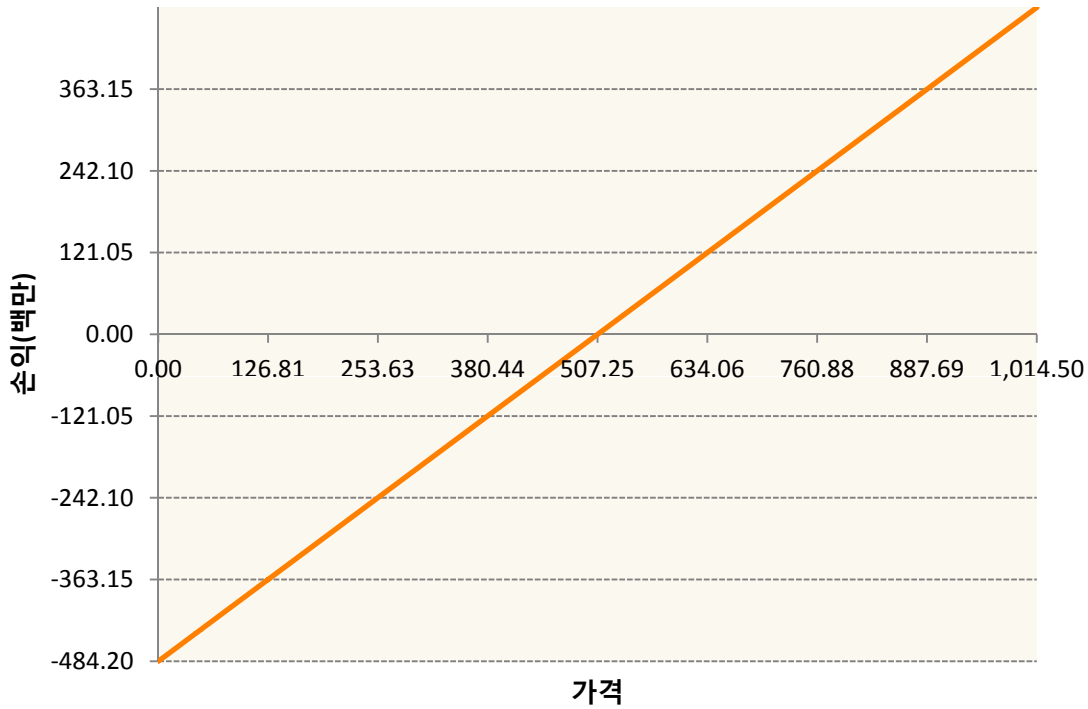


SMF9-SOYBEAN MEAL FUTR Jan19





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	67
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)

316