

공시일	2018-11-09
기준일	2018-11-08

## 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)

69

공시일	2018-11-09
기준일	2018-11-08

## 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

1,109

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

527

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-11-09
기준일	2018-11-08

## 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

266

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

379

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-11-09
기준일	2018-11-08

## 유로인덱스모(주식-파생형)

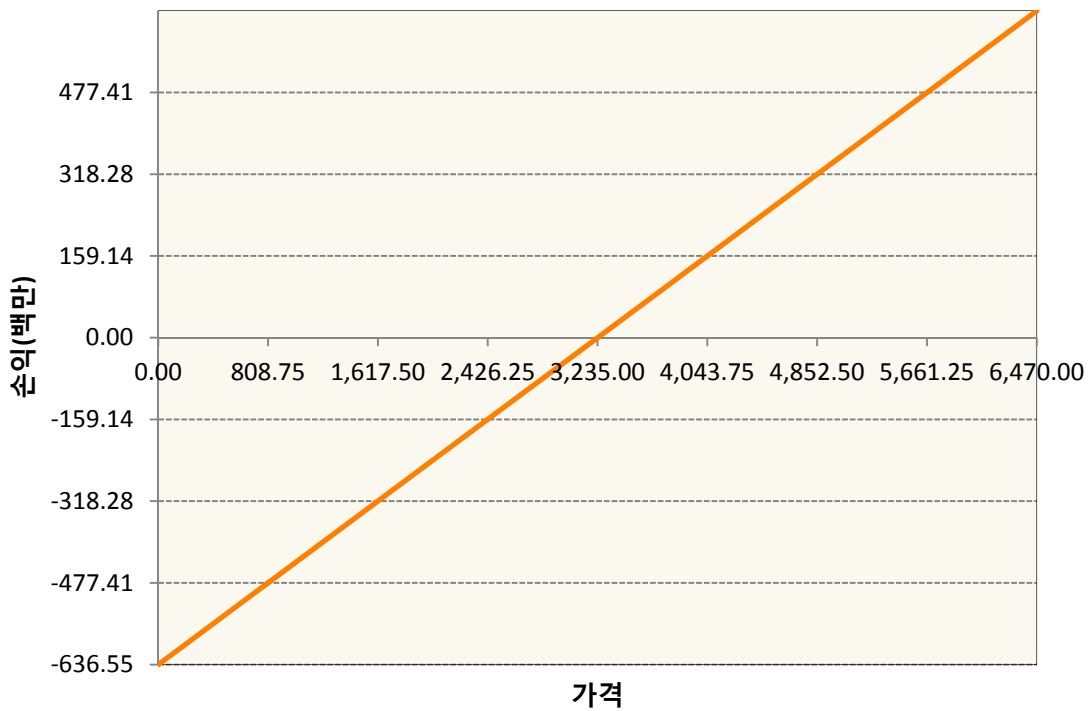
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	637	0	637	

### 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	2018-11-09
기준일	2018-11-08

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

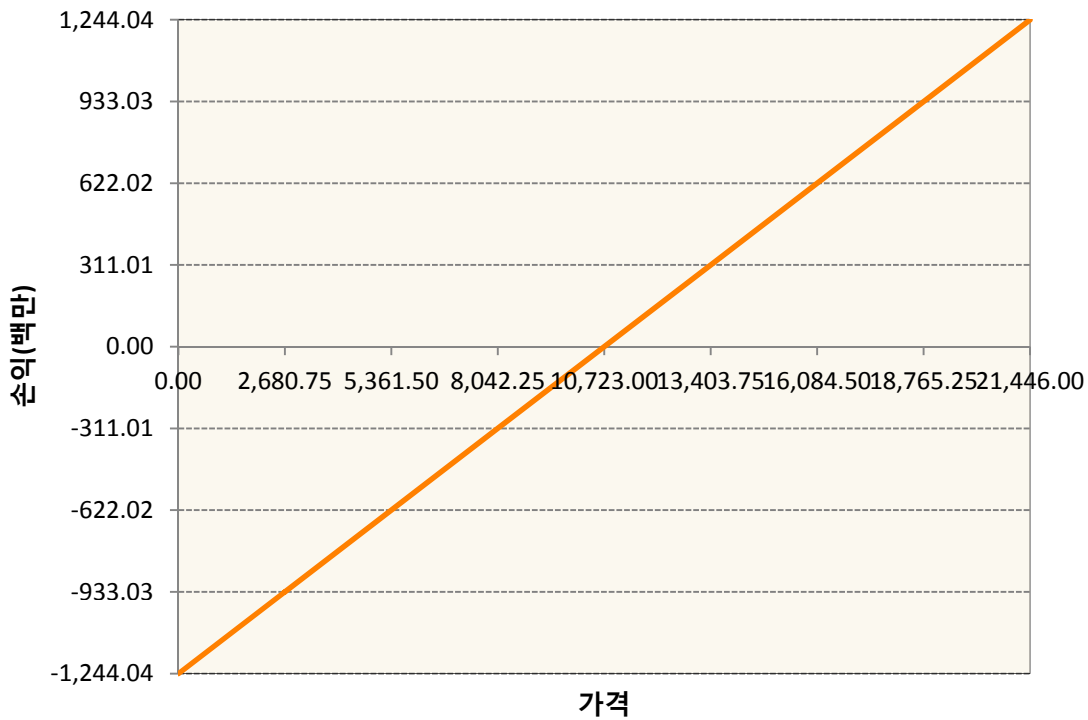
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

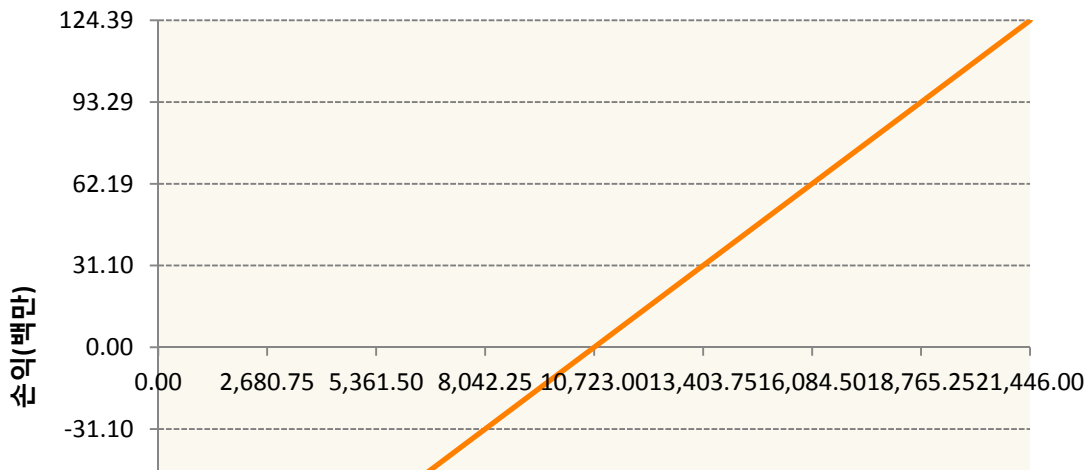
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,368	0	1,368	장내

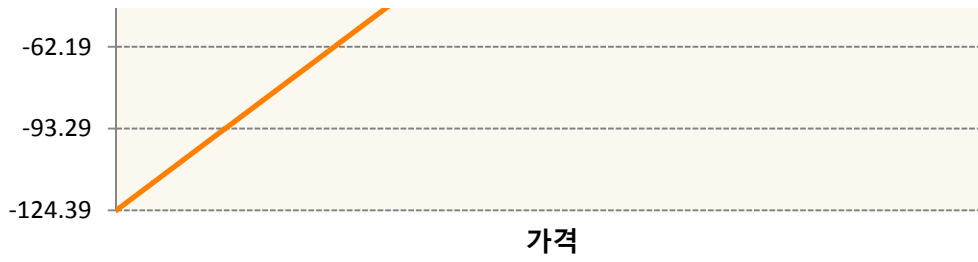
### 2. 만기시점의 손익구조

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)

<b>108</b>
------------

공시일	2018-11-09
기준일	2018-11-08

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

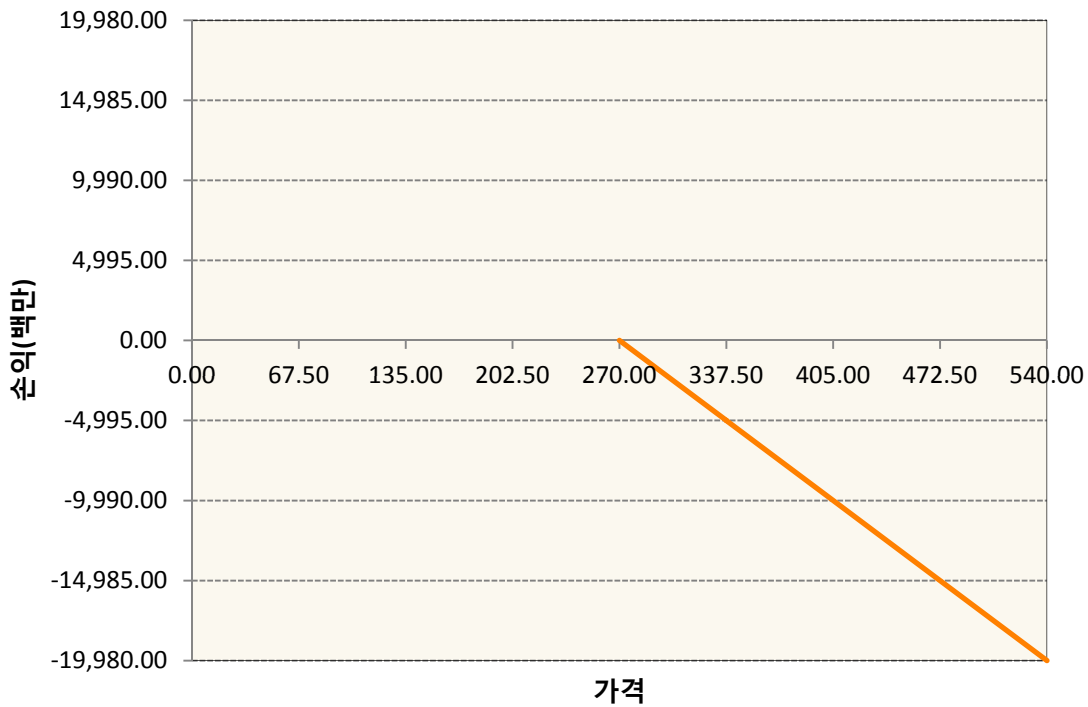
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

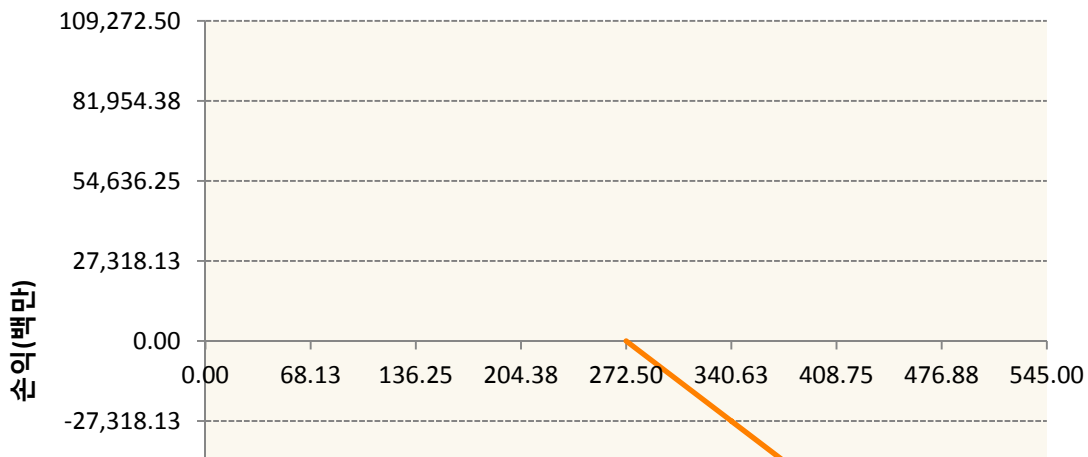
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	131,671	-131,671	장내
누계	유가증권	옵션	0	129,253	-129,253	장내

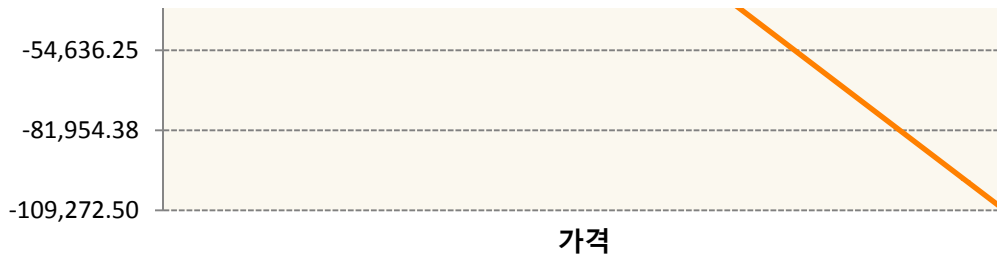
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201NC2702-2018-12 콜270**



**KR4201NC2728-2018-12 콜272.5**





**3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4201NC2; 2018-12 콜270 1,268

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	679	651	620	586	549	510	470
-5.33%	586	544	500	454	407	359	311
-2.67%	421	368	315	261	207	153	99
0%	167	111	56	0	-56	-112	-167
2.67%	-174	-224	-276	-328	-380	-434	-487
5.33%	-591	-629	-671	-715	-761	-808	-856
8.00%	-1,060	-1,087	-1,117	-1,151	-1,187	-1,226	-1,268

KR4201NC2; 2018-12 콜272.5 6,606

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,281	3,152	3,003	2,836	2,655	2,460	2,255
-5.33%	2,877	2,671	2,451	2,220	1,980	1,732	1,479
-2.67%	2,122	1,848	1,570	1,288	1,004	717	429
0%	914	609	305	0	-305	-609	-914
2.67%	-776	-1,065	-1,357	-1,652	-1,949	-2,248	-2,548
5.33%	-2,898	-3,134	-3,383	-3,641	-3,907	-4,179	-4,456
8.00%	-5,351	-5,519	-5,708	-5,913	-6,133	-6,364	-6,606

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

**7,236**

공시일	2018-11-09
기준일	2018-11-08

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

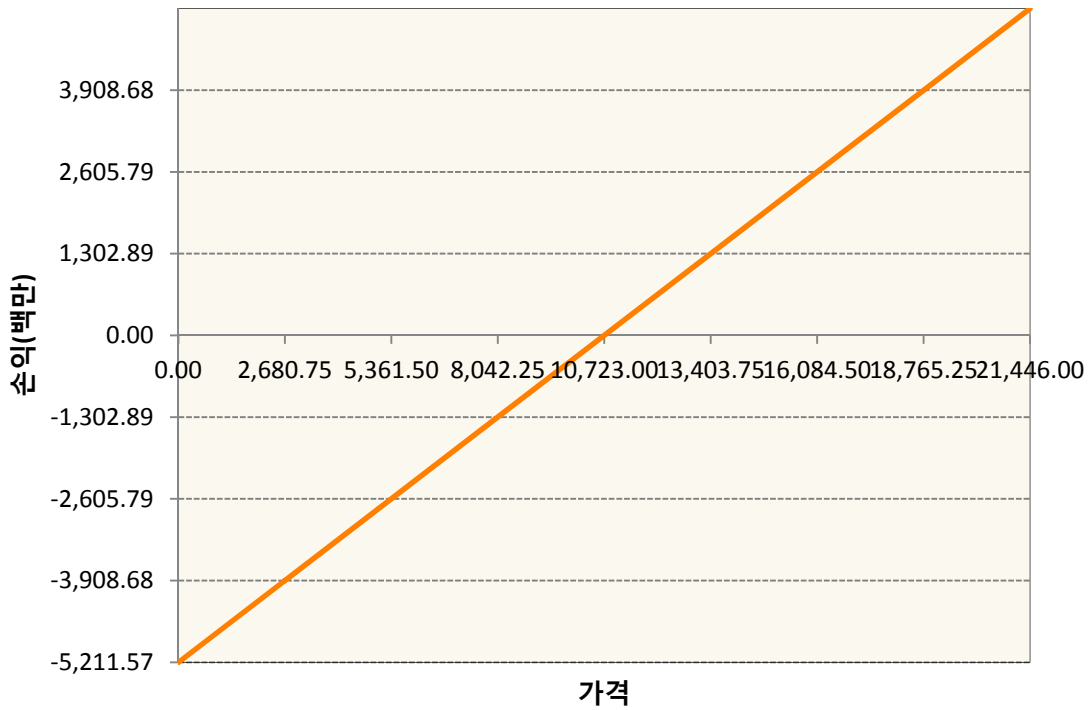
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

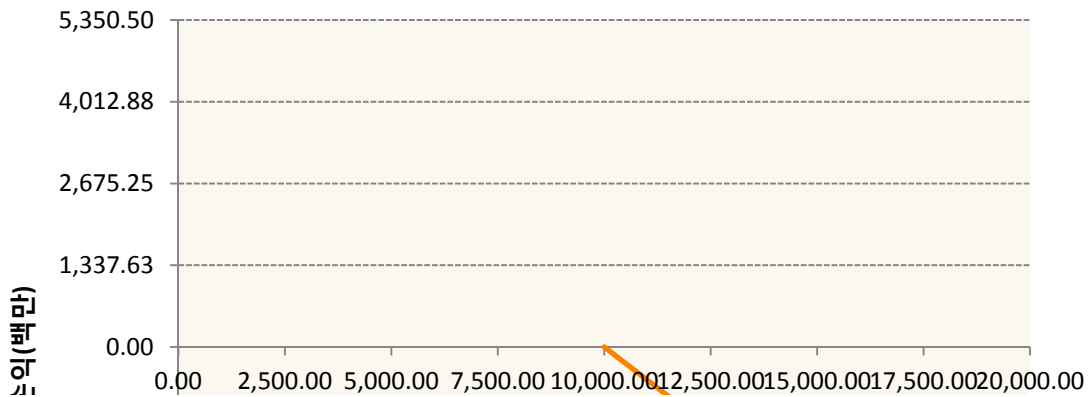
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,212	0	5,212	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,701	-10,701	장내

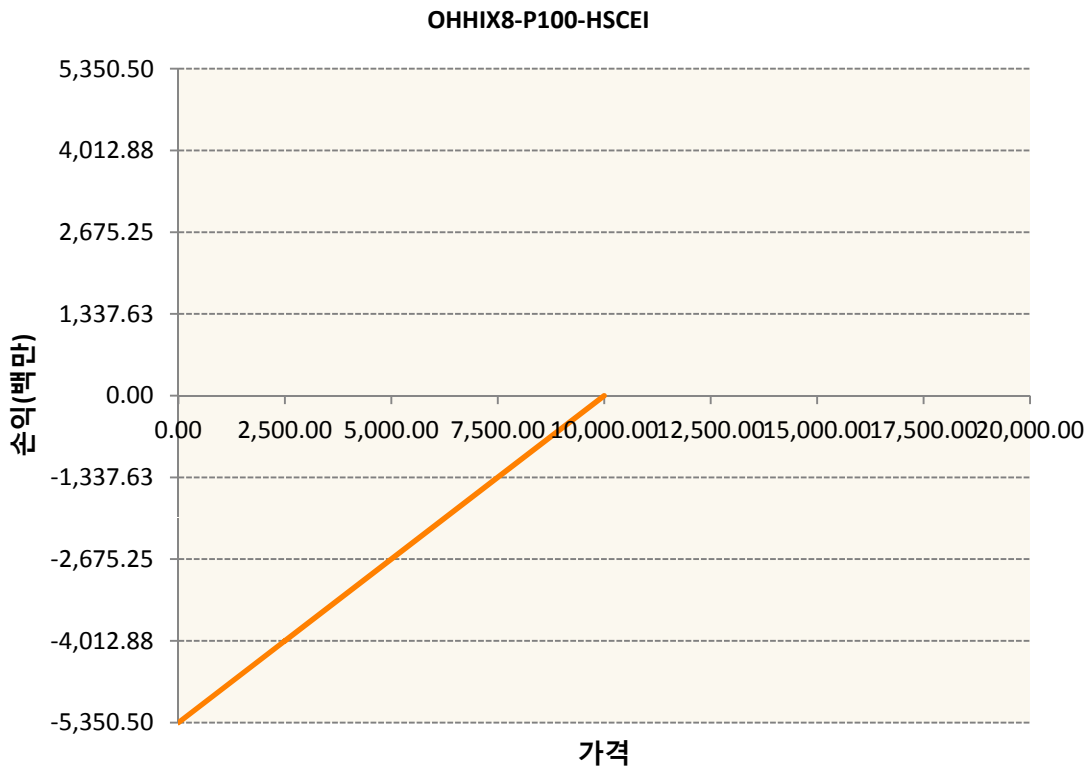
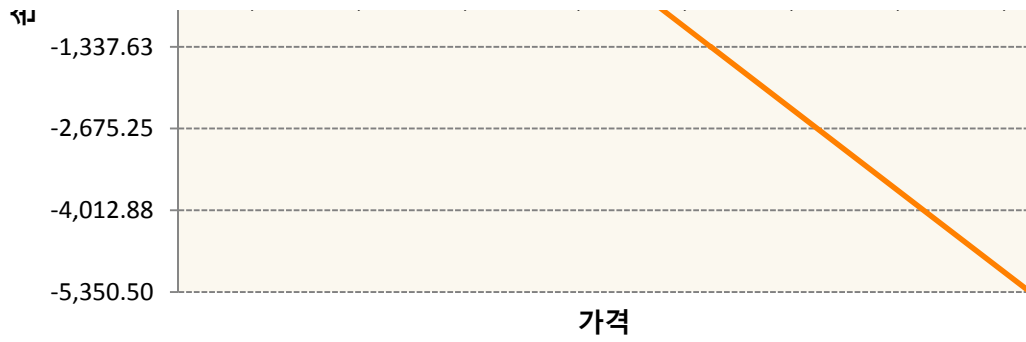
### 2. 만기시점의 손익구조

HCX8-HSCEI FUTURES NOV 18



OHHIX8-C100-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCX8	HSCEI FUTURES NOV 18	417
	OHHIX8-C1C HSCEI	428
	OHHIX8-P10 HSCEI	428

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

공시일	2018-11-09
기준일	2018-11-08

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

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

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX\_14

3,570

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,570	-3,570	-3,570	-3,570	-3,570	-3,570	-3,570
-5.33%	-2,380	-2,380	-2,380	-2,380	-2,380	-2,380	-2,380
-2.67%	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,190	1,190	1,190	1,190	1,190	1,190	1,190
5.33%	2,380	2,380	2,380	2,380	2,380	2,380	2,380
8.00%	3,570	3,570	3,570	3,570	3,570	3,570	3,570

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

(단위:백만원)

3,571

공시일	2018-11-09
기준일	2018-11-08

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

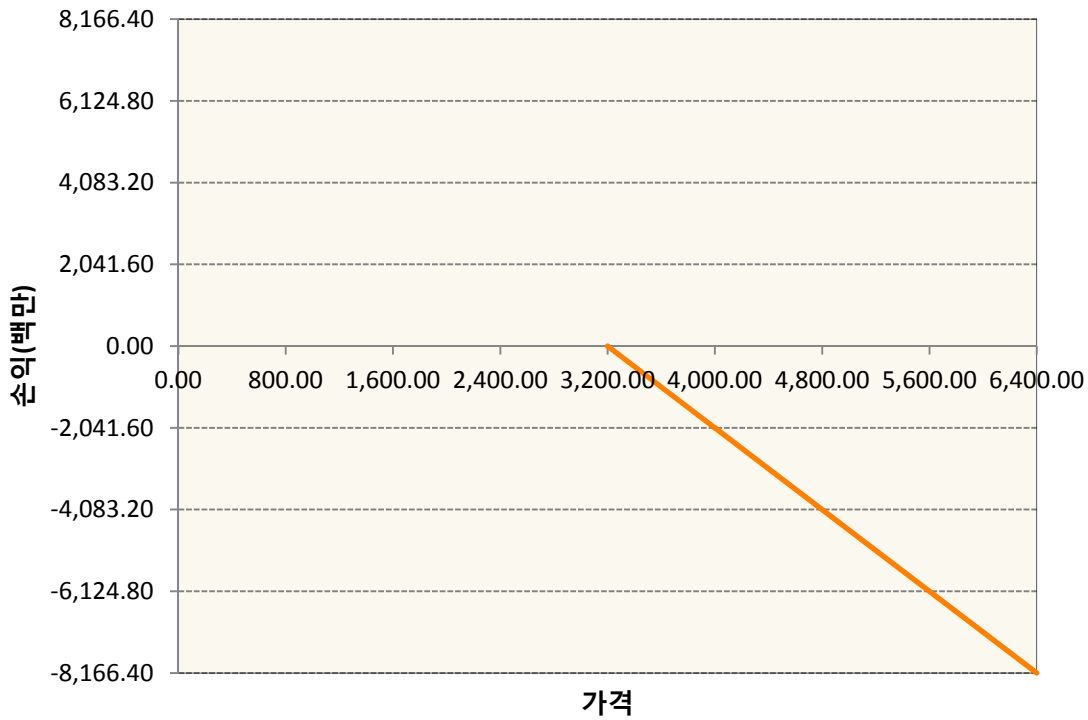
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

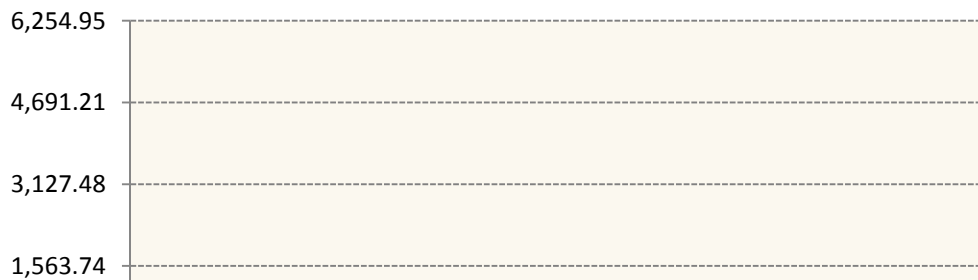
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,266	0	8,266	
누계	유가증권	스왑	71,266	0	71,266	장외
누계	유가증권	옵션	0	28,843	-28,843	장내

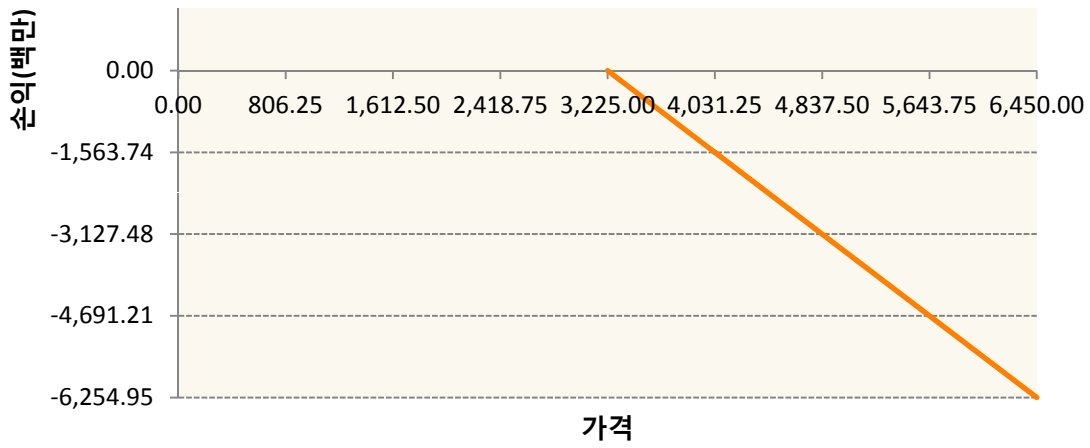
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXX8-C3200-EURO STOXX 50**

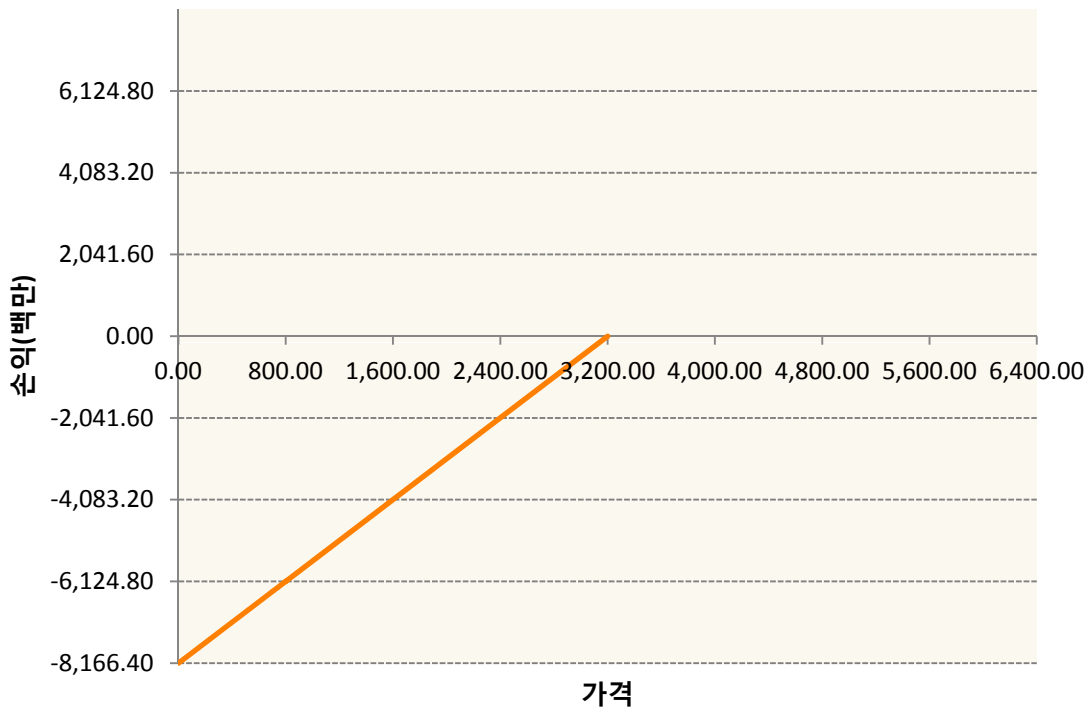


**OESXX8-C3225-EURO STOXX 50**

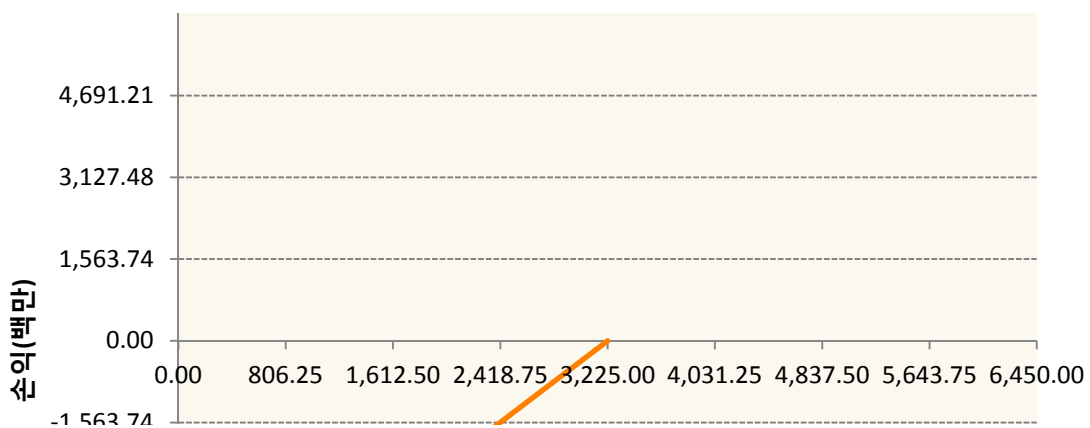


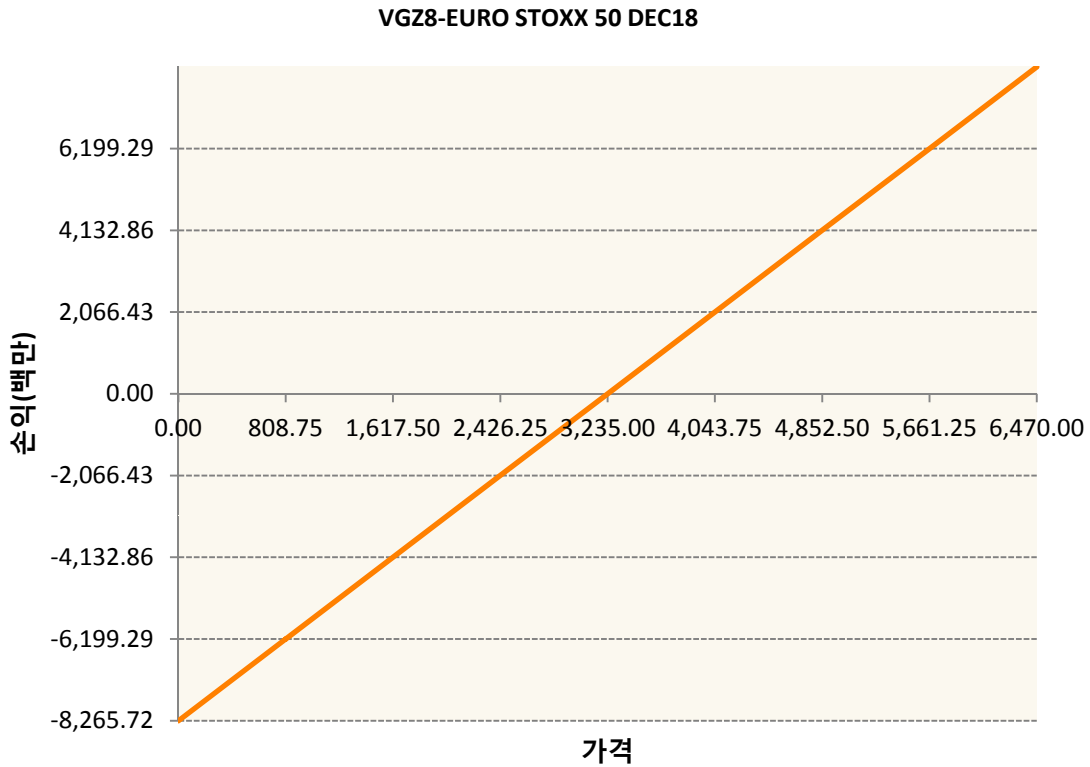


**OESXX8-P3200-EURO STOXX 50**



**OESXX8-P3225-EURO STOXX 50**





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY		36
OESXX8-C32 EURO STOXX 50		653
OESXX8-C32 EURO STOXX 50		500
OESXX8-P32 EURO STOXX 50		653
OESXX8-P32 EURO STOXX 50		500
VGZ8        EURO STOXX 50 DEC18		661

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	<b>1,929</b>



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)

155



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

(단위:백만원)

41

공시일	2018-11-09
기준일	2018-11-08

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

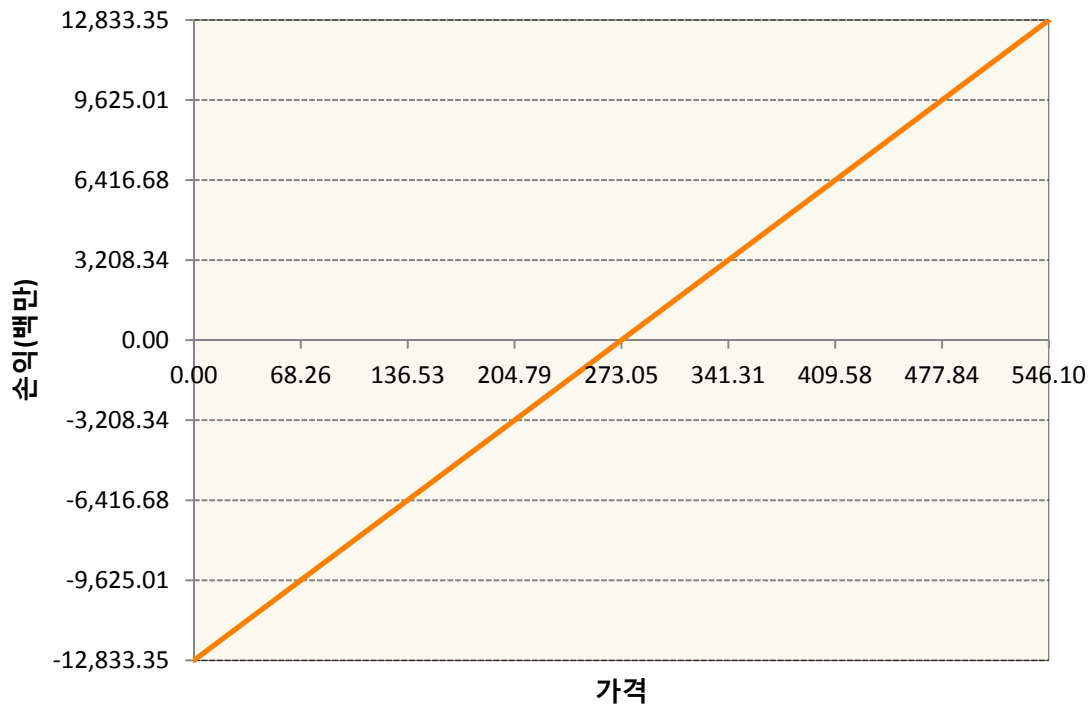
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

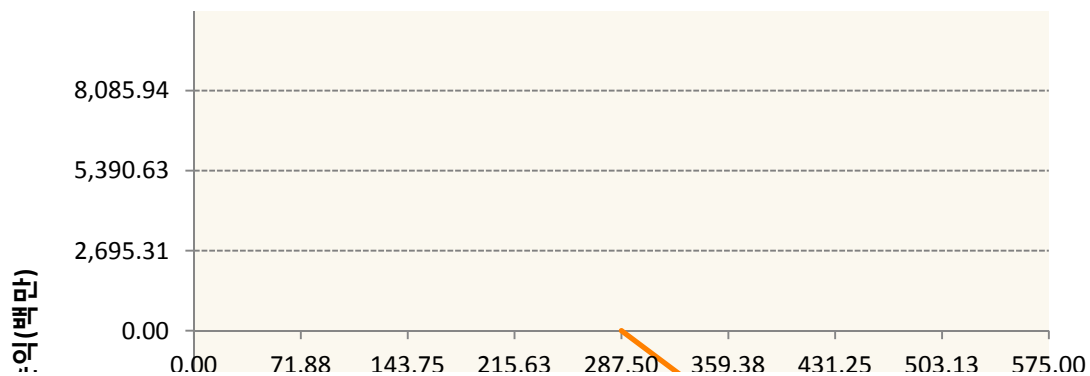
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	3,505	23,163	-19,658	장내
누계	유가증권	선물	12,833	0	12,833	장내
누계	유가증권	옵션	3,575	23,106	-19,531	장내

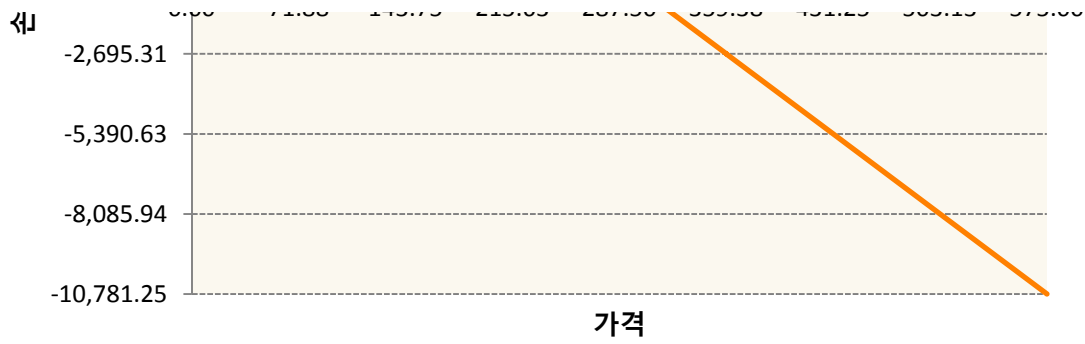
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

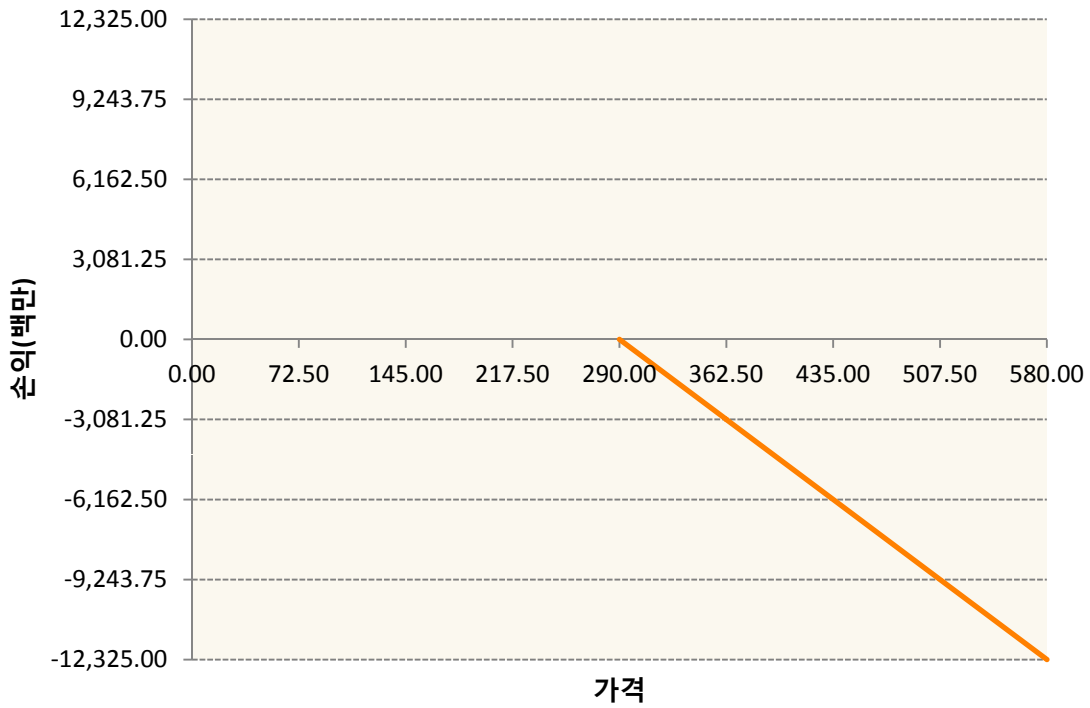


KR4201NC2876-2018-12 콜287.5

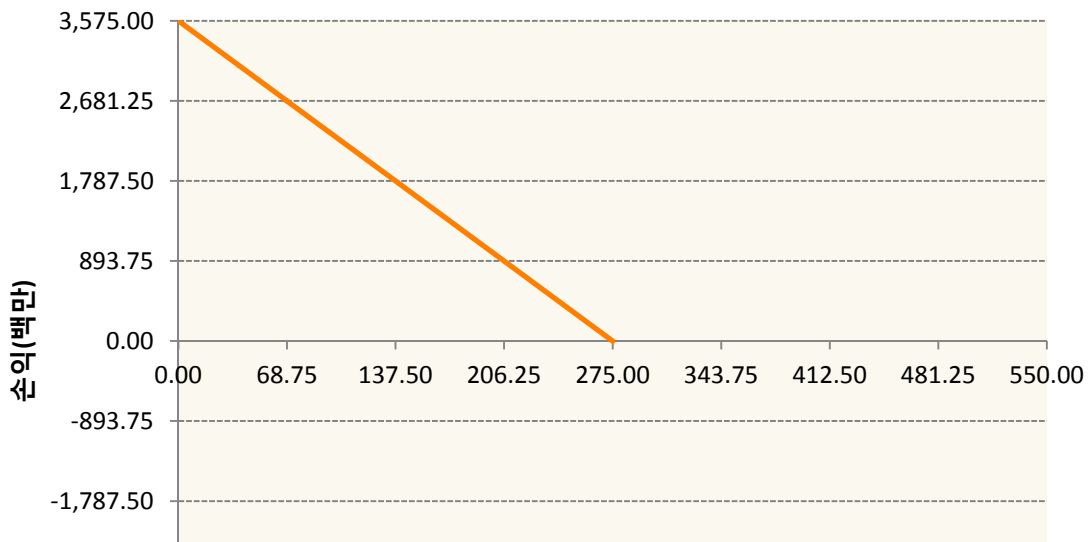


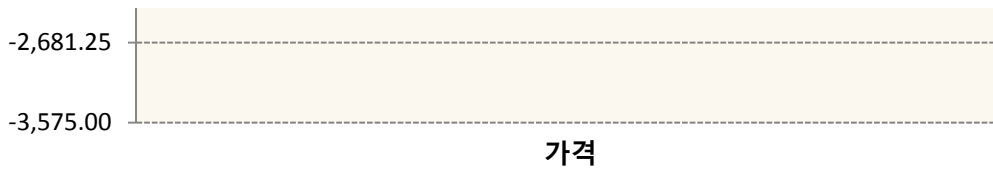


**KR4201NC2900-2018-12 콜290**



**KR4301NC2750-2018-12 풋275**





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101NC0( 2018-12 코스피200지수선물							1,023
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,023	-1,023	-1,023	-1,023	-1,023	-1,023	-1,023
-5.33%	-682	-682	-682	-682	-682	-682	-682
-2.67%	-341	-341	-341	-341	-341	-341	-341
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	341	341	341	341	341	341	341
5.33%	682	682	682	682	682	682	682
8.00%	1,023	1,023	1,023	1,023	1,023	1,023	1,023
KR4201NC2( 2018-12 콜287.5							447
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	131	128	123	117	109	99	88
-5.33%	124	117	108	96	84	69	53
-2.67%	105	92	77	59	41	21	1
0%	66	45	23	0	-24	-49	-74
2.67%	-6	-32	-60	-88	-116	-144	-172
5.33%	-117	-147	-177	-207	-237	-267	-297
8.00%	-271	-300	-329	-359	-388	-418	-447
KR4201NC2( 2018-12 콜290							473
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	126	123	119	113	105	96	85
-5.33%	120	113	105	94	81	66	50
-2.67%	104	91	76	58	39	19	-3
0%	68	47	24	0	-25	-52	-79
2.67%	0	-29	-58	-88	-119	-150	-182
5.33%	-110	-144	-177	-211	-245	-279	-313
8.00%	-268	-302	-336	-371	-405	-439	-473
KR4301NC2( 2018-12 풋275							231
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	221	222	223	224	226	228	231
-5.33%	130	132	135	138	142	145	149
-2.67%	47	52	57	62	67	73	78

0%	-20	-13	-7	0	7	13	20
2.67%	-64	-58	-51	-45	-38	-32	-25
5.33%	-88	-83	-78	-73	-68	-62	-56
8.00%	-97	-95	-92	-89	-85	-81	-77

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

(단위:백만원)

**1,730**

공시일	2018-11-09
기준일	2018-11-08

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

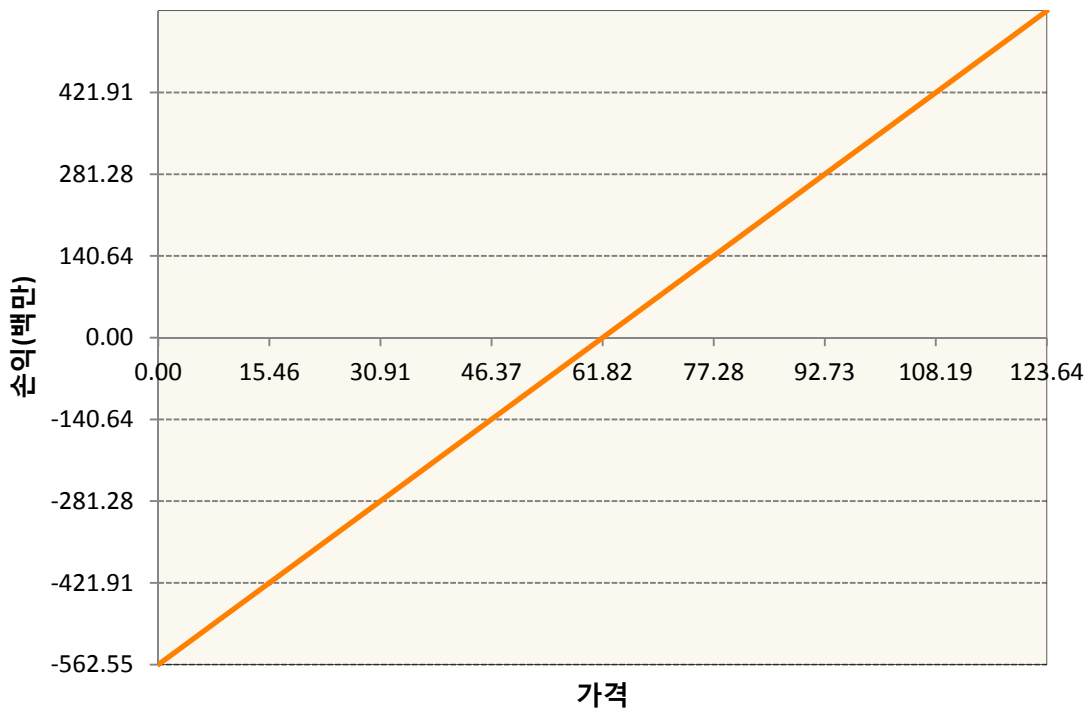
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

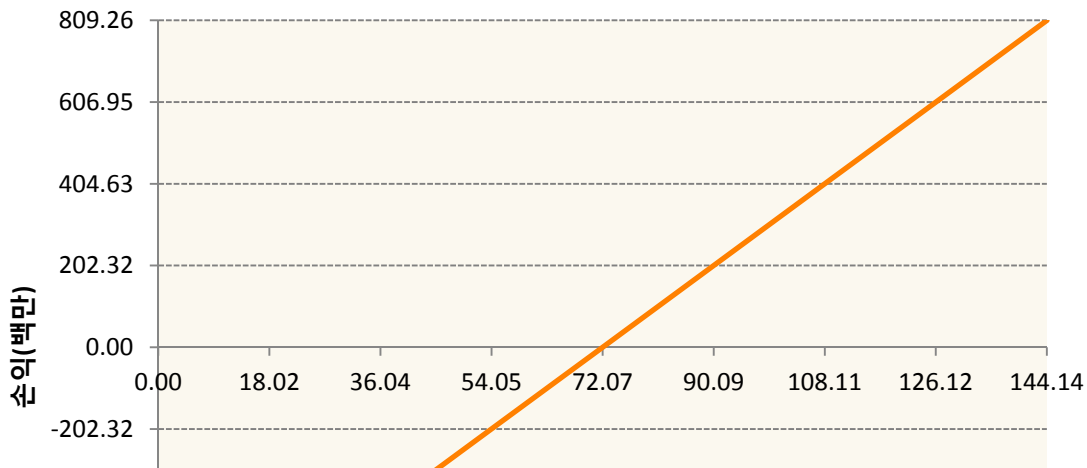
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,200	402	2,799	

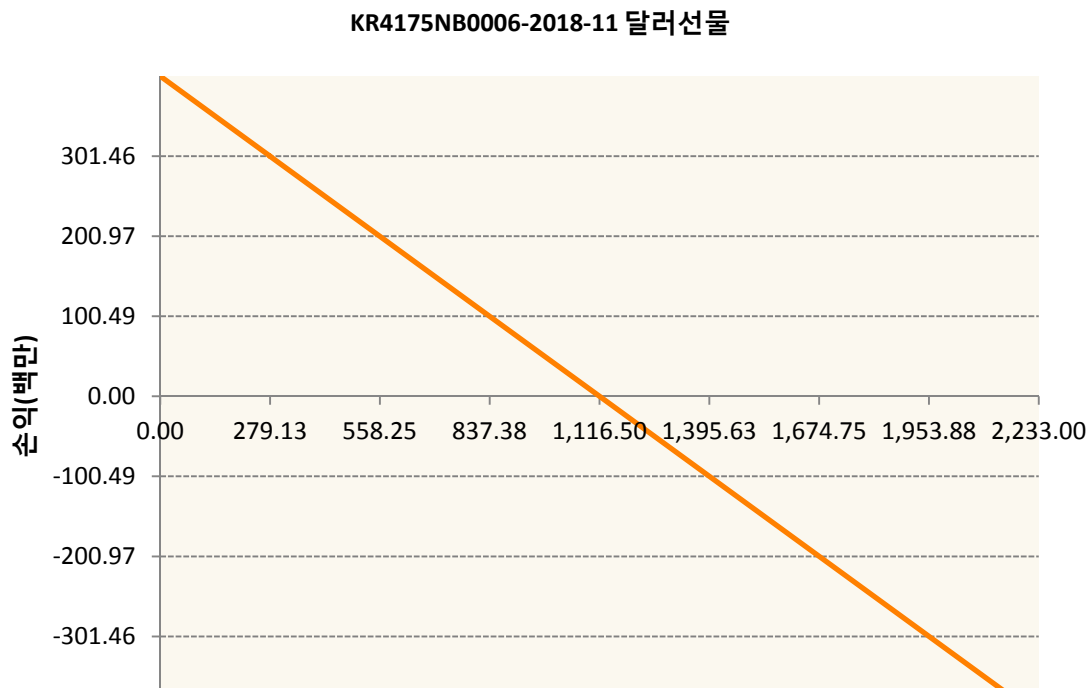
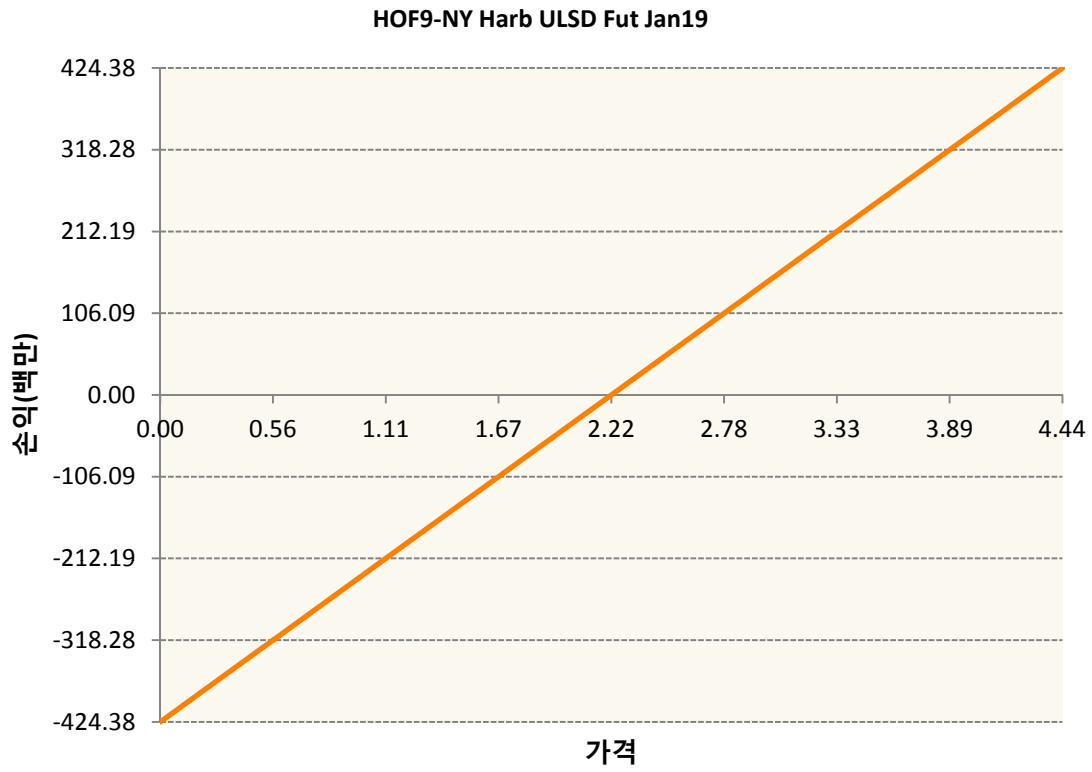
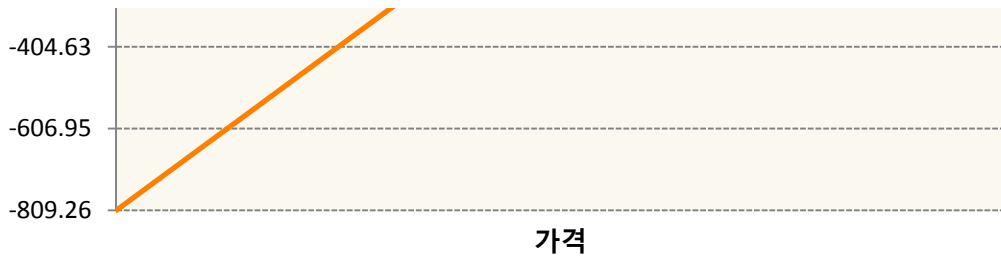
### 2. 만기시점의 손익구조

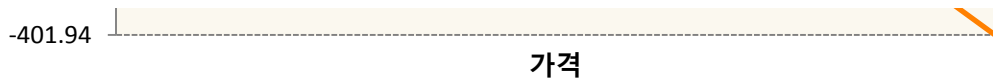
CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19



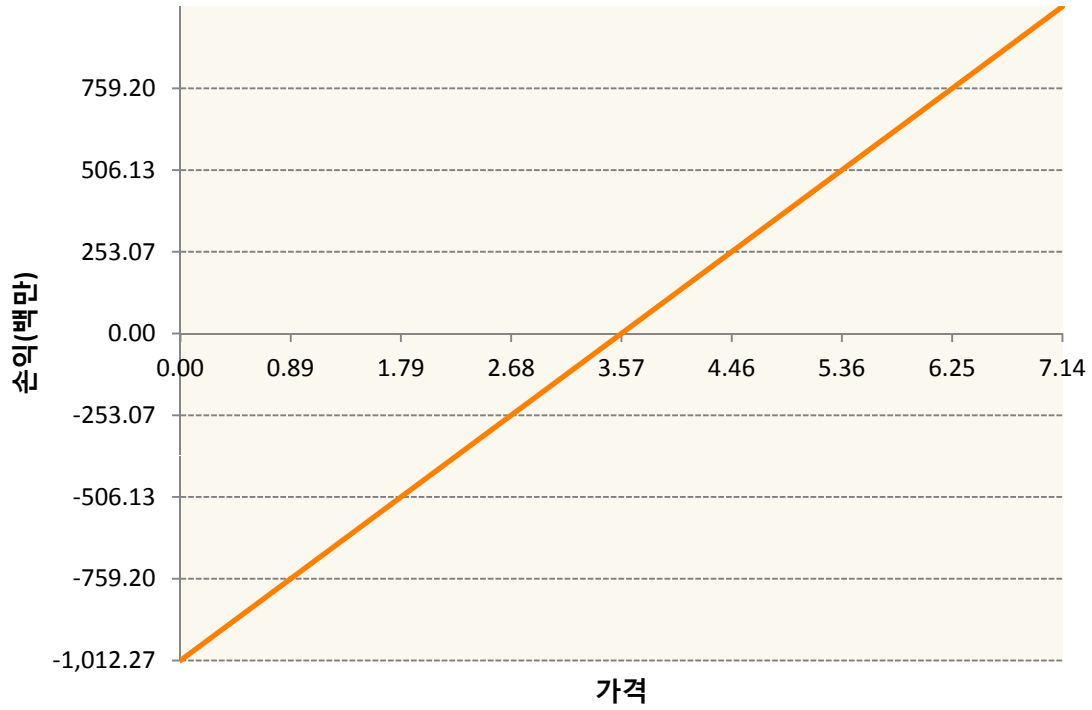
COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19



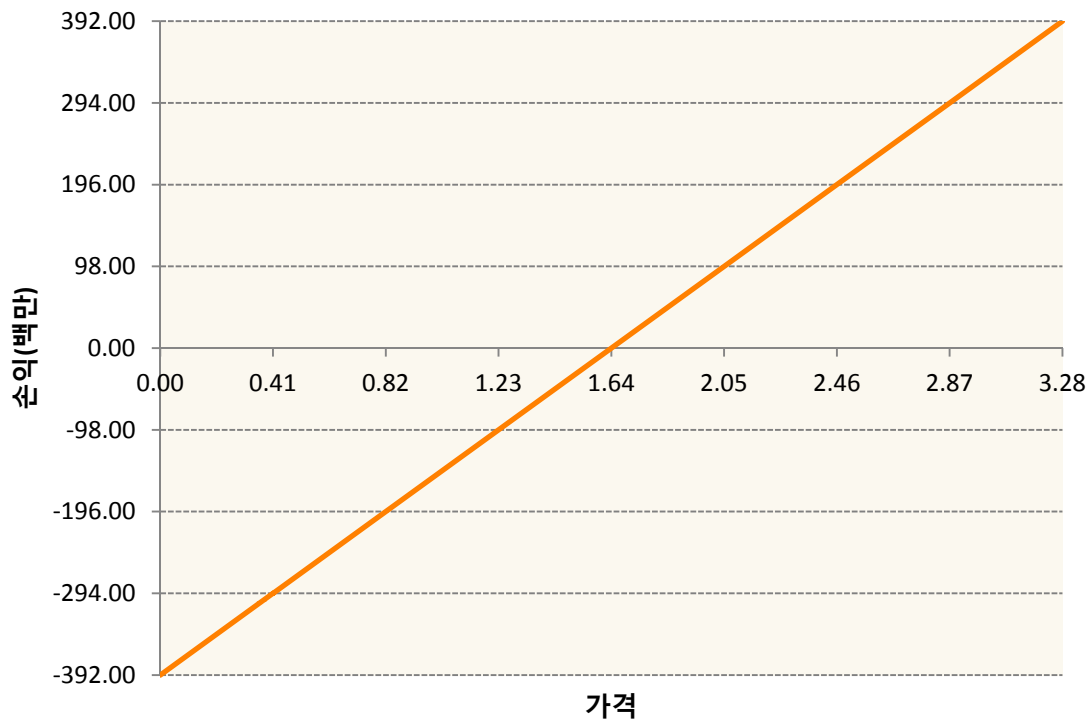




NGF19-NATURAL GAS FUTR Jan19



XBF9-GASOLINE RBOB FUT Jan19



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

CLF9	WTI CRUDE FUTURE Jan19	45
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	65
HOF9	NY Harb ULSD Fut Jan19	34
KR4175NB0(2018-11 달러선물		32
NGF19	NATURAL GAS FUTR Jan19	81
XBF9	GASOLINE RBOB FUT Jan19	31

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

**390**

공시일	2018-11-09
기준일	2018-11-08

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

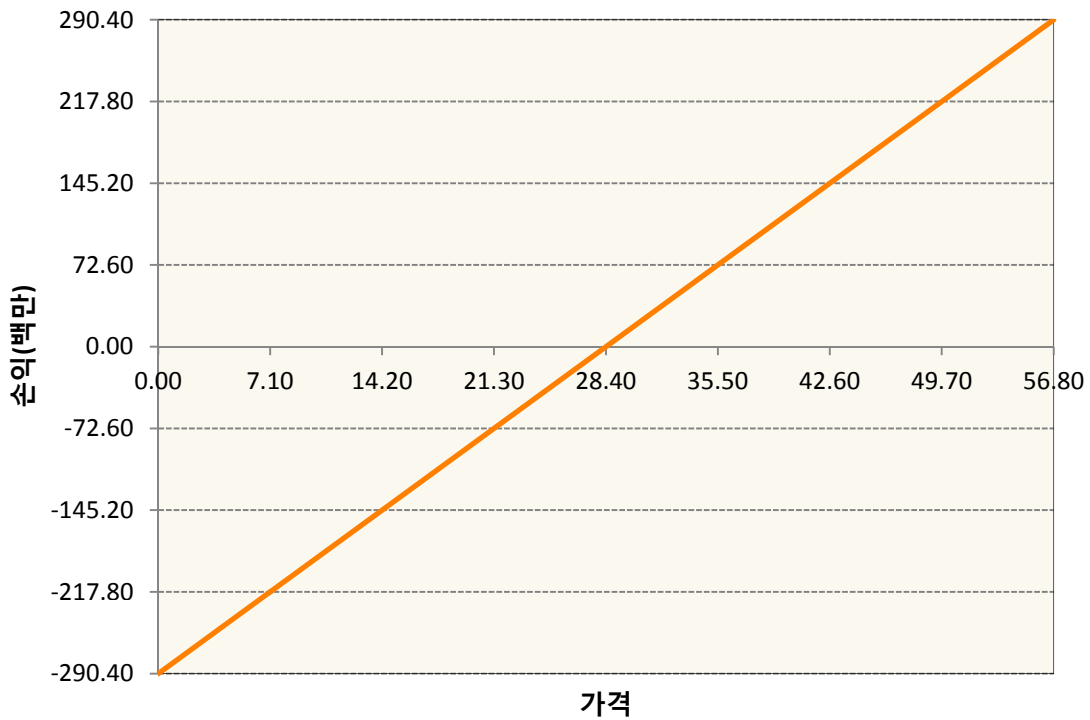
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

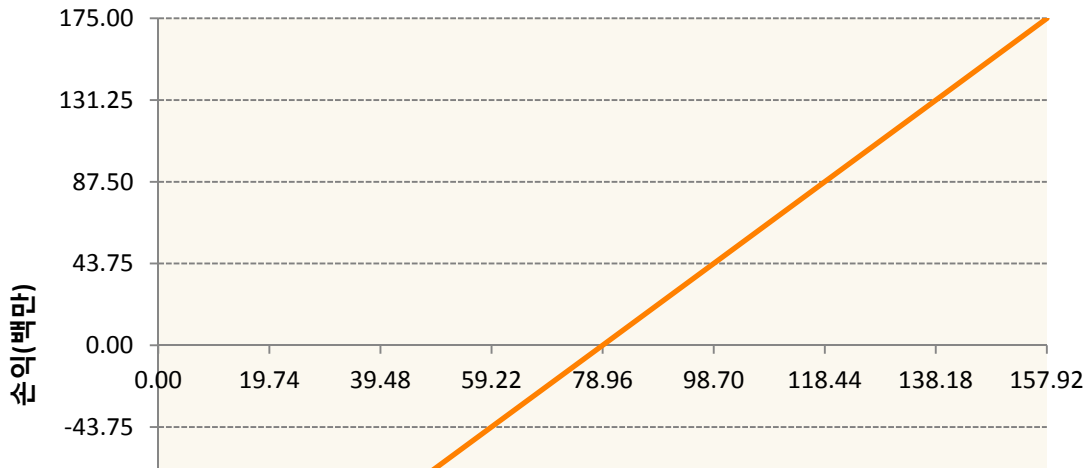
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,605	78	3,527	

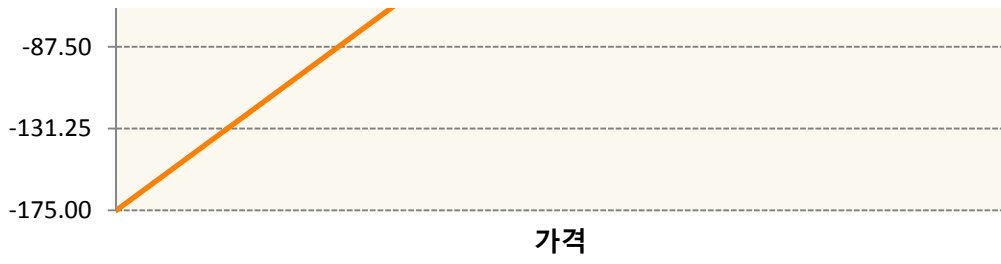
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19**

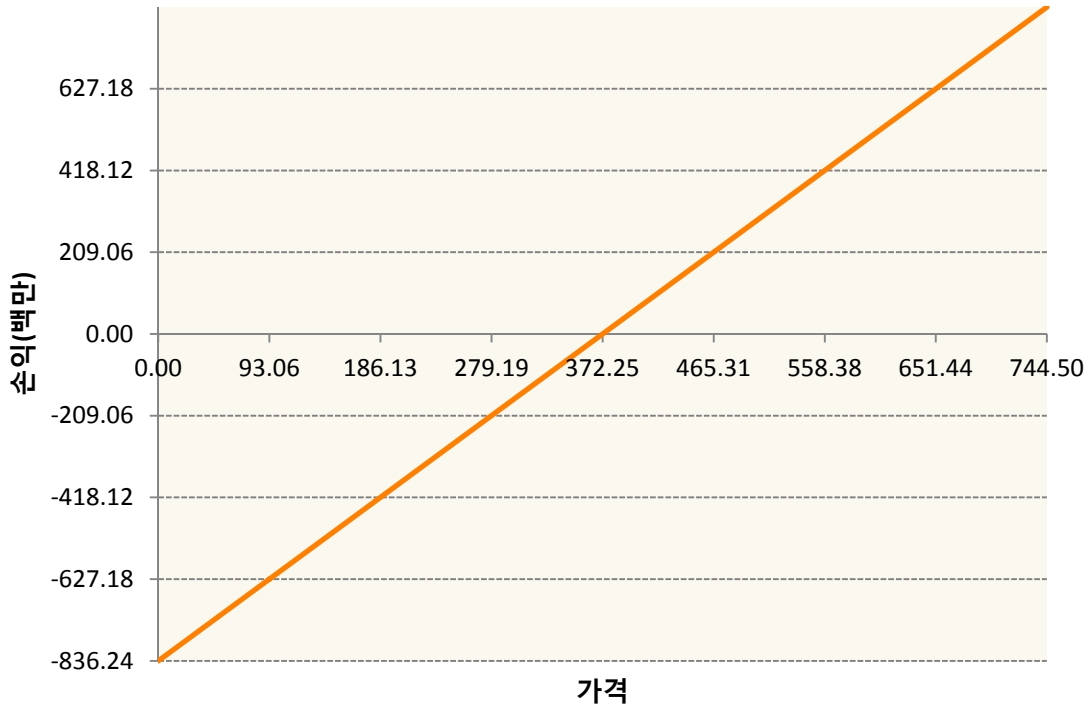


**CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18**

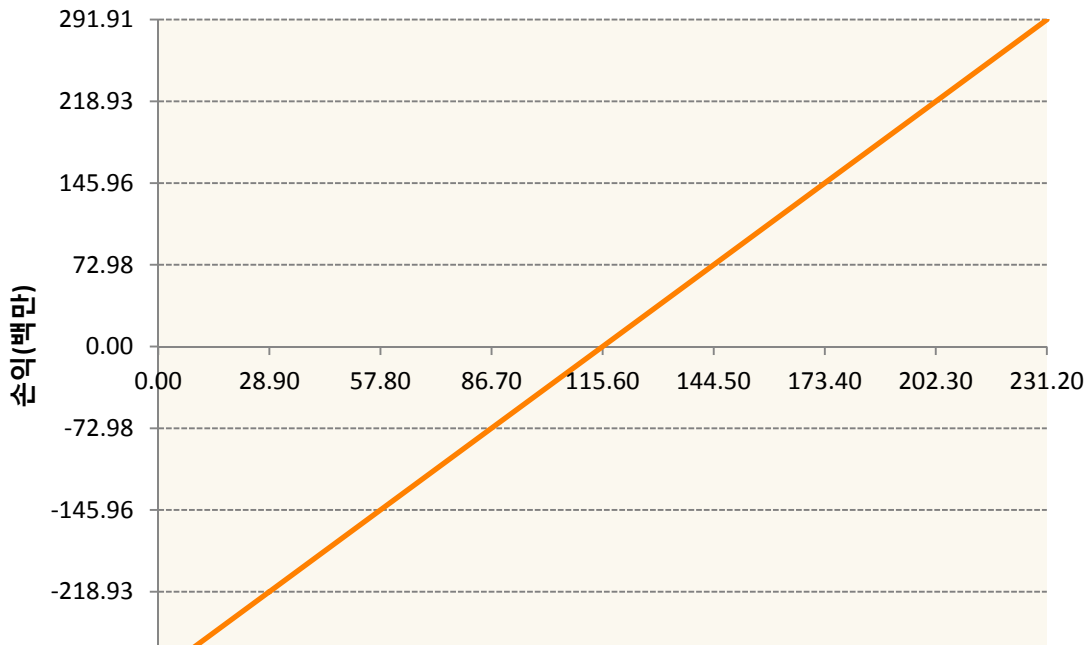


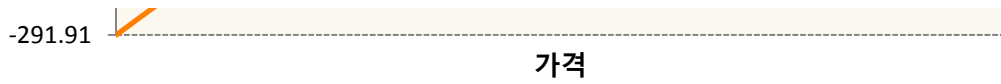


**CZ8-CORN FUTURE DEC18**

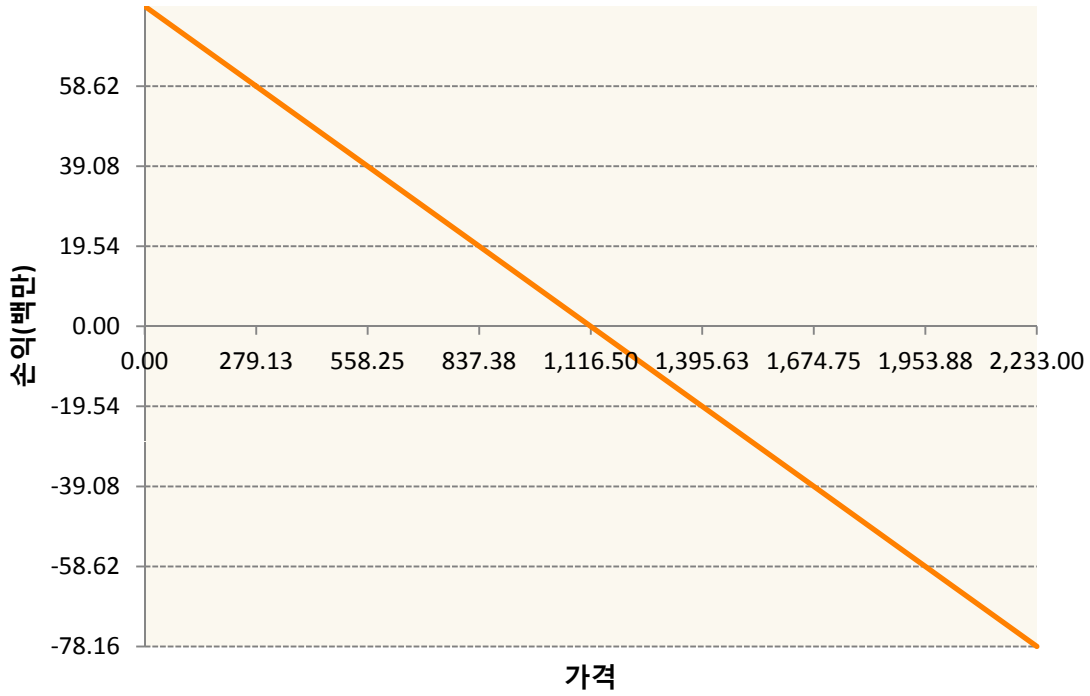


**KCZ8-COFFEE 'C' FUTURE Dec18**

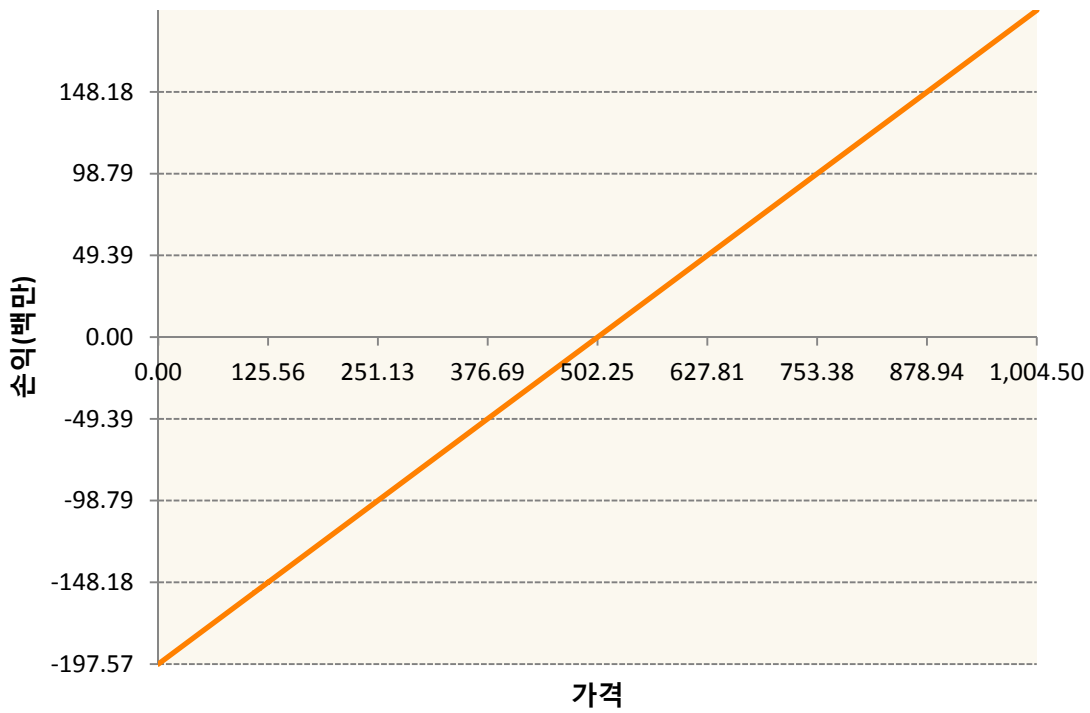




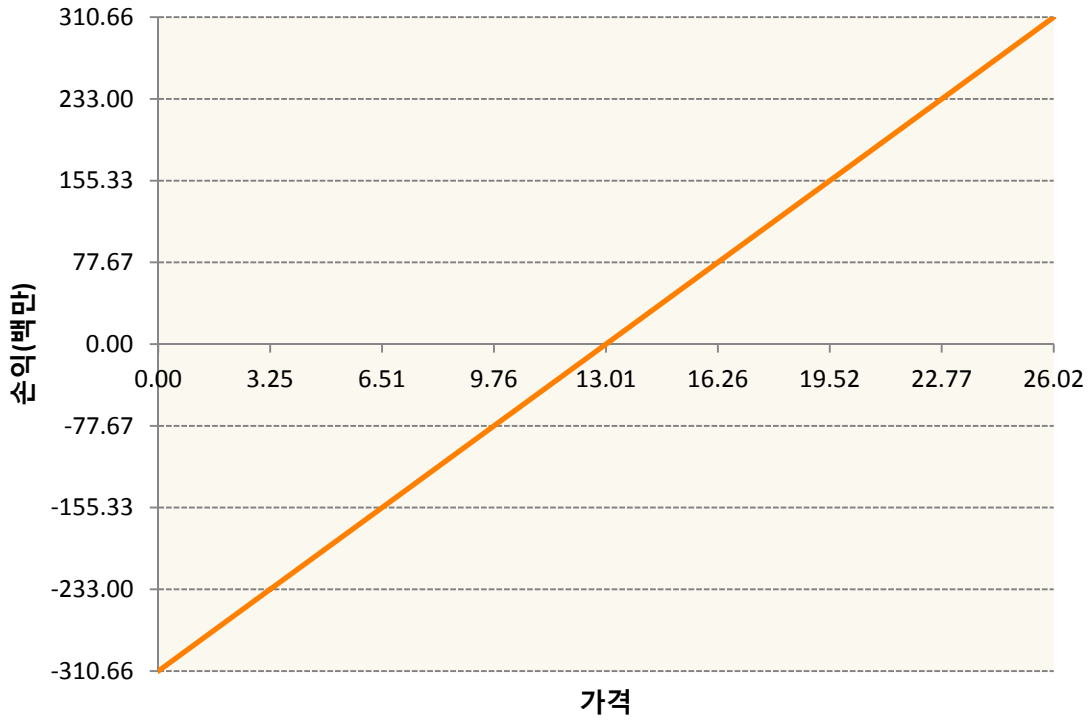
KR4175NB0006-2018-11 달러선물



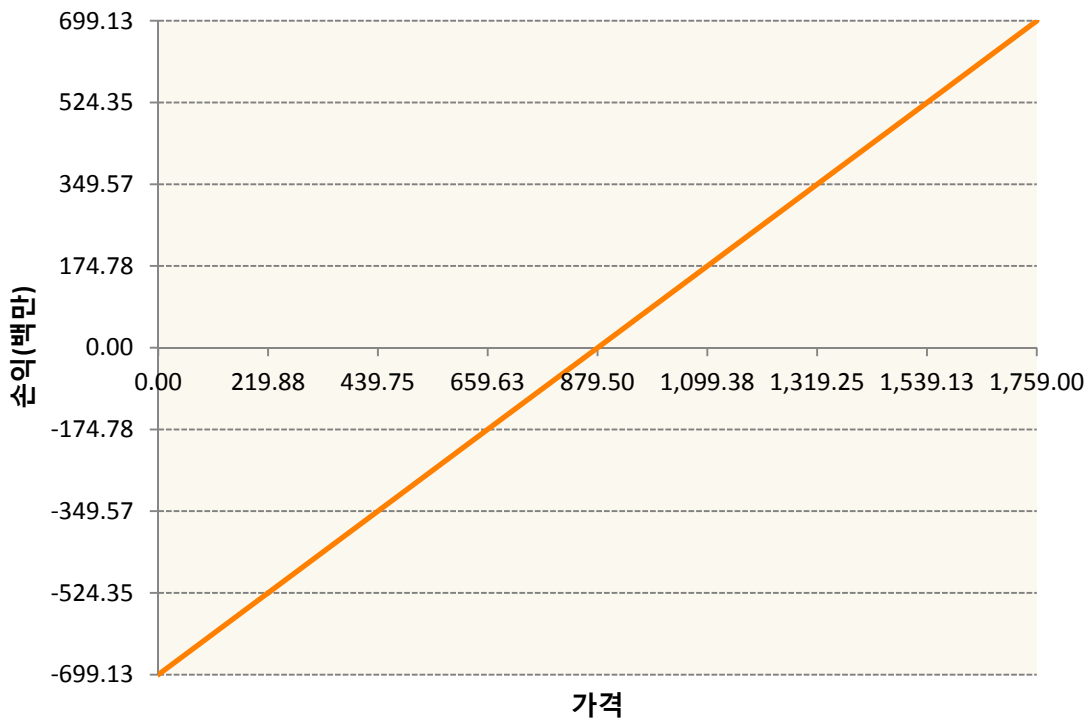
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

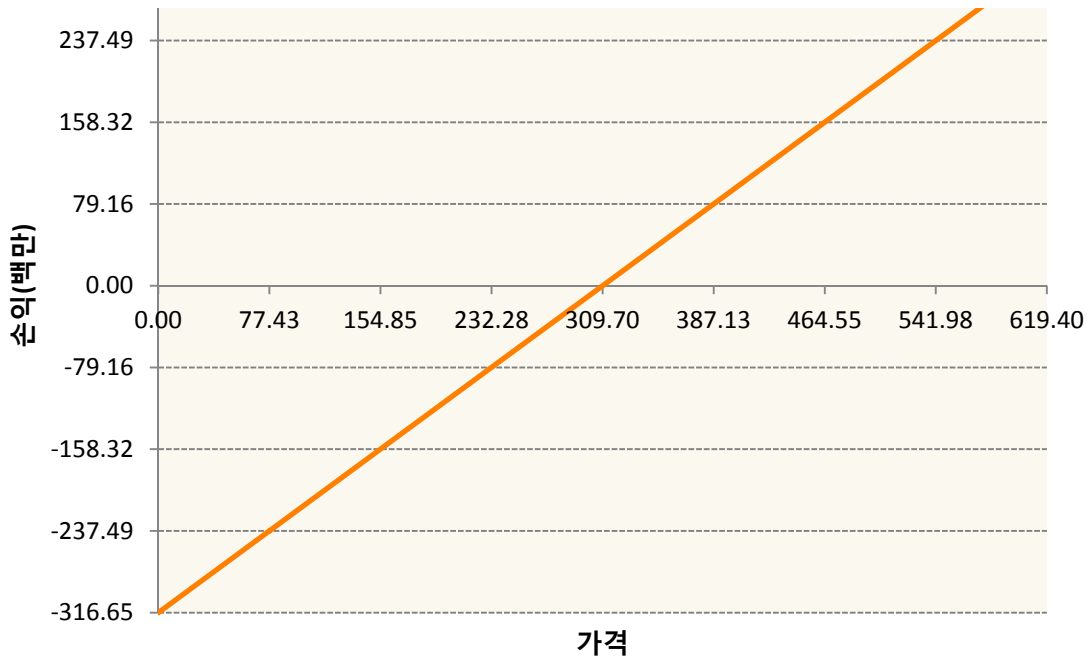


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19

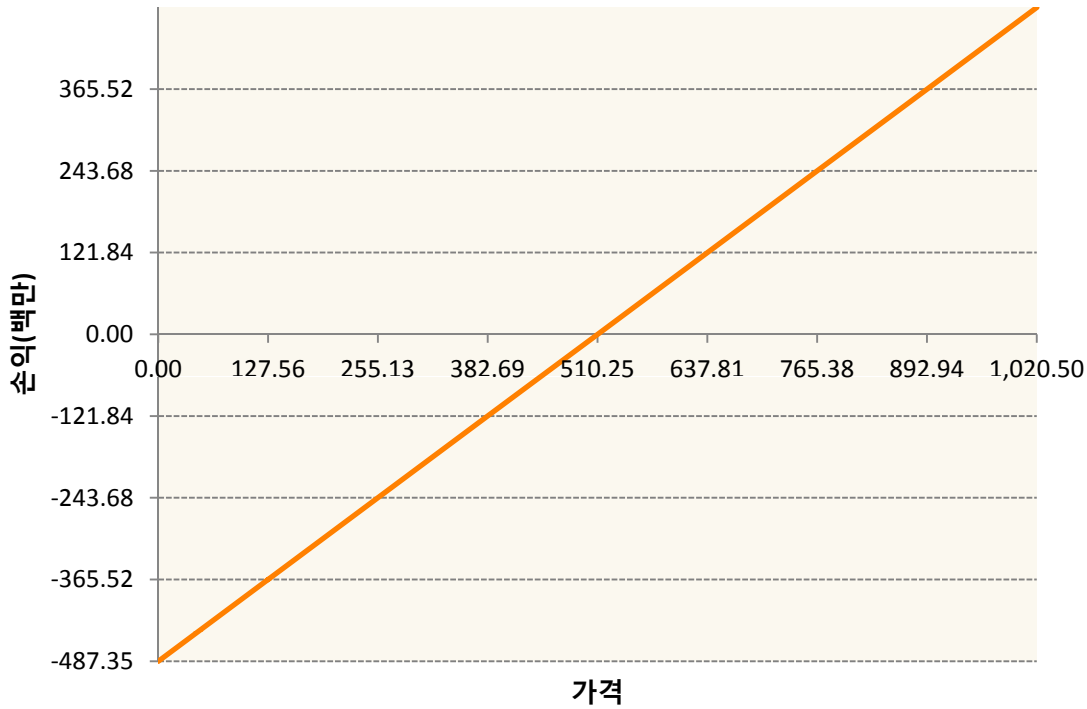


SMF9-SOYBEAN MEAL FUTR Jan19





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	23
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	25
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	39

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

(단위:백만원)

**314**