

공시일	2018-11-12
기준일	2018-11-09

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	2018-11-12
기준일	2018-11-09

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

1,106

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

526

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-11-12
기준일	2018-11-09

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

265

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

378

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-11-12
기준일	2018-11-09

유로인덱스모(주식-파생형)

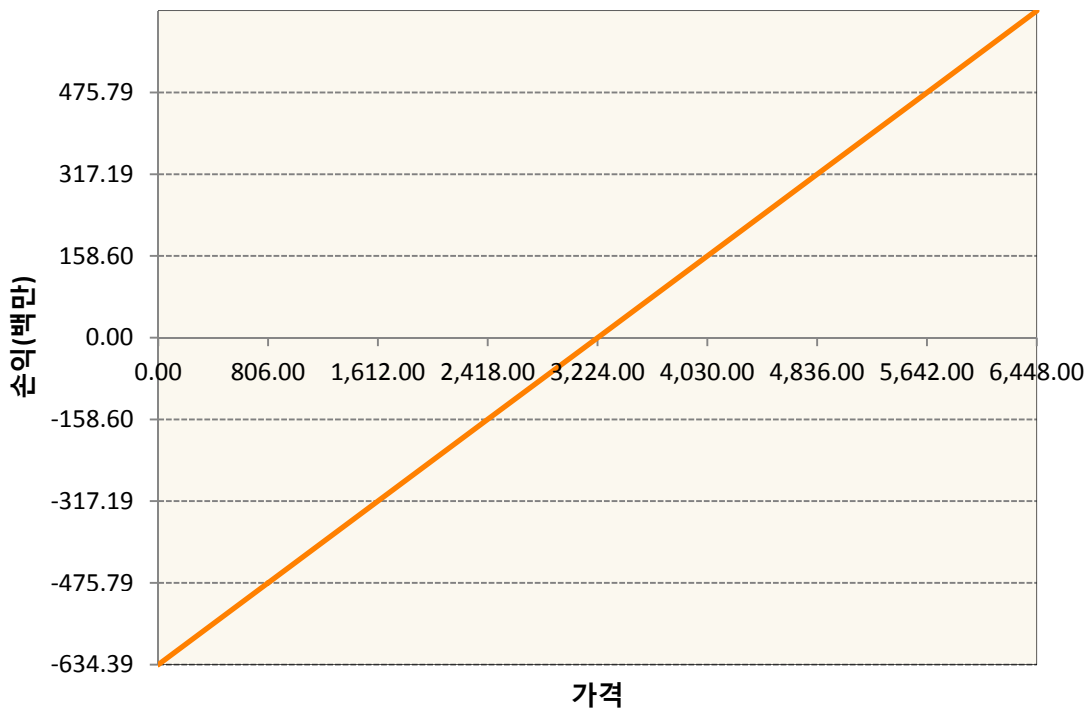
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	634	0	634	

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	2018-11-12
기준일	2018-11-09

차이나인덱스모(주식-파생형)

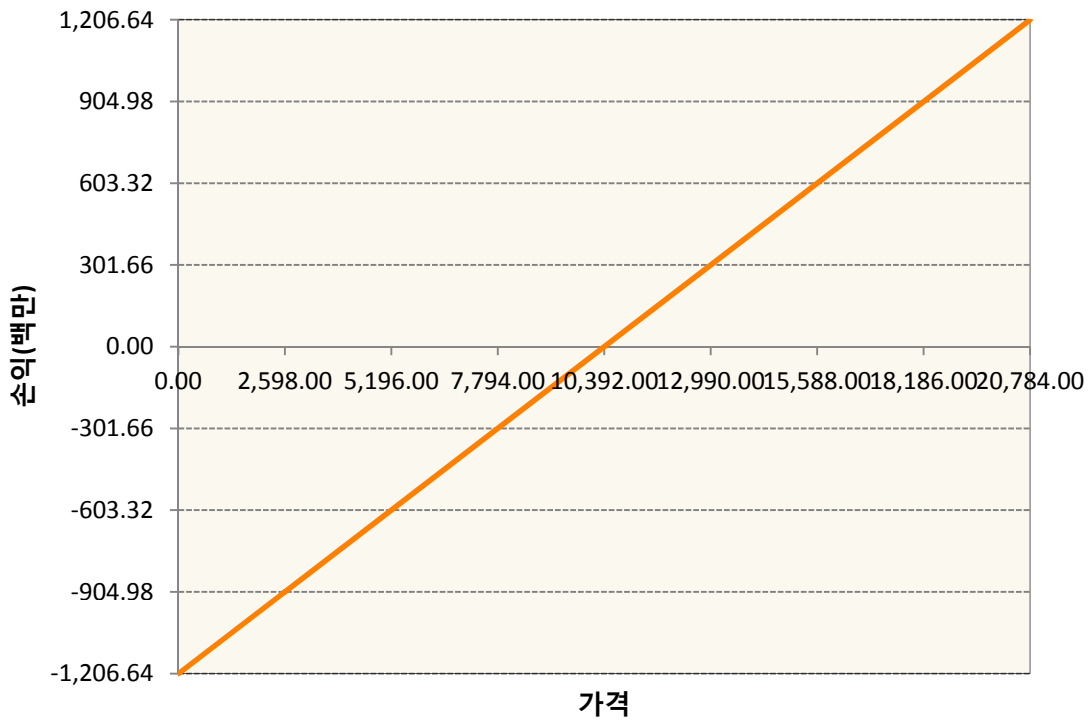
1. 계약금액

(단위:백만원)

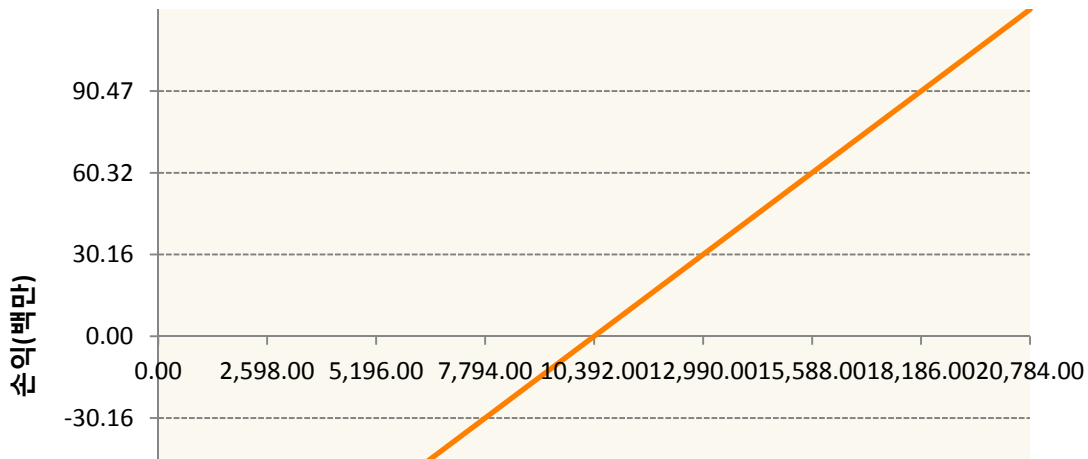
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,327	0	1,327	장내

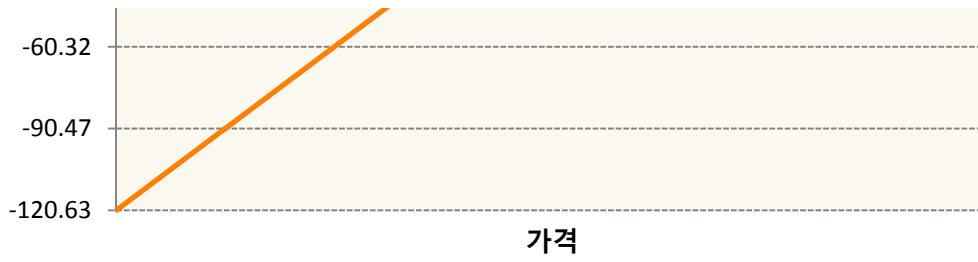
2. 만기시점의 손익구조

HCX8-HSCEI FUTURES NOV 18



MHCX8-MINI H-SHR IDX FU NOV 18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCX8	HSCEI FUTURES NOV 18	97
MHCX8	MINI H-SHR IDX FU NOV 18	10

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

105

공시일	2018-11-12
기준일	2018-11-09

커버드콜모(주식혼합-파생형)

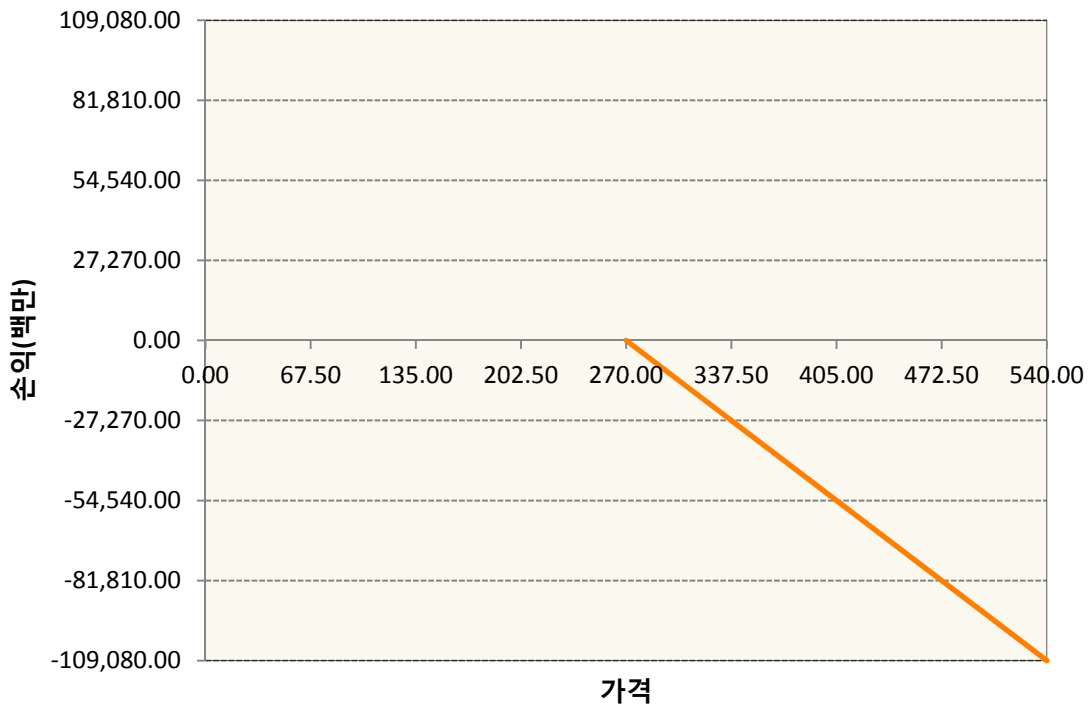
1. 계약금액

(단위:백만원)

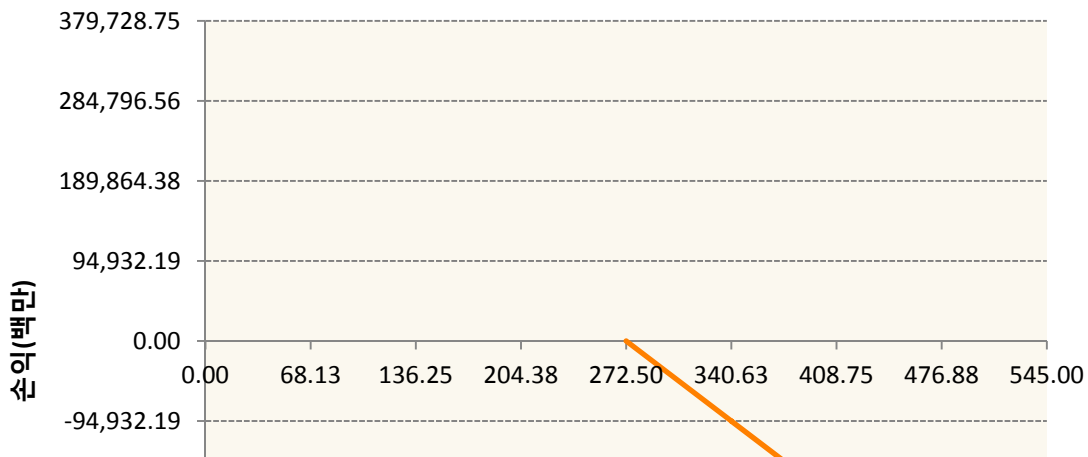
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	657,418	-657,418	장내
누계	유가증권	옵션	0	774,934	-774,934	장내

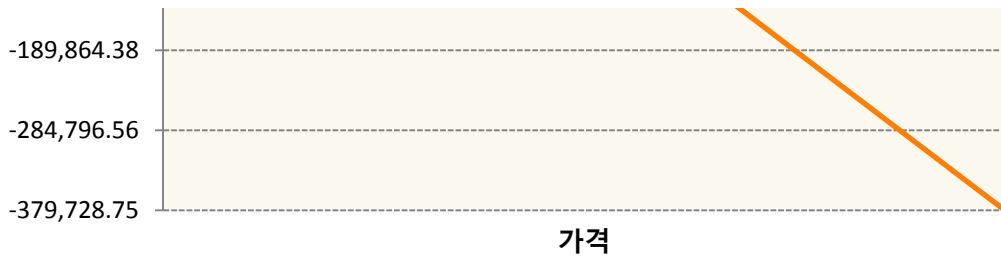
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NC2702-2018-12 콜270

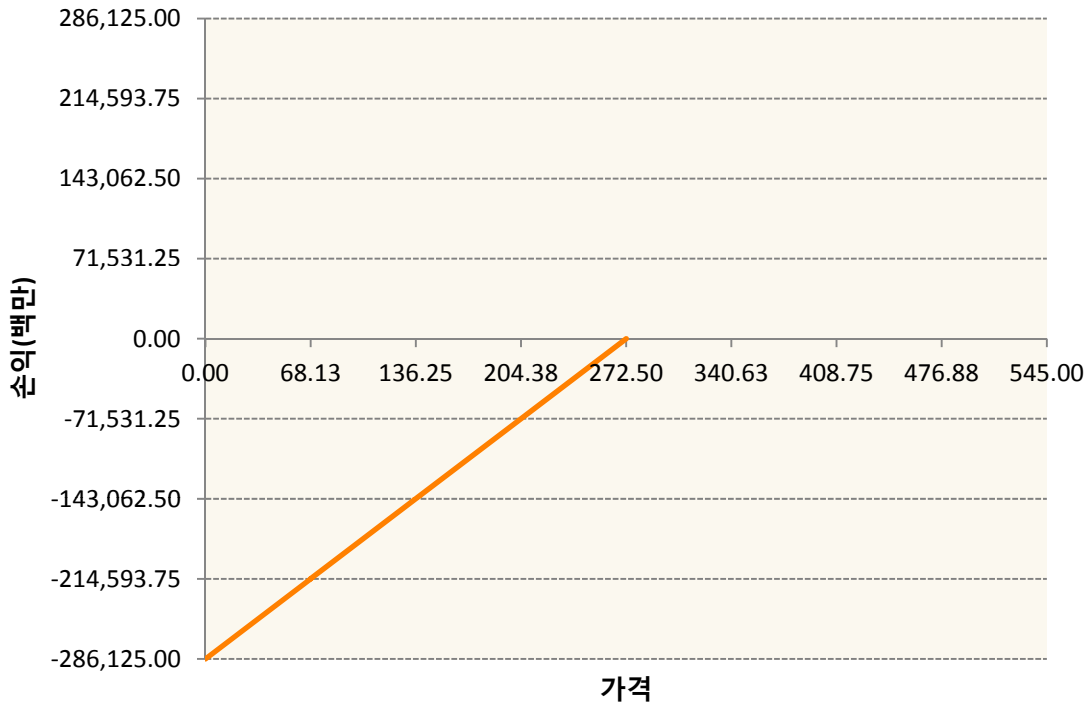


KR4201NC2728-2018-12 콜272.5





KR4301NC2727-2018-12 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NC272018-12 콜270

6,827

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,488	3,355	3,202	3,034	2,851	2,656	2,452
-5.33%	3,040	2,829	2,606	2,373	2,133	1,887	1,636
-2.67%	2,204	1,931	1,654	1,375	1,095	813	530
0%	883	589	294	0	-294	-589	-883
2.67%	-937	-1,203	-1,476	-1,752	-2,032	-2,314	-2,599
5.33%	-3,182	-3,388	-3,610	-3,843	-4,085	-4,336	-4,592
8.00%	-5,734	-5,872	-6,032	-6,210	-6,403	-6,609	-6,827

KR4201NC272018-12 풋272.5

22,585

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,634	10,251	9,797	9,282	8,712	8,098	7,443

-5.33%	9,418	8,771	8,072	7,331	6,556	5,753	4,927
-2.67%	7,025	6,134	5,222	4,295	3,357	2,409	1,453
0%	3,058	2,039	1,020	0	-1,020	-2,040	-3,060
2.67%	-2,634	-3,613	-4,603	-5,600	-6,602	-7,609	-8,619
5.33%	-9,896	-10,699	-11,541	-12,415	-13,313	-14,231	-15,166
8.00%	-18,362	-18,930	-19,565	-20,257	-20,996	-21,774	-22,585
KR4301NC27, 2018-12 풋272.5							18,311
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-17,715	-17,754	-17,816	-17,903	-18,014	-18,150	-18,311
-5.33%	-10,356	-10,508	-10,693	-10,910	-11,153	-11,420	-11,707
-2.67%	-3,701	-4,043	-4,405	-4,784	-5,175	-5,577	-5,988
0%	1,423	950	475	0	-475	-951	-1,427
2.67%	4,511	4,093	3,663	3,224	2,779	2,329	1,874
5.33%	5,889	5,645	5,368	5,063	4,735	4,388	4,025
8.00%	6,333	6,236	6,105	5,942	5,749	5,527	5,281

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

(단위:백만원)

46,112

공시일	2018-11-12
기준일	2018-11-09

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

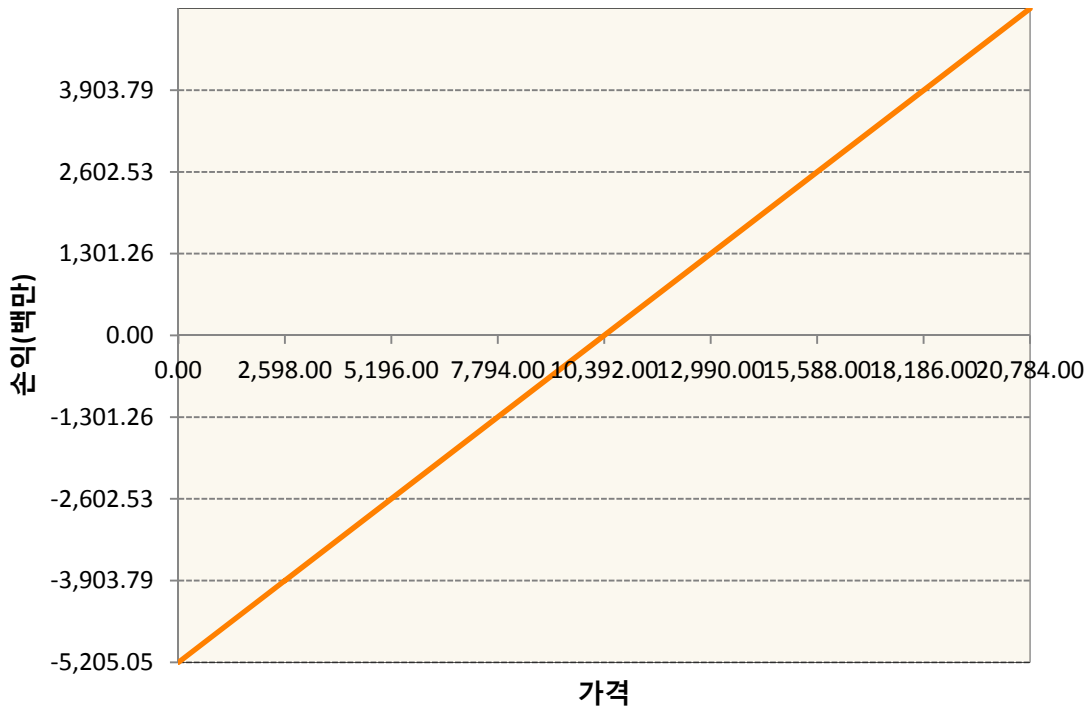
1. 계약금액

(단위:백만원)

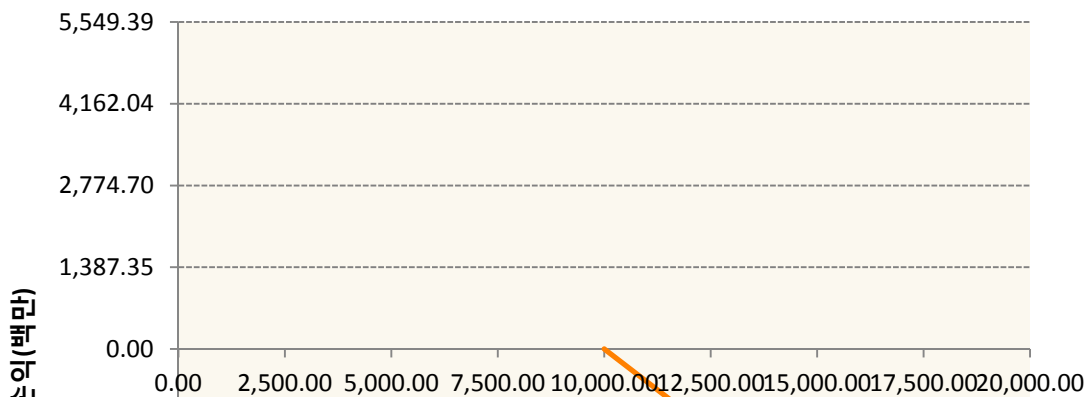
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,205	0	5,205	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,099	-11,099	장내

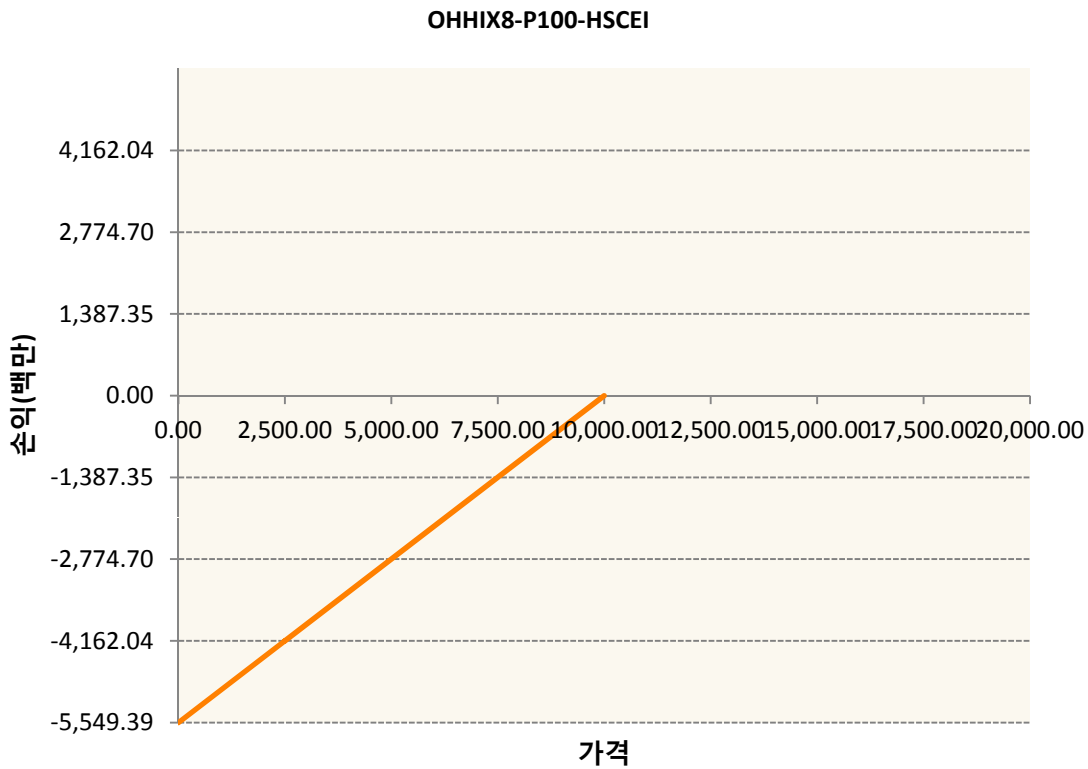
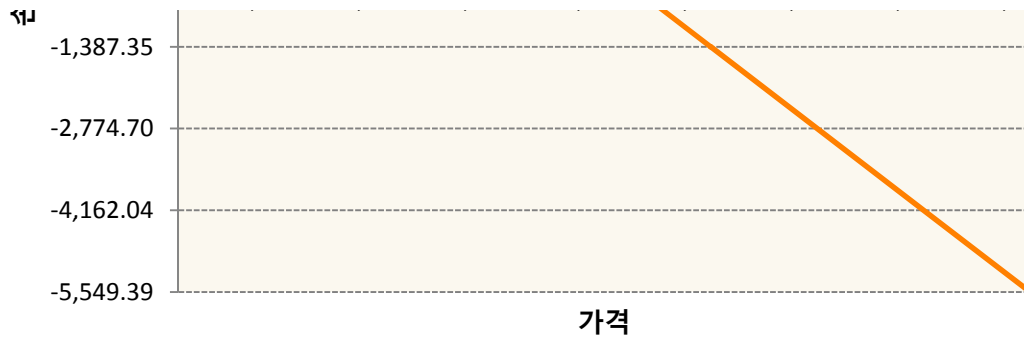
2. 만기시점의 손익구조

HCX8-HSCEI FUTURES NOV 18



OHHIX8-C100-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCX8	HSCEI FUTURES NOV 18	416
	OHHIX8-C1C HSCEI	444
	OHHIX8-P10 HSCEI	444

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

1,286

공시일	2018-11-12
기준일	2018-11-09

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

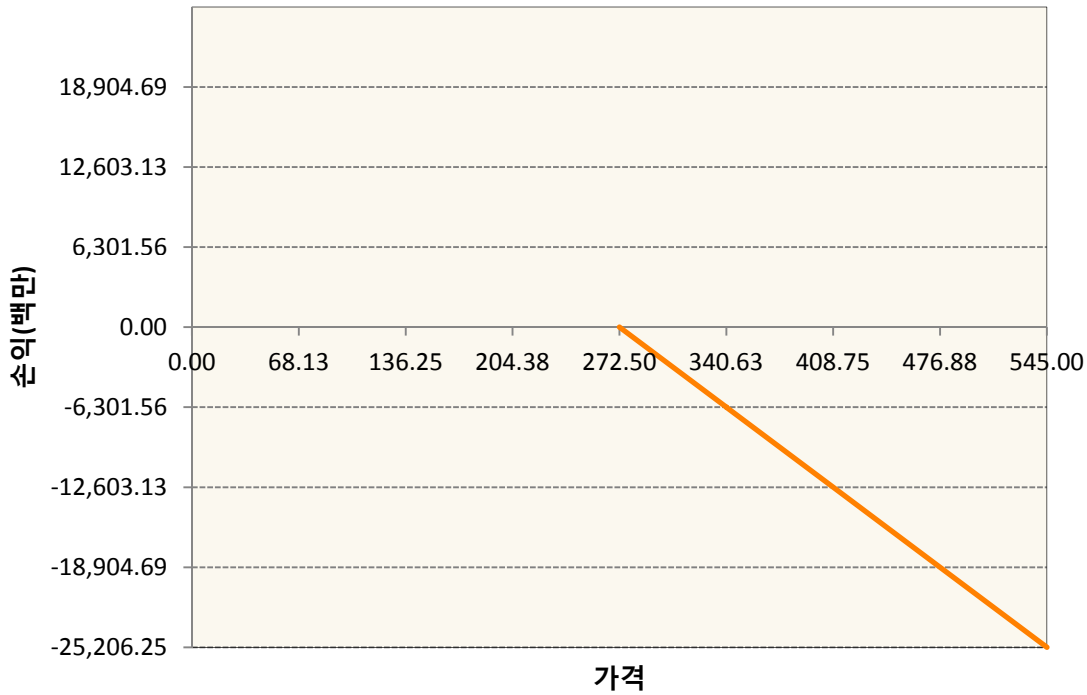
1. 계약금액

(단위:백만원)

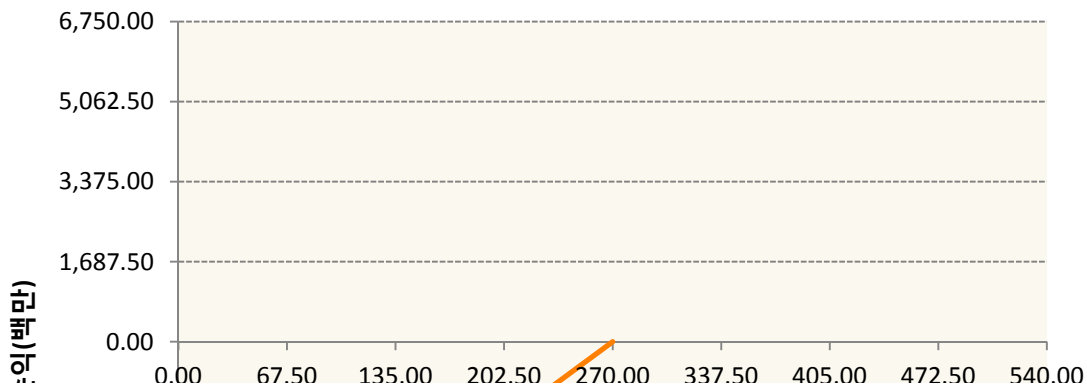
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	44,270	-44,270	장내
누계	유가증권	스왑	43,836	0	43,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	43,538	-43,538	장내

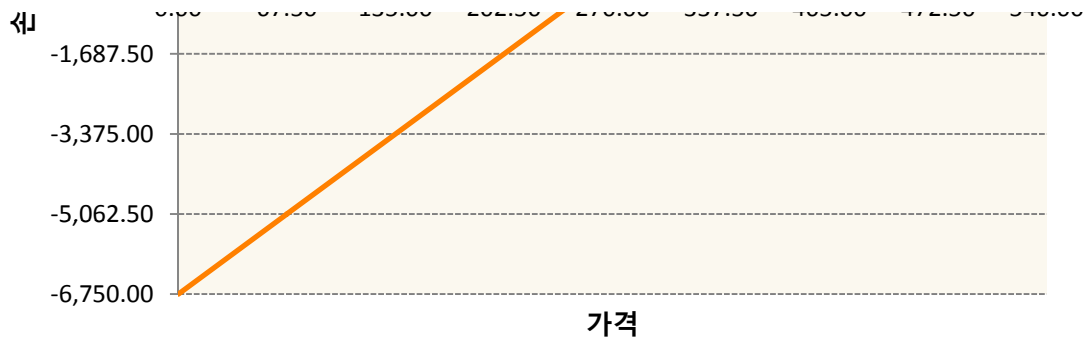
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NC2728-2018-12 콜272.5

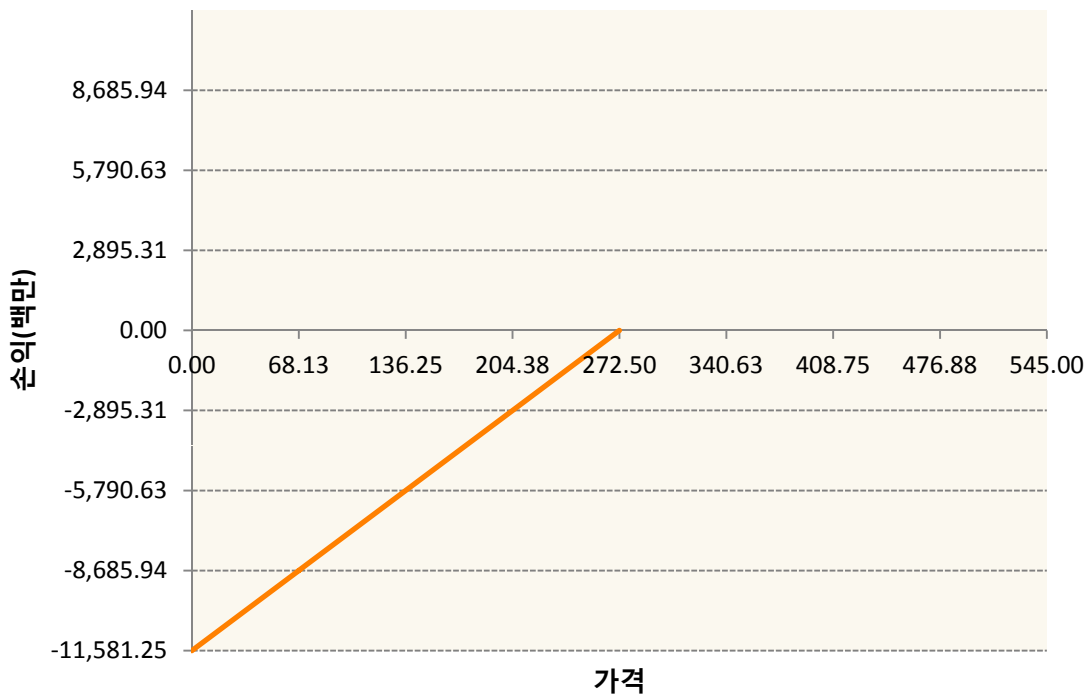


KR4301NC2701-2018-12 풋270





KR4301NC2727-2018-12 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,594
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,594	-3,594	-3,594	-3,594	-3,594	-3,594	-3,594
-5.33%	-2,396	-2,396	-2,396	-2,396	-2,396	-2,396	-2,396
-2.67%	-1,198	-1,198	-1,198	-1,198	-1,198	-1,198	-1,198
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,198	1,198	1,198	1,198	1,198	1,198	1,198
5.33%	2,396	2,396	2,396	2,396	2,396	2,396	2,396
8.00%	3,594	3,594	3,594	3,594	3,594	3,594	3,594
KR4201NC2727-2018-12 콜272.5							1,499
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	706	680	650	616	578	538	494
-5.33%	625	582	536	487	435	382	327
-2.67%	466	407	347	285	223	160	96
0%	203	135	68	0	-68	-135	-203
2.67%	-175	-240	-306	-372	-438	-505	-572
5.33%	-657	-710	-766	-824	-884	-945	-1,007
8.00%	-1,219	-1,257	-1,299	-1,345	-1,394	-1,445	-1,499

KR4301NC2; 2018-12 풋270

411

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-392	-394	-396	-399	-402	-406	-411
-5.33%	-221	-225	-231	-238	-245	-252	-260
-2.67%	-72	-82	-91	-101	-111	-122	-132
0%	34	23	11	0	-11	-23	-34
2.67%	91	83	74	64	55	45	35
5.33%	114	110	104	99	92	85	77
8.00%	120	119	117	114	110	106	101

KR4301NC2; 2018-12 풋272.5

741

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-717	-719	-721	-725	-729	-735	-741
-5.33%	-419	-425	-433	-442	-451	-462	-474
-2.67%	-150	-164	-178	-194	-209	-226	-242
0%	58	38	19	0	-19	-38	-58
2.67%	183	166	148	131	112	94	76
5.33%	238	228	217	205	192	178	163
8.00%	256	252	247	241	233	224	214

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

(단위:백만원)

6,154

공시일	2018-11-12
기준일	2018-11-09

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

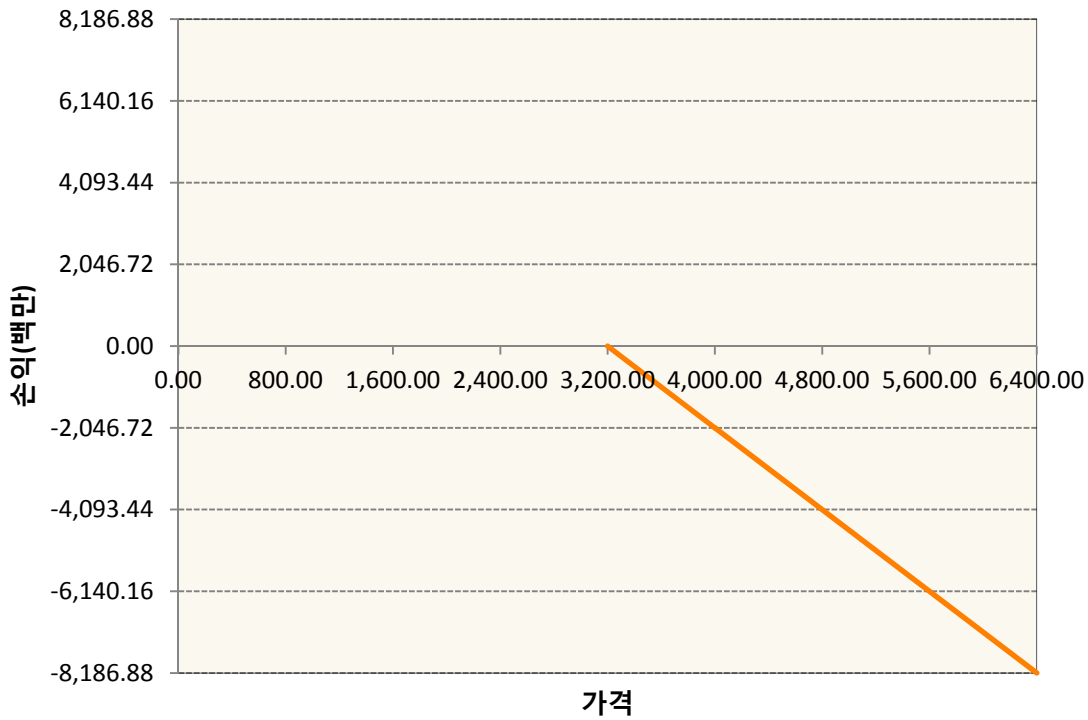
1. 계약금액

(단위:백만원)

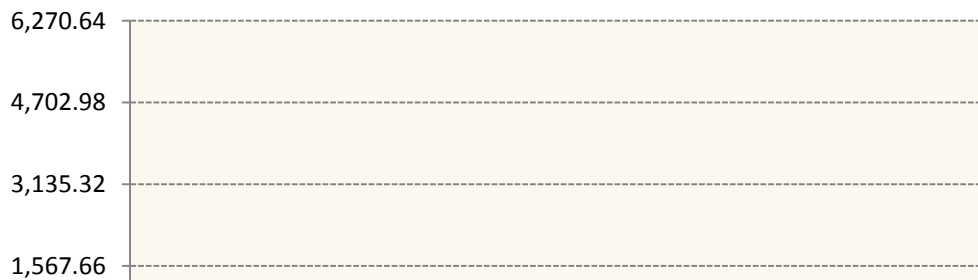
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,238	0	8,238	
누계	유가증권	스왑	71,448	0	71,448	장외
누계	유가증권	옵션	0	28,915	-28,915	장내

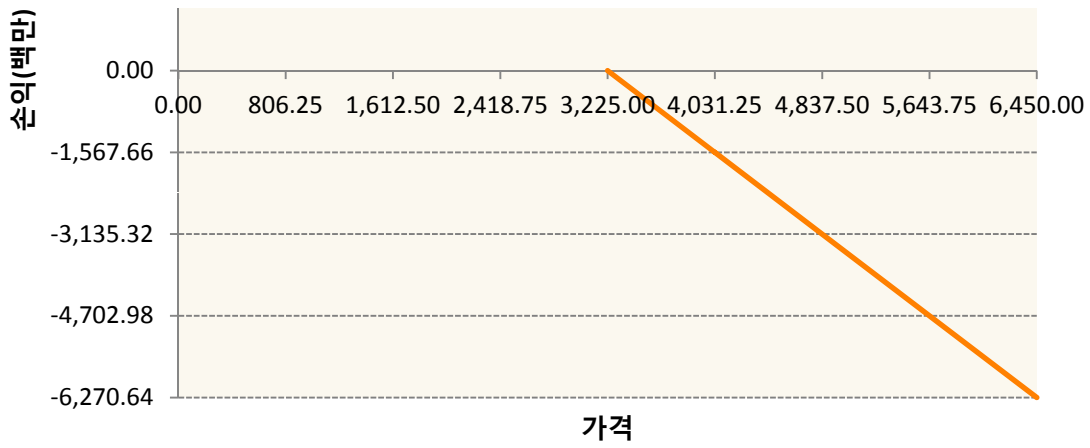
2. 만기시점의 손익구조

OESXX8-C3200-EURO STOXX 50

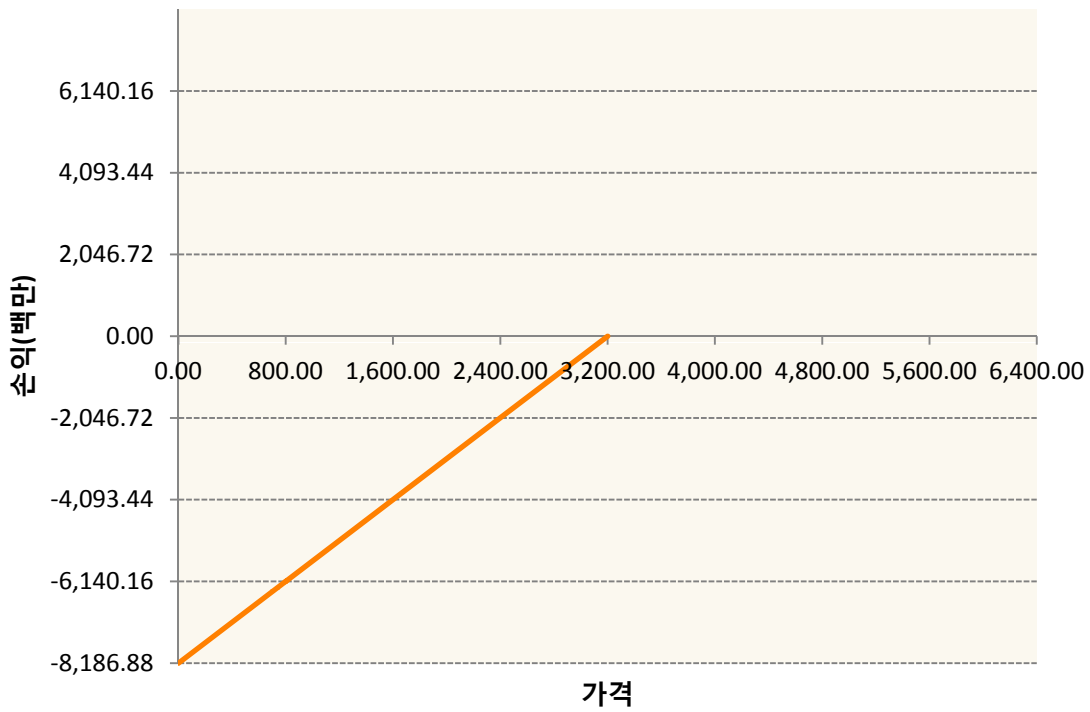


OESXX8-C3225-EURO STOXX 50

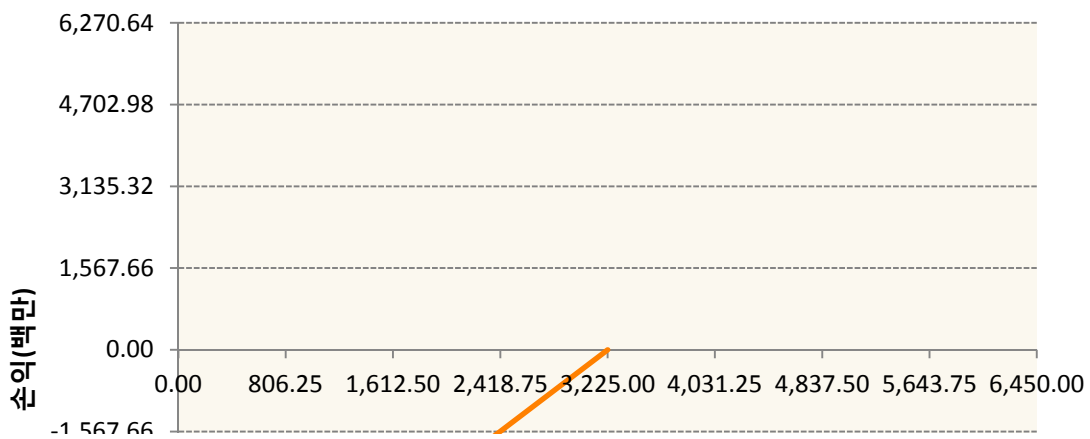


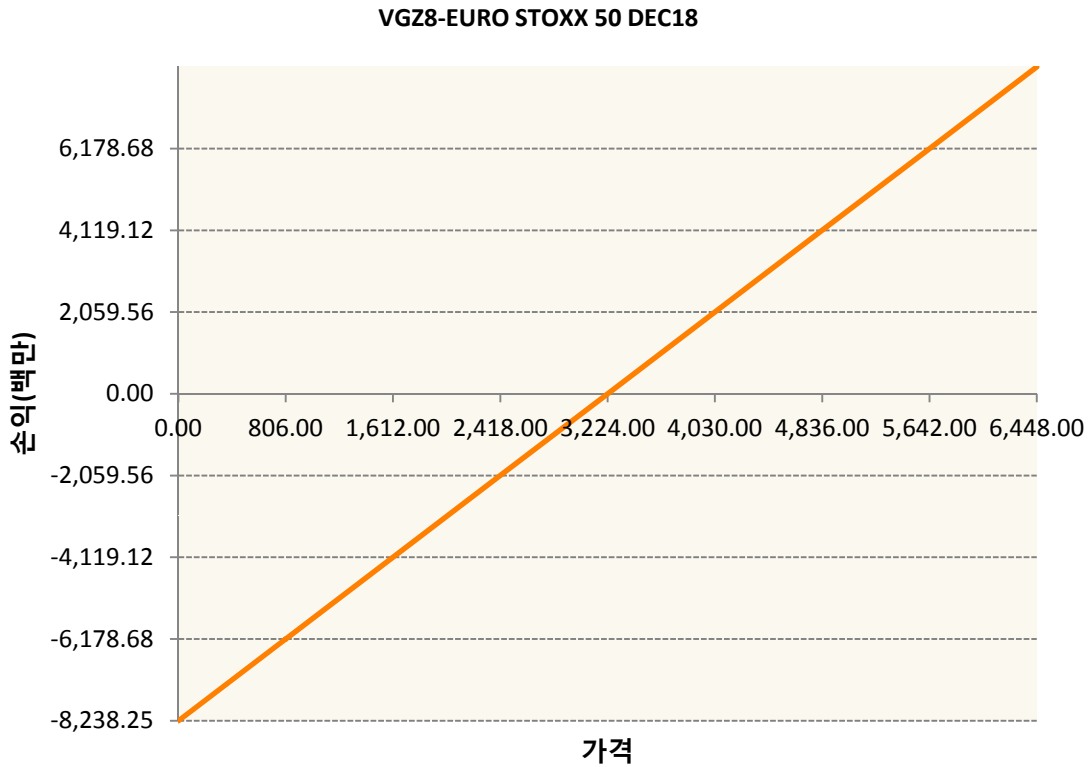


OESXX8-P3200-EURO STOXX 50



OESXX8-P3225-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	75
OESXX8-C32 EURO STOXX 50	655
OESXX8-C32 EURO STOXX 50	502
OESXX8-P32 EURO STOXX 50	655
OESXX8-P32 EURO STOXX 50	502
VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18	659

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

1,972

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

(단위:백만원)

1,153

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)

156

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

(단위:백만원)

41

공시일	2018-11-12
기준일	2018-11-09

리디파인K200(주식혼합-파생재간

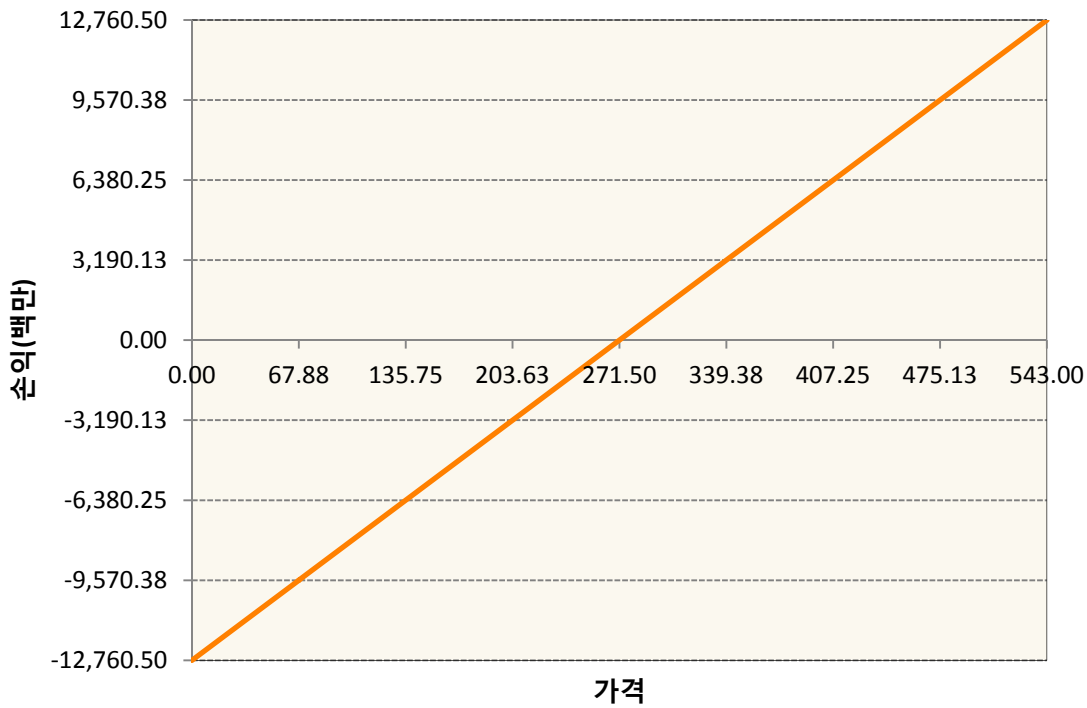
1. 계약금액

(단위:백만원)

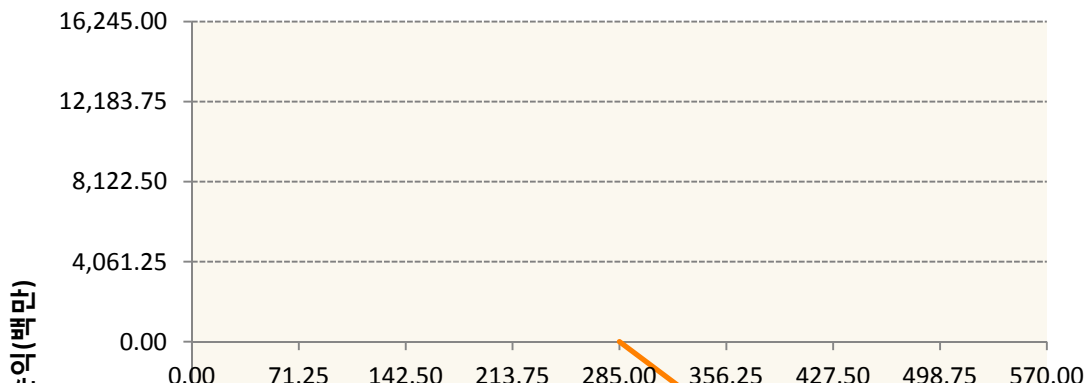
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	7,840	16,288	-8,447	장내
누계	유가증권	선물	12,761	0	12,761	장내
누계	유가증권	옵션	3,743	22,858	-19,115	장내

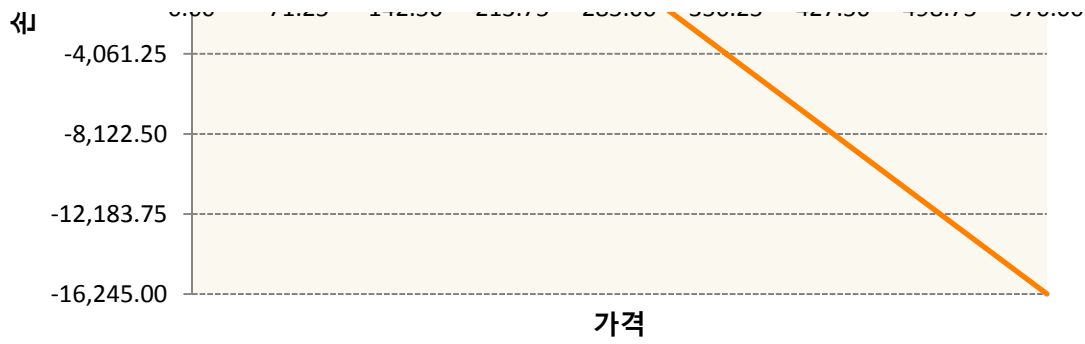
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

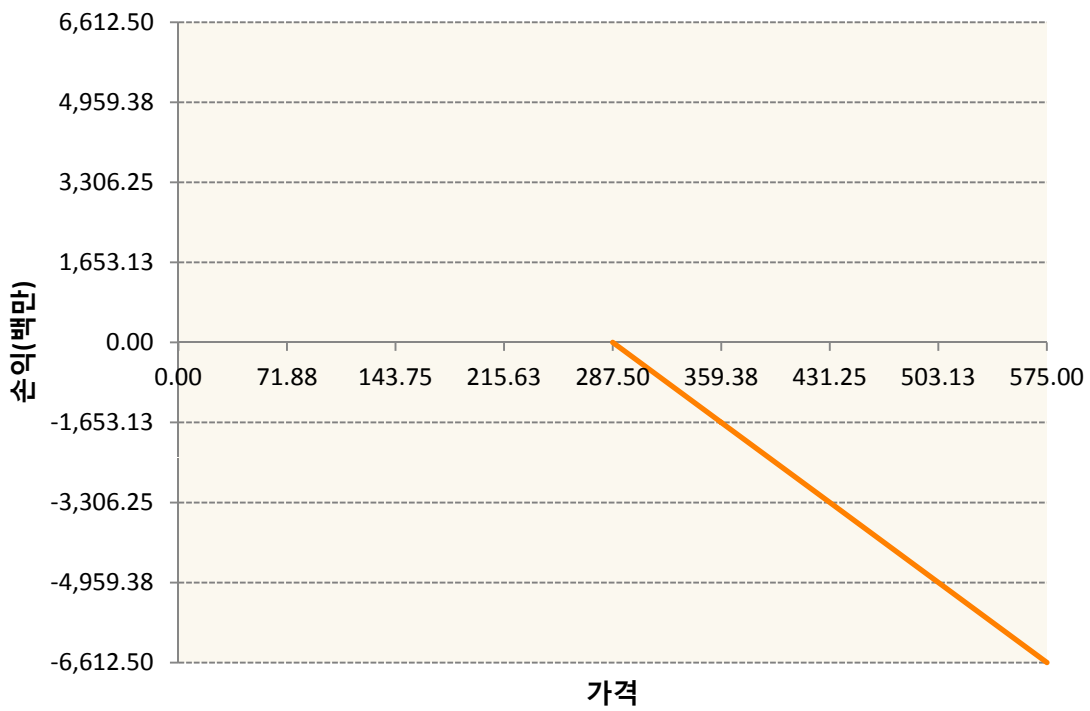


KR4201NC2850-2018-12 콜285

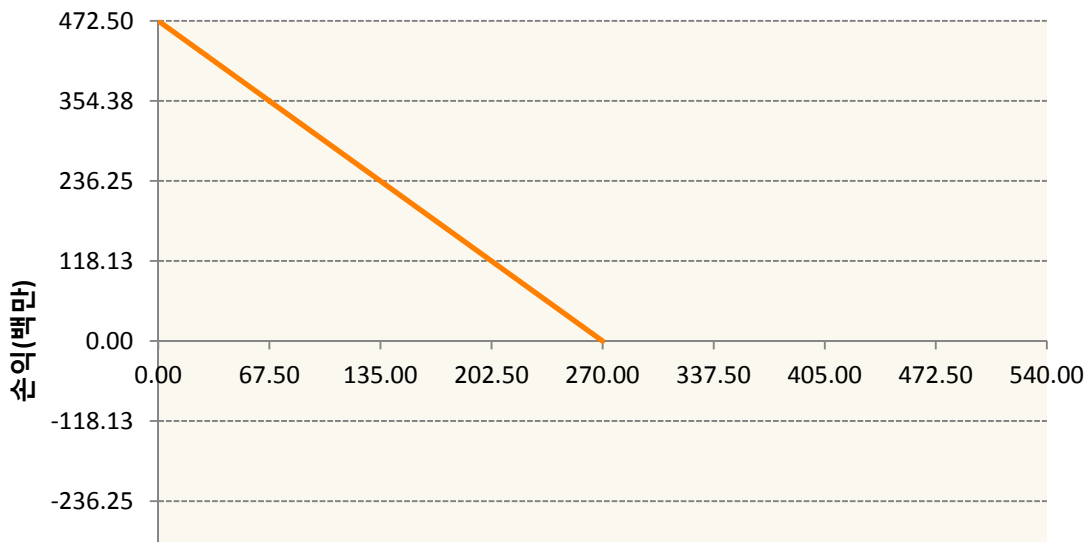


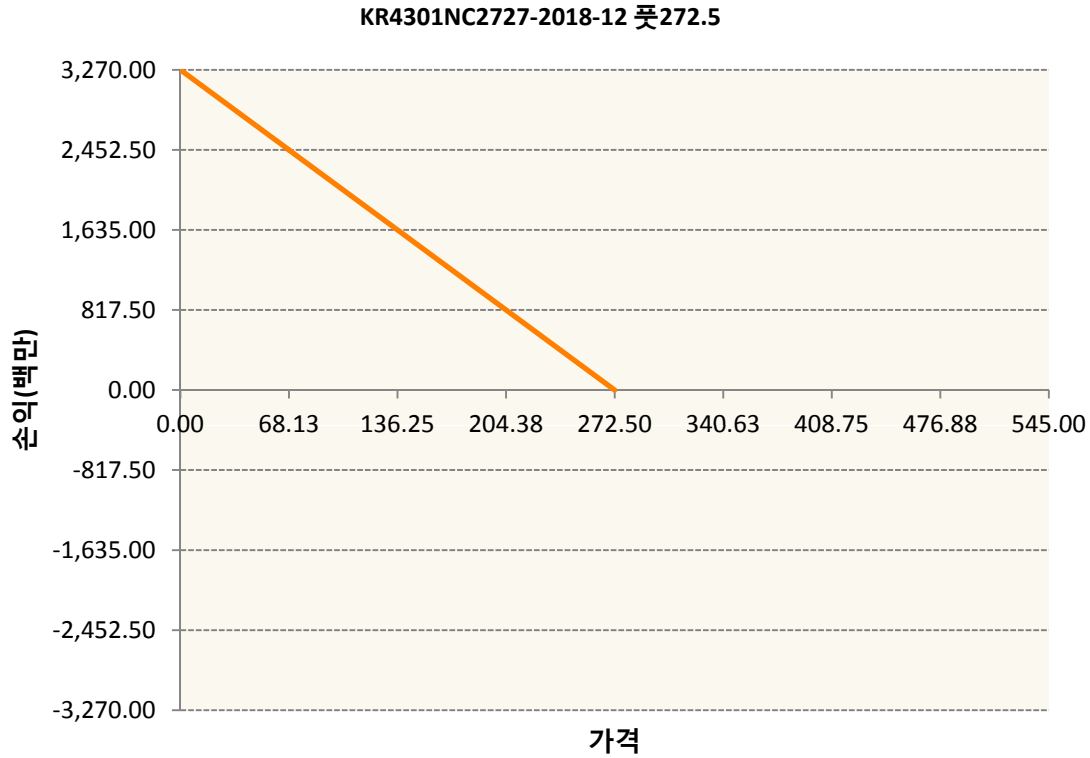
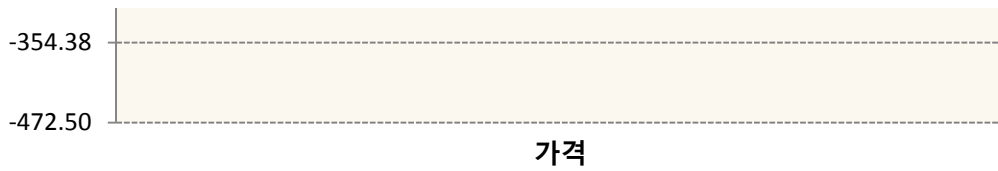


KR4201NC2876-2018-12 콜287.5



KR4301NC2701-2018-12 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물)							1,020
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020
-5.33%	-680	-680	-680	-680	-680	-680	-680
-2.67%	-340	-340	-340	-340	-340	-340	-340
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	340	340	340	340	340	340	340
5.33%	680	680	680	680	680	680	680
8.00%	1,020	1,020	1,020	1,020	1,020	1,020	1,020
KR4201NC2(2018-12 콜285)							701
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	208	203	196	187	175	160	144
-5.33%	196	185	171	154	135	113	89
-2.67%	166	145	121	95	67	38	7

0%	100	68	35	0	-36	-73	-110
2.67%	-18	-58	-99	-141	-182	-224	-266
5.33%	-200	-244	-288	-332	-376	-420	-464
8.00%	-450	-491	-532	-574	-616	-658	-701

KR4201NC27 2018-12 콜287.5

264

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	71	69	67	64	60	55	49
-5.33%	67	64	59	53	46	39	30
-2.67%	58	51	43	33	23	12	0
0%	37	25	13	0	-14	-28	-42
2.67%	-3	-18	-34	-50	-67	-83	-100
5.33%	-67	-85	-103	-121	-138	-156	-174
8.00%	-159	-176	-194	-211	-229	-246	-264

KR4301NC27 2018-12 풋270

29

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	27	28	28	28	28	28	29
-5.33%	15	16	16	17	17	18	18
-2.67%	5	6	6	7	8	9	9
0%	-2	-2	-1	0	1	2	2
2.67%	-6	-6	-5	-4	-4	-3	-2
5.33%	-8	-8	-7	-7	-6	-6	-5
8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-7	-7

KR4301NC27 2018-12 풋272.5

209

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	202	203	204	205	206	207	209
-5.33%	118	120	122	125	127	131	134
-2.67%	42	46	50	55	59	64	68
0%	-16	-11	-5	0	5	11	16
2.67%	-52	-47	-42	-37	-32	-27	-21
5.33%	-67	-65	-61	-58	-54	-50	-46
8.00%	-72	-71	-70	-68	-66	-63	-60

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

(단위:백만원)

1,782

공시일	2018-11-12
기준일	2018-11-09

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

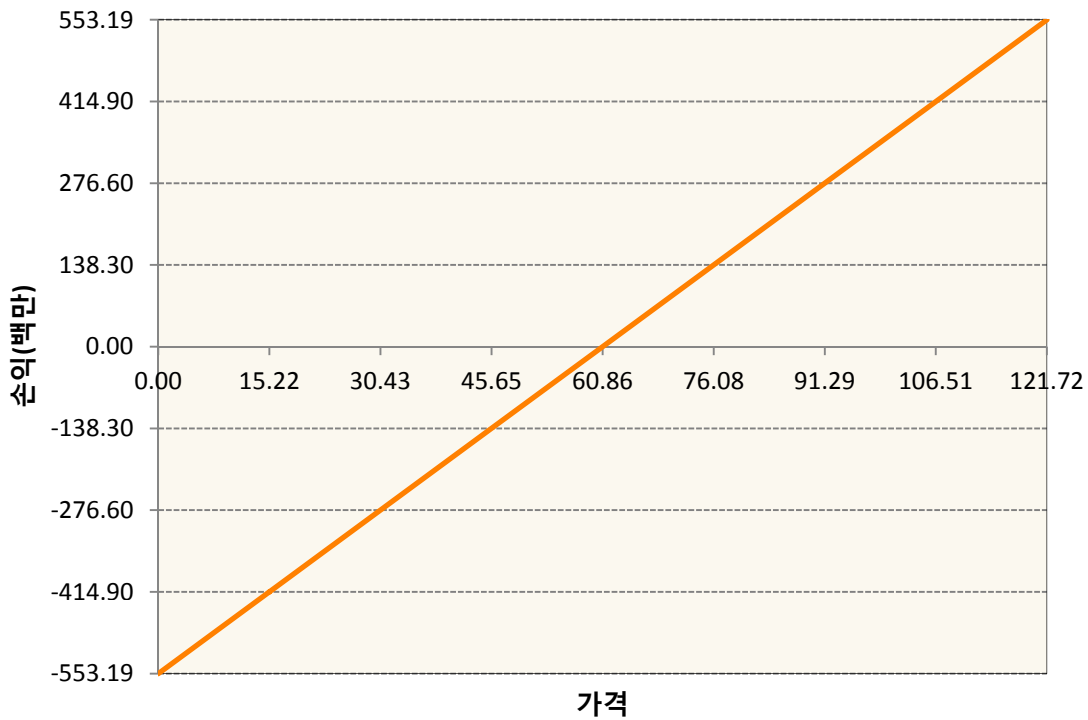
1. 계약금액

(단위:백만원)

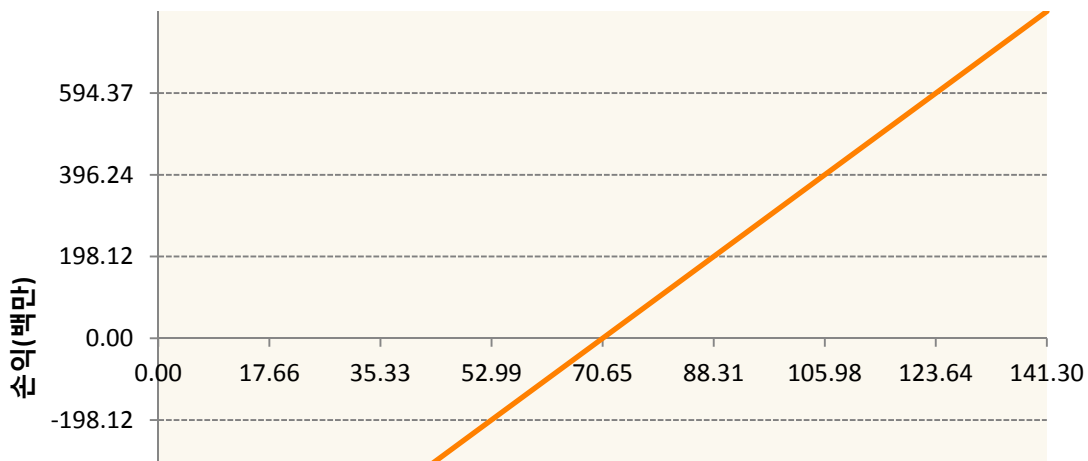
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,156	406	2,750	

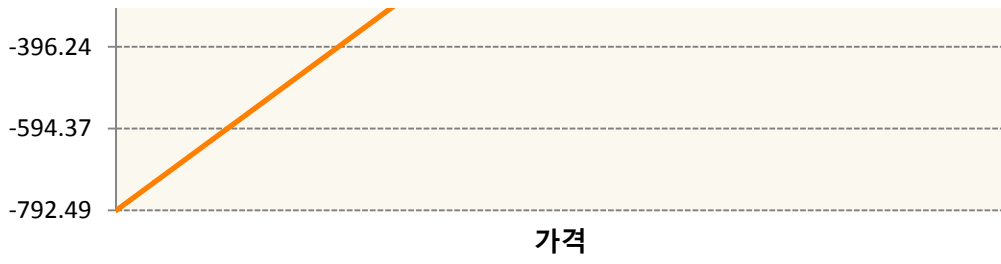
2. 만기시점의 손익구조

CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19

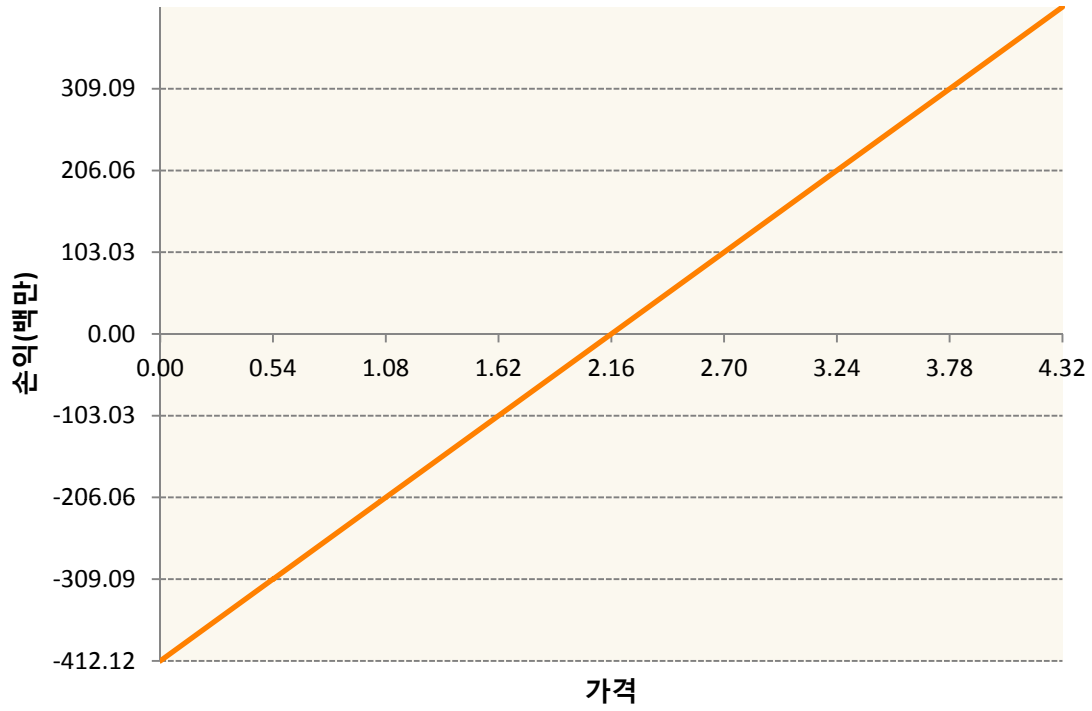


COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19

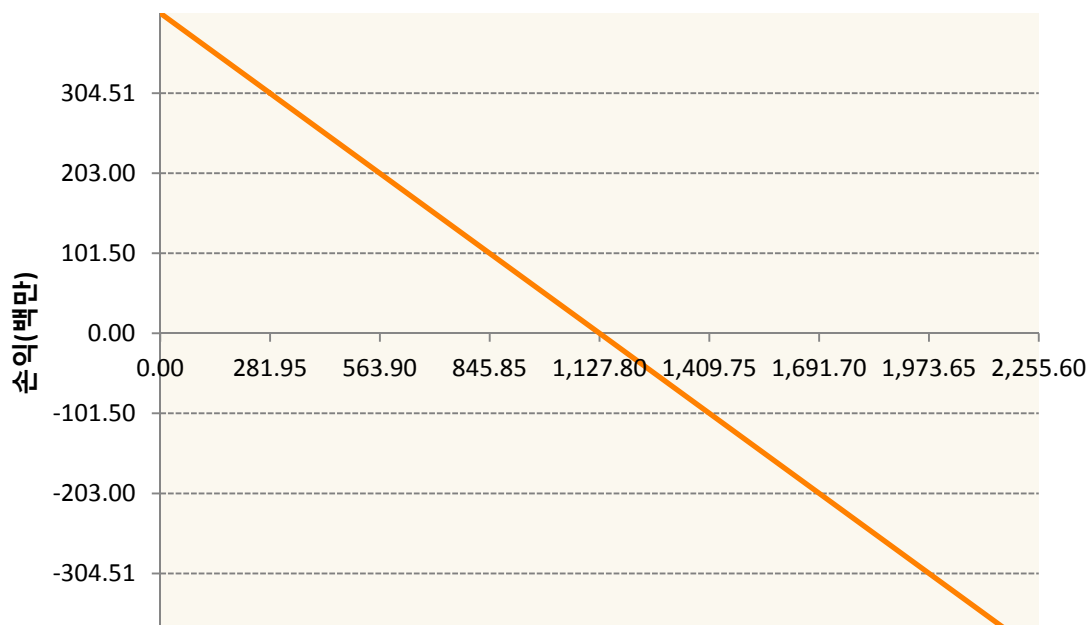


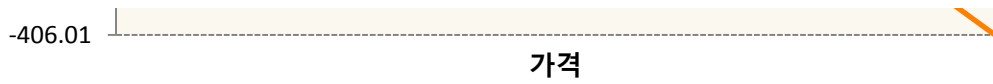


HOF9-NY Harb ULSD Fut Jan19

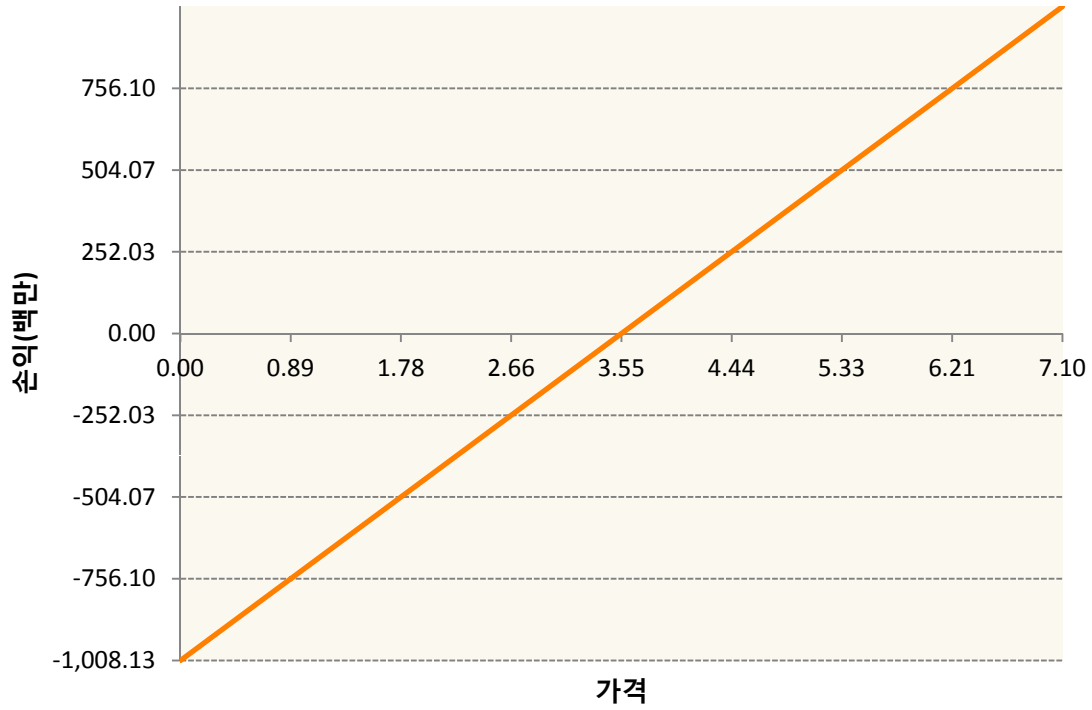


KR4175NB0006-2018-11 달러선물

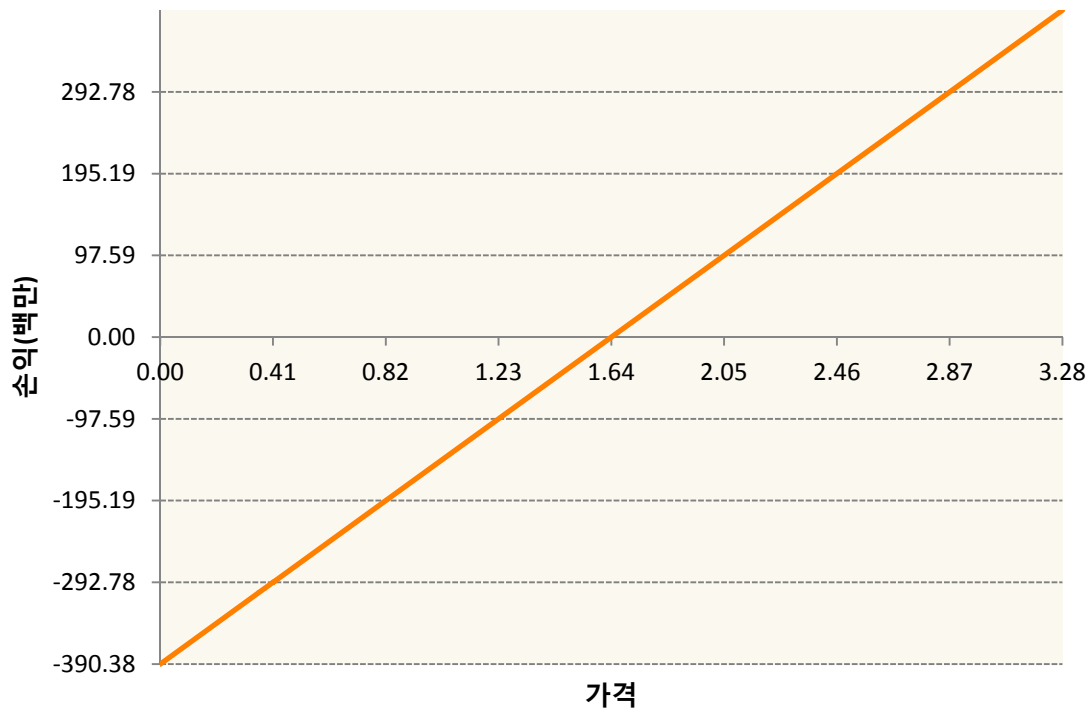




NGF19-NATURAL GAS FUTR Jan19



XBF9-GASOLINE RBOB FUT Jan19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF9	WTI CRUDE FUTURE Jan19	44
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	63
HOF9	NY Harb ULSD Fut Jan19	33
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)

386

공시일	2018-11-12
기준일	2018-11-09

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

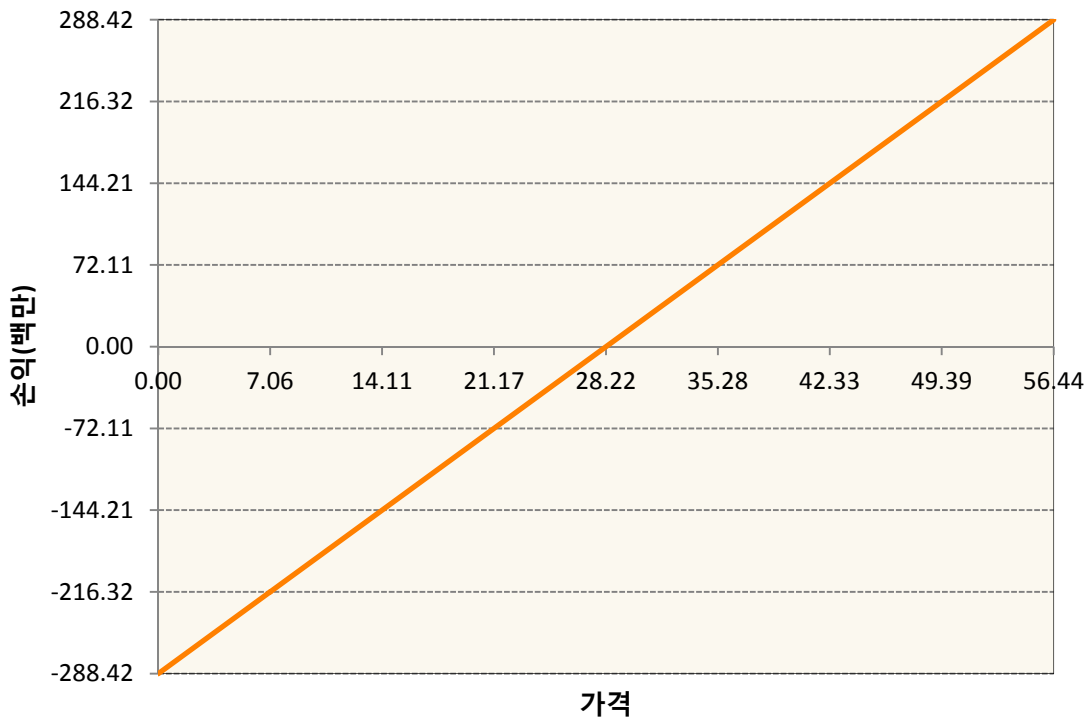
1. 계약금액

(단위:백만원)

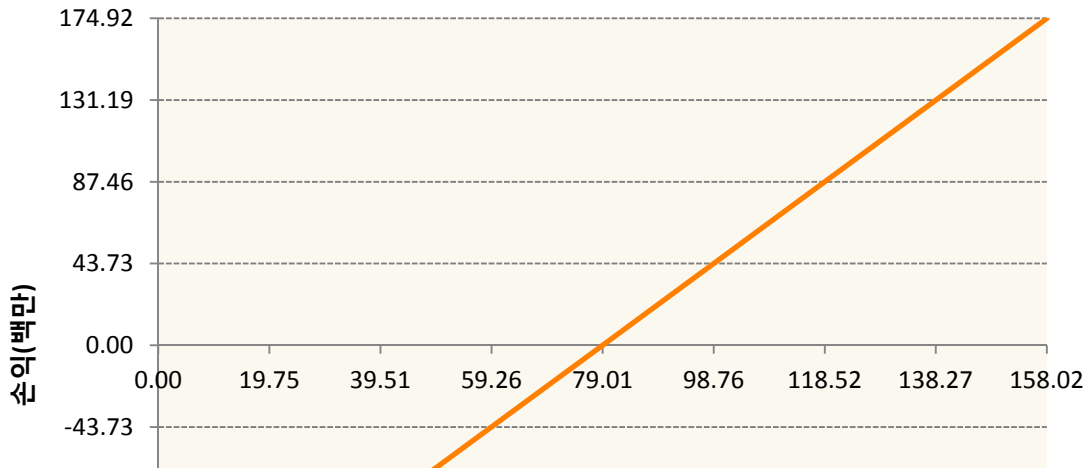
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,597	79	3,518	

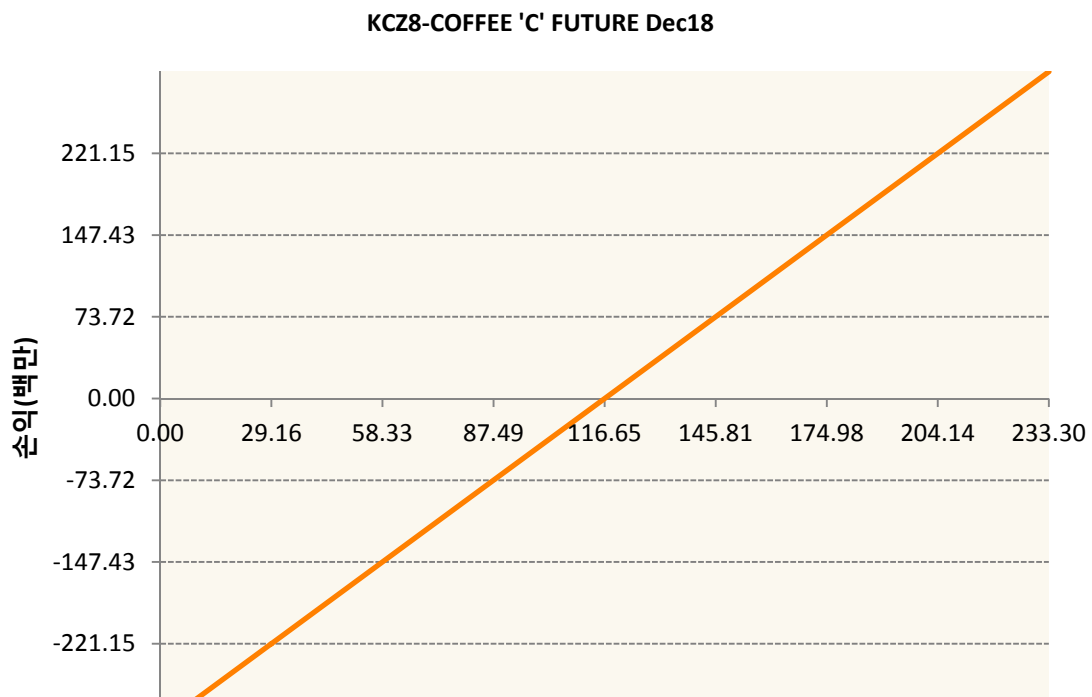
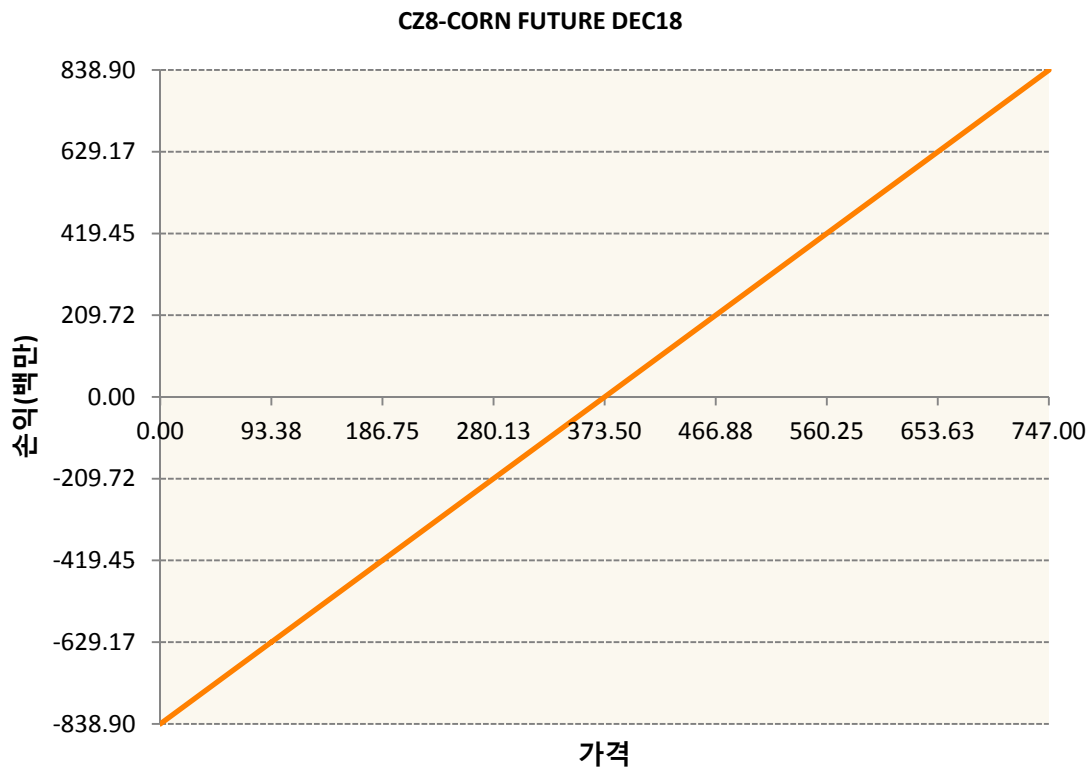
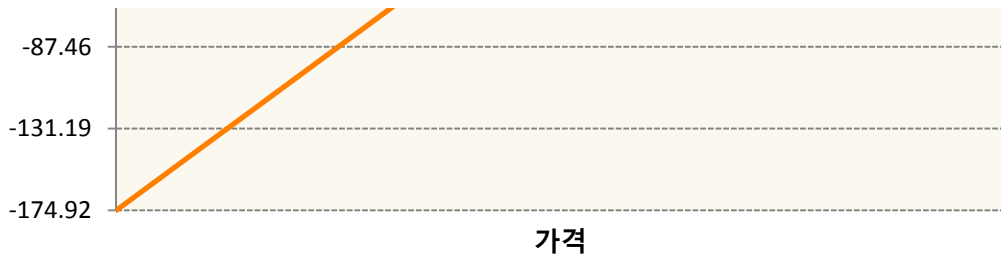
2. 만기시점의 손익구조

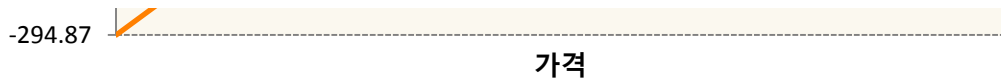
BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19



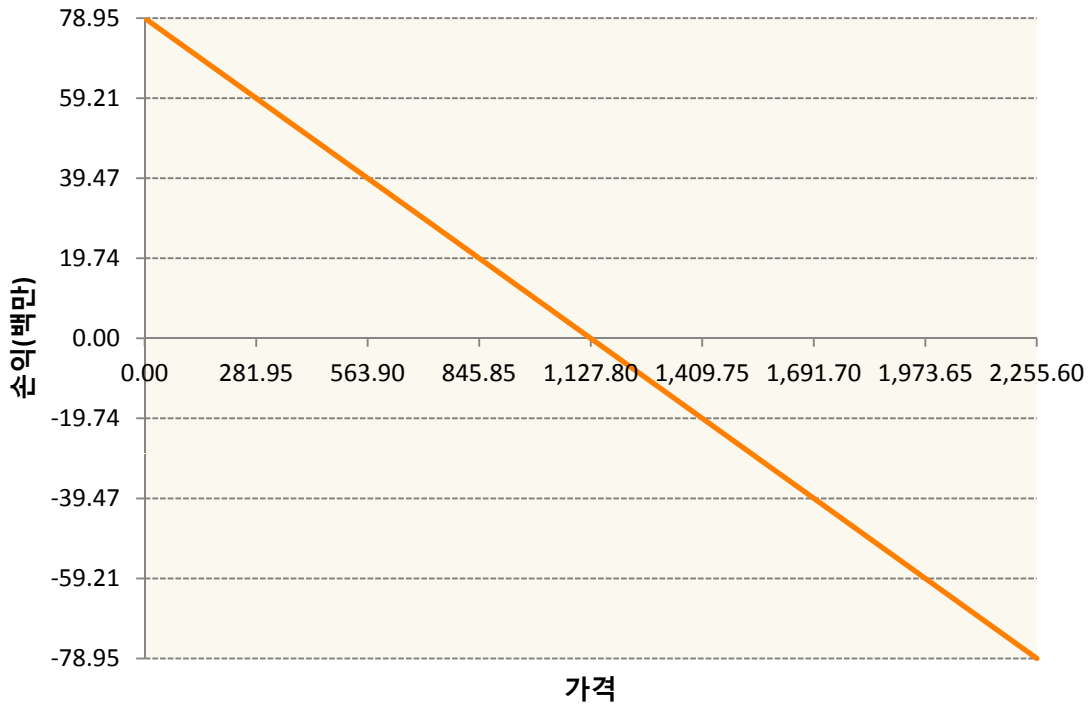
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



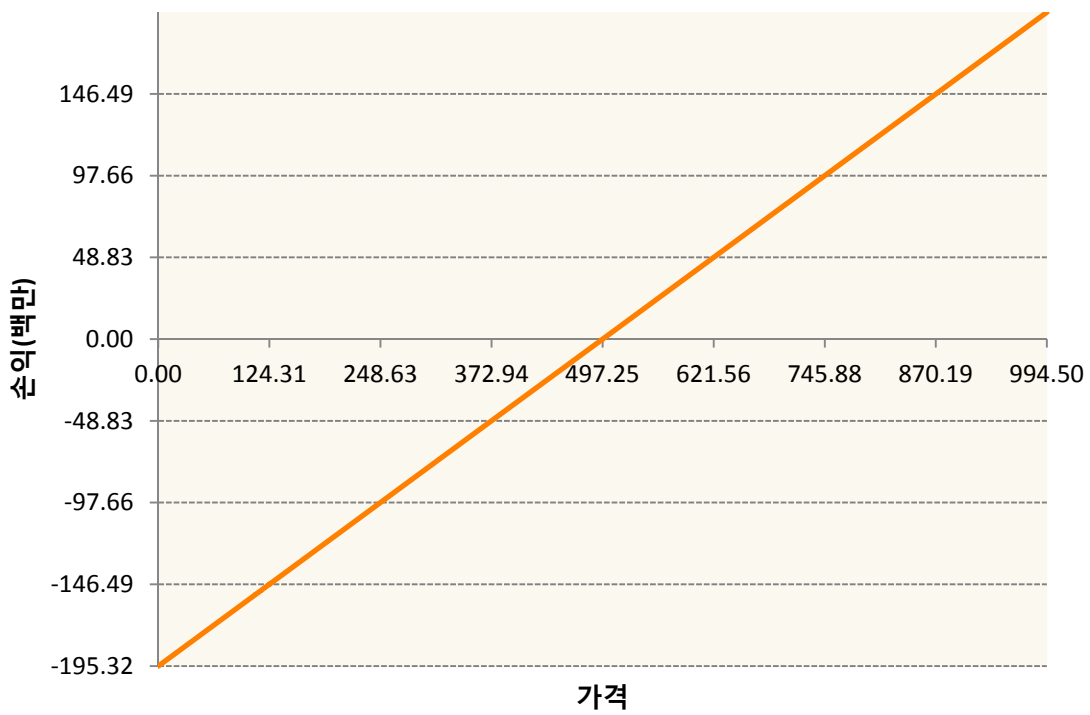




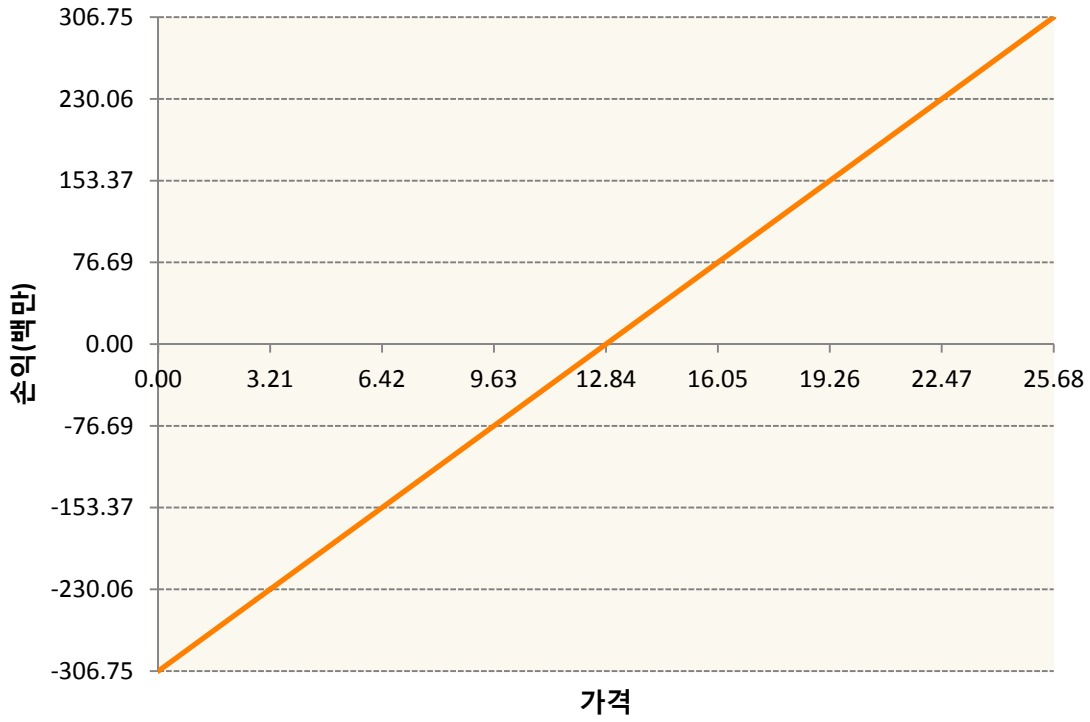
KR4175NB0006-2018-11 달러선물



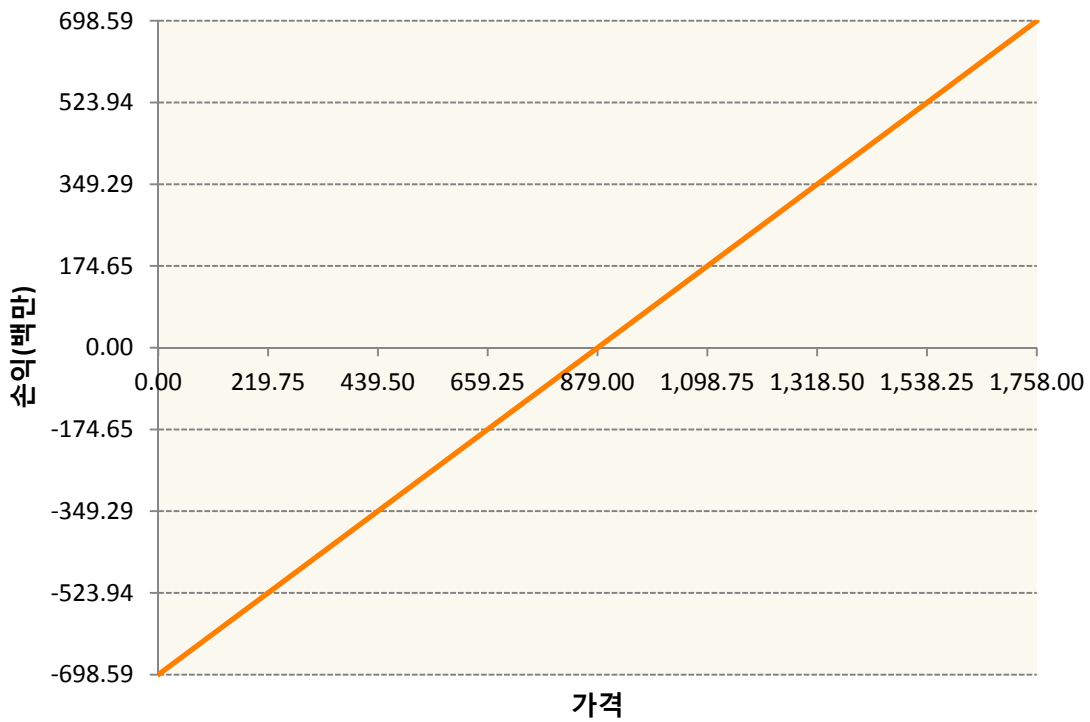
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

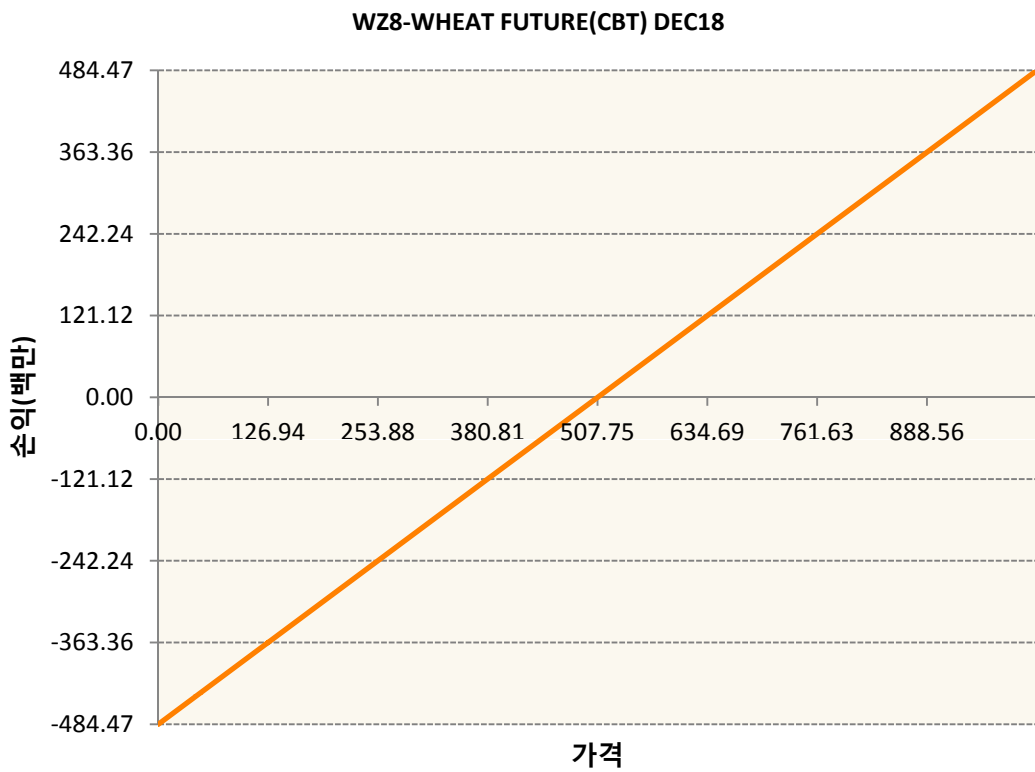
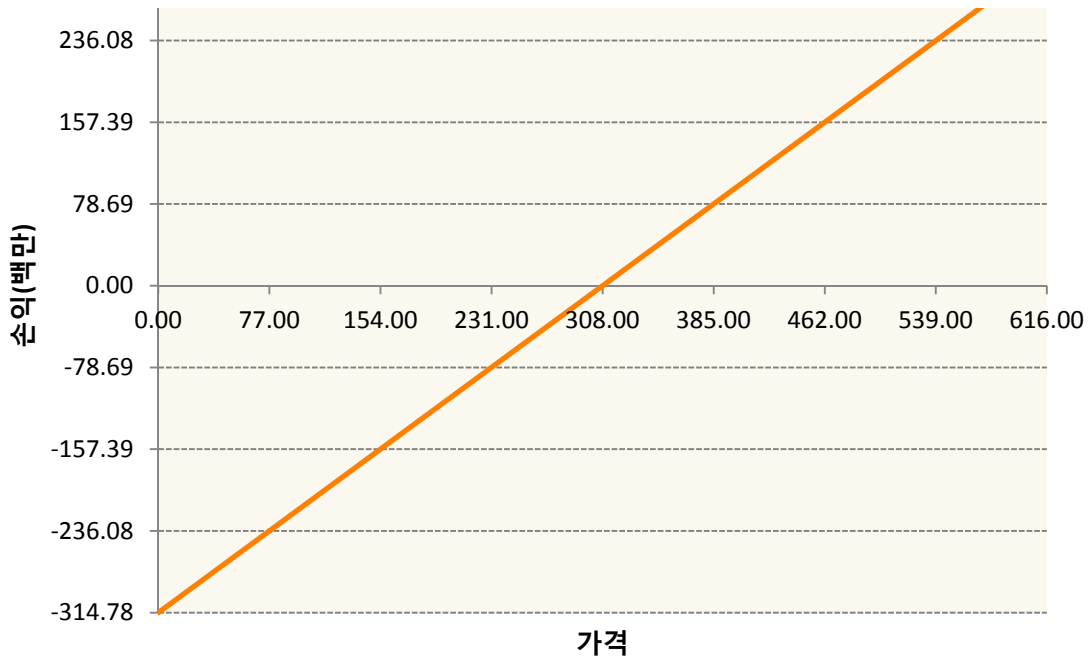


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19



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	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	25
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	39

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

(단위:백만원)

313