

공시일	2018-11-13
기준일	2018-11-12

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	2018-11-13
기준일	2018-11-12

스마트인덱스모

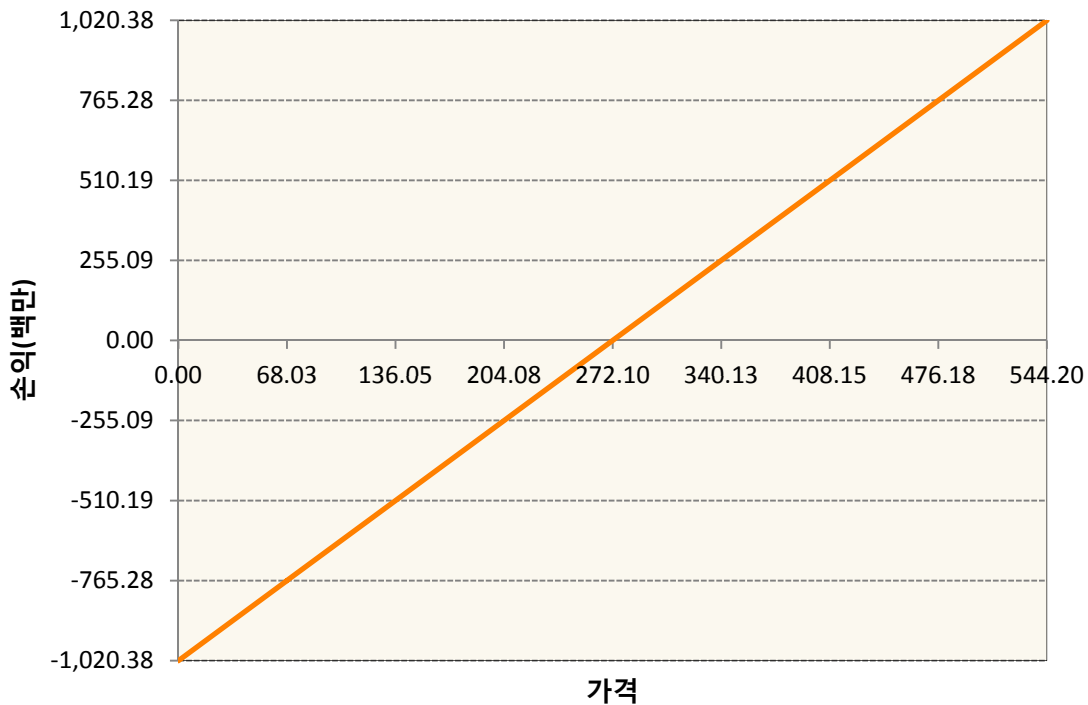
1. 계약금액

(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	2018-11-13
기준일	2018-11-12

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

1,096

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

522

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-11-13
기준일	2018-11-12

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

271

* 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	2018-11-13
기준일	2018-11-12

유로인덱스모(주식-파생형)

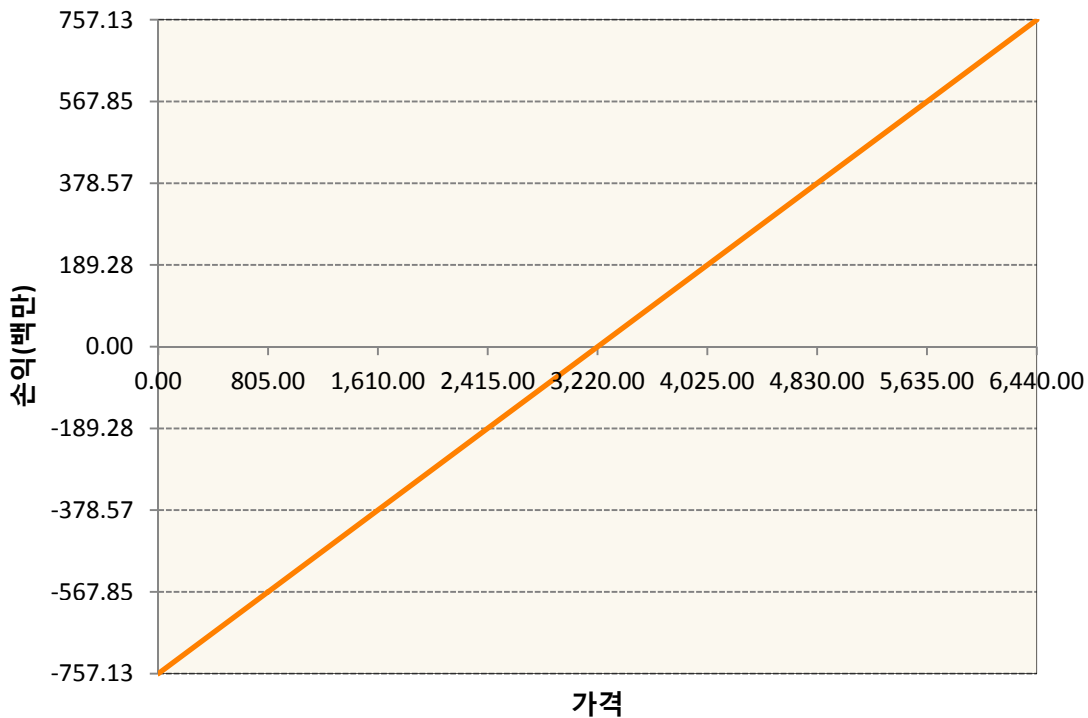
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	757	0	757	

2. 만기시점의 손익구조

VGZ8-EURO STOXX 50 DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ8	EURO STOXX 50 DEC18	61
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

39

공시일	2018-11-13
기준일	2018-11-12

차이나인덱스모(주식-파생형)

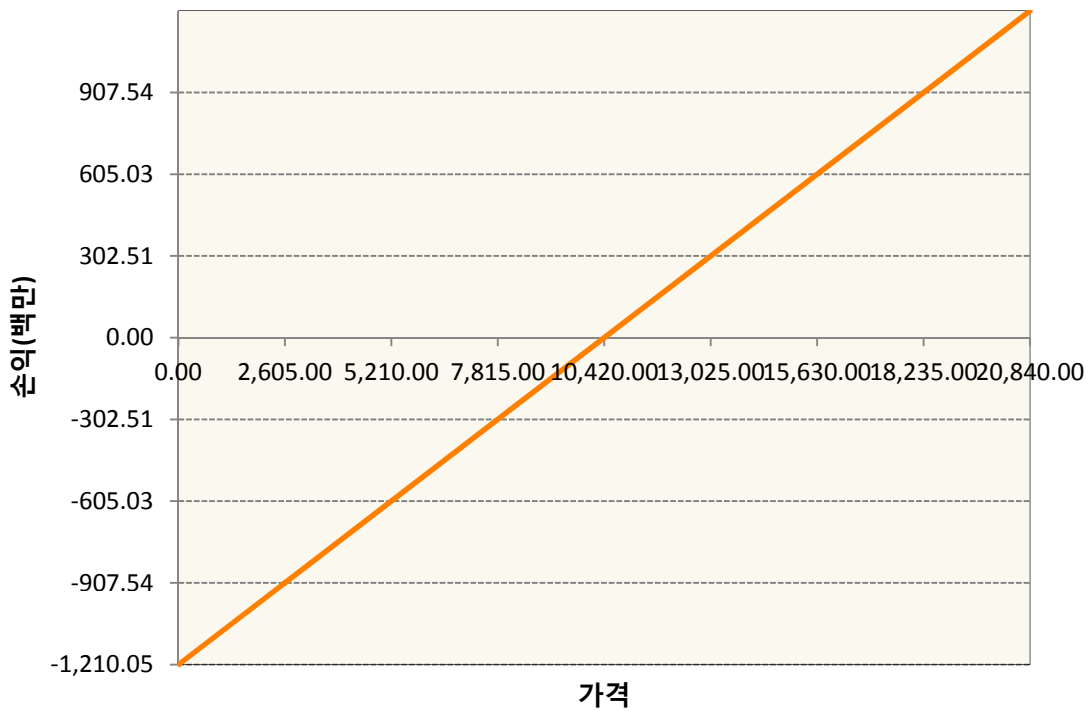
1. 계약금액

(단위:백만원)

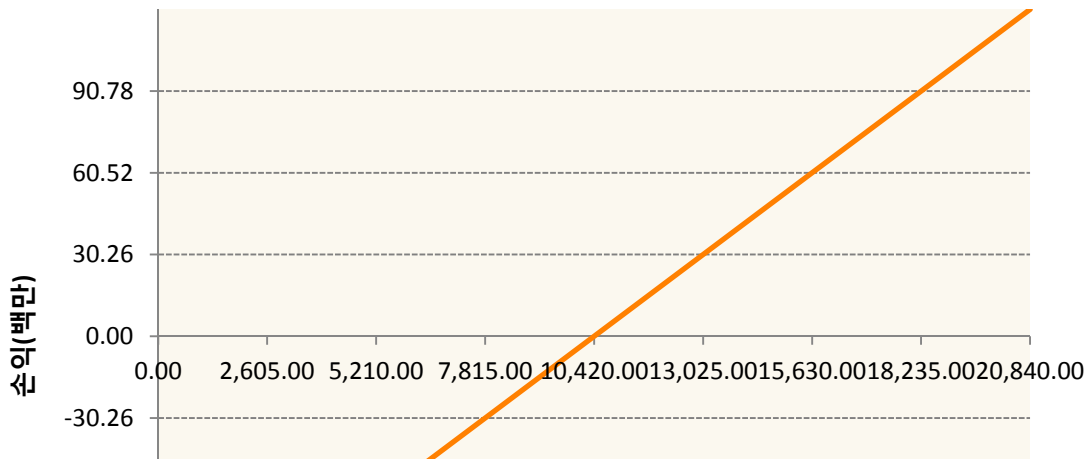
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,331	0	1,331	장내

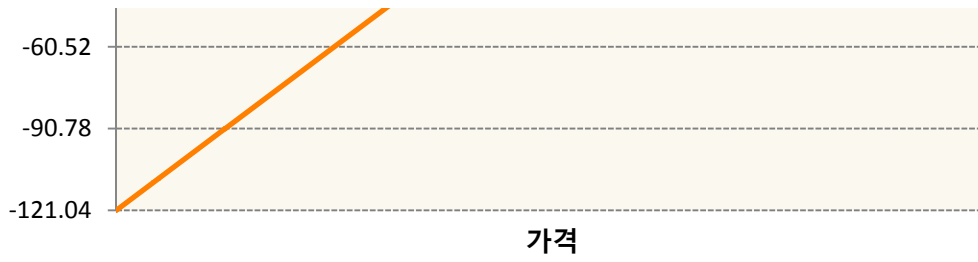
2. 만기시점의 손익구조

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)

106

공시일	2018-11-13
기준일	2018-11-12

커버드콜모(주식혼합-파생형)

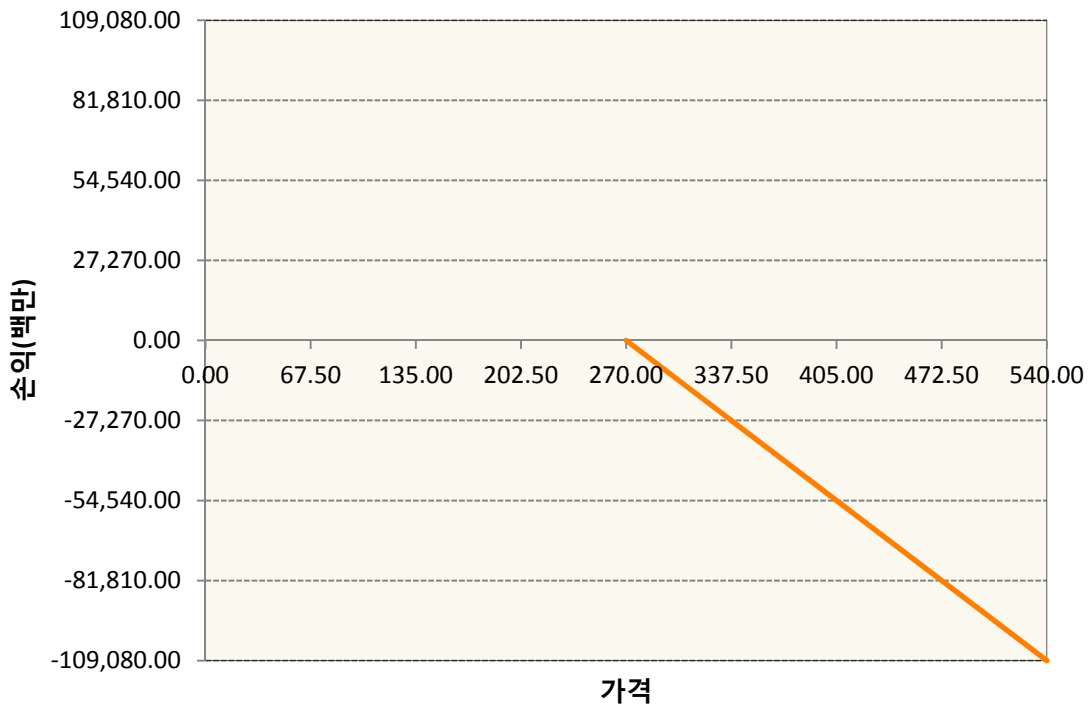
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	66,974	0	66,974	장내
누계	유가증권	옵션	0	706,809	-706,809	장내

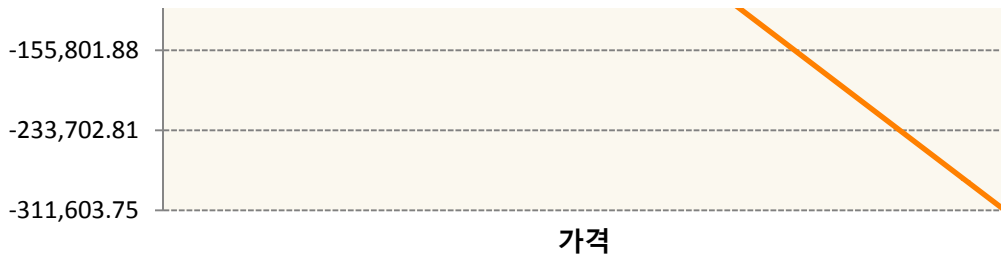
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NC2702-2018-12 콜270

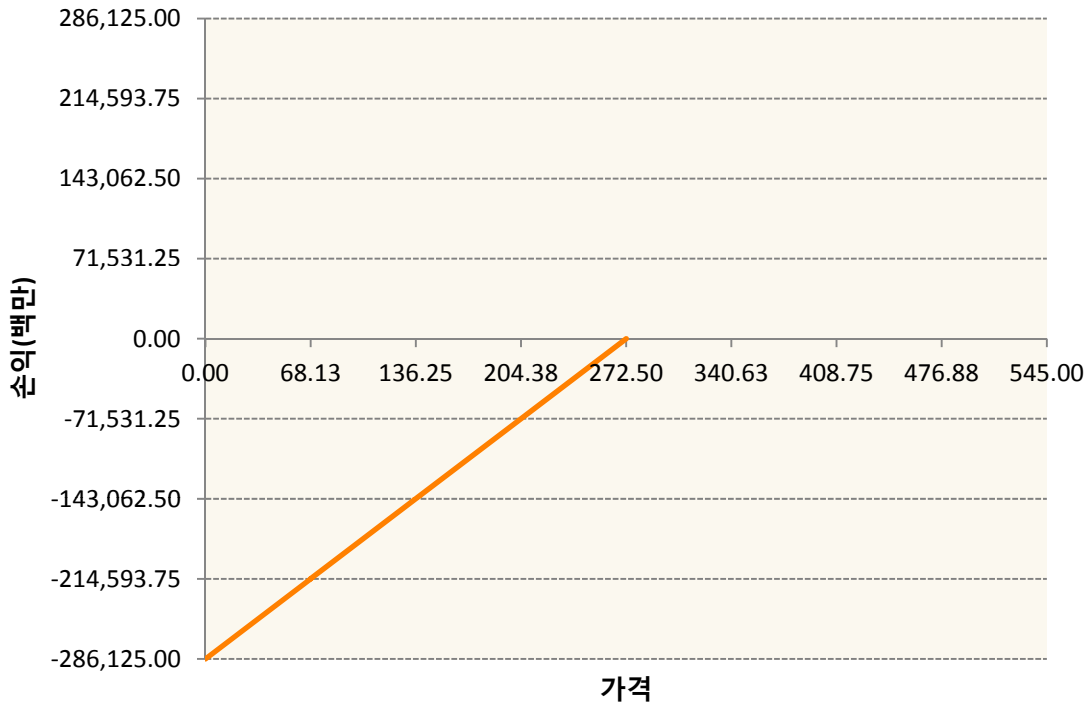


KR4201NC2728-2018-12 콜272.5





KR4301NC2727-2018-12 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NC27 2018-12 콜270

6,872

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,435	3,313	3,172	3,015	2,844	2,661	2,468
-5.33%	3,006	2,806	2,595	2,374	2,145	1,910	1,670
-2.67%	2,179	1,917	1,651	1,383	1,114	843	571
0%	847	565	282	0	-283	-565	-848
2.67%	-1,004	-1,255	-1,513	-1,776	-2,042	-2,310	-2,582
5.33%	-3,290	-3,479	-3,684	-3,900	-4,127	-4,362	-4,604
8.00%	-5,880	-6,002	-6,144	-6,305	-6,481	-6,671	-6,872

KR4201NC27 2018-12 콜272.5

18,638

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,544	8,260	7,919	7,529	7,095	6,625	6,122

-5.33%	7,602	7,104	6,563	5,988	5,385	4,759	4,115
-2.67%	5,677	4,977	4,261	3,532	2,793	2,047	1,295
0%	2,412	1,608	804	0	-804	-1,608	-2,412
2.67%	-2,330	-3,094	-3,867	-4,647	-5,433	-6,222	-7,015
5.33%	-8,399	-9,010	-9,655	-10,328	-11,021	-11,733	-12,458
8.00%	-15,461	-15,877	-16,349	-16,868	-17,427	-18,019	-18,638

KR4301NC27, 2018-12 풋272.5

18,298

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-17,734	-17,771	-17,829	-17,910	-18,016	-18,146	-18,298
-5.33%	-10,360	-10,506	-10,686	-10,895	-11,131	-11,391	-11,670
-2.67%	-3,695	-4,032	-4,388	-4,759	-5,144	-5,538	-5,940
0%	1,396	931	466	0	-466	-932	-1,398
2.67%	4,402	4,000	3,587	3,163	2,733	2,296	1,855
5.33%	5,696	5,471	5,213	4,927	4,617	4,287	3,941
8.00%	6,091	6,006	5,890	5,743	5,566	5,362	5,133

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

(단위:백만원)

42,836

공시일	2018-11-13
기준일	2018-11-12

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

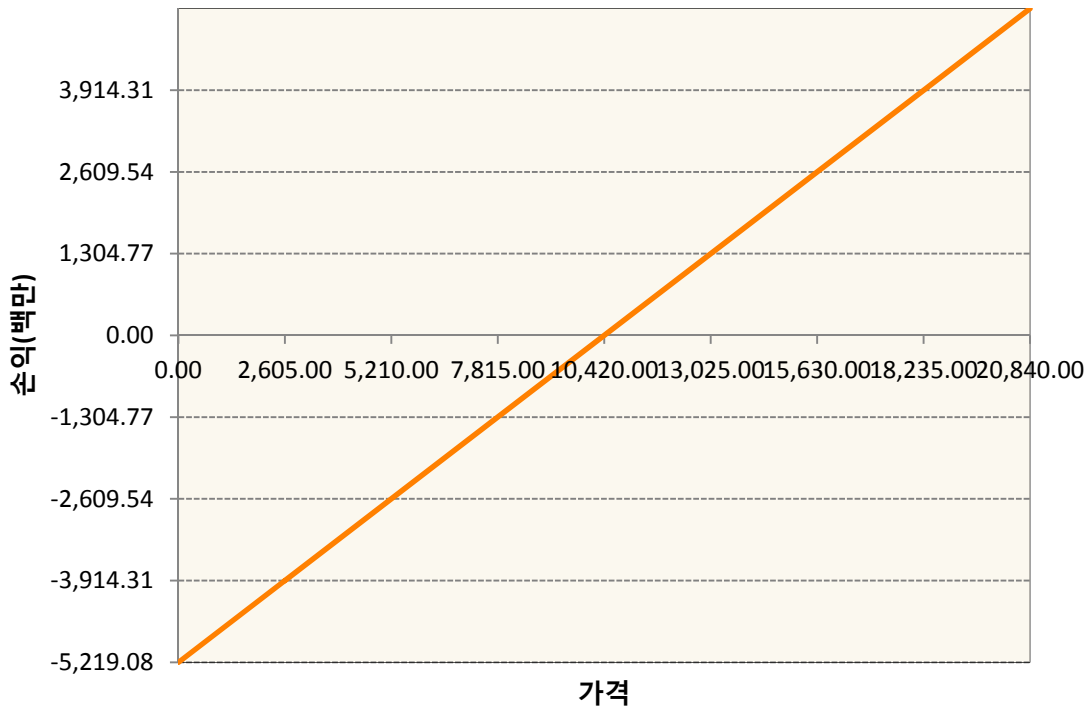
1. 계약금액

(단위:백만원)

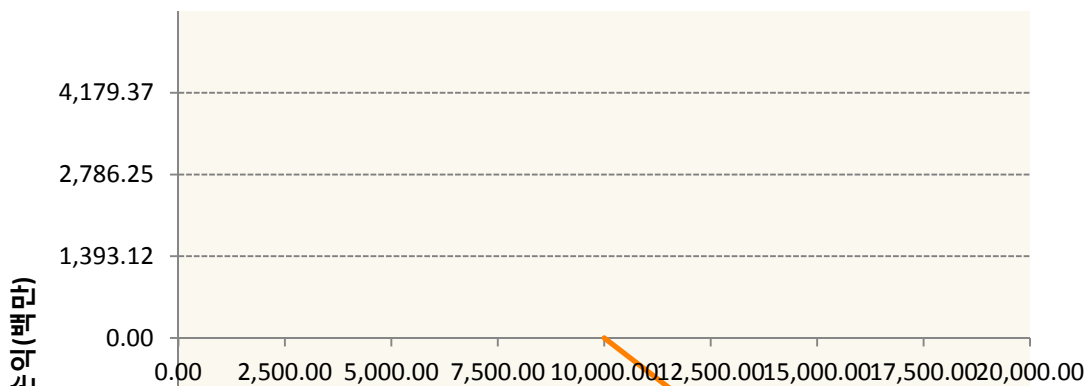
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,219	0	5,219	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,145	-11,145	장내

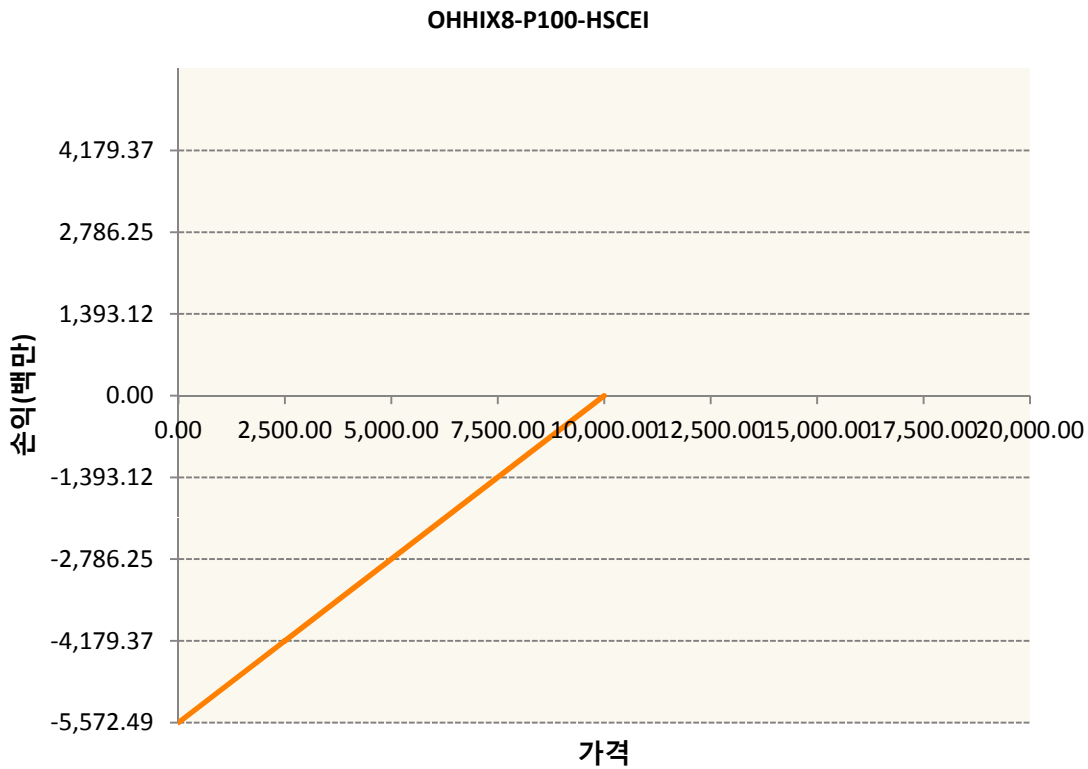
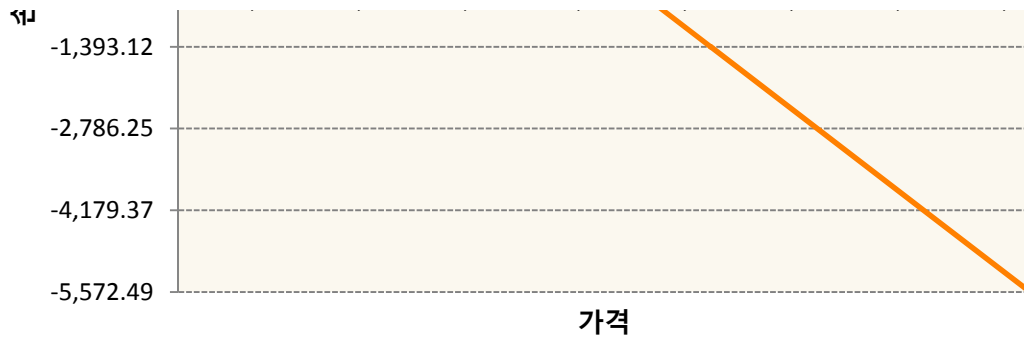
2. 만기시점의 손익구조

HCX8-HSCEI FUTURES NOV 18



OHHIX8-C100-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCX8	HSCEI FUTURES NOV 18	418
	OHHIX8-C1C HSCEI	446
	OHHIX8-P10 HSCEI	446

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,300

공시일	2018-11-13
기준일	2018-11-12

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

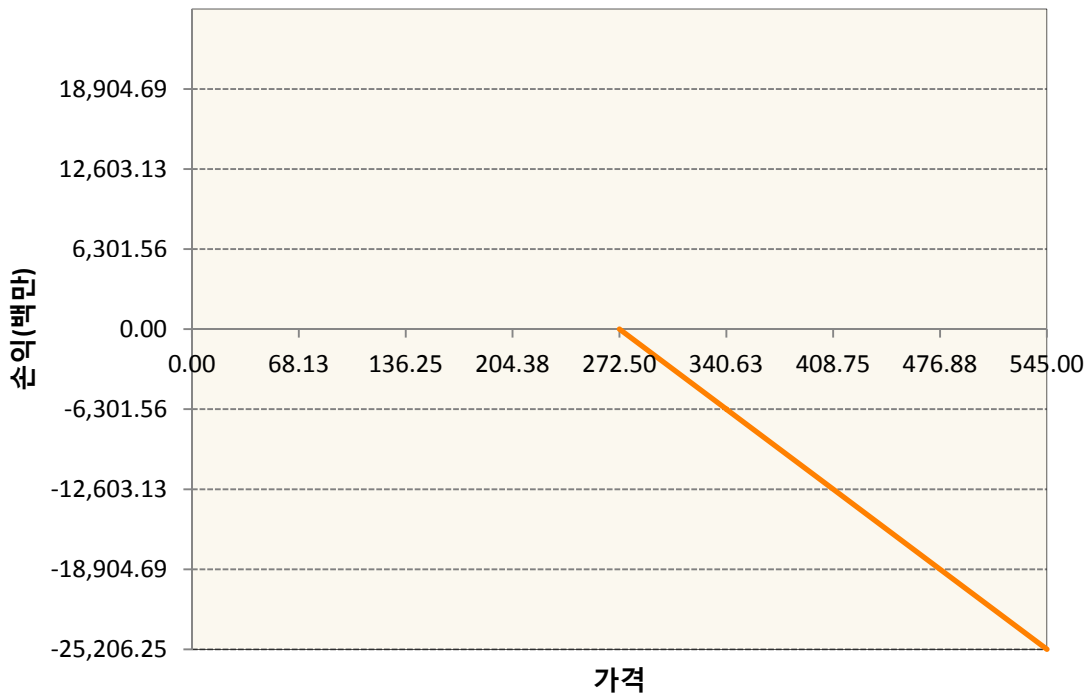
1. 계약금액

(단위:백만원)

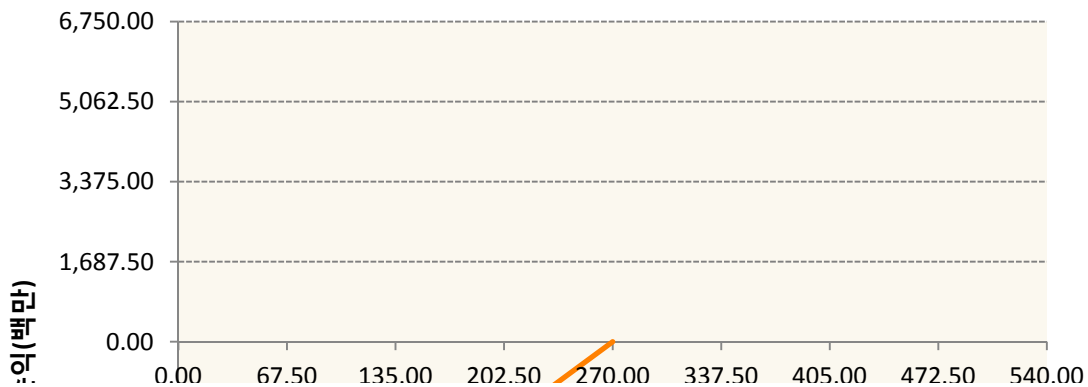
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	43,836	0	43,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	43,538	-43,538	장내

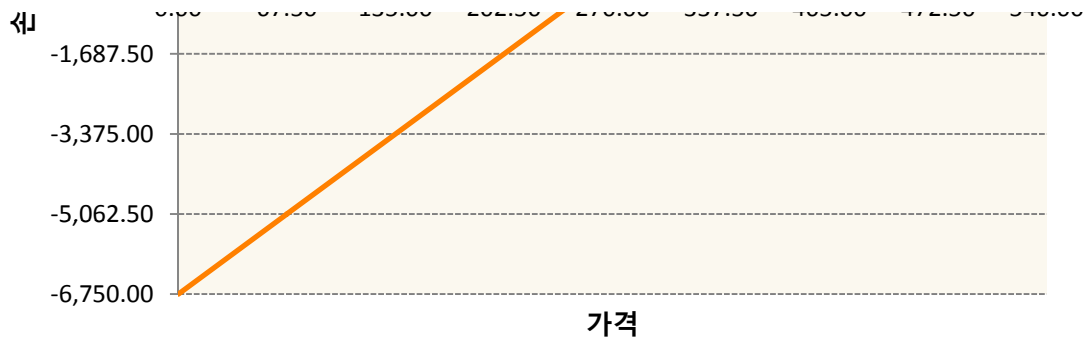
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NC2728-2018-12 콜272.5

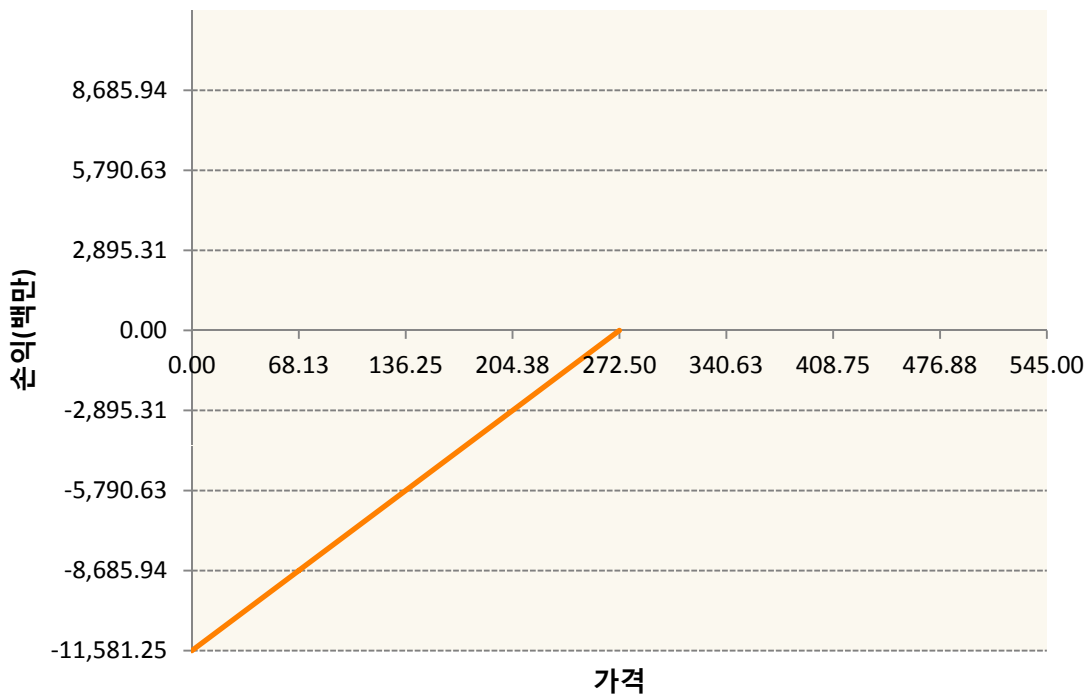


KR4301NC2701-2018-12 풋270





KR4301NC2727-2018-12 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,599	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,599	-3,599	-3,599	-3,599	-3,599	-3,599	-3,599	
-5.33%	-2,399	-2,399	-2,399	-2,399	-2,399	-2,399	-2,399	
-2.67%	-1,200	-1,200	-1,200	-1,200	-1,200	-1,200	-1,200	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	1,200	1,200	1,200	1,200	1,200	1,200	1,200	
5.33%	2,399	2,399	2,399	2,399	2,399	2,399	2,399	
8.00%	3,599	3,599	3,599	3,599	3,599	3,599	3,599	
KR4201NC2727-2018-12 풋272.5							1,508	
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	691	668	641	609	574	536	495
-5.33%	615	575	531	484	436	385	333
-2.67%	459	403	345	286	226	166	105
0%	195	130	65	0	-65	-130	-195
2.67%	-188	-250	-313	-376	-439	-503	-567
5.33%	-679	-729	-781	-835	-892	-949	-1,008
8.00%	-1,251	-1,284	-1,322	-1,365	-1,410	-1,458	-1,508

KR4301NC2; 2018-12 풋270

410

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-392	-394	-396	-398	-402	-406	-410
-5.33%	-220	-225	-230	-237	-243	-251	-258
-2.67%	-72	-81	-91	-100	-110	-120	-131
0%	33	22	11	0	-11	-22	-33
2.67%	88	80	72	63	53	44	34
5.33%	109	105	101	95	89	82	75
8.00%	115	113	112	109	106	102	98

KR4301NC2; 2018-12 풋272.5

741

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-718	-719	-722	-725	-729	-734	-741
-5.33%	-419	-425	-433	-441	-451	-461	-472
-2.67%	-150	-163	-178	-193	-208	-224	-240
0%	56	38	19	0	-19	-38	-57
2.67%	178	162	145	128	111	93	75
5.33%	231	221	211	199	187	174	160
8.00%	247	243	238	232	225	217	208

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

(단위:백만원)

6,184

공시일	2018-11-13
기준일	2018-11-12

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

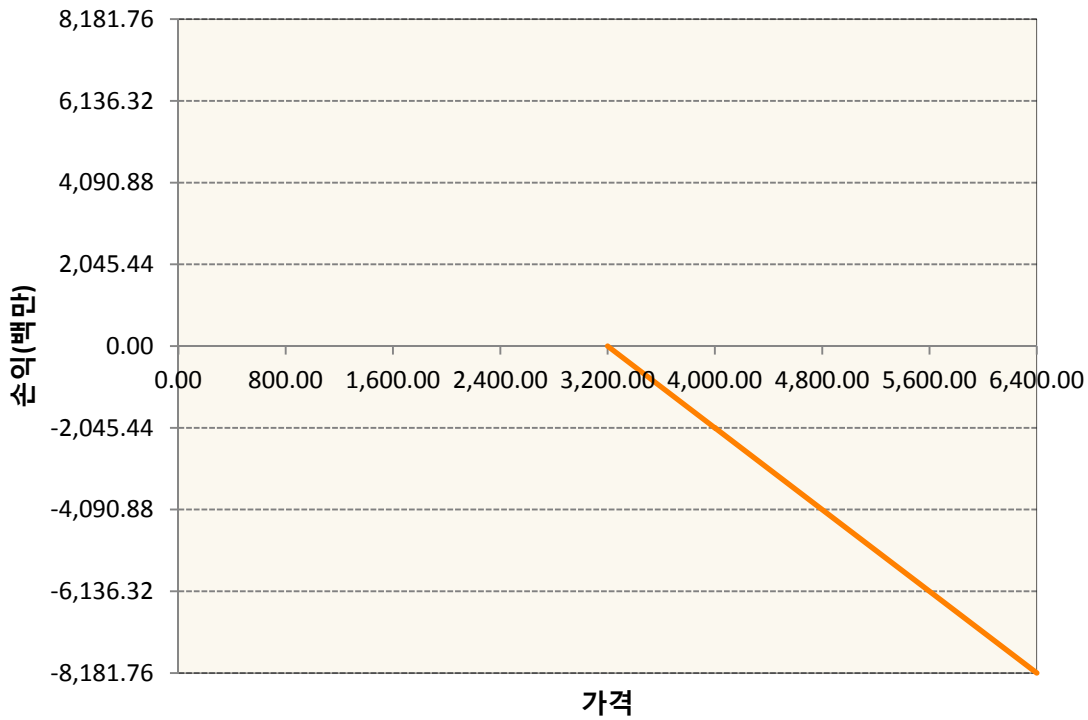
1. 계약금액

(단위:백만원)

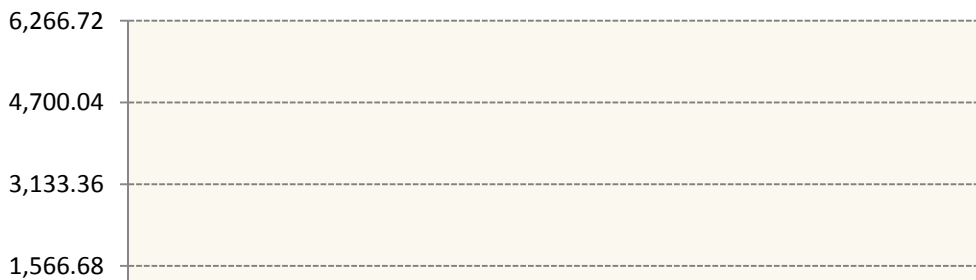
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,228	0	8,228	
누계	유가증권	스왑	71,404	0	71,404	장외
누계	유가증권	옵션	0	28,897	-28,897	장내

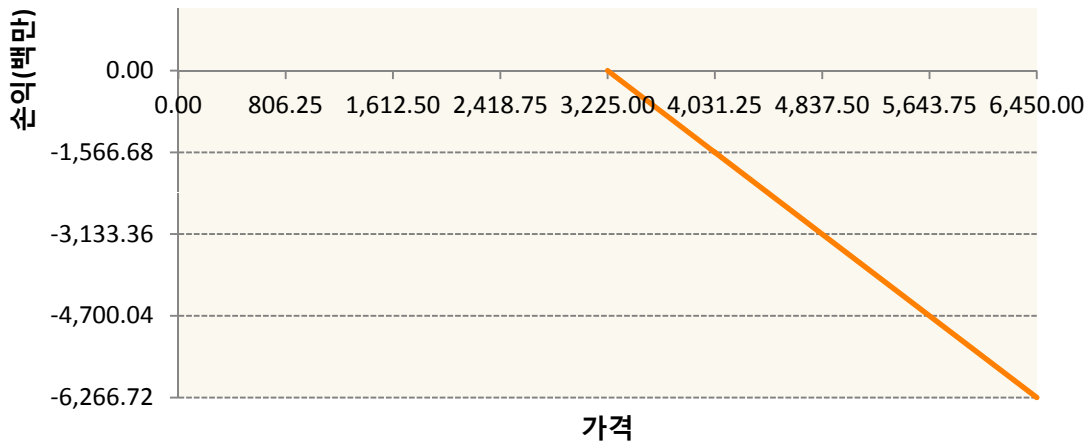
2. 만기시점의 손익구조

OESXX8-C3200-EURO STOXX 50

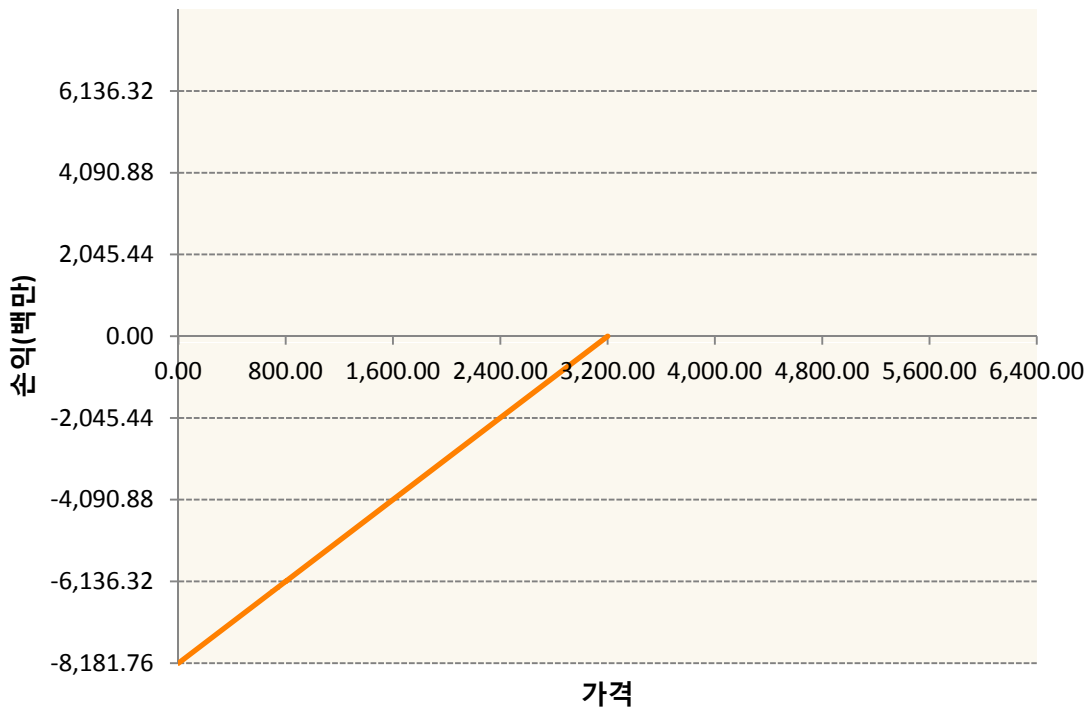


OESXX8-C3225-EURO STOXX 50

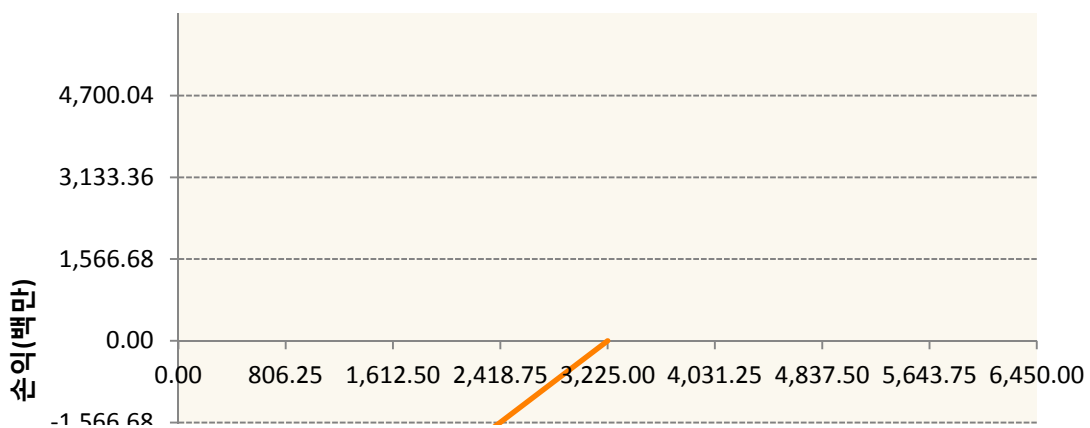


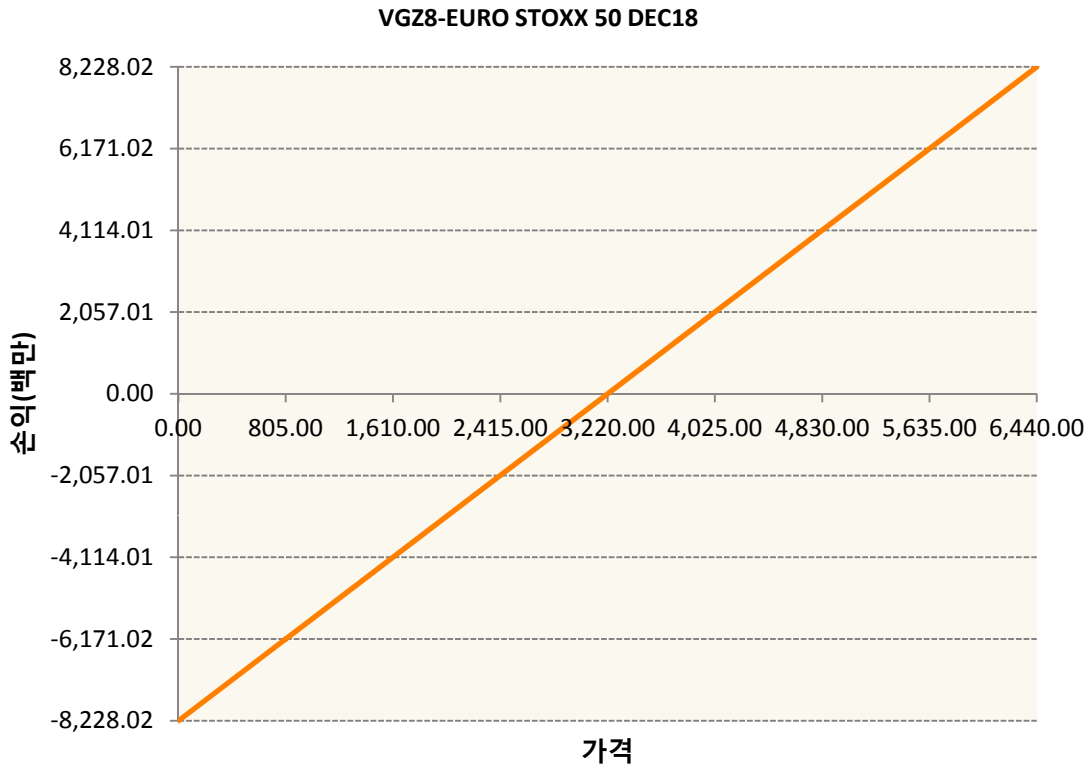
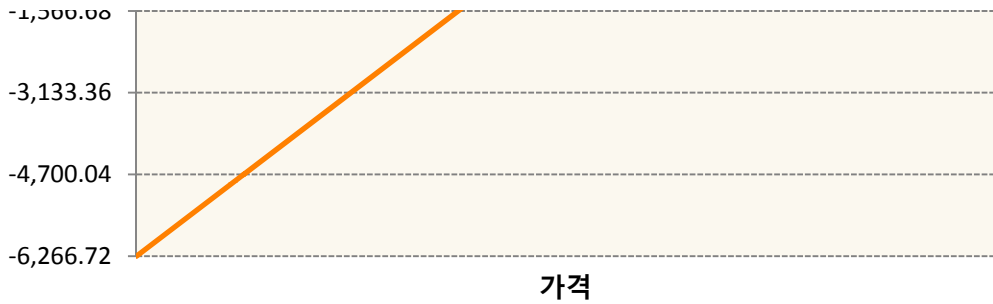


OESXX8-P3200-EURO STOXX 50



OESXX8-P3225-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY		72
OESXX8-C32 EURO STOXX 50		655
OESXX8-C32 EURO STOXX 50		501
OESXX8-P32 EURO STOXX 50		655
OESXX8-P32 EURO STOXX 50		501
VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18		658

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,965

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

(단위:백만원)

1,149

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	2018-11-13
기준일	2018-11-12

리디파인K200(주식혼합-파생재간

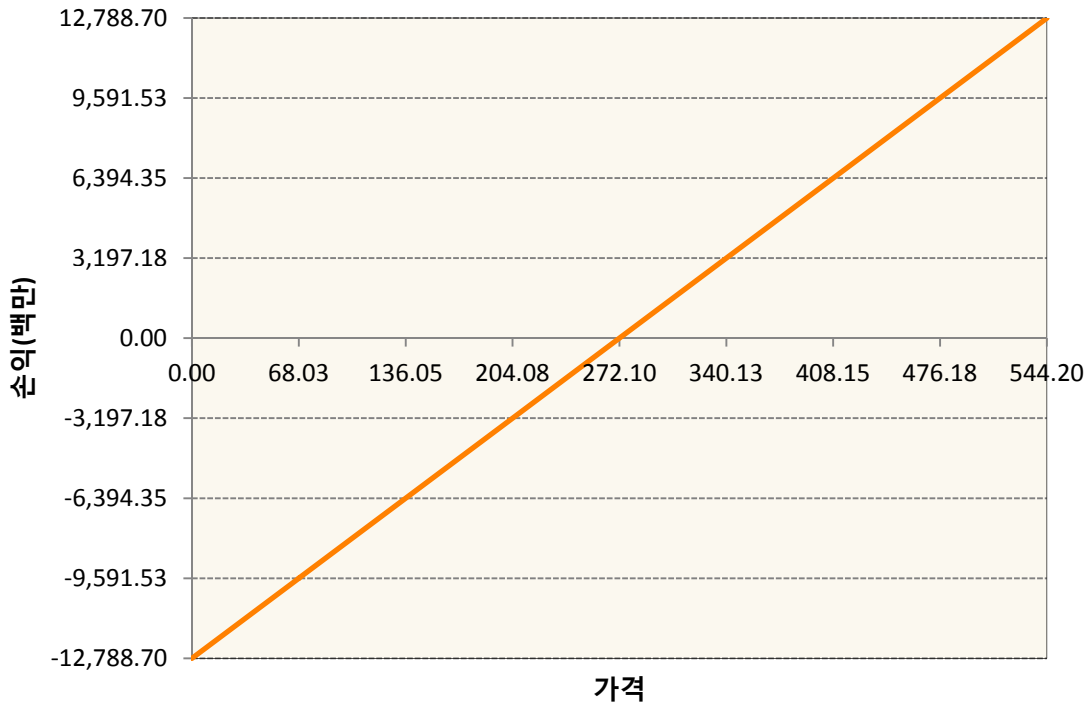
1. 계약금액

(단위:백만원)

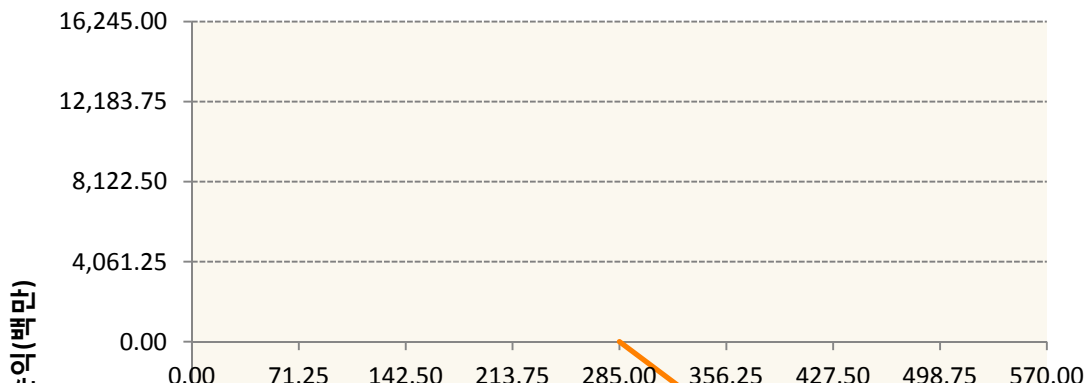
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,789	0	12,789	장내
누계	유가증권	옵션	3,743	22,858	-19,115	장내

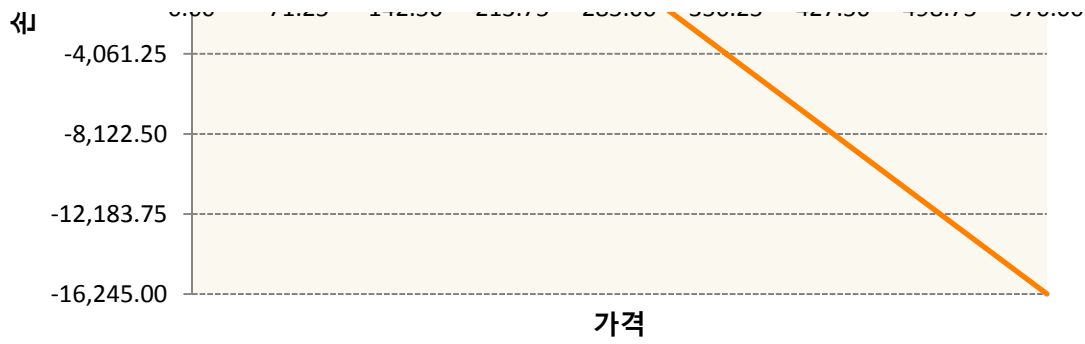
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

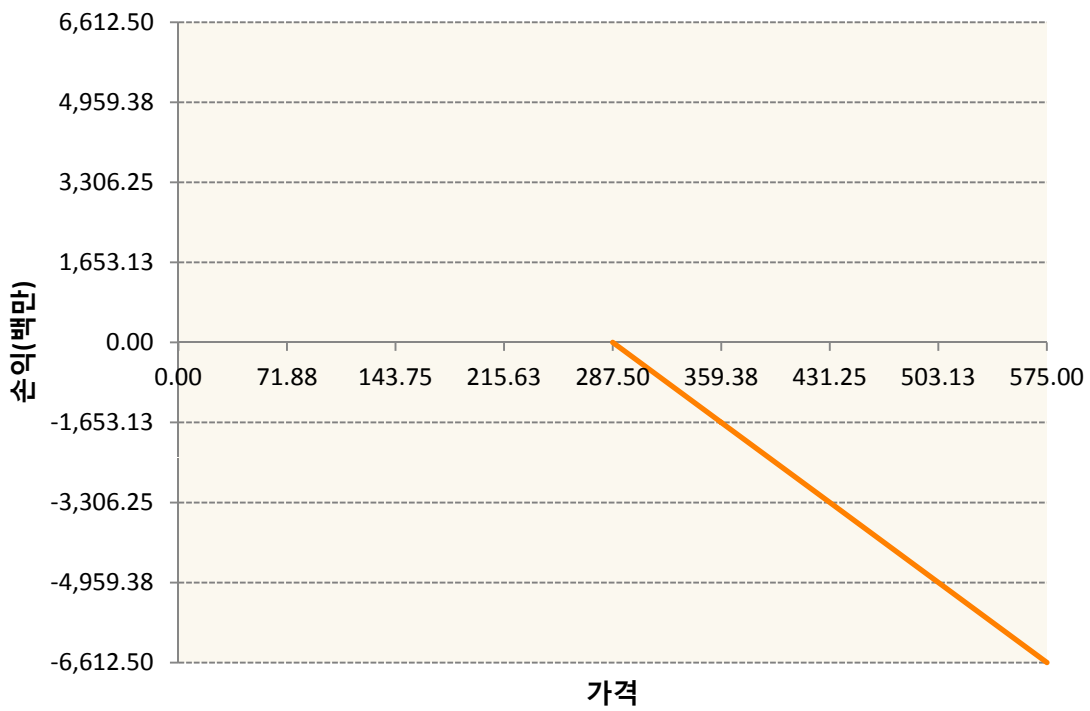


KR4201NC2850-2018-12 콜285

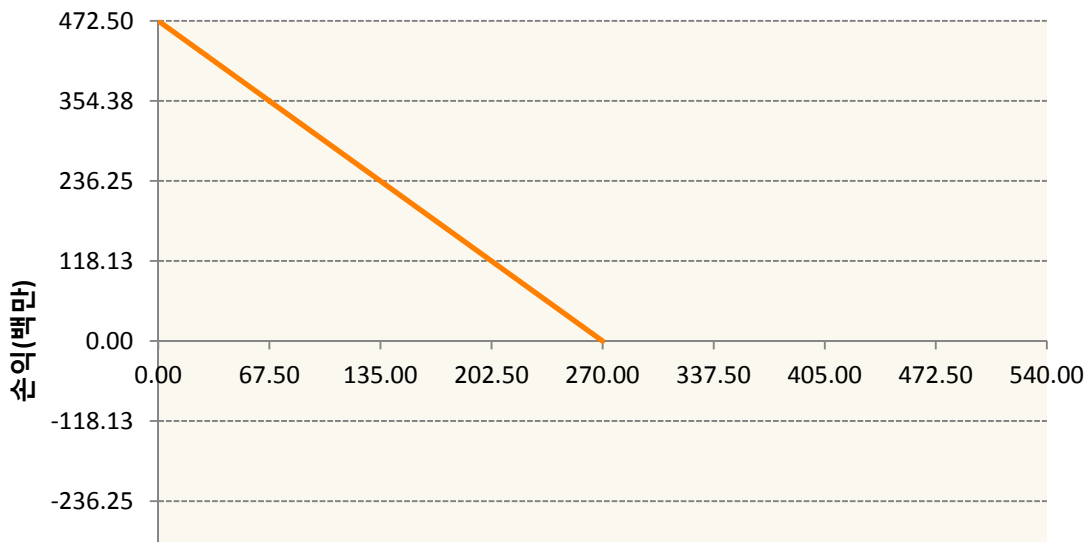


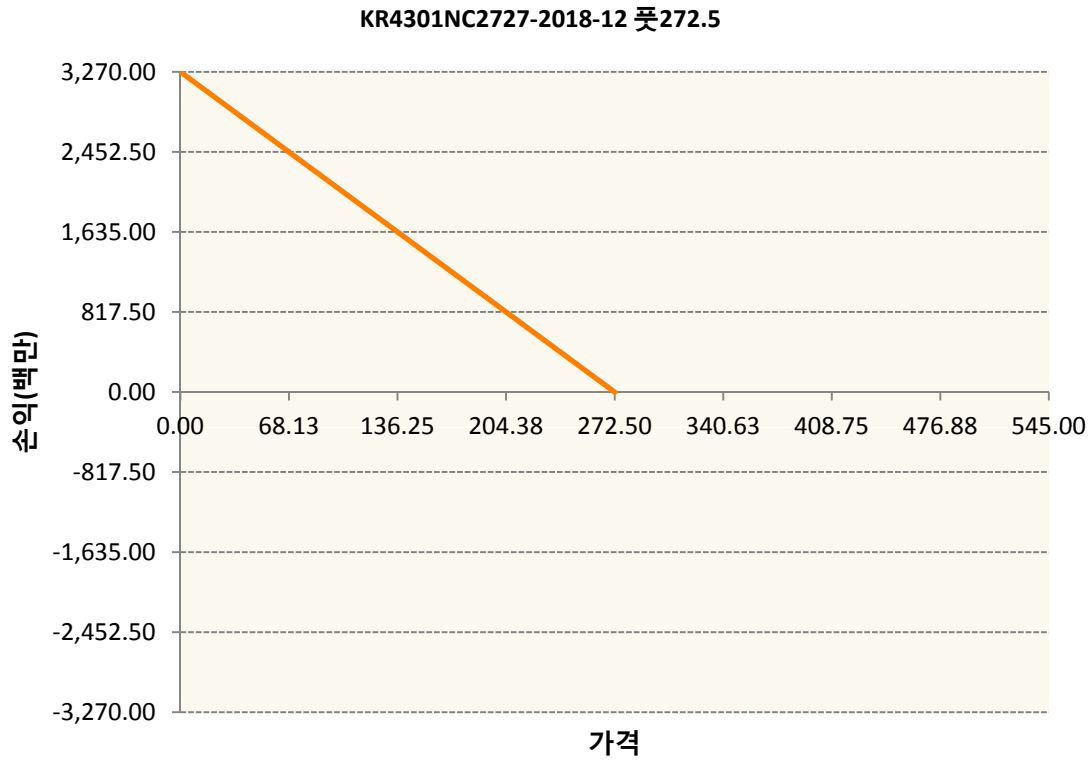
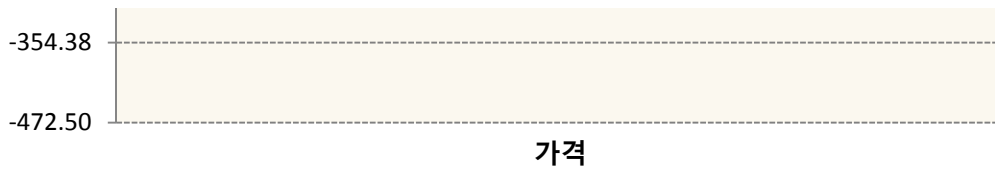


KR4201NC2876-2018-12 콜287.5



KR4301NC2701-2018-12 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 1,021

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,021	-1,021	-1,021	-1,021	-1,021	-1,021	-1,021
-5.33%	-681	-681	-681	-681	-681	-681	-681
-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%	681	681	681	681	681	681	681
8.00%	1,021	1,021	1,021	1,021	1,021	1,021	1,021

KR4201NC2(2018-12 콜285) 698

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	196	192	186	178	167	155	140
-5.33%	186	176	164	148	131	111	89
-2.67%	158	139	117	93	67	39	9

0%	95	65	33	0	-34	-69	-105
2.67%	-22	-61	-100	-140	-180	-220	-260
5.33%	-206	-248	-290	-332	-374	-416	-458
8.00%	-459	-498	-537	-577	-617	-657	-698

KR4201NC27 2018-12 콜287.5

262

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	66	65	63	60	57	52	47
-5.33%	63	60	56	51	45	37	29
-2.67%	55	48	41	32	23	12	1
0%	35	24	12	0	-13	-26	-40
2.67%	-4	-19	-34	-50	-65	-81	-97
5.33%	-69	-86	-103	-120	-137	-154	-171
8.00%	-162	-178	-195	-212	-228	-245	-262

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	8	9
0%	-2	-2	-1	0	1	2	2
2.67%	-6	-6	-5	-4	-4	-3	-2
5.33%	-8	-7	-7	-7	-6	-6	-5
8.00%	-8	-8	-8	-8	-7	-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%	203	203	204	205	206	207	209
-5.33%	118	120	122	125	127	130	133
-2.67%	42	46	50	54	59	63	68
0%	-16	-11	-5	0	5	11	16
2.67%	-50	-46	-41	-36	-31	-26	-21
5.33%	-65	-63	-60	-56	-53	-49	-45
8.00%	-70	-69	-67	-66	-64	-61	-59

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

(단위:백만원)

1,781

공시일	2018-11-13
기준일	2018-11-12

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

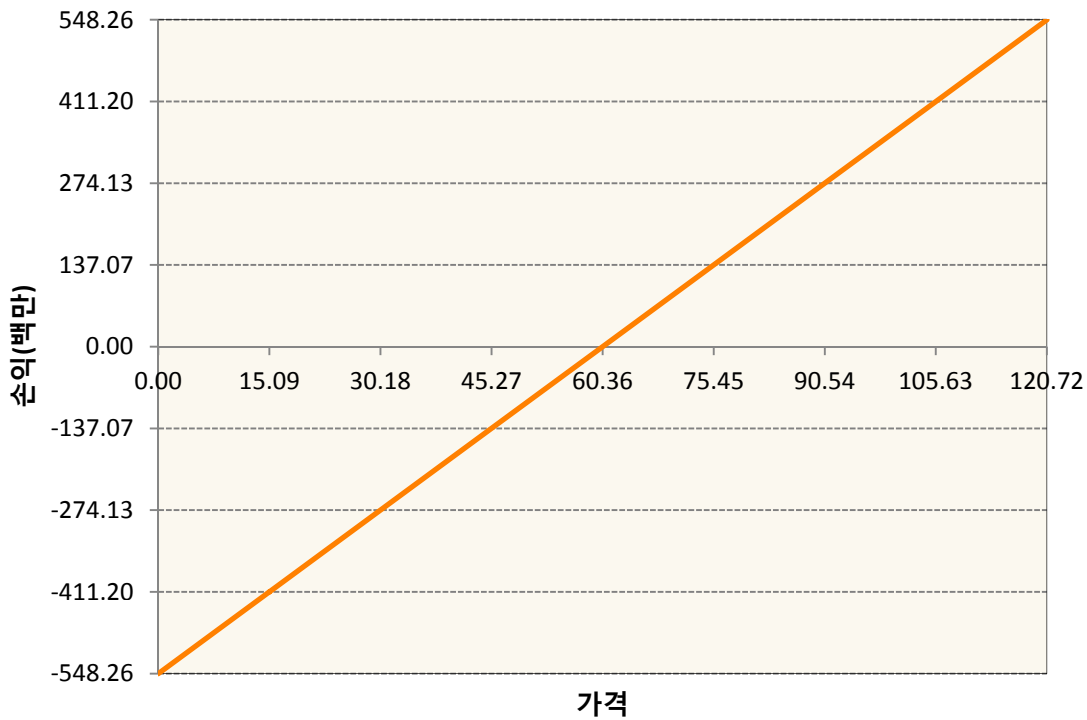
1. 계약금액

(단위:백만원)

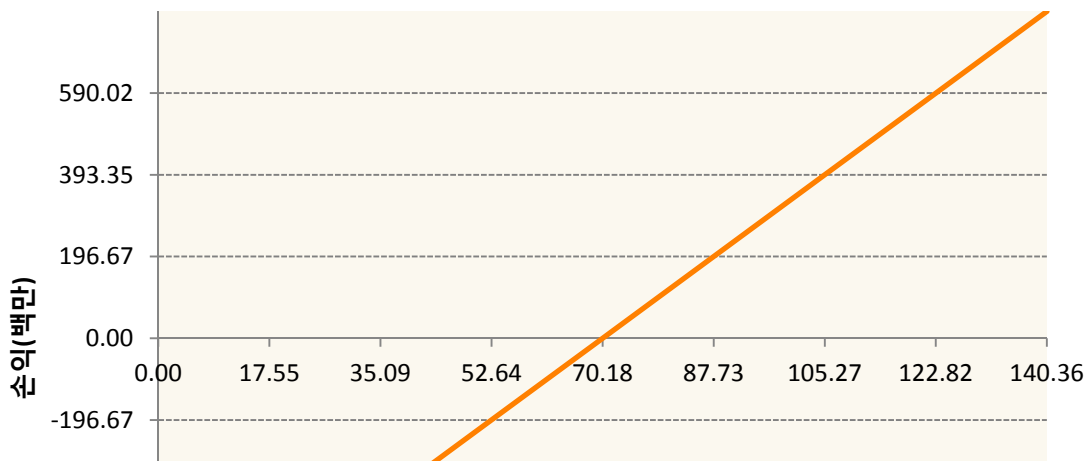
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,188	408	2,780	

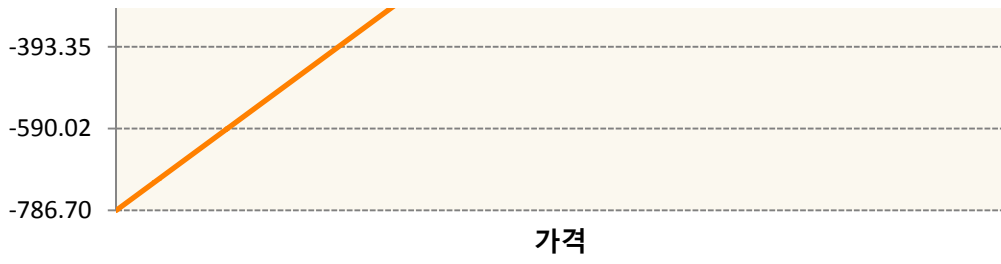
2. 만기시점의 손익구조

CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19

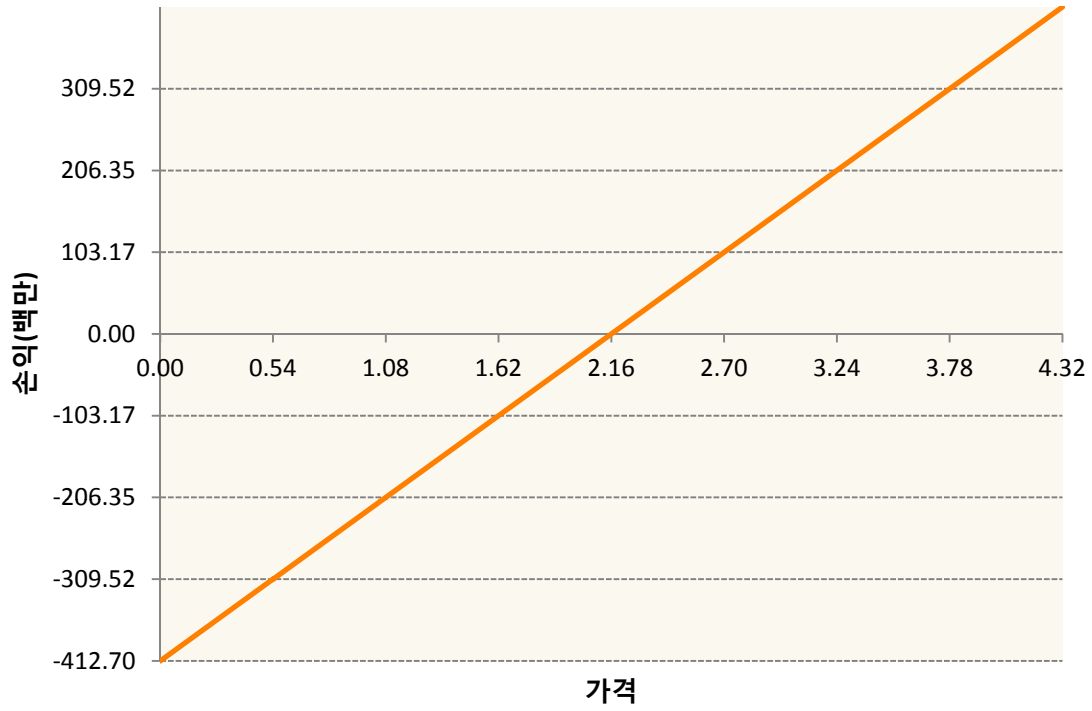


COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19

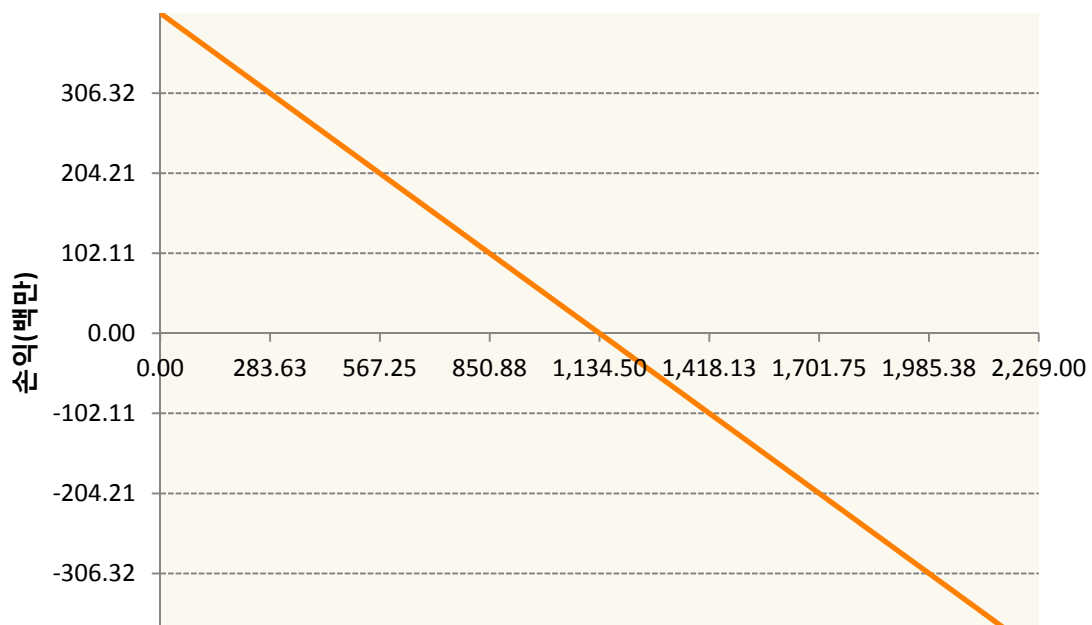


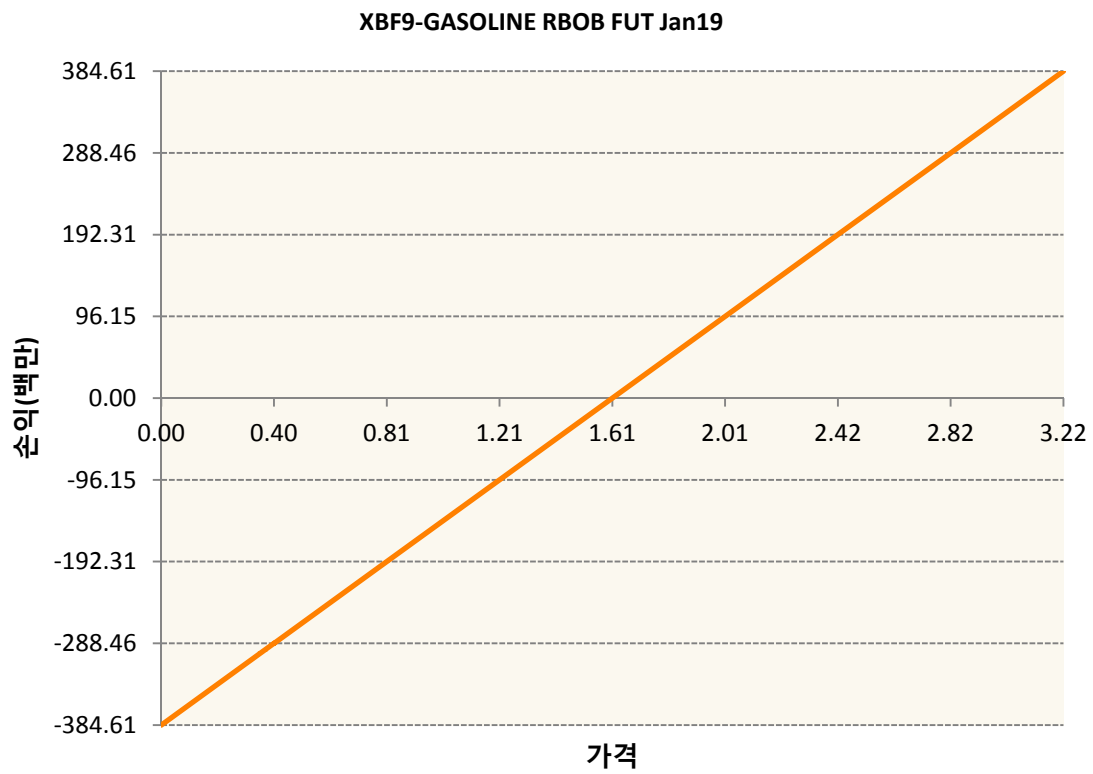
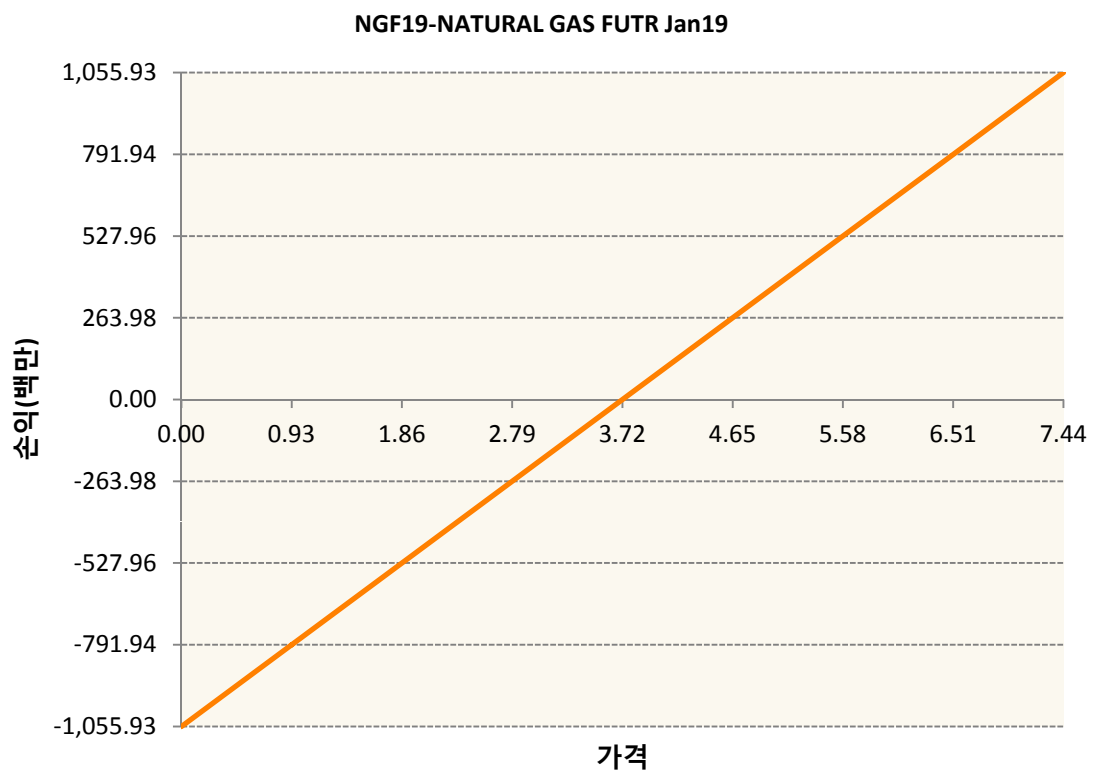
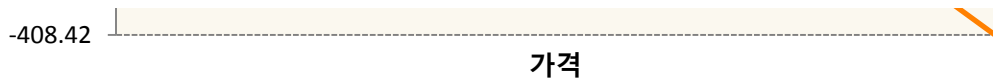


HOF9-NY Harb ULSD Fut Jan19



KR4175NB0006-2018-11 달러선물





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		33
NGF19	NATURAL GAS FUTR Jan19	84
XBF9	GASOLINE RBOB FUT Jan19	31

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

391

공시일	2018-11-13
기준일	2018-11-12

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

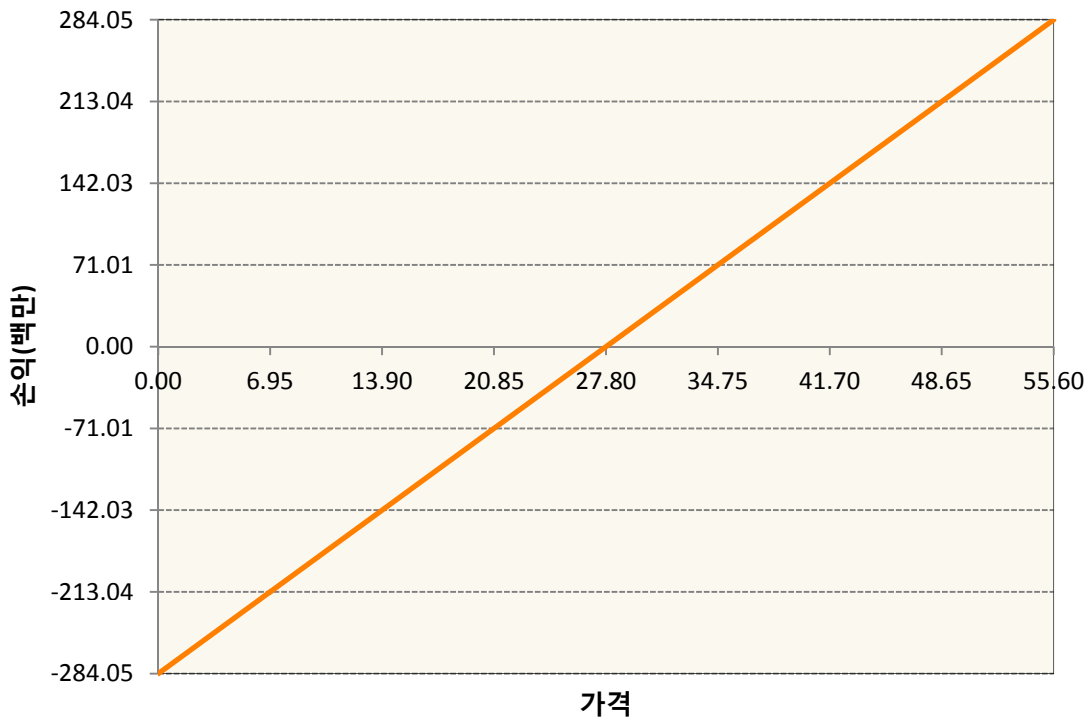
1. 계약금액

(단위:백만원)

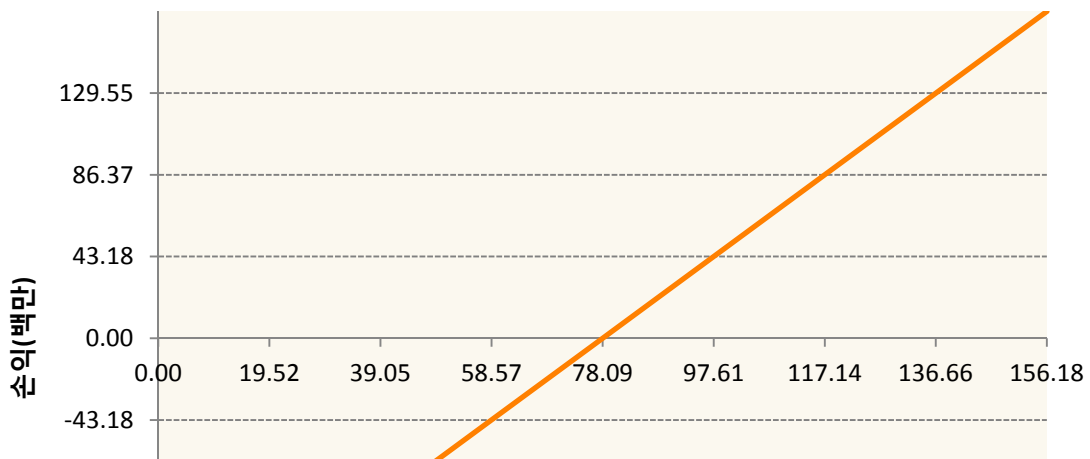
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,568	79	3,488	

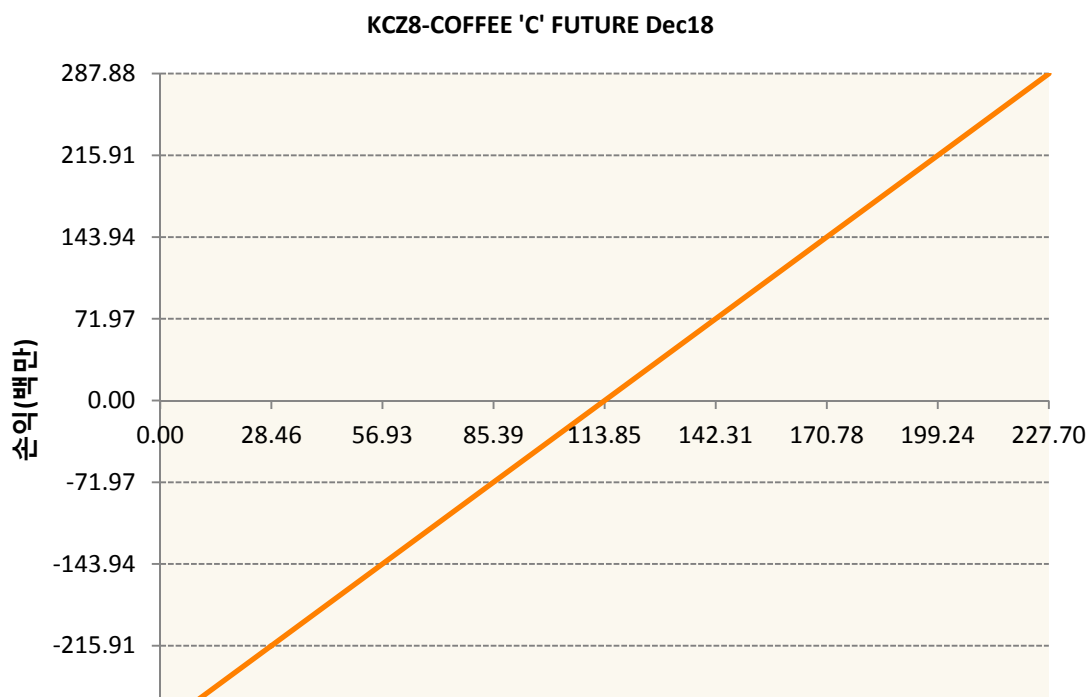
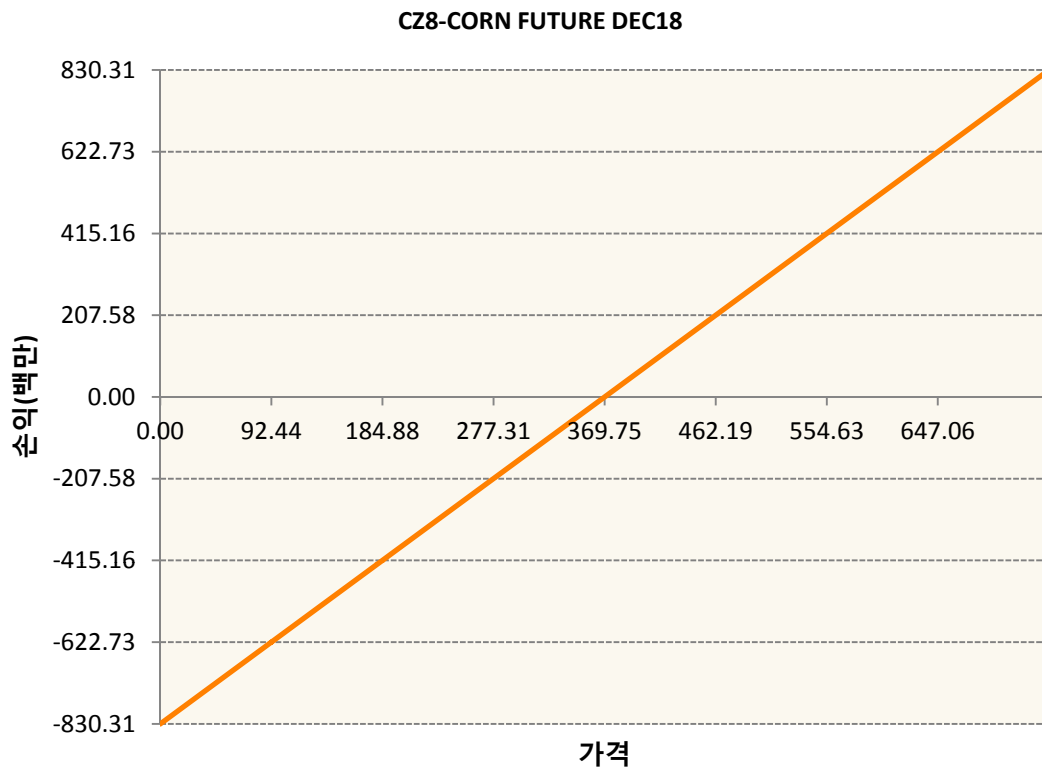
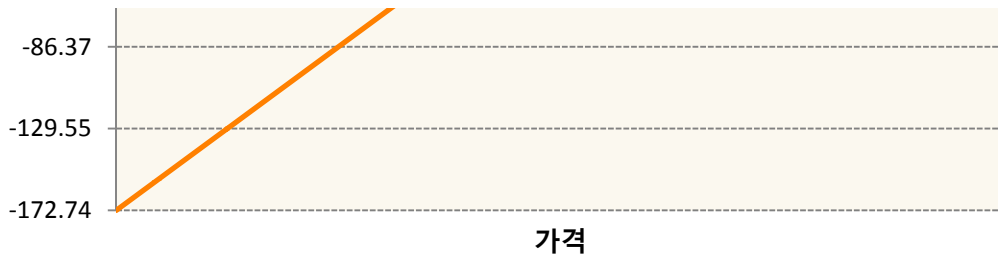
2. 만기시점의 손익구조

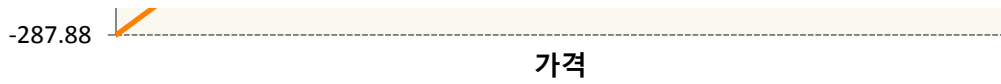
BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19



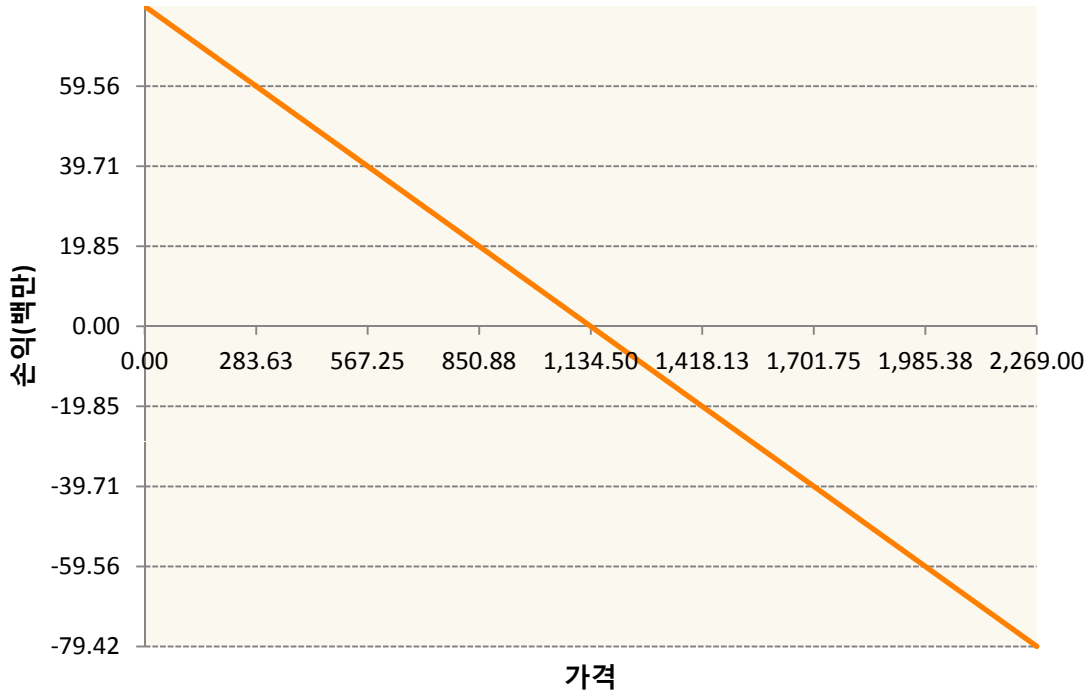
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



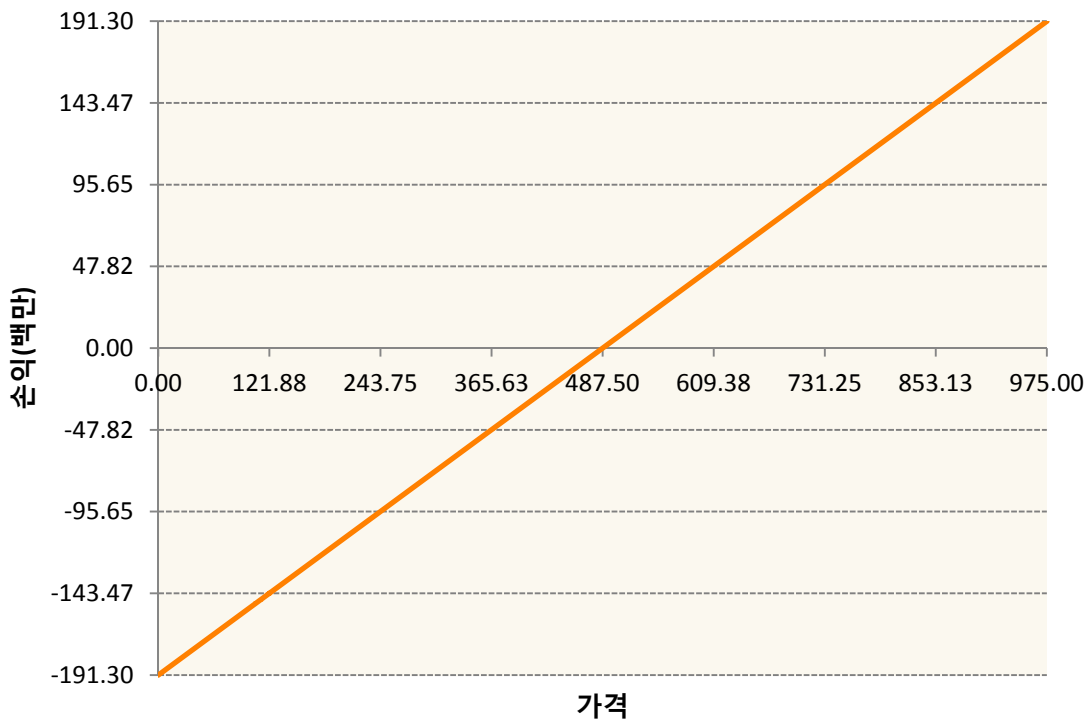




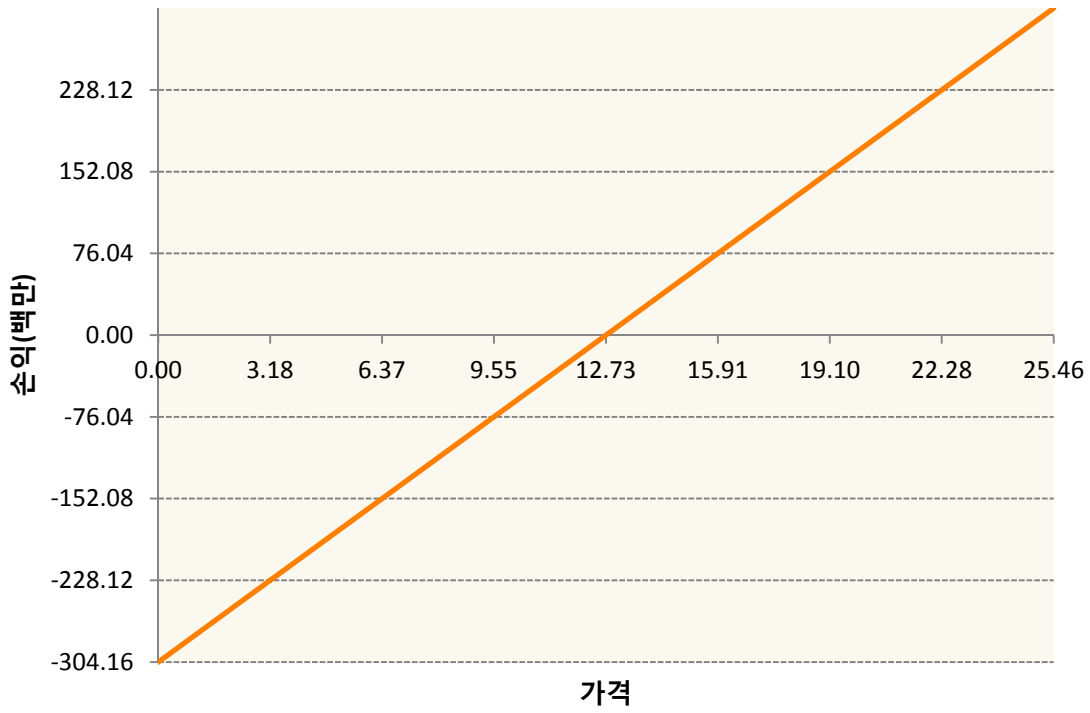
KR4175NB0006-2018-11 달러선물



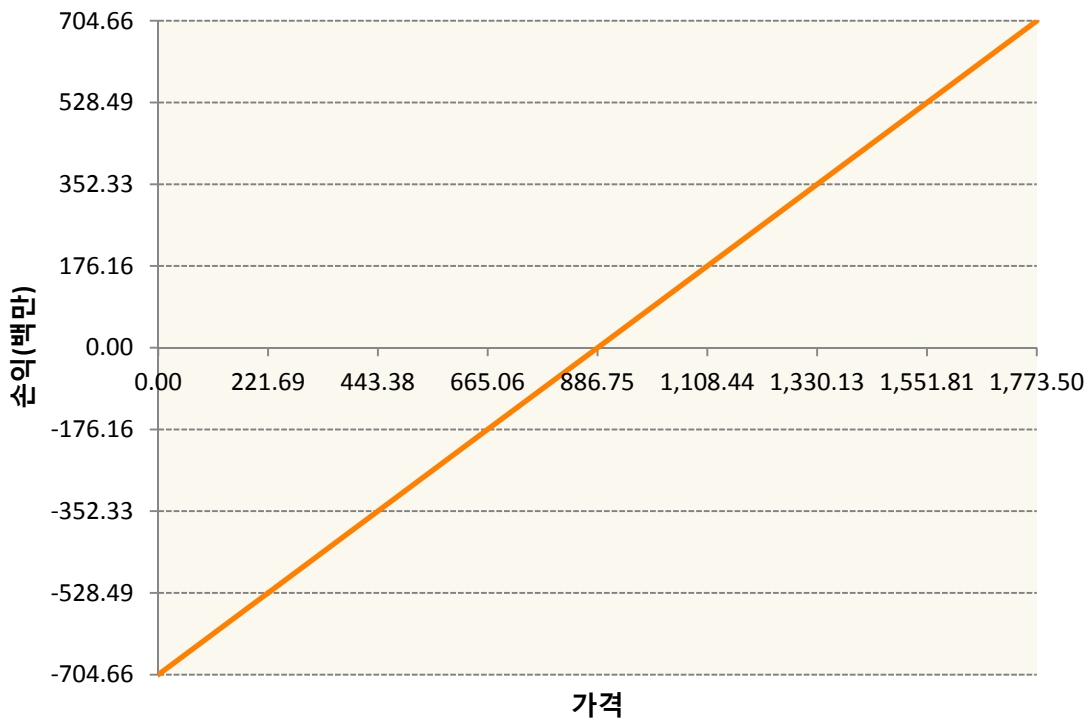
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



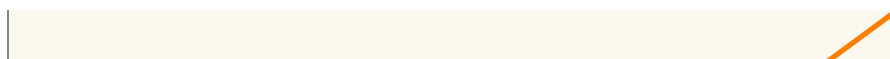
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

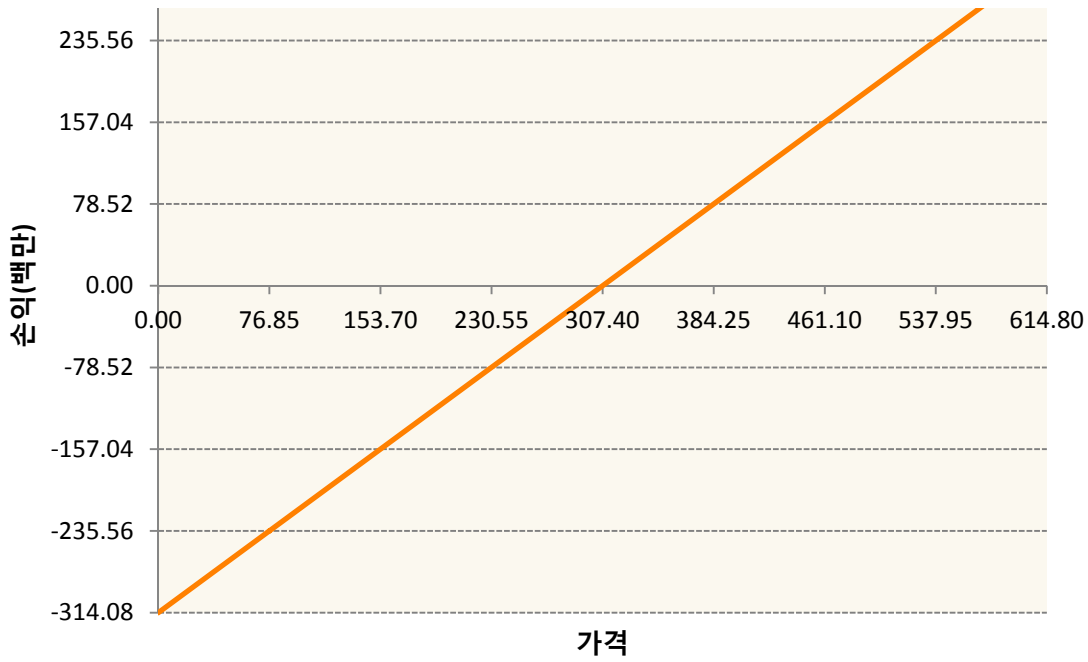


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19

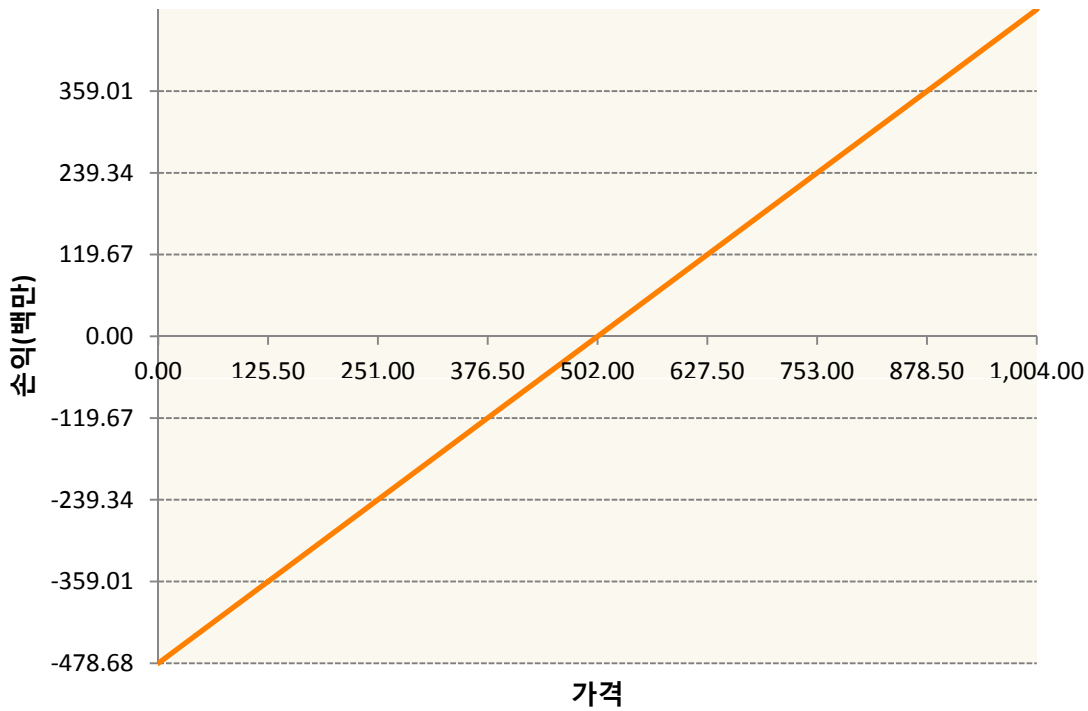


SMF9-SOYBEAN MEAL FUTR Jan19





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	66
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	23
KR4175NB0(2018-11 달러선물	6

KWZ8	KC HRW WHEAT FUT DEC18	15
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	24
SF9	SOYBEAN FUTURE Jan19	56
SMF9	SOYBEAN MEAL FUTR Jan19	25
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	38

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

(단위:백만원)

311