

공시일	2018-09-03
기준일	2018-08-31

## 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	2018-09-03
기준일	2018-08-31

## 스마트인덱스모

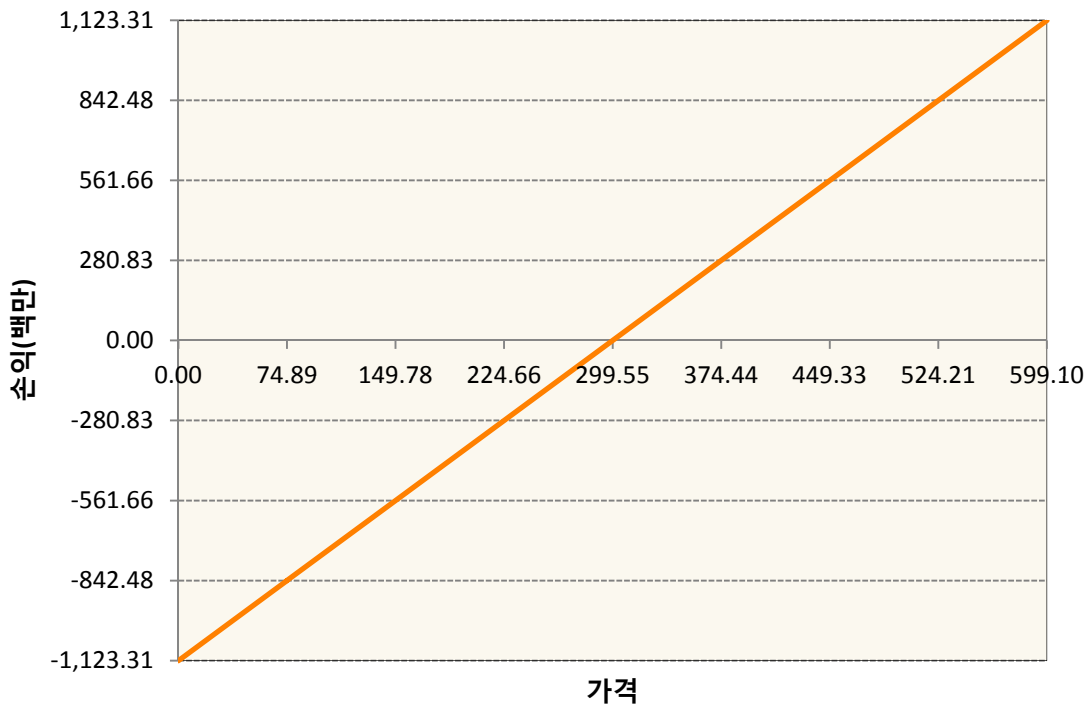
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,123	0	1,123	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물

90

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90
-5.33%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	30	30	30	30	30	30	30
5.33%	60	60	60	60	60	60	60
8.00%	90	90	90	90	90	90	90

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

(단위:백만원)

68

공시일	2018-09-03
기준일	2018-08-31

## 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

1,157

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

496

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-03
기준일	2018-08-31

## 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	4,755	0	4,755	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

#### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI500000 신한CSI500미래S180608

298

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

376

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-03
기준일	2018-08-31

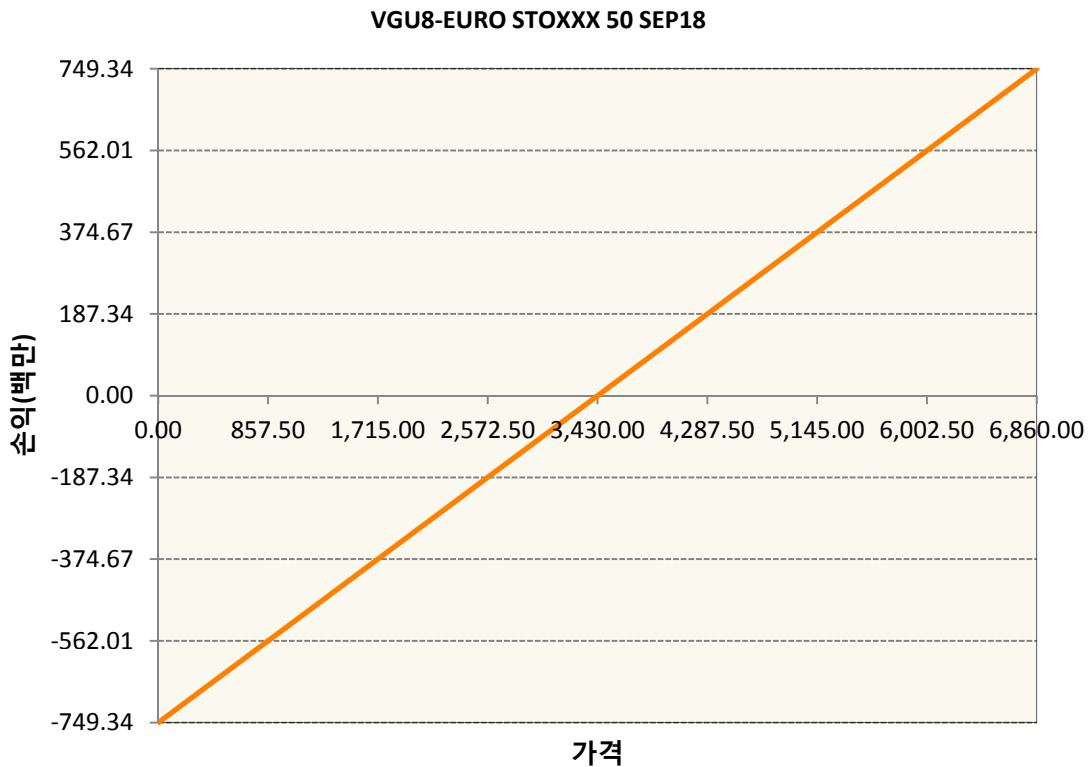
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

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

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU8	EURO STOXXX 50 SEP18	60
------	----------------------	----

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

(단위:백만원)

37
----

공시일	2018-09-03
기준일	2018-08-31

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

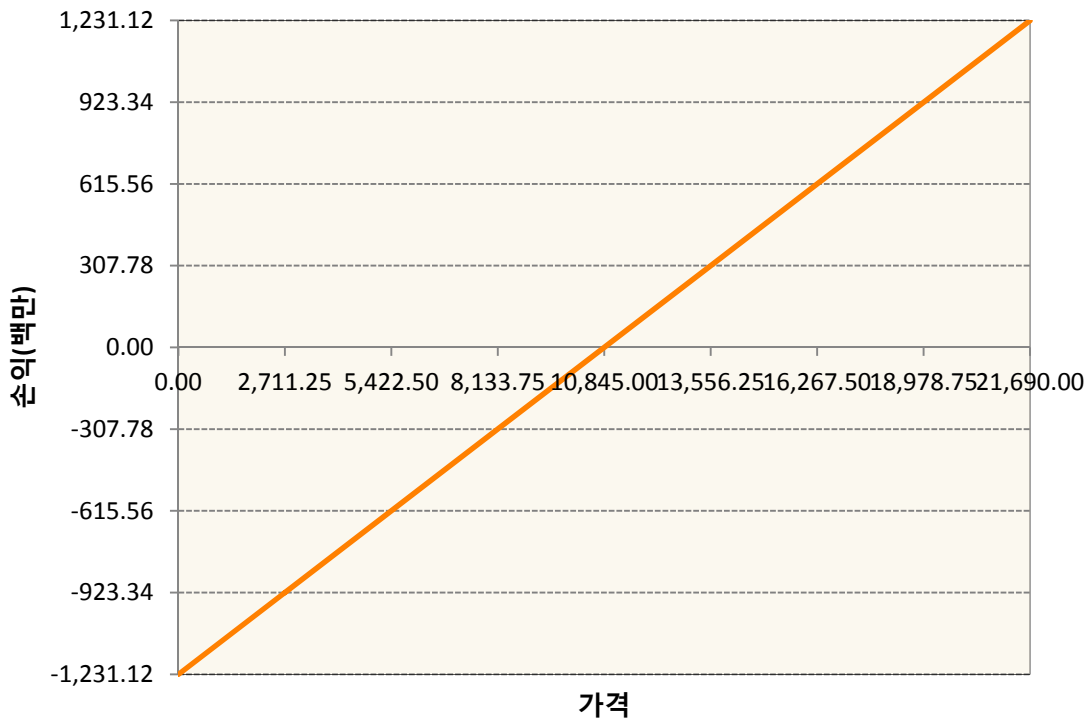
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

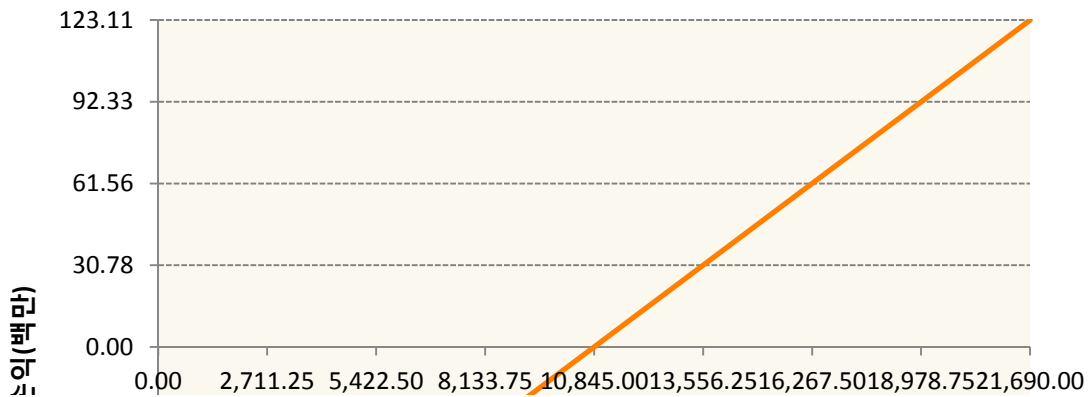
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	123	0	123	
누계	유가증권	선물	1,231	0	1,231	장내

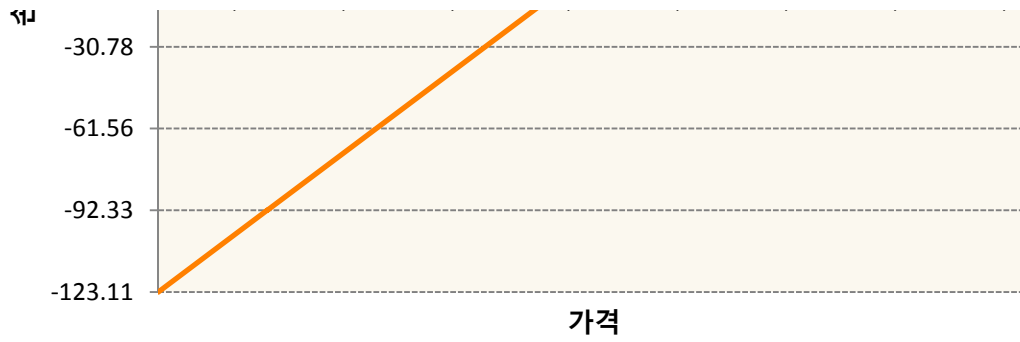
### 2. 만기시점의 손익구조

**HCU8-H-SHARES IDX FUT Sep18**



**MHCU8-MINI H-SHR IDX Fut Sep18**





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

HCU8	H-SHARES IDX FUT Sep18	98
MHCU8	MINI H-SHR IDX Fut Sep18	10

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

<b>99</b>
-----------

공시일	2018-09-03
기준일	2018-08-31

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

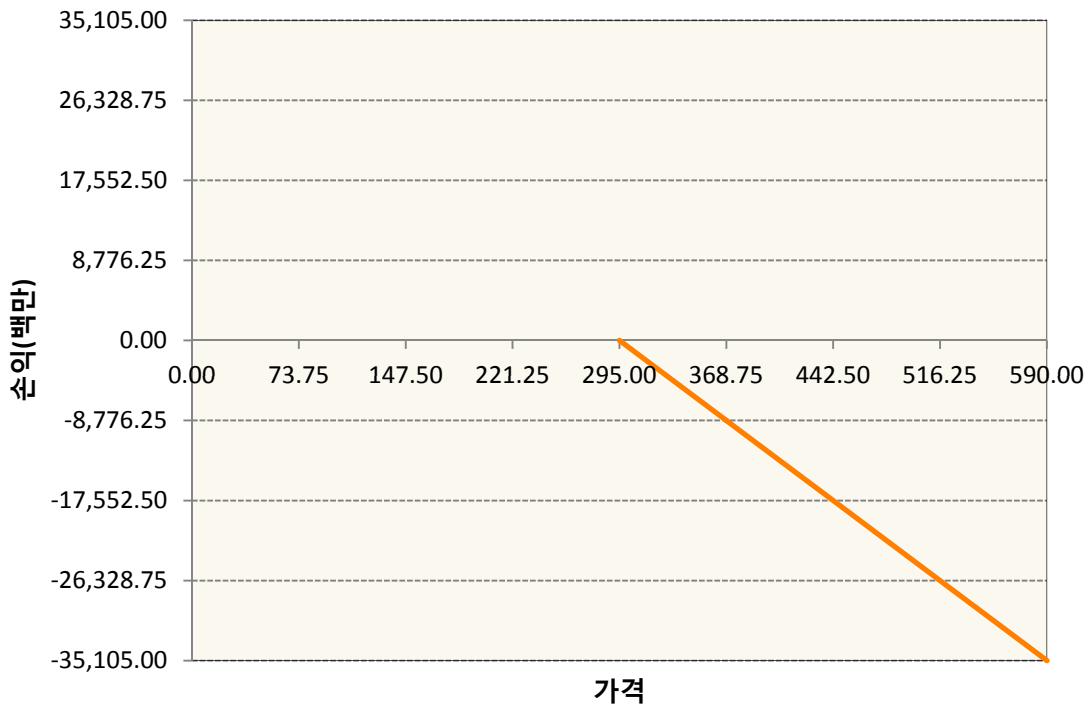
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

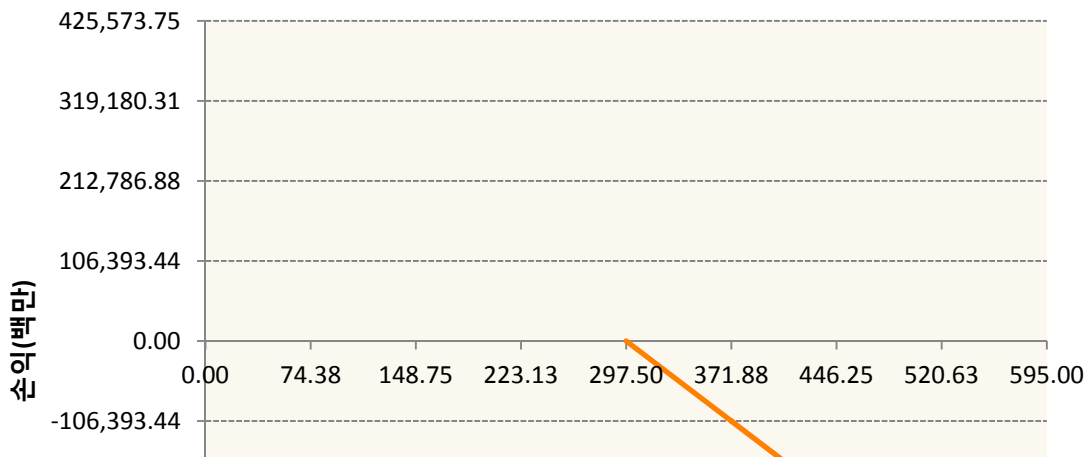
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	1,501	-1,501	장내
누계	유가증권	옵션	0	758,179	-758,179	장내

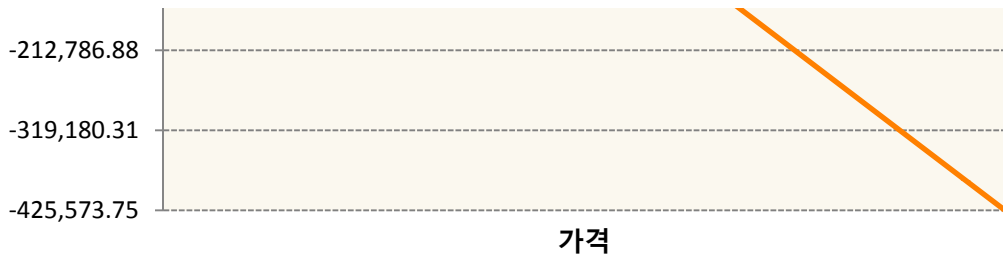
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92950-2018-09 콜295

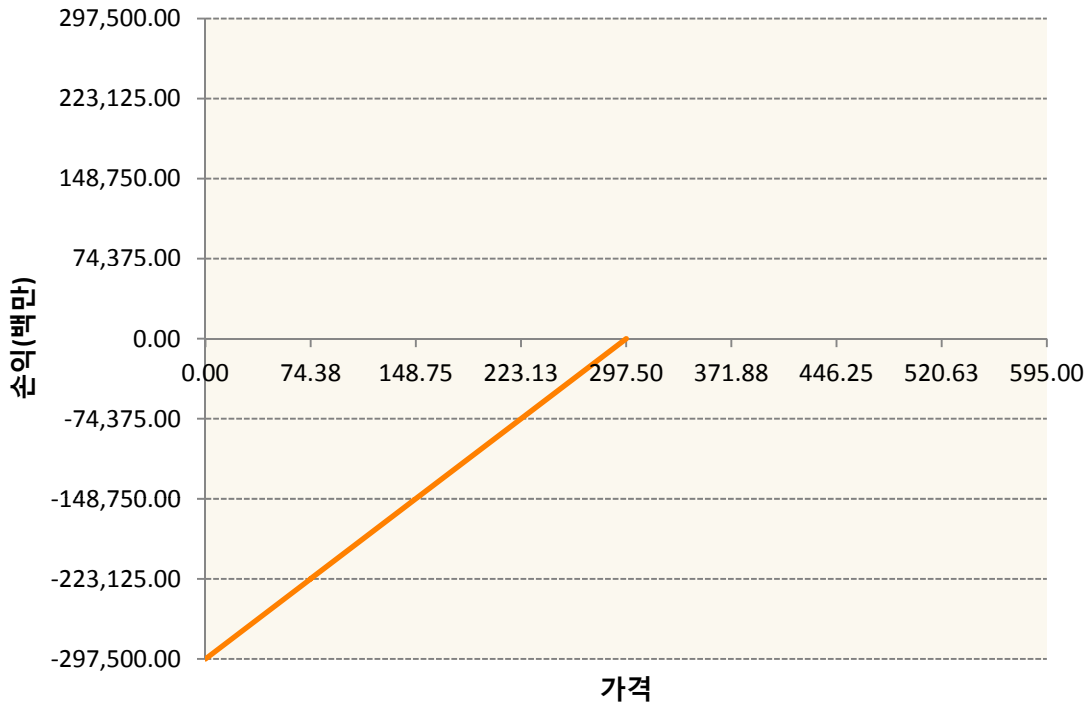


KR4201N92976-2018-09 콜297.5





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N929 2018-09 콜295

2,467

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,038	1,023	1,004	981	955	925	893
-5.33%	947	910	869	826	780	733	685
-2.67%	684	627	569	511	453	394	336
0%	168	113	57	0	-57	-115	-173
2.67%	-580	-614	-652	-693	-737	-783	-831
5.33%	-1,462	-1,477	-1,495	-1,518	-1,545	-1,575	-1,608
8.00%	-2,397	-2,401	-2,408	-2,418	-2,431	-2,448	-2,467

KR4201N929 2018-09 풋297.5

28,491

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,487	10,362	10,191	9,975	9,716	9,419	9,086

-5.33%	9,760	9,394	8,982	8,531	8,048	7,538	7,006
-2.67%	7,363	6,719	6,062	5,396	4,723	4,043	3,360
0%	2,137	1,427	715	0	-716	-1,434	-2,152
2.67%	-6,065	-6,573	-7,115	-7,686	-8,279	-8,891	-9,518
5.33%	-16,275	-16,518	-16,817	-17,164	-17,554	-17,982	-18,443
8.00%	-27,378	-27,459	-27,580	-27,745	-27,953	-28,202	-28,491

KR4301N929 2018-09 풋 297.5

19,826

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19,814	-19,814	-19,815	-19,815	-19,817	-19,820	-19,826
-5.33%	-11,824	-11,832	-11,847	-11,871	-11,904	-11,947	-12,001
-2.67%	-4,181	-4,313	-4,459	-4,615	-4,780	-4,952	-5,131
0%	621	418	210	0	-213	-428	-644
2.67%	1,600	1,564	1,513	1,448	1,370	1,278	1,174
5.33%	1,640	1,639	1,637	1,632	1,622	1,608	1,586
8.00%	1,641	1,641	1,641	1,640	1,640	1,639	1,637

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

(단위:백만원)

**55,661**

공시일	2018-09-03
기준일	2018-08-31

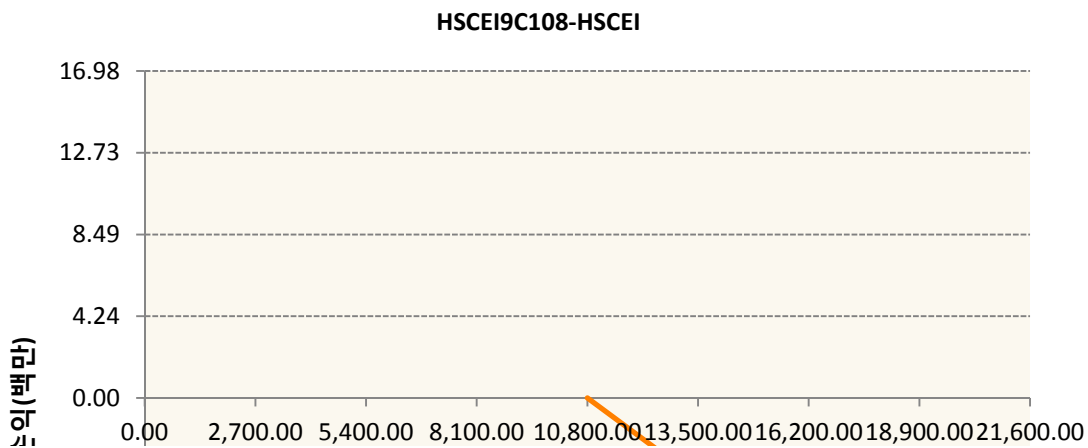
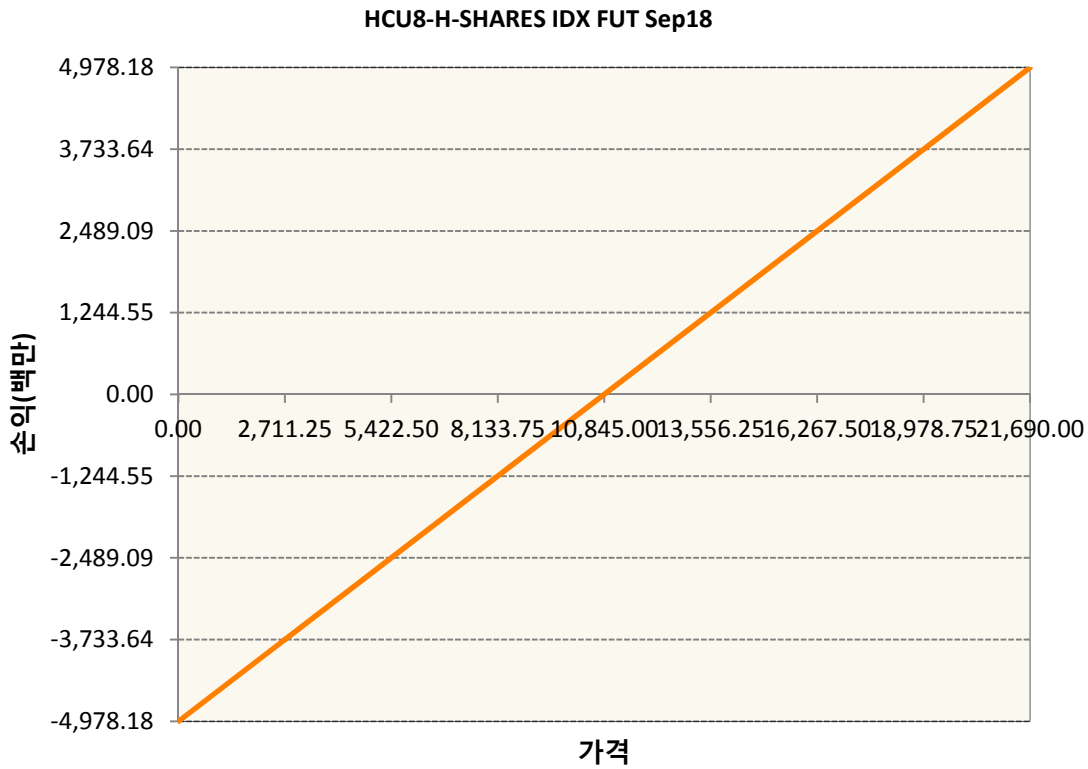
## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

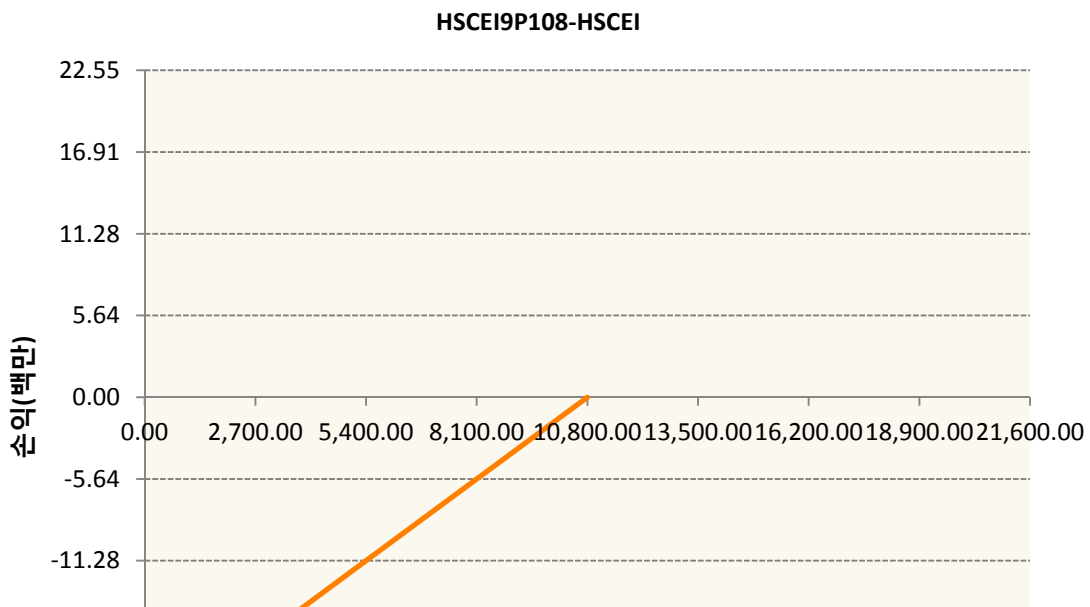
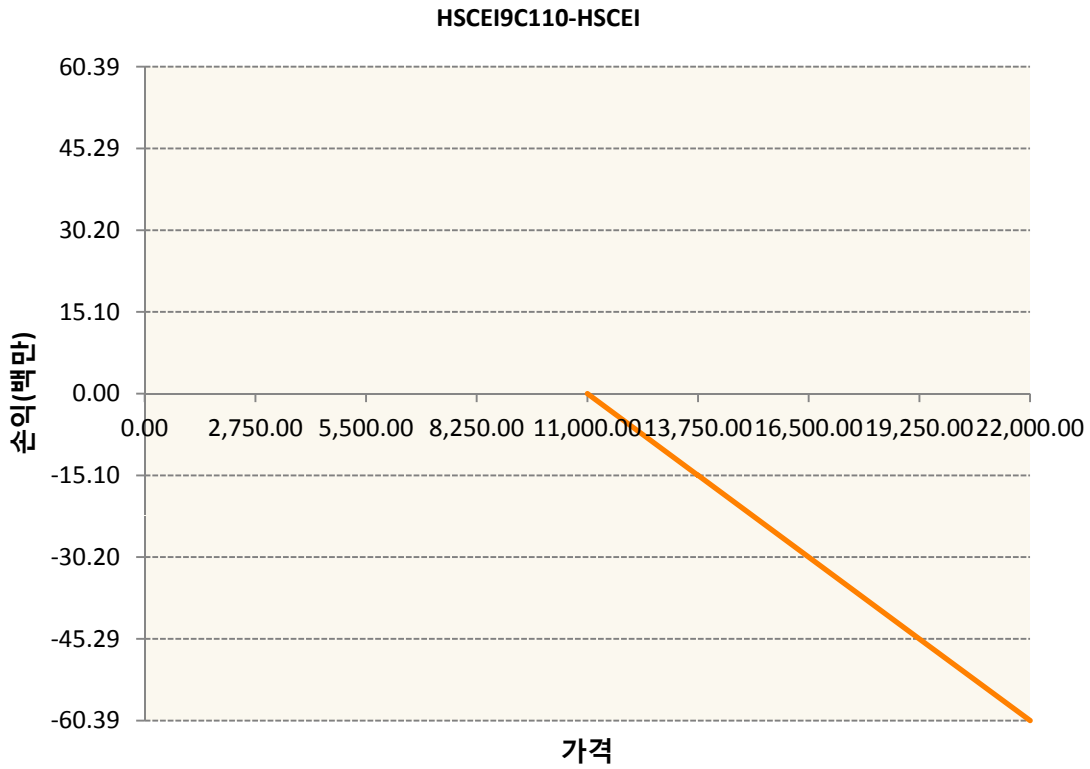
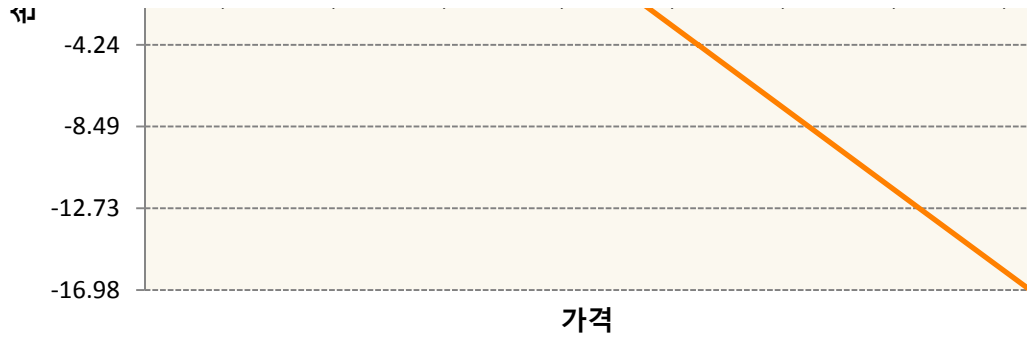
### 1. 계약금액

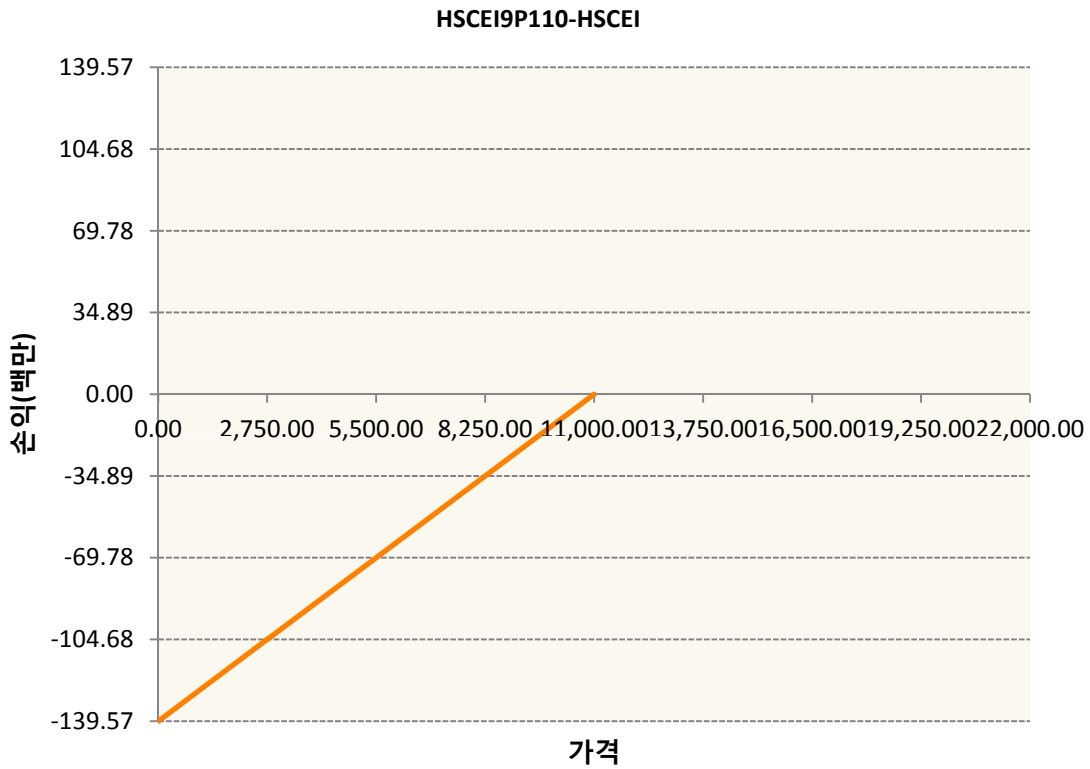
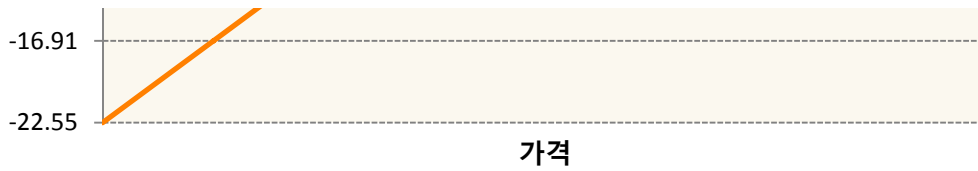
(단위:백만원)

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	4,978	0	4,978	장내
누계	유가증권	옵션	0	239	-239	장내

### 2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU8	H-SHARES IDX FUT Sep18	398
HSCEI9C108	HSCEI	1
HSCEI9C110	HSCEI	5
HSCEI9P108	HSCEI	2
HSCEI9P110	HSCEI	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	381

공시일	2018-09-03
기준일	2018-08-31

## 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	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	49,668	-49,668	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92976-2018-09 콜297.5

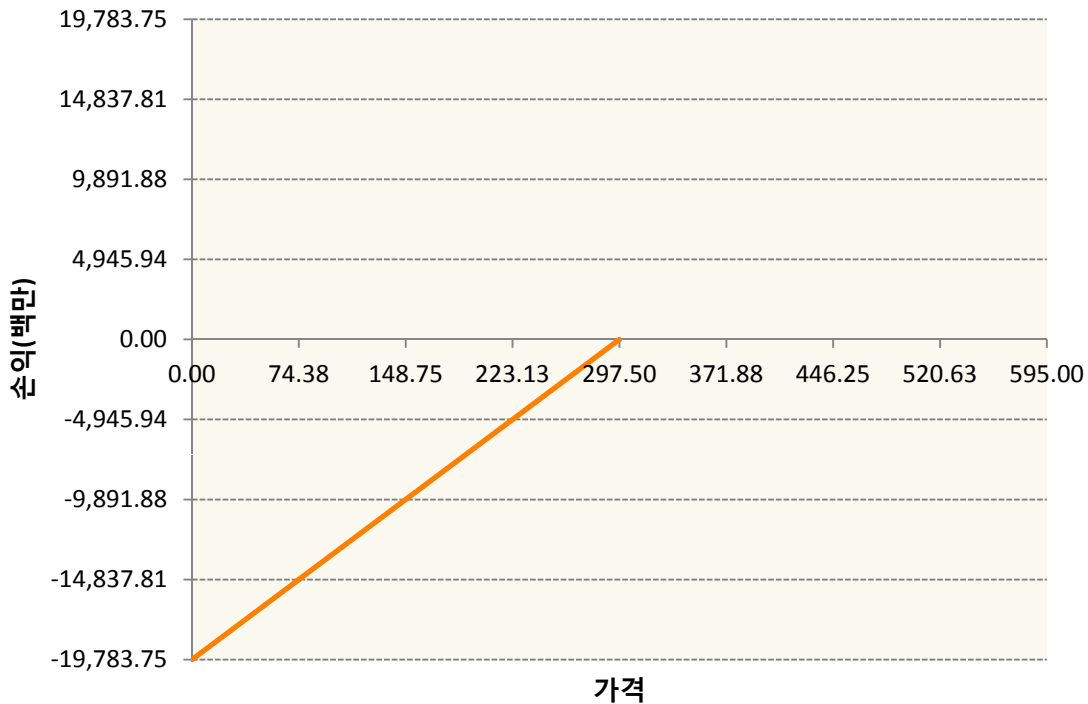


KR4301N92958-2018-09 풋295





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,960
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,960	-3,960	-3,960	-3,960	-3,960	-3,960	-3,960
-5.33%	-2,640	-2,640	-2,640	-2,640	-2,640	-2,640	-2,640
-2.67%	-1,320	-1,320	-1,320	-1,320	-1,320	-1,320	-1,320
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,320	1,320	1,320	1,320	1,320	1,320	1,320
5.33%	2,640	2,640	2,640	2,640	2,640	2,640	2,640
8.00%	3,960	3,960	3,960	3,960	3,960	3,960	3,960
KR4201N92974-2018-09 풋297.5							1,882
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	693	684	673	659	642	622	600
-5.33%	645	621	593	564	532	498	463
-2.67%	486	444	400	356	312	267	222
0%	141	94	47	0	-47	-95	-142
2.67%	-401	-434	-470	-508	-547	-587	-629
5.33%	-1,075	-1,091	-1,111	-1,134	-1,160	-1,188	-1,218
8.00%	-1,809	-1,814	-1,822	-1,833	-1,847	-1,863	-1,882

KR4301N929 2018-09 풋295

108

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-108	-108	-108	-108	-108	-108	-108
-5.33%	-60	-61	-61	-61	-62	-62	-62
-2.67%	-18	-19	-20	-21	-22	-24	-25
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	5	5	5	5	5	4	4
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

KR4301N929 2018-09 풋297.5

1,318

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,318	-1,318	-1,318	-1,318	-1,318	-1,318	-1,318
-5.33%	-786	-787	-788	-789	-792	-795	-798
-2.67%	-278	-287	-297	-307	-318	-329	-341
0%	41	28	14	0	-14	-28	-43
2.67%	106	104	101	96	91	85	78
5.33%	109	109	109	109	108	107	105
8.00%	109	109	109	109	109	109	109

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

(단위:백만원)

7,588

공시일	2018-09-03
기준일	2018-08-31

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

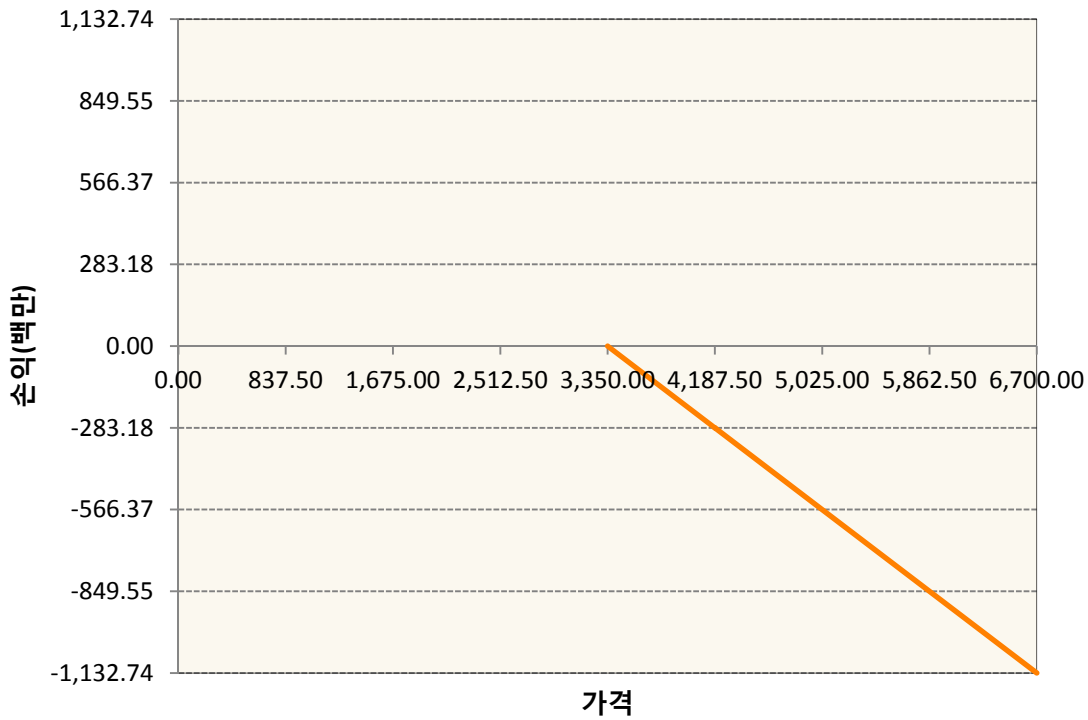
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

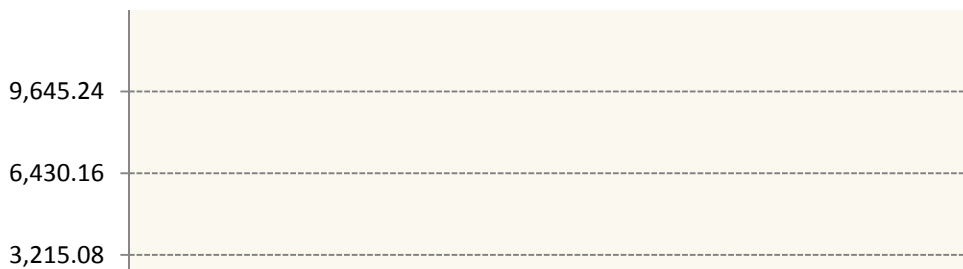
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,081	0	7,081	
누계	유가증권	옵션	0	27,986	-27,986	장내
누계	지수	스왑	87,138	0	87,138	장외

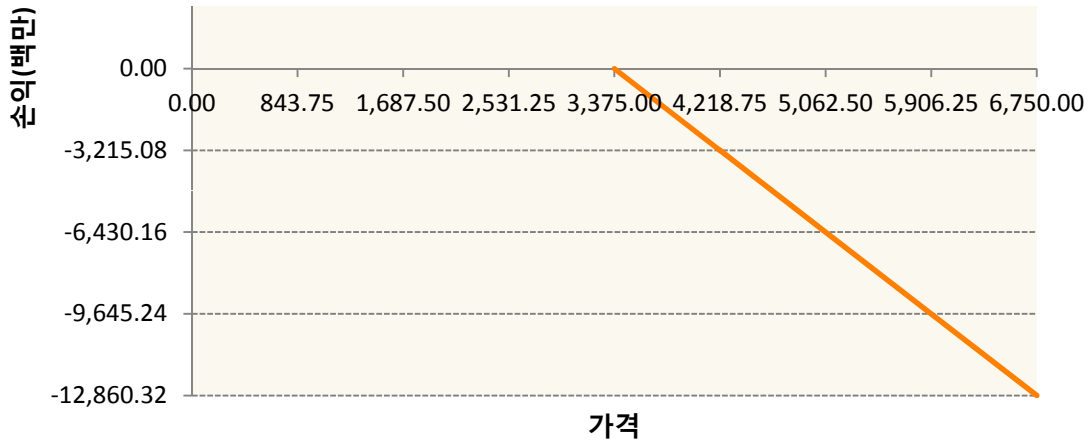
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXU8-C3350-EURO STOXX 50**

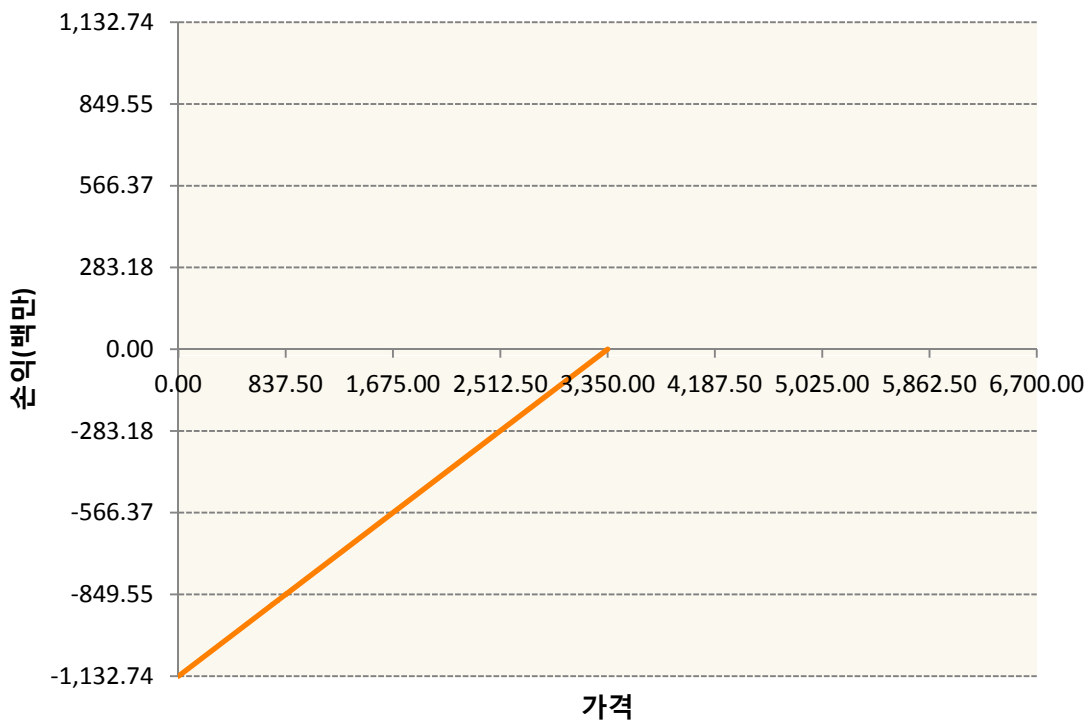


**OESXU8-C3375-EURO STOXX 50**

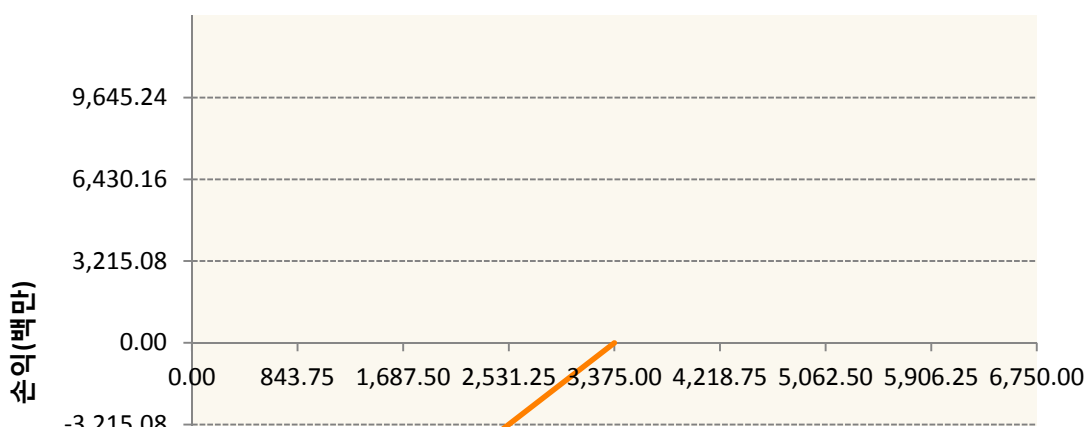


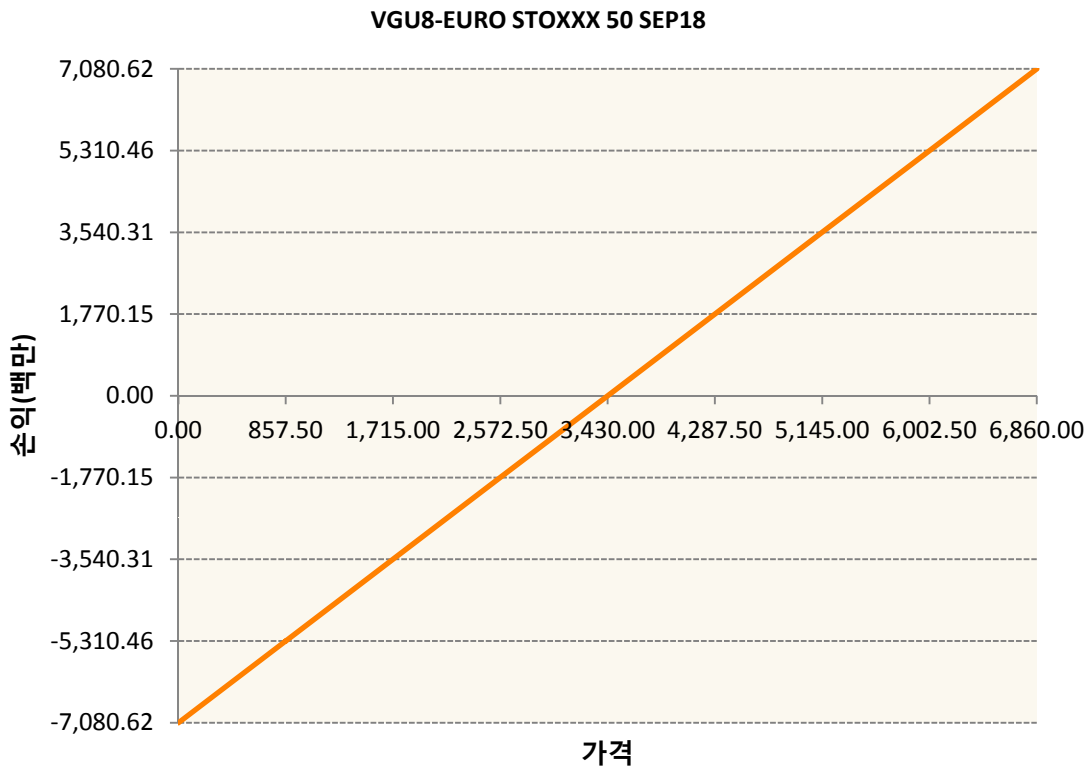


OESXU8-P3350-EURO STOXX 50



OESXU8-P3375-EURO STOXX 50





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

260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	12
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY	8
OESXU8-C33 EURO STOXX 50	91
OESXU8-C33 EURO STOXX 50	1,029
OESXU8-P33 EURO STOXX 50	91
OESXU8-P33 EURO STOXX 50	1,029
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18	566

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

**1,767**



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

(단위:백만원)

1,144



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

(단위:백만원)

90



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

(단위:백만원)

135



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

(단위:백만원)

170

공시일	2018-09-03
기준일	2018-08-31

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1

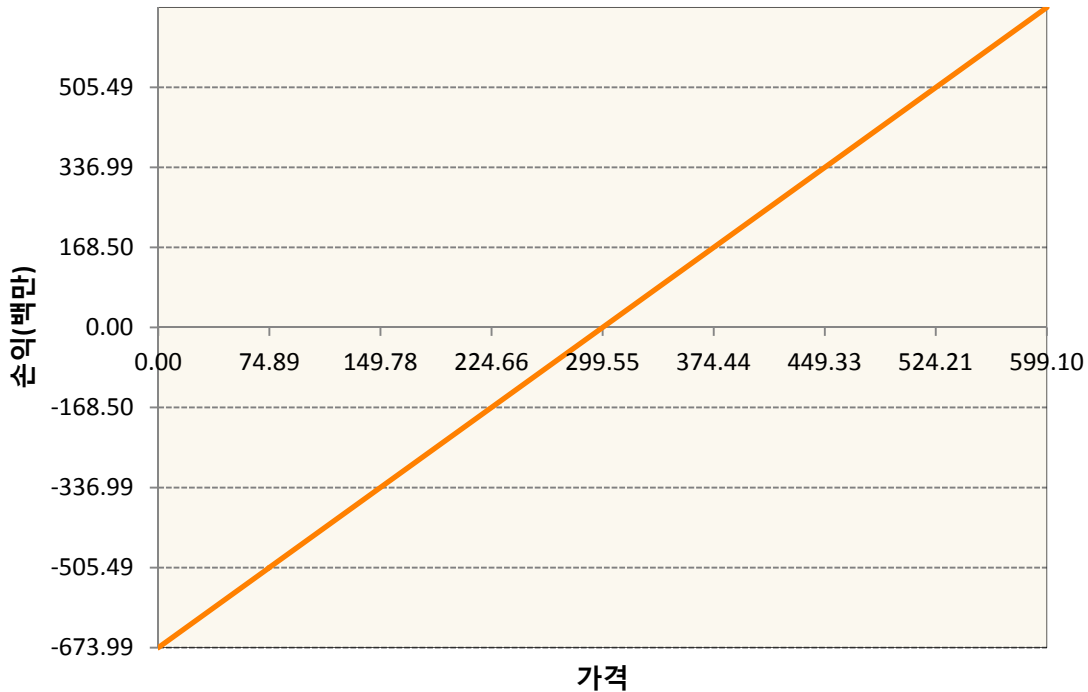
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	674	0	674	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물

54

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	18	18	18	18	18	18	18
5.33%	36	36	36	36	36	36	36
8.00%	54	54	54	54	54	54	54

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

(단위:백만원)

41

공시일	2018-09-03
기준일	2018-08-31

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

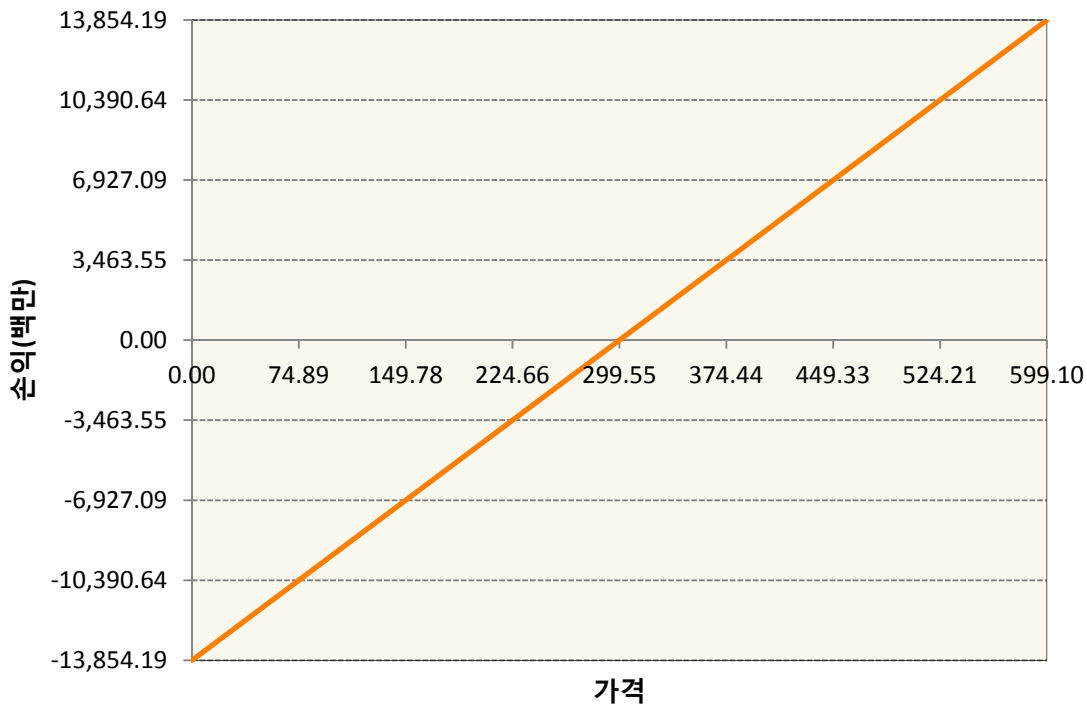
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

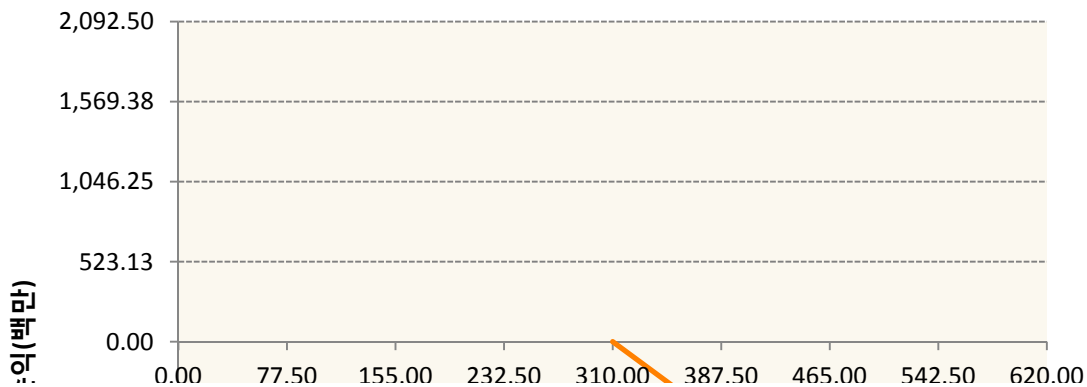
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,854	0	13,854	장내
누계	유가증권	옵션	1,339	24,671	-23,332	장내

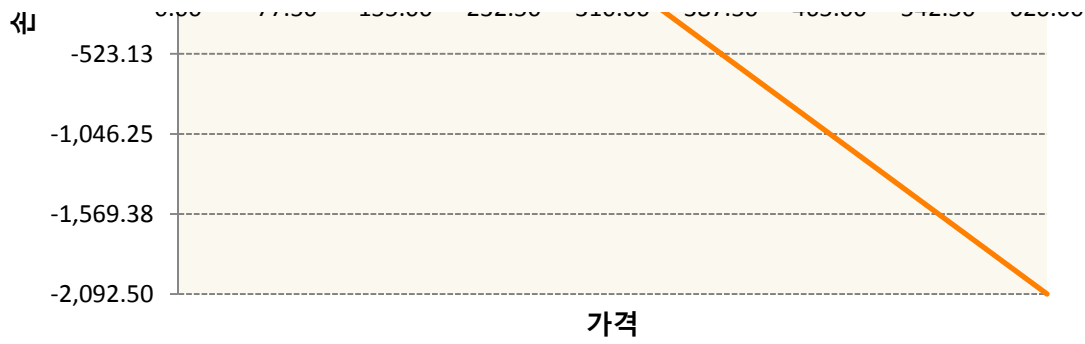
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

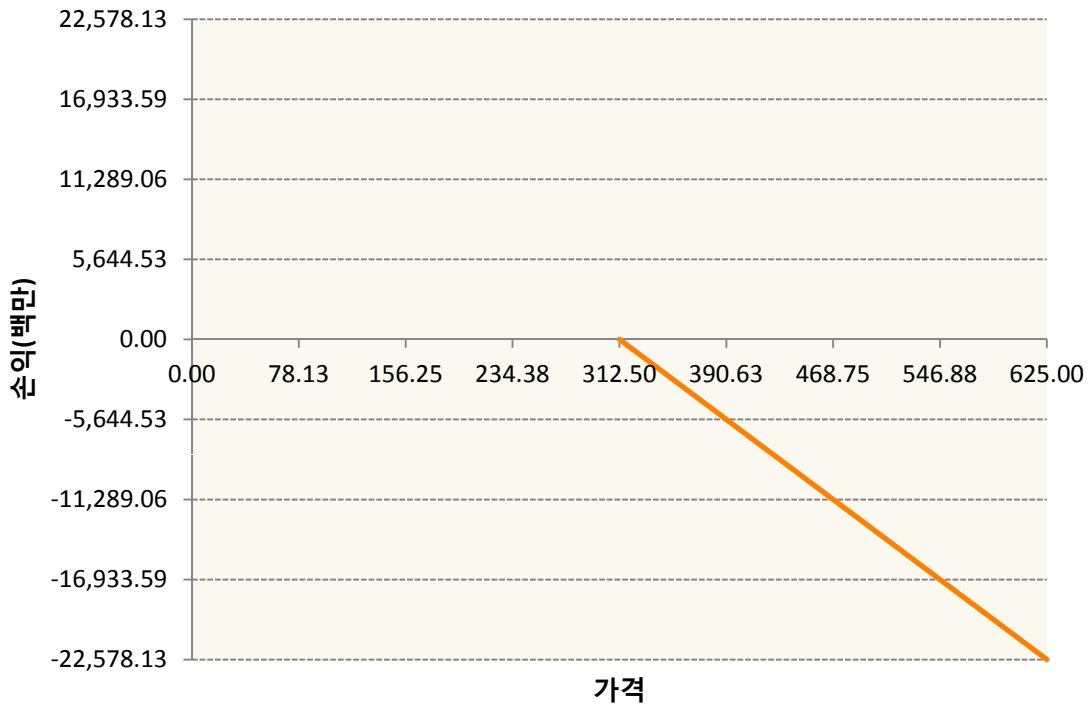


KR4201N93107-2018-09 콜310

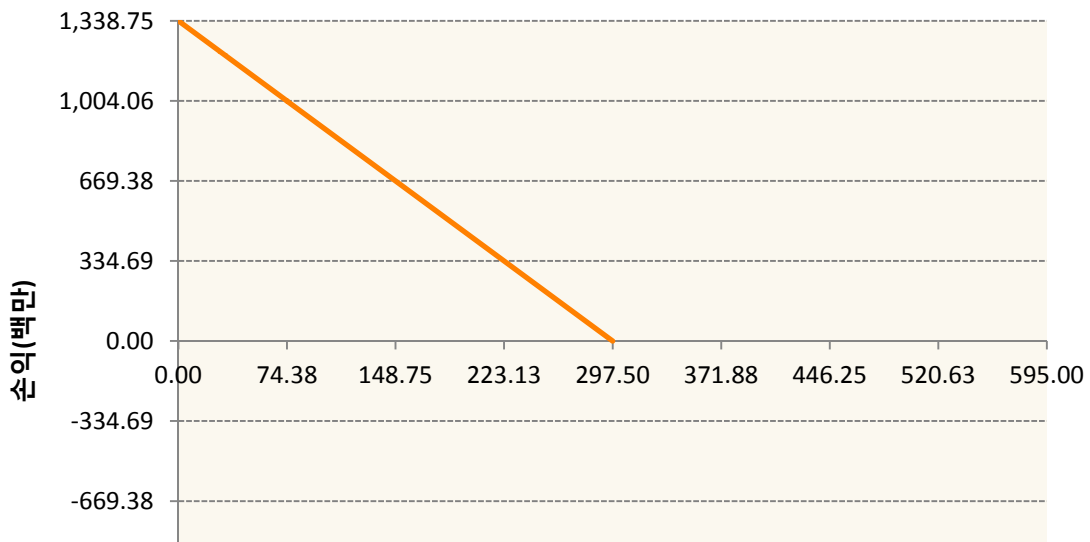


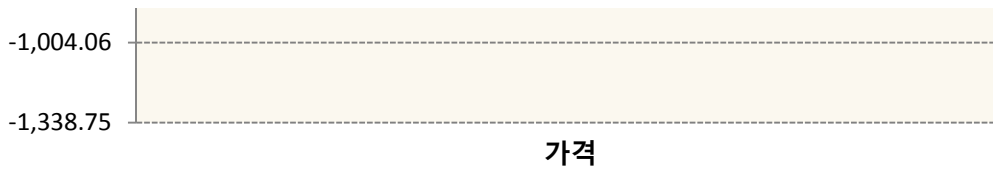


**KR4201N93123-2018-09 콜312.5**



**KR4301N92974-2018-09 풋297.5**





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

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물							1,110
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,110	-1,110	-1,110	-1,110	-1,110	-1,110	-1,110
-5.33%	-740	-740	-740	-740	-740	-740	-740
-2.67%	-370	-370	-370	-370	-370	-370	-370
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	370	370	370	370	370	370	370
5.33%	740	740	740	740	740	740	740
8.00%	1,110	1,110	1,110	1,110	1,110	1,110	1,110
KR4201N9312018-09 콜310							98
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17	17	16	16	16	15	15
-5.33%	16	16	15	15	14	13	12
-2.67%	15	13	12	10	9	7	4
0%	8	5	3	0	-3	-6	-9
2.67%	-9	-13	-16	-20	-23	-27	-30
5.33%	-40	-43	-46	-50	-53	-57	-60
8.00%	-83	-85	-87	-90	-92	-95	-98
KR4201N9312018-09 콜312.5							957
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	136	136	135	134	131	128	123
-5.33%	135	133	129	123	116	107	96
-2.67%	124	115	103	89	72	54	33
0%	74	51	27	0	-28	-57	-87
2.67%	-69	-104	-140	-177	-214	-250	-287
5.33%	-353	-390	-427	-465	-502	-540	-578
8.00%	-778	-804	-832	-862	-892	-924	-957
KR4301N92C 2018-09 풋297.5							89
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	89	89	89	89	89	89	89
-5.33%	53	53	53	53	54	54	54
-2.67%	19	19	20	21	22	22	23

0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-7	-7	-7	-7	-6	-6	-5
5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7

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

(단위:백만원)

**1,761**

공시일	2018-09-03
기준일	2018-08-31

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

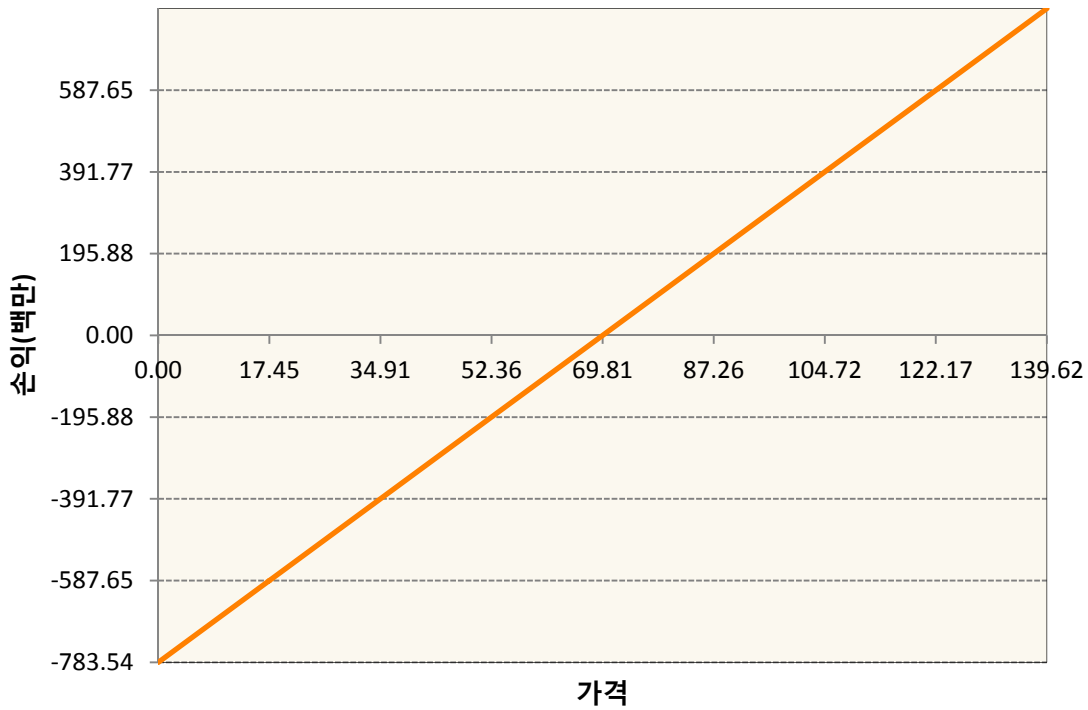
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

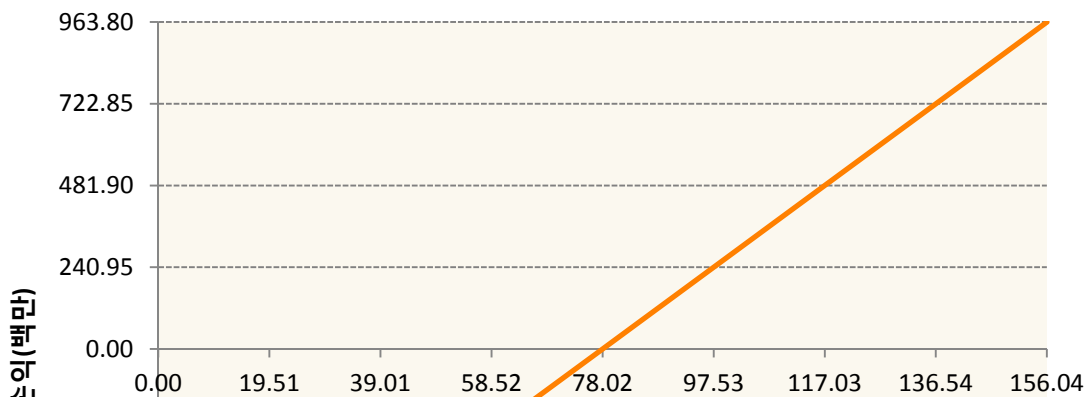
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,194	612	2,582	
누계	유가증권	선물	532	0	532	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18

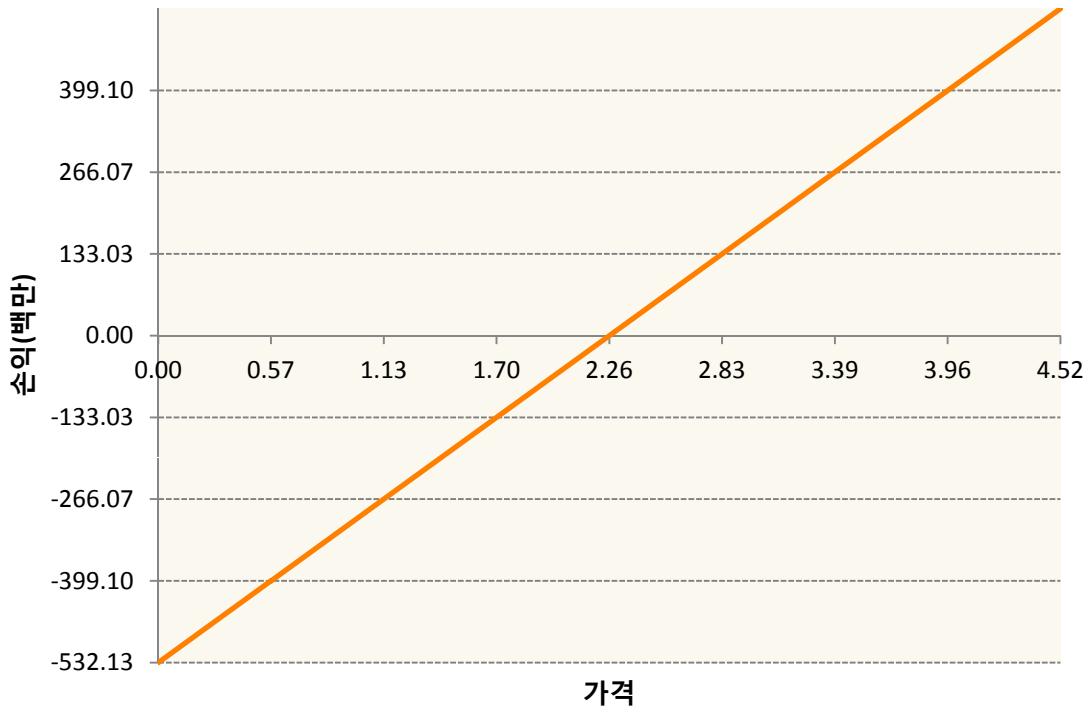


COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18

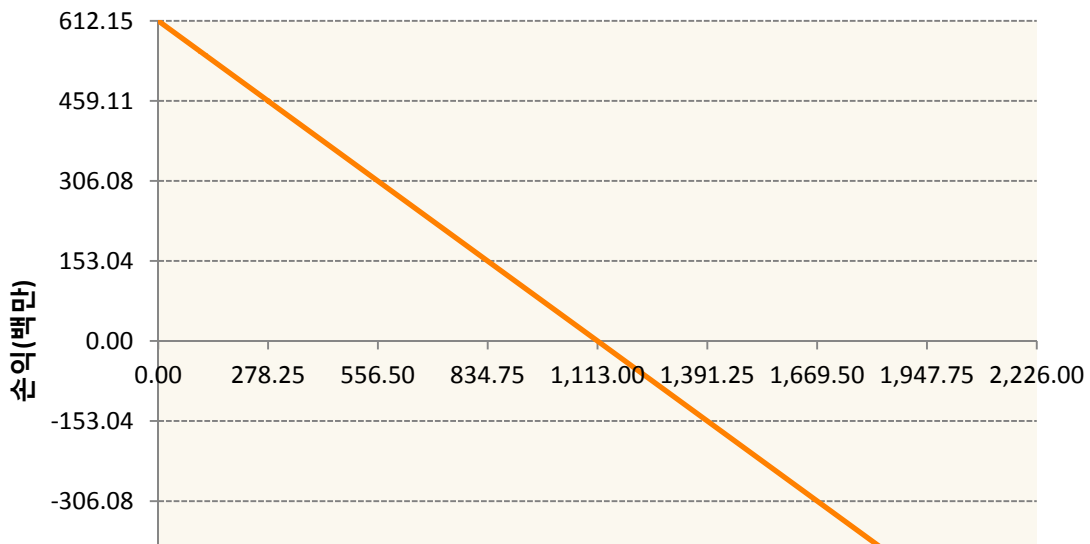


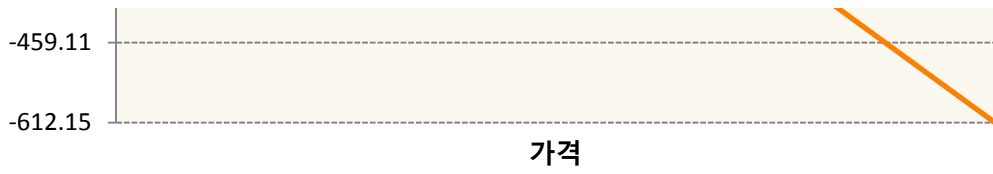


HOX8-Heating Oil



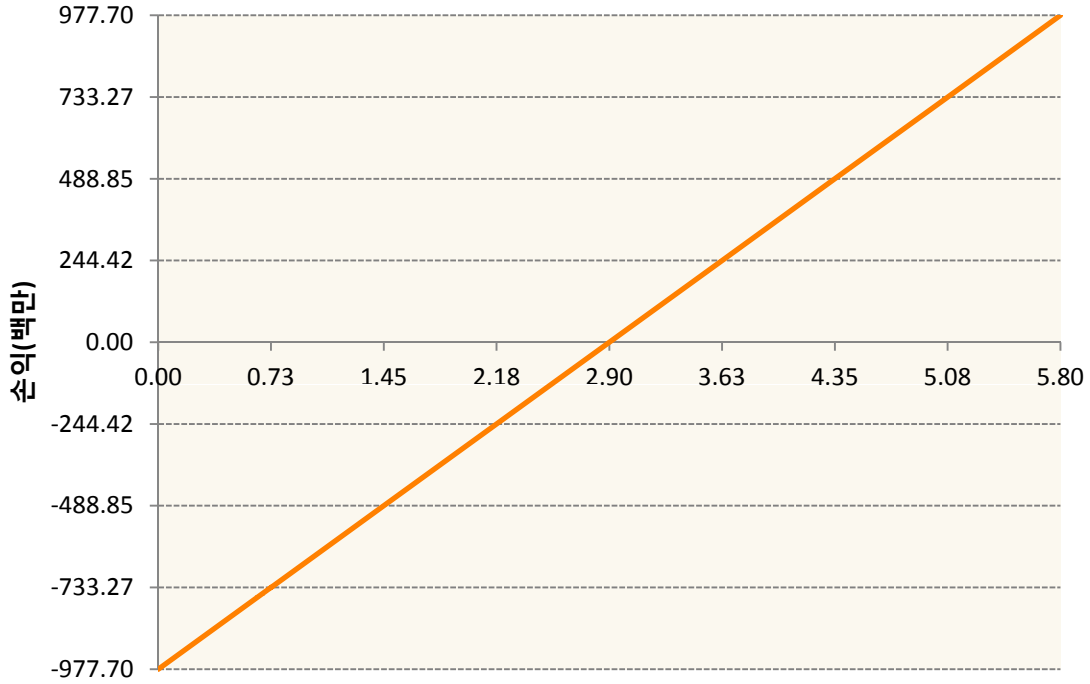
KR4175N90000-2018-09 달러선물





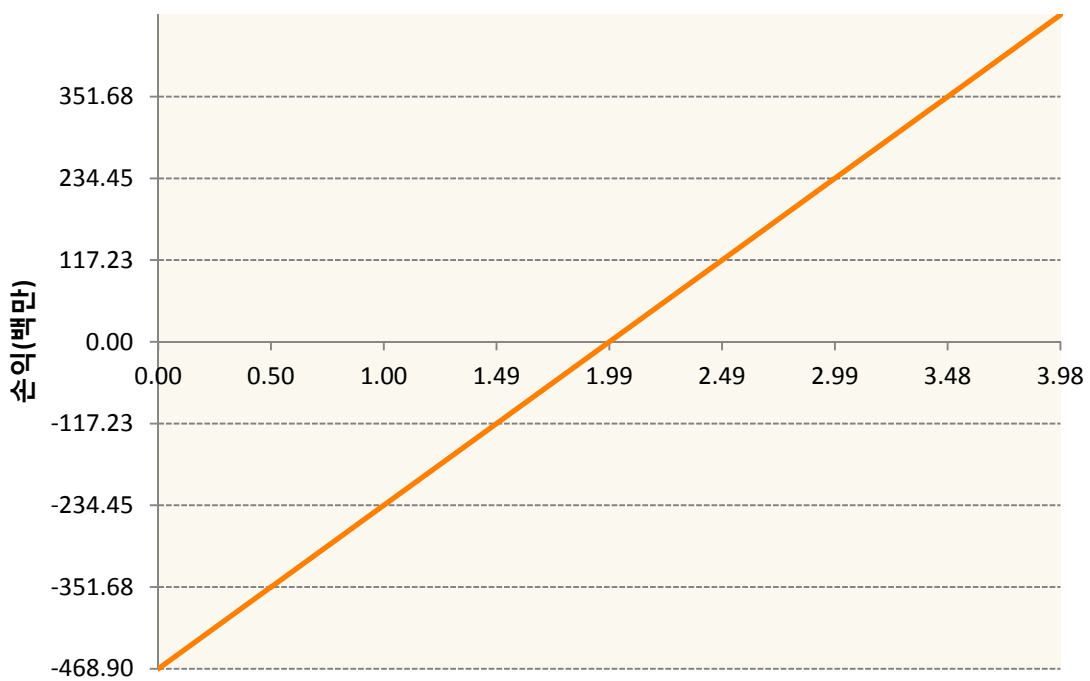
가격

**NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18**



가격

**XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18**



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	63
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	77
HOX8	Heating Oil	43
	KR4175N90C 2018-09 달러선물	49
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	78
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	38

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	447

공시일	2018-09-03
기준일	2018-08-31

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

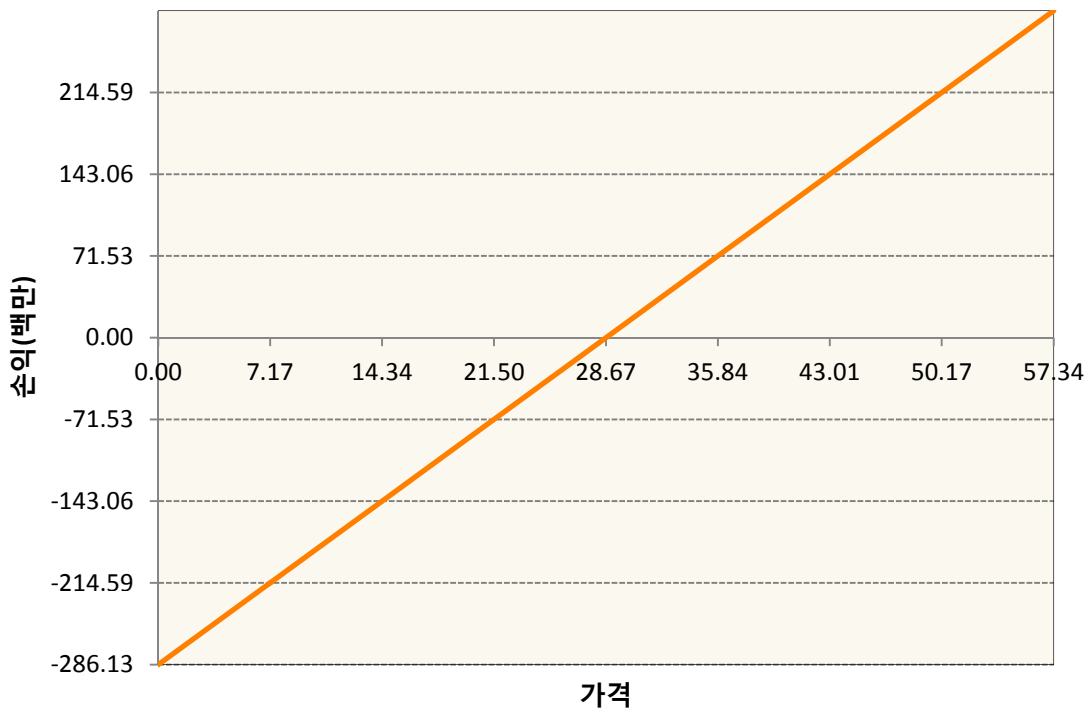
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

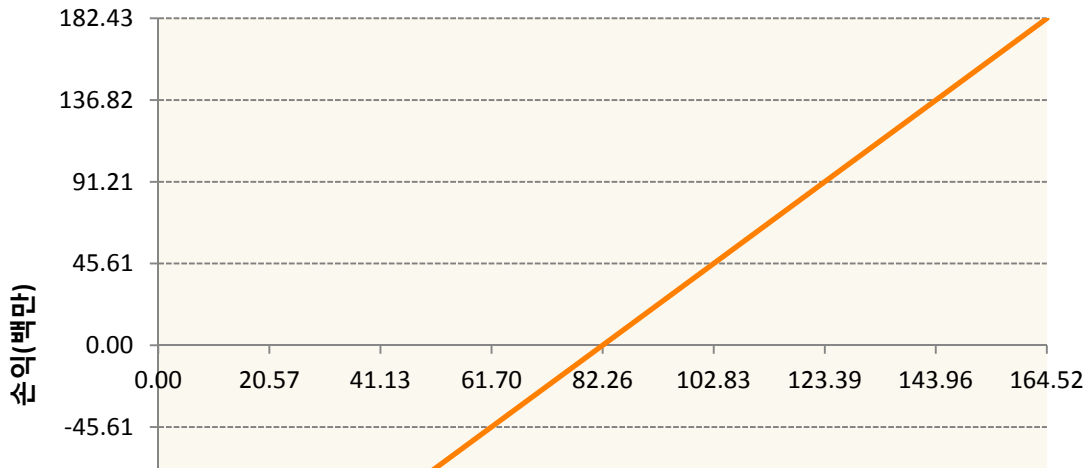
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,580	78	3,502	

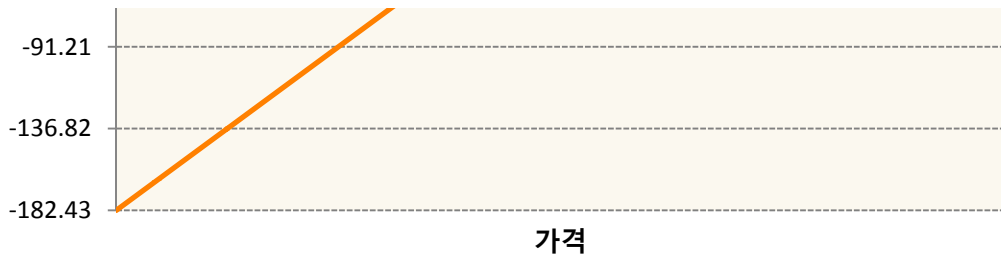
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18**

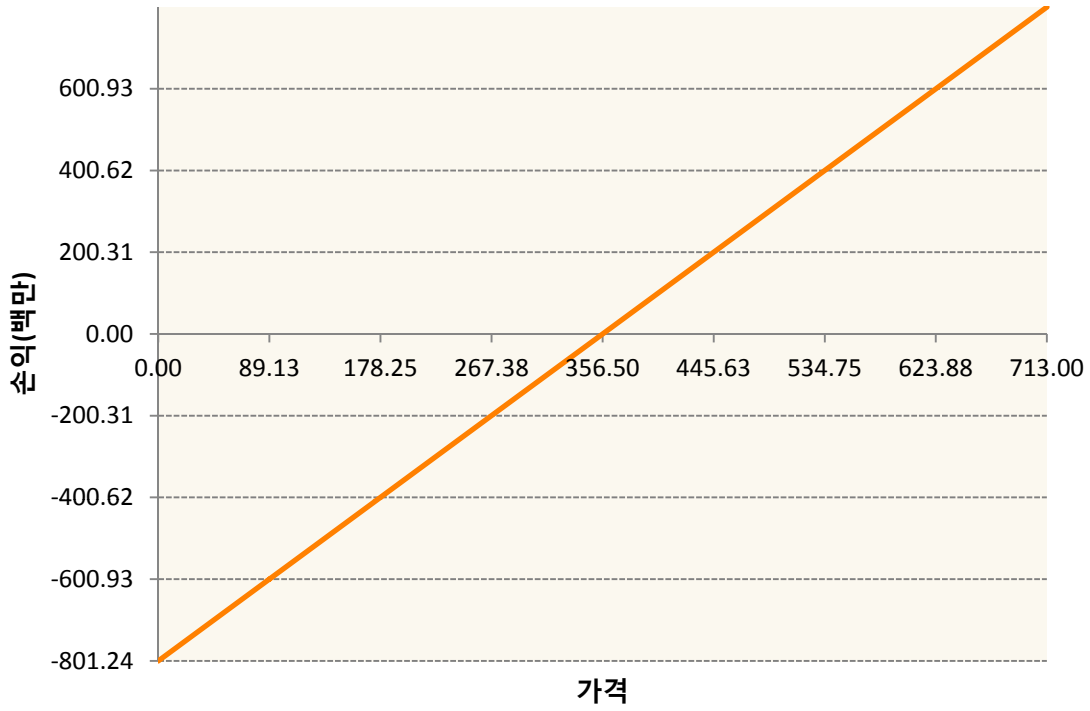


**CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18**

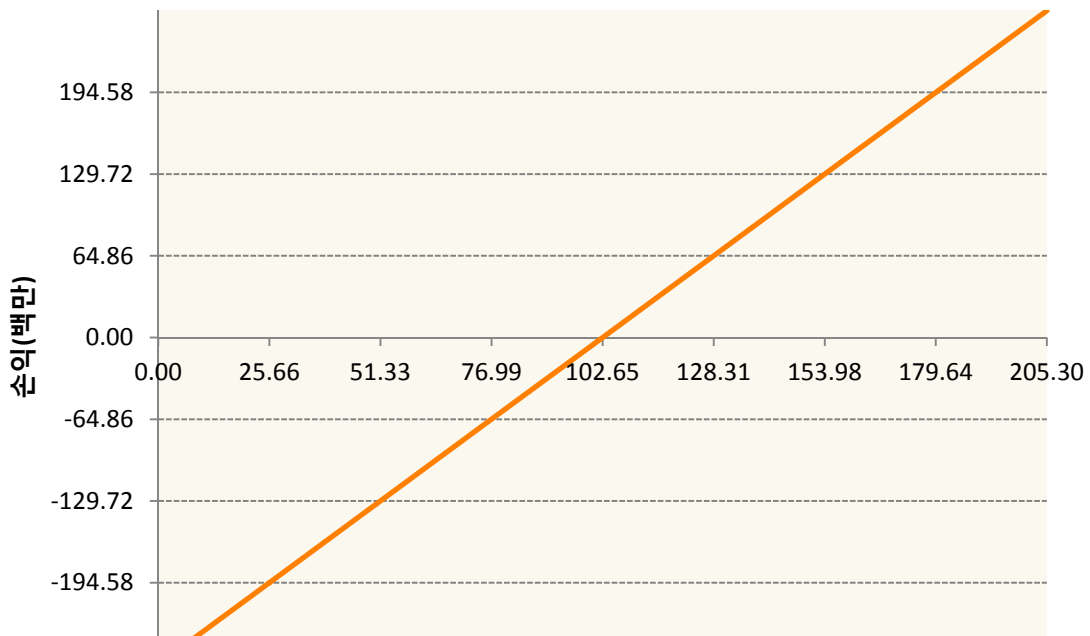


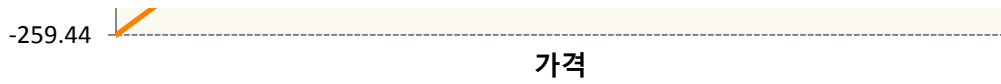


**CZ8-CORN FUTURE DEC18**

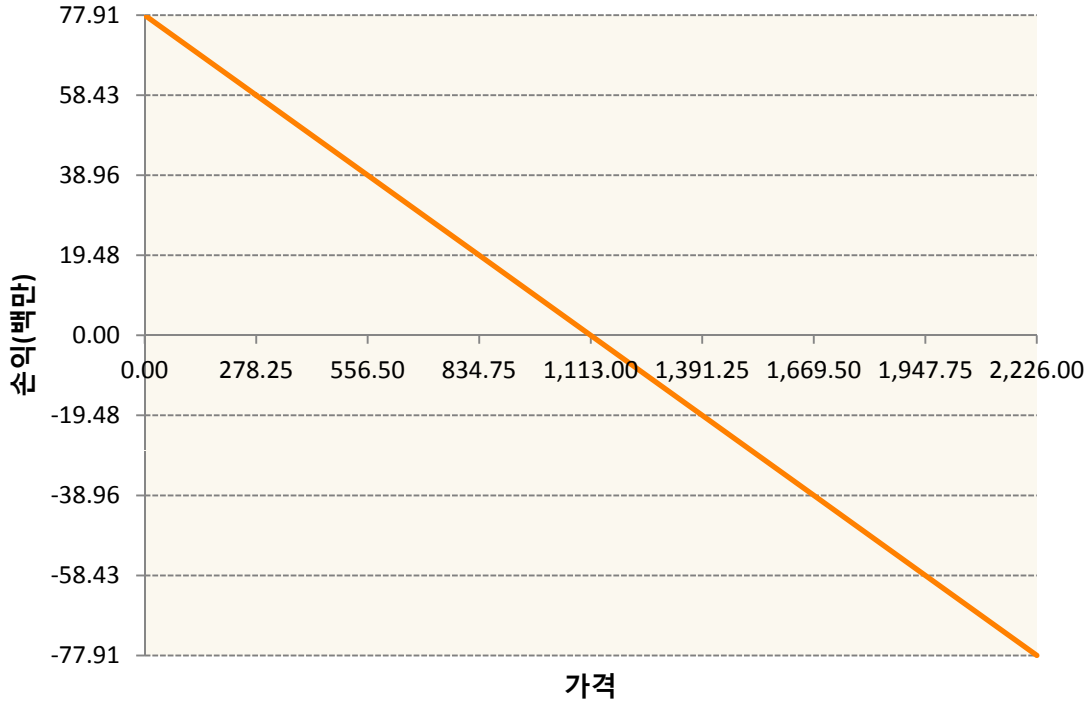


**KCZ8-COFFEE 'C' FUTURE Dec18**

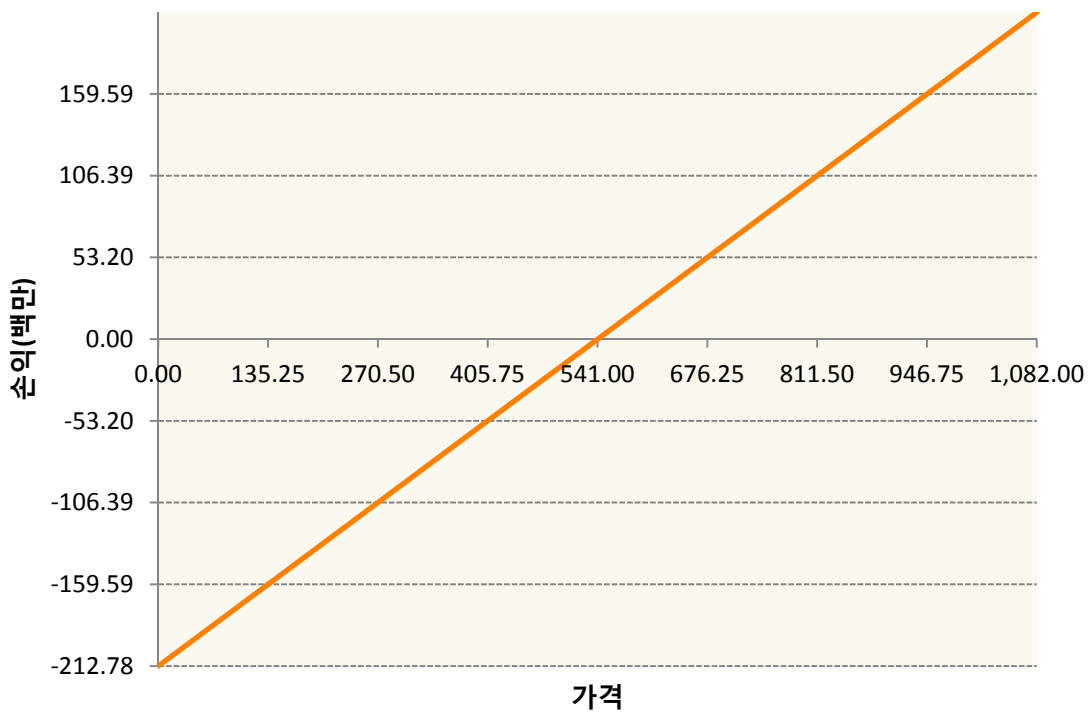




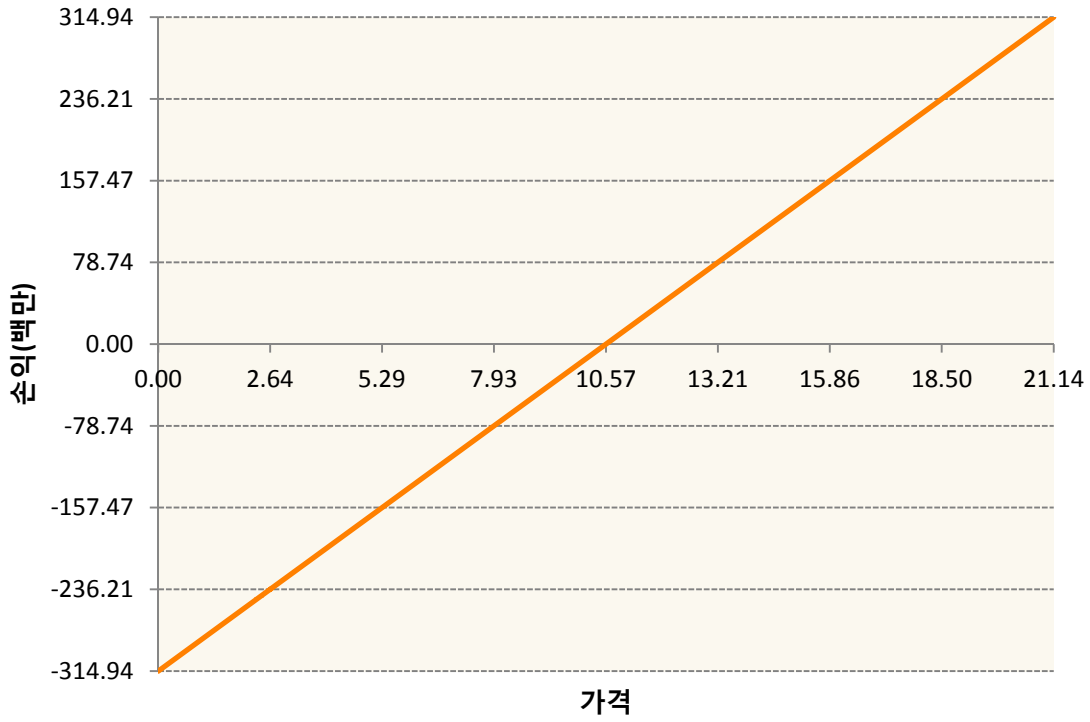
**KR4175N90000-2018-09 달러선물**



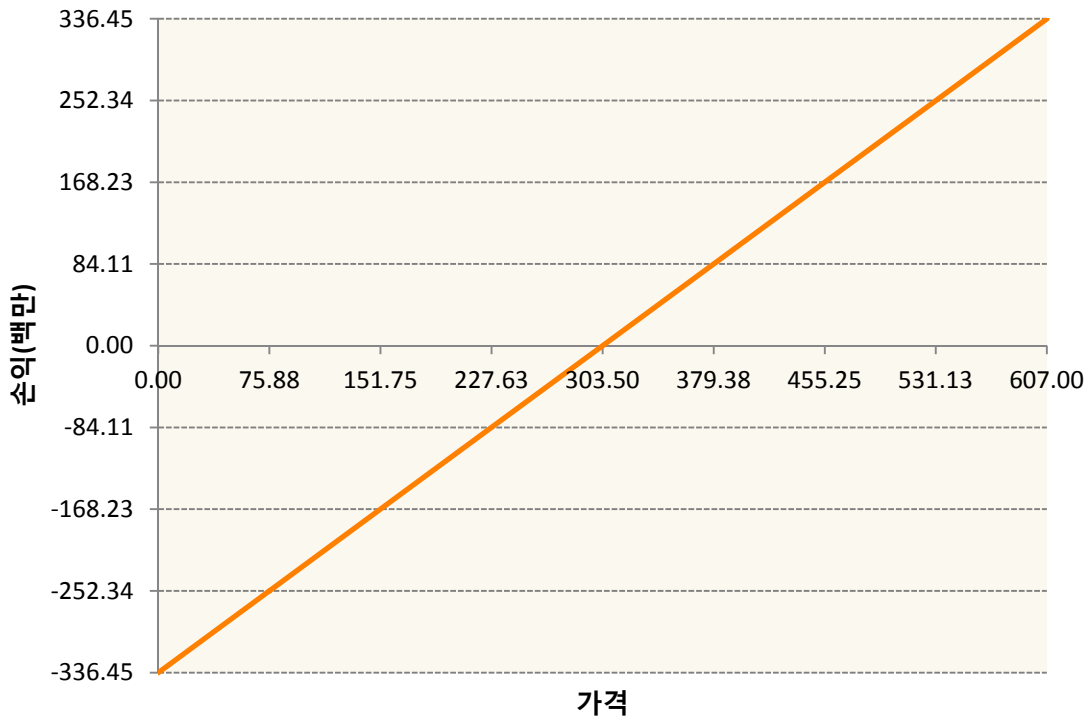
**KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18**



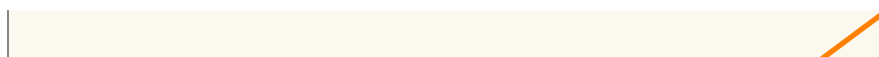
SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

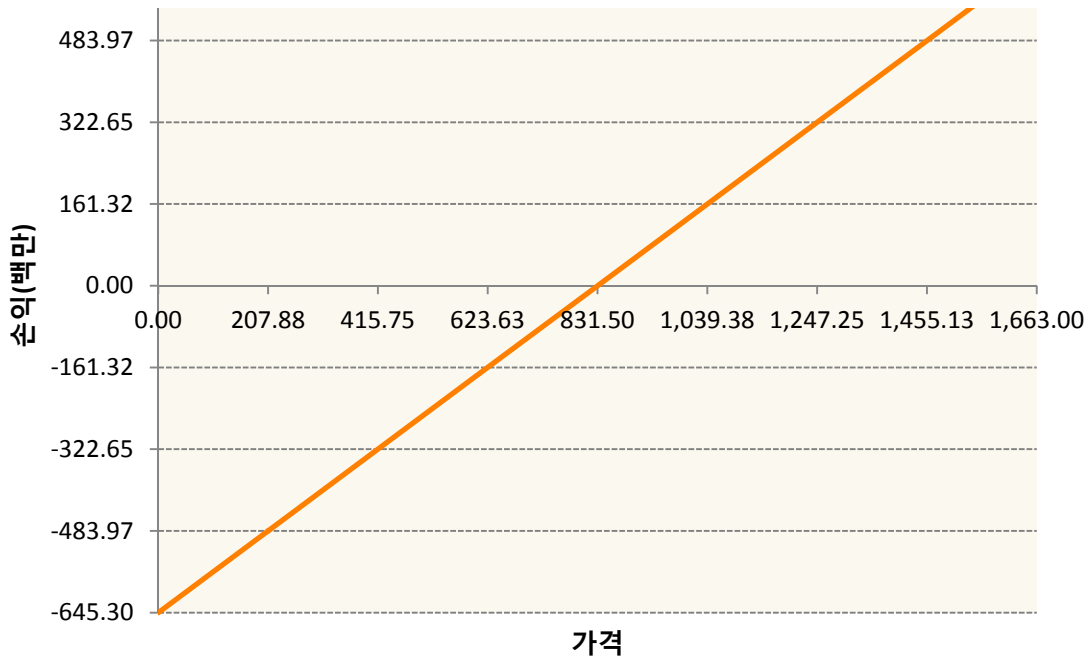


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

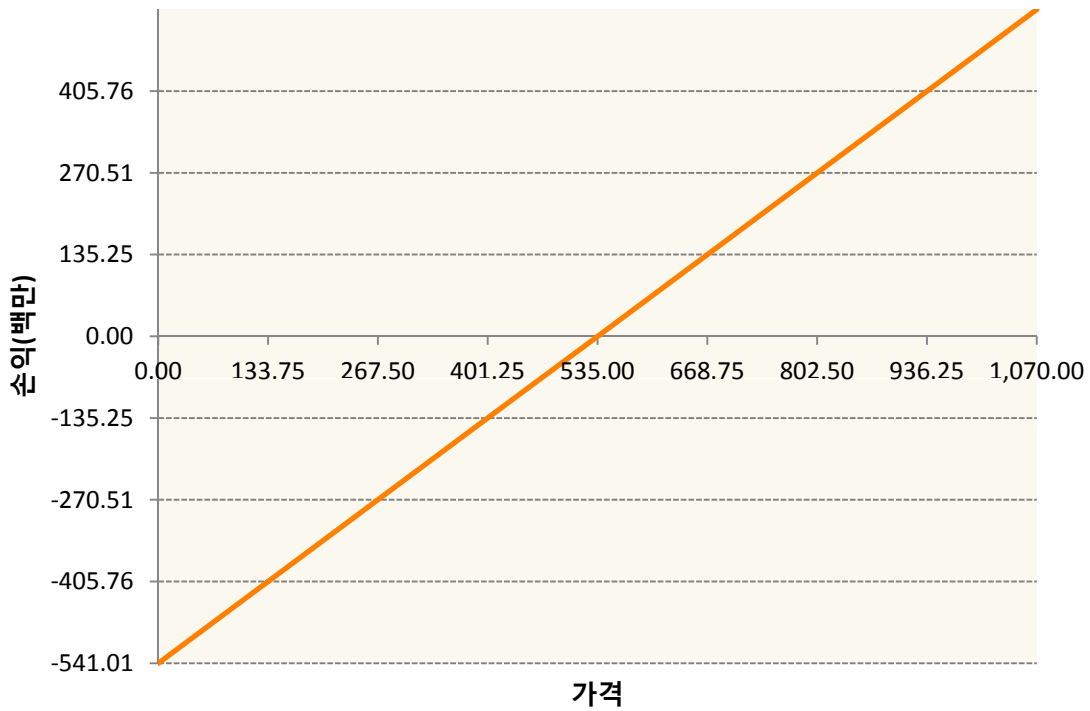


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





WZ8-WHEAT FUTURE(CBT) DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	23
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	15
CZ8	CORN FUTURE DEC18	64
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	21
KR4175N90C	2018-09 달러선물	6

KWZ8	KC HRW WHEAT FUT DEC18	17
SBV8	SUGAR #11 (WORLD) OCT18	25
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	27
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	52
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	43

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

(단위:백만원)

**308**