

공시일	2018-09-07
기준일	2018-09-06

## 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	2018-09-07
기준일	2018-09-06

## 스마트인덱스모

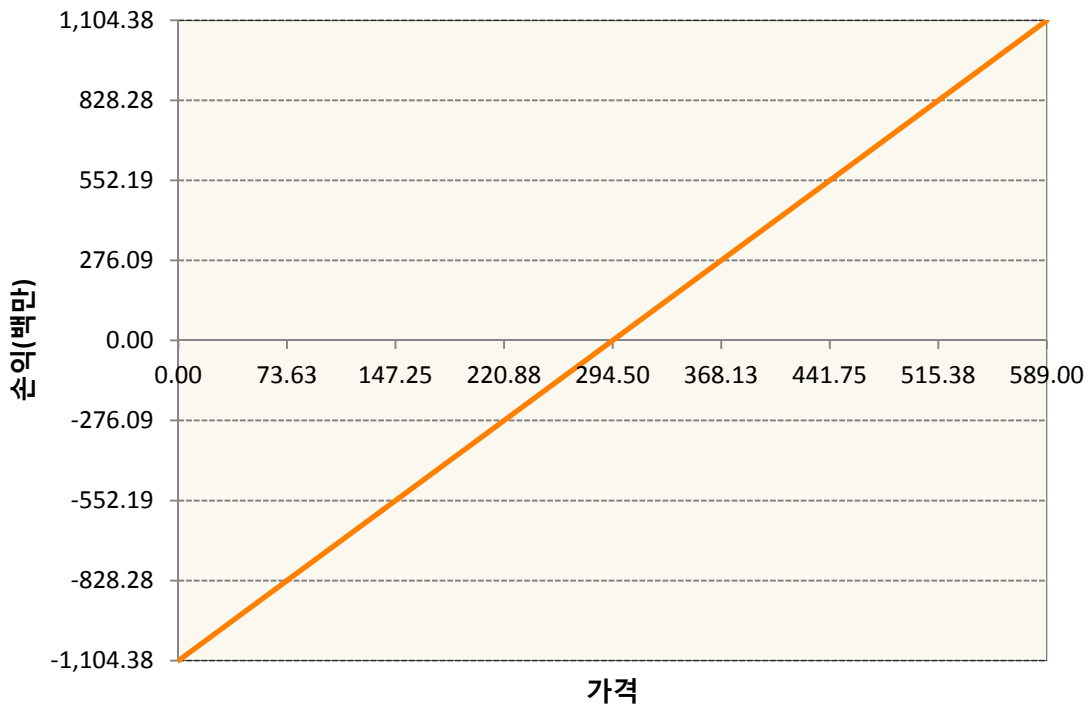
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,104	0	1,104	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물

88

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-5.33%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
-2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	29	29	29	29	29	29	29
5.33%	59	59	59	59	59	59	59
8.00%	88	88	88	88	88	88	88

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

(단위:백만원)

67

공시일	2018-09-07
기준일	2018-09-06

## 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

1,142

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

488

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-07
기준일	2018-09-06

## 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	4,755	0	4,755	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

#### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI500000 신한CSI500미래S180608

295

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

373

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-07
기준일	2018-09-06

## 유로인덱스모(주식-파생형)

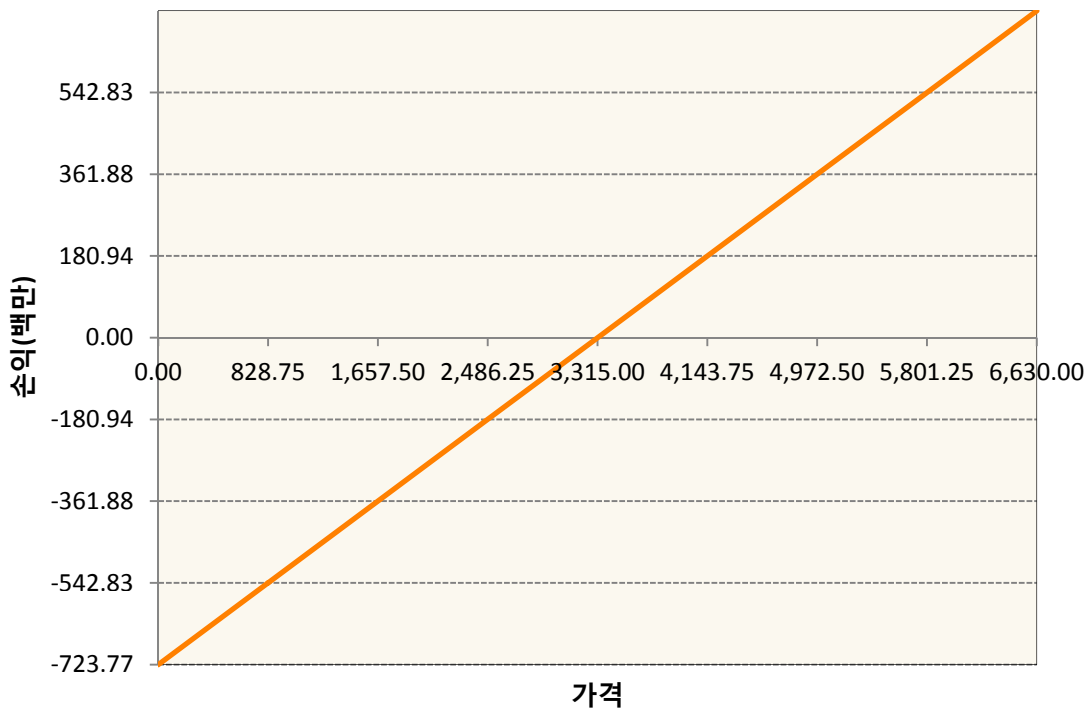
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	724	0	724	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGU8-EURO STOXXX 50 SEP18



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU8	EURO STOXXX 50 SEP18	58
------	----------------------	----

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

(단위:백만원)

36
----

공시일	2018-09-07
기준일	2018-09-06

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

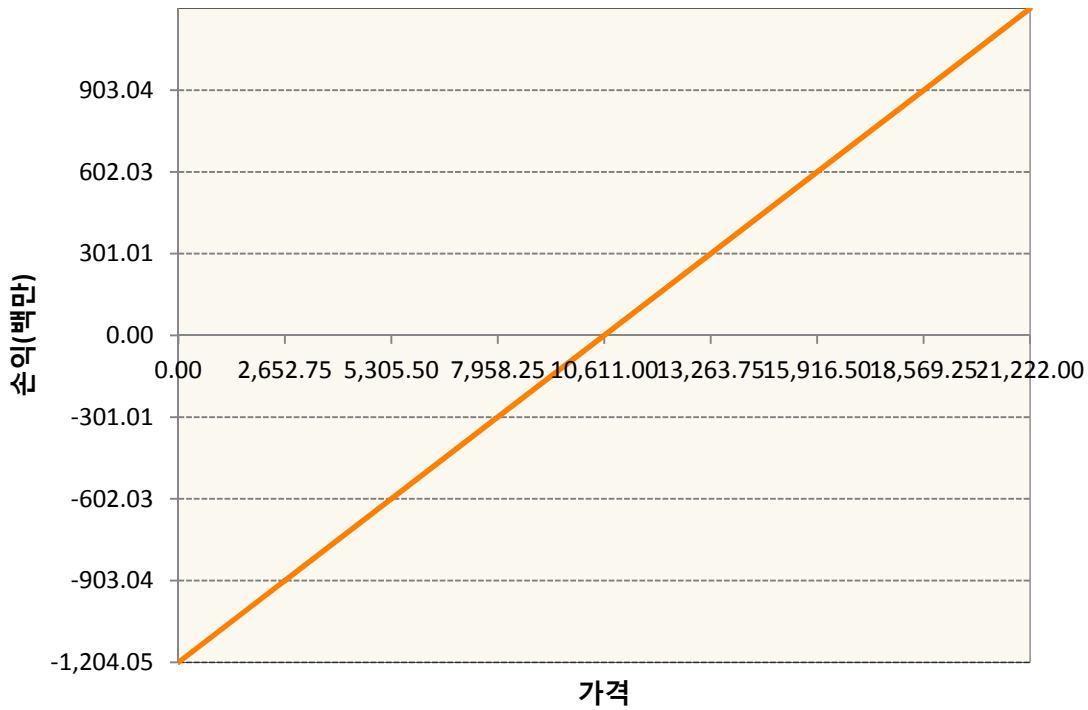
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

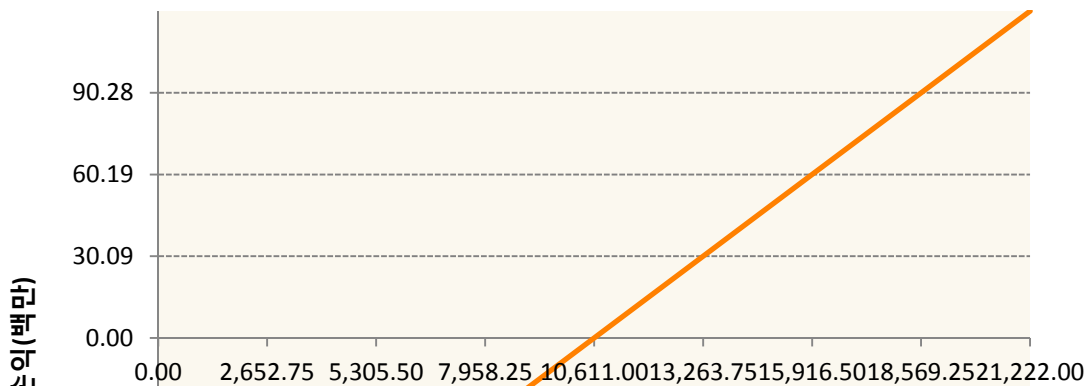
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	120	0	120	
누계	유가증권	선물	1,204	0	1,204	장내

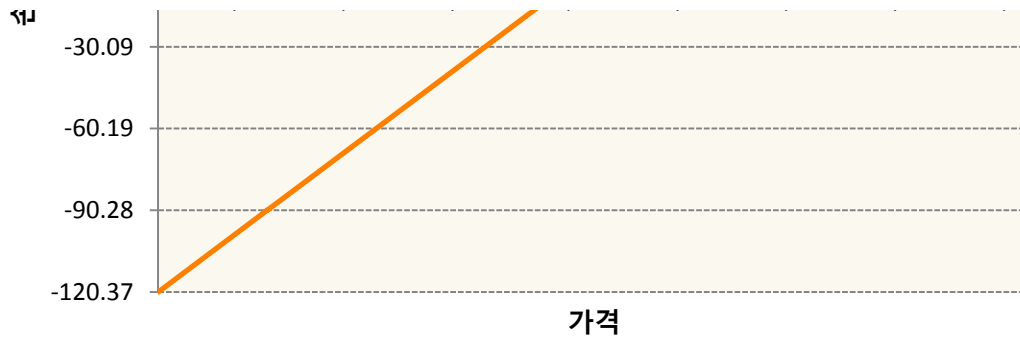
### 2. 만기시점의 손익구조

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	96
MHCU8	MINI H-SHR IDX Fut Sep18	10

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

<b>97</b>
-----------

공시일	2018-09-07
기준일	2018-09-06

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

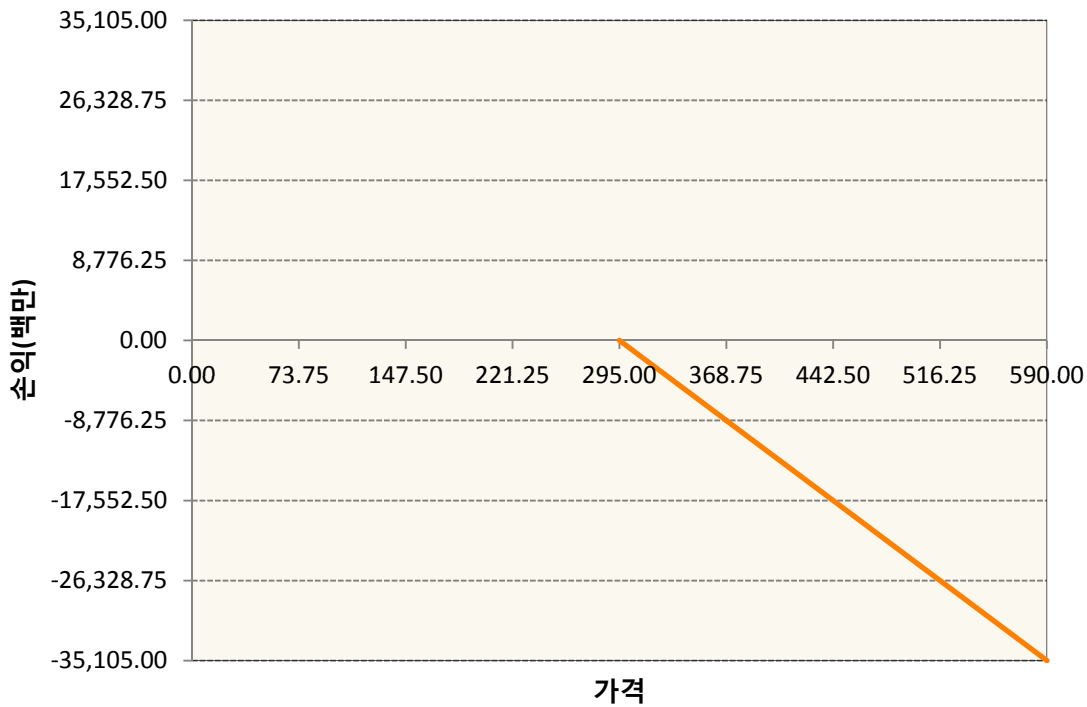
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

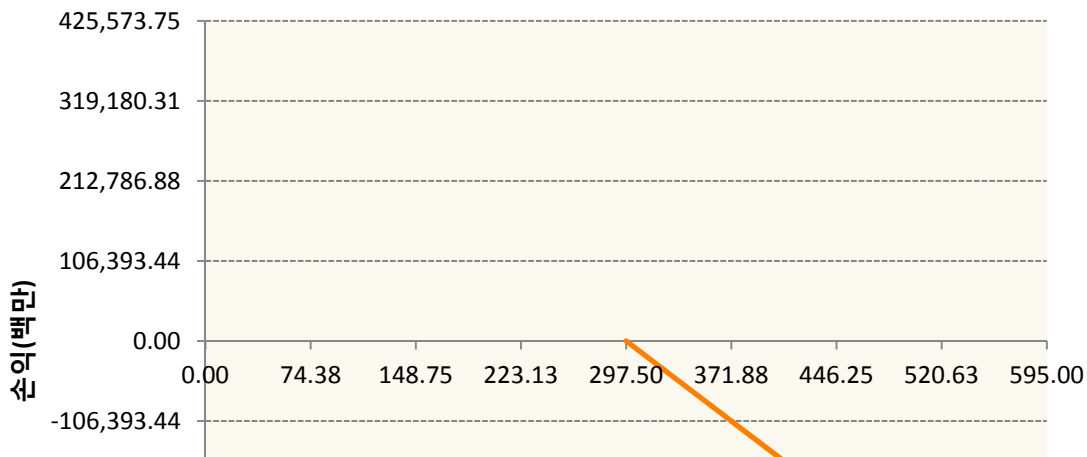
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	758,179	-758,179	장내

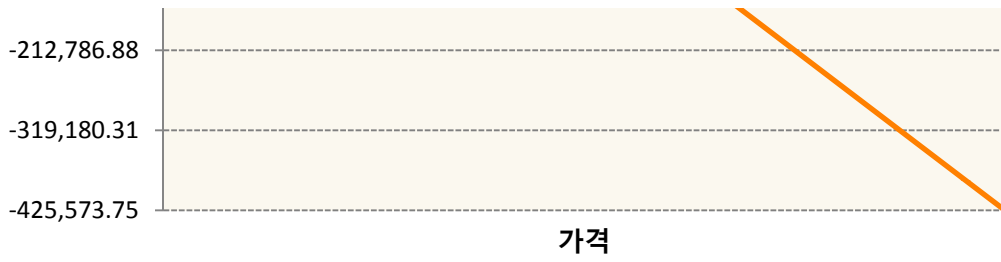
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92950-2018-09 콜295

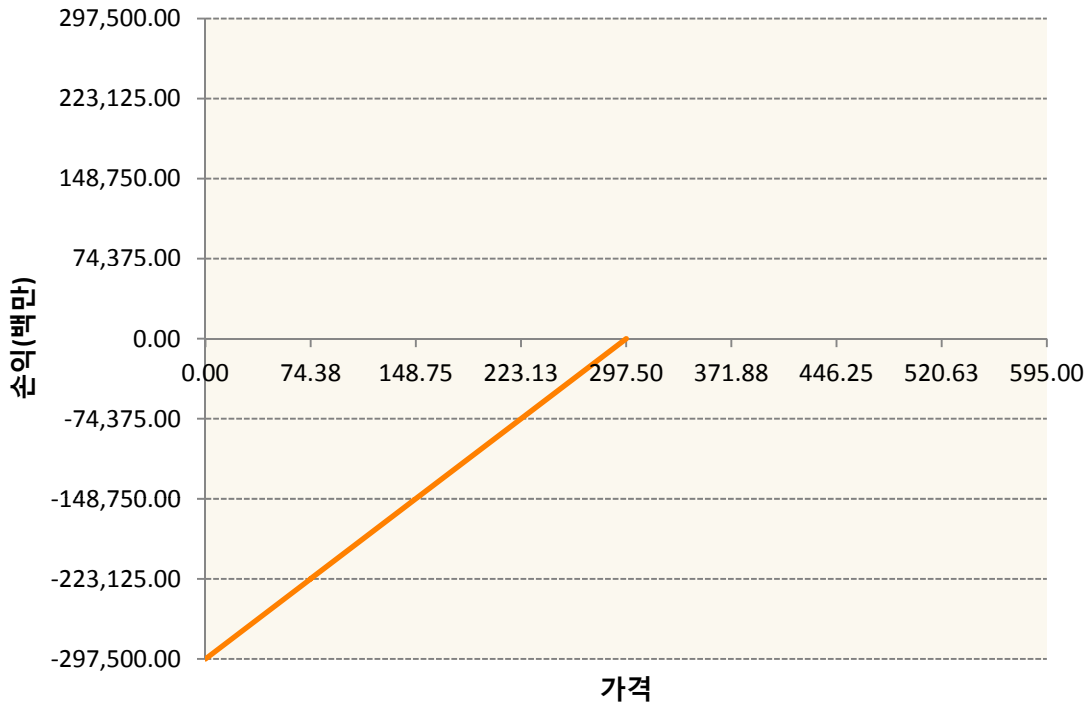


KR4201N92976-2018-09 콜297.5





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N929 2018-09 콜295

2,273

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	480	479	478	475	472	466	459
-5.33%	473	466	457	445	431	414	395
-2.67%	407	381	352	322	290	256	221
0%	130	87	43	0	-43	-87	-130
2.67%	-475	-507	-541	-576	-613	-651	-689
5.33%	-1,315	-1,326	-1,340	-1,357	-1,377	-1,400	-1,424
8.00%	-2,234	-2,236	-2,239	-2,244	-2,251	-2,261	-2,273

KR4201N929 2018-09 풋297.5

25,500

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,261	4,258	4,250	4,234	4,207	4,166	4,109

-5.33%	4,225	4,181	4,114	4,019	3,896	3,745	3,568
-2.67%	3,788	3,561	3,296	3,001	2,679	2,334	1,969
0%	1,490	999	502	0	-505	-1,014	-1,524
2.67%	-4,529	-4,994	-5,472	-5,958	-6,450	-6,949	-7,452
5.33%	-13,934	-14,140	-14,386	-14,666	-14,976	-15,312	-15,669
8.00%	-24,805	-24,850	-24,922	-25,022	-25,152	-25,312	-25,500
KR4301N929 2018-09 풋 297.5							22,736
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,736	-22,736	-22,736	-22,736	-22,736	-22,736	-22,736
-5.33%	-14,892	-14,892	-14,892	-14,892	-14,892	-14,892	-14,893
-2.67%	-7,049	-7,052	-7,059	-7,070	-7,087	-7,111	-7,141
0%	384	263	134	0	-139	-282	-428
2.67%	3,821	3,732	3,632	3,522	3,405	3,281	3,152
5.33%	4,037	4,035	4,031	4,024	4,011	3,994	3,970
8.00%	4,038	4,038	4,038	4,038	4,037	4,037	4,036

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

(단위:백만원)

60,308

공시일	2018-09-07
기준일	2018-09-06

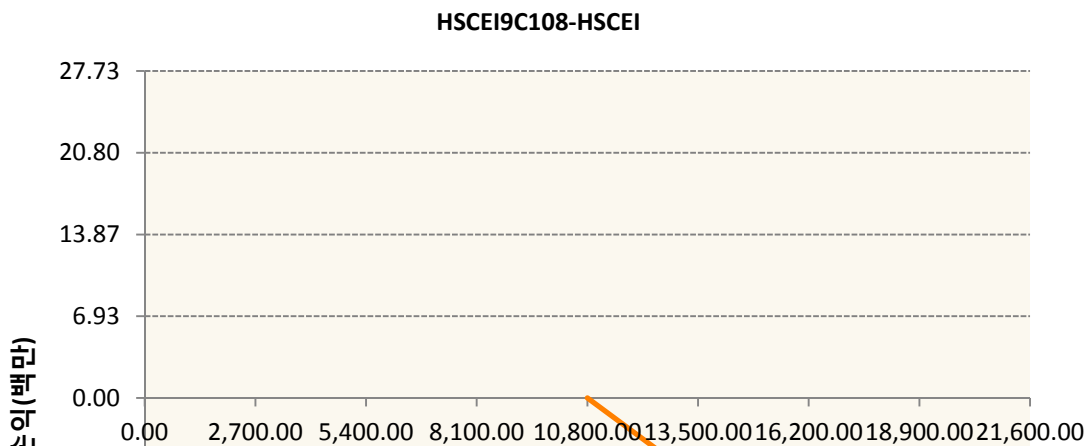
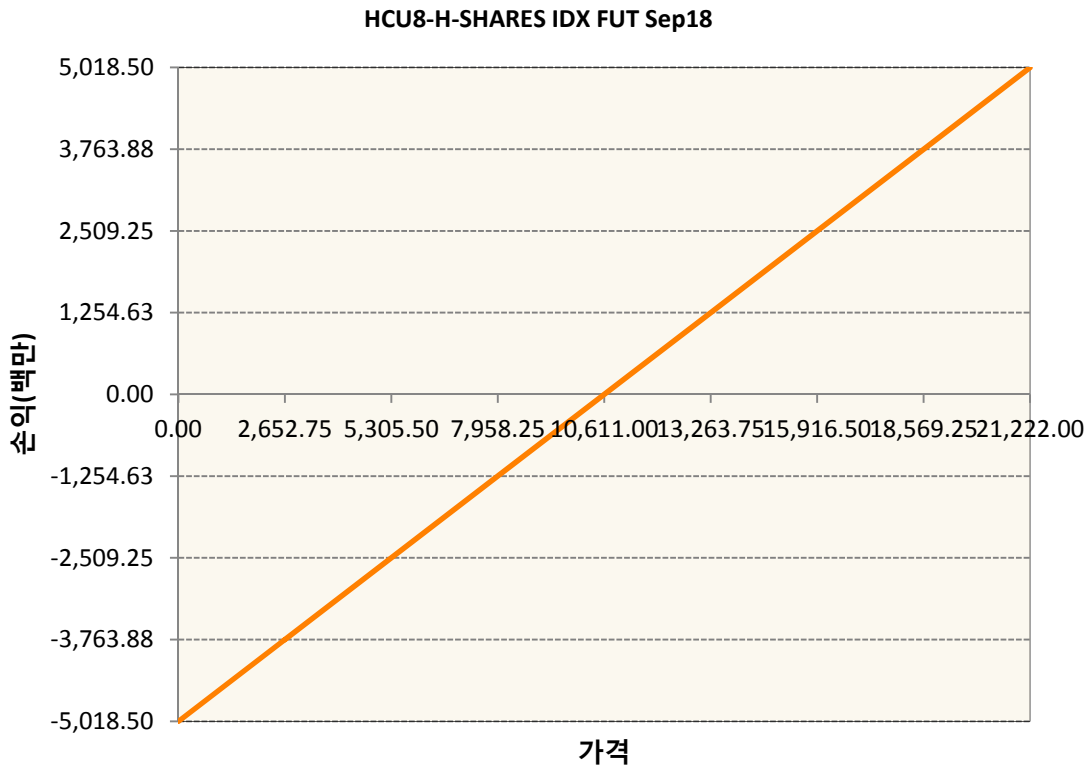
## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

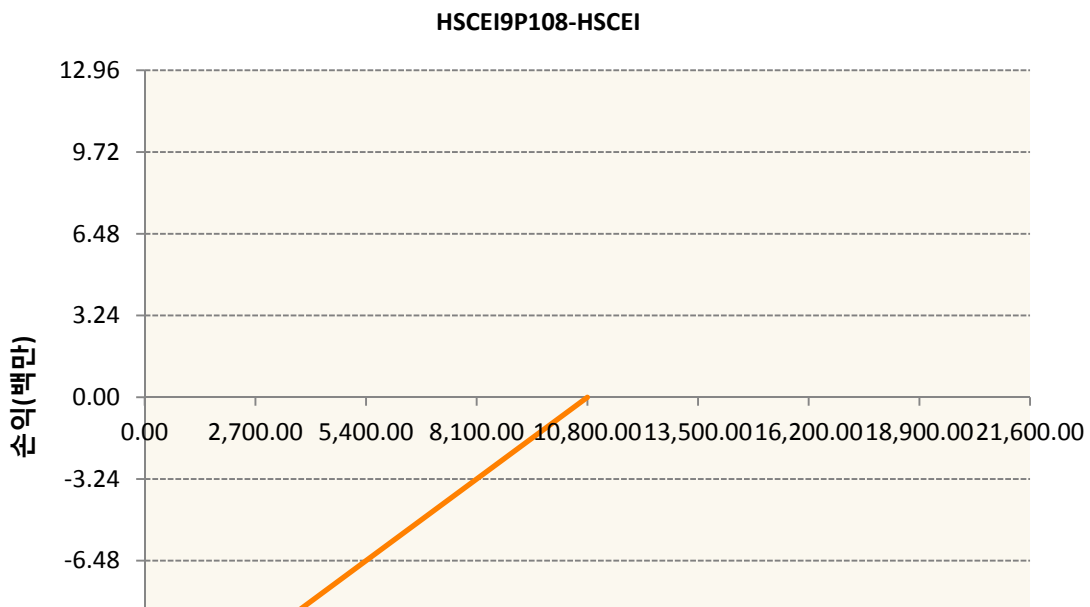
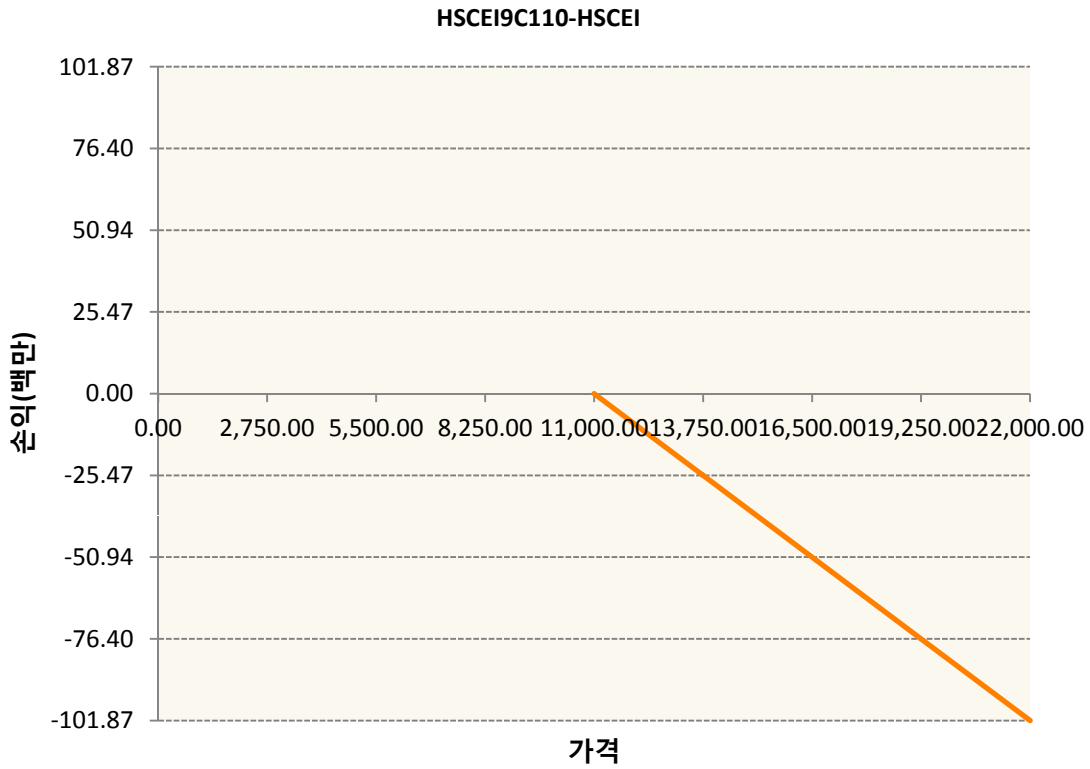
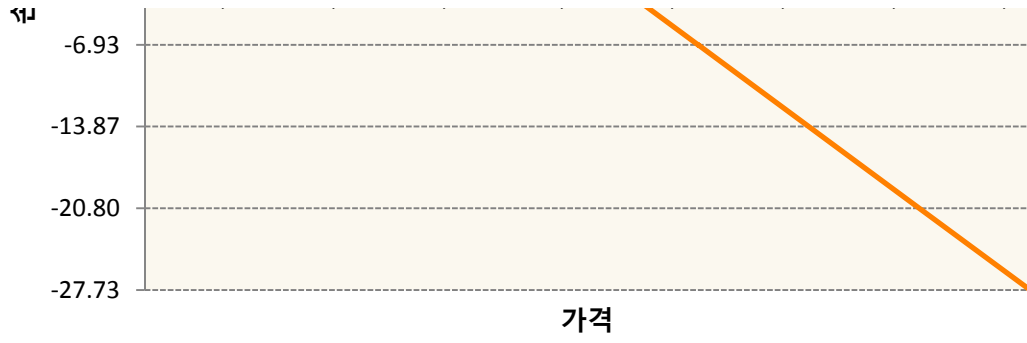
### 1. 계약금액

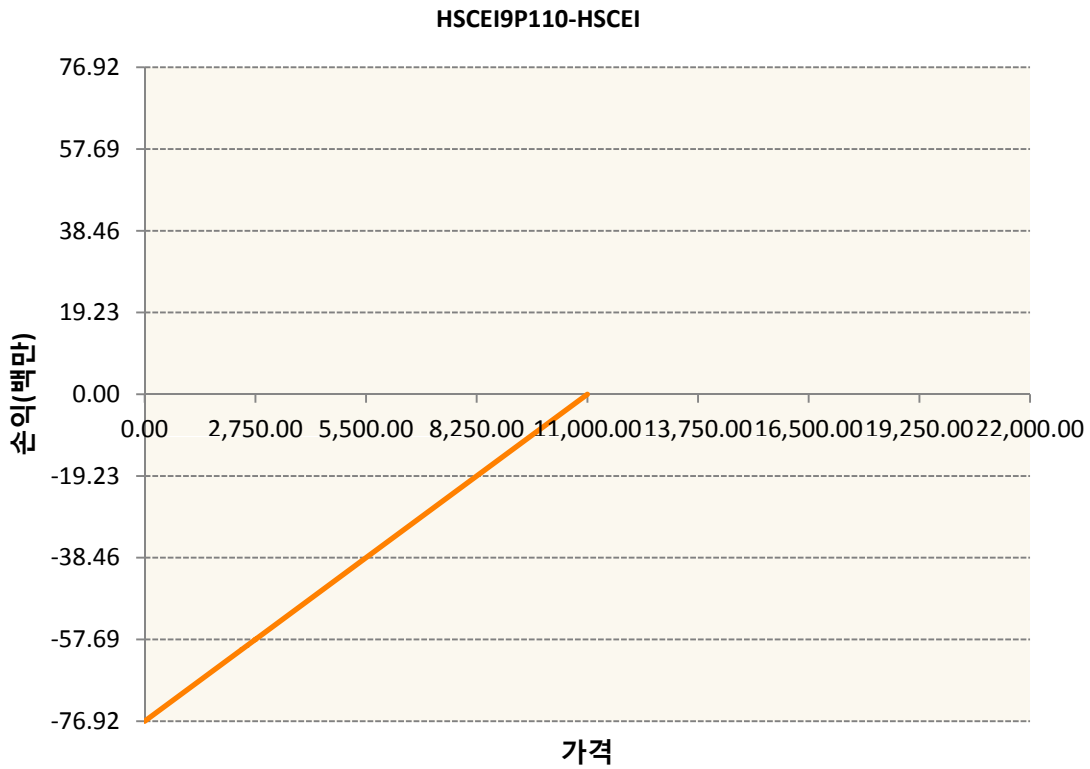
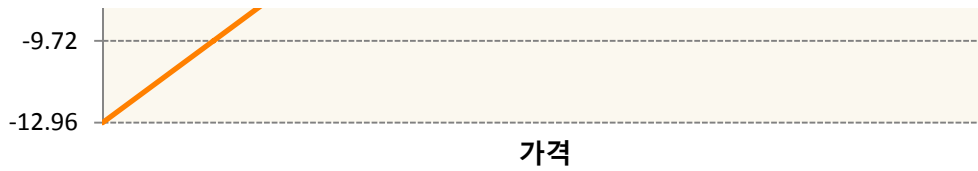
(단위:백만원)

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	5,019	0	5,019	장내
누계	유가증권	옵션	0	219	-219	장내

### 2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU8	H-SHARES IDX FUT Sep18	401
HSCEI9C108	HSCEI	2
HSCEI9C110	HSCEI	8
HSCEI9P108	HSCEI	1
HSCEI9P110	HSCEI	6

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	384

공시일	2018-09-07
기준일	2018-09-06

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

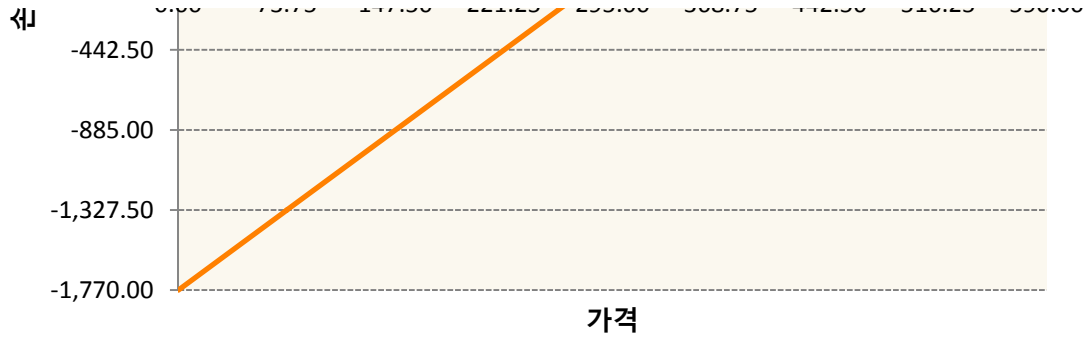
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92976-2018-09 콜297.5

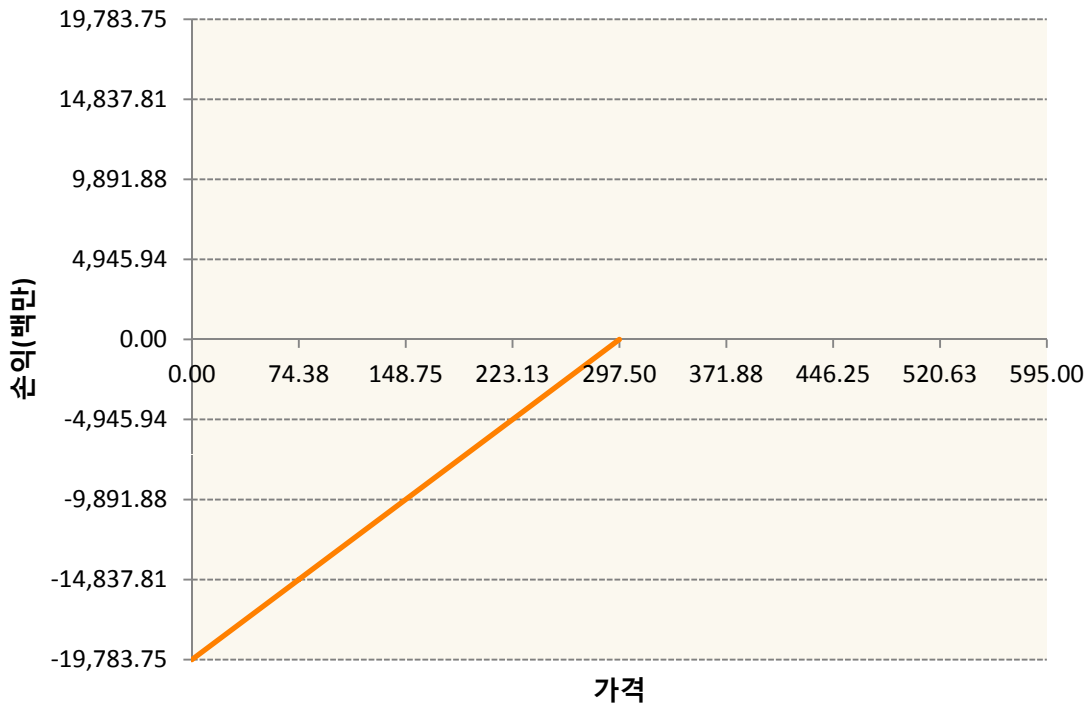


KR4301N92958-2018-09 풋295





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,979
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,979	-3,979	-3,979	-3,979	-3,979	-3,979	-3,979
-5.33%	-2,653	-2,653	-2,653	-2,653	-2,653	-2,653	-2,653
-2.67%	-1,326	-1,326	-1,326	-1,326	-1,326	-1,326	-1,326
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,326	1,326	1,326	1,326	1,326	1,326	1,326
5.33%	2,653	2,653	2,653	2,653	2,653	2,653	2,653
8.00%	3,979	3,979	3,979	3,979	3,979	3,979	3,979
KR4201N92974-2018-09 풋297.5							1,685
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	281	281	281	280	278	275	271
-5.33%	279	276	272	265	257	247	236
-2.67%	250	235	218	198	177	154	130
0%	98	66	33	0	-33	-67	-101
2.67%	-299	-330	-361	-394	-426	-459	-492
5.33%	-920	-934	-950	-969	-989	-1,011	-1,035
8.00%	-1,639	-1,642	-1,646	-1,653	-1,662	-1,672	-1,685

KR4301N929 2018-09 풋295

131

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-5.33%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
-2.67%	-37	-37	-37	-38	-38	-38	-39
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	14	14	14	13	13	12	12
5.33%	14	14	14	14	14	14	14
8.00%	14	14	14	14	14	14	14

KR4301N929 2018-09 풋297.5

1,512

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,512	-1,512	-1,512	-1,512	-1,512	-1,512	-1,512
-5.33%	-990	-990	-990	-990	-990	-990	-990
-2.67%	-469	-469	-469	-470	-471	-473	-475
0%	26	17	9	0	-9	-19	-28
2.67%	254	248	242	234	226	218	210
5.33%	268	268	268	268	267	266	264
8.00%	269	269	269	269	268	268	268

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

(단위:백만원)

7,996

공시일	2018-09-07
기준일	2018-09-06

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

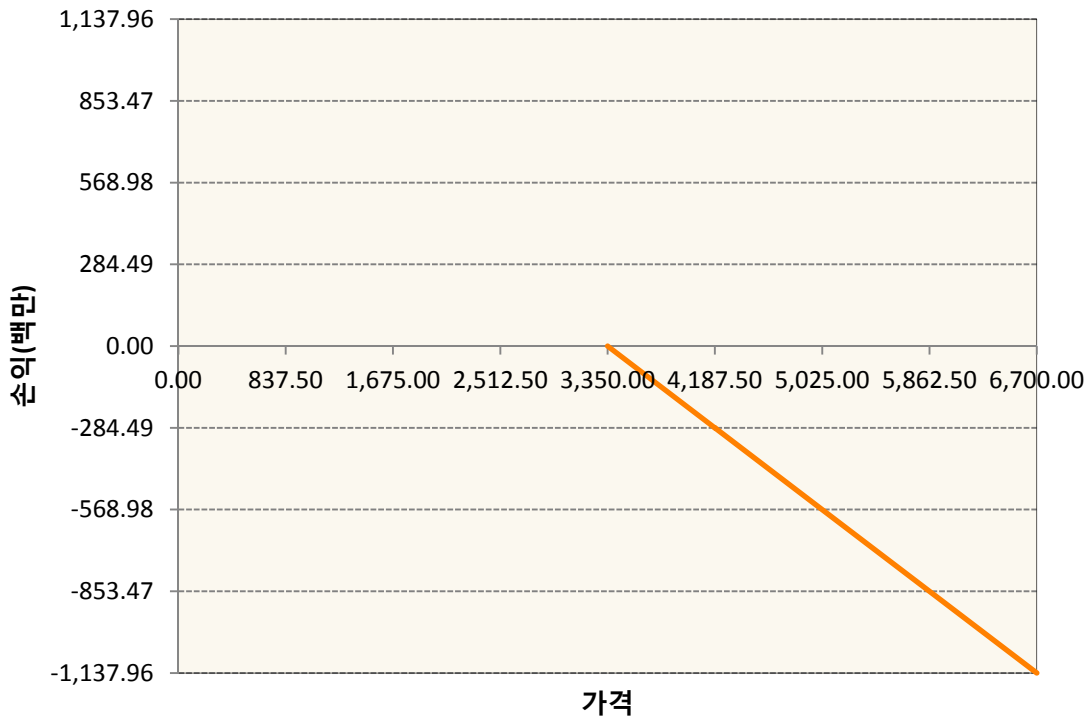
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

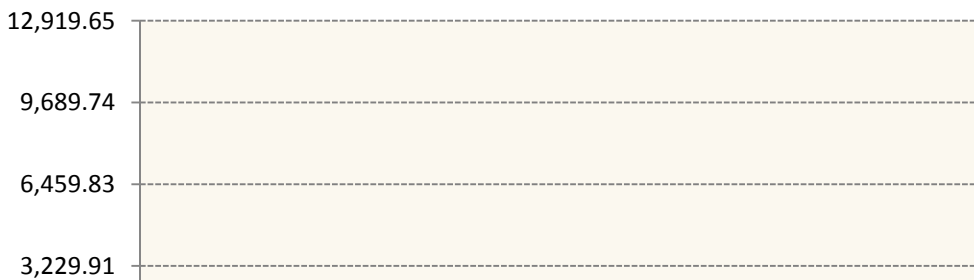
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,841	0	6,841	
누계	유가증권	옵션	0	28,115	-28,115	장내
누계	지수	스왑	87,540	0	87,540	장외

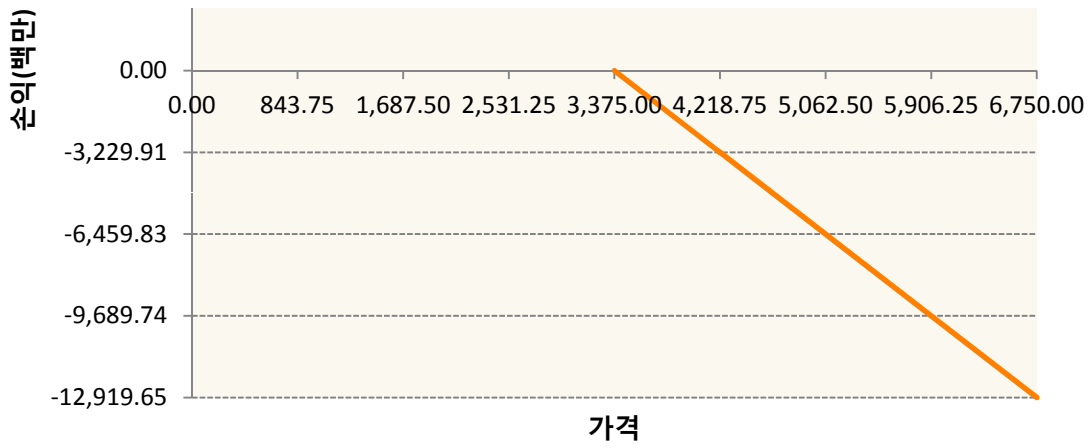
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXU8-C3350-EURO STOXX 50**

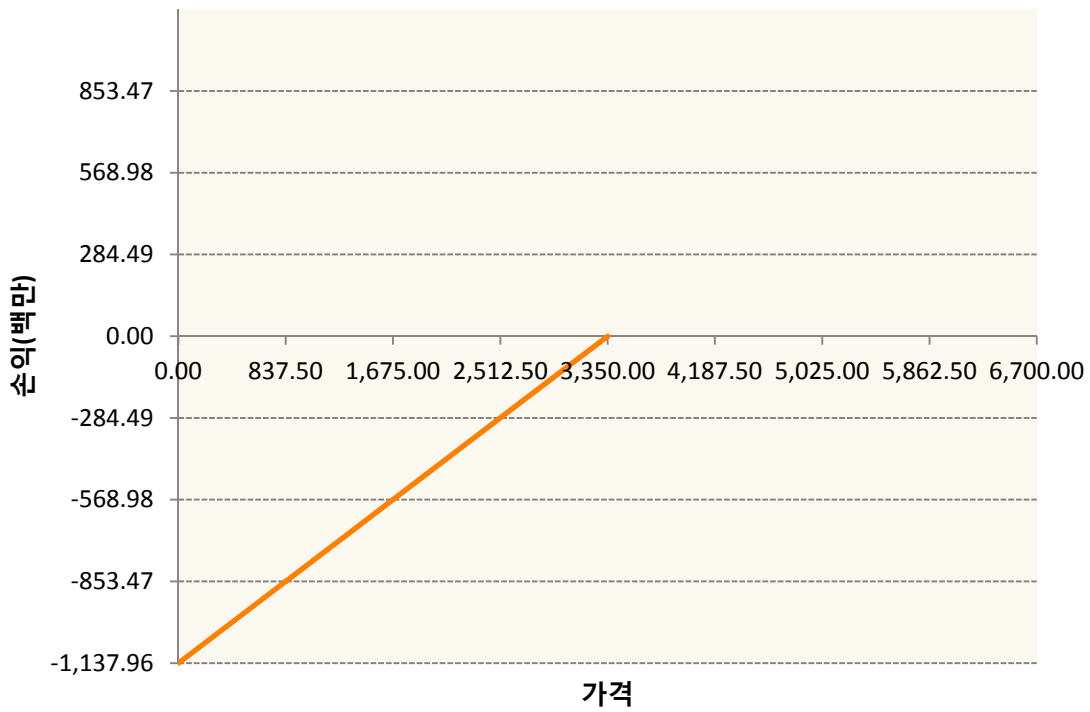


**OESXU8-C3375-EURO STOXX 50**

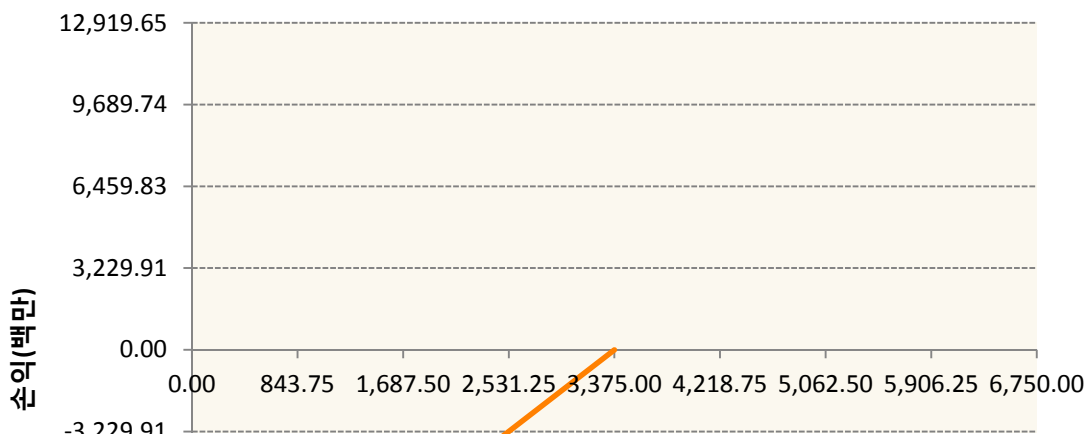


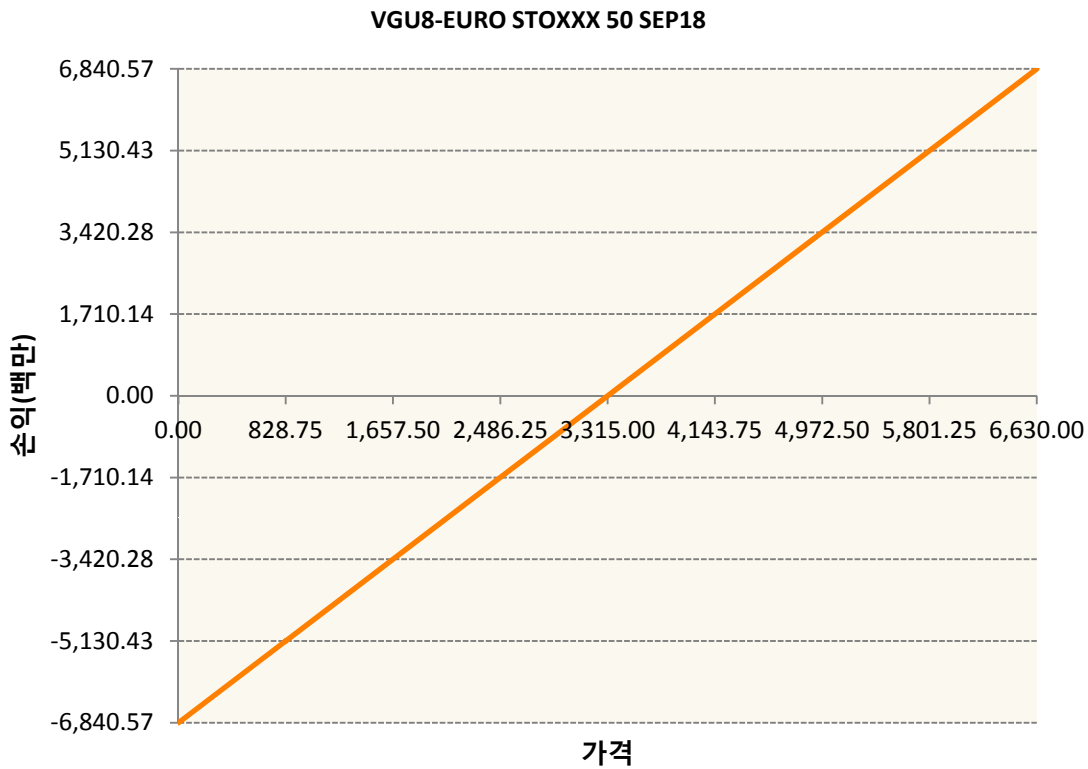
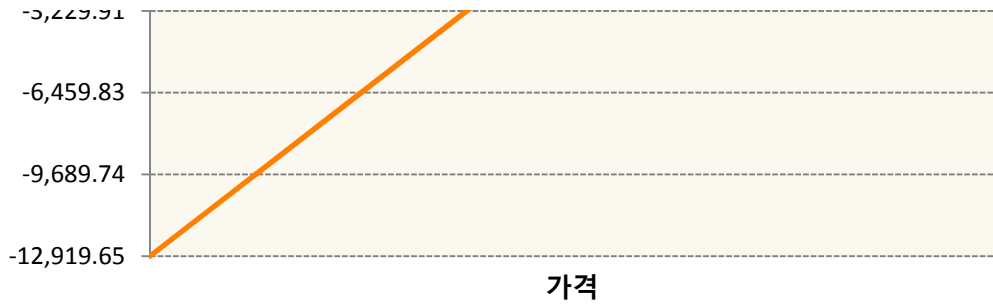


OESXU8-P3350-EURO STOXX 50



OESXU8-P3375-EURO STOXX 50





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

260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	77
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY	50
OESXU8-C33 EURO STOXX 50	91
OESXU8-C33 EURO STOXX 50	1,034
OESXU8-P33 EURO STOXX 50	91
OESXU8-P33 EURO STOXX 50	1,034
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18	547

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

<b>1,844</b>
--------------



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

(단위:백만원)

1,129



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

(단위:백만원)

89



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

(단위:백만원)

133



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

(단위:백만원)

165



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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-09-07
기준일	2018-09-06

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

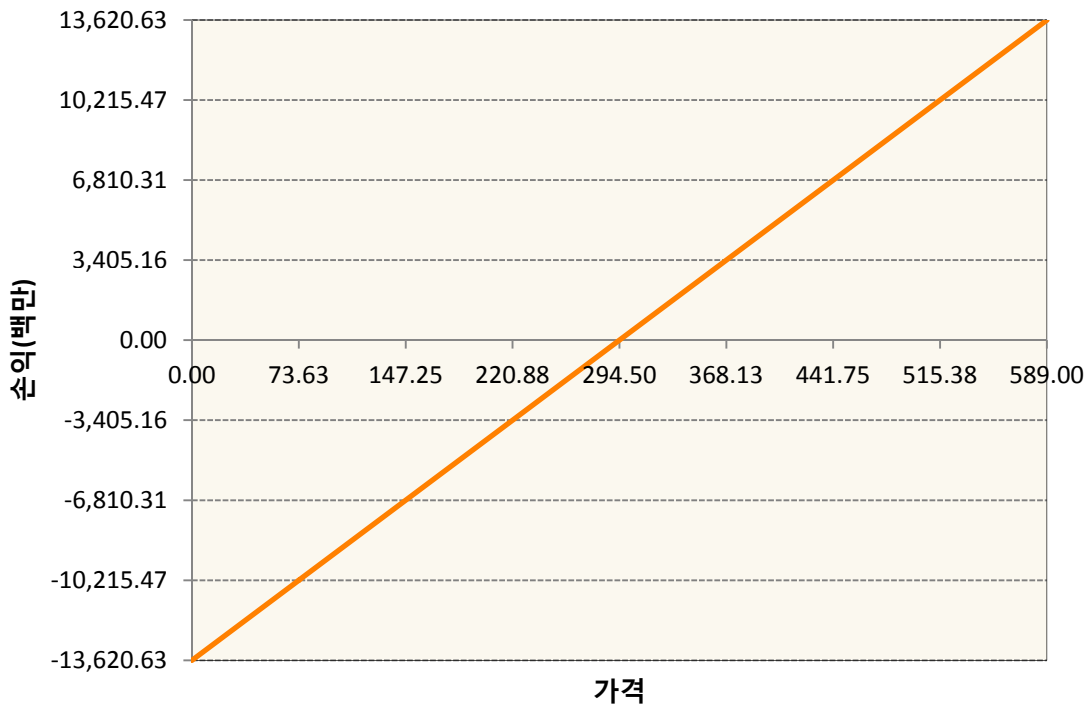
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

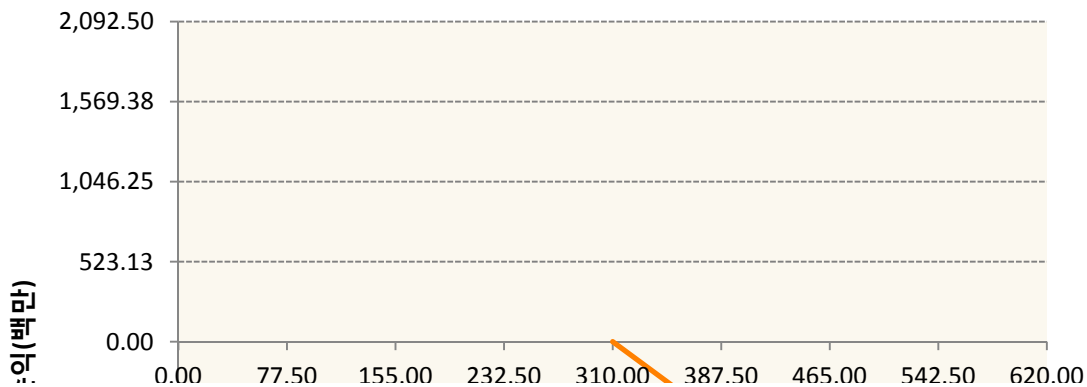
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,621	0	13,621	장내
누계	유가증권	옵션	1,339	24,671	-23,332	장내

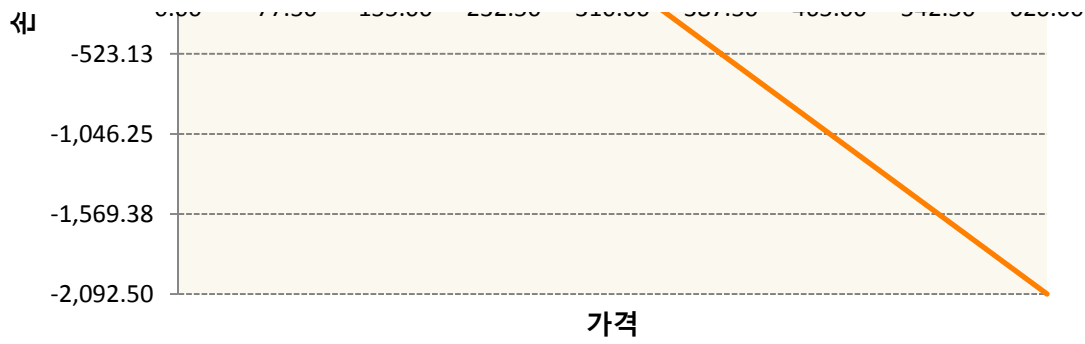
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

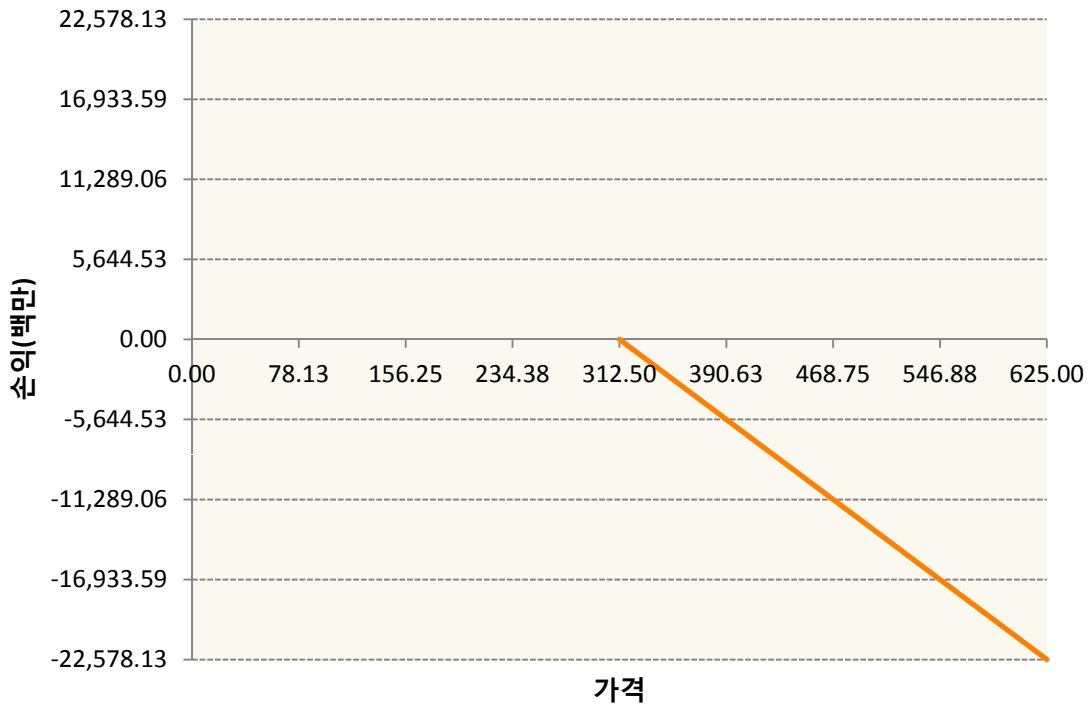


KR4201N93107-2018-09 콜310

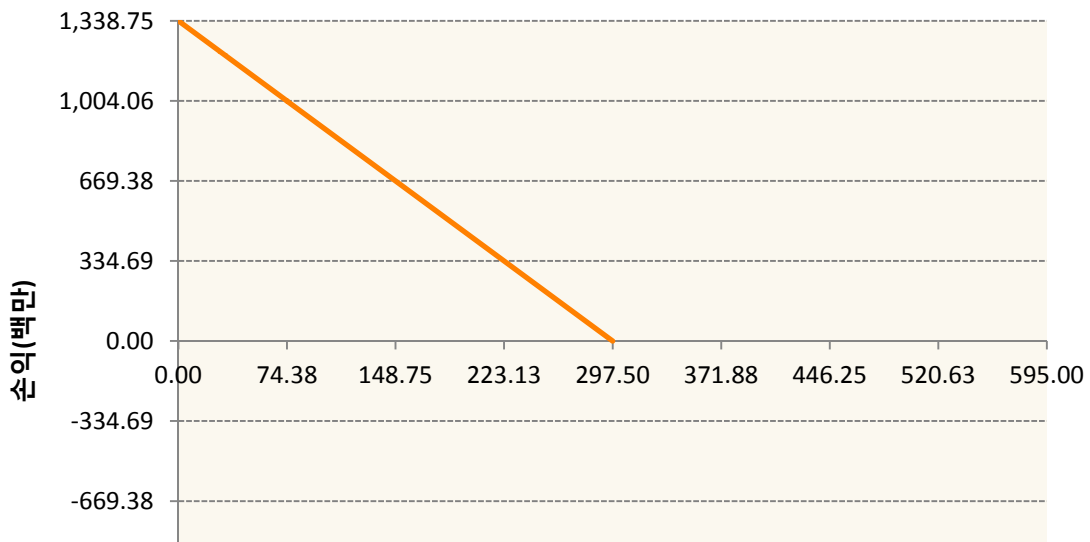


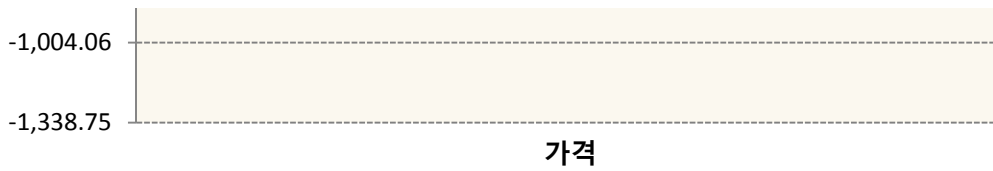


**KR4201N93123-2018-09 콜312.5**



**KR4301N92974-2018-09 풋297.5**





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

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물							1,089
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,089	-1,089	-1,089	-1,089	-1,089	-1,089	-1,089
-5.33%	-726	-726	-726	-726	-726	-726	-726
-2.67%	-363	-363	-363	-363	-363	-363	-363
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	363	363	363	363	363	363	363
5.33%	726	726	726	726	726	726	726
8.00%	1,089	1,089	1,089	1,089	1,089	1,089	1,089
KR4201N9312018-09 콜310							68
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3	3	3	3	3	3	3
-5.33%	3	3	3	3	3	3	2
-2.67%	3	3	3	2	2	2	1
0%	2	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	-3	-5	-6	-8	-10	-13	-15
5.33%	-20	-23	-26	-28	-31	-33	-36
8.00%	-56	-58	-60	-62	-64	-66	-68
KR4201N9312018-09 콜312.5							624
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19	19	19	19	19	19	18
-5.33%	19	19	19	18	18	17	16
-2.67%	18	18	17	16	14	11	6
0%	15	12	7	0	-8	-18	-29
2.67%	-16	-30	-46	-64	-83	-103	-124
5.33%	-151	-178	-205	-233	-260	-287	-315
8.00%	-472	-496	-521	-546	-572	-598	-624
KR4301N92C 2018-09 풋297.5							102
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	102	102	102	102	102	102	102
-5.33%	67	67	67	67	67	67	67
-2.67%	32	32	32	32	32	32	32

0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-17	-17	-16	-16	-15	-15	-14
5.33%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
8.00%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18

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

(단위:백만원)

**1,282**

공시일	2018-09-07
기준일	2018-09-06

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

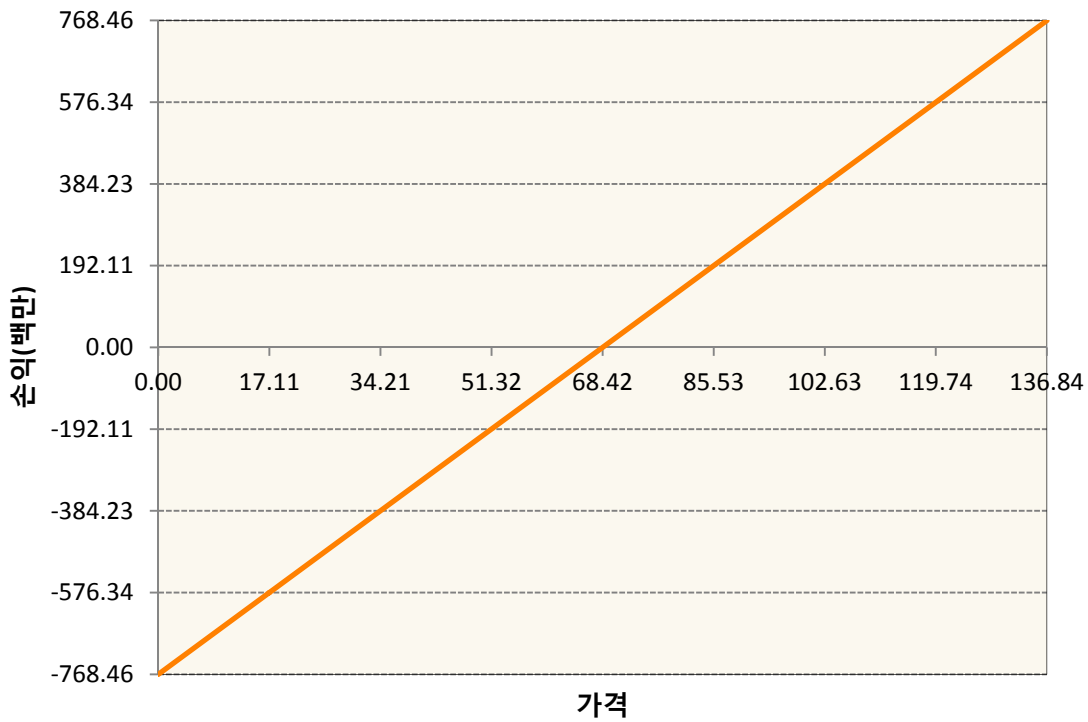
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

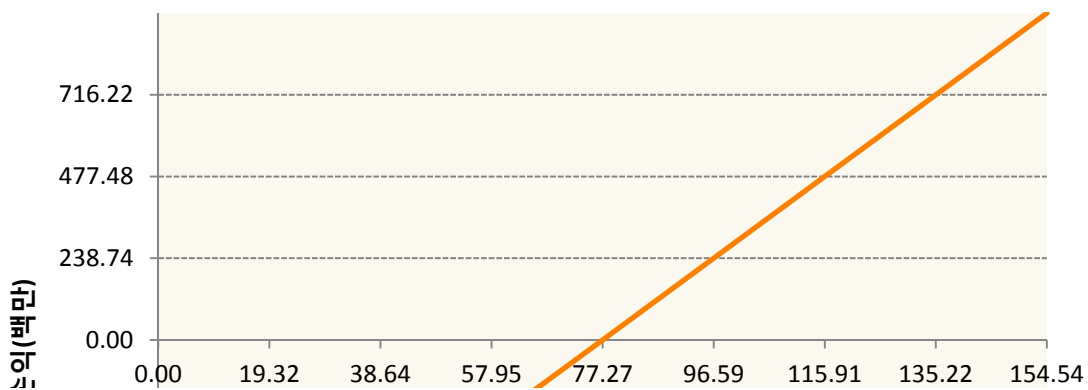
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,132	618	2,514	
누계	유가증권	선물	528	0	528	장내

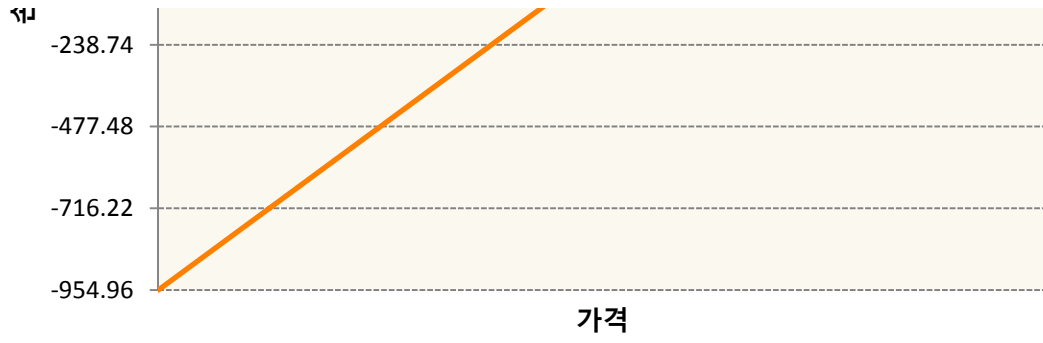
### 2. 만기시점의 손익구조

CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18

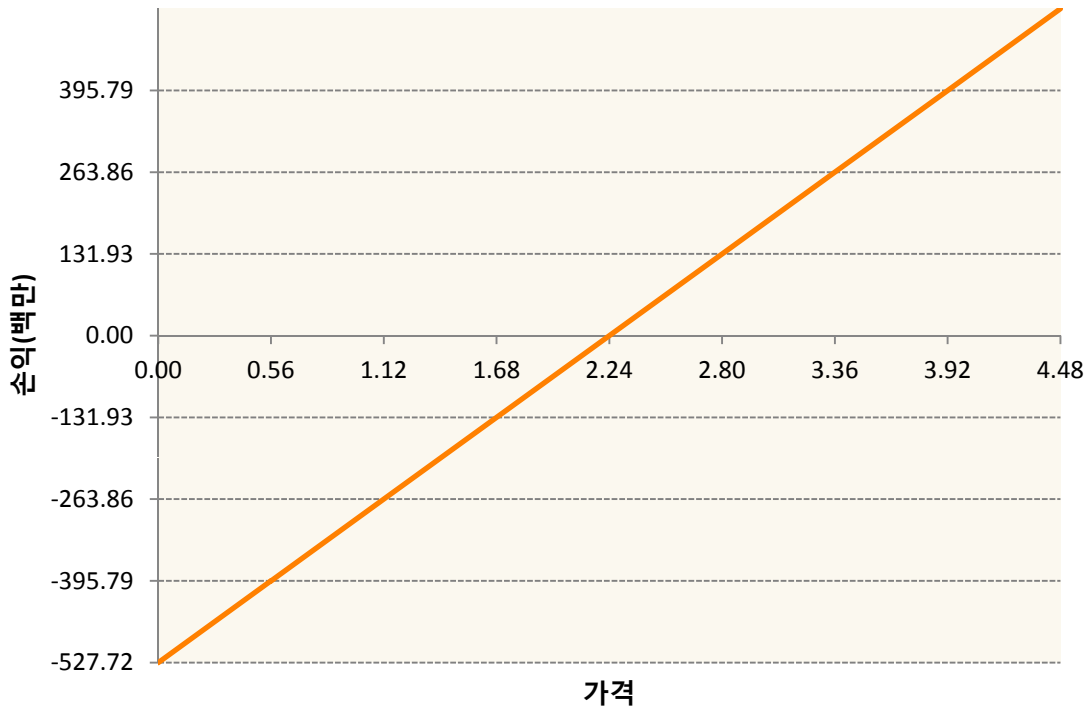


COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18

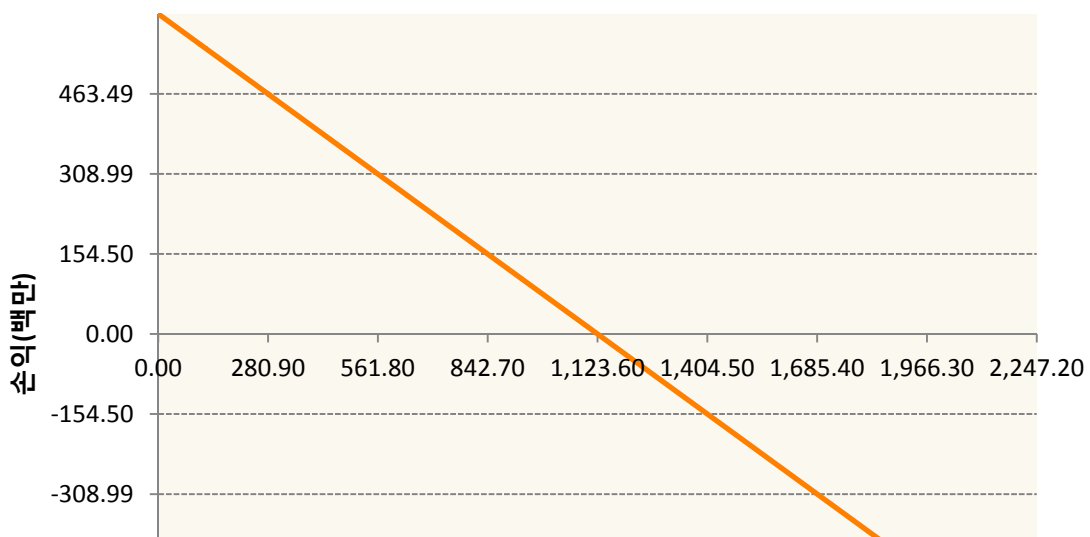


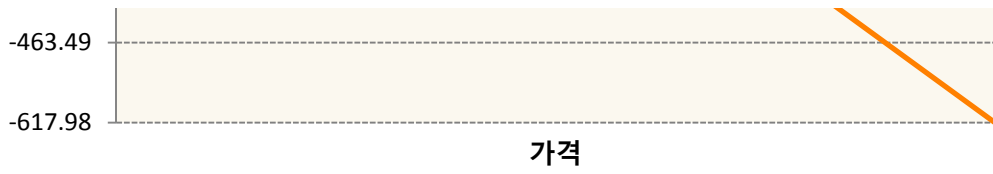


HOX8-Heating Oil

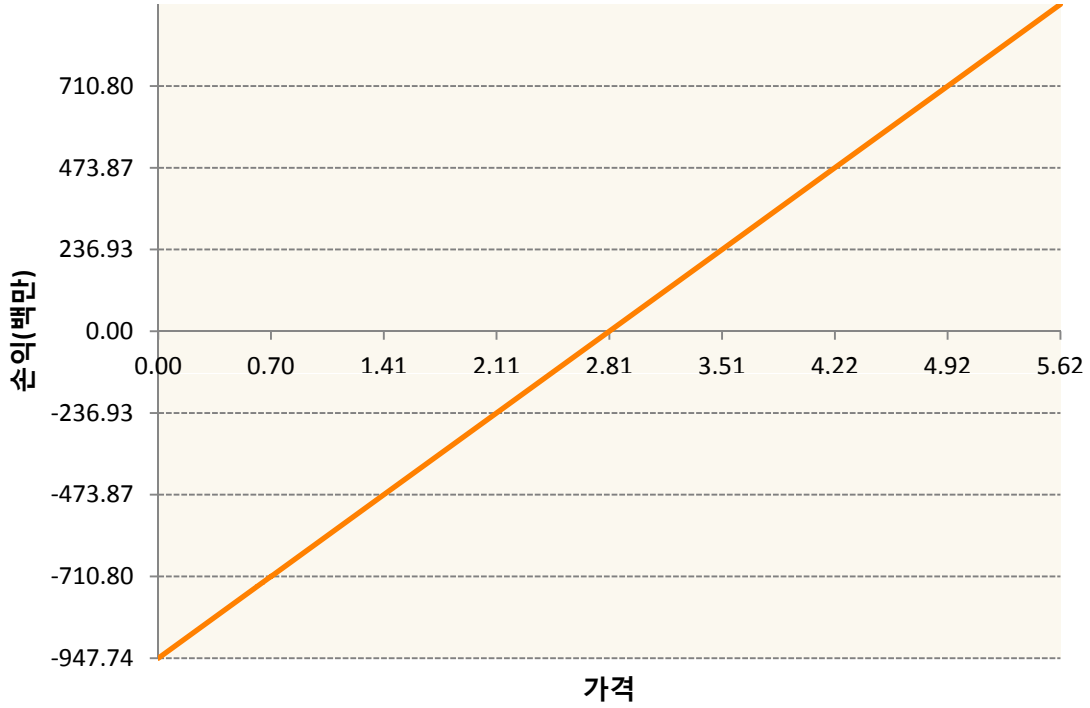


KR4175N90000-2018-09 달러선물

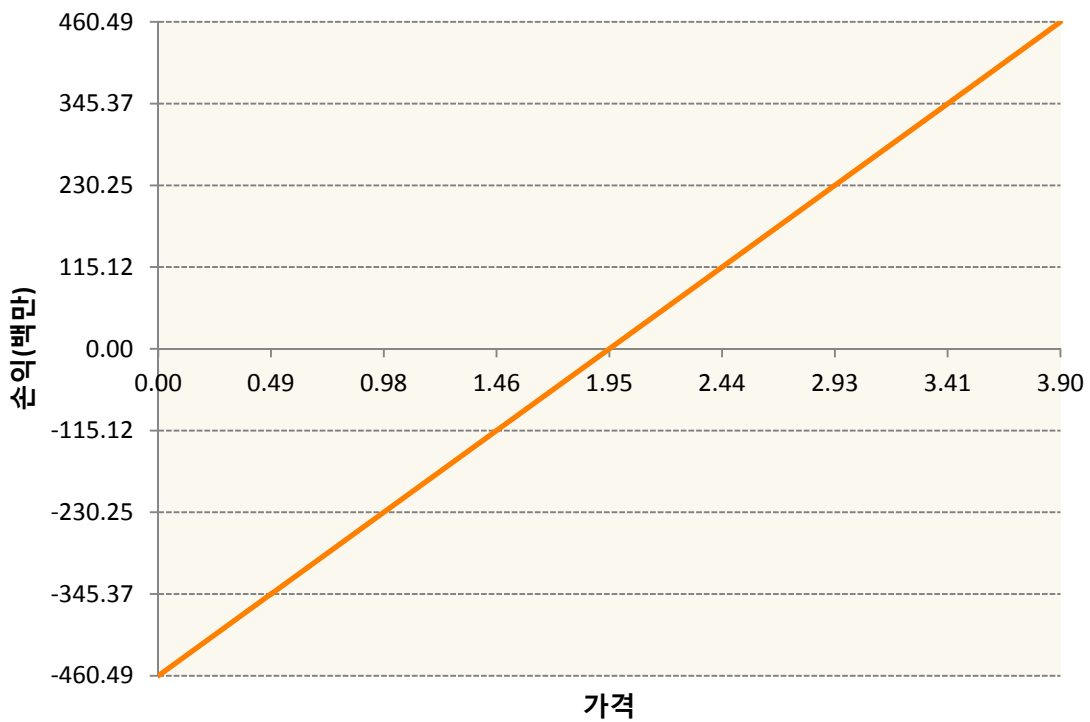




**NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18**



**XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18**



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	61
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	76
HOX8	Heating Oil	42
	KR4175N90C 2018-09 달러선물	49
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	76
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	37

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	440

공시일	2018-09-07
기준일	2018-09-06

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

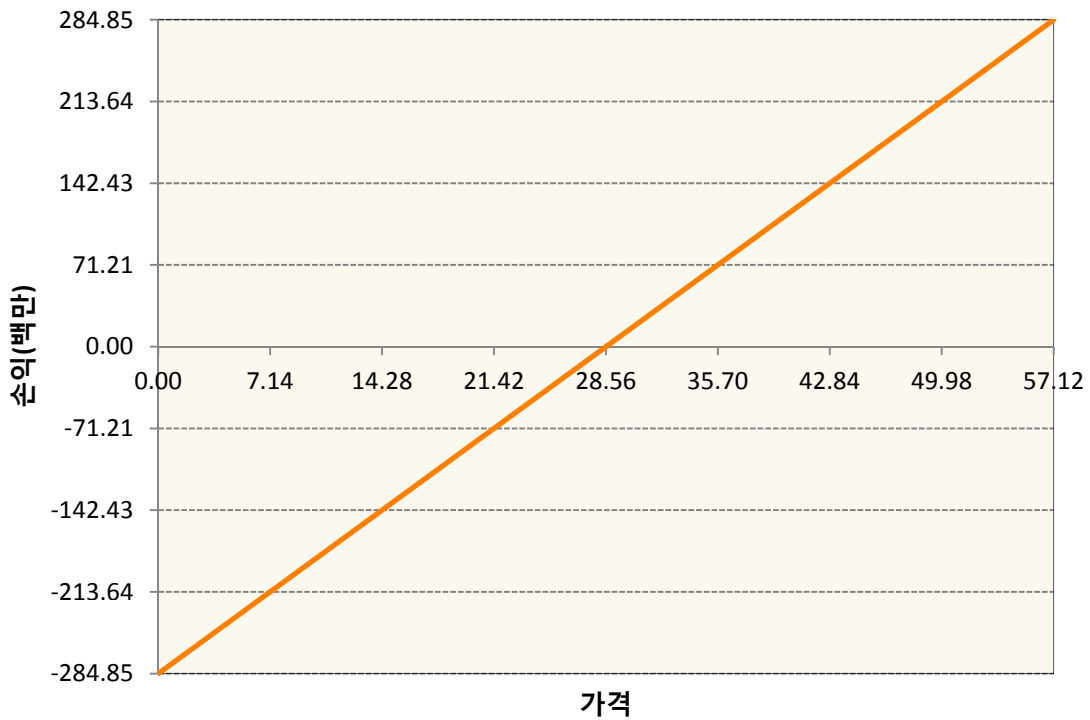
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

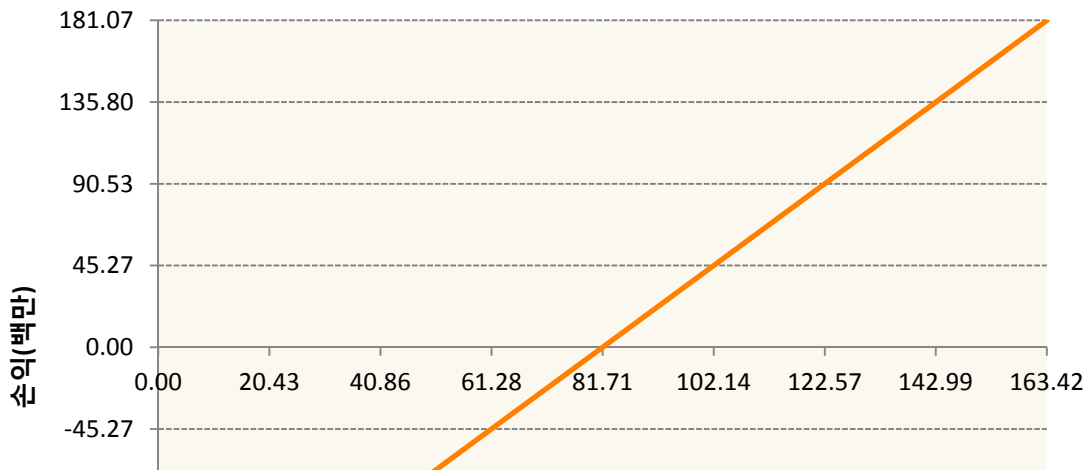
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,600	79	3,522	

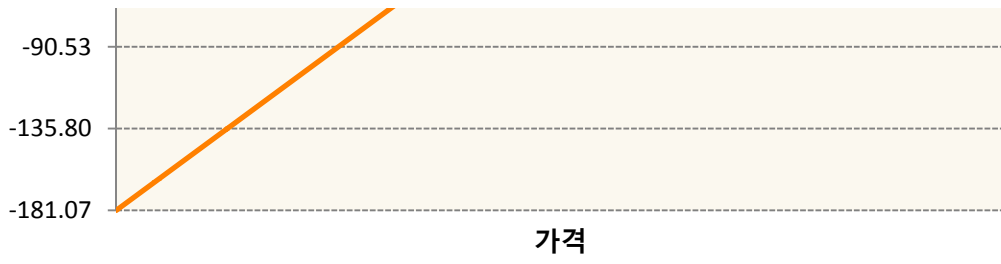
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18**

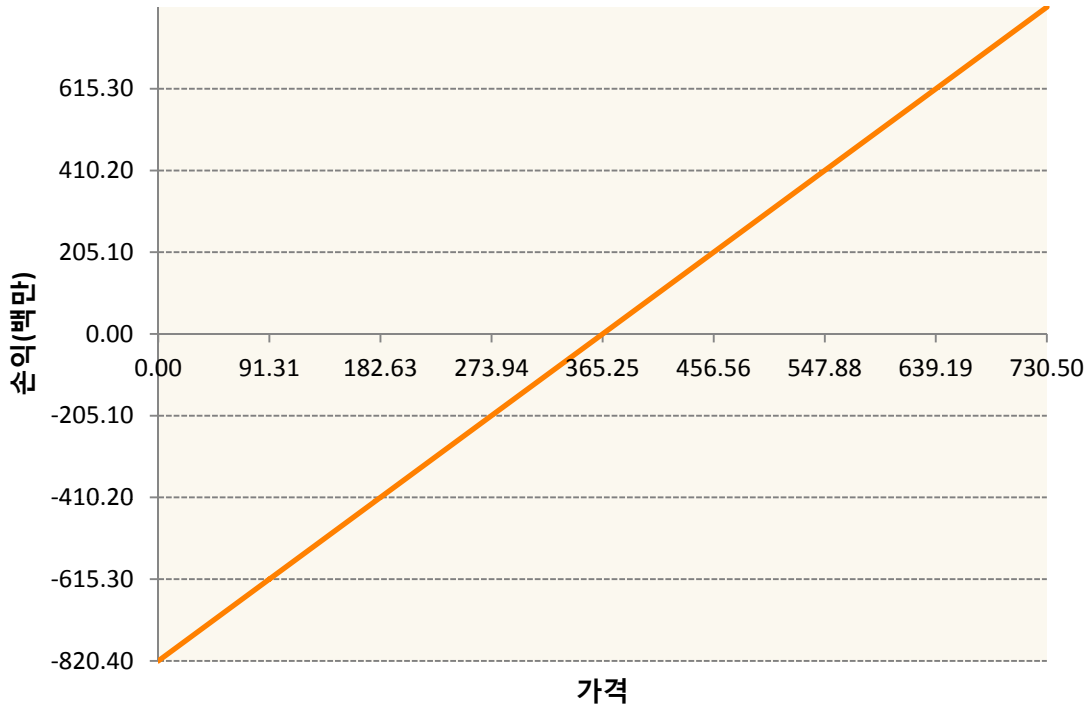


**CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18**

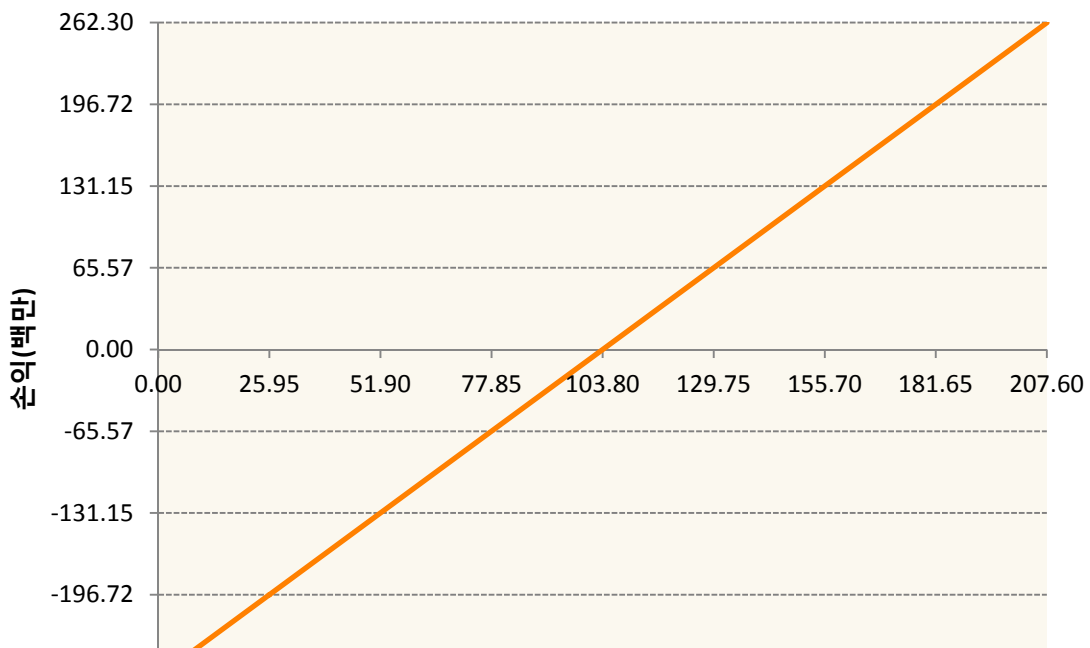


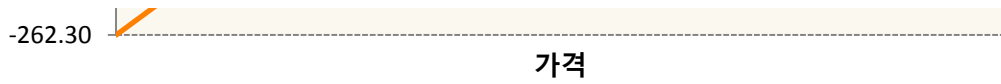


**CZ8-CORN FUTURE DEC18**

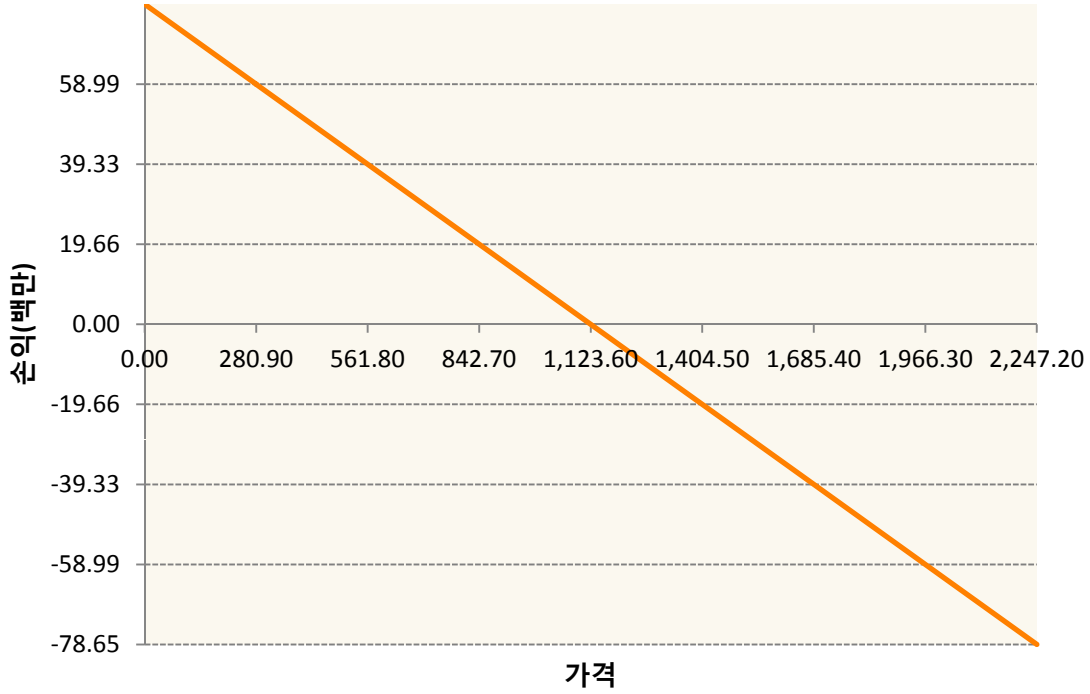


**KCZ8-COFFEE 'C' FUTURE Dec18**

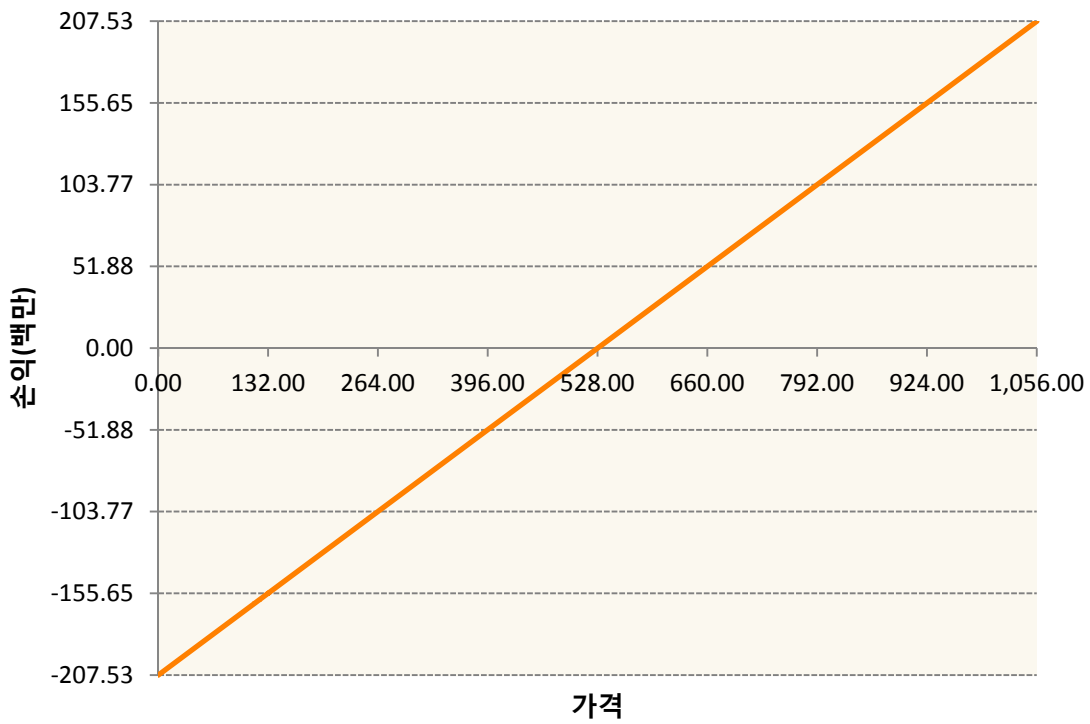




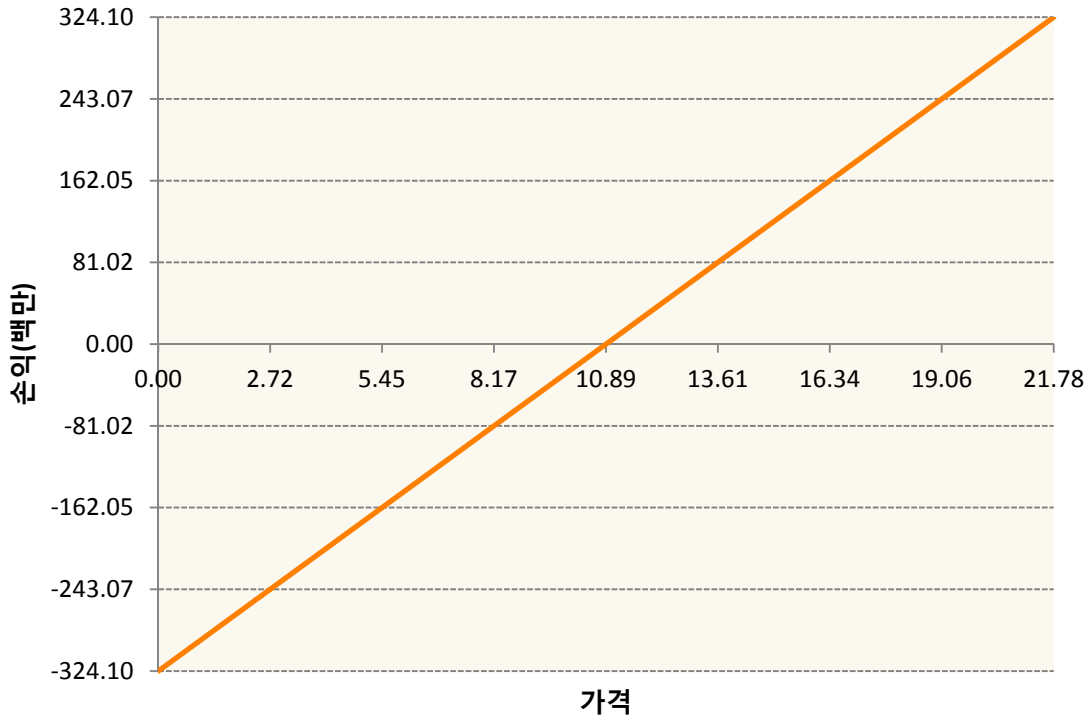
**KR4175N90000-2018-09 달러선물**



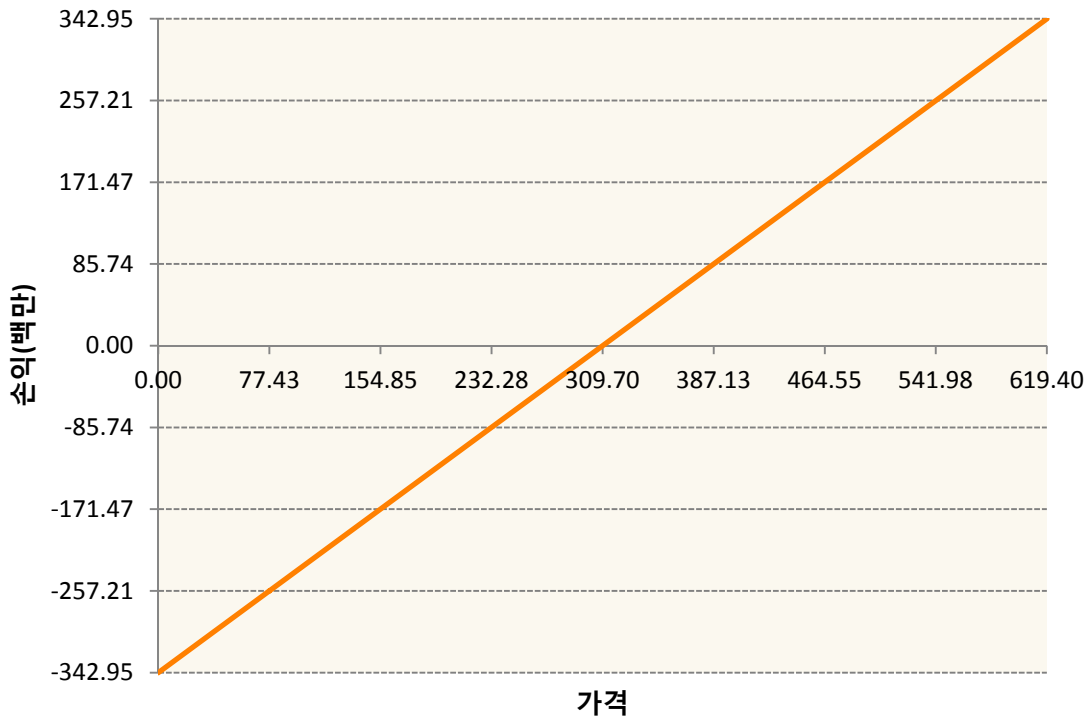
**KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18**



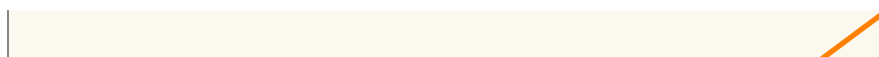
SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

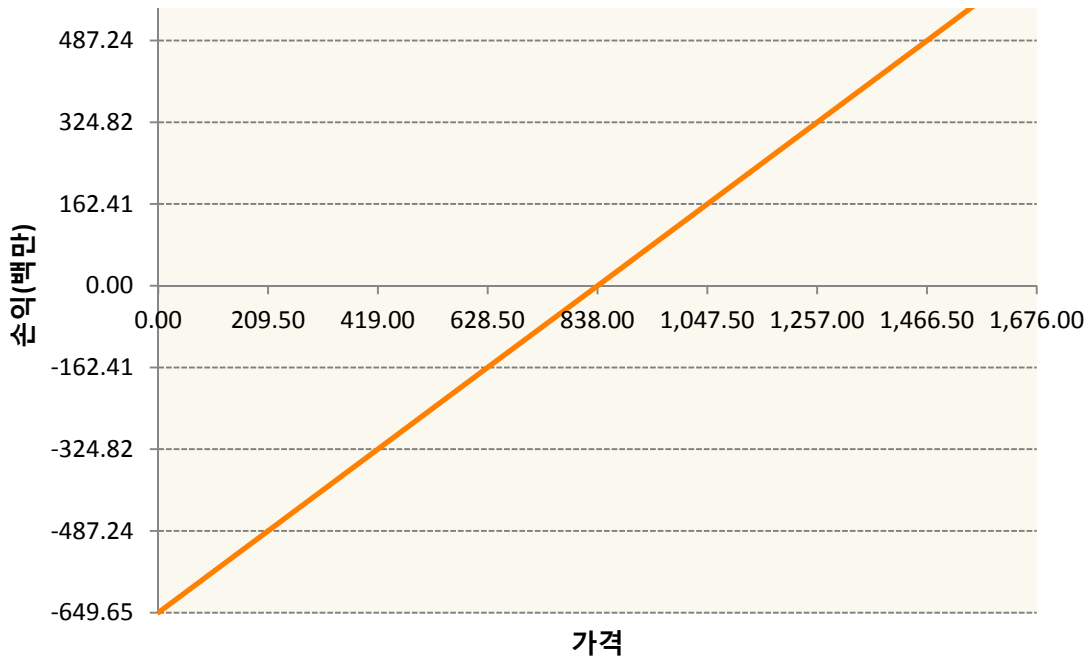


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

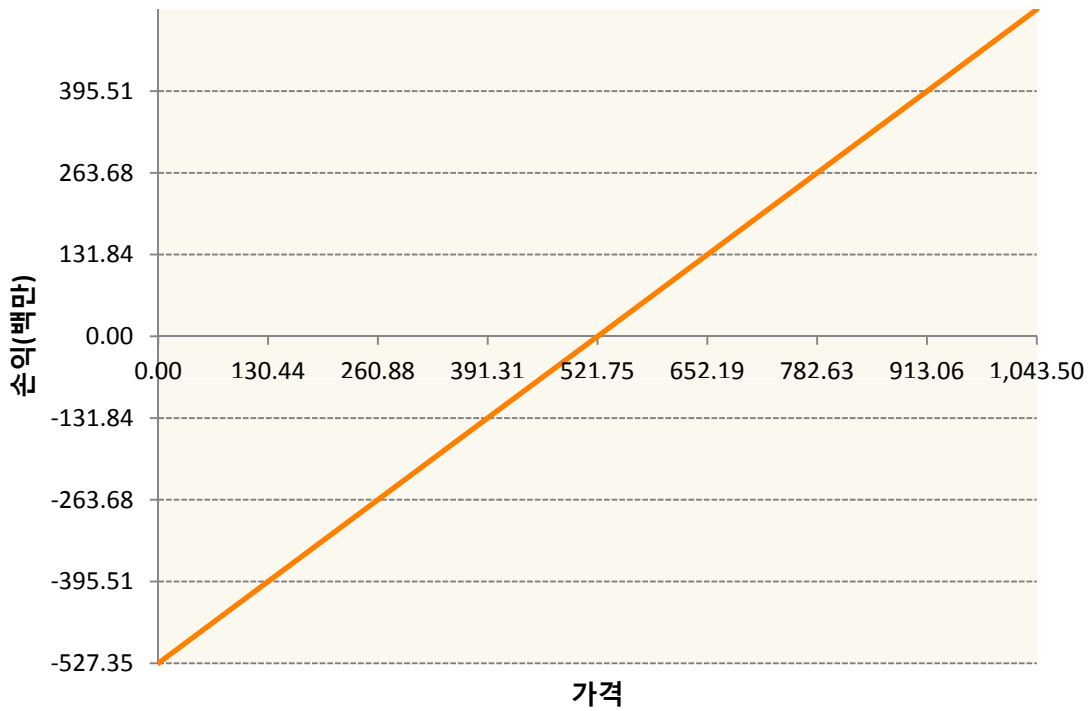


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





WZ8-WHEAT FUTURE(CBT) DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	23
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	14
CZ8	CORN FUTURE DEC18	66
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	21
KR4175N90C	2018-09 달러선물	6

KWZ8	KC HRW WHEAT FUT DEC18	17
SBV8	SUGAR #11 (WORLD) OCT18	26
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	27
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	52
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	42

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

(단위:백만원)

**310**