

공시일	2018-09-17
기준일	2018-09-14

## 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	2018-09-17
기준일	2018-09-14

## 스마트인덱스모

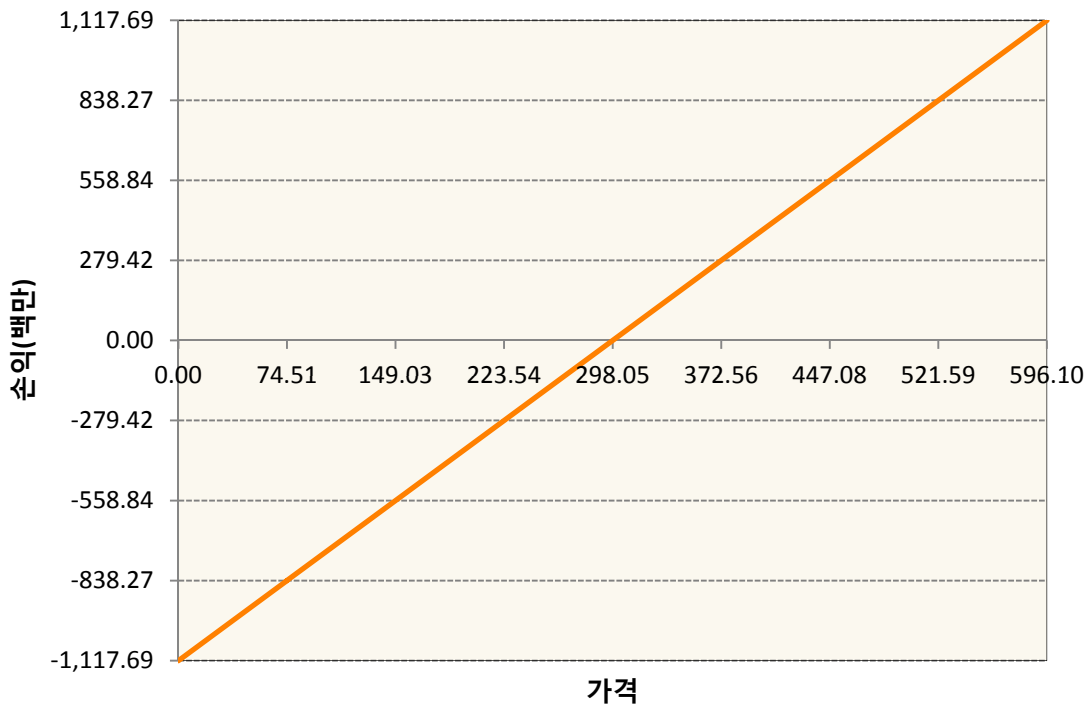
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,118	0	1,118	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물)

89

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-5.33%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
-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%	59	59	59	59	59	59	59
8.00%	89	89	89	89	89	89	89

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

(단위:백만원)

68

공시일	2018-09-17
기준일	2018-09-14

## 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

1,148

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

486

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-17
기준일	2018-09-14

## 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)

SWCSI500000 신한CSI500미래S180910

286

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

362

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-17
기준일	2018-09-14

## 유로인덱스모(주식-파생형)

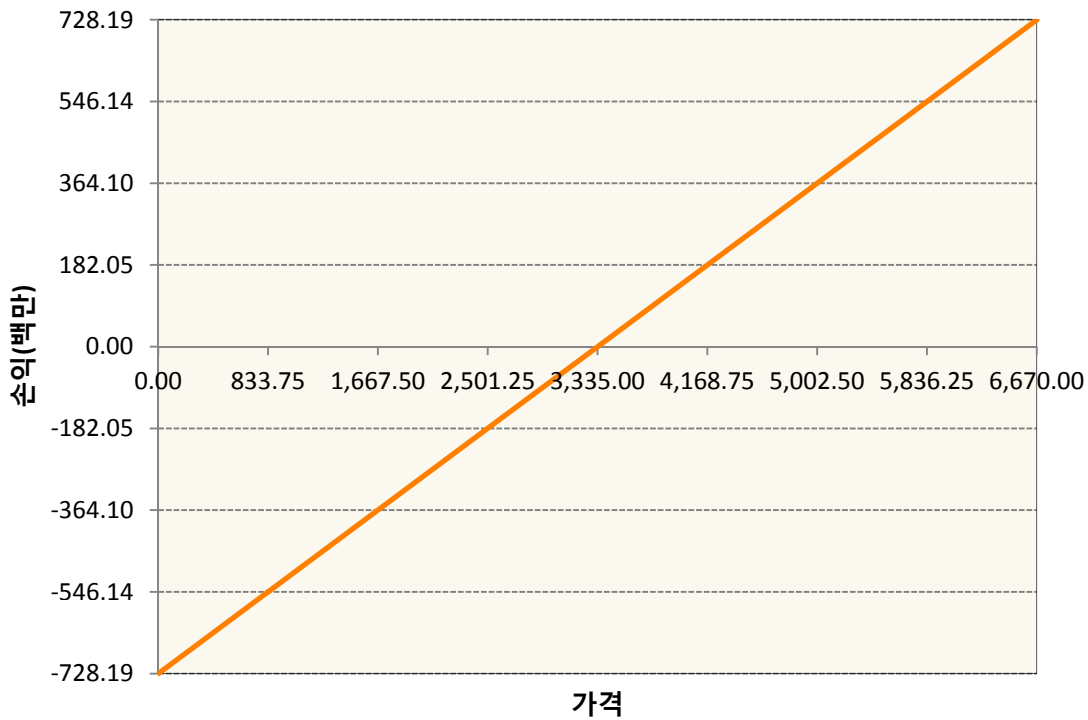
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	728	0	728	

### 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)

37
----

공시일	2018-09-17
기준일	2018-09-14

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

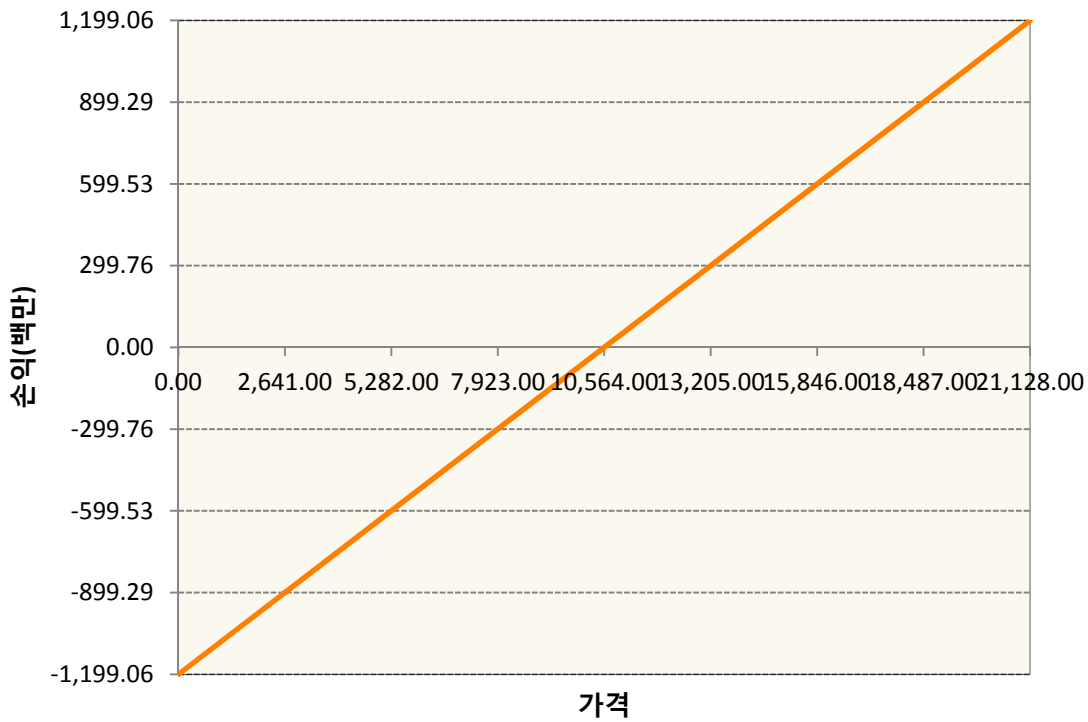
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

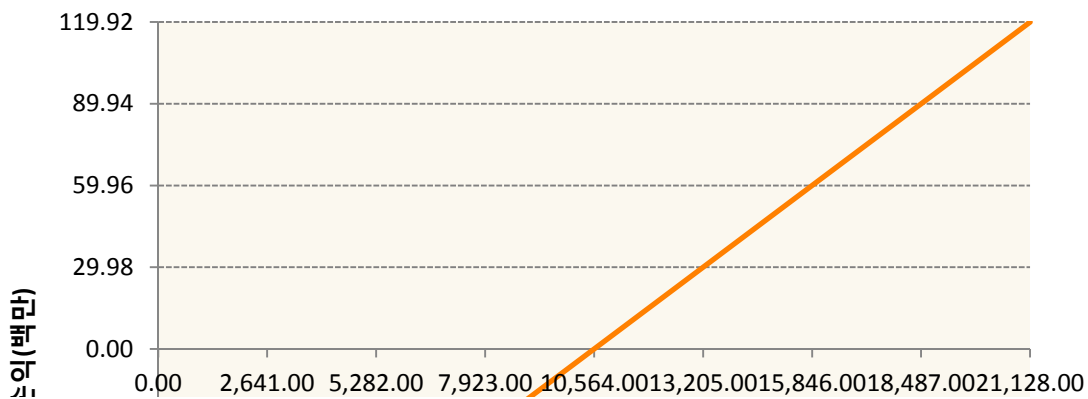
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	120	0	120	
누계	유가증권	선물	1,199	0	1,199	장내

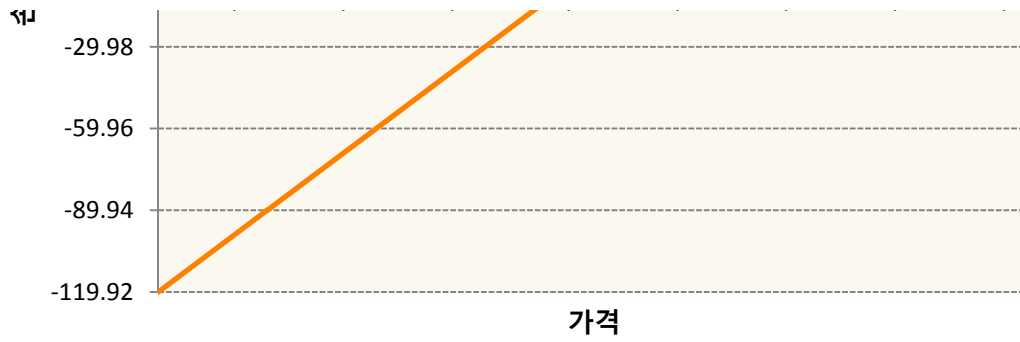
### 2. 만기시점의 손익구조

**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	2018-09-17
기준일	2018-09-14

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

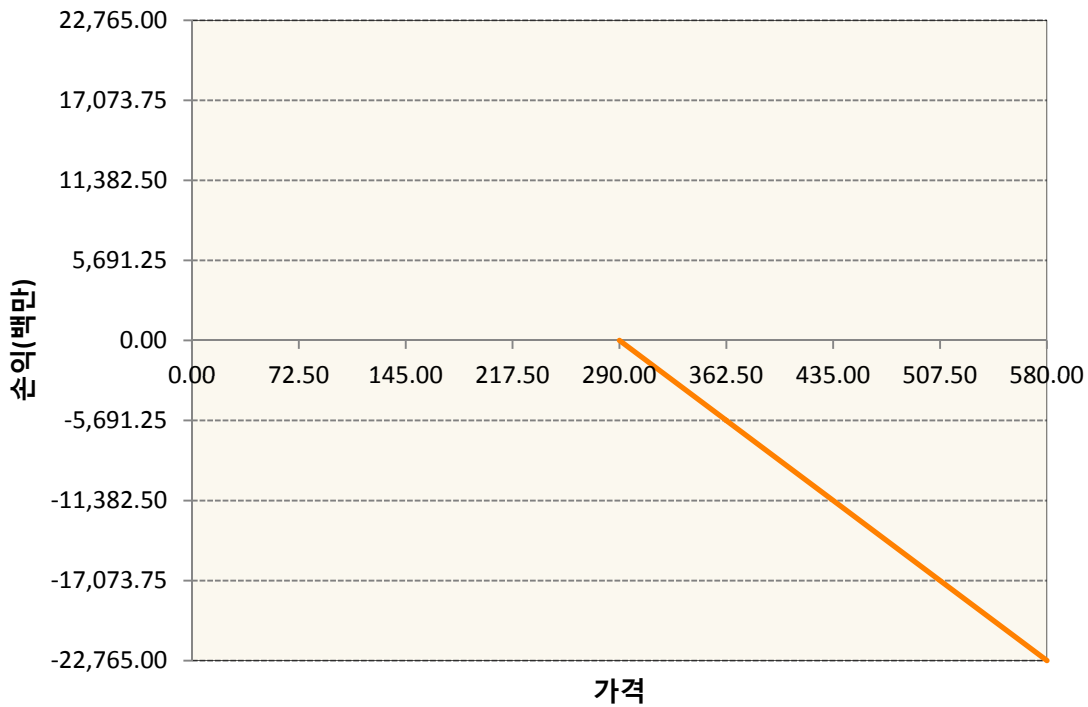
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

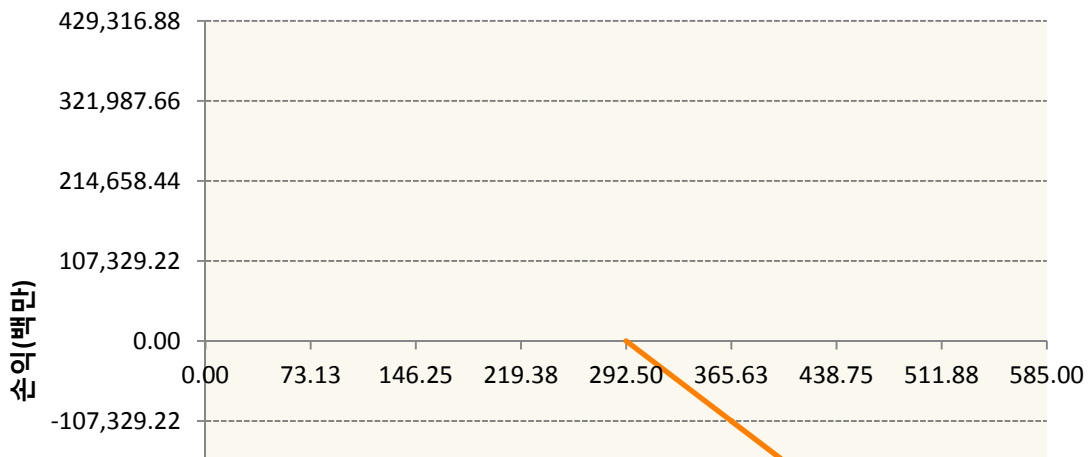
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	593,678	-593,678	장내
누계	유가증권	옵션	0	737,269	-737,269	장내

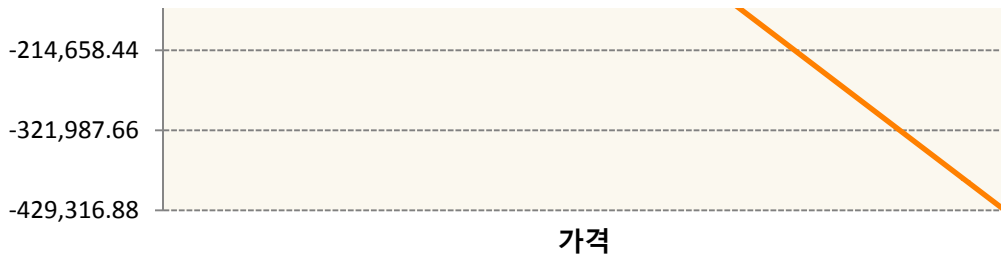
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201NA2902-2018-10 콜290

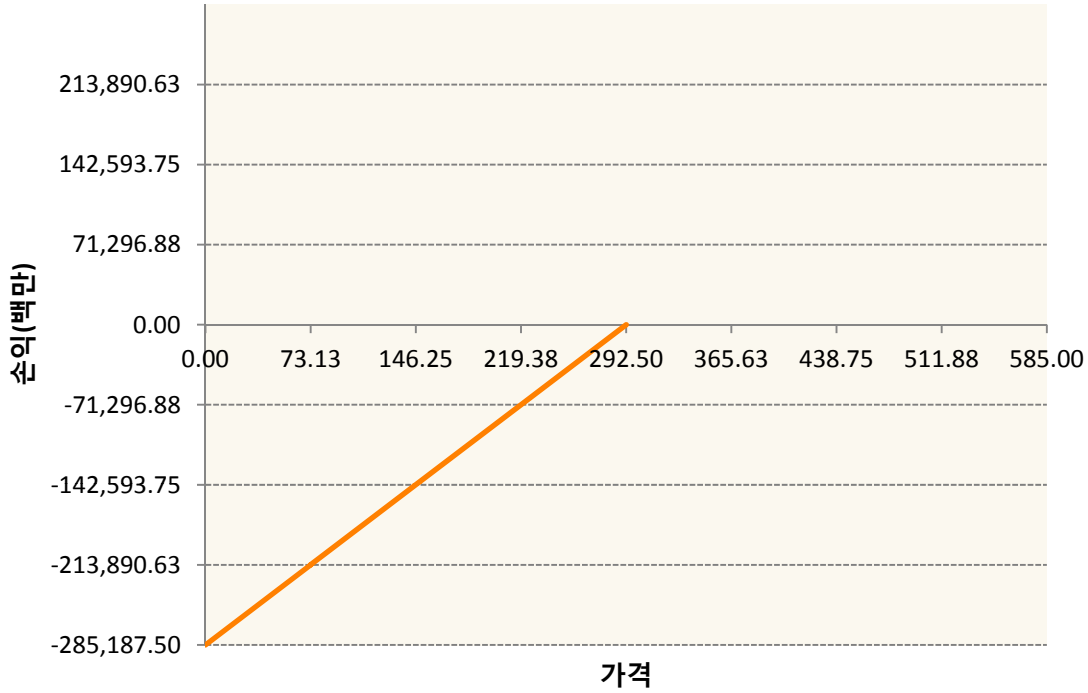


KR4201NA2928-2018-10 콜292.5





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NA2927-2018-10 콜290

1,588

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	898	867	833	797	758	717	675
-5.33%	764	718	670	622	572	522	472
-2.67%	520	466	412	357	303	249	195
0%	153	102	52	0	-52	-105	-157
2.67%	-323	-360	-400	-442	-487	-532	-579
5.33%	-872	-895	-922	-952	-986	-1,022	-1,060
8.00%	-1,464	-1,476	-1,491	-1,510	-1,533	-1,559	-1,588

KR4201NA2927-2018-10 풋292.5

28,761

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15,029	14,538	13,980	13,367	12,706	12,007	11,275

-5.33%	13,027	12,231	11,401	10,544	9,666	8,771	7,863	
-2.67%	9,147	8,147	7,144	6,139	5,132	4,123	3,113	
0%	2,996	2,004	1,005	0	-1,009	-2,021	-3,035	
2.67%	-5,293	-6,086	-6,920	-7,785	-8,676	-9,588	-10,516	
5.33%	-15,182	-15,700	-16,291	-16,941	-17,643	-18,386	-19,166	
8.00%	-26,034	-26,317	-26,676	-27,107	-27,603	-28,157	-28,761	
KR4301NA29 2018-10 풋 292.5							17,177	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-17,060	-17,064	-17,071	-17,085	-17,106	-17,136	-17,177	
-5.33%	-9,428	-9,491	-9,572	-9,672	-9,787	-9,918	-10,061	
-2.67%	-2,814	-3,055	-3,302	-3,552	-3,805	-4,061	-4,319	
0%	671	456	232	0	-238	-481	-728	
2.67%	1,436	1,386	1,319	1,233	1,130	1,012	879	
5.33%	1,494	1,490	1,483	1,469	1,448	1,417	1,375	
8.00%	1,495	1,495	1,495	1,494	1,491	1,487	1,479	

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

(단위:백만원)

47,499

공시일	2018-09-17
기준일	2018-09-14

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

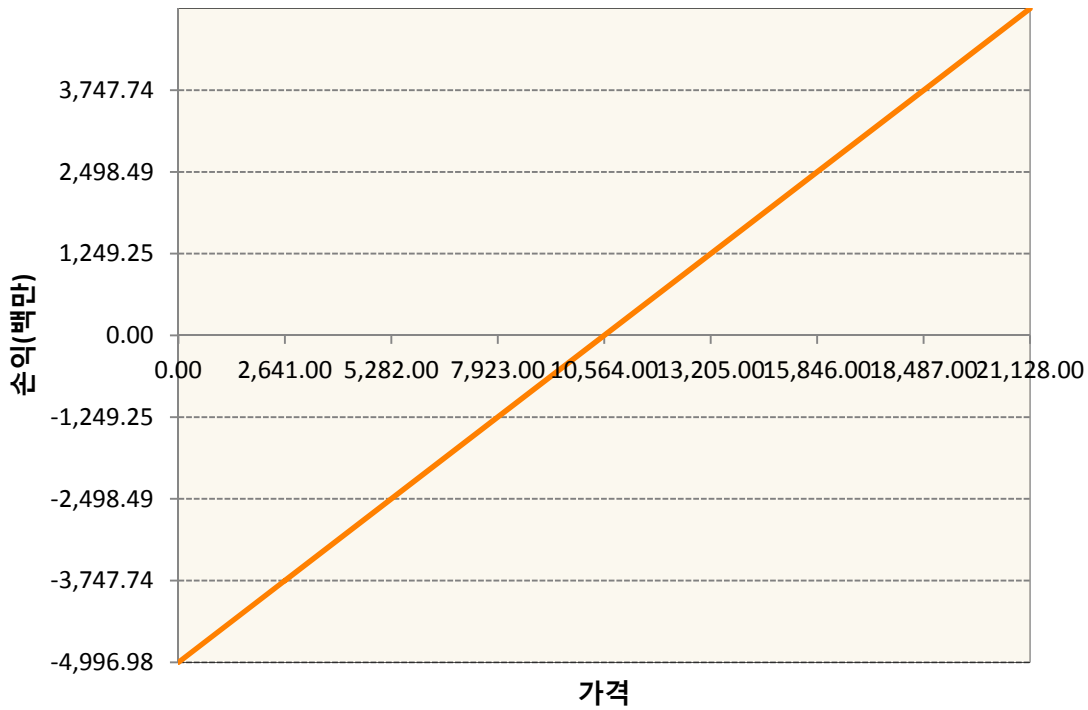
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

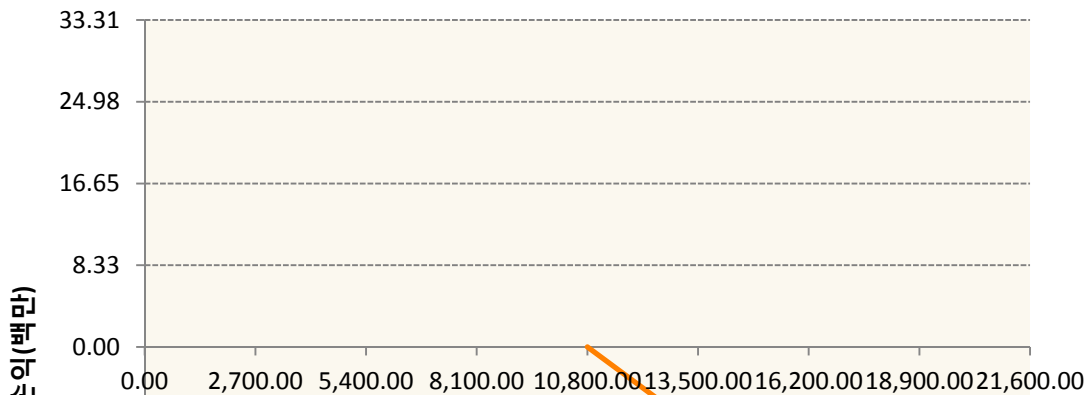
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,997	0	4,997	장내
누계	유가증권	옵션	0	246	-246	장내

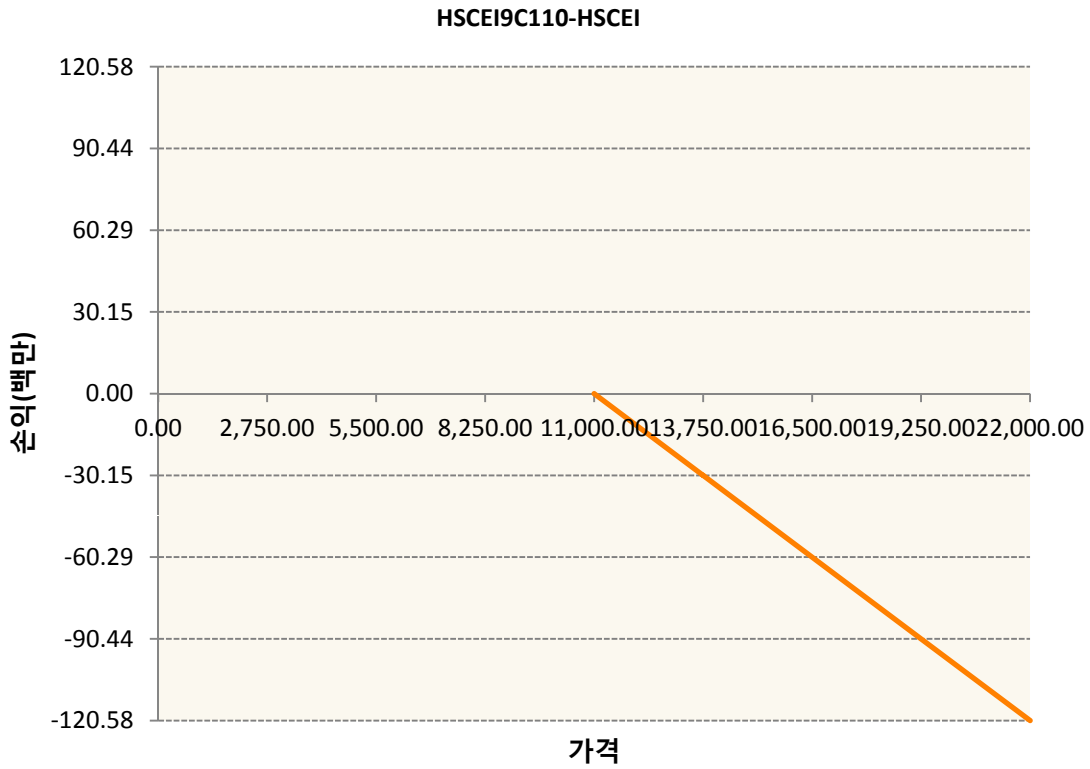
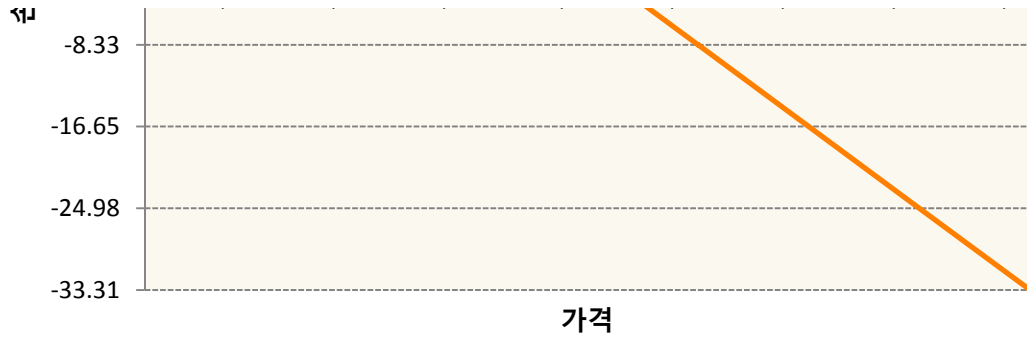
### 2. 만기시점의 손익구조

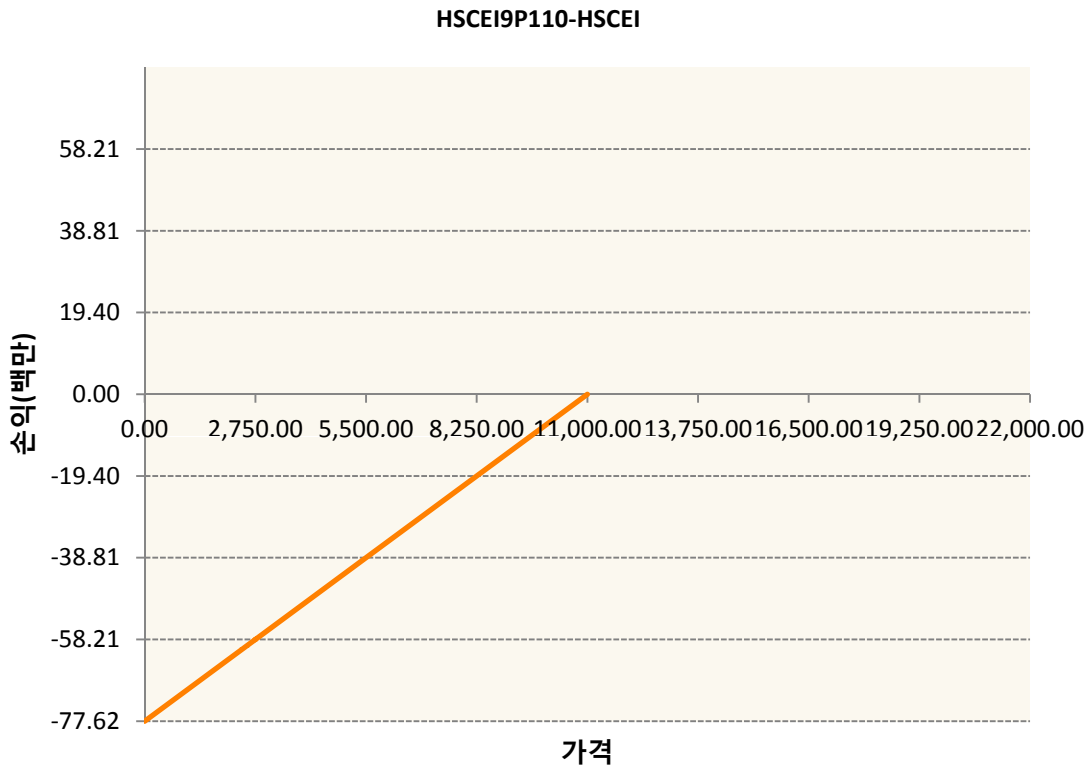
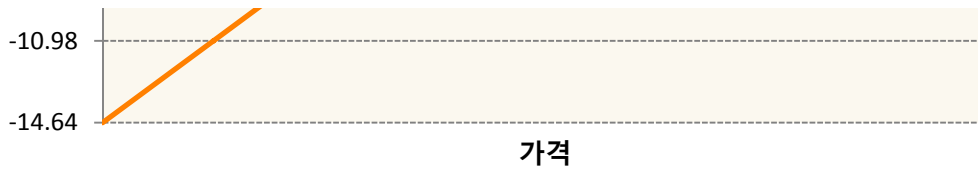
HCU8-H-SHARES IDX FUT Sep18



HSCEI9C108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU8	H-SHARES IDX FUT Sep18	400
HSCEI9C108	HSCEI	3
HSCEI9C110	HSCEI	10
HSCEI9P108	HSCEI	1
HSCEI9P110	HSCEI	6

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	387

공시일	2018-09-17
기준일	2018-09-14

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

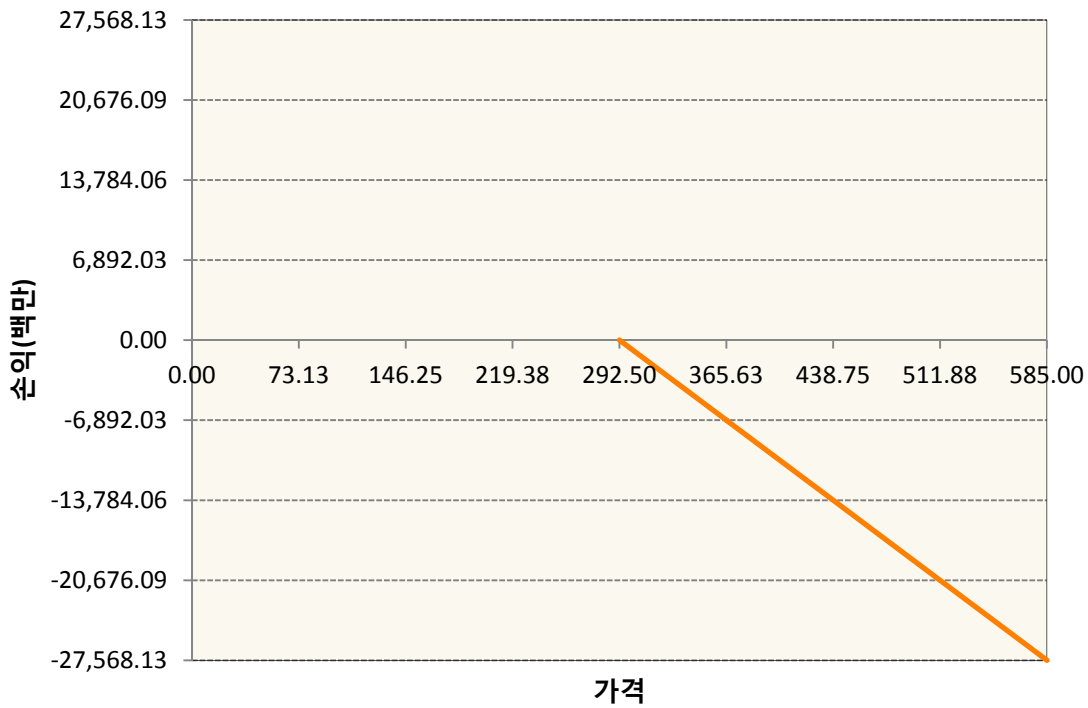
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

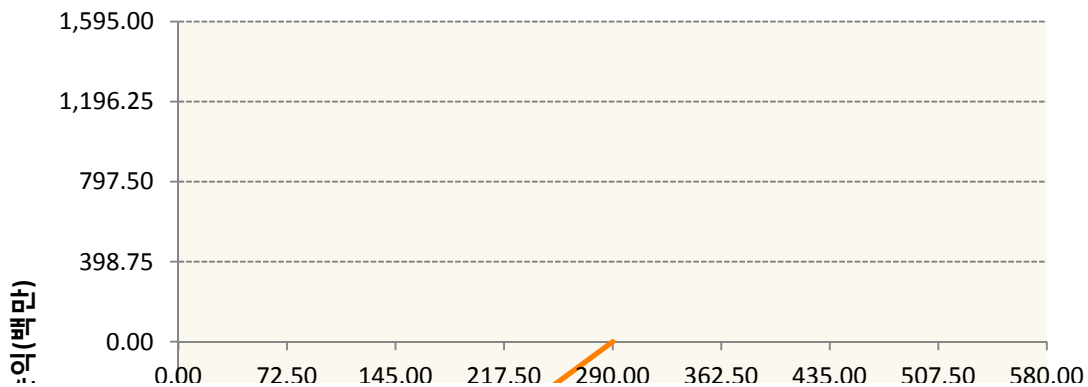
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	49,426	-49,426	장내
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	48,761	-48,761	장내

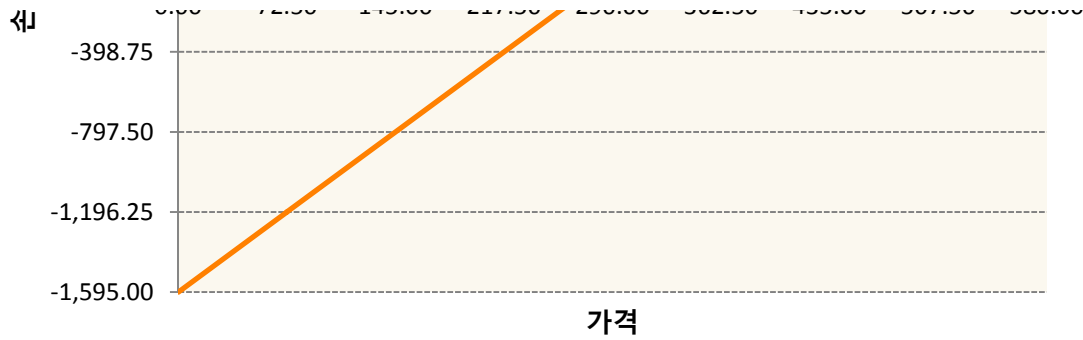
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201NA2928-2018-10 콜292.5

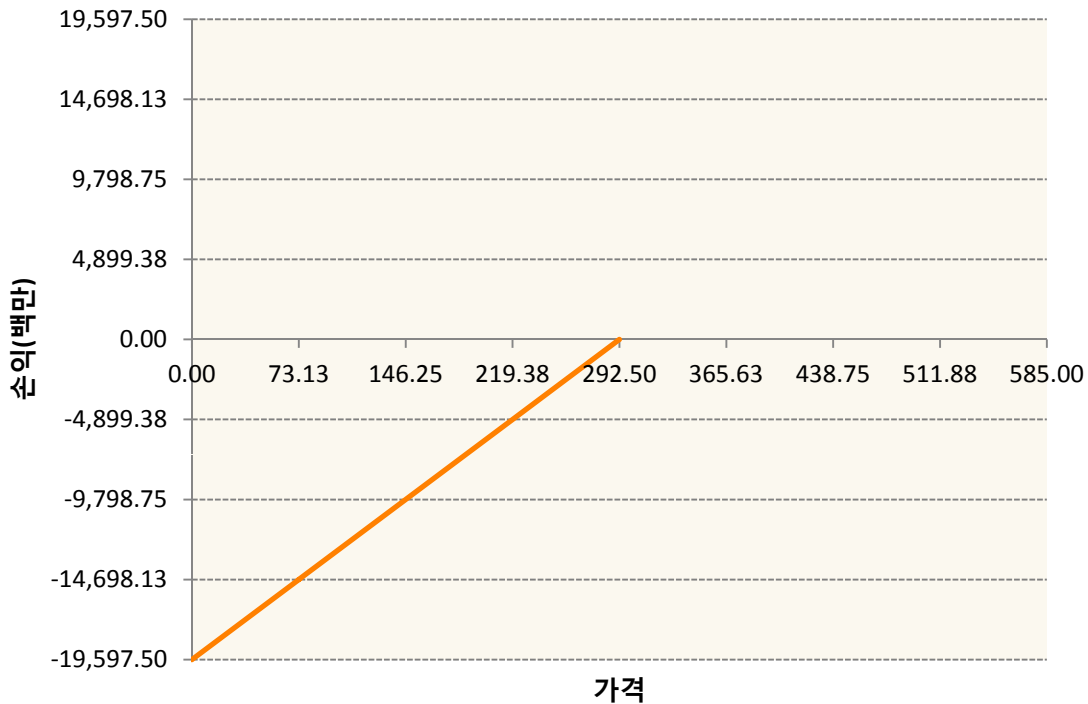


KR4301NA2901-2018-10 풋290





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,987	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,987	-3,987	-3,987	-3,987	-3,987	-3,987	-3,987	
-5.33%	-2,658	-2,658	-2,658	-2,658	-2,658	-2,658	-2,658	
-2.67%	-1,329	-1,329	-1,329	-1,329	-1,329	-1,329	-1,329	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	1,329	1,329	1,329	1,329	1,329	1,329	1,329	
5.33%	2,658	2,658	2,658	2,658	2,658	2,658	2,658	
8.00%	3,987	3,987	3,987	3,987	3,987	3,987	3,987	
KR4201NA2927-2018-10 풋292.5							1,847	
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	965	934	898	858	816	771	724
-5.33%	837	785	732	677	621	563	505
-2.67%	587	523	459	394	330	265	200
0%	192	129	65	0	-65	-130	-195
2.67%	-340	-391	-444	-500	-557	-616	-675
5.33%	-975	-1,008	-1,046	-1,088	-1,133	-1,181	-1,231
8.00%	-1,672	-1,690	-1,713	-1,741	-1,773	-1,808	-1,847

KR4301NA2☹ 2018-10 풋290

87

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-86	-86	-86	-86	-86	-87	-87
-5.33%	-44	-44	-45	-46	-47	-48	-49
-2.67%	-11	-12	-14	-15	-17	-18	-20
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	5	5	5	4	4	4	3
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

KR4301NA2☹ 2018-10 풋292.5

1,180

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,172	-1,173	-1,173	-1,174	-1,175	-1,178	-1,180
-5.33%	-648	-652	-658	-665	-673	-682	-691
-2.67%	-193	-210	-227	-244	-261	-279	-297
0%	46	31	16	0	-16	-33	-50
2.67%	99	95	91	85	78	70	60
5.33%	103	102	102	101	99	97	94
8.00%	103	103	103	103	102	102	102

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

(단위:백만원)

7,095

공시일	2018-09-17
기준일	2018-09-14

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

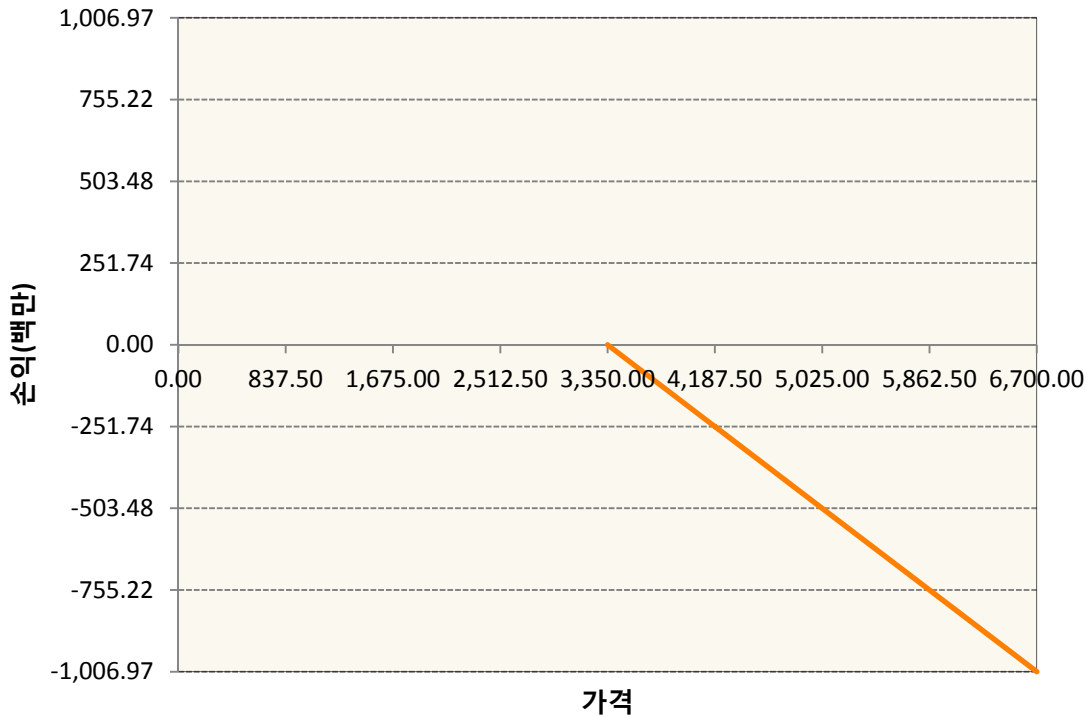
### 1. 계약금액

(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
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,462	0	5,462	
누계	유가증권	스왑	34,512	0	34,512	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,215	-25,215	장내
누계	지수	스왑	53,058	0	53,058	장외

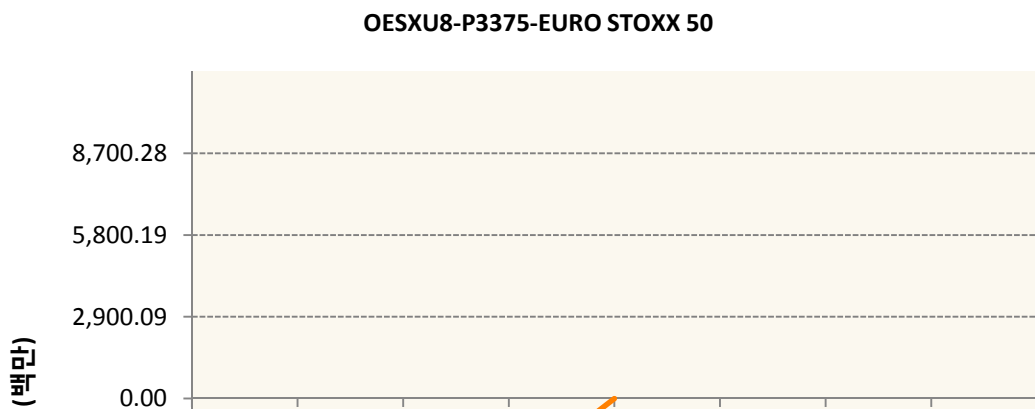
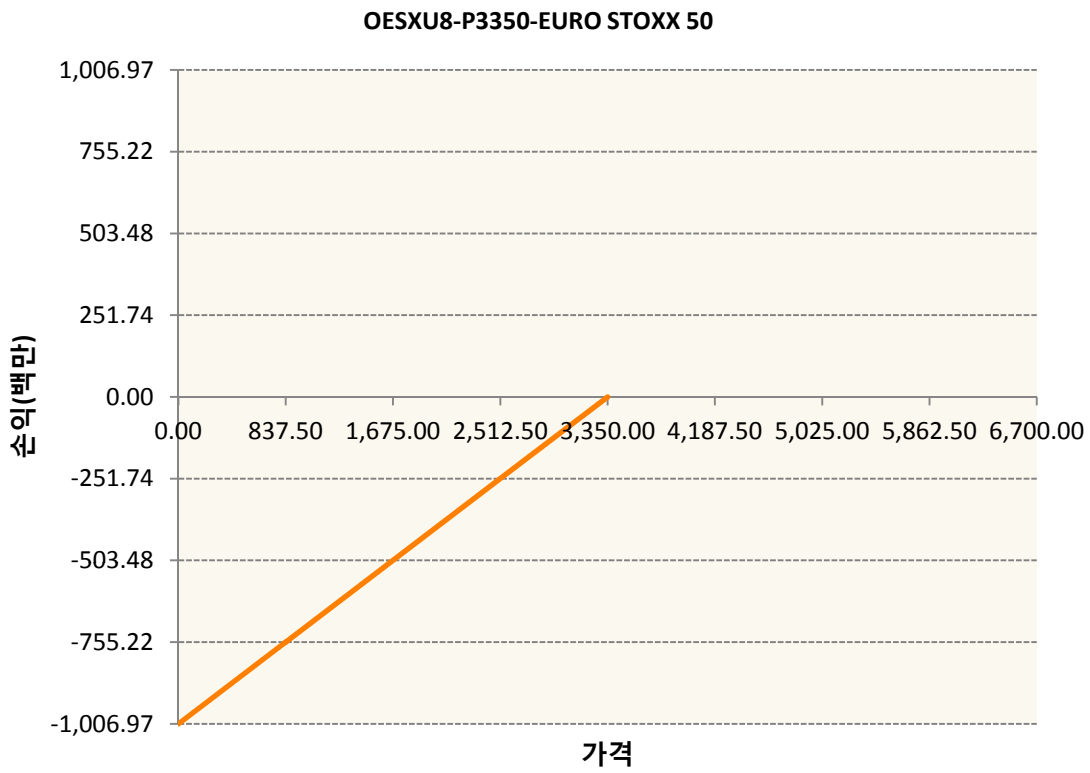
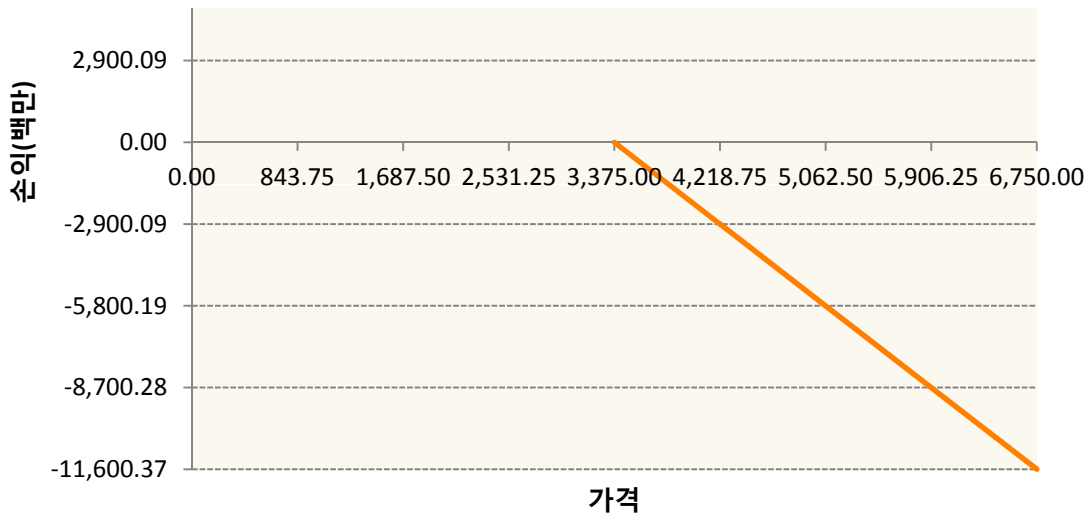
### 2. 만기시점의 손익구조

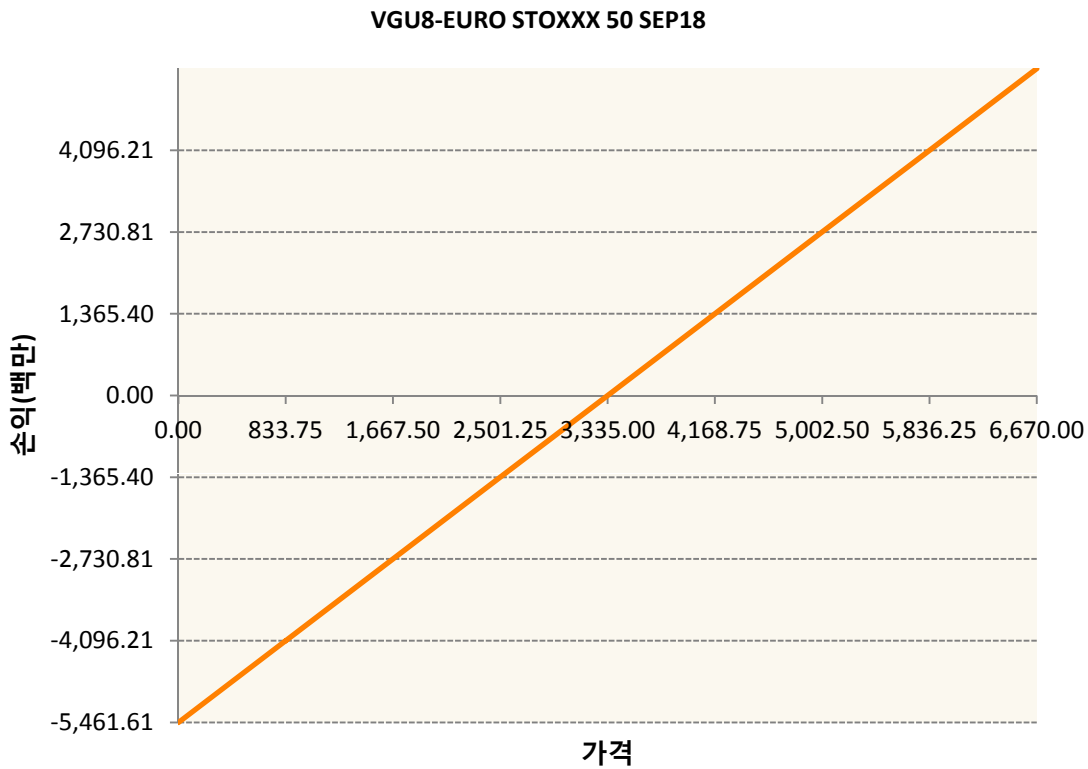
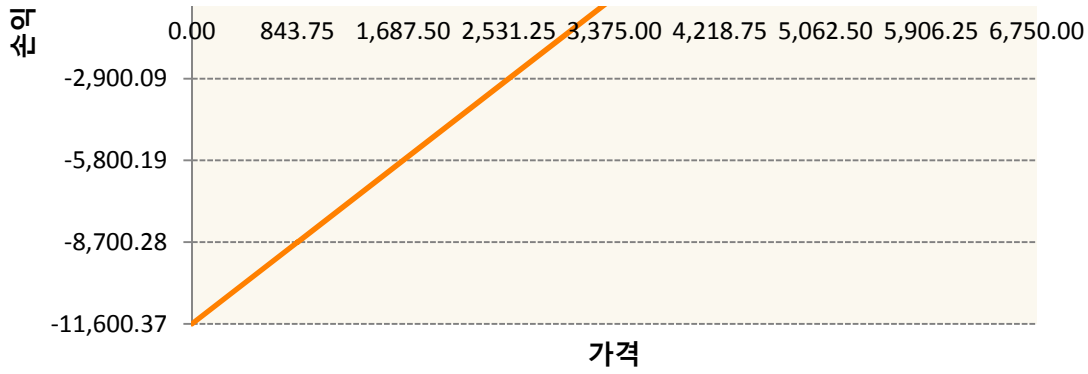
**OESXU8-C3350-EURO STOXX 50**



**OESXU8-C3375-EURO STOXX 50**







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		45
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY		29
OESXU8-C3E EURO STOXX 50		81
OESXU8-C3E EURO STOXX 50		928
OESXU8-P3E EURO STOXX 50		81
OESXU8-P3E EURO STOXX 50		928
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18		437

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





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

(단위:백만원)

1,146



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)

167

공시일	2018-09-17
기준일	2018-09-14

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1

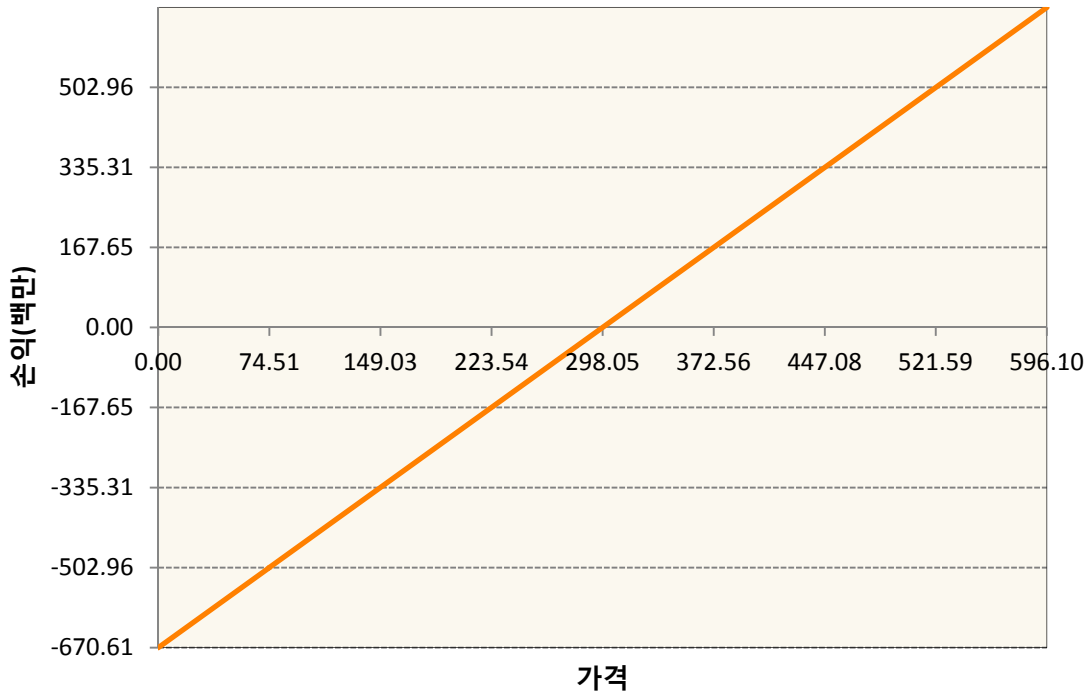
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	671	0	671	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 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	2018-09-17
기준일	2018-09-14

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

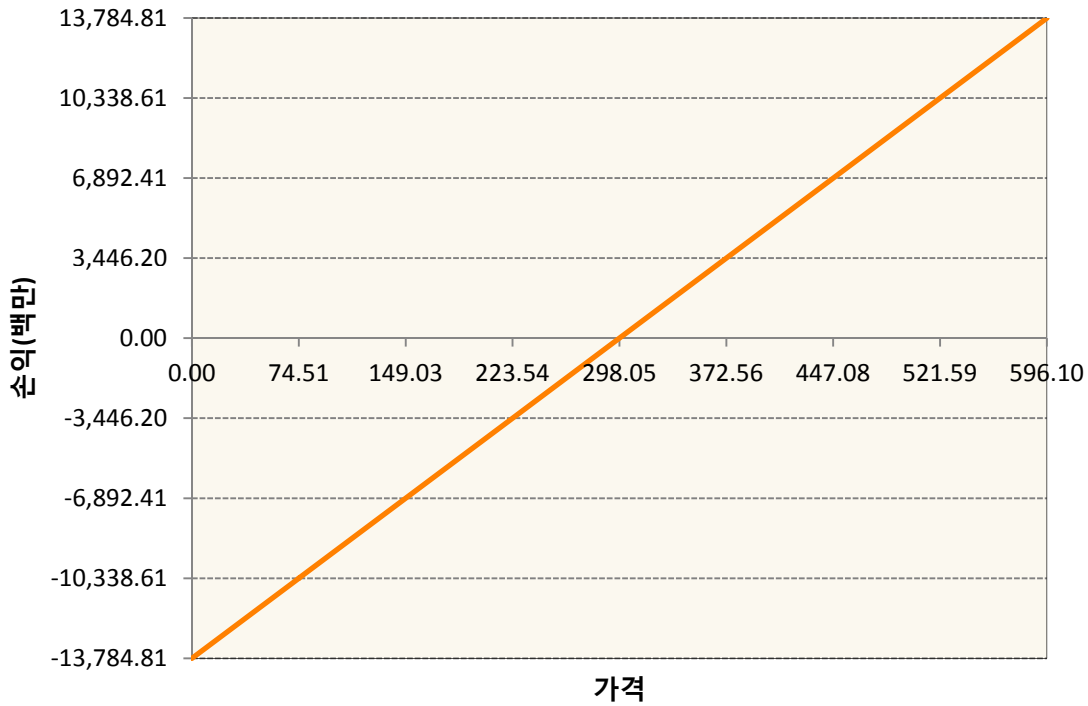
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

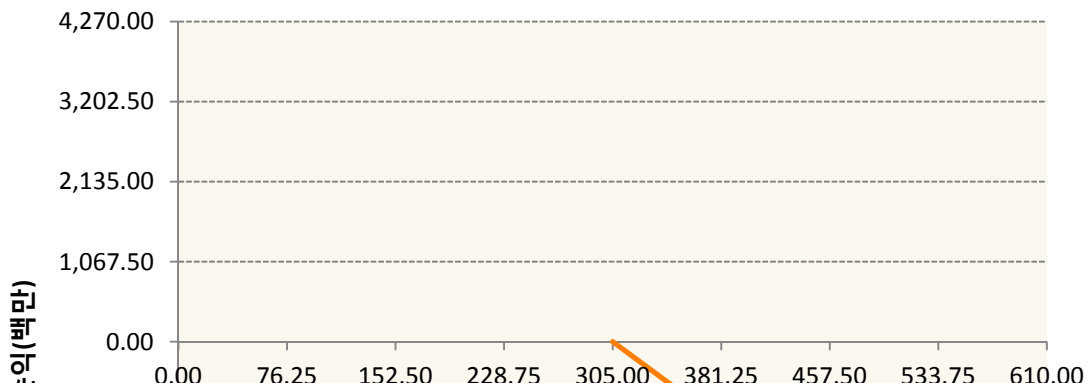
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	2,830	1,539	1,291	장내
누계	유가증권	선물	13,785	0	13,785	장내
누계	유가증권	옵션	2,119	24,258	-22,138	장내

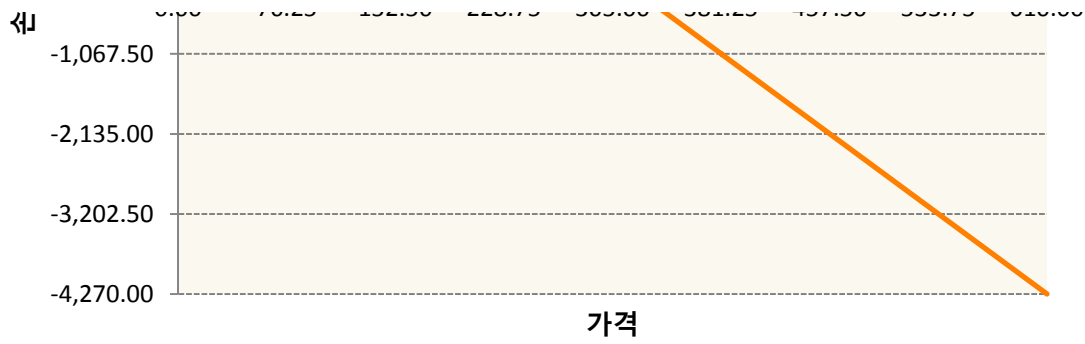
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

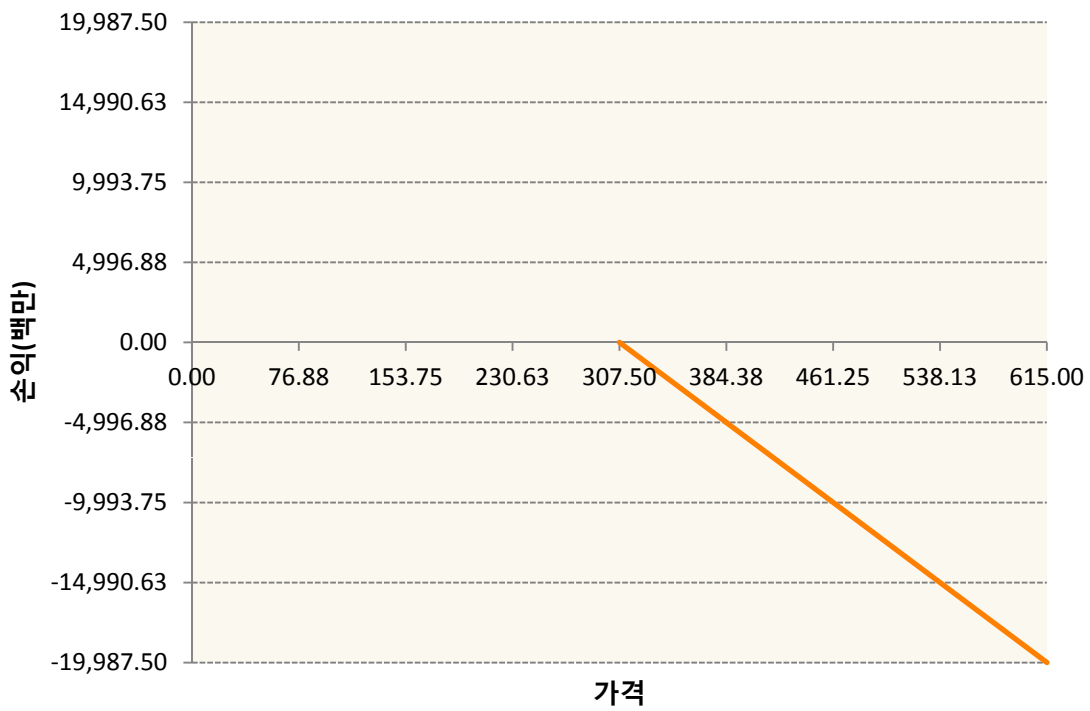


KR4201NA3058-2018-10 콜305

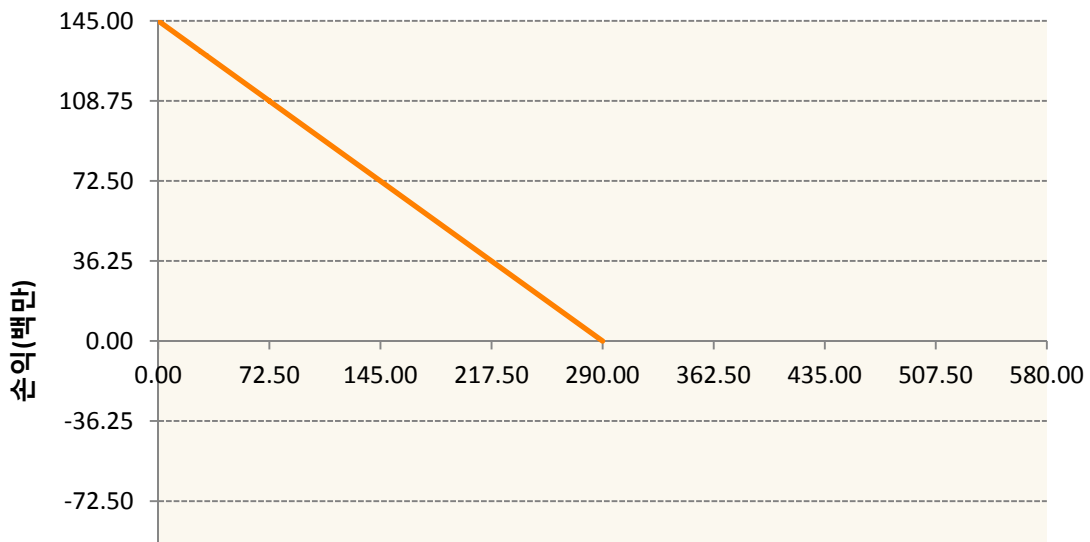


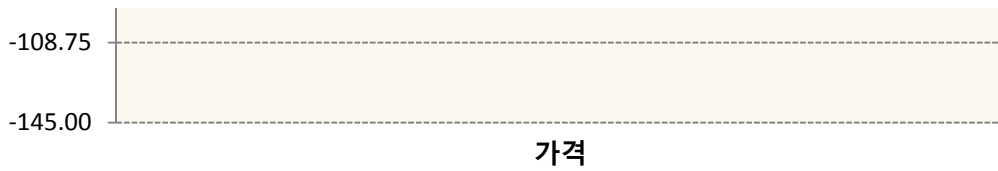


KR4201NA3074-2018-10 콜307.5

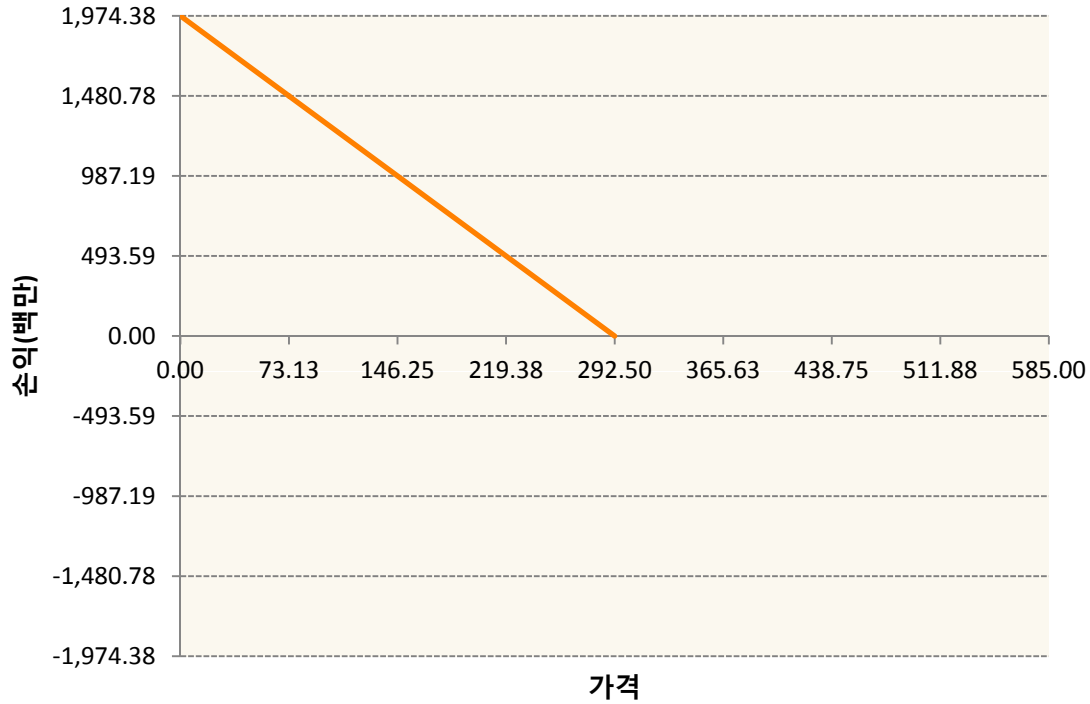


KR4301NA2901-2018-10 풋290





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 1,100

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,100	-1,100	-1,100	-1,100	-1,100	-1,100	-1,100
-5.33%	-733	-733	-733	-733	-733	-733	-733
-2.67%	-367	-367	-367	-367	-367	-367	-367
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	367	367	367	367	367	367	367
5.33%	733	733	733	733	733	733	733
8.00%	1,100	1,100	1,100	1,100	1,100	1,100	1,100

KR4201NA3(2018-10 콜305) 219

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	72	71	69	66	63	59	54
-5.33%	68	64	60	55	49	43	37
-2.67%	55	48	41	34	26	18	10

0%	28	19	9	0	-9	-19	-29
2.67%	-19	-29	-39	-49	-59	-70	-80
5.33%	-86	-95	-105	-114	-124	-134	-144
8.00%	-171	-178	-186	-194	-202	-211	-219

KR4201NA3(2018-10 콜307.5

960

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	286	280	272	262	249	233	215
-5.33%	270	256	239	219	197	172	145
-2.67%	224	198	169	138	104	70	34
0%	121	82	41	0	-42	-85	-129
2.67%	-65	-112	-159	-206	-253	-301	-348
5.33%	-347	-393	-439	-485	-532	-579	-626
8.00%	-718	-755	-794	-834	-875	-917	-960

KR4301NA2(2018-10 풋290

8

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8	8	8	8	8	8	8
-5.33%	4	4	4	4	4	4	4
-2.67%	1	1	1	1	2	2	2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

KR4301NA2(2018-10 풋292.5

119

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	118	118	118	118	118	119	119
-5.33%	65	66	66	67	68	69	70
-2.67%	19	21	23	25	26	28	30
0%	-5	-3	-2	0	2	3	5
2.67%	-10	-10	-9	-9	-8	-7	-6
5.33%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10

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

(단위:백만원)

1,908

공시일	2018-09-17
기준일	2018-09-14

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

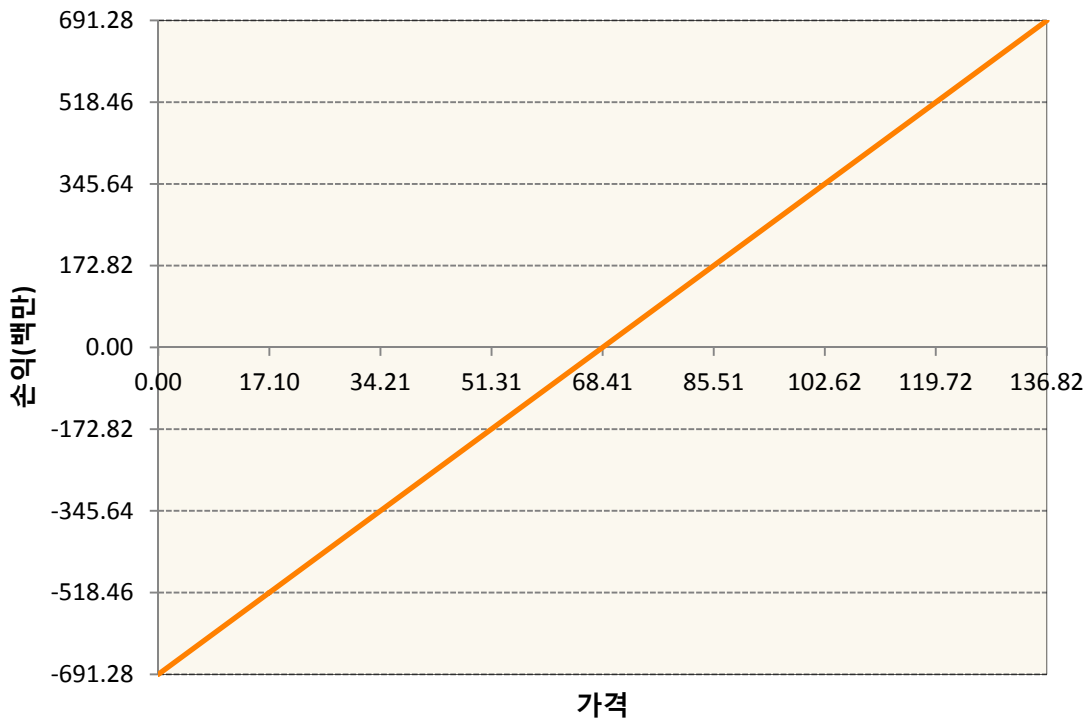
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

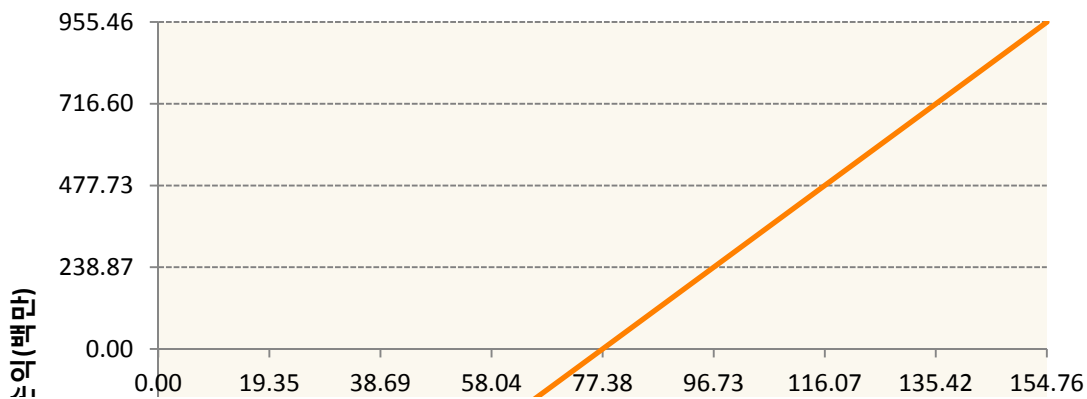
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,025	614	2,411	
누계	유가증권	선물	525	0	525	장내

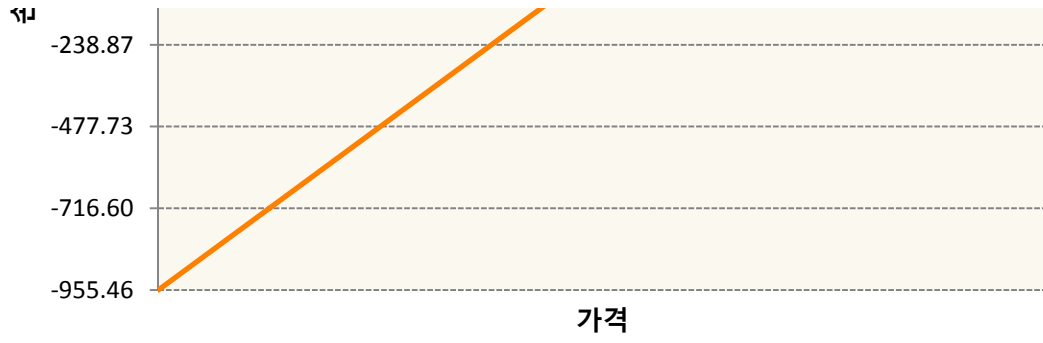
### 2. 만기시점의 손익구조

CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18

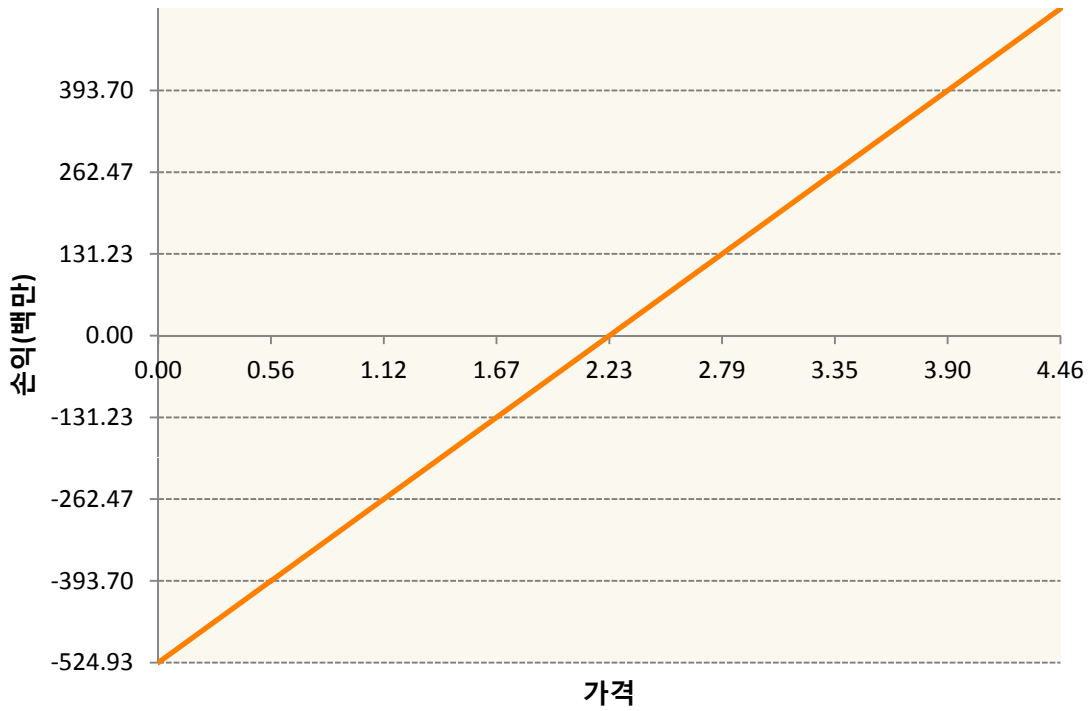


COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19

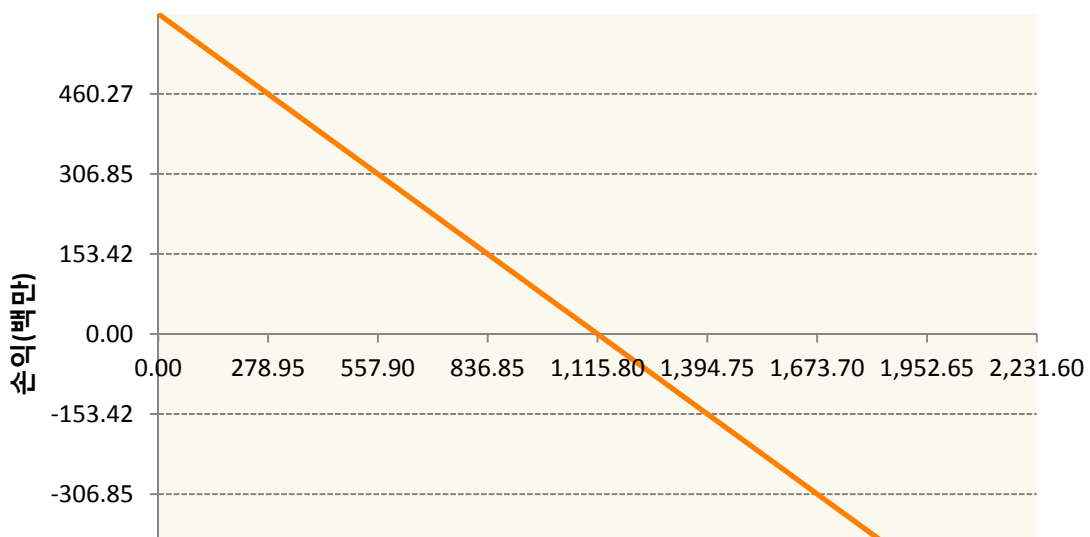


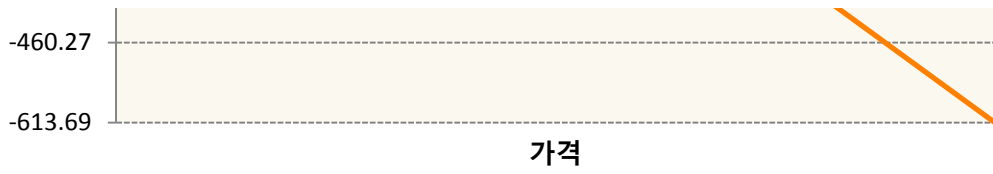


HOX8-Heating Oil

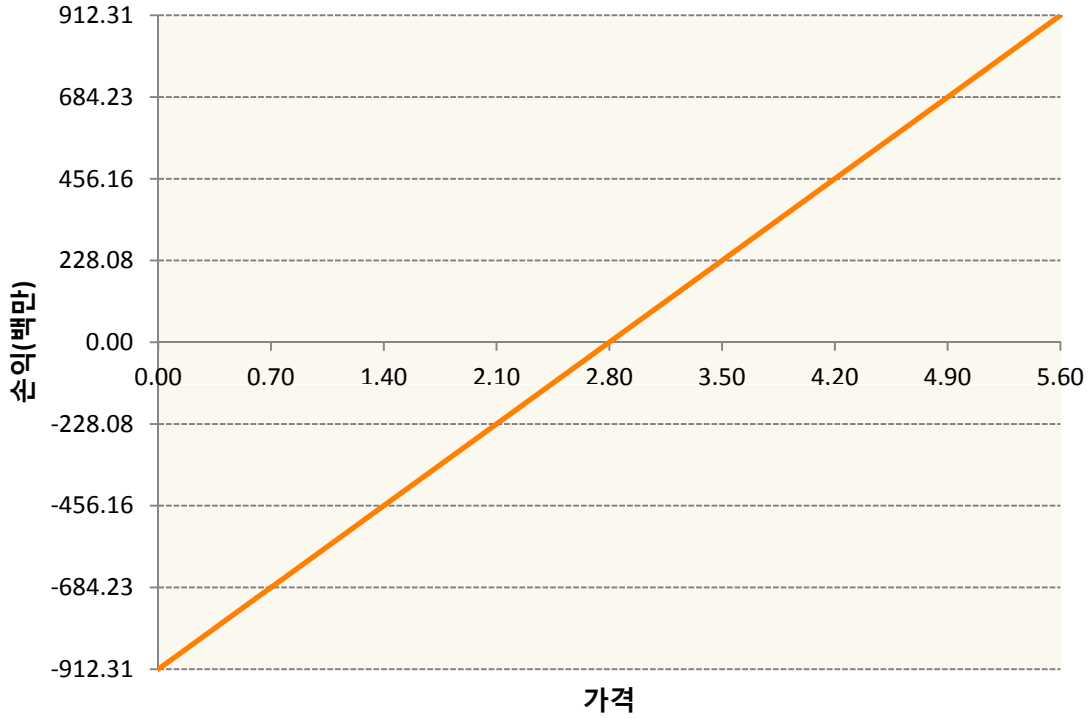


KR4175NA0007-2018-10 달러선물

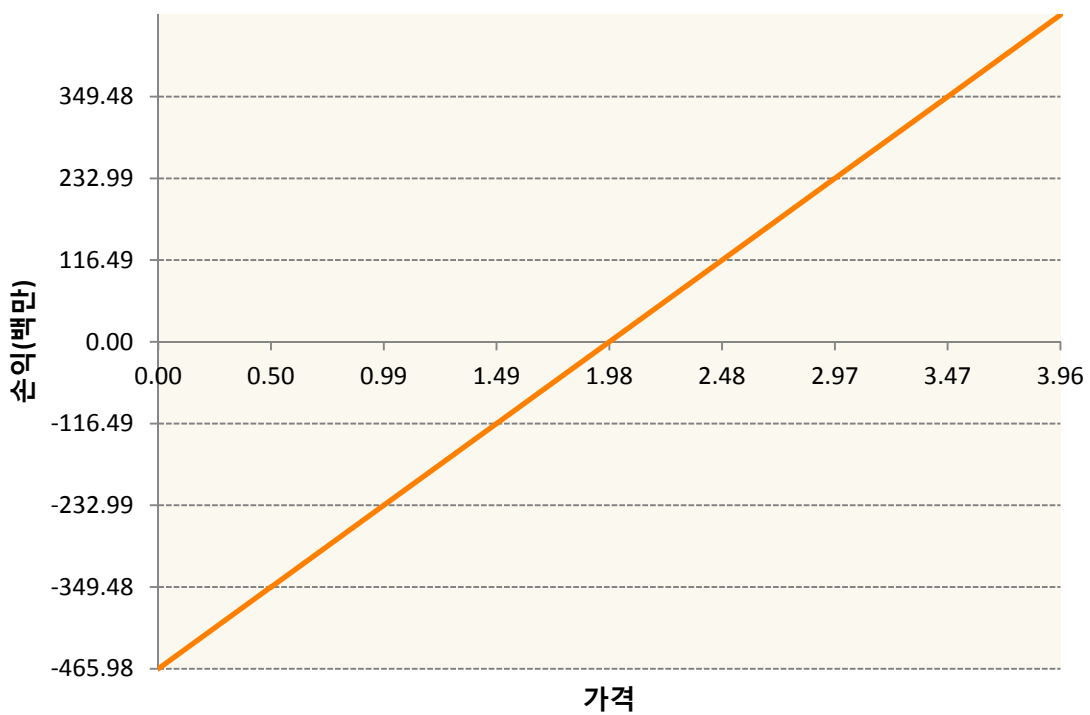




**NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18**



**XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18**



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	55
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	76
HOX8	Heating Oil	42
KR4175NA0	(2018-10 달러선물	49
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	73
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	37

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	424

공시일	2018-09-17
기준일	2018-09-14

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

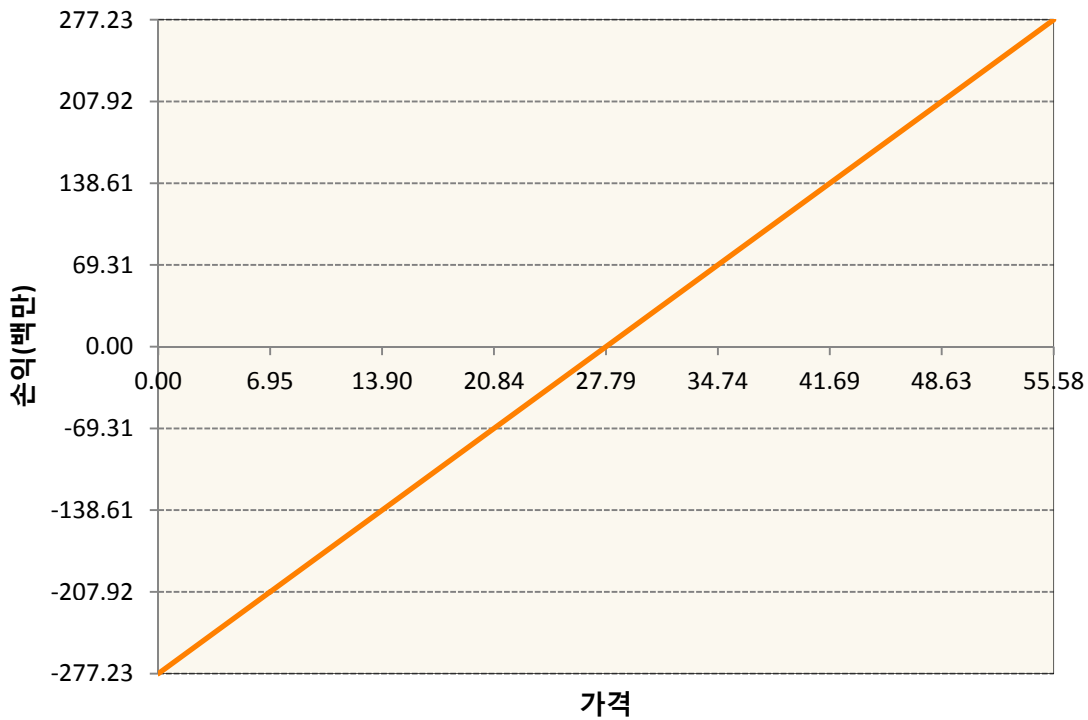
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

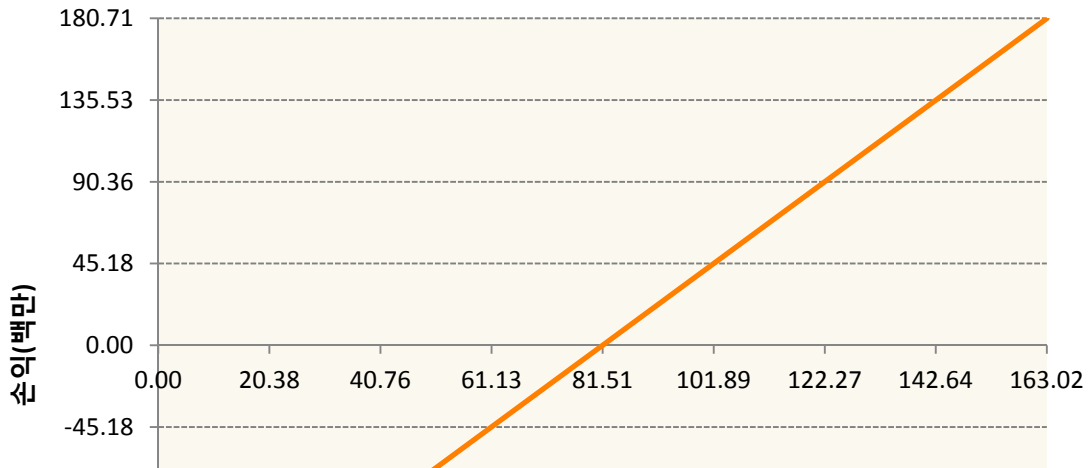
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,515	78	3,437	

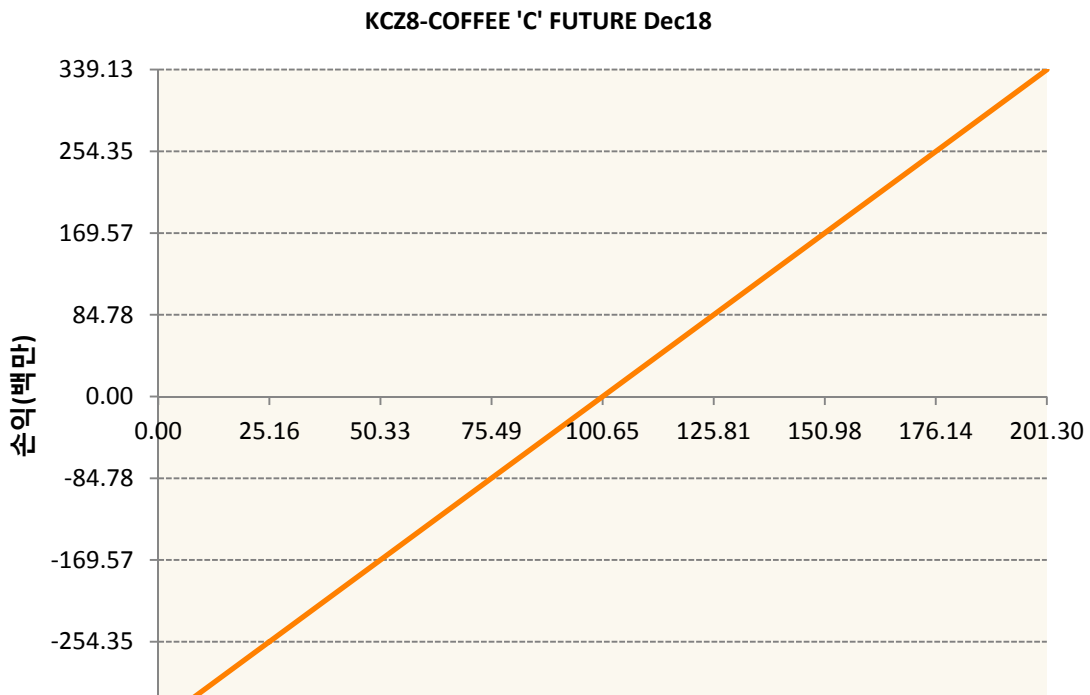
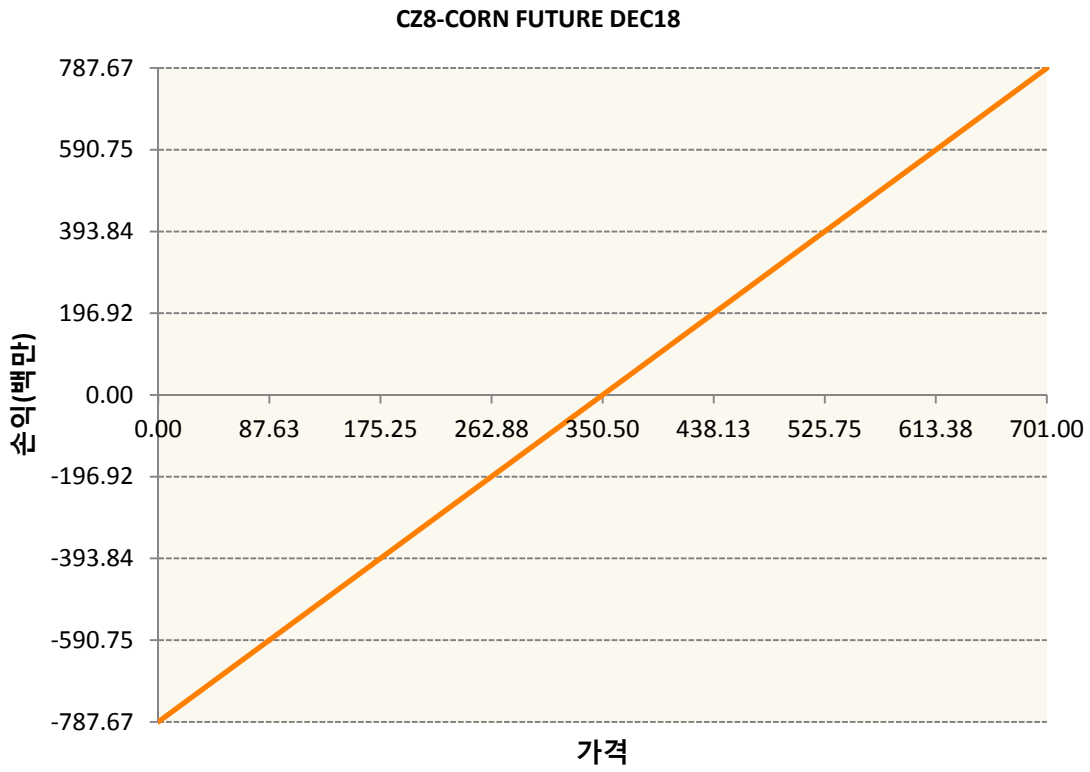
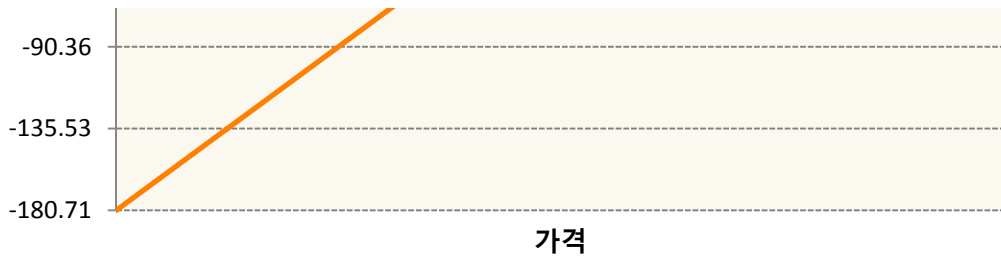
### 2. 만기시점의 손익구조

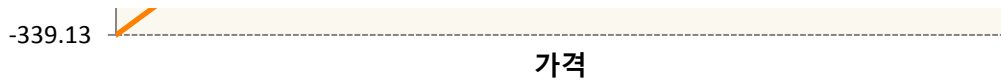
**BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18**



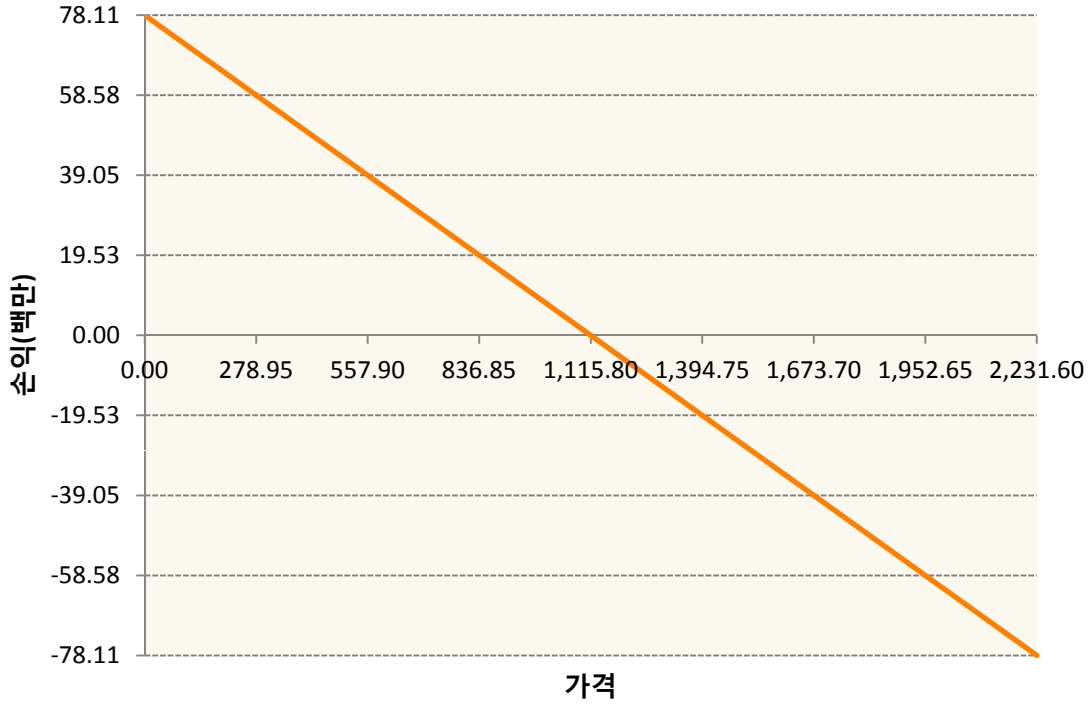
**CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18**



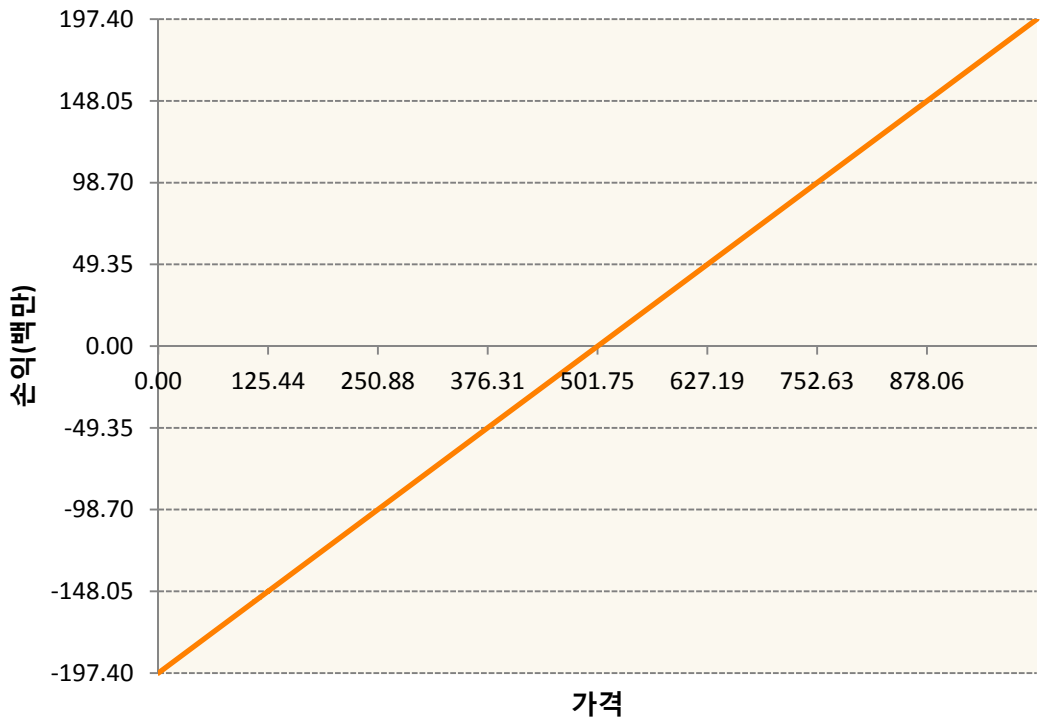




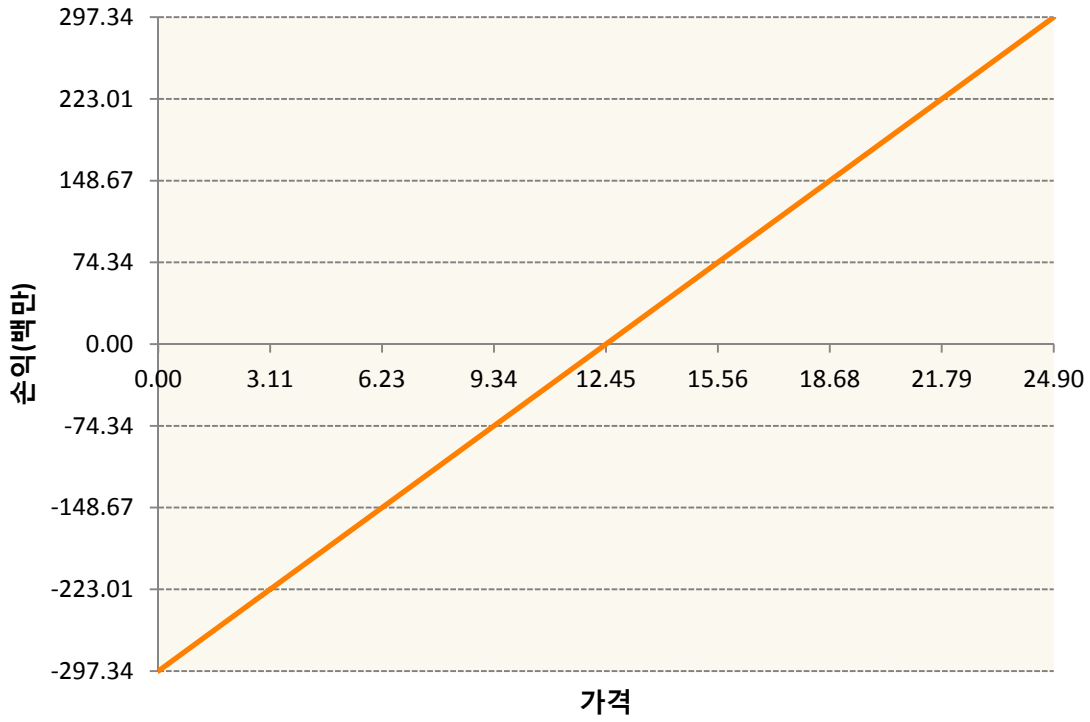
KR4175NA0007-2018-10 달러선물



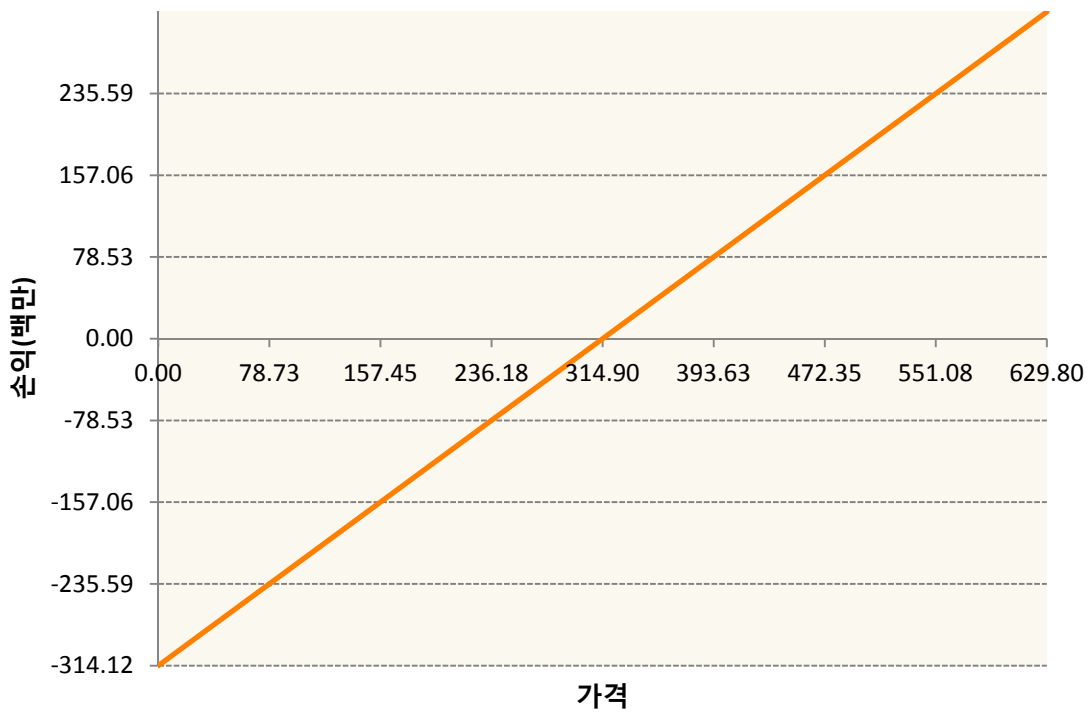
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

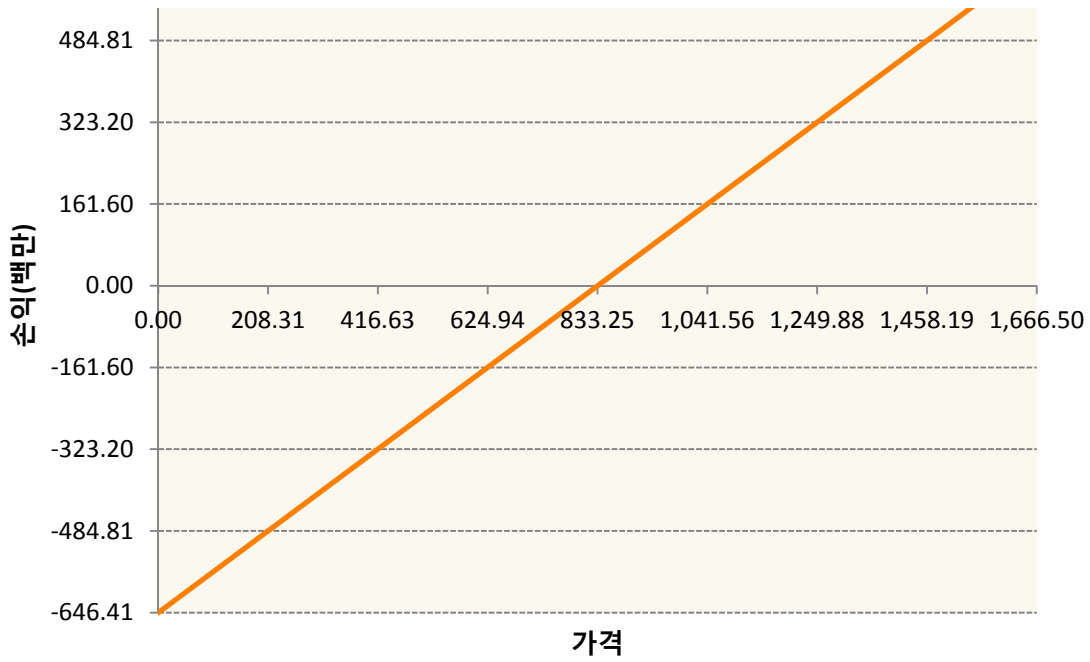


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

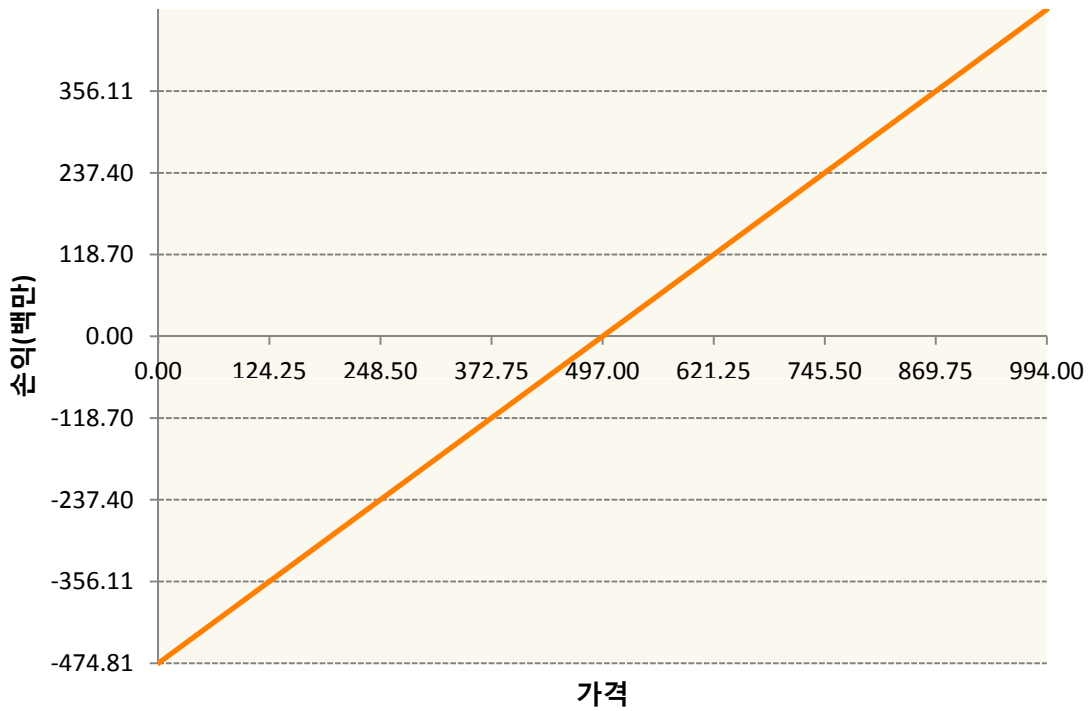


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





WZ8-WHEAT FUTURE(CBT) DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	22
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	14
CZ8	CORN FUTURE DEC18	63
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	27
KR4175NA0	(2018-10 달러선물	6

KWZ8	KC HRW WHEAT FUT DEC18	16
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	24
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	25
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	52
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	38

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

(단위:백만원)

**304**