

공시일	2018-09-18
기준일	2018-09-17

## 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	2018-09-18
기준일	2018-09-17

## 스마트인덱스모

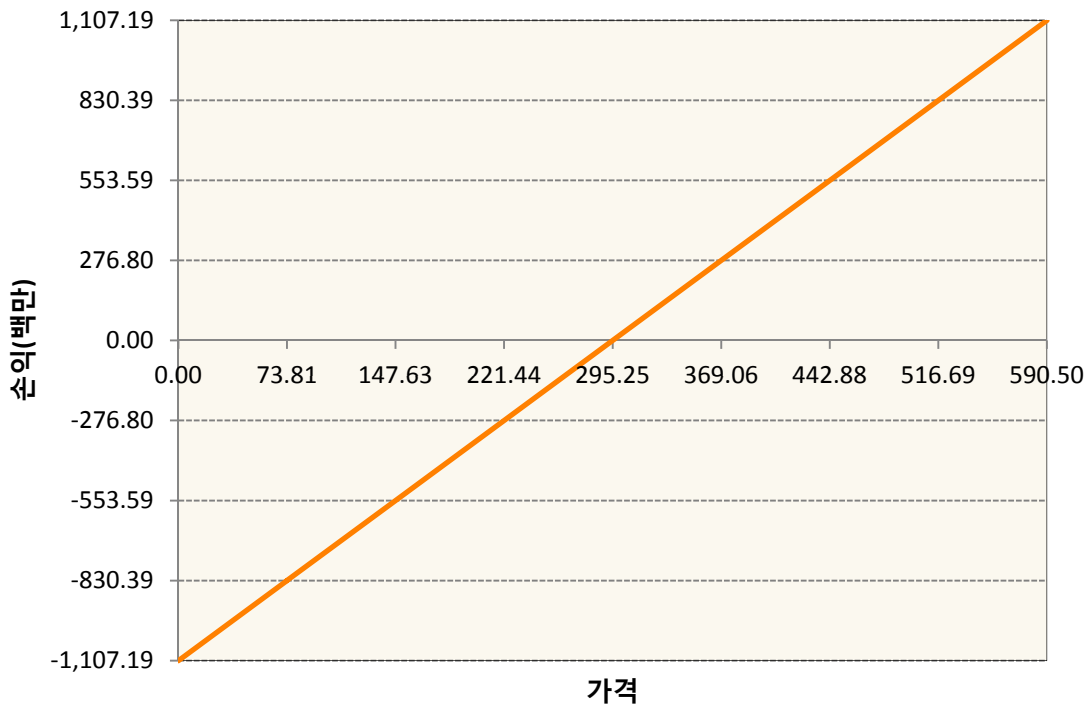
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,107	0	1,107	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)

67

공시일	2018-09-18
기준일	2018-09-17

## 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

1,150

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

487

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-18
기준일	2018-09-17

## 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

282

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

357

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-18
기준일	2018-09-17

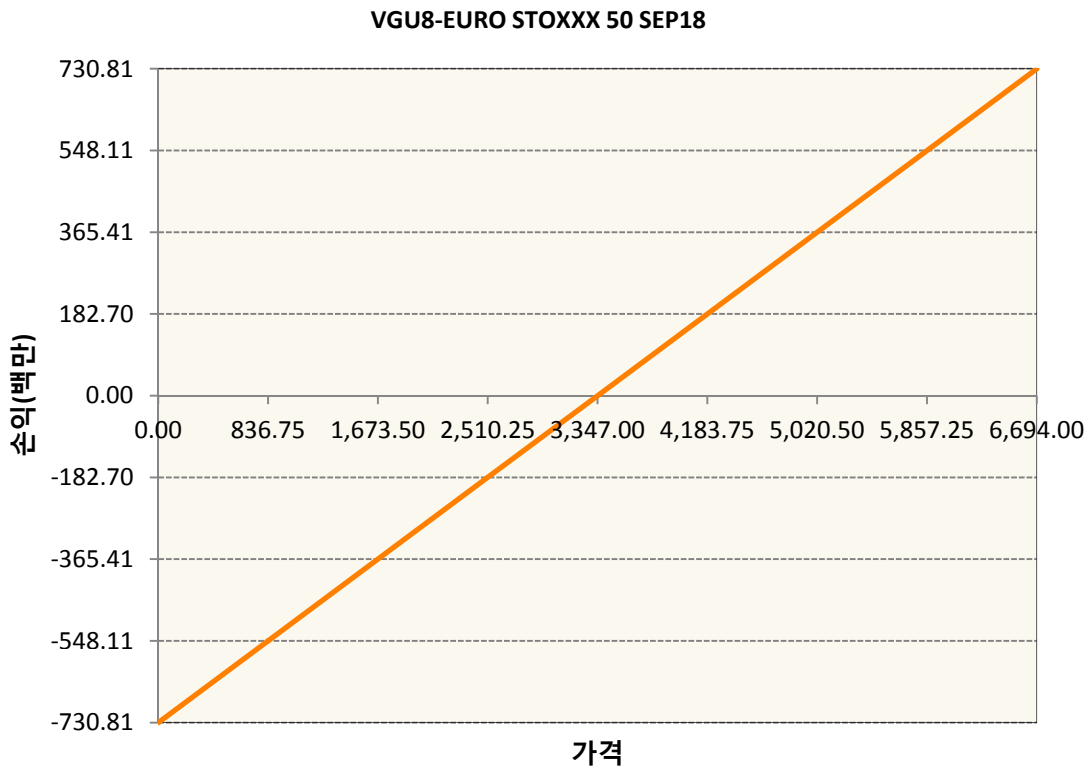
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	731	0	731	

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

37
----

공시일	2018-09-18
기준일	2018-09-17

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

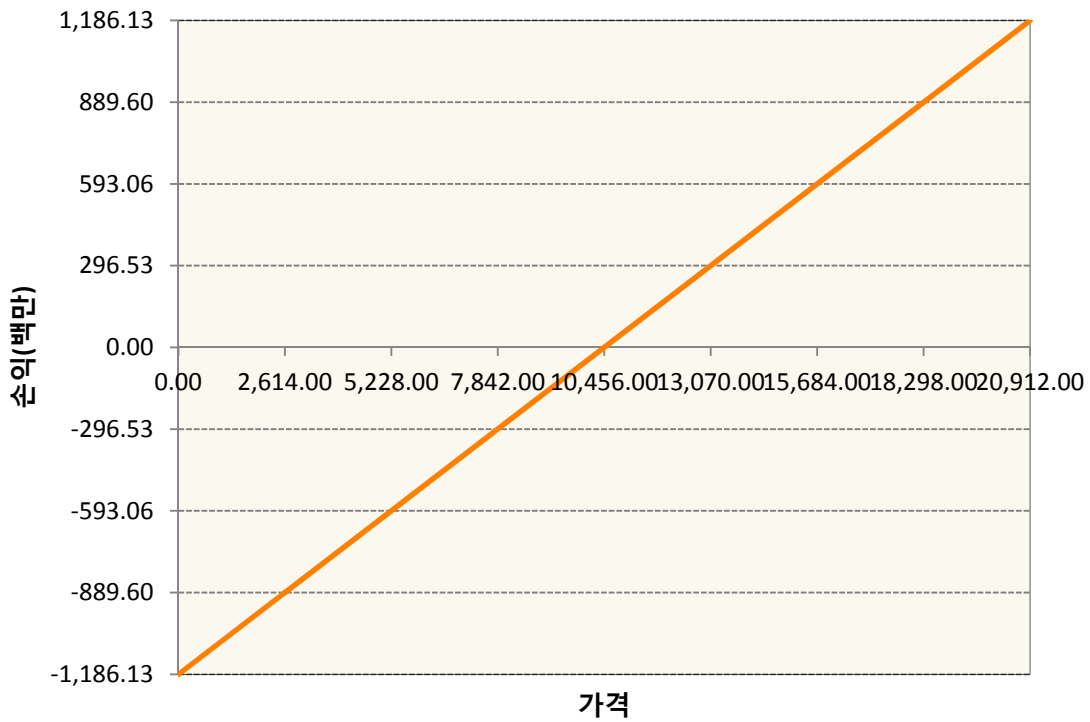
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

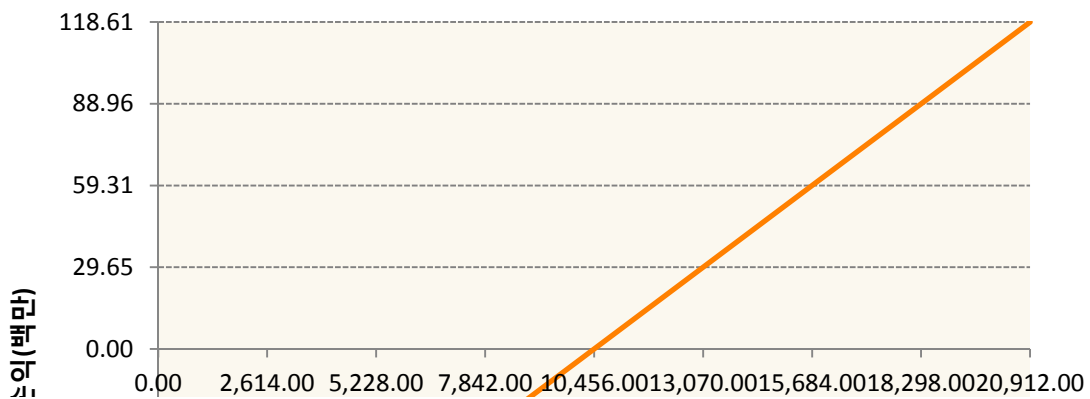
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	119	0	119	
누계	유가증권	선물	1,186	0	1,186	장내

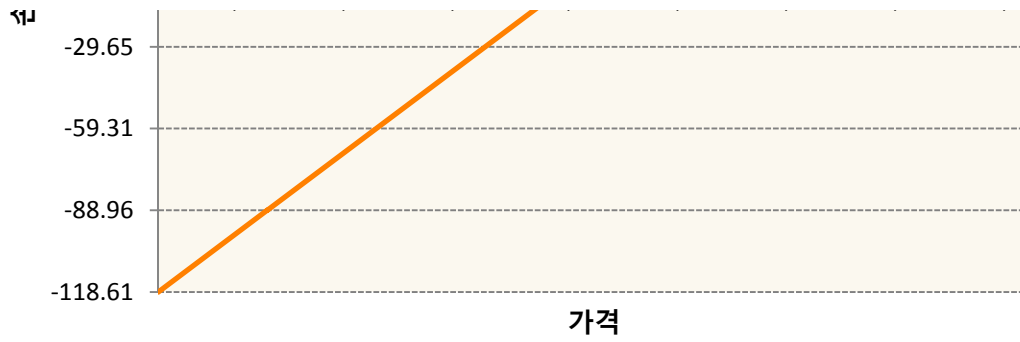
### 2. 만기시점의 손익구조

**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	95
MHCU8	MINI H-SHR IDX Fut Sep18	9

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

<b>96</b>
-----------

공시일	2018-09-18
기준일	2018-09-17

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

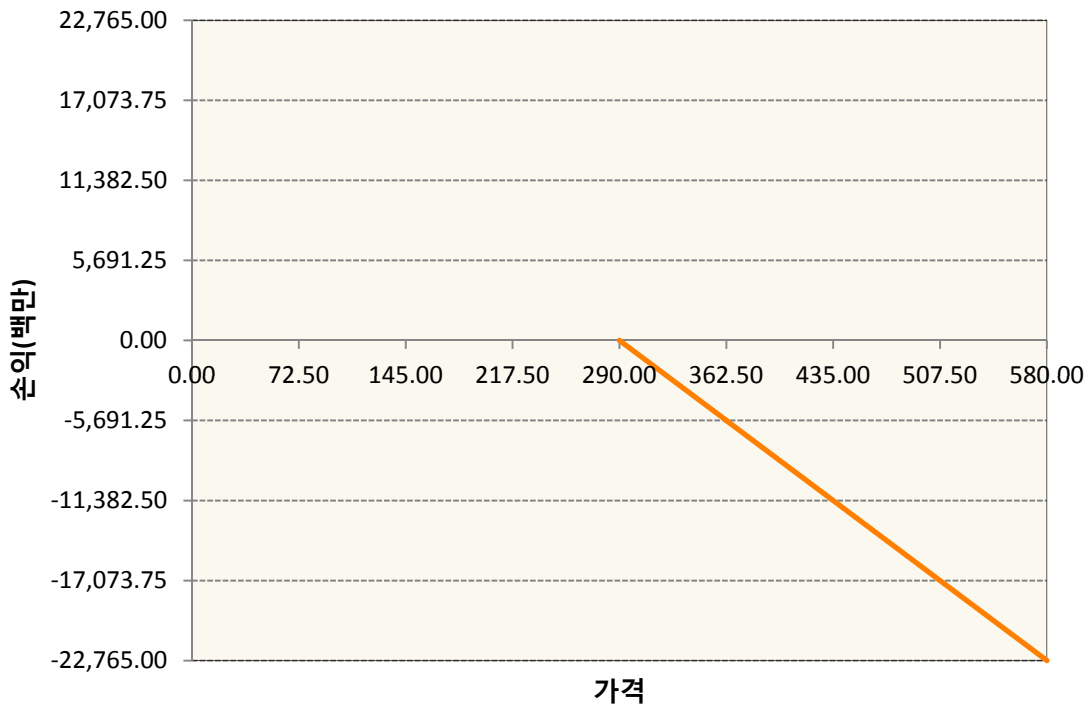
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

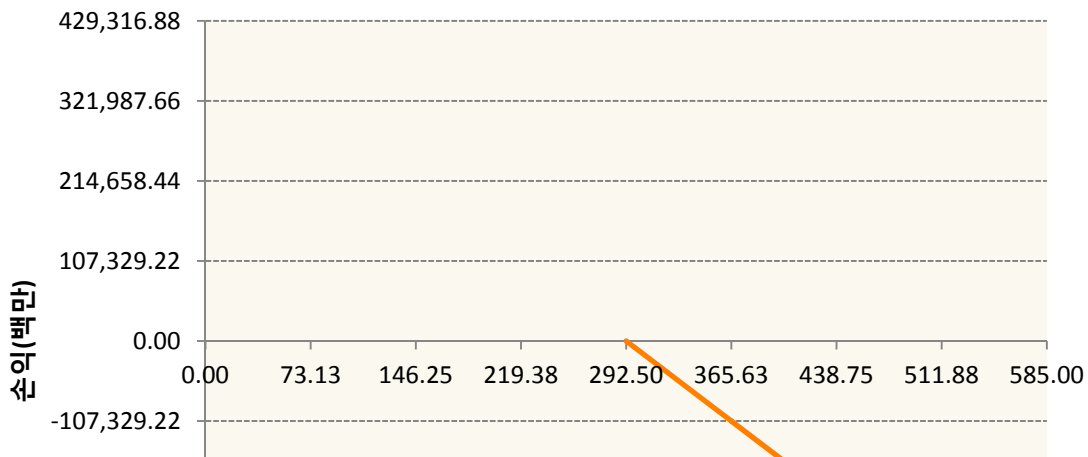
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	737,269	-737,269	장내

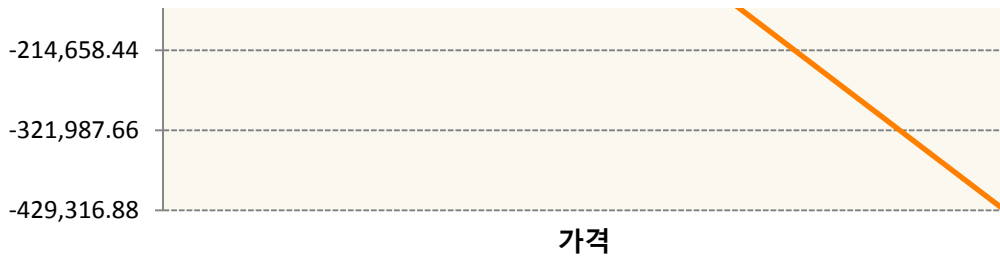
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201NA2902-2018-10 콜290**

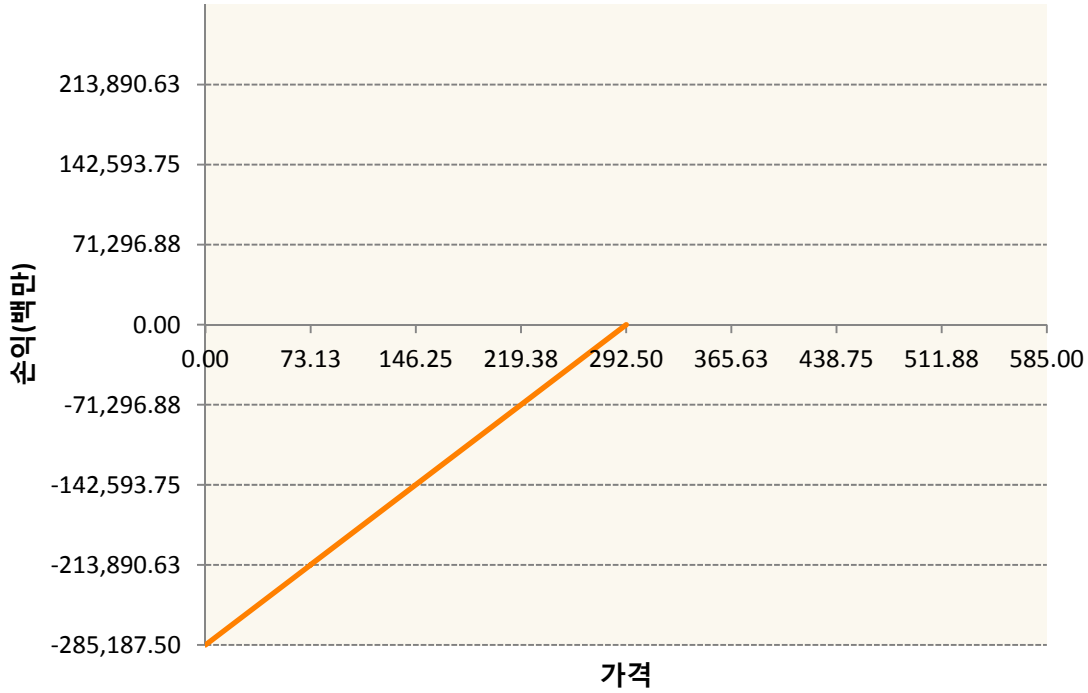


**KR4201NA2928-2018-10 콜292.5**





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NA2927-2018-10 콜290

1,545

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	797	773	746	715	682	647	611
-5.33%	693	653	611	568	523	478	432
-2.67%	485	434	383	332	281	230	178
0%	150	100	50	0	-51	-102	-153
2.67%	-302	-340	-380	-423	-467	-512	-558
5.33%	-838	-861	-889	-919	-953	-988	-1,026
8.00%	-1,422	-1,434	-1,449	-1,469	-1,491	-1,517	-1,545

KR4201NA2927-2018-10 풋292.5

27,863

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13,144	12,774	12,337	11,840	11,291	10,699	10,069

-5.33%	11,639	10,969	10,254	9,504	8,726	7,925	7,104
-2.67%	8,414	7,496	6,570	5,637	4,698	3,755	2,809
0%	2,912	1,943	973	0	-974	-1,949	-2,924
2.67%	-4,881	-5,685	-6,521	-7,381	-8,261	-9,156	-10,063
5.33%	-14,460	-14,995	-15,595	-16,249	-16,949	-17,685	-18,453
8.00%	-25,138	-25,429	-25,794	-26,227	-26,720	-27,268	-27,863

KR4301NA29 2018-10 풋 292.5

18,255

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-18,174	-18,176	-18,180	-18,189	-18,203	-18,225	-18,255
-5.33%	-10,551	-10,591	-10,648	-10,721	-10,811	-10,916	-11,035
-2.67%	-3,577	-3,782	-3,999	-4,225	-4,458	-4,696	-4,940
0%	788	529	266	0	-268	-538	-809
2.67%	2,071	1,981	1,871	1,742	1,597	1,436	1,264
5.33%	2,213	2,203	2,186	2,158	2,119	2,066	2,000
8.00%	2,218	2,218	2,217	2,214	2,208	2,198	2,183

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

(단위:백만원)

**48,954**

공시일	2018-09-18
기준일	2018-09-17

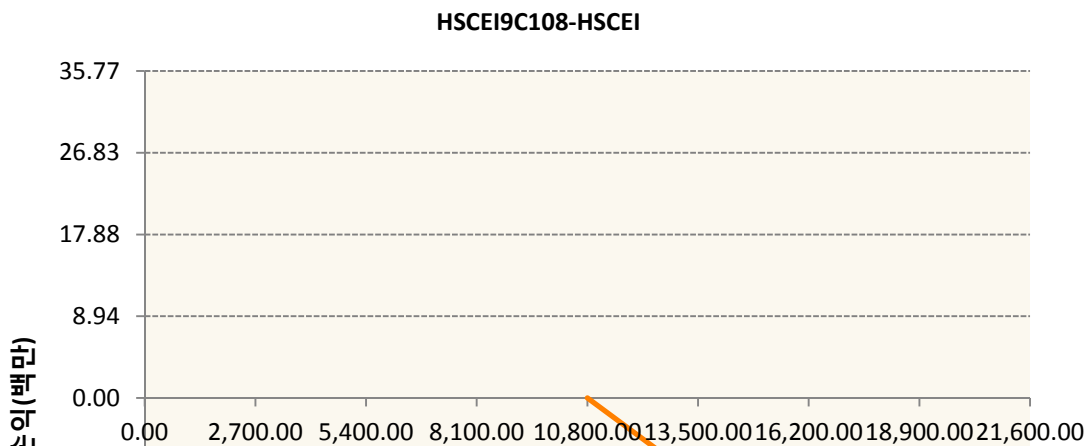
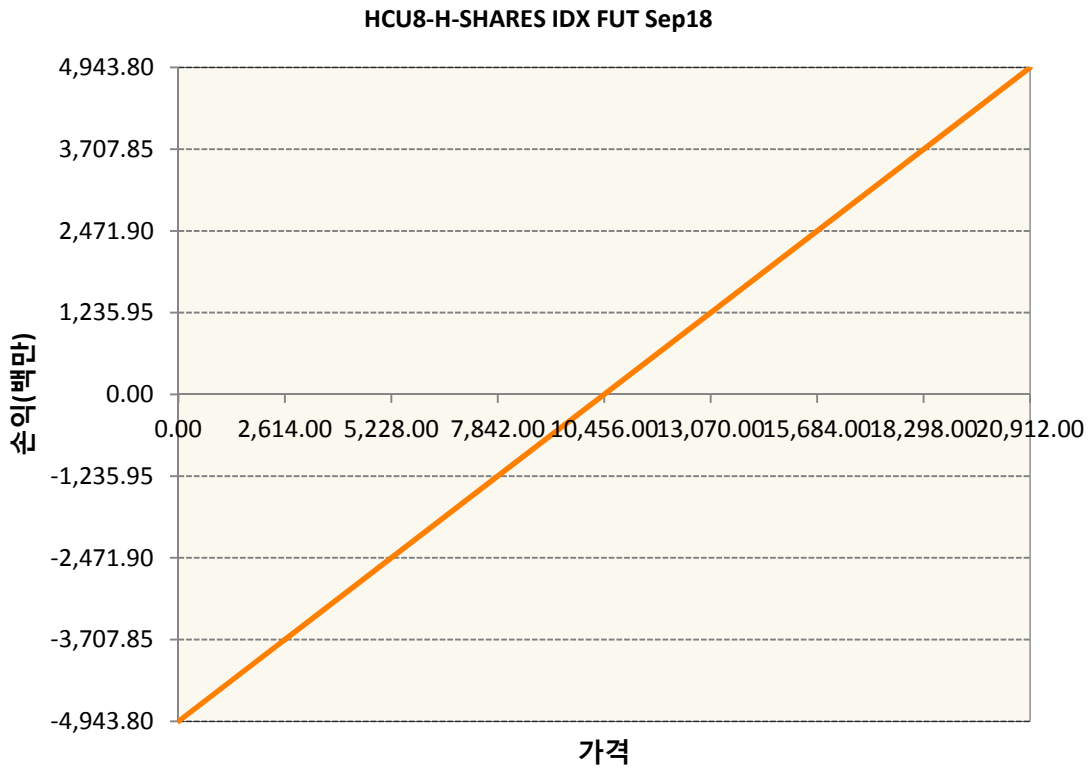
## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

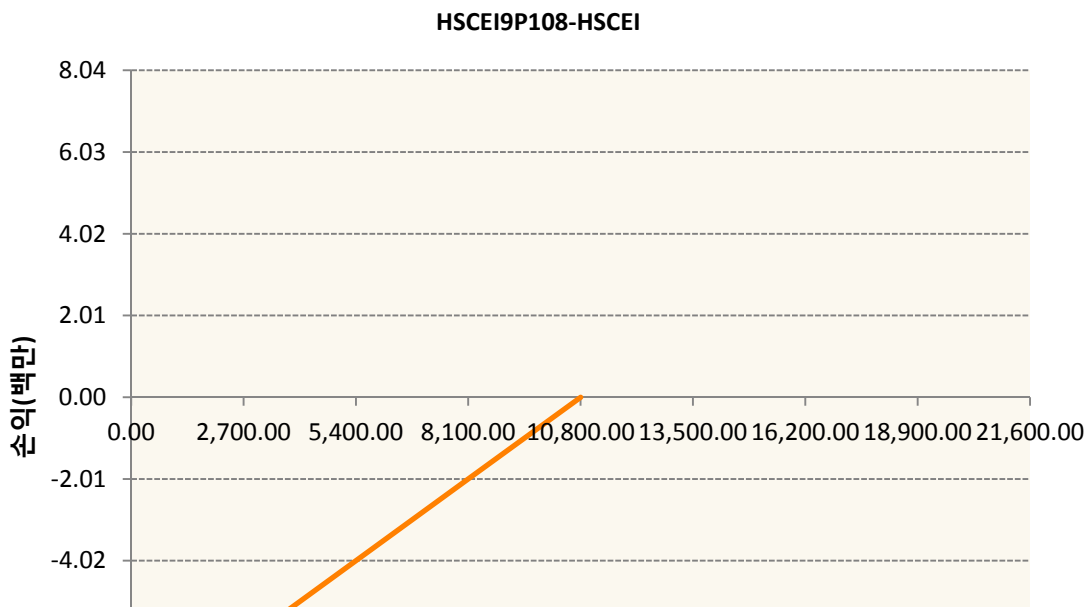
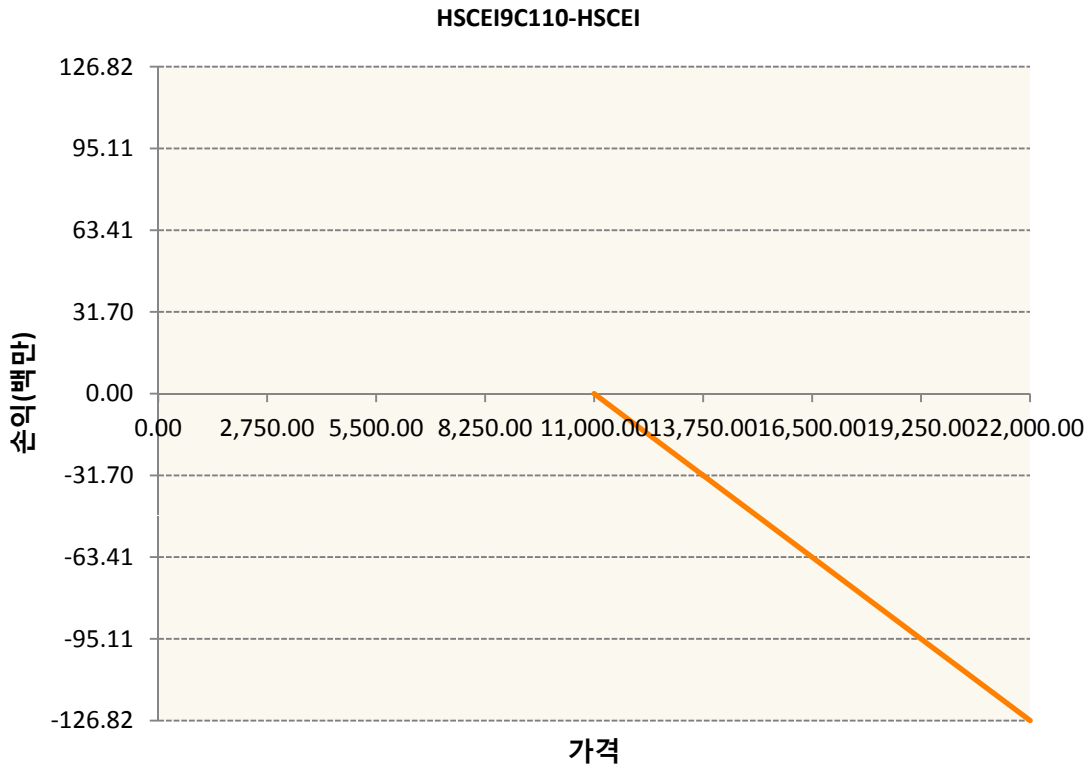
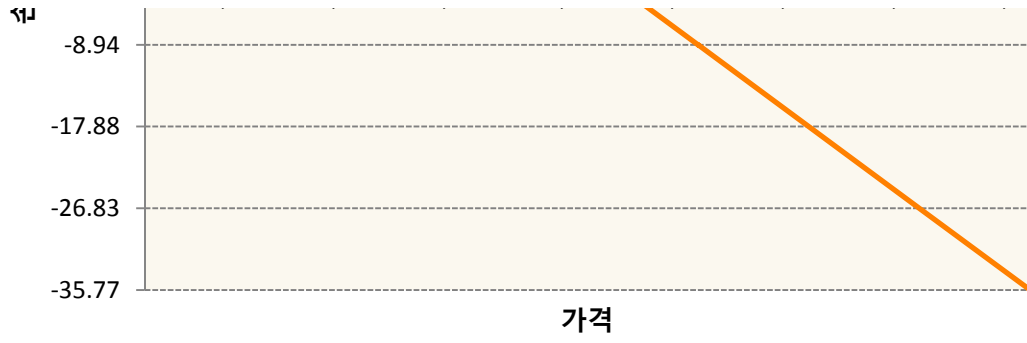
### 1. 계약금액

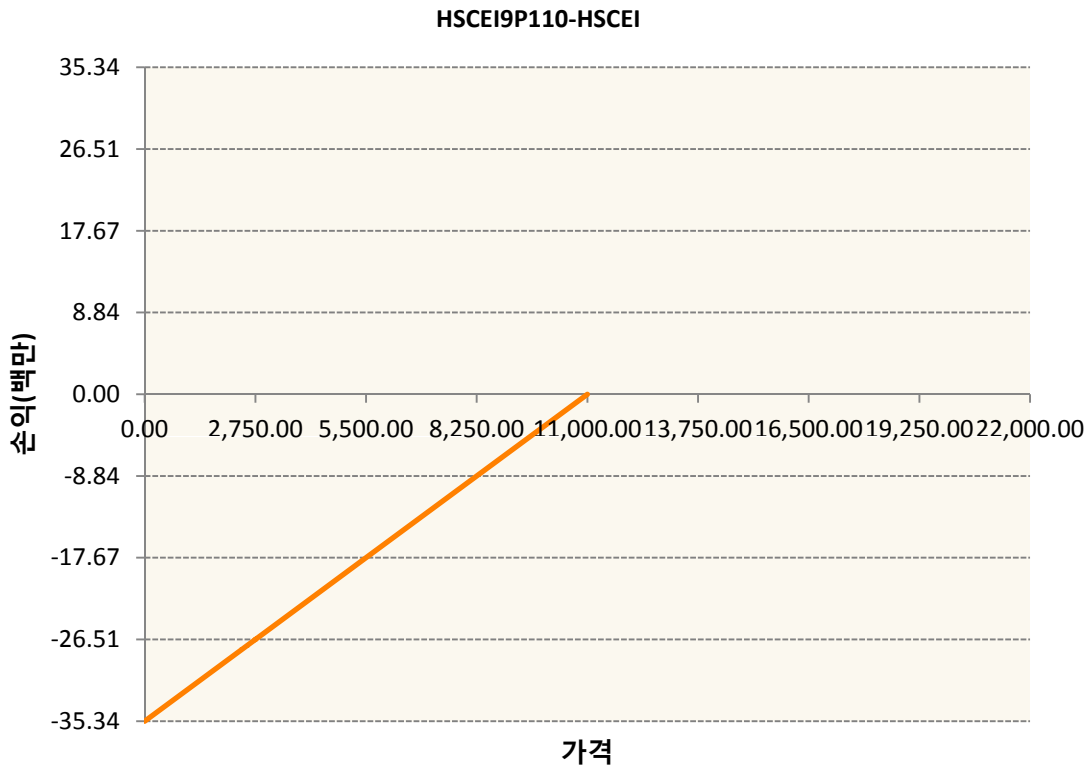
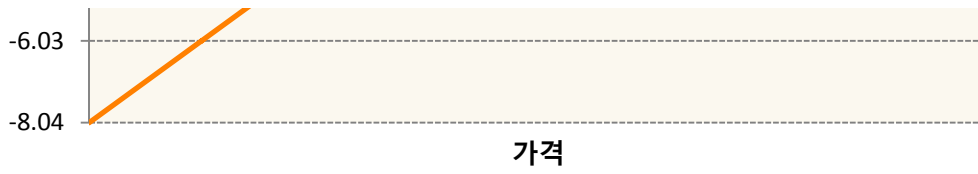
(단위:백만원)

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	4,944	0	4,944	장내
누계	유가증권	옵션	0	206	-206	장내

### 2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU8	H-SHARES IDX FUT Sep18	395
HSCEI9C108	HSCEI	3
HSCEI9C110	HSCEI	10
HSCEI9P108	HSCEI	1
HSCEI9P110	HSCEI	3

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	380

공시일	2018-09-18
기준일	2018-09-17

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

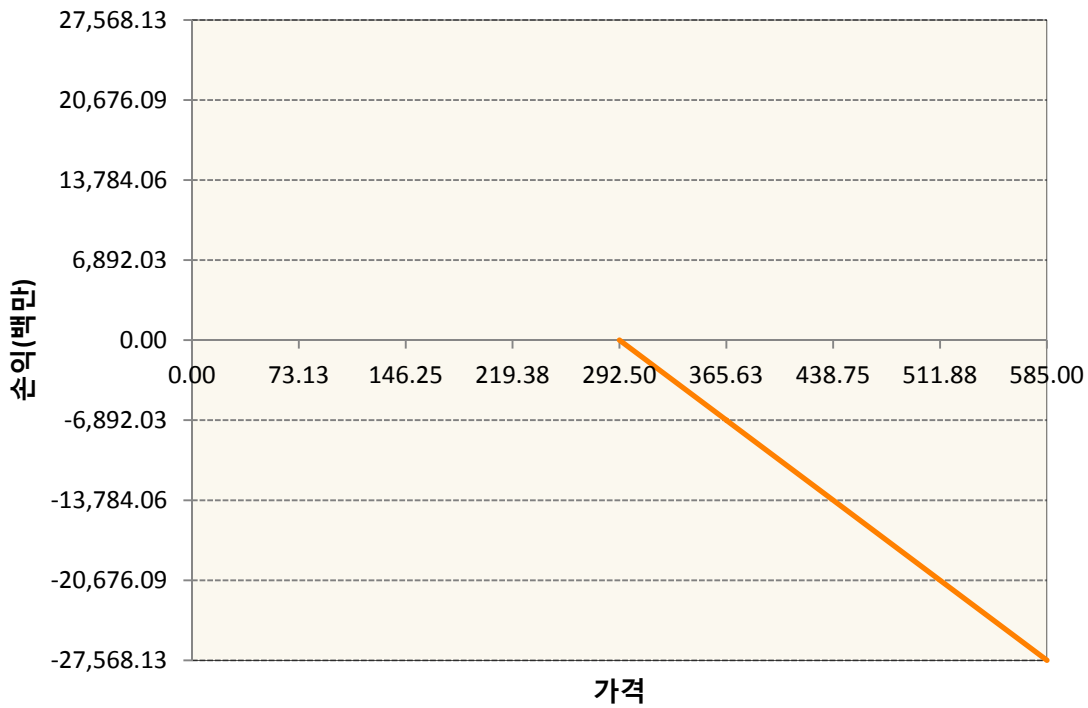
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

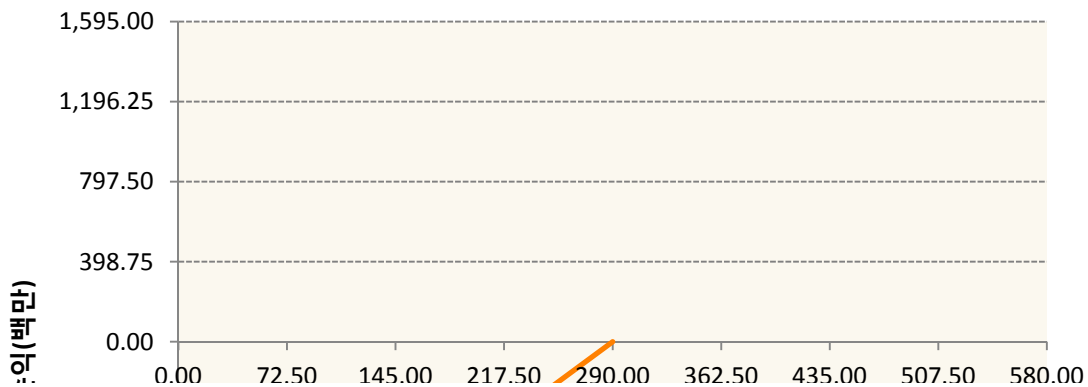
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	48,761	-48,761	장내

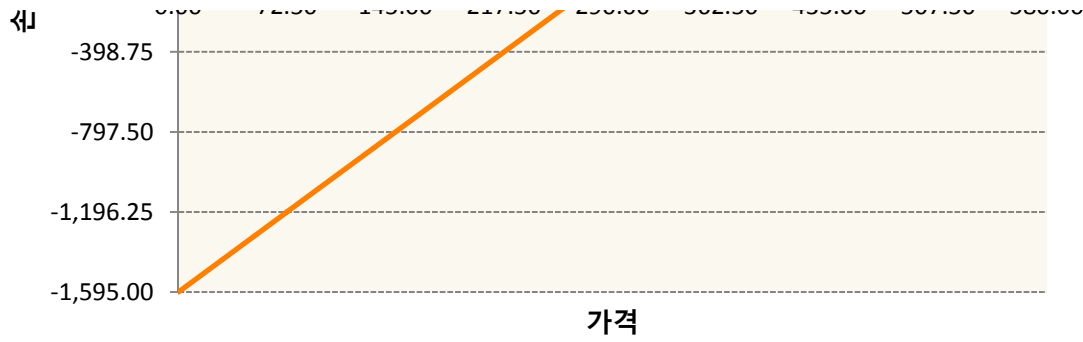
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201NA2928-2018-10 콜292.5

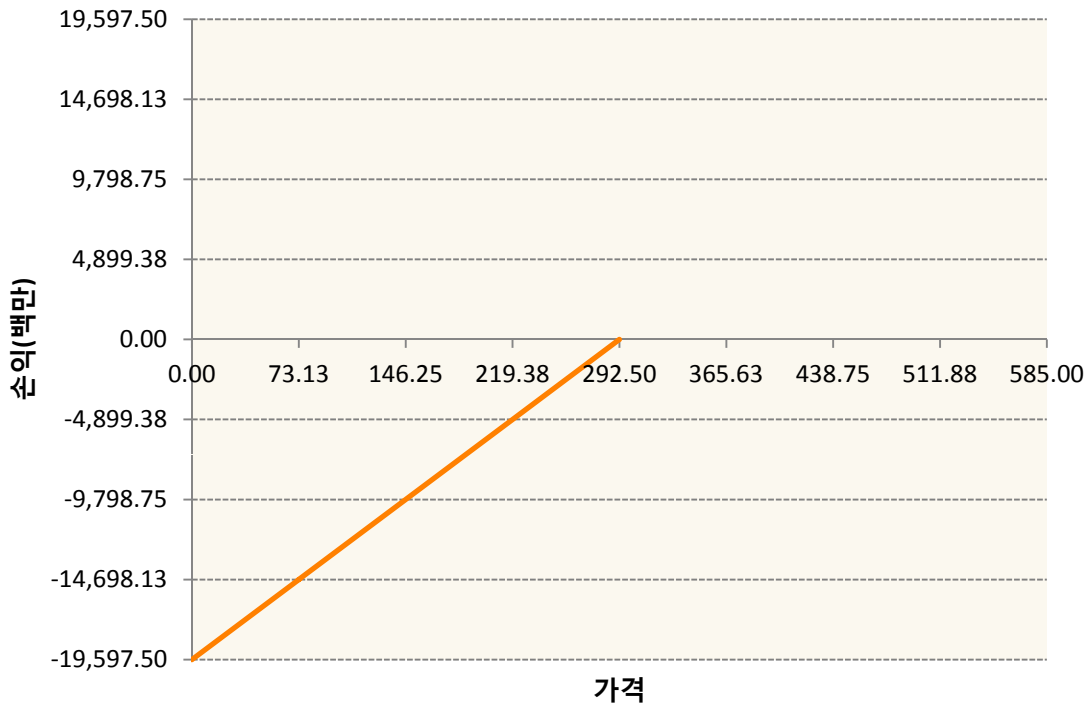


KR4301NA2901-2018-10 풋290





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 콜292.5							1,789
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	844	820	792	760	725	687	647
-5.33%	747	704	658	610	560	509	456
-2.67%	540	481	422	362	302	241	180
0%	187	125	62	0	-63	-125	-188
2.67%	-313	-365	-419	-474	-530	-588	-646
5.33%	-929	-963	-1,001	-1,043	-1,088	-1,136	-1,185
8.00%	-1,614	-1,633	-1,656	-1,684	-1,716	-1,751	-1,789

KR4301NA2☹ 2018-10 풋290

94

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-93	-93	-93	-94	-94	-94	-94
-5.33%	-51	-51	-52	-52	-53	-54	-55
-2.67%	-15	-16	-18	-19	-20	-22	-23
0%	4	3	1	0	-1	-3	-4
2.67%	8	7	7	7	6	5	5
5.33%	8	8	8	8	8	8	7
8.00%	8	8	8	8	8	8	8

KR4301NA2☹ 2018-10 풋292.5

1,254

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,249	-1,249	-1,249	-1,250	-1,251	-1,252	-1,254
-5.33%	-725	-728	-732	-737	-743	-750	-758
-2.67%	-246	-260	-275	-290	-306	-323	-339
0%	54	36	18	0	-18	-37	-56
2.67%	142	136	129	120	110	99	87
5.33%	152	151	150	148	146	142	137
8.00%	152	152	152	152	152	151	150

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

(단위:백만원)

7,218

공시일	2018-09-18
기준일	2018-09-17

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

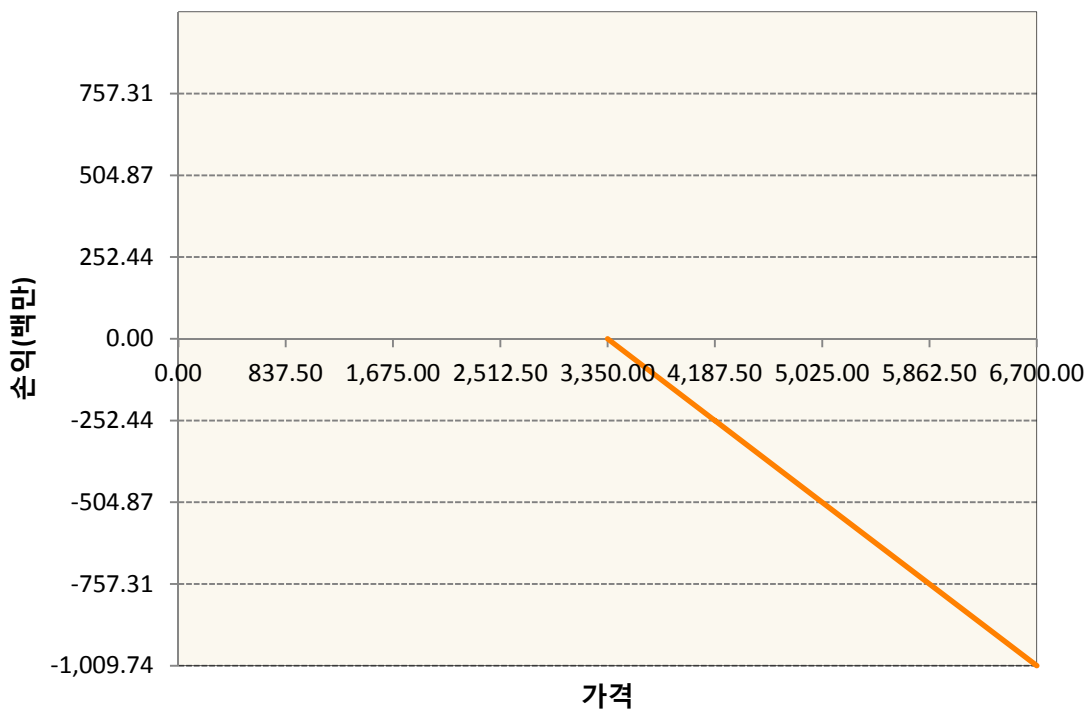
### 1. 계약금액

(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	5,481	0	5,481	
누계	유가증권	스왑	34,606	0	34,606	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,284	-25,284	장내
누계	지수	스왑	53,201	0	53,201	장외

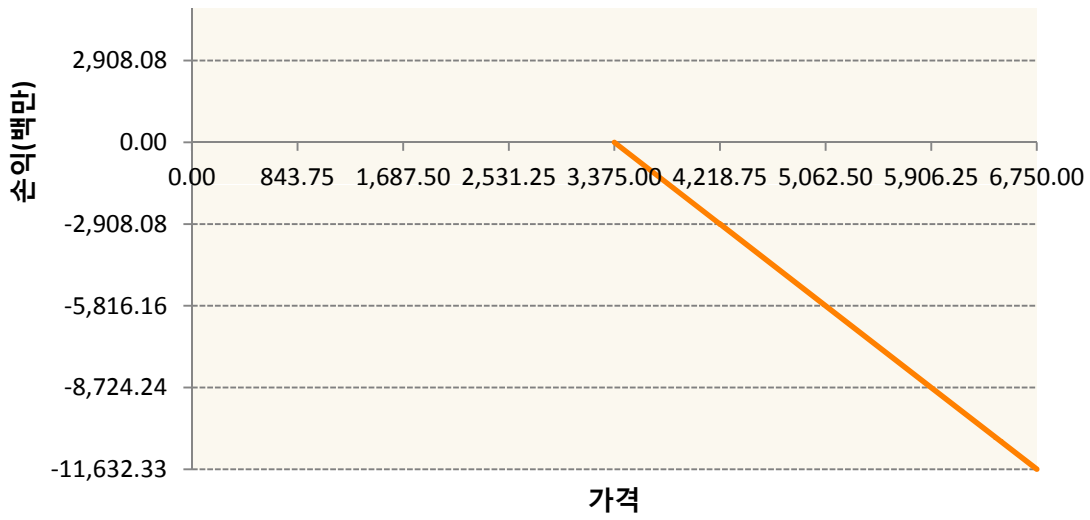
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXU8-C3350-EURO STOXX 50**

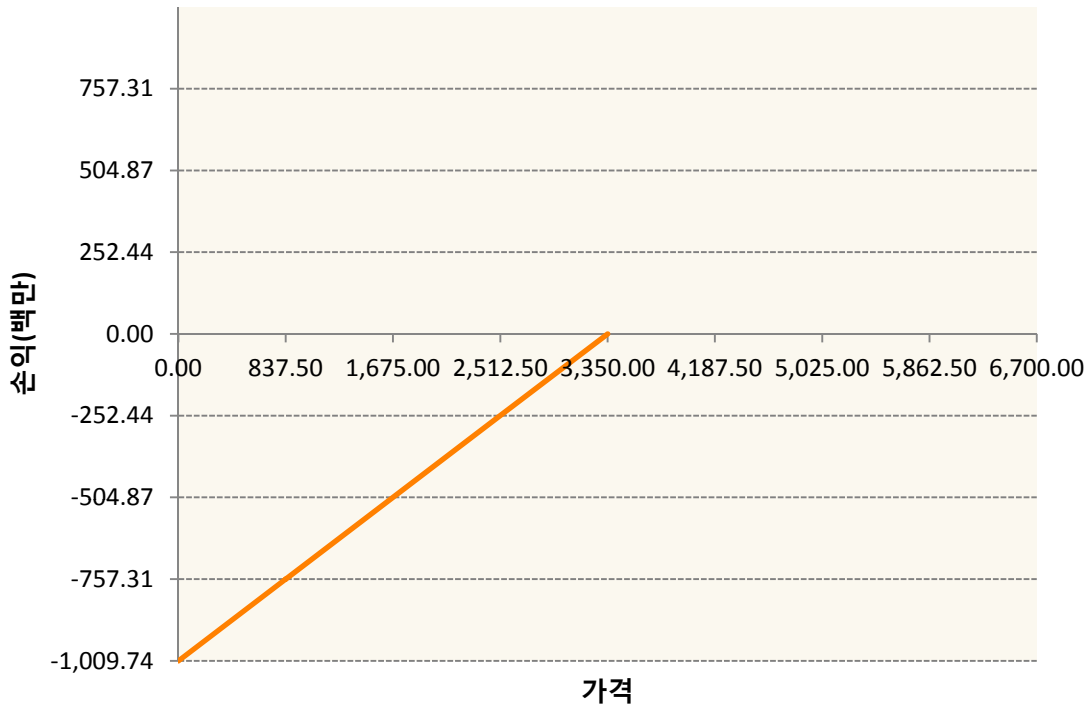


**OESXU8-C3375-EURO STOXX 50**

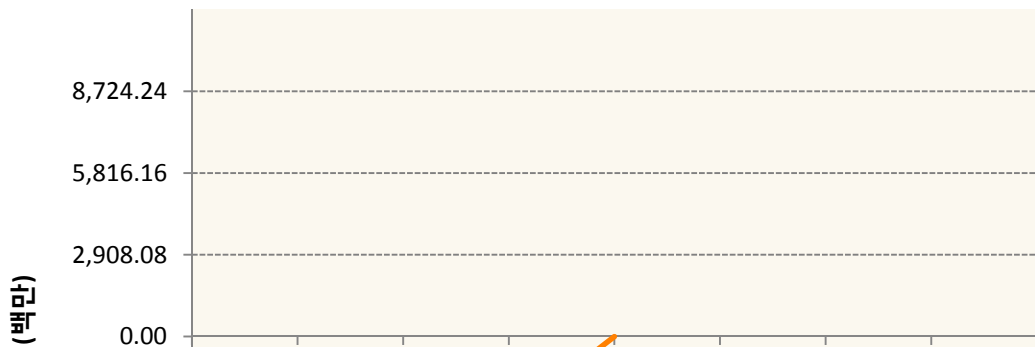


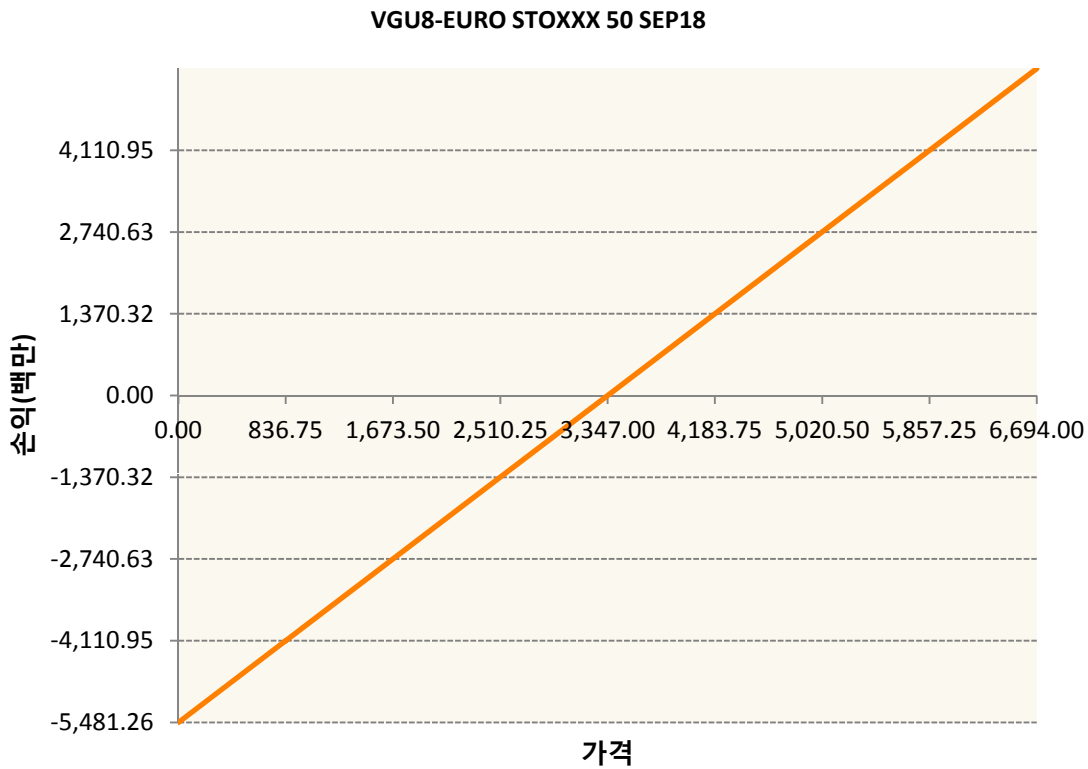
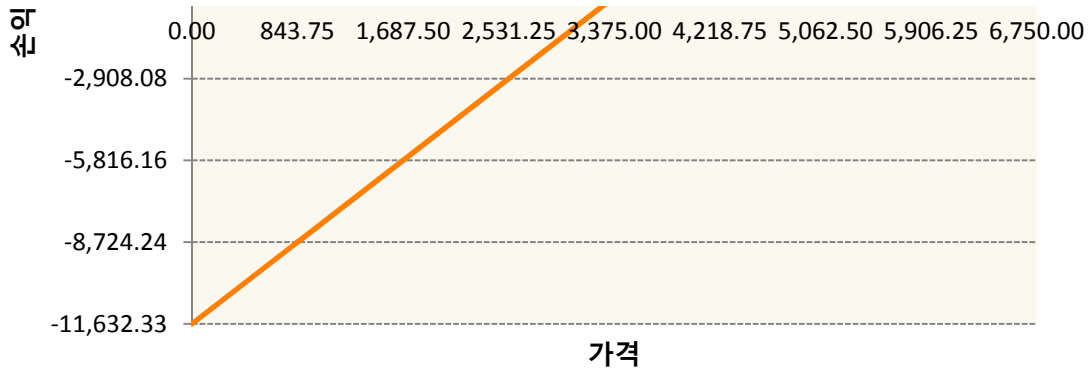


OESXU8-P3350-EURO STOXX 50



OESXU8-P3375-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		32
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY		21
OESXU8-C3E EURO STOXX 50		81
OESXU8-C3E EURO STOXX 50		931
OESXU8-P3E EURO STOXX 50		81
OESXU8-P3E EURO STOXX 50		931
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18		438

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





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

(단위:백만원)

1,134



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

(단위:백만원)

89



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

(단위:백만원)

134



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

(단위:백만원)

164



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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-09-18
기준일	2018-09-17

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

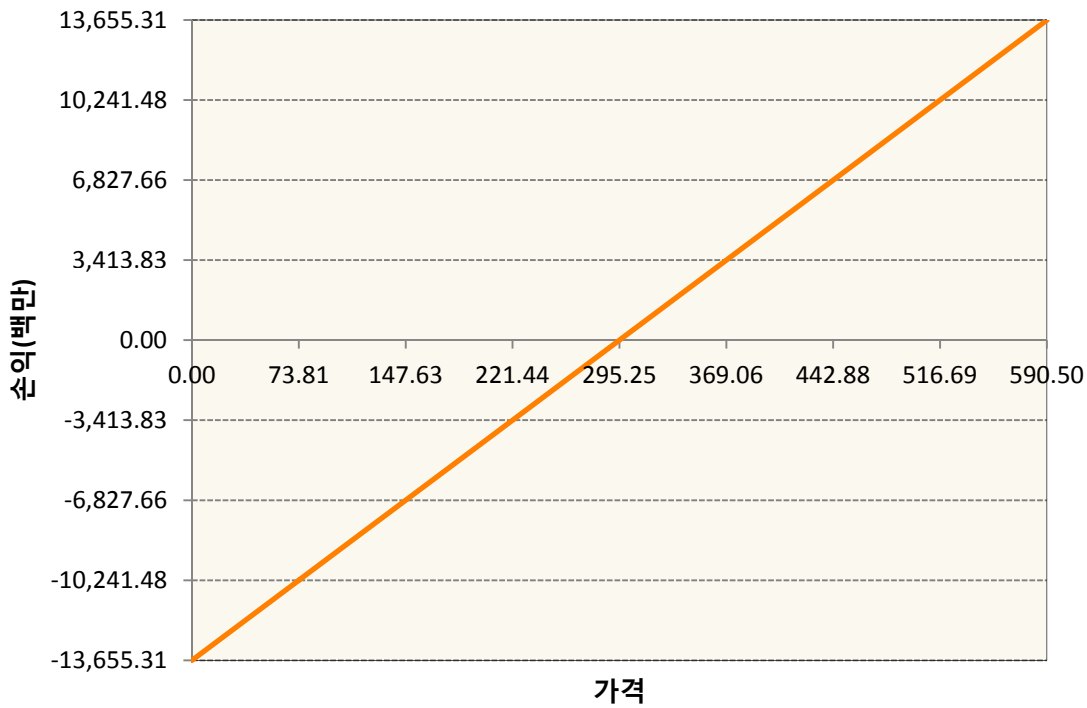
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

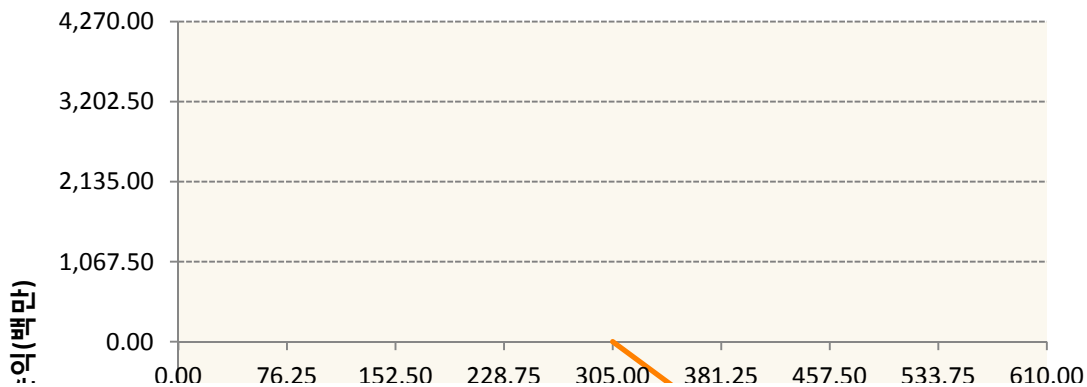
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,655	0	13,655	장내
누계	유가증권	옵션	2,119	24,258	-22,138	장내

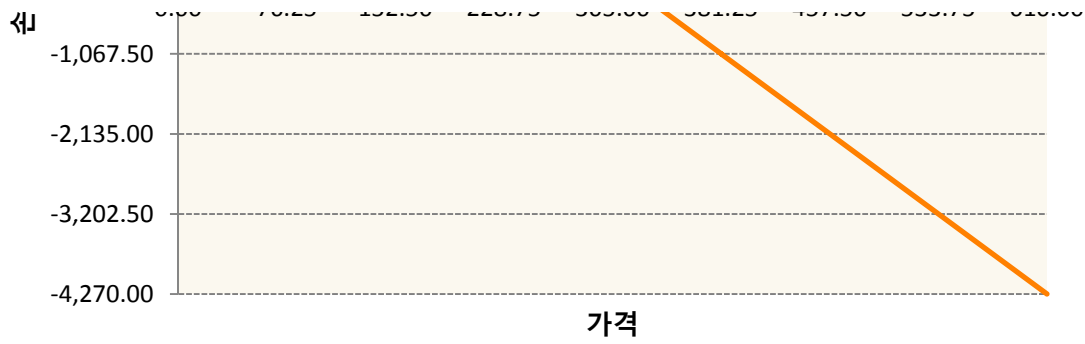
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

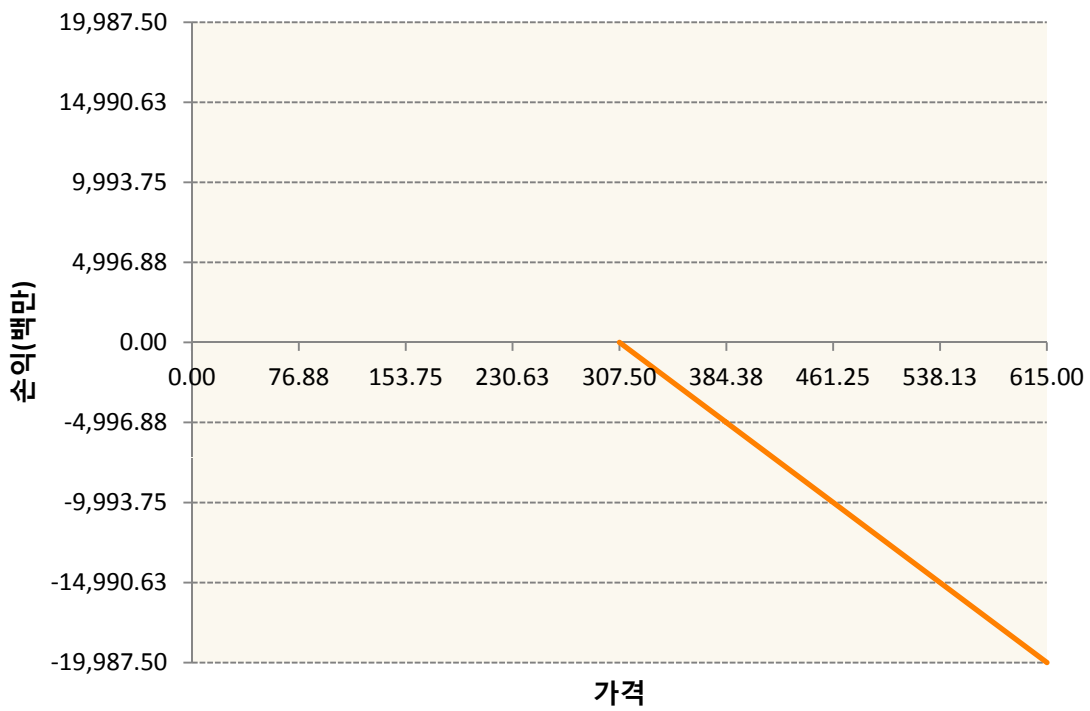


KR4201NA3058-2018-10 콜305

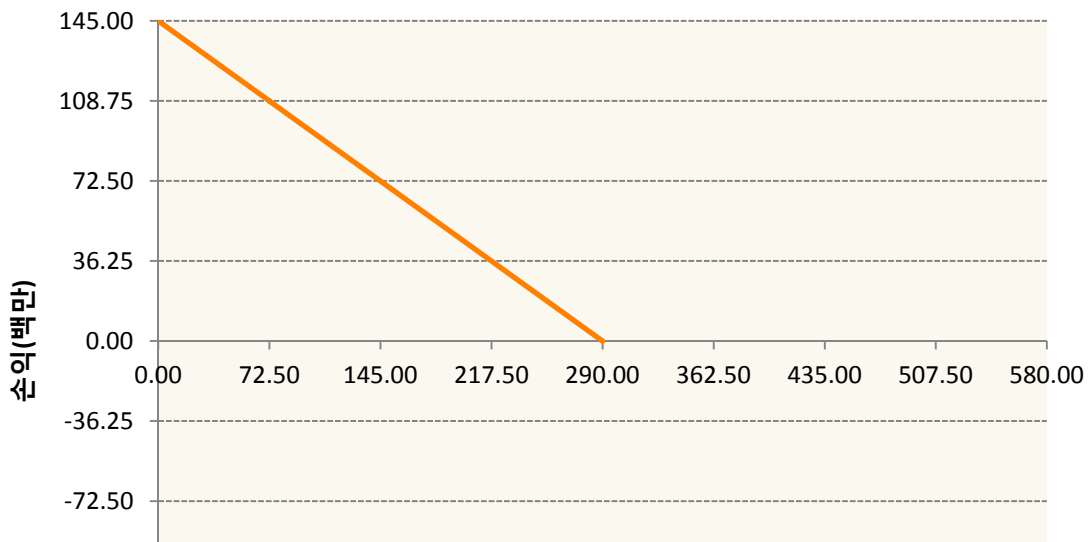


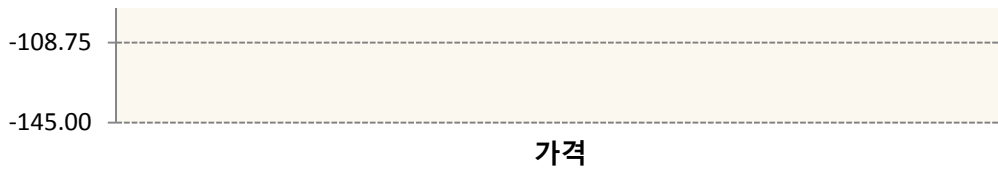


KR4201NA3074-2018-10 콜307.5

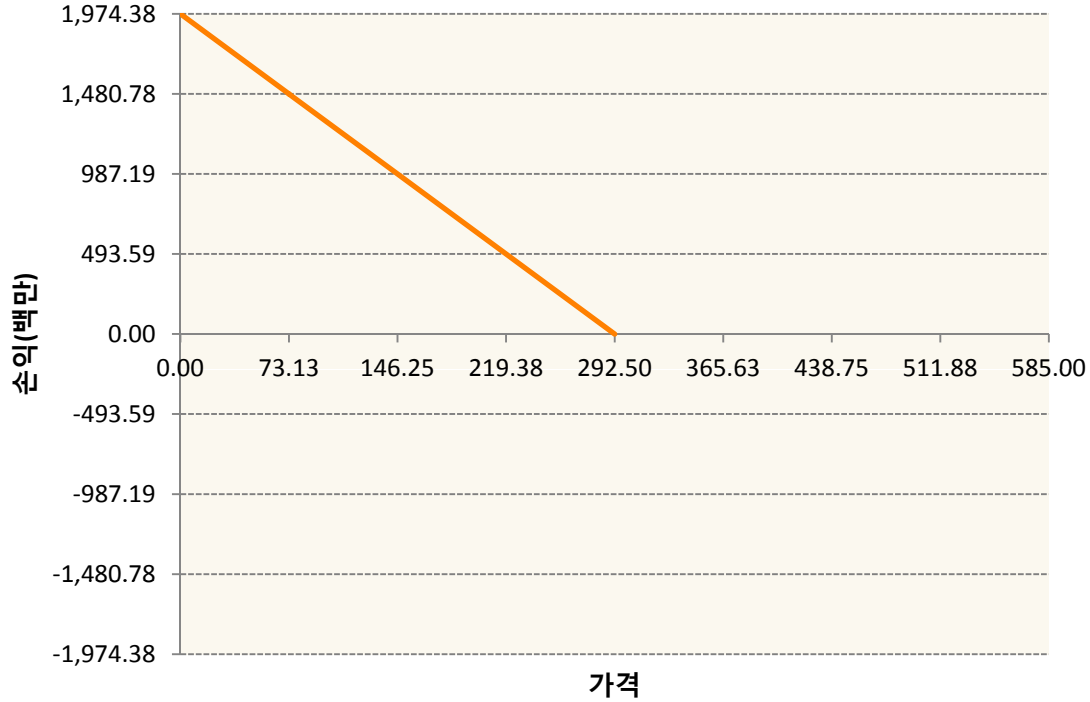


KR4301NA2901-2018-10 풋290





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 1,092

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,092	-1,092	-1,092	-1,092	-1,092	-1,092	-1,092
-5.33%	-728	-728	-728	-728	-728	-728	-728
-2.67%	-364	-364	-364	-364	-364	-364	-364
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	364	364	364	364	364	364	364
5.33%	728	728	728	728	728	728	728
8.00%	1,092	1,092	1,092	1,092	1,092	1,092	1,092

KR4201NA3(2018-10 콜305) 206

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	58	57	56	54	51	48	45
-5.33%	55	53	49	46	41	36	31
-2.67%	46	41	35	29	22	15	8

0%	25	17	8	0	-9	-17	-26
2.67%	-15	-25	-35	-44	-54	-64	-73
5.33%	-77	-86	-95	-105	-114	-124	-133
8.00%	-158	-165	-173	-181	-189	-197	-206

KR4201NA3(2018-10 콜307.5

895

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	225	222	217	210	200	189	175
-5.33%	216	206	194	179	162	141	119
-2.67%	184	164	141	115	87	57	26
0%	106	72	37	0	-38	-77	-116
2.67%	-51	-94	-138	-182	-227	-271	-315
5.33%	-305	-350	-395	-440	-485	-530	-576
8.00%	-654	-692	-730	-770	-811	-852	-895

KR4301NA2(2018-10 풋290

9

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8	8	8	9	9	9	9
-5.33%	5	5	5	5	5	5	5
-2.67%	1	1	2	2	2	2	2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	0	0
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1

KR4301NA2(2018-10 풋292.5

126

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	126	126	126	126	126	126	126
-5.33%	73	73	74	74	75	76	76
-2.67%	25	26	28	29	31	33	34
0%	-5	-4	-2	0	2	4	6
2.67%	-14	-14	-13	-12	-11	-10	-9
5.33%	-15	-15	-15	-15	-15	-14	-14
8.00%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15

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

(단위:백만원)

1,821

공시일	2018-09-18
기준일	2018-09-17

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

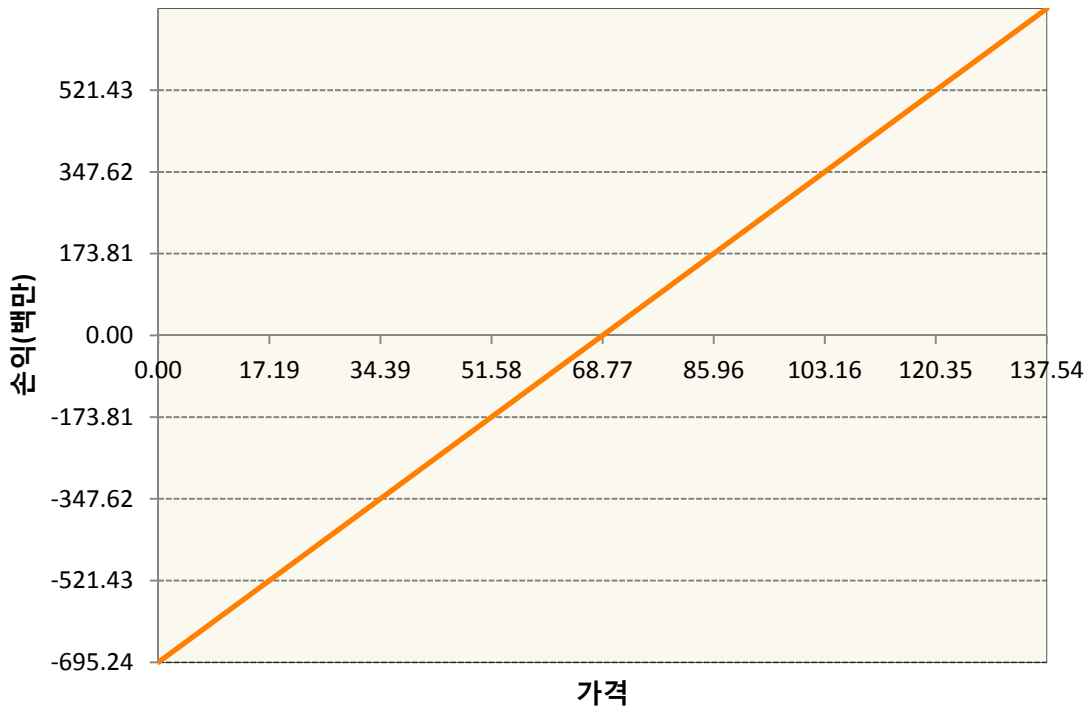
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

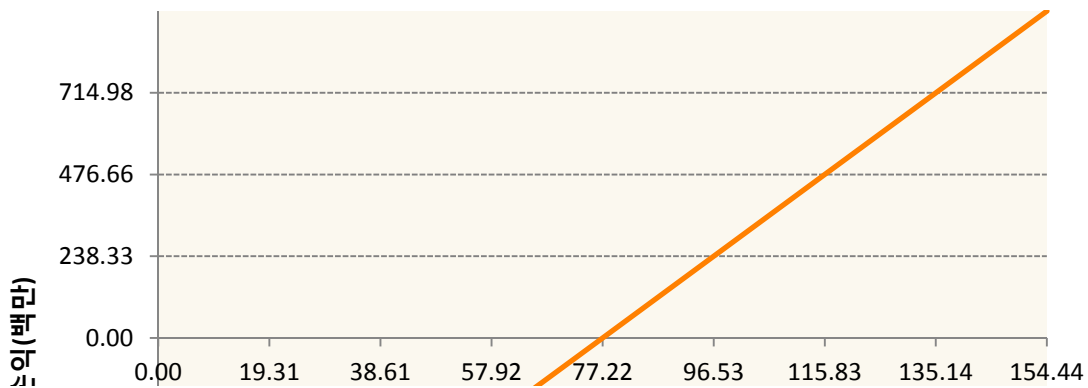
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,006	619	2,387	
누계	유가증권	선물	522	0	522	장내

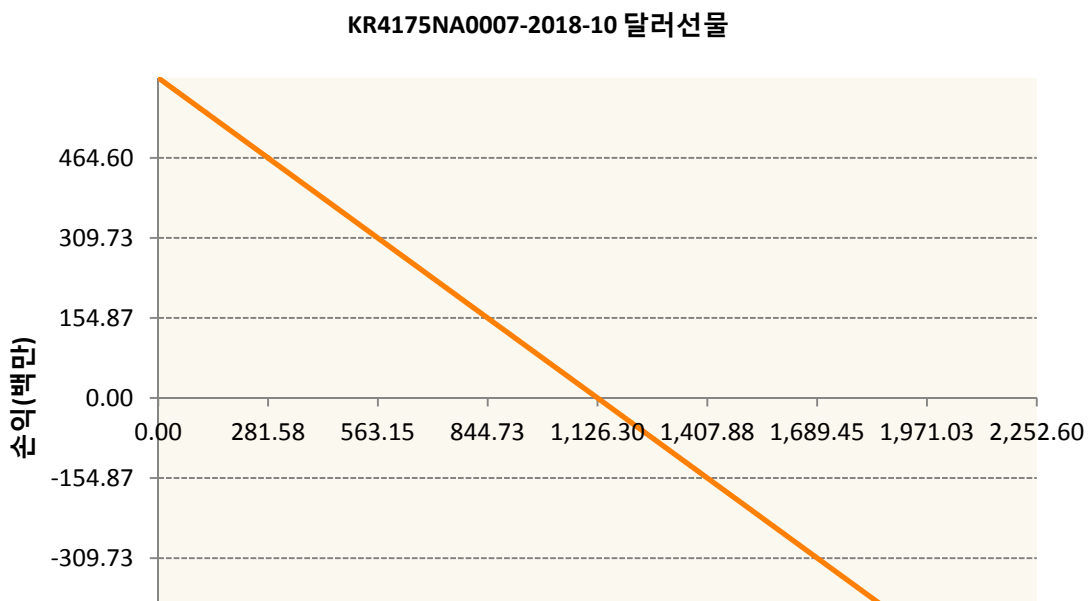
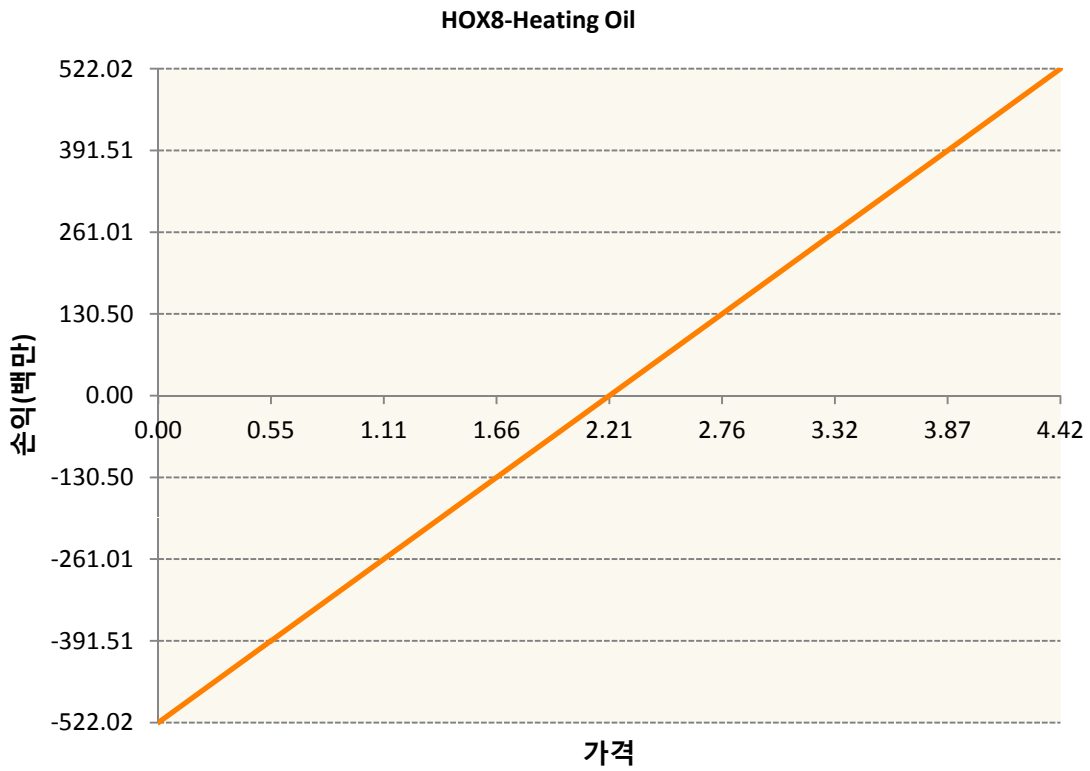
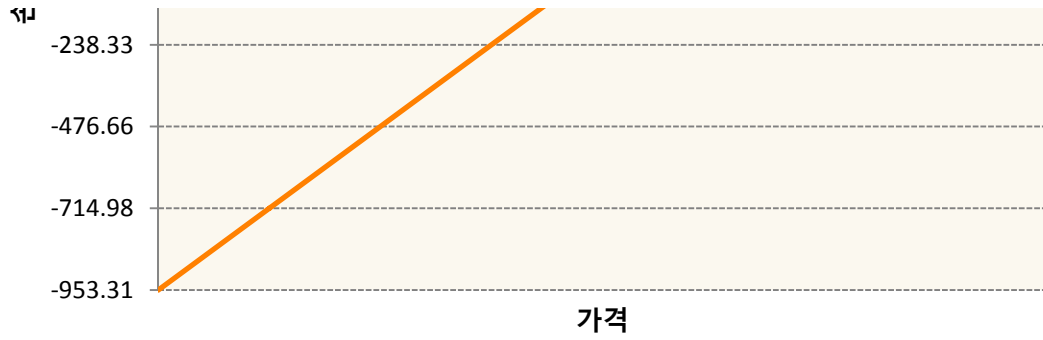
### 2. 만기시점의 손익구조

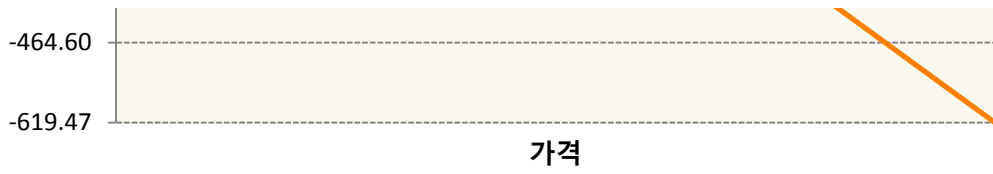
CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18



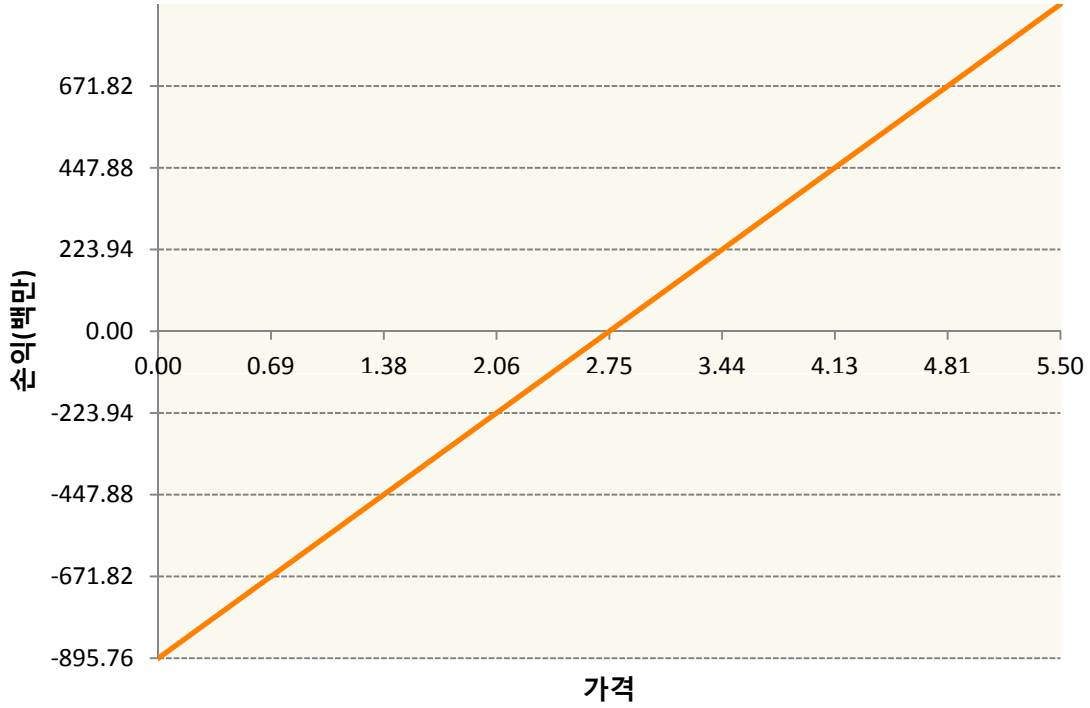
COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19



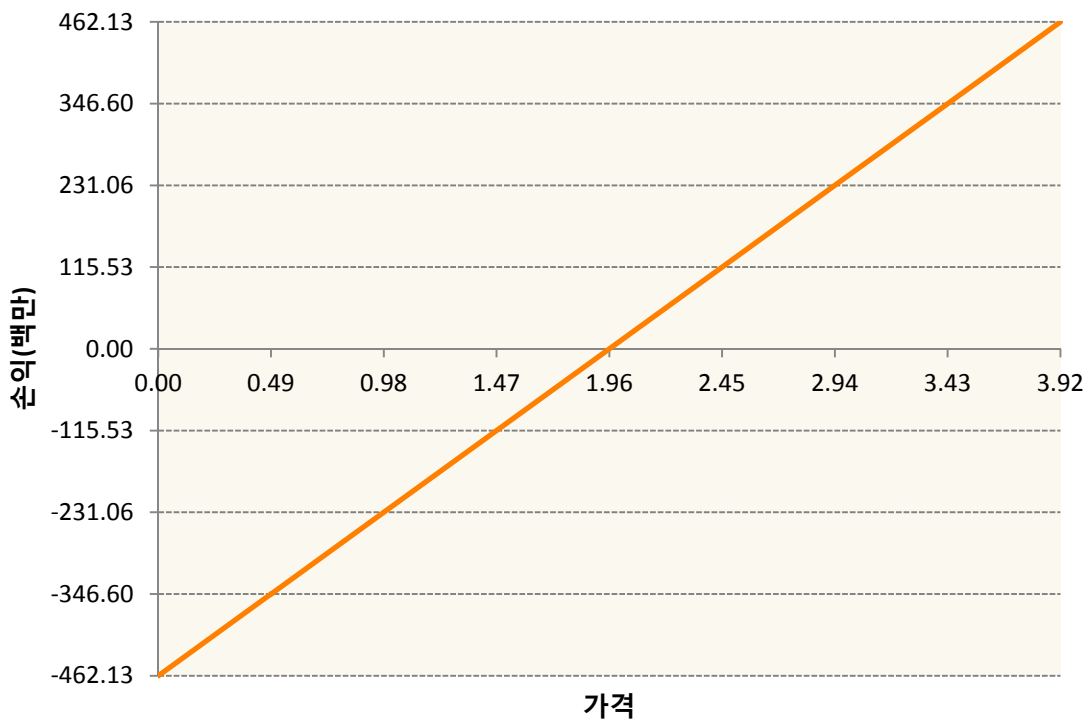




**NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18**



**XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18**



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	56
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	76
HOX8	Heating Oil	42
KR4175NA0(2018-10 달러선물		50
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	72
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	37

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	422

공시일	2018-09-18
기준일	2018-09-17

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

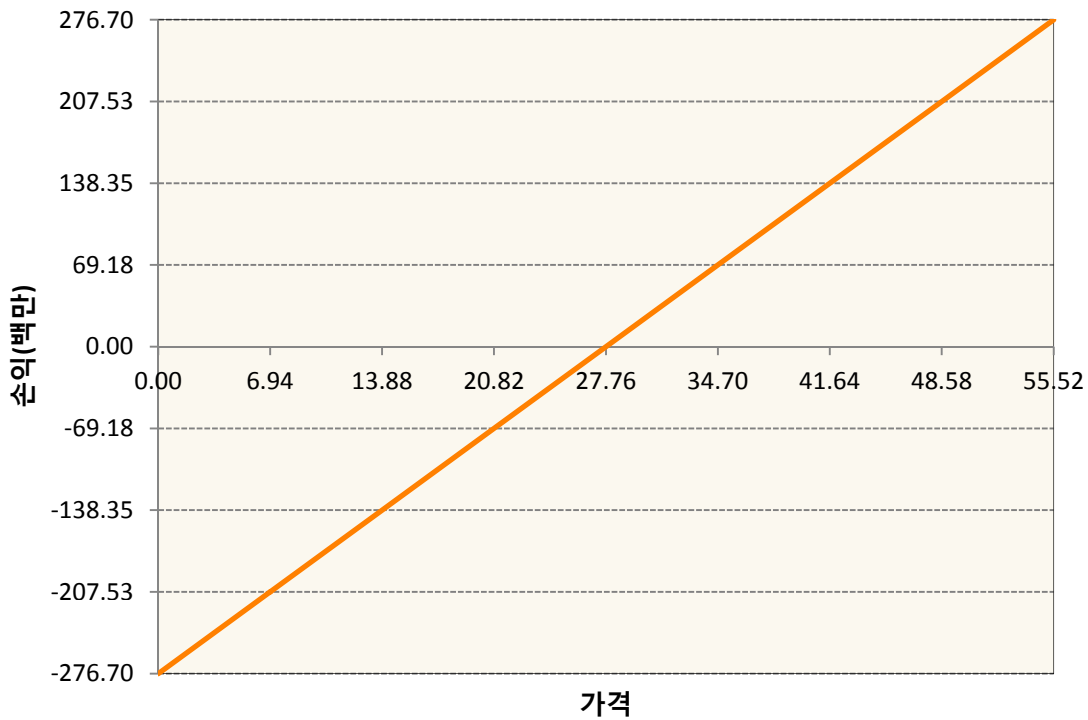
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

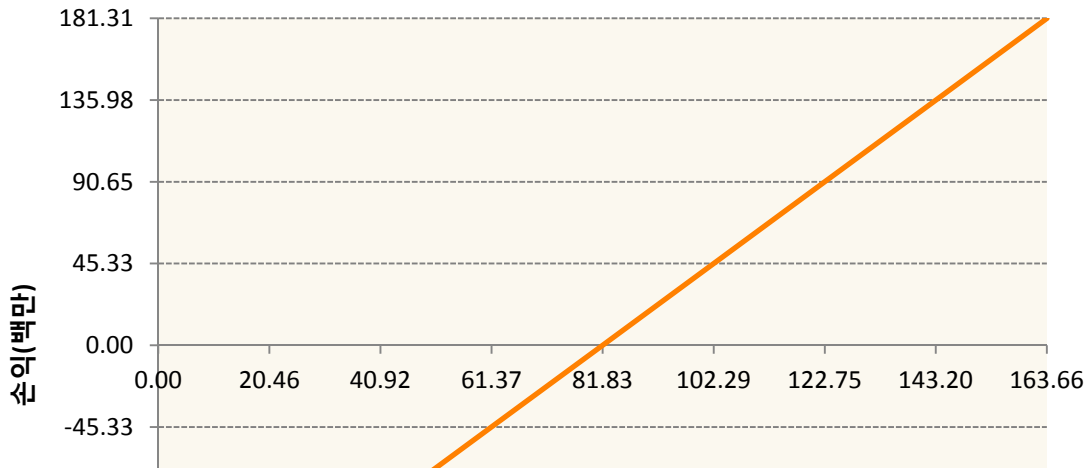
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,513	79	3,434	

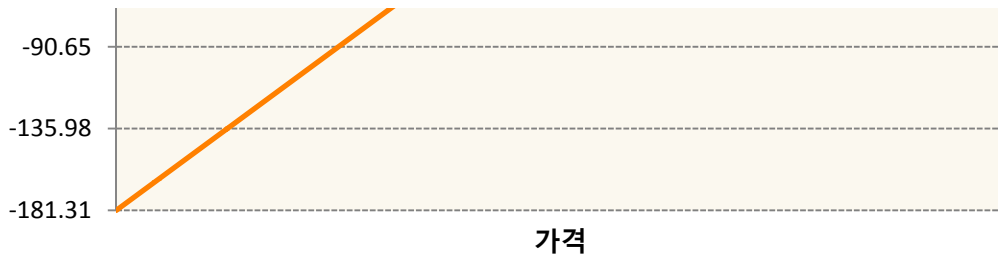
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18**

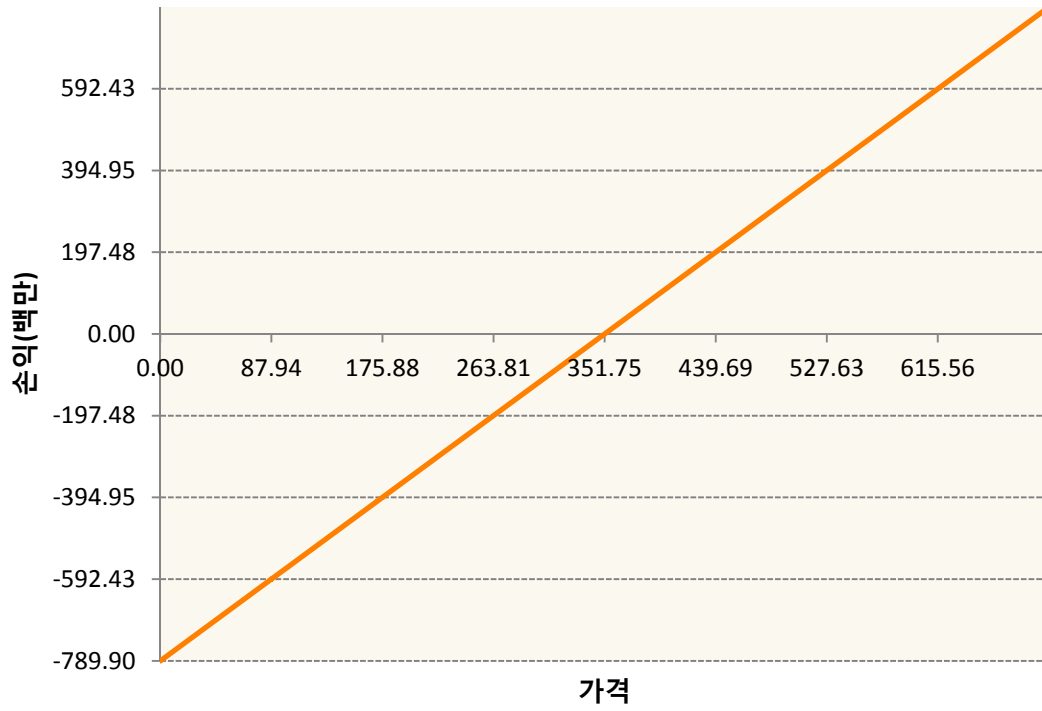


**CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18**

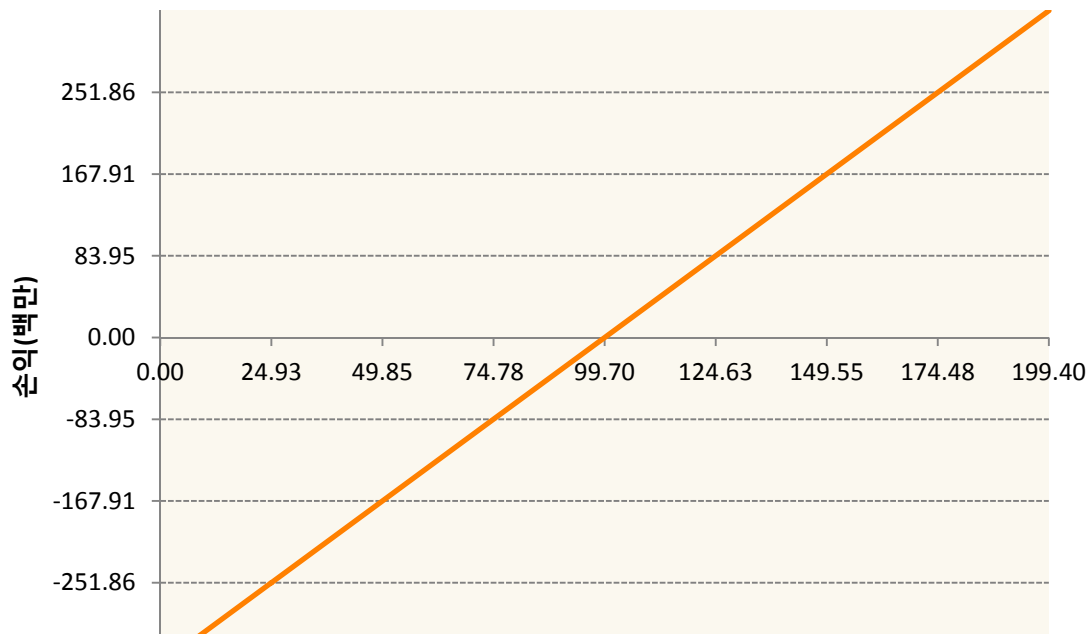


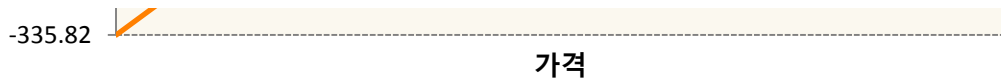


**CZ8-CORN FUTURE DEC18**

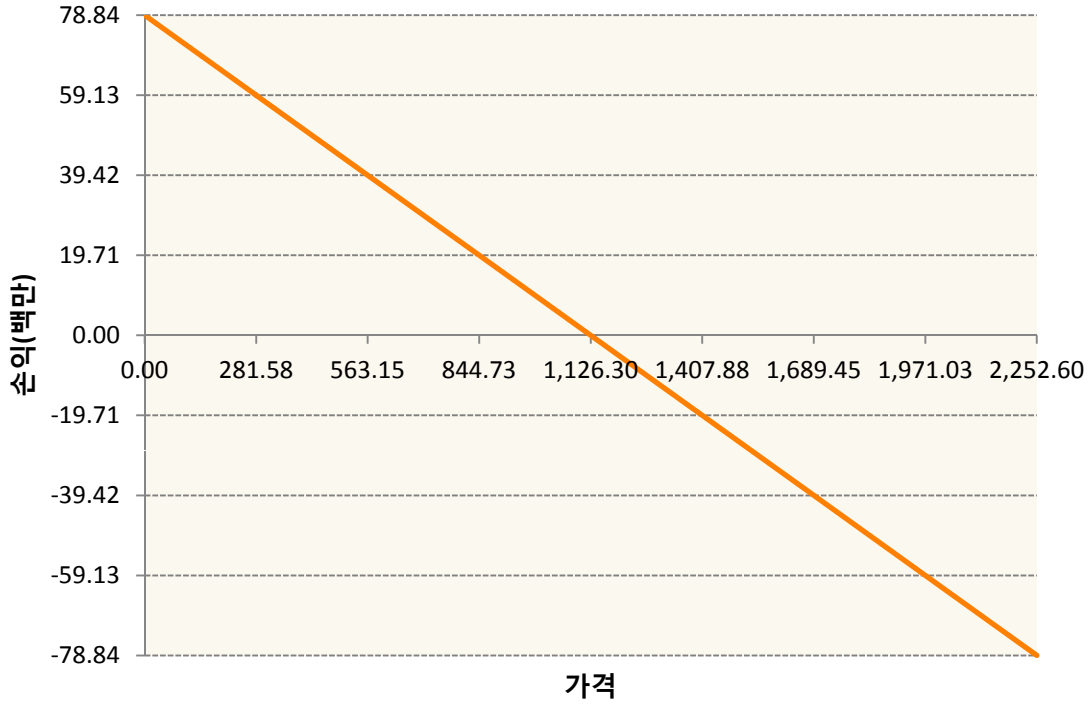


**KCZ8-COFFEE 'C' FUTURE Dec18**

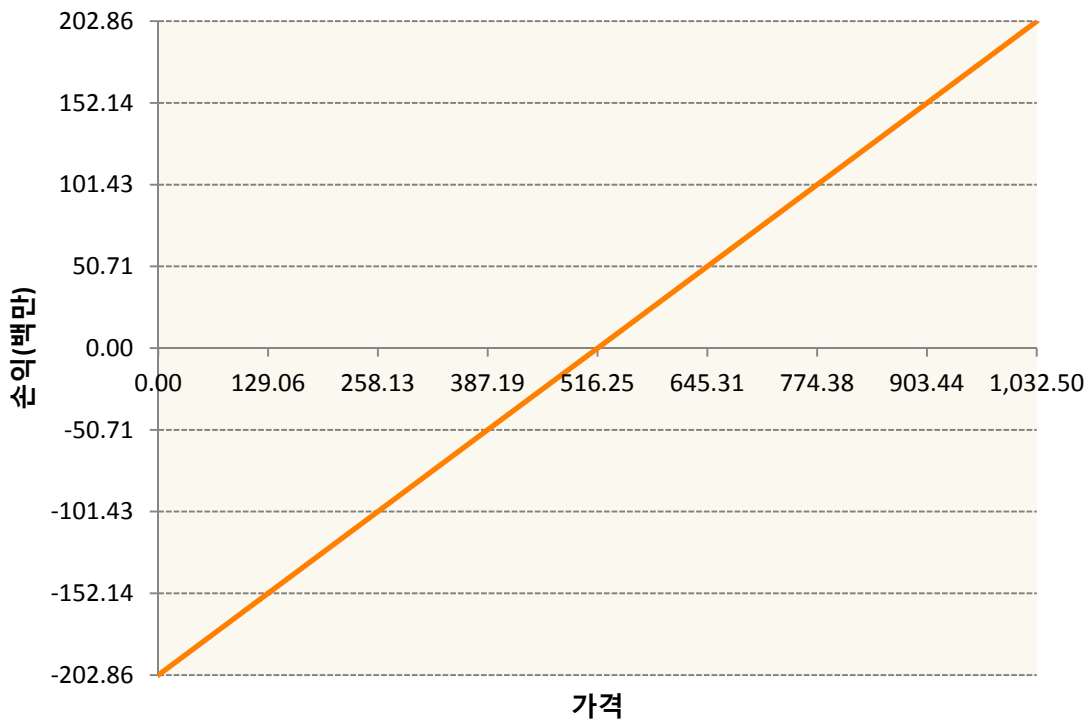




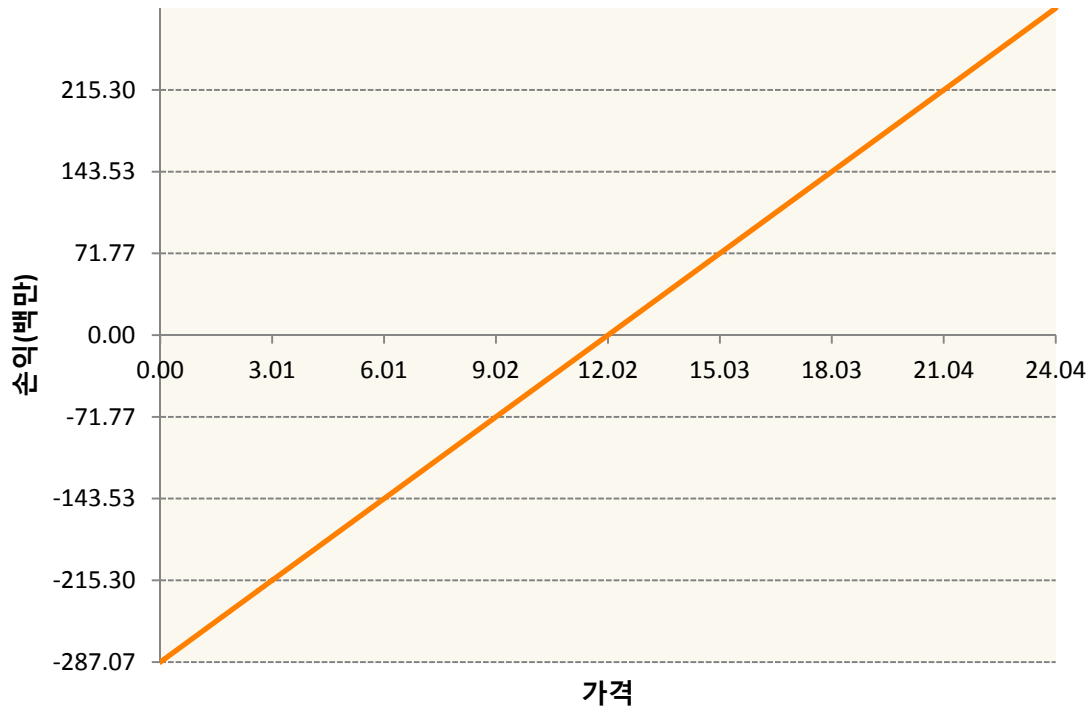
KR4175NA0007-2018-10 달러선물



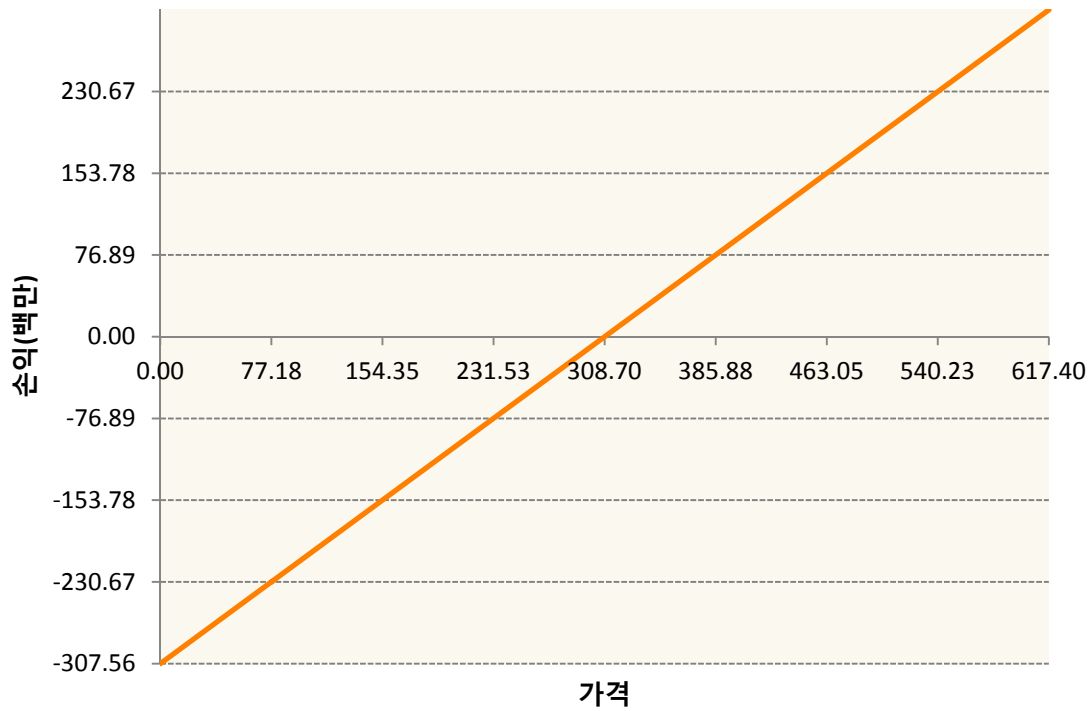
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



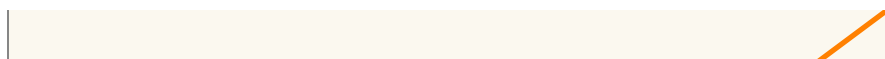
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

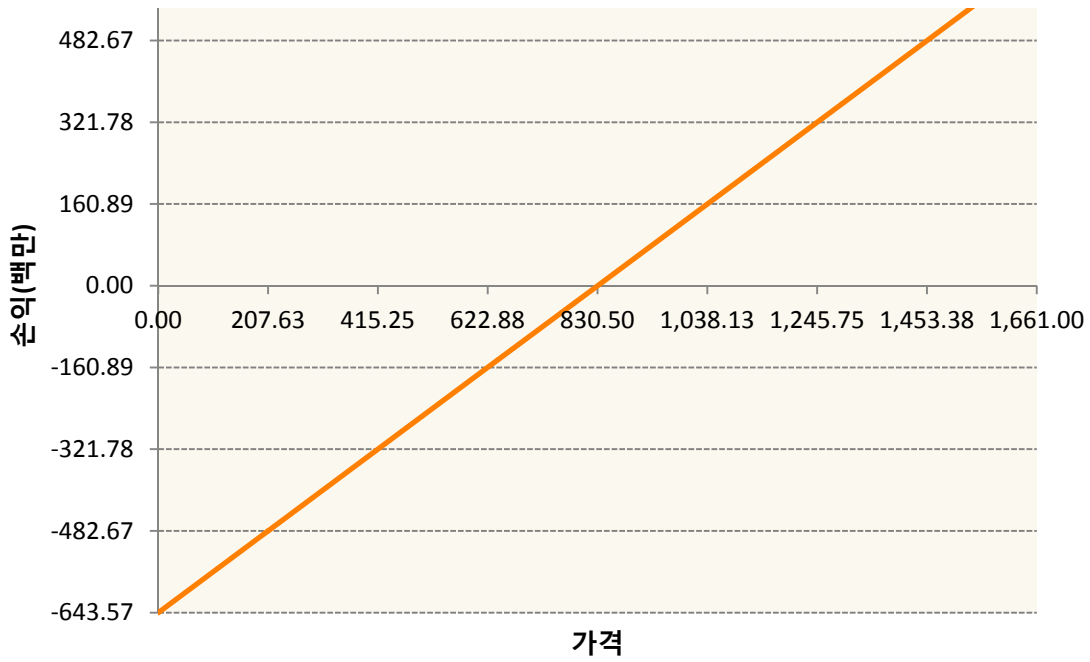


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

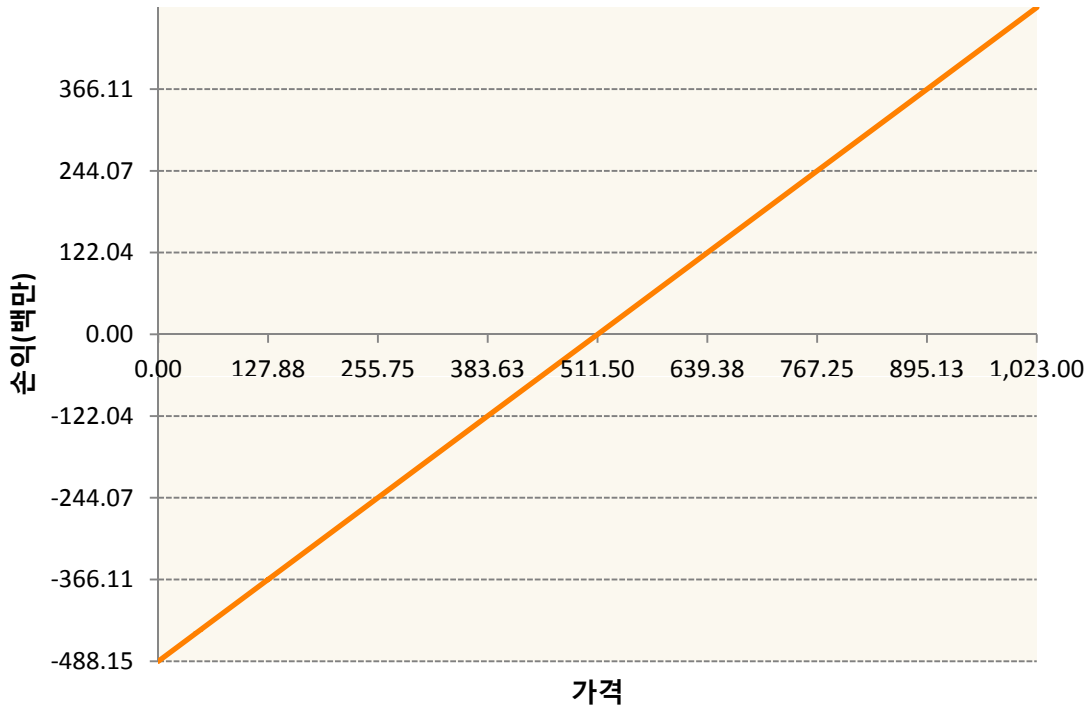


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





WZ8-WHEAT FUTURE(CBT) DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	22
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	15
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	23
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	25
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	51
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	39

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

(단위:백만원)

**305**