

공시일	2018-09-21
기준일	2018-09-20

## 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	2018-09-21
기준일	2018-09-20

## 스마트인덱스모

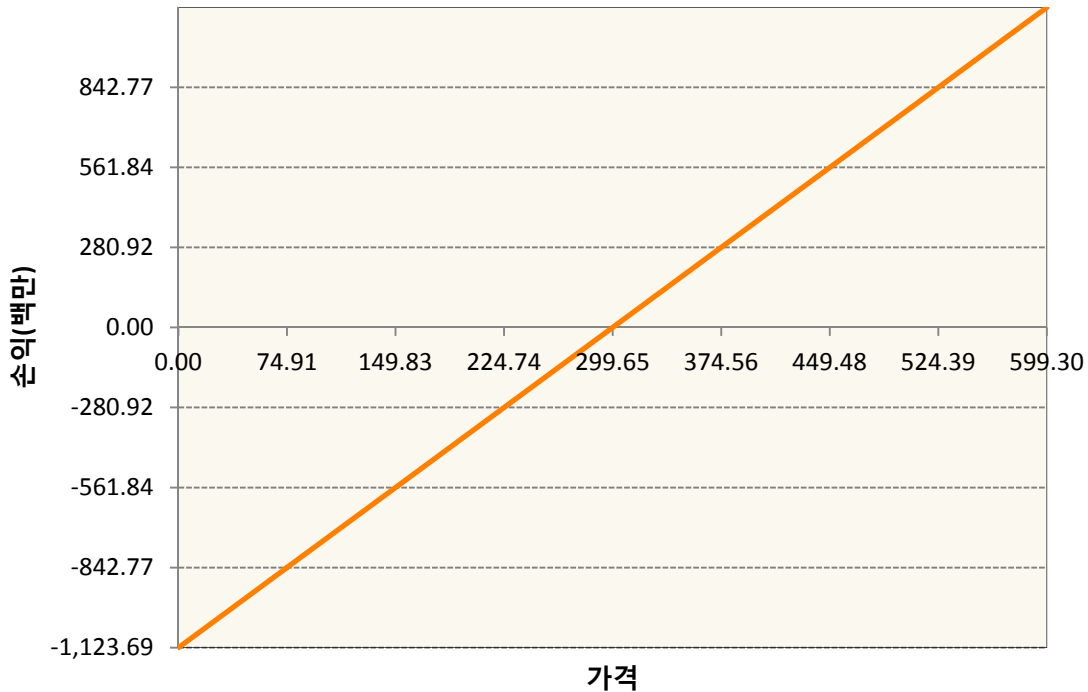
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,124	0	1,124	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 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	2018-09-21
기준일	2018-09-20

## 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

1,156

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

490

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-21
기준일	2018-09-20

## 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

290

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

369

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-21
기준일	2018-09-20

## 유로인덱스모(주식-파생형)

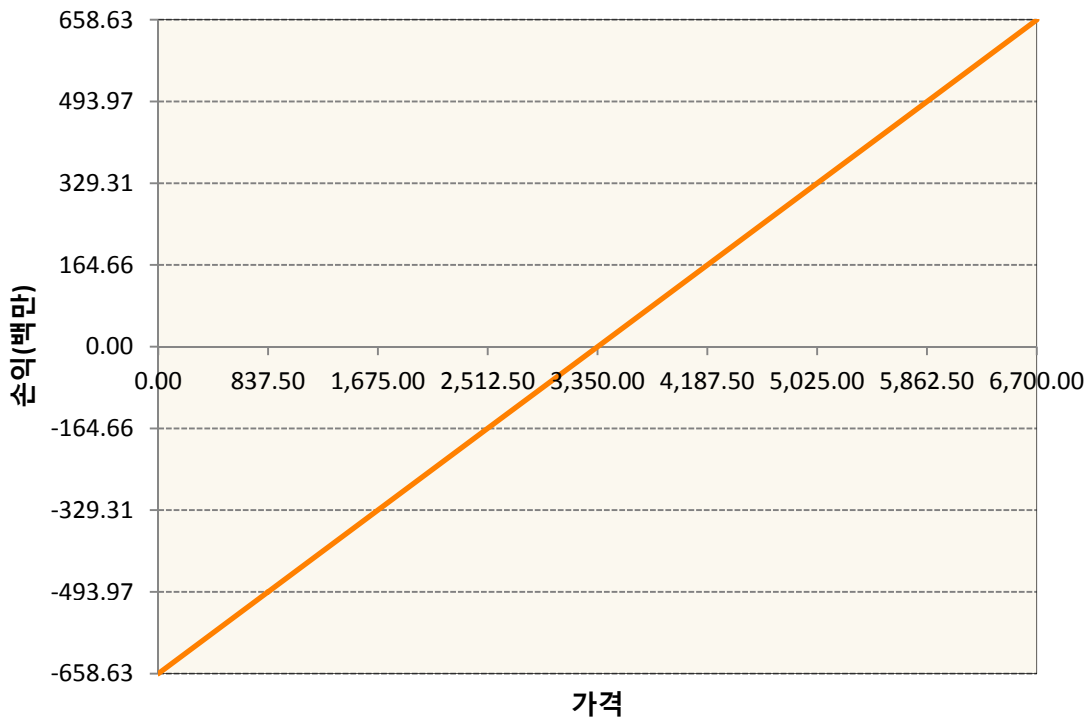
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	659	0	659	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGZ8-EURO STOXX 50 DEC18



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ8	EURO STOXX 50 DEC18	53
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

32
----

공시일	2018-09-21
기준일	2018-09-20

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

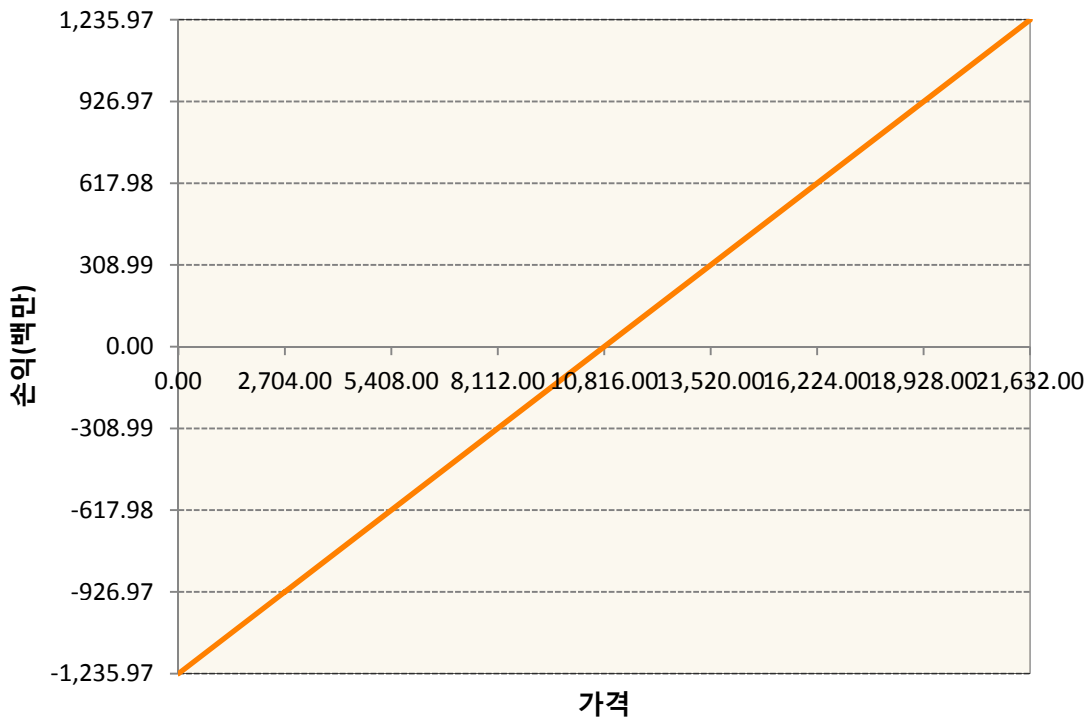
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

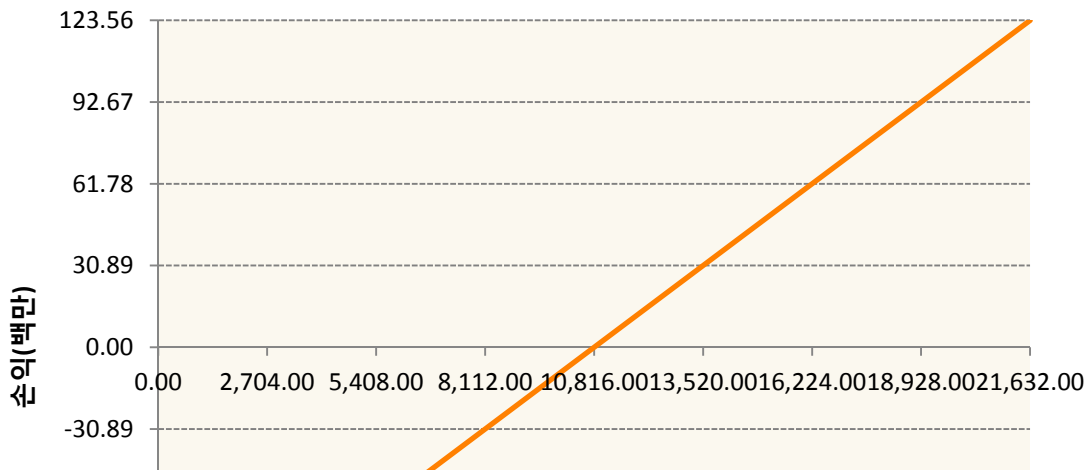
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,360	0	1,360	장내

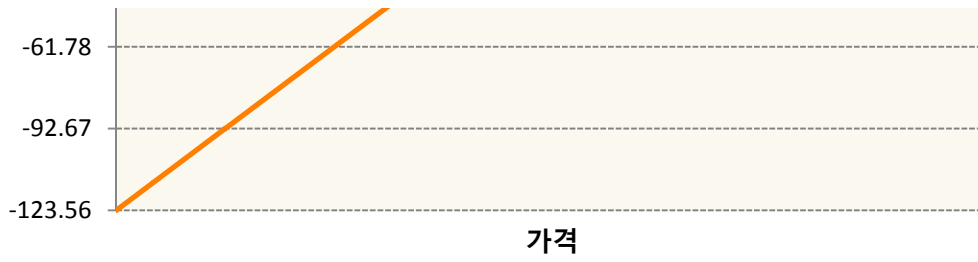
### 2. 만기시점의 손익구조

**HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18**



**MHCV8-MINI H-SHR IDX FU OCT 18**





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

HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	99
MHCV8	MINI H-SHR IDX FU OCT 18	10

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

<b>100</b>
------------

공시일	2018-09-21
기준일	2018-09-20

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

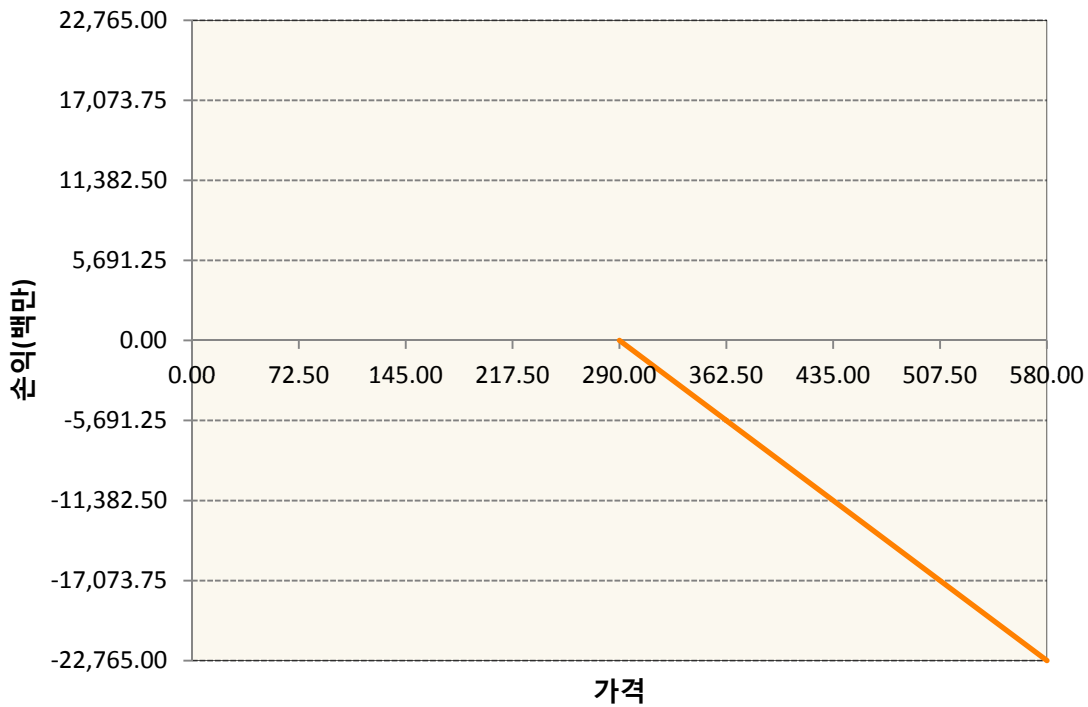
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

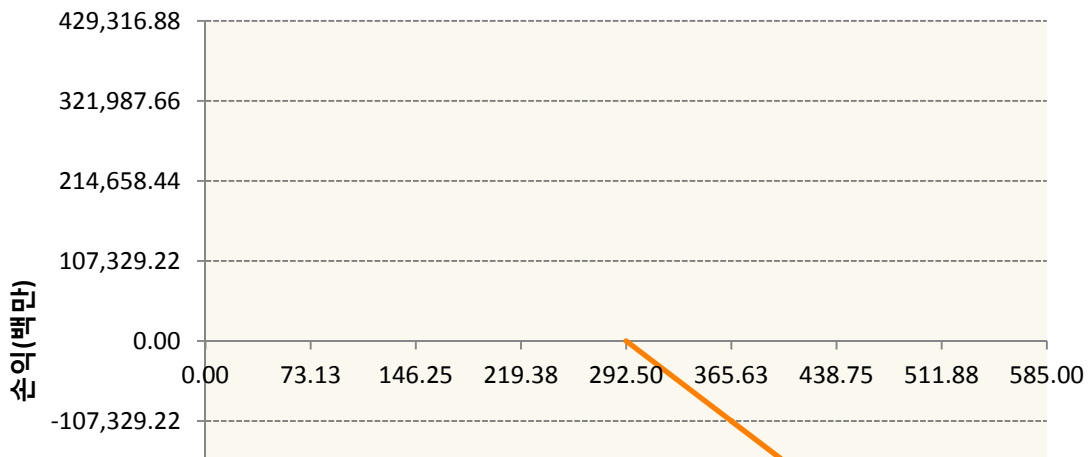
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	737,269	-737,269	장내

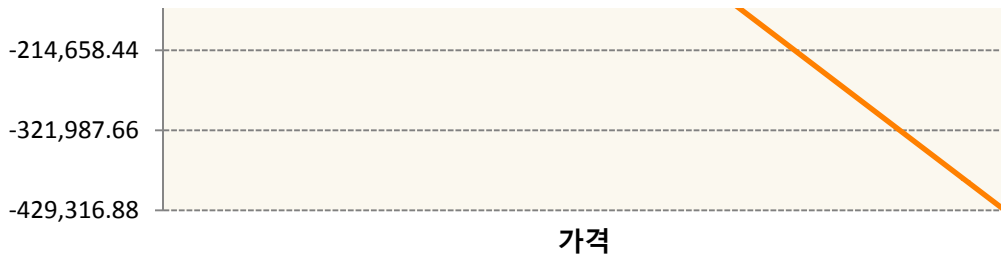
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201NA2902-2018-10 콜290**

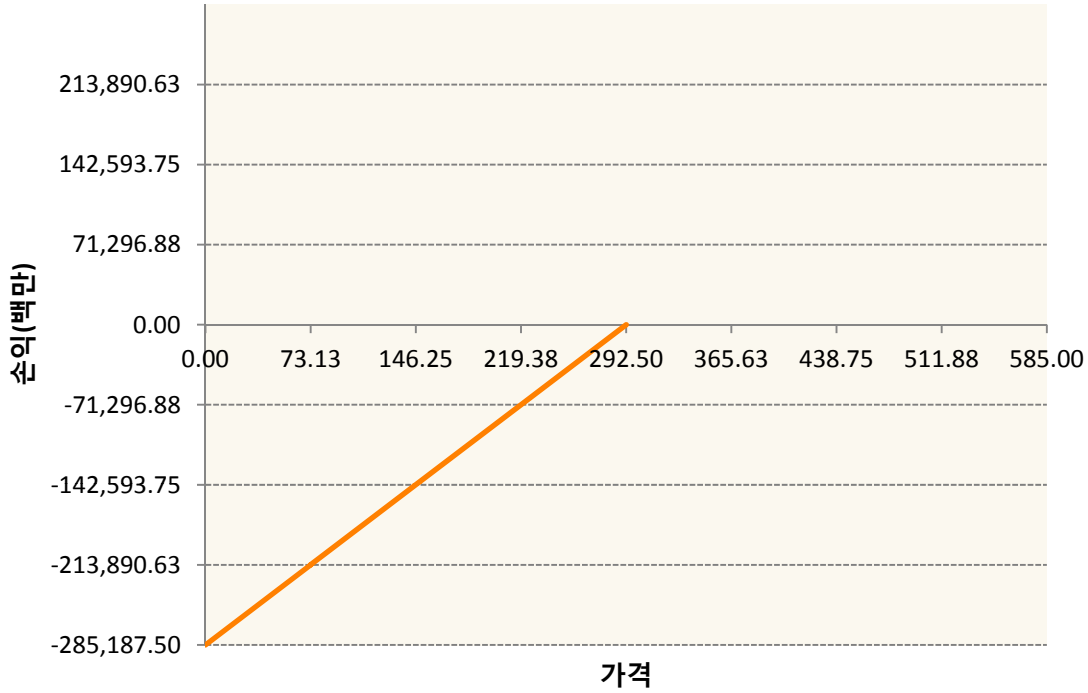


**KR4201NA2928-2018-10 콜292.5**





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NA2927-2018-10 콜290

1,655

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	933	906	876	844	810	775	738
-5.33%	795	753	710	667	622	578	533
-2.67%	530	482	434	386	338	290	243
0%	125	85	43	0	-44	-88	-133
2.67%	-391	-417	-446	-477	-511	-547	-584
5.33%	-972	-985	-1,001	-1,021	-1,044	-1,070	-1,097
8.00%	-1,583	-1,588	-1,596	-1,607	-1,620	-1,636	-1,655

KR4201NA2927-2018-10 풋292.5

30,035

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15,462	15,048	14,575	14,050	13,483	12,879	12,245

-5.33%	13,468	12,752	12,007	11,240	10,455	9,657	8,847
-2.67%	9,302	8,406	7,509	6,612	5,714	4,816	3,918
0%	2,527	1,698	855	0	-863	-1,733	-2,609
2.67%	-6,532	-7,113	-7,745	-8,419	-9,126	-9,860	-10,618
5.33%	-17,083	-17,398	-17,783	-18,228	-18,728	-19,274	-19,861
8.00%	-28,375	-28,510	-28,703	-28,954	-29,262	-29,624	-30,035
KR4301NA29 2018-10 풋 292.5							16,240
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-16,140	-16,143	-16,149	-16,161	-16,179	-16,205	-16,240
-5.33%	-8,476	-8,544	-8,628	-8,730	-8,845	-8,974	-9,113
-2.67%	-2,171	-2,408	-2,647	-2,888	-3,128	-3,370	-3,612
0%	463	323	168	0	-178	-365	-560
2.67%	814	798	772	733	682	618	542
5.33%	826	825	824	821	815	804	789
8.00%	826	826	826	826	825	825	823

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

(단위:백만원)

47,611

공시일	2018-09-21
기준일	2018-09-20

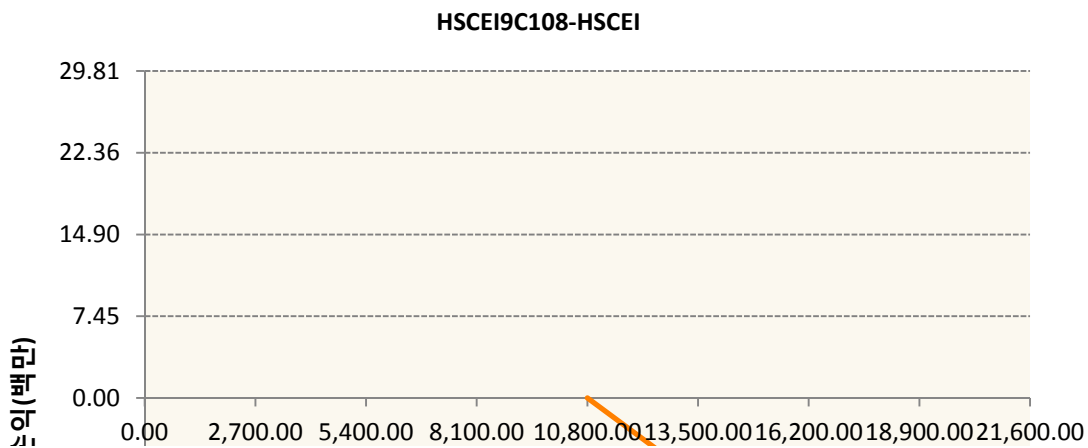
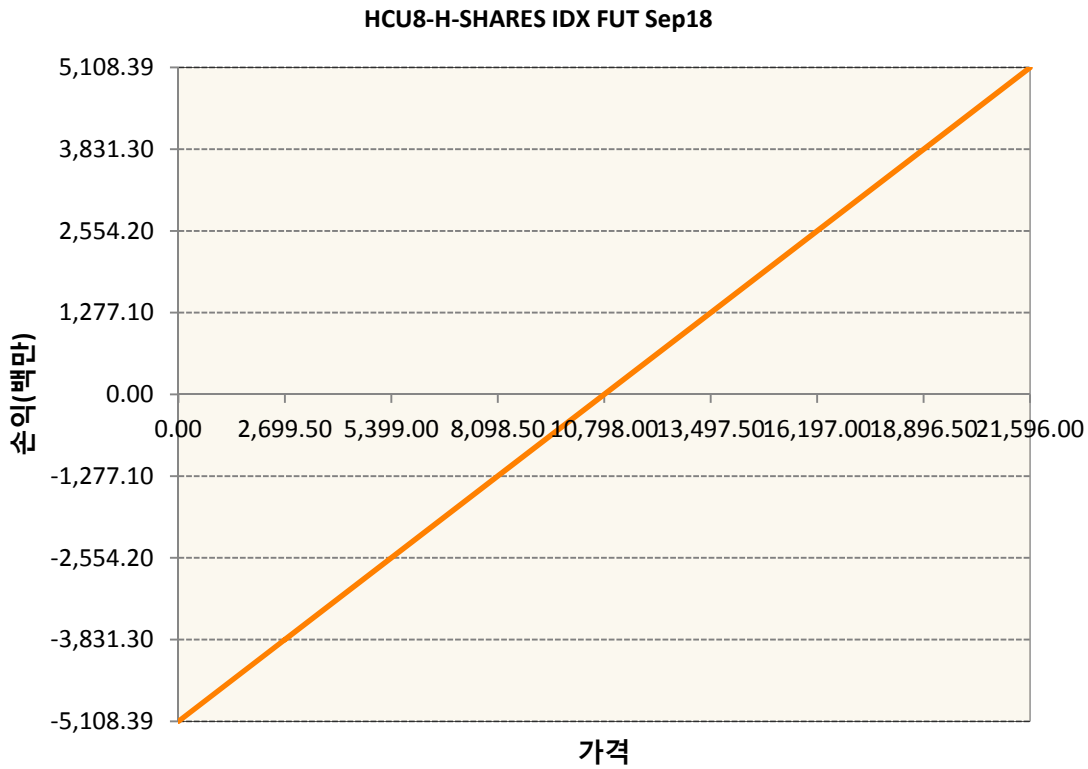
## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

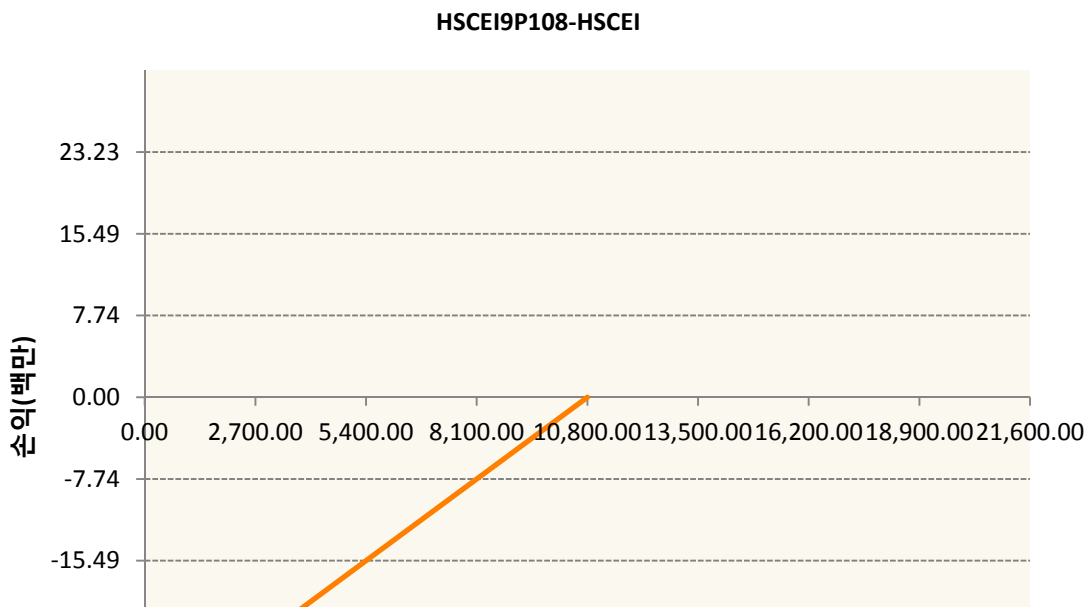
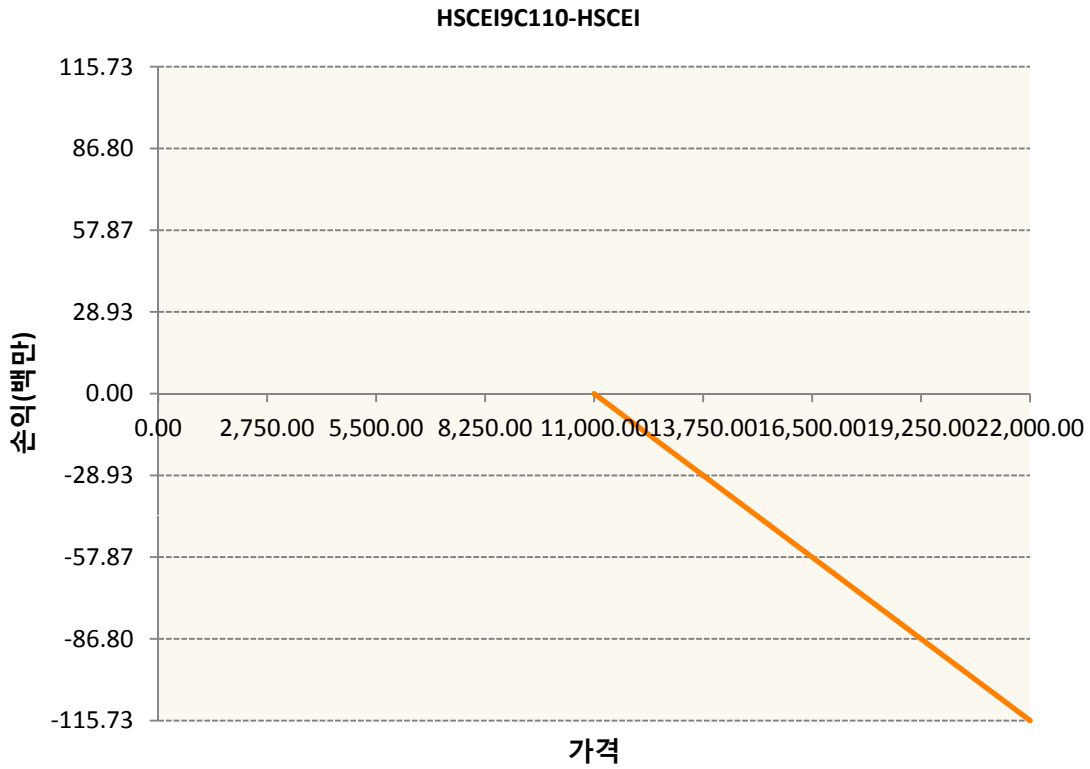
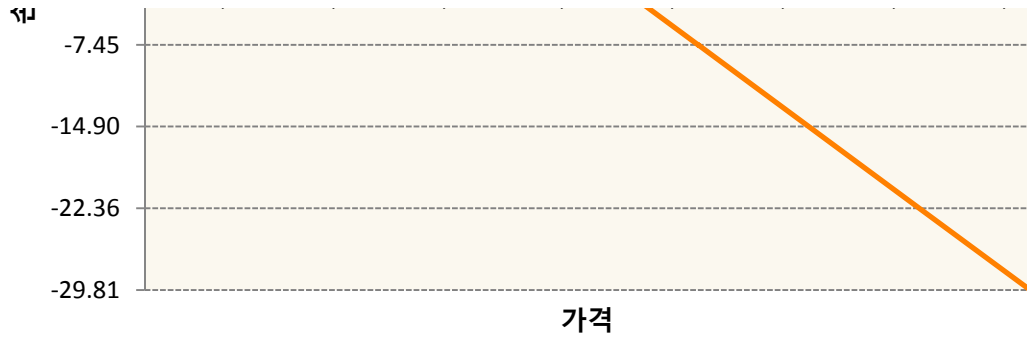
### 1. 계약금액

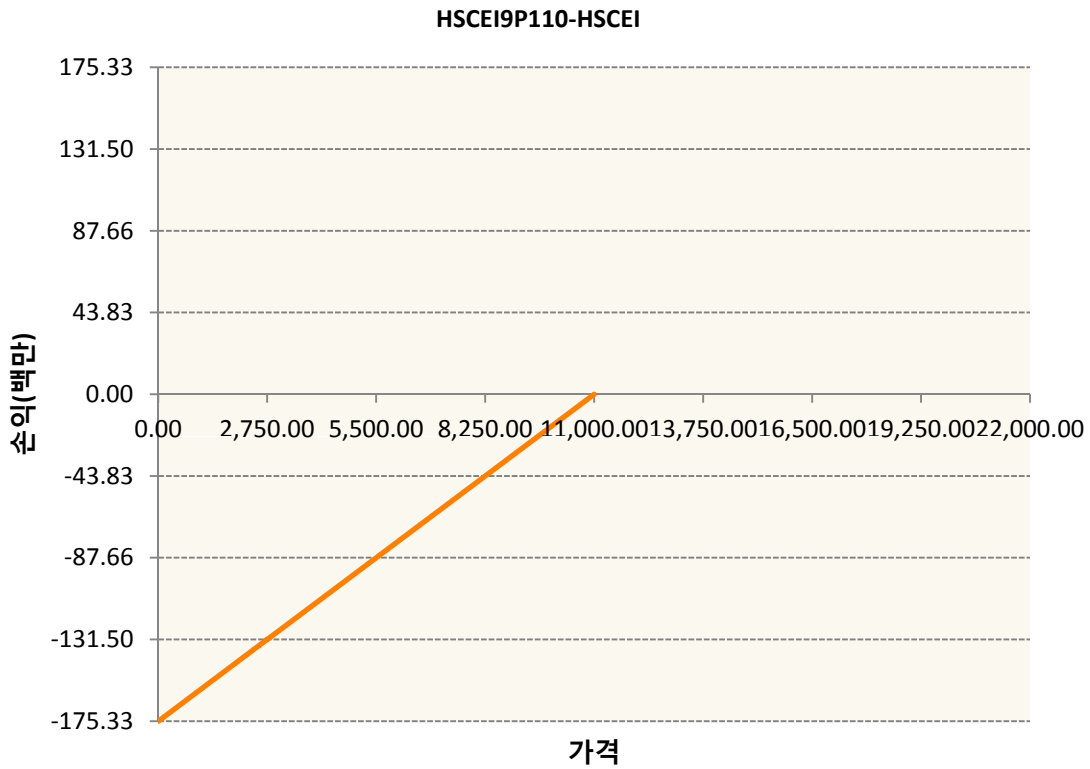
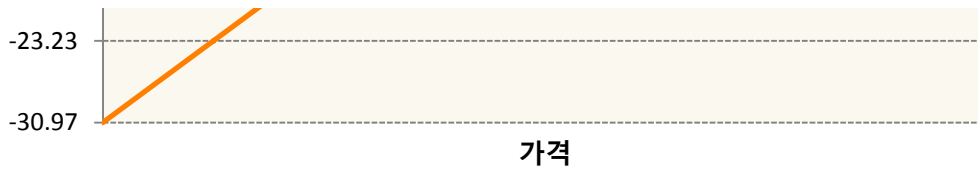
(단위:백만원)

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	5,108	0	5,108	장내
누계	유가증권	옵션	0	352	-352	장내

### 2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU8	H-SHARES IDX FUT Sep18	409
HSCEI9C108	HSCEI	2
HSCEI9C110	HSCEI	9
HSCEI9P108	HSCEI	2
HSCEI9P110	HSCEI	14

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	404

공시일	2018-09-21
기준일	2018-09-20

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

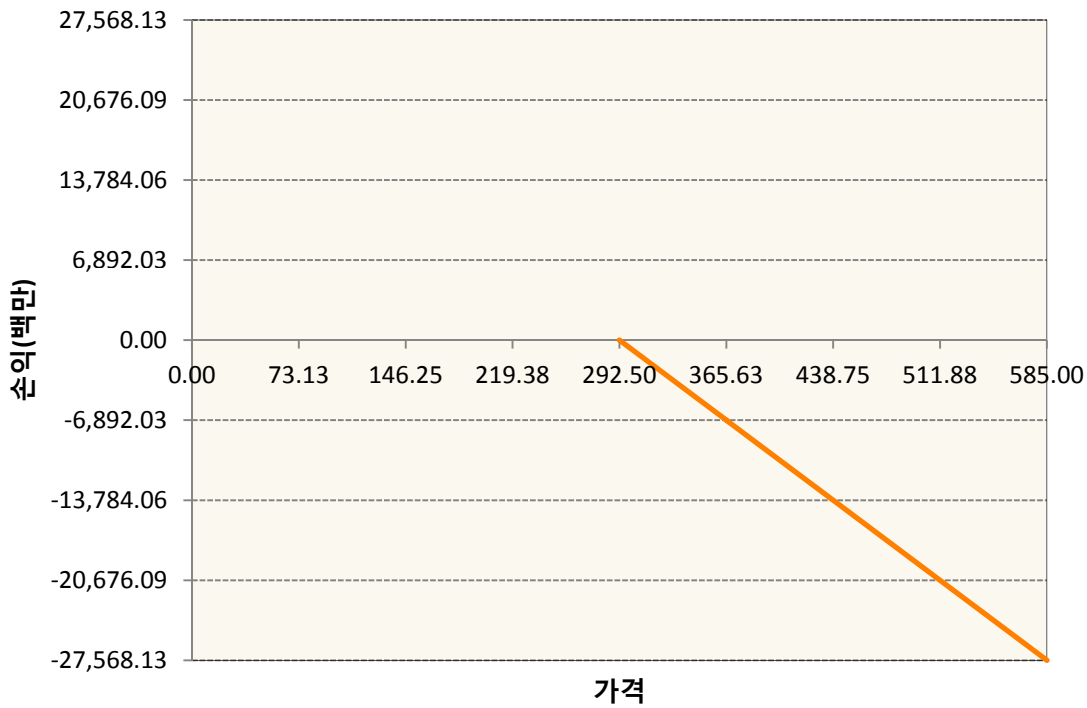
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

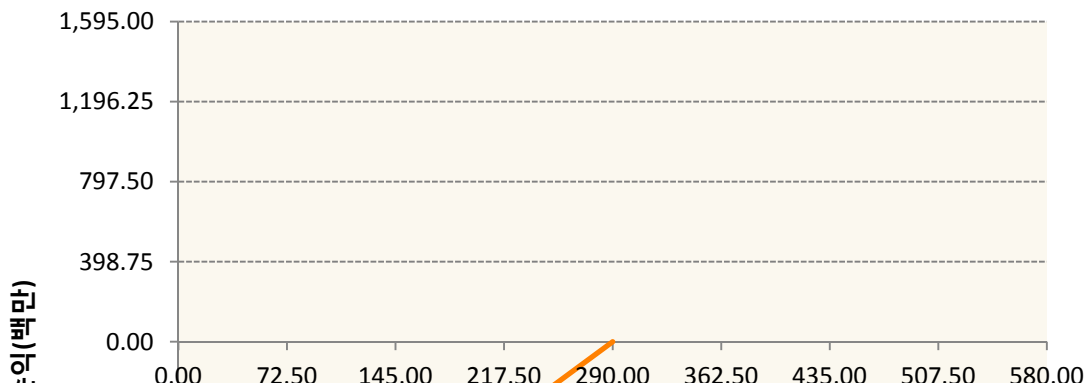
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	48,761	-48,761	장내

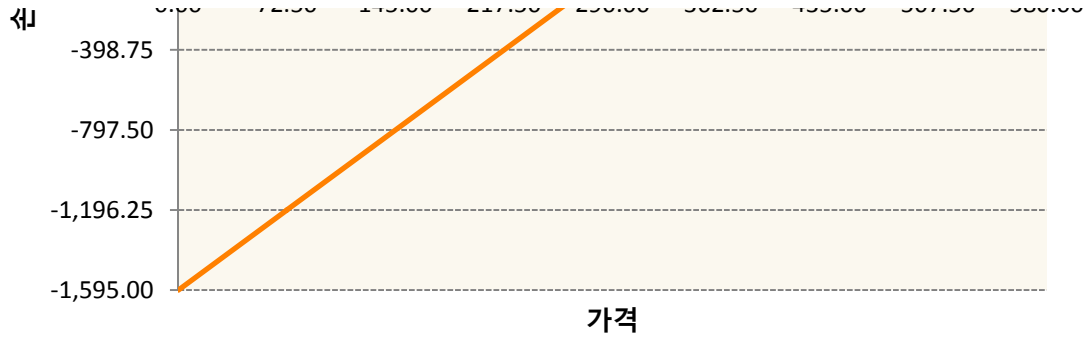
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201NA2928-2018-10 콜292.5

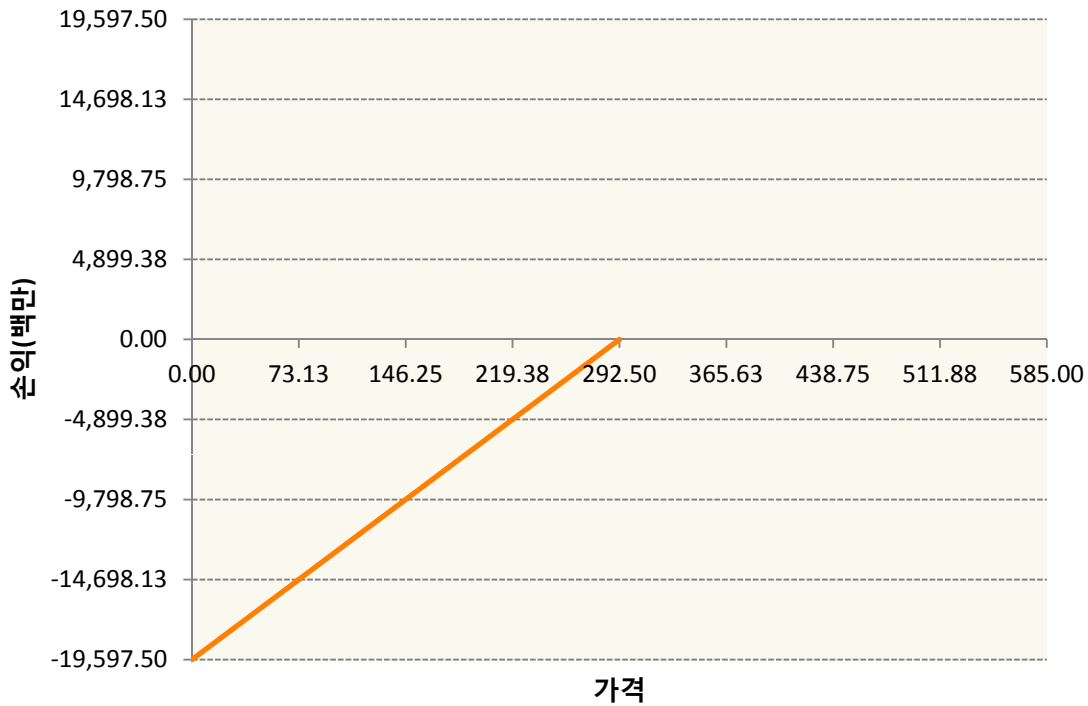


KR4301NA2901-2018-10 풋290





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,991
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,991	-3,991	-3,991	-3,991	-3,991	-3,991	-3,991
-5.33%	-2,661	-2,661	-2,661	-2,661	-2,661	-2,661	-2,661
-2.67%	-1,330	-1,330	-1,330	-1,330	-1,330	-1,330	-1,330
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,330	1,330	1,330	1,330	1,330	1,330	1,330
5.33%	2,661	2,661	2,661	2,661	2,661	2,661	2,661
8.00%	3,991	3,991	3,991	3,991	3,991	3,991	3,991
KR4201NA2927-2018-10 풋292.5							1,929
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	993	966	936	902	866	827	786
-5.33%	865	819	771	722	671	620	568
-2.67%	597	540	482	425	367	309	252
0%	162	109	55	0	-55	-111	-168
2.67%	-419	-457	-497	-541	-586	-633	-682
5.33%	-1,097	-1,117	-1,142	-1,171	-1,203	-1,238	-1,275
8.00%	-1,822	-1,831	-1,843	-1,859	-1,879	-1,902	-1,929

KR4301NA2☞ 2018-10 풋290

81

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-81
-5.33%	-37	-38	-39	-40	-40	-41	-42
-2.67%	-7	-9	-10	-11	-13	-14	-15
0%	2	1	1	0	-1	-2	-2
2.67%	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

KR4301NA2☞ 2018-10 풋292.5

1,116

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,109	-1,109	-1,110	-1,111	-1,112	-1,114	-1,116
-5.33%	-582	-587	-593	-600	-608	-617	-626
-2.67%	-149	-165	-182	-198	-215	-232	-248
0%	32	22	12	0	-12	-25	-38
2.67%	56	55	53	50	47	42	37
5.33%	57	57	57	56	56	55	54
8.00%	57	57	57	57	57	57	57

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

(단위:백만원)

7,072

공시일	2018-09-21
기준일	2018-09-20

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

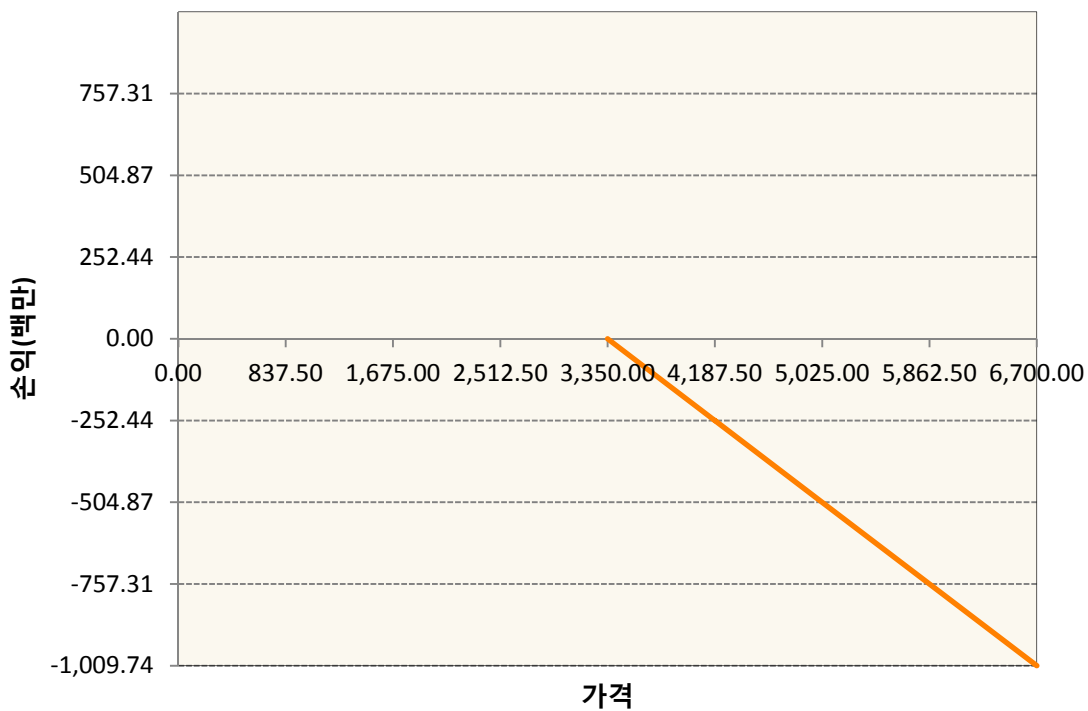
### 1. 계약금액

(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	5,518	0	5,518	
누계	유가증권	스왑	34,606	0	34,606	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,284	-25,284	장내
누계	지수	스왑	53,202	0	53,202	장외

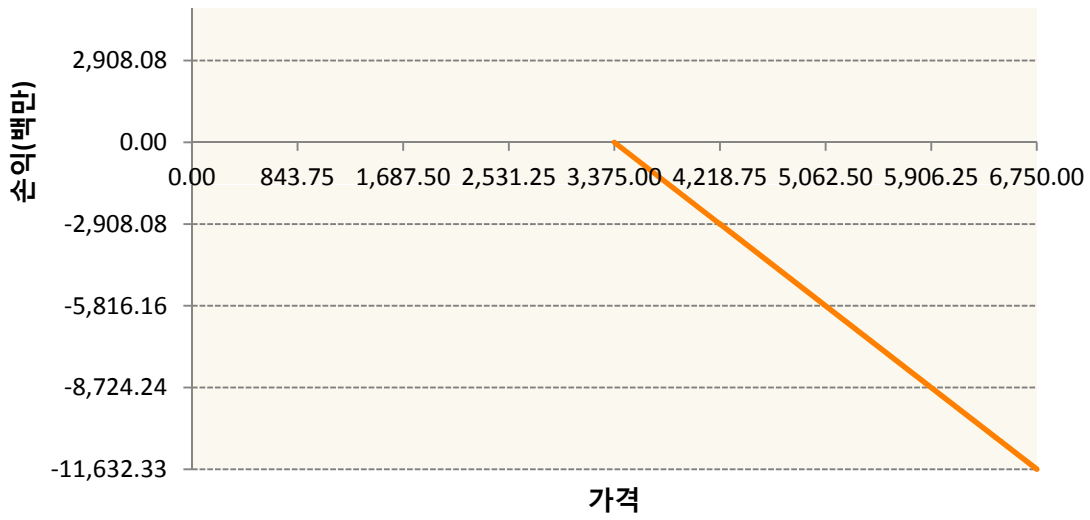
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXU8-C3350-EURO STOXX 50**

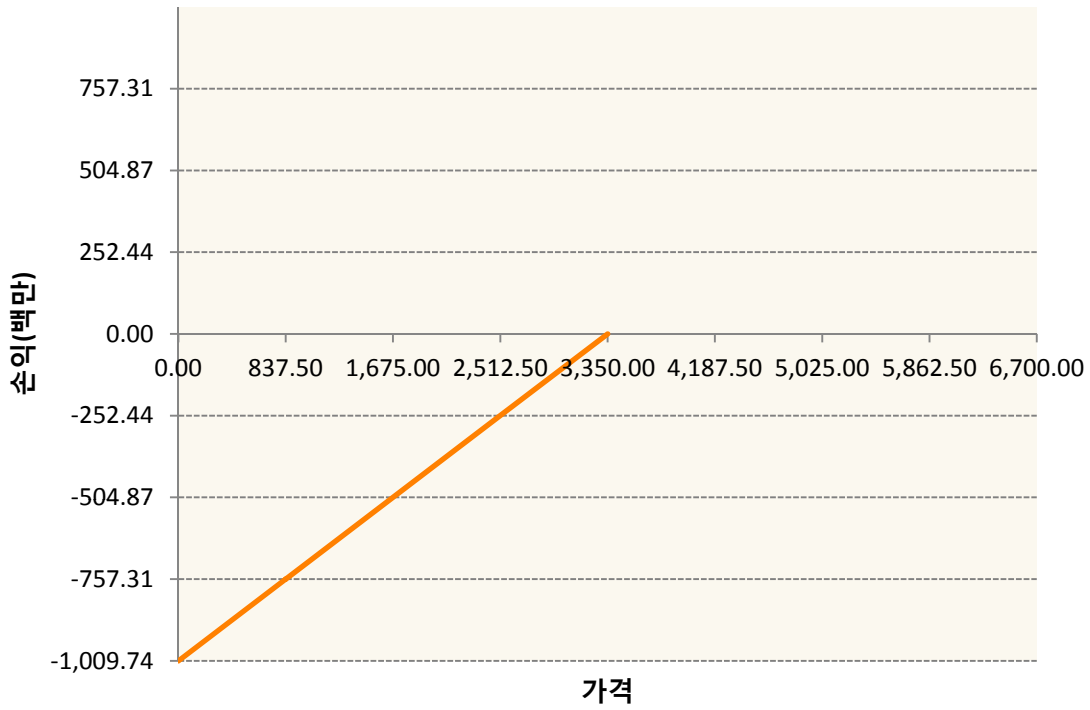


**OESXU8-C3375-EURO STOXX 50**

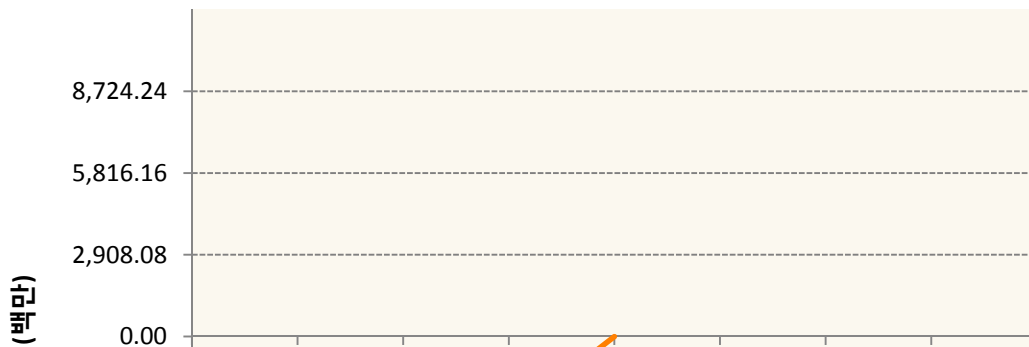


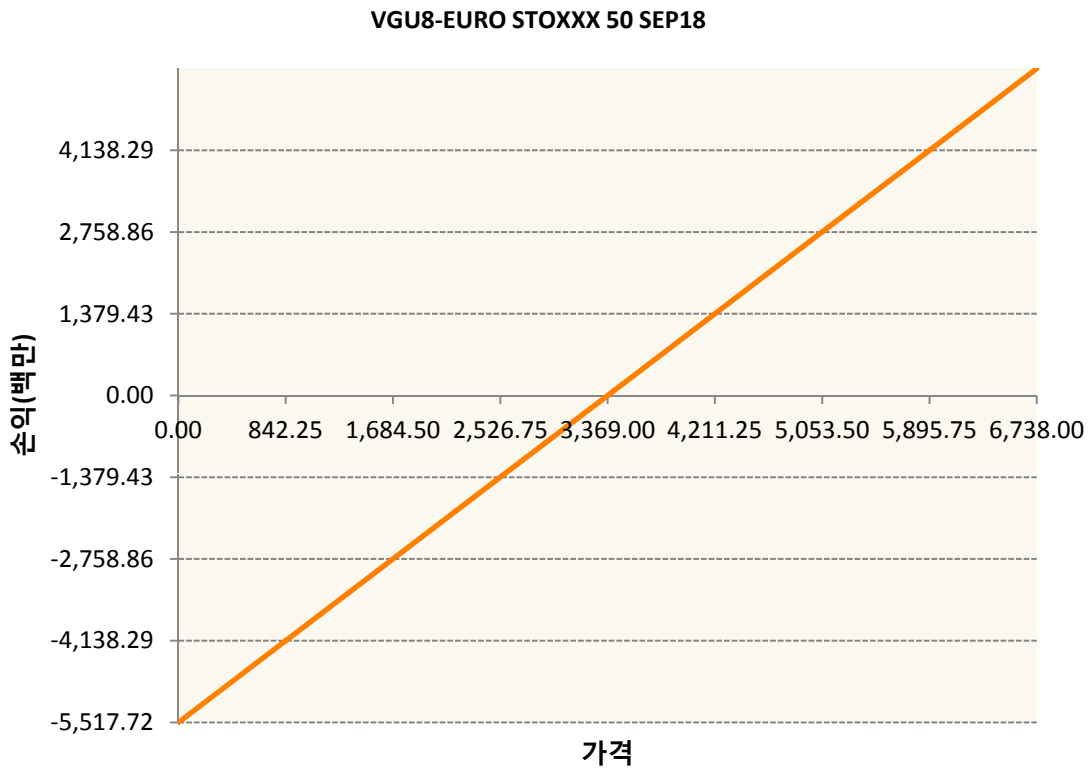
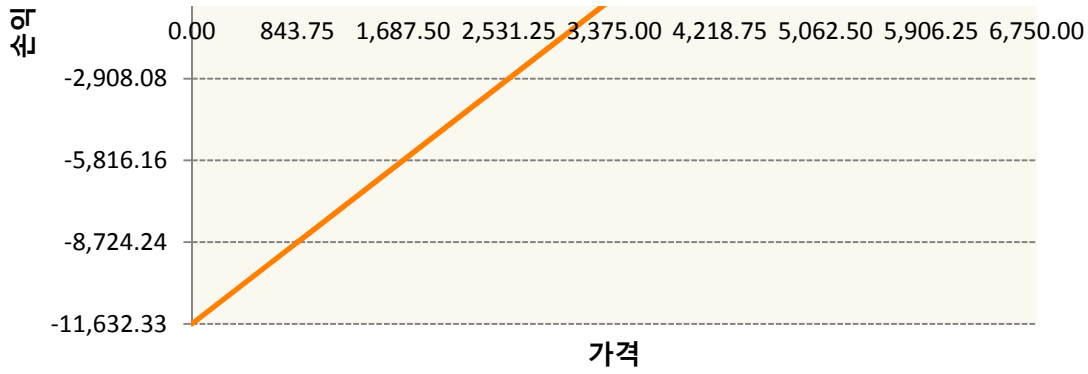


OESXU8-P3350-EURO STOXX 50



OESXU8-P3375-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		3
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY		2
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		441

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





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

(단위:백만원)

1,149



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

(단위:백만원)

91



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

(단위:백만원)

136



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

(단위:백만원)

170

공시일	2018-09-21
기준일	2018-09-20

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1

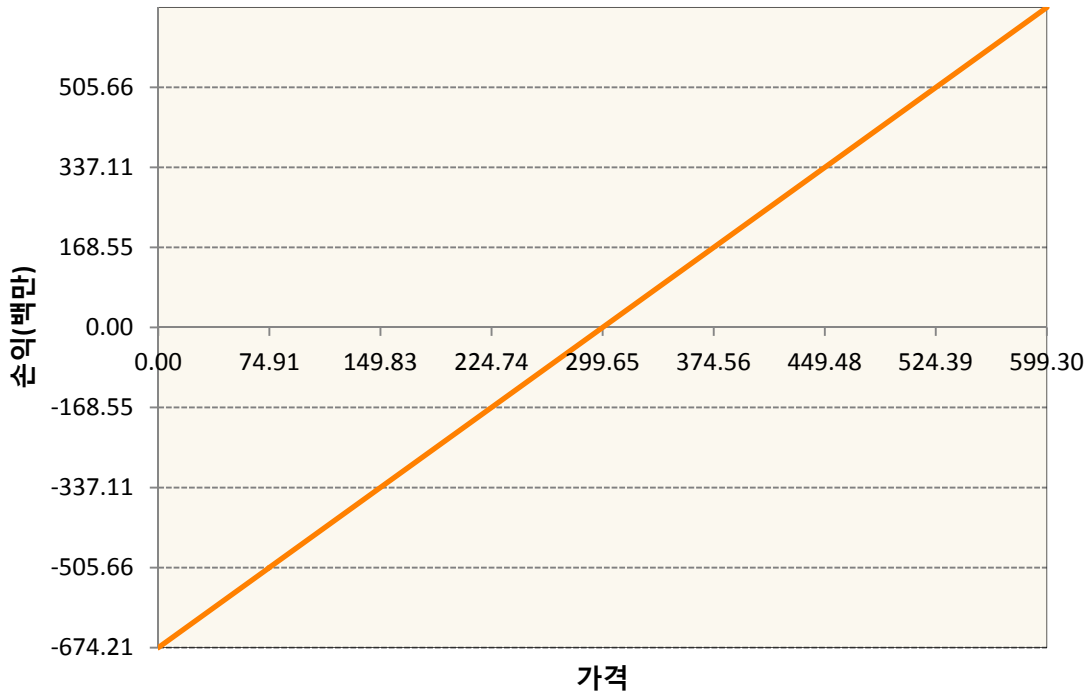
### 1. 계약금액

(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

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	2018-09-21
기준일	2018-09-20

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

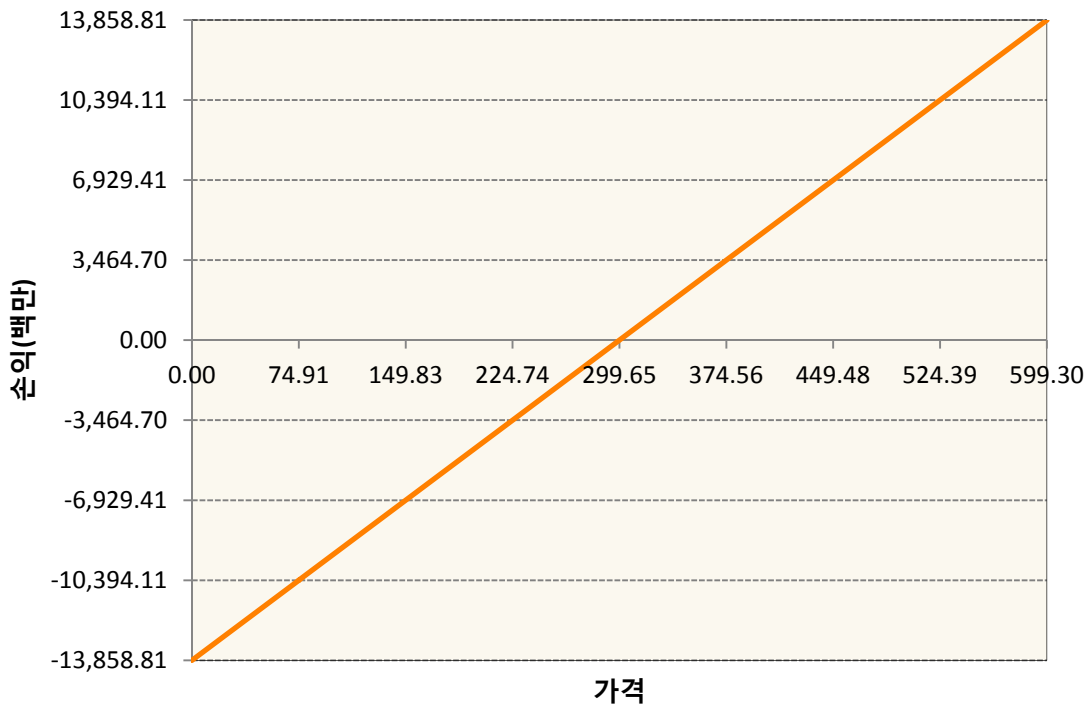
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

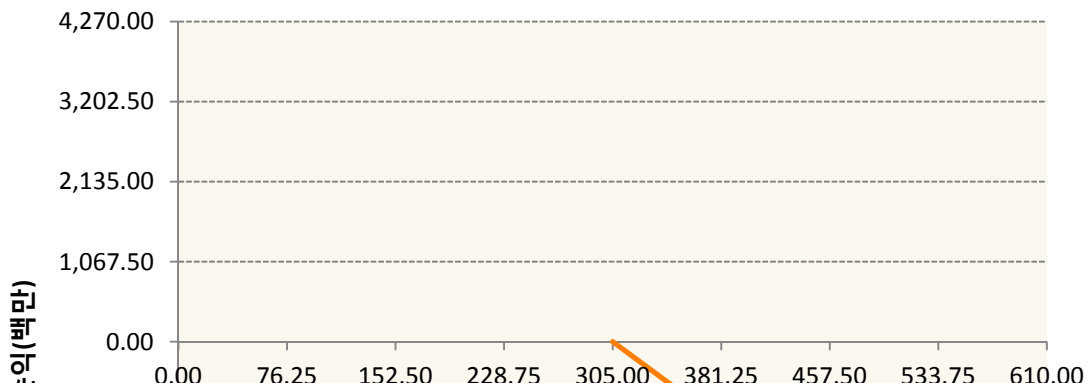
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,859	0	13,859	장내
누계	유가증권	옵션	2,119	24,258	-22,138	장내

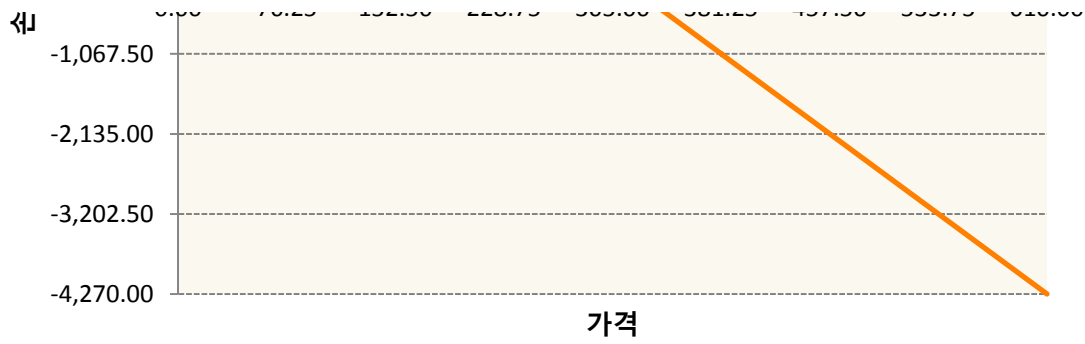
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

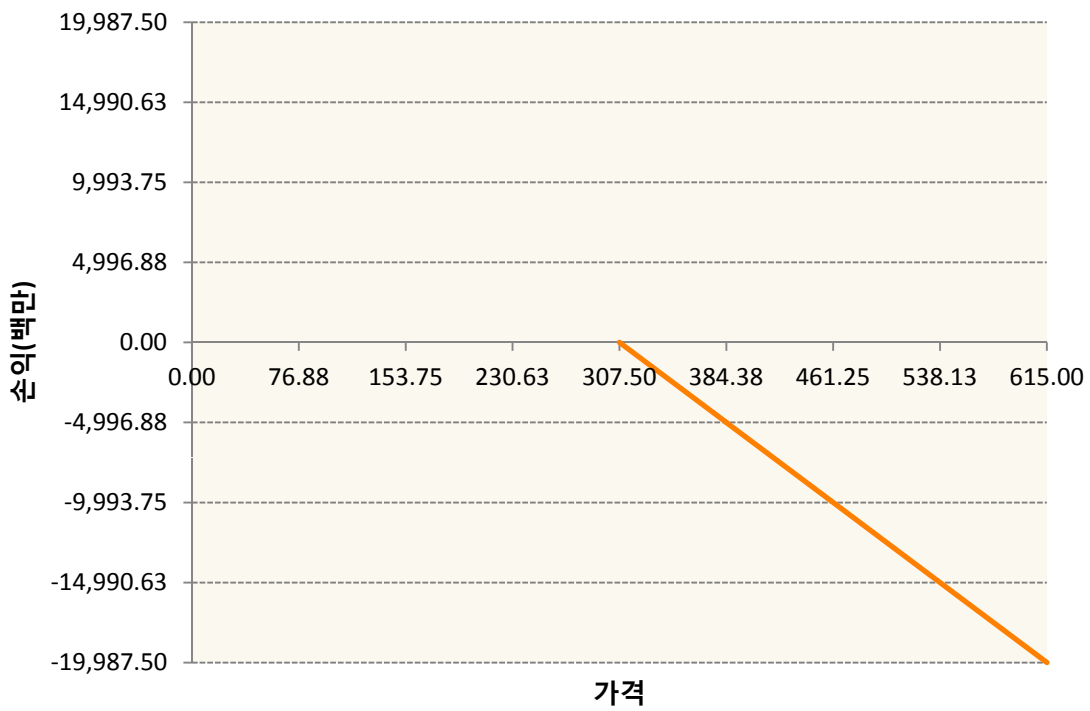


KR4201NA3058-2018-10 콜305

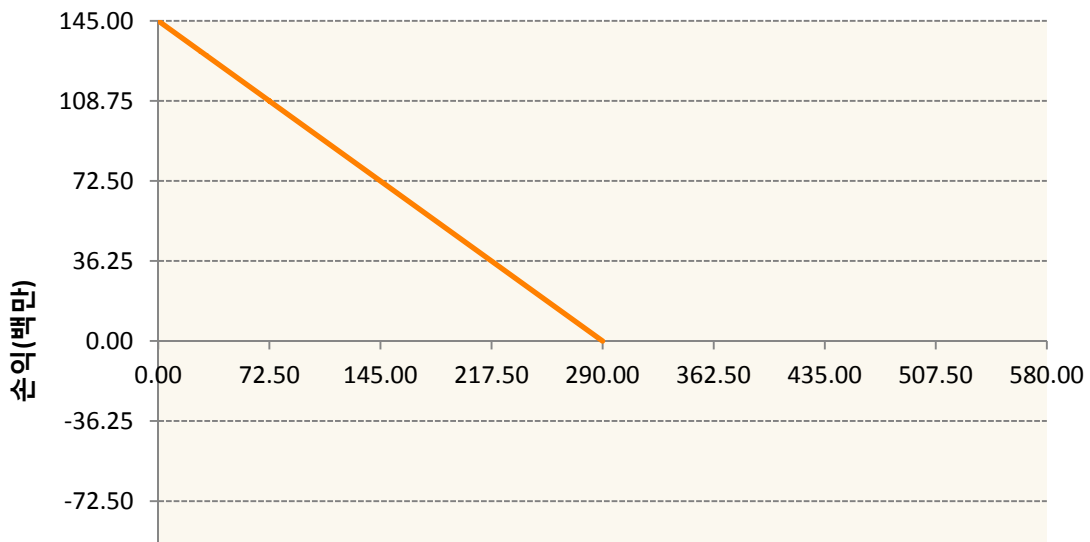


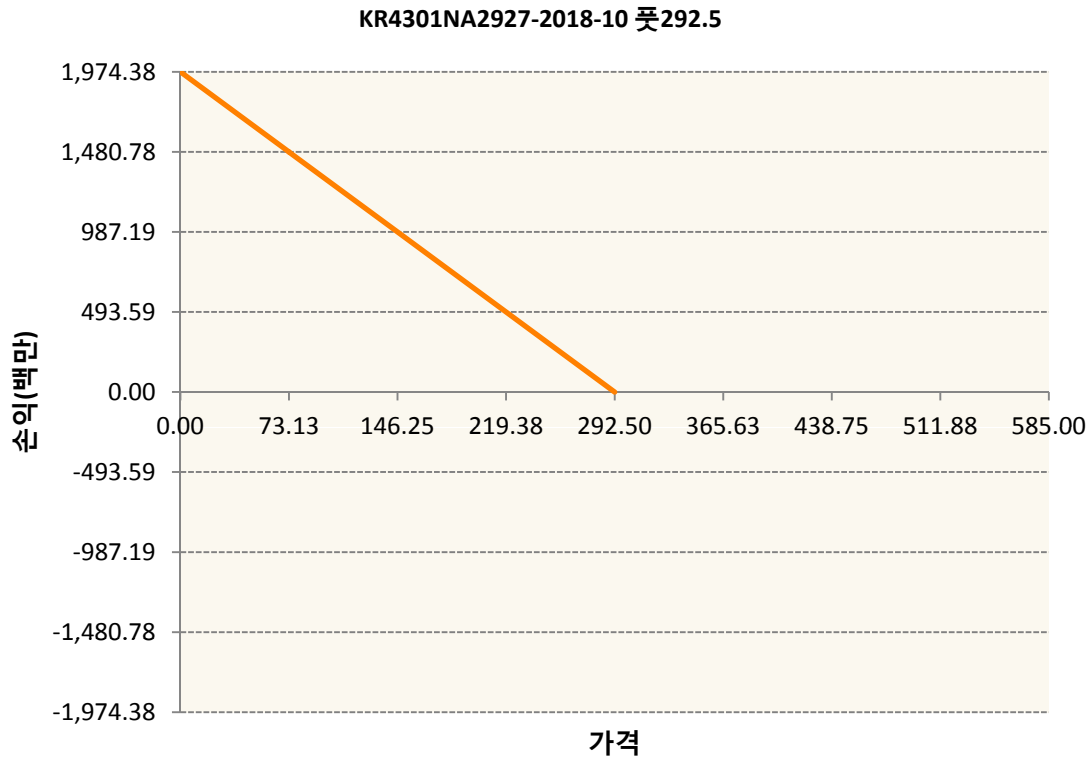
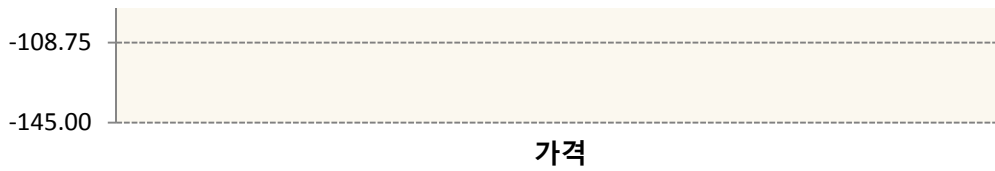


KR4201NA3074-2018-10 콜307.5



KR4301NA2901-2018-10 풋290





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

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 1,106

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,106	-1,106	-1,106	-1,106	-1,106	-1,106	-1,106
-5.33%	-738	-738	-738	-738	-738	-738	-738
-2.67%	-369	-369	-369	-369	-369	-369	-369
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	369	369	369	369	369	369	369
5.33%	738	738	738	738	738	738	738
8.00%	1,106	1,106	1,106	1,106	1,106	1,106	1,106

KR4201NA3(2018-10 콜305) 229

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	69	68	66	64	62	59	55
-5.33%	65	62	59	55	50	45	40
-2.67%	53	47	41	35	28	21	14

0%	25	17	8	0	-8	-17	-26
2.67%	-26	-35	-44	-53	-61	-70	-79
5.33%	-100	-107	-115	-123	-131	-139	-148
8.00%	-192	-197	-203	-209	-215	-222	-229

KR4201NA3(2018-10 콜307.5

997

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	267	263	258	251	241	229	216
-5.33%	255	244	231	215	197	176	154
-2.67%	213	191	166	139	110	80	48
0%	109	74	37	0	-38	-76	-115
2.67%	-92	-134	-176	-218	-260	-302	-344
5.33%	-403	-441	-480	-519	-559	-599	-639
8.00%	-808	-835	-864	-895	-928	-962	-997

KR4301NA2(2018-10 풋290

7

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7	7	7	7	7	7	7
-5.33%	3	3	4	4	4	4	4
-2.67%	1	1	1	1	1	1	1
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

112

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	112	112	112	112	112	112	112
-5.33%	59	59	60	60	61	62	63
-2.67%	15	17	18	20	22	23	25
0%	-3	-2	-1	0	1	3	4
2.67%	-6	-6	-5	-5	-5	-4	-4
5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-5
8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6

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

(단위:백만원)

**1,980**

공시일	2018-09-21
기준일	2018-09-20

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

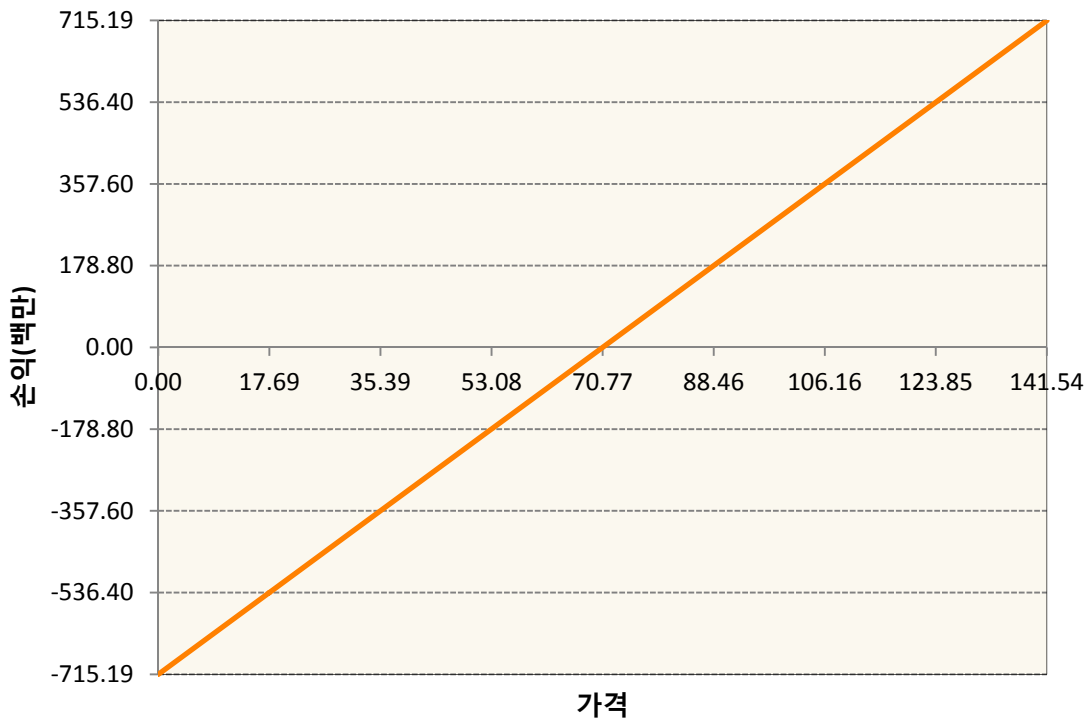
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

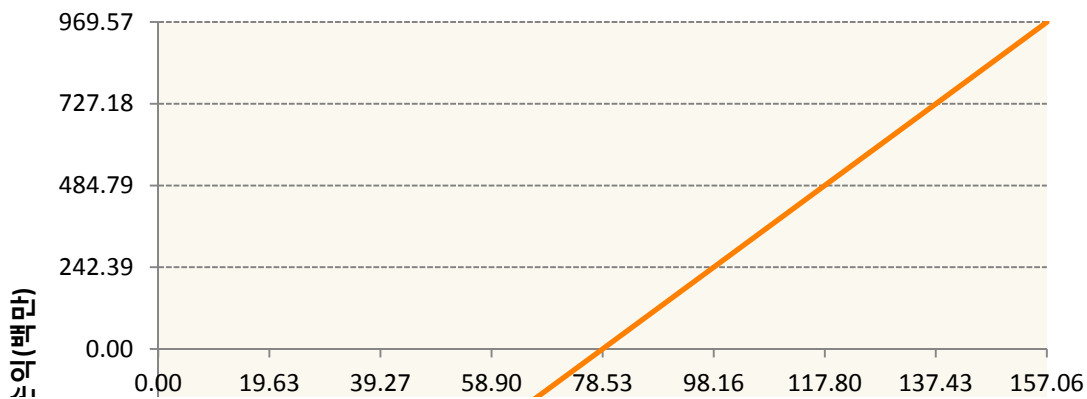
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,097	616	2,481	
누계	유가증권	선물	531	0	531	장내

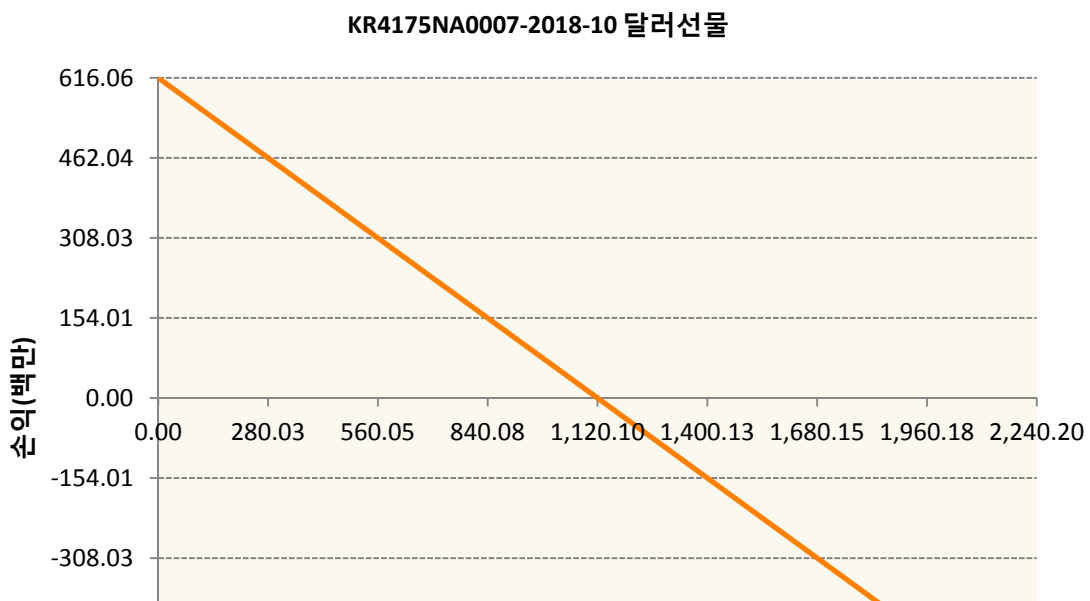
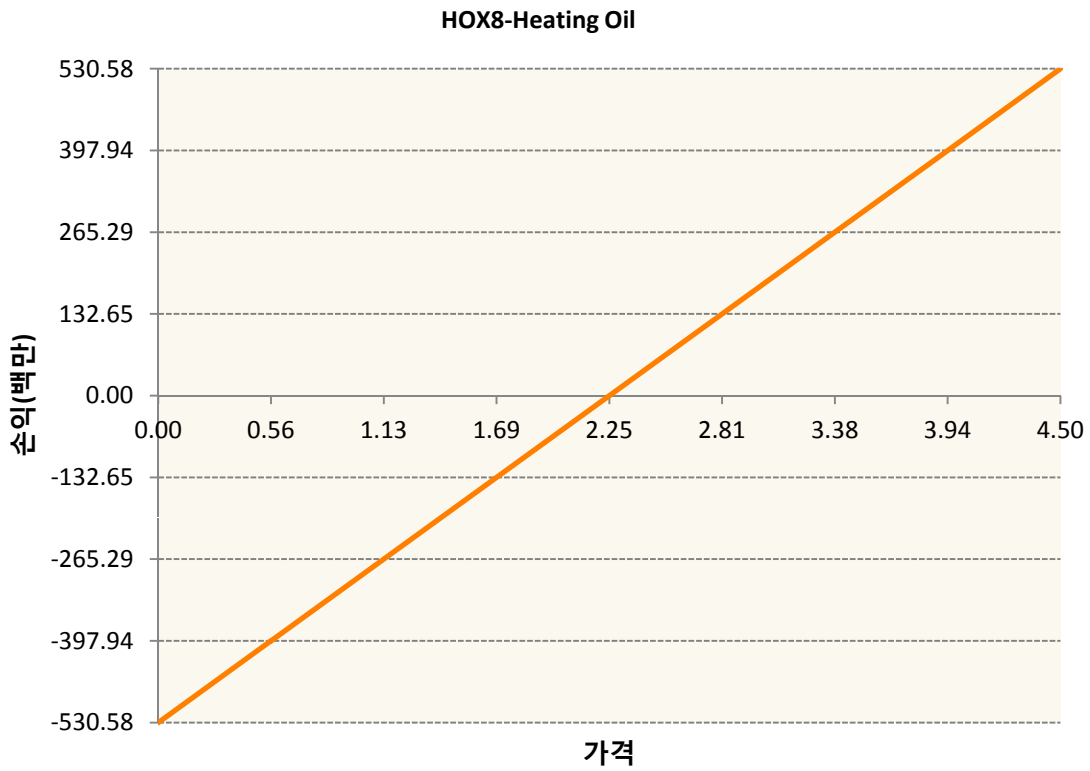
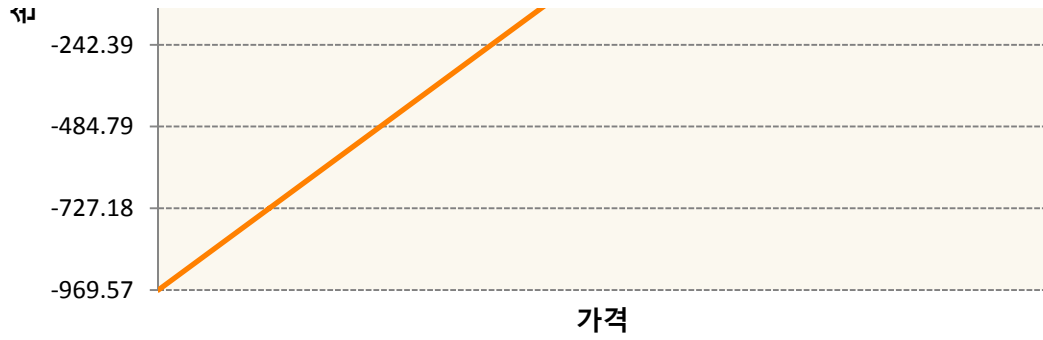
### 2. 만기시점의 손익구조

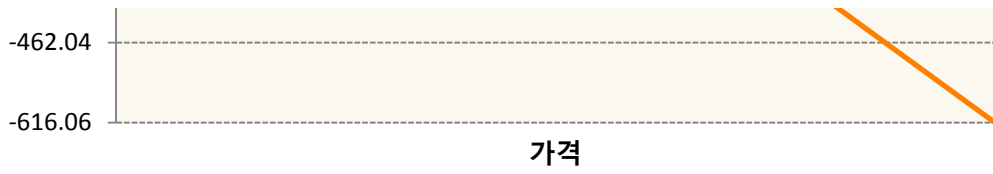
CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18



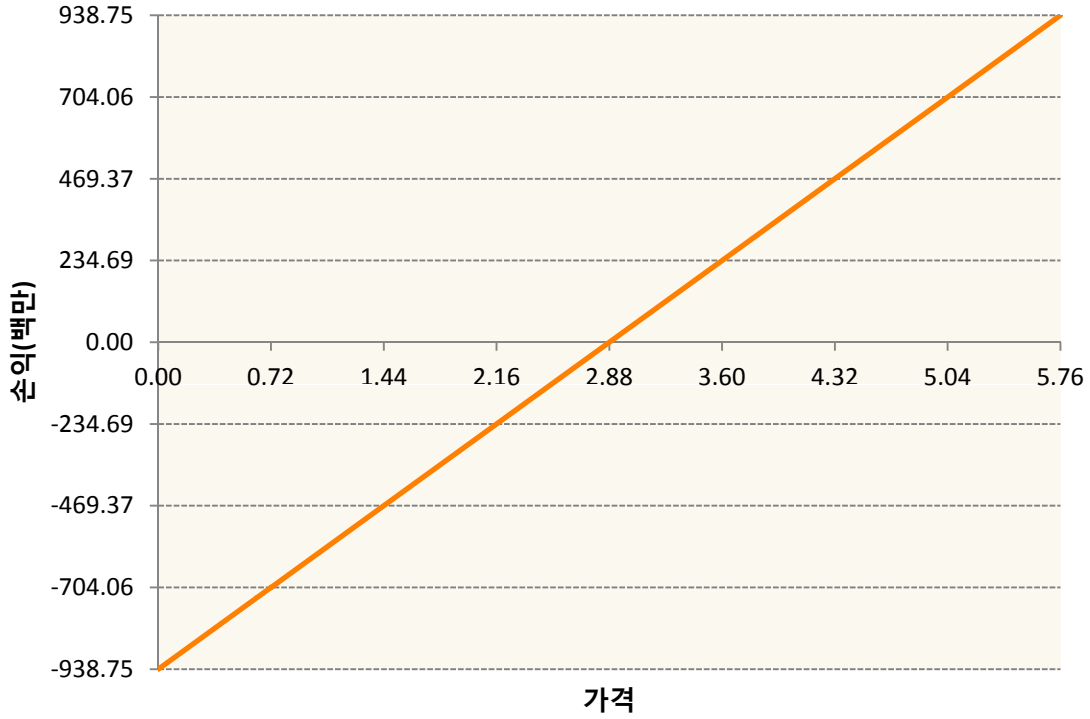
COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19



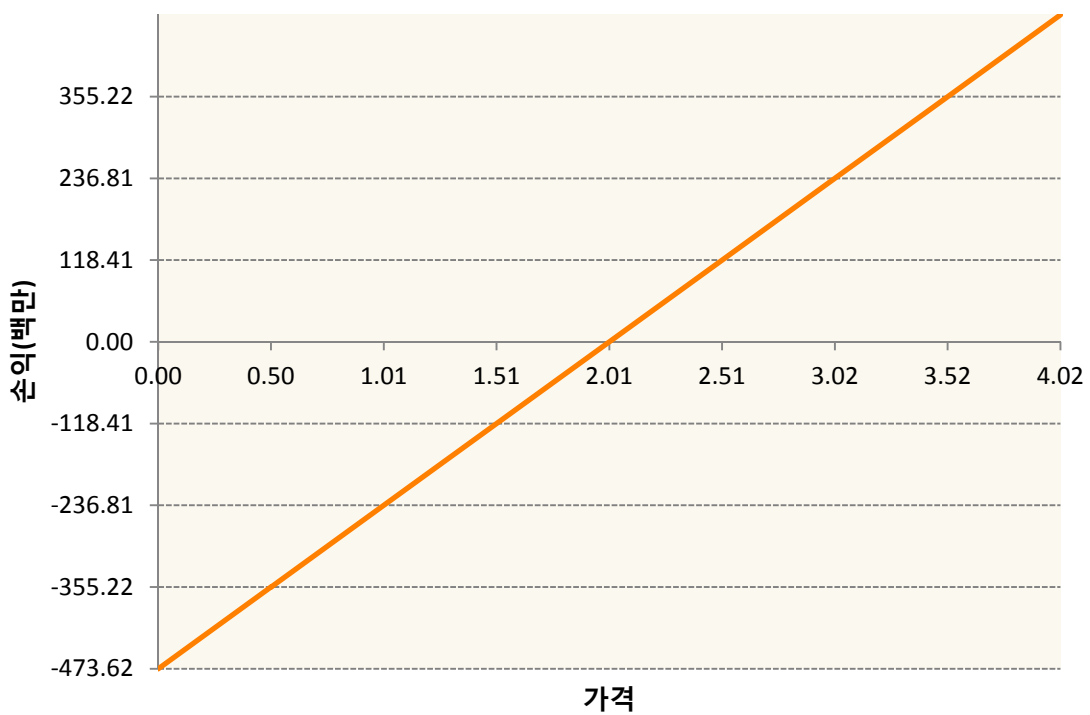




**NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18**



**XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18**



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	57
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	78
HOX8	Heating Oil	42
KR4175NA0	(2018-10 달러선물	49
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	75
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	38

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	433

공시일	2018-09-21
기준일	2018-09-20

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

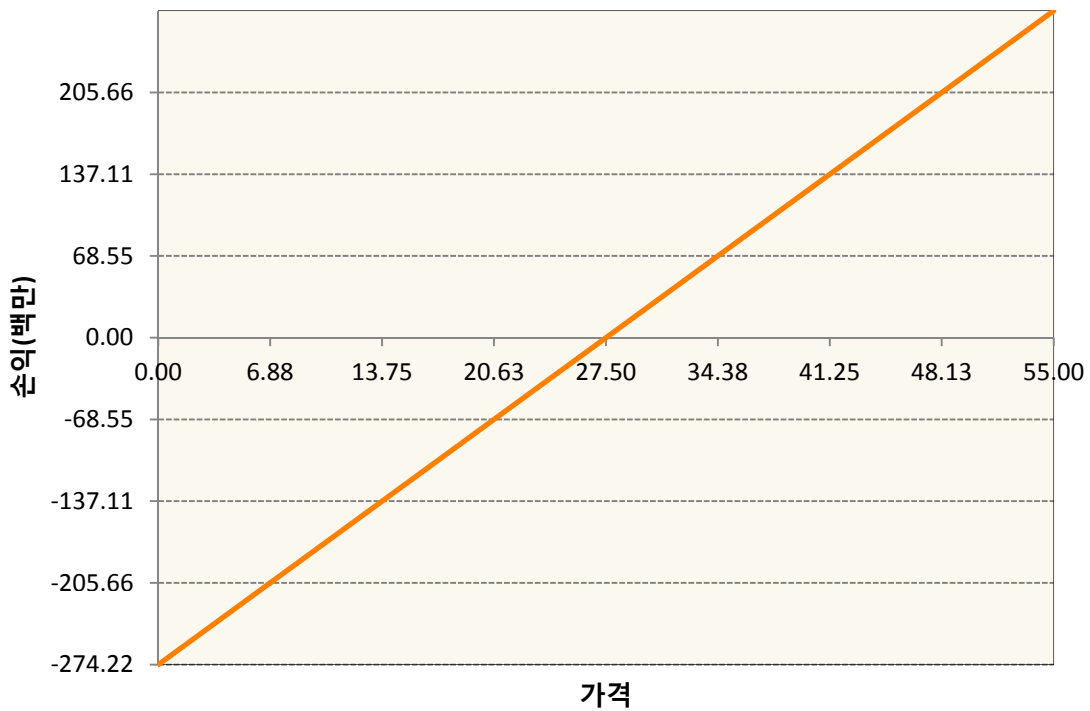
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

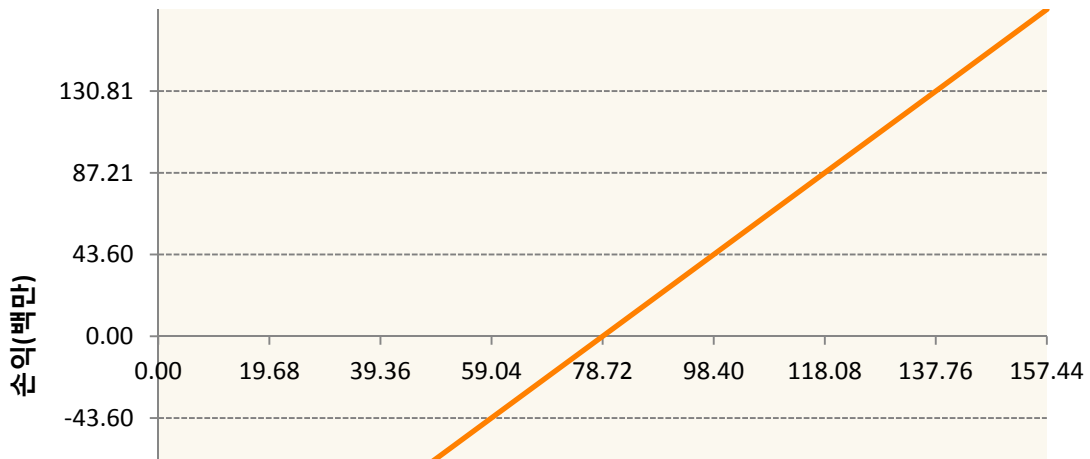
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,487	78	3,409	

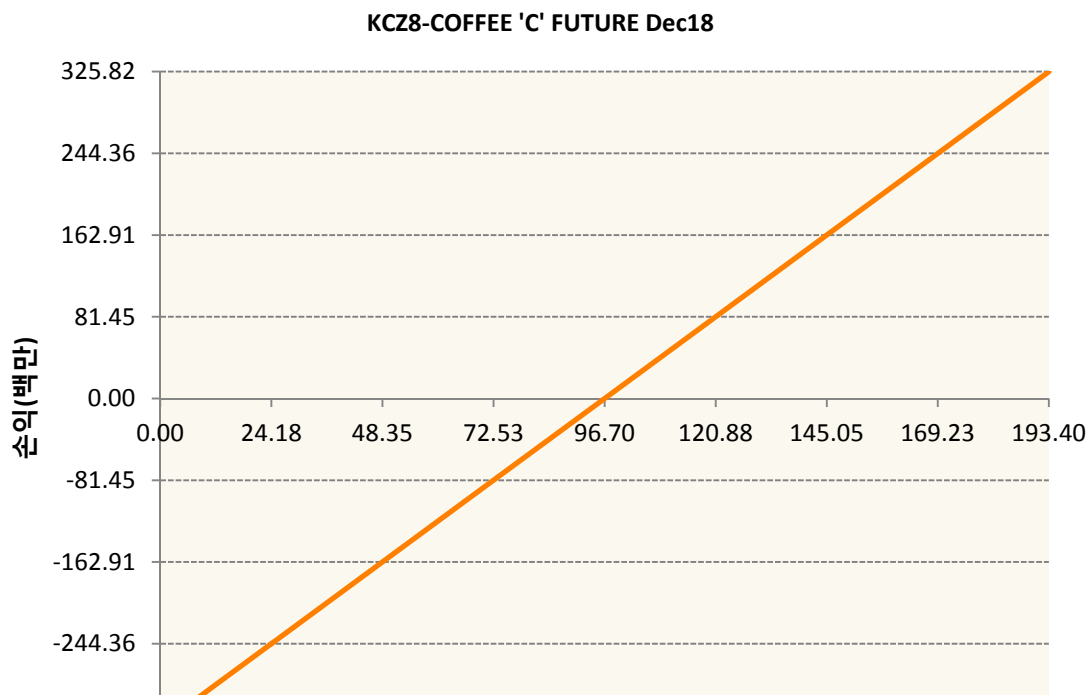
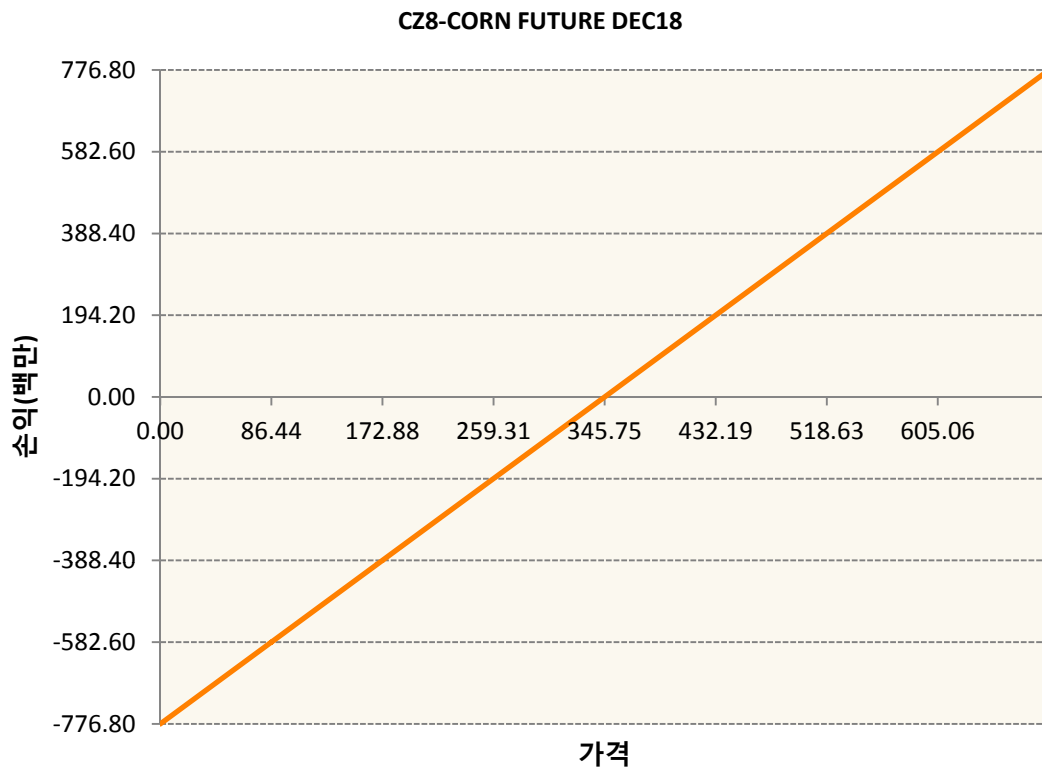
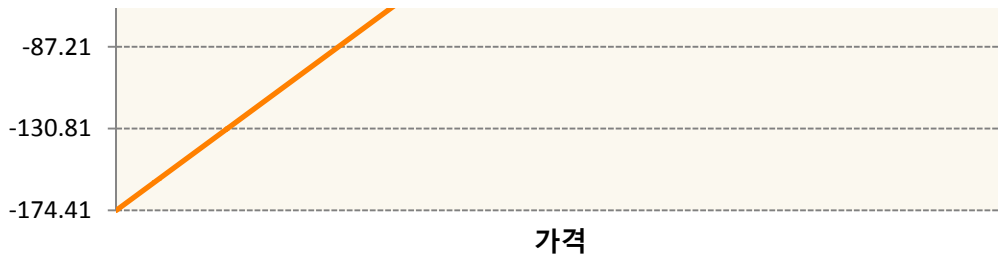
### 2. 만기시점의 손익구조

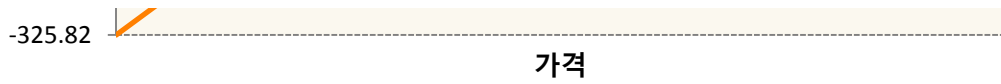
**BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18**



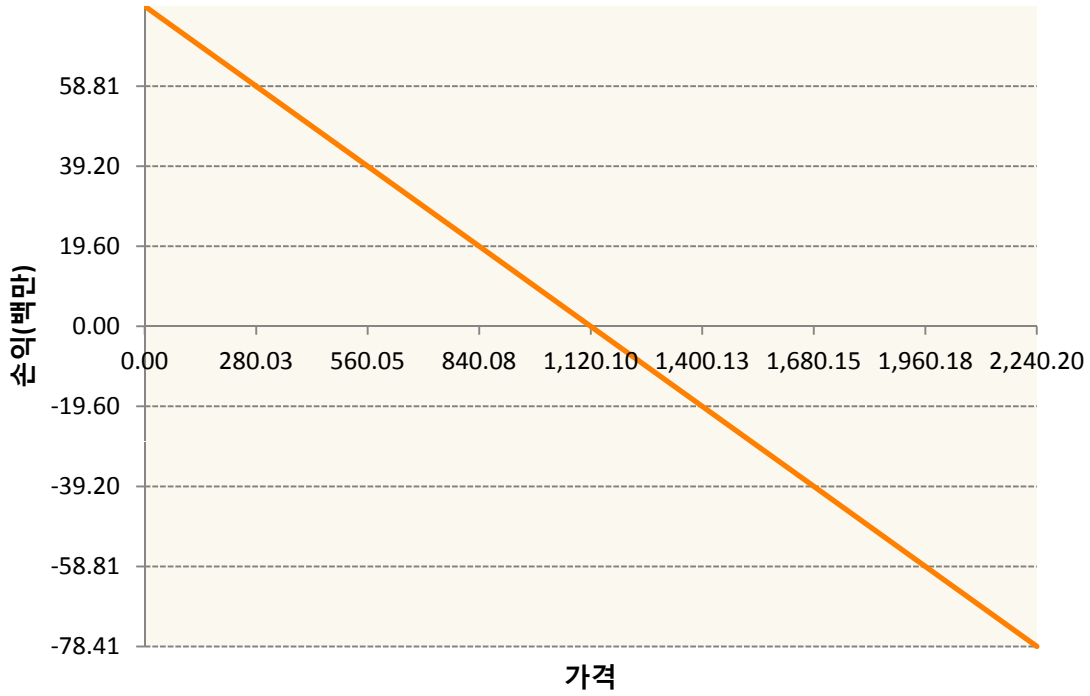
**CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18**



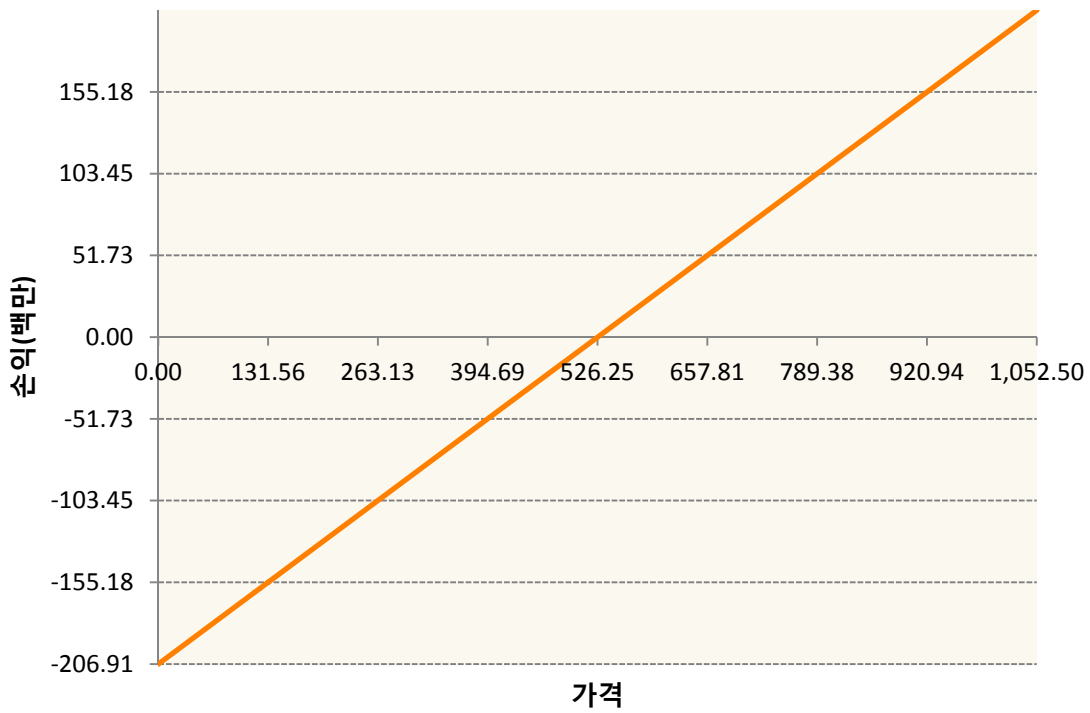




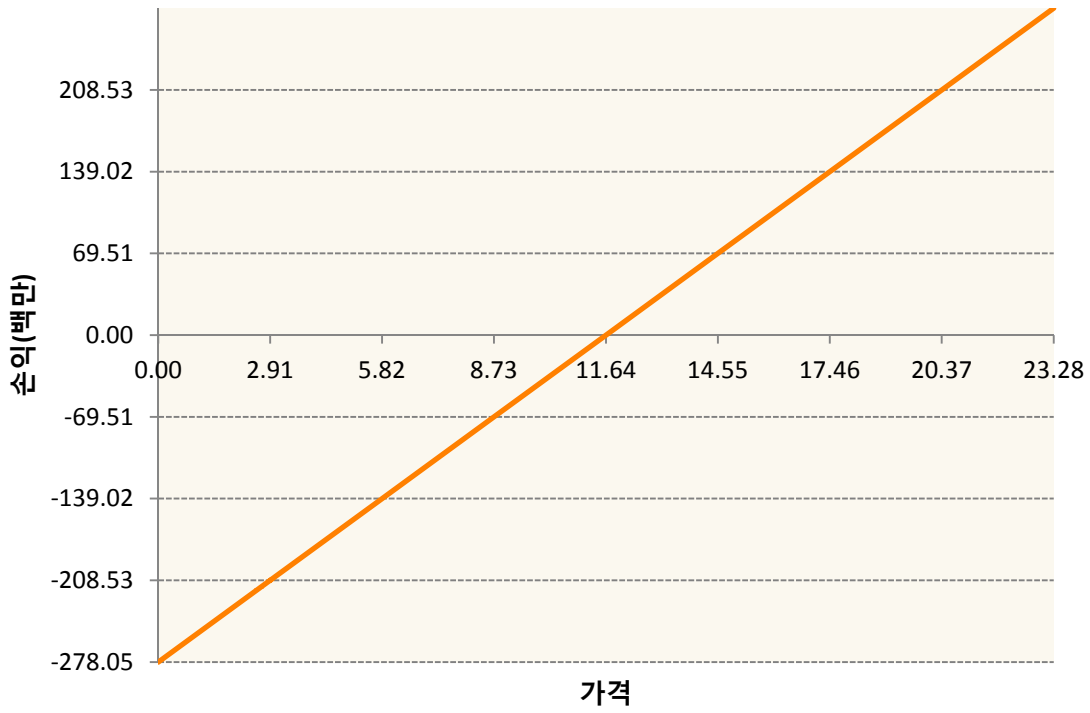
**KR4175NA0007-2018-10 달러선물**



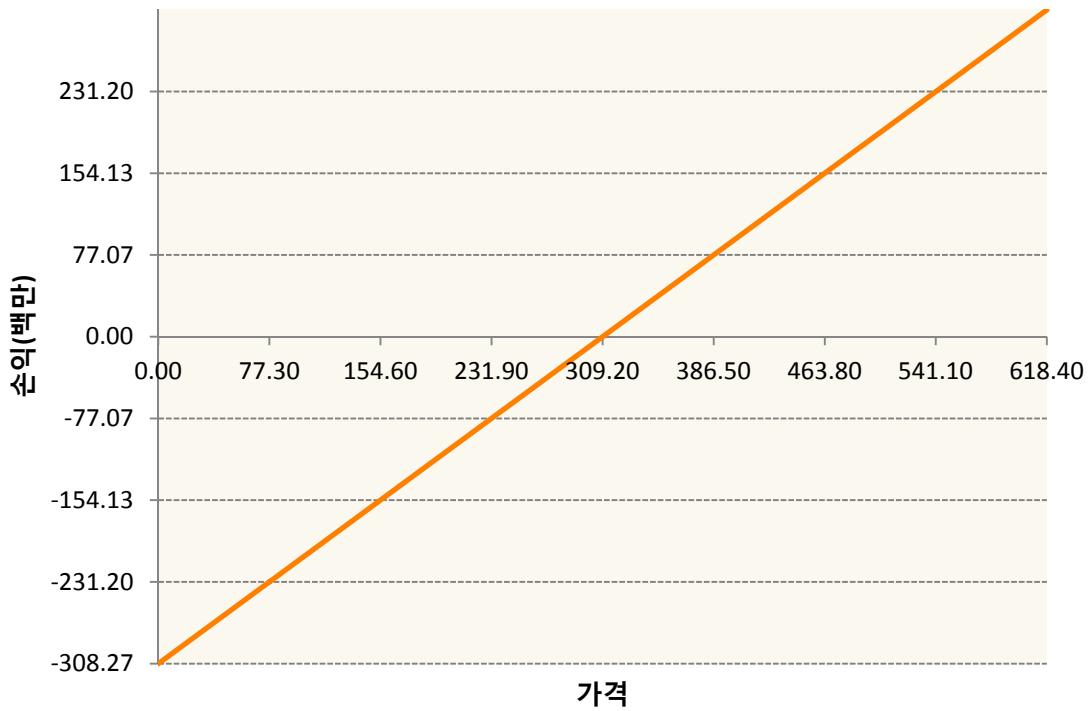
**KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18**



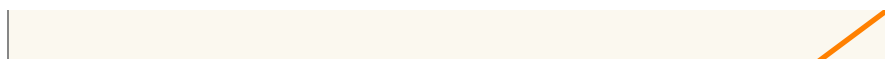
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

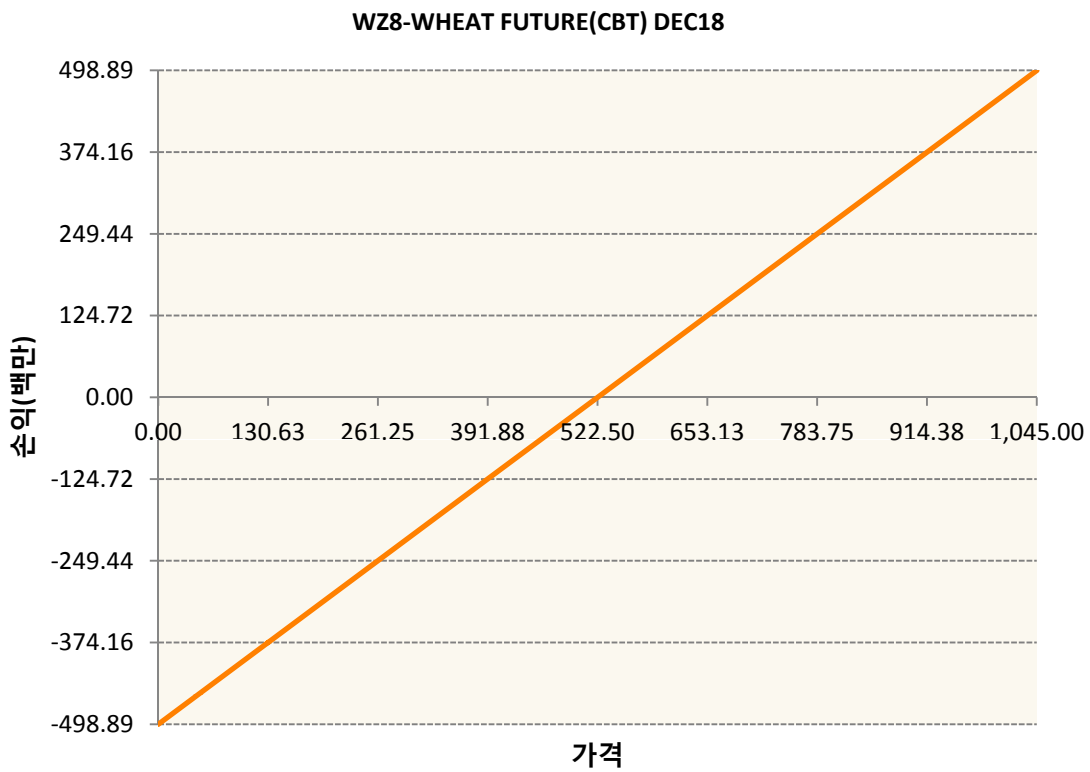
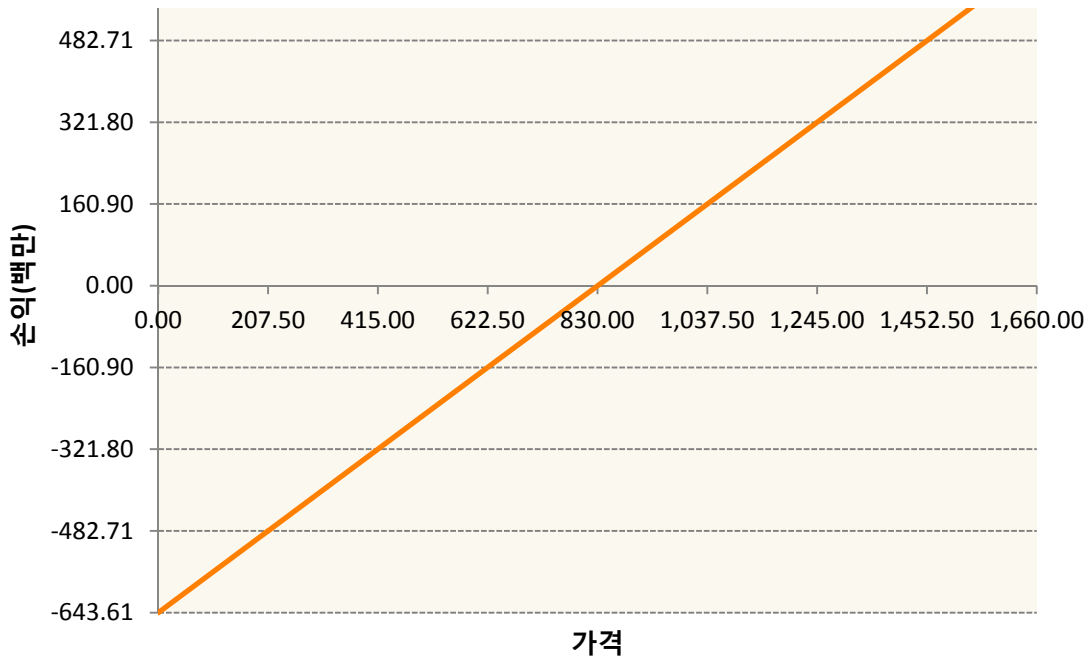


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	22
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	14
CZ8	CORN FUTURE DEC18	62
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	26
KR4175NA0(2018-10 달러선물)		6

KWZ8	KC HRW WHEAT FUT DEC18	17
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	22
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	25
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	51
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	40

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

(단위:백만원)

**305**