

공시일	2018-09-27
기준일	2018-09-21

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	2018-09-27
기준일	2018-09-21

스마트인덱스모

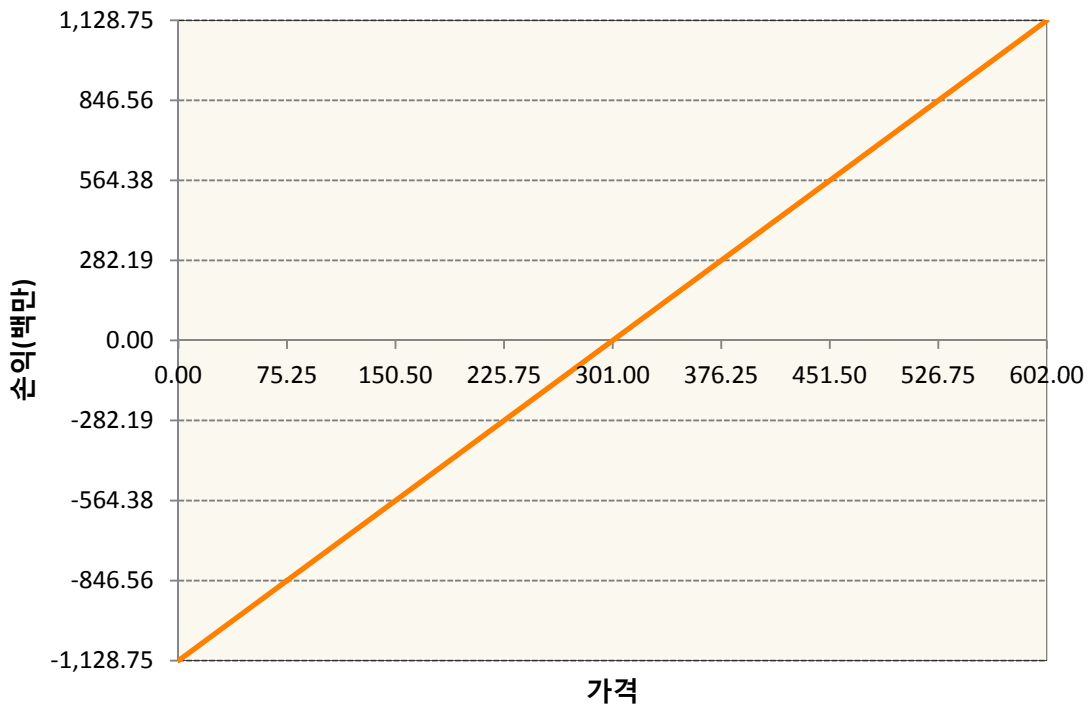
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,129	0	1,129	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	2018-09-27
기준일	2018-09-21

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

1,166

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

495

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-27
기준일	2018-09-21

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)

SWCSI50000 신한CSI500미래S180910

295

* 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	2018-09-27
기준일	2018-09-21

유로인덱스모(주식-파생형)

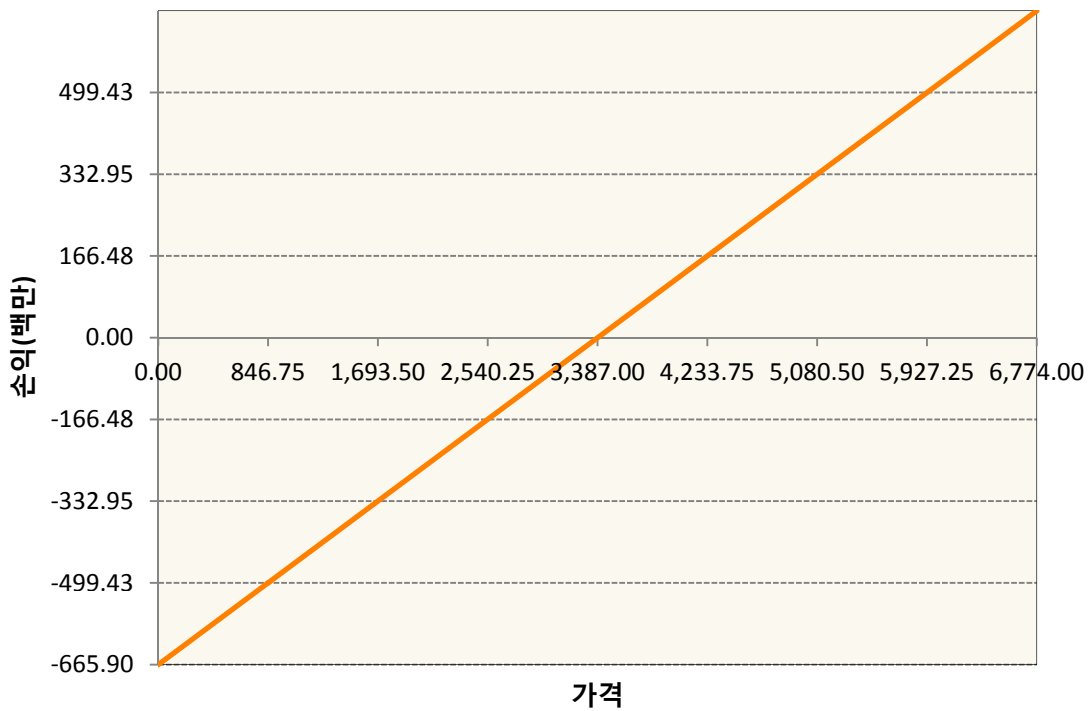
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	666	0	666	

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)

33

공시일	2018-09-27
기준일	2018-09-21

차이나인덱스모(주식-파생형)

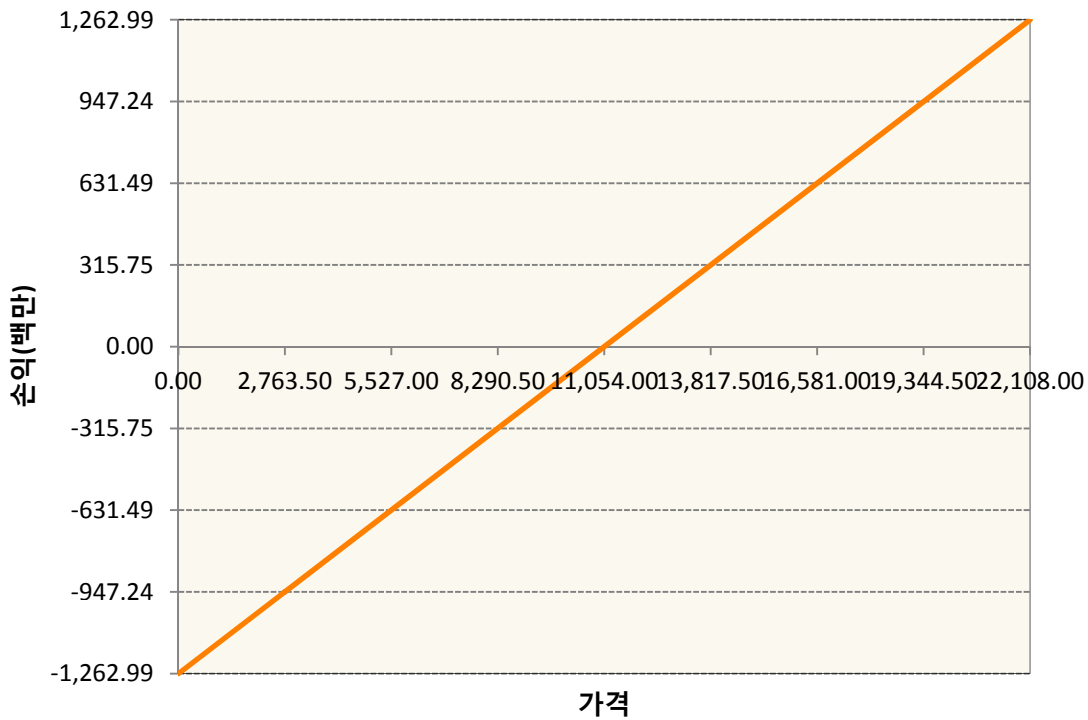
1. 계약금액

(단위:백만원)

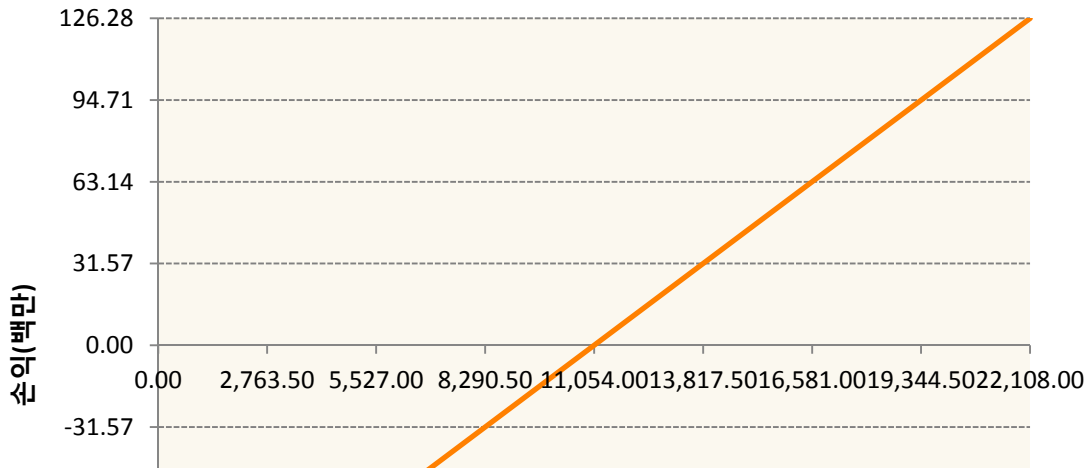
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,389	0	1,389	장내

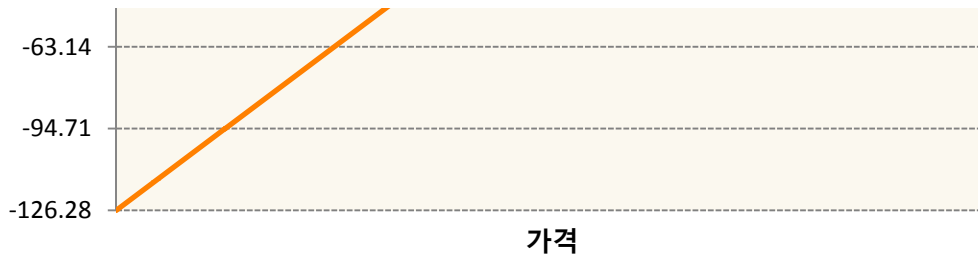
2. 만기시점의 손익구조

HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



MHCV8-MINI H-SHR IDX FU OCT 18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	101
MHCV8	MINI H-SHR IDX FU OCT 18	10

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

103

공시일	2018-09-27
기준일	2018-09-21

커버드콜모(주식혼합-파생형)

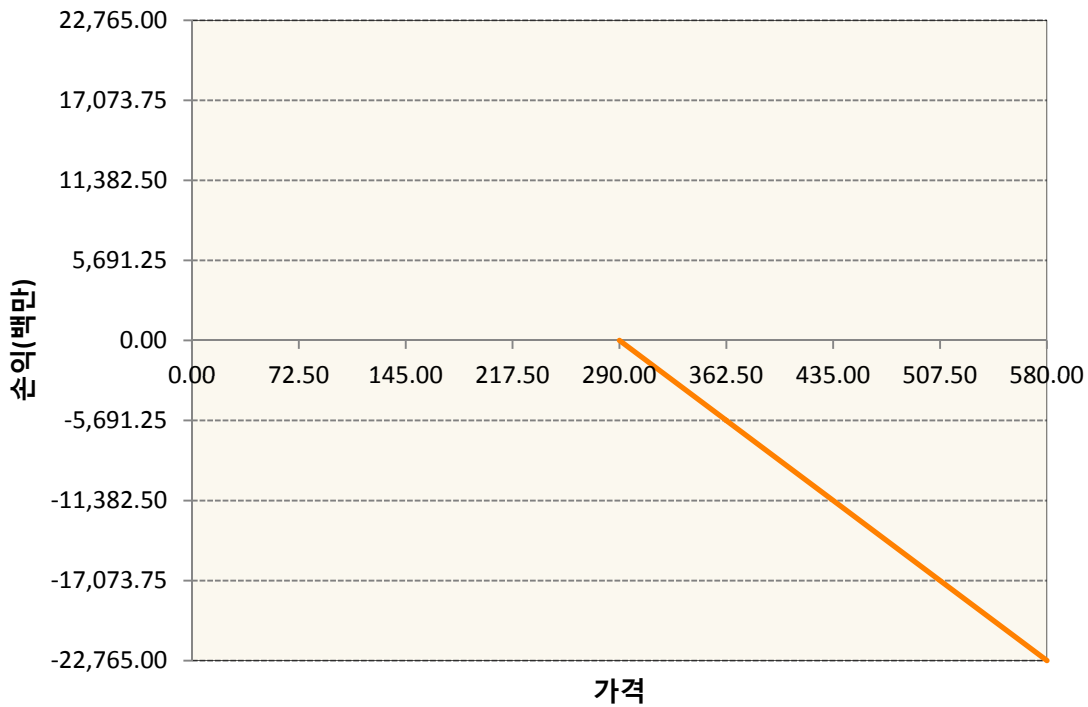
1. 계약금액

(단위:백만원)

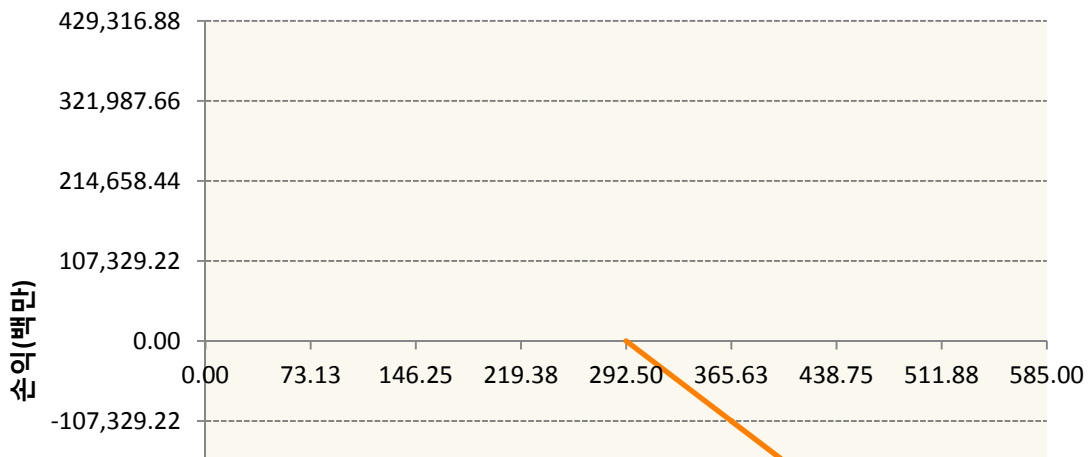
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	2,919	0	2,919	장내
누계	유가증권	옵션	0	734,344	-734,344	장내

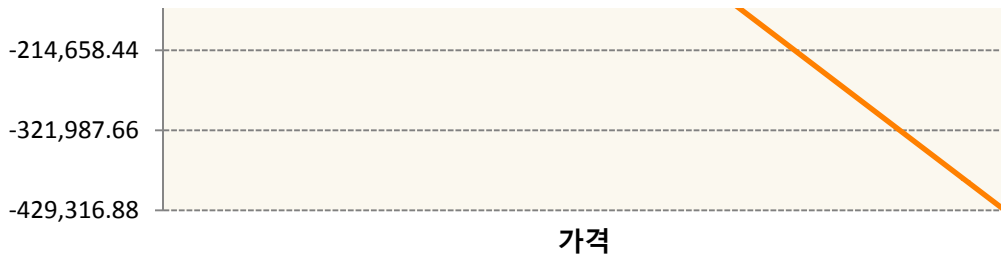
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NA2902-2018-10 콜290

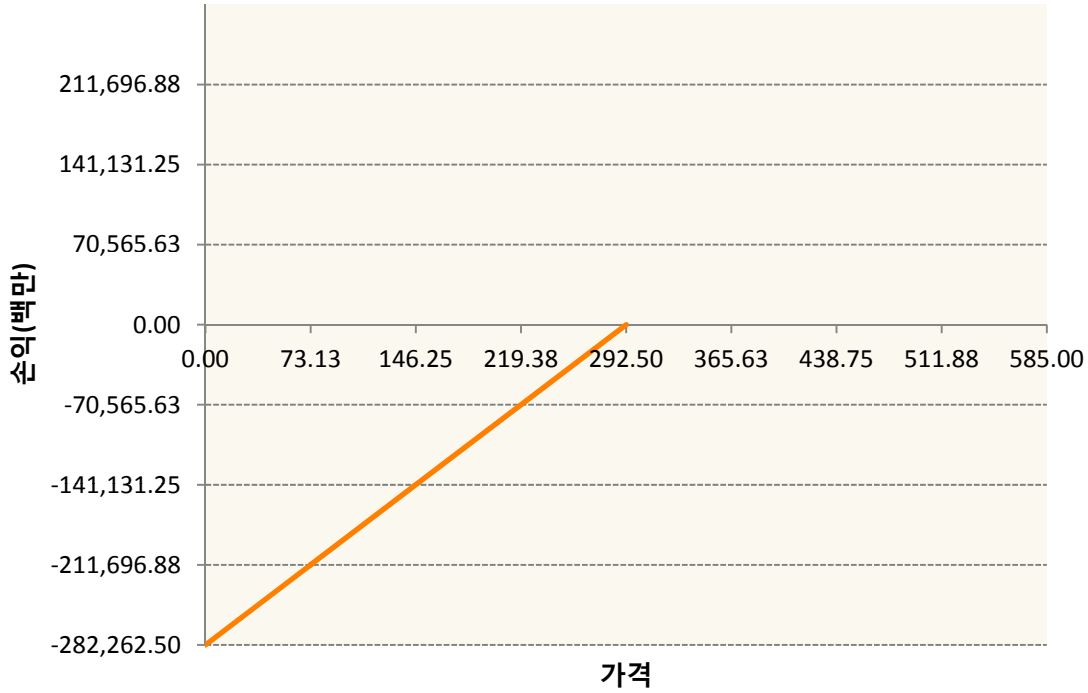


KR4201NA2928-2018-10 콜292.5





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NA2927-2018-10 콜290

1,701

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,006	977	946	913	878	842	804
-5.33%	848	805	761	717	673	628	583
-2.67%	551	505	459	412	366	320	273
0%	113	77	39	0	-40	-82	-124
2.67%	-428	-449	-474	-501	-531	-563	-597
5.33%	-1,025	-1,035	-1,048	-1,063	-1,082	-1,104	-1,128
8.00%	-1,645	-1,648	-1,654	-1,662	-1,672	-1,685	-1,701

KR4201NA2927-2018-10 풋292.5

30,963

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	16,763	16,314	15,810	15,260	14,671	14,049	13,401

-5.33%	14,445	13,699	12,933	12,151	11,356	10,551	9,739
-2.67%	9,739	8,859	7,979	7,099	6,220	5,340	4,461
0%	2,335	1,578	798	0	-811	-1,634	-2,465
2.67%	-7,259	-7,746	-8,292	-8,885	-9,518	-10,184	-10,877
5.33%	-18,162	-18,402	-18,709	-19,076	-19,499	-19,971	-20,486
8.00%	-29,652	-29,745	-29,886	-30,078	-30,323	-30,619	-30,963
KR4301NA29 2018-10 풋 292.5							14,879
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,756	-14,760	-14,769	-14,784	-14,807	-14,838	-14,879
-5.33%	-7,194	-7,284	-7,390	-7,511	-7,645	-7,789	-7,943
-2.67%	-1,511	-1,743	-1,976	-2,209	-2,441	-2,674	-2,907
0%	308	222	119	0	-132	-275	-428
2.67%	462	457	446	428	402	365	318
5.33%	465	465	465	464	462	458	450
8.00%	465	465	465	465	465	465	464

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

(단위:백만원)

45,956

공시일	2018-09-27
기준일	2018-09-21

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

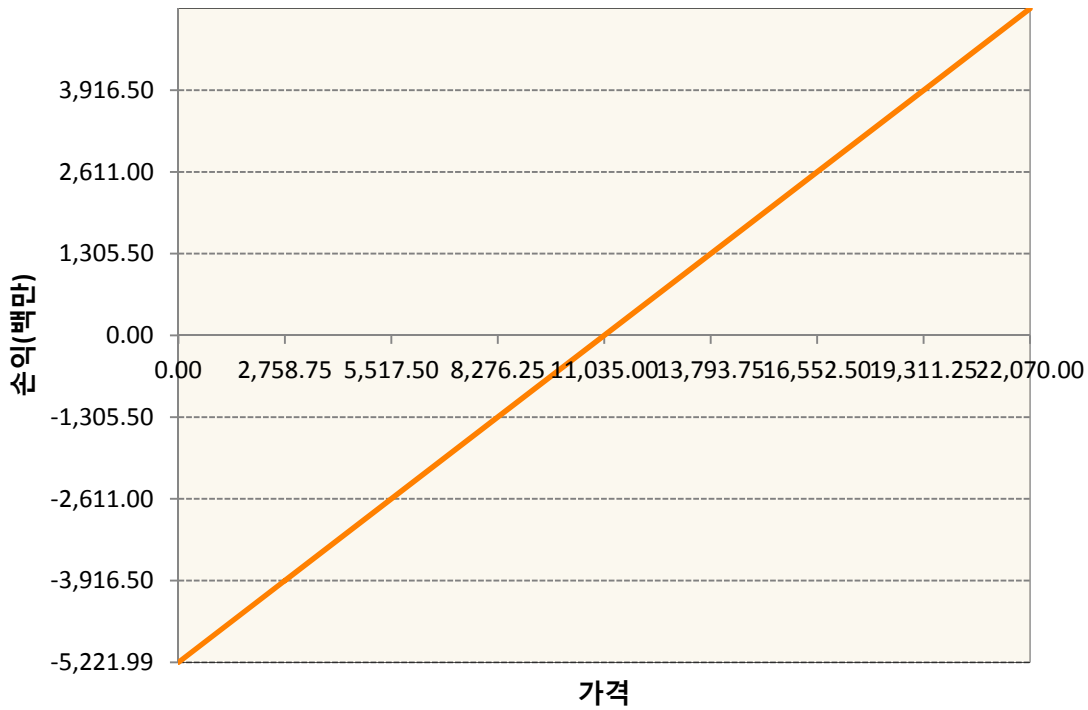
1. 계약금액

(단위:백만원)

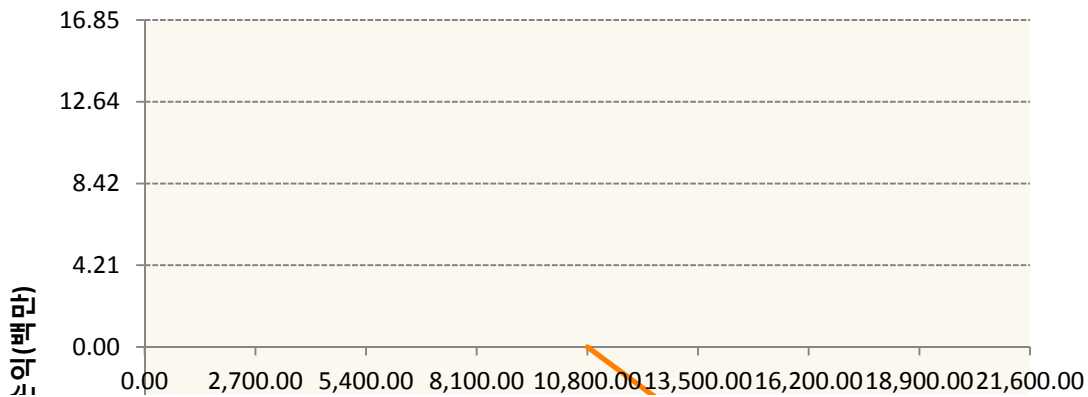
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,222	0	5,222	장내
누계	유가증권	옵션	0	381	-381	장내

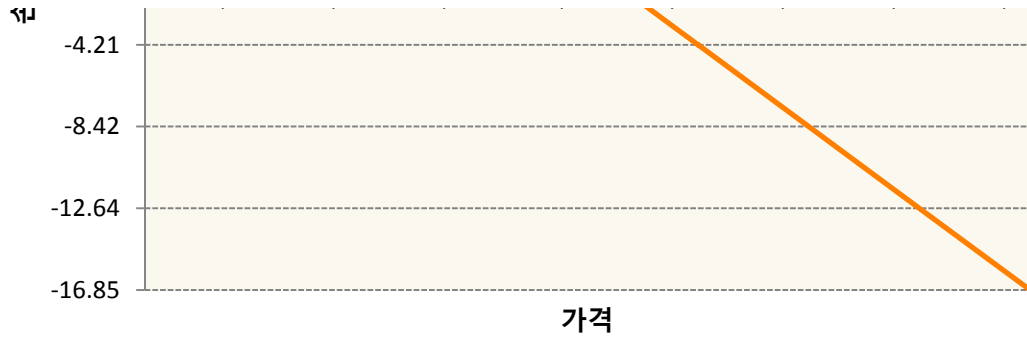
2. 만기시점의 손익구조

HCU8-H-SHARES IDX FUT Sep18

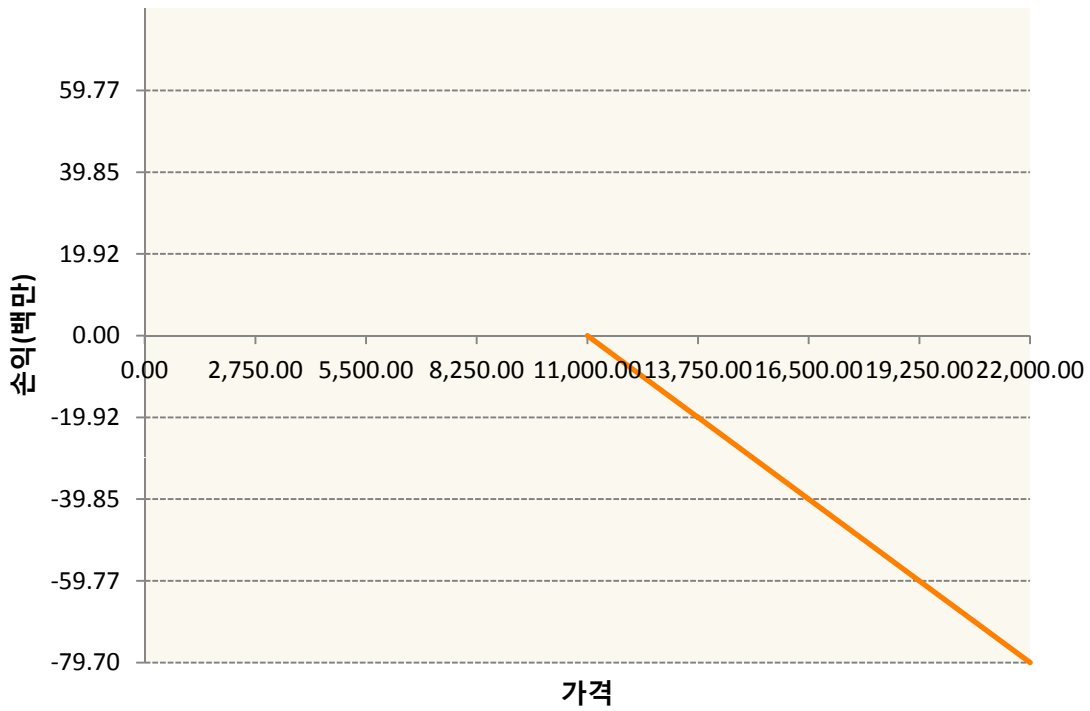


HSCEI9C108-HSCEI

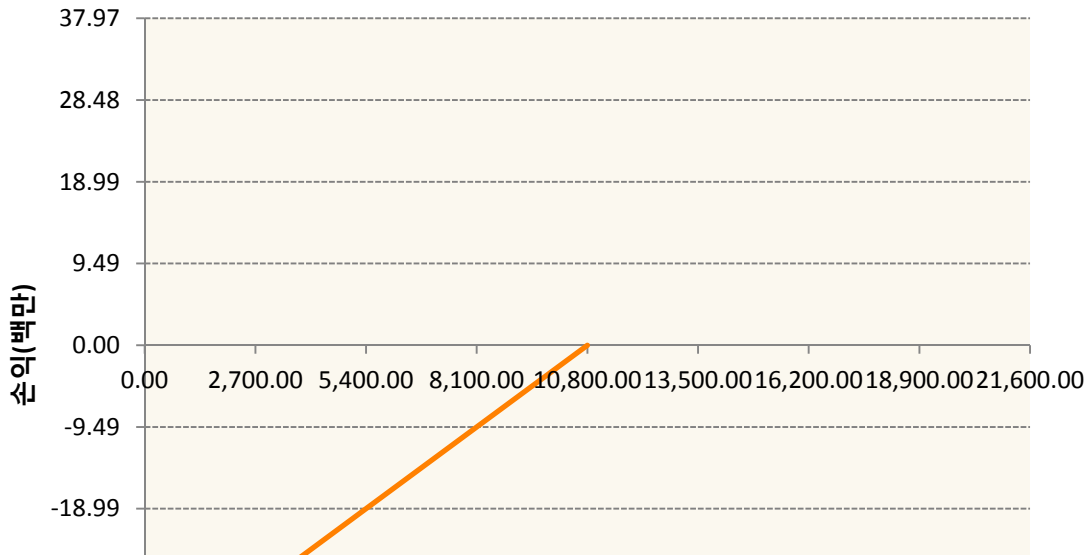


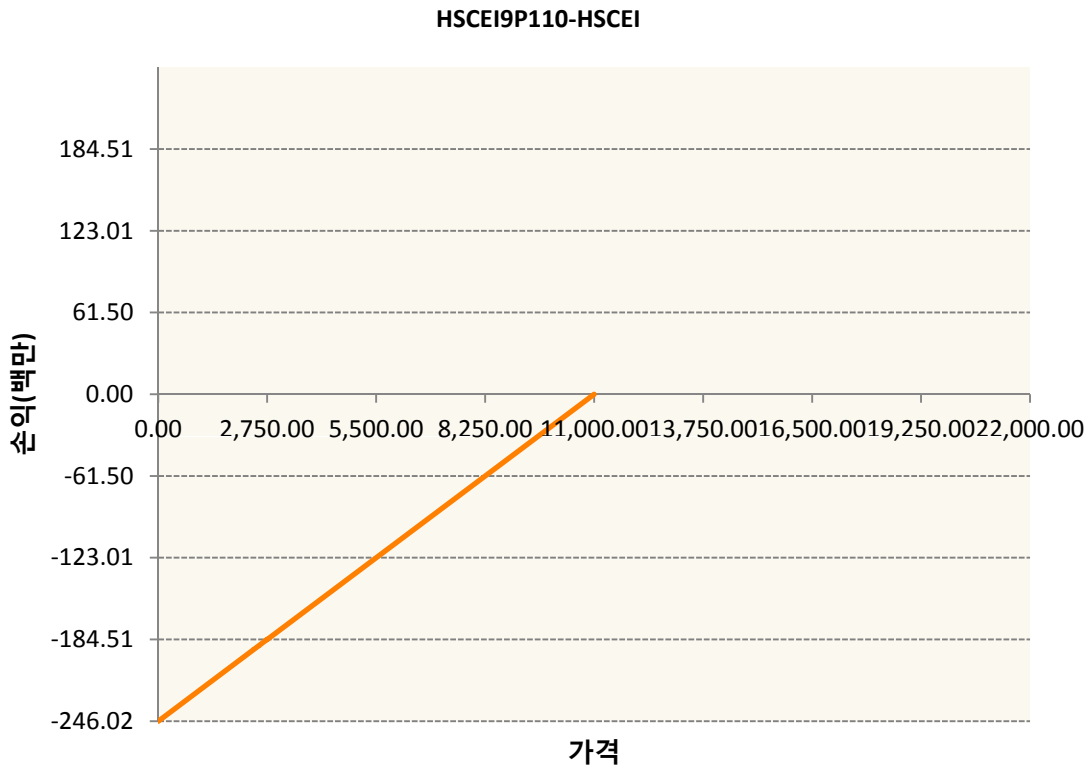
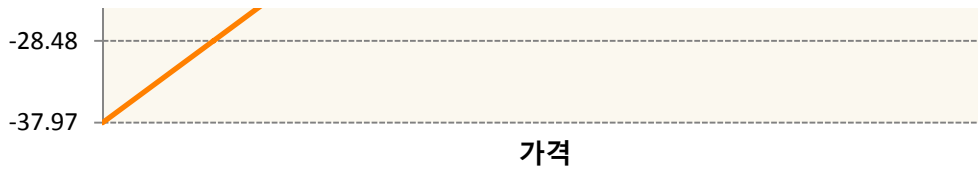


HSCEI9C110-HSCEI



HSCEI9P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU8	H-SHARES IDX FUT Sep18	418
HSCEI9C108	HSCEI	1
HSCEI9C110	HSCEI	6
HSCEI9P108	HSCEI	3
HSCEI9P110	HSCEI	20

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	416

공시일	2018-09-27
기준일	2018-09-21

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

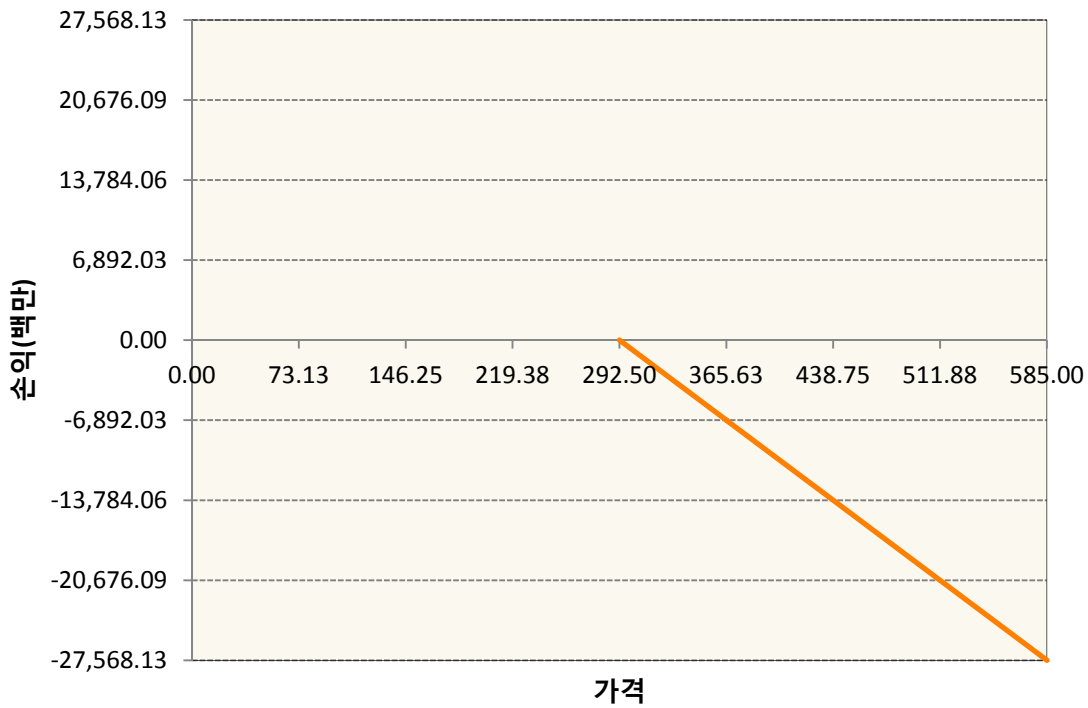
1. 계약금액

(단위:백만원)

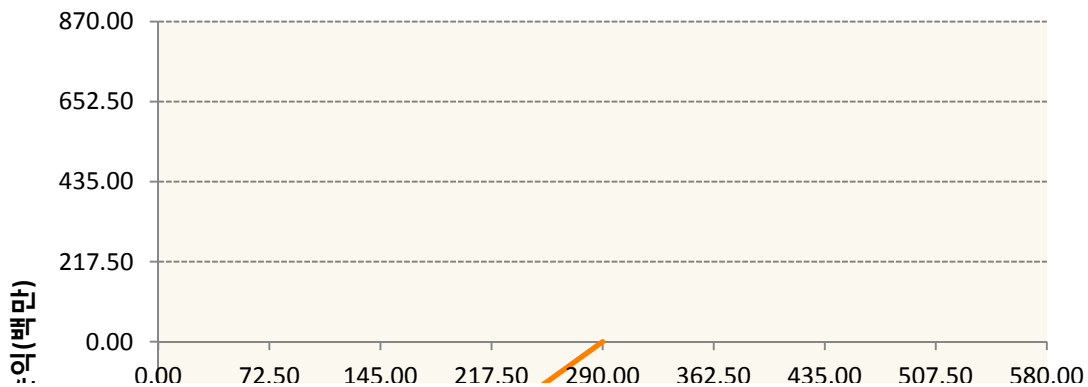
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	724	0	724	장내
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	48,036	-48,036	장내

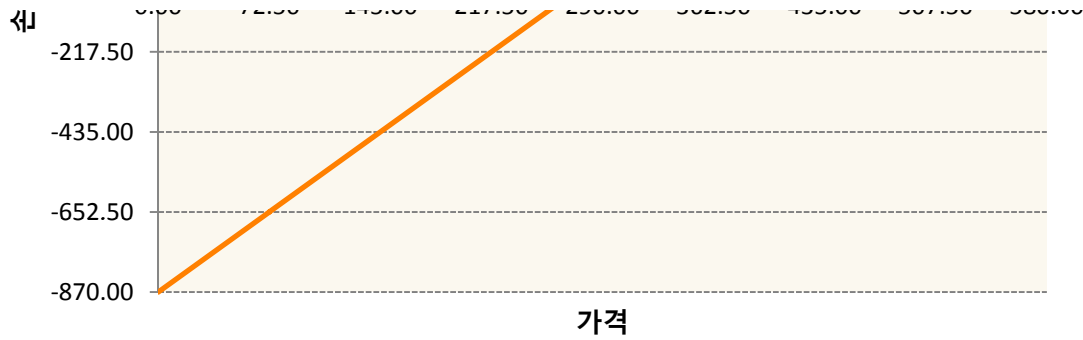
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NA2928-2018-10 콜292.5

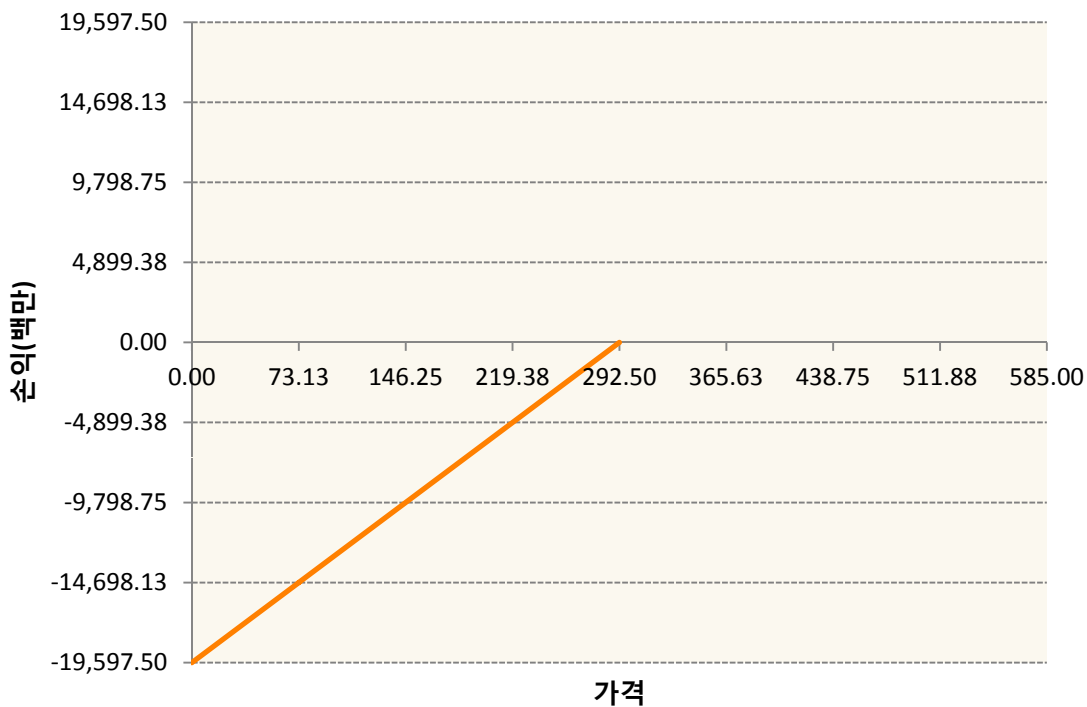


KR4301NA2901-2018-10 풋290





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14

3,986

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,986	-3,986	-3,986	-3,986	-3,986	-3,986	-3,986
-5.33%	-2,657	-2,657	-2,657	-2,657	-2,657	-2,657	-2,657
-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%	2,657	2,657	2,657	2,657	2,657	2,657	2,657
8.00%	3,986	3,986	3,986	3,986	3,986	3,986	3,986

KR4201NA2927-2018-10 풋292.5

1,988

기초자산의 변동성							
-----------	--	--	--	--	--	--	--

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,076	1,048	1,015	980	942	902	861
-5.33%	928	880	830	780	729	678	625
-2.67%	625	569	512	456	399	343	286
0%	150	101	51	0	-52	-105	-158
2.67%	-466	-497	-532	-571	-611	-654	-698
5.33%	-1,166	-1,182	-1,201	-1,225	-1,252	-1,282	-1,315
8.00%	-1,904	-1,910	-1,919	-1,931	-1,947	-1,966	-1,988

KR4301NA2 2018-10 풋290

40

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-39	-39	-39	-39	-40	-40	-40
-5.33%	-16	-17	-17	-18	-19	-19	-20
-2.67%	-2	-3	-4	-4	-5	-6	-6
0%	1	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	1	1	1	1	1	1	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

KR4301NA2 2018-10 풋292.5

1,033

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,025	-1,025	-1,025	-1,026	-1,028	-1,030	-1,033
-5.33%	-499	-506	-513	-522	-531	-541	-551
-2.67%	-105	-121	-137	-153	-170	-186	-202
0%	21	15	8	0	-9	-19	-30
2.67%	32	32	31	30	28	25	22
5.33%	32	32	32	32	32	32	31
8.00%	32	32	32	32	32	32	32

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

(단위:백만원)

6,914

공시일	2018-09-27
기준일	2018-09-21

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

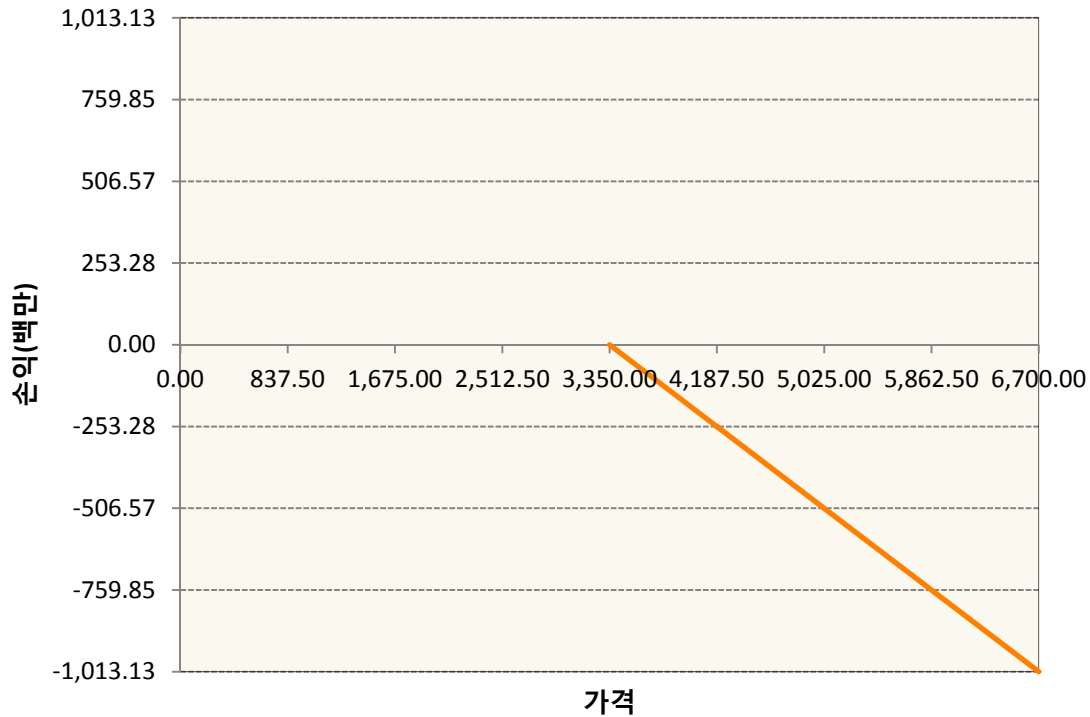
1. 계약금액

(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	5,579	0	5,579	
누계	유가증권	스왑	34,722	0	34,722	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,369	-25,369	장내
누계	지수	스왑	53,381	0	53,381	장외

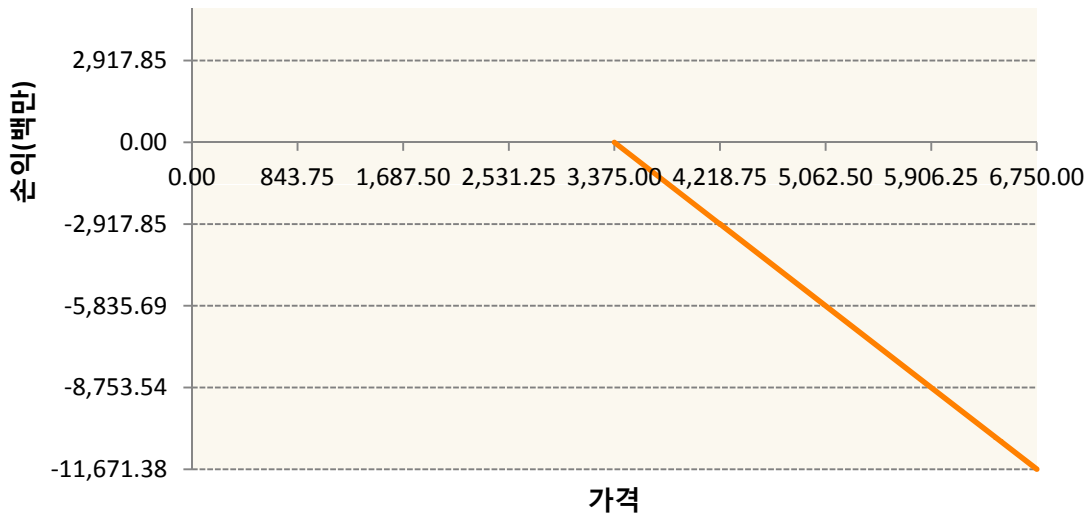
2. 만기시점의 손익구조

OESXU8-C3350-EURO STOXX 50

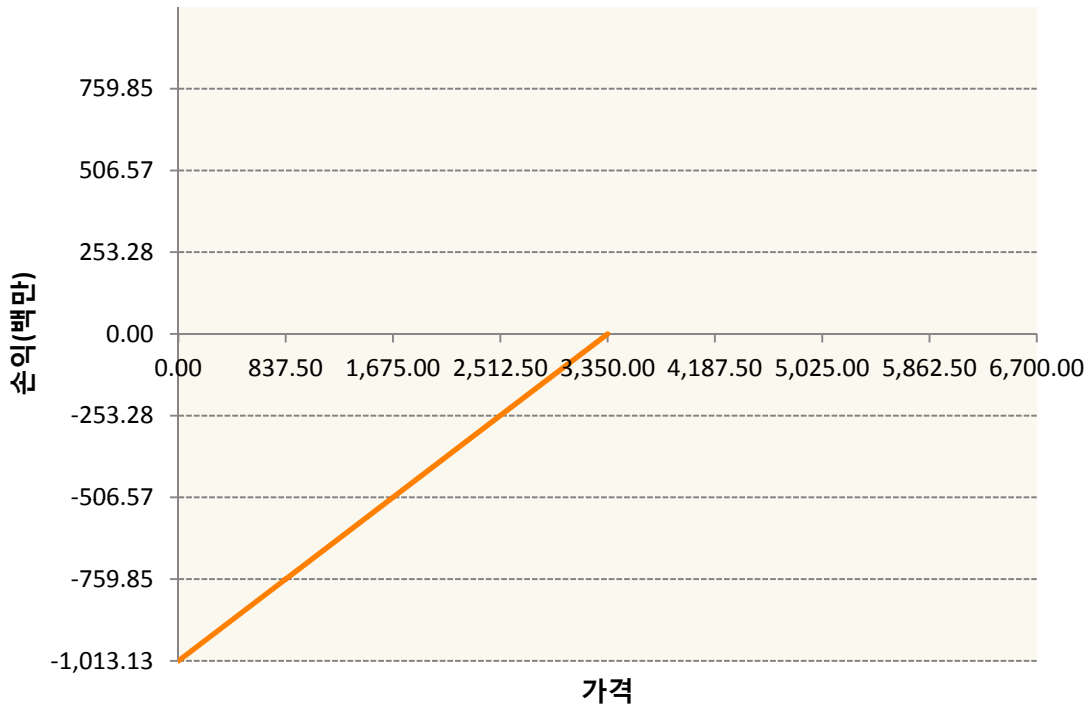


OESXU8-C3375-EURO STOXX 50

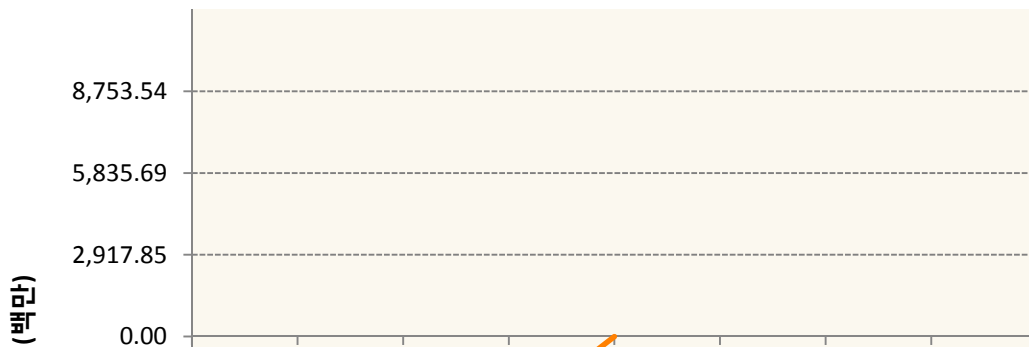


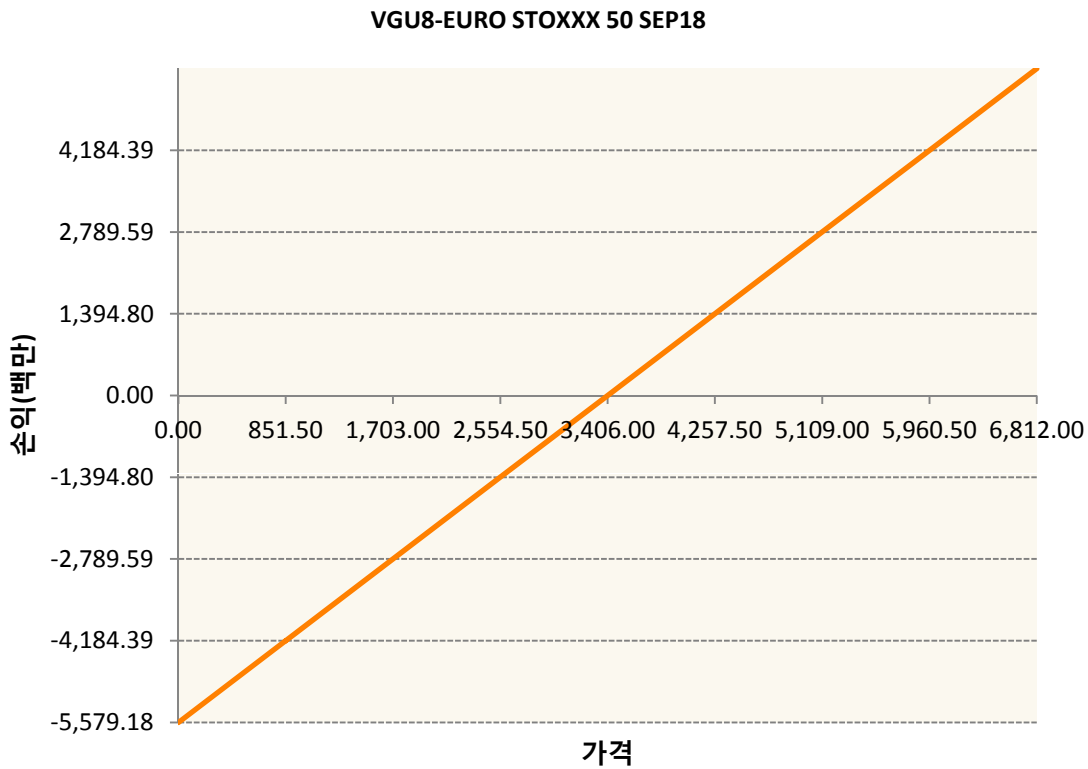
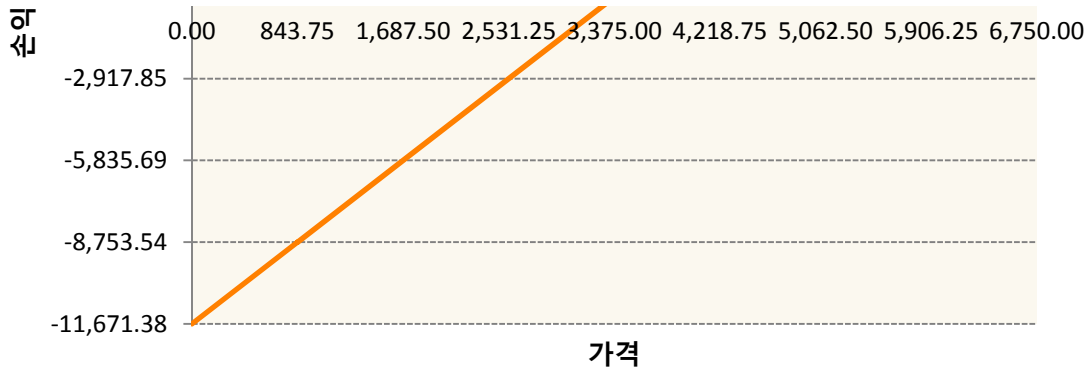


OESXU8-P3350-EURO STOXX 50



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-C3E EURO STOXX 50		81
OESXU8-C3E EURO STOXX 50		934
OESXU8-P3E EURO STOXX 50		81
OESXU8-P3E EURO STOXX 50		934
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18		446

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

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

(단위:백만원)

1,157

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

(단위:백만원)

91

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

(단위:백만원)

137

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

(단위:백만원)

170

공시일	2018-09-27
기준일	2018-09-21

스마트KRX300인덱스목표전환형1

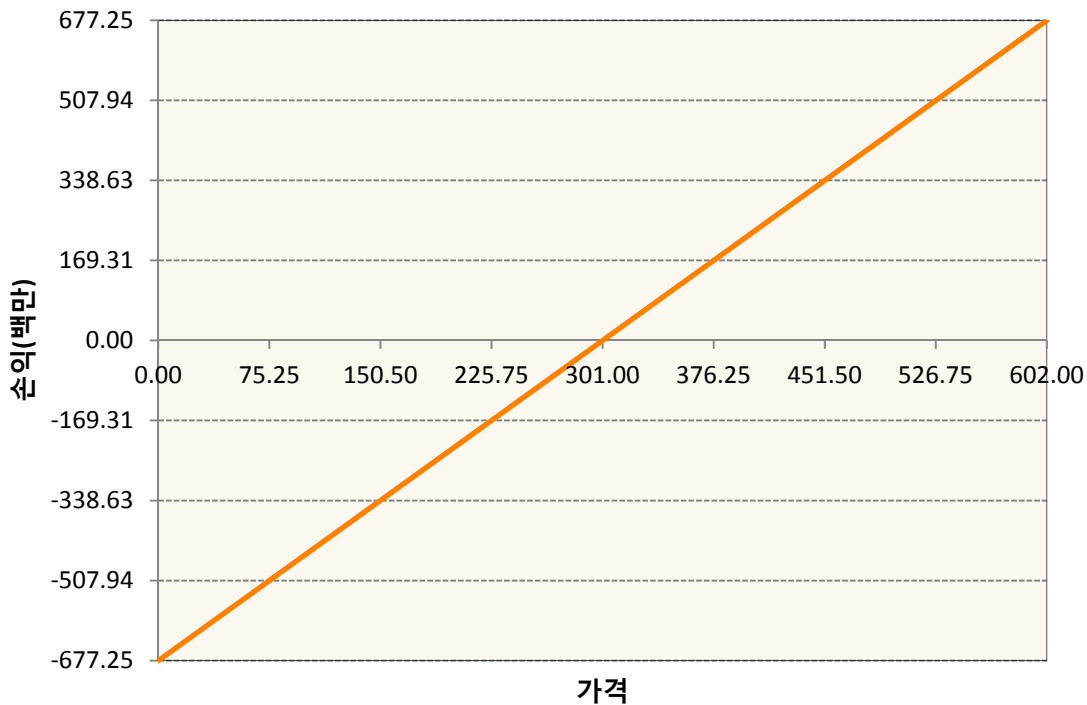
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	677	0	677	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	2018-09-27
기준일	2018-09-21

리디파인K200(주식혼합-파생재간

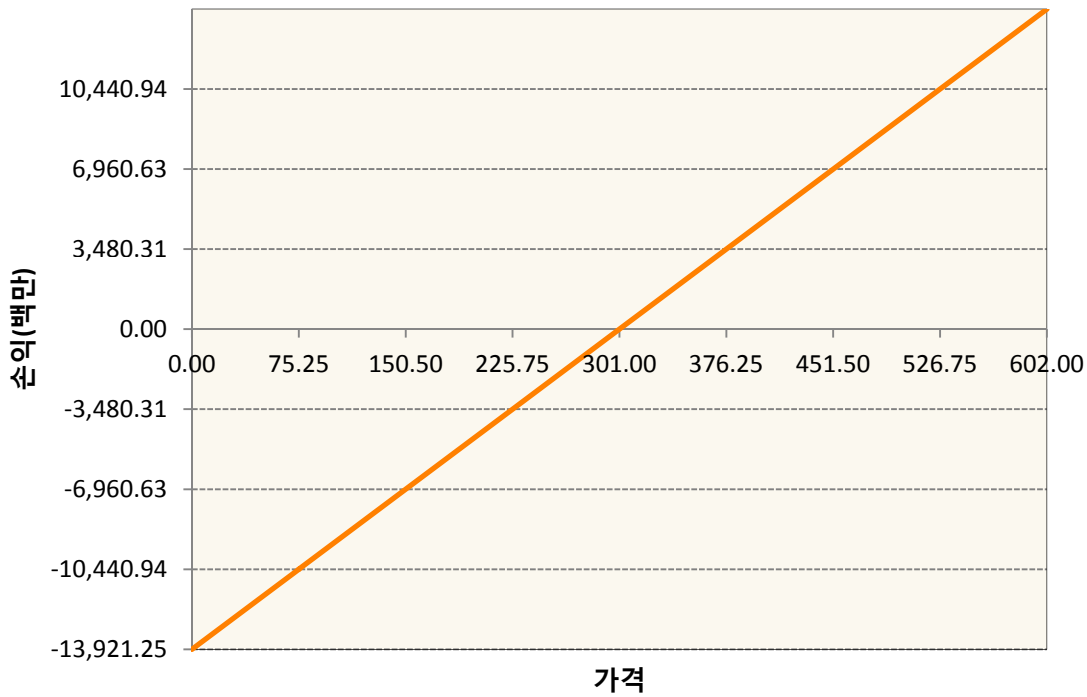
1. 계약금액

(단위:백만원)

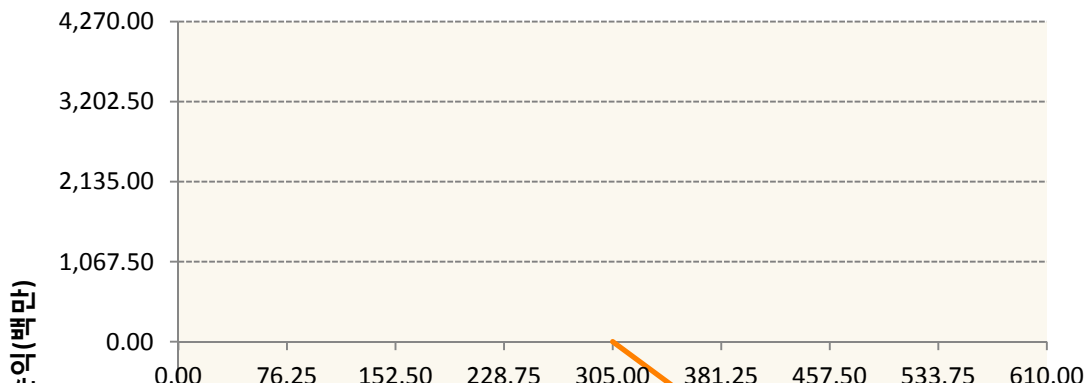
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,921	0	13,921	장내
누계	유가증권	옵션	2,119	24,258	-22,138	장내

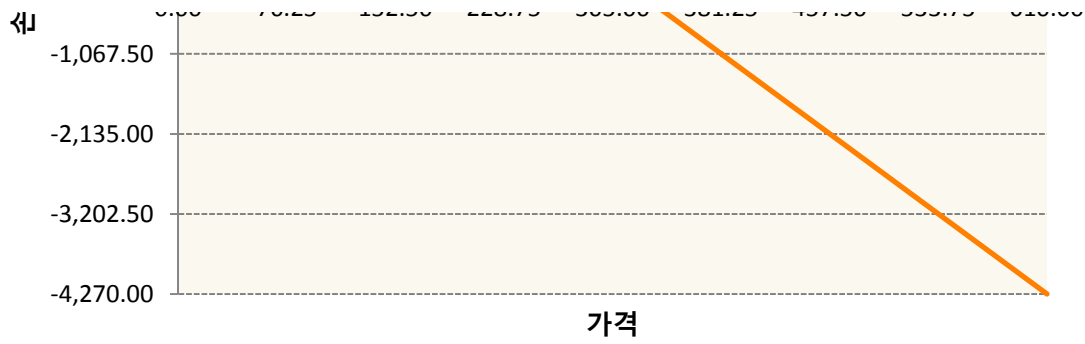
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

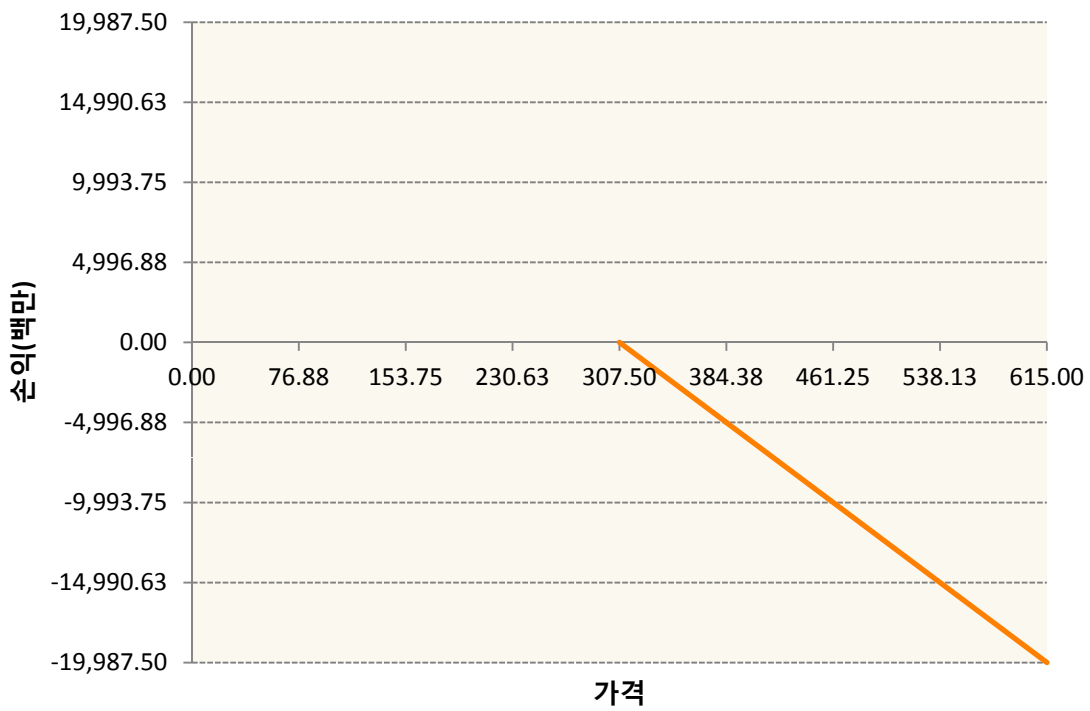


KR4201NA3058-2018-10 콜305

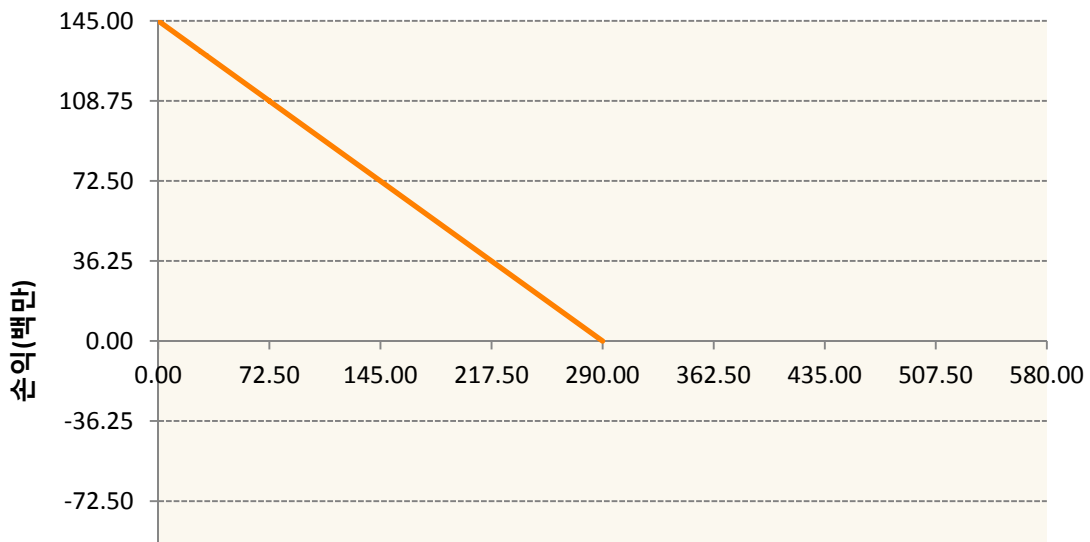


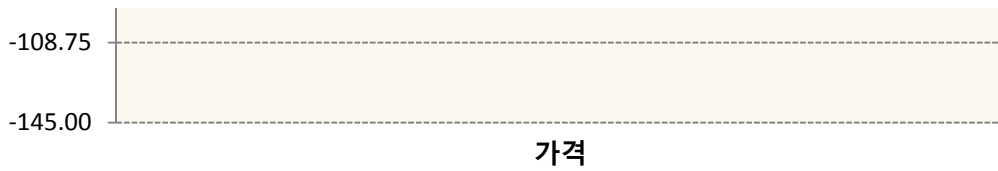


KR4201NA3074-2018-10 콜307.5

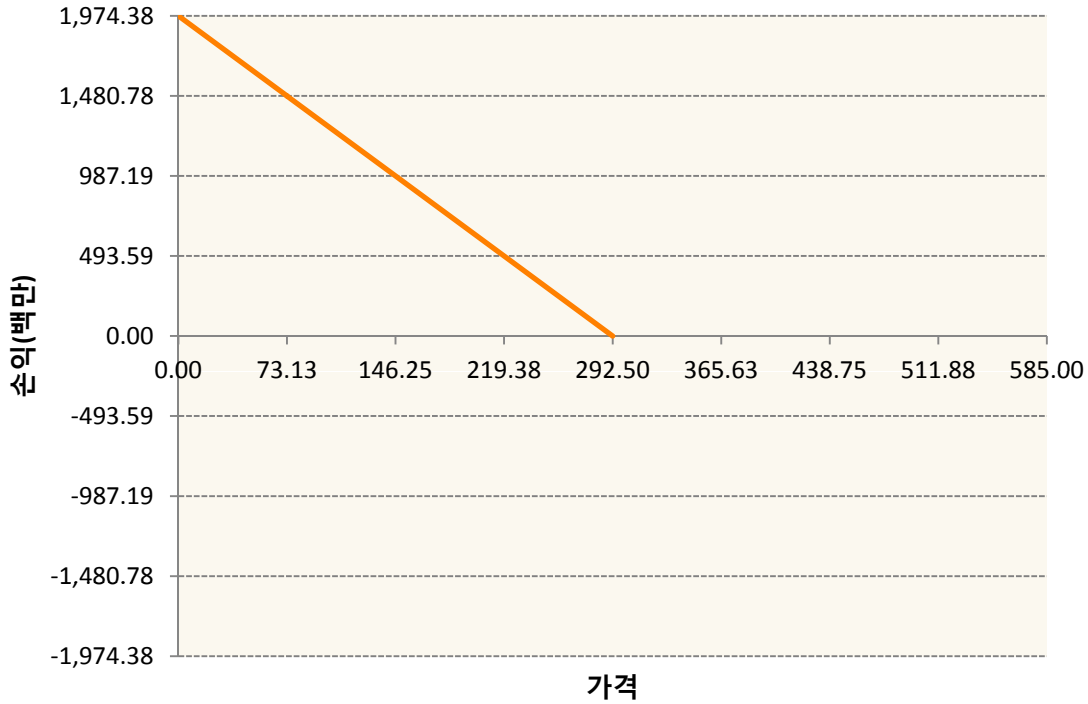


KR4301NA2901-2018-10 풋290





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 1,113

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,113	-1,113	-1,113	-1,113	-1,113	-1,113	-1,113
-5.33%	-742	-742	-742	-742	-742	-742	-742
-2.67%	-371	-371	-371	-371	-371	-371	-371
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	371	371	371	371	371	371	371
5.33%	742	742	742	742	742	742	742
8.00%	1,113	1,113	1,113	1,113	1,113	1,113	1,113

KR4201NA3(2018-10 콜305) 240

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	76	75	73	71	69	65	62
-5.33%	72	68	65	60	56	50	45
-2.67%	57	51	45	38	31	24	17

0%	25	17	8	0	-8	-17	-26
2.67%	-31	-40	-48	-57	-66	-74	-83
5.33%	-111	-118	-125	-132	-139	-147	-155
8.00%	-208	-212	-217	-222	-227	-233	-240

KR4201NA3(2018-10 콜307.5

1,049

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	295	291	286	278	268	255	241
-5.33%	281	269	255	238	219	198	175
-2.67%	232	208	181	153	123	92	60
0%	112	75	38	0	-38	-77	-115
2.67%	-114	-155	-196	-237	-278	-319	-360
5.33%	-453	-488	-523	-560	-597	-635	-674
8.00%	-882	-904	-930	-957	-986	-1,017	-1,049

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	3	3	3	3	3
-2.67%	0	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

104

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	103	103	103	103	104	104	104
-5.33%	50	51	52	53	53	54	56
-2.67%	11	12	14	15	17	19	20
0%	-2	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-2
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3

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

(단위:백만원)

2,064

공시일	2018-09-27
기준일	2018-09-21

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

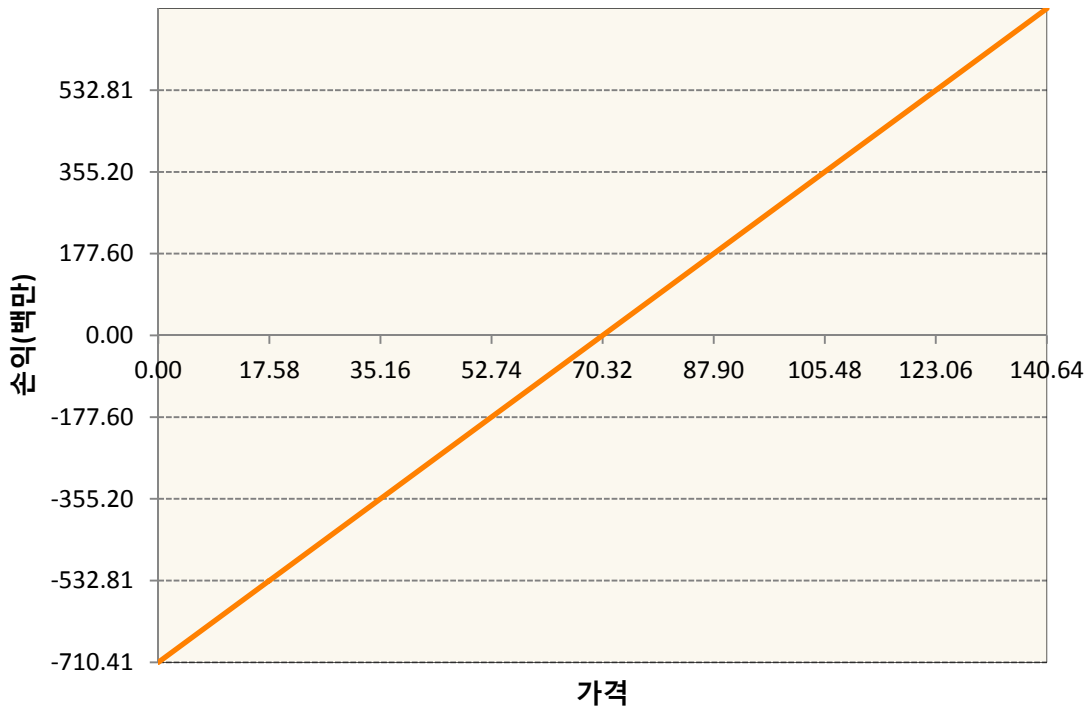
1. 계약금액

(단위:백만원)

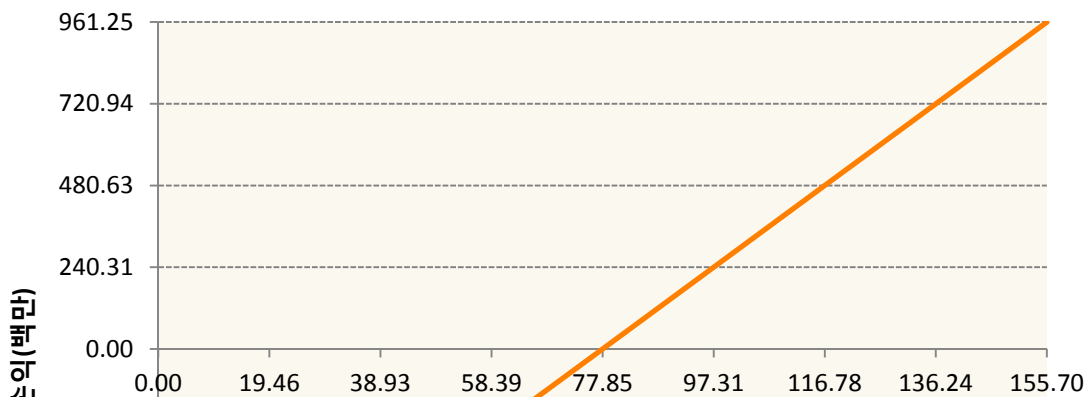
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,109	613	2,496	
누계	유가증권	선물	526	0	526	장내

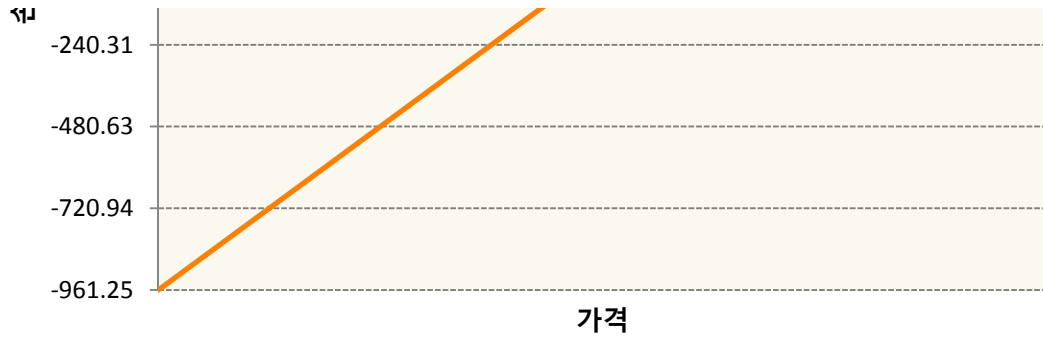
2. 만기시점의 손익구조

CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18

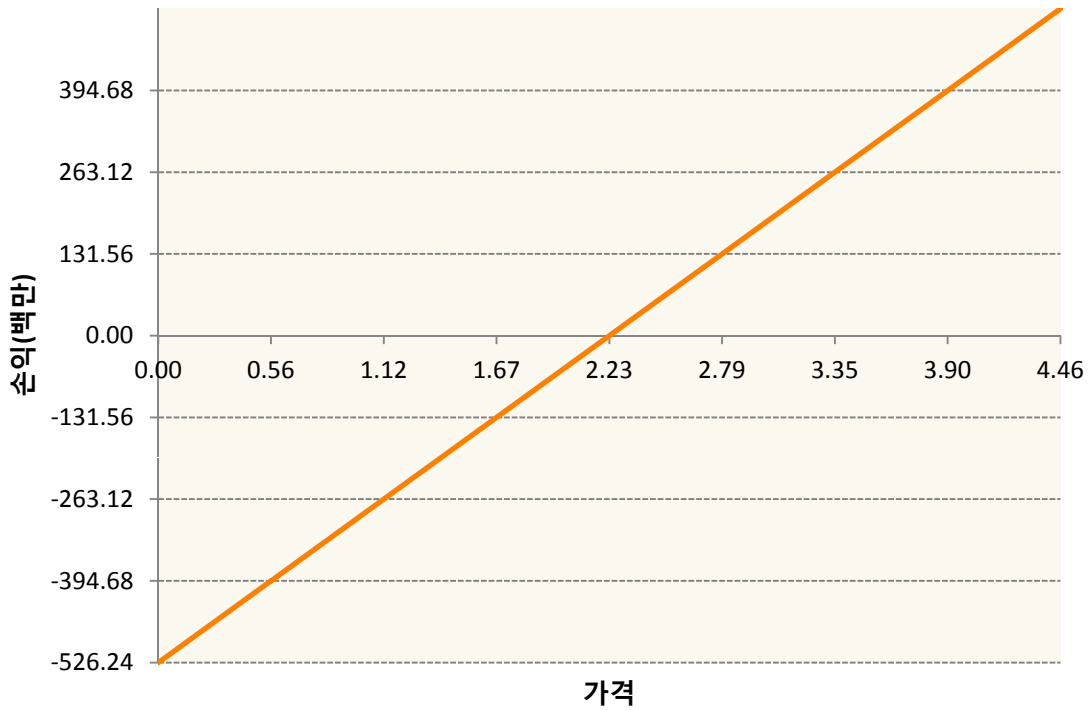


COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19

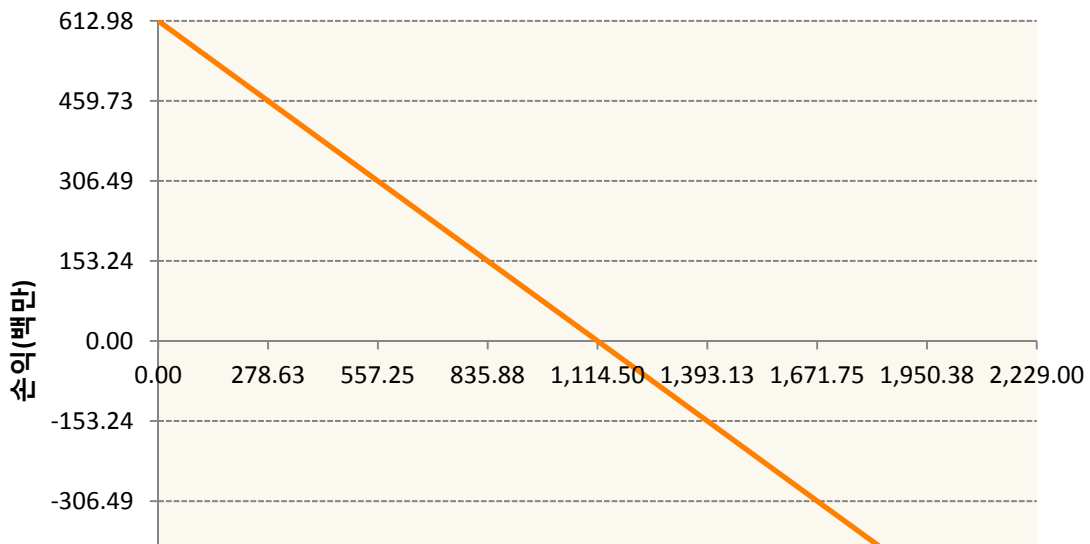


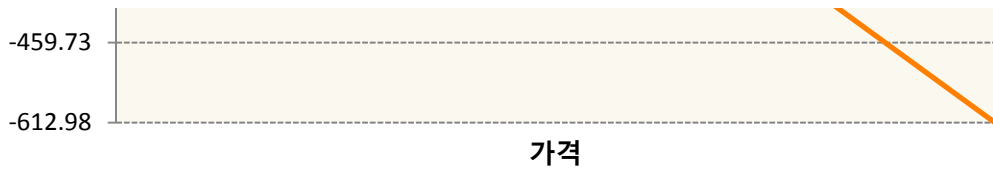


HOX8-Heating Oil

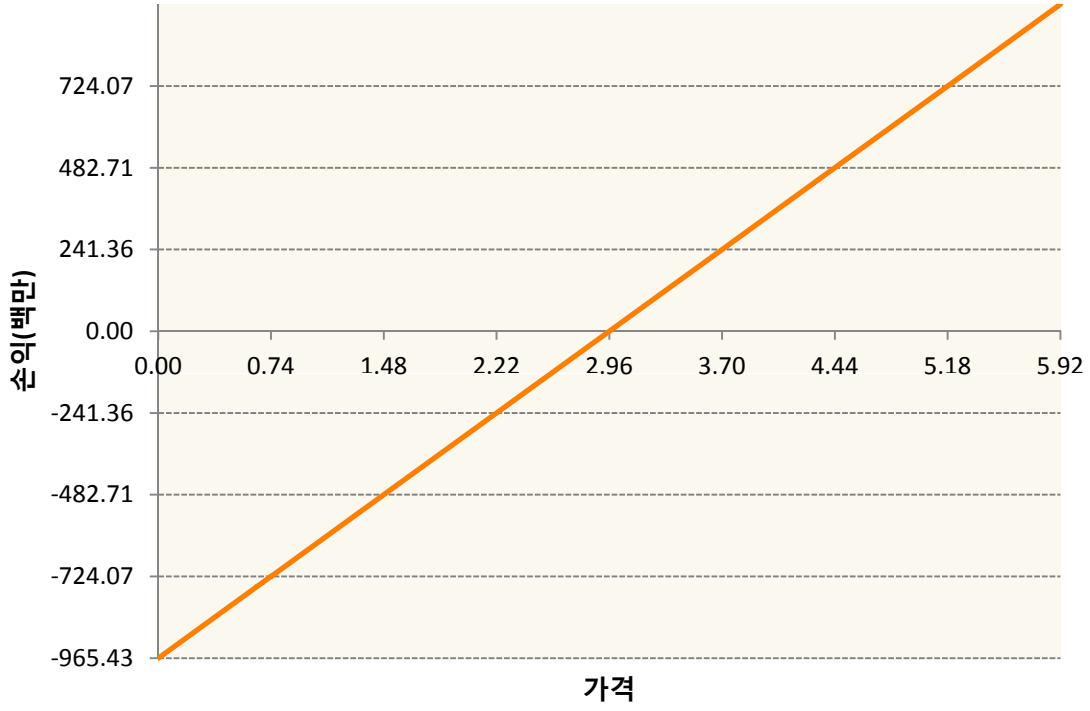


KR4175NA0007-2018-10 달러선물

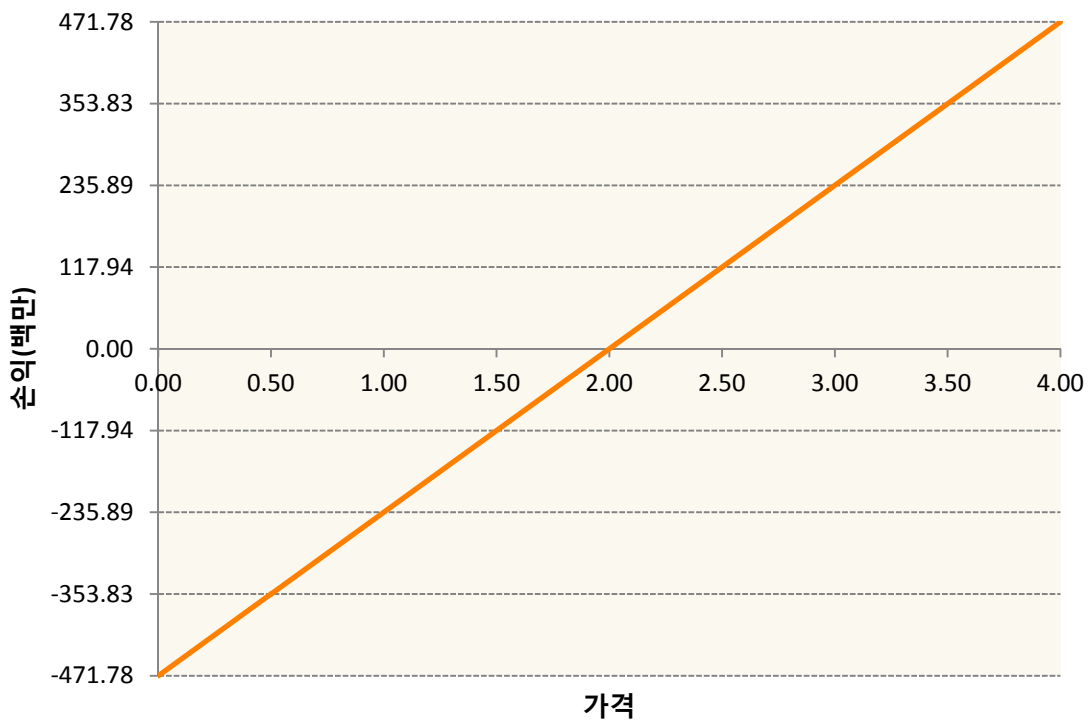




NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18



XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	57
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	77
HOX8	Heating Oil	42
	KR4175NA0(2018-10 달러선물	49
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	77
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	38

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	434

공시일	2018-09-27
기준일	2018-09-21

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

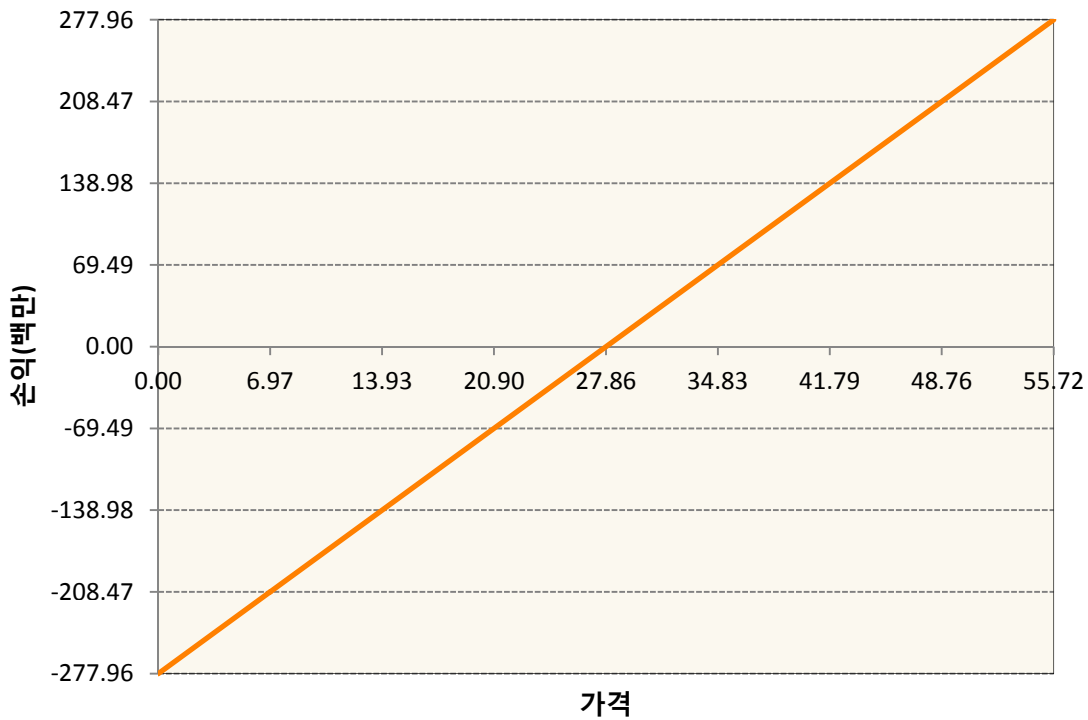
1. 계약금액

(단위:백만원)

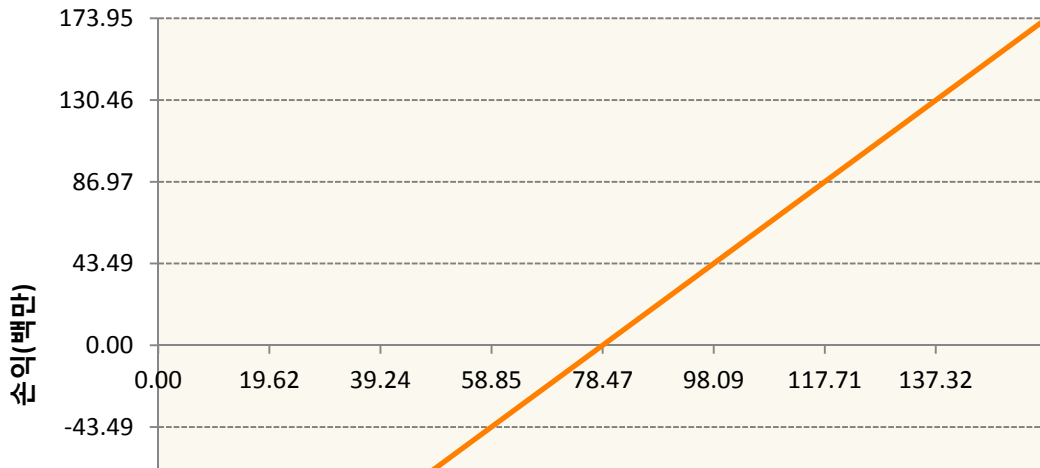
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,539	78	3,461	

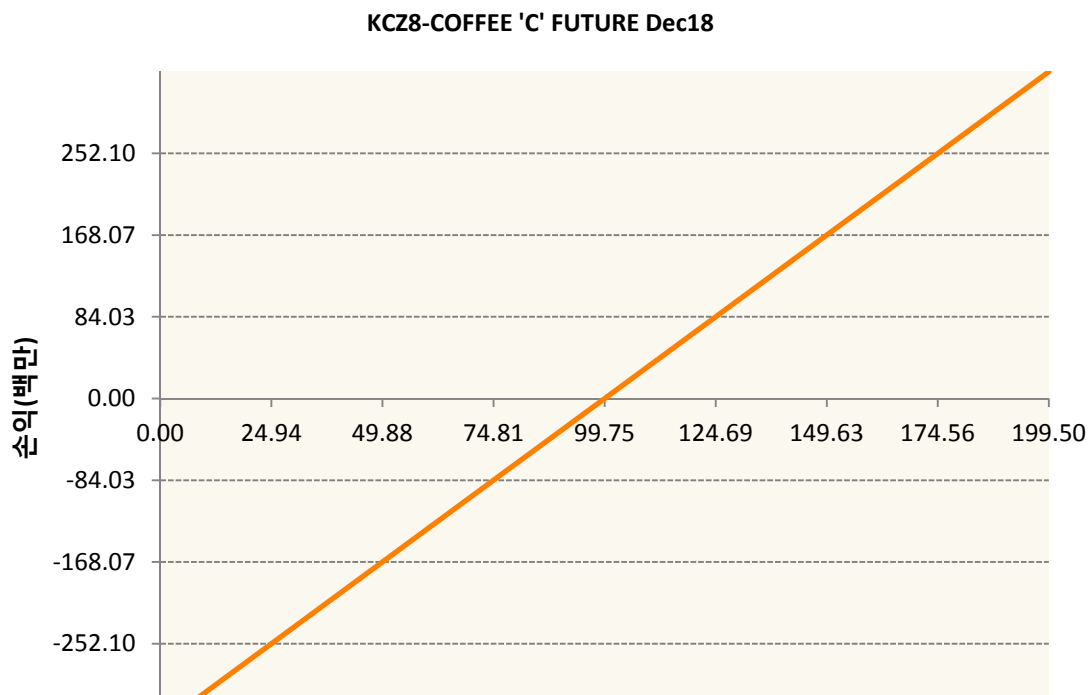
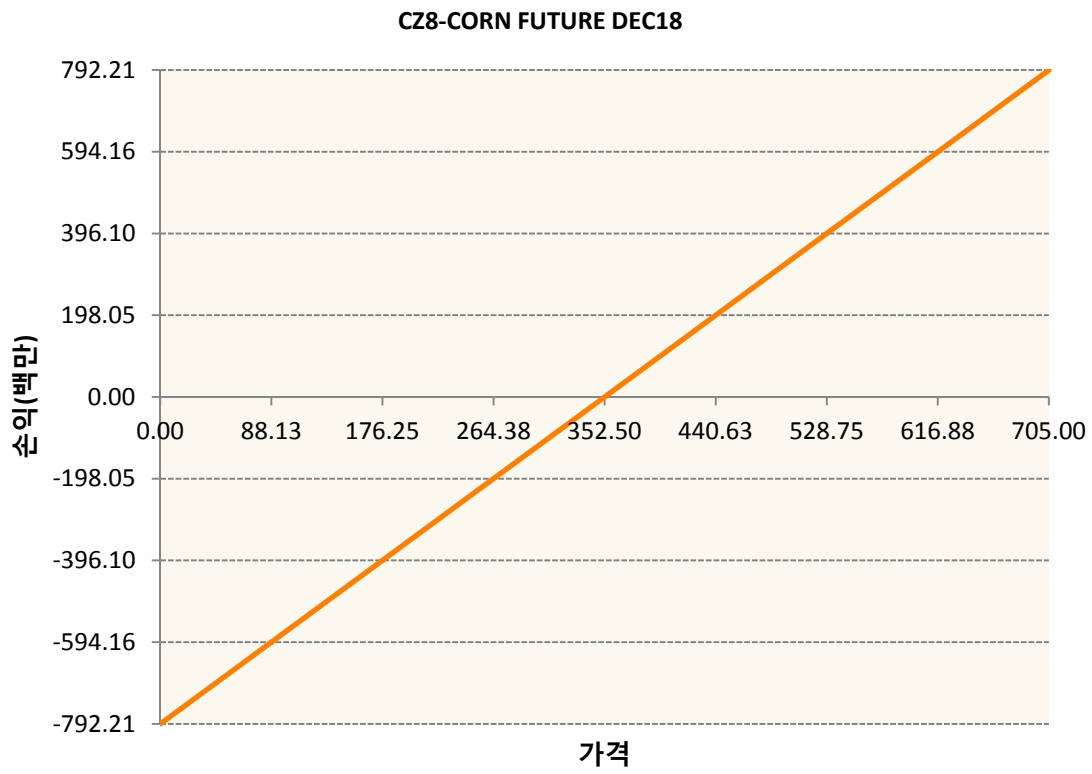
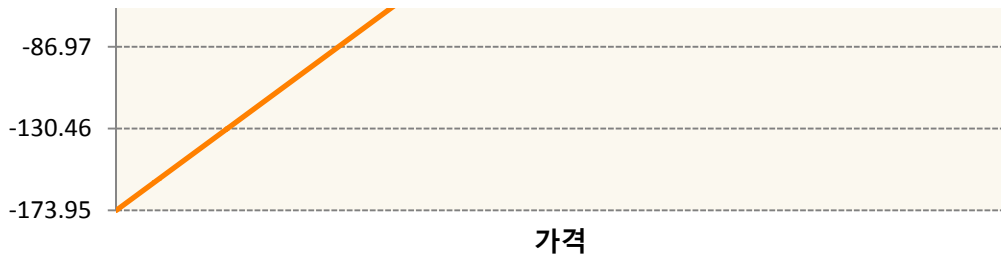
2. 만기시점의 손익구조

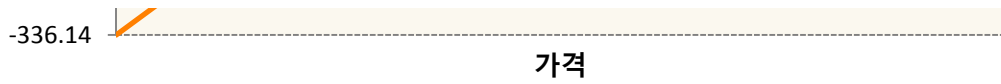
BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18



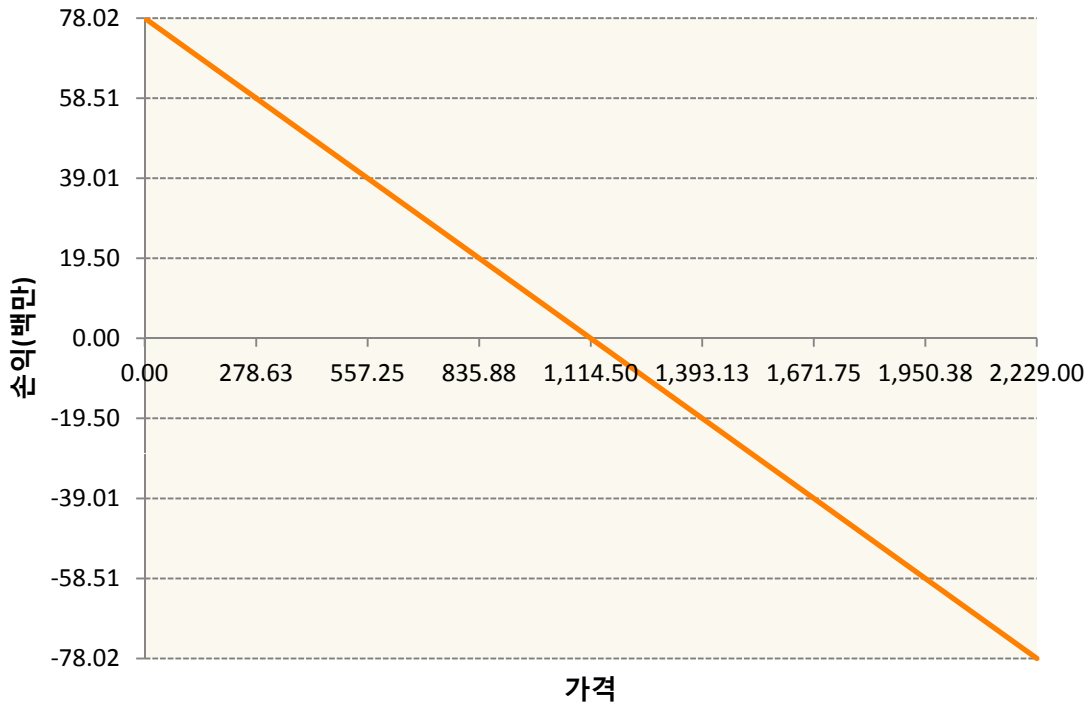
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



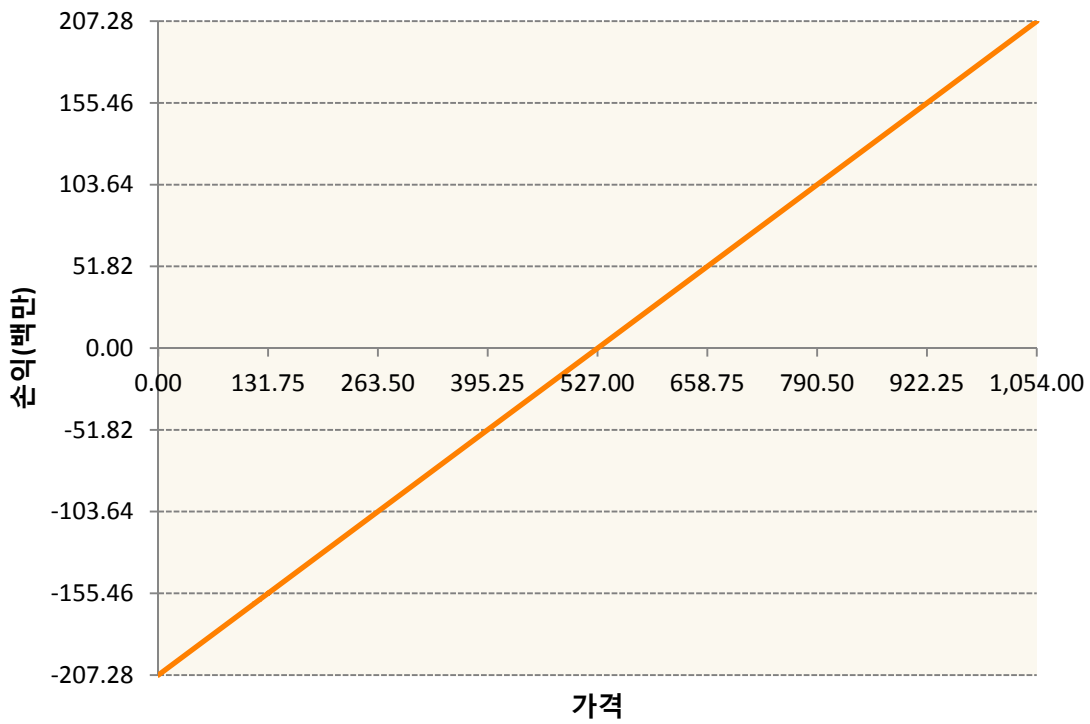




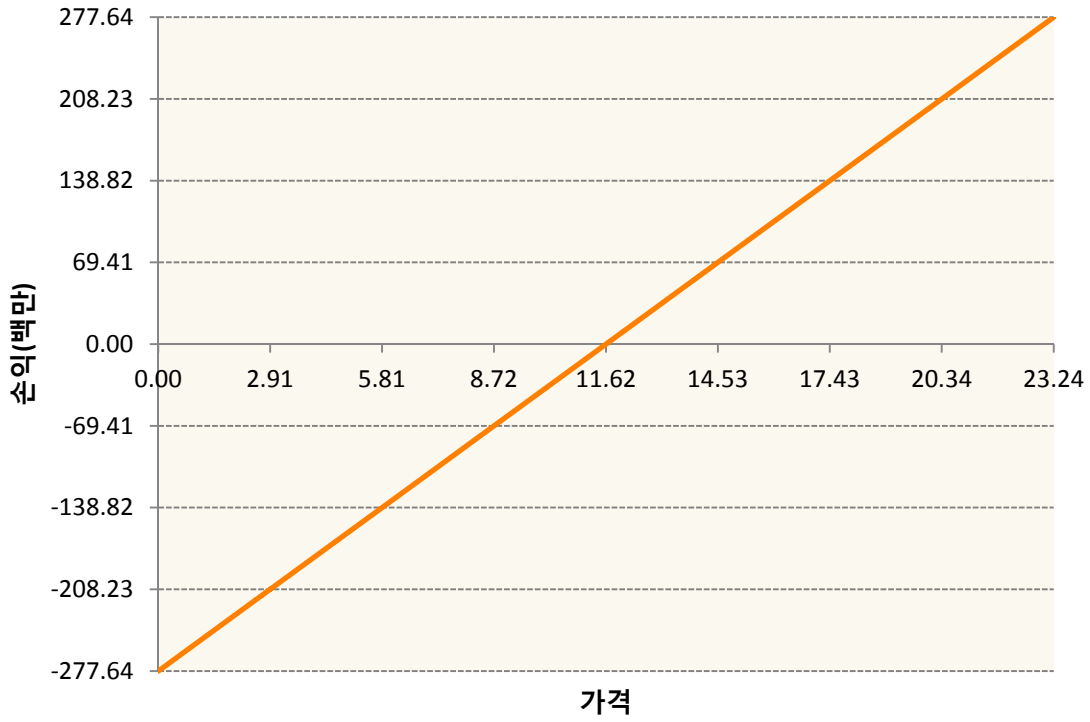
KR4175NA0007-2018-10 달러선물



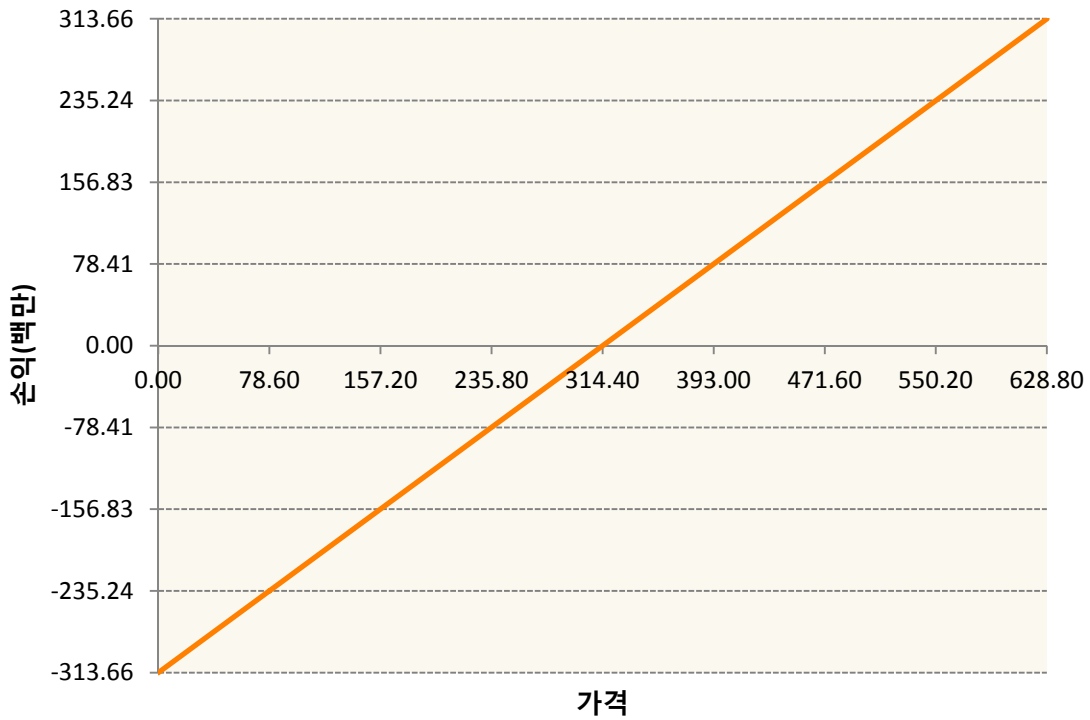
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



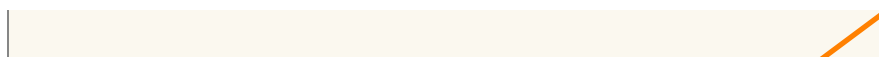
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

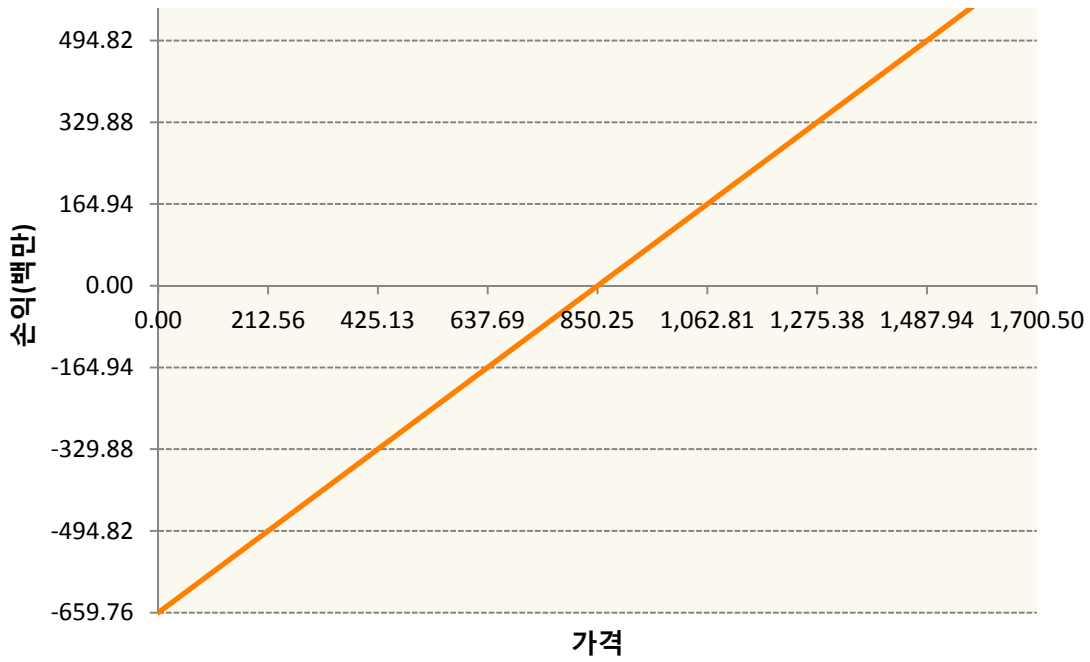


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

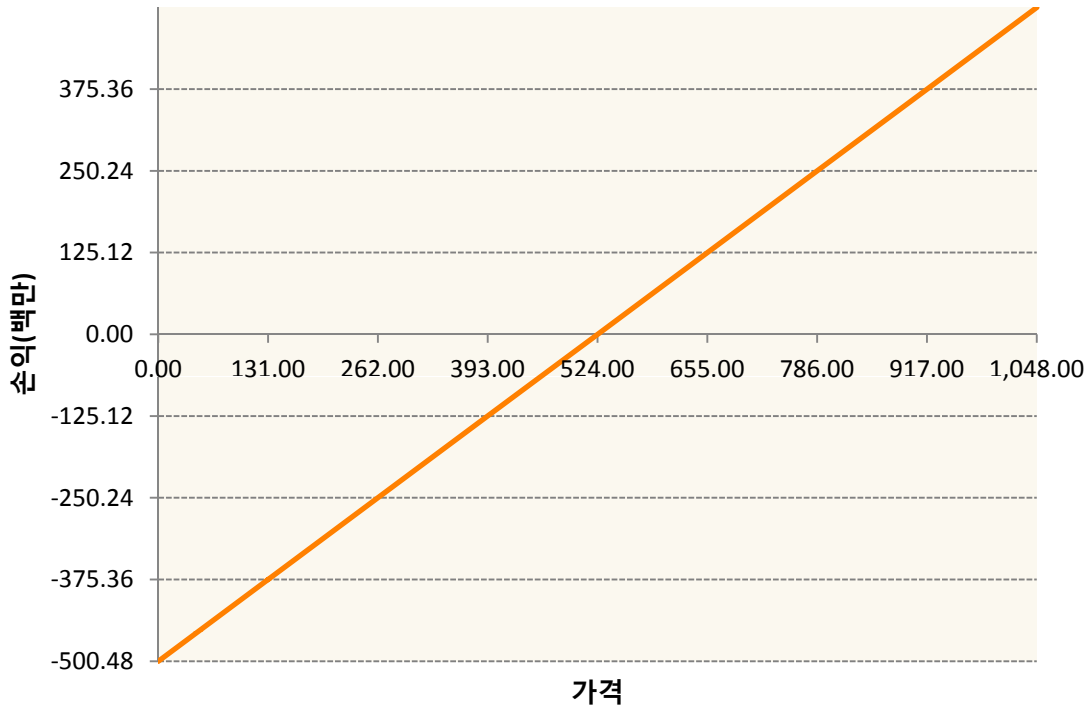


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





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	17
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	22
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	25
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	53
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	40

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

(단위:백만원)

309