

공시일	2018-09-28
기준일	2018-09-27

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	2018-09-28
기준일	2018-09-27

스마트인덱스모

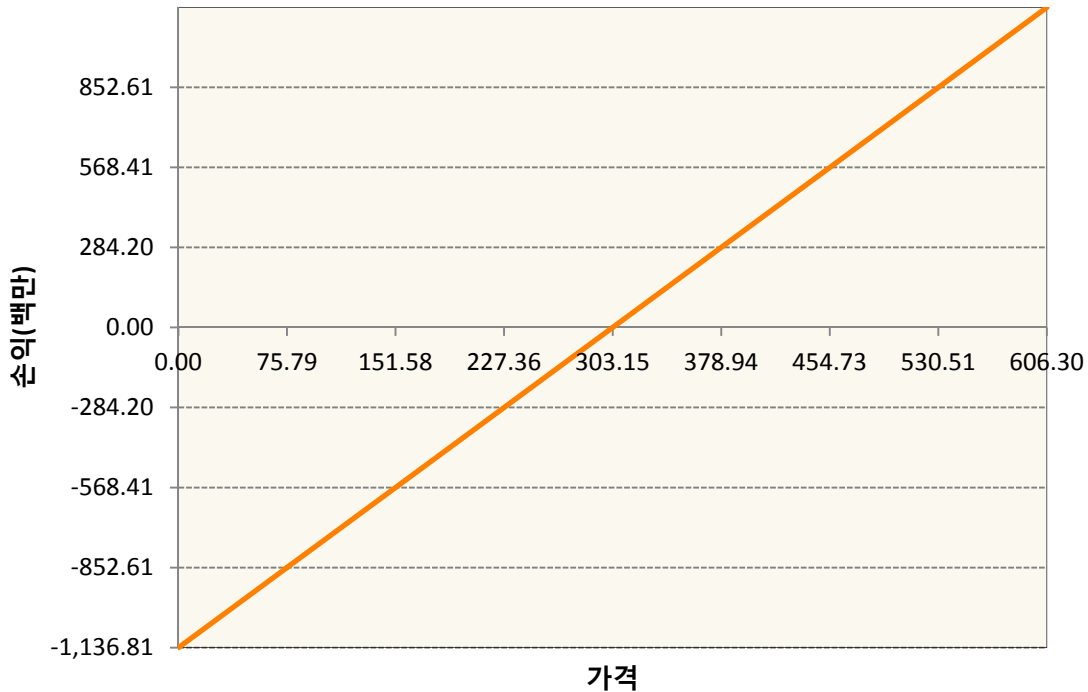
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,137	0	1,137	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물)

91

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
-5.33%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61
-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%	61	61	61	61	61	61	61
8.00%	91	91	91	91	91	91	91

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

(단위:백만원)

69

공시일	2018-09-28
기준일	2018-09-27

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

1,163

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

493

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-28
기준일	2018-09-27

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

291

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

371

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-28
기준일	2018-09-27

유로인덱스모(주식-파생형)

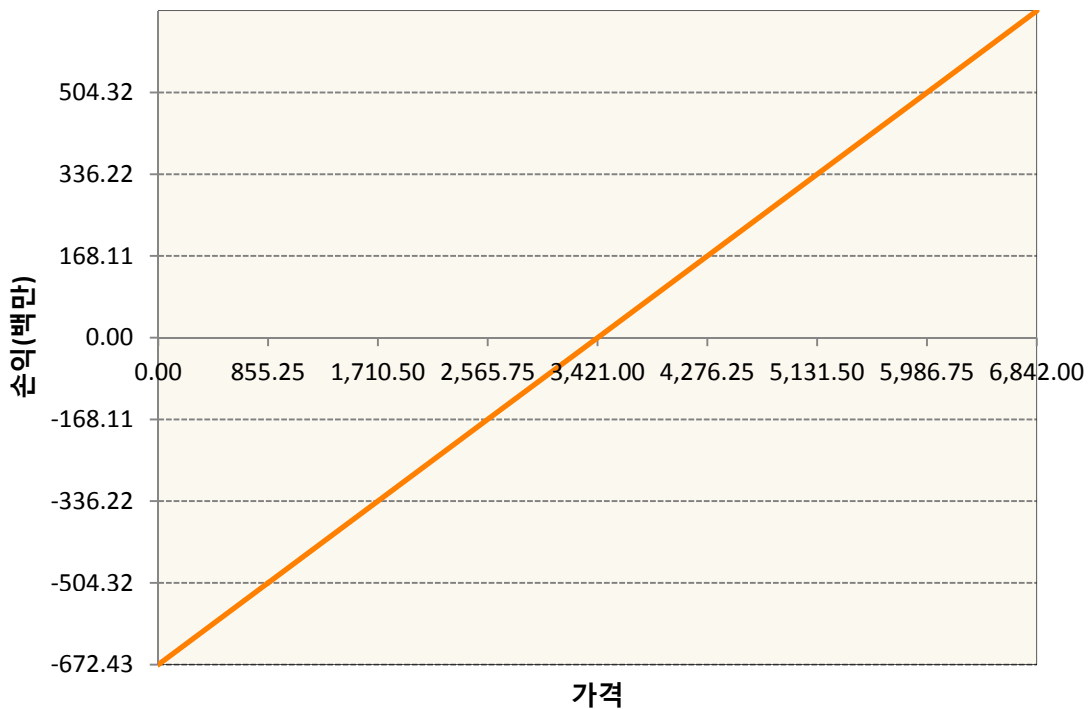
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	672	0	672	

2. 만기시점의 손익구조

VGZ8-EURO STOXX 50 DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ8	EURO STOXX 50 DEC18	54
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

33

공시일	2018-09-28
기준일	2018-09-27

차이나인덱스모(주식-파생형)

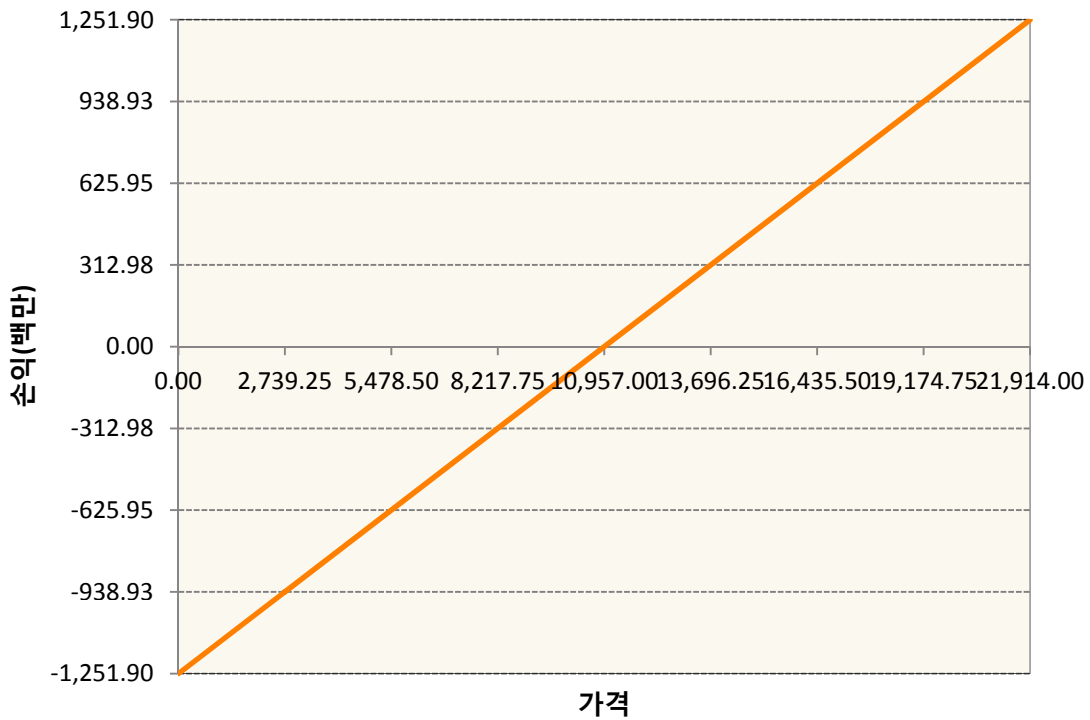
1. 계약금액

(단위:백만원)

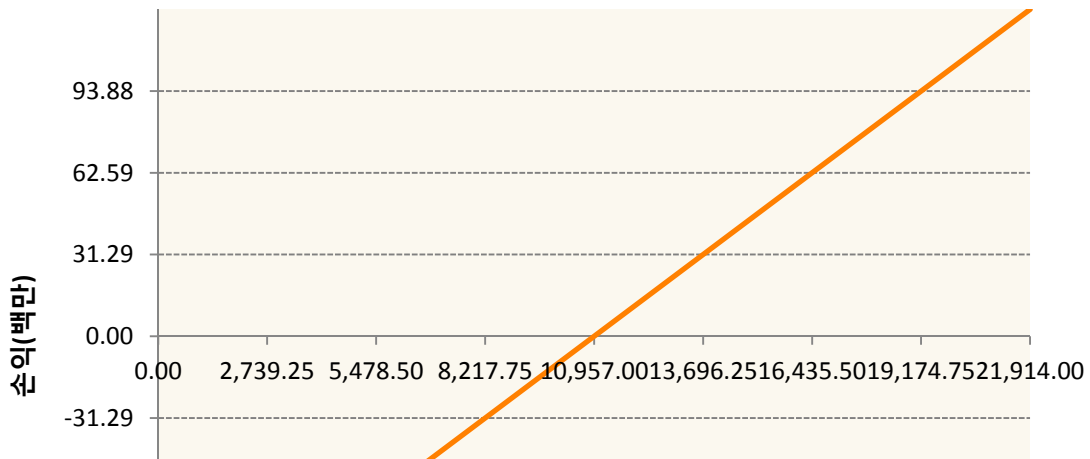
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,377	0	1,377	장내

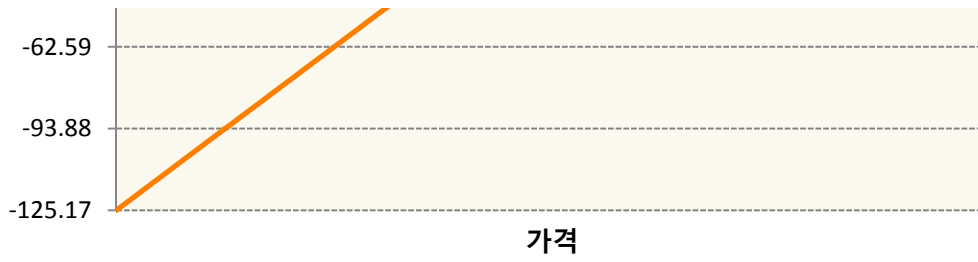
2. 만기시점의 손익구조

HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



MHCV8-MINI H-SHR IDX FU OCT 18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	100
MHCV8	MINI H-SHR IDX FU OCT 18	10

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

103

공시일	2018-09-28
기준일	2018-09-27

커버드콜모(주식혼합-파생형)

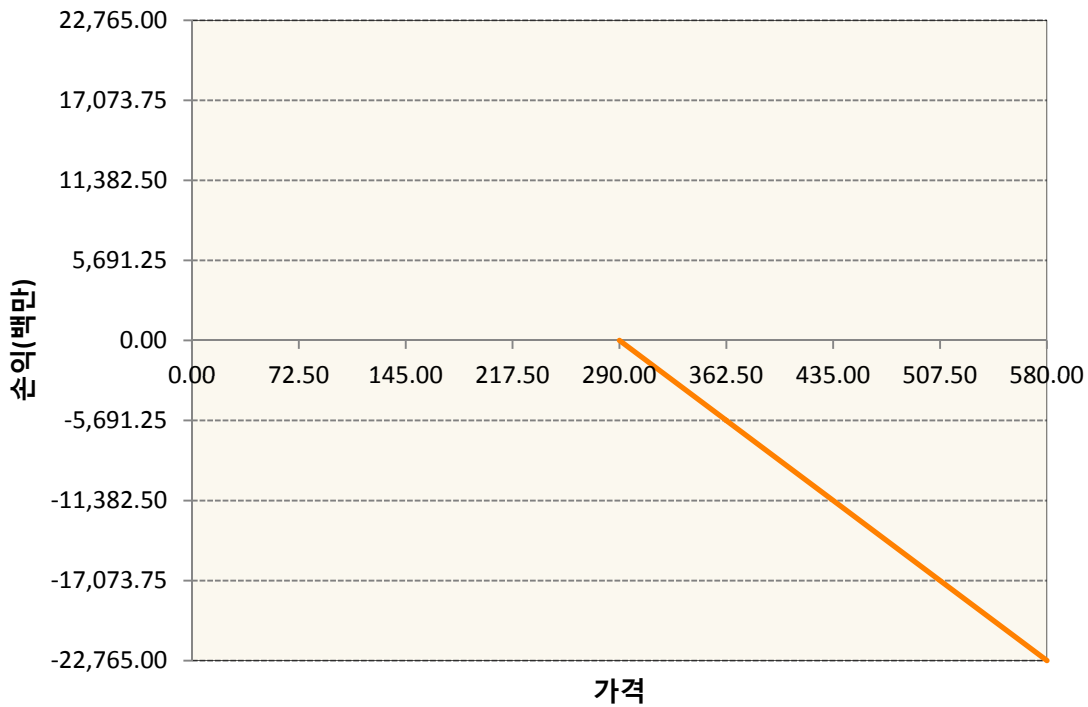
1. 계약금액

(단위:백만원)

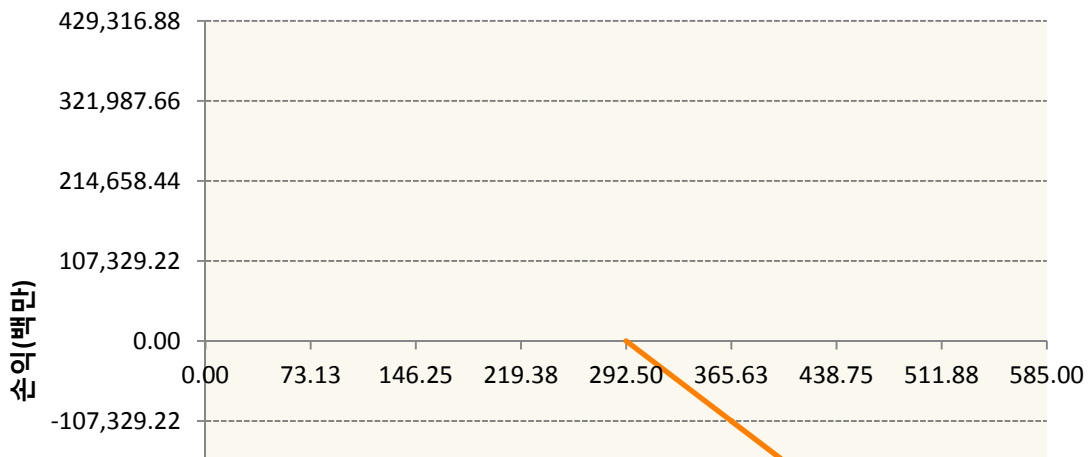
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	3,652	0	3,652	장내
누계	유가증권	옵션	0	730,688	-730,688	장내

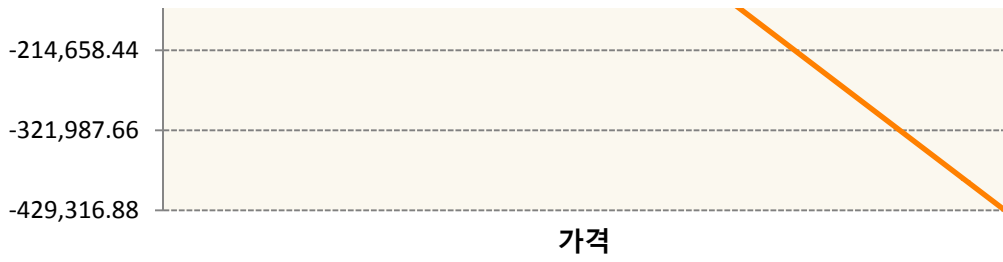
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NA2902-2018-10 콜290

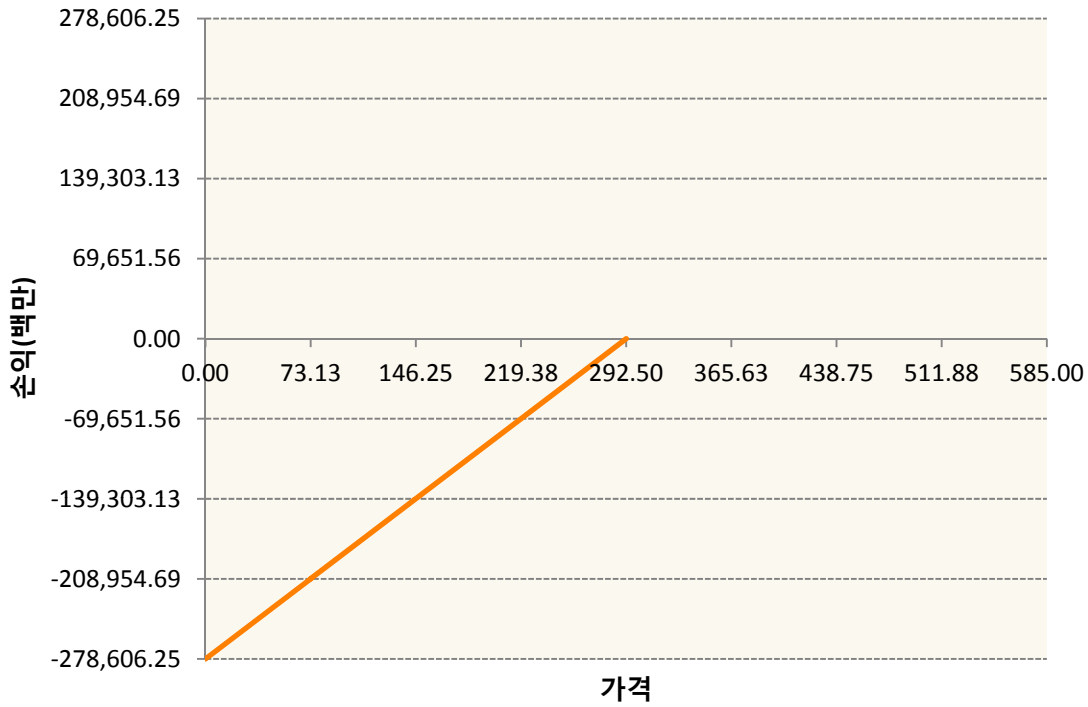


KR4201NA2928-2018-10 콜292.5





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NA2927-2018-10 콜290

1,777

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,062	1,038	1,012	985	956	925	894
-5.33%	898	860	822	784	746	708	669
-2.67%	567	529	492	454	416	377	339
0%	78	54	28	0	-30	-61	-93
2.67%	-505	-515	-529	-544	-563	-583	-606
5.33%	-1,126	-1,129	-1,134	-1,141	-1,150	-1,161	-1,175
8.00%	-1,757	-1,757	-1,759	-1,761	-1,765	-1,770	-1,777

KR4201NA2927-2018-10 풋292.5

32,498

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17,511	17,158	16,755	16,311	15,832	15,324	14,791

-5.33%	15,206	14,558	13,896	13,222	12,538	11,847	11,151
-2.67%	10,024	9,287	8,549	7,809	7,068	6,327	5,585
0%	1,717	1,177	602	0	-623	-1,264	-1,919
2.67%	-8,753	-9,019	-9,340	-9,712	-10,128	-10,581	-11,067
5.33%	-20,209	-20,299	-20,432	-20,611	-20,834	-21,101	-21,409
8.00%	-31,968	-31,990	-32,031	-32,099	-32,198	-32,330	-32,498

KR4301NA29 2018-10 풋 292.5

13,394

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-13,281	-13,285	-13,293	-13,307	-13,328	-13,357	-13,394
-5.33%	-5,831	-5,931	-6,046	-6,172	-6,308	-6,452	-6,603
-2.67%	-887	-1,079	-1,274	-1,471	-1,669	-1,869	-2,070
0%	140	107	60	0	-73	-157	-252
2.67%	178	177	175	171	163	151	134
5.33%	178	178	178	178	177	177	175
8.00%	178	178	178	178	178	178	178

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

(단위:백만원)

45,365

공시일	2018-09-28
기준일	2018-09-27

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

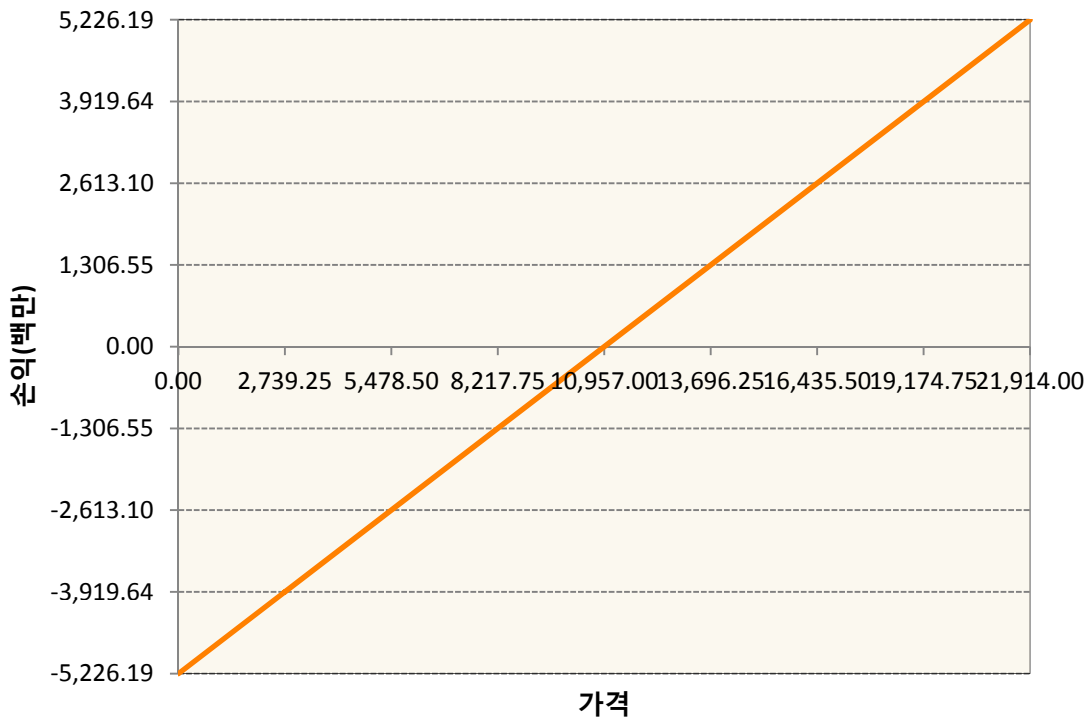
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1	0	1	장내
누계	유가증권	선물	5,226	0	5,226	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	418
------	----------------------	-----

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

(단위:백만원)

391

공시일	2018-09-28
기준일	2018-09-27

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

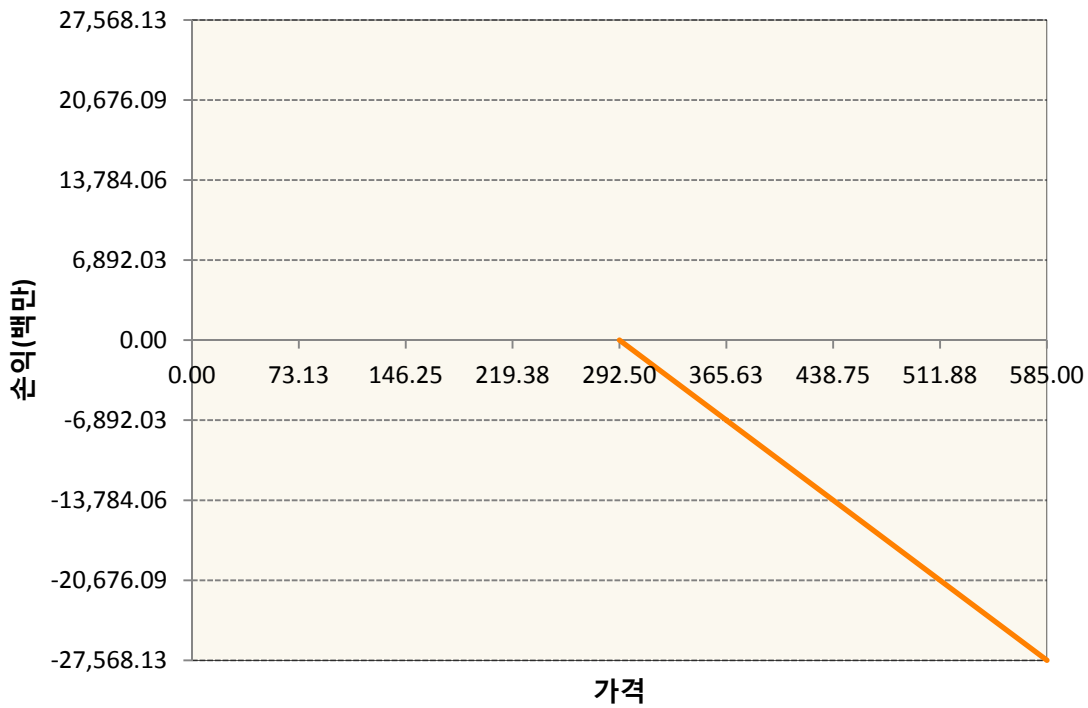
1. 계약금액

(단위:백만원)

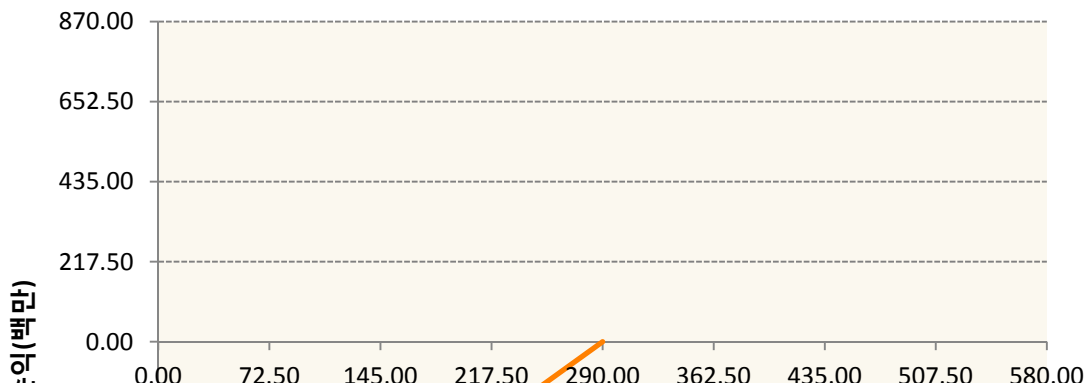
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	48,036	-48,036	장내

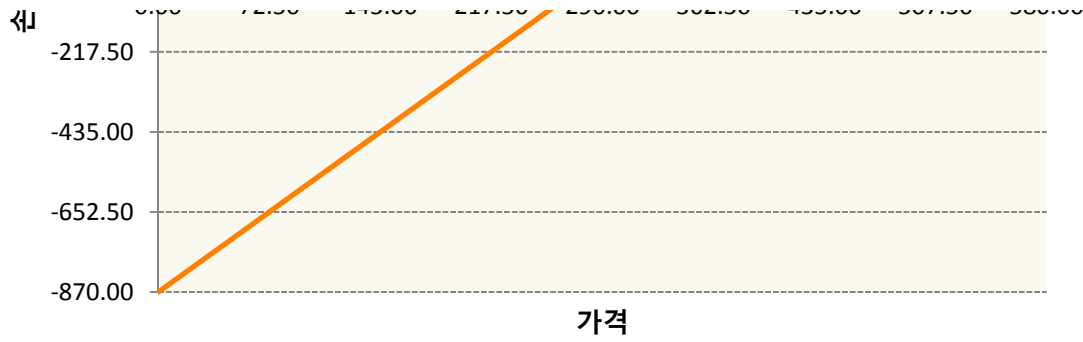
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NA2928-2018-10 콜292.5

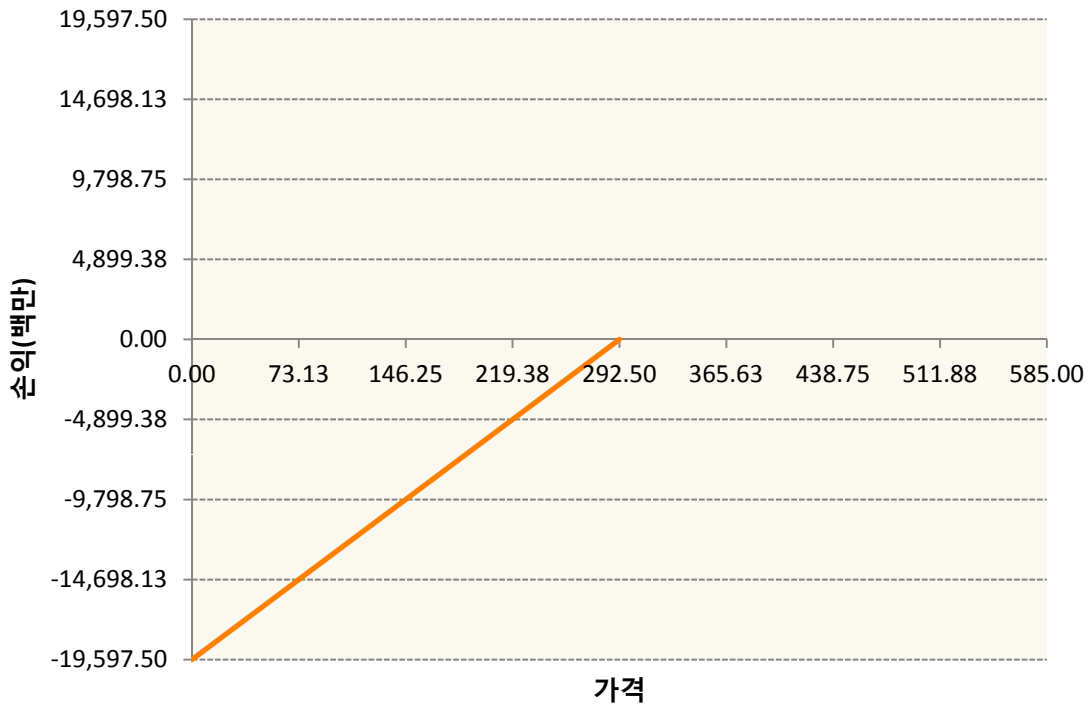


KR4301NA2901-2018-10 풋290





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,985	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,985	-3,985	-3,985	-3,985	-3,985	-3,985	-3,985	
-5.33%	-2,657	-2,657	-2,657	-2,657	-2,657	-2,657	-2,657	
-2.67%	-1,328	-1,328	-1,328	-1,328	-1,328	-1,328	-1,328	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	1,328	1,328	1,328	1,328	1,328	1,328	1,328	
5.33%	2,657	2,657	2,657	2,657	2,657	2,657	2,657	
8.00%	3,985	3,985	3,985	3,985	3,985	3,985	3,985	
KR4201NA2927-2018-10 풋292.5							2,087	
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,124	1,102	1,076	1,047	1,017	984	950
-5.33%	976	935	892	849	805	761	716
-2.67%	644	596	549	501	454	406	359
0%	110	76	39	0	-40	-81	-123
2.67%	-562	-579	-600	-624	-650	-679	-711
5.33%	-1,298	-1,303	-1,312	-1,323	-1,338	-1,355	-1,375
8.00%	-2,053	-2,054	-2,057	-2,061	-2,068	-2,076	-2,087

KR4301NA2☹ 2018-10 풋290

35

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-5.33%	-12	-13	-13	-14	-15	-15	-16
-2.67%	-1	-2	-2	-3	-3	-4	-4
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

942

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-934	-935	-935	-936	-937	-940	-942
-5.33%	-410	-417	-425	-434	-444	-454	-464
-2.67%	-62	-76	-90	-103	-117	-131	-146
0%	10	7	4	0	-5	-11	-18
2.67%	12	12	12	12	11	11	9
5.33%	13	13	13	12	12	12	12
8.00%	13	13	13	13	13	13	12

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

(단위:백만원)

6,848

공시일	2018-09-28
기준일	2018-09-27

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

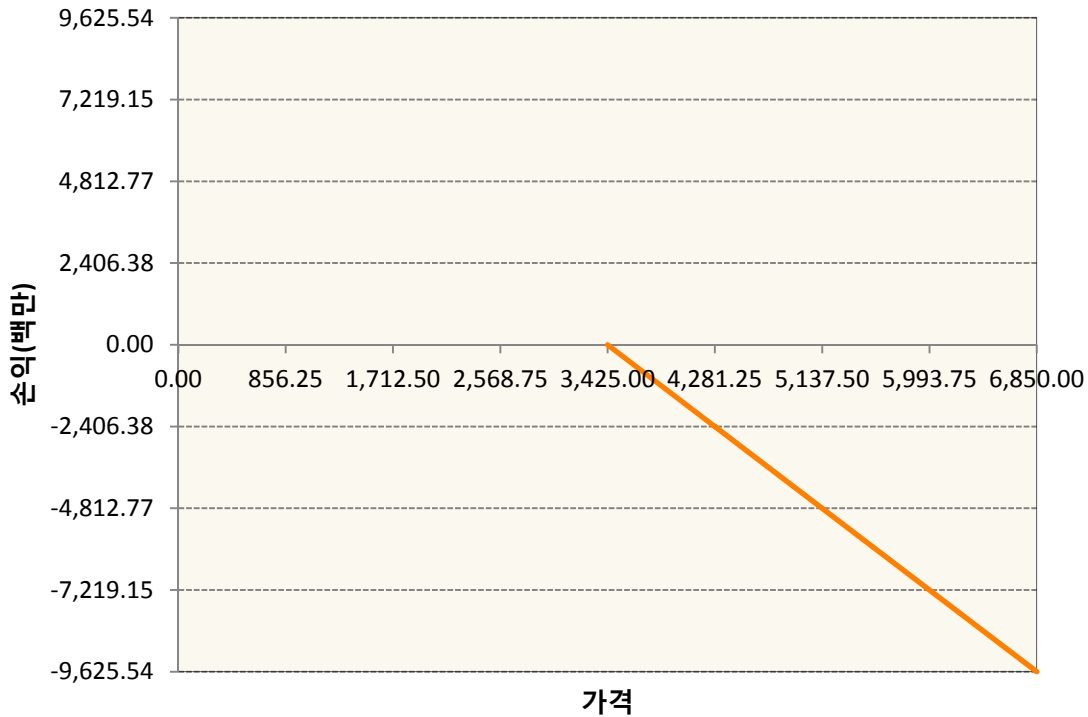
1. 계약금액

(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	5,653	0	5,653	
누계	유가증권	스왑	34,358	0	34,358	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,176	-25,176	장내
누계	지수	스왑	52,820	0	52,820	장외

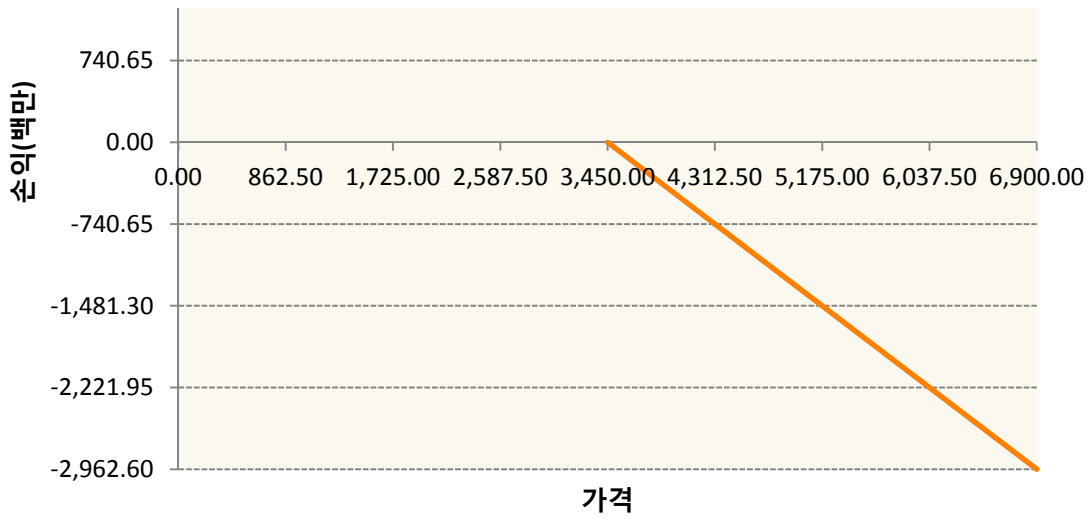
2. 만기시점의 손익구조

OESXV8-C3425-EURO STOXX 50

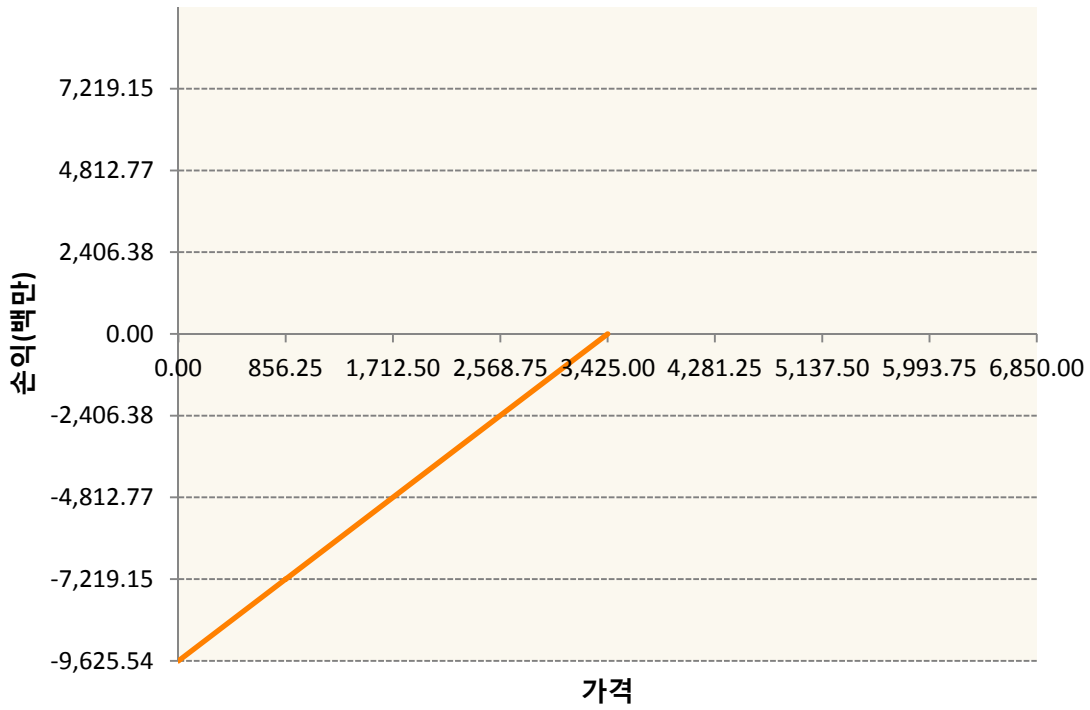


OESXV8-C3450-EURO STOXX 50

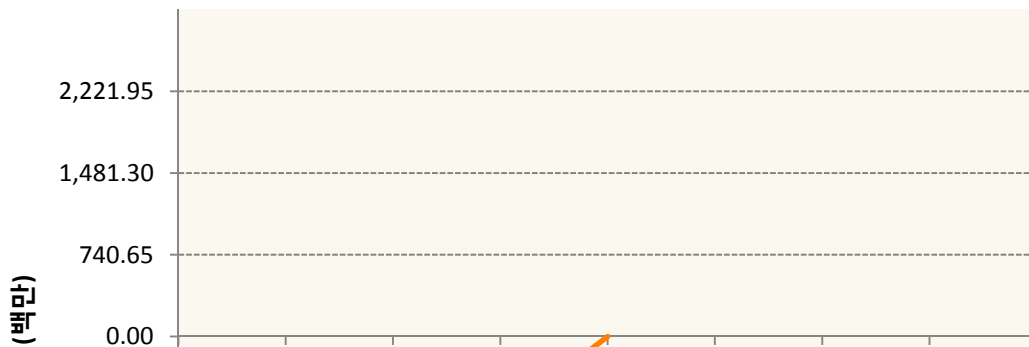


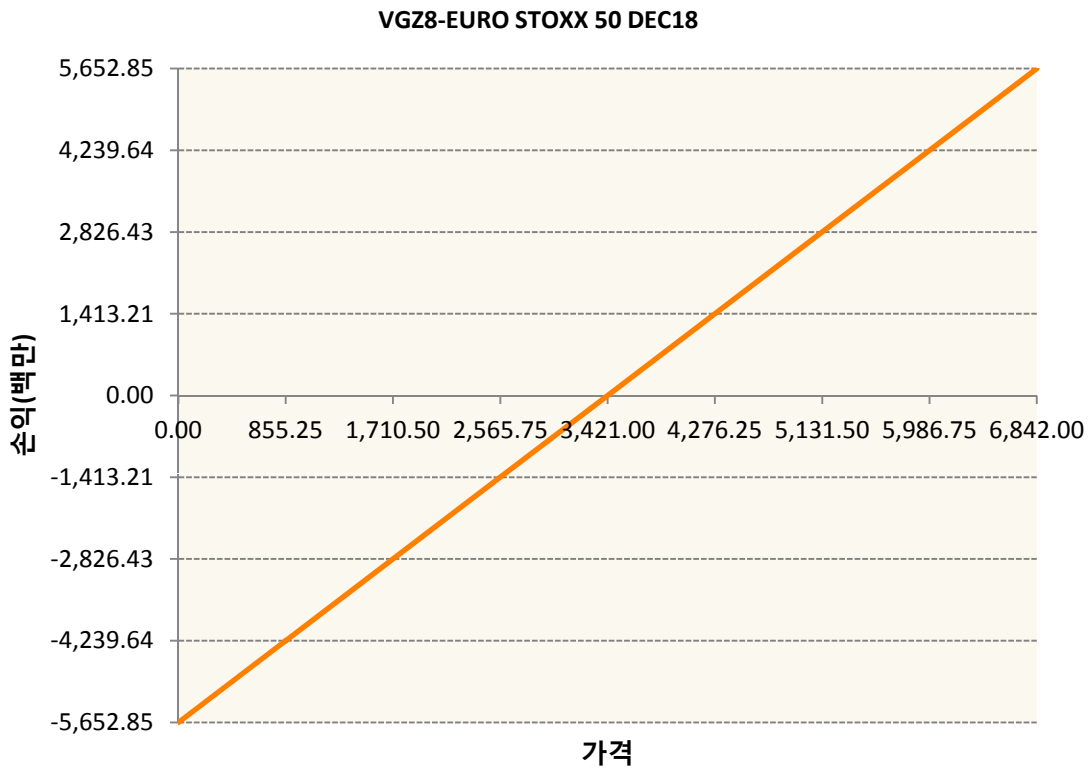
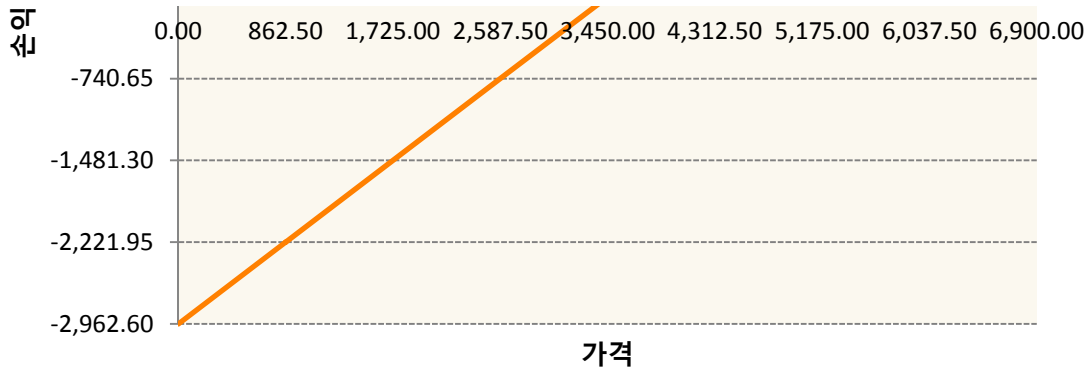


OESXV8-P3425-EURO STOXX 50



OESXV8-P3450-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		21
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		13
OESXV8-C34 EURO STOXX 50		770
OESXV8-C34 EURO STOXX 50		237
OESXV8-P34 EURO STOXX 50		770
OESXV8-P34 EURO STOXX 50		237
VGZ8	EURO STOXX 50 DEC18	452

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

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

(단위:백만원)

1,163

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

(단위:백만원)

92

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

(단위:백만원)

137

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

(단위:백만원)

170

공시일	2018-09-28
기준일	2018-09-27

스마트KRX300인덱스목표전환형1

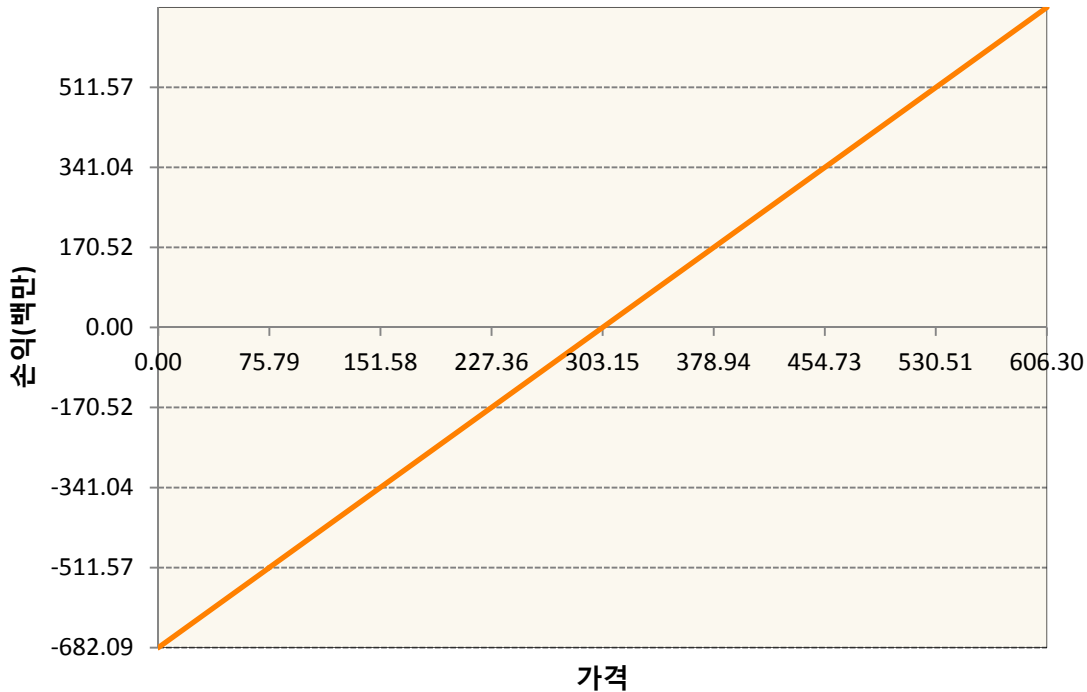
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	682	0	682	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	2018-09-28
기준일	2018-09-27

리디파인K200(주식혼합-파생재간

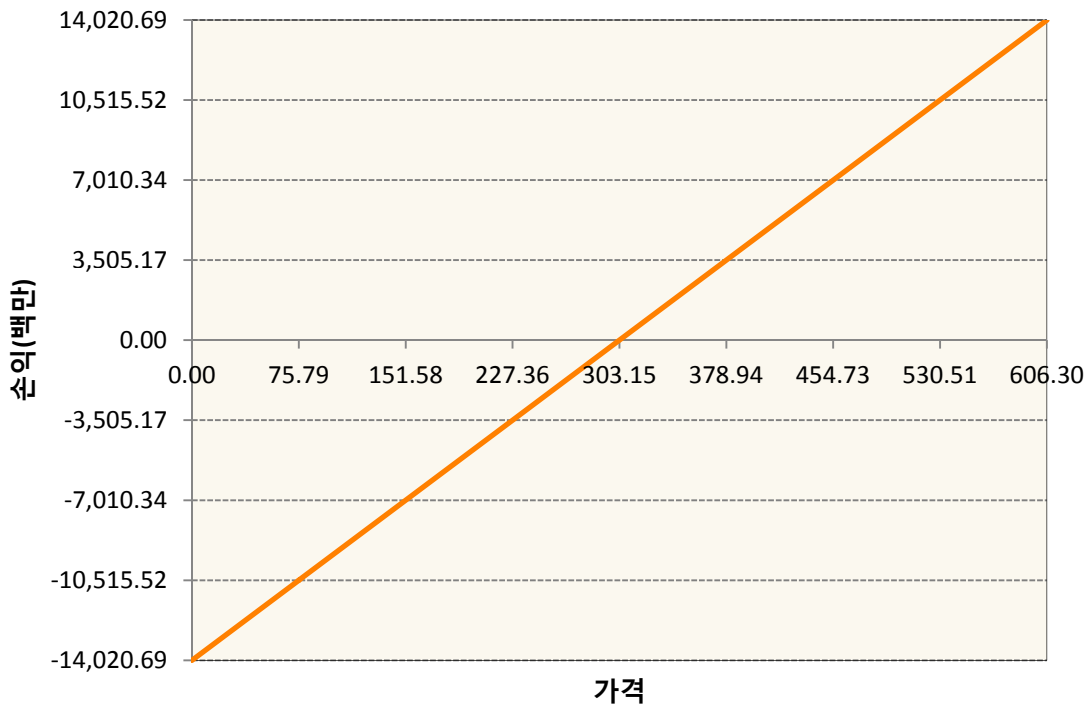
1. 계약금액

(단위:백만원)

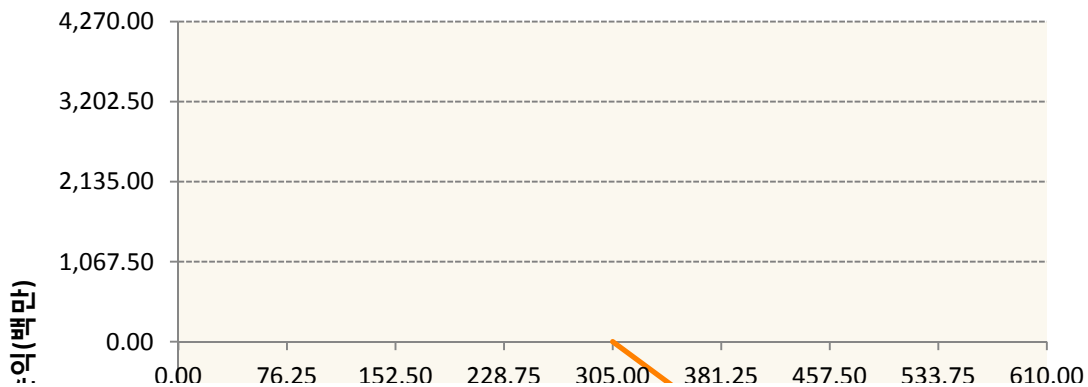
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	14,021	0	14,021	장내
누계	유가증권	옵션	2,119	24,258	-22,138	장내

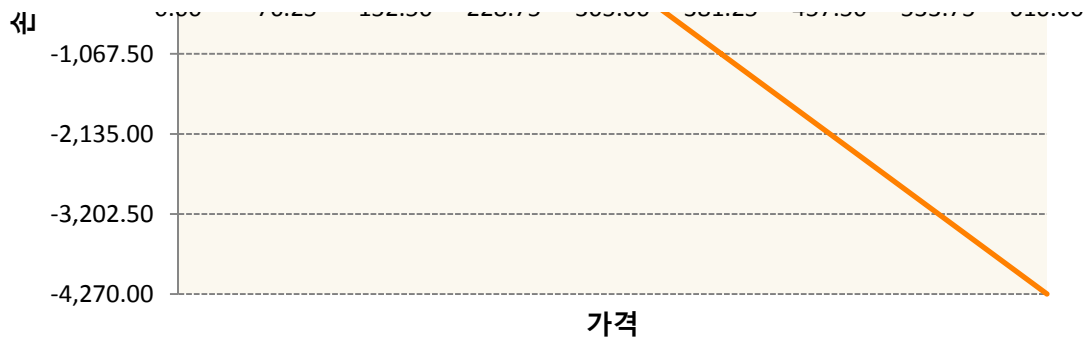
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

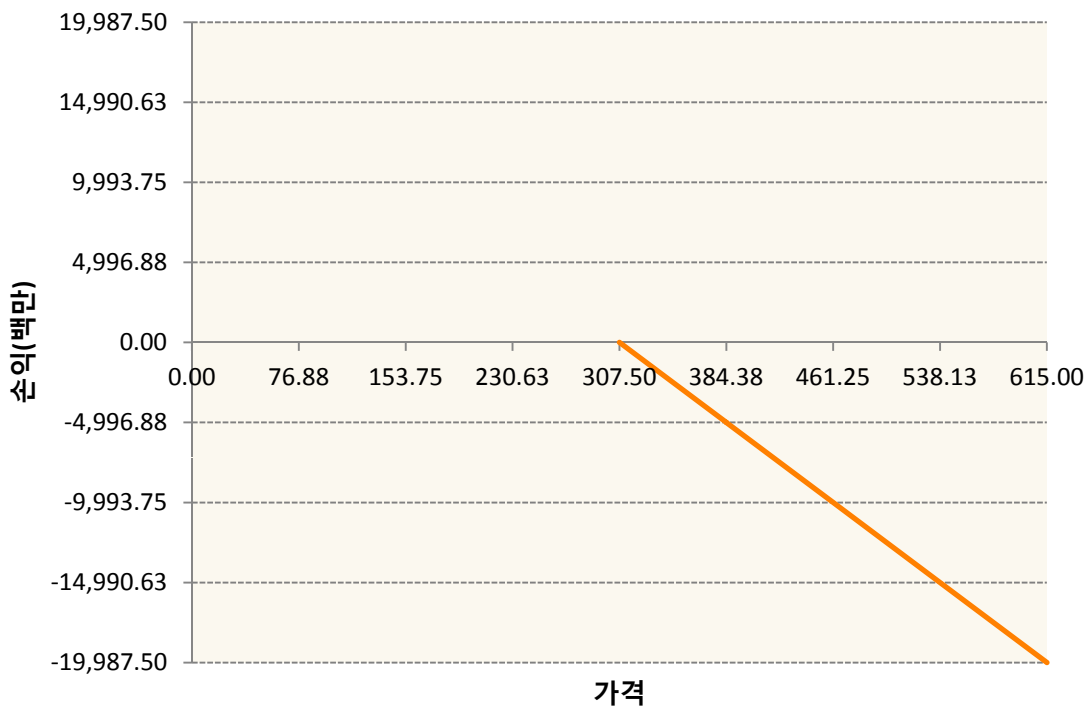


KR4201NA3058-2018-10 콜305

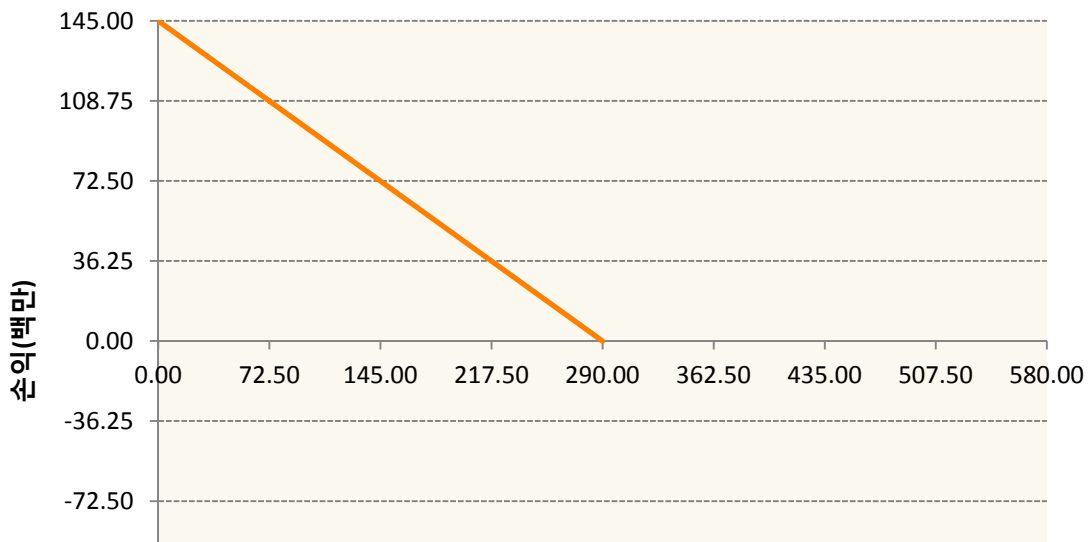


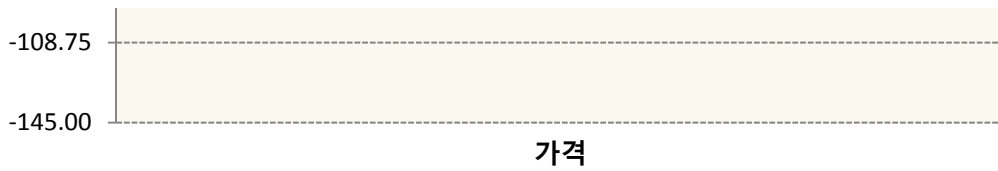


KR4201NA3074-2018-10 콜307.5

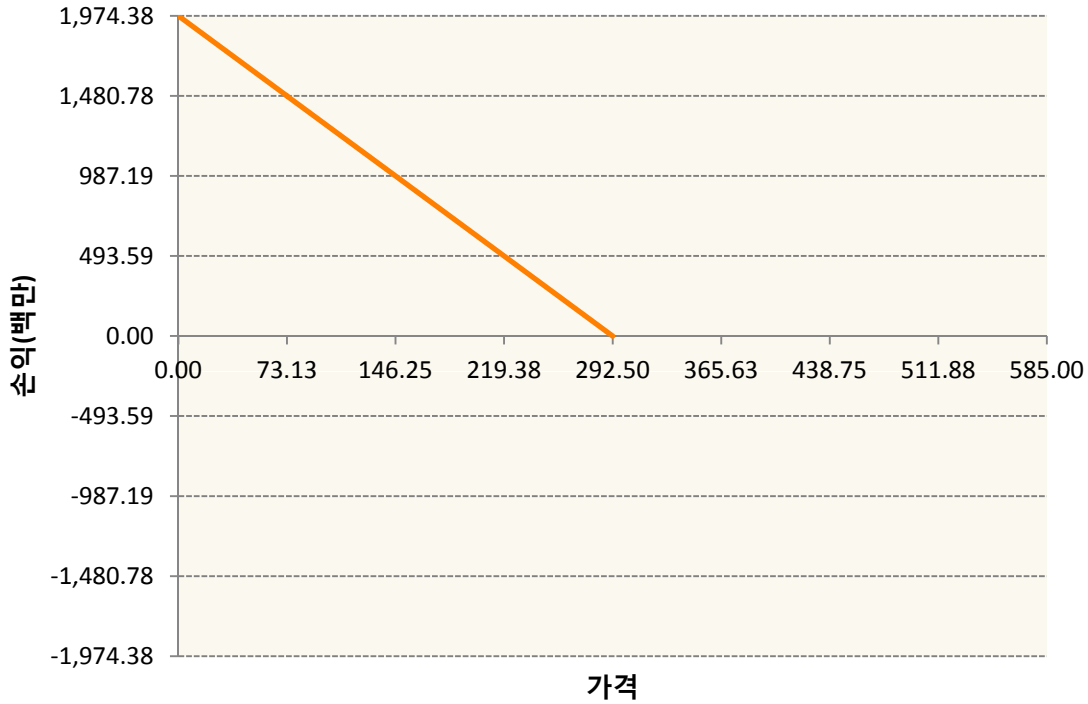


KR4301NA2901-2018-10 풋290





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 1,120

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,120	-1,120	-1,120	-1,120	-1,120	-1,120	-1,120
-5.33%	-746	-746	-746	-746	-746	-746	-746
-2.67%	-373	-373	-373	-373	-373	-373	-373
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	373	373	373	373	373	373	373
5.33%	746	746	746	746	746	746	746
8.00%	1,120	1,120	1,120	1,120	1,120	1,120	1,120

KR4201NA3(2018-10 콜305) 254

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	72	71	70	69	67	65	63
-5.33%	69	67	64	60	57	53	48
-2.67%	56	51	45	40	34	28	21

0%	22	15	7	0	-7	-15	-22
2.67%	-41	-48	-55	-62	-69	-76	-83
5.33%	-130	-135	-139	-145	-150	-156	-162
8.00%	-235	-237	-239	-242	-246	-249	-254

KR4201NA3(2018-10 콜307.5

1,107

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	271	269	266	261	255	247	238
-5.33%	261	254	244	232	217	201	184
-2.67%	220	200	179	155	130	105	78
0%	97	65	33	0	-33	-66	-99
2.67%	-154	-188	-222	-256	-290	-324	-359
5.33%	-534	-558	-584	-611	-640	-669	-699
8.00%	-1,001	-1,013	-1,028	-1,045	-1,064	-1,085	-1,107

KR4301NA2(2018-10 풋290

6

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6	6	6	6	6	6	6
-5.33%	2	2	2	2	2	3	3
-2.67%	0	0	0	0	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

95

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	94	94	94	94	94	95	95
-5.33%	41	42	43	44	45	46	47
-2.67%	6	8	9	10	12	13	15
0%	-1	-1	0	0	1	1	2
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1

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

(단위:백만원)

2,189

공시일	2018-09-28
기준일	2018-09-27

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

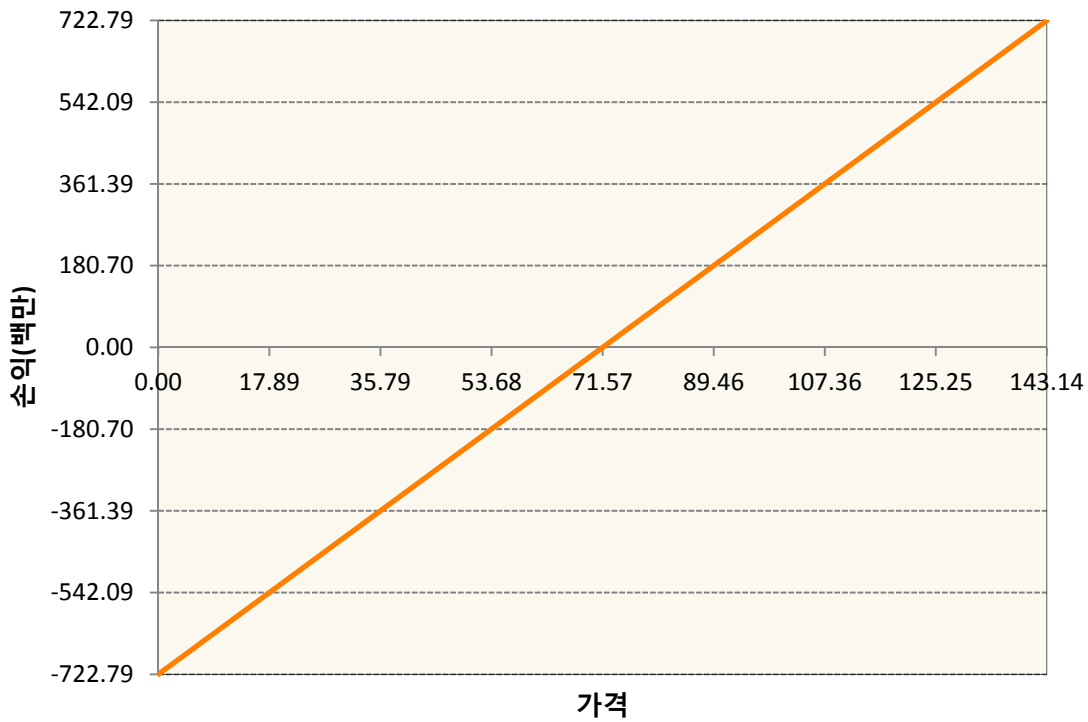
1. 계약금액

(단위:백만원)

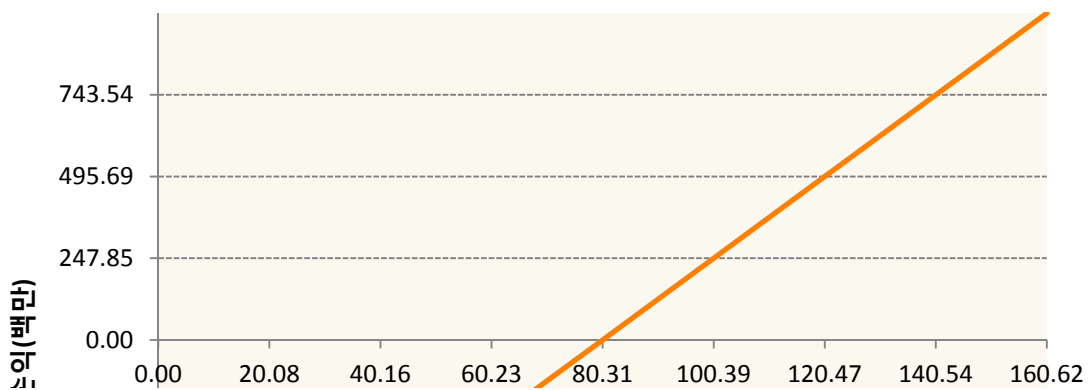
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,167	612	2,555	
누계	유가증권	선물	543	0	543	장내

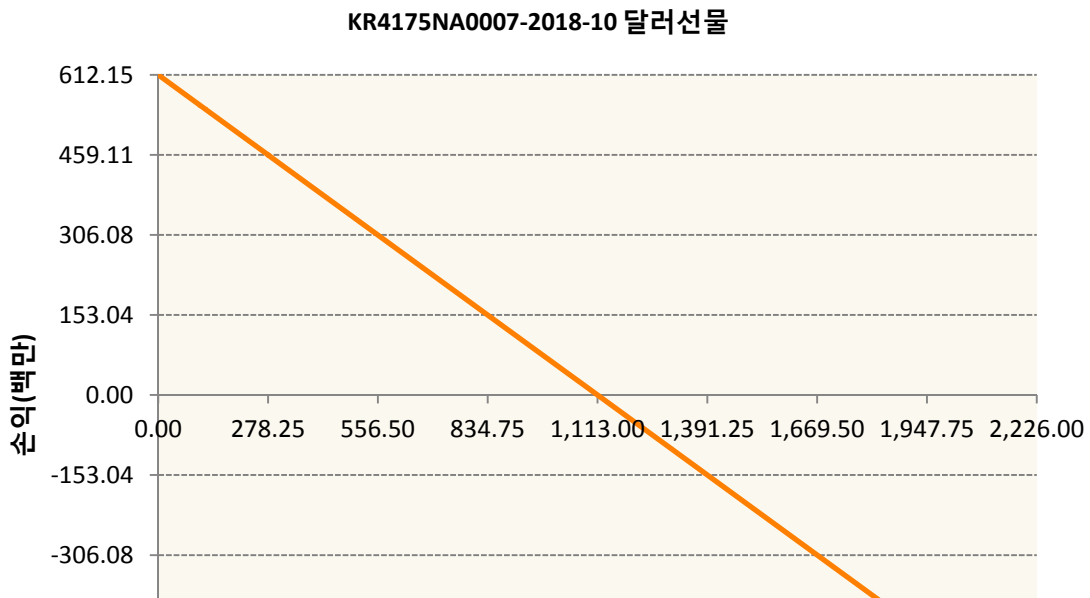
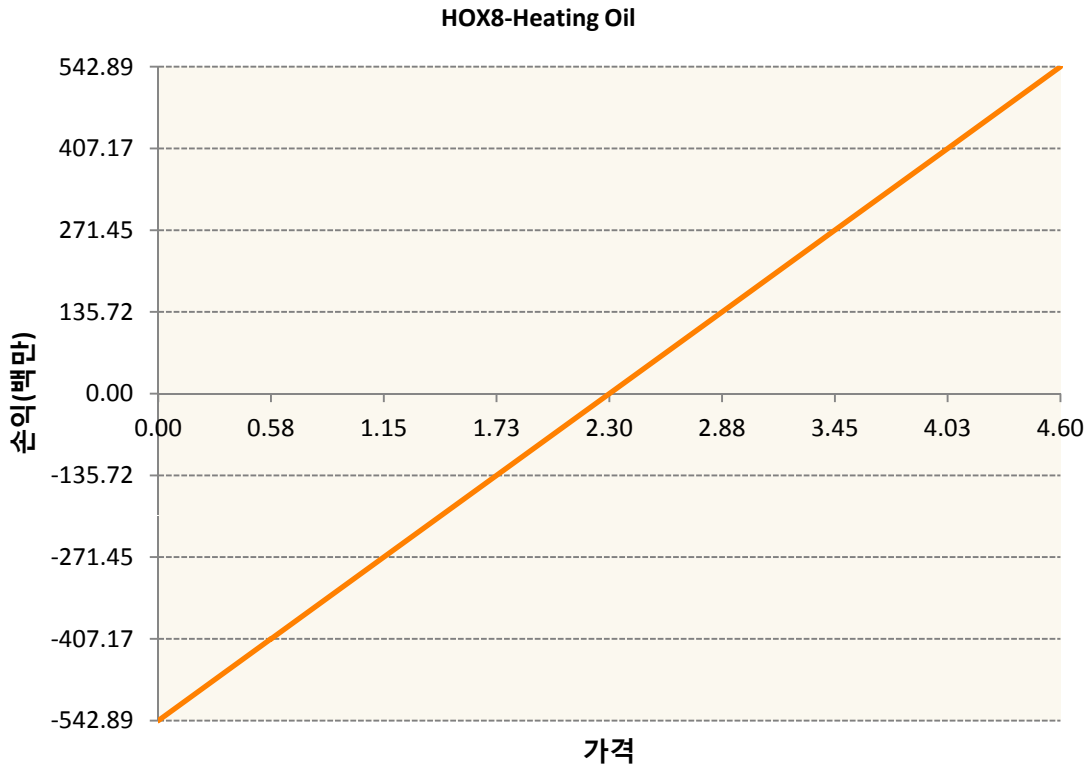
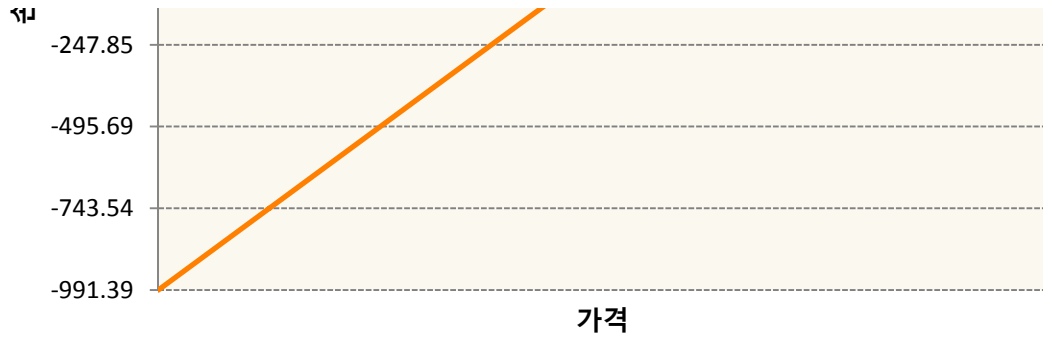
2. 만기시점의 손익구조

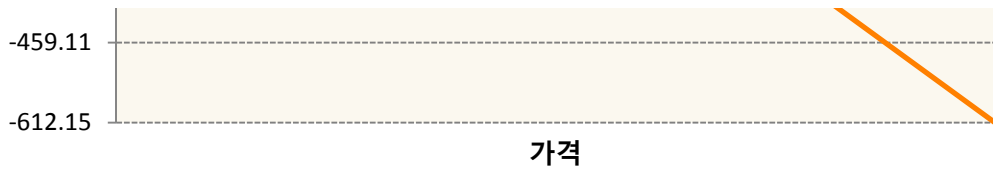
CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18



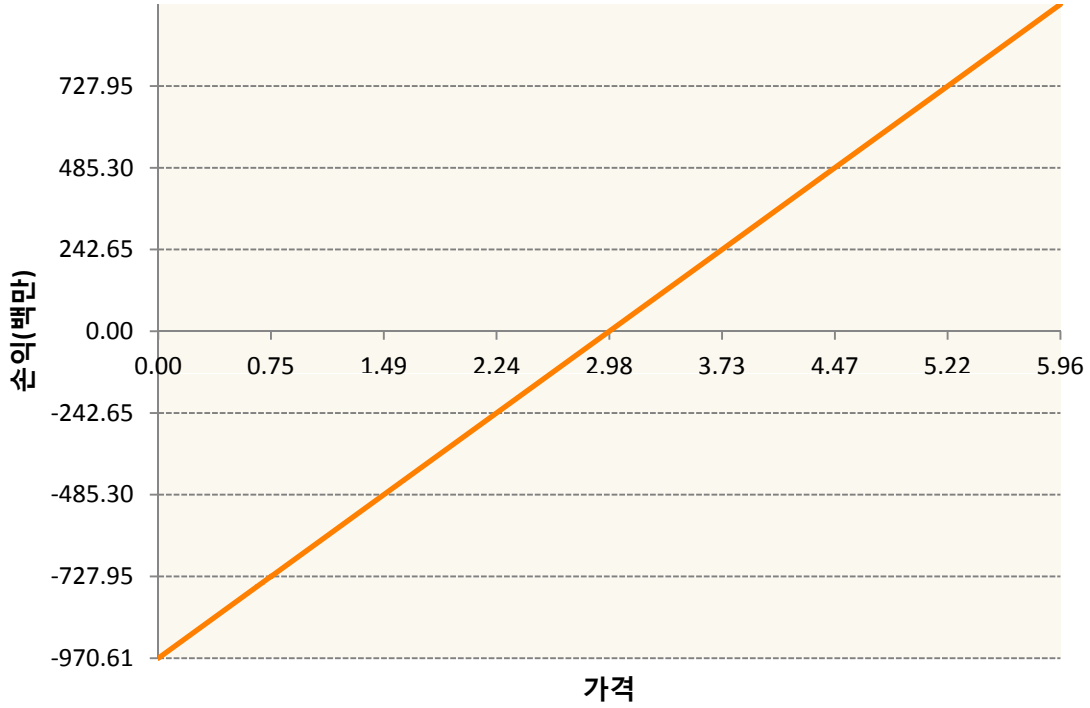
COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19



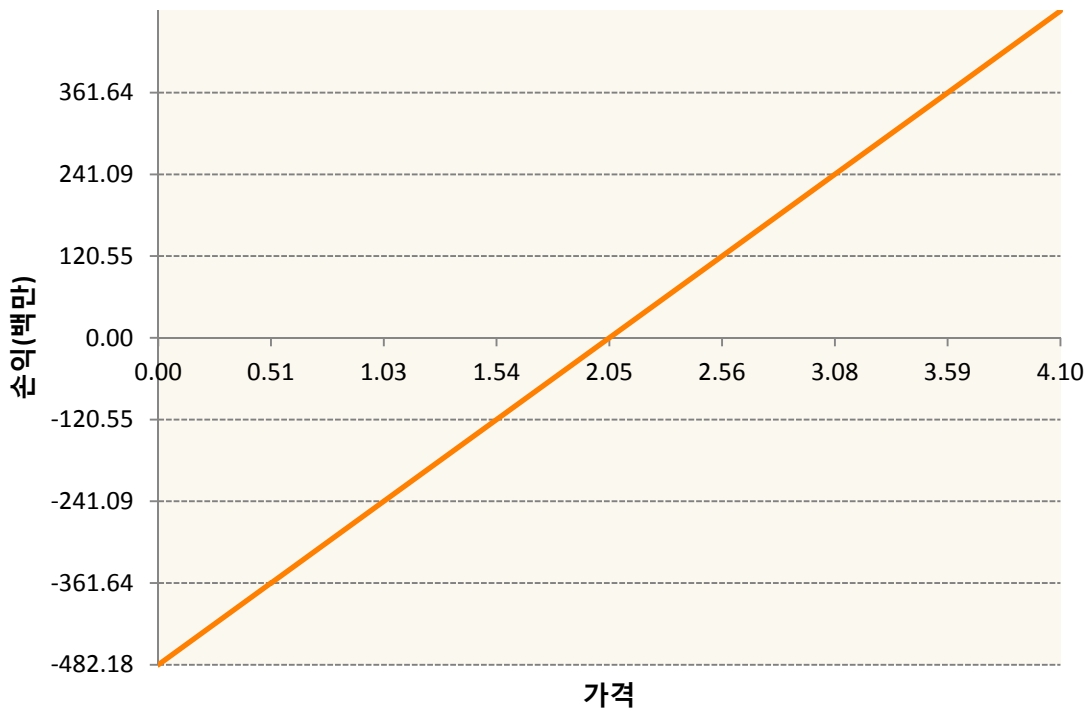




NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18



XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	58
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	79
HOX8	Heating Oil	43
	KR4175NA0(2018-10 달러선물	49
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	78
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	39

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	442

공시일	2018-09-28
기준일	2018-09-27

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

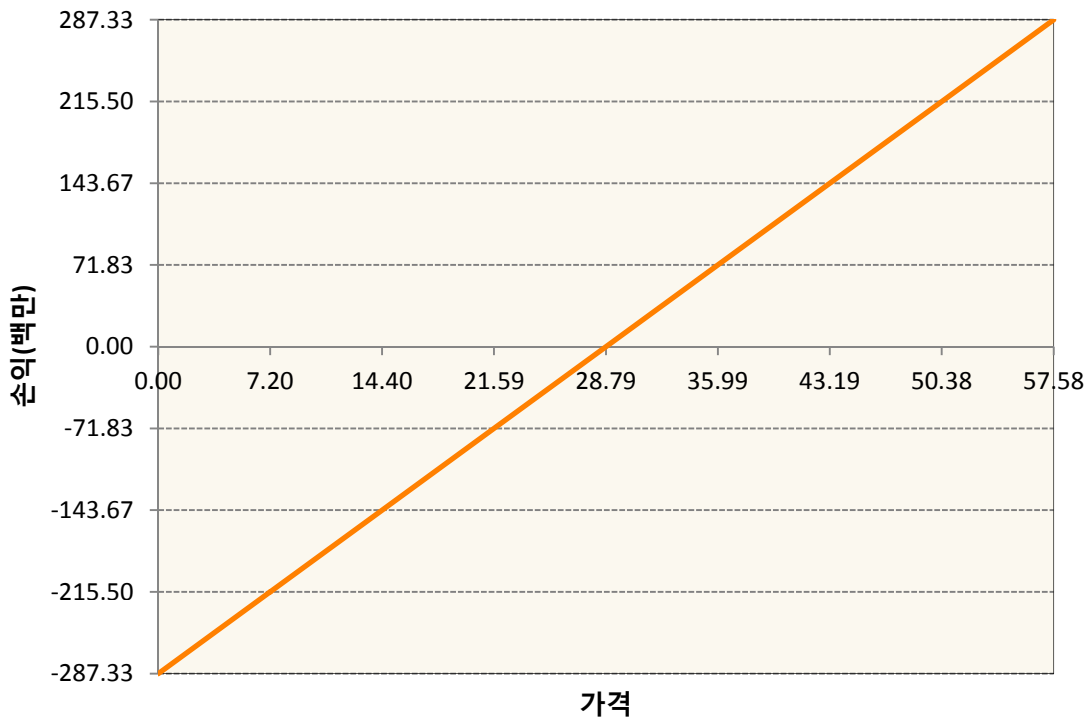
1. 계약금액

(단위:백만원)

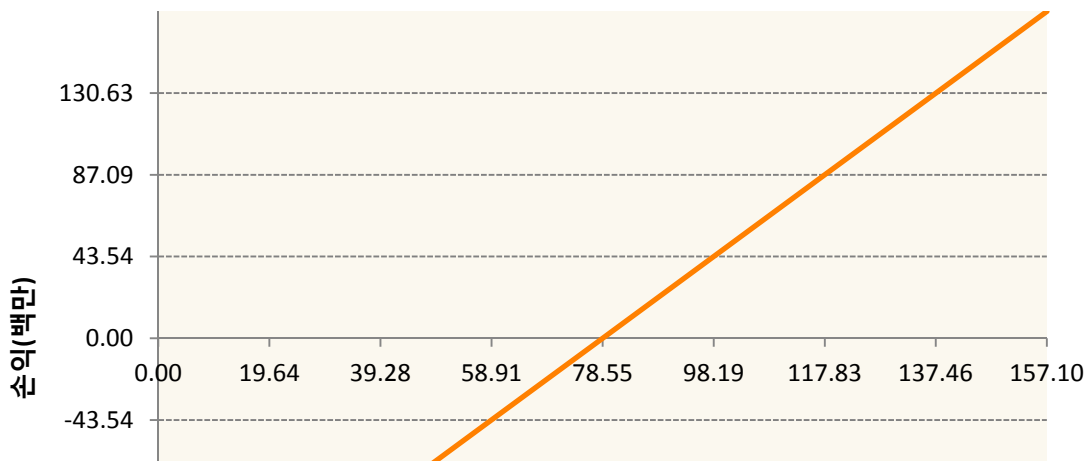
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,537	78	3,459	

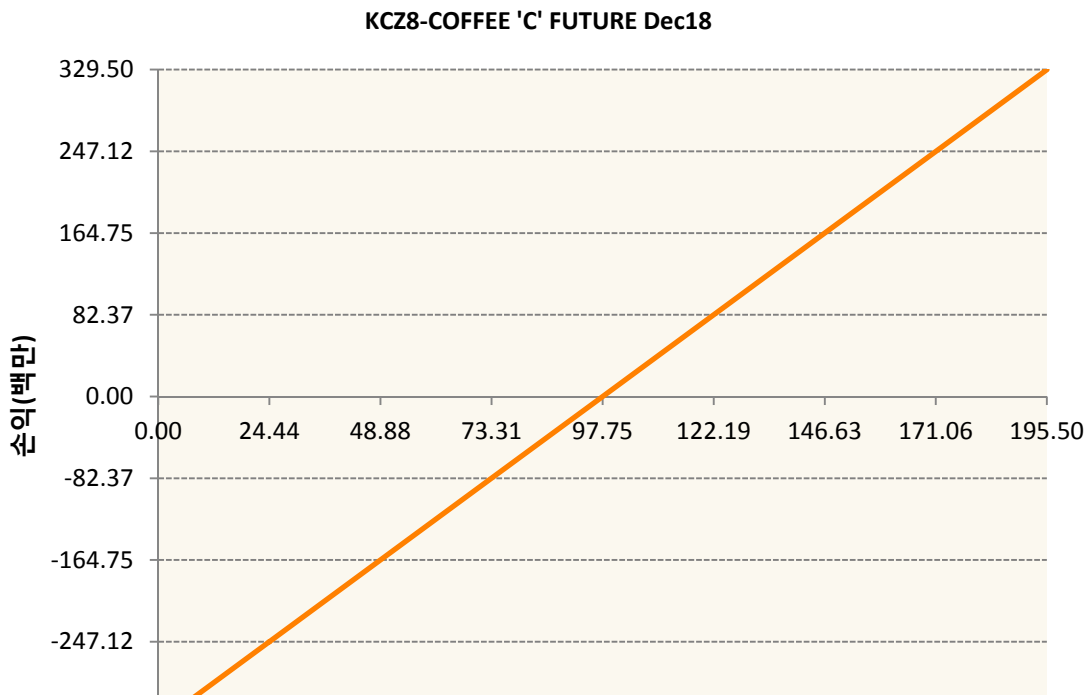
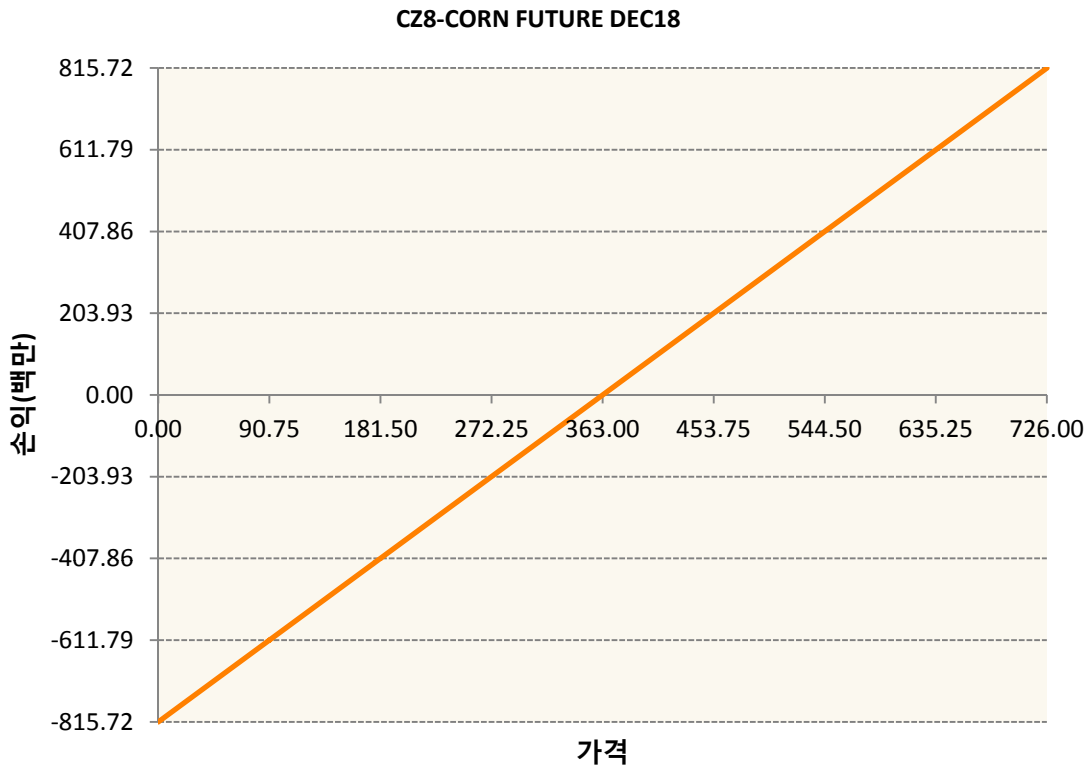
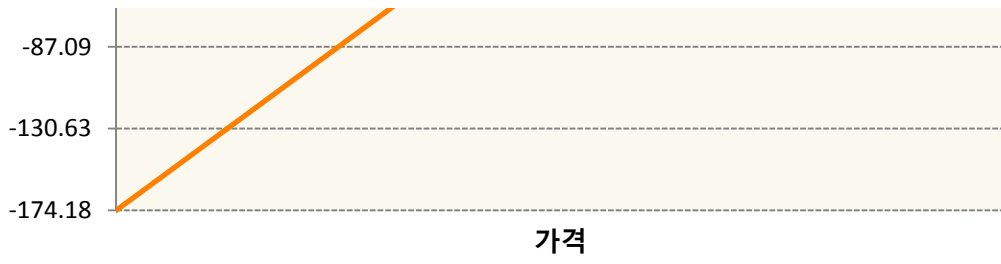
2. 만기시점의 손익구조

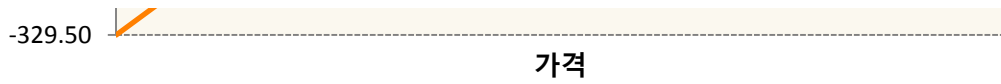
BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18



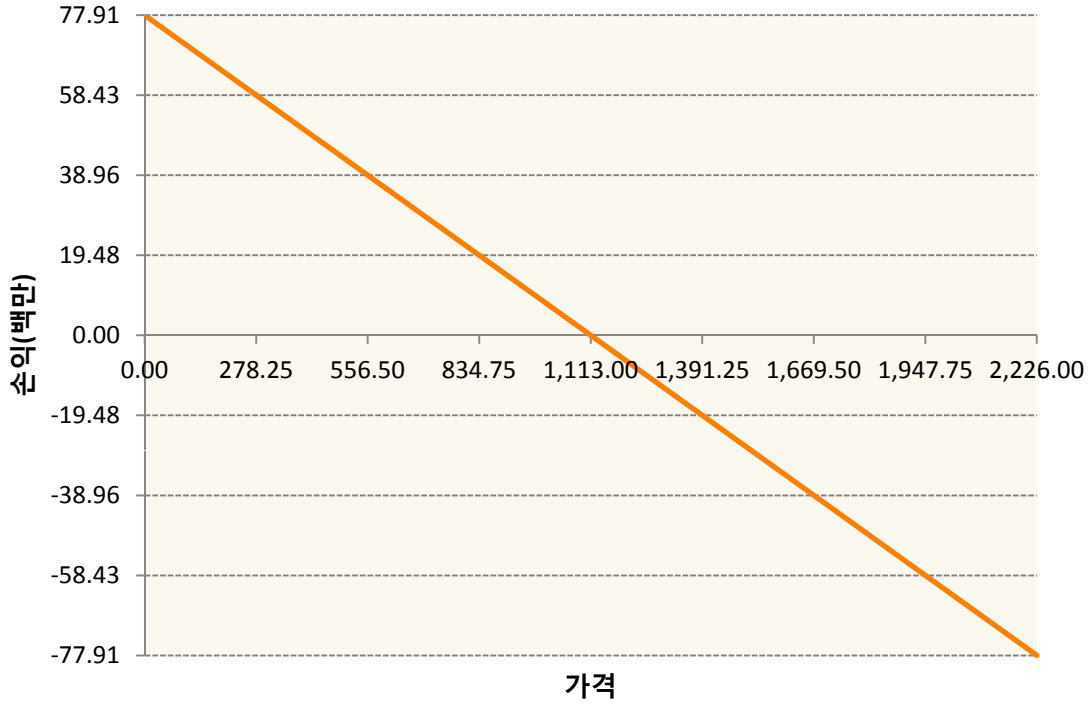
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



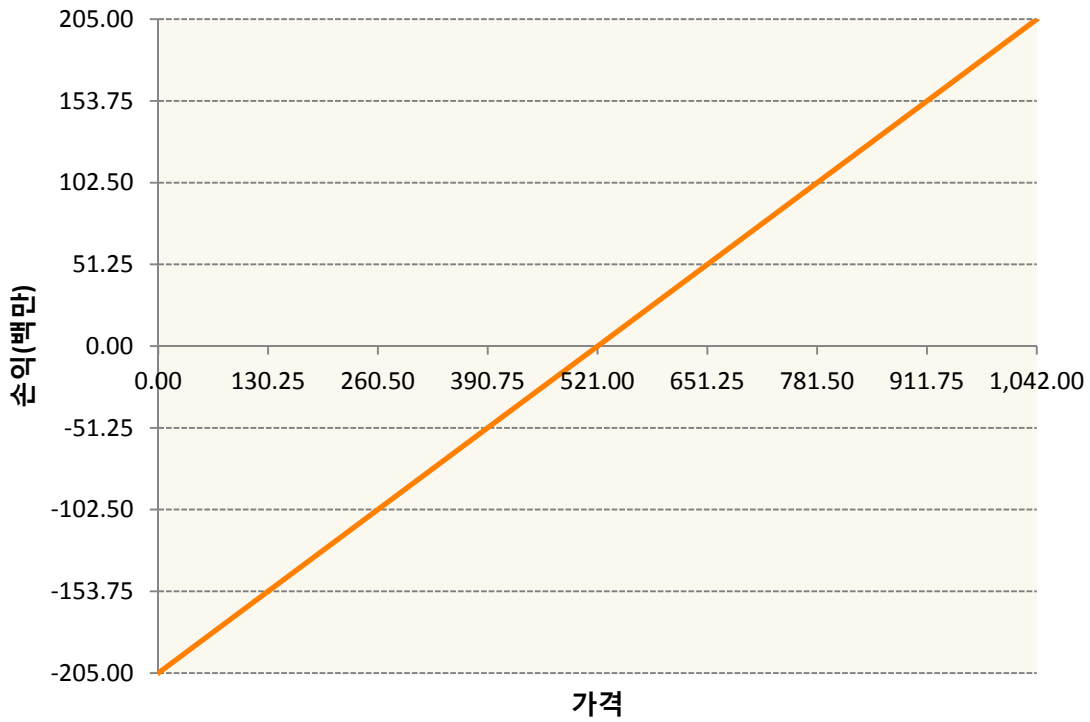




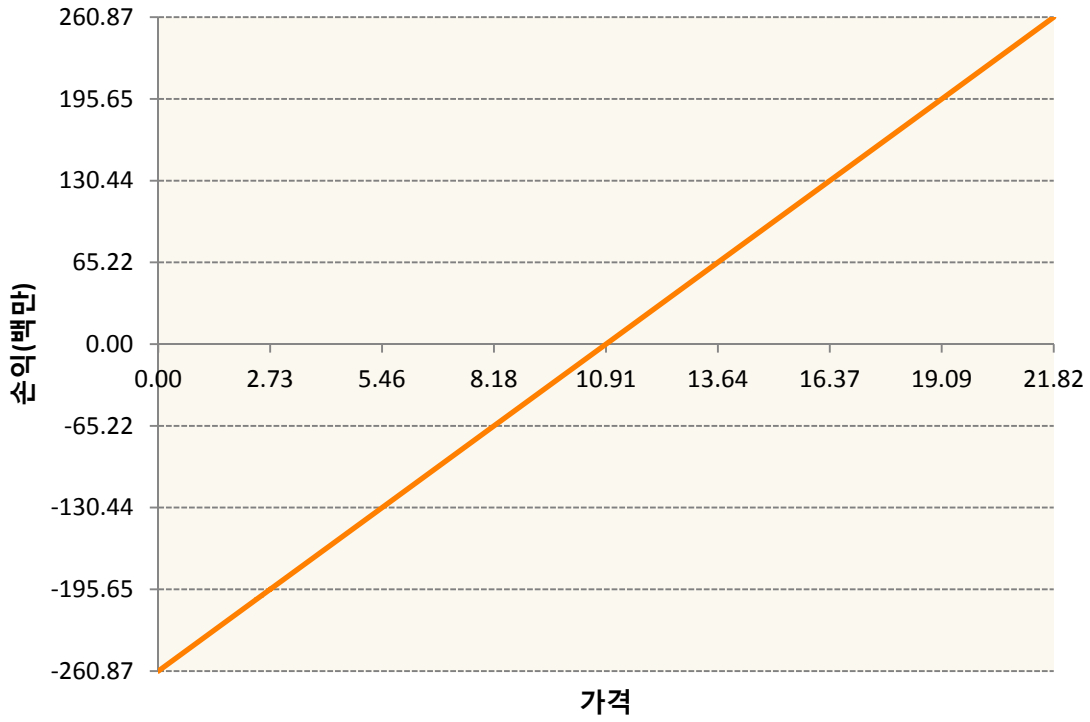
KR4175NA0007-2018-10 달러선물



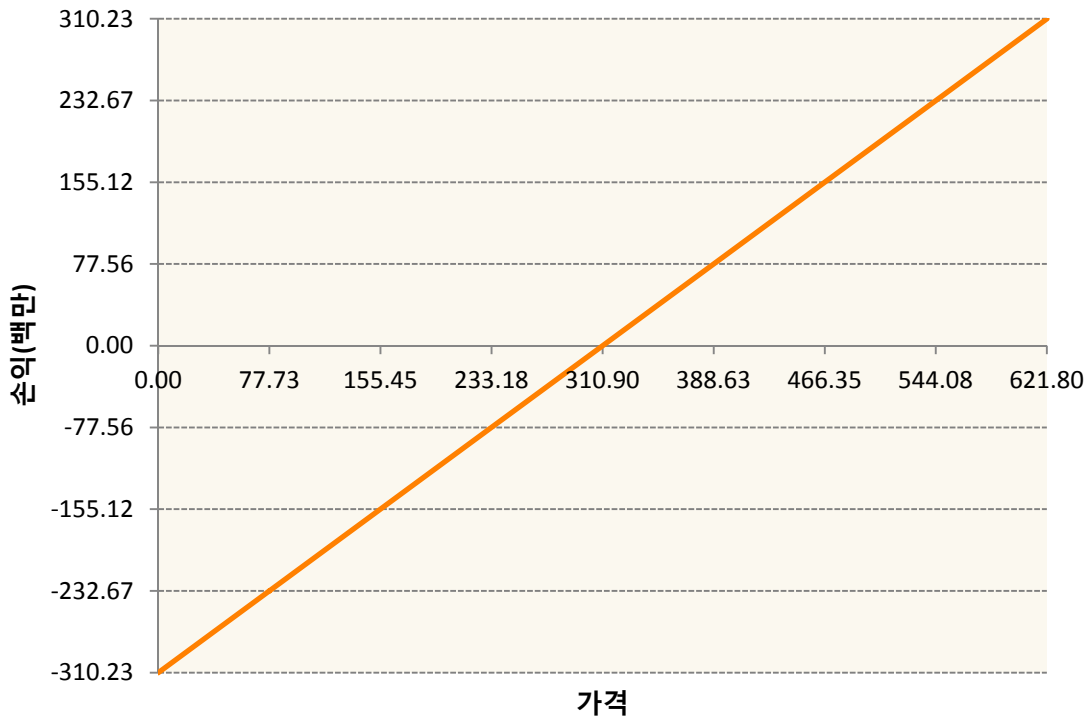
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

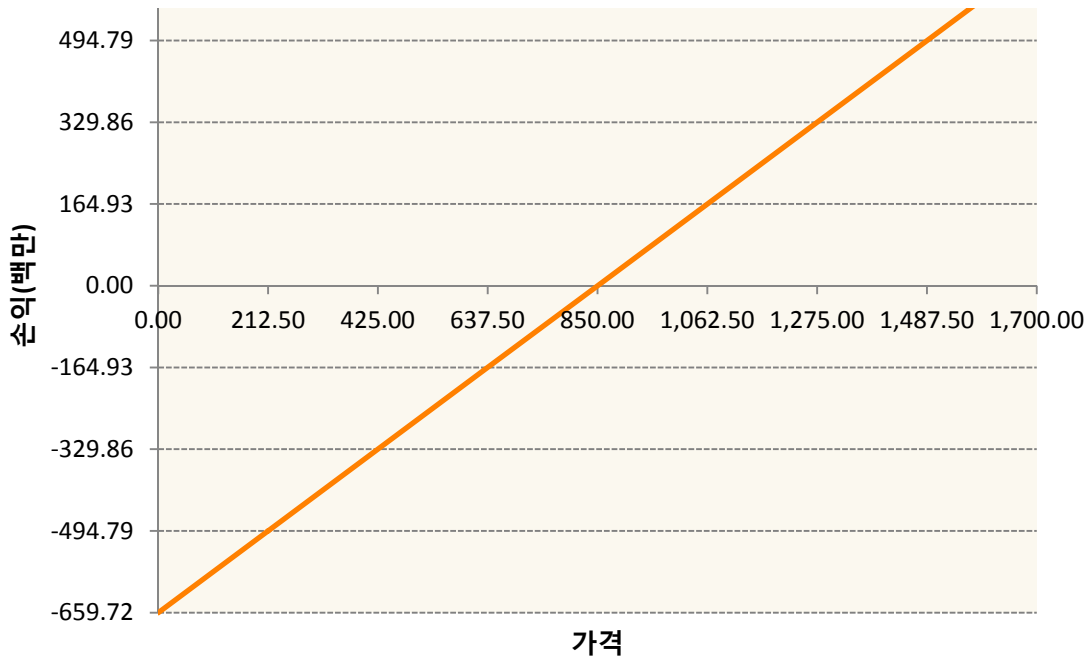


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

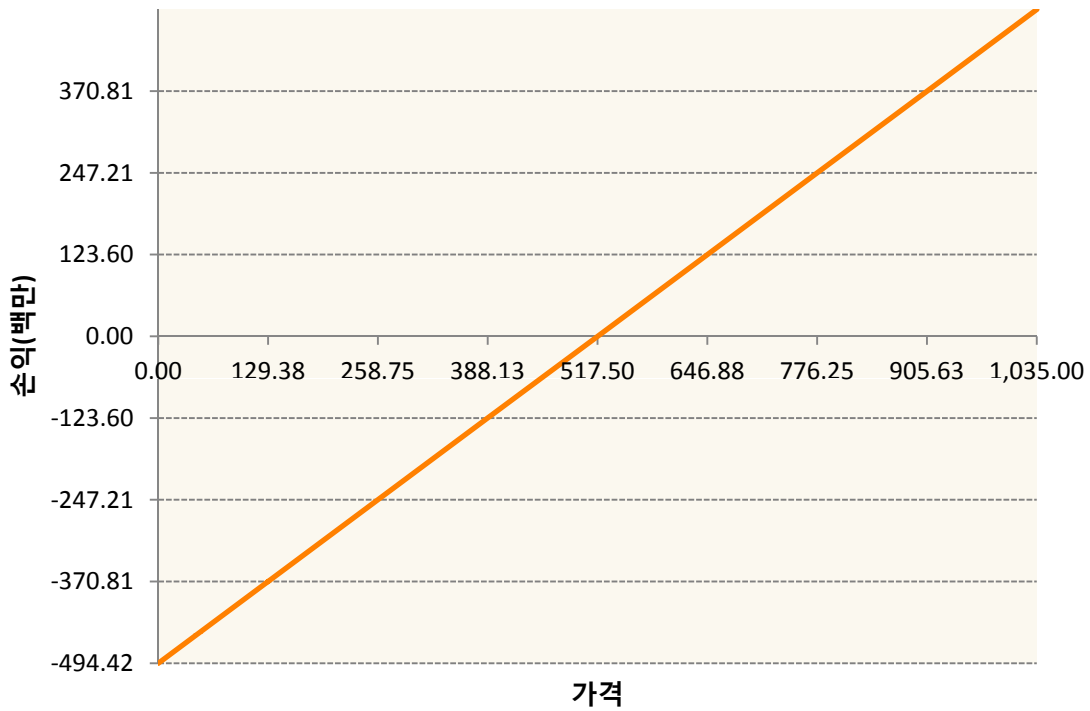


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





WZ8-WHEAT FUTURE(CBT) DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	23
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	14
CZ8	CORN FUTURE DEC18	65
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	26
KR4175NA0	(2018-10 달러선물	6

KWZ8	KC HRW WHEAT FUT DEC18	16
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	21
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)

308