

공시일	2018-10-01
기준일	2018-09-28

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	2018-10-01
기준일	2018-09-28

스마트인덱스모

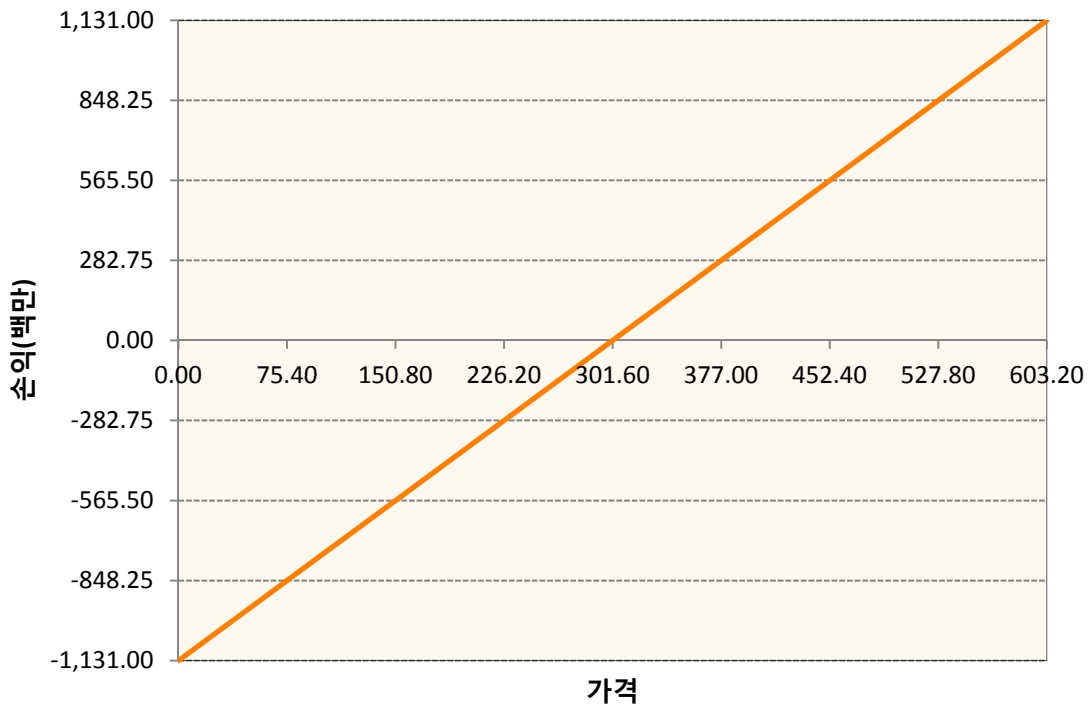
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,131	0	1,131	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	2018-10-01
기준일	2018-09-28

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)

494

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-01
기준일	2018-09-28

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

294

* 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	2018-10-01
기준일	2018-09-28

유로인덱스모(주식-파생형)

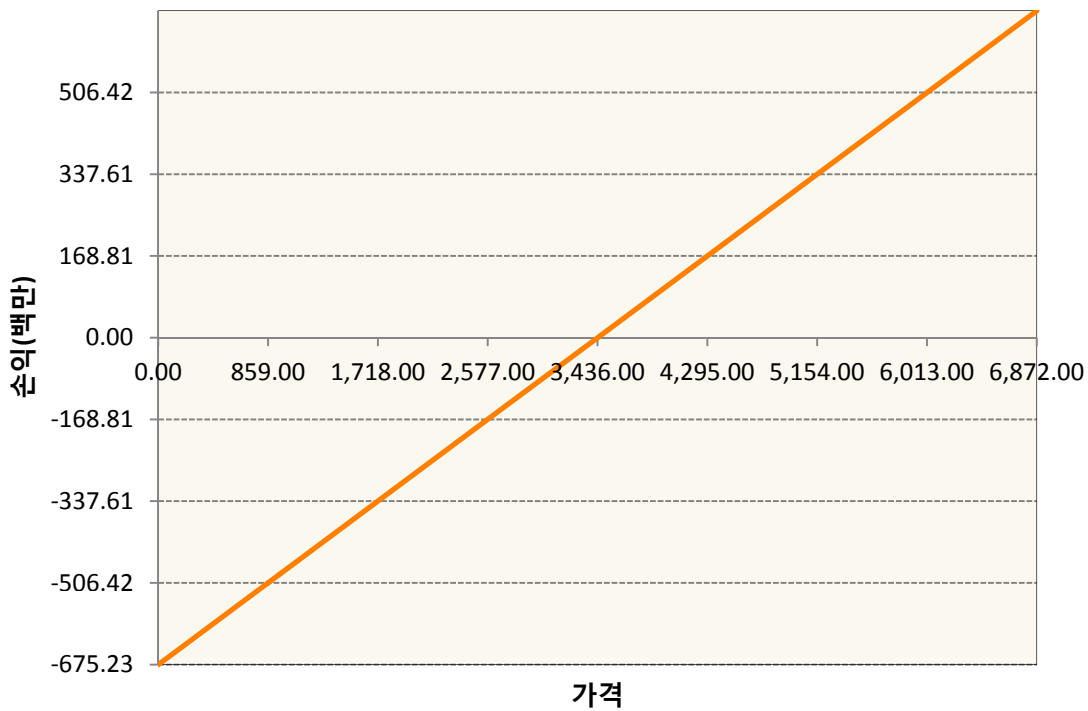
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	675	0	675	

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	2018-10-01
기준일	2018-09-28

차이나인덱스모(주식-파생형)

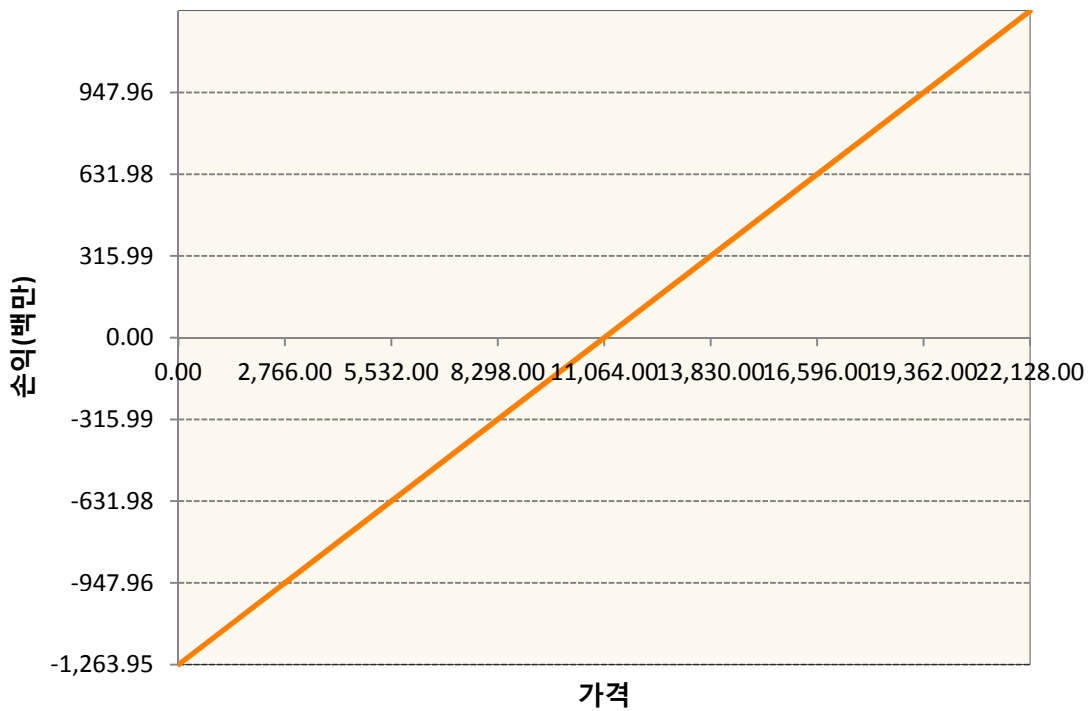
1. 계약금액

(단위:백만원)

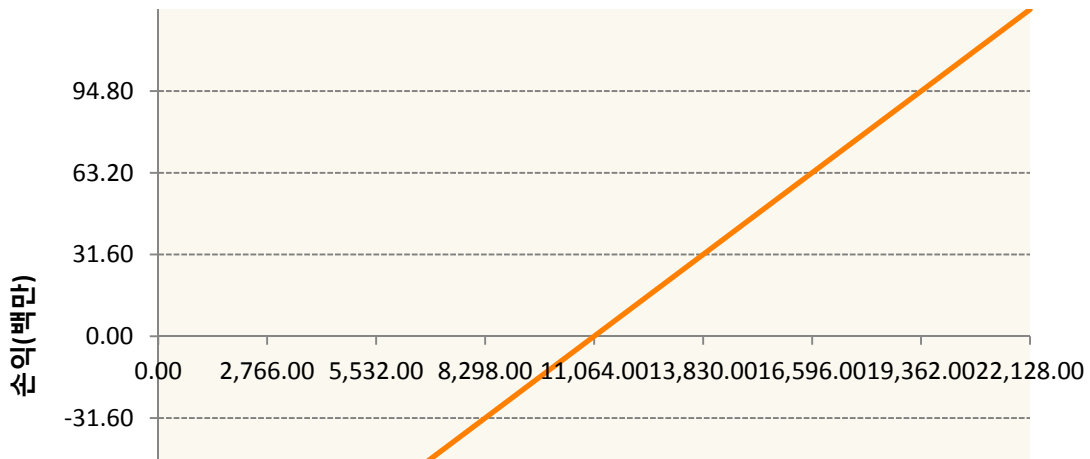
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,390	0	1,390	장내

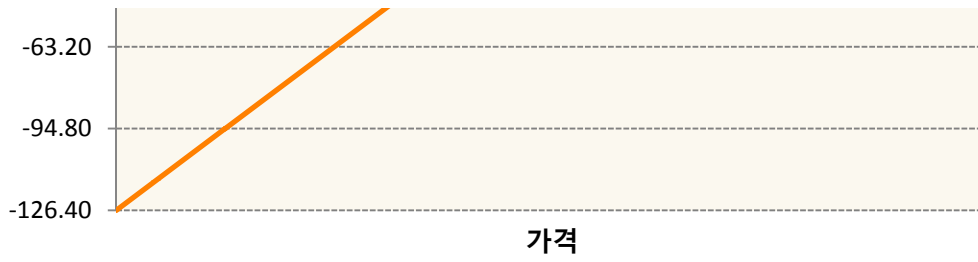
2. 만기시점의 손익구조

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)

104

공시일	2018-10-01
기준일	2018-09-28

커버드콜모(주식혼합-파생형)

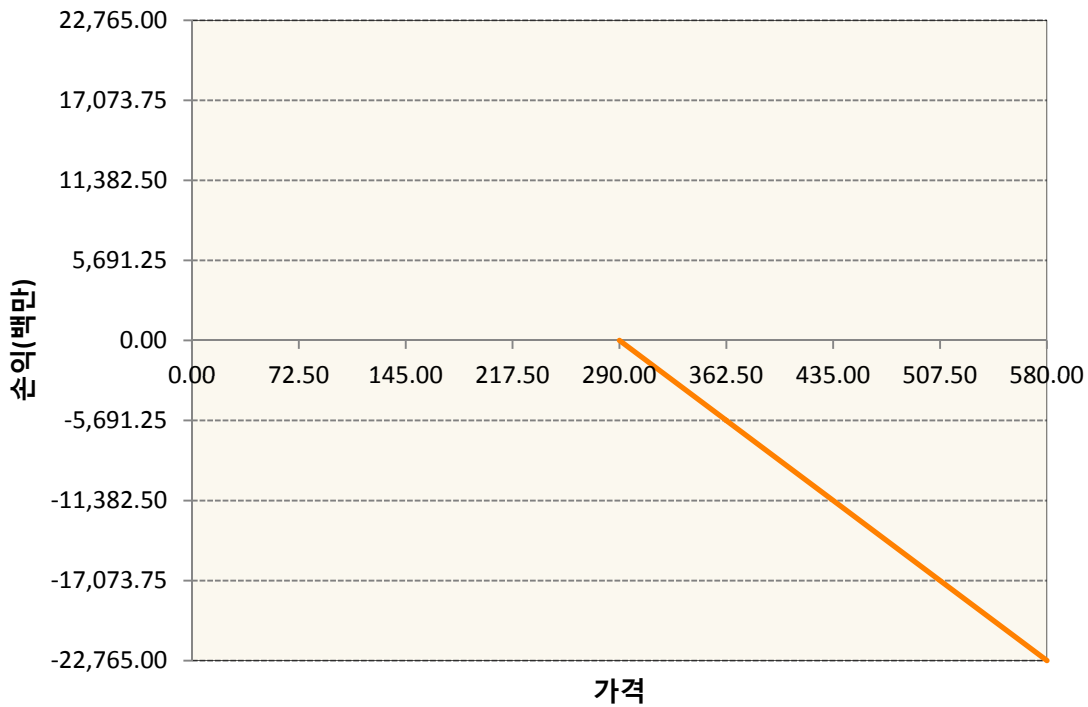
1. 계약금액

(단위:백만원)

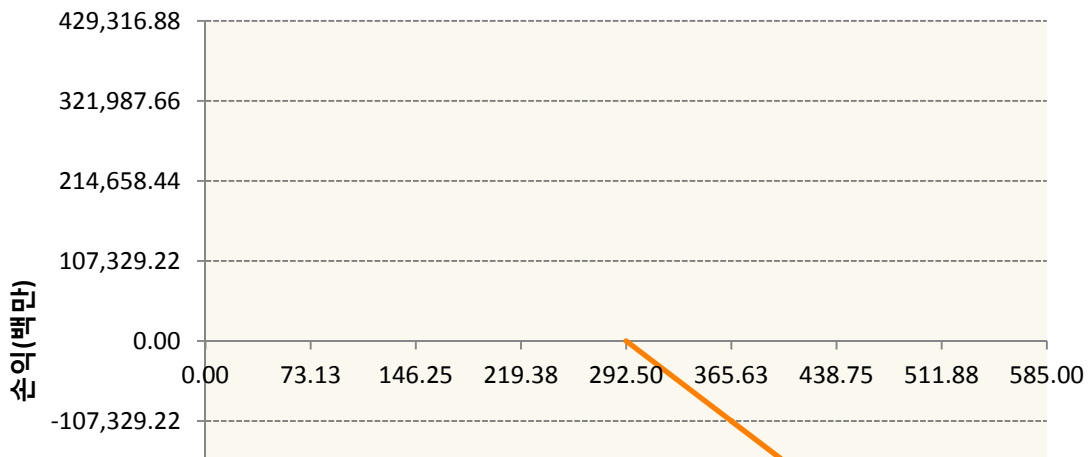
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	3,653	0	3,653	장내
누계	유가증권	옵션	0	727,032	-727,032	장내

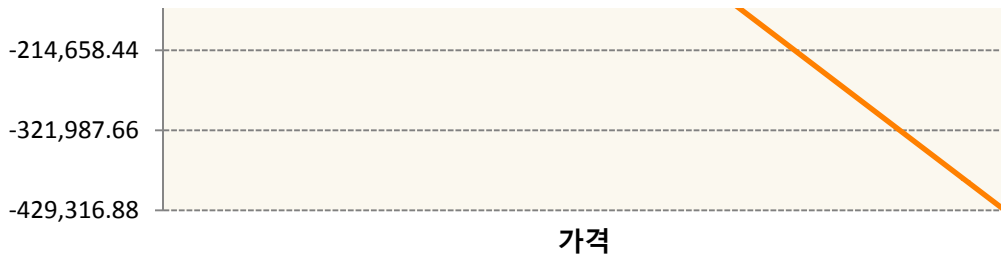
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NA2902-2018-10 콜290

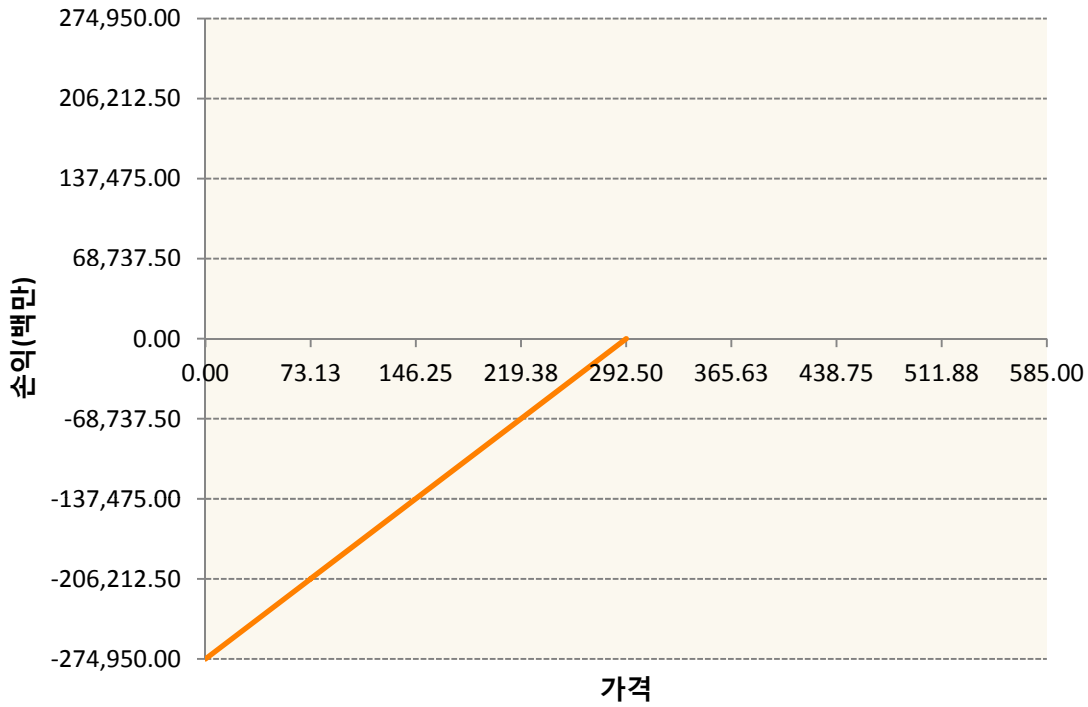


KR4201NA2928-2018-10 콜292.5





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NA2927-2018-10 콜290

1,744

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	947	929	909	886	861	835	808
-5.33%	823	789	755	720	685	649	614
-2.67%	538	501	463	426	388	350	312
0%	83	57	29	0	-31	-62	-95
2.67%	-483	-495	-509	-526	-546	-567	-591
5.33%	-1,096	-1,100	-1,105	-1,113	-1,123	-1,135	-1,149
8.00%	-1,722	-1,723	-1,724	-1,727	-1,731	-1,736	-1,744

KR4201NA2927-2018-10 풋292.5

31,759

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15,350	15,094	14,788	14,437	14,047	13,623	13,170

-5.33%	13,678	13,125	12,546	11,948	11,334	10,708	10,071
-2.67%	9,372	8,655	7,938	7,221	6,504	5,787	5,070
0%	1,801	1,223	621	0	-636	-1,285	-1,943
2.67%	-8,262	-8,562	-8,916	-9,315	-9,754	-10,226	-10,727
5.33%	-19,535	-19,640	-19,789	-19,984	-20,223	-20,505	-20,826
8.00%	-31,193	-31,218	-31,265	-31,339	-31,445	-31,584	-31,759
KR4301NA29 2018-10 풋 292.5							14,823
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,780	-14,781	-14,782	-14,787	-14,794	-14,806	-14,823
-5.33%	-7,323	-7,372	-7,435	-7,511	-7,598	-7,696	-7,803
-2.67%	-1,468	-1,663	-1,857	-2,052	-2,246	-2,441	-2,635
0%	206	151	82	0	-94	-199	-312
2.67%	289	288	284	278	267	250	226
5.33%	290	290	290	290	289	288	286
8.00%	290	290	290	290	290	290	290

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

(단위:백만원)

47,844

공시일	2018-10-01
기준일	2018-09-28

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

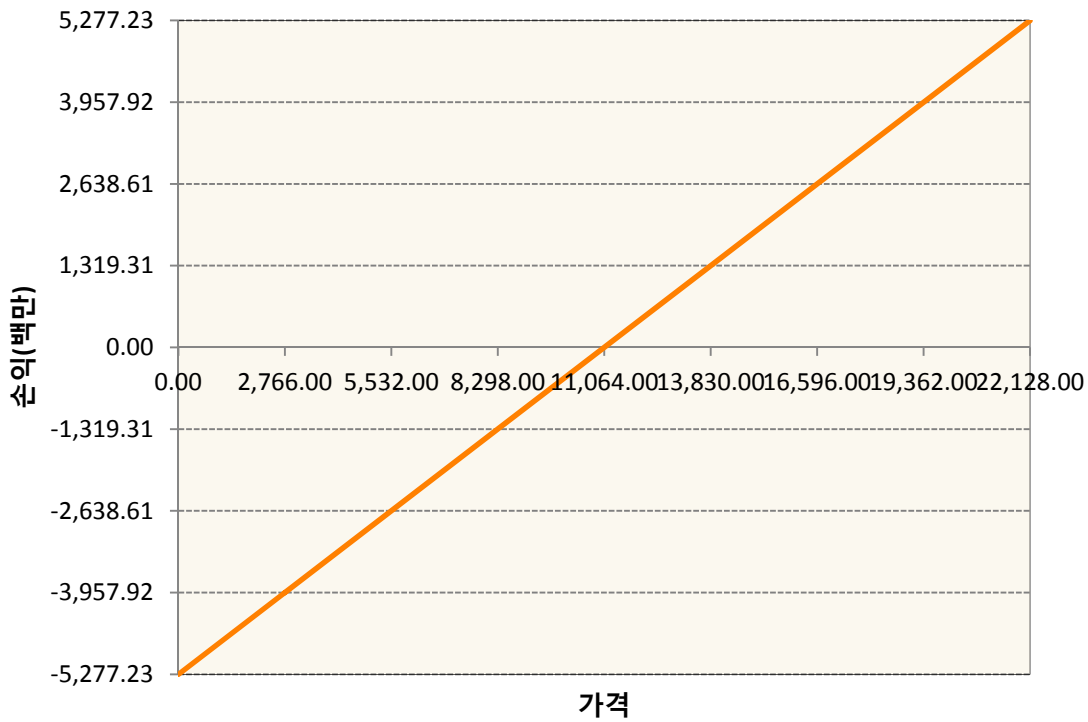
1. 계약금액

(단위:백만원)

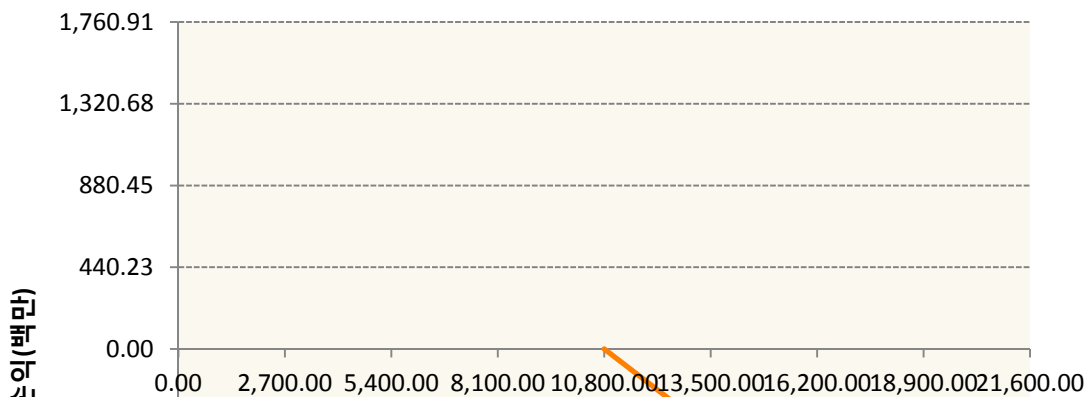
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,277	0	5,277	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,632	-11,632	장내

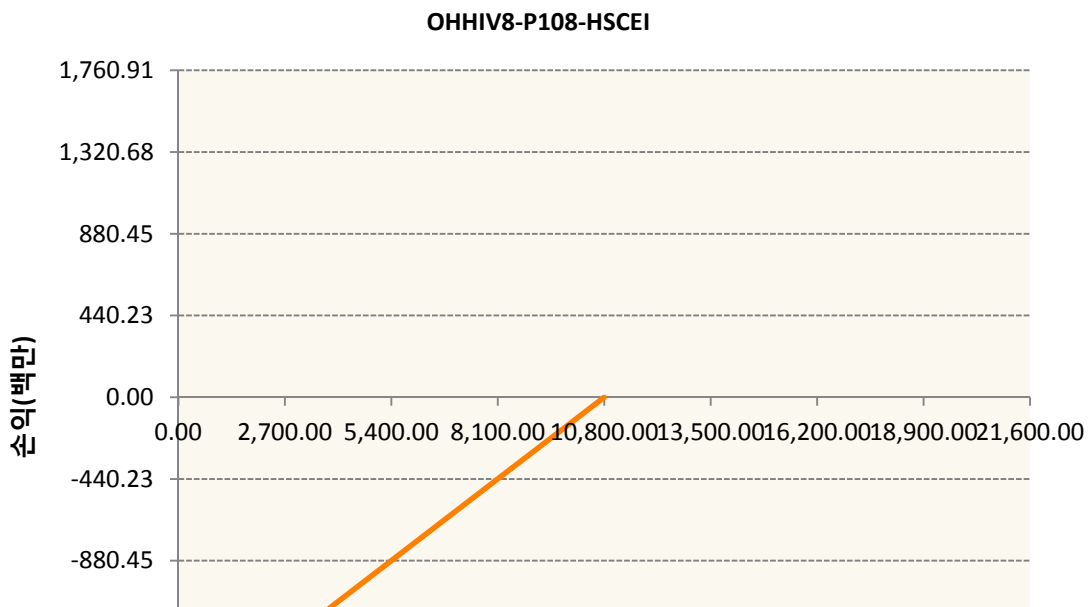
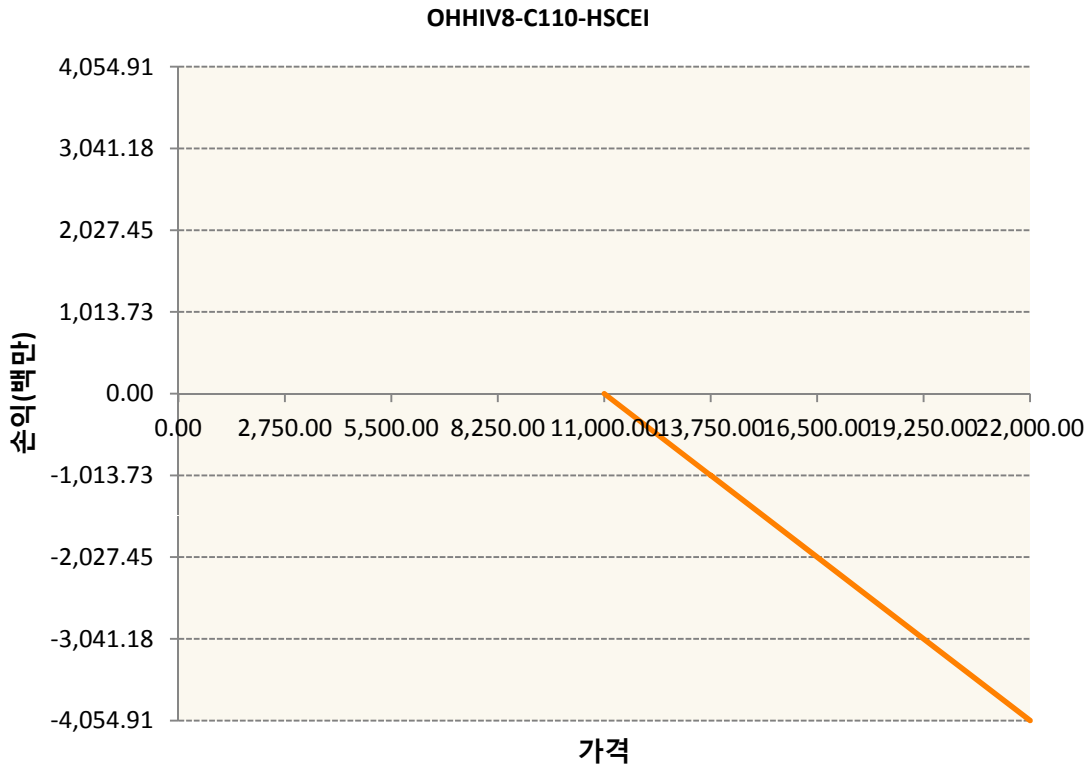
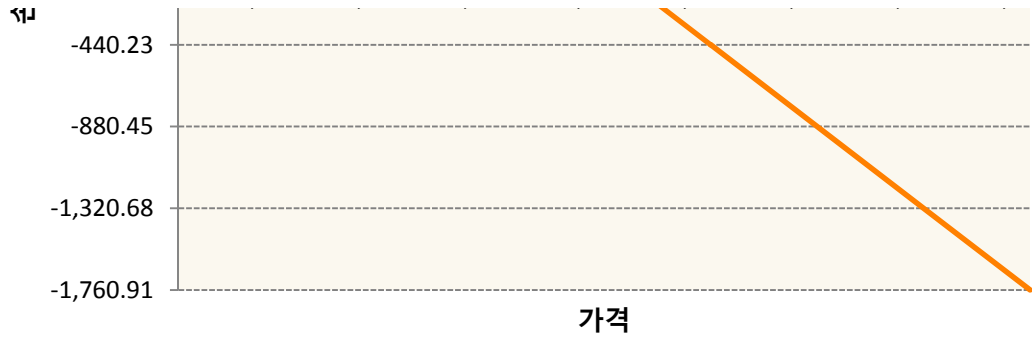
2. 만기시점의 손익구조

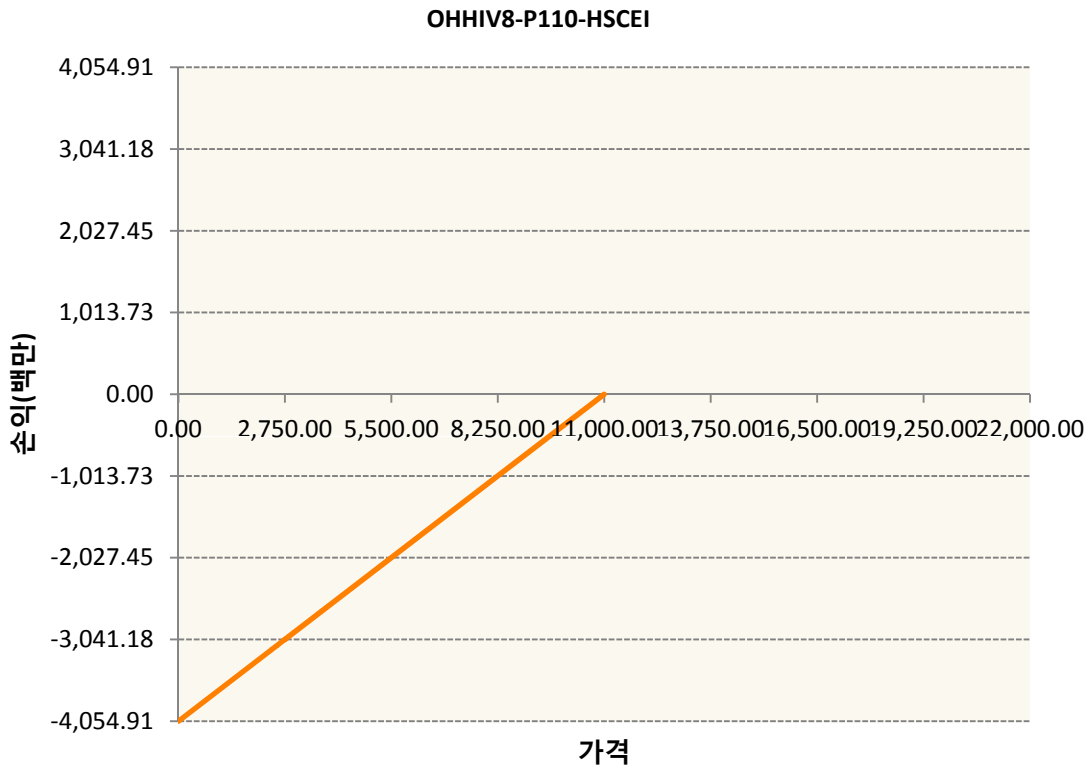
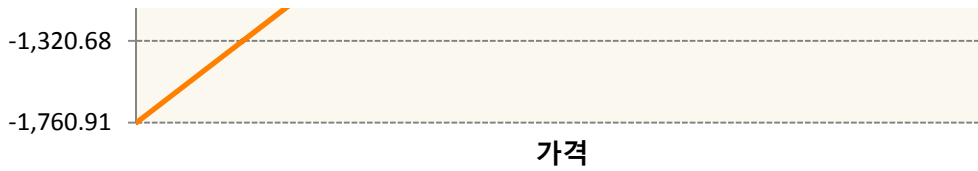
HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



OHHIV8-C108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	422
OHHIV8-C1	HSCEI	141
OHHIV8-C11	HSCEI	324
OHHIV8-P1C	HSCEI	141
OHHIV8-P11	HSCEI	324

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,263

공시일	2018-10-01
기준일	2018-09-28

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

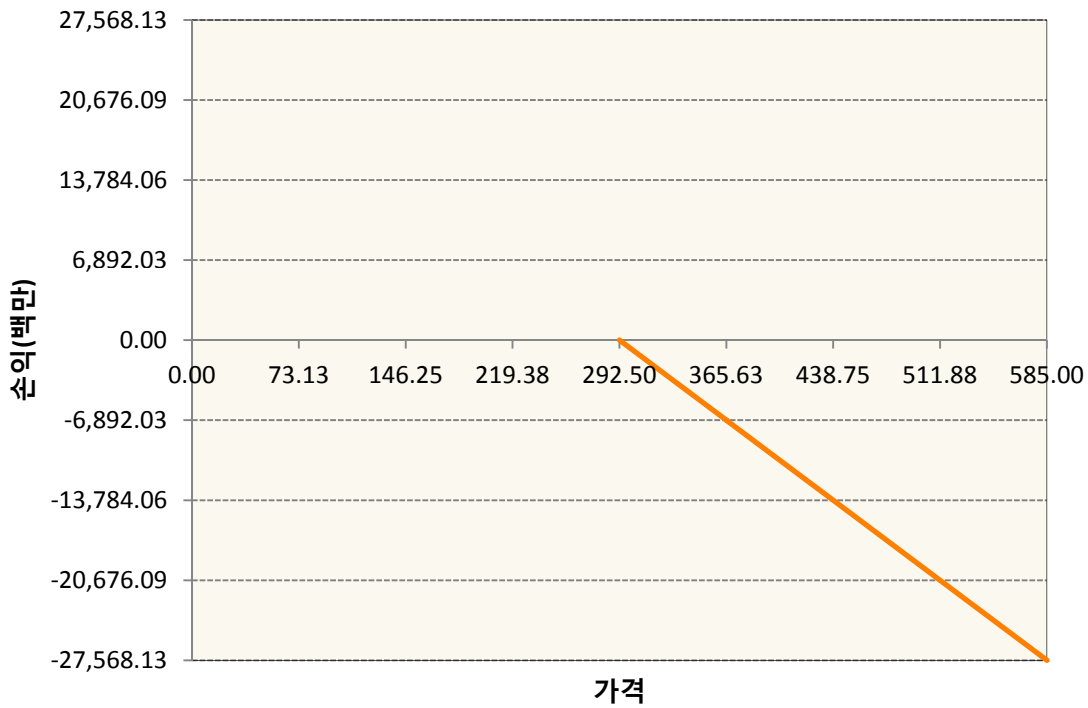
1. 계약금액

(단위:백만원)

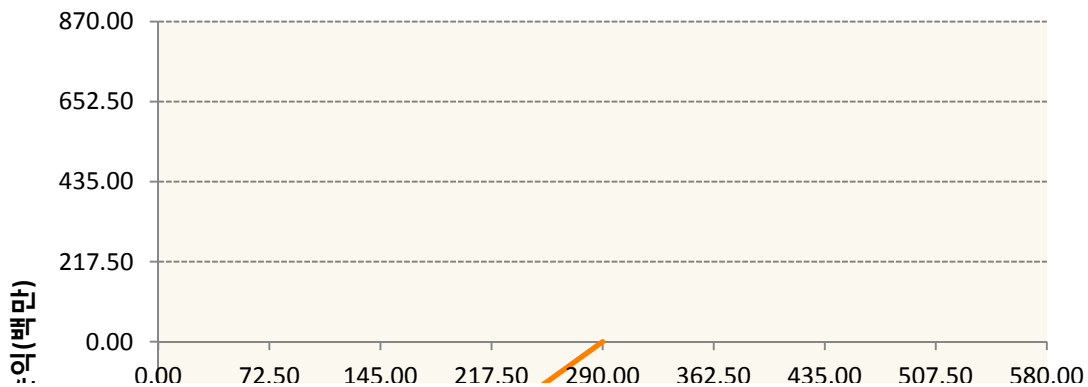
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	48,036	-48,036	장내

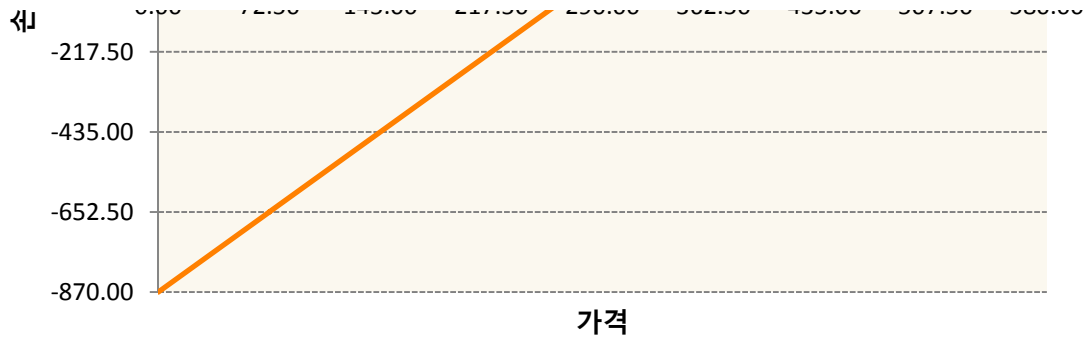
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NA2928-2018-10 콜292.5

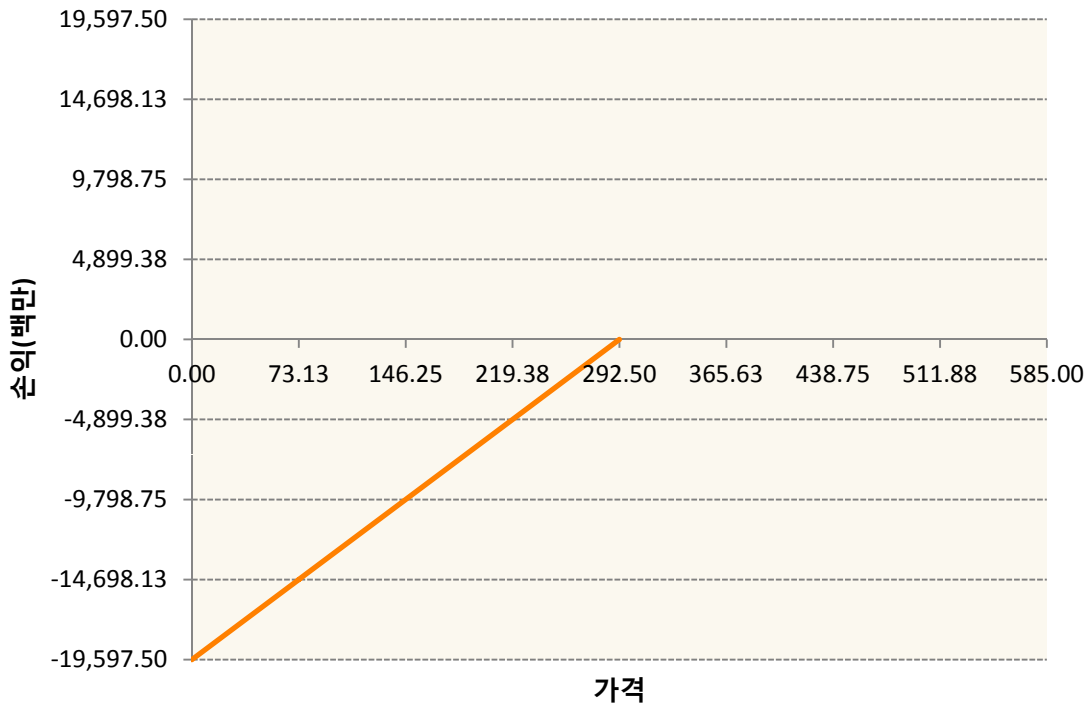


KR4301NA2901-2018-10 풋290





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,976
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,976	-3,976	-3,976	-3,976	-3,976	-3,976	-3,976
-5.33%	-2,651	-2,651	-2,651	-2,651	-2,651	-2,651	-2,651
-2.67%	-1,325	-1,325	-1,325	-1,325	-1,325	-1,325	-1,325
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,325	1,325	1,325	1,325	1,325	1,325	1,325
5.33%	2,651	2,651	2,651	2,651	2,651	2,651	2,651
8.00%	3,976	3,976	3,976	3,976	3,976	3,976	3,976
KR4201NA2927-2018-10 풋292.5							2,039
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	986	969	950	927	902	875	846
-5.33%	878	843	806	767	728	688	647
-2.67%	602	556	510	464	418	372	326
0%	116	79	40	0	-41	-83	-125
2.67%	-531	-550	-573	-598	-626	-657	-689
5.33%	-1,254	-1,261	-1,271	-1,283	-1,299	-1,317	-1,337
8.00%	-2,003	-2,005	-2,008	-2,012	-2,019	-2,028	-2,039

KR4301NA2☹ 2018-10 풋290

41

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-41
-5.33%	-17	-17	-18	-18	-18	-19	-19
-2.67%	-2	-3	-3	-4	-4	-5	-6
0%	0	0	0	0	0	0	-1
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

1,057

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,053	-1,054	-1,054	-1,054	-1,054	-1,055	-1,057
-5.33%	-522	-525	-530	-535	-542	-549	-556
-2.67%	-105	-119	-132	-146	-160	-174	-188
0%	15	11	6	0	-7	-14	-22
2.67%	21	21	20	20	19	18	16
5.33%	21	21	21	21	21	21	20
8.00%	21	21	21	21	21	21	21

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

(단위:백만원)

7,037

공시일	2018-10-01
기준일	2018-09-28

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

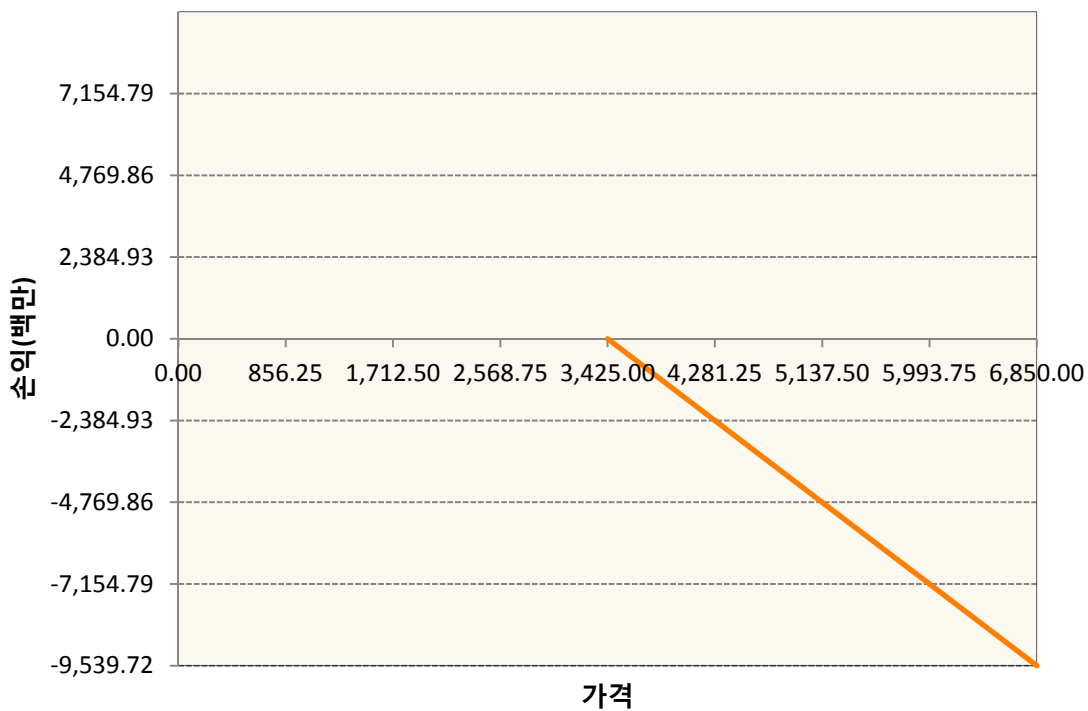
1. 계약금액

(단위:백만원)

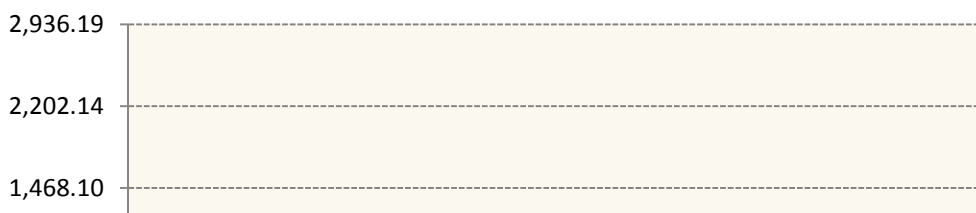
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,677	0	5,677	
누계	유가증권	스왑	34,052	0	34,052	장외
누계	유가증권	옵션	0	24,952	-24,952	장내
누계	지수	스왑	52,351	0	52,351	장외

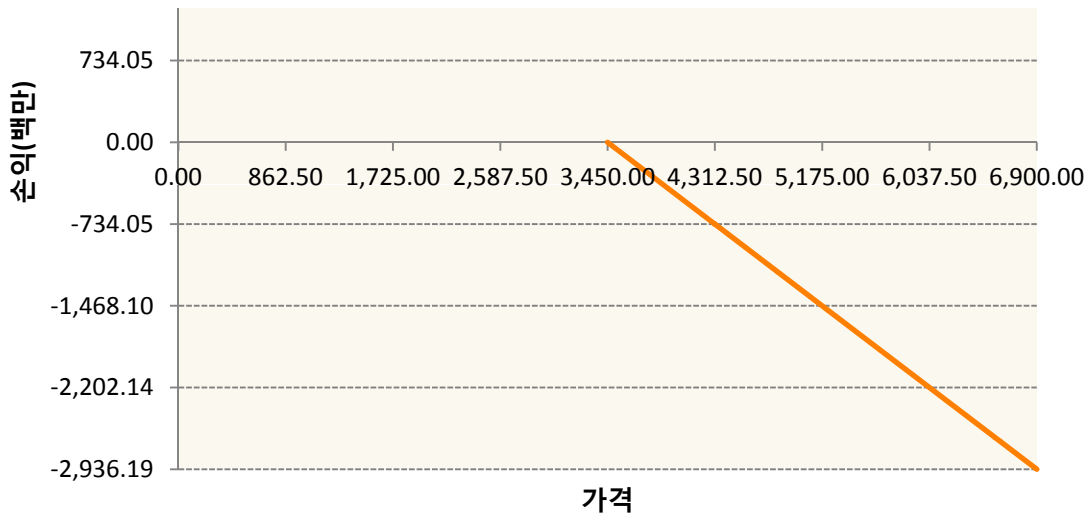
2. 만기시점의 손익구조

OESXV8-C3425-EURO STOXX 50

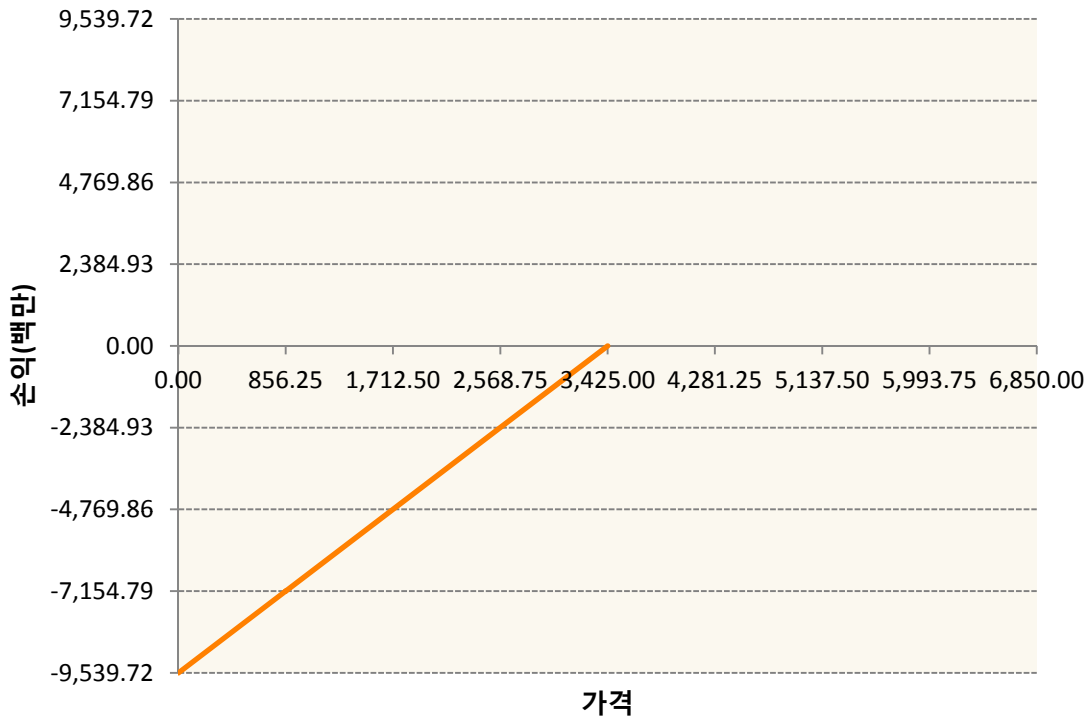


OESXV8-C3450-EURO STOXX 50

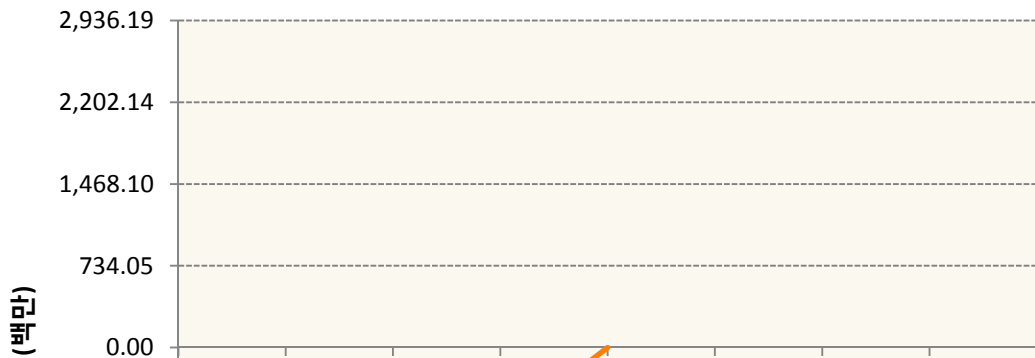


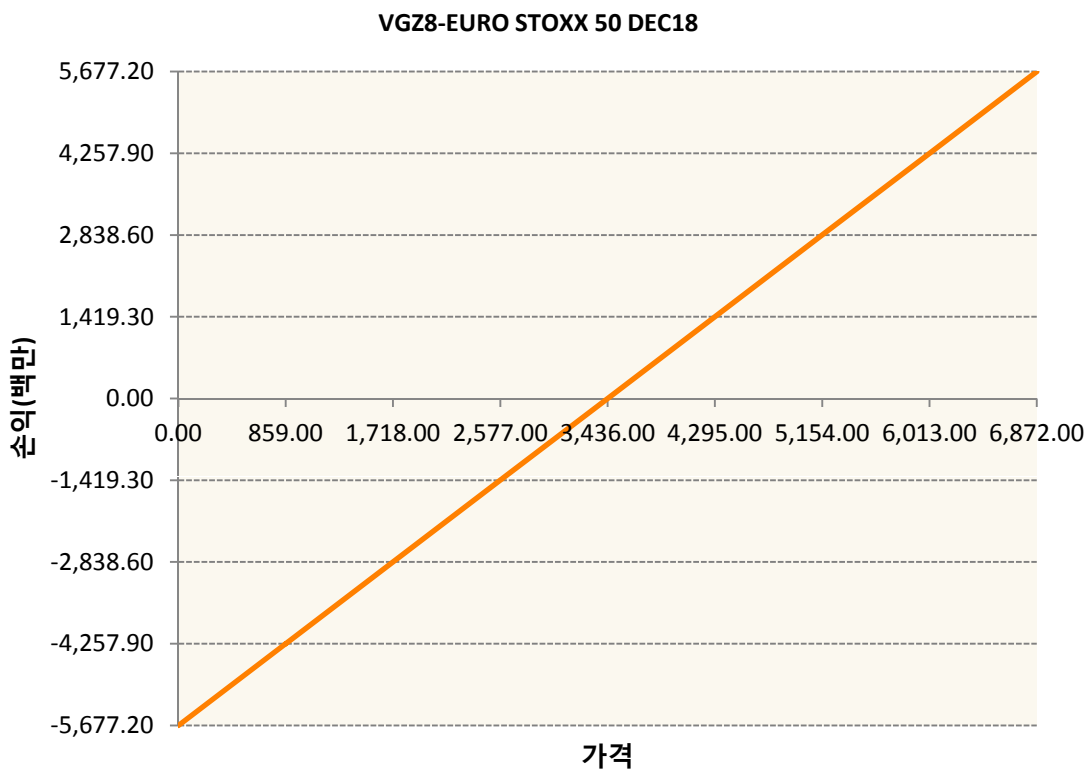
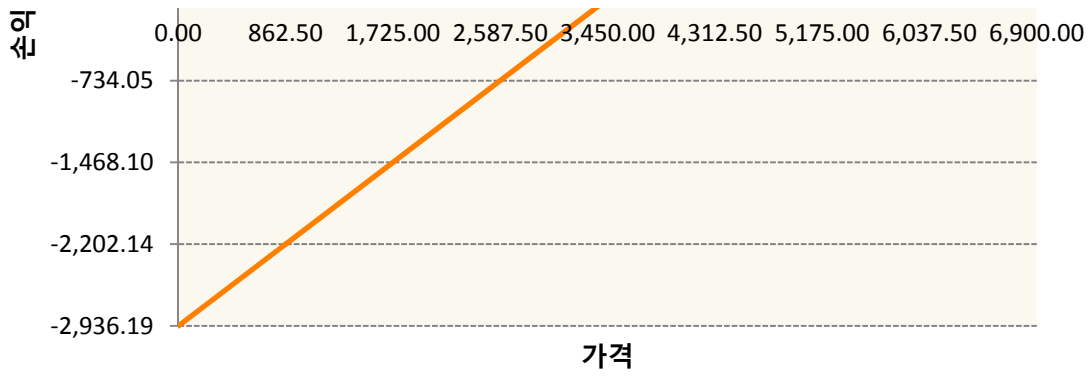


OESXV8-P3425-EURO STOXX 50



OESXV8-P3450-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		28
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		18
OESXV8-C34 EURO STOXX 50		763
OESXV8-C34 EURO STOXX 50		235
OESXV8-P34 EURO STOXX 50		763
OESXV8-P34 EURO STOXX 50		235
VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18		454

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

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

(단위:백만원)

1,156

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)

167

공시일	2018-10-01
기준일	2018-09-28

스마트KRX300인덱스목표전환형1

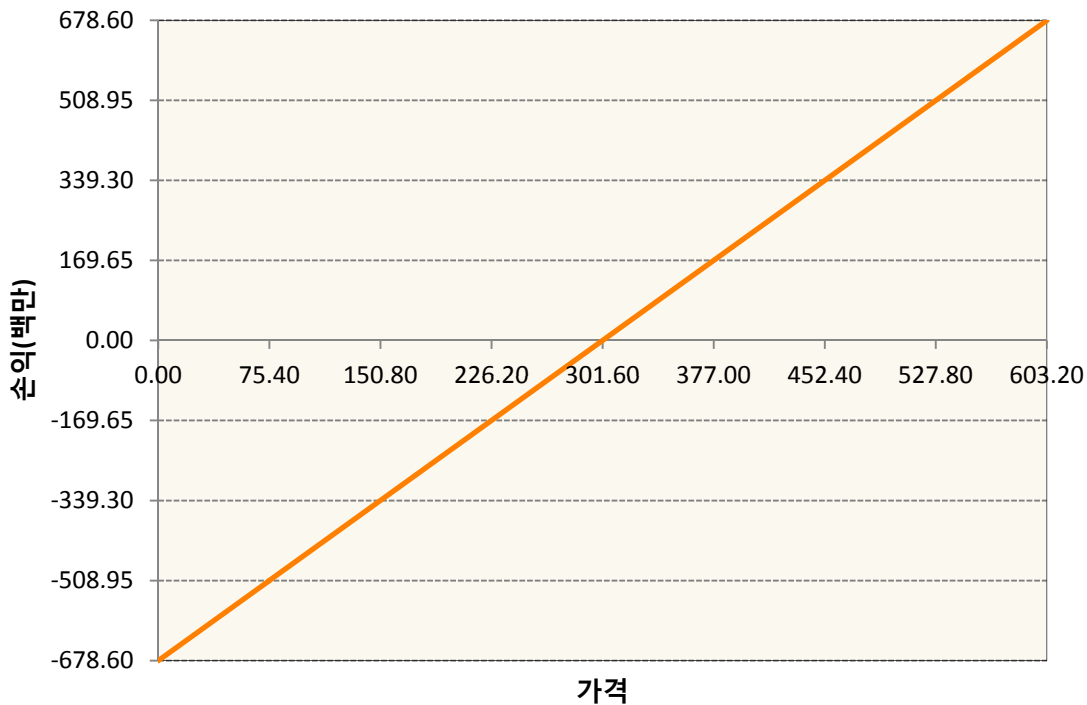
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	679	0	679	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	2018-10-01
기준일	2018-09-28

리디파인K200(주식혼합-파생재간

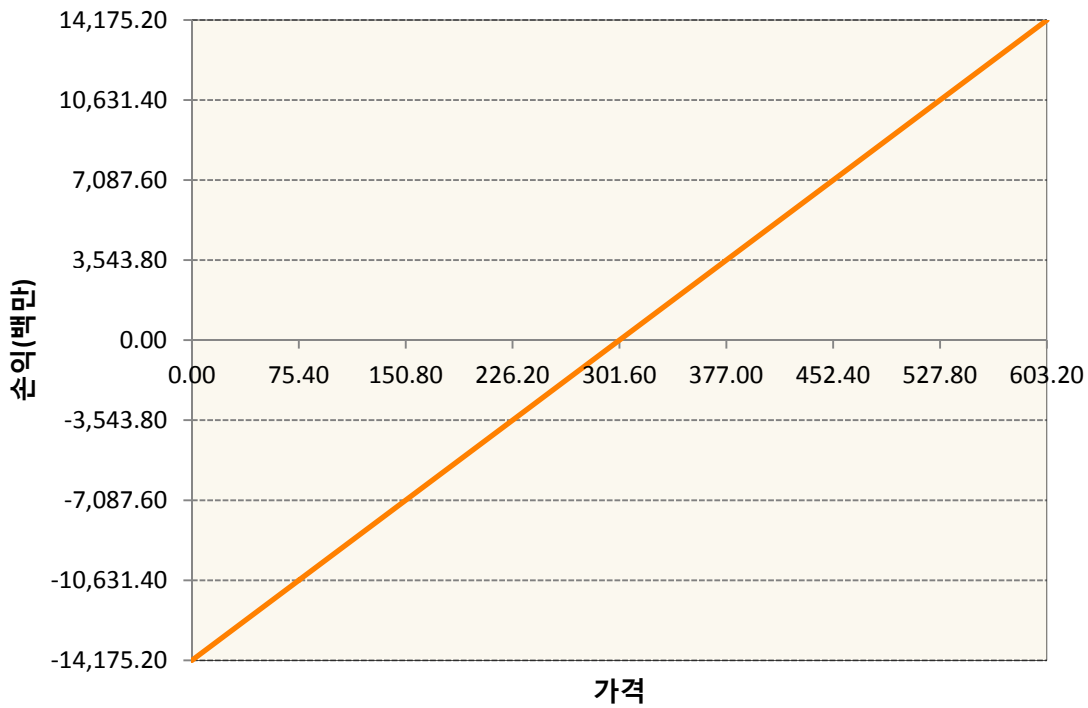
1. 계약금액

(단위:백만원)

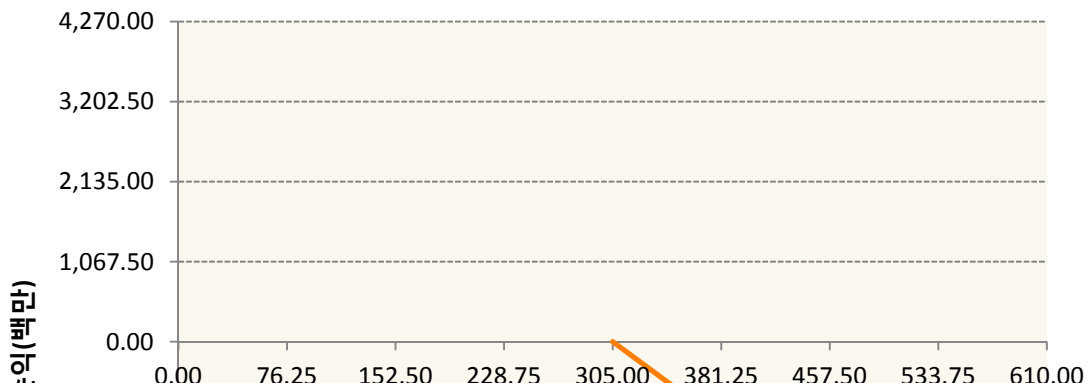
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	227	0	227	장내
신규	유가증권	옵션	0	231	-231	장내
누계	유가증권	선물	14,175	0	14,175	장내
누계	유가증권	옵션	2,119	24,488	-22,369	장내

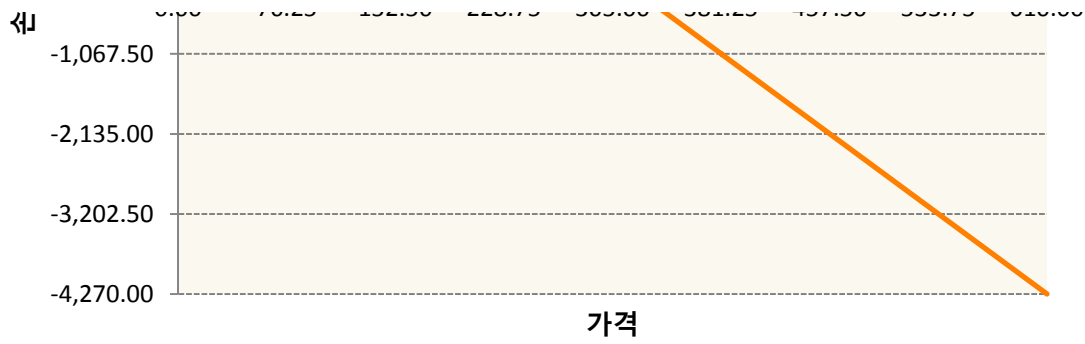
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

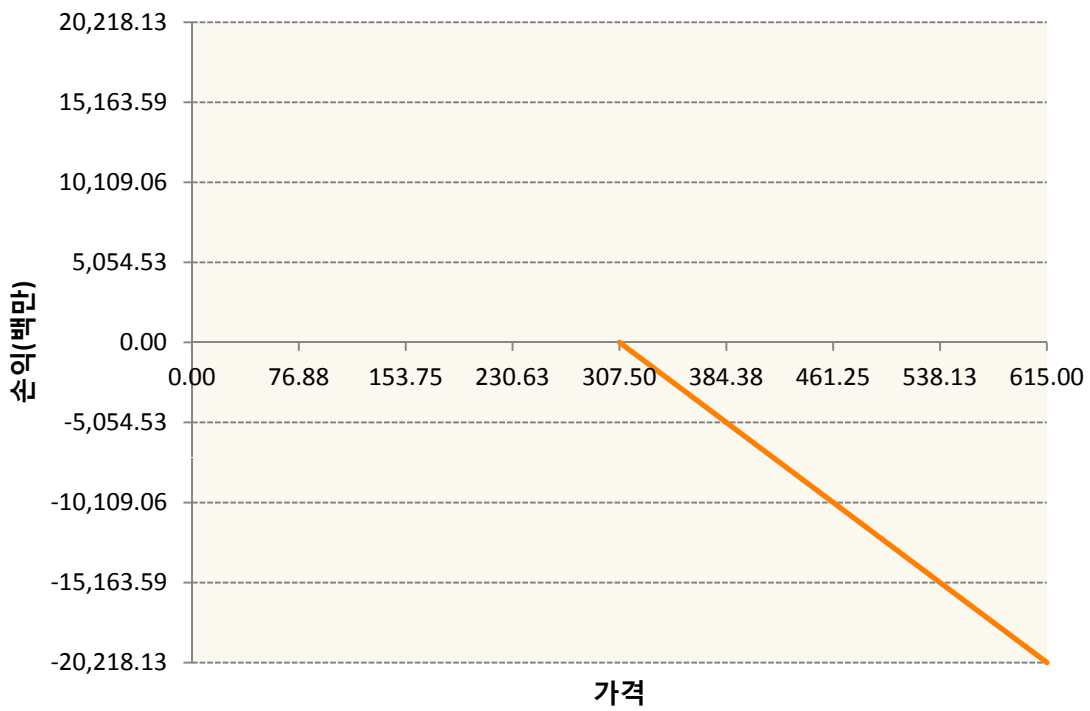


KR4201NA3058-2018-10 콜305

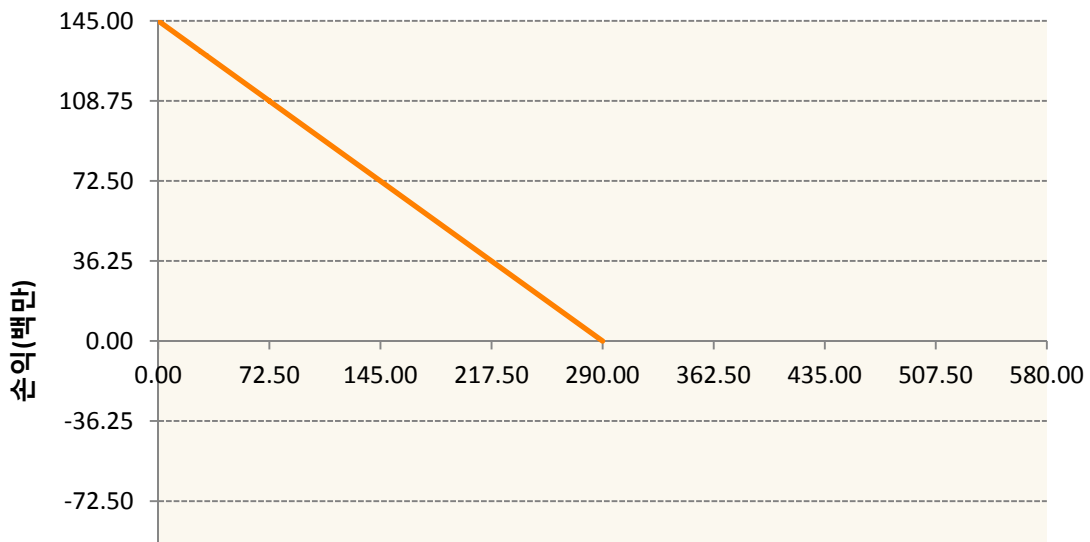


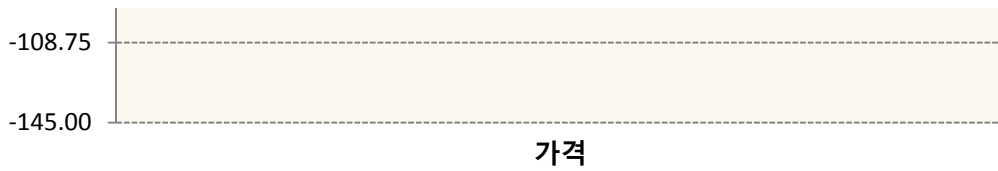


KR4201NA3074-2018-10 콜307.5

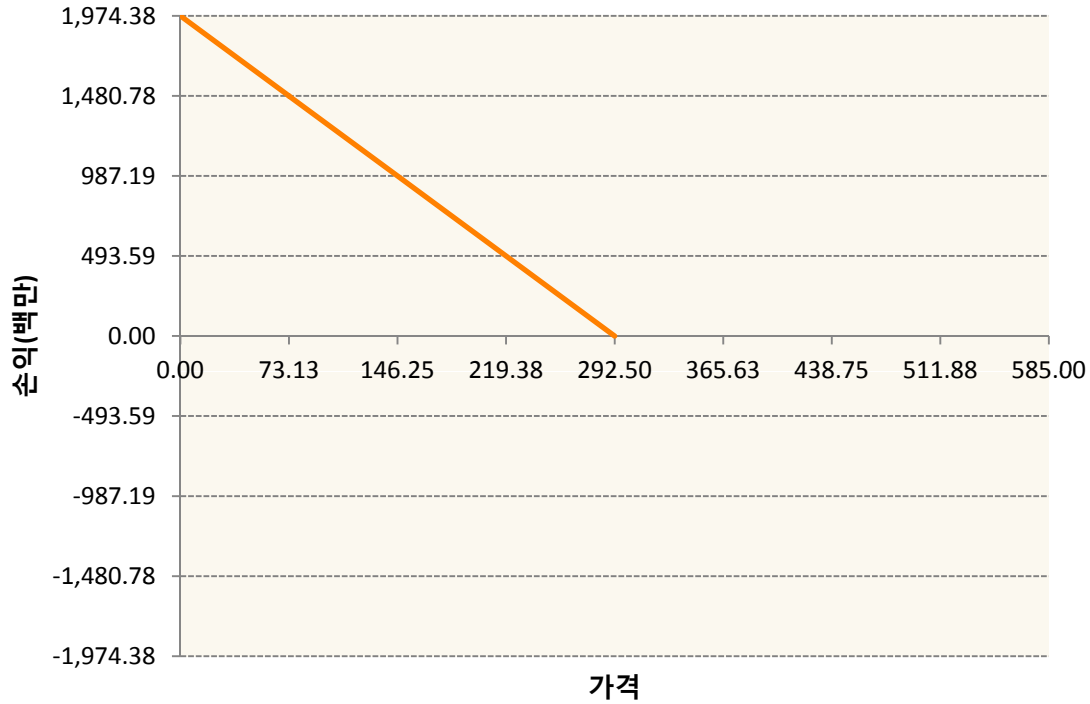


KR4301NA2901-2018-10 풋290





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 1,130

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,130	-1,130	-1,130	-1,130	-1,130	-1,130	-1,130
-5.33%	-753	-753	-753	-753	-753	-753	-753
-2.67%	-377	-377	-377	-377	-377	-377	-377
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	377	377	377	377	377	377	377
5.33%	753	753	753	753	753	753	753
8.00%	1,130	1,130	1,130	1,130	1,130	1,130	1,130

KR4201NA3(2018-10 콜305) 240

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	57	57	56	55	54	53	51
-5.33%	55	54	52	49	46	43	40
-2.67%	47	43	38	33	28	23	17

0%	20	13	7	0	-7	-14	-21
2.67%	-35	-42	-49	-56	-63	-70	-77
5.33%	-118	-123	-128	-133	-139	-145	-151
8.00%	-220	-222	-225	-228	-231	-235	-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%	211	211	209	206	202	196	190
-5.33%	207	202	195	186	176	163	149
-2.67%	180	165	148	129	108	86	62
0%	87	59	30	0	-30	-61	-92
2.67%	-127	-161	-194	-228	-262	-296	-329
5.33%	-480	-506	-533	-562	-591	-621	-652
8.00%	-934	-948	-965	-983	-1,004	-1,026	-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	0	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

106

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	106	106	106	106	106	106	106
-5.33%	53	53	53	54	55	55	56
-2.67%	11	12	13	15	16	18	19
0%	-1	-1	-1	0	1	1	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

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

(단위:백만원)

2,102

공시일	2018-10-01
기준일	2018-09-28

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

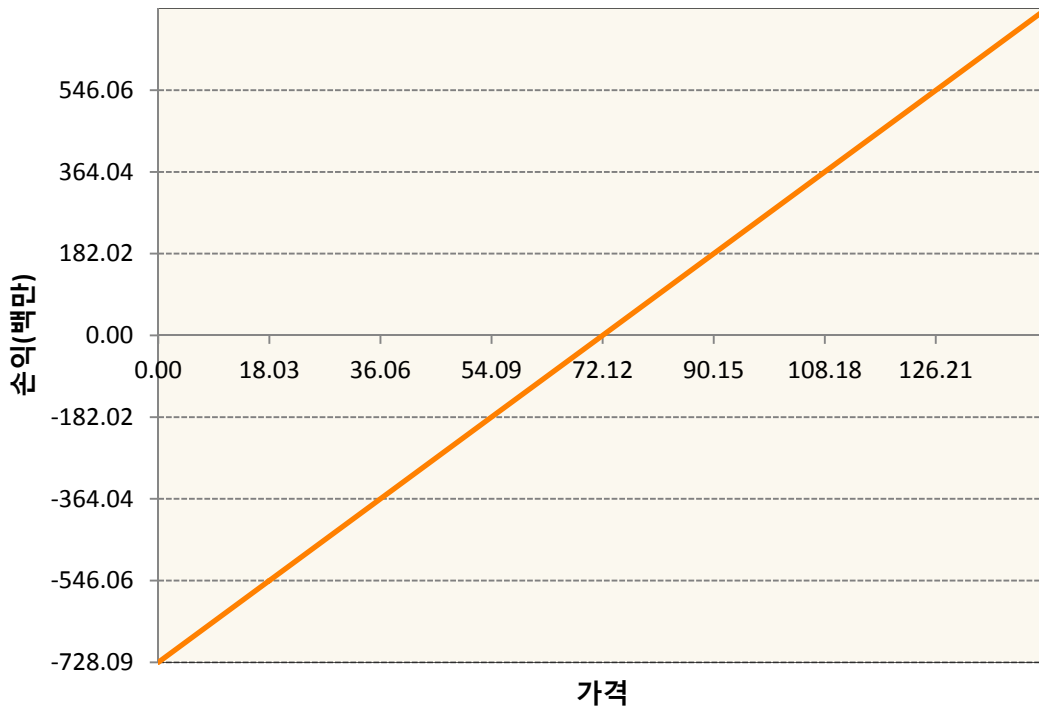
1. 계약금액

(단위:백만원)

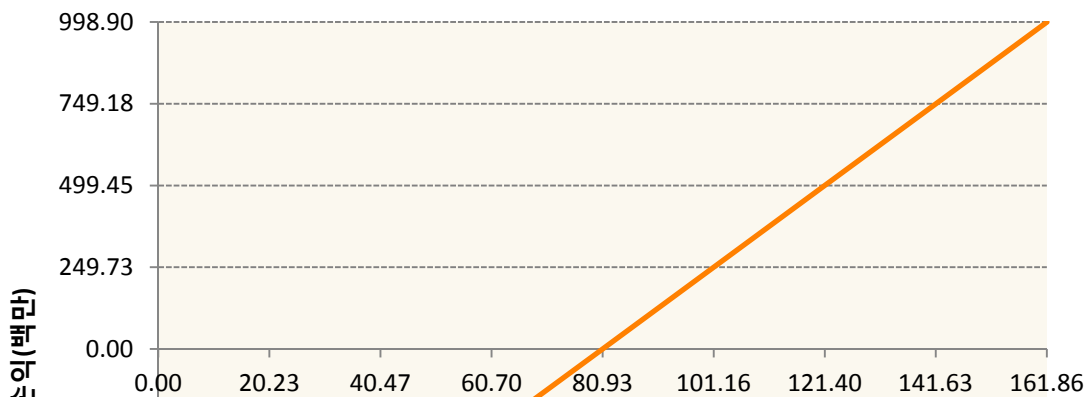
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,209	610	2,599	
누계	유가증권	선물	548	0	548	장내

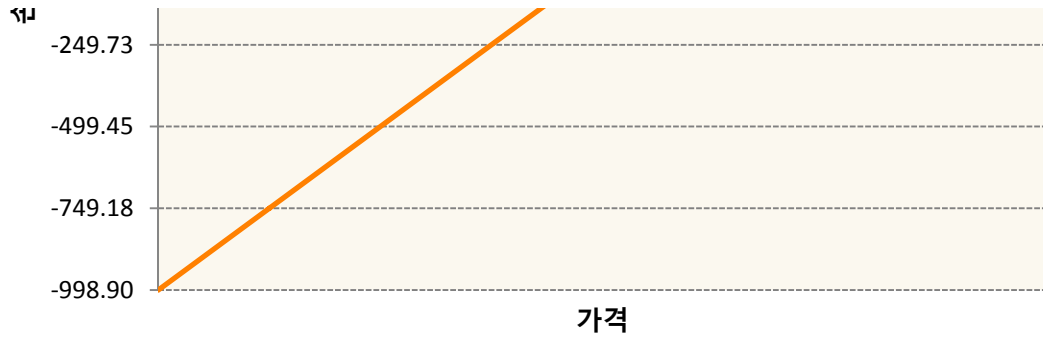
2. 만기시점의 손익구조

CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18

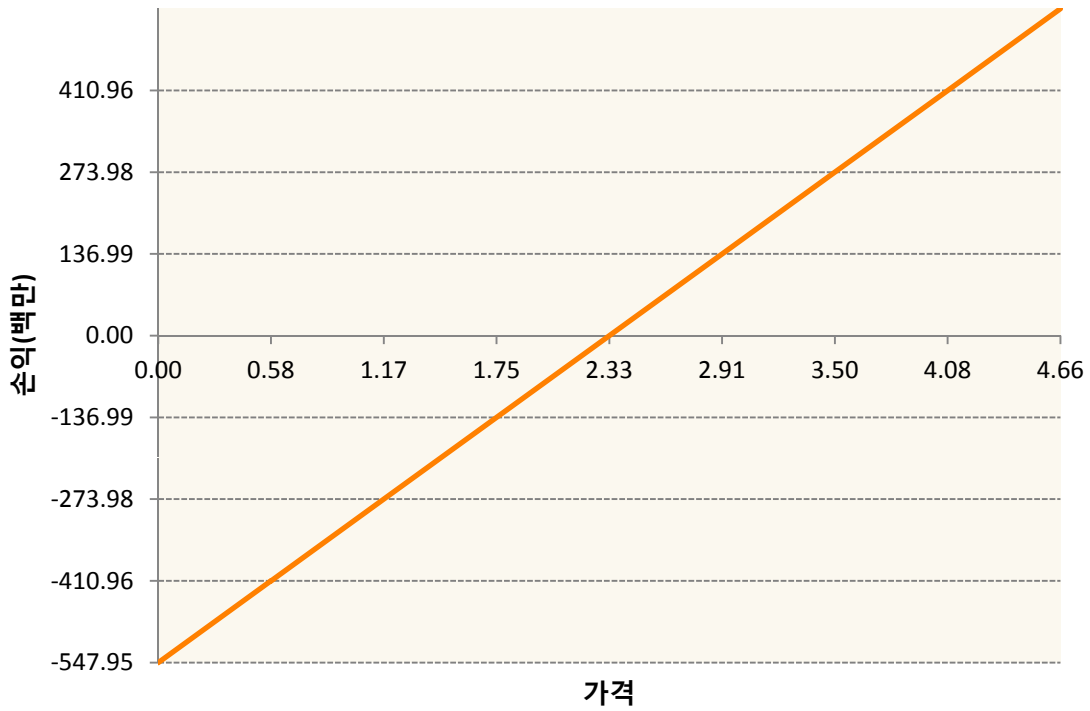


COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19

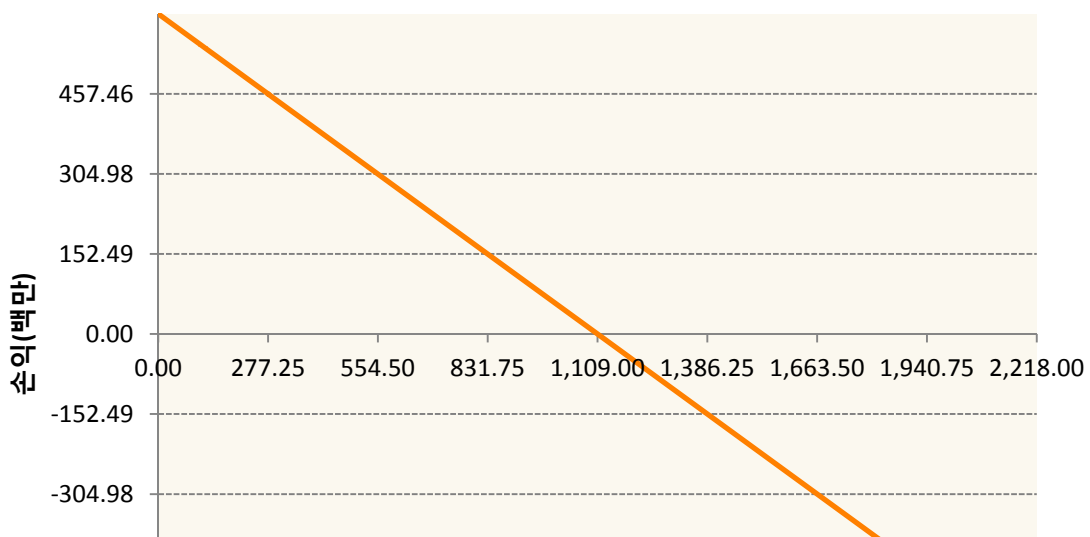


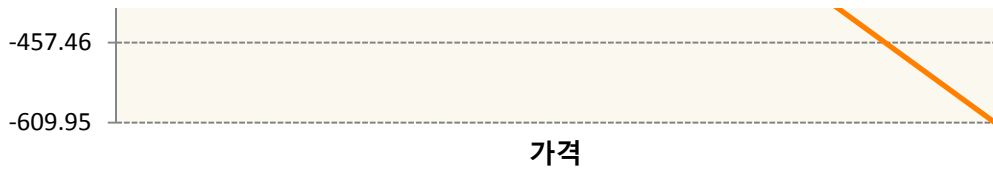


HOX8-Heating Oil

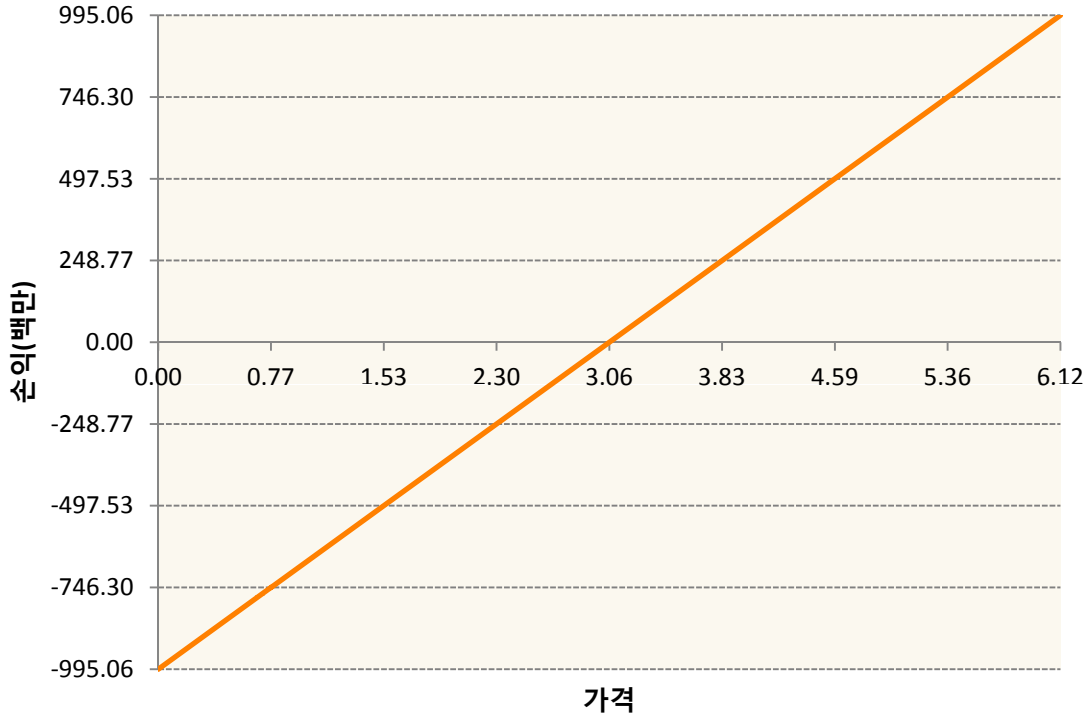


KR4175NA0007-2018-10 달러선물

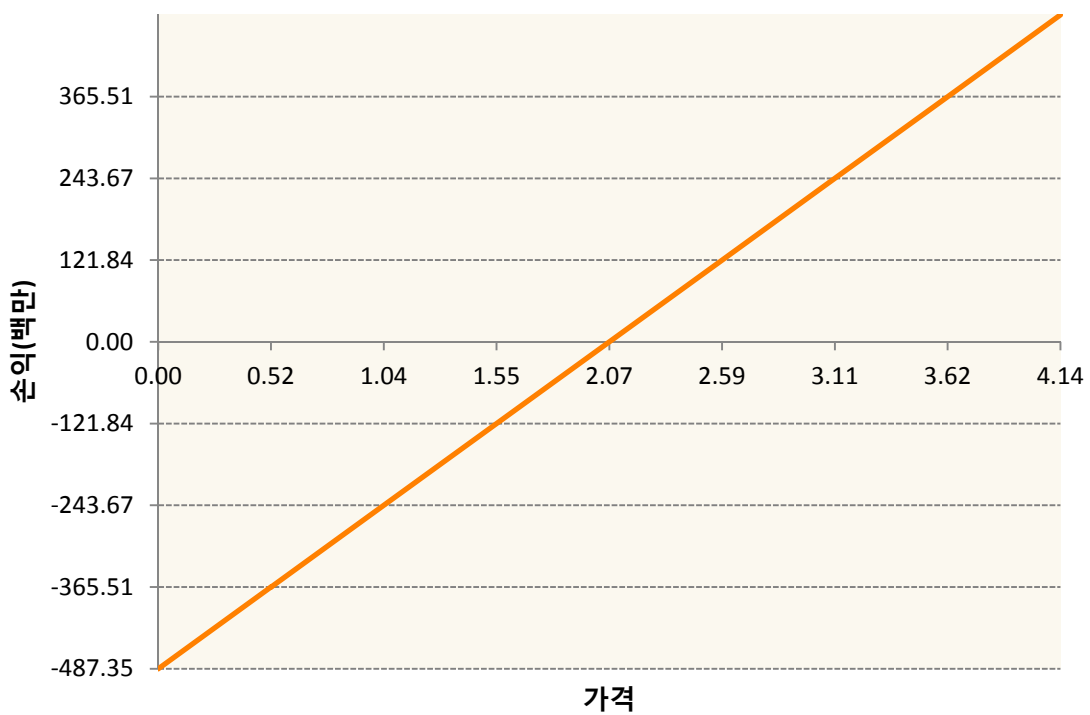




NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18



XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	58
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	80
HOX8	Heating Oil	44
	KR4175NA0(2018-10 달러선물	49
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	80
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	39

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	449

공시일	2018-10-01
기준일	2018-09-28

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

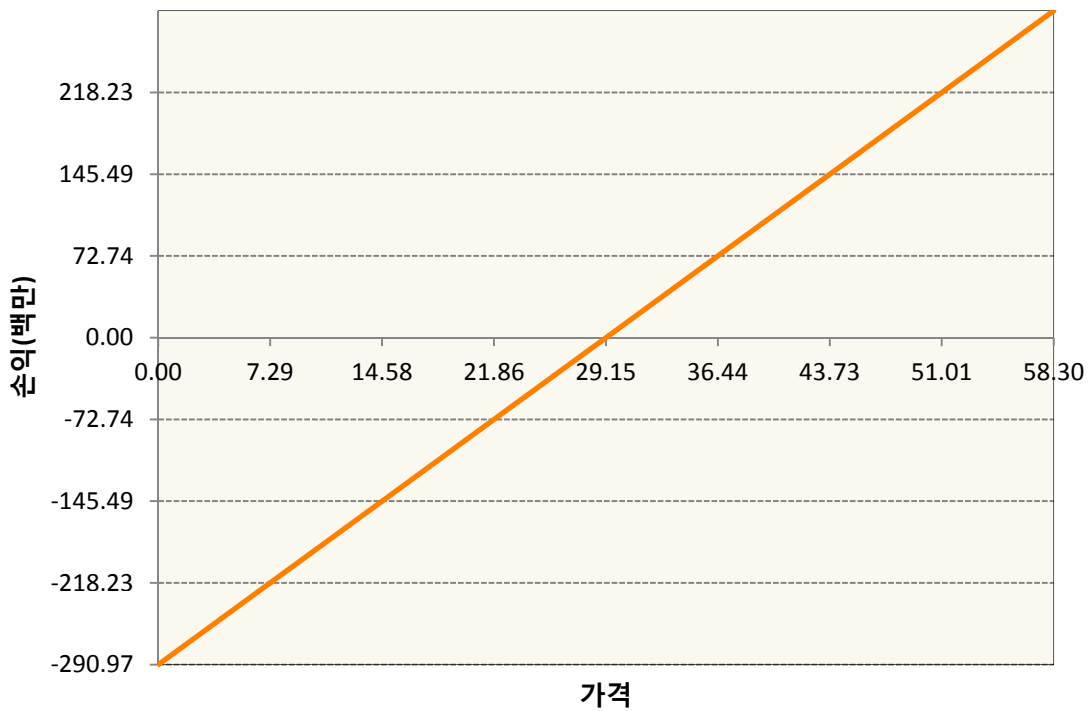
1. 계약금액

(단위:백만원)

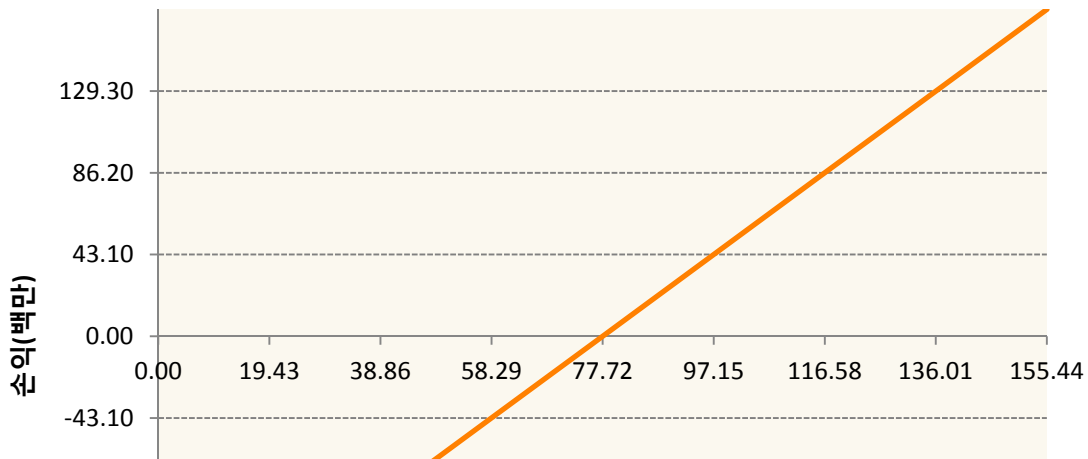
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,548	78	3,470	

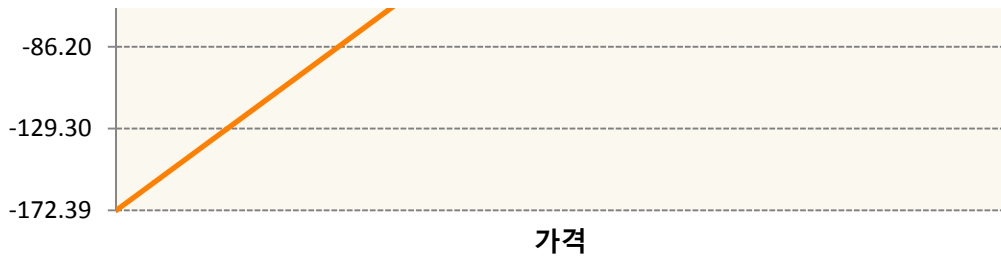
2. 만기시점의 손익구조

BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18

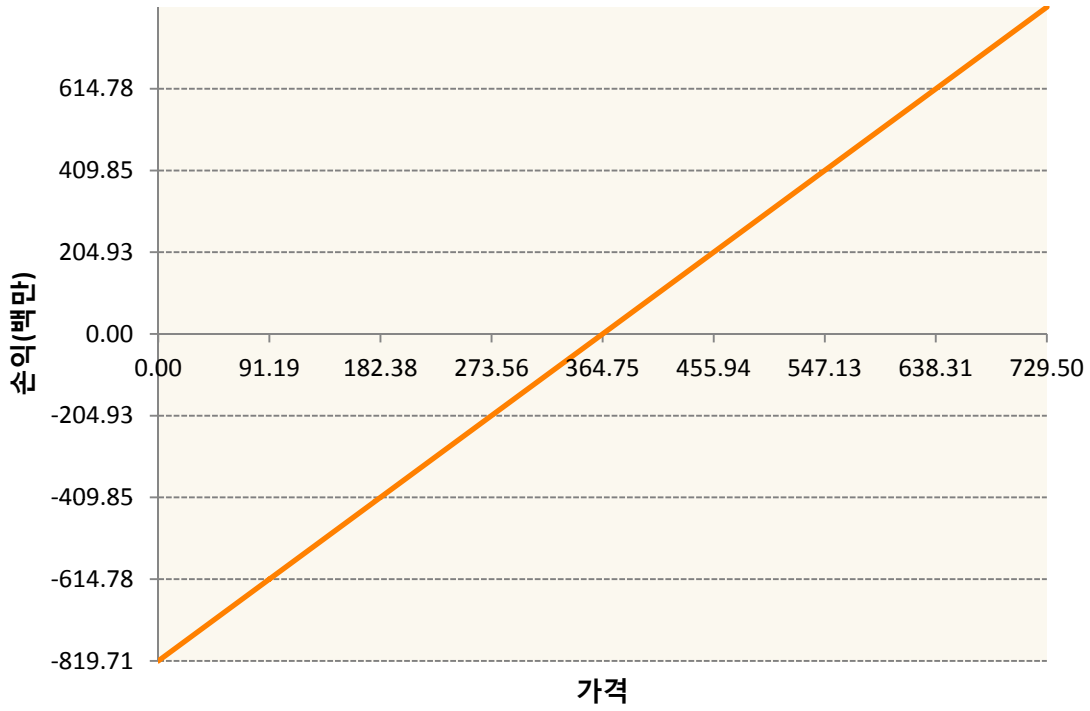


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

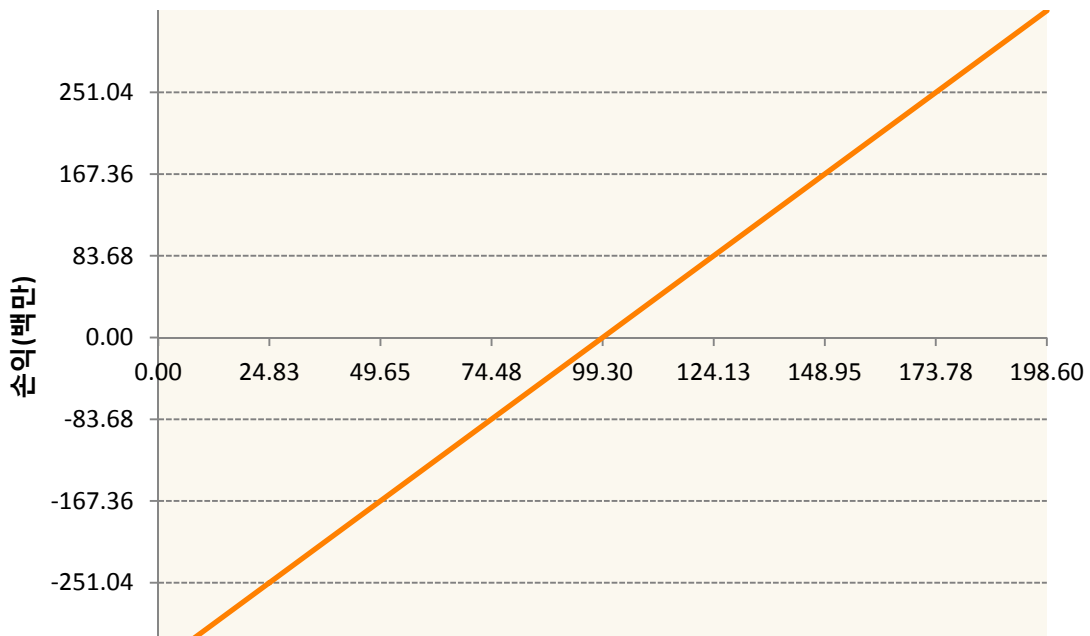


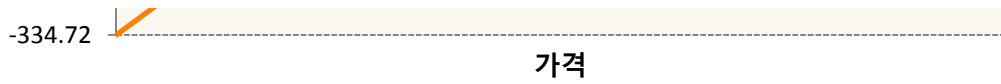


CZ8-CORN FUTURE DEC18

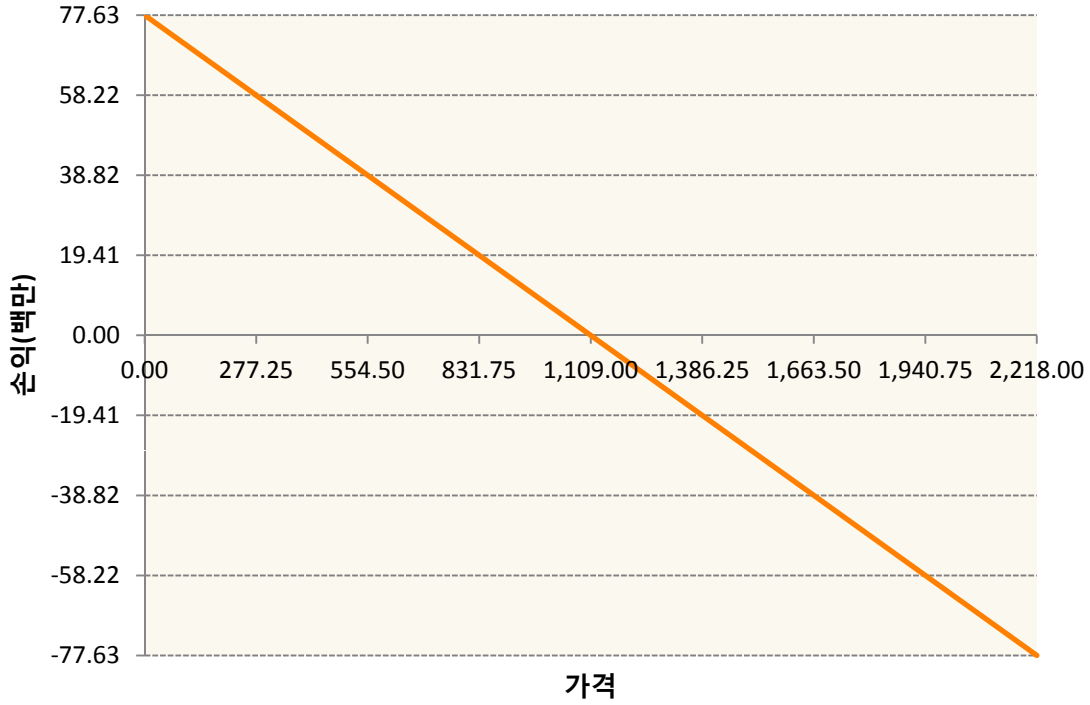


KCZ8-COFFEE 'C' FUTURE Dec18

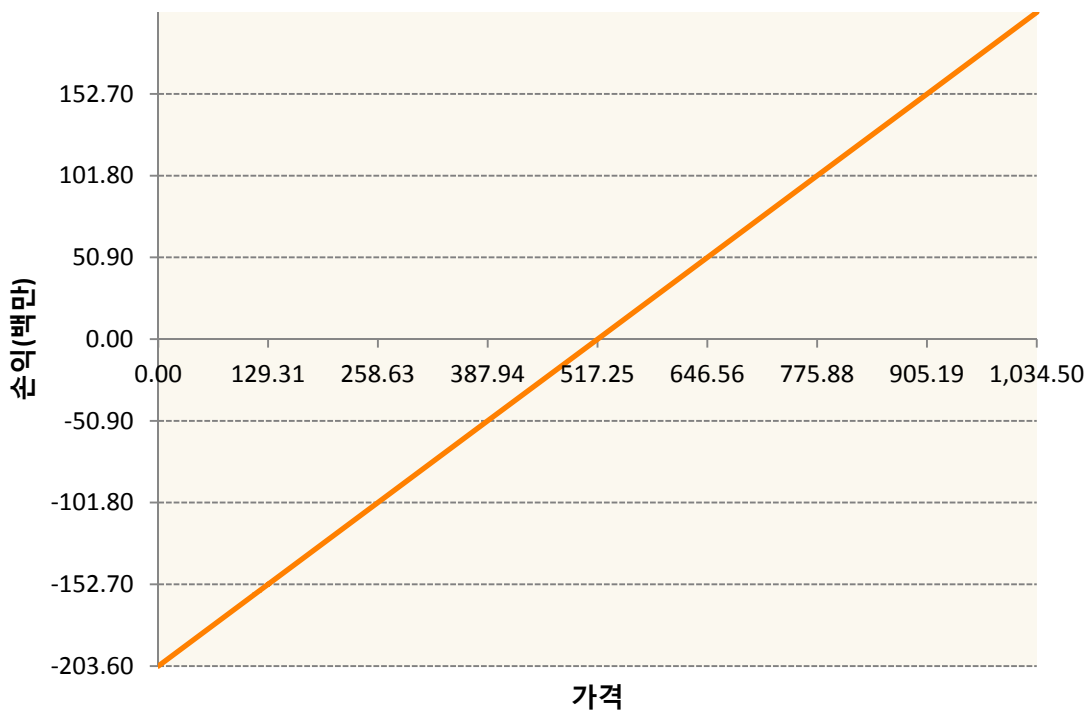




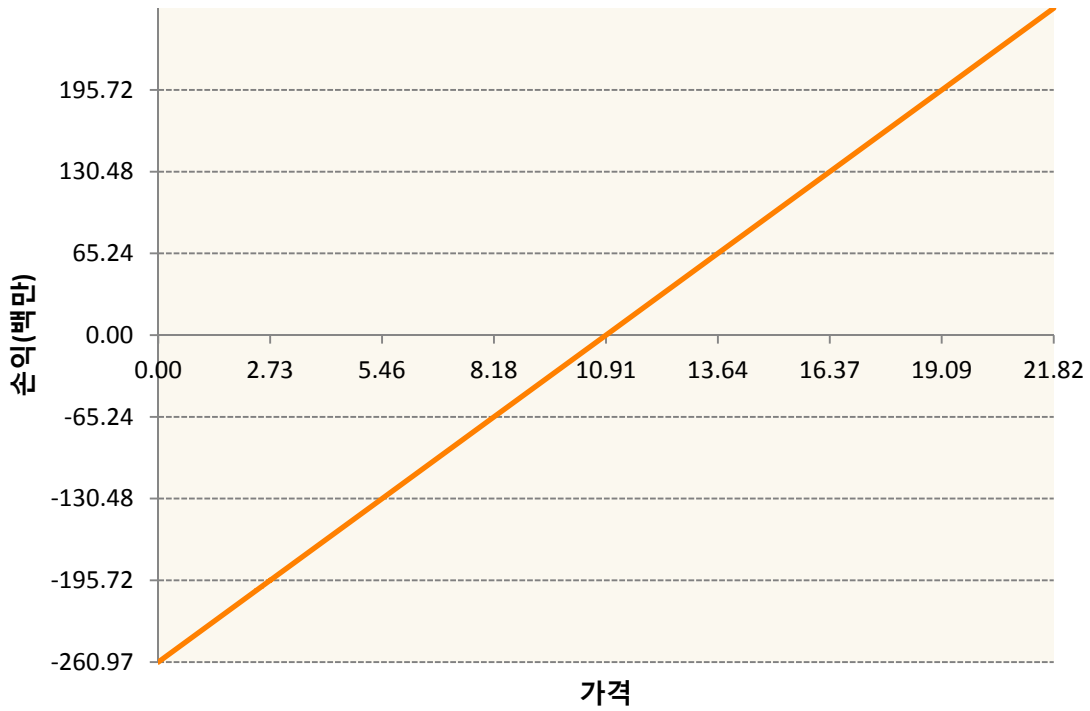
KR4175NA0007-2018-10 달러선물



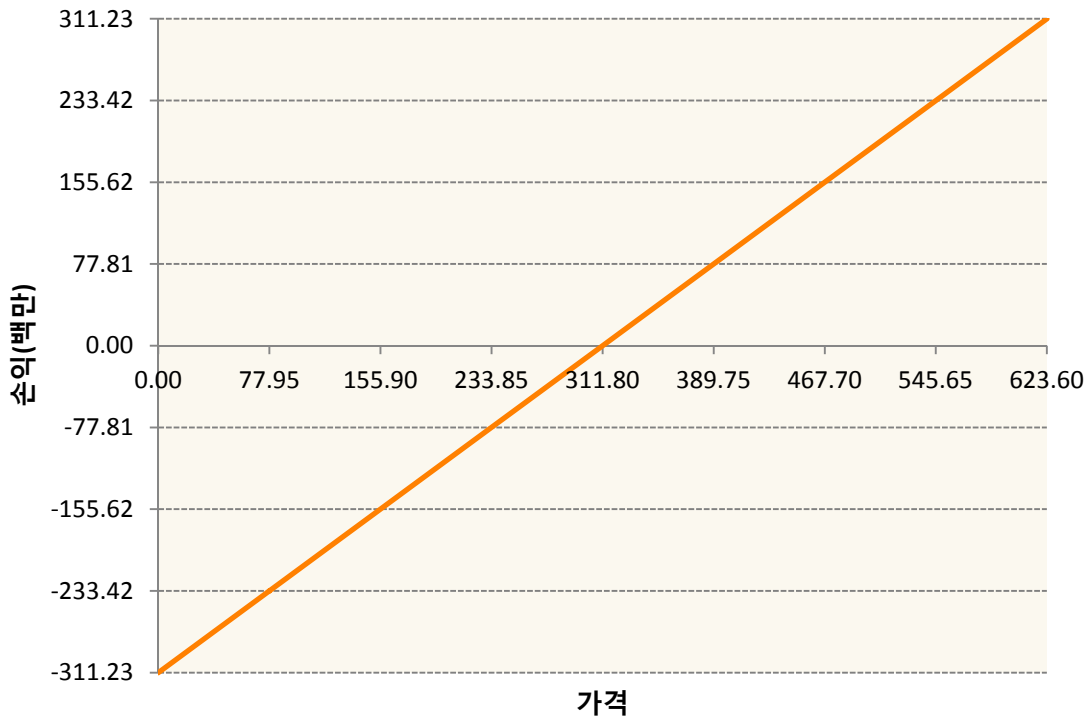
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

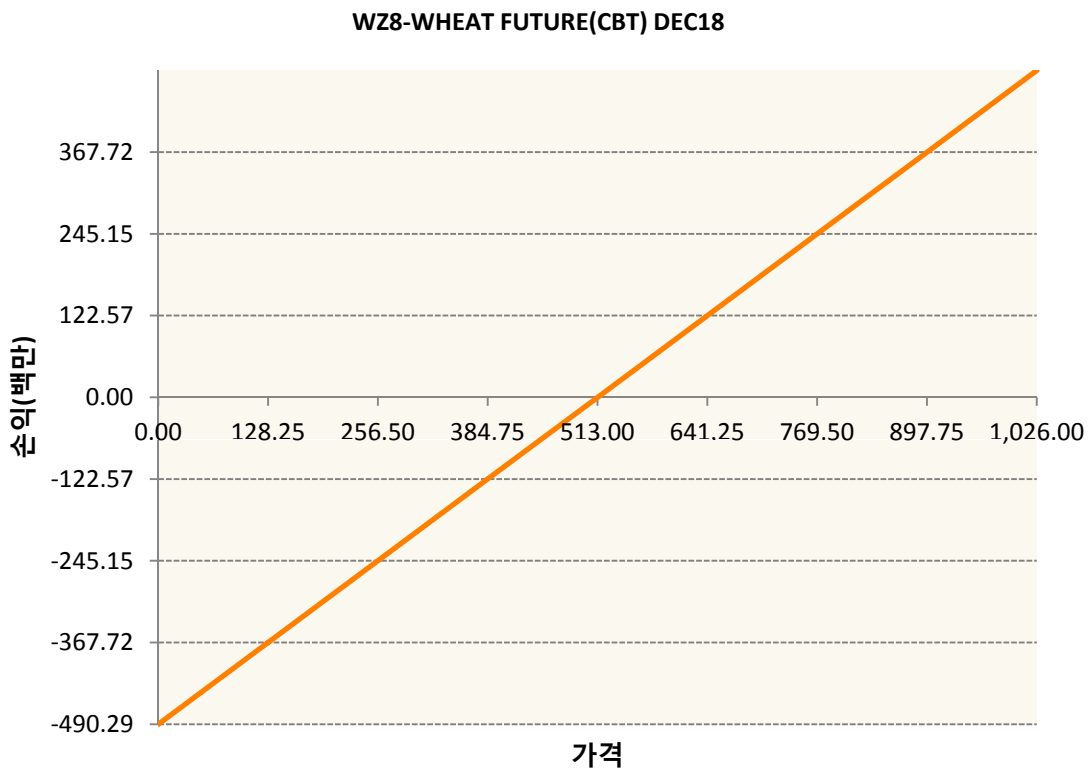
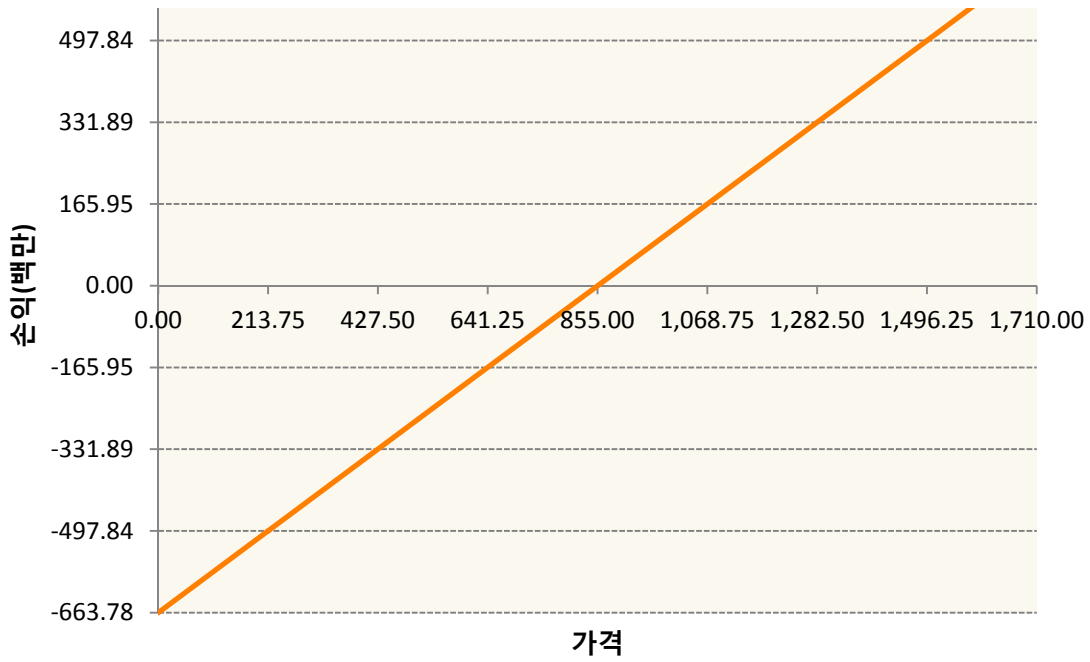


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	23
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	14
CZ8	CORN FUTURE DEC18	66
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	27
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	39

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

(단위:백만원)

308