

공시일	2018-10-02
기준일	2018-10-01

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	2018-10-02
기준일	2018-10-01

스마트인덱스모

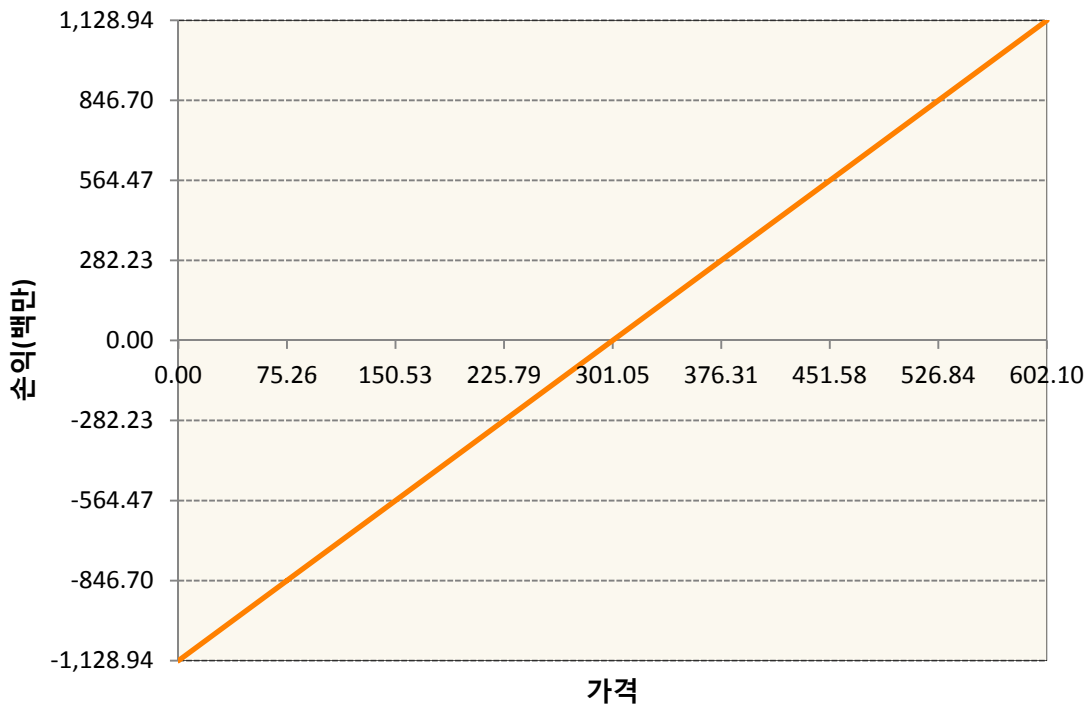
1. 계약금액

(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	2018-10-02
기준일	2018-10-01

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

1,161

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

492

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-02
기준일	2018-10-01

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

293

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

375

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-02
기준일	2018-10-01

유로인덱스모(주식-파생형)

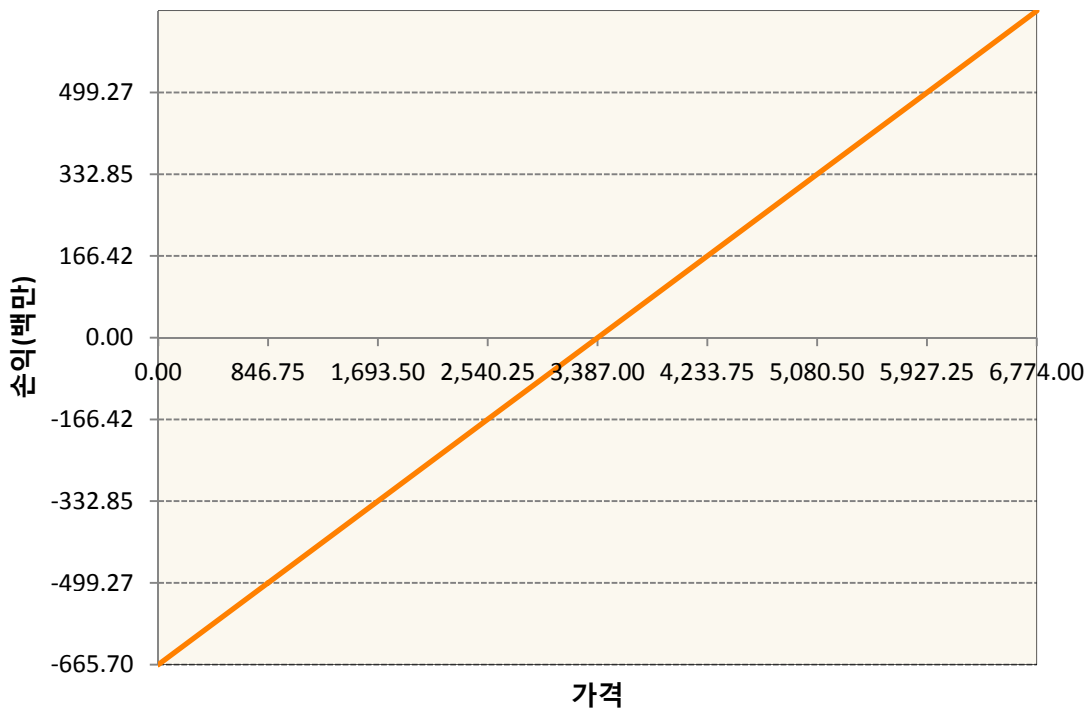
1. 계약금액

(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)

32

공시일	2018-10-02
기준일	2018-10-01

차이나인덱스모(주식-파생형)

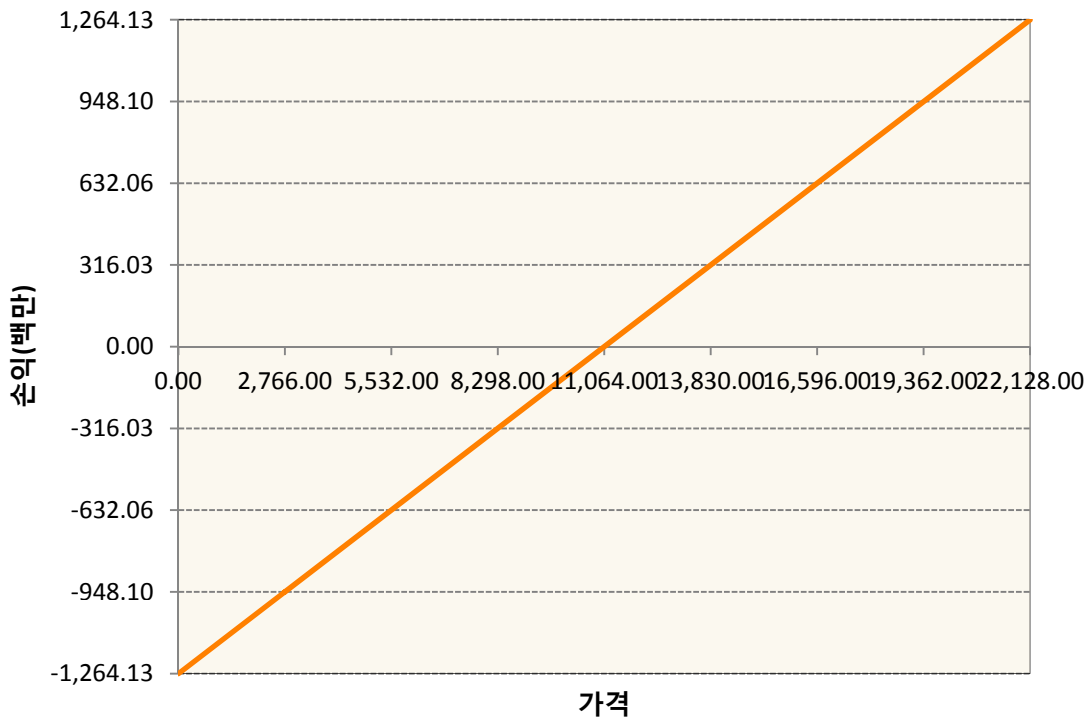
1. 계약금액

(단위:백만원)

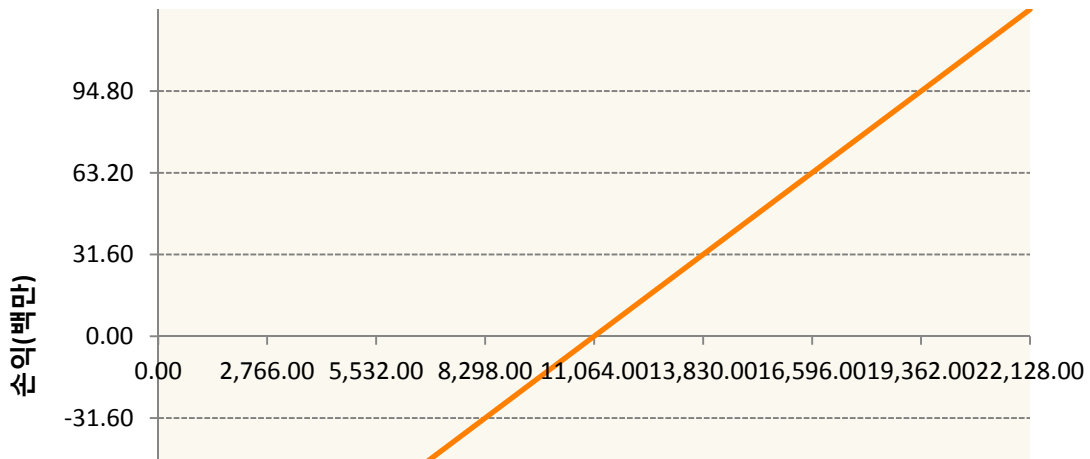
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,391	0	1,391	장내

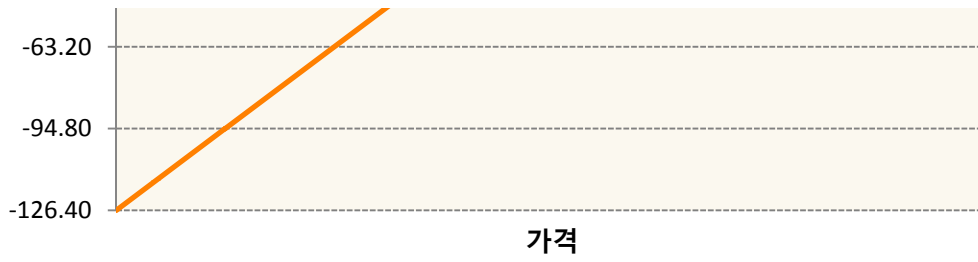
2. 만기시점의 손익구조

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	2018-10-02
기준일	2018-10-01

커버드콜모(주식혼합-파생형)

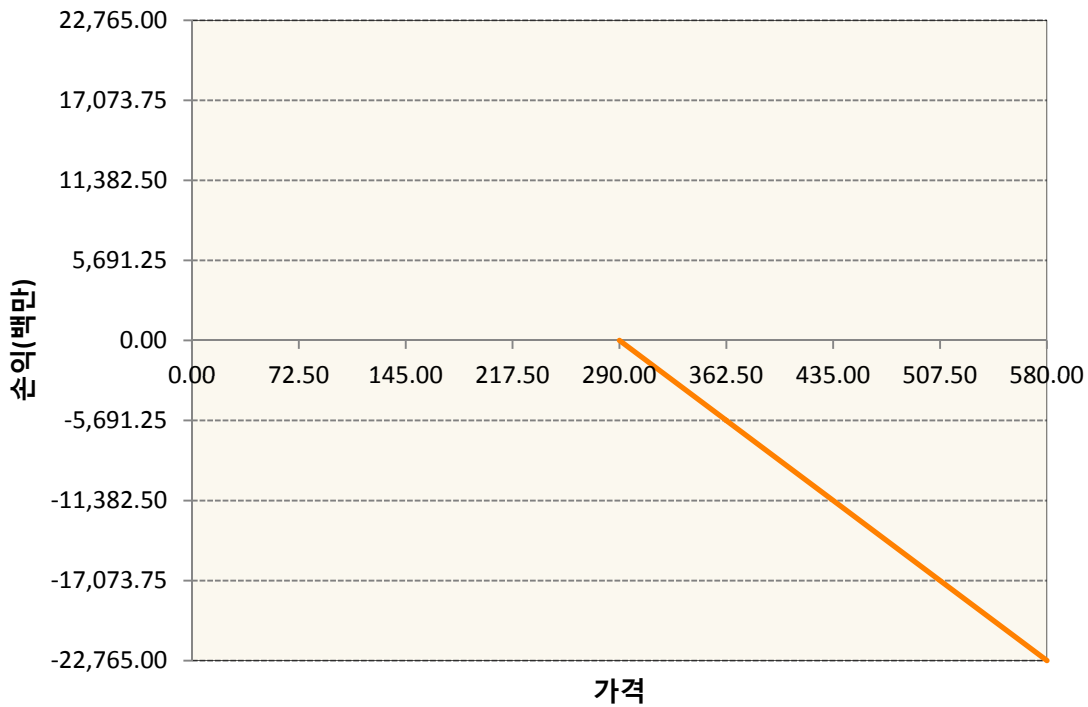
1. 계약금액

(단위:백만원)

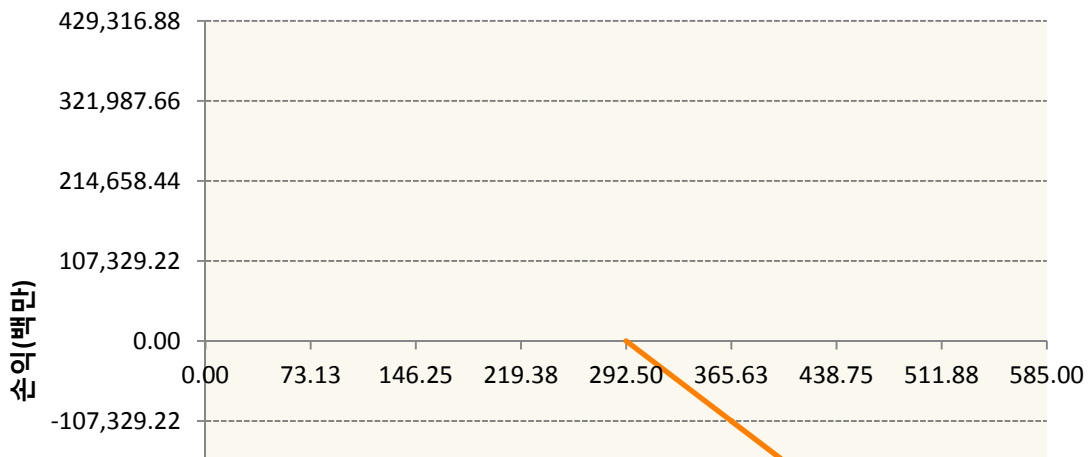
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	727,032	-727,032	장내

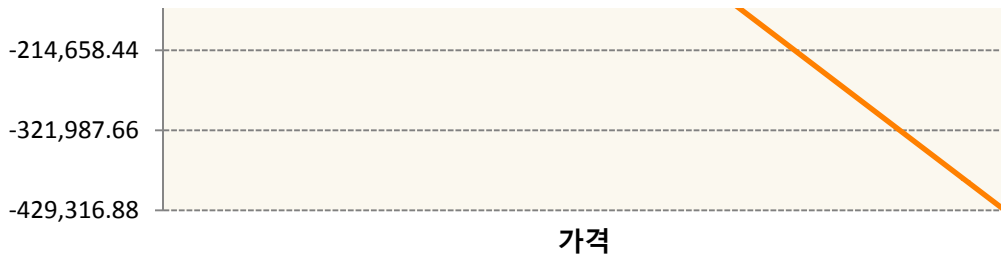
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NA2902-2018-10 콜290

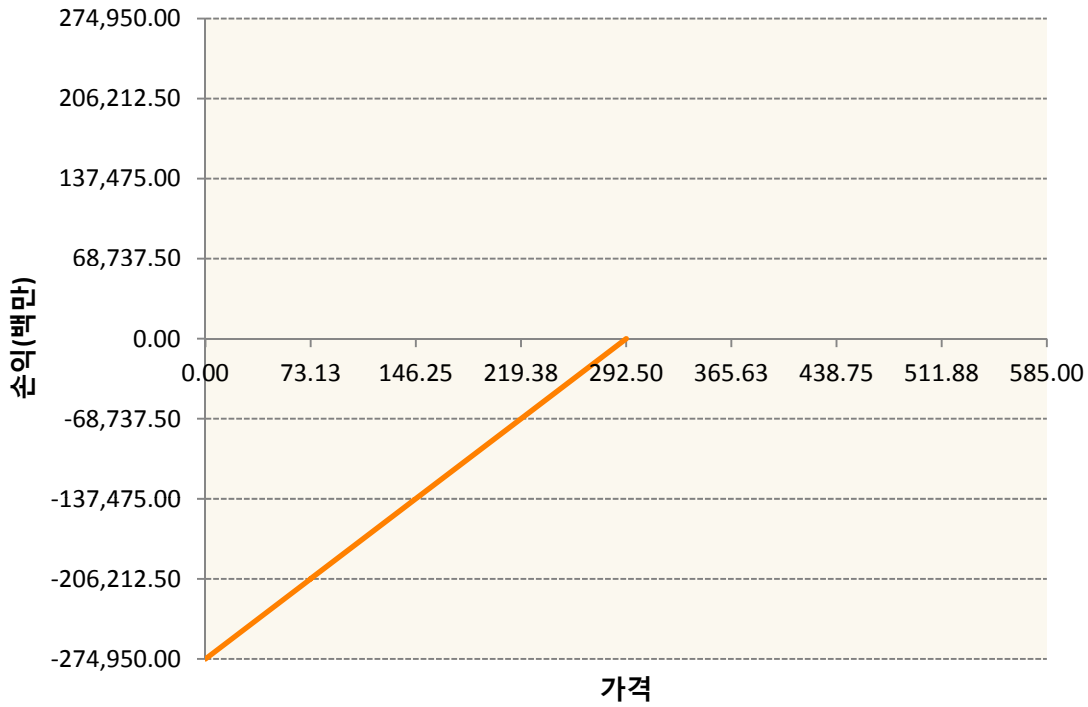


KR4201NA2928-2018-10 콜292.5





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NA2927-2018-10 콜290

1,768

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	902	889	875	858	840	820	798
-5.33%	802	774	745	716	686	655	625
-2.67%	531	498	465	432	399	366	333
0%	68	47	24	0	-26	-52	-80
2.67%	-511	-519	-529	-541	-555	-572	-589
5.33%	-1,130	-1,132	-1,135	-1,139	-1,145	-1,153	-1,162
8.00%	-1,757	-1,757	-1,758	-1,759	-1,761	-1,764	-1,768

KR4201NA2927-2018-10 풋292.5

32,221

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	14,317	14,160	13,959	13,717	13,438	13,126	12,784

-5.33%	13,076	12,637	12,169	11,679	11,170	10,647	10,113	
-2.67%	9,135	8,506	7,878	7,249	6,621	5,992	5,363	
0%	1,522	1,038	528	0	-544	-1,100	-1,667	
2.67%	-8,792	-9,004	-9,263	-9,564	-9,903	-10,274	-10,674	
5.33%	-20,224	-20,279	-20,364	-20,485	-20,641	-20,832	-21,057	
8.00%	-31,924	-31,932	-31,952	-31,986	-32,041	-32,118	-32,221	
KR4301NA29 2018-10 풋292.5							15,177	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-15,163	-15,163	-15,163	-15,164	-15,167	-15,171	-15,177	
-5.33%	-7,670	-7,695	-7,731	-7,777	-7,833	-7,899	-7,973	
-2.67%	-1,506	-1,677	-1,848	-2,018	-2,189	-2,360	-2,531	
0%	149	111	61	0	-72	-154	-244	
2.67%	200	199	198	196	191	182	170	
5.33%	200	200	200	200	200	200	199	
8.00%	200	200	200	200	200	200	200	

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

(단위:백만원)

49,430

공시일	2018-10-02
기준일	2018-10-01

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

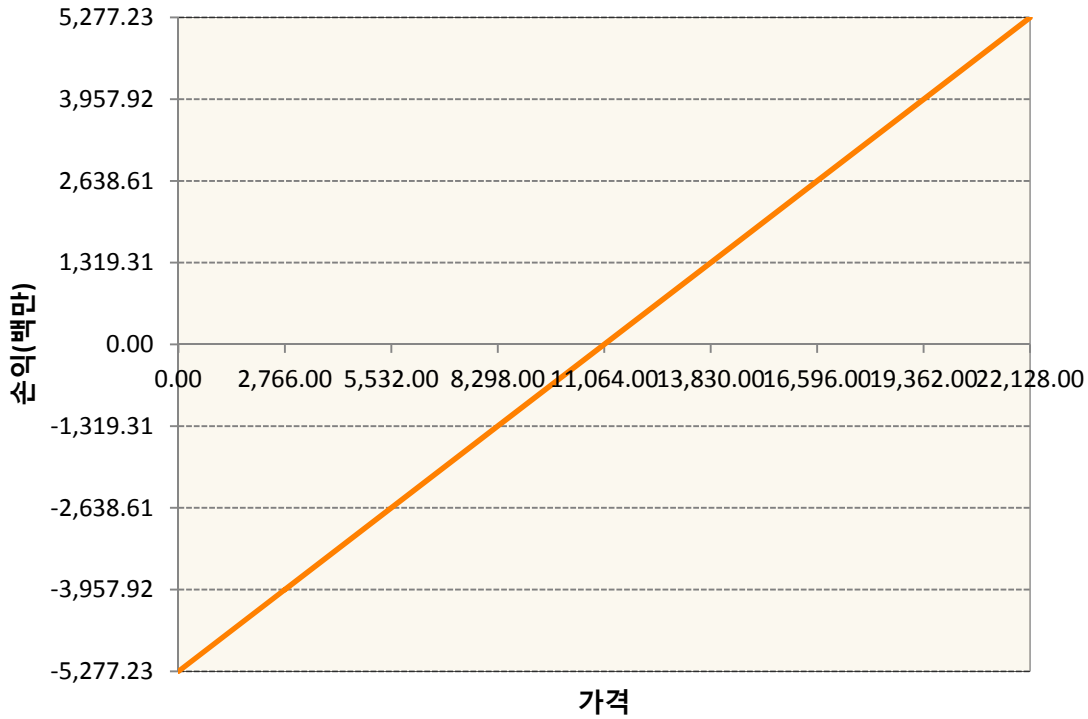
1. 계약금액

(단위:백만원)

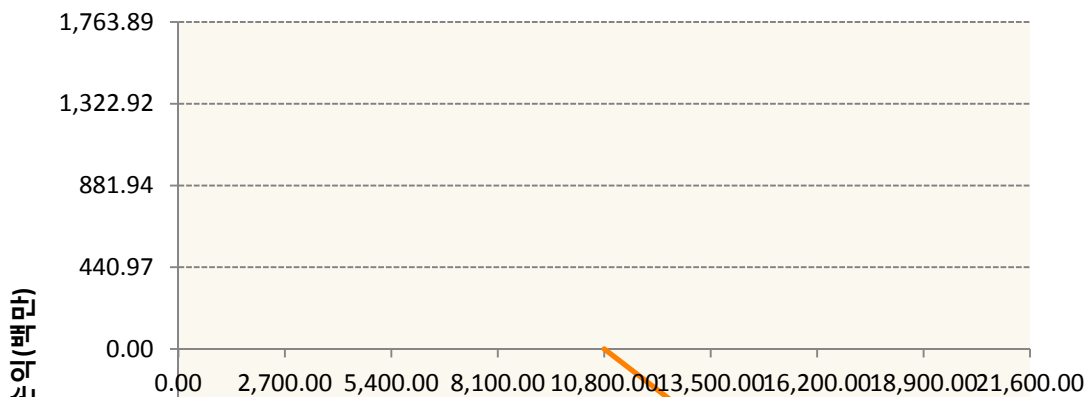
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,277	0	5,277	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,651	-11,651	장내

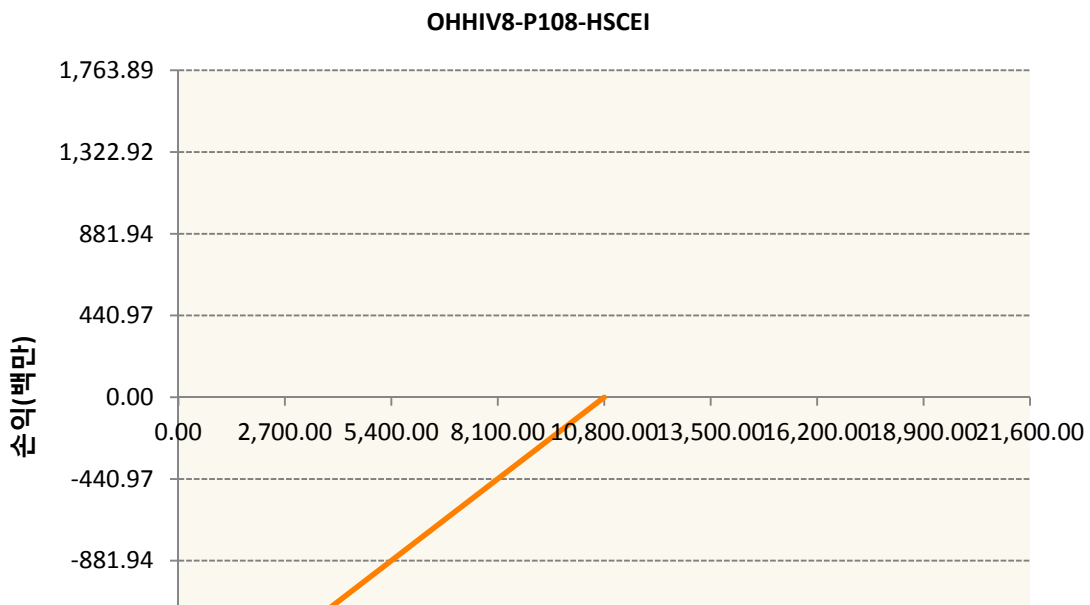
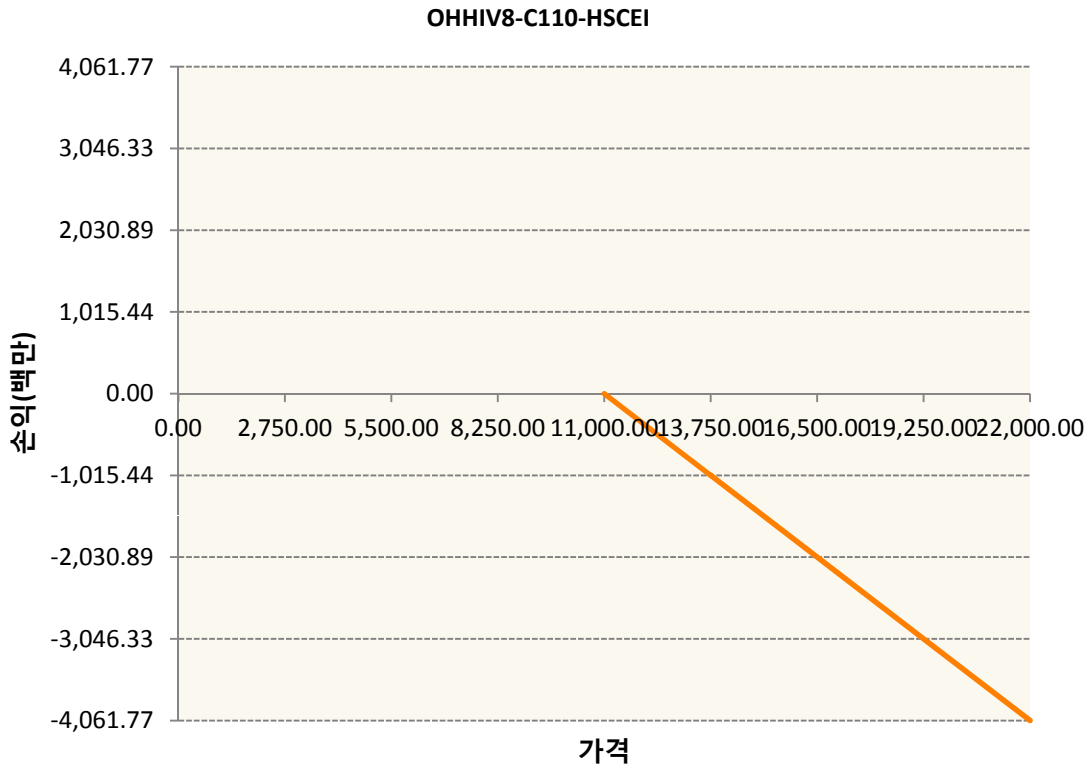
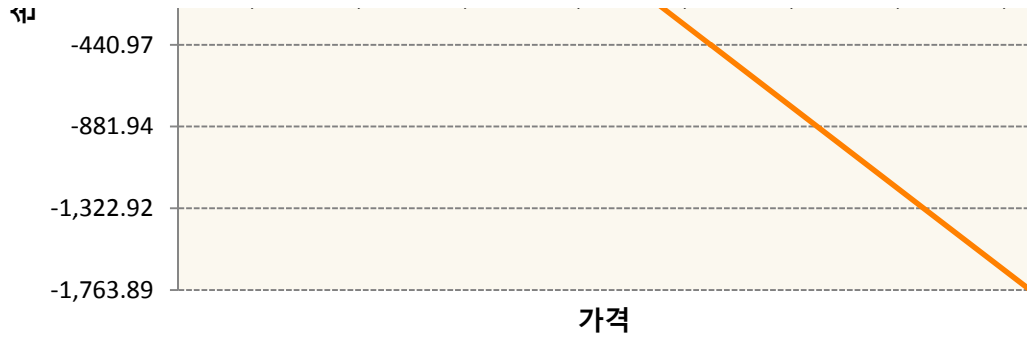
2. 만기시점의 손익구조

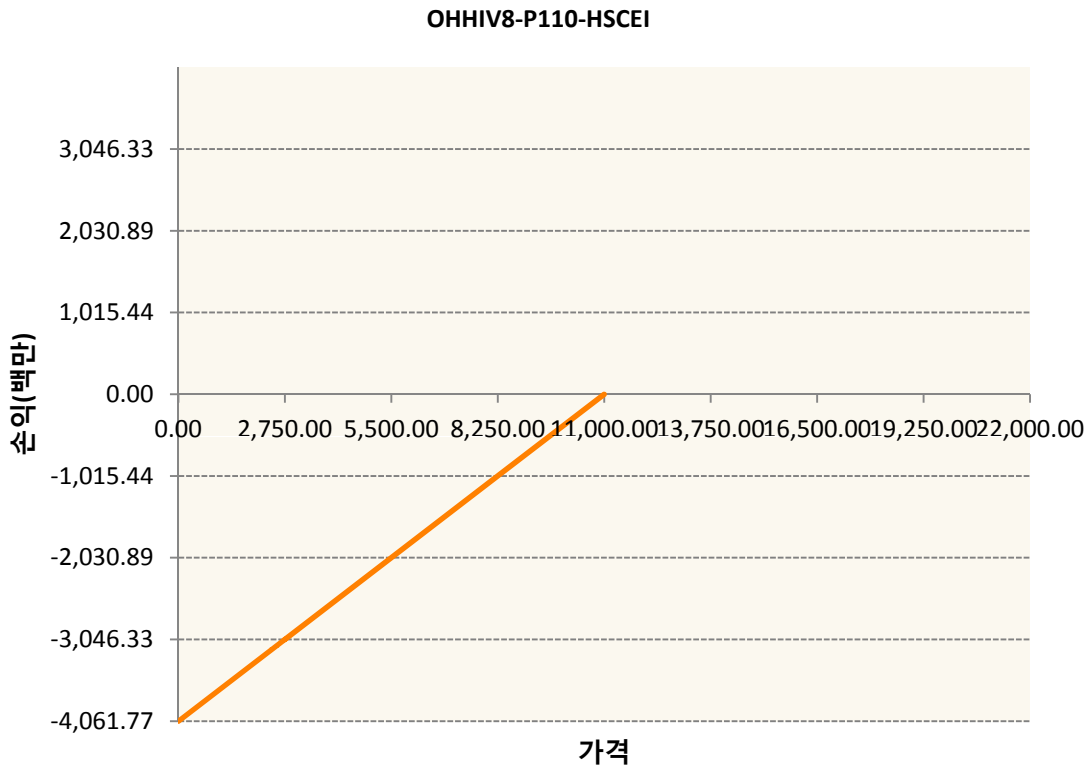
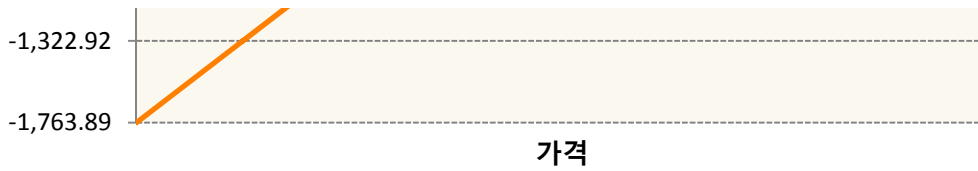
HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



OHHIV8-C108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	422
OHHIV8-C1	HSCEI	141
OHHIV8-C11	HSCEI	325
OHHIV8-P1C	HSCEI	141
OHHIV8-P11	HSCEI	325

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,265

공시일	2018-10-02
기준일	2018-10-01

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

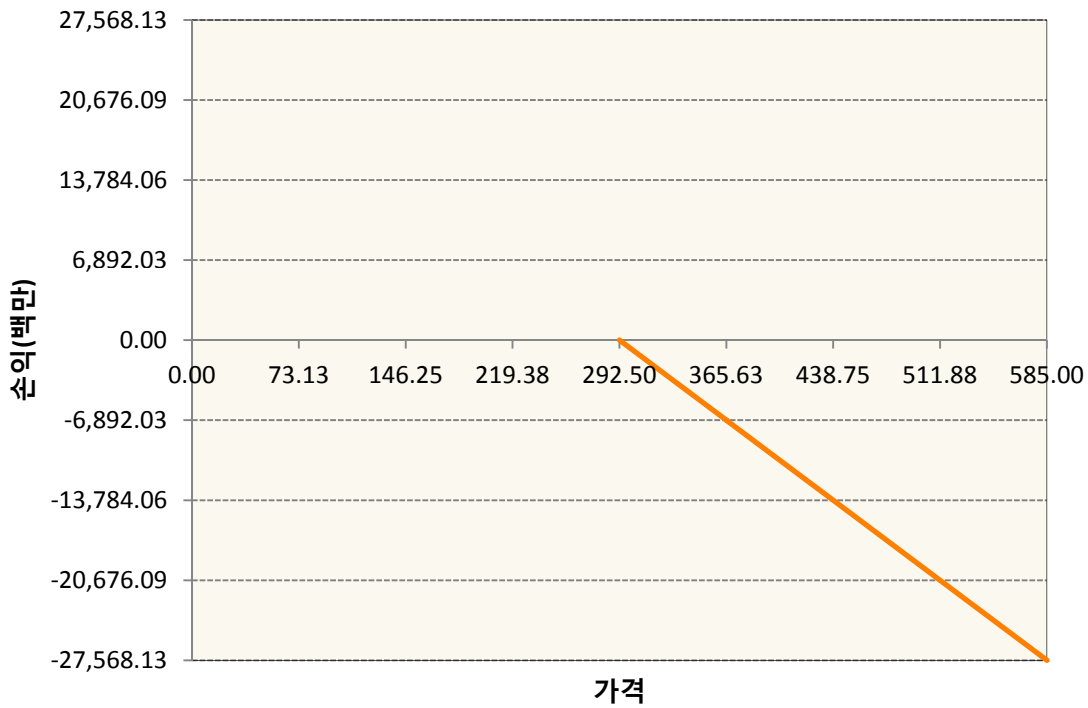
1. 계약금액

(단위:백만원)

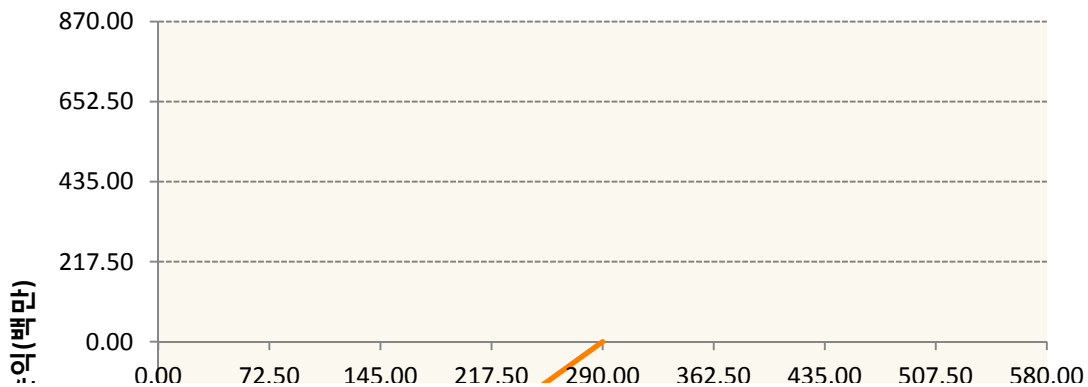
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	48,036	-48,036	장내

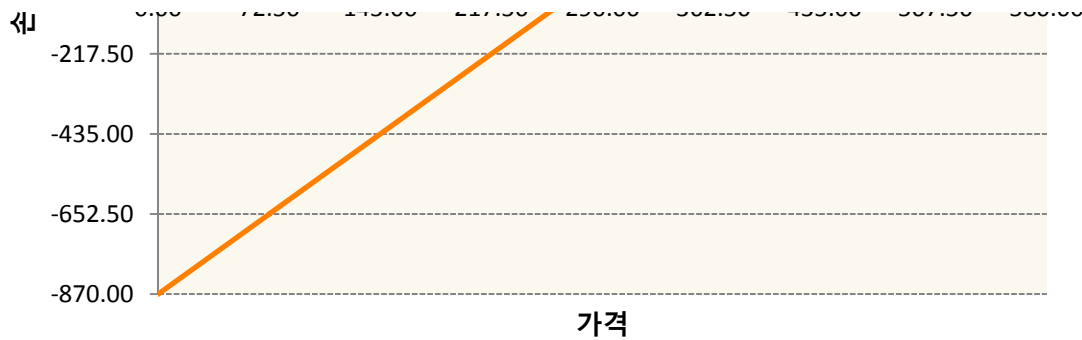
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NA2928-2018-10 콜292.5

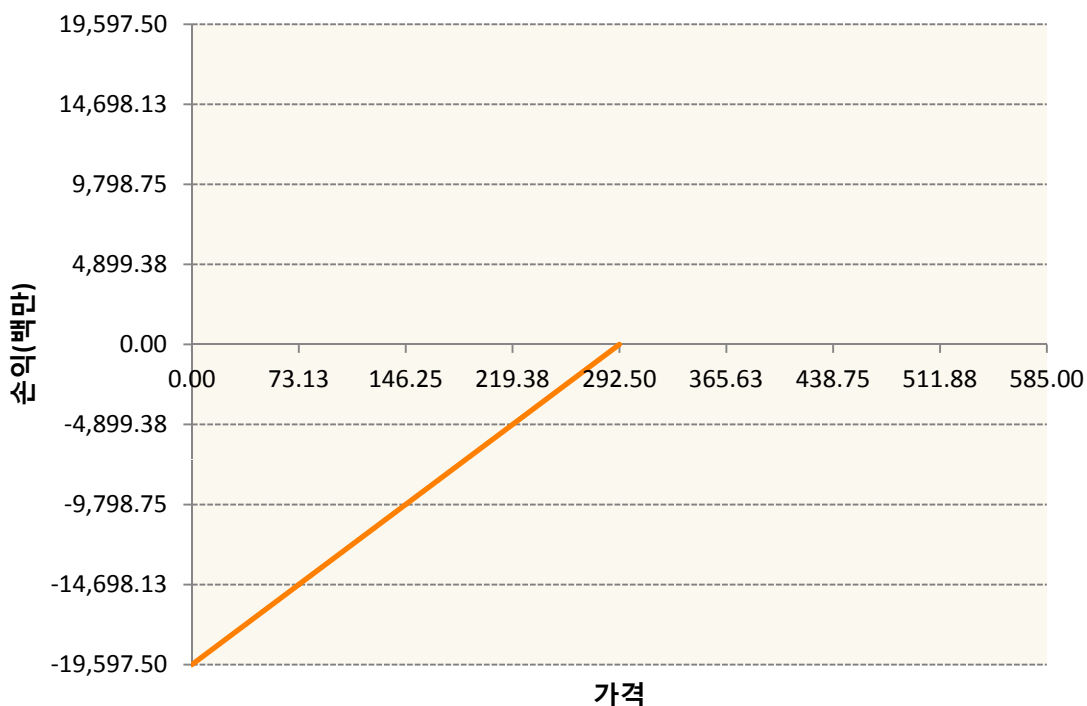


KR4301NA2901-2018-10 풋290





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,980
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,980	-3,980	-3,980	-3,980	-3,980	-3,980	-3,980
-5.33%	-2,653	-2,653	-2,653	-2,653	-2,653	-2,653	-2,653
-2.67%	-1,327	-1,327	-1,327	-1,327	-1,327	-1,327	-1,327
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,327	1,327	1,327	1,327	1,327	1,327	1,327
5.33%	2,653	2,653	2,653	2,653	2,653	2,653	2,653
8.00%	3,980	3,980	3,980	3,980	3,980	3,980	3,980
KR4201NA2927-2018-10 풋292.5							2,069
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	919	909	896	881	863	843	821
-5.33%	840	811	781	750	717	684	649
-2.67%	587	546	506	465	425	385	344
0%	98	67	34	0	-35	-71	-107
2.67%	-565	-578	-595	-614	-636	-660	-685
5.33%	-1,299	-1,302	-1,308	-1,315	-1,325	-1,338	-1,352
8.00%	-2,050	-2,051	-2,052	-2,054	-2,057	-2,062	-2,069

KR4301NA2☹ 2018-10 풋290

41

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

1,082

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,081	-1,081	-1,081	-1,081	-1,081	-1,081	-1,082
-5.33%	-547	-548	-551	-554	-558	-563	-568
-2.67%	-107	-120	-132	-144	-156	-168	-180
0%	11	8	4	0	-5	-11	-17
2.67%	14	14	14	14	14	13	12
5.33%	14	14	14	14	14	14	14
8.00%	14	14	14	14	14	14	14

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

(단위:백만원)

7,138

공시일	2018-10-02
기준일	2018-10-01

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

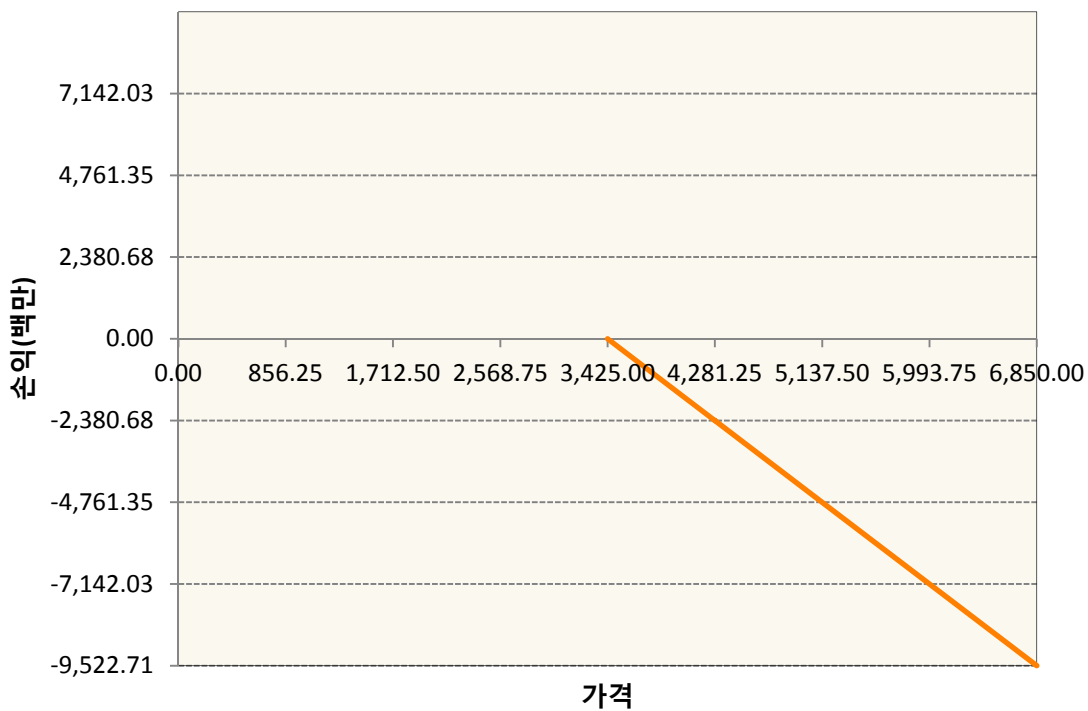
1. 계약금액

(단위:백만원)

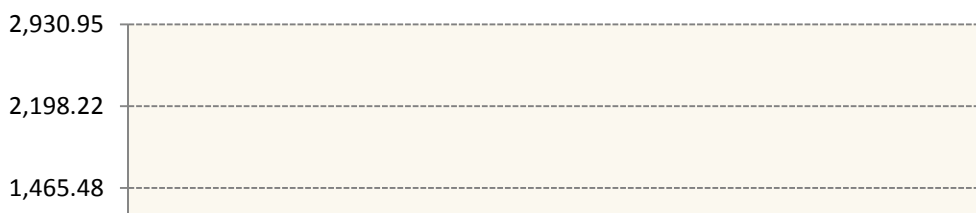
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,597	0	5,597	
누계	유가증권	스왑	33,991	0	33,991	장외
누계	유가증권	옵션	0	24,907	-24,907	장내
누계	지수	스왑	52,257	0	52,257	장외

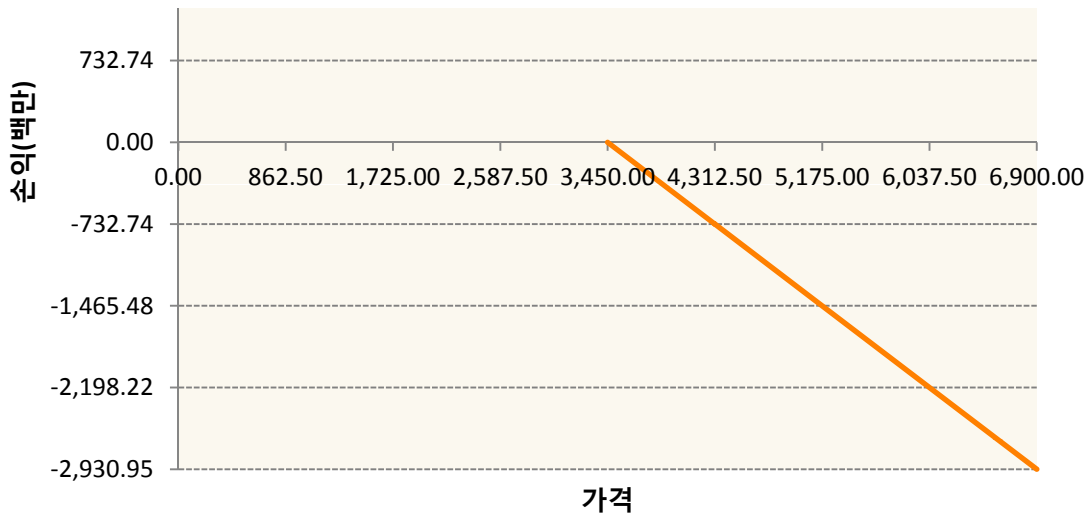
2. 만기시점의 손익구조

OESXV8-C3425-EURO STOXX 50

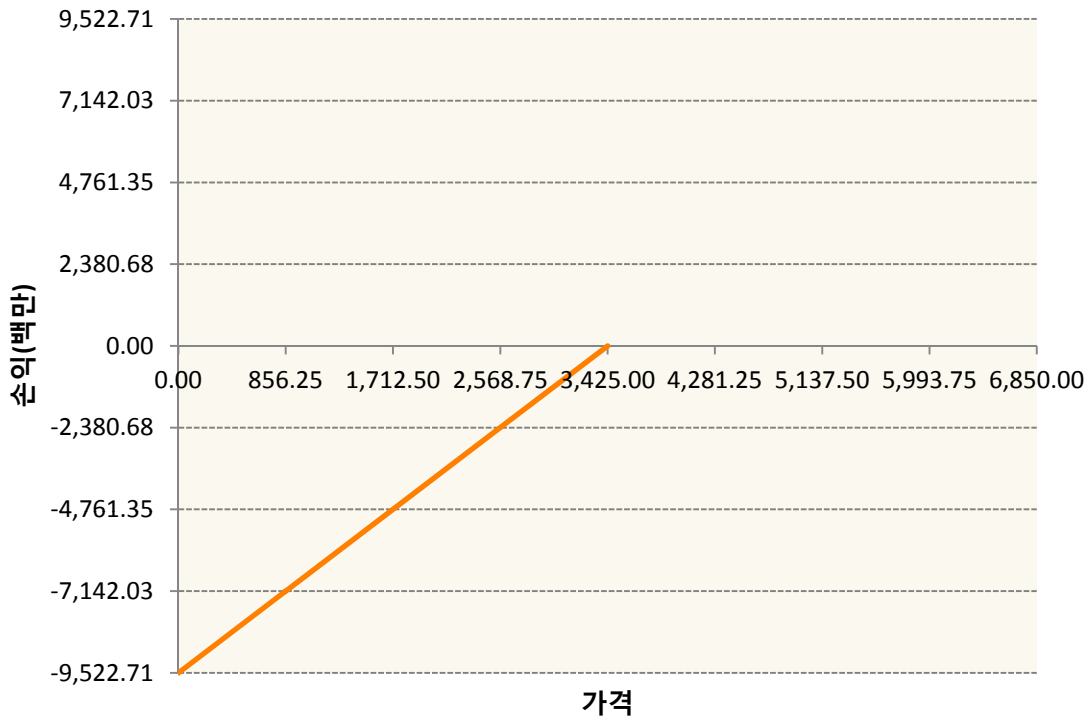


OESXV8-C3450-EURO STOXX 50

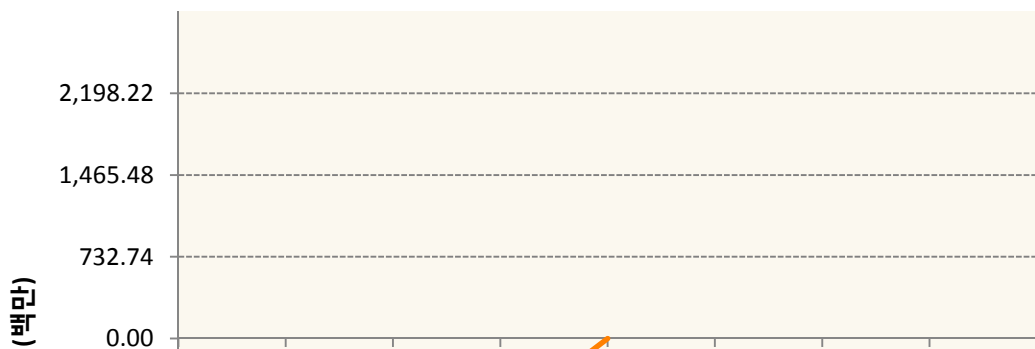


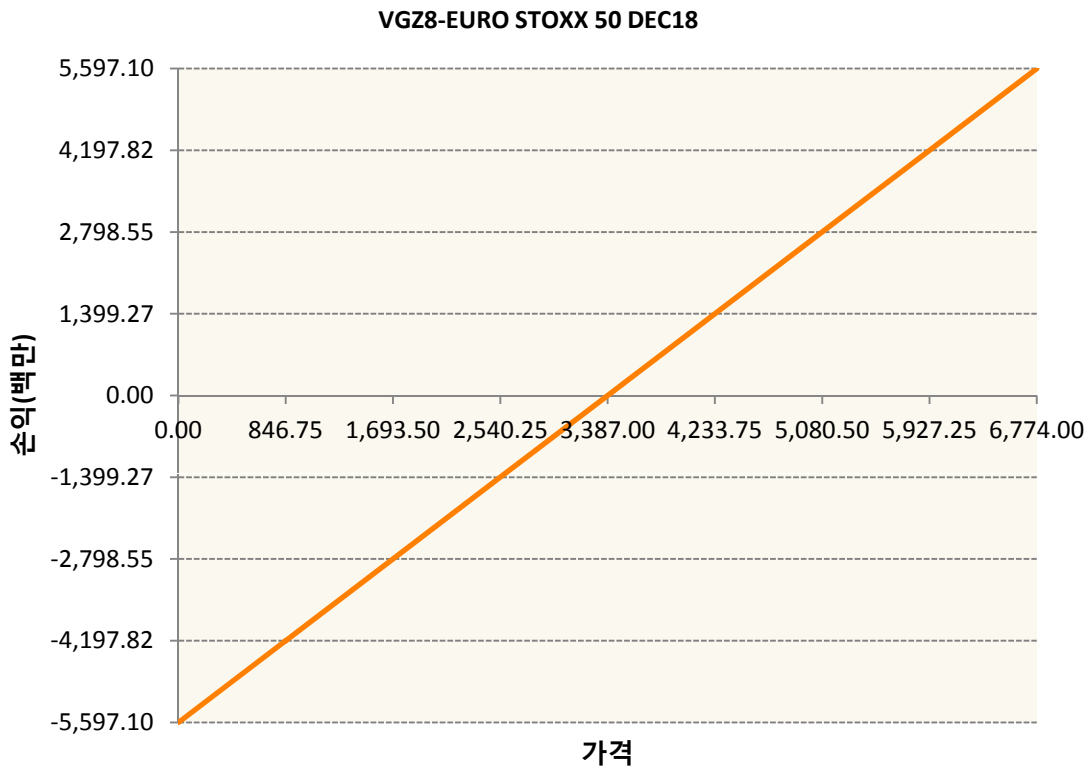
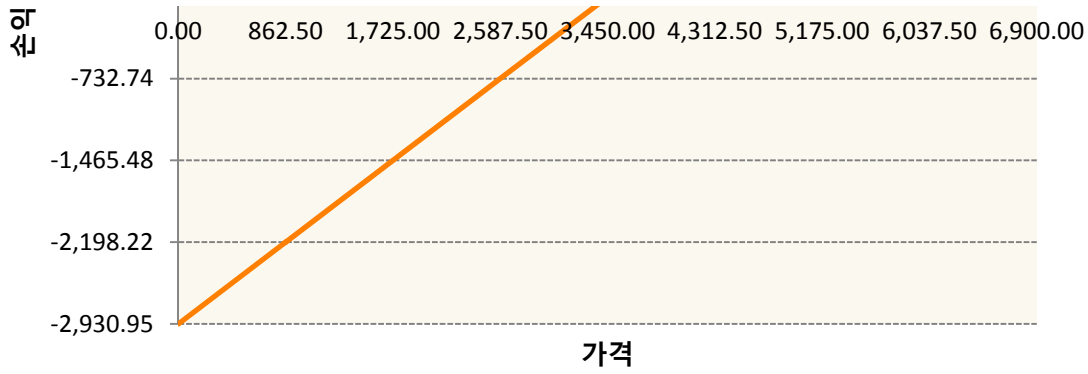


OESXV8-P3425-EURO STOXX 50



OESXV8-P3450-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		5
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		3
OESXV8-C34 EURO STOXX 50		762
OESXV8-C34 EURO STOXX 50		234
OESXV8-P34 EURO STOXX 50		762
OESXV8-P34 EURO STOXX 50		234
VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18		448

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

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

(단위:백만원)

1,145

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

(단위:백만원)

90

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

(단위:백만원)

135

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

(단위:백만원)

165

공시일	2018-10-02
기준일	2018-10-01

스마트KRX300인덱스목표전환형1

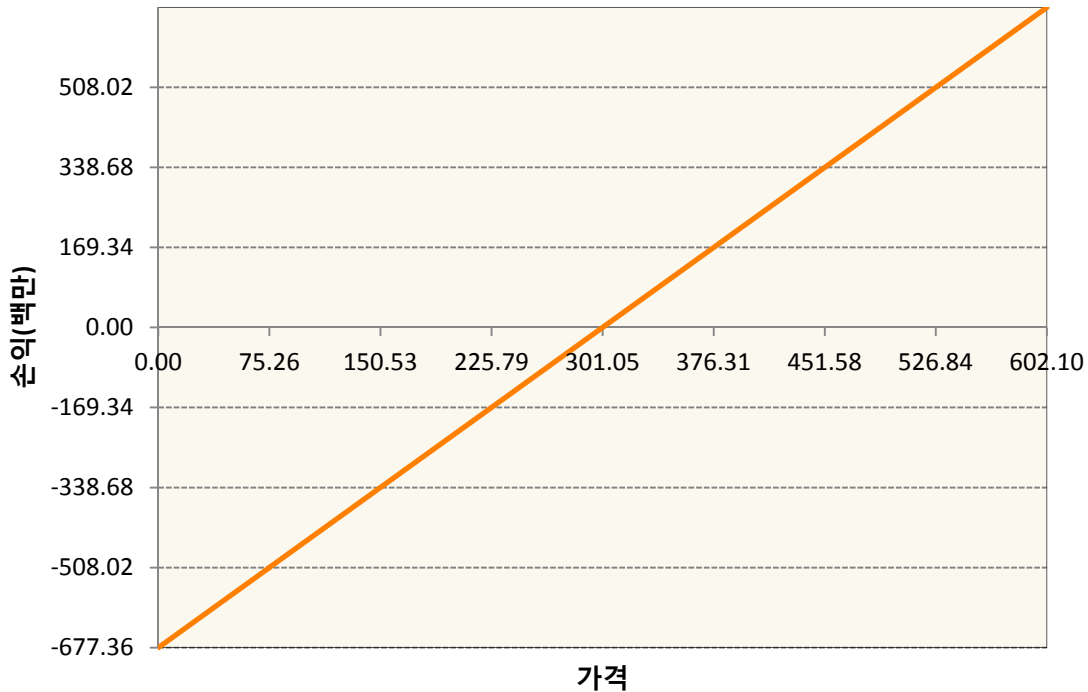
1. 계약금액

(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	2018-10-02
기준일	2018-10-01

리디파인K200(주식혼합-파생재간

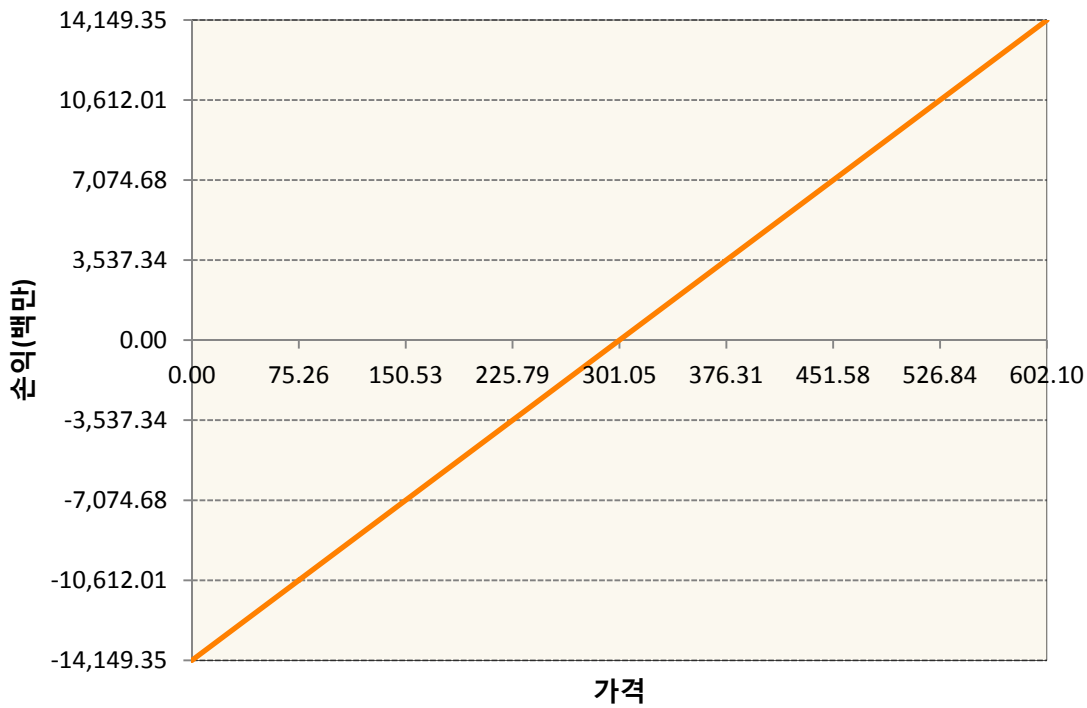
1. 계약금액

(단위:백만원)

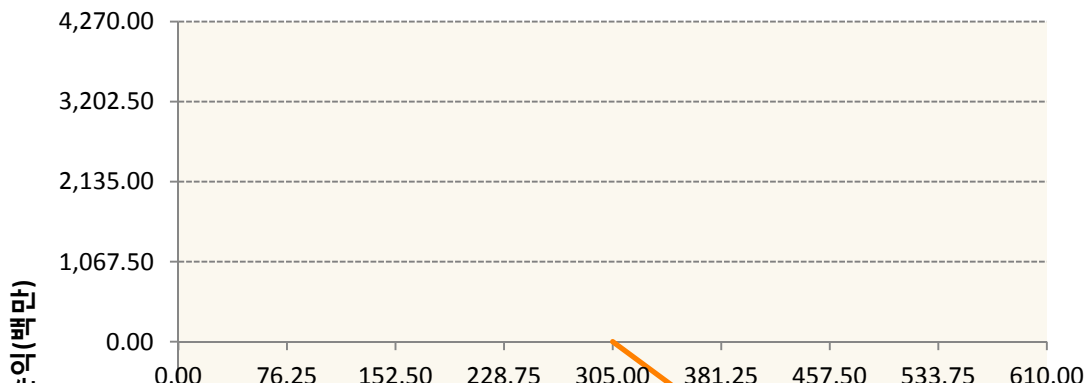
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	14,149	0	14,149	장내
누계	유가증권	옵션	2,119	24,488	-22,369	장내

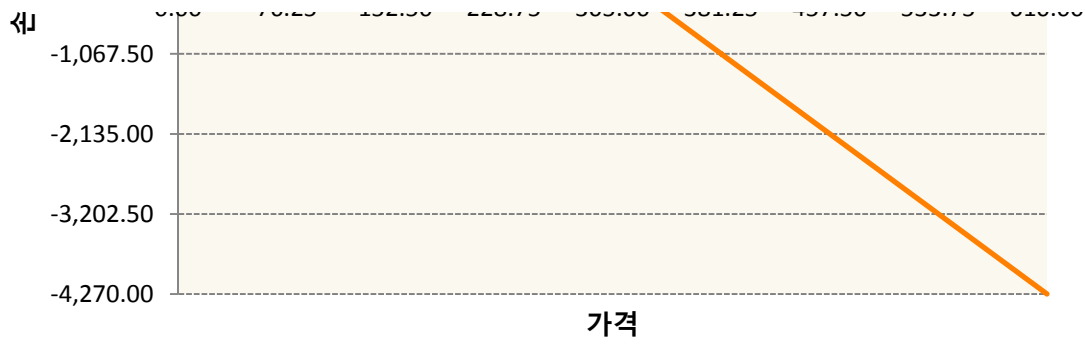
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

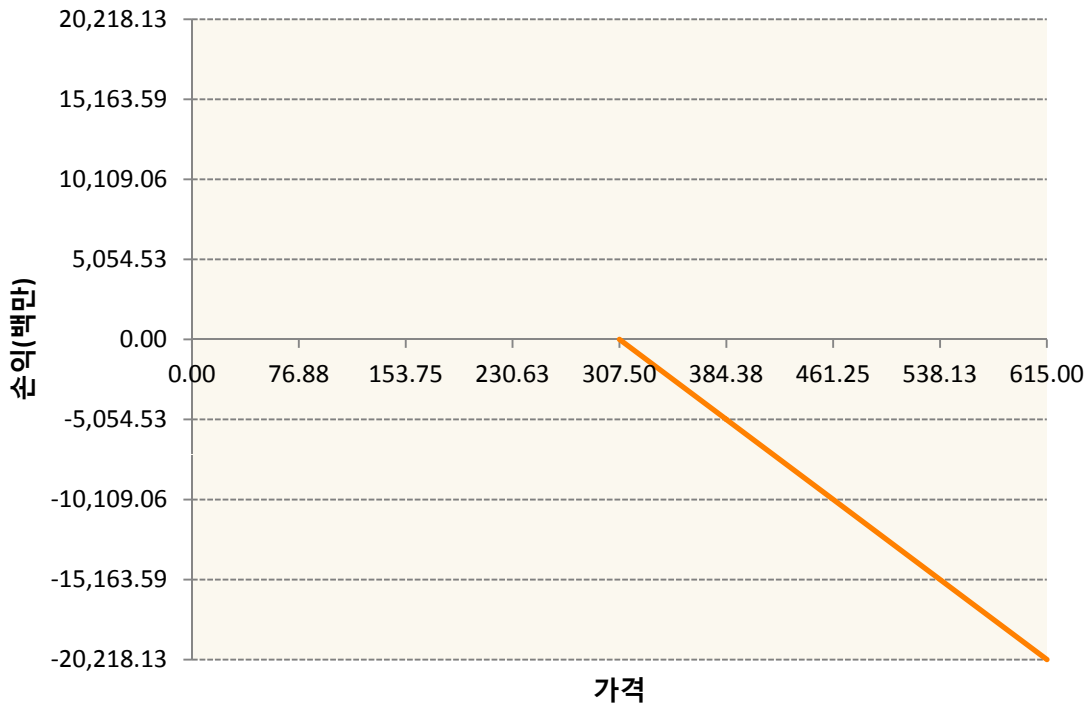


KR4201NA3058-2018-10 콜305

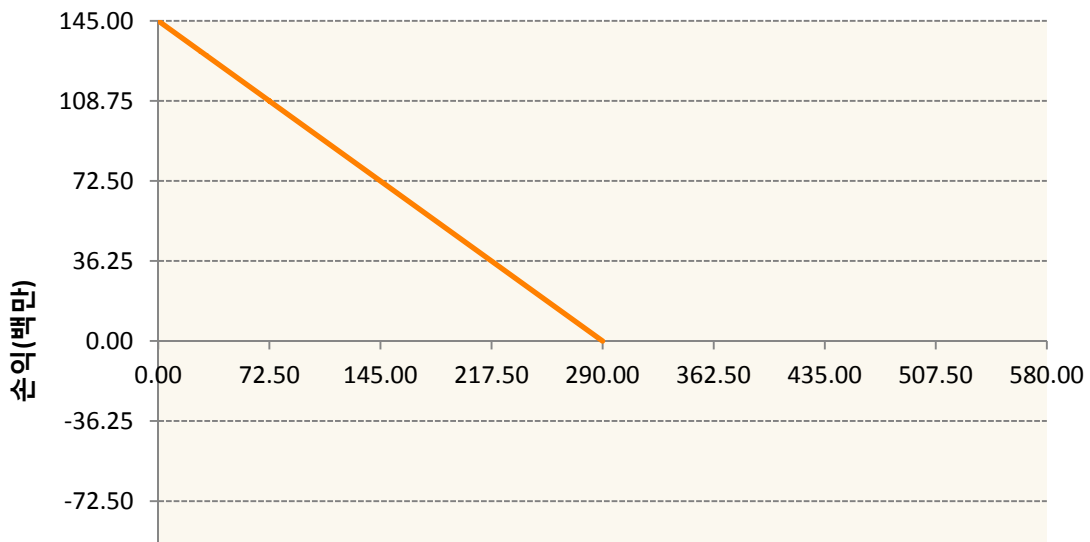


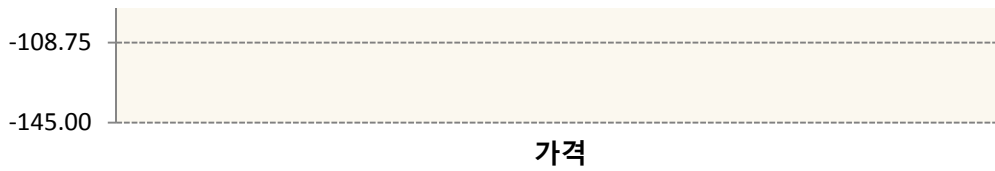


KR4201NA3074-2018-10 콜307.5

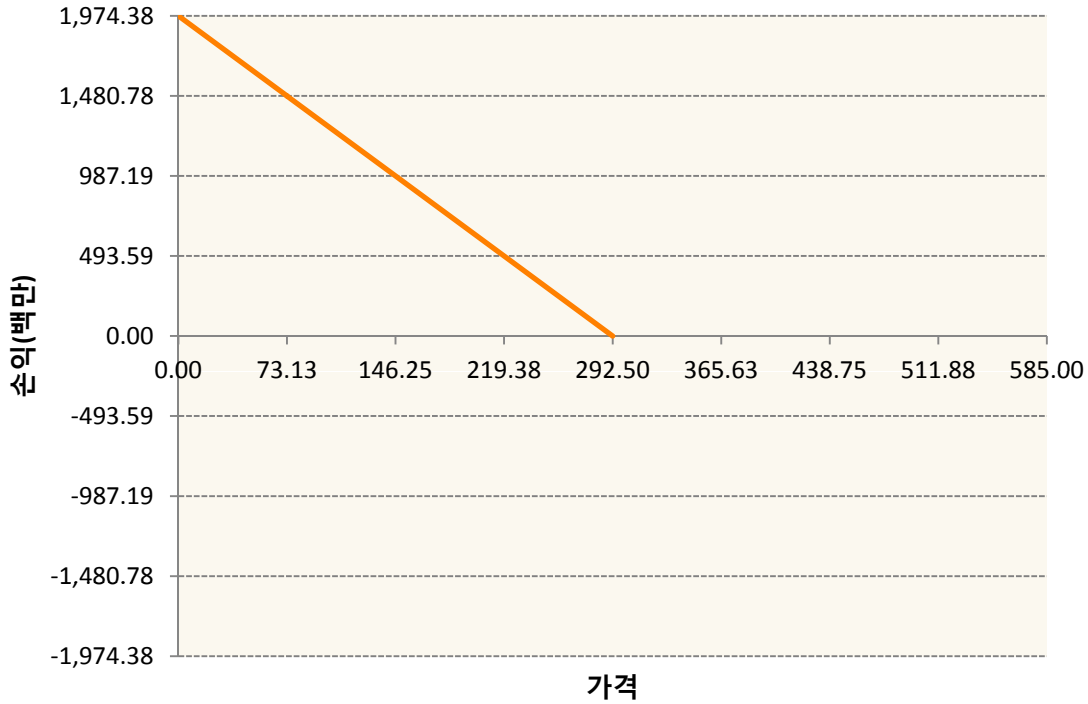


KR4301NA2901-2018-10 풋290





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물)							1,129
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,129	-1,129	-1,129	-1,129	-1,129	-1,129	-1,129
-5.33%	-752	-752	-752	-752	-752	-752	-752
-2.67%	-376	-376	-376	-376	-376	-376	-376
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	376	376	376	376	376	376	376
5.33%	752	752	752	752	752	752	752
8.00%	1,129	1,129	1,129	1,129	1,129	1,129	1,129
KR4201NA3(2018-10 콜305)							239
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	45	45	45	45	44	43	42
-5.33%	45	44	43	41	39	37	35
-2.67%	39	36	33	29	25	21	17

0%	17	11	6	0	-6	-12	-18
2.67%	-36	-42	-48	-54	-60	-66	-73
5.33%	-121	-125	-129	-133	-138	-143	-148
8.00%	-225	-226	-228	-230	-233	-236	-239

KR4201NA3(2018-10 콜307.5

1,037

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	162	161	161	160	158	155	151
-5.33%	160	158	154	149	143	135	125
-2.67%	144	135	123	109	93	76	58
0%	72	49	25	0	-25	-51	-78
2.67%	-128	-157	-187	-217	-246	-276	-306
5.33%	-484	-506	-529	-553	-578	-604	-630
8.00%	-950	-960	-972	-986	-1,002	-1,019	-1,037

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

109

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	109	109	109	109	109	109	109
-5.33%	55	55	56	56	56	57	57
-2.67%	11	12	13	14	16	17	18
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)

2,087

공시일	2018-10-02
기준일	2018-10-01

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

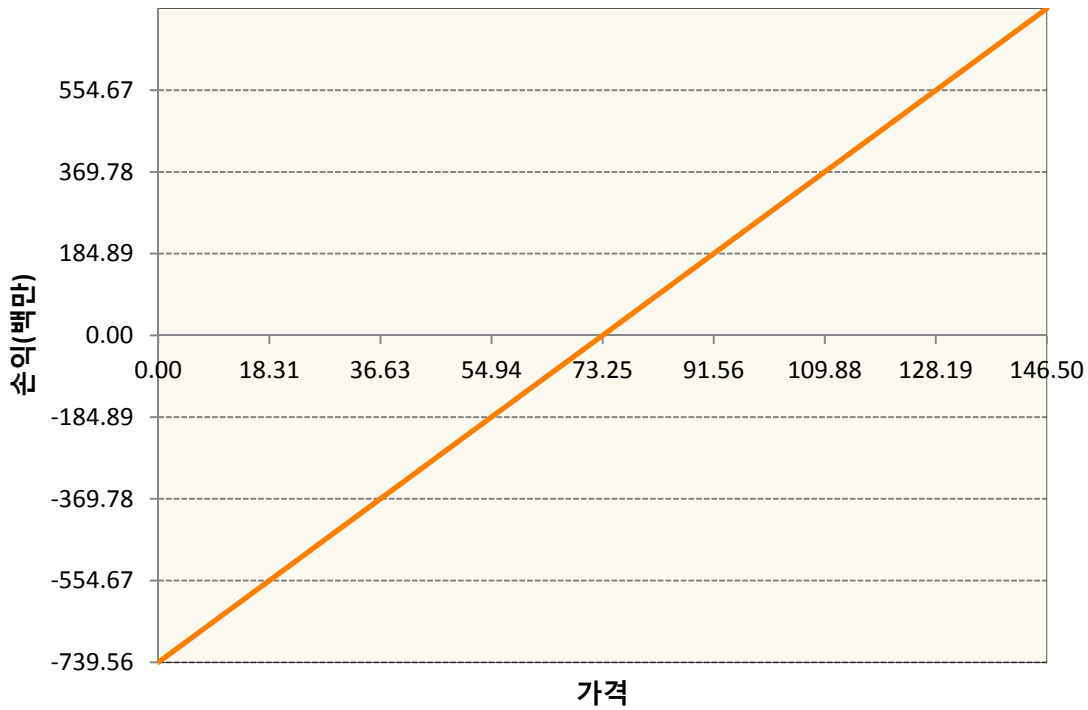
1. 계약금액

(단위:백만원)

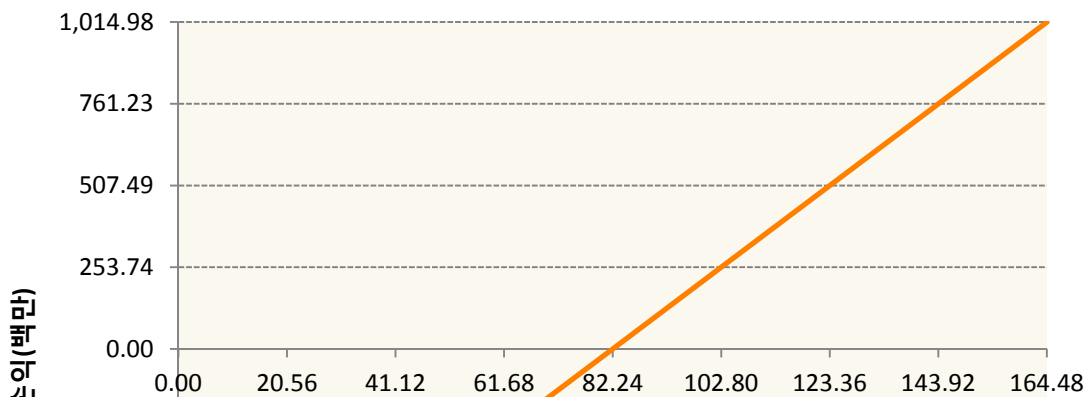
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,226	611	2,614	
누계	유가증권	선물	553	0	553	장내

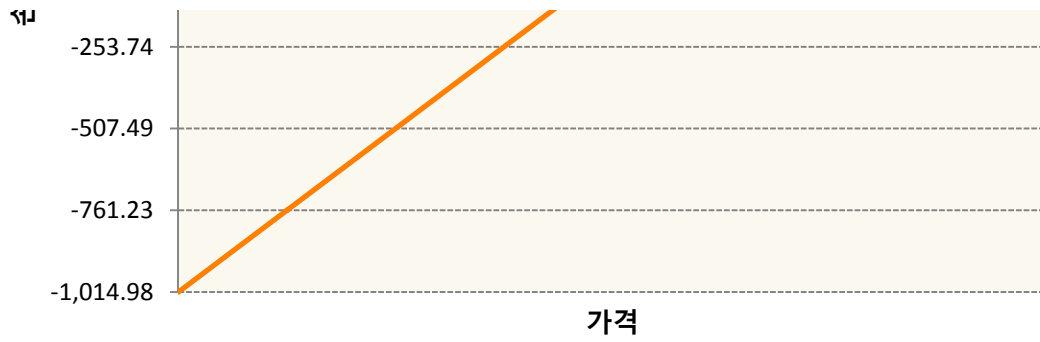
2. 만기시점의 손익구조

CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18

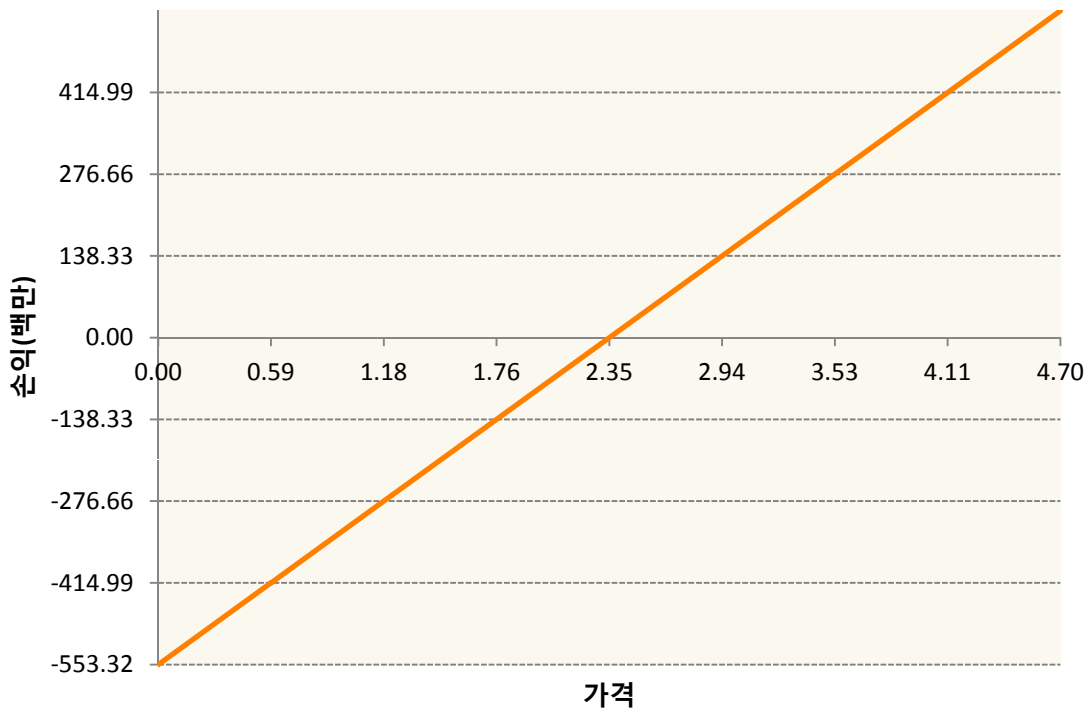


COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19

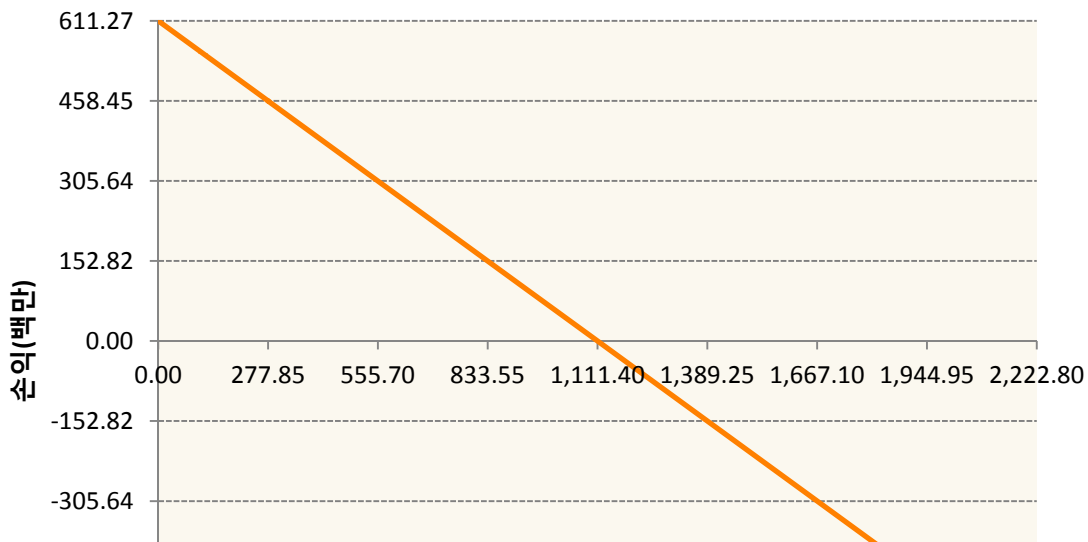


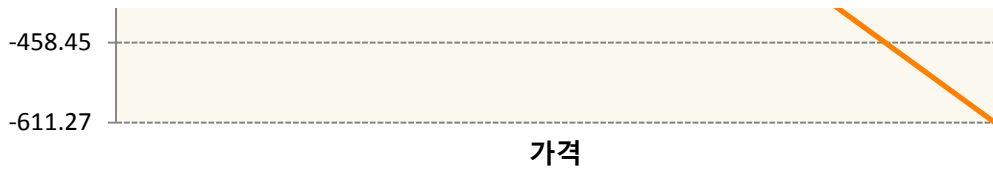


HOX8-Heating Oil

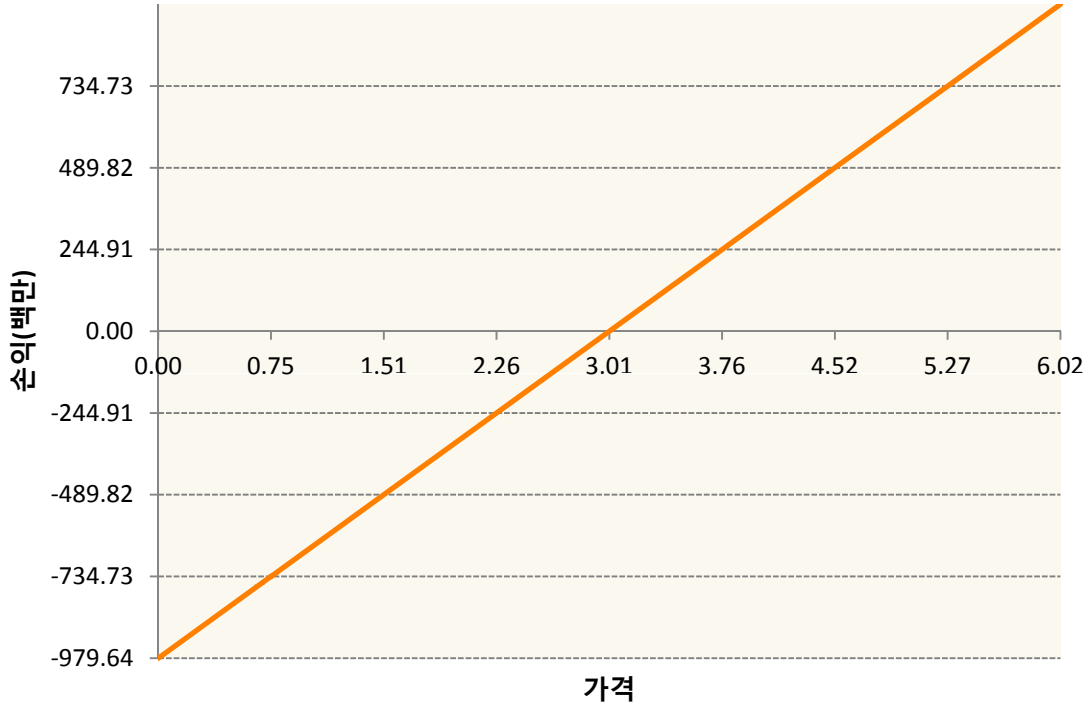


KR4175NA0007-2018-10 달러선물

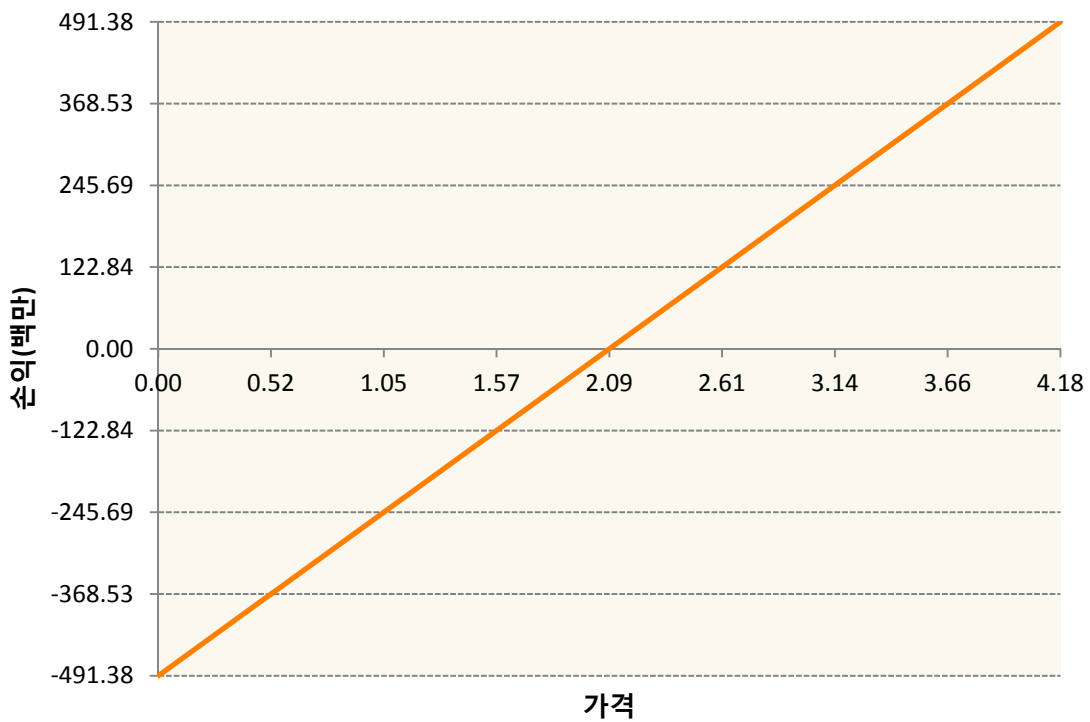




NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18



XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	59
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	81
HOX8	Heating Oil	44
	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)
	451

공시일	2018-10-02
기준일	2018-10-01

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

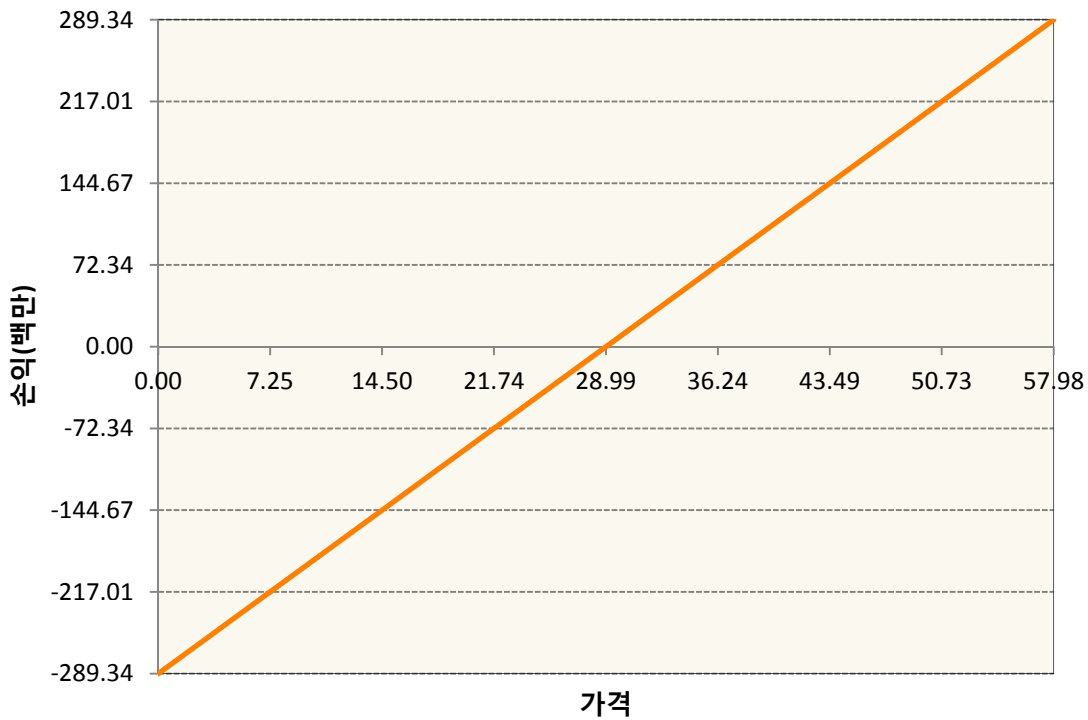
1. 계약금액

(단위:백만원)

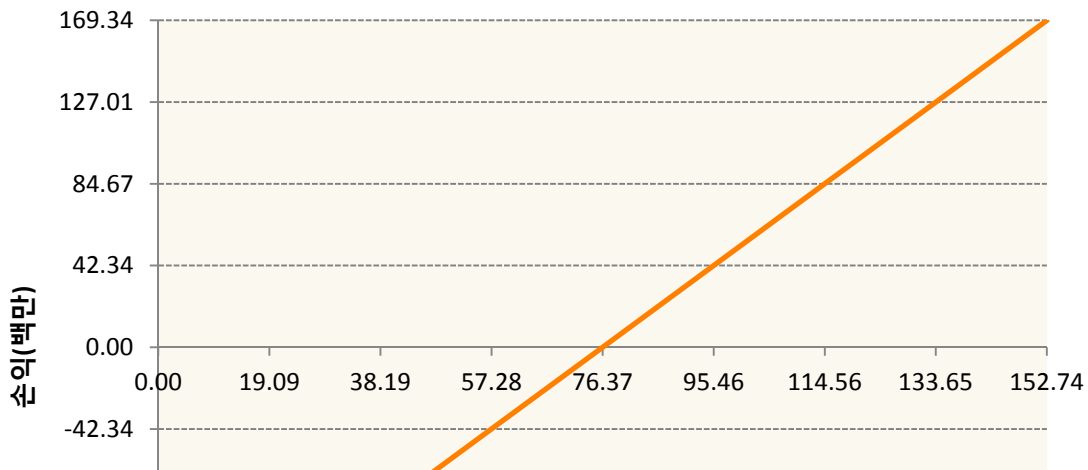
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,525	78	3,447	

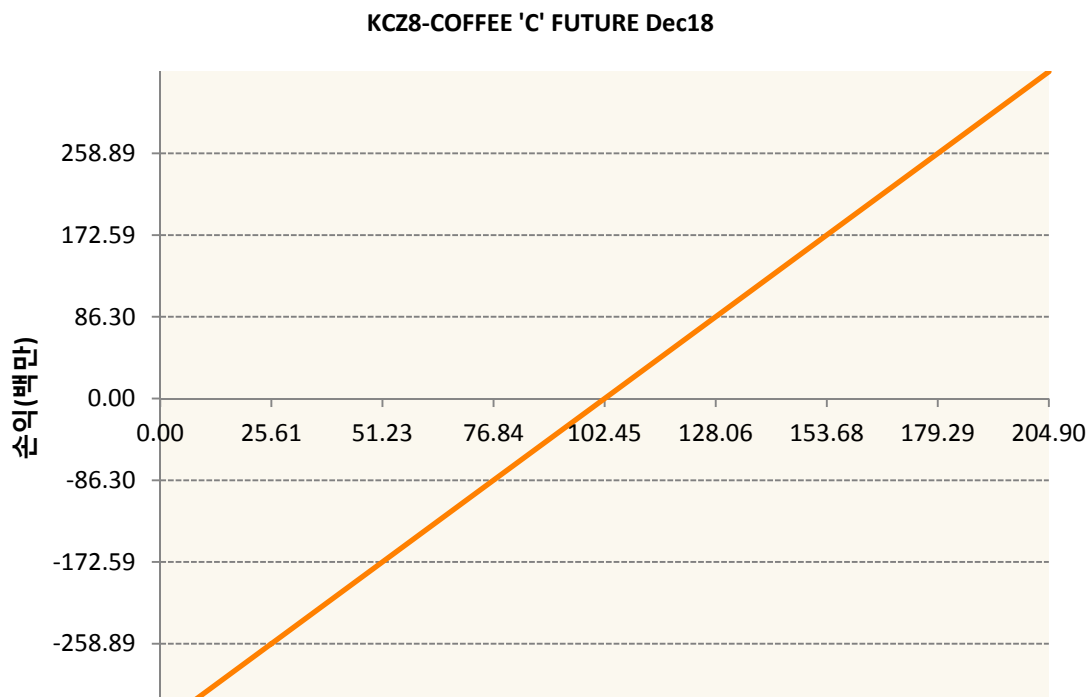
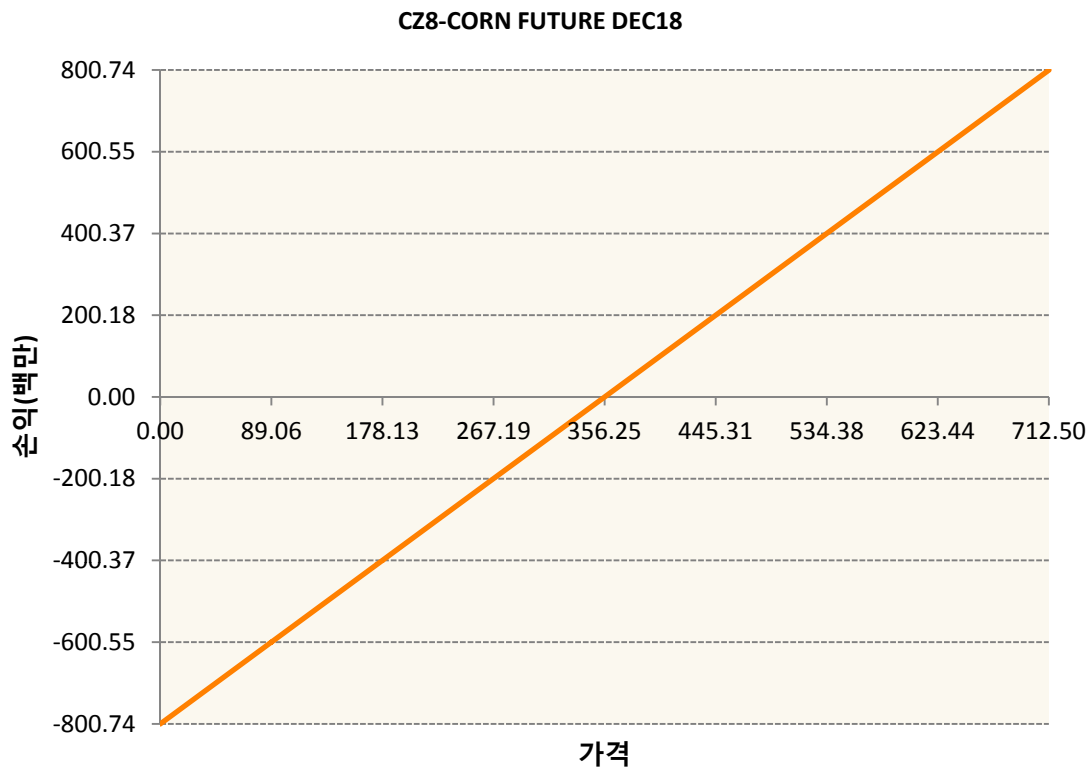
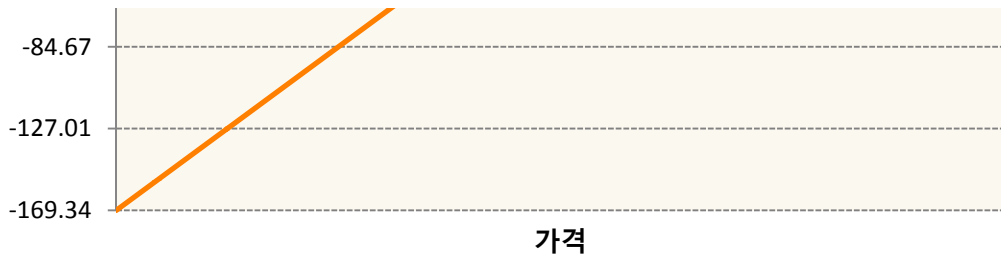
2. 만기시점의 손익구조

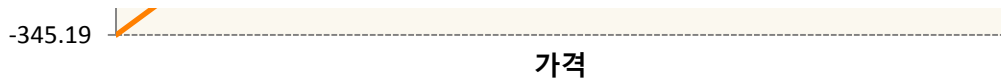
BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18



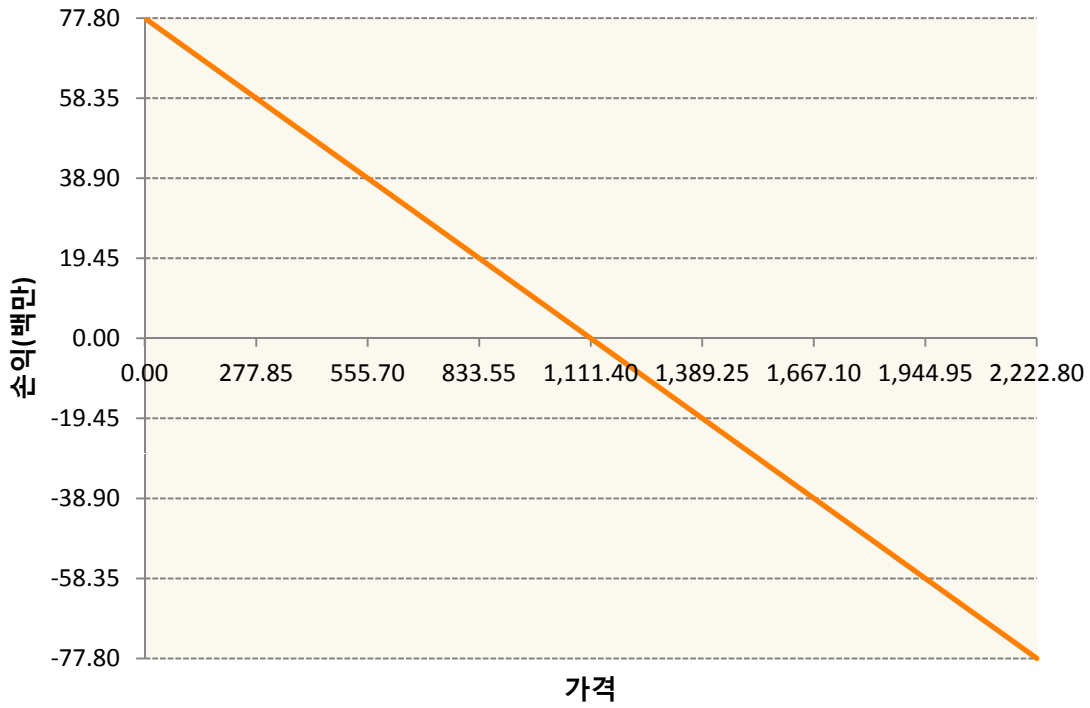
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



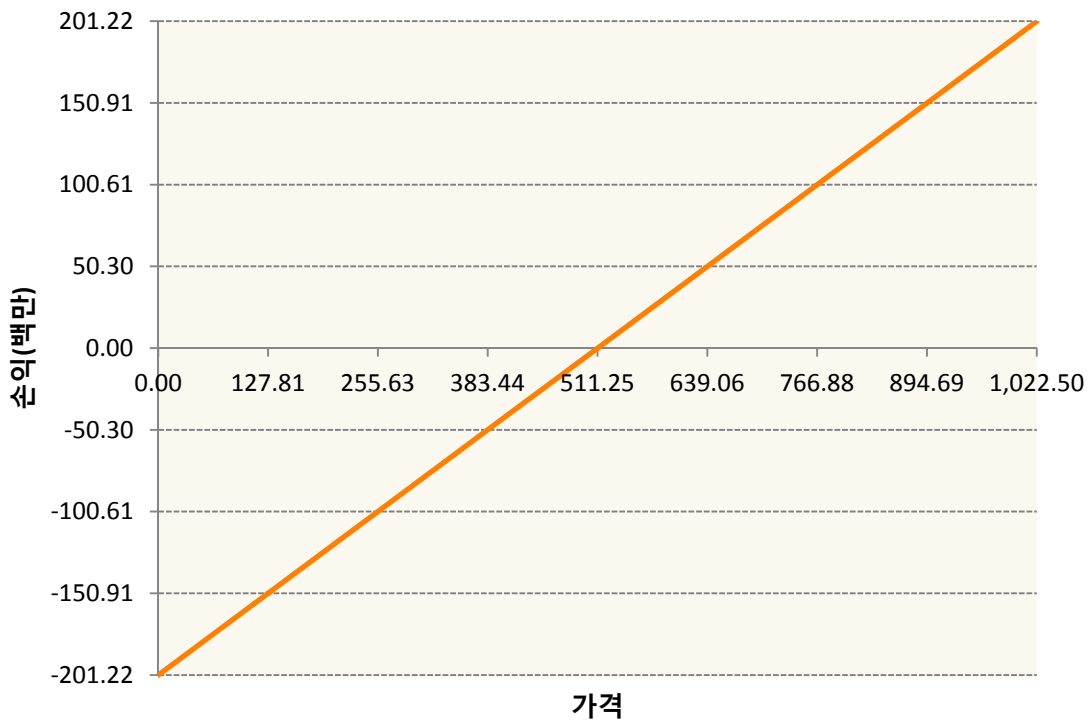




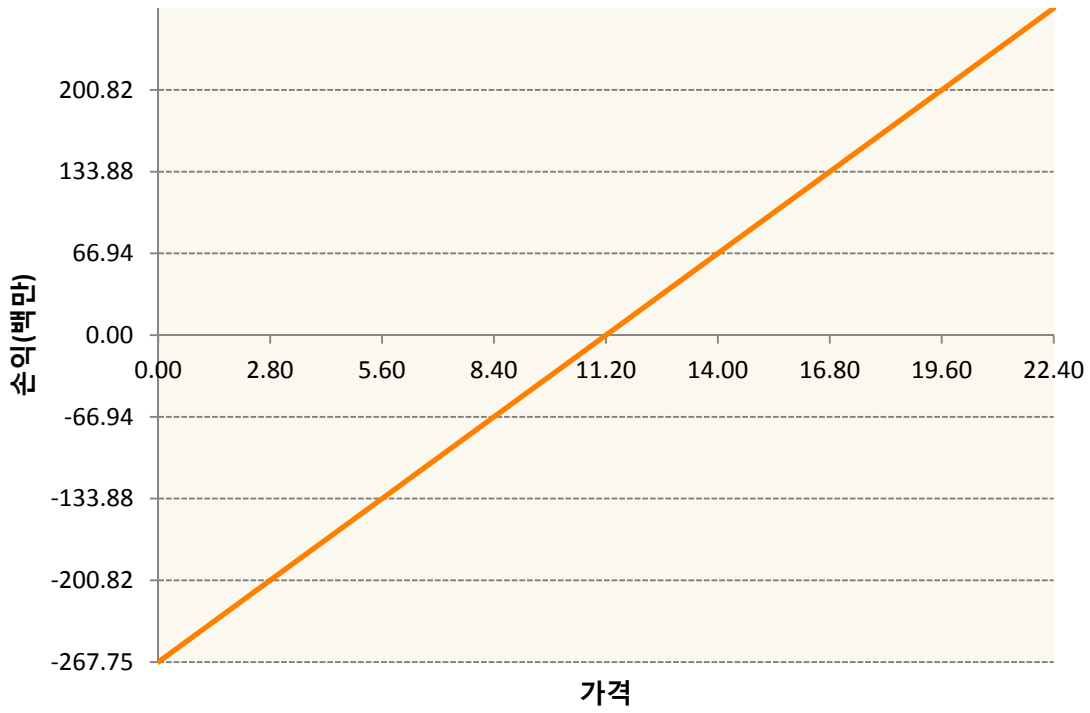
KR4175NA0007-2018-10 달러선물



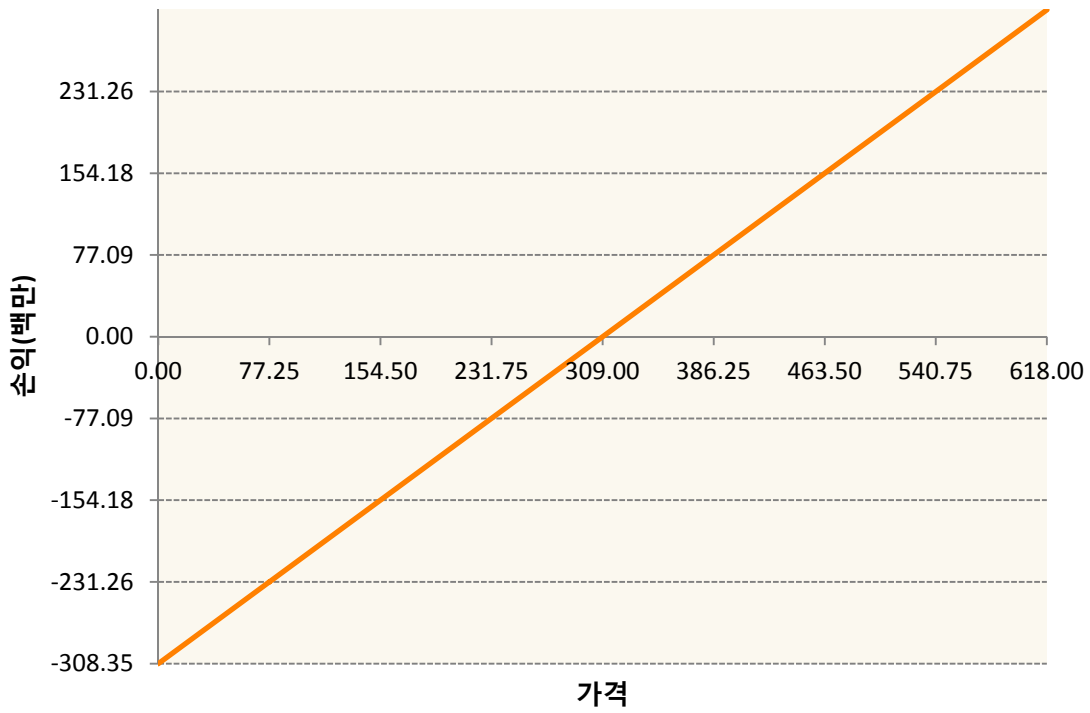
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

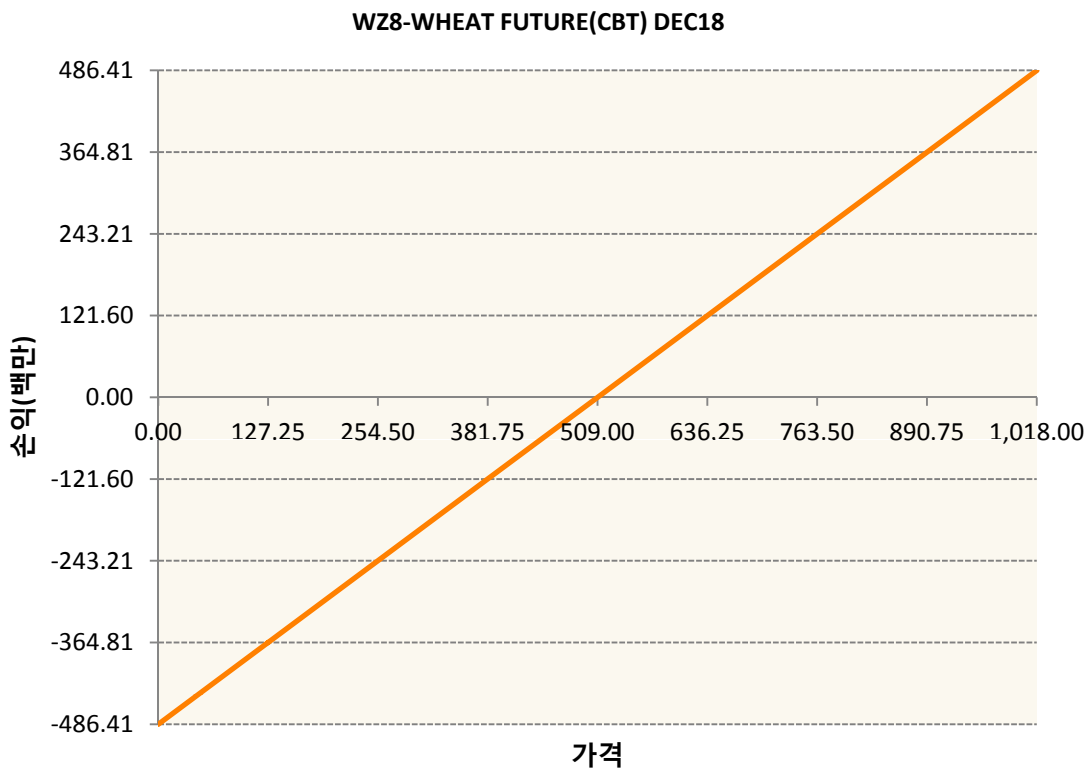
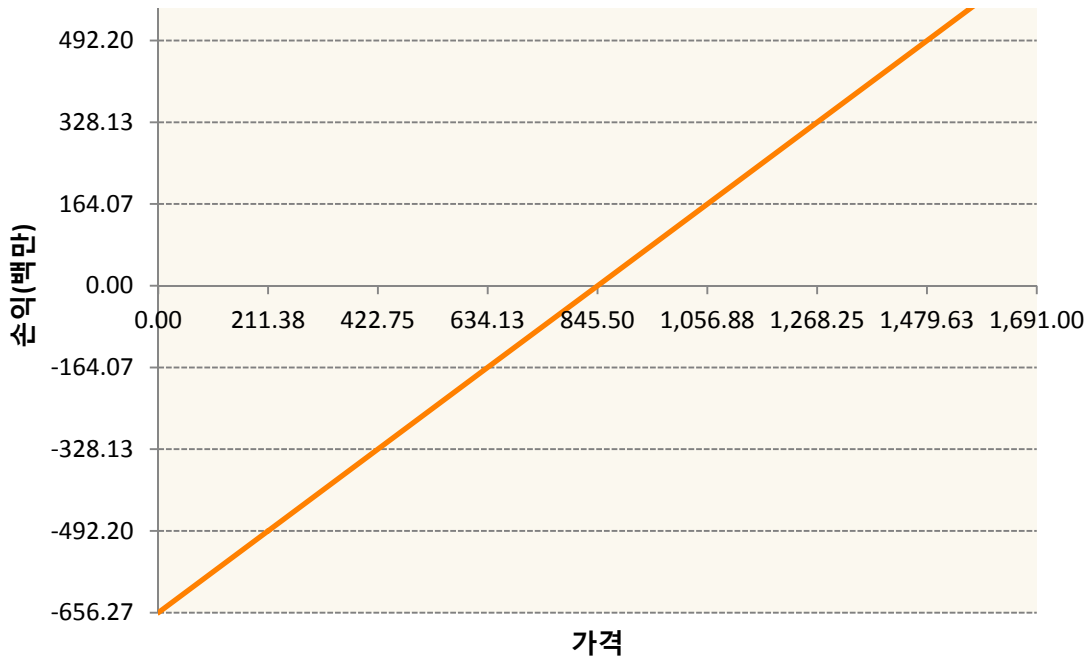


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	23
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	14
CZ8	CORN FUTURE DEC18	64
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	28
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)

307