

공시일	2018-10-15
기준일	2018-10-12

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	2018-10-15
기준일	2018-10-12

스마트인덱스모

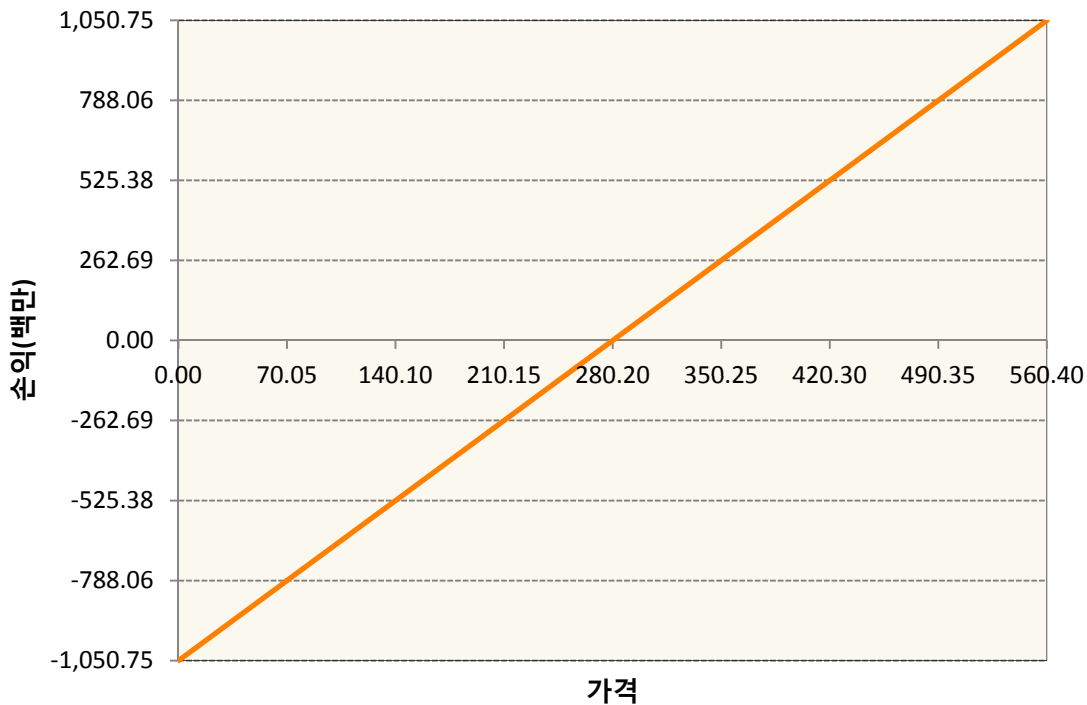
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,051	0	1,051	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물)

84

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
-5.33%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
-2.67%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	28	28	28	28	28	28	28
5.33%	56	56	56	56	56	56	56
8.00%	84	84	84	84	84	84	84

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

(단위:백만원)

68

공시일	2018-10-15
기준일	2018-10-12

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

1,087

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

481

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-15
기준일	2018-10-12

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

258

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

349

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-15
기준일	2018-10-12

유로인덱스모(주식-파생형)

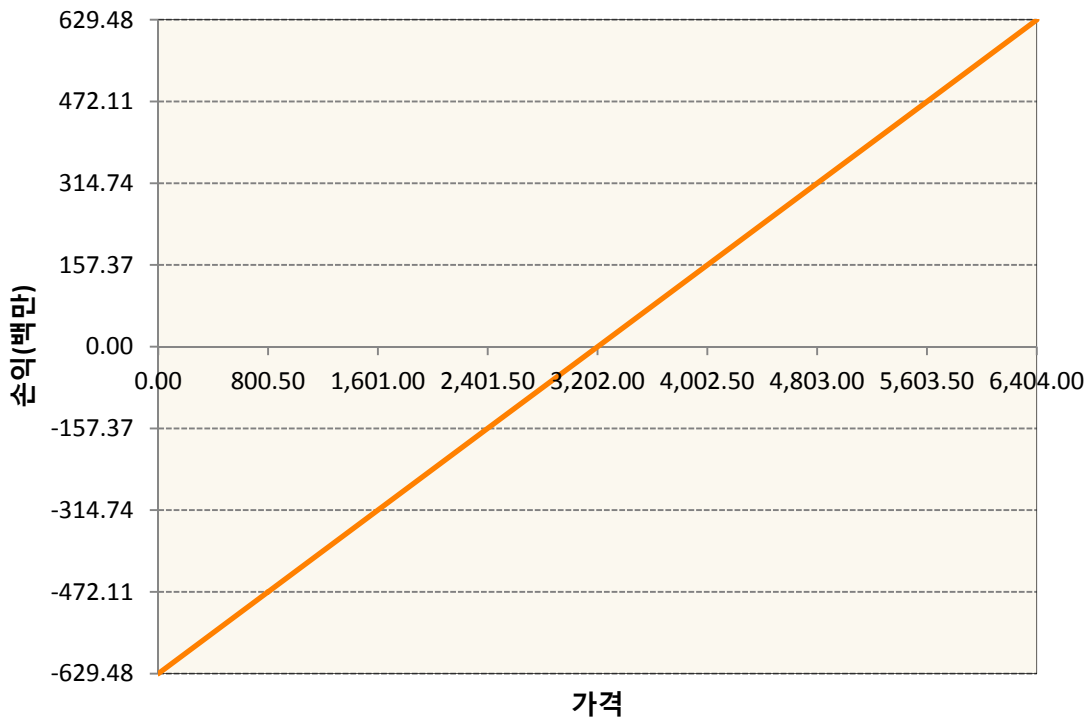
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	629	0	629	

2. 만기시점의 손익구조

VGZ8-EURO STOXX 50 DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

31

공시일	2018-10-15
기준일	2018-10-12

차이나인덱스모(주식-파생형)

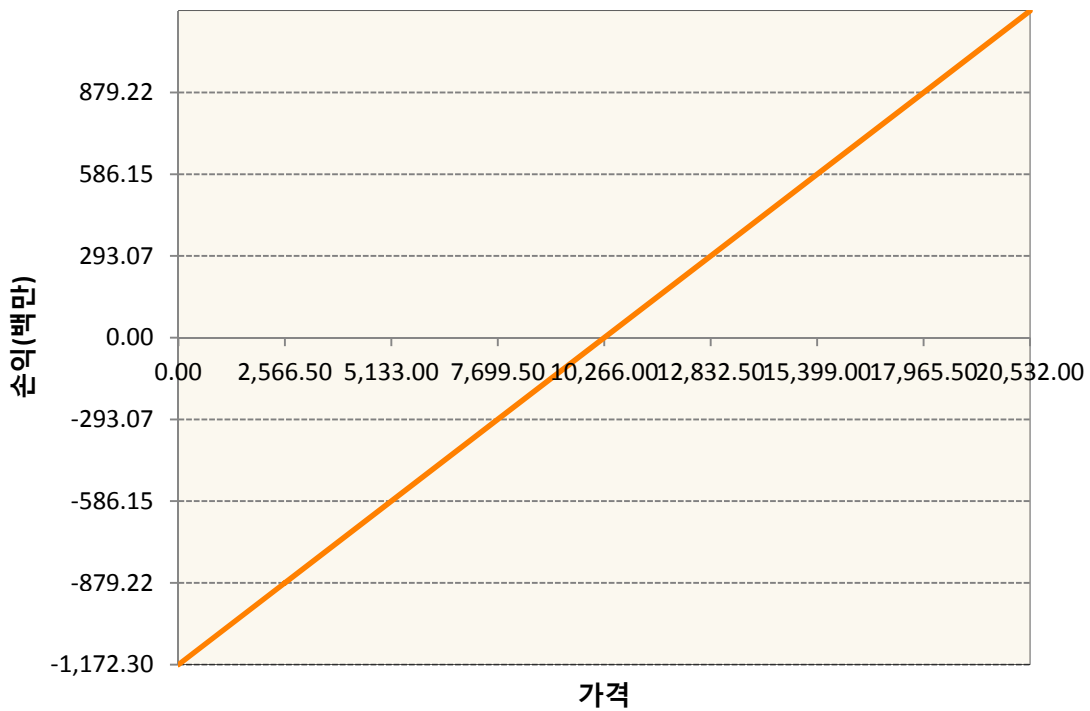
1. 계약금액

(단위:백만원)

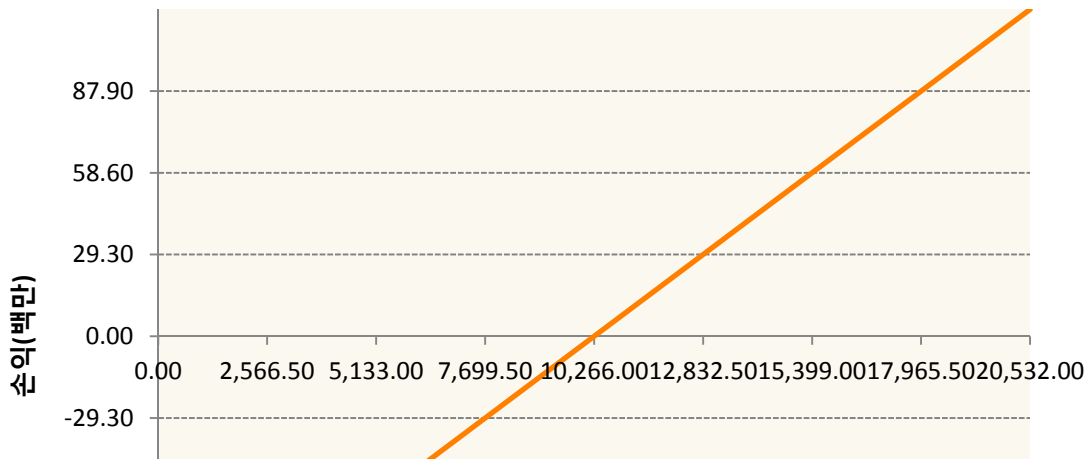
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,289	0	1,289	장내

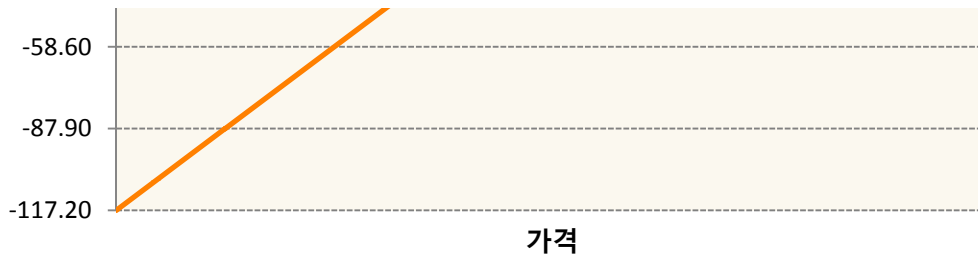
2. 만기시점의 손익구조

HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



MHCV8-MINI H-SHR IDX FU OCT 18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	94
MHCV8	MINI H-SHR IDX FU OCT 18	9

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

99

공시일	2018-10-15
기준일	2018-10-12

커버드콜모(주식혼합-파생형)

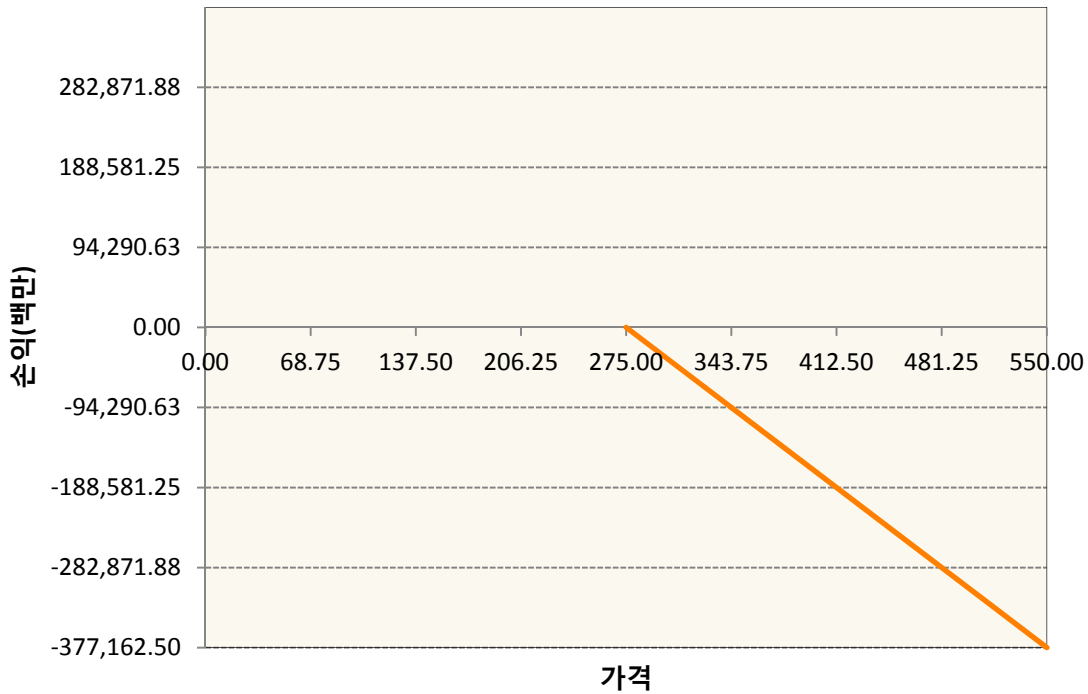
1. 계약금액

(단위:백만원)

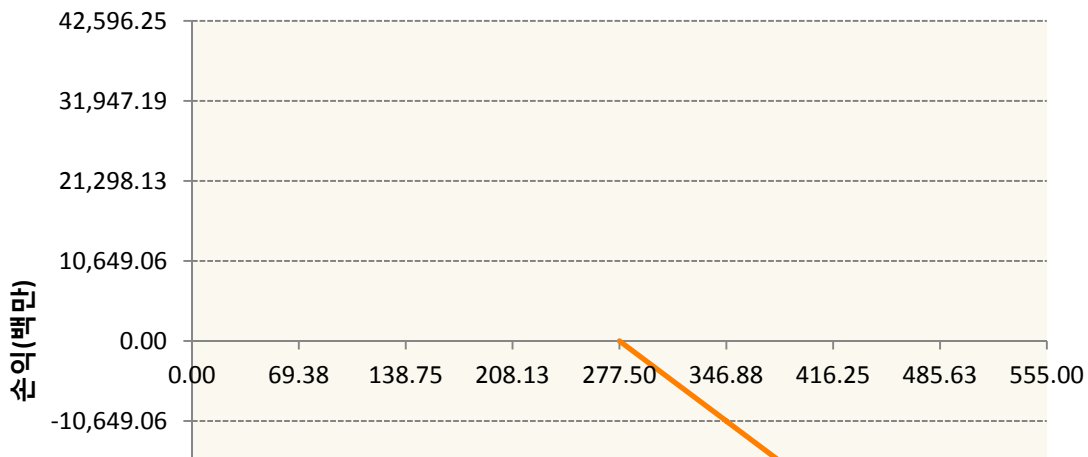
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	560,934	-560,934	장내
누계	유가증권	옵션	0	681,009	-681,009	장내

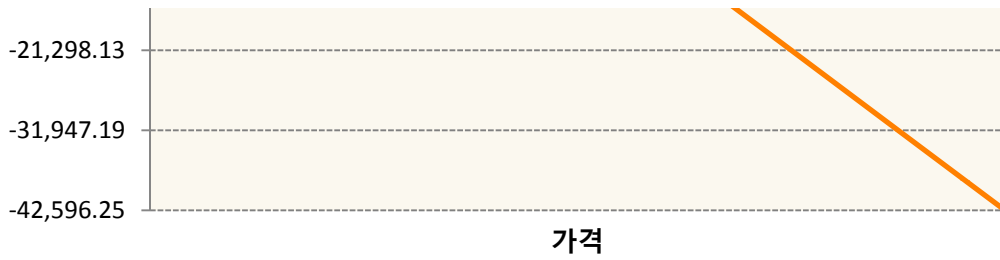
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

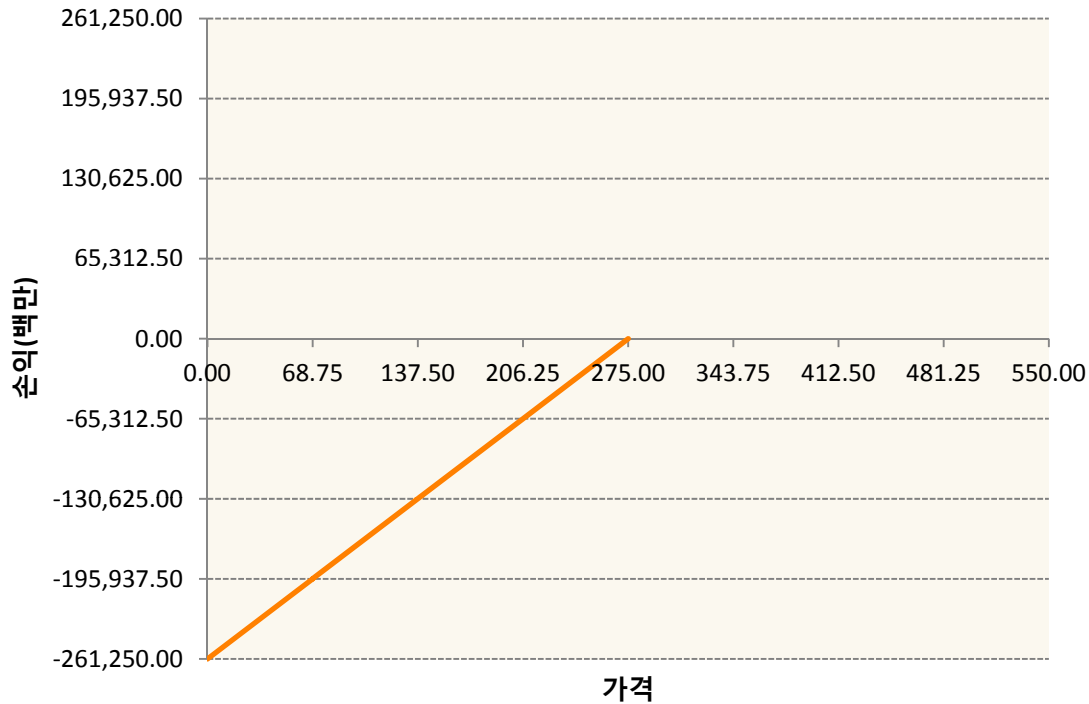


KR4201NB2778-2018-11 콜277.5





KR4301NB2751-2018-11 풋275



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NB27 2018-11 콜275

25,188

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13,187	12,750	12,253	11,708	11,120	10,499	9,848
-5.33%	11,426	10,720	9,984	9,225	8,446	7,653	6,847
-2.67%	8,031	7,146	6,257	5,366	4,473	3,579	2,684
0%	2,664	1,781	893	0	-896	-1,795	-2,696
2.67%	-4,570	-5,281	-6,027	-6,801	-7,596	-8,409	-9,236
5.33%	-13,211	-13,682	-14,215	-14,801	-15,432	-16,099	-16,797
8.00%	-22,711	-22,971	-23,300	-23,693	-24,143	-24,643	-25,188

KR4201NB27 2018-11 콜277.5

2,713

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,300	1,260	1,213	1,159	1,100	1,037	969

-5.33%	1,147	1,077	1,002	923	842	758	672
-2.67%	833	738	641	544	446	348	249
0%	307	205	102	0	-103	-205	-308
2.67%	-435	-524	-615	-708	-803	-899	-997
5.33%	-1,354	-1,417	-1,486	-1,560	-1,639	-1,720	-1,805
8.00%	-2,389	-2,427	-2,472	-2,524	-2,582	-2,645	-2,713

KR4301NB27 2018-11 풋275

14,862

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,035	-14,111	-14,213	-14,341	-14,493	-14,667	-14,862
-5.33%	-7,483	-7,713	-7,968	-8,243	-8,534	-8,838	-9,154
-2.67%	-2,171	-2,558	-2,949	-3,343	-3,738	-4,135	-4,533
0%	1,149	771	388	0	-392	-786	-1,182
2.67%	2,618	2,396	2,147	1,876	1,586	1,281	963
5.33%	3,060	2,978	2,867	2,729	2,565	2,378	2,169
8.00%	3,149	3,129	3,094	3,042	2,969	2,876	2,762

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

(단위:백만원)

41,753

공시일	2018-10-15
기준일	2018-10-12

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

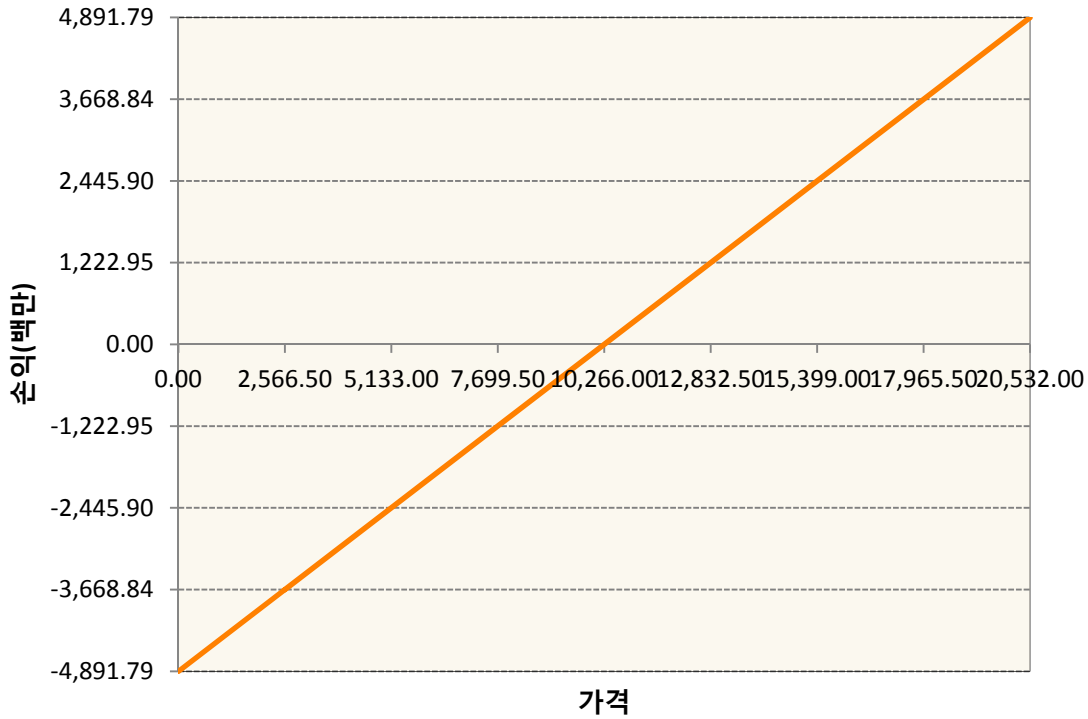
1. 계약금액

(단위:백만원)

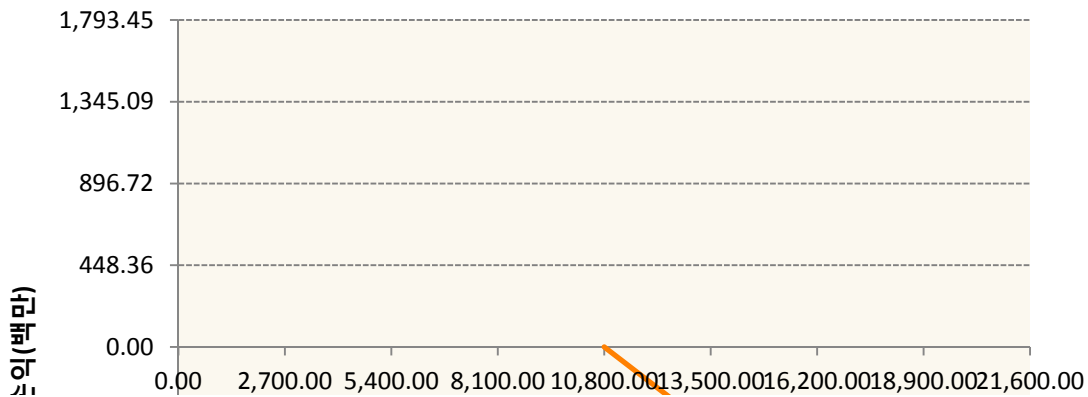
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,892	0	4,892	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,847	-11,847	장내

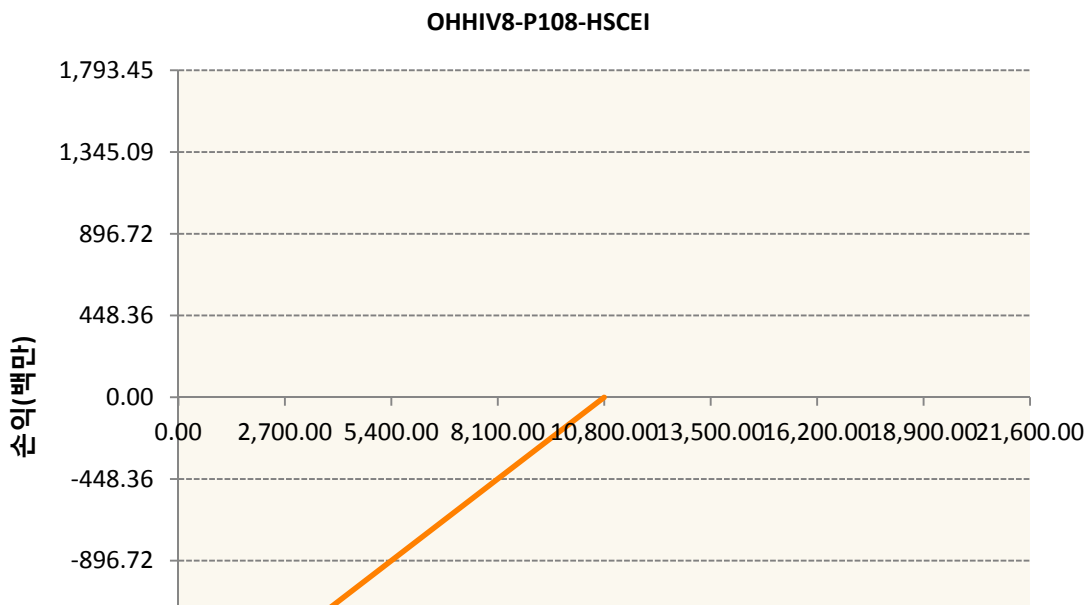
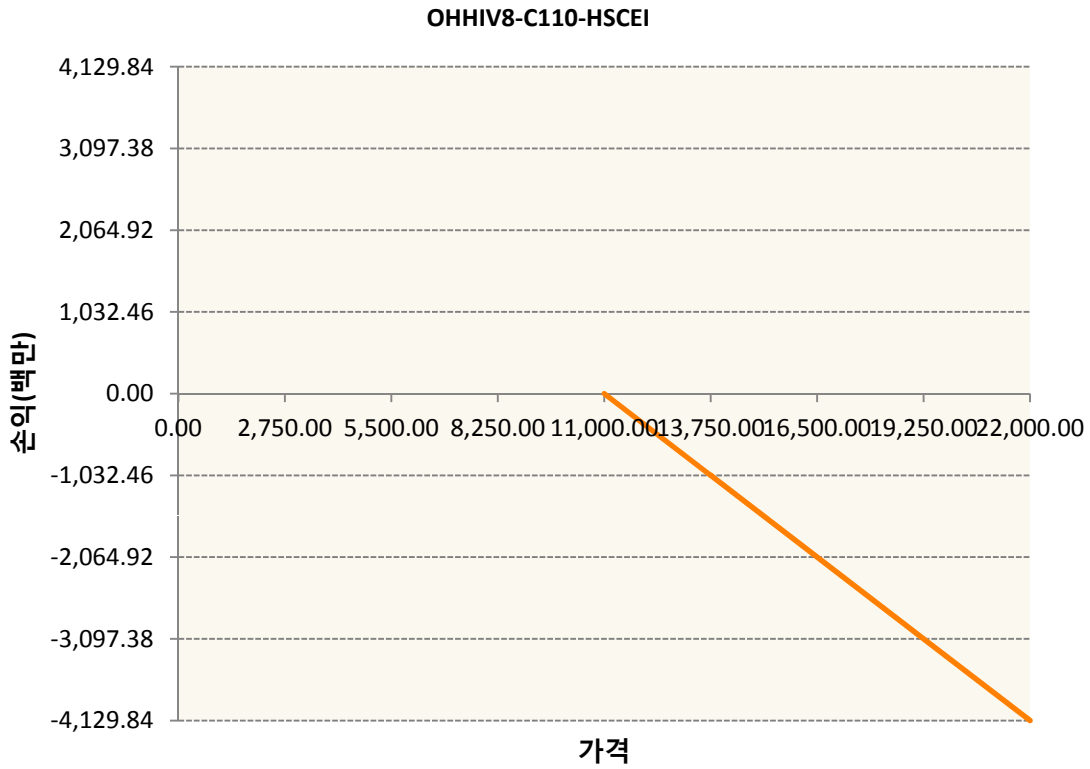
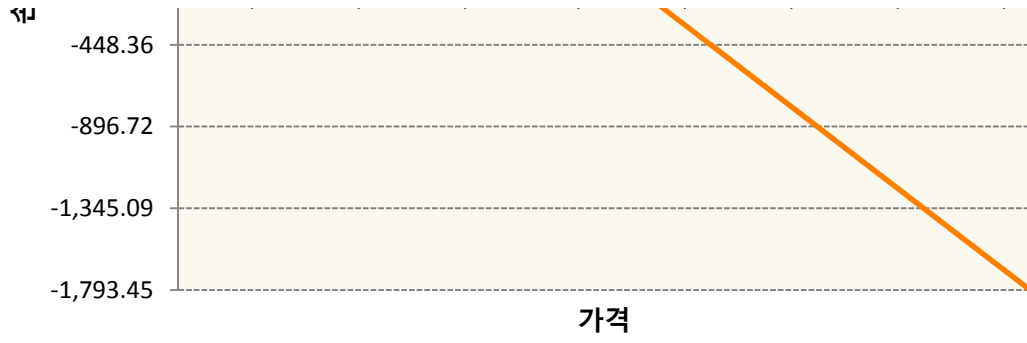
2. 만기시점의 손익구조

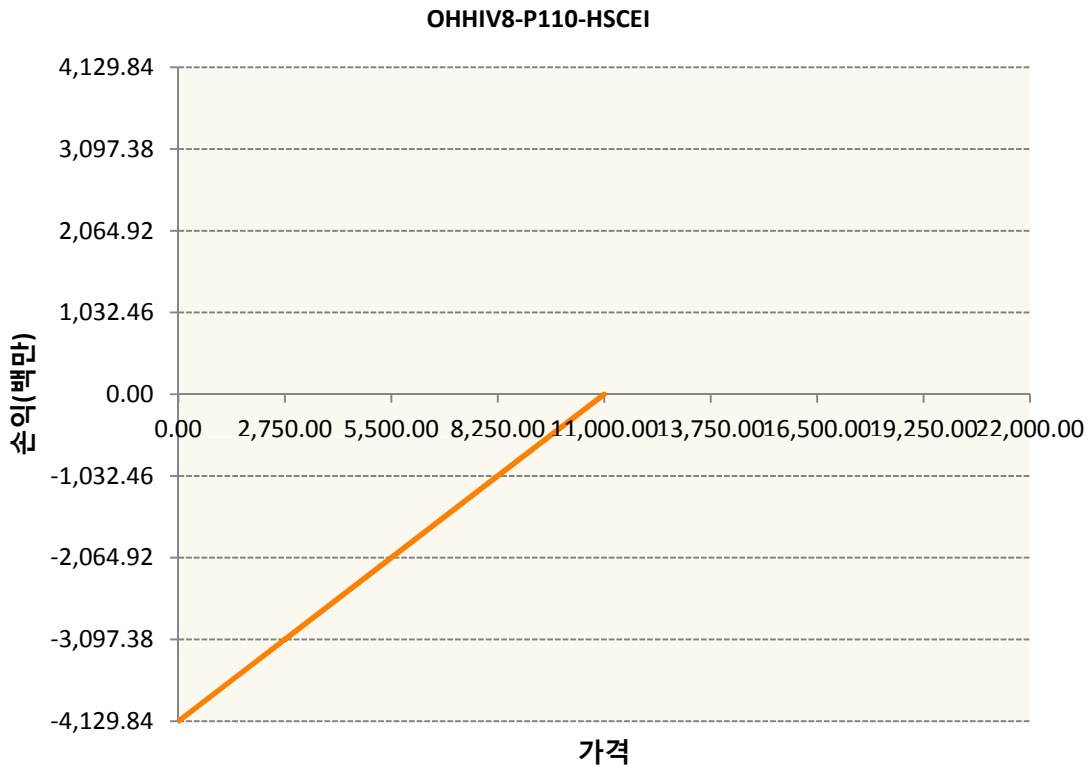
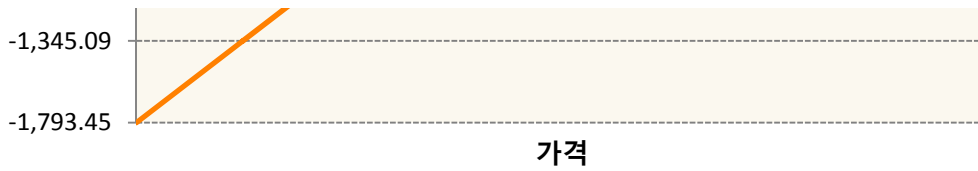
HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



OHHIV8-C108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	391
OHHIV8-C1	HSCEI	143
OHHIV8-C11	HSCEI	330
OHHIV8-P1C	HSCEI	143
OHHIV8-P11	HSCEI	330

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,282

공시일	2018-10-15
기준일	2018-10-12

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

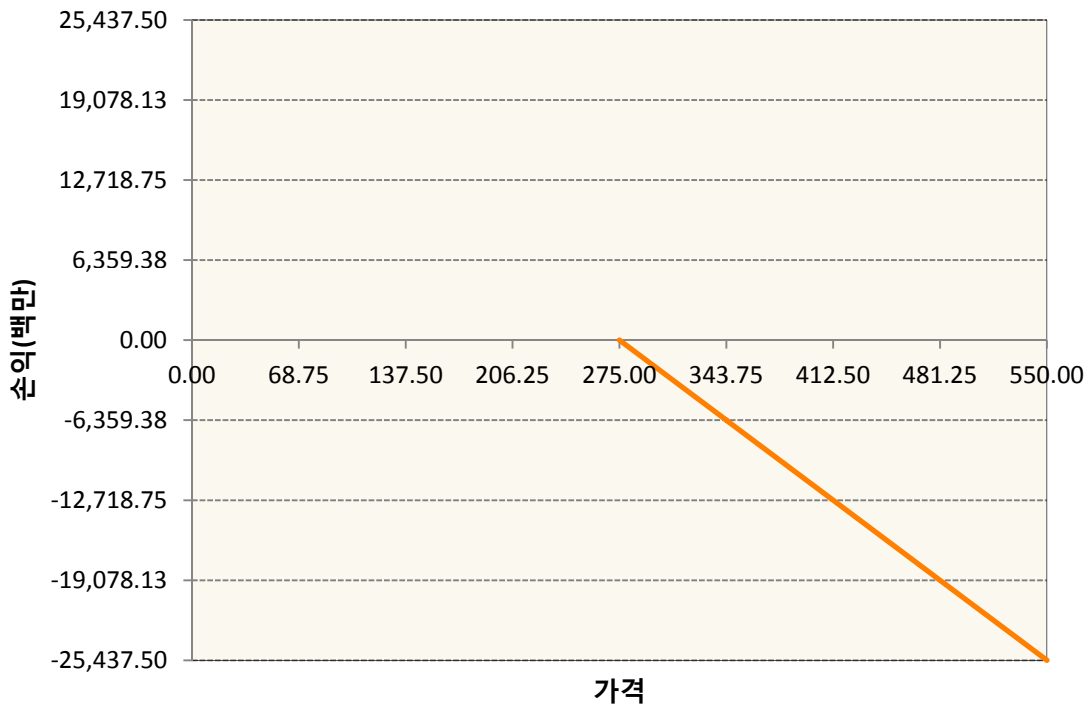
1. 계약금액

(단위:백만원)

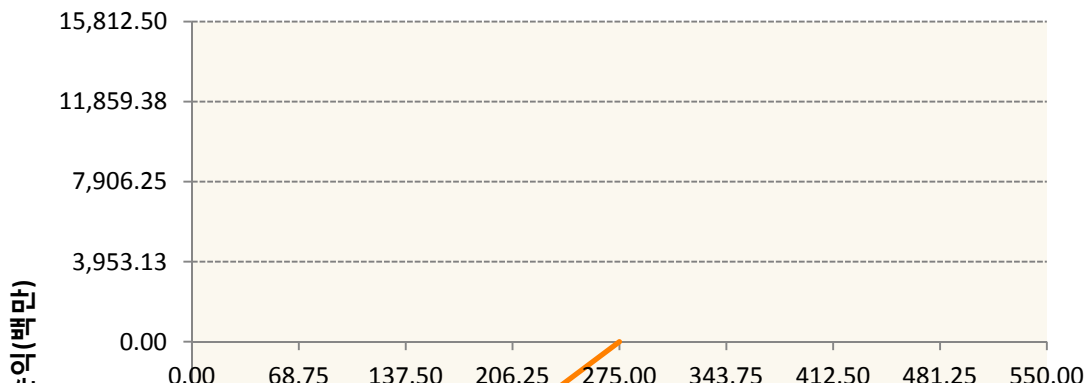
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	44,932	-44,932	장내
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	44,025	-44,025	장내

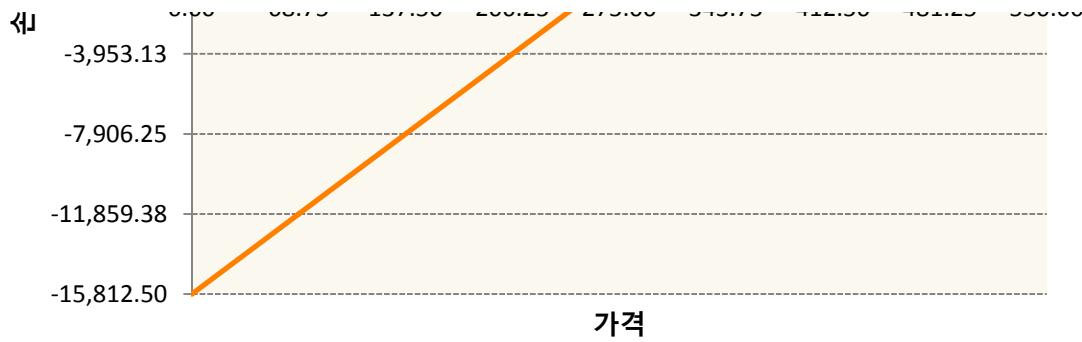
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

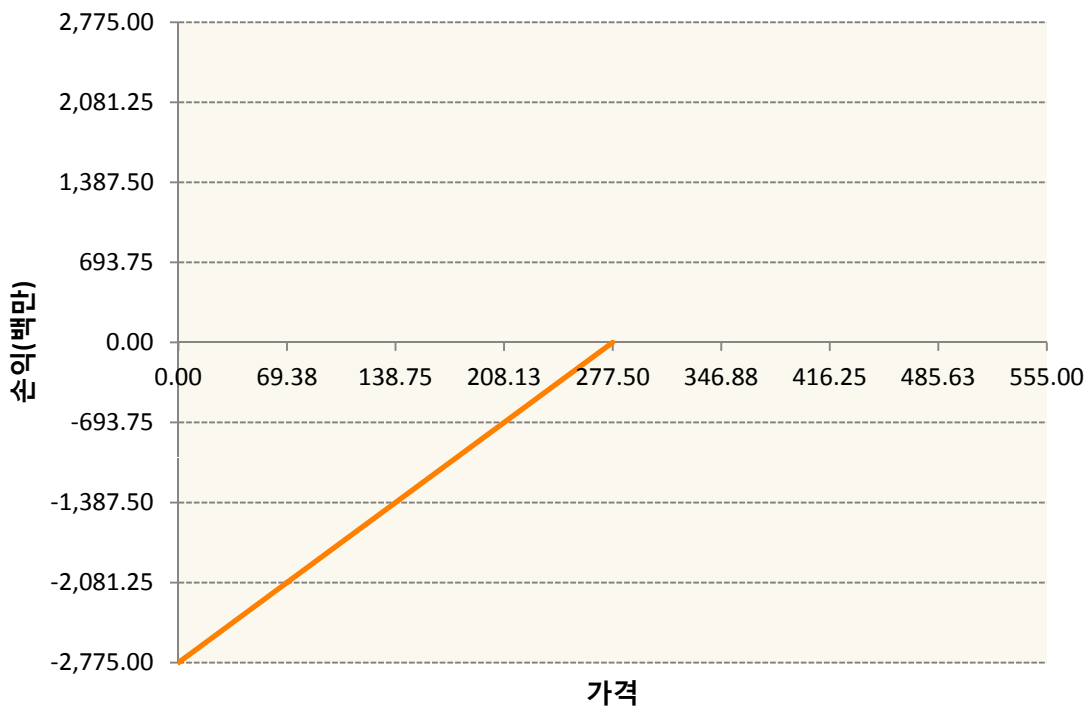


KR4301NB2751-2018-11 풋275





KR4301NB2777-2018-11 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							4,005	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-4,005	-4,005	-4,005	-4,005	-4,005	-4,005	-4,005	
-5.33%	-2,670	-2,670	-2,670	-2,670	-2,670	-2,670	-2,670	
-2.67%	-1,335	-1,335	-1,335	-1,335	-1,335	-1,335	-1,335	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	1,335	1,335	1,335	1,335	1,335	1,335	1,335	
5.33%	2,670	2,670	2,670	2,670	2,670	2,670	2,670	
8.00%	4,005	4,005	4,005	4,005	4,005	4,005	4,005	
KR4201NB27 2018-11 콜275							1,699	
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	889	860	826	790	750	708	664
-5.33%	771	723	673	622	570	516	462
-2.67%	542	482	422	362	302	241	181
0%	180	120	60	0	-60	-121	-182
2.67%	-308	-356	-406	-459	-512	-567	-623
5.33%	-891	-923	-959	-998	-1,041	-1,086	-1,133
8.00%	-1,532	-1,549	-1,571	-1,598	-1,628	-1,662	-1,699

KR4301NB27 2018-11 풋275

900

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-850	-854	-860	-868	-877	-888	-900
-5.33%	-453	-467	-482	-499	-517	-535	-554
-2.67%	-131	-155	-179	-202	-226	-250	-274
0%	70	47	23	0	-24	-48	-72
2.67%	158	145	130	114	96	78	58
5.33%	185	180	174	165	155	144	131
8.00%	191	189	187	184	180	174	167

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

168

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-162	-162	-163	-164	-165	-167	-168
-5.33%	-91	-93	-95	-97	-100	-102	-105
-2.67%	-29	-33	-37	-41	-45	-49	-53
0%	13	9	4	0	-4	-9	-13
2.67%	34	31	28	25	21	17	14
5.33%	42	40	39	37	35	32	30
8.00%	43	43	42	42	41	39	38

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

(단위:백만원)

6,716

공시일	2018-10-15
기준일	2018-10-12

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

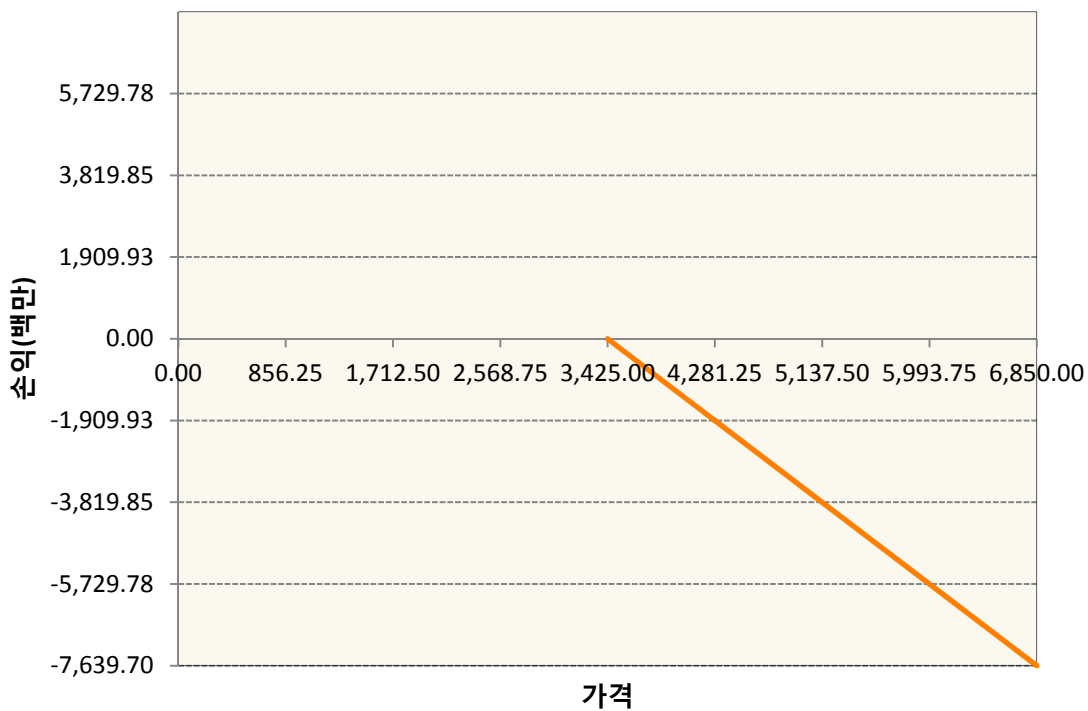
1. 계약금액

(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	2,831	0	2,831	
누계	유가증권	스왑	34,648	0	34,648	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,078	-20,078	장내
누계	지수	스왑	53,267	0	53,267	장외

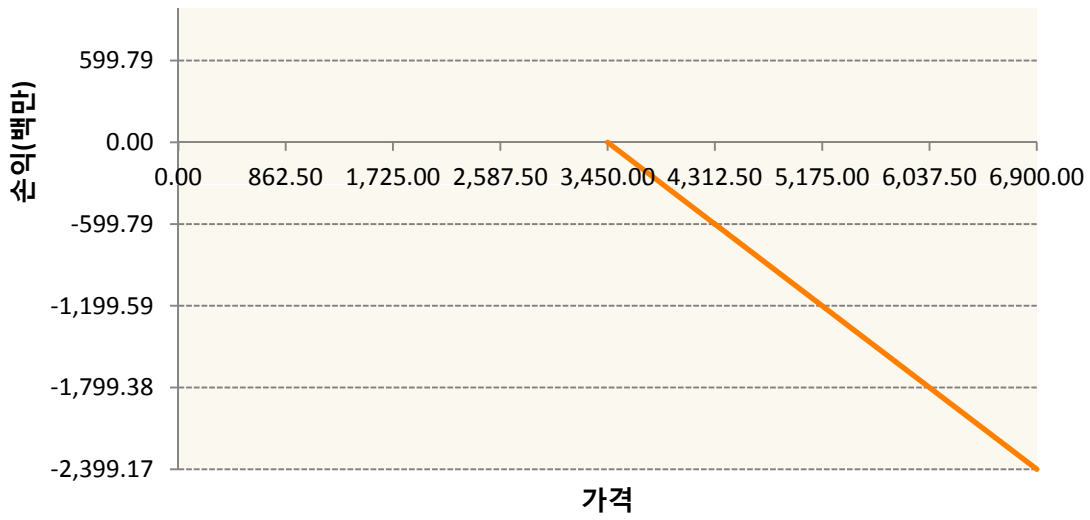
2. 만기시점의 손익구조

OESXV8-C3425-EURO STOXX 50

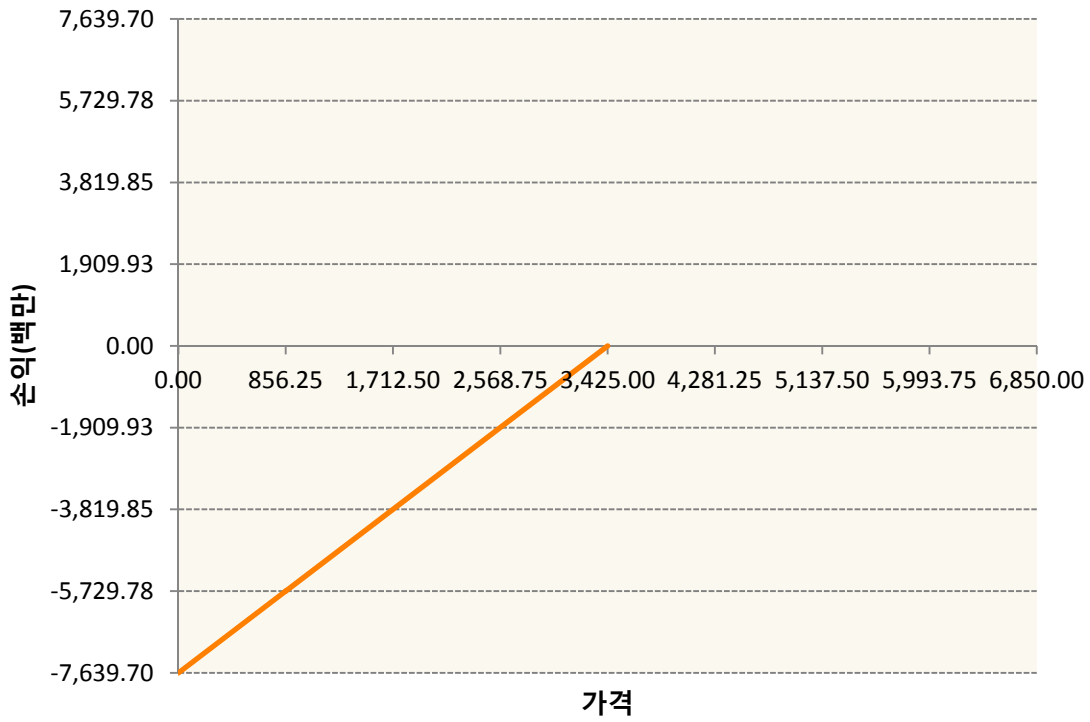


OESXV8-C3450-EURO STOXX 50

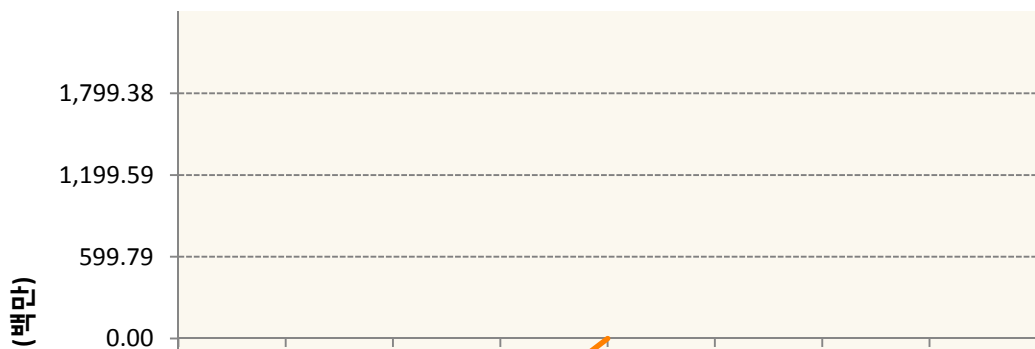


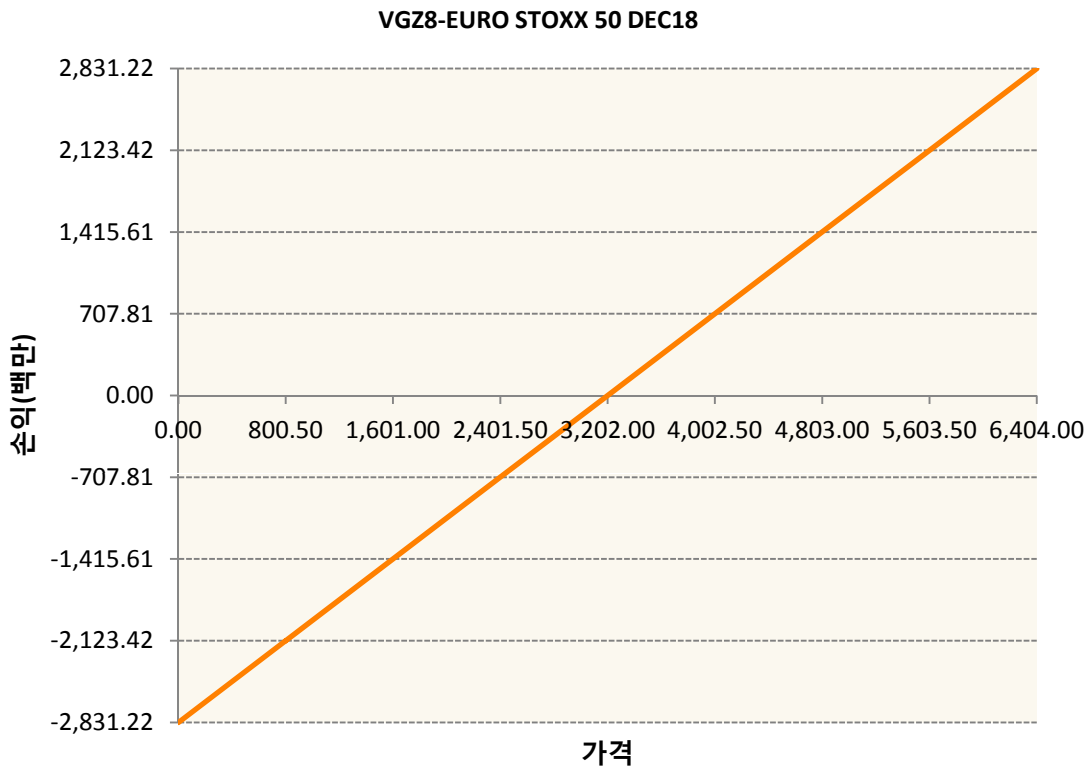
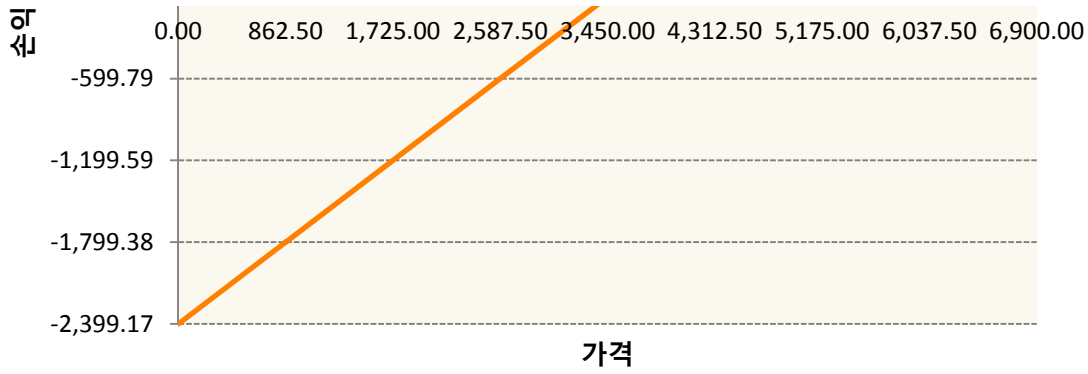


OESXV8-P3425-EURO STOXX 50



OESXV8-P3450-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		143
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		93
OESXV8-C34 EURO STOXX 50		611
OESXV8-C34 EURO STOXX 50		192
OESXV8-P34 EURO STOXX 50		611
OESXV8-P34 EURO STOXX 50		192
VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18		227

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

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

(단위:백만원)

1,147

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

(단위:백만원)

90

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

(단위:백만원)

136

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

(단위:백만원)

160

공시일	2018-10-15
기준일	2018-10-12

스마트KRX300인덱스목표전환형1

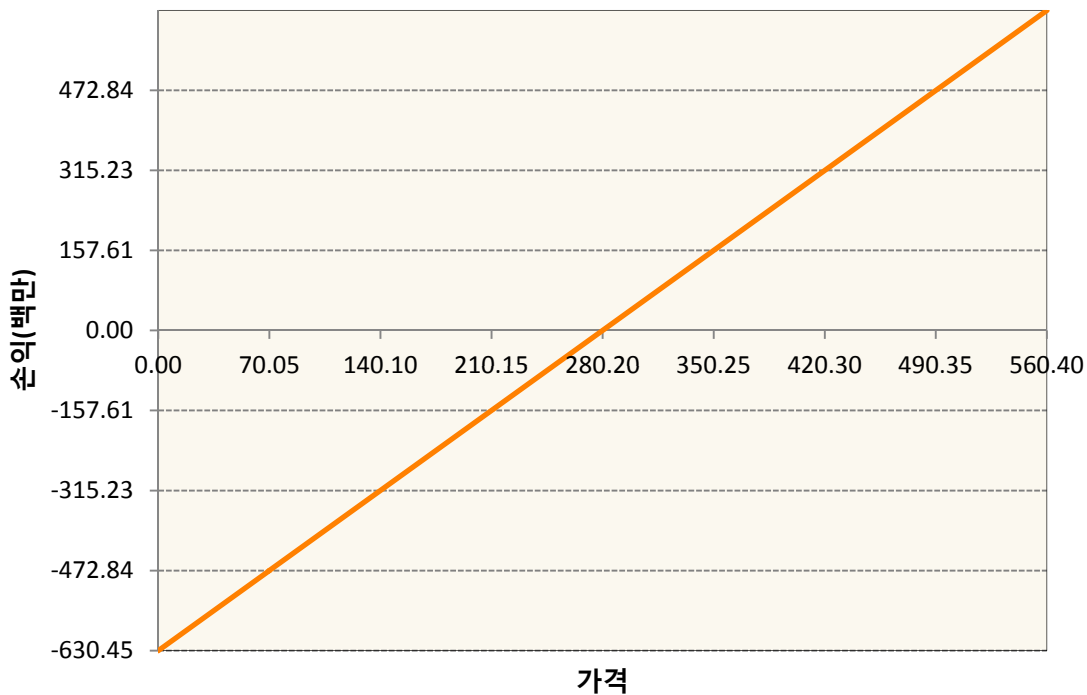
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	630	0	630	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물)

50

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
-5.33%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	17	17	17	17	17	17	17
5.33%	34	34	34	34	34	34	34
8.00%	50	50	50	50	50	50	50

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

(단위:백만원)

41

공시일	2018-10-15
기준일	2018-10-12

리디파인K200(주식혼합-파생재간

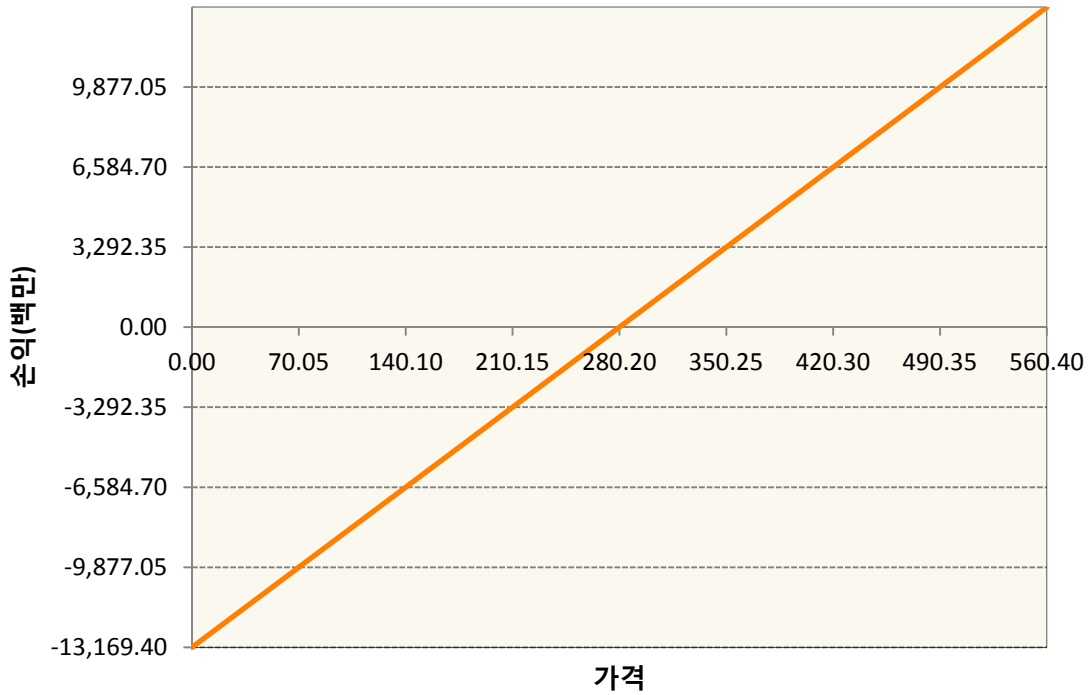
1. 계약금액

(단위:백만원)

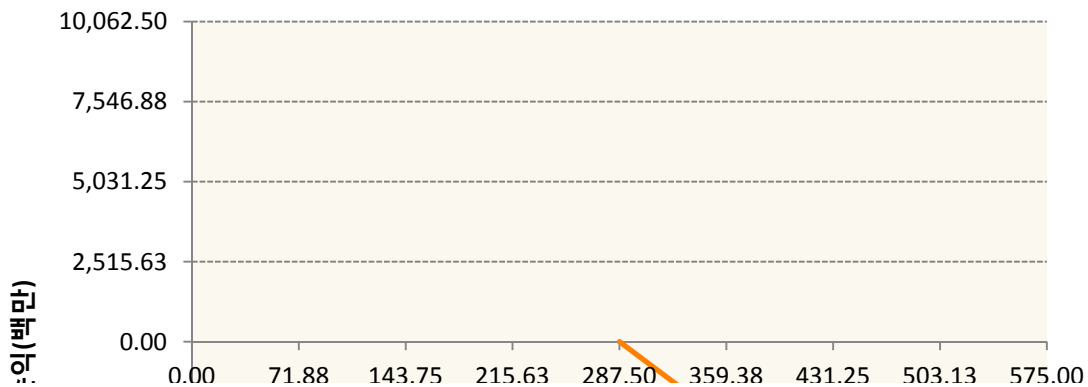
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	9,018	11,942	-2,924	장내
누계	유가증권	선물	13,169	0	13,169	장내
누계	유가증권	옵션	4,059	23,113	-19,054	장내

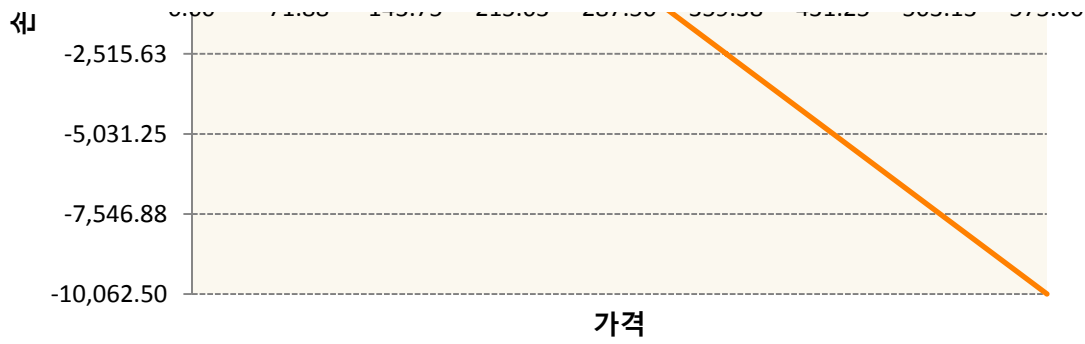
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

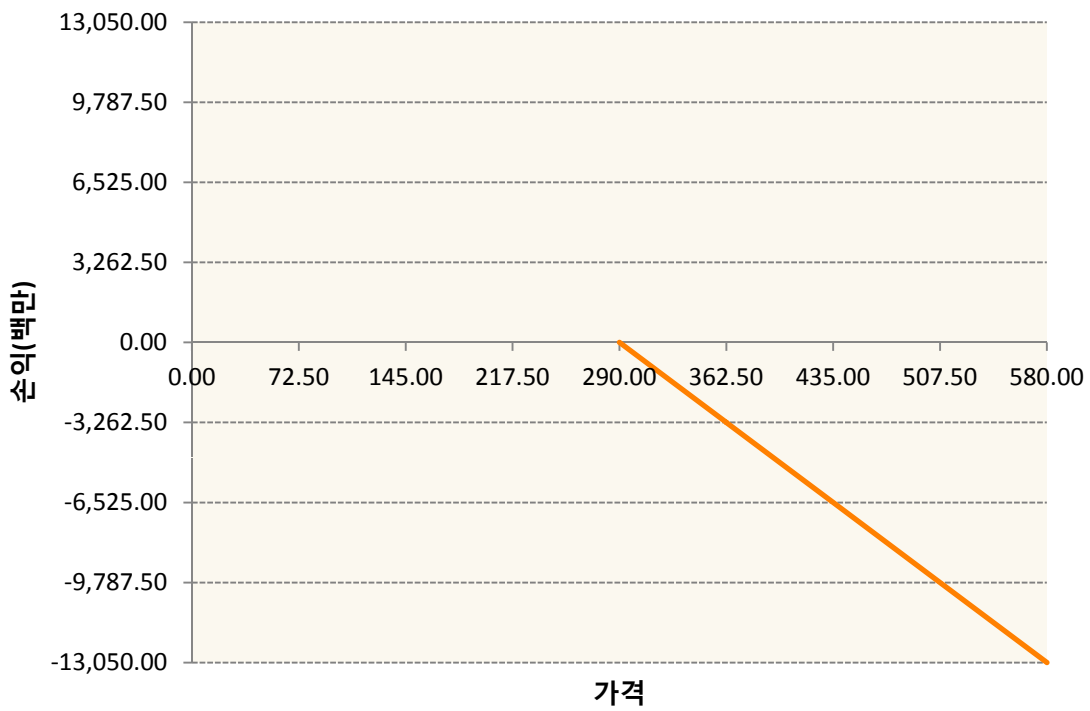


KR4201NB2877-2018-11 콜287.5

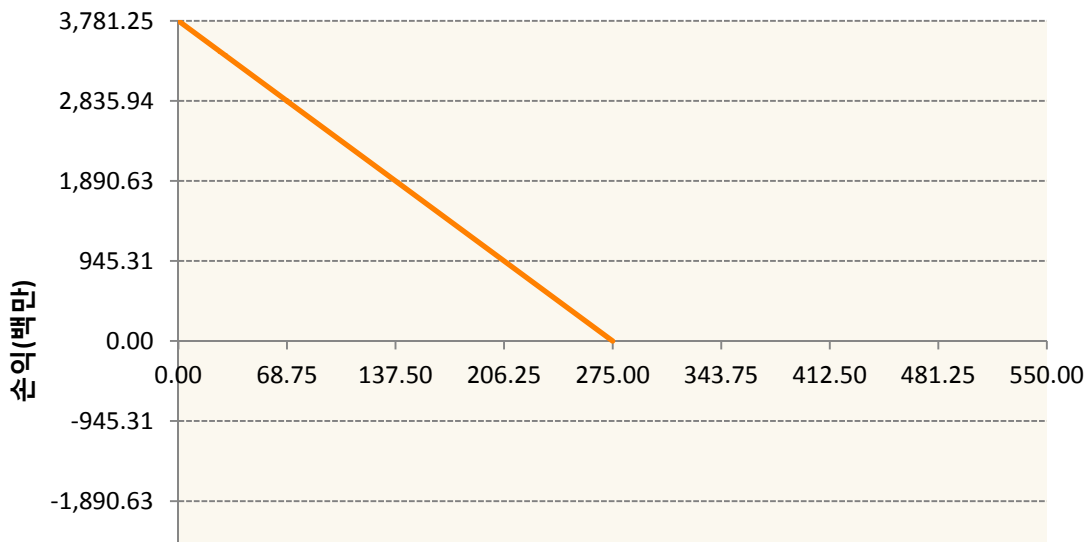


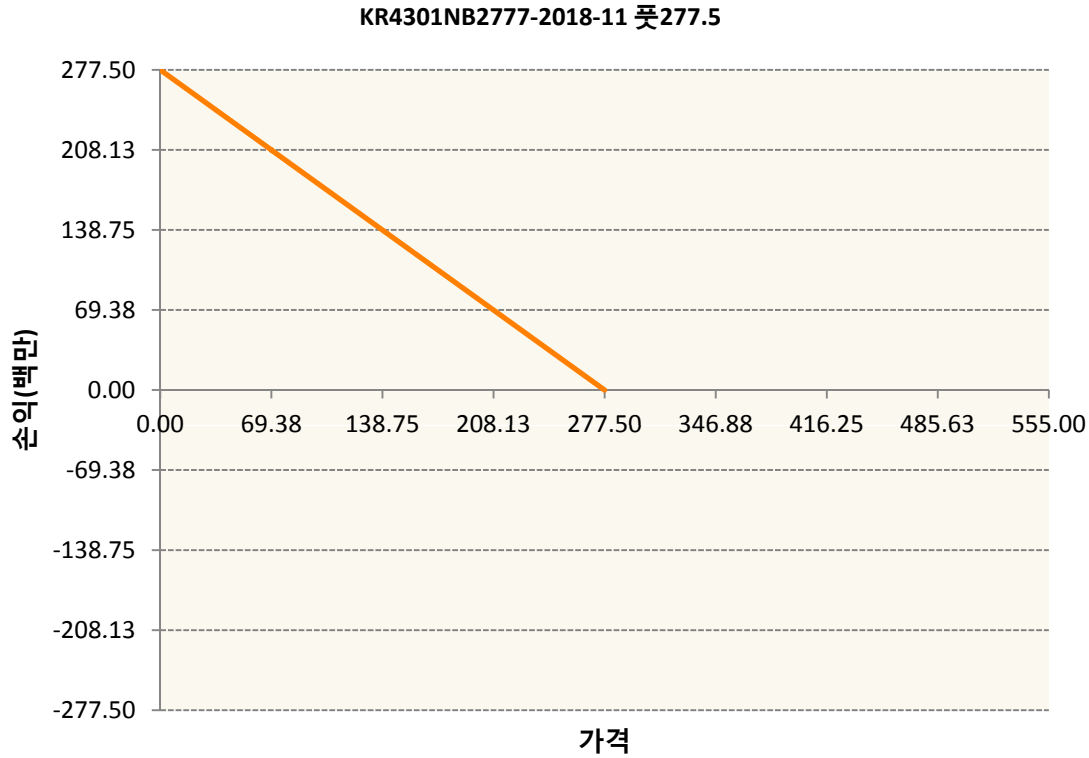
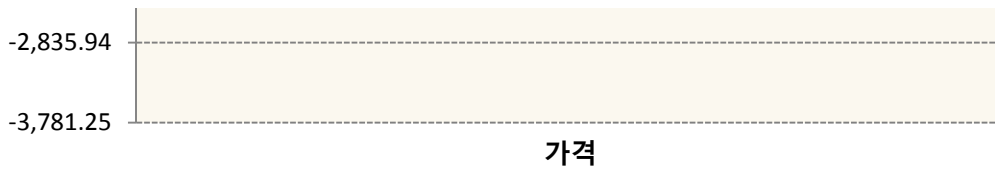


KR4201NB2901-2018-11 콜290



KR4301NB2751-2018-11 풋275





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 1,050

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,050	-1,050	-1,050	-1,050	-1,050	-1,050	-1,050
-5.33%	-700	-700	-700	-700	-700	-700	-700
-2.67%	-350	-350	-350	-350	-350	-350	-350
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	350	350	350	350	350	350	350
5.33%	700	700	700	700	700	700	700
8.00%	1,050	1,050	1,050	1,050	1,050	1,050	1,050

KR4201NB2828 2018-11 콜287.5 505

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	162	159	154	148	140	132	121
-5.33%	152	144	134	123	110	97	82
-2.67%	124	109	93	76	58	40	21

0%	65	43	22	0	-22	-45	-67
2.67%	-39	-63	-88	-112	-136	-160	-184
5.33%	-191	-214	-237	-260	-284	-307	-331
8.00%	-387	-404	-423	-443	-463	-484	-505

KR4201NB27 2018-11 콜290

609

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	176	172	168	161	153	143	132
-5.33%	166	158	148	135	121	105	88
-2.67%	139	123	105	85	64	42	18
0%	77	53	27	0	-27	-55	-83
2.67%	-36	-67	-97	-128	-159	-190	-221
5.33%	-211	-242	-273	-303	-335	-366	-397
8.00%	-445	-470	-496	-524	-552	-580	-609

KR4301NB27 2018-11 풋275

215

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	203	204	206	208	210	212	215
-5.33%	108	112	115	119	124	128	132
-2.67%	31	37	43	48	54	60	66
0%	-17	-11	-6	0	6	11	17
2.67%	-38	-35	-31	-27	-23	-19	-14
5.33%	-44	-43	-41	-39	-37	-34	-31
8.00%	-46	-45	-45	-44	-43	-42	-40

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

17

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	16	16	16	16	17	17	17
-5.33%	9	9	9	10	10	10	11
-2.67%	3	3	4	4	4	5	5
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-3	-3	-3	-2	-2	-2	-1
5.33%	-4	-4	-4	-4	-3	-3	-3
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4

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

(단위:백만원)

1,931

공시일	2018-10-15
기준일	2018-10-12

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

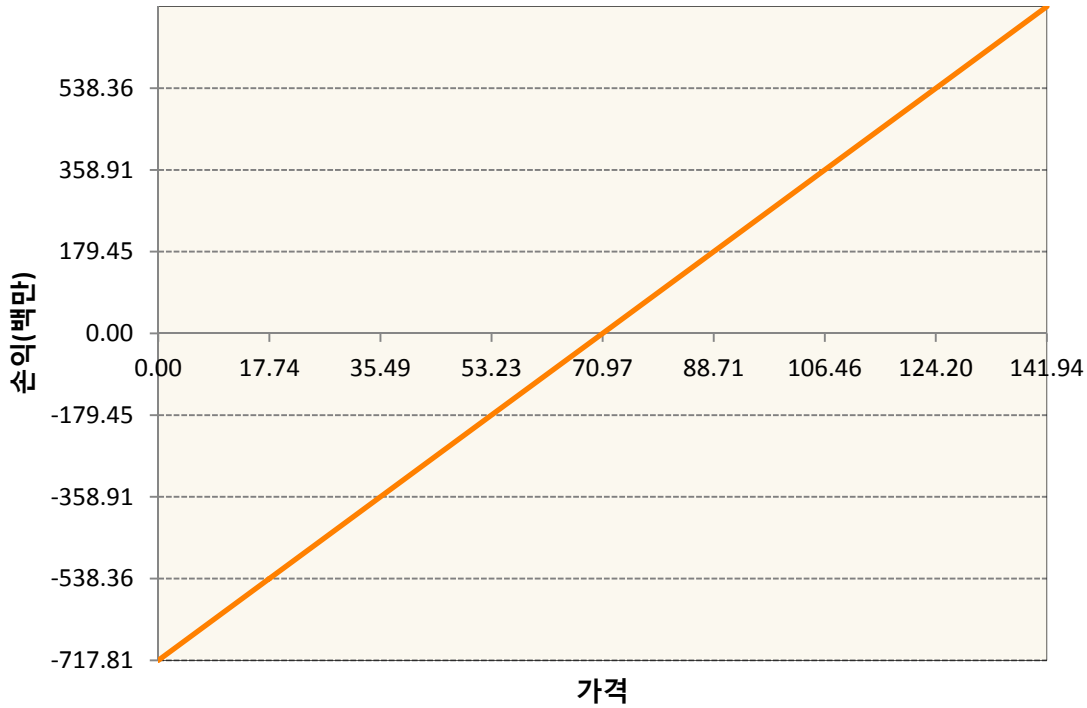
1. 계약금액

(단위:백만원)

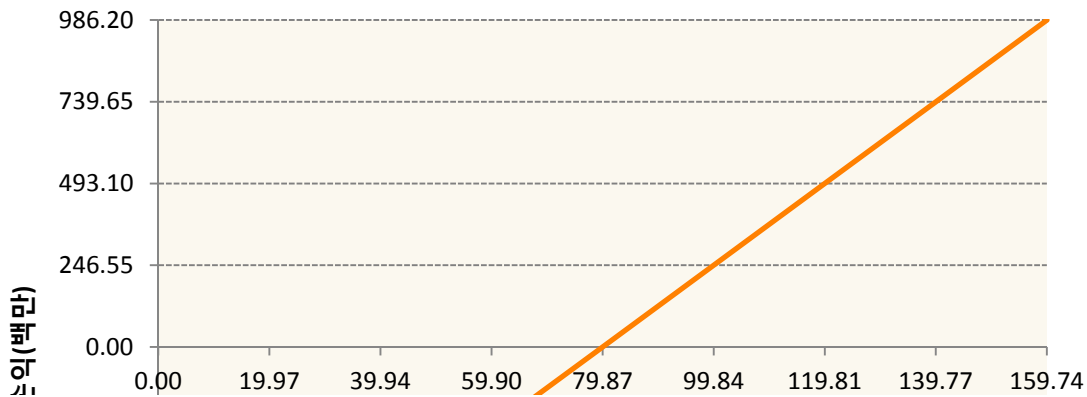
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,138	622	2,516	
누계	유가증권	선물	440	0	440	장내

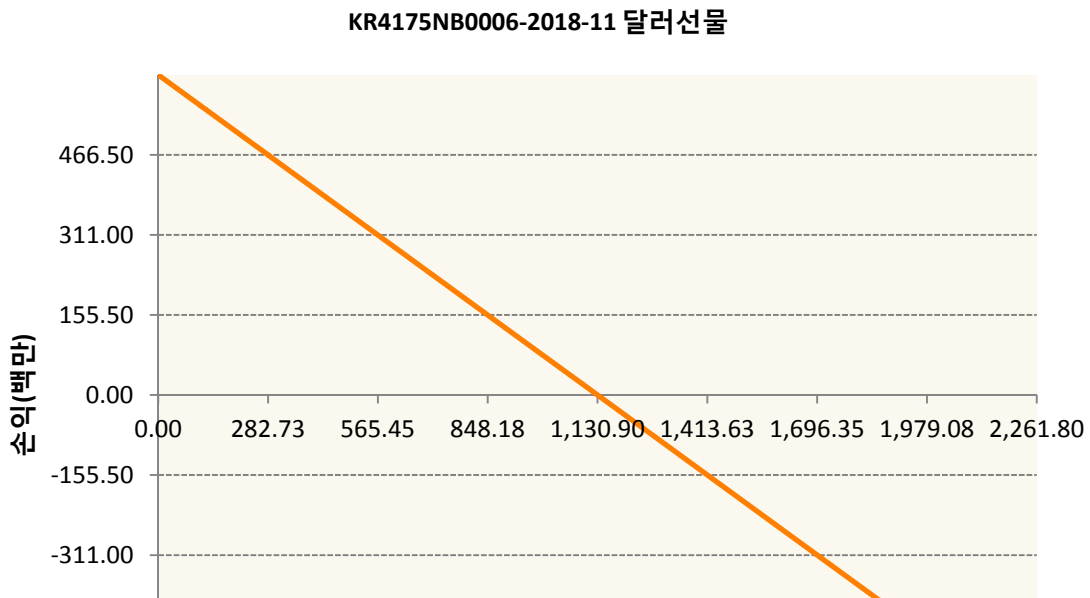
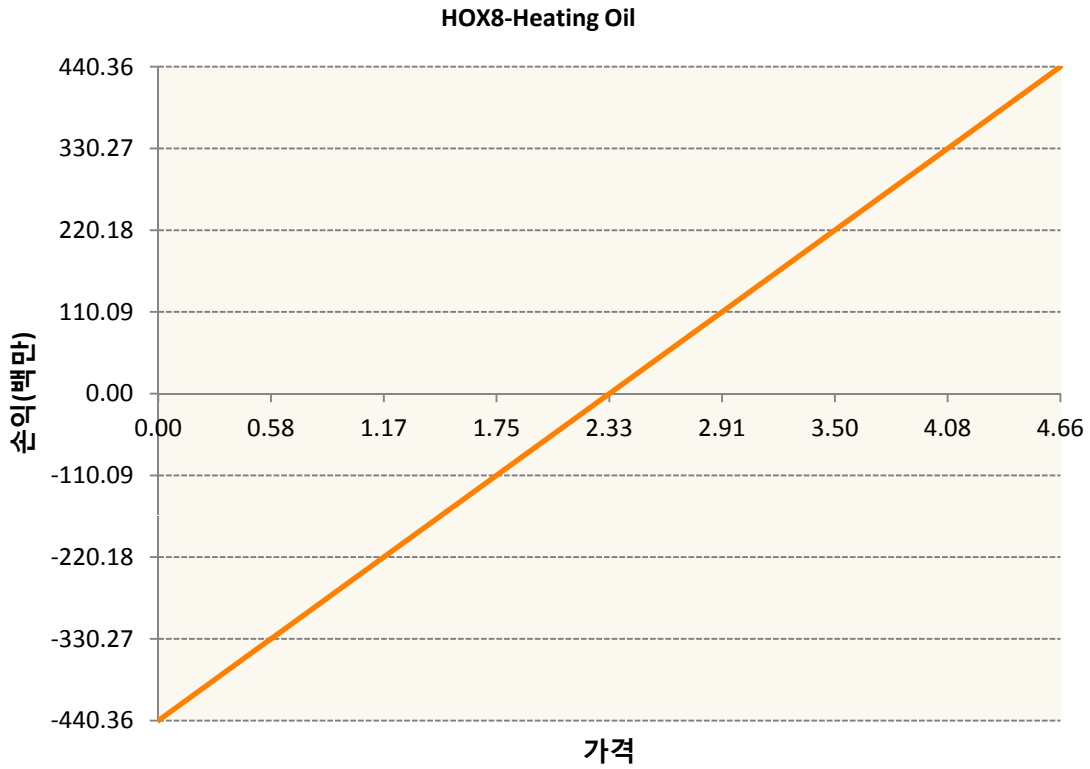
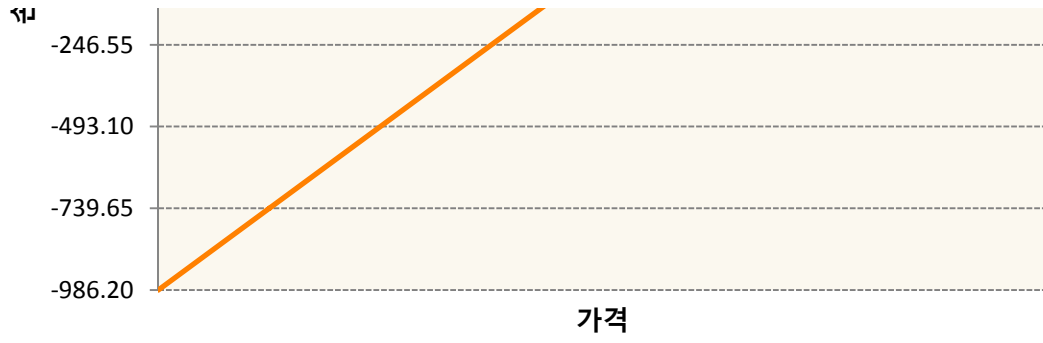
2. 만기시점의 손익구조

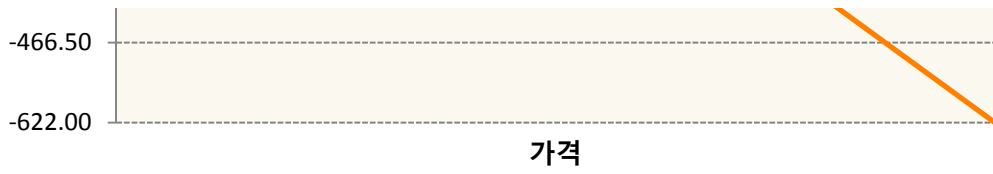
CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18



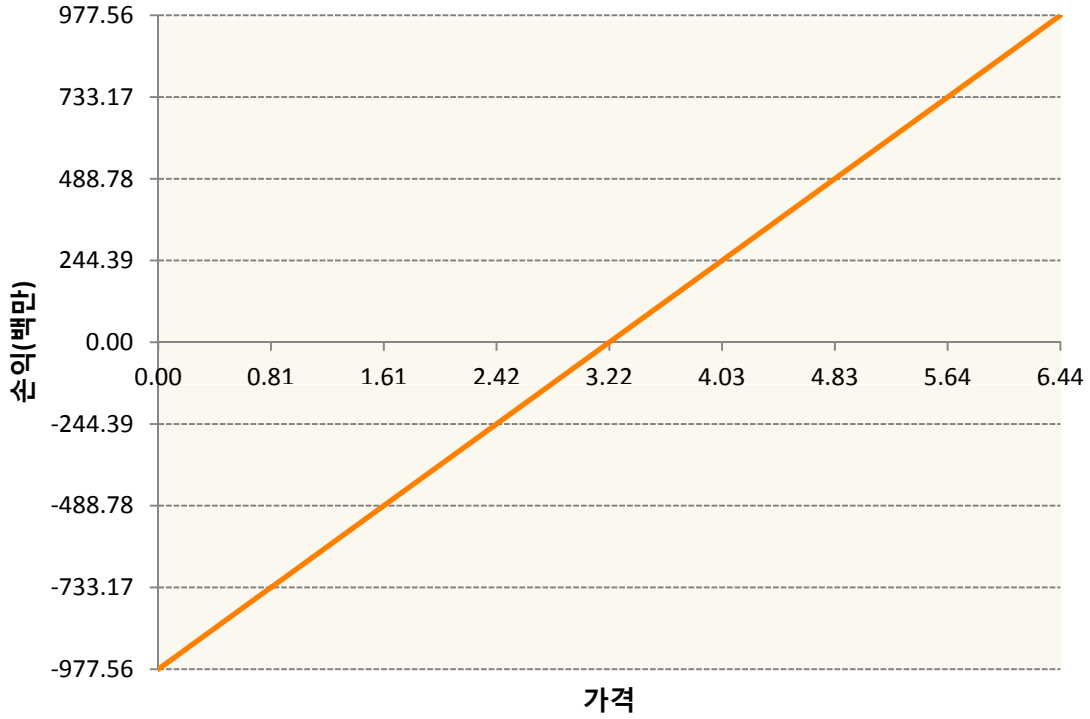
COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19



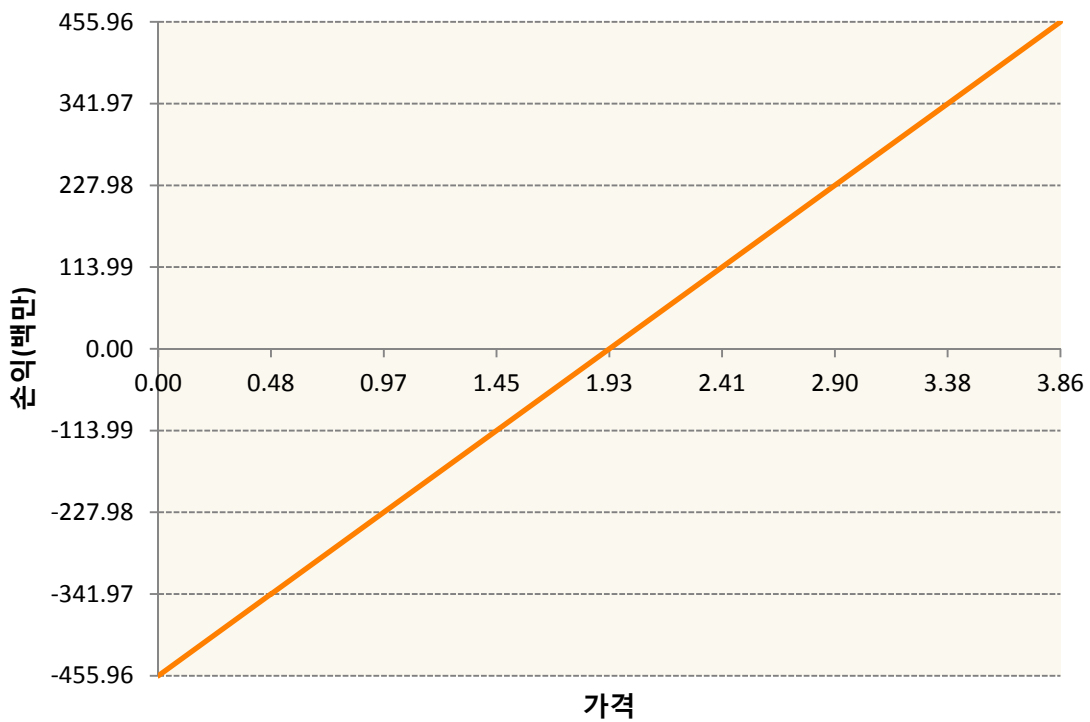




NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18



XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	57
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	79
HOX8	Heating Oil	35
	KR4175NB0(2018-11 달러선물	50
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	78
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	36

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	432

공시일	2018-10-15
기준일	2018-10-12

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

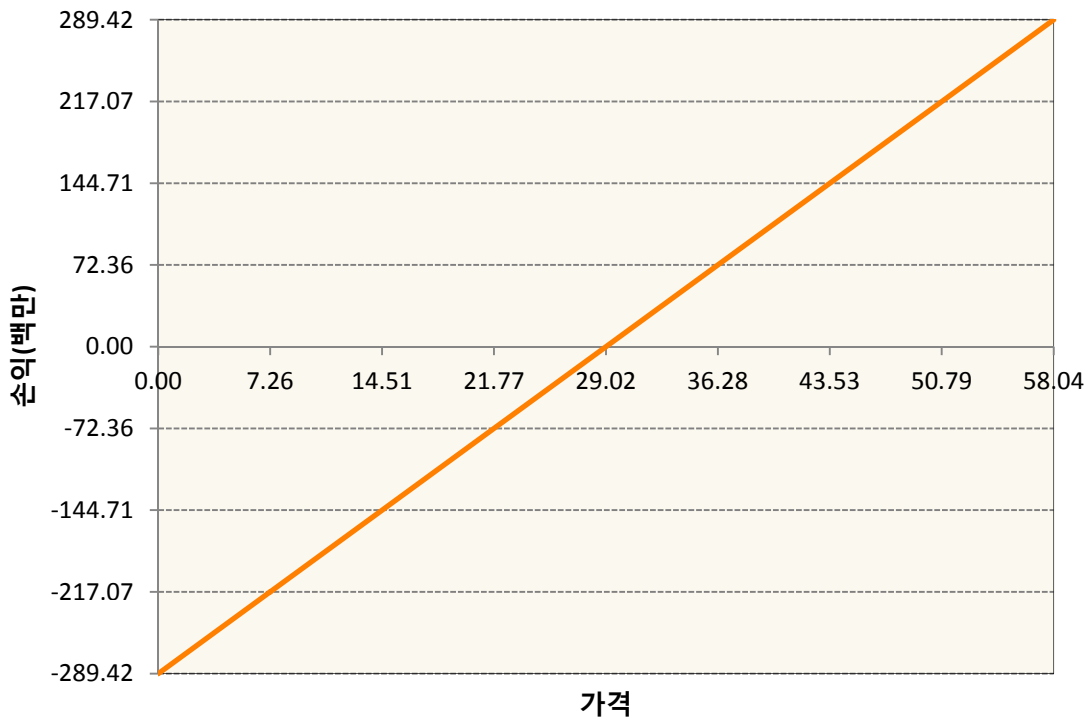
1. 계약금액

(단위:백만원)

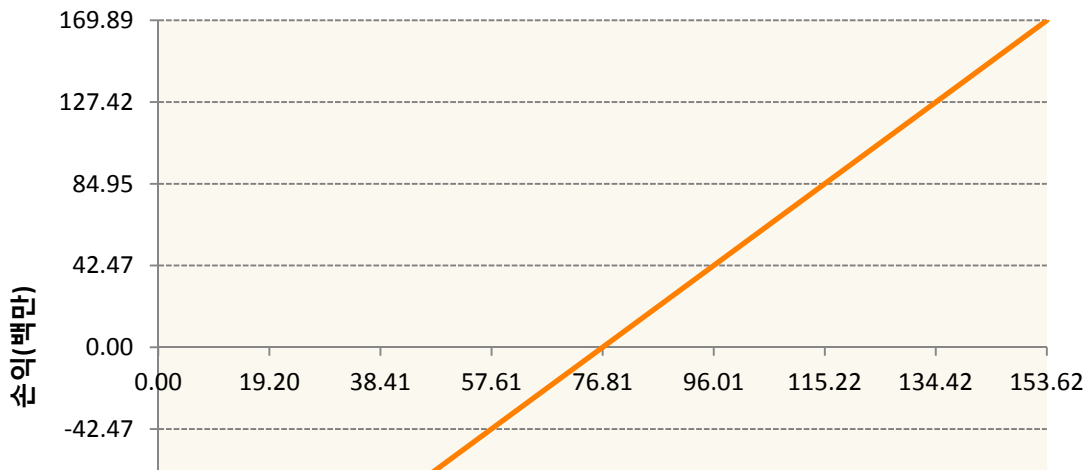
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,550	79	3,471	

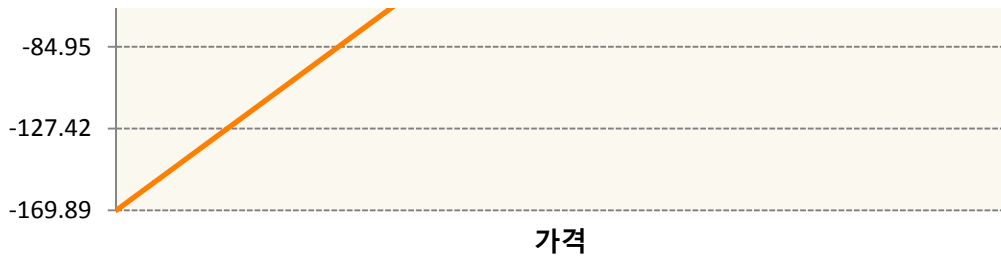
2. 만기시점의 손익구조

BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18

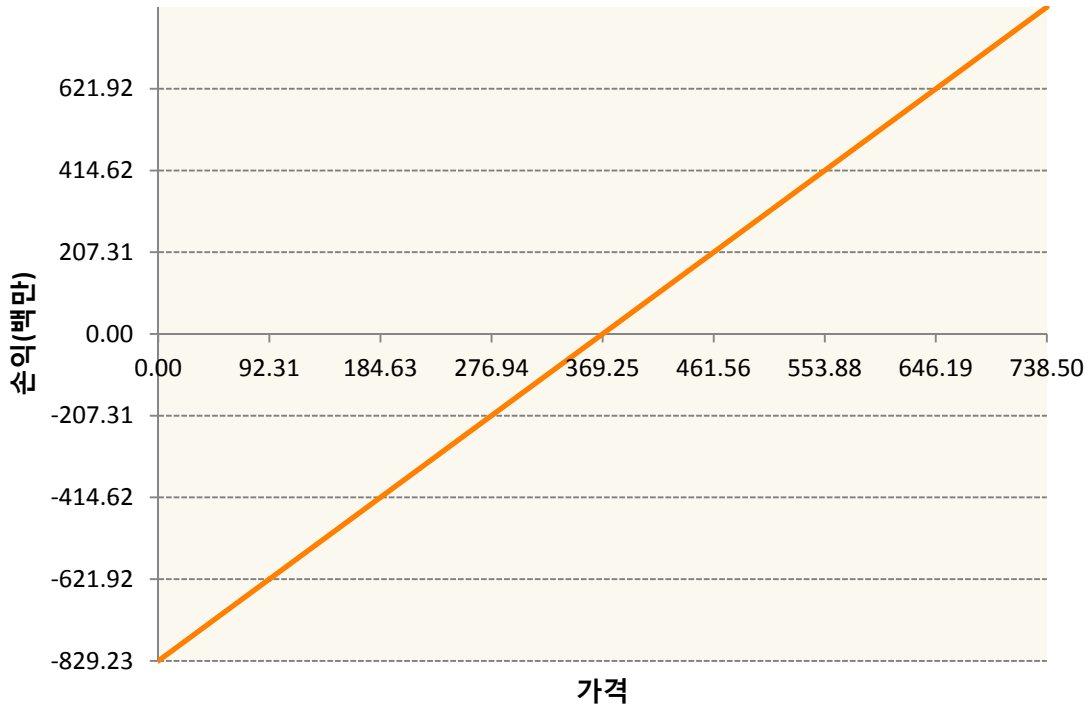


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

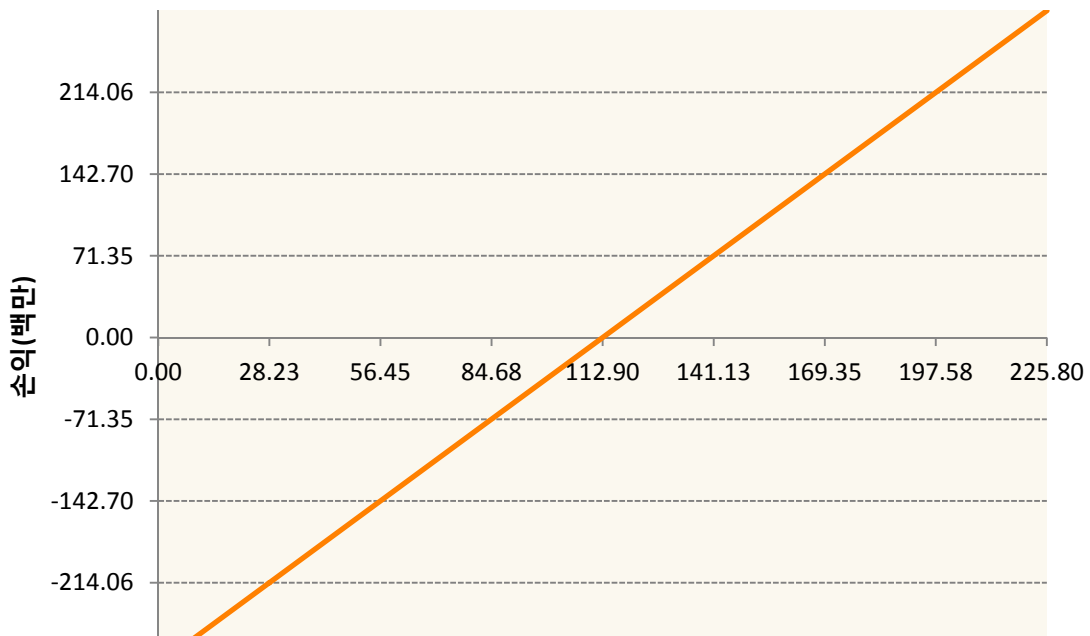


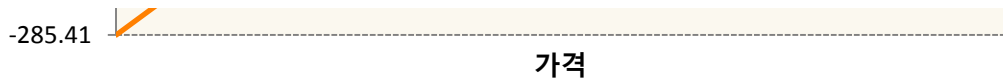


CZ8-CORN FUTURE DEC18

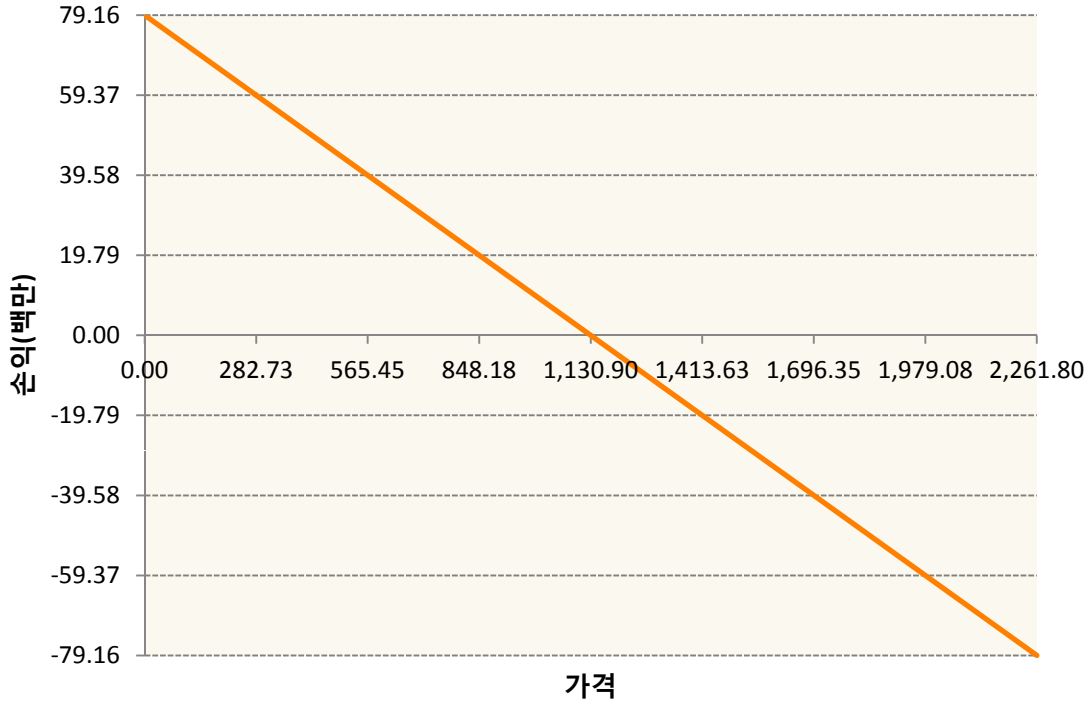


KCZ8-COFFEE 'C' FUTURE Dec18

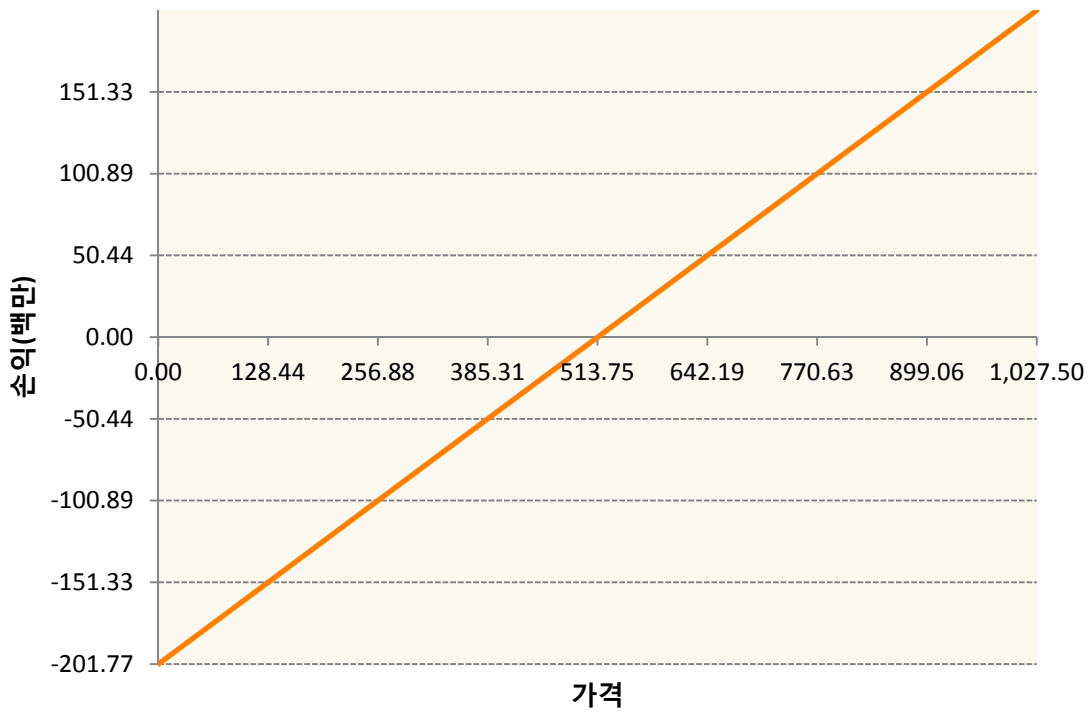




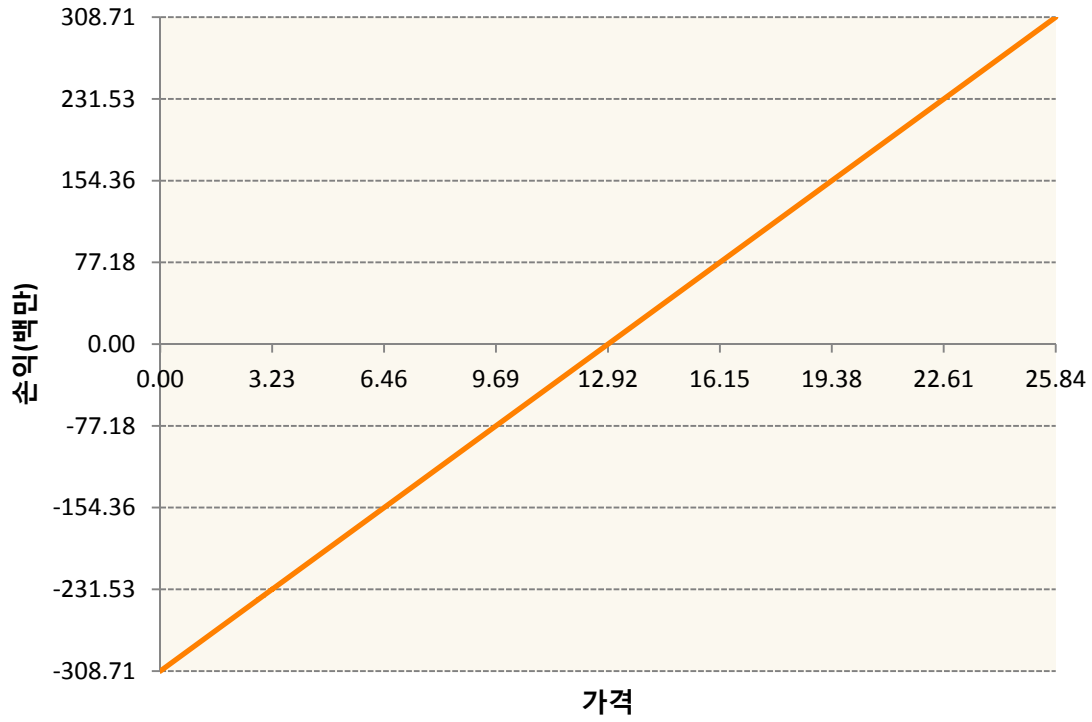
KR4175NB0006-2018-11 달러선물



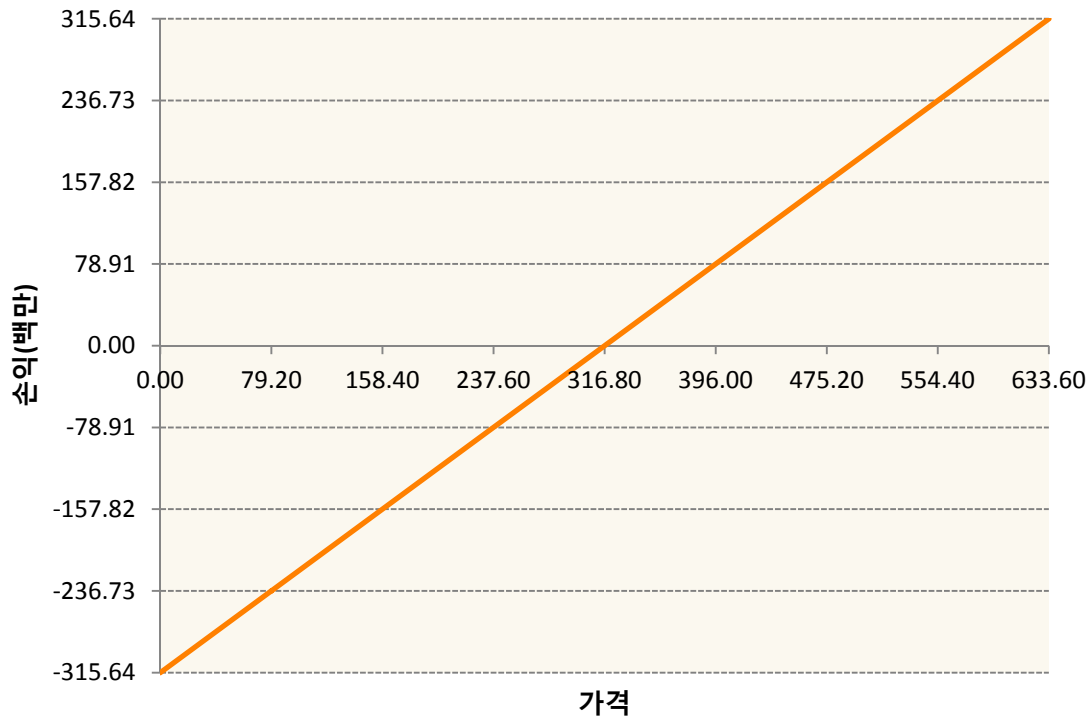
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

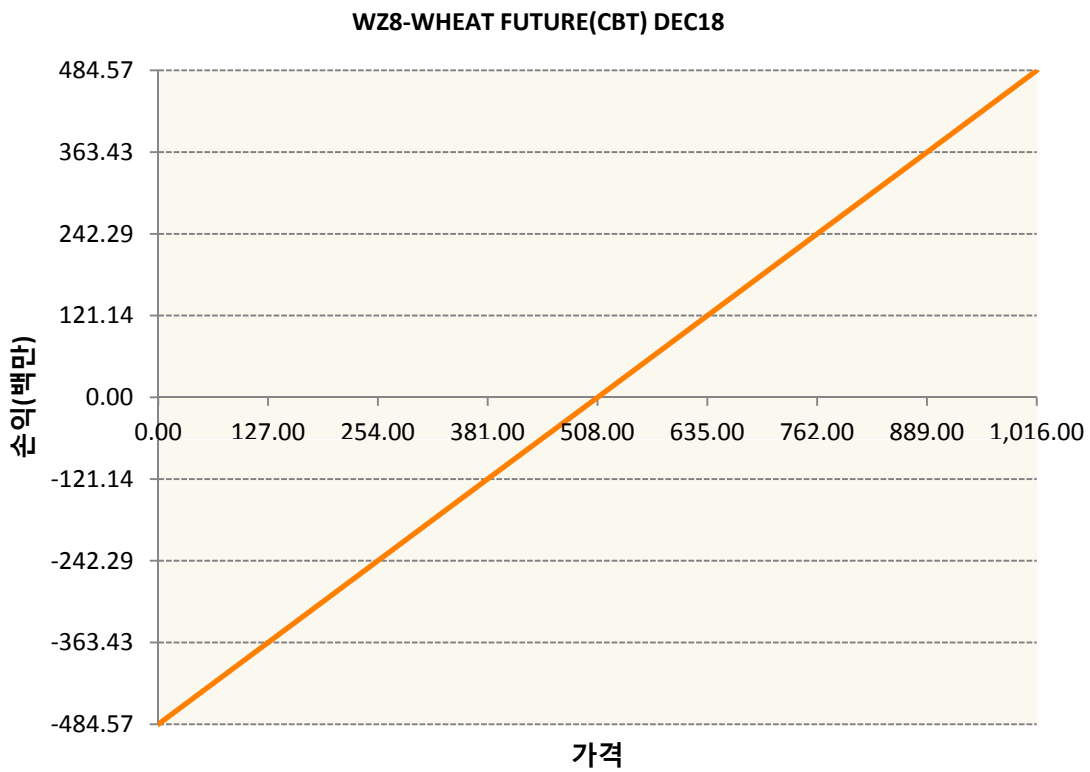
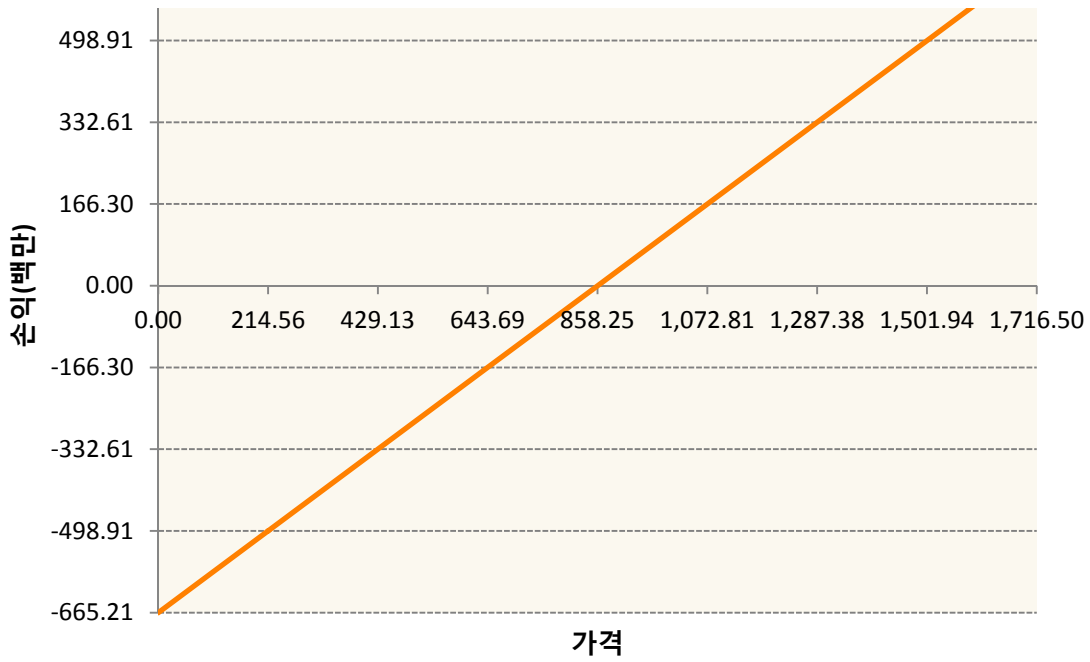


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



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	23
KR4175NB0(2018-11	달러선물	6

KWZ8	KC HRW WHEAT FUT DEC18	16
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	25
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)

309