

공시일	2018-10-17
기준일	2018-10-16

## 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	2018-10-17
기준일	2018-10-16

## 스마트인덱스모

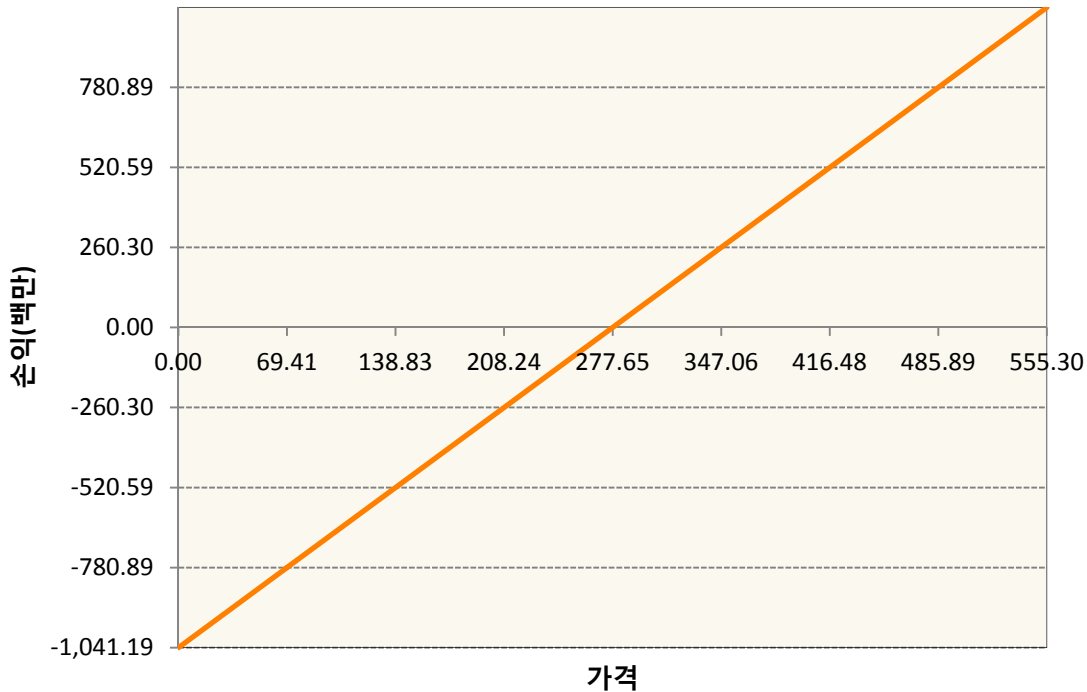
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,041	0	1,041	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 83

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-5.33%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-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%	55	55	55	55	55	55	55
8.00%	83	83	83	83	83	83	83

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

(단위:백만원)

67

공시일	2018-10-17
기준일	2018-10-16

## 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

1,093

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

485

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-17
기준일	2018-10-16

## 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

249

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

337

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-10-17
기준일	2018-10-16

## 유로인덱스모(주식-파생형)

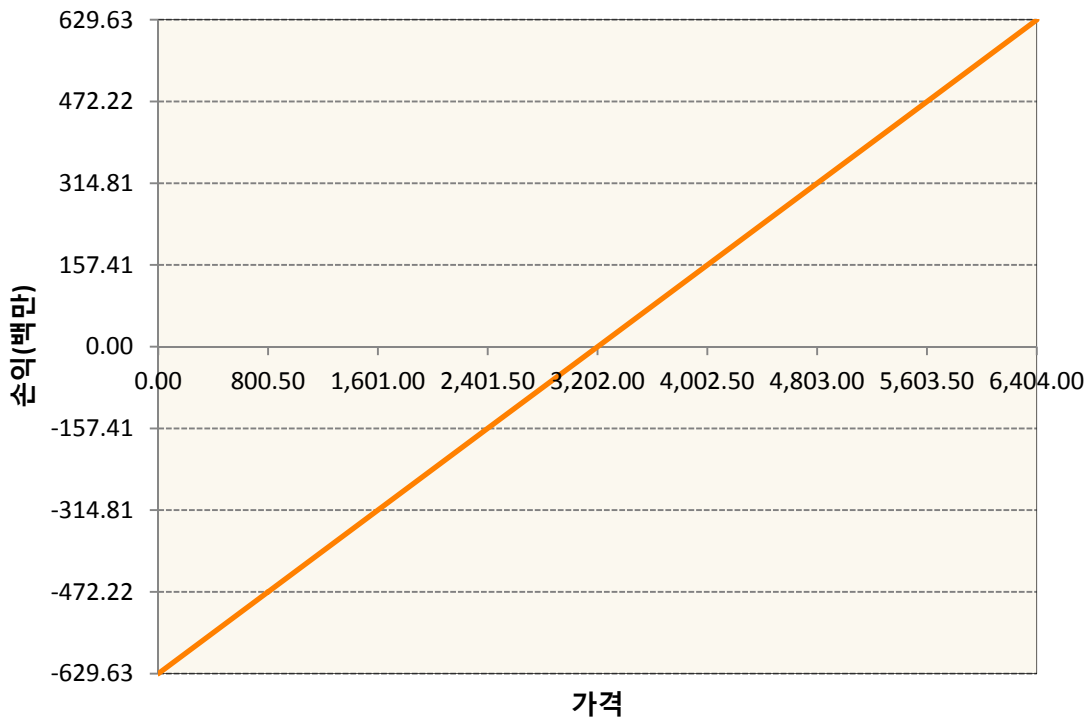
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

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

### 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	2018-10-17
기준일	2018-10-16

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

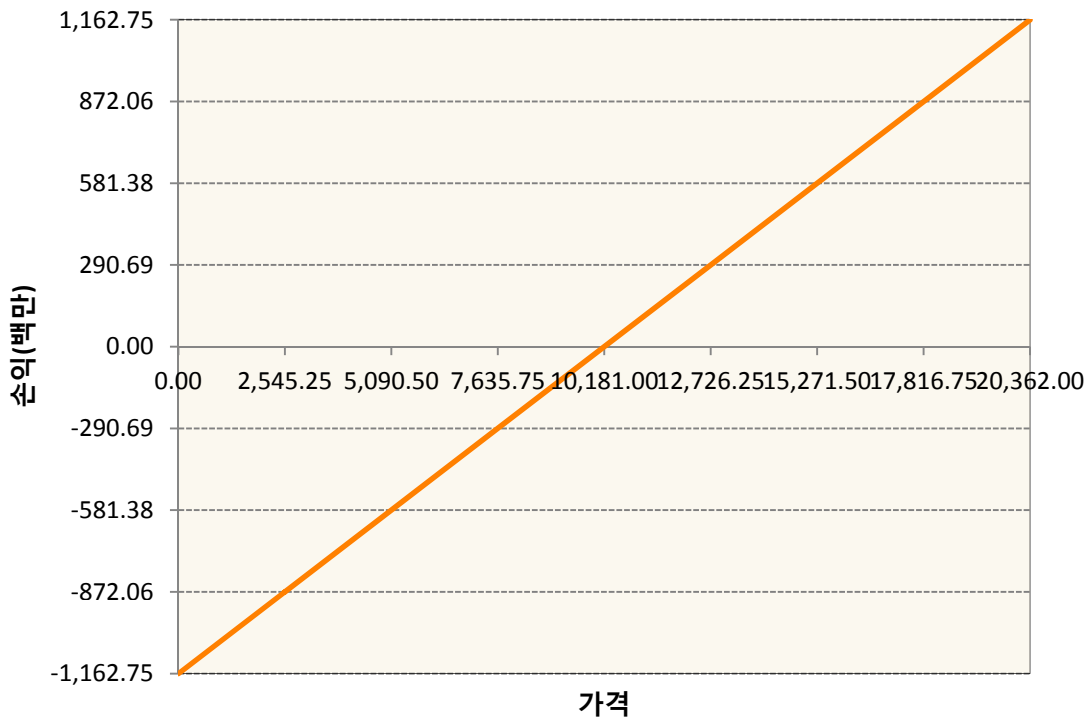
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

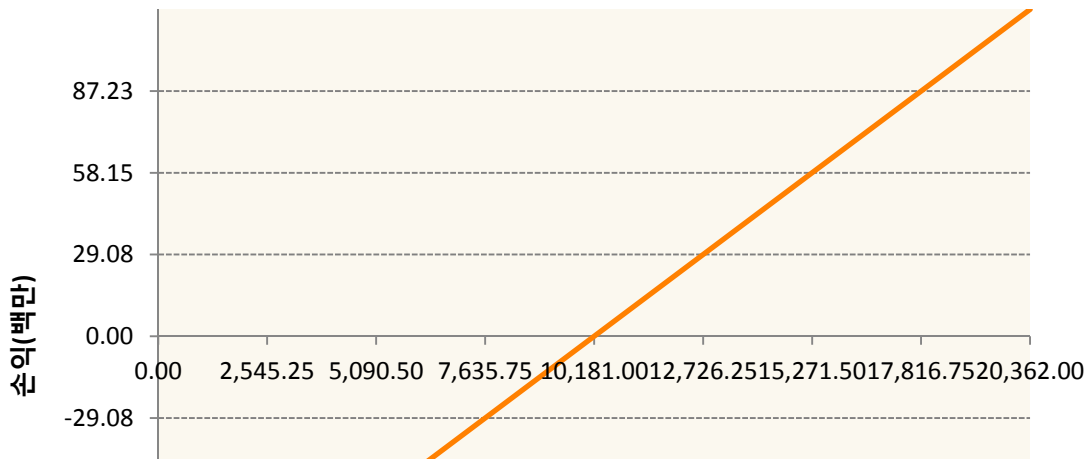
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,279	0	1,279	장내

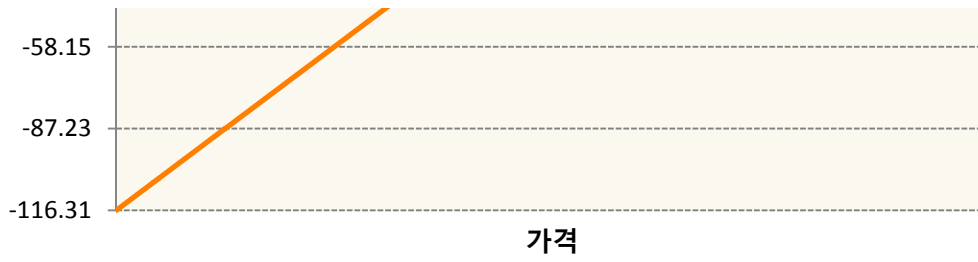
### 2. 만기시점의 손익구조

HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



MHCV8-MINI H-SHR IDX FU OCT 18





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	93
MHCV8	MINI H-SHR IDX FU OCT 18	9

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

<b>98</b>
-----------

공시일	2018-10-17
기준일	2018-10-16

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

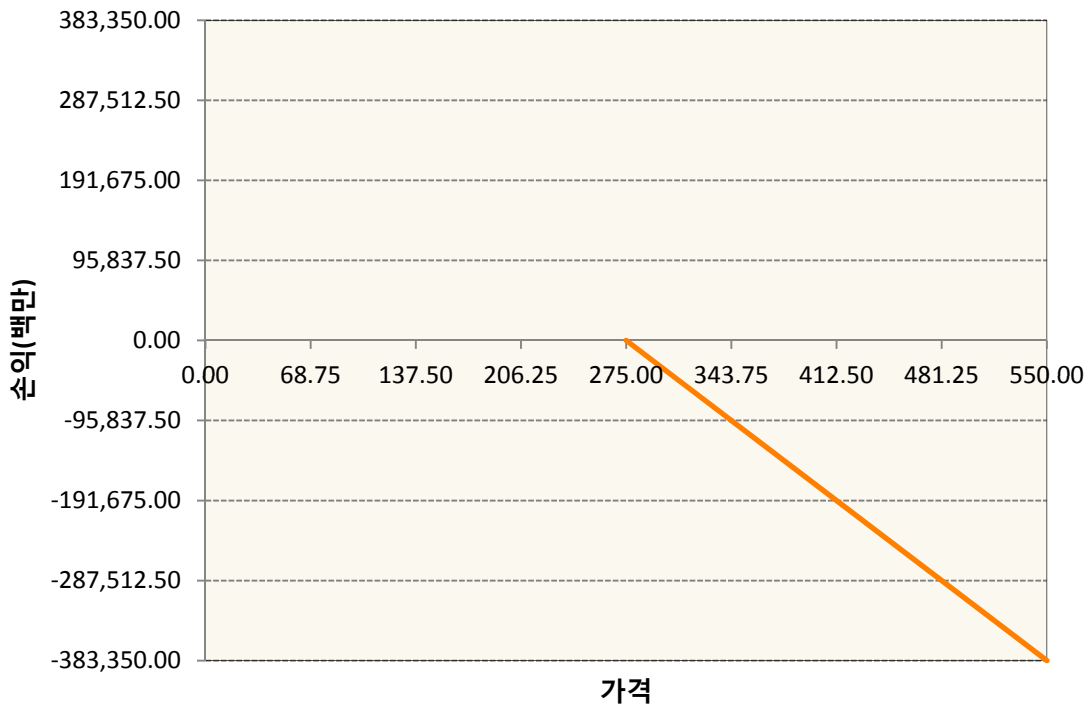
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

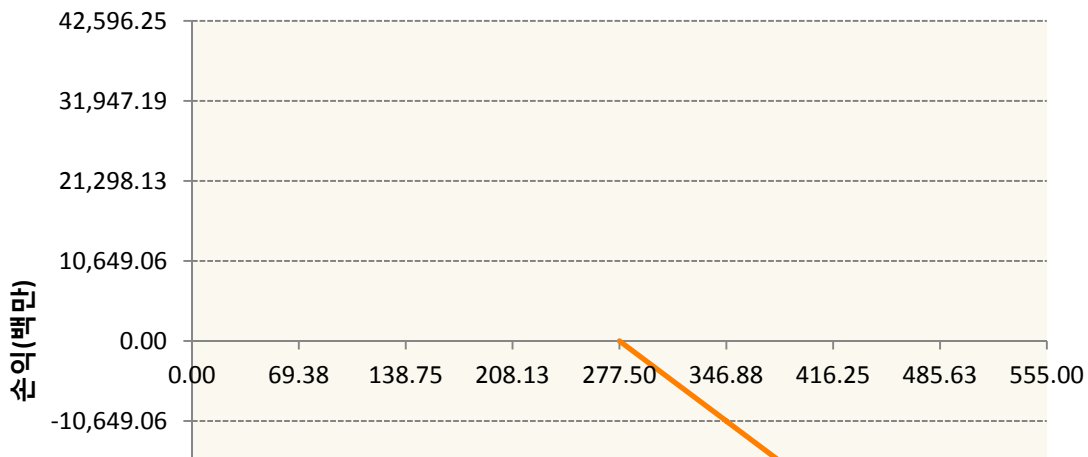
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	20,897	-20,897	장내
누계	유가증권	옵션	0	707,821	-707,821	장내

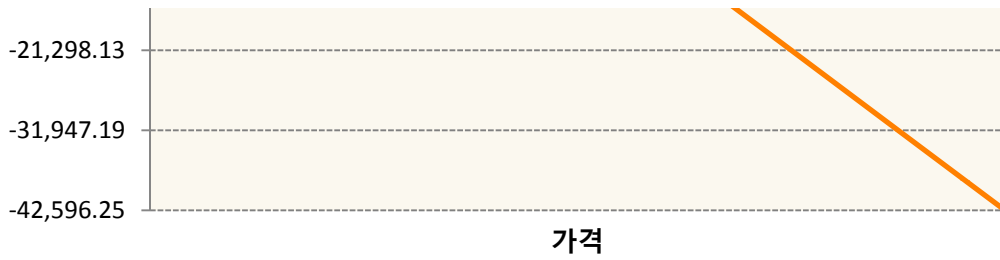
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201NB2752-2018-11 콜275**

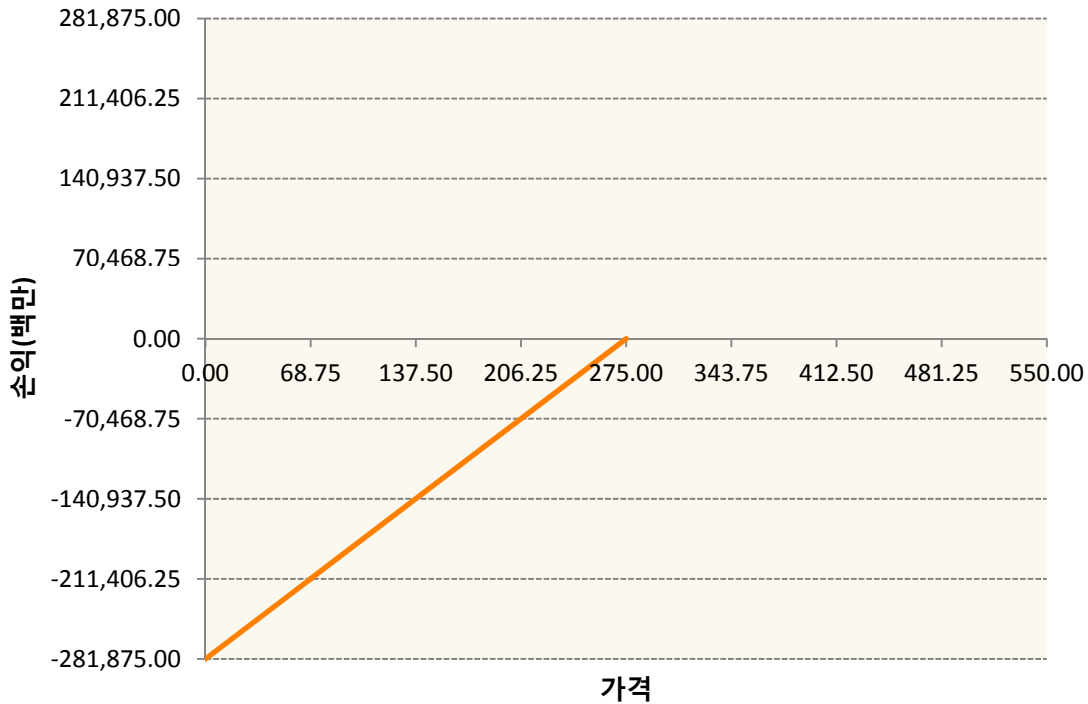


**KR4201NB2778-2018-11 콜277.5**





KR4301NB2751-2018-11 풋275



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NB27 2018-11 콜275

24,593

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,125	10,834	10,482	10,077	9,625	9,133	8,606
-5.33%	9,931	9,377	8,779	8,147	7,488	6,806	6,106
-2.67%	7,260	6,472	5,675	4,869	4,057	3,241	2,421
0%	2,558	1,706	853	0	-854	-1,709	-2,564
2.67%	-4,240	-4,957	-5,700	-6,462	-7,240	-8,030	-8,830
5.33%	-12,698	-13,177	-13,712	-14,294	-14,913	-15,565	-16,243
8.00%	-22,183	-22,442	-22,766	-23,149	-23,586	-24,069	-24,593

KR4201NB27 2018-11 콜277.5

2,587

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,053	1,028	997	959	916	868	816

-5.33%	957	905	847	785	719	650	577
-2.67%	724	643	561	476	391	304	216
0%	285	190	95	0	-95	-190	-285
2.67%	-388	-475	-563	-653	-744	-835	-927
5.33%	-1,263	-1,326	-1,394	-1,467	-1,542	-1,621	-1,702
8.00%	-2,274	-2,311	-2,355	-2,406	-2,462	-2,522	-2,587

KR4301NB27 2018-11 풋275

17,163

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-16,558	-16,602	-16,668	-16,757	-16,870	-17,005	-17,163
-5.33%	-9,303	-9,475	-9,678	-9,907	-10,158	-10,427	-10,713
-2.67%	-3,033	-3,395	-3,767	-4,148	-4,534	-4,926	-5,322
0%	1,270	848	424	0	-425	-851	-1,277
2.67%	3,383	3,096	2,787	2,459	2,118	1,764	1,400
5.33%	4,082	3,964	3,813	3,634	3,428	3,198	2,947
8.00%	4,235	4,204	4,153	4,081	3,986	3,867	3,726

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

(단위:백만원)

44,134

공시일	2018-10-17
기준일	2018-10-16

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

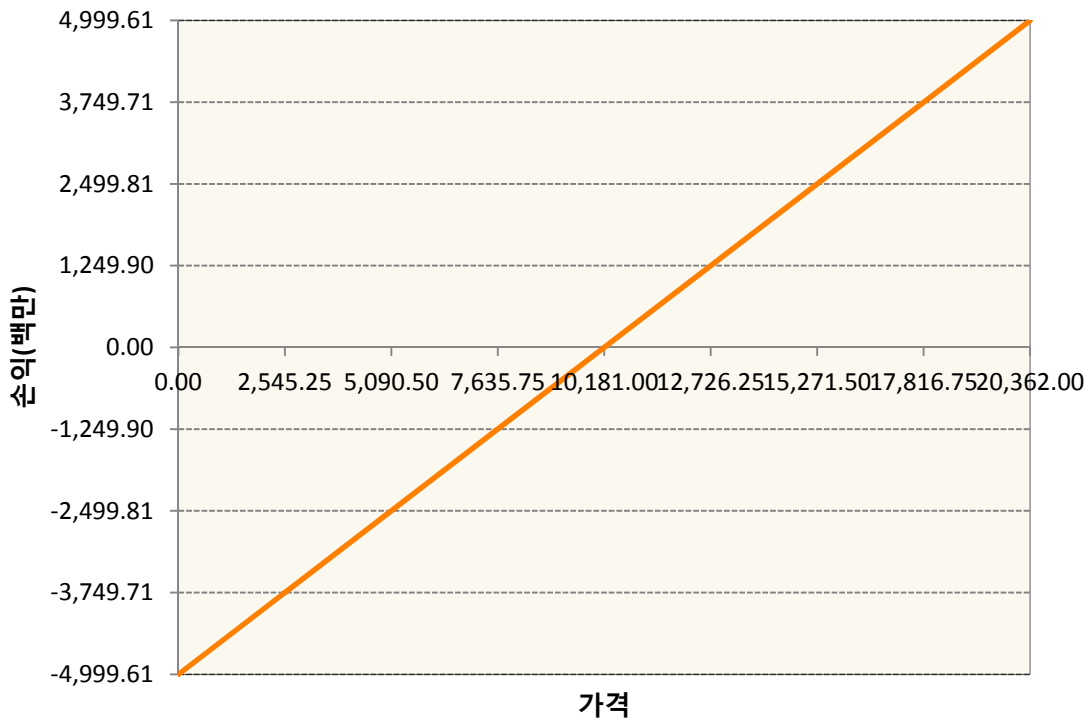
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

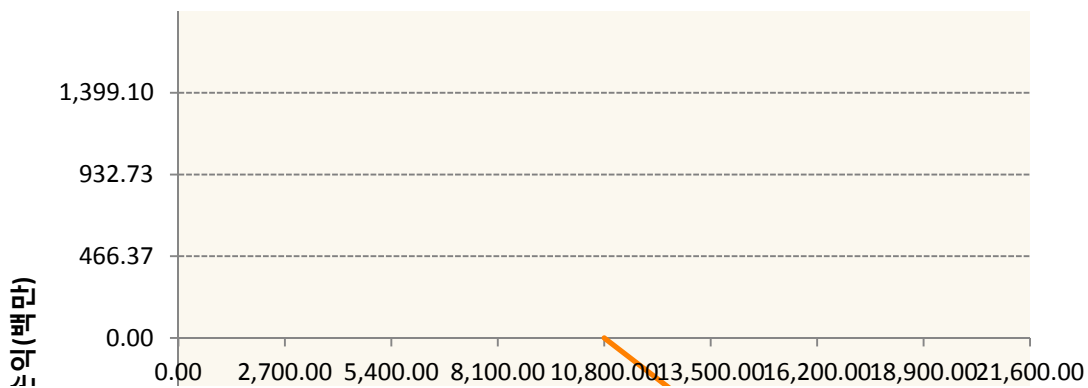
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,000	0	5,000	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,123	-12,123	장내

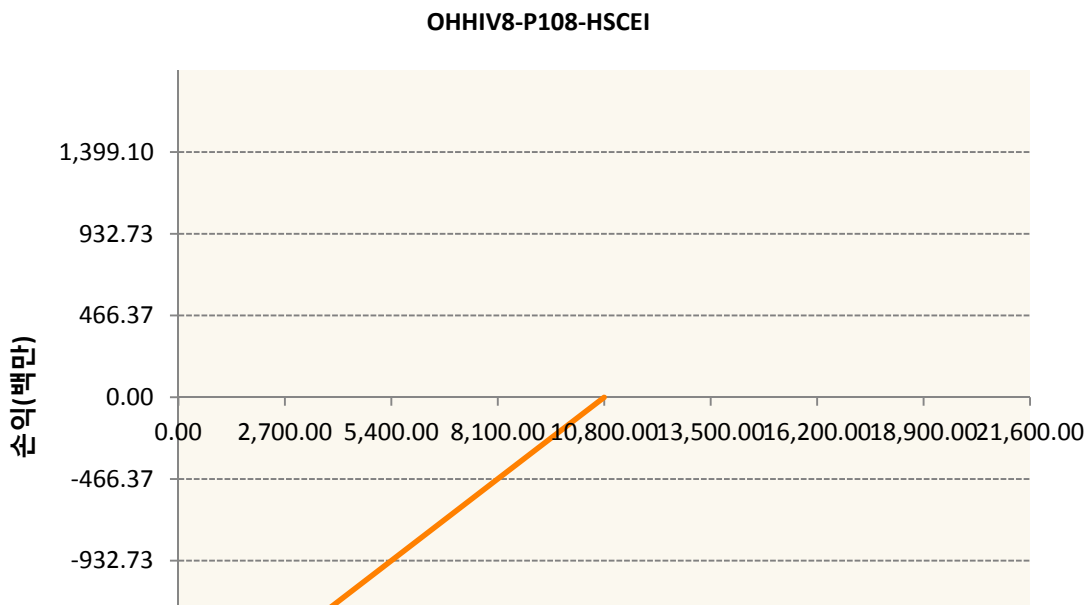
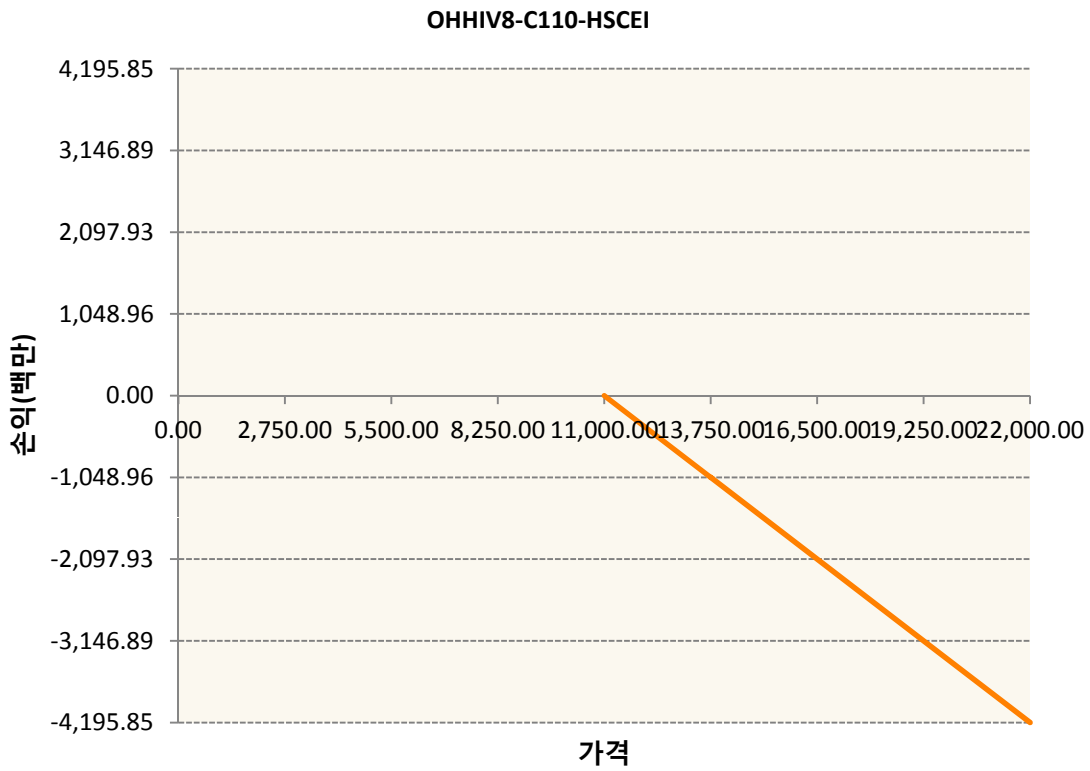
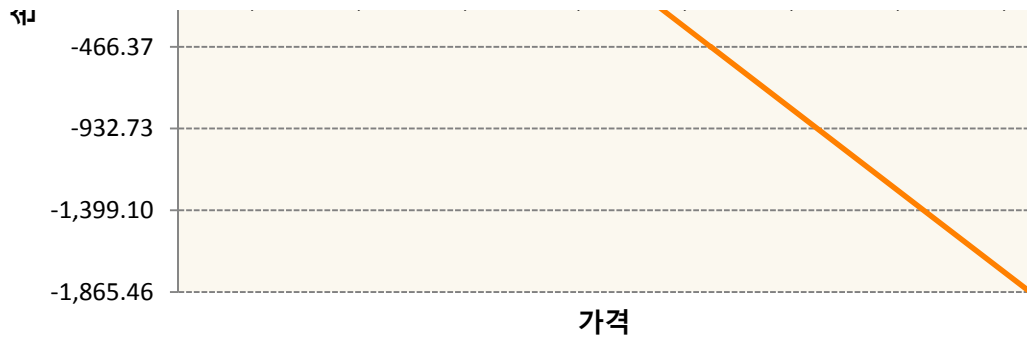
### 2. 만기시점의 손익구조

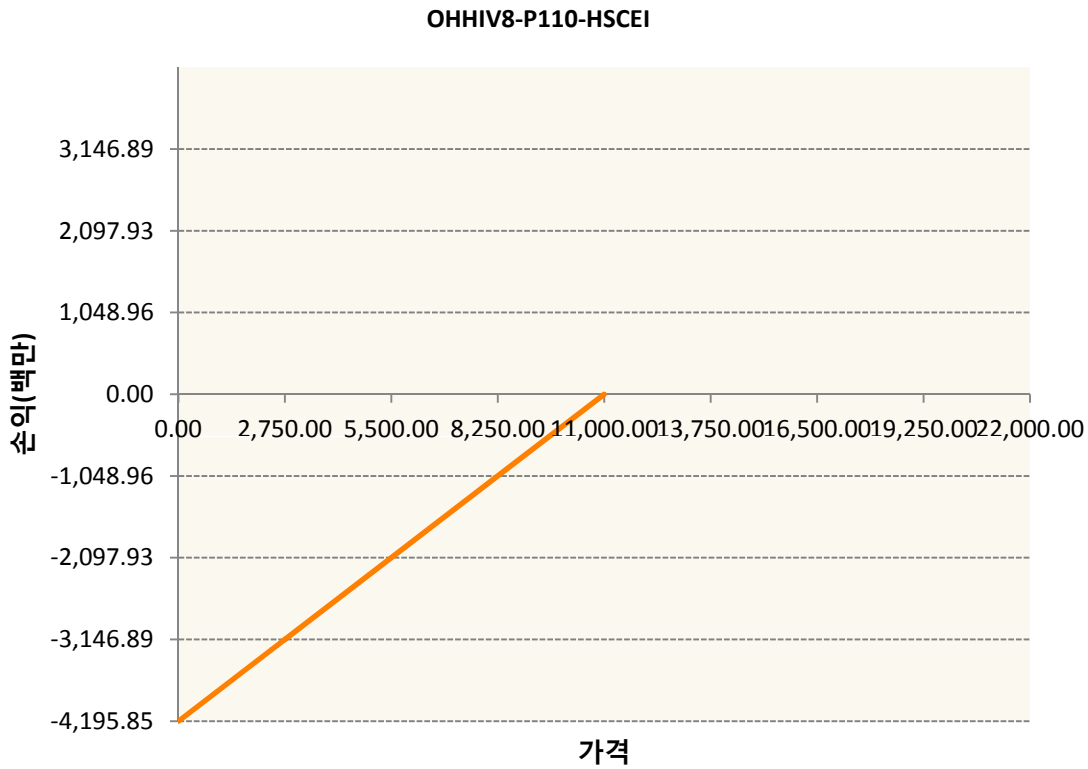
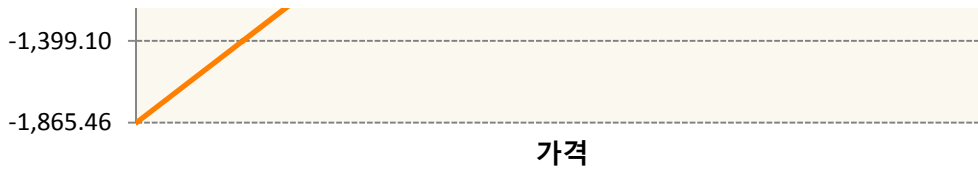
HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



OHHIV8-C108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	400
OHHIV8-C1	HSCEI	149
OHHIV8-C11	HSCEI	336
OHHIV8-P1C	HSCEI	149
OHHIV8-P11	HSCEI	336

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	<b>1,313</b>

공시일	2018-10-17
기준일	2018-10-16

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

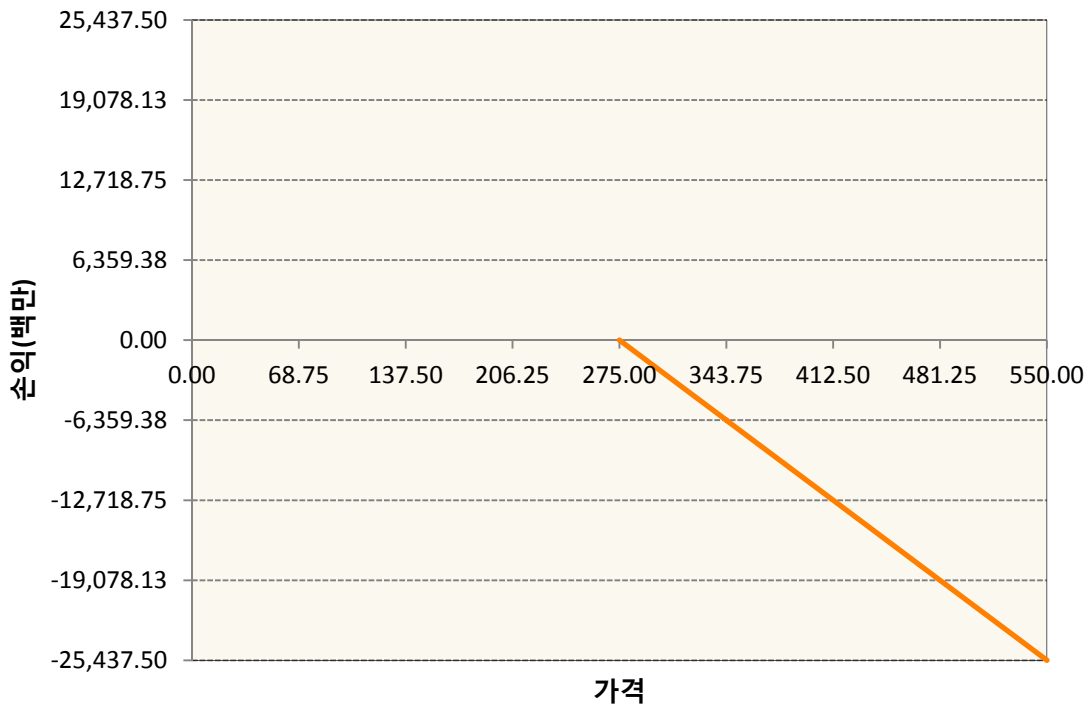
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

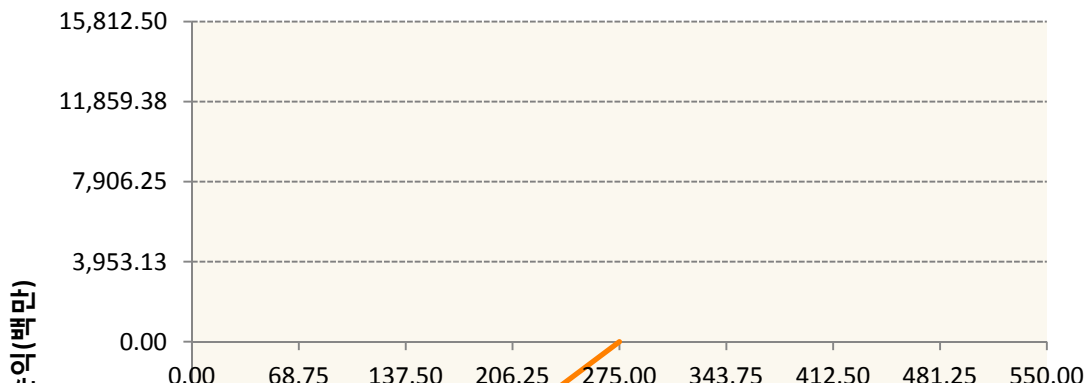
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	44,025	-44,025	장내

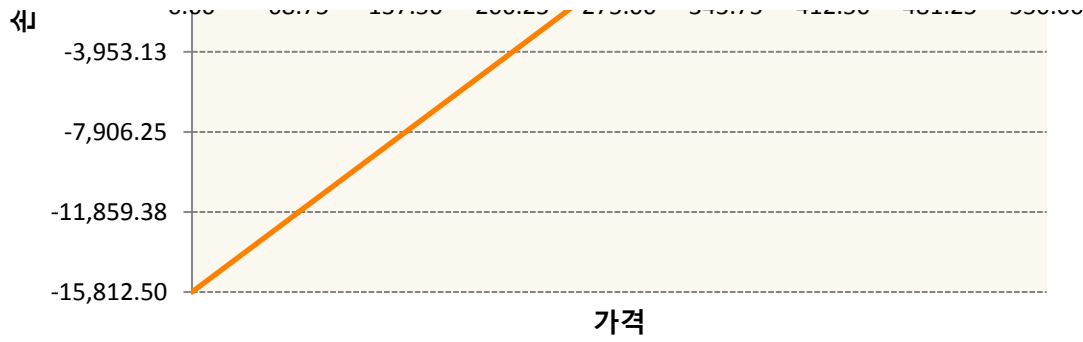
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

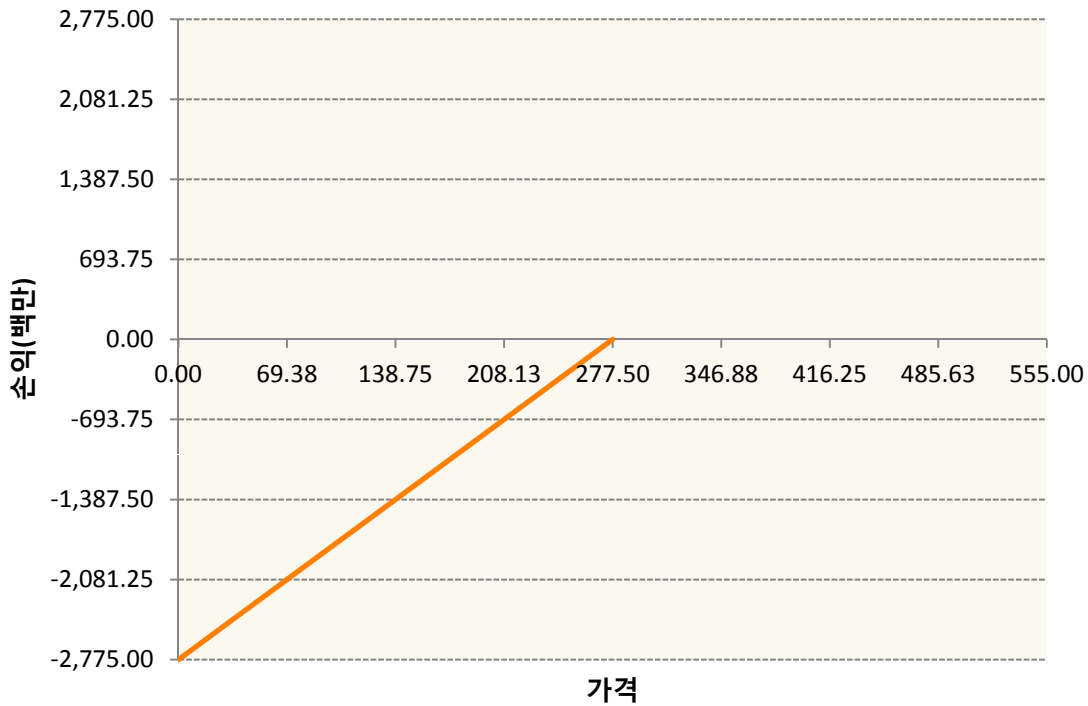


KR4301NB2751-2018-11 풋275





KR4301NB2777-2018-11 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,994	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,994	-3,994	-3,994	-3,994	-3,994	-3,994	-3,994	
-5.33%	-2,663	-2,663	-2,663	-2,663	-2,663	-2,663	-2,663	
-2.67%	-1,331	-1,331	-1,331	-1,331	-1,331	-1,331	-1,331	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	1,331	1,331	1,331	1,331	1,331	1,331	1,331	
5.33%	2,663	2,663	2,663	2,663	2,663	2,663	2,663	
8.00%	3,994	3,994	3,994	3,994	3,994	3,994	3,994	
KR4201NB27 2018-11 콜275							1,632	
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	738	719	696	669	639	606	571
-5.33%	659	622	583	541	497	452	405
-2.67%	482	429	377	323	269	215	161
0%	170	113	57	0	-57	-113	-170
2.67%	-281	-329	-378	-429	-480	-533	-586
5.33%	-843	-874	-910	-948	-990	-1,033	-1,078
8.00%	-1,472	-1,489	-1,511	-1,536	-1,565	-1,597	-1,632

KR4301NB27 2018-11 풋275

963

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-929	-931	-935	-940	-946	-954	-963
-5.33%	-522	-532	-543	-556	-570	-585	-601
-2.67%	-170	-190	-211	-233	-254	-276	-299
0%	71	48	24	0	-24	-48	-72
2.67%	190	174	156	138	119	99	79
5.33%	229	222	214	204	192	179	165
8.00%	238	236	233	229	224	217	209

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

178

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-174	-174	-175	-175	-176	-177	-178
-5.33%	-102	-103	-105	-106	-108	-111	-113
-2.67%	-37	-40	-43	-46	-49	-53	-57
0%	13	8	4	0	-4	-8	-13
2.67%	40	37	33	29	26	22	18
5.33%	51	49	47	45	42	39	37
8.00%	53	53	52	51	50	48	46

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

(단위:백만원)

6,767

공시일	2018-10-17
기준일	2018-10-16

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

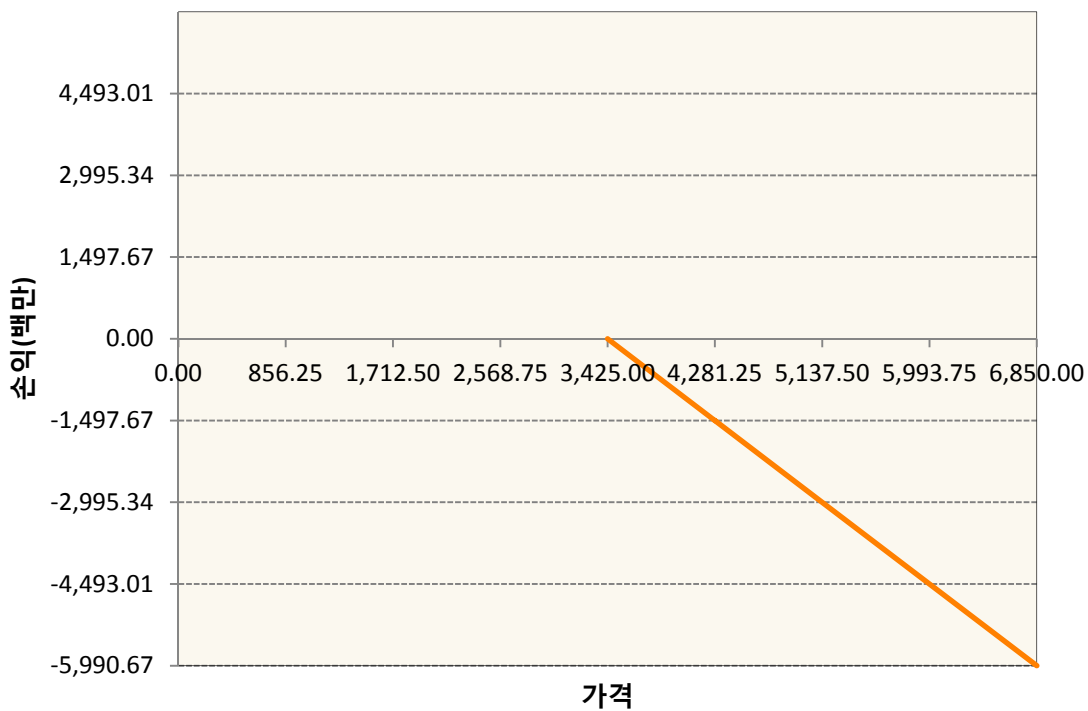
### 1. 계약금액

(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	875	0	875	
누계	유가증권	스왑	34,470	0	34,470	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,764	-15,764	장내
누계	지수	스왑	52,993	0	52,993	장외

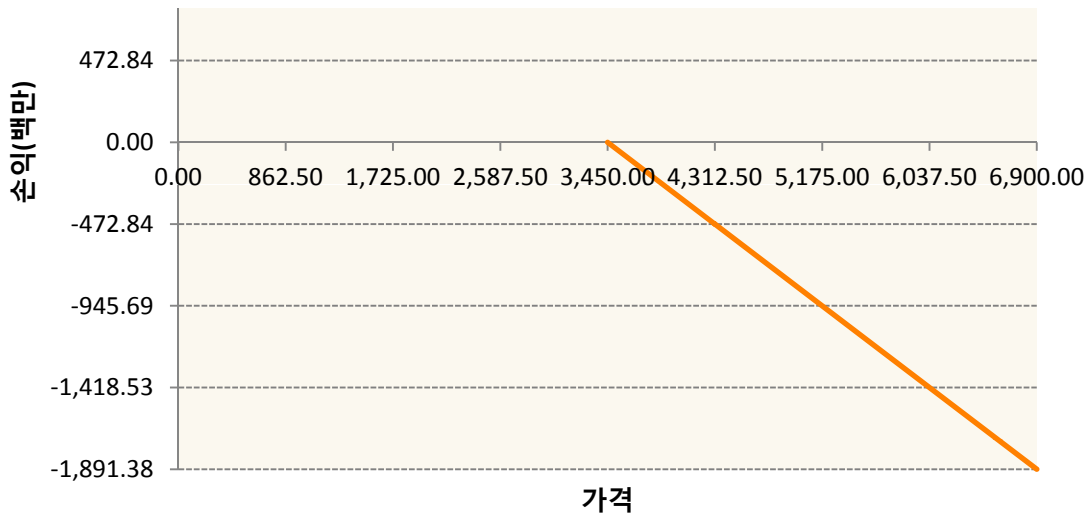
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXV8-C3425-EURO STOXX 50

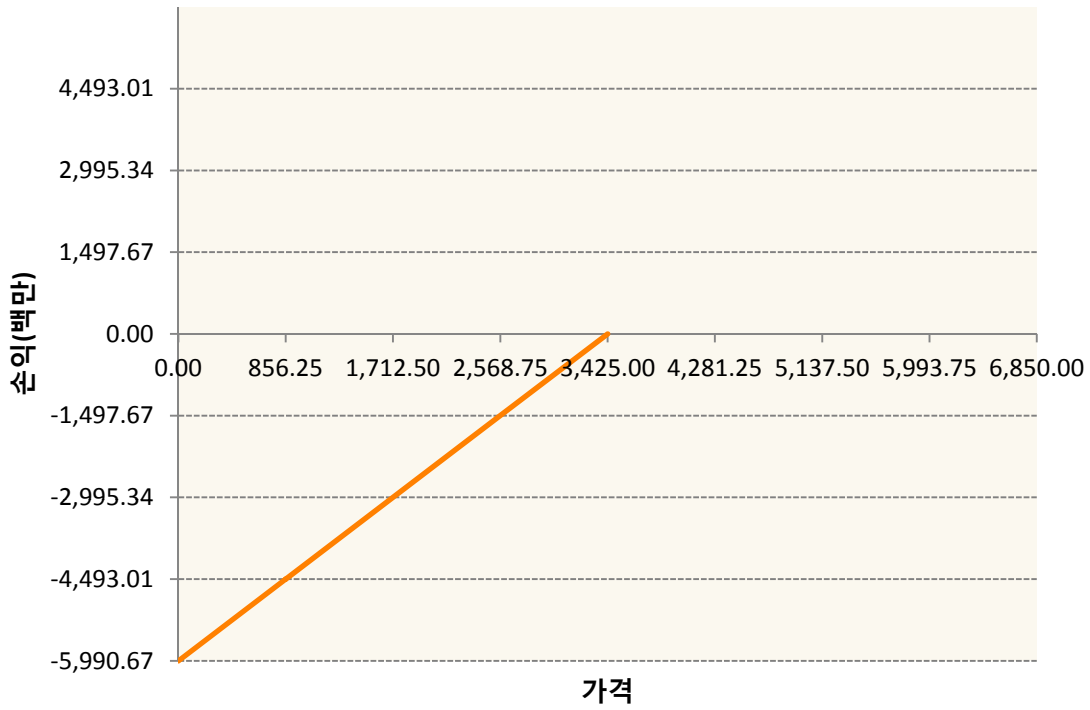


OESXV8-C3450-EURO STOXX 50

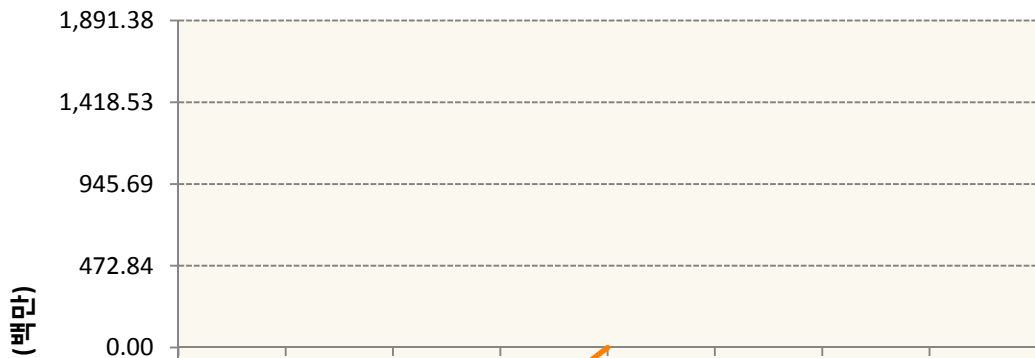


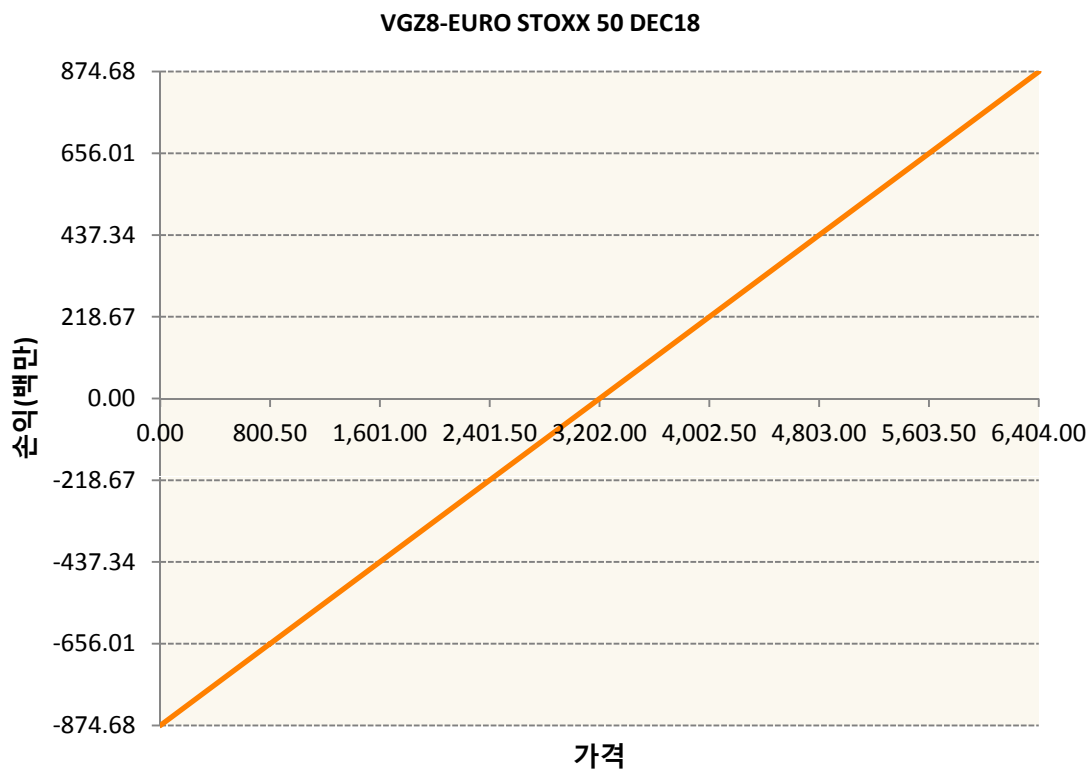
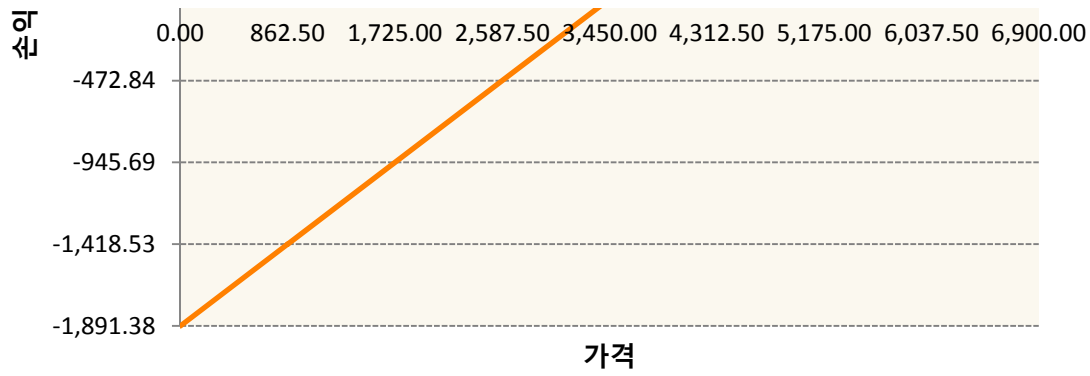


OESXV8-P3425-EURO STOXX 50



OESXV8-P3450-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		213
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		138
OESXV8-C34 EURO STOXX 50		479
OESXV8-C34 EURO STOXX 50		151
OESXV8-P34 EURO STOXX 50		479
OESXV8-P34 EURO STOXX 50		151
VGZ8	EURO STOXX 50 DEC18	70

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





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

(단위:백만원)

1,137



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

(단위:백만원)

90



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

(단위:백만원)

134



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

(단위:백만원)

157

공시일	2018-10-17
기준일	2018-10-16

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1

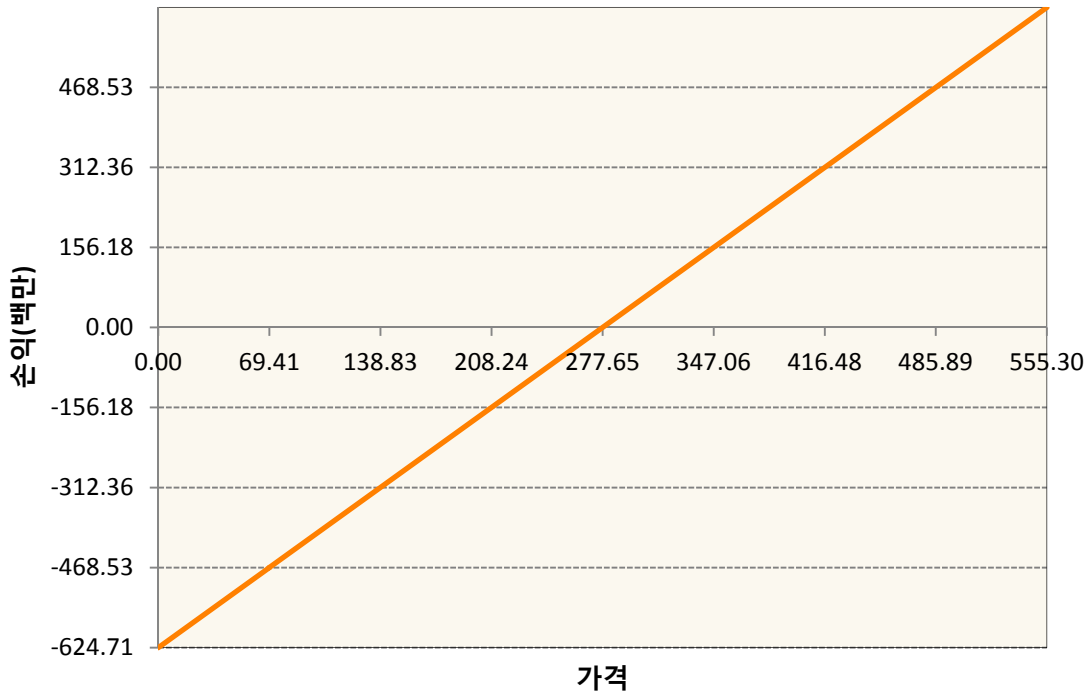
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	625	0	625	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%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-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%	33	33	33	33	33	33	33
8.00%	50	50	50	50	50	50	50

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-10-17
기준일	2018-10-16

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

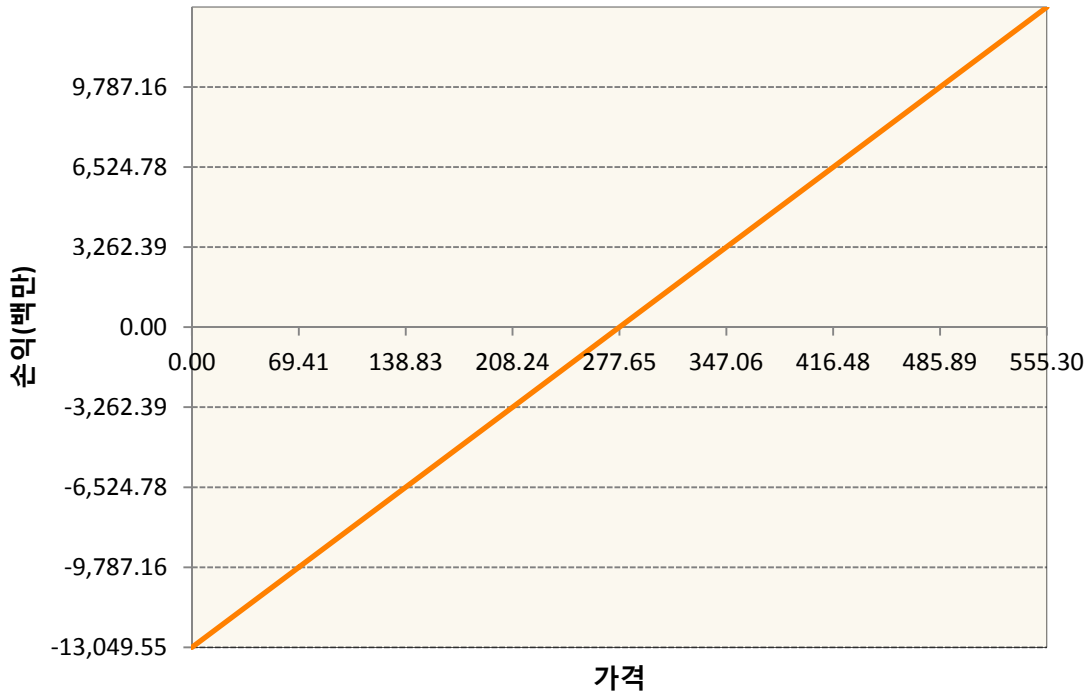
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

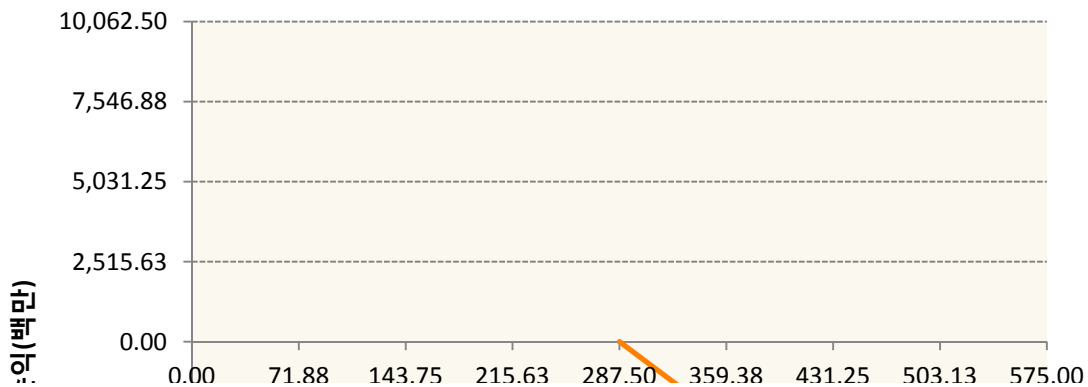
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,050	0	13,050	장내
누계	유가증권	옵션	4,059	23,113	-19,054	장내

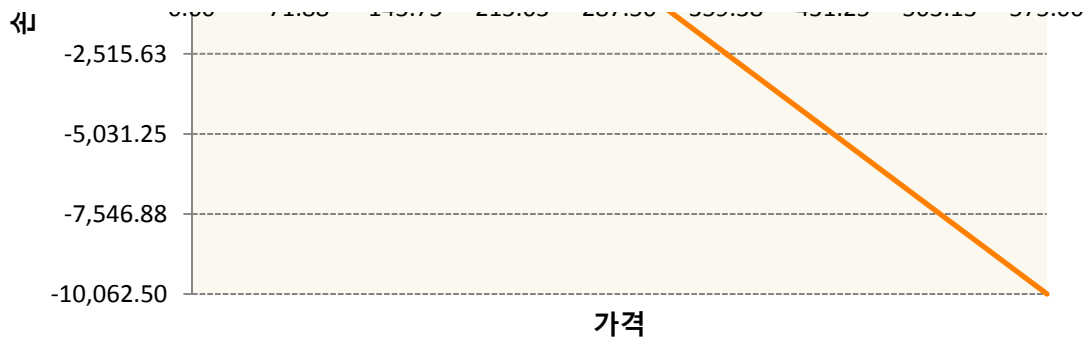
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

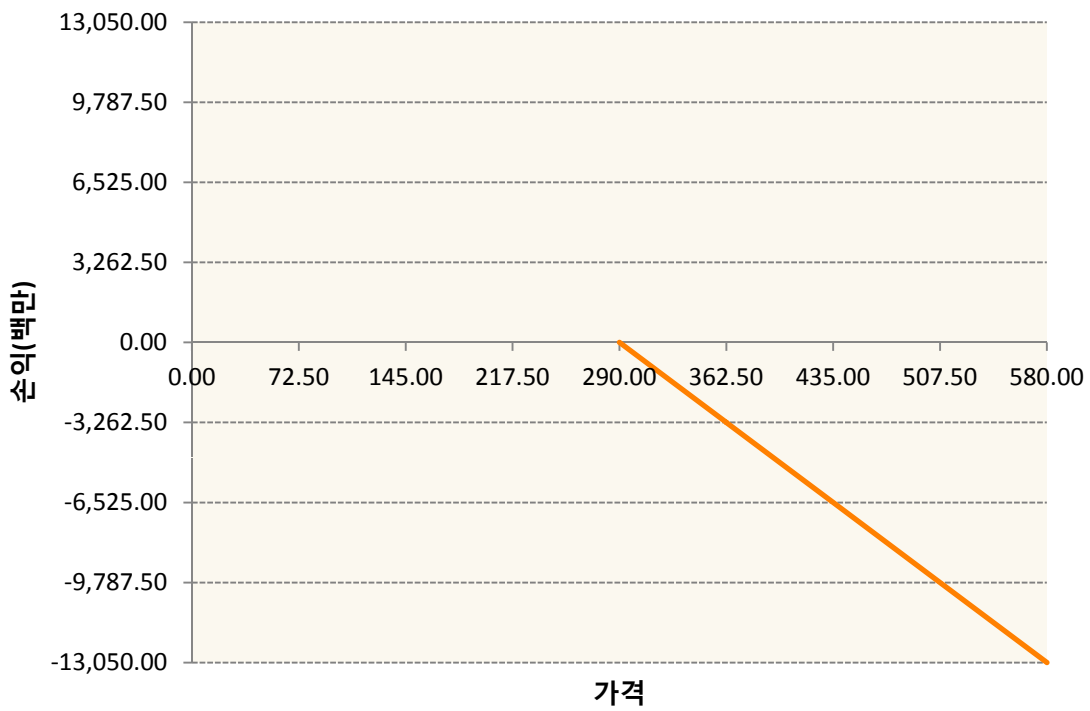


KR4201NB2877-2018-11 콜287.5

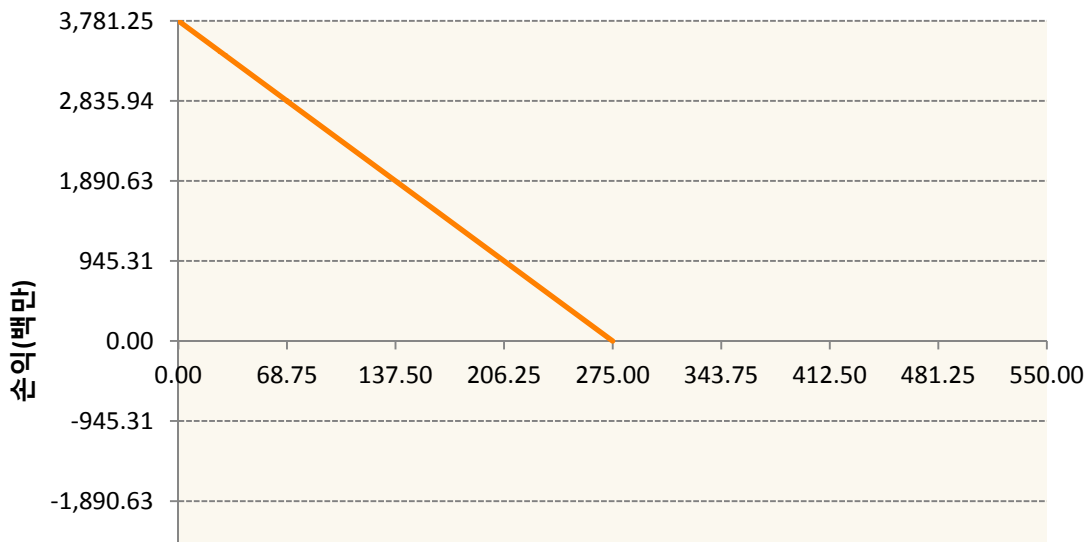


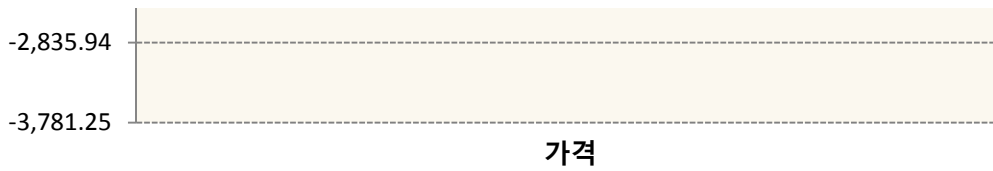


**KR4201NB2901-2018-11 콜290**

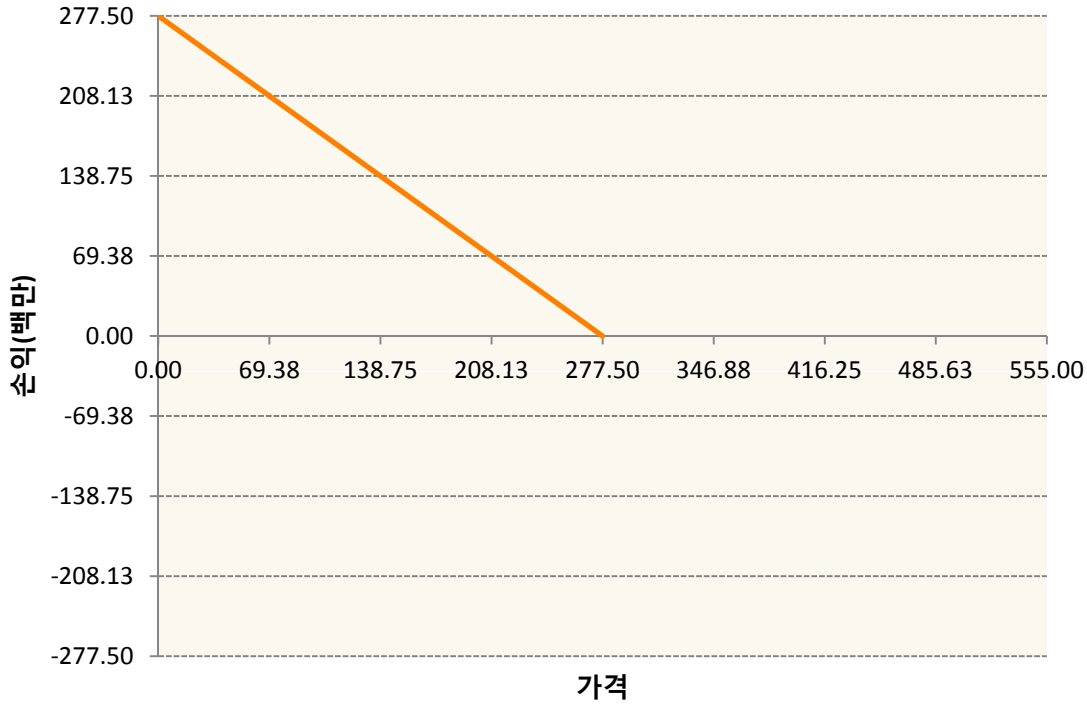


**KR4301NB2751-2018-11 풋275**





KR4301NB2777-2018-11 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 1,041

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,041	-1,041	-1,041	-1,041	-1,041	-1,041	-1,041
-5.33%	-694	-694	-694	-694	-694	-694	-694
-2.67%	-347	-347	-347	-347	-347	-347	-347
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	347	347	347	347	347	347	347
5.33%	694	694	694	694	694	694	694
8.00%	1,041	1,041	1,041	1,041	1,041	1,041	1,041

KR4201NB282018-11 콜287.5 462

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	118	116	114	110	105	99	92
-5.33%	113	108	102	94	85	75	64
-2.67%	96	86	74	61	46	31	16

0%	54	36	19	0	-19	-38	-58
2.67%	-30	-52	-74	-96	-118	-140	-162
5.33%	-165	-186	-208	-230	-253	-275	-297
8.00%	-348	-365	-383	-402	-422	-442	-462

KR4201NB27 2018-11 콜290

551

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	123	122	120	116	111	105	97
-5.33%	119	115	108	100	91	79	66
-2.67%	104	93	80	66	49	32	13
0%	62	43	22	0	-23	-46	-71
2.67%	-26	-53	-80	-107	-135	-163	-191
5.33%	-177	-206	-235	-264	-293	-322	-351
8.00%	-392	-417	-443	-469	-496	-523	-551

KR4301NB27 2018-11 풋275

230

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	222	223	224	225	226	228	230
-5.33%	125	127	130	133	136	140	144
-2.67%	41	46	51	56	61	66	71
0%	-17	-11	-6	0	6	11	17
2.67%	-45	-42	-37	-33	-28	-24	-19
5.33%	-55	-53	-51	-49	-46	-43	-40
8.00%	-57	-56	-56	-55	-53	-52	-50

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

18

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17	17	17	18	18	18	18
-5.33%	10	10	10	11	11	11	11
-2.67%	4	4	4	5	5	5	6
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-4	-4	-3	-3	-3	-2	-2
5.33%	-5	-5	-5	-4	-4	-4	-4
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5

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

(단위:백만원)

1,830

공시일	2018-10-17
기준일	2018-10-16

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

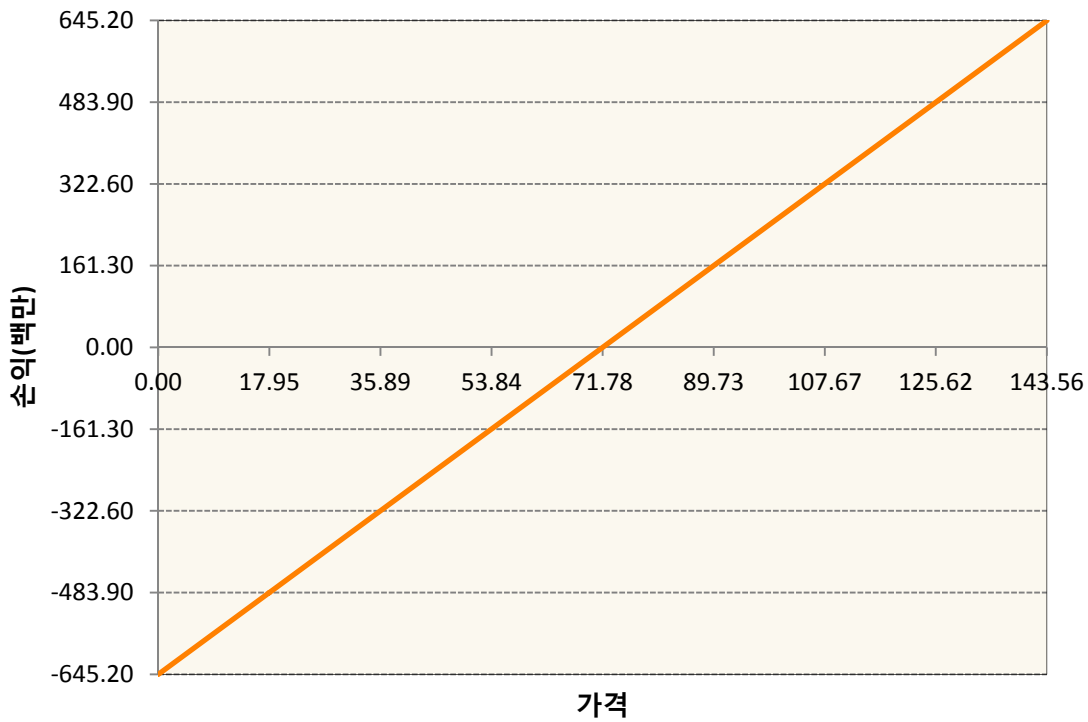
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

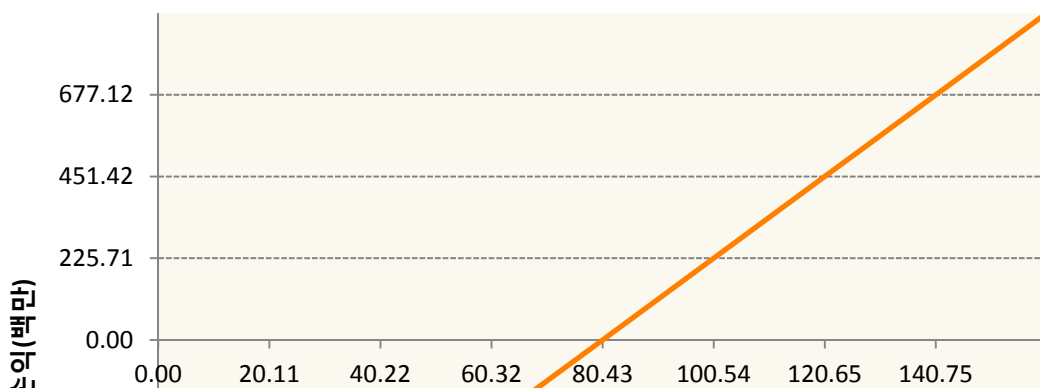
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,990	620	2,370	
누계	유가증권	선물	439	0	439	장내

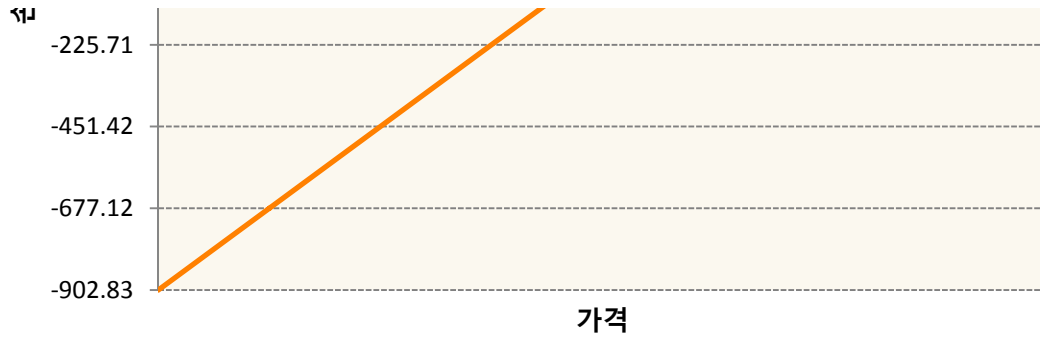
### 2. 만기시점의 손익구조

CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18

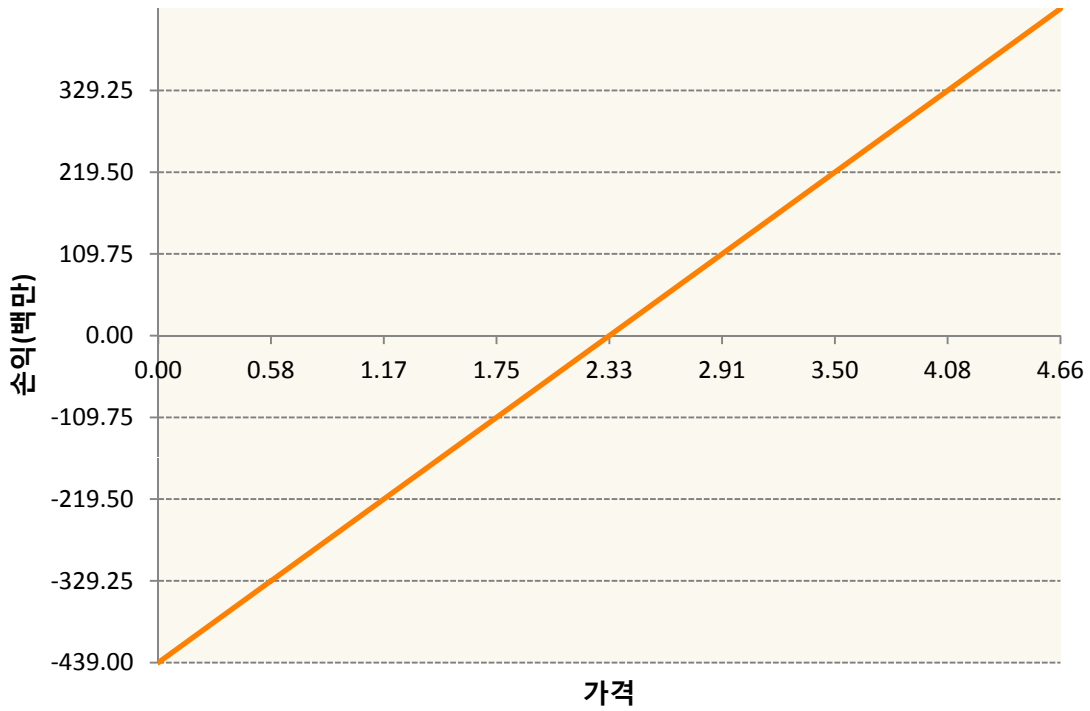


COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19

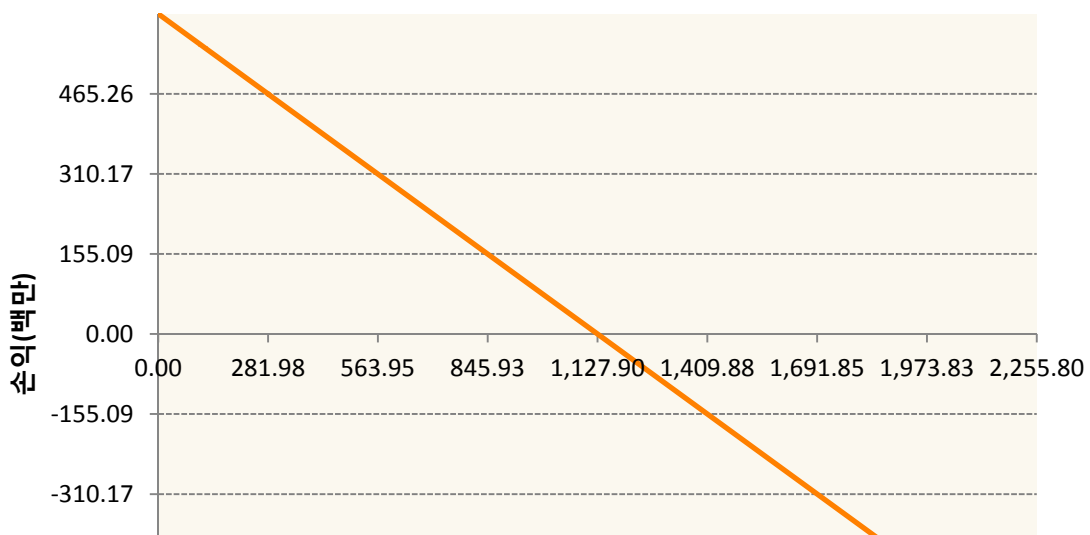


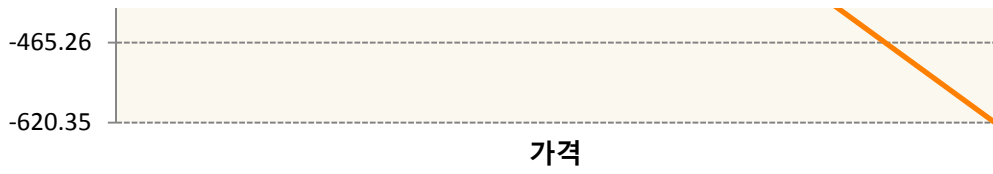


HOX8-Heating Oil

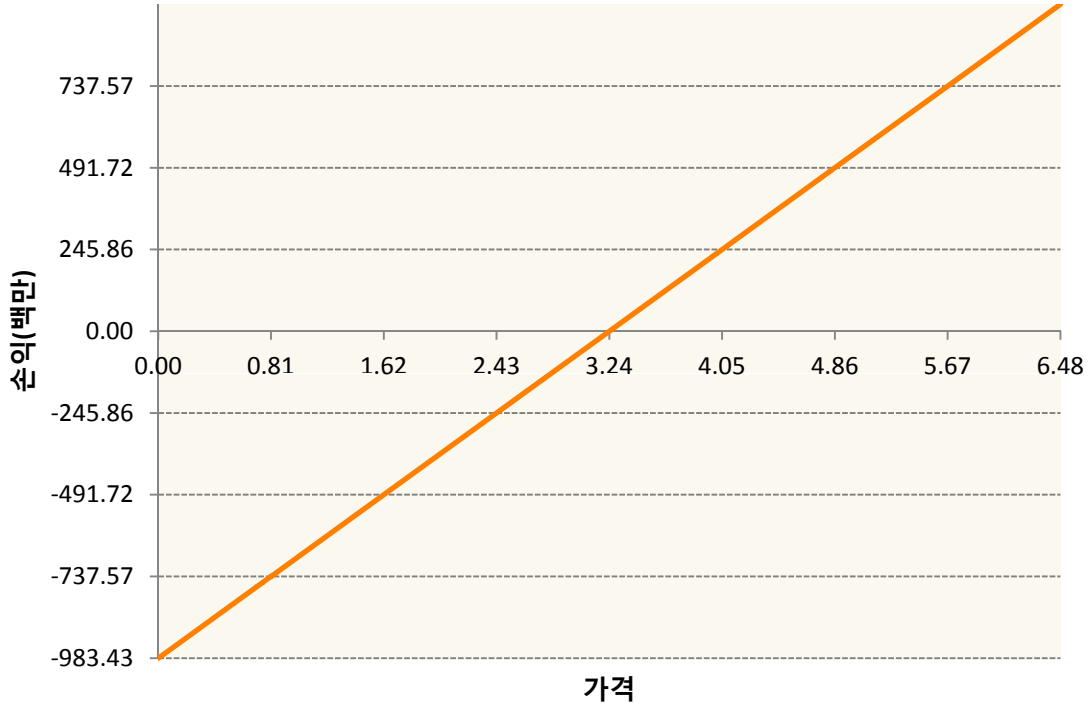


KR4175NB0006-2018-11 달러선물

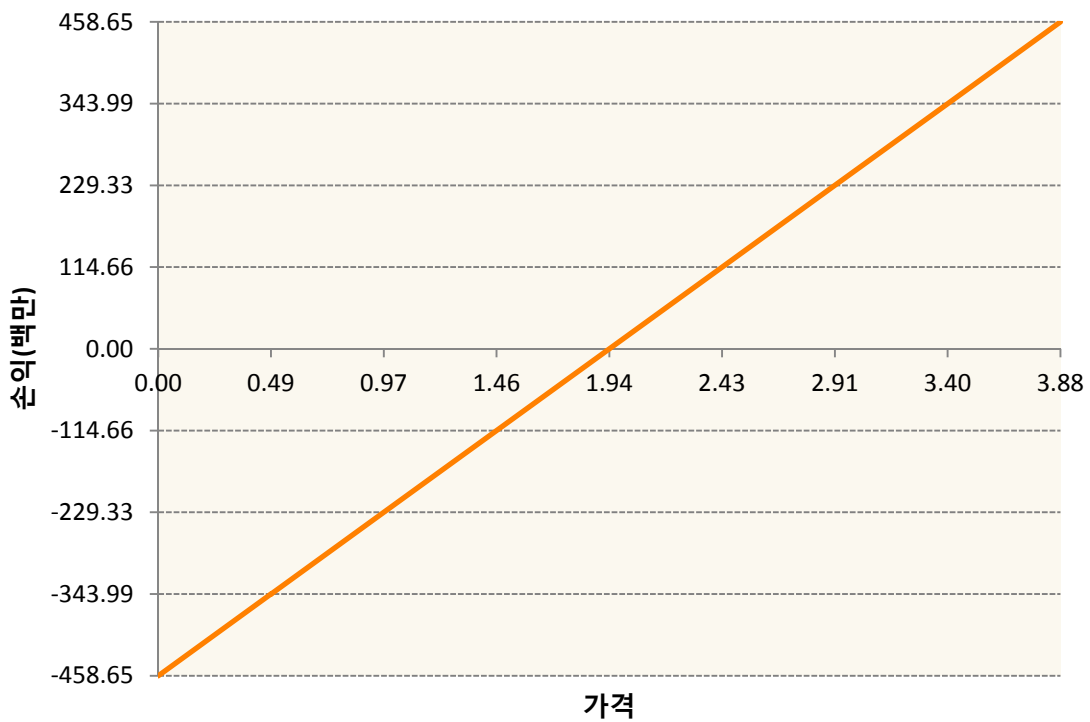




**NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18**



**XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18**



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	52
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	72
HOX8	Heating Oil	35
	KR4175NB0(2018-11 달러선물	50
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	79
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	37

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

공시일	2018-10-17
기준일	2018-10-16

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

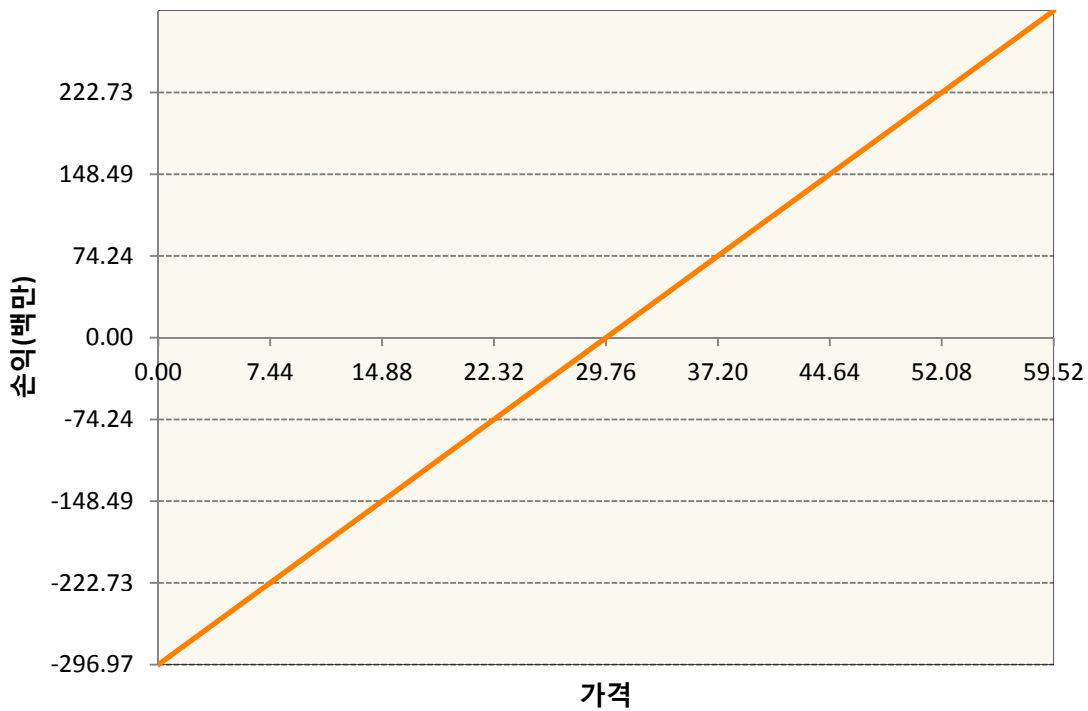
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

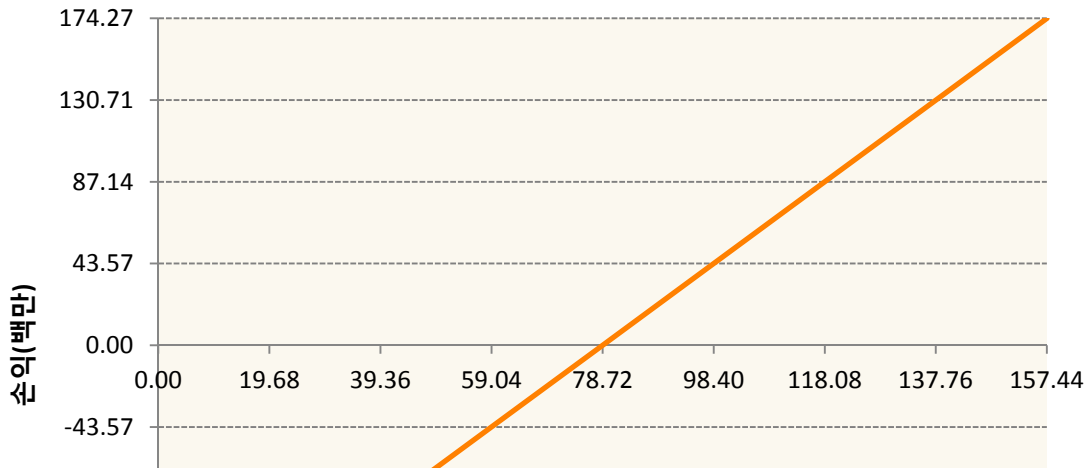
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,671	79	3,592	

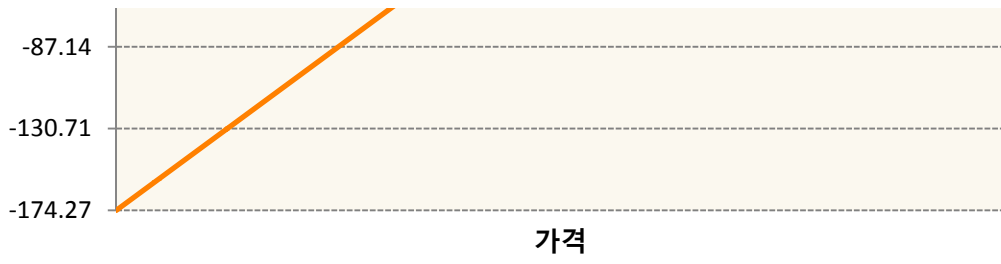
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18**

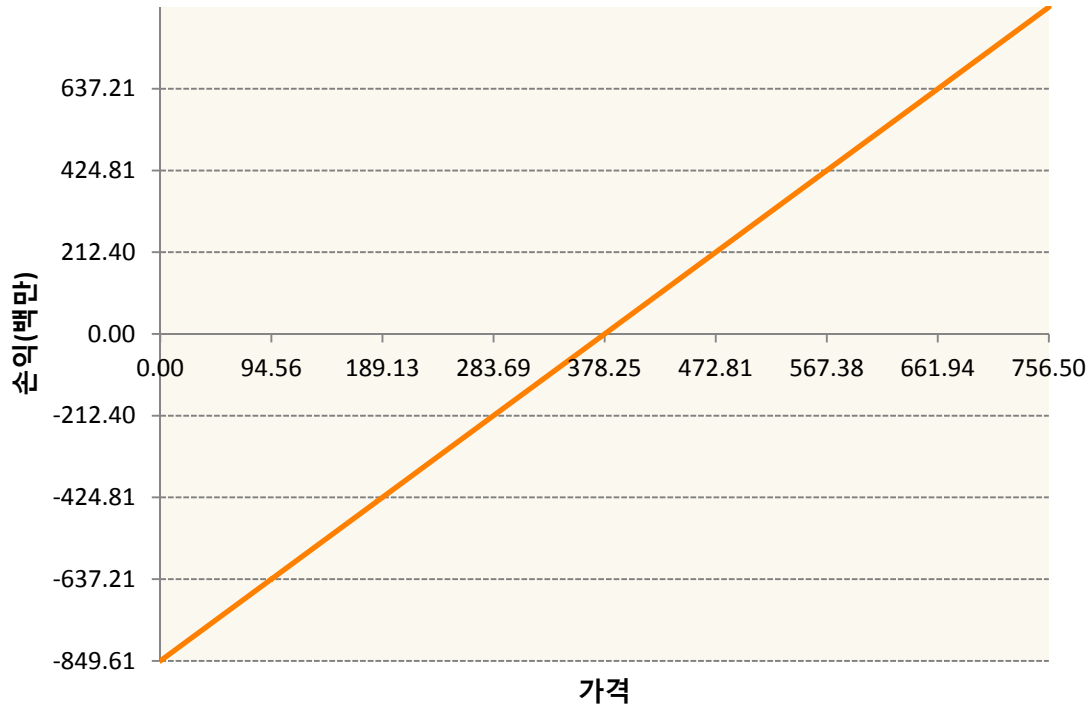


**CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18**

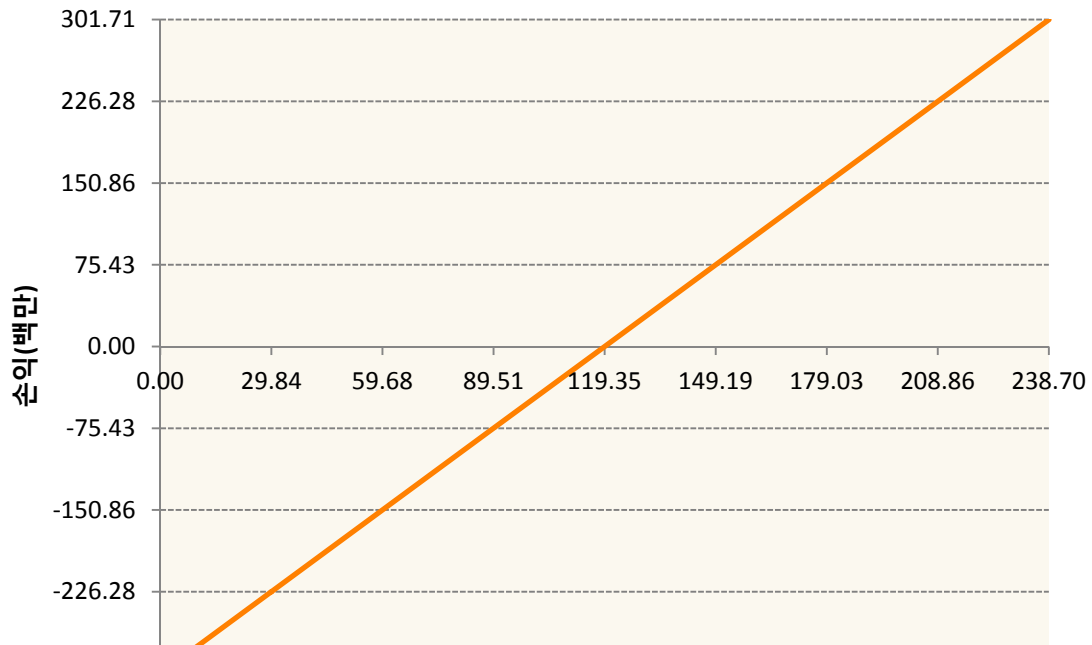


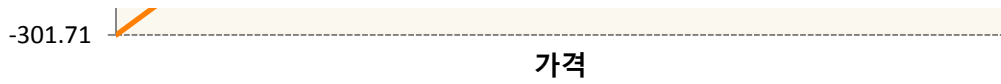


**CZ8-CORN FUTURE DEC18**

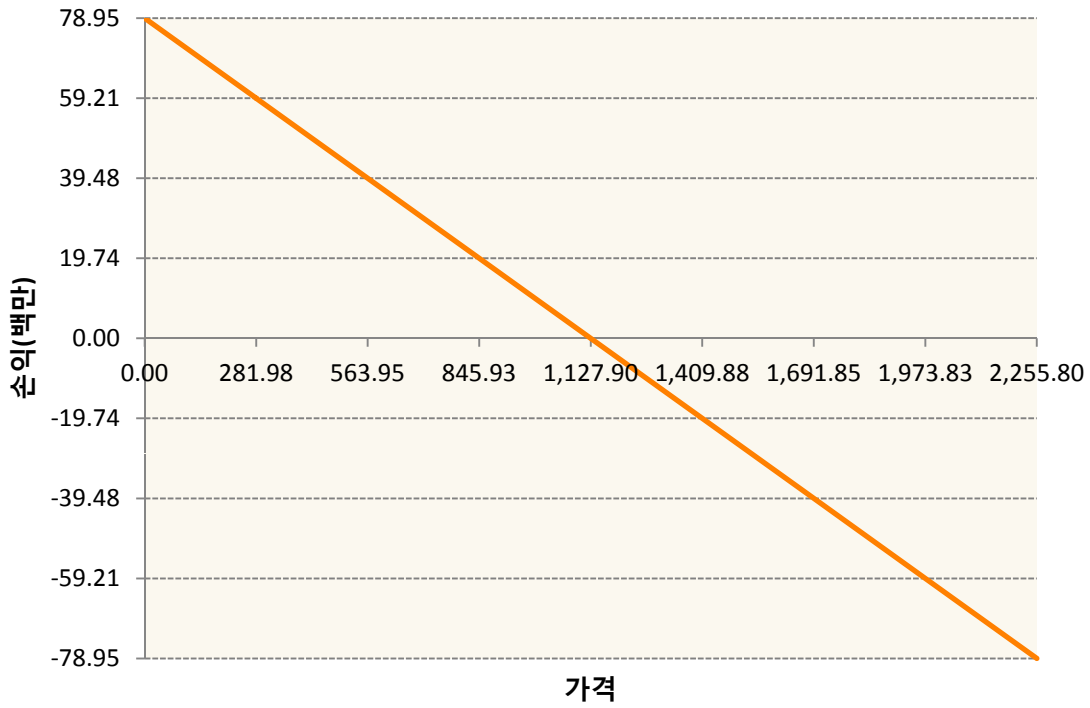


**KCZ8-COFFEE 'C' FUTURE Dec18**

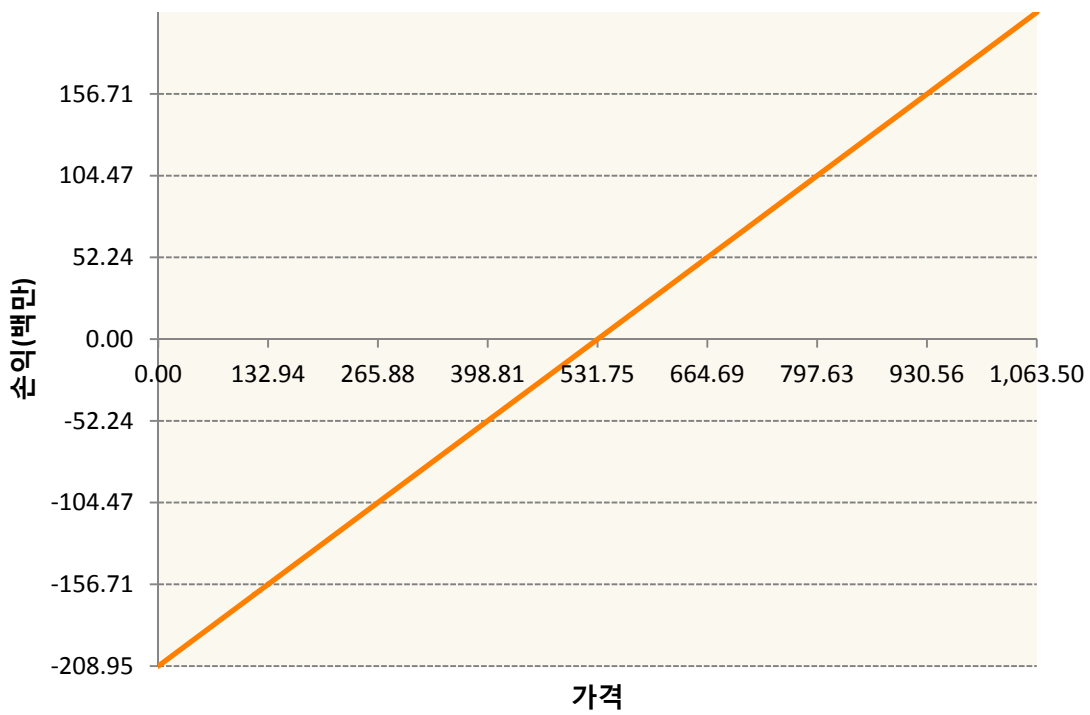




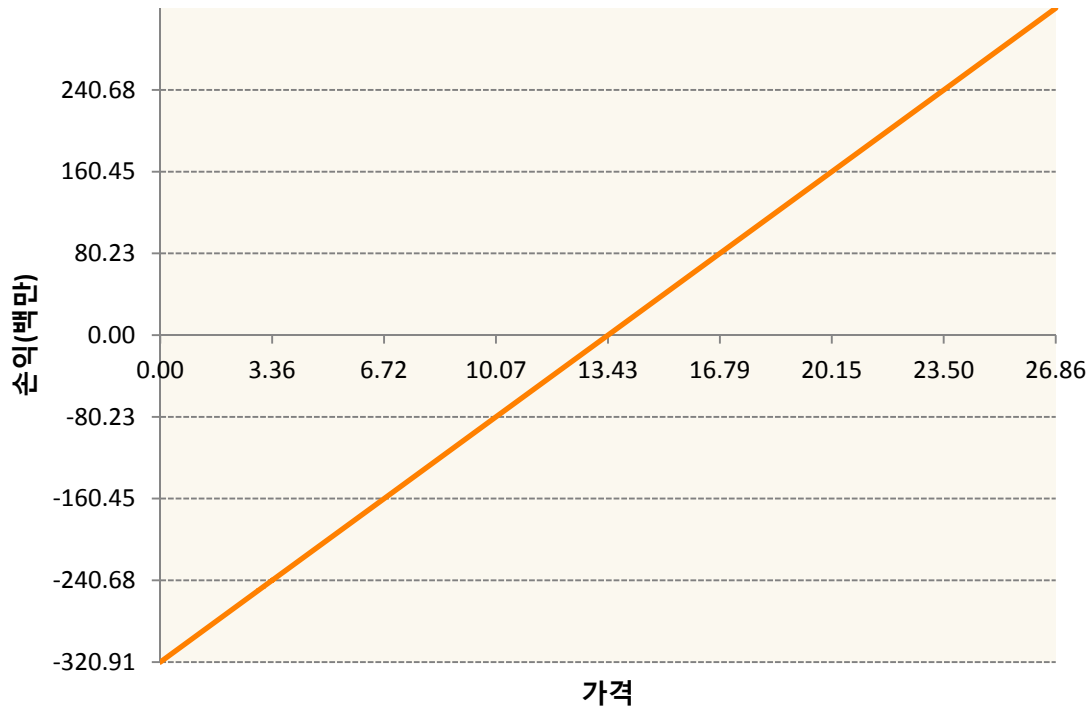
**KR4175NB0006-2018-11 달러선물**



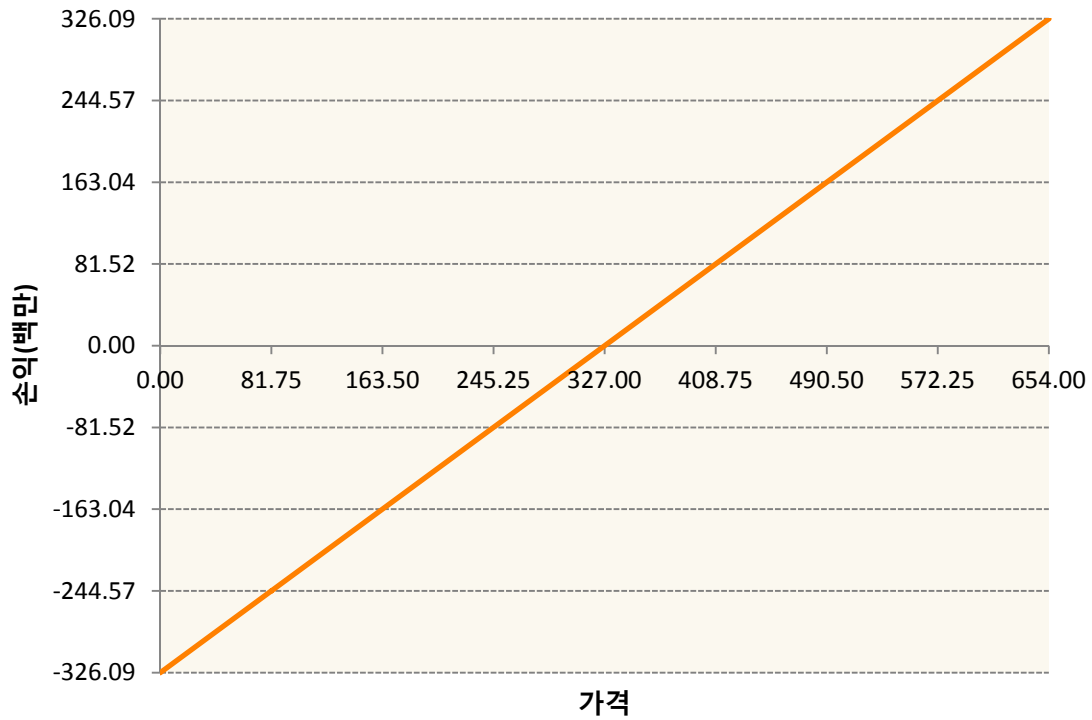
**KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18**



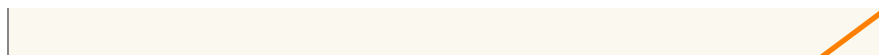
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

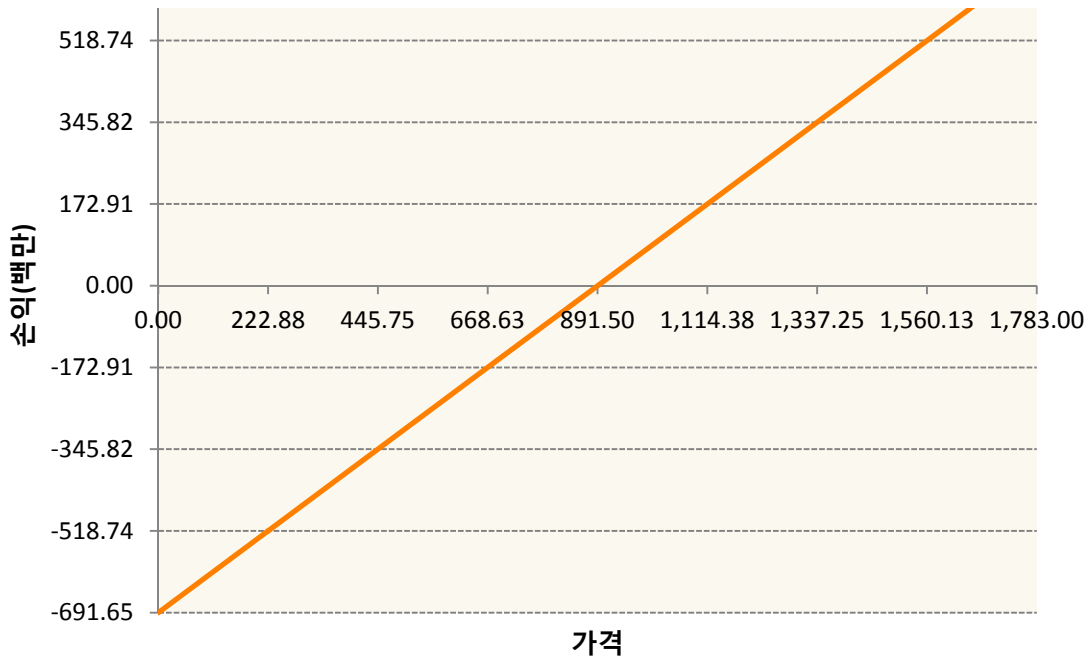


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

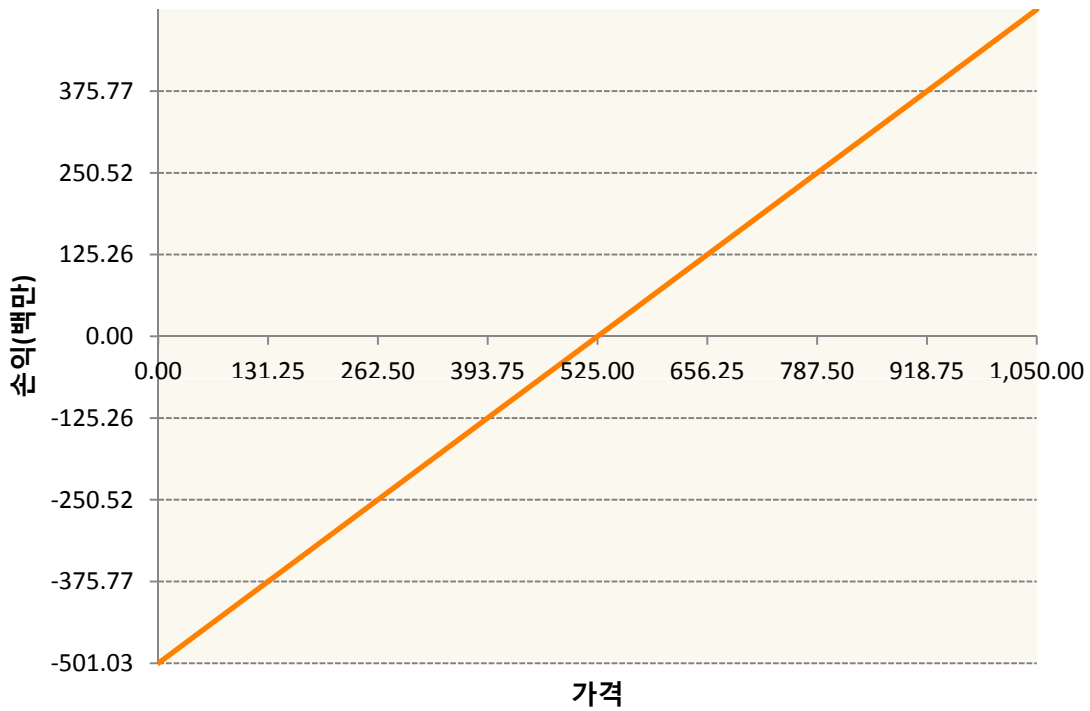


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





WZ8-WHEAT FUTURE(CBT) DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	24
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	14
CZ8	CORN FUTURE DEC18	68
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	24
KR4175NB0( 2018-11	달러선물	6

KWZ8	KC HRW WHEAT FUT DEC18	17
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	26
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	26
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	55
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	40

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

(단위:백만원)

**321**