

공시일	2018-11-14
기준일	2018-11-13

포커스농산물모(채권-파생형)

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	2018-11-14
기준일	2018-11-13

스마트인덱스모

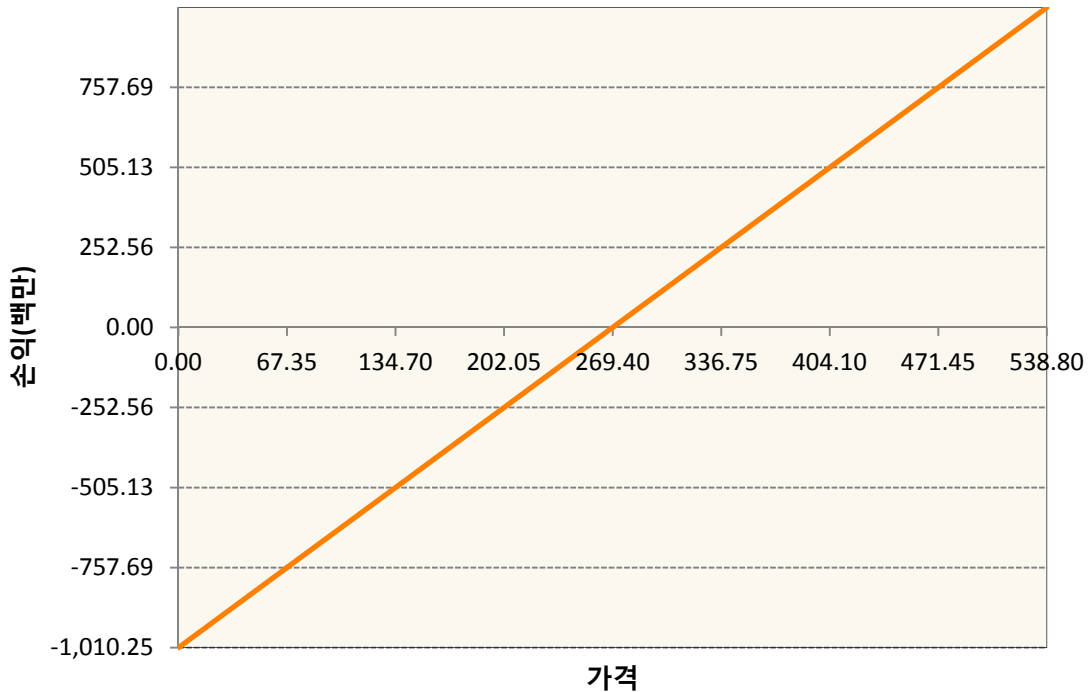
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,010	0	1,010	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0004		2018-12 코스피200지수선물						81
가격	기초자산의 변동성							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81	
-5.33%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54	
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	27	27	27	27	27	27	27	
5.33%	54	54	54	54	54	54	54	
8.00%	81	81	81	81	81	81	81	

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

(단위:백만원)

69

공시일	2018-11-14
기준일	2018-11-13

SMART합성-MSCI선진국증권상장

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

1,077

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

519

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-11-14
기준일	2018-11-13

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

276

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

395

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-11-14
기준일	2018-11-13

유로인덱스모(주식-파생형)

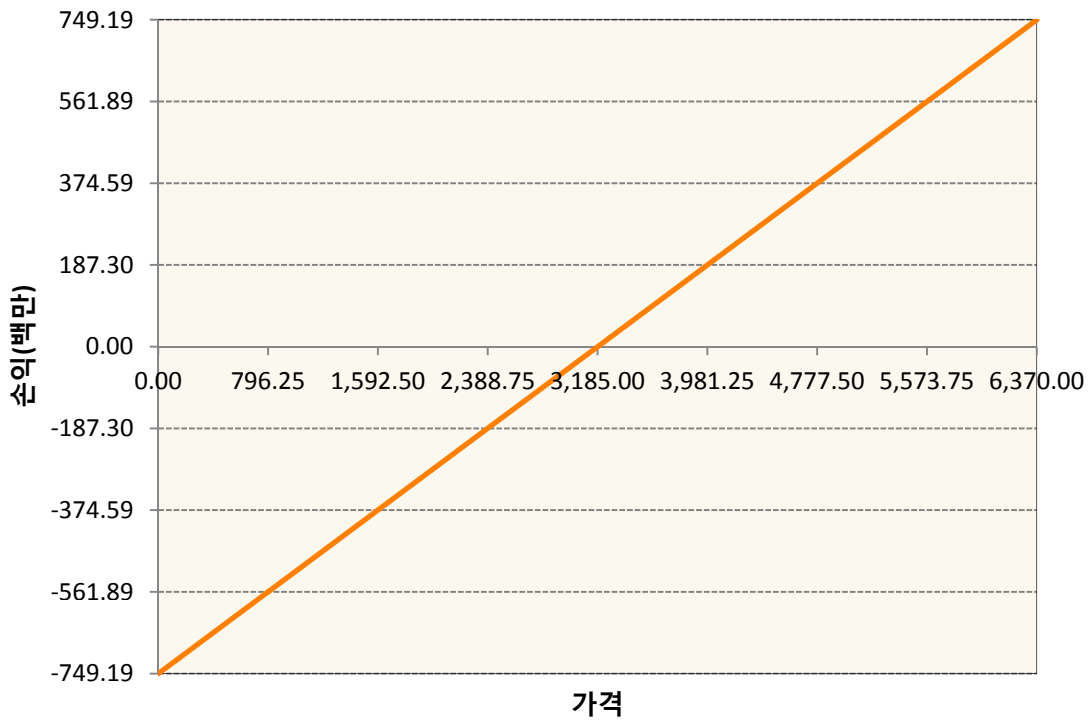
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	749	0	749	

2. 만기시점의 손익구조

VGZ8-EURO STOXX 50 DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ8	EURO STOXX 50 DEC18	60
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

38

공시일	2018-11-14
기준일	2018-11-13

차이나인덱스모(주식-파생형)

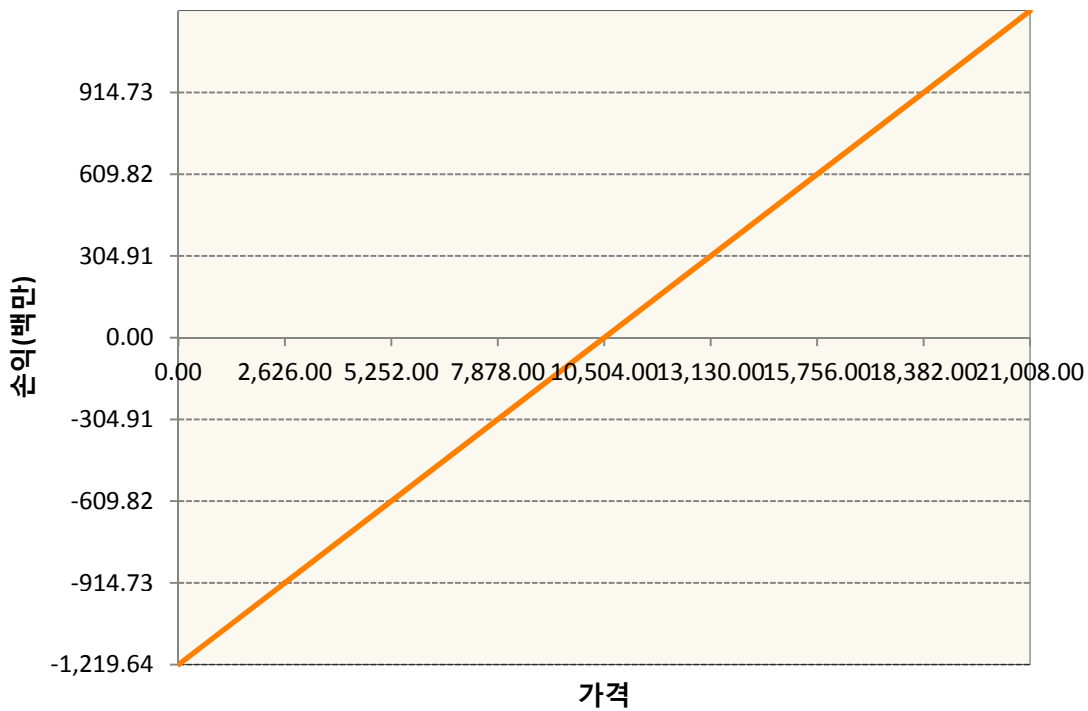
1. 계약금액

(단위:백만원)

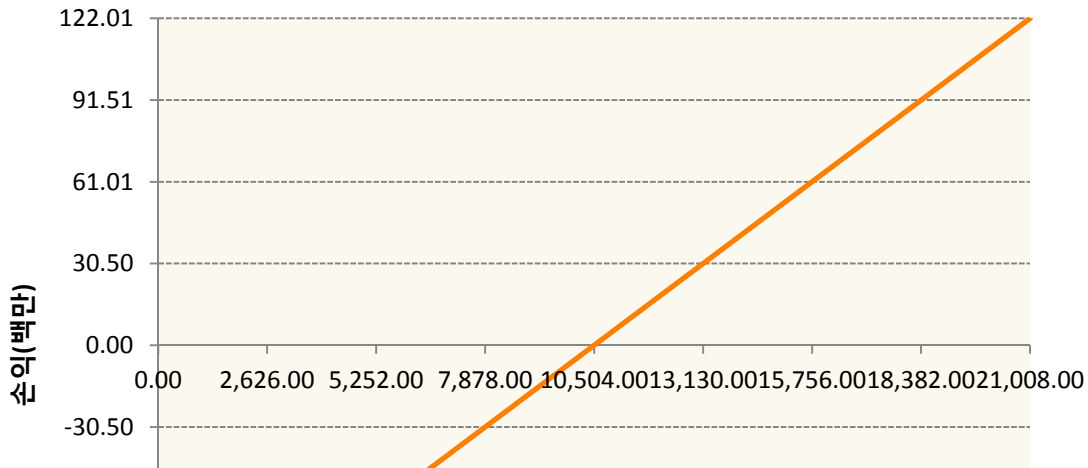
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,342	0	1,342	장내

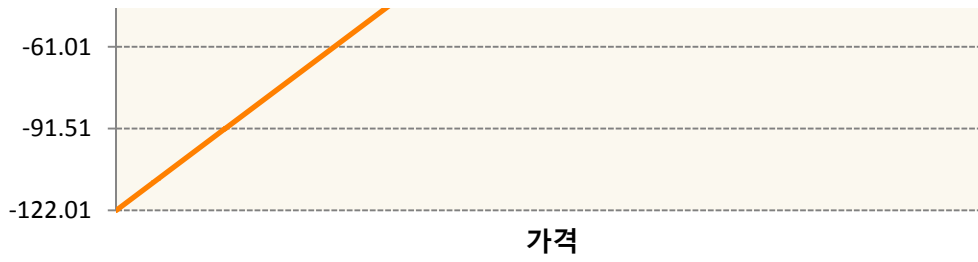
2. 만기시점의 손익구조

HCX8-HSCEI FUTURES NOV 18



MHCX8-MINI H-SHR IDX FU NOV 18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCX8	HSCEI FUTURES NOV 18	98
MHCX8	MINI H-SHR IDX FU NOV 18	10

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

107

공시일	2018-11-14
기준일	2018-11-13

커버드콜모(주식혼합-파생형)

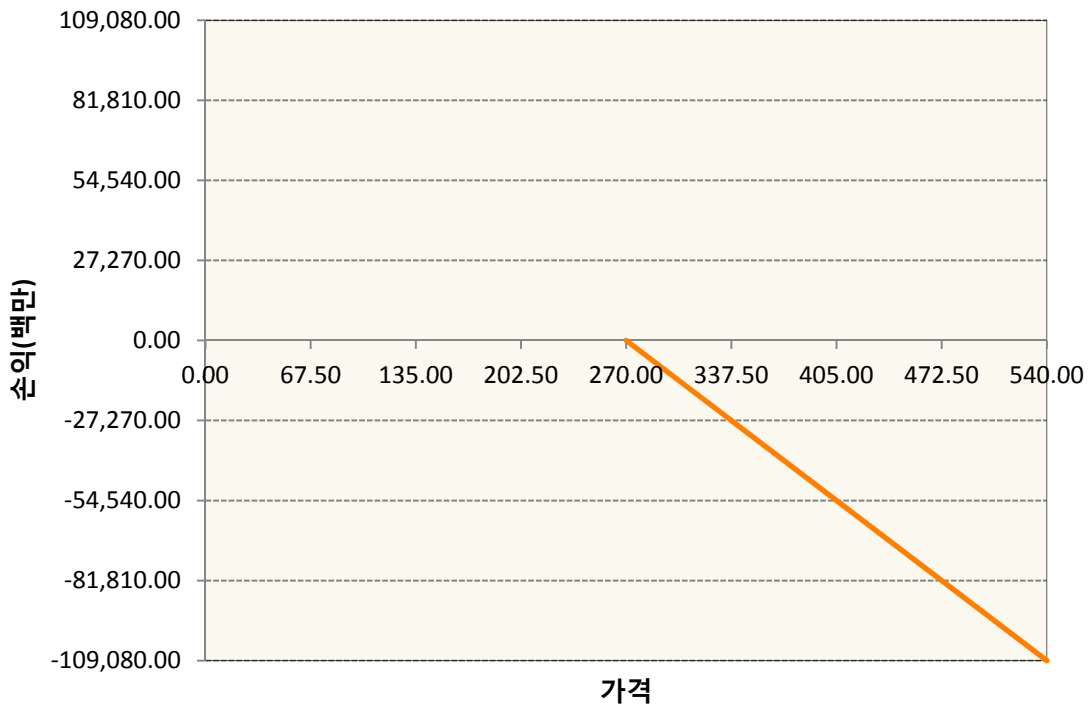
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	706,809	-706,809	장내

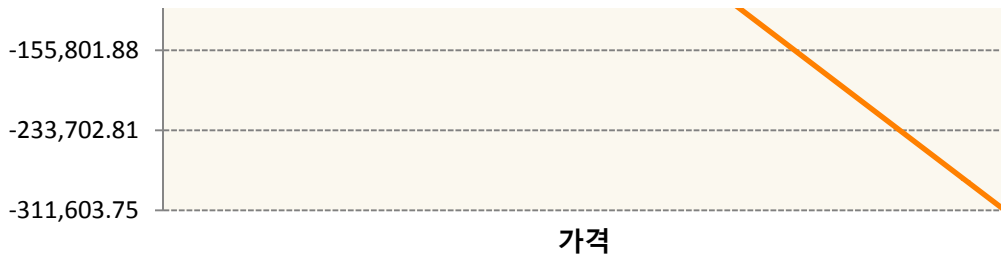
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NC2702-2018-12 콜270

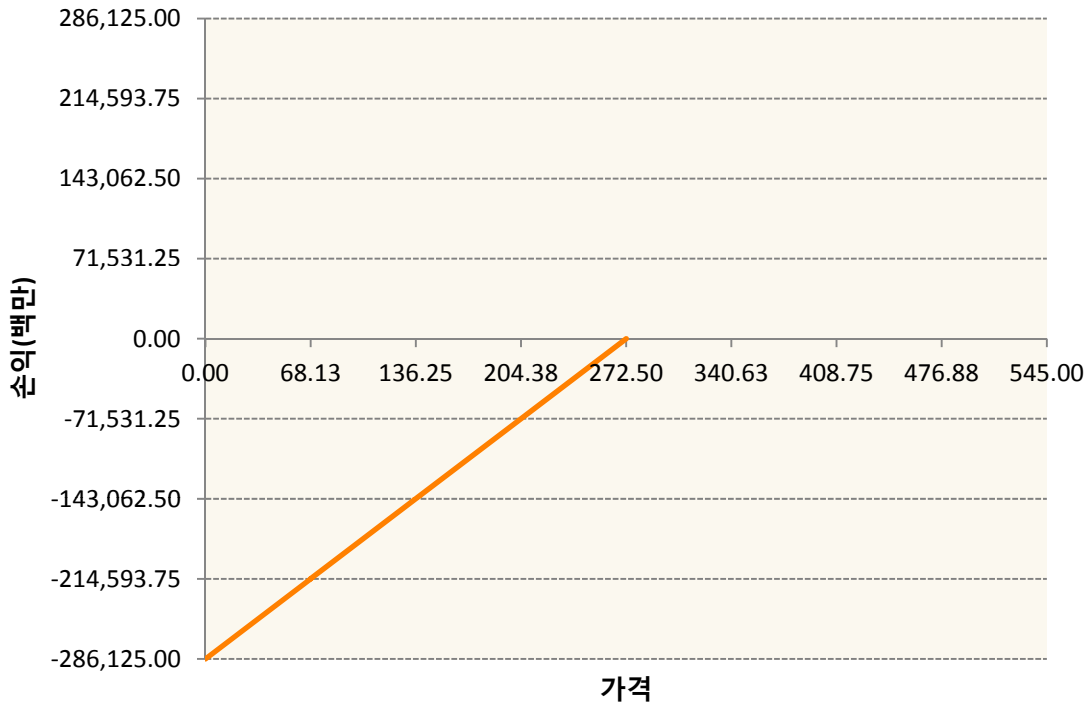


KR4201NC2728-2018-12 콜272.5





KR4301NC2727-2018-12 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NC2702		2018-12 콜270					6,613	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,114	3,007	2,881	2,737	2,579	2,408	2,226	
-5.33%	2,757	2,574	2,378	2,169	1,952	1,727	1,496	
-2.67%	2,043	1,791	1,535	1,274	1,011	746	478	
0%	851	567	284	0	-284	-567	-851	
2.67%	-856	-1,122	-1,391	-1,664	-1,938	-2,215	-2,492	
5.33%	-3,019	-3,229	-3,452	-3,684	-3,925	-4,173	-4,426	
8.00%	-5,519	-5,660	-5,822	-6,000	-6,193	-6,398	-6,613	
KR4201NC2728		2018-12 콜272.5					17,871	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	7,694	7,449	7,147	6,795	6,397	5,959	5,487	

-5.33%	6,920	6,471	5,975	5,439	4,871	4,276	3,658
-2.67%	5,278	4,617	3,934	3,233	2,518	1,792	1,058
0%	2,390	1,595	798	0	-800	-1,600	-2,401
2.67%	-1,939	-2,732	-3,529	-4,329	-5,132	-5,937	-6,743
5.33%	-7,634	-8,299	-8,991	-9,704	-10,434	-11,177	-11,930
8.00%	-14,404	-14,880	-15,407	-15,977	-16,581	-17,214	-17,871
KR4301NC2727 2018-12 풋272.5							18,608
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-17,980	-18,021	-18,087	-18,177	-18,295	-18,439	-18,608
-5.33%	-10,648	-10,797	-10,983	-11,201	-11,448	-11,721	-12,016
-2.67%	-3,921	-4,257	-4,618	-4,999	-5,397	-5,808	-6,229
0%	1,480	989	496	0	-497	-996	-1,496
2.67%	5,016	4,535	4,049	3,558	3,064	2,567	2,067
5.33%	6,812	6,486	6,132	5,754	5,357	4,944	4,519
8.00%	7,502	7,345	7,149	6,919	6,657	6,368	6,054

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

(단위:백만원)

41,745

공시일	2018-11-14
기준일	2018-11-13

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

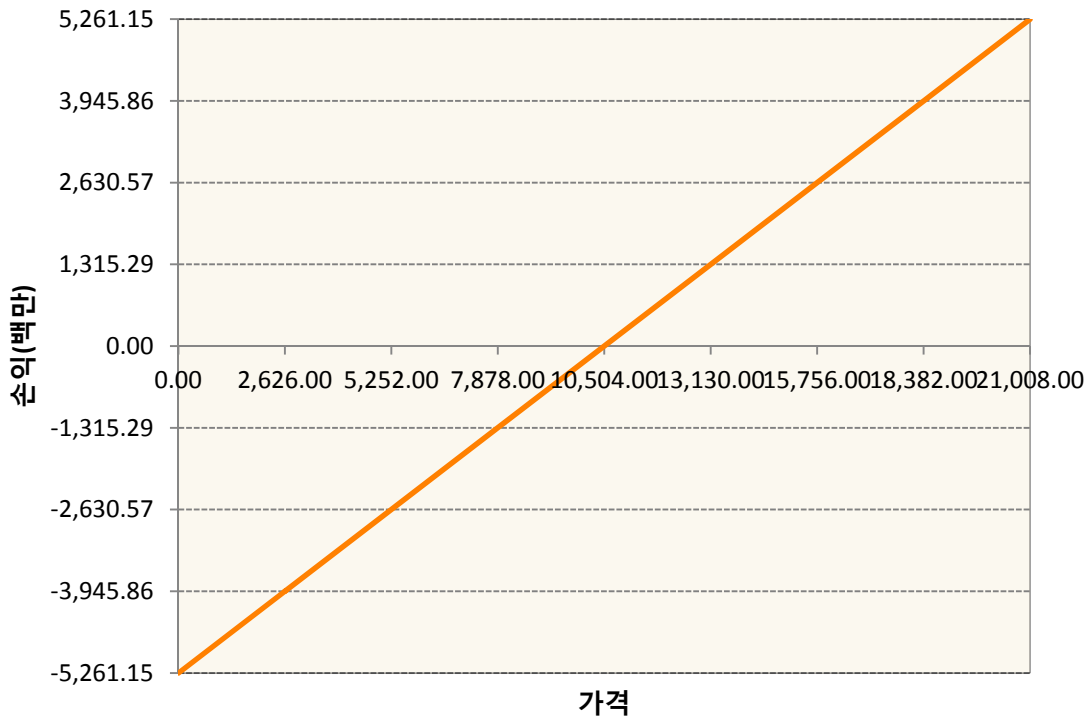
1. 계약금액

(단위:백만원)

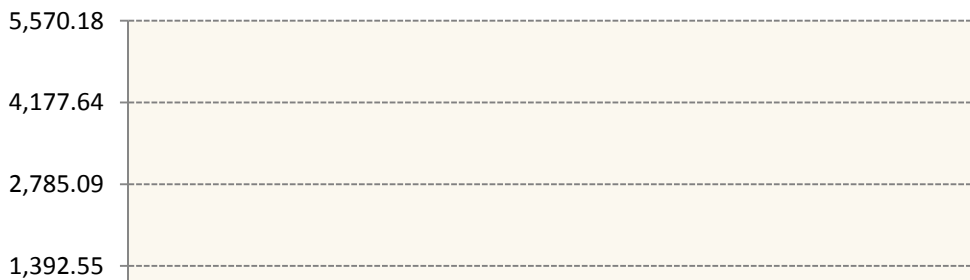
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,261	0	5,261	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,140	-11,140	장내
누계	통화	선도	434	3,183	-2,749	장외

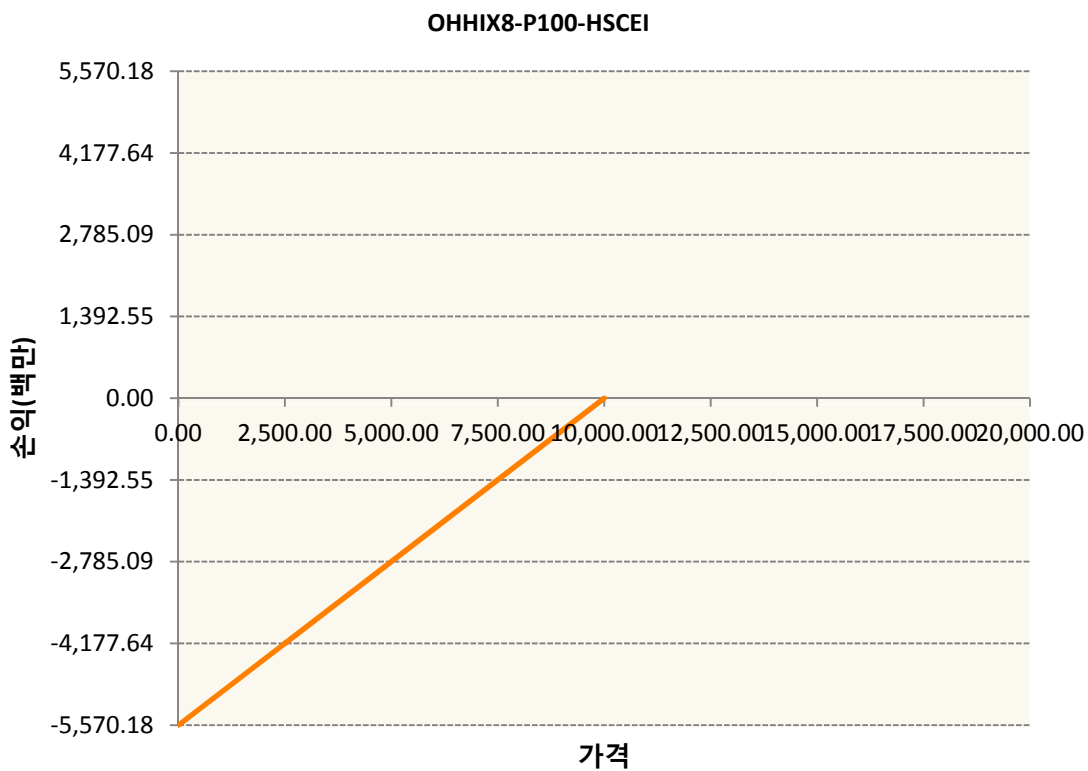
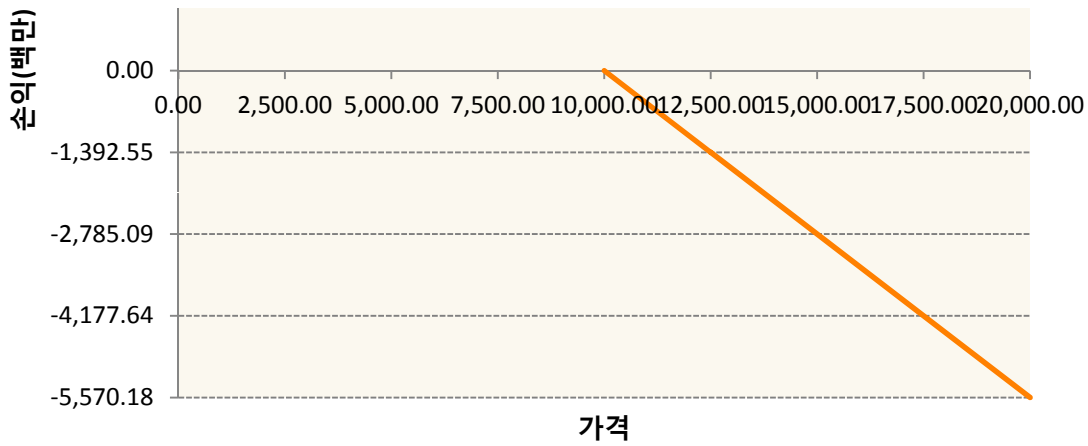
2. 만기시점의 손익구조

HCX8-HSCEI FUTURES NOV 18



OHHIX8-C100-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21018U00 KRW/HKD 10-12-18E		220
FX21018U03 KRW/HKD 10-12-18E		35
FX21018V01 HKD/KRW 10-12-18E		35
HCX8 HSCEI FUTURES NOV 18		421
OHHIX8-C1C HSCEI		446
OHHIX8-P10 HSCEI		446

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

공시일	2018-11-14
기준일	2018-11-13

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

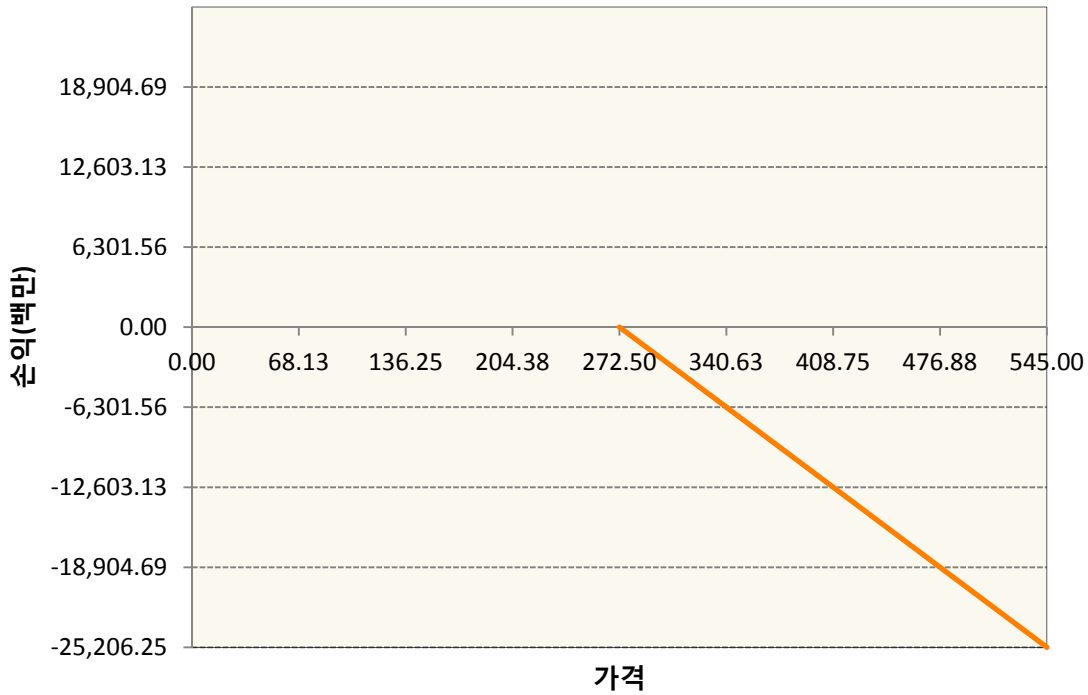
1. 계약금액

(단위:백만원)

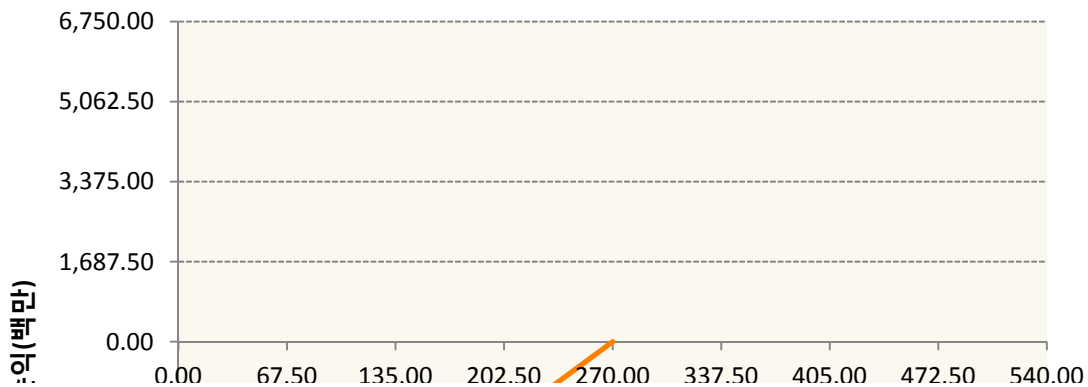
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	43,836	0	43,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	43,538	-43,538	장내

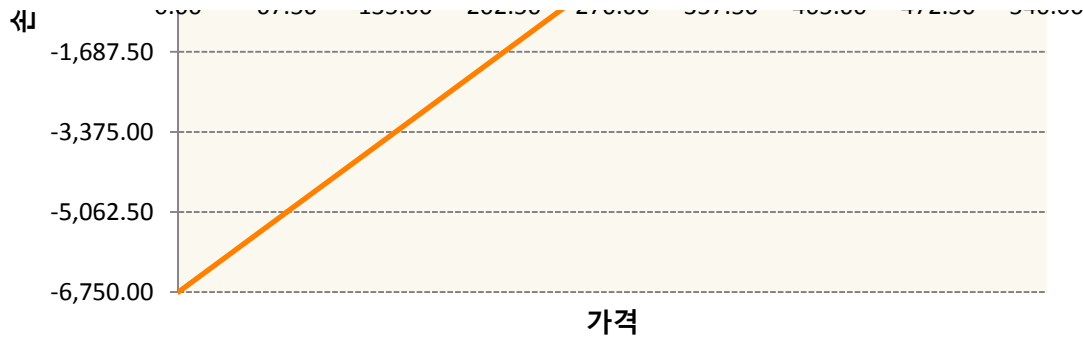
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NC2728-2018-12 콜272.5

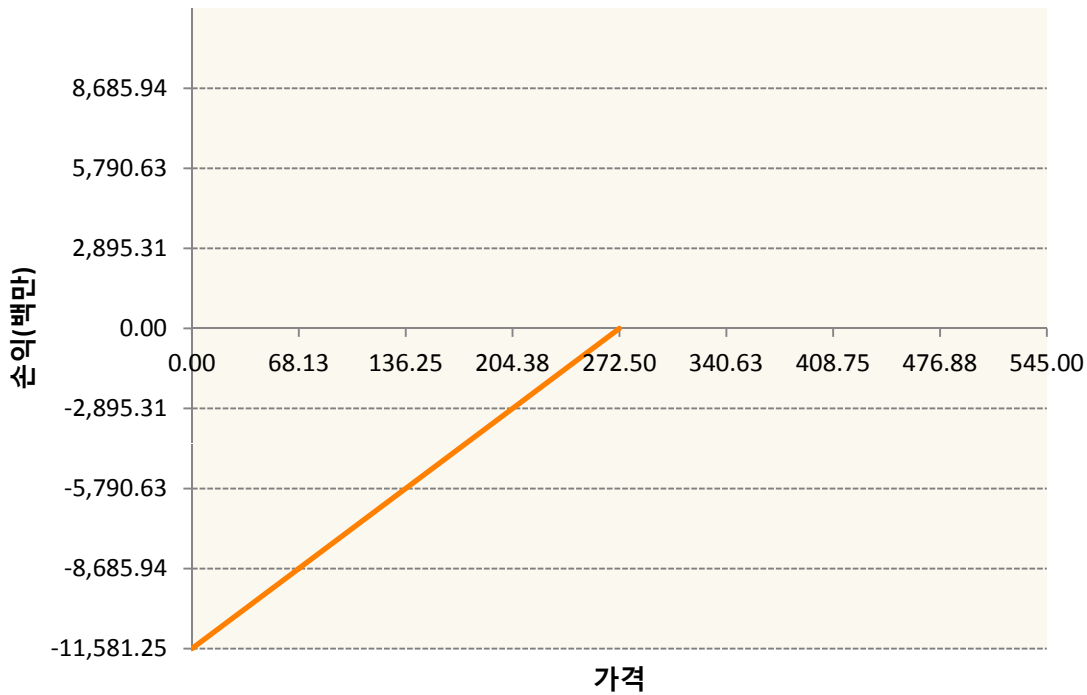


KR4301NC2701-2018-12 풋270





KR4301NC2727-2018-12 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	2.529E+11	UBCSFXC1 INDEX_14						3,599
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,599	-3,599	-3,599	-3,599	-3,599	-3,599	-3,599	
-5.33%	-2,399	-2,399	-2,399	-2,399	-2,399	-2,399	-2,399	
-2.67%	-1,200	-1,200	-1,200	-1,200	-1,200	-1,200	-1,200	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	1,200	1,200	1,200	1,200	1,200	1,200	1,200	
5.33%	2,399	2,399	2,399	2,399	2,399	2,399	2,399	
8.00%	3,599	3,599	3,599	3,599	3,599	3,599	3,599	
	KR4201NC2728	2018-12 콜272.5						1,446
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	622	603	578	550	517	482	444
-5.33%	560	523	483	440	394	346	296
-2.67%	427	373	318	262	204	145	86
0%	193	129	65	0	-65	-129	-194
2.67%	-157	-221	-285	-350	-415	-480	-545
5.33%	-618	-671	-727	-785	-844	-904	-965
8.00%	-1,165	-1,204	-1,246	-1,292	-1,341	-1,392	-1,446

KR4301NC2701 2018-12 풋270 421

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-401	-403	-405	-408	-412	-416	-421
-5.33%	-230	-235	-240	-247	-254	-261	-269
-2.67%	-78	-88	-97	-108	-118	-129	-139
0%	36	24	12	0	-12	-24	-36
2.67%	104	94	84	73	62	50	39
5.33%	136	130	123	115	107	98	89
8.00%	146	144	140	136	131	125	119

KR4301NC2727 2018-12 풋272.5 753

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-728	-729	-732	-736	-741	-746	-753
-5.33%	-431	-437	-445	-453	-463	-474	-486
-2.67%	-159	-172	-187	-202	-218	-235	-252
0%	60	40	20	0	-20	-40	-61
2.67%	203	184	164	144	124	104	84
5.33%	276	263	248	233	217	200	183
8.00%	304	297	289	280	269	258	245

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

(단위:백만원)

6,126

공시일	2018-11-14
기준일	2018-11-13

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

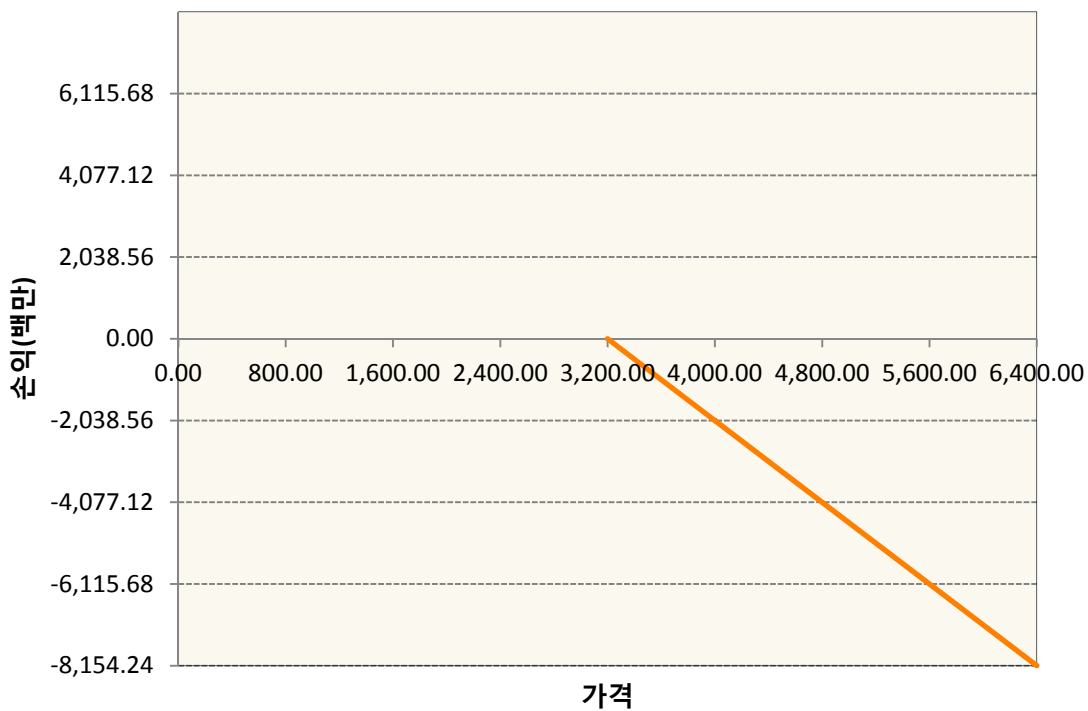
1. 계약금액

(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	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	8,140	0	8,140	
누계	유가증권	스왑	71,163	0	71,163	장외
누계	유가증권	옵션	0	28,800	-28,800	장내
누계	통화	선도	0	15,289	-15,289	장외

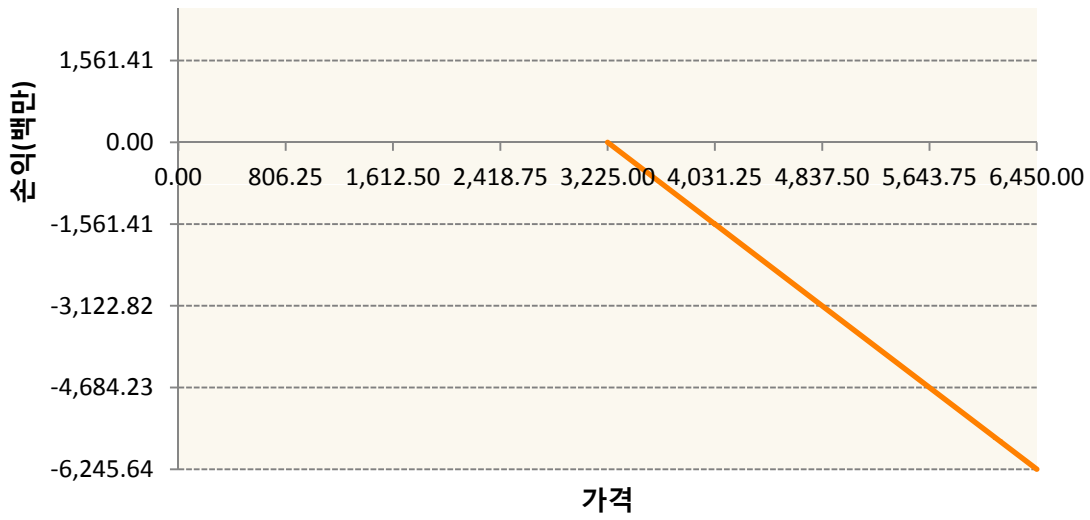
2. 만기시점의 손익구조

OESXX8-C3200-EURO STOXX 50

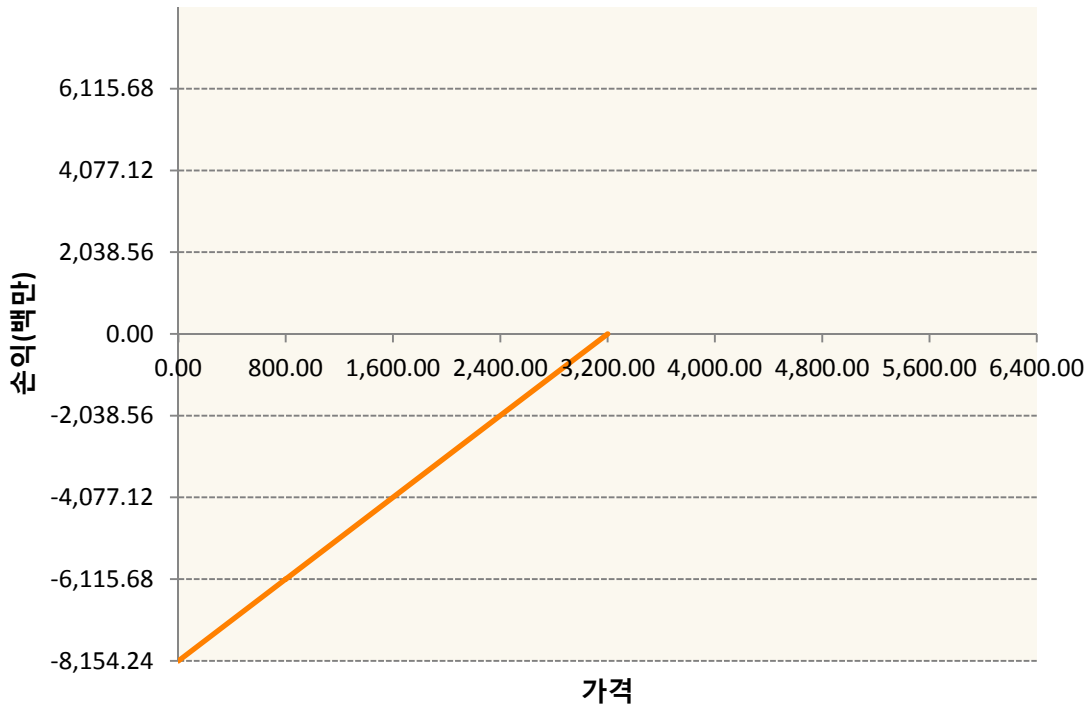


OESXX8-C3225-EURO STOXX 50

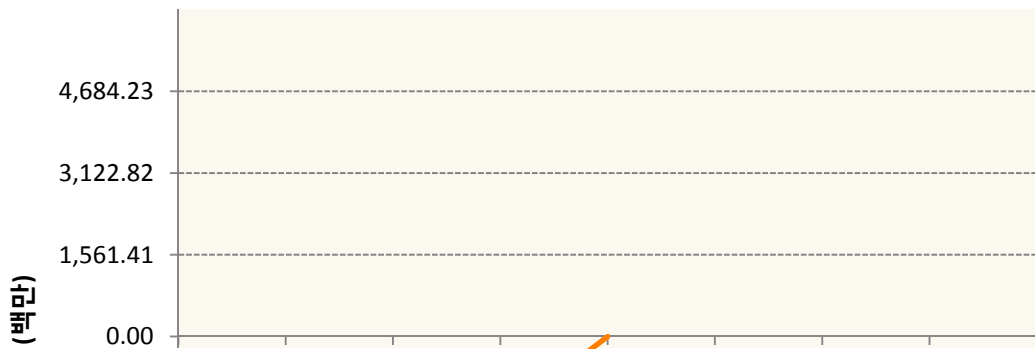


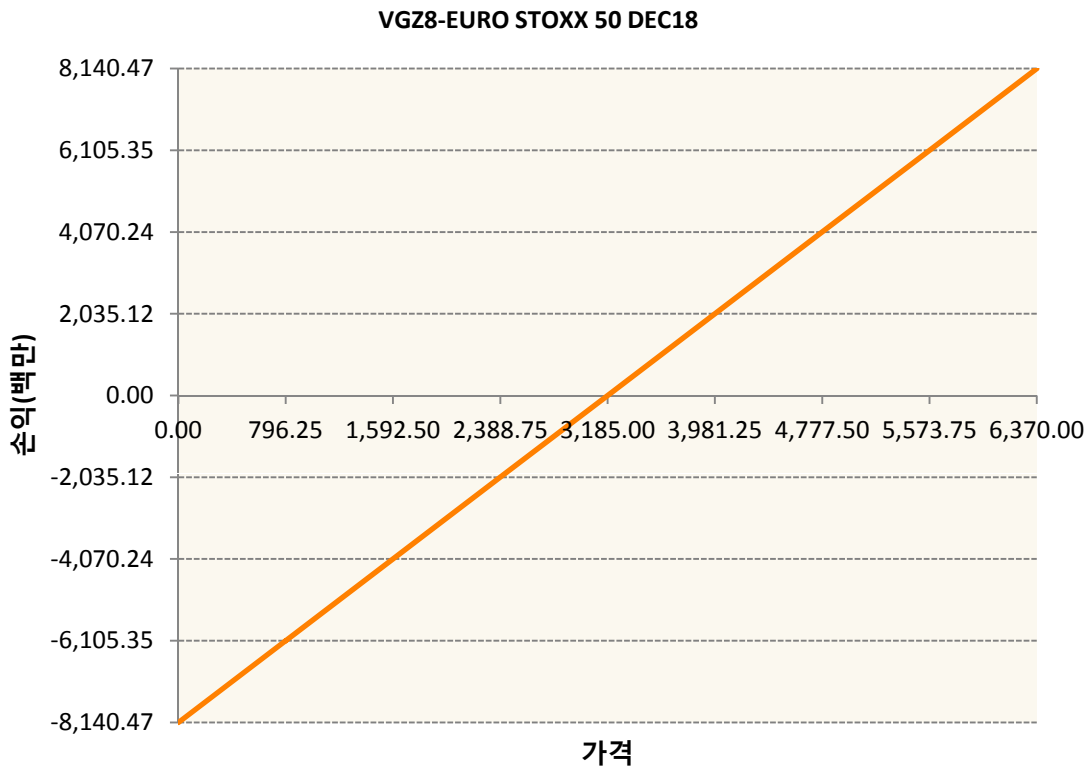
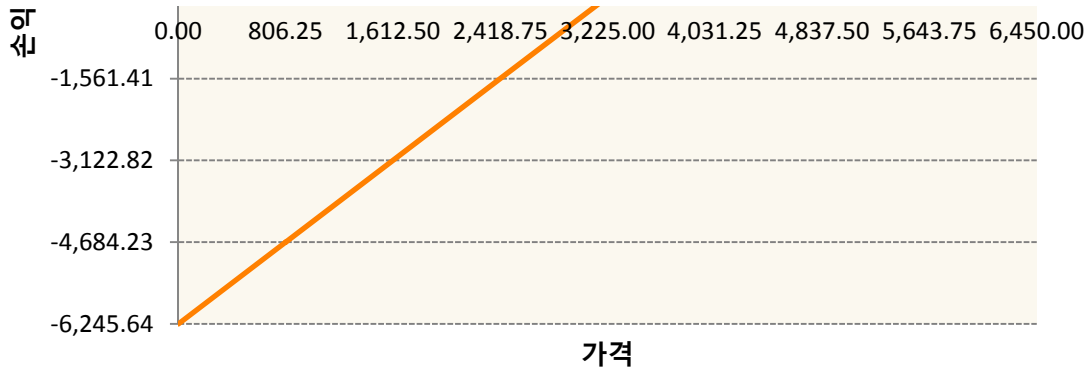


OESXX8-P3200-EURO STOXX 50



OESXX8-P3225-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	71
FX21018Q01 KRW/EUR 23-11-18E	204
FX21018Q02 KRW/EUR 23-11-18E	204
FX21018U03 KRW/EUR 21-12-18E	815
OESXX8-C32 EURO STOXX 50	652
OESXX8-C32 EURO STOXX 50	500
OESXX8-P32 EURO STOXX 50	652
OESXX8-P32 EURO STOXX 50	500
VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18	651

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

(단위:백만원)

2,628

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

(단위:백만원)

1,142

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)

41

공시일	2018-11-14
기준일	2018-11-13

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

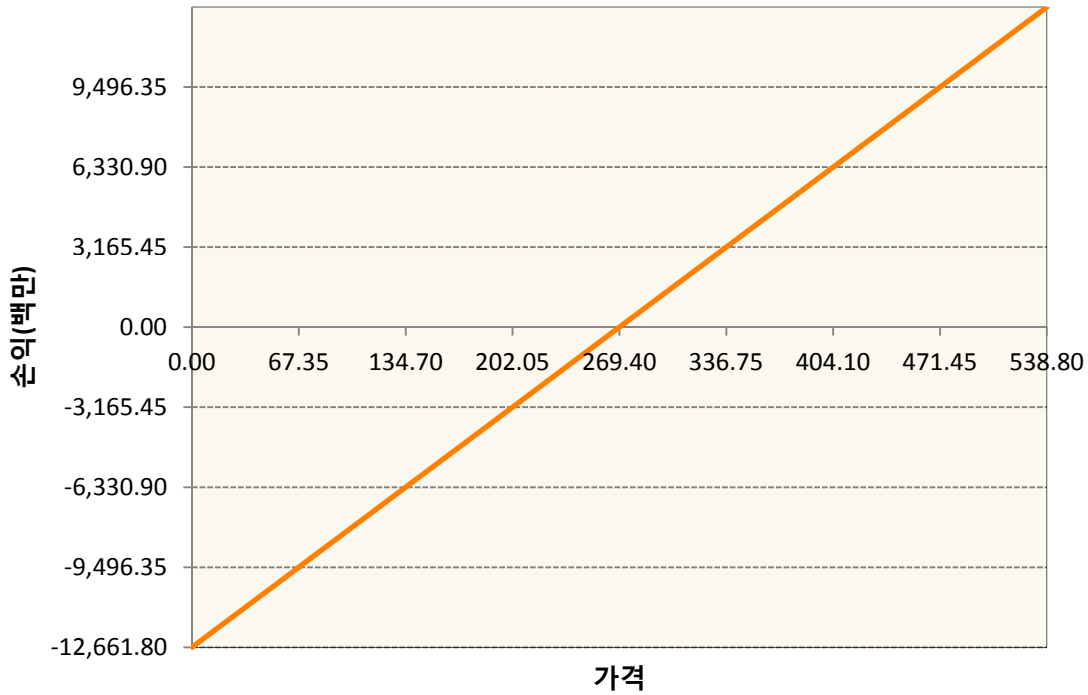
1. 계약금액

(단위:백만원)

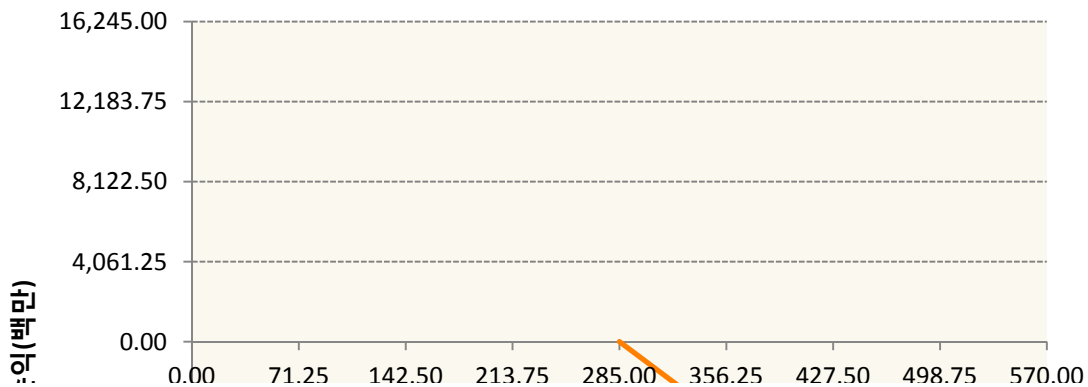
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,662	0	12,662	장내
누계	유가증권	옵션	3,743	22,858	-19,115	장내

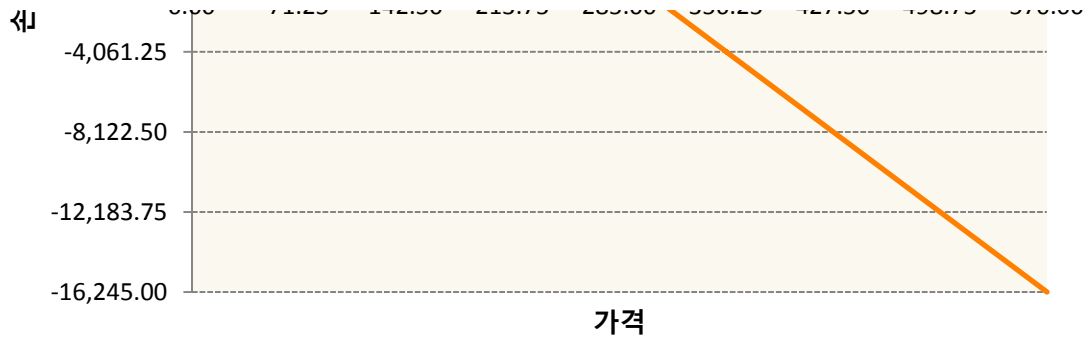
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

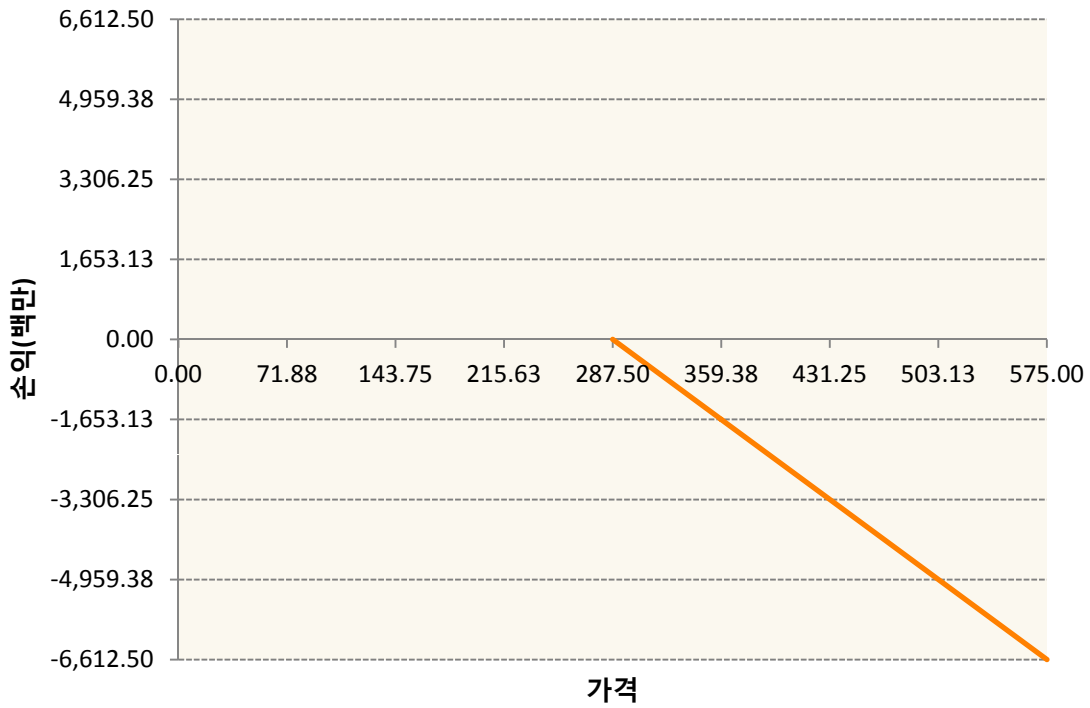


KR4201NC2850-2018-12 콜285

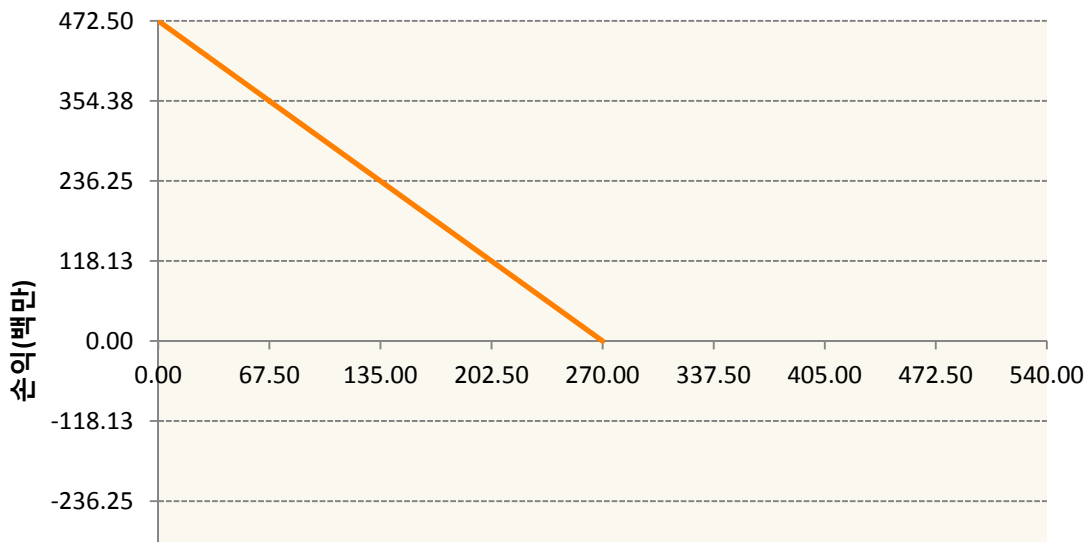


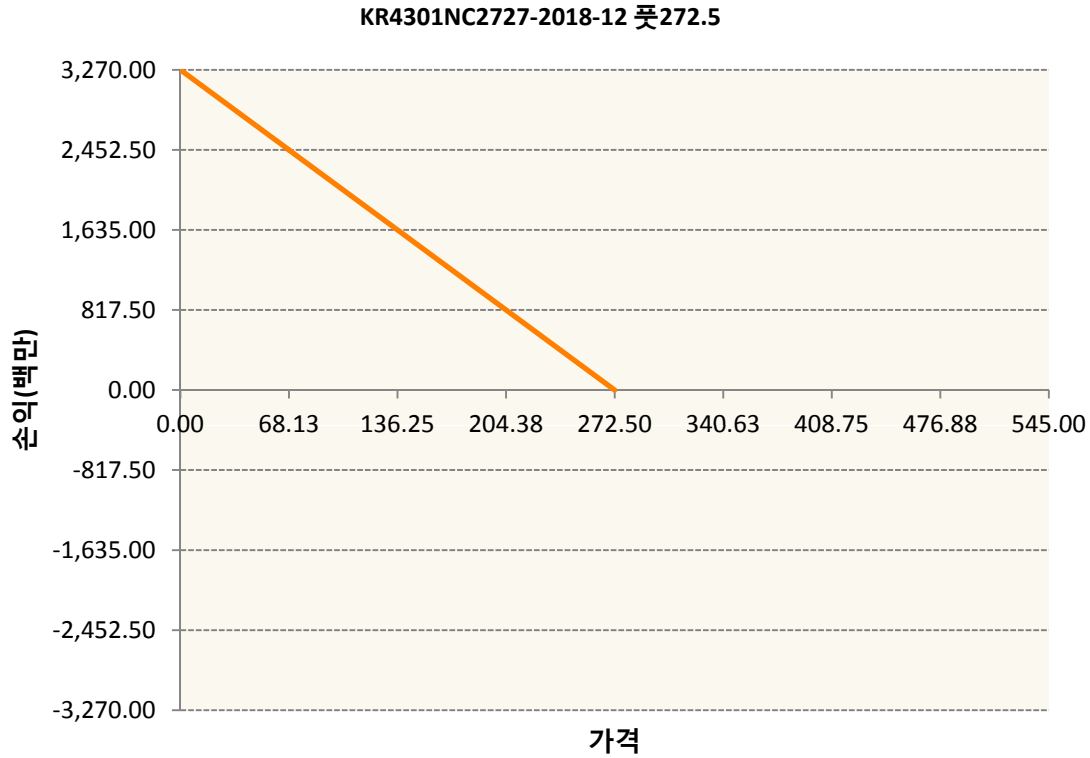
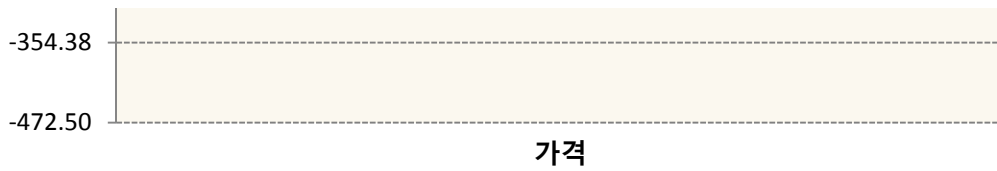


KR4201NC2876-2018-12 콜287.5



KR4301NC2701-2018-12 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0004		2018-12 코스피200지수선물						1,014
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,014	-1,014	-1,014	-1,014	-1,014	-1,014	-1,014	
-5.33%	-676	-676	-676	-676	-676	-676	-676	
-2.67%	-338	-338	-338	-338	-338	-338	-338	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	338	338	338	338	338	338	338	
5.33%	676	676	676	676	676	676	676	
8.00%	1,014	1,014	1,014	1,014	1,014	1,014	1,014	
KR4201NC2850		2018-12 콜285						657
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	171	168	163	156	146	135	122	
-5.33%	163	155	144	131	114	96	76	
-2.67%	141	124	104	82	58	32	4	

0%	88	61	31	0	-33	-66	-101
2.67%	-12	-50	-88	-126	-165	-205	-244
5.33%	-177	-219	-261	-303	-345	-387	-430
8.00%	-410	-450	-491	-532	-574	-615	-657
KR4201NC2876 2018-12 콜287.5							246
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	57	56	55	53	49	45	41
-5.33%	55	53	49	44	39	32	25
-2.67%	48	43	36	28	20	10	0
0%	32	22	12	0	-12	-25	-38
2.67%	-1	-15	-30	-45	-60	-75	-91
5.33%	-58	-75	-92	-109	-126	-143	-160
8.00%	-143	-160	-177	-194	-211	-228	-246
KR4301NC2701 2018-12 풋270							29
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	28	28	28	29	29	29	29
-5.33%	16	16	17	17	18	18	19
-2.67%	5	6	7	8	8	9	10
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-7	-7	-6	-5	-4	-4	-3
5.33%	-10	-9	-9	-8	-7	-7	-6
8.00%	-10	-10	-10	-10	-9	-9	-8
KR4301NC2727 2018-12 풋272.5							213
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	205	206	207	208	209	211	213
-5.33%	122	123	126	128	131	134	137
-2.67%	45	49	53	57	62	66	71
0%	-17	-11	-6	0	6	11	17
2.67%	-57	-52	-46	-41	-35	-29	-24
5.33%	-78	-74	-70	-66	-61	-57	-52
8.00%	-86	-84	-82	-79	-76	-73	-69

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

(단위:백만원)

1,721

공시일	2018-11-14
기준일	2018-11-13

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	321	0	321	
누계	유가증권	수익증권	321	0	321	

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	2018-11-14
기준일	2018-11-13

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	113	0	113	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	113	0	113	
누계	통화	선도	0	174	-174	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21018X01 KRW/USD 13-12-18E		9
FX21018X01 KRW/USD 30-11-18E		2
FX21018X01 KRW/USD 30-11-18E		3

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

(단위:백만원)

5

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

(단위:백만원)

154

공시일	2018-11-14
기준일	2018-11-13

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

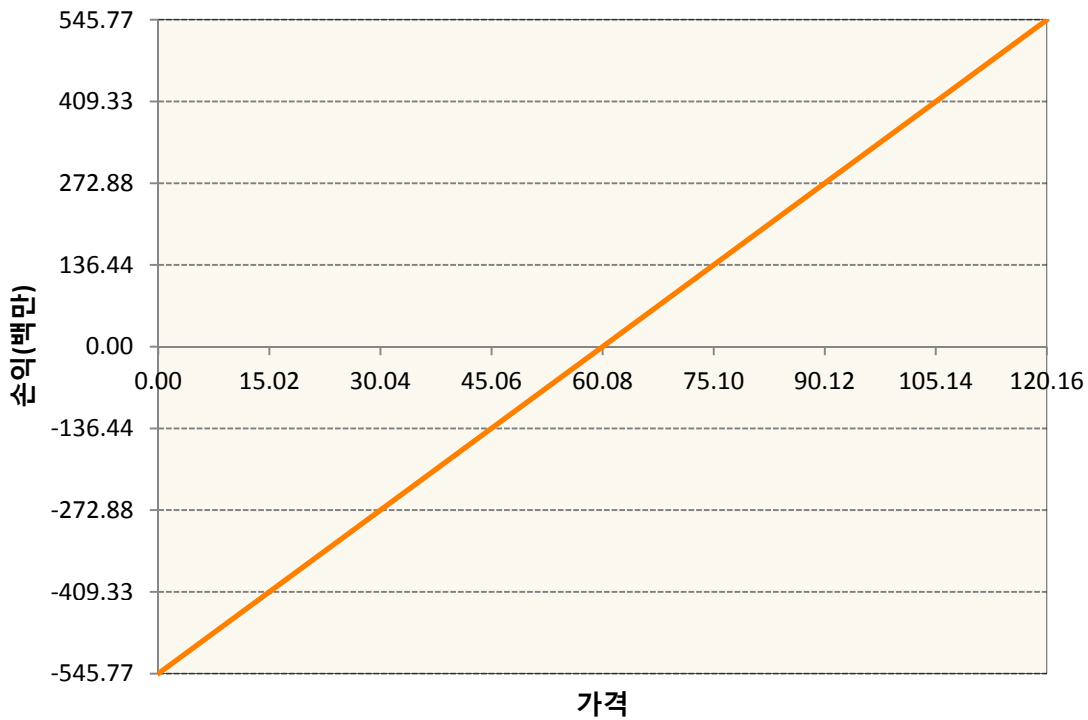
1. 계약금액

(단위:백만원)

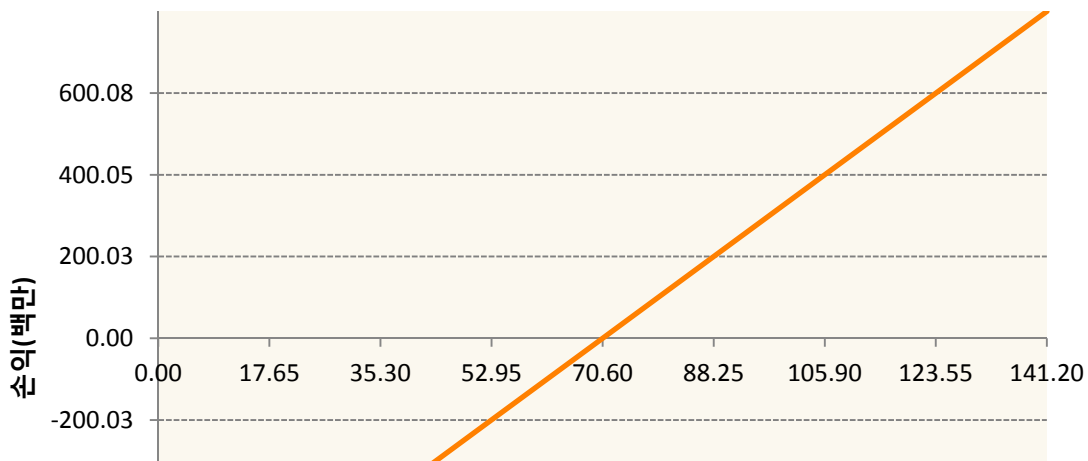
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,222	408	2,814	

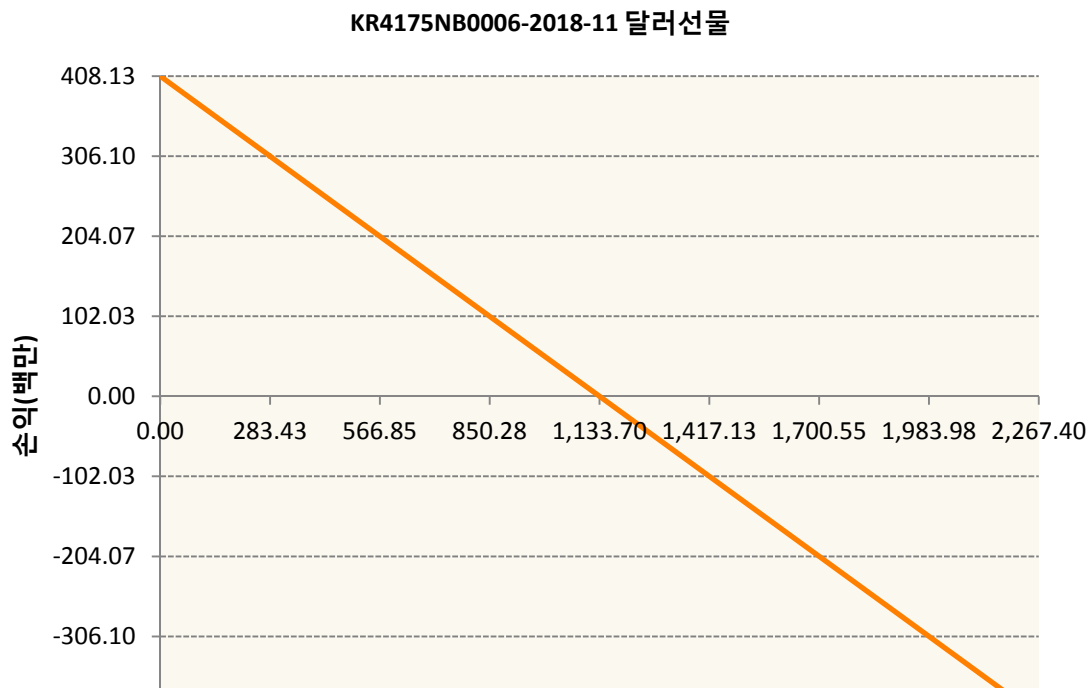
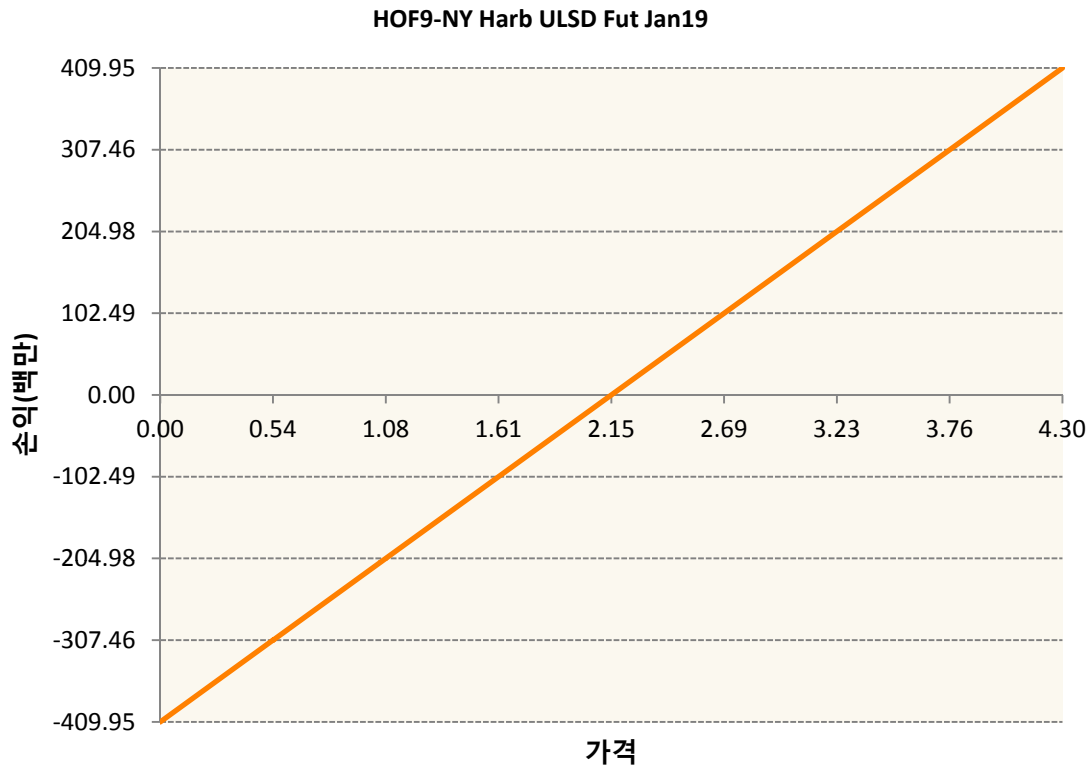
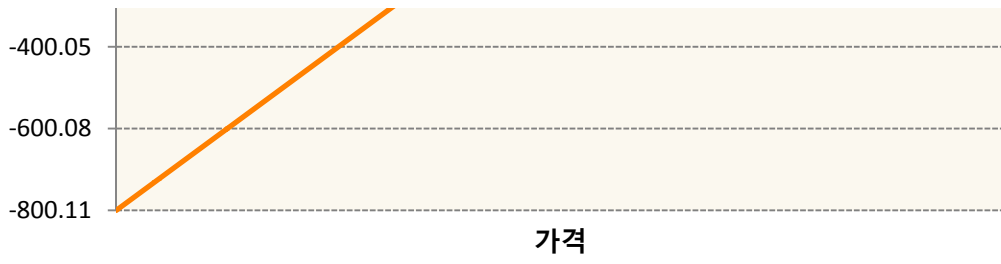
2. 만기시점의 손익구조

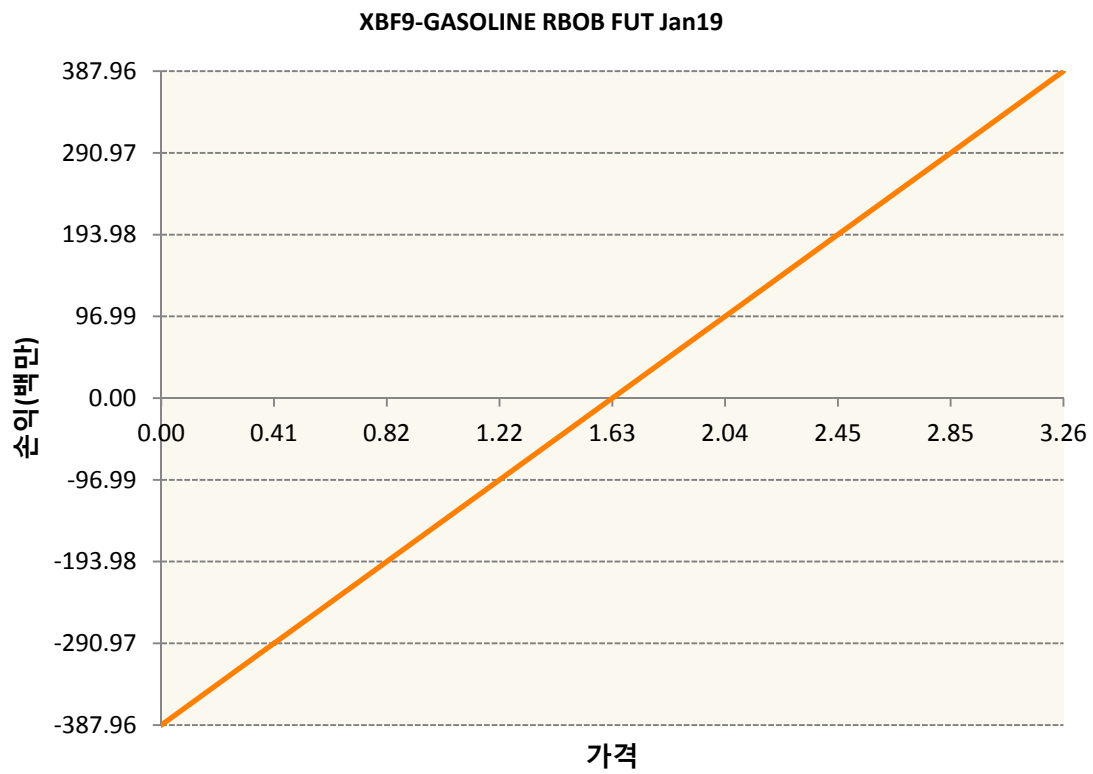
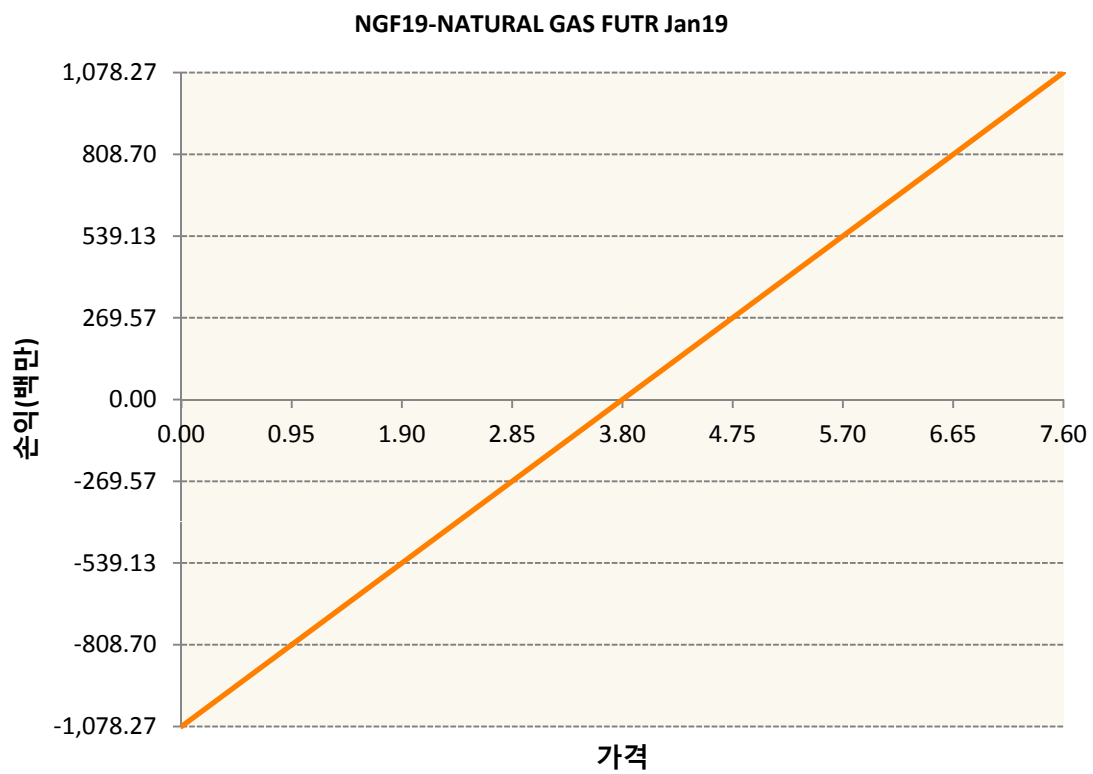
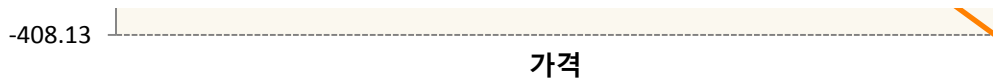
CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19



COH9-BRENT CRUDE FUTR Mar19







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF9	WTI CRUDE FUTURE Jan19	44
COH9	BRENT CRUDE FUTR Mar19	64
HOF9	NY Harb ULSD Fut Jan19	33
KR4175NB0(2018-11 달러선물		33
NGF19	NATURAL GAS FUTR Jan19	86
XBF9	GASOLINE RBOB FUT Jan19	31

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

394

공시일	2018-11-14
기준일	2018-11-13

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

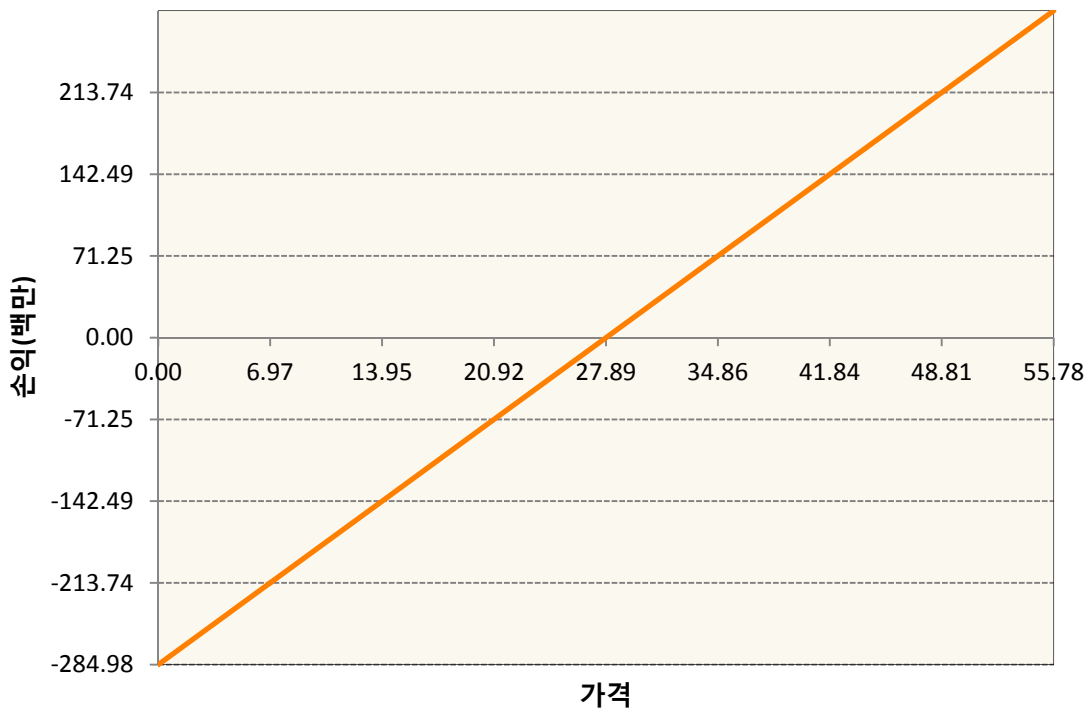
1. 계약금액

(단위:백만원)

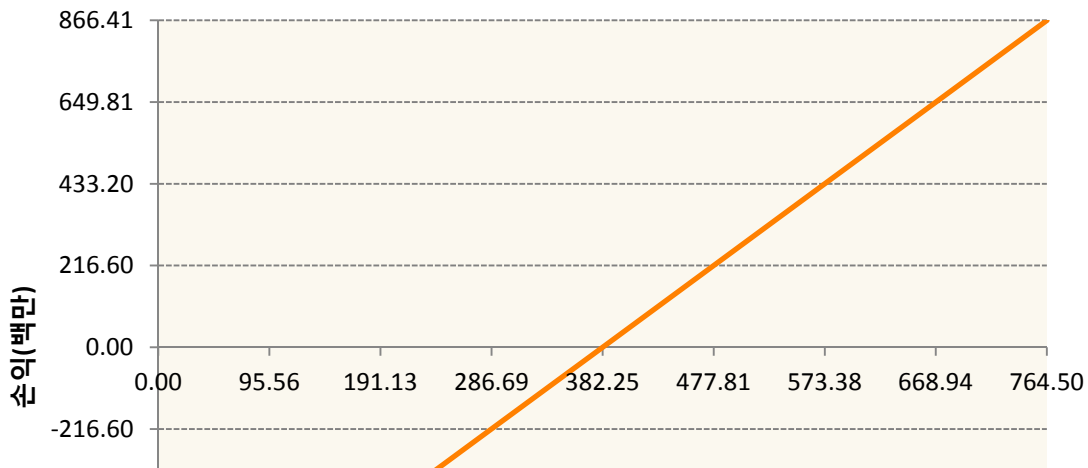
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,722	79	3,643	

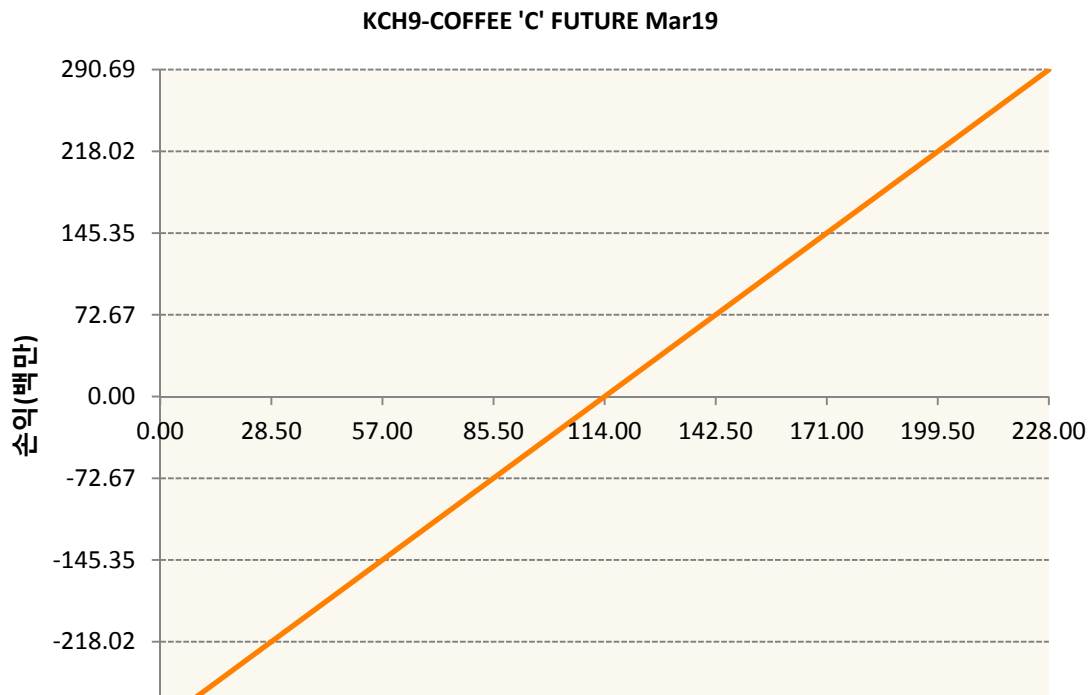
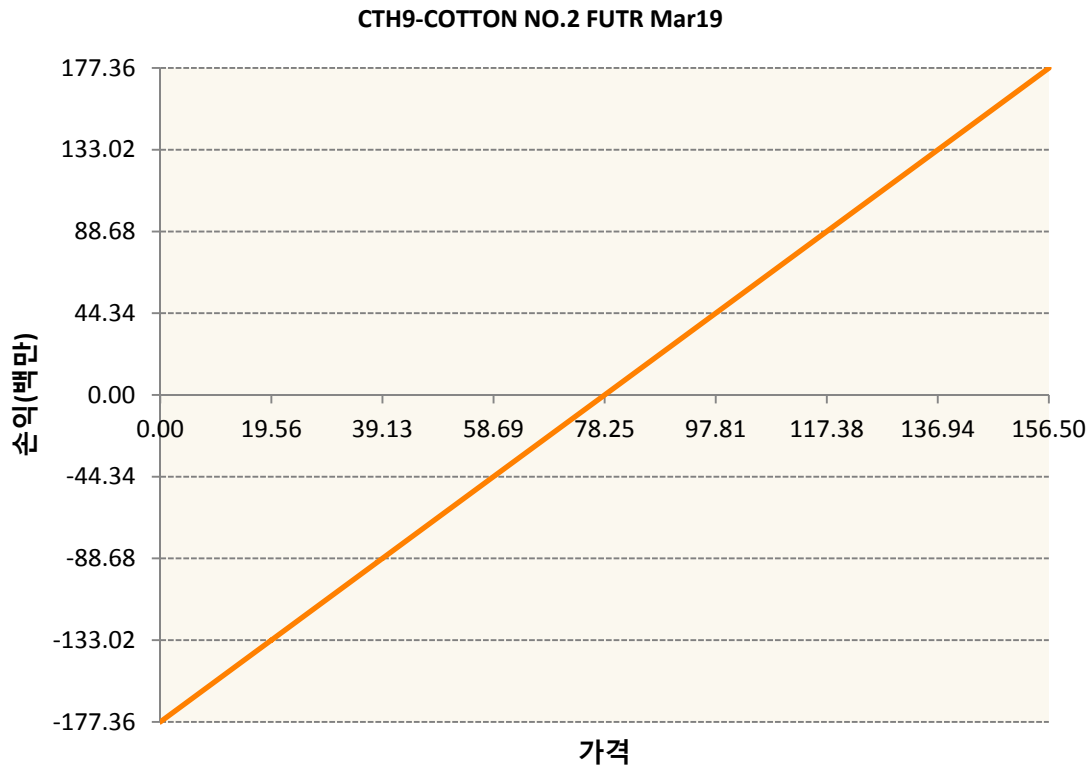
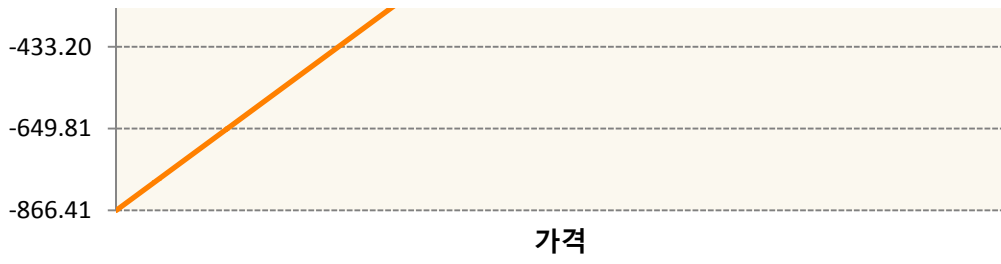
2. 만기시점의 손익구조

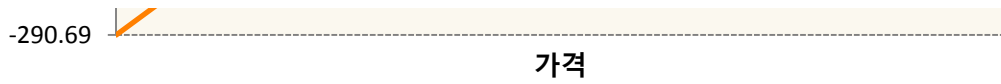
BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19



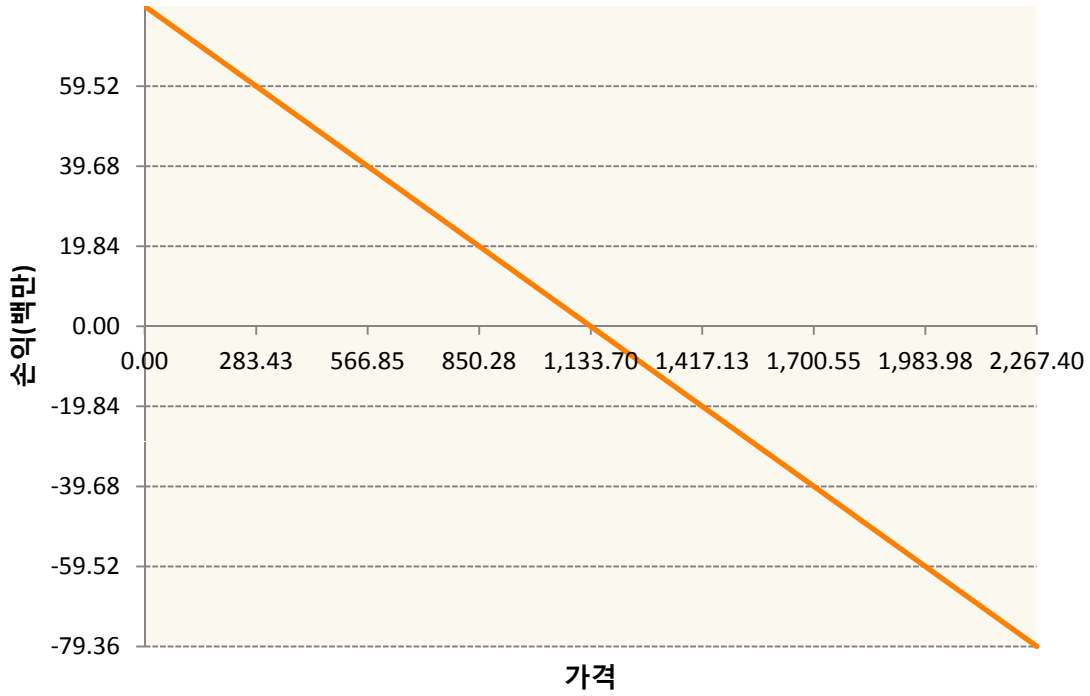
CH9-CORN FUTURE Mar19



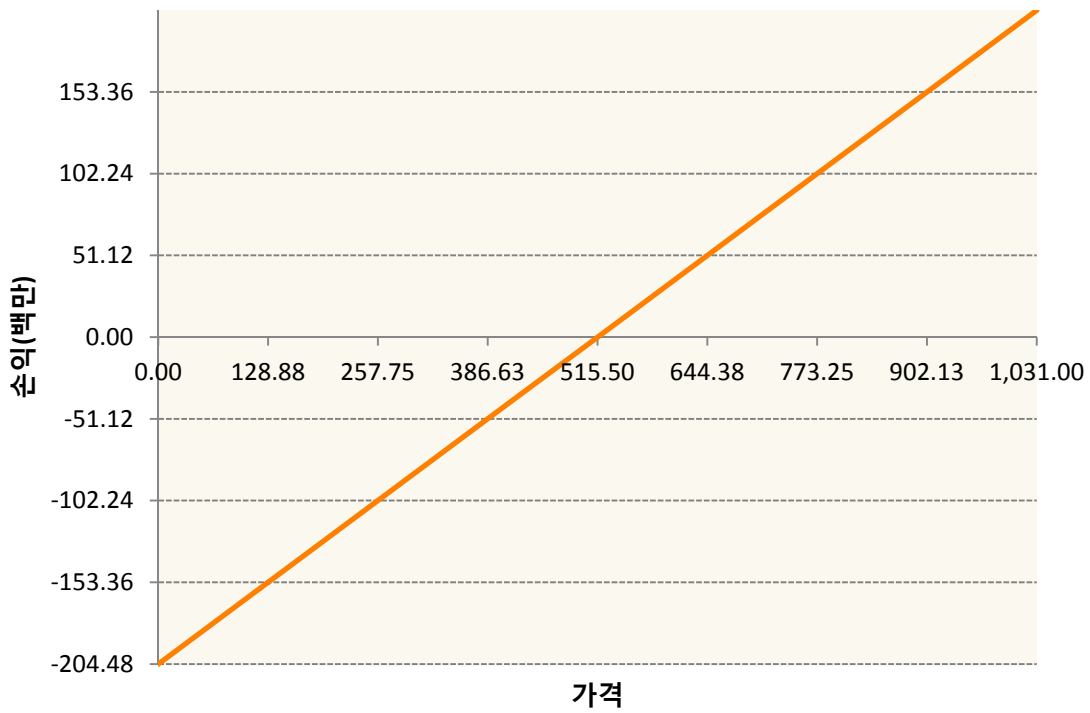




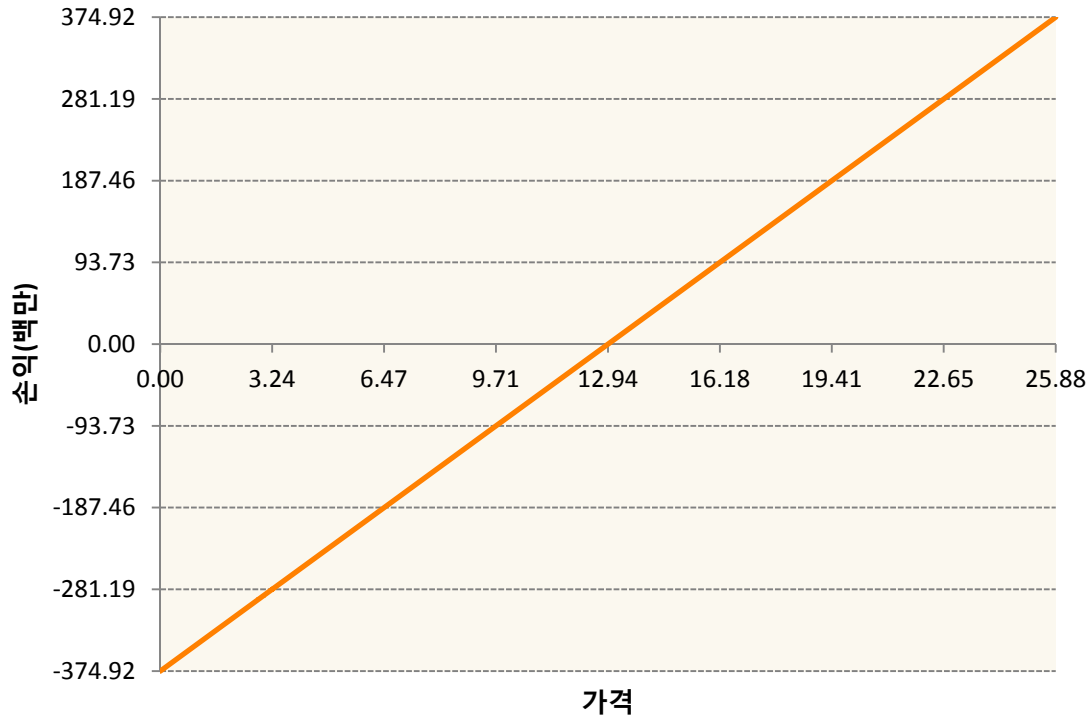
KR4175NB0006-2018-11 달러선물



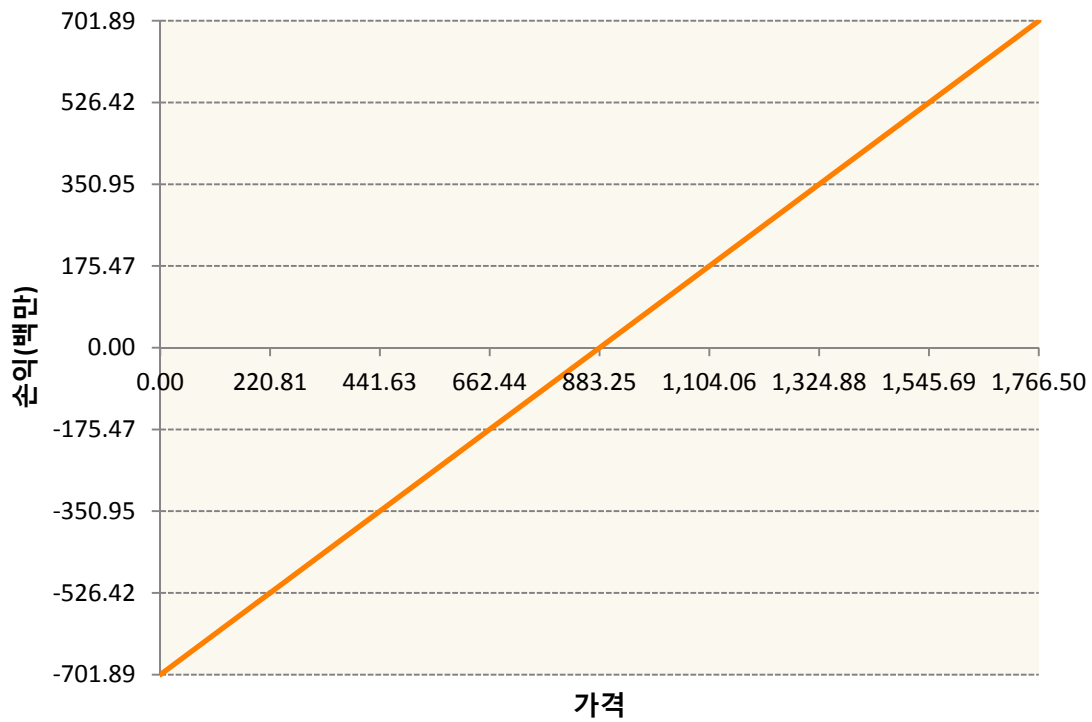
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

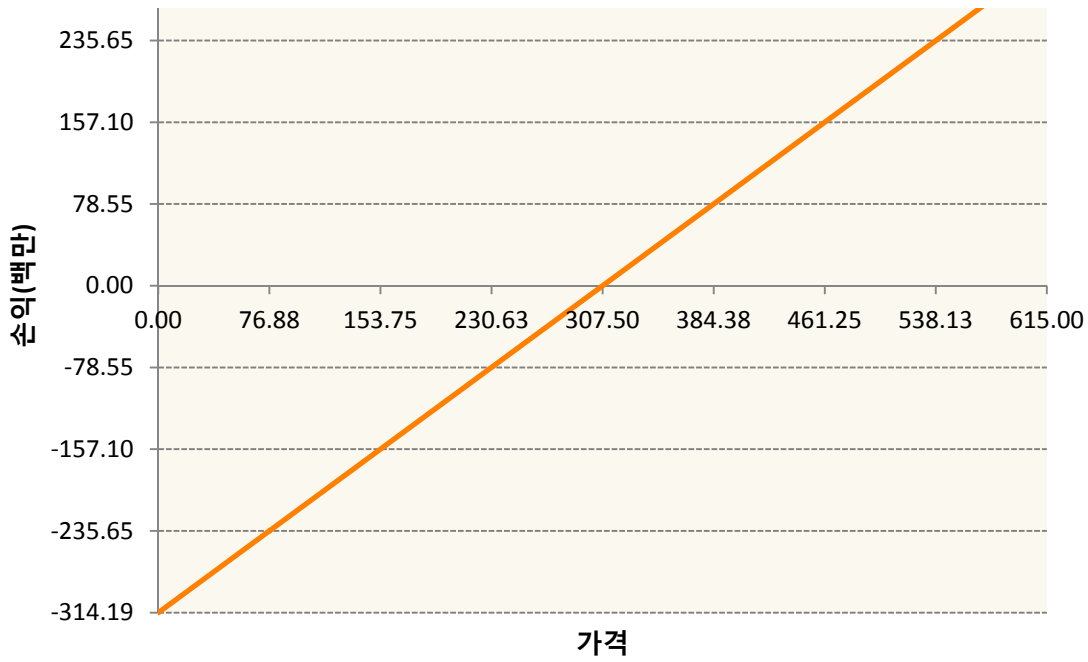


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19

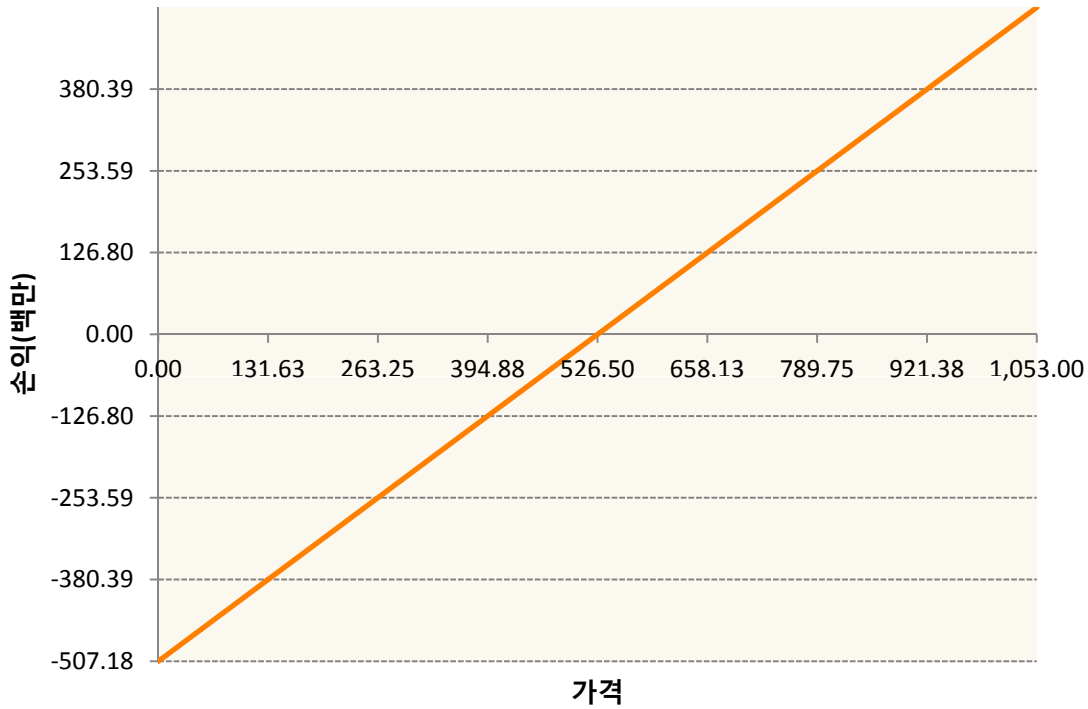


SMF9-SOYBEAN MEAL FUTR Jan19





WH9-WHEAT FUTURE(CBT) Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF9	SOYBEAN OIL FUTR Jan19	23
CH9	CORN FUTURE Mar19	69
CTH9	COTTON NO.2 FUTR Mar19	14
KCH9	COFFEE 'C' FUTURE Mar19	23
KR4175NB0	(2018-11 달러선물)	6

KWH9	KC HRW WHEAT FUT Mar19	16
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	30
SF9	SOYBEAN FUTURE Jan19	56
SMF9	SOYBEAN MEAL FUTR Jan19	25
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	41

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

(단위:백만원)

327