

공시일	2018-11-20
기준일	2018-11-19

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

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

(단위:백만원)

69

공시일	2018-11-20
기준일	2018-11-19

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

1,080

* 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	2018-11-20
기준일	2018-11-19

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)

SWCSI50000 신한CSI500미래S180910

283

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

407

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-11-20
기준일	2018-11-19

유로인덱스모(주식-파생형)

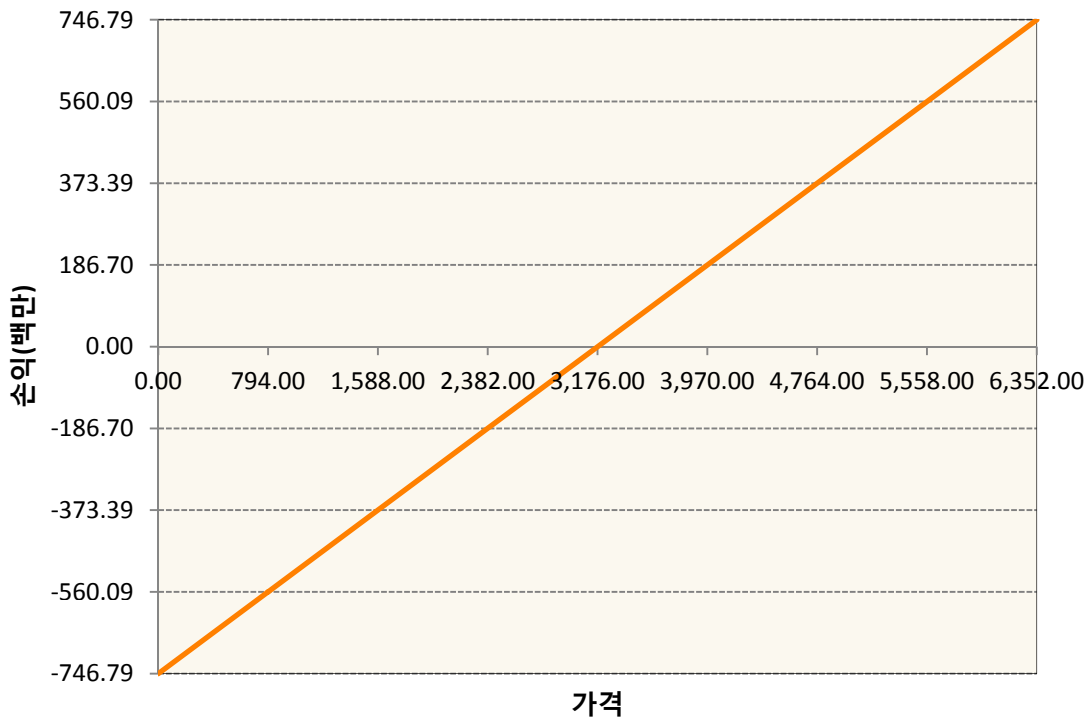
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	747	0	747	

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	2018-11-20
기준일	2018-11-19

차이나인덱스모(주식-파생형)

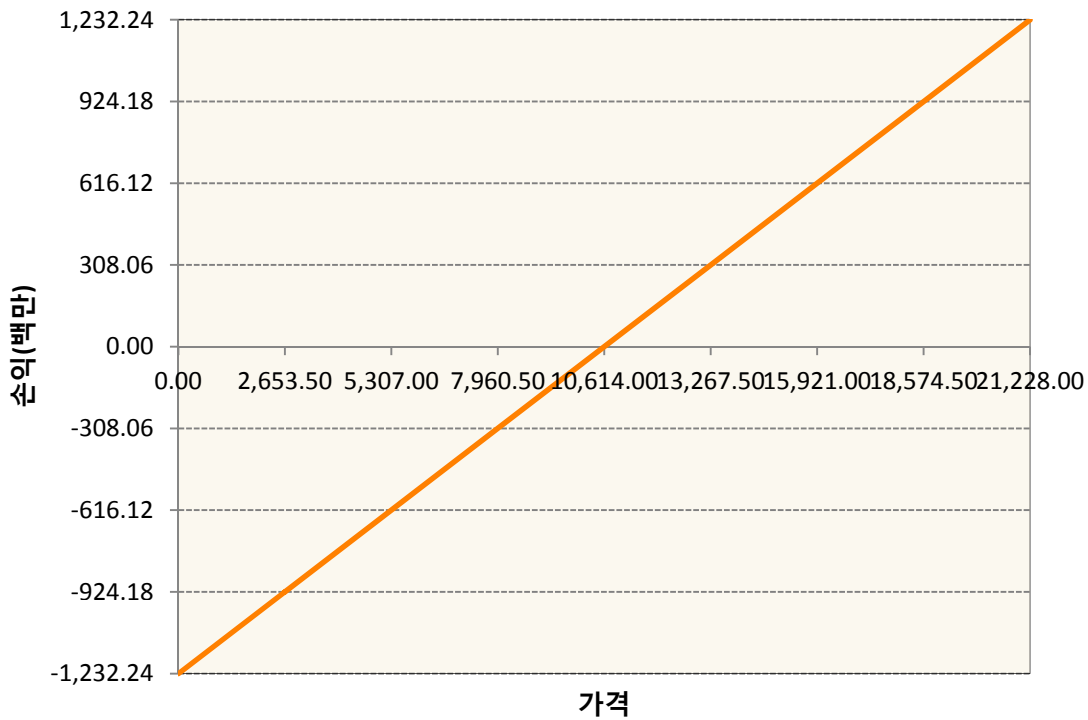
1. 계약금액

(단위:백만원)

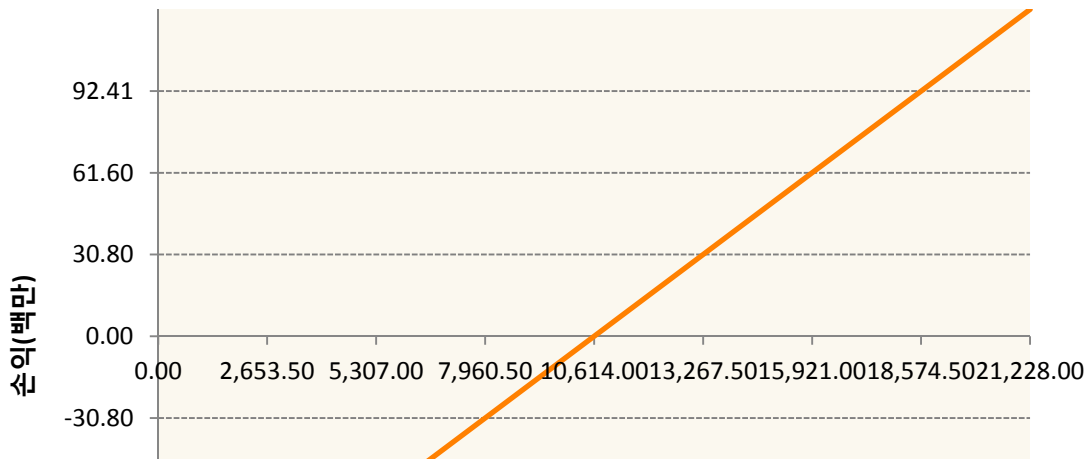
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,355	0	1,355	장내

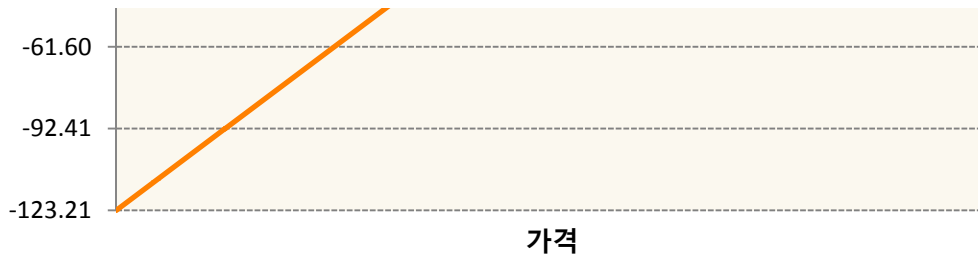
2. 만기시점의 손익구조

HCX8-HSCEI FUTURES NOV 18



MHCX8-MINI H-SHR IDX FU NOV 18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCX8	HSCEI FUTURES NOV 18	99
MHCX8	MINI H-SHR IDX FU NOV 18	10

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

108

공시일	2018-11-20
기준일	2018-11-19

커버드콜모(주식혼합-파생형)

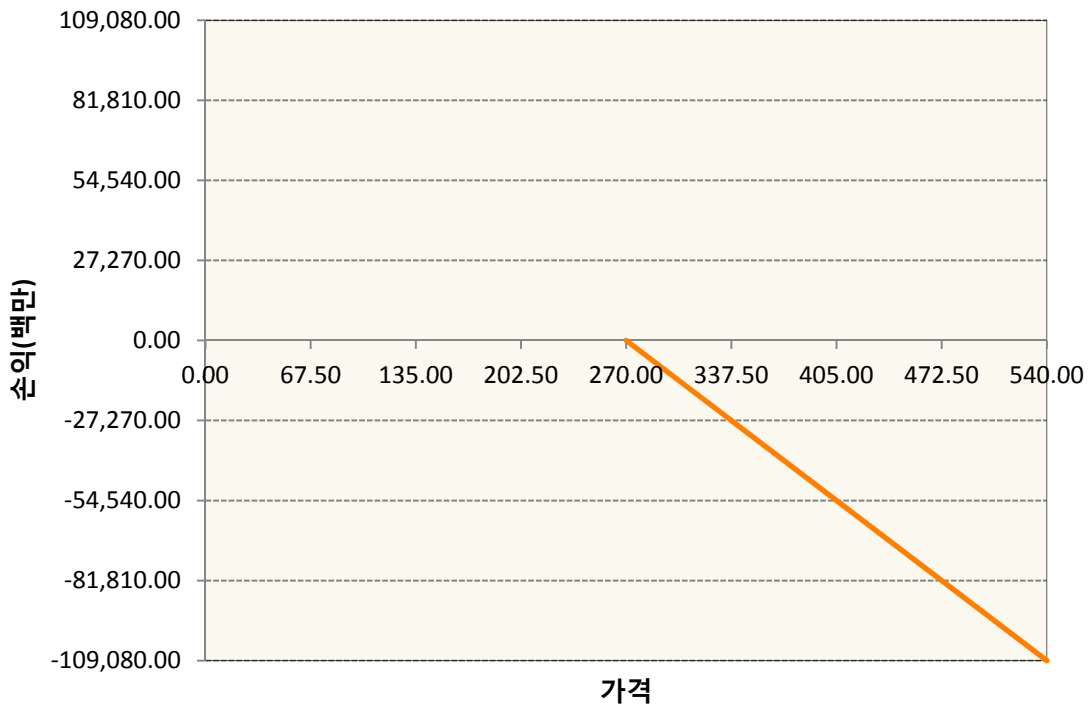
1. 계약금액

(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

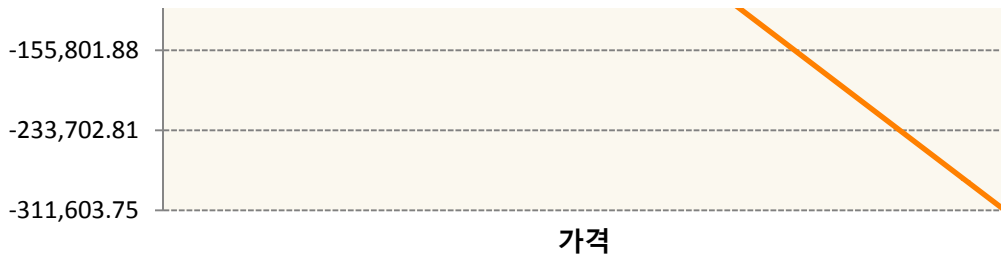
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NC2702-2018-12 콜270

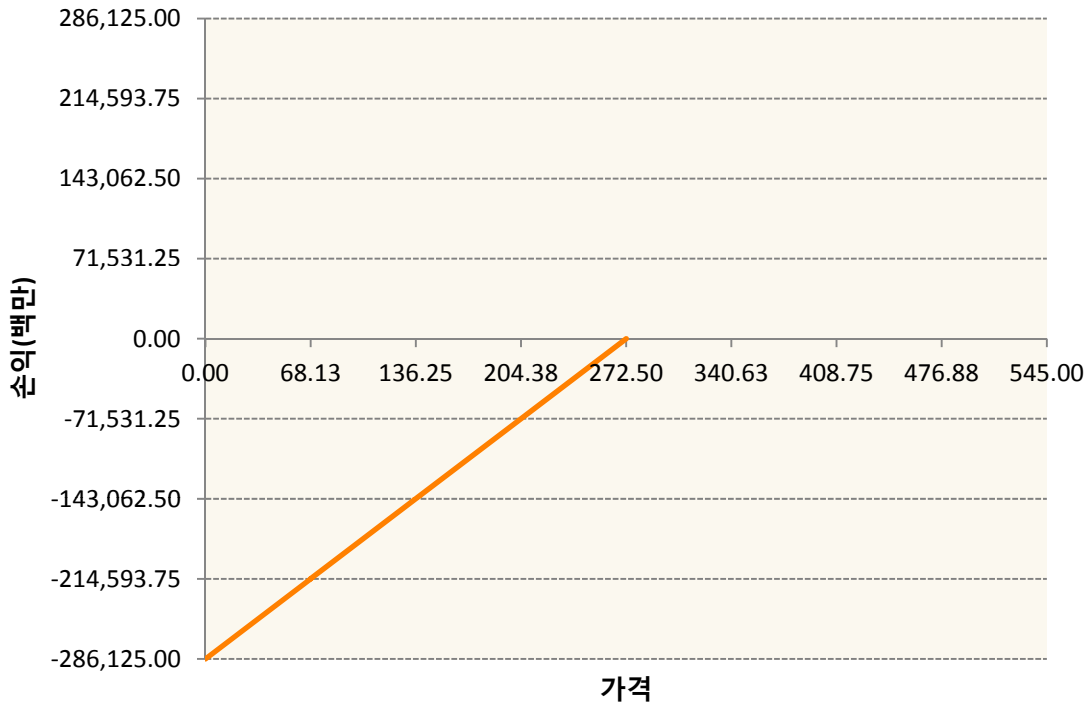


KR4201NC2728-2018-12 콜272.5





KR4301NC2727-2018-12 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NC2702		2018-12 콜270					7,017
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,386	3,282	3,160	3,023	2,873	2,711	2,540
-5.33%	2,984	2,803	2,611	2,410	2,201	1,987	1,768
-2.67%	2,156	1,913	1,667	1,420	1,171	921	670
0%	775	517	259	0	-259	-518	-778
2.67%	-1,166	-1,385	-1,612	-1,845	-2,082	-2,323	-2,567
5.33%	-3,554	-3,707	-3,876	-4,058	-4,252	-4,454	-4,664
8.00%	-6,231	-6,319	-6,427	-6,553	-6,694	-6,849	-7,017
KR4201NC2728		2018-12 콜272.5					19,009
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,328	8,093	7,806	7,472	7,098	6,687	6,246

-5.33%	7,470	7,027	6,542	6,025	5,480	4,913	4,328
-2.67%	5,579	4,932	4,271	3,599	2,918	2,230	1,537
0%	2,223	1,482	741	0	-741	-1,482	-2,222
2.67%	-2,740	-3,421	-4,113	-4,815	-5,524	-6,239	-6,958
5.33%	-9,098	-9,607	-10,154	-10,732	-11,335	-11,958	-12,598
8.00%	-16,428	-16,743	-17,113	-17,531	-17,990	-18,485	-19,009
KR4301NC2727 2018-12 풋272.5							18,305
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-17,868	-17,893	-17,935	-17,996	-18,078	-18,181	-18,305
-5.33%	-10,430	-10,553	-10,706	-10,887	-11,092	-11,319	-11,566
-2.67%	-3,710	-4,020	-4,348	-4,690	-5,044	-5,406	-5,776
0%	1,285	857	428	0	-428	-857	-1,285
2.67%	4,005	3,666	3,312	2,946	2,570	2,187	1,797
5.33%	5,011	4,852	4,660	4,440	4,195	3,929	3,644
8.00%	5,257	5,210	5,139	5,044	4,923	4,777	4,608

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

(단위:백만원)

44,165

공시일	2018-11-20
기준일	2018-11-19

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

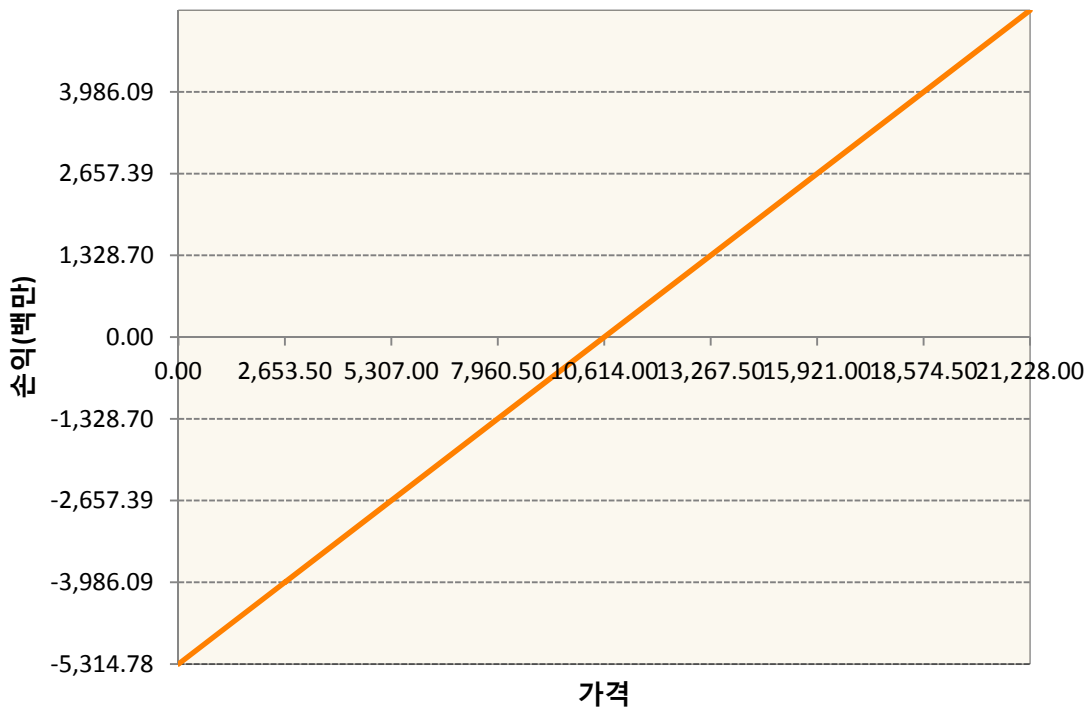
1. 계약금액

(단위:백만원)

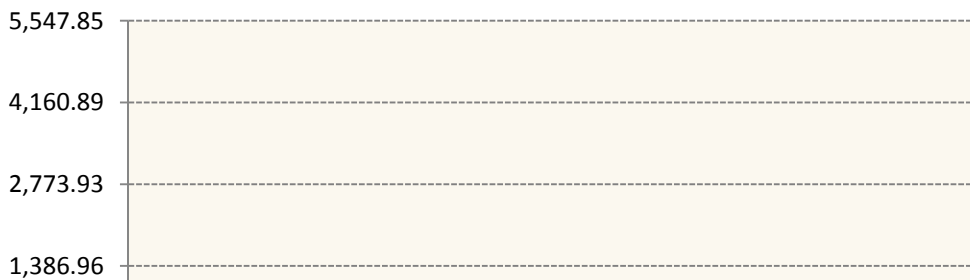
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,315	0	5,315	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,096	-11,096	장내
누계	통화	선도	432	3,170	-2,738	장외

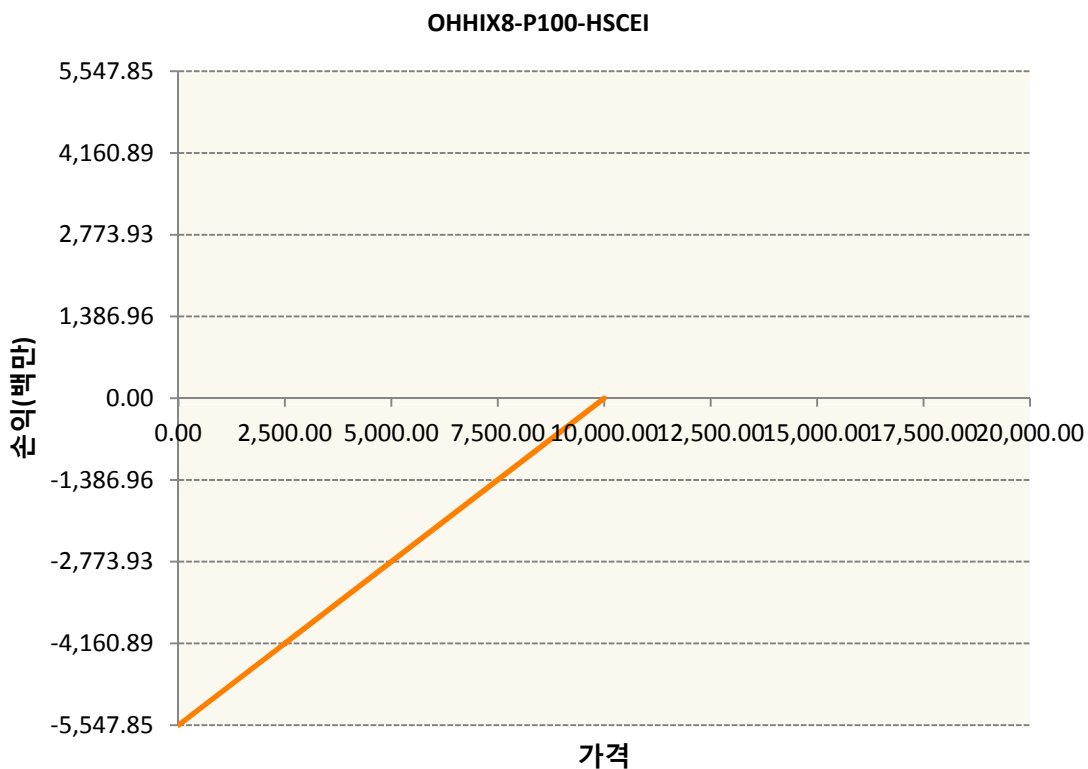
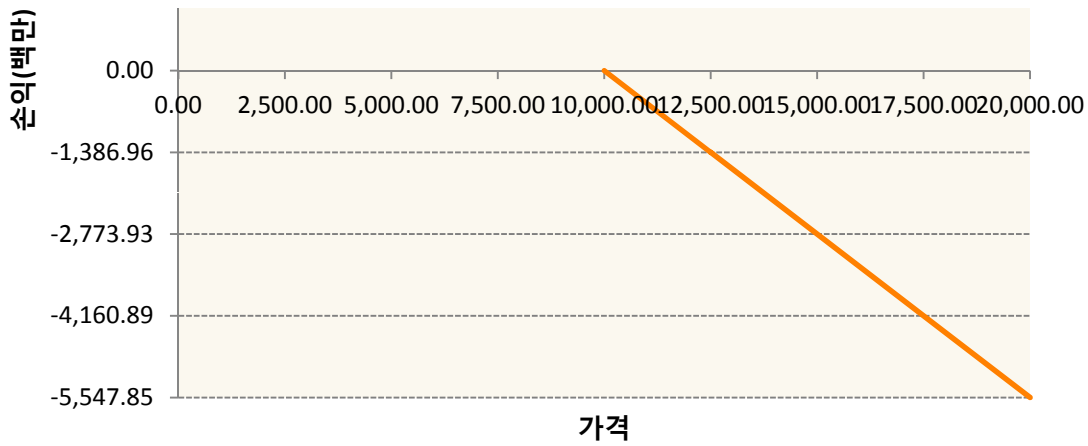
2. 만기시점의 손익구조

HCX8-HSCEI FUTURES NOV 18



OHHIX8-C100-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21018U00	KRW/HKD 10-12-18E	219
FX21018U03	KRW/HKD 10-12-18E	35
FX21018V01	HKD/KRW 10-12-18E	35
HCX8	HSCEI FUTURES NOV 18	425
OHHIX8-C1C	HSCEI	444
OHHIX8-P10	HSCEI	444

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

공시일	2018-11-20
기준일	2018-11-19

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

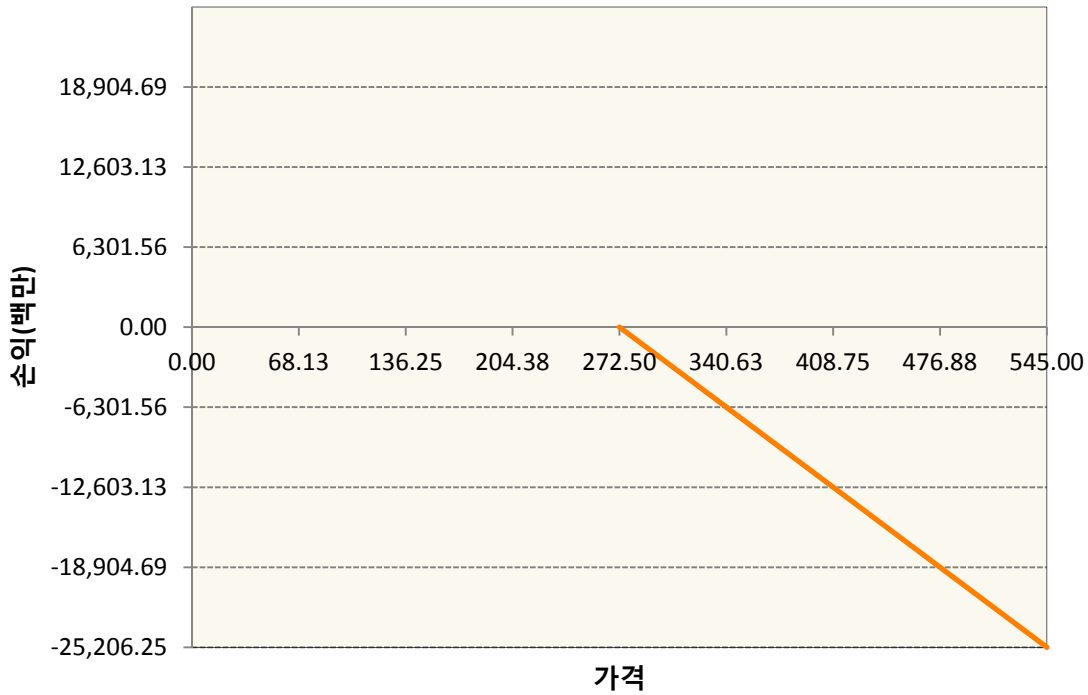
1. 계약금액

(단위:백만원)

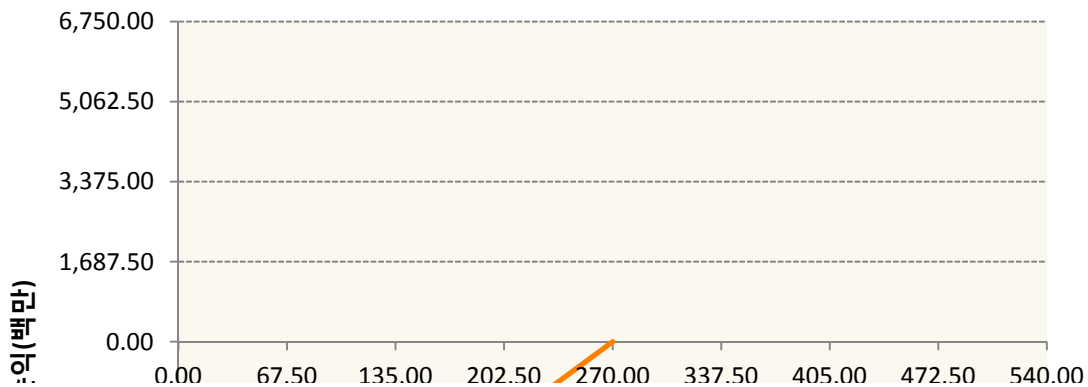
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	43,836	0	43,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	43,538	-43,538	장내

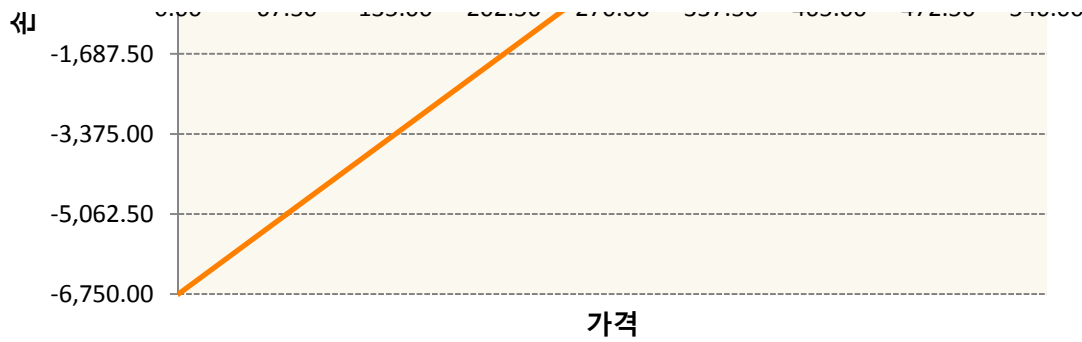
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NC2728-2018-12 콜272.5

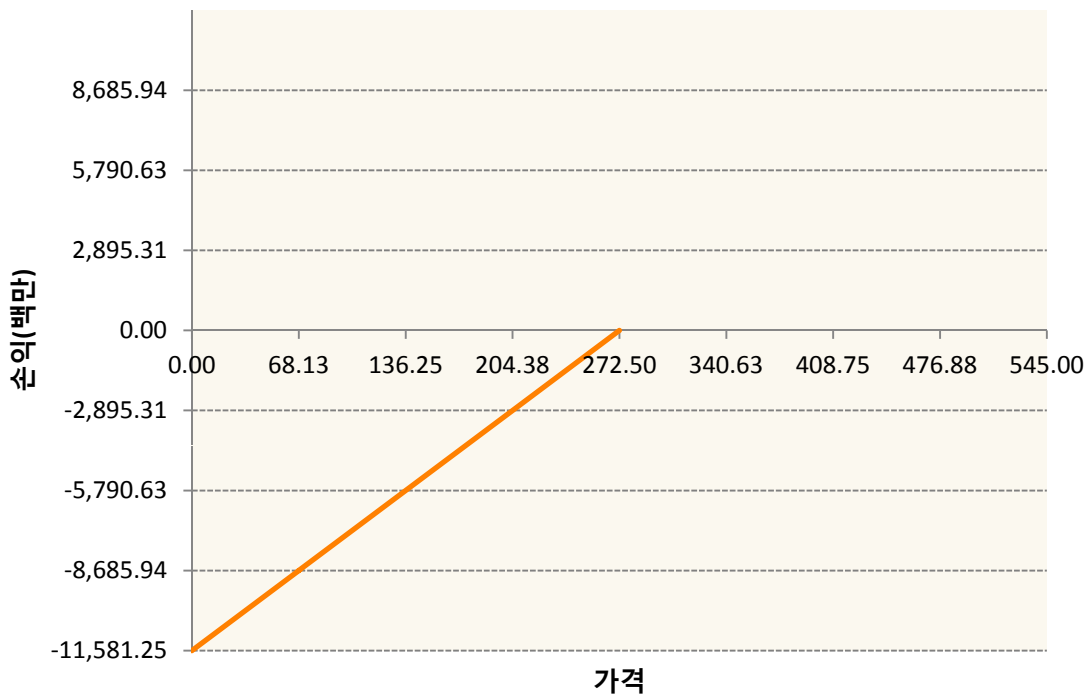


KR4301NC2701-2018-12 풋270





KR4301NC2727-2018-12 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14				3,598
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,598	-3,598	-3,598	-3,598	-3,598	-3,598	-3,598
-5.33%	-2,399	-2,399	-2,399	-2,399	-2,399	-2,399	-2,399
-2.67%	-1,199	-1,199	-1,199	-1,199	-1,199	-1,199	-1,199
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,199	1,199	1,199	1,199	1,199	1,199	1,199
5.33%	2,399	2,399	2,399	2,399	2,399	2,399	2,399
8.00%	3,598	3,598	3,598	3,598	3,598	3,598	3,598
	KR4201NC2728		2018-12 콜272.5				1,538
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	674	655	631	604	574	541	505
-5.33%	604	568	529	487	443	397	350
-2.67%	451	399	345	291	236	180	124
0%	180	120	60	0	-60	-120	-180
2.67%	-222	-277	-333	-389	-447	-505	-563
5.33%	-736	-777	-821	-868	-917	-967	-1,019
8.00%	-1,329	-1,354	-1,384	-1,418	-1,455	-1,495	-1,538

KR4301NC2701 2018-12 풋270 408

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-393	-394	-396	-398	-401	-404	-408
-5.33%	-220	-224	-229	-234	-240	-247	-254
-2.67%	-71	-79	-88	-97	-107	-116	-125
0%	30	20	10	0	-10	-20	-30
2.67%	78	71	64	57	49	41	32
5.33%	93	90	87	83	78	73	68
8.00%	96	95	94	93	91	88	85

KR4301NC2727 2018-12 풋272.5 741

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-723	-724	-726	-728	-732	-736	-741
-5.33%	-422	-427	-433	-441	-449	-458	-468
-2.67%	-150	-163	-176	-190	-204	-219	-234
0%	52	35	17	0	-17	-35	-52
2.67%	162	148	134	119	104	89	73
5.33%	203	196	189	180	170	159	148
8.00%	213	211	208	204	199	193	187

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

(단위:백만원)

6,257

공시일	2018-11-20
기준일	2018-11-19

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

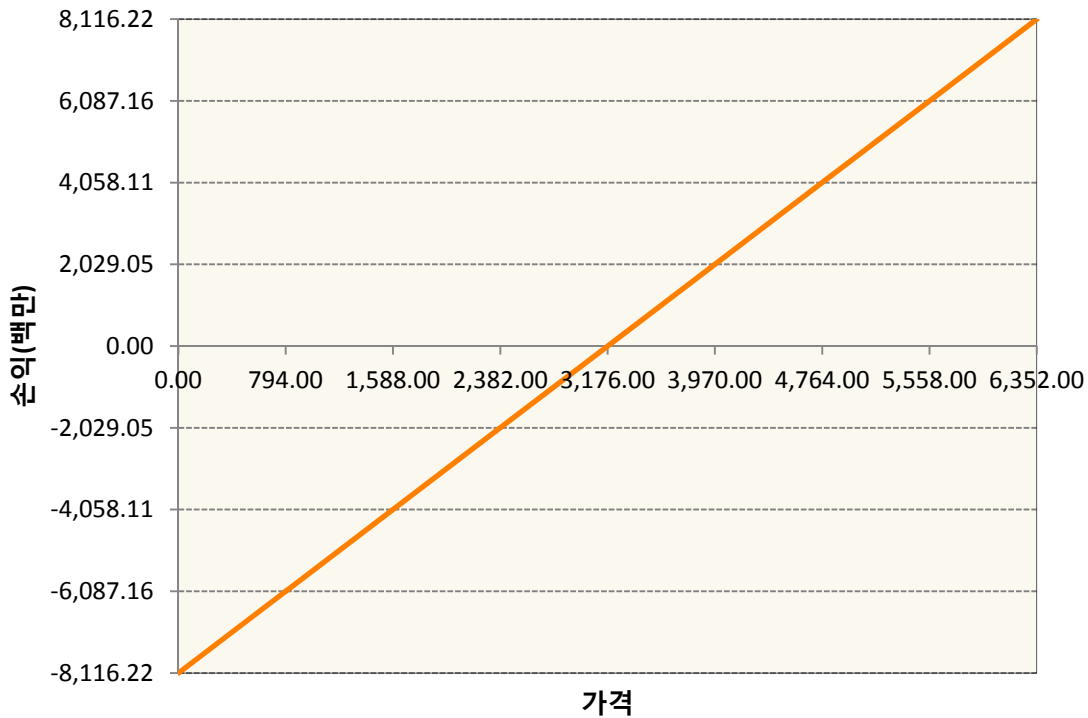
1. 계약금액

(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	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	8,116	0	8,116	
누계	유가증권	스왑	71,921	0	71,921	장외
누계	통화	선도	0	15,452	-15,452	장외

2. 만기시점의 손익구조

VGZ8-EURO STOXX 50 DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	47
FX21018Q01 KRW/EUR 23-11-18E	206
FX21018Q02 KRW/EUR 23-11-18E	206
FX21018U03 KRW/EUR 21-12-18E	824
VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18	649

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

(단위:백만원)

1,148

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

(단위:백만원)

1,156

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

(단위:백만원)

92

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

(단위:백만원)

139

공시일	2018-11-20
기준일	2018-11-19

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

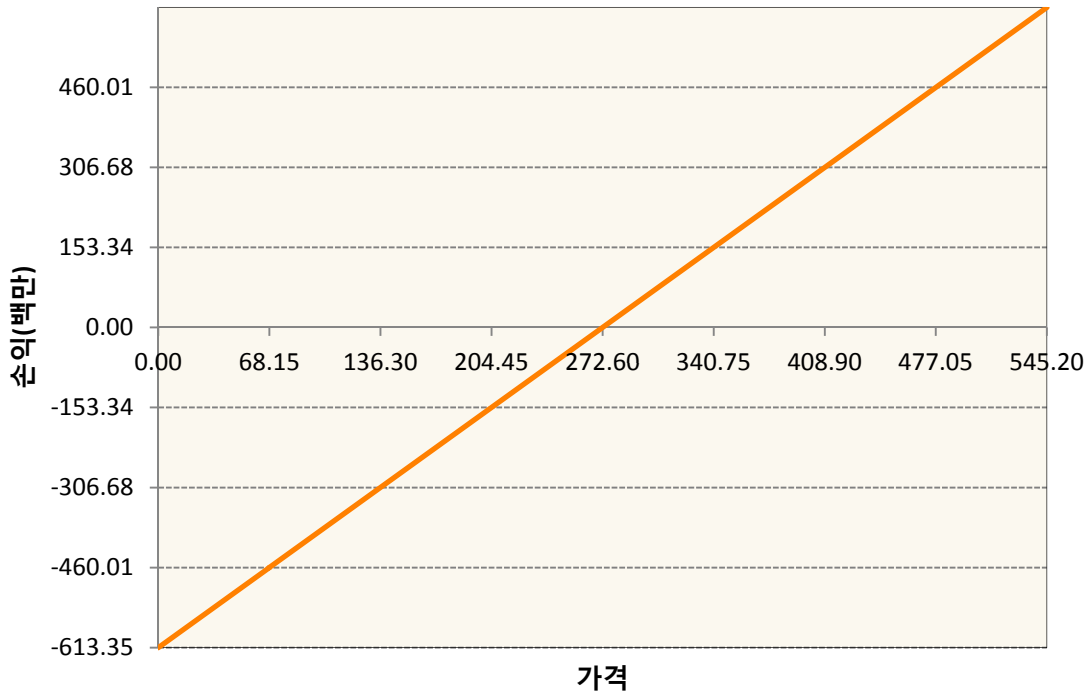
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	613	0	613	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0004		2018-12 코스피200지수선물						49
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	16	16	16	16	16	16	16	
5.33%	33	33	33	33	33	33	33	
8.00%	49	49	49	49	49	49	49	

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

(단위:백만원)

42

공시일	2018-11-20
기준일	2018-11-19

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

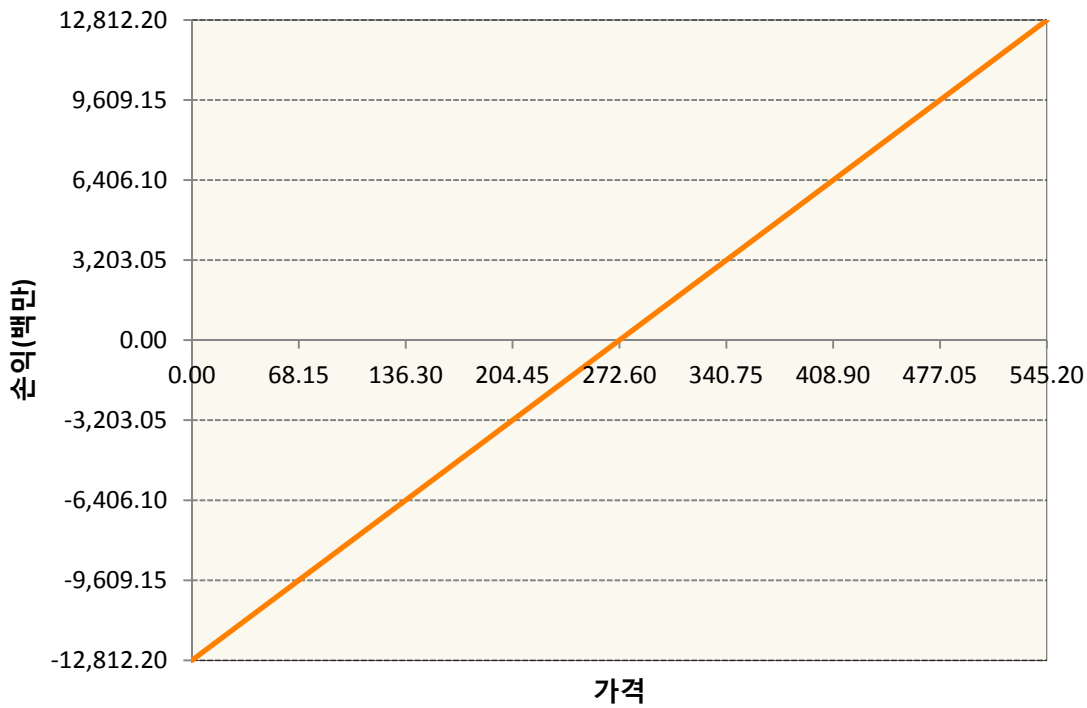
1. 계약금액

(단위:백만원)

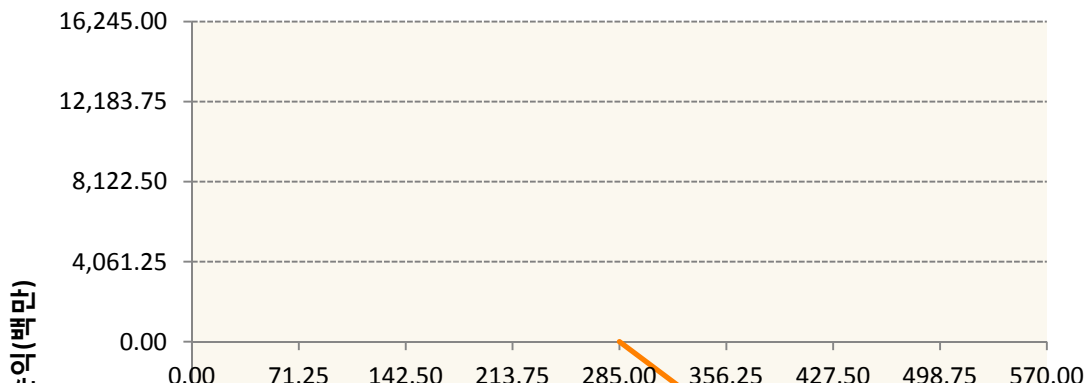
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,812	0	12,812	장내
누계	유가증권	옵션	3,743	22,858	-19,115	장내

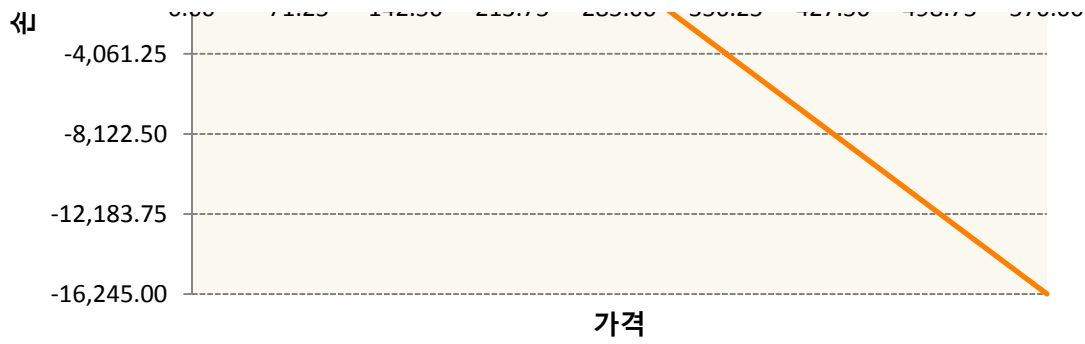
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

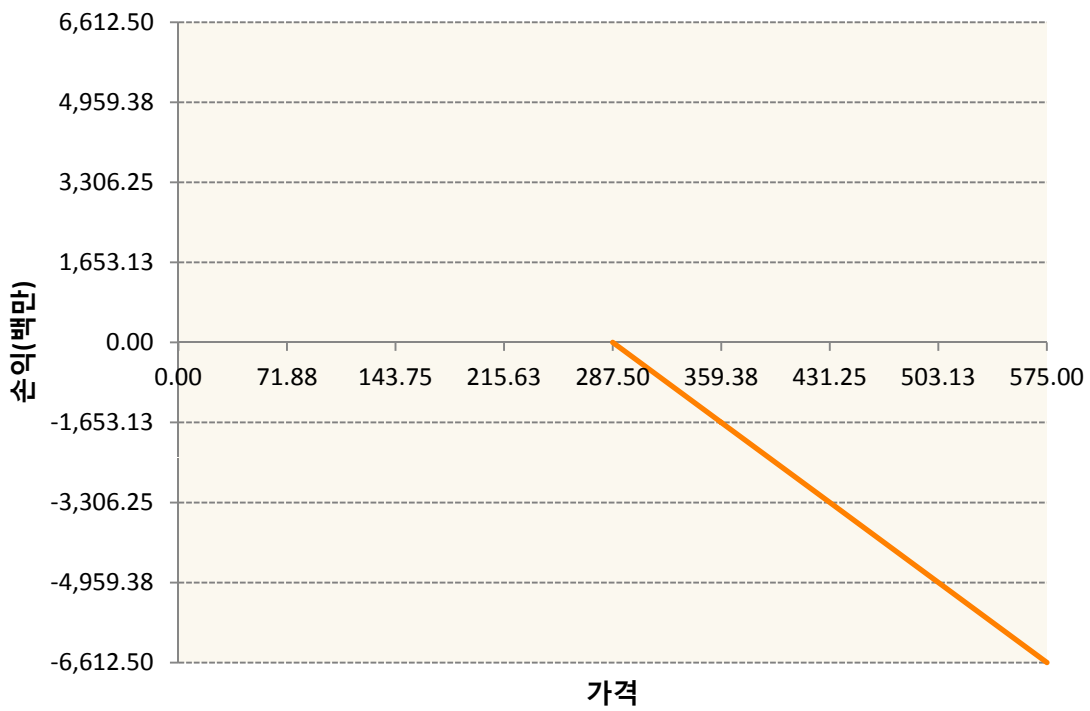


KR4201NC2850-2018-12 콜285

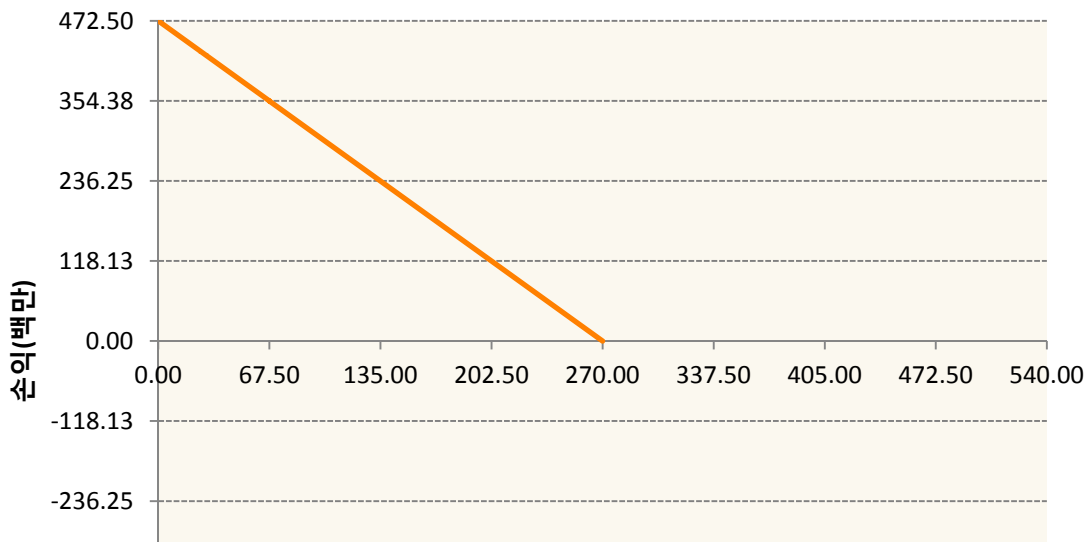


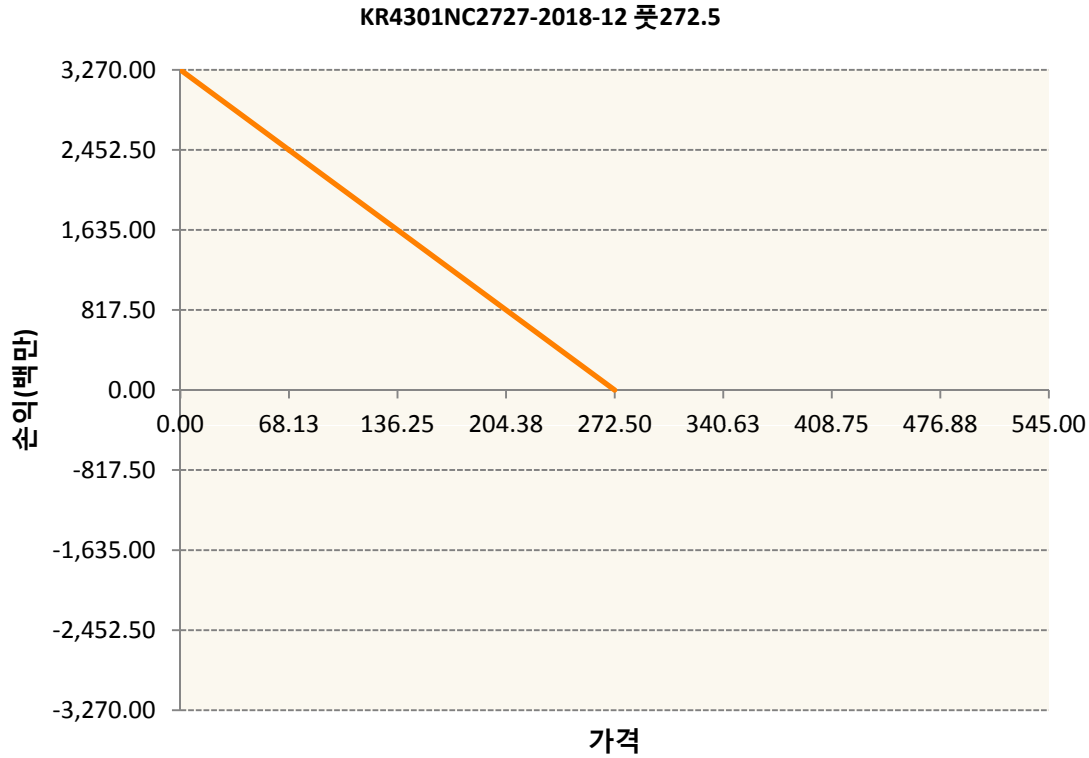
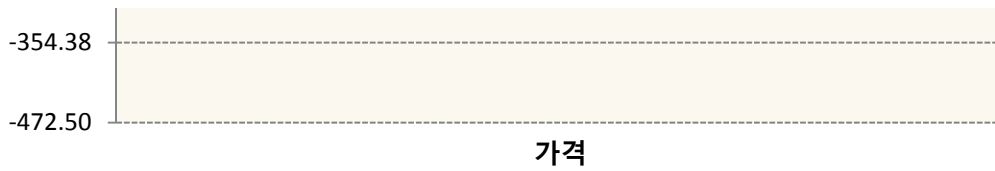


KR4201NC2876-2018-12 콜287.5



KR4301NC2701-2018-12 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0004		2018-12 코스피200지수선물						1,024
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,024	-1,024	-1,024	-1,024	-1,024	-1,024	-1,024	
-5.33%	-683	-683	-683	-683	-683	-683	-683	
-2.67%	-341	-341	-341	-341	-341	-341	-341	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	341	341	341	341	341	341	341	
5.33%	683	683	683	683	683	683	683	
8.00%	1,024	1,024	1,024	1,024	1,024	1,024	1,024	
KR4201NC2850		2018-12 콜285						700
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	177	174	170	164	156	146	134	
-5.33%	169	162	152	139	124	108	89	
-2.67%	145	129	110	89	66	41	15	

0%	86	59	30	0	-31	-63	-96
2.67%	-30	-66	-103	-140	-177	-214	-251
5.33%	-221	-259	-298	-337	-375	-414	-453
8.00%	-487	-521	-556	-591	-627	-663	-700
KR4201NC2876 2018-12 콜287.5							261
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	59	58	56	55	52	48	44
-5.33%	57	54	51	47	42	36	29
-2.67%	50	44	38	30	22	13	3
0%	31	22	11	0	-12	-24	-36
2.67%	-7	-21	-35	-49	-64	-78	-93
5.33%	-74	-89	-105	-121	-136	-152	-168
8.00%	-171	-185	-200	-215	-231	-246	-261
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	28	28	28	29
-5.33%	15	16	16	16	17	17	18
-2.67%	5	6	6	7	7	8	9
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-5	-5	-4	-4	-3	-3	-2
5.33%	-6	-6	-6	-6	-5	-5	-5
8.00%	-7	-7	-7	-6	-6	-6	-6
KR4301NC2727 2018-12 풋272.5							209
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	204	204	205	206	207	208	209
-5.33%	119	121	122	124	127	129	132
-2.67%	42	46	50	54	58	62	66
0%	-15	-10	-5	0	5	10	15
2.67%	-46	-42	-38	-34	-29	-25	-21
5.33%	-57	-55	-53	-51	-48	-45	-42
8.00%	-60	-60	-59	-58	-56	-55	-53

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

(단위:백만원)

1,794

공시일	2018-11-20
기준일	2018-11-19

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	121	0	121	

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	2018-11-20
기준일	2018-11-19

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	1,263	0	1,263	

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	2018-11-20
기준일	2018-11-19

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	172	0	172	
누계	통화	선도	0	181	-181	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
FX21018X02 KRW/USD 30-11-18E		1

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

(단위:백만원)

6

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

(단위:백만원)

151

공시일	2018-11-20
기준일	2018-11-19

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

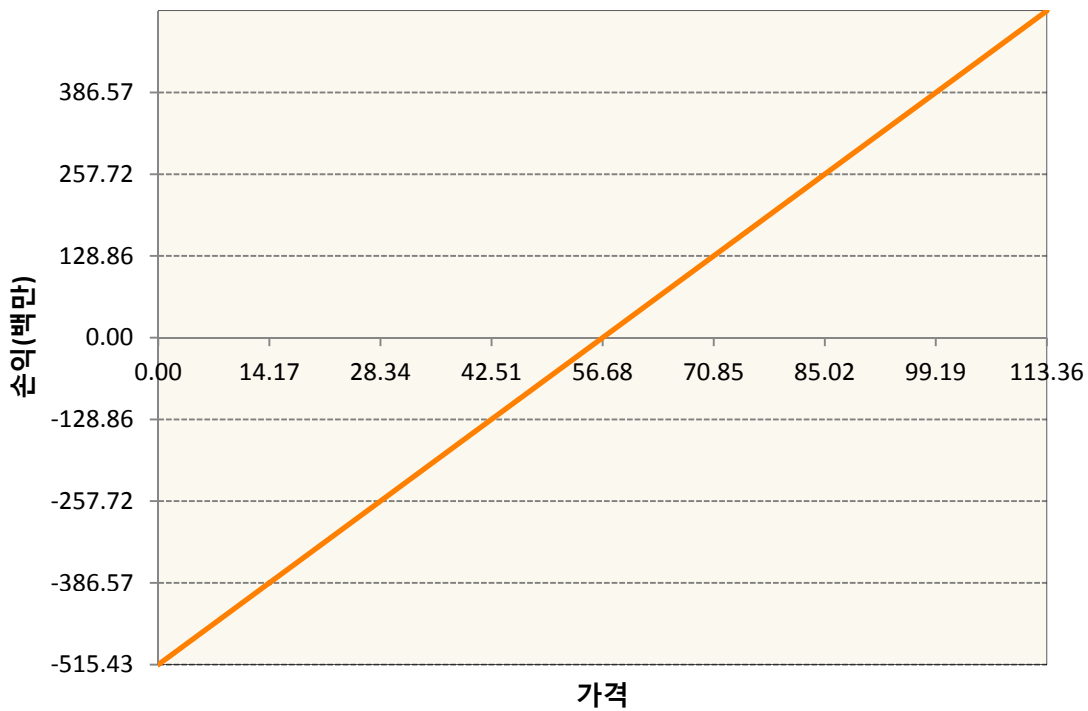
1. 계약금액

(단위:백만원)

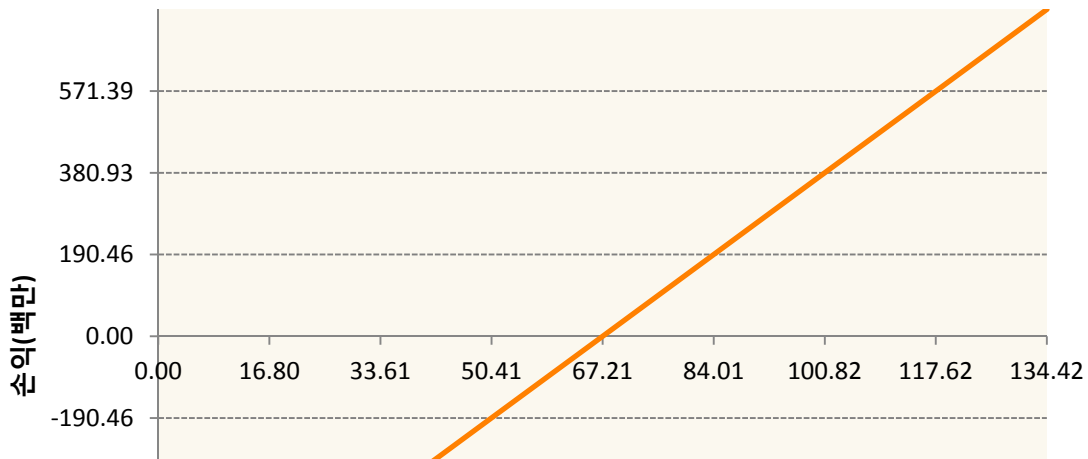
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,188	406	2,782	

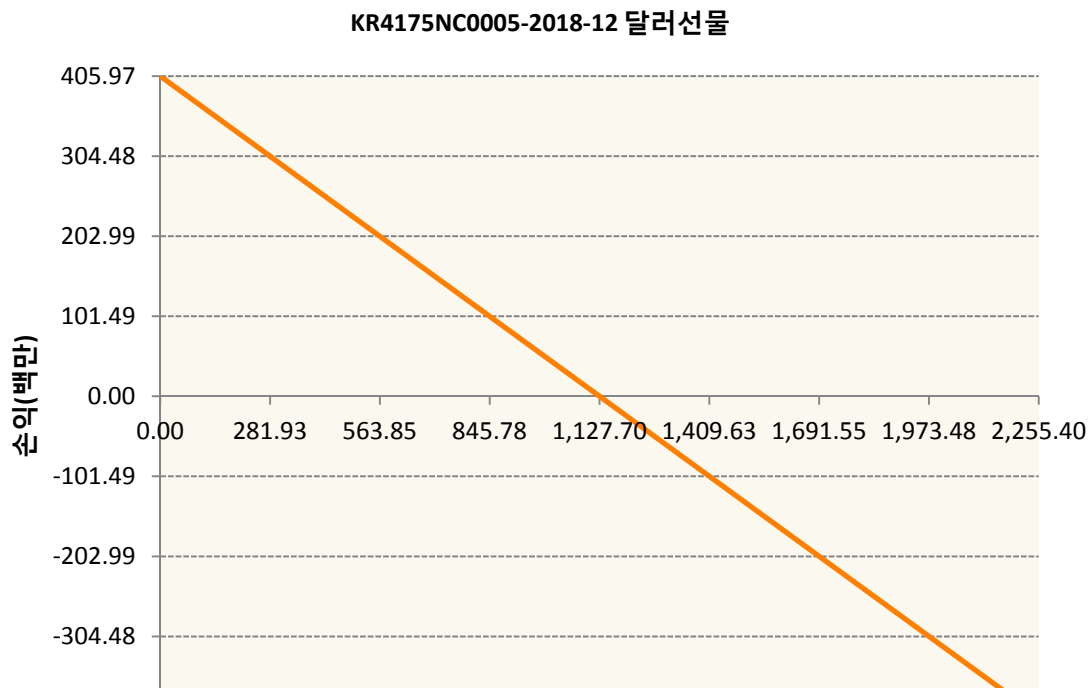
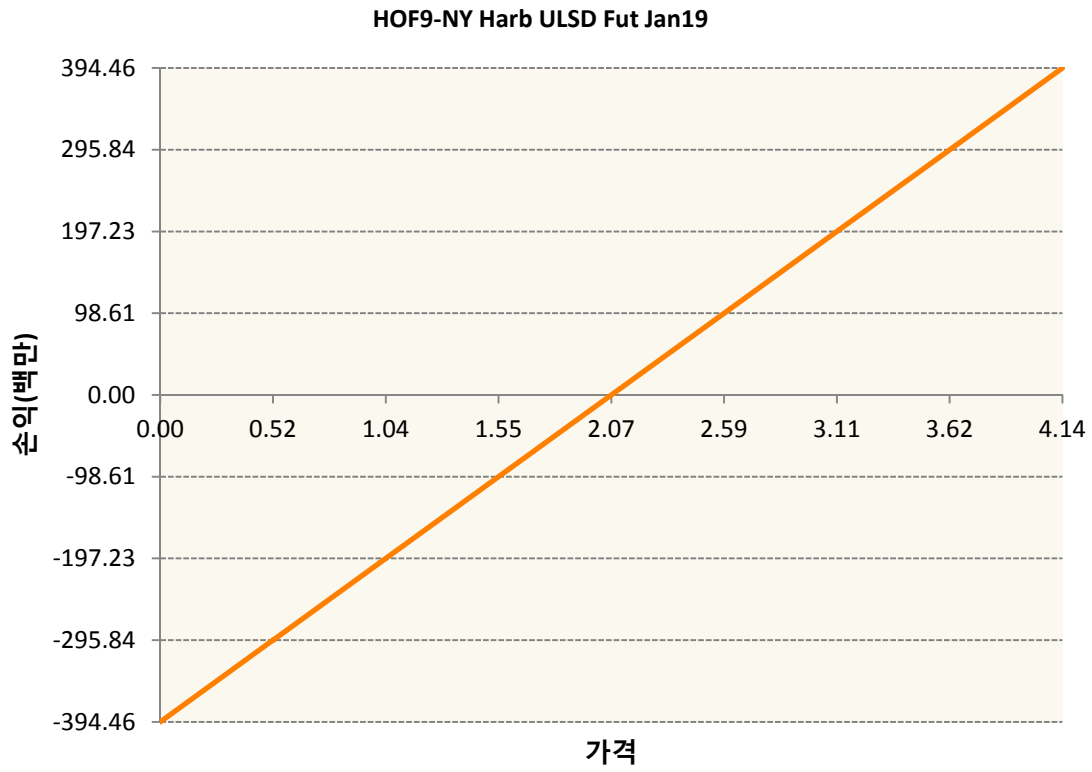
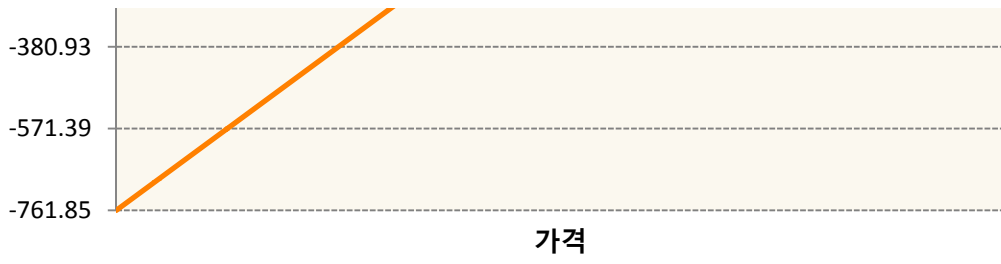
2. 만기시점의 손익구조

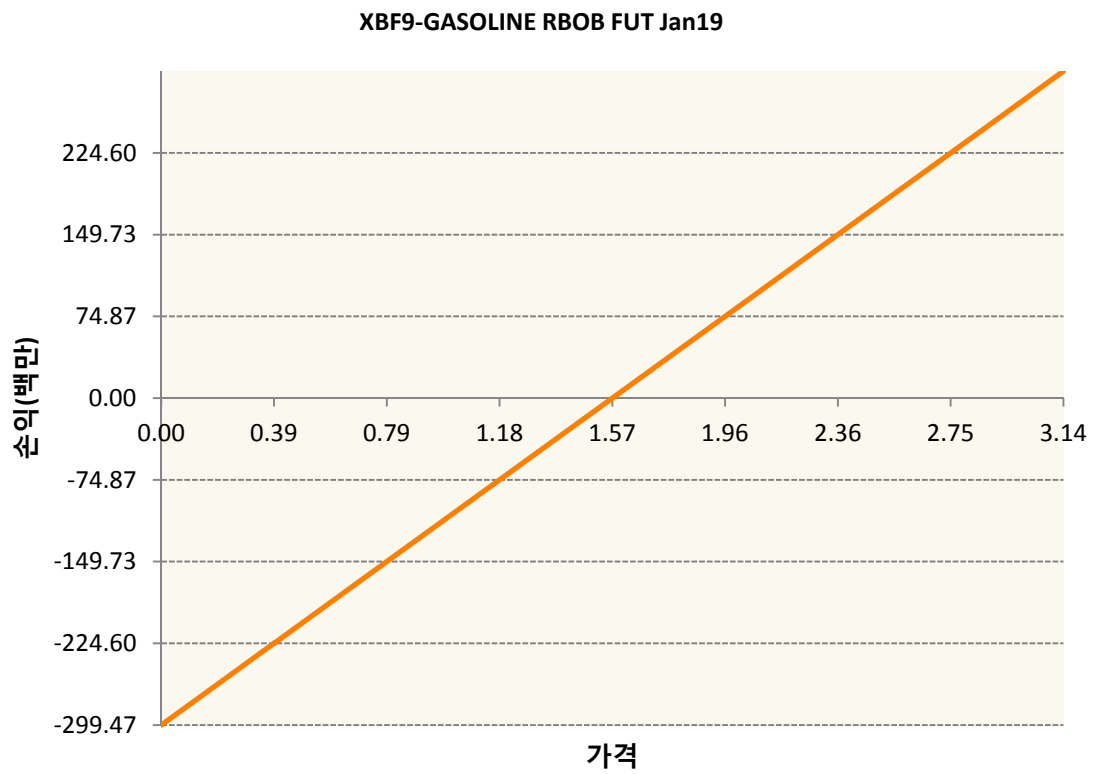
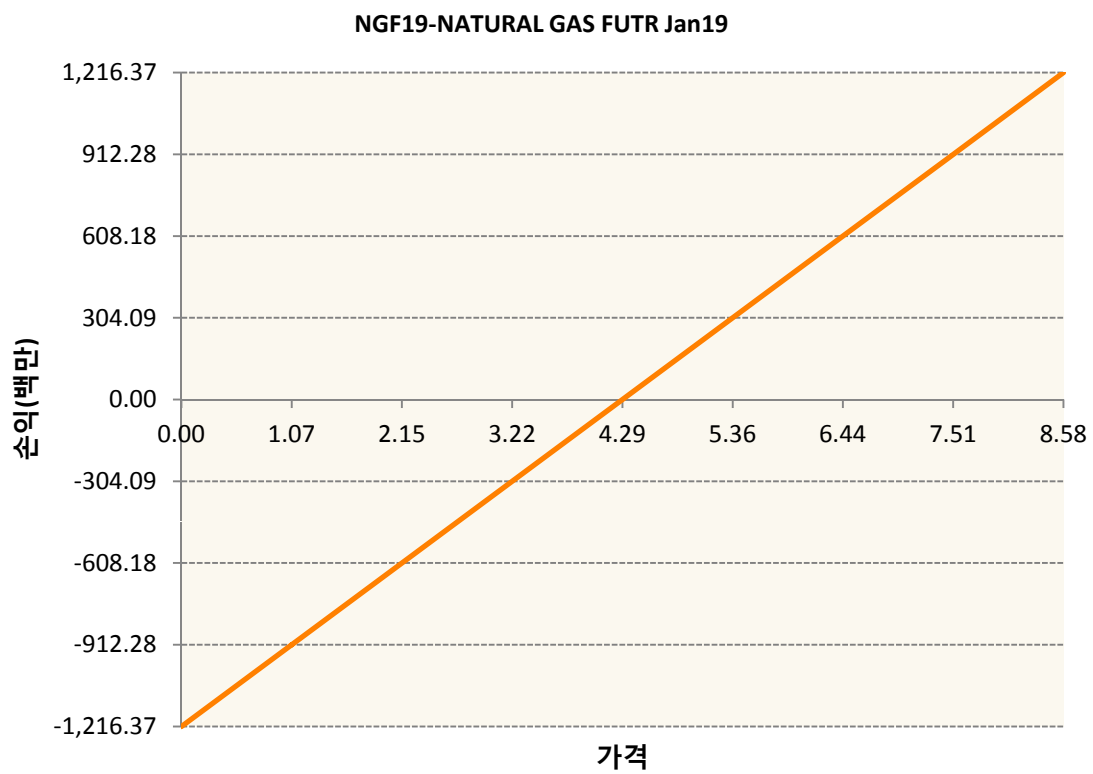
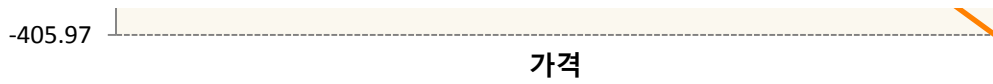
CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19



COH9-BRENT CRUDE FUTR Mar19







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF9	WTI CRUDE FUTURE Jan19	41
COH9	BRENT CRUDE FUTR Mar19	61
HOF9	NY Harb ULSD Fut Jan19	32
KR4175NC0	(2018-12 달러선물	32
NGF19	NATURAL GAS FUTR Jan19	97
XBF9	GASOLINE RBOB FUT Jan19	24

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

429

공시일	2018-11-20
기준일	2018-11-19

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

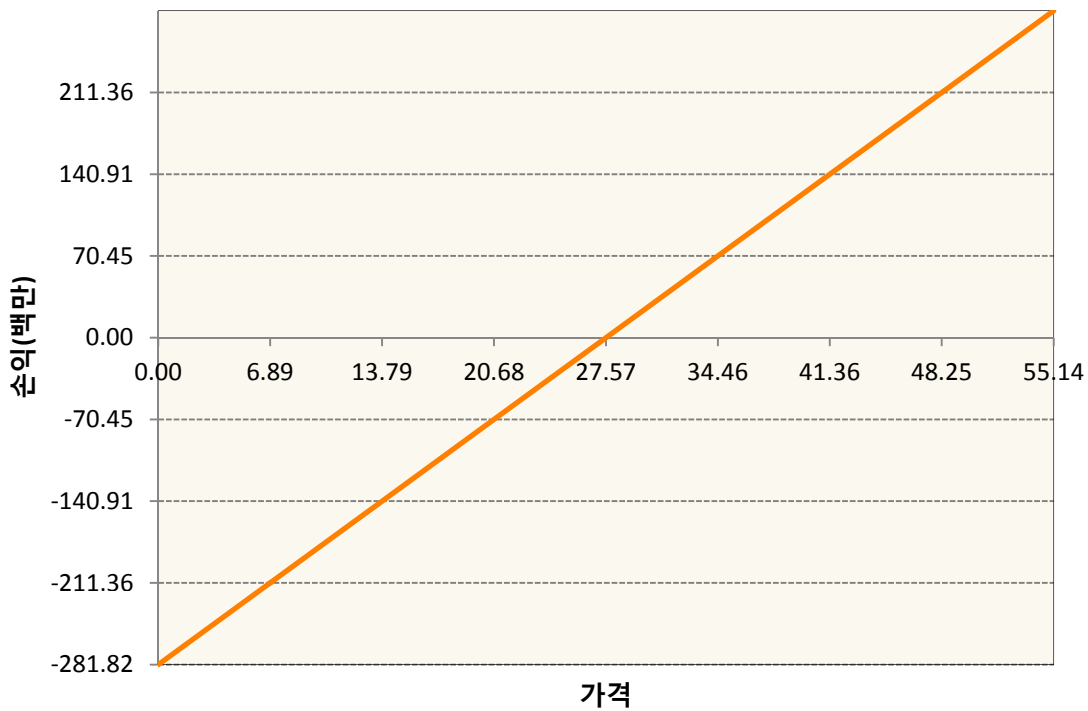
1. 계약금액

(단위:백만원)

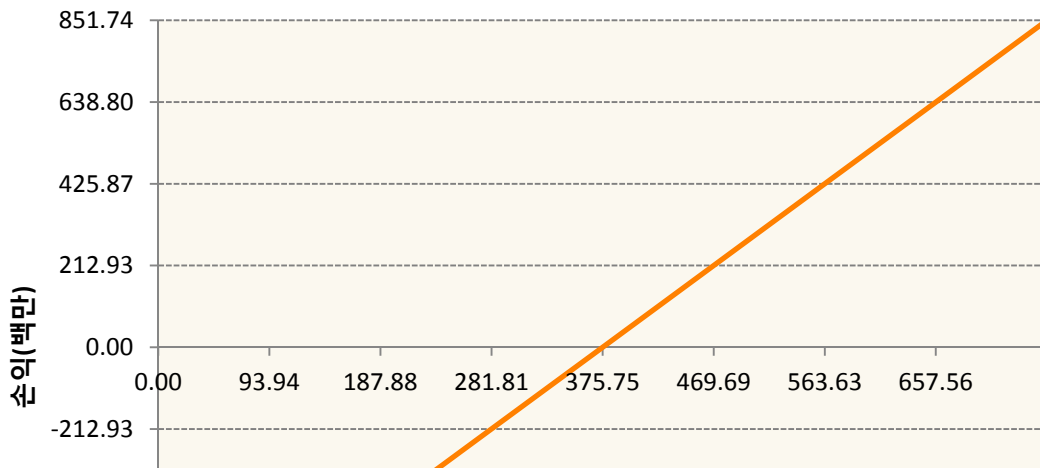
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,701	79	3,622	

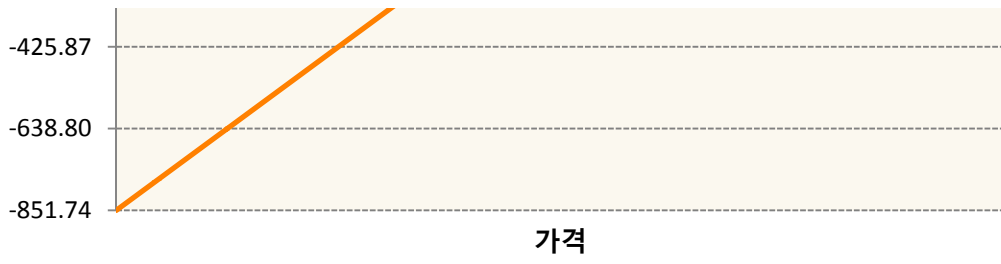
2. 만기시점의 손익구조

BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19

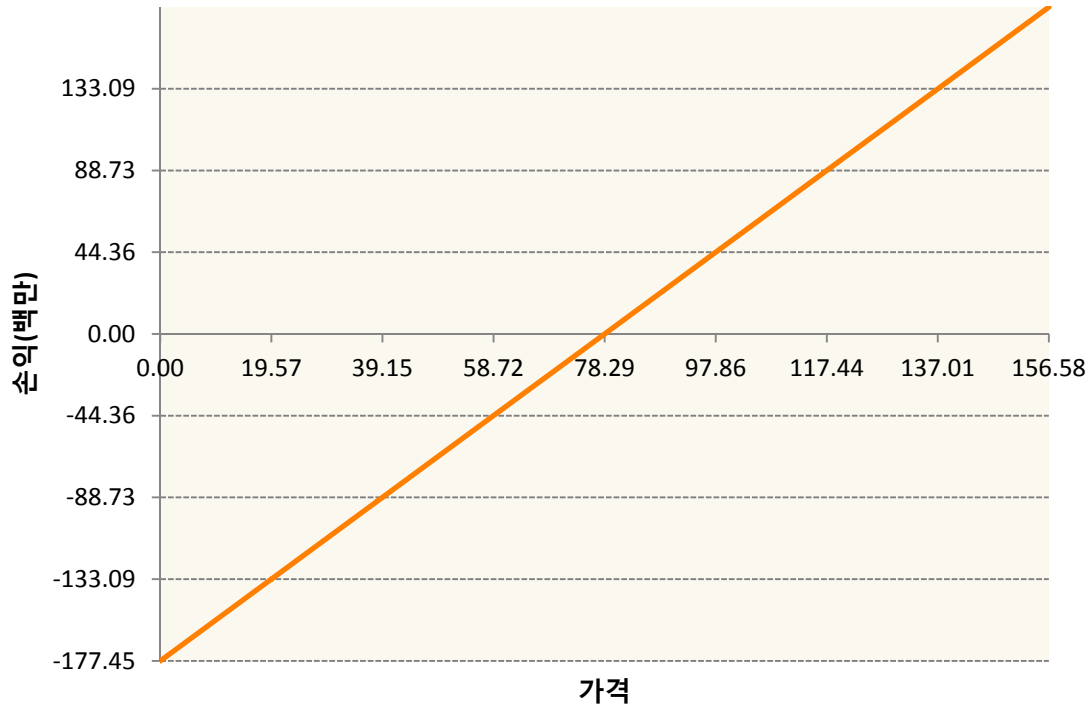


CH9-CORN FUTURE Mar19

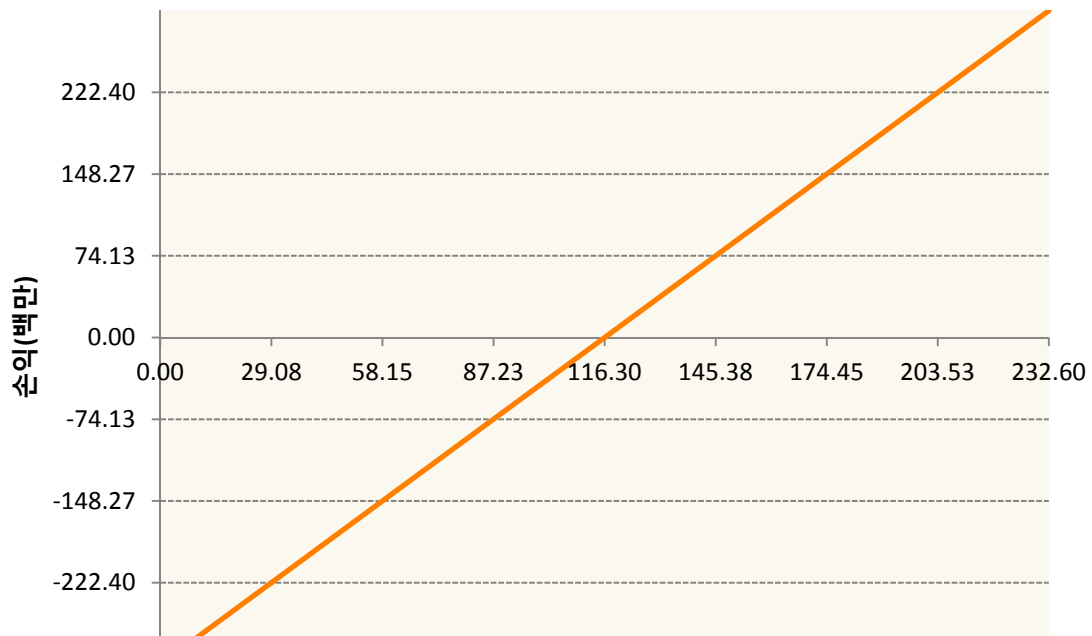


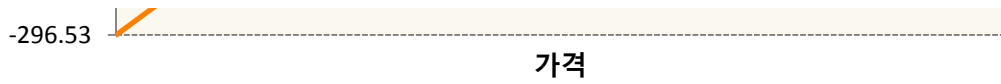


CTH9-COTTON NO.2 FUTR Mar19

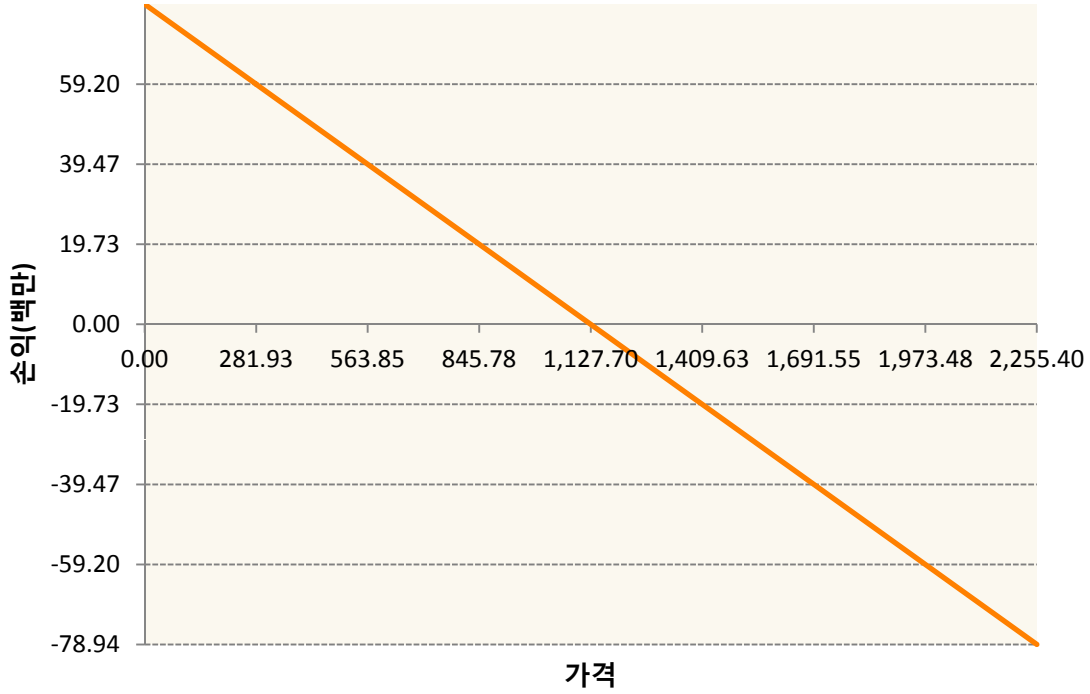


KCH9-COFFEE 'C' FUTURE Mar19

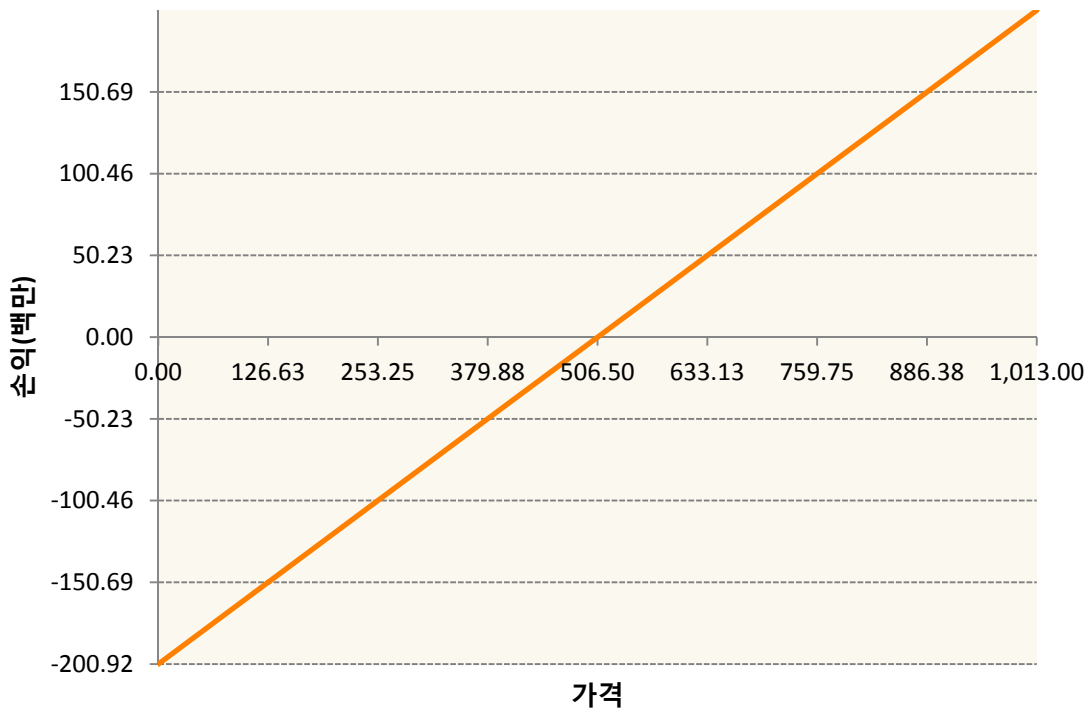




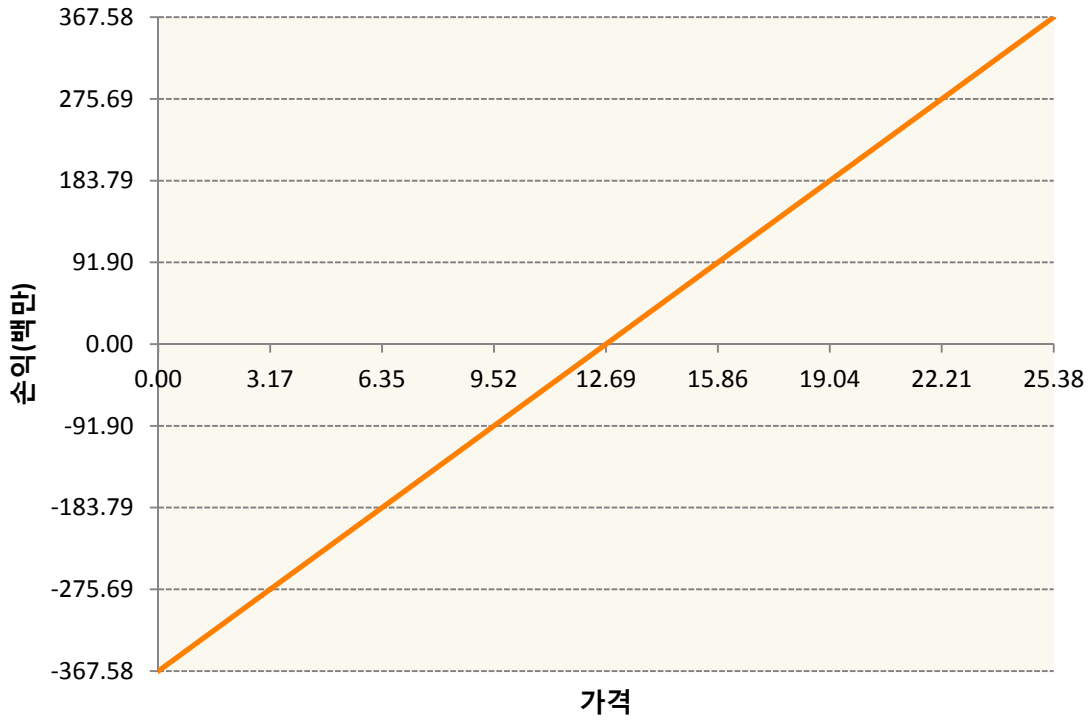
KR4175NC0005-2018-12 달러선물



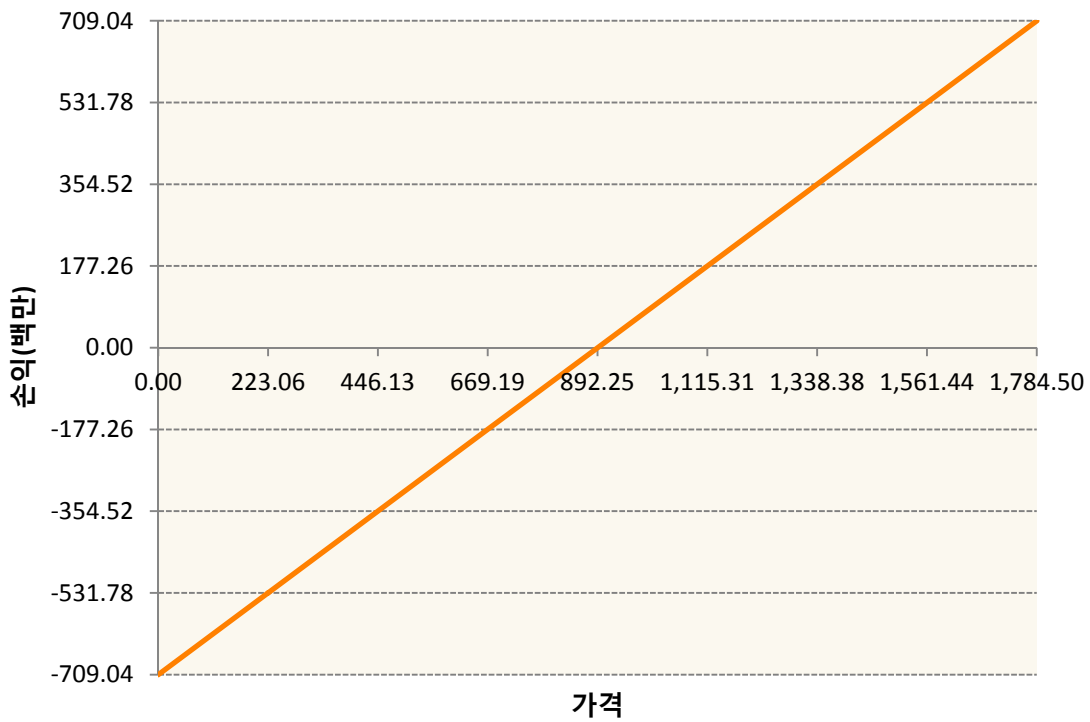
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

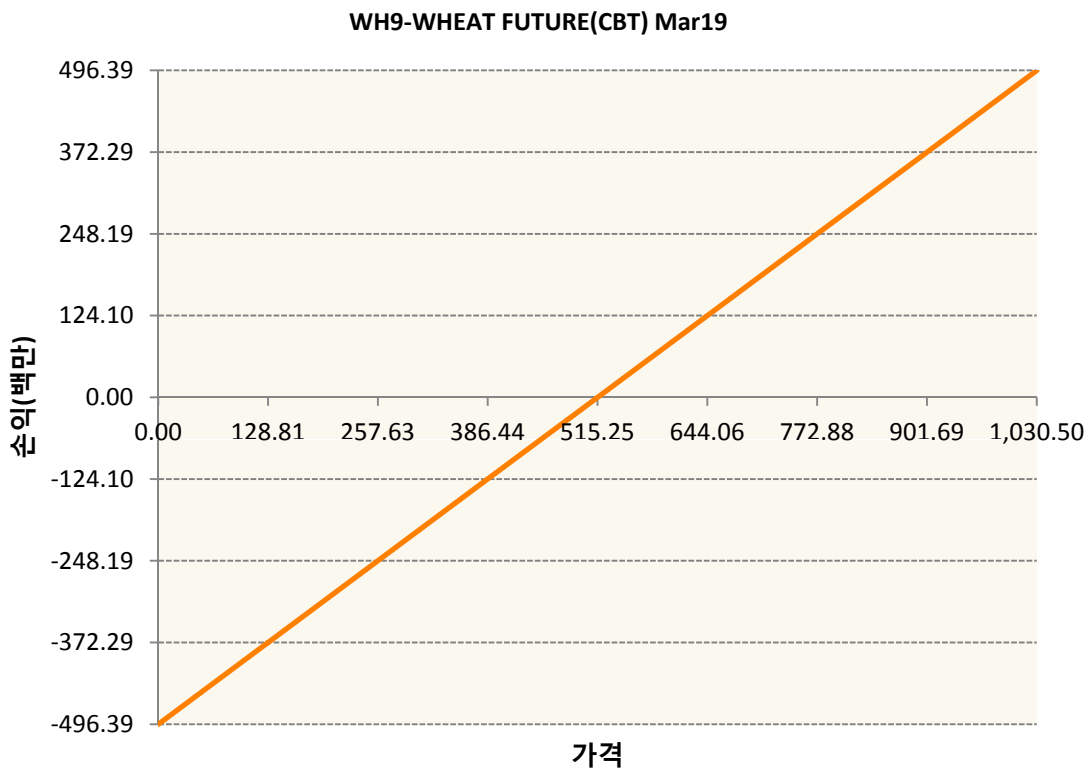
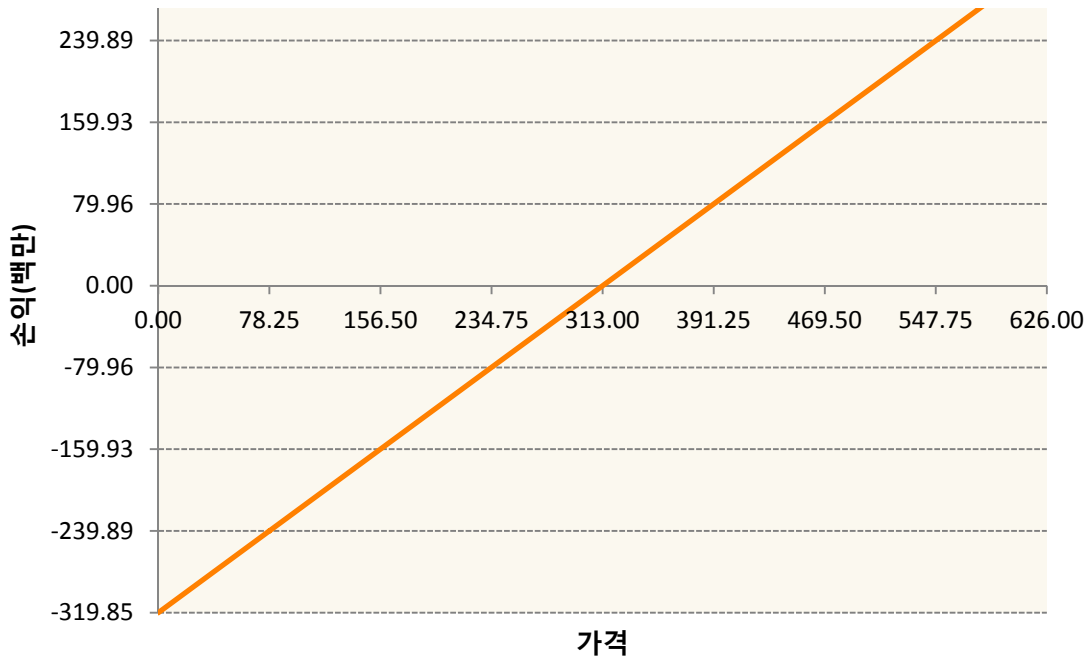


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19



SMF9-SOYBEAN MEAL FUTR Jan19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF9	SOYBEAN OIL FUTR Jan19	23
CH9	CORN FUTURE Mar19	68
CTH9	COTTON NO.2 FUTR Mar19	14
KCH9	COFFEE 'C' FUTURE Mar19	24
KR4175NC0	(2018-12 달러선물	6

KWH9	KC HRW WHEAT FUT Mar19	16
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	29
SF9	SOYBEAN FUTURE Jan19	57
SMF9	SOYBEAN MEAL FUTR Jan19	26
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	40

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

(단위:백만원)

325