

공시일	2018-11-29
기준일	2018-11-28

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)

70

공시일	2018-11-29
기준일	2018-11-28

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	13,197	0	13,197	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S181122

1,064

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

521

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-11-29
기준일	2018-11-28

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

269

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

391

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-11-29
기준일	2018-11-28

유로인덱스모(주식-파생형)

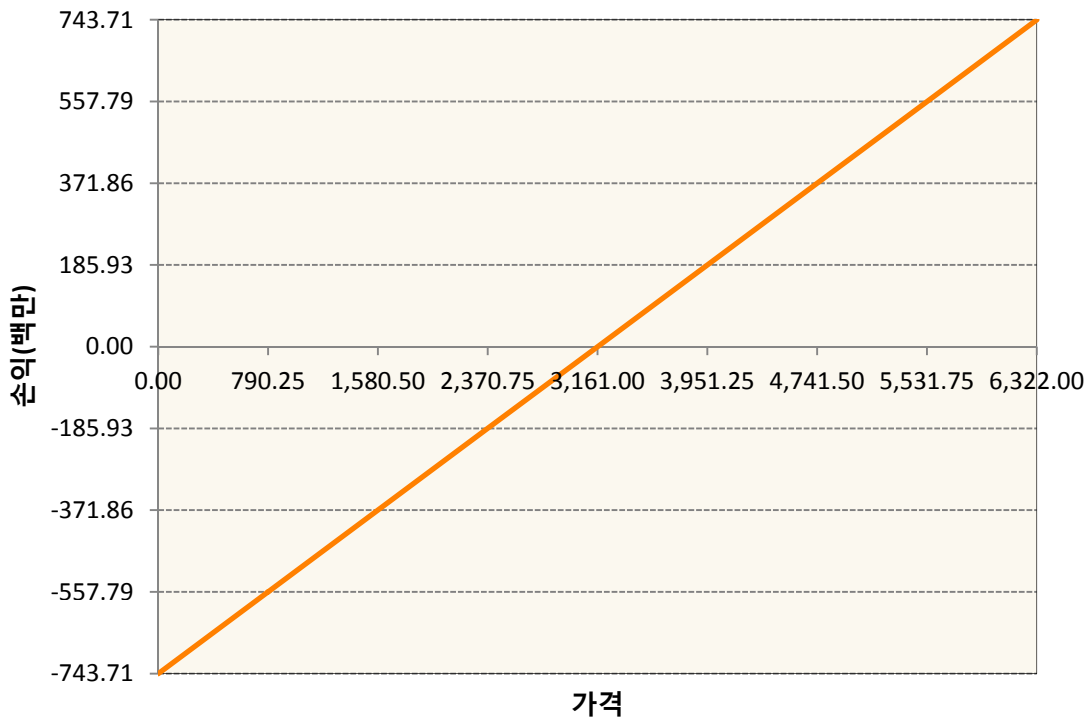
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	744	0	744	

2. 만기시점의 손익구조

VGZ8-EURO STOXX 50 DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ8	EURO STOXX 50 DEC18	59
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

38

공시일	2018-11-29
기준일	2018-11-28

차이나인덱스모(주식-파생형)

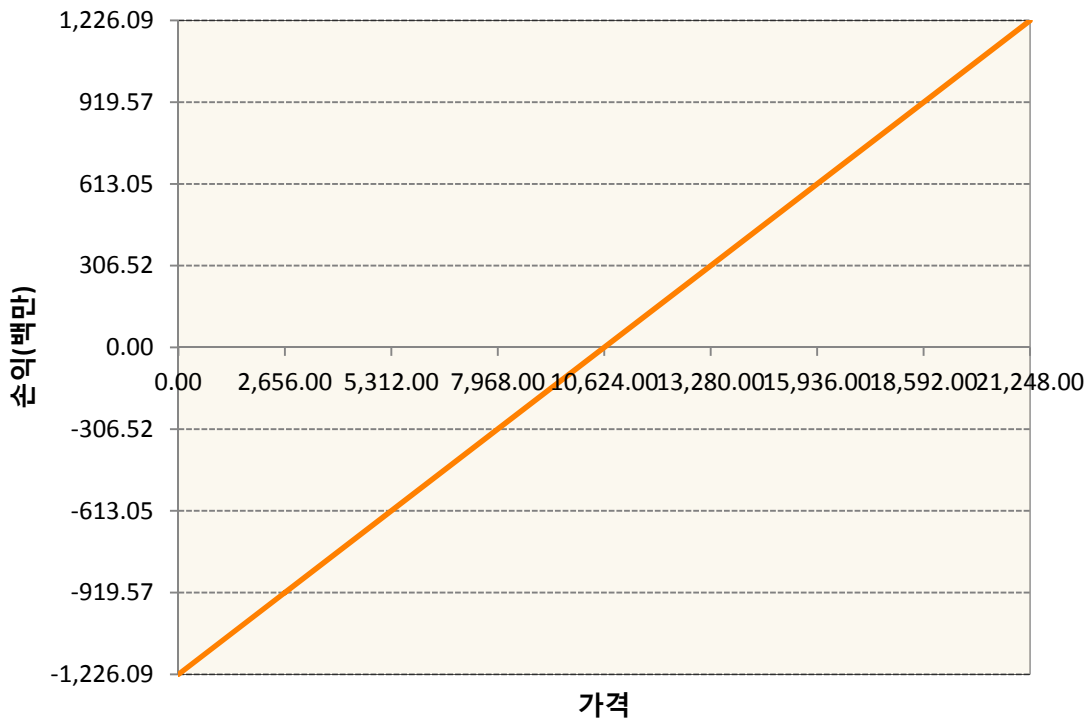
1. 계약금액

(단위:백만원)

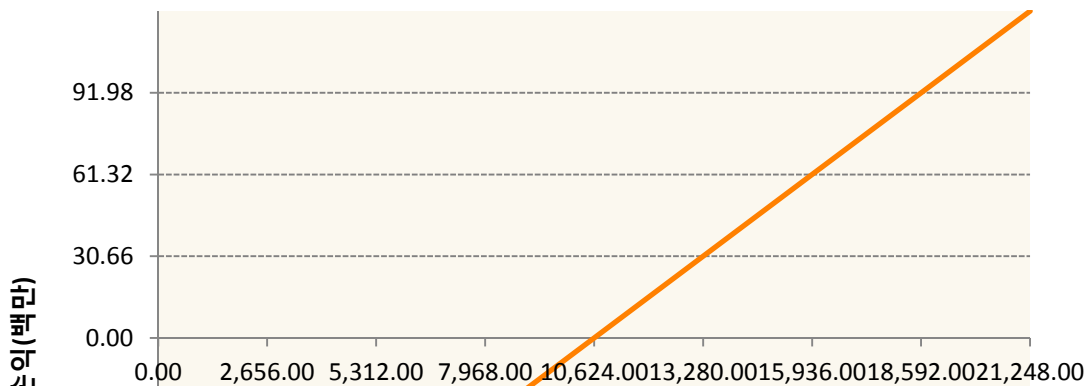
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,226	0	1,226	
누계	유가증권	선물	123	0	123	장내

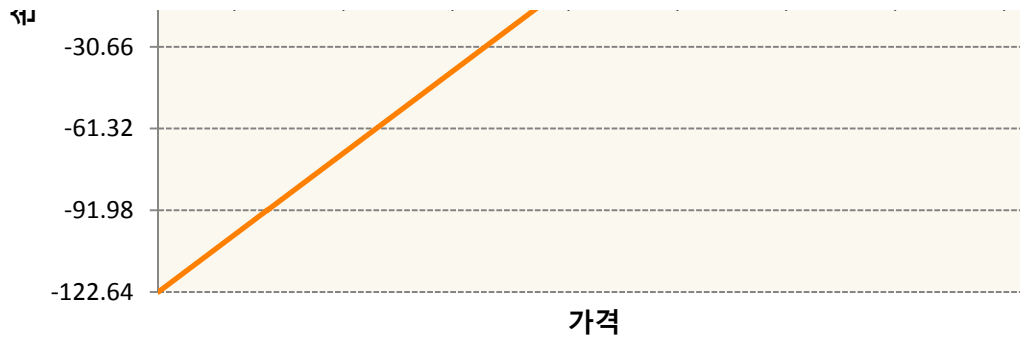
2. 만기시점의 손익구조

HCZ8-HSCEI FUTURES DEC 18



MHCZ8-MINI H-SHR IDX FU DEC18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCZ8	HSCEI FUTURES DEC 18	98
MHCZ8	MINI H-SHR IDX FU DEC18	10

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

96

공시일	2018-11-29
기준일	2018-11-28

커버드콜모(주식혼합-파생형)

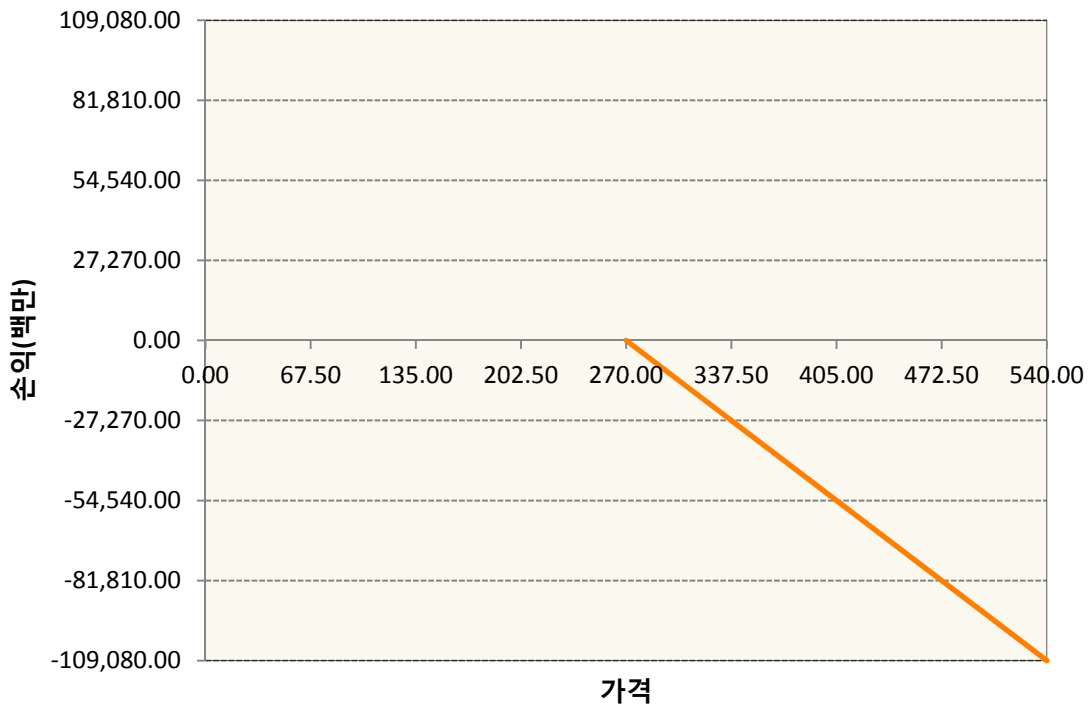
1. 계약금액

(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

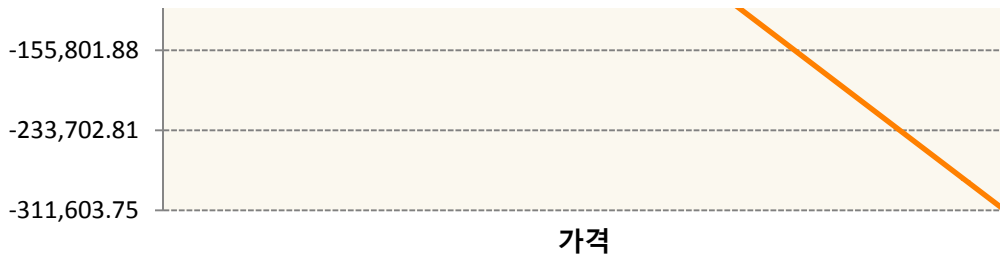
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NC2702-2018-12 콜270

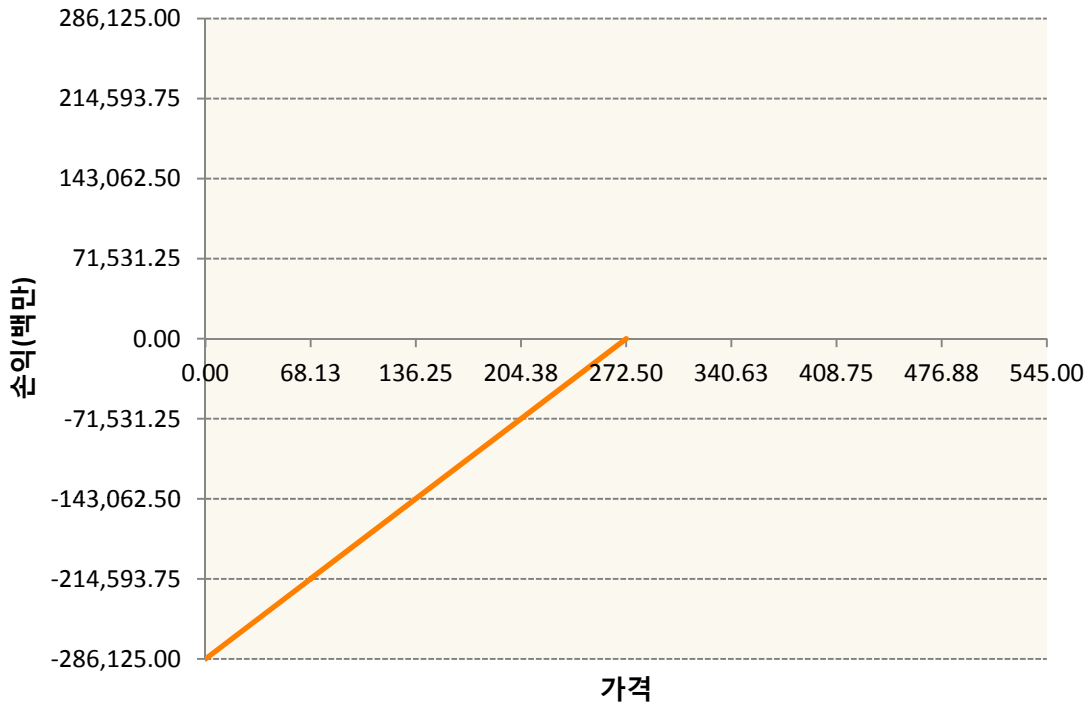


KR4201NC2728-2018-12 콜272.5





KR4301NC2727-2018-12 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201NC2702		2018-12 콜270					7,378
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,119	3,064	2,994	2,912	2,817	2,712	2,598
-5.33%	2,832	2,705	2,567	2,421	2,267	2,108	1,943
-2.67%	2,064	1,872	1,679	1,483	1,287	1,090	892
0%	596	398	200	0	-201	-402	-603
2.67%	-1,559	-1,701	-1,854	-2,014	-2,181	-2,353	-2,530
5.33%	-4,178	-4,252	-4,341	-4,444	-4,559	-4,685	-4,819
8.00%	-7,019	-7,048	-7,089	-7,143	-7,209	-7,288	-7,378
KR4201NC2728		2018-12 콜272.5					19,926
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,376	7,265	7,116	6,931	6,711	6,461	6,182

-5.33%	6,829	6,539	6,212	5,853	5,468	5,061	4,635
-2.67%	5,194	4,695	4,184	3,662	3,132	2,596	2,055
0%	1,746	1,164	582	0	-582	-1,165	-1,747
2.67%	-3,727	-4,201	-4,694	-5,203	-5,723	-6,253	-6,791
5.33%	-10,757	-11,034	-11,353	-11,708	-12,092	-12,501	-12,932
8.00%	-18,633	-18,753	-18,914	-19,114	-19,352	-19,624	-19,926
KR4301NC2727 2018-12 풋272.5							18,571
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-18,399	-18,405	-18,417	-18,438	-18,470	-18,514	-18,571
-5.33%	-10,823	-10,886	-10,970	-11,075	-11,201	-11,345	-11,506
-2.67%	-3,870	-4,105	-4,355	-4,617	-4,890	-5,170	-5,458
0%	1,012	675	338	0	-338	-676	-1,015
2.67%	3,100	2,901	2,682	2,445	2,195	1,933	1,661
5.33%	3,570	3,519	3,446	3,352	3,236	3,101	2,948
8.00%	3,623	3,617	3,604	3,582	3,547	3,499	3,437

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

(단위:백만원)

48,117

공시일	2018-11-29
기준일	2018-11-28

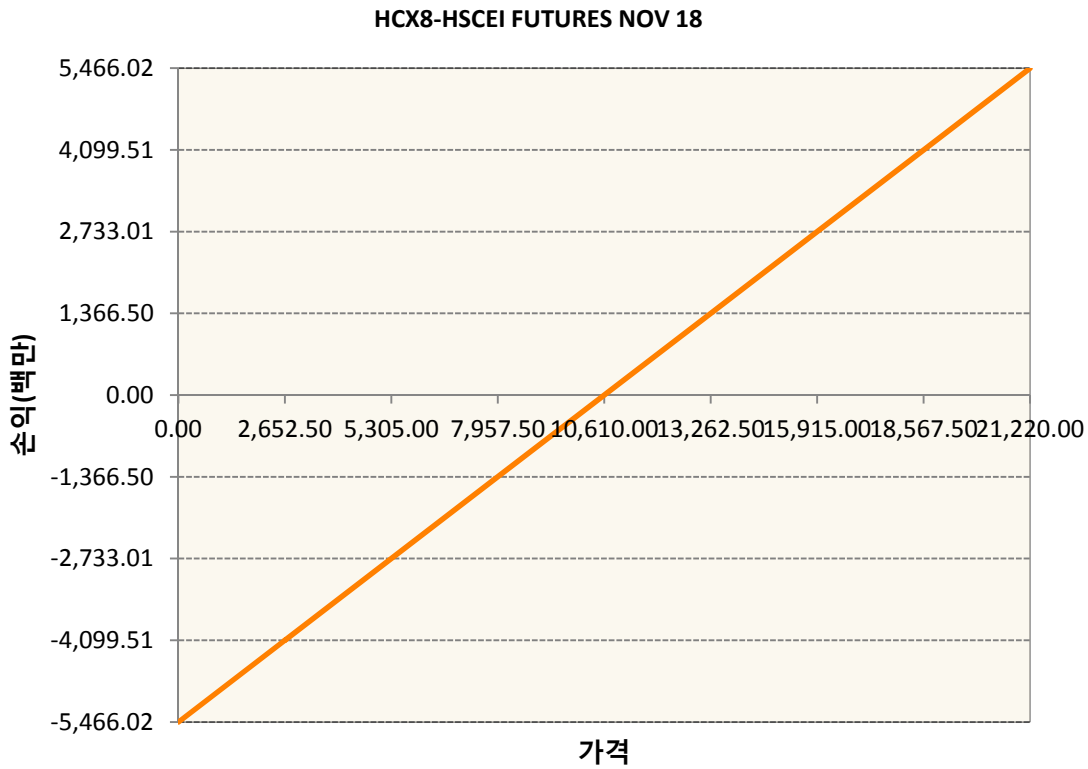
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

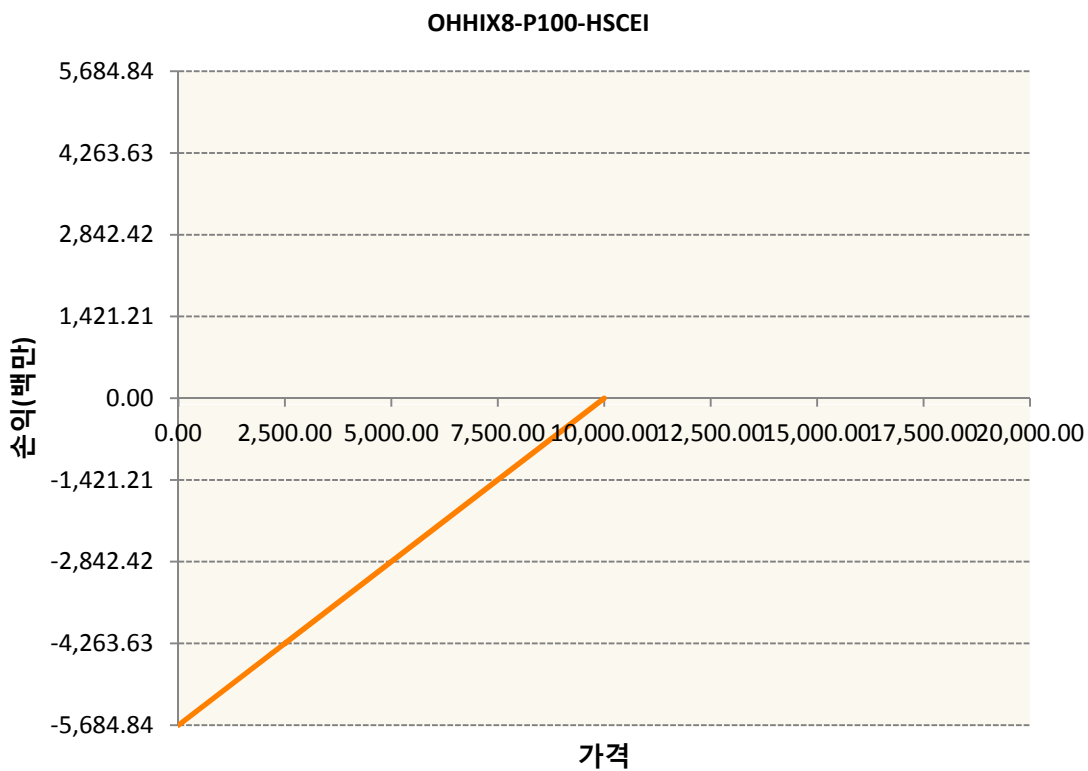
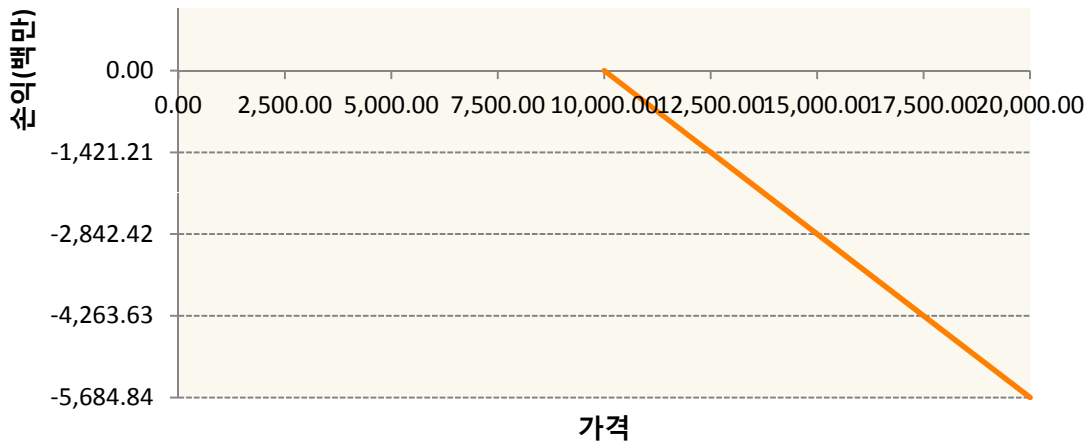
1. 계약금액

(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	5,466	0	5,466	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,370	-11,370	장내
누계	통화	선도	432	3,166	-2,734	장외

2. 만기시점의 손익구조





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	437
OHHIX8-C1C	HSCEI	455
OHHIX8-P10	HSCEI	455

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

공시일	2018-11-29
기준일	2018-11-28

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

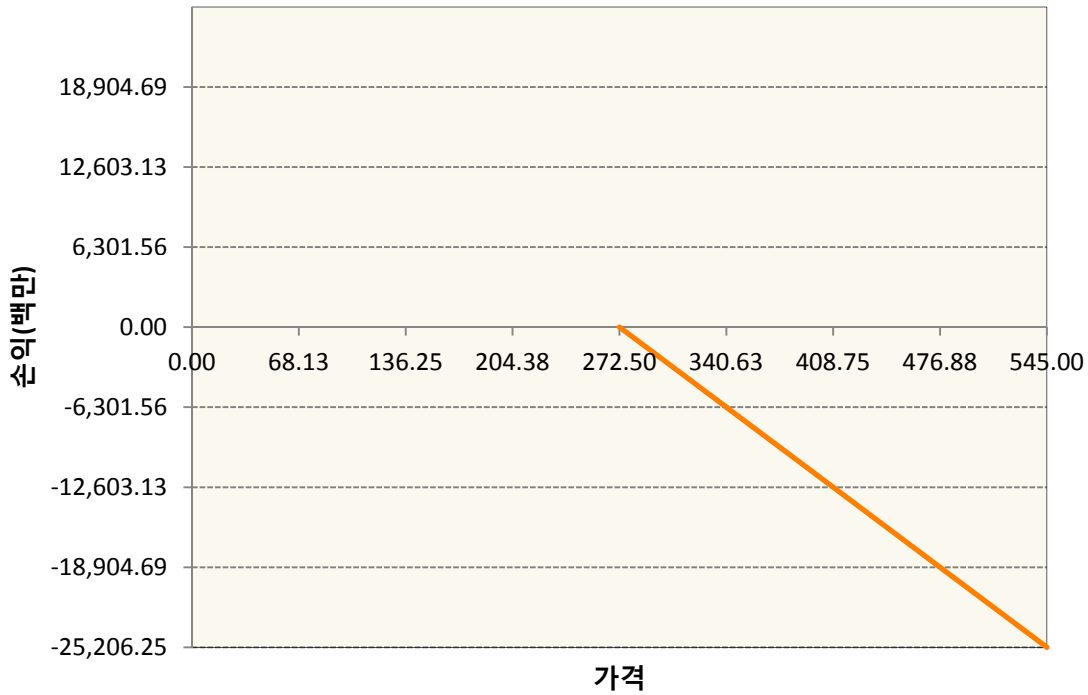
1. 계약금액

(단위:백만원)

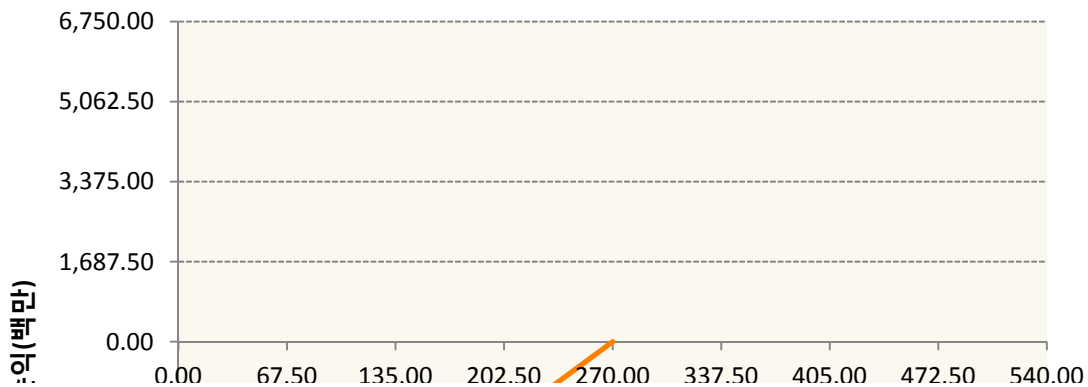
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	43,836	0	43,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	43,538	-43,538	장내

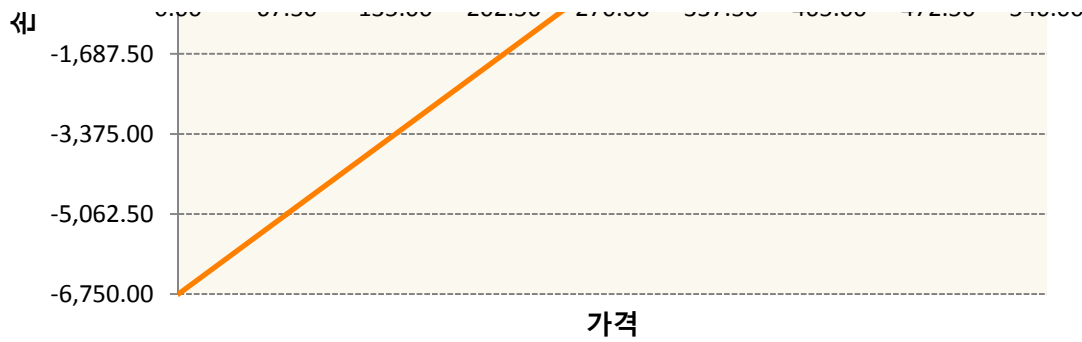
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NC2728-2018-12 콜272.5

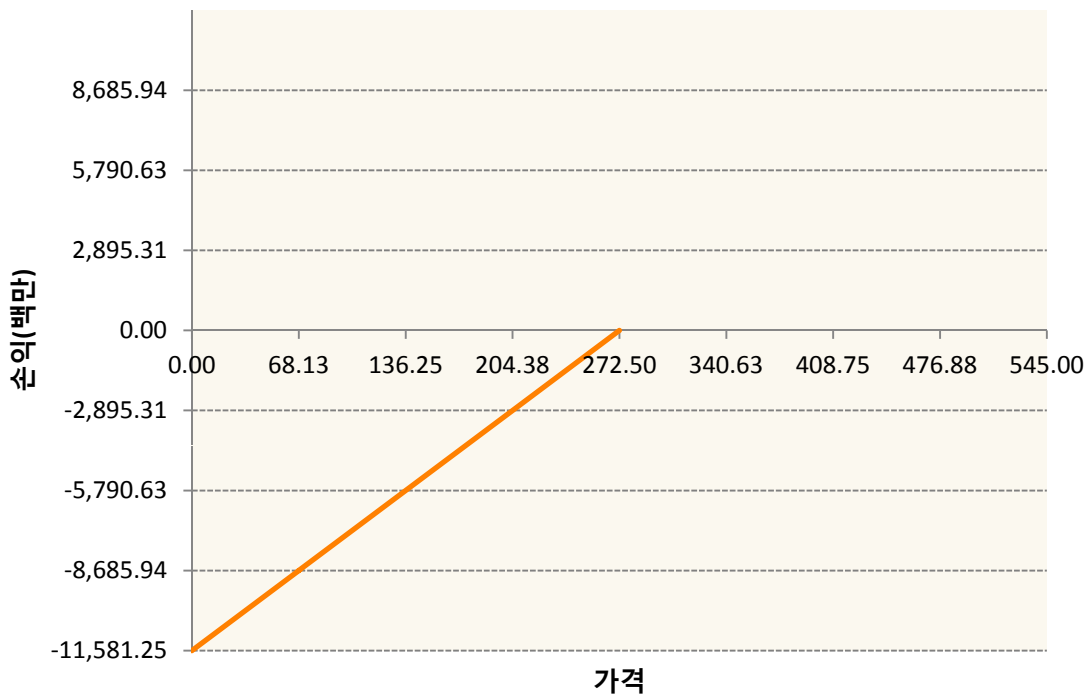


KR4301NC2701-2018-12 풋270





KR4301NC2727-2018-12 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14				3,607
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,607	-3,607	-3,607	-3,607	-3,607	-3,607	-3,607
-5.33%	-2,405	-2,405	-2,405	-2,405	-2,405	-2,405	-2,405
-2.67%	-1,202	-1,202	-1,202	-1,202	-1,202	-1,202	-1,202
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,202	1,202	1,202	1,202	1,202	1,202	1,202
5.33%	2,405	2,405	2,405	2,405	2,405	2,405	2,405
8.00%	3,607	3,607	3,607	3,607	3,607	3,607	3,607
	KR4201NC2728		2018-12 콜272.5				1,612
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	597	588	576	561	543	523	500
-5.33%	552	529	502	473	442	409	375
-2.67%	420	380	338	296	253	210	166
0%	141	94	47	0	-47	-94	-141
2.67%	-301	-340	-380	-421	-463	-506	-549
5.33%	-870	-893	-918	-947	-978	-1,011	-1,046
8.00%	-1,507	-1,517	-1,530	-1,546	-1,565	-1,587	-1,612

KR4301NC2701 2018-12 풋270 409

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-402	-402	-403	-404	-405	-407	-409
-5.33%	-224	-226	-230	-233	-237	-242	-247
-2.67%	-71	-77	-85	-92	-99	-107	-114
0%	22	15	8	0	-8	-15	-23
2.67%	54	51	47	43	38	33	28
5.33%	60	59	58	57	55	53	50
8.00%	60	60	60	60	59	58	57

KR4301NC2727 2018-12 풋272.5 752

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-745	-745	-745	-746	-748	-749	-752
-5.33%	-438	-441	-444	-448	-453	-459	-466
-2.67%	-157	-166	-176	-187	-198	-209	-221
0%	41	27	14	0	-14	-27	-41
2.67%	125	117	109	99	89	78	67
5.33%	145	142	139	136	131	126	119
8.00%	147	146	146	145	144	142	139

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

(단위:백만원)

6,486

공시일	2018-11-29
기준일	2018-11-28

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

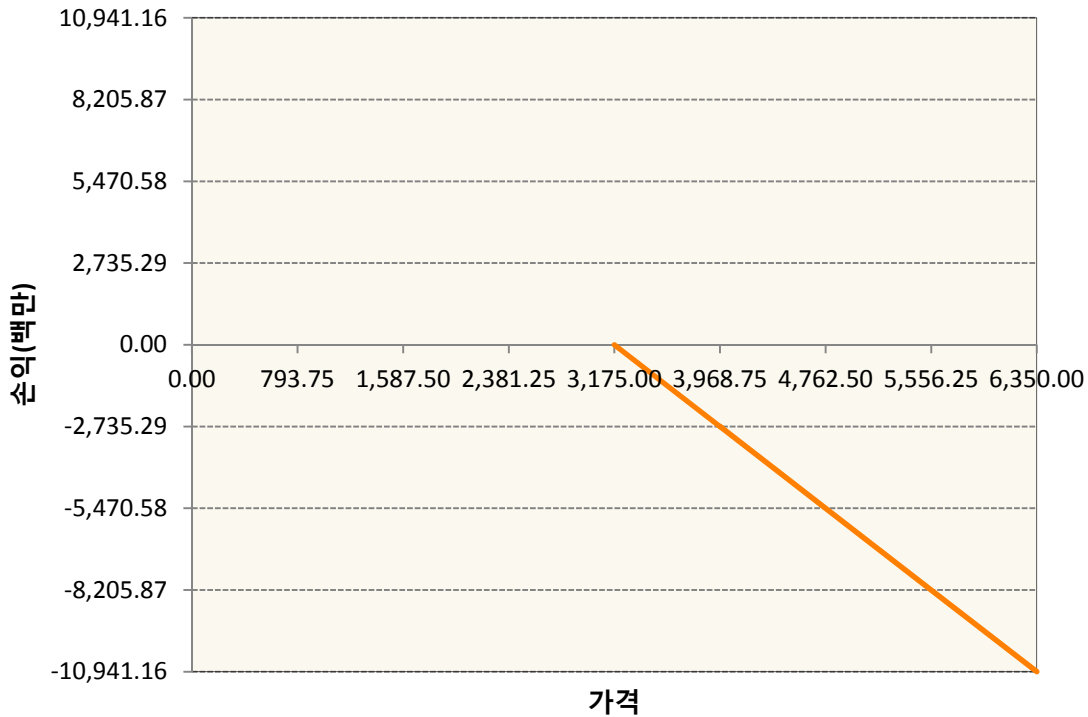
1. 계약금액

(단위:백만원)

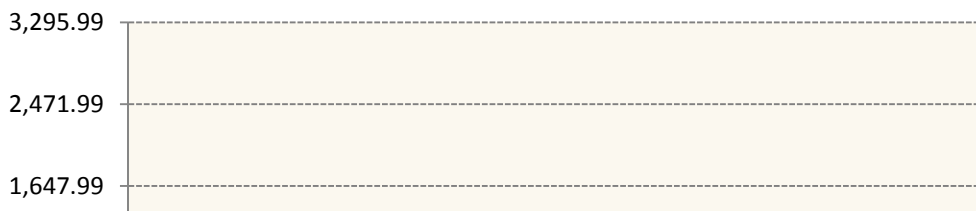
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	8,080	0	8,080	
누계	유가증권	스왑	71,022	0	71,022	장외
누계	유가증권	옵션	0	28,474	-28,474	장내
누계	통화	선도	0	15,259	-15,259	장외

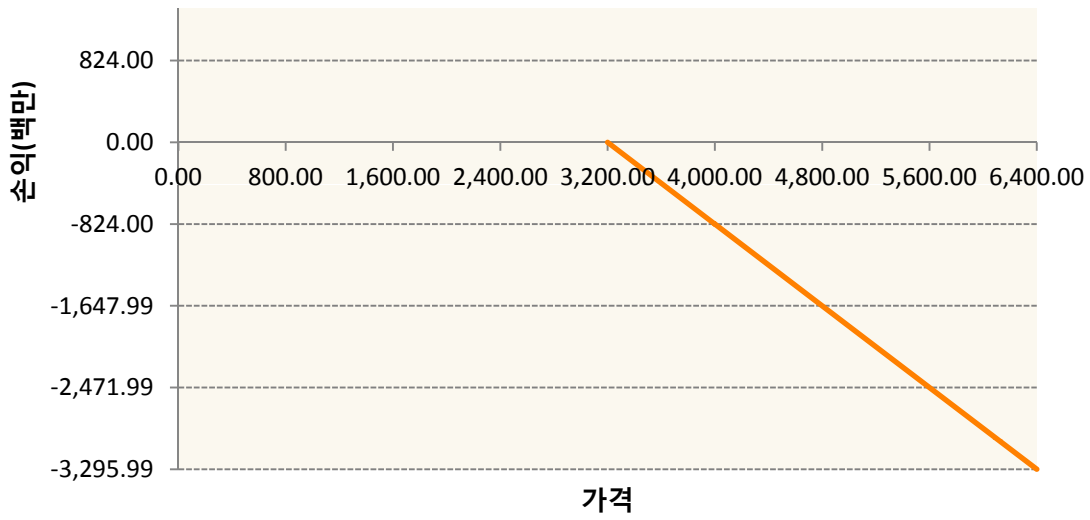
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ8-C3175-EURO STOXX 50

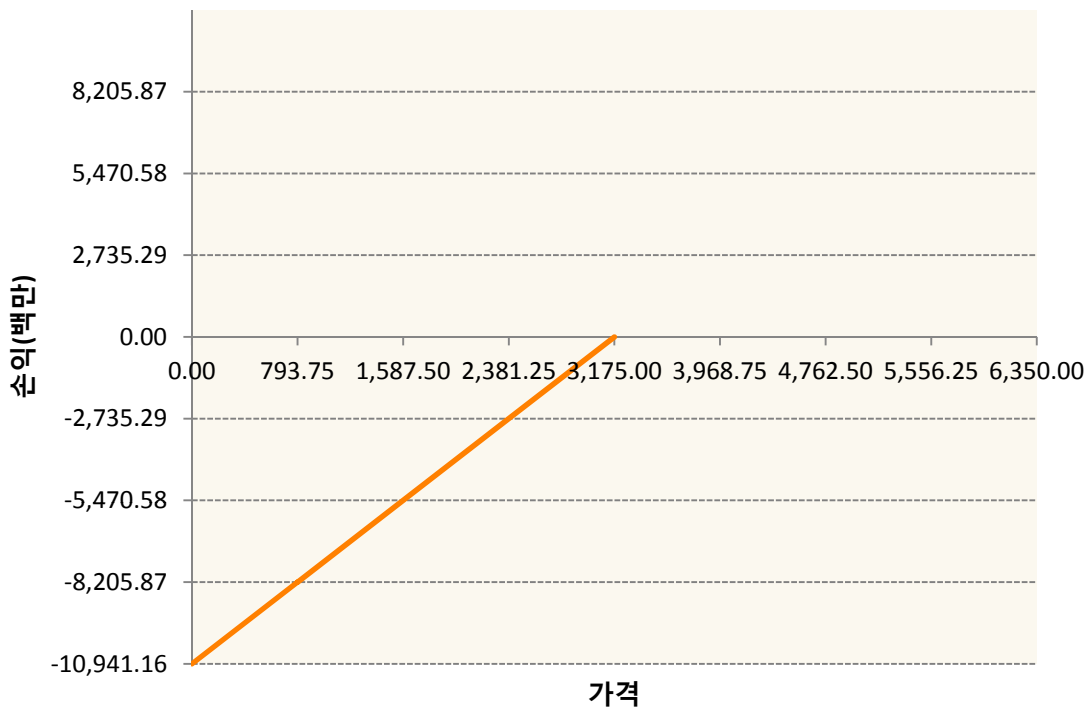


OESXZ8-C3200-EURO STOXX 50

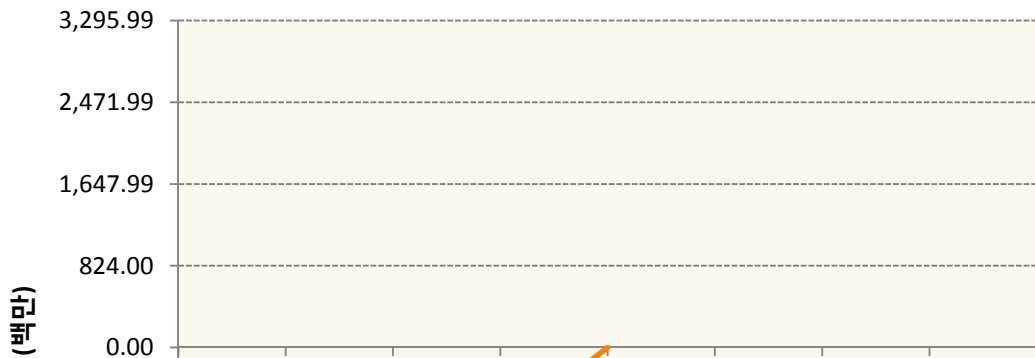


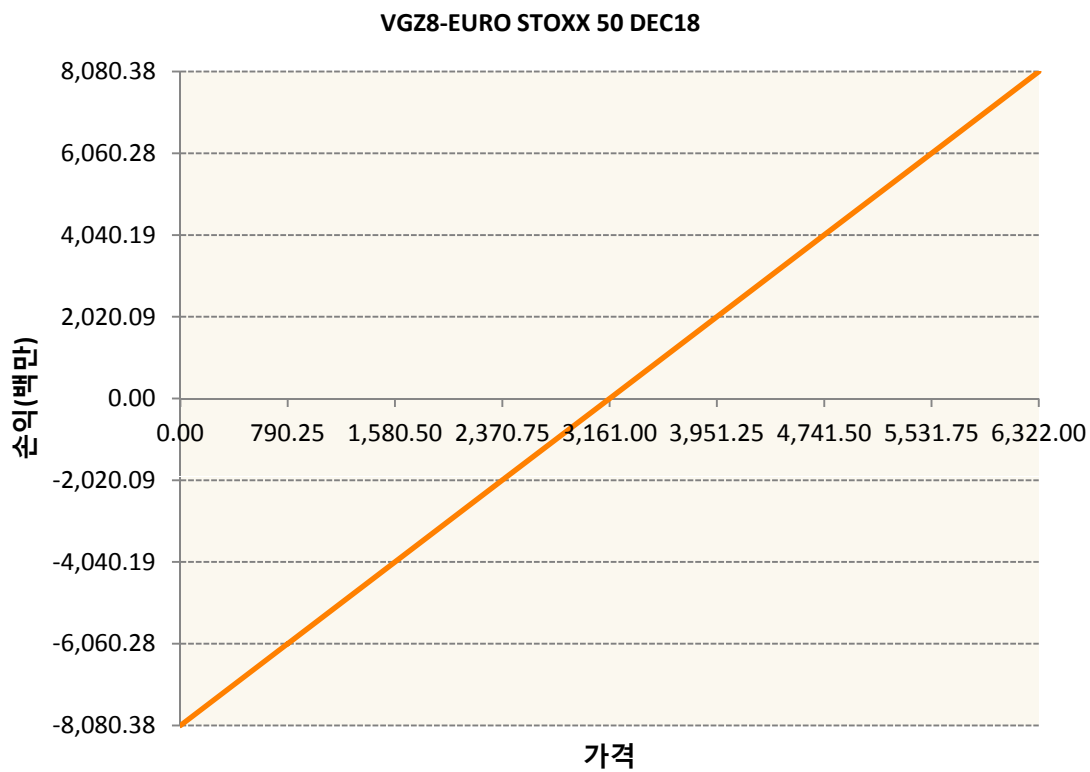
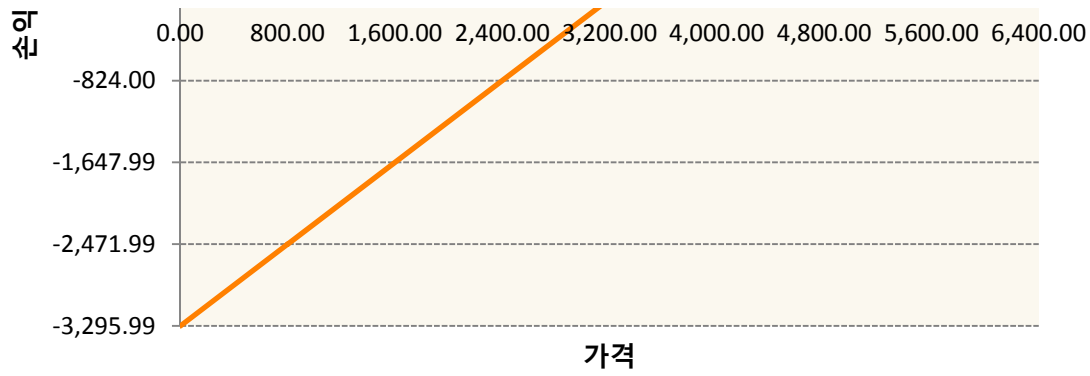


OESXZ8-P3175-EURO STOXX 50



OESXZ8-P3200-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	48
FX21018U03 KRW/EUR 21-12-18E	814
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E	407
OESXZ8-C31 EURO STOXX 50	875
OESXZ8-C32 EURO STOXX 50	264
OESXZ8-P31 EURO STOXX 50	875
OESXZ8-P32 EURO STOXX 50	264
VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18	646

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

(단위:백만원)

2,581

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

(단위:백만원)

1,109

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

(단위:백만원)

94

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

(단위:백만원)

140

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

(단위:백만원)

42

공시일	2018-11-29
기준일	2018-11-28

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

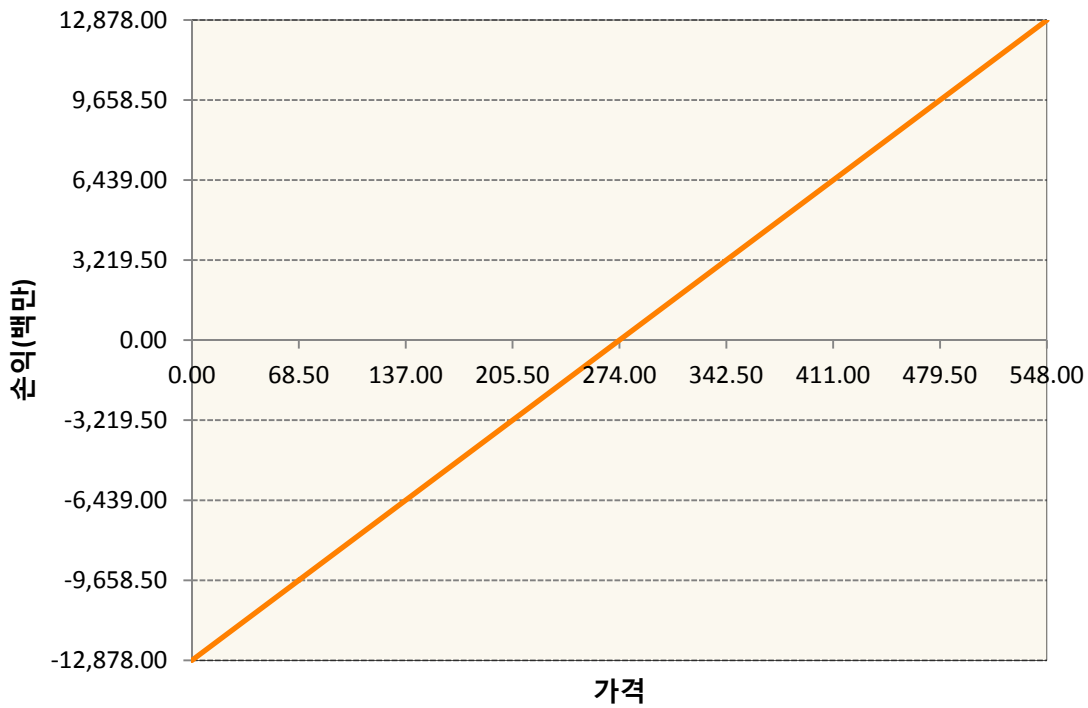
1. 계약금액

(단위:백만원)

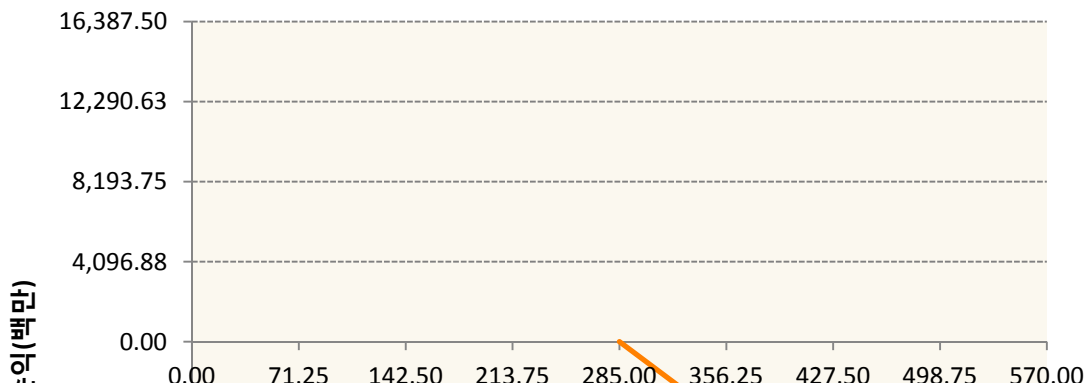
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	215	-215	장내
누계	유가증권	선물	12,878	0	12,878	장내
누계	유가증권	옵션	3,743	23,072	-19,329	장내

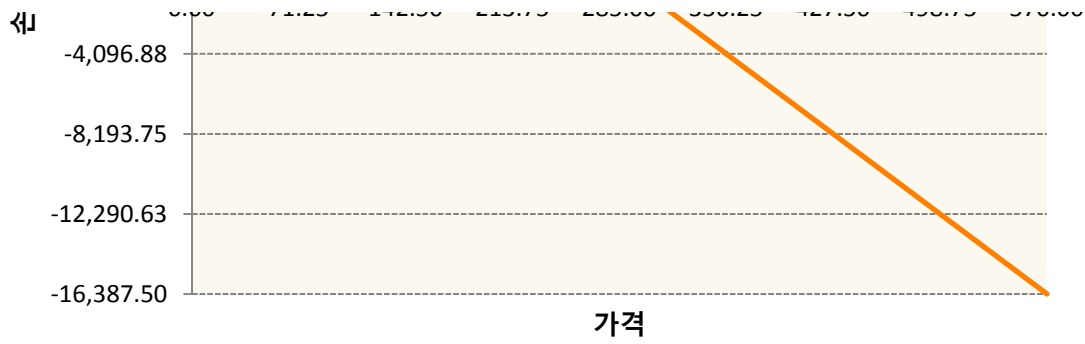
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

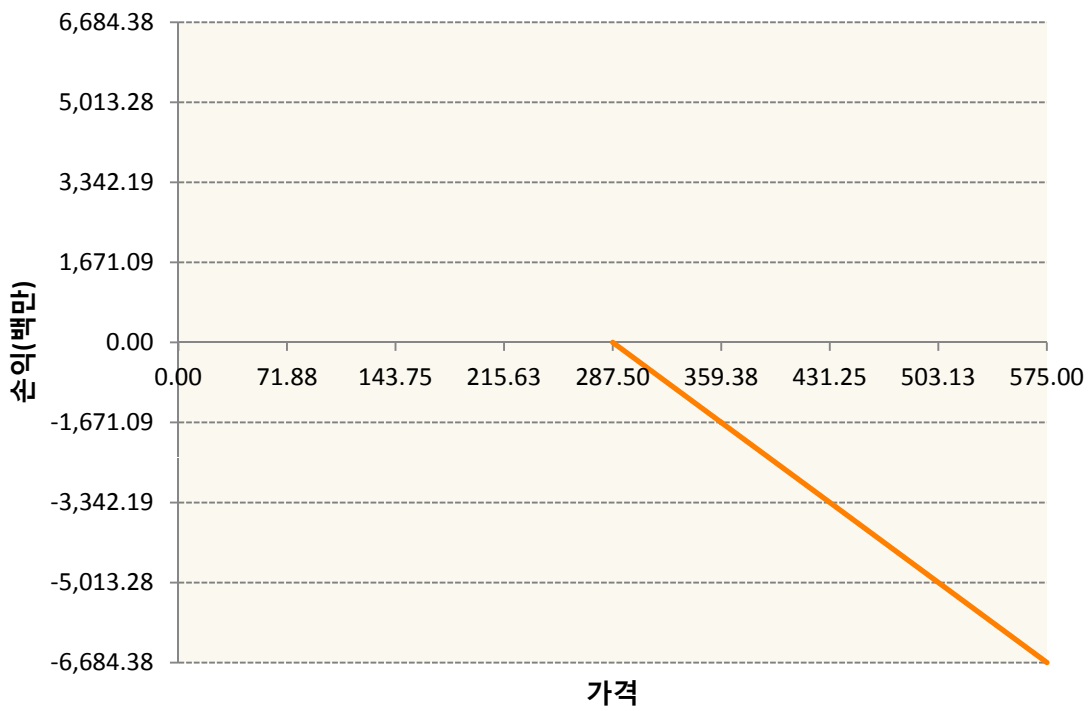


KR4201NC2850-2018-12 콜285

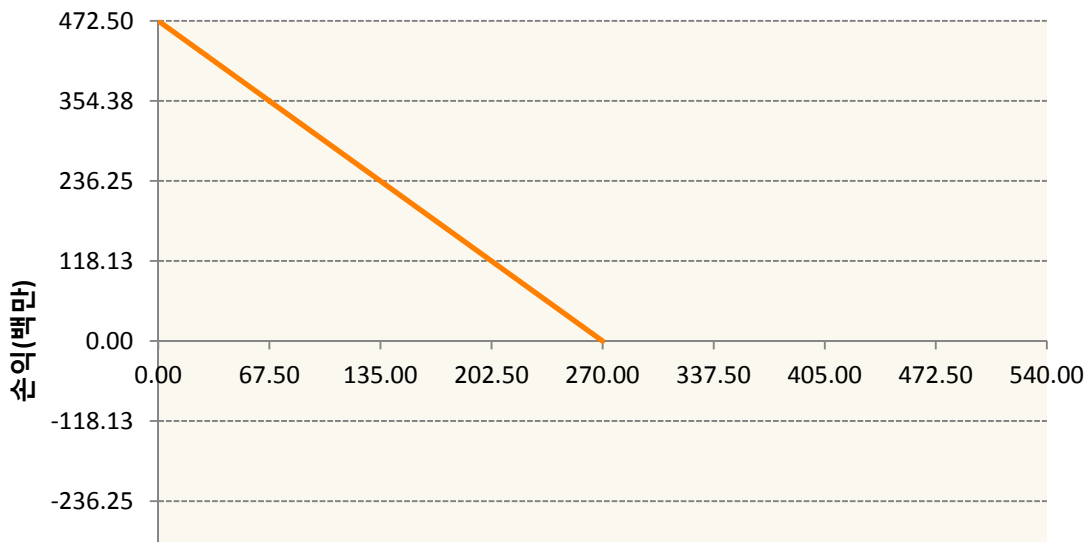


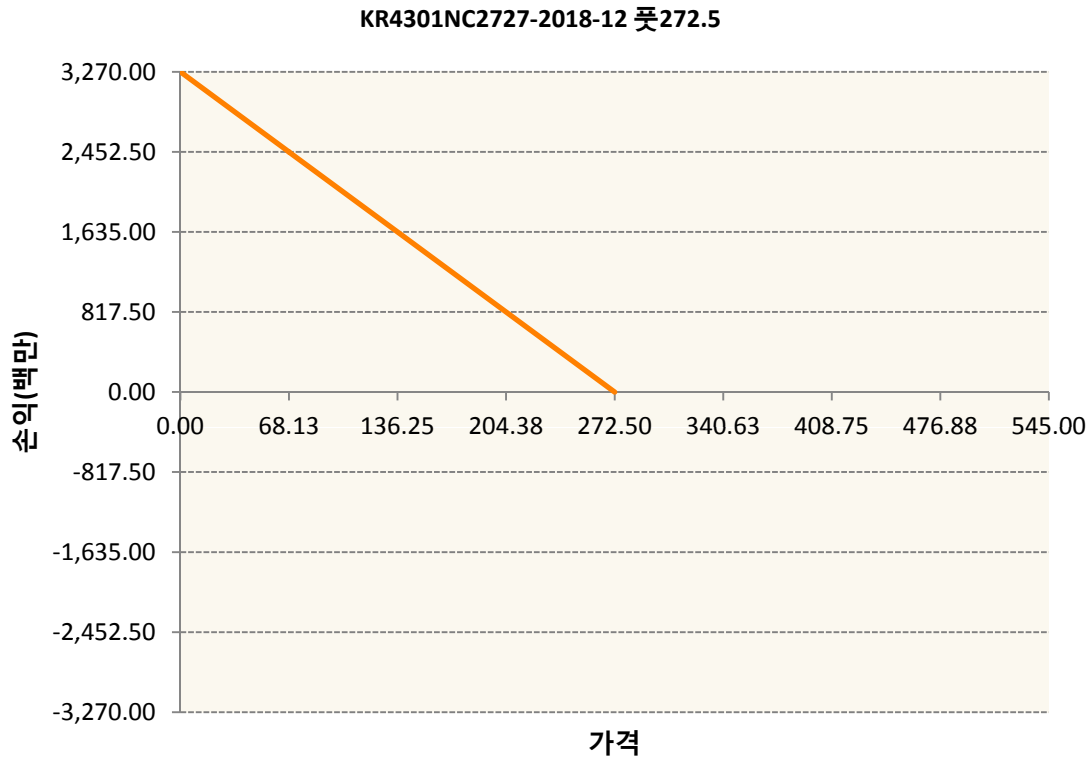
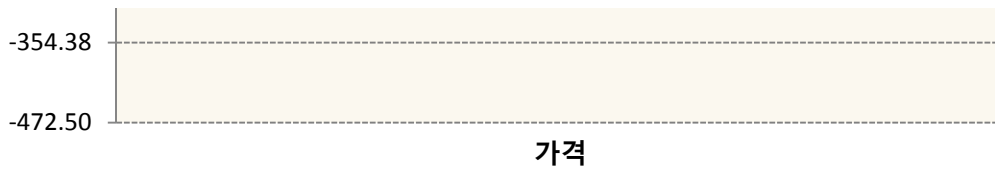


KR4201NC2876-2018-12 콜287.5



KR4301NC2701-2018-12 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0004		2018-12 코스피200지수선물						1,028
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,028	-1,028	-1,028	-1,028	-1,028	-1,028	-1,028	
-5.33%	-685	-685	-685	-685	-685	-685	-685	
-2.67%	-343	-343	-343	-343	-343	-343	-343	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	343	343	343	343	343	343	343	
5.33%	685	685	685	685	685	685	685	
8.00%	1,028	1,028	1,028	1,028	1,028	1,028	1,028	
KR4201NC2850		2018-12 콜285						700
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	120	120	118	117	114	109	104	
-5.33%	118	115	111	105	97	88	78	
-2.67%	106	97	86	73	58	41	23	

0%	63	43	22	0	-23	-47	-72
2.67%	-47	-75	-104	-133	-163	-192	-222
5.33%	-250	-280	-310	-340	-371	-401	-431
8.00%	-548	-570	-595	-620	-646	-672	-700
KR4201NC2876 2018-12 콜287.5							256
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	37	37	37	36	35	34	32
-5.33%	37	36	35	33	31	28	24
-2.67%	34	31	27	23	18	12	6
0%	22	15	8	0	-8	-17	-27
2.67%	-12	-23	-34	-45	-56	-68	-79
5.33%	-81	-93	-106	-118	-131	-143	-156
8.00%	-189	-199	-210	-222	-233	-245	-256
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%	16	16	16	16	17	17	17
-2.67%	5	5	6	6	7	7	8
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-4	-4	-3	-3	-3	-2	-2
5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-3
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
KR4301NC2727 2018-12 풋272.5							212
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	210	210	210	211	211	212	212
-5.33%	124	124	125	127	128	130	132
-2.67%	44	47	50	53	56	59	62
0%	-12	-8	-4	0	4	8	12
2.67%	-35	-33	-31	-28	-25	-22	-19
5.33%	-41	-40	-39	-38	-37	-35	-34
8.00%	-41	-41	-41	-41	-41	-40	-39

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

(단위:백만원)

1,802

공시일	2018-11-29
기준일	2018-11-28

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	126	0	126	

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	2018-11-29
기준일	2018-11-28

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	1,457	0	1,457	

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	2018-11-29
기준일	2018-11-28

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	182	0	182	
누계	통화	선도	3	247	-244	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
FX21018X03 USD/KRW 30-11-18E		0.2
FX21018X04 KRW/USD 28-02-19E		2
FX21018X04 KRW/USD 28-02-19E		3

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

(단위:백만원)

7

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

(단위:백만원)

149

공시일	2018-11-29
기준일	2018-11-28

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

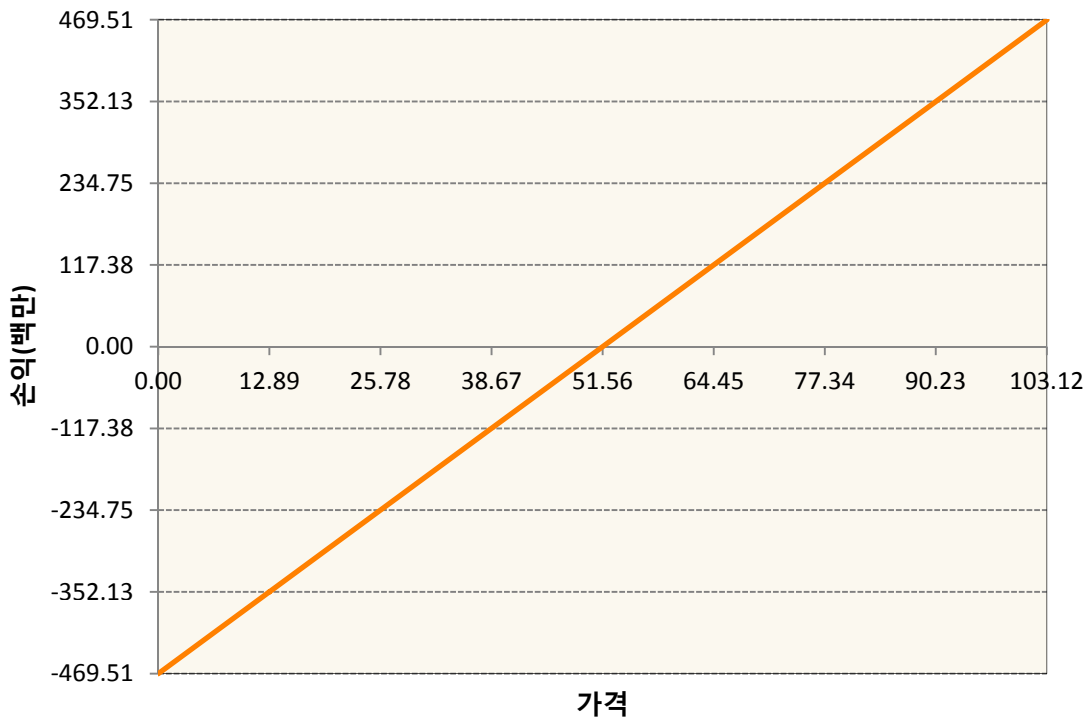
1. 계약금액

(단위:백만원)

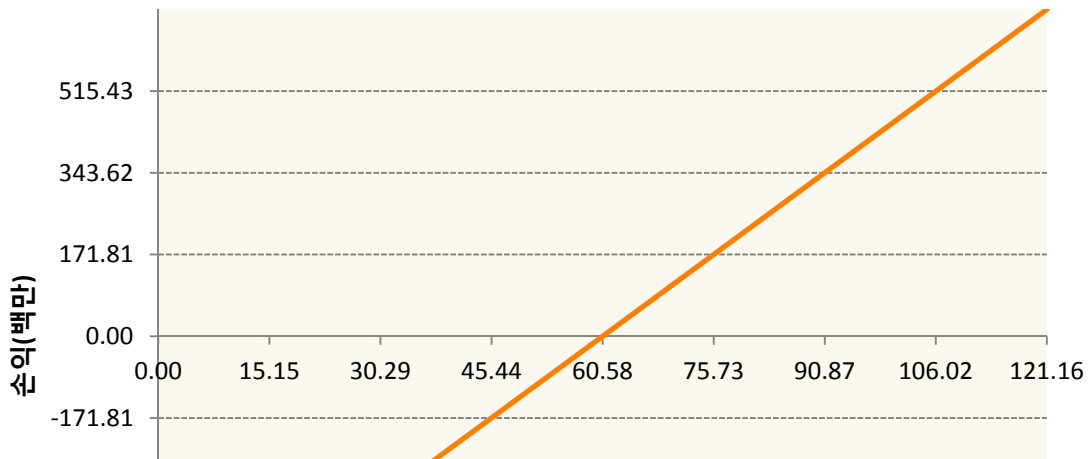
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,001	405	2,596	

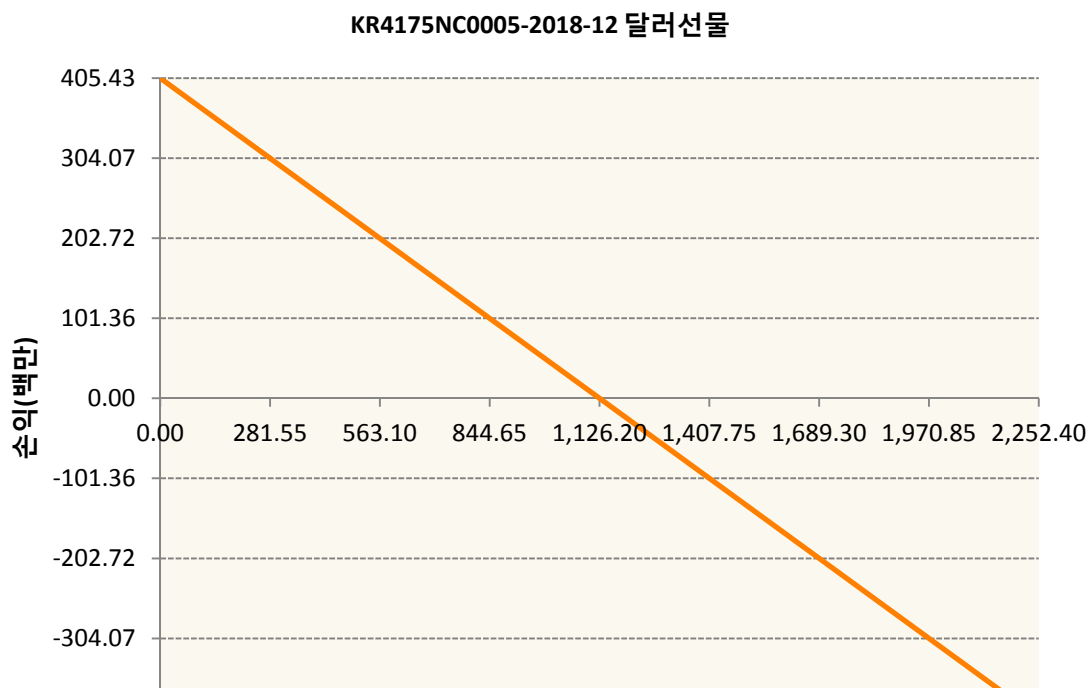
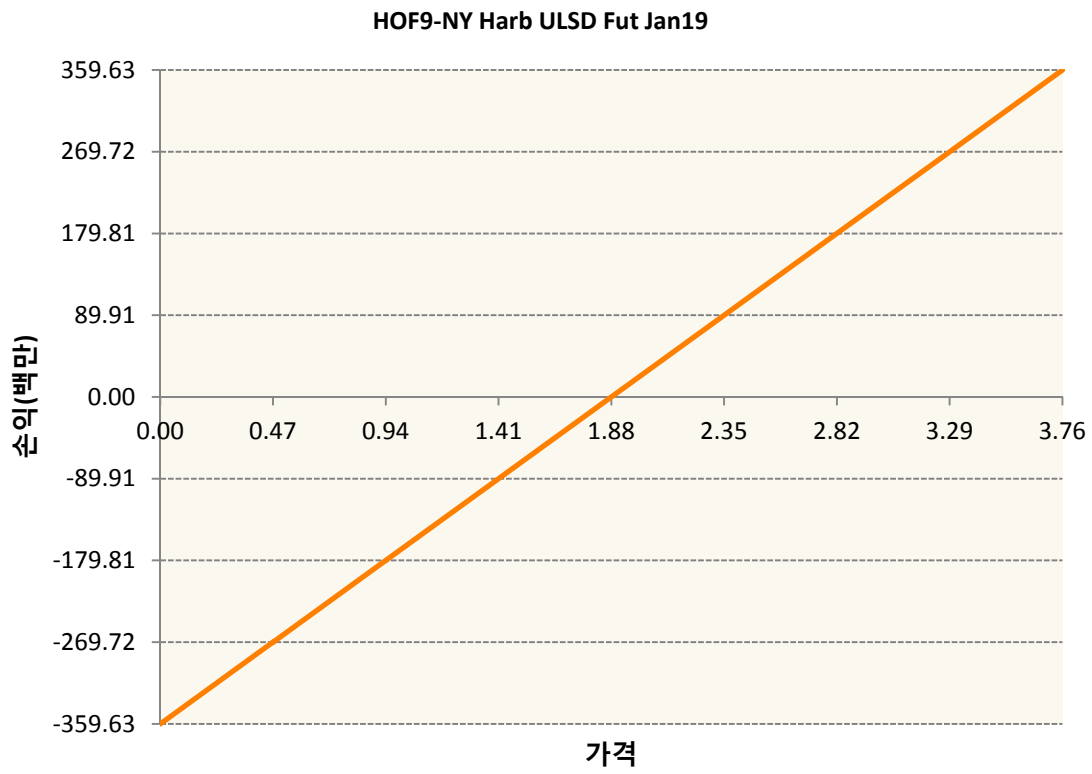
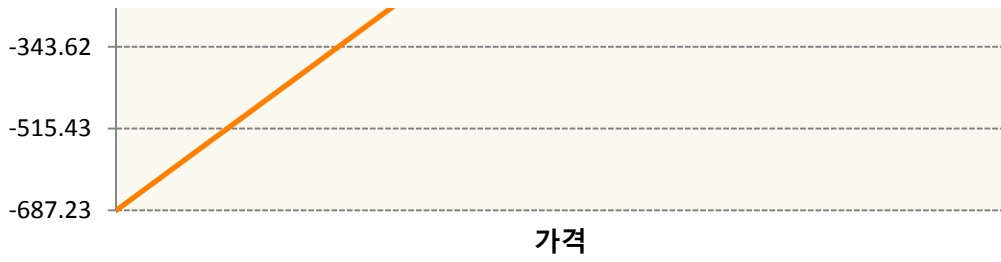
2. 만기시점의 손익구조

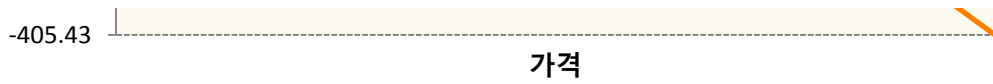
CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19



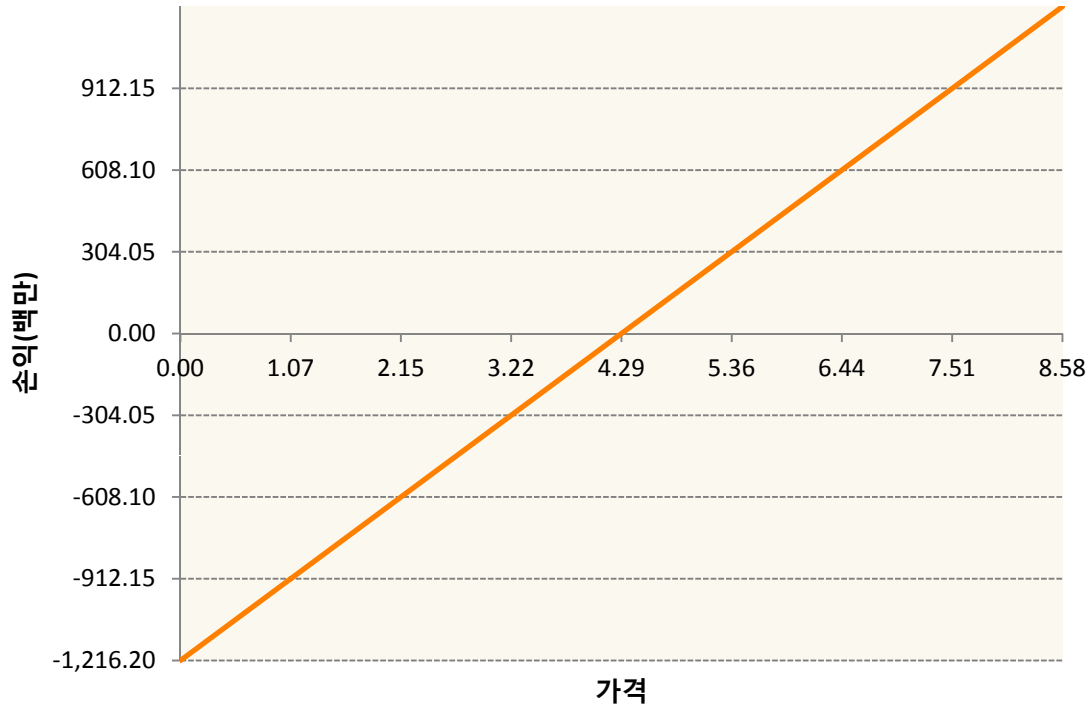
COH9-BRENT CRUDE FUTR Mar19



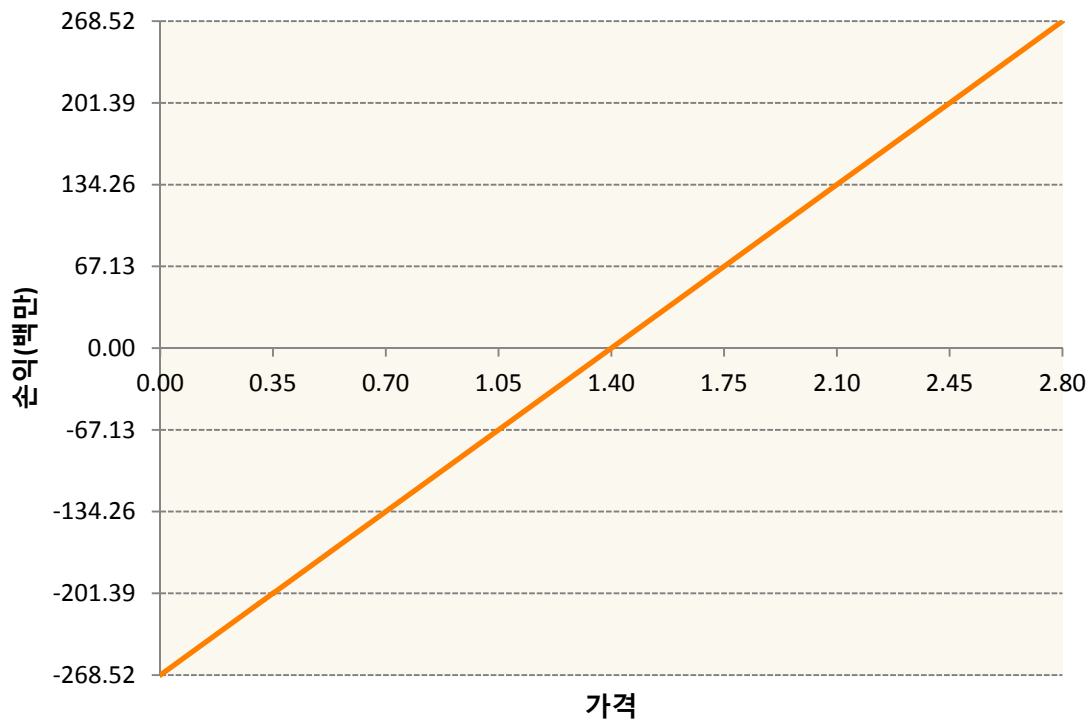




NGF19-NATURAL GAS FUTR Jan19



XBF9-GASOLINE RBOB FUT Jan19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF9	WTI CRUDE FUTURE Jan19	38
COH9	BRENT CRUDE FUTR Mar19	55
HOF9	NY Harb ULSD Fut Jan19	29
KR4175NC0	(2018-12 달러선물	32
NGF19	NATURAL GAS FUTR Jan19	97
XBF9	GASOLINE RBOB FUT Jan19	21

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

423

공시일	2018-11-29
기준일	2018-11-28

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

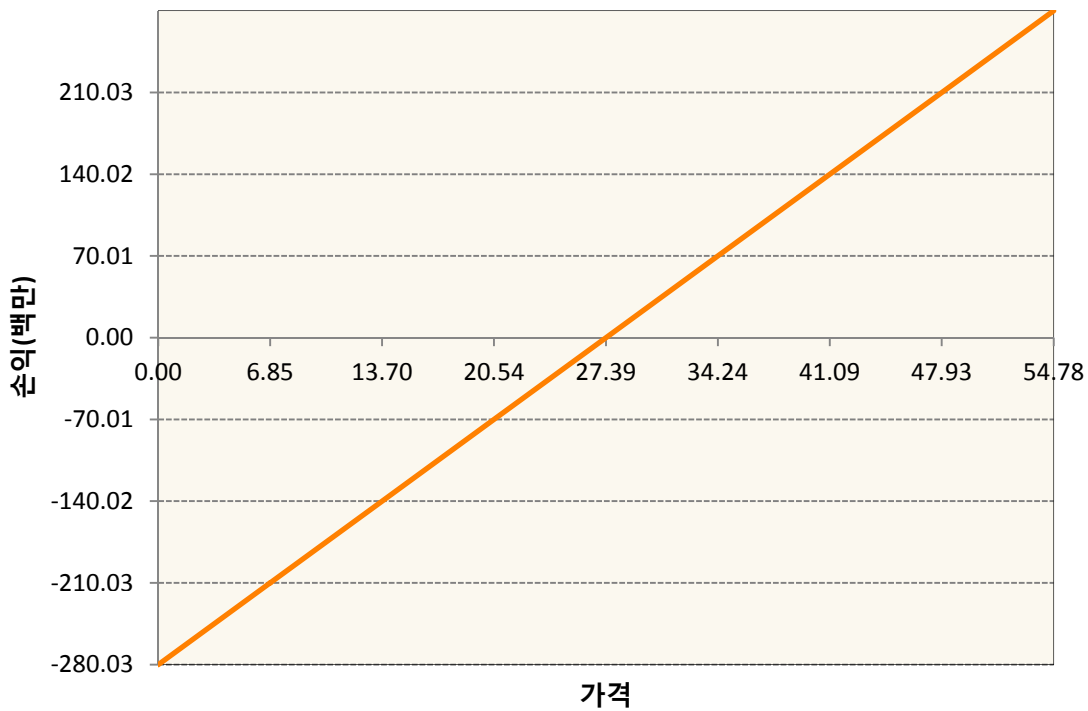
1. 계약금액

(단위:백만원)

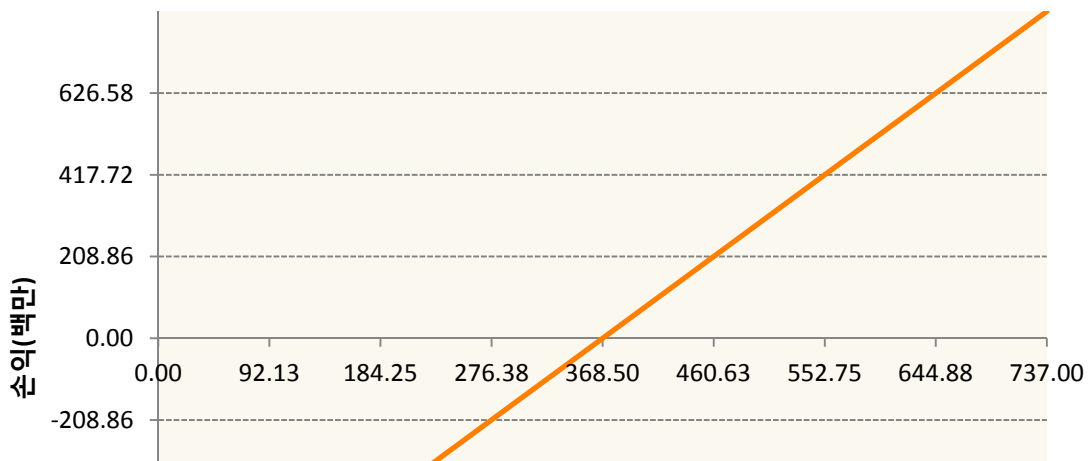
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,628	79	3,549	

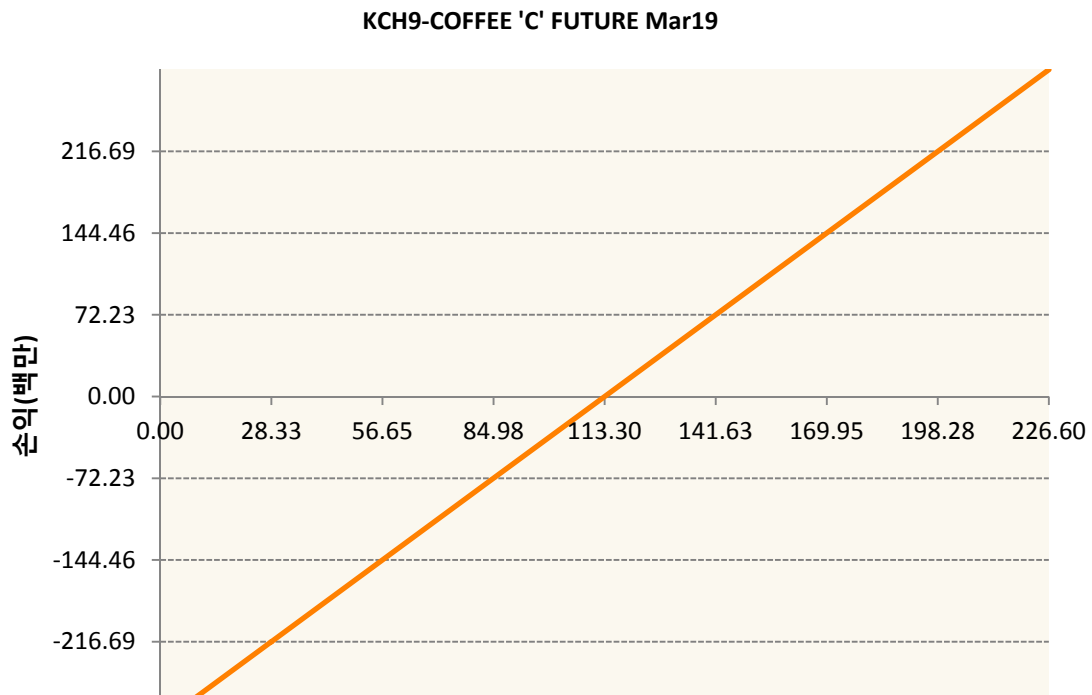
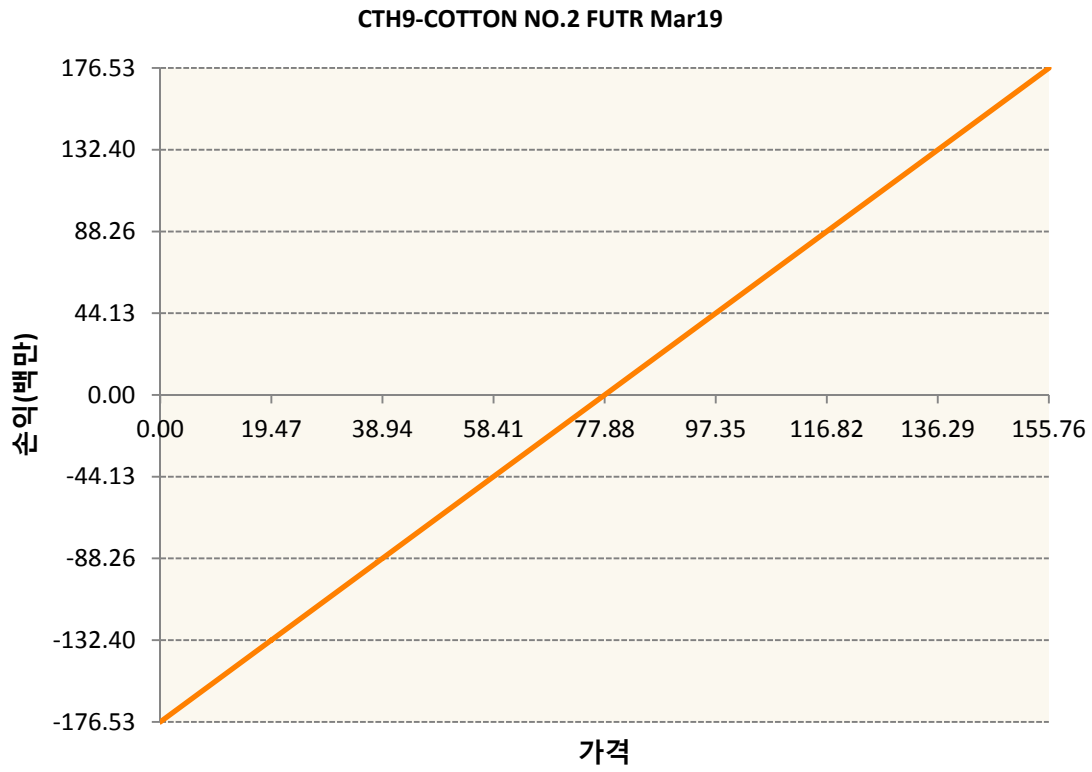
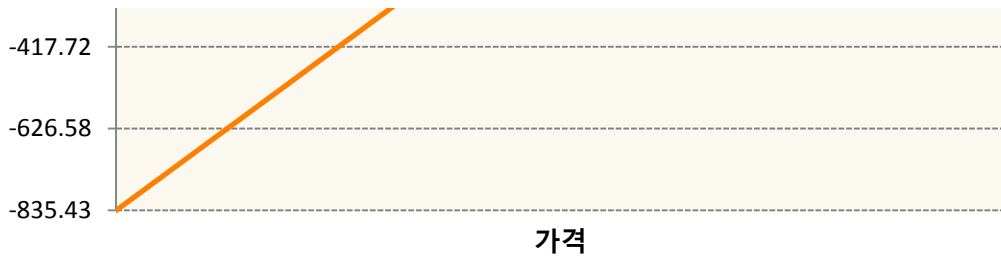
2. 만기시점의 손익구조

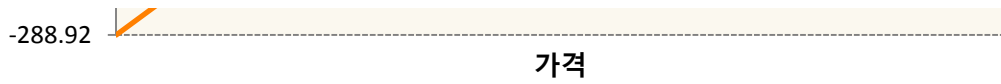
BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19



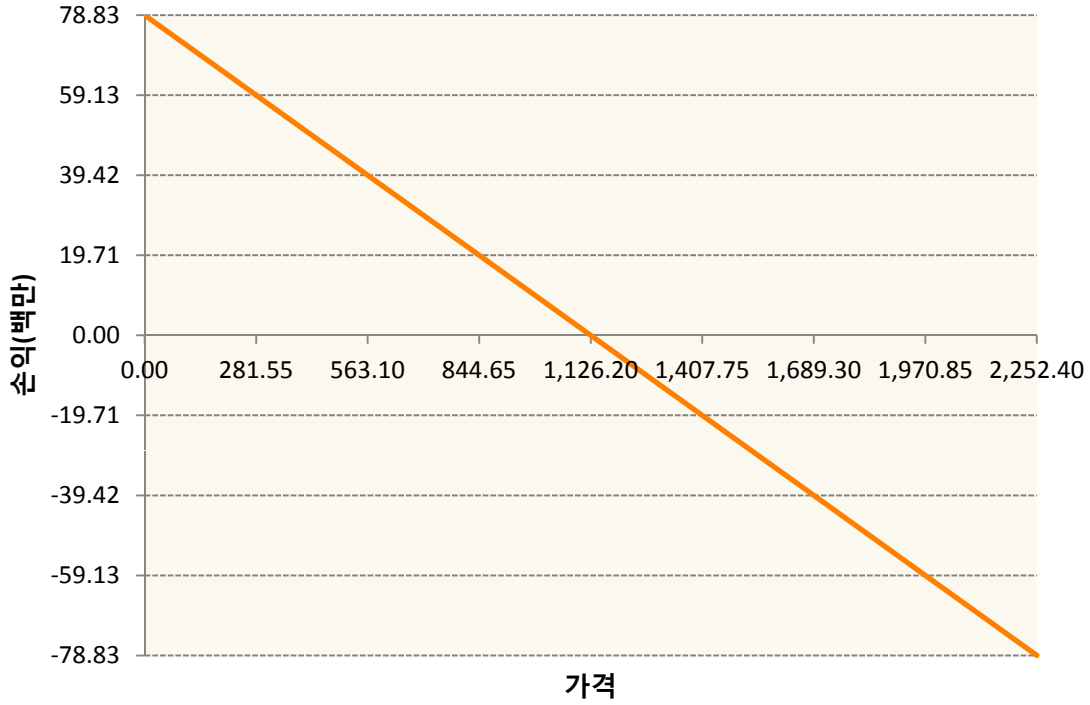
CH9-CORN FUTURE Mar19



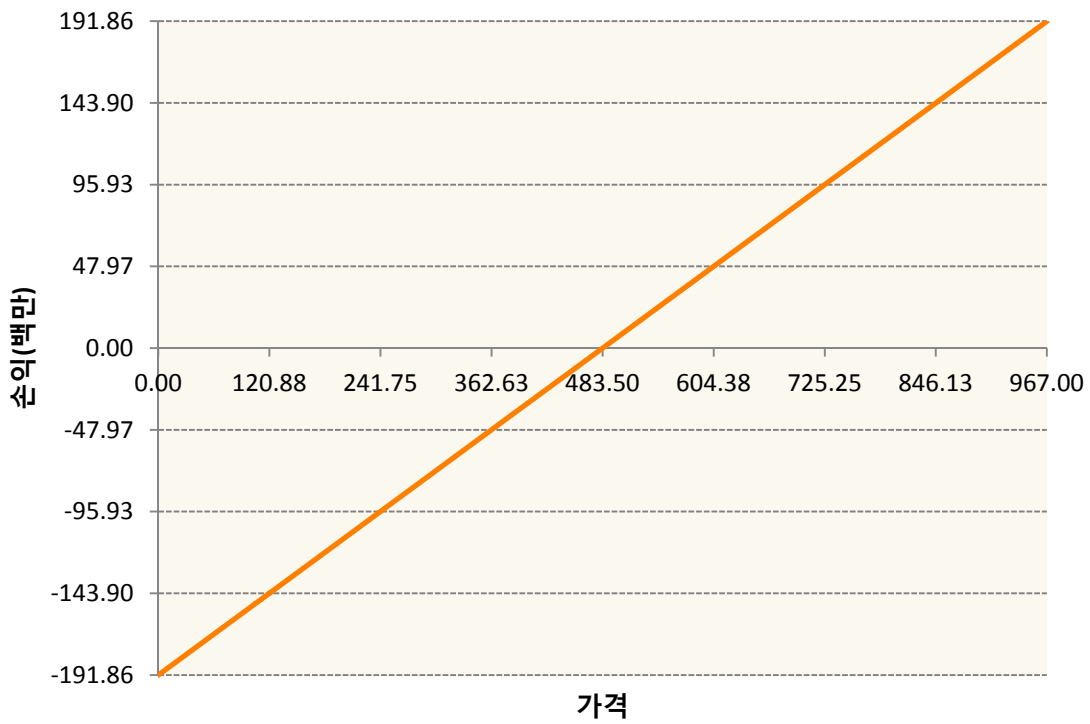




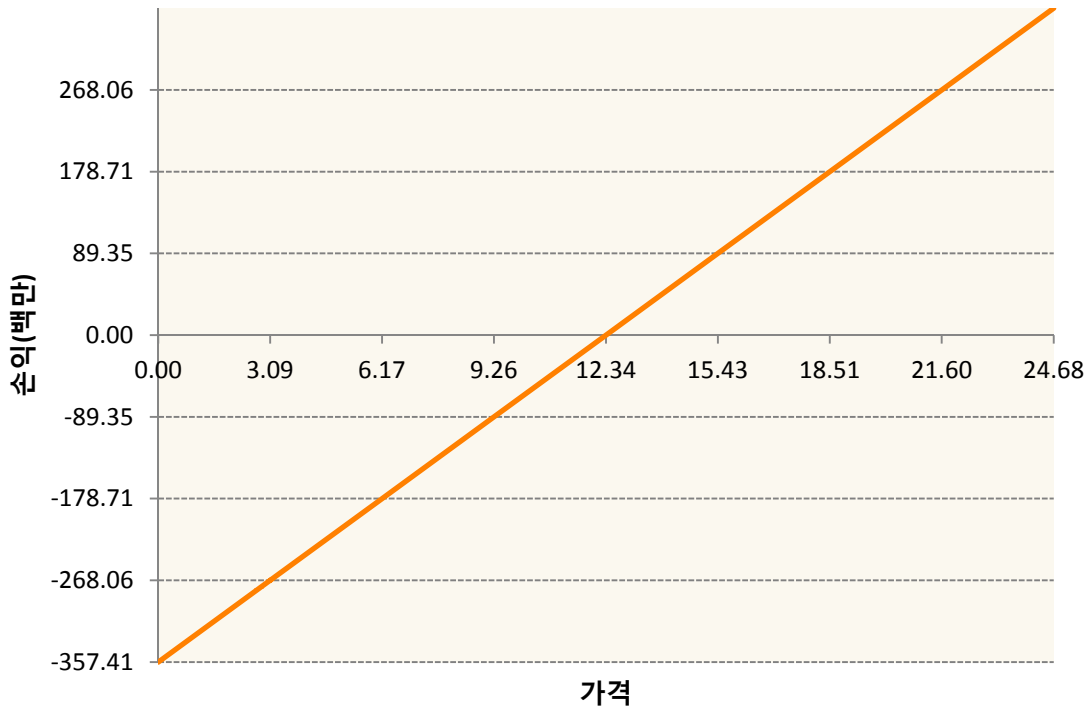
KR4175NC0005-2018-12 달러선물



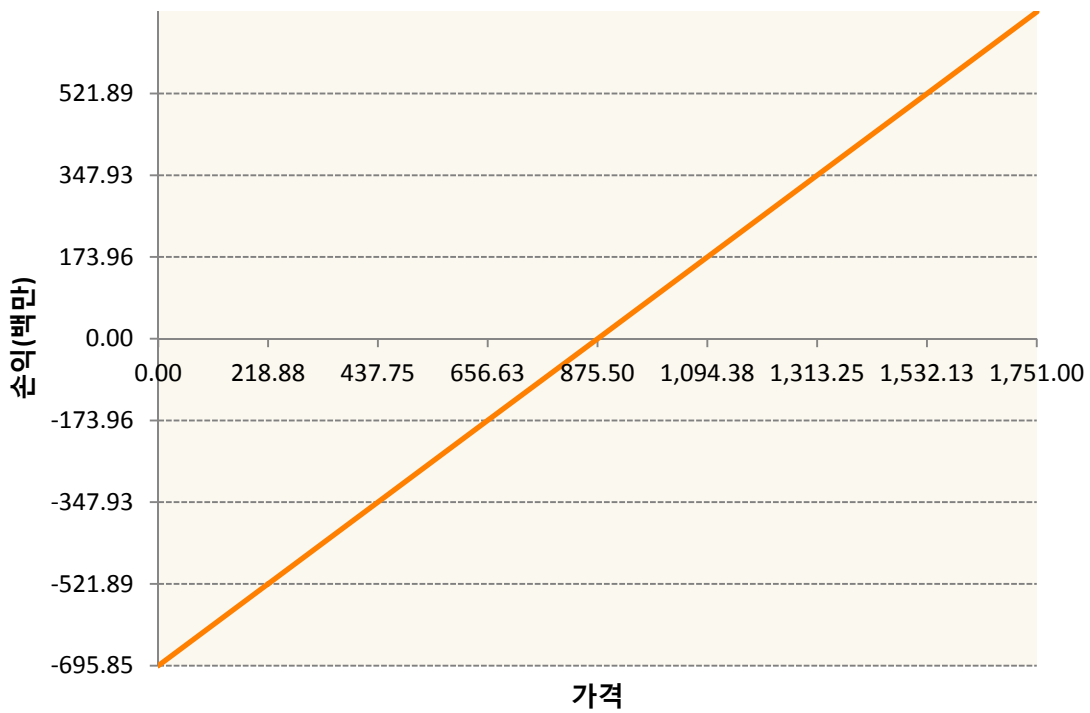
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

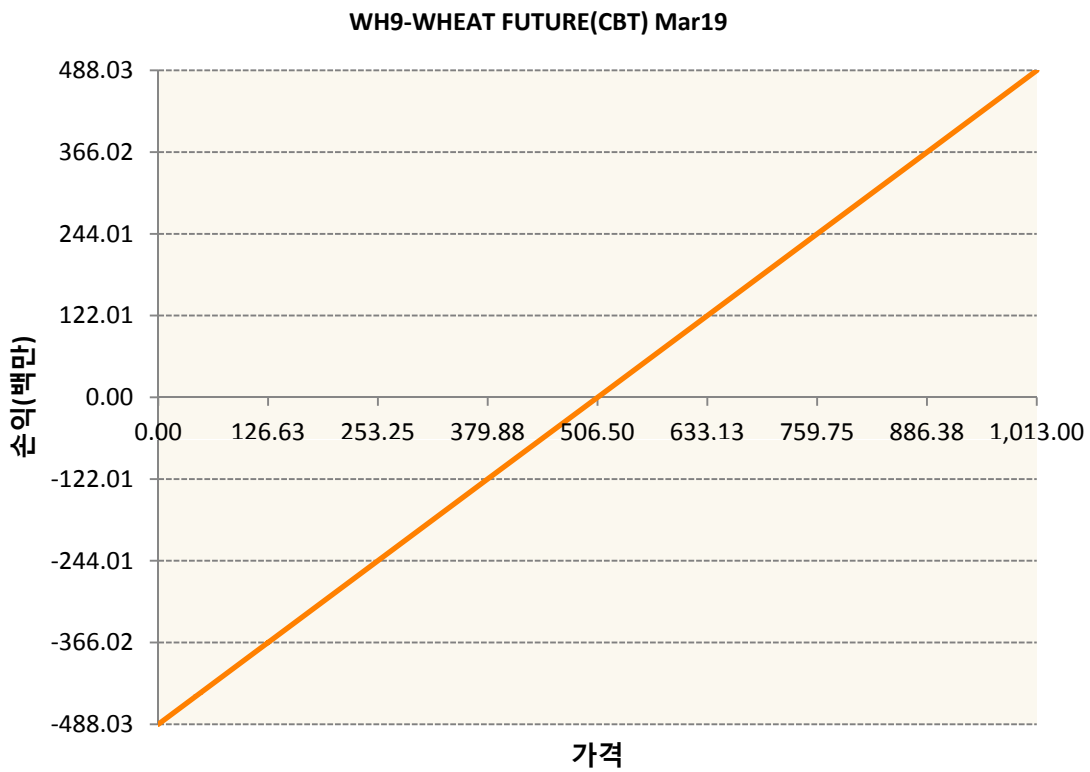
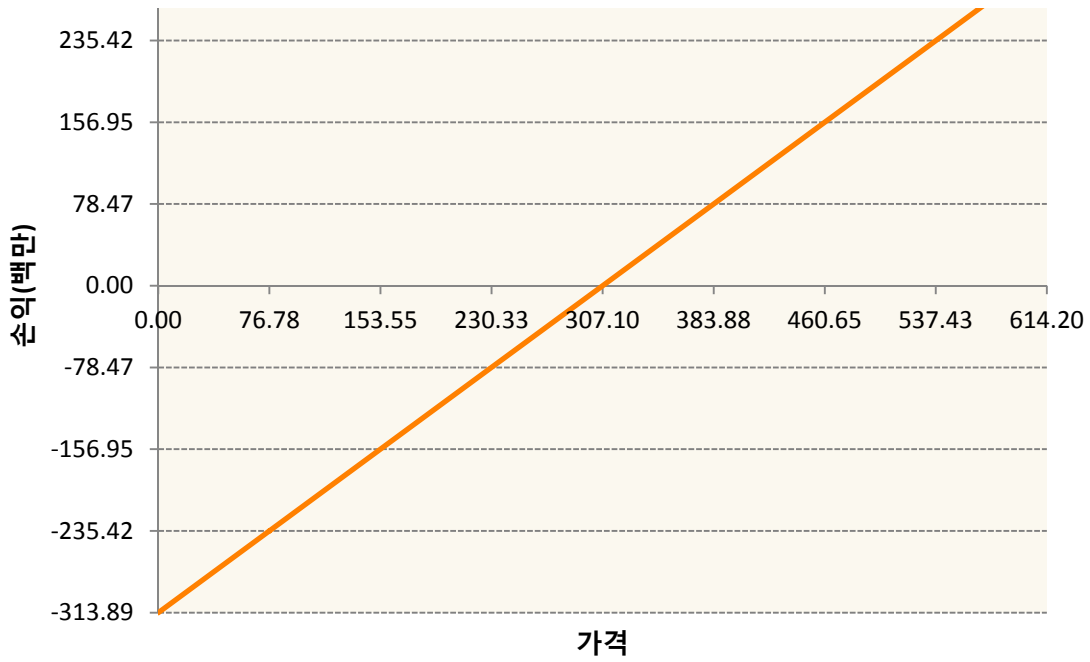


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19



SMF9-SOYBEAN MEAL FUTR Jan19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOF9	SOYBEAN OIL FUTR Jan19	22
CH9	CORN FUTURE Mar19	67
CTH9	COTTON NO.2 FUTR Mar19	14
KCH9	COFFEE 'C' FUTURE Mar19	23
KR4175NC0(2018-12 달러선물)		6

KWH9	KC HRW WHEAT FUT Mar19	15
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	29
SF9	SOYBEAN FUTURE Jan19	56
SMF9	SOYBEAN MEAL FUTR Jan19	25
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	39

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

(단위:백만원)

317