

공시일	2018-12-04
기준일	2018-12-03

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)

71

공시일	2018-12-04
기준일	2018-12-03

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

1,086

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

534

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-12-04
기준일	2018-12-03

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

277

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

403

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-12-04
기준일	2018-12-03

유로인덱스모(주식-파생형)

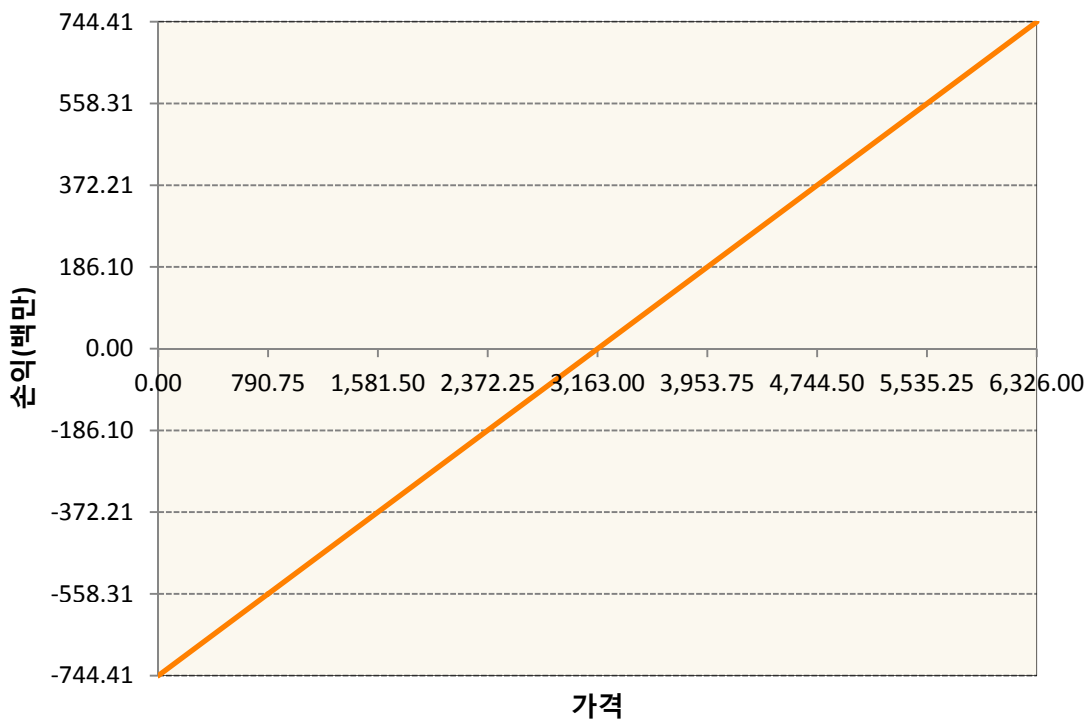
1. 계약금액

(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	60
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

38

공시일	2018-12-04
기준일	2018-12-03

차이나인덱스모(주식-파생형)

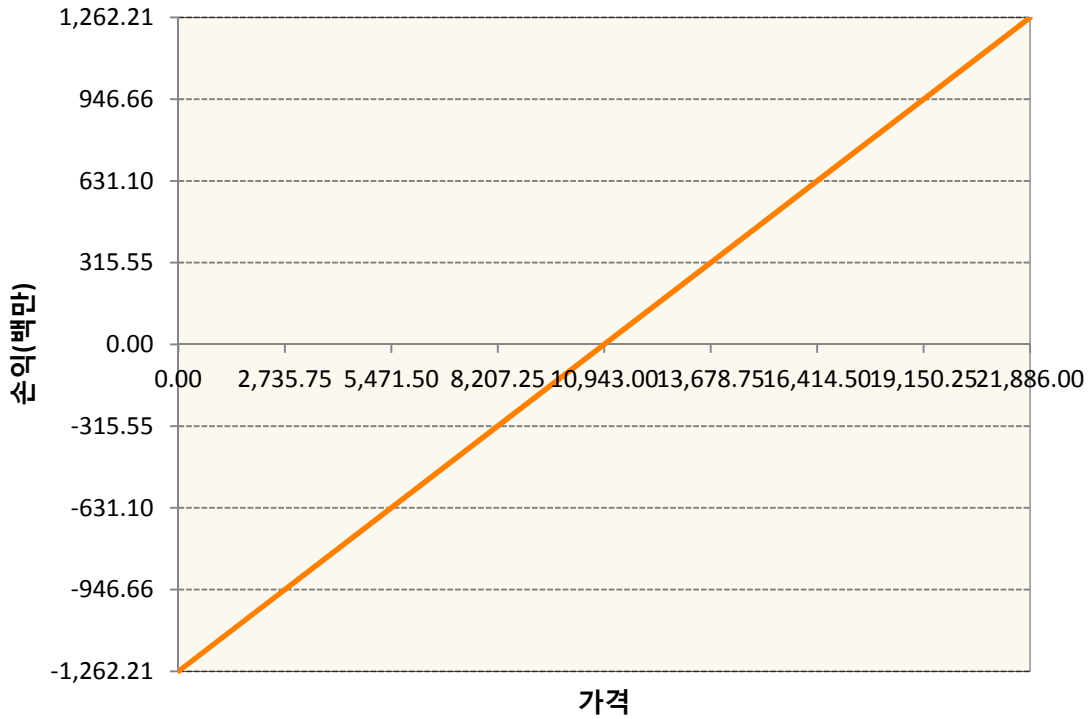
1. 계약금액

(단위:백만원)

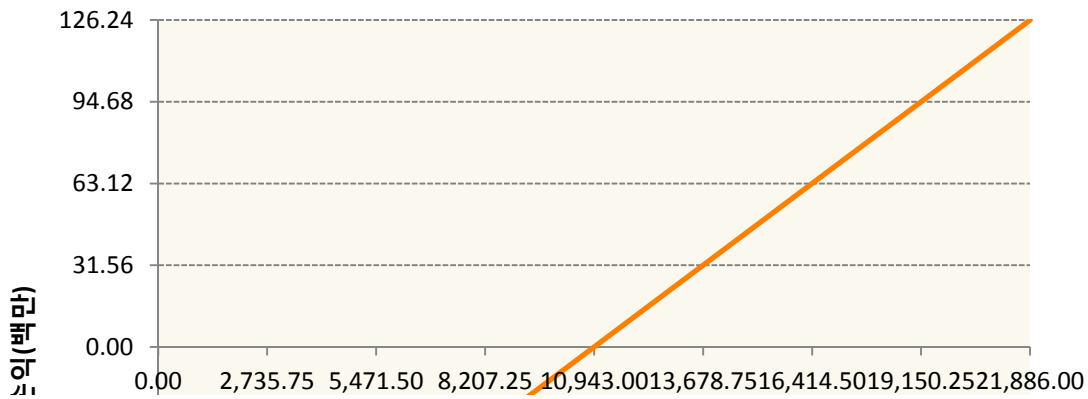
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,262	0	1,262	
누계	유가증권	선물	126	0	126	장내

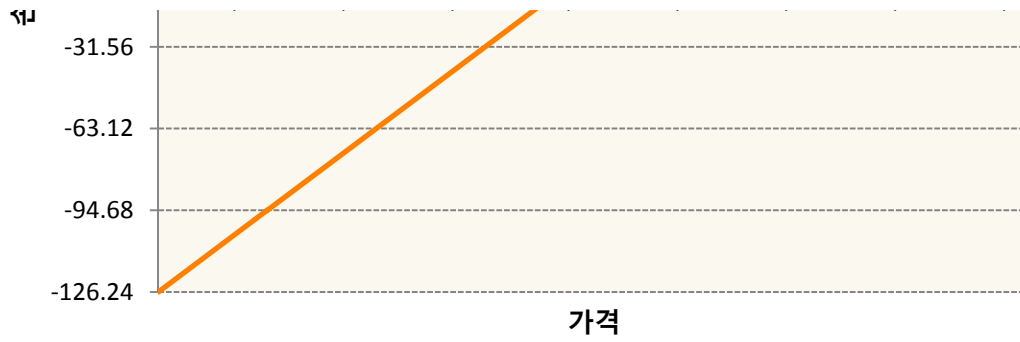
2. 만기시점의 손익구조

HCZ8-HSCEI FUTURES DEC 18



MHCZ8-MINI H-SHR IDX FU DEC18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCZ8	HSCEI FUTURES DEC 18	101
MHCZ8	MINI H-SHR IDX FU DEC18	10

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

99

공시일	2018-12-04
기준일	2018-12-03

커버드콜모(주식혼합-파생형)

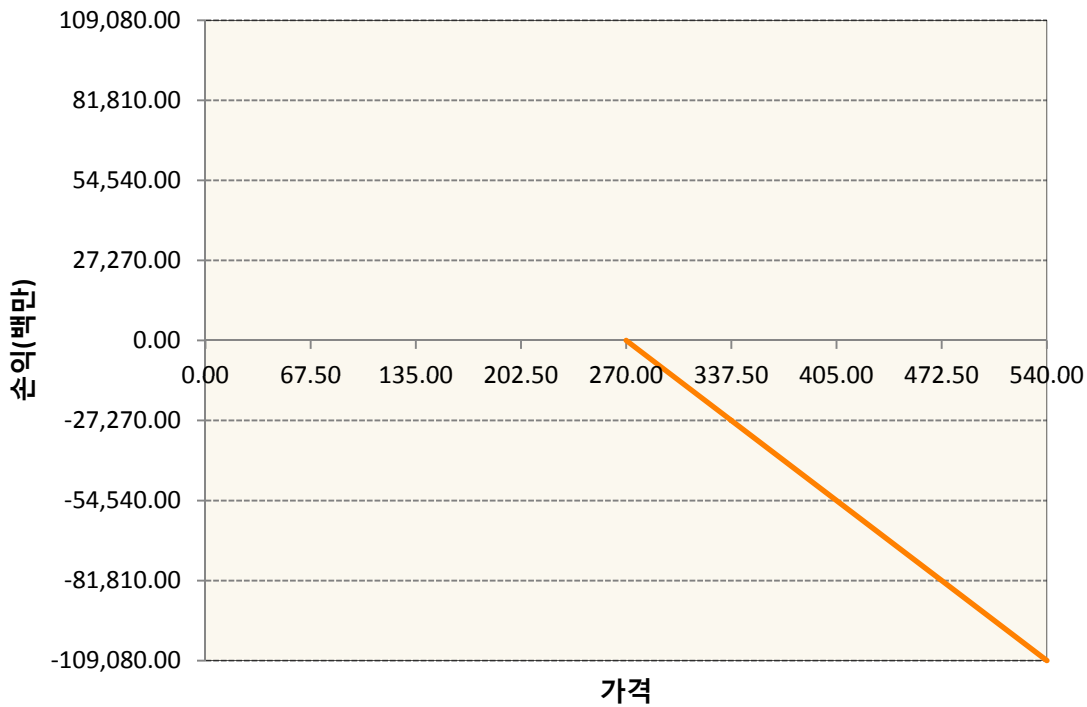
1. 계약금액

(단위:백만원)

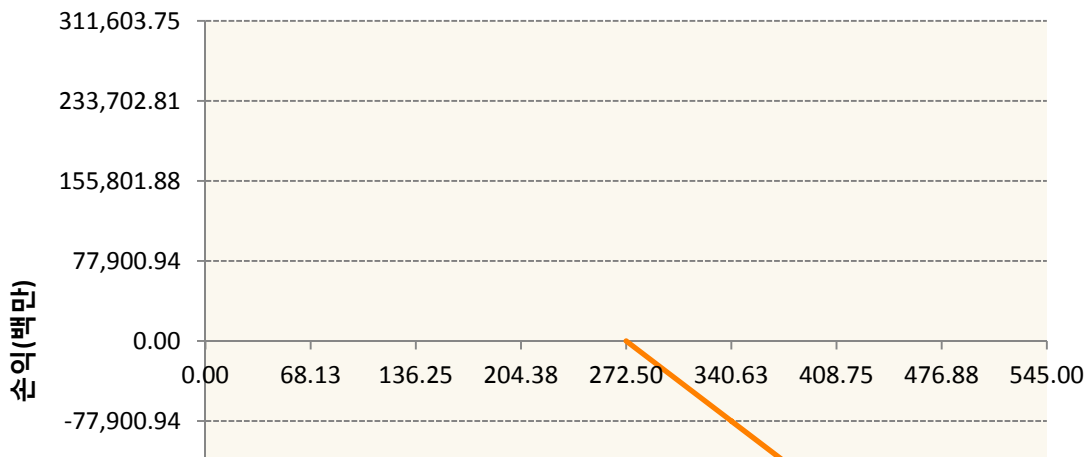
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	706,809	-706,809	장내

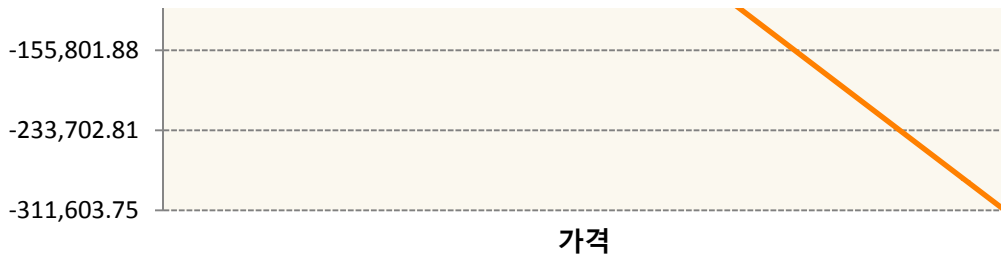
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NC2702-2018-12 콜270

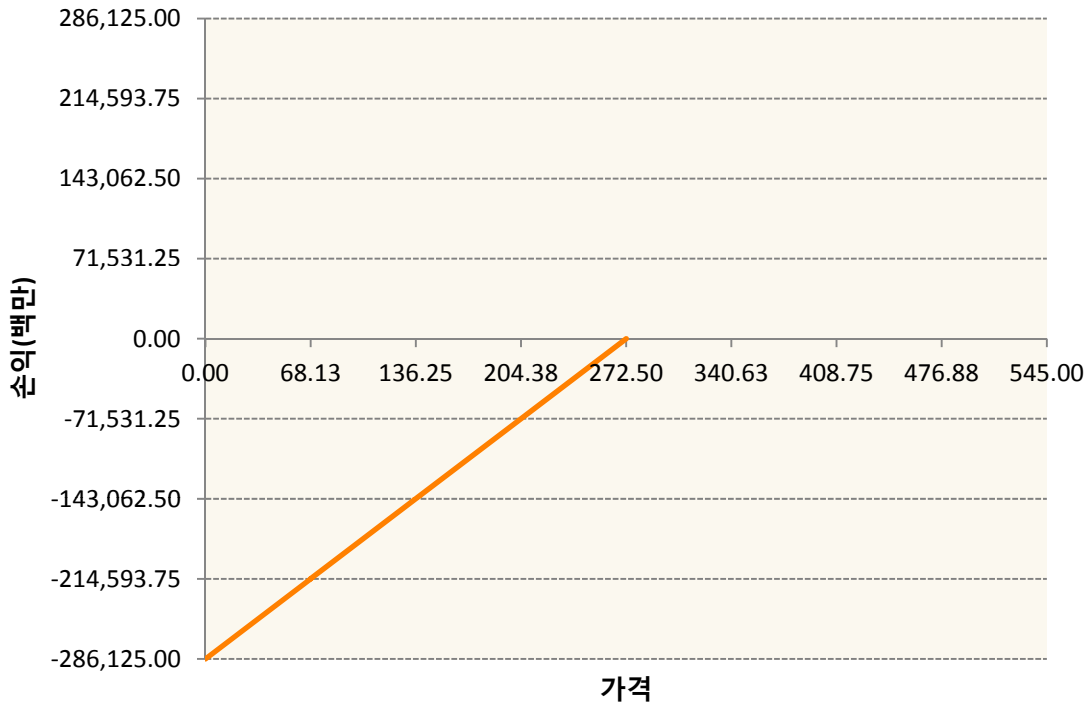


KR4201NC2728-2018-12 콜272.5





KR4301NC2727-2018-12 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NC2702		2018-12 콜270					8,026
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,424	3,386	3,337	3,277	3,207	3,128	3,042
-5.33%	3,142	3,034	2,917	2,794	2,666	2,533	2,397
-2.67%	2,233	2,070	1,907	1,743	1,580	1,416	1,252
0%	425	288	146	0	-149	-300	-453
2.67%	-2,104	-2,172	-2,251	-2,341	-2,440	-2,547	-2,661
5.33%	-4,967	-4,987	-5,017	-5,057	-5,106	-5,166	-5,234
8.00%	-7,923	-7,927	-7,935	-7,947	-7,966	-7,993	-8,026
KR4201NC2728		2018-12 콜272.5					21,845
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,927	7,859	7,763	7,639	7,487	7,310	7,109

-5.33%	7,441	7,205	6,938	6,646	6,333	6,002	5,656
-2.67%	5,587	5,153	4,713	4,269	3,821	3,371	2,918
0%	1,342	900	452	0	-455	-913	-1,373
2.67%	-5,228	-5,490	-5,782	-6,099	-6,438	-6,793	-7,163
5.33%	-13,104	-13,198	-13,325	-13,483	-13,671	-13,886	-14,126
8.00%	-21,417	-21,439	-21,476	-21,534	-21,614	-21,718	-21,845
KR4301NC2727 2018-12 풋272.5							17,822
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-17,749	-17,751	-17,754	-17,762	-17,775	-17,795	-17,822
-5.33%	-10,069	-10,111	-10,169	-10,244	-10,334	-10,439	-10,557
-2.67%	-3,182	-3,396	-3,617	-3,844	-4,076	-4,312	-4,552
0%	679	460	233	0	-237	-478	-722
2.67%	1,555	1,503	1,433	1,346	1,242	1,124	991
5.33%	1,618	1,615	1,608	1,595	1,574	1,544	1,504
8.00%	1,619	1,619	1,619	1,618	1,616	1,612	1,605

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

(단위:백만원)

51,500

공시일	2018-12-04
기준일	2018-12-03

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

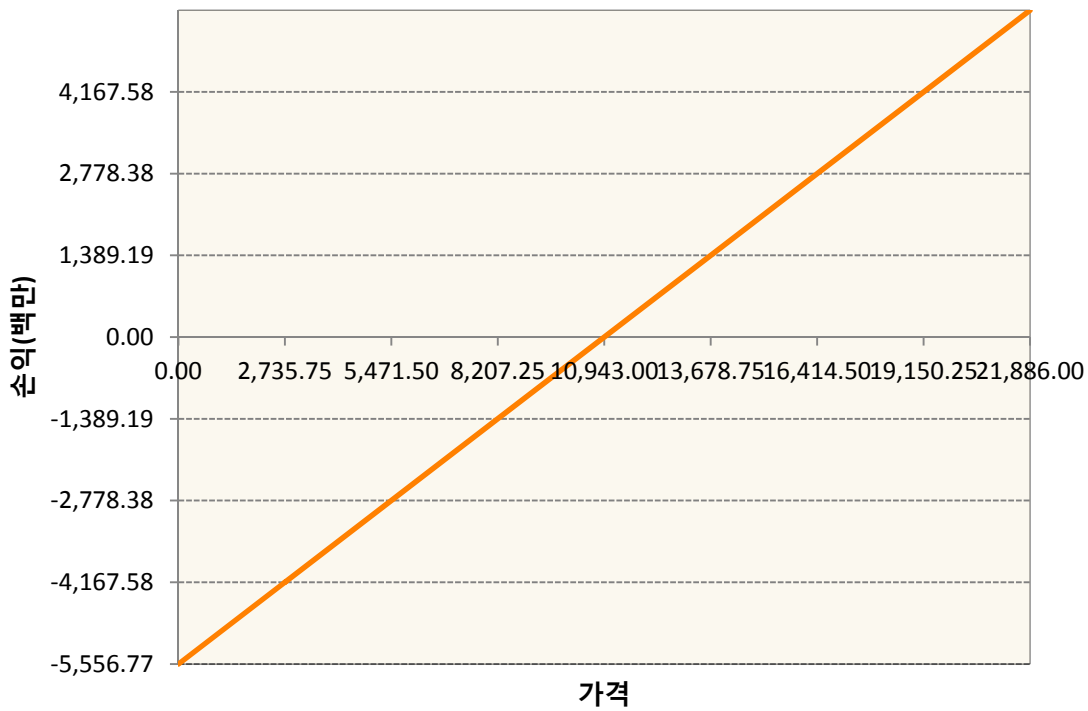
1. 계약금액

(단위:백만원)

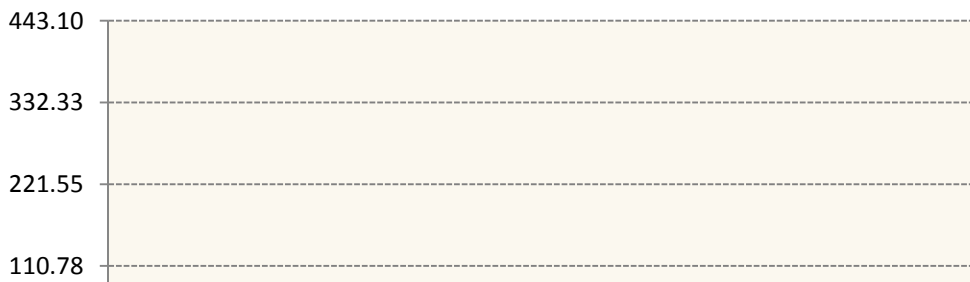
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,557	0	5,557	
누계	유가증권	옵션	0	11,876	-11,876	장내
누계	통화	선도	426	3,124	-2,698	장외

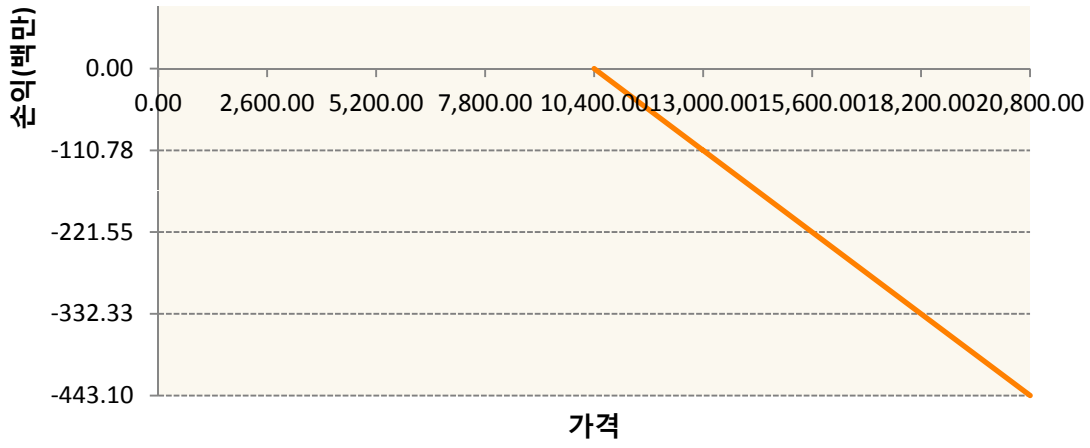
2. 만기시점의 손익구조

HCZ8-HSCEI FUTURES DEC 18

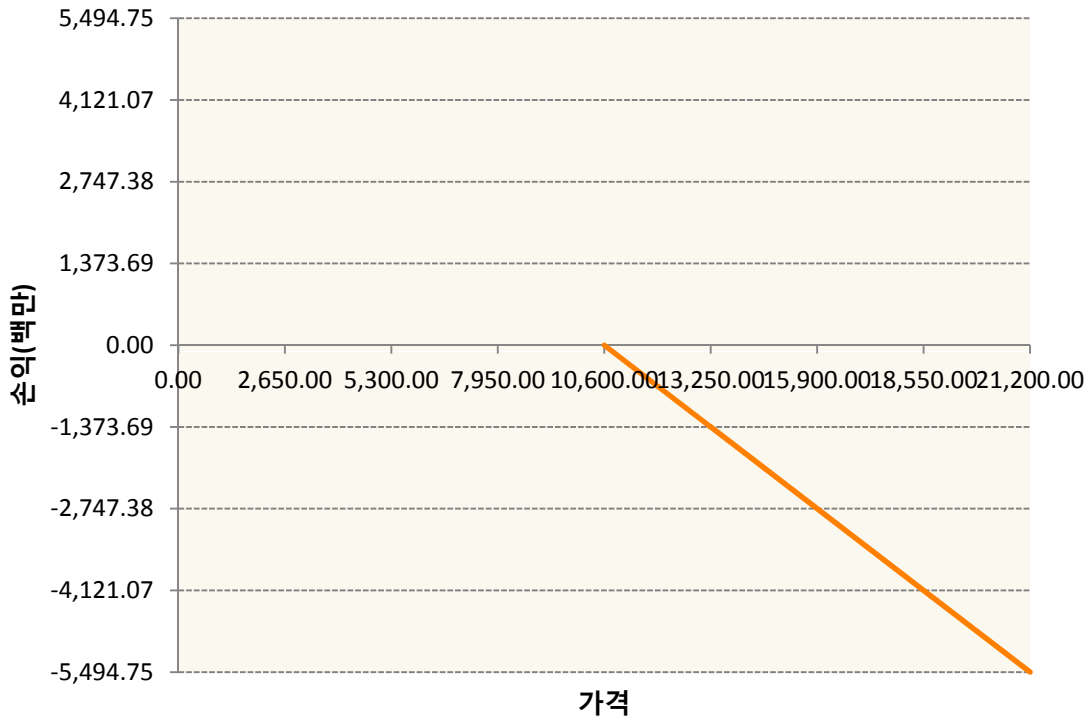


OHHIZ8-C104-HSCEI

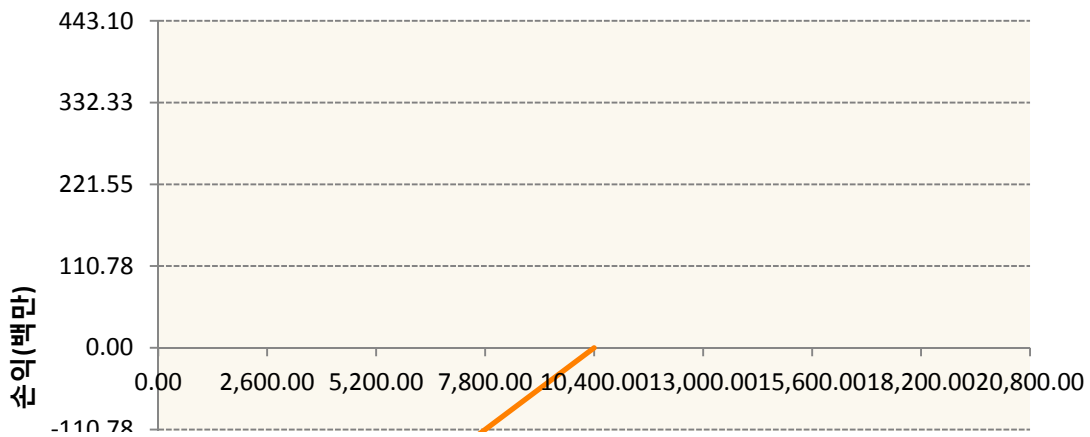


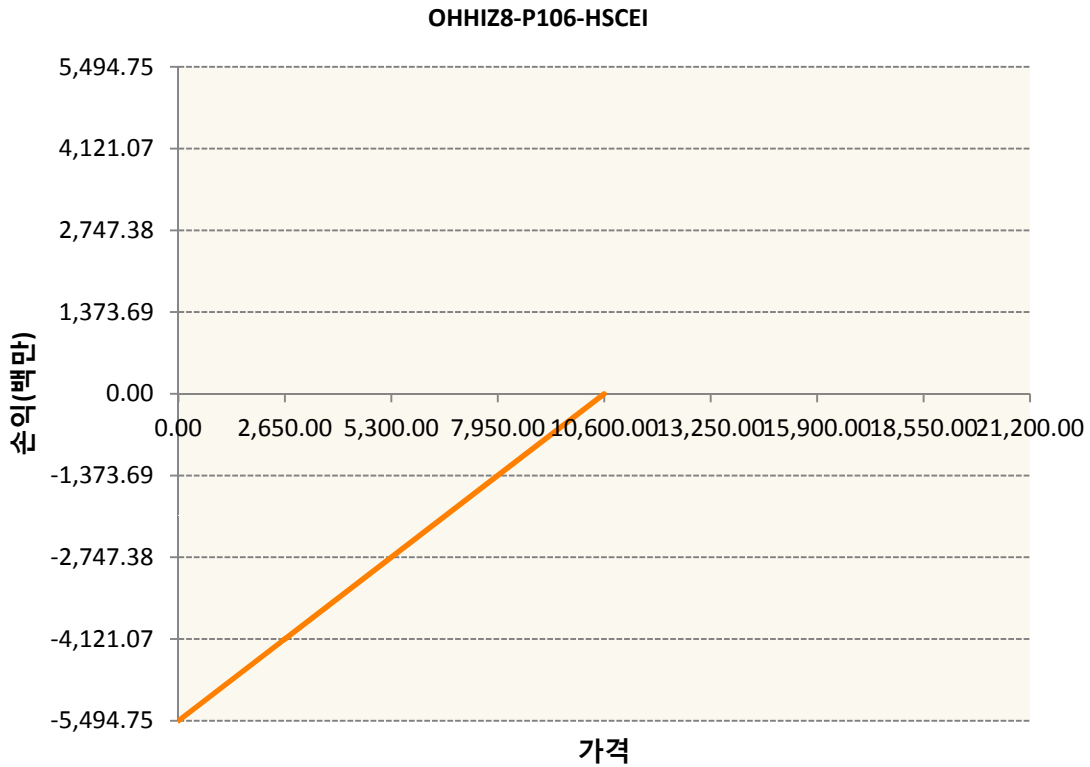
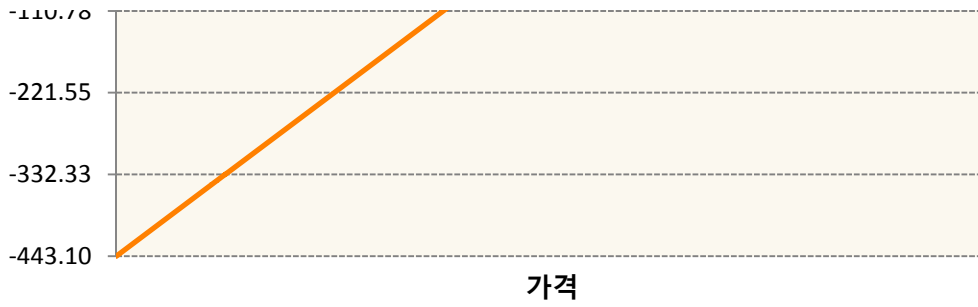


OHHIZ8-C106-HSCEI



OHHIZ8-P104-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21018U00 KRW/HKD 10-12-18E	216
FX21018U03 KRW/HKD 10-12-18E	34
FX21018V01 HKD/KRW 10-12-18E	34
HCZ8 HSCEI FUTURES DEC 18	445
OHHIZ8-C1C HSCEI	35
OHHIZ8-C1C HSCEI	440
OHHIZ8-P10 HSCEI	35
OHHIZ8-P10 HSCEI	440

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,446

공시일	2018-12-04
기준일	2018-12-03

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

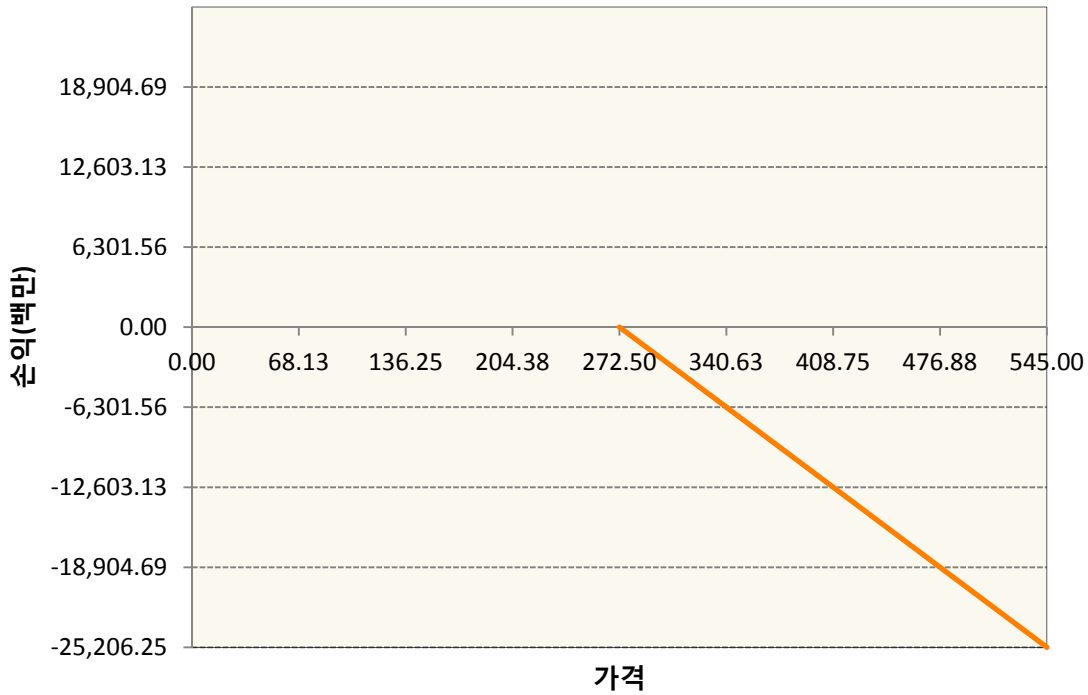
1. 계약금액

(단위:백만원)

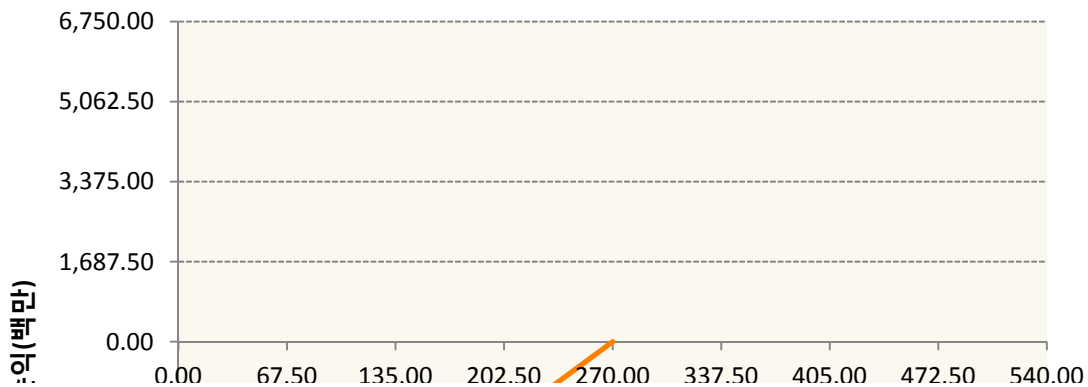
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	43,836	0	43,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	43,538	-43,538	장내

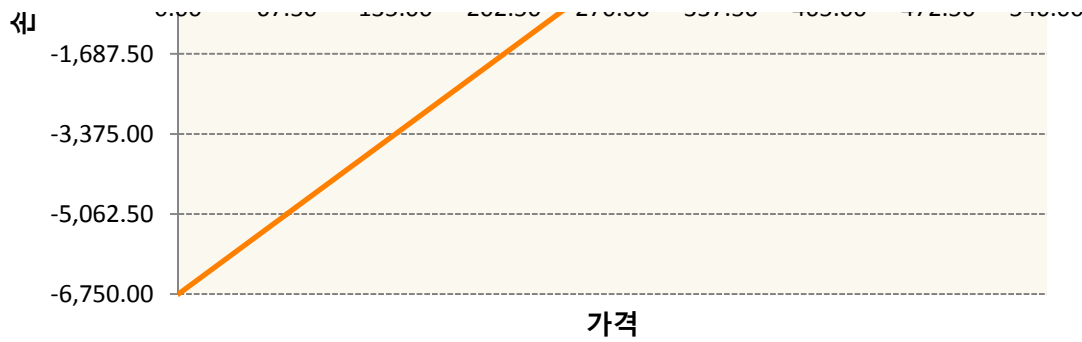
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NC2728-2018-12 콜272.5

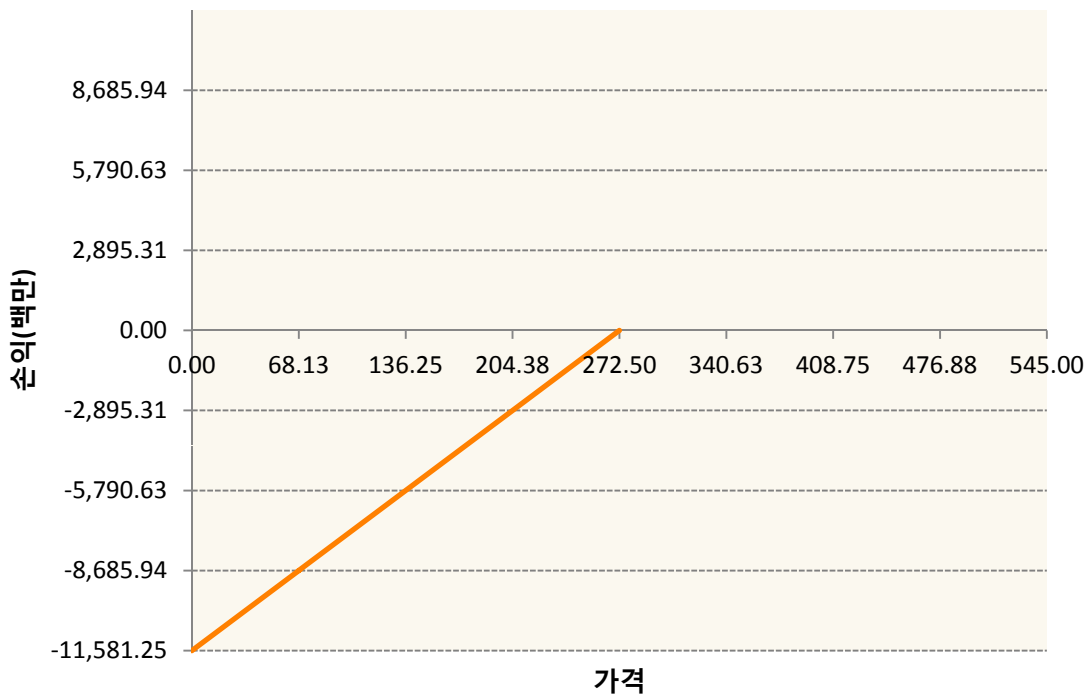


KR4301NC2701-2018-12 풋270





KR4301NC2727-2018-12 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14				3,580
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,580	-3,580	-3,580	-3,580	-3,580	-3,580	-3,580
-5.33%	-2,387	-2,387	-2,387	-2,387	-2,387	-2,387	-2,387
-2.67%	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,193	1,193	1,193	1,193	1,193	1,193	1,193
5.33%	2,387	2,387	2,387	2,387	2,387	2,387	2,387
8.00%	3,580	3,580	3,580	3,580	3,580	3,580	3,580
	KR4201NC2728		2018-12 콜272.5				1,767
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	641	636	628	618	606	591	575
-5.33%	602	583	561	538	512	485	458
-2.67%	452	417	381	345	309	273	236
0%	109	73	37	0	-37	-74	-111
2.67%	-423	-444	-468	-493	-521	-550	-579
5.33%	-1,060	-1,068	-1,078	-1,091	-1,106	-1,123	-1,143
8.00%	-1,732	-1,734	-1,737	-1,742	-1,748	-1,757	-1,767

KR4301NC2701 2018-12 풋270 380

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-377	-377	-377	-377	-378	-379	-380
-5.33%	-196	-198	-201	-203	-207	-210	-214
-2.67%	-50	-56	-62	-68	-74	-81	-87
0%	12	8	4	0	-5	-9	-14
2.67%	22	21	20	19	18	16	14
5.33%	22	22	22	22	22	21	21
8.00%	22	22	22	22	22	22	22

KR4301NC2727 2018-12 풋272.5 721

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-718	-718	-719	-719	-719	-720	-721
-5.33%	-408	-409	-412	-415	-418	-423	-427
-2.67%	-129	-137	-146	-156	-165	-175	-184
0%	27	19	9	0	-10	-19	-29
2.67%	63	61	58	54	50	45	40
5.33%	65	65	65	65	64	62	61
8.00%	66	66	66	65	65	65	65

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

(단위:백만원)

6,624

공시일	2018-12-04
기준일	2018-12-03

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

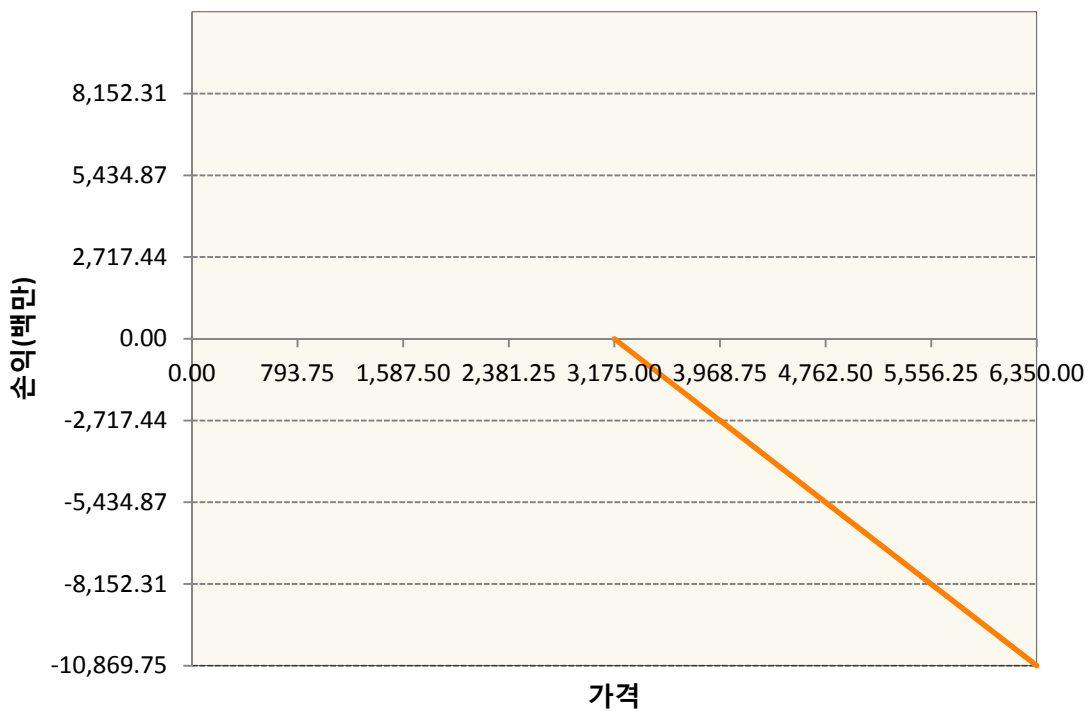
1. 계약금액

(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	8,086	0	8,086	
누계	유가증권	스왑	70,557	0	70,557	장외
누계	유가증권	옵션	0	28,288	-28,288	장내
누계	통화	선도	0	15,159	-15,159	장외

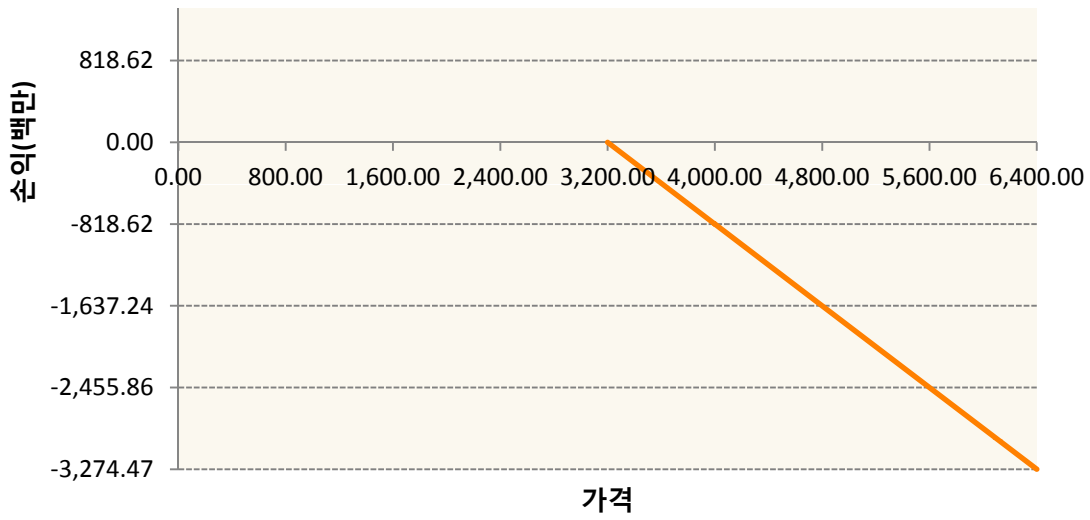
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ8-C3175-EURO STOXX 50

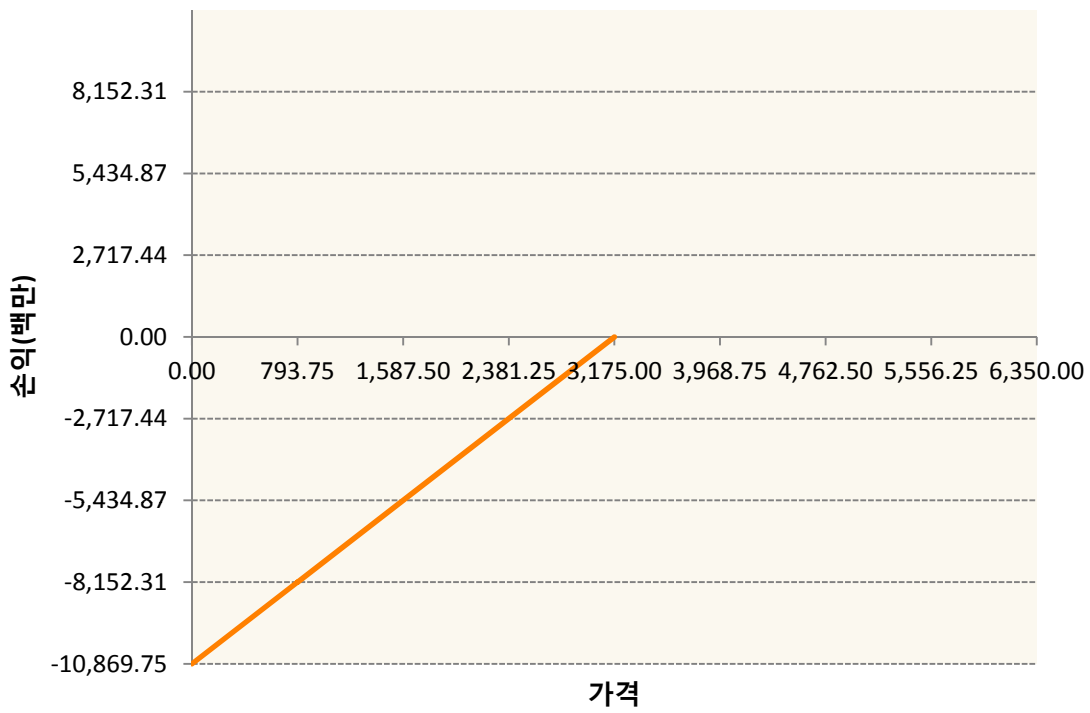


OESXZ8-C3200-EURO STOXX 50

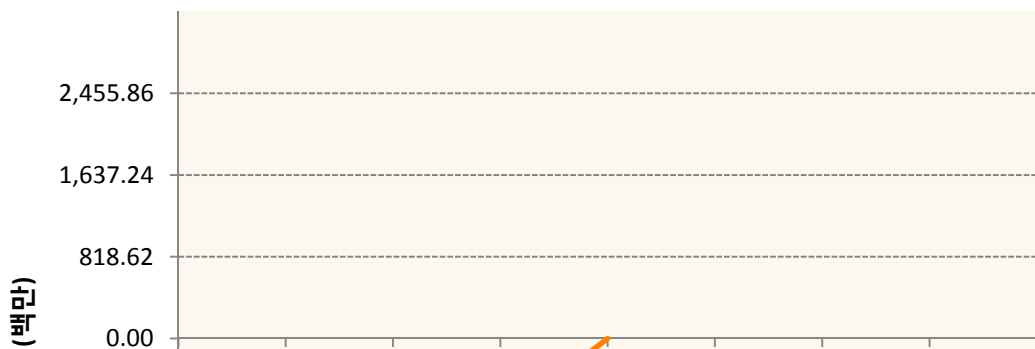


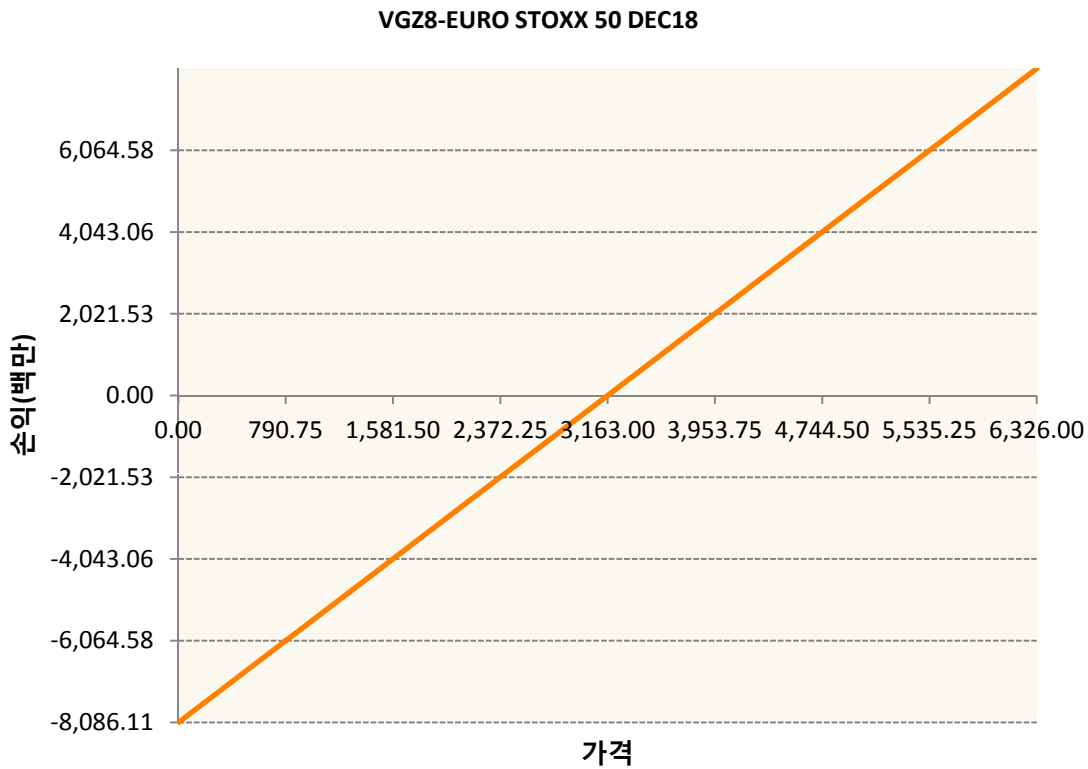
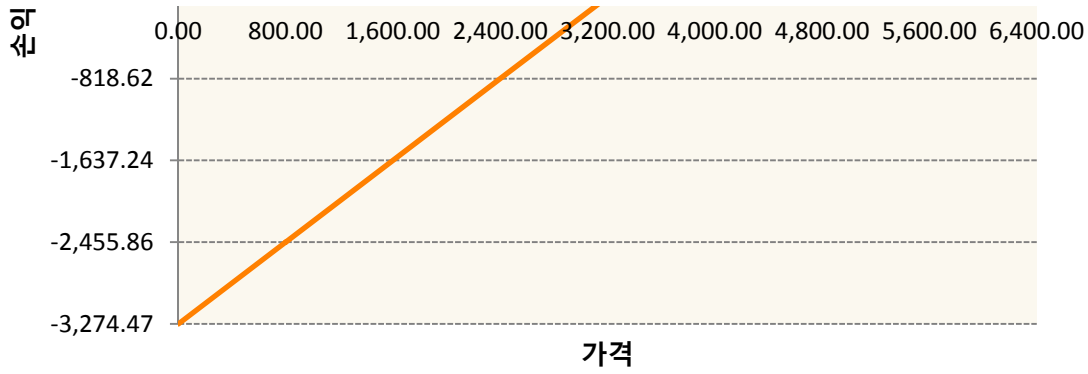


OESXZ8-P3175-EURO STOXX 50



OESXZ8-P3200-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		57
FX21018U03 KRW/EUR 21-12-18E		808
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E		404
OESXZ8-C31 EURO STOXX 50		870
OESXZ8-C32 EURO STOXX 50		262
OESXZ8-P31 EURO STOXX 50		870
OESXZ8-P32 EURO STOXX 50		262
VGZ8	EURO STOXX 50 DEC18	647

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

(단위:백만원)

2,579

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

(단위:백만원)

1,130

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

(단위:백만원)

95

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

(단위:백만원)

143

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

(단위:백만원)

43

공시일	2018-12-04
기준일	2018-12-03

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

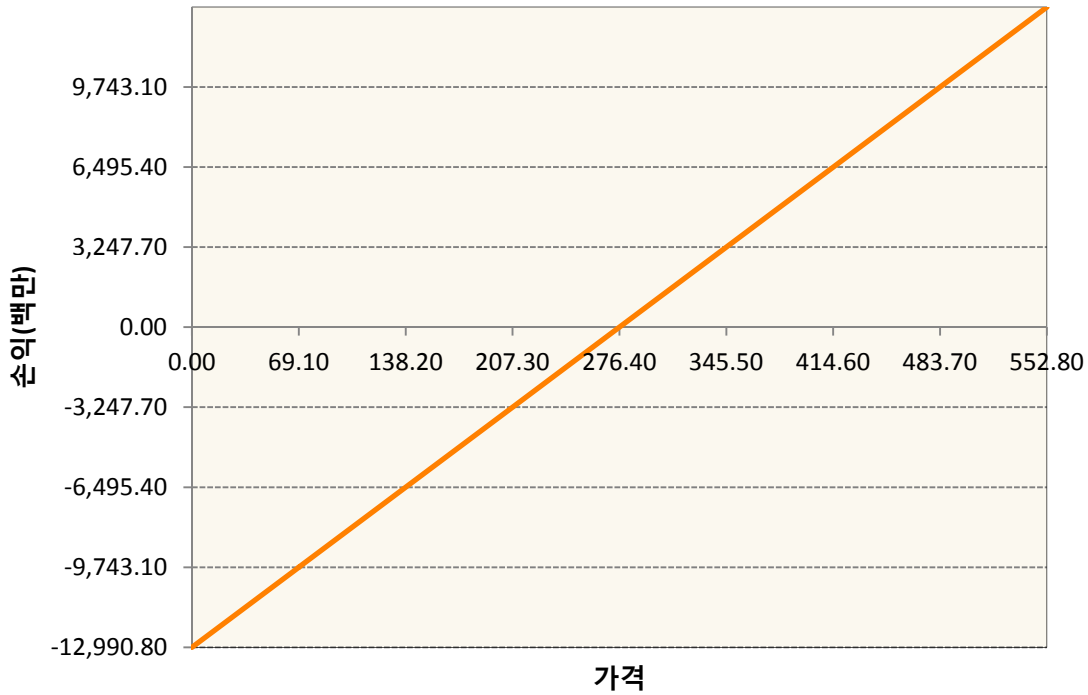
1. 계약금액

(단위:백만원)

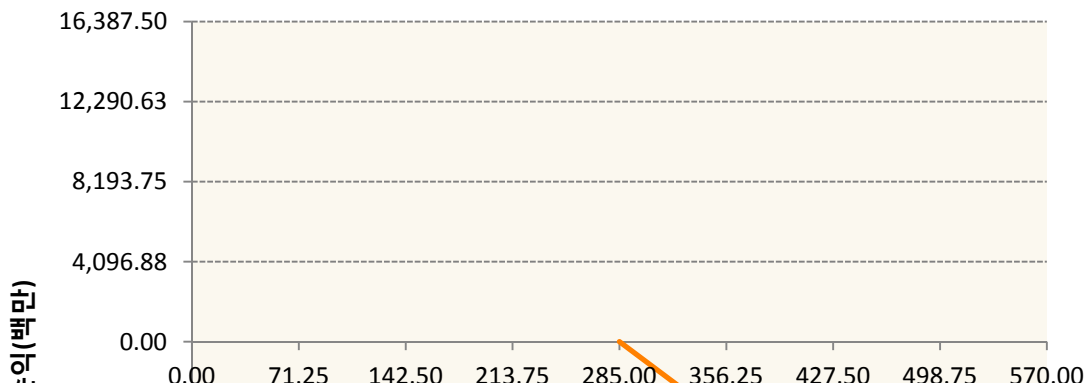
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,991	0	12,991	장내
누계	유가증권	옵션	3,743	23,072	-19,329	장내

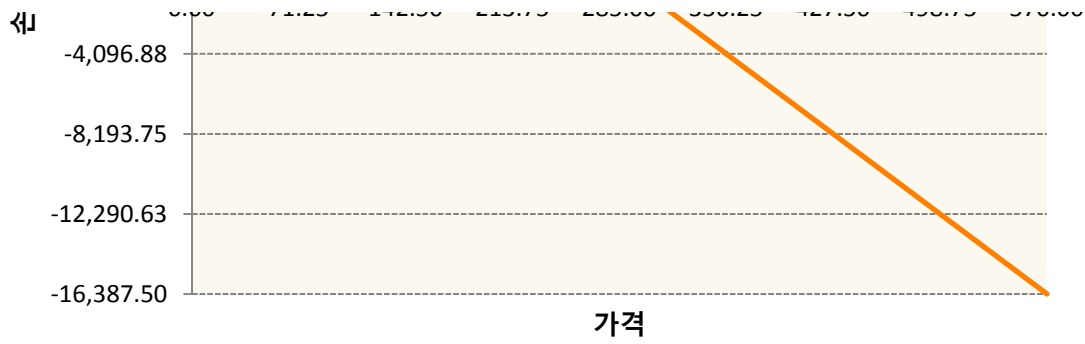
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

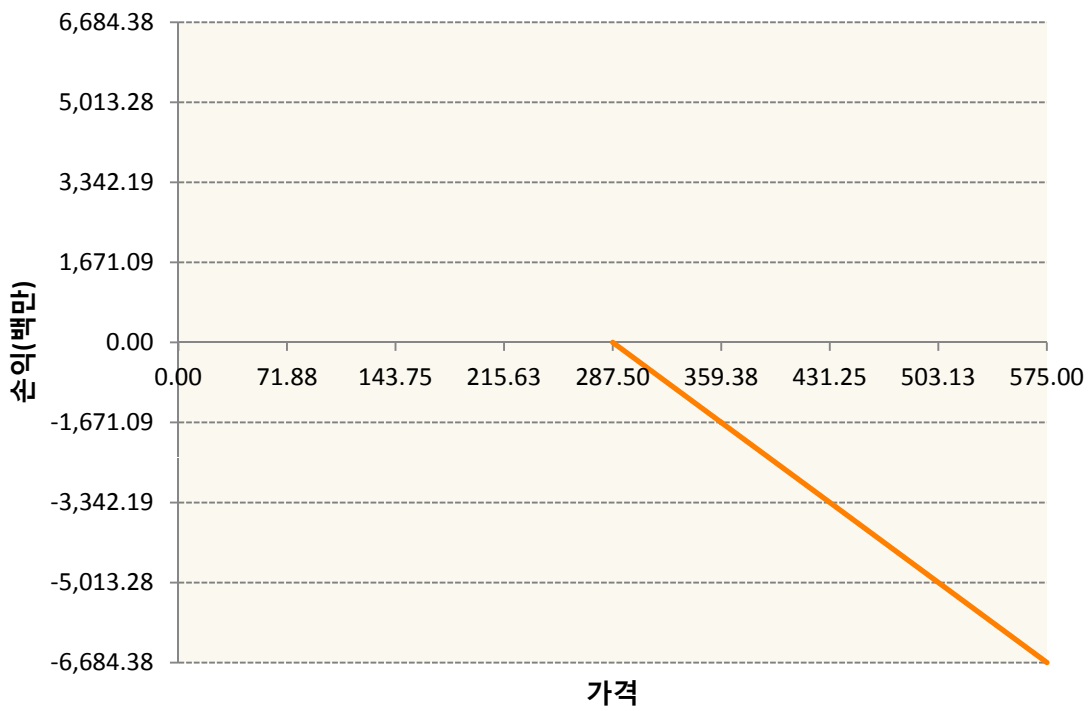


KR4201NC2850-2018-12 콜285

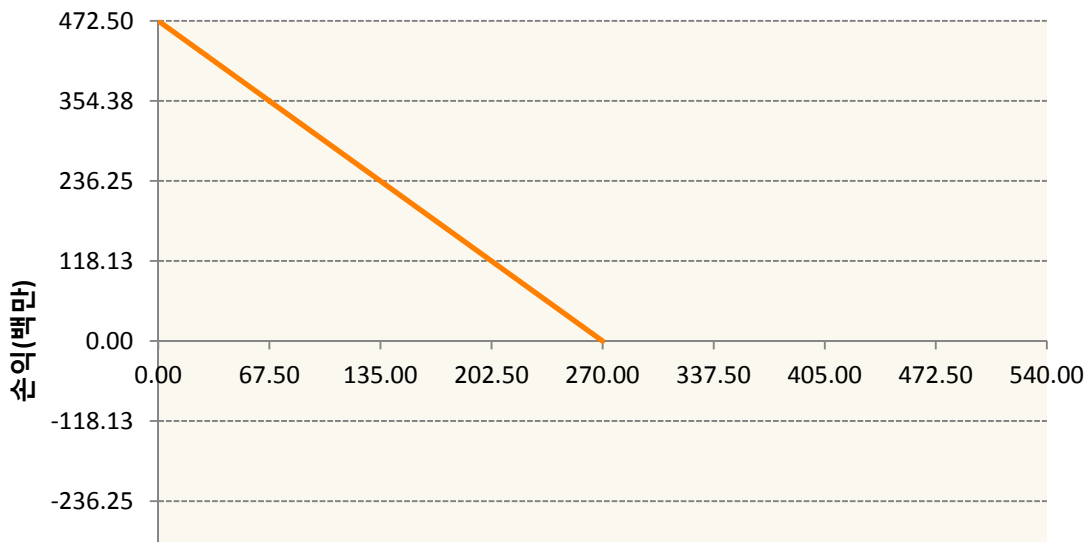


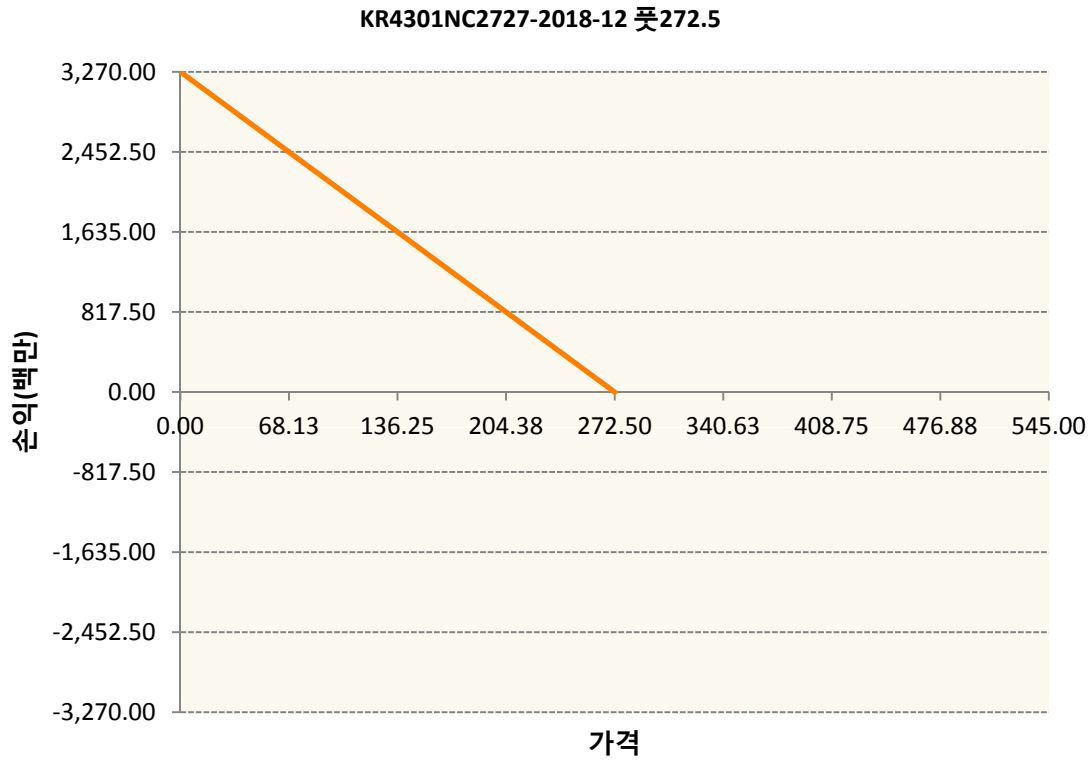
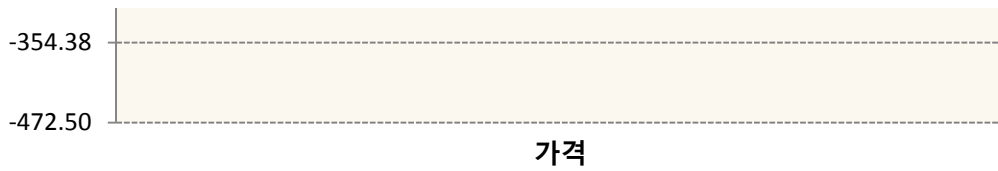


KR4201NC2876-2018-12 콜287.5



KR4301NC2701-2018-12 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0004		2018-12 코스피200지수선물						1,038
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,038	-1,038	-1,038	-1,038	-1,038	-1,038	-1,038	-1,038
-5.33%	-692	-692	-692	-692	-692	-692	-692	-692
-2.67%	-346	-346	-346	-346	-346	-346	-346	-346
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	346	346	346	346	346	346	346	346
5.33%	692	692	692	692	692	692	692	692
8.00%	1,038	1,038	1,038	1,038	1,038	1,038	1,038	1,038
KR4201NC2850		2018-12 콜285						769
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	105	105	105	104	103	101	99	
-5.33%	105	103	101	98	93	87	81	
-2.67%	96	90	82	72	61	48	35	

0%	53	36	19	0	-19	-40	-60
2.67%	-76	-101	-125	-150	-174	-199	-223
5.33%	-327	-348	-370	-393	-415	-438	-462
8.00%	-679	-690	-704	-718	-734	-751	-769
KR4201NC2876 2018-12 콜287.5							279
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	31	31	30	30	30	29	29
-5.33%	30	30	30	29	27	26	24
-2.67%	29	27	25	22	18	14	9
0%	18	12	6	0	-7	-14	-22
2.67%	-21	-30	-39	-49	-58	-68	-78
5.33%	-105	-115	-125	-134	-144	-154	-164
8.00%	-235	-242	-248	-255	-263	-271	-279
KR4301NC2701 2018-12 풋270							27
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	26	26	26	26	26	27	27
-5.33%	14	14	14	14	14	15	15
-2.67%	4	4	4	5	5	6	6
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-2	-1	-1	-1	-1	-1	-1
5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-1	-1
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
KR4301NC2727 2018-12 풋272.5							204
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	203	203	203	203	203	203	204
-5.33%	115	116	116	117	118	119	121
-2.67%	36	39	41	44	47	49	52
0%	-8	-5	-3	0	3	5	8
2.67%	-18	-17	-16	-15	-14	-13	-11
5.33%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-17
8.00%	-19	-19	-19	-18	-18	-18	-18

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

(단위:백만원)

1,910

공시일	2018-12-04
기준일	2018-12-03

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	124	0	124	

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	2018-12-04
기준일	2018-12-03

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	1,439	0	1,439	

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	2018-12-04
기준일	2018-12-03

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	180	0	180	
누계	통화	선도	0	188	-188	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21018X01 KRW/USD 13-12-18E		9
FX21018X04 KRW/USD 28-02-19E		2
FX21018X04 KRW/USD 28-02-19E		3
FX21018X04 KRW/USD 28-02-19E		1

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

(단위:백만원)

6

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

(단위:백만원)

153

공시일	2018-12-04
기준일	2018-12-03

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

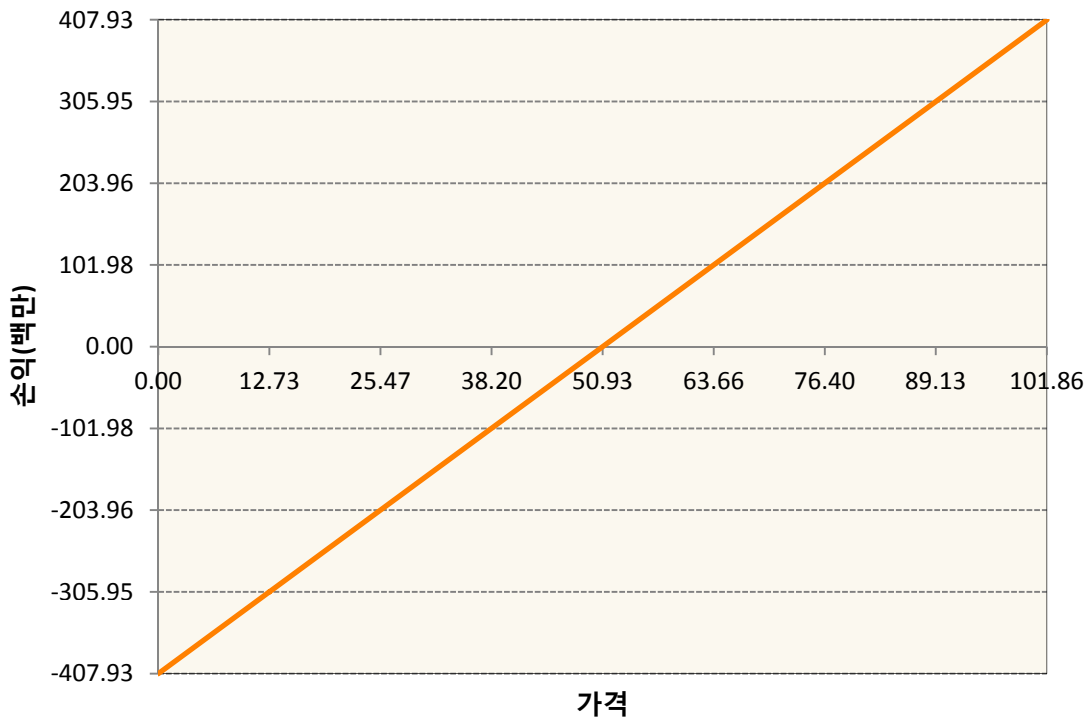
1. 계약금액

(단위:백만원)

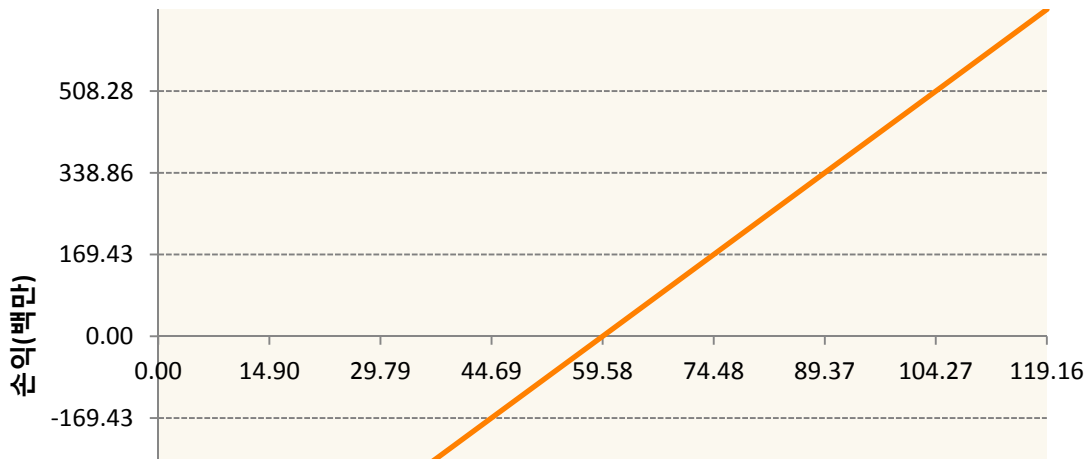
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,008	255	2,752	

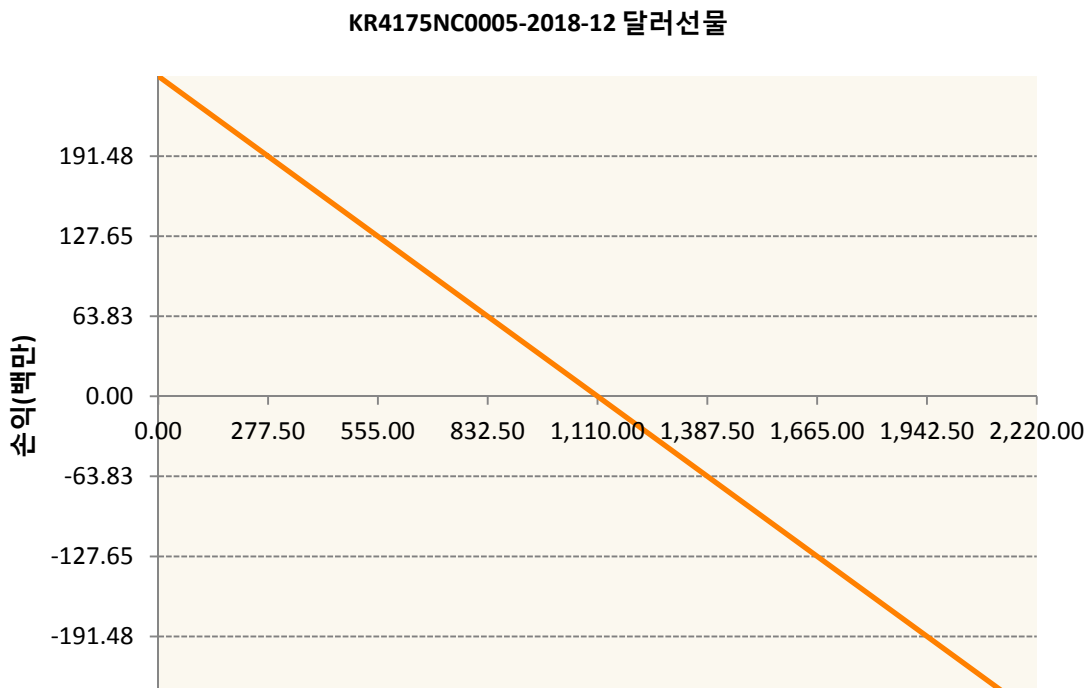
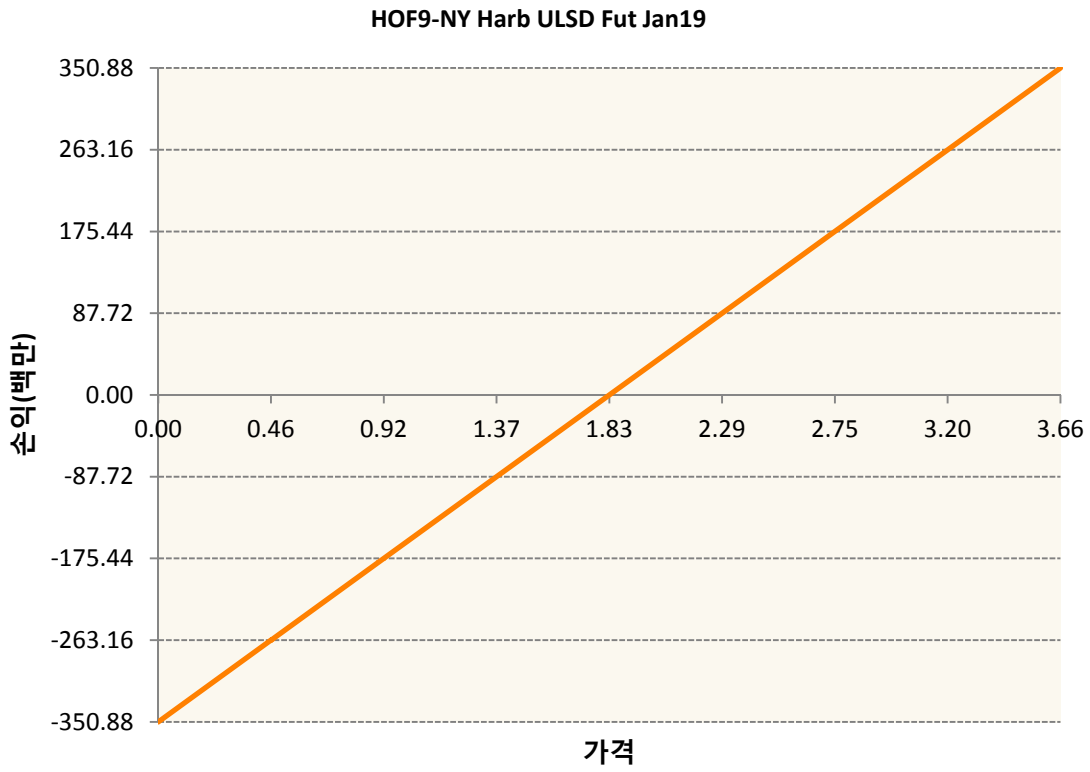
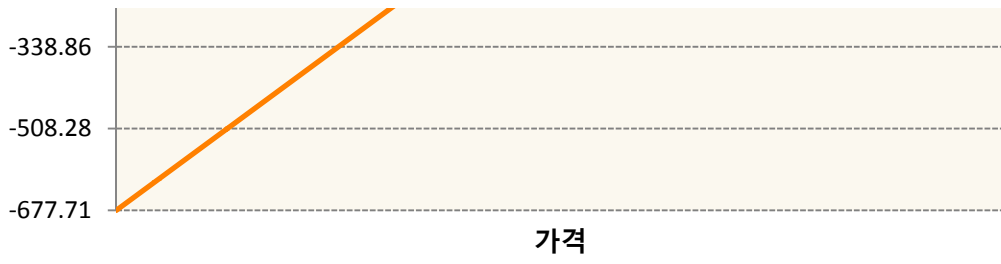
2. 만기시점의 손익구조

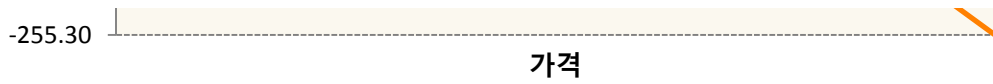
CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19



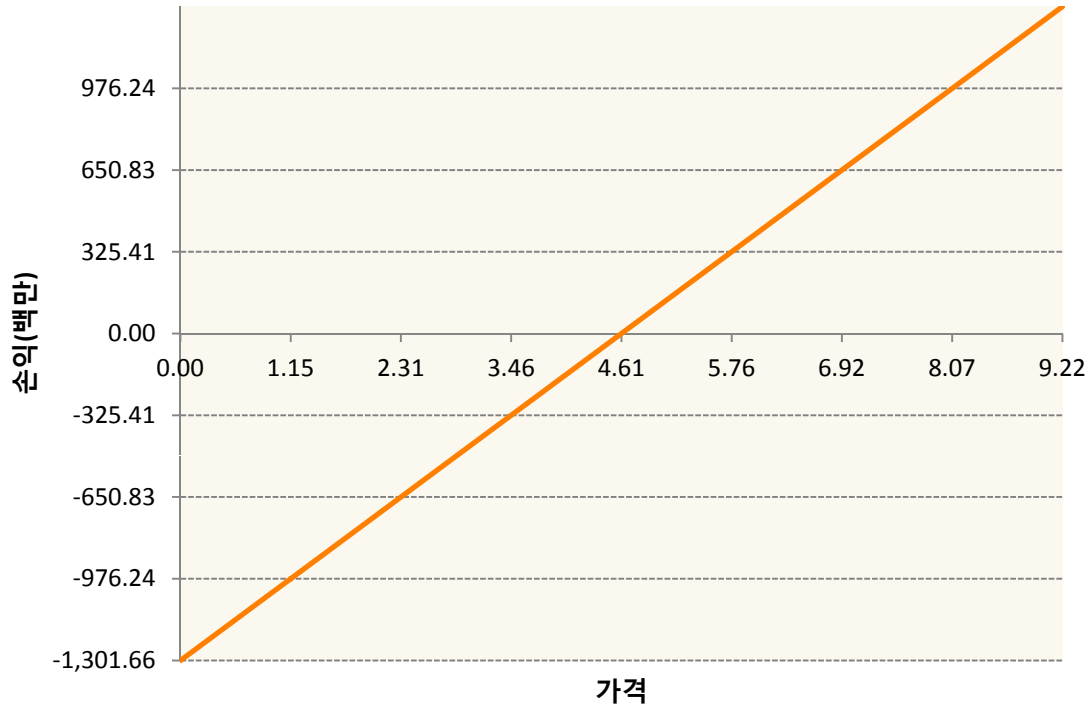
COH9-BRENT CRUDE FUTR Mar19



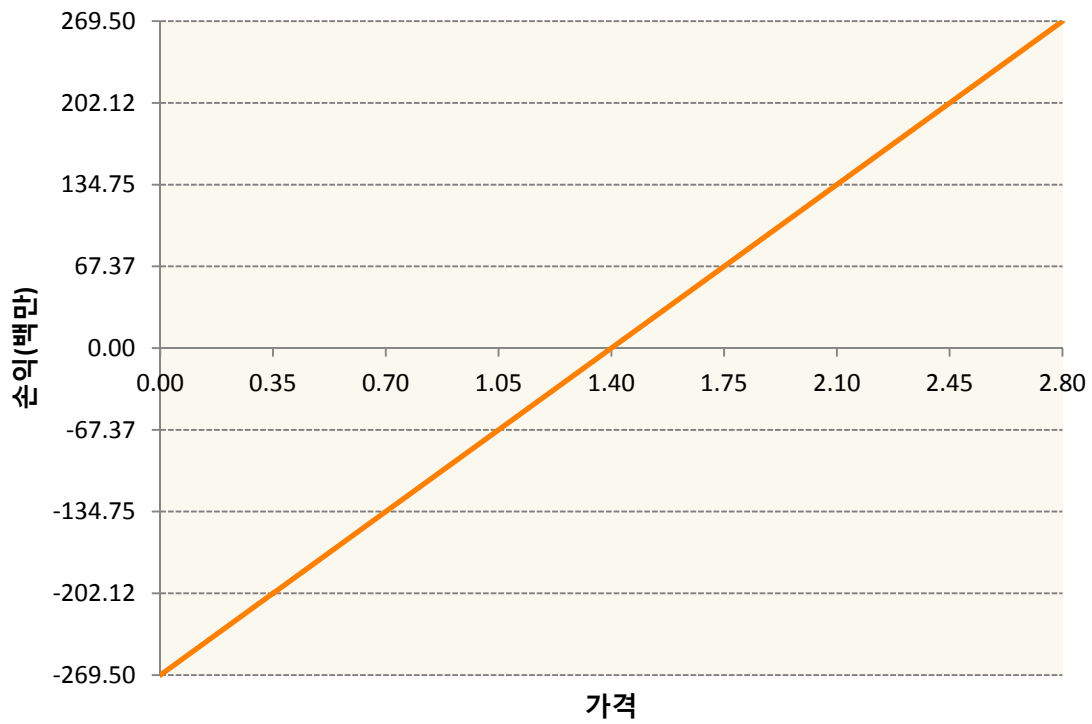




NGF19-NATURAL GAS FUTR Jan19



XBF9-GASOLINE RBOB FUT Jan19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF9	WTI CRUDE FUTURE Jan19	33
COH9	BRENT CRUDE FUTR Mar19	54
HOF9	NY Harb ULSD Fut Jan19	28
KR4175NC0	(2018-12 달러선물	20
NGF19	NATURAL GAS FUTR Jan19	104
XBF9	GASOLINE RBOB FUT Jan19	22

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

428

공시일	2018-12-04
기준일	2018-12-03

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

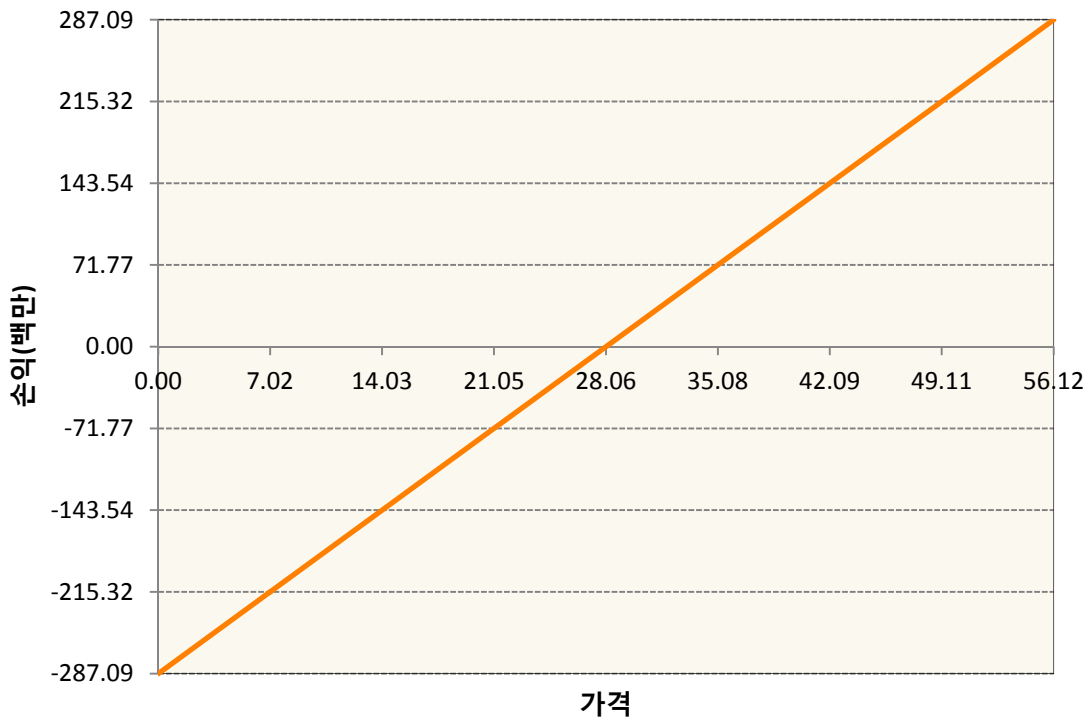
1. 계약금액

(단위:백만원)

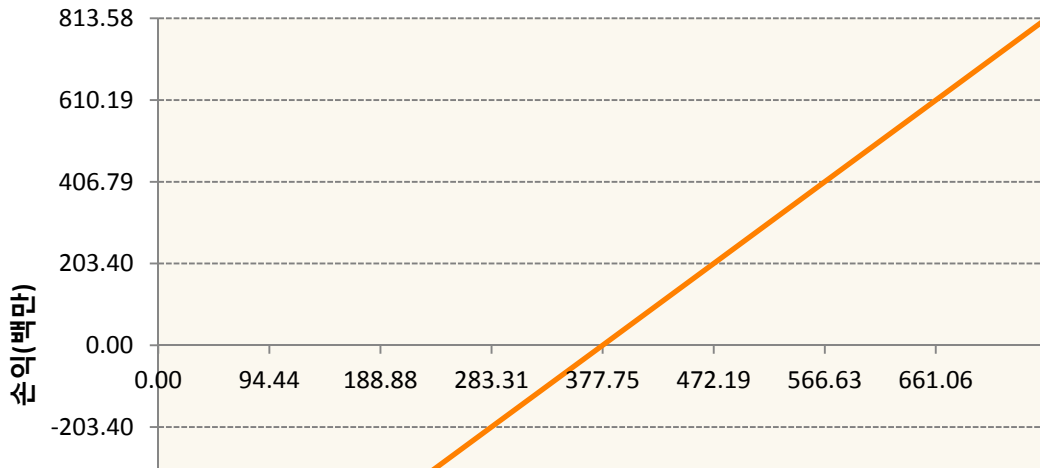
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,656	78	3,578	

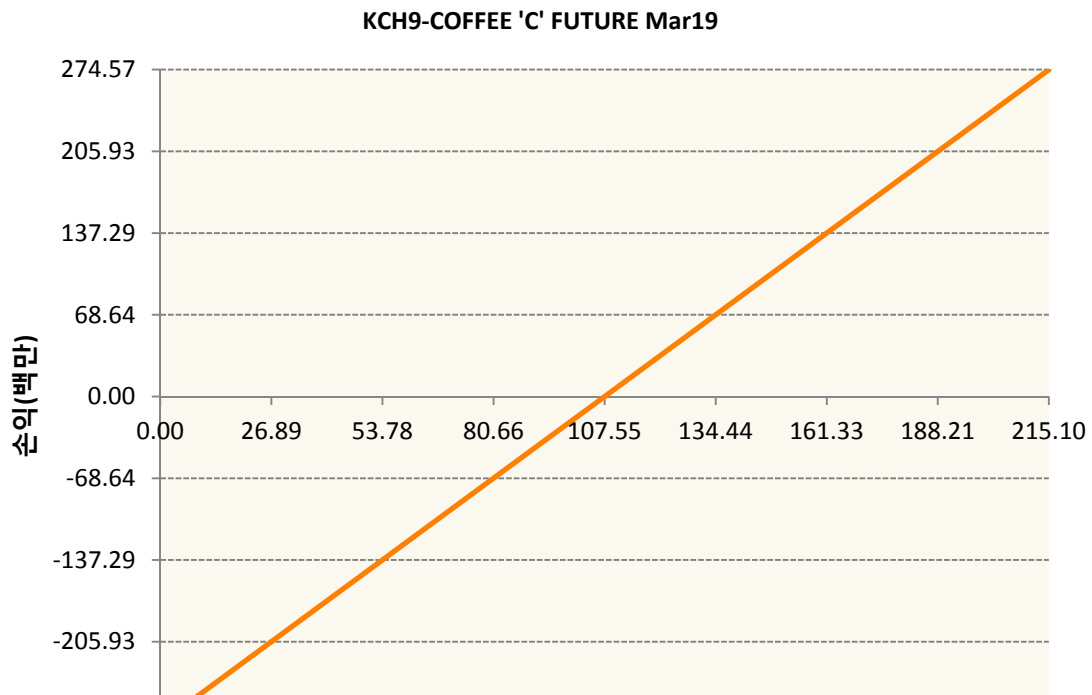
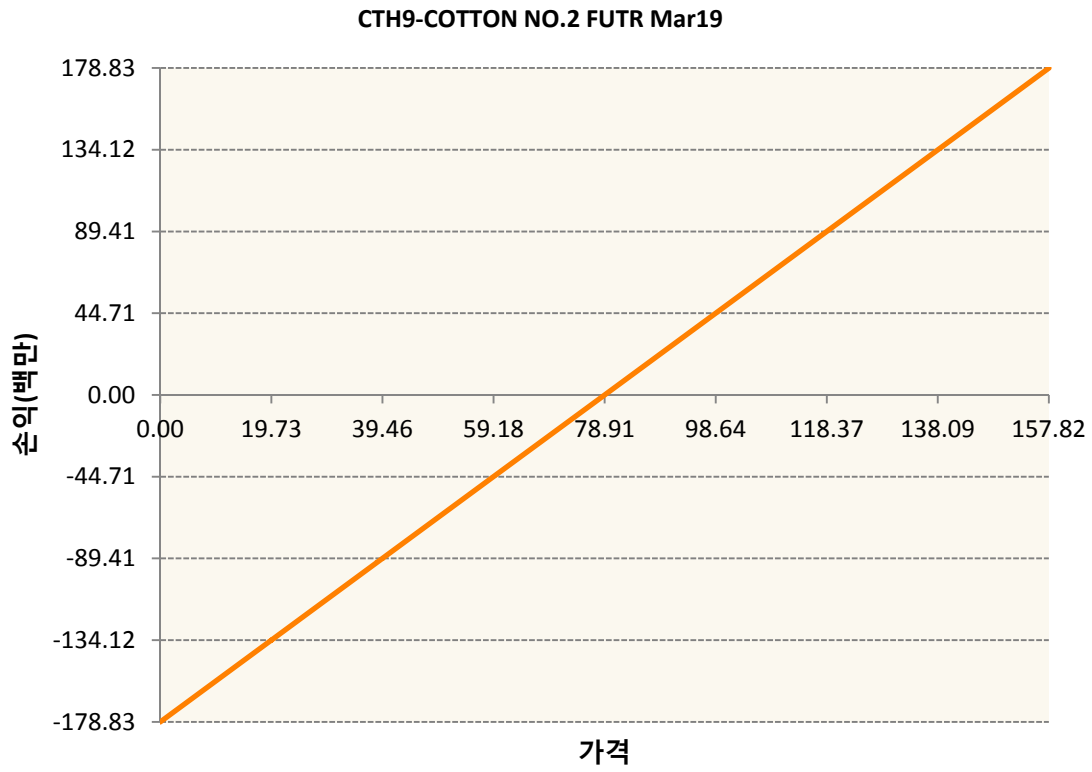
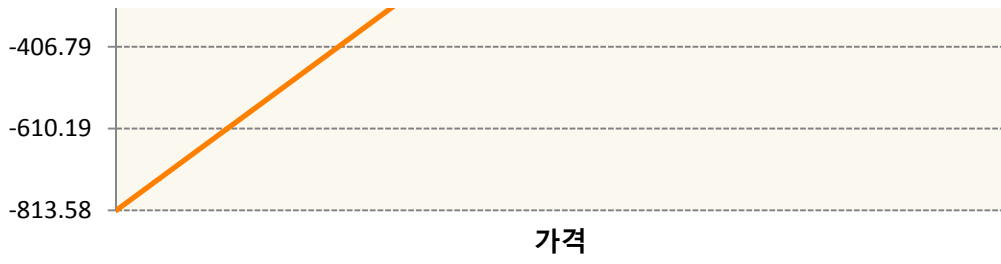
2. 만기시점의 손익구조

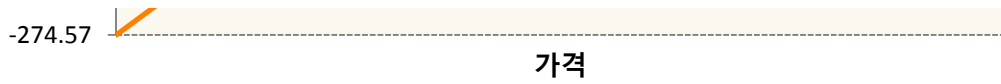
BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19



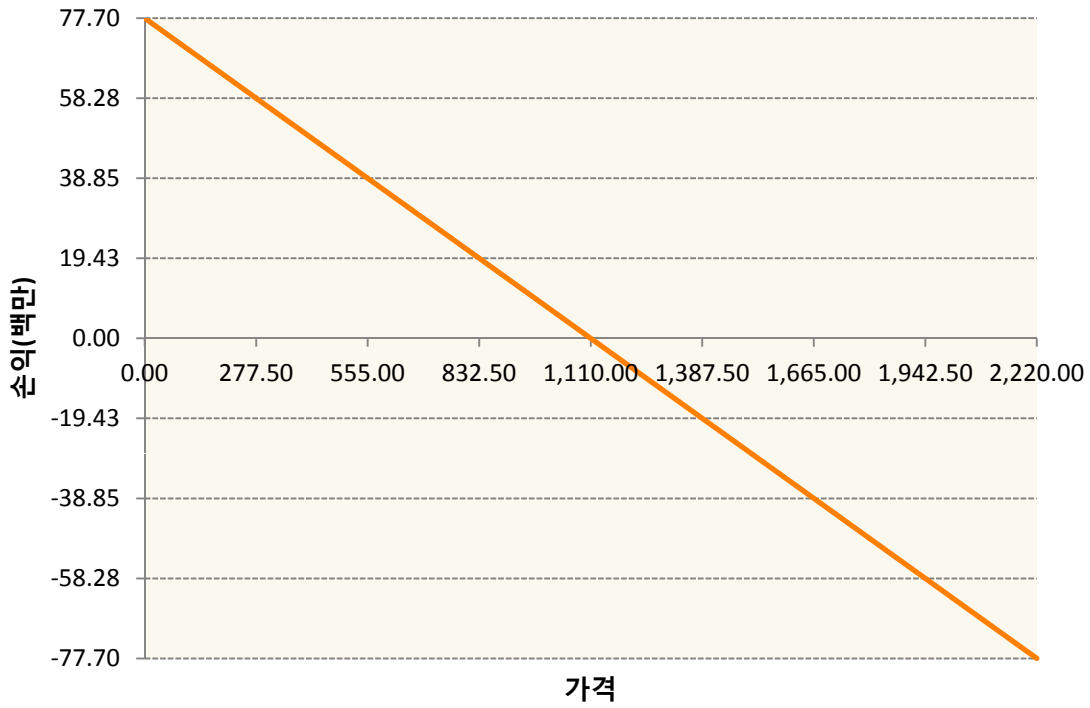
CH9-CORN FUTURE Mar19



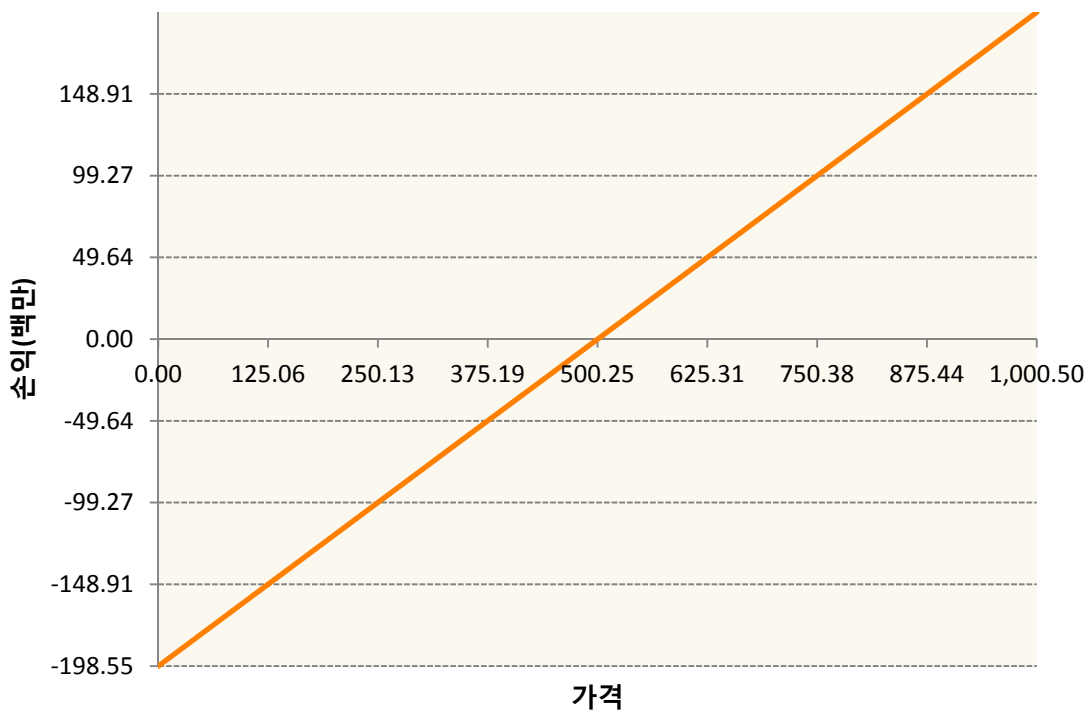




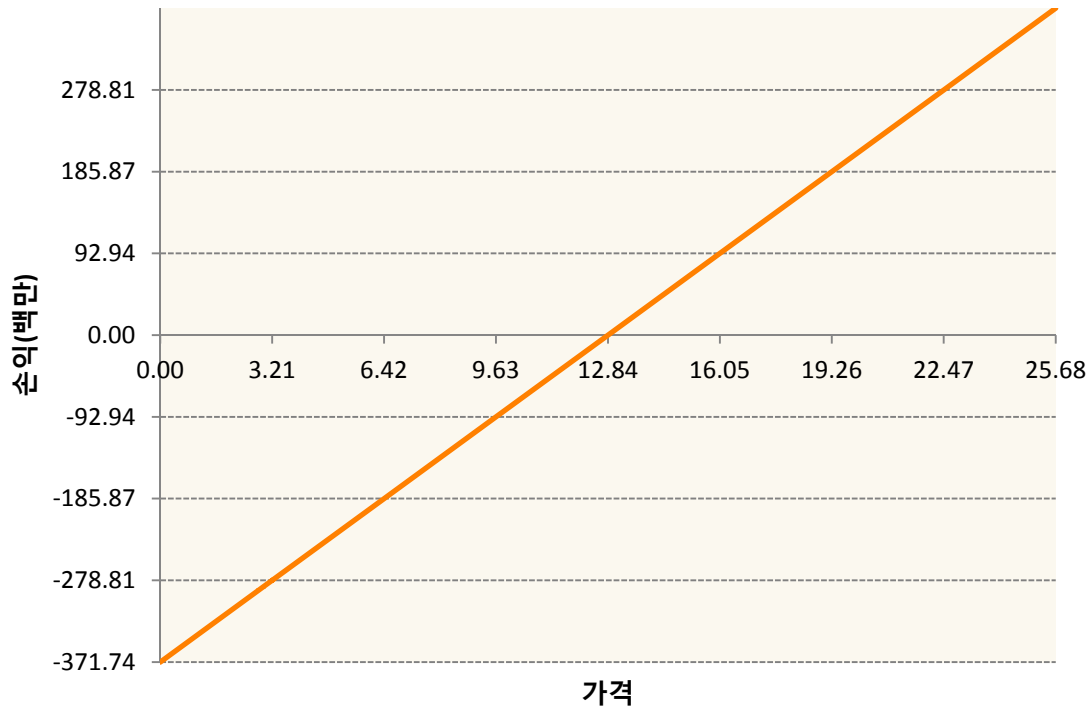
KR4175NC0005-2018-12 달러선물



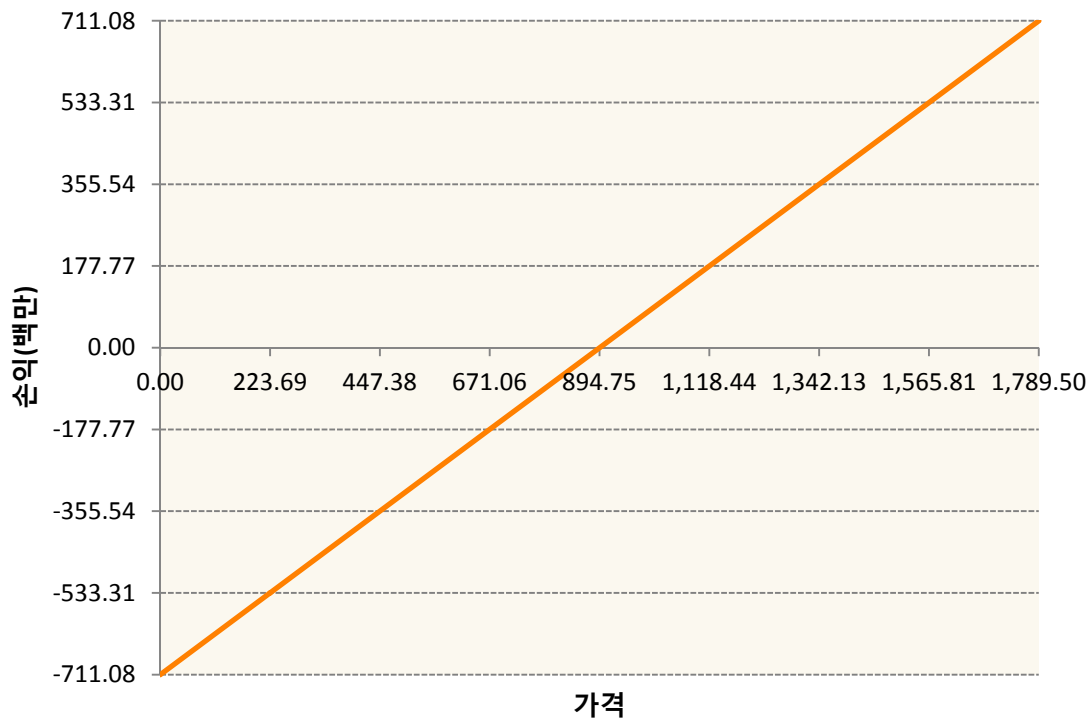
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



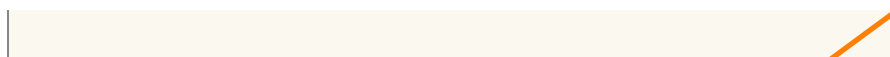
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

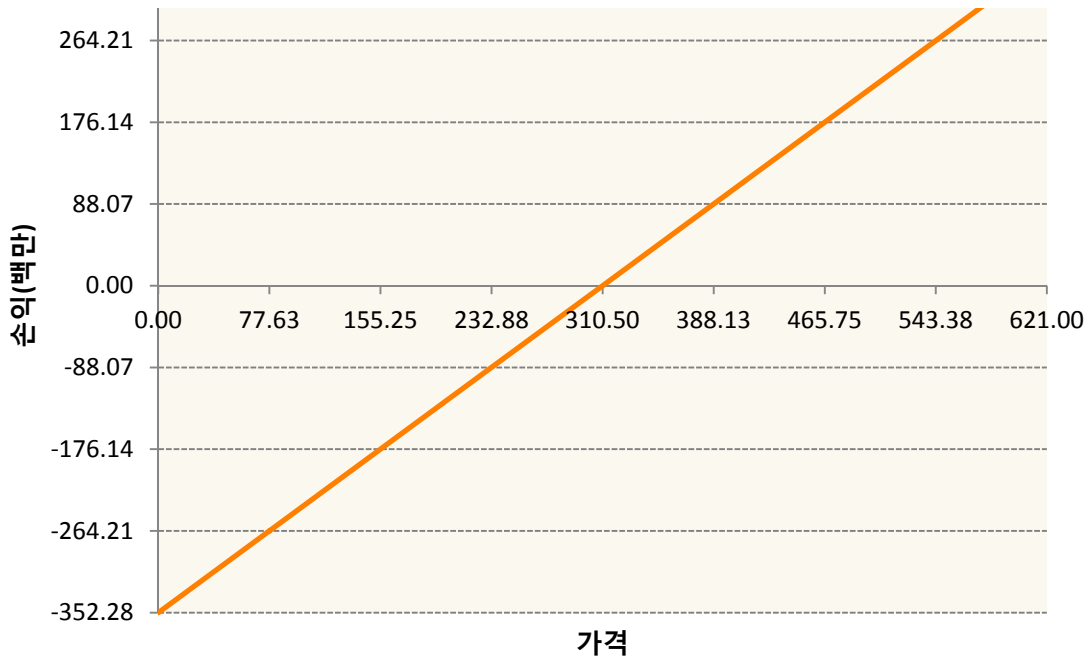


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19

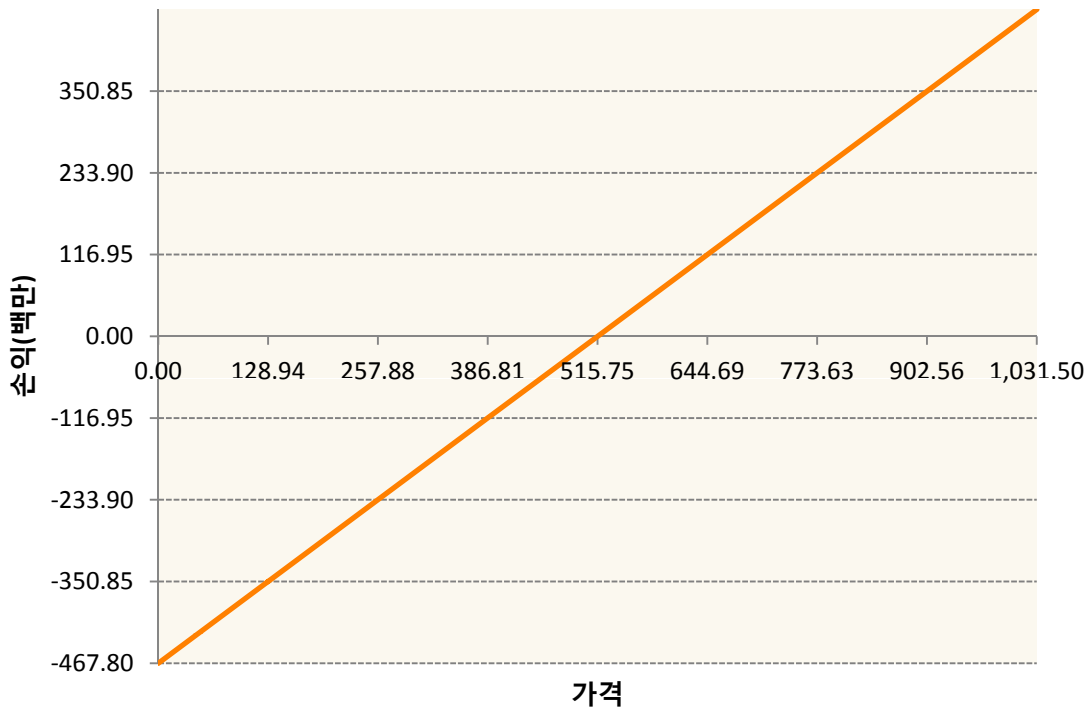


SMF9-SOYBEAN MEAL FUTR Jan19





WH9-WHEAT FUTURE(CBT) Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF9	SOYBEAN OIL FUTR Jan19	23
CH9	CORN FUTURE Mar19	65
CTH9	COTTON NO.2 FUTR Mar19	14
KCH9	COFFEE 'C' FUTURE Mar19	22
KR4175NC0	(2018-12 달러선물)	6

KWH9	KC HRW WHEAT FUT Mar19	16
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	30
SF9	SOYBEAN FUTURE Jan19	57
SMF9	SOYBEAN MEAL FUTR Jan19	28
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	37

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

(단위:백만원)

318