

공시일	2018-12-11
기준일	2018-12-10

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	2018-12-11
기준일	2018-12-10

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

1,046

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

532

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-12-11
기준일	2018-12-10

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	3,355	0	3,355	장외
누계	지수	스왑	3,355	0	3,355	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI500000 신한CSI500미래S180910

264

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

388

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-12-11
기준일	2018-12-10

유로인덱스모(주식-파생형)

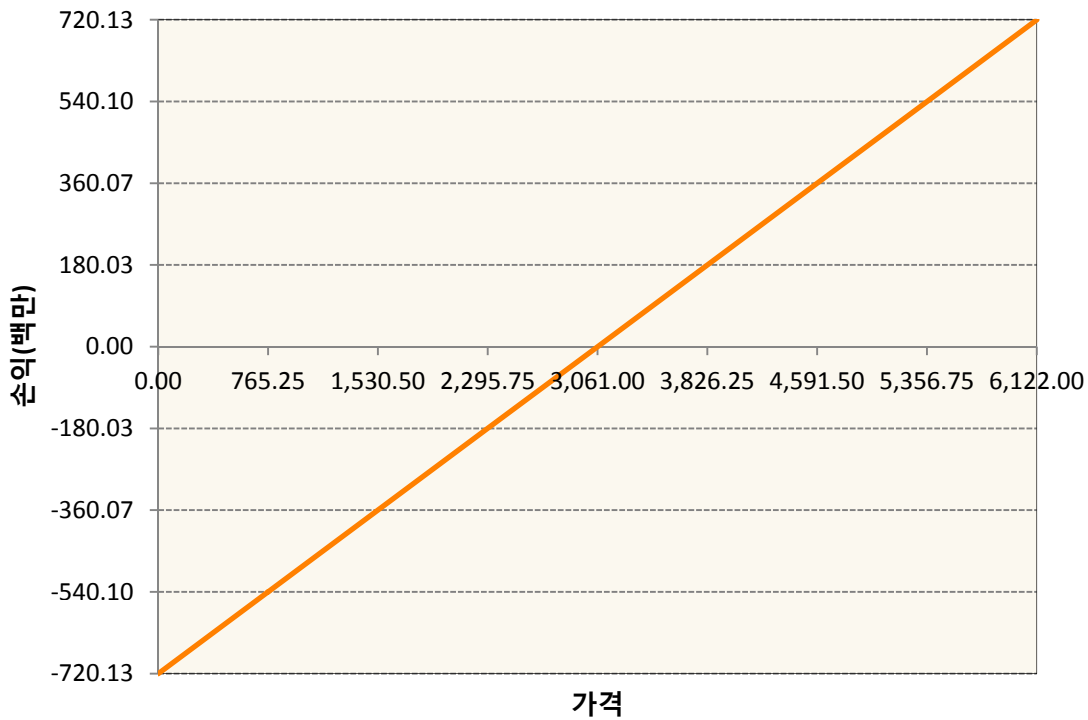
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	720	0	720	

2. 만기시점의 손익구조

VGZ8-EURO STOXX 50 DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ8	EURO STOXX 50 DEC18	58
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

38

공시일	2018-12-11
기준일	2018-12-10

차이나인덱스모(주식-파생형)

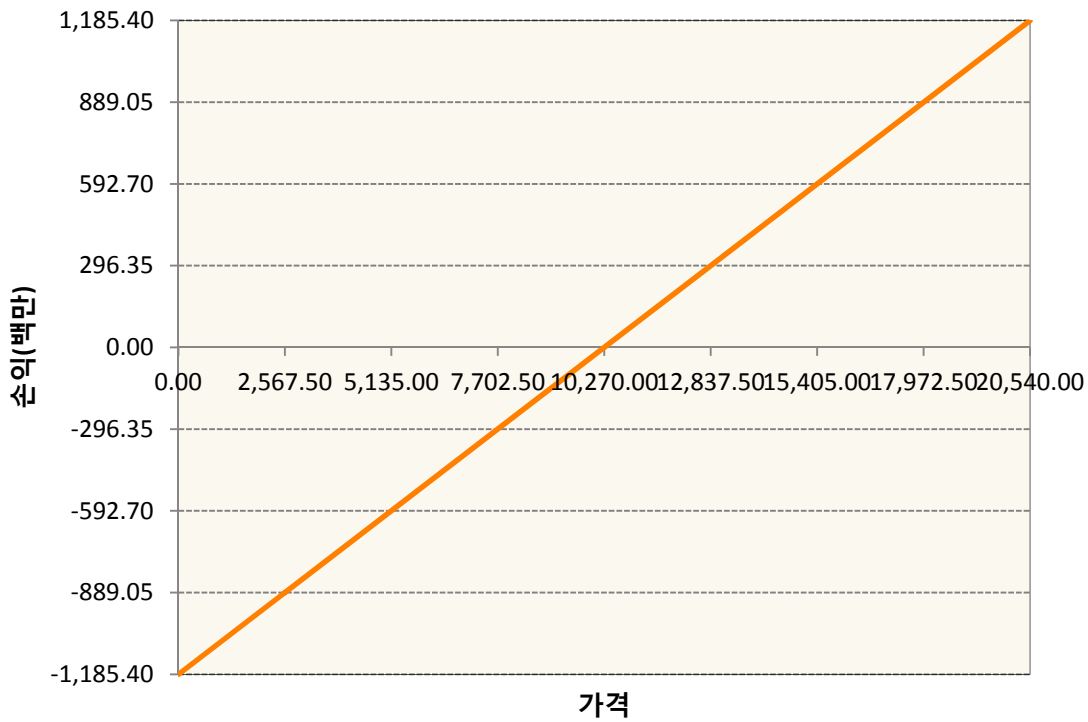
1. 계약금액

(단위:백만원)

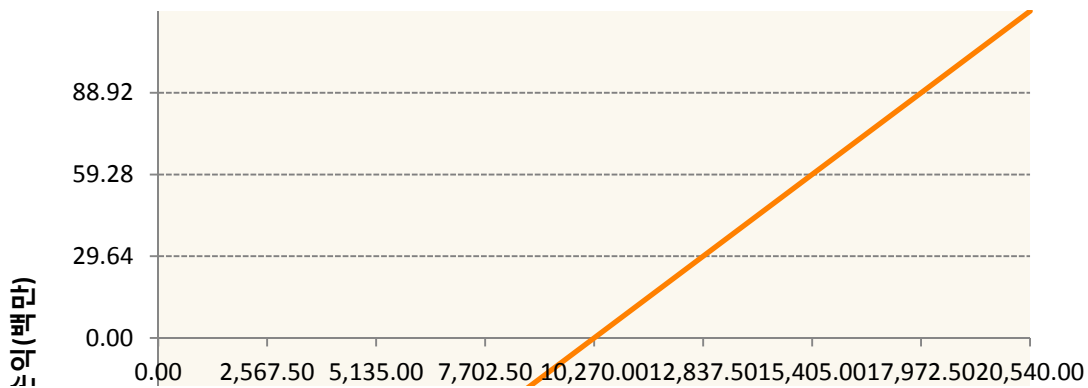
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,185	0	1,185	
누계	유가증권	선물	119	0	119	장내

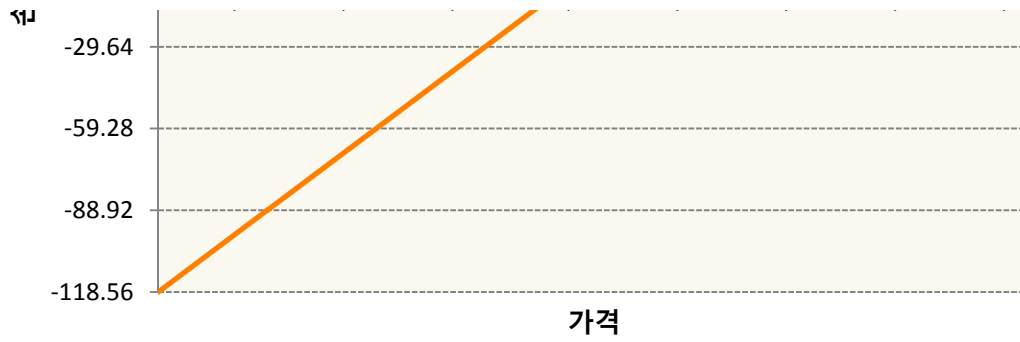
2. 만기시점의 손익구조

HCZ8-HSCEI FUTURES DEC 18



MHCZ8-MINI H-SHR IDX FU DEC18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCZ8	HSCEI FUTURES DEC 18	95
MHCZ8	MINI H-SHR IDX FU DEC18	9

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

95

공시일	2018-12-11
기준일	2018-12-10

커버드콜모(주식혼합-파생형)

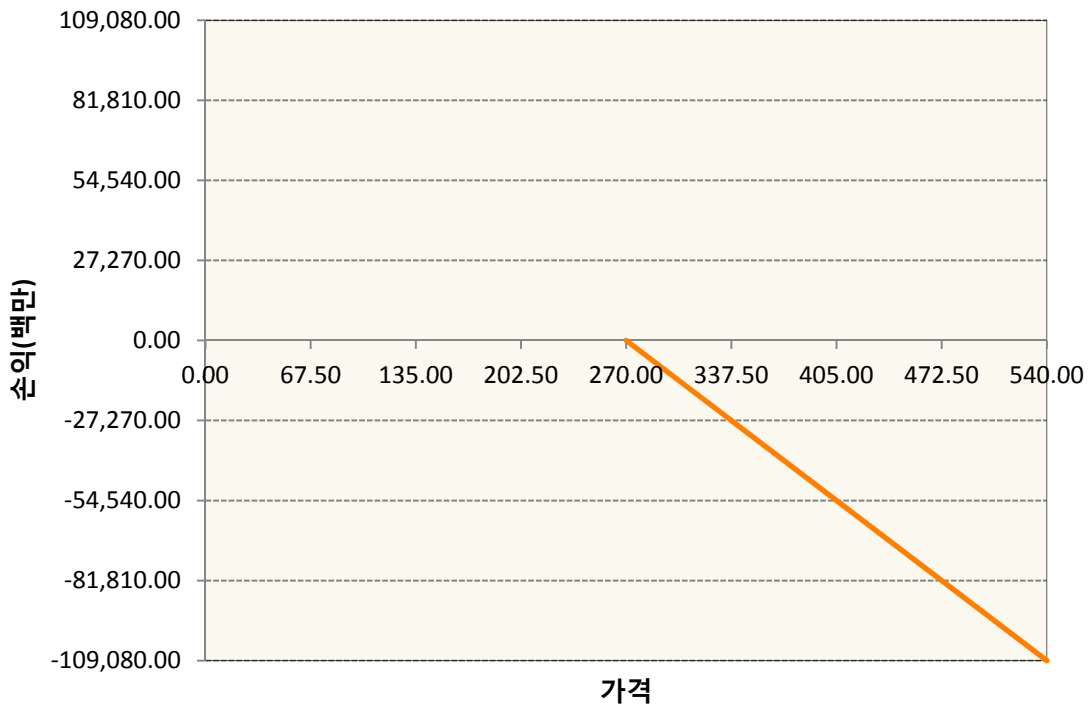
1. 계약금액

(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



-5.33%	621	621	621	620	617	612	603
-2.67%	616	608	592	568	532	485	426
0%	392	279	148	0	-161	-334	-517
2.67%	-1,733	-2,000	-2,268	-2,535	-2,802	-3,069	-3,337
5.33%	-7,639	-7,765	-7,909	-8,069	-8,243	-8,428	-8,623
8.00%	-15,464	-15,477	-15,500	-15,535	-15,583	-15,644	-15,718
KR4301NC2727 2018-12 풋272.5							22,148
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,148	-22,148	-22,148	-22,148	-22,148	-22,148	-22,148
-5.33%	-14,719	-14,719	-14,719	-14,719	-14,719	-14,719	-14,720
-2.67%	-7,291	-7,291	-7,292	-7,293	-7,295	-7,299	-7,305
0%	108	82	46	0	-56	-122	-196
2.67%	6,115	5,949	5,783	5,616	5,450	5,284	5,117
5.33%	7,621	7,590	7,547	7,493	7,429	7,355	7,273
8.00%	7,660	7,660	7,659	7,657	7,654	7,647	7,637

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

(단위:백만원)

46,938

공시일	2018-12-11
기준일	2018-12-10

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

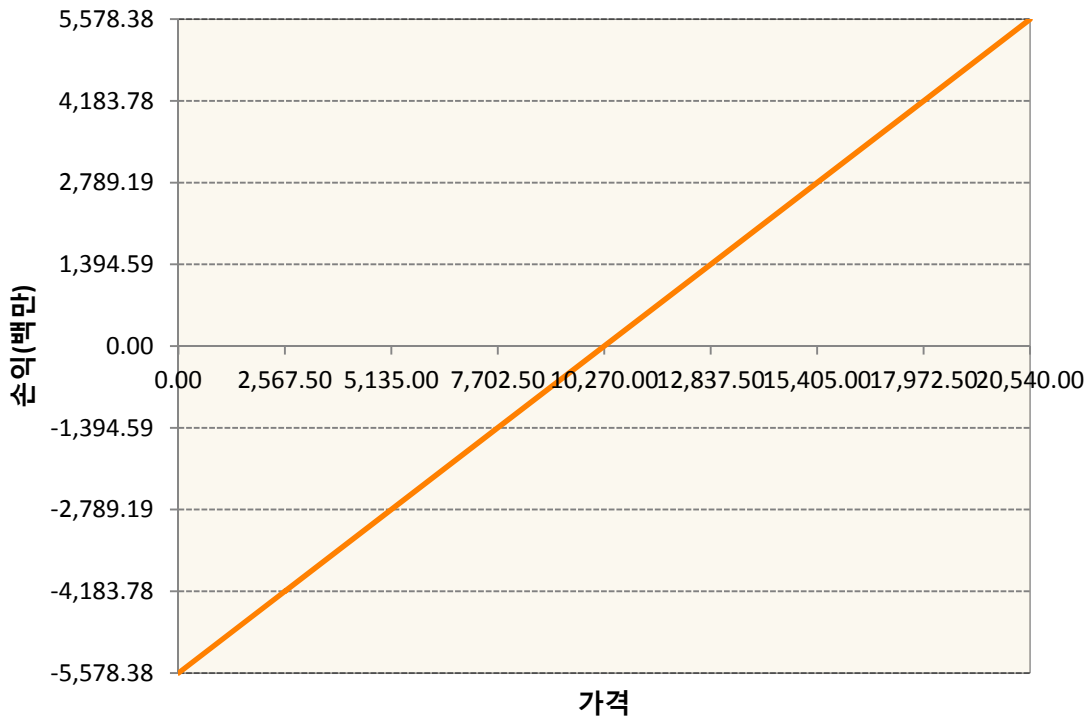
1. 계약금액

(단위:백만원)

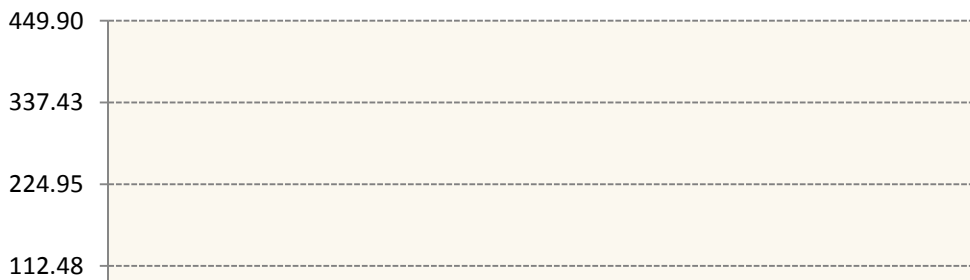
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,578	0	5,578	
누계	유가증권	옵션	0	12,822	-12,822	장내
누계	통화	선도	0	2,740	-2,740	장외

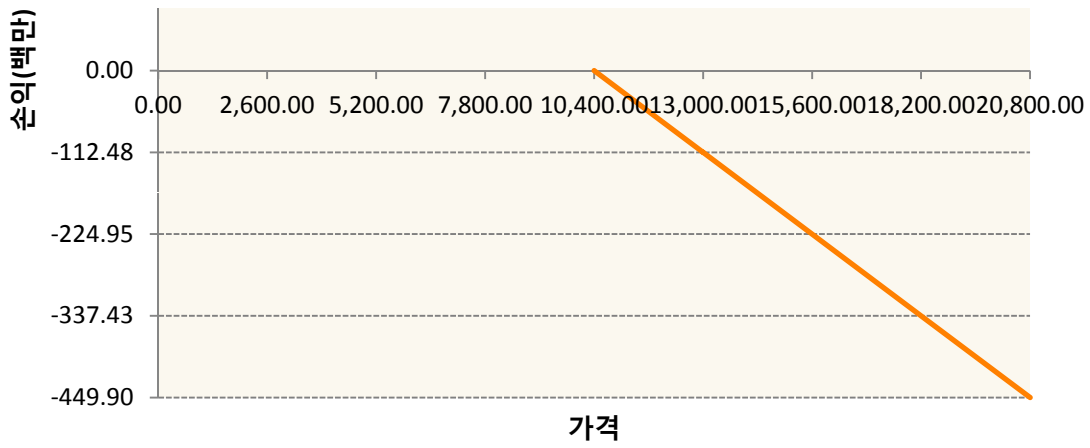
2. 만기시점의 손익구조

HCZ8-HSCEI FUTURES DEC 18

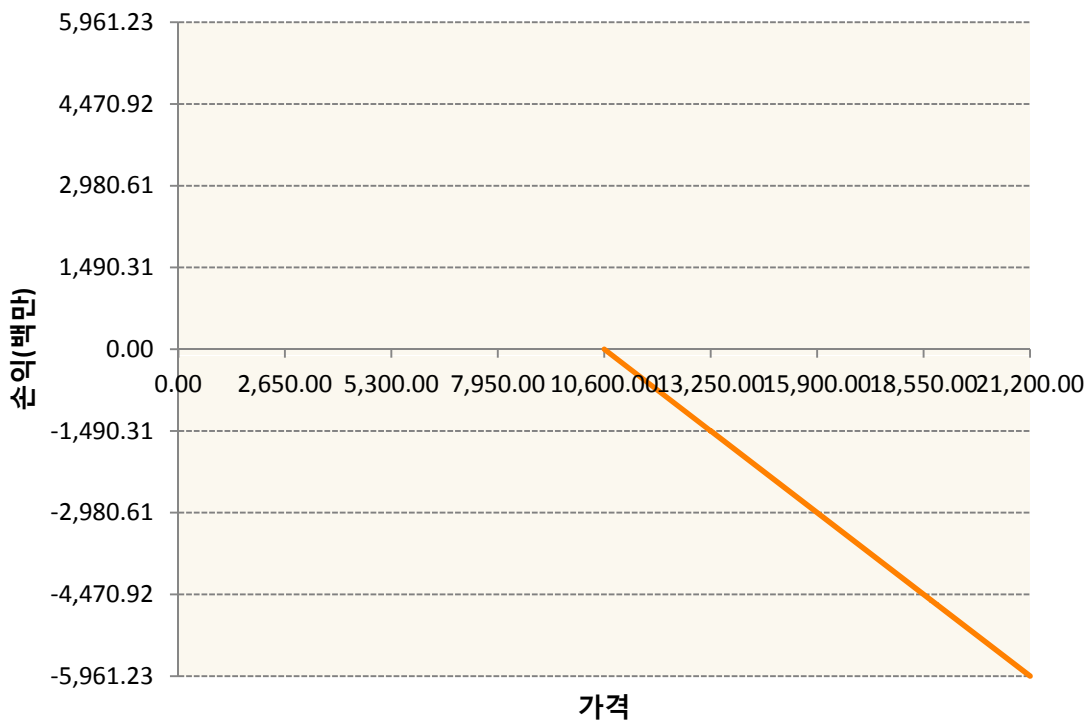


OHHI28-C104-HSCEI

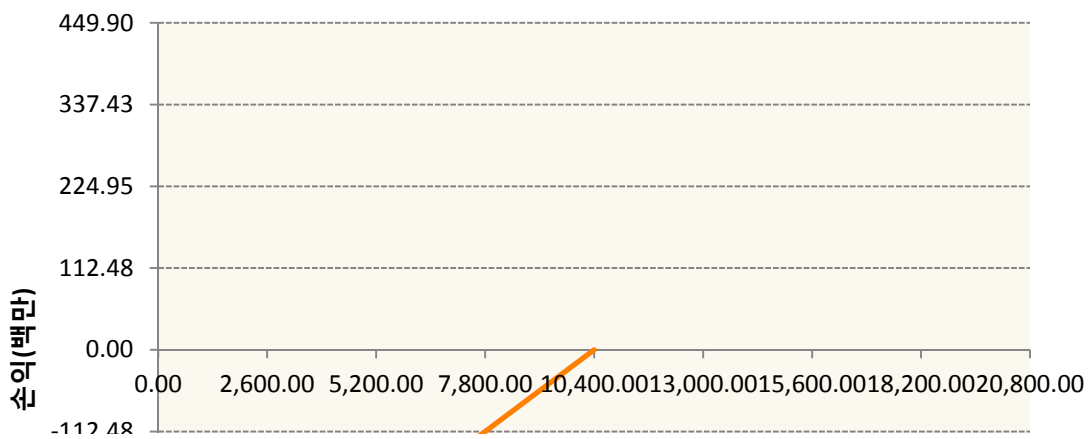


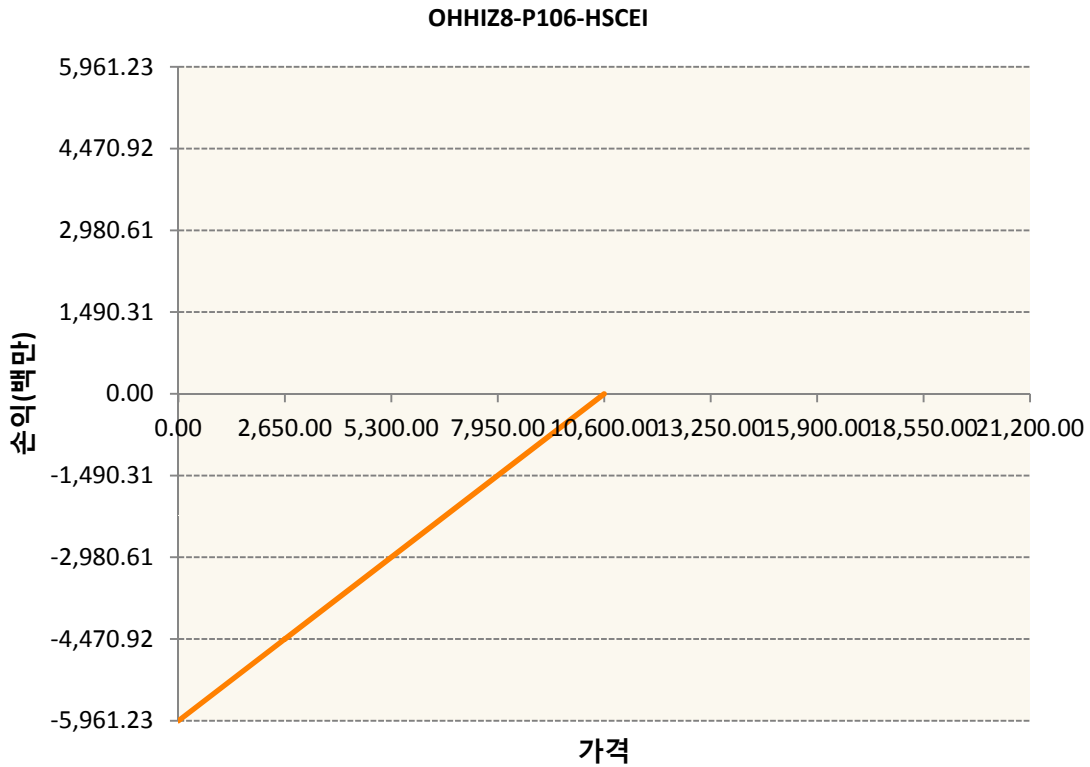
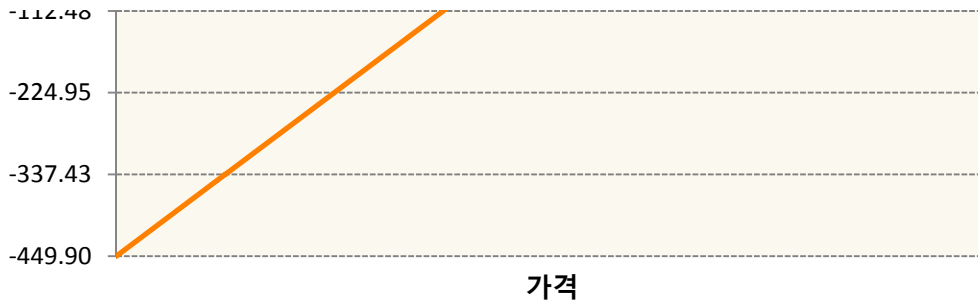


OHHIZ8-C106-HSCEI



OHHIZ8-P104-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	219
HCZ8 HSCEI FUTURES DEC 18	446
OHHIZ8-C1C HSCEI	36
OHHIZ8-C1C HSCEI	477
OHHIZ8-P10 HSCEI	36
OHHIZ8-P10 HSCEI	477

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

1,518

공시일	2018-12-11
기준일	2018-12-10

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

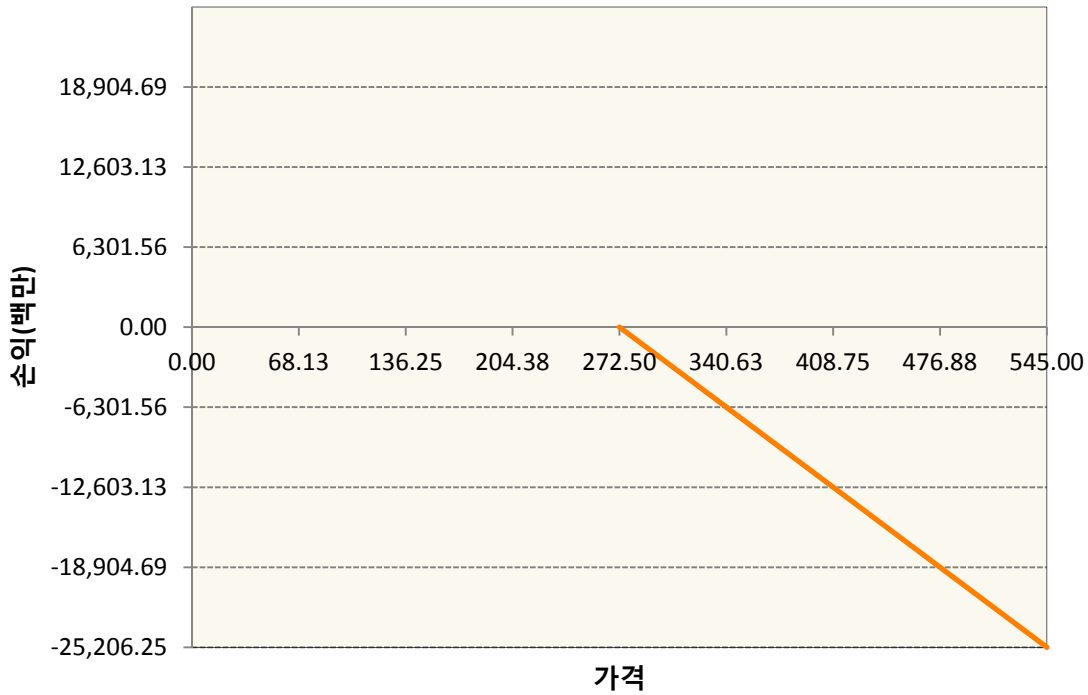
1. 계약금액

(단위:백만원)

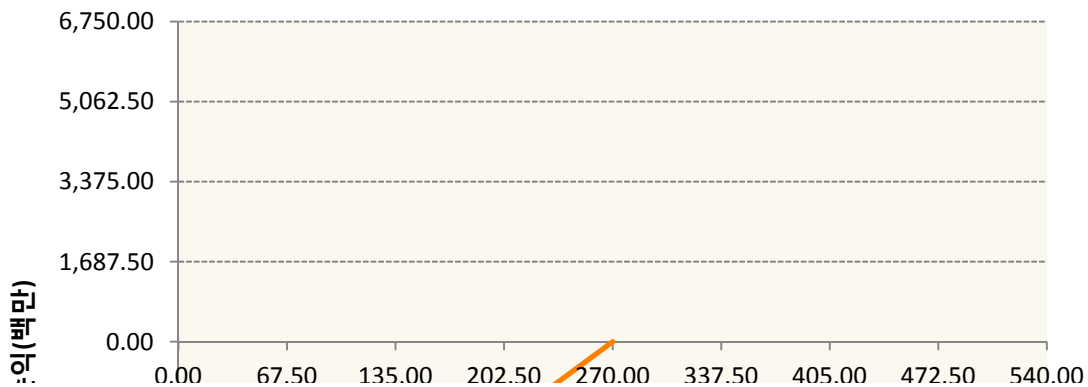
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	43,836	0	43,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	43,538	-43,538	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201NC2728-2018-12 콜272.5

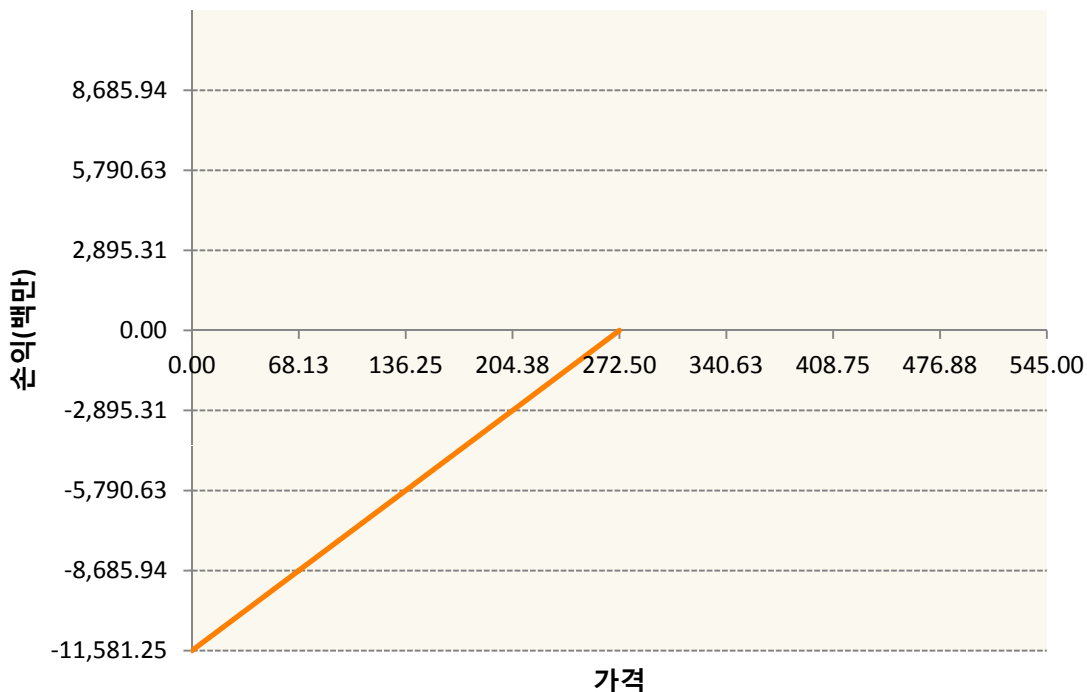


KR4301NC2701-2018-12 풋270





KR4301NC2727-2018-12 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14				3,597
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,597	-3,597	-3,597	-3,597	-3,597	-3,597	-3,597
-5.33%	-2,398	-2,398	-2,398	-2,398	-2,398	-2,398	-2,398
-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%	2,398	2,398	2,398	2,398	2,398	2,398	2,398
8.00%	3,597	3,597	3,597	3,597	3,597	3,597	3,597
	KR4201NC2728		2018-12 콜272.5				1,272
	기초자산의 변동성						

공시일	2018-12-11
기준일	2018-12-10

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

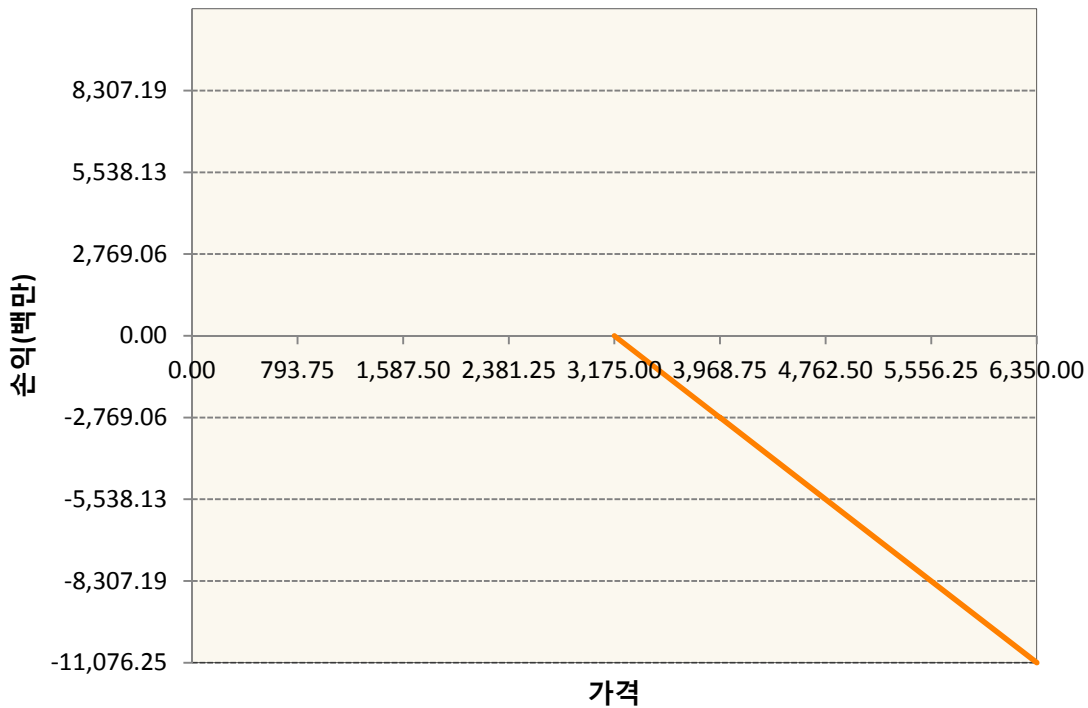
1. 계약금액

(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	7,825	0	7,825	
누계	유가증권	스왑	71,897	0	71,897	장외
누계	유가증권	옵션	0	28,826	-28,826	장내
누계	통화	선도	0	15,447	-15,447	장외

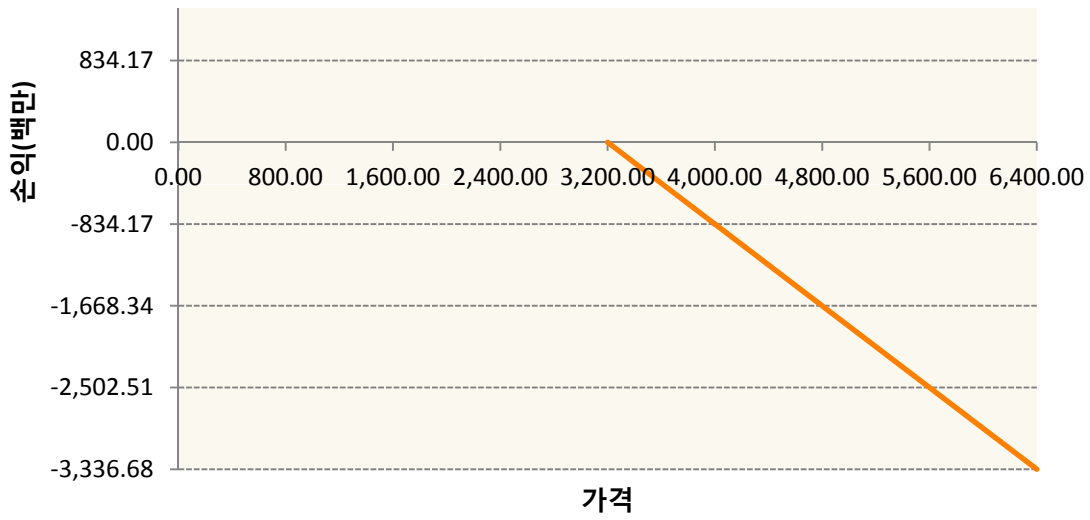
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ8-C3175-EURO STOXX 50

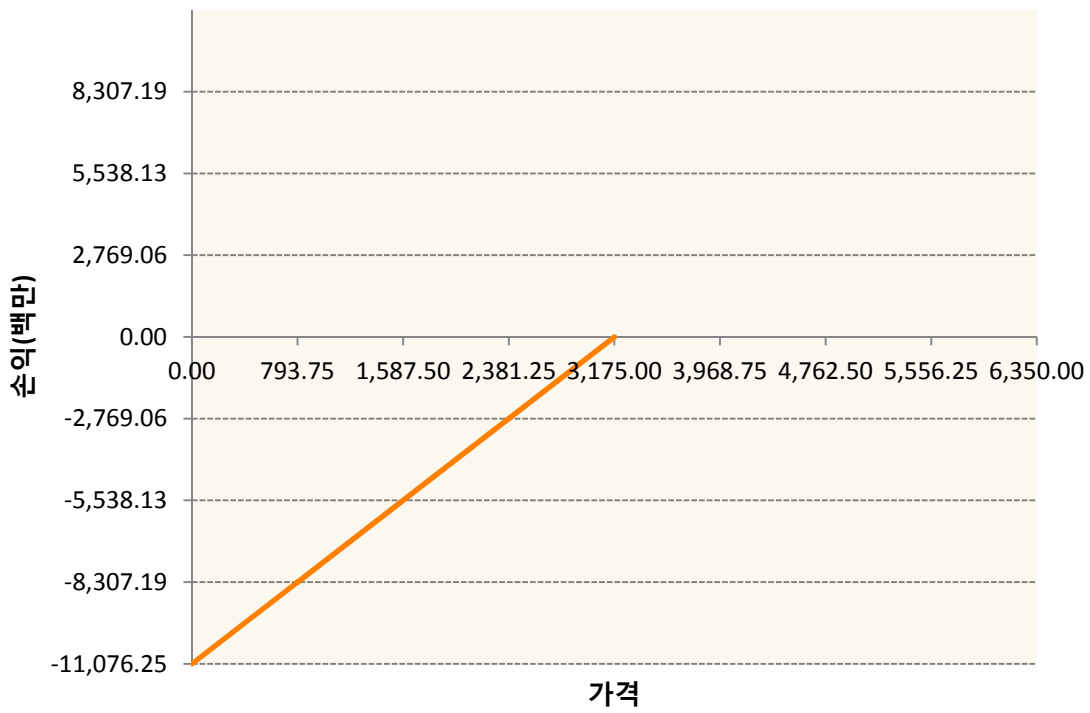


OESXZ8-C3200-EURO STOXX 50

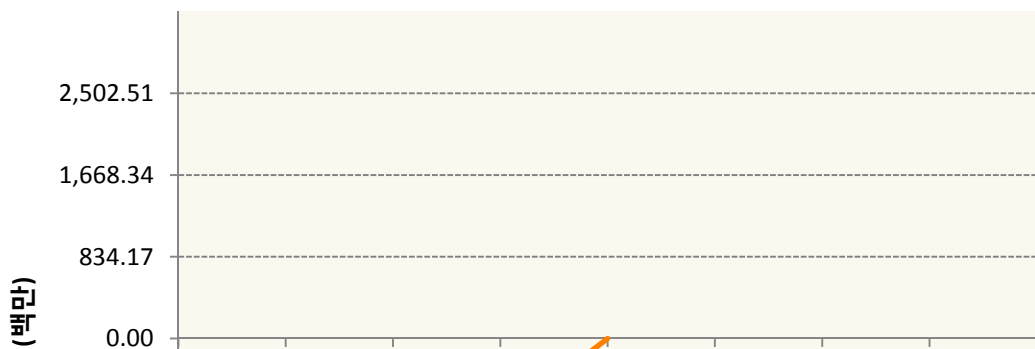


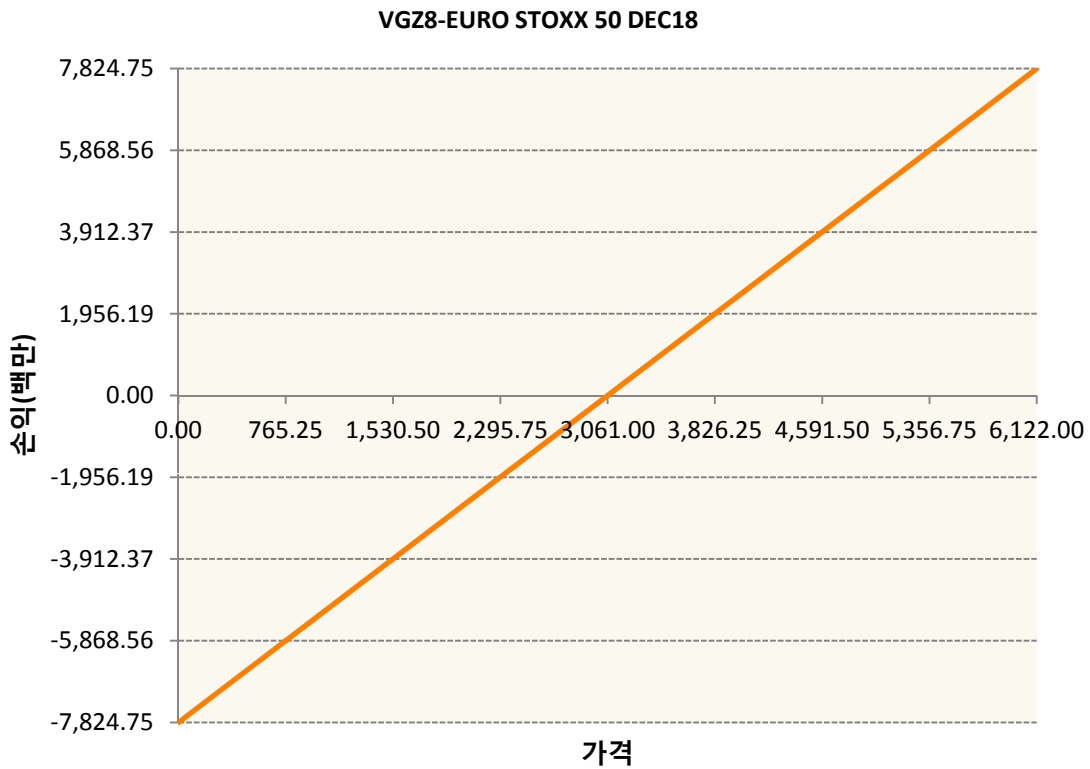
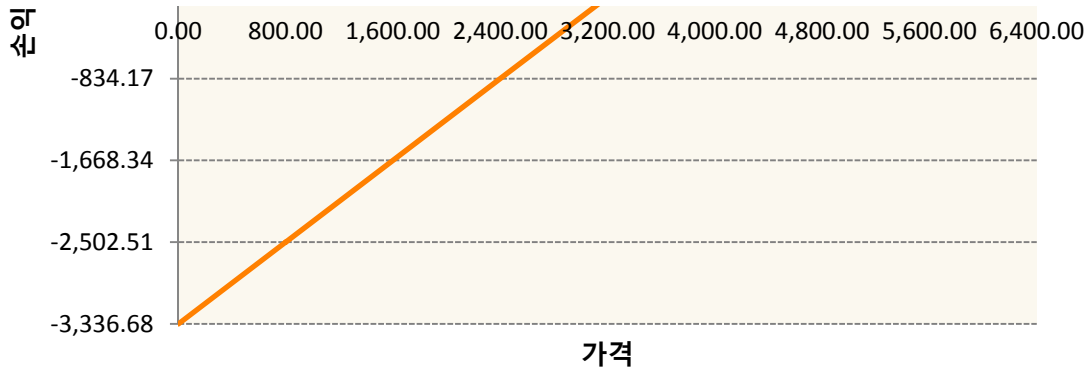


OESXZ8-P3175-EURO STOXX 50



OESXZ8-P3200-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		81
FX21018U03 KRW/EUR 21-12-18E		824
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E		412
OESXZ8-C31 EURO STOXX 50		886
OESXZ8-C32 EURO STOXX 50		267
OESXZ8-P31 EURO STOXX 50		886
OESXZ8-P32 EURO STOXX 50		267
VGZ8	EURO STOXX 50 DEC18	626

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

(단위:백만원)

2,698

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

(단위:백만원)

1,083

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

(단위:백만원)

91

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

(단위:백만원)

137

공시일	2018-12-11
기준일	2018-12-10

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

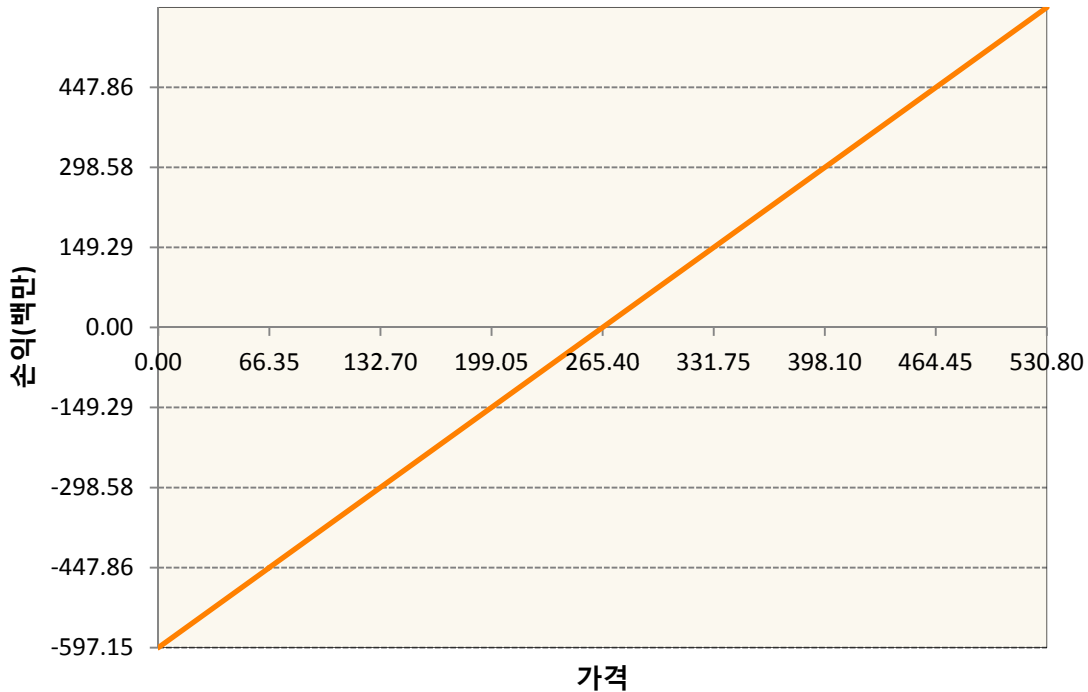
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	597	0	597	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0004		2018-12 코스피200지수선물						48
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48	
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
-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%	32	32	32	32	32	32	32	
8.00%	48	48	48	48	48	48	48	

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

(단위:백만원)

41

공시일	2018-12-11
기준일	2018-12-10

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

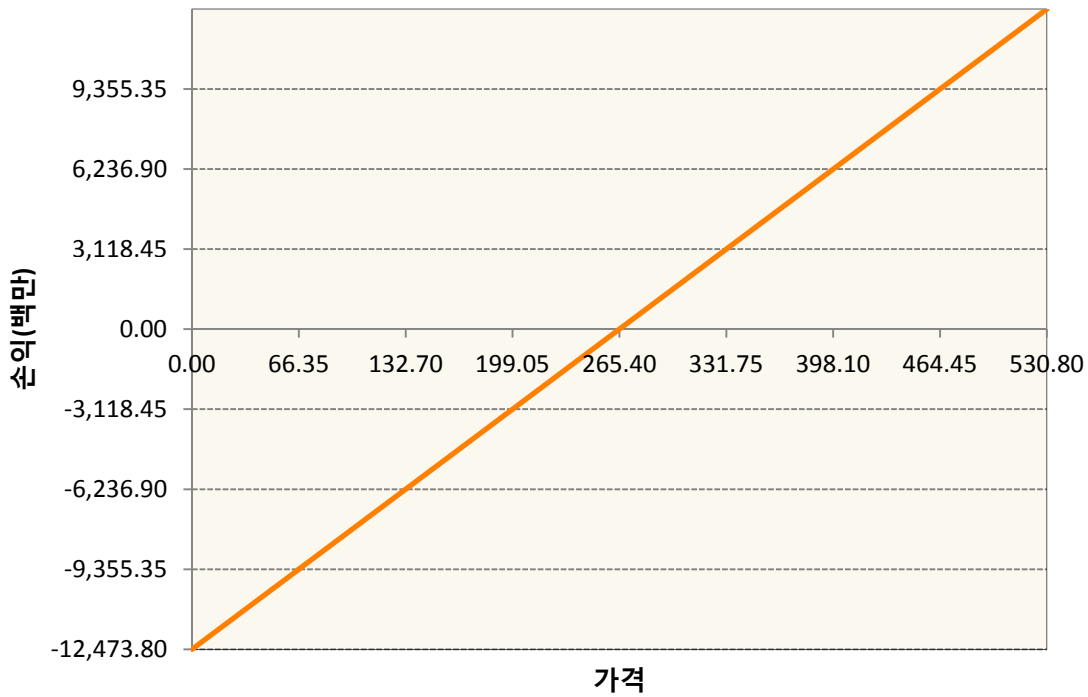
1. 계약금액

(단위:백만원)

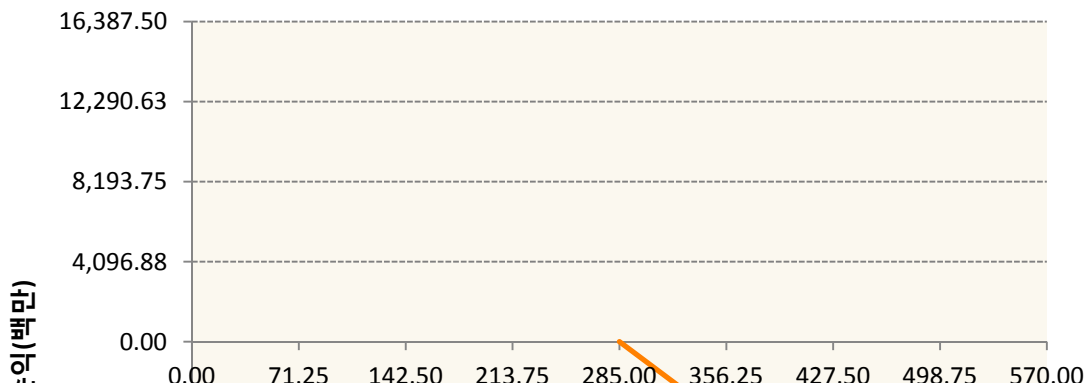
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,474	0	12,474	장내
누계	유가증권	옵션	3,743	23,072	-19,329	장내

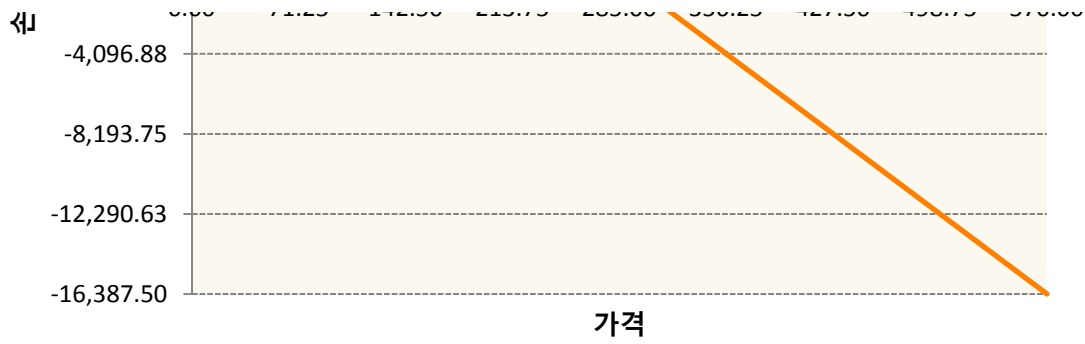
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

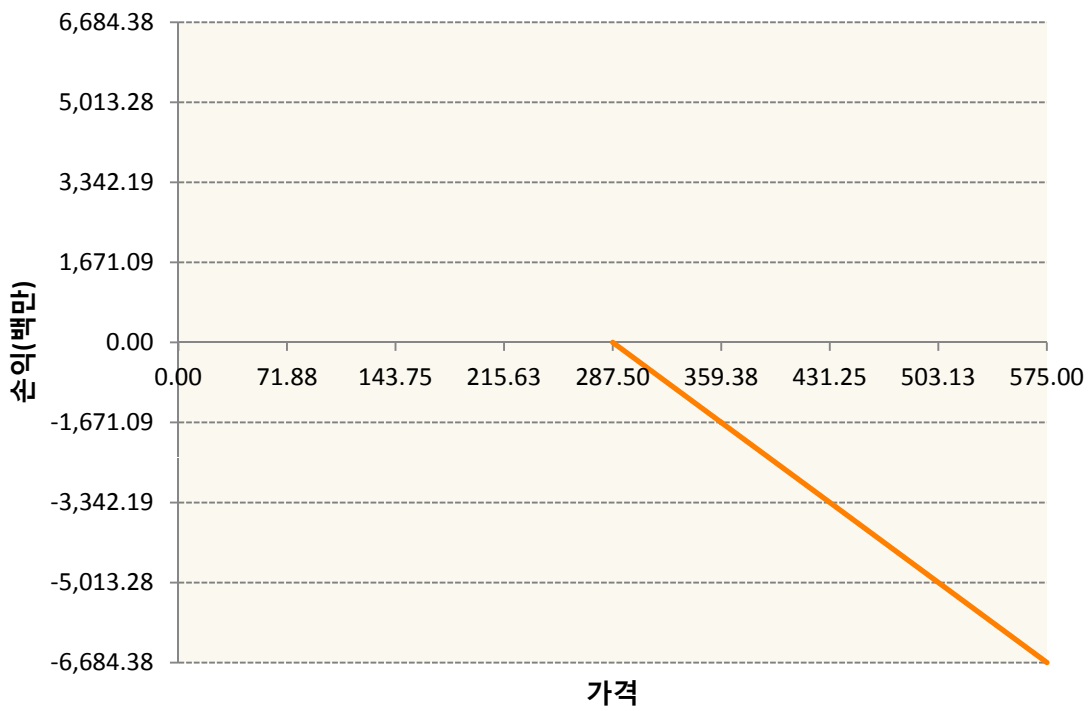


KR4201NC2850-2018-12 콜285

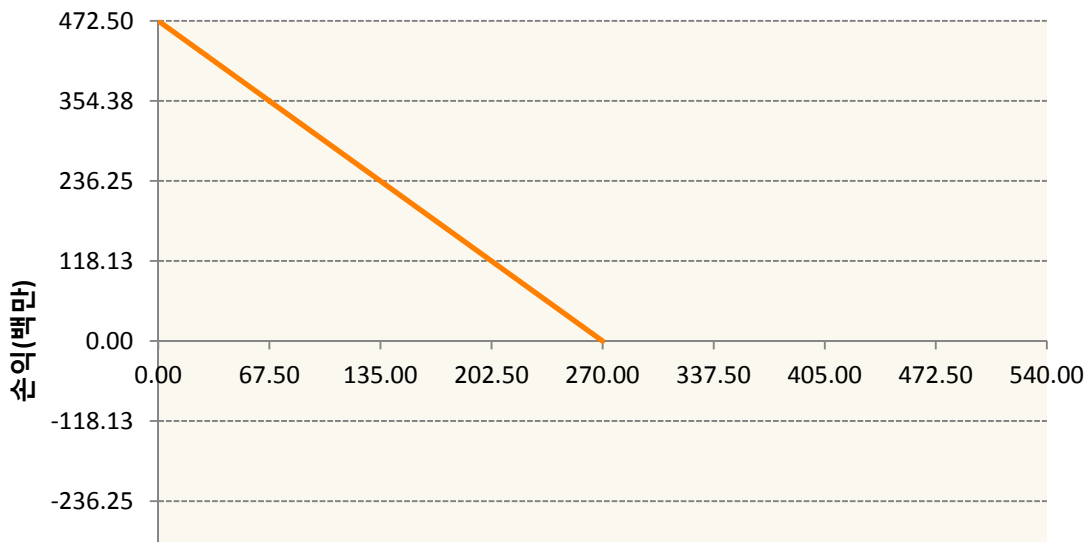


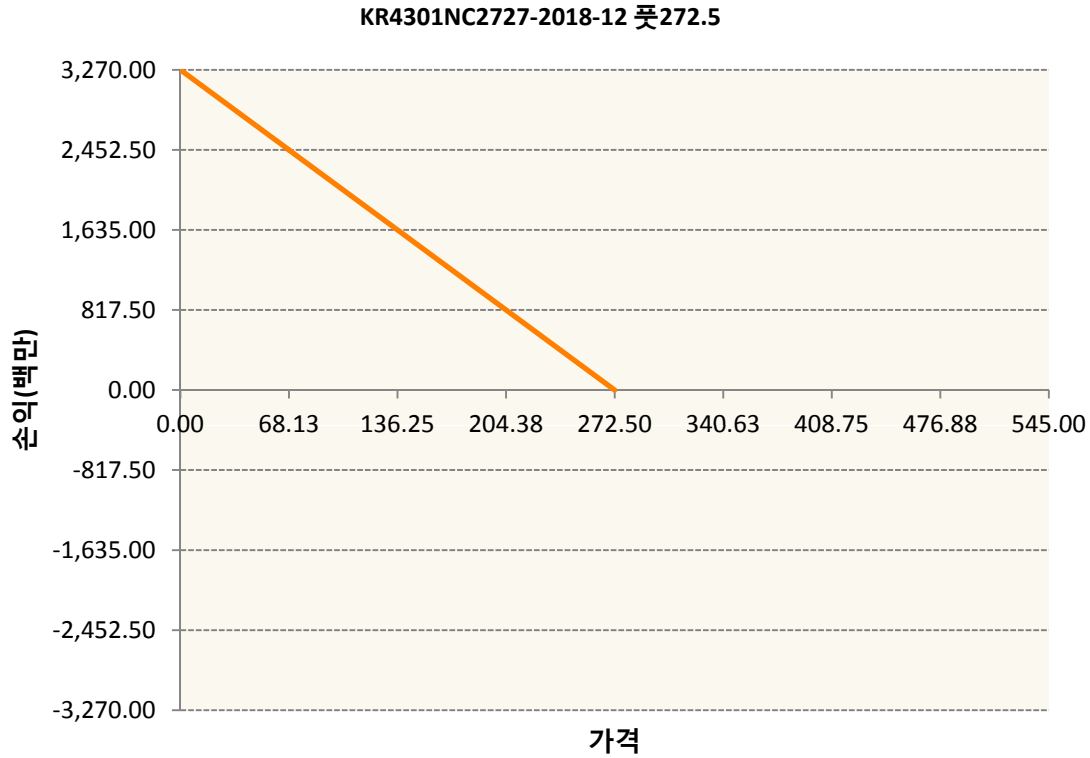
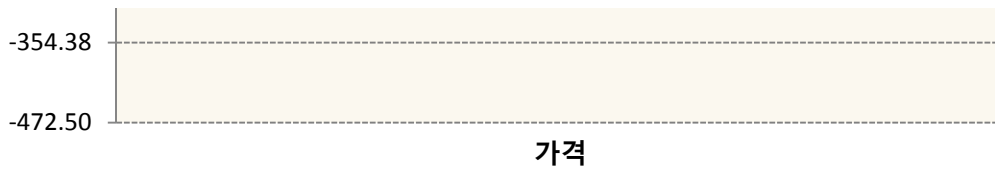


KR4201NC2876-2018-12 콜287.5



KR4301NC2701-2018-12 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0004		2018-12 코스피200지수선물						998
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-998	-998	-998	-998	-998	-998	-998	
-5.33%	-665	-665	-665	-665	-665	-665	-665	
-2.67%	-333	-333	-333	-333	-333	-333	-333	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	333	333	333	333	333	333	333	
5.33%	665	665	665	665	665	665	665	
8.00%	998	998	998	998	998	998	998	
KR4201NC2850		2018-12 콜285						259
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0	
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0	
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	

0%	0	0	0	0	0	-1	-2
2.67%	-1	-2	-4	-6	-10	-14	-19
5.33%	-25	-34	-44	-54	-65	-76	-87
8.00%	-176	-190	-204	-217	-231	-245	-259
KR4201NC2876 2018-12 콜287.5							75
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	-1	-1	-2	-3	-4
5.33%	-4	-6	-9	-12	-15	-19	-22
8.00%	-41	-47	-53	-58	-64	-70	-75
KR4301NC2701 2018-12 풋270							36
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	36	36	36	36	36	36	36
-5.33%	24	24	24	24	24	24	24
-2.67%	12	12	12	12	12	12	12
0%	0	0	0	0	0	0	1
2.67%	-8	-8	-7	-7	-7	-7	-6
5.33%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
8.00%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
KR4301NC2727 2018-12 풋272.5							253
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	253	253	253	253	253	253	253
-5.33%	168	168	168	168	168	168	168
-2.67%	83	83	83	83	83	83	83
0%	-1	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-70	-68	-66	-64	-62	-60	-58
5.33%	-87	-87	-86	-86	-85	-84	-83
8.00%	-88	-88	-88	-88	-87	-87	-87

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

(단위:백만원)

1,154

공시일	2018-12-11
기준일	2018-12-10

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	2018-12-11
기준일	2018-12-10

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	51	0	51	
누계	유가증권	수익증권	1,586	0	1,586	

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	2018-12-11
기준일	2018-12-10

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	216	0	216	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	411	0	411	
누계	통화	선도	0	426	-426	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
FX21018Z00 KRW/USD 28-02-19E		17
FX21018Z01 KRW/USD 28-02-19E		2

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

(단위:백만원)

13

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

(단위:백만원)

144

공시일	2018-12-11
기준일	2018-12-10

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

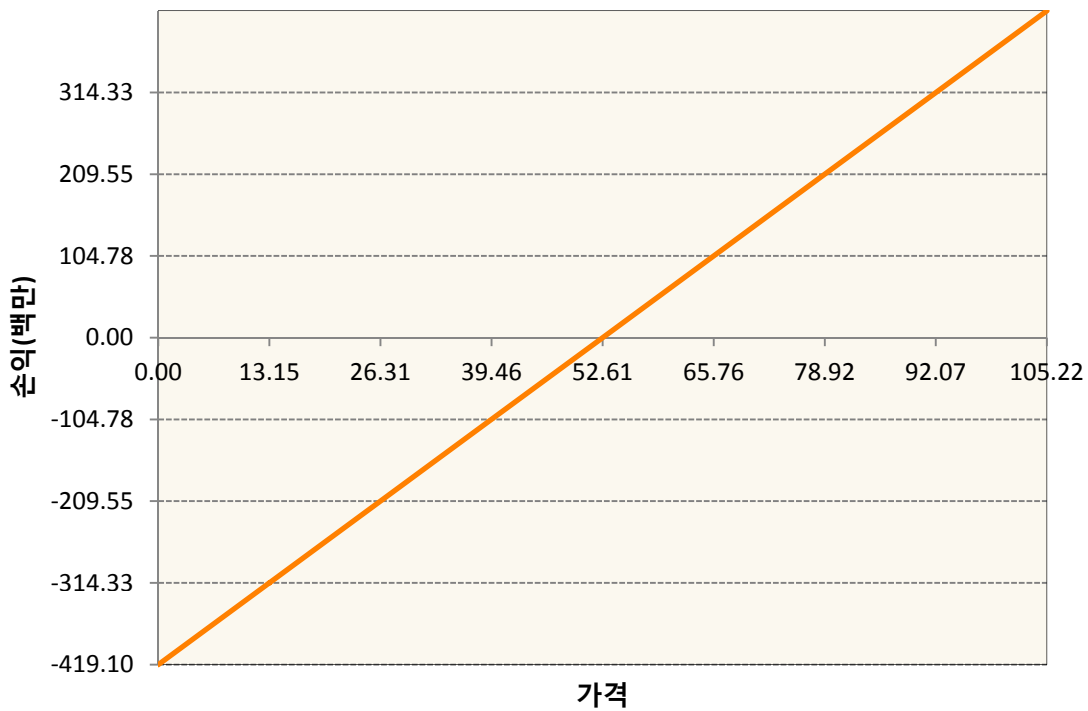
1. 계약금액

(단위:백만원)

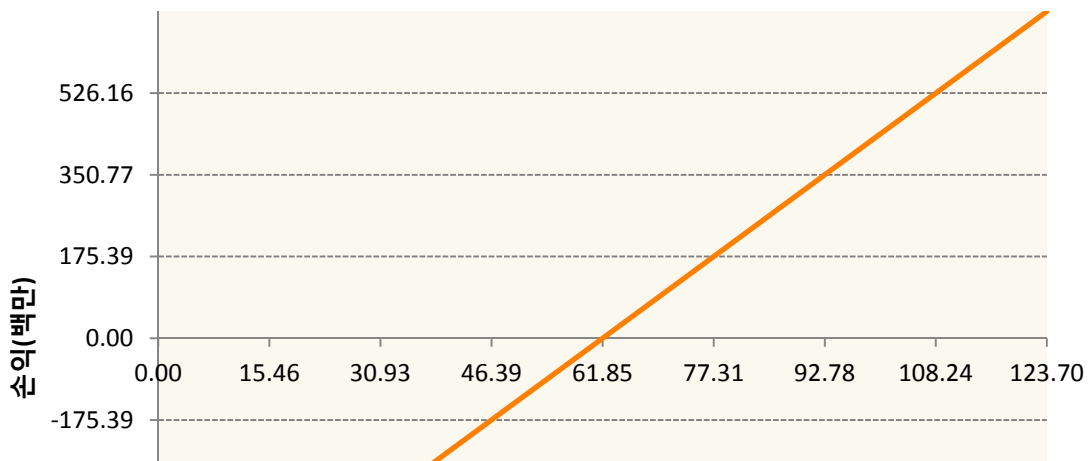
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,036	259	2,777	

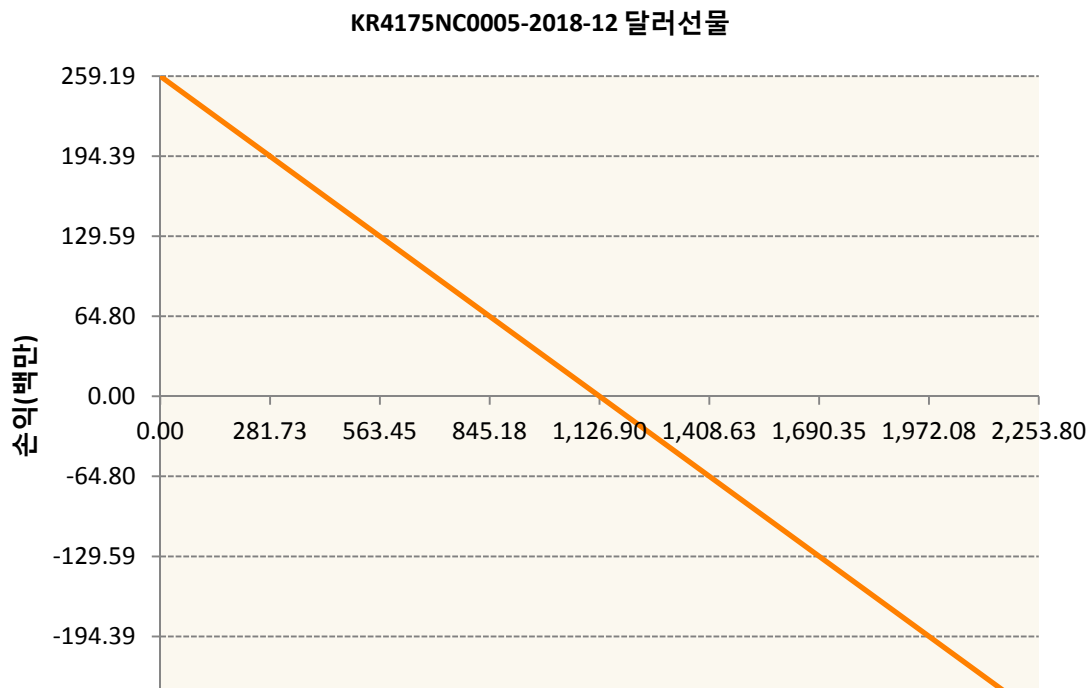
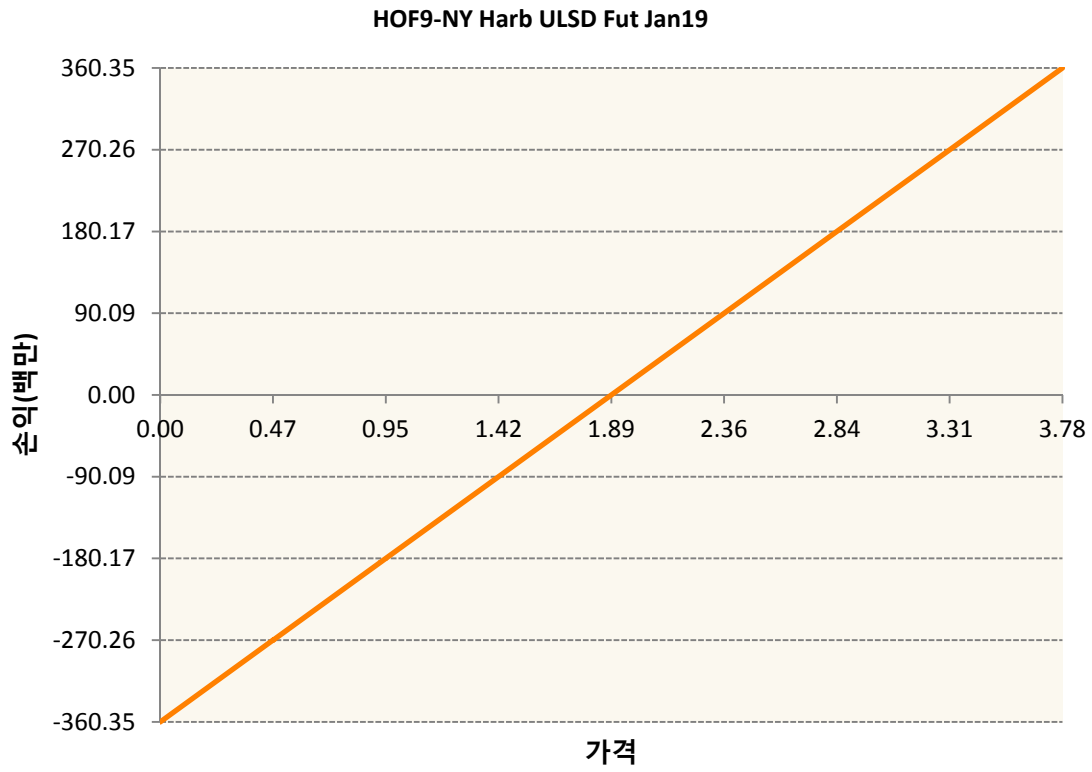
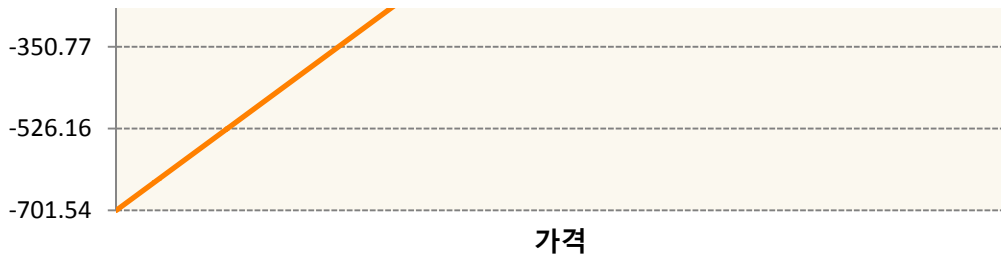
2. 만기시점의 손익구조

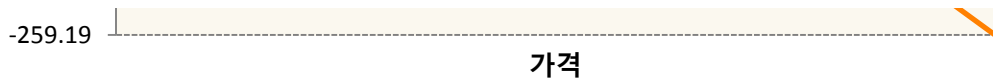
CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19



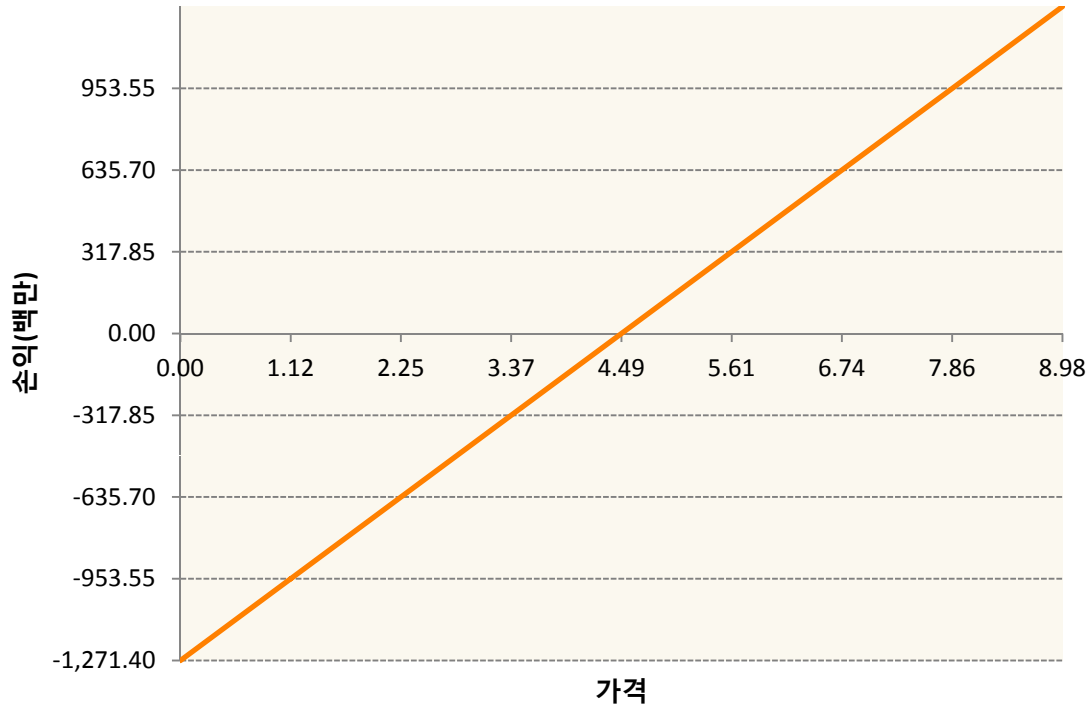
COH9-BRENT CRUDE FUTR Mar19



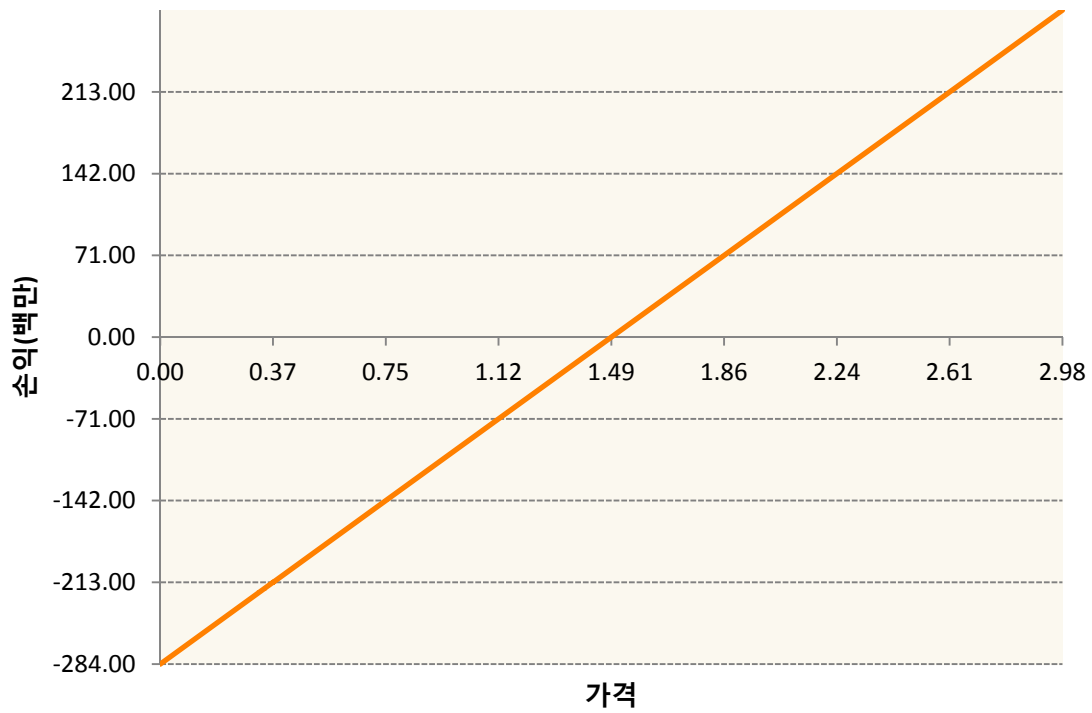




NGF19-NATURAL GAS FUTR Jan19



XBF9-GASOLINE RBOB FUT Jan19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF9	WTI CRUDE FUTURE Jan19	34
COH9	BRENT CRUDE FUTR Mar19	56
HOF9	NY Harb ULSD Fut Jan19	29
KR4175NC0	(2018-12 달러선물	21
NGF19	NATURAL GAS FUTR Jan19	102
XBF9	GASOLINE RBOB FUT Jan19	23

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

435

공시일	2018-12-11
기준일	2018-12-10

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

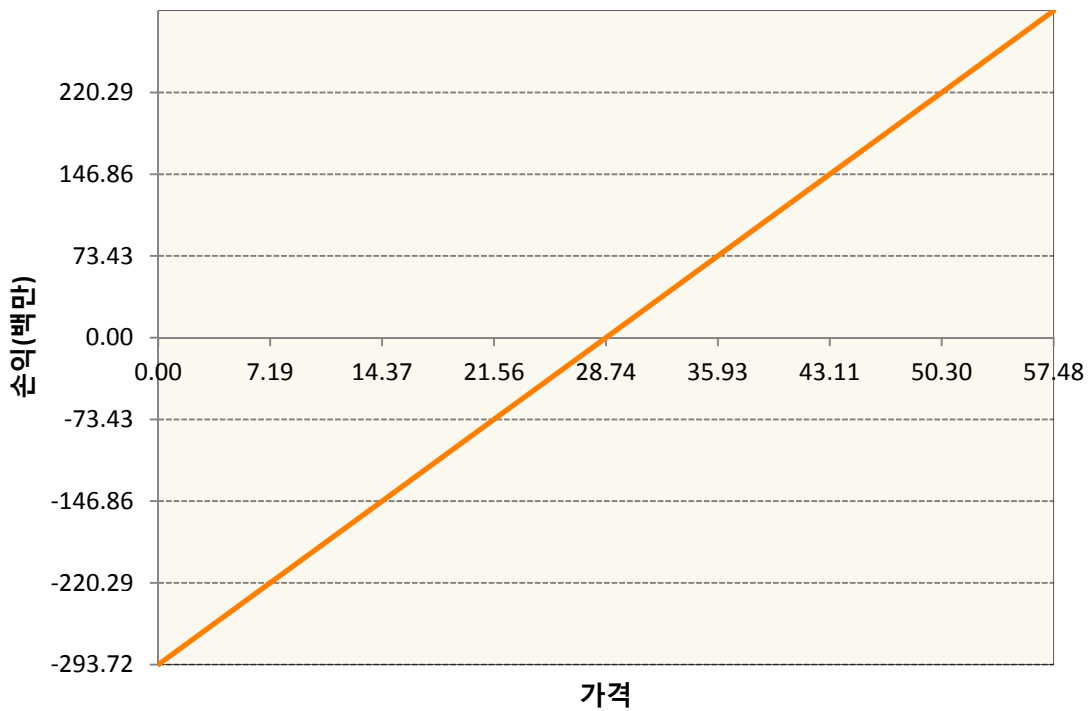
1. 계약금액

(단위:백만원)

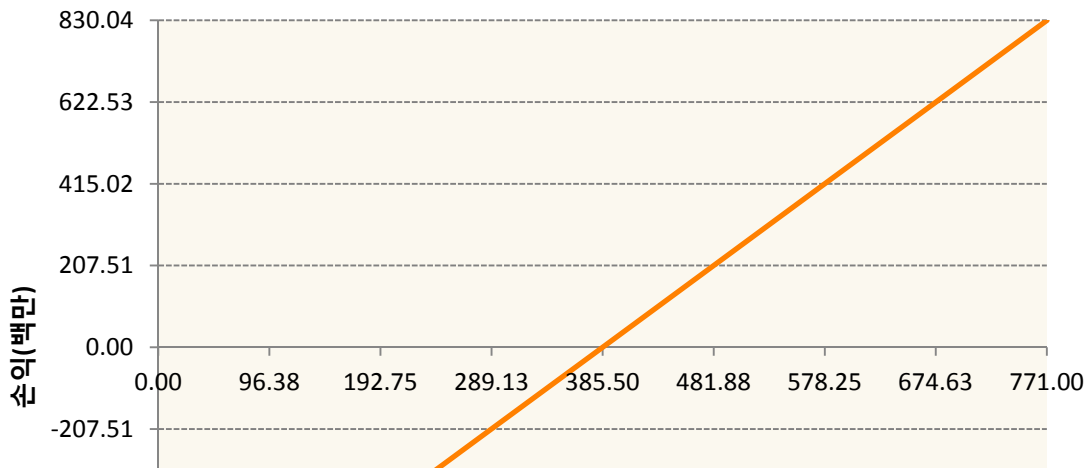
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,710	79	3,631	

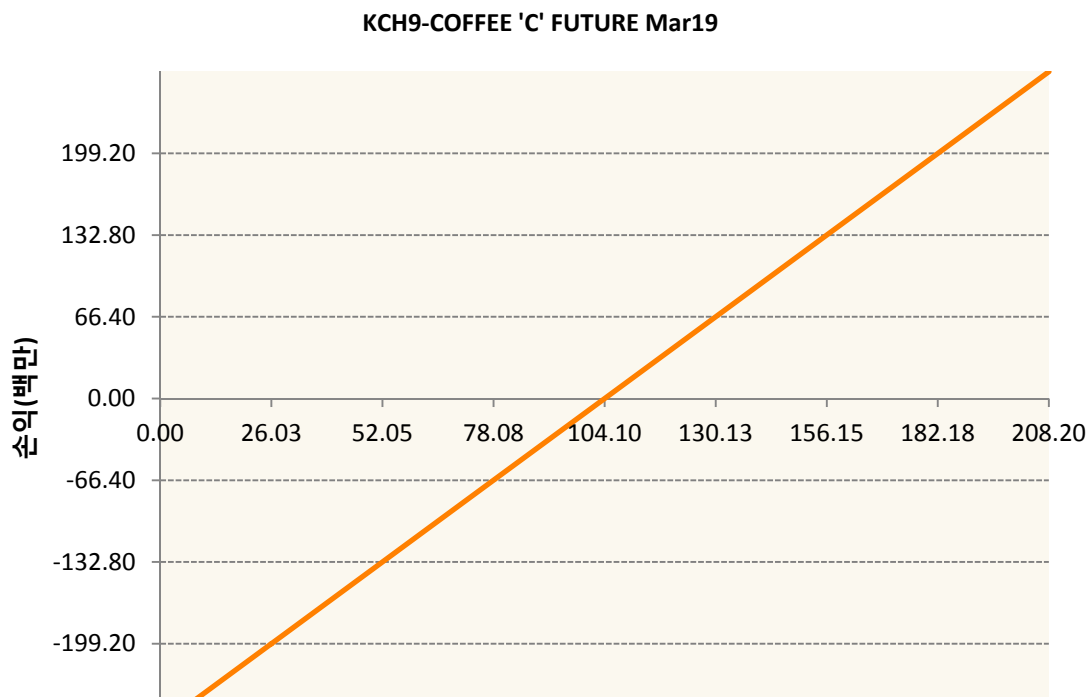
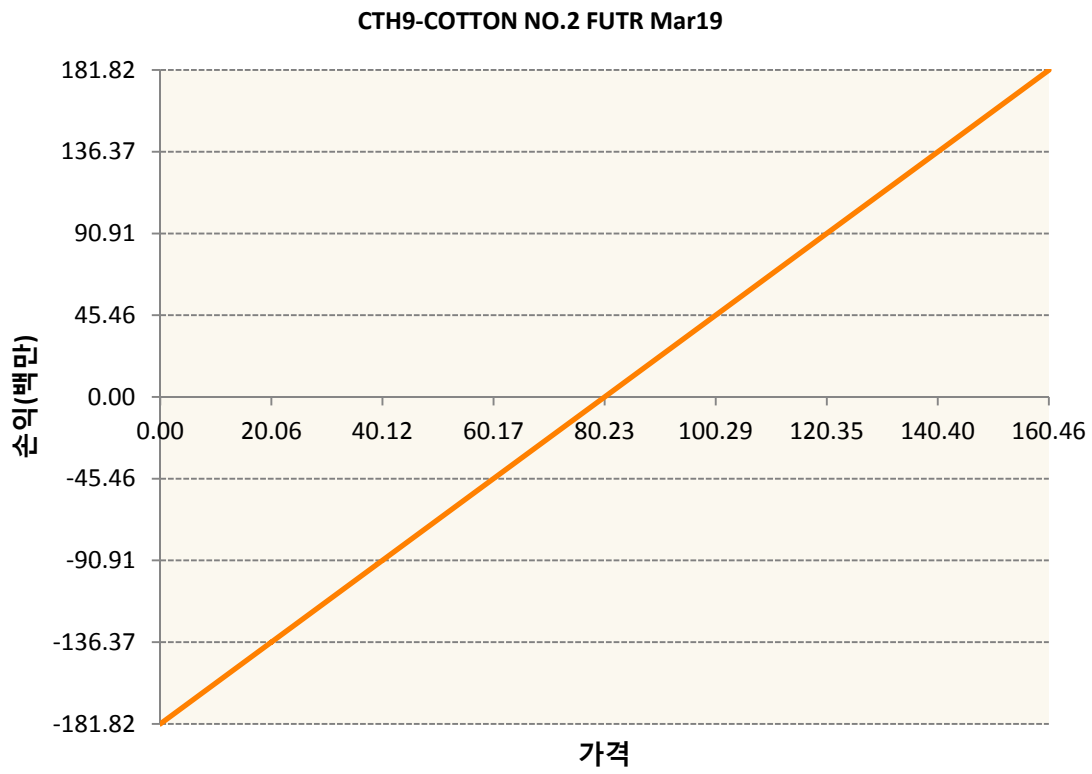
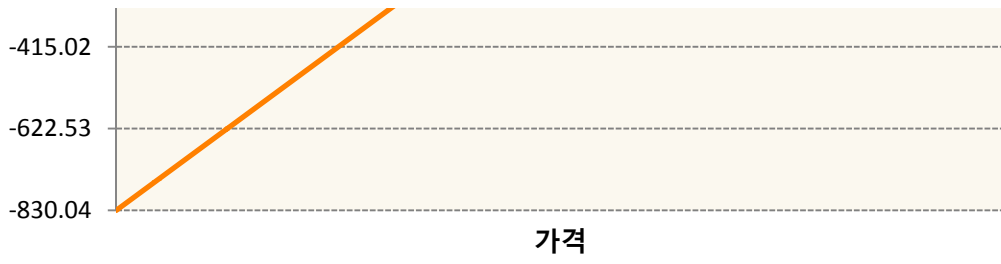
2. 만기시점의 손익구조

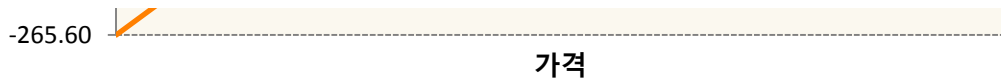
BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19



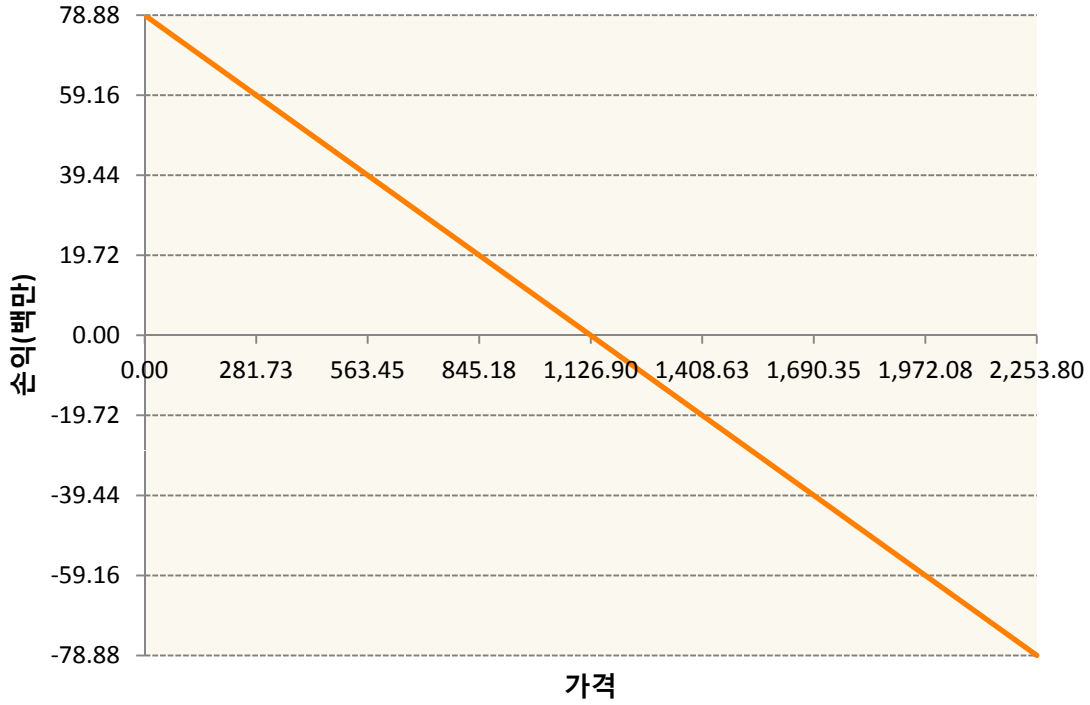
CH9-CORN FUTURE Mar19



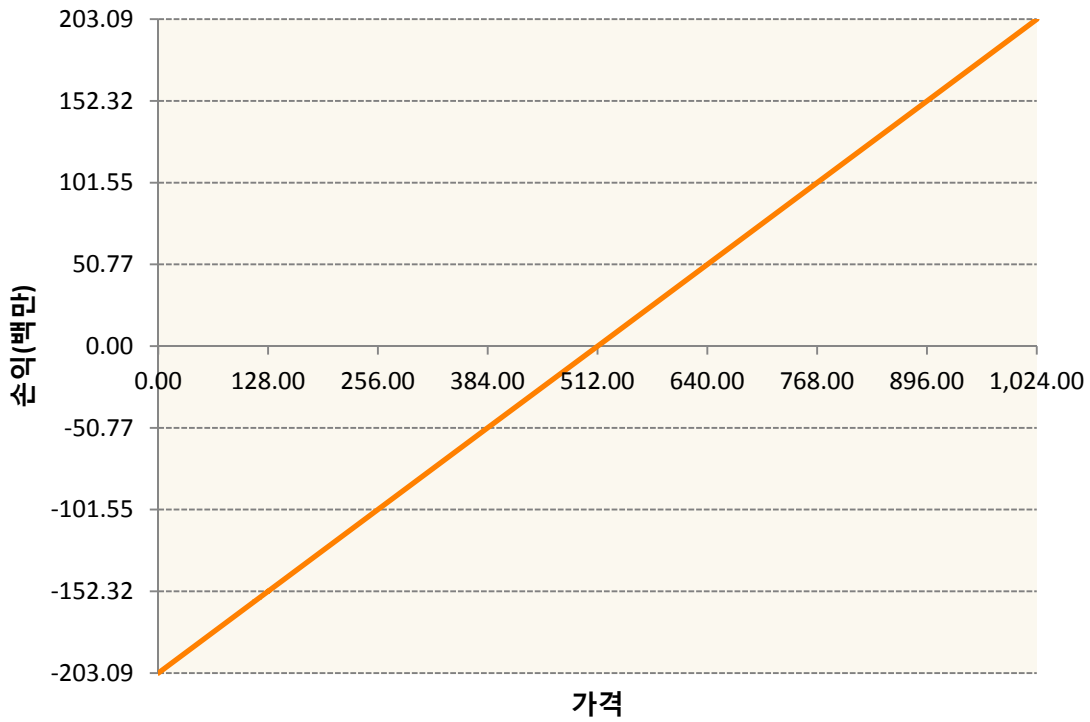




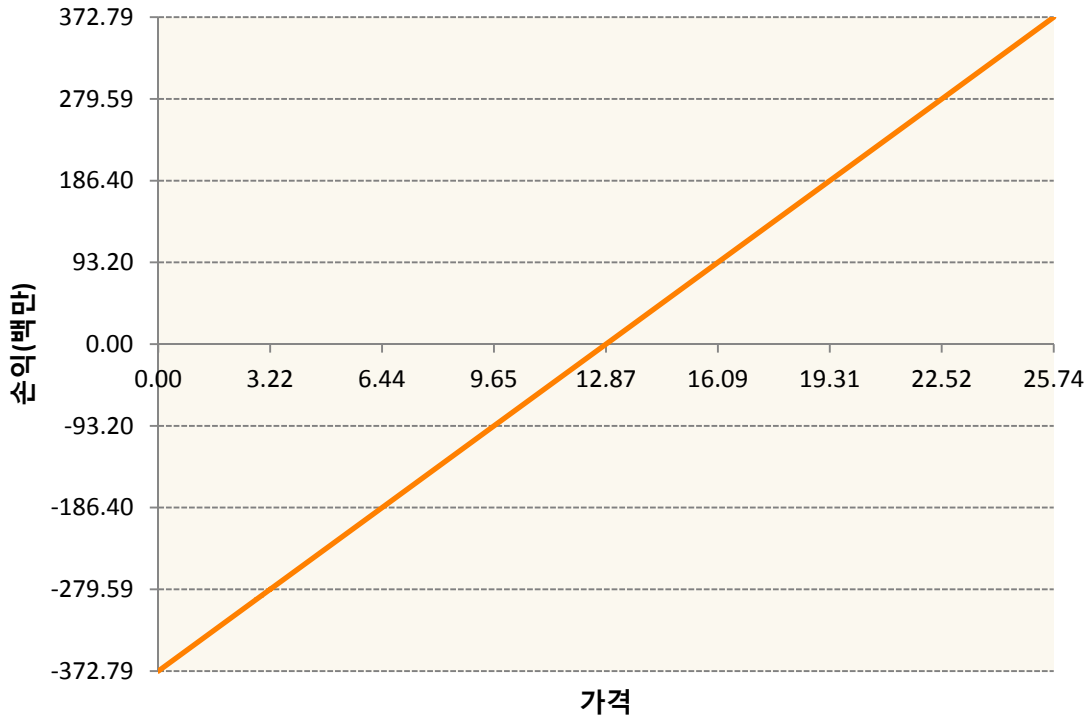
KR4175NC0005-2018-12 달러선물



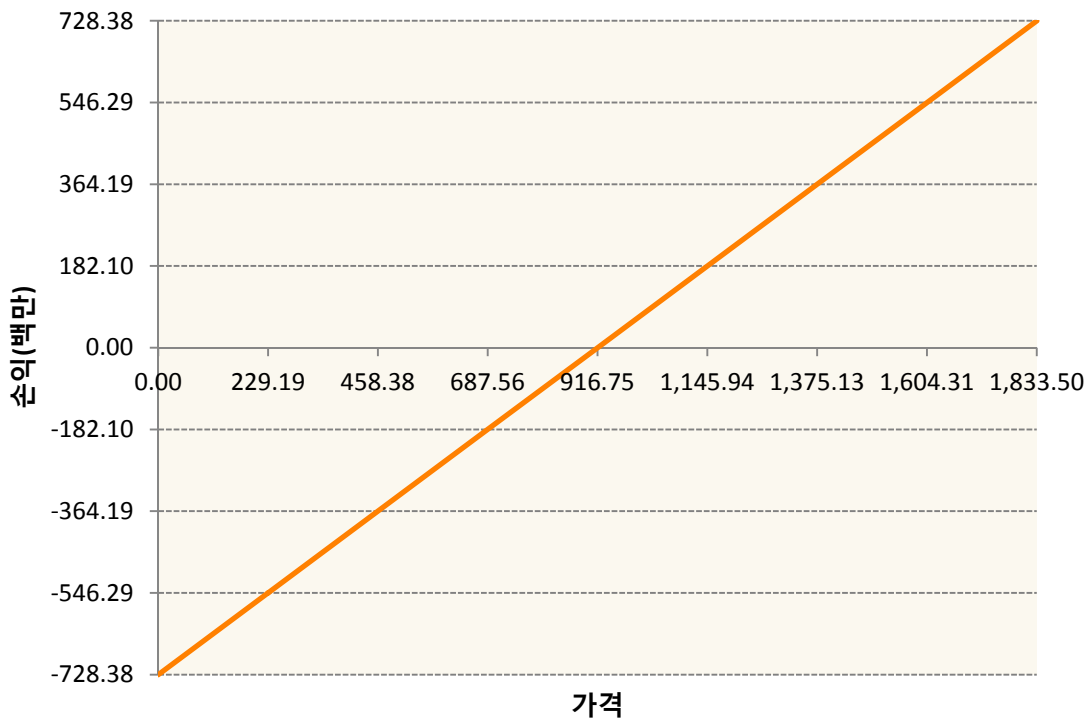
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



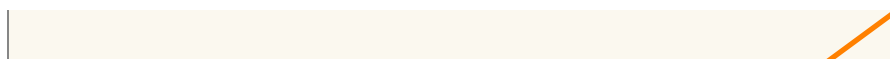
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

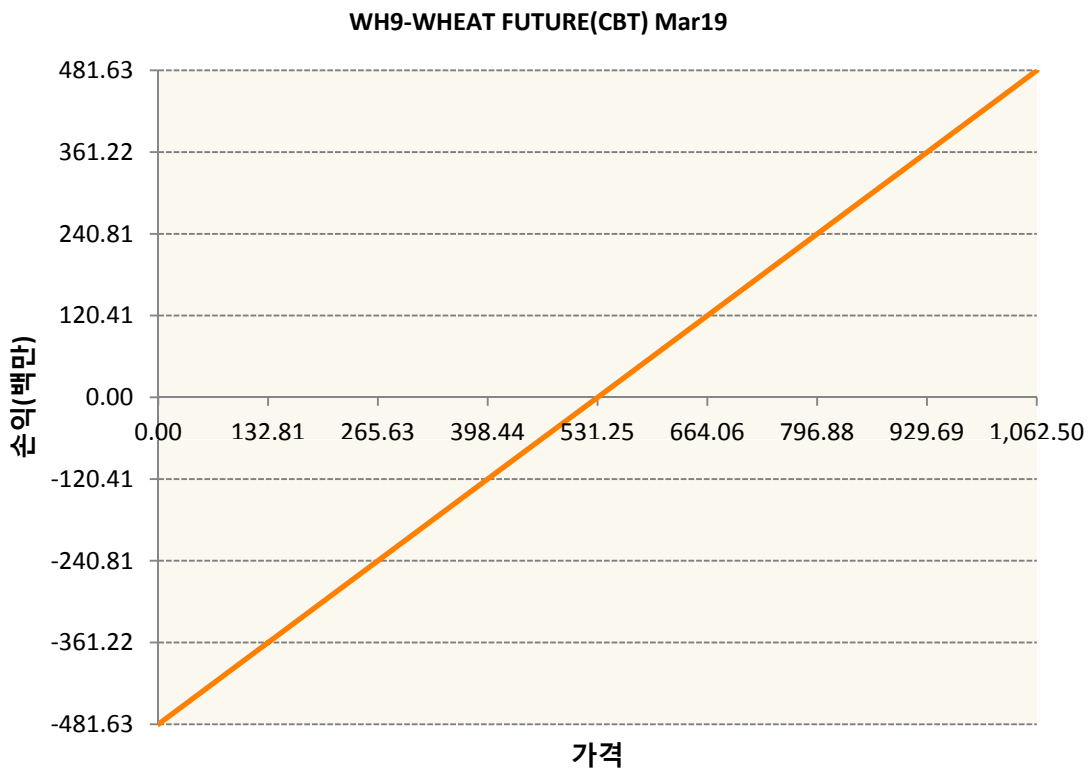
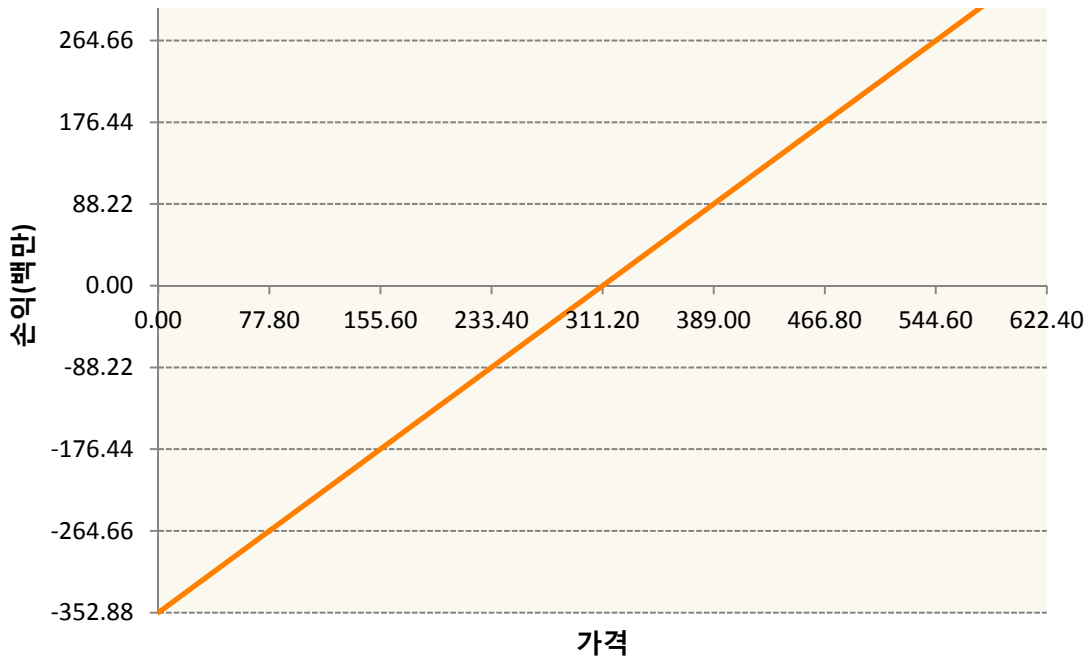


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19



SMF9-SOYBEAN MEAL FUTR Jan19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF9	SOYBEAN OIL FUTR Jan19	23
CH9	CORN FUTURE Mar19	66
CTH9	COTTON NO.2 FUTR Mar19	15
KCH9	COFFEE 'C' FUTURE Mar19	21
KR4175NC0	(2018-12 달러선물	6

KWH9	KC HRW WHEAT FUT Mar19	16
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	30
SF9	SOYBEAN FUTURE Jan19	58
SMF9	SOYBEAN MEAL FUTR Jan19	28
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	39

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

(단위:백만원)

319