

공시일	2018-12-12
기준일	2018-12-11

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)

68

공시일	2018-12-12
기준일	2018-12-11

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

1,039

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

530

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-12-12
기준일	2018-12-11

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	3,355	0	3,355	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S180910

267

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

393

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-12-12
기준일	2018-12-11

유로인덱스모(주식-파생형)

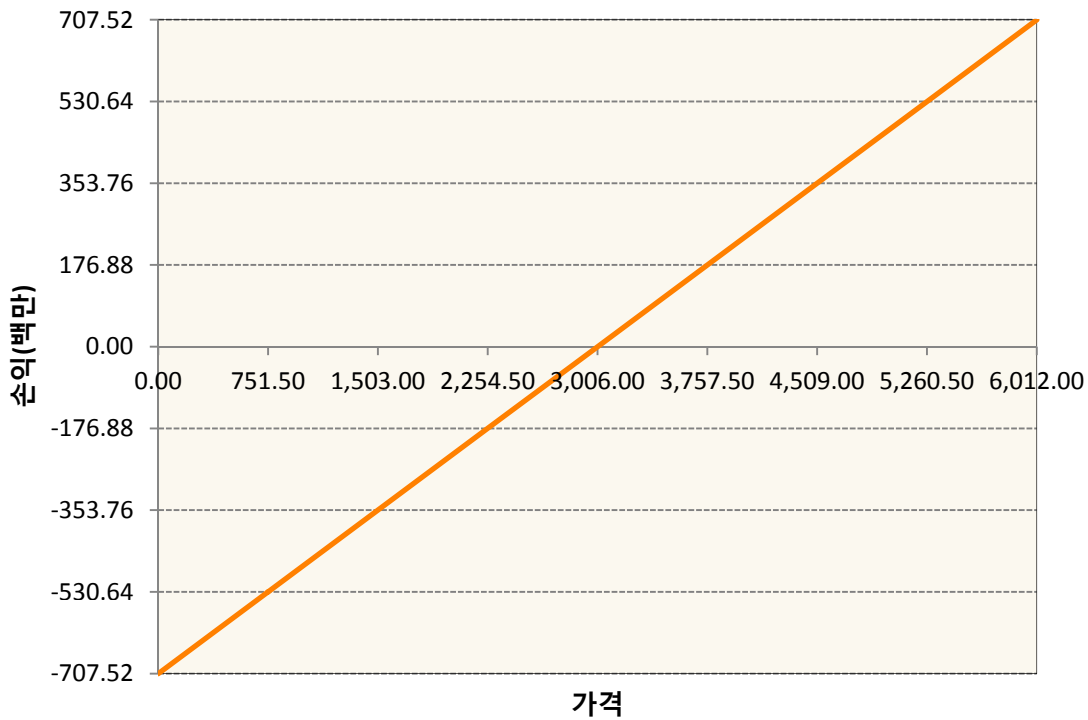
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	708	0	708	

2. 만기시점의 손익구조

VGZ8-EURO STOXX 50 DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ8	EURO STOXX 50 DEC18	57
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

37

공시일	2018-12-12
기준일	2018-12-11

차이나인덱스모(주식-파생형)

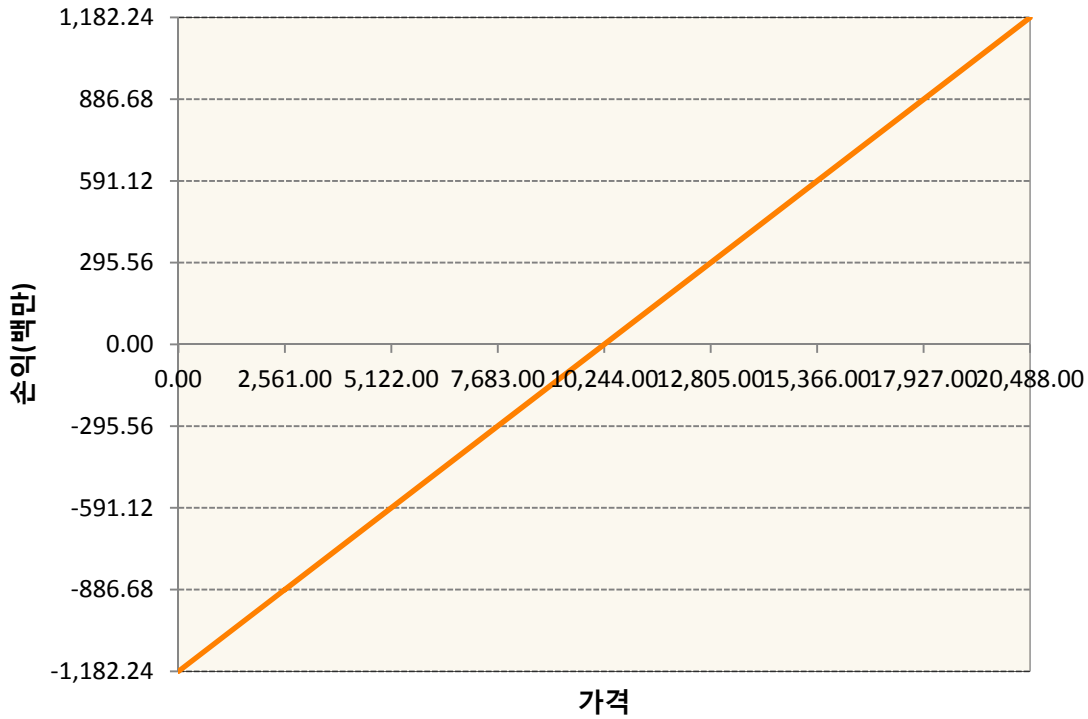
1. 계약금액

(단위:백만원)

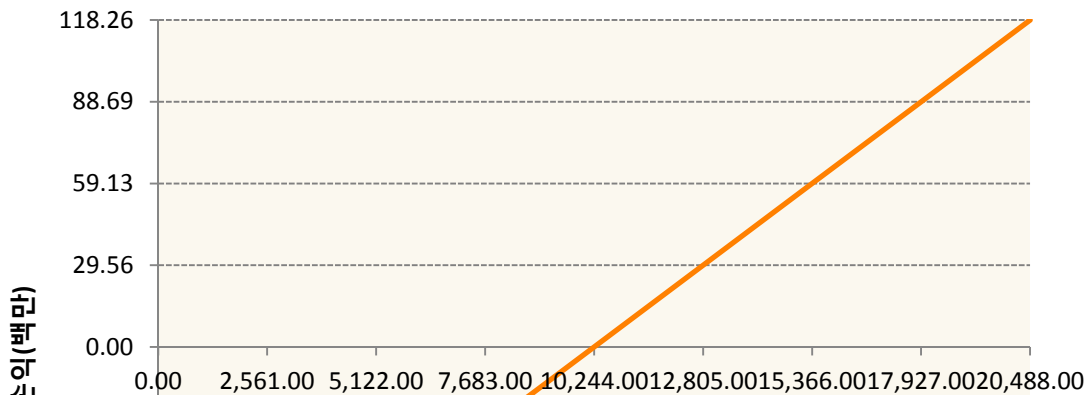
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,182	0	1,182	
누계	유가증권	선물	118	0	118	장내

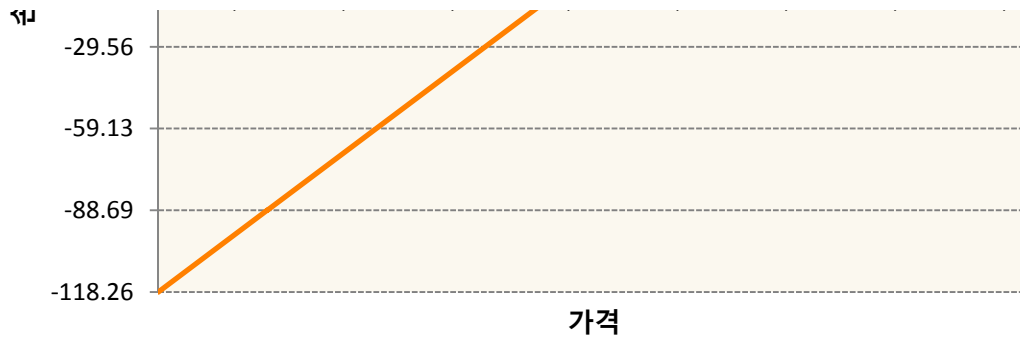
2. 만기시점의 손익구조

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	2018-12-12
기준일	2018-12-11

커버드콜모(주식혼합-파생형)

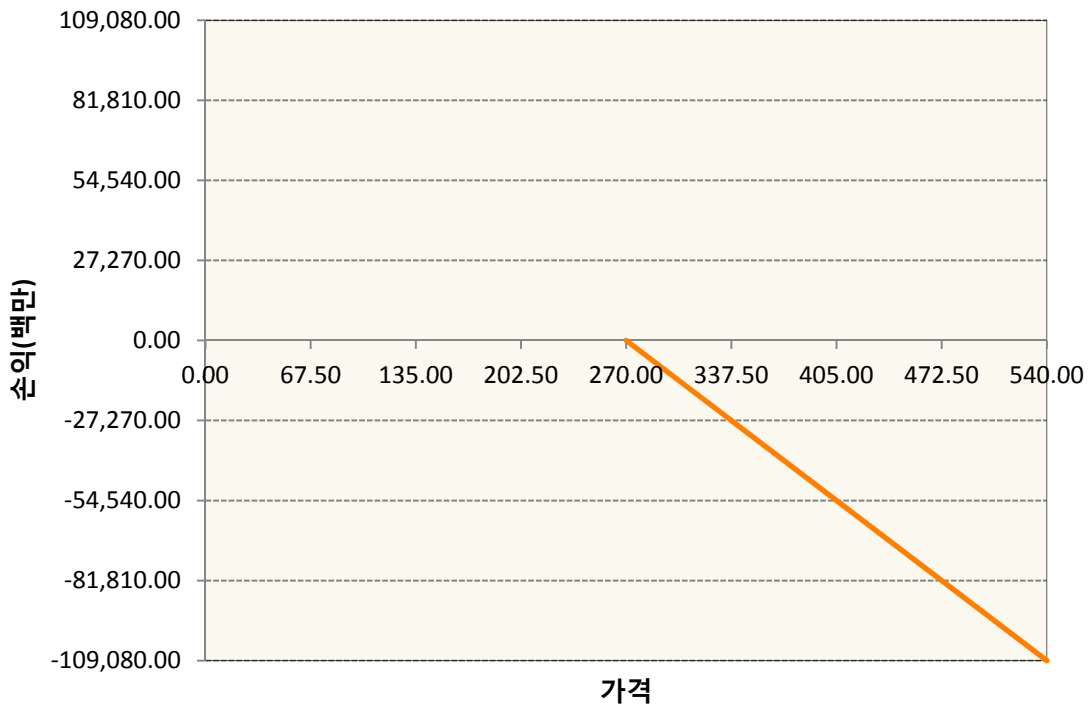
1. 계약금액

(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%	247	247	247	247	247	246	245
-2.67%	247	246	244	239	231	218	200
0%	185	138	76	0	-89	-190	-302
2.67%	-1,310	-1,525	-1,740	-1,956	-2,172	-2,389	-2,605
5.33%	-7,116	-7,203	-7,305	-7,422	-7,550	-7,689	-7,836
8.00%	-15,023	-15,027	-15,035	-15,048	-15,069	-15,098	-15,137
KR4301NC2727 2018-12 풋272.5							22,201
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,201	-22,201	-22,201	-22,201	-22,201	-22,201	-22,201
-5.33%	-14,790	-14,790	-14,790	-14,790	-14,790	-14,790	-14,790
-2.67%	-7,380	-7,380	-7,380	-7,380	-7,380	-7,380	-7,381
0%	27	23	14	0	-20	-45	-77
2.67%	6,581	6,450	6,318	6,185	6,052	5,919	5,785
5.33%	8,223	8,206	8,180	8,146	8,104	8,054	7,997
8.00%	8,241	8,241	8,241	8,241	8,240	8,239	8,236

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

(단위:백만원)

43,250

공시일	2018-12-12
기준일	2018-12-11

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

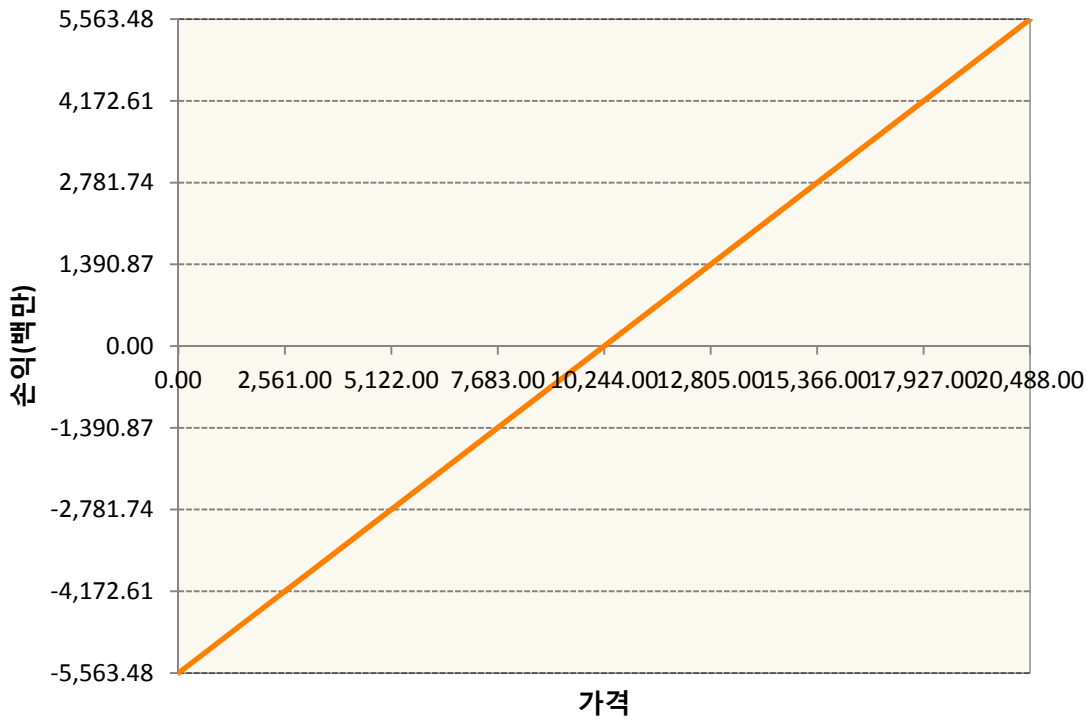
1. 계약금액

(단위:백만원)

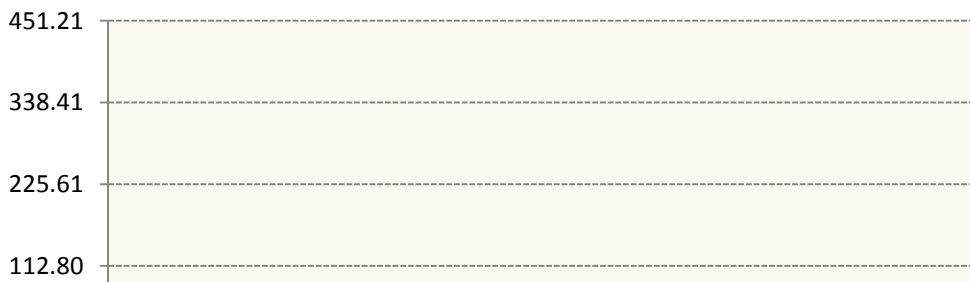
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,563	0	5,563	
누계	유가증권	옵션	0	12,860	-12,860	장내
누계	통화	선도	0	2,748	-2,748	장외

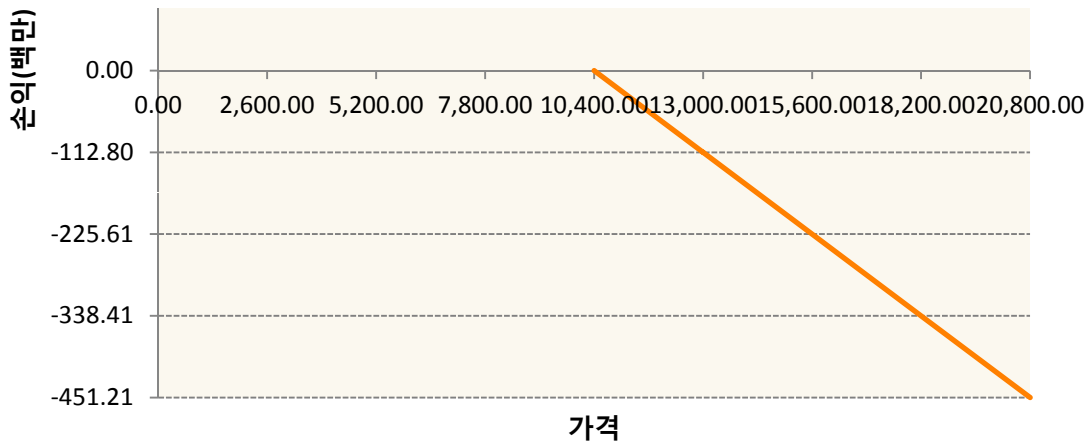
2. 만기시점의 손익구조

HCZ8-HSCEI FUTURES DEC 18

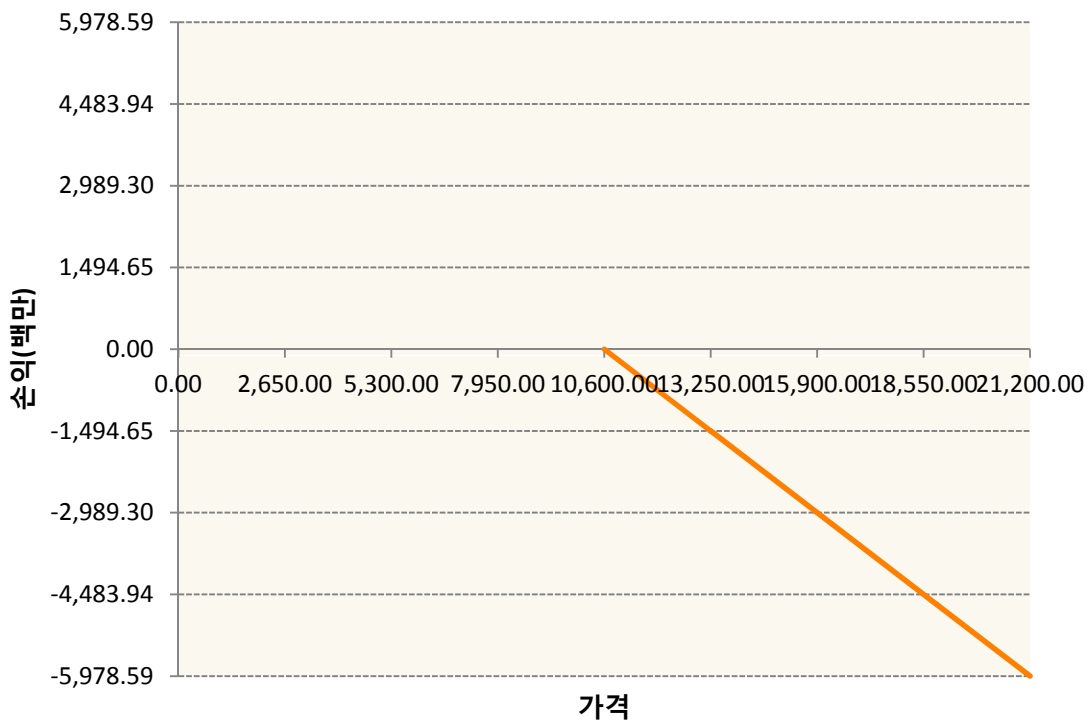


OHHI28-C104-HSCEI

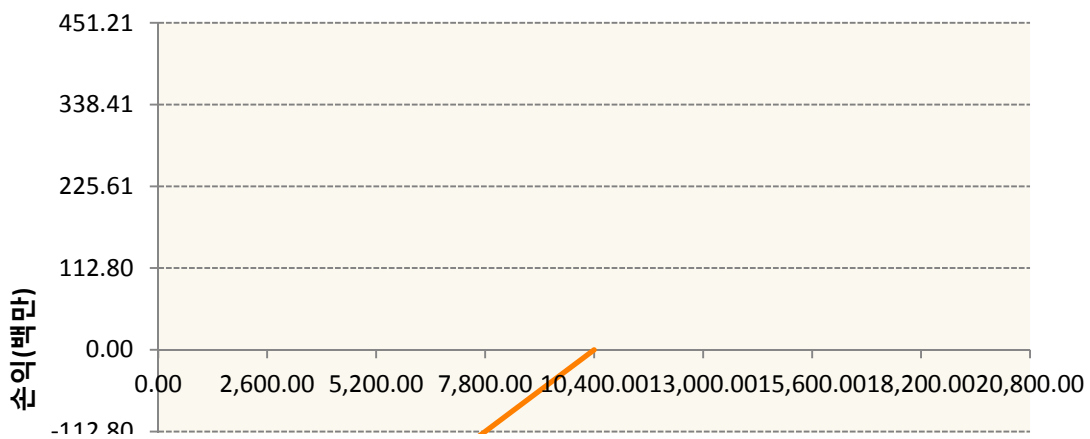


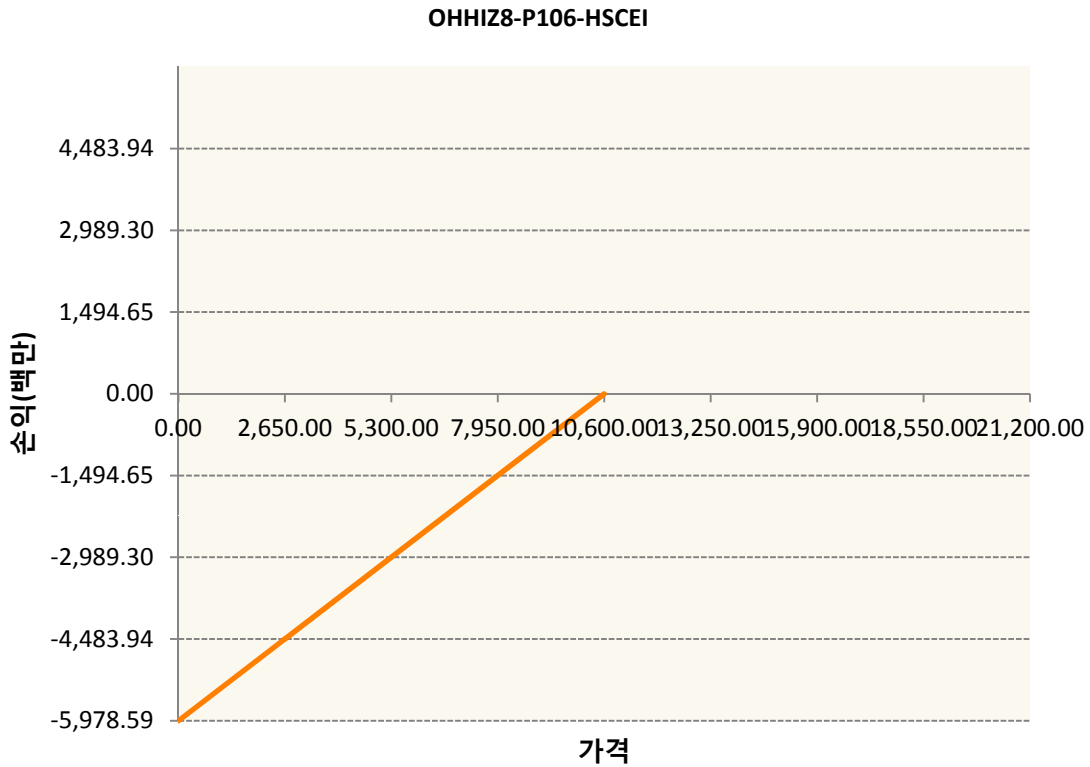
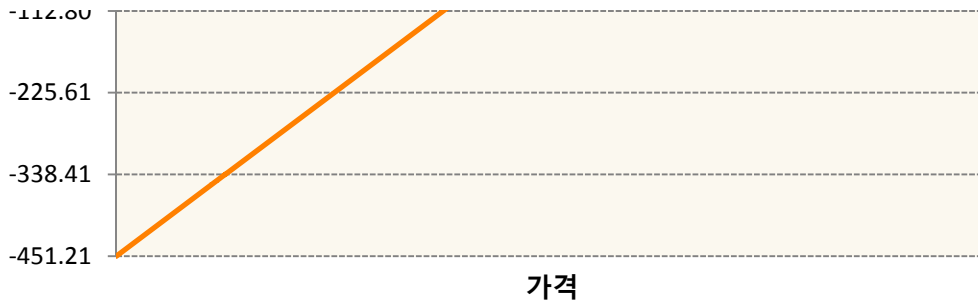


OHHIZ8-C106-HSCEI



OHHIZ8-P104-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	220
HCZ8 HSCEI FUTURES DEC 18	445
OHHIZ8-C1C HSCEI	36
OHHIZ8-C1C HSCEI	478
OHHIZ8-P10 HSCEI	36
OHHIZ8-P10 HSCEI	478

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,519

공시일	2018-12-12
기준일	2018-12-11

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

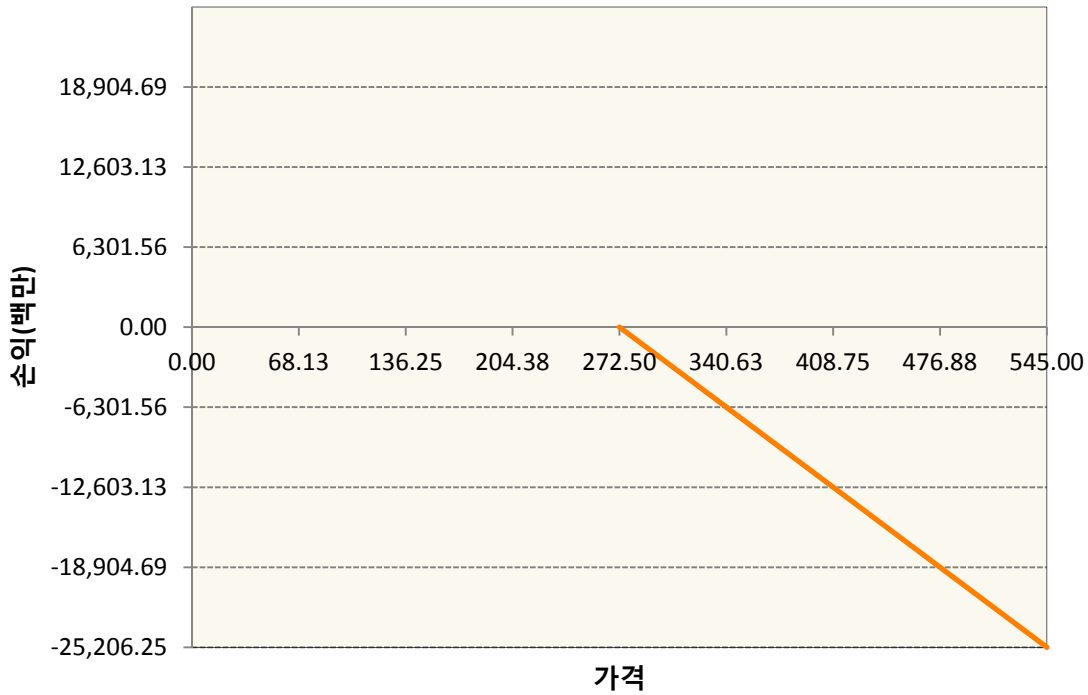
1. 계약금액

(단위:백만원)

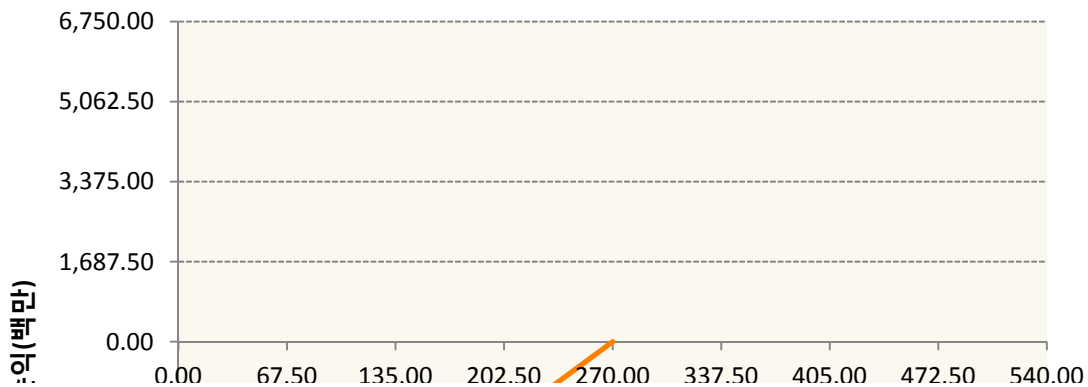
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	43,836	0	43,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	43,538	-43,538	장내

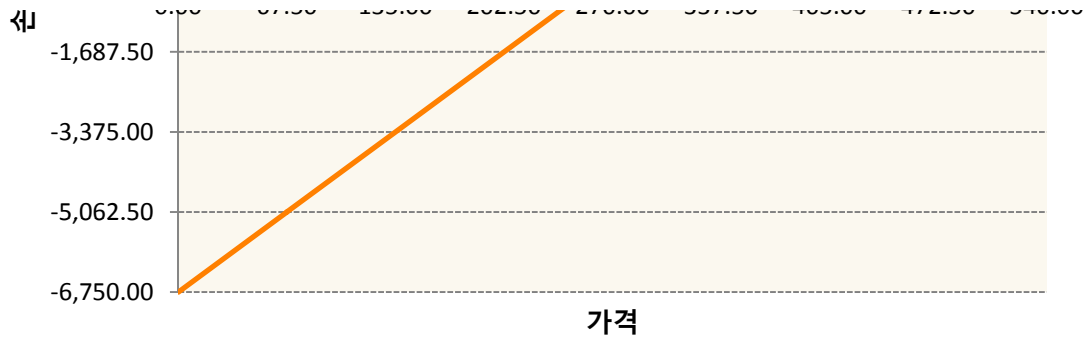
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NC2728-2018-12 콜272.5

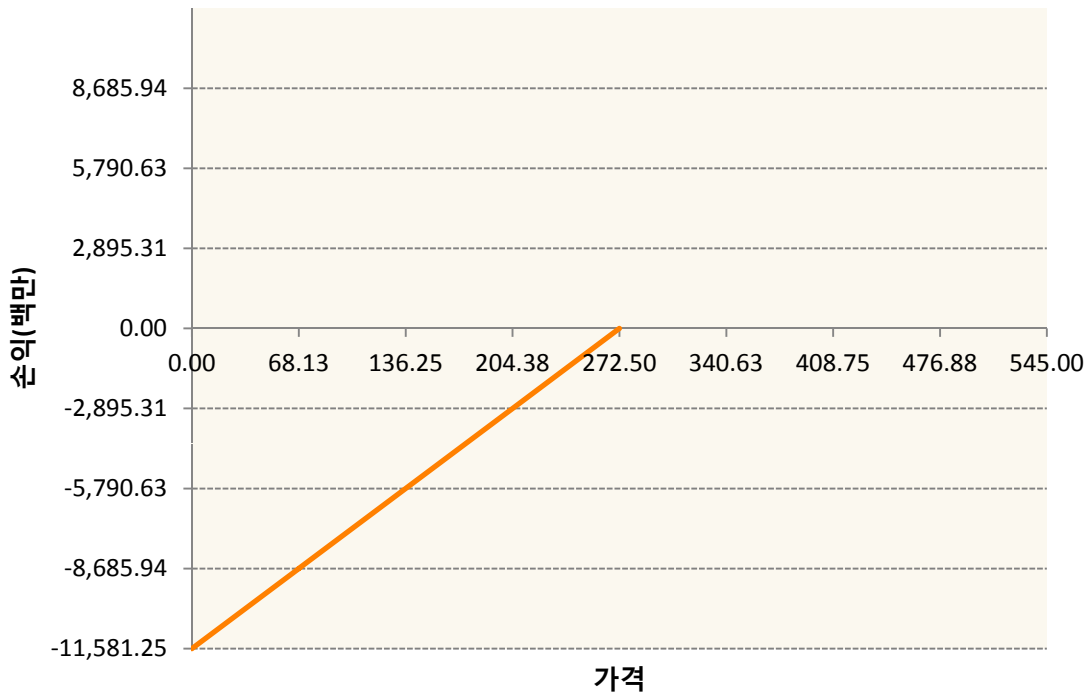


KR4301NC2701-2018-12 풋270





KR4301NC2727-2018-12 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14				3,621
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,621	-3,621	-3,621	-3,621	-3,621	-3,621	-3,621
-5.33%	-2,414	-2,414	-2,414	-2,414	-2,414	-2,414	-2,414
-2.67%	-1,207	-1,207	-1,207	-1,207	-1,207	-1,207	-1,207
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,207	1,207	1,207	1,207	1,207	1,207	1,207
5.33%	2,414	2,414	2,414	2,414	2,414	2,414	2,414
8.00%	3,621	3,621	3,621	3,621	3,621	3,621	3,621
	KR4201NC2728		2018-12 콜272.5				1,224
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	20	20	20	20	20	20	20
-5.33%	20	20	20	20	20	20	20
-2.67%	20	20	20	19	19	18	16
0%	15	11	6	0	-7	-15	-24
2.67%	-106	-123	-141	-158	-176	-193	-211
5.33%	-576	-583	-591	-600	-611	-622	-634
8.00%	-1,215	-1,216	-1,216	-1,217	-1,219	-1,221	-1,224
KR4301NC2701 2018-12 풋270							526
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-526	-526	-526	-526	-526	-526	-526
-5.33%	-349	-349	-349	-349	-349	-349	-349
-2.67%	-173	-173	-173	-173	-173	-173	-173
0%	3	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	124	122	119	116	113	110	107
5.33%	137	136	136	136	136	135	135
8.00%	137	137	137	137	137	137	137
KR4301NC2727 2018-12 풋272.5							899
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-899	-899	-899	-899	-899	-899	-899
-5.33%	-599	-599	-599	-599	-599	-599	-599
-2.67%	-299	-299	-299	-299	-299	-299	-299
0%	1	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	266	261	256	250	245	240	234
5.33%	333	332	331	330	328	326	324
8.00%	334	334	334	334	334	333	333

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

(단위:백만원)

6,269

공시일	2018-12-12
기준일	2018-12-11

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

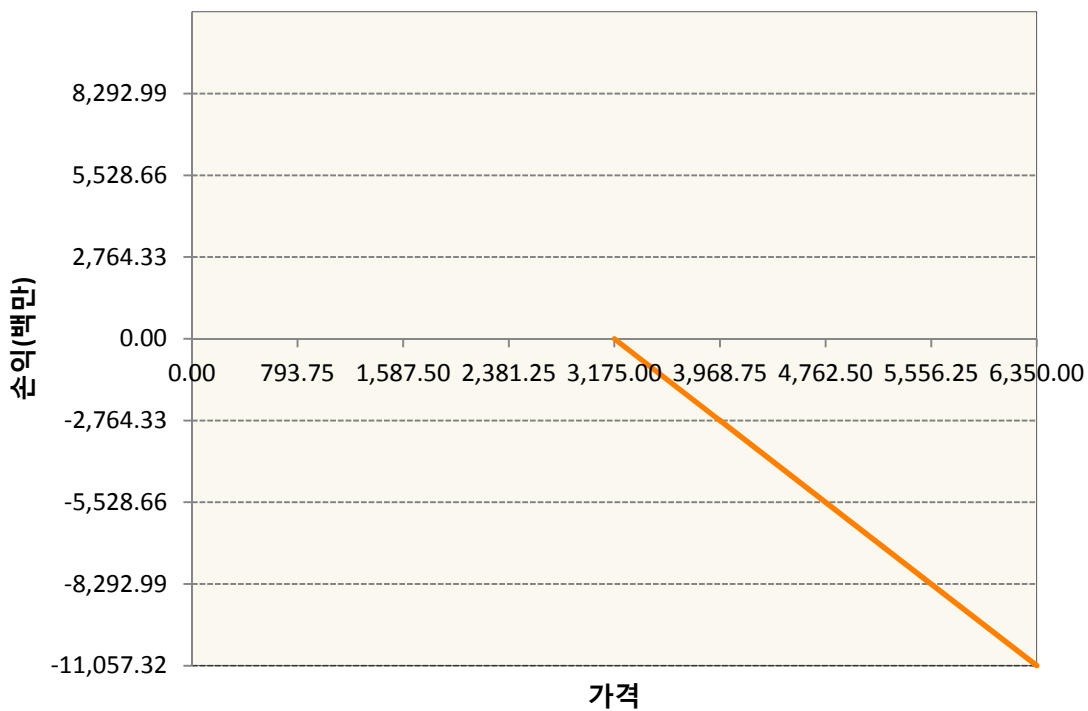
1. 계약금액

(단위:백만원)

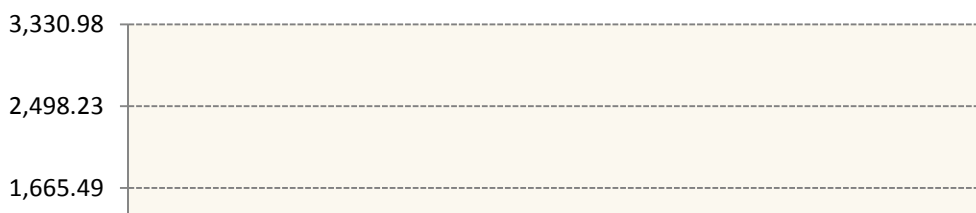
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,686	0	7,686	
누계	유가증권	스왑	71,780	0	71,780	장외
누계	유가증권	옵션	0	28,777	-28,777	장내
누계	통화	선도	0	15,422	-15,422	장외

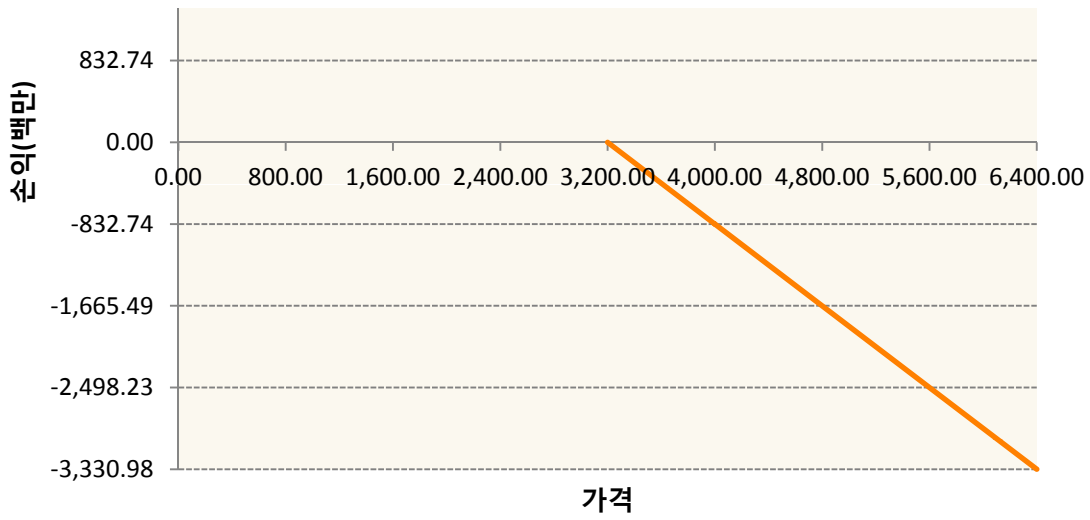
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ8-C3175-EURO STOXX 50

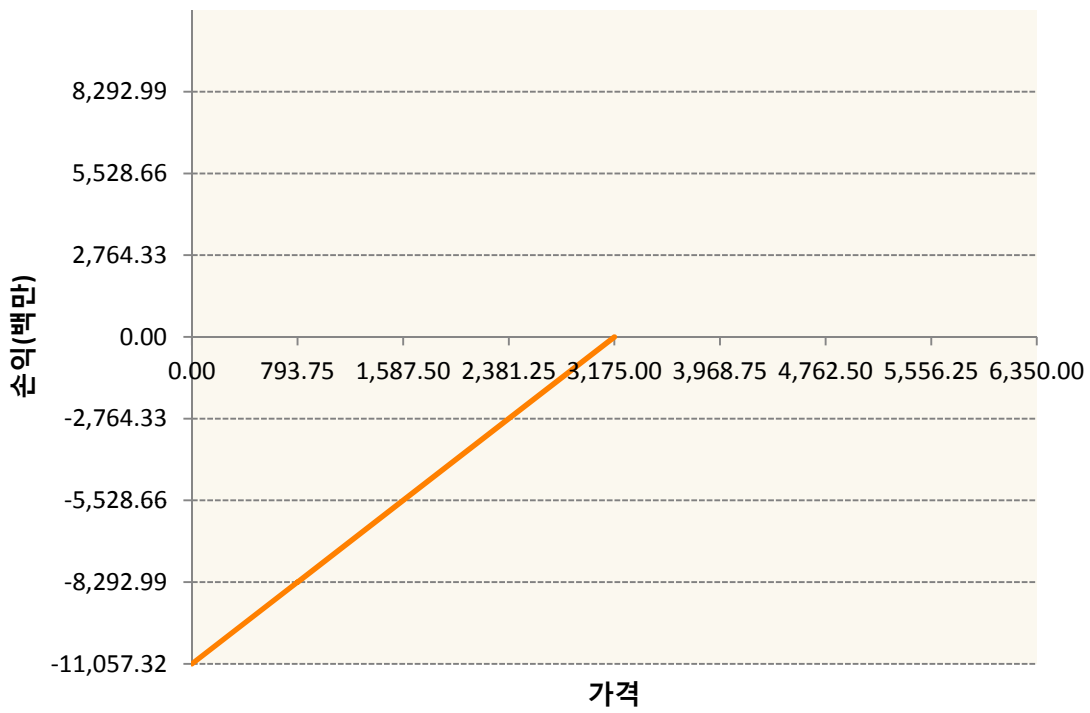


OESXZ8-C3200-EURO STOXX 50

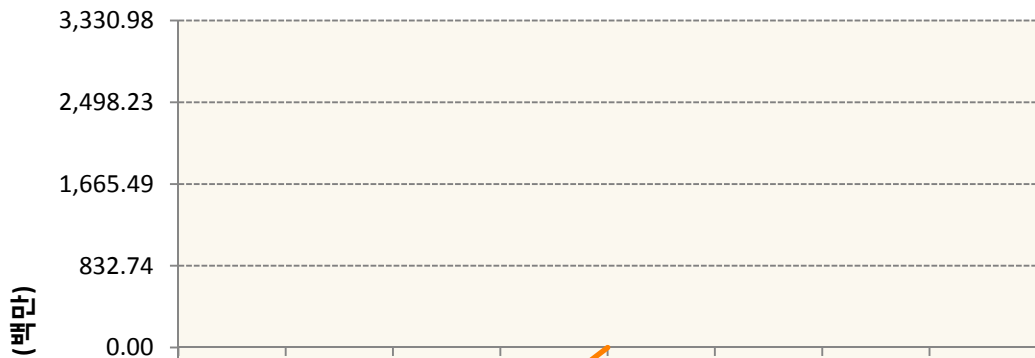


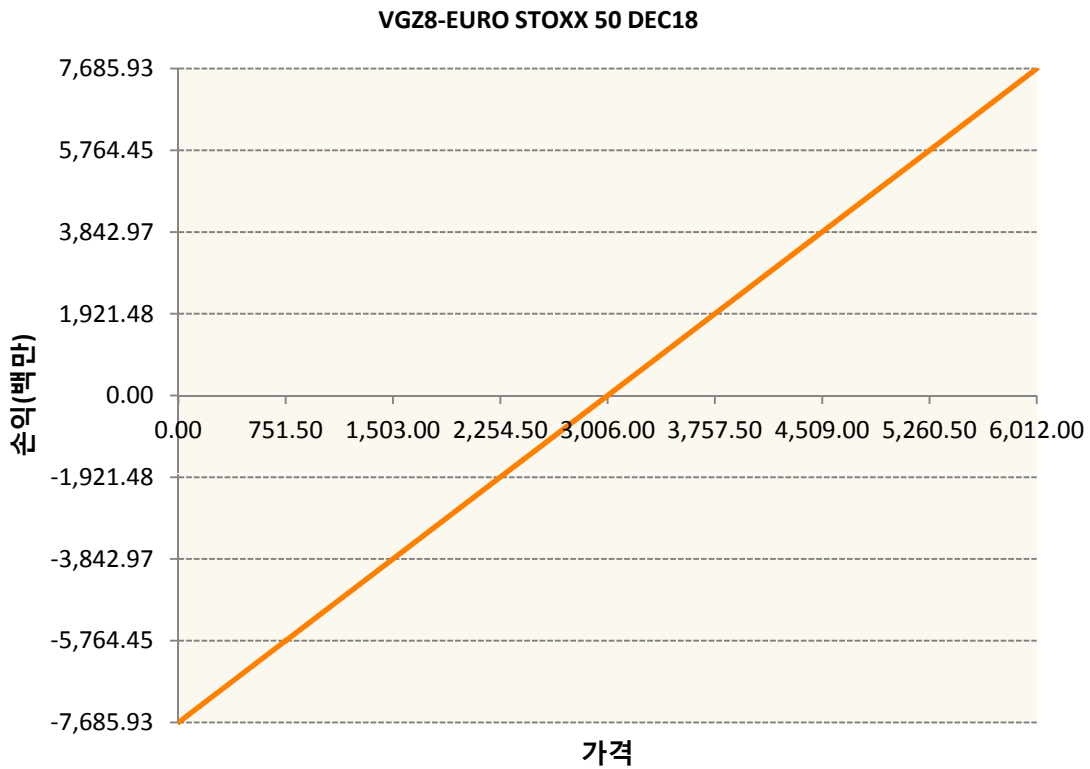
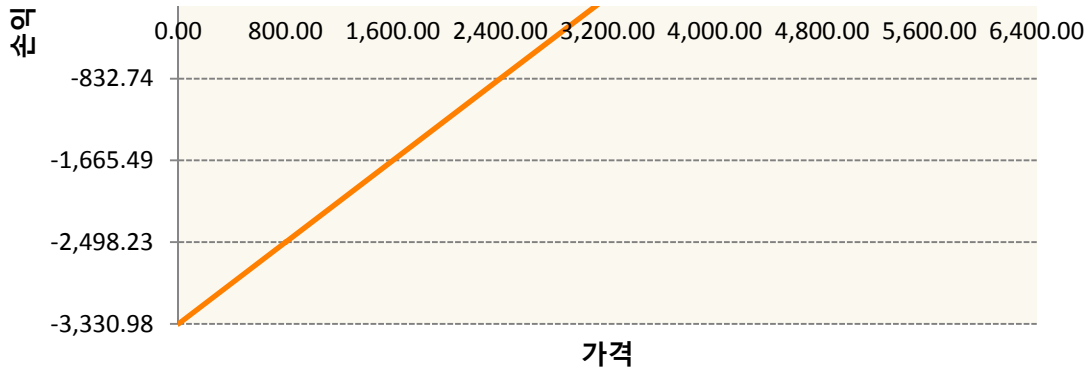


OESXZ8-P3175-EURO STOXX 50



OESXZ8-P3200-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	149
FX21018U03 KRW/EUR 21-12-18E	822
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E	411
OESXZ8-C31 EURO STOXX 50	885
OESXZ8-C32 EURO STOXX 50	266
OESXZ8-P31 EURO STOXX 50	885
OESXZ8-P32 EURO STOXX 50	266
VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18	615

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

(단위:백만원)

2,777

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

(단위:백만원)

1,077

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

(단위:백만원)

91

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

(단위:백만원)

136

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

(단위:백만원)

41

공시일	2018-12-12
기준일	2018-12-11

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

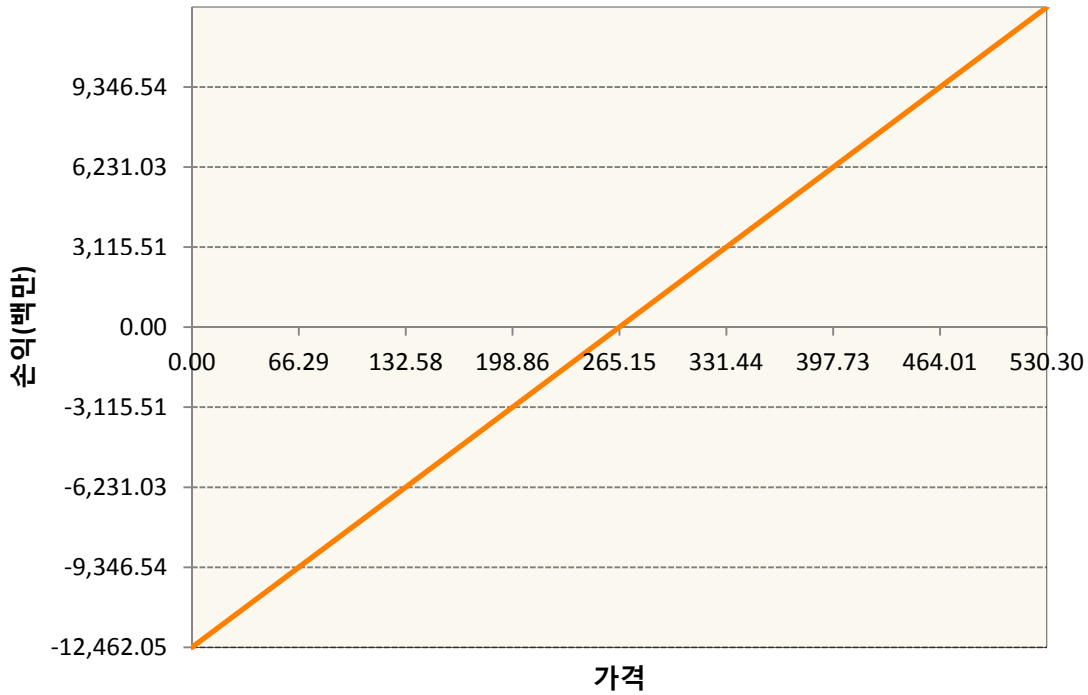
1. 계약금액

(단위:백만원)

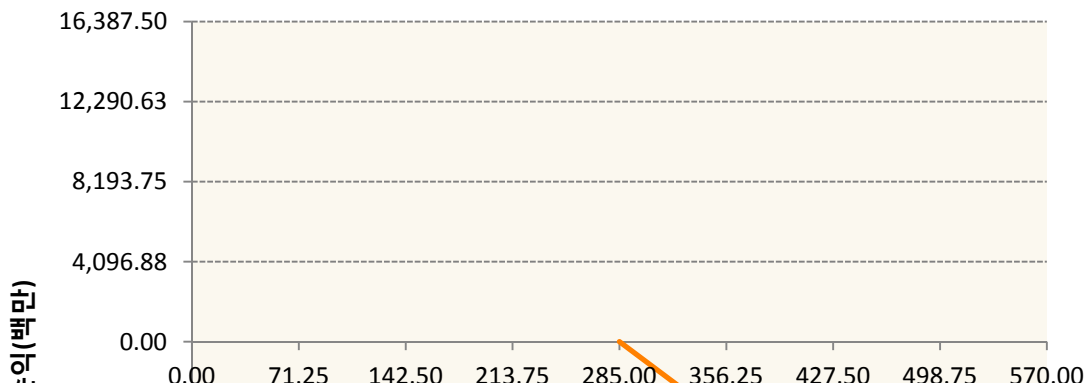
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,462	0	12,462	장내
누계	유가증권	옵션	3,743	23,072	-19,329	장내

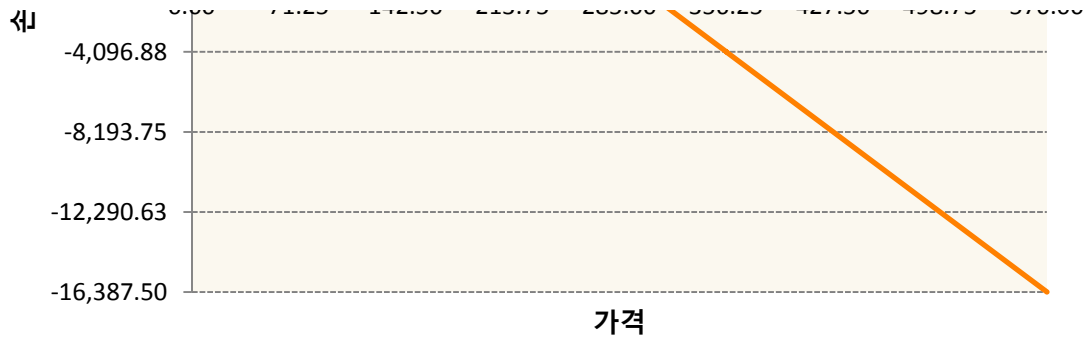
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

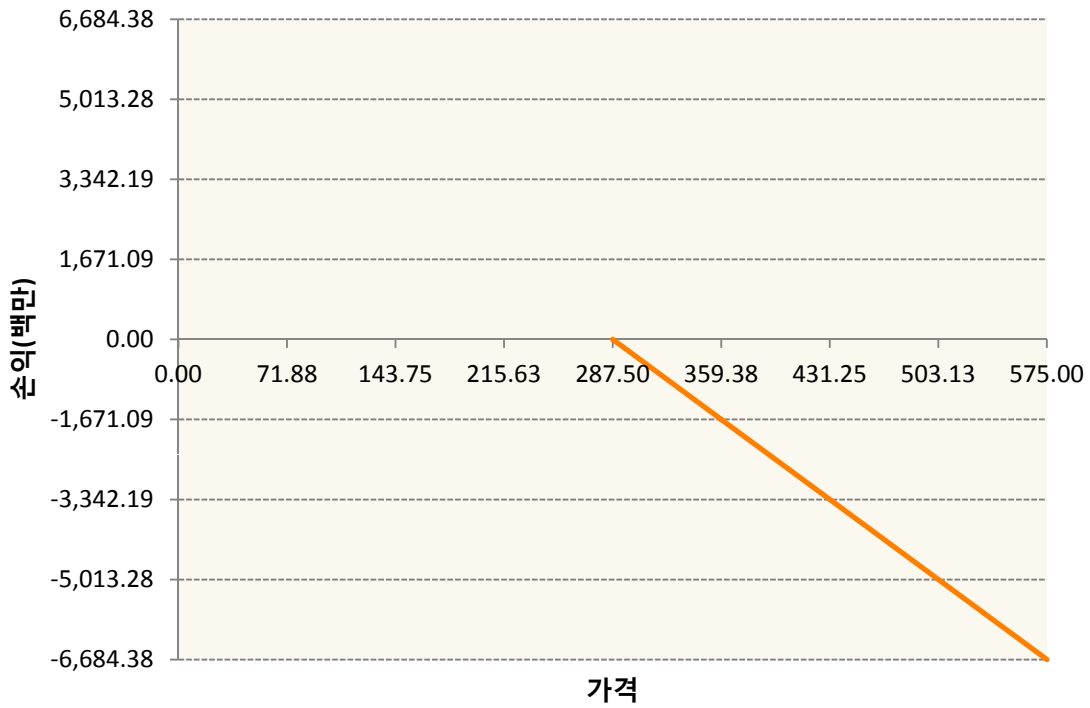


KR4201NC2850-2018-12 콜285

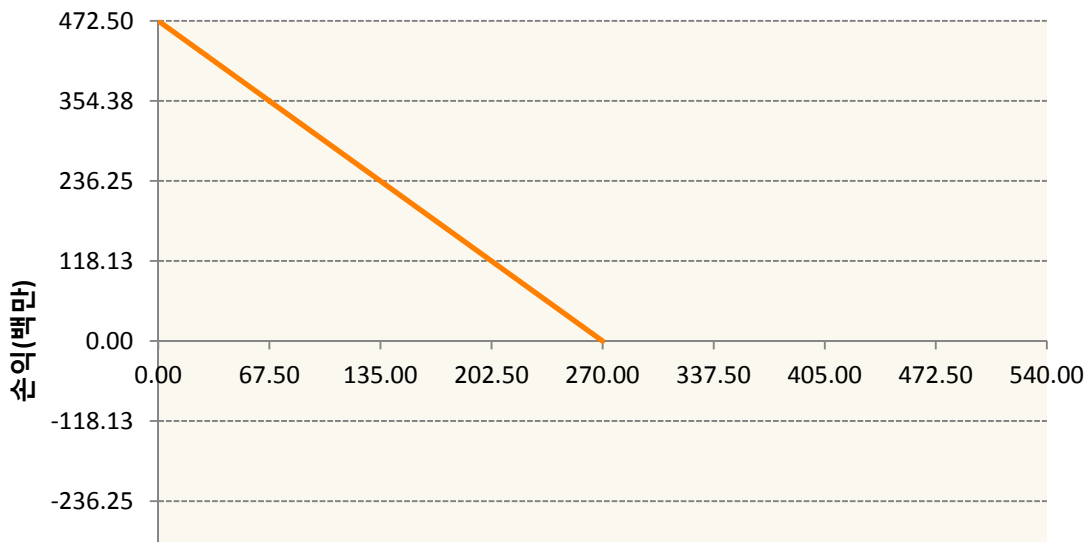


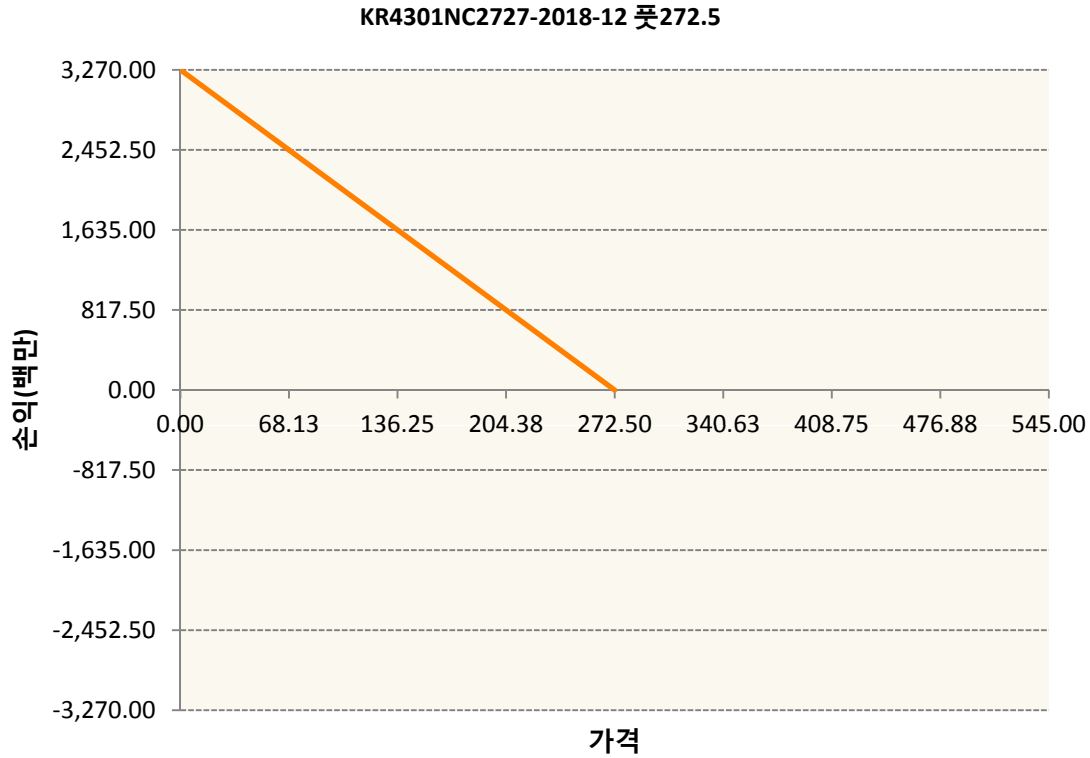
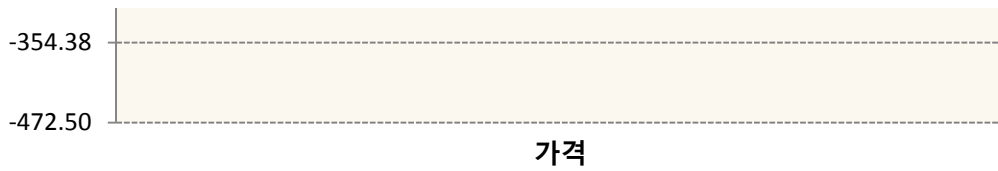


KR4201NC2876-2018-12 콜287.5



KR4301NC2701-2018-12 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0004		2018-12 코스피200지수선물						995
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-995	-995	-995	-995	-995	-995	-995	
-5.33%	-663	-663	-663	-663	-663	-663	-663	
-2.67%	-332	-332	-332	-332	-332	-332	-332	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	332	332	332	332	332	332	332	
5.33%	663	663	663	663	663	663	663	
8.00%	995	995	995	995	995	995	995	
KR4201NC2850		2018-12 콜285						198
		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	-4	-6
5.33%	-10	-14	-20	-26	-33	-40	-48
8.00%	-130	-141	-152	-164	-175	-187	-198
KR4201NC2876 2018-12 콜287.5							53
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	0	0	0	-1	-1
5.33%	-1	-2	-3	-4	-6	-8	-10
8.00%	-26	-30	-34	-39	-43	-48	-53
KR4301NC2701 2018-12 풋270							37
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	37	37	37	37	37	37	37
-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	0
2.67%	-9	-9	-8	-8	-8	-8	-7
5.33%	-10	-10	-10	-10	-10	-9	-9
8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
KR4301NC2727 2018-12 풋272.5							254
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	254	254	254	254	254	254	254
-5.33%	169	169	169	169	169	169	169
-2.67%	84	84	84	84	84	84	84
0%	0	0	0	0	0	1	1
2.67%	-75	-74	-72	-71	-69	-68	-66
5.33%	-94	-94	-93	-93	-93	-92	-91
8.00%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94

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

(단위:백만원)

1,123

공시일	2018-12-12
기준일	2018-12-11

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	127	0	127	

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	2018-12-12
기준일	2018-12-11

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	1,594	0	1,594	

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	2018-12-12
기준일	2018-12-11

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	413	0	413	
누계	통화	선도	0	887	-887	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
FX21018Z01 KRW/USD 28-02-19E	28
FX21018Z01 KRW/USD 28-02-19E	9

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

(단위:백만원)

27

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

(단위:백만원)

143

공시일	2018-12-12
기준일	2018-12-11

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

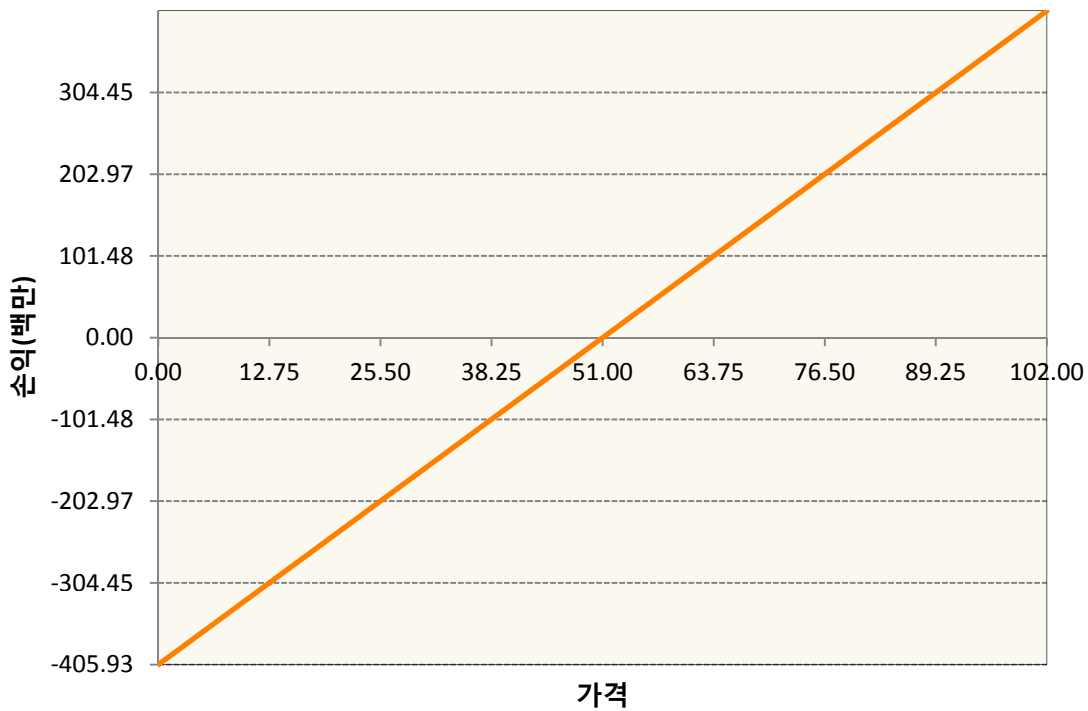
1. 계약금액

(단위:백만원)

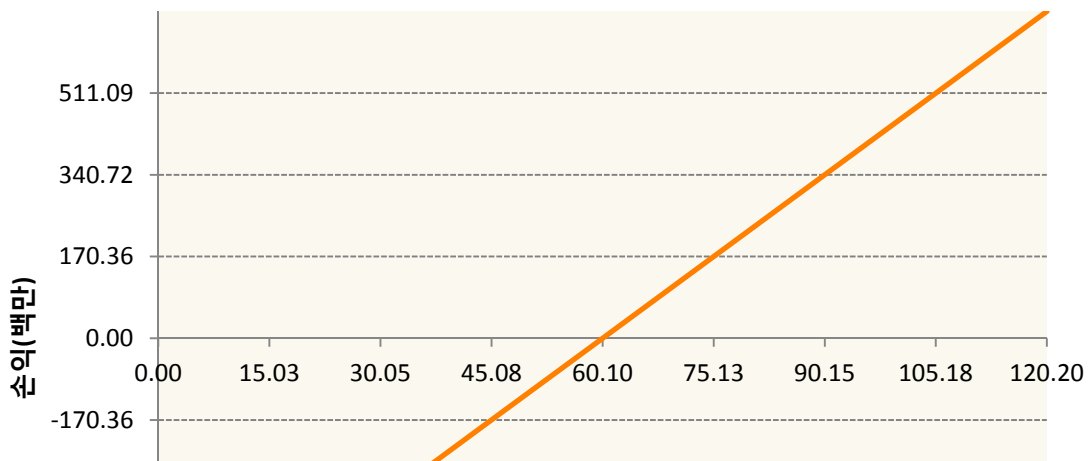
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,999	260	2,739	

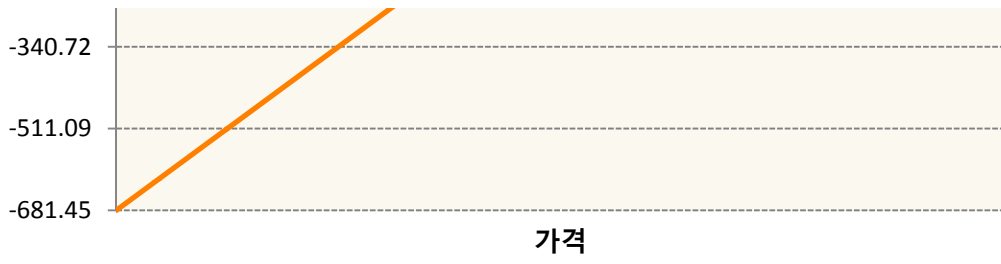
2. 만기시점의 손익구조

CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19

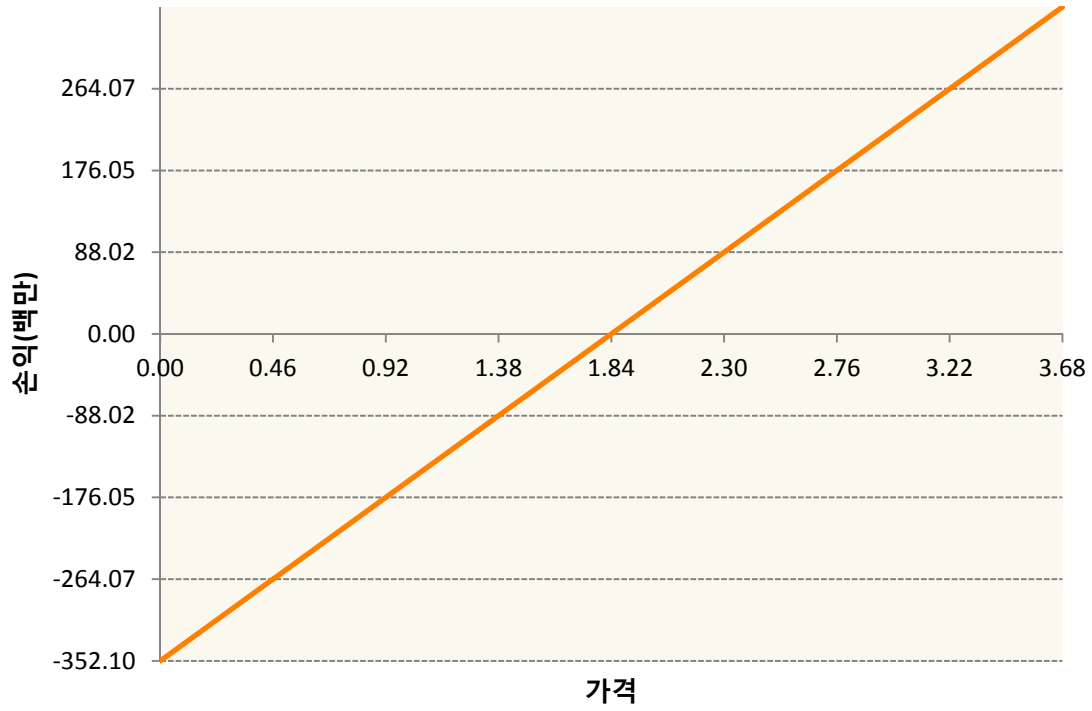


COH9-BRENT CRUDE FUTR Mar19

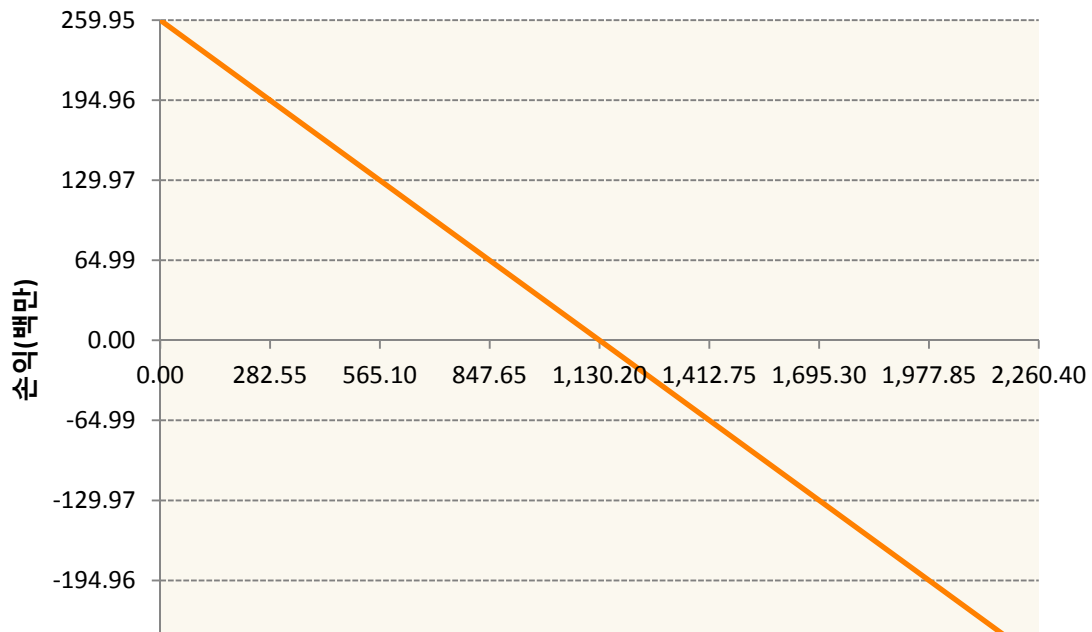


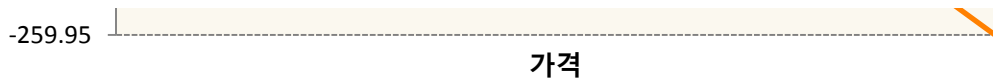


HOF9-NY Harb ULSD Fut Jan19

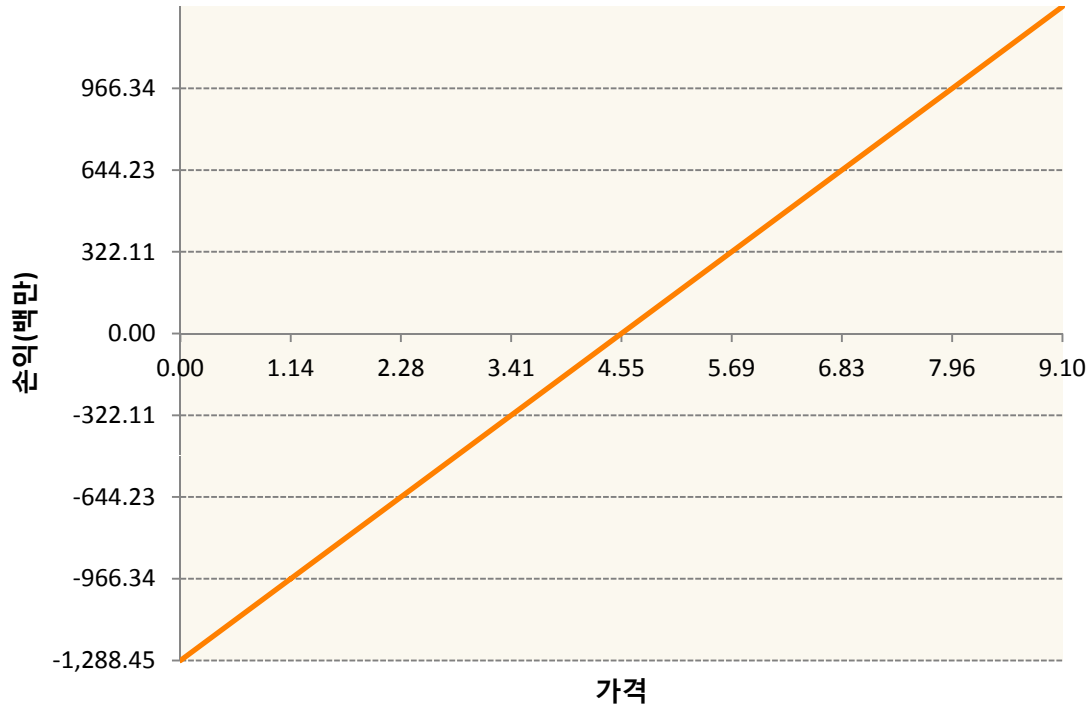


KR4175NC0005-2018-12 달러선물

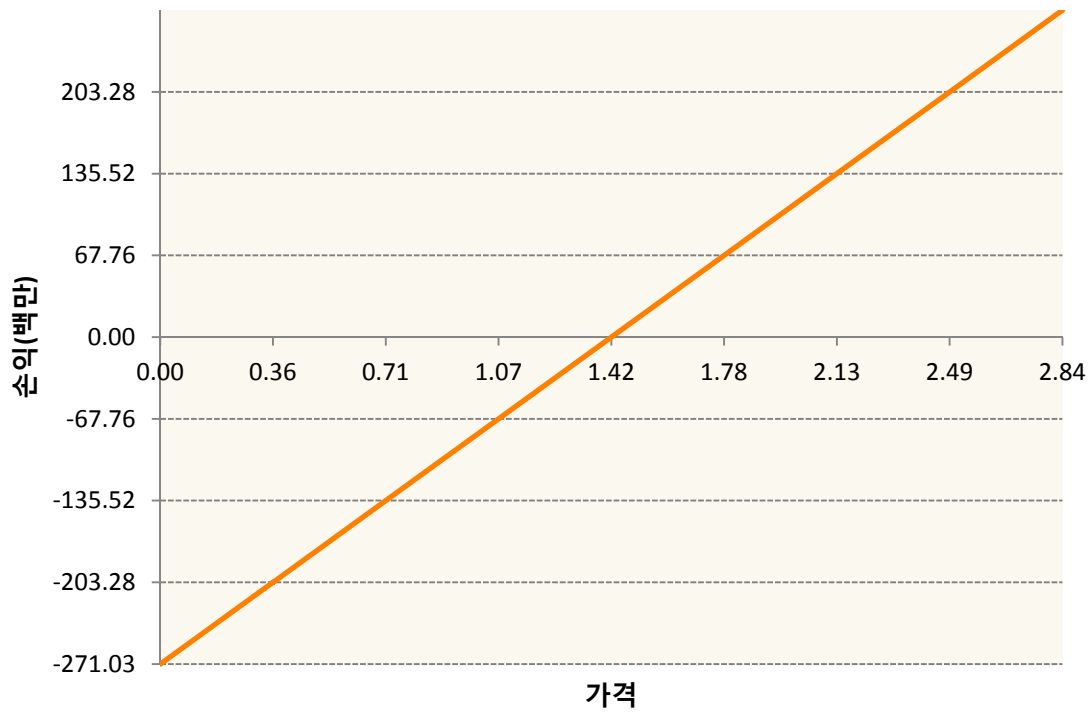




NGF19-NATURAL GAS FUTR Jan19



XBF9-GASOLINE RBOB FUT Jan19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF9	WTI CRUDE FUTURE Jan19	32
COH9	BRENT CRUDE FUTR Mar19	55
HOF9	NY Harb ULSD Fut Jan19	28
KR4175NC0	(2018-12 달러선물	21
NGF19	NATURAL GAS FUTR Jan19	103
XBF9	GASOLINE RBOB FUT Jan19	22

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

432

공시일	2018-12-12
기준일	2018-12-11

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

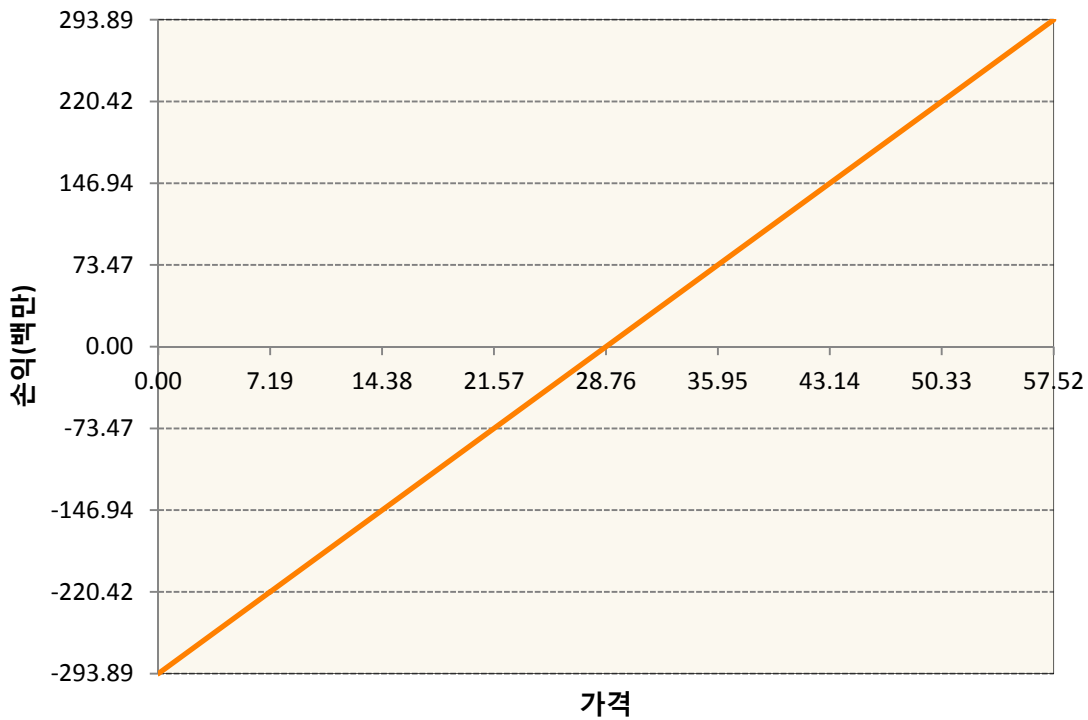
1. 계약금액

(단위:백만원)

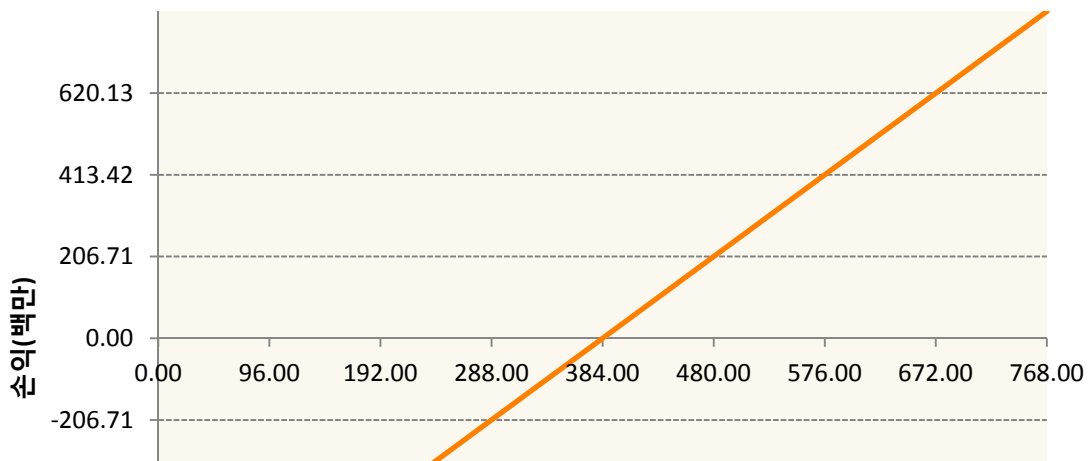
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,691	79	3,612	

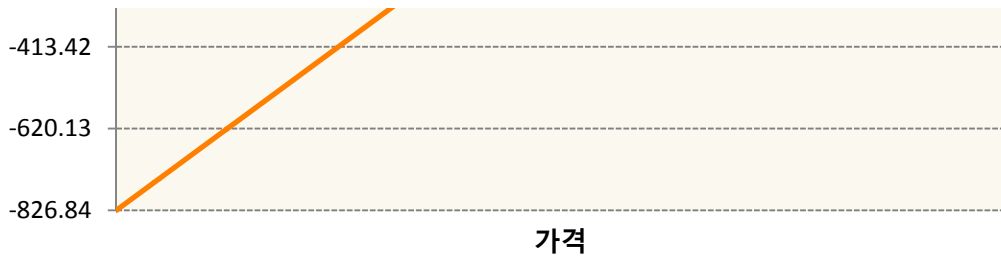
2. 만기시점의 손익구조

BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19

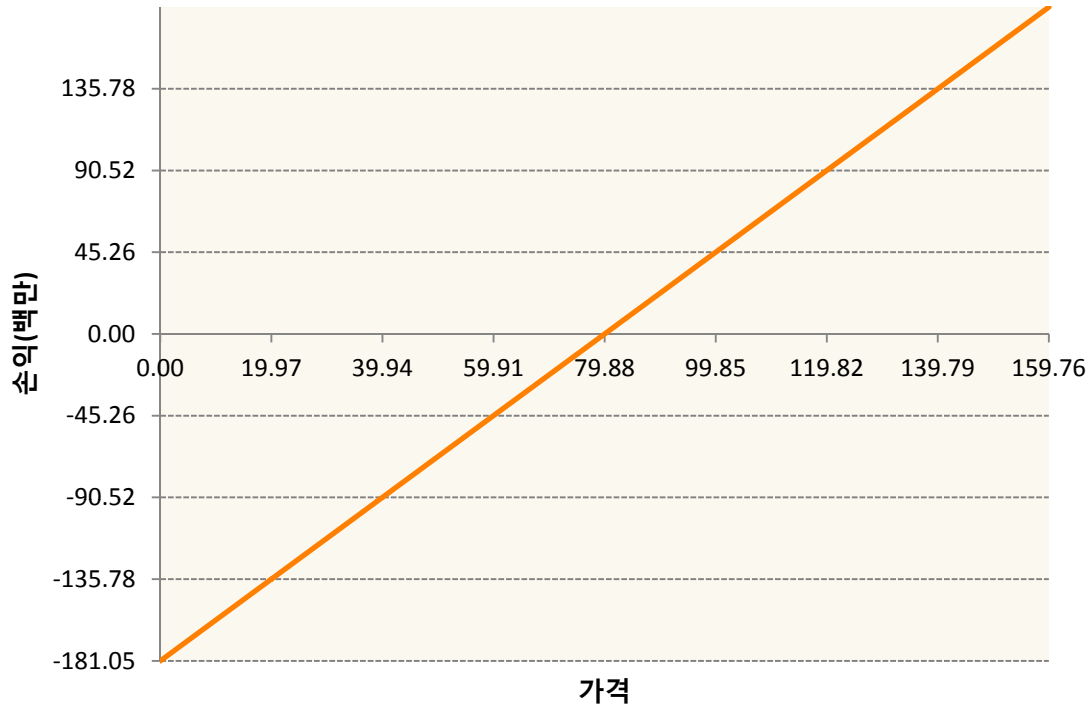


CH9-CORN FUTURE Mar19

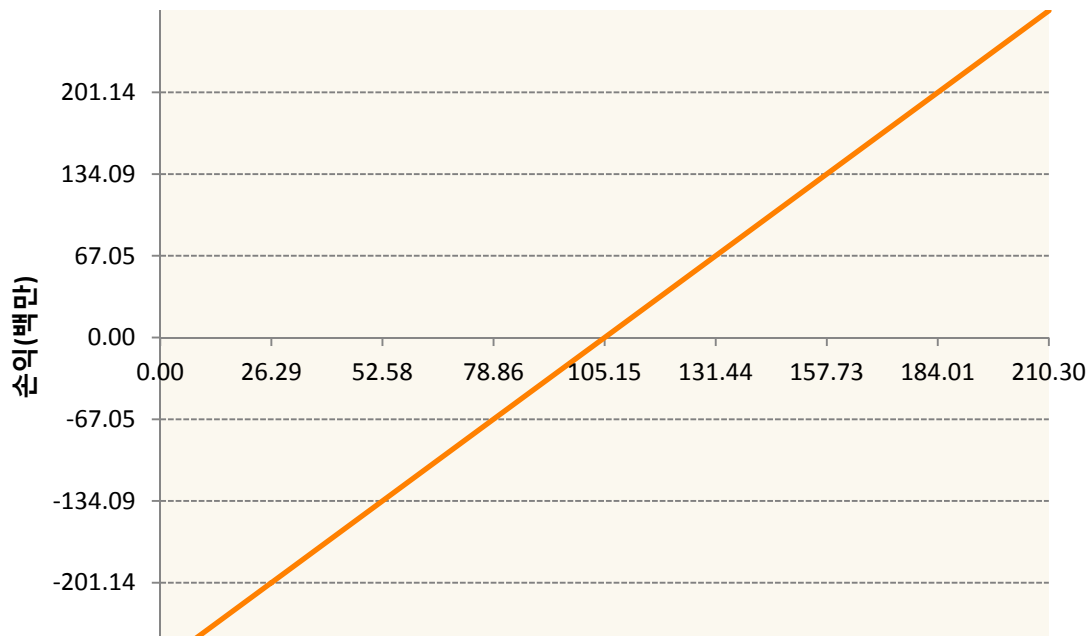


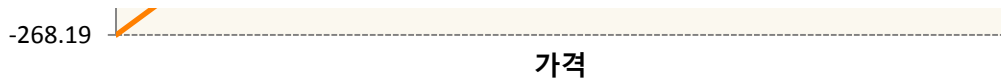


CTH9-COTTON NO.2 FUTR Mar19

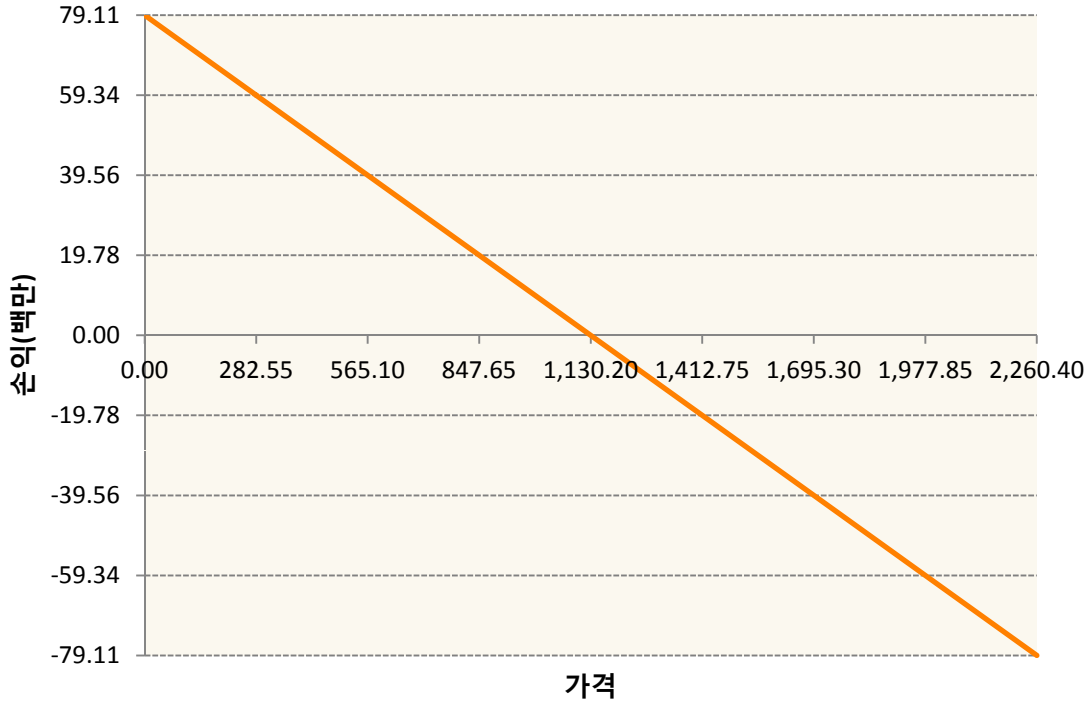


KCH9-COFFEE 'C' FUTURE Mar19

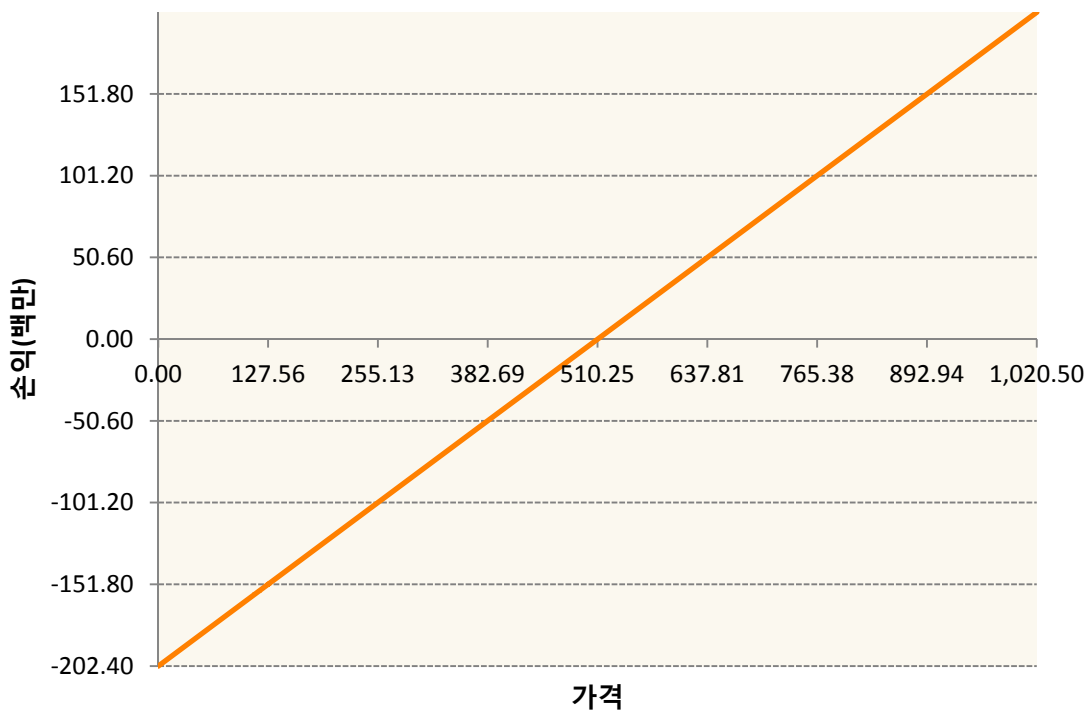




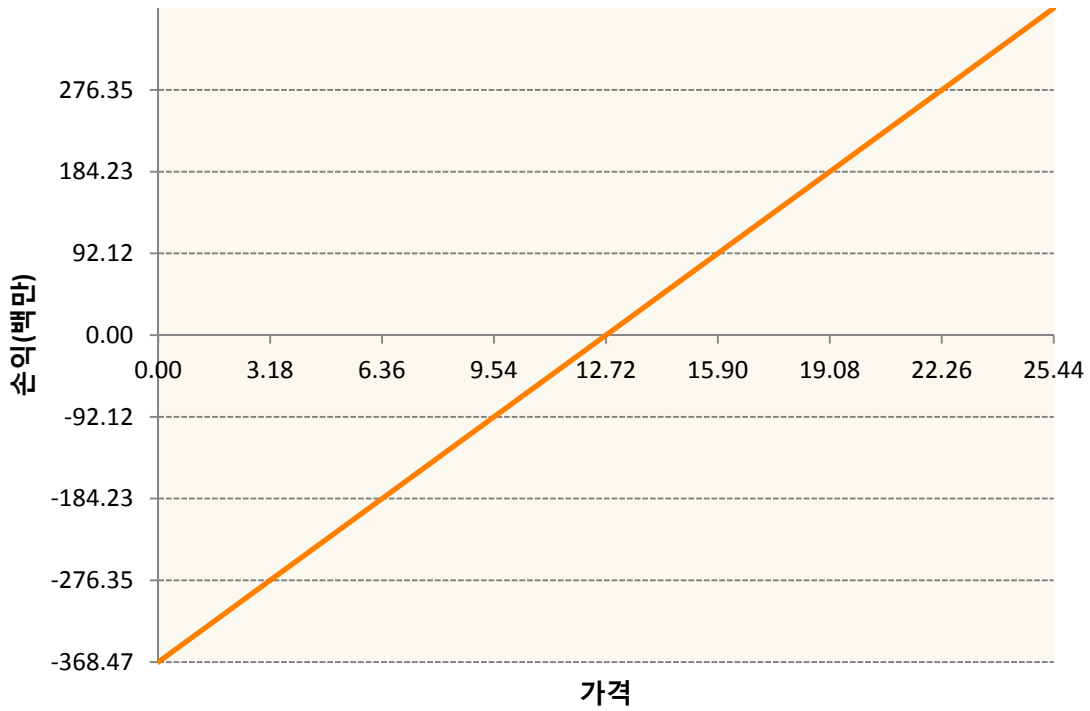
KR4175NC0005-2018-12 달러선물



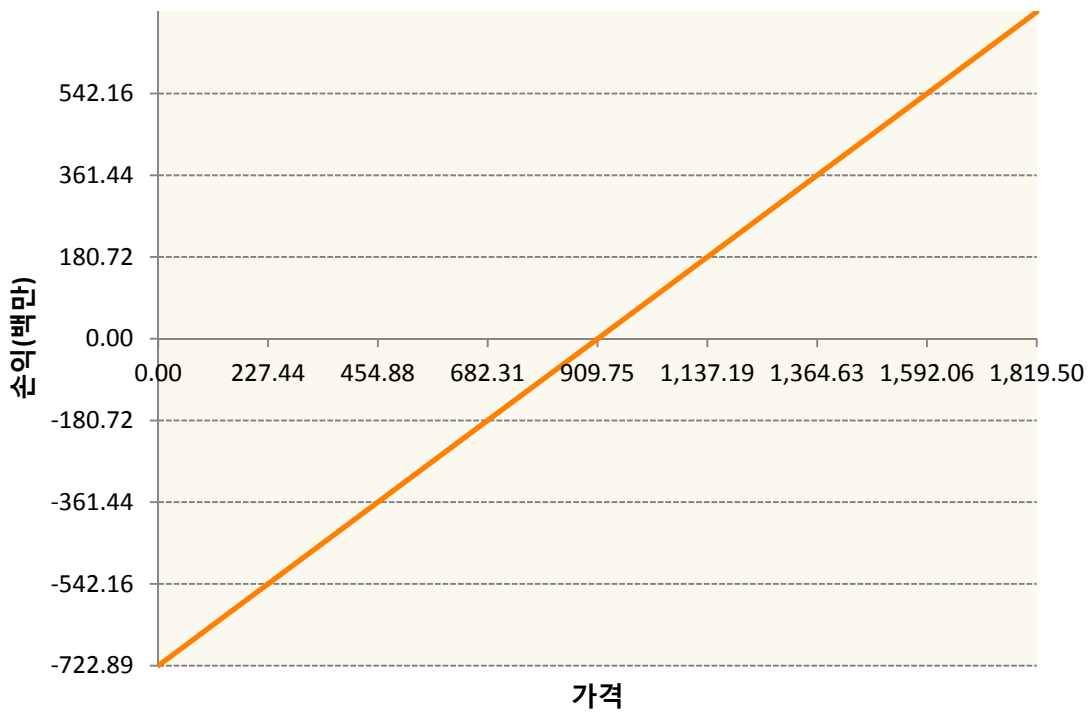
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

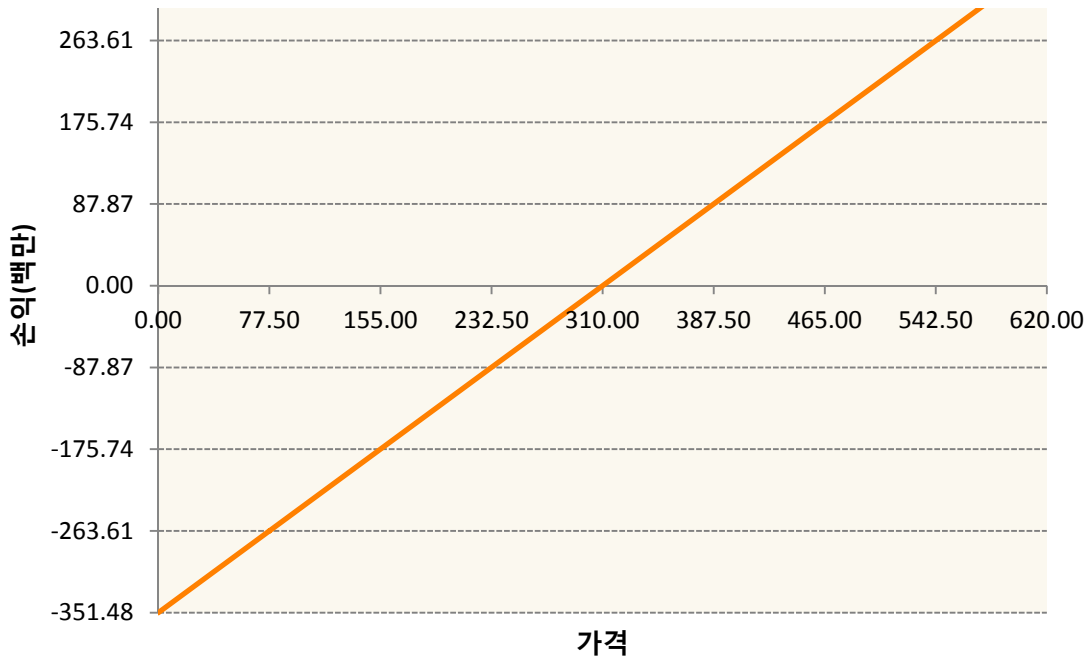


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19

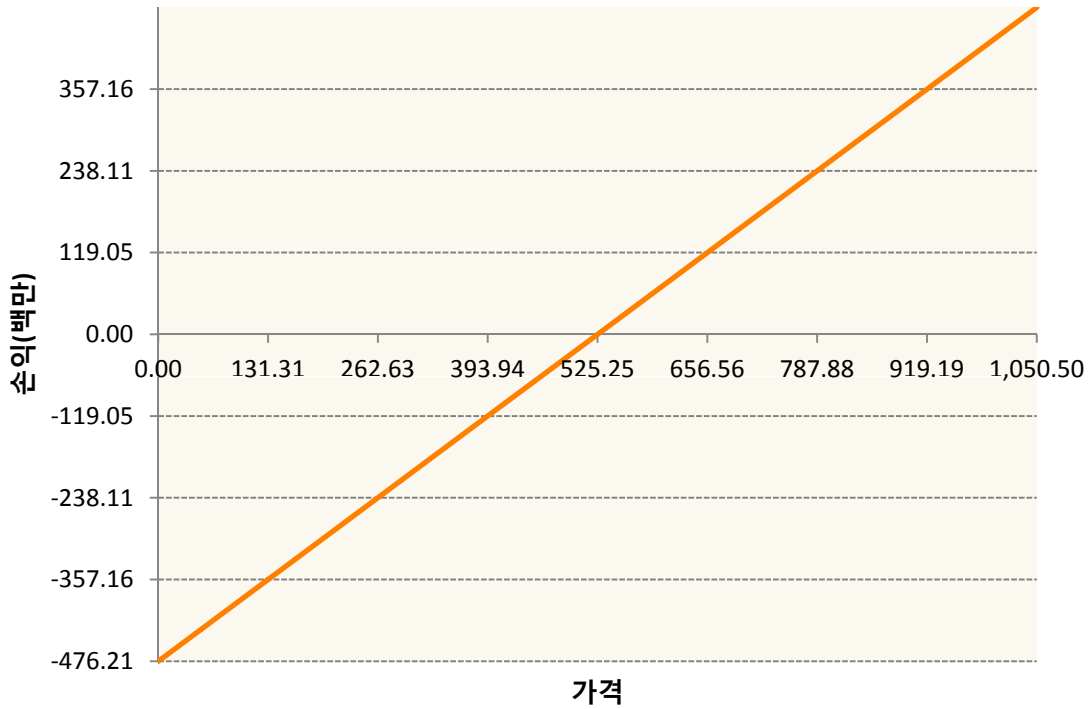


SMF9-SOYBEAN MEAL FUTR Jan19





WH9-WHEAT FUTURE(CBT) Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF9	SOYBEAN OIL FUTR Jan19	24
CH9	CORN FUTURE Mar19	66
CTH9	COTTON NO.2 FUTR Mar19	14
KCH9	COFFEE 'C' FUTURE Mar19	21
KR4175NC0	(2018-12 달러선물	6

KWH9	KC HRW WHEAT FUT Mar19	16
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	29
SF9	SOYBEAN FUTURE Jan19	58
SMF9	SOYBEAN MEAL FUTR Jan19	28
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	38

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

(단위:백만원)

315