

공시일	2018-12-26
기준일	2018-12-24

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

공시일	2018-12-26
기준일	2018-12-24

스마트인덱스모

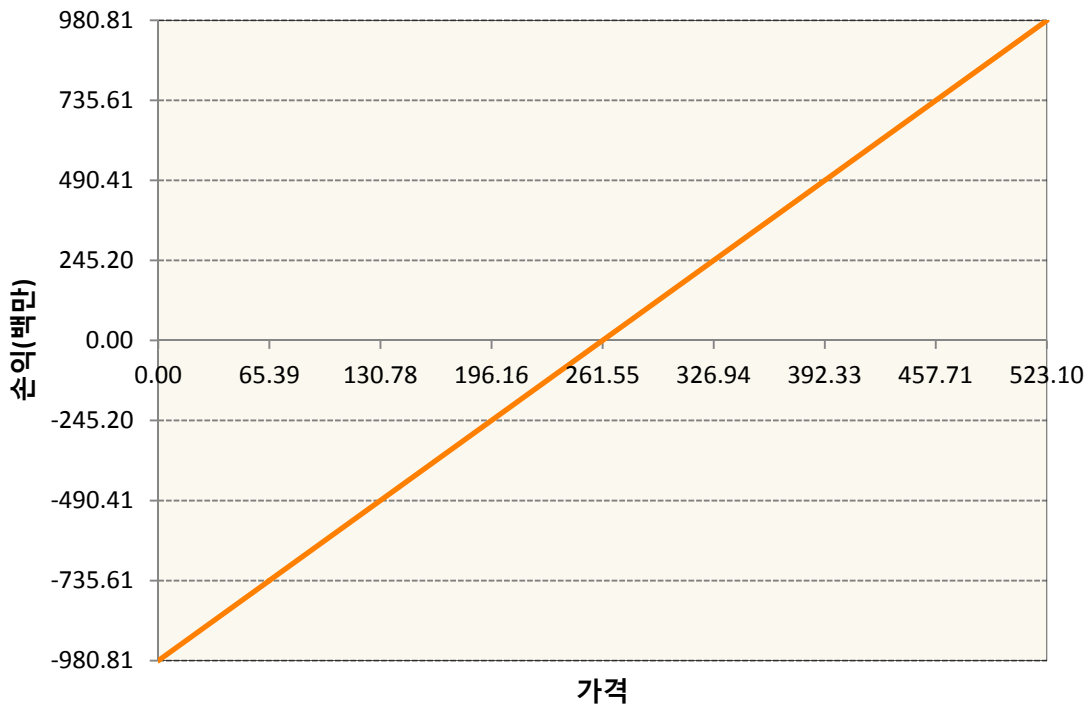
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	981	0	981	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						79
가격	기초자산의 변동성							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79	
-5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53	
-2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	26	26	26	26	26	26	26	
5.33%	53	53	53	53	53	53	53	
8.00%	79	79	79	79	79	79	79	

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

(단위:백만원)

68

공시일	2018-12-26
기준일	2018-12-24

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

976

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

516

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-12-26
기준일	2018-12-24

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

260

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

383

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-12-26
기준일	2018-12-24

유로인덱스모(주식-파생형)

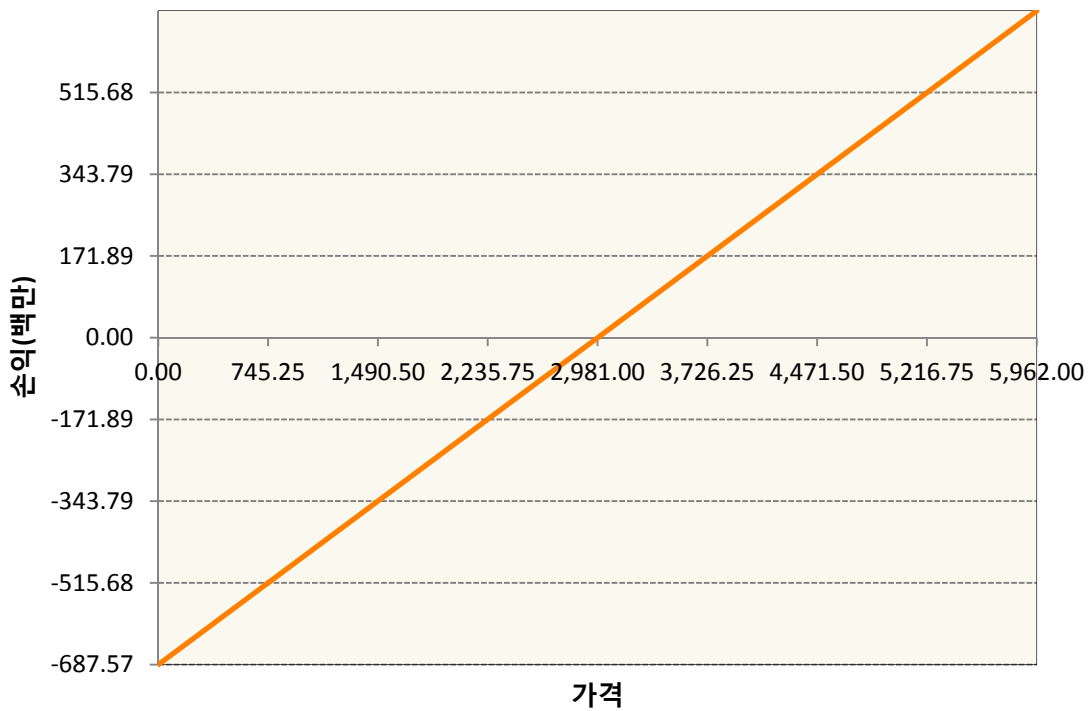
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	688	0	688	

2. 만기시점의 손익구조

VGH9-EURO STOXX 50 Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH9	EURO STOXX 50 Mar19	55
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

37

공시일	2018-12-26
기준일	2018-12-24

차이나인덱스모(주식-파생형)

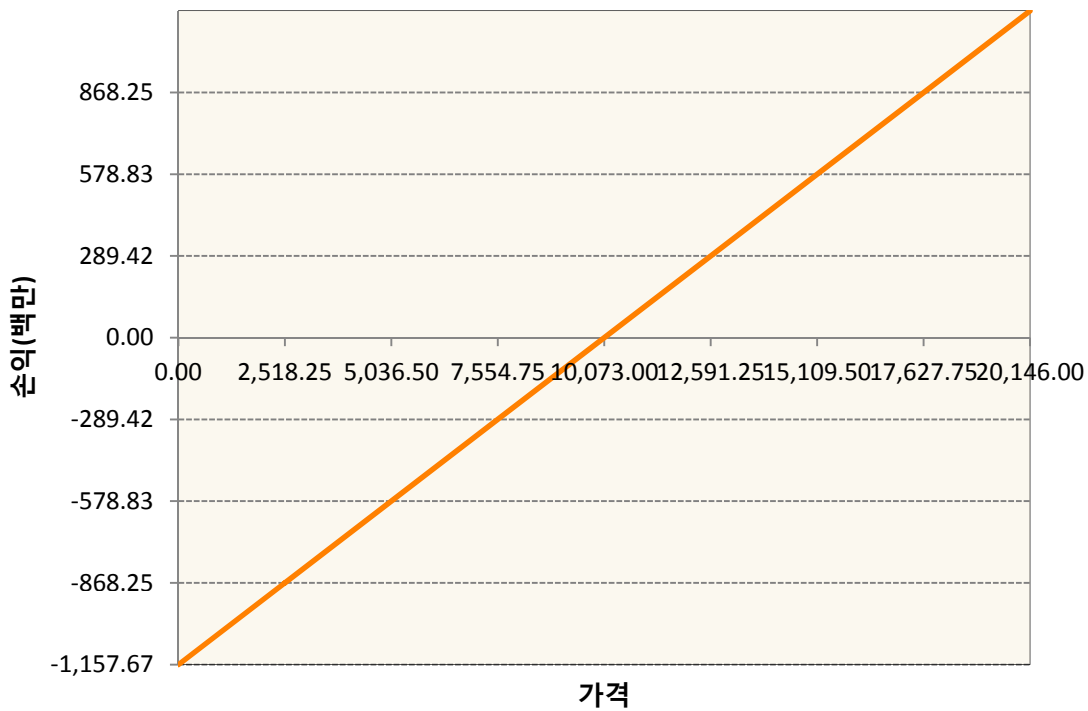
1. 계약금액

(단위:백만원)

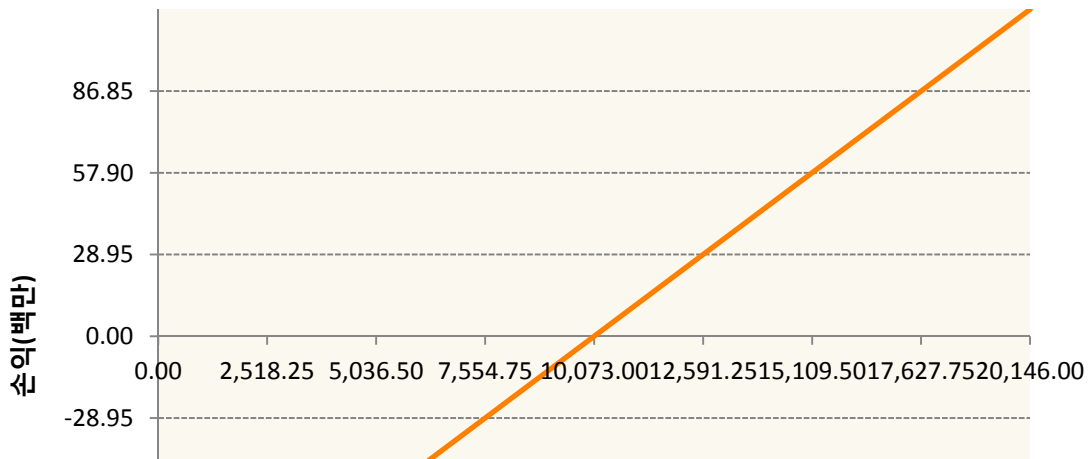
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,273	0	1,273	장내

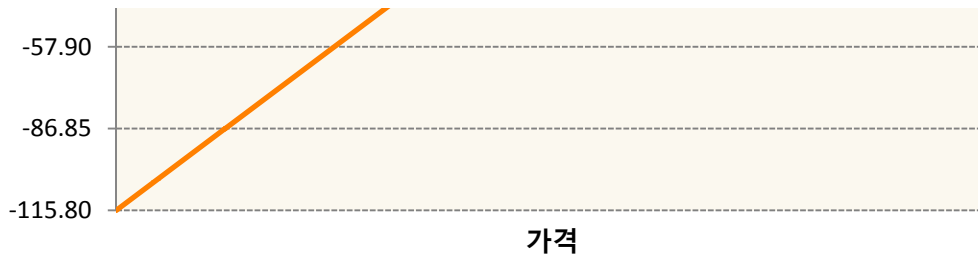
2. 만기시점의 손익구조

HCF9-HSCEI FUTURES JAN19



MHCF9-MINI H-SHR IDX FU JAN19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCF9	HSCEI FUTURES JAN19	93
MHCF9	MINI H-SHR IDX FU JAN19	9

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

103

공시일	2018-12-26
기준일	2018-12-24

커버드콜모(주식혼합-파생형)

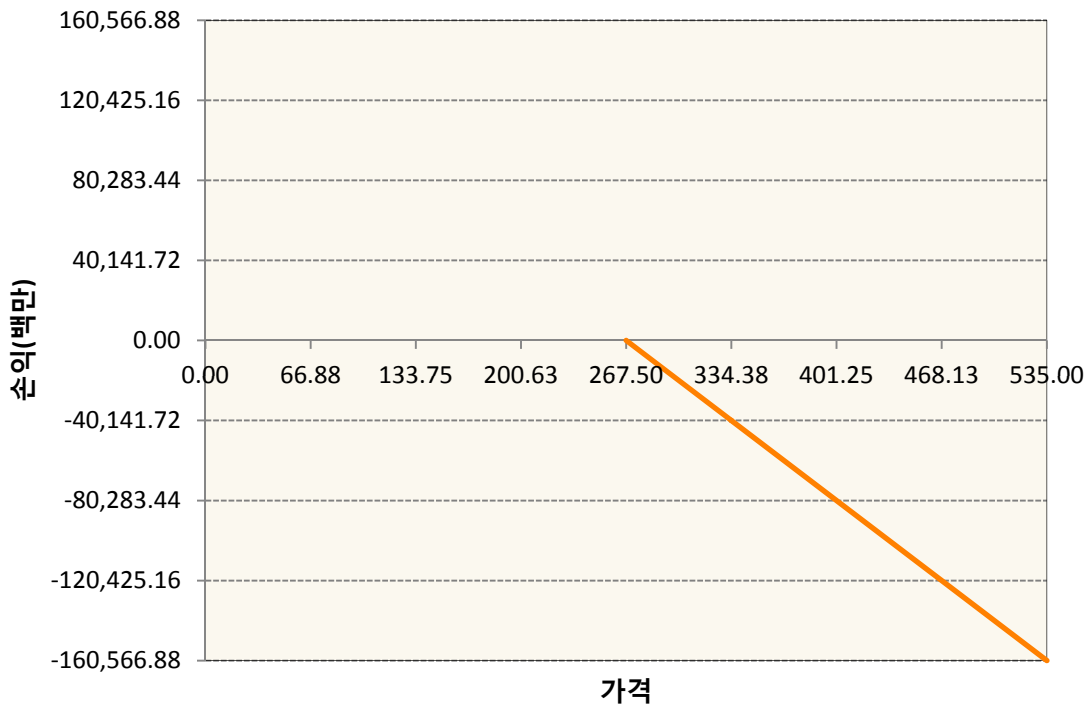
1. 계약금액

(단위:백만원)

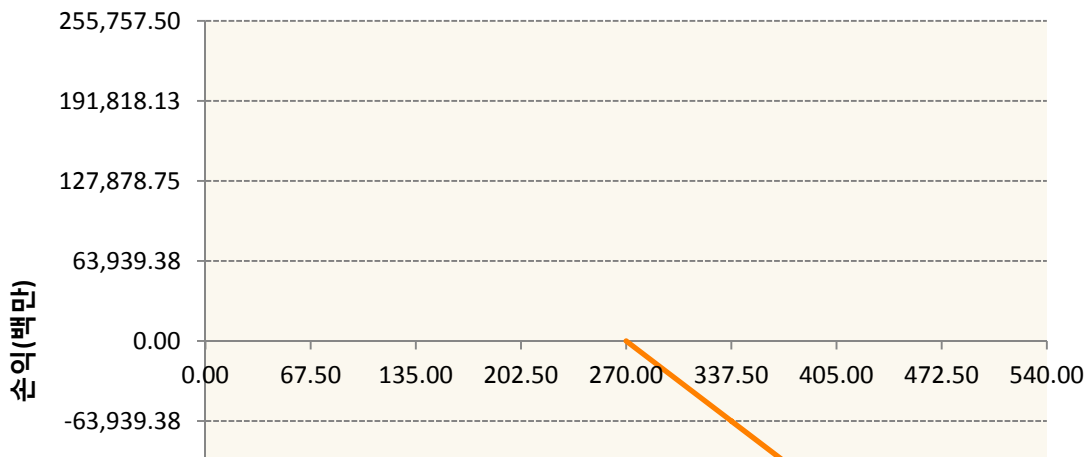
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	699,824	-699,824	장내

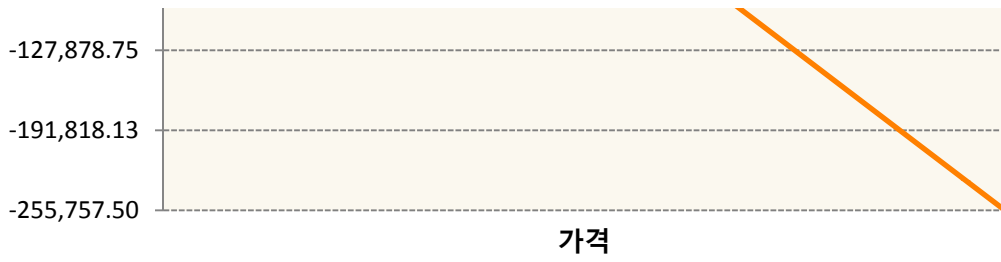
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P12672-2019-01 콜267.5

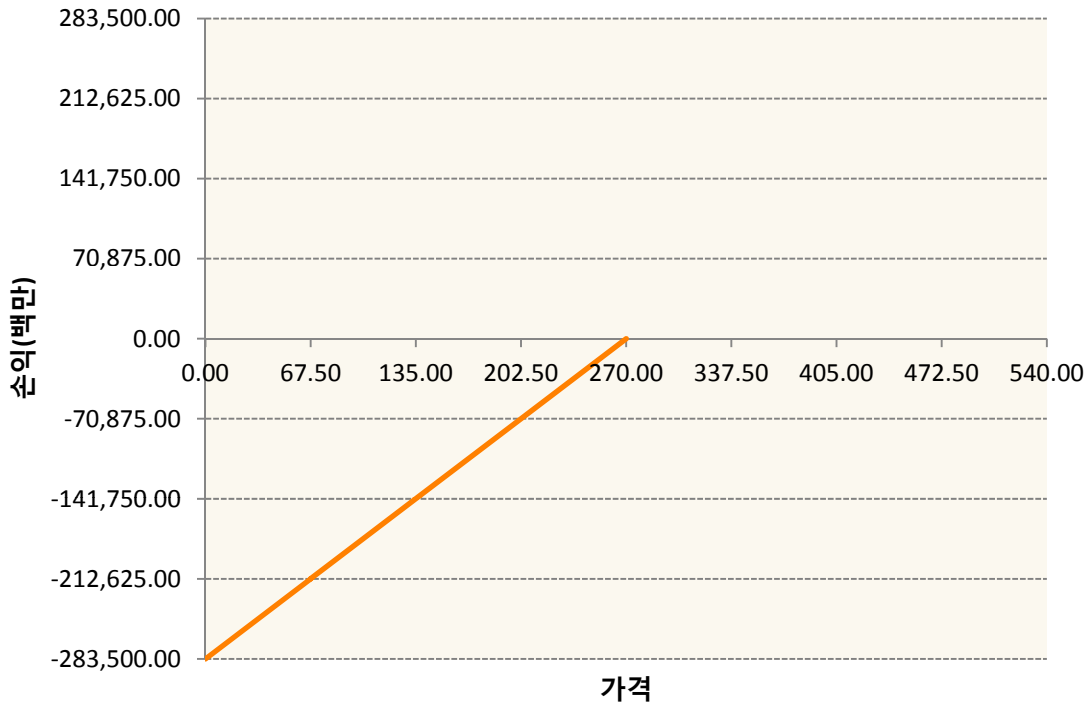


KR4201P12706-2019-01 콜270





KR4301P12704-2019-01 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P12672		2019-01 콜267.5					9,180
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,841	2,804	2,749	2,677	2,588	2,481	2,359
-5.33%	2,682	2,572	2,441	2,290	2,122	1,939	1,743
-2.67%	2,154	1,937	1,706	1,463	1,211	952	687
0%	911	609	305	0	-306	-613	-921
2.67%	-1,293	-1,594	-1,898	-2,203	-2,511	-2,819	-3,129
5.33%	-4,408	-4,629	-4,865	-5,113	-5,372	-5,638	-5,911
8.00%	-8,150	-8,272	-8,417	-8,584	-8,768	-8,967	-9,180
KR4201P12706		2019-01 콜270					13,529
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,614	3,575	3,514	3,429	3,318	3,182	3,020

-5.33%	3,457	3,329	3,167	2,972	2,749	2,500	2,228
-2.67%	2,876	2,590	2,275	1,936	1,578	1,203	815
0%	1,362	916	461	0	-466	-936	-1,409
2.67%	-1,565	-2,063	-2,561	-3,060	-3,560	-4,059	-4,559
5.33%	-6,001	-6,409	-6,833	-7,270	-7,717	-8,172	-8,634
8.00%	-11,602	-11,853	-12,138	-12,452	-12,792	-13,152	-13,529
KR4301P12704 2019-01 풋270							19,884
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19,736	-19,740	-19,749	-19,765	-19,792	-19,831	-19,884
-5.33%	-12,368	-12,402	-12,455	-12,529	-12,625	-12,742	-12,880
-2.67%	-5,218	-5,367	-5,545	-5,749	-5,974	-6,219	-6,480
0%	1,035	701	355	0	-362	-730	-1,102
2.67%	5,378	4,973	4,568	4,162	3,755	3,348	2,941
5.33%	7,511	7,235	6,937	6,622	6,294	5,955	5,606
8.00%	8,204	8,092	7,950	7,780	7,585	7,367	7,129

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

(단위:백만원)

43,316

공시일	2018-12-26
기준일	2018-12-24

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

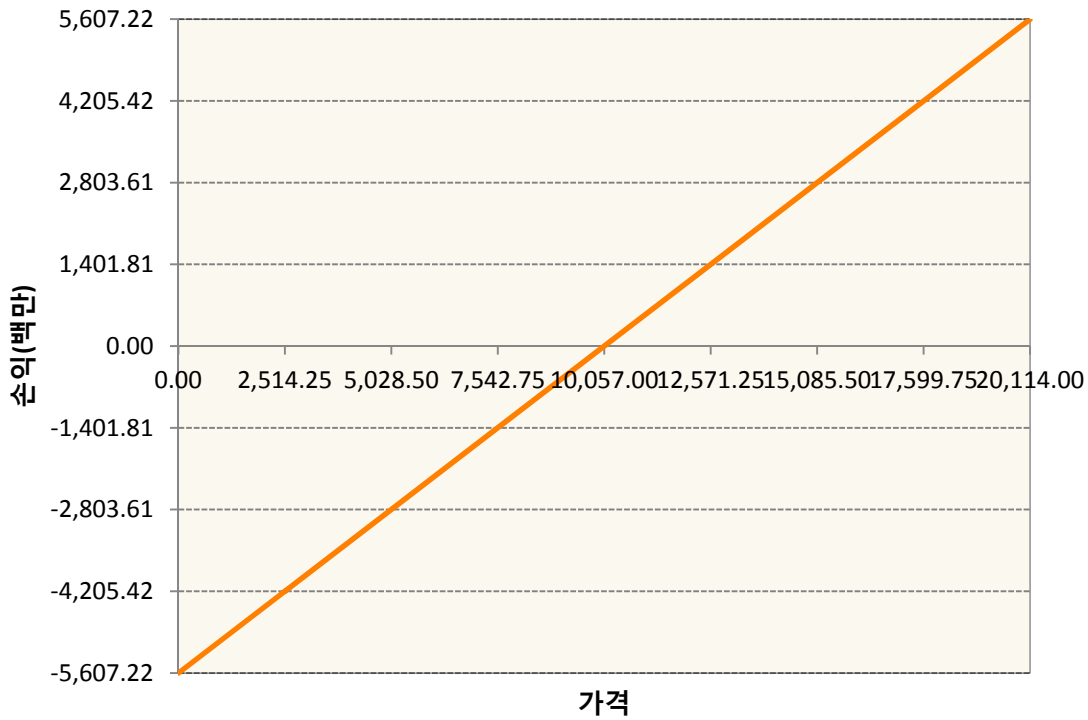
1. 계약금액

(단위:백만원)

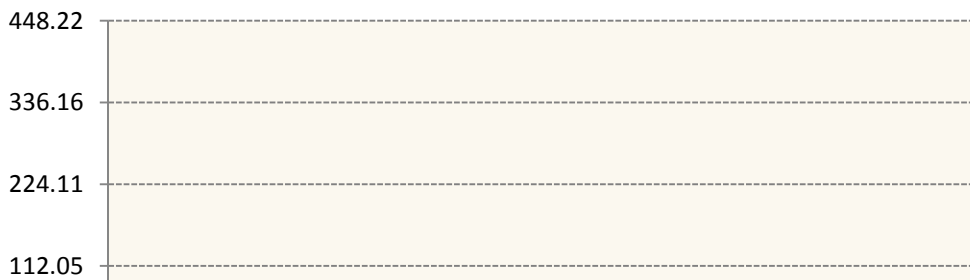
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,607	0	5,607	
누계	유가증권	옵션	0	13,079	-13,079	장내
누계	통화	선도	0	2,730	-2,730	장외

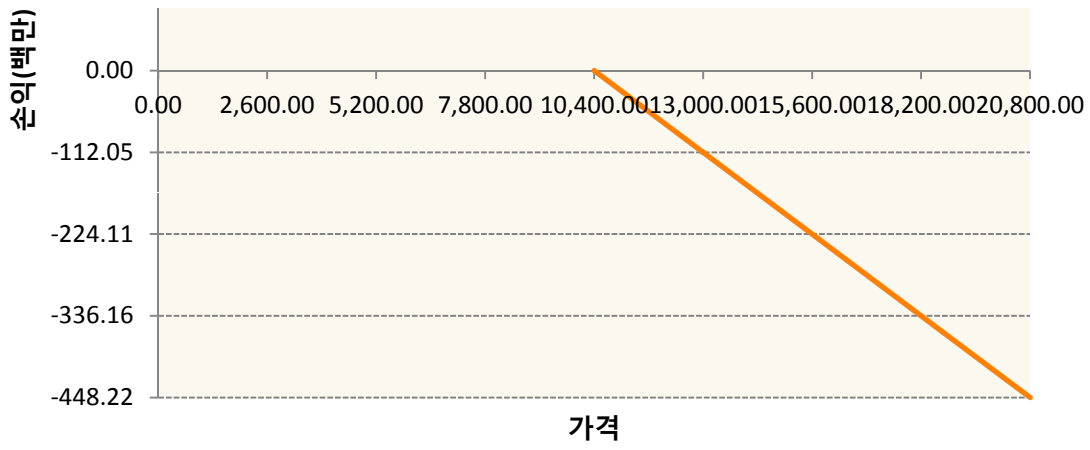
2. 만기시점의 손익구조

HCZ8-HSCEI FUTURES DEC 18

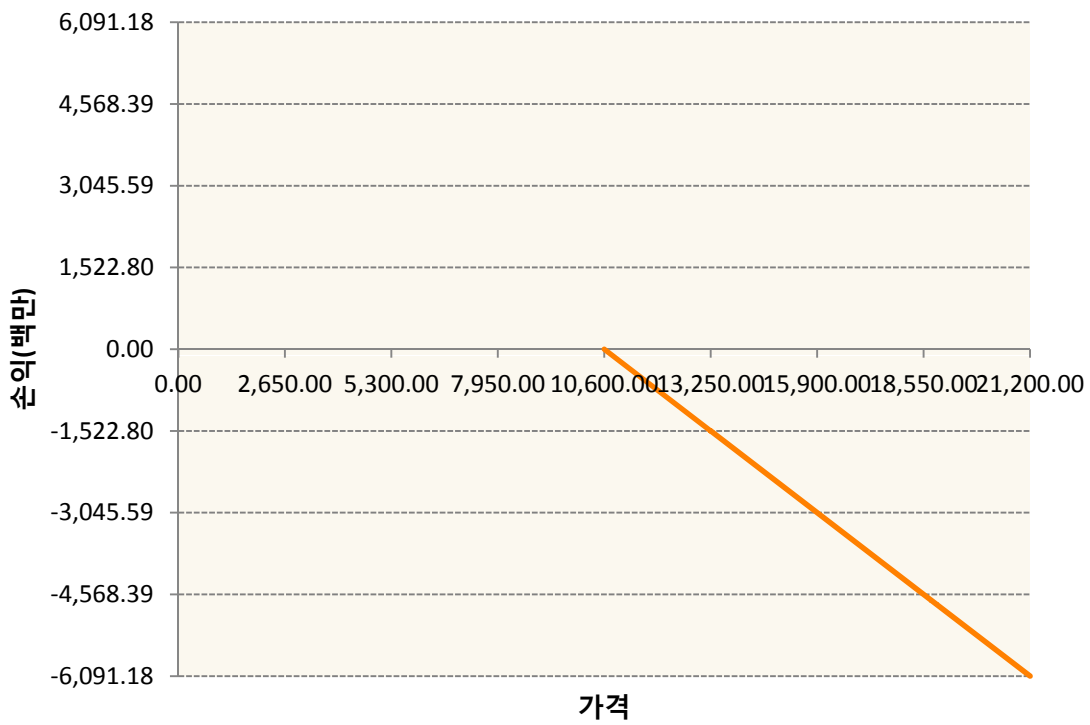


OHHI28-C104-HSCEI

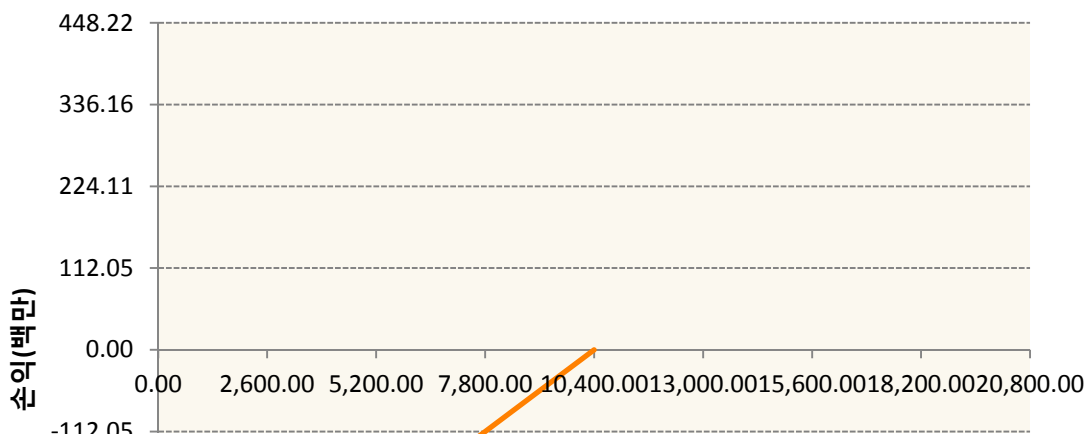


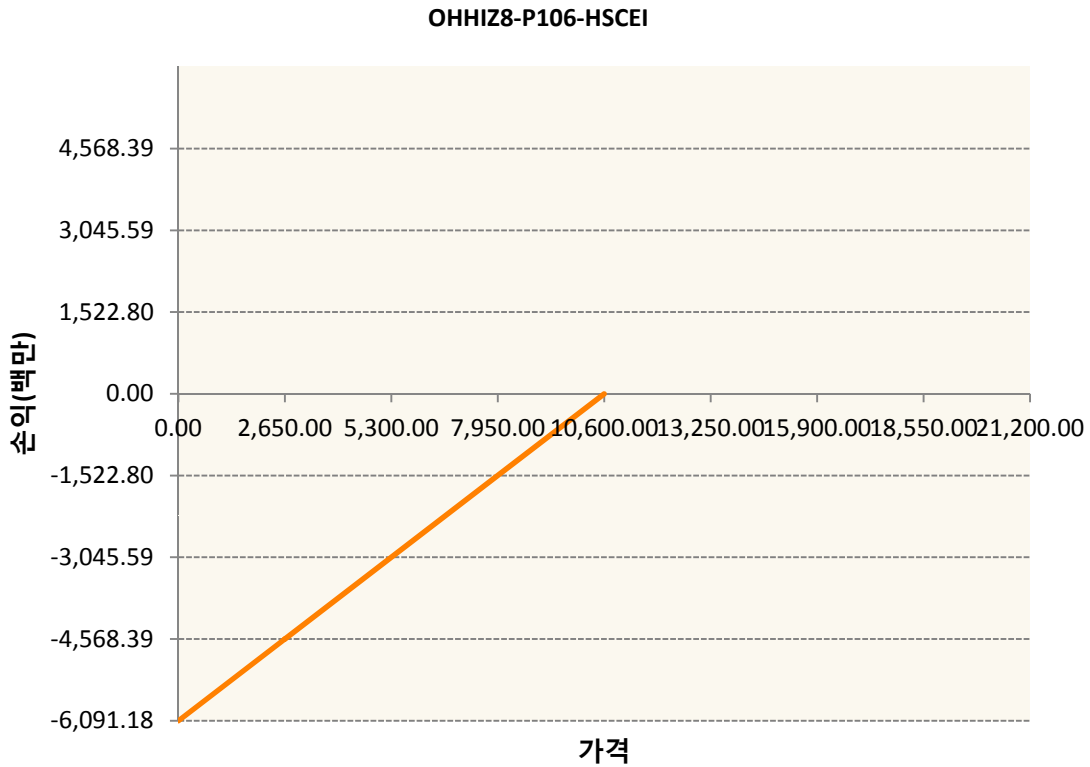
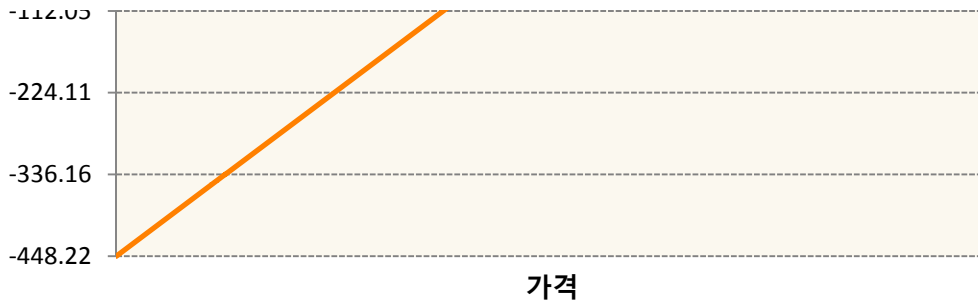


OHHIZ8-C106-HSCEI



OHHIZ8-P104-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	218
HCZ8 HSCEI FUTURES DEC 18	449
OHHIZ8-C1C HSCEI	36
OHHIZ8-C1C HSCEI	487
OHHIZ8-P10 HSCEI	36
OHHIZ8-P10 HSCEI	487

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,541

공시일	2018-12-26
기준일	2018-12-24

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

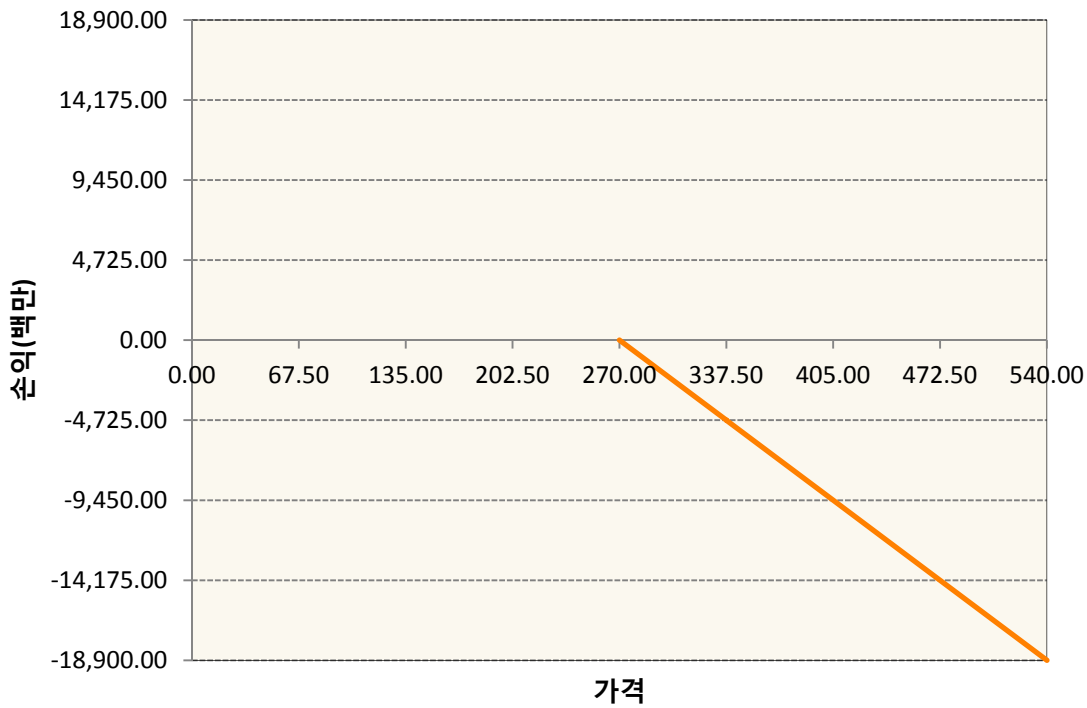
1. 계약금액

(단위:백만원)

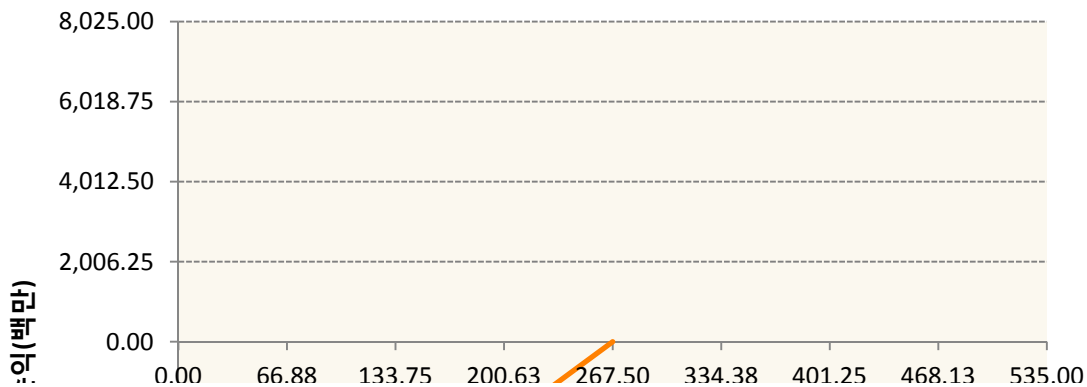
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	31,836	0	31,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,350	-34,350	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201P12706-2019-01 콜270

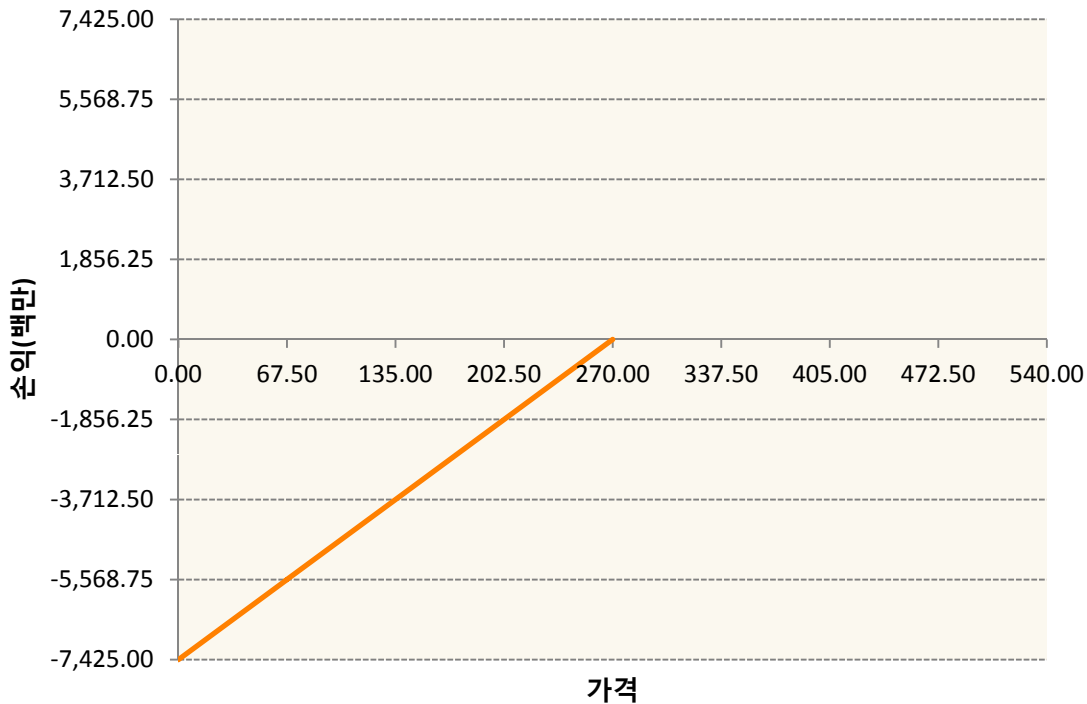


KR4301P12670-2019-01 풋267.5





KR4301P12704-2019-01 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14				2,639
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,639	-2,639	-2,639	-2,639	-2,639	-2,639	-2,639
-5.33%	-1,759	-1,759	-1,759	-1,759	-1,759	-1,759	-1,759
-2.67%	-880	-880	-880	-880	-880	-880	-880
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	880	880	880	880	880	880	880
5.33%	1,759	1,759	1,759	1,759	1,759	1,759	1,759
8.00%	2,639	2,639	2,639	2,639	2,639	2,639	2,639
	KR4201P12706		2019-01 콜270				1,000
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	267	264	260	253	245	235	223	
-5.33%	255	246	234	220	203	185	165	
-2.67%	213	191	168	143	117	89	60	
0%	101	68	34	0	-34	-69	-104	
2.67%	-116	-152	-189	-226	-263	-300	-337	
5.33%	-443	-474	-505	-537	-570	-604	-638	
8.00%	-857	-876	-897	-920	-945	-972	-1,000	
KR4301P12670							2019-01 풋267.5	545
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-538	-538	-539	-540	-541	-543	-545	
-5.33%	-329	-330	-333	-336	-340	-344	-349	
-2.67%	-130	-136	-143	-150	-158	-166	-175	
0%	33	22	11	0	-11	-22	-33	
2.67%	134	123	112	101	90	79	68	
5.33%	176	170	163	156	148	140	131	
8.00%	188	186	183	180	175	170	165	
KR4301P12704							2019-01 풋270	521
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-517	-517	-517	-518	-518	-519	-521	
-5.33%	-324	-325	-326	-328	-331	-334	-337	
-2.67%	-137	-141	-145	-151	-156	-163	-170	
0%	27	18	9	0	-9	-19	-29	
2.67%	141	130	120	109	98	88	77	
5.33%	197	189	182	173	165	156	147	
8.00%	215	212	208	204	199	193	187	

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

(단위:백만원)

4,736

공시일	2018-12-26
기준일	2018-12-24

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

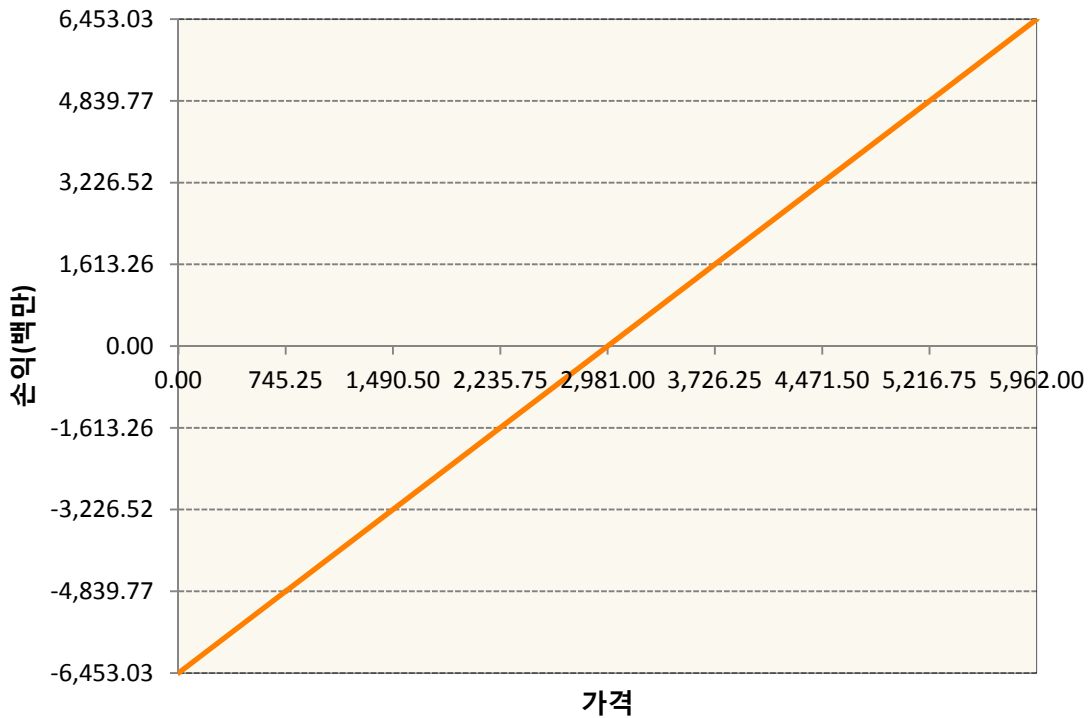
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1	0	1	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,453	0	6,453	
누계	유가증권	스왑	71,544	0	71,544	장외
누계	통화	선도	0	15,371	-15,371	장외

2. 만기시점의 손익구조

VGH9-EURO STOXX 50 Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	167
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E	410
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E	820
VGH9 EURO STOXX 50 Mar19	516

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

(단위:백만원)

1,219

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

(단위:백만원)

1,073

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

(단위:백만원)

91

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

(단위:백만원)

137

공시일	2018-12-26
기준일	2018-12-24

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

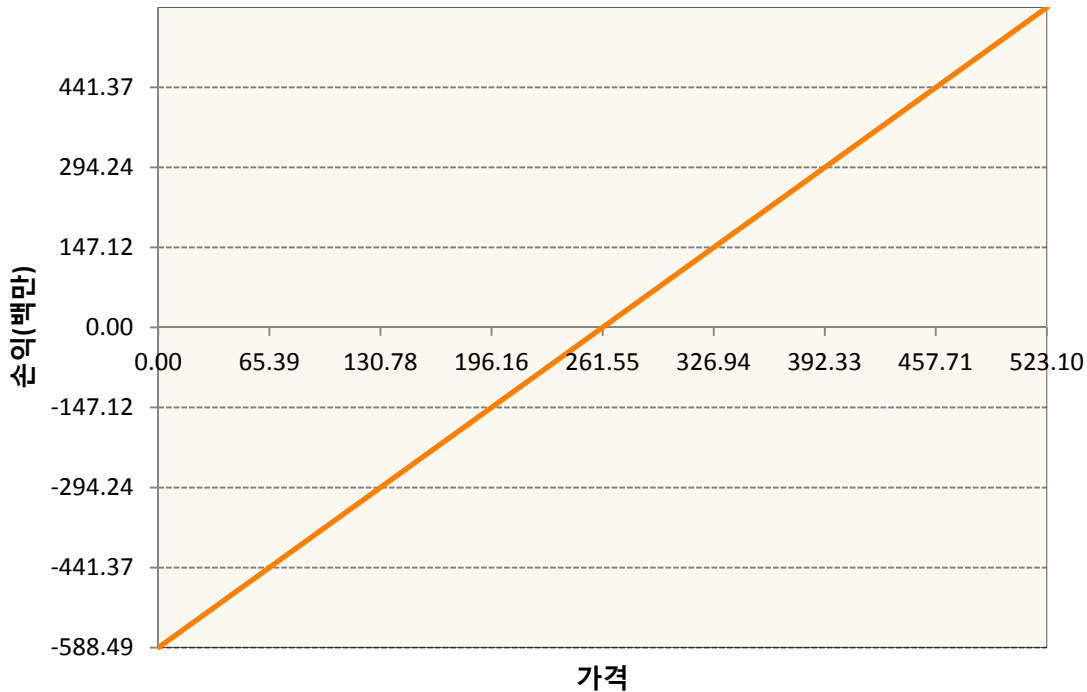
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	588	0	588	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P30007 2019-03 코스피200지수선물 48

가격	기초자산의 변동성						
	-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	2018-12-26
기준일	2018-12-24

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

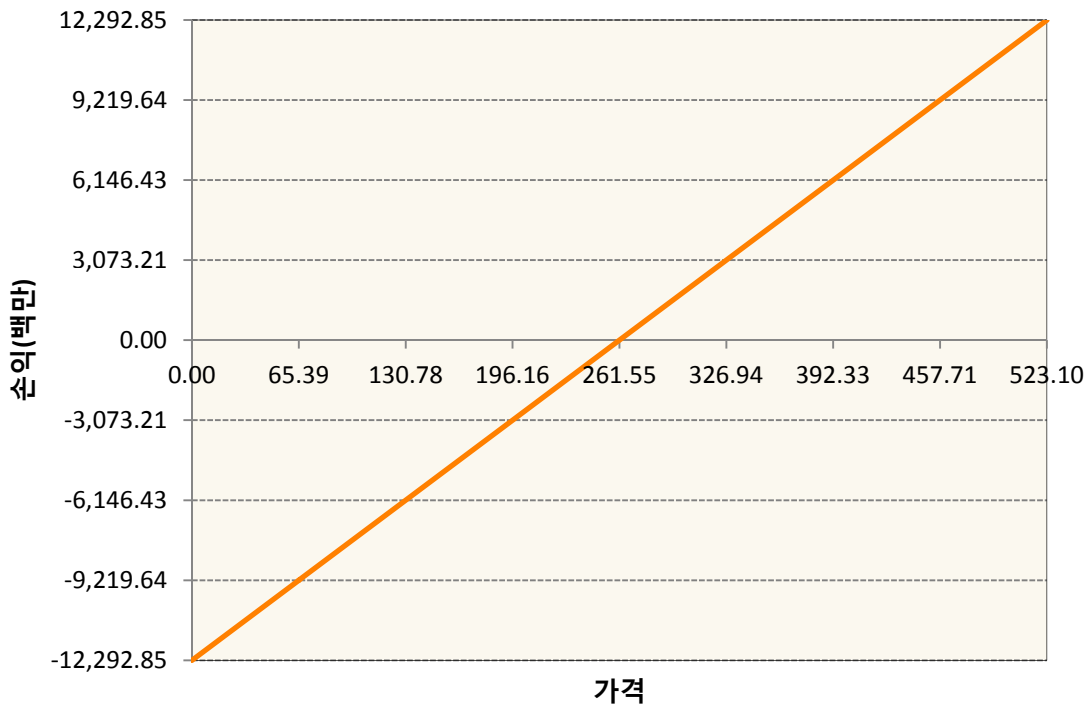
1. 계약금액

(단위:백만원)

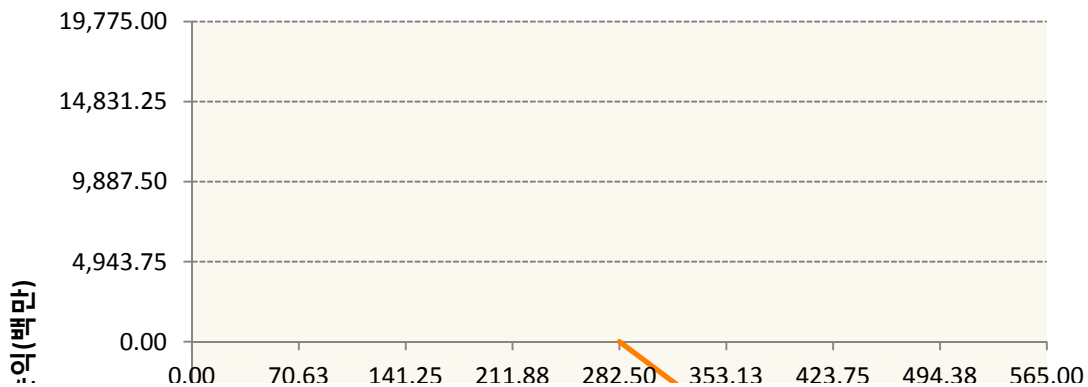
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,293	0	12,293	장내
누계	유가증권	옵션	1,145	23,338	-22,193	장내

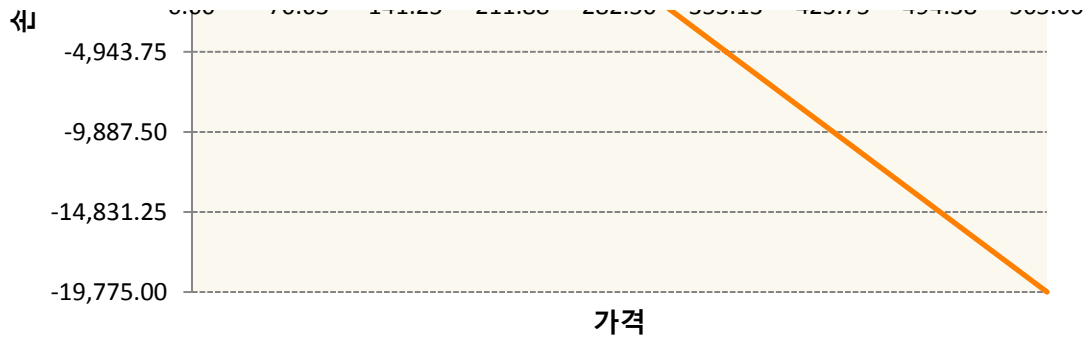
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

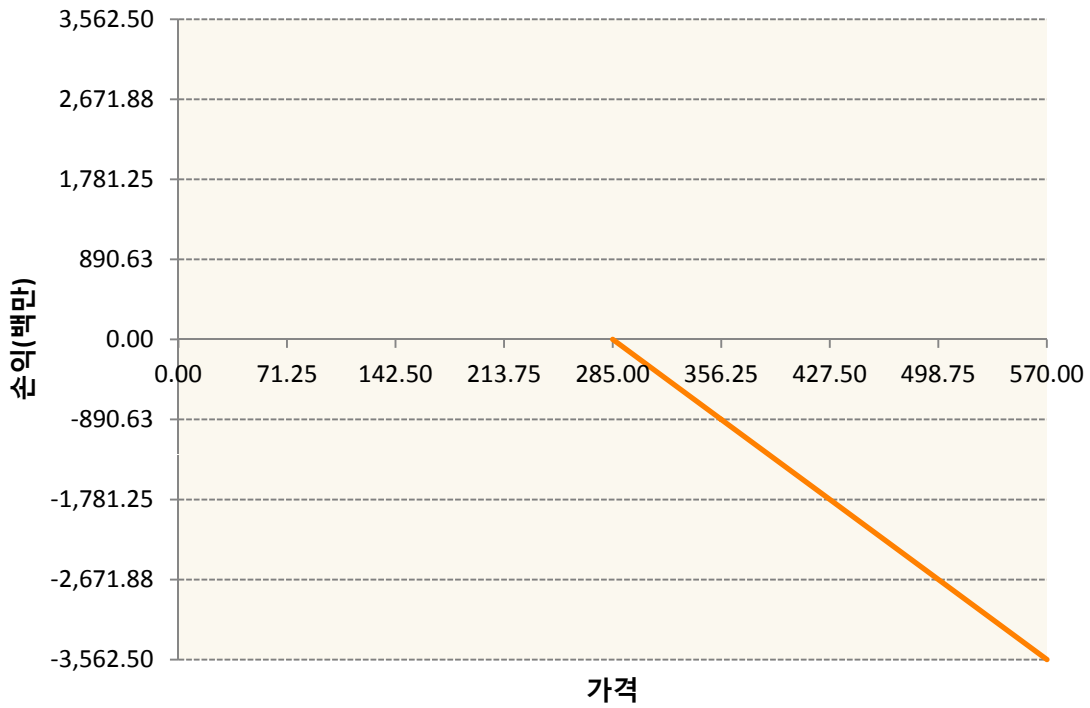


KR4201P12821-2019-01 콜282.5

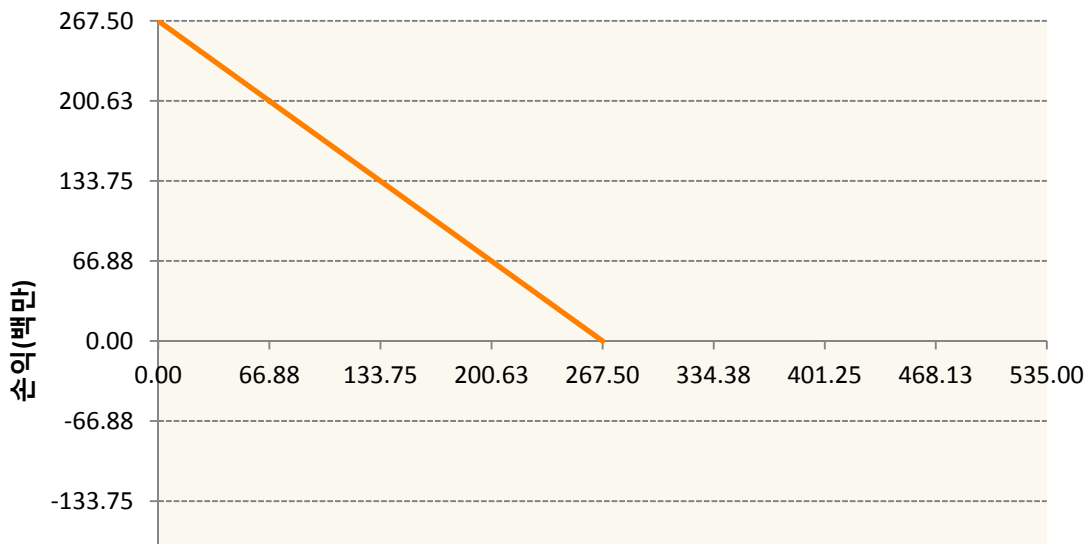


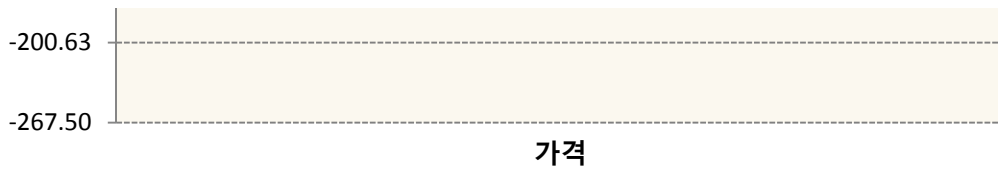


KR4201P12854-2019-01 콜285

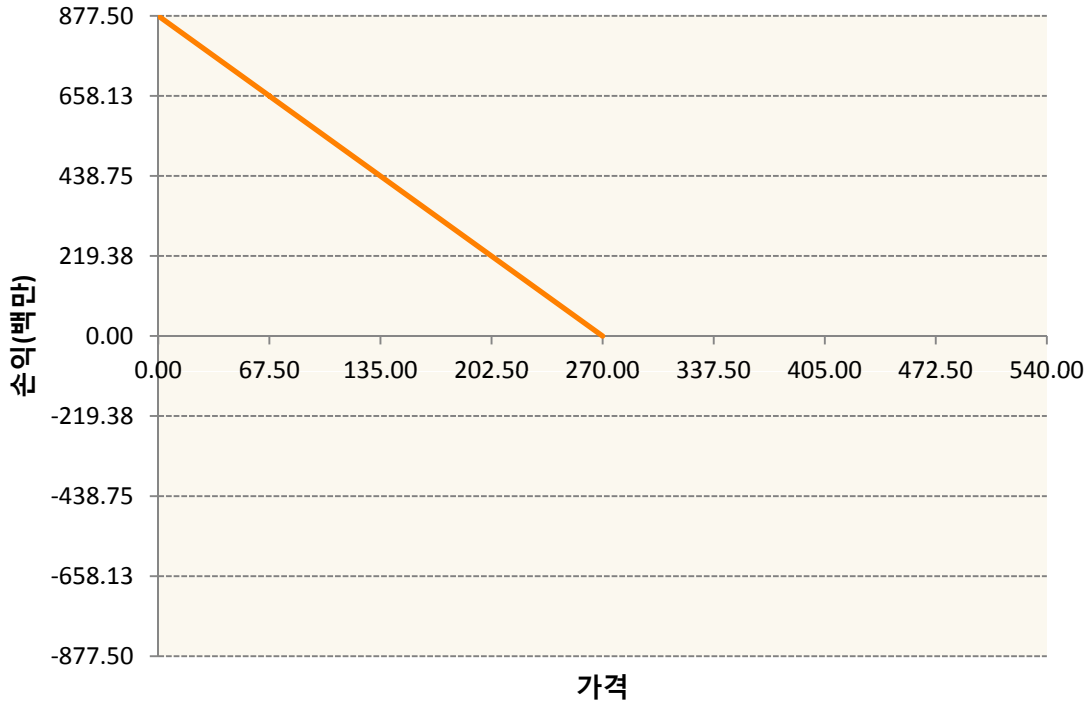


KR4301P12670-2019-01 풋267.5





KR4301P12704-2019-01 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						994
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-994	-994	-994	-994	-994	-994	-994	
-5.33%	-663	-663	-663	-663	-663	-663	-663	
-2.67%	-331	-331	-331	-331	-331	-331	-331	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	331	331	331	331	331	331	331	
5.33%	663	663	663	663	663	663	663	
8.00%	994	994	994	994	994	994	994	
KR4201P12821		2019-01 콜282.5						621
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	73	73	72	71	69	67	63	
-5.33%	72	71	69	65	60	53	45	
-2.67%	68	63	56	46	35	21	6	

공시일	2018-12-26
기준일	2018-12-24

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	197	0	197	

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	2018-12-26
기준일	2018-12-24

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	1,895	0	1,895	

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	2018-12-26
기준일	2018-12-24

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	1,654	0	1,654	
누계	통화	선도	0	1,621	-1,621	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
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
FX21018Z02 KRW/USD 28-02-19E	40
FX21018Z02 KRW/USD 19-02-19E	2
FX21018Z02 KRW/USD 19-02-19E	5
FX21018Z03 KRW/USD 19-02-19E	21

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

(단위:백만원)

49

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

(단위:백만원)

129

공시일	2018-12-26
기준일	2018-12-24

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

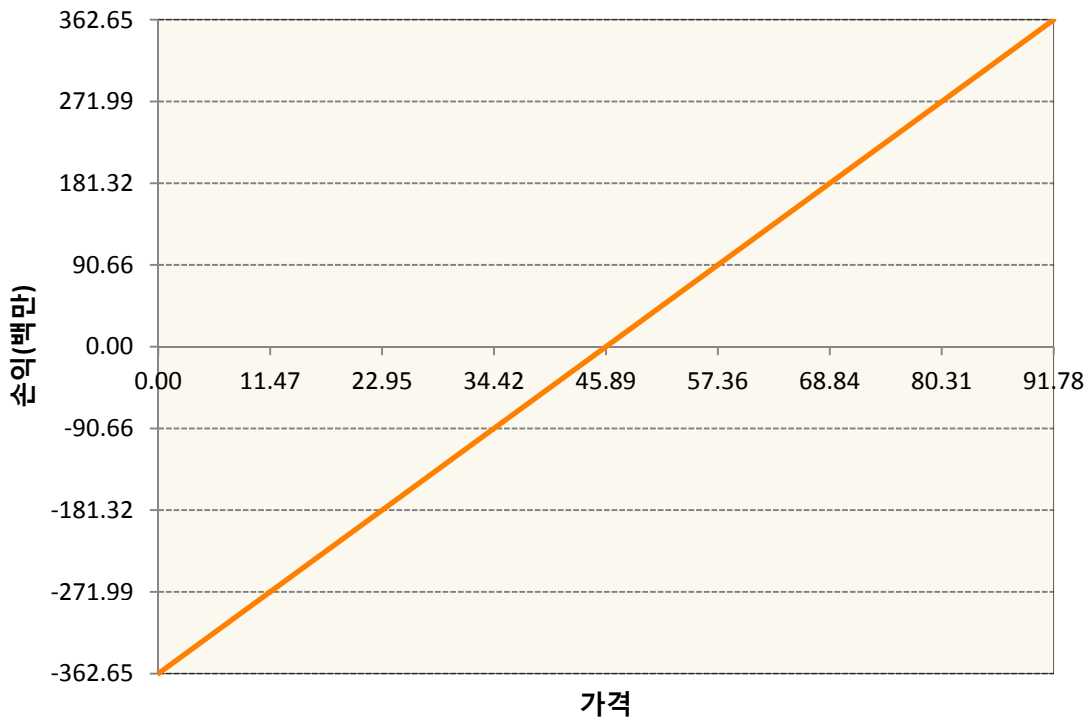
1. 계약금액

(단위:백만원)

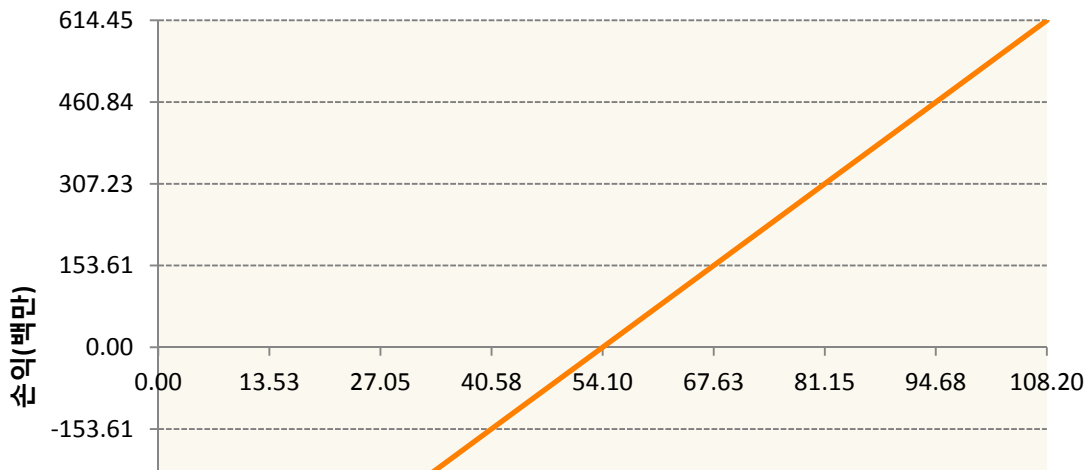
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,552	202	2,349	

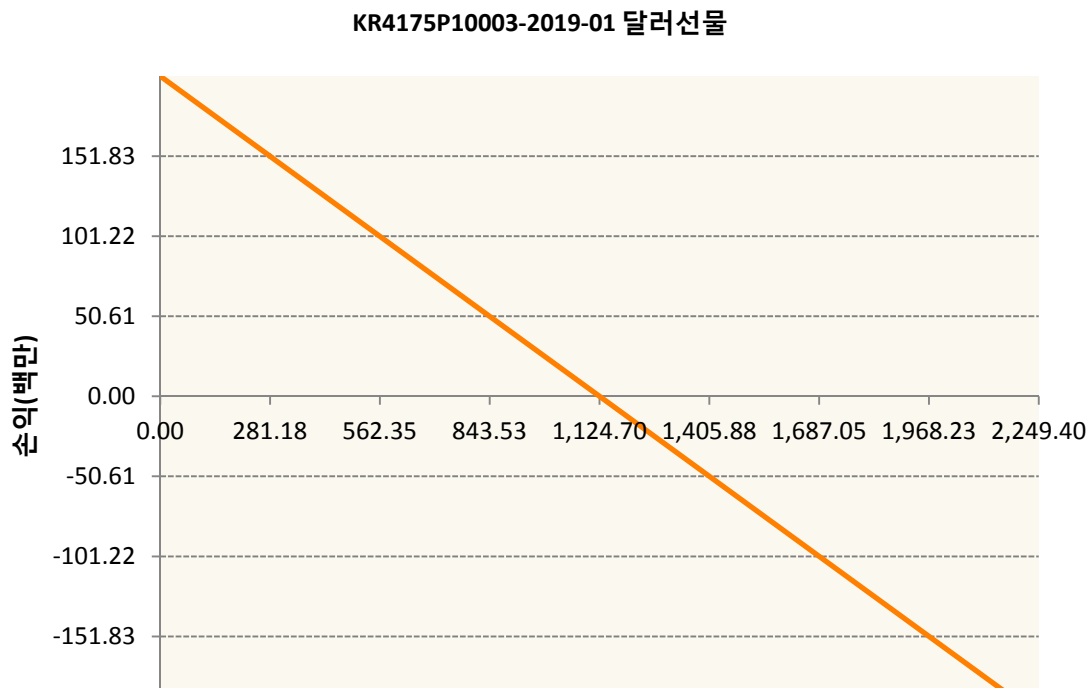
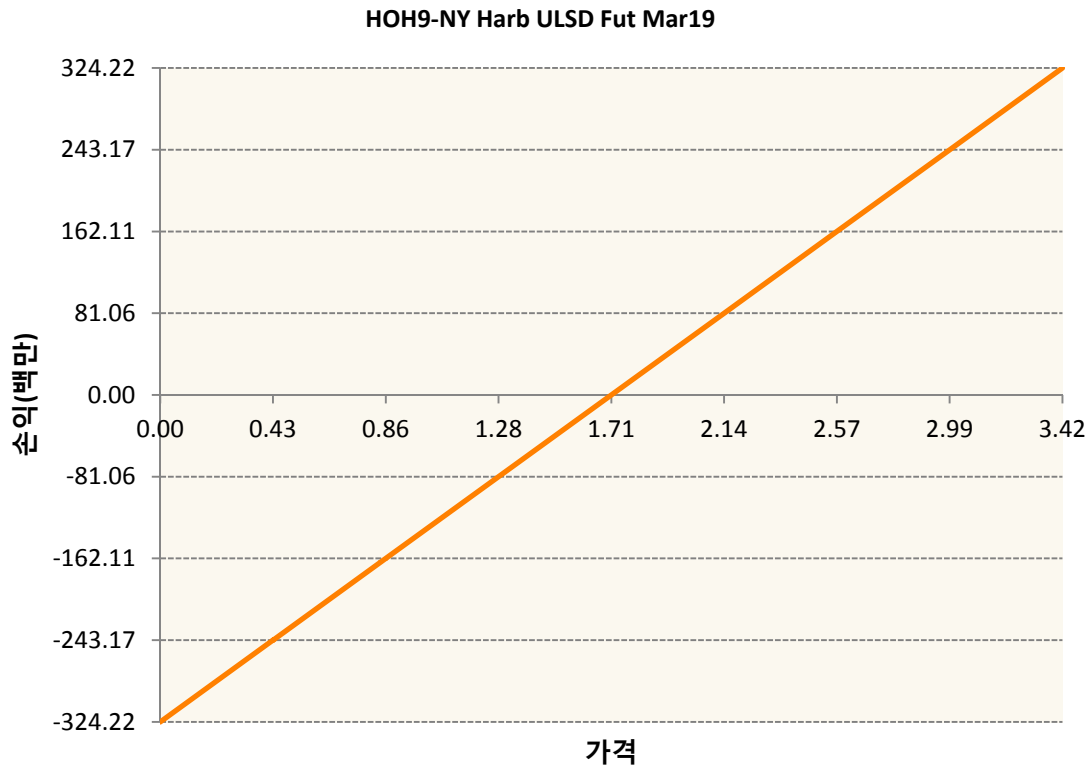
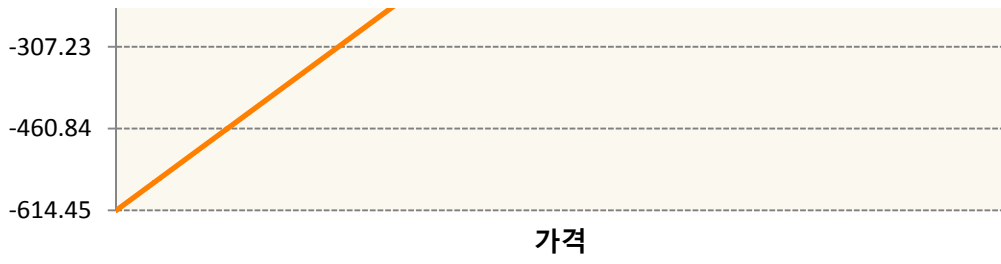
2. 만기시점의 손익구조

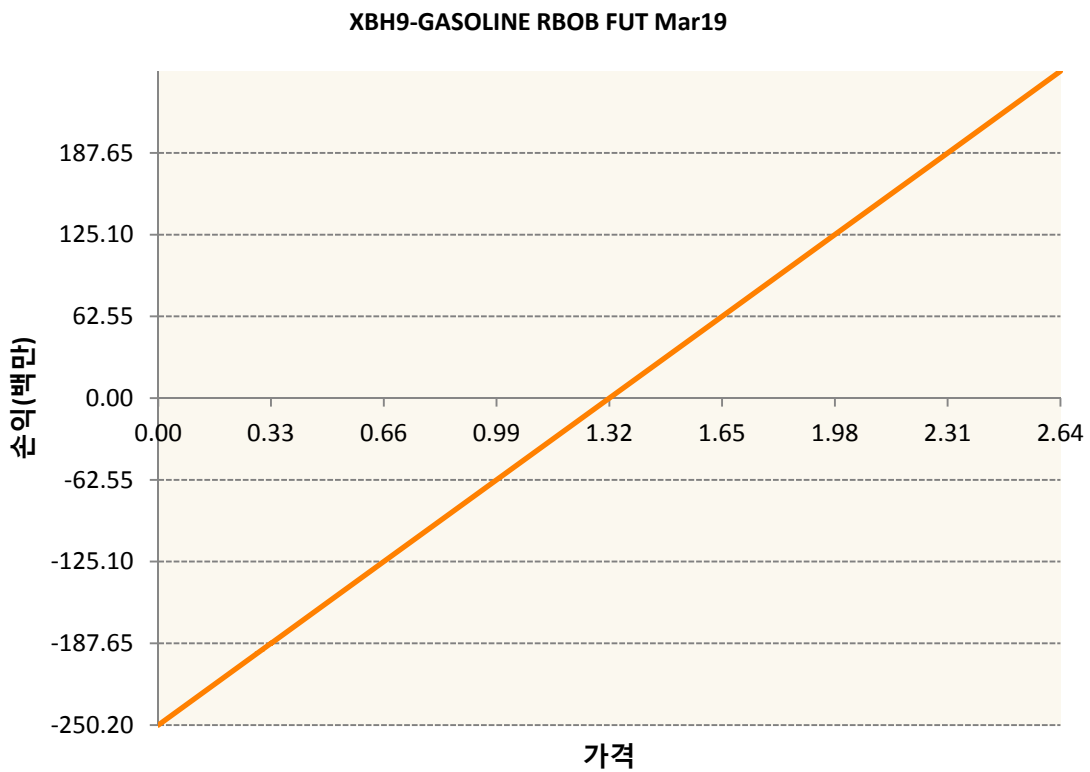
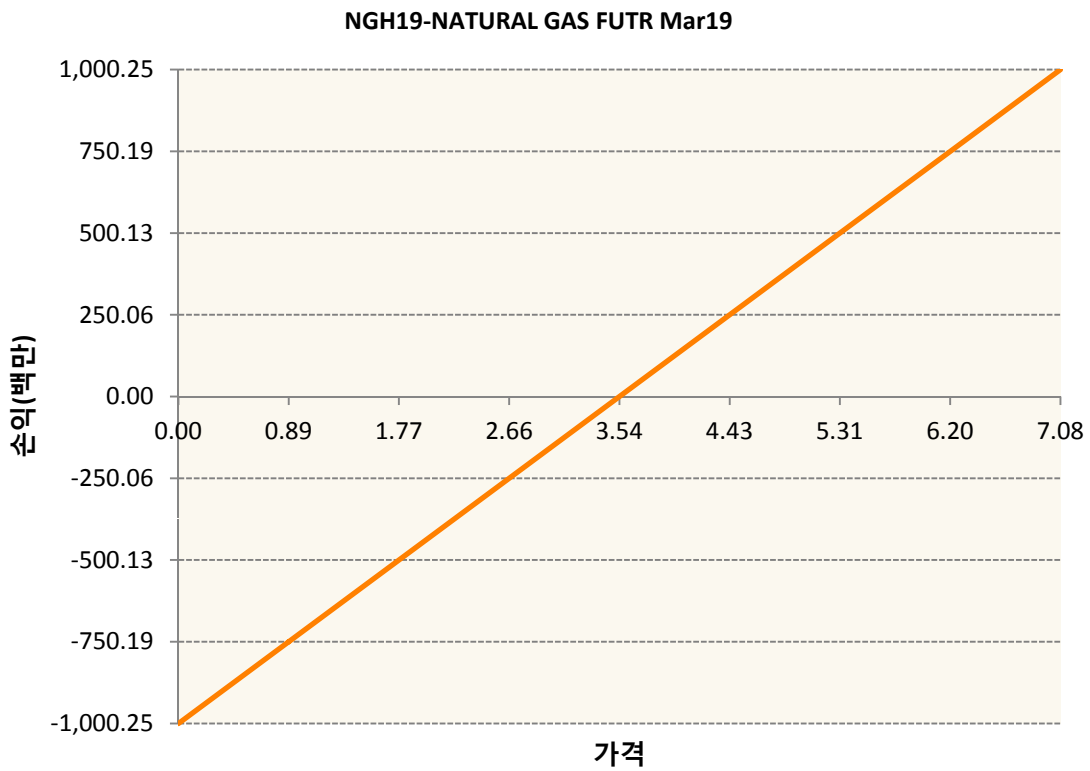
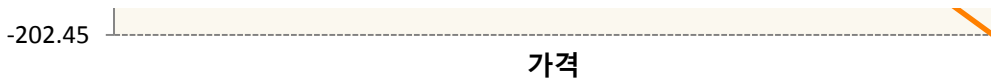
CLH9-WTI CRUDE FUTURE MAR19



COH9-BRENT CRUDE FUTR Mar19







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH9	WTI CRUDE FUTURE MAR19	29
COH9	BRENT CRUDE FUTR Mar19	49
HOH9	NY Harb ULSD Fut Mar19	26
KR4175P100	2019-01 달러선물	16
NGH19	NATURAL GAS FUTR Mar19	80
XBH9	GASOLINE RBOB FUT Mar19	20

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

377

공시일	2018-12-26
기준일	2018-12-24

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

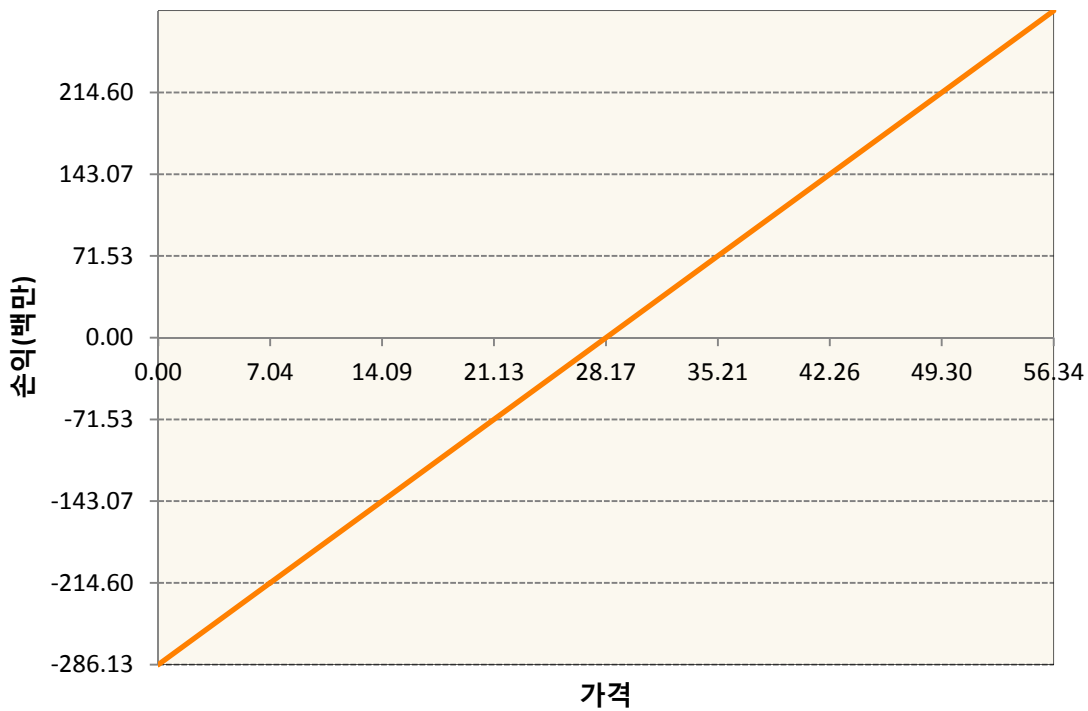
1. 계약금액

(단위:백만원)

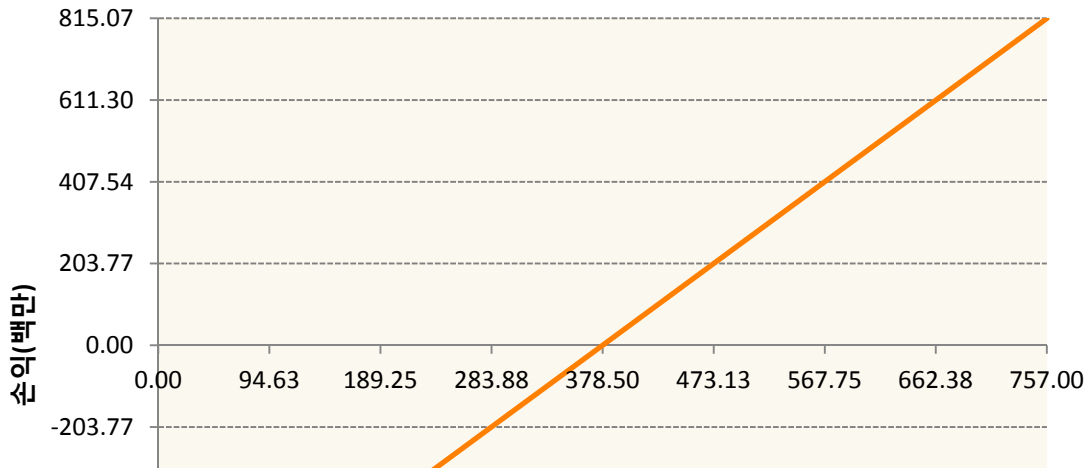
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,604	79	3,525	

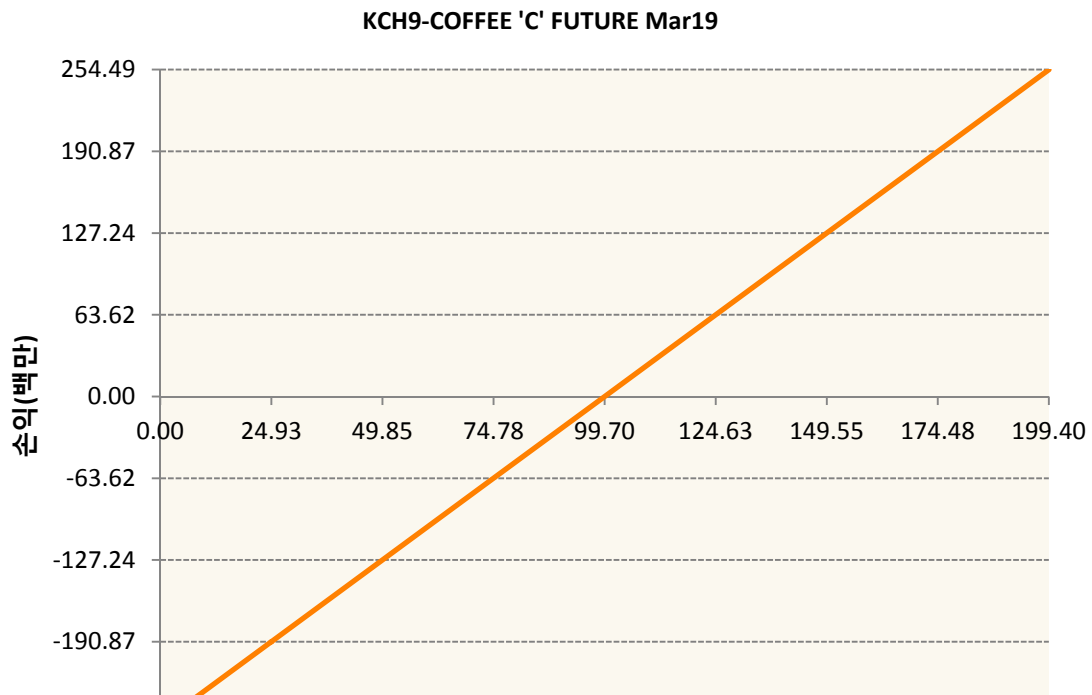
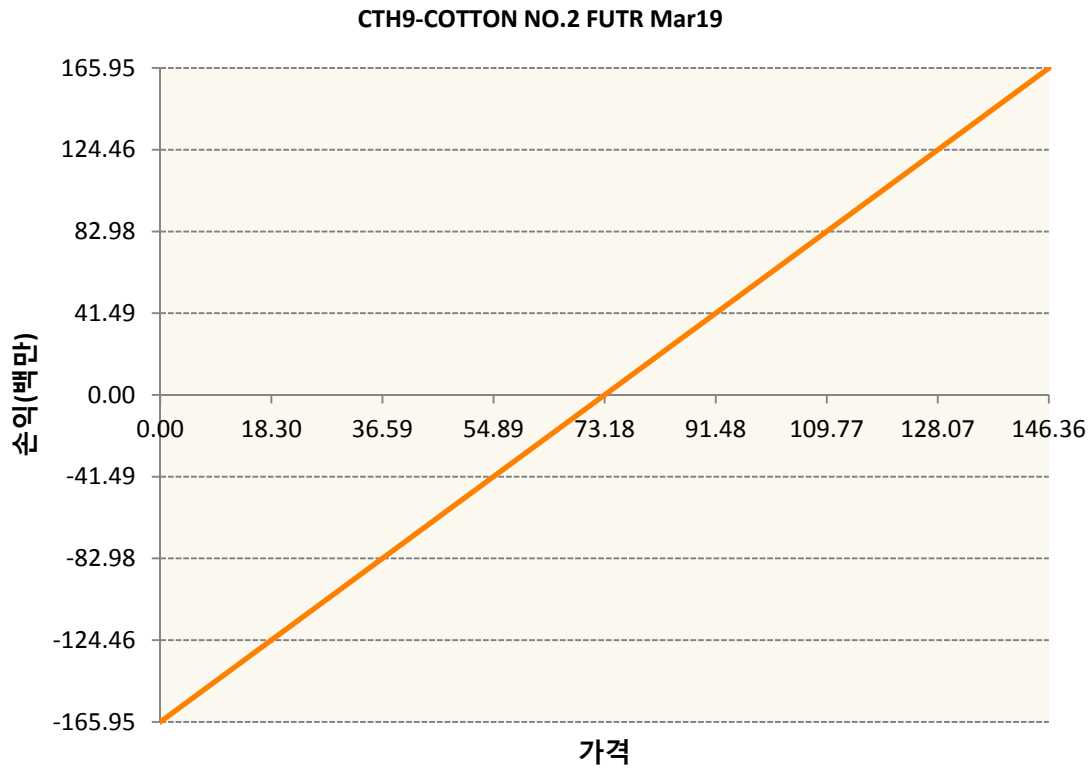
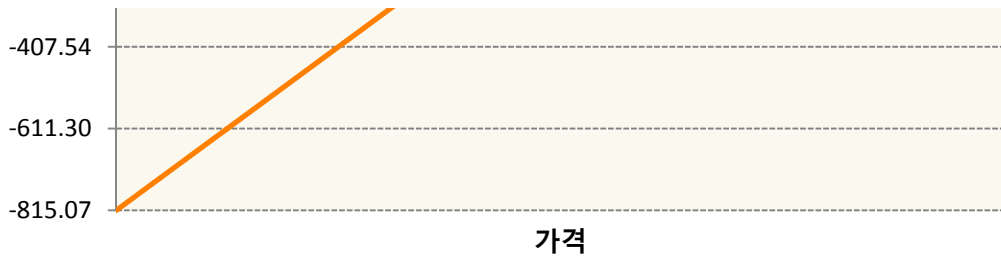
2. 만기시점의 손익구조

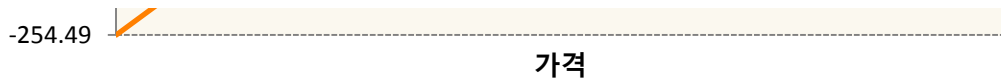
BOH9-SOYBEAN OIL FUTR Mar19



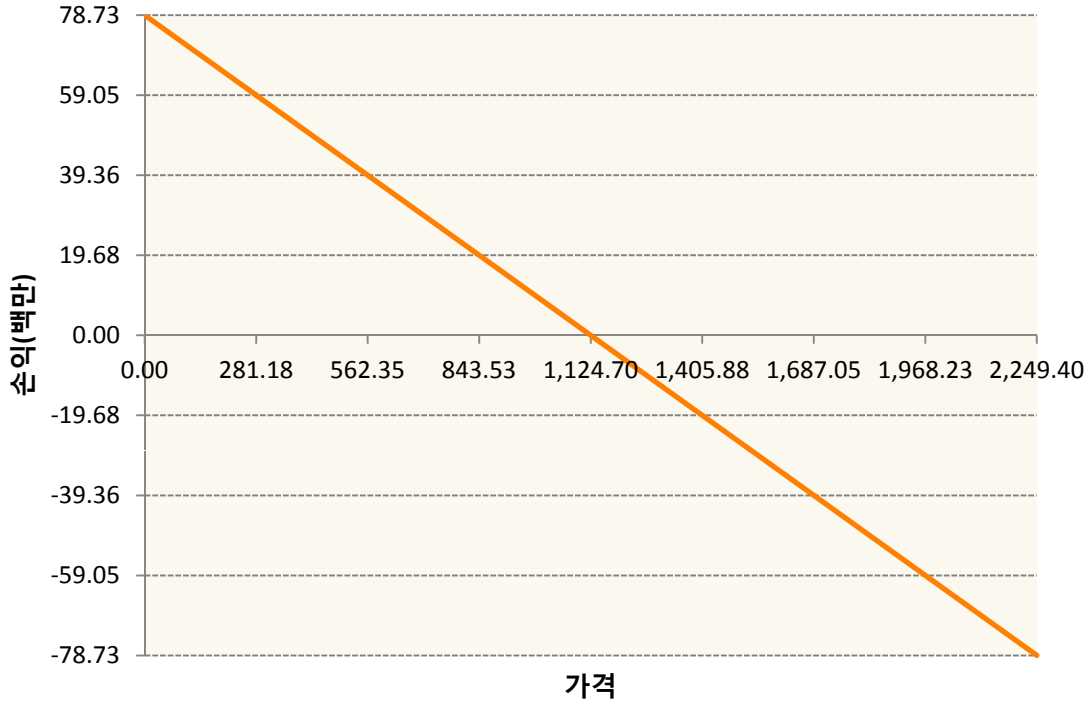
CH9-CORN FUTURE Mar19



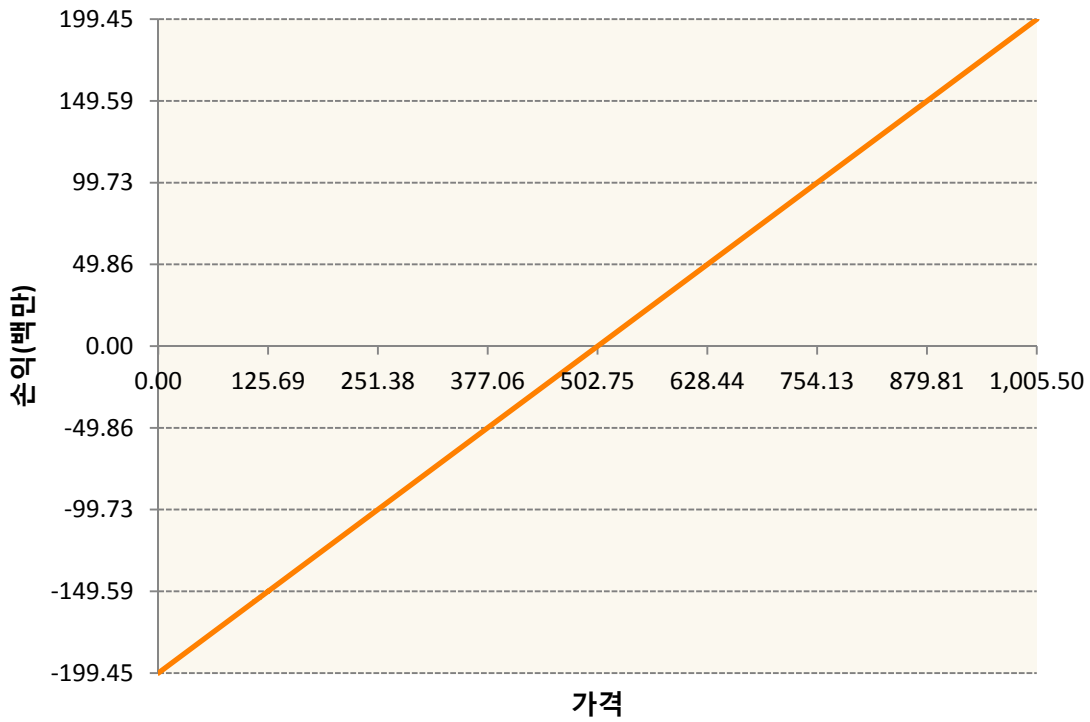




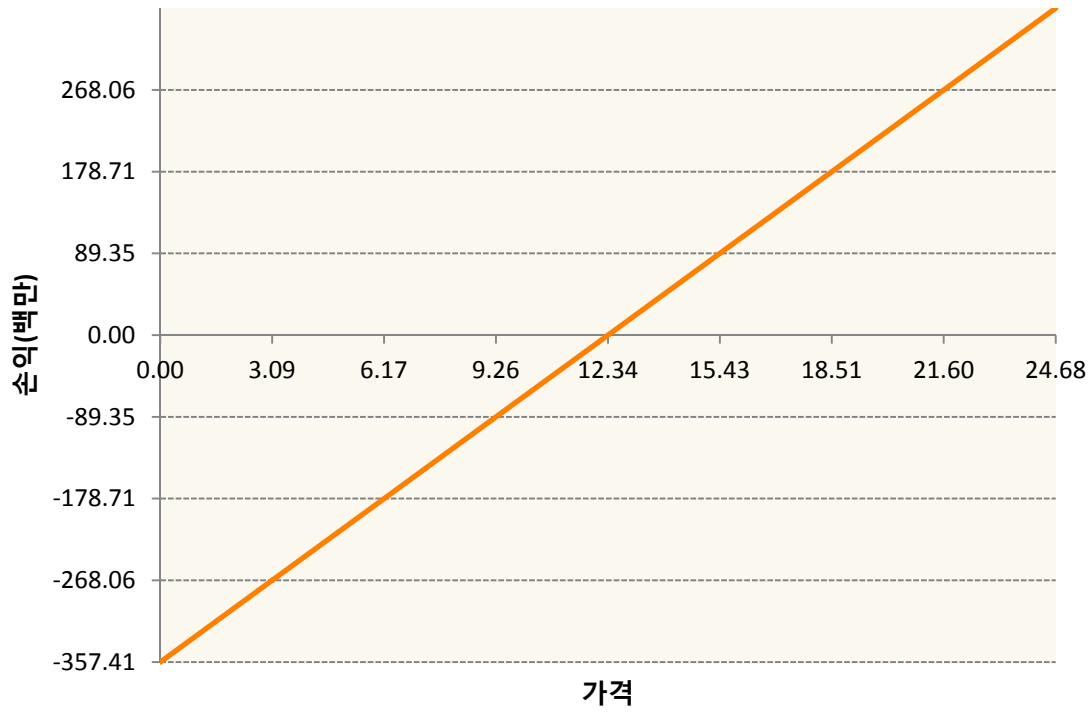
KR4175P10003-2019-01 달러선물



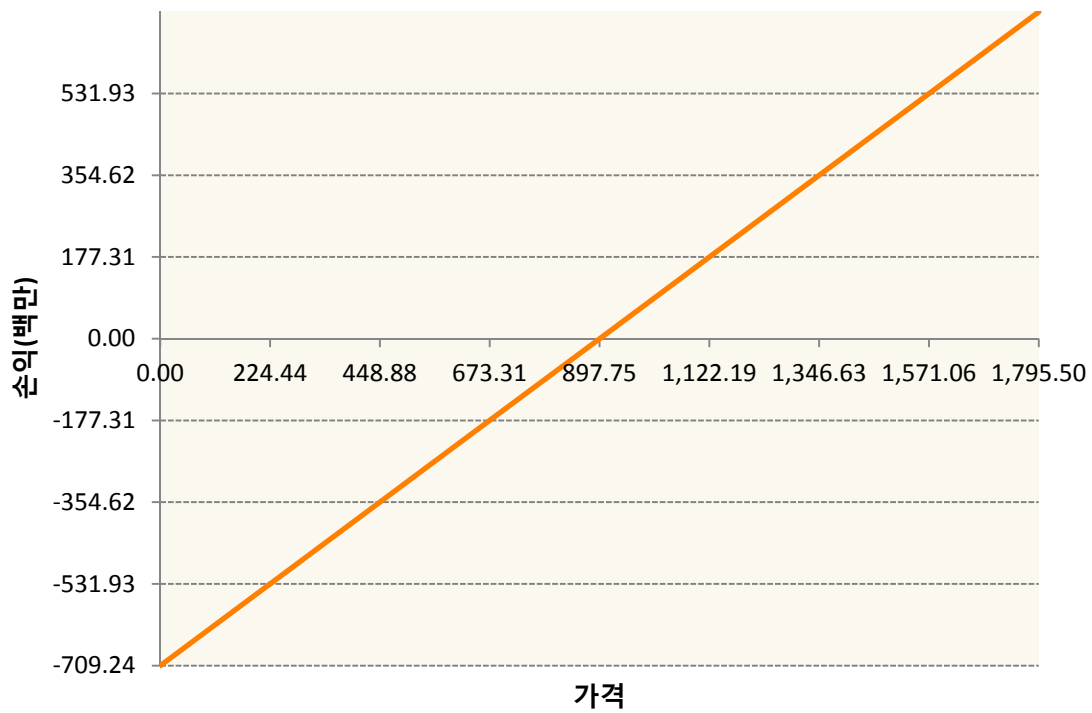
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



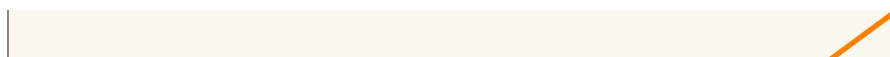
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

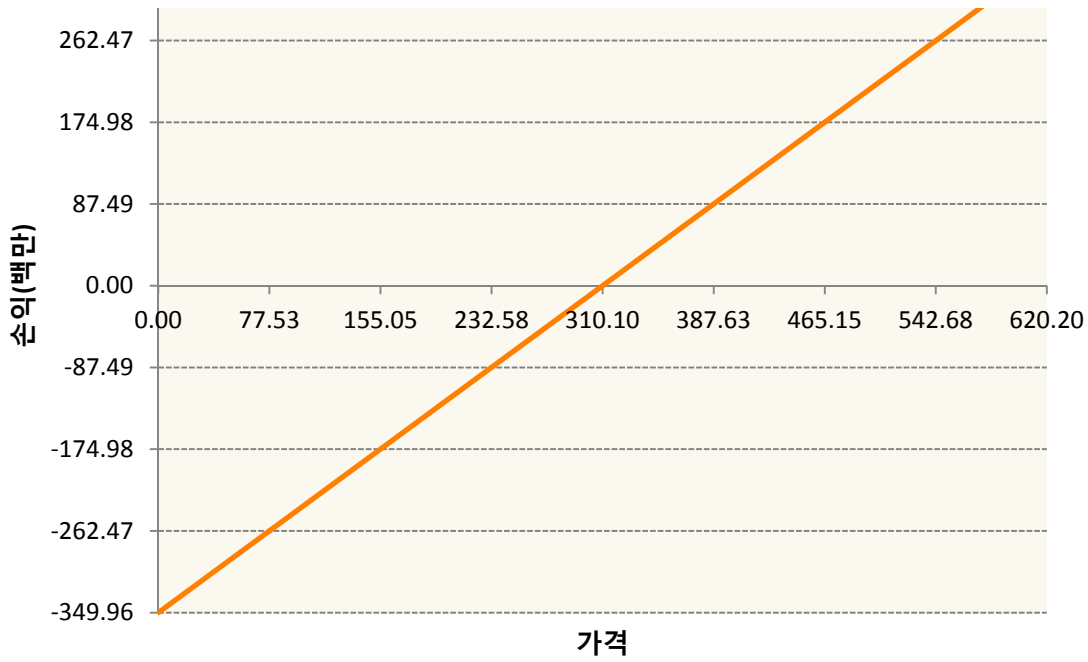


SH9-SOYBEAN FUTURE Mar19

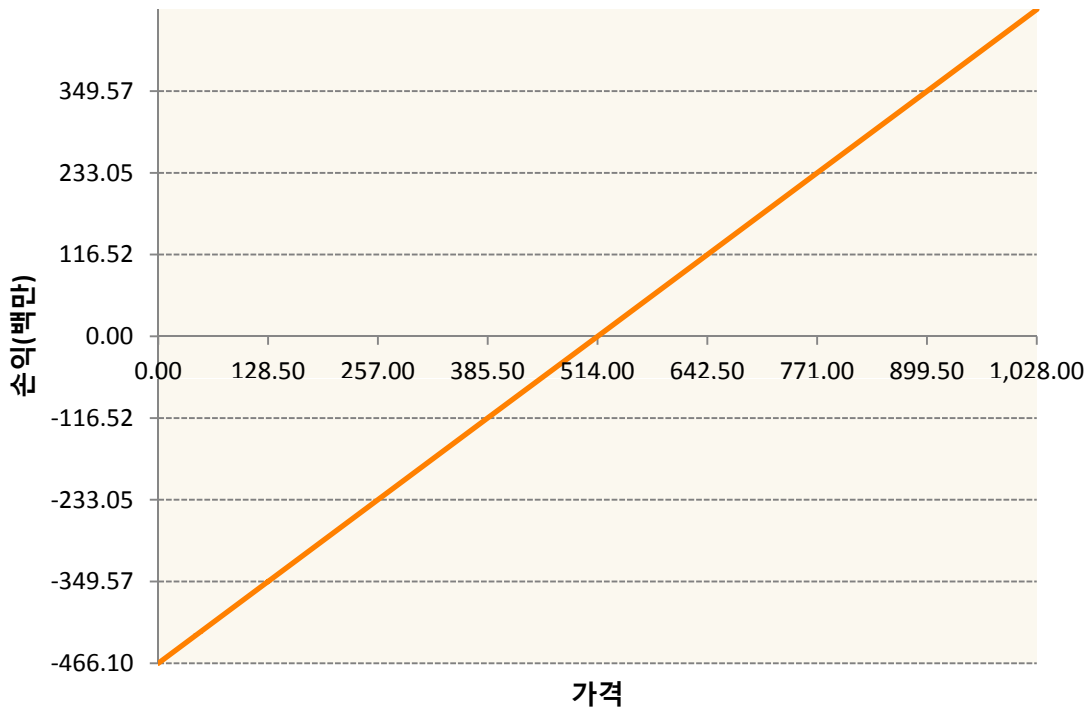


SMH9-SOYBEAN MEAL FUTR Mar19





WH9-WHEAT FUTURE(CBT) Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH9	SOYBEAN OIL FUTR Mar19	23
CH9	CORN FUTURE Mar19	65
CTH9	COTTON NO.2 FUTR Mar19	13
KCH9	COFFEE 'C' FUTURE Mar19	20
KR4175P100	2019-01 달러선물	6

KWH9	KC HRW WHEAT FUT Mar19	16
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	29
SH9	SOYBEAN FUTURE Mar19	57
SMH9	SOYBEAN MEAL FUTR Mar19	28
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	37

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

(단위:백만원)

303