

공시일	2018-12-13
기준일	2018-12-12

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	2018-12-13
기준일	2018-12-12

스마트인덱스모

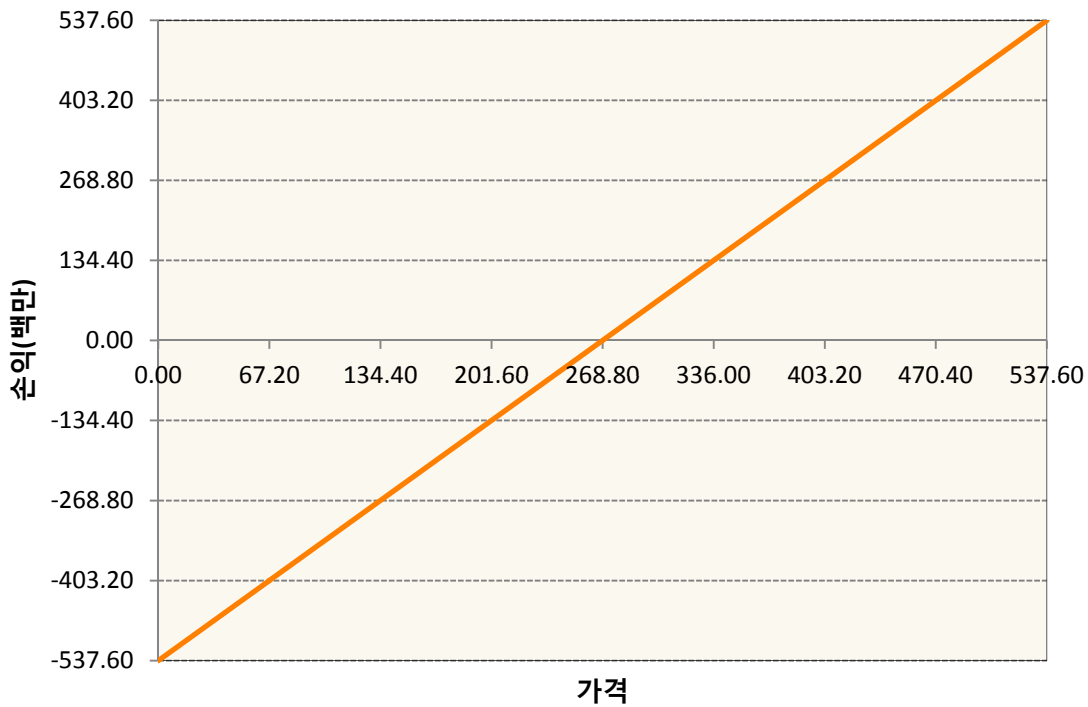
1. 계약금액

(단위:백만원)

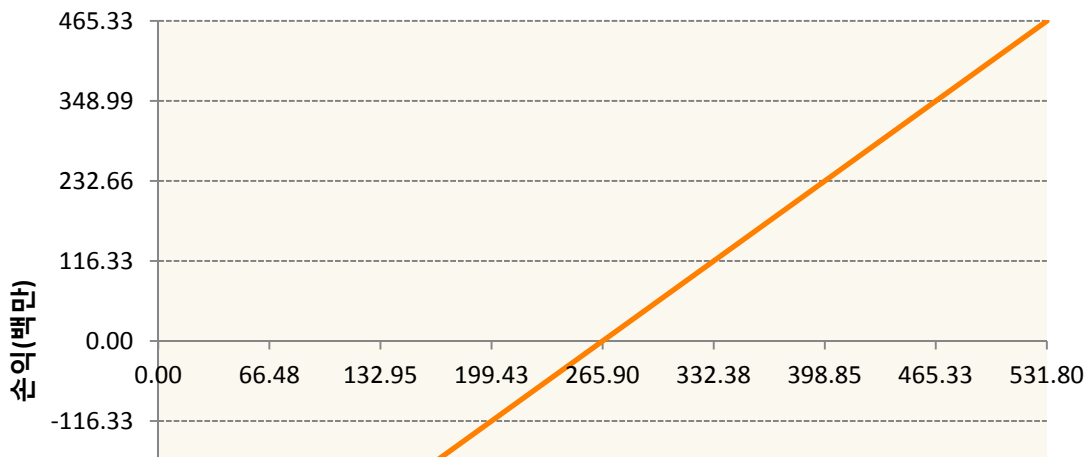
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	464	469	-5	장내
누계	유가증권	선물	1,003	0	1,003	장내

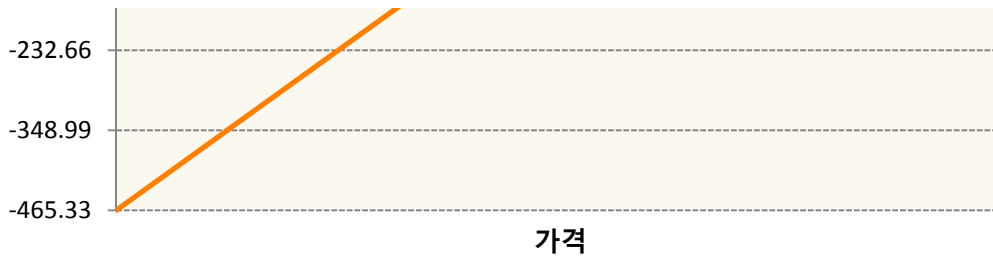
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0004		2018-12 코스피200지수선물						43
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43	
-5.33%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29	
-2.67%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	14	14	14	14	14	14	14	
5.33%	29	29	29	29	29	29	29	
8.00%	43	43	43	43	43	43	43	
KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						38
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38	
-5.33%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25	
-2.67%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	13	13	13	13	13	13	13	
5.33%	25	25	25	25	25	25	25	
8.00%	38	38	38	38	38	38	38	

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

69

공시일	2018-12-13
기준일	2018-12-12

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

1,040

* 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	2018-12-13
기준일	2018-12-12

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)

392

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-12-13
기준일	2018-12-12

유로인덱스모(주식-파생형)

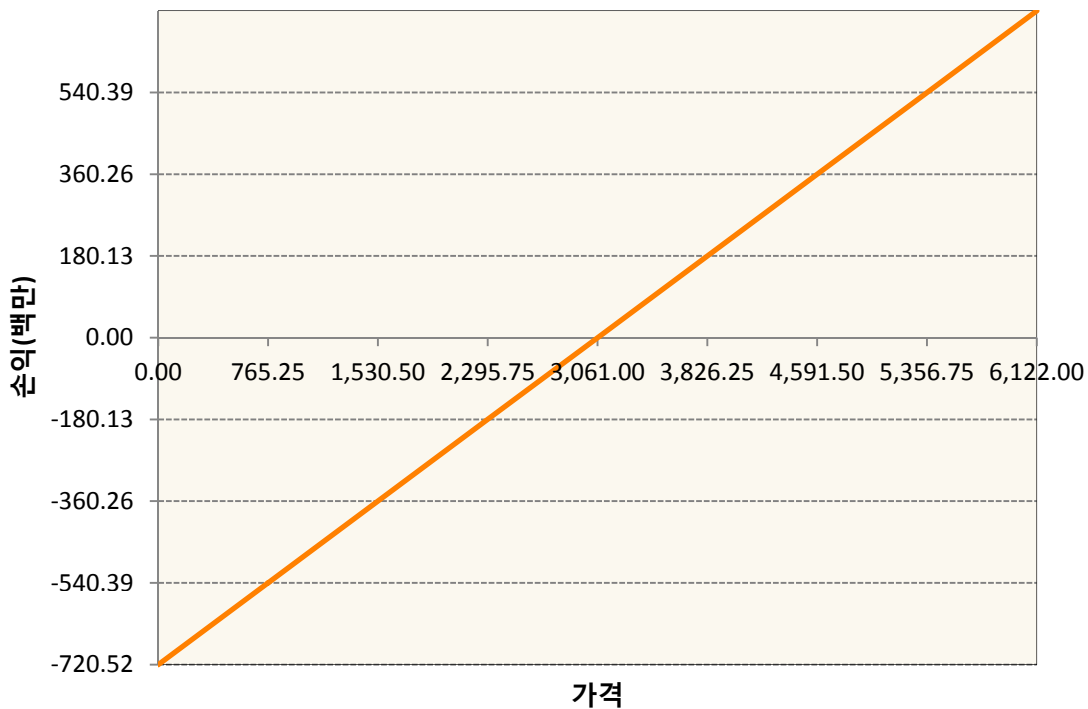
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	721	0	721	

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	2018-12-13
기준일	2018-12-12

차이나인덱스모(주식-파생형)

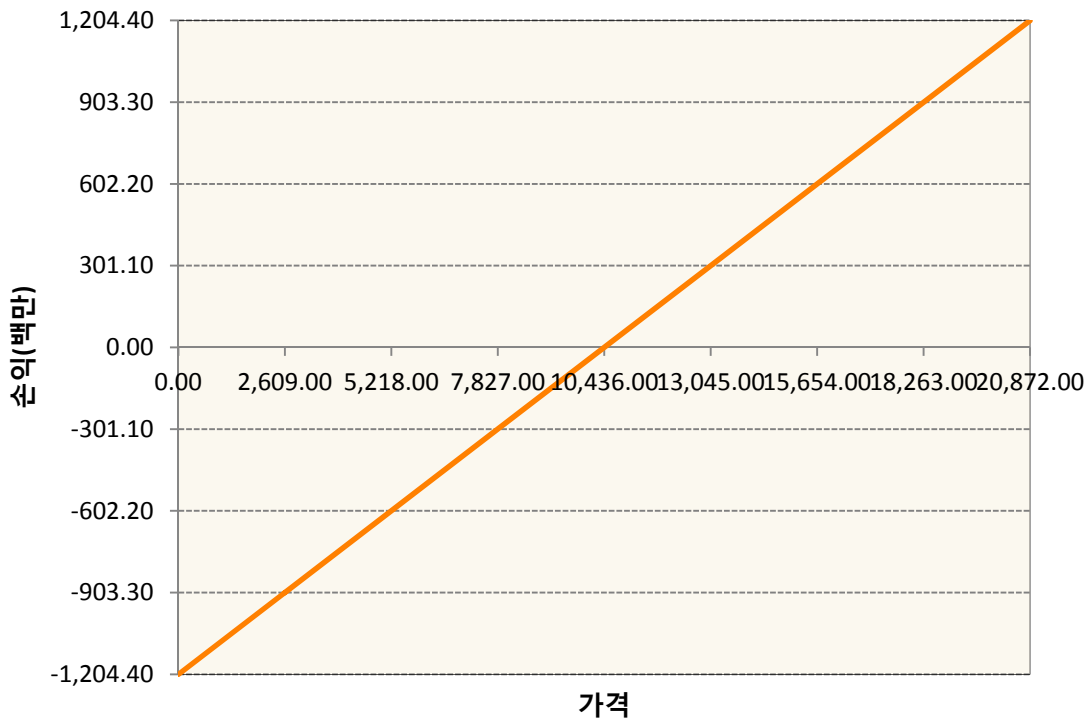
1. 계약금액

(단위:백만원)

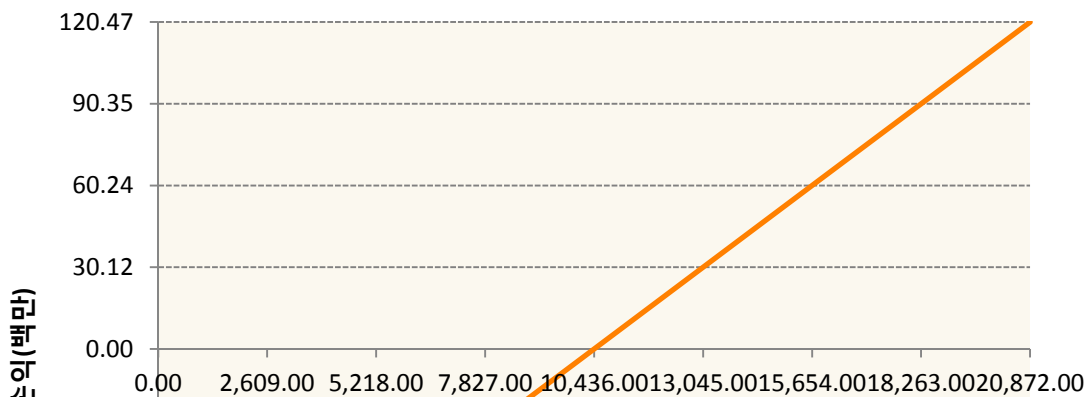
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,204	0	1,204	
누계	유가증권	선물	120	0	120	장내

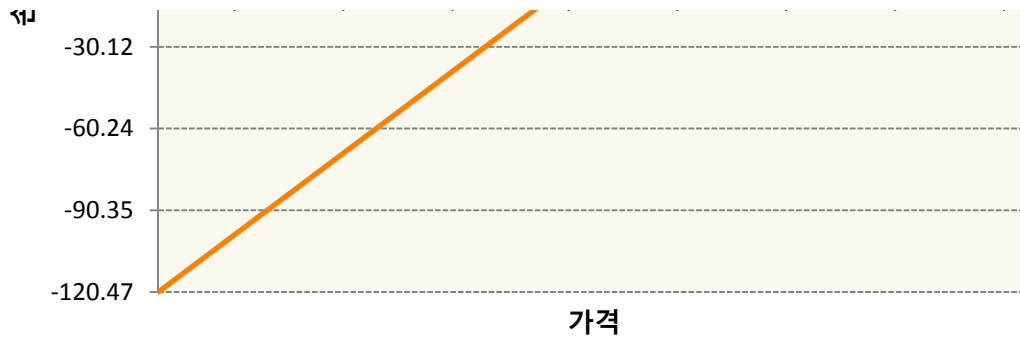
2. 만기시점의 손익구조

HCZ8-HSCEI FUTURES DEC 18



MHCZ8-MINI H-SHR IDX FU DEC18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCZ8	HSCEI FUTURES DEC 18	96
MHCZ8	MINI H-SHR IDX FU DEC18	10

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

96

공시일	2018-12-13
기준일	2018-12-12

커버드콜모(주식혼합-파생형)

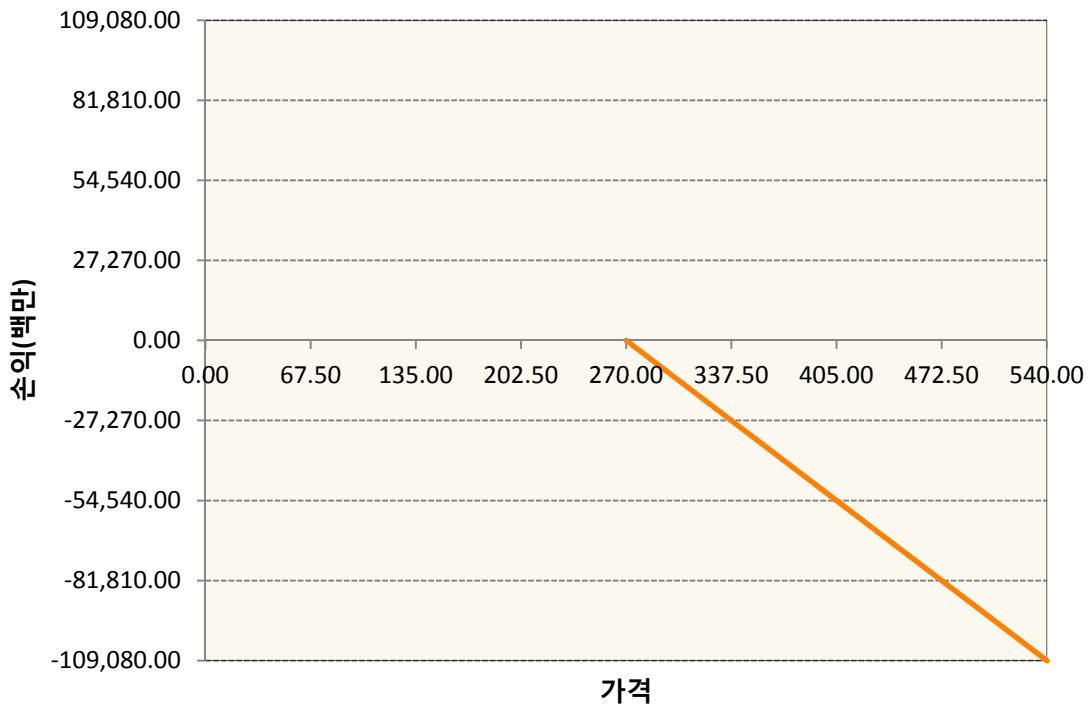
1. 계약금액

(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%	342	342	342	342	342	342	342
-2.67%	342	342	341	340	337	332	324
0%	217	154	82	0	-89	-186	-287
2.67%	-3,480	-3,570	-3,669	-3,775	-3,887	-4,003	-4,123
5.33%	-11,416	-11,417	-11,419	-11,423	-11,430	-11,441	-11,456
8.00%	-19,602	-19,602	-19,602	-19,602	-19,602	-19,602	-19,602
KR4301NC2727 2018-12 풋272.5							22,496
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,496	-22,496	-22,496	-22,496	-22,496	-22,496	-22,496
-5.33%	-14,979	-14,979	-14,979	-14,979	-14,979	-14,979	-14,979
-2.67%	-7,462	-7,462	-7,462	-7,462	-7,462	-7,462	-7,463
0%	44	34	20	0	-25	-54	-88
2.67%	4,253	4,228	4,197	4,160	4,118	4,071	4,021
5.33%	4,291	4,291	4,291	4,291	4,291	4,291	4,290
8.00%	4,291	4,291	4,291	4,291	4,291	4,291	4,291

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

(단위:백만원)

63,945

공시일	2018-12-13
기준일	2018-12-12

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

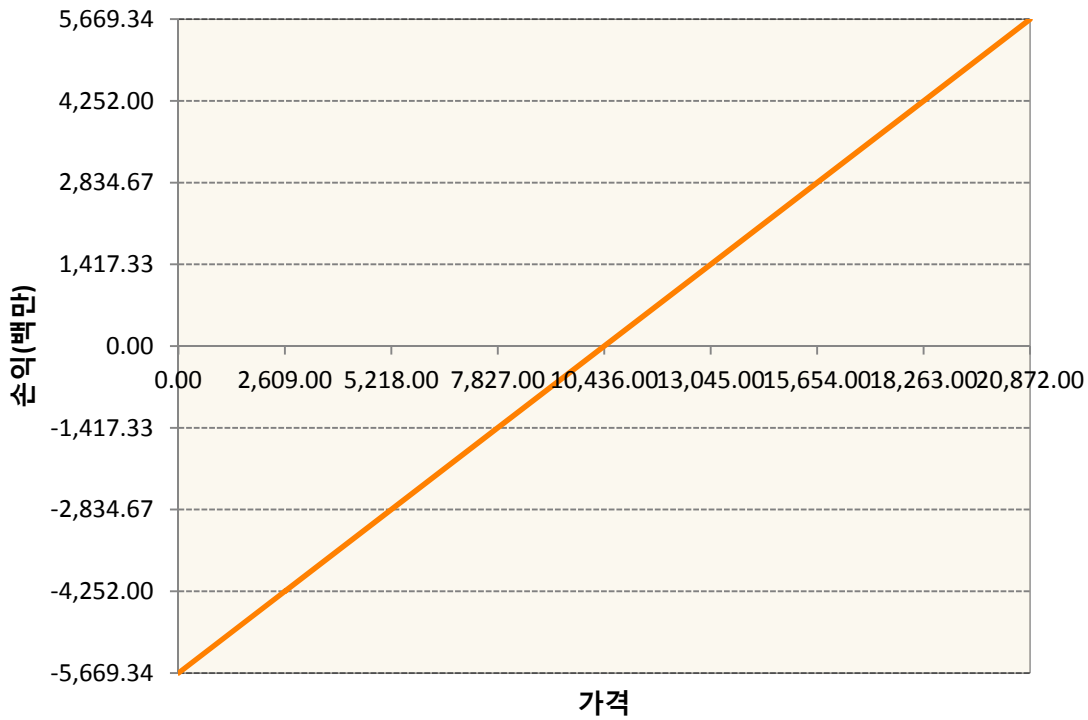
1. 계약금액

(단위:백만원)

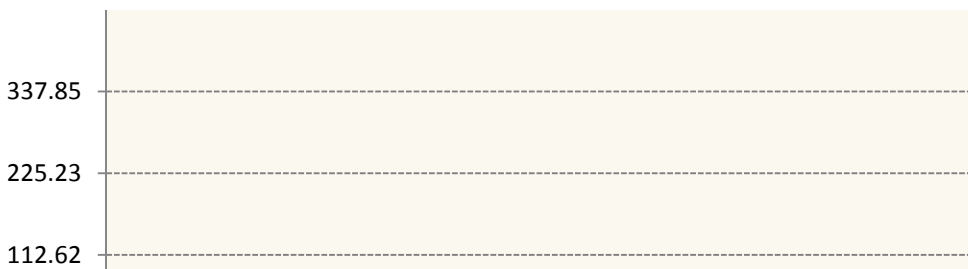
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,669	0	5,669	
누계	유가증권	옵션	0	12,838	-12,838	장내
누계	통화	선도	0	2,743	-2,743	장외

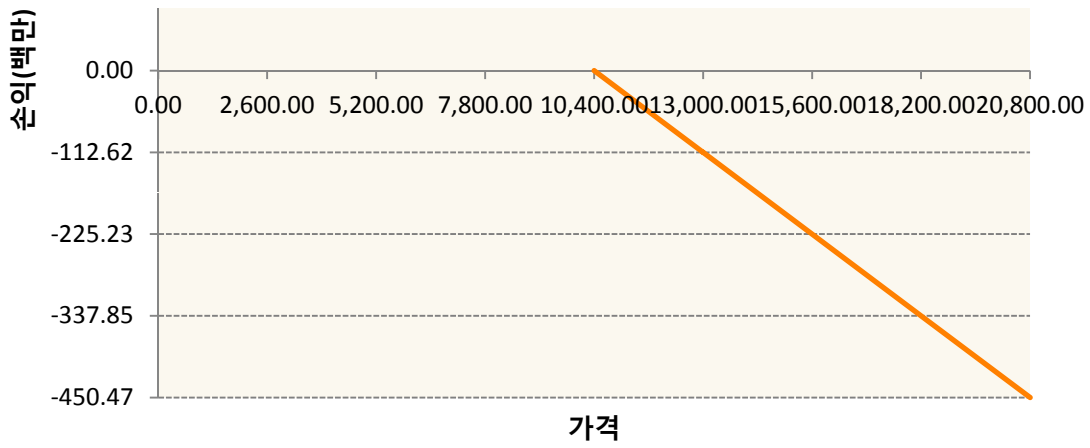
2. 만기시점의 손익구조

HCZ8-HSCEI FUTURES DEC 18

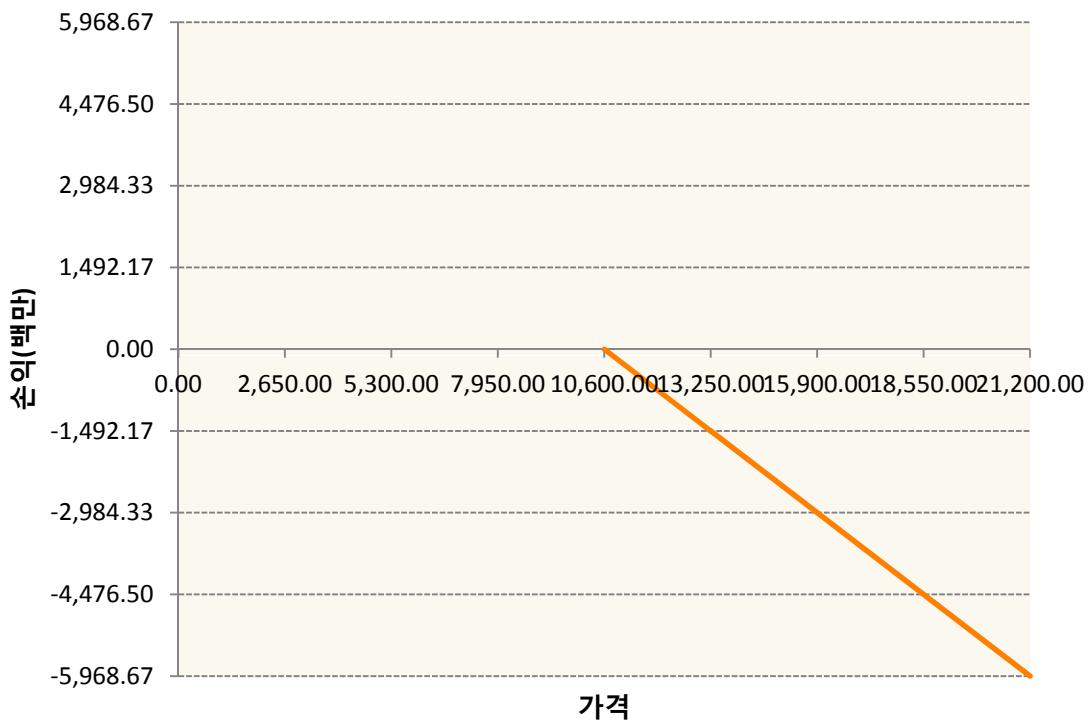


OHHI28-C104-HSCEI

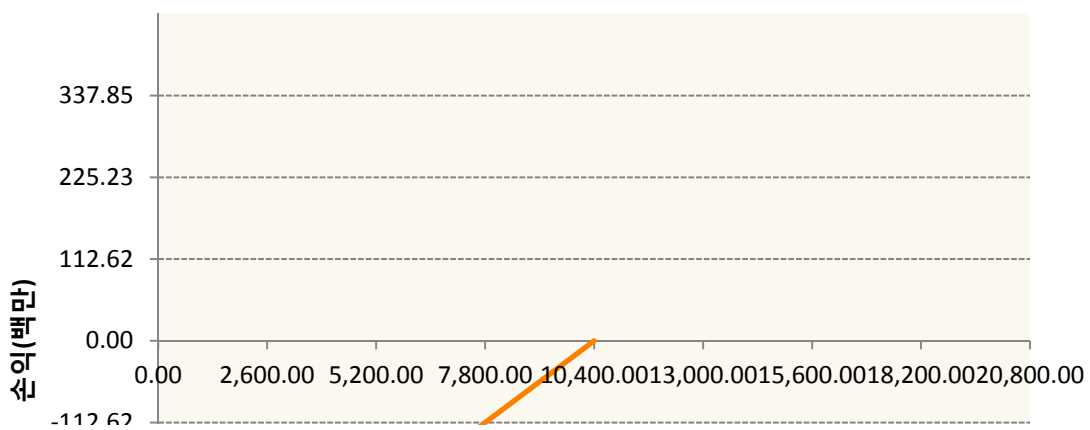


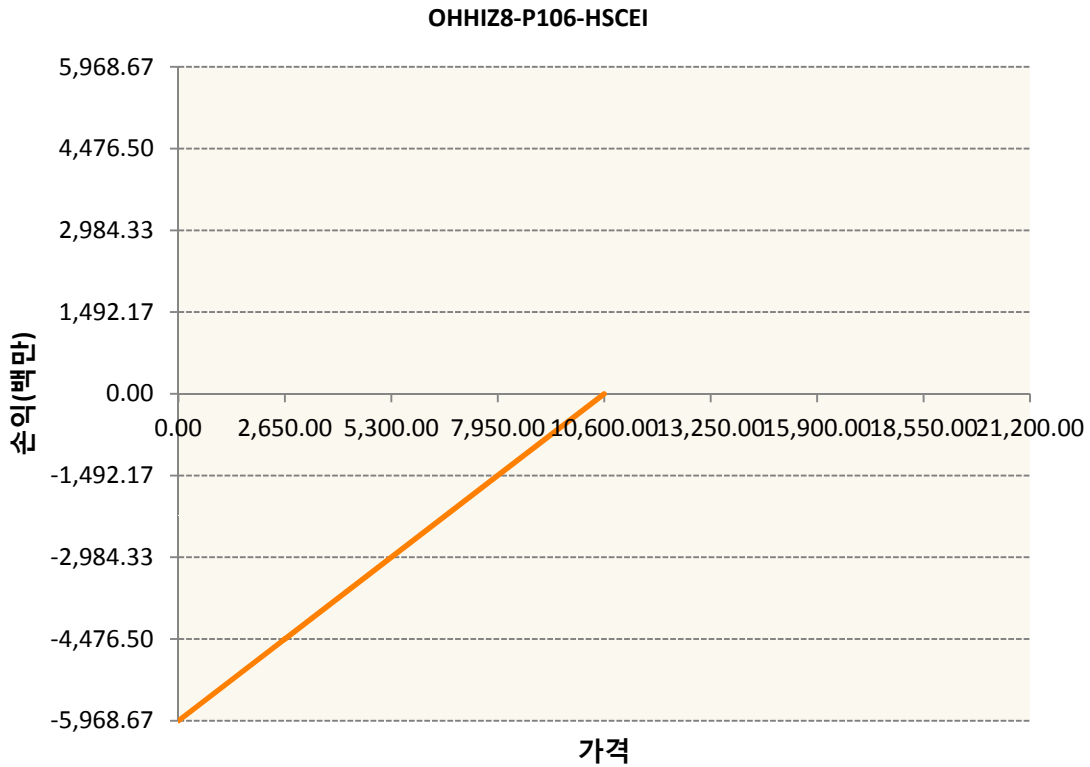


OHHIZ8-C106-HSCEI



OHHIZ8-P104-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	219
HCZ8 HSCEI FUTURES DEC 18	454
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)
	1,523

공시일	2018-12-13
기준일	2018-12-12

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

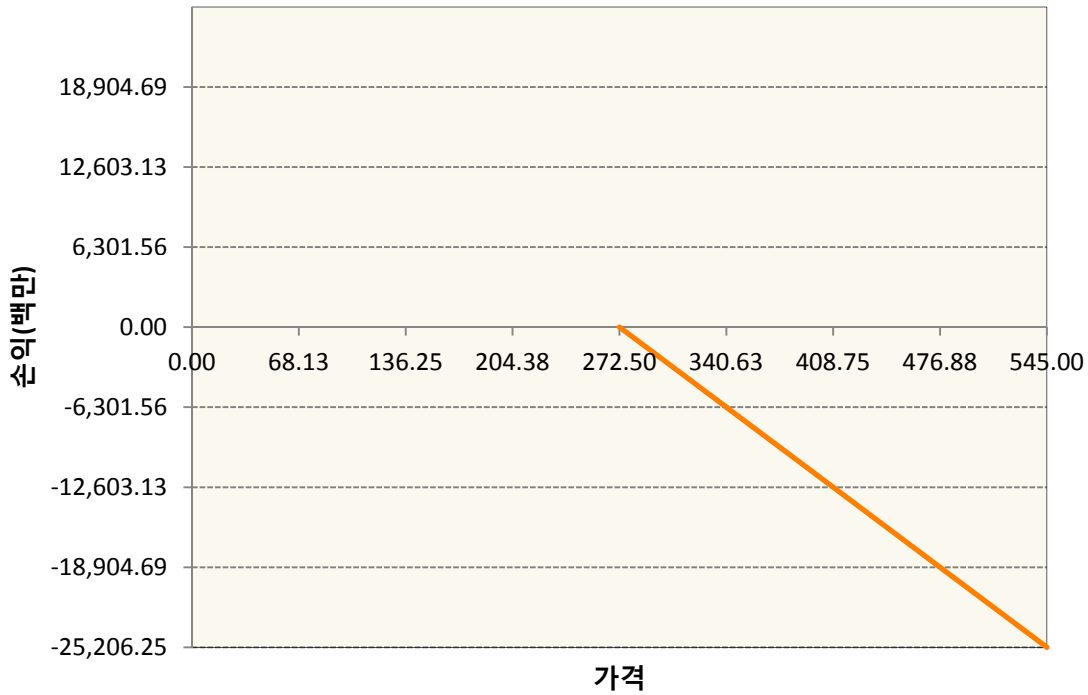
1. 계약금액

(단위:백만원)

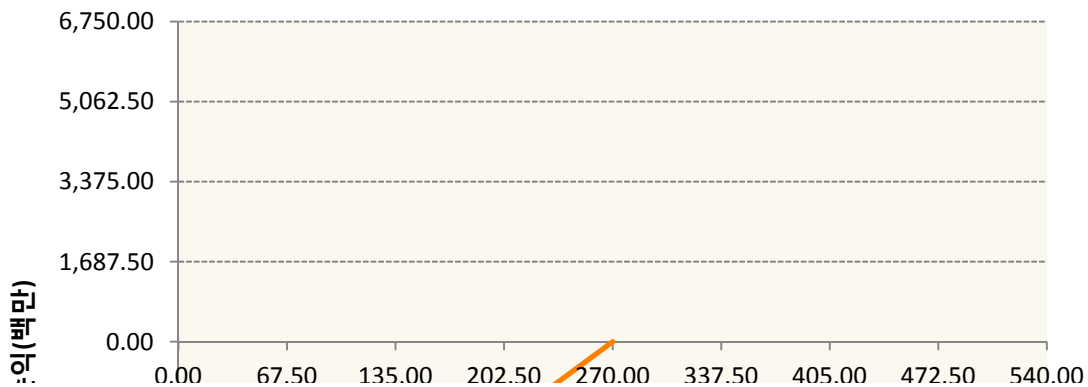
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	43,836	0	43,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	43,538	-43,538	장내

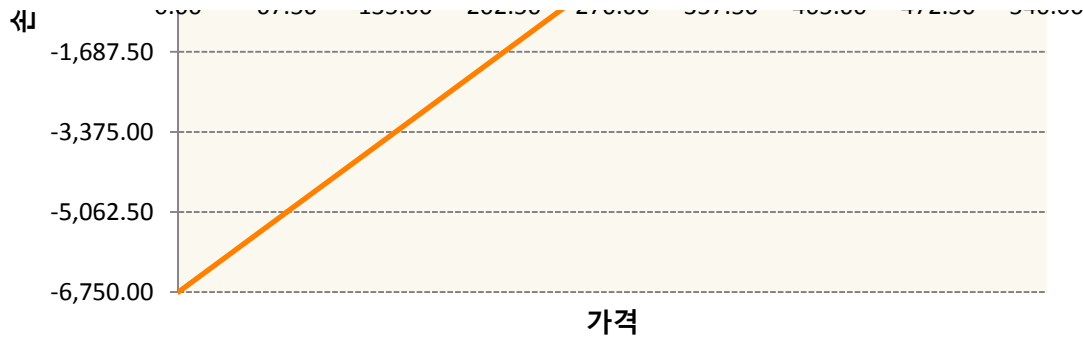
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NC2728-2018-12 콜272.5

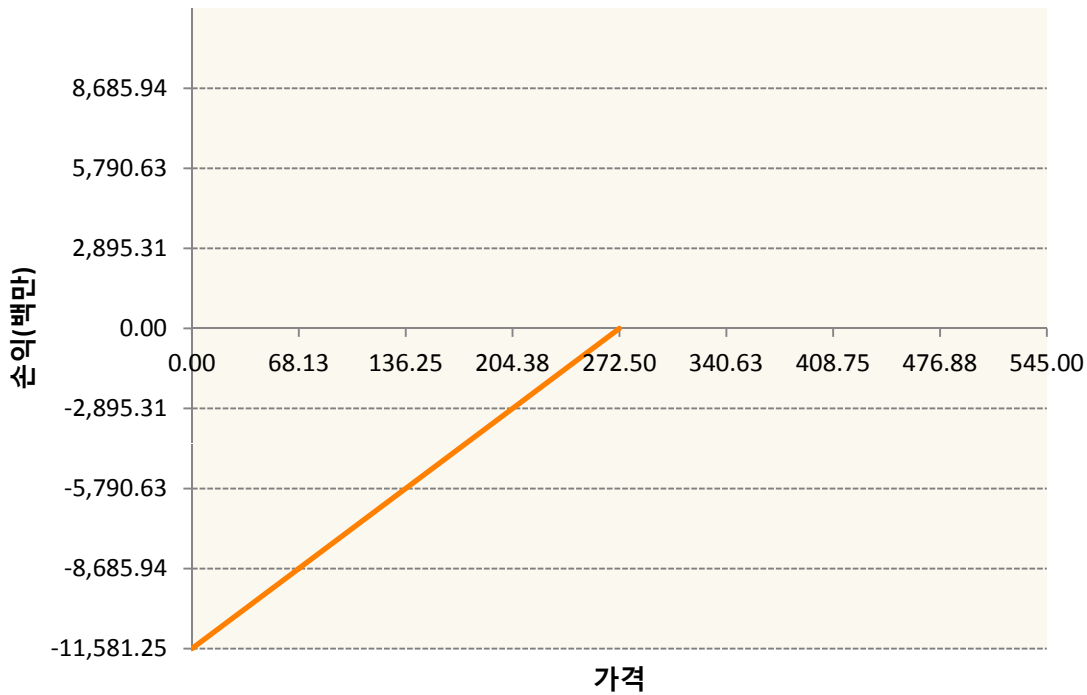


KR4301NC2701-2018-12 풋270





KR4301NC2727-2018-12 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14				3,622
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,622	-3,622	-3,622	-3,622	-3,622	-3,622	-3,622
-5.33%	-2,415	-2,415	-2,415	-2,415	-2,415	-2,415	-2,415
-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%	2,415	2,415	2,415	2,415	2,415	2,415	2,415
8.00%	3,622	3,622	3,622	3,622	3,622	3,622	3,622
	KR4201NC2728		2018-12 풋272.5				1,586
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	28	28	28	28	28	28	28
-5.33%	28	28	28	28	28	28	28
-2.67%	28	28	28	27	27	27	26
0%	18	12	7	0	-7	-15	-23
2.67%	-282	-289	-297	-305	-314	-324	-334
5.33%	-923	-924	-924	-924	-925	-925	-927
8.00%	-1,586	-1,586	-1,586	-1,586	-1,586	-1,586	-1,586

KR4301NC2701 2018-12 풋270 527

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-527	-527	-527	-527	-527	-527	-527
-5.33%	-348	-348	-348	-348	-348	-348	-348
-2.67%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169
0%	5	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	48	48	48	48	48	48	47
5.33%	48	48	48	48	48	48	48
8.00%	48	48	48	48	48	48	48

KR4301NC2727 2018-12 풋272.5 911

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-911	-911	-911	-911	-911	-911	-911
-5.33%	-606	-606	-606	-606	-606	-606	-606
-2.67%	-302	-302	-302	-302	-302	-302	-302
0%	2	1	1	0	-1	-2	-4
2.67%	172	171	170	168	167	165	163
5.33%	174	174	174	174	174	174	174
8.00%	174	174	174	174	174	174	174

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

(단위:백만원)

7,497

공시일	2018-12-13
기준일	2018-12-12

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

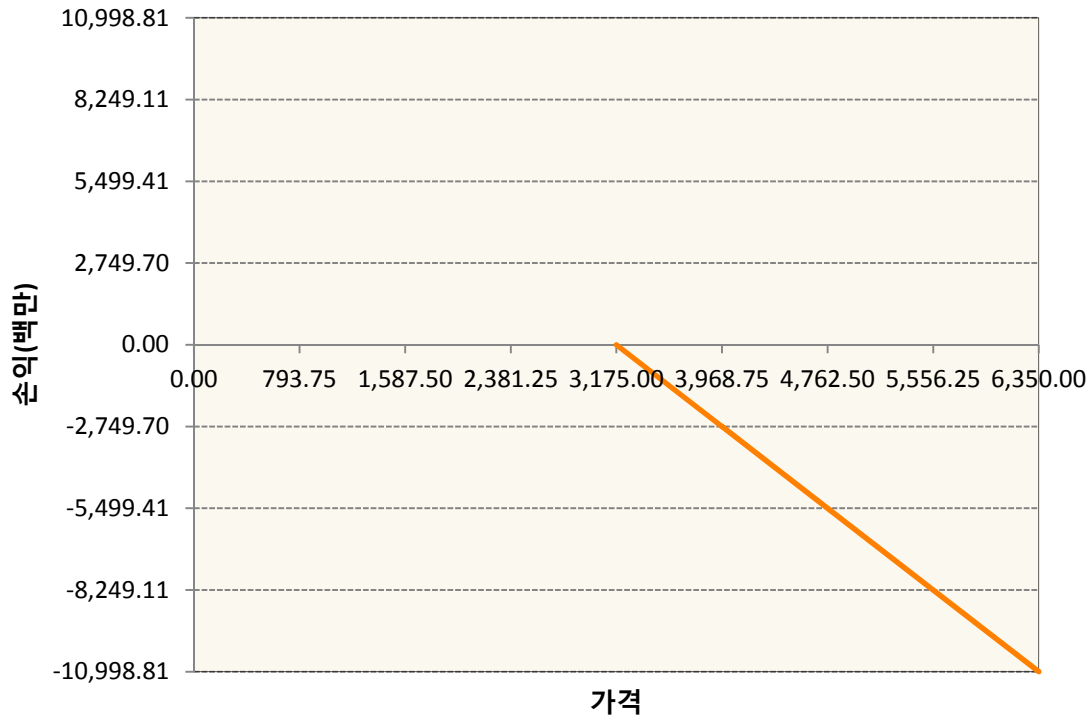
1. 계약금액

(단위:백만원)

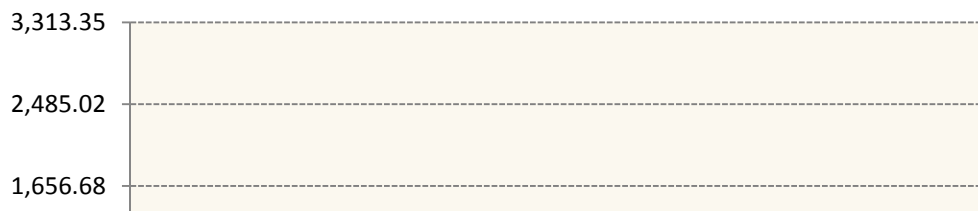
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,828	0	7,828	
누계	유가증권	스왑	71,398	0	71,398	장외
누계	유가증권	옵션	0	28,624	-28,624	장내
누계	통화	선도	0	15,340	-15,340	장외

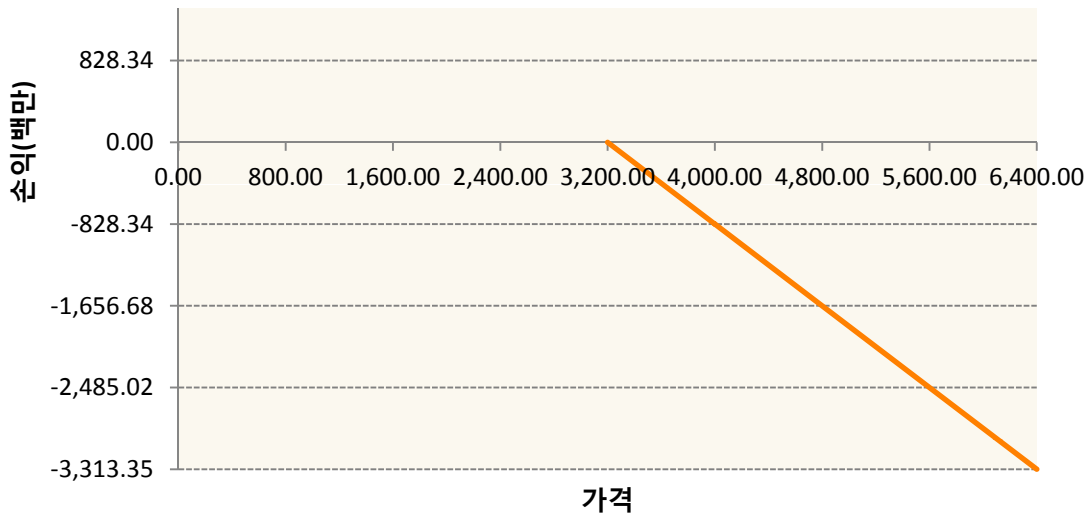
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ8-C3175-EURO STOXX 50

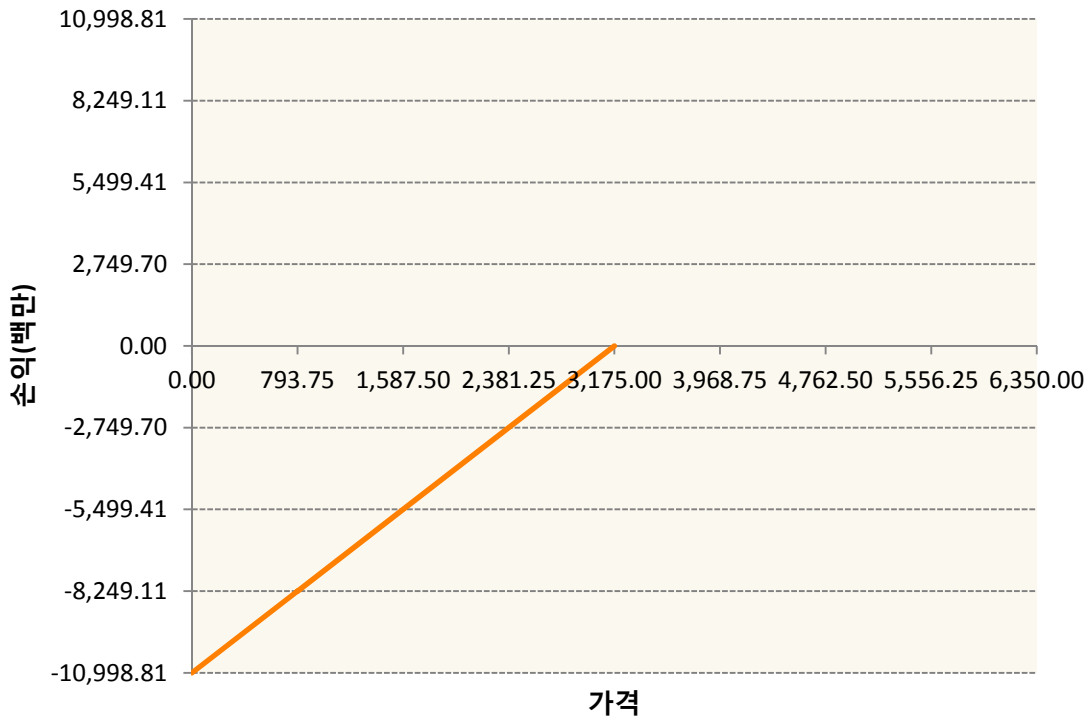


OESXZ8-C3200-EURO STOXX 50

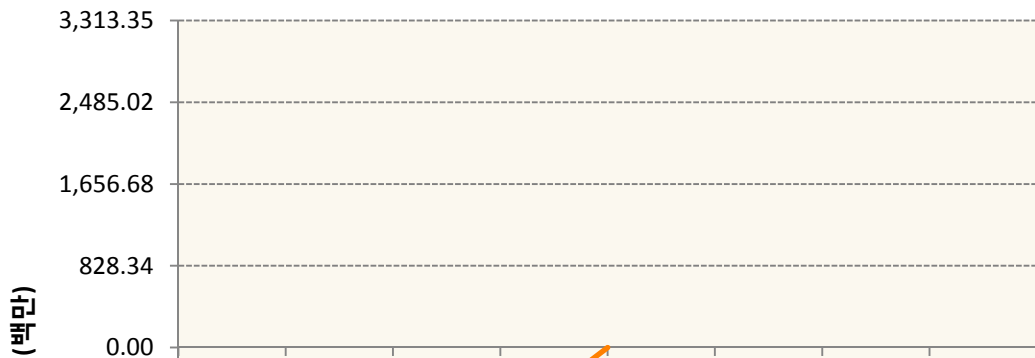


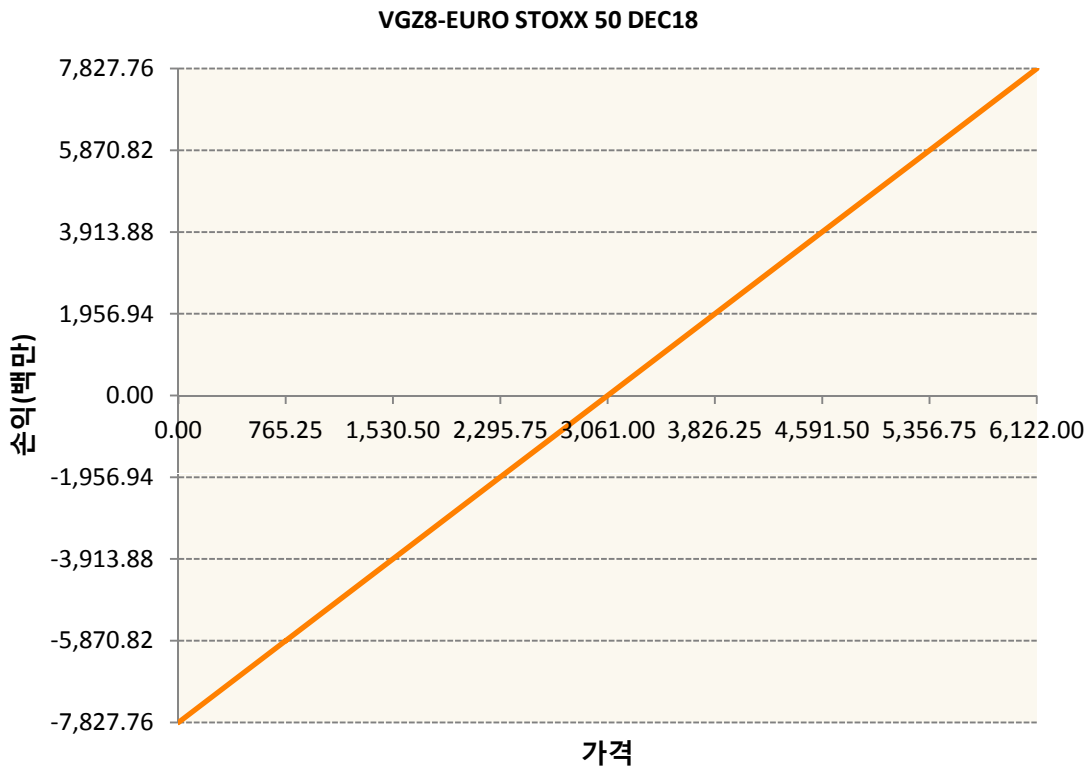
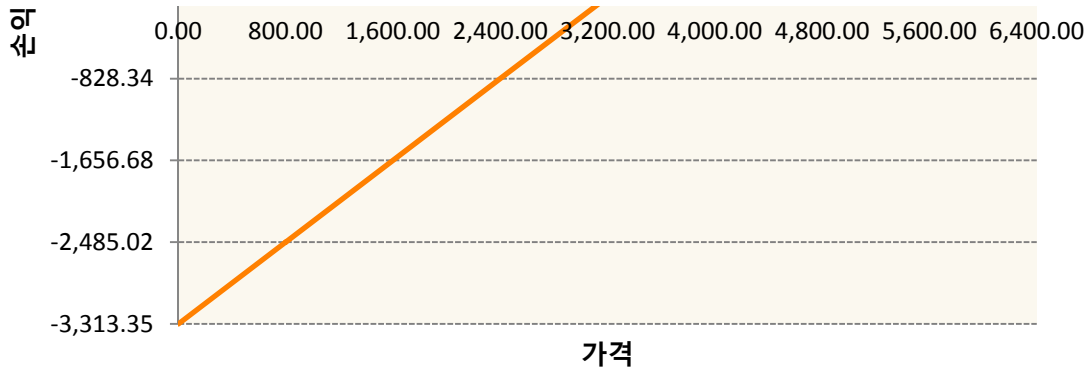


OESXZ8-P3175-EURO STOXX 50



OESXZ8-P3200-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	80
FX21018U03 KRW/EUR 21-12-18E	818
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E	409
OESXZ8-C31 EURO STOXX 50	880
OESXZ8-C32 EURO STOXX 50	265
OESXZ8-P31 EURO STOXX 50	880
OESXZ8-P32 EURO STOXX 50	265
VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18	626

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

(단위:백만원)

2,704

공시일	2018-12-13
기준일	2018-12-12

ETF스마트레버리지목표전환형8호

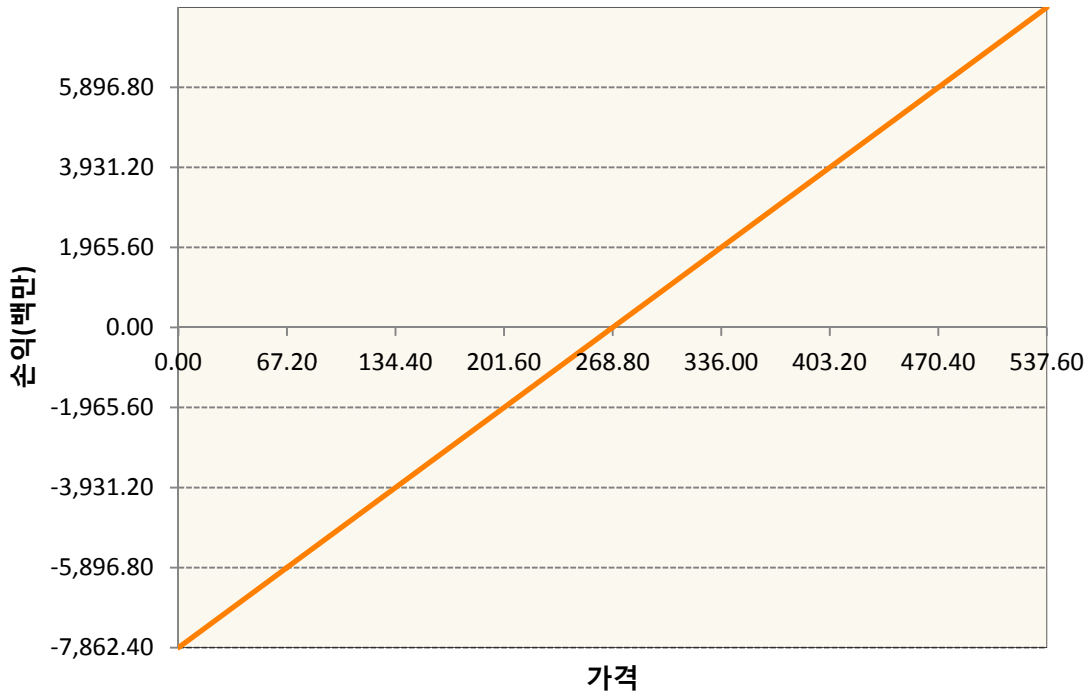
1. 계약금액

(단위:백만원)

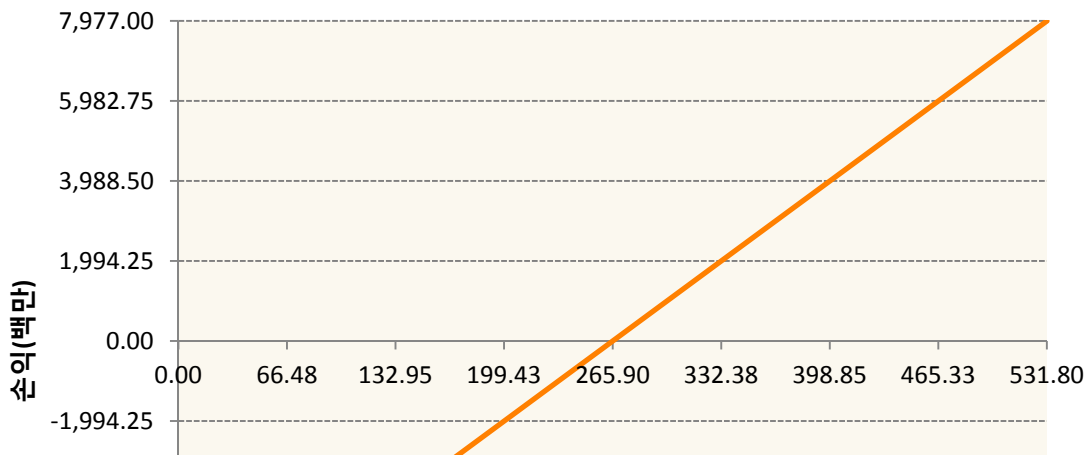
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	7,958	8,047	-89	장내
누계	유가증권	선물	15,839	0	15,839	장내

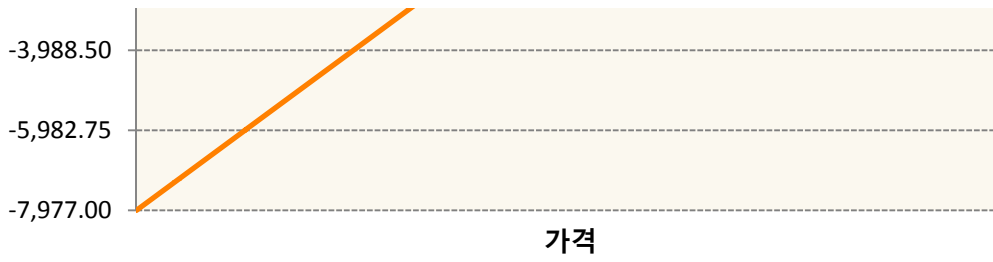
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0004		2018-12 코스피200지수선물						628
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-628	-628	-628	-628	-628	-628	-628	
-5.33%	-419	-419	-419	-419	-419	-419	-419	
-2.67%	-209	-209	-209	-209	-209	-209	-209	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	209	209	209	209	209	209	209	
5.33%	419	419	419	419	419	419	419	
8.00%	628	628	628	628	628	628	628	
KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						644
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-644	-644	-644	-644	-644	-644	-644	
-5.33%	-430	-430	-430	-430	-430	-430	-430	
-2.67%	-215	-215	-215	-215	-215	-215	-215	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	215	215	215	215	215	215	215	
5.33%	430	430	430	430	430	430	430	
8.00%	644	644	644	644	644	644	644	

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

1,097

공시일	2018-12-13
기준일	2018-12-12

ETF스마트레버리지목표전환형9호

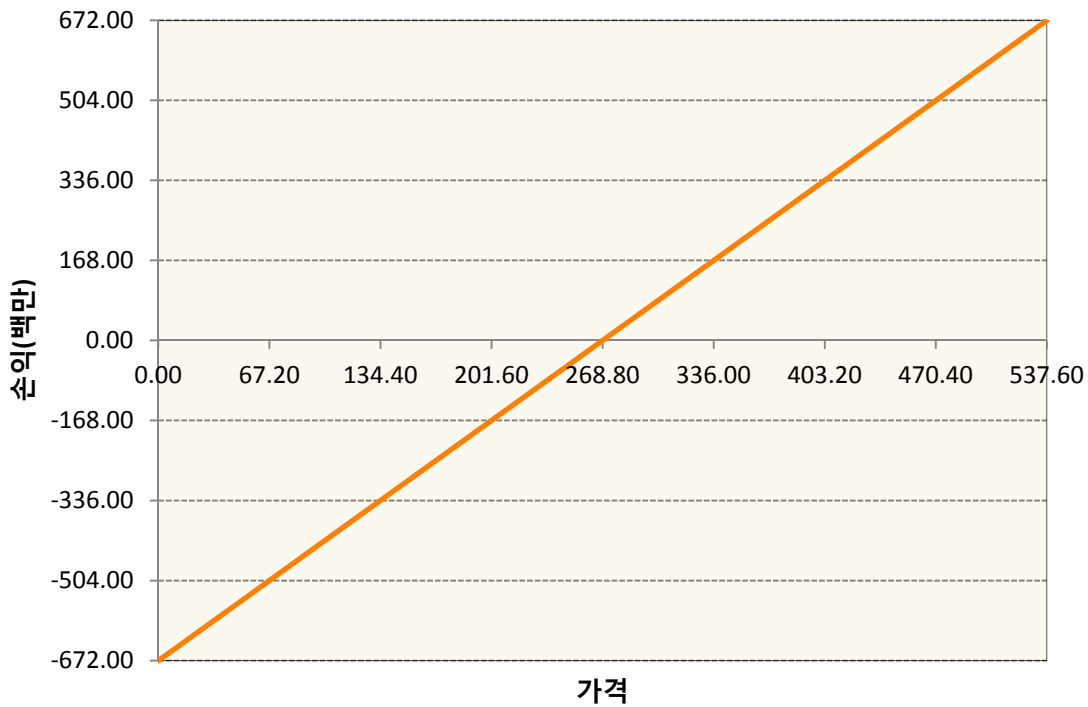
1. 계약금액

(단위:백만원)

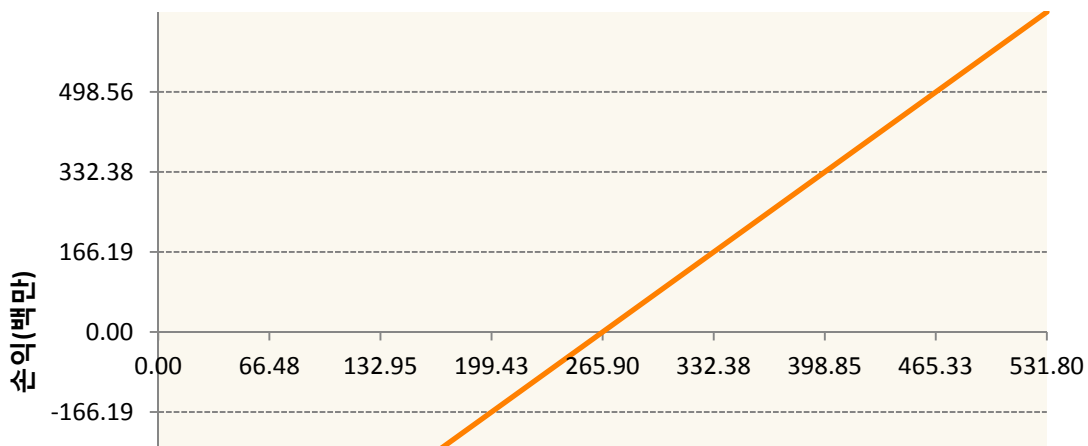
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	663	670	-7	장내
누계	유가증권	선물	1,337	0	1,337	장내

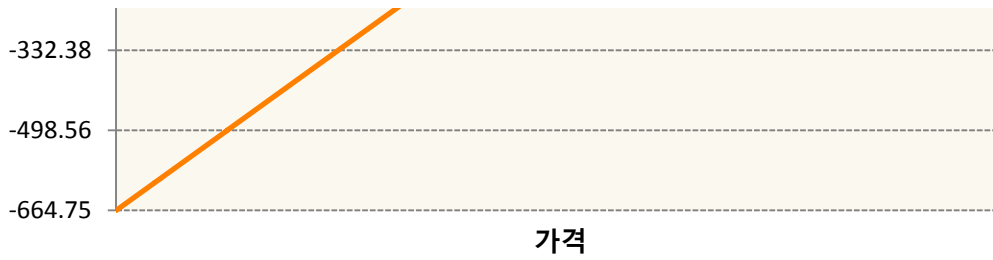
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0004		2018-12 코스피200지수선물						54
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54	
-5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	18	18	18	18	18	18	18	
5.33%	36	36	36	36	36	36	36	
8.00%	54	54	54	54	54	54	54	
KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						54
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54	
-5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	18	18	18	18	18	18	18	
5.33%	36	36	36	36	36	36	36	
8.00%	54	54	54	54	54	54	54	

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

93

공시일	2018-12-13
기준일	2018-12-12

ETF스마트레버리지목표전환형10호

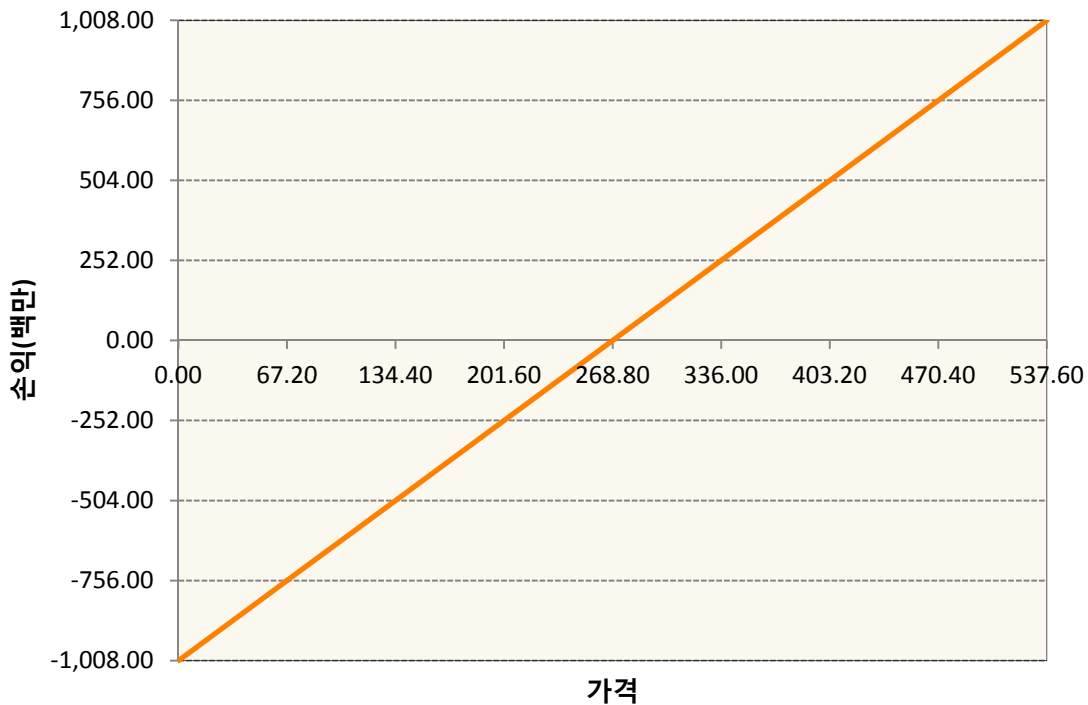
1. 계약금액

(단위:백만원)

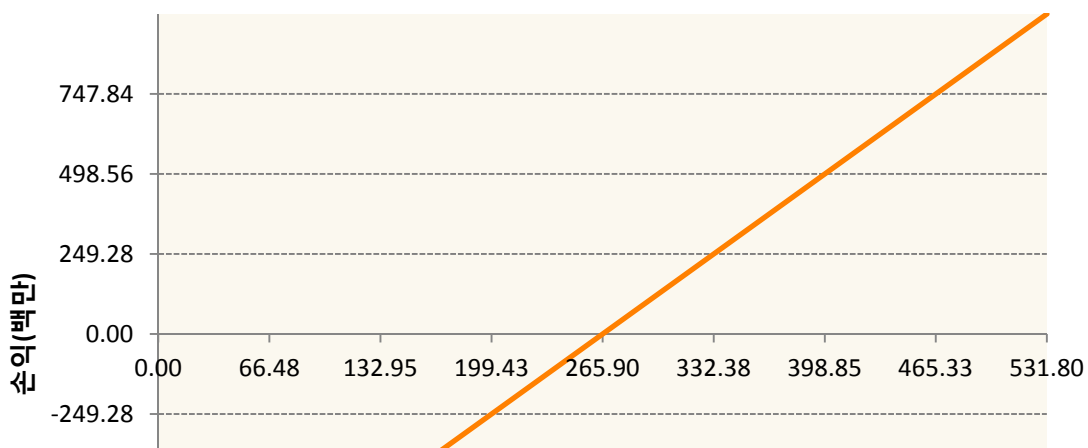
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	995	1,006	-11	장내
누계	유가증권	선물	2,005	0	2,005	장내

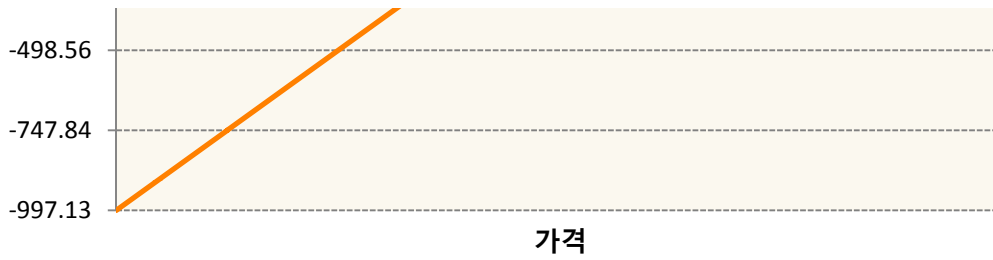
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0004		2018-12 코스피200지수선물						81
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81	
-5.33%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54	
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	27	27	27	27	27	27	27	
5.33%	54	54	54	54	54	54	54	
8.00%	81	81	81	81	81	81	81	
KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						81
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81	
-5.33%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54	
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	27	27	27	27	27	27	27	
5.33%	54	54	54	54	54	54	54	
8.00%	81	81	81	81	81	81	81	

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

139

공시일	2018-12-13
기준일	2018-12-12

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

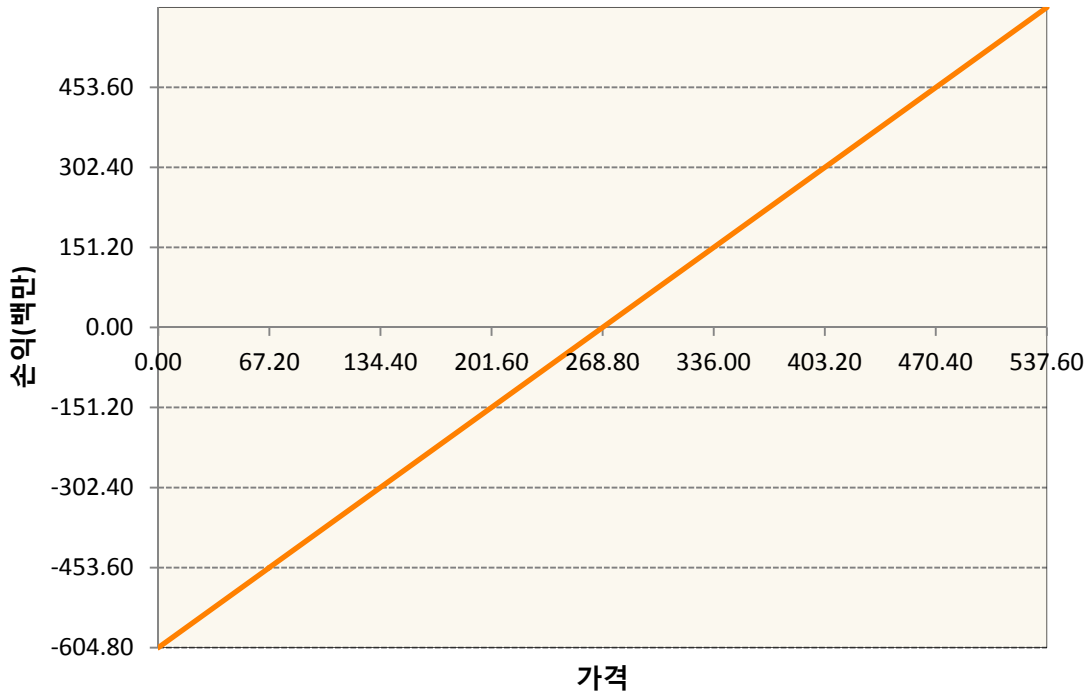
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	605	0	605	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)

42

공시일	2018-12-13
기준일	2018-12-12

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

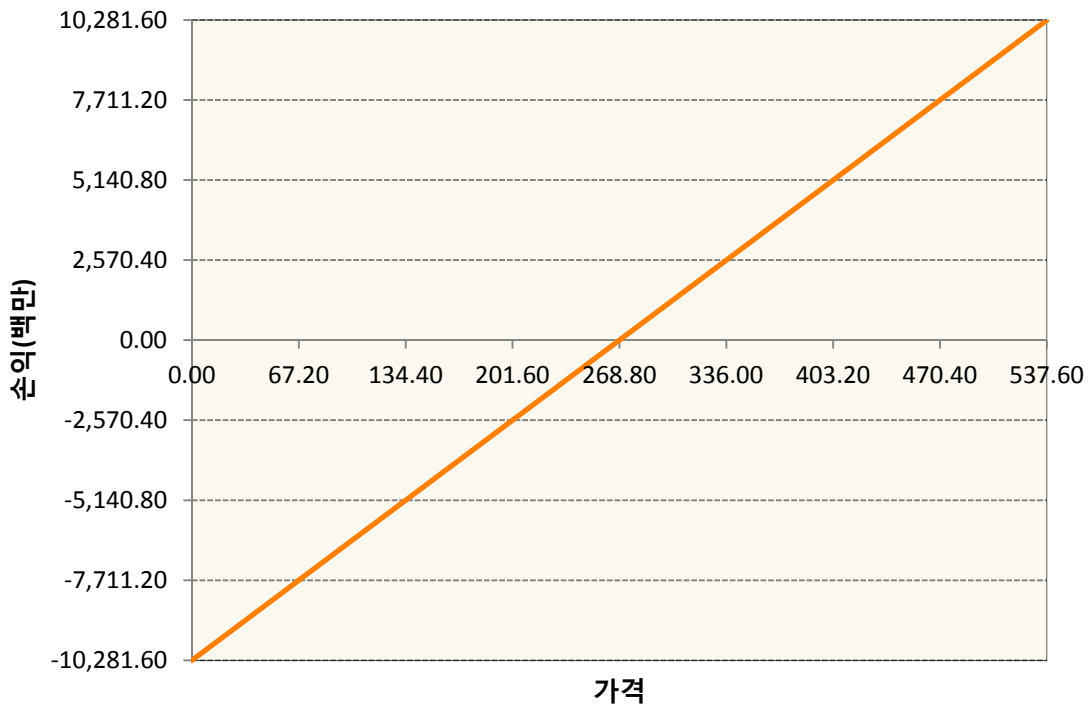
1. 계약금액

(단위:백만원)

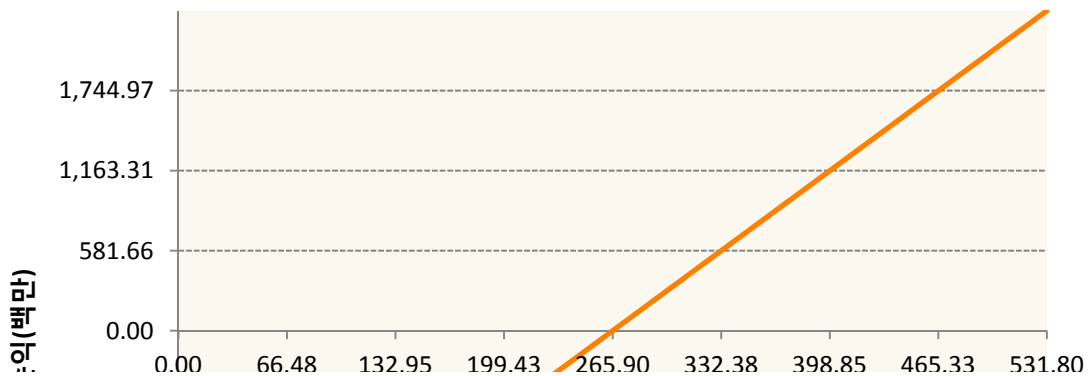
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,322	2,348	-26	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,608	0	12,608	장내
누계	유가증권	옵션	3,743	23,072	-19,329	장내

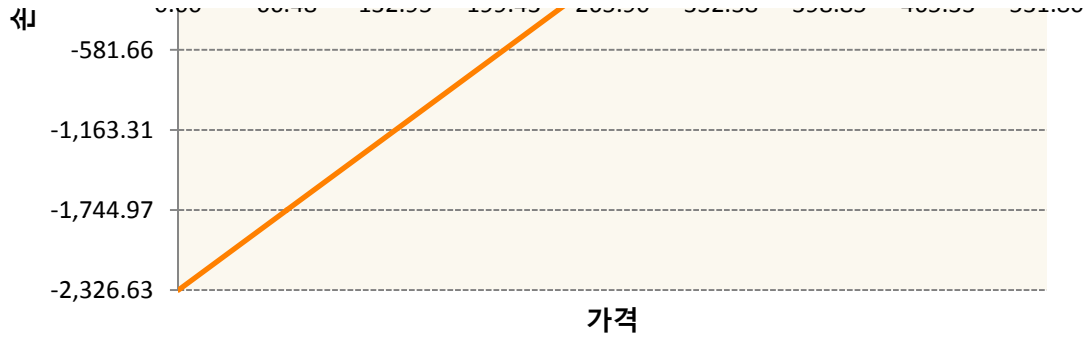
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

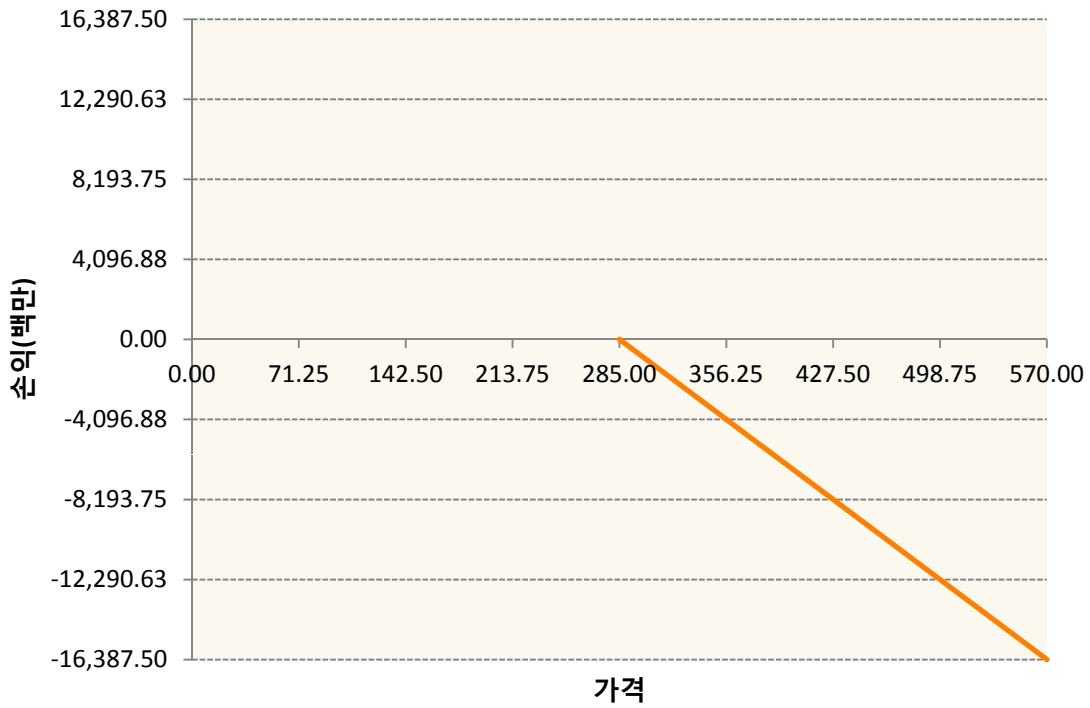


KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

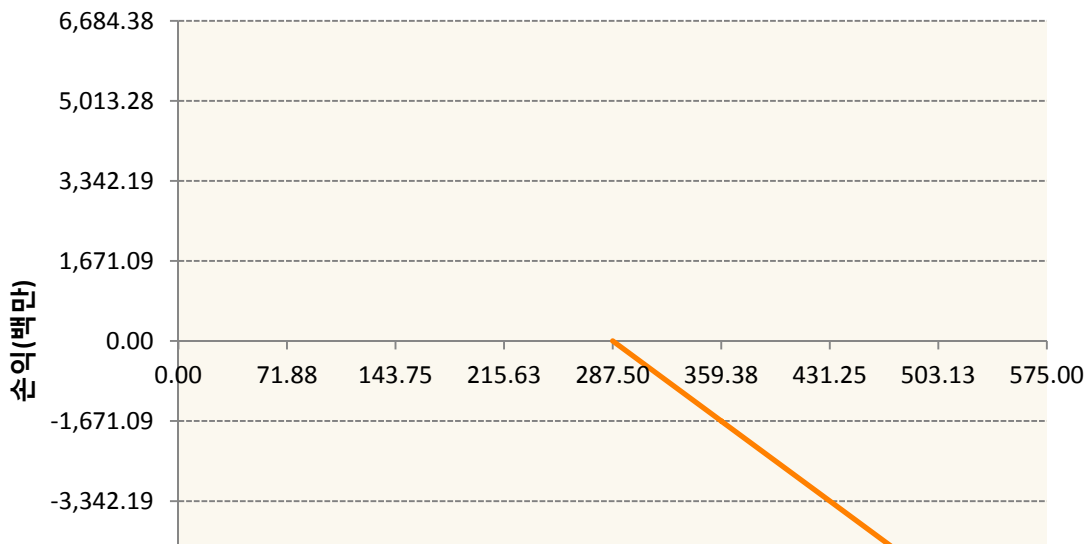


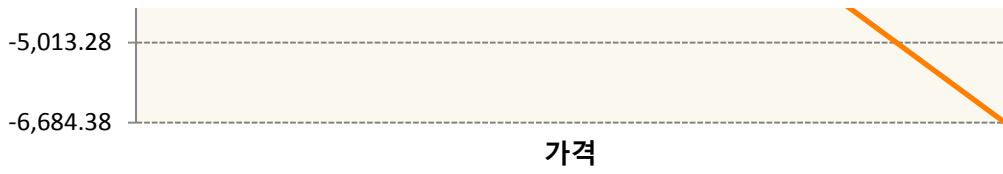


KR4201NC2850-2018-12 콜285

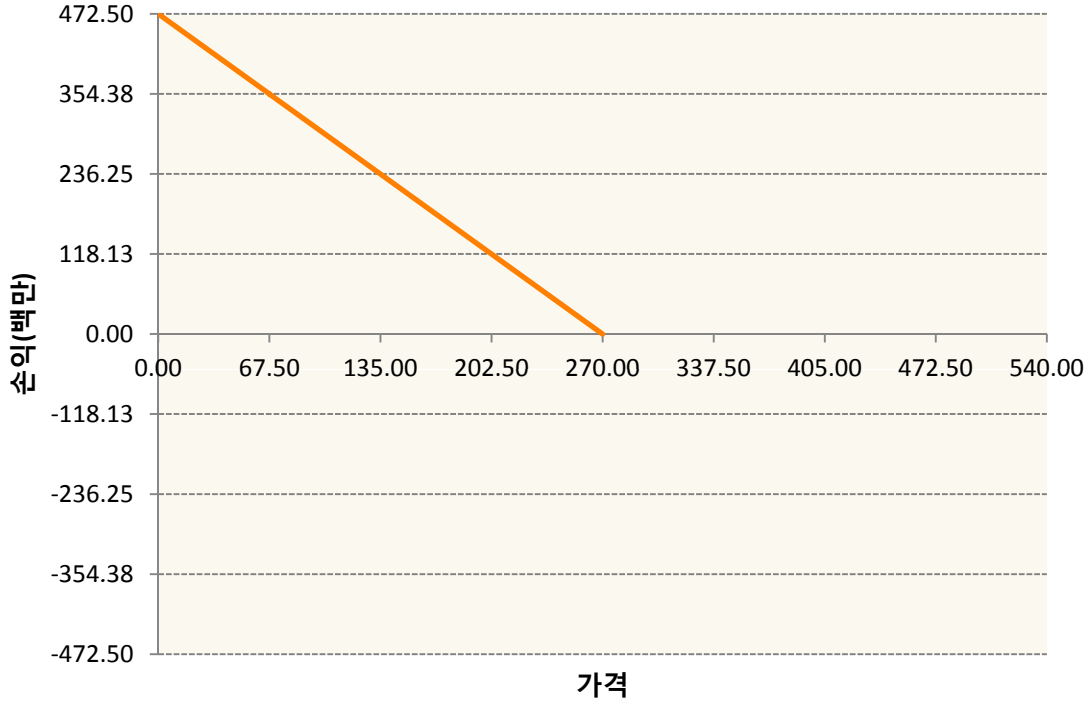


KR4201NC2876-2018-12 콜287.5

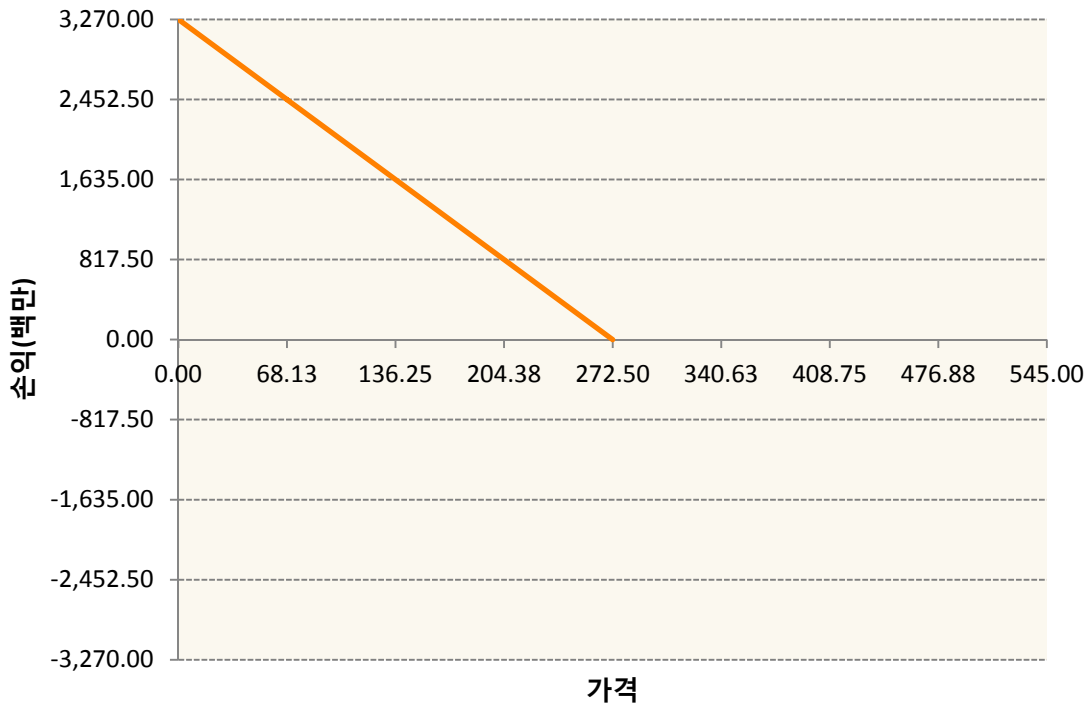




KR4301NC2701-2018-12 풋270



KR4301NC2727-2018-12 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0004 2018-12 코스피200지수선물							822
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-822	-822	-822	-822	-822	-822	-822
-5.33%	-548	-548	-548	-548	-548	-548	-548
-2.67%	-274	-274	-274	-274	-274	-274	-274
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	274	274	274	274	274	274	274
5.33%	548	548	548	548	548	548	548
8.00%	822	822	822	822	822	822	822
KR4101P30007 2019-03 코스피200지수선물							188
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-188	-188	-188	-188	-188	-188	-188
-5.33%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125
-2.67%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	63	63	63	63	63	63	63
5.33%	125	125	125	125	125	125	125
8.00%	188	188	188	188	188	188	188
KR4201NC2850 2018-12 콜285							311
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	-1	-1	-2	-3
5.33%	-24	-30	-37	-43	-50	-57	-64
8.00%	-288	-291	-294	-297	-302	-306	-311
KR4201NC2876 2018-12 콜287.5							82
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	0	0
5.33%	-2	-3	-4	-6	-8	-9	-11
8.00%	-66	-68	-71	-73	-76	-79	-82

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%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	
KR4301NC2727		2018-12 풋272.5						257
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	257	257	257	257	257	257	257	
-5.33%	171	171	171	171	171	171	171	
-2.67%	85	85	85	85	85	85	85	
0%	-1	0	0	0	0	1	1	
2.67%	-49	-48	-48	-48	-47	-47	-46	
5.33%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	

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

(단위:백만원)

1,093

공시일	2018-12-13
기준일	2018-12-12

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	2018-12-13
기준일	2018-12-12

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	97	0	97	
누계	유가증권	수익증권	1,693	0	1,693	

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	2018-12-13
기준일	2018-12-12

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	20	0	20	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	433	0	433	
누계	통화	선도	0	886	-886	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)

134

공시일	2018-12-13
기준일	2018-12-12

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

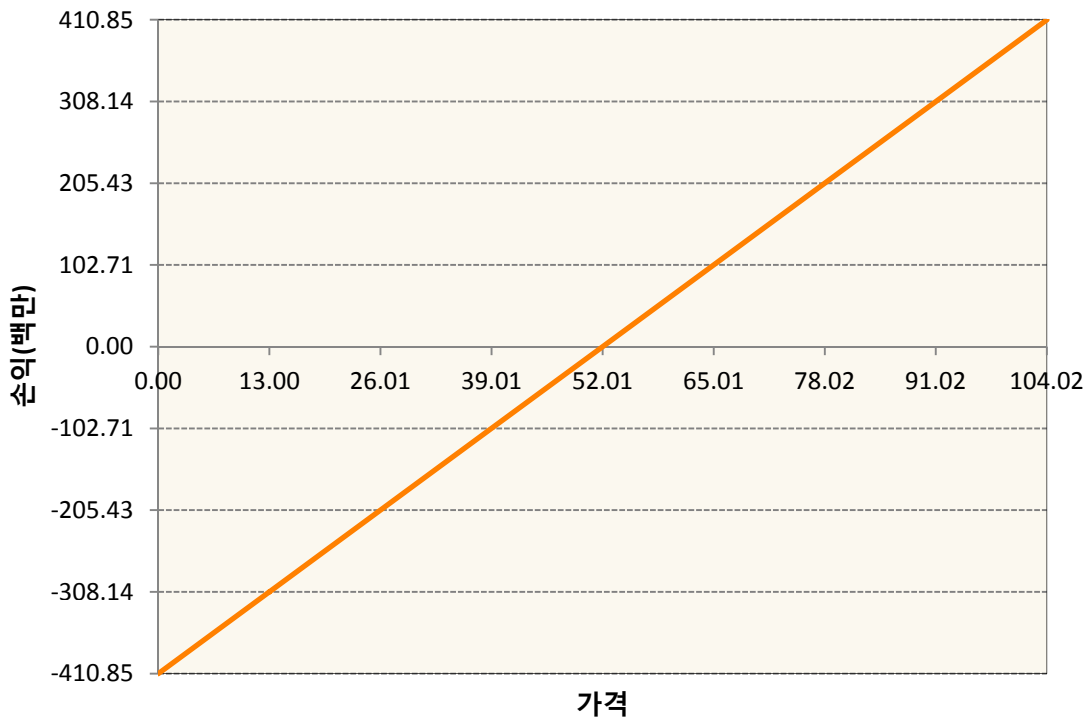
1. 계약금액

(단위:백만원)

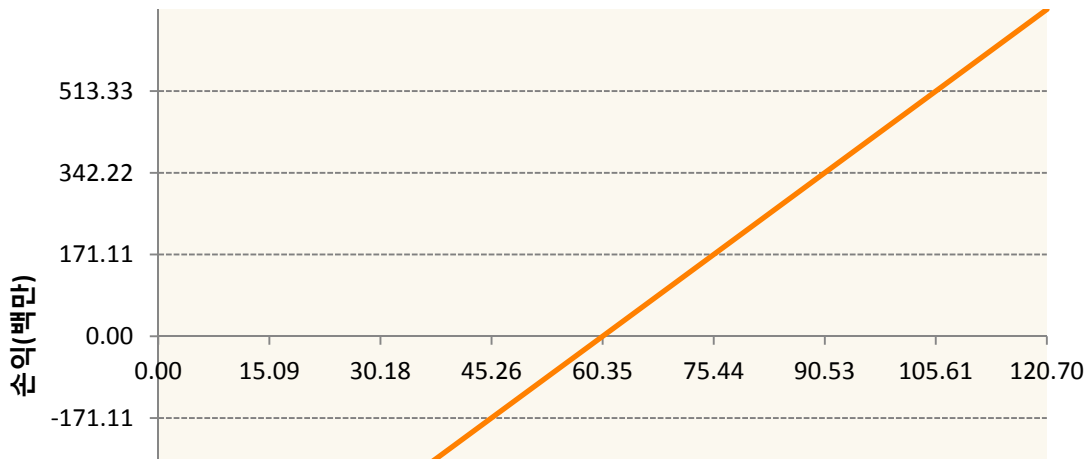
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,858	259	2,599	

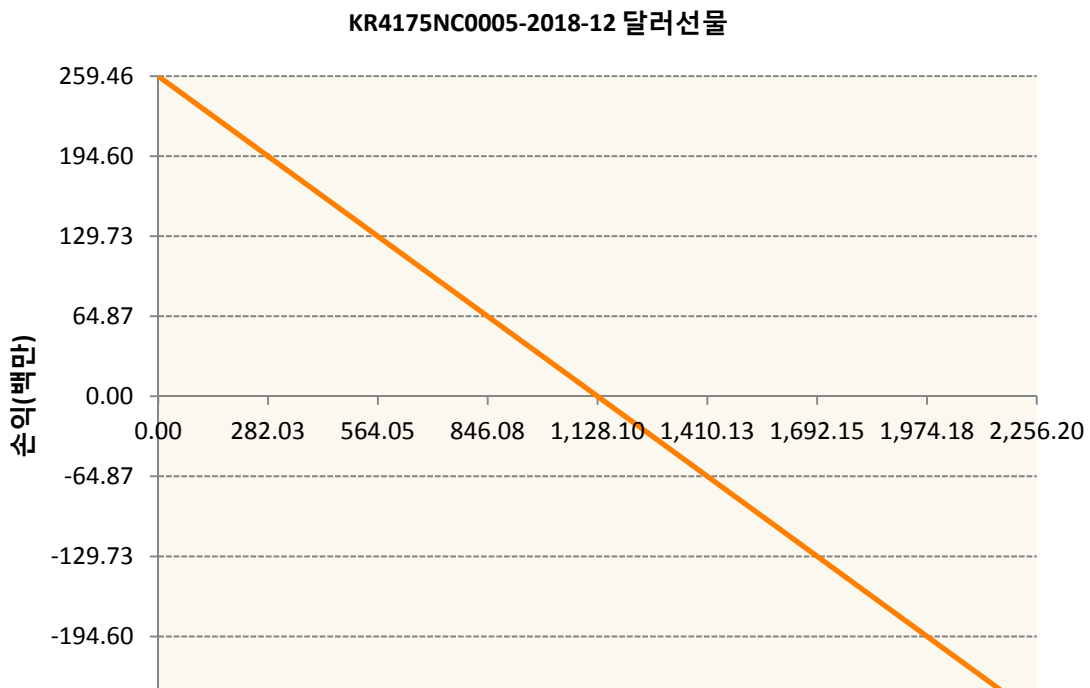
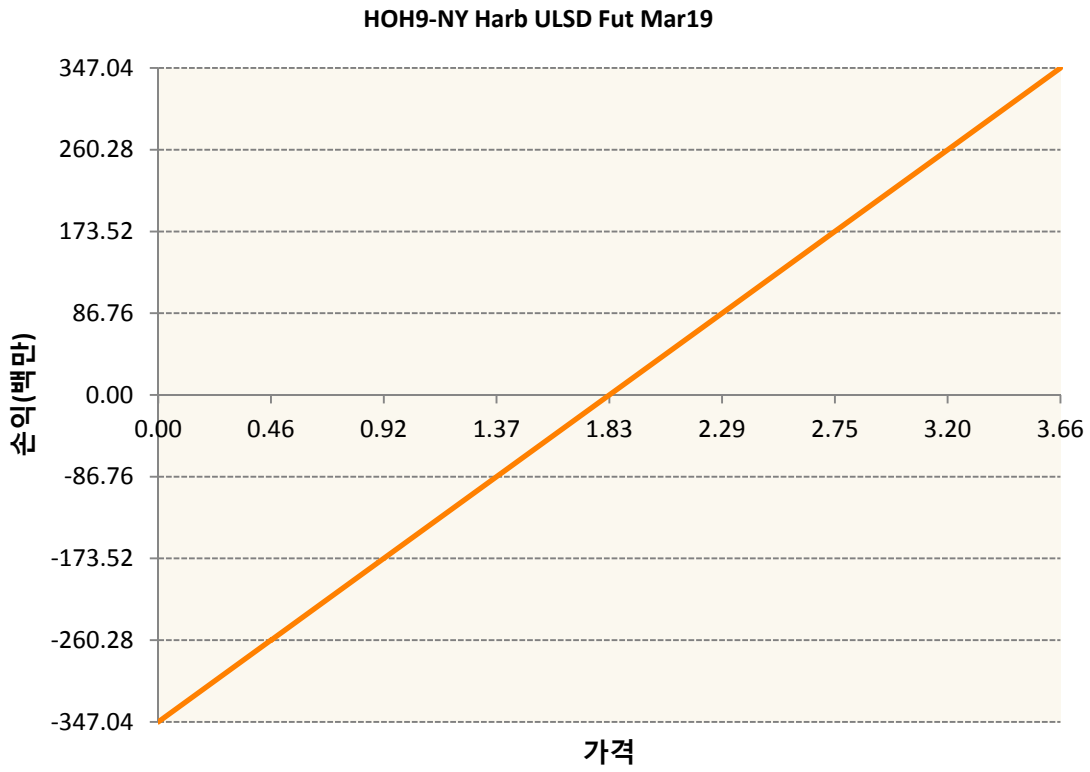
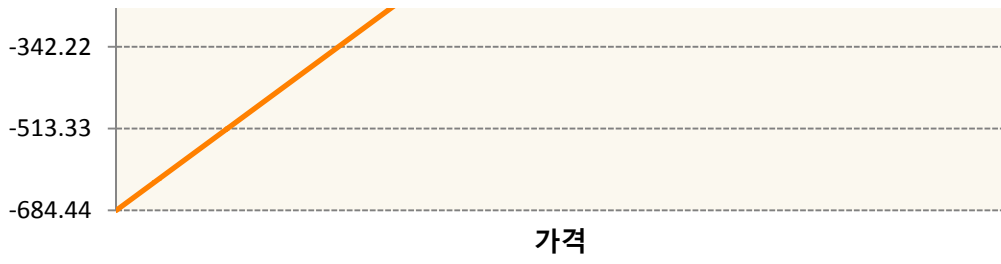
2. 만기시점의 손익구조

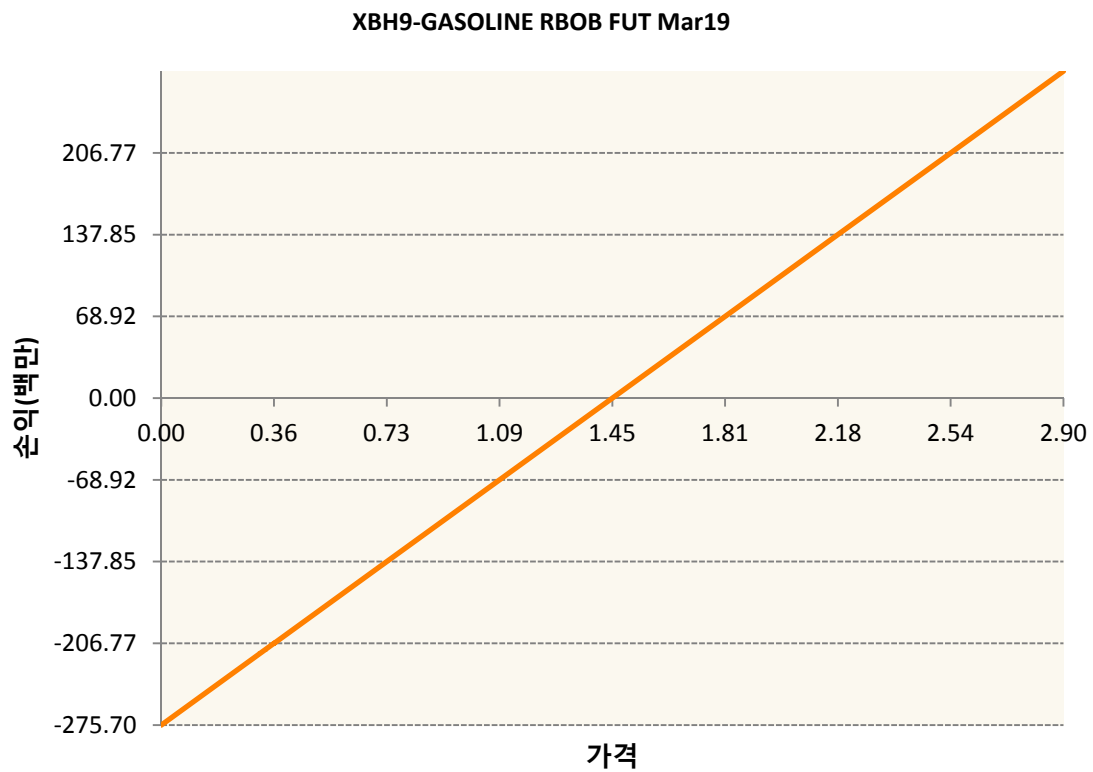
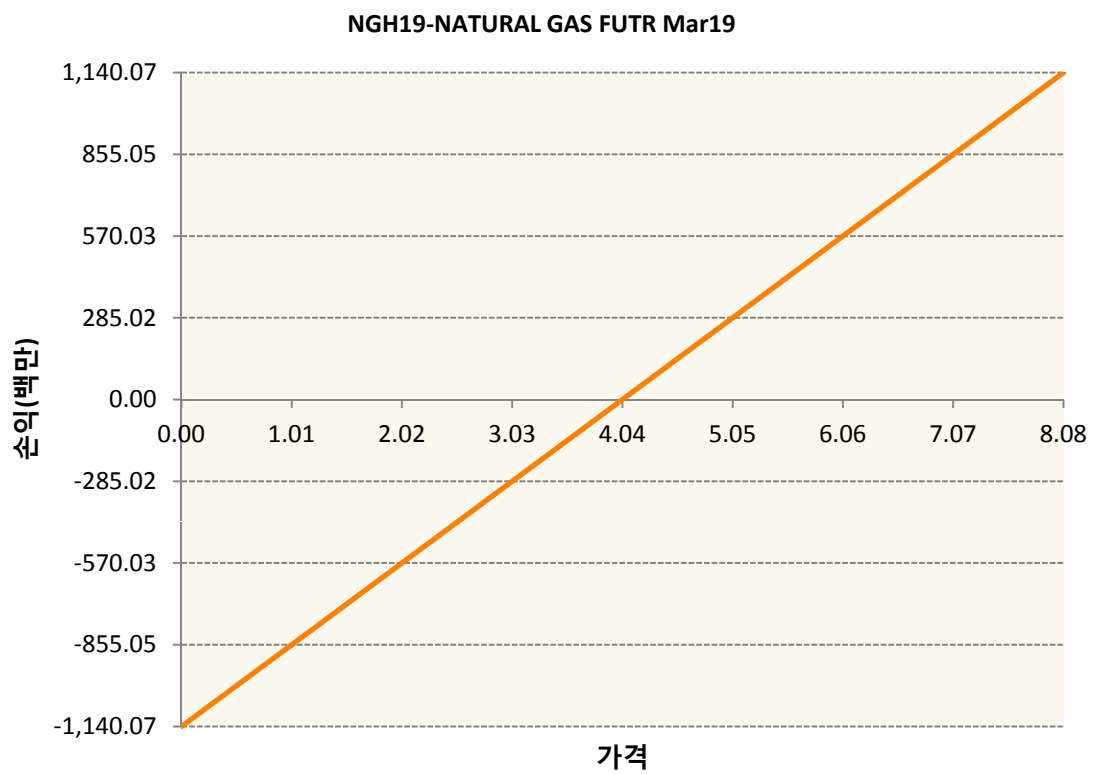
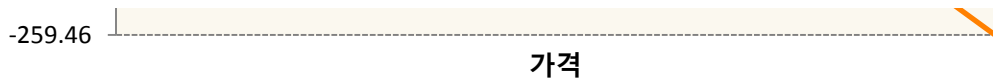
CLH9-WTI CRUDE FUTURE MAR19



COH9-BRENT CRUDE FUTR Mar19







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH9	WTI CRUDE FUTURE MAR19	33
COH9	BRENT CRUDE FUTR Mar19	55
HOH9	NY Harb ULSD Fut Mar19	28
KR4175NC0	(2018-12 달러선물	21
NGH19	NATURAL GAS FUTR Mar19	91
XBH9	GASOLINE RBOB FUT Mar19	22

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

408

공시일	2018-12-13
기준일	2018-12-12

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

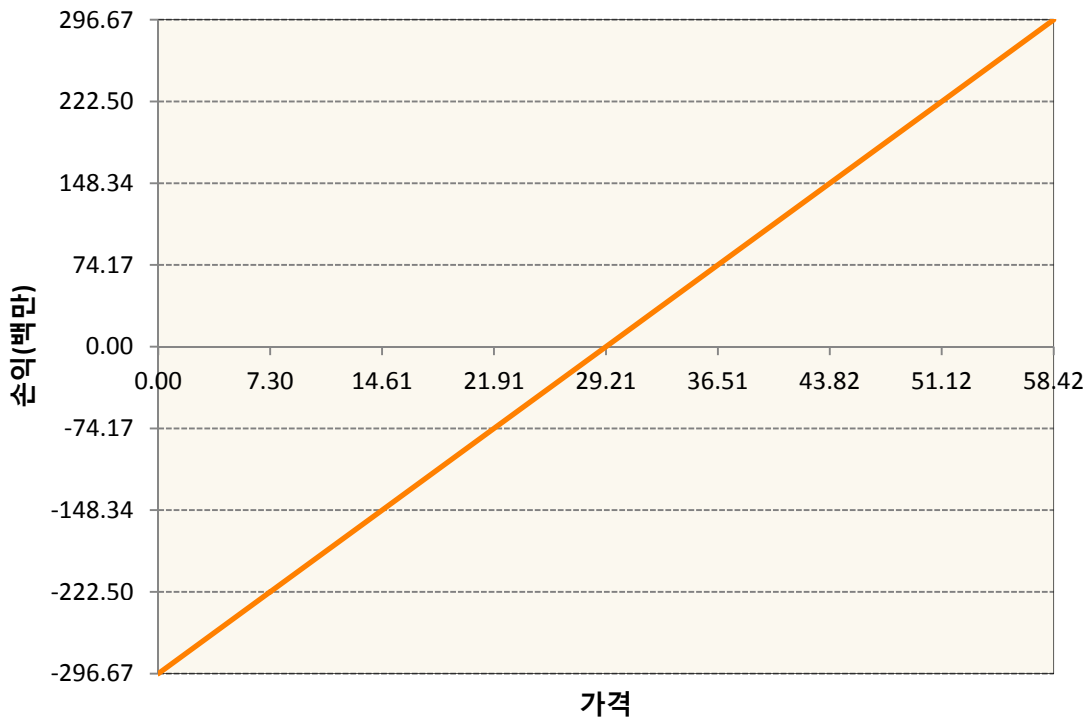
1. 계약금액

(단위:백만원)

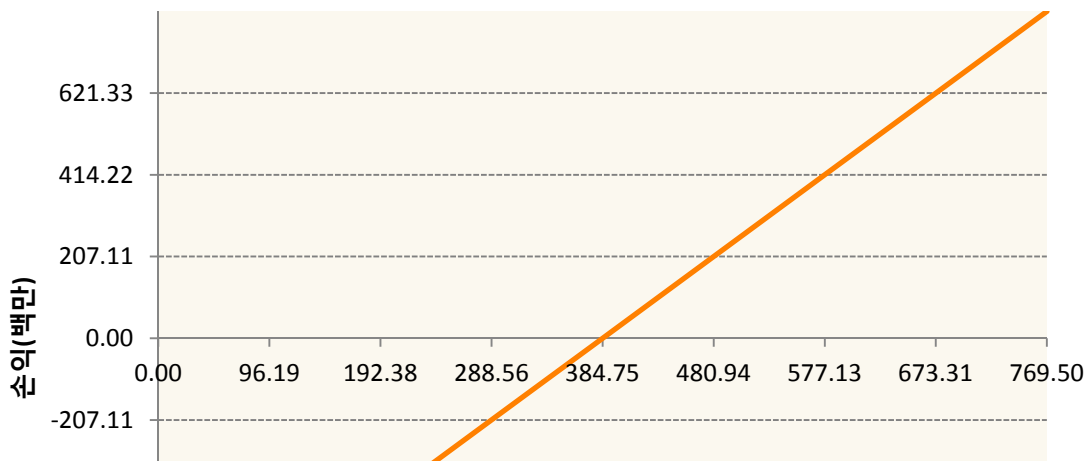
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,700	79	3,621	

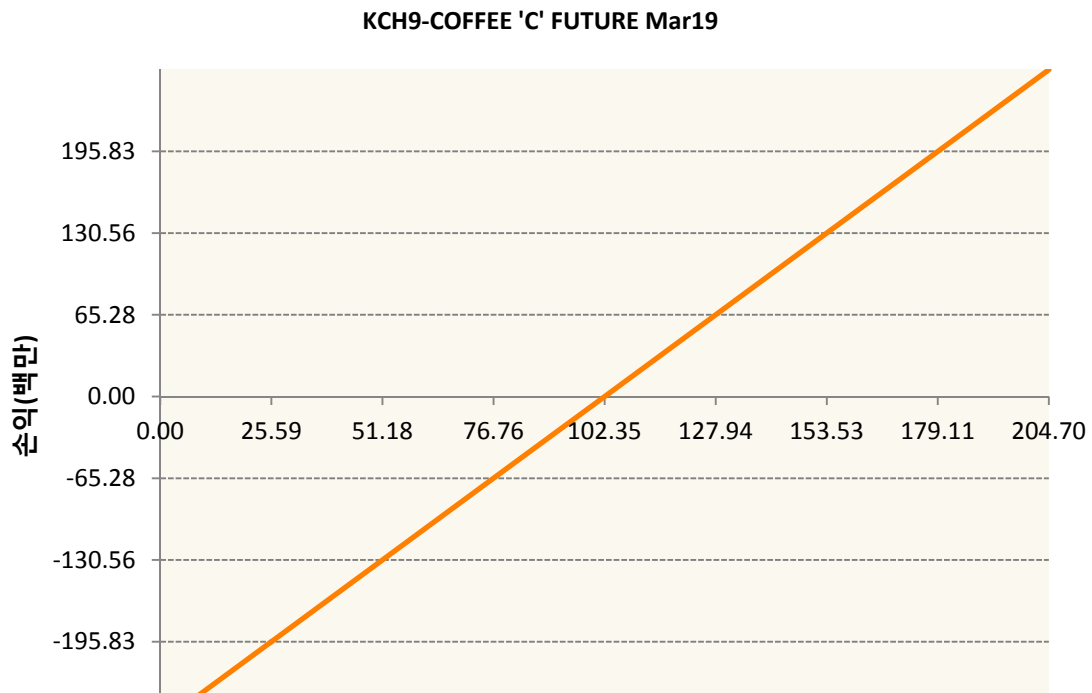
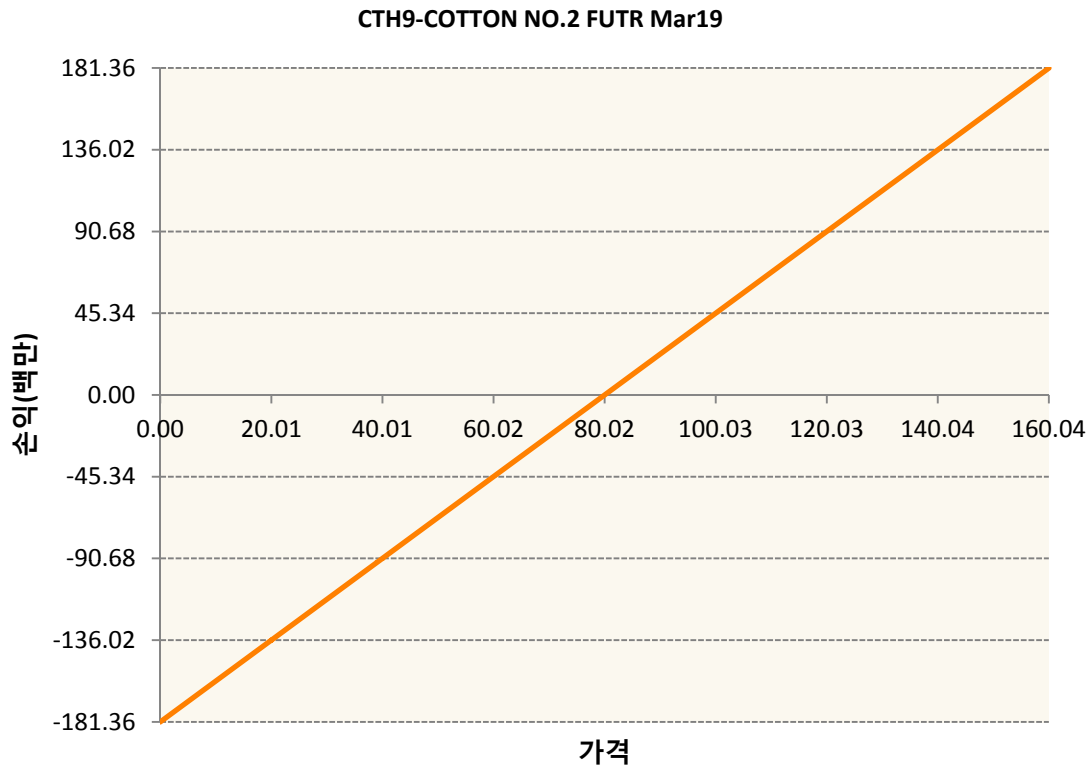
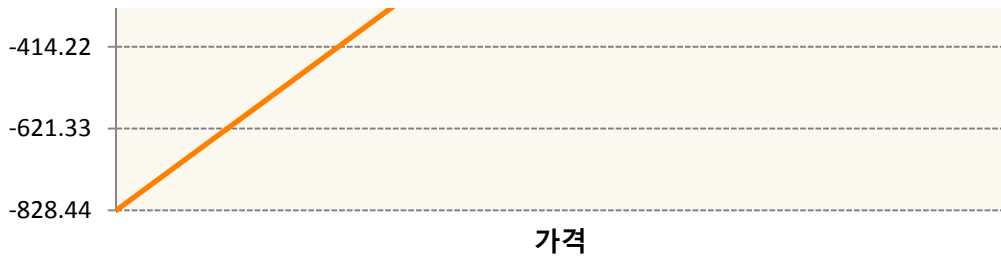
2. 만기시점의 손익구조

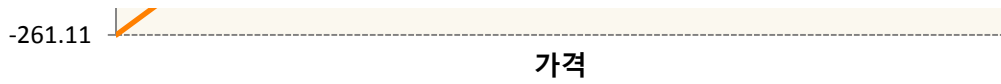
BOH9-SOYBEAN OIL FUTR Mar19



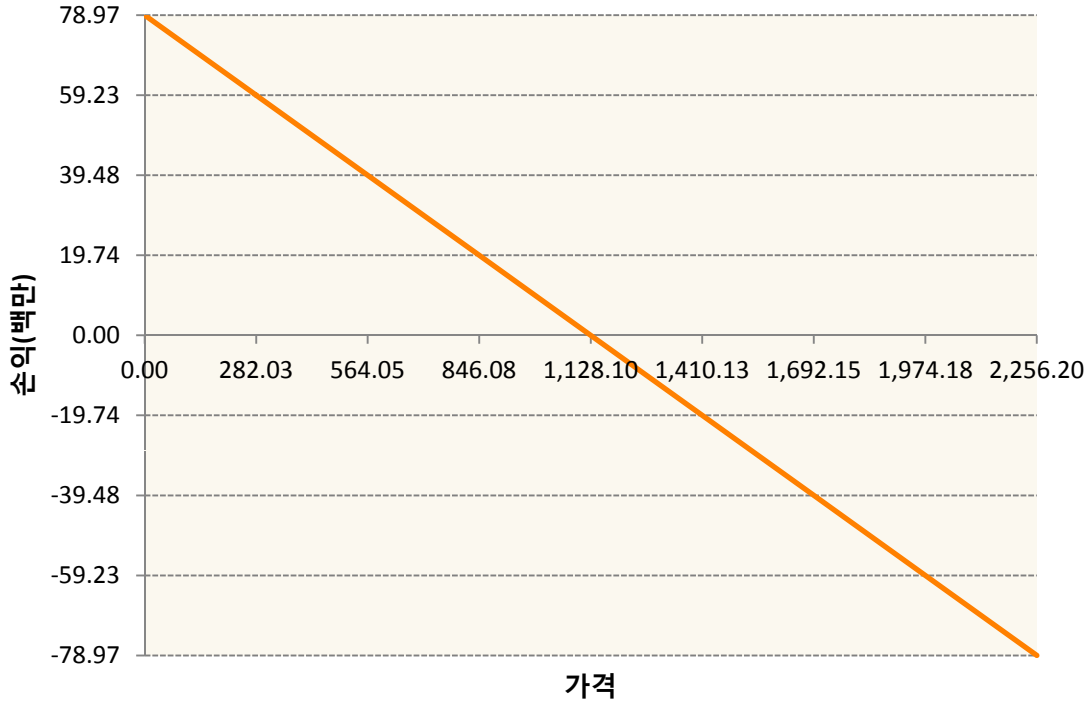
CH9-CORN FUTURE Mar19



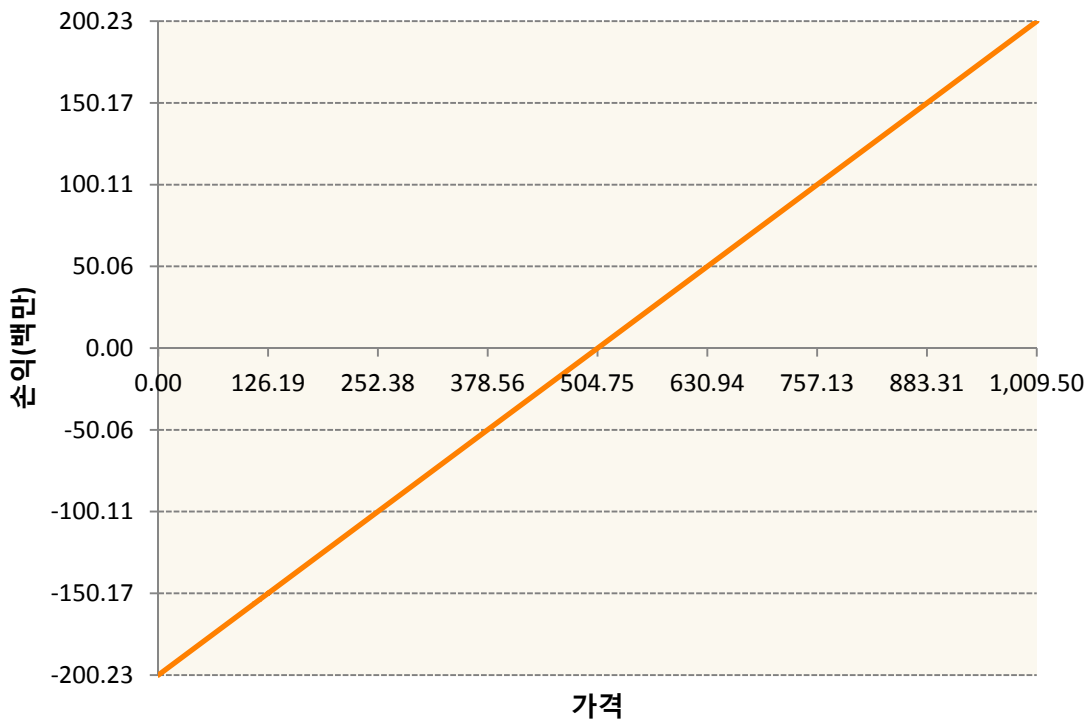




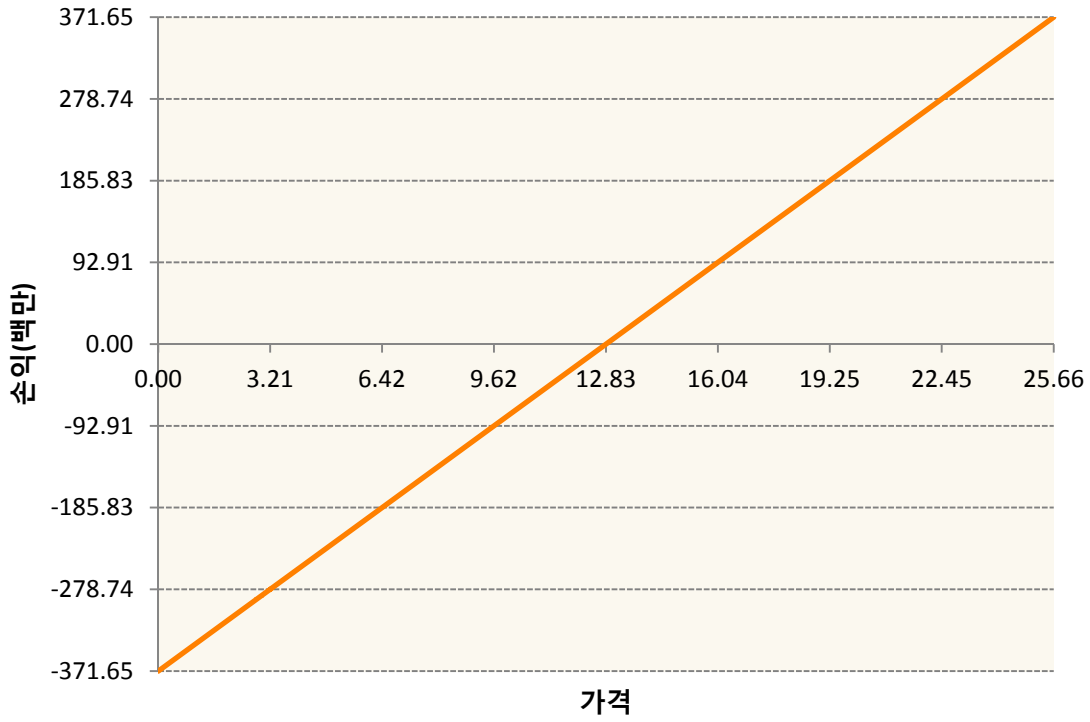
KR4175NC0005-2018-12 달러선물



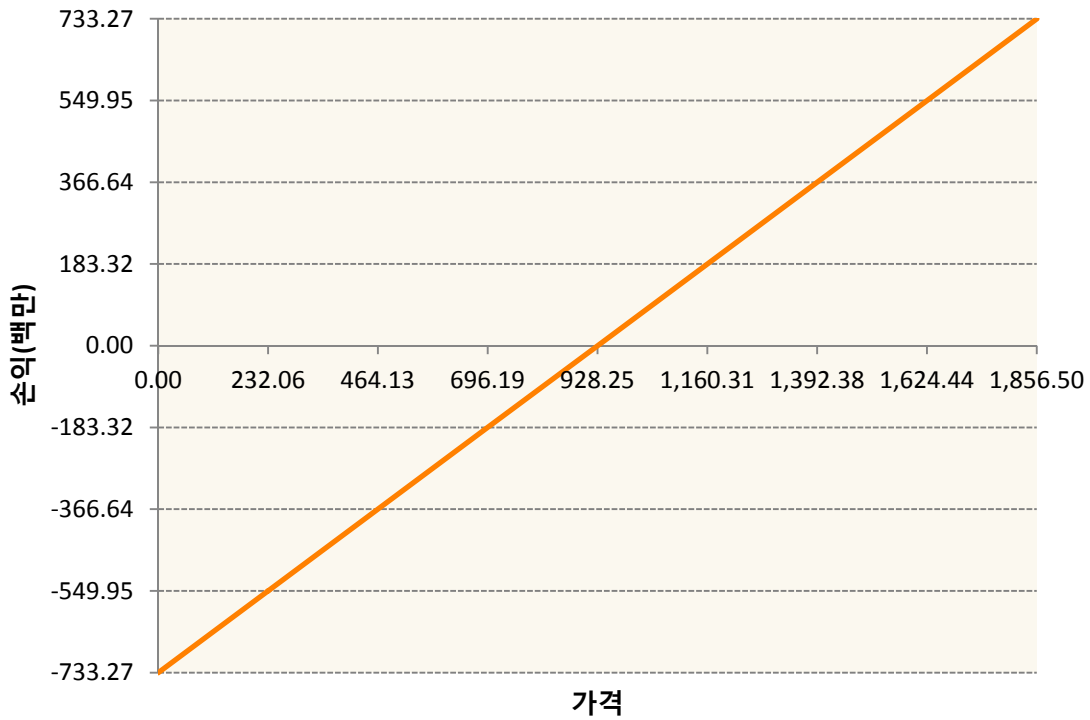
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



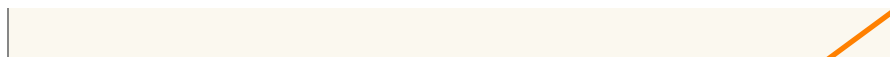
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

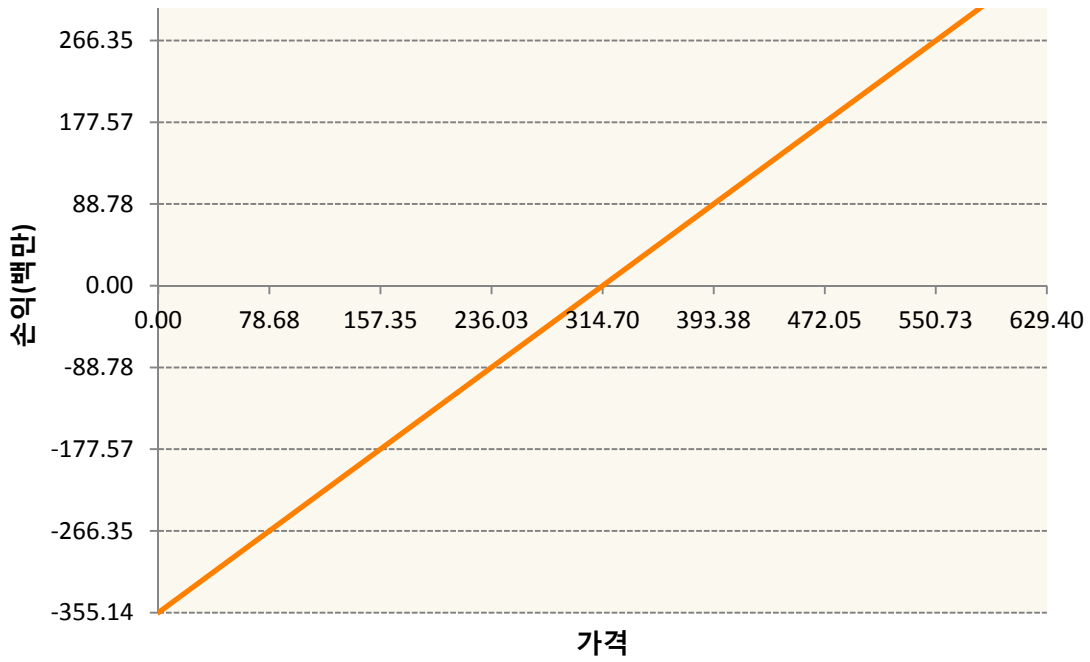


SH9-SOYBEAN FUTURE Mar19

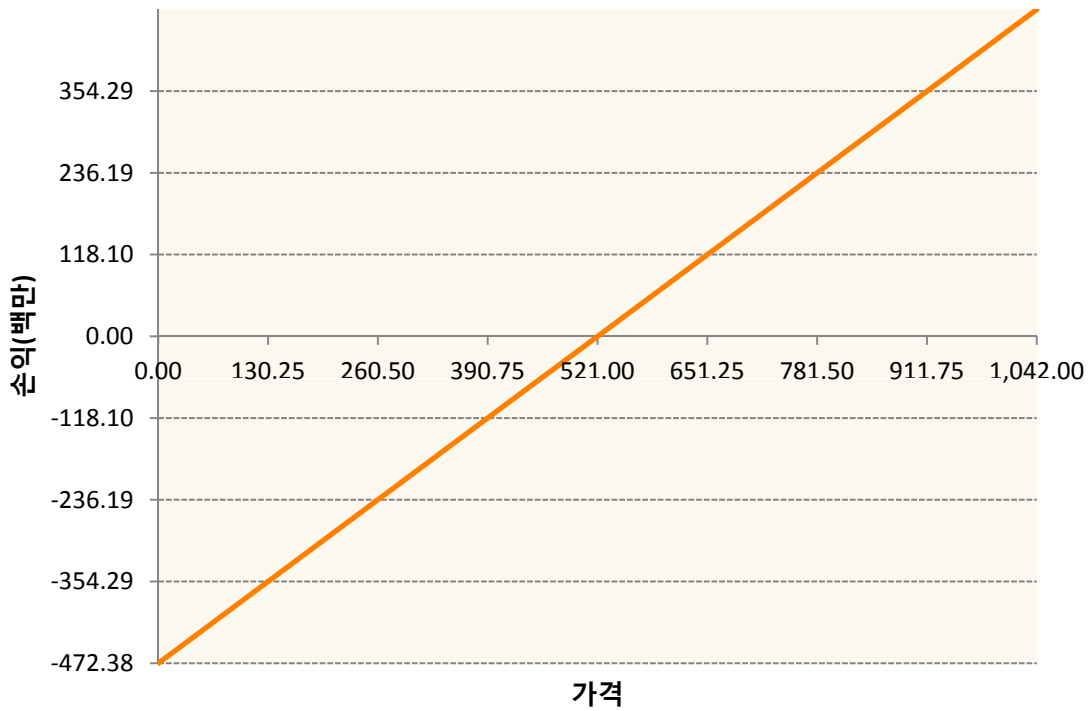


SMH9-SOYBEAN MEAL FUTR Mar19





WH9-WHEAT FUTURE(CBT) Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH9	SOYBEAN OIL FUTR Mar19	24
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
SH9	SOYBEAN FUTURE Mar19	59
SMH9	SOYBEAN MEAL FUTR Mar19	28
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	38

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

(단위:백만원)

315