

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-25 |
| 기준일 | 2019-01-24 |

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

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

(단위:백만원)

97

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-25 |
| 기준일 | 2019-01-24 |

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

1,054

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

598

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-25 |
| 기준일 | 2019-01-24 |

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

268

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

399

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-25 |
| 기준일 | 2019-01-24 |

유로인덱스모(주식-파생형)

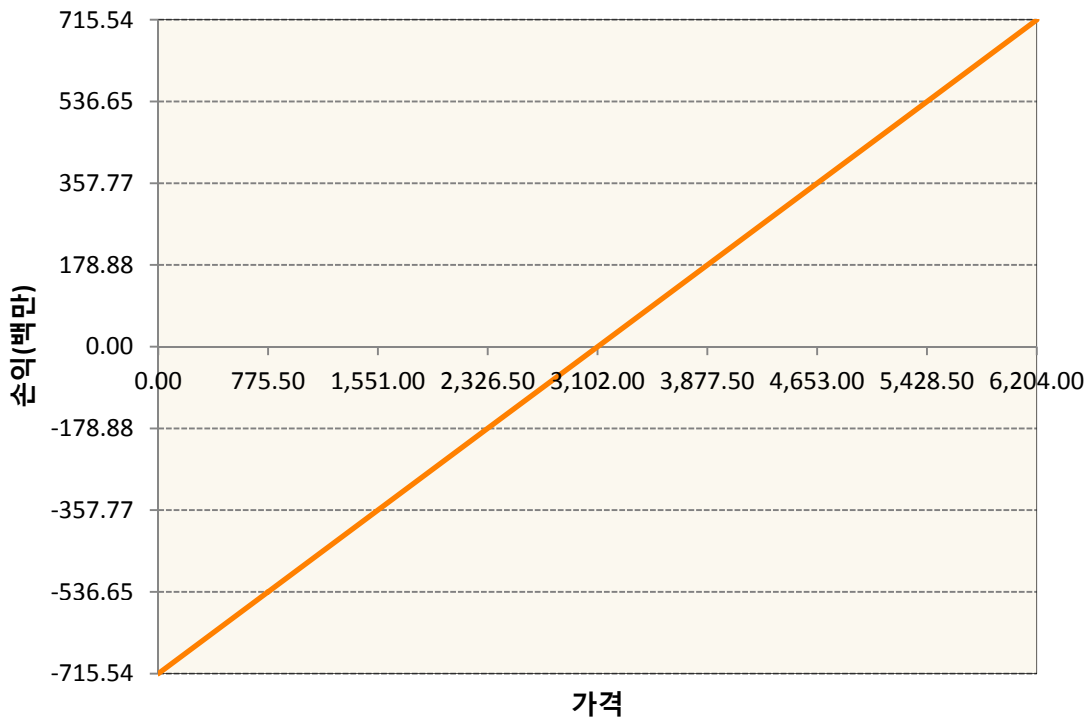
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 716 | 0 | 716 | |

2. 만기시점의 손익구조

VGH9-EURO STOXX 50 Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------|---------------------|----|
| VGH9 | EURO STOXX 50 Mar19 | 57 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

| |
|----|
| 39 |
|----|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-25 |
| 기준일 | 2019-01-24 |

차이나인덱스모(주식-파생형)

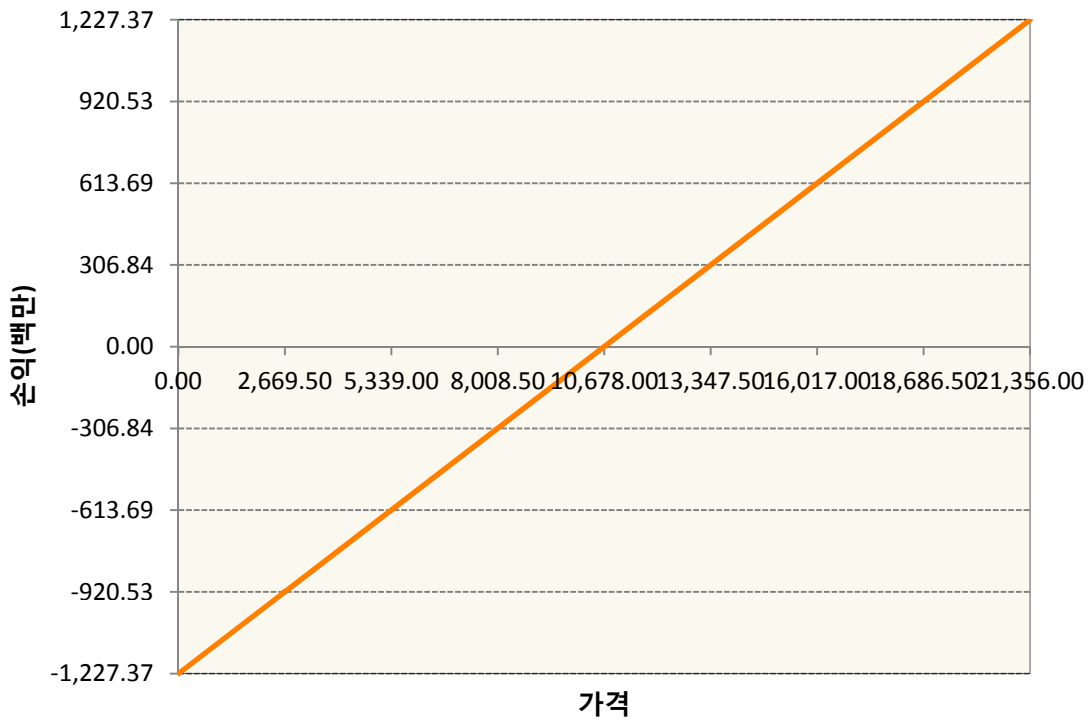
1. 계약금액

(단위:백만원)

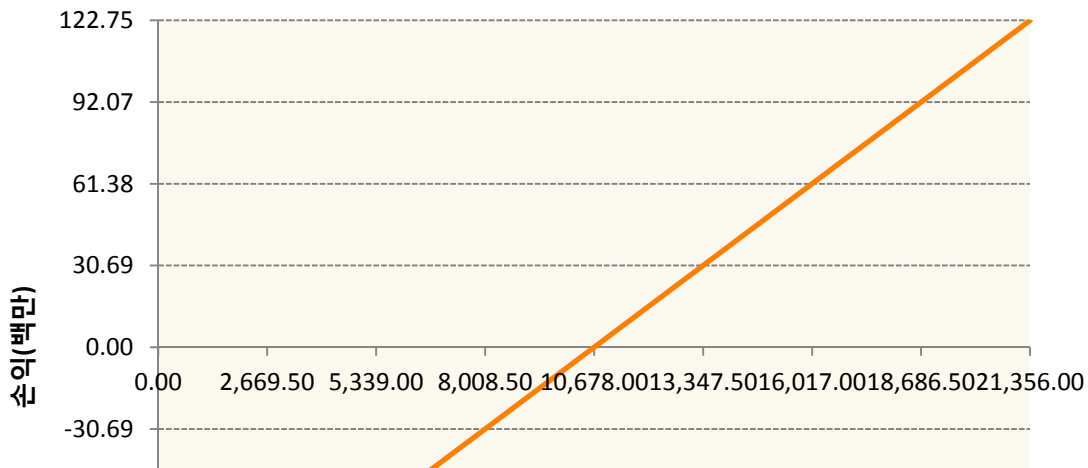
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,350 | 0 | 1,350 | 장내 |

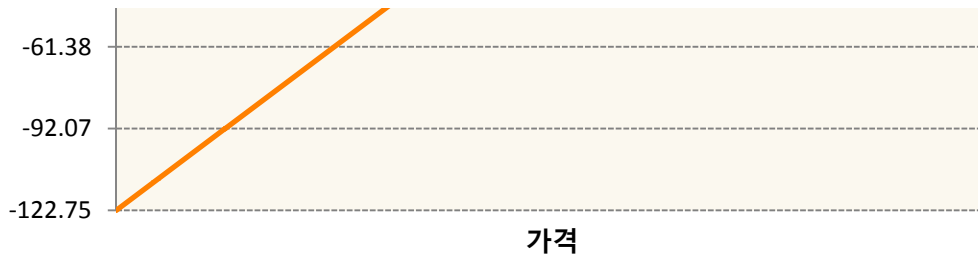
2. 만기시점의 손익구조

HCF9-HSCEI FUTURES JAN19



MHCF9-MINI H-SHR IDX FU JAN19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | |
|-------|-------------------------|----|
| HCF9 | HSCEI FUTURES JAN19 | 98 |
| MHCF9 | MINI H-SHR IDX FU JAN19 | 10 |

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

| |
|------------|
| 110 |
|------------|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-25 |
| 기준일 | 2019-01-24 |

커버드콜모(주식혼합-파생형)

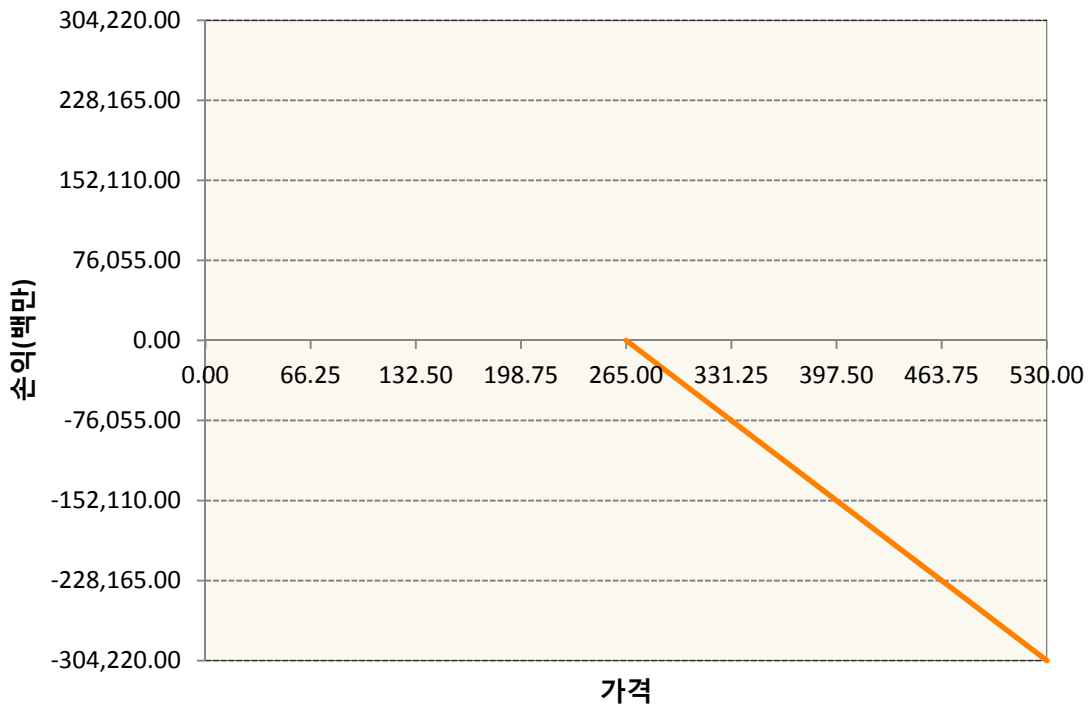
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 16,519 | 0 | 16,519 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 676,755 | -676,755 | 장내 |

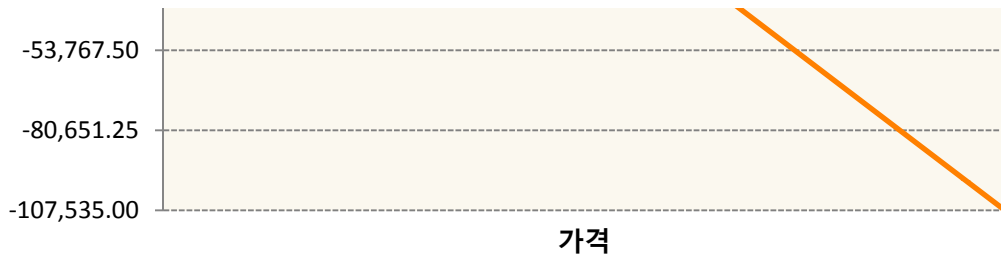
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P22655-2019-02 콜265

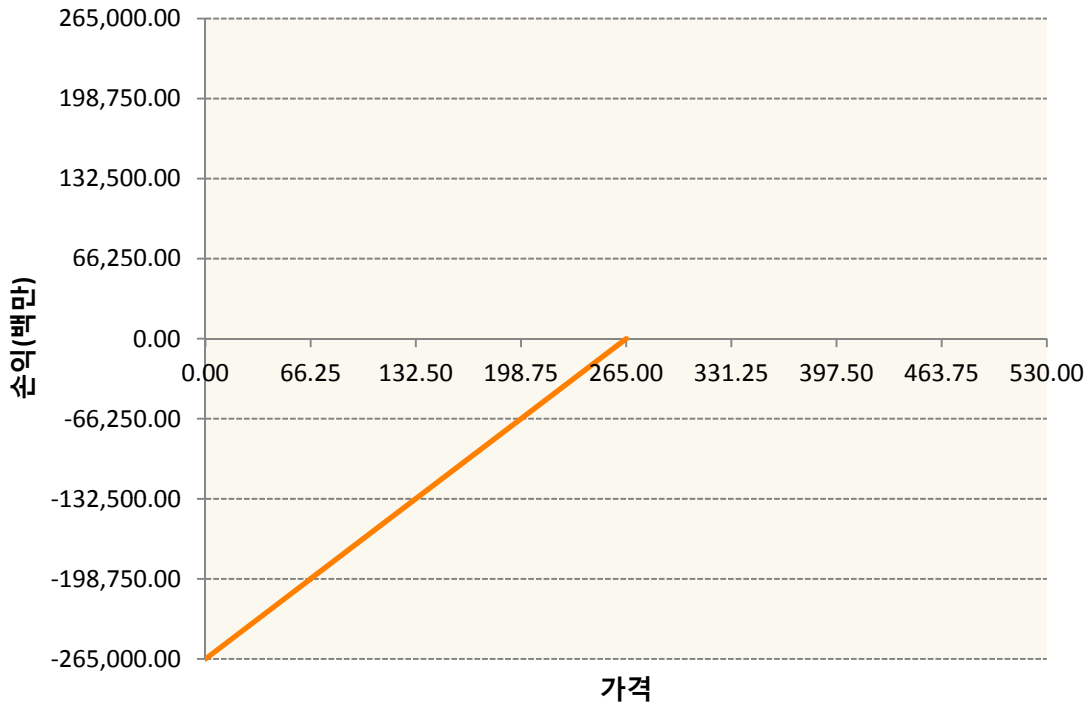


KR4201P22671-2019-02 콜267.5





KR4301P22653-2019-02 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4201P22655 | | 2019-02 콜265 | | | | | 23,278 |
|--------------|---------|----------------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 14,652 | 14,219 | 13,758 | 13,275 | 12,775 | 12,260 | 11,734 |
| -5.33% | 12,133 | 11,532 | 10,928 | 10,321 | 9,713 | 9,103 | 8,492 |
| -2.67% | 7,670 | 7,075 | 6,475 | 5,870 | 5,262 | 4,651 | 4,038 |
| 0% | 1,381 | 950 | 487 | 0 | -508 | -1,032 | -1,570 |
| 2.67% | -6,145 | -6,379 | -6,661 | -6,984 | -7,343 | -7,734 | -8,151 |
| 5.33% | -14,287 | -14,385 | -14,524 | -14,703 | -14,921 | -15,176 | -15,465 |
| 8.00% | -22,662 | -22,694 | -22,750 | -22,834 | -22,950 | -23,097 | -23,278 |
| KR4201P22671 | | 2019-02 콜267.5 | | | | | 7,946 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 4,565 | 4,438 | 4,298 | 4,147 | 3,988 | 3,823 | 3,651 |

| | | | | | | | |
|--|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| -5.33% | 3,877 | 3,679 | 3,477 | 3,273 | 3,067 | 2,859 | 2,650 |
| -2.67% | 2,550 | 2,331 | 2,112 | 1,893 | 1,673 | 1,454 | 1,234 |
| 0% | 551 | 374 | 190 | 0 | -195 | -394 | -596 |
| 2.67% | -1,958 | -2,065 | -2,187 | -2,322 | -2,469 | -2,625 | -2,788 |
| 5.33% | -4,752 | -4,801 | -4,866 | -4,946 | -5,041 | -5,148 | -5,266 |
| 8.00% | -7,664 | -7,682 | -7,710 | -7,751 | -7,803 | -7,868 | -7,946 |
| KR4301P22653 2019-02 풋265 | | | | | | | 11,017 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -10,191 | -10,283 | -10,396 | -10,527 | -10,676 | -10,840 | -11,017 |
| -5.33% | -4,049 | -4,315 | -4,586 | -4,861 | -5,139 | -5,418 | -5,700 |
| -2.67% | -640 | -889 | -1,145 | -1,409 | -1,677 | -1,949 | -2,225 |
| 0% | 308 | 227 | 124 | 0 | -142 | -300 | -472 |
| 2.67% | 424 | 414 | 395 | 365 | 322 | 265 | 194 |
| 5.33% | 430 | 430 | 428 | 424 | 416 | 403 | 383 |
| 8.00% | 431 | 431 | 431 | 430 | 429 | 427 | 423 |

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

(단위:백만원)

40,023

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-25 |
| 기준일 | 2019-01-24 |

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

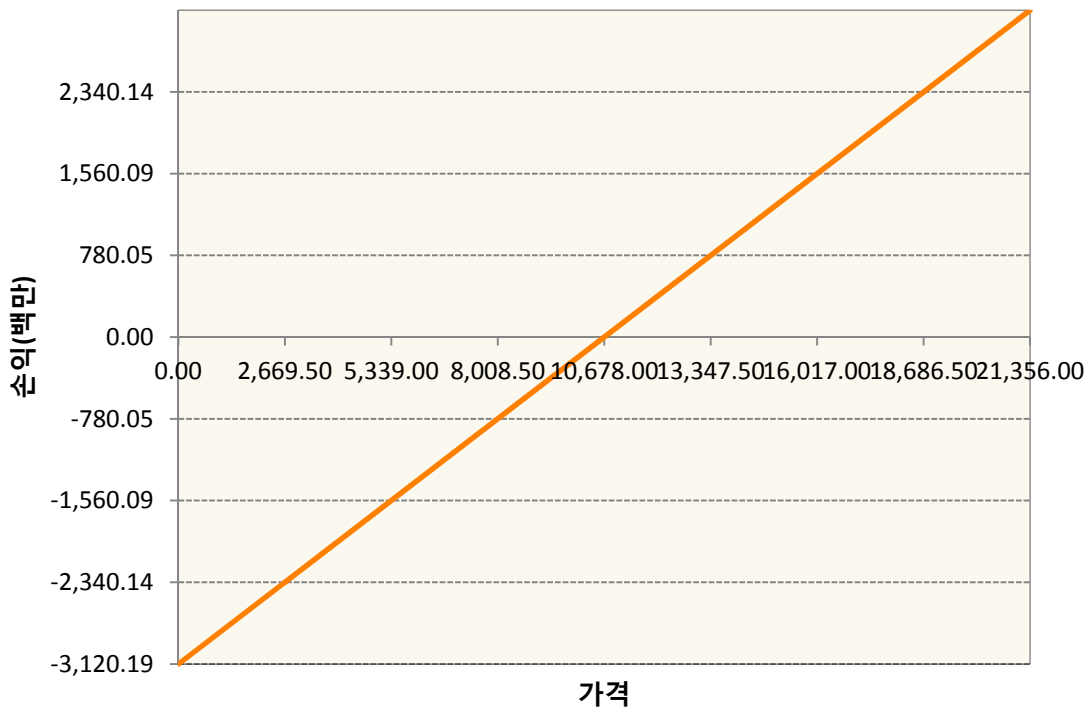
1. 계약금액

(단위:백만원)

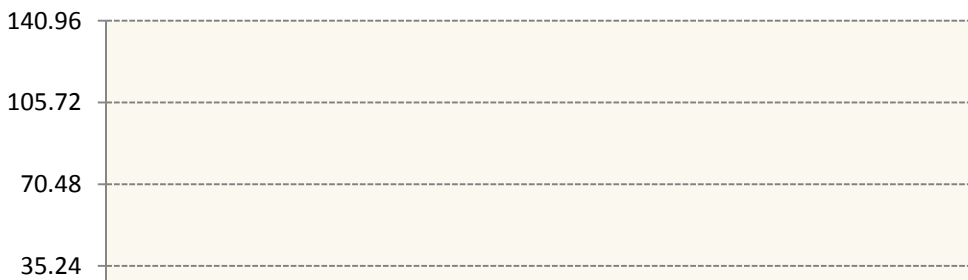
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,120 | 0 | 3,120 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 7,042 | -7,042 | 장내 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 2,733 | -2,733 | 장외 |

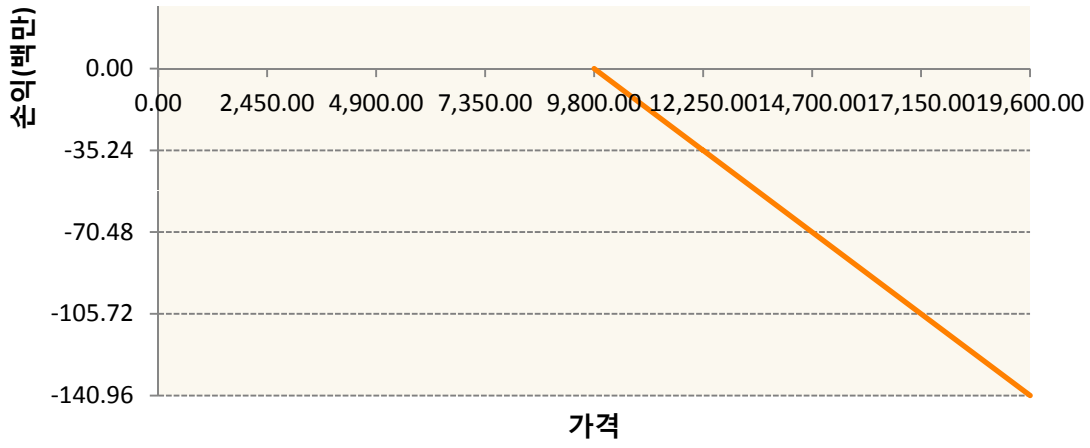
2. 만기시점의 손익구조

HCF9-HSCEI FUTURES JAN19

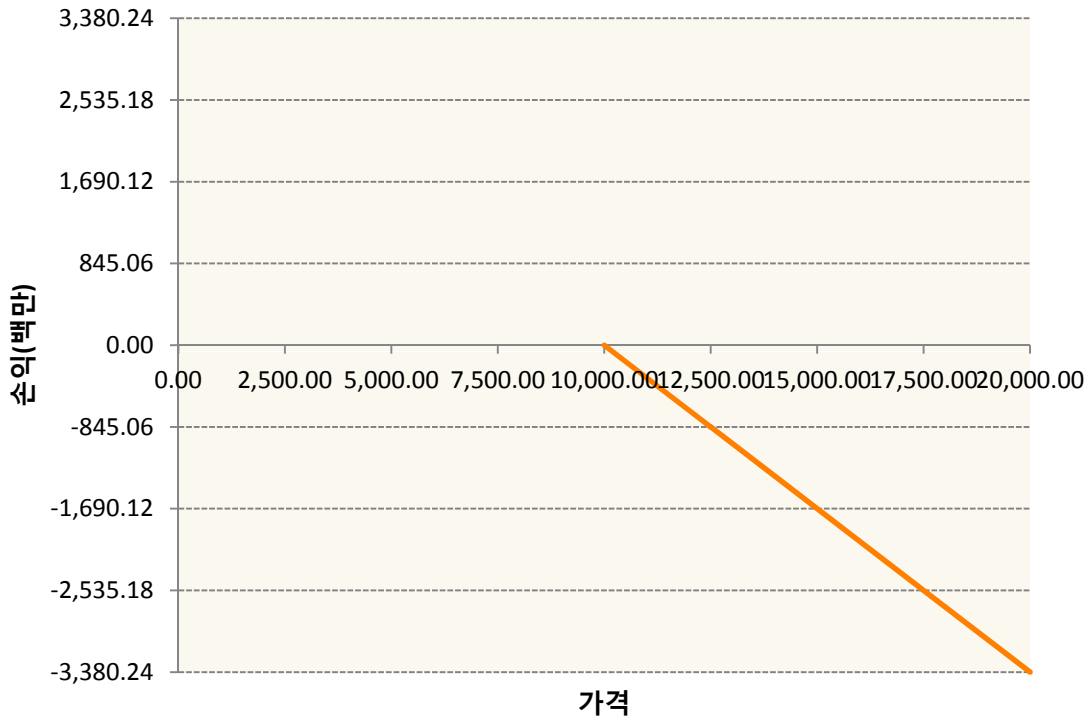


OHHIF9-C098-HSCEI

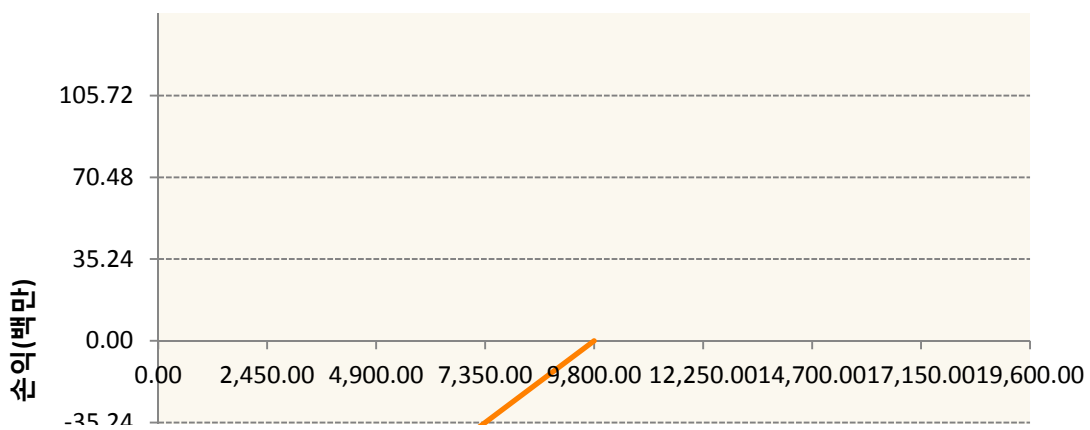


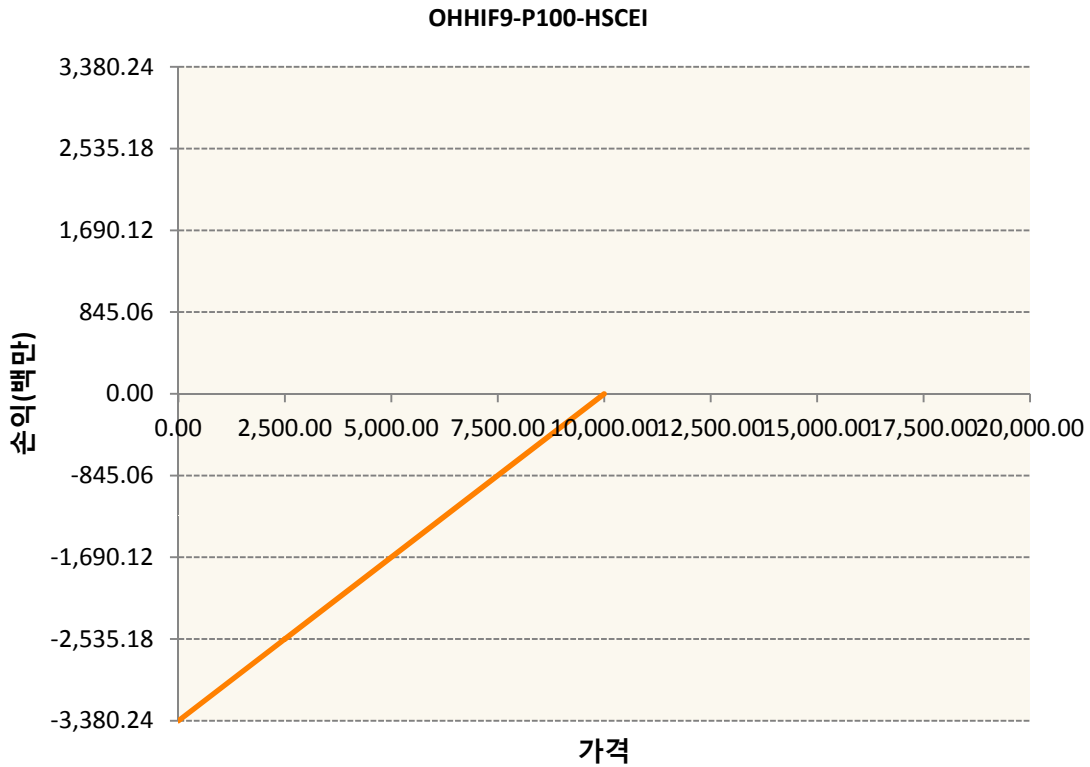
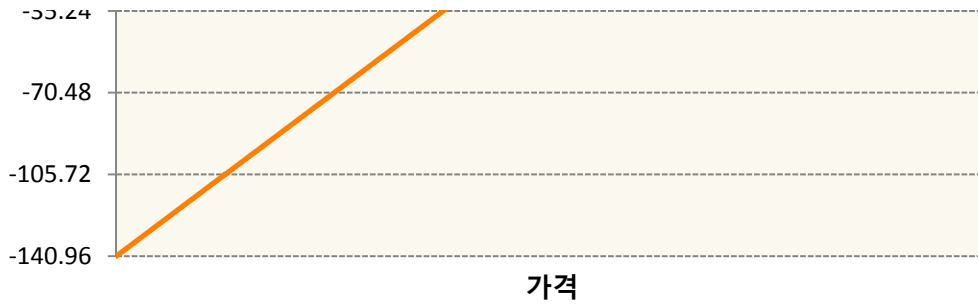


OHHIF9-C100-HSCEI



OHHIF9-P098-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | |
|------------------------------|-----|
| FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E | 219 |
| HCF9 HSCEI FUTURES JAN19 | 250 |
| OHHIF9-C09 HSCEI | 11 |
| OHHIF9-C10 HSCEI | 270 |
| OHHIF9-P09 HSCEI | 11 |
| OHHIF9-P10 HSCEI | 270 |

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

913

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-25 |
| 기준일 | 2019-01-24 |

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

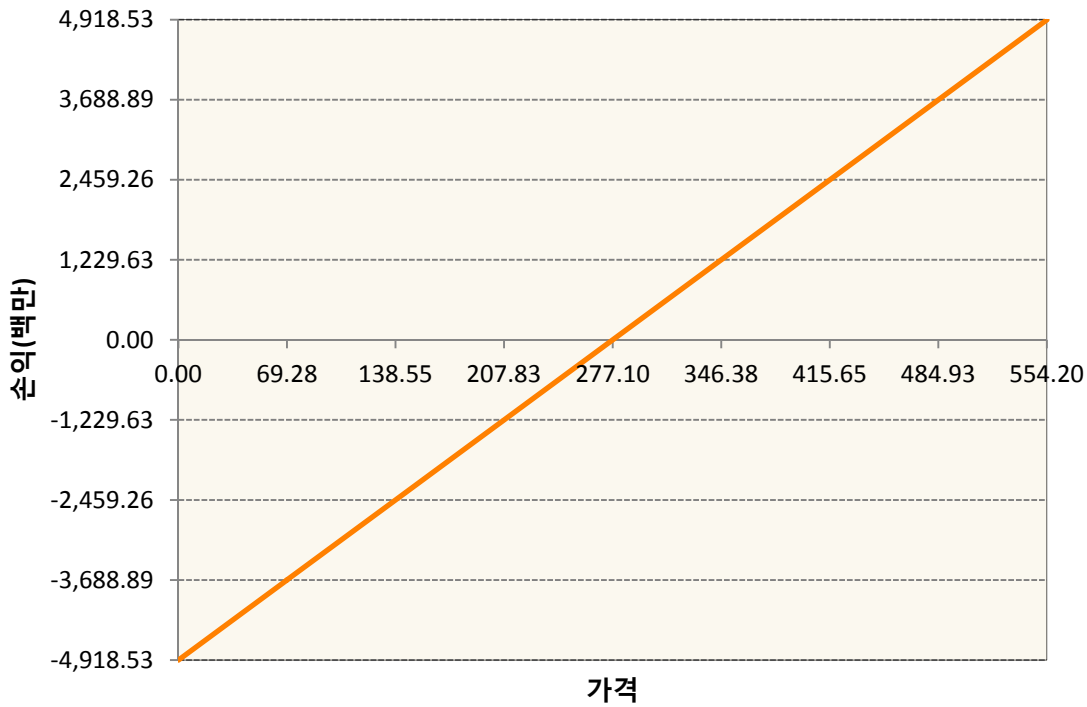
1. 계약금액

(단위:백만원)

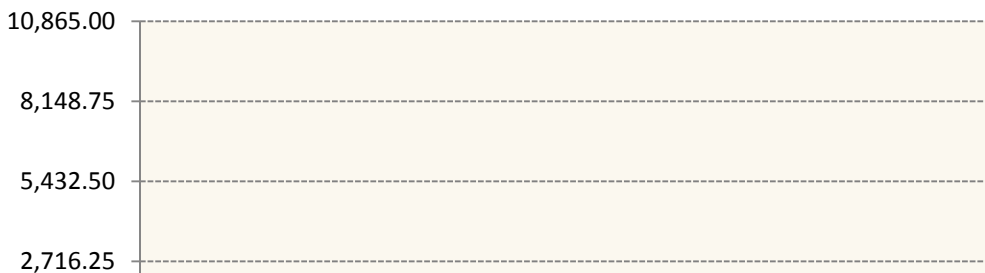
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 138 | -138 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 511 | 0 | 511 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 4,919 | 0 | 4,919 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 31,836 | 0 | 31,836 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 33,325 | -33,325 | 장내 |

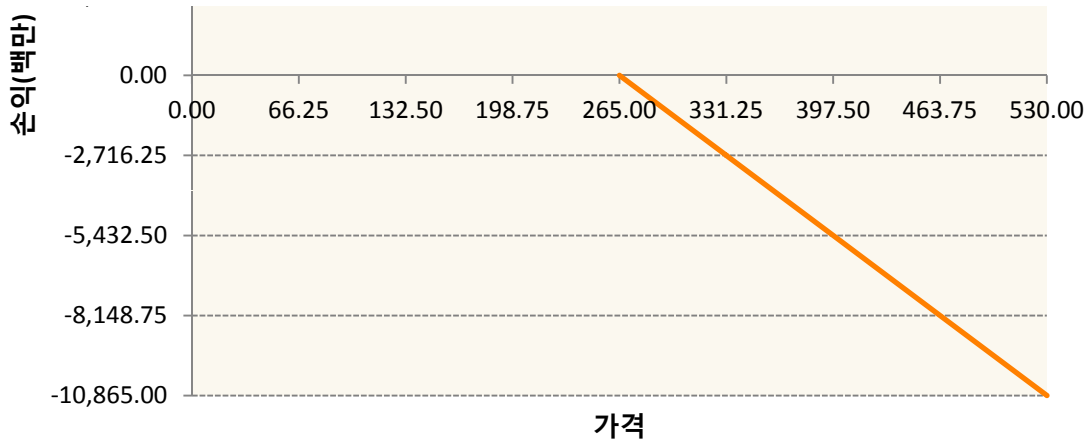
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

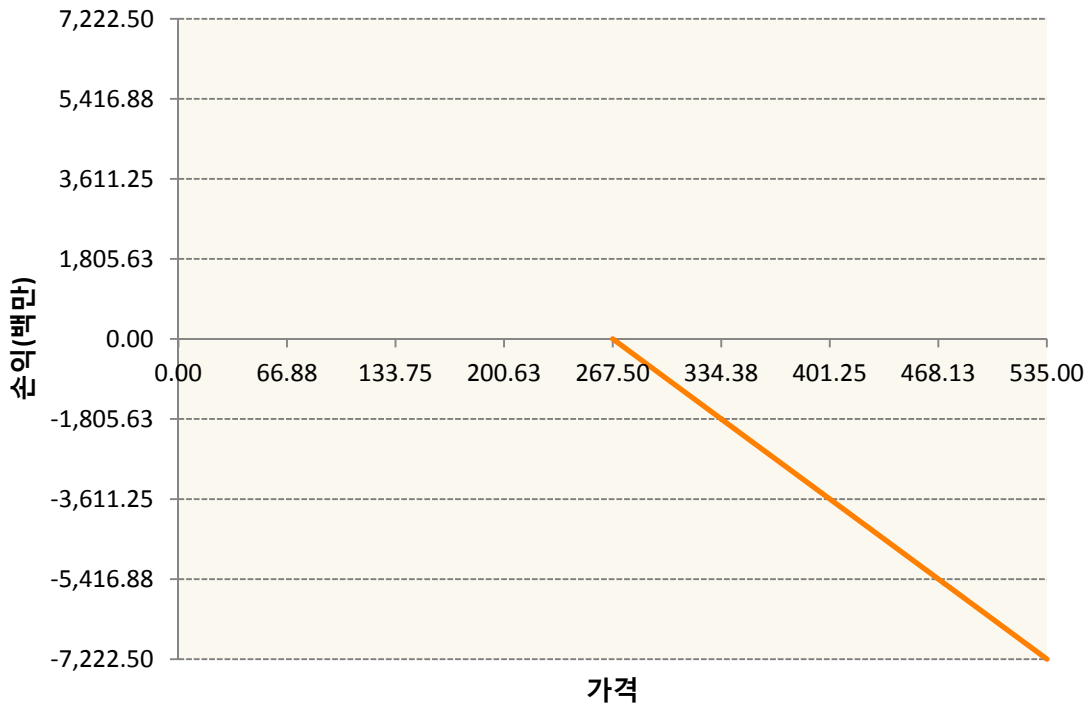


KR4201P22655-2019-02 콜265

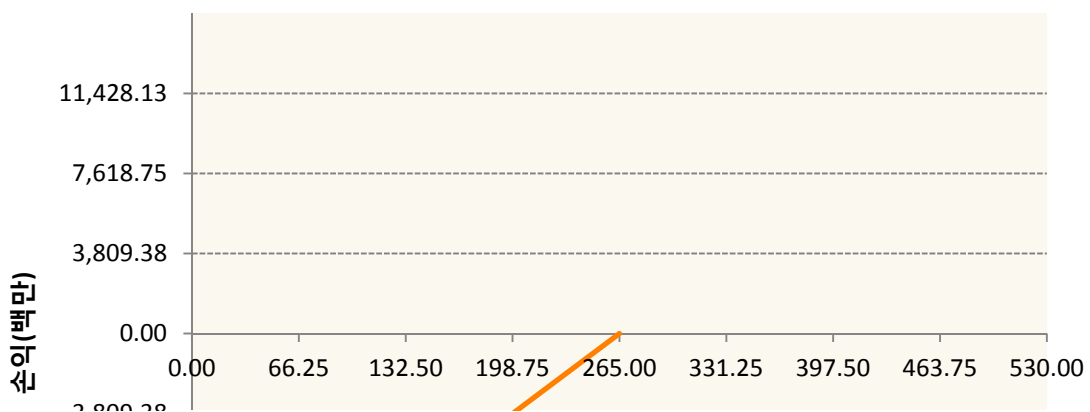


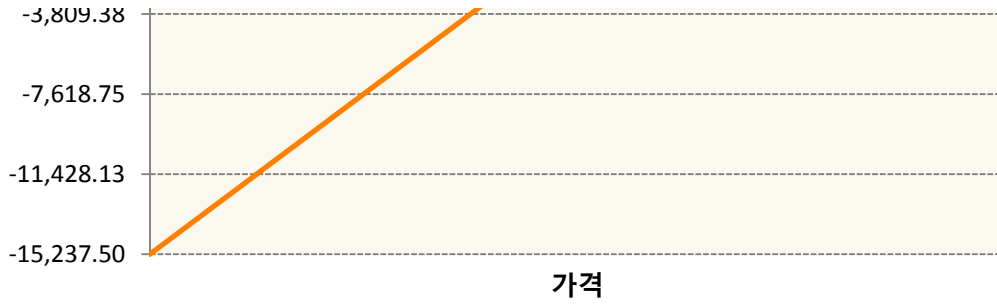


KR4201P22671-2019-02 콜267.5



KR4301P22653-2019-02 풋265





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| 2.529E+11 | | UBCSFXC1 INDEX_14 | | | | | | 2,661 |
|--------------|---------|--------------------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -2,661 | -2,661 | -2,661 | -2,661 | -2,661 | -2,661 | -2,661 | |
| -5.33% | -1,774 | -1,774 | -1,774 | -1,774 | -1,774 | -1,774 | -1,774 | |
| -2.67% | -887 | -887 | -887 | -887 | -887 | -887 | -887 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 887 | 887 | 887 | 887 | 887 | 887 | 887 | |
| 5.33% | 1,774 | 1,774 | 1,774 | 1,774 | 1,774 | 1,774 | 1,774 | |
| 8.00% | 2,661 | 2,661 | 2,661 | 2,661 | 2,661 | 2,661 | 2,661 | |
| KR4101P30007 | | 2019-03 코스피200지수선물 | | | | | | 393 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -393 | -393 | -393 | -393 | -393 | -393 | -393 | |
| -5.33% | -262 | -262 | -262 | -262 | -262 | -262 | -262 | |
| -2.67% | -131 | -131 | -131 | -131 | -131 | -131 | -131 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 131 | 131 | 131 | 131 | 131 | 131 | 131 | |
| 5.33% | 262 | 262 | 262 | 262 | 262 | 262 | 262 | |
| 8.00% | 393 | 393 | 393 | 393 | 393 | 393 | 393 | |
| KR4201P22655 | | 2019-02 콜265 | | | | | | 831 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 523 | 508 | 491 | 474 | 456 | 438 | 419 | |
| -5.33% | 433 | 412 | 390 | 369 | 347 | 325 | 303 | |
| -2.67% | 274 | 253 | 231 | 210 | 188 | 166 | 144 | |
| 0% | 49 | 34 | 17 | 0 | -18 | -37 | -56 | |
| 2.67% | -219 | -228 | -238 | -249 | -262 | -276 | -291 | |
| 5.33% | -510 | -514 | -519 | -525 | -533 | -542 | -552 | |
| 8.00% | -809 | -811 | -813 | -816 | -820 | -825 | -831 | |
| KR4201P22671 | | 2019-02 콜267.5 | | | | | | 534 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |

| | | | | | | | |
|--|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| -8.00% | 307 | 298 | 289 | 279 | 268 | 257 | 245 |
| -5.33% | 260 | 247 | 234 | 220 | 206 | 192 | 178 |
| -2.67% | 171 | 157 | 142 | 127 | 112 | 98 | 83 |
| 0% | 37 | 25 | 13 | 0 | -13 | -26 | -40 |
| 2.67% | -132 | -139 | -147 | -156 | -166 | -176 | -187 |
| 5.33% | -319 | -322 | -327 | -332 | -339 | -346 | -354 |
| 8.00% | -515 | -516 | -518 | -521 | -524 | -528 | -534 |
| KR4301P22653 2019-02 풋265 | | | | | | | 633 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -586 | -591 | -598 | -605 | -614 | -623 | -633 |
| -5.33% | -233 | -248 | -264 | -280 | -295 | -312 | -328 |
| -2.67% | -37 | -51 | -66 | -81 | -96 | -112 | -128 |
| 0% | 18 | 13 | 7 | 0 | -8 | -17 | -27 |
| 2.67% | 24 | 24 | 23 | 21 | 19 | 15 | 11 |
| 5.33% | 25 | 25 | 25 | 24 | 24 | 23 | 22 |
| 8.00% | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 | 24 |

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

(단위:백만원)

4,859

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-25 |
| 기준일 | 2019-01-24 |

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

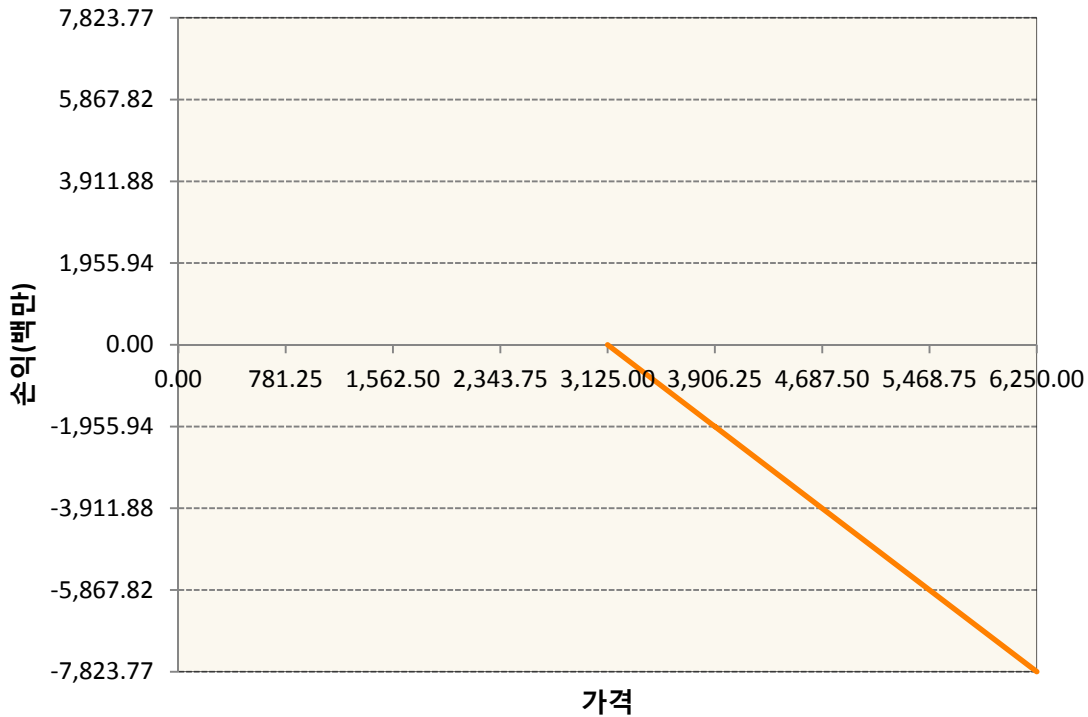
1. 계약금액

(단위:백만원)

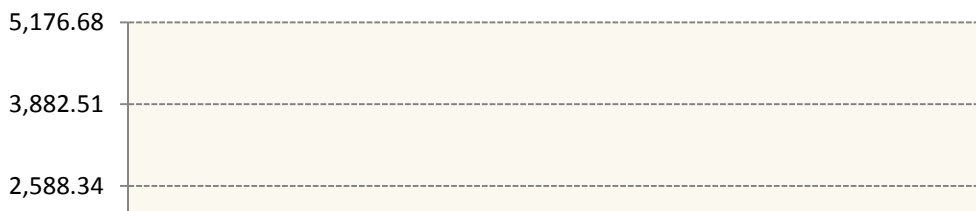
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 6,715 | 0 | 6,715 | |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 60,614 | 0 | 60,614 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 26,001 | -26,001 | 장내 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 15,407 | -15,407 | 장외 |

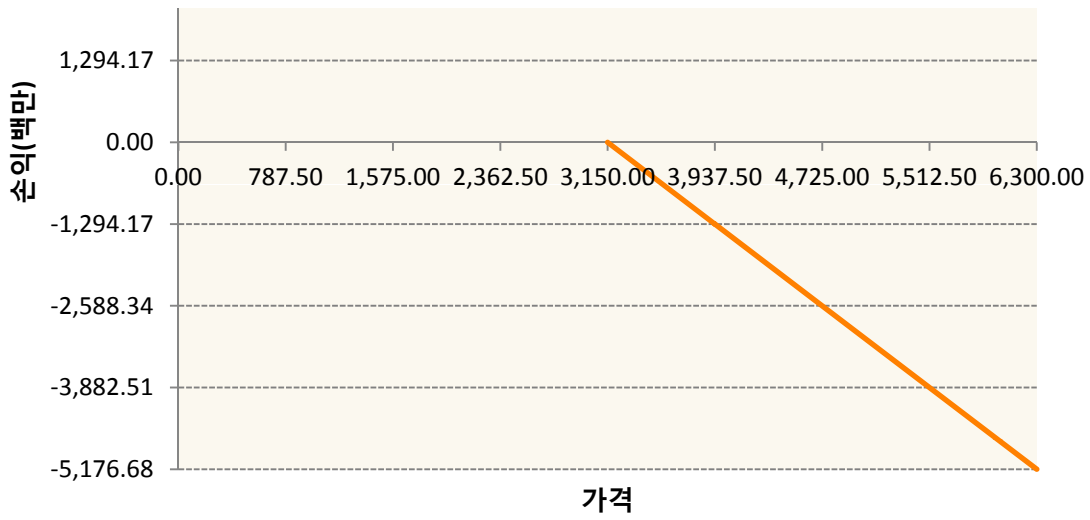
2. 만기시점의 손익구조

OESXG9-C3125-EURO STOXX 50

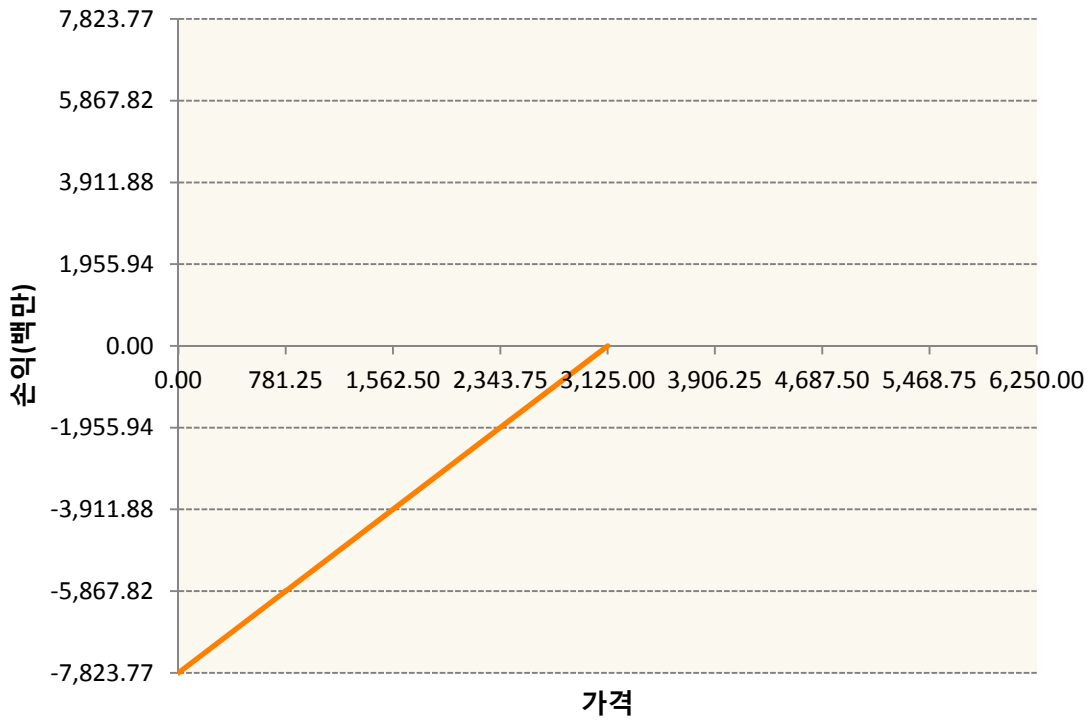


OESXG9-C3150-EURO STOXX 50

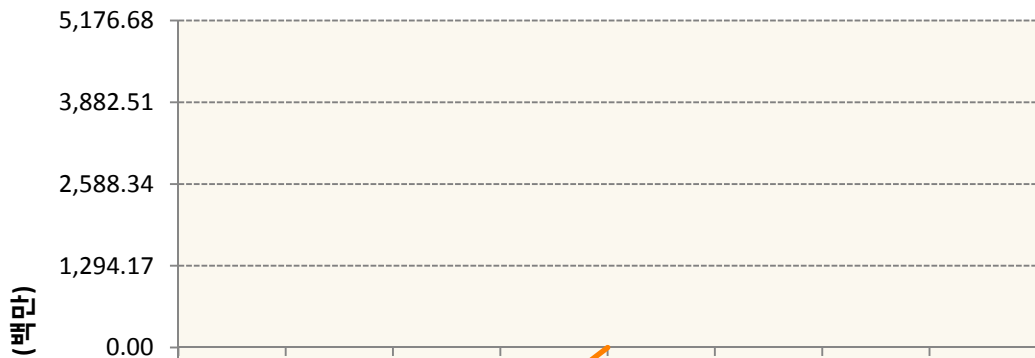


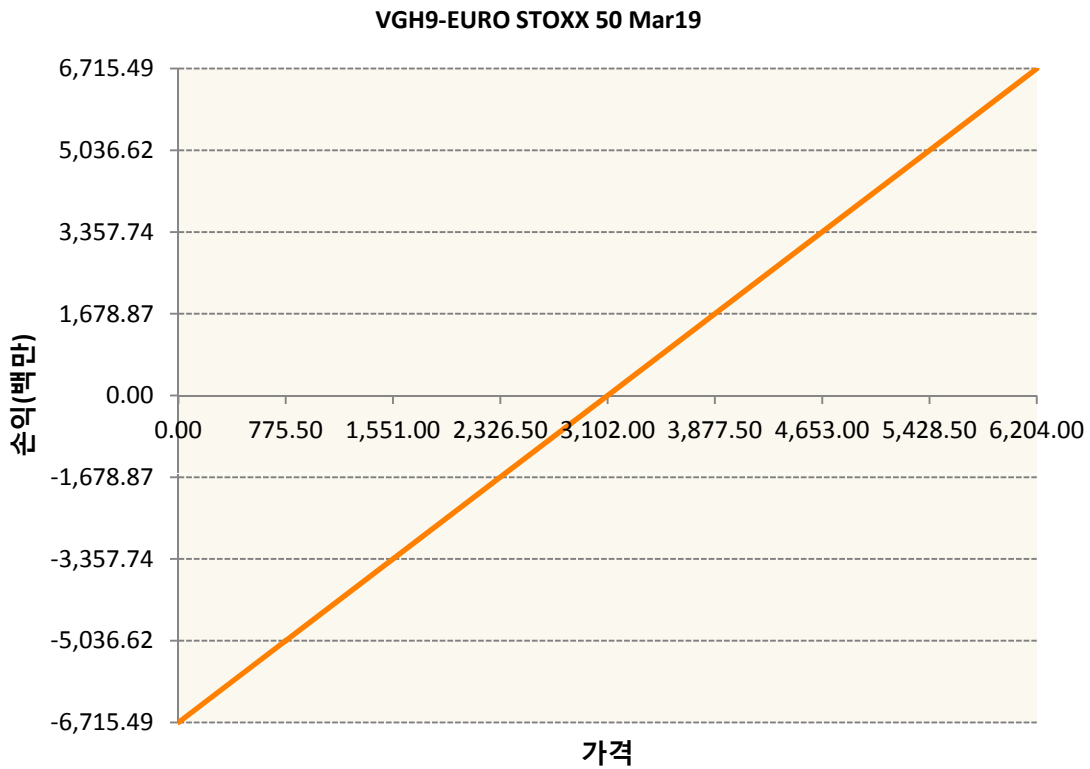
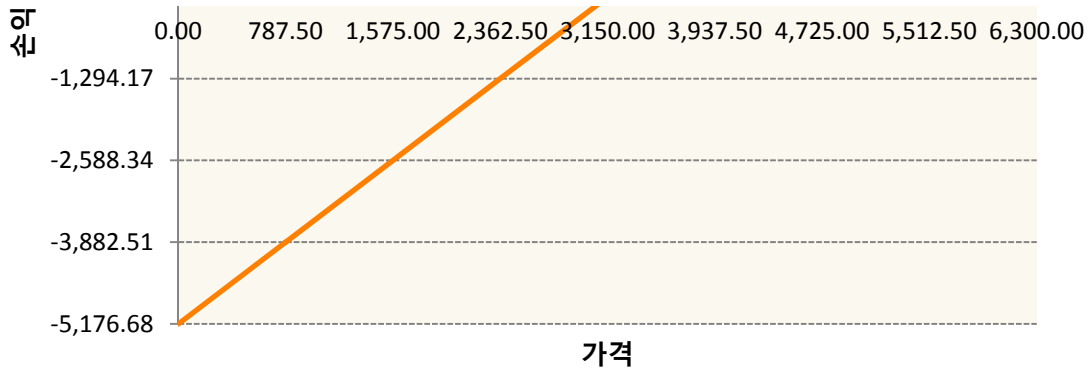


OESXG9-P3125-EURO STOXX 50



OESXG9-P3150-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | |
|---|-----|
| 260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY | 19 |
| FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E | 411 |
| FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E | 822 |
| OESXG9-C31EURO STOXX 50 | 626 |
| OESXG9-C31EURO STOXX 50 | 414 |
| OESXG9-P31EURO STOXX 50 | 626 |
| OESXG9-P31EURO STOXX 50 | 414 |
| VGH9 EURO STOXX 50 Mar19 | 537 |

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

(단위:백만원)

2,499

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

(단위:백만원)

1,145

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

(단위:백만원)

97

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

(단위:백만원)

146

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-25 |
| 기준일 | 2019-01-24 |

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

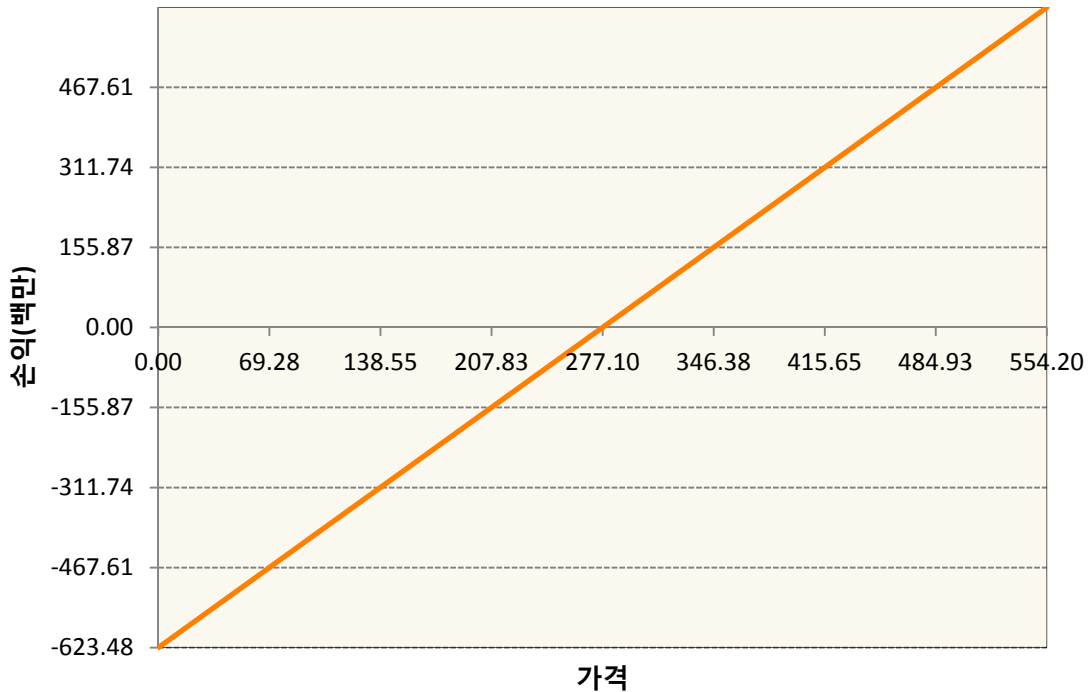
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 623 | 0 | 623 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101P30007 | | 2019-03 코스피200지수선물 | | | | | | 50 |
|--------------|---------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|----|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -50 | -50 | -50 | -50 | -50 | -50 | -50 | |
| -5.33% | -33 | -33 | -33 | -33 | -33 | -33 | -33 | |
| -2.67% | -17 | -17 | -17 | -17 | -17 | -17 | -17 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 17 | 17 | 17 | 17 | 17 | 17 | 17 | |
| 5.33% | 33 | 33 | 33 | 33 | 33 | 33 | 33 | |
| 8.00% | 50 | 50 | 50 | 50 | 50 | 50 | 50 | |

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

(단위:백만원)

| |
|----|
| 44 |
|----|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-25 |
| 기준일 | 2019-01-24 |

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

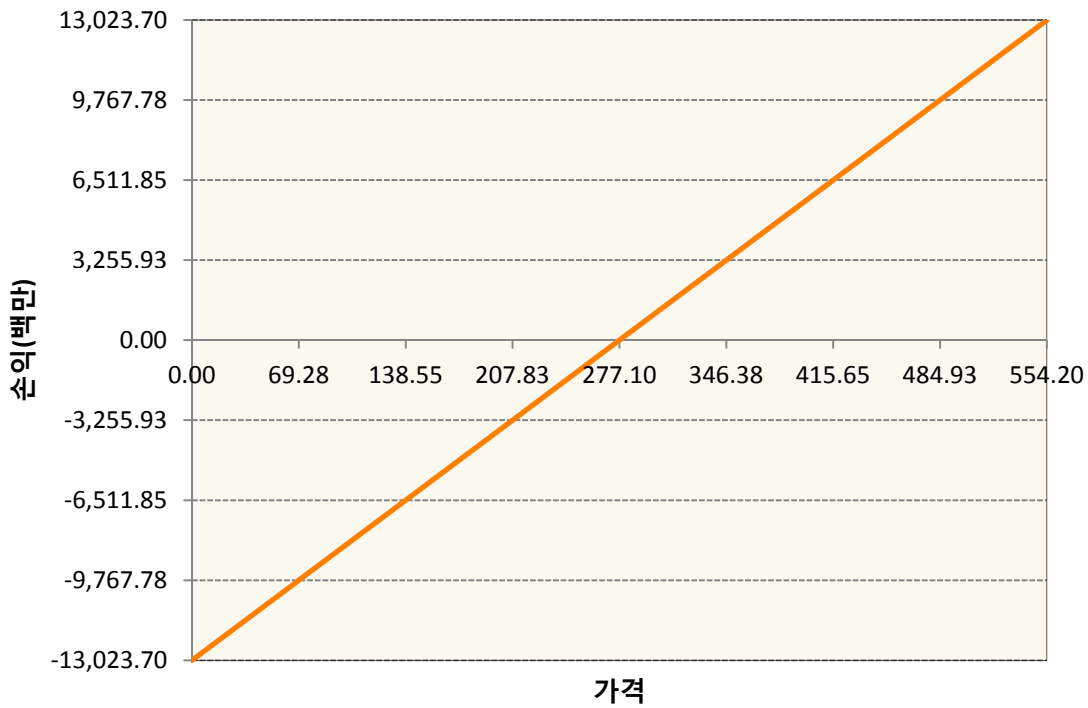
1. 계약금액

(단위:백만원)

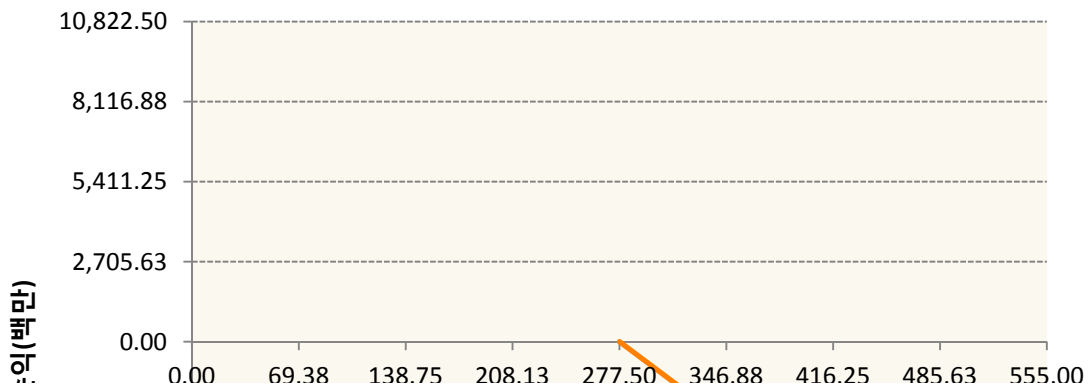
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 13,024 | 0 | 13,024 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 2,523 | 23,213 | -20,690 | 장내 |

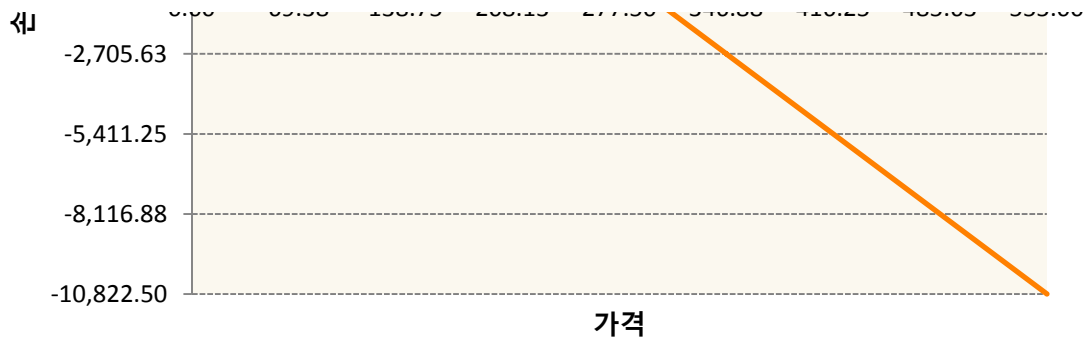
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

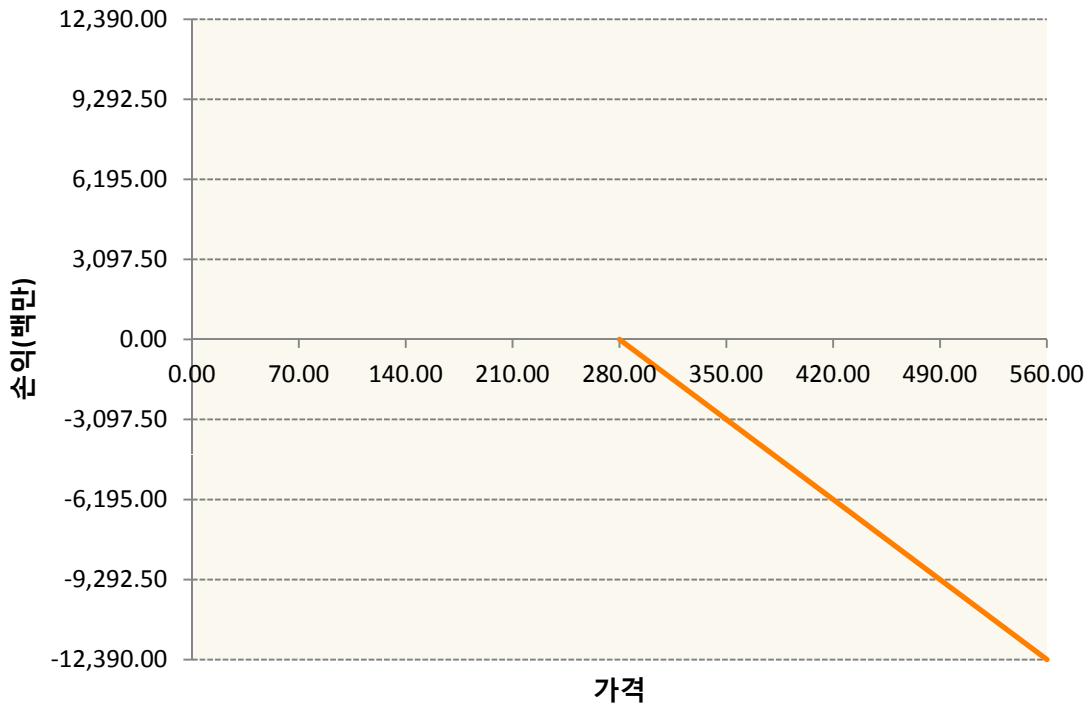


KR4201P22770-2019-02 콜277.5

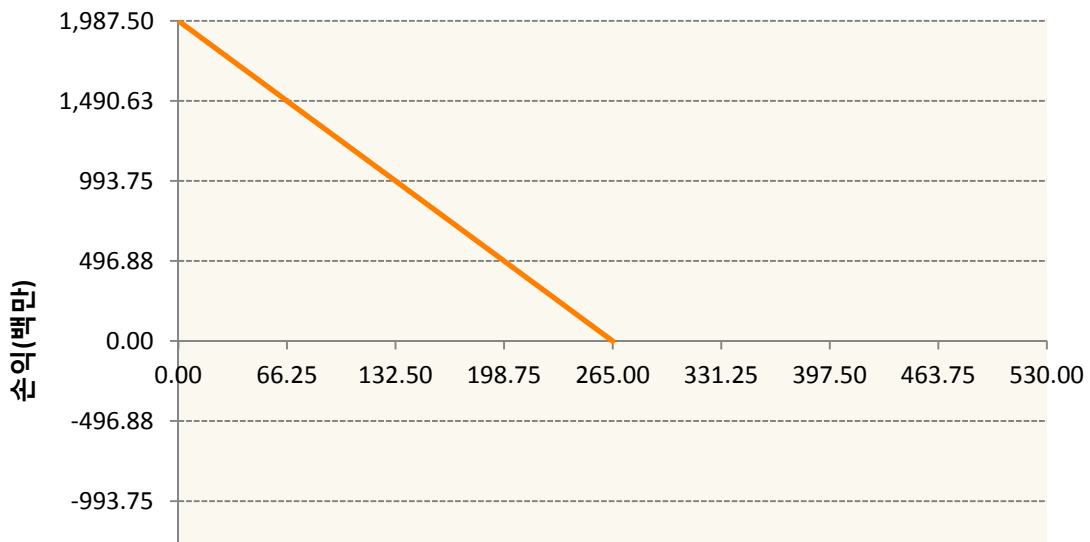


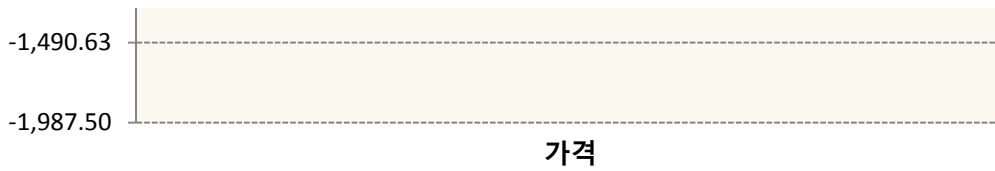


KR4201P22804-2019-02 콜280

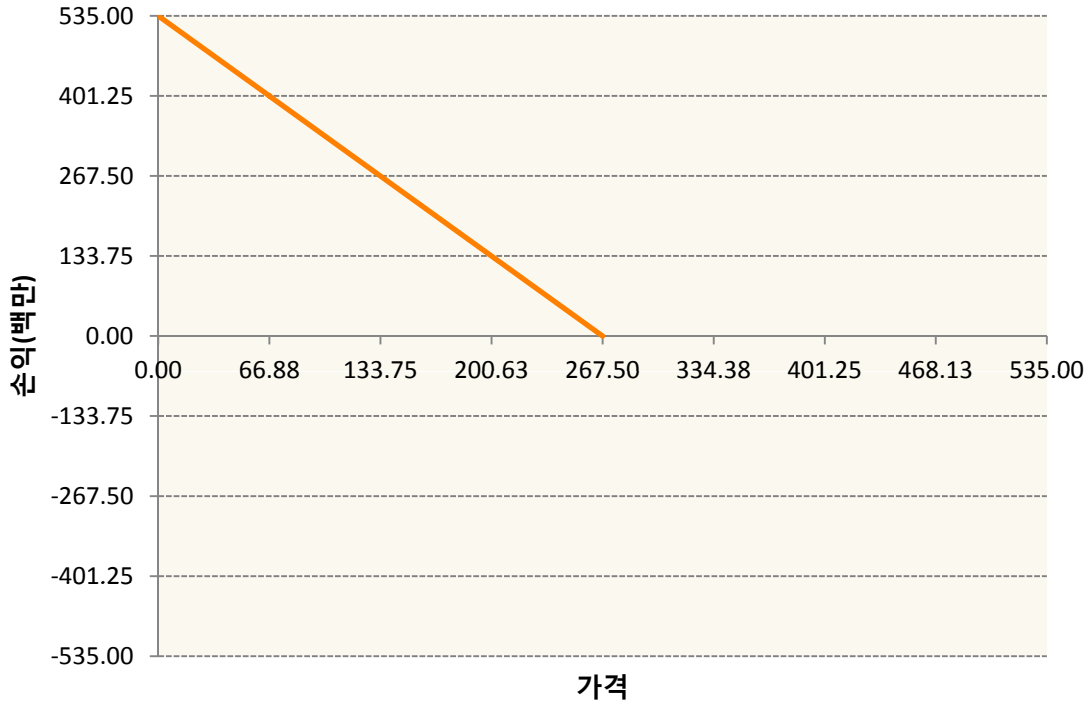


KR4301P22653-2019-02 풋265





KR4301P22679-2019-02 풋267.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4101P30007 | | 2019-03 코스피200지수선물 | | | | | | 1,040 |
|--------------|---------|--------------------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|
| | | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -1,040 | -1,040 | -1,040 | -1,040 | -1,040 | -1,040 | -1,040 | |
| -5.33% | -693 | -693 | -693 | -693 | -693 | -693 | -693 | |
| -2.67% | -347 | -347 | -347 | -347 | -347 | -347 | -347 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 347 | 347 | 347 | 347 | 347 | 347 | 347 | |
| 5.33% | 693 | 693 | 693 | 693 | 693 | 693 | 693 | |
| 8.00% | 1,040 | 1,040 | 1,040 | 1,040 | 1,040 | 1,040 | 1,040 | |
| KR4201P22770 | | 2019-02 콜277.5 | | | | | | 658 |
| | | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 243 | 239 | 233 | 226 | 217 | 208 | 197 | |
| -5.33% | 225 | 214 | 202 | 189 | 174 | 159 | 143 | |
| -2.67% | 173 | 155 | 136 | 117 | 97 | 78 | 58 | |

| | | | | | | | |
|--|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 0% | 66 | 44 | 22 | 0 | -22 | -44 | -66 |
| 2.67% | -105 | -125 | -145 | -166 | -187 | -208 | -229 |
| 5.33% | -331 | -344 | -360 | -376 | -393 | -410 | -429 |
| 8.00% | -592 | -599 | -608 | -619 | -631 | -644 | -658 |
| KR4201P22804 2019-02 콜280 | | | | | | | 706 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 230 | 227 | 222 | 215 | 207 | 198 | 187 |
| -5.33% | 216 | 206 | 195 | 182 | 168 | 152 | 136 |
| -2.67% | 172 | 154 | 135 | 115 | 94 | 73 | 51 |
| 0% | 74 | 49 | 25 | 0 | -25 | -50 | -74 |
| 2.67% | -96 | -120 | -145 | -170 | -194 | -219 | -244 |
| 5.33% | -333 | -351 | -371 | -391 | -413 | -435 | -457 |
| 8.00% | -618 | -628 | -641 | -655 | -671 | -688 | -706 |
| KR4301P22653 2019-02 풋265 | | | | | | | 83 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 76 | 77 | 78 | 79 | 80 | 81 | 83 |
| -5.33% | 30 | 32 | 34 | 36 | 39 | 41 | 43 |
| -2.67% | 5 | 7 | 9 | 11 | 13 | 15 | 17 |
| 0% | -2 | -2 | -1 | 0 | 1 | 2 | 4 |
| 2.67% | -3 | -3 | -3 | -3 | -2 | -2 | -1 |
| 5.33% | -3 | -3 | -3 | -3 | -3 | -3 | -3 |
| 8.00% | -3 | -3 | -3 | -3 | -3 | -3 | -3 |
| KR4301P22679 2019-02 풋267.5 | | | | | | | 26 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 | 26 |
| -5.33% | 11 | 12 | 12 | 13 | 13 | 14 | 14 |
| -2.67% | 2 | 3 | 3 | 4 | 5 | 5 | 6 |
| 0% | -1 | -1 | 0 | 0 | 0 | 1 | 1 |
| 2.67% | -1 | -1 | -1 | -1 | -1 | -1 | -1 |
| 5.33% | -2 | -2 | -2 | -1 | -1 | -1 | -1 |
| 8.00% | -2 | -2 | -2 | -2 | -2 | -2 | -1 |

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

(단위:백만원)

2,261

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-25 |
| 기준일 | 2019-01-24 |

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 | 626 | 0 | 626 | |

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 | 2019-01-25 |
| 기준일 | 2019-01-24 |

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 | 2,876 | 0 | 2,876 | |

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 | 2019-01-25 |
| 기준일 | 2019-01-24 |

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 | 5,033 | 0 | 5,033 | |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 12,912 | -12,912 | 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 |
| FX21018Z03 KRW/USD 19-02-19E | | 32 |
| FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E | | 15 |
| FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E | | 8 |
| FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E | | 26 |
| FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E | | 8 |
| FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E | | 14 |
| FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E | | 29 |
| FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E | | 14 |
| FX21019F01 KRW/USD 19-02-19E | | 38 |
| FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E | | 14 |
| FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E | | 58 |
| FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E | | 9 |
| FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E | | 33 |
| FX21019F02 KRW/USD 25-02-19E | | 136 |
| FX21019F02 KRW/USD 28-03-19E | | 469 |

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

(단위:백만원)

390

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-25 |
| 기준일 | 2019-01-24 |

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

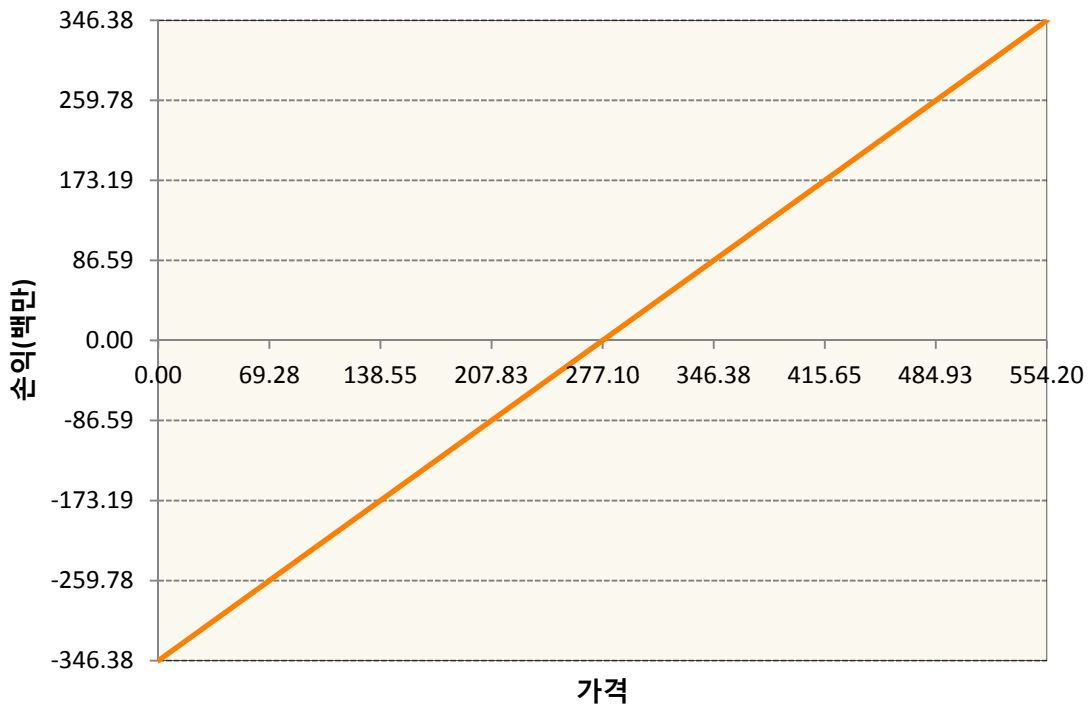
1. 계약금액

(단위:백만원)

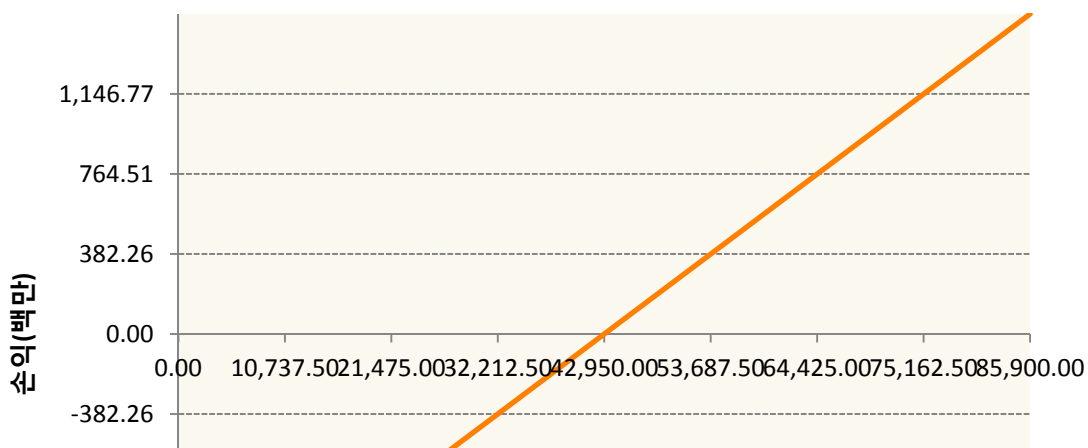
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,875 | 0 | 1,875 | 장내 |

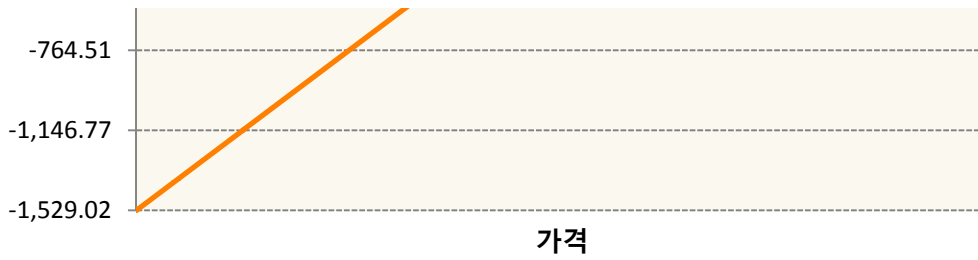
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



KR4111P20007-2019-02 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4101P30007 | | 2019-03 코스피200지수선물 | | | | | | 28 |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
| 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% | -18 | -18 | -18 | -18 | -18 | -18 | -18 | |
| -2.67% | -9 | -9 | -9 | -9 | -9 | -9 | -9 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 | |
| 5.33% | 18 | 18 | 18 | 18 | 18 | 18 | 18 | |
| 8.00% | 28 | 28 | 28 | 28 | 28 | 28 | 28 | |
| KR4111P20007 | | 2019-02 삼성전자개별선물 | | | | | | 123 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -123 | -123 | -123 | -123 | -123 | -123 | -123 | |
| -5.33% | -82 | -82 | -82 | -82 | -82 | -82 | -82 | |
| -2.67% | -41 | -41 | -41 | -41 | -41 | -41 | -41 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 41 | 41 | 41 | 41 | 41 | 41 | 41 | |
| 5.33% | 82 | 82 | 82 | 82 | 82 | 82 | 82 | |
| 8.00% | 123 | 123 | 123 | 123 | 123 | 123 | 123 | |

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

166

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-25 |
| 기준일 | 2019-01-24 |

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

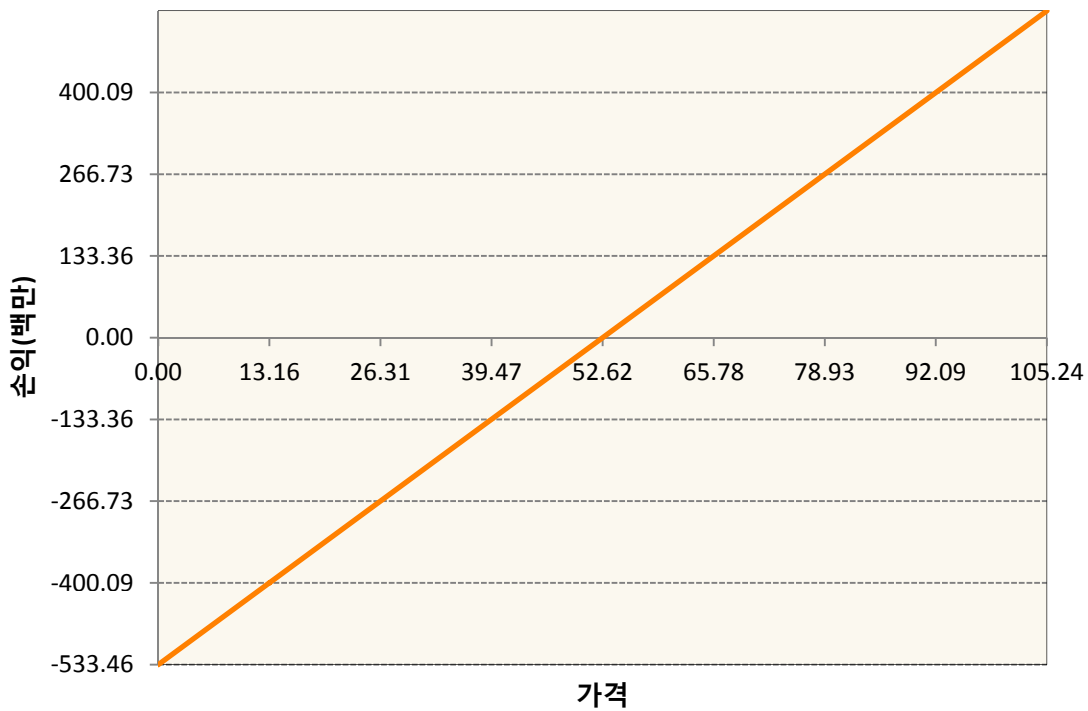
1. 계약금액

(단위:백만원)

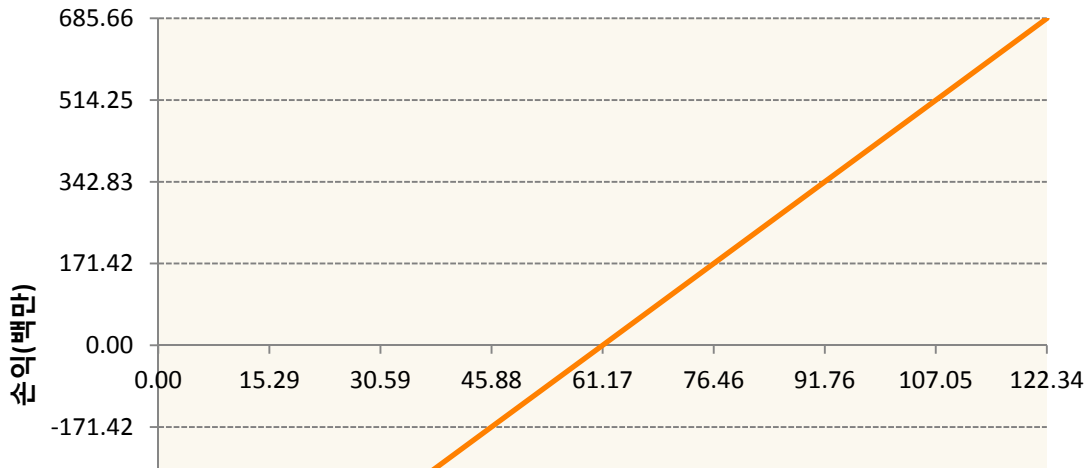
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,704 | 282 | 2,422 | |

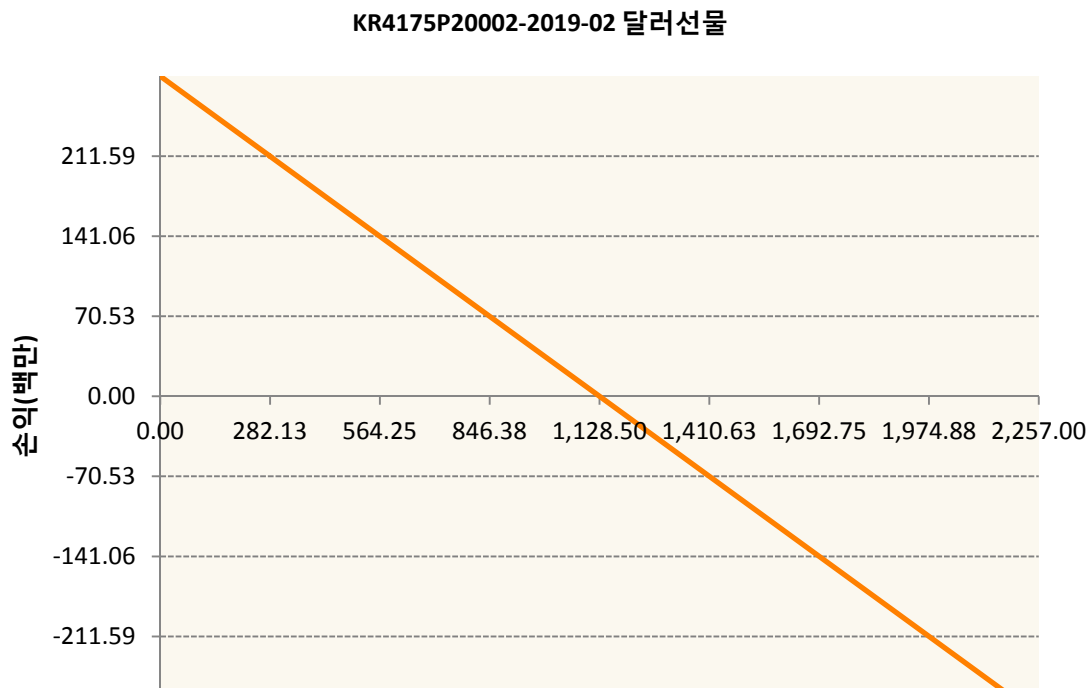
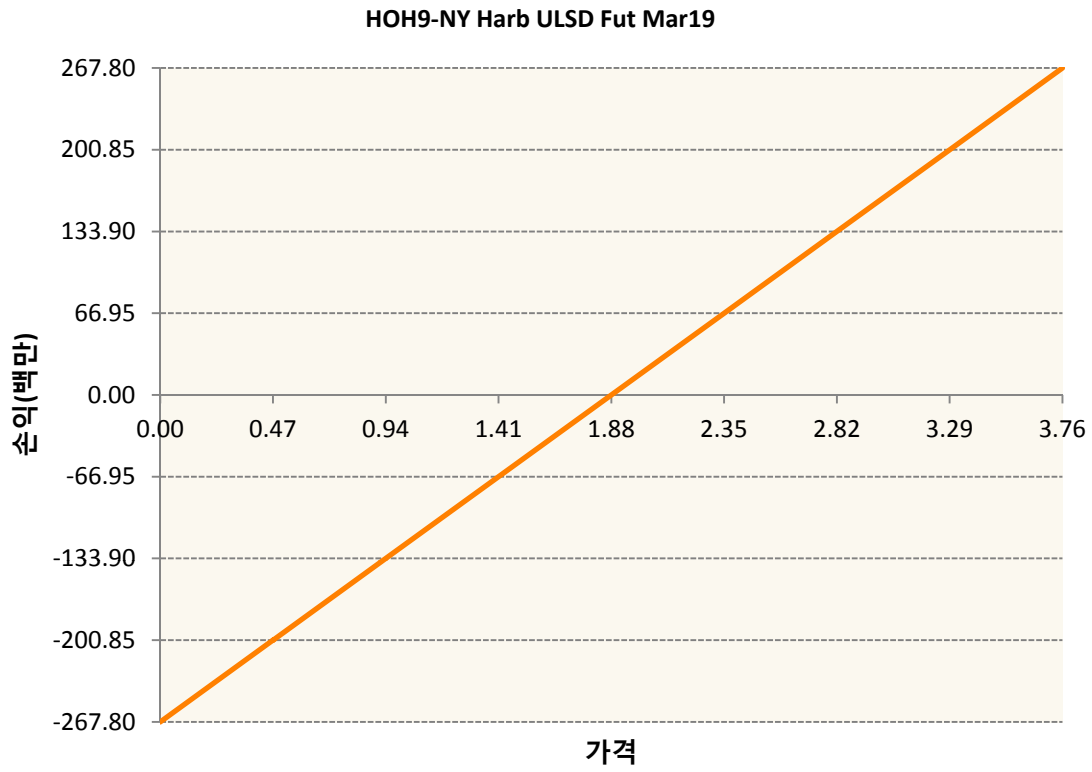
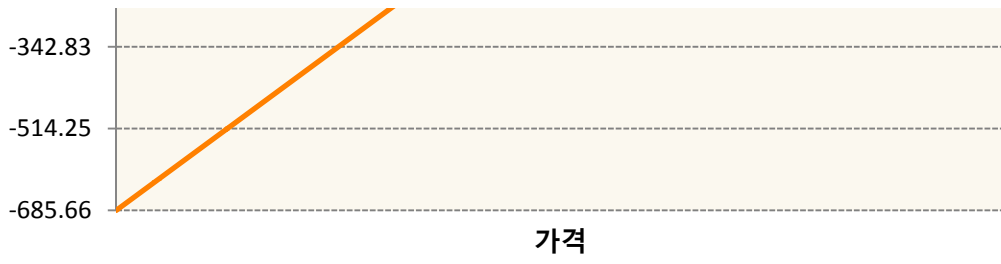
2. 만기시점의 손익구조

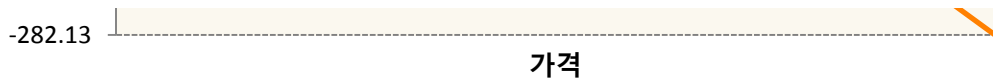
CLH9-WTI CRUDE FUTURE MAR19



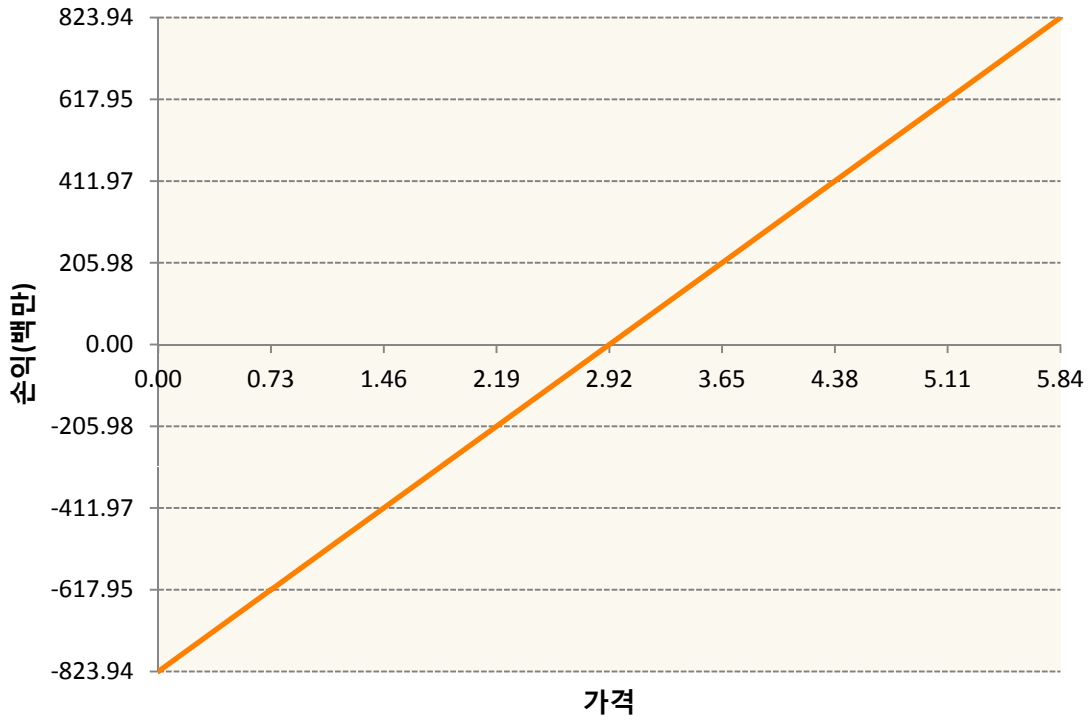
COK9-BRENT CRUDE FUTR May19



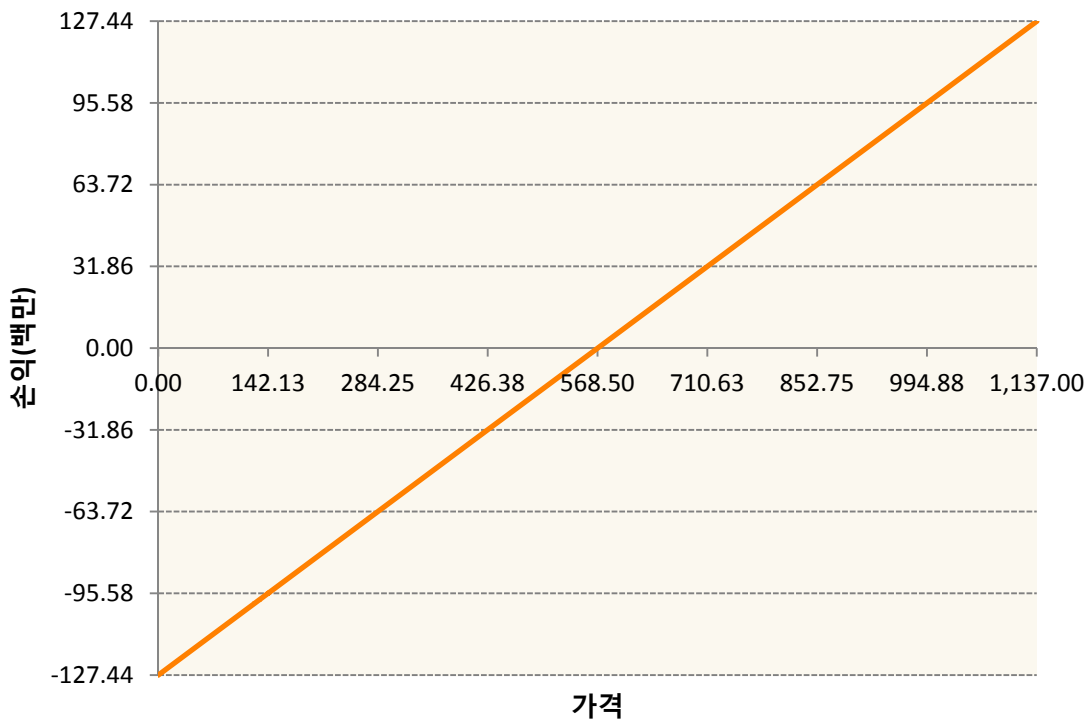




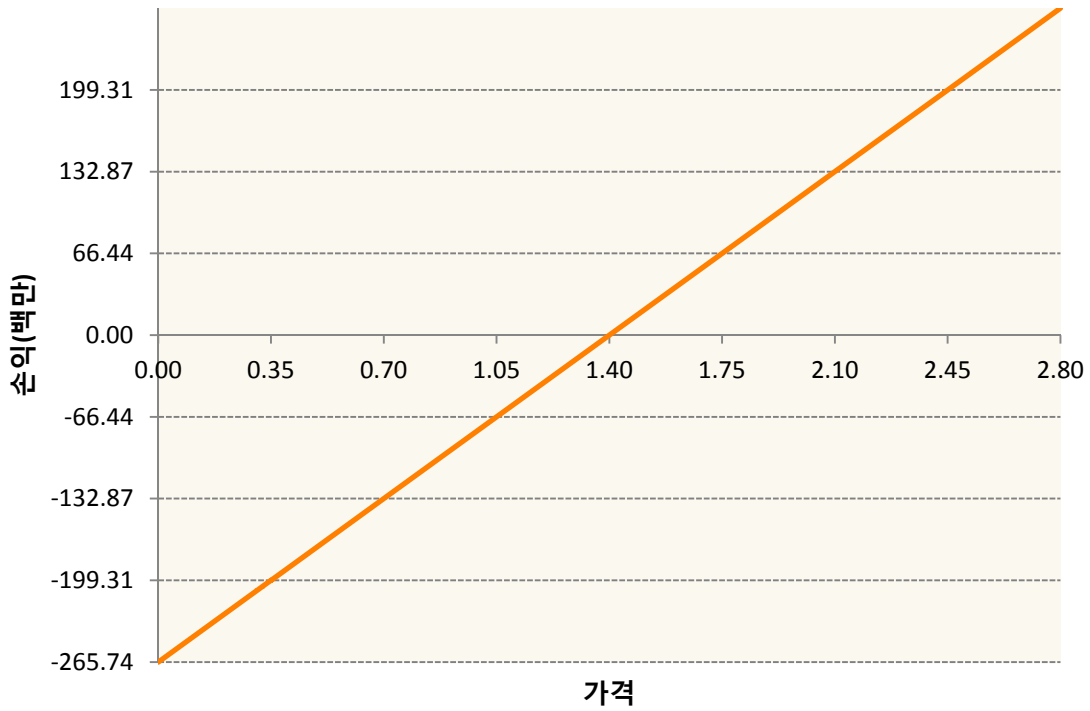
NGH19-NATURAL GAS FUTR Mar19



QSH9-Low Su Gasoil G May19



XBH9-GASOLINE RBOB FUT Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | |
|------------|-------------------------|----|
| CLH9 | WTI CRUDE FUTURE MAR19 | 43 |
| COK9 | BRENT CRUDE FUTR May19 | 55 |
| HOH9 | NY Harb ULSD Fut Mar19 | 21 |
| KR4175P200 | 2019-02 달러선물 | 23 |
| NGH19 | NATURAL GAS FUTR Mar19 | 66 |
| QSH9 | Low Su Gasoil G May19 | 10 |
| XBH9 | GASOLINE RBOB FUT Mar19 | 21 |

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

425

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-25 |
| 기준일 | 2019-01-24 |

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

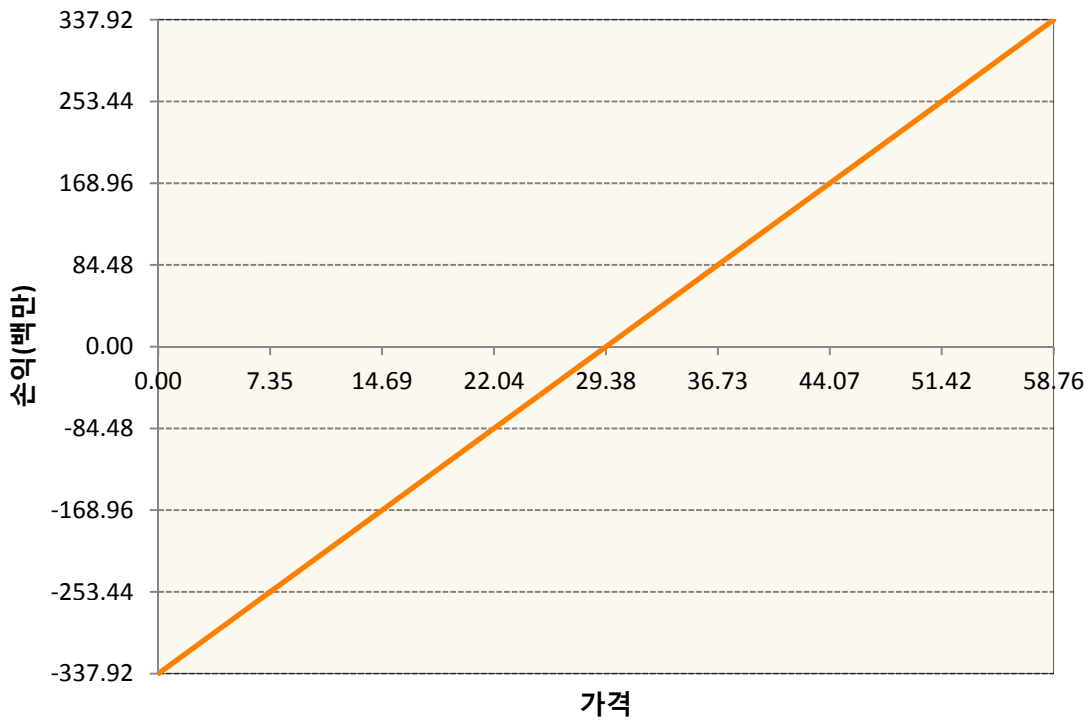
1. 계약금액

(단위:백만원)

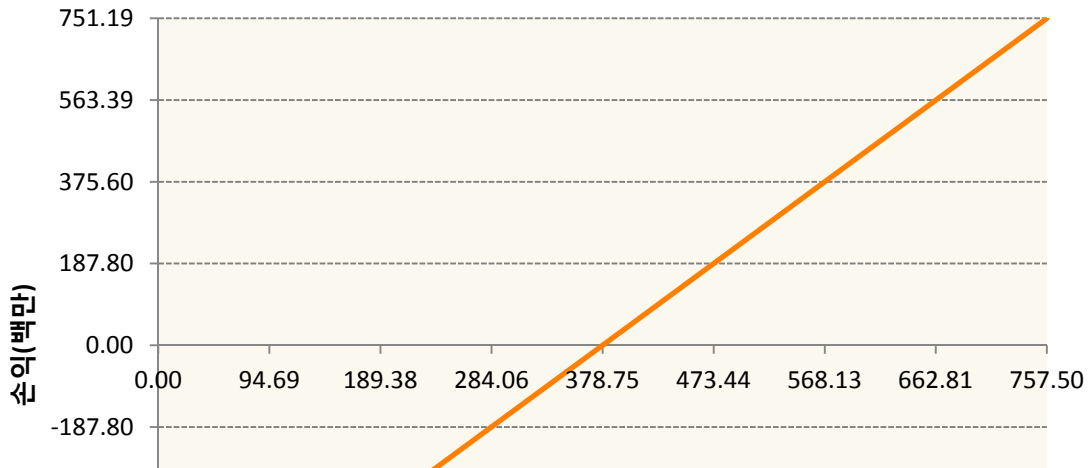
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,598 | 79 | 3,519 | |

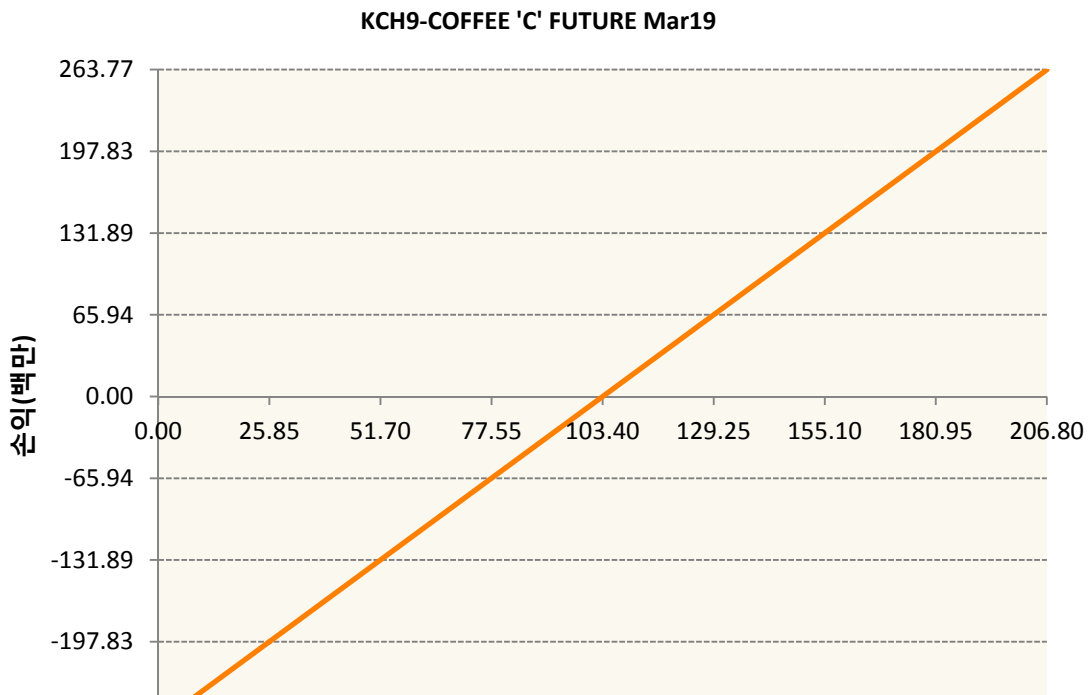
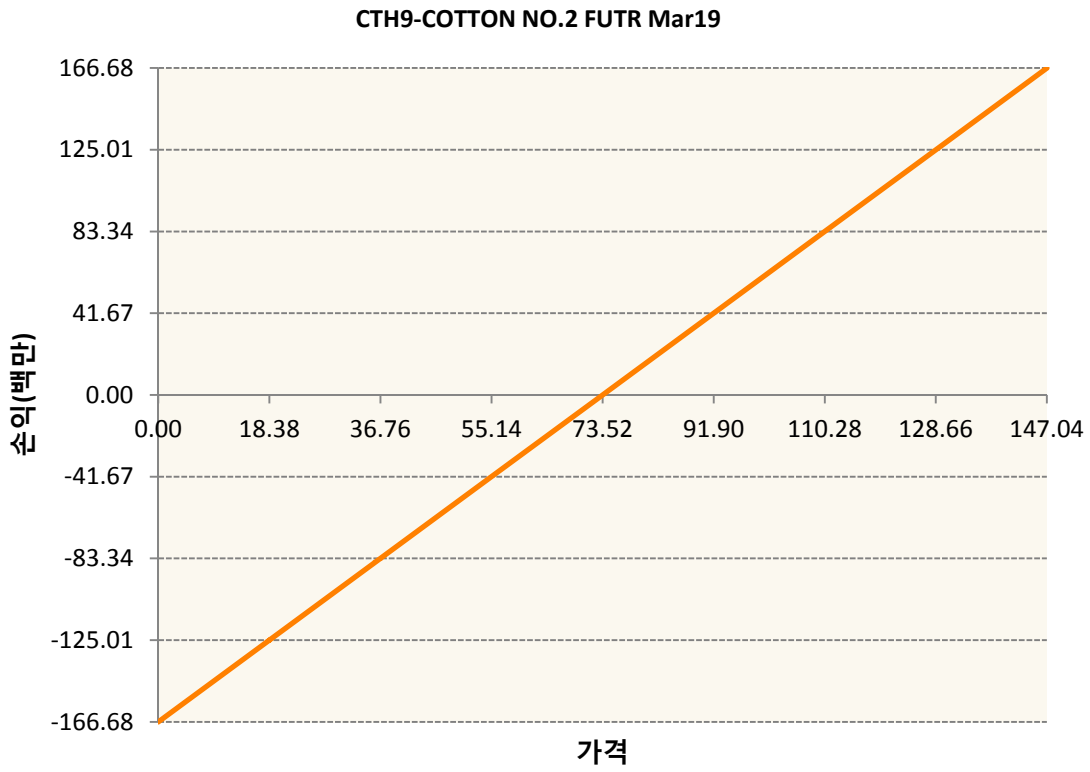
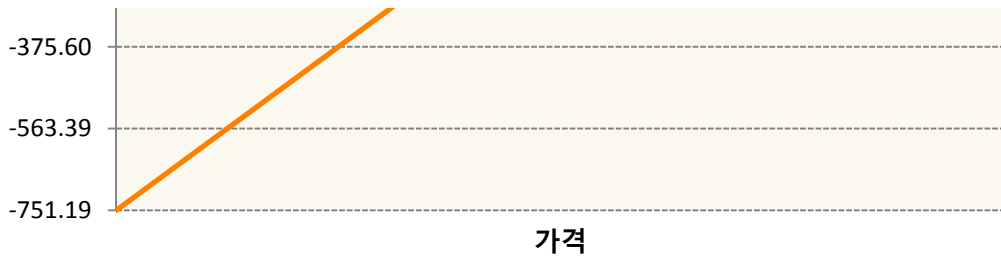
2. 만기시점의 손익구조

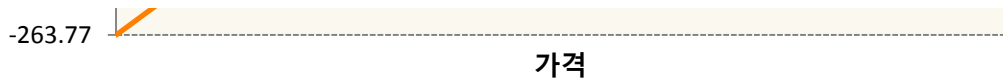
BOH9-SOYBEAN OIL FUTR Mar19



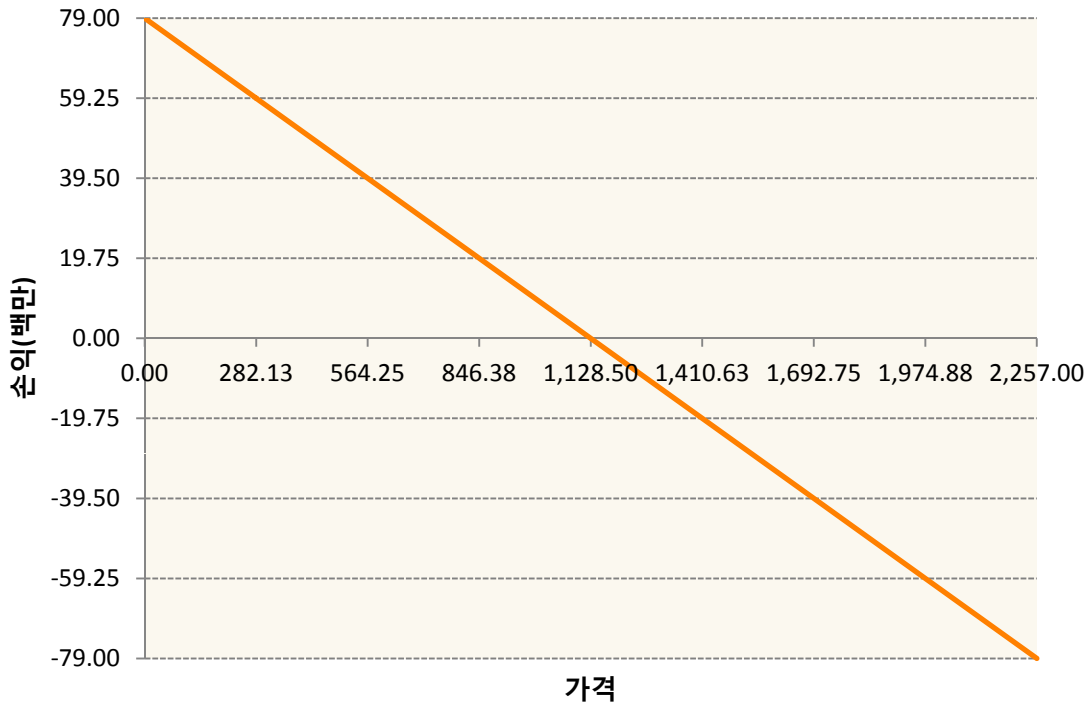
CH9-CORN FUTURE Mar19



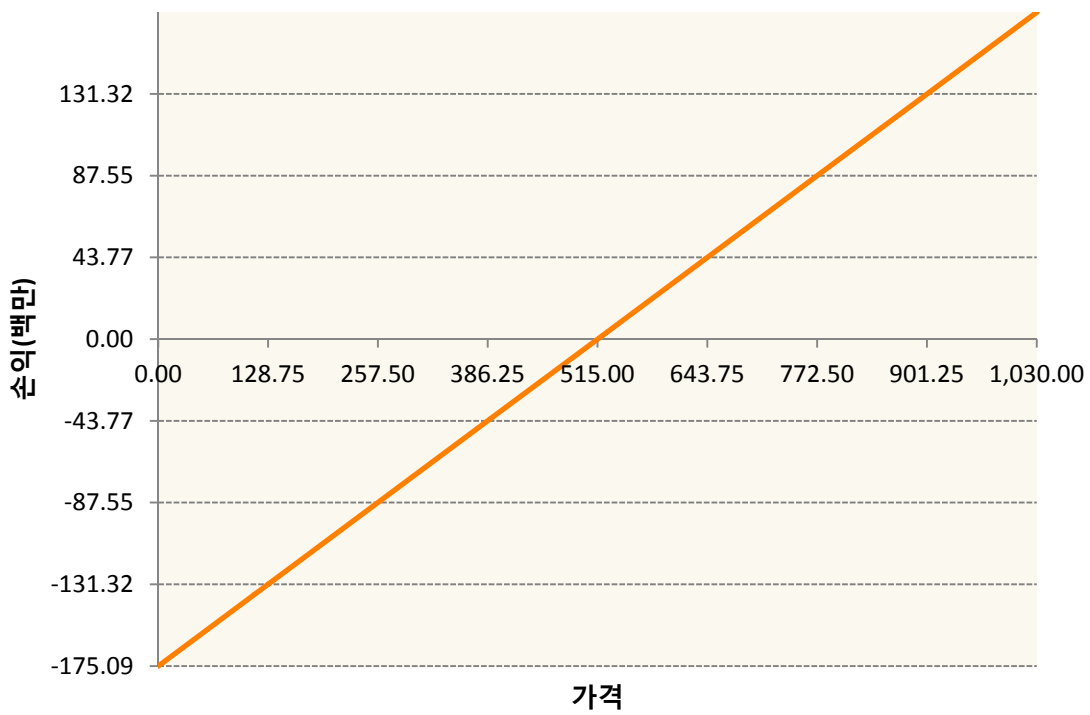




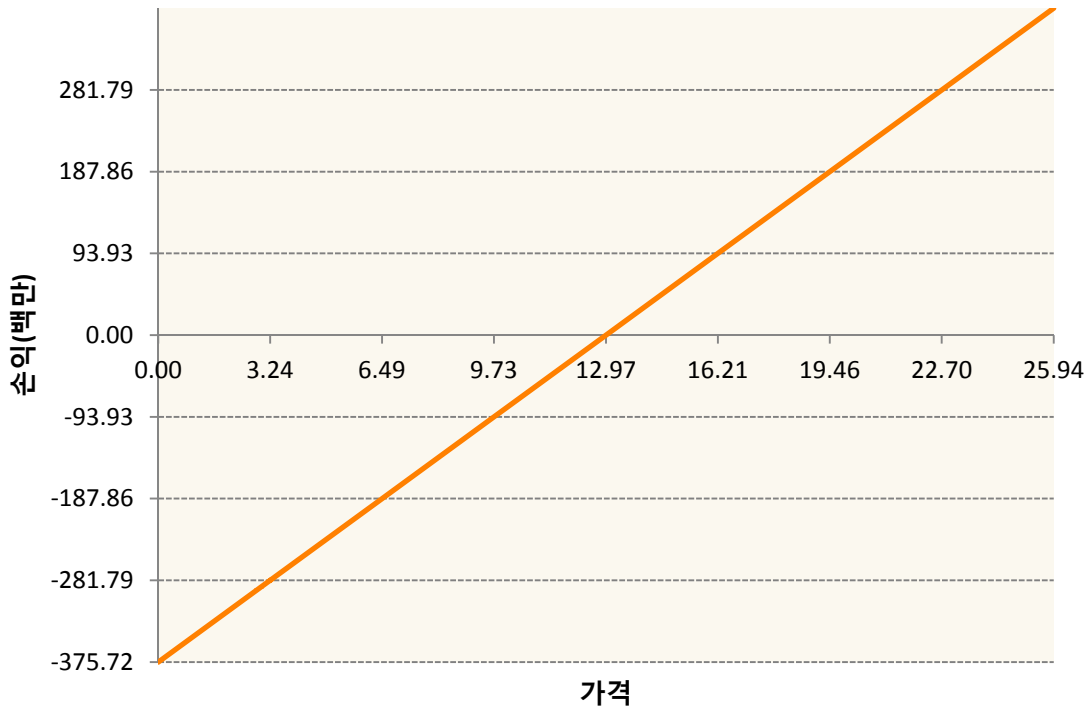
KR4175P20002-2019-02 달러선물



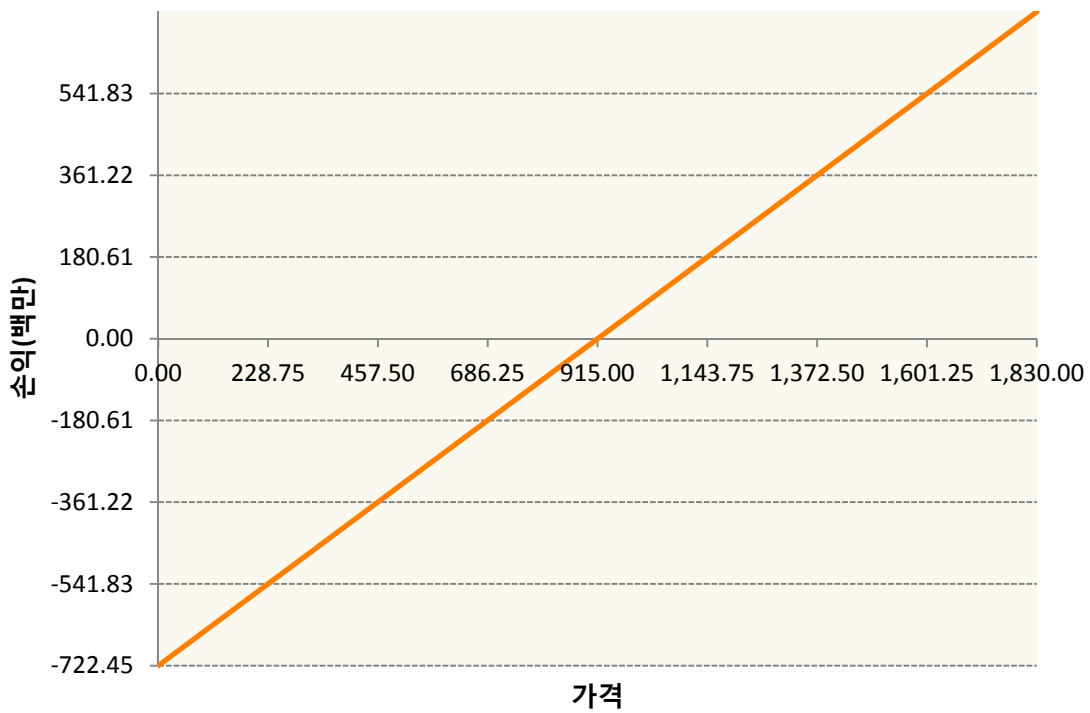
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



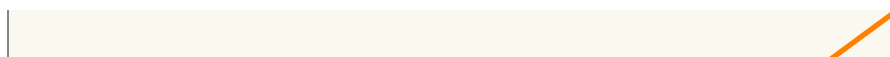
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

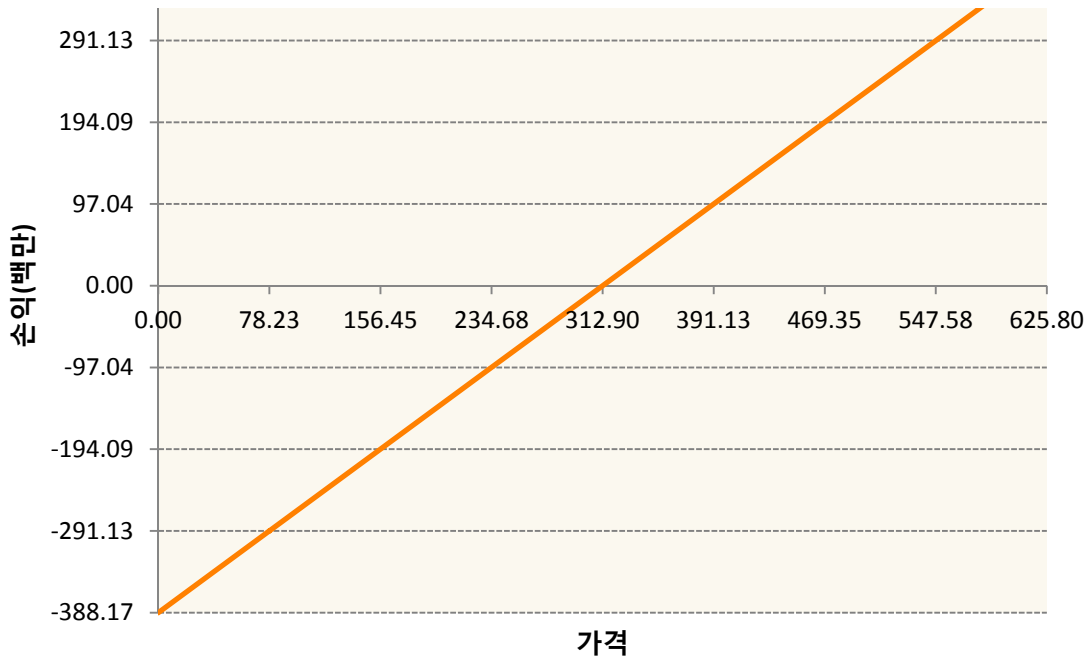


SH9-SOYBEAN FUTURE Mar19

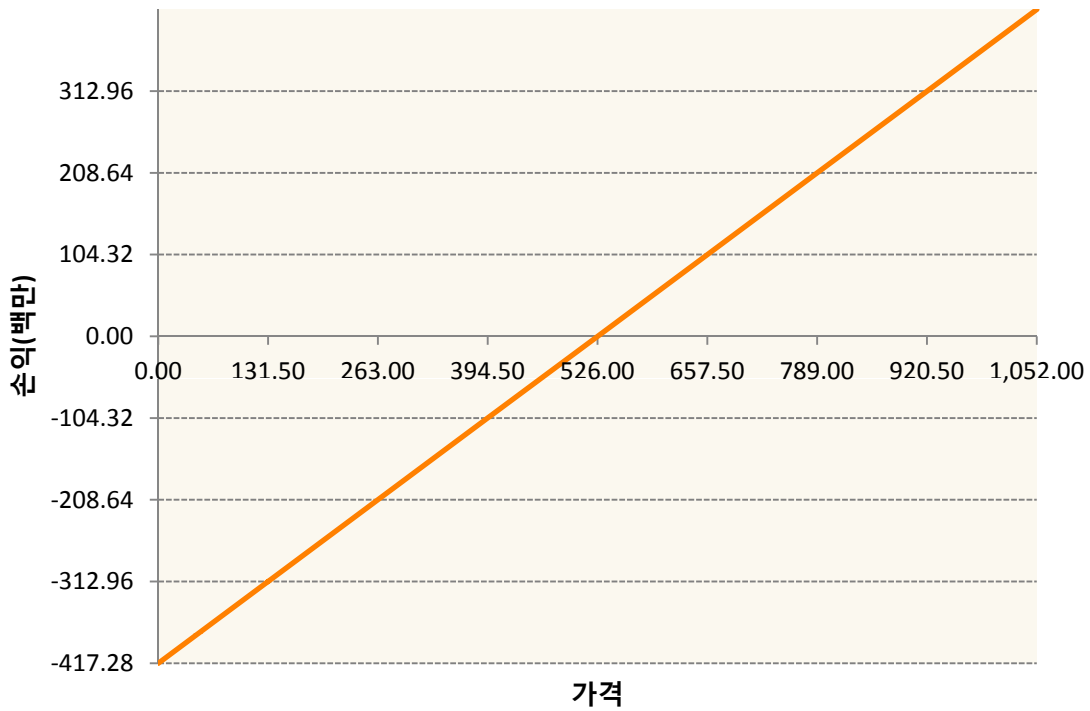


SMH9-SOYBEAN MEAL FUTR Mar19





WH9-WHEAT FUTURE(CBT) Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------------|-------------------------|----|
| BOH9 | SOYBEAN OIL FUTR Mar19 | 27 |
| CH9 | CORN FUTURE Mar19 | 60 |
| CTH9 | COTTON NO.2 FUTR Mar19 | 13 |
| KCH9 | COFFEE 'C' FUTURE Mar19 | 21 |
| KR4175P200 | 2019-02 달러선물 | 6 |

| | | |
|------|-------------------------|----|
| KWH9 | KC HRW WHEAT FUT Mar19 | 14 |
| SBH9 | SUGAR #11 (WORLD) MAR19 | 30 |
| SH9 | SOYBEAN FUTURE Mar19 | 58 |
| SMH9 | SOYBEAN MEAL FUTR Mar19 | 31 |
| WH9 | WHEAT FUTURE(CBT) Mar19 | 33 |

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

(단위:백만원)

295