

공시일	2019-03-14
기준일	2019-03-13

## 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	2019-03-14
기준일	2019-03-13

## 스마트인덱스모

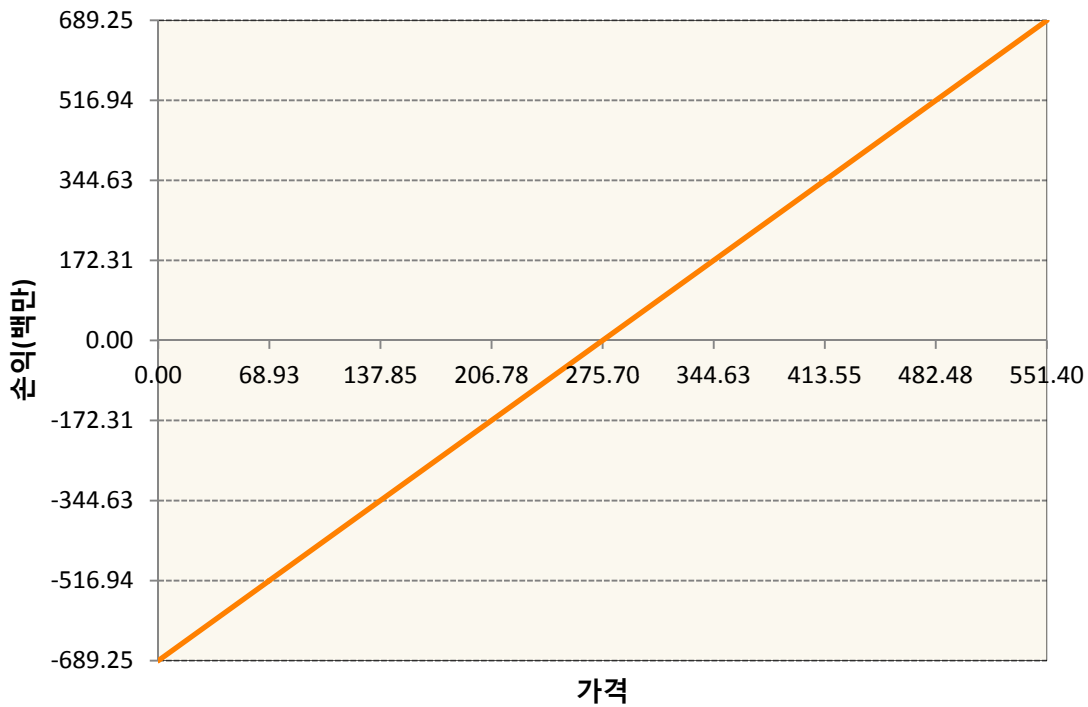
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

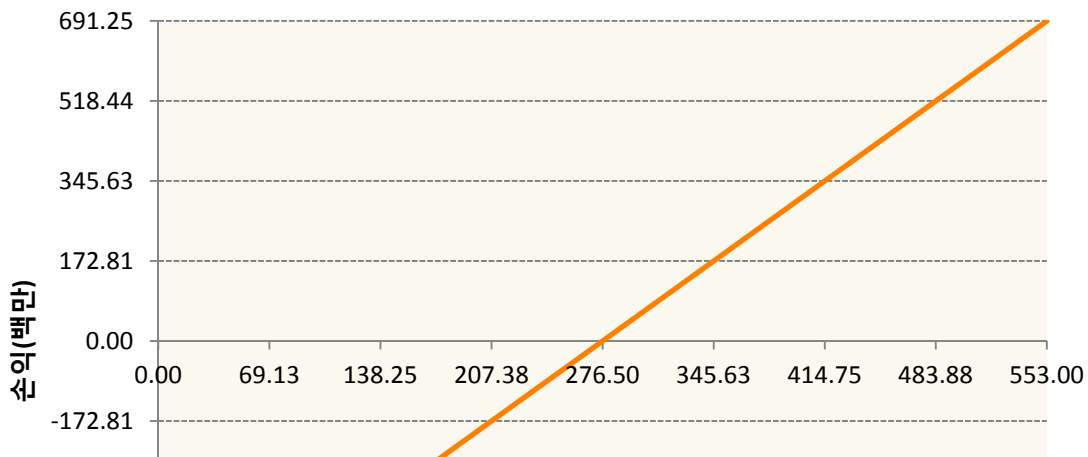
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	690	688	2	장내
누계	유가증권	선물	1,381	0	1,381	장내

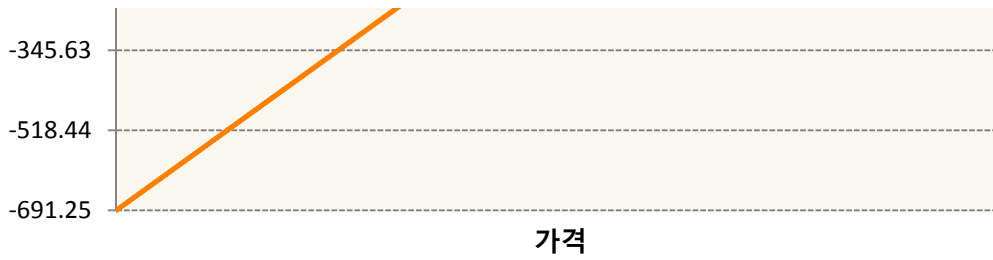
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						55
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55	
-5.33%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37	
-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%	37	37	37	37	37	37	37	
8.00%	55	55	55	55	55	55	55	
KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						55
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55	
-5.33%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37	
-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%	37	37	37	37	37	37	37	
8.00%	55	55	55	55	55	55	55	

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

94

공시일	2019-03-14
기준일	2019-03-13

## 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	13,865	0	13,865	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0( 신한MXWO 미래S190222

1,113

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

645

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-03-14
기준일	2019-03-13

## 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	7,434	0	7,434	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S180910 신규)	339
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	93
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	158

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

<b>919</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-03-14
기준일	2019-03-13

## 유로인덱스모(주식-파생형)

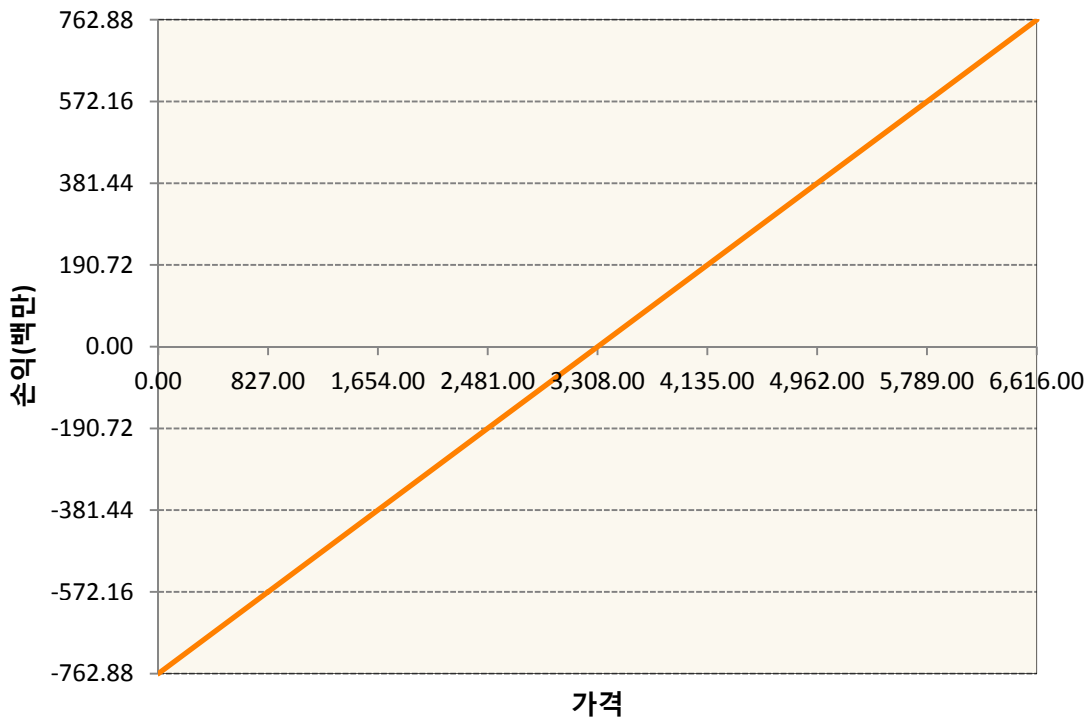
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	763	0	763	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGH9-EURO STOXX 50 Mar19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH9	EURO STOXX 50 Mar19	61
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

43
----

공시일	2019-03-14
기준일	2019-03-13

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

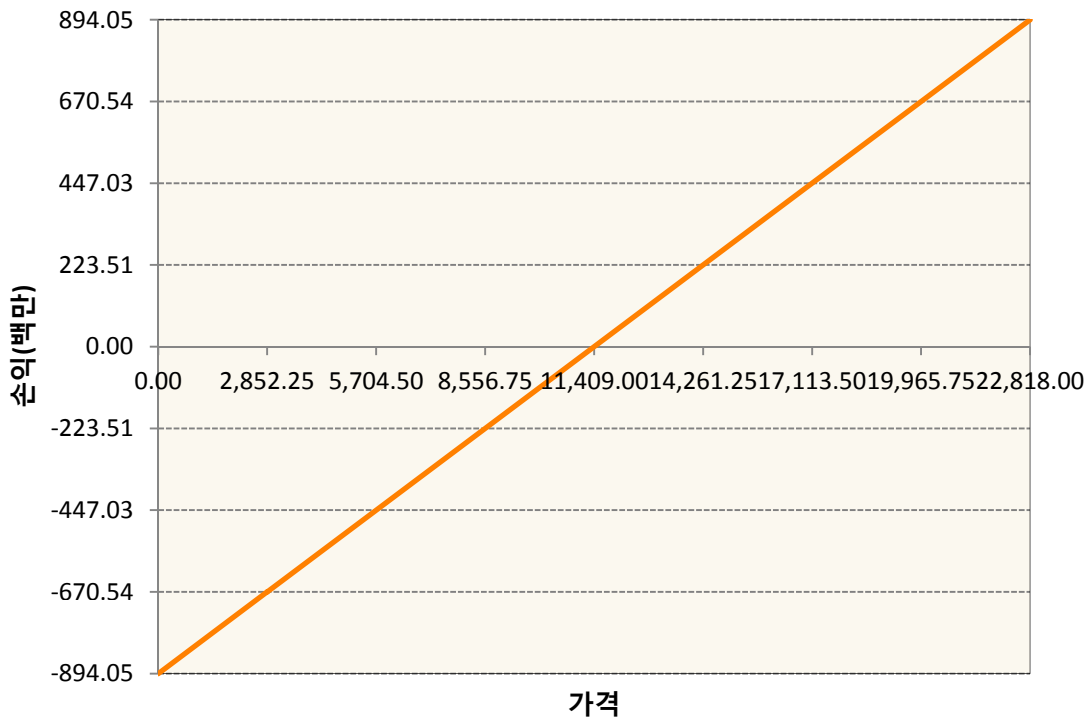
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	894	0	894	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCH9-HSCEI Futures Mar19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH9	HSCEI Futures Mar19	72
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

74
----

공시일	2019-03-14
기준일	2019-03-13

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

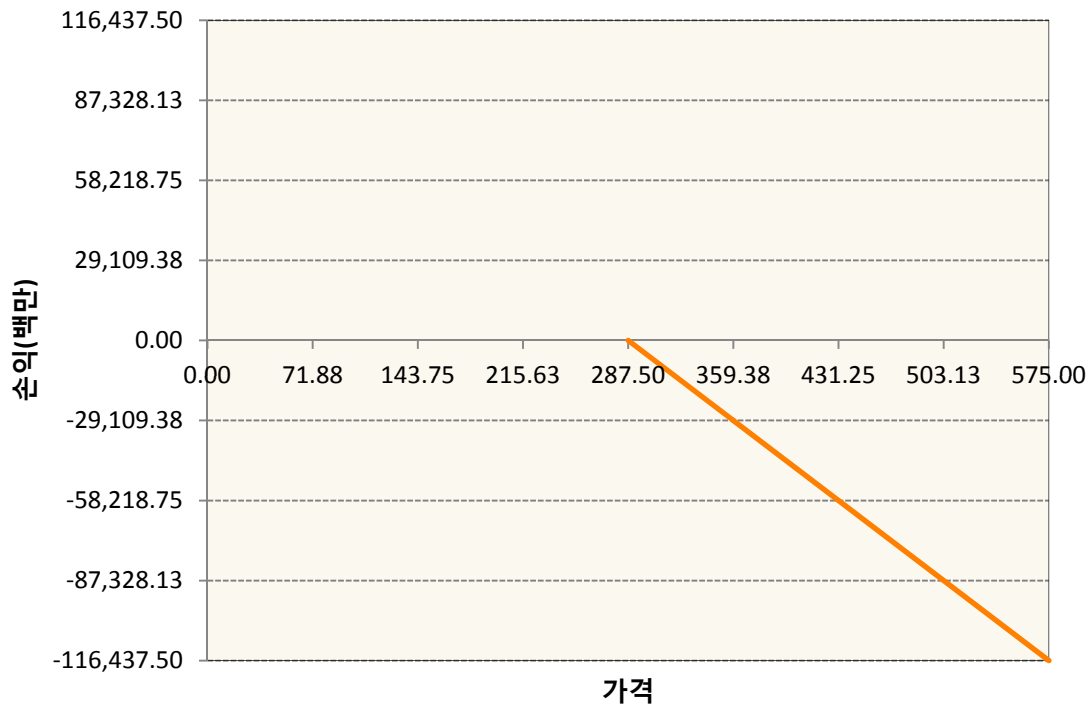
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

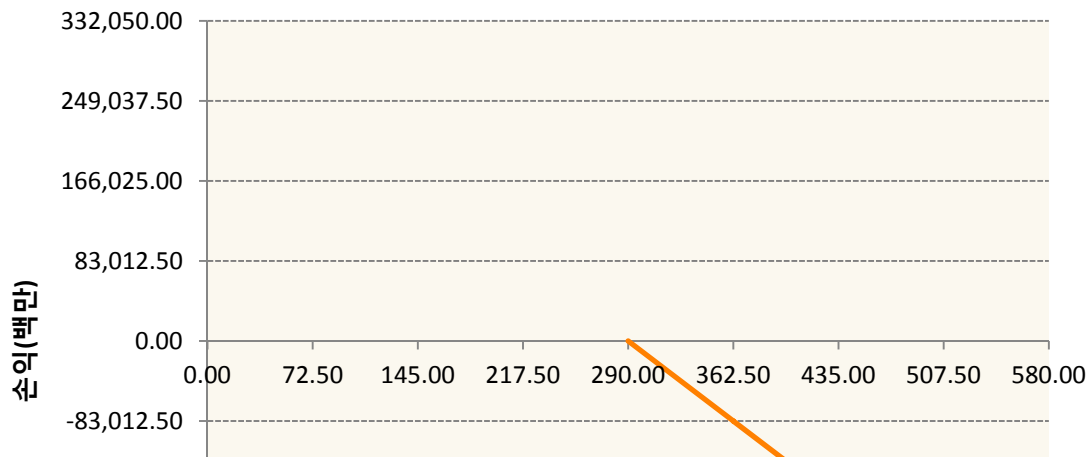
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	701,488	-701,488	장내

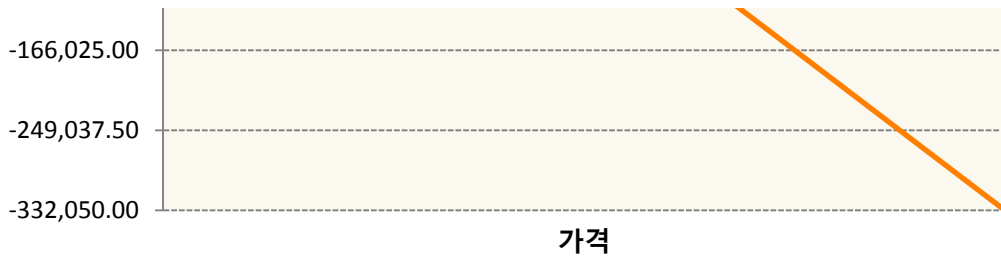
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201P32878-2019-03 콜287.5**

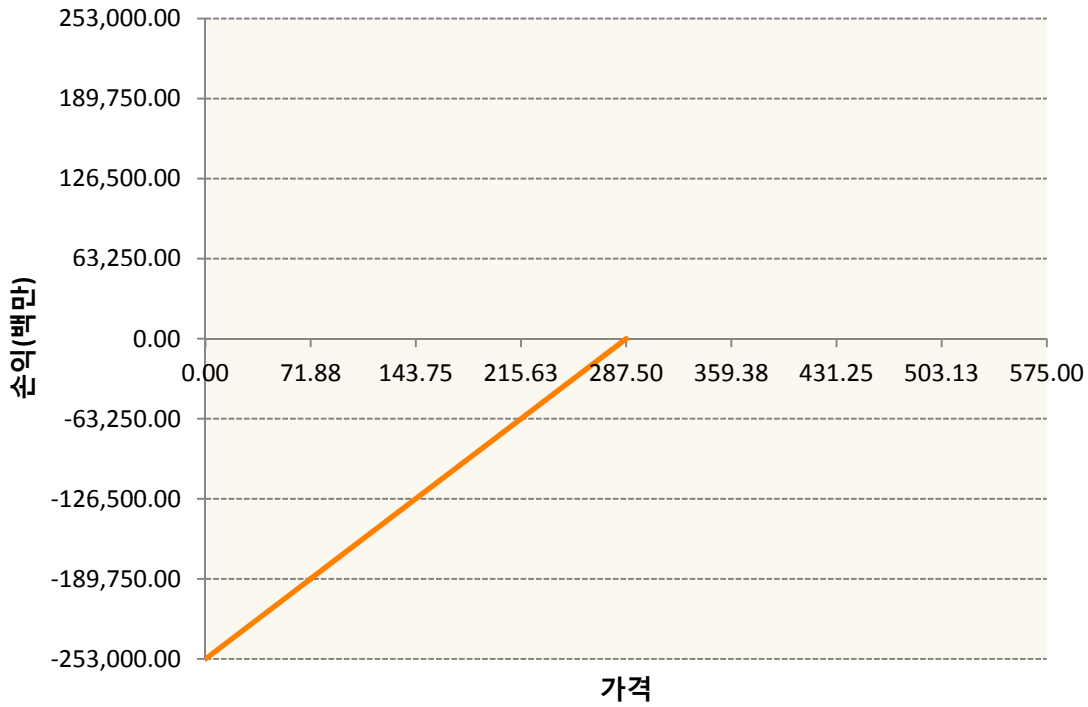


**KR4201P32902-2019-03 콜290**





KR4301P32876-2019-03 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201P32878		2019-03 콜287.5					4,295
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1
-2.67%	1	1	1	1	1	1	1
0%	1	1	0	0	-1	-2	-5
2.67%	-42	-64	-89	-118	-149	-183	-219
5.33%	-1,387	-1,419	-1,454	-1,491	-1,531	-1,572	-1,615
8.00%	-4,282	-4,282	-4,283	-4,284	-4,286	-4,290	-4,295
KR4201P32902		2019-03 콜290					9,379
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0

-5.33%	0	0	0	0	0	0	0	
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	
0%	0	0	0	0	0	-1	-3	
2.67%	-14	-30	-53	-85	-125	-173	-230	
5.33%	-1,814	-1,961	-2,110	-2,259	-2,408	-2,558	-2,708	
8.00%	-9,249	-9,256	-9,267	-9,284	-9,309	-9,340	-9,379	
KR4301P32876                      2019-03 풋287.5							19,429	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-19,429	-19,429	-19,429	-19,429	-19,429	-19,429	-19,429	
-5.33%	-12,953	-12,953	-12,953	-12,953	-12,953	-12,953	-12,953	
-2.67%	-6,476	-6,476	-6,476	-6,476	-6,476	-6,476	-6,476	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	6,474	6,471	6,465	6,456	6,445	6,430	6,412	
5.33%	10,110	10,098	10,083	10,063	10,039	10,012	9,981	
8.00%	10,124	10,124	10,124	10,124	10,124	10,124	10,124	

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

(단위:백만원)

**21,169**

공시일	2019-03-14
기준일	2019-03-13

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

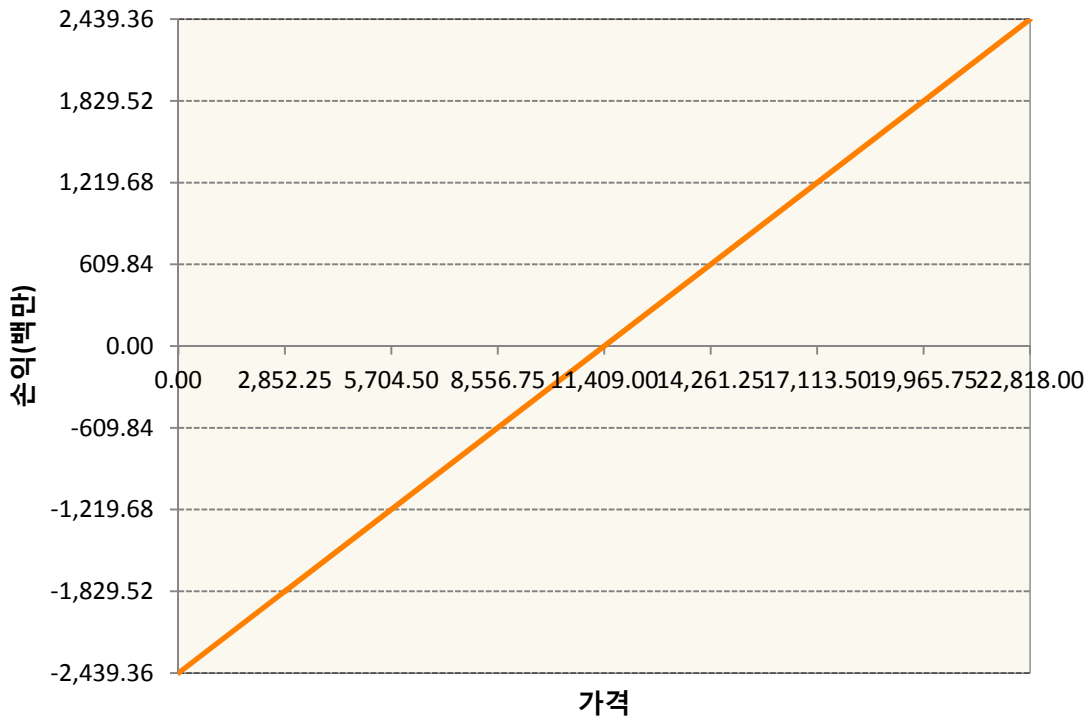
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

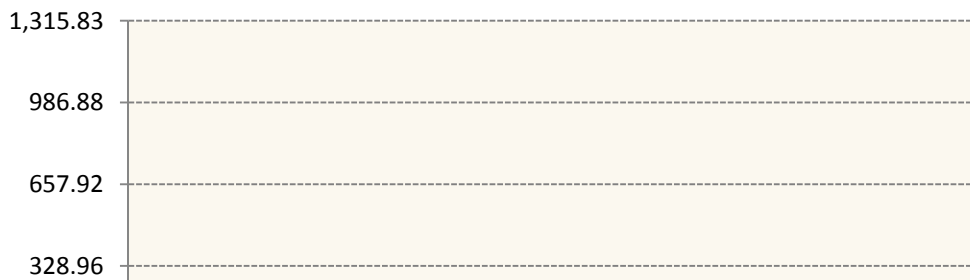
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,439	0	2,439	장내
누계	유가증권	옵션	0	6,282	-6,282	장내
누계	통화	선도	0	3,030	-3,030	장외

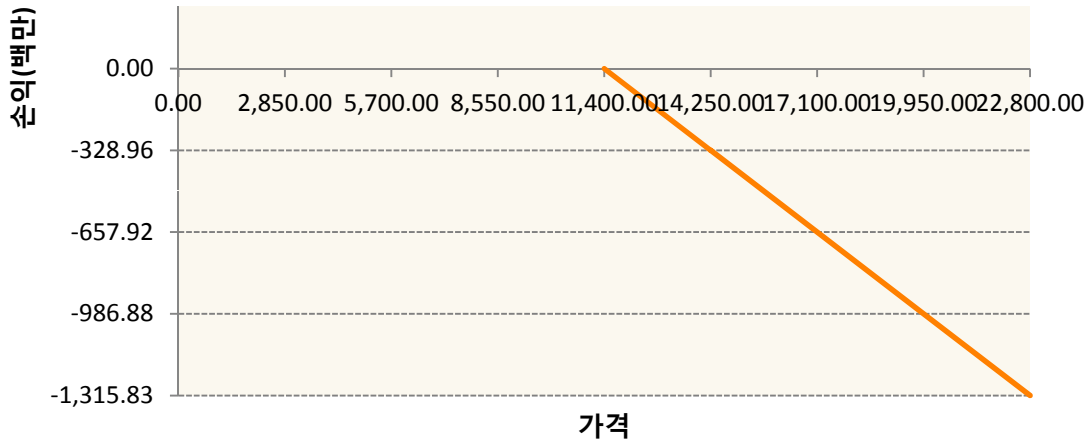
### 2. 만기시점의 손익구조

HCH9-HSCEI Futures Mar19

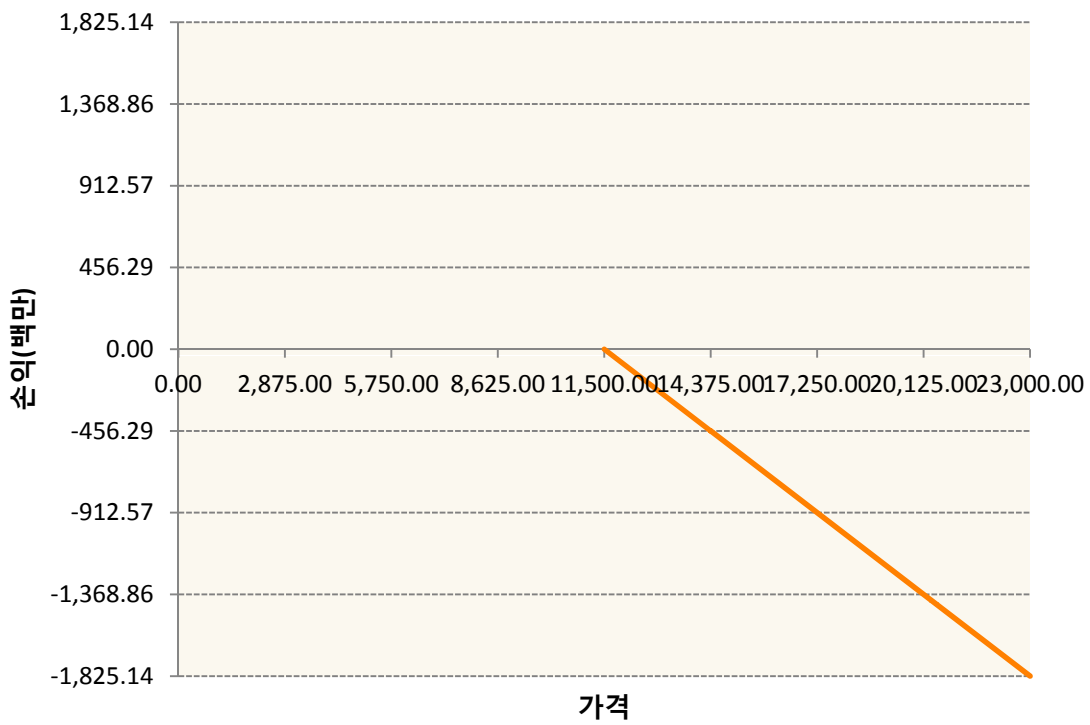


OHHIH9-C114-HSCEI

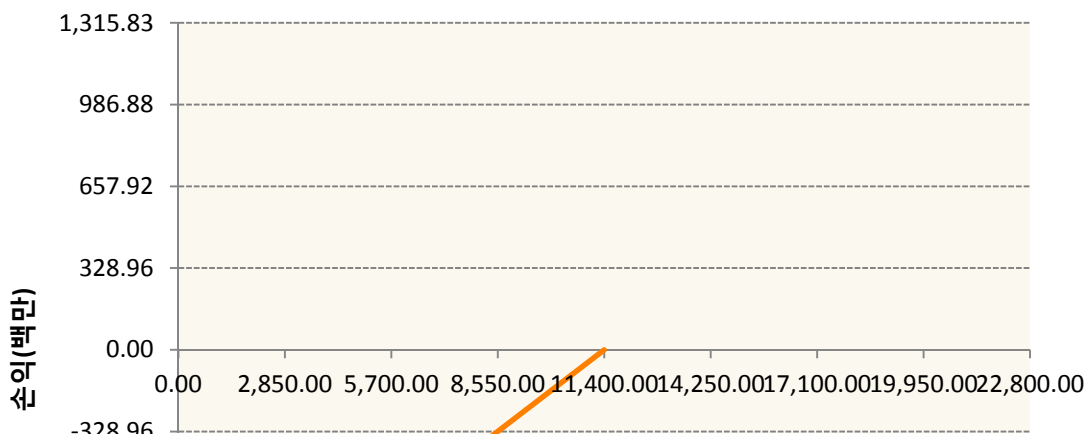


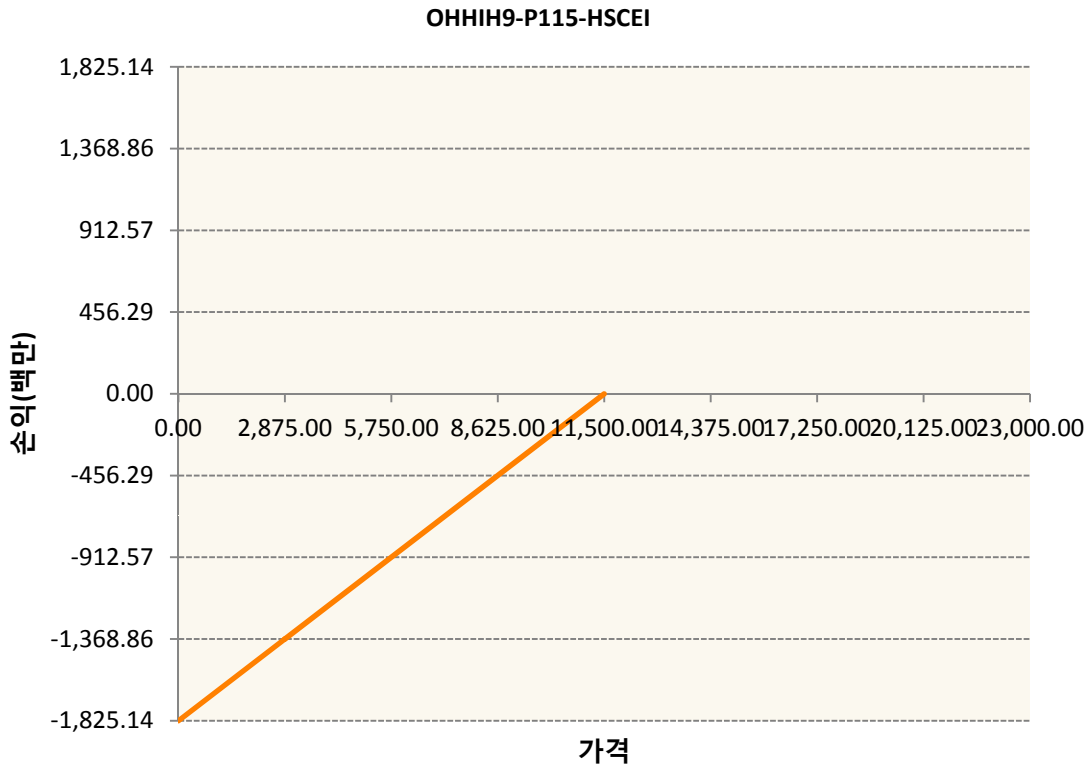


OHHIH9-C115-HSCEI



OHHIH9-P114-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	219
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	23
HCH9 HSCEI Futures Mar19	195
OHHIH9-C11 HSCEI	105
OHHIH9-C11 HSCEI	146
OHHIH9-P11 HSCEI	105
OHHIH9-P11 HSCEI	146

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	805

공시일	2019-03-14
기준일	2019-03-13

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

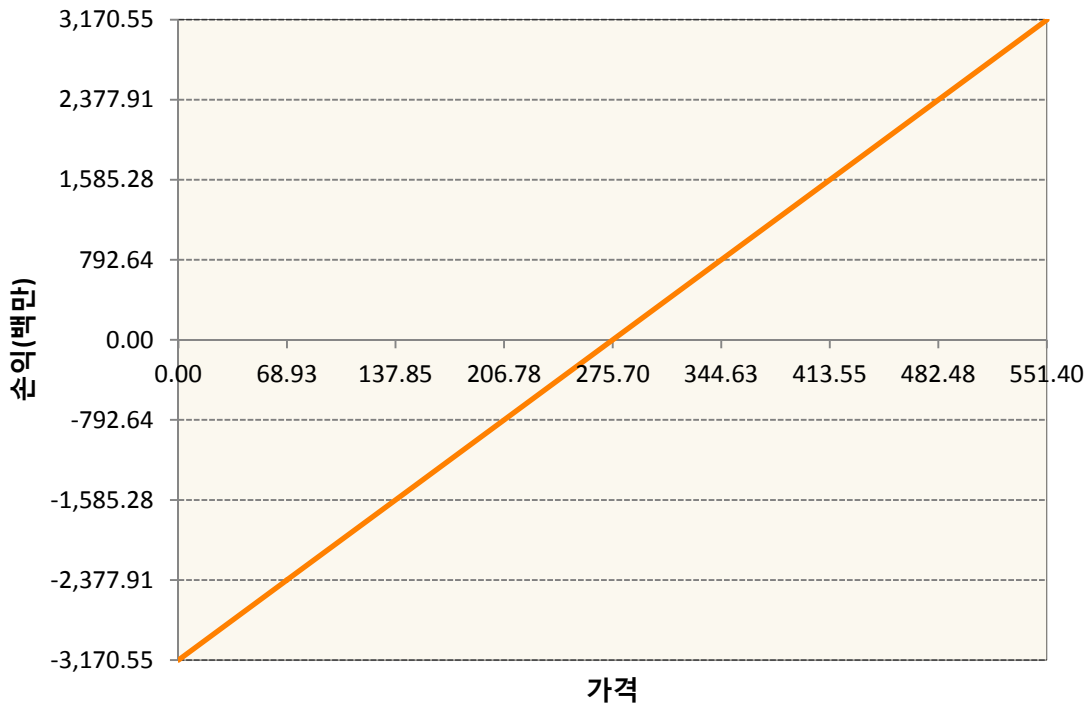
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

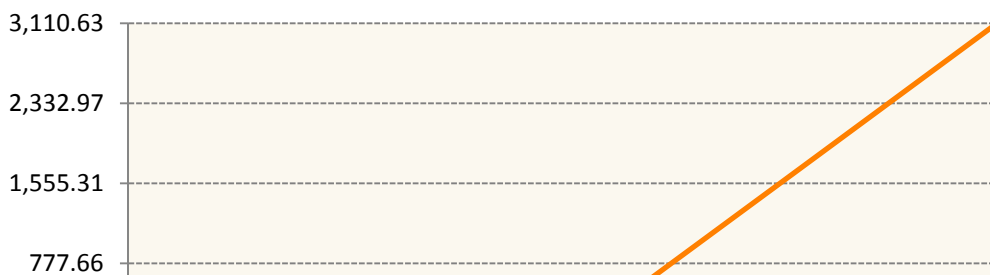
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3,103	3,095	9	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,281	0	6,281	장내
누계	유가증권	스왑	35,836	0	35,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	36,139	-36,139	장내

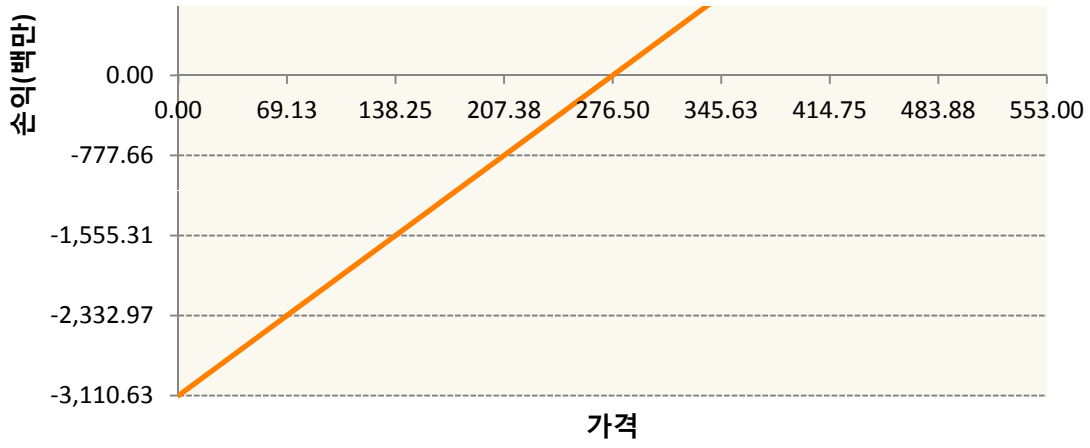
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

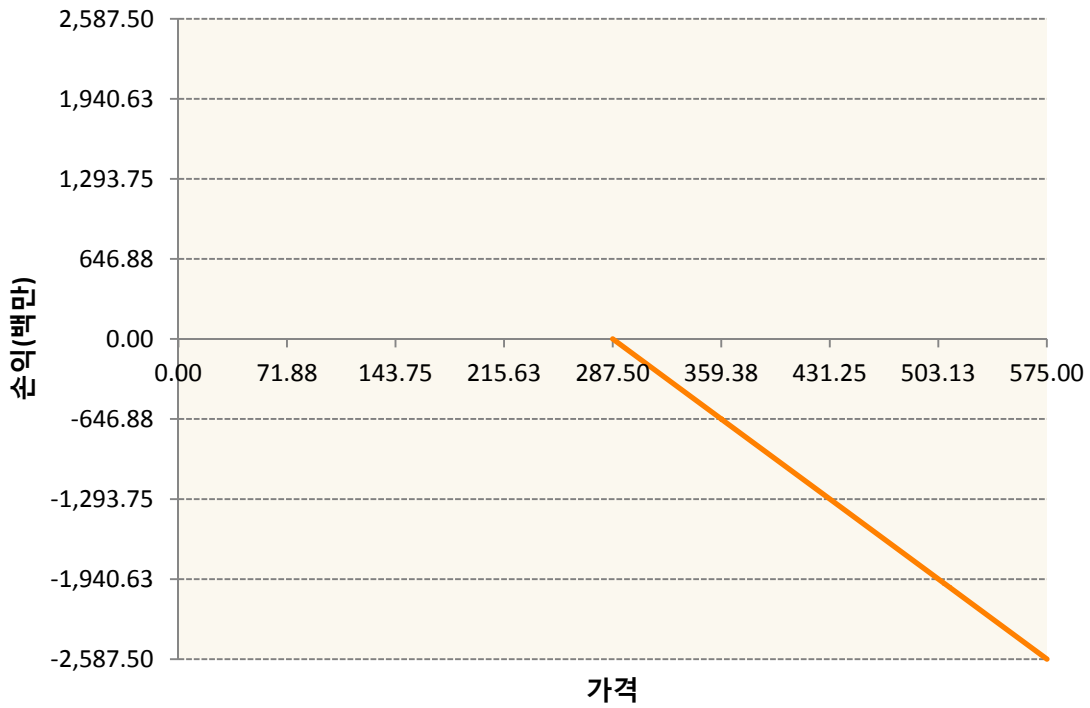


KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

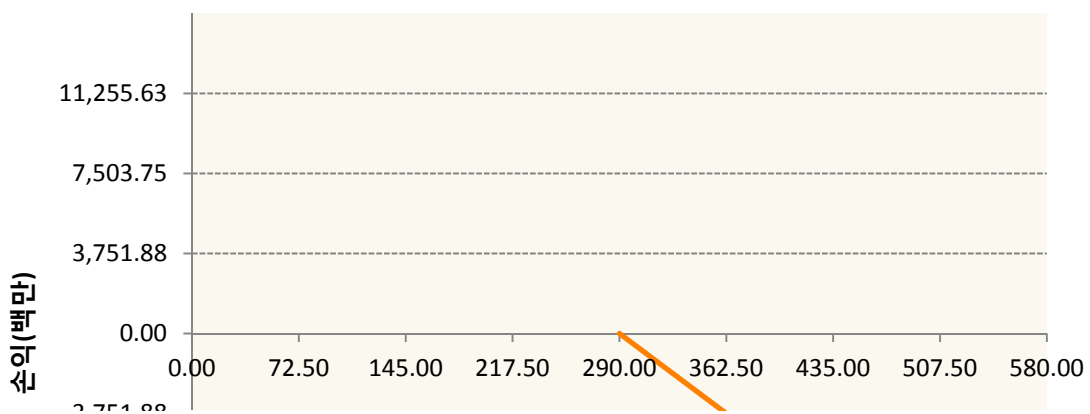


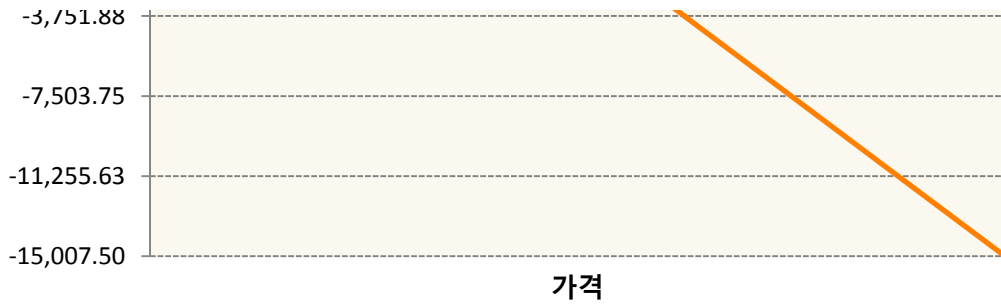


**KR4201P32878-2019-03 콜287.5**

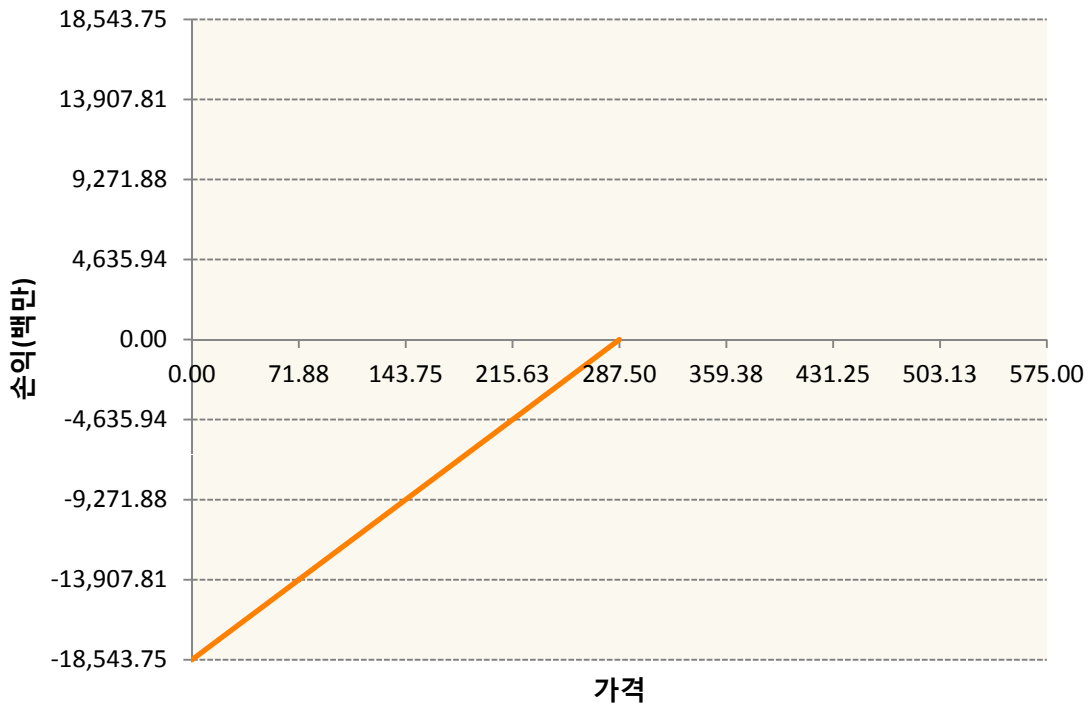


**KR4201P32902-2019-03 콜290**





KR4301P32876-2019-03 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14						2,433
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,433	-2,433	-2,433	-2,433	-2,433	-2,433	-2,433
-5.33%	-1,622	-1,622	-1,622	-1,622	-1,622	-1,622	-1,622
-2.67%	-811	-811	-811	-811	-811	-811	-811
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	811	811	811	811	811	811	811
5.33%	1,622	1,622	1,622	1,622	1,622	1,622	1,622
8.00%	2,433	2,433	2,433	2,433	2,433	2,433	2,433
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_15						591
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-591	-591	-591	-591	-591	-591	-591
-5.33%	-394	-394	-394	-394	-394	-394	-394
-2.67%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	197	197	197	197	197	197	197
5.33%	394	394	394	394	394	394	394
8.00%	591	591	591	591	591	591	591

KR4101P30007      2019-03 코스피200지수선물      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%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	85	85	85	85	85	85	85
5.33%	169	169	169	169	169	169	169
8.00%	254	254	254	254	254	254	254

KR4101P60004      2019-06 코스피200지수선물      248

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-248	-248	-248	-248	-248	-248	-248
-5.33%	-166	-166	-166	-166	-166	-166	-166
-2.67%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	83	83	83	83	83	83	83
5.33%	166	166	166	166	166	166	166
8.00%	248	248	248	248	248	248	248

KR4201P32878      2019-03 콜287.5      95

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%	-1	-1	-2	-3	-3	-4	-5
5.33%	-31	-32	-32	-33	-34	-35	-36
8.00%	-95	-95	-95	-95	-95	-95	-95

KR4201P32902      2019-03 콜290      424

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%	-1	-1	-2	-4	-6	-8	-10
5.33%	-82	-89	-95	-102	-109	-116	-122
8.00%	-418	-418	-419	-420	-421	-422	-424
KR4301P32876      2019-03 풋287.5							1,424
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,424	-1,424	-1,424	-1,424	-1,424	-1,424	-1,424
-5.33%	-949	-949	-949	-949	-949	-949	-949
-2.67%	-475	-475	-475	-475	-475	-475	-475
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	475	474	474	473	472	471	470
5.33%	741	740	739	738	736	734	732
8.00%	742	742	742	742	742	742	742

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

(단위:백만원)

**4,936**

공시일	2019-03-14
기준일	2019-03-13

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

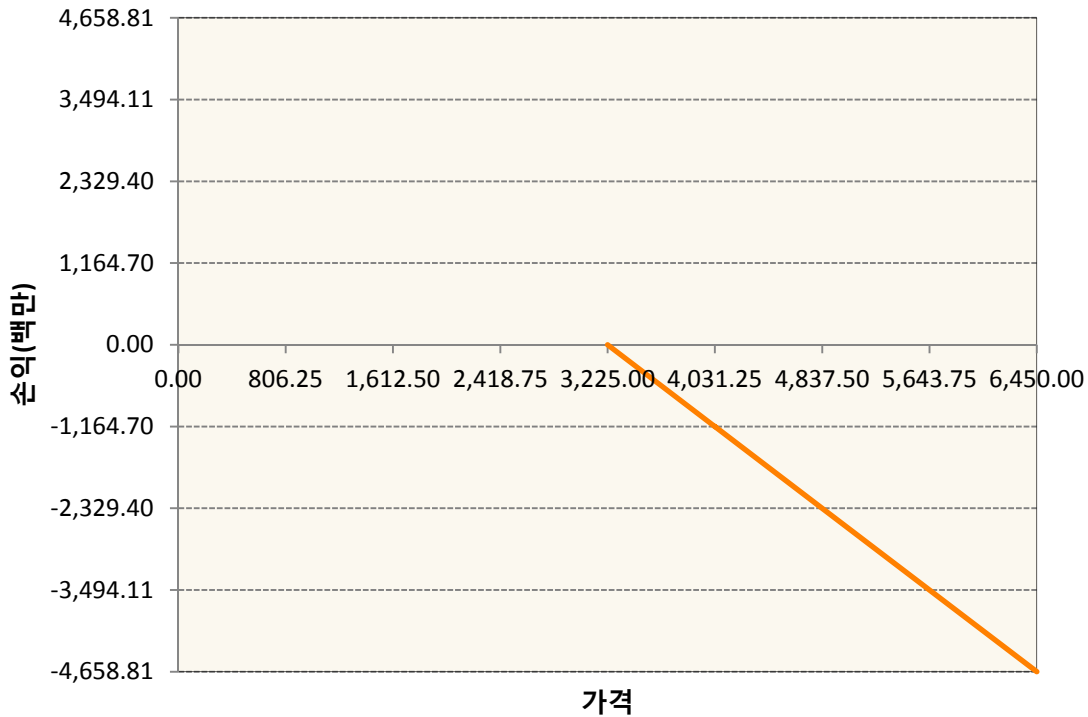
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

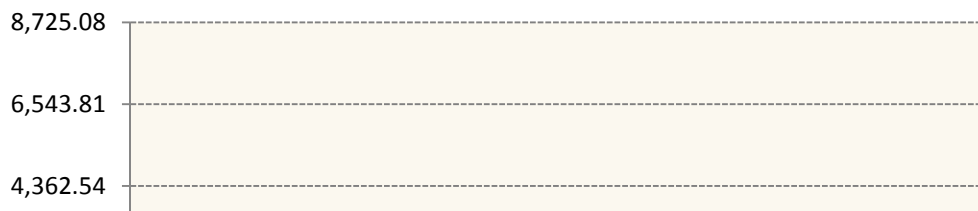
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,160	0	7,160	
누계	유가증권	스왑	60,355	0	60,355	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,768	-26,768	장내
누계	통화	선도	0	15,341	-15,341	장외

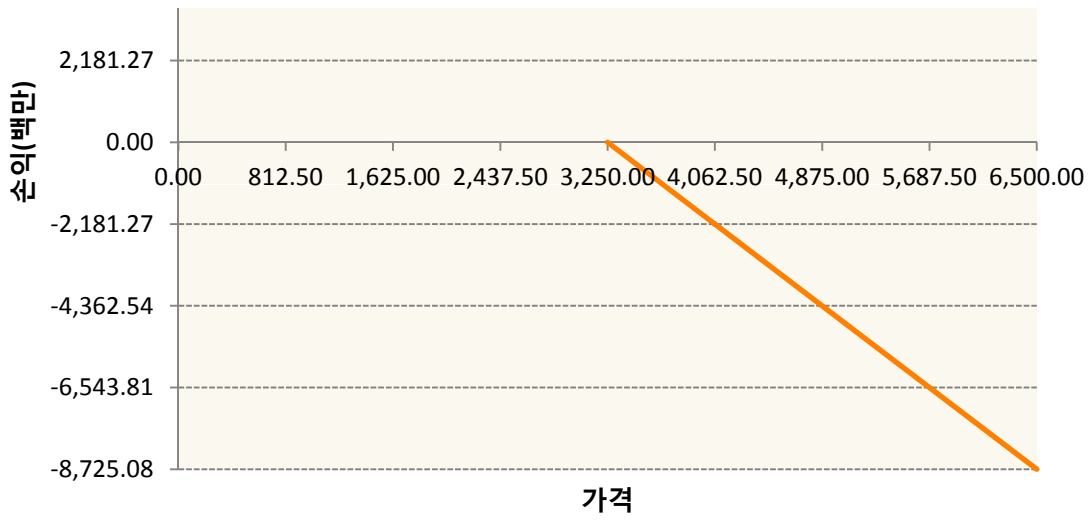
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXH9-C3225-EURO STOXX 50

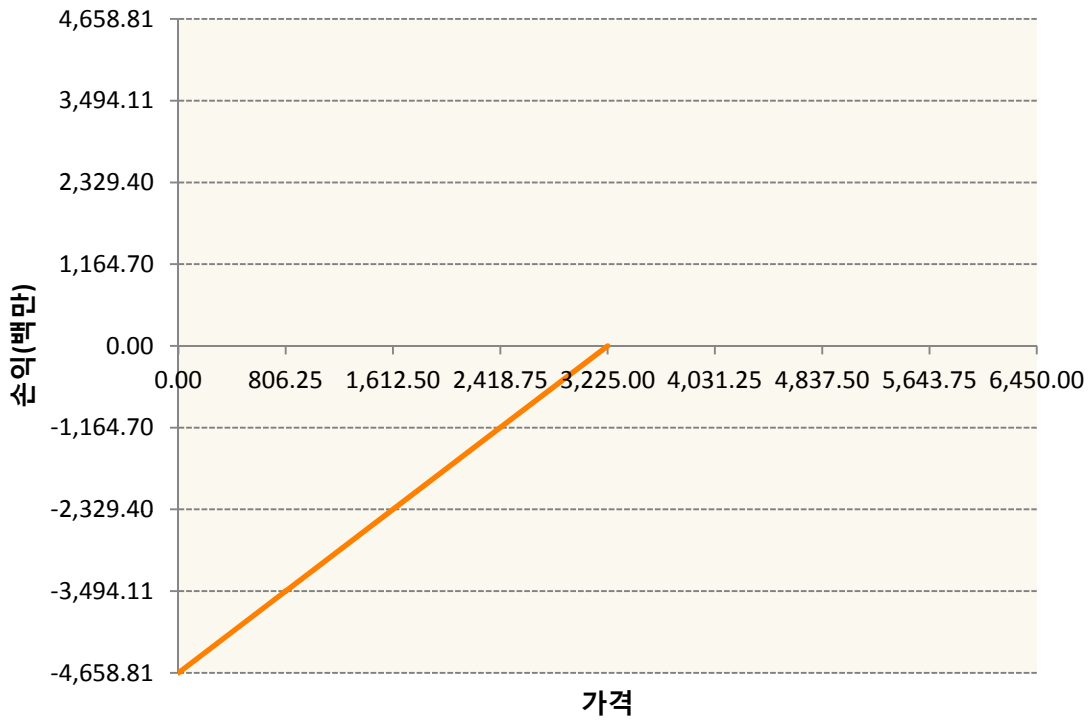


OESXH9-C3250-EURO STOXX 50

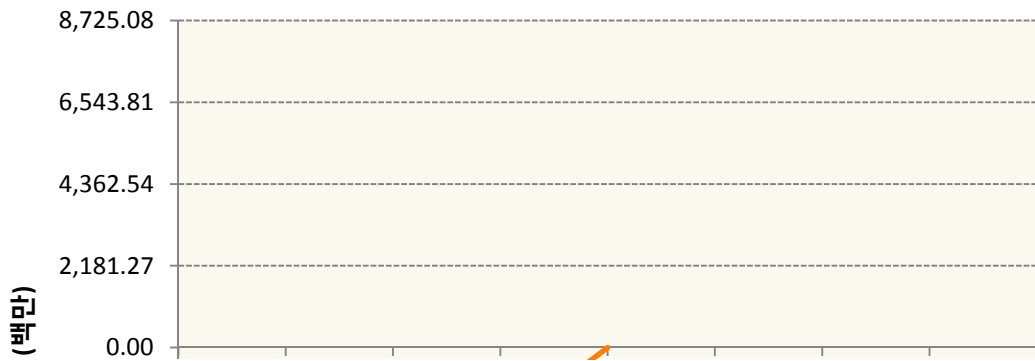


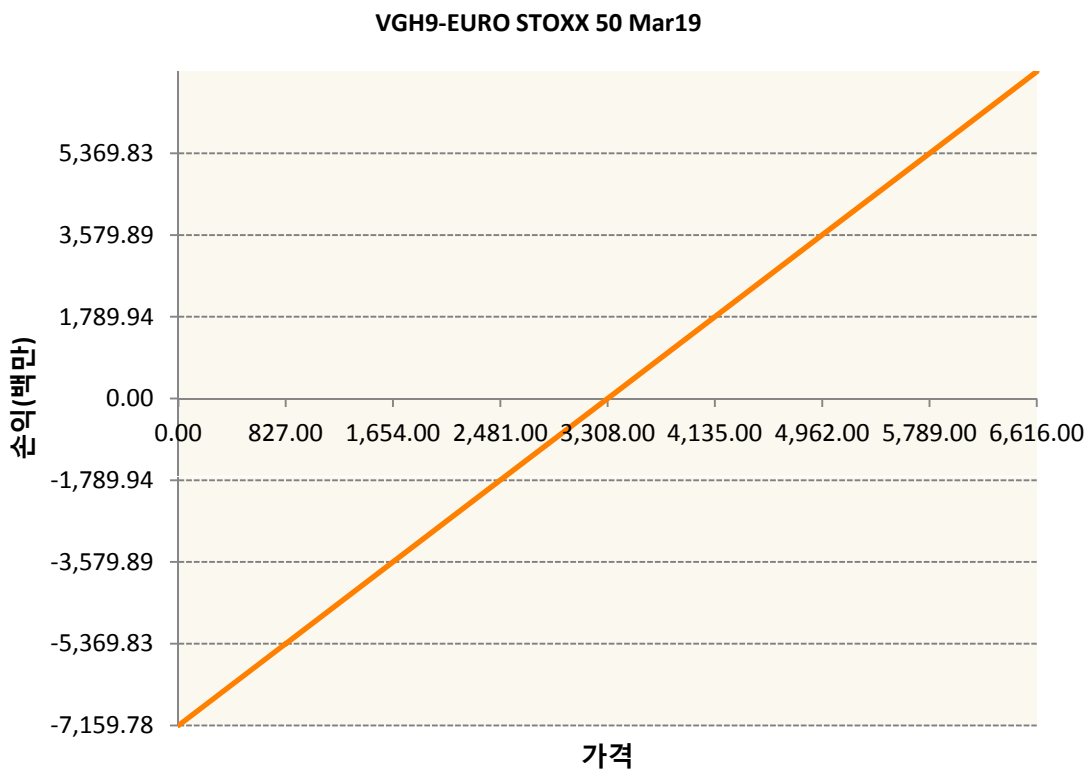
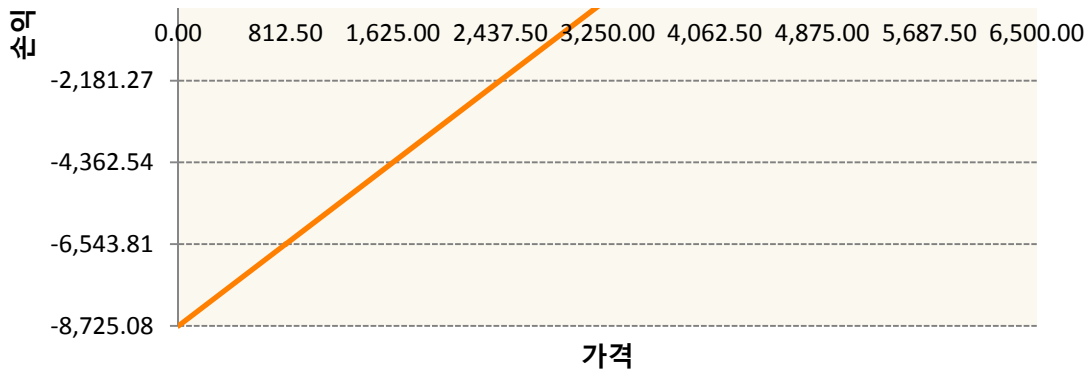


OESXH9-P3225-EURO STOXX 50



OESXH9-P3250-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		134
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E		818
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E		409
OESXH9-C32 EURO STOXX 50		373
OESXH9-C32 EURO STOXX 50		698
OESXH9-P32 EURO STOXX 50		373
OESXH9-P32 EURO STOXX 50		698
VGH9	EURO STOXX 50 Mar19	573

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

(단위:백만원)

2,682

공시일	2019-03-14
기준일	2019-03-13

## ETF스마트레버리지목표전환형8호

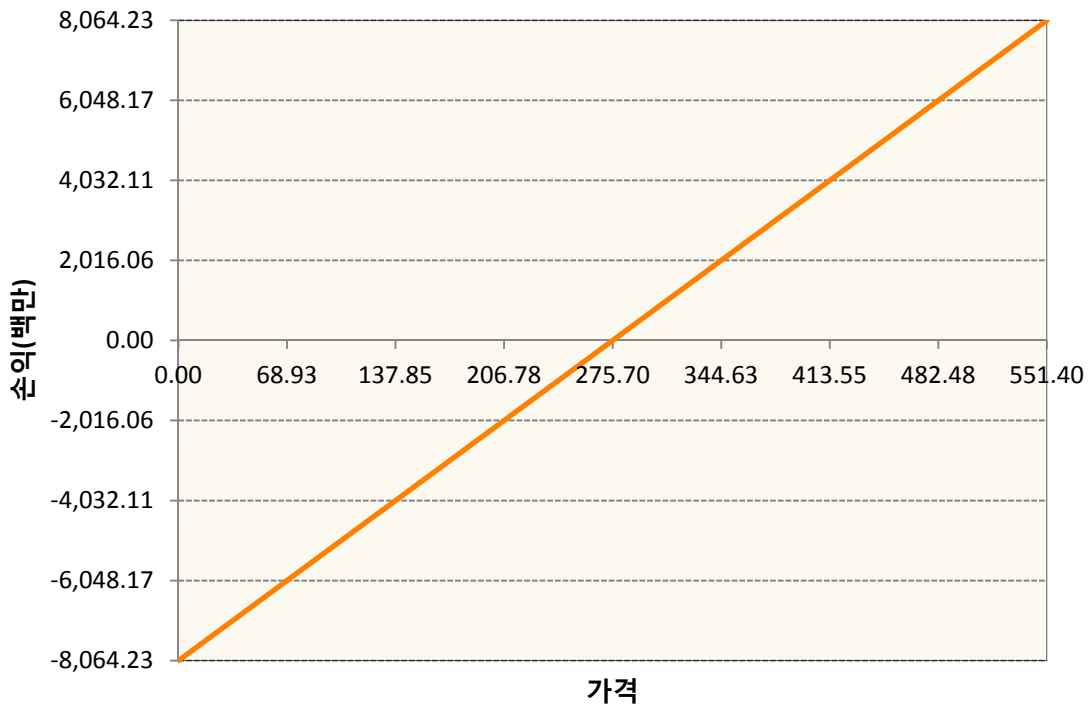
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

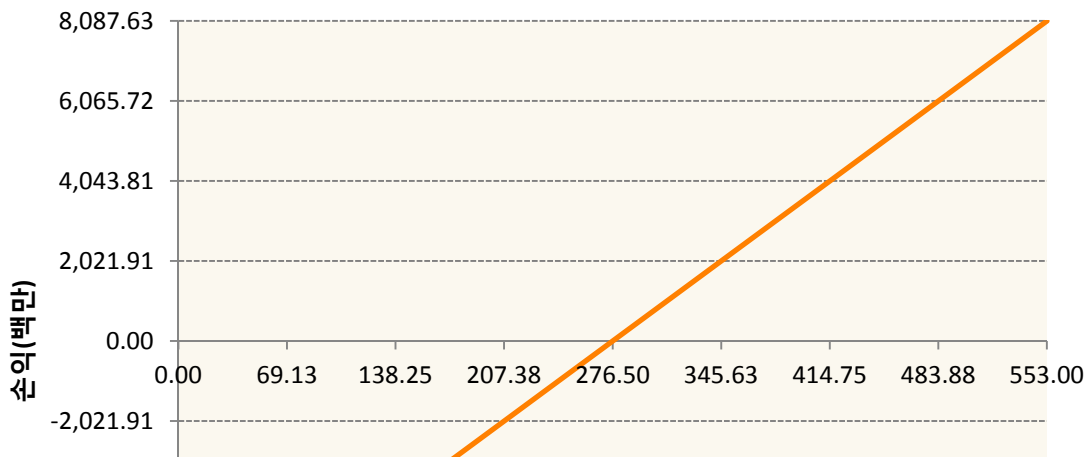
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	8,085	8,063	23	장내
누계	유가증권	선물	16,152	0	16,152	장내

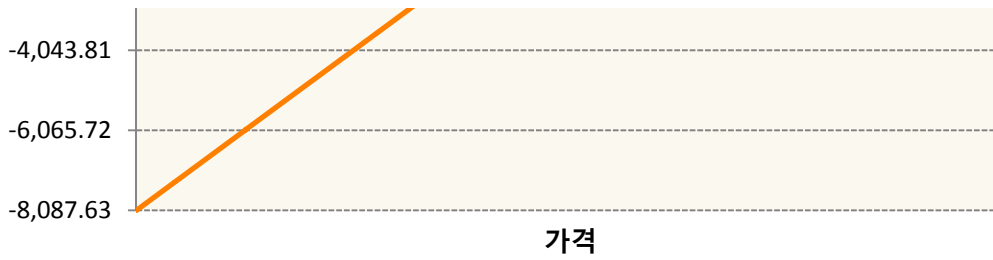
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						646
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-646	-646	-646	-646	-646	-646	-646	
-5.33%	-431	-431	-431	-431	-431	-431	-431	
-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%	431	431	431	431	431	431	431	
8.00%	646	646	646	646	646	646	646	

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						646
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-646	-646	-646	-646	-646	-646	-646	
-5.33%	-431	-431	-431	-431	-431	-431	-431	
-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%	431	431	431	431	431	431	431	
8.00%	646	646	646	646	646	646	646	

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

**1,098**

공시일	2019-03-14
기준일	2019-03-13

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

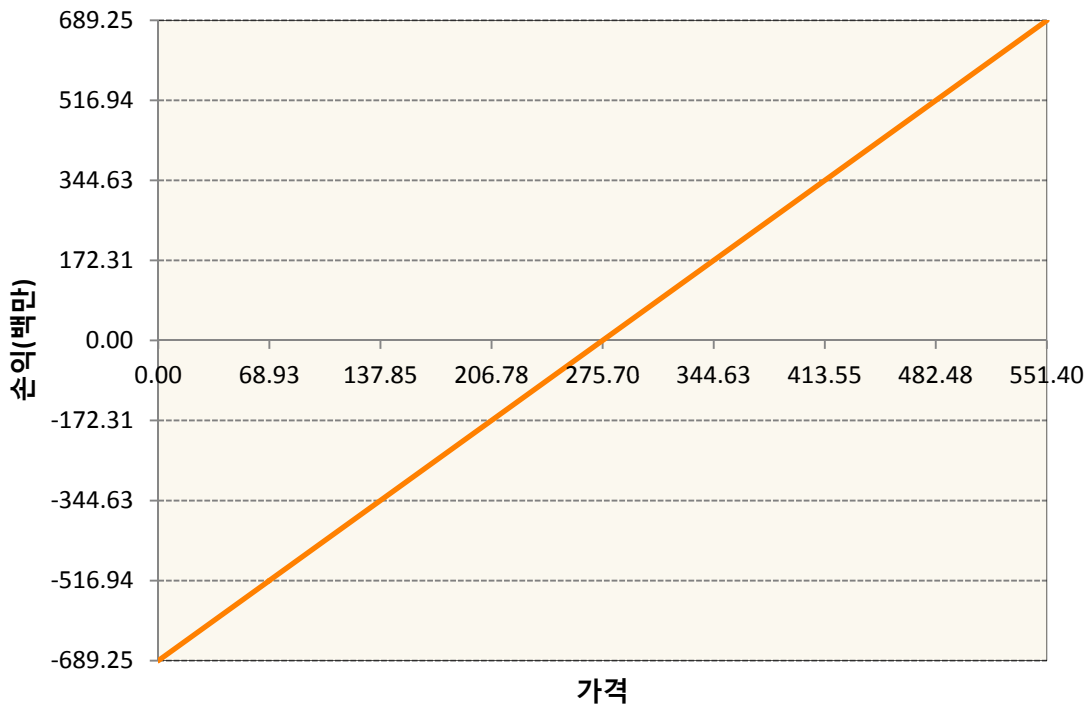
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

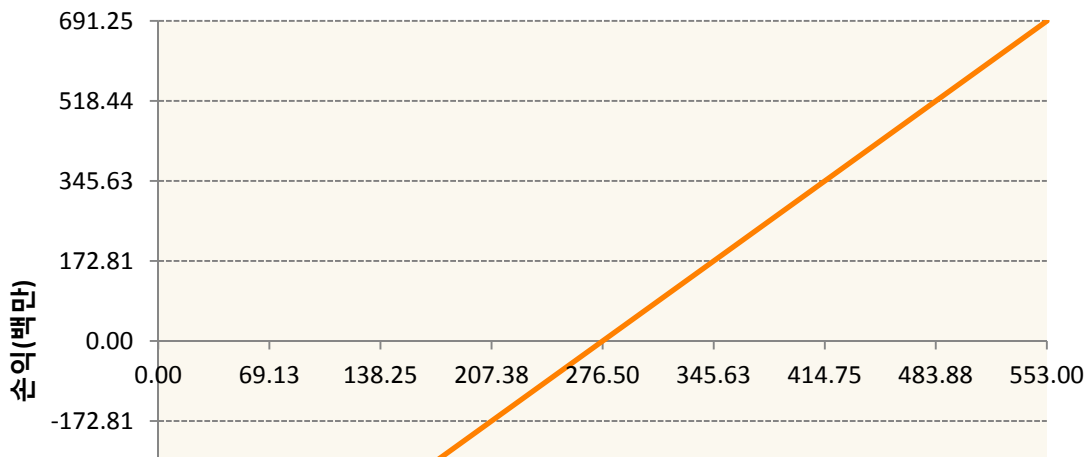
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	692	690	2	장내
누계	유가증권	선물	1,381	0	1,381	장내

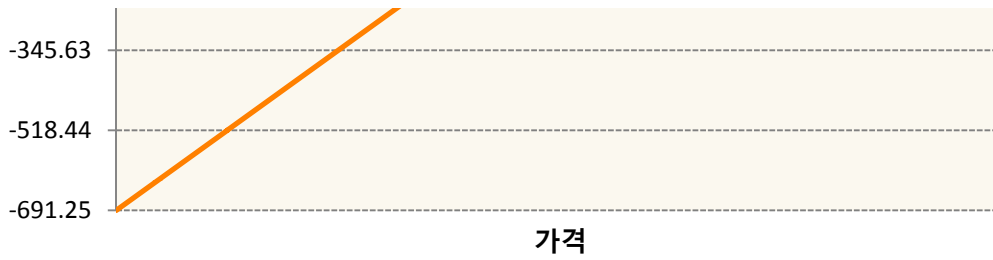
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						55
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55	
-5.33%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37	
-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%	37	37	37	37	37	37	37	
8.00%	55	55	55	55	55	55	55	
KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						55
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55	
-5.33%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37	
-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%	37	37	37	37	37	37	37	
8.00%	55	55	55	55	55	55	55	

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

94

공시일	2019-03-14
기준일	2019-03-13

## ETF스마트레버리지목표전환형10호

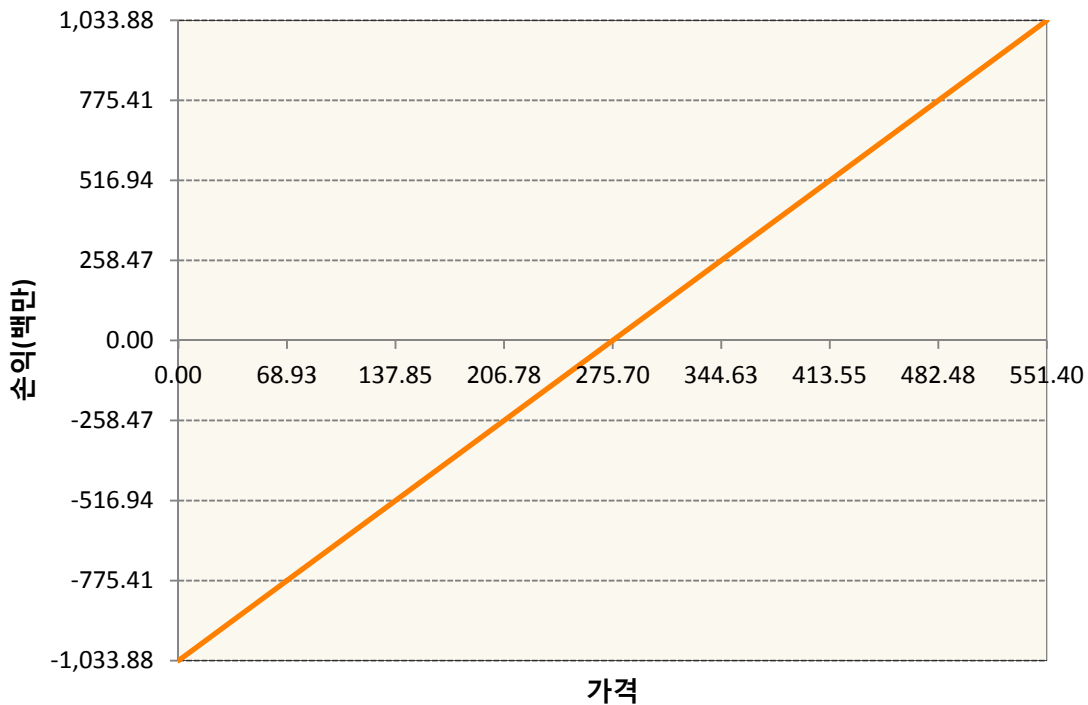
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

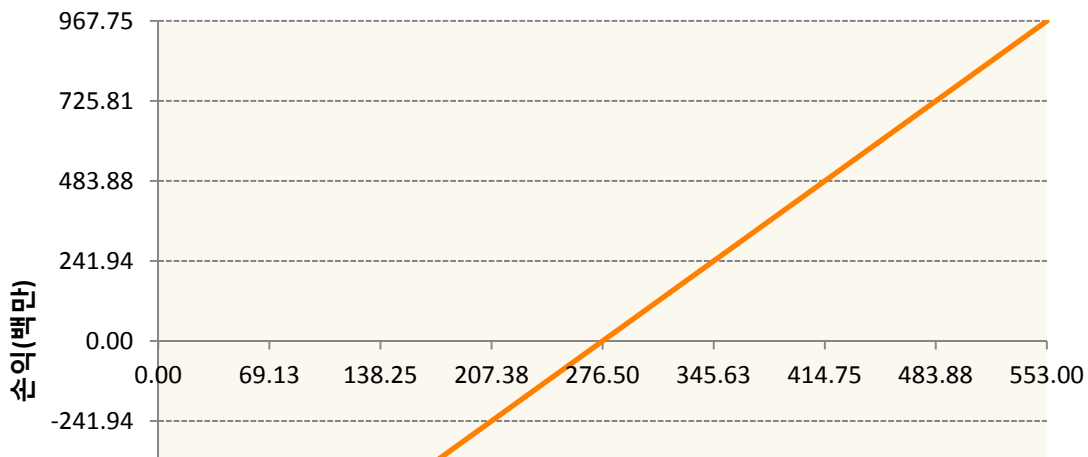
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	967	964	3	장내
누계	유가증권	선물	2,002	0	2,002	장내

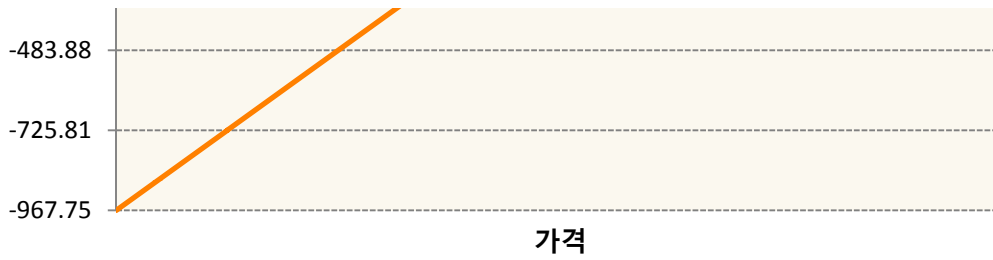
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						83
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83	
-5.33%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55	
-2.67%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	28	28	28	28	28	28	28	
5.33%	55	55	55	55	55	55	55	
8.00%	83	83	83	83	83	83	83	
KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						77
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77	
-5.33%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52	
-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%	52	52	52	52	52	52	52	
8.00%	77	77	77	77	77	77	77	

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

**136**

공시일	2019-03-14
기준일	2019-03-13

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

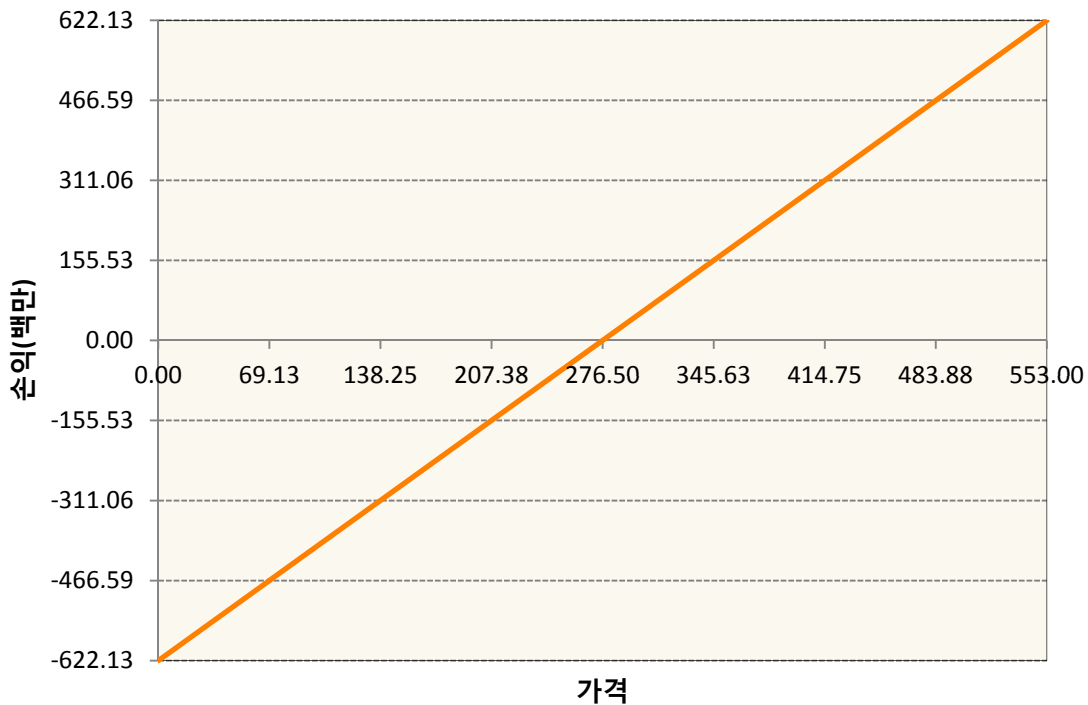
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	622	0	622	장내
누계	유가증권	선물	622	0	622	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 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)

42

공시일	2019-03-14
기준일	2019-03-13

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

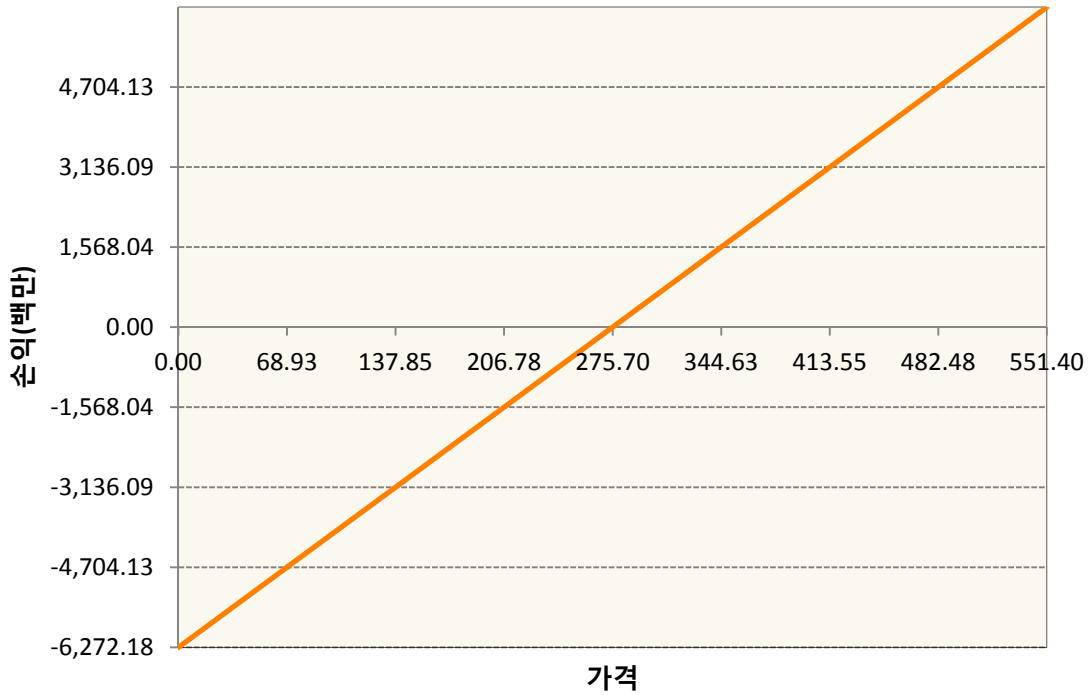
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

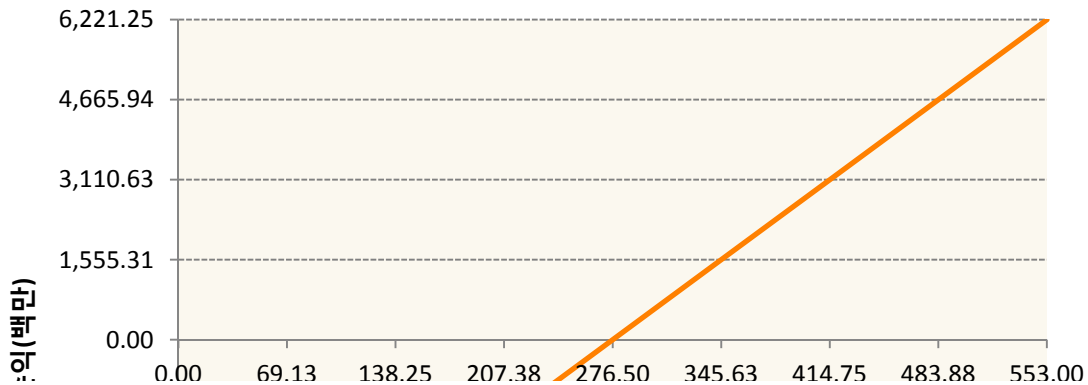
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	6,210	6,193	17	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,493	0	12,493	장내
누계	유가증권	옵션	2,165	24,931	-22,766	장내

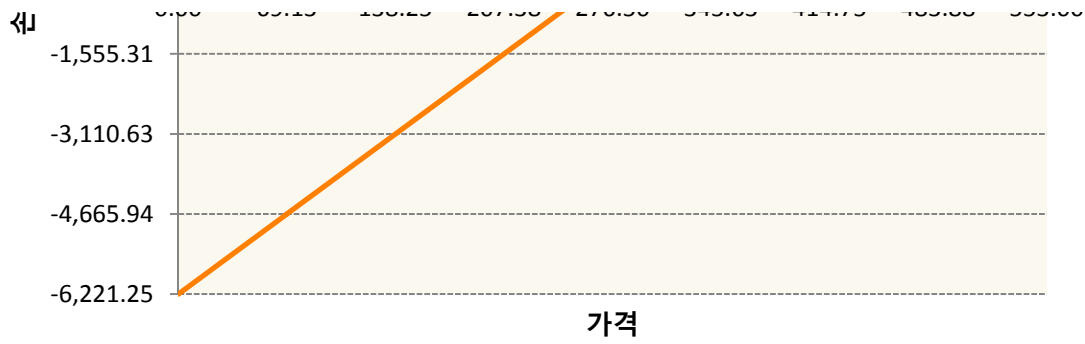
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

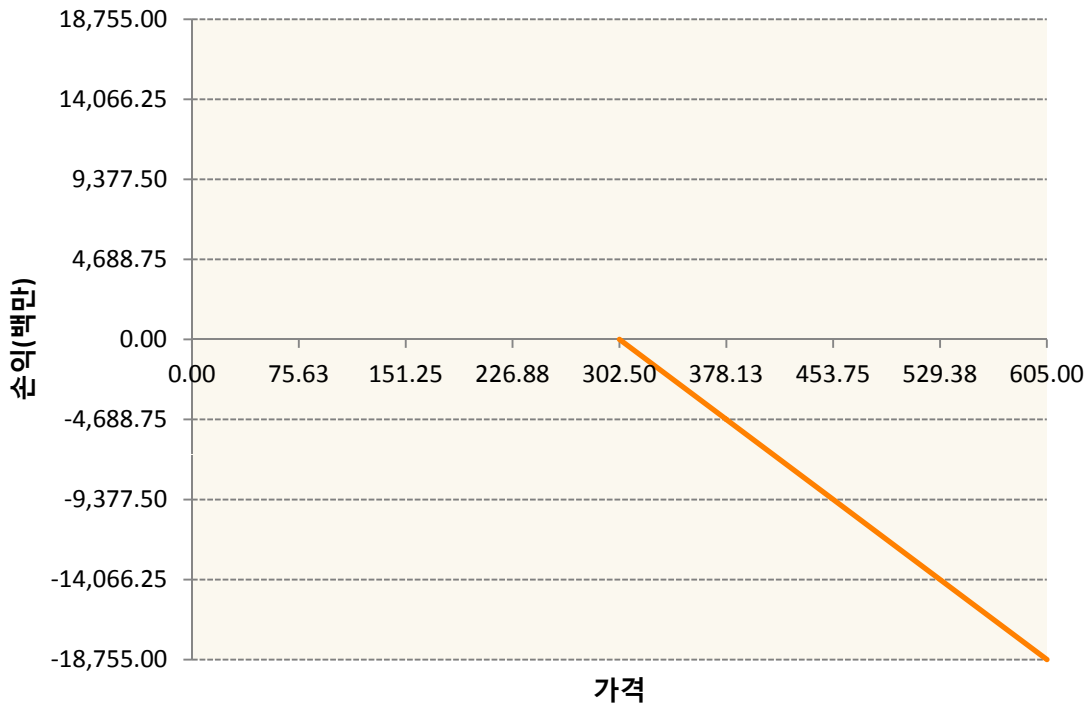


KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

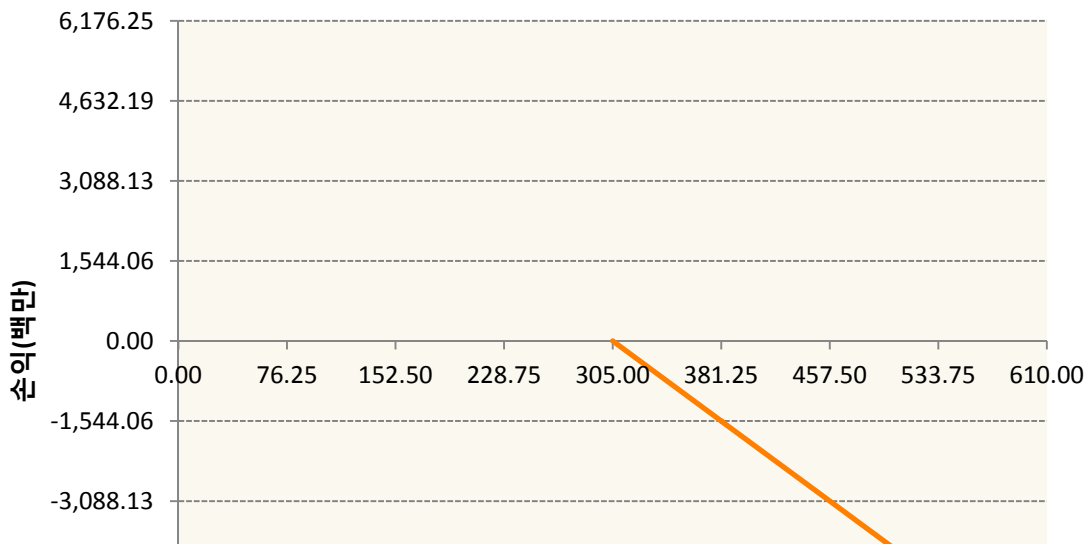


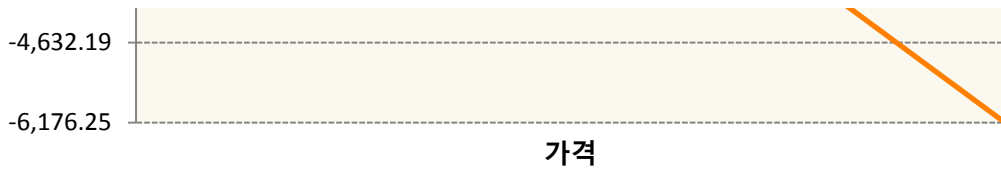


KR4201P33025-2019-03 콜302.5

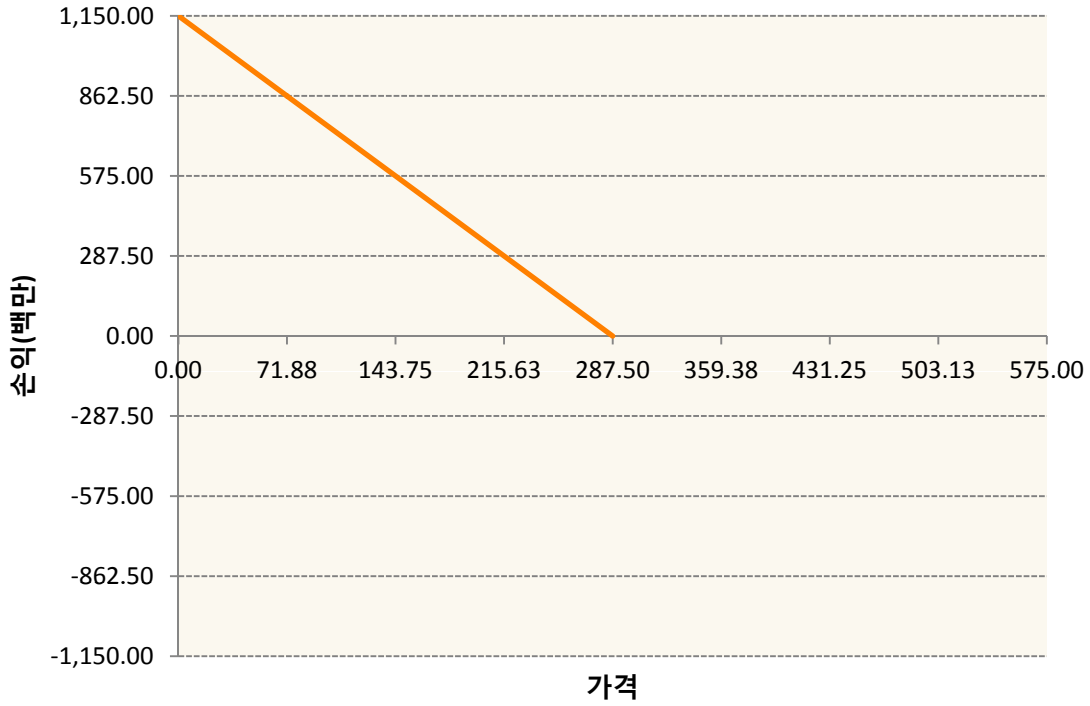


KR4201P33058-2019-03 콜305

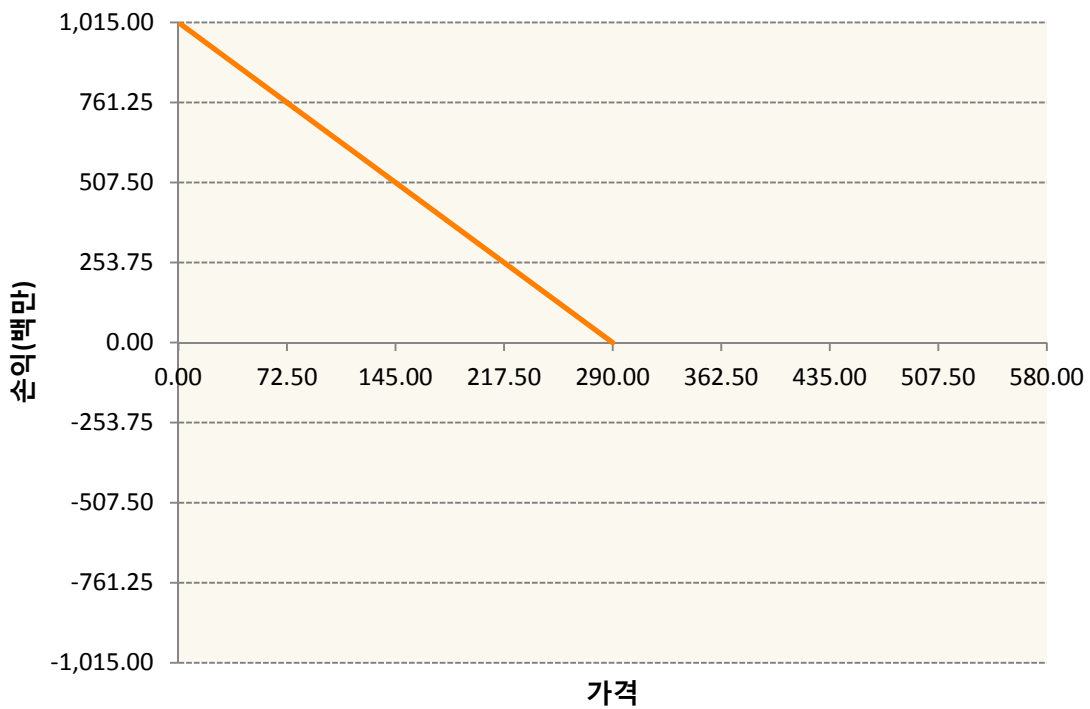




**KR4301P32876-2019-03 풋287.5**



**KR4301P32900-2019-03 풋290**



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101P30007 2019-03 코스피200지수선물							502
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-502	-502	-502	-502	-502	-502	-502
-5.33%	-335	-335	-335	-335	-335	-335	-335
-2.67%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	167	167	167	167	167	167	167
5.33%	335	335	335	335	335	335	335
8.00%	502	502	502	502	502	502	502
KR4101P60004 2019-06 코스피200지수선물							497
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-497	-497	-497	-497	-497	-497	-497
-5.33%	-331	-331	-331	-331	-331	-331	-331
-2.67%	-166	-166	-166	-166	-166	-166	-166
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	166	166	166	166	166	166	166
5.33%	331	331	331	331	331	331	331
8.00%	497	497	497	497	497	497	497
KR4201P33025 2019-03 콜302.5							35
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%	0	0	0	0	0	-1	-1
8.00%	-7	-10	-14	-18	-23	-29	-35
KR4201P33058 2019-03 콜305							4
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%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	-1	-1	-2	-2	-3	-4

KR4301P32876

2019-03 풋287.5

88

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	88	88	88	88	88	88	88
-5.33%	59	59	59	59	59	59	59
-2.67%	29	29	29	29	29	29	29
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
5.33%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-45
8.00%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46

KR4301P32900

2019-03 풋290

77

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	77	77	77	77	77	77	77
-5.33%	52	52	52	52	52	52	52
-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%	-48	-48	-47	-47	-47	-47	-46
8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49

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

(단위:백만원)

1,014

공시일	2019-03-14
기준일	2019-03-13

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	198	0	198	
누계	유가증권	수익증권	1,897	0	1,897	

### 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	2019-03-14
기준일	2019-03-13

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	566	0	566	
누계	유가증권	수익증권	8,053	0	8,053	

### 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	2019-03-14
기준일	2019-03-13

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,492	0	2,492	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	43,758	0	43,758	
누계	통화	선도	0	45,083	-45,083	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019F02: KRW/USD 28-03-19E	471
FX21019F02: KRW/USD 29-03-19E	24
FX21019F02: KRW/USD 29-03-19E	72
FX21019G00 KRW/USD 29-03-19E	27
FX21019G00 KRW/USD 29-03-19E	14
FX21019G00 KRW/USD 19-03-19E	50
FX21019G00 KRW/USD 19-03-19E	27
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E	54
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E	106
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E	106
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E	43
FX21019G01 KRW/USD 21-03-19E	426
FX21019G01 KRW/USD 21-03-19E	272
FX21019G02 KRW/USD 25-03-19E	137
FX21019G02 KRW/USD 25-03-19E	480
FX21019G03 KRW/USD 28-03-19E	254
FX21019G03 KRW/USD 28-03-19E	118
FX21019G03 KRW/USD 29-03-19E	335
FX21019G04 KRW/USD 10-04-19E	72
FX21019H00 KRW/USD 08-04-19E	36
FX21019H00 KRW/USD 10-04-19E	36
FX21019H01 KRW/USD 10-04-19E	100
FX21019H01 KRW/USD 10-04-19E	91
FX21019H01 KRW/USD 10-04-19E	109
FX21019H01 KRW/USD 19-04-19E	145

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

(단위:백만원)

1,264

공시일	2019-03-14
기준일	2019-03-13

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

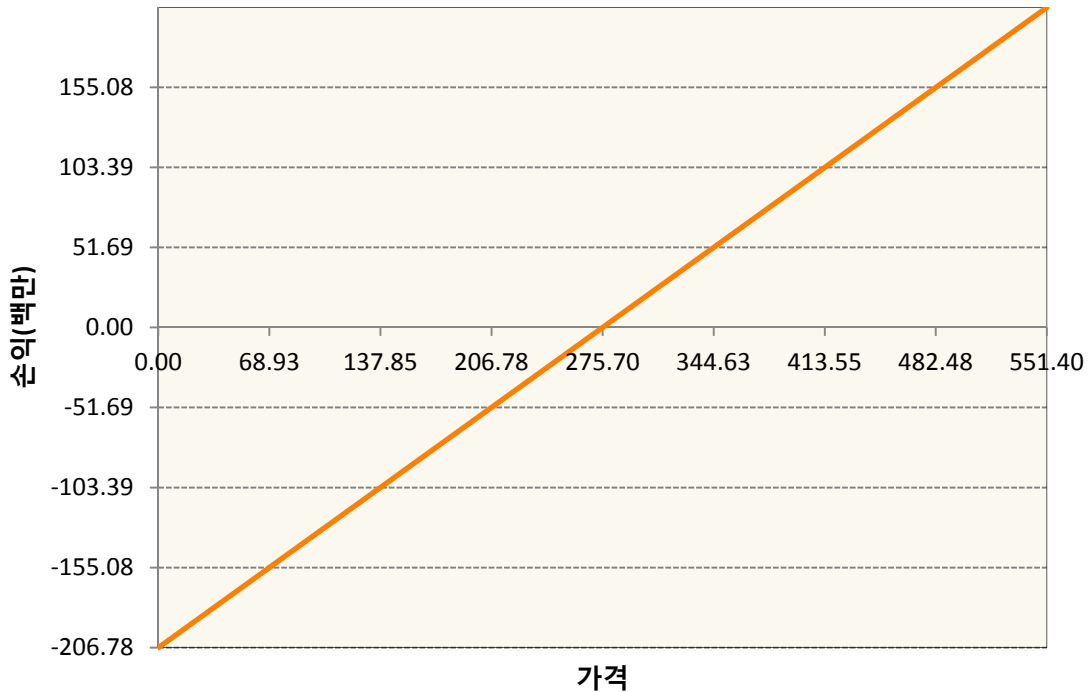
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

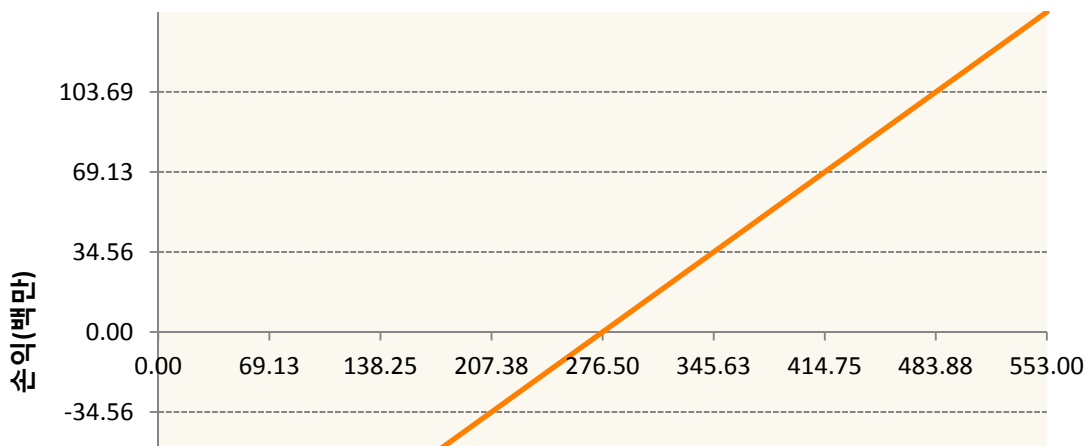
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,692	138	1,554	장내
누계	유가증권	선물	1,897	0	1,897	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물





-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	11	11	11	11	11	11	11
KR4111P40005                      2019-04 삼성전자개별선물							125
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	42	42	42	42	42	42	42
5.33%	83	83	83	83	83	83	83
8.00%	125	125	125	125	125	125	125

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

(단위:백만원)

**166**

공시일	2019-03-14
기준일	2019-03-13

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

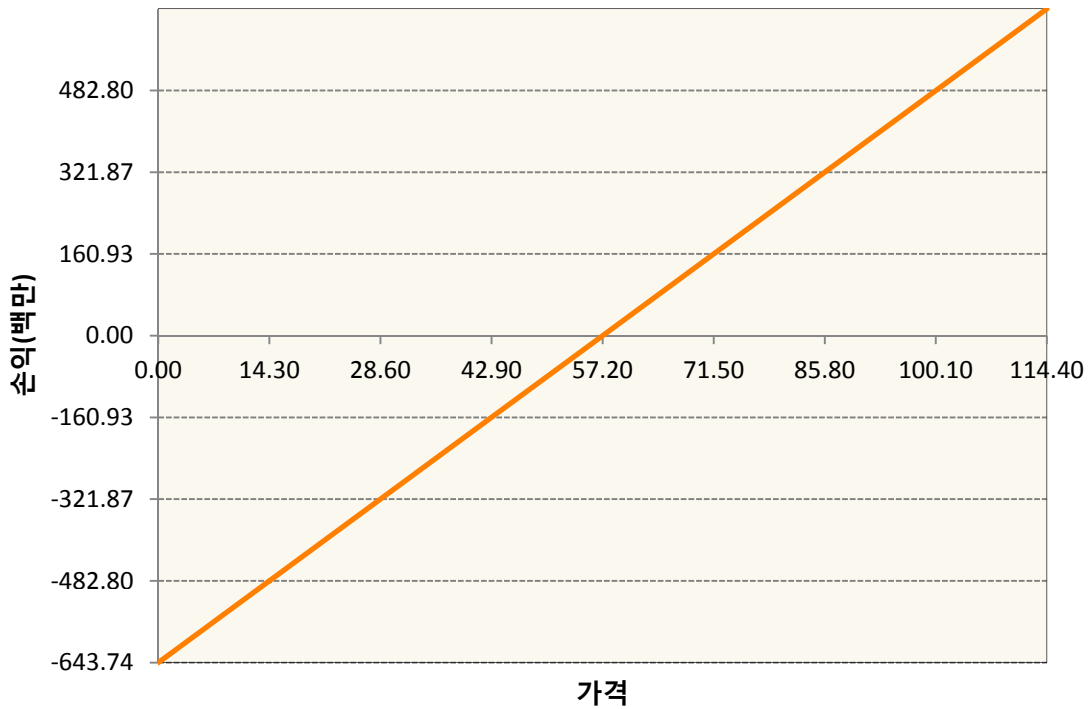
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

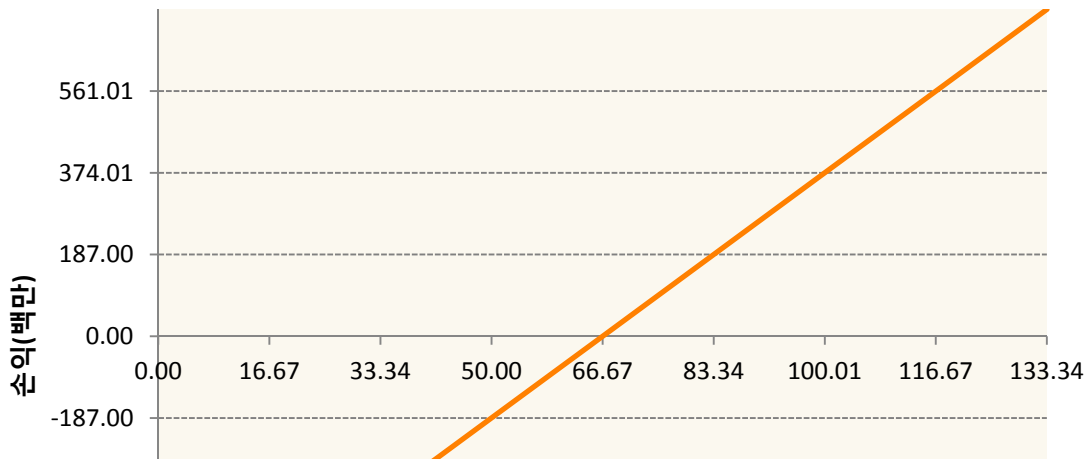
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,834	283	2,551	

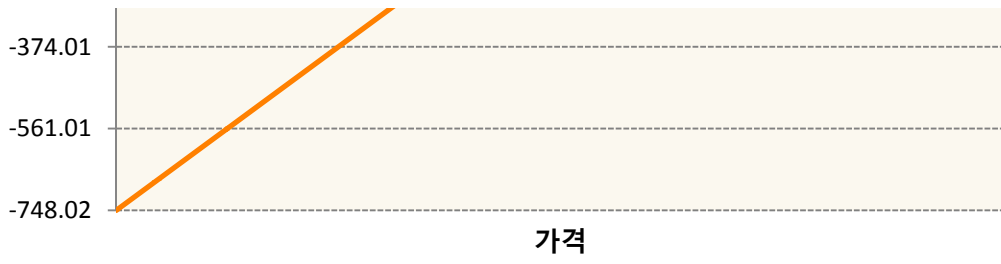
### 2. 만기시점의 손익구조

CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19

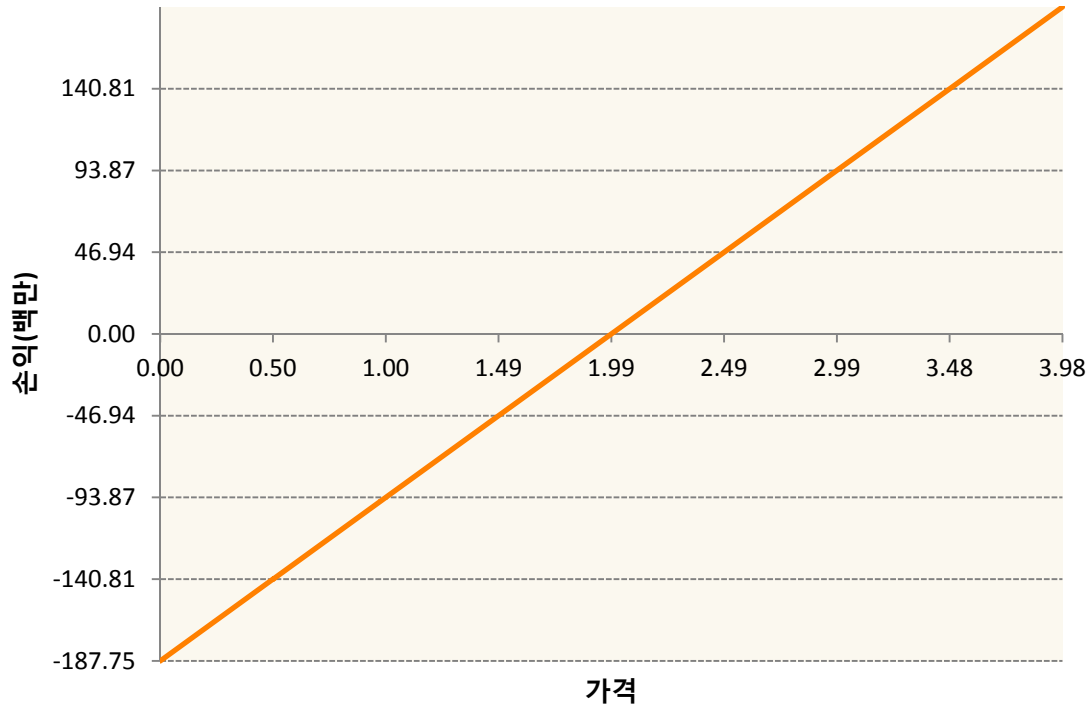


COK9-BRENT CRUDE FUTR May19

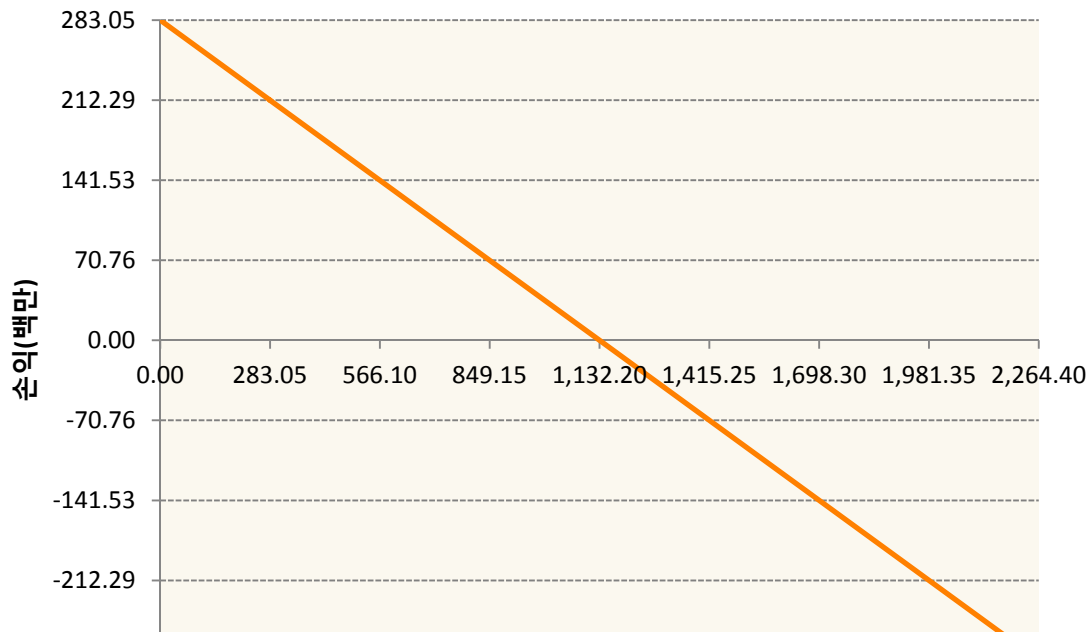


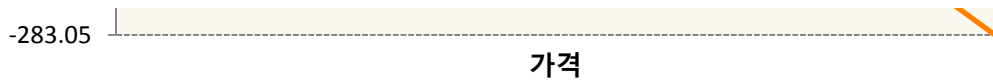


HOK9-NY Harb ULSD Fut May19

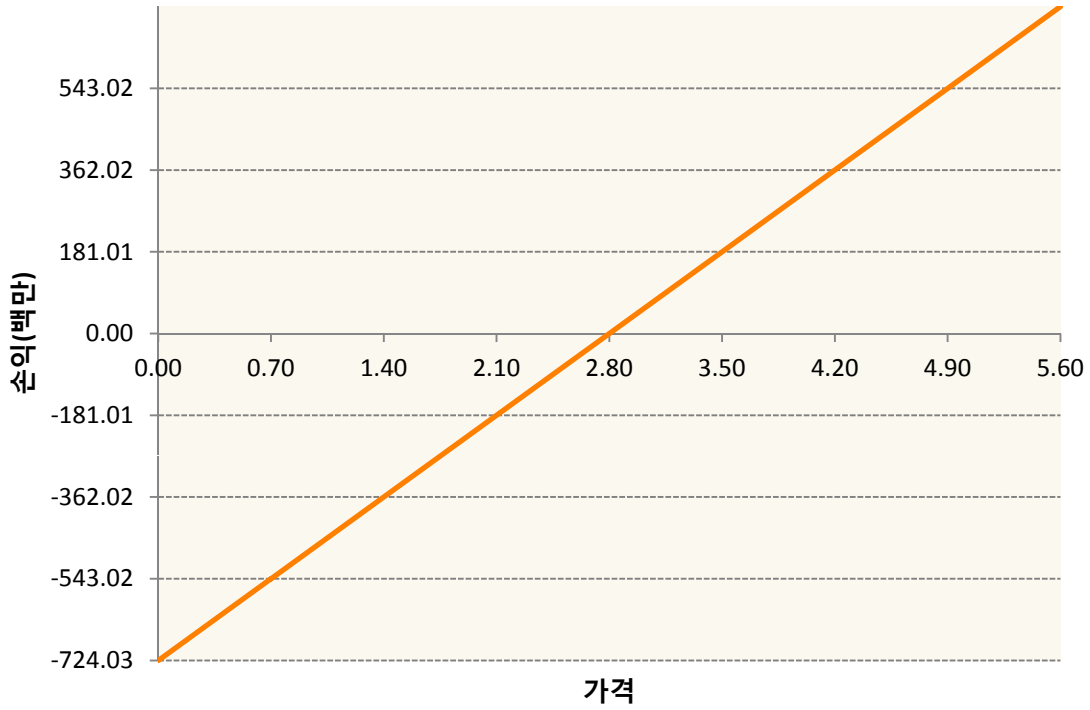


KR4175P30001-2019-03 달러선물

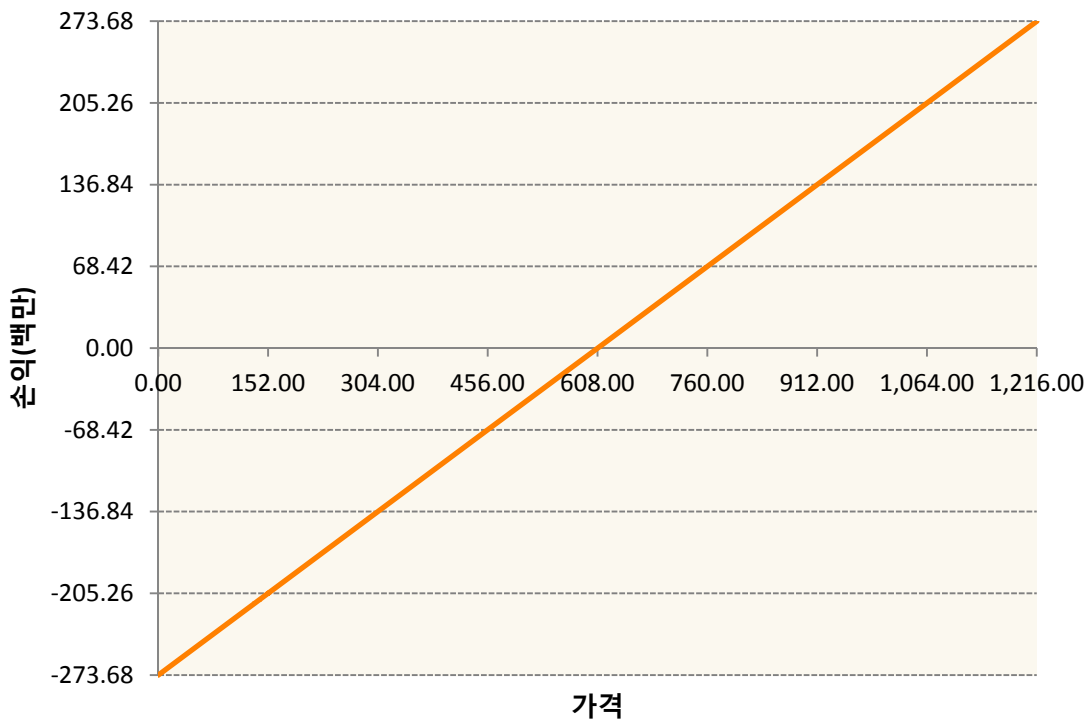




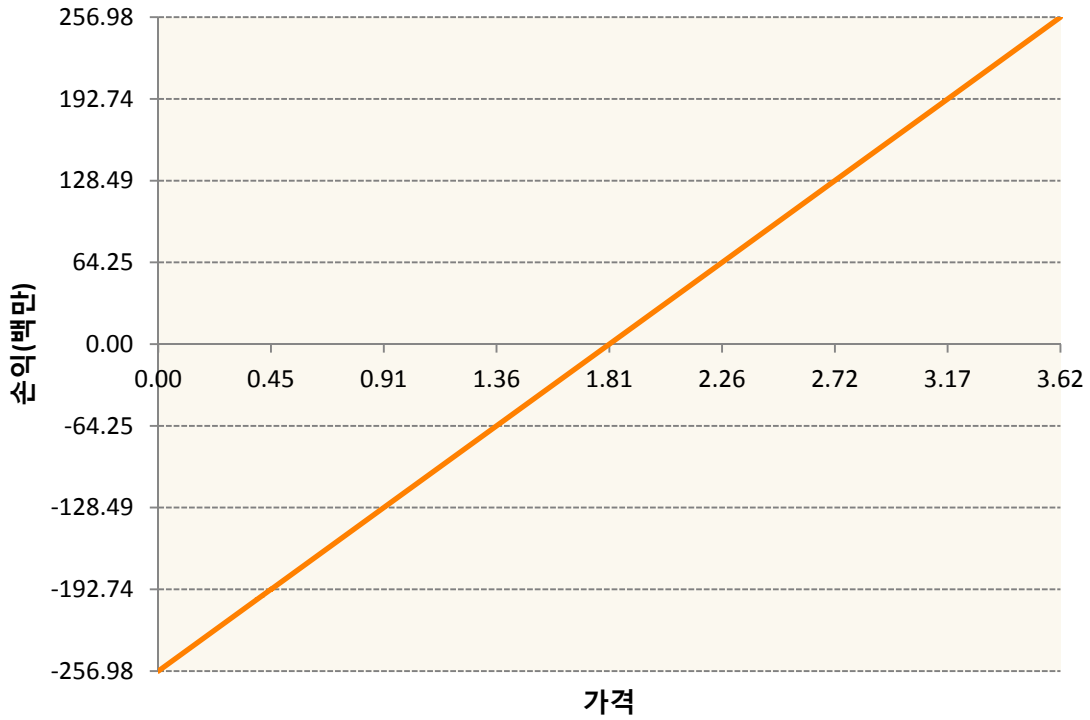
NGK19-NATURAL GAS FUTR May19



QSK9-Low Su Gasoil G May19



**XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19**



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

CLK9	WTI CRUDE FUTURE May19	51
COK9	BRENT CRUDE FUTR May19	60
HOK9	NY Harb ULSD Fut May19	15
KR4175P300	2019-03 달러선물	23
NGK19	NATURAL GAS FUTR May19	58
QSK9	Low Su Gasoil G May19	22
XBK9	GASOLINE RBOB FUT May19	21

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

(단위:백만원)

**433**

공시일	2019-03-14
기준일	2019-03-13

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

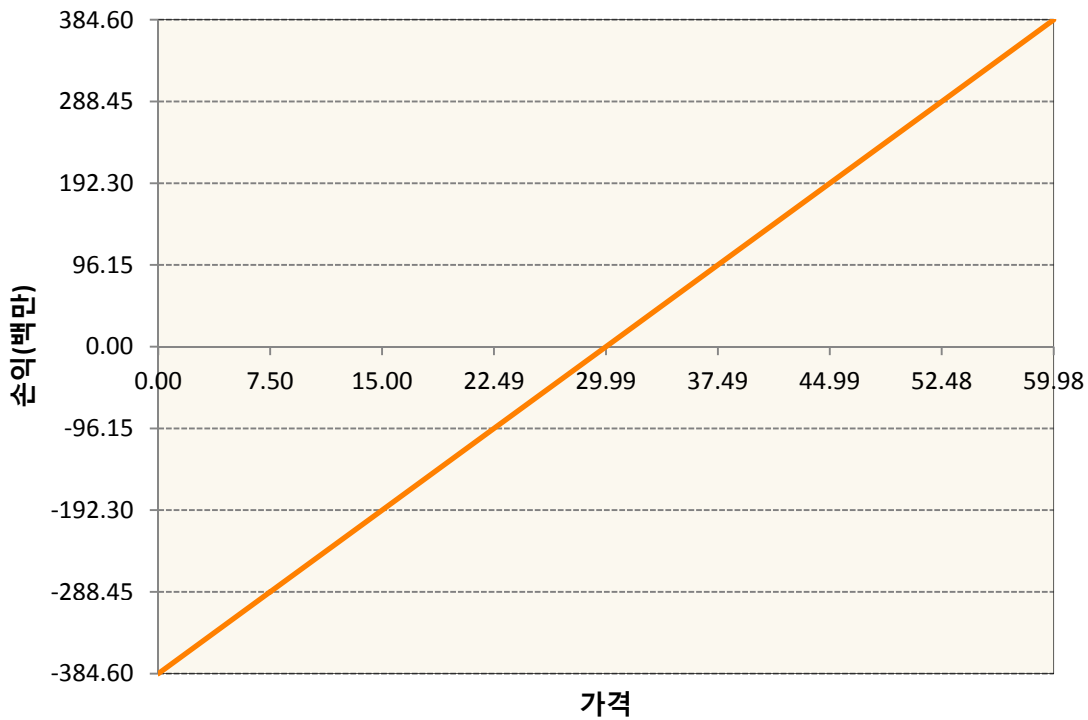
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

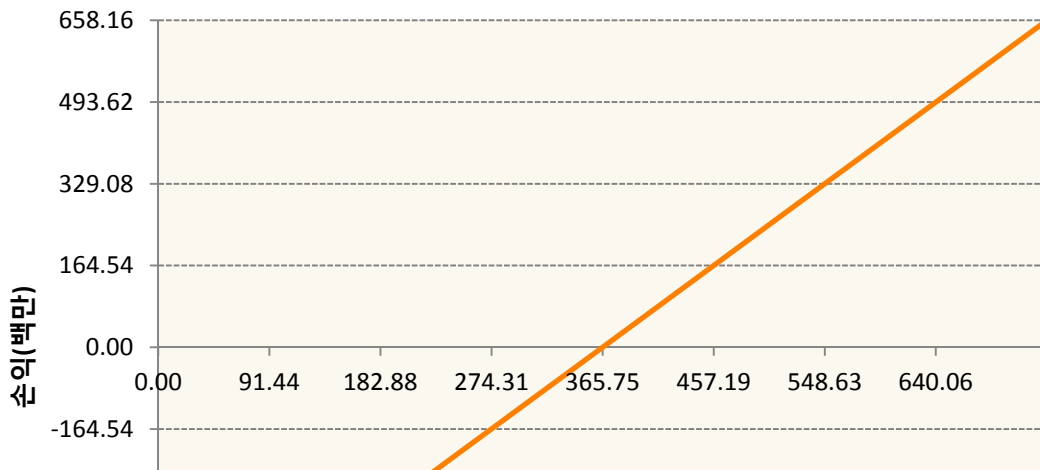
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,348	79	3,269	

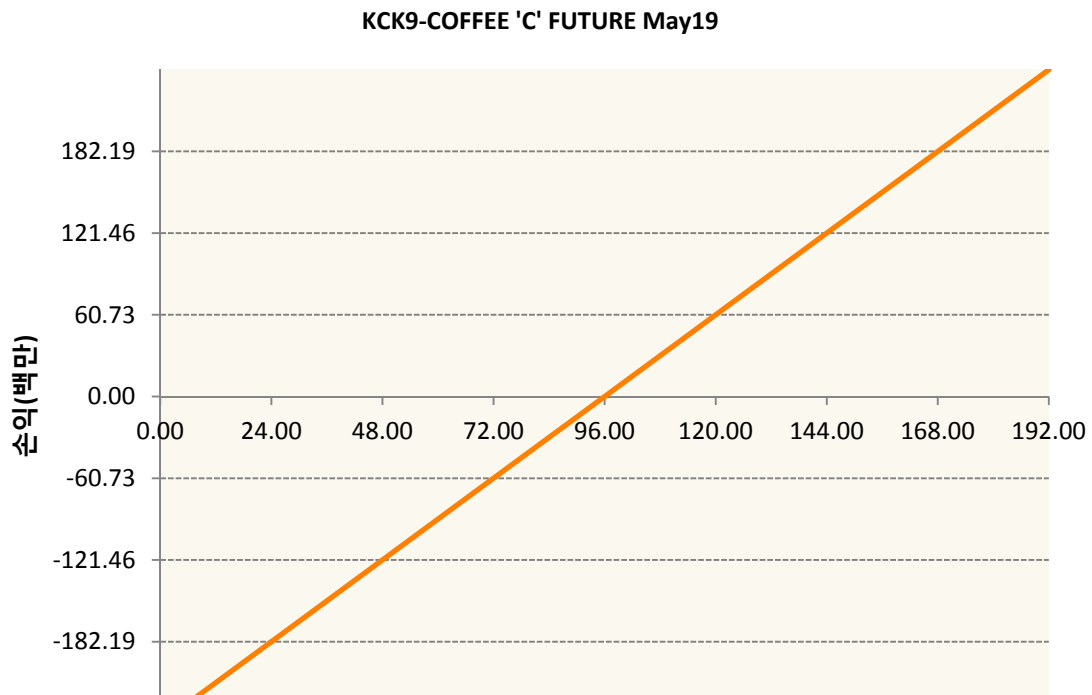
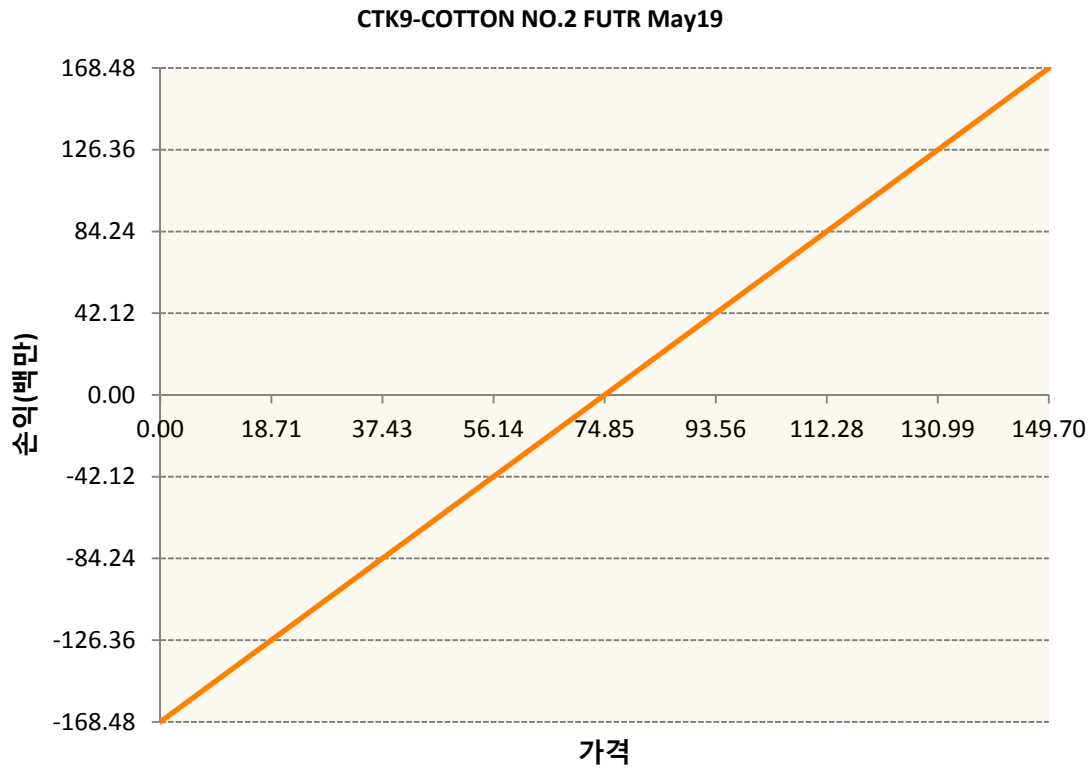
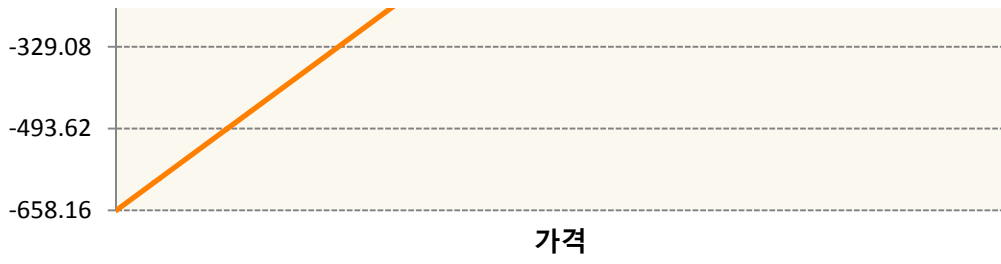
### 2. 만기시점의 손익구조

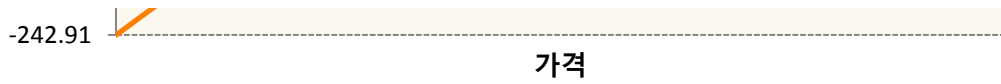
**BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19**



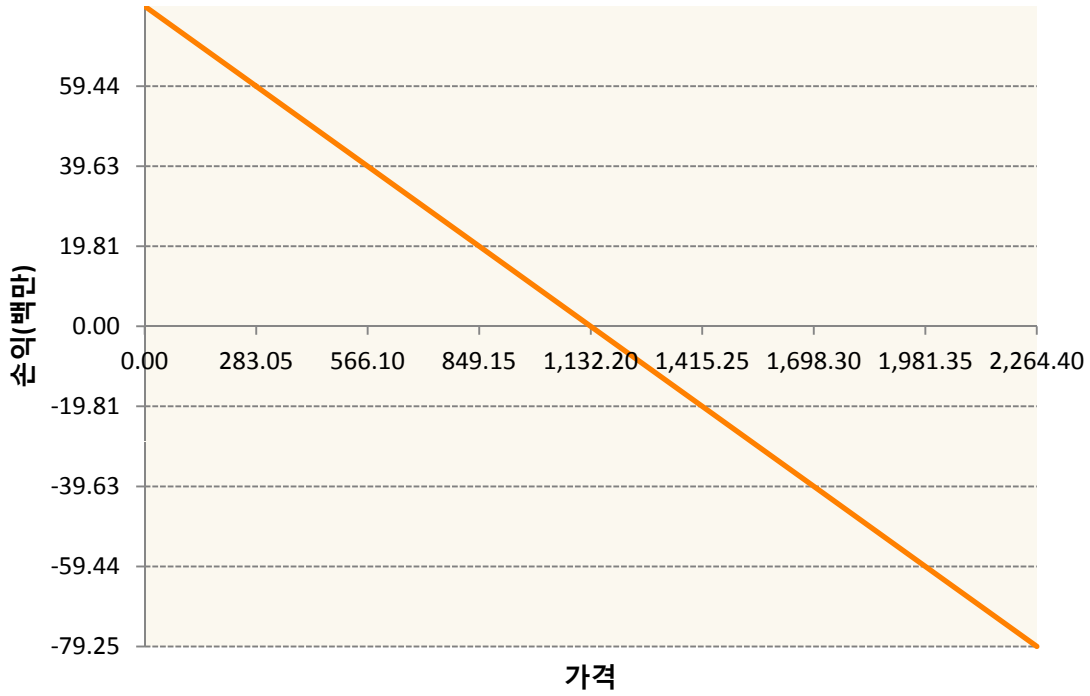
**CK9-CORN FUTURE May19**



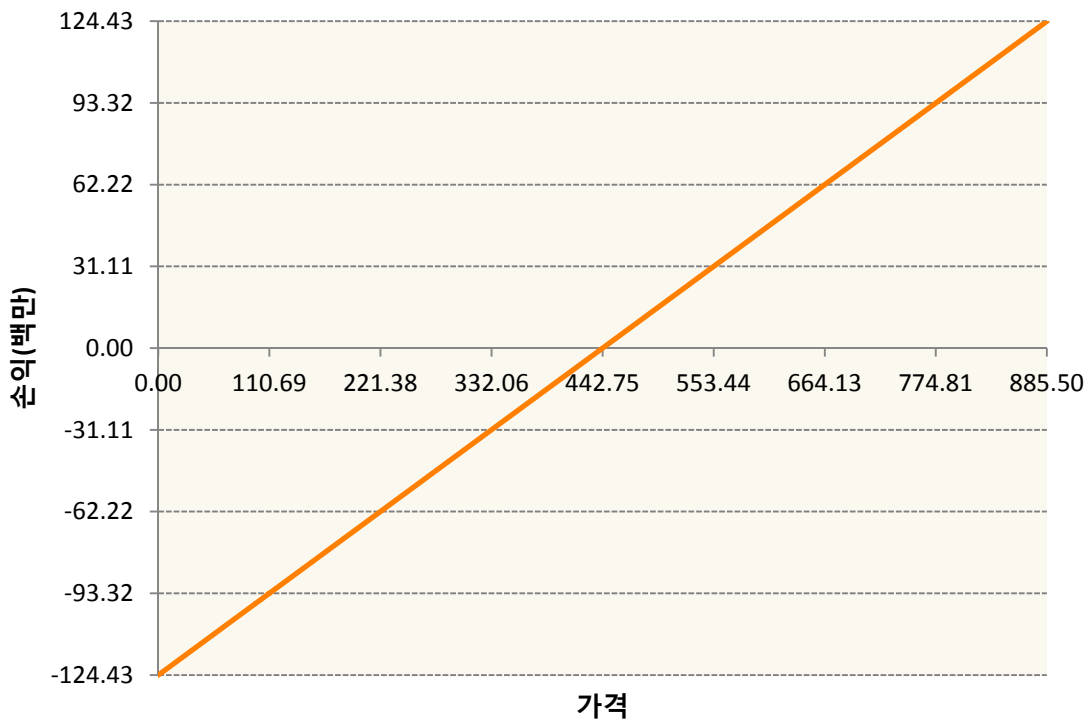




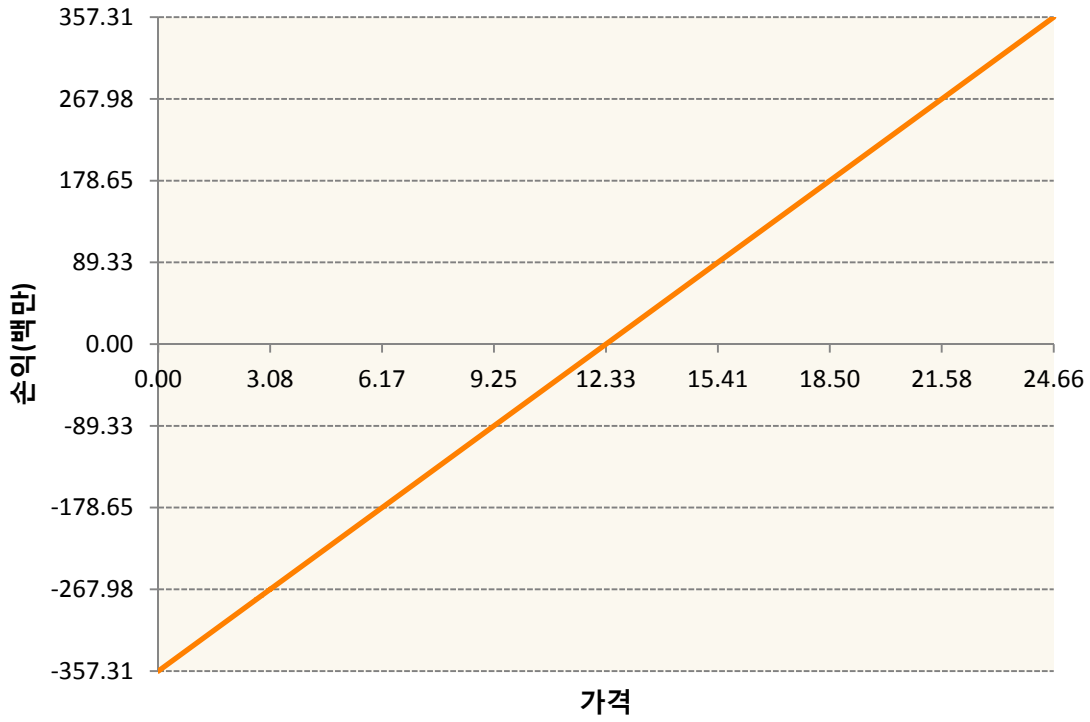
KR4175P30001-2019-03 달러선물



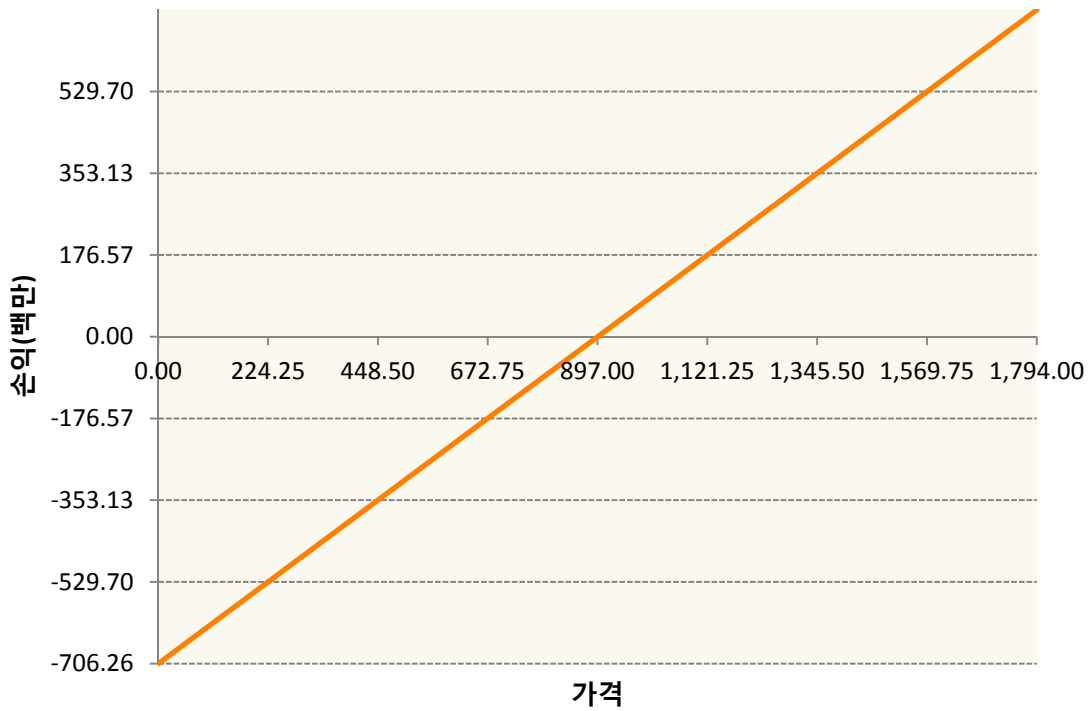
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



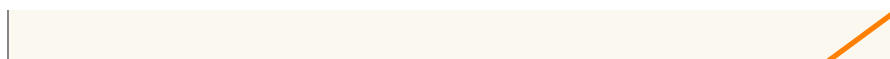
SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

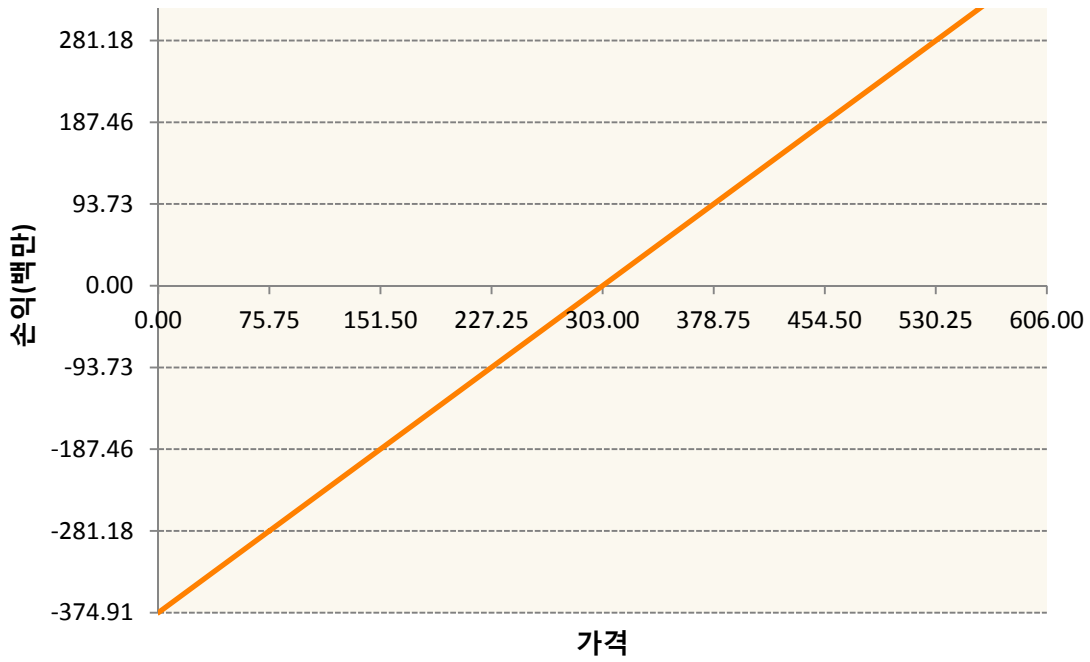


SK9-SOYBEAN FUTURE May19

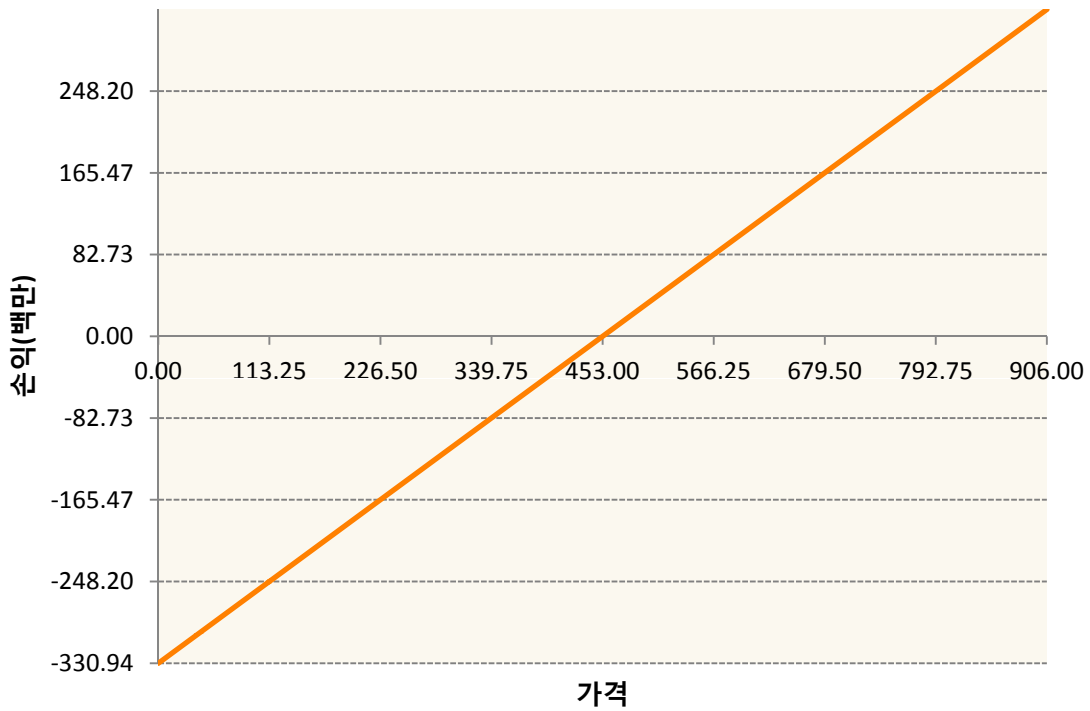


SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





WK9-WHEAT FUTURE(CBT) May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK9	SOYBEAN OIL FUTR May19	31
CK9	CORN FUTURE May19	53
CTK9	COTTON NO.2 FUTR May19	13
KCK9	COFFEE 'C' FUTURE May19	19
KR4175P300	2019-03 달러선물	6

KWK9	KC HRW WHEAT FUT May19	10
SBK9	SUGAR #11 (WORLD) May19	29
SK9	SOYBEAN FUTURE May19	57
SMK9	SOYBEAN MEAL FUTR May19	30
WK9	WHEAT FUTURE(CBT) May19	26

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

(단위:백만원)

**268**