

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-15 |
| 기준일 | 2019-01-14 |

## 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)

93

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-15 |
| 기준일 | 2019-01-14 |

## 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

1,042

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

586

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-15 |
| 기준일 | 2019-01-14 |

## 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

|     |
|-----|
| 266 |
|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 396 |
|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-15 |
| 기준일 | 2019-01-14 |

## 유로인덱스모(주식-파생형)

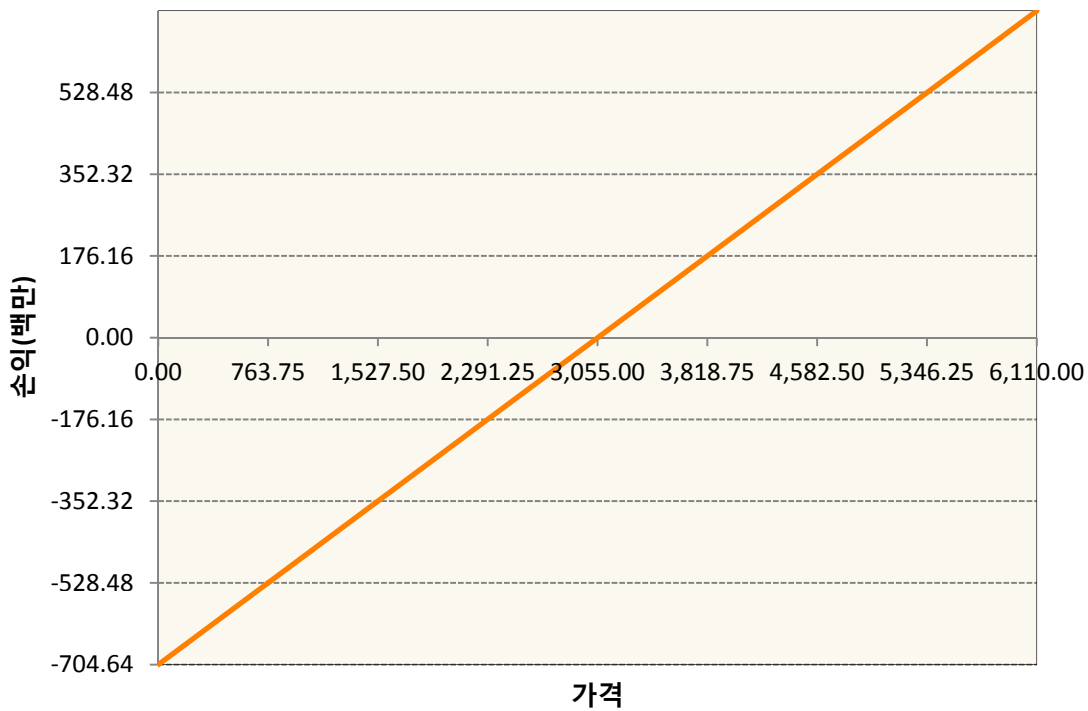
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 705   | 0     | 705       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

VGH9-EURO STOXX 50 Mar19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGH9 | EURO STOXX 50 Mar19 | 56 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 38 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-15 |
| 기준일 | 2019-01-14 |

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

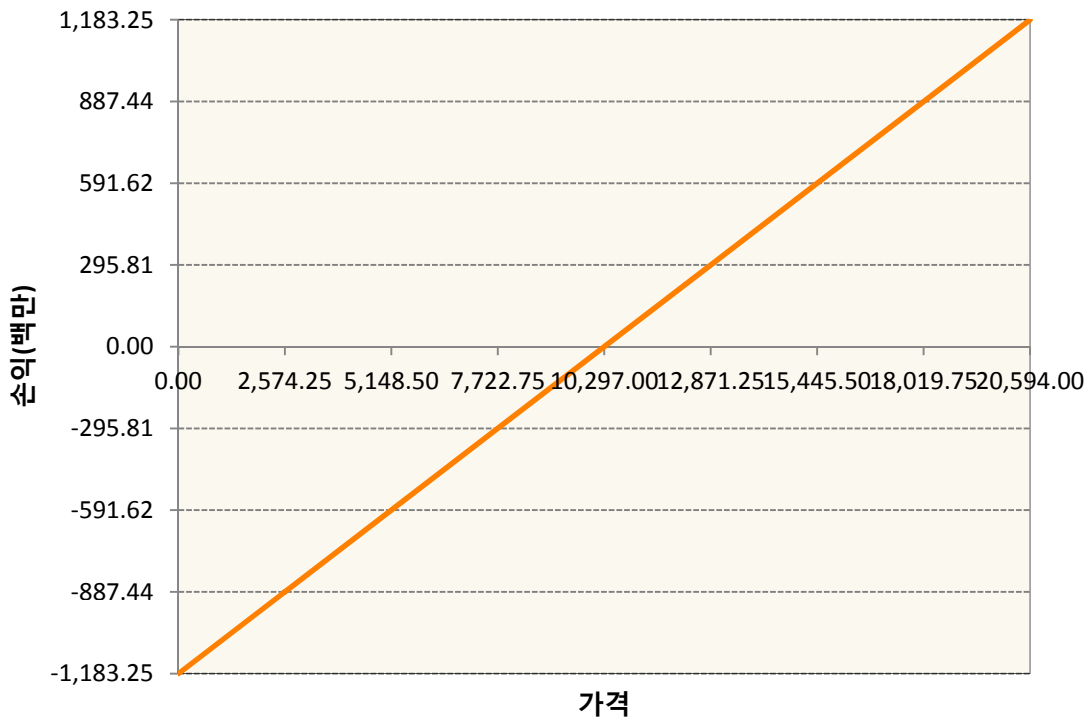
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

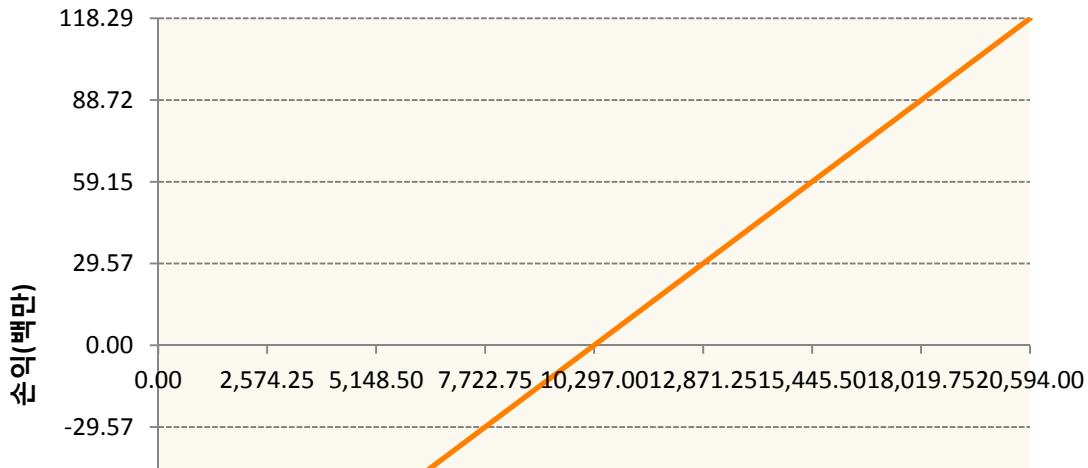
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,302 | 0     | 1,302     | 장내 |

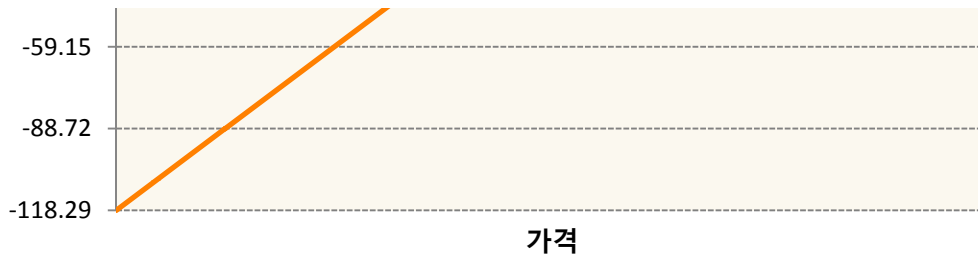
### 2. 만기시점의 손익구조

HCF9-HSCEI FUTURES JAN19



MHCF9-MINI H-SHR IDX FU JAN19





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

|       |                         |    |
|-------|-------------------------|----|
| HCF9  | HSCEI FUTURES JAN19     | 95 |
| MHCF9 | MINI H-SHR IDX FU JAN19 | 9  |

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

|            |
|------------|
| <b>106</b> |
|------------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-15 |
| 기준일 | 2019-01-14 |

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

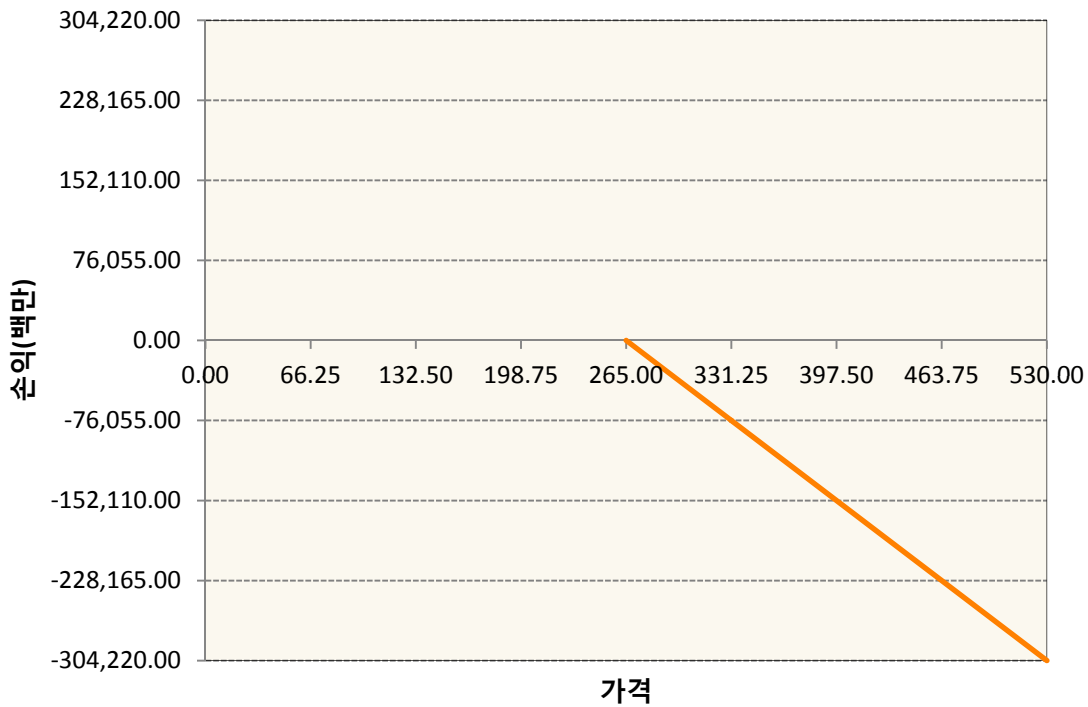
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)   | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0       | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 719,818 | -719,818  | 장내 |

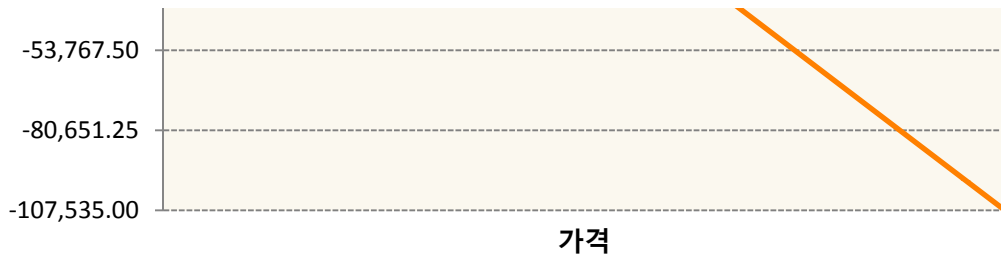
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P22655-2019-02 콜265

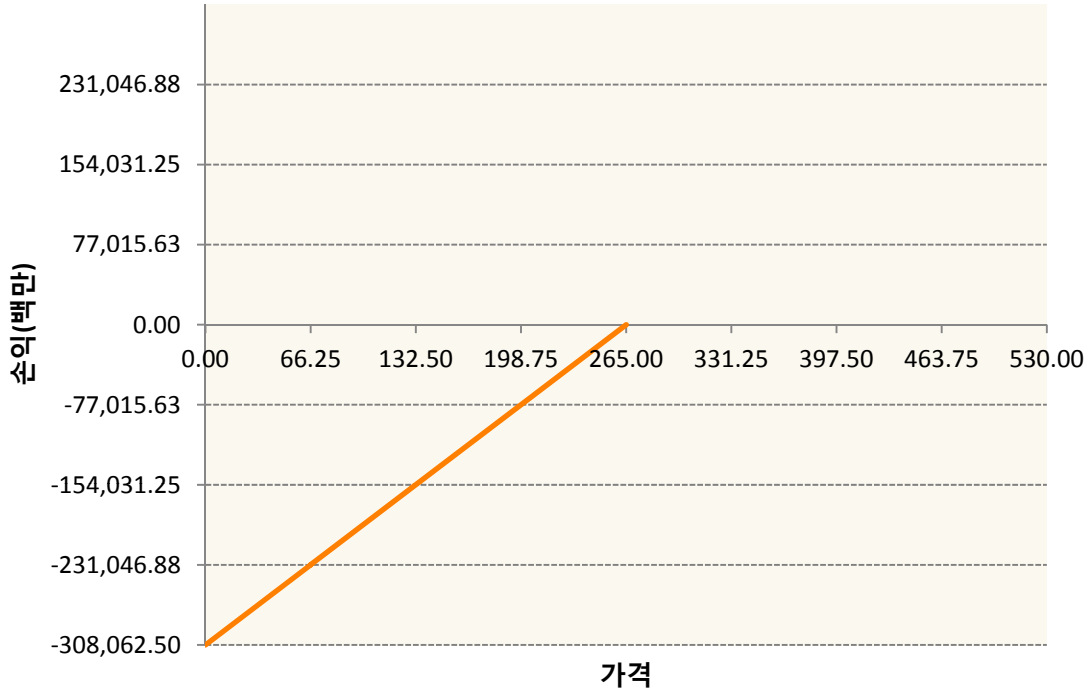


KR4201P22671-2019-02 콜267.5





KR4301P22653-2019-02 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4201P22655 |         | 2019-02 콜265   |         |         |         |         | 18,642  |  |
|--------------|---------|----------------|---------|---------|---------|---------|---------|--|
|              |         | 기초자산의 변동성      |         |         |         |         |         |  |
| 가격           | -25.00% | -16.67%        | -8.33%  | 0%      | 8.33%   | 16.67%  | 25.00%  |  |
| -8.00%       | 8,706   | 8,423          | 8,085   | 7,701   | 7,276   | 6,817   | 6,328   |  |
| -5.33%       | 7,720   | 7,225          | 6,691   | 6,127   | 5,537   | 4,928   | 4,301   |  |
| -2.67%       | 5,704   | 5,018          | 4,319   | 3,611   | 2,895   | 2,173   | 1,447   |  |
| 0%           | 2,306   | 1,537          | 769     | 0       | -769    | -1,537  | -2,305  |  |
| 2.67%        | -2,573  | -3,281         | -4,001  | -4,730  | -5,467  | -6,209  | -6,956  |  |
| 5.33%        | -8,741  | -9,284         | -9,865  | -10,477 | -11,113 | -11,768 | -12,440 |  |
| 8.00%        | -15,830 | -16,183        | -16,592 | -17,049 | -17,547 | -18,080 | -18,642 |  |
| KR4201P22671 |         | 2019-02 콜267.5 |         |         |         |         | 6,226   |  |
|              |         | 기초자산의 변동성      |         |         |         |         |         |  |
| 가격           | -25.00% | -16.67%        | -8.33%  | 0%      | 8.33%   | 16.67%  | 25.00%  |  |
| -8.00%       | 2,645   | 2,566          | 2,467   | 2,351   | 2,220   | 2,076   | 1,920   |  |

|  |         |         |         |         |         |         |         |
|--|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| -5.33%   | 2,384   | 2,235   | 2,069   | 1,890   | 1,701   | 1,502   | 1,296   |
| -2.67%   | 1,816   | 1,594   | 1,364   | 1,128   | 888     | 644     | 398     |
| 0%   | 803     | 536     | 268     | 0       | -269    | -537    | -806    |
| 2.67%  | -724    | -987    | -1,253  | -1,519  | -1,787  | -2,056  | -2,325  |
| 5.33%  | -2,732  | -2,948  | -3,175  | -3,408  | -3,648  | -3,894  | -4,143  |
| 8.00%  | -5,111  | -5,260  | -5,428  | -5,611  | -5,806  | -6,011  | -6,226  |
| KR4301P22653                      2019-02 풋265 |         |         |         |         |         |         | 19,659  |
| 기초자산의 변동성                                      |         |         |         |         |         |         |         |
| 가격   | -25.00% | -16.67% | -8.33%  | 0%      | 8.33%   | 16.67%  | 25.00%  |
| -8.00%   | -19,218 | -19,243 | -19,284 | -19,346 | -19,428 | -19,533 | -19,659 |
| -5.33%   | -11,196 | -11,323 | -11,482 | -11,670 | -11,884 | -12,121 | -12,379 |
| -2.67%   | -3,961  | -4,289  | -4,637  | -4,998  | -5,371  | -5,754  | -6,144  |
| 0%   | 1,349   | 899     | 450     | 0       | -450    | -899    | -1,349  |
| 2.67%  | 4,148   | 3,806   | 3,446   | 3,072   | 2,687   | 2,292   | 1,889   |
| 5.33%  | 5,127   | 4,976   | 4,791   | 4,576   | 4,334   | 4,069   | 3,784   |
| 8.00%  | 5,346   | 5,306   | 5,243   | 5,155   | 5,042   | 4,903   | 4,740   |

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

(단위:백만원)

**44,015**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-15 |
| 기준일 | 2019-01-14 |

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

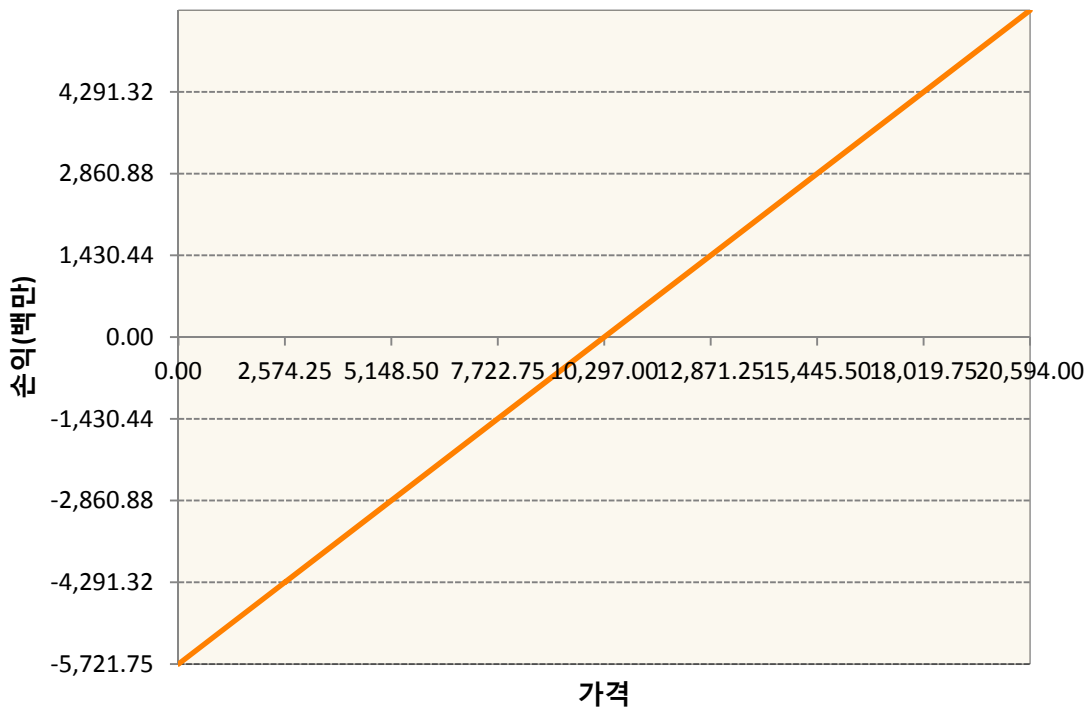
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

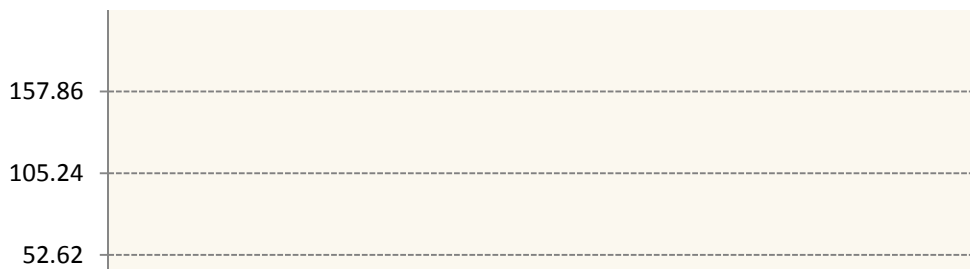
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0      | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0      | 0         | 장내 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0      | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 5,722 | 0      | 5,722     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 12,305 | -12,305   | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 2,721  | -2,721    | 장외 |

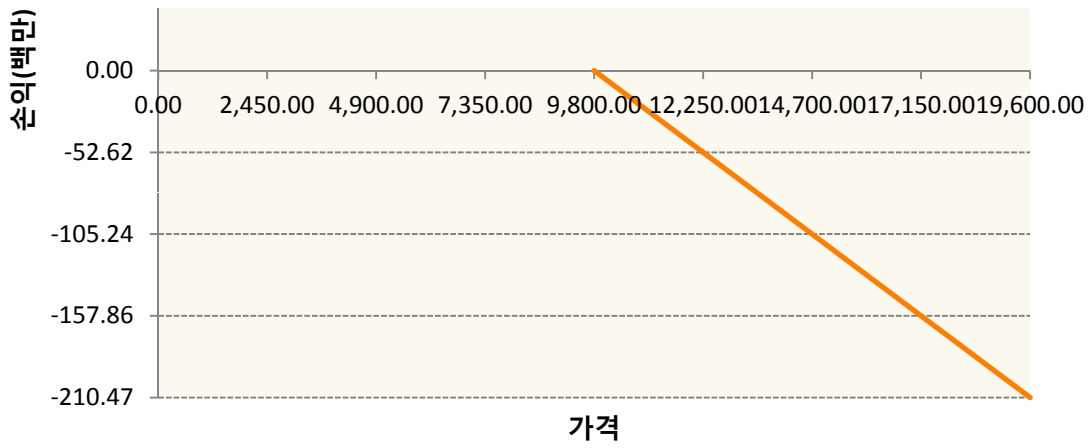
### 2. 만기시점의 손익구조

HCF9-HSCEI FUTURES JAN19

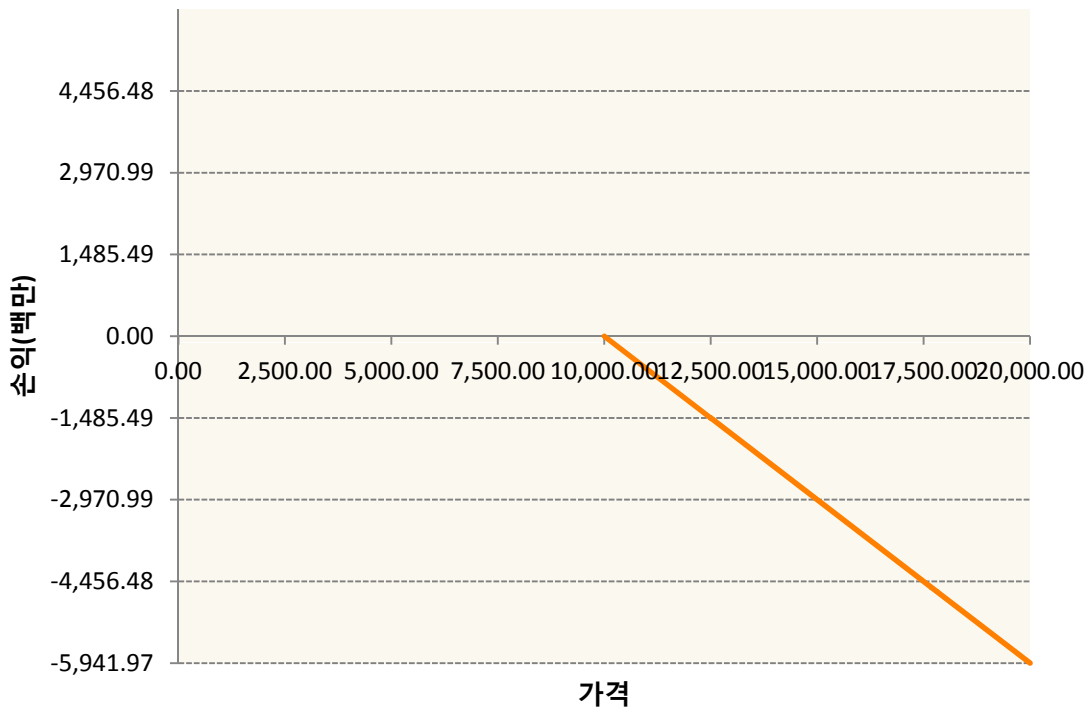


OHHIF9-C098-HSCEI

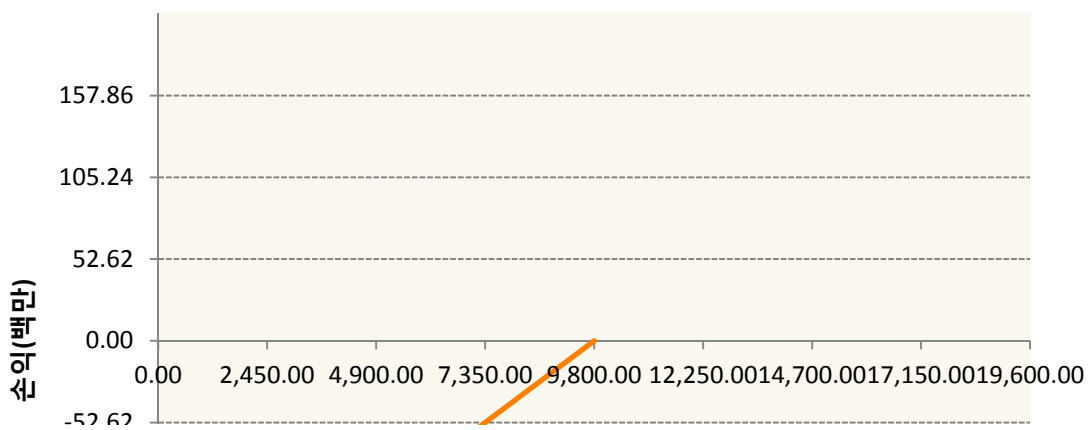


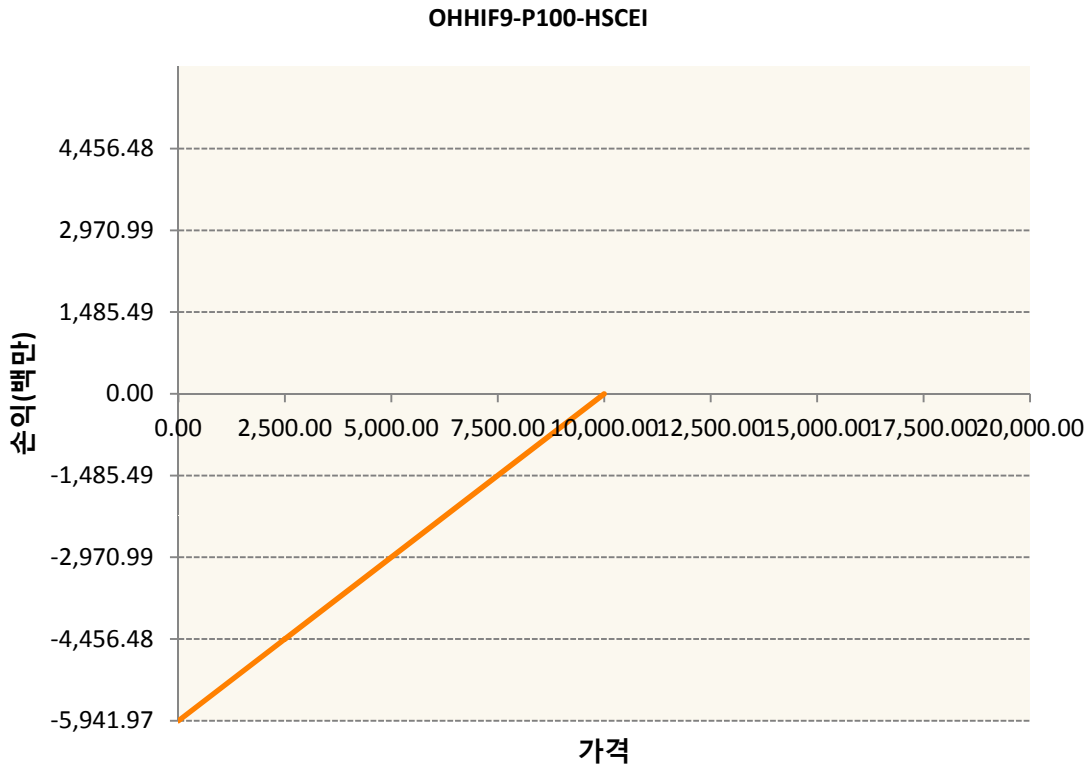
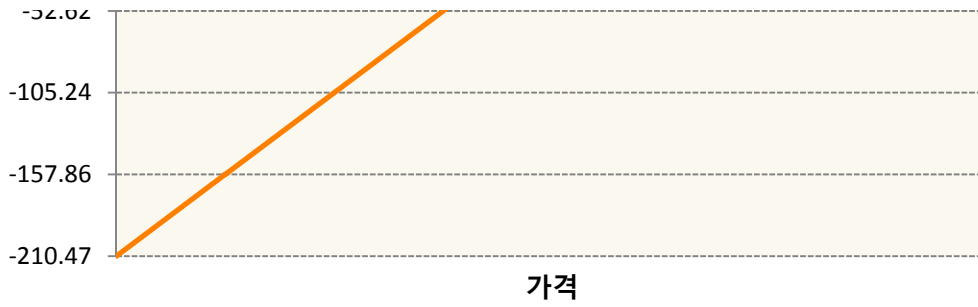


OHHIF9-C100-HSCEI



OHHIF9-P098-HSCEI





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)    | (단위:백만원) |
|------------------------------|----------|
| FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E | 218      |
| HCF9 HSCEI FUTURES JAN19     | 458      |
| OHHIF9-C09 HSCEI             | 17       |
| OHHIF9-C10 HSCEI             | 475      |
| OHHIF9-P09 HSCEI             | 17       |
| OHHIF9-P10 HSCEI             | 475      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|--|----------|
|  | 1,557    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-15 |
| 기준일 | 2019-01-14 |

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

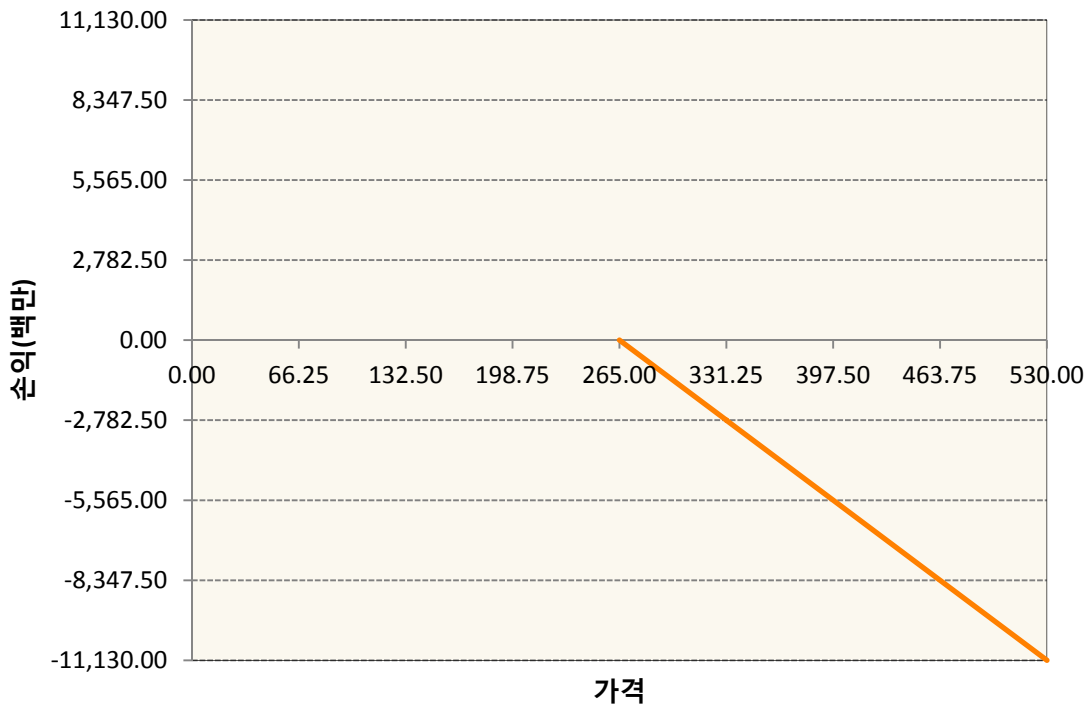
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

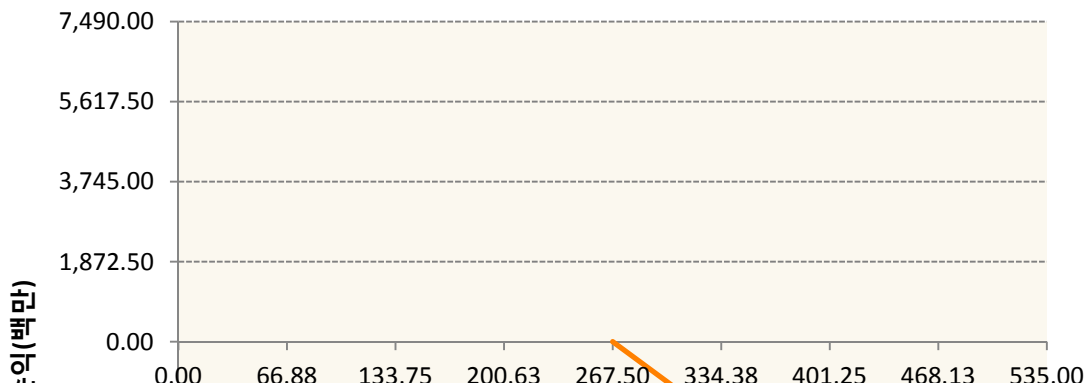
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 스왑   | 0      | 0      | 0         | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0      | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 31,836 | 0      | 31,836    | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0      | 33,858 | -33,858   | 장내 |

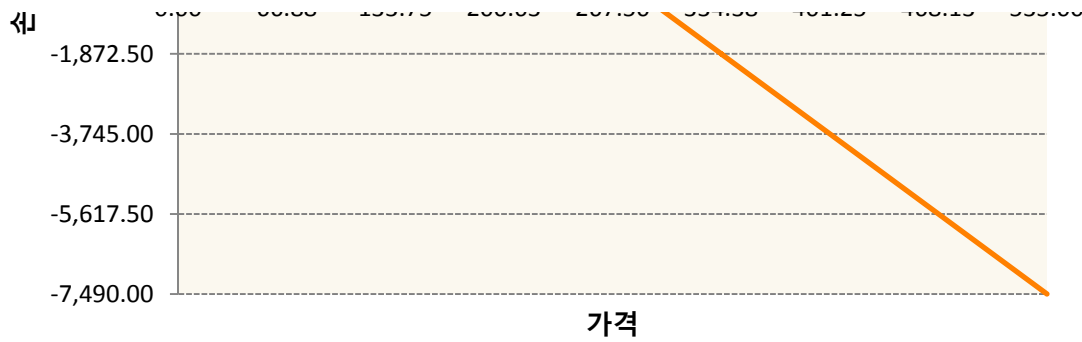
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P22655-2019-02 콜265

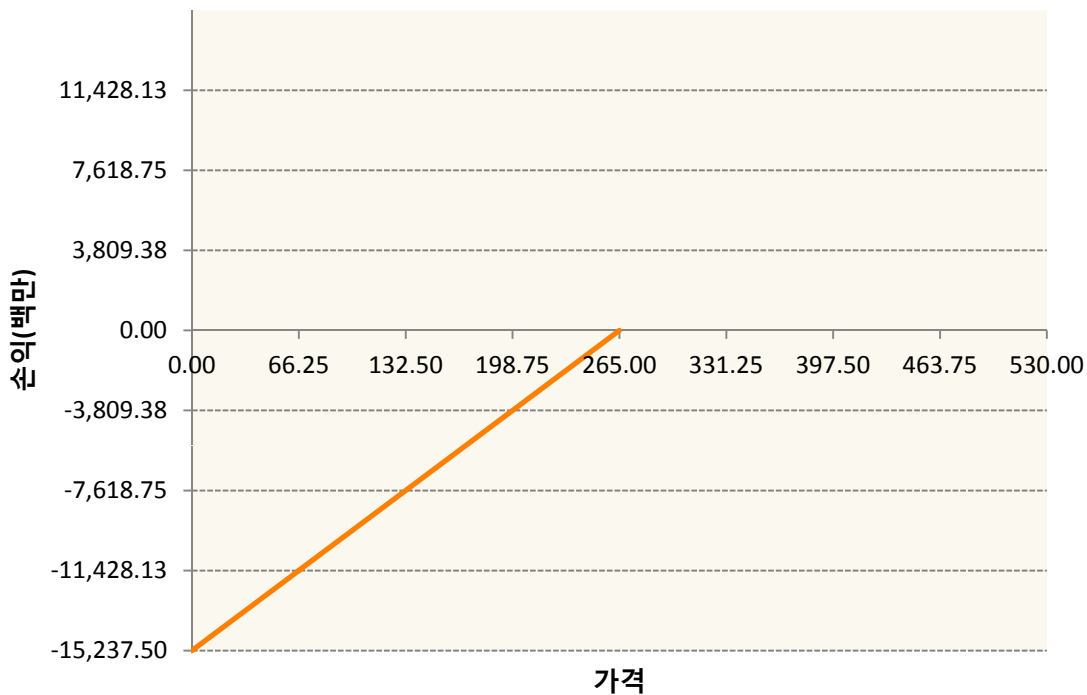


KR4201P22671-2019-02 콜267.5





KR4301P22653-2019-02 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

|        |              |         |                   |        |        |        |        |
|--------|--------------|---------|-------------------|--------|--------|--------|--------|
|        | 2.529E+11    |         | UBCSFXC1 INDEX_14 |        |        |        | 2,651  |
|        | 기초자산의 변동성    |         |                   |        |        |        |        |
| 가격     | -25.00%      | -16.67% | -8.33%            | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -2,651       | -2,651  | -2,651            | -2,651 | -2,651 | -2,651 | -2,651 |
| -5.33% | -1,767       | -1,767  | -1,767            | -1,767 | -1,767 | -1,767 | -1,767 |
| -2.67% | -884         | -884    | -884              | -884   | -884   | -884   | -884   |
| 0%     | 0            | 0       | 0                 | 0      | 0      | 0      | 0      |
| 2.67%  | 884          | 884     | 884               | 884    | 884    | 884    | 884    |
| 5.33%  | 1,767        | 1,767   | 1,767             | 1,767  | 1,767  | 1,767  | 1,767  |
| 8.00%  | 2,651        | 2,651   | 2,651             | 2,651  | 2,651  | 2,651  | 2,651  |
|        | KR4201P22655 |         | 2019-02 풋265      |        |        |        | 682    |
|        | 기초자산의 변동성    |         |                   |        |        |        |        |

|  |         |         |        |      |       |        |        |
|--|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격   | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%   | 319     | 308     | 296    | 282  | 266   | 249    | 232    |
| -5.33%   | 282     | 264     | 245    | 224  | 203   | 180    | 157    |
| -2.67%   | 209     | 184     | 158    | 132  | 106   | 80     | 53     |
| 0%   | 84      | 56      | 28     | 0    | -28   | -56    | -84    |
| 2.67%  | -94     | -120    | -146   | -173 | -200  | -227   | -255   |
| 5.33%  | -320    | -340    | -361   | -383 | -407  | -431   | -455   |
| 8.00%  | -579    | -592    | -607   | -624 | -642  | -661   | -682   |
| KR4201P22671                      2019-02 콜267.5 |         |         |        |      |       |        | 434    |

|  |         |         |        |      |       |        |        |
|--|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 기초자산의 변동성                                      |         |         |        |      |       |        |        |
| 가격   | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%   | 184     | 179     | 172    | 164  | 155   | 145    | 134    |
| -5.33%   | 166     | 156     | 144    | 132  | 118   | 105    | 90     |
| -2.67%   | 127     | 111     | 95     | 79   | 62    | 45     | 28     |
| 0%   | 56      | 37      | 19     | 0    | -19   | -37    | -56    |
| 2.67%  | -50     | -69     | -87    | -106 | -124  | -143   | -162   |
| 5.33%  | -190    | -205    | -221   | -237 | -254  | -271   | -289   |
| 8.00%  | -356    | -366    | -378   | -391 | -404  | -419   | -434   |
| KR4301P22653                      2019-02 풋265 |         |         |        |      |       |        | 972    |

|           |         |         |        |      |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 기초자산의 변동성 |         |         |        |      |       |        |        |
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | -951    | -952    | -954   | -957 | -961  | -966   | -972   |
| -5.33%    | -554    | -560    | -568   | -577 | -588  | -600   | -612   |
| -2.67%    | -196    | -212    | -229   | -247 | -266  | -285   | -304   |
| 0%        | 67      | 44      | 22     | 0    | -22   | -44    | -67    |
| 2.67%     | 205     | 188     | 170    | 152  | 133   | 113    | 93     |
| 5.33%     | 254     | 246     | 237    | 226  | 214   | 201    | 187    |
| 8.00%     | 264     | 262     | 259    | 255  | 249   | 243    | 234    |

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

(단위:백만원)

4,718

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-15 |
| 기준일 | 2019-01-14 |

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

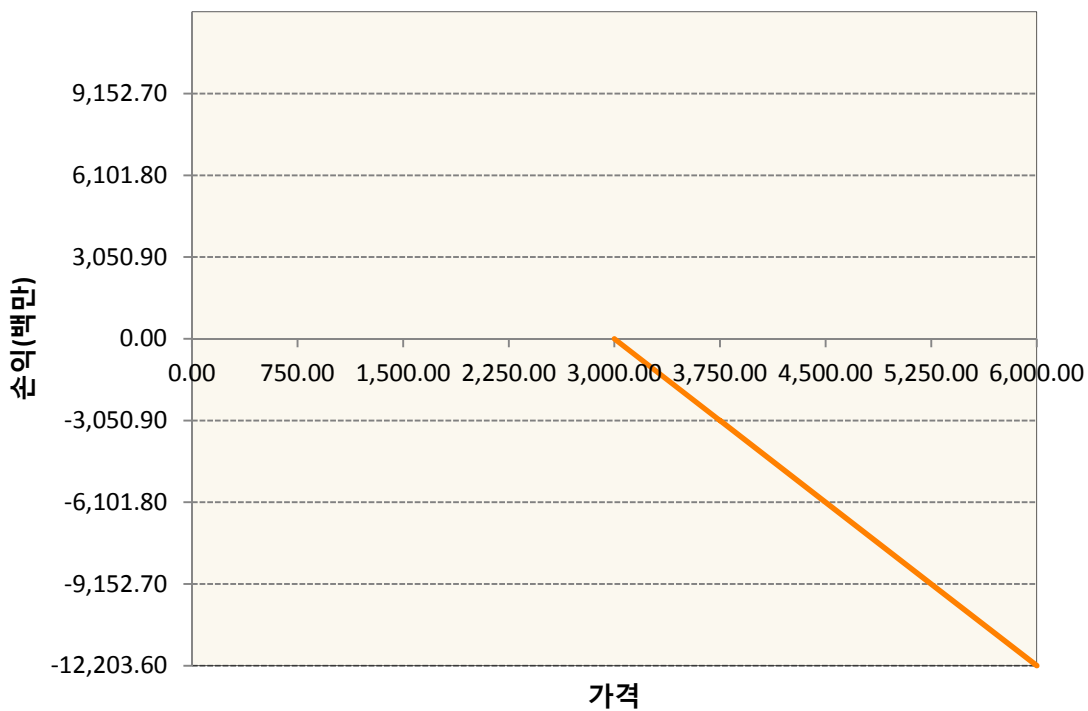
### 1. 계약금액

(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   | 6,614  | 0      | 6,614     |    |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 71,899 | 0      | 71,899    | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0      | 25,030 | -25,030   | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 15,447 | -15,447   | 장외 |

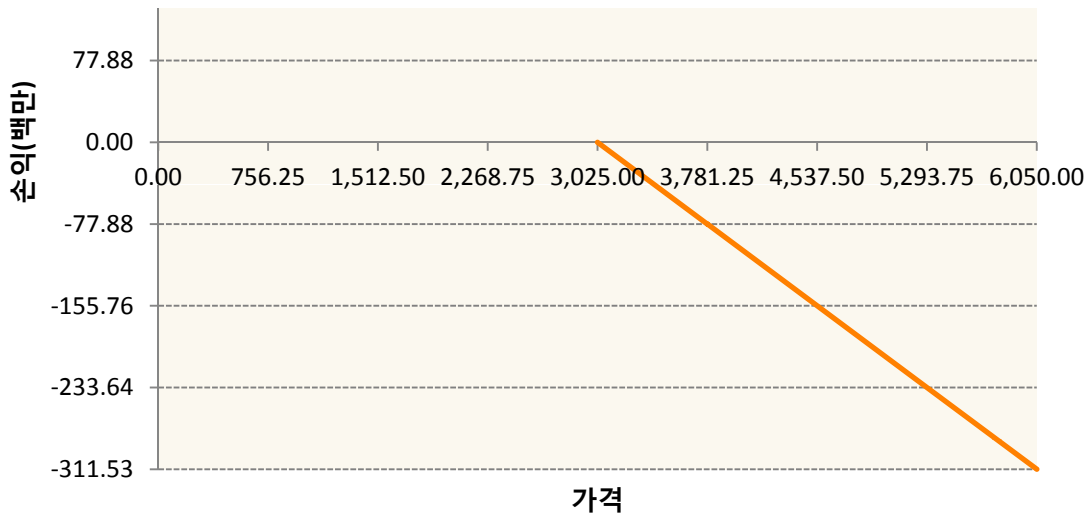
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXF9-C3000-EURO STOXX 50

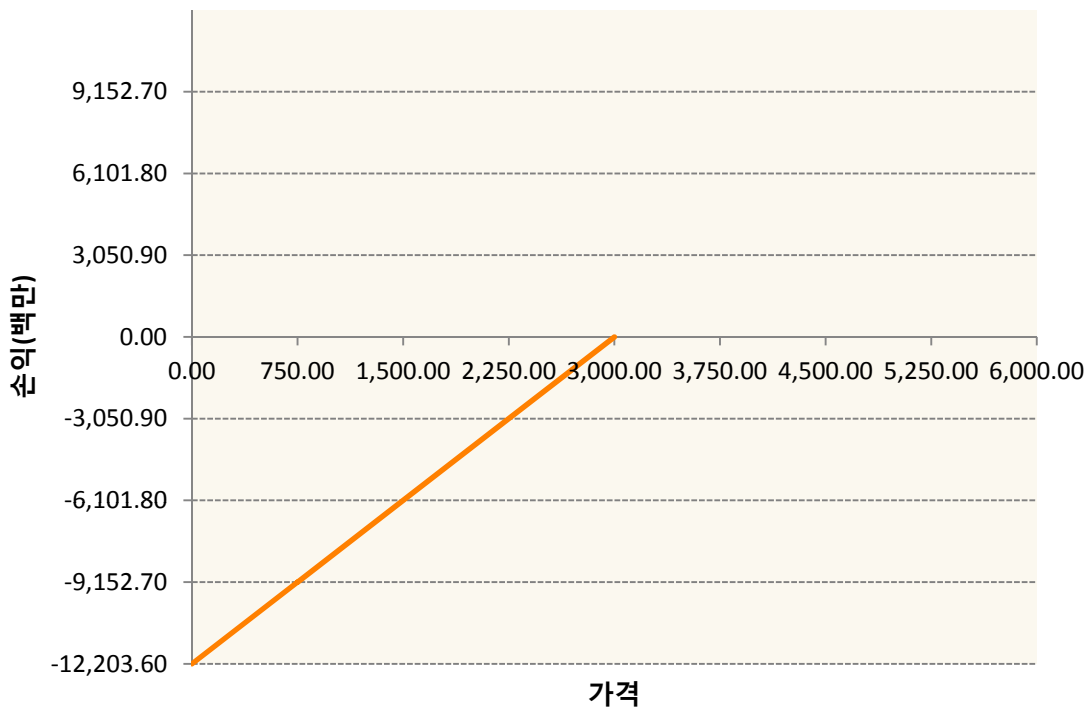


OESXF9-C3025-EURO STOXX 50

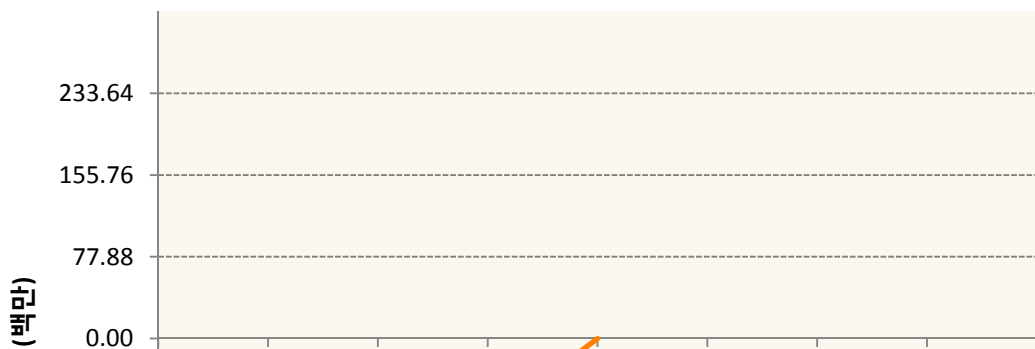


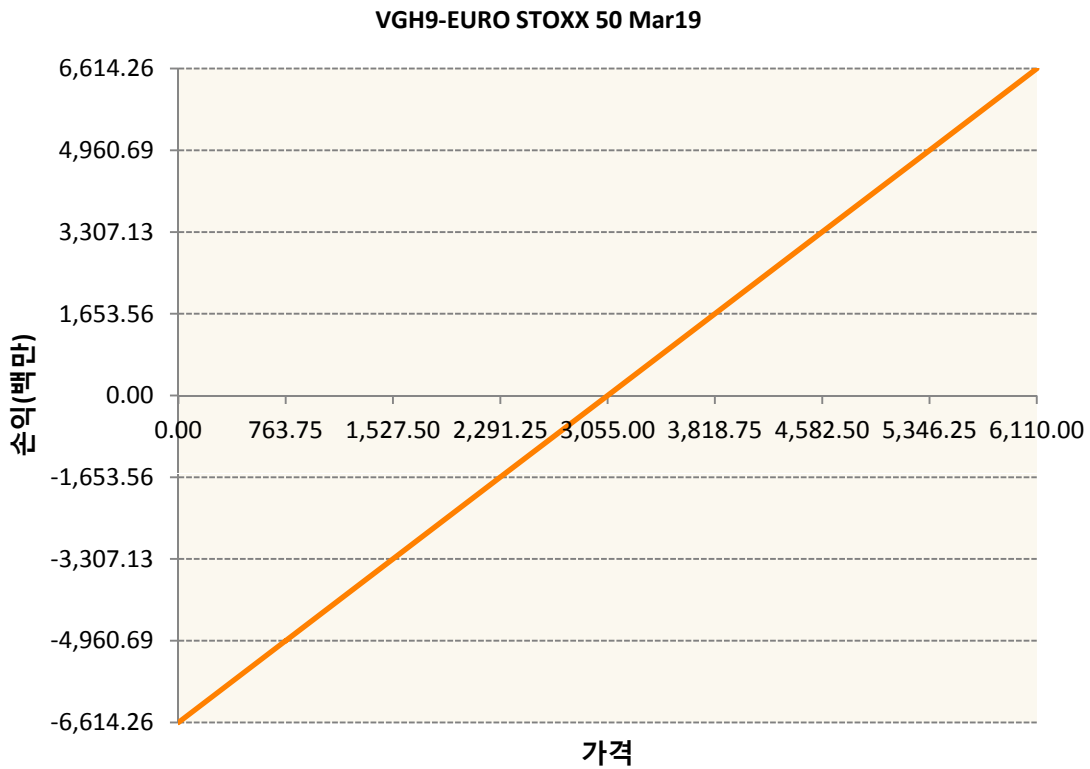
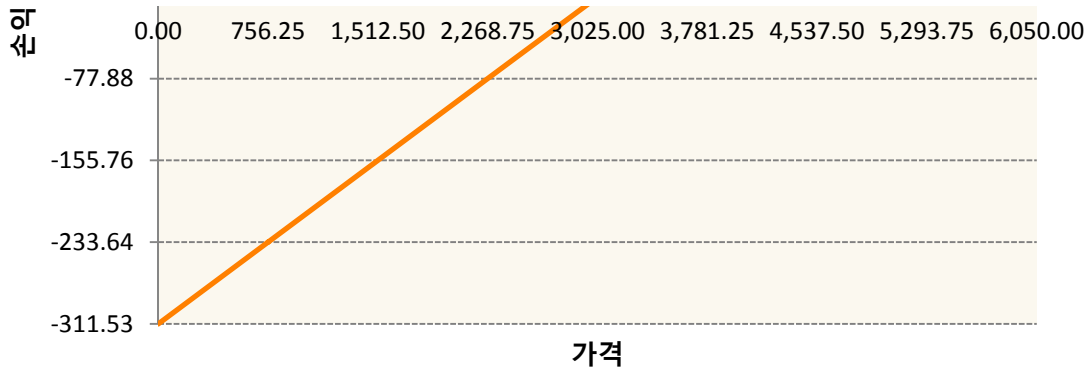


OESXF9-P3000-EURO STOXX 50



OESXF9-P3025-EURO STOXX 50





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)               |  | (단위:백만원) |
|---|--|----------|
| 260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY |  | 71       |
| FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E            |  | 412      |
| FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E            |  | 824      |
| OESXF9-C30 EURO STOXX 50                |  | 976      |
| OESXF9-C30 EURO STOXX 50                |  | 25       |
| OESXF9-P30 EURO STOXX 50                |  | 976      |
| OESXF9-P30 EURO STOXX 50                |  | 25       |
| VGH9 EURO STOXX 50 Mar19                |  | 529      |

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

(단위:백만원)

2,498



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

(단위:백만원)

1,087



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

(단위:백만원)

93



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

(단위:백만원)

139

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-15 |
| 기준일 | 2019-01-14 |

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

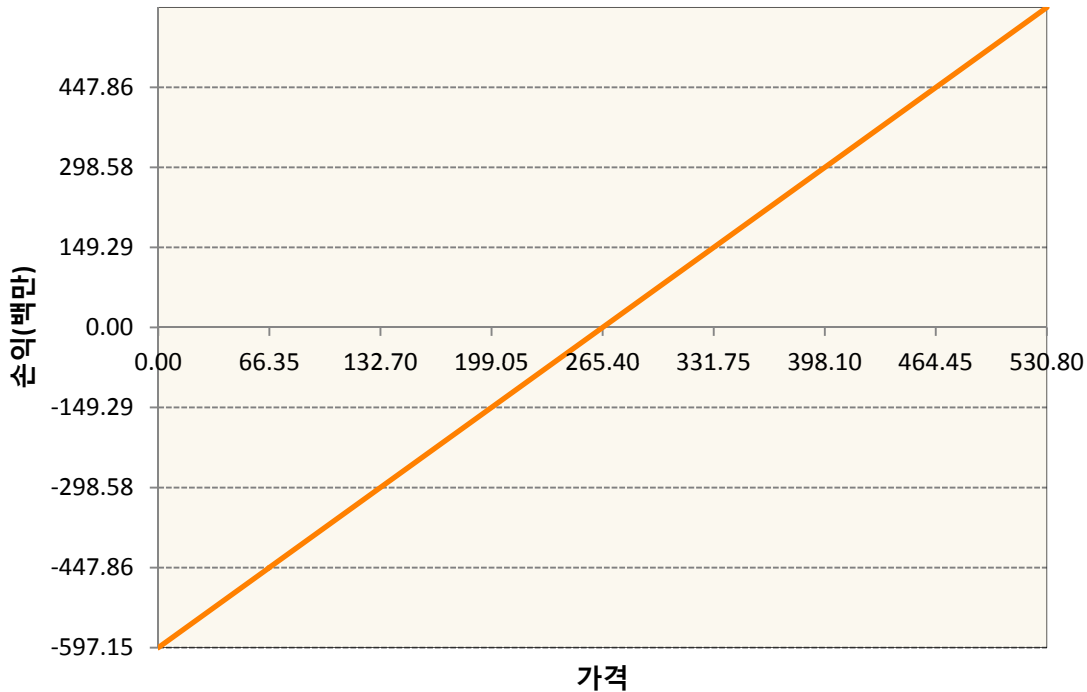
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 597   | 0     | 597       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101P30007 |         | 2019-03 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 | 2019-01-15 |
| 기준일 | 2019-01-14 |

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

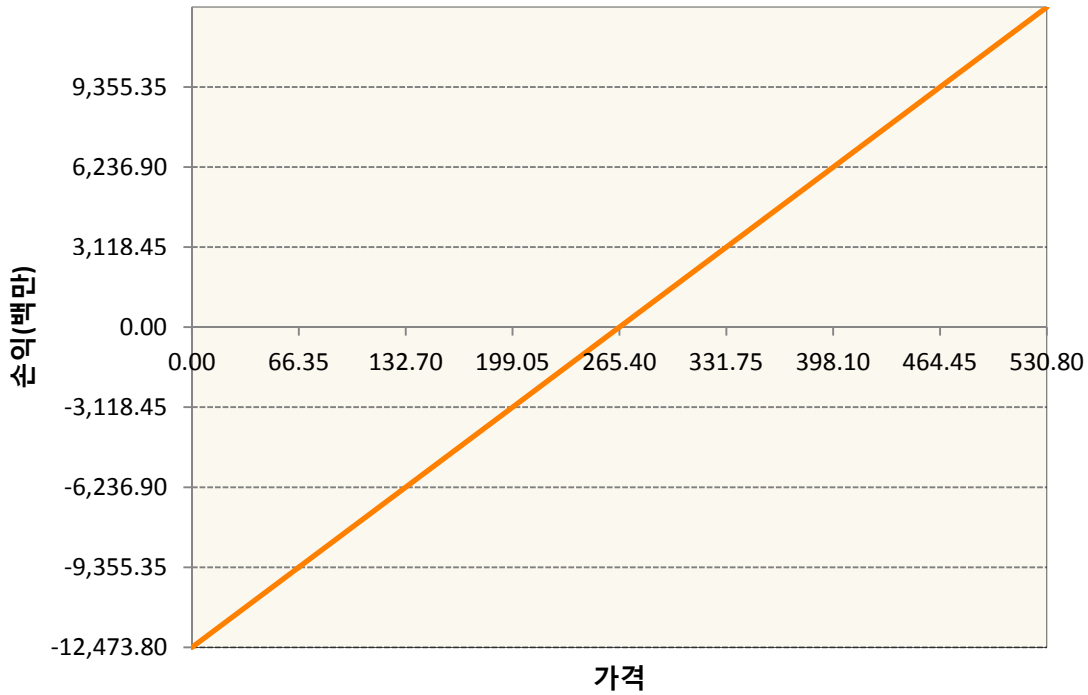
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

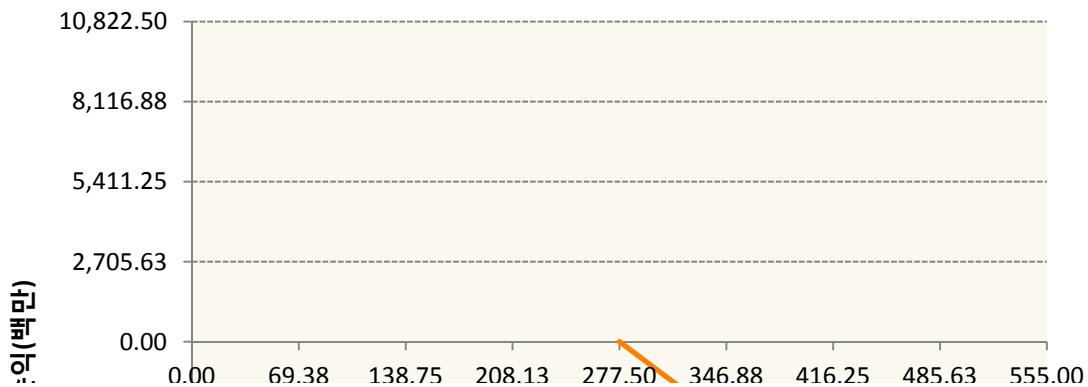
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0      | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0      | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 12,474 | 0      | 12,474    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 2,523  | 23,213 | -20,690   | 장내 |

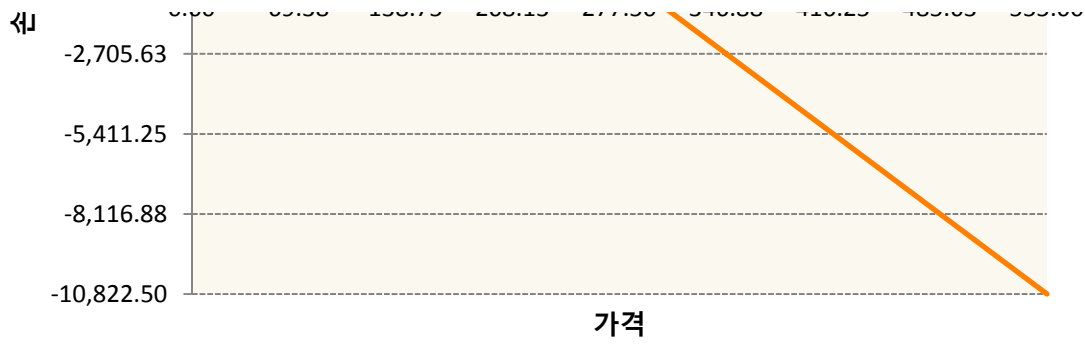
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

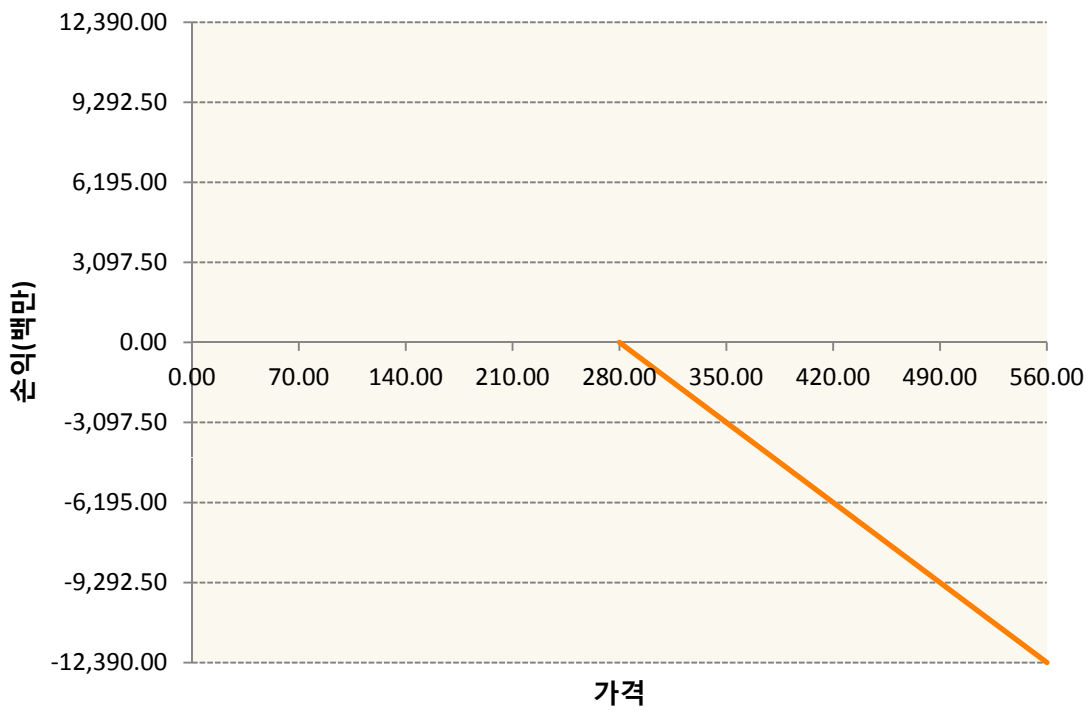


KR4201P22770-2019-02 콜277.5

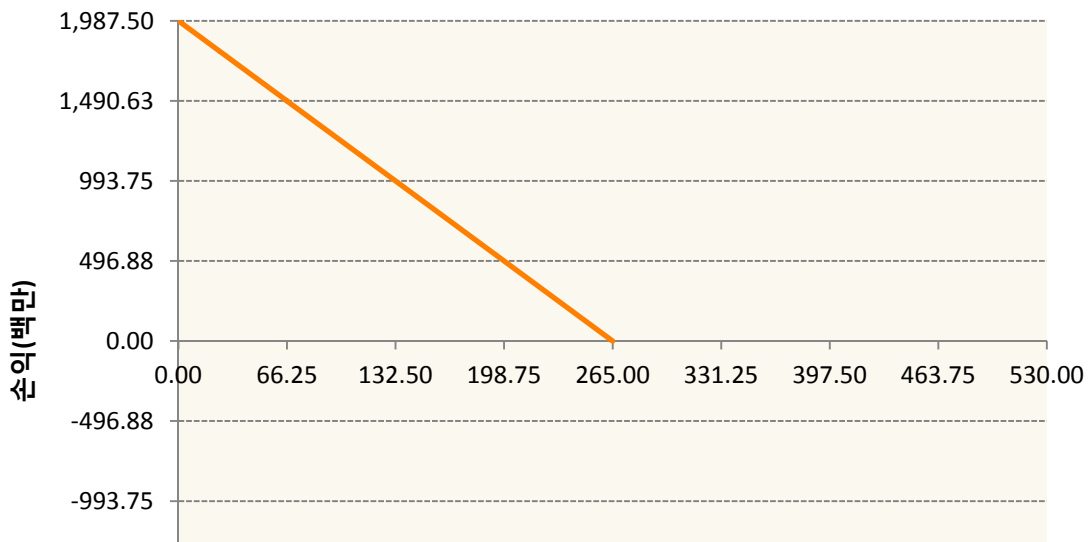


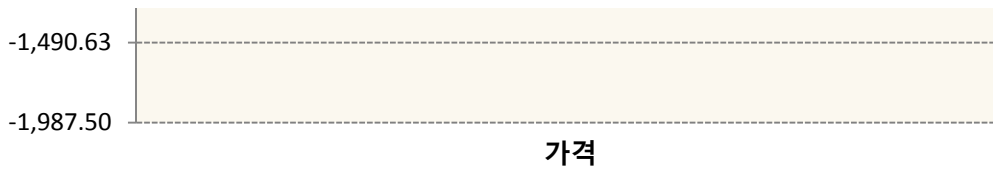


KR4201P22804-2019-02 콜280

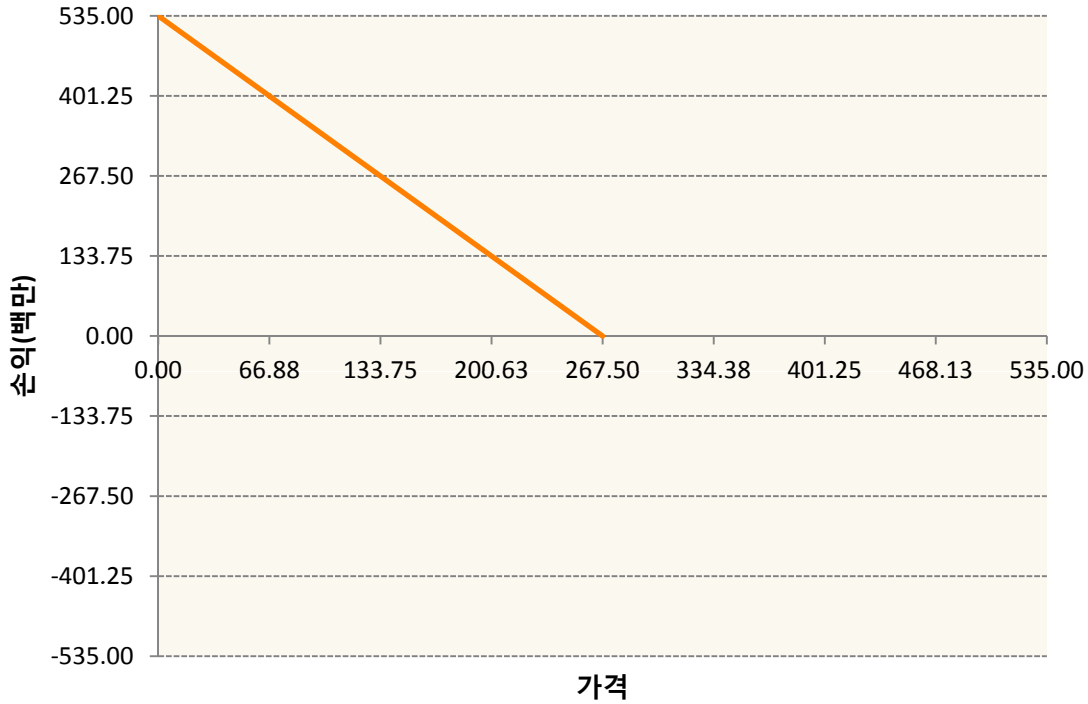


KR4301P22653-2019-02 풋265





KR4301P22679-2019-02 풋267.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4101P30007 |         | 2019-03 코스피200지수선물 |        |      |       |        |        | 996 |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
|              |         | 기초자산의 변동성          |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | -996    | -996               | -996   | -996 | -996  | -996   | -996   |     |
| -5.33%       | -664    | -664               | -664   | -664 | -664  | -664   | -664   |     |
| -2.67%       | -332    | -332               | -332   | -332 | -332  | -332   | -332   |     |
| 0%           | 0       | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |     |
| 2.67%        | 332     | 332                | 332    | 332  | 332   | 332    | 332    |     |
| 5.33%        | 664     | 664                | 664    | 664  | 664   | 664    | 664    |     |
| 8.00%        | 996     | 996                | 996    | 996  | 996   | 996    | 996    |     |
| KR4201P22770 |         | 2019-02 콜277.5     |        |      |       |        |        | 474 |
|              |         | 기초자산의 변동성          |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | 132     | 130                | 126    | 121  | 114   | 106    | 96     |     |
| -5.33%       | 126     | 119                | 111    | 101  | 89    | 76     | 62     |     |
| -2.67%       | 106     | 94                 | 79     | 63   | 46    | 28     | 9      |     |

|  |         |         |        |      |       |        |        |
|--|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 0%   | 63      | 43      | 22     | 0    | -23   | -46    | -69    |
| 2.67%  | -18     | -44     | -70    | -96  | -122  | -148   | -175   |
| 5.33%  | -146    | -173    | -200   | -228 | -255  | -283   | -310   |
| 8.00%  | -321    | -345    | -370   | -396 | -422  | -448   | -474   |
| KR4201P22804                      2019-02 콜280   |         |         |        |      |       |        | 499    |
| 기초자산의 변동성  |         |         |        |      |       |        |        |
| 가격   | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%   | 125     | 122     | 119    | 114  | 108   | 100    | 90     |
| -5.33%   | 119     | 114     | 106    | 96   | 85    | 72     | 57     |
| -2.67%   | 103     | 91      | 77     | 61   | 44    | 25     | 4      |
| 0%   | 65      | 45      | 23     | 0    | -24   | -49    | -74    |
| 2.67%  | -11     | -39     | -67    | -96  | -124  | -154   | -183   |
| 5.33%  | -137    | -168    | -200   | -231 | -262  | -293   | -324   |
| 8.00%  | -317    | -347    | -377   | -407 | -438  | -468   | -499   |
| KR4301P22653                      2019-02 풋265   |         |         |        |      |       |        | 127    |
| 기초자산의 변동성  |         |         |        |      |       |        |        |
| 가격   | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%   | 124     | 124     | 124    | 125  | 125   | 126    | 127    |
| -5.33%   | 72      | 73      | 74     | 75   | 77    | 78     | 80     |
| -2.67%   | 26      | 28      | 30     | 32   | 35    | 37     | 40     |
| 0%   | -9      | -6      | -3     | 0    | 3     | 6      | 9      |
| 2.67%  | -27     | -25     | -22    | -20  | -17   | -15    | -12    |
| 5.33%  | -33     | -32     | -31    | -30  | -28   | -26    | -24    |
| 8.00%  | -34     | -34     | -34    | -33  | -33   | -32    | -31    |
| KR4301P22679                      2019-02 풋267.5 |         |         |        |      |       |        | 36     |
| 기초자산의 변동성  |         |         |        |      |       |        |        |
| 가격   | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%   | 35      | 35      | 35     | 35   | 36    | 36     | 36     |
| -5.33%   | 21      | 21      | 22     | 22   | 22    | 23     | 23     |
| -2.67%   | 8       | 9       | 9      | 10   | 10    | 11     | 11     |
| 0%   | -2      | -2      | -1     | 0    | 1     | 2      | 2      |
| 2.67%  | -9      | -8      | -7     | -6   | -6    | -5     | -4     |
| 5.33%  | -11     | -11     | -10    | -10  | -9    | -9     | -8     |
| 8.00%  | -12     | -12     | -12    | -11  | -11   | -11    | -10    |

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

(단위:백만원)

1,749

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-15 |
| 기준일 | 2019-01-14 |

## 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 | 617   | 0     | 617       |    |

### 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 | 2019-01-15 |
| 기준일 | 2019-01-14 |

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 124   | 0     | 124       |    |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 2,404 | 0     | 2,404     |    |

### 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 | 2019-01-15 |
| 기준일 | 2019-01-14 |

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 371   | 0     | 371       |    |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 3,297 | 0     | 3,297     |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 3,425 | -3,425    | 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 | 31                              |
| 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 | 13                              |
| FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E | 29                              |
| FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E | 13                              |

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

(단위:백만원)

104

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-15 |
| 기준일 | 2019-01-14 |

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

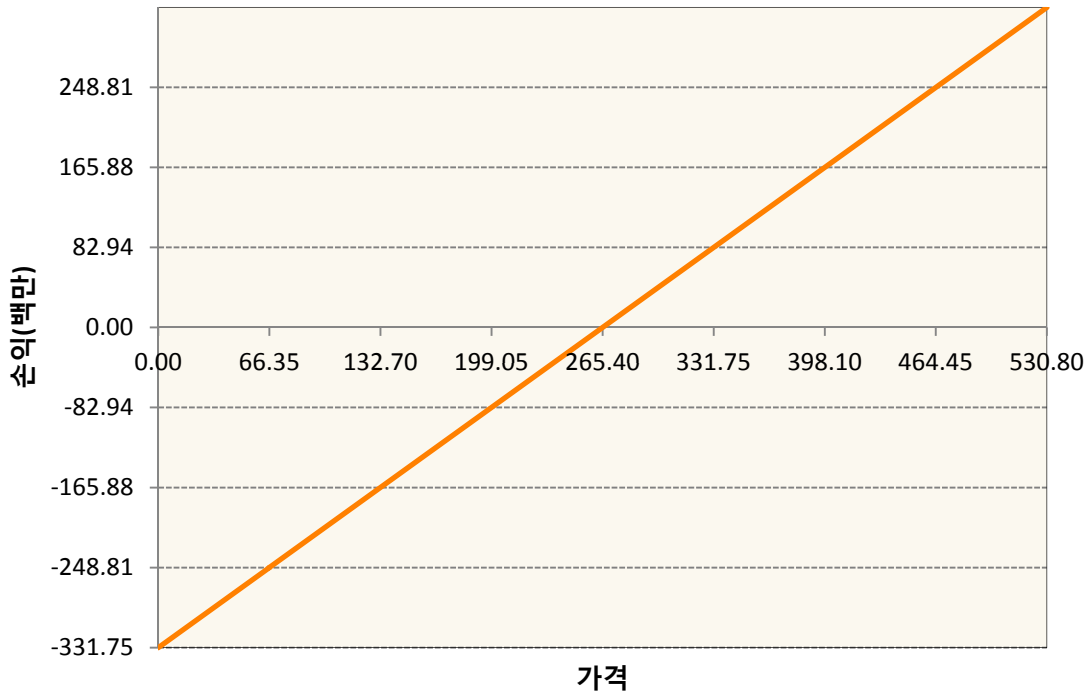
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

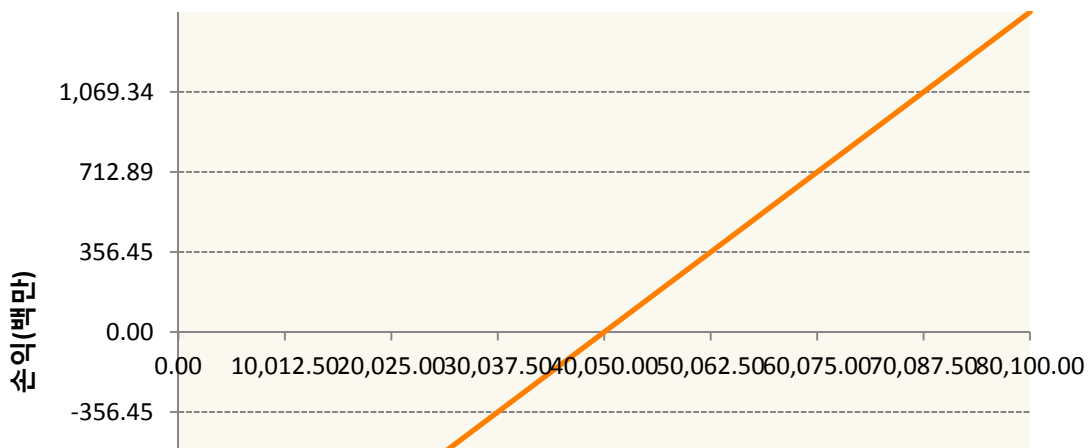
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,758 | 0     | 1,758     | 장내 |

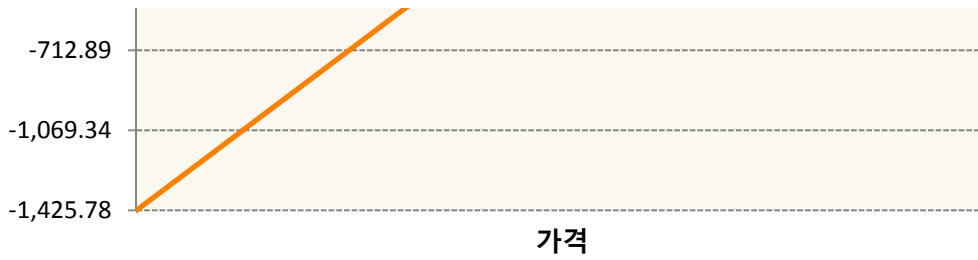
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



KR4111P20007-2019-02 삼성전자개별선물





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

| KR4101P30007 |         | 2019-03 코스피200지수선물 |        |      |       |        |        | 26  |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | -26     | -26                | -26    | -26  | -26   | -26    | -26    |     |
| -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%        | 26      | 26                 | 26     | 26   | 26    | 26     | 26     |     |
| KR4111P20007 |         | 2019-02 삼성전자개별선물   |        |      |       |        |        | 114 |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | -114    | -114               | -114   | -114 | -114  | -114   | -114   |     |
| -5.33%       | -76     | -76                | -76    | -76  | -76   | -76    | -76    |     |
| -2.67%       | -38     | -38                | -38    | -38  | -38   | -38    | -38    |     |
| 0%           | 0       | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |     |
| 2.67%        | 38      | 38                 | 38     | 38   | 38    | 38     | 38     |     |
| 5.33%        | 76      | 76                 | 76     | 76   | 76    | 76     | 76     |     |
| 8.00%        | 114     | 114                | 114    | 114  | 114   | 114    | 114    |     |

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

**156**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-15 |
| 기준일 | 2019-01-14 |

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

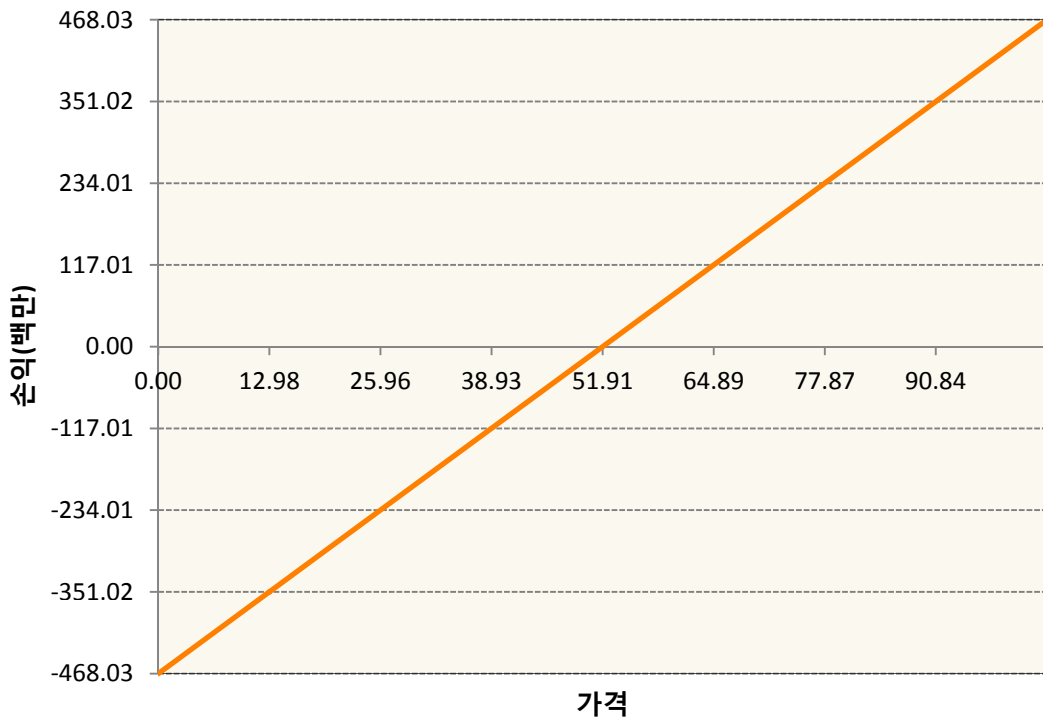
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

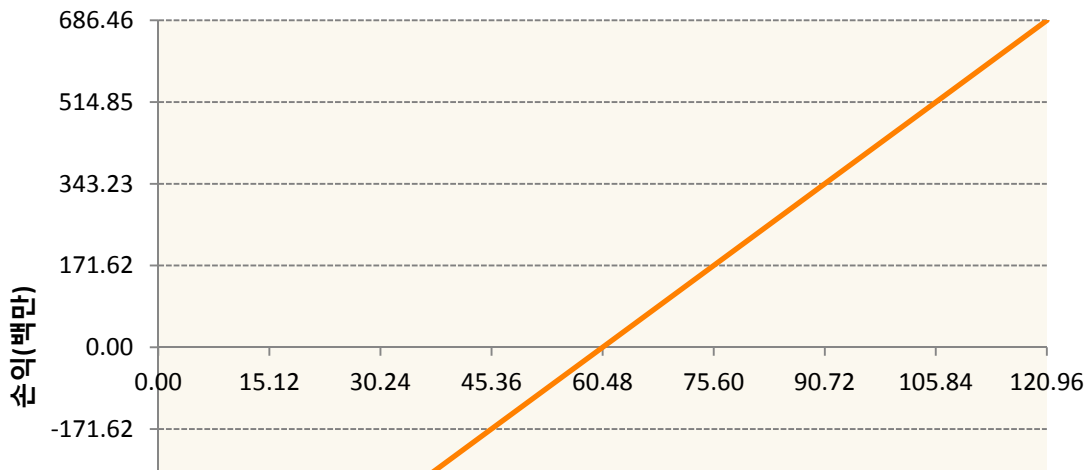
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,643 | 202   | 2,441     |    |

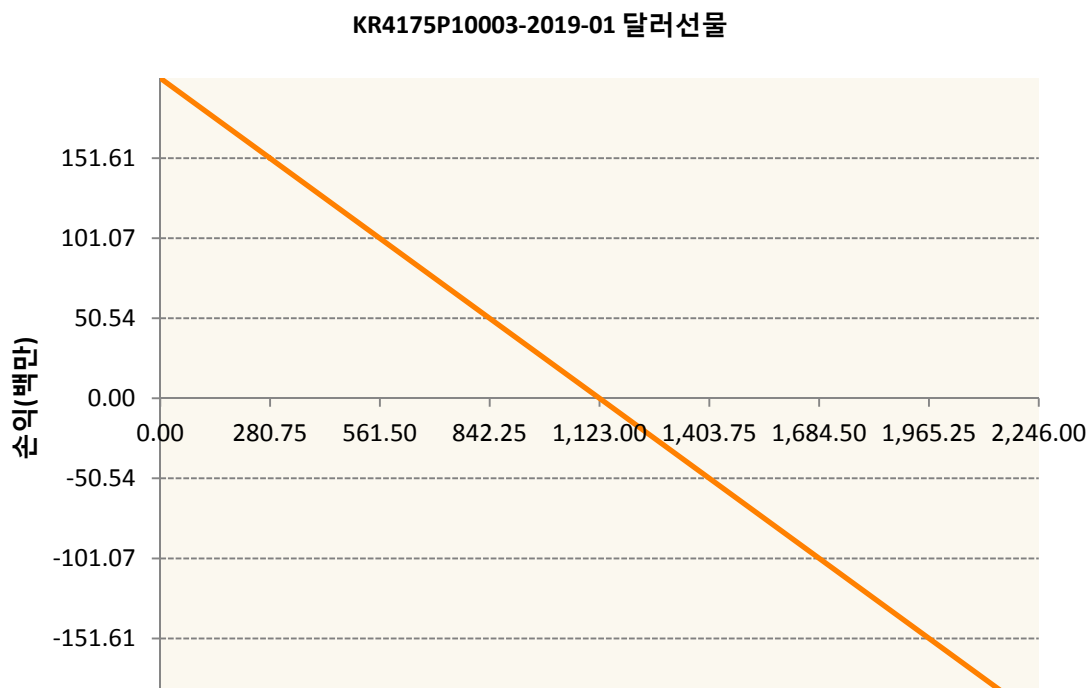
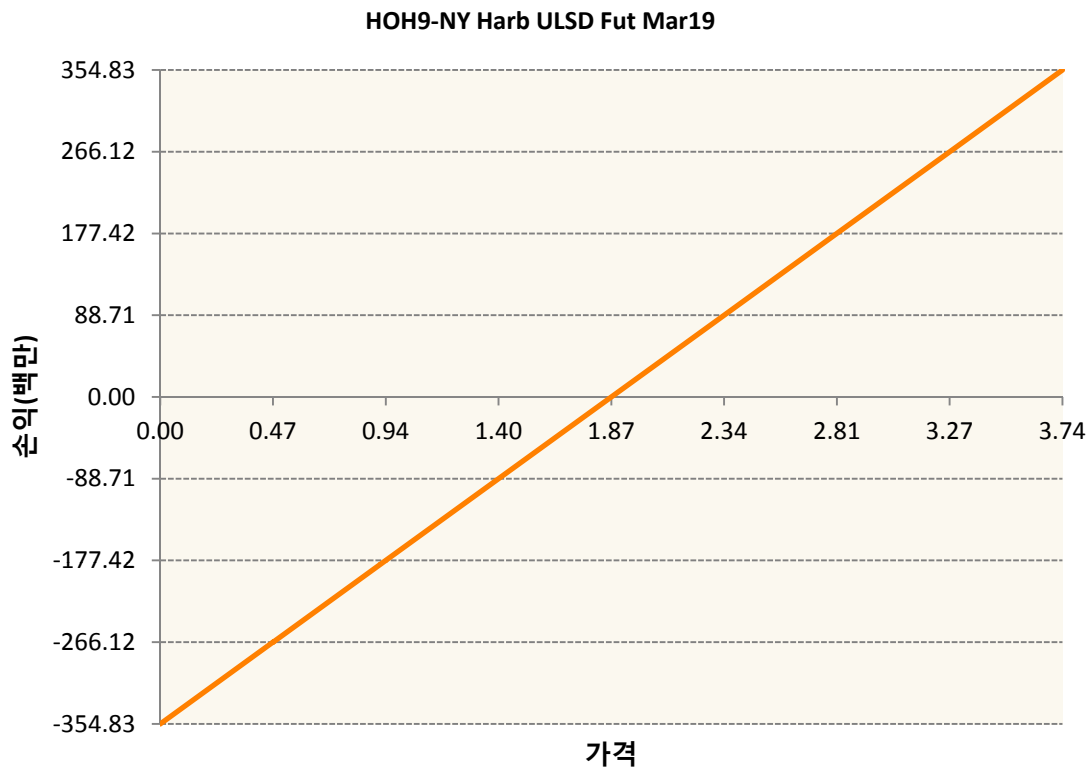
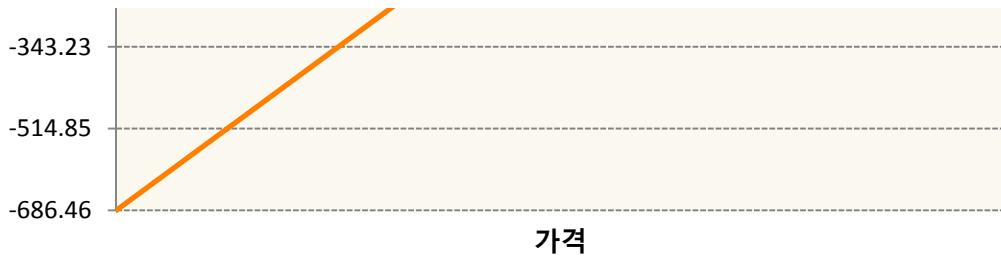
### 2. 만기시점의 손익구조

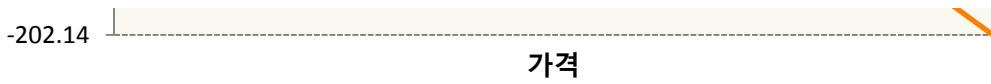
**CLH9-WTI CRUDE FUTURE MAR19**



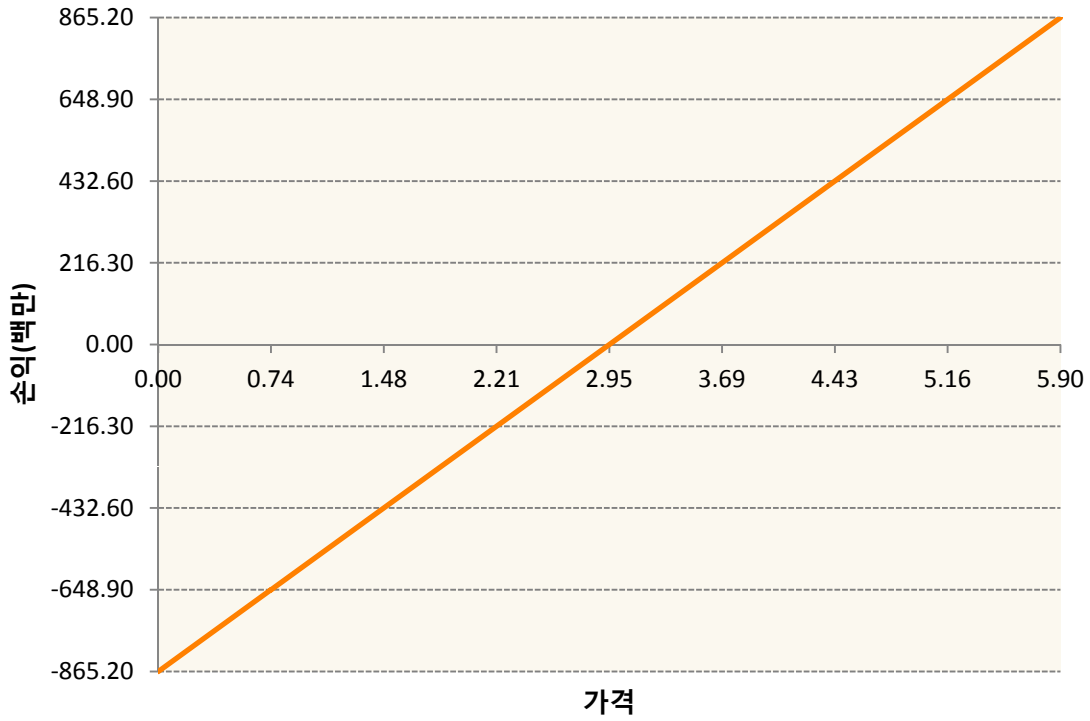
**COH9-BRENT CRUDE FUTR Mar19**



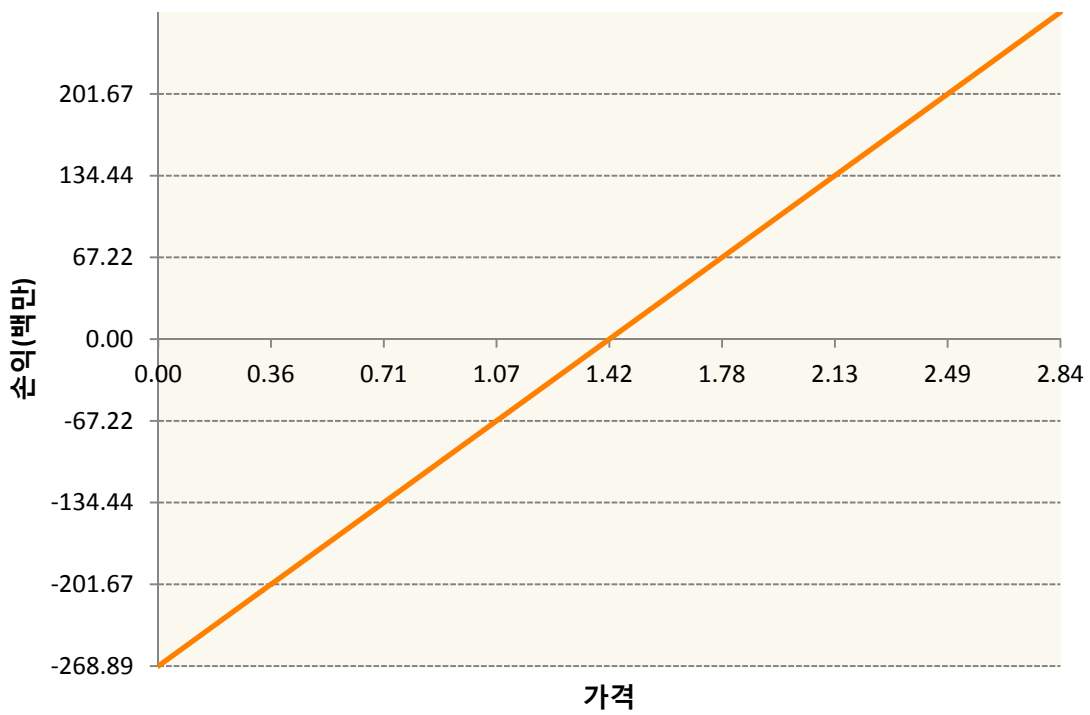




NGH19-NATURAL GAS FUTR Mar19



XBH9-GASOLINE RBOB FUT Mar19



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

|            |                         |    |
|------------|-------------------------|----|
| CLH9       | WTI CRUDE FUTURE MAR19  | 37 |
| COH9       | BRENT CRUDE FUTR Mar19  | 55 |
| HOH9       | NY Harb ULSD Fut Mar19  | 28 |
| KR4175P100 | 2019-01 달러선물            | 16 |
| NGH19      | NATURAL GAS FUTR Mar19  | 69 |
| XBH9       | GASOLINE RBOB FUT Mar19 | 22 |

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

**407**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-15 |
| 기준일 | 2019-01-14 |

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

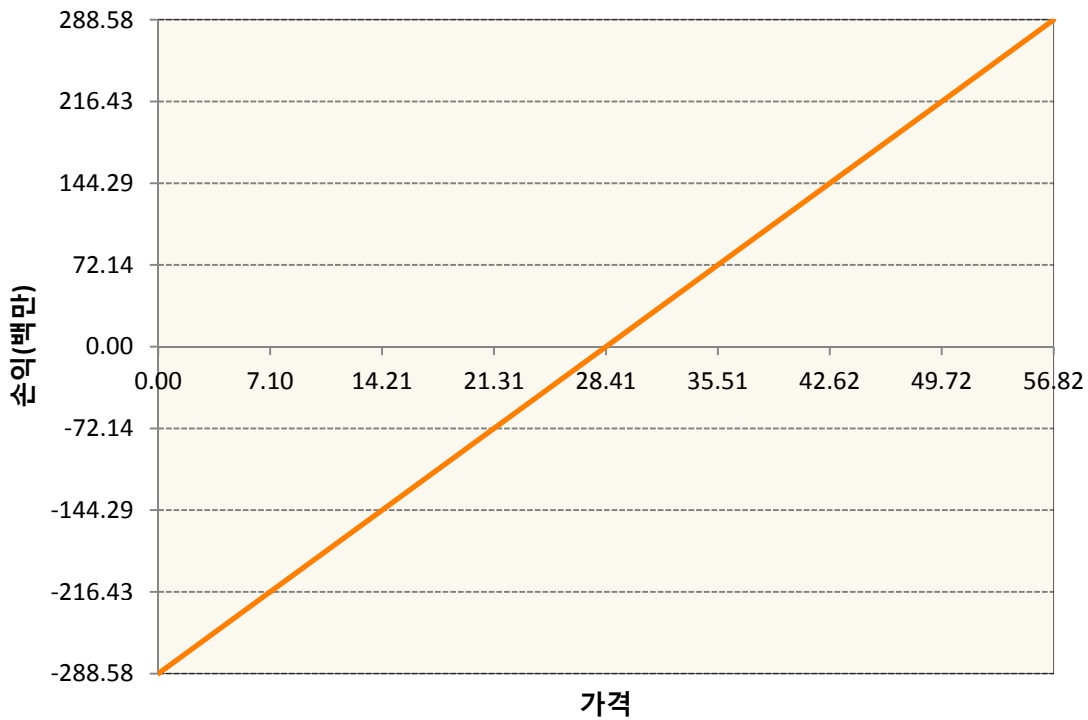
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

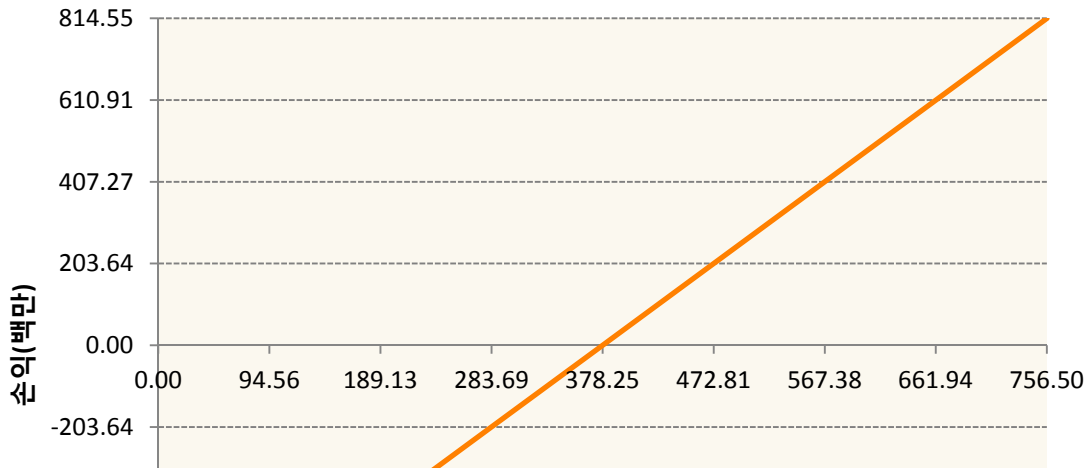
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 3,597 | 79    | 3,518     |    |

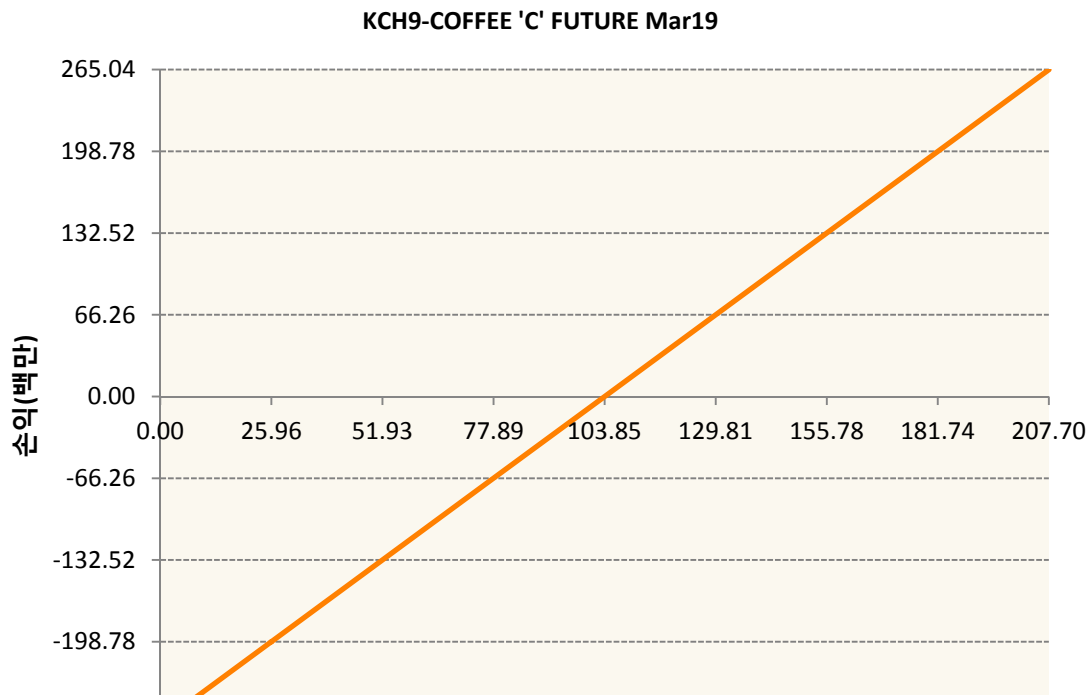
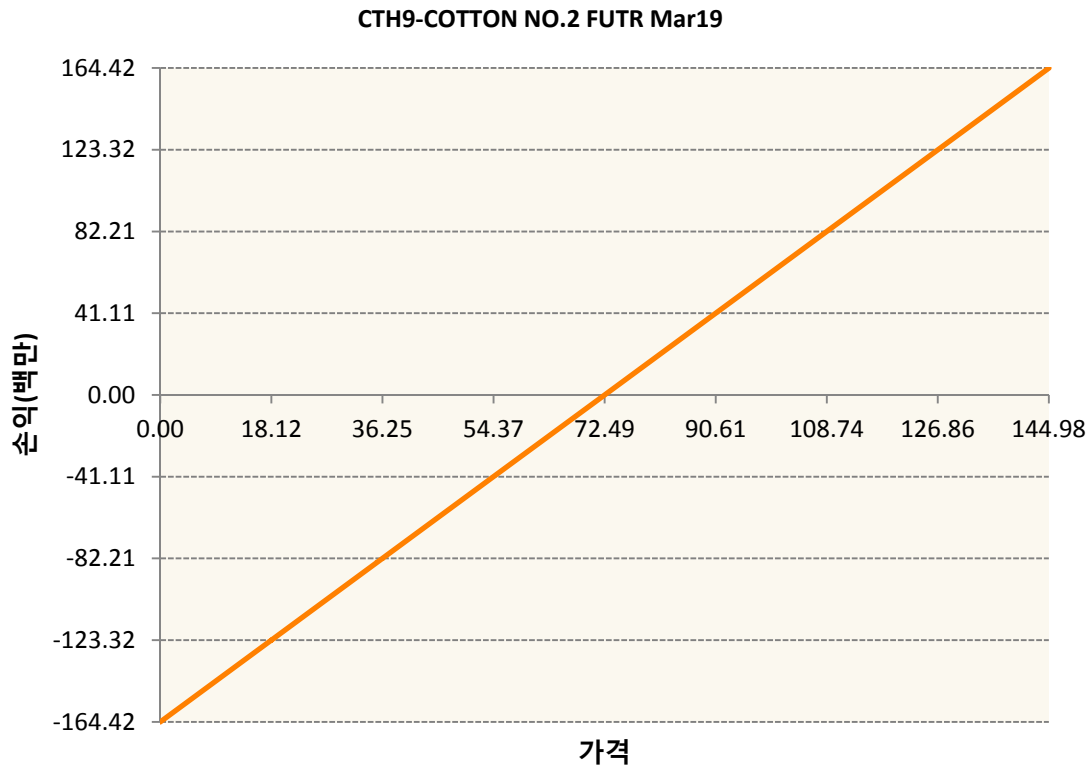
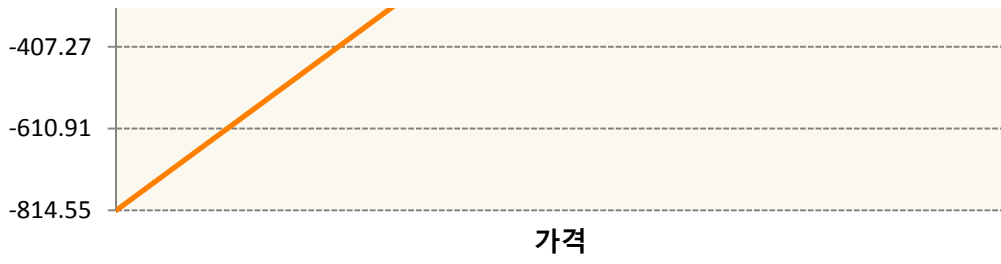
### 2. 만기시점의 손익구조

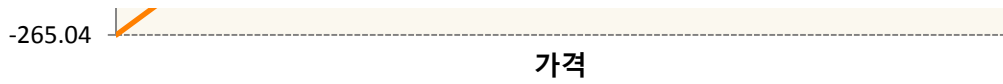
**BOH9-SOYBEAN OIL FUTR Mar19**



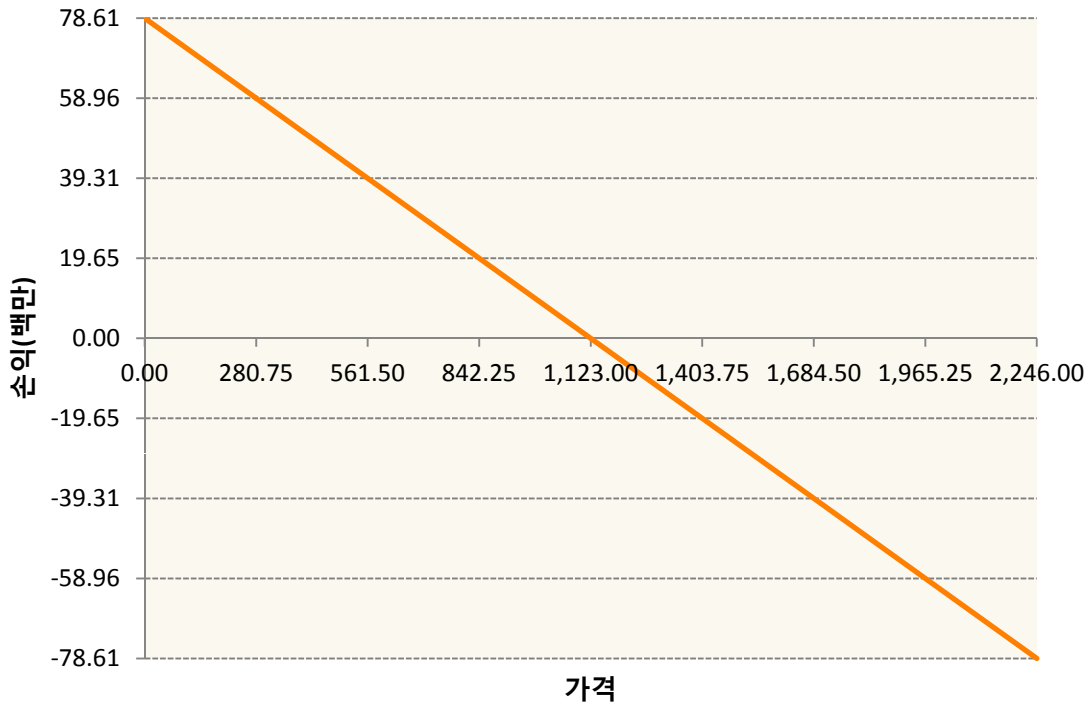
**CH9-CORN FUTURE Mar19**



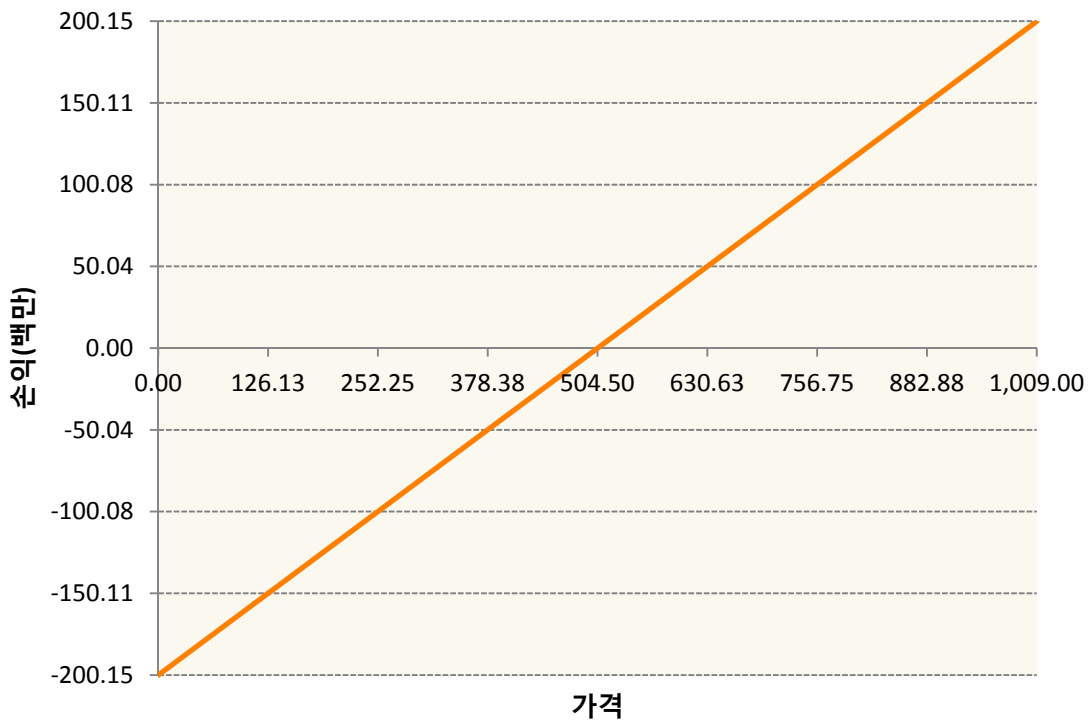




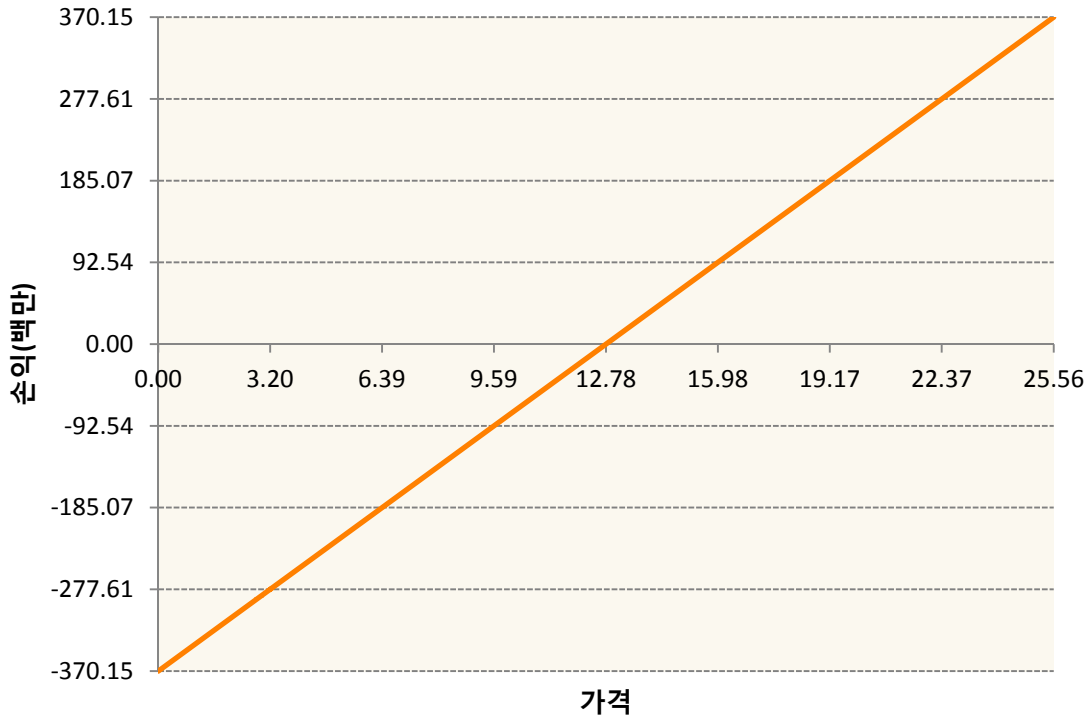
KR4175P10003-2019-01 달러선물



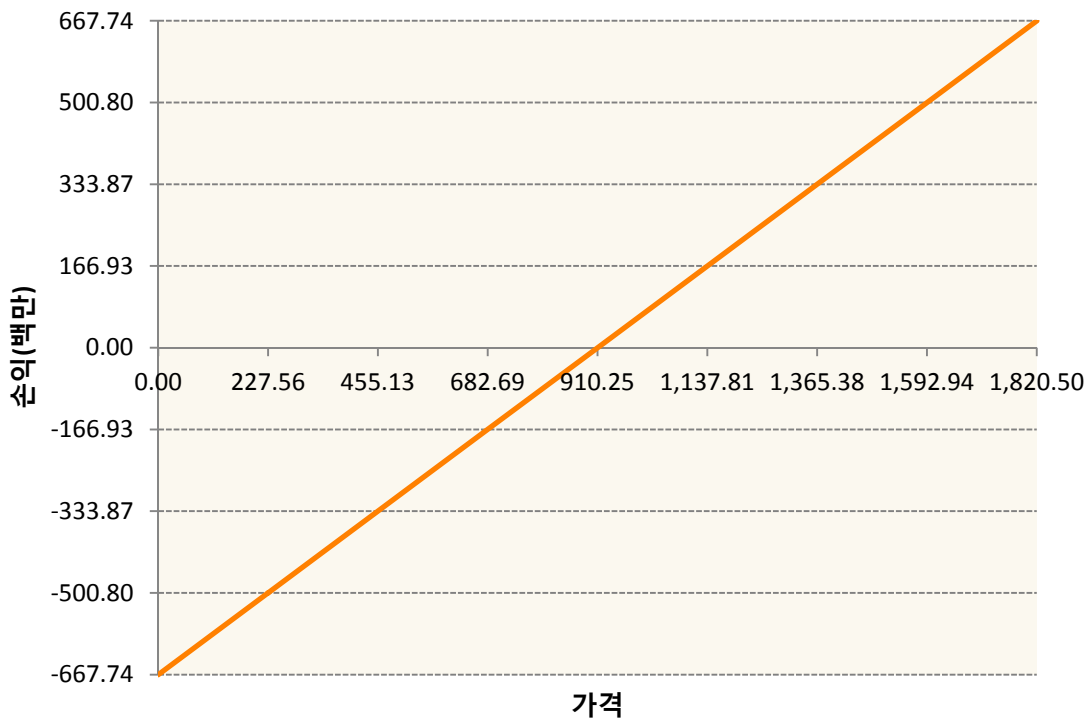
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

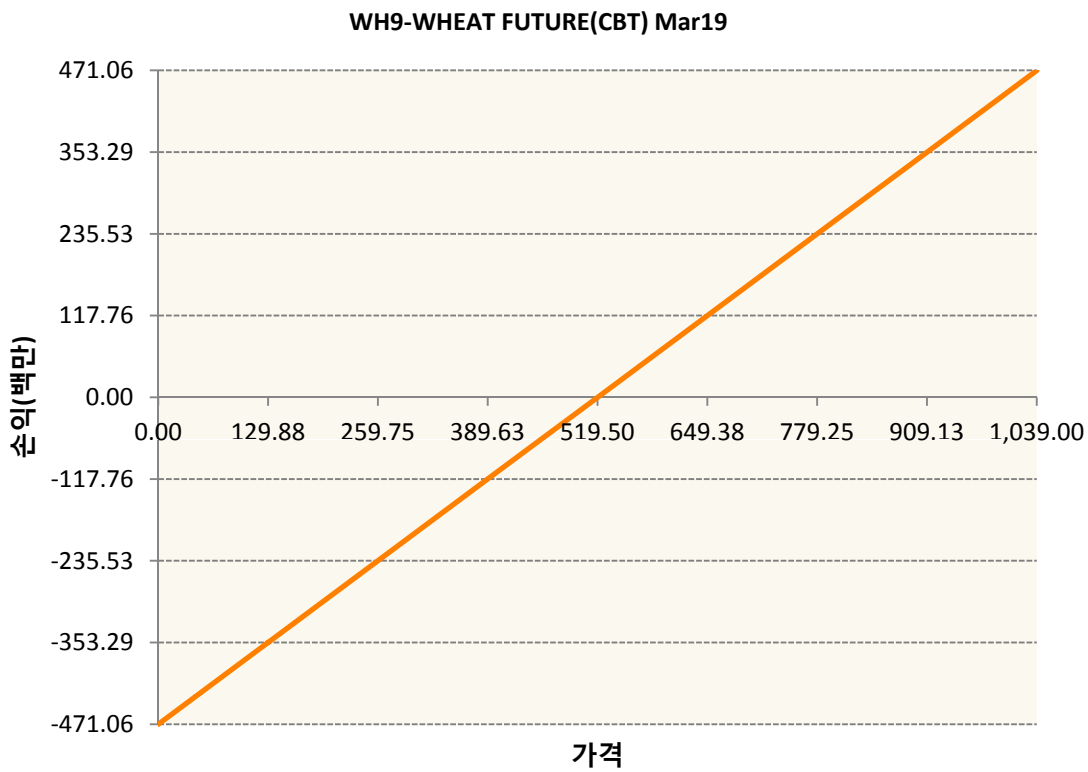
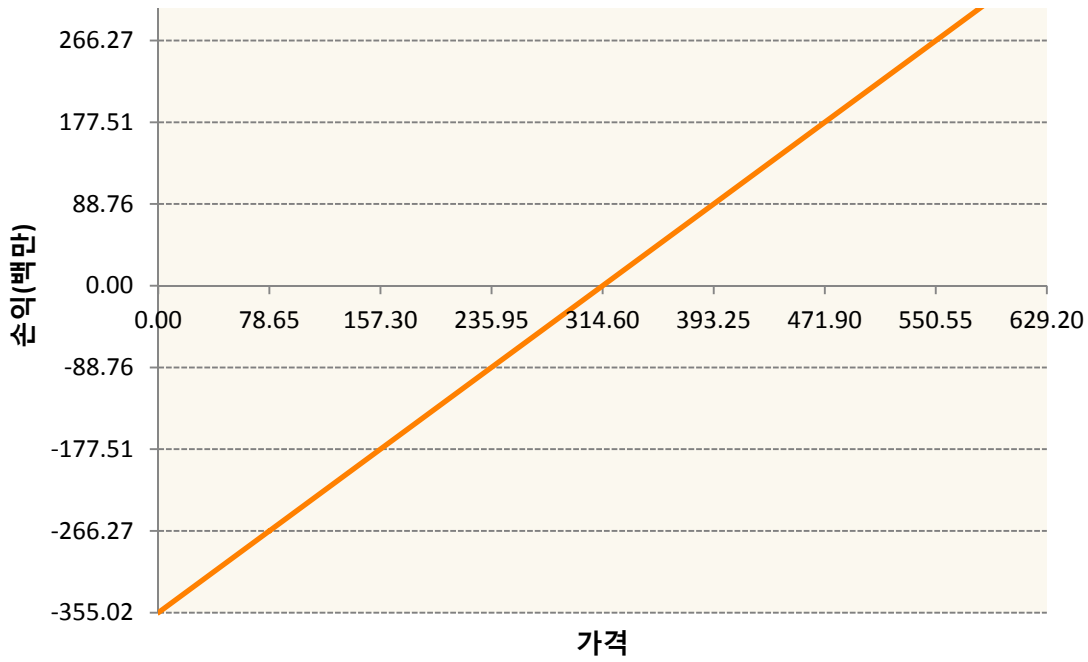


SH9-SOYBEAN FUTURE Mar19



SMH9-SOYBEAN MEAL FUTR Mar19





**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 | 21 |
| KR4175P100 | 2019-01 달러선물            | 6  |

|      |                         |    |
|------|-------------------------|----|
| KWH9 | KC HRW WHEAT FUT Mar19  | 16 |
| SBH9 | SUGAR #11 (WORLD) MAR19 | 30 |
| SH9  | SOYBEAN FUTURE Mar19    | 53 |
| SMH9 | SOYBEAN MEAL FUTR Mar19 | 28 |
| WH9  | WHEAT FUTURE(CBT) Mar19 | 38 |

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

(단위:백만원)

**302**