

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-23 |
| 기준일 | 2019-01-22 |

## 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)

96

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-23 |
| 기준일 | 2019-01-22 |

## 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

1,065

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

602

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-23 |
| 기준일 | 2019-01-22 |

## 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

|     |
|-----|
| 265 |
|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 395 |
|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-23 |
| 기준일 | 2019-01-22 |

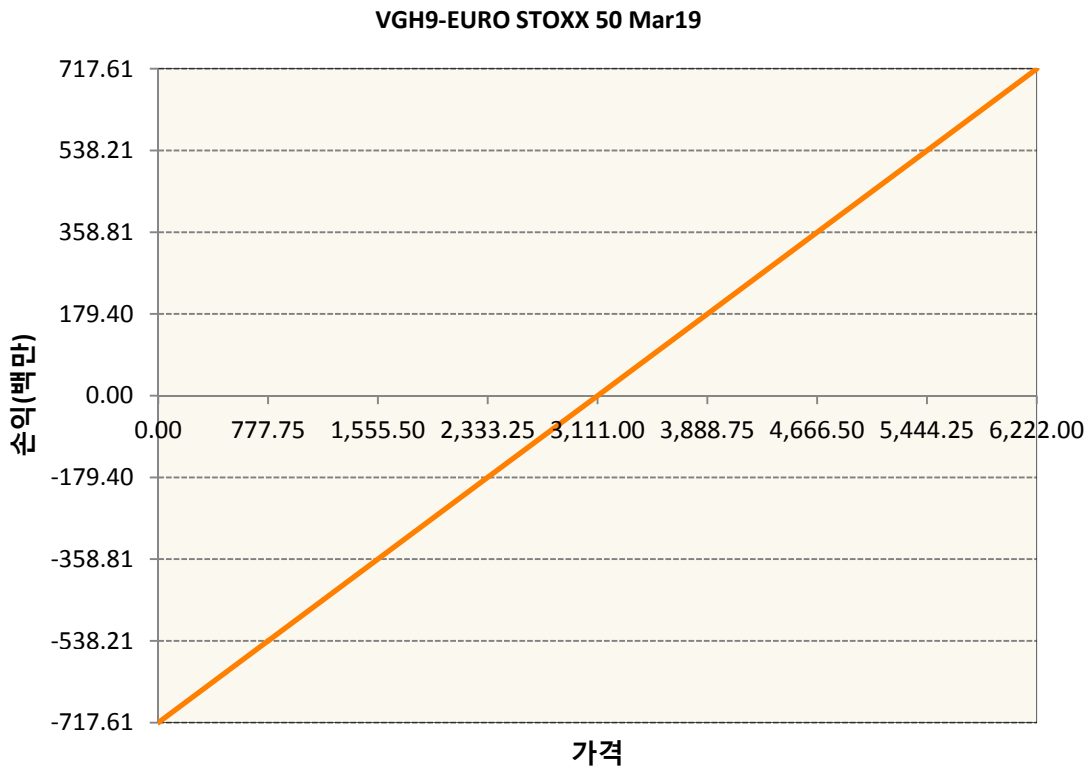
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 718   | 0     | 718       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-23 |
| 기준일 | 2019-01-22 |

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

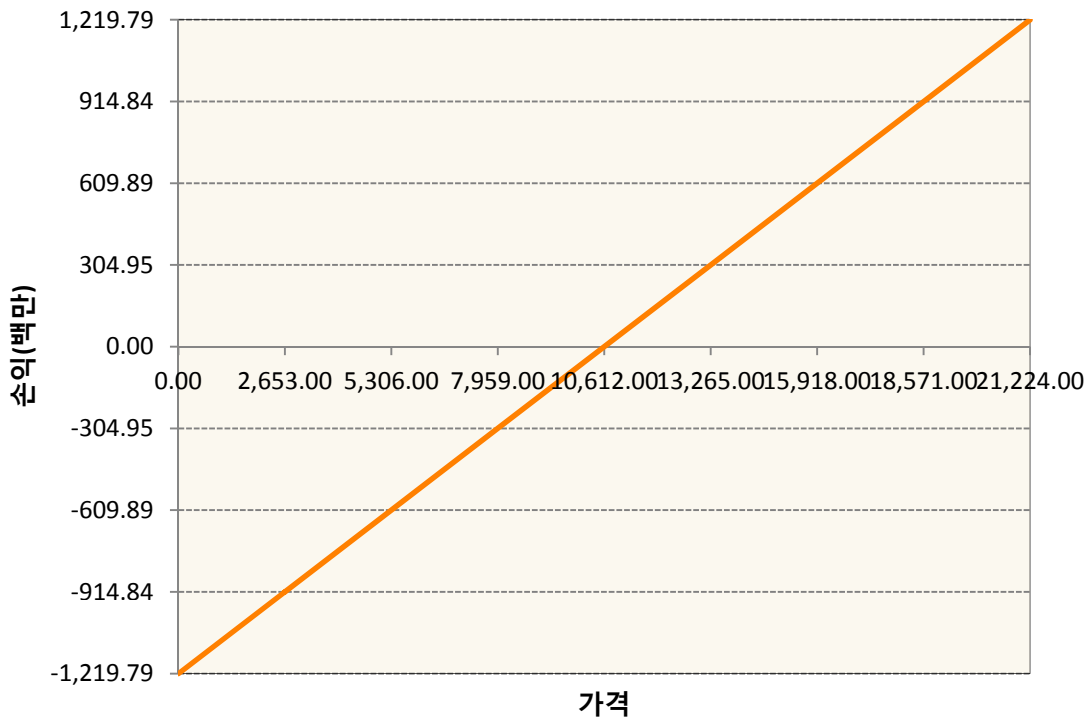
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

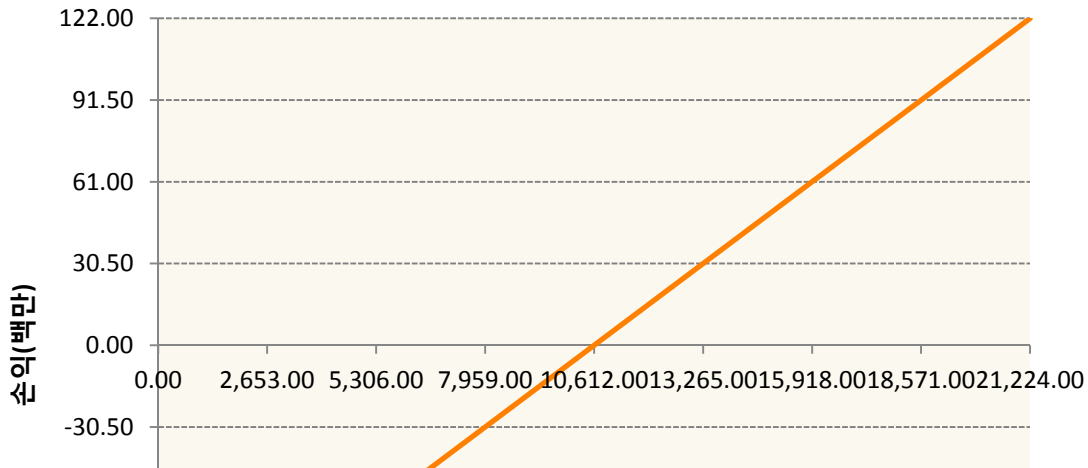
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,342 | 0     | 1,342     | 장내 |

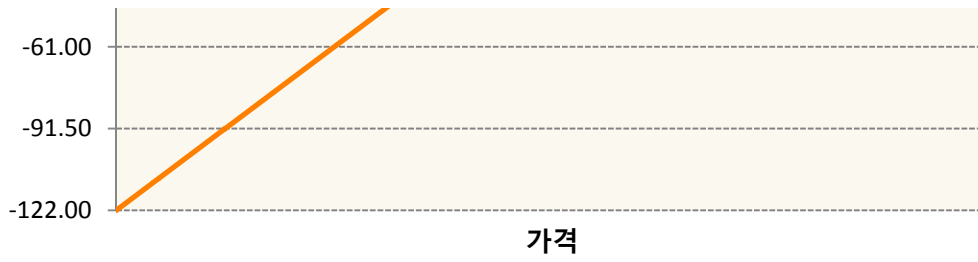
### 2. 만기시점의 손익구조

**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)

|            |
|------------|
| <b>110</b> |
|------------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-23 |
| 기준일 | 2019-01-22 |

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

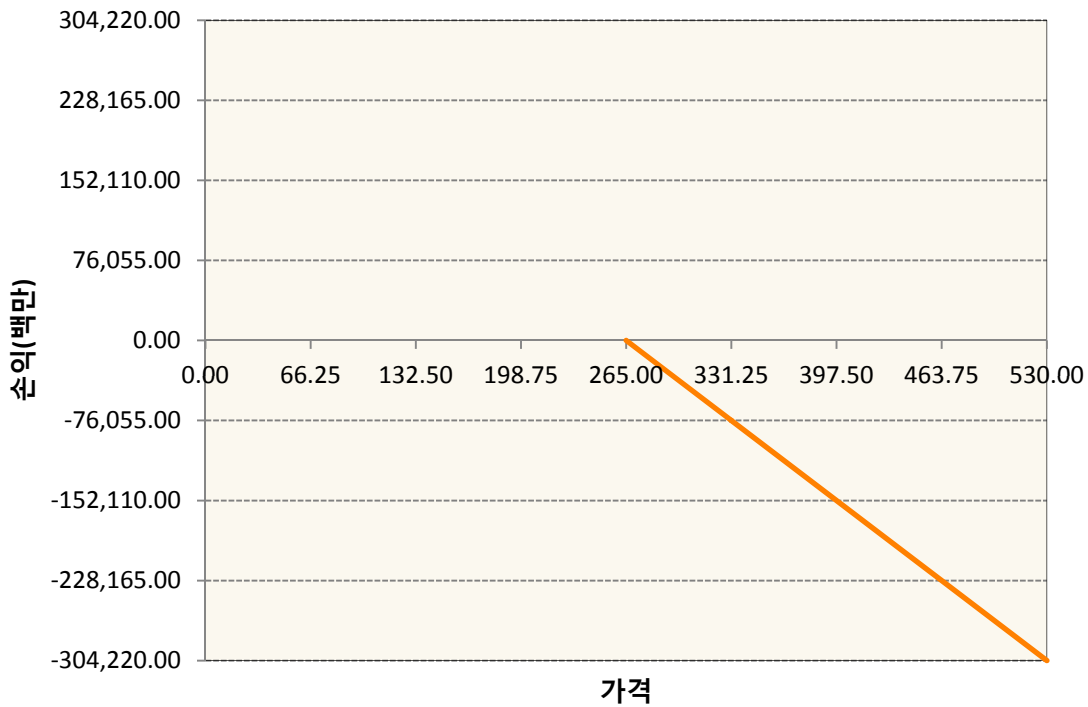
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)   | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0       | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 693,318 | -693,318  | 장내 |

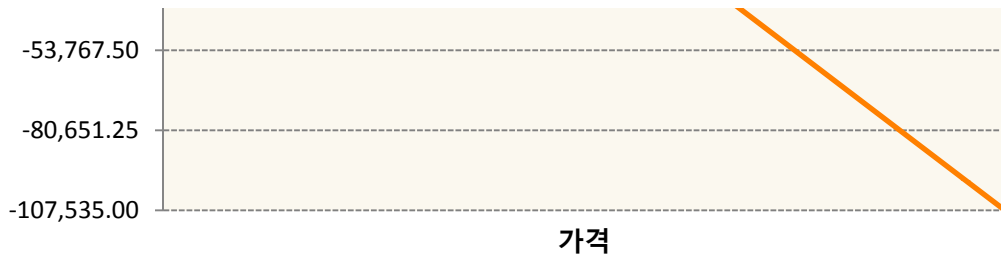
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P22655-2019-02 콜265

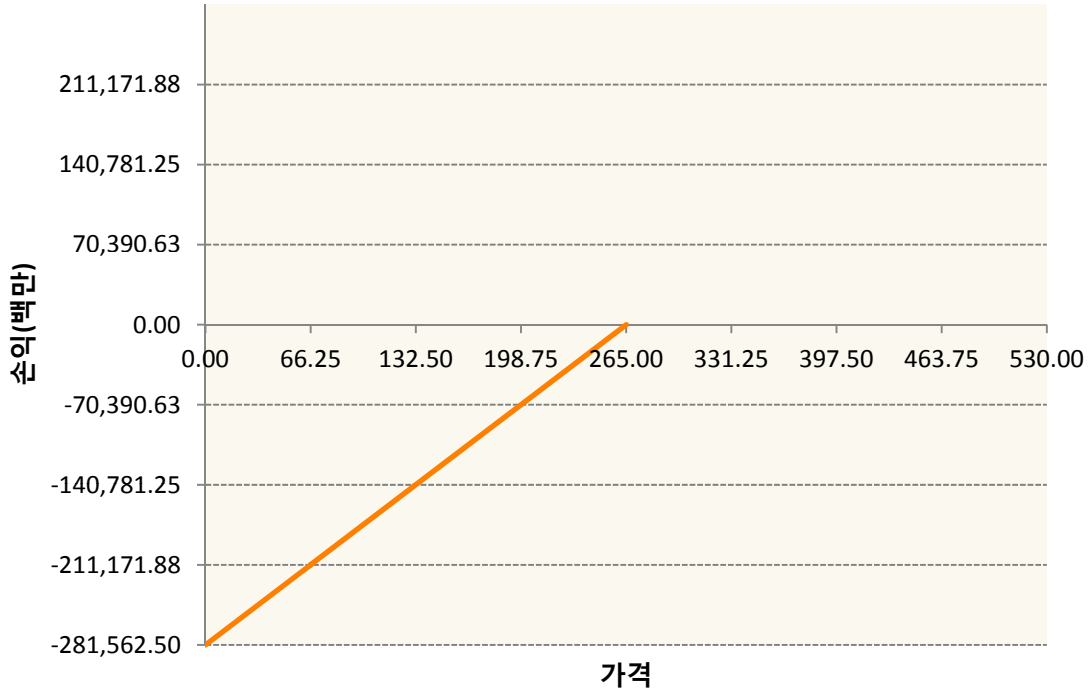


KR4201P22671-2019-02 콜267.5





KR4301P22653-2019-02 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4201P22655 |         | 2019-02 콜265   |         |         |         |         | 21,872  |
|--------------|---------|----------------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 기초자산의 변동성    |         |                |         |         |         |         |         |
| 가격           | -25.00% | -16.67%        | -8.33%  | 0%      | 8.33%   | 16.67%  | 25.00%  |
| -8.00%       | 12,267  | 11,902         | 11,497  | 11,061  | 10,598  | 10,113  | 9,610   |
| -5.33%       | 10,469  | 9,897          | 9,312   | 8,717   | 8,114   | 7,505   | 6,890   |
| -2.67%       | 7,021   | 6,363          | 5,705   | 5,047   | 4,389   | 3,731   | 3,074   |
| 0%           | 1,757   | 1,187          | 600     | 0       | -609    | -1,227  | -1,850  |
| 2.67%        | -4,991  | -5,373         | -5,796  | -6,253  | -6,738  | -7,248  | -7,776  |
| 5.33%        | -12,659 | -12,860        | -13,111 | -13,407 | -13,743 | -14,116 | -14,520 |
| 8.00%        | -20,768 | -20,853        | -20,977 | -21,142 | -21,347 | -21,592 | -21,872 |
| KR4201P22671 |         | 2019-02 콜267.5 |         |         |         |         | 7,405   |
| 기초자산의 변동성    |         |                |         |         |         |         |         |
| 가격           | -25.00% | -16.67%        | -8.33%  | 0%      | 8.33%   | 16.67%  | 25.00%  |
| -8.00%       | 3,770   | 3,665          | 3,546   | 3,412   | 3,268   | 3,114   | 2,953   |

|  |         |         |         |         |         |         |         |
|--|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| -5.33%   | 3,290   | 3,109   | 2,921   | 2,727   | 2,527   | 2,324   | 2,118   |
| -2.67%   | 2,292   | 2,063   | 1,834   | 1,604   | 1,374   | 1,144   | 913     |
| 0%   | 664     | 445     | 224     | 0       | -225    | -452    | -679    |
| 2.67%  | -1,536  | -1,697  | -1,869  | -2,050  | -2,240  | -2,435  | -2,636  |
| 5.33%  | -4,127  | -4,219  | -4,329  | -4,454  | -4,593  | -4,742  | -4,902  |
| 8.00%  | -6,924  | -6,966  | -7,025  | -7,099  | -7,188  | -7,290  | -7,405  |
| KR4301P22653                      2019-02 풋265 |         |         |         |         |         |         | 14,343  |
| 기초자산의 변동성                                      |         |         |         |         |         |         |         |
| 가격   | -25.00% | -16.67% | -8.33%  | 0%      | 8.33%   | 16.67%  | 25.00%  |
| -8.00%   | -13,624 | -13,690 | -13,779 | -13,890 | -14,022 | -14,174 | -14,343 |
| -5.33%   | -6,594  | -6,834  | -7,090  | -7,361  | -7,642  | -7,932  | -8,229  |
| -2.67%   | -1,553  | -1,907  | -2,260  | -2,614  | -2,968  | -3,322  | -3,676  |
| 0%   | 734     | 508     | 262     | 0       | -275    | -560    | -855    |
| 2.67%  | 1,308   | 1,241   | 1,150   | 1,035   | 898     | 741     | 565     |
| 5.33%  | 1,384   | 1,374   | 1,355   | 1,324   | 1,279   | 1,218   | 1,140   |
| 8.00%  | 1,389   | 1,388   | 1,386   | 1,381   | 1,370   | 1,353   | 1,327   |

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

(단위:백만원)

**42,497**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-23 |
| 기준일 | 2019-01-22 |

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

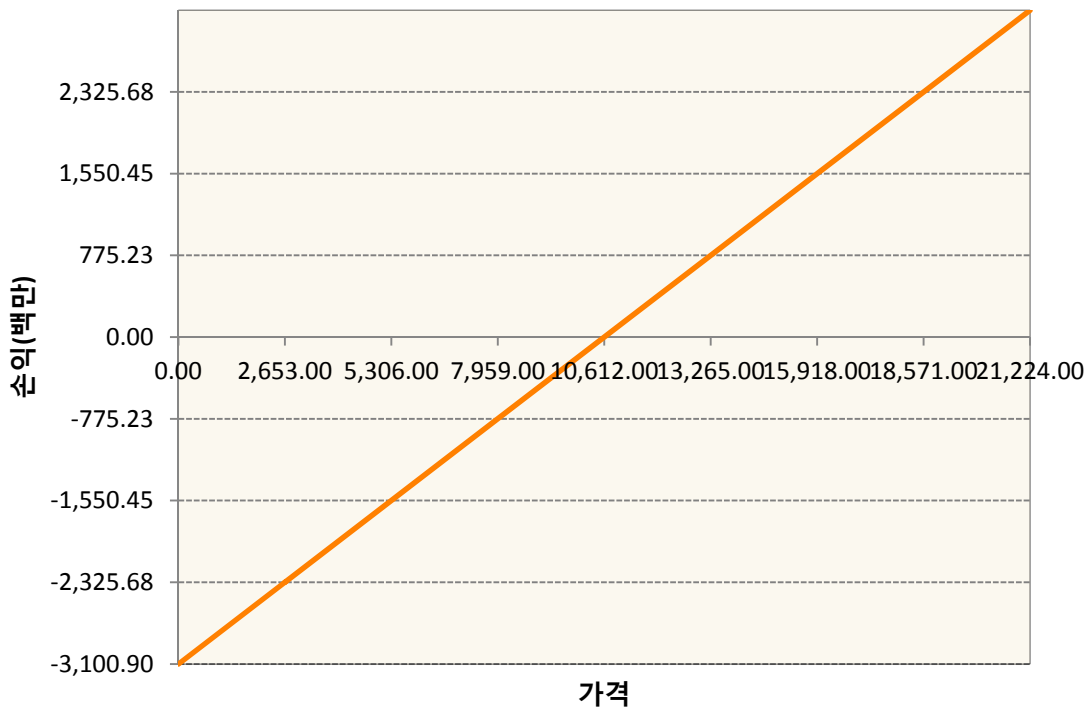
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

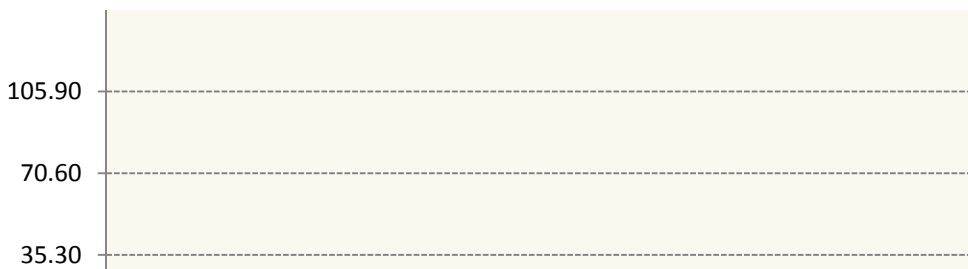
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 3,101 | 0     | 3,101     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 7,054 | -7,054    | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 2,738 | -2,738    | 장외 |

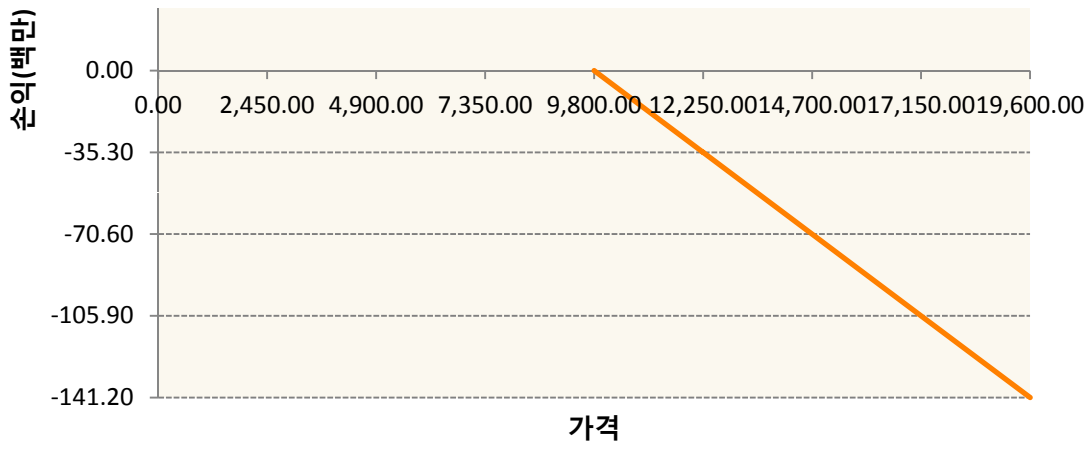
### 2. 만기시점의 손익구조

HCF9-HSCEI FUTURES JAN19

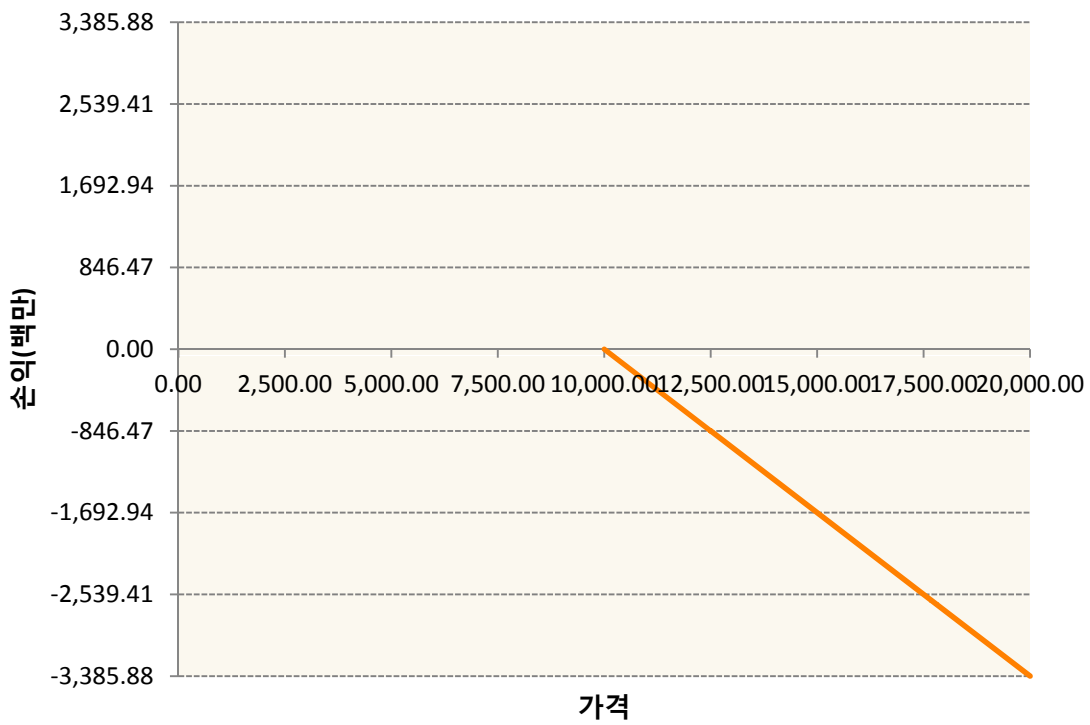


OHHIF9-C098-HSCEI

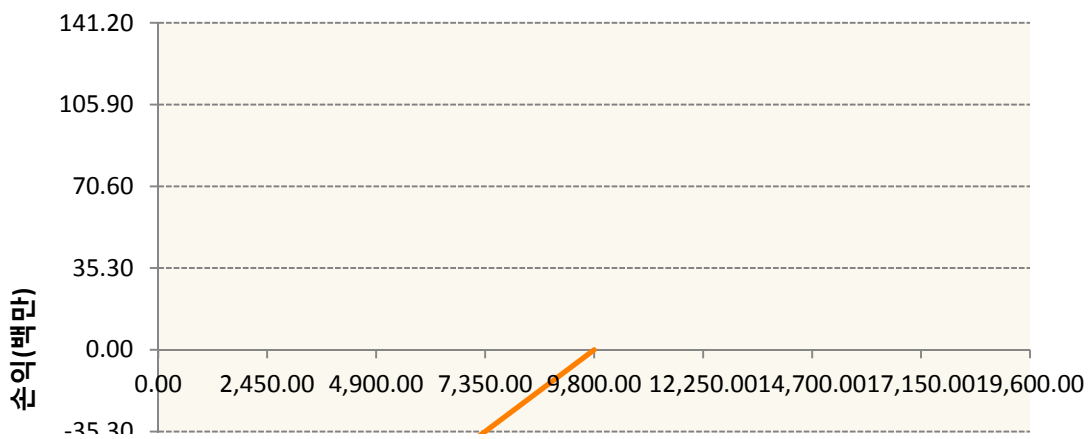


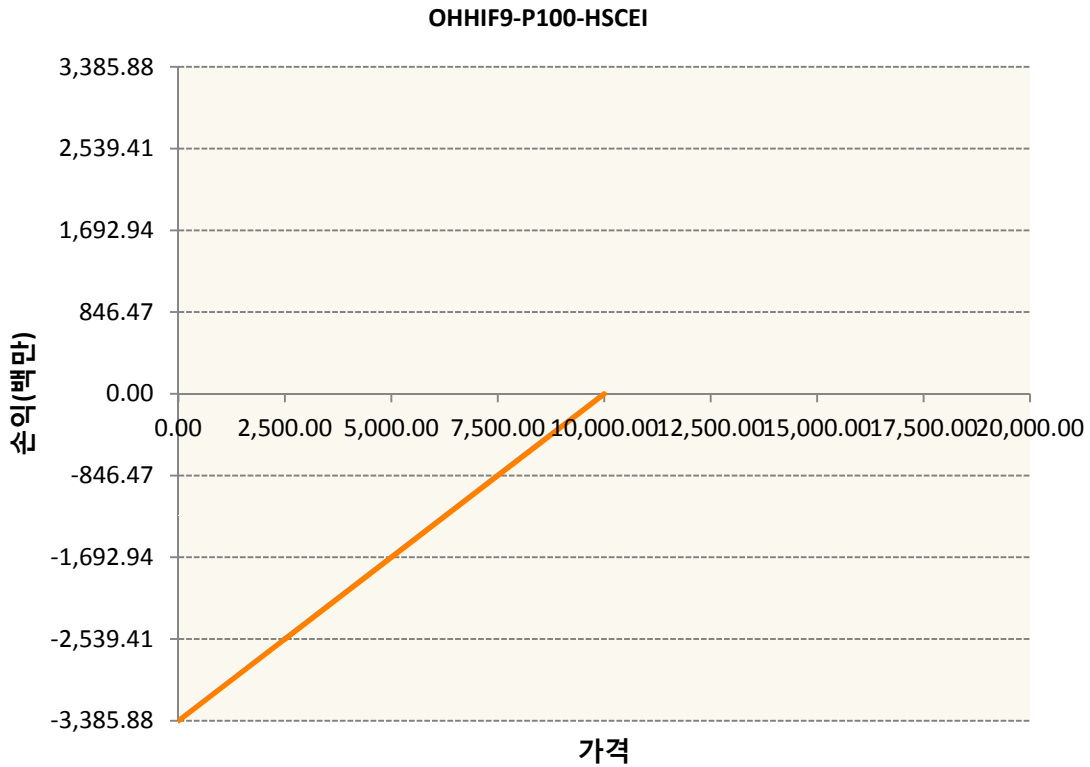
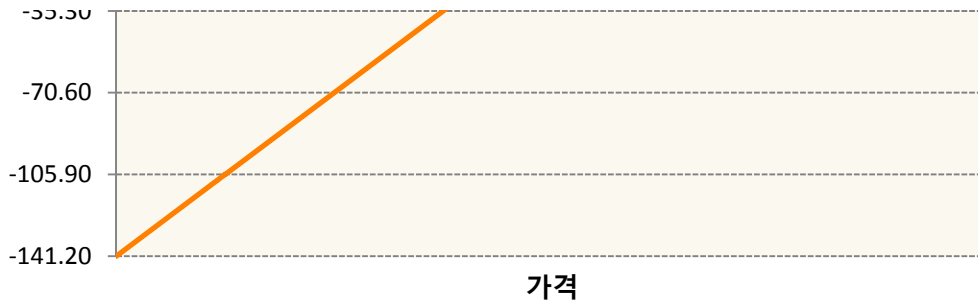


**OHHIF9-C100-HSCEI**



**OHHIF9-P098-HSCEI**





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)    | (단위:백만원) |
|------------------------------|----------|
| FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E | 219      |
| HCF9 HSCEI FUTURES JAN19     | 248      |
| OHHIF9-C09 HSCEI             | 11       |
| OHHIF9-C10 HSCEI             | 271      |
| OHHIF9-P09 HSCEI             | 11       |
| OHHIF9-P10 HSCEI             | 271      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|--|----------|
|  | 915      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-23 |
| 기준일 | 2019-01-22 |

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

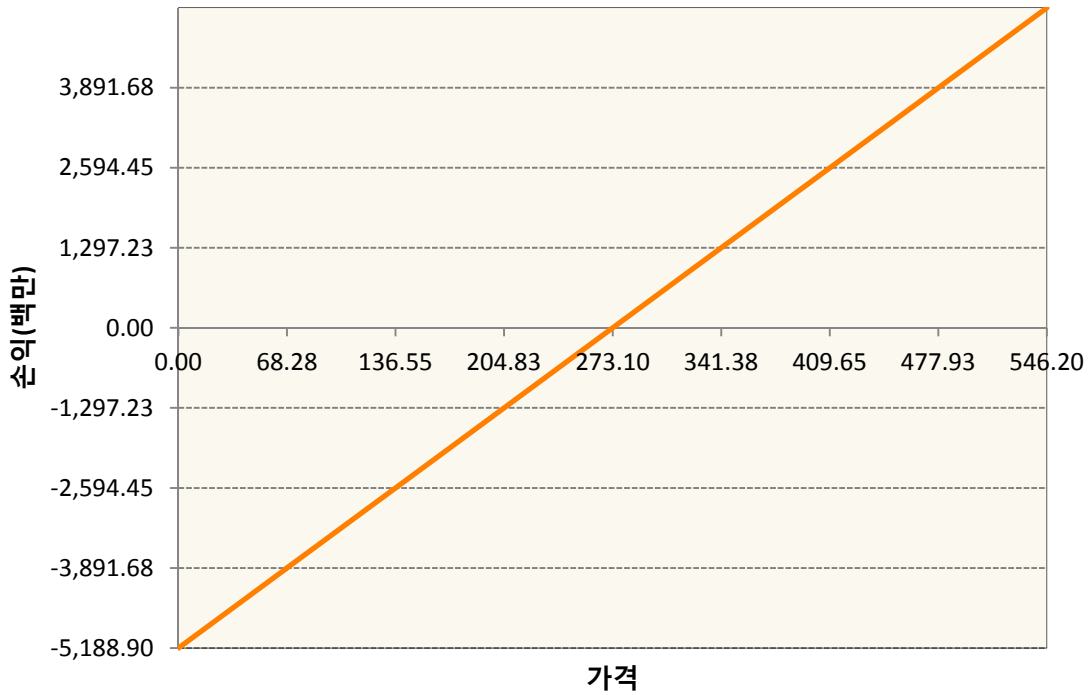
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

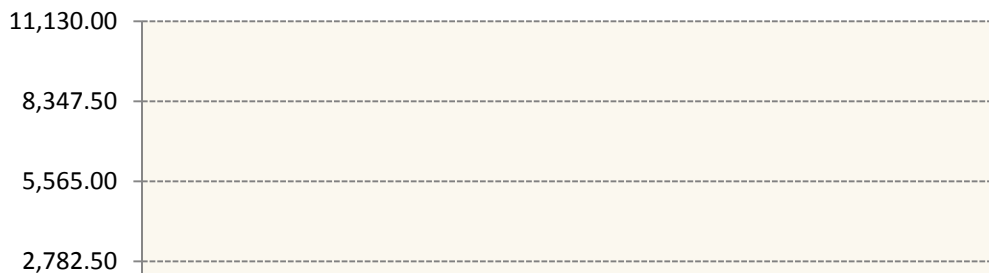
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 1,092  | 0      | 1,092     | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑   | 0      | 0      | 0         | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0      | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 5,189  | 0      | 5,189     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 31,836 | 0      | 31,836    | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0      | 33,858 | -33,858   | 장내 |

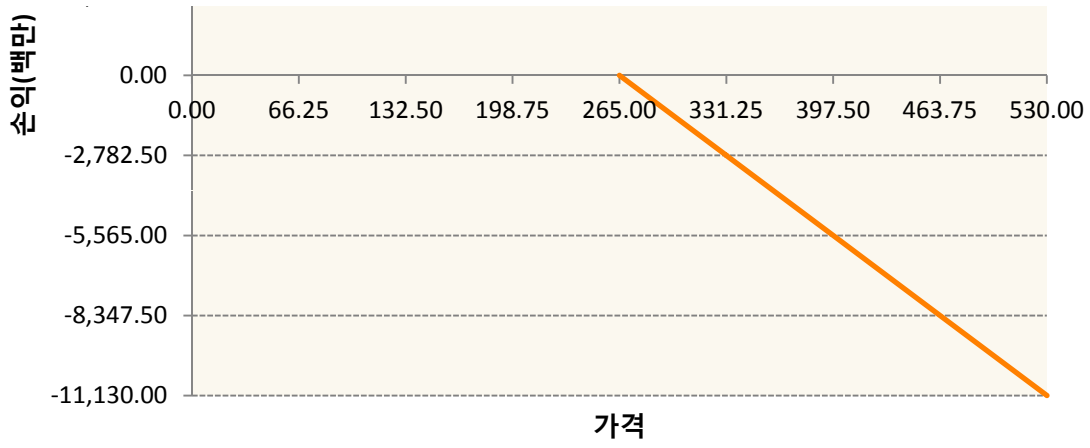
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

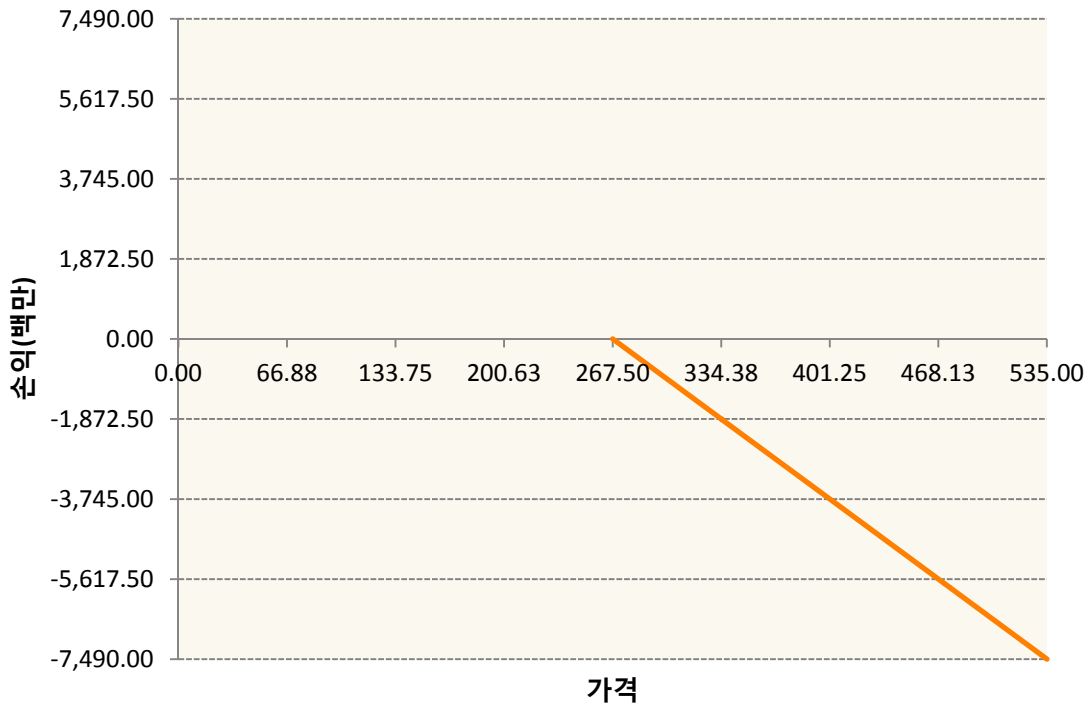


KR4201P22655-2019-02 콜265

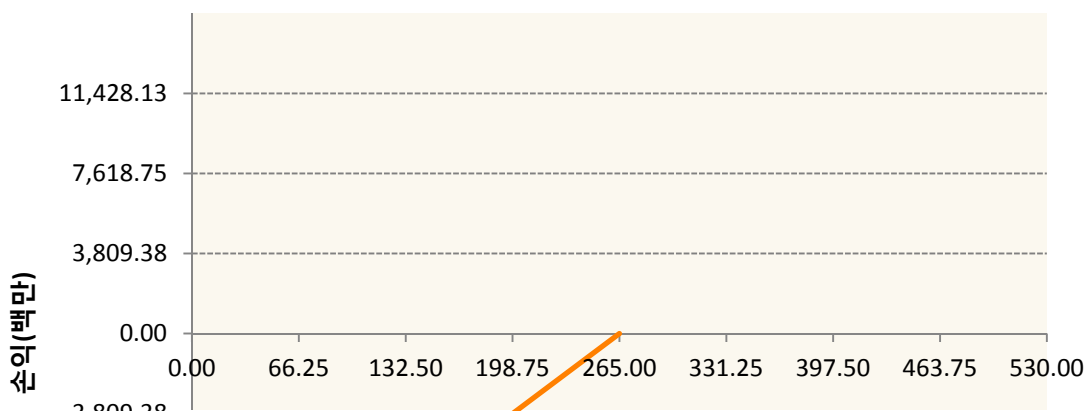




KR4201P22671-2019-02 콜267.5



KR4301P22653-2019-02 풋265





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

|              |         |                    |        |        |        |        |        |       |
|--------------|---------|--------------------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|
| 2.529E+11    |         | UBCSFXC1 INDEX_14  |        |        |        |        |        | 2,662 |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |        |        |        |        |       |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |       |
| -8.00%       | -2,662  | -2,662             | -2,662 | -2,662 | -2,662 | -2,662 | -2,662 |       |
| -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%        | 2,662   | 2,662              | 2,662  | 2,662  | 2,662  | 2,662  | 2,662  |       |
| KR4101P30007 |         | 2019-03 코스피200지수선물 |        |        |        |        |        | 415   |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |        |        |        |        |       |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |       |
| -8.00%       | -415    | -415               | -415   | -415   | -415   | -415   | -415   |       |
| -5.33%       | -276    | -276               | -276   | -276   | -276   | -276   | -276   |       |
| -2.67%       | -138    | -138               | -138   | -138   | -138   | -138   | -138   |       |
| 0%           | 0       | 0                  | 0      | 0      | 0      | 0      | 0      |       |
| 2.67%        | 138     | 138                | 138    | 138    | 138    | 138    | 138    |       |
| 5.33%        | 276     | 276                | 276    | 276    | 276    | 276    | 276    |       |
| 8.00%        | 415     | 415                | 415    | 415    | 415    | 415    | 415    |       |
| KR4201P22655 |         | 2019-02 콜265       |        |        |        |        |        | 800   |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |        |        |        |        |       |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |       |
| -8.00%       | 449     | 435                | 421    | 405    | 388    | 370    | 352    |       |
| -5.33%       | 383     | 362                | 341    | 319    | 297    | 275    | 252    |       |
| -2.67%       | 257     | 233                | 209    | 185    | 161    | 137    | 112    |       |
| 0%           | 64      | 43                 | 22     | 0      | -22    | -45    | -68    |       |
| 2.67%        | -183    | -197               | -212   | -229   | -247   | -265   | -284   |       |
| 5.33%        | -463    | -470               | -480   | -490   | -503   | -516   | -531   |       |
| 8.00%        | -760    | -763               | -767   | -773   | -781   | -790   | -800   |       |
| KR4201P22671 |         | 2019-02 콜267.5     |        |        |        |        |        | 516   |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |        |        |        |        |       |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |       |

|  |         |         |        |      |       |        |        |
|--|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| -8.00%   | 263     | 255     | 247    | 238  | 228   | 217    | 206    |
| -5.33%   | 229     | 217     | 203    | 190  | 176   | 162    | 147    |
| -2.67%   | 160     | 144     | 128    | 112  | 96    | 80     | 64     |
| 0%   | 46      | 31      | 16     | 0    | -16   | -31    | -47    |
| 2.67%  | -107    | -118    | -130   | -143 | -156  | -170   | -184   |
| 5.33%  | -287    | -294    | -302   | -310 | -320  | -330   | -341   |
| 8.00%  | -482    | -485    | -489   | -494 | -501  | -508   | -516   |
| KR4301P22653                      2019-02 풋265 |         |         |        |      |       |        | 776    |
| 기초자산의 변동성                                      |         |         |        |      |       |        |        |
| 가격   | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%   | -737    | -741    | -746   | -752 | -759  | -767   | -776   |
| -5.33%   | -357    | -370    | -384   | -398 | -414  | -429   | -445   |
| -2.67%   | -84     | -103    | -122   | -141 | -161  | -180   | -199   |
| 0%   | 40      | 27      | 14     | 0    | -15   | -30    | -46    |
| 2.67%  | 71      | 67      | 62     | 56   | 49    | 40     | 31     |
| 5.33%  | 75      | 74      | 73     | 72   | 69    | 66     | 62     |
| 8.00%  | 75      | 75      | 75     | 75   | 74    | 73     | 72     |

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

(단위:백만원)

**5,051**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-23 |
| 기준일 | 2019-01-22 |

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

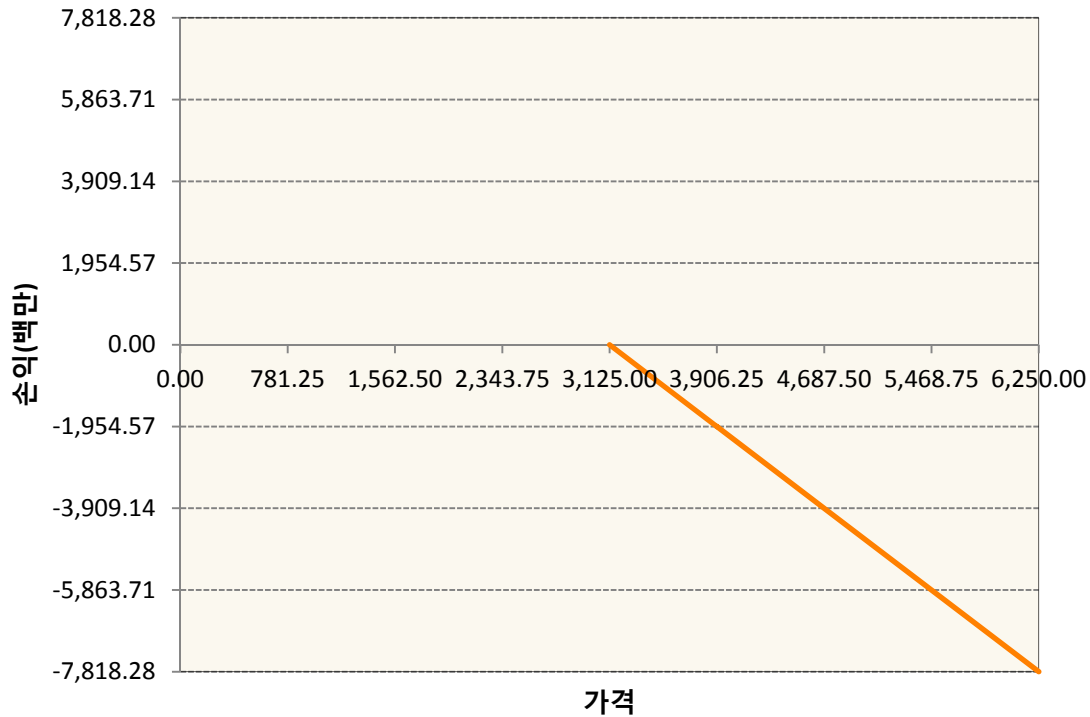
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

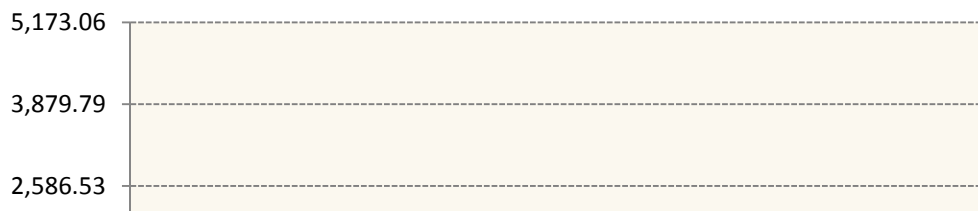
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0      | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 스왑   | 0      | 0      | 0         | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0      | 0      | 0         | 장내 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0      | 0      | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 6,735  | 0      | 6,735     |    |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 60,572 | 0      | 60,572    | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0      | 25,983 | -25,983   | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 15,396 | -15,396   | 장외 |

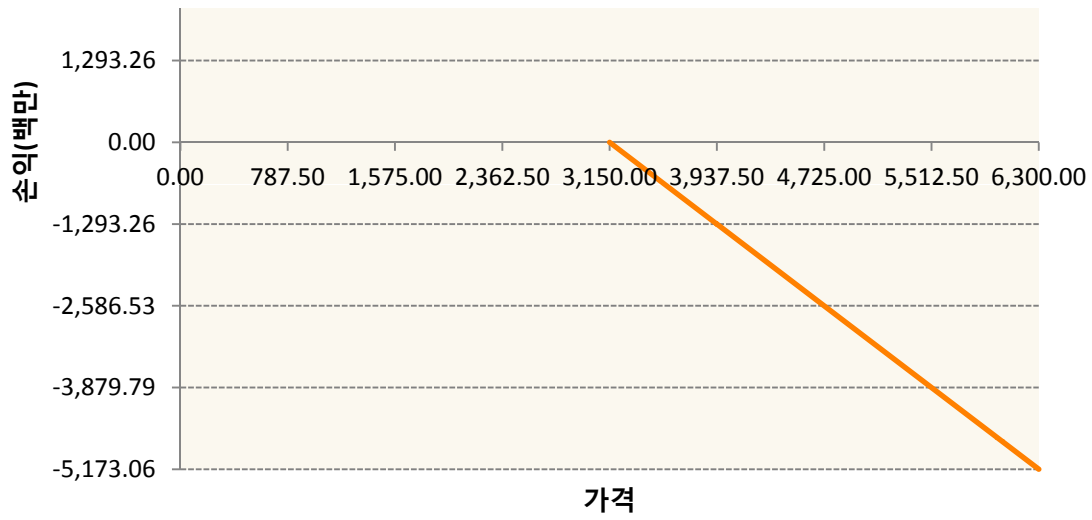
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXG9-C3125-EURO STOXX 50**

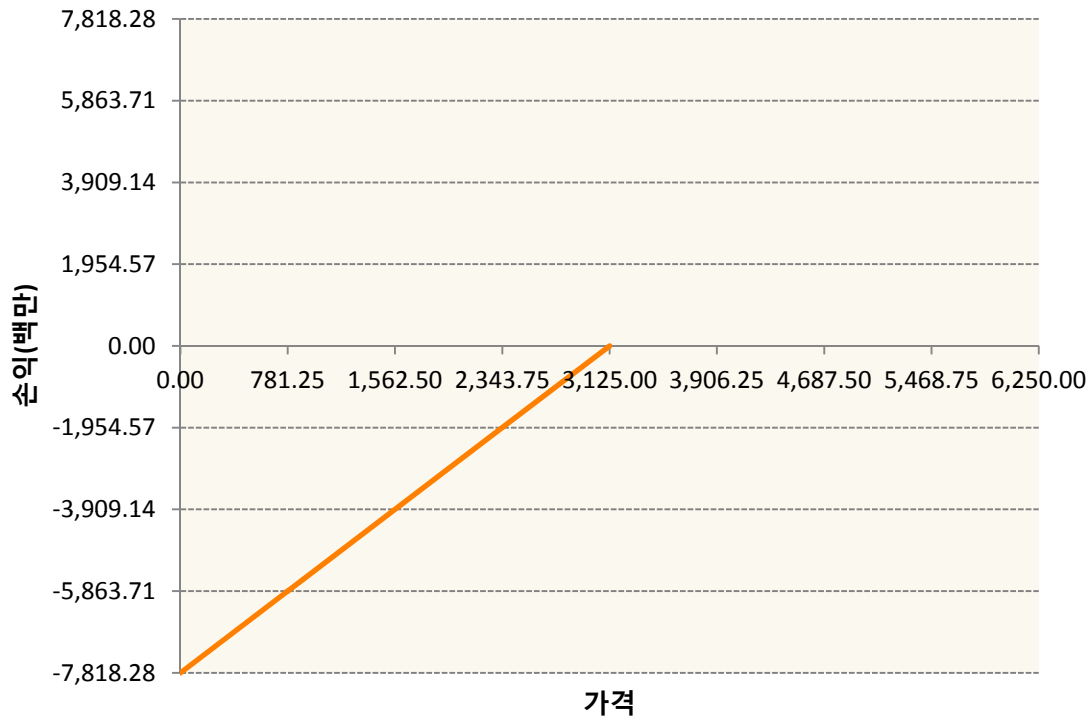


**OESXG9-C3150-EURO STOXX 50**

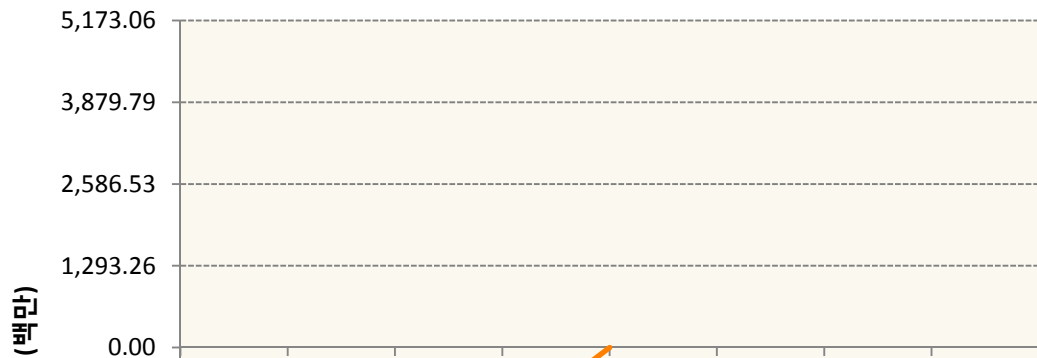


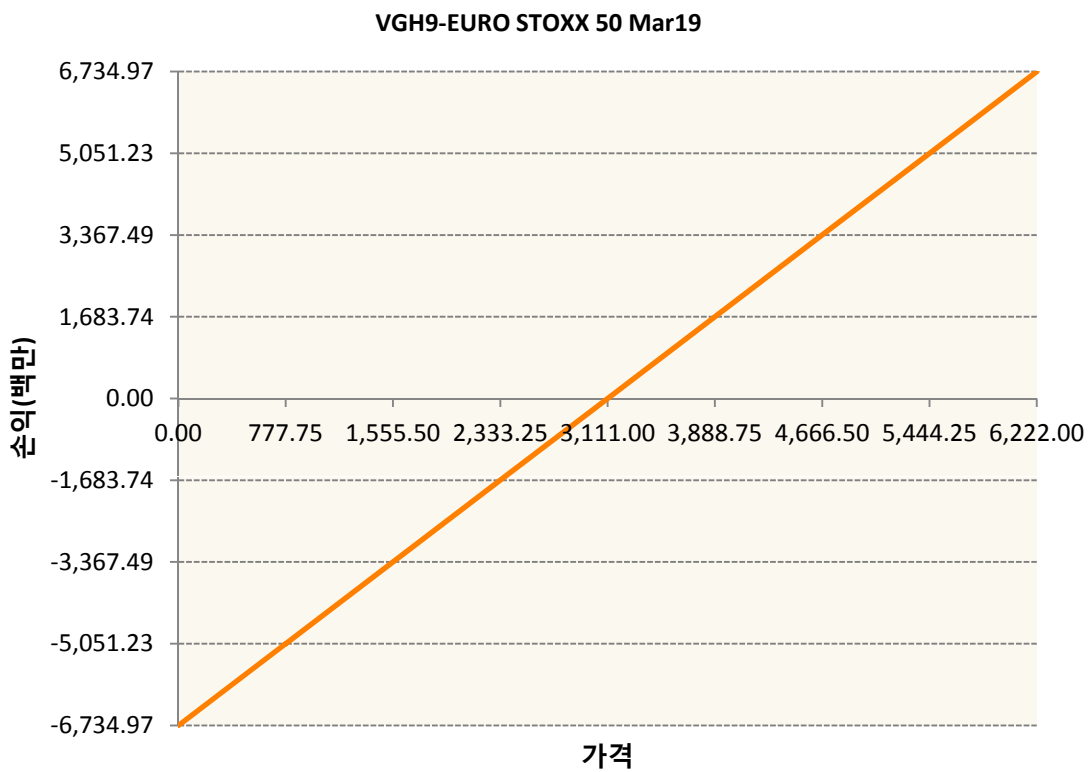
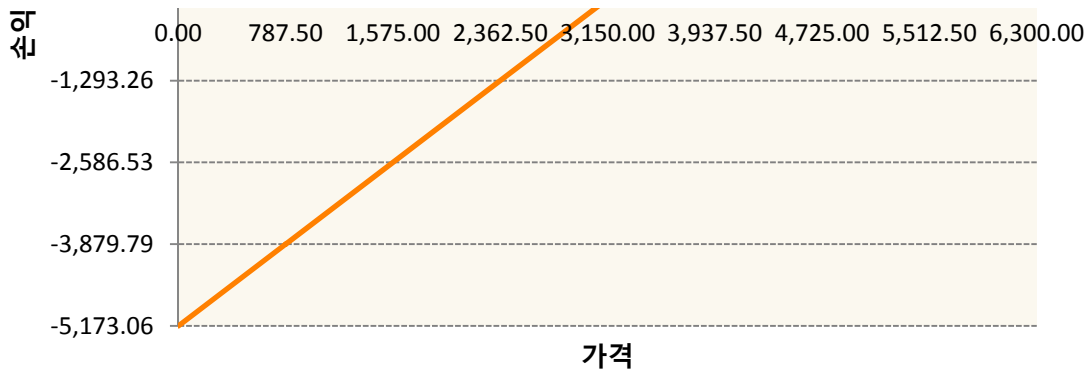


**OESXG9-P3125-EURO STOXX 50**



**OESXG9-P3150-EURO STOXX 50**





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)               |                     | (단위:백만원) |
|---|---------------------|----------|
| 260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY |                     | 6        |
| FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E            |                     | 411      |
| FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E            |                     | 821      |
| OESXG9-C31EURO STOXX 50                 |                     | 625      |
| OESXG9-C31EURO STOXX 50                 |                     | 414      |
| OESXG9-P31EURO STOXX 50                 |                     | 625      |
| OESXG9-P31EURO STOXX 50                 |                     | 414      |
| VGH9                                    | EURO STOXX 50 Mar19 | 539      |

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

(단위:백만원)

2,484



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

(단위:백만원)

1,127



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

(단위:백만원)

96



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

(단위:백만원)

144



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

(단위:백만원)

43

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-23 |
| 기준일 | 2019-01-22 |

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

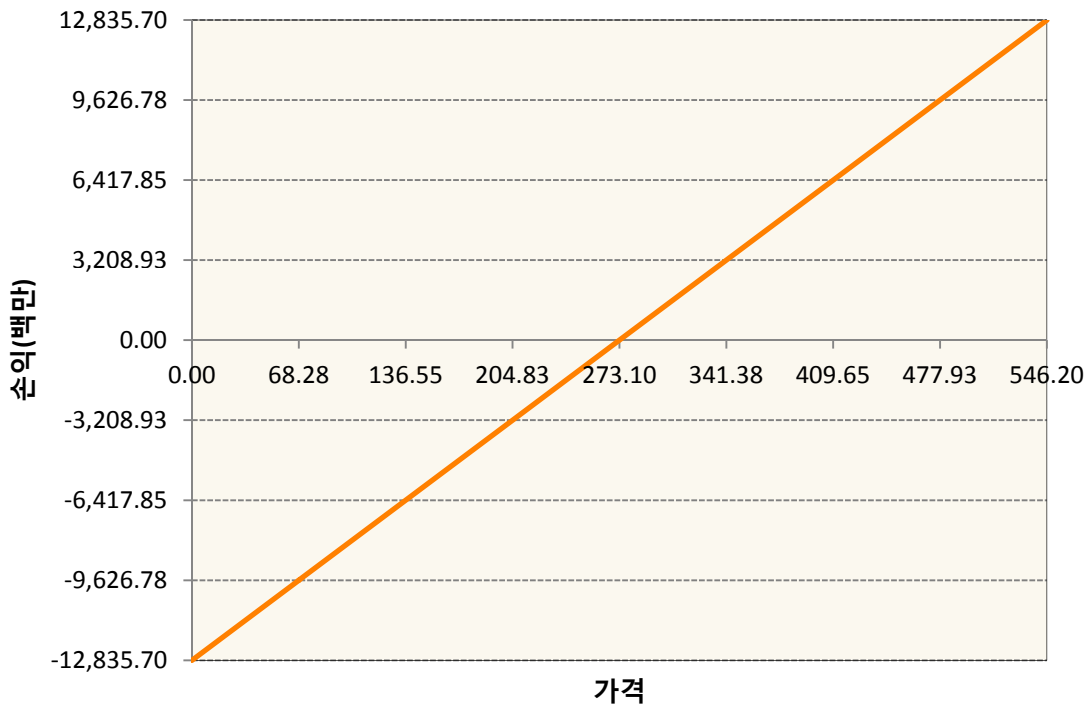
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

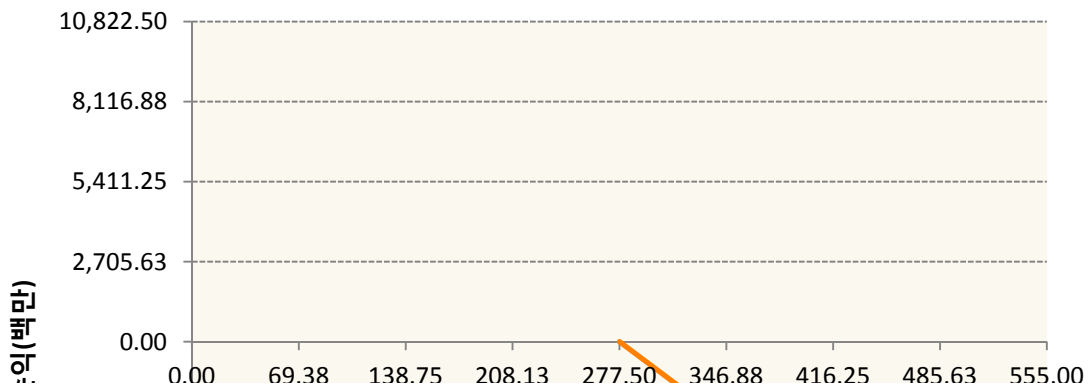
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0      | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0      | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 12,836 | 0      | 12,836    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 2,523  | 23,213 | -20,690   | 장내 |

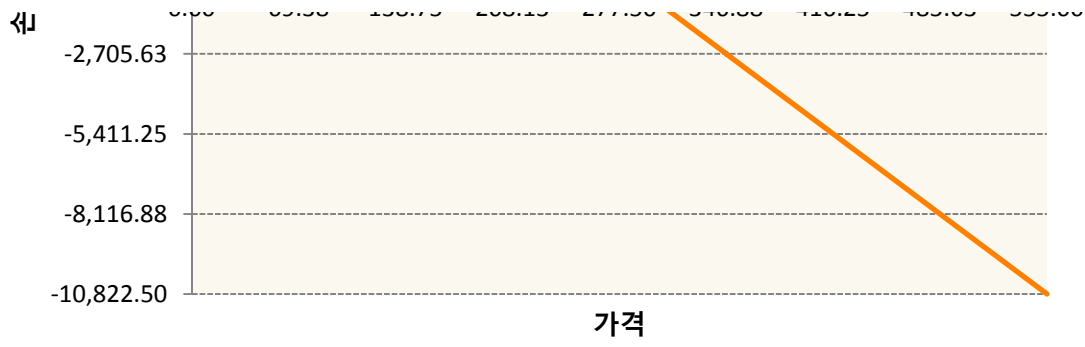
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

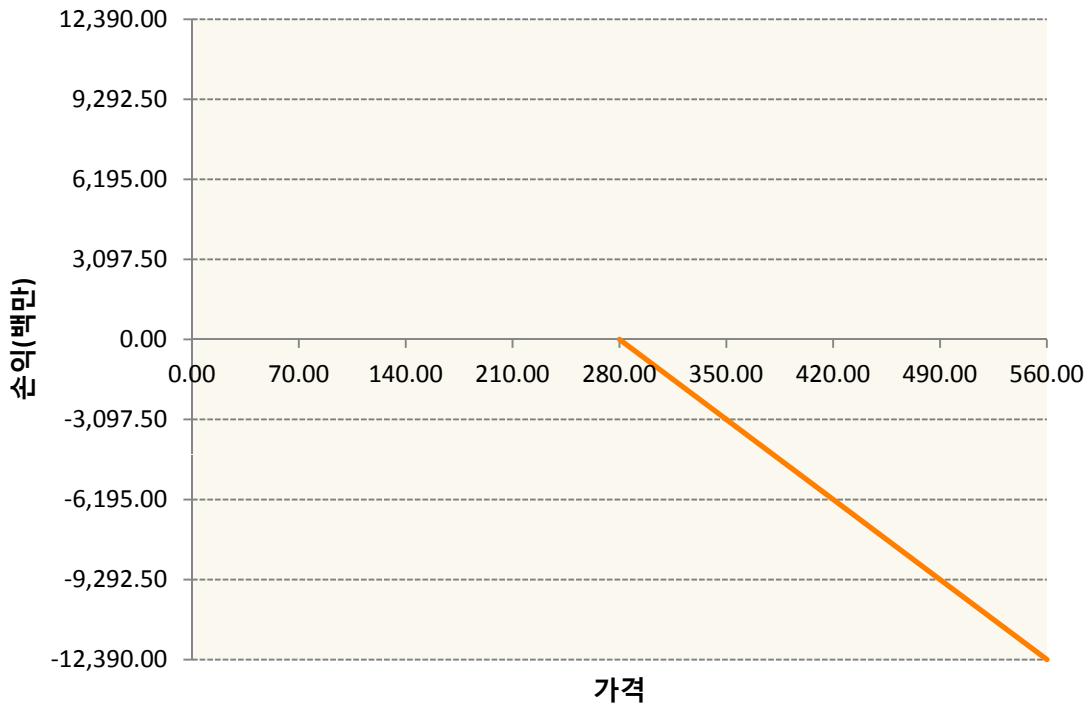


KR4201P22770-2019-02 콜277.5

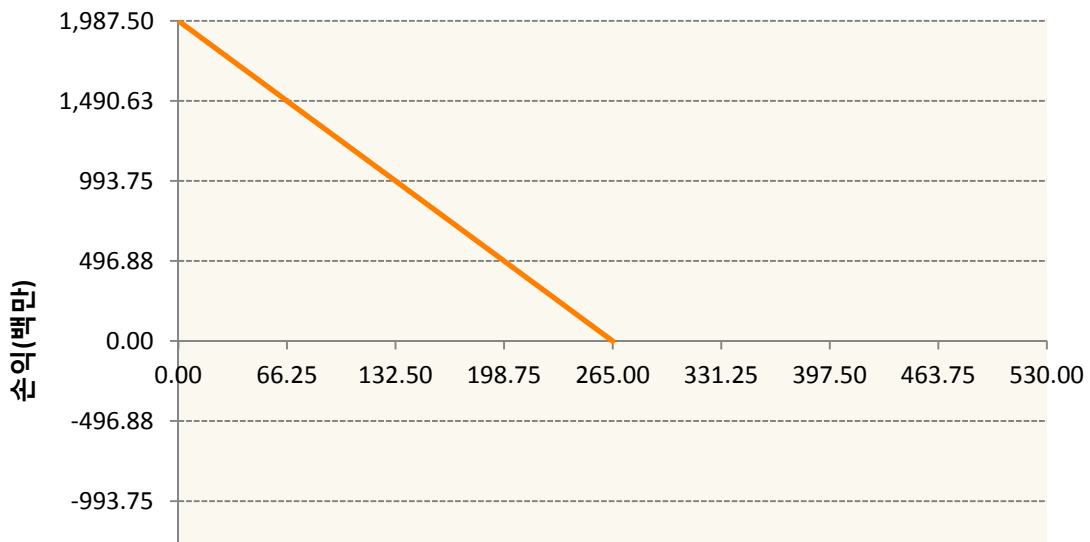


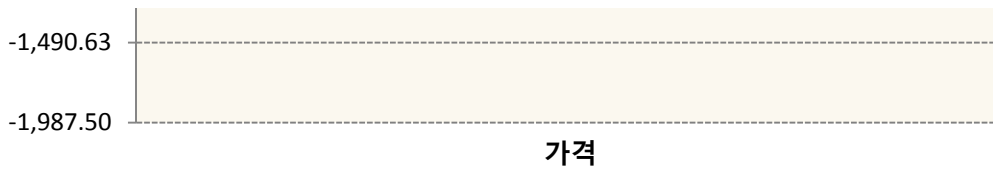


KR4201P22804-2019-02 콜280

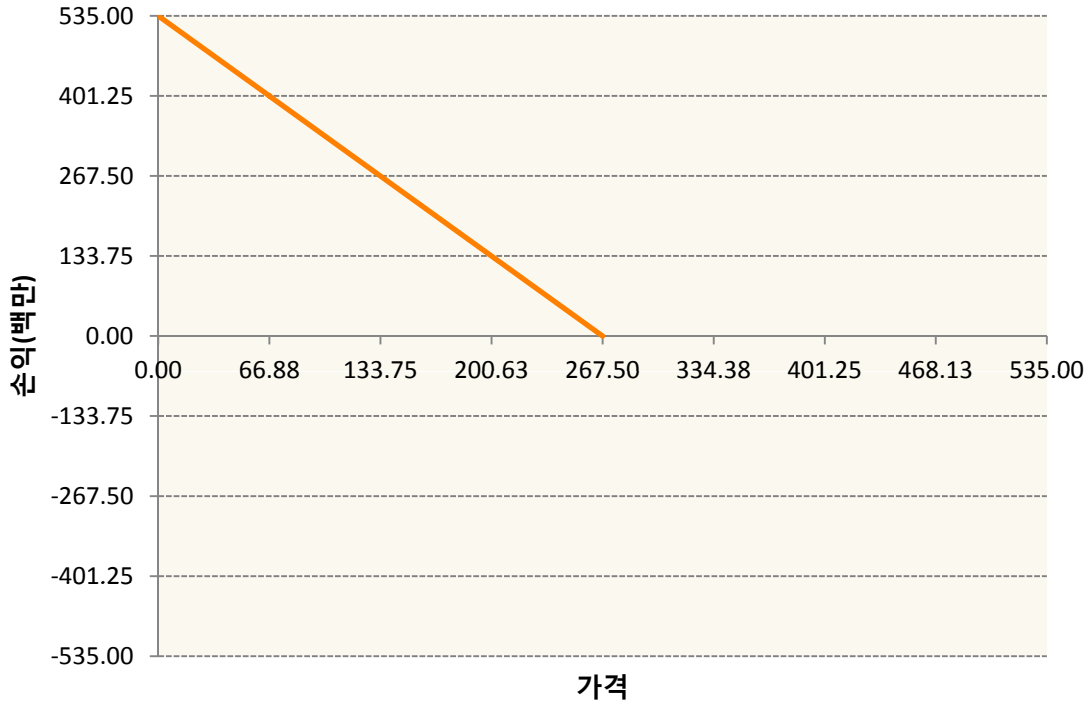


KR4301P22653-2019-02 풋265





KR4301P22679-2019-02 풋267.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4101P30007 |         | 2019-03 코스피200지수선물 |        |        |        |        |        | 1,025 |
|--------------|---------|--------------------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|
|              |         | 기초자산의 변동성          |        |        |        |        |        |       |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |       |
| -8.00%       | -1,025  | -1,025             | -1,025 | -1,025 | -1,025 | -1,025 | -1,025 |       |
| -5.33%       | -684    | -684               | -684   | -684   | -684   | -684   | -684   |       |
| -2.67%       | -342    | -342               | -342   | -342   | -342   | -342   | -342   |       |
| 0%           | 0       | 0                  | 0      | 0      | 0      | 0      | 0      |       |
| 2.67%        | 342     | 342                | 342    | 342    | 342    | 342    | 342    |       |
| 5.33%        | 684     | 684                | 684    | 684    | 684    | 684    | 684    |       |
| 8.00%        | 1,025   | 1,025              | 1,025  | 1,025  | 1,025  | 1,025  | 1,025  |       |
| KR4201P22770 |         | 2019-02 콜277.5     |        |        |        |        |        | 592   |
|              |         | 기초자산의 변동성          |        |        |        |        |        |       |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |       |
| -8.00%       | 192     | 189                | 184    | 178    | 171    | 162    | 152    |       |
| -5.33%       | 180     | 171                | 161    | 150    | 137    | 123    | 108    |       |
| -2.67%       | 144     | 129                | 112    | 94     | 75     | 56     | 37     |       |

|  |         |         |        |      |       |        |        |
|--|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 0%   | 66      | 44      | 22     | 0    | -22   | -45    | -68    |
| 2.67%  | -69     | -92     | -115   | -138 | -162  | -185   | -208   |
| 5.33%  | -261    | -280    | -300   | -321 | -341  | -363   | -384   |
| 8.00%  | -499    | -511    | -525   | -540 | -556  | -574   | -592   |
| KR4201P22804                      2019-02 콜280   |         |         |        |      |       |        | 629    |
| 기초자산의 변동성  |         |         |        |      |       |        |        |
| 가격   | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%   | 180     | 177     | 173    | 168  | 161   | 153    | 143    |
| -5.33%   | 171     | 163     | 154    | 143  | 130   | 116    | 101    |
| -2.67%   | 141     | 126     | 109    | 91   | 72    | 52     | 31     |
| 0%   | 71      | 48      | 24     | 0    | -25   | -49    | -74    |
| 2.67%  | -59     | -86     | -113   | -140 | -166  | -193   | -220   |
| 5.33%  | -256    | -280    | -305   | -330 | -355  | -380   | -406   |
| 8.00%  | -509    | -526    | -545   | -565 | -585  | -607   | -629   |
| KR4301P22653                      2019-02 풋265   |         |         |        |      |       |        | 101    |
| 기초자산의 변동성  |         |         |        |      |       |        |        |
| 가격   | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%   | 96      | 97      | 97     | 98   | 99    | 100    | 101    |
| -5.33%   | 47      | 48      | 50     | 52   | 54    | 56     | 58     |
| -2.67%   | 11      | 13      | 16     | 18   | 21    | 23     | 26     |
| 0%   | -5      | -4      | -2     | 0    | 2     | 4      | 6      |
| 2.67%  | -9      | -9      | -8     | -7   | -6    | -5     | -4     |
| 5.33%  | -10     | -10     | -10    | -9   | -9    | -9     | -8     |
| 8.00%  | -10     | -10     | -10    | -10  | -10   | -10    | -9     |
| KR4301P22679                      2019-02 풋267.5 |         |         |        |      |       |        | 30     |
| 기초자산의 변동성  |         |         |        |      |       |        |        |
| 가격   | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%   | 29      | 29      | 29     | 30   | 30    | 30     | 30     |
| -5.33%   | 15      | 16      | 16     | 16   | 17    | 17     | 18     |
| -2.67%   | 4       | 5       | 6      | 6    | 7     | 8      | 8      |
| 0%   | -2      | -1      | -1     | 0    | 1     | 1      | 2      |
| 2.67%  | -4      | -3      | -3     | -3   | -2    | -2     | -2     |
| 5.33%  | -4      | -4      | -4     | -4   | -4    | -3     | -3     |
| 8.00%  | -4      | -4      | -4     | -4   | -4    | -4     | -4     |

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

(단위:백만원)

2,068

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-23 |
| 기준일 | 2019-01-22 |

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 0     | 4     | -4        |    |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 627   | 0     | 627       |    |

### 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 | 2019-01-23 |
| 기준일 | 2019-01-22 |

## 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 | 2,778 | 0     | 2,778     |    |

### 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 | 2019-01-23 |
| 기준일 | 2019-01-22 |

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 724   | 0     | 724       |    |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 4,926 | 0     | 4,926     |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 5,348 | -5,348    | 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 |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-23 |
| 기준일 | 2019-01-22 |

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

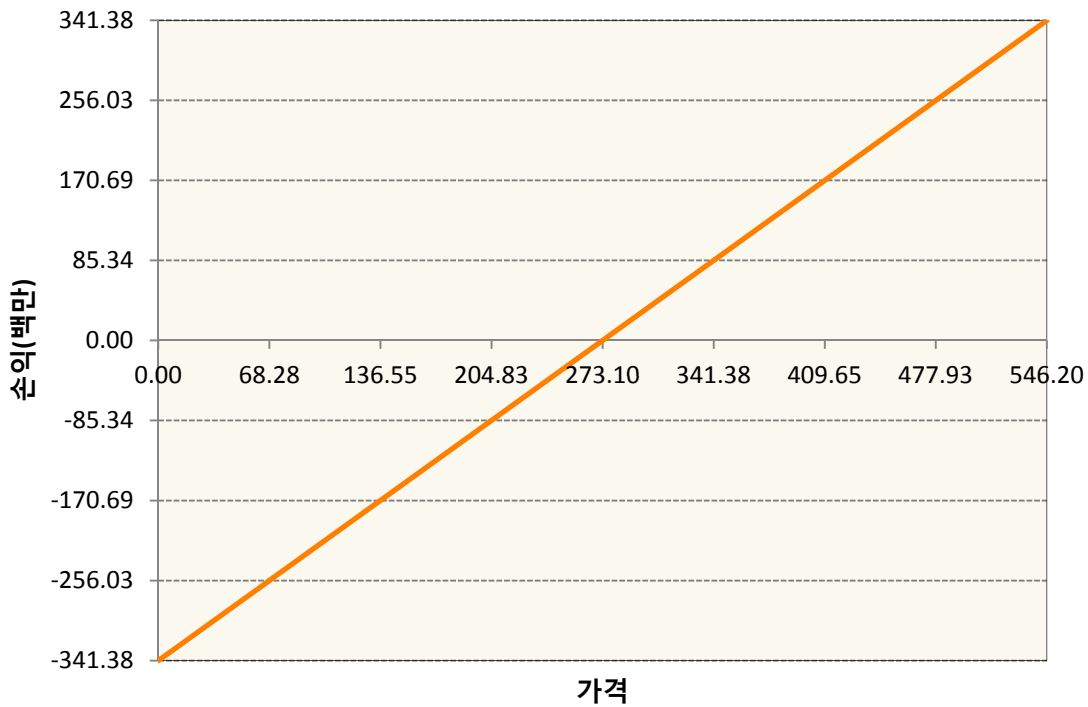
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

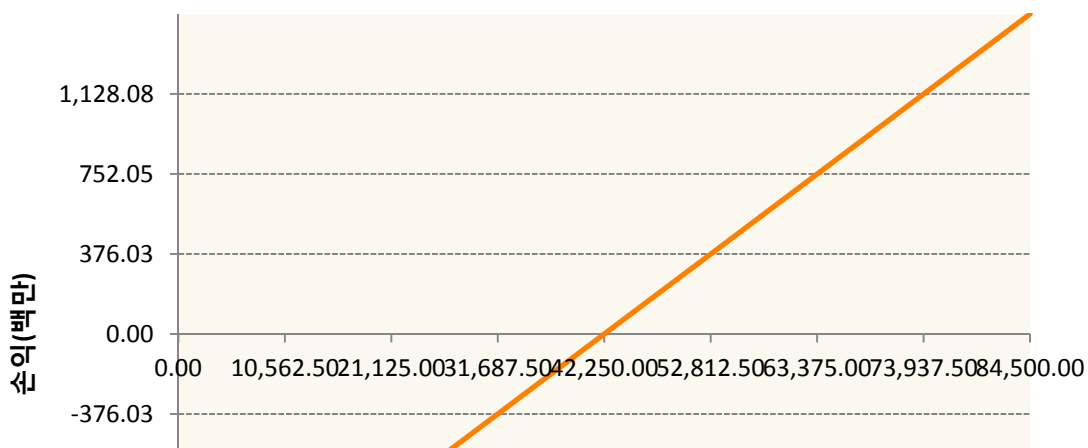
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,845 | 0     | 1,845     | 장내 |

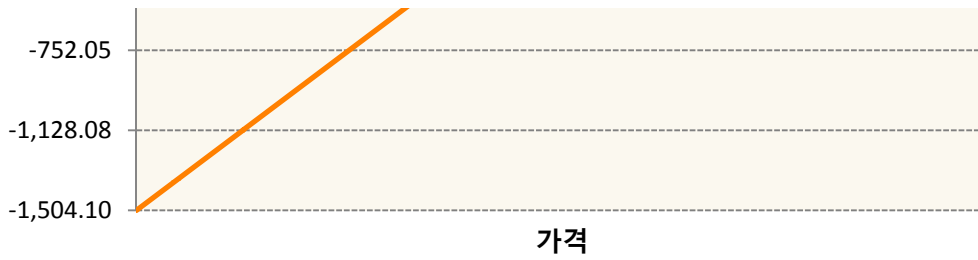
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



KR4111P20007-2019-02 삼성전자개별선물





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

| KR4101P30007 |         | 2019-03 코스피200지수선물 |        |      |       |        |        | 27  |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | -27     | -27                | -27    | -27  | -27   | -27    | -27    |     |
| -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%        | 27      | 27                 | 27     | 27   | 27    | 27     | 27     |     |
| KR4111P20007 |         | 2019-02 삼성전자개별선물   |        |      |       |        |        | 120 |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | -120    | -120               | -120   | -120 | -120  | -120   | -120   |     |
| -5.33%       | -80     | -80                | -80    | -80  | -80   | -80    | -80    |     |
| -2.67%       | -40     | -40                | -40    | -40  | -40   | -40    | -40    |     |
| 0%           | 0       | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |     |
| 2.67%        | 40      | 40                 | 40     | 40   | 40    | 40     | 40     |     |
| 5.33%        | 80      | 80                 | 80     | 80   | 80    | 80     | 80     |     |
| 8.00%        | 120     | 120                | 120    | 120  | 120   | 120    | 120    |     |

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

**162**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-23 |
| 기준일 | 2019-01-22 |

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

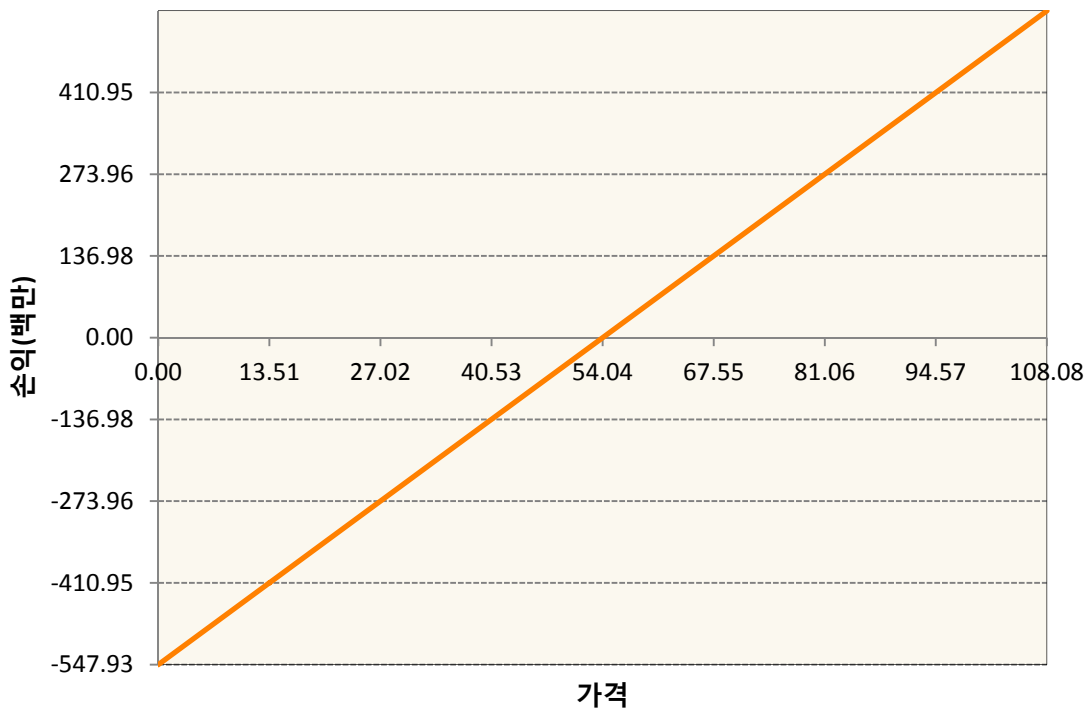
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

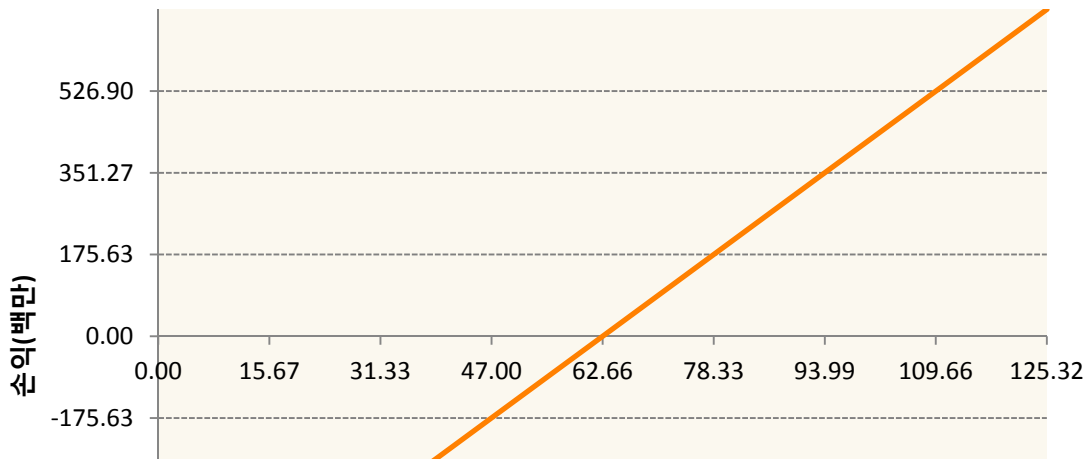
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,842 | 283   | 2,559     |    |

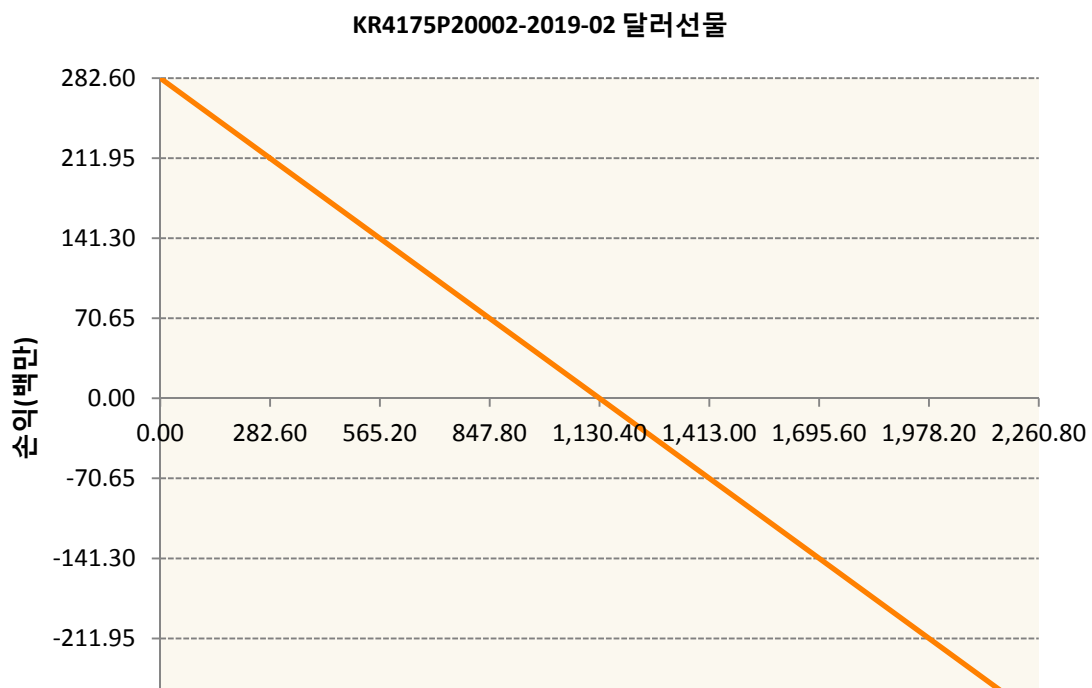
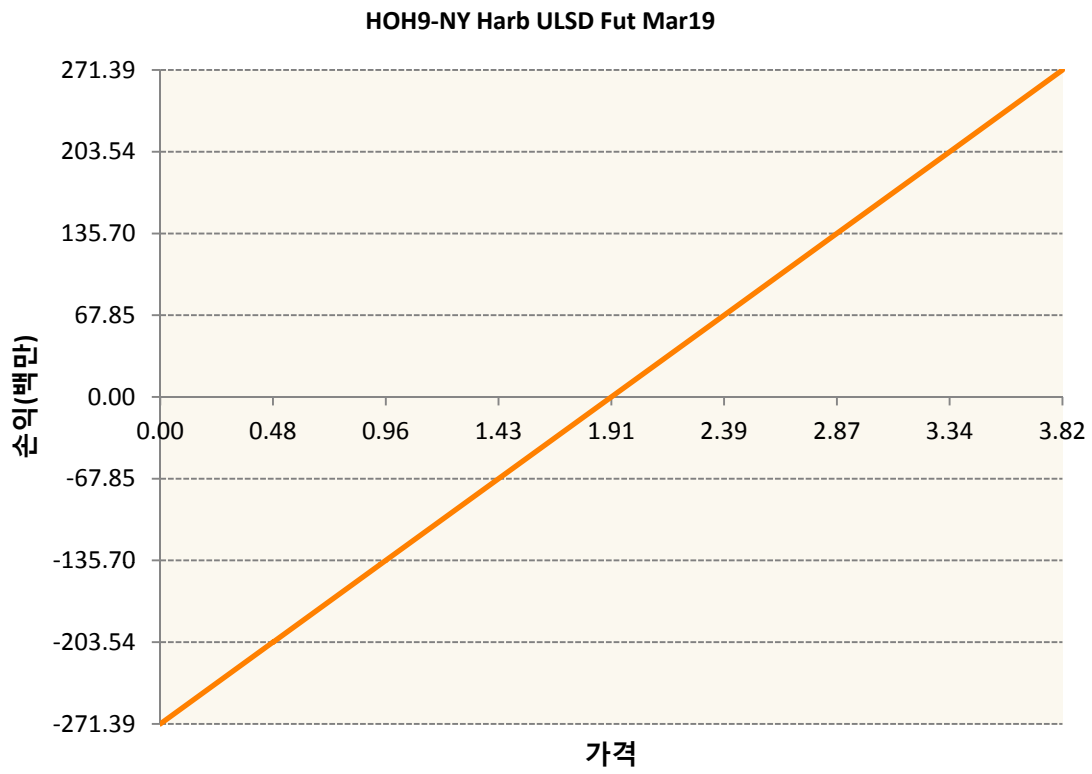
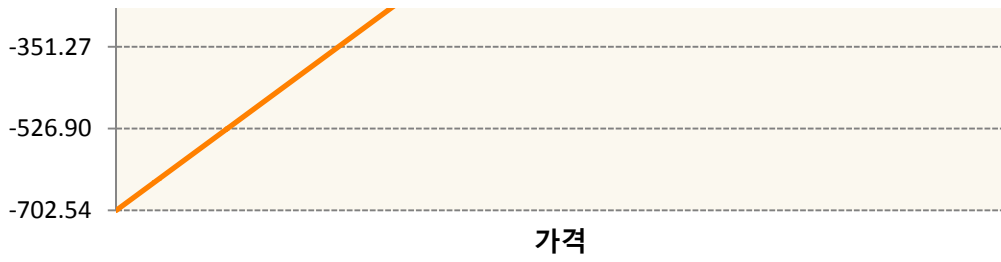
### 2. 만기시점의 손익구조

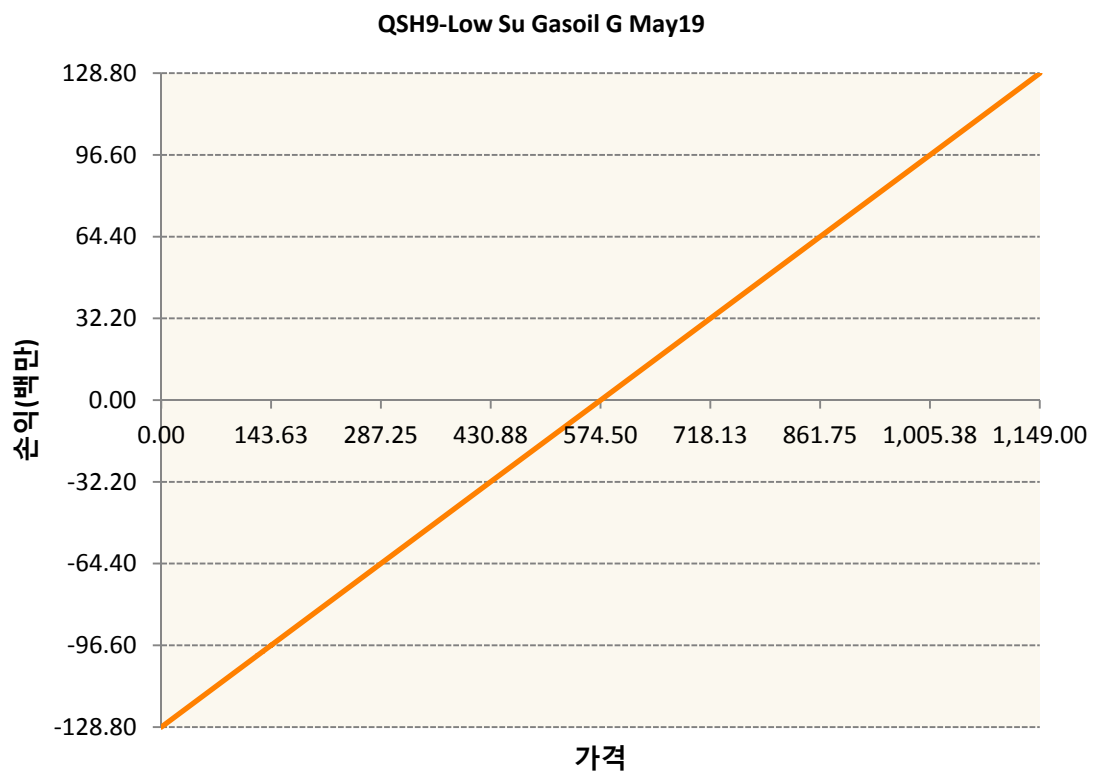
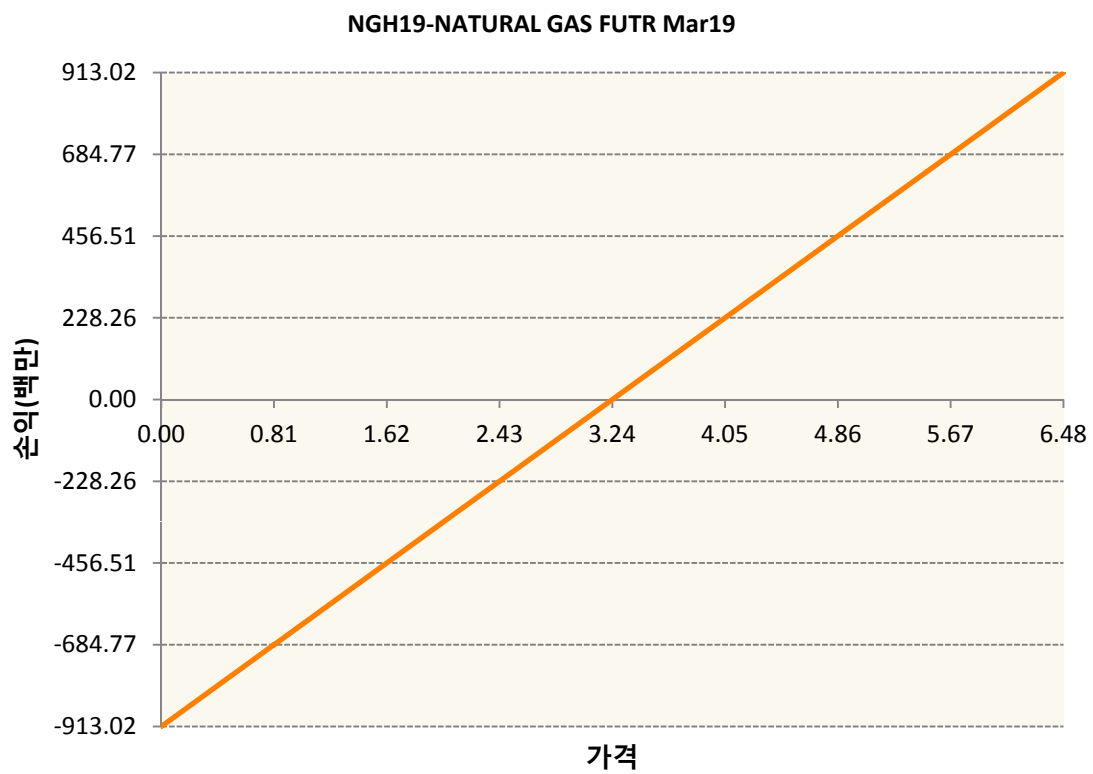
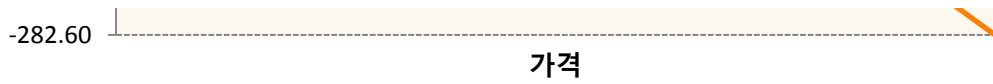
**CLH9-WTI CRUDE FUTURE MAR19**



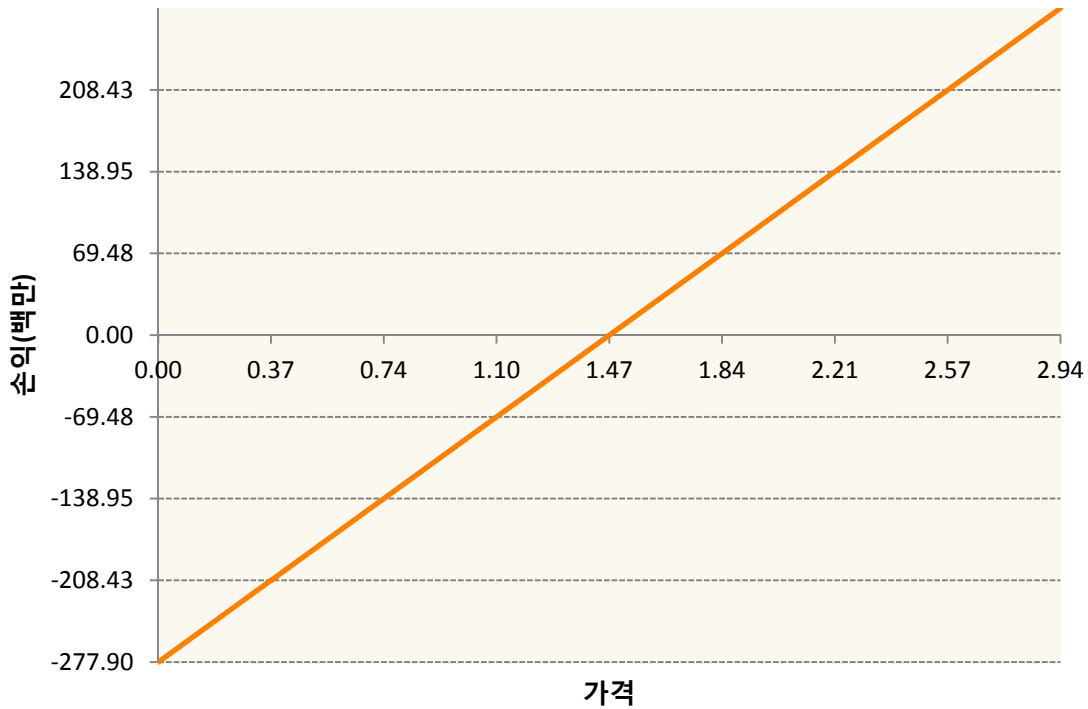
**COK9-BRENT CRUDE FUTR May19**







**XBH9-GASOLINE RBOB FUT Mar19**



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

|            |                         |    |
|------------|-------------------------|----|
| CLH9       | WTI CRUDE FUTURE MAR19  | 44 |
| COK9       | BRENT CRUDE FUTR May19  | 56 |
| HOH9       | NY Harb ULSD Fut Mar19  | 22 |
| KR4175P200 | 2019-02 달러선물            | 23 |
| NGH19      | NATURAL GAS FUTR Mar19  | 73 |
| QSH9       | Low Su Gasoil G May19   | 10 |
| XBH9       | GASOLINE RBOB FUT Mar19 | 22 |

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

**445**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-23 |
| 기준일 | 2019-01-22 |

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

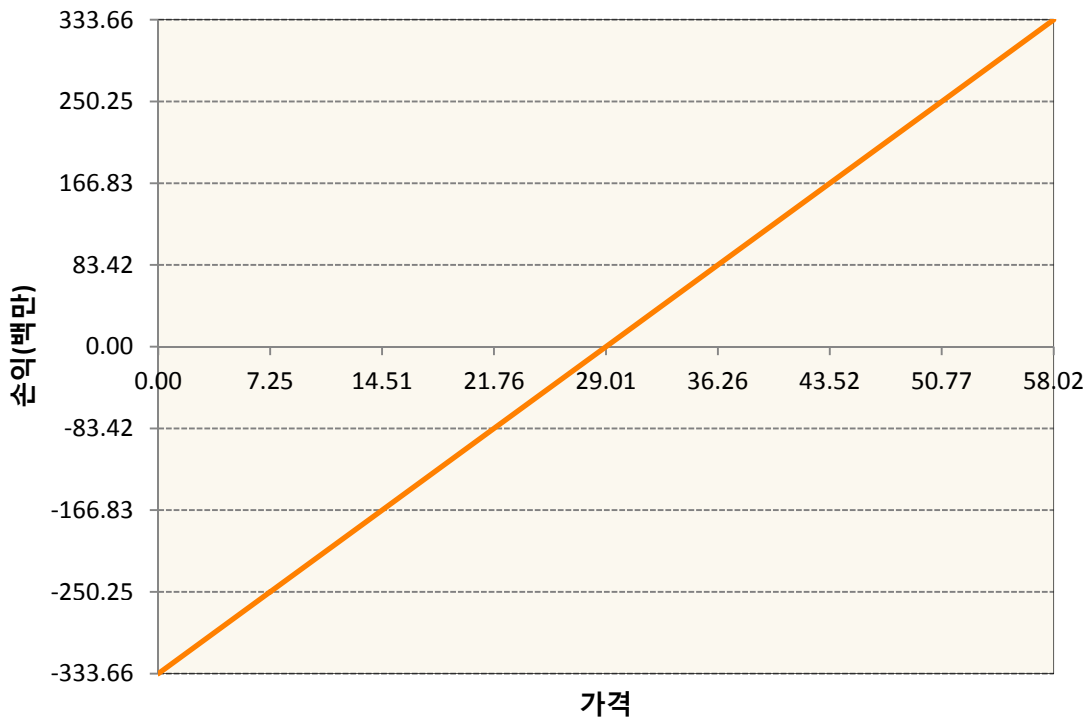
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

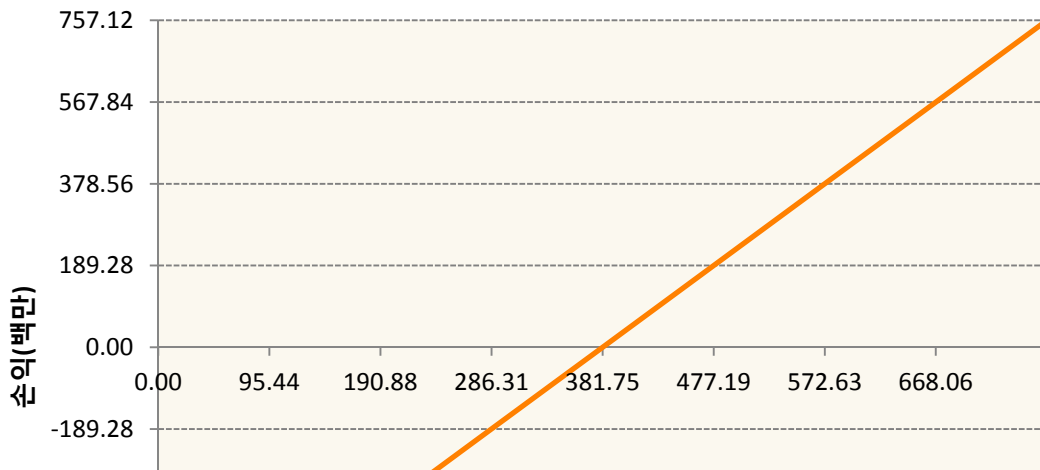
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 3,601 | 79    | 3,522     |    |

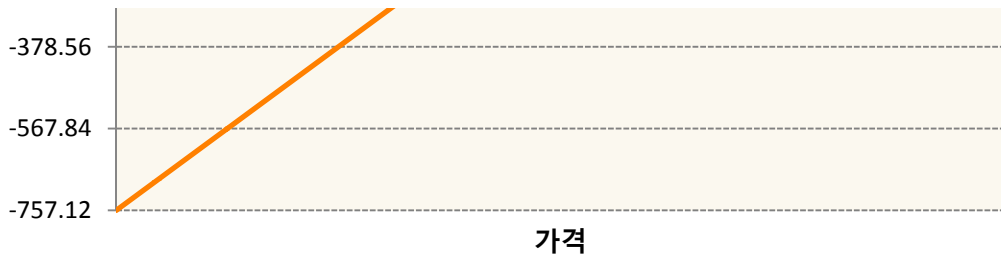
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOH9-SOYBEAN OIL FUTR Mar19**

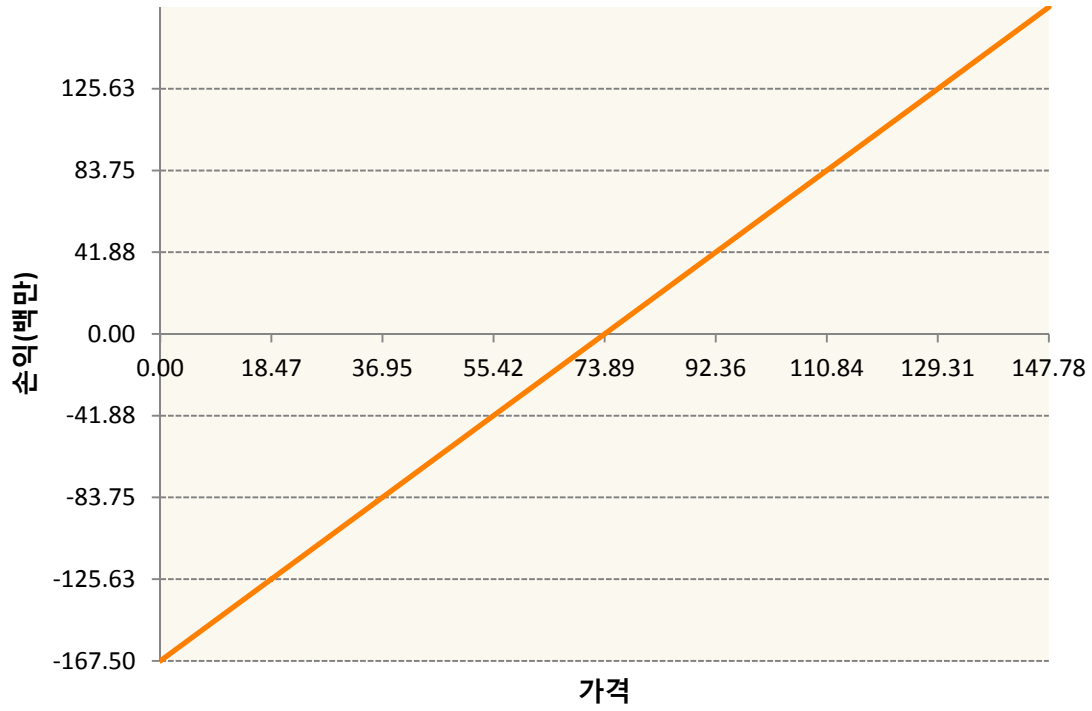


**CH9-CORN FUTURE Mar19**

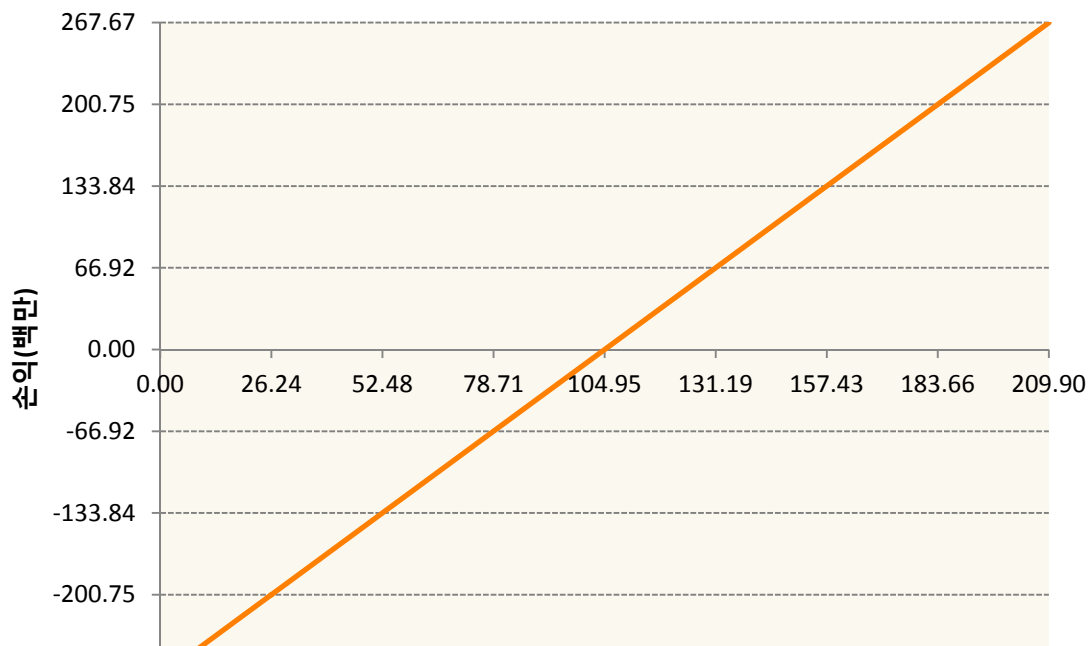


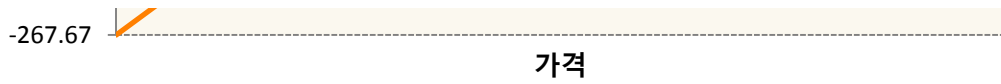


CTH9-COTTON NO.2 FUTR Mar19

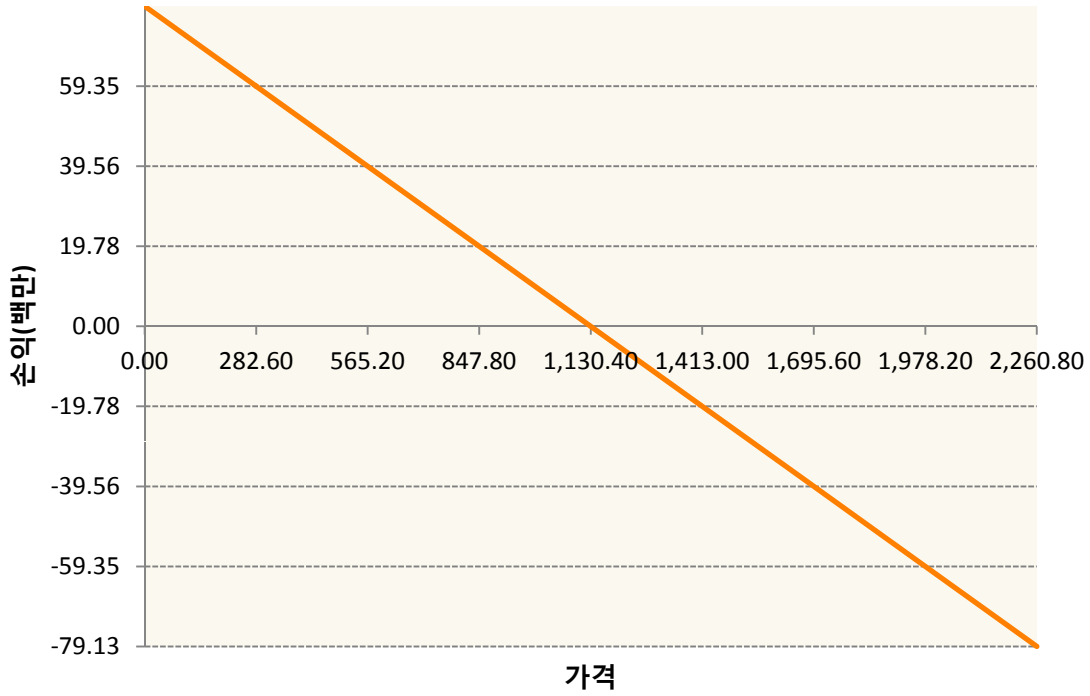


KCH9-COFFEE 'C' FUTURE Mar19

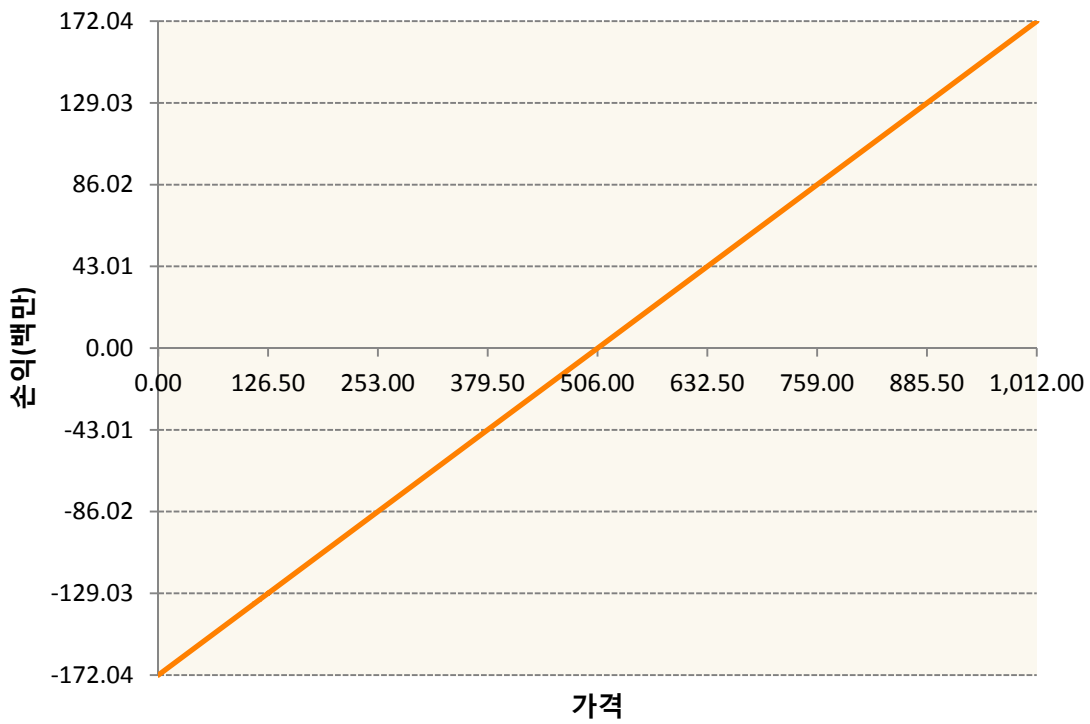




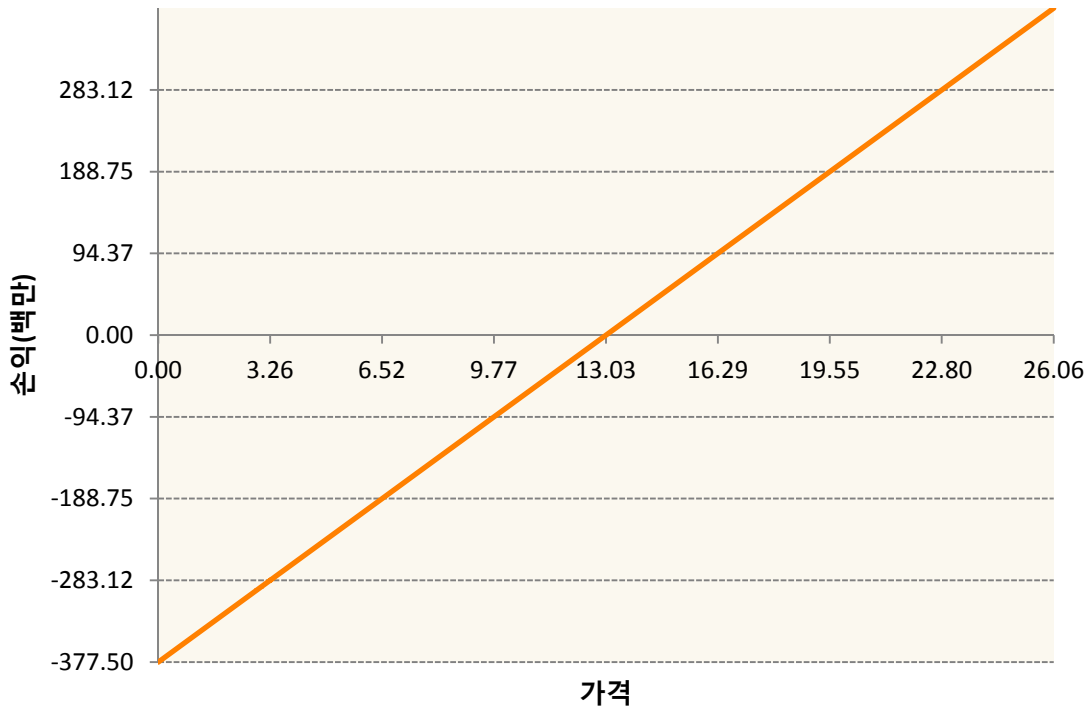
KR4175P20002-2019-02 달러선물



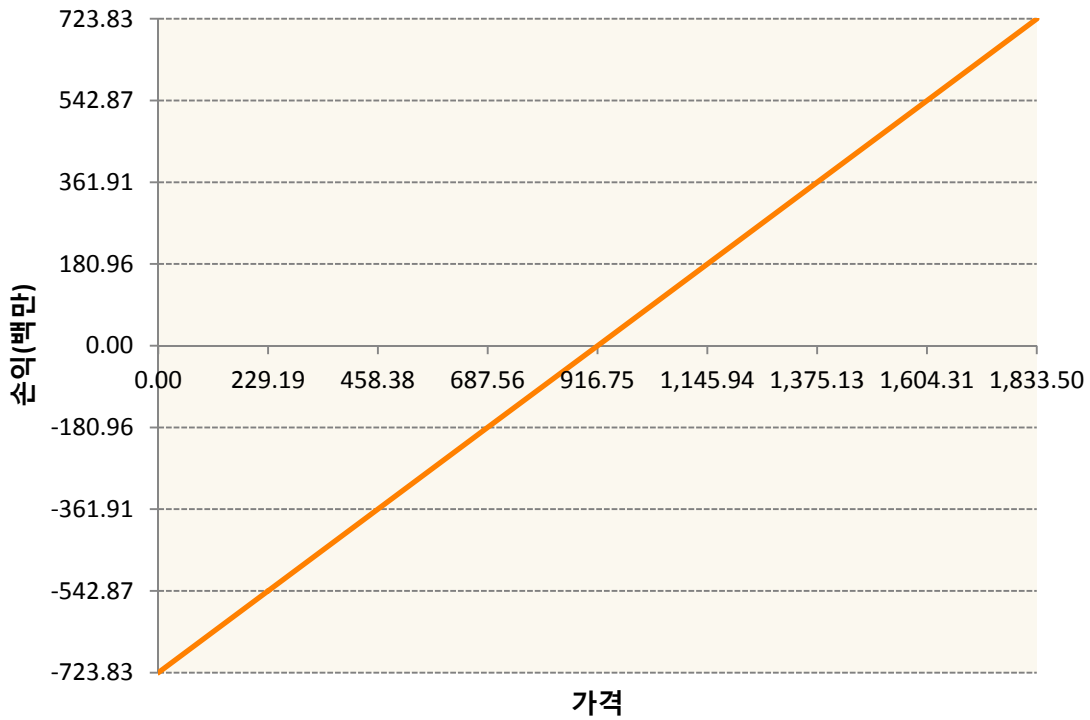
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



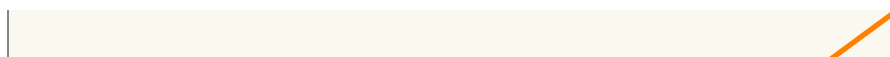
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

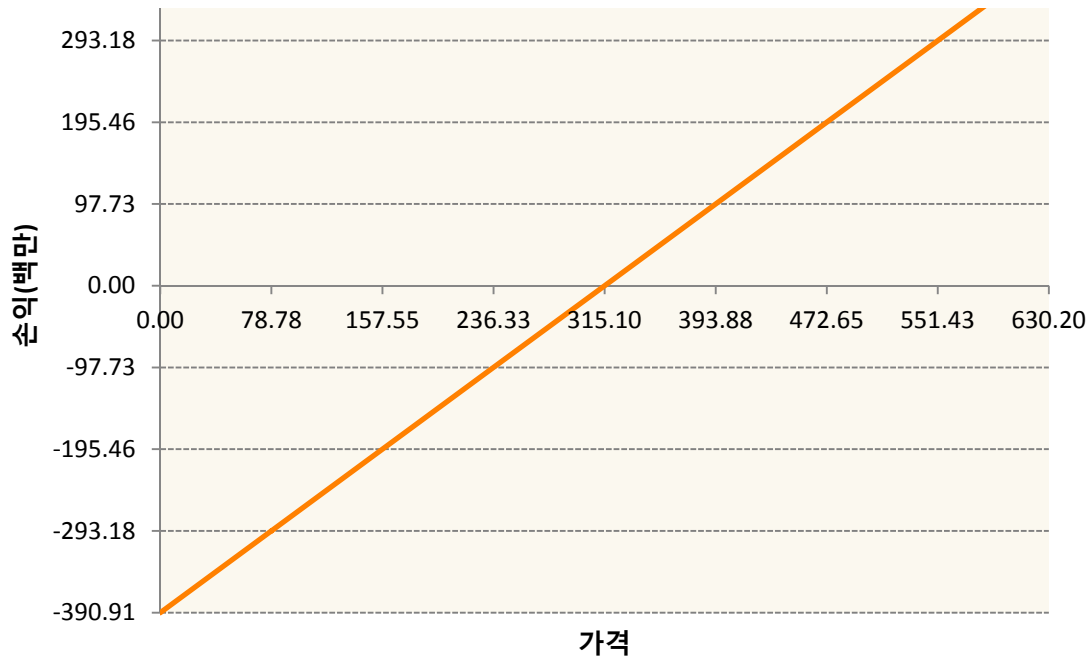


SH9-SOYBEAN FUTURE Mar19

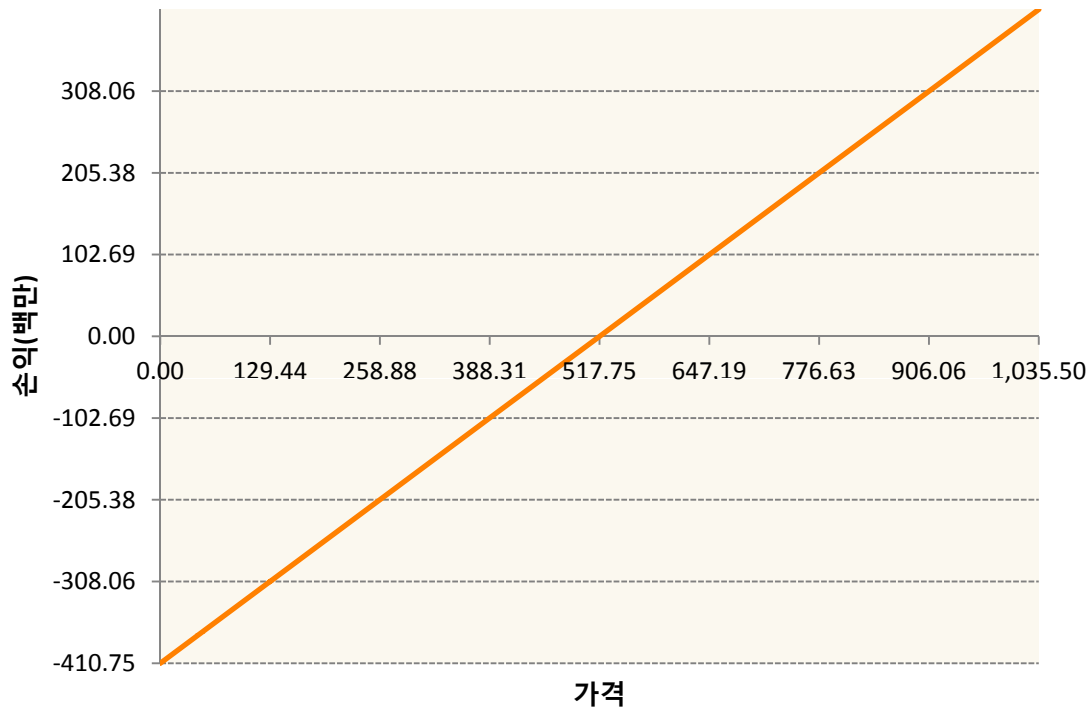


SMH9-SOYBEAN MEAL FUTR Mar19





WH9-WHEAT FUTURE(CBT) Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|            |                         |    |
|------------|-------------------------|----|
| BOH9       | SOYBEAN OIL FUTR Mar19  | 27 |
| CH9        | CORN FUTURE Mar19       | 61 |
| 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**