

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-29 |
| 기준일 | 2019-01-28 |

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)

100

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-29 |
| 기준일 | 2019-01-28 |

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)

604

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-29 |
| 기준일 | 2019-01-28 |

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 지수 | 스왑 | 3,355 | 0 | 3,355 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S180910

| |
|-----|
| 267 |
|-----|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|------------|
| 398 |
|------------|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-29 |
| 기준일 | 2019-01-28 |

유로인덱스모(주식-파생형)

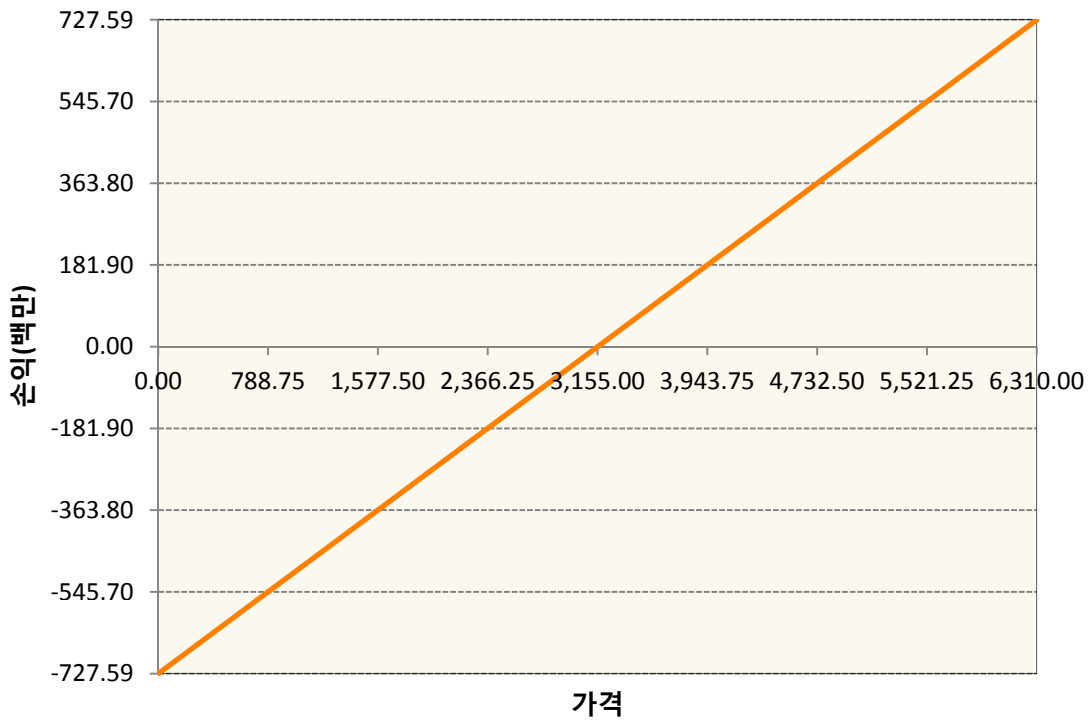
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 728 | 0 | 728 | |

2. 만기시점의 손익구조

VGH9-EURO STOXX 50 Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------|---------------------|----|
| VGH9 | EURO STOXX 50 Mar19 | 58 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

| |
|----|
| 40 |
|----|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-29 |
| 기준일 | 2019-01-28 |

차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

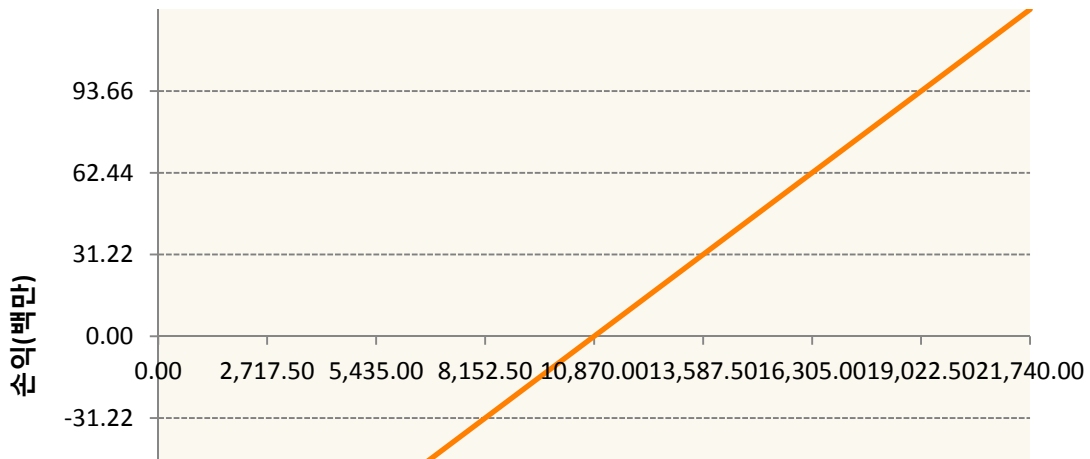
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,373 | 0 | 1,373 | 장내 |

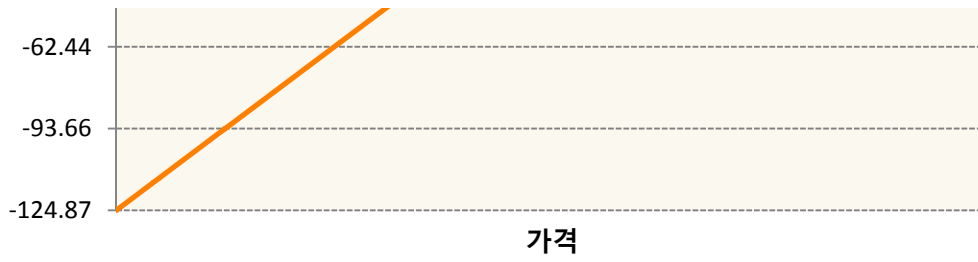
2. 만기시점의 손익구조

HCF9-HSCEI FUTURES JAN19



MHCF9-MINI H-SHR IDX FU JAN19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | |
|-------|-------------------------|-----|
| HCF9 | HSCEI FUTURES JAN19 | 100 |
| MHCF9 | MINI H-SHR IDX FU JAN19 | 10 |

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

| |
|------------|
| 112 |
|------------|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-29 |
| 기준일 | 2019-01-28 |

커버드콜모(주식혼합-파생형)

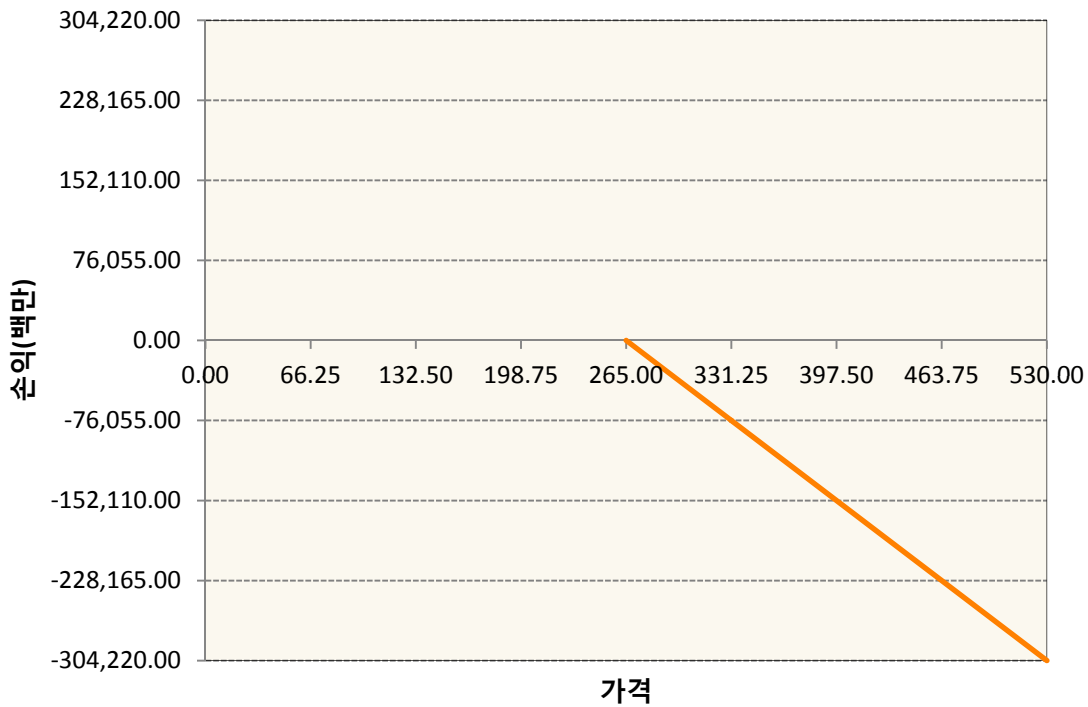
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 9,928 | 0 | 9,928 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 663,505 | -663,505 | 장내 |

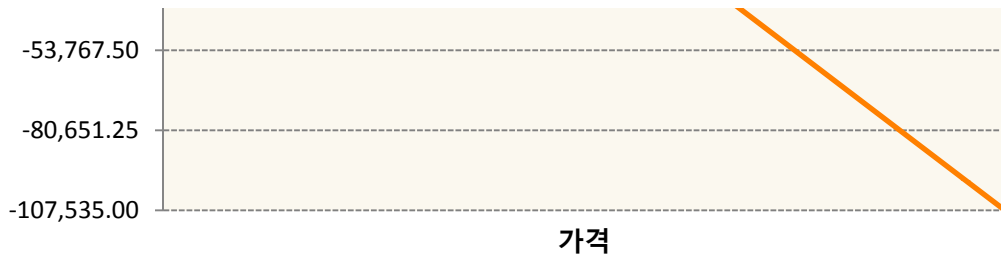
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P22655-2019-02 콜265

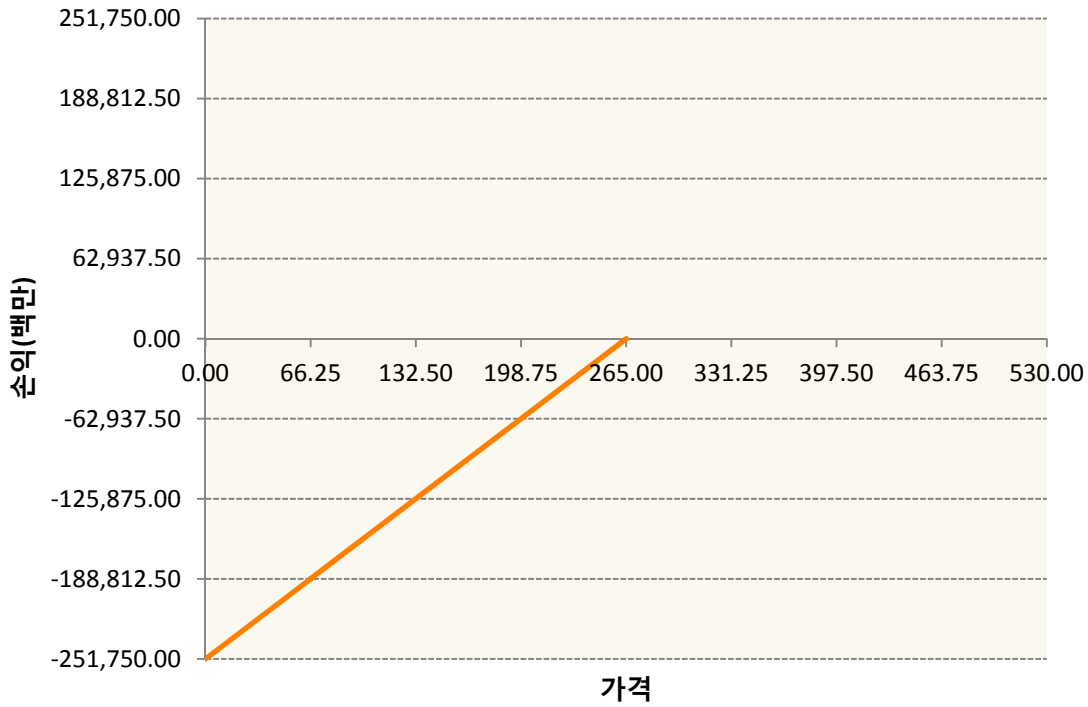


KR4201P22671-2019-02 콜267.5





KR4301P22653-2019-02 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4201P22655 | | 2019-02 콜265 | | | | | 24,835 |
|--------------|---------|----------------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 17,972 | 17,482 | 16,981 | 16,471 | 15,954 | 15,431 | 14,905 |
| -5.33% | 14,241 | 13,682 | 13,121 | 12,560 | 11,998 | 11,435 | 10,873 |
| -2.67% | 8,307 | 7,881 | 7,431 | 6,963 | 6,480 | 5,985 | 5,480 |
| 0% | 792 | 569 | 303 | 0 | -335 | -697 | -1,082 |
| 2.67% | -7,489 | -7,573 | -7,692 | -7,847 | -8,037 | -8,260 | -8,514 |
| 5.33% | -16,030 | -16,052 | -16,094 | -16,158 | -16,248 | -16,366 | -16,512 |
| 8.00% | -24,632 | -24,637 | -24,648 | -24,670 | -24,706 | -24,760 | -24,835 |
| KR4201P22671 | | 2019-02 콜267.5 | | | | | 8,563 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 5,706 | 5,555 | 5,397 | 5,233 | 5,064 | 4,892 | 4,717 |

| | | | | | | | |
|--|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| -5.33% | 4,655 | 4,456 | 4,258 | 4,059 | 3,861 | 3,662 | 3,464 |
| -2.67% | 2,823 | 2,650 | 2,472 | 2,291 | 2,107 | 1,920 | 1,731 |
| 0% | 348 | 245 | 128 | 0 | -138 | -283 | -436 |
| 2.67% | -2,484 | -2,528 | -2,586 | -2,657 | -2,741 | -2,837 | -2,943 |
| 5.33% | -5,454 | -5,468 | -5,490 | -5,522 | -5,565 | -5,618 | -5,683 |
| 8.00% | -8,462 | -8,465 | -8,472 | -8,484 | -8,502 | -8,528 | -8,563 |
| KR4301P22653 2019-02 풋265 | | | | | | | 7,277 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -6,051 | -6,229 | -6,421 | -6,624 | -6,835 | -7,053 | -7,277 |
| -5.33% | -1,629 | -1,890 | -2,152 | -2,415 | -2,679 | -2,943 | -3,208 |
| -2.67% | -128 | -239 | -370 | -517 | -679 | -854 | -1,039 |
| 0% | 80 | 64 | 38 | 0 | -52 | -118 | -197 |
| 2.67% | 91 | 90 | 87 | 83 | 73 | 59 | 37 |
| 5.33% | 91 | 91 | 91 | 90 | 89 | 87 | 83 |
| 8.00% | 91 | 91 | 91 | 91 | 91 | 90 | 90 |

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

(단위:백만원)

38,206

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-29 |
| 기준일 | 2019-01-28 |

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

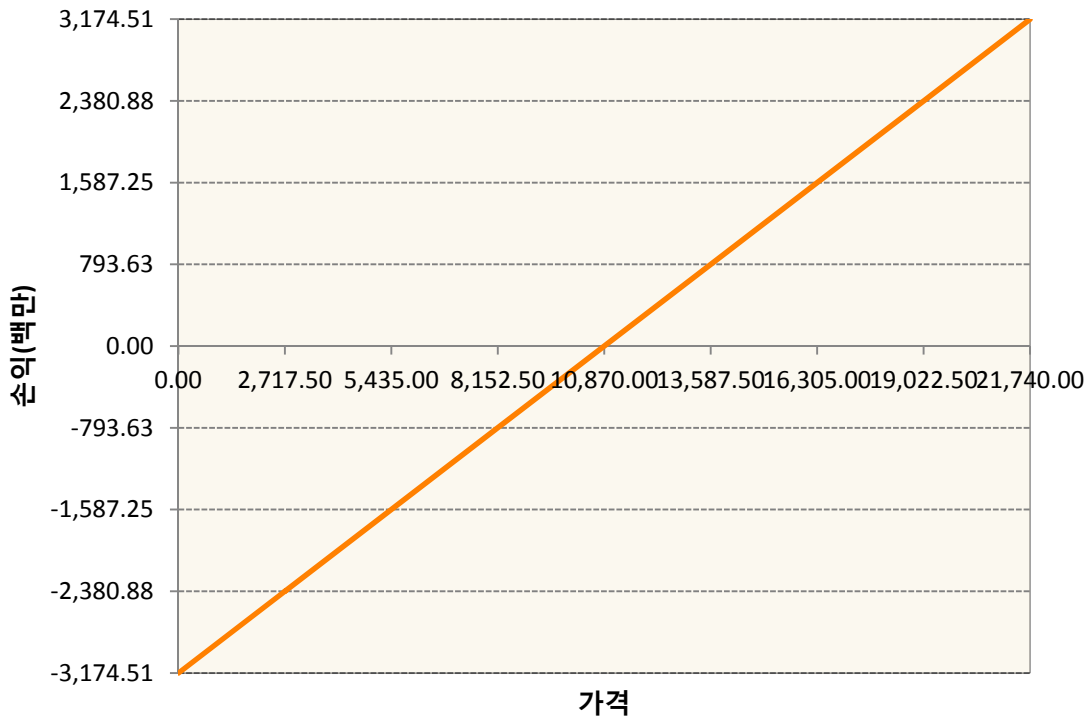
1. 계약금액

(단위:백만원)

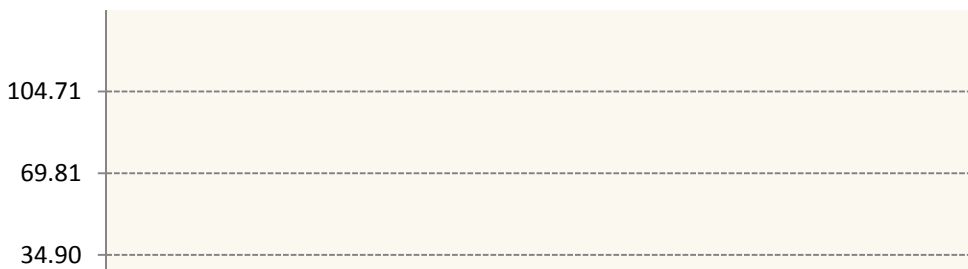
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,175 | 0 | 3,175 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 6,975 | -6,975 | 장내 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 2,707 | -2,707 | 장외 |

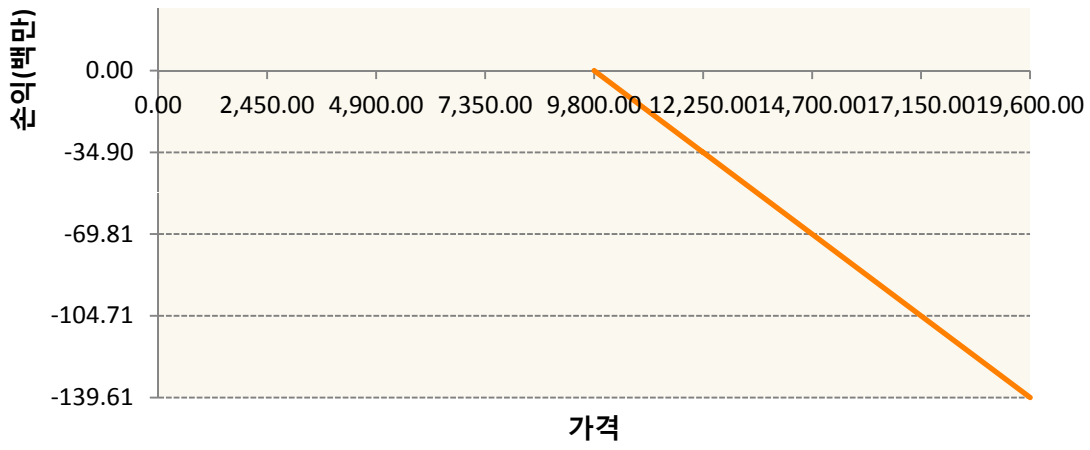
2. 만기시점의 손익구조

HCF9-HSCEI FUTURES JAN19

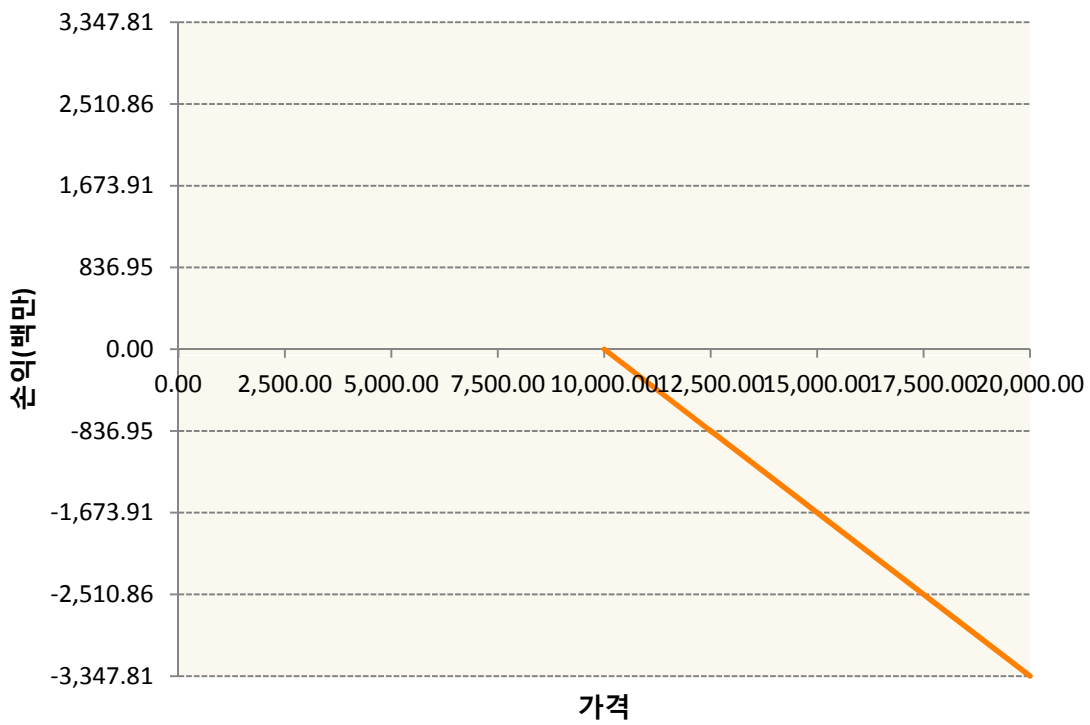


OHHIF9-C098-HSCEI

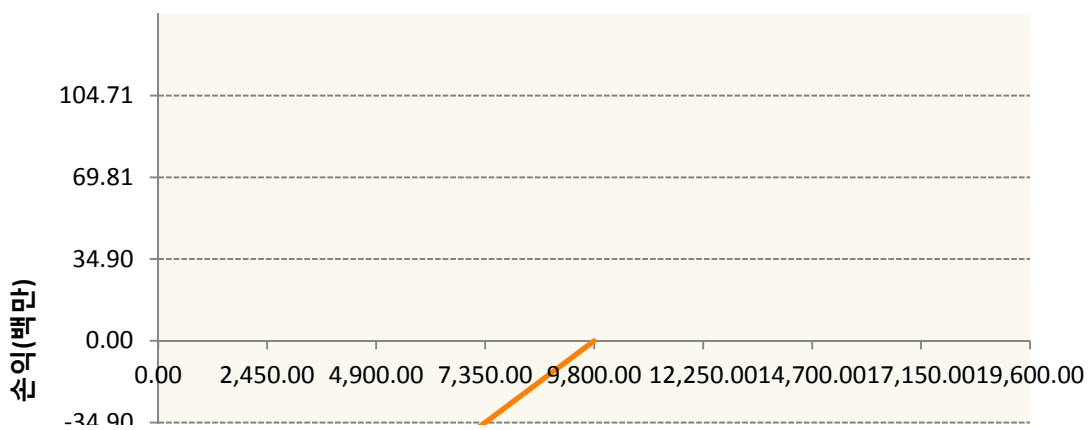


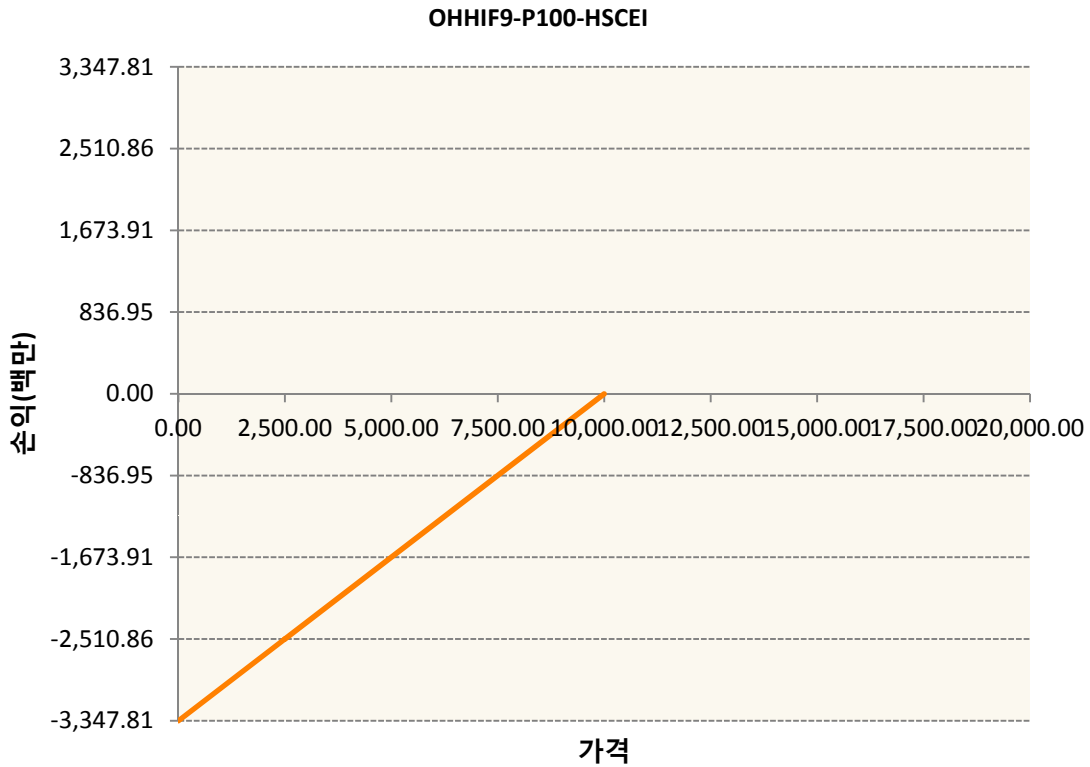


OHHIF9-C100-HSCEI



OHHIF9-P098-HSCEI





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | (단위:백만원) |
|------------------------------|----------|
| FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E | 217 |
| HCF9 HSCEI FUTURES JAN19 | 254 |
| OHHIF9-C09 HSCEI | 11 |
| OHHIF9-C10 HSCEI | 268 |
| OHHIF9-P09 HSCEI | 11 |
| OHHIF9-P10 HSCEI | 268 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|--|----------|
| | 911 |

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-29 |
| 기준일 | 2019-01-28 |

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

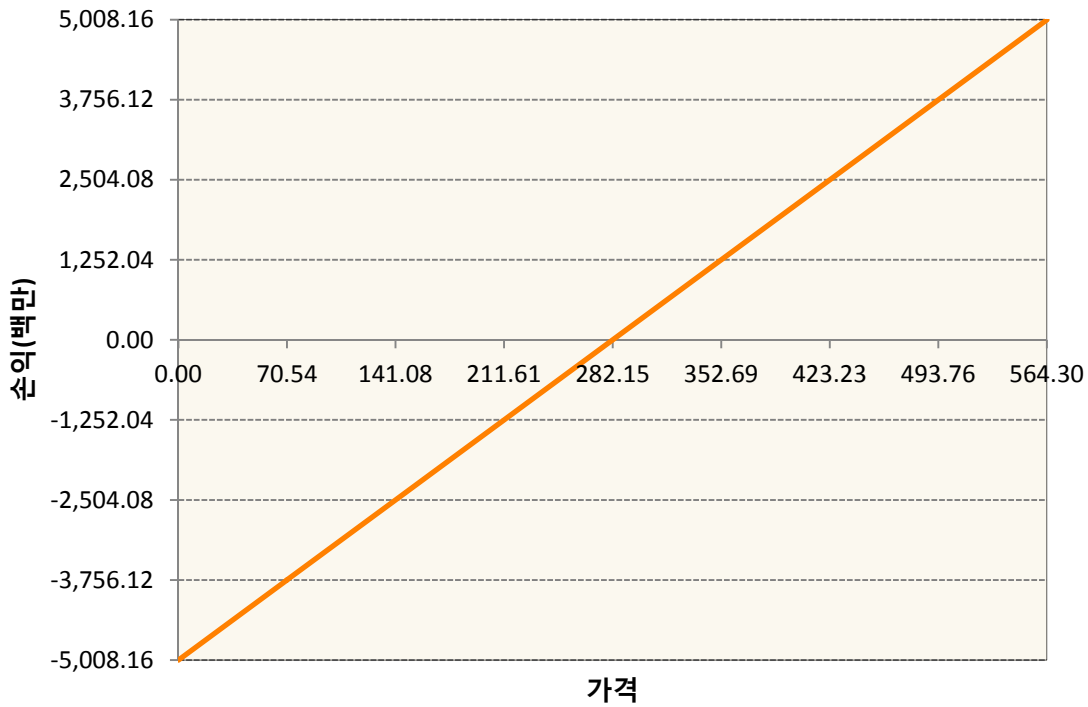
1. 계약금액

(단위:백만원)

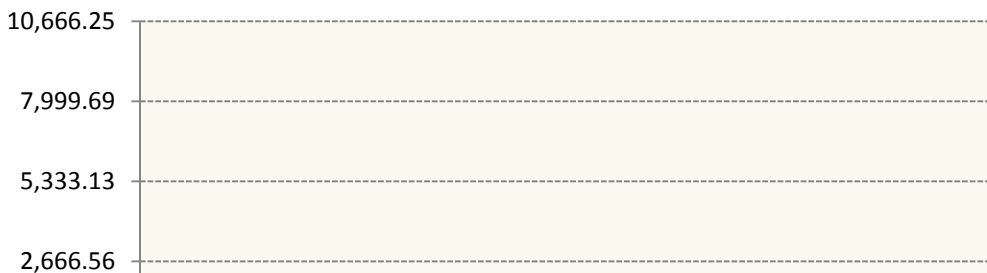
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 463 | 0 | 463 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 5,008 | 0 | 5,008 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 31,836 | 0 | 31,836 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 31,932 | -31,932 | 장내 |

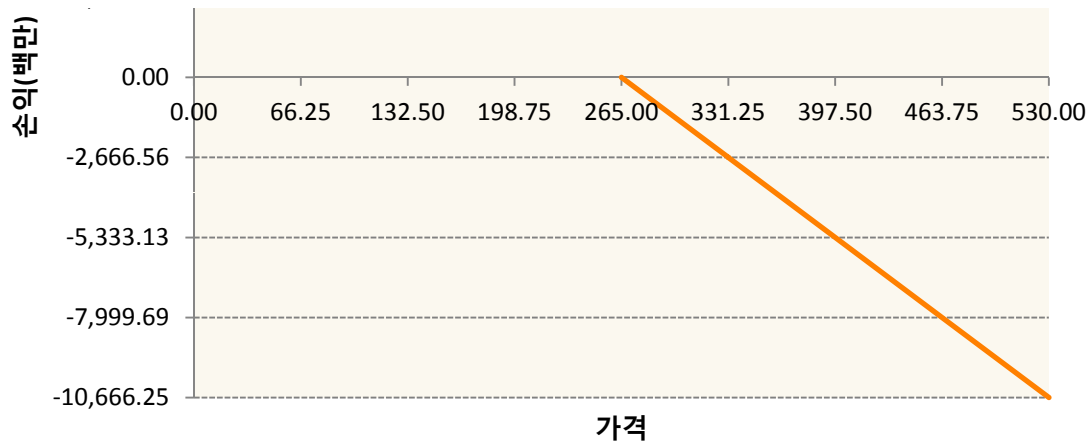
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

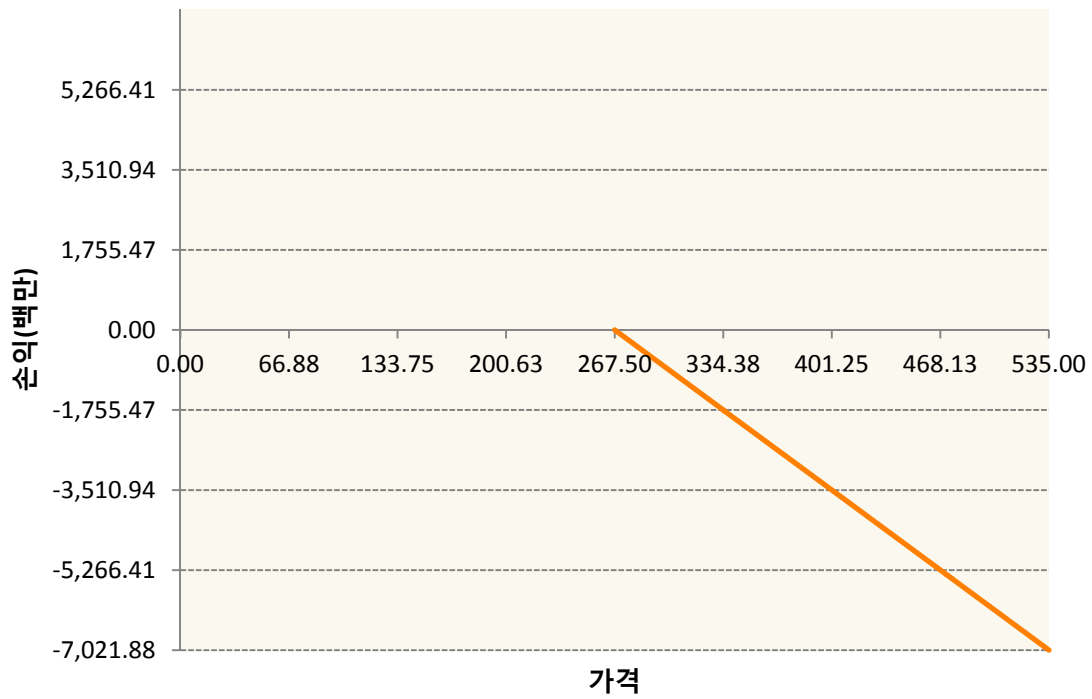


KR4201P22655-2019-02 콜265

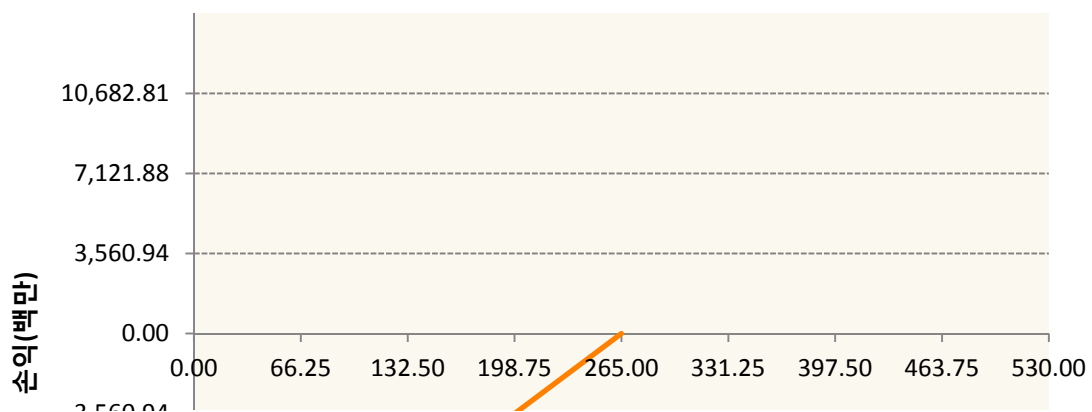


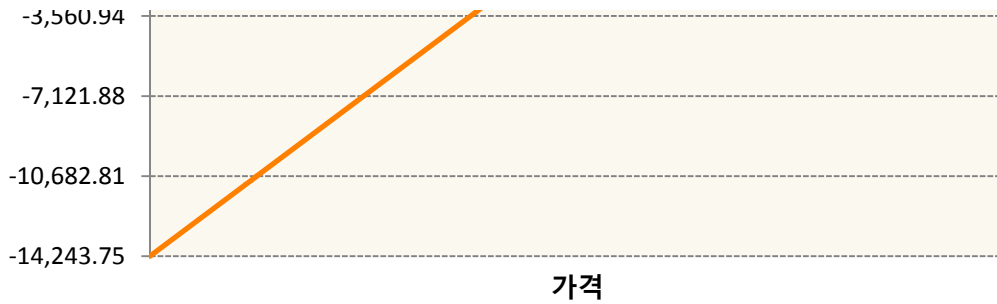


KR4201P22671-2019-02 콜267.5



KR4301P22653-2019-02 풋265





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| 2.529E+11 | | UBCSFXC1 INDEX_14 | | | | | | 2,652 |
|--------------|---------|--------------------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -2,652 | -2,652 | -2,652 | -2,652 | -2,652 | -2,652 | -2,652 | |
| -5.33% | -1,768 | -1,768 | -1,768 | -1,768 | -1,768 | -1,768 | -1,768 | |
| -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% | 1,768 | 1,768 | 1,768 | 1,768 | 1,768 | 1,768 | 1,768 | |
| 8.00% | 2,652 | 2,652 | 2,652 | 2,652 | 2,652 | 2,652 | 2,652 | |
| KR4101P30007 | | 2019-03 코스피200지수선물 | | | | | | 400 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -400 | -400 | -400 | -400 | -400 | -400 | -400 | |
| -5.33% | -267 | -267 | -267 | -267 | -267 | -267 | -267 | |
| -2.67% | -133 | -133 | -133 | -133 | -133 | -133 | -133 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 133 | 133 | 133 | 133 | 133 | 133 | 133 | |
| 5.33% | 267 | 267 | 267 | 267 | 267 | 267 | 267 | |
| 8.00% | 400 | 400 | 400 | 400 | 400 | 400 | 400 | |
| KR4201P22655 | | 2019-02 콜265 | | | | | | 871 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 630 | 613 | 595 | 577 | 559 | 541 | 523 | |
| -5.33% | 499 | 480 | 460 | 440 | 421 | 401 | 381 | |
| -2.67% | 291 | 276 | 261 | 244 | 227 | 210 | 192 | |
| 0% | 28 | 20 | 11 | 0 | -12 | -24 | -38 | |
| 2.67% | -263 | -266 | -270 | -275 | -282 | -290 | -299 | |
| 5.33% | -562 | -563 | -564 | -567 | -570 | -574 | -579 | |
| 8.00% | -864 | -864 | -864 | -865 | -866 | -868 | -871 | |
| KR4201P22671 | | 2019-02 콜267.5 | | | | | | 559 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |

| | | | | | | | |
|--|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| -8.00% | 373 | 363 | 352 | 342 | 331 | 319 | 308 |
| -5.33% | 304 | 291 | 278 | 265 | 252 | 239 | 226 |
| -2.67% | 184 | 173 | 161 | 150 | 138 | 125 | 113 |
| 0% | 23 | 16 | 8 | 0 | -9 | -19 | -28 |
| 2.67% | -162 | -165 | -169 | -174 | -179 | -185 | -192 |
| 5.33% | -356 | -357 | -358 | -361 | -363 | -367 | -371 |
| 8.00% | -553 | -553 | -553 | -554 | -555 | -557 | -559 |
| KR4301P22653 2019-02 풋265 | | | | | | | 412 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -342 | -352 | -363 | -375 | -387 | -399 | -412 |
| -5.33% | -92 | -107 | -122 | -137 | -152 | -167 | -182 |
| -2.67% | -7 | -14 | -21 | -29 | -38 | -48 | -59 |
| 0% | 5 | 4 | 2 | 0 | -3 | -7 | -11 |
| 2.67% | 5 | 5 | 5 | 5 | 4 | 3 | 2 |
| 5.33% | 5 | 5 | 5 | 5 | 5 | 5 | 5 |
| 8.00% | 5 | 5 | 5 | 5 | 5 | 5 | 5 |

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

(단위:백만원)

4,685

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-29 |
| 기준일 | 2019-01-28 |

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

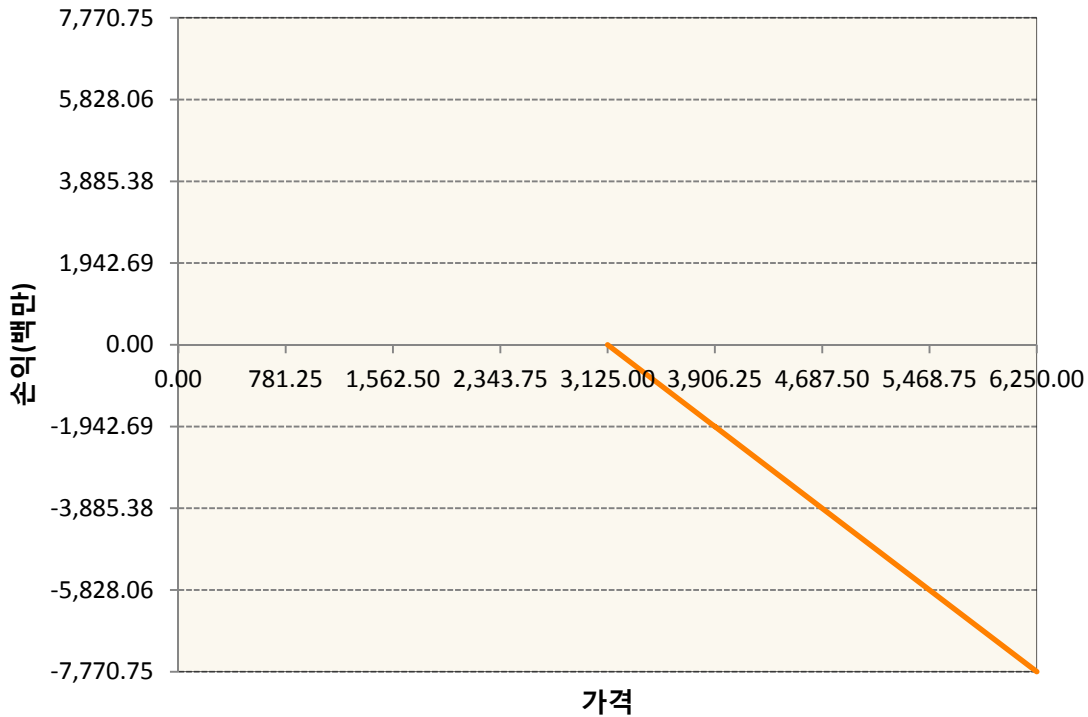
1. 계약금액

(단위:백만원)

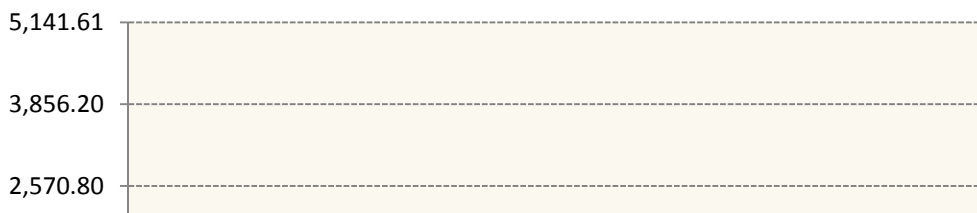
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 6,828 | 0 | 6,828 | |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 60,205 | 0 | 60,205 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 25,825 | -25,825 | 장내 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 15,303 | -15,303 | 장외 |

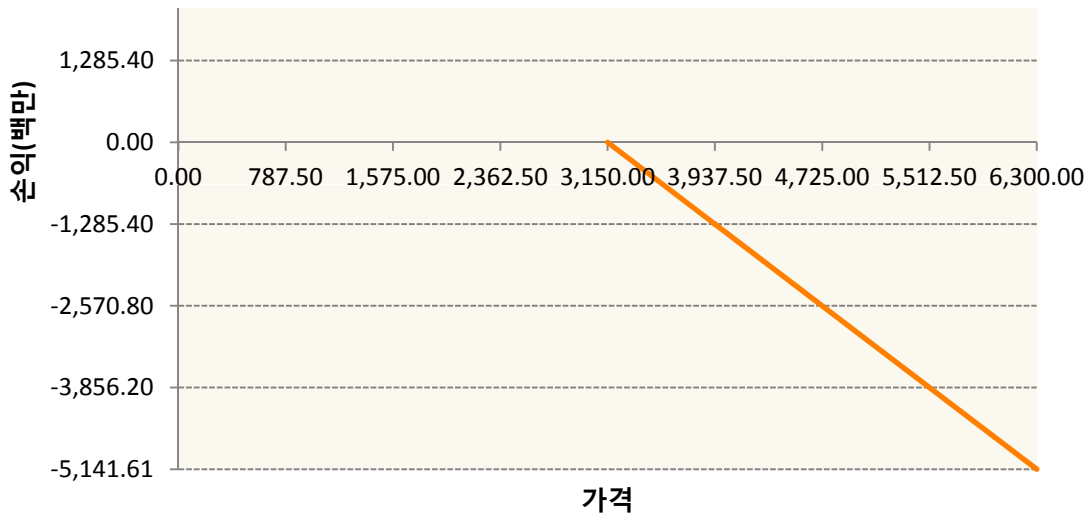
2. 만기시점의 손익구조

OESXG9-C3125-EURO STOXX 50

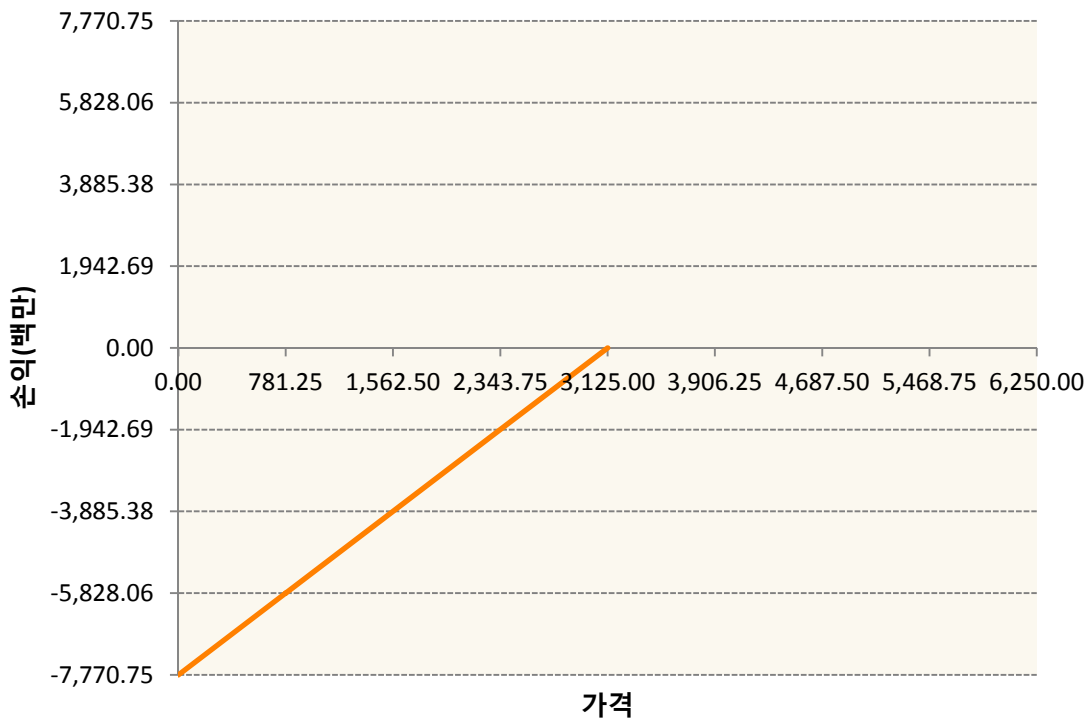


OESXG9-C3150-EURO STOXX 50

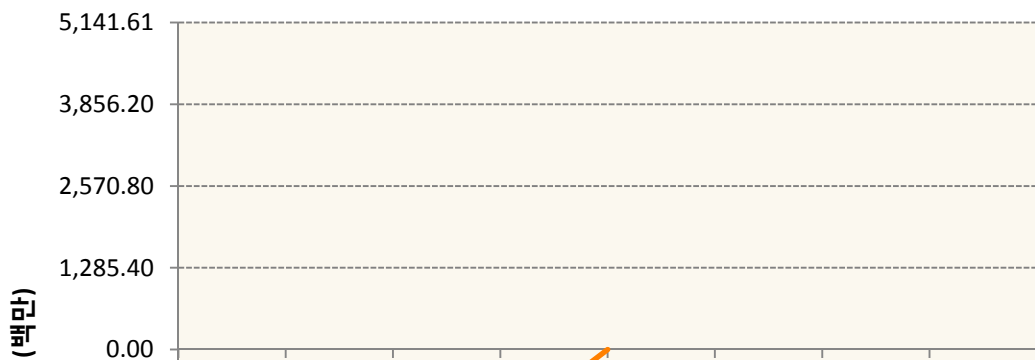


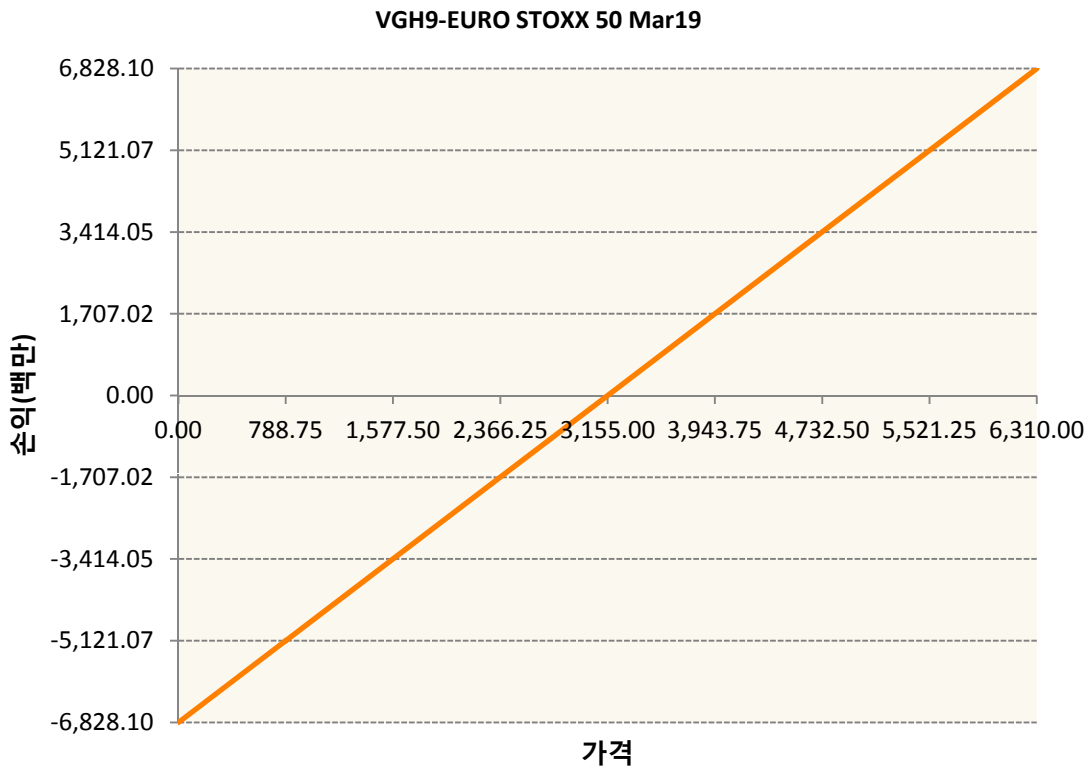
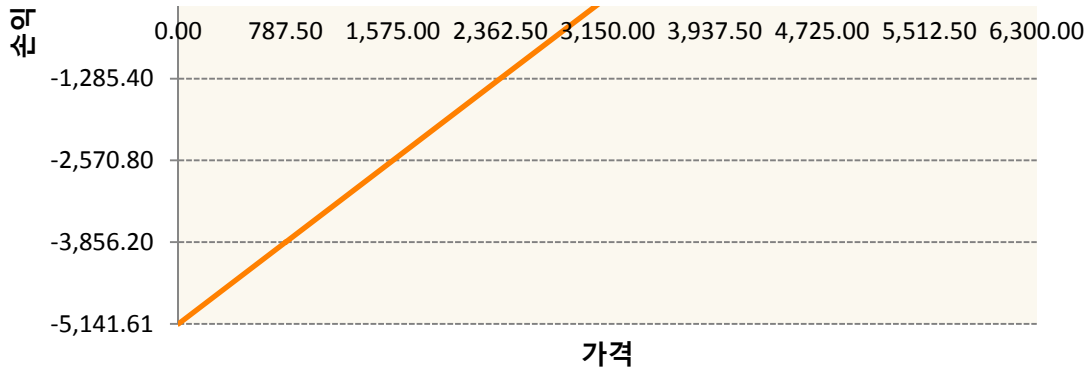


OESXG9-P3125-EURO STOXX 50



OESXG9-P3150-EURO STOXX 50





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---------------------|----------|
| 260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY | | 29 |
| FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E | | 408 |
| FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E | | 816 |
| OESXG9-C31EURO STOXX 50 | | 622 |
| OESXG9-C31EURO STOXX 50 | | 411 |
| OESXG9-P31EURO STOXX 50 | | 622 |
| OESXG9-P31EURO STOXX 50 | | 411 |
| VGH9 | EURO STOXX 50 Mar19 | 546 |

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

(단위:백만원)

2,504

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

(단위:백만원)

1,175

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

(단위:백만원)

100

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

(단위:백만원)

150

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-29 |
| 기준일 | 2019-01-28 |

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

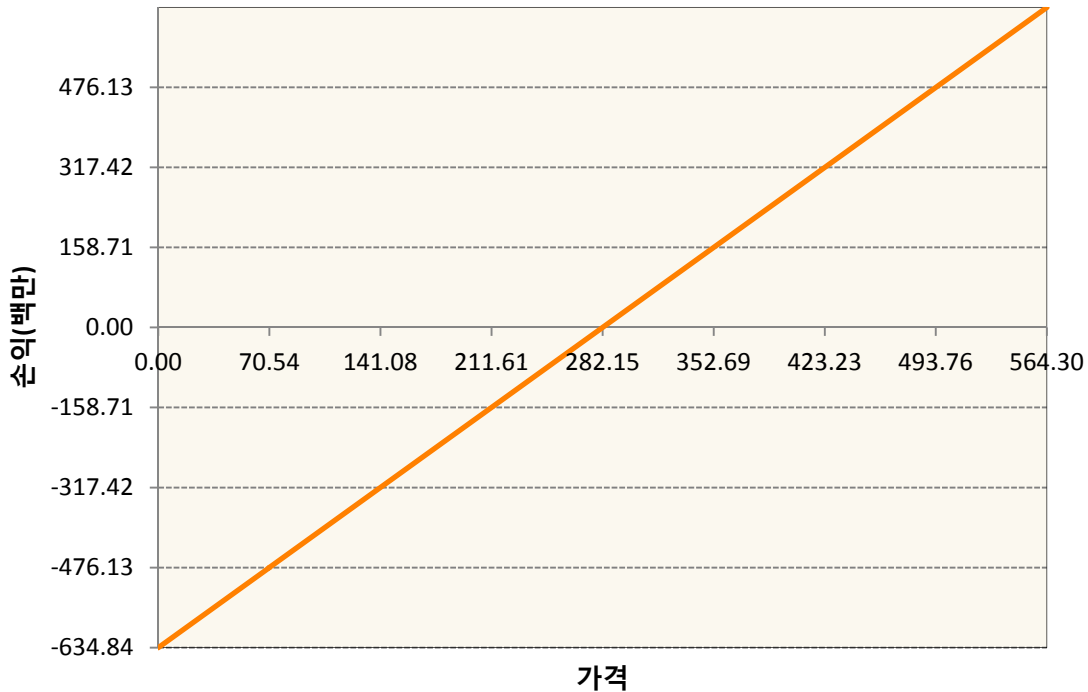
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 635 | 0 | 635 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101P30007 | | 2019-03 코스피200지수선물 | | | | | | 51 |
|--------------|---------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|----|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -51 | -51 | -51 | -51 | -51 | -51 | -51 | |
| -5.33% | -34 | -34 | -34 | -34 | -34 | -34 | -34 | |
| -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% | 34 | 34 | 34 | 34 | 34 | 34 | 34 | |
| 8.00% | 51 | 51 | 51 | 51 | 51 | 51 | 51 | |

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

(단위:백만원)

45

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-29 |
| 기준일 | 2019-01-28 |

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

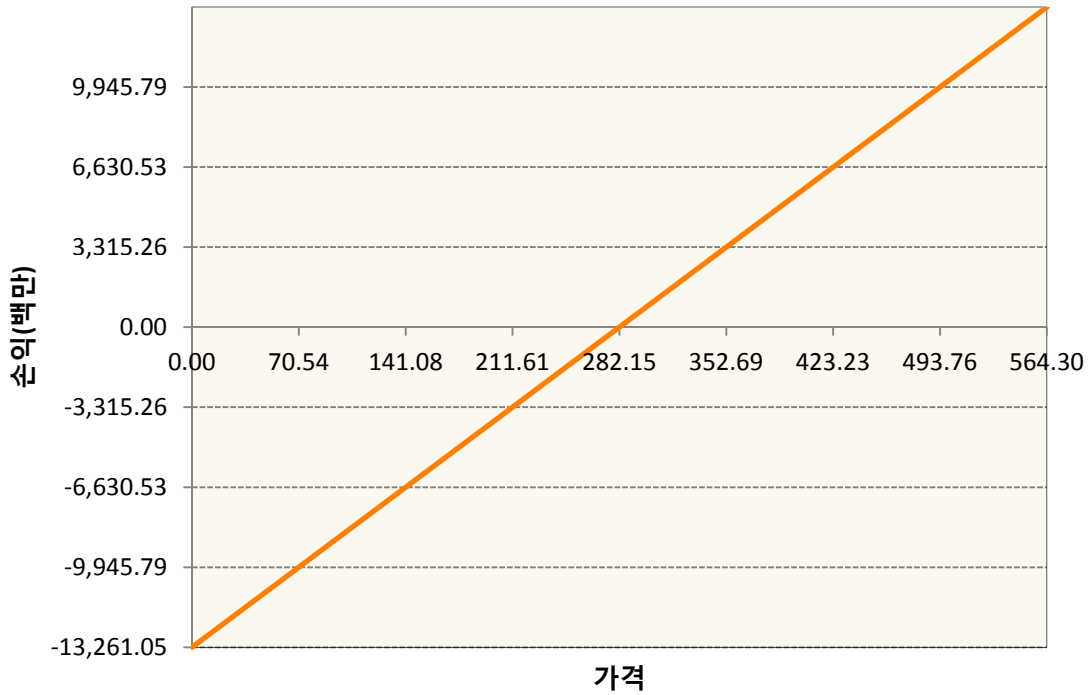
1. 계약금액

(단위:백만원)

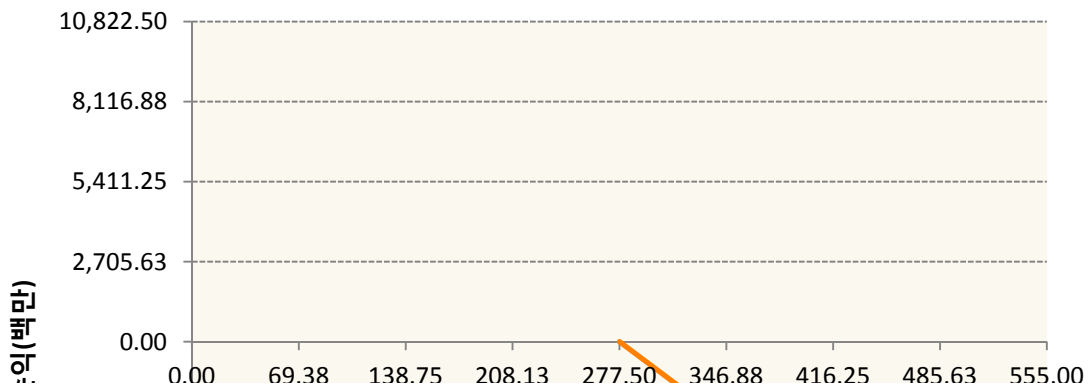
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 13,261 | 0 | 13,261 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 2,523 | 23,213 | -20,690 | 장내 |

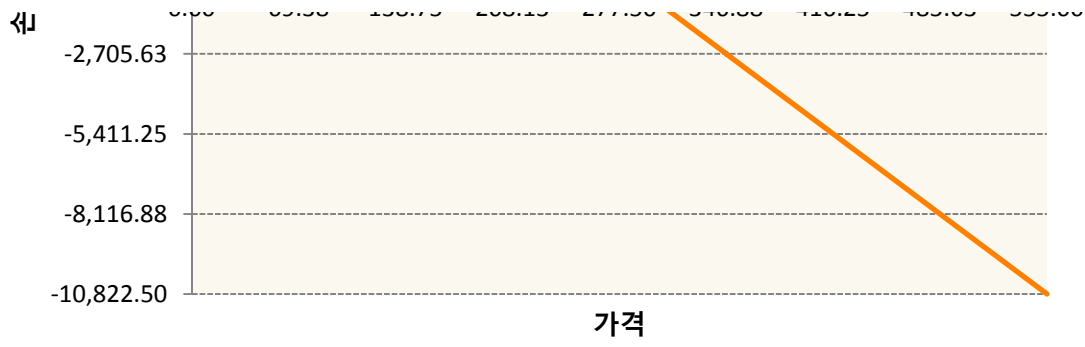
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

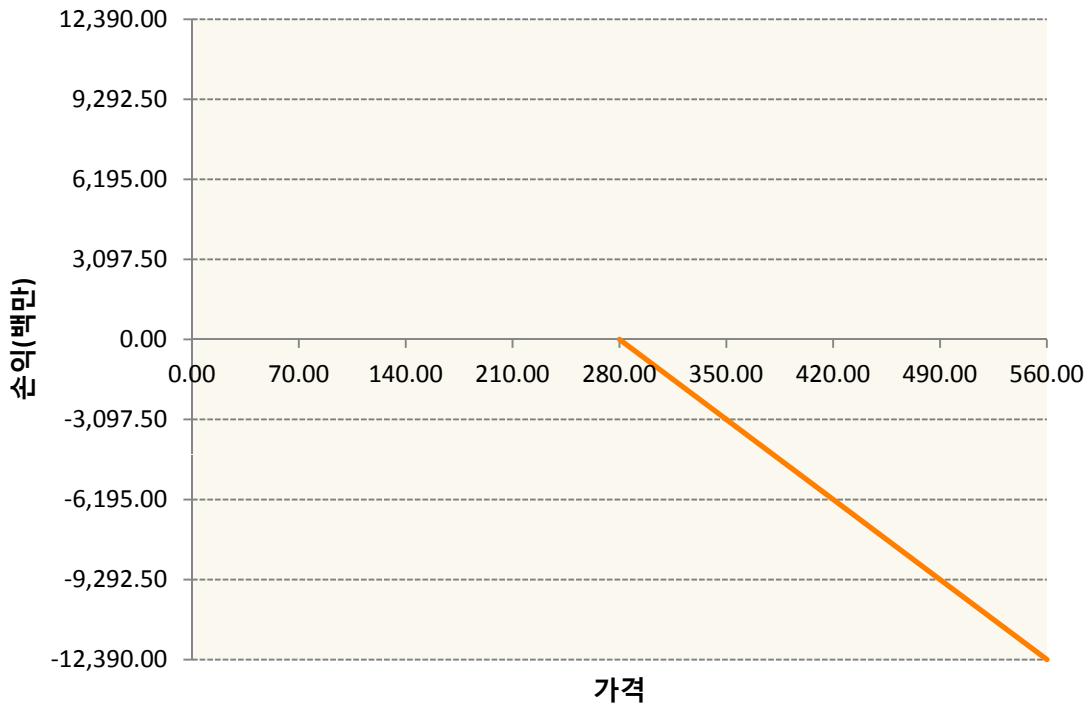


KR4201P22770-2019-02 콜277.5

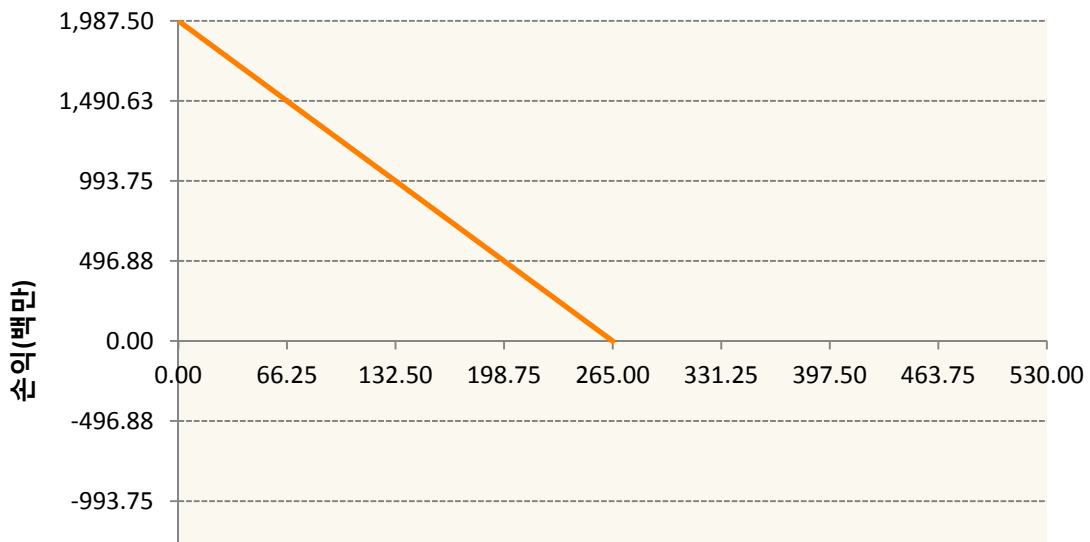


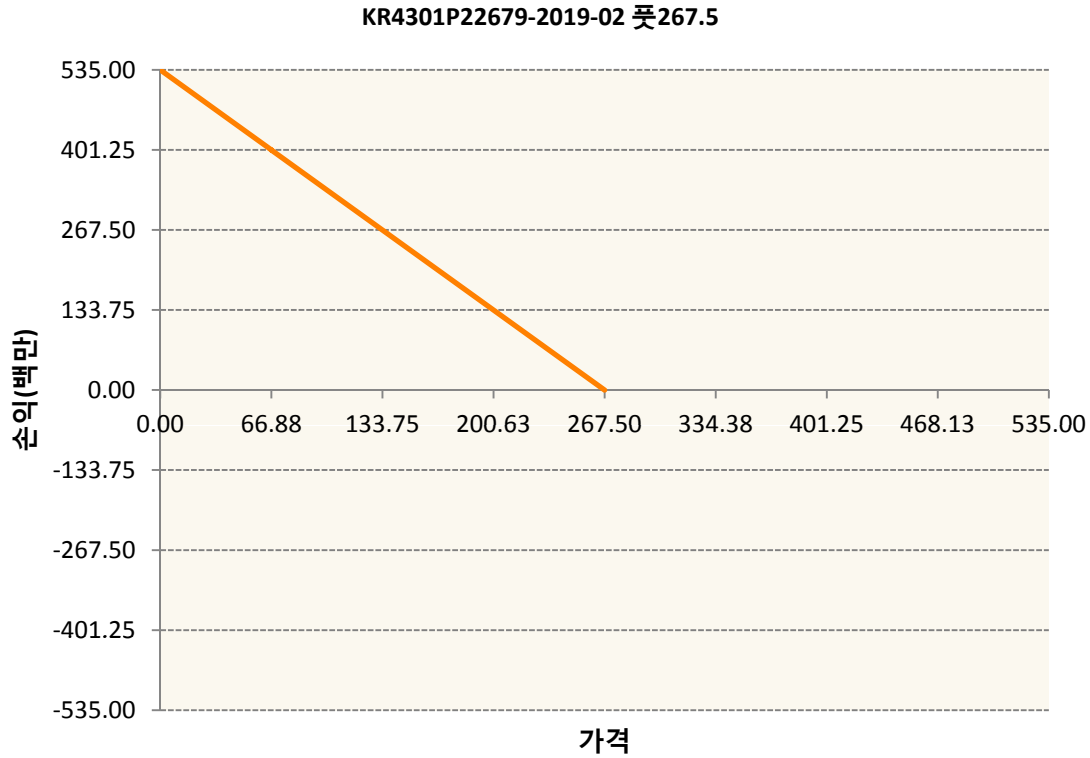
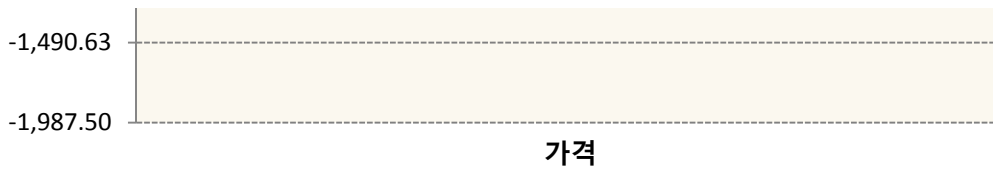


KR4201P22804-2019-02 콜280



KR4301P22653-2019-02 풋265





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4101P30007 | | 2019-03 코스피200지수선물 | | | | | | 1,059 |
|--------------|---------|--------------------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|
| | | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -1,059 | -1,059 | -1,059 | -1,059 | -1,059 | -1,059 | -1,059 | |
| -5.33% | -706 | -706 | -706 | -706 | -706 | -706 | -706 | |
| -2.67% | -353 | -353 | -353 | -353 | -353 | -353 | -353 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 353 | 353 | 353 | 353 | 353 | 353 | 353 | |
| 5.33% | 706 | 706 | 706 | 706 | 706 | 706 | 706 | |
| 8.00% | 1,059 | 1,059 | 1,059 | 1,059 | 1,059 | 1,059 | 1,059 | |
| KR4201P22770 | | 2019-02 콜277.5 | | | | | | 743 |
| | | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 323 | 317 | 310 | 301 | 291 | 281 | 269 | |
| -5.33% | 292 | 279 | 265 | 250 | 234 | 218 | 202 | |
| -2.67% | 210 | 191 | 172 | 152 | 133 | 113 | 94 | |

| | | | | | | | |
|--|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 0% | 58 | 39 | 19 | 0 | -20 | -39 | -59 |
| 2.67% | -162 | -176 | -190 | -205 | -221 | -237 | -254 |
| 5.33% | -426 | -433 | -441 | -451 | -461 | -473 | -486 |
| 8.00% | -710 | -713 | -716 | -721 | -727 | -734 | -743 |
| KR4201P22804 2019-02 콜280 | | | | | | | 807 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 308 | 303 | 297 | 289 | 280 | 270 | 259 |
| -5.33% | 284 | 272 | 259 | 244 | 228 | 212 | 194 |
| -2.67% | 214 | 194 | 173 | 152 | 131 | 109 | 88 |
| 0% | 69 | 46 | 23 | 0 | -23 | -46 | -69 |
| 2.67% | -158 | -175 | -194 | -214 | -234 | -254 | -275 |
| 5.33% | -443 | -453 | -465 | -478 | -492 | -508 | -524 |
| 8.00% | -760 | -764 | -770 | -777 | -786 | -796 | -807 |
| KR4301P22653 2019-02 풋265 | | | | | | | 57 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 48 | 49 | 51 | 52 | 54 | 56 | 57 |
| -5.33% | 13 | 15 | 17 | 19 | 21 | 23 | 25 |
| -2.67% | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 7 | 8 |
| 0% | -1 | -1 | 0 | 0 | 0 | 1 | 2 |
| 2.67% | -1 | -1 | -1 | -1 | -1 | 0 | 0 |
| 5.33% | -1 | -1 | -1 | -1 | -1 | -1 | -1 |
| 8.00% | -1 | -1 | -1 | -1 | -1 | -1 | -1 |
| KR4301P22679 2019-02 풋267.5 | | | | | | | 19 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 17 | 17 | 17 | 18 | 18 | 18 | 19 |
| -5.33% | 6 | 6 | 7 | 7 | 8 | 8 | 9 |
| -2.67% | 1 | 1 | 1 | 2 | 2 | 3 | 3 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 1 |
| 2.67% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 5.33% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 8.00% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |

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

(단위:백만원)

2,547

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-29 |
| 기준일 | 2019-01-28 |

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 | 652 | 0 | 652 | |

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 | 2019-01-29 |
| 기준일 | 2019-01-28 |

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 101 | 0 | 101 | |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 2,967 | 0 | 2,967 | |

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 | 2019-01-29 |
| 기준일 | 2019-01-28 |

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 1,677 | 0 | 1,677 | |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 7,103 | 0 | 7,103 | |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 14,542 | -14,542 | 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 | 27 |
| FX21018Z01 KRW/USD 28-02-19E | 9 |
| FX21018Z02 KRW/USD 28-02-19E | 39 |
| 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 |
| FX21019F01 KRW/USD 19-02-19E | 38 |
| FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E | 14 |
| FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E | 57 |
| FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E | 9 |
| FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E | 32 |
| FX21019F02 KRW/USD 25-02-19E | 135 |
| FX21019F02 KRW/USD 28-03-19E | 465 |
| FX21019F02 KRW/USD 28-02-19E | 116 |

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

(단위:백만원)

439

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-29 |
| 기준일 | 2019-01-28 |

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

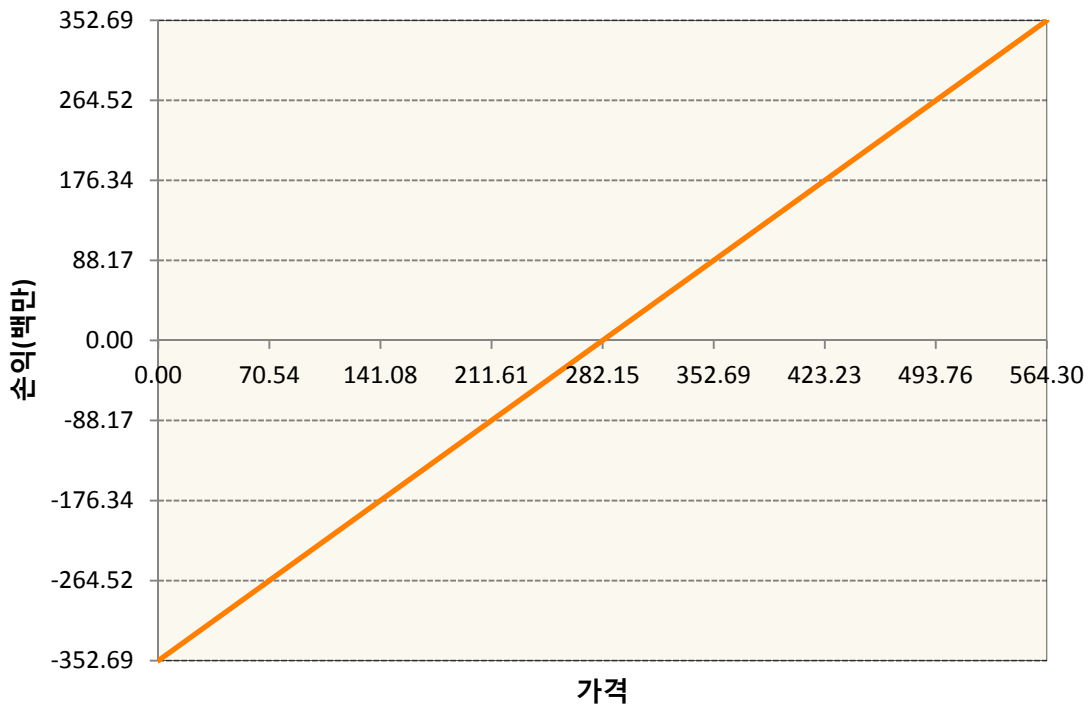
1. 계약금액

(단위:백만원)

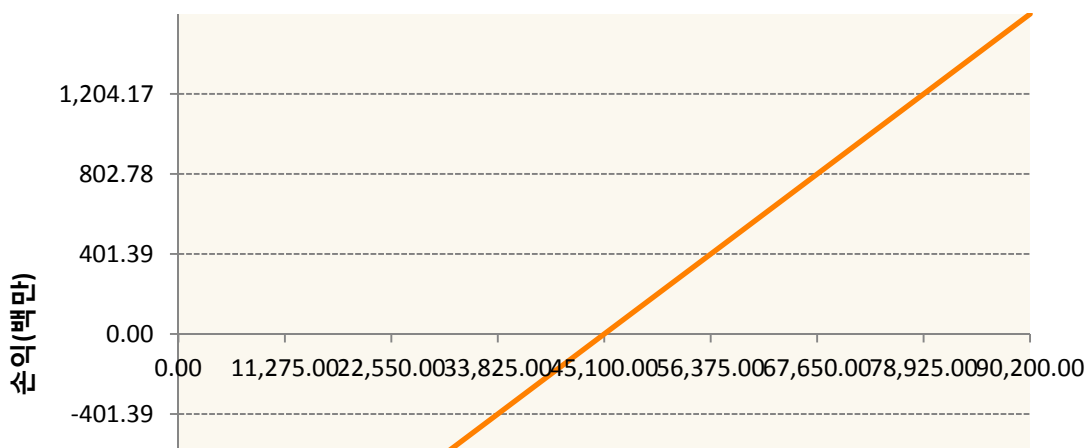
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,958 | 0 | 1,958 | 장내 |

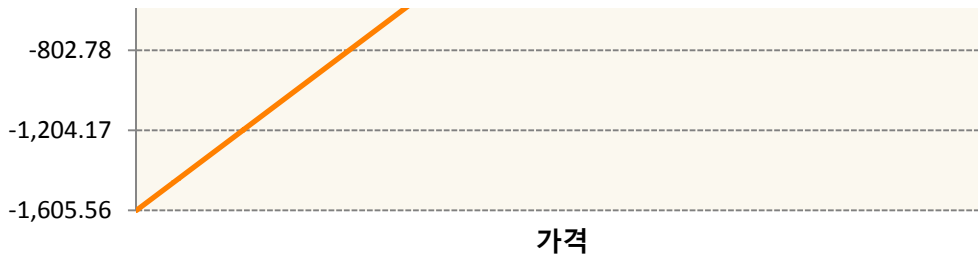
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



KR4111P20007-2019-02 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4101P30007 | | 2019-03 코스피200지수선물 | | | | | | 28 |
|--------------|---------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|----|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -28 | -28 | -28 | -28 | -28 | -28 | -28 | |
| -5.33% | -19 | -19 | -19 | -19 | -19 | -19 | -19 | |
| -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% | 19 | 19 | 19 | 19 | 19 | 19 | 19 | |
| 8.00% | 28 | 28 | 28 | 28 | 28 | 28 | 28 | |

| KR4111P20007 | | 2019-02 삼성전자개별선물 | | | | | | 128 |
|--------------|---------|------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -128 | -128 | -128 | -128 | -128 | -128 | -128 | |
| -5.33% | -86 | -86 | -86 | -86 | -86 | -86 | -86 | |
| -2.67% | -43 | -43 | -43 | -43 | -43 | -43 | -43 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 43 | 43 | 43 | 43 | 43 | 43 | 43 | |
| 5.33% | 86 | 86 | 86 | 86 | 86 | 86 | 86 | |
| 8.00% | 128 | 128 | 128 | 128 | 128 | 128 | 128 | |

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

177

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-29 |
| 기준일 | 2019-01-28 |

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

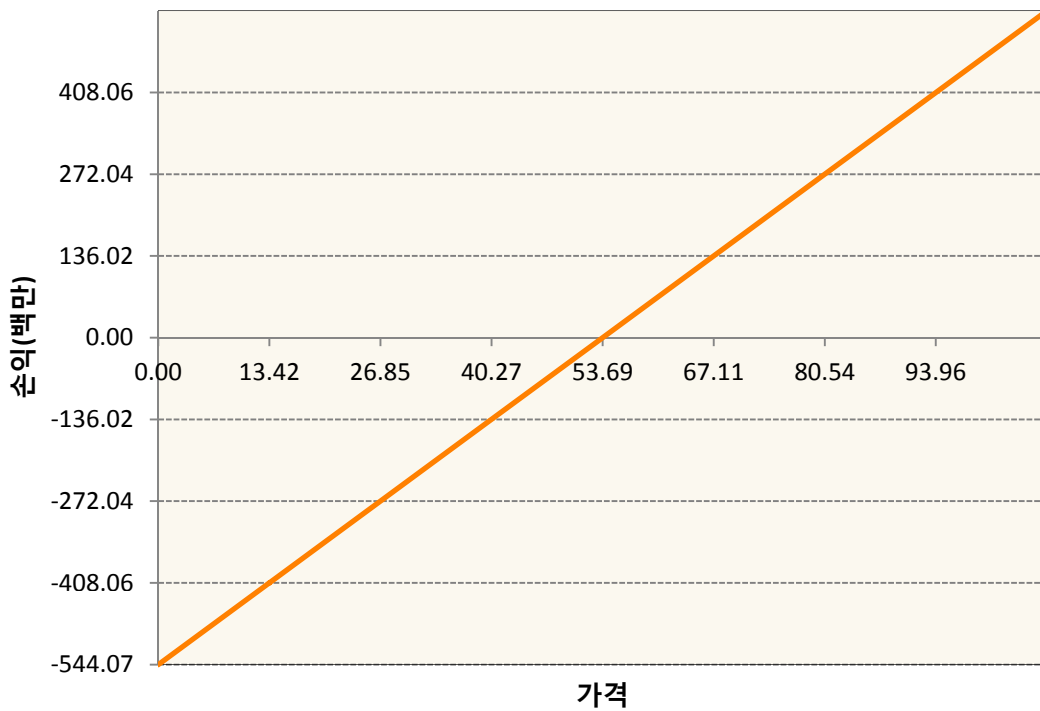
1. 계약금액

(단위:백만원)

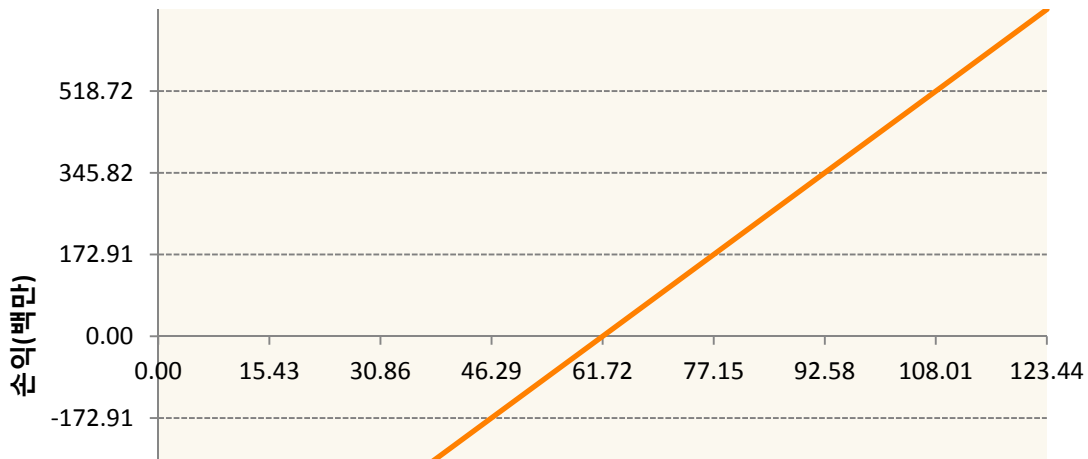
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,767 | 279 | 2,487 | |

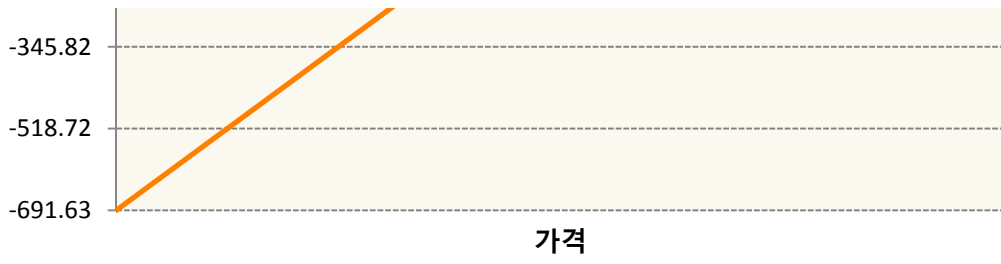
2. 만기시점의 손익구조

CLH9-WTI CRUDE FUTURE MAR19

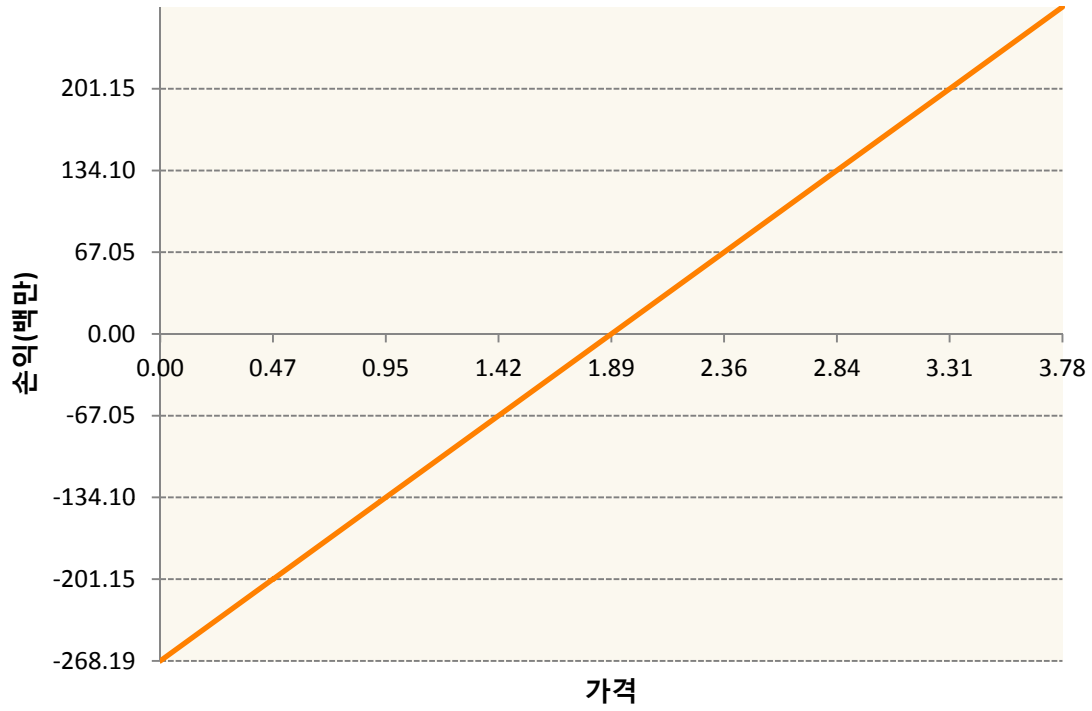


COK9-BRENT CRUDE FUTR May19

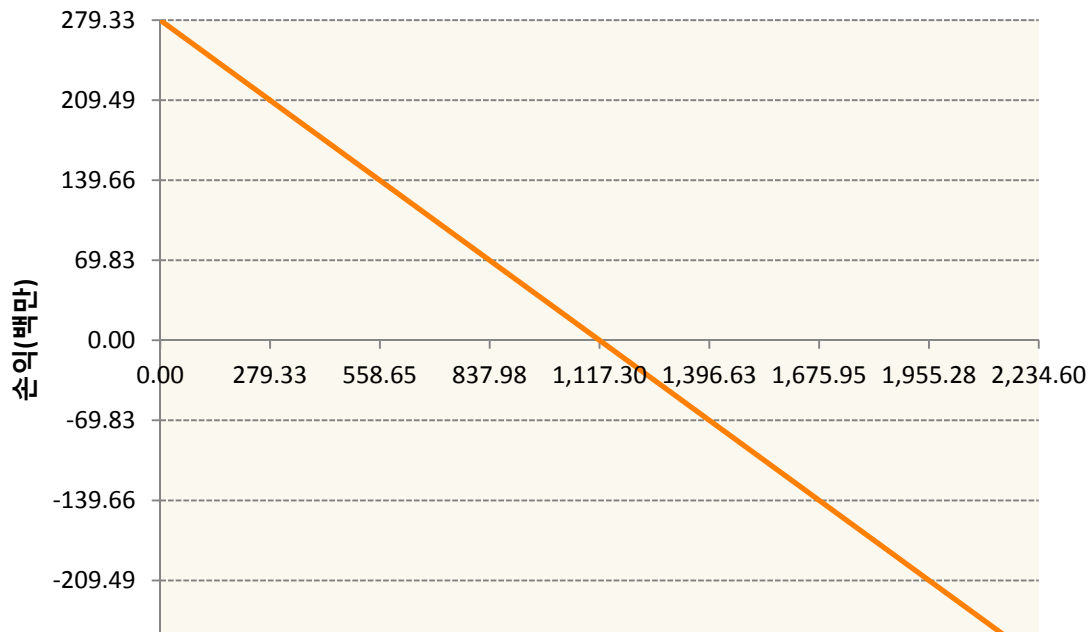


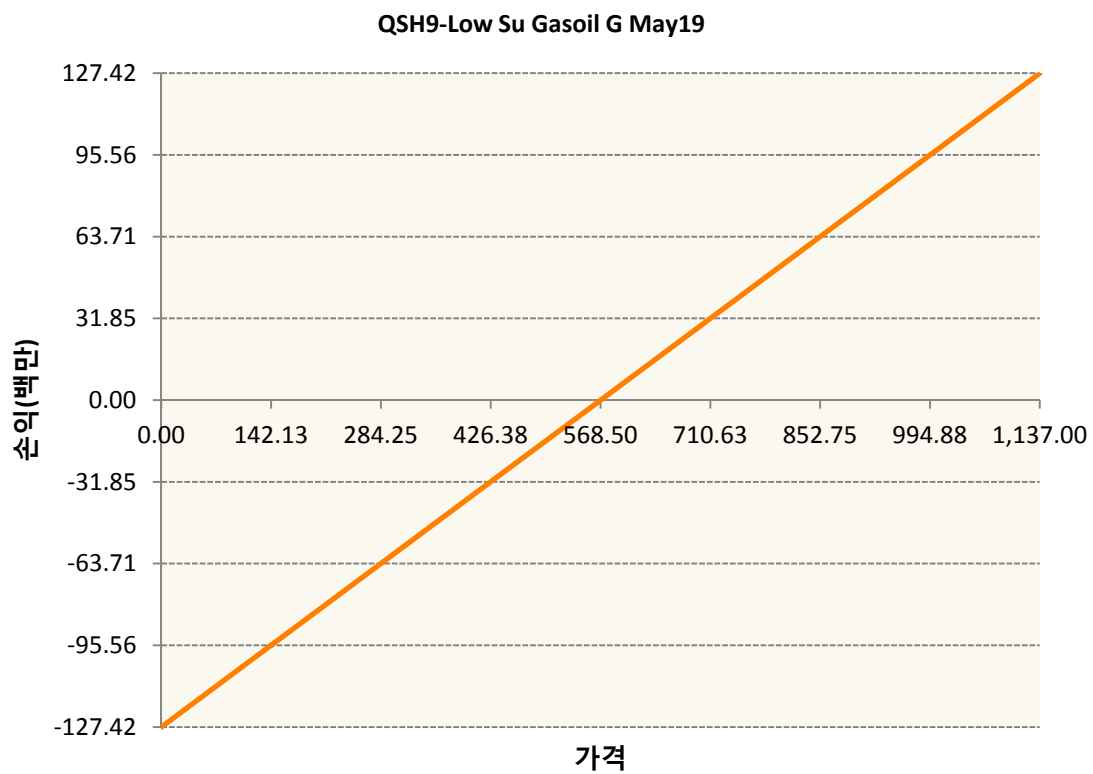
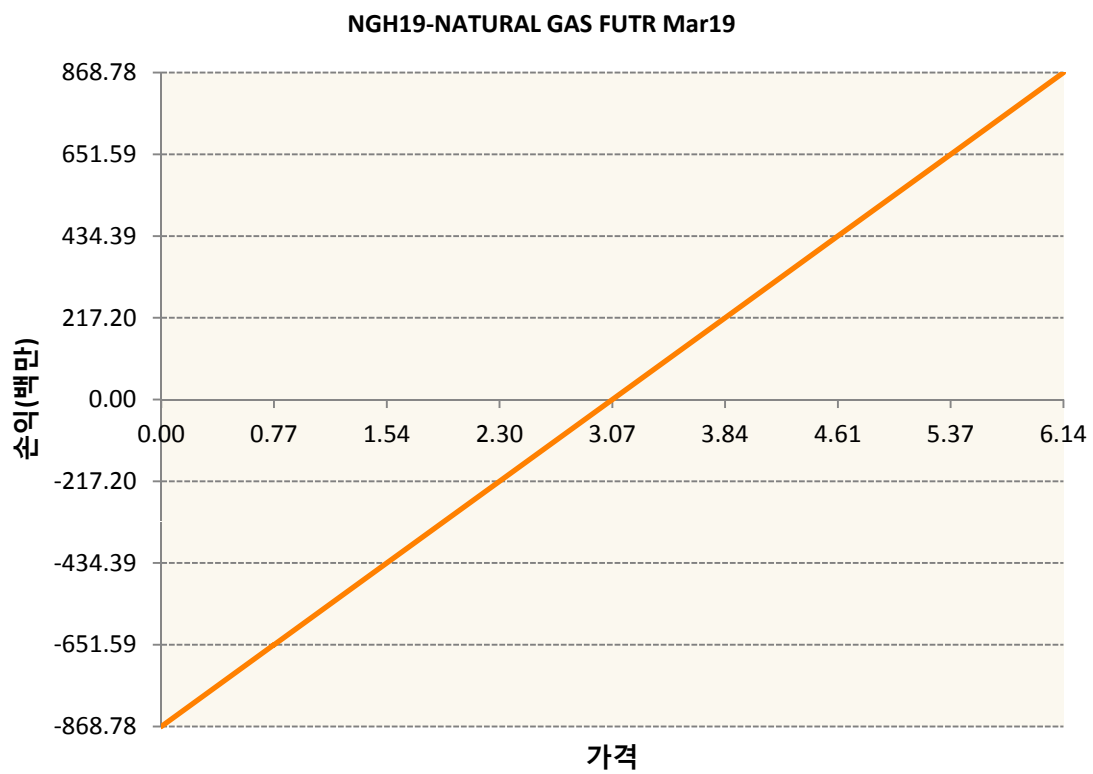
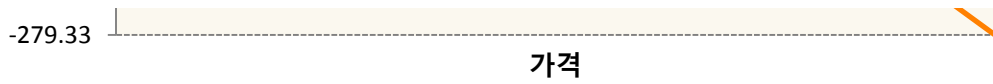


HOH9-NY Harb ULSD Fut Mar19

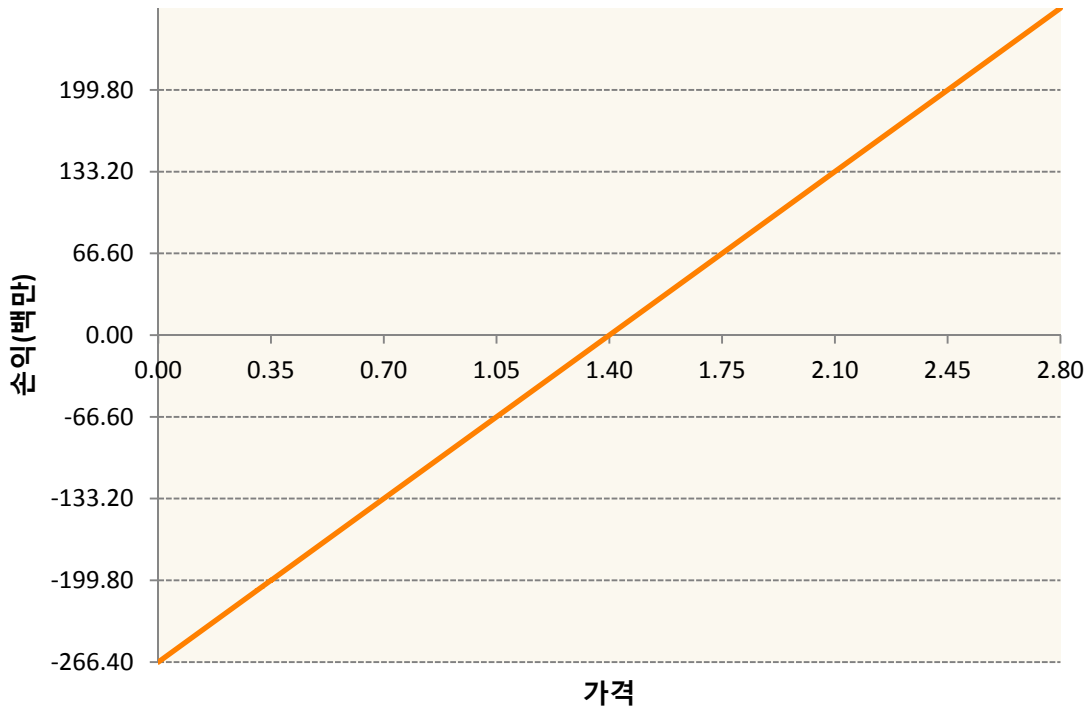


KR4175P20002-2019-02 달러선물





XBH9-GASOLINE RBOB FUT Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | |
|------------|-------------------------|----|
| CLH9 | WTI CRUDE FUTURE MAR19 | 44 |
| COK9 | BRENT CRUDE FUTR May19 | 55 |
| HOH9 | NY Harb ULSD Fut Mar19 | 21 |
| KR4175P200 | 2019-02 달러선물 | 22 |
| NGH19 | NATURAL GAS FUTR Mar19 | 70 |
| QSH9 | Low Su Gasoil G May19 | 10 |
| XBH9 | GASOLINE RBOB FUT Mar19 | 21 |

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

437

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-01-29 |
| 기준일 | 2019-01-28 |

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

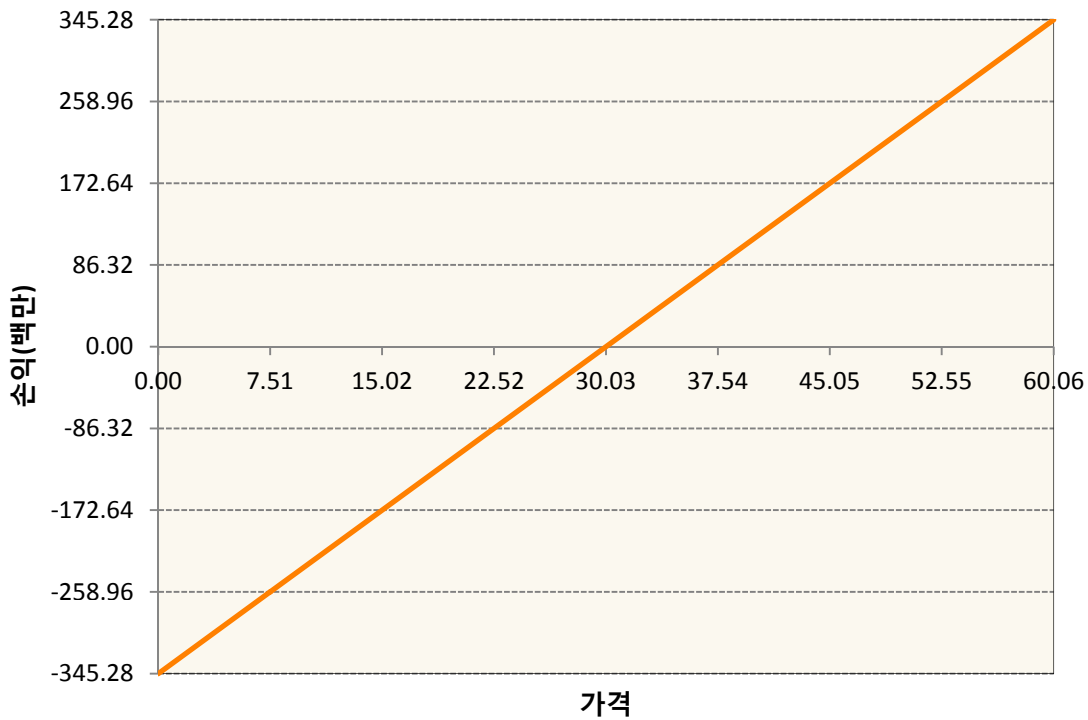
1. 계약금액

(단위:백만원)

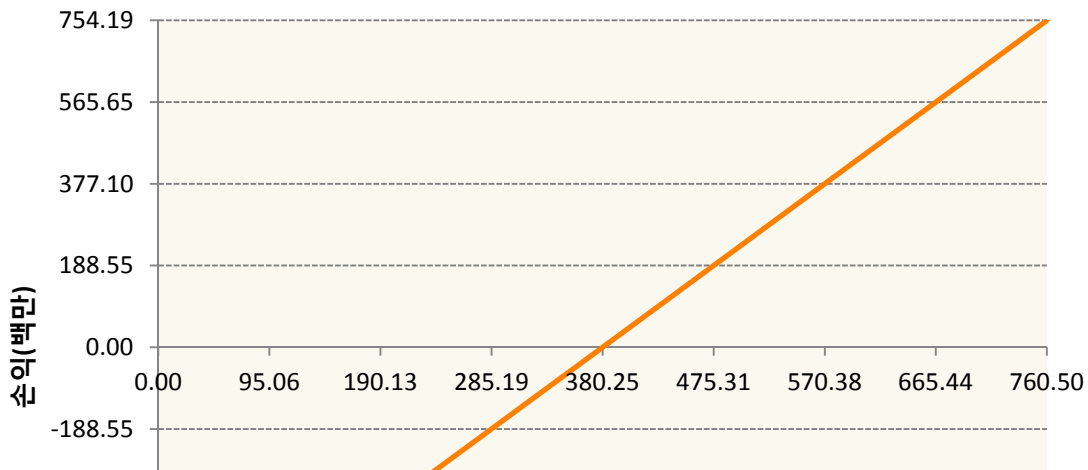
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,606 | 78 | 3,528 | |

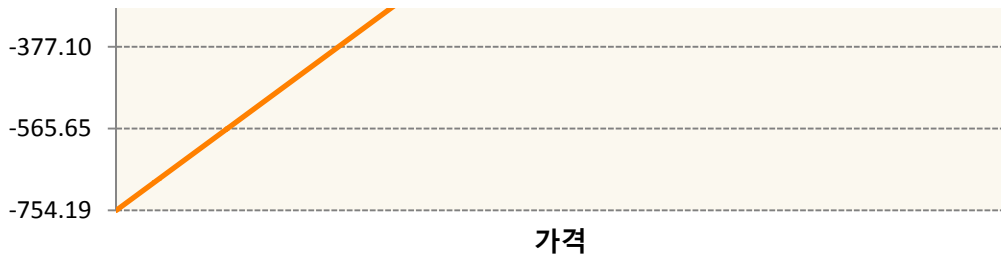
2. 만기시점의 손익구조

BOH9-SOYBEAN OIL FUTR Mar19

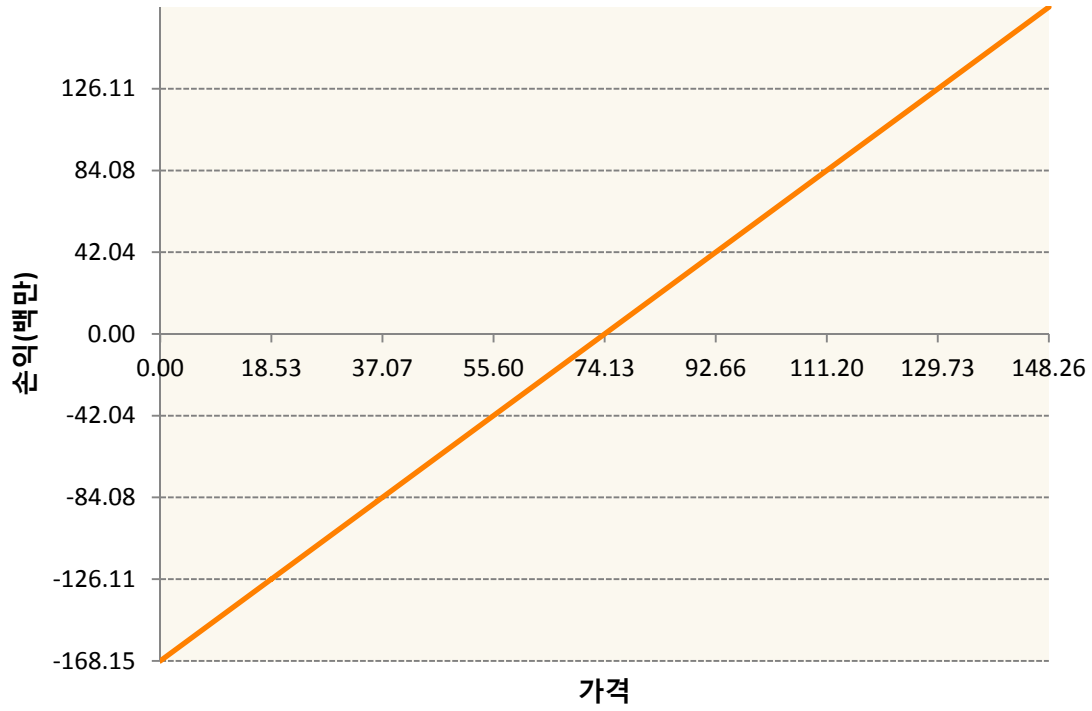


CH9-CORN FUTURE Mar19

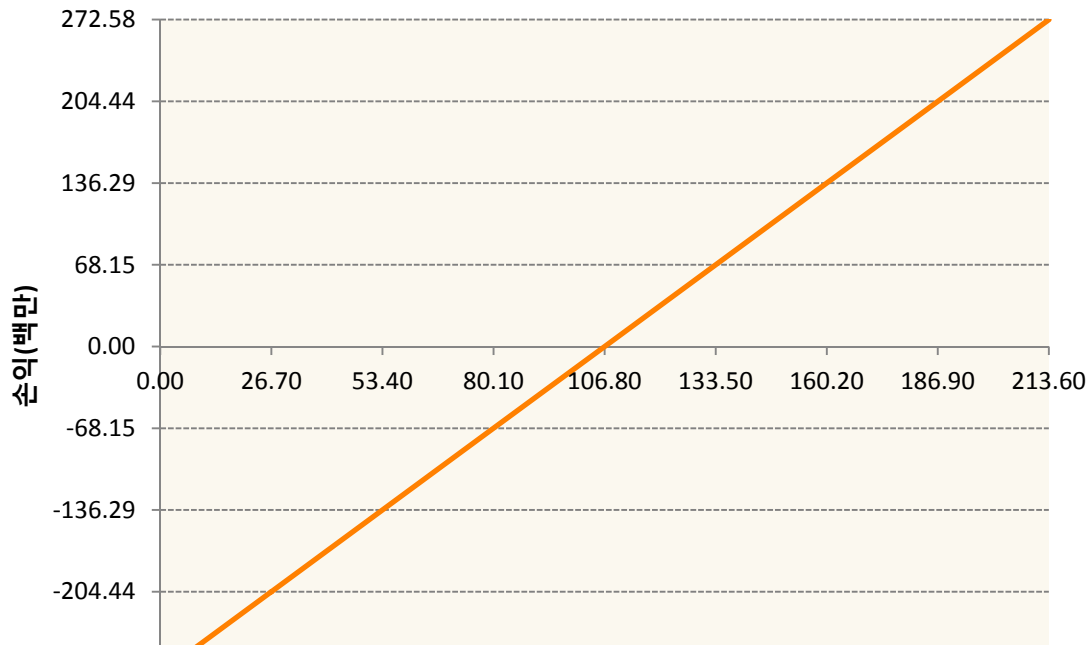


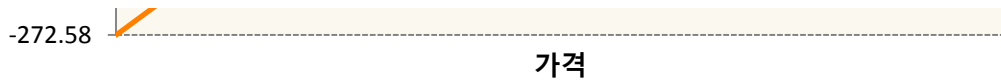


CTH9-COTTON NO.2 FUTR Mar19

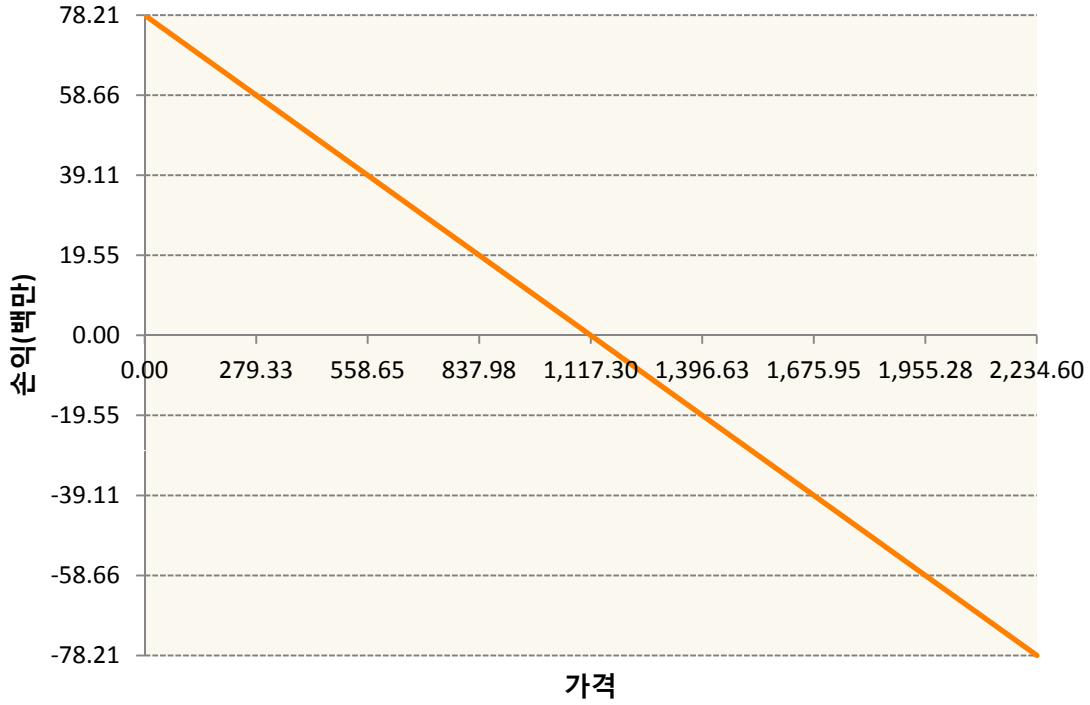


KCH9-COFFEE 'C' FUTURE Mar19

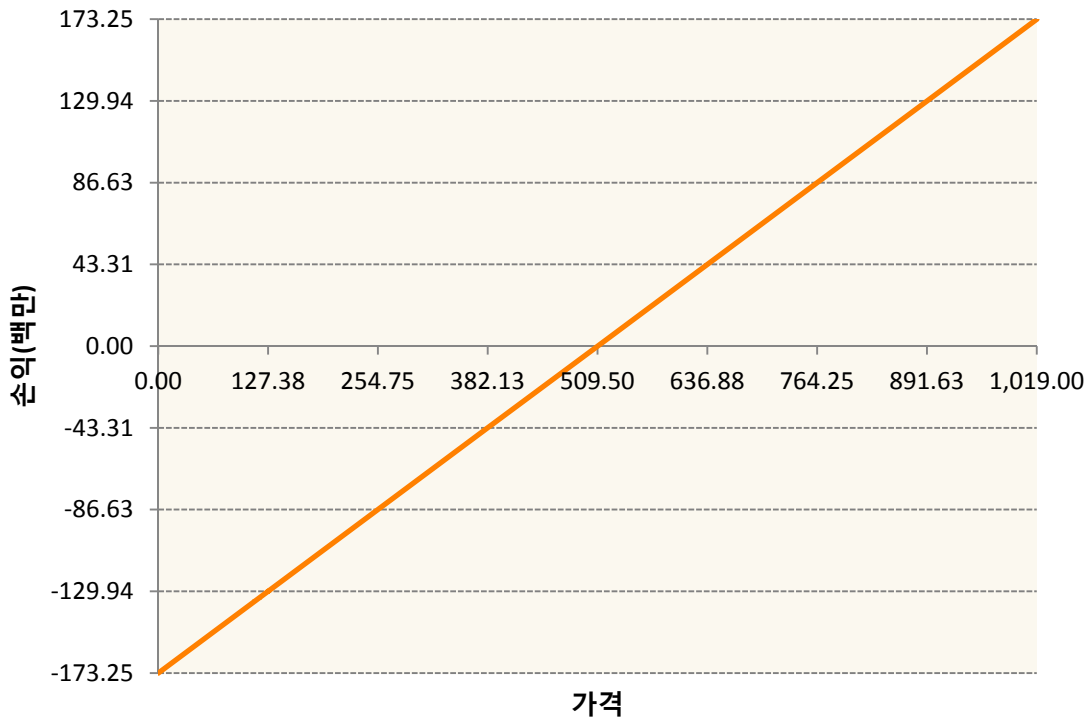




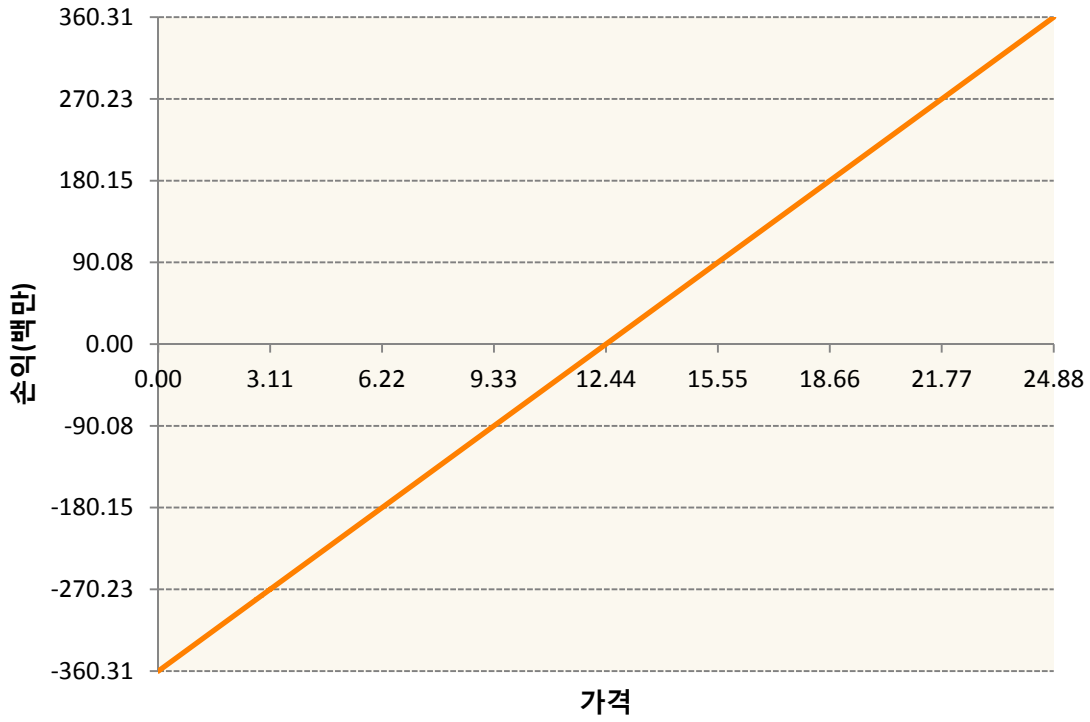
KR4175P20002-2019-02 달러선물



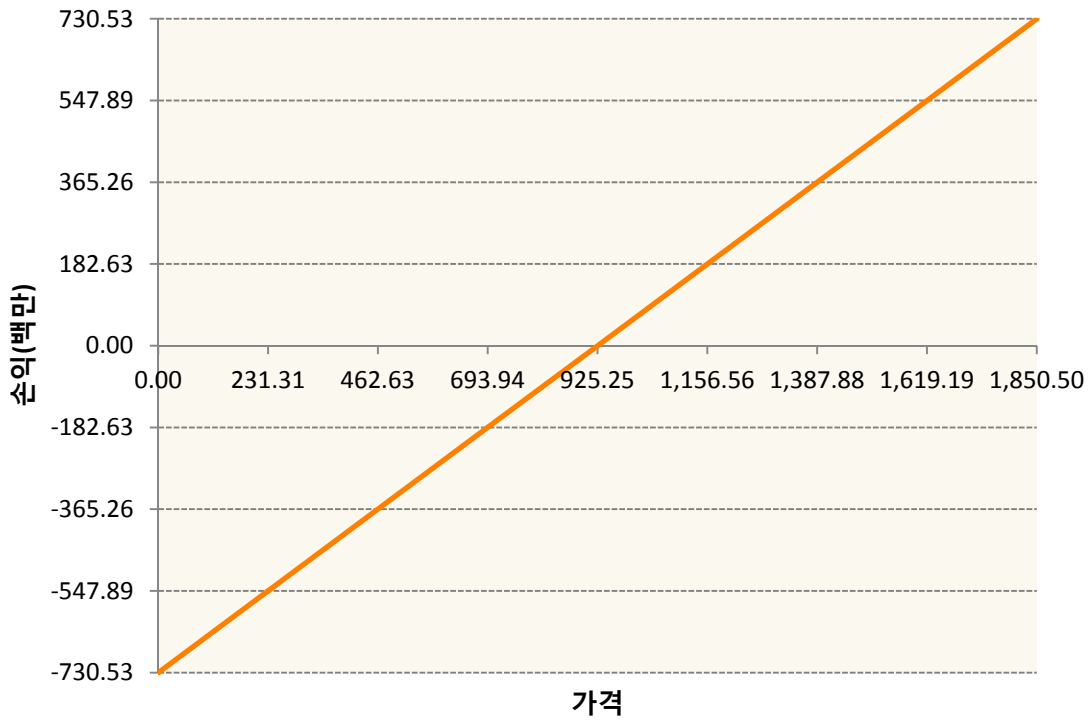
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

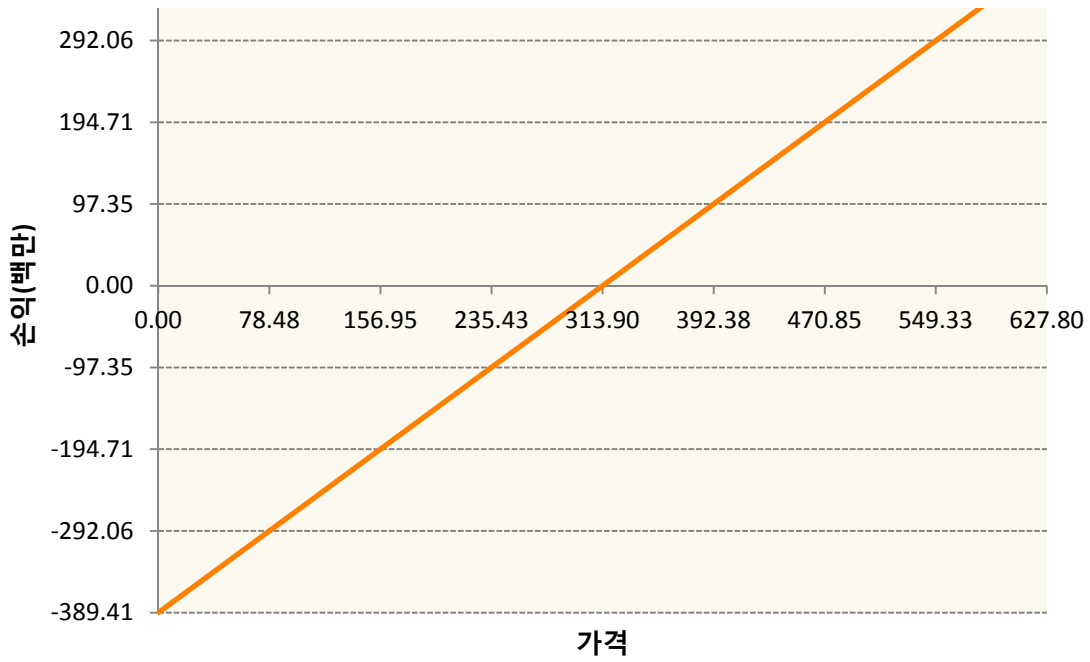


SH9-SOYBEAN FUTURE Mar19

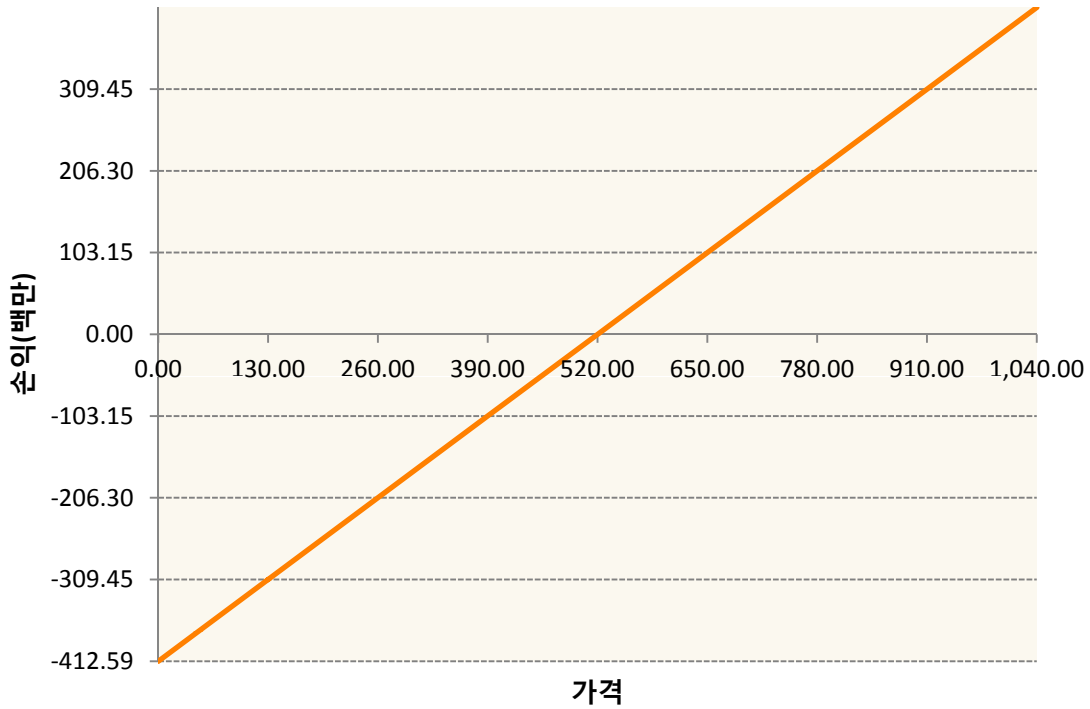


SMH9-SOYBEAN MEAL FUTR Mar19





WH9-WHEAT FUTURE(CBT) Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------------|-------------------------|----|
| BOH9 | SOYBEAN OIL FUTR Mar19 | 28 |
| CH9 | CORN FUTURE Mar19 | 60 |
| CTH9 | COTTON NO.2 FUTR Mar19 | 13 |
| KCH9 | COFFEE 'C' FUTURE Mar19 | 22 |
| KR4175P200 | 2019-02 달러선물 | 6 |

| | | |
|------|-------------------------|----|
| KWH9 | KC HRW WHEAT FUT Mar19 | 14 |
| SBH9 | SUGAR #11 (WORLD) MAR19 | 29 |
| 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