

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-03-27 |
| 기준일 | 2019-03-26 |

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)

94

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-03-27 |
| 기준일 | 2019-03-26 |

SMART합성-MSCI선진국증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 지수 | 스왑 | 13,865 | 0 | 13,865 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S190222

1,115

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

653

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-03-27 |
| 기준일 | 2019-03-26 |

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 지수 | 스왑 | 7,434 | 0 | 7,434 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|--|-----|
| SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S180910 신규) | 337 |
| SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규) | 93 |
| SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규) | 158 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|------------|
| 925 |
|------------|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-03-27 |
| 기준일 | 2019-03-26 |

유로인덱스모(주식-파생형)

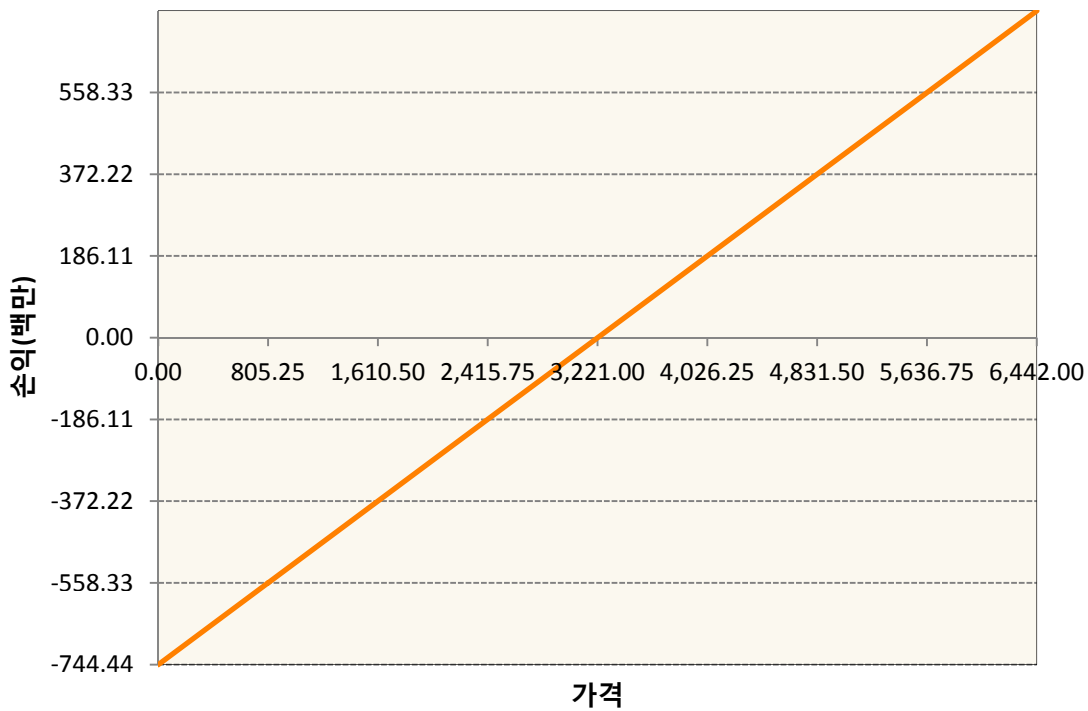
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 744 | 0 | 744 | |

2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------|---------------------|----|
| VGM9 | EURO STOXX 50 JUN19 | 60 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

| |
|----|
| 42 |
|----|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-03-27 |
| 기준일 | 2019-03-26 |

차이나인덱스모(주식-파생형)

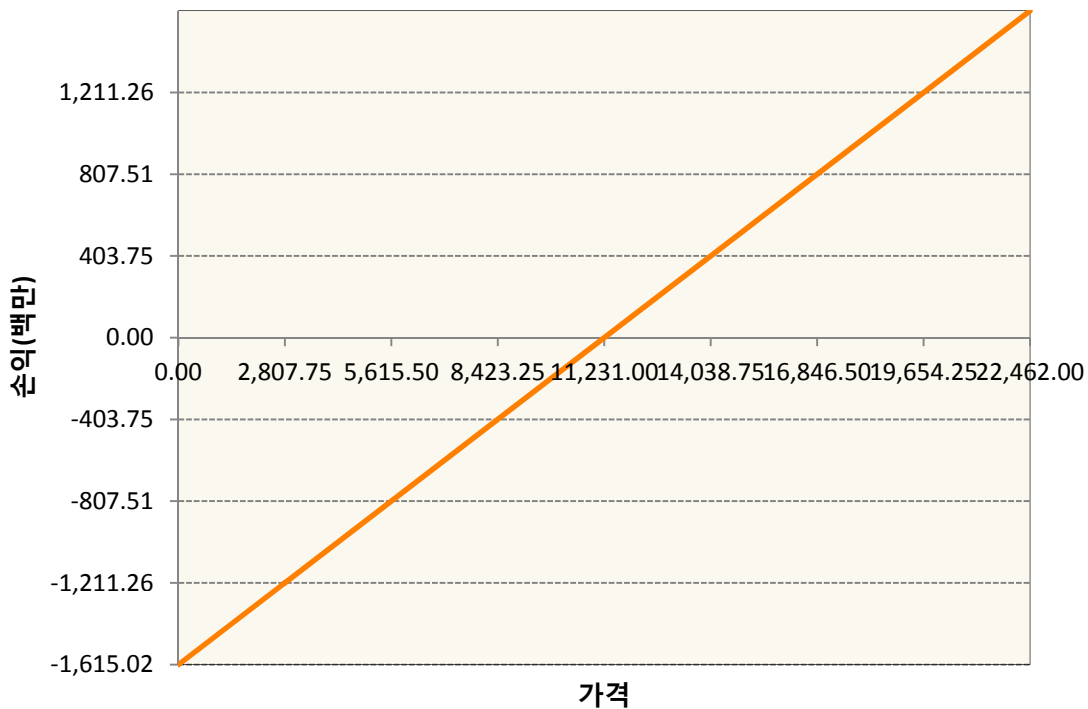
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,615 | 0 | 1,615 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

HCH9-HSCEI Futures Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------|---------------------|-----|
| HCH9 | HSCEI Futures Mar19 | 129 |
|------|---------------------|-----|

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

(단위:백만원)

133

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-03-27 |
| 기준일 | 2019-03-26 |

커버드콜모(주식혼합-파생형)

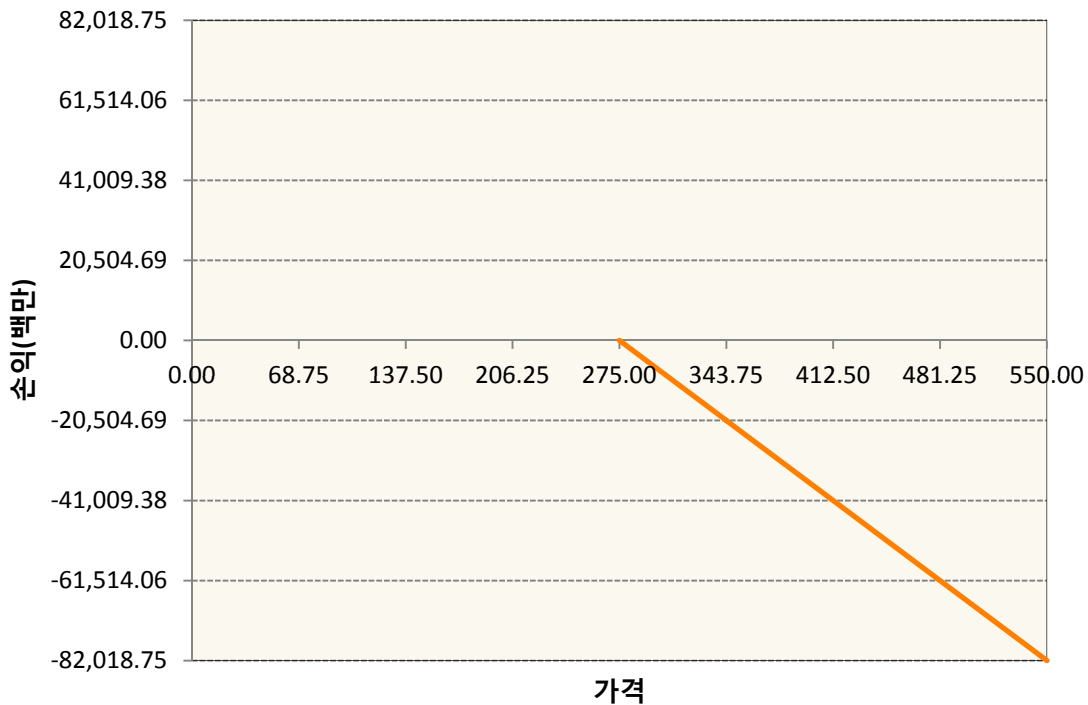
1. 계약금액

(단위:백만원)

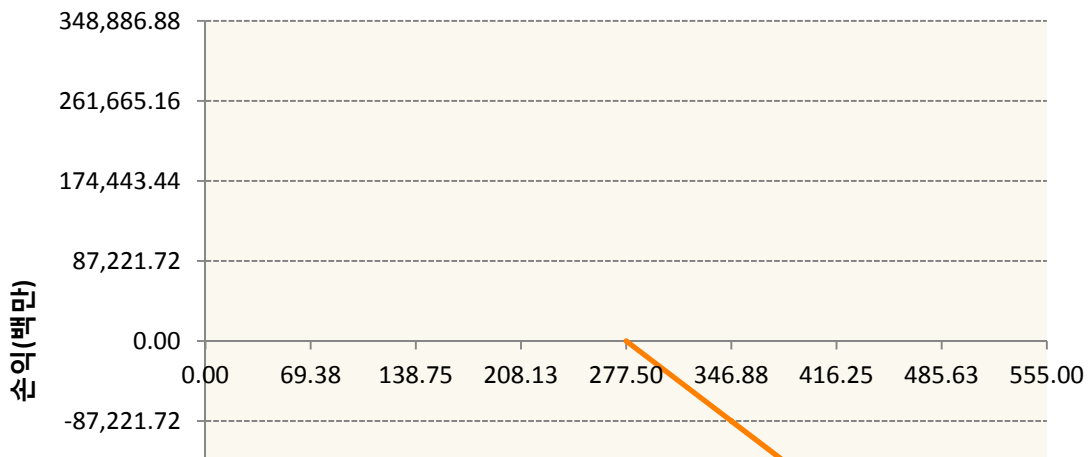
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 1,543 | -1,543 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 668,968 | -668,968 | 장내 |

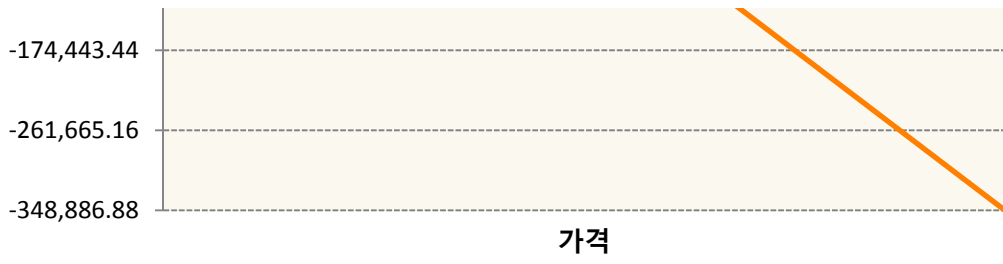
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P42752-2019-04 콜275

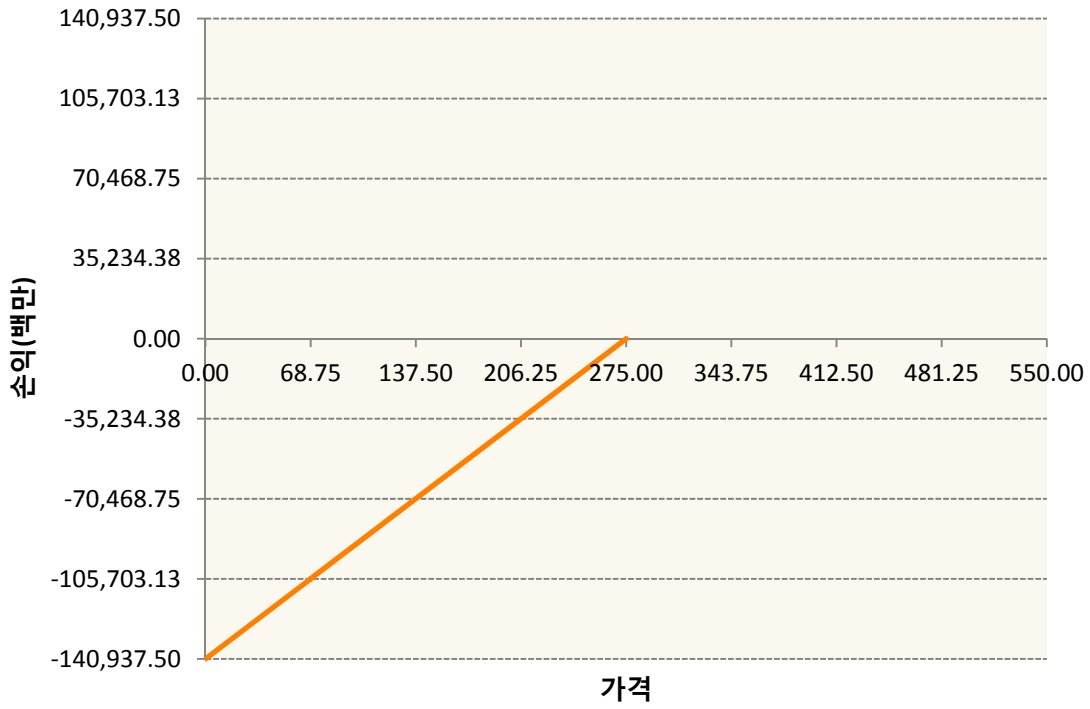


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

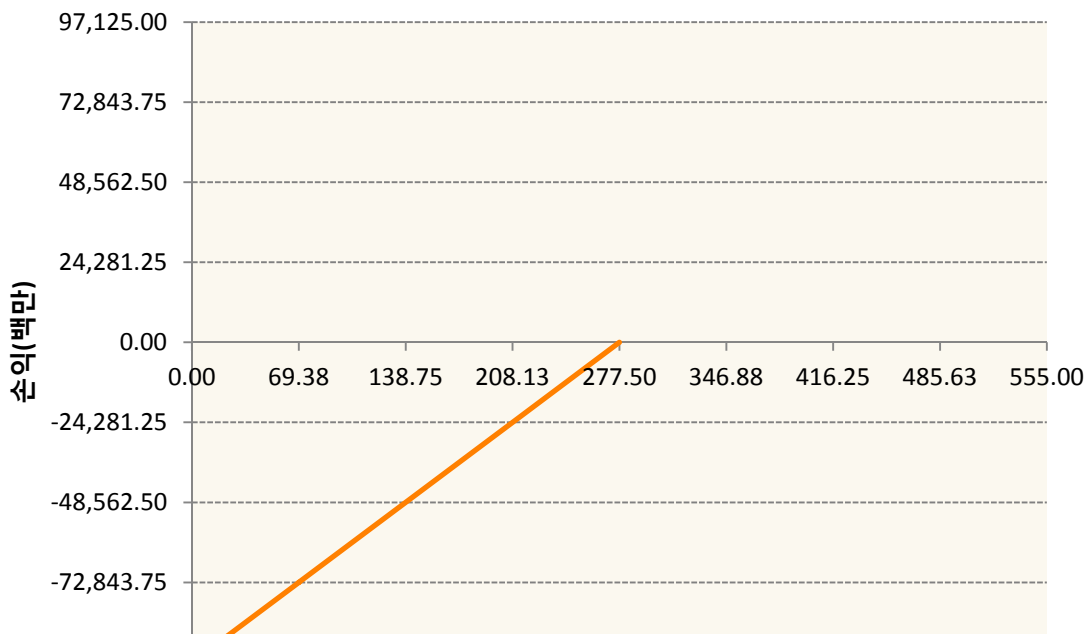




KR4301P42750-2019-04 풋275



KR4301P42776-2019-04 풋277.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4201P42752 | | | | | | | 2019-04 콜275 | | 5,482 |
|--------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|----------------|--|--------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | | |
| -8.00% | 2,111 | 2,082 | 2,043 | 1,994 | 1,937 | 1,872 | 1,801 | | |
| -5.33% | 1,949 | 1,870 | 1,783 | 1,688 | 1,587 | 1,481 | 1,371 | | |
| -2.67% | 1,455 | 1,324 | 1,191 | 1,055 | 919 | 782 | 644 | | |
| 0% | 428 | 286 | 143 | 0 | -144 | -288 | -432 | | |
| 2.67% | -1,150 | -1,253 | -1,364 | -1,480 | -1,600 | -1,724 | -1,850 | | |
| 5.33% | -3,106 | -3,158 | -3,221 | -3,294 | -3,375 | -3,464 | -3,559 | | |
| 8.00% | -5,238 | -5,257 | -5,284 | -5,321 | -5,366 | -5,420 | -5,482 | | |
| KR4201P42778 | | | | | | | 2019-04 콜277.5 | | 21,978 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | | |
| -8.00% | 7,328 | 7,244 | 7,125 | 6,969 | 6,777 | 6,553 | 6,297 | | |
| -5.33% | 6,888 | 6,630 | 6,330 | 5,993 | 5,624 | 5,229 | 4,812 | | |
| -2.67% | 5,371 | 4,875 | 4,361 | 3,832 | 3,291 | 2,742 | 2,184 | | |
| 0% | 1,850 | 1,233 | 617 | 0 | -617 | -1,233 | -1,850 | | |
| 2.67% | -4,060 | -4,574 | -5,106 | -5,652 | -6,210 | -6,776 | -7,351 | | |
| 5.33% | -11,854 | -12,149 | -12,487 | -12,863 | -13,270 | -13,703 | -14,159 | | |
| 8.00% | -20,654 | -20,775 | -20,938 | -21,142 | -21,386 | -21,666 | -21,978 | | |
| KR4301P42750 | | | | | | | 2019-04 풋275 | | 8,973 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | | |
| -8.00% | -8,922 | -8,923 | -8,926 | -8,932 | -8,941 | -8,954 | -8,973 | | |
| -5.33% | -5,159 | -5,182 | -5,215 | -5,256 | -5,306 | -5,364 | -5,429 | | |
| -2.67% | -1,740 | -1,848 | -1,961 | -2,079 | -2,200 | -2,324 | -2,450 | | |
| 0% | 406 | 272 | 137 | 0 | -138 | -277 | -416 | | |
| 2.67% | 1,069 | 1,019 | 958 | 888 | 810 | 725 | 633 | | |
| 5.33% | 1,151 | 1,145 | 1,134 | 1,117 | 1,094 | 1,063 | 1,026 | | |
| 8.00% | 1,155 | 1,155 | 1,154 | 1,152 | 1,148 | 1,141 | 1,131 | | |
| KR4301P42776 | | | | | | | 2019-04 풋277.5 | | 6,595 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | | |
| -8.00% | -6,577 | -6,577 | -6,578 | -6,580 | -6,583 | -6,588 | -6,595 | | |
| -5.33% | -3,995 | -4,002 | -4,014 | -4,031 | -4,053 | -4,080 | -4,112 | | |
| -2.67% | -1,530 | -1,582 | -1,641 | -1,704 | -1,772 | -1,844 | -1,919 | | |
| 0% | 296 | 197 | 99 | 0 | -99 | -197 | -296 | | |
| 2.67% | 1,040 | 985 | 923 | 857 | 786 | 712 | 634 | | |

| | | | | | | | |
|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 5.33% | 1,170 | 1,160 | 1,145 | 1,124 | 1,097 | 1,065 | 1,027 |
| 8.00% | 1,179 | 1,178 | 1,176 | 1,173 | 1,168 | 1,159 | 1,148 |

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

(단위:백만원)

45,464

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-03-27 |
| 기준일 | 2019-03-26 |

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

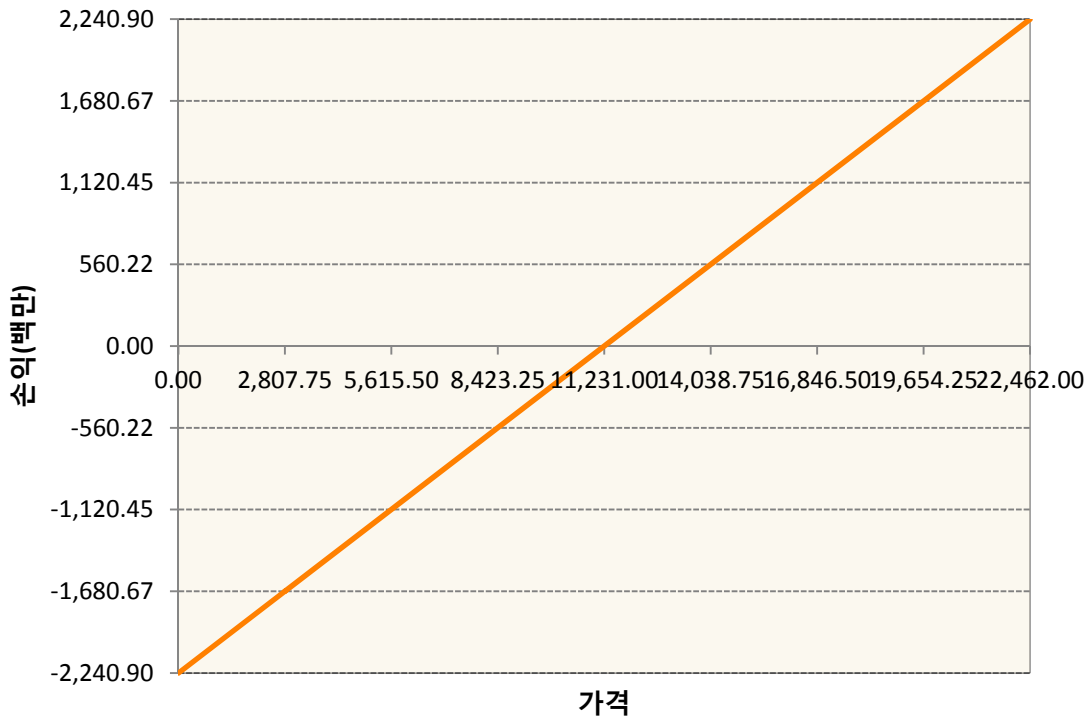
1. 계약금액

(단위:백만원)

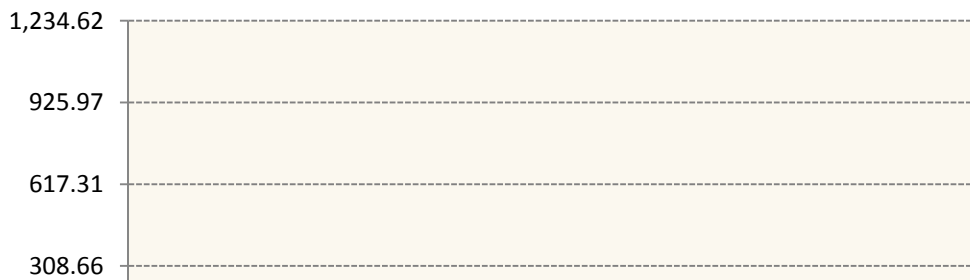
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,241 | 0 | 2,241 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 5,957 | -5,957 | 장내 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 3,032 | -3,032 | 장외 |

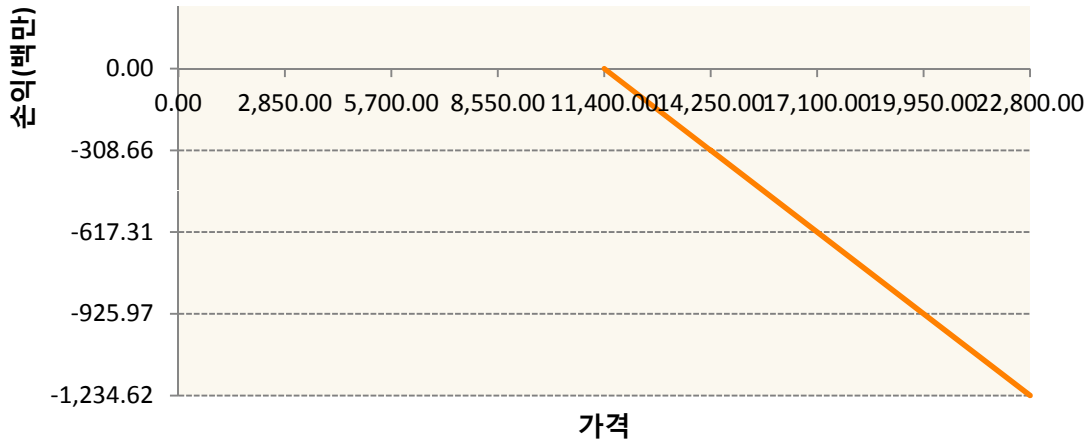
2. 만기시점의 손익구조

HCH9-HSCEI Futures Mar19

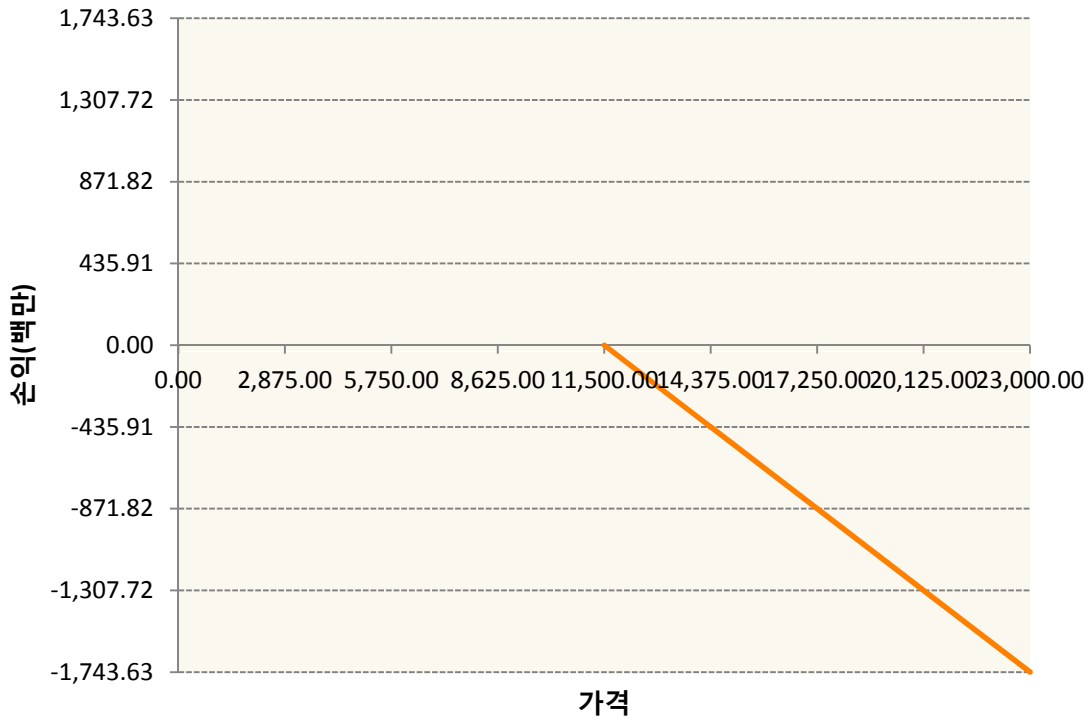


OHHIH9-C114-HSCEI

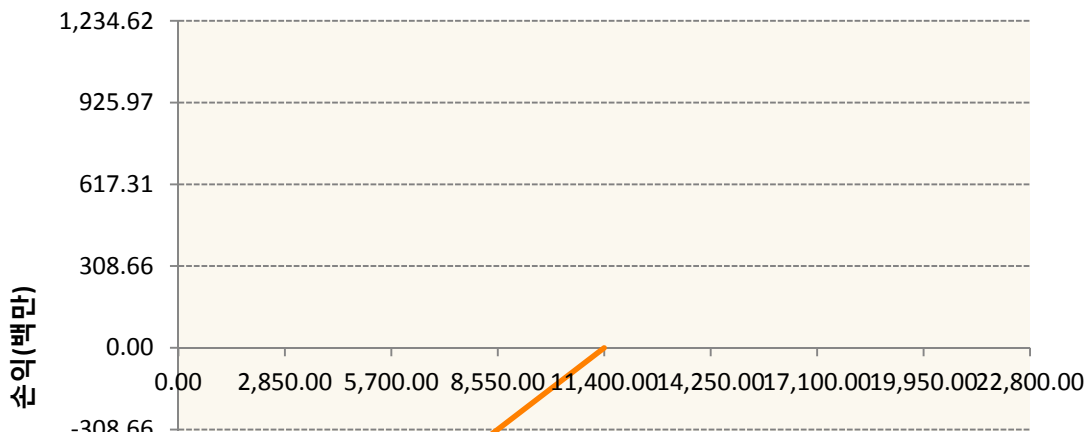


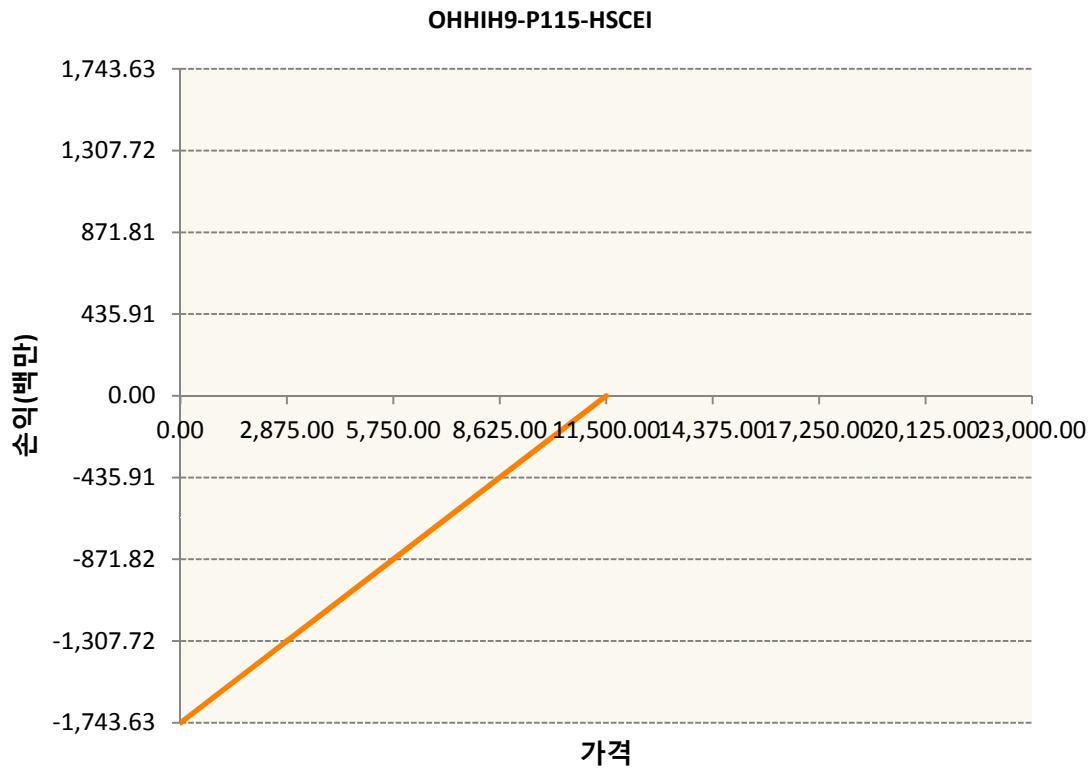


OHHIH9-C115-HSCEI



OHHIH9-P114-HSCEI





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | (단위:백만원) |
|------------------------------|----------|
| FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E | 219 |
| FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E | 23 |
| HCH9 HSCEI Futures Mar19 | 179 |
| OHHIH9-C11 HSCEI | 99 |
| OHHIH9-C11 HSCEI | 139 |
| OHHIH9-P11 HSCEI | 99 |
| OHHIH9-P11 HSCEI | 139 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|--|----------|
| | 757 |

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-03-27 |
| 기준일 | 2019-03-26 |

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

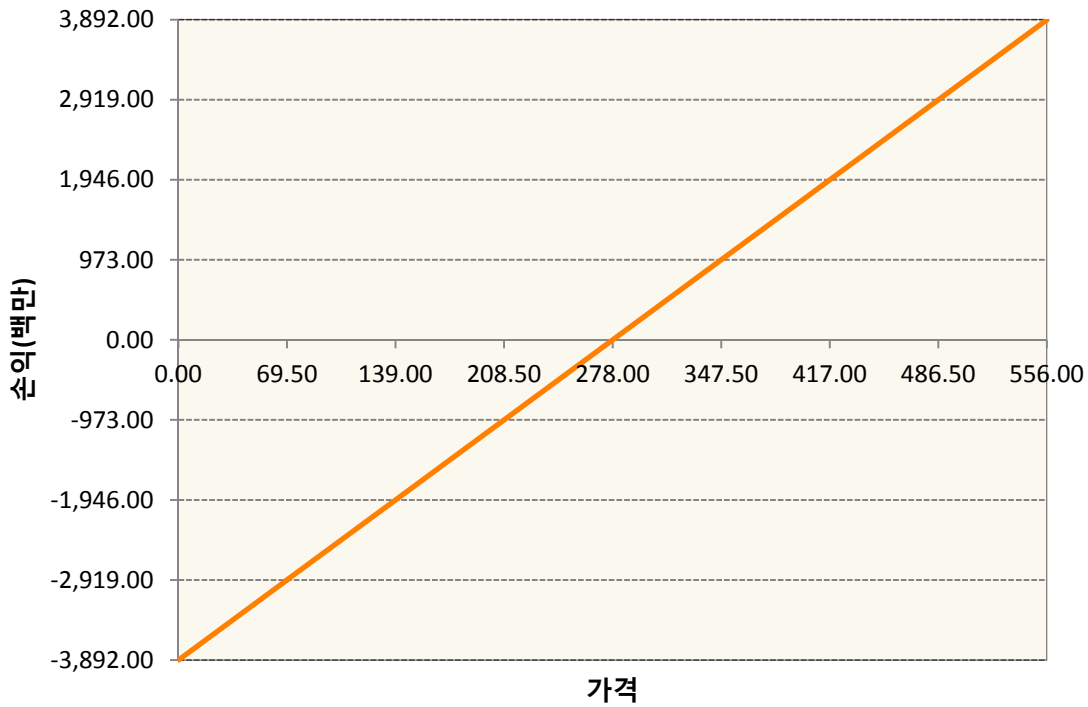
1. 계약금액

(단위:백만원)

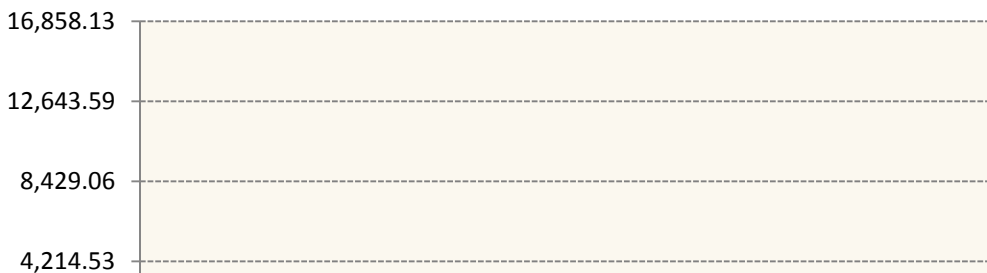
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,892 | 0 | 3,892 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 35,836 | 0 | 35,836 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 34,649 | -34,649 | 장내 |

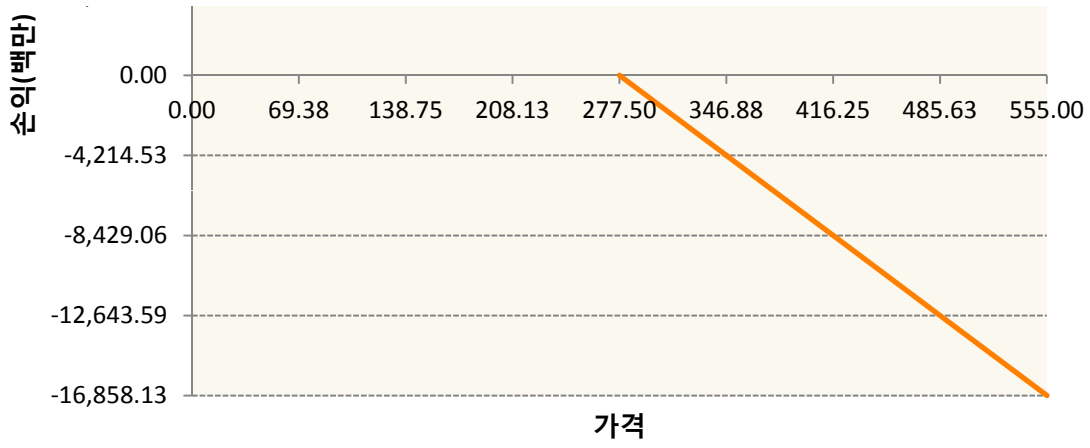
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

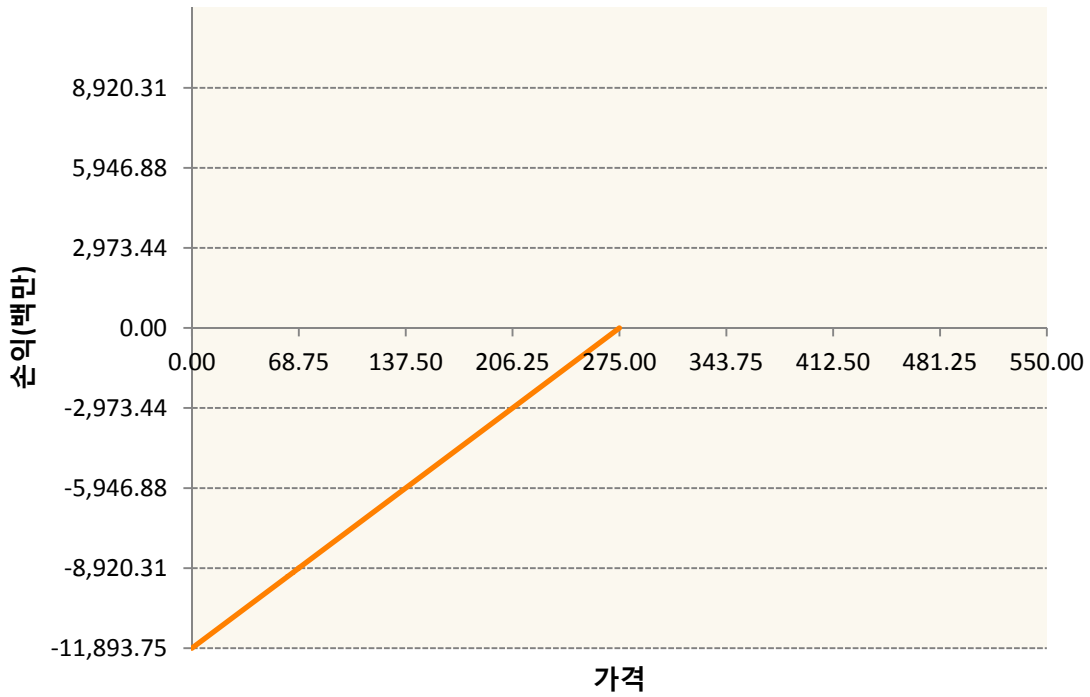


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

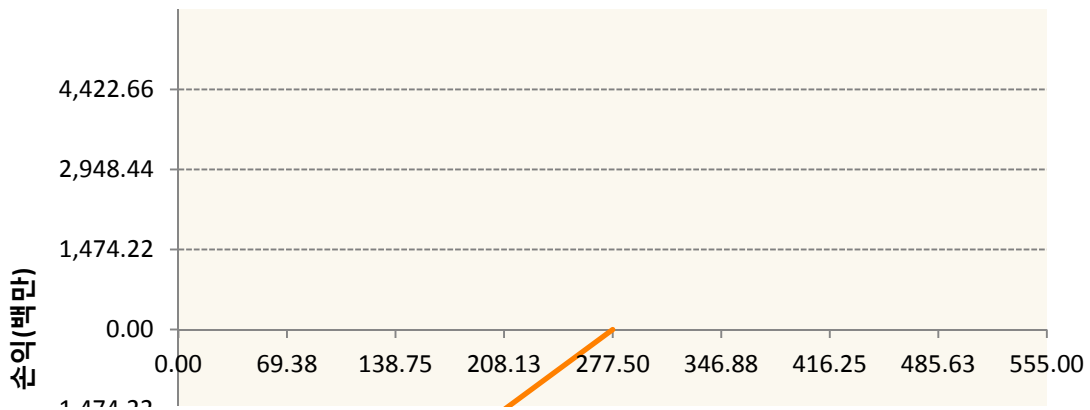


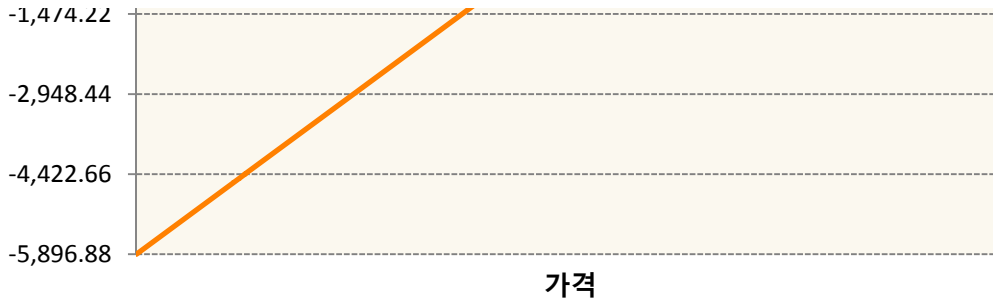


KR4301P42750-2019-04 풋275



KR4301P42776-2019-04 풋277.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| 2.529E+11 | | UBCSFXC1 INDEX_14 | | | | | | 2,438 |
|--------------|---------|--------------------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -2,438 | -2,438 | -2,438 | -2,438 | -2,438 | -2,438 | -2,438 | |
| -5.33% | -1,626 | -1,626 | -1,626 | -1,626 | -1,626 | -1,626 | -1,626 | |
| -2.67% | -813 | -813 | -813 | -813 | -813 | -813 | -813 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 813 | 813 | 813 | 813 | 813 | 813 | 813 | |
| 5.33% | 1,626 | 1,626 | 1,626 | 1,626 | 1,626 | 1,626 | 1,626 | |
| 8.00% | 2,438 | 2,438 | 2,438 | 2,438 | 2,438 | 2,438 | 2,438 | |
| 2.529E+11 | | UBCSFXC1 INDEX_15 | | | | | | 592 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -592 | -592 | -592 | -592 | -592 | -592 | -592 | |
| -5.33% | -395 | -395 | -395 | -395 | -395 | -395 | -395 | |
| -2.67% | -197 | -197 | -197 | -197 | -197 | -197 | -197 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 197 | 197 | 197 | 197 | 197 | 197 | 197 | |
| 5.33% | 395 | 395 | 395 | 395 | 395 | 395 | 395 | |
| 8.00% | 592 | 592 | 592 | 592 | 592 | 592 | 592 | |
| KR4101P60004 | | 2019-06 코스피200지수선물 | | | | | | 311 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -311 | -311 | -311 | -311 | -311 | -311 | -311 | |
| -5.33% | -207 | -207 | -207 | -207 | -207 | -207 | -207 | |
| -2.67% | -104 | -104 | -104 | -104 | -104 | -104 | -104 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 104 | 104 | 104 | 104 | 104 | 104 | 104 | |
| 5.33% | 207 | 207 | 207 | 207 | 207 | 207 | 207 | |
| 8.00% | 311 | 311 | 311 | 311 | 311 | 311 | 311 | |
| KR4201P42778 | | 2019-04 콜277.5 | | | | | | 1,062 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |

| | | | | | | | |
|--|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| -8.00% | 354 | 350 | 344 | 337 | 327 | 317 | 304 |
| -5.33% | 333 | 320 | 306 | 290 | 272 | 253 | 232 |
| -2.67% | 260 | 236 | 211 | 185 | 159 | 132 | 106 |
| 0% | 89 | 60 | 30 | 0 | -30 | -60 | -89 |
| 2.67% | -196 | -221 | -247 | -273 | -300 | -327 | -355 |
| 5.33% | -573 | -587 | -603 | -622 | -641 | -662 | -684 |
| 8.00% | -998 | -1,004 | -1,012 | -1,022 | -1,033 | -1,047 | -1,062 |
| KR4301P42750 2019-04 풋275 | | | | | | | 757 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -753 | -753 | -753 | -754 | -755 | -756 | -757 |
| -5.33% | -435 | -437 | -440 | -444 | -448 | -453 | -458 |
| -2.67% | -147 | -156 | -165 | -175 | -186 | -196 | -207 |
| 0% | 34 | 23 | 12 | 0 | -12 | -23 | -35 |
| 2.67% | 90 | 86 | 81 | 75 | 68 | 61 | 53 |
| 5.33% | 97 | 97 | 96 | 94 | 92 | 90 | 87 |
| 8.00% | 97 | 97 | 97 | 97 | 97 | 96 | 95 |
| KR4301P42776 2019-04 풋277.5 | | | | | | | 400 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -399 | -399 | -399 | -399 | -400 | -400 | -400 |
| -5.33% | -243 | -243 | -244 | -245 | -246 | -248 | -250 |
| -2.67% | -93 | -96 | -100 | -103 | -108 | -112 | -116 |
| 0% | 18 | 12 | 6 | 0 | -6 | -12 | -18 |
| 2.67% | 63 | 60 | 56 | 52 | 48 | 43 | 39 |
| 5.33% | 71 | 70 | 69 | 68 | 67 | 65 | 62 |
| 8.00% | 72 | 72 | 71 | 71 | 71 | 70 | 70 |

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

(단위:백만원)

5,662

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-03-27 |
| 기준일 | 2019-03-26 |

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

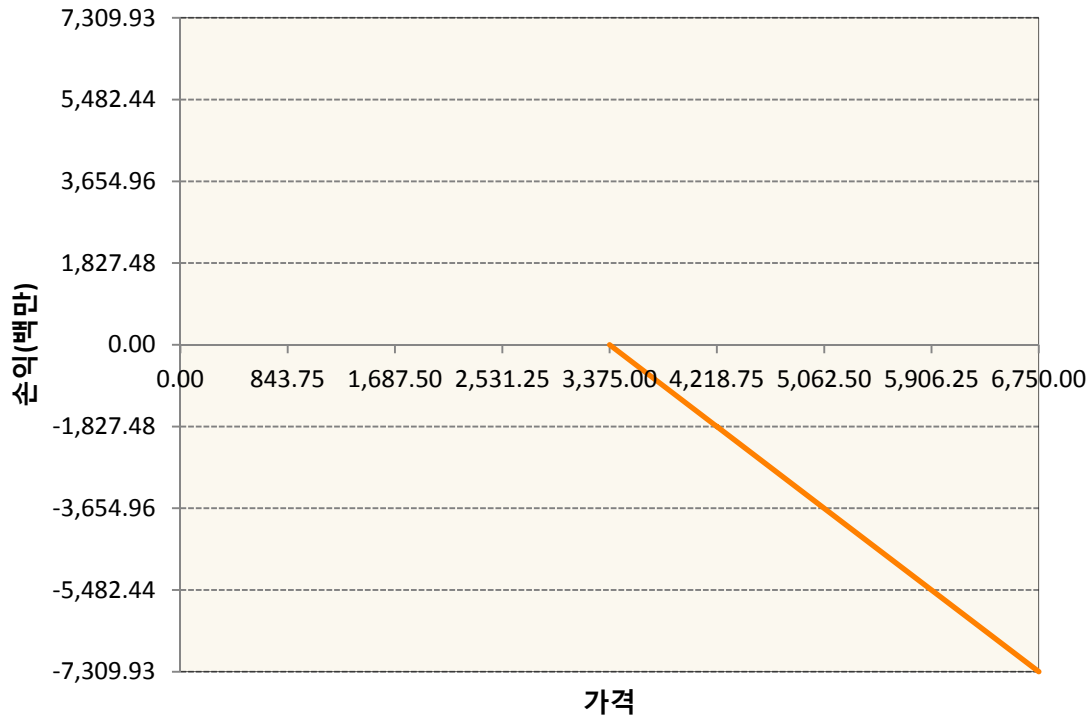
1. 계약금액

(단위:백만원)

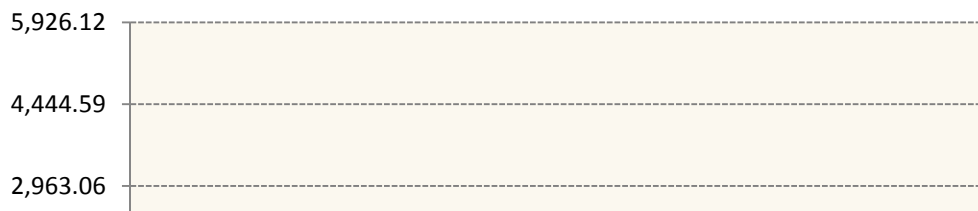
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 6,204 | 0 | 6,204 | |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 60,505 | 0 | 60,505 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 26,472 | -26,472 | 장내 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 15,379 | -15,379 | 장외 |

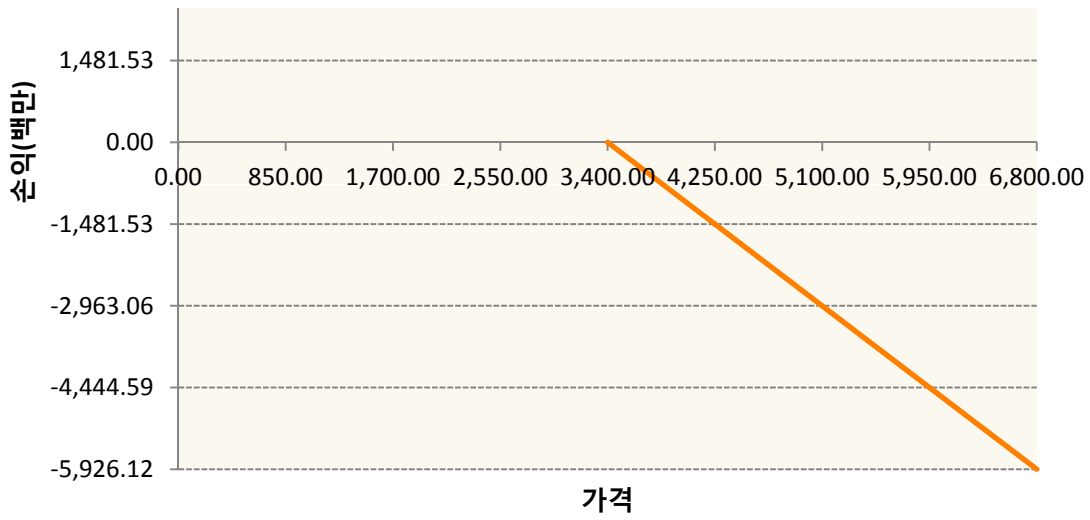
2. 만기시점의 손익구조

OESXJ9-C3375-EURO STOXX 50

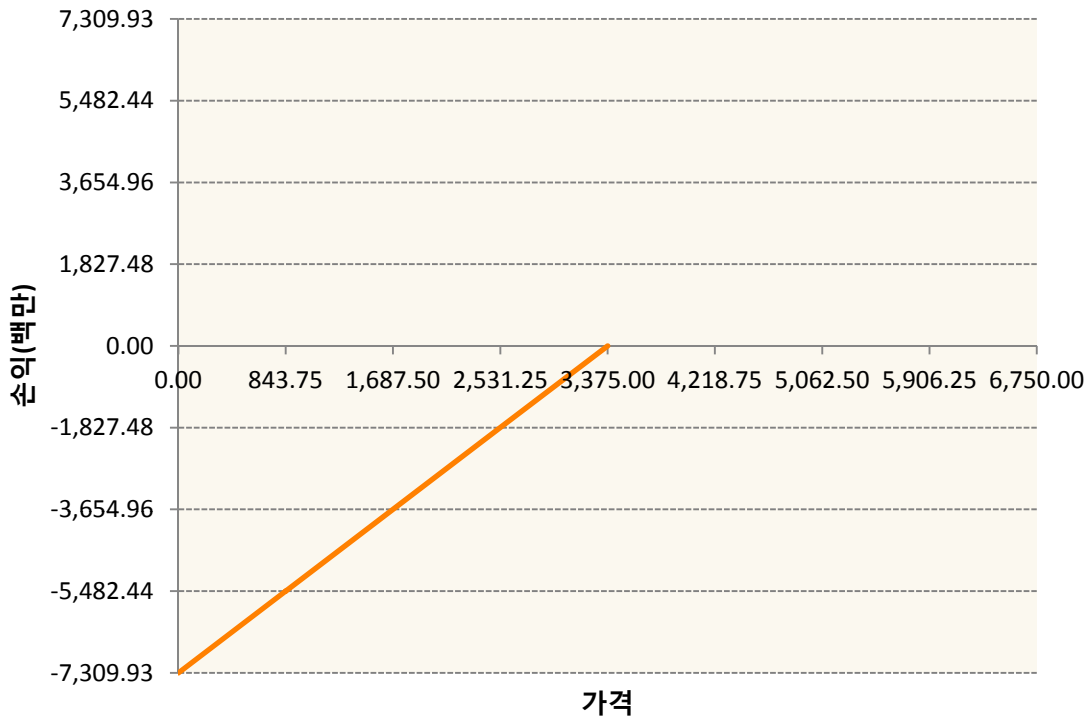


OESXJ9-C3400-EURO STOXX 50

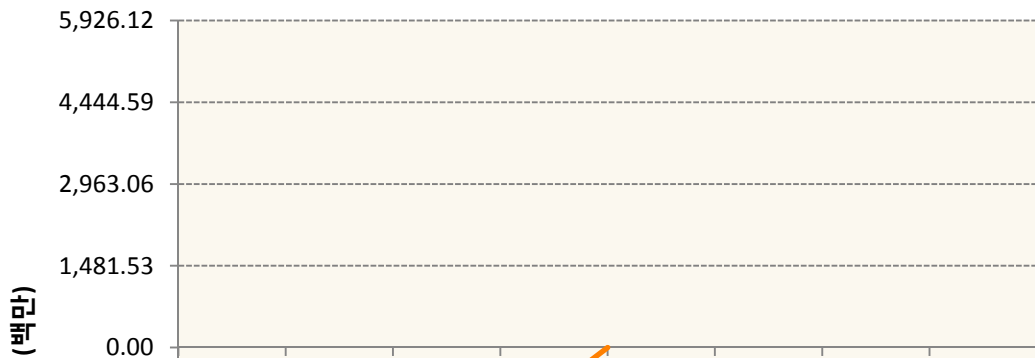


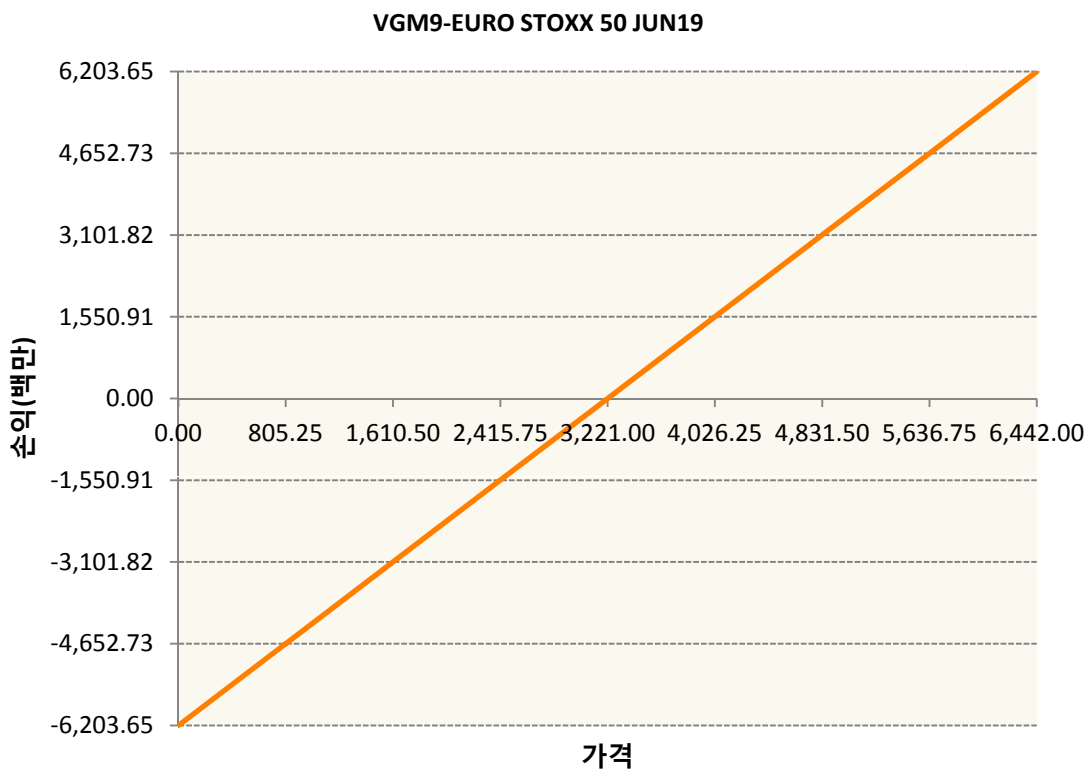
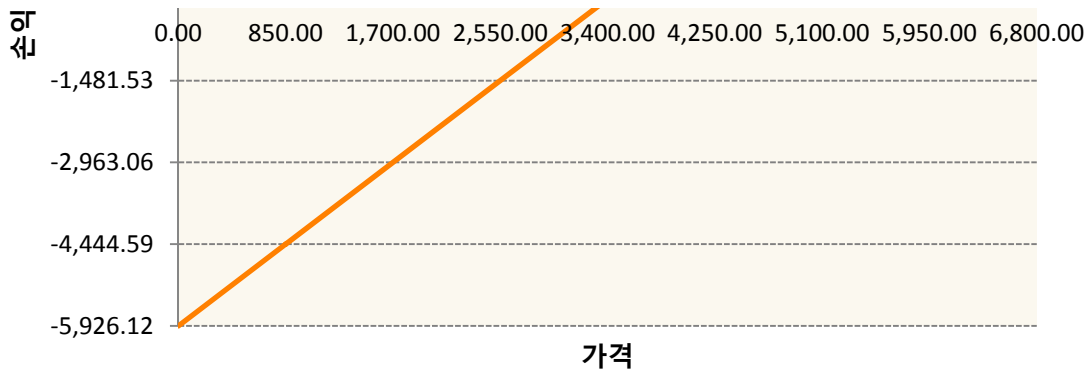


OESXJ9-P3375-EURO STOXX 50



OESXJ9-P3400-EURO STOXX 50





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---------------------|----------|
| 260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY | | 52 |
| FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E | | 410 |
| FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E | | 820 |
| OESXJ9-C33` EURO STOXX 50 | | 585 |
| OESXJ9-C34` EURO STOXX 50 | | 474 |
| OESXJ9-P33` EURO STOXX 50 | | 585 |
| OESXJ9-P34` EURO STOXX 50 | | 474 |
| VGM9 | EURO STOXX 50 JUN19 | 496 |

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

(단위:백만원)

2,568

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

(단위:백만원)

1,100

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

(단위:백만원)

94

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

(단위:백만원)

136

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

(단위:백만원)

42

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-03-27 |
| 기준일 | 2019-03-26 |

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

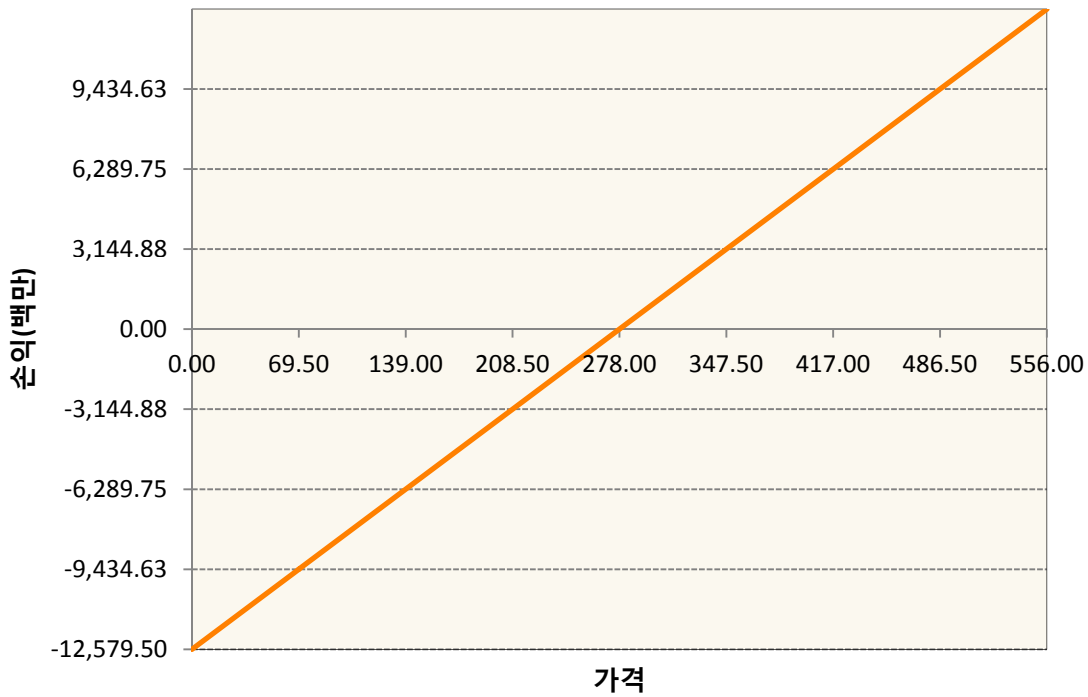
1. 계약금액

(단위:백만원)

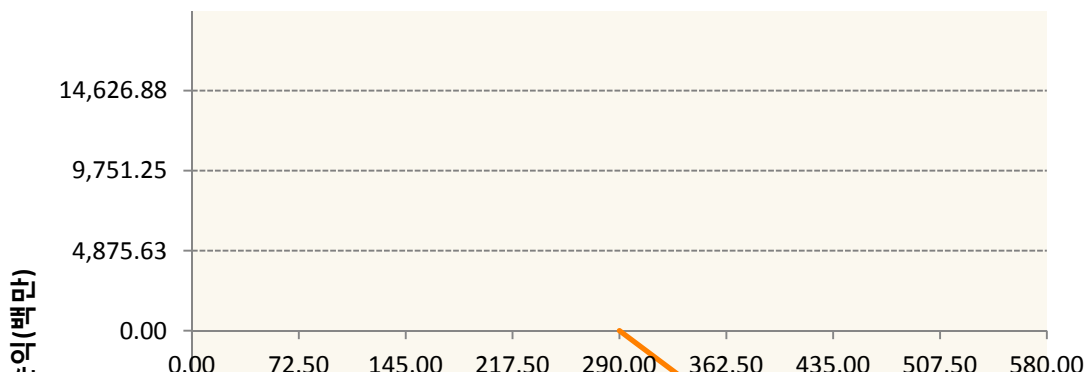
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 12,580 | 0 | 12,580 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 1,867 | 24,036 | -22,169 | 장내 |

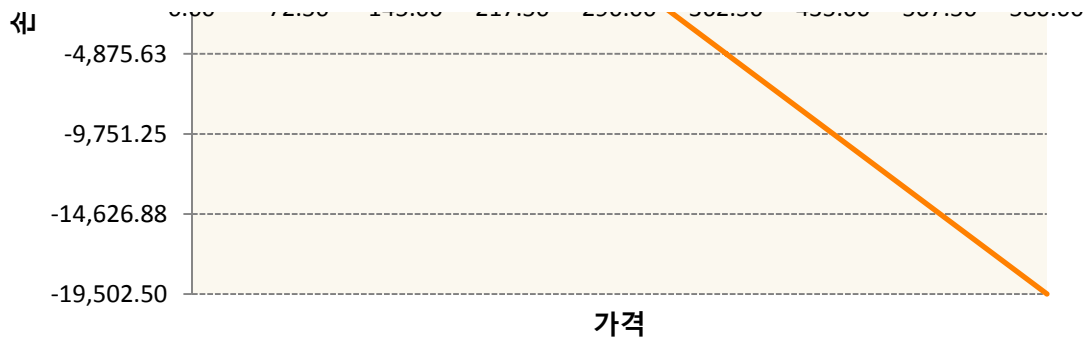
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

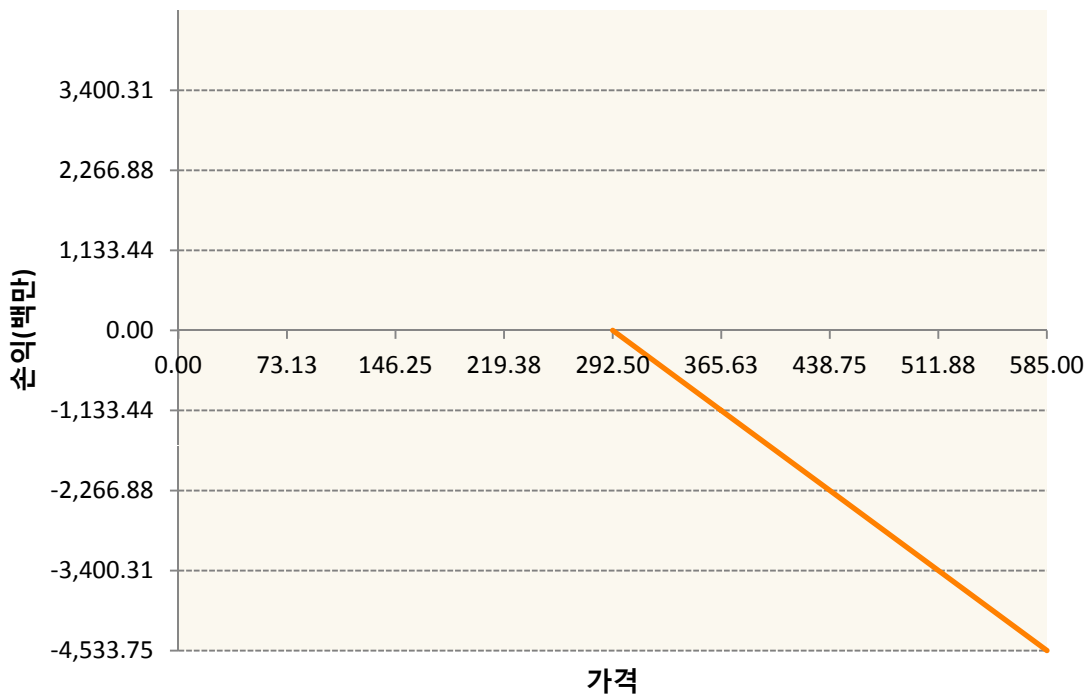


KR4201P42901-2019-04 콜290

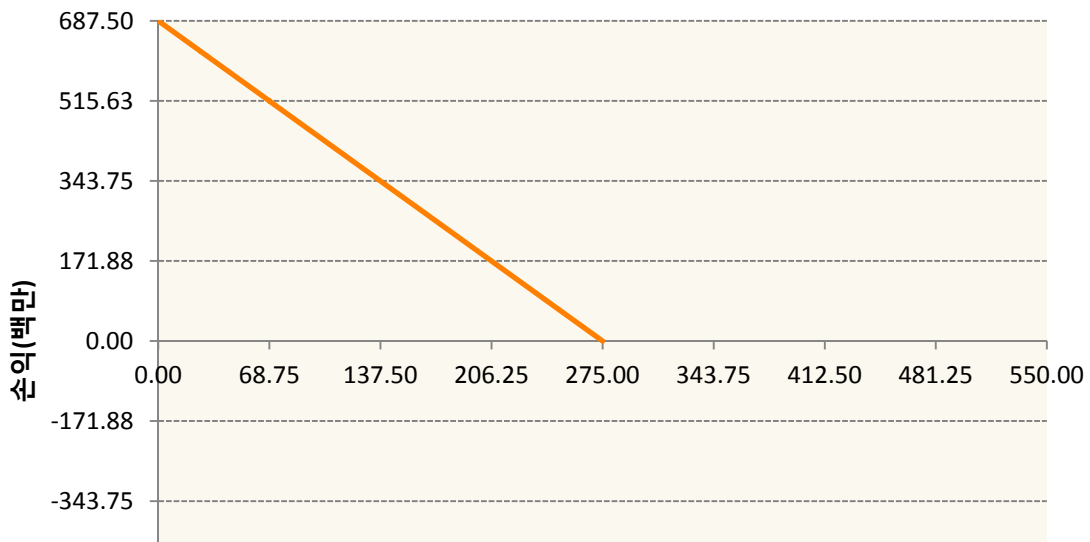


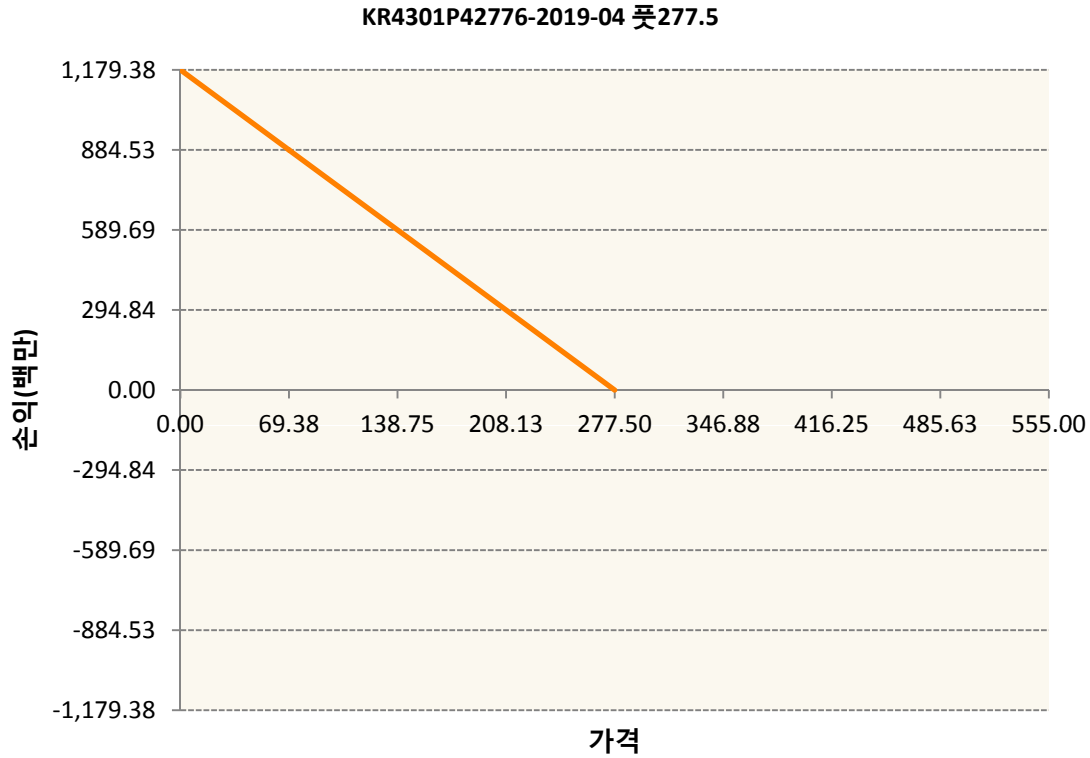
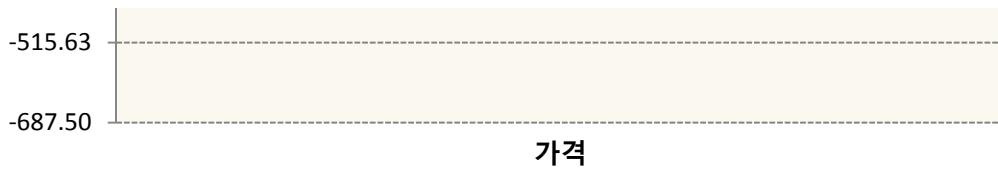


KR4201P42927-2019-04 콜292.5



KR4301P42750-2019-04 풋275





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4101P60004 | | 2019-06 코스피200지수선물 | | | | | | 1,005 |
|--------------|---------|--------------------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|
| | | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -1,005 | -1,005 | -1,005 | -1,005 | -1,005 | -1,005 | -1,005 | |
| -5.33% | -670 | -670 | -670 | -670 | -670 | -670 | -670 | |
| -2.67% | -335 | -335 | -335 | -335 | -335 | -335 | -335 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 335 | 335 | 335 | 335 | 335 | 335 | 335 | |
| 5.33% | 670 | 670 | 670 | 670 | 670 | 670 | 670 | |
| 8.00% | 1,005 | 1,005 | 1,005 | 1,005 | 1,005 | 1,005 | 1,005 | |
| KR4201P42901 | | 2019-04 콜290 | | | | | | 800 |
| | | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 116 | 116 | 115 | 114 | 111 | 108 | 103 | |
| -5.33% | 115 | 113 | 109 | 104 | 97 | 89 | 79 | |
| -2.67% | 105 | 97 | 87 | 74 | 59 | 43 | 25 | |

| | | | | | | | |
|--|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 0% | 64 | 45 | 23 | 0 | -25 | -50 | -77 |
| 2.67% | -50 | -82 | -113 | -146 | -178 | -211 | -244 |
| 5.33% | -280 | -314 | -348 | -382 | -416 | -450 | -485 |
| 8.00% | -628 | -654 | -681 | -709 | -739 | -769 | -800 |
| KR4201P42927 2019-04 콜292.5 | | | | | | | 166 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 20 | 20 | 20 | 20 | 19 | 19 | 18 |
| -5.33% | 20 | 20 | 19 | 18 | 17 | 15 | 14 |
| -2.67% | 19 | 17 | 15 | 13 | 10 | 7 | 4 |
| 0% | 12 | 9 | 5 | 0 | -5 | -10 | -16 |
| 2.67% | -7 | -14 | -21 | -28 | -35 | -42 | -49 |
| 5.33% | -51 | -59 | -67 | -75 | -83 | -91 | -99 |
| 8.00% | -122 | -129 | -136 | -143 | -151 | -158 | -166 |
| KR4301P42750 2019-04 풋275 | | | | | | | 44 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 44 | 44 | 44 | 44 | 44 | 44 | 44 |
| -5.33% | 25 | 25 | 25 | 26 | 26 | 26 | 26 |
| -2.67% | 8 | 9 | 10 | 10 | 11 | 11 | 12 |
| 0% | -2 | -1 | -1 | 0 | 1 | 1 | 2 |
| 2.67% | -5 | -5 | -5 | -4 | -4 | -4 | -3 |
| 5.33% | -6 | -6 | -6 | -5 | -5 | -5 | -5 |
| 8.00% | -6 | -6 | -6 | -6 | -6 | -6 | -6 |
| KR4301P42776 2019-04 풋277.5 | | | | | | | 80 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 80 | 80 | 80 | 80 | 80 | 80 | 80 |
| -5.33% | 49 | 49 | 49 | 49 | 49 | 50 | 50 |
| -2.67% | 19 | 19 | 20 | 21 | 22 | 22 | 23 |
| 0% | -4 | -2 | -1 | 0 | 1 | 2 | 4 |
| 2.67% | -13 | -12 | -11 | -10 | -10 | -9 | -8 |
| 5.33% | -14 | -14 | -14 | -14 | -13 | -13 | -12 |
| 8.00% | -14 | -14 | -14 | -14 | -14 | -14 | -14 |

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

(단위:백만원)

1,700

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-03-27 |
| 기준일 | 2019-03-26 |

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 | 2,563 | 0 | 2,563 | |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-03-27 |
| 기준일 | 2019-03-26 |

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 227 | 0 | 227 | |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 7,854 | 0 | 7,854 | |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-03-27 |
| 기준일 | 2019-03-26 |

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 2,267 | 0 | 2,267 | |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 60,051 | 0 | 60,051 | |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 71,631 | -71,631 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| IE00BD8RGM75 | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 |
|-------------------------------|---------------------------------|
| FX21019F02: KRW/USD 28-03-19E | 471 |
| FX21019F02: KRW/USD 29-03-19E | 24 |
| FX21019F02: KRW/USD 29-03-19E | 73 |
| FX21019G00 KRW/USD 29-03-19E | 27 |
| FX21019G00 KRW/USD 29-03-19E | 14 |
| FX21019G03 KRW/USD 28-03-19E | 254 |
| FX21019G03 KRW/USD 28-03-19E | 118 |
| FX21019G03 KRW/USD 29-03-19E | 335 |
| FX21019G04 KRW/USD 10-04-19E | 73 |
| FX21019H00 KRW/USD 08-04-19E | 36 |
| FX21019H00 KRW/USD 10-04-19E | 36 |
| FX21019H01 KRW/USD 10-04-19E | 100 |
| FX21019H01 KRW/USD 10-04-19E | 91 |
| FX21019H01 KRW/USD 10-04-19E | 109 |
| FX21019H01 KRW/USD 19-04-19E | 145 |
| FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E | 118 |
| FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E | 207 |
| FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E | 254 |
| FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E | 154 |
| FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E | 363 |
| FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E | 426 |
| FX21019H03 KRW/USD 22-04-19E | 363 |
| FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E | 363 |
| FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E | 417 |
| FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E | 181 |
| FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E | 453 |
| FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E | 526 |

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

(단위:백만원)

2,004

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-03-27 |
| 기준일 | 2019-03-26 |

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

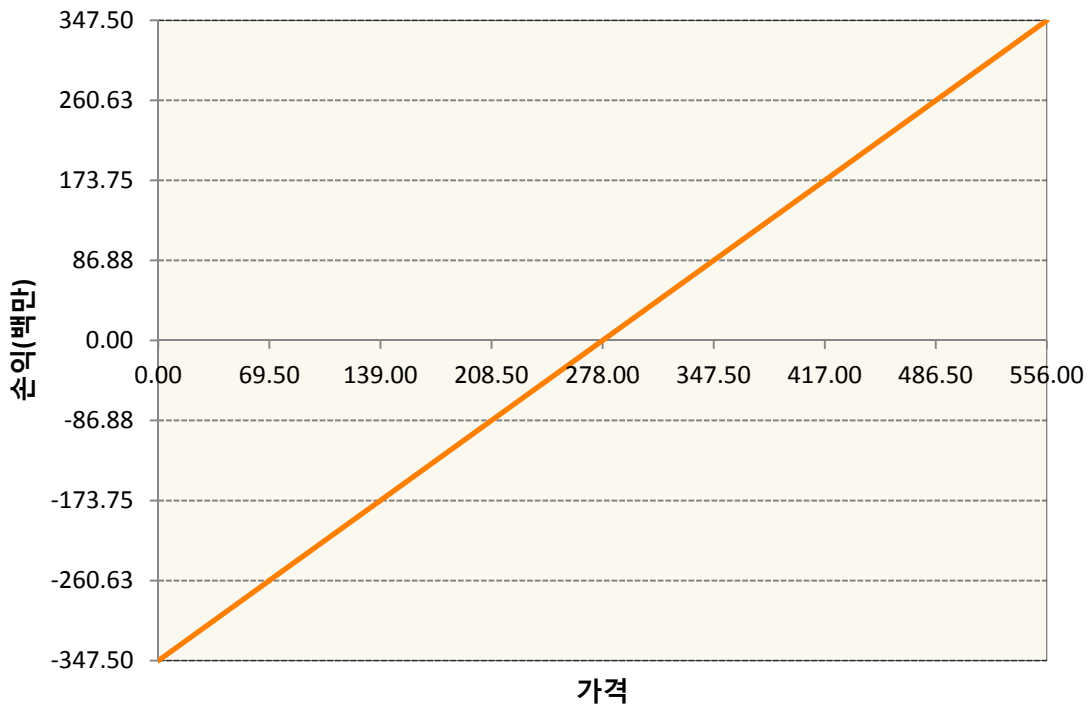
1. 계약금액

(단위:백만원)

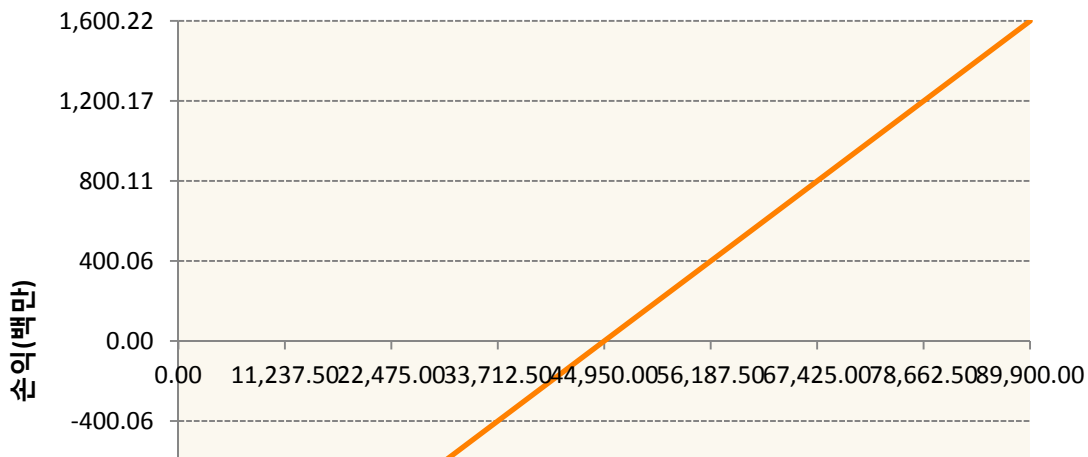
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,948 | 0 | 1,948 | 장내 |

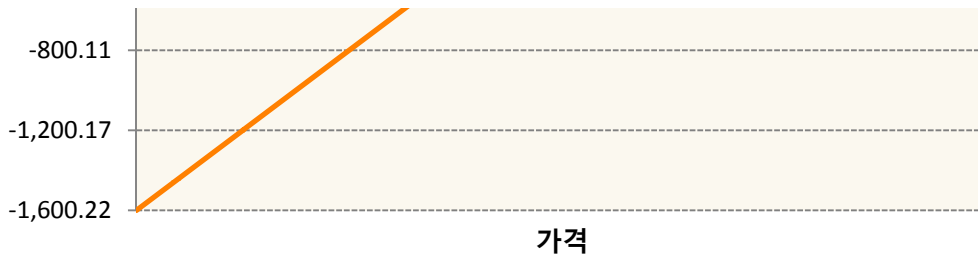
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4111P40005-2019-04 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4101P60004 | | 2019-06 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 | |
| KR4111P40005 | | 2019-04 삼성전자개별선물 | | | | | | 129 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -129 | -129 | -129 | -129 | -129 | -129 | -129 | |
| -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% | 129 | 129 | 129 | 129 | 129 | 129 | 129 | |

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

176

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-03-27 |
| 기준일 | 2019-03-26 |

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

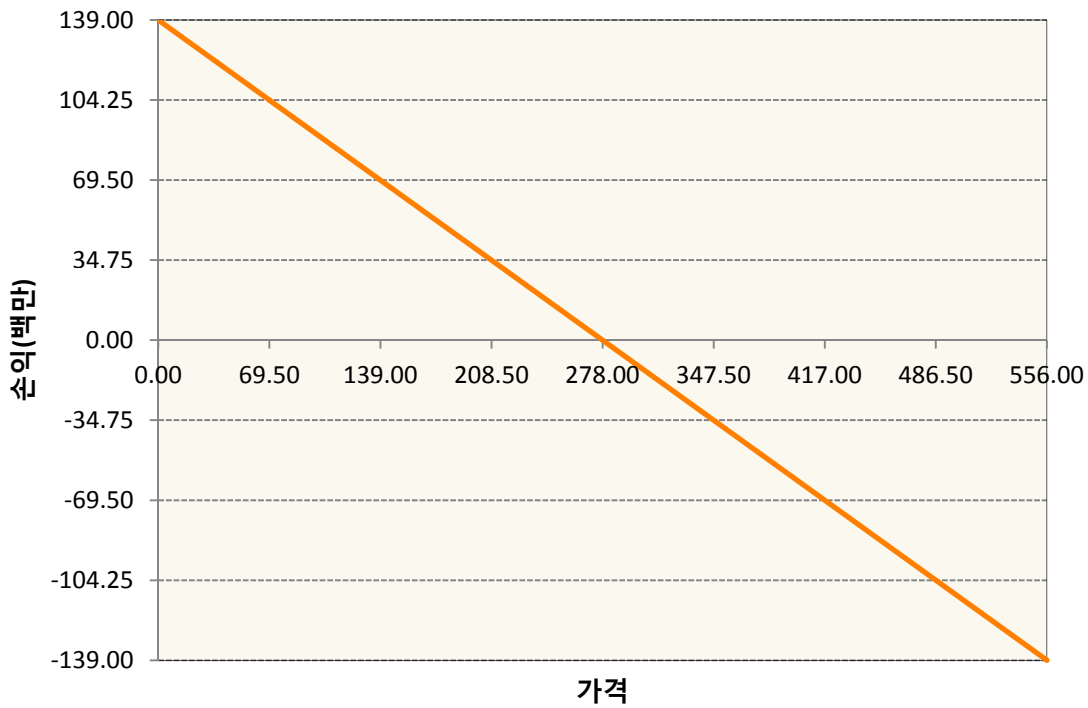
1. 계약금액

(단위:백만원)

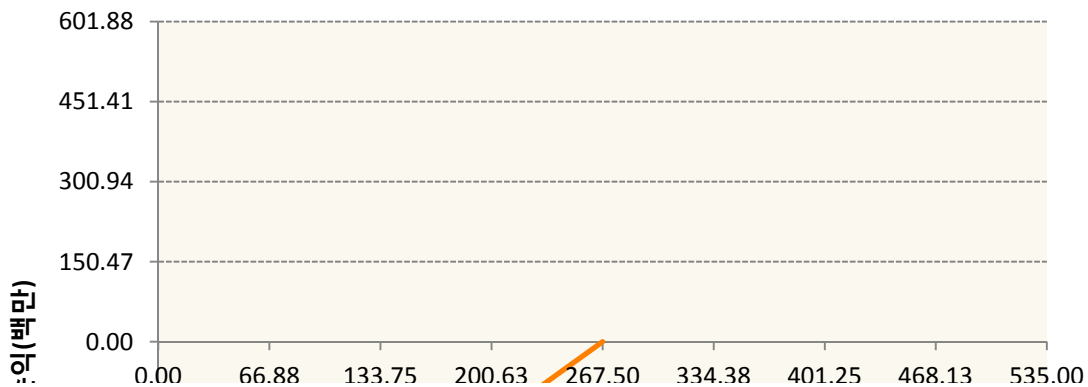
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 139 | -139 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 1,074 | -1,074 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

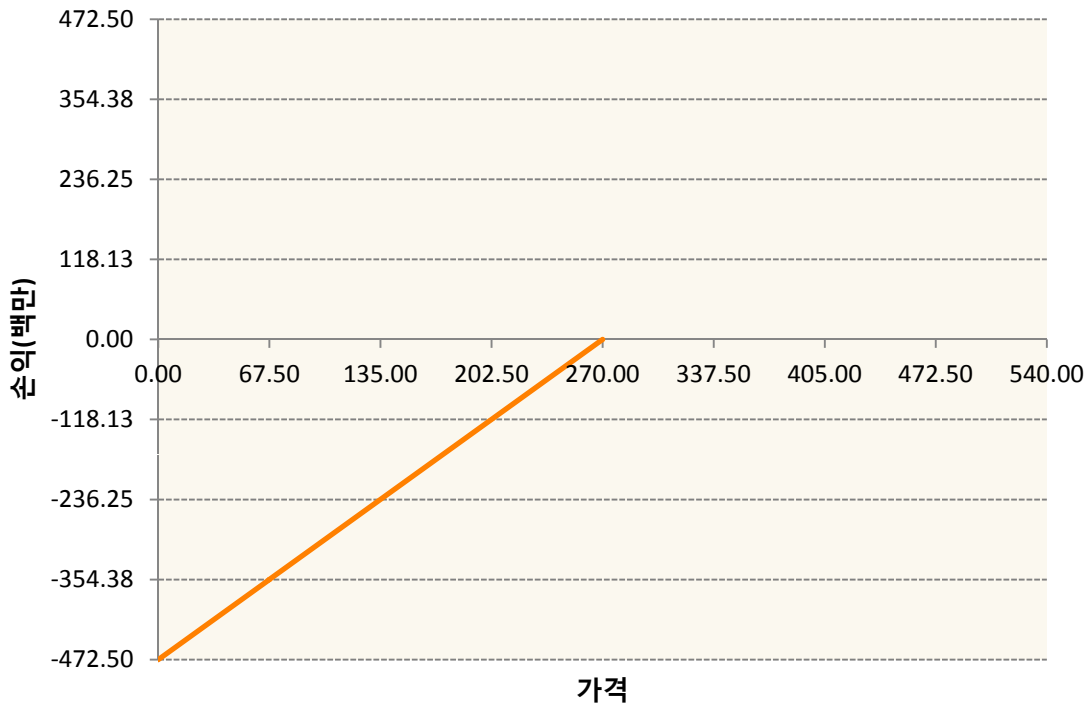


KR4301P42677-2019-04 풋267.5





KR4301P42701-2019-04 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | | | | | | | |
|--------------|---------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|----|
| KR4101P60004 | | 2019-06 코스피200지수선물 | | | | | | 11 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 11 | 11 | 11 | 11 | 11 | 11 | 11 | |
| -5.33% | 7 | 7 | 7 | 7 | 7 | 7 | 7 | |
| -2.67% | 4 | 4 | 4 | 4 | 4 | 4 | 4 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | -4 | -4 | -4 | -4 | -4 | -4 | -4 | |
| 5.33% | -7 | -7 | -7 | -7 | -7 | -7 | -7 | |
| 8.00% | -11 | -11 | -11 | -11 | -11 | -11 | -11 | |
| KR4301P42677 | | 2019-04 풋267.5 | | | | | | 28 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|--------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -26 | -27 | -27 | -27 | -27 | -27 | -28 |
| -5.33% | -11 | -12 | -12 | -13 | -13 | -14 | -14 |
| -2.67% | -2 | -3 | -3 | -4 | -4 | -5 | -6 |
| 0% | 1 | 1 | 0 | 0 | 0 | -1 | -1 |
| 2.67% | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |
| 5.33% | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |
| 8.00% | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |

KR4301P42701

2019-04 풋270

25

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -24 | -24 | -24 | -24 | -24 | -25 | -25 |
| -5.33% | -12 | -12 | -12 | -13 | -13 | -13 | -14 |
| -2.67% | -3 | -3 | -4 | -4 | -5 | -5 | -6 |
| 0% | 1 | 1 | 0 | 0 | 0 | -1 | -1 |
| 2.67% | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |
| 5.33% | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |
| 8.00% | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |

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

(단위:백만원)

51

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-03-27 |
| 기준일 | 2019-03-26 |

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

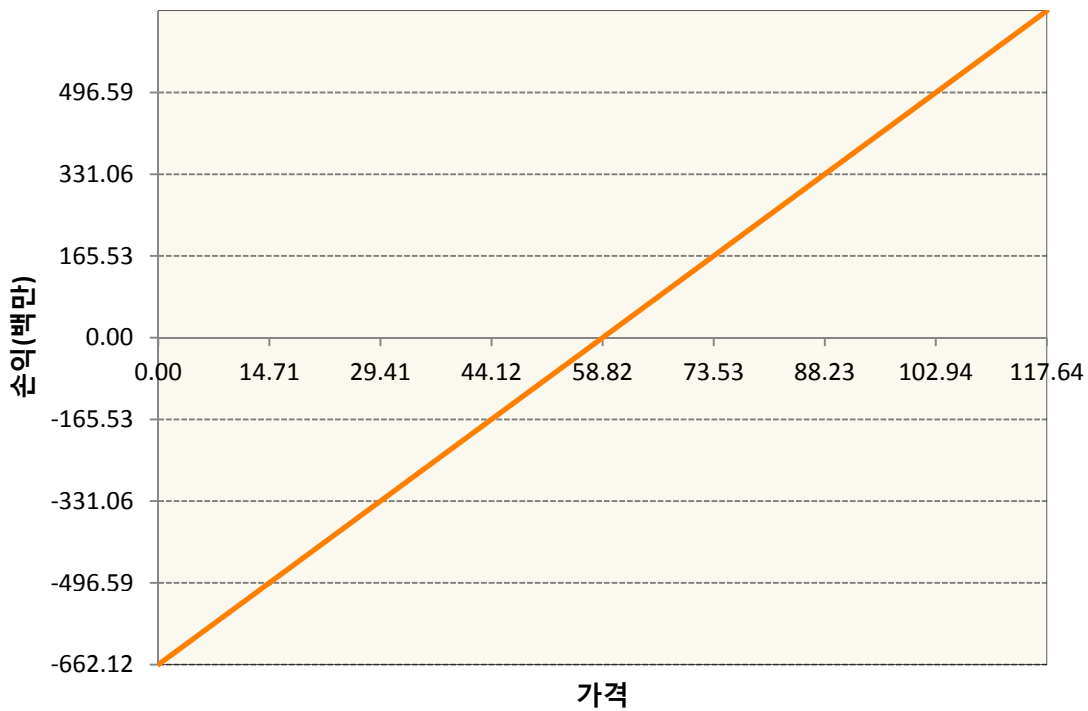
1. 계약금액

(단위:백만원)

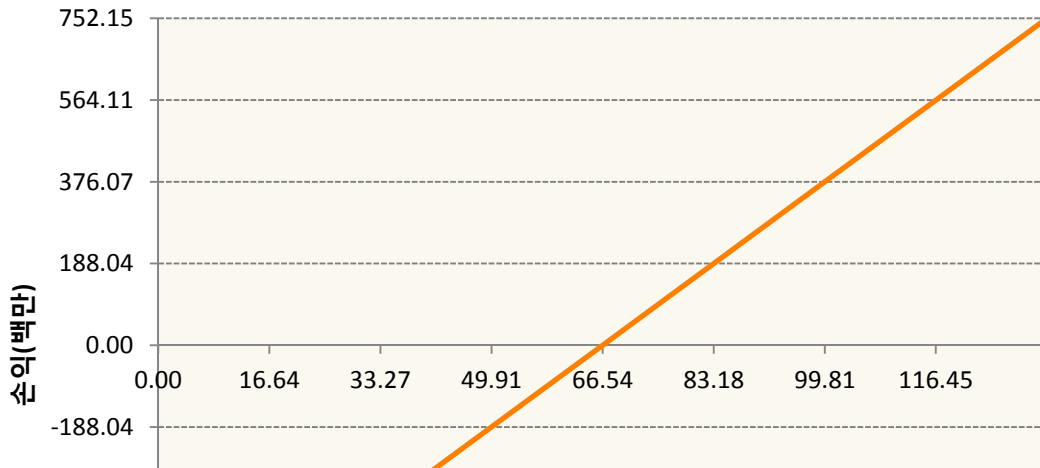
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,861 | 283 | 2,578 | |

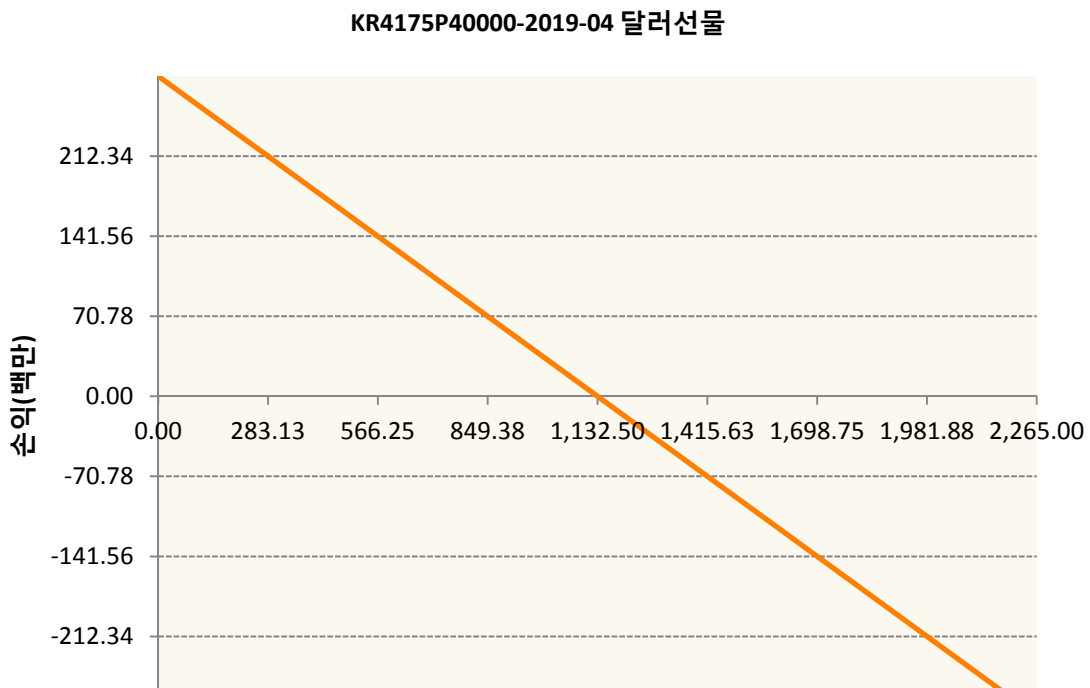
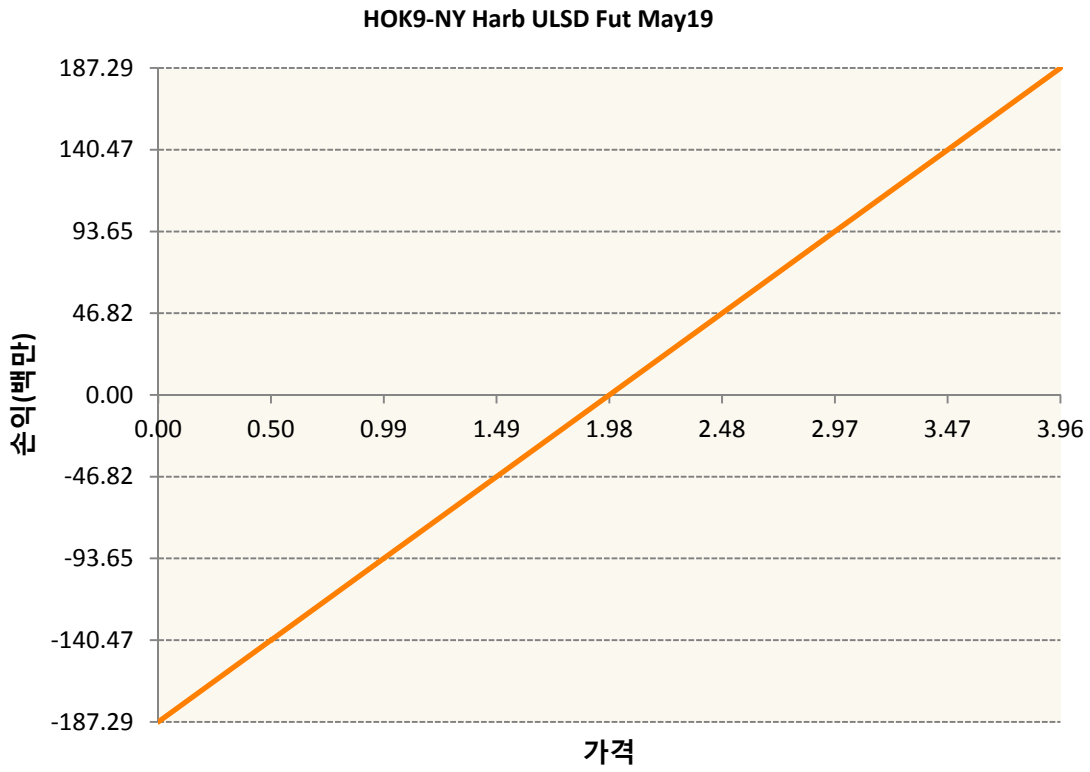
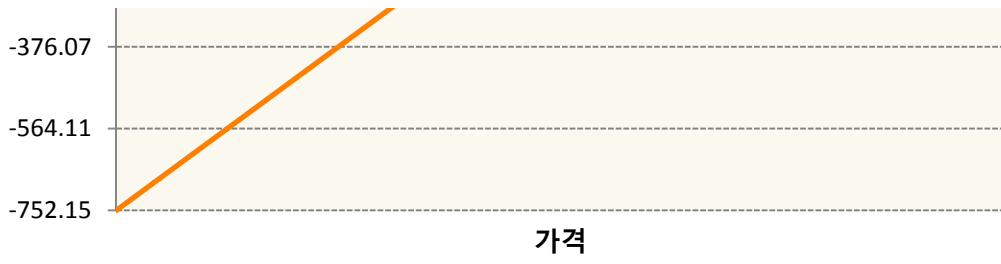
2. 만기시점의 손익구조

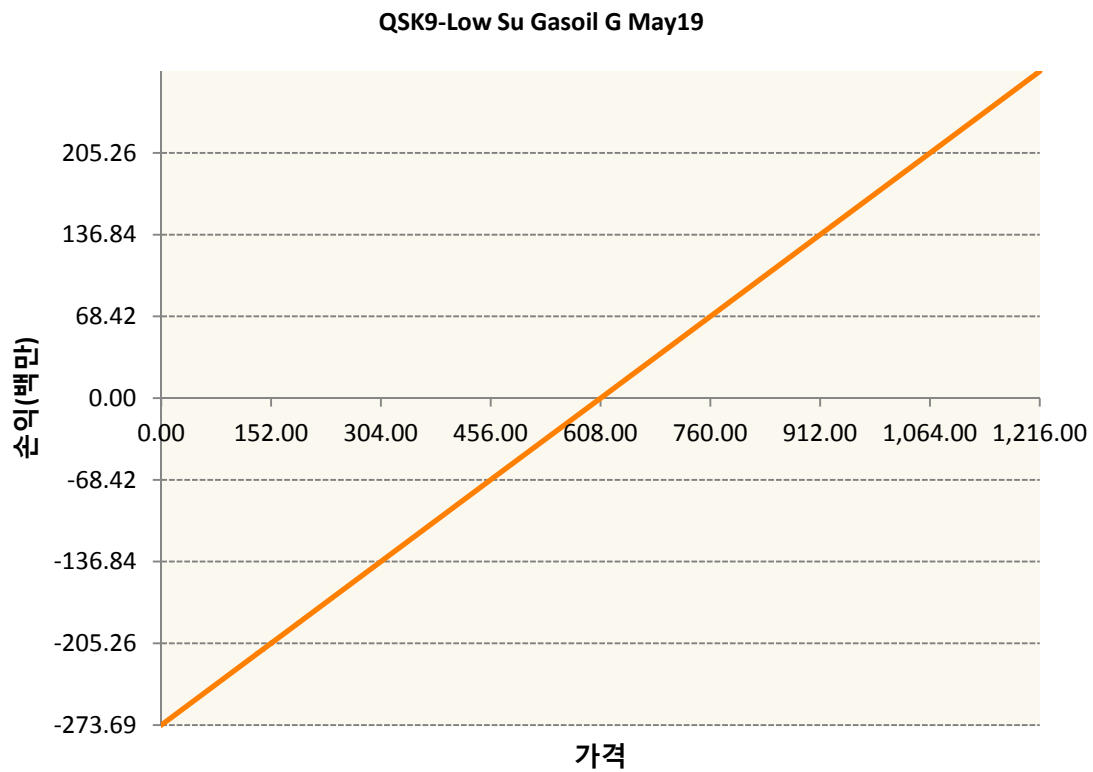
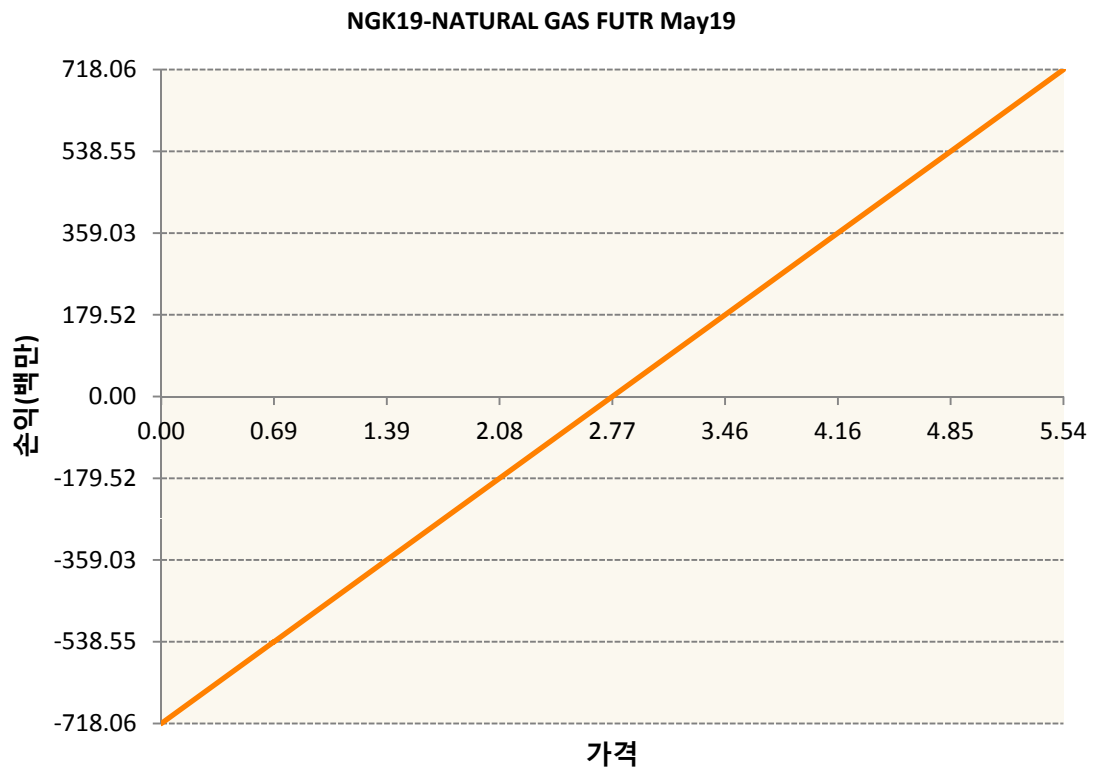
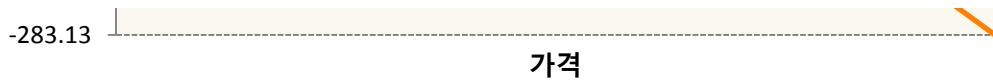
CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19



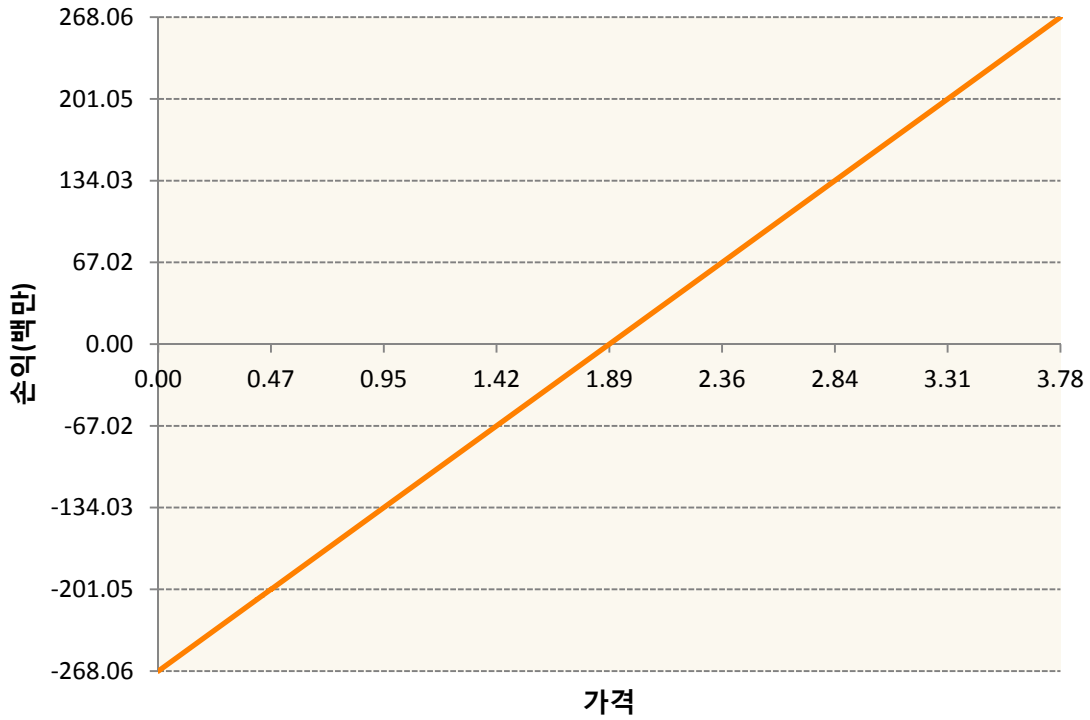
CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19







XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------------|-------------------------|----|
| CLK9 | WTI CRUDE FUTURE May19 | 53 |
| CON9 | BRENT CRUDE FUTR Jul19 | 60 |
| HOK9 | NY Harb ULSD Fut May19 | 15 |
| KR4175P400 | 2019-04 달러선물 | 23 |
| NGK19 | NATURAL GAS FUTR May19 | 57 |
| QSK9 | Low Su Gasoil G May19 | 22 |
| XBK9 | GASOLINE RBOB FUT May19 | 21 |

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

(단위:백만원)

| |
|------------|
| 434 |
|------------|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-03-27 |
| 기준일 | 2019-03-26 |

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

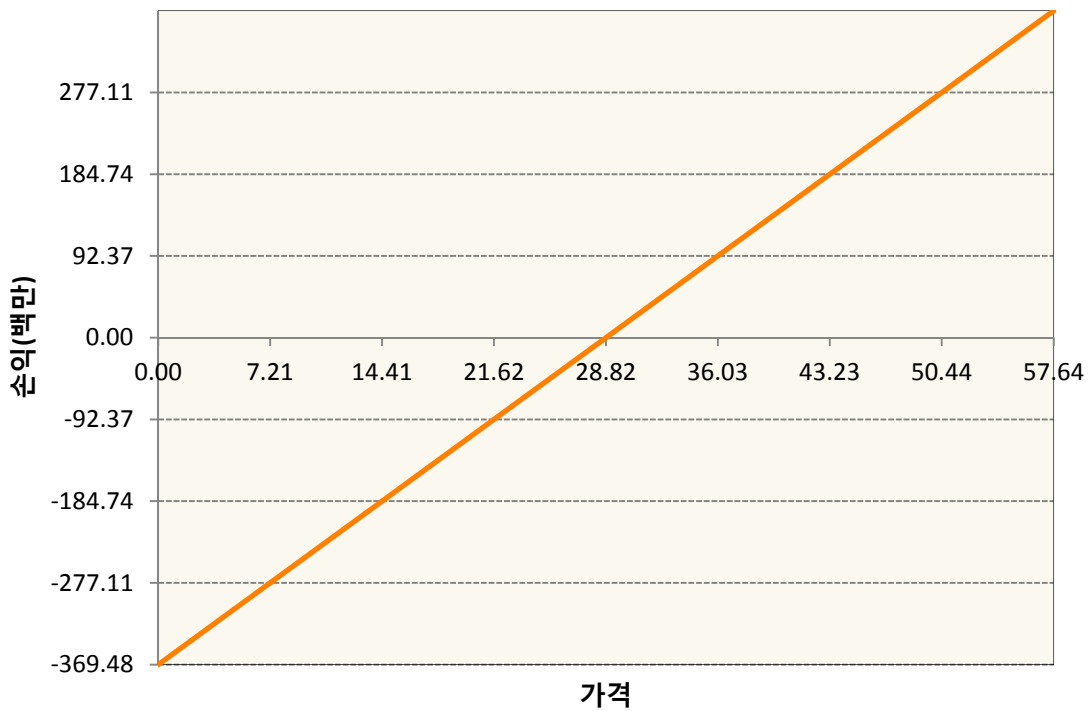
1. 계약금액

(단위:백만원)

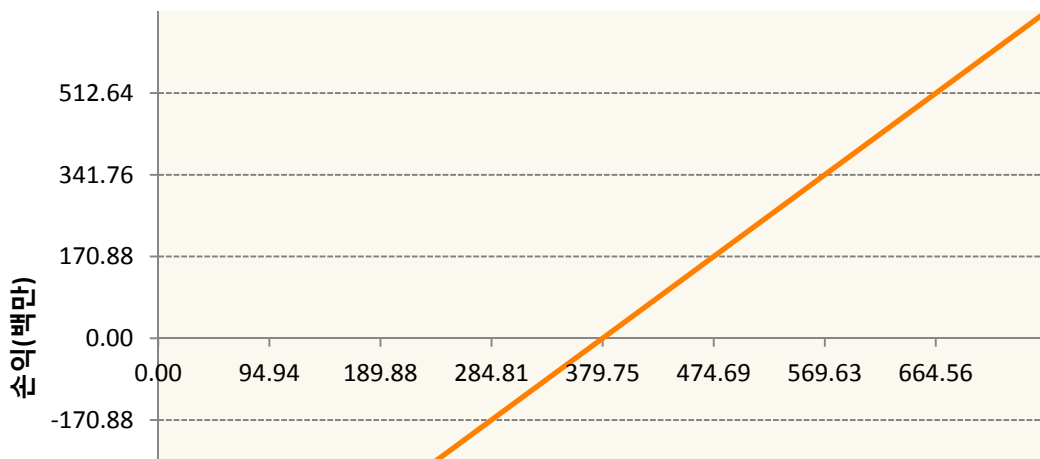
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,401 | 79 | 3,322 | |

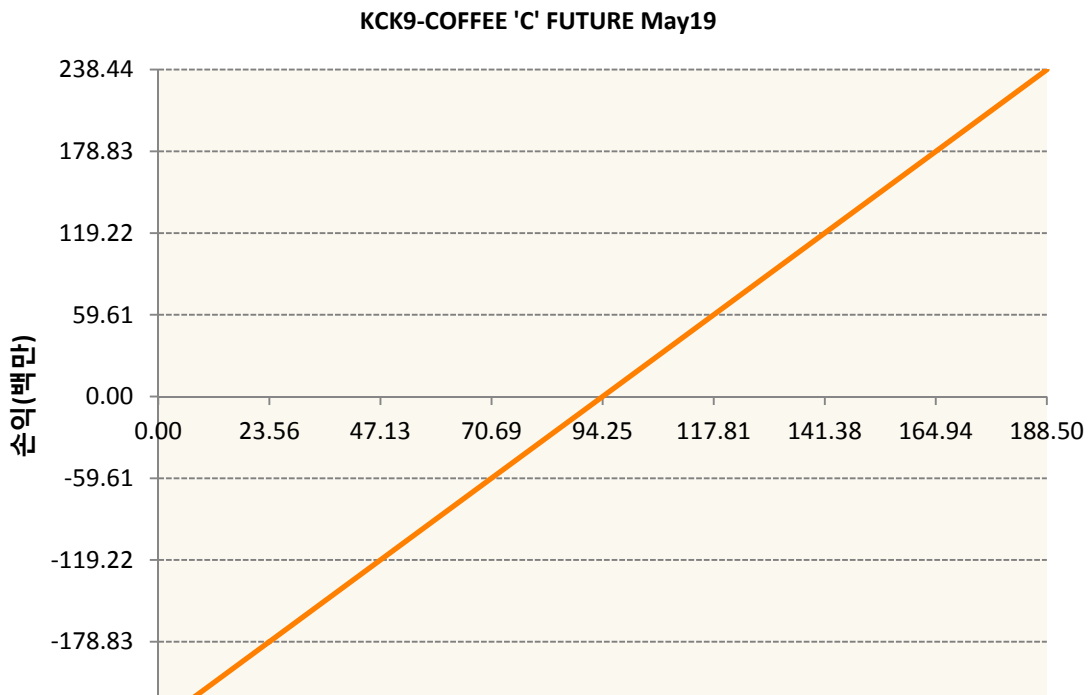
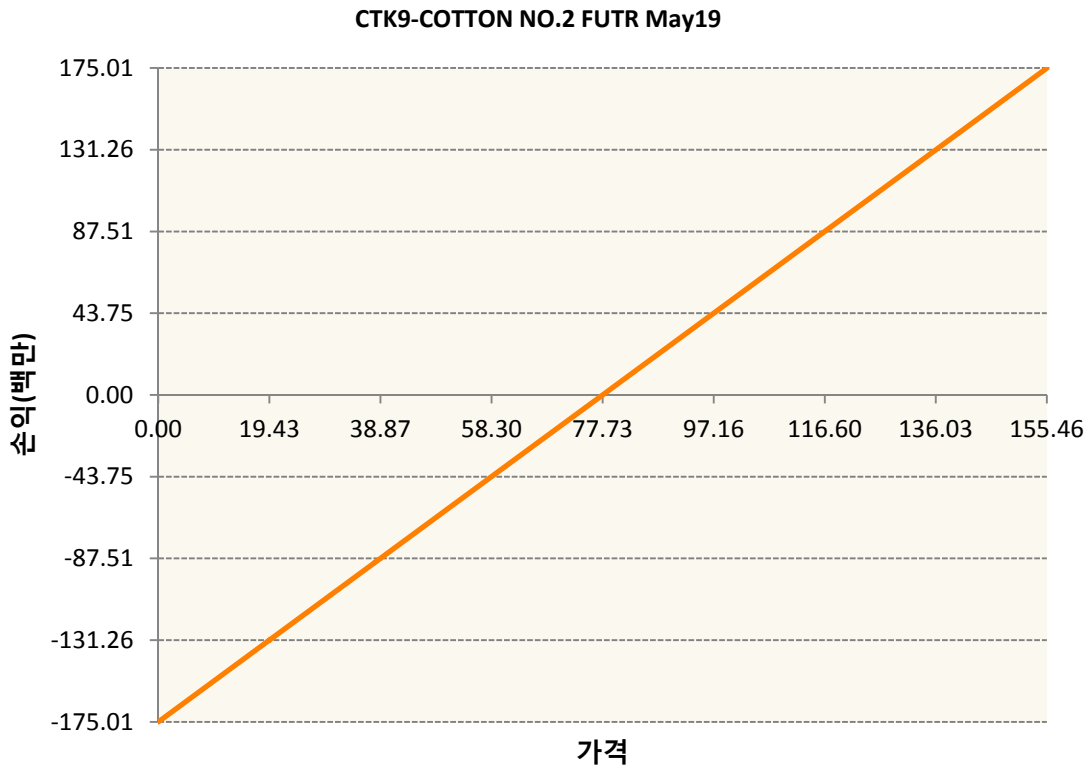
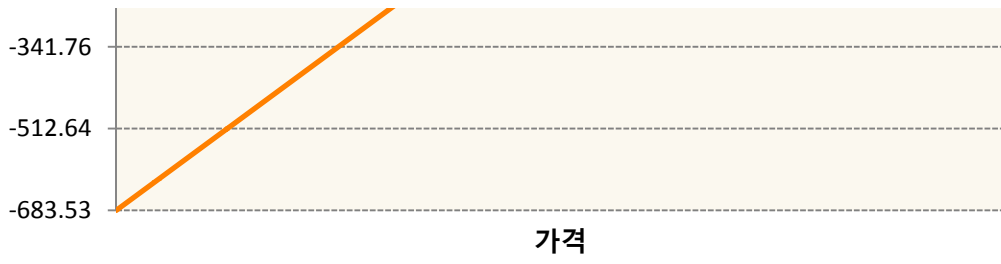
2. 만기시점의 손익구조

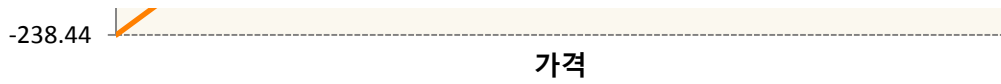
BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19



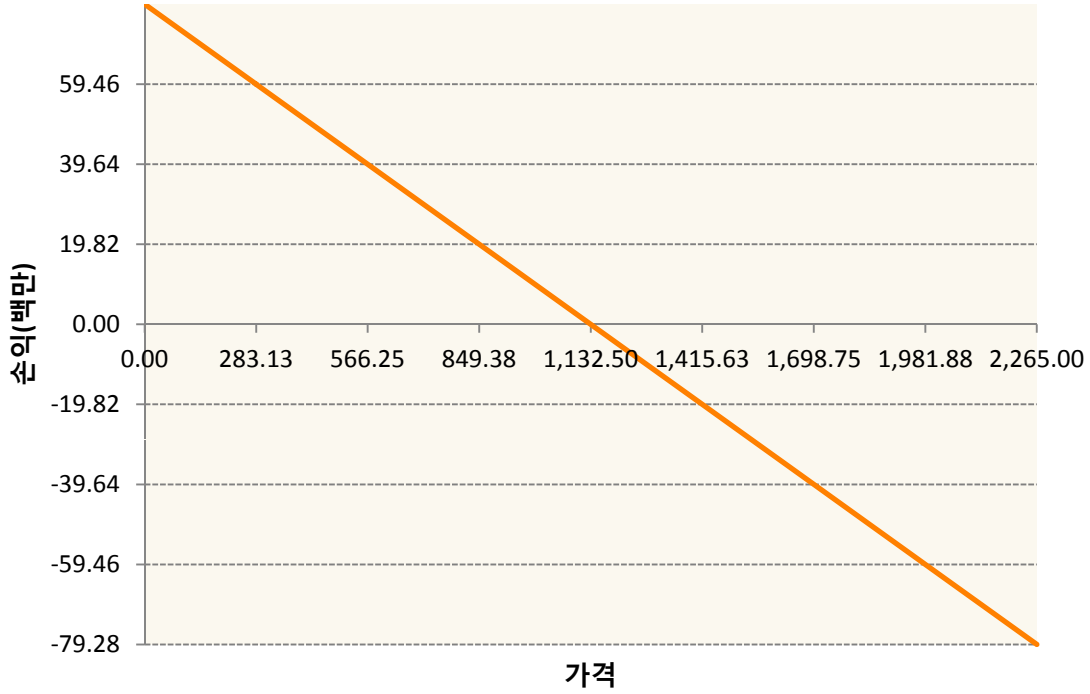
CK9-CORN FUTURE May19



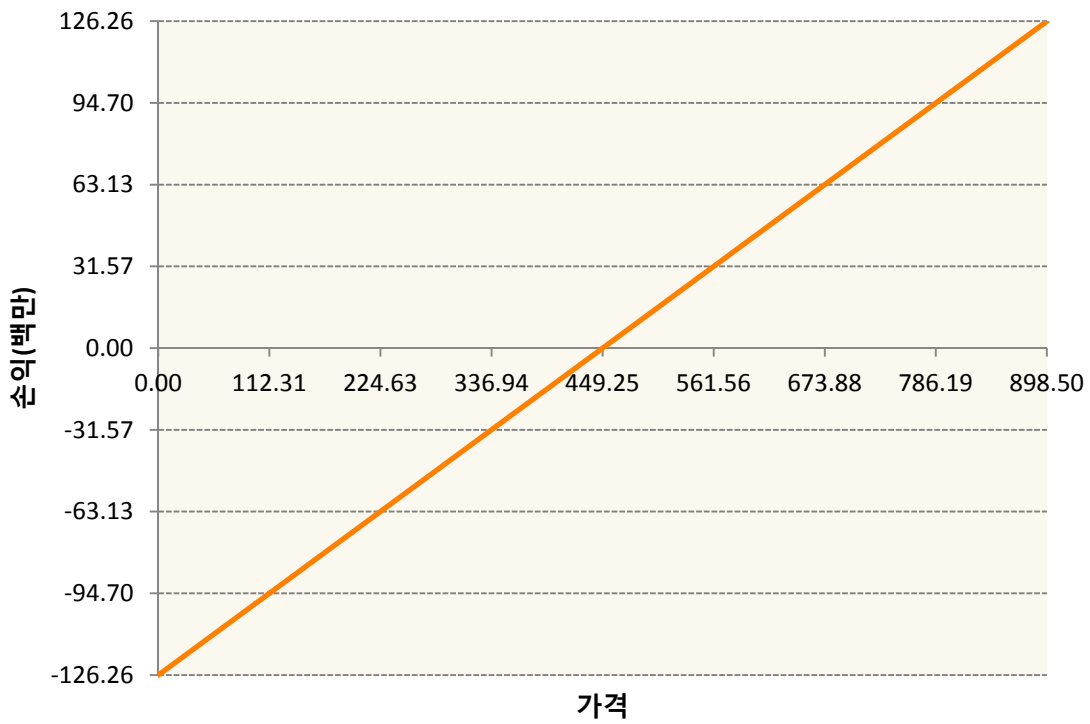




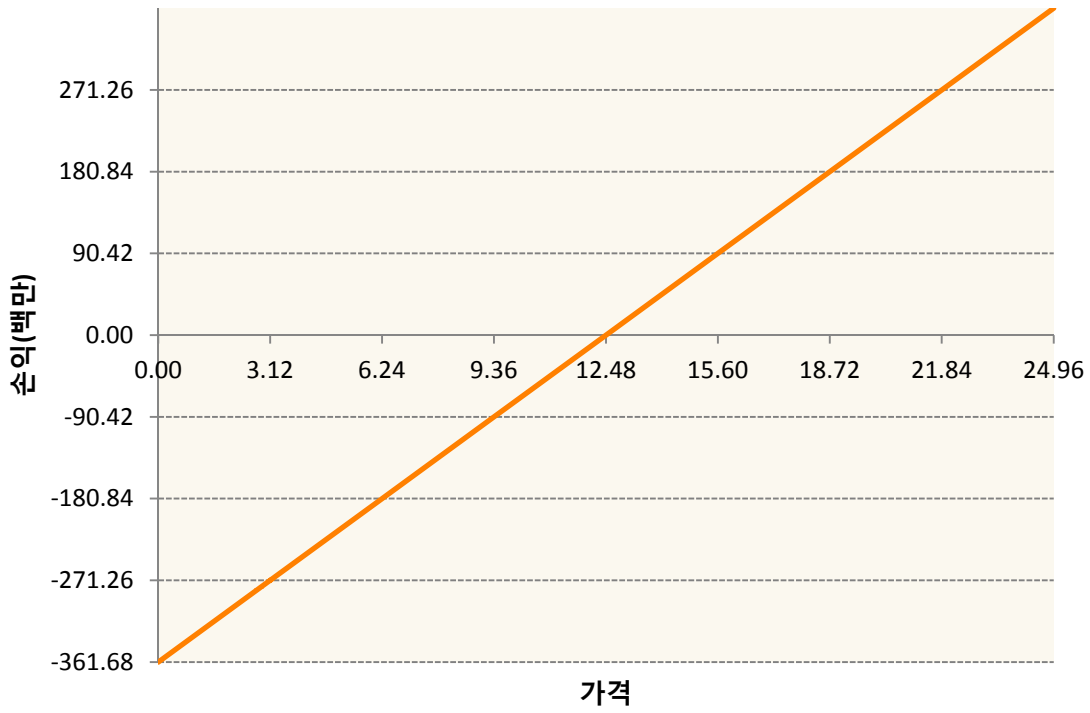
KR4175P40000-2019-04 달러선물



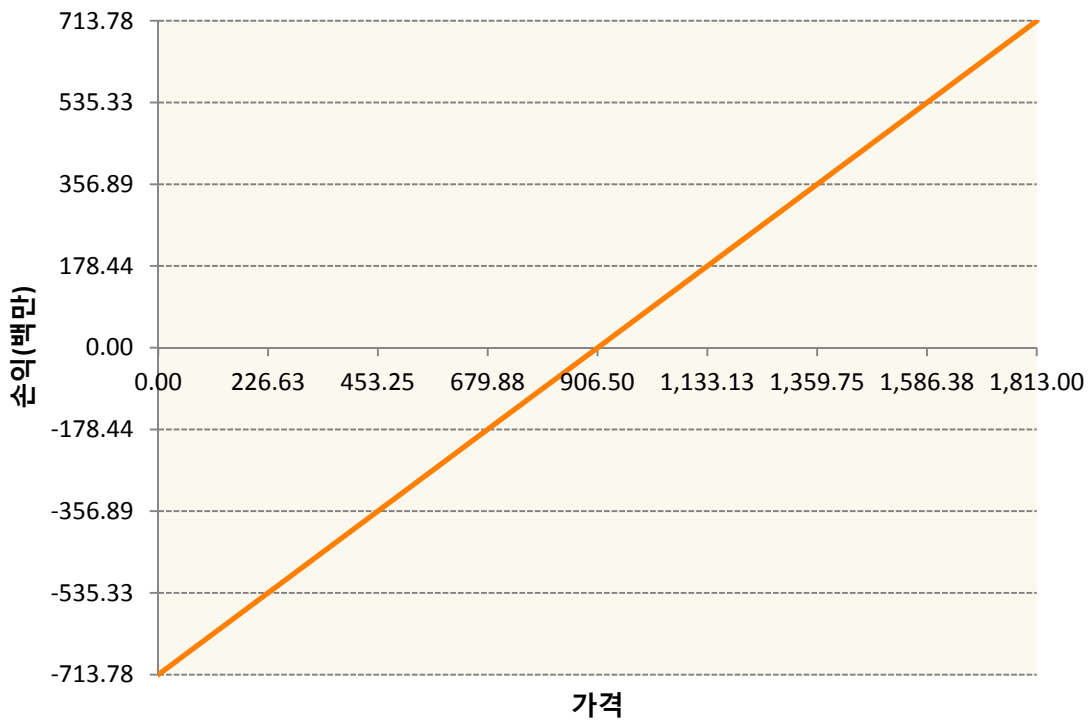
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

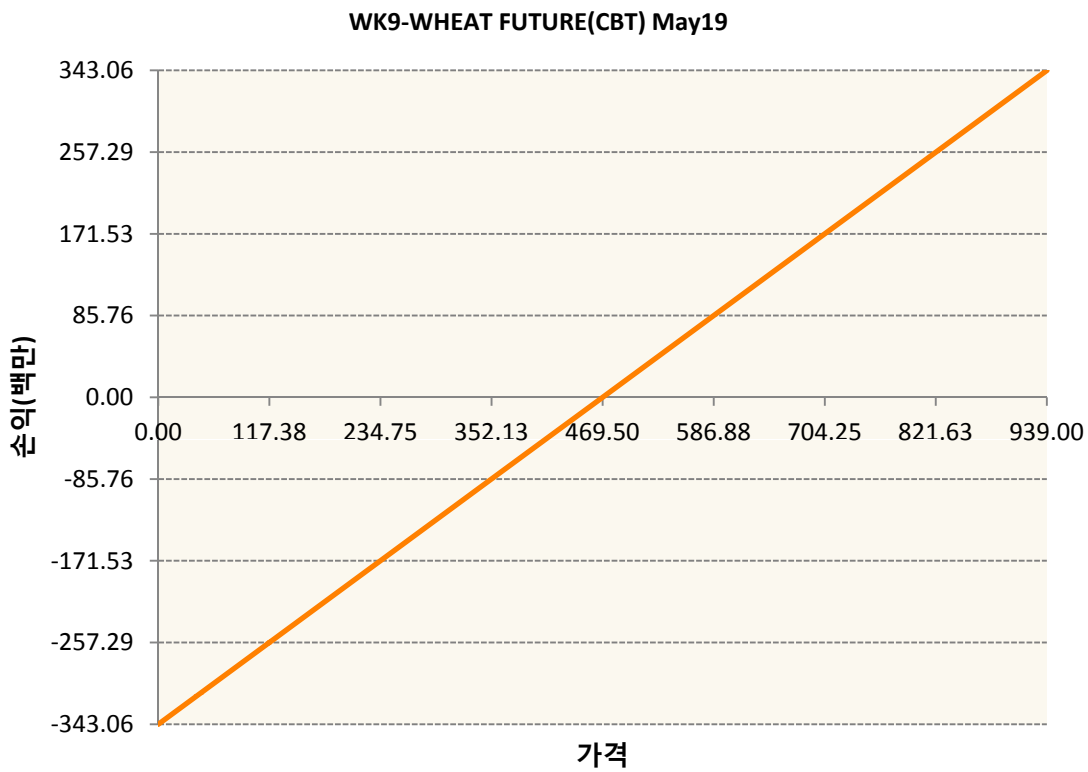
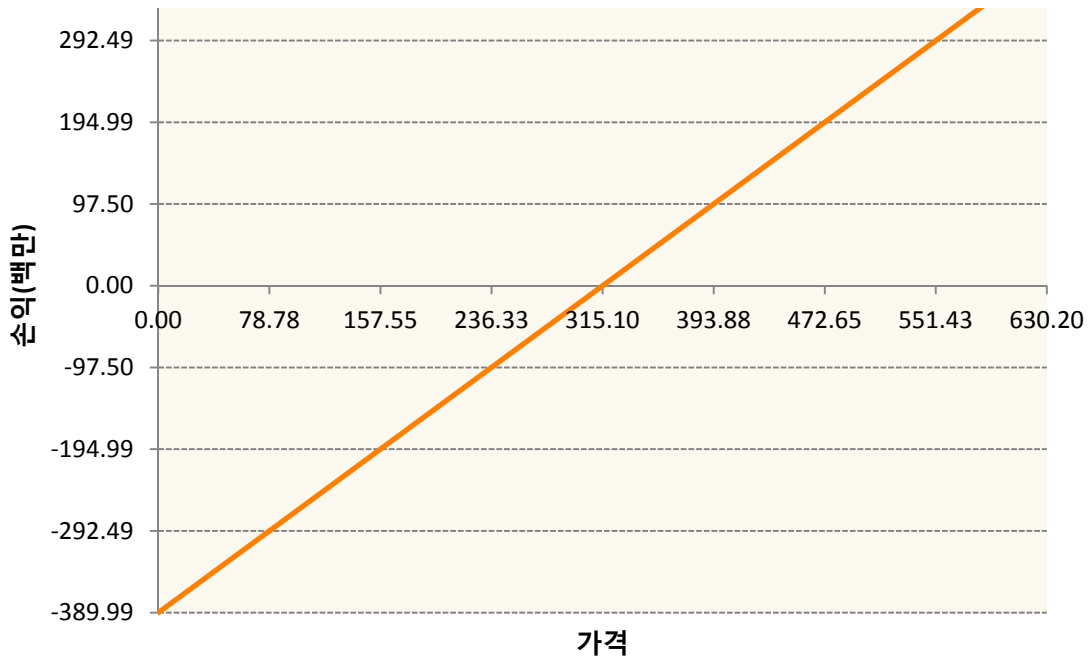


SK9-SOYBEAN FUTURE May19



SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------------|-------------------------|----|
| BOK9 | SOYBEAN OIL FUTR May19 | 30 |
| CK9 | CORN FUTURE May19 | 55 |
| CTK9 | COTTON NO.2 FUTR May19 | 14 |
| KCK9 | COFFEE 'C' FUTURE May19 | 19 |
| KR4175P400 | 2019-04 달러선물 | 6 |

| | | |
|------|-------------------------|----|
| KWK9 | KC HRW WHEAT FUT May19 | 10 |
| SBK9 | SUGAR #11 (WORLD) May19 | 29 |
| SK9 | SOYBEAN FUTURE May19 | 57 |
| SMK9 | SOYBEAN MEAL FUTR May19 | 31 |
| WK9 | WHEAT FUTURE(CBT) May19 | 27 |

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

(단위:백만원)

273