

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-20 |
| 기준일 | 2019-05-17 |

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)

90

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-20 |
| 기준일 | 2019-05-17 |

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

1,142

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

682

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-20 |
| 기준일 | 2019-05-17 |

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) | 299 |
| SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규) | 82 |
| SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규) | 140 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|------------|
| 861 |
|------------|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-20 |
| 기준일 | 2019-05-17 |

유로인덱스모(주식-파생형)

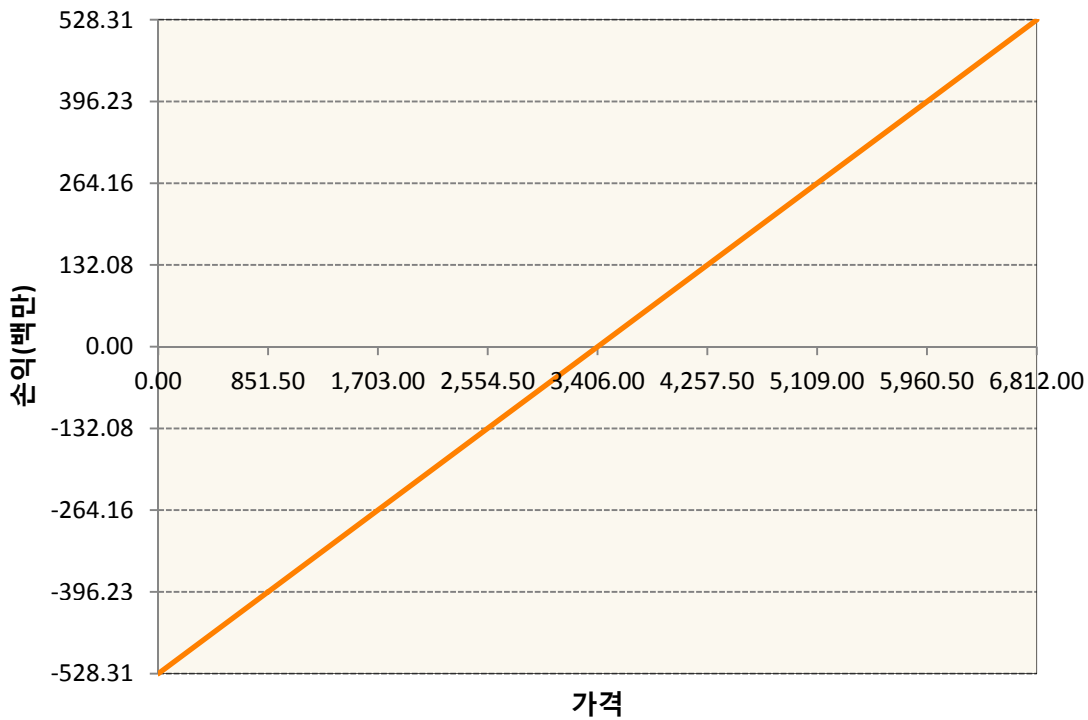
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------|---------------------|----|
| VGM9 | EURO STOXX 50 JUN19 | 42 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

| |
|----|
| 31 |
|----|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-20 |
| 기준일 | 2019-05-17 |

차이나인덱스모(주식-파생형)

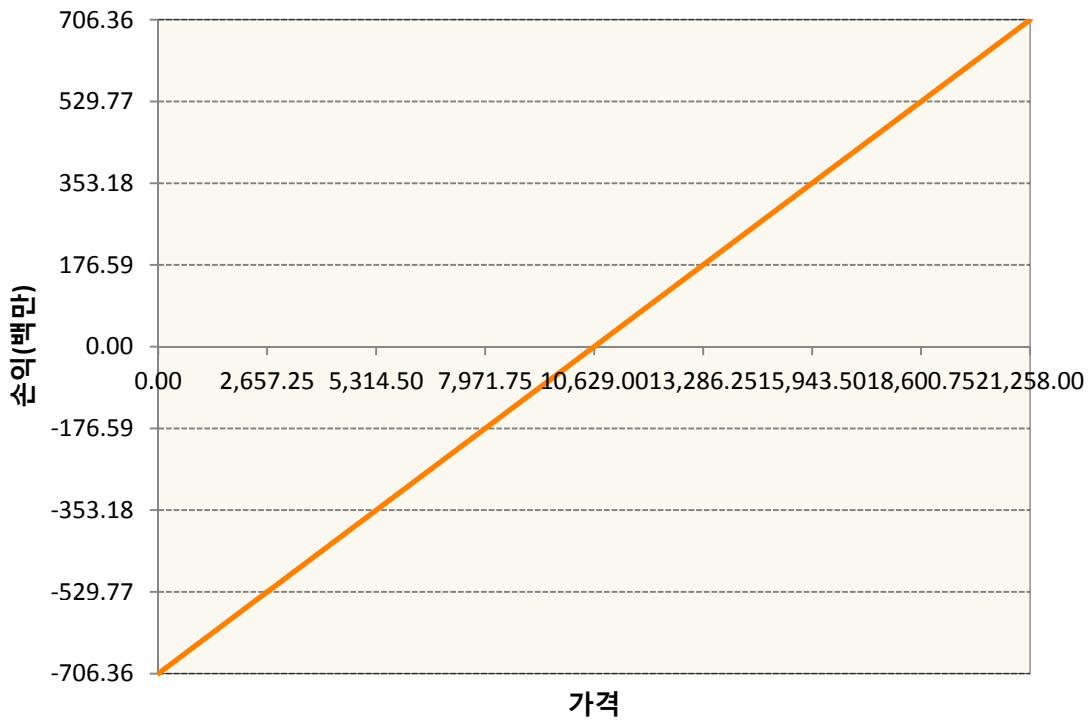
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 706 | 0 | 706 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------|---------------------|----|
| HCK9 | HSCEI Futures May19 | 57 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

| |
|----|
| 58 |
|----|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-20 |
| 기준일 | 2019-05-17 |

커버드콜모(주식혼합-파생형)

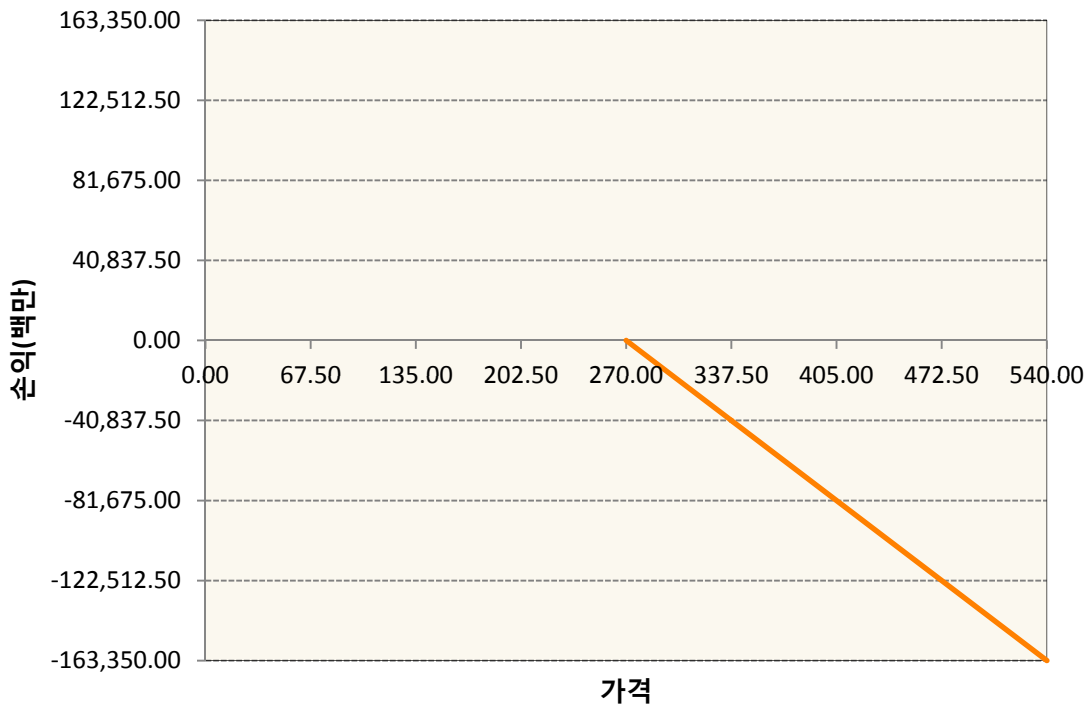
1. 계약금액

(단위:백만원)

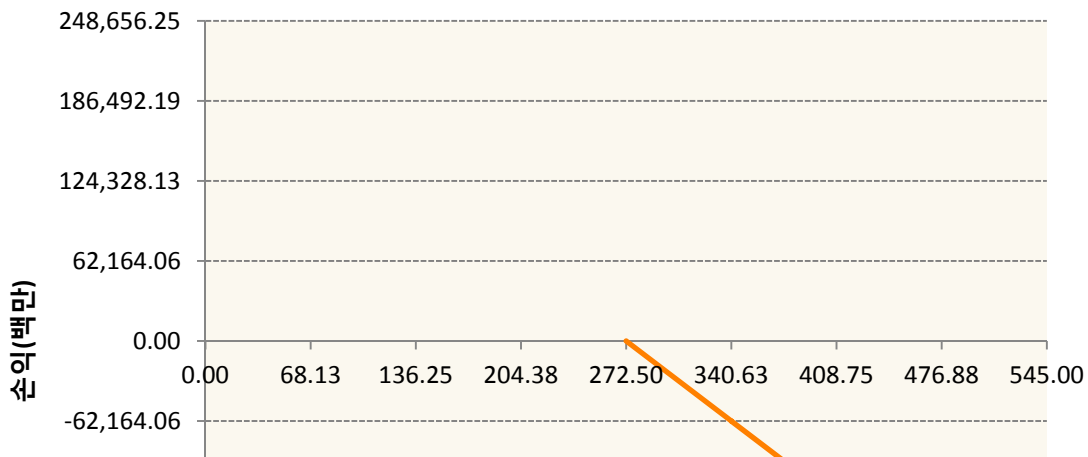
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 614,506 | -614,506 | 장내 |

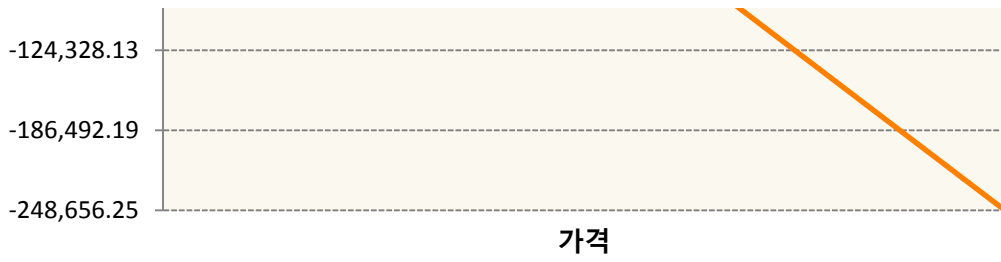
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P62701-2019-06 콜270



KR4201P62727-2019-06 콜272.5





KR4301P62709-2019-06 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4201P62701 | | 2019-06 콜270 | | | | | 8,637 |
|--------------|---------|----------------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 2,836 | 2,780 | 2,703 | 2,603 | 2,482 | 2,341 | 2,182 |
| -5.33% | 2,650 | 2,516 | 2,356 | 2,172 | 1,969 | 1,749 | 1,513 |
| -2.67% | 2,137 | 1,893 | 1,630 | 1,353 | 1,064 | 765 | 458 |
| 0% | 1,037 | 696 | 350 | 0 | -353 | -708 | -1,065 |
| 2.67% | -858 | -1,231 | -1,604 | -1,977 | -2,351 | -2,724 | -3,098 |
| 5.33% | -3,583 | -3,909 | -4,243 | -4,584 | -4,931 | -5,283 | -5,638 |
| 8.00% | -6,993 | -7,223 | -7,475 | -7,746 | -8,031 | -8,329 | -8,637 |
| KR4201P62727 | | 2019-06 콜272.5 | | | | | 12,187 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 3,542 | 3,483 | 3,394 | 3,274 | 3,123 | 2,943 | 2,734 |

| | | | | | | | |
|--|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| -5.33% | 3,352 | 3,194 | 2,996 | 2,763 | 2,496 | 2,201 | 1,881 |
| -2.67% | 2,782 | 2,469 | 2,122 | 1,746 | 1,348 | 931 | 498 |
| 0% | 1,468 | 992 | 501 | 0 | -510 | -1,026 | -1,548 |
| 2.67% | -950 | -1,515 | -2,080 | -2,646 | -3,212 | -3,778 | -4,344 |
| 5.33% | -4,625 | -5,159 | -5,700 | -6,246 | -6,796 | -7,350 | -7,906 |
| 8.00% | -9,428 | -9,836 | -10,270 | -10,727 | -11,200 | -11,688 | -12,187 |
| KR4301P62709 2019-06 풋270 | | | | | | | 14,260 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -14,166 | -14,168 | -14,173 | -14,183 | -14,200 | -14,225 | -14,260 |
| -5.33% | -8,905 | -8,927 | -8,961 | -9,009 | -9,072 | -9,150 | -9,242 |
| -2.67% | -3,787 | -3,886 | -4,005 | -4,143 | -4,297 | -4,464 | -4,644 |
| 0% | 718 | 487 | 247 | 0 | -252 | -509 | -769 |
| 2.67% | 3,865 | 3,579 | 3,293 | 3,007 | 2,721 | 2,434 | 2,147 |
| 5.33% | 5,410 | 5,214 | 5,004 | 4,782 | 4,550 | 4,311 | 4,065 |
| 8.00% | 5,907 | 5,828 | 5,729 | 5,610 | 5,473 | 5,320 | 5,154 |

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

(단위:백만원)

34,240

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-20 |
| 기준일 | 2019-05-17 |

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

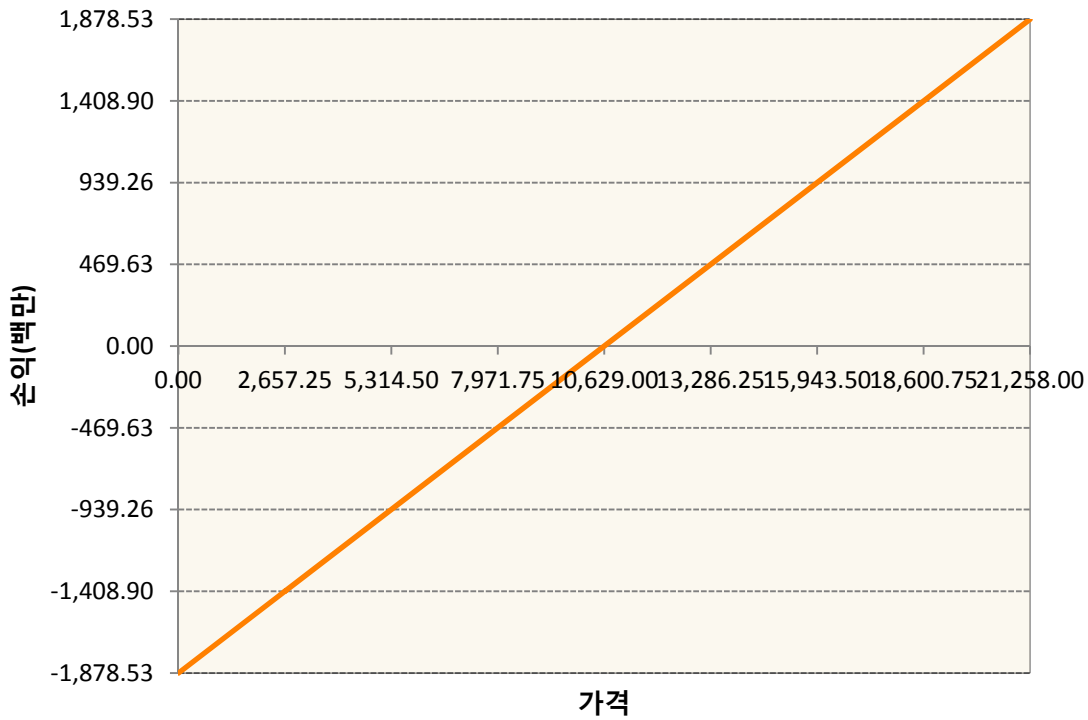
1. 계약금액

(단위:백만원)

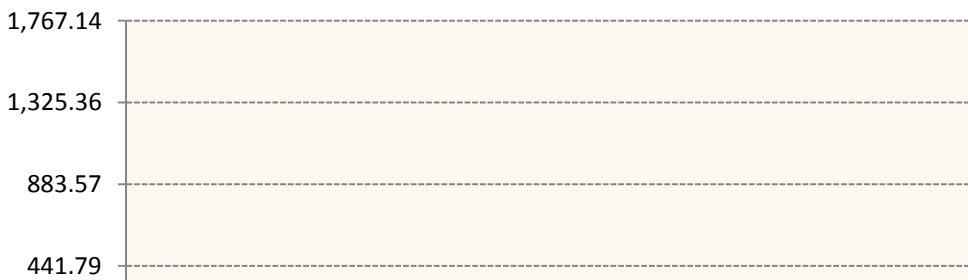
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,879 | 0 | 1,879 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 5,673 | -5,673 | 장내 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 3,199 | -3,199 | 장외 |

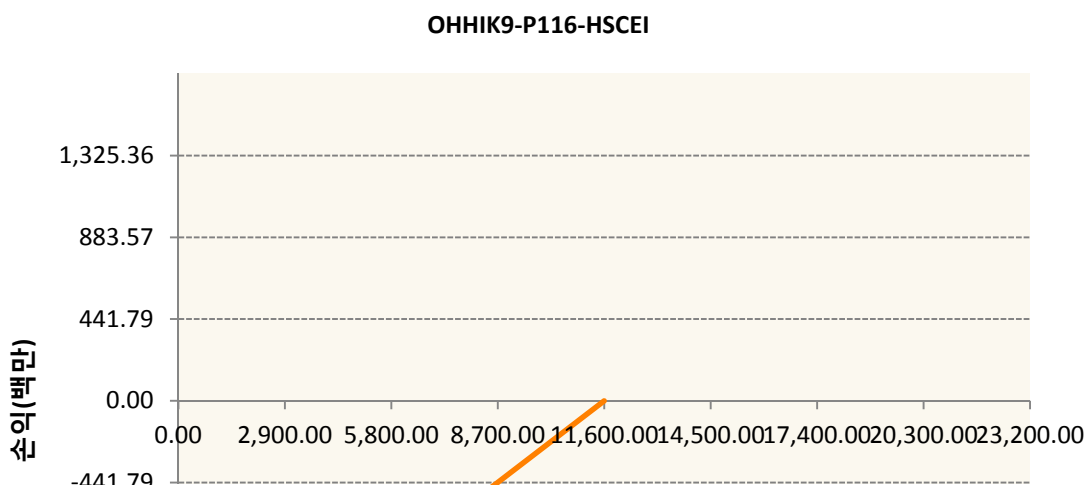
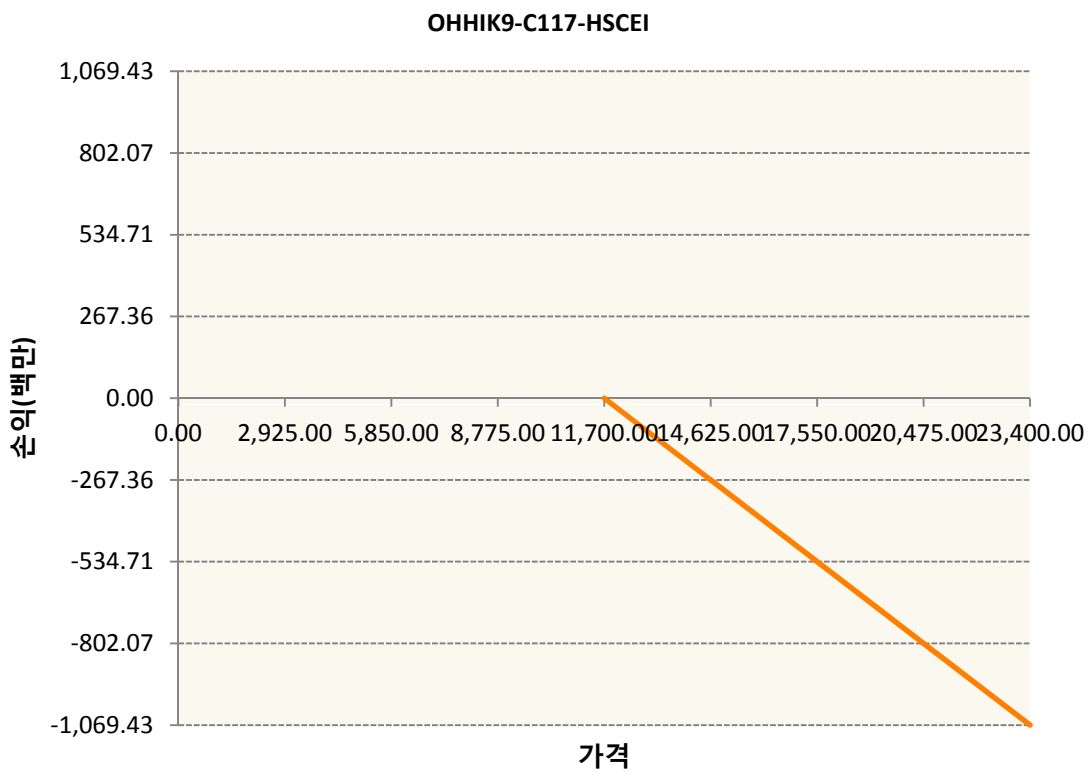
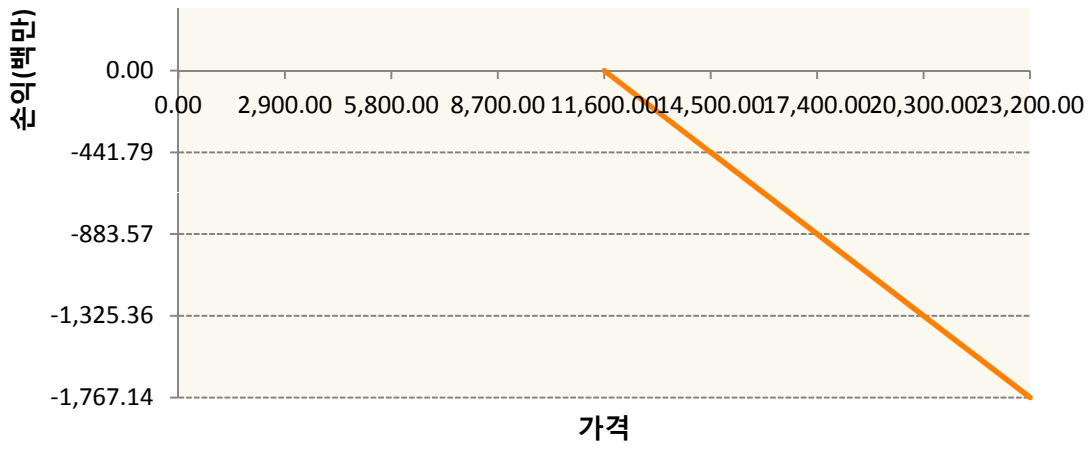
2. 만기시점의 손익구조

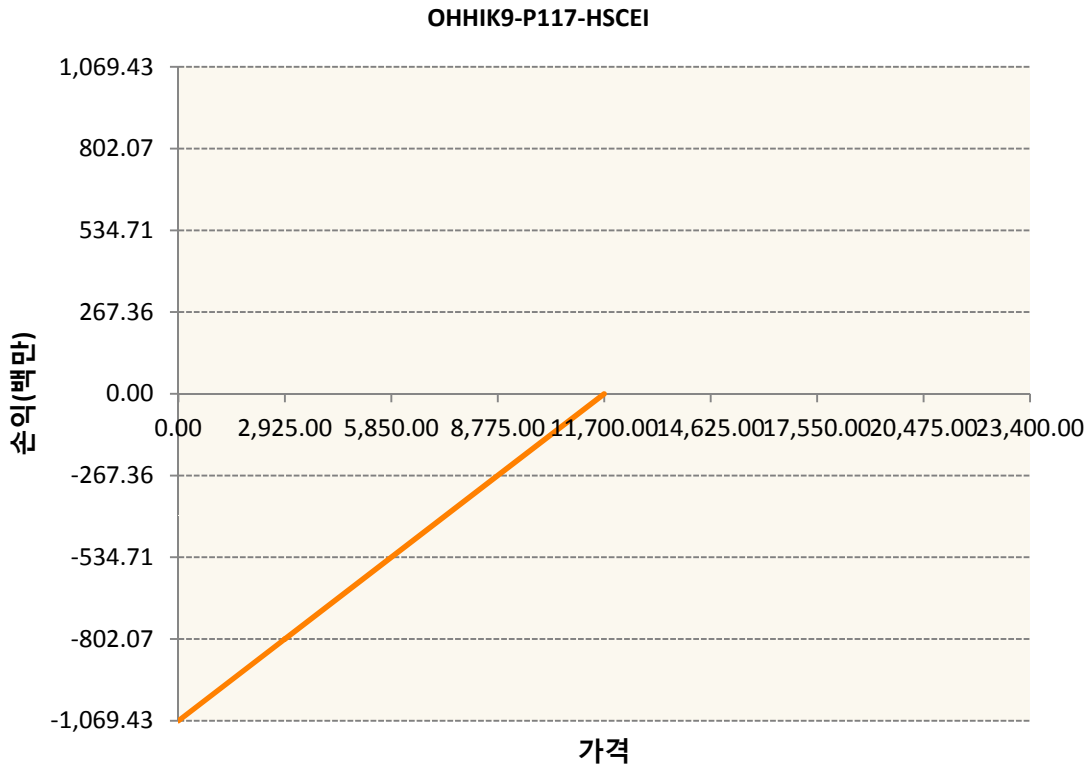
HCK9-HSCEI Futures May19



OHHIK9-C116-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | |
|------------------------------|-----|
| FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E | 232 |
| FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E | 24 |
| HCK9 HSCEI Futures May19 | 150 |
| OHHIK9-C11 HSCEI | 141 |
| OHHIK9-C11 HSCEI | 86 |
| OHHIK9-P11 HSCEI | 141 |
| OHHIK9-P11 HSCEI | 86 |

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

| |
|------------|
| 707 |
|------------|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-20 |
| 기준일 | 2019-05-17 |

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

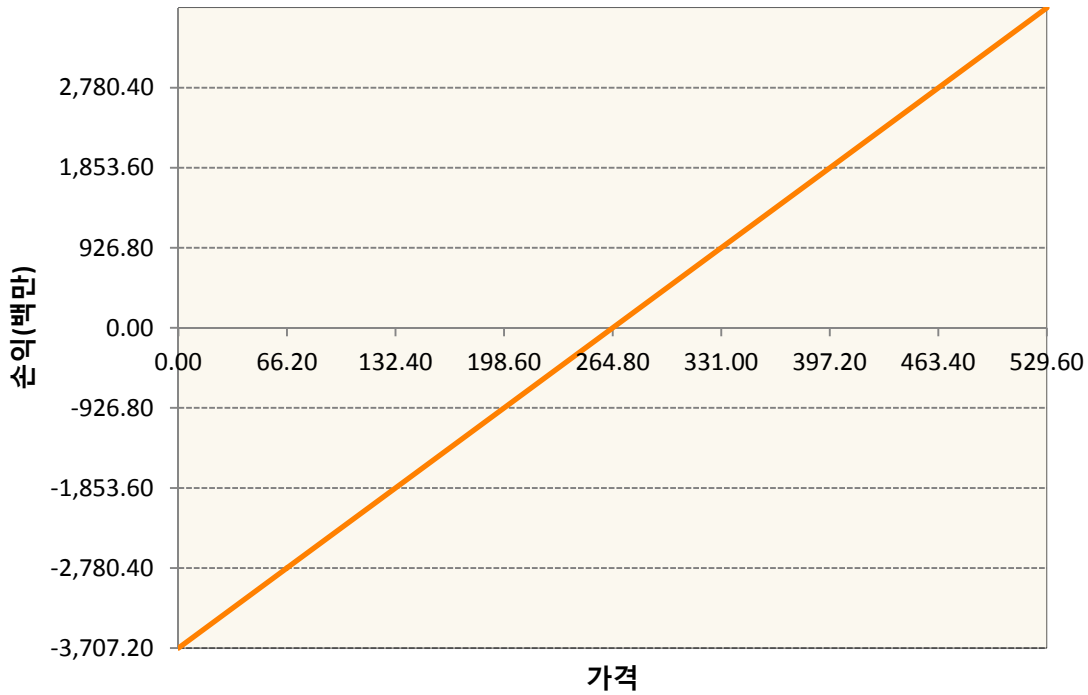
1. 계약금액

(단위:백만원)

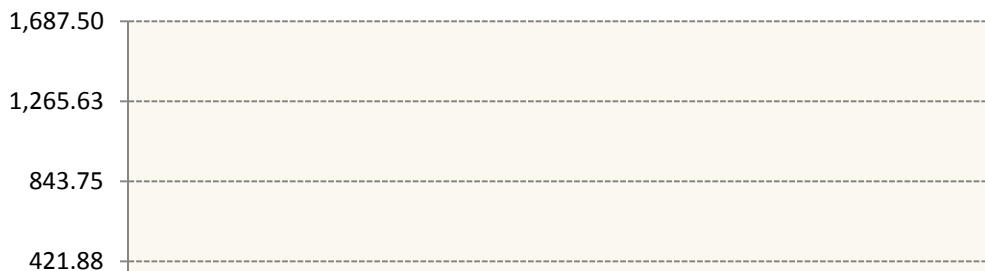
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 3,639 | 0 | 3,639 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,707 | 0 | 3,707 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 26,836 | 0 | 26,836 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 21,759 | -21,759 | 장내 |

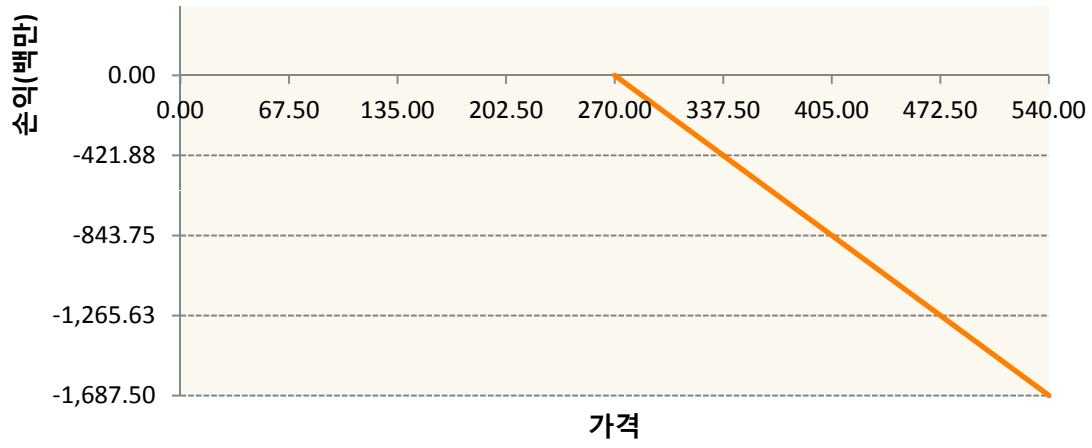
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

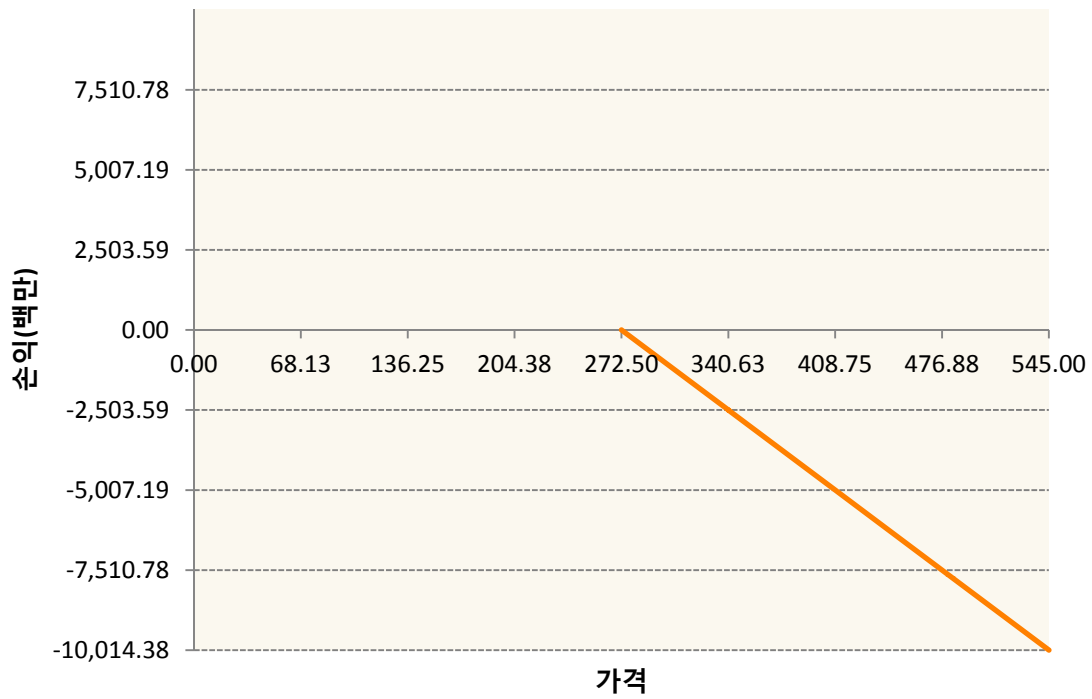


KR4201P62701-2019-06 콜270

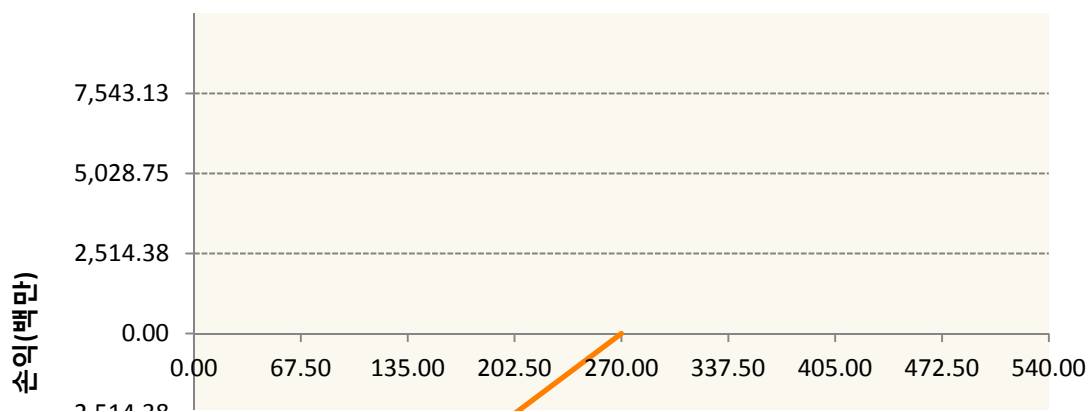


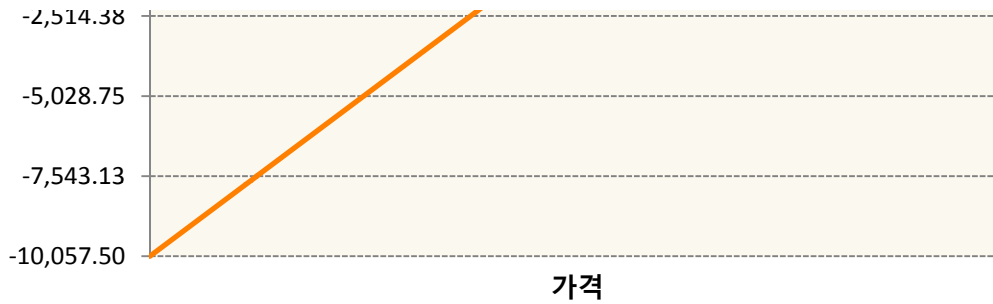


KR4201P62727-2019-06 콜272.5



KR4301P62709-2019-06 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | | | | | | | |
|--------------|-----------|--------------------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|
| 2.529E+11 | | UBCSFXC1 INDEX_14 | | | | | | 1,707 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -1,707 | -1,707 | -1,707 | -1,707 | -1,707 | -1,707 | -1,707 | |
| -5.33% | -1,138 | -1,138 | -1,138 | -1,138 | -1,138 | -1,138 | -1,138 | |
| -2.67% | -569 | -569 | -569 | -569 | -569 | -569 | -569 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 569 | 569 | 569 | 569 | 569 | 569 | 569 | |
| 5.33% | 1,138 | 1,138 | 1,138 | 1,138 | 1,138 | 1,138 | 1,138 | |
| 8.00% | 1,707 | 1,707 | 1,707 | 1,707 | 1,707 | 1,707 | 1,707 | |
| 2.529E+11 | | UBCSFXC1 INDEX_15 | | | | | | 602 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -602 | -602 | -602 | -602 | -602 | -602 | -602 | |
| -5.33% | -402 | -402 | -402 | -402 | -402 | -402 | -402 | |
| -2.67% | -201 | -201 | -201 | -201 | -201 | -201 | -201 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 201 | 201 | 201 | 201 | 201 | 201 | 201 | |
| 5.33% | 402 | 402 | 402 | 402 | 402 | 402 | 402 | |
| 8.00% | 602 | 602 | 602 | 602 | 602 | 602 | 602 | |
| KR4101P60004 | | 2019-06 코스피200지수선물 | | | | | | 296 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -296 | -296 | -296 | -296 | -296 | -296 | -296 | |
| -5.33% | -197 | -197 | -197 | -197 | -197 | -197 | -197 | |
| -2.67% | -99 | -99 | -99 | -99 | -99 | -99 | -99 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 99 | 99 | 99 | 99 | 99 | 99 | 99 | |
| 5.33% | 197 | 197 | 197 | 197 | 197 | 197 | 197 | |
| 8.00% | 296 | 296 | 296 | 296 | 296 | 296 | 296 | |
| KR4201P62701 | | 2019-06 콜270 | | | | | | 89 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |

| | | | | | | | |
|----------------------------------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| -8.00% | 29 | 29 | 28 | 27 | 26 | 24 | 23 |
| -5.33% | 27 | 26 | 24 | 22 | 20 | 18 | 16 |
| -2.67% | 22 | 20 | 17 | 14 | 11 | 8 | 5 |
| 0% | 11 | 7 | 4 | 0 | -4 | -7 | -11 |
| 2.67% | -9 | -13 | -17 | -20 | -24 | -28 | -32 |
| 5.33% | -37 | -40 | -44 | -47 | -51 | -55 | -58 |
| 8.00% | -72 | -75 | -77 | -80 | -83 | -86 | -89 |
| KR4201P62727 2019-06 콜272.5 | | | | | | | 491 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 143 | 140 | 137 | 132 | 126 | 119 | 110 |
| -5.33% | 135 | 129 | 121 | 111 | 101 | 89 | 76 |
| -2.67% | 112 | 99 | 85 | 70 | 54 | 38 | 20 |
| 0% | 59 | 40 | 20 | 0 | -21 | -41 | -62 |
| 2.67% | -38 | -61 | -84 | -107 | -129 | -152 | -175 |
| 5.33% | -186 | -208 | -230 | -252 | -274 | -296 | -318 |
| 8.00% | -380 | -396 | -414 | -432 | -451 | -471 | -491 |
| KR4301P62709 2019-06 풋270 | | | | | | | 708 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -704 | -704 | -704 | -704 | -705 | -707 | -708 |
| -5.33% | -442 | -443 | -445 | -447 | -451 | -454 | -459 |
| -2.67% | -188 | -193 | -199 | -206 | -213 | -222 | -231 |
| 0% | 36 | 24 | 12 | 0 | -13 | -25 | -38 |
| 2.67% | 192 | 178 | 164 | 149 | 135 | 121 | 107 |
| 5.33% | 269 | 259 | 249 | 237 | 226 | 214 | 202 |
| 8.00% | 293 | 289 | 285 | 279 | 272 | 264 | 256 |

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

(단위:백만원)

3,853

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-20 |
| 기준일 | 2019-05-17 |

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

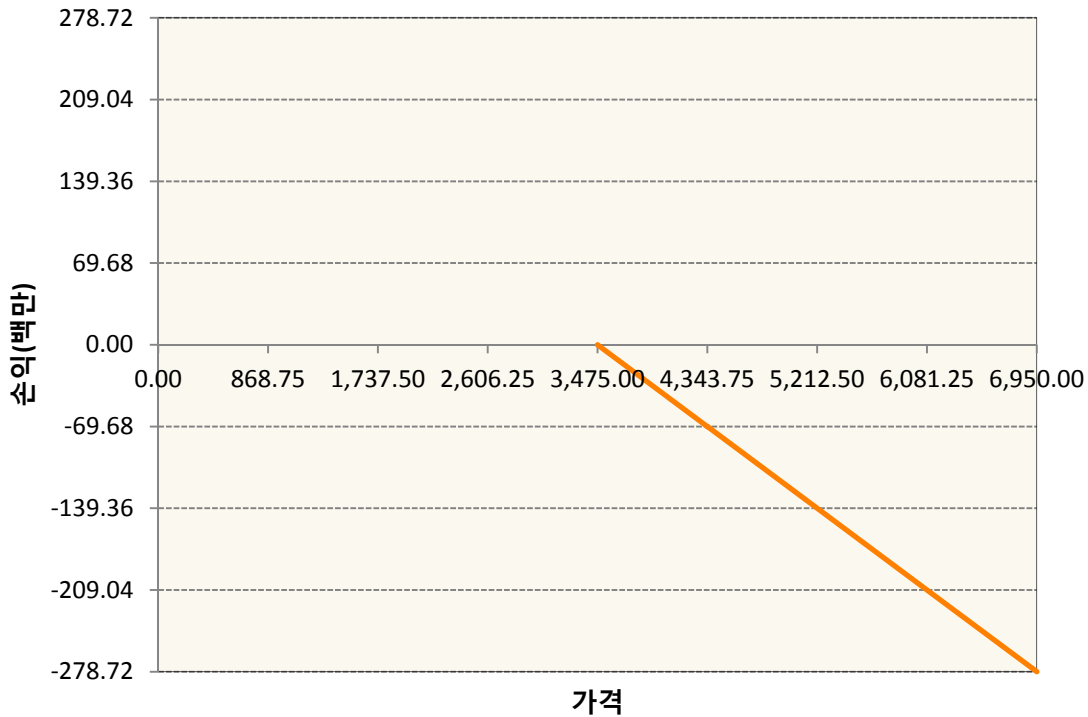
1. 계약금액

(단위:백만원)

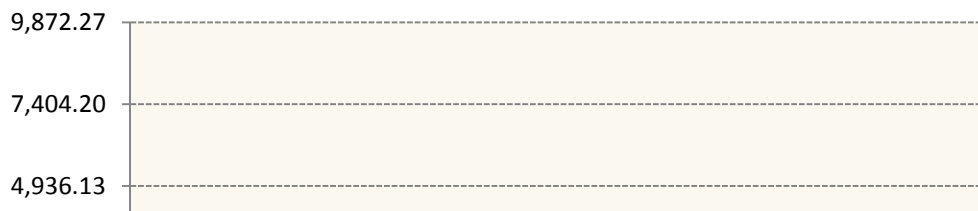
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,725 | 0 | 3,725 | |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 56,585 | 0 | 56,585 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 20,302 | -20,302 | 장내 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 18,715 | -18,715 | 장외 |

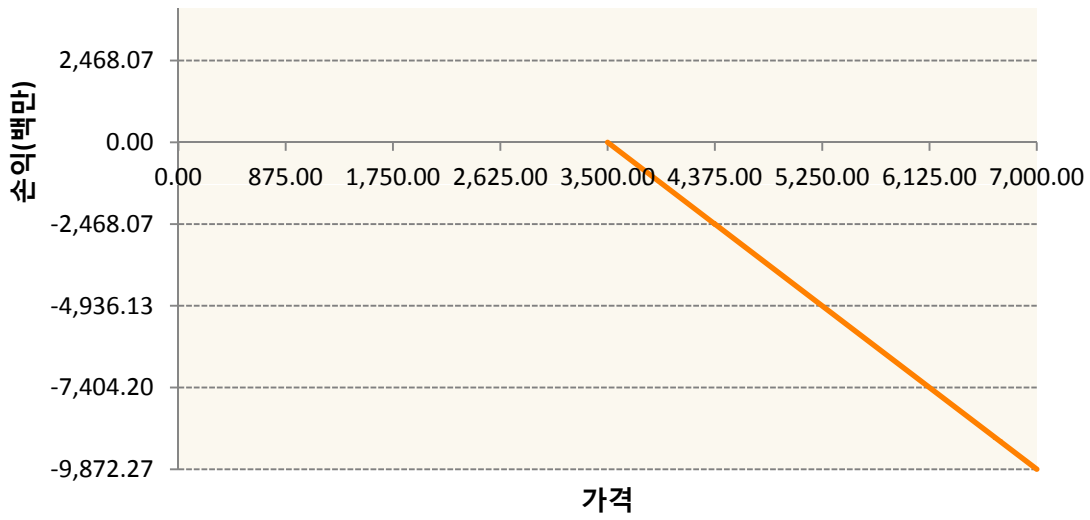
2. 만기시점의 손익구조

OESXK9-C3475-EURO STOXX 50

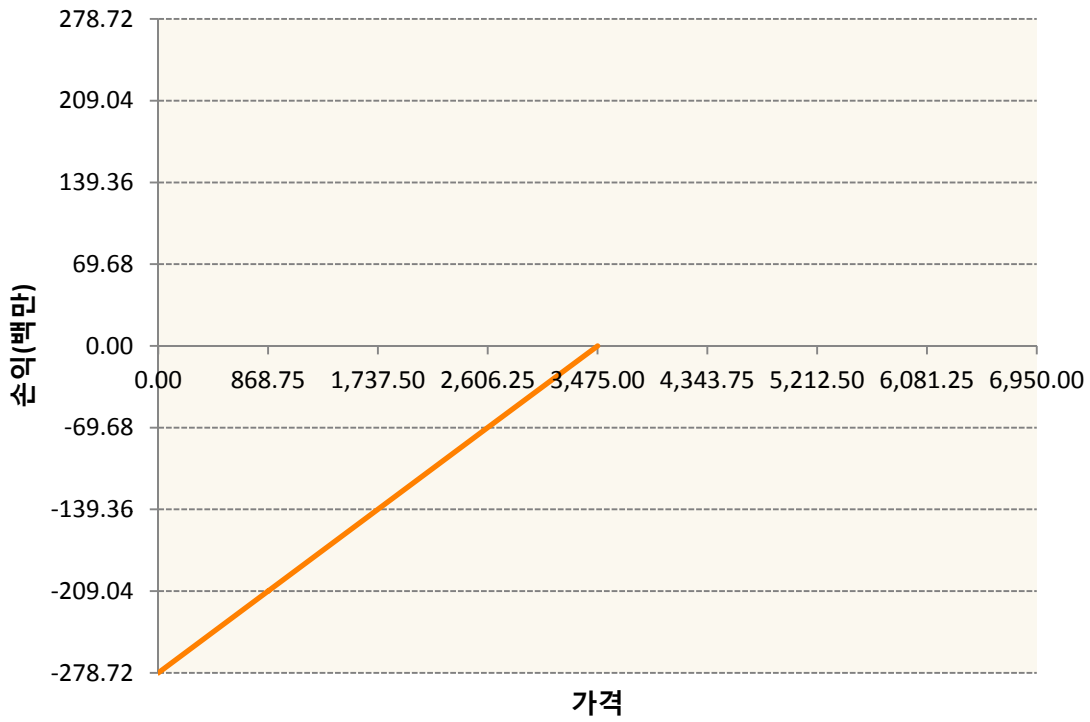


OESXK9-C3500-EURO STOXX 50

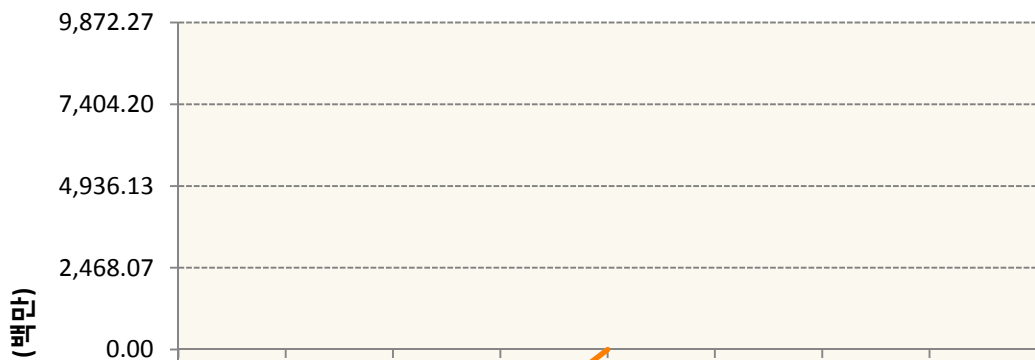


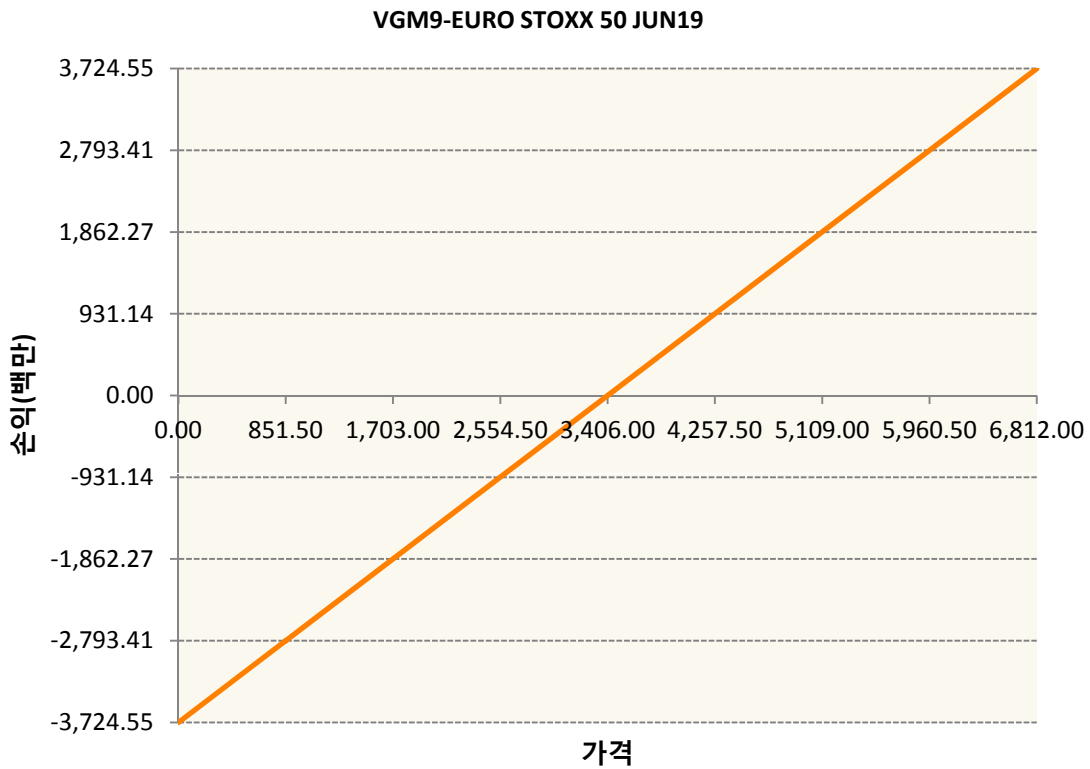
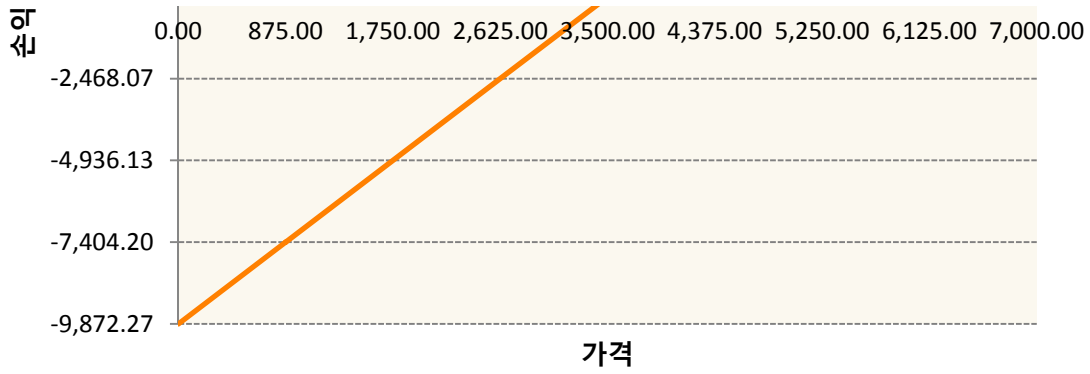


OESXK9-P3475-EURO STOXX 50



OESXK9-P3500-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | |
|---|-----|
| 260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY | 13 |
| FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E | 428 |
| FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E | 856 |
| FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E | 214 |
| OESXK9-C34 EURO STOXX 50 | 22 |
| OESXK9-C35 EURO STOXX 50 | 790 |
| OESXK9-P34 EURO STOXX 50 | 22 |
| OESXK9-P35 EURO STOXX 50 | 790 |
| VGM9 EURO STOXX 50 JUN19 | 298 |

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

(단위:백만원)

2,142

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

(단위:백만원)

1,016

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

(단위:백만원)

90

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

(단위:백만원)

130

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-20 |
| 기준일 | 2019-05-17 |

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

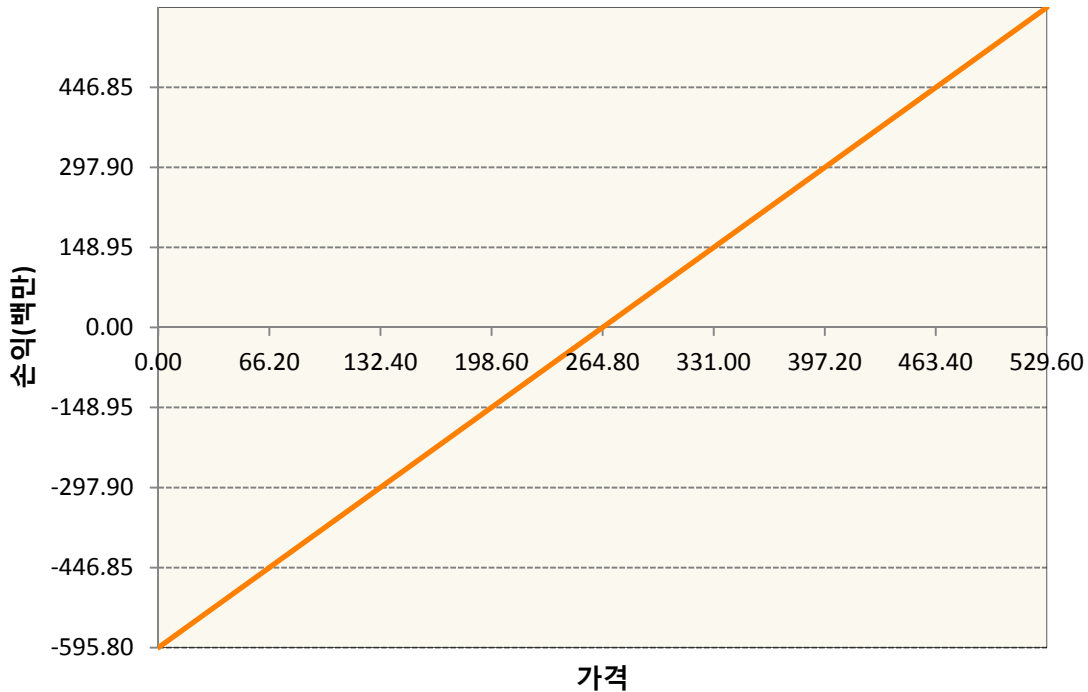
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 596 | 0 | 596 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101P60004 | | 2019-06 코스피200지수선물 | | | | | | 48 |
|--------------|---------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|----|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -48 | -48 | -48 | -48 | -48 | -48 | -48 | |
| -5.33% | -32 | -32 | -32 | -32 | -32 | -32 | -32 | |
| -2.67% | -16 | -16 | -16 | -16 | -16 | -16 | -16 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 16 | 16 | 16 | 16 | 16 | 16 | 16 | |
| 5.33% | 32 | 32 | 32 | 32 | 32 | 32 | 32 | |
| 8.00% | 48 | 48 | 48 | 48 | 48 | 48 | 48 | |

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

(단위:백만원)

40

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-20 |
| 기준일 | 2019-05-17 |

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

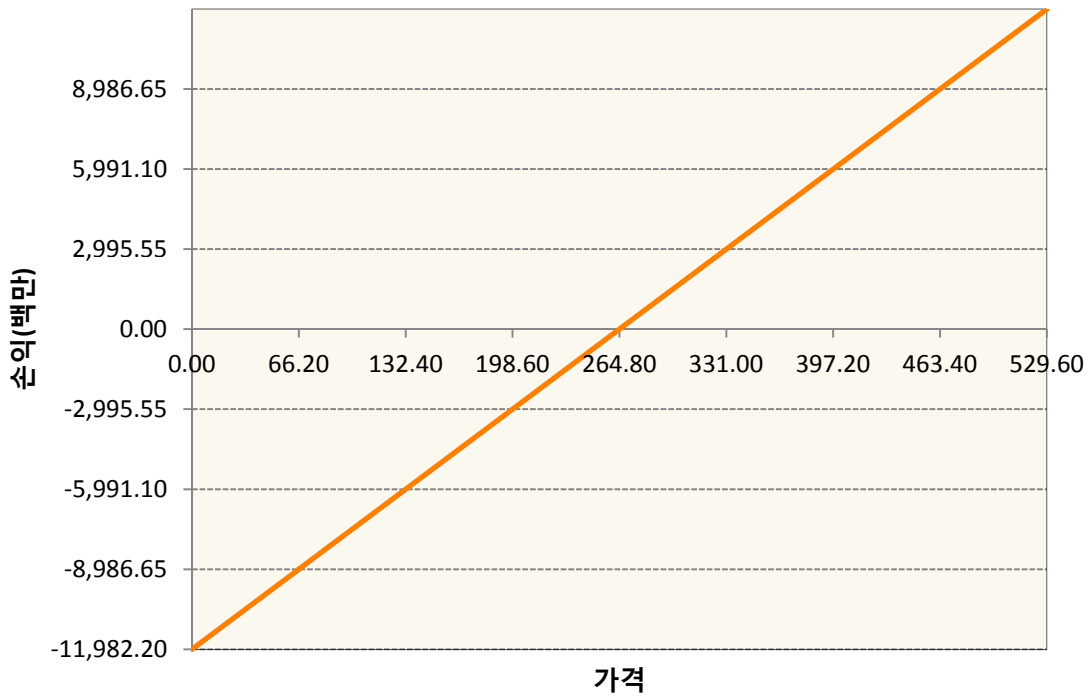
1. 계약금액

(단위:백만원)

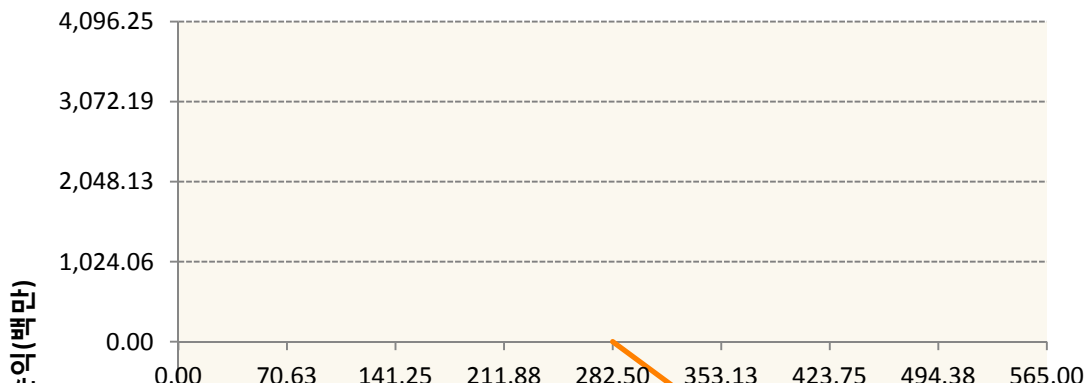
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 11,982 | 0 | 11,982 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 5,081 | 22,906 | -17,825 | 장내 |

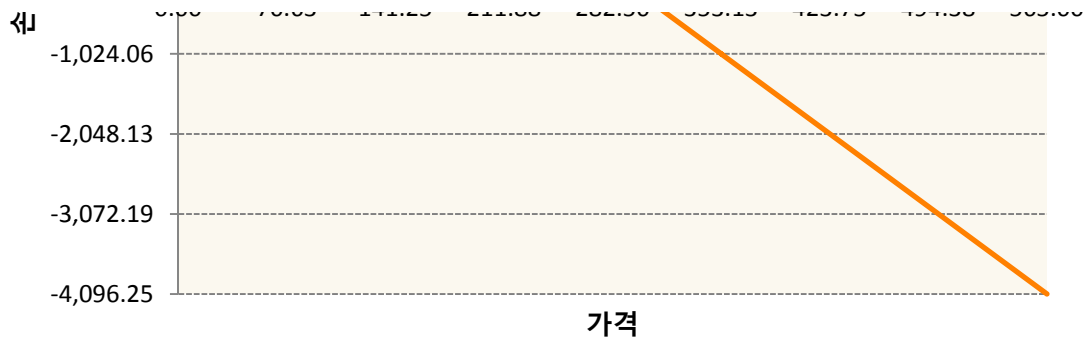
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

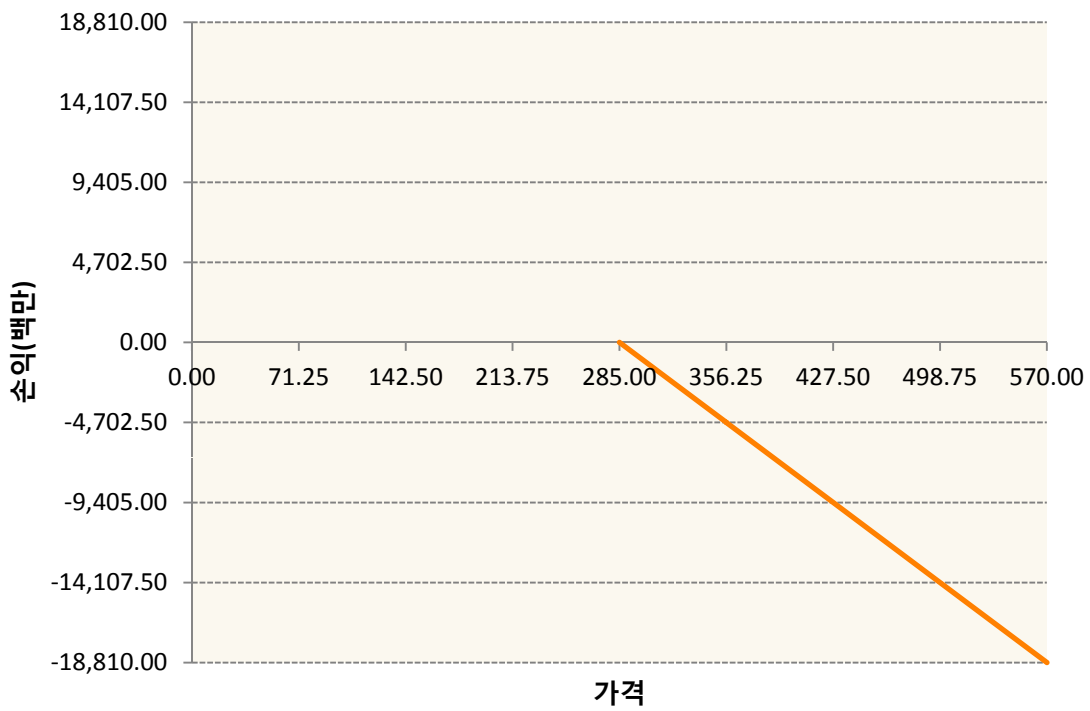


KR4201P62826-2019-06 콜282.5

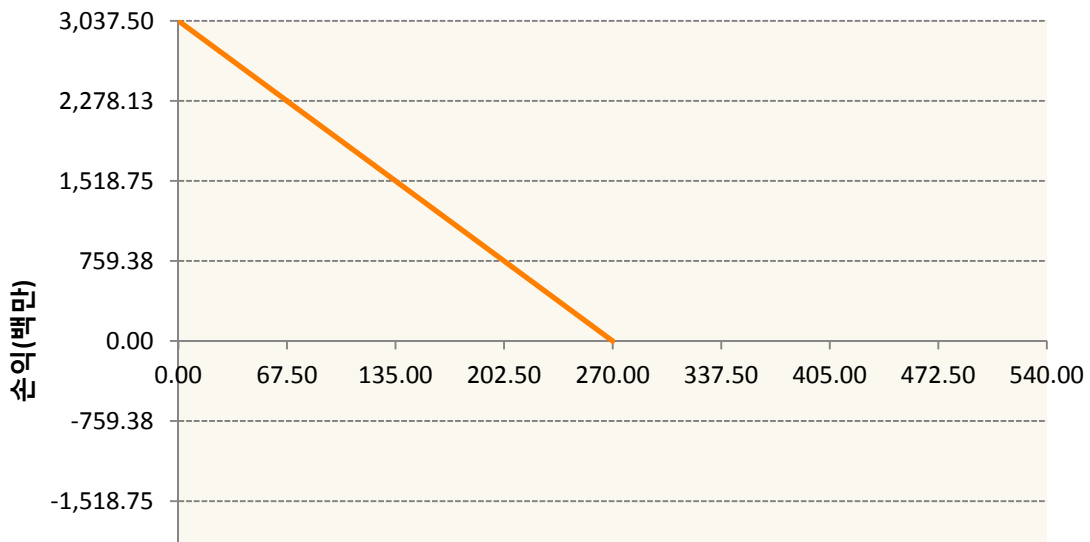


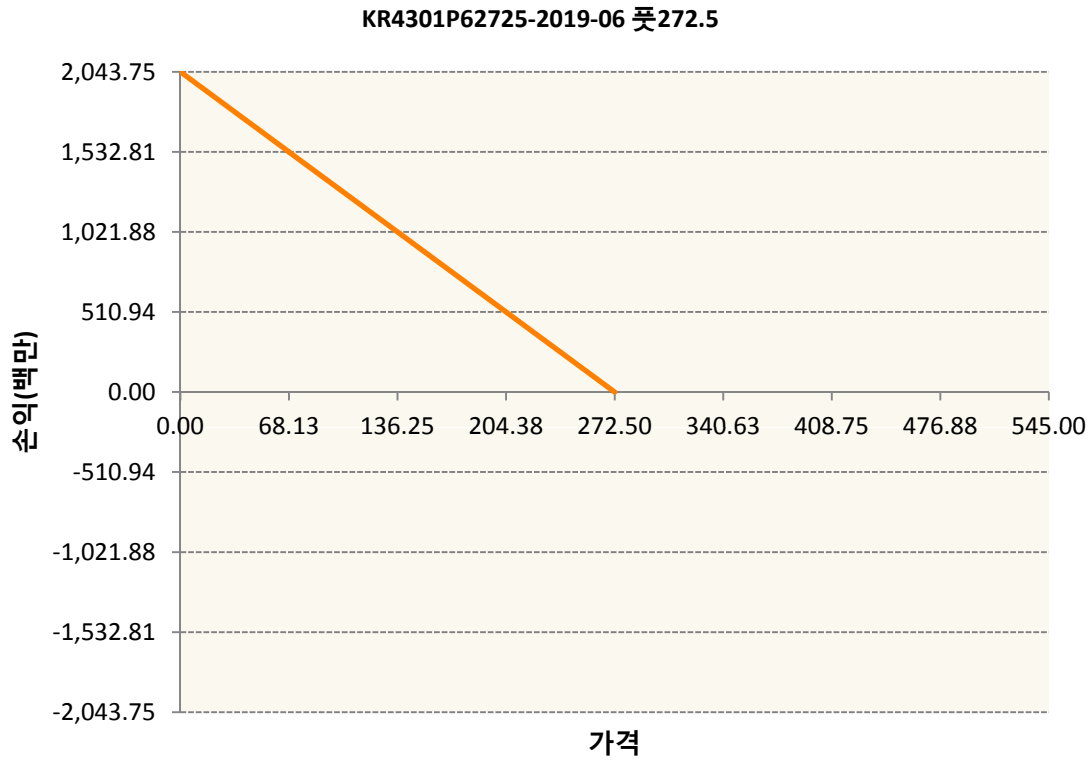
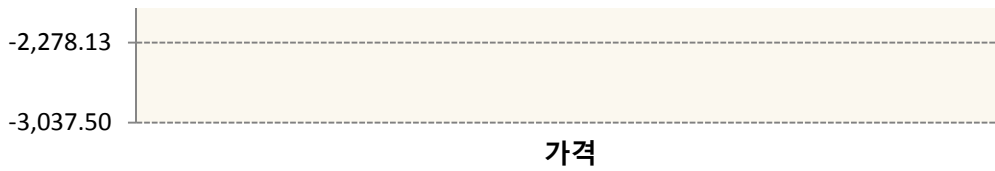


KR4201P62859-2019-06 콜285



KR4301P62709-2019-06 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4101P60004 | | 2019-06 코스피200지수선물 | | | | | 957 |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -957 | -957 | -957 | -957 | -957 | -957 | -957 |
| -5.33% | -638 | -638 | -638 | -638 | -638 | -638 | -638 |
| -2.67% | -319 | -319 | -319 | -319 | -319 | -319 | -319 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 319 | 319 | 319 | 319 | 319 | 319 | 319 |
| 5.33% | 638 | 638 | 638 | 638 | 638 | 638 | 638 |
| 8.00% | 957 | 957 | 957 | 957 | 957 | 957 | 957 |
| KR4201P62826 | | 2019-06 콜282.5 | | | | | 139 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 24 | 24 | 23 | 23 | 22 | 20 | 19 |
| -5.33% | 23 | 23 | 21 | 20 | 18 | 15 | 12 |
| -2.67% | 21 | 19 | 16 | 13 | 9 | 5 | 0 |

| | | | | | | | |
|--|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 0% | 15 | 10 | 5 | 0 | -6 | -12 | -19 |
| 2.67% | -2 | -8 | -16 | -23 | -31 | -39 | -47 |
| 5.33% | -33 | -42 | -51 | -60 | -69 | -78 | -87 |
| 8.00% | -83 | -92 | -101 | -111 | -120 | -129 | -139 |
| KR4201P62859 2019-06 콜285 | | | | | | | 571 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 85 | 84 | 83 | 81 | 78 | 73 | 67 |
| -5.33% | 84 | 81 | 77 | 72 | 64 | 54 | 43 |
| -2.67% | 77 | 70 | 61 | 49 | 34 | 17 | -2 |
| 0% | 56 | 40 | 21 | 0 | -24 | -49 | -77 |
| 2.67% | 0 | -28 | -58 | -89 | -122 | -157 | -192 |
| 5.33% | -116 | -154 | -194 | -233 | -274 | -314 | -355 |
| 8.00% | -313 | -356 | -399 | -442 | -485 | -528 | -571 |
| KR4301P62709 2019-06 풋270 | | | | | | | 214 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 212 | 213 | 213 | 213 | 213 | 213 | 214 |
| -5.33% | 134 | 134 | 134 | 135 | 136 | 137 | 139 |
| -2.67% | 57 | 58 | 60 | 62 | 64 | 67 | 70 |
| 0% | -11 | -7 | -4 | 0 | 4 | 8 | 12 |
| 2.67% | -58 | -54 | -49 | -45 | -41 | -37 | -32 |
| 5.33% | -81 | -78 | -75 | -72 | -68 | -65 | -61 |
| 8.00% | -89 | -87 | -86 | -84 | -82 | -80 | -77 |
| KR4301P62725 2019-06 풋272.5 | | | | | | | 147 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 147 | 147 | 147 | 147 | 147 | 147 | 147 |
| -5.33% | 94 | 94 | 94 | 94 | 95 | 95 | 96 |
| -2.67% | 42 | 43 | 43 | 44 | 46 | 47 | 48 |
| 0% | -6 | -4 | -2 | 0 | 2 | 5 | 7 |
| 2.67% | -43 | -40 | -37 | -34 | -31 | -29 | -26 |
| 5.33% | -64 | -61 | -59 | -56 | -54 | -51 | -48 |
| 8.00% | -72 | -71 | -69 | -68 | -66 | -64 | -62 |

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

(단위:백만원)

1,582

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-20 |
| 기준일 | 2019-05-17 |

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 538 | 0 | 538 | |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 10,742 | 0 | 10,742 | |

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 | 2019-05-20 |
| 기준일 | 2019-05-17 |

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 | 60,336 | 0 | 60,336 | |

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 | 2019-05-20 |
| 기준일 | 2019-05-17 |

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 7,174 | 0 | 7,174 | |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 237,241 | 0 | 237,241 | |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 266,258 | -266,258 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|-------------------------------|---------------------------------|-------|
| IE00BD8RGM75 | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 | |
| IE00BHNZKL13 | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 | |
| FX21019J004 KRW/USD 10-06-19E | | 105 |
| FX21019J012 KRW/USD 20-05-19E | | 134 |
| FX21019J012 KRW/USD 20-05-19E | | 19 |
| FX21019J013 KRW/USD 20-05-19E | | 143 |
| FX21019J016 KRW/USD 20-05-19E | | 143 |
| FX21019J019 KRW/USD 18-06-19E | | 383 |
| FX21019J020 KRW/USD 20-05-19E | | 517 |
| FX21019J021 KRW/USD 20-05-19E | | 486 |
| FX21019J024 KRW/USD 24-06-19E | | 957 |
| FX21019J024 KRW/USD 22-05-19E | | 804 |
| FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E | | 957 |
| FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E | | 1,014 |
| FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E | | 383 |
| FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E | | 77 |
| FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E | | 1,006 |
| FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E | | 1,033 |
| FX21019J041 KRW/USD 28-05-19E | | 287 |
| FX21019J043 KRW/USD 03-06-19E | | 574 |
| FX21019J044 KRW/USD 03-06-19E | | 478 |
| FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E | | 287 |
| FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E | | 478 |
| FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E | | 670 |
| FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E | | 670 |
| FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E | | 832 |
| FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E | | 823 |
| FX21019K00 KRW/USD 18-06-19E | | 574 |

| | |
|------------------------------|-------|
| FX21019K01 KRW/USD 14-06-19E | 670 |
| FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E | 574 |
| FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E | 478 |
| FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E | 574 |
| FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E | 1,435 |
| FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E | 1,339 |
| FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E | 478 |
| FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E | 804 |
| FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E | 639 |
| FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E | 478 |

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

(단위:백만원)

7,217

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-20 |
| 기준일 | 2019-05-17 |

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

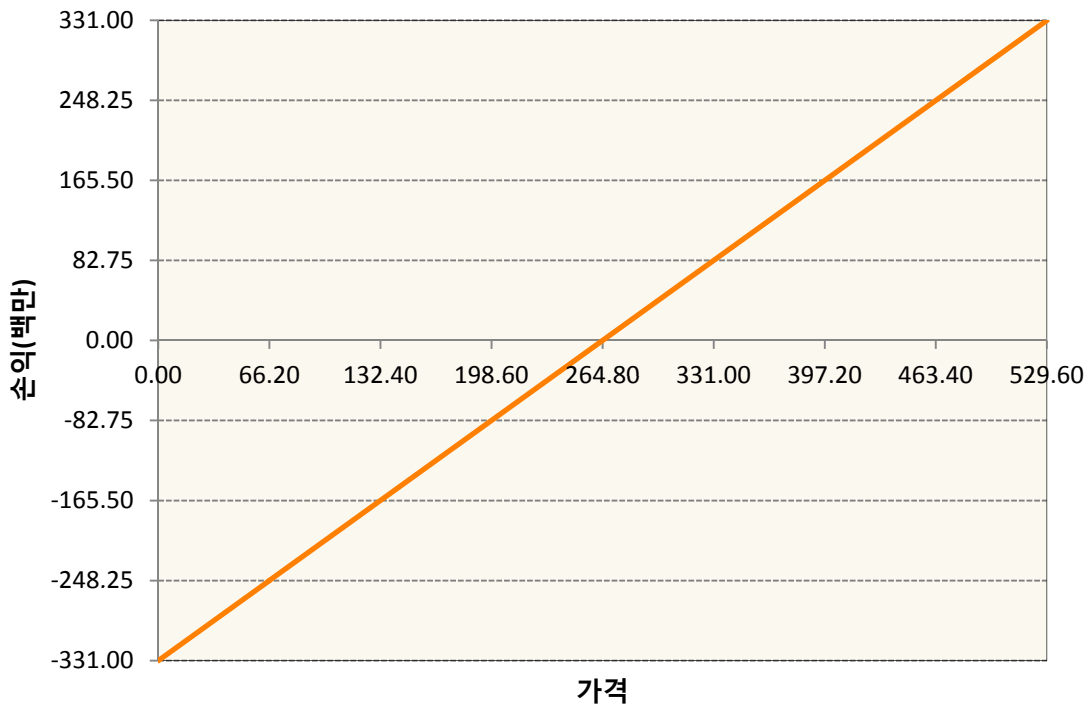
1. 계약금액

(단위:백만원)

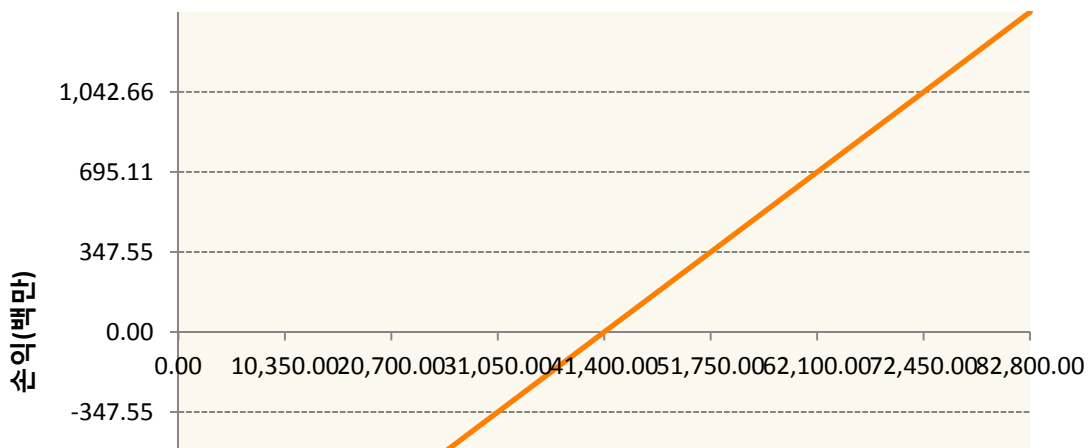
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,721 | 0 | 1,721 | 장내 |

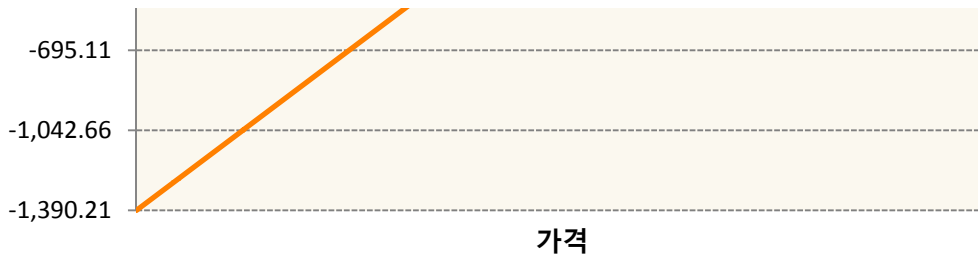
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4111P60003-2019-06 삼성전자개별선물





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4101P60004 | | 2019-06 코스피200지수선물 | | | | | | 26 |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -26 | -26 | -26 | -26 | -26 | -26 | -26 | |
| -5.33% | -18 | -18 | -18 | -18 | -18 | -18 | -18 | |
| -2.67% | -9 | -9 | -9 | -9 | -9 | -9 | -9 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 | |
| 5.33% | 18 | 18 | 18 | 18 | 18 | 18 | 18 | |
| 8.00% | 26 | 26 | 26 | 26 | 26 | 26 | 26 | |
| KR4111P60003 | | 2019-06 삼성전자개별선물 | | | | | | 111 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -111 | -111 | -111 | -111 | -111 | -111 | -111 | |
| -5.33% | -74 | -74 | -74 | -74 | -74 | -74 | -74 | |
| -2.67% | -37 | -37 | -37 | -37 | -37 | -37 | -37 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 37 | 37 | 37 | 37 | 37 | 37 | 37 | |
| 5.33% | 74 | 74 | 74 | 74 | 74 | 74 | 74 | |
| 8.00% | 111 | 111 | 111 | 111 | 111 | 111 | 111 | |

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

151

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-20 |
| 기준일 | 2019-05-17 |

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

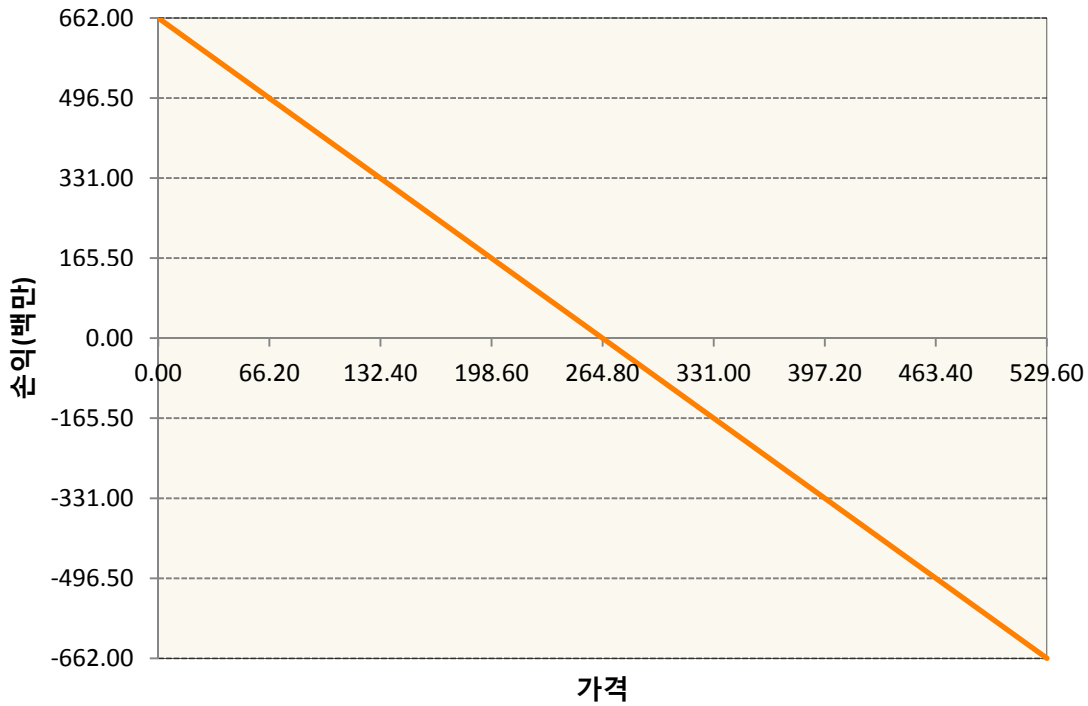
1. 계약금액

(단위:백만원)

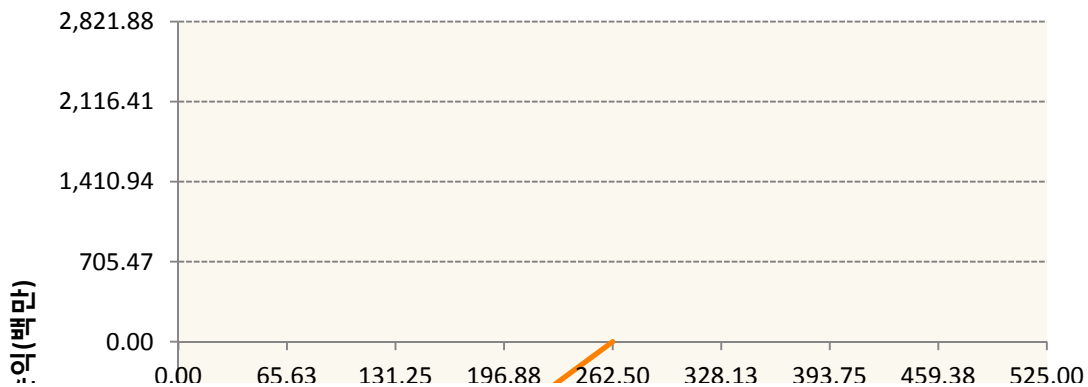
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 133 | -133 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 662 | -662 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 3,352 | -3,352 | 장내 |

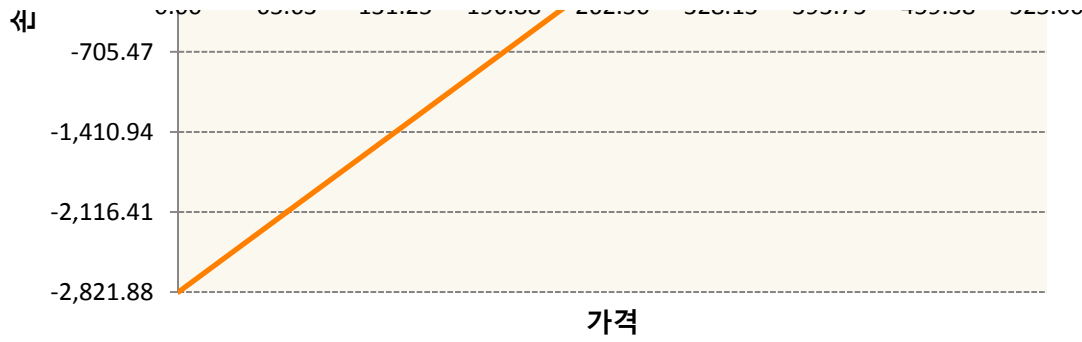
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

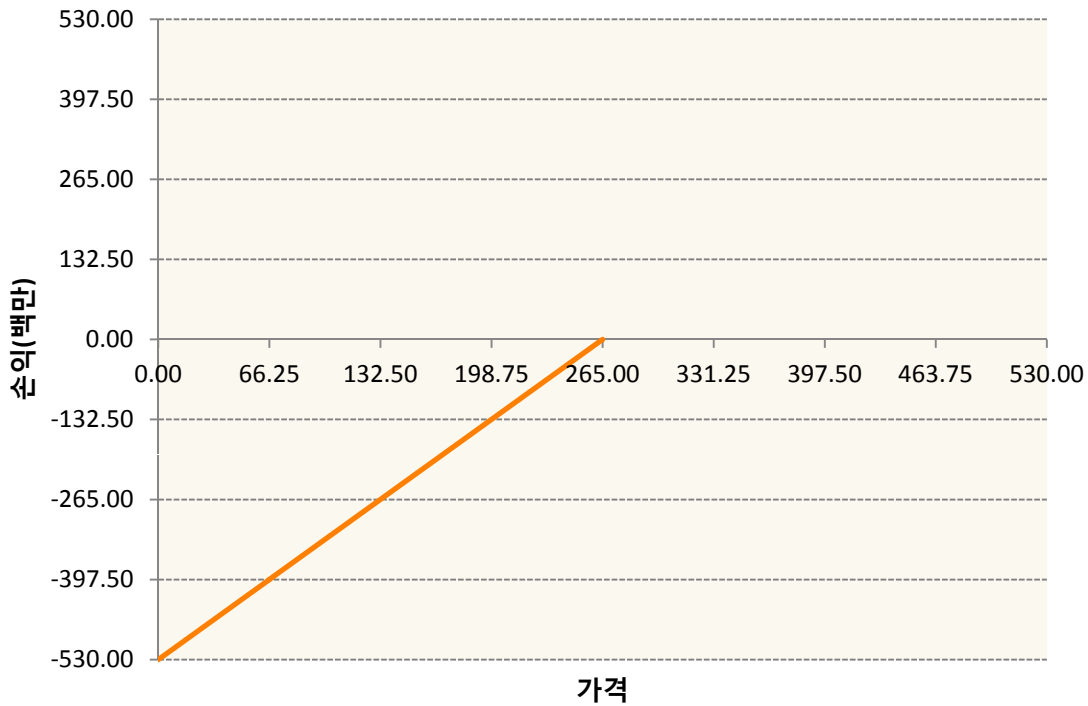


KR4301P62626-2019-06 풋262.5





KR4301P62659-2019-06 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | | | | | | | |
|--------------|---------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|-----|
| KR4101P60004 | | 2019-06 코스피200지수선물 | | | | | | 53 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 53 | 53 | 53 | 53 | 53 | 53 | 53 | |
| -5.33% | 35 | 35 | 35 | 35 | 35 | 35 | 35 | |
| -2.67% | 18 | 18 | 18 | 18 | 18 | 18 | 18 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | -18 | -18 | -18 | -18 | -18 | -18 | -18 | |
| 5.33% | -35 | -35 | -35 | -35 | -35 | -35 | -35 | |
| 8.00% | -53 | -53 | -53 | -53 | -53 | -53 | -53 | |
| KR4301P62626 | | 2019-06 풋262.5 | | | | | | 174 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|--|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -169 | -170 | -170 | -171 | -172 | -173 | -174 |
| -5.33% | -96 | -97 | -99 | -101 | -103 | -106 | -108 |
| -2.67% | -32 | -35 | -39 | -42 | -46 | -49 | -53 |
| 0% | 12 | 8 | 4 | 0 | -4 | -8 | -12 |
| 2.67% | 32 | 30 | 27 | 24 | 21 | 18 | 14 |
| 5.33% | 38 | 38 | 36 | 35 | 33 | 31 | 29 |
| 8.00% | 40 | 39 | 39 | 38 | 38 | 37 | 36 |
| KR4301P62659 2019-06 풋265 | | | | | | | 35 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -34 | -34 | -34 | -34 | -34 | -34 | -35 |
| -5.33% | -20 | -20 | -21 | -21 | -21 | -21 | -22 |
| -2.67% | -7 | -8 | -8 | -9 | -10 | -10 | -11 |
| 0% | 2 | 1 | 1 | 0 | -1 | -1 | -2 |
| 2.67% | 7 | 7 | 6 | 6 | 5 | 4 | 4 |
| 5.33% | 9 | 9 | 9 | 8 | 8 | 8 | 7 |
| 8.00% | 10 | 10 | 10 | 9 | 9 | 9 | 9 |

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

(단위:백만원)

262

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-20 |
| 기준일 | 2019-05-17 |

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

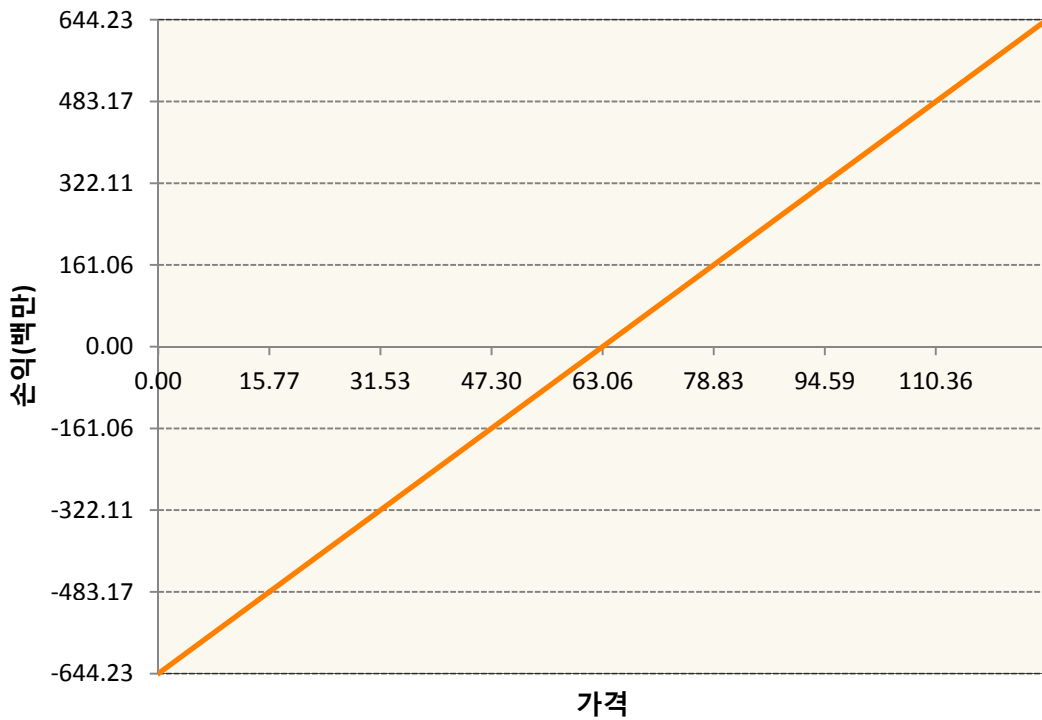
1. 계약금액

(단위:백만원)

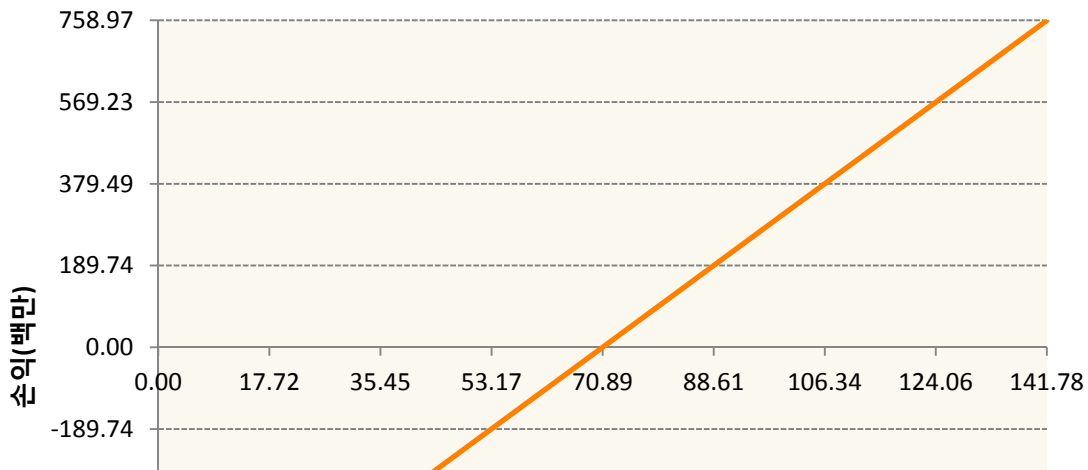
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,834 | 298 | 2,536 | |

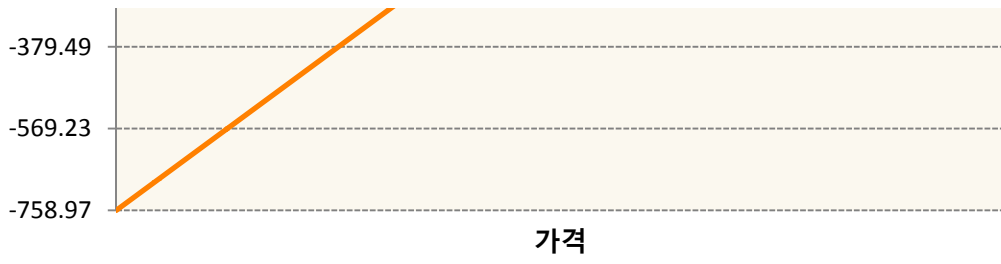
2. 만기시점의 손익구조

CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19

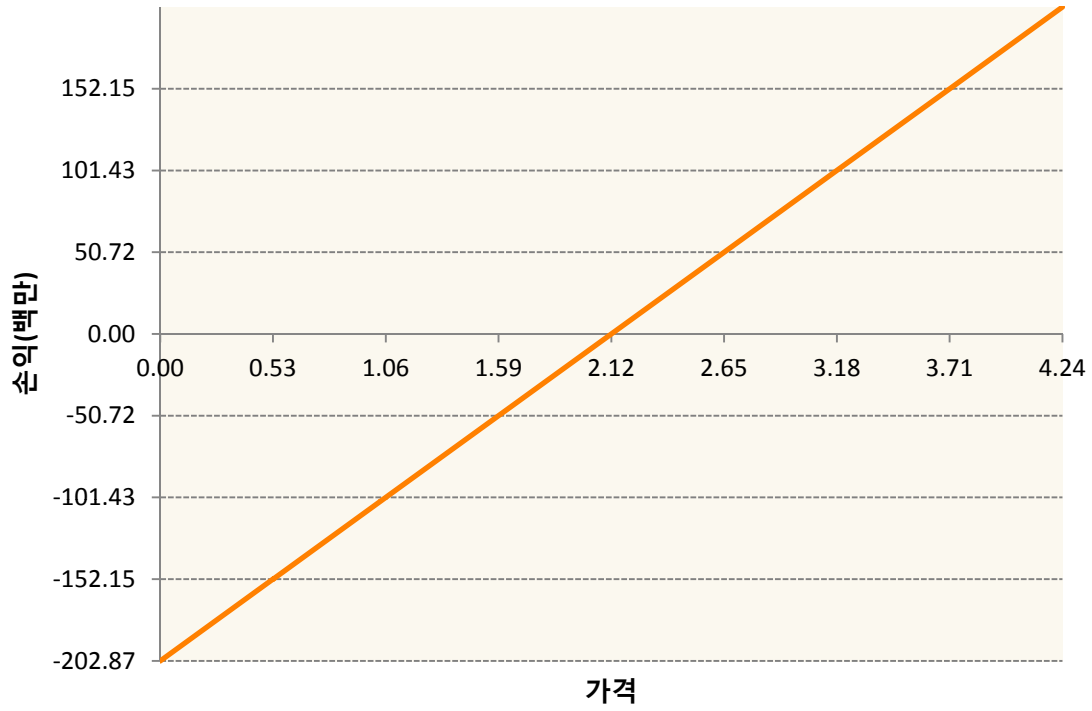


COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19

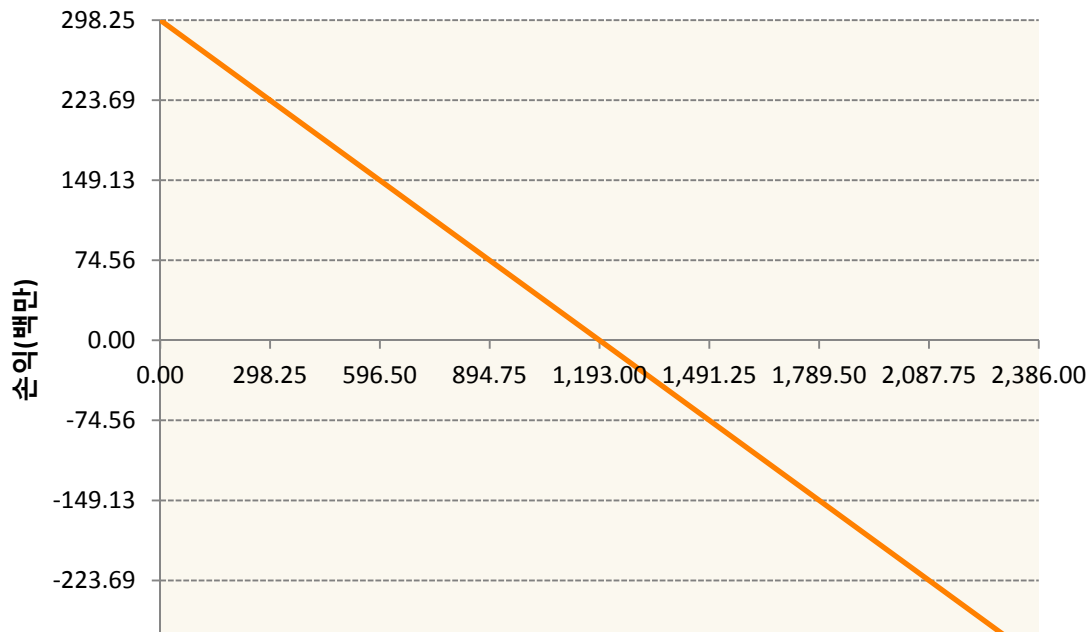


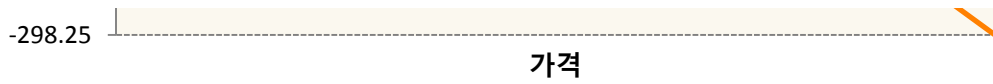


HON9-NY Harb ULSD Fut Jul19

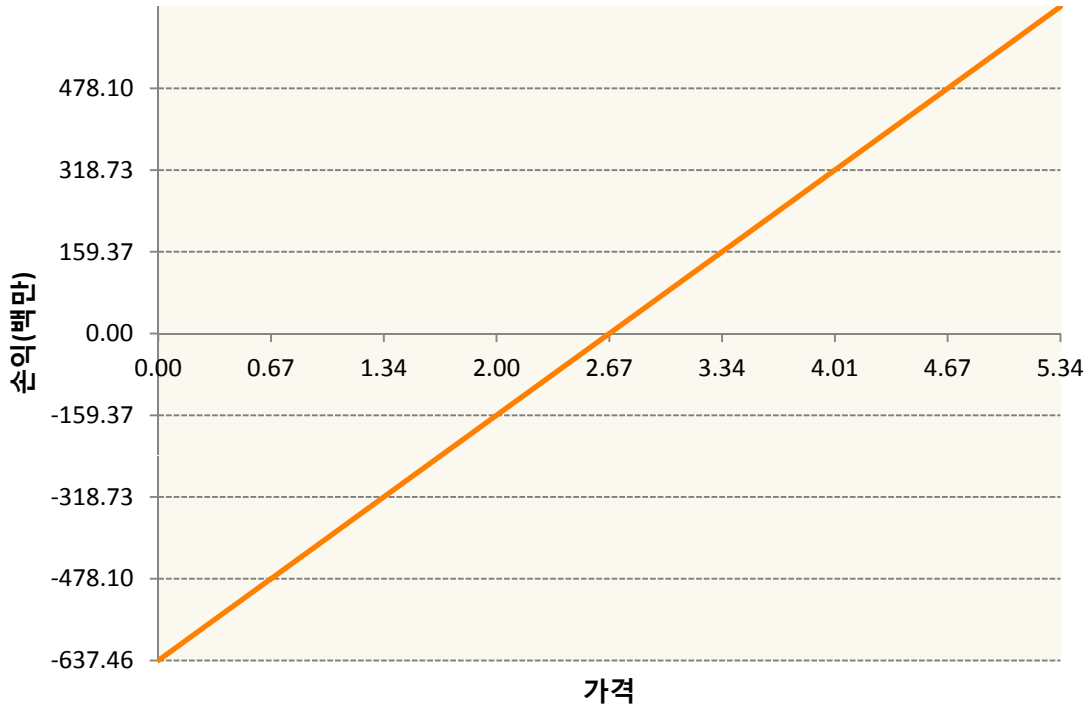


KR4175P60008-2019-06 달러선물

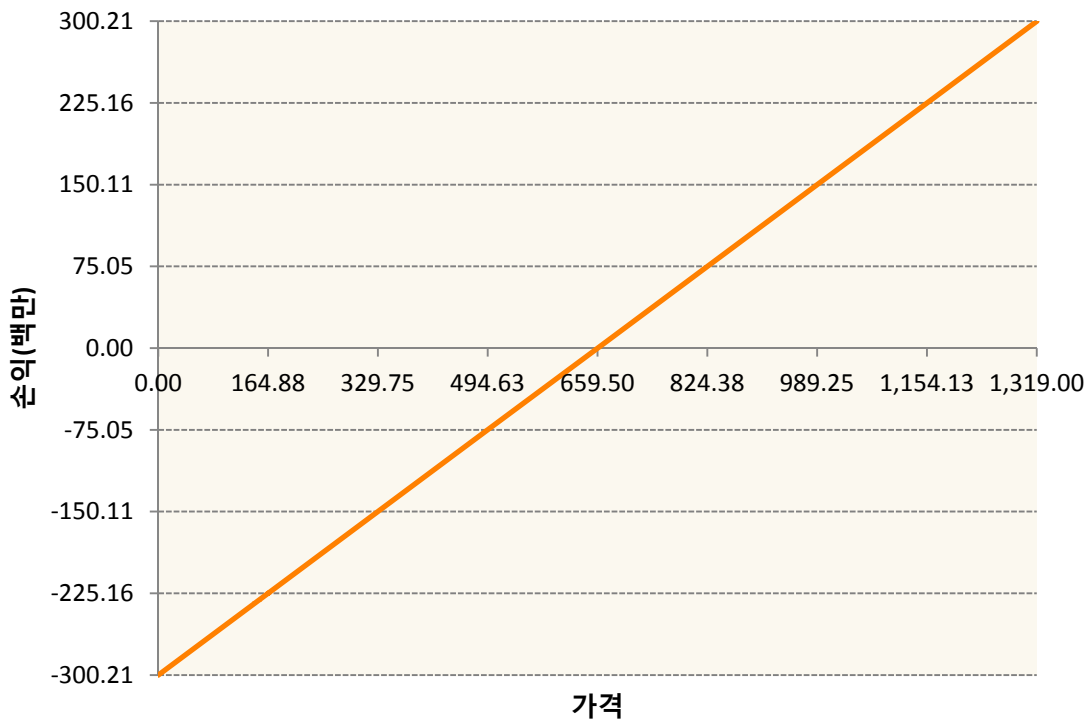




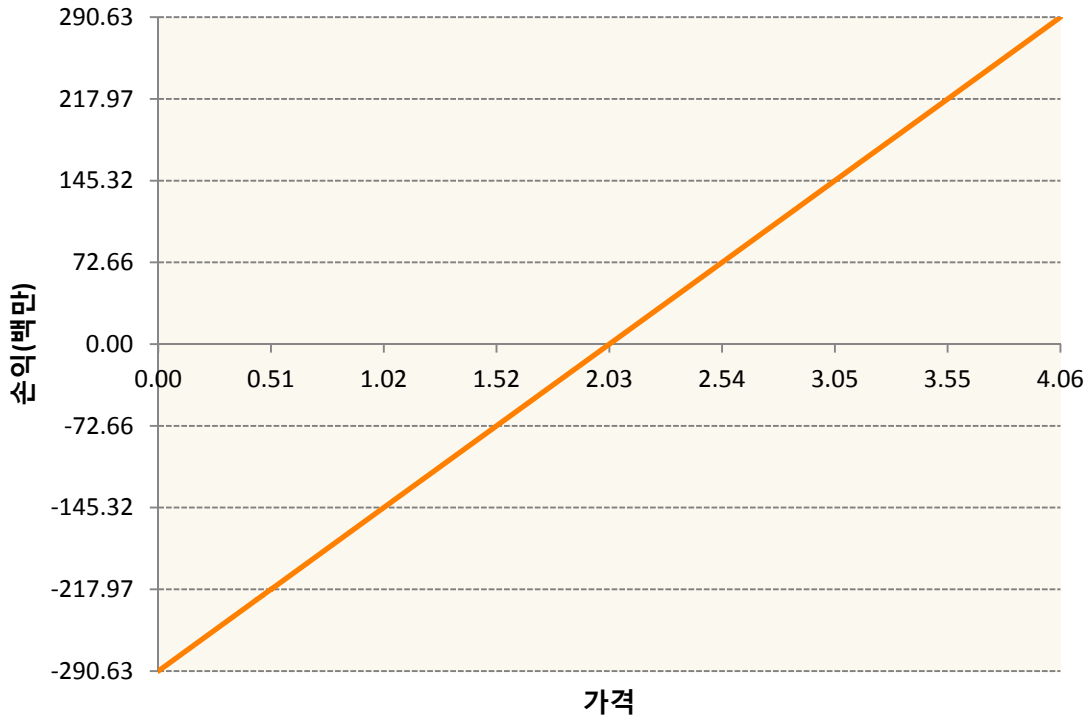
NGN19-NATURAL GAS FUTR Jul19



QSN9-Low Su Gasoil G Jul19



XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------------|-------------------------|----|
| CLN9 | WTI CRUDE FUTURE Jul19 | 52 |
| COU9 | BRENT CRUDE FUTR Sep19 | 61 |
| HON9 | NY Harb ULSD Fut Jul19 | 16 |
| KR4175P600 | 2019-06 달러선물 | 24 |
| NGN19 | NATURAL GAS FUTR Jul19 | 51 |
| QSN9 | Low Su Gasoil G Jul19 | 24 |
| XBN9 | GASOLINE RBOB FUT Jul19 | 23 |

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

(단위:백만원)

415

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-20 |
| 기준일 | 2019-05-17 |

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

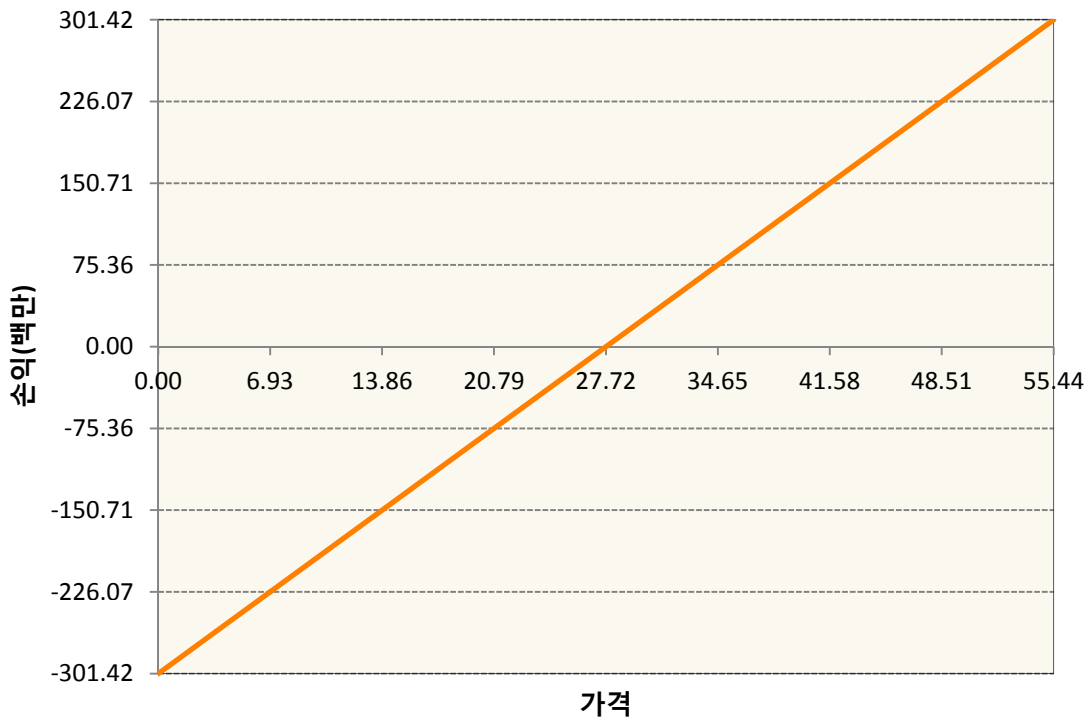
1. 계약금액

(단위:백만원)

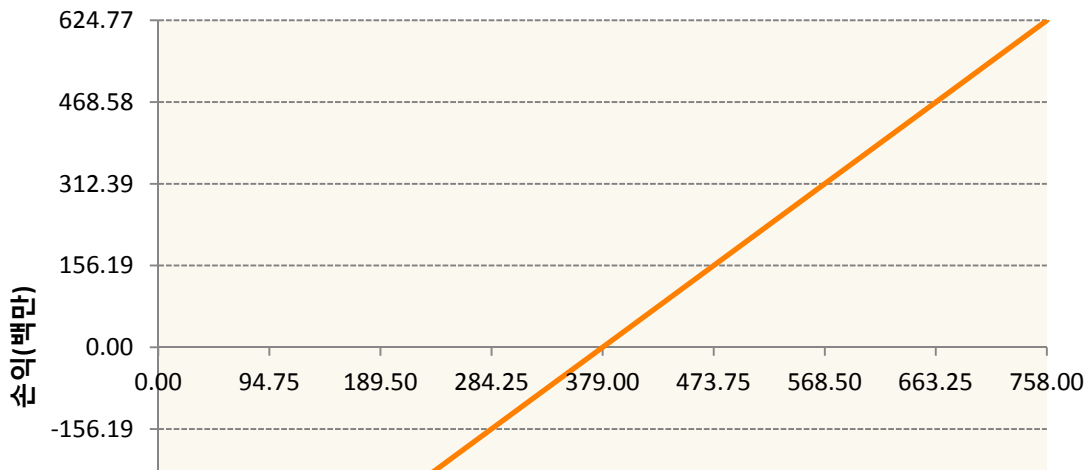
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,907 | 60 | 2,847 | |

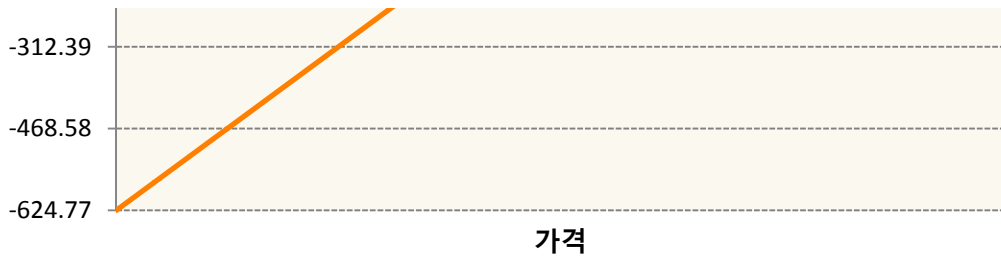
2. 만기시점의 손익구조

BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19

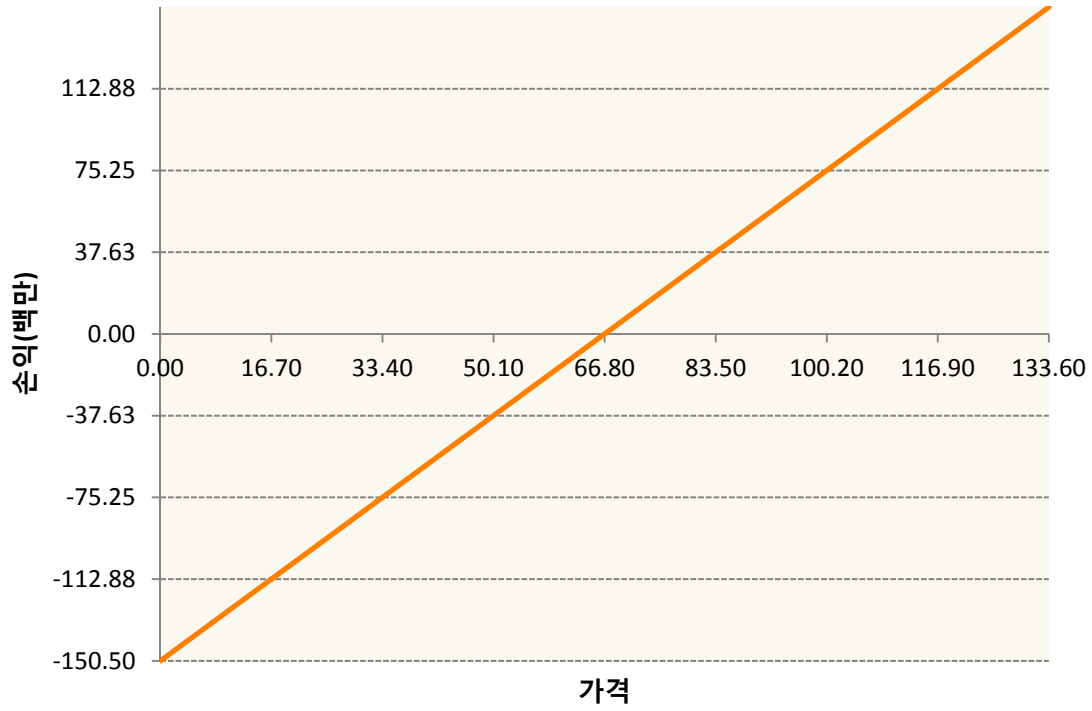


CN9-CORN FUTURE Jul19

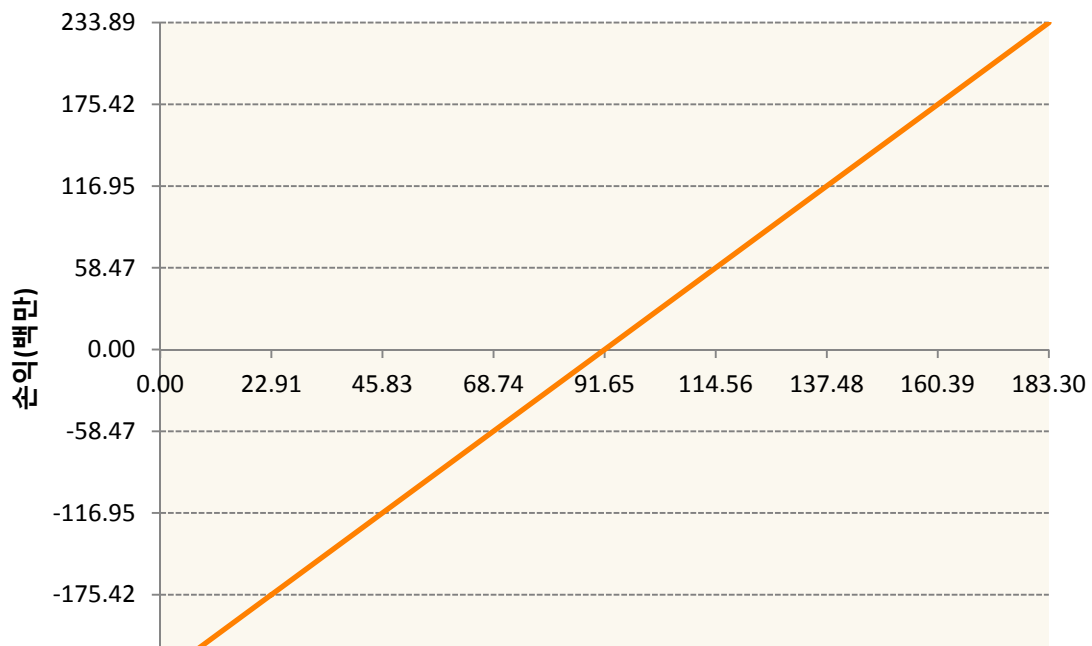


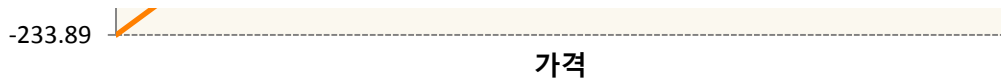


CTN9-COTTON NO.2 FUTR Jul19

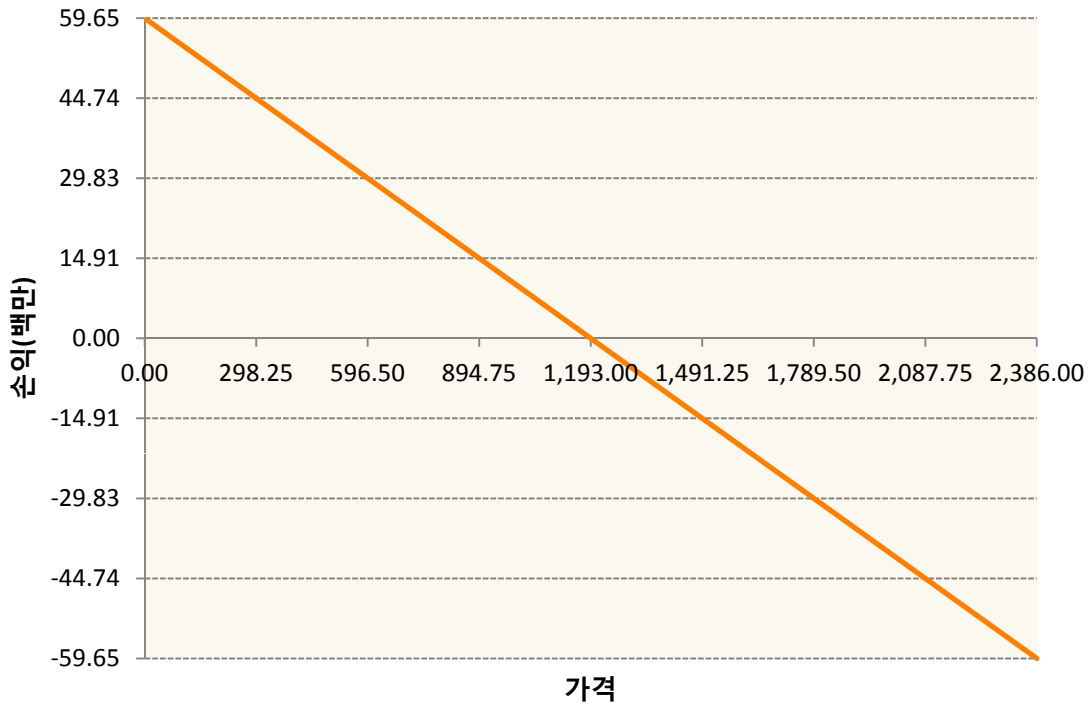


KCN9-COFFEE 'C' FUTURE Jul19

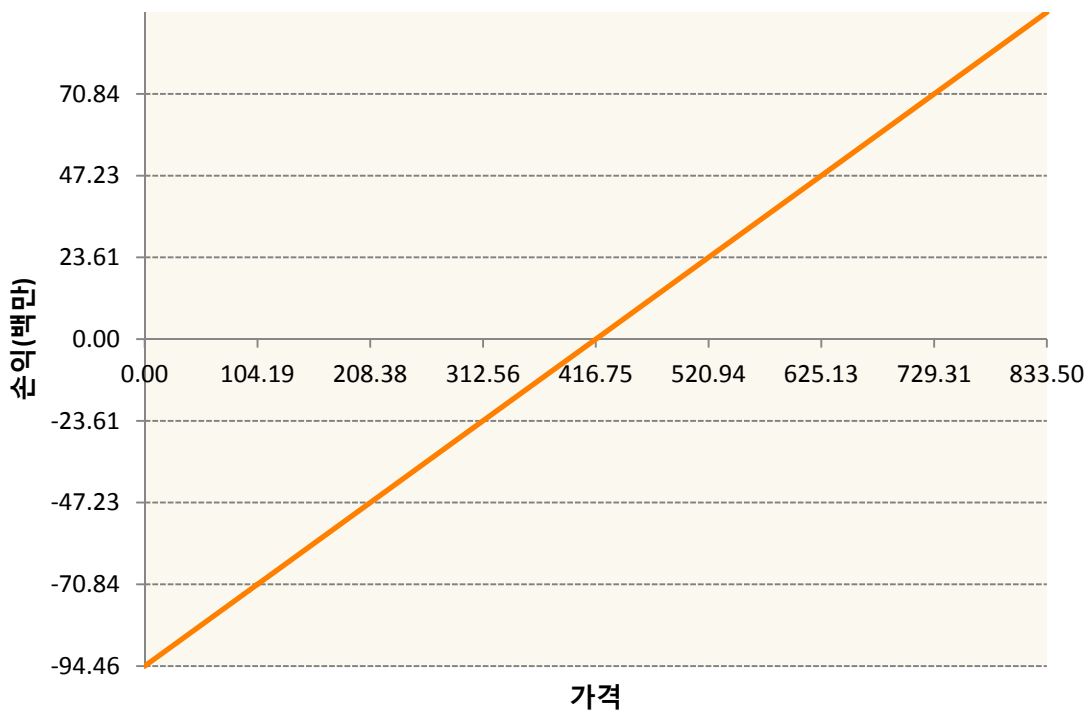




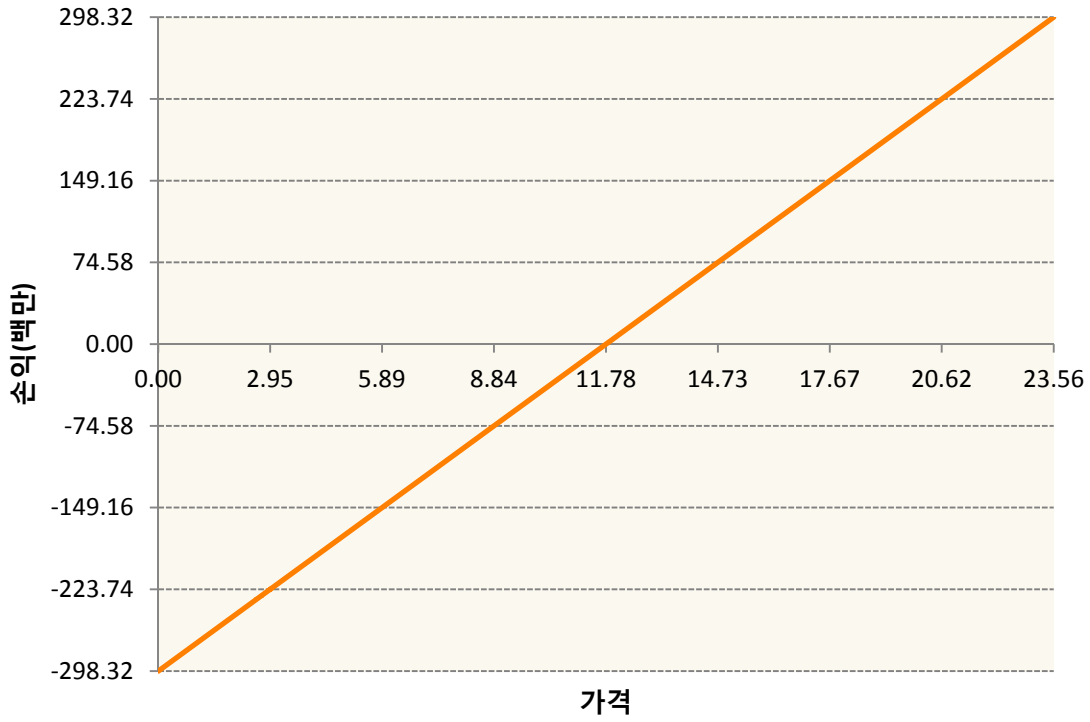
KR4175P60008-2019-06 달러선물



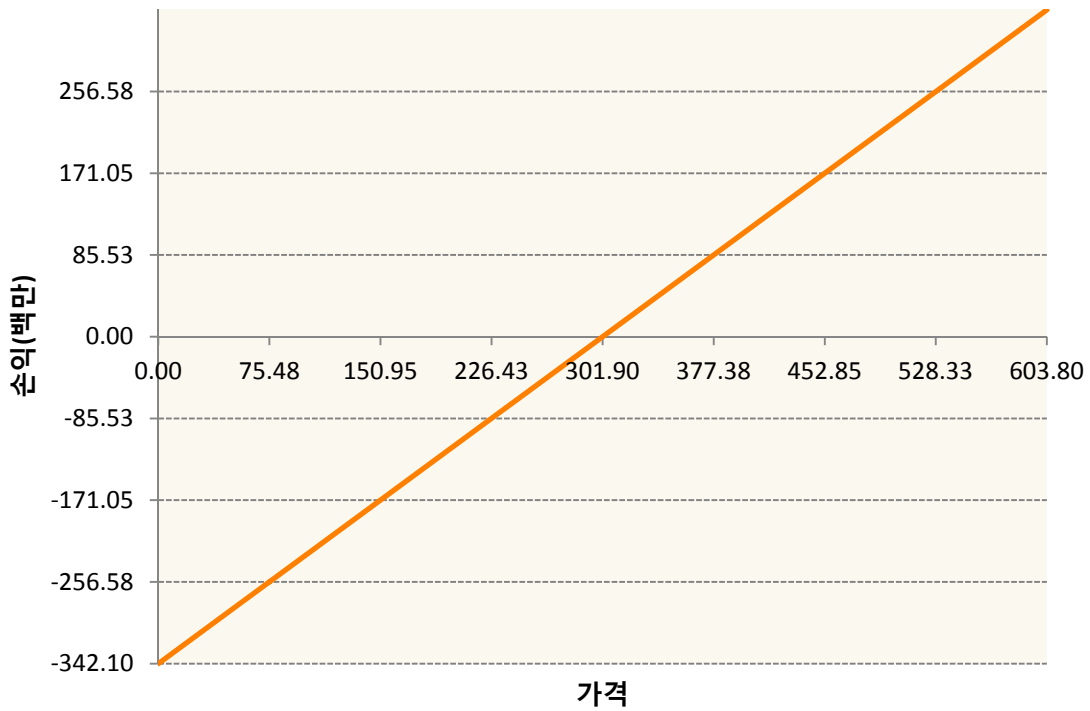
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



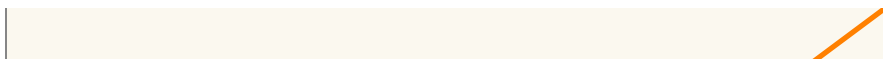
SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

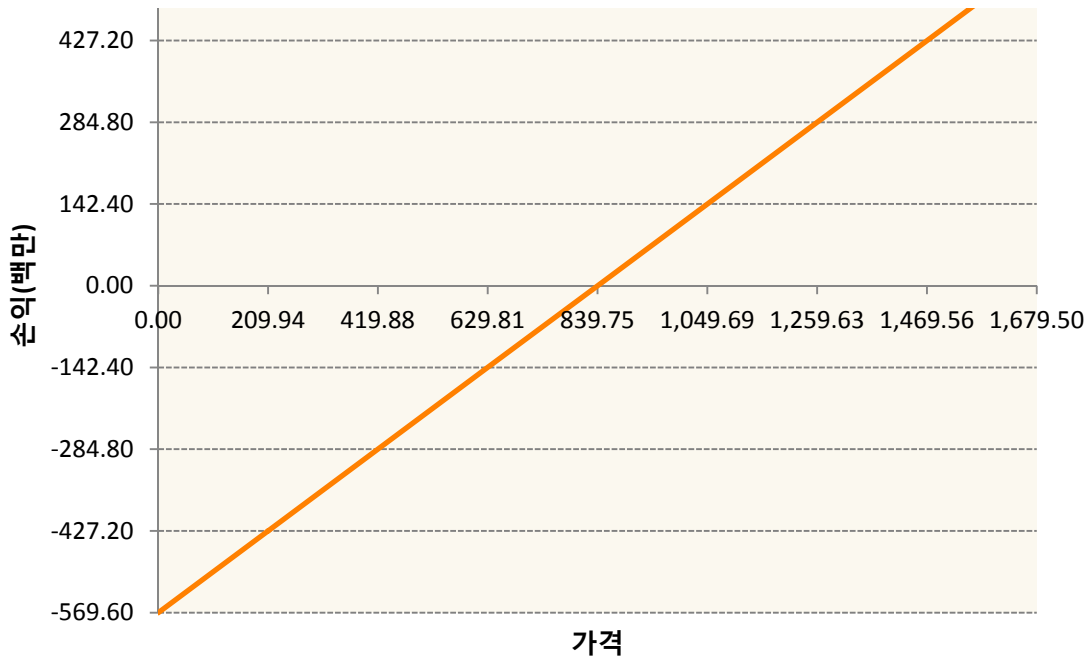


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19

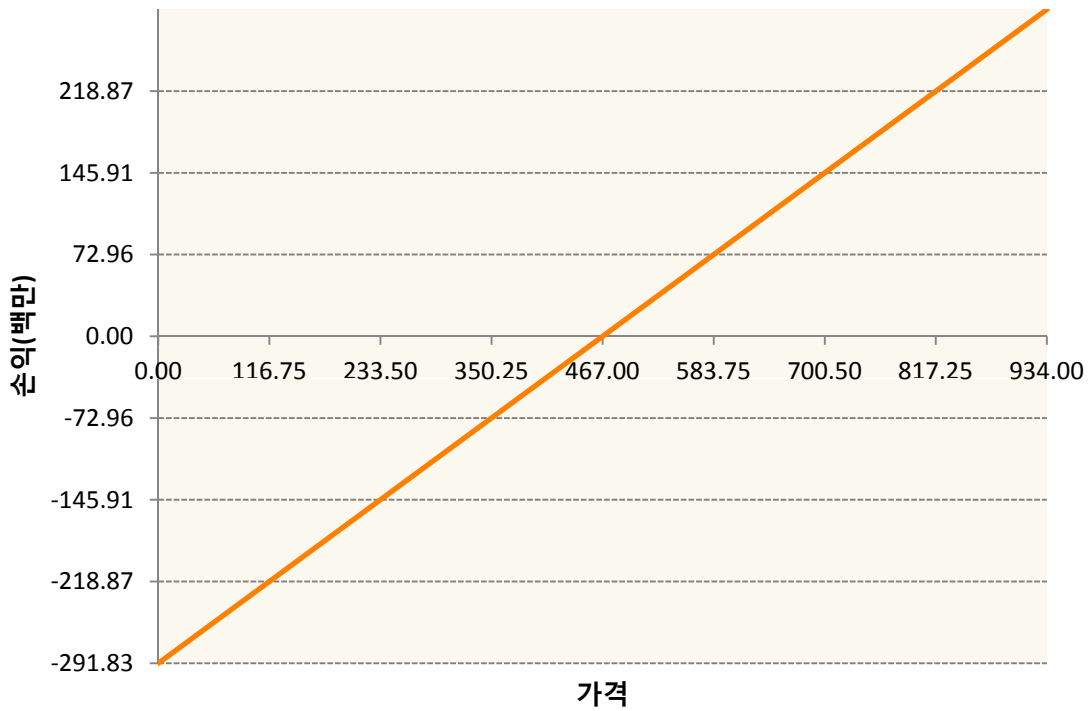


SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





WN9-WHEAT FUTURE(CBT) Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------------|-------------------------|----|
| BON9 | SOYBEAN OIL FUTR Jul19 | 24 |
| CN9 | CORN FUTURE Jul19 | 50 |
| CTN9 | COTTON NO.2 FUTR Jul19 | 12 |
| KCN9 | COFFEE 'C' FUTURE Jul19 | 19 |
| KR4175P600 | 2019-06 달러선물 | 5 |

| | | |
|------|-------------------------|----|
| KWN9 | KC HRW WHEAT FUT Jul19 | 8 |
| SBN9 | SUGAR #11 (WORLD) Jul19 | 24 |
| SMN9 | SOYBEAN MEAL FUTR Jul19 | 27 |
| SN9 | SOYBEAN FUTURE Jul19 | 46 |
| WN9 | WHEAT FUTURE(CBT) Jul19 | 23 |

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

(단위:백만원)

238