

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-27 |
| 기준일 | 2019-05-24 |

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)

89

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-27 |
| 기준일 | 2019-05-24 |

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 | 14,160 | 0 | 14,160 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S190522

1,117

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

668

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-27 |
| 기준일 | 2019-05-24 |

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) | 293 |
| SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규) | 80 |
| SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규) | 137 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|------------|
| 855 |
|------------|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-27 |
| 기준일 | 2019-05-24 |

유로인덱스모(주식-파생형)

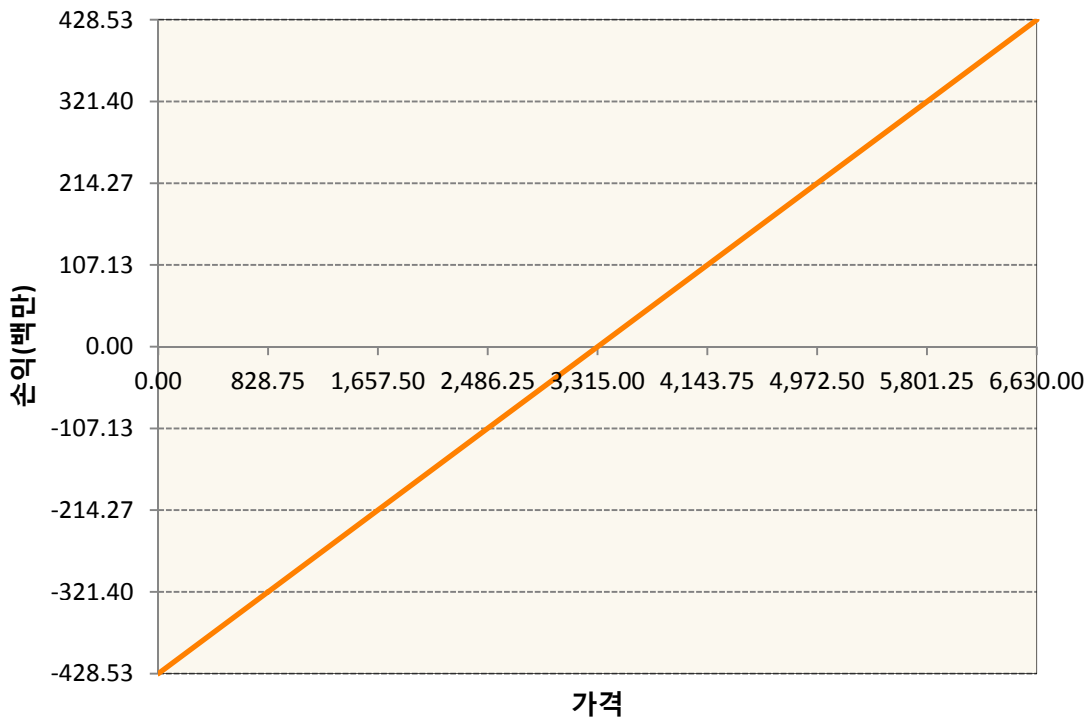
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 429 | 0 | 429 | |

2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------|---------------------|----|
| VGM9 | EURO STOXX 50 JUN19 | 34 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

| |
|----|
| 25 |
|----|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-27 |
| 기준일 | 2019-05-24 |

차이나인덱스모(주식-파생형)

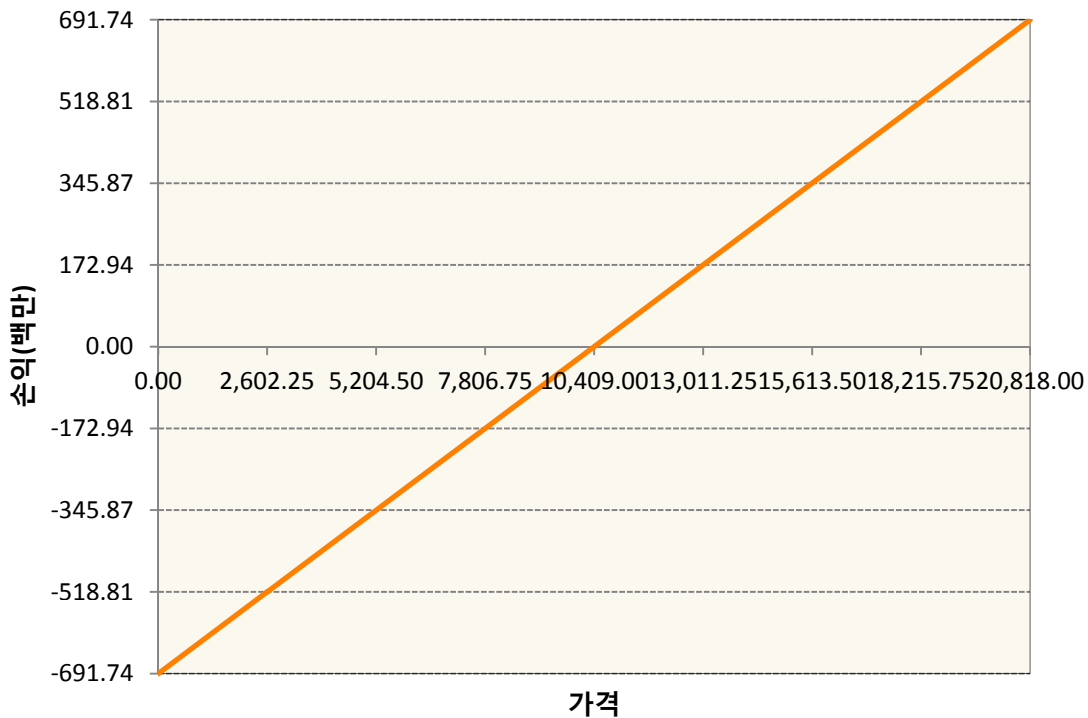
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 692 | 0 | 692 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------|---------------------|----|
| HCK9 | HSCEI Futures May19 | 55 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

| |
|----|
| 57 |
|----|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-27 |
| 기준일 | 2019-05-24 |

커버드콜모(주식혼합-파생형)

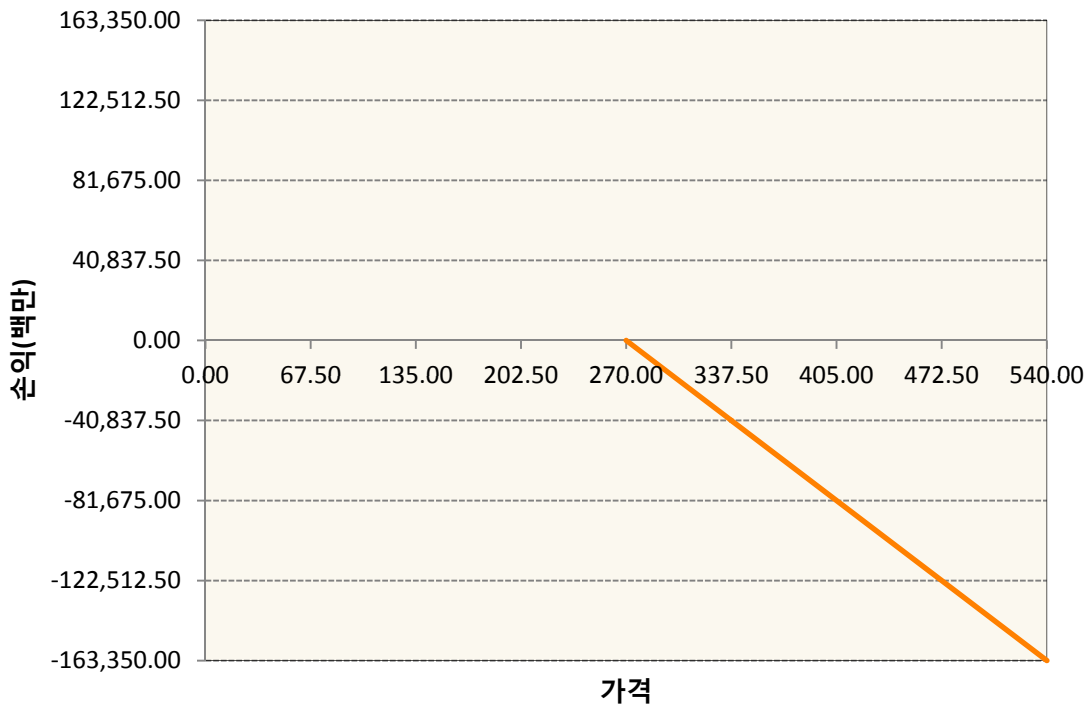
1. 계약금액

(단위:백만원)

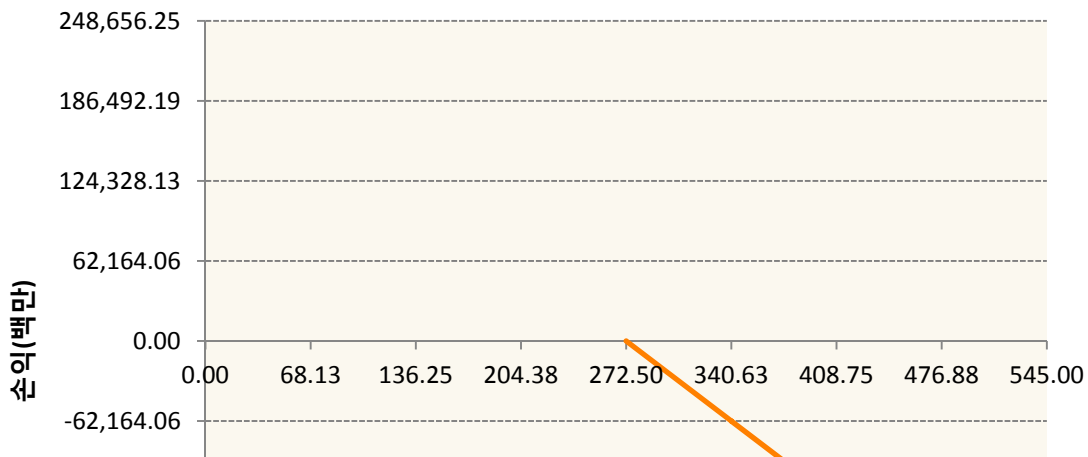
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 614,506 | -614,506 | 장내 |

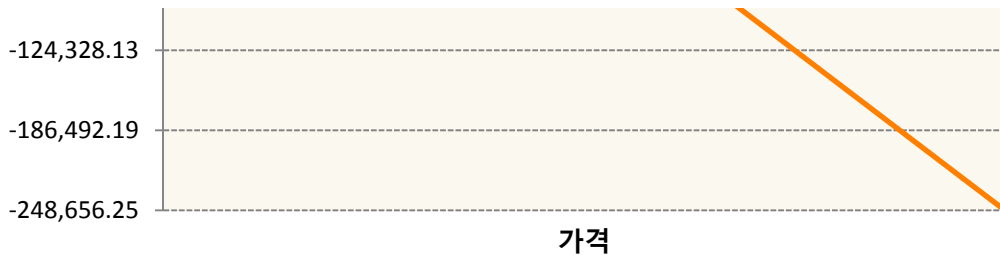
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P62701-2019-06 콜270



KR4201P62727-2019-06 콜272.5





KR4301P62709-2019-06 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4201P62701 | | 2019-06 콜270 | | | | | 8,624 |
|--------------|---------|----------------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 2,359 | 2,332 | 2,290 | 2,231 | 2,155 | 2,062 | 1,954 |
| -5.33% | 2,251 | 2,164 | 2,055 | 1,925 | 1,776 | 1,610 | 1,430 |
| -2.67% | 1,866 | 1,677 | 1,470 | 1,247 | 1,012 | 766 | 512 |
| 0% | 888 | 597 | 300 | 0 | -304 | -610 | -918 |
| 2.67% | -978 | -1,302 | -1,627 | -1,952 | -2,277 | -2,603 | -2,928 |
| 5.33% | -3,791 | -4,059 | -4,338 | -4,625 | -4,918 | -5,216 | -5,518 |
| 8.00% | -7,342 | -7,511 | -7,702 | -7,911 | -8,136 | -8,375 | -8,624 |
| KR4201P62727 | | 2019-06 콜272.5 | | | | | 12,055 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 2,841 | 2,814 | 2,770 | 2,704 | 2,615 | 2,503 | 2,367 |

| | | | | | | | | |
|--|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|--|
| -5.33% | 2,741 | 2,646 | 2,520 | 2,362 | 2,176 | 1,963 | 1,726 | |
| -2.67% | 2,344 | 2,114 | 1,850 | 1,559 | 1,244 | 910 | 559 | |
| 0% | 1,232 | 835 | 423 | 0 | -433 | -873 | -1,319 | |
| 2.67% | -1,082 | -1,575 | -2,067 | -2,560 | -3,054 | -3,547 | -4,040 | |
| 5.33% | -4,832 | -5,285 | -5,745 | -6,213 | -6,685 | -7,161 | -7,640 | |
| 8.00% | -9,833 | -10,148 | -10,491 | -10,857 | -11,242 | -11,642 | -12,055 | |
| KR4301P62709 2019-06 풋270 | | | | | | | 14,443 | |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -14,386 | -14,387 | -14,390 | -14,395 | -14,405 | -14,420 | -14,443 | |
| -5.33% | -9,114 | -9,127 | -9,149 | -9,182 | -9,228 | -9,286 | -9,357 | |
| -2.67% | -3,947 | -4,025 | -4,121 | -4,234 | -4,363 | -4,505 | -4,659 | |
| 0% | 646 | 439 | 223 | 0 | -229 | -462 | -698 | |
| 2.67% | 3,813 | 3,551 | 3,289 | 3,026 | 2,762 | 2,498 | 2,235 | |
| 5.33% | 5,262 | 5,096 | 4,915 | 4,722 | 4,518 | 4,307 | 4,088 | |
| 8.00% | 5,662 | 5,607 | 5,533 | 5,441 | 5,333 | 5,209 | 5,072 | |

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

(단위:백만원)

34,933

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-27 |
| 기준일 | 2019-05-24 |

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

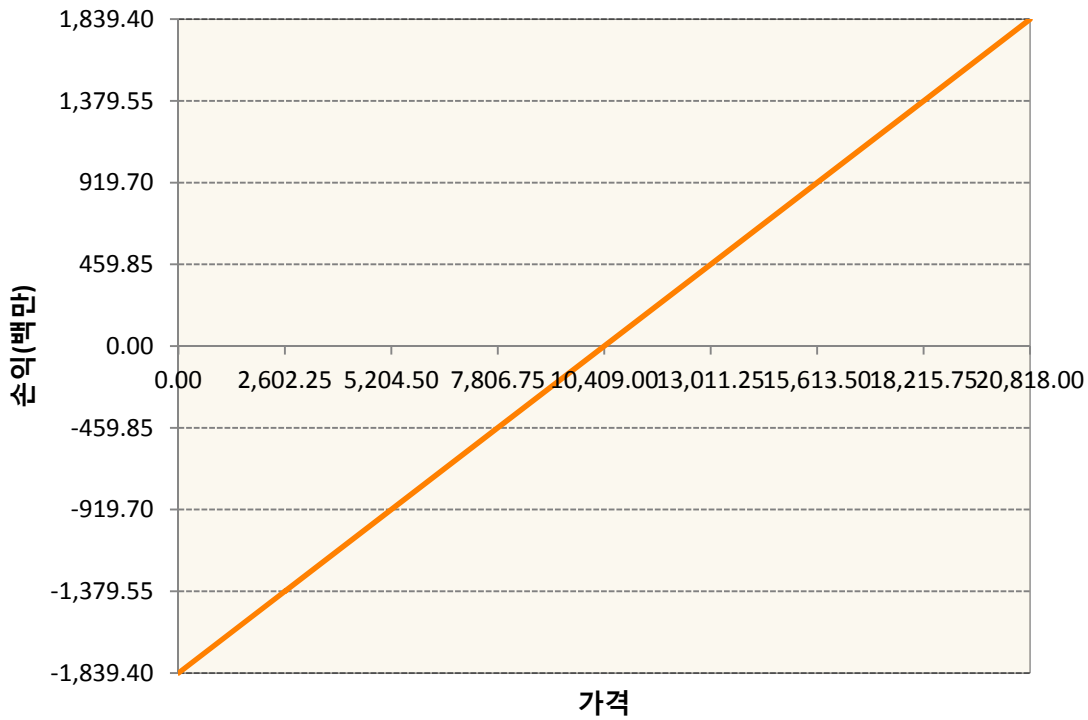
1. 계약금액

(단위:백만원)

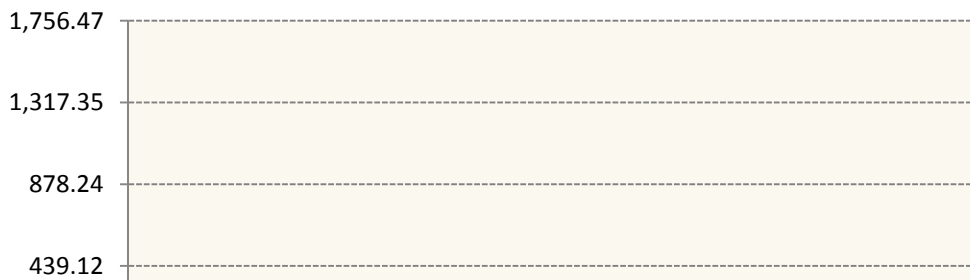
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,839 | 0 | 1,839 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 5,639 | -5,639 | 장내 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 151 | 3,180 | -3,028 | 장외 |

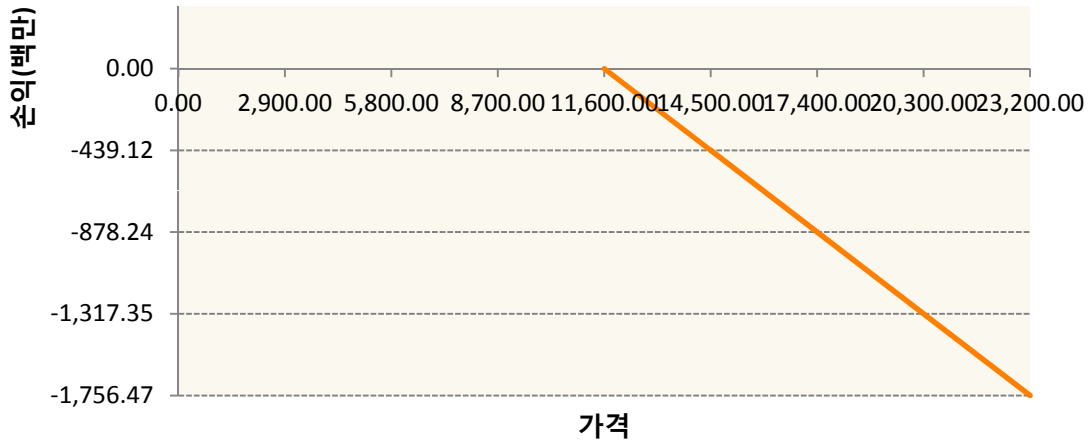
2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19

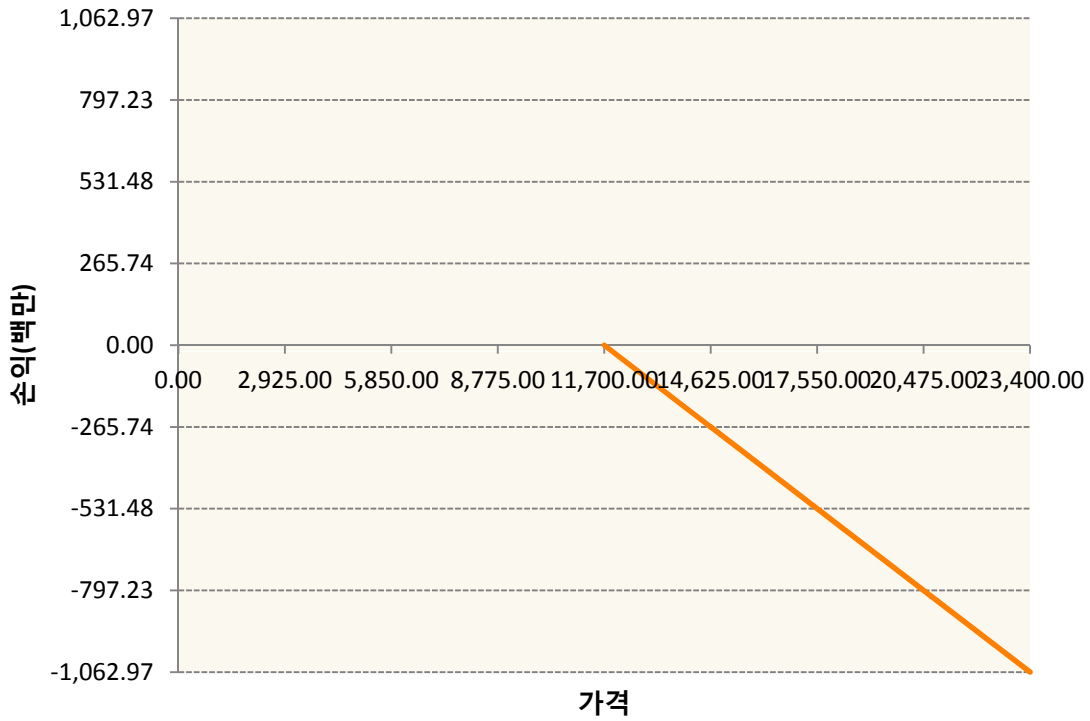


OHHIK9-C116-HSCEI

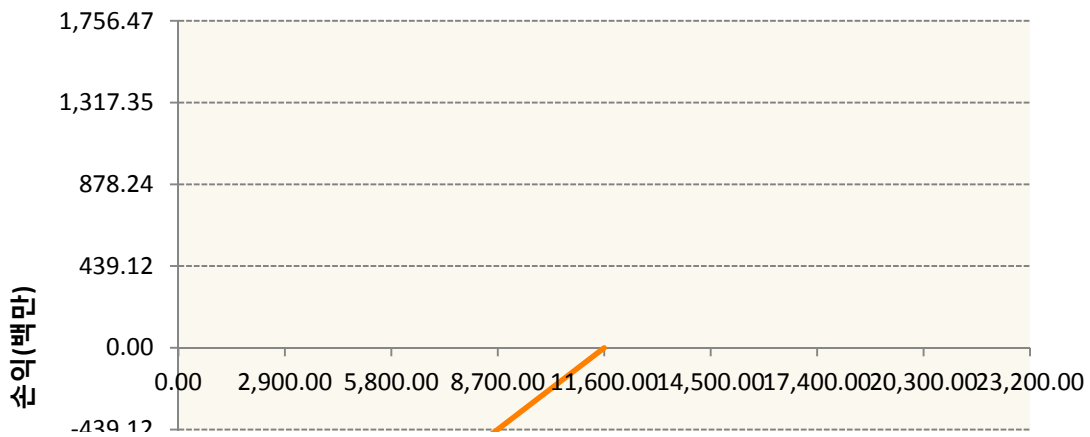


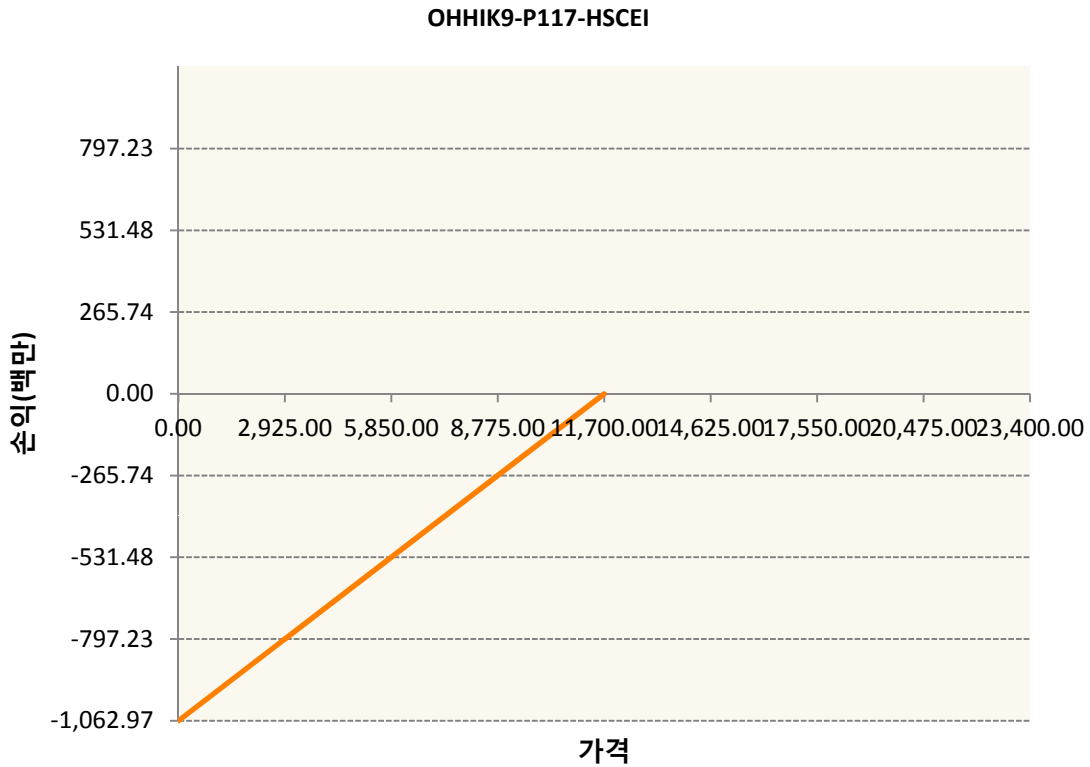


OHHIK9-C117-HSCEI



OHHIK9-P116-HSCEI





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | (단위:백만원) |
|------------------------------|----------|
| FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E | 254 |
| FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E | 12 |
| HCK9 HSCEI Futures May19 | 147 |
| OHHIK9-C11 HSCEI | 141 |
| OHHIK9-C11 HSCEI | 85 |
| OHHIK9-P11 HSCEI | 141 |
| OHHIK9-P11 HSCEI | 85 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|--|------------|
| | 702 |

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-27 |
| 기준일 | 2019-05-24 |

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

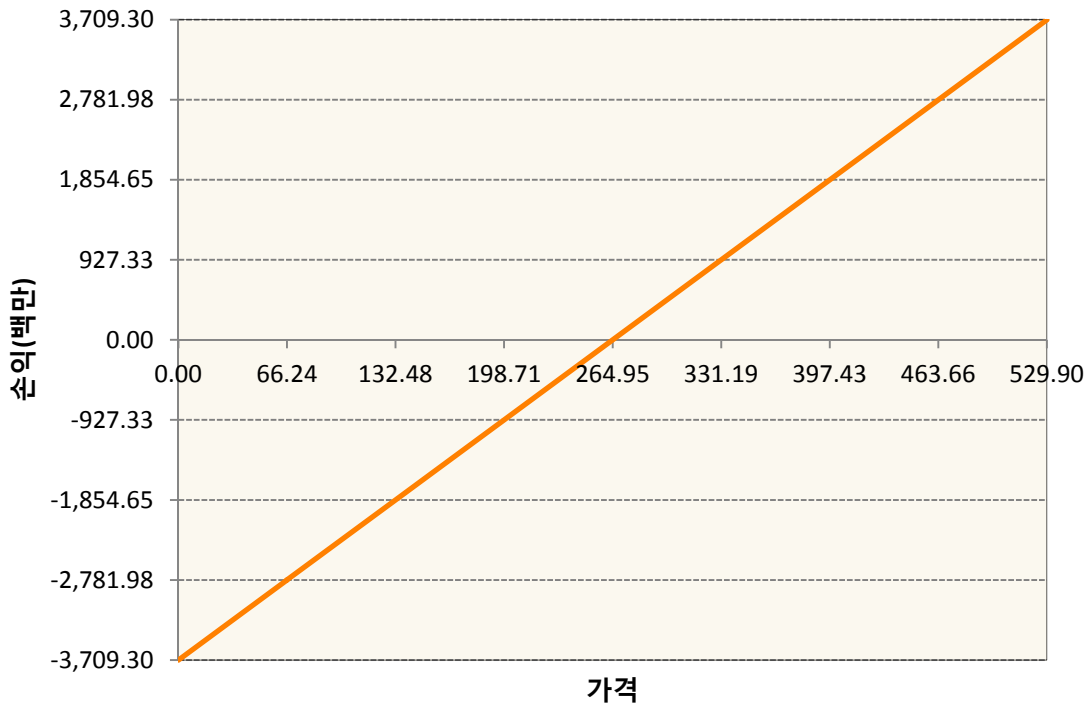
1. 계약금액

(단위:백만원)

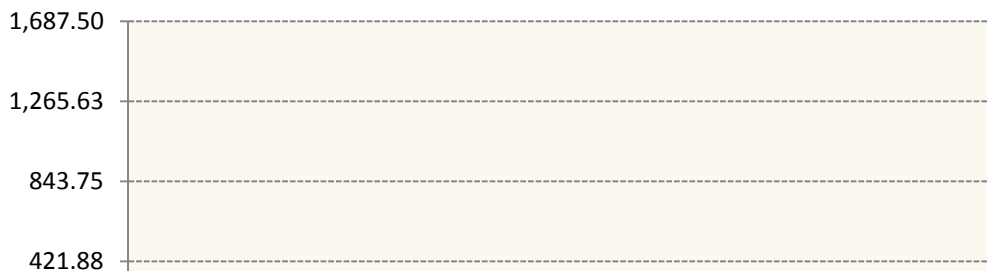
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,709 | 0 | 3,709 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 20,836 | 0 | 20,836 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 21,759 | -21,759 | 장내 |

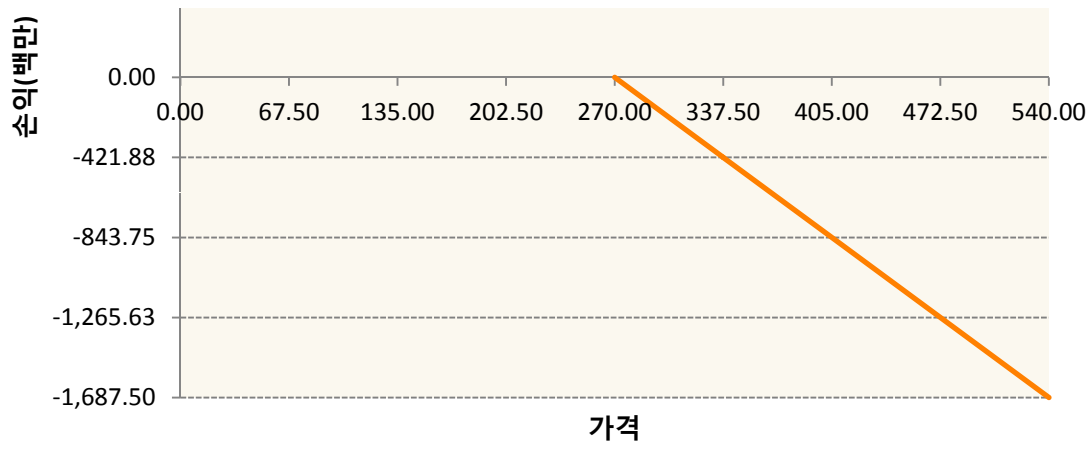
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

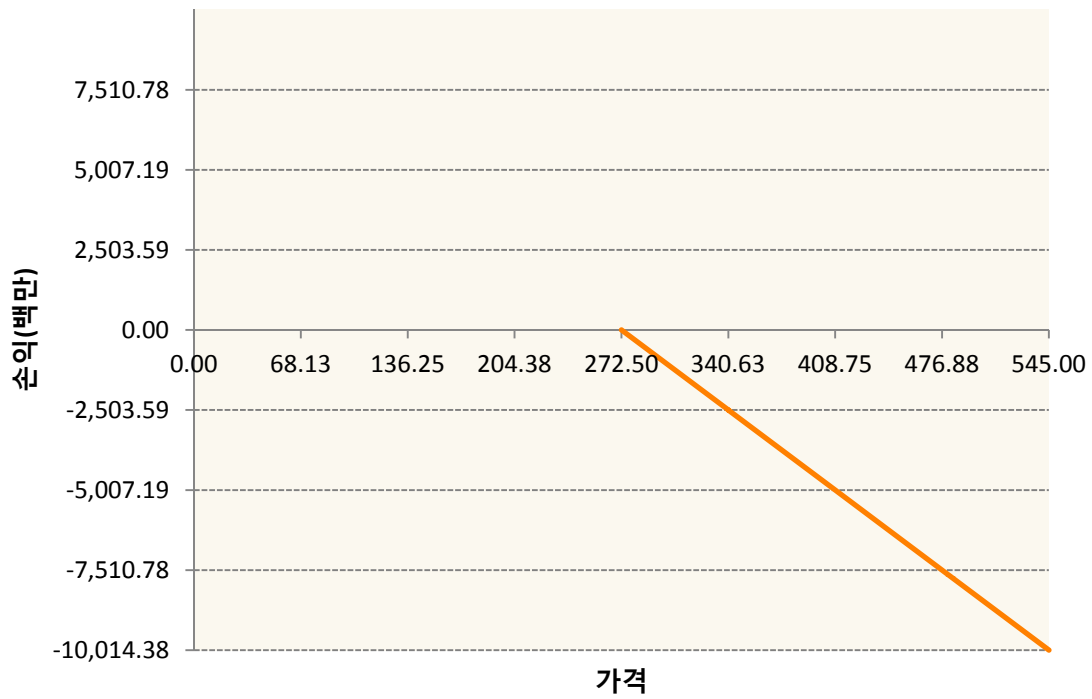


KR4201P62701-2019-06 콜270

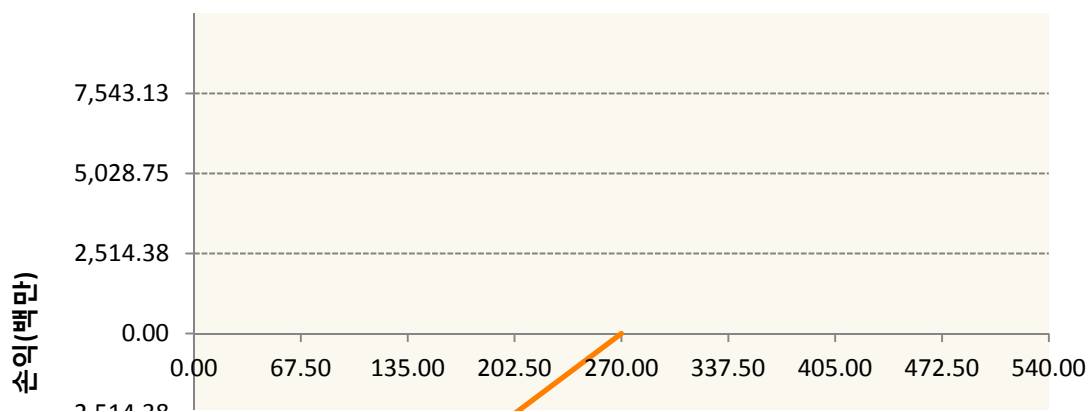


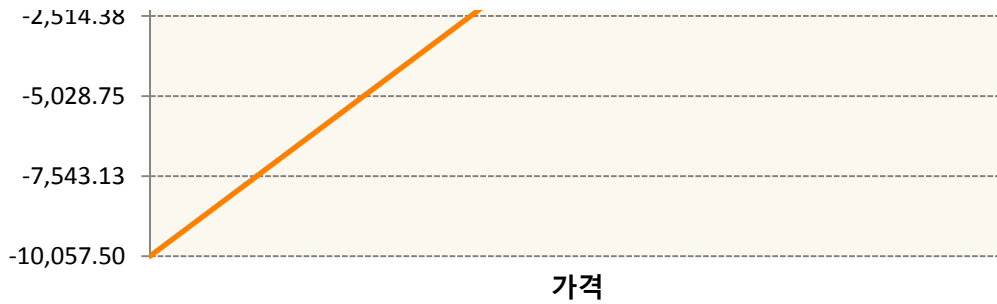


KR4201P62727-2019-06 콜272.5



KR4301P62709-2019-06 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| 2.529E+11 | | UBCSFXC1 INDEX_14 | | | | | | 1,191 |
|--------------|---------|--------------------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -1,191 | -1,191 | -1,191 | -1,191 | -1,191 | -1,191 | -1,191 | |
| -5.33% | -794 | -794 | -794 | -794 | -794 | -794 | -794 | |
| -2.67% | -397 | -397 | -397 | -397 | -397 | -397 | -397 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 397 | 397 | 397 | 397 | 397 | 397 | 397 | |
| 5.33% | 794 | 794 | 794 | 794 | 794 | 794 | 794 | |
| 8.00% | 1,191 | 1,191 | 1,191 | 1,191 | 1,191 | 1,191 | 1,191 | |
| 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% | 24 | 24 | 24 | 23 | 22 | 21 | 20 |
| -5.33% | 23 | 22 | 21 | 20 | 18 | 17 | 15 |
| -2.67% | 19 | 17 | 15 | 13 | 10 | 8 | 5 |
| 0% | 9 | 6 | 3 | 0 | -3 | -6 | -9 |
| 2.67% | -10 | -13 | -17 | -20 | -24 | -27 | -30 |
| 5.33% | -39 | -42 | -45 | -48 | -51 | -54 | -57 |
| 8.00% | -76 | -78 | -80 | -82 | -84 | -87 | -89 |

KR4201P62727 2019-06 콜272.5 486

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 114 | 113 | 112 | 109 | 105 | 101 | 95 |
| -5.33% | 110 | 107 | 101 | 95 | 88 | 79 | 69 |
| -2.67% | 94 | 85 | 75 | 63 | 50 | 37 | 23 |
| 0% | 50 | 34 | 17 | 0 | -17 | -35 | -53 |
| 2.67% | -44 | -63 | -83 | -103 | -123 | -143 | -163 |
| 5.33% | -195 | -213 | -231 | -250 | -269 | -288 | -308 |
| 8.00% | -396 | -409 | -423 | -437 | -453 | -469 | -486 |

KR4301P62709 2019-06 풋270 717

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -715 | -715 | -715 | -715 | -715 | -716 | -717 |
| -5.33% | -453 | -453 | -454 | -456 | -458 | -461 | -465 |
| -2.67% | -196 | -200 | -205 | -210 | -217 | -224 | -231 |
| 0% | 32 | 22 | 11 | 0 | -11 | -23 | -35 |
| 2.67% | 189 | 176 | 163 | 150 | 137 | 124 | 111 |
| 5.33% | 261 | 253 | 244 | 235 | 224 | 214 | 203 |
| 8.00% | 281 | 278 | 275 | 270 | 265 | 259 | 252 |

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

(단위:백만원)

3,364

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-27 |
| 기준일 | 2019-05-24 |

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

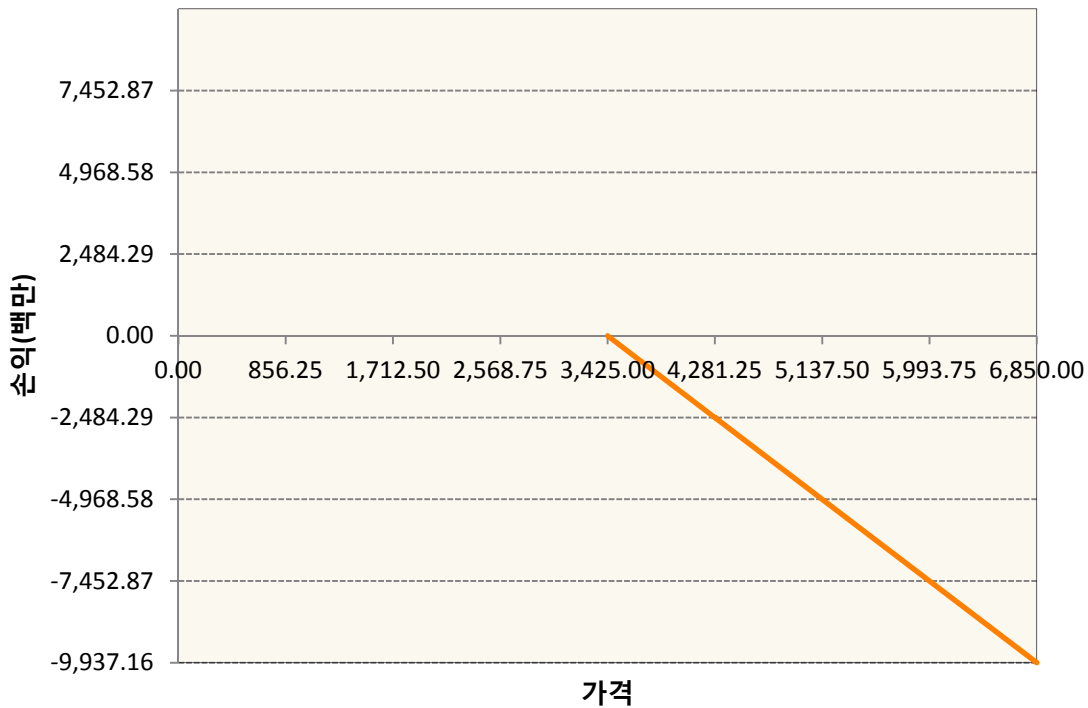
1. 계약금액

(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 | 3,624 | 0 | 3,624 | |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 56,338 | 0 | 56,338 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 20,425 | -20,425 | 장내 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 18,633 | -18,633 | 장외 |

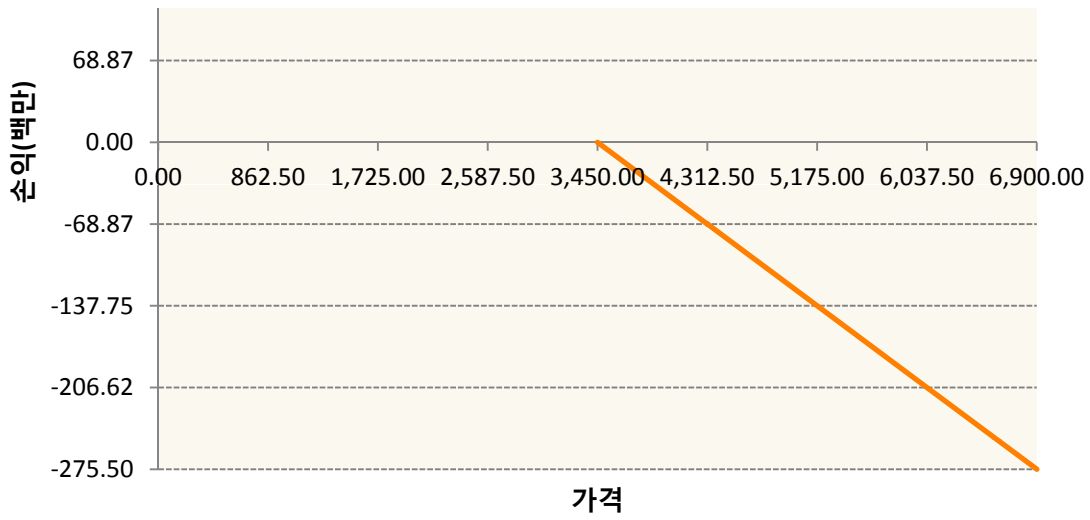
2. 만기시점의 손익구조

OESXM9-C3425-EURO STOXX 50

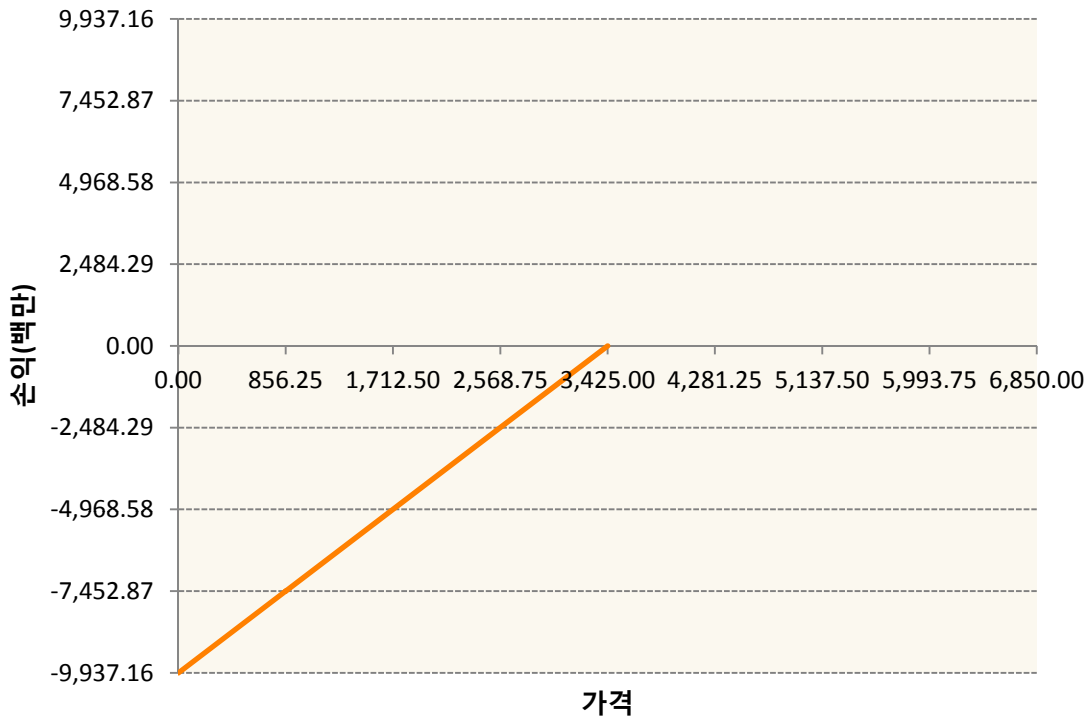


OESXM9-C3450-EURO STOXX 50

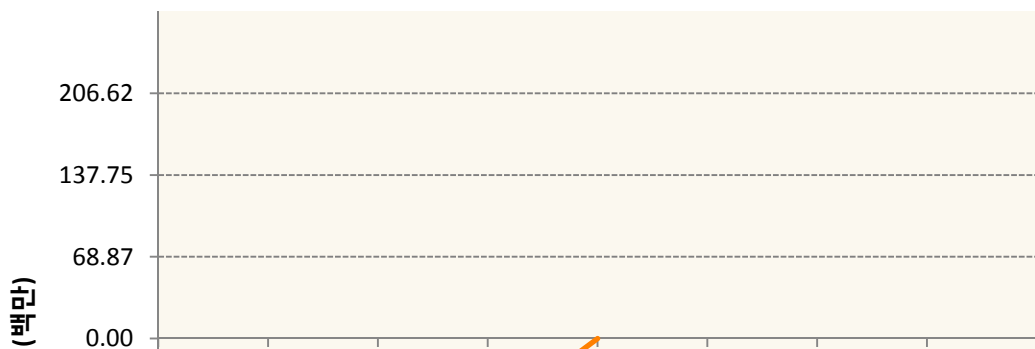


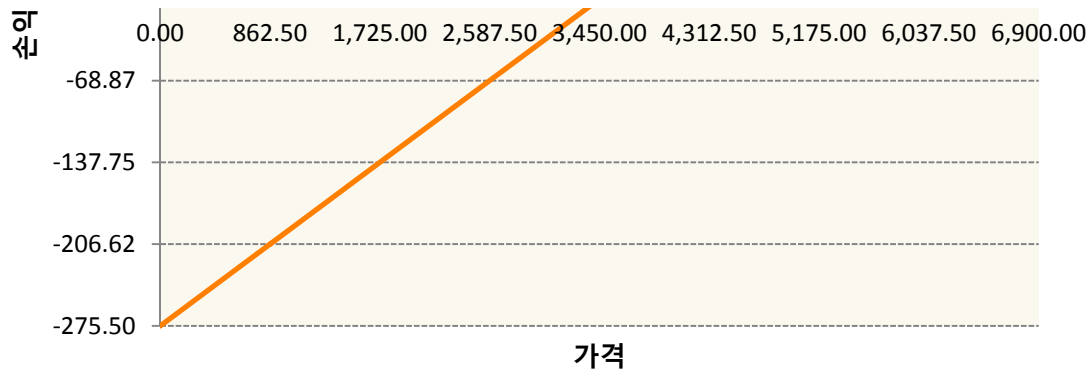


OESXM9-P3425-EURO STOXX 50

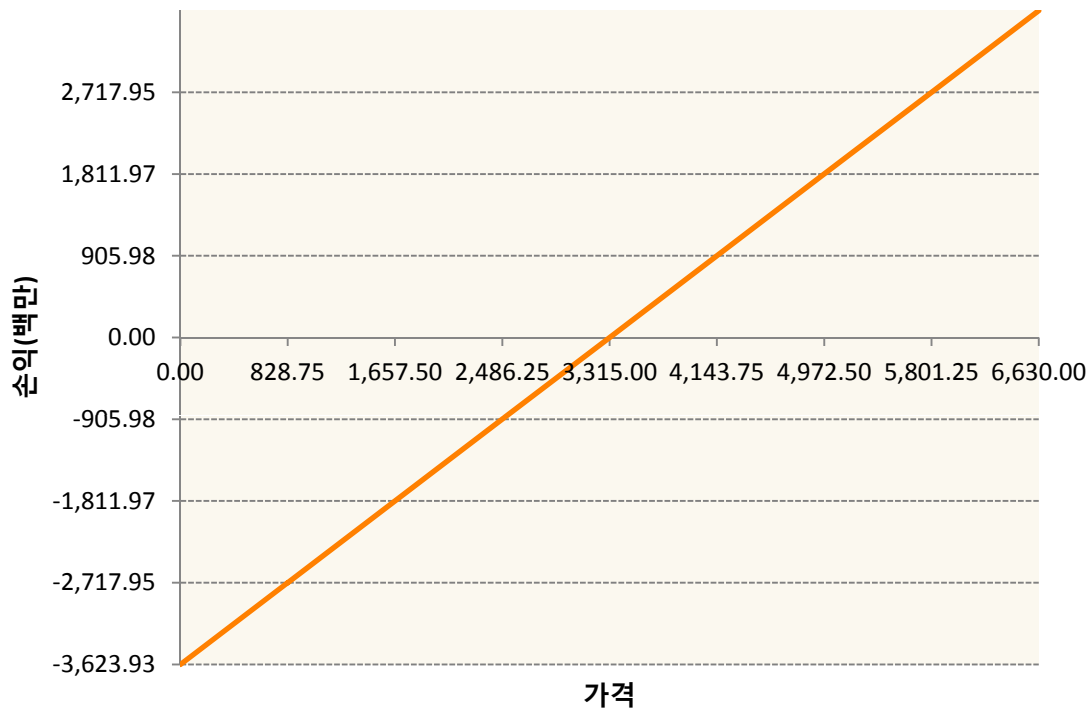


OESXM9-P3450-EURO STOXX 50





VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|-----|
| 260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY | 107 |
| FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E | 852 |
| FX21019J01: KRW/EUR 28-06-19E | 213 |
| FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E | 426 |
| OESXM9-C3·EURO STOXX 50 | 795 |
| OESXM9-C3·EURO STOXX 50 | 22 |
| OESXM9-P3·EURO STOXX 50 | 795 |
| OESXM9-P3·EURO STOXX 50 | 22 |
| VGM9 EURO STOXX 50 JUN19 | 290 |

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

(단위:백만원)

2,248

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

(단위:백만원)

1,014

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

(단위:백만원)

89

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

(단위:백만원)

129

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-27 |
| 기준일 | 2019-05-24 |

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

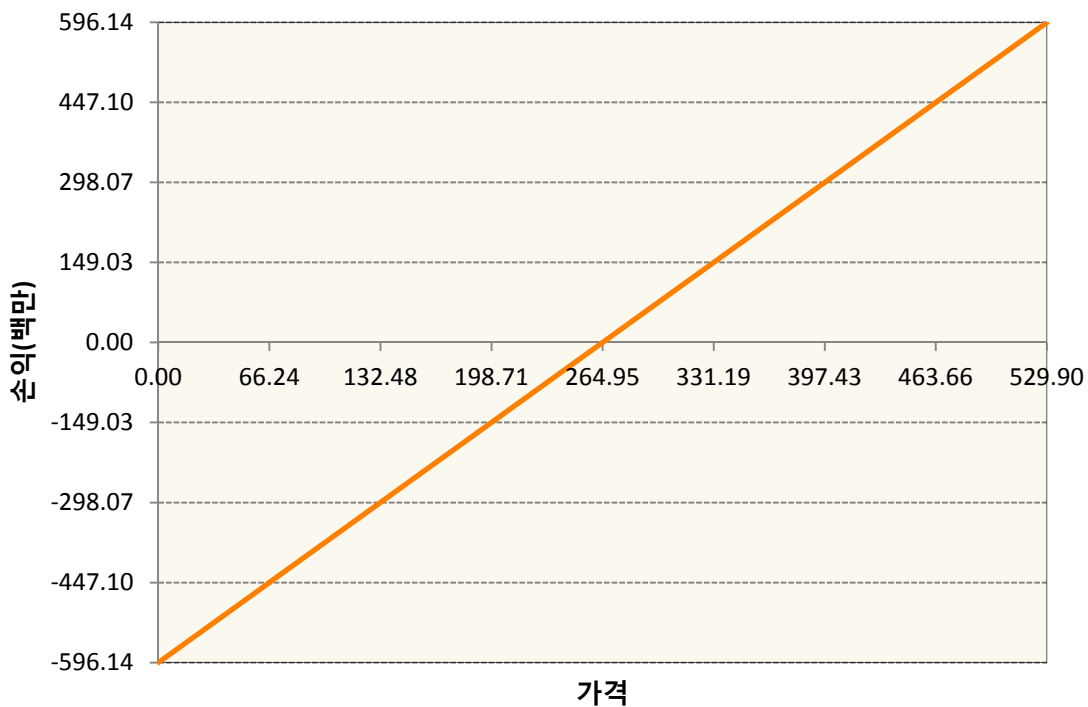
1. 계약금액

(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 | 2019-05-27 |
| 기준일 | 2019-05-24 |

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

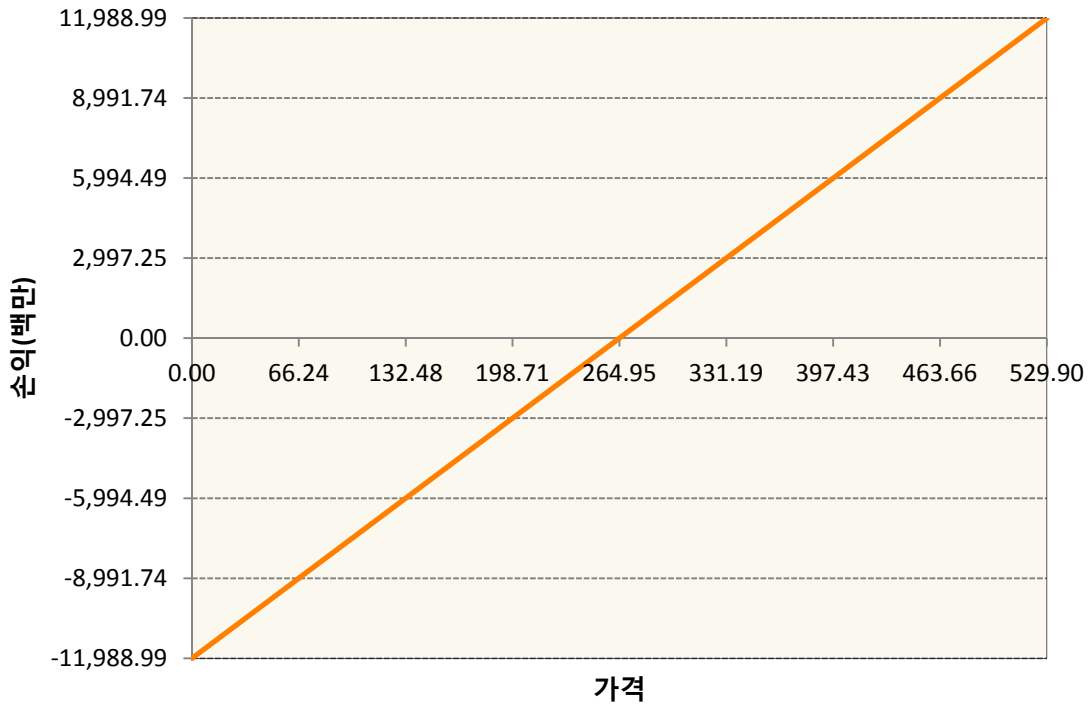
1. 계약금액

(단위:백만원)

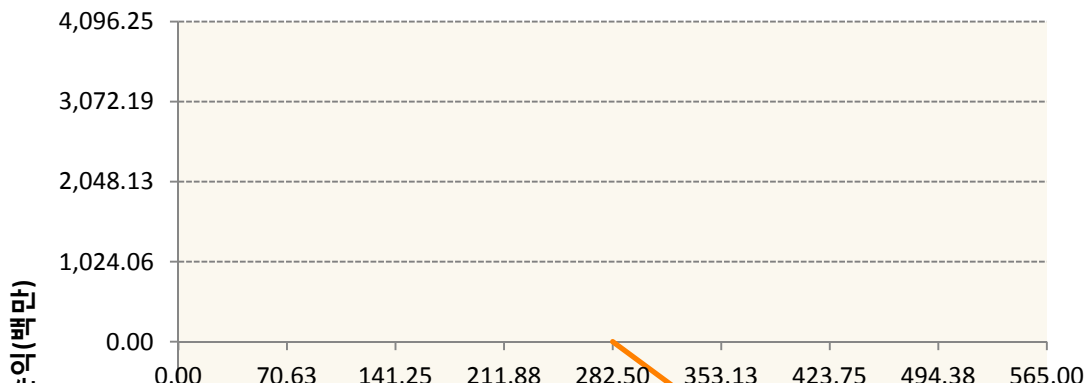
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 11,989 | 0 | 11,989 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 5,081 | 22,906 | -17,825 | 장내 |

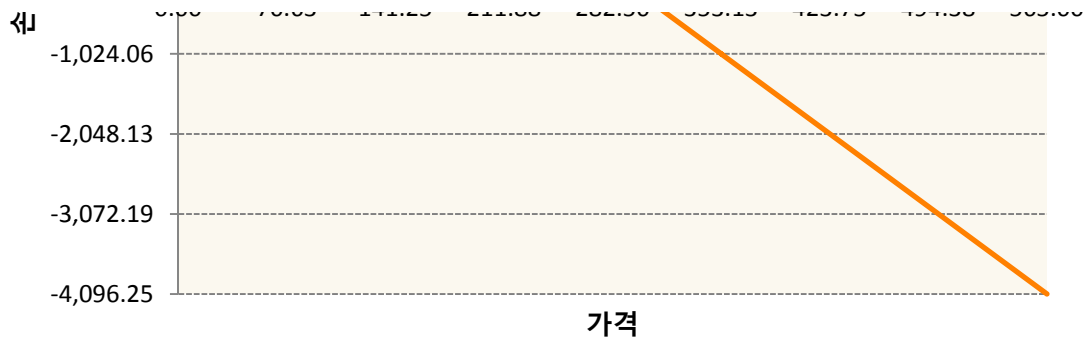
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

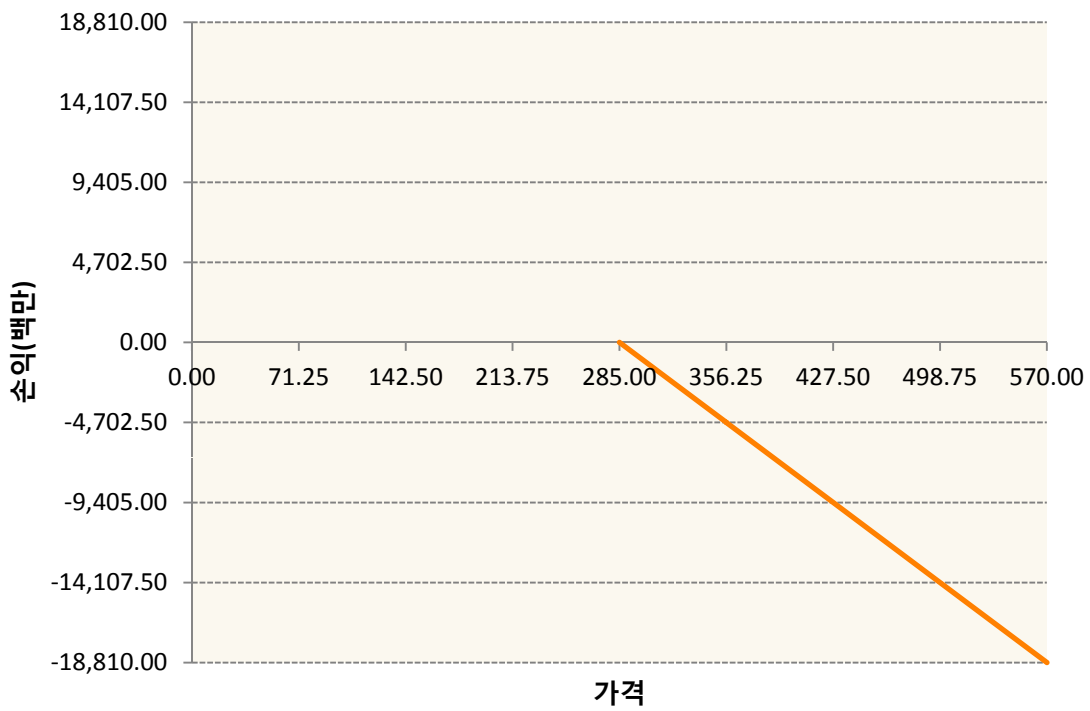


KR4201P62826-2019-06 콜282.5

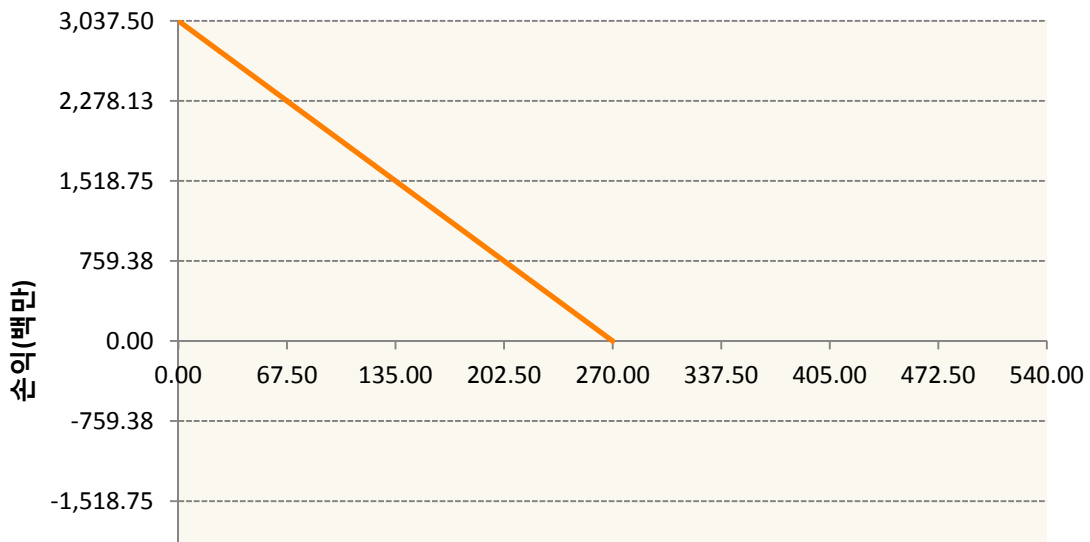


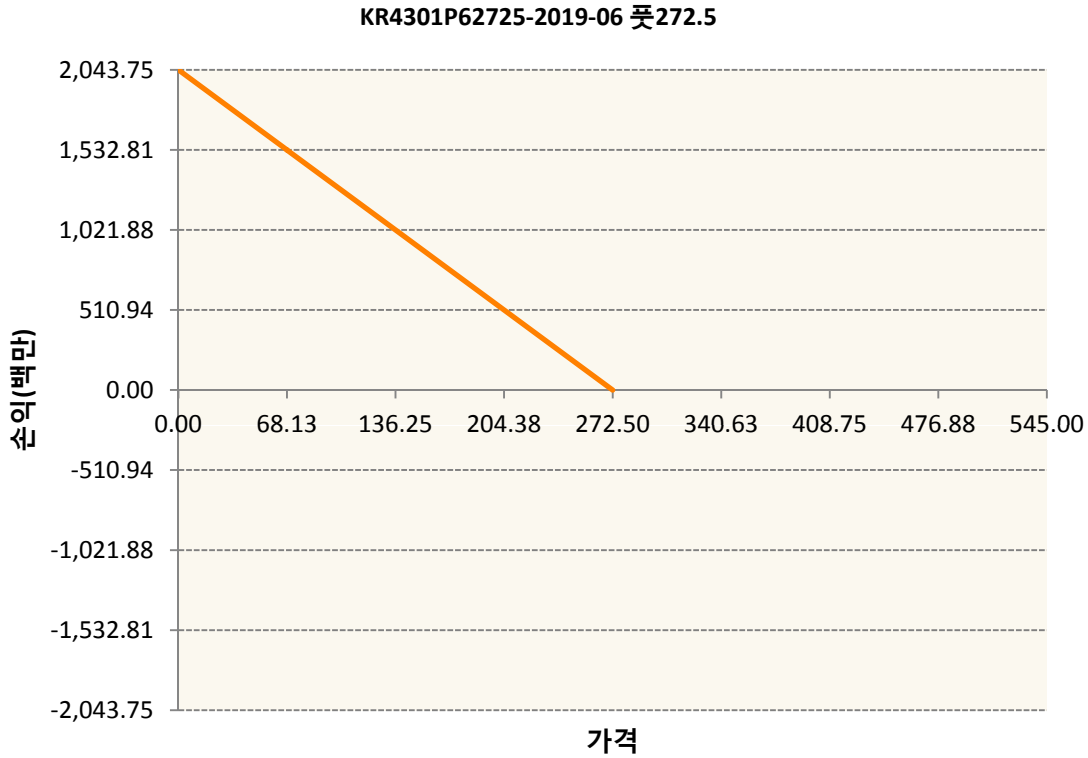
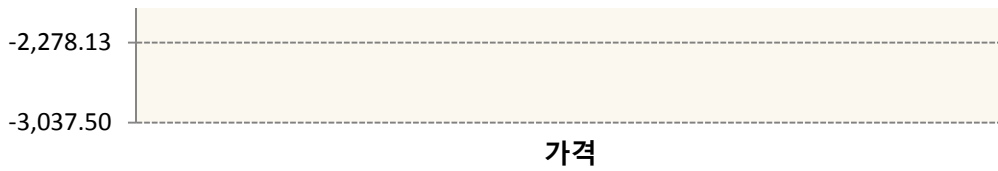


KR4201P62859-2019-06 콜285



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 | | | | | | 130 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 16 | 16 | 16 | 16 | 15 | 14 | 14 | |
| -5.33% | 16 | 15 | 15 | 14 | 13 | 11 | 10 | |
| -2.67% | 15 | 14 | 12 | 10 | 7 | 4 | 1 | |

| | | | | | | | |
|--|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 0% | 11 | 8 | 4 | 0 | -4 | -9 | -14 |
| 2.67% | -2 | -8 | -14 | -20 | -27 | -33 | -40 |
| 5.33% | -31 | -39 | -47 | -54 | -62 | -70 | -78 |
| 8.00% | -81 | -89 | -97 | -105 | -113 | -121 | -130 |
| KR4201P62859 2019-06 콜285 | | | | | | | 523 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 54 | 54 | 54 | 53 | 51 | 49 | 46 |
| -5.33% | 54 | 53 | 51 | 49 | 44 | 39 | 32 |
| -2.67% | 51 | 47 | 42 | 35 | 26 | 14 | 1 |
| 0% | 38 | 28 | 15 | 0 | -17 | -37 | -58 |
| 2.67% | -3 | -25 | -48 | -74 | -101 | -129 | -158 |
| 5.33% | -106 | -139 | -172 | -206 | -241 | -275 | -311 |
| 8.00% | -298 | -336 | -373 | -411 | -448 | -486 | -523 |
| KR4301P62709 2019-06 풋270 | | | | | | | 217 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 216 | 216 | 216 | 216 | 216 | 216 | 217 |
| -5.33% | 137 | 137 | 137 | 138 | 138 | 139 | 140 |
| -2.67% | 59 | 60 | 62 | 64 | 65 | 68 | 70 |
| 0% | -10 | -7 | -3 | 0 | 3 | 7 | 10 |
| 2.67% | -57 | -53 | -49 | -45 | -41 | -37 | -34 |
| 5.33% | -79 | -76 | -74 | -71 | -68 | -65 | -61 |
| 8.00% | -85 | -84 | -83 | -82 | -80 | -78 | -76 |
| KR4301P62725 2019-06 풋272.5 | | | | | | | 149 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 149 | 149 | 149 | 149 | 149 | 149 | 149 |
| -5.33% | 96 | 96 | 96 | 96 | 96 | 97 | 97 |
| -2.67% | 43 | 44 | 45 | 45 | 46 | 47 | 49 |
| 0% | -5 | -4 | -2 | 0 | 2 | 4 | 6 |
| 2.67% | -43 | -40 | -38 | -35 | -32 | -30 | -27 |
| 5.33% | -63 | -61 | -59 | -56 | -54 | -52 | -49 |
| 8.00% | -70 | -69 | -68 | -67 | -65 | -64 | -62 |

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

(단위:백만원)

1,524

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-27 |
| 기준일 | 2019-05-24 |

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 0 | 785 | -785 | |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 15,818 | 0 | 15,818 | |

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 | 2019-05-27 |
| 기준일 | 2019-05-24 |

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 | 60,514 | 0 | 60,514 | |

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 | 2019-05-27 |
| 기준일 | 2019-05-24 |

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 30,898 | 0 | 30,898 | |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 290,246 | 0 | 290,246 | |
| 누계 | 통화 | 선도 | 3,565 | 322,294 | -318,729 | 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 |
| FX21019J019 KRW/USD 18-06-19E | | 380 |
| FX21019J024 KRW/USD 24-06-19E | | 951 |
| FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E | | 951 |
| FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E | | 1,008 |
| FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E | | 380 |
| FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E | | 76 |
| FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E | | 1,000 |
| FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E | | 1,027 |
| FX21019J041 KRW/USD 28-05-19E | | 285 |
| FX21019J043 KRW/USD 03-06-19E | | 570 |
| FX21019J044 KRW/USD 03-06-19E | | 475 |
| FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E | | 285 |
| FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E | | 475 |
| FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E | | 666 |
| FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E | | 666 |
| FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E | | 827 |
| FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E | | 818 |
| FX21019K00 KRW/USD 18-06-19E | | 570 |
| FX21019K01 KRW/USD 14-06-19E | | 666 |
| FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E | | 570 |
| FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E | | 475 |
| FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E | | 570 |
| FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E | | 1,426 |
| FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E | | 1,331 |
| FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E | | 475 |

| | |
|------------------------------|-------|
| FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E | 799 |
| FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E | 635 |
| FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E | 475 |
| FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E | 380 |
| FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E | 799 |
| FX21019K02 KRW/USD 24-06-19E | 380 |
| FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E | 951 |
| FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E | 1,521 |
| FX21019K03 USD/KRW 28-05-19E | 285 |
| FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E | 285 |
| FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E | 1,236 |
| FX21019K04 KRW/USD 28-06-19E | 1,293 |

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

(단위:백만원)

8,697

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-27 |
| 기준일 | 2019-05-24 |

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

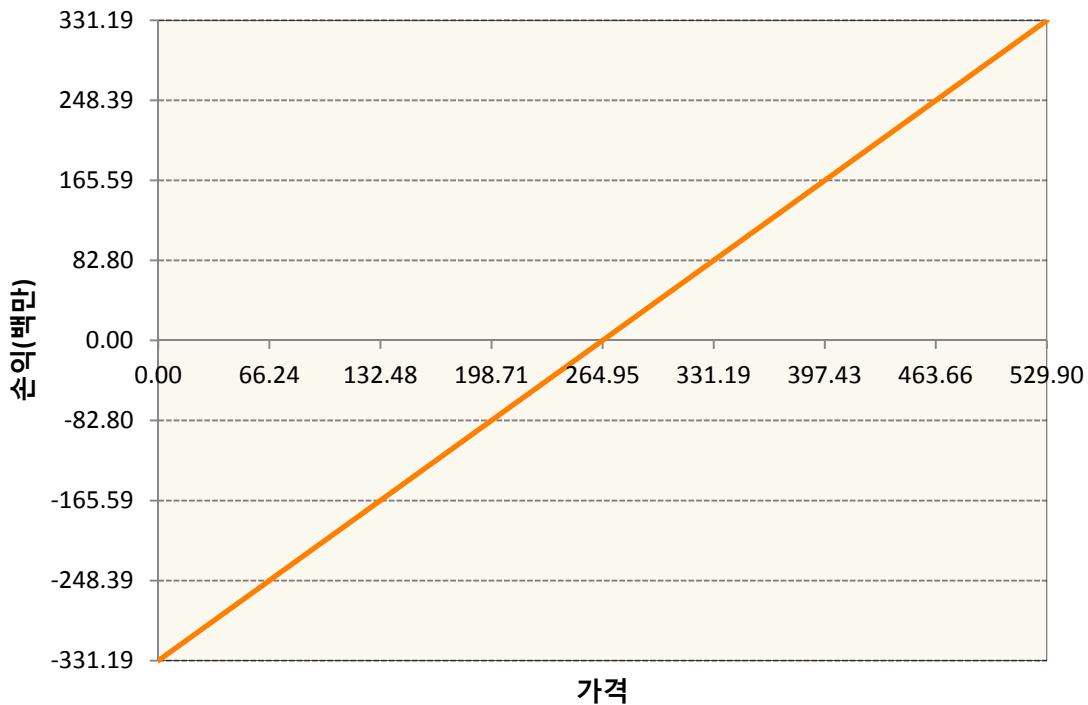
1. 계약금액

(단위:백만원)

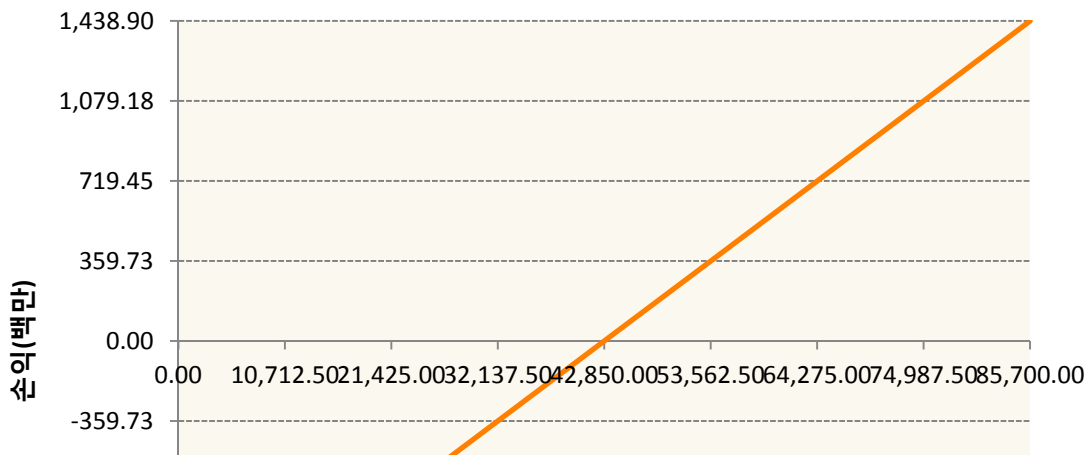
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,770 | 0 | 1,770 | 장내 |

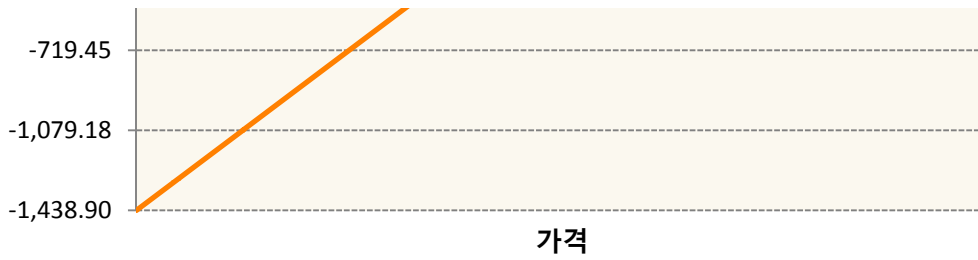
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4111P60003-2019-06 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 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 | | | | | | 115 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -115 | -115 | -115 | -115 | -115 | -115 | -115 | |
| -5.33% | -76 | -76 | -76 | -76 | -76 | -76 | -76 | |
| -2.67% | -38 | -38 | -38 | -38 | -38 | -38 | -38 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 38 | 38 | 38 | 38 | 38 | 38 | 38 | |
| 5.33% | 76 | 76 | 76 | 76 | 76 | 76 | 76 | |
| 8.00% | 115 | 115 | 115 | 115 | 115 | 115 | 115 | |

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

157

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-27 |
| 기준일 | 2019-05-24 |

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

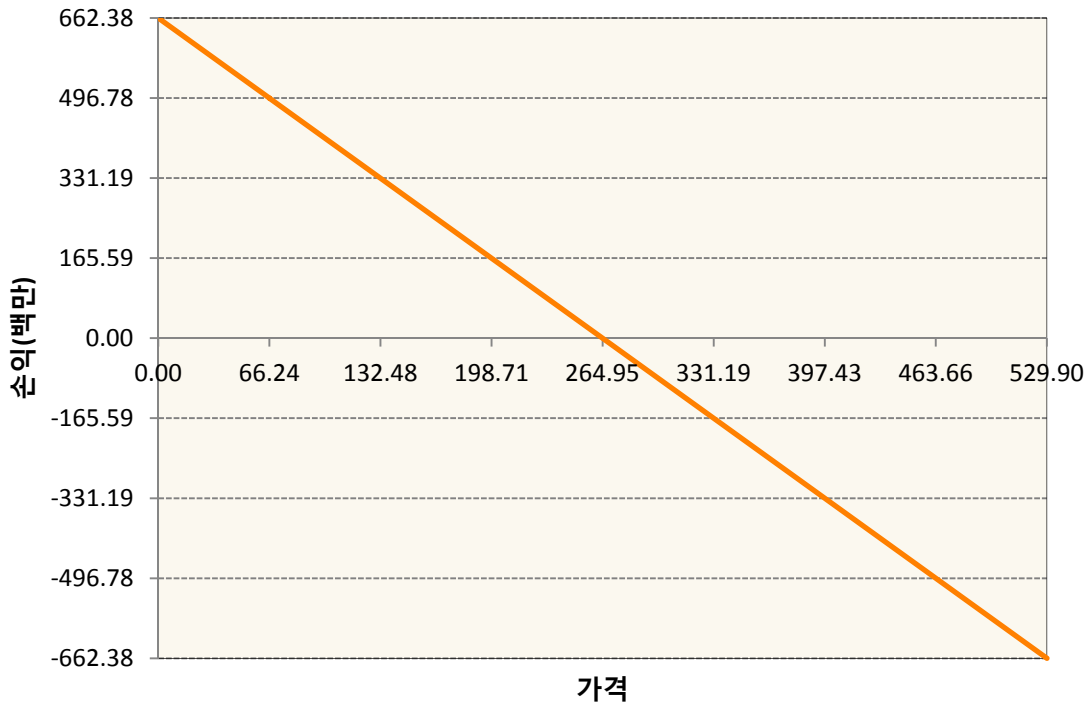
1. 계약금액

(단위:백만원)

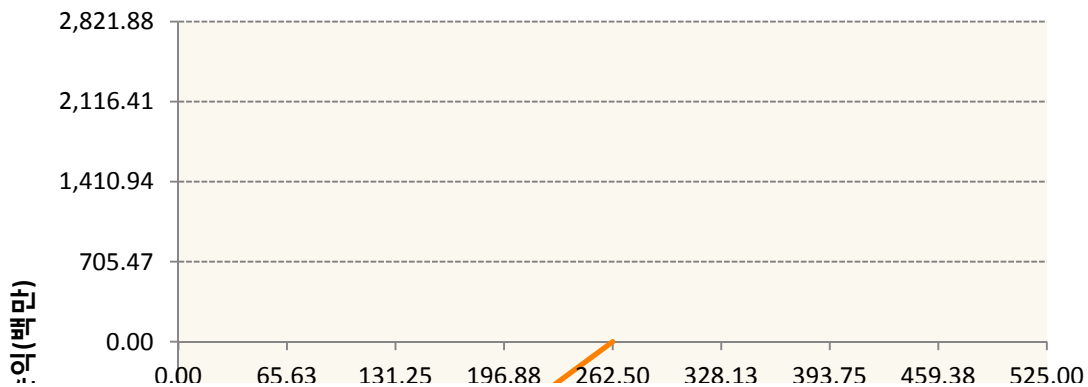
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 662 | -662 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 3,352 | -3,352 | 장내 |

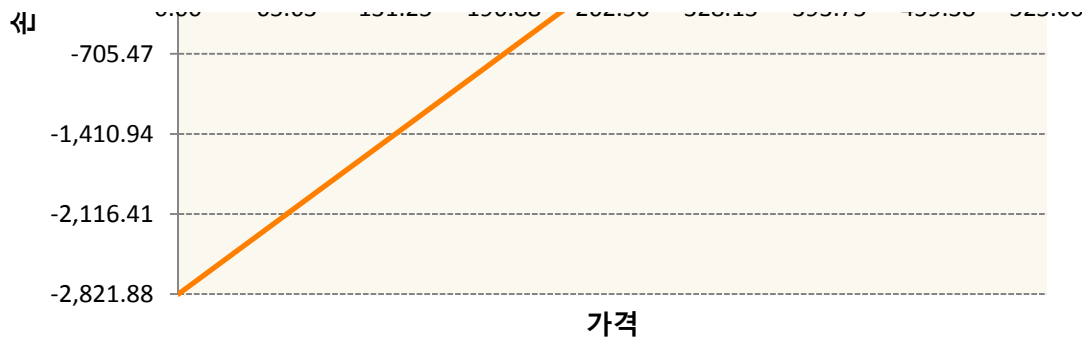
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

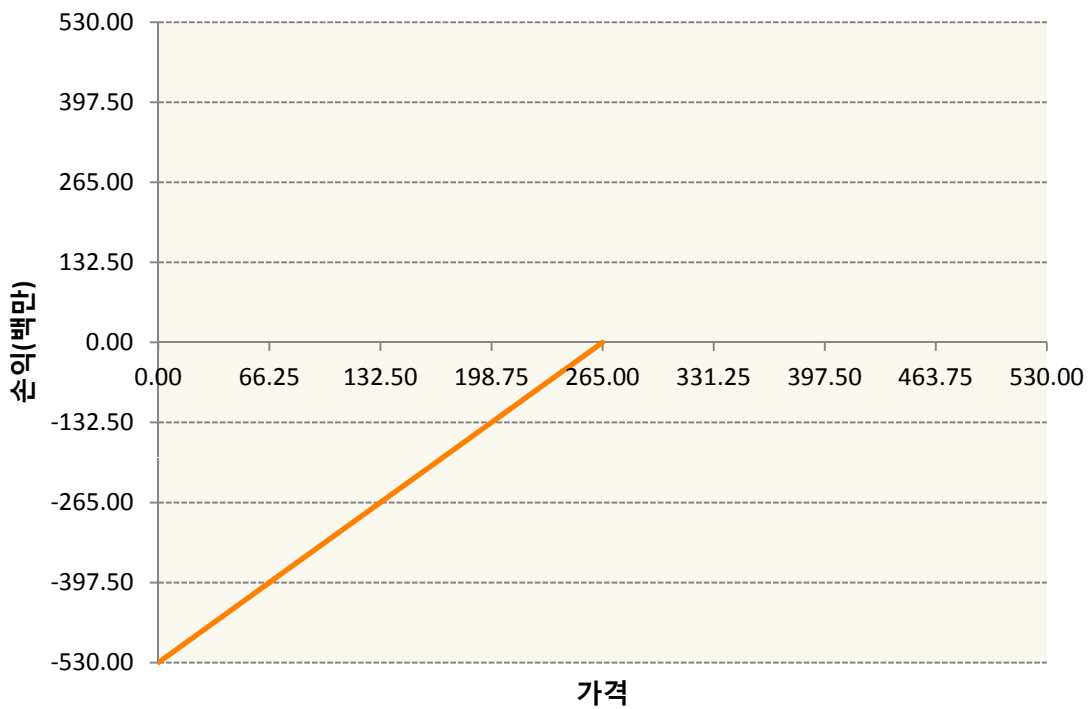


KR4301P62626-2019-06 풋262.5





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 | | | | | | 176 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|--|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -172 | -173 | -173 | -173 | -174 | -175 | -176 |
| -5.33% | -98 | -100 | -101 | -103 | -104 | -106 | -108 |
| -2.67% | -33 | -36 | -39 | -42 | -45 | -49 | -52 |
| 0% | 11 | 7 | 4 | 0 | -4 | -7 | -11 |
| 2.67% | 30 | 28 | 25 | 23 | 20 | 17 | 14 |
| 5.33% | 35 | 34 | 33 | 32 | 31 | 29 | 27 |
| 8.00% | 35 | 35 | 35 | 35 | 34 | 34 | 33 |
| KR4301P62659 2019-06 풋265 | | | | | | | 35 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -35 | -35 | -35 | -35 | -35 | -35 | -35 |
| -5.33% | -21 | -21 | -21 | -21 | -21 | -22 | -22 |
| -2.67% | -8 | -8 | -9 | -9 | -10 | -10 | -11 |
| 0% | 2 | 1 | 1 | 0 | -1 | -1 | -2 |
| 2.67% | 7 | 7 | 6 | 5 | 5 | 4 | 4 |
| 5.33% | 9 | 9 | 8 | 8 | 8 | 7 | 7 |
| 8.00% | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 | 8 | 8 |

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

(단위:백만원)

267

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-27 |
| 기준일 | 2019-05-24 |

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

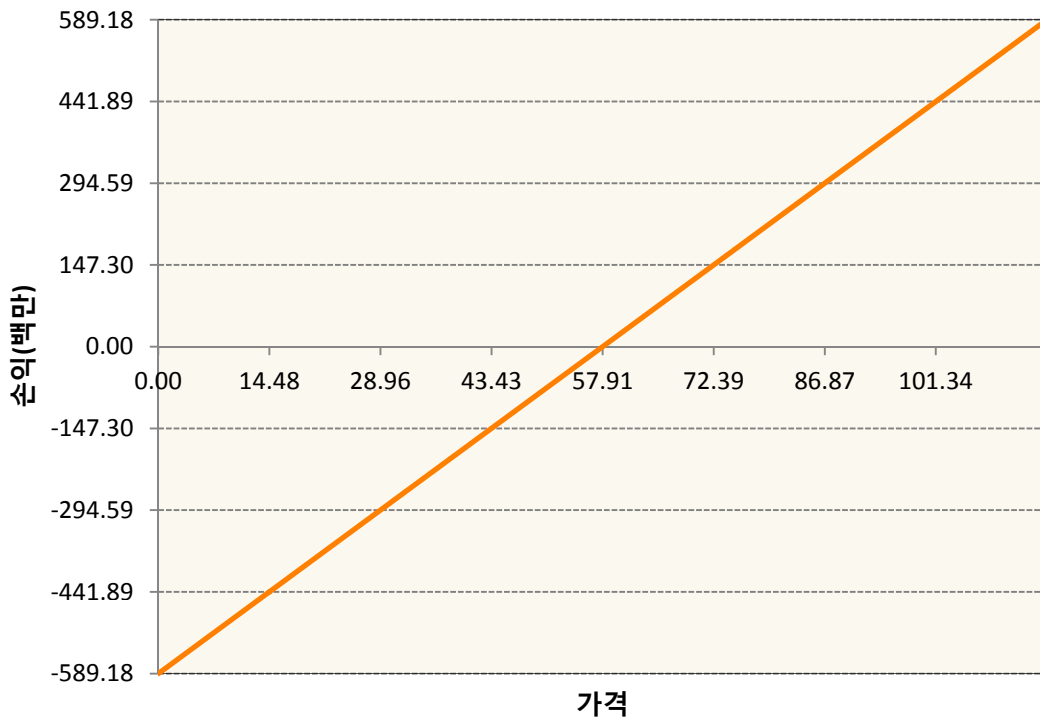
1. 계약금액

(단위:백만원)

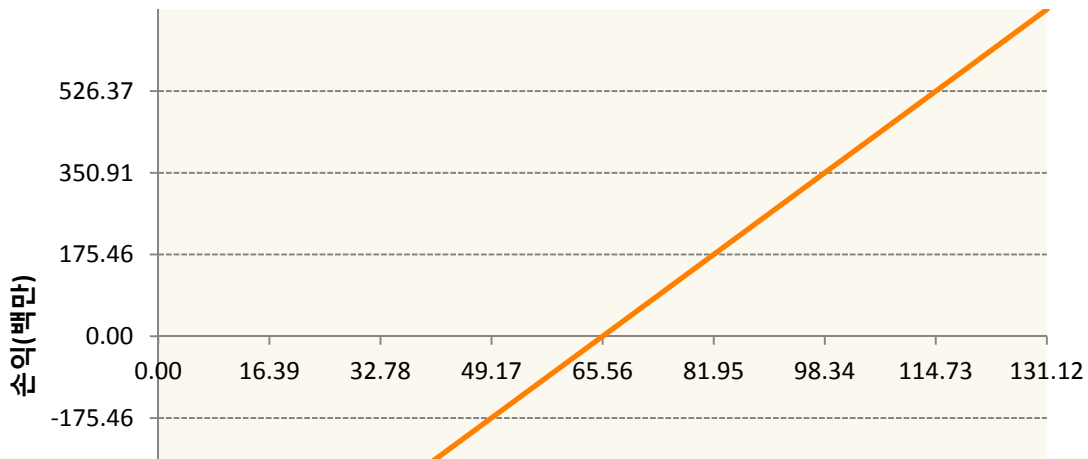
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,640 | 297 | 2,343 | |

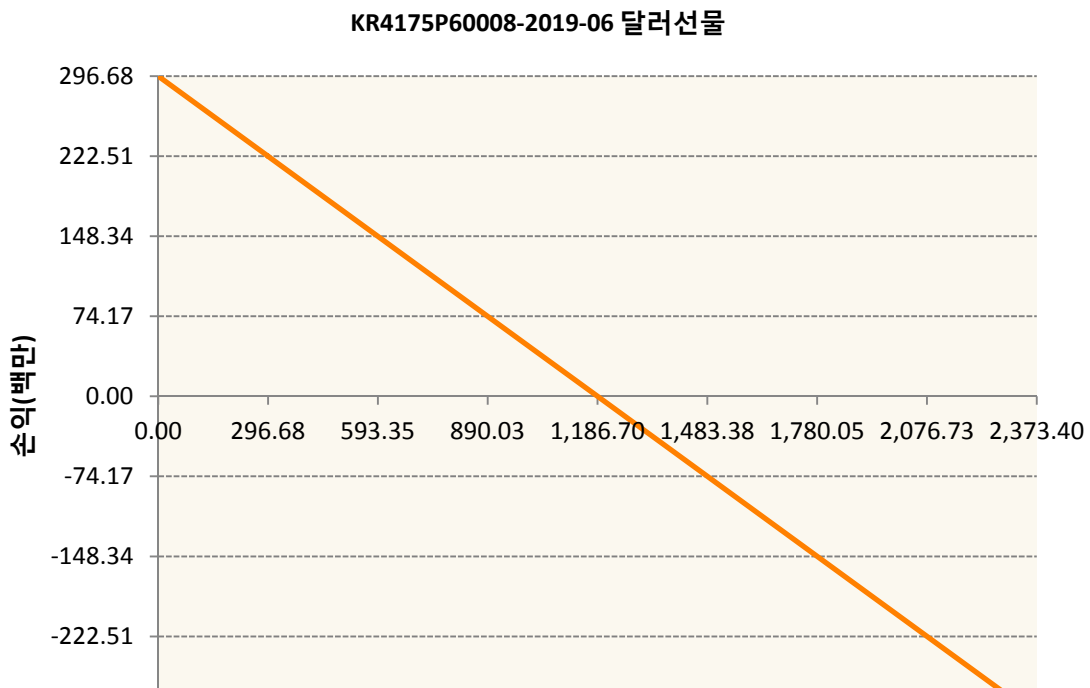
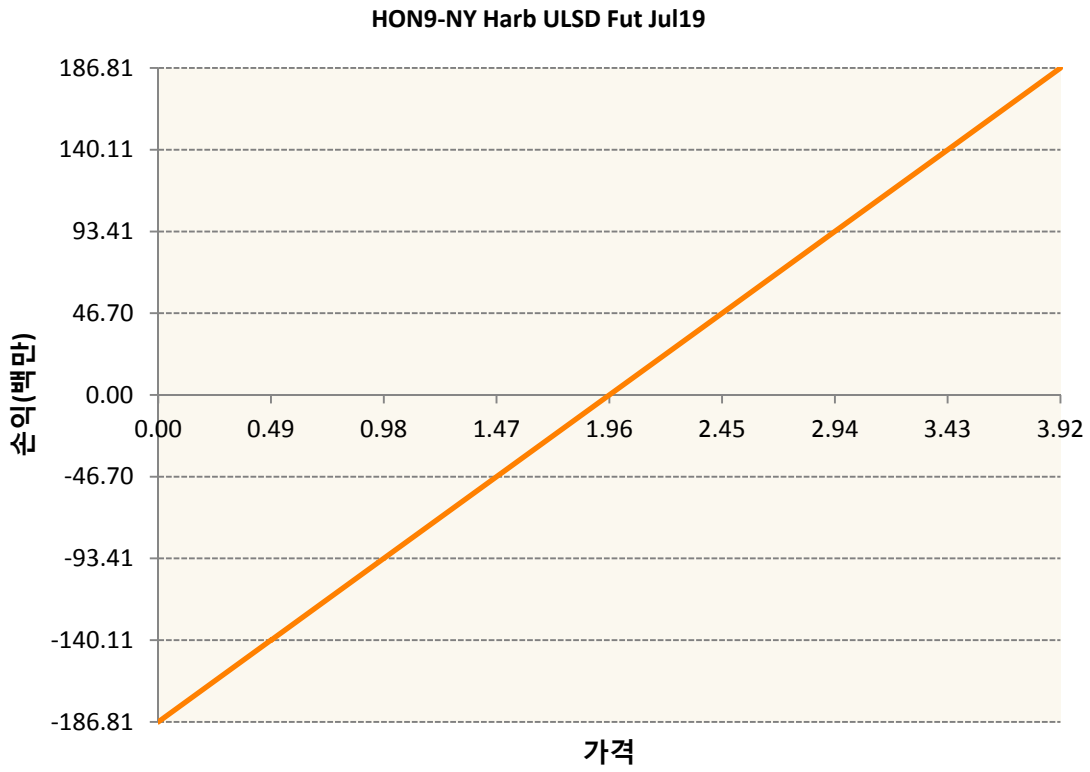
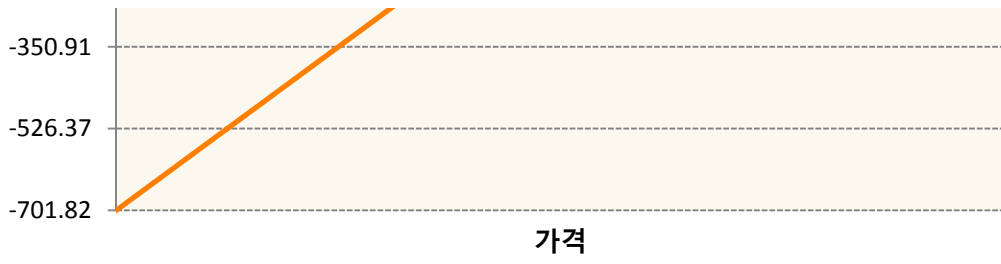
2. 만기시점의 손익구조

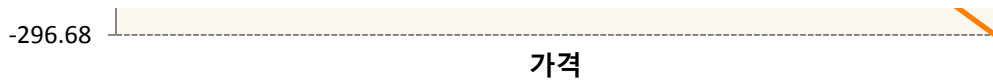
CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19



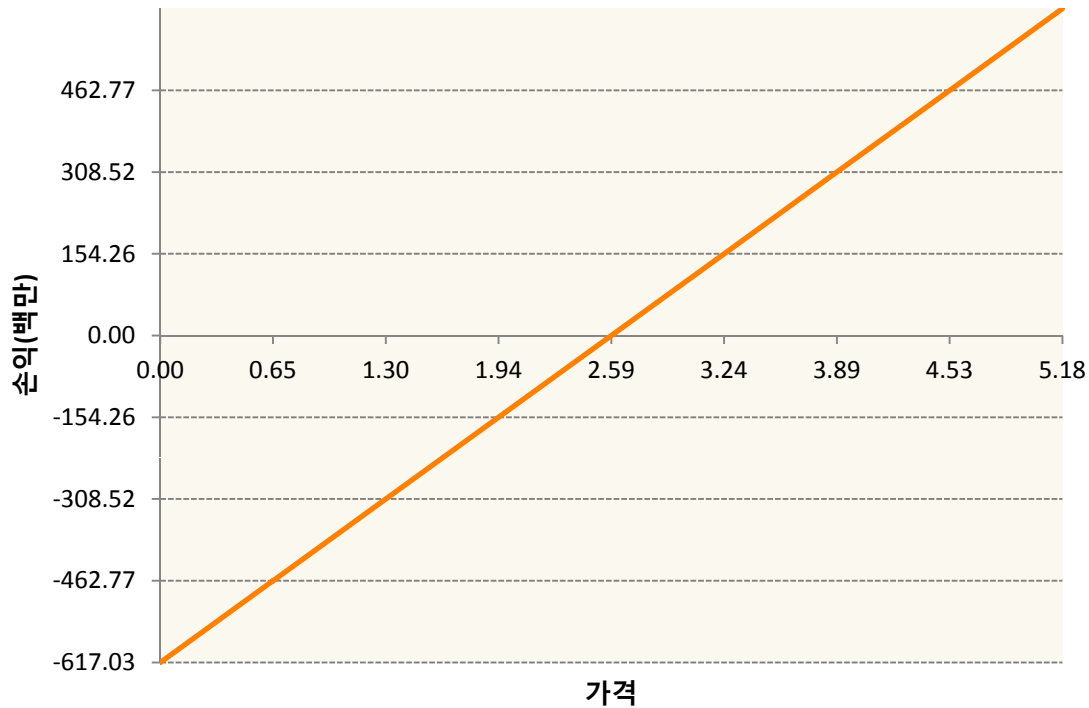
COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19



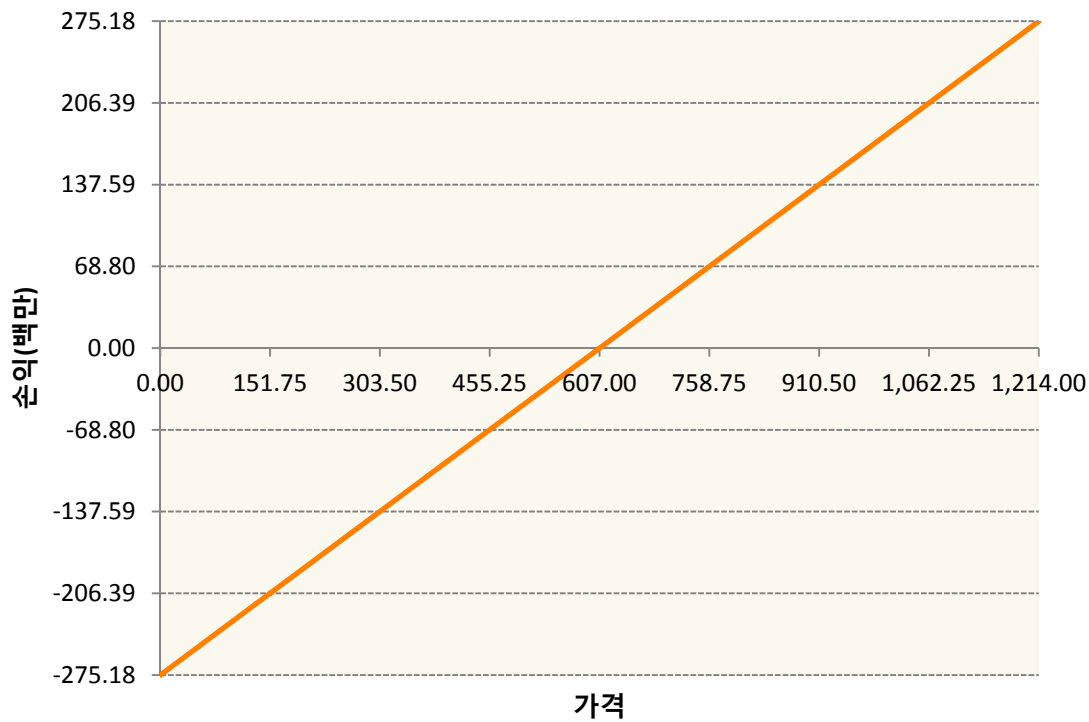




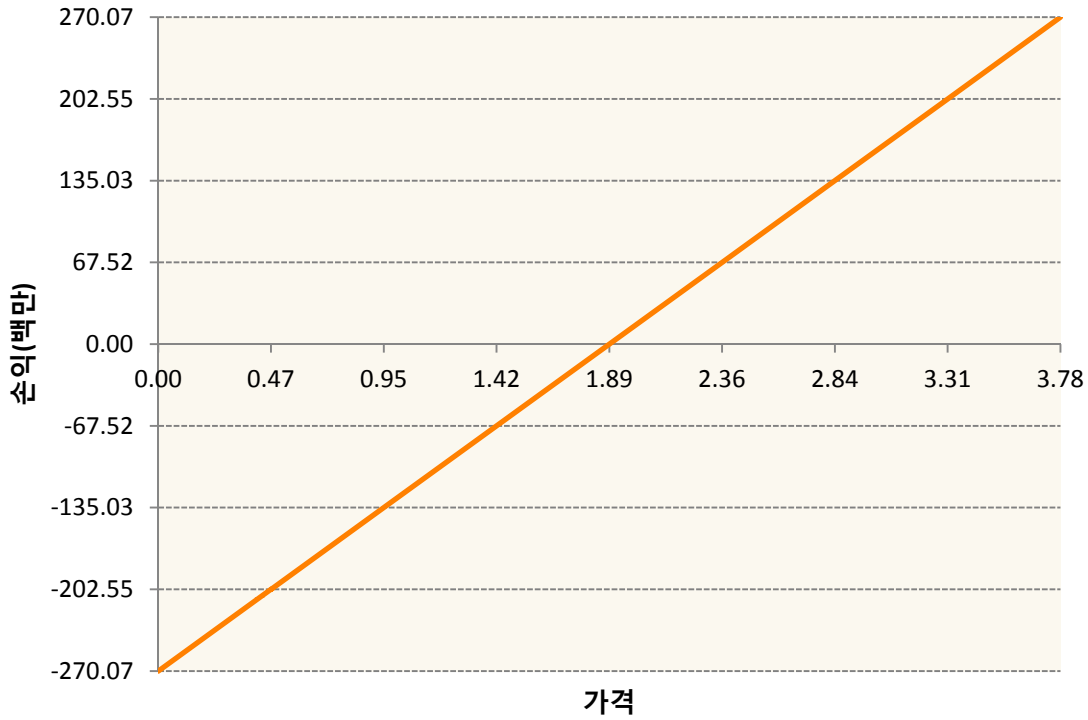
NGN19-NATURAL GAS FUTR Jul19



QSN9-Low Su Gasoil G Jul19



XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------------|-------------------------|----|
| CLN9 | WTI CRUDE FUTURE Jul19 | 47 |
| COU9 | BRENT CRUDE FUTR Sep19 | 56 |
| HON9 | NY Harb ULSD Fut Jul19 | 15 |
| KR4175P600 | 2019-06 달러선물 | 24 |
| NGN19 | NATURAL GAS FUTR Jul19 | 49 |
| QSN9 | Low Su Gasoil G Jul19 | 22 |
| XBN9 | GASOLINE RBOB FUT Jul19 | 22 |

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

(단위:백만원)

391

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-27 |
| 기준일 | 2019-05-24 |

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

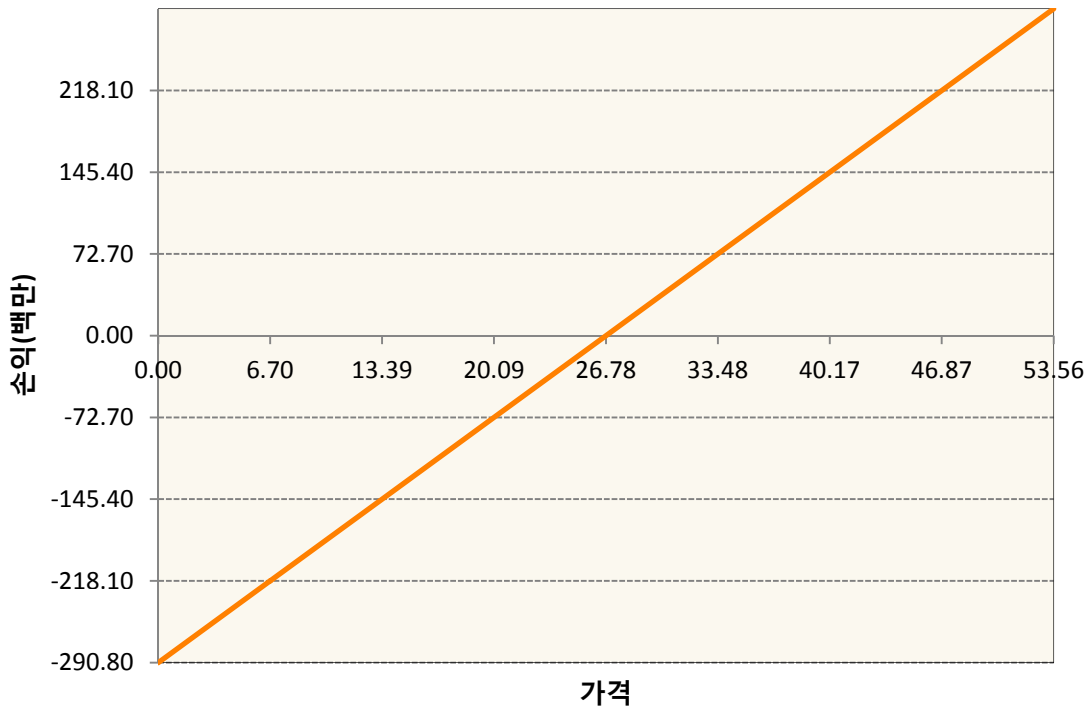
1. 계약금액

(단위:백만원)

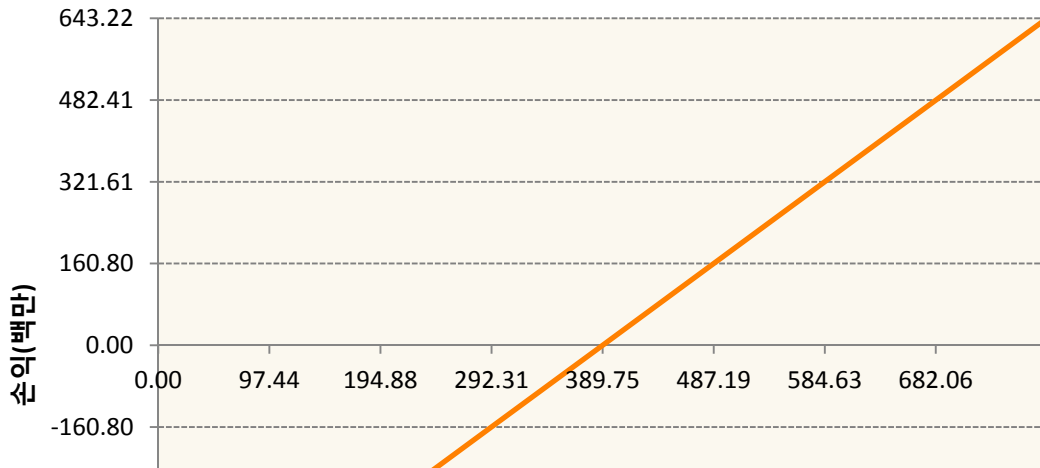
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,902 | 59 | 2,843 | |

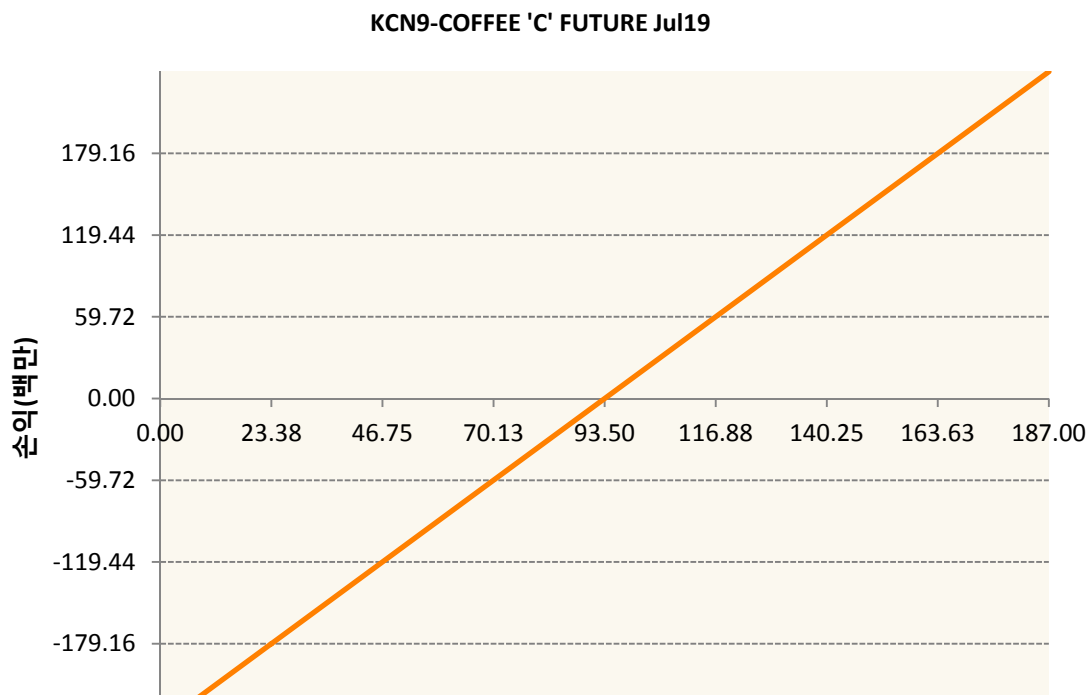
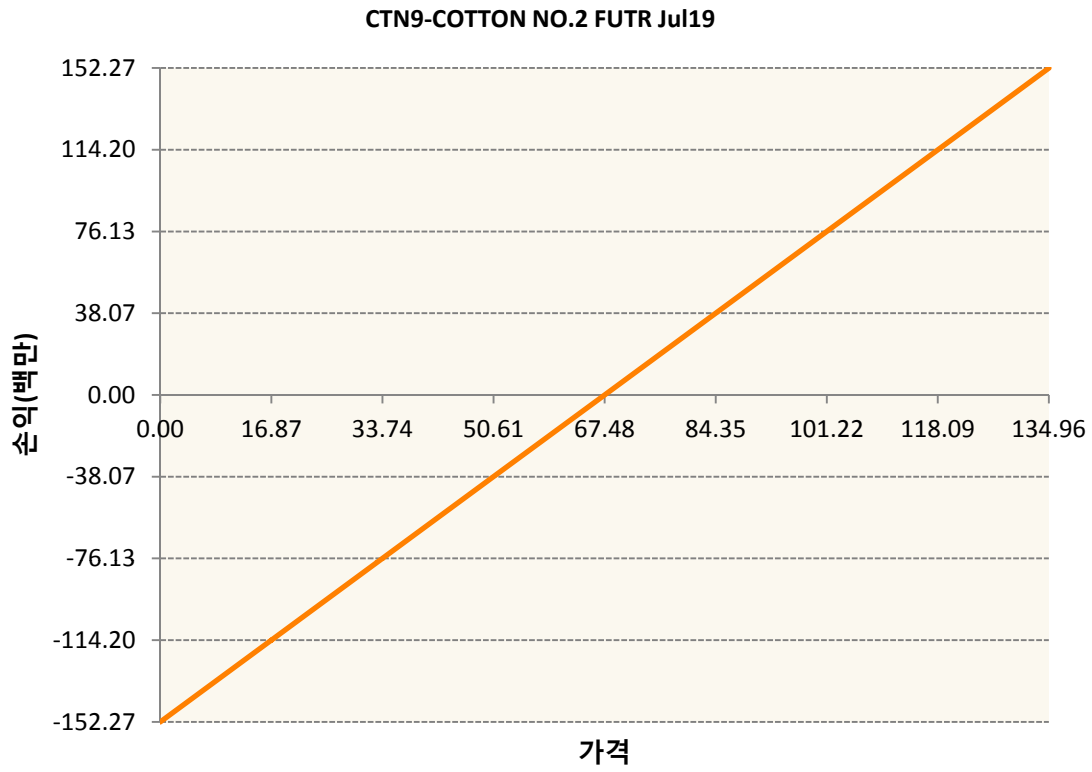
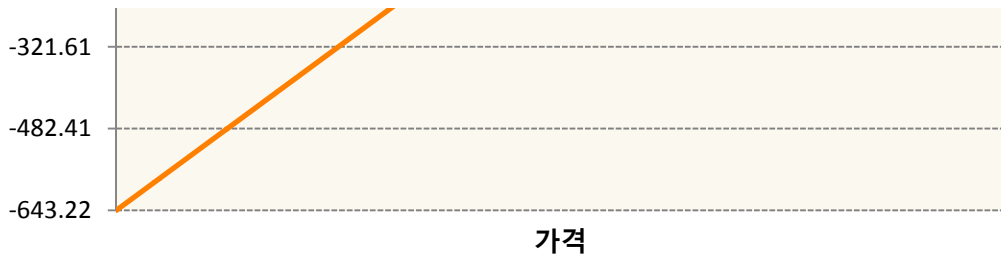
2. 만기시점의 손익구조

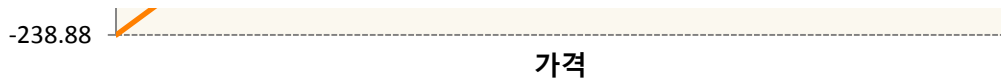
BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19



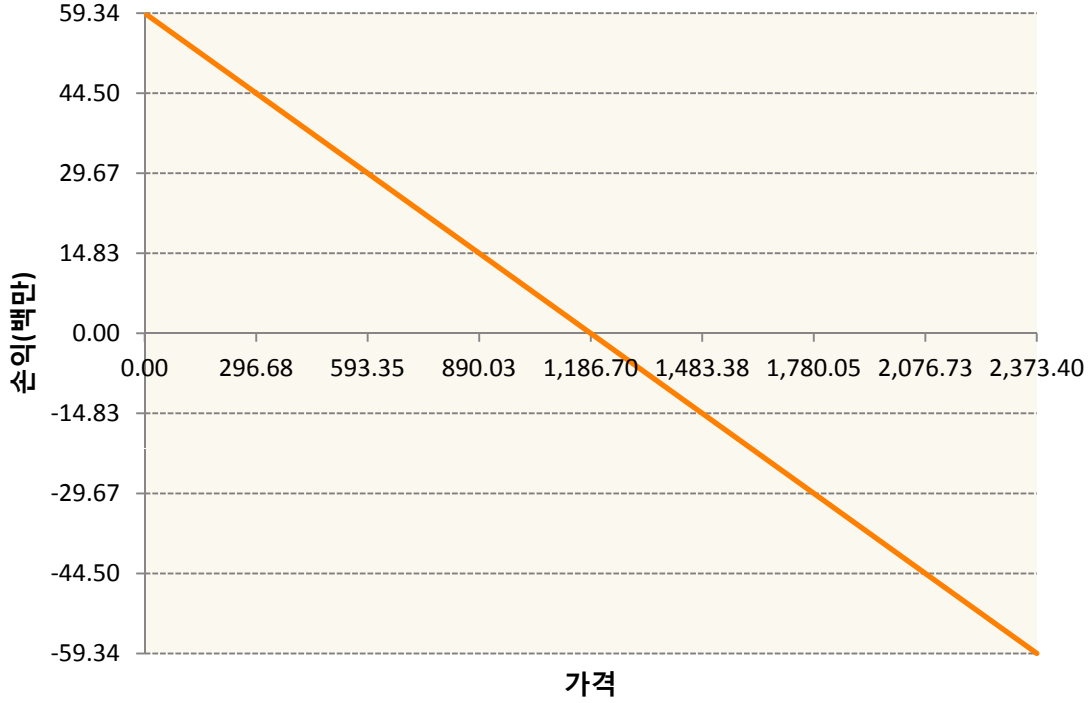
CN9-CORN FUTURE Jul19



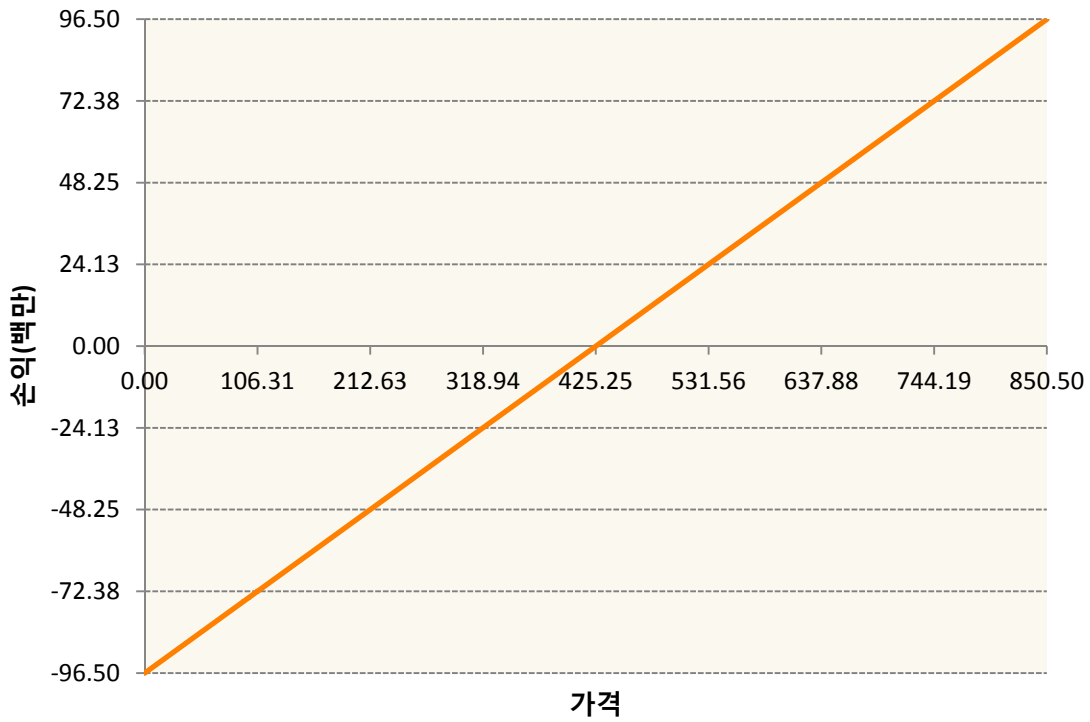




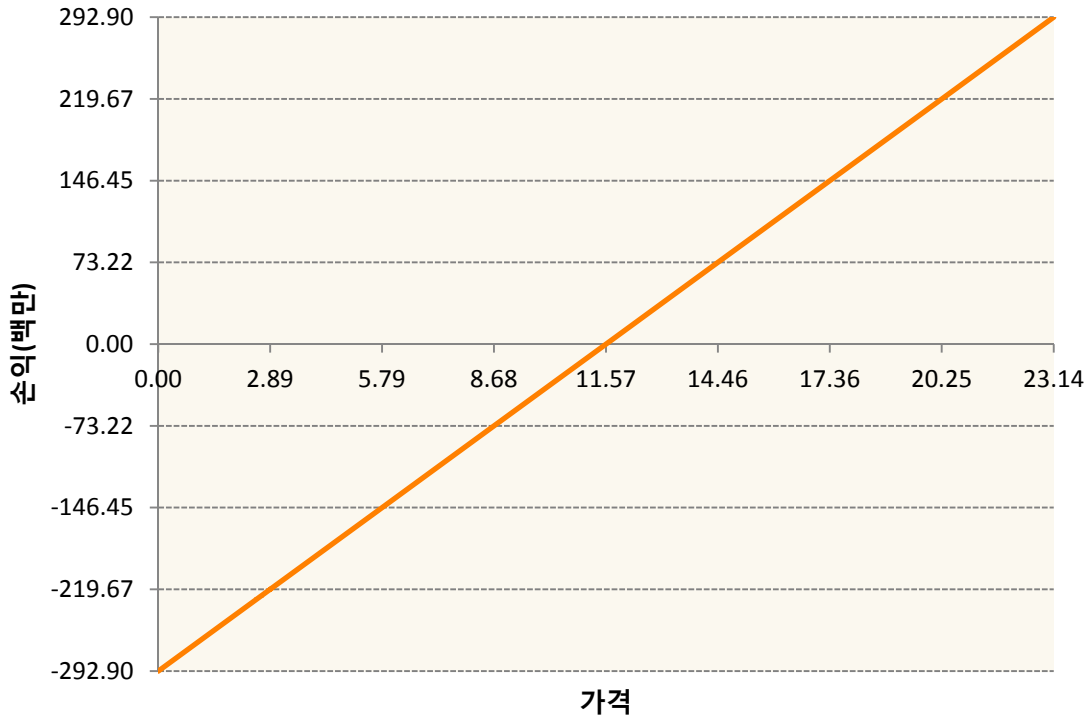
KR4175P60008-2019-06 달러선물



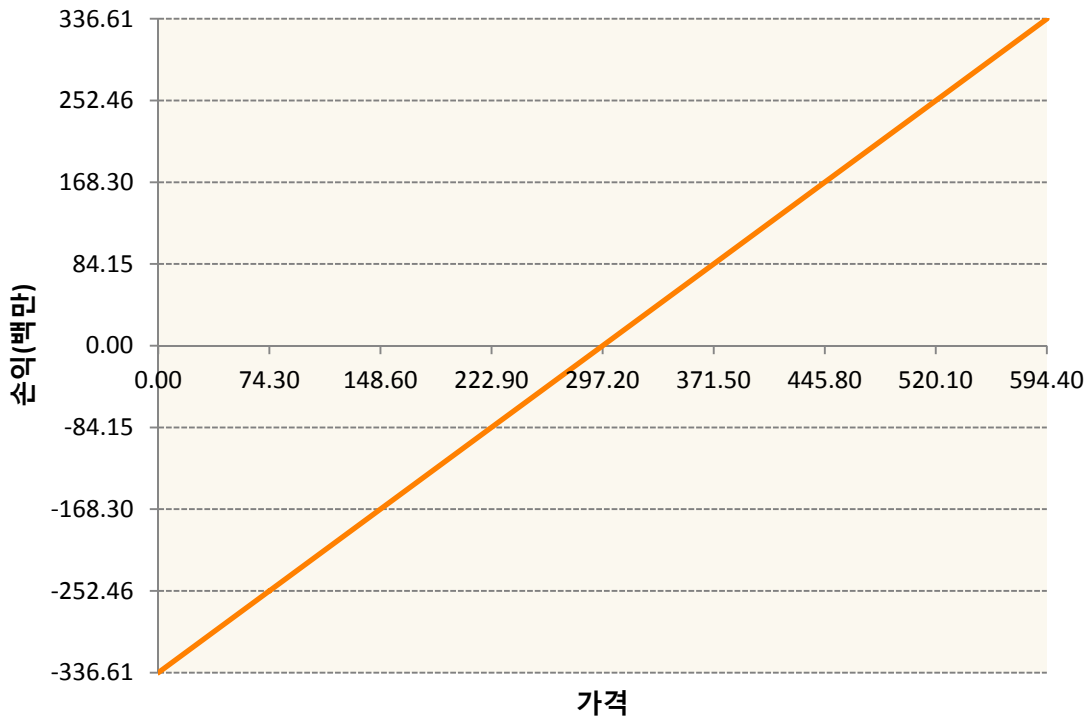
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



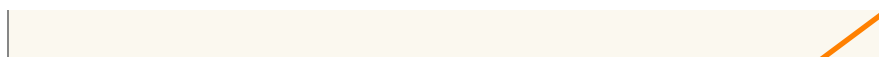
SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

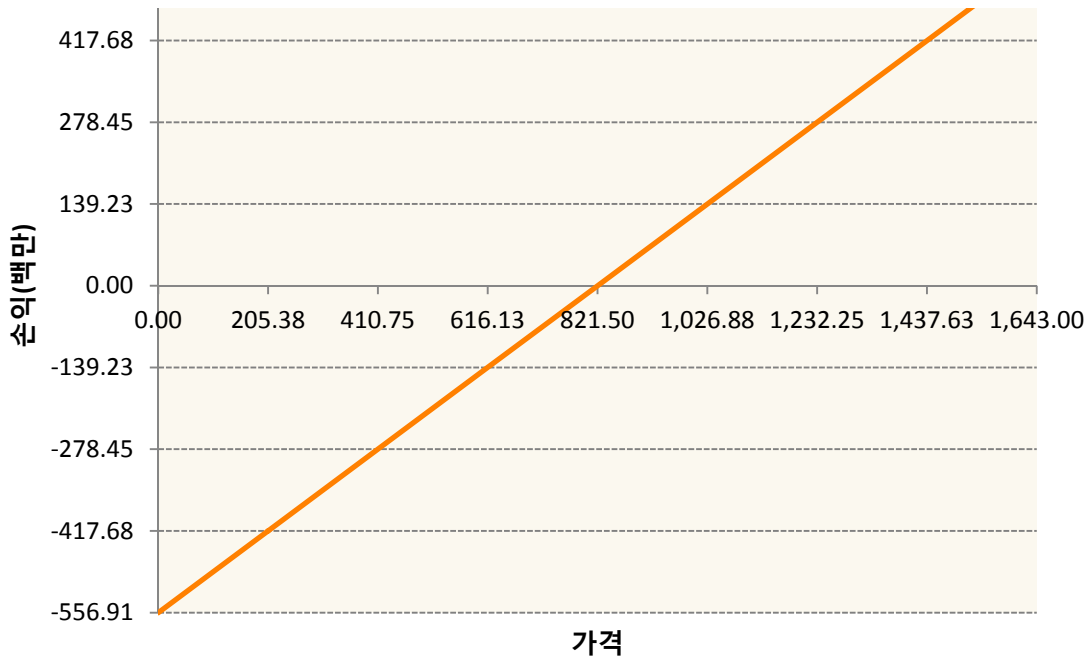


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19

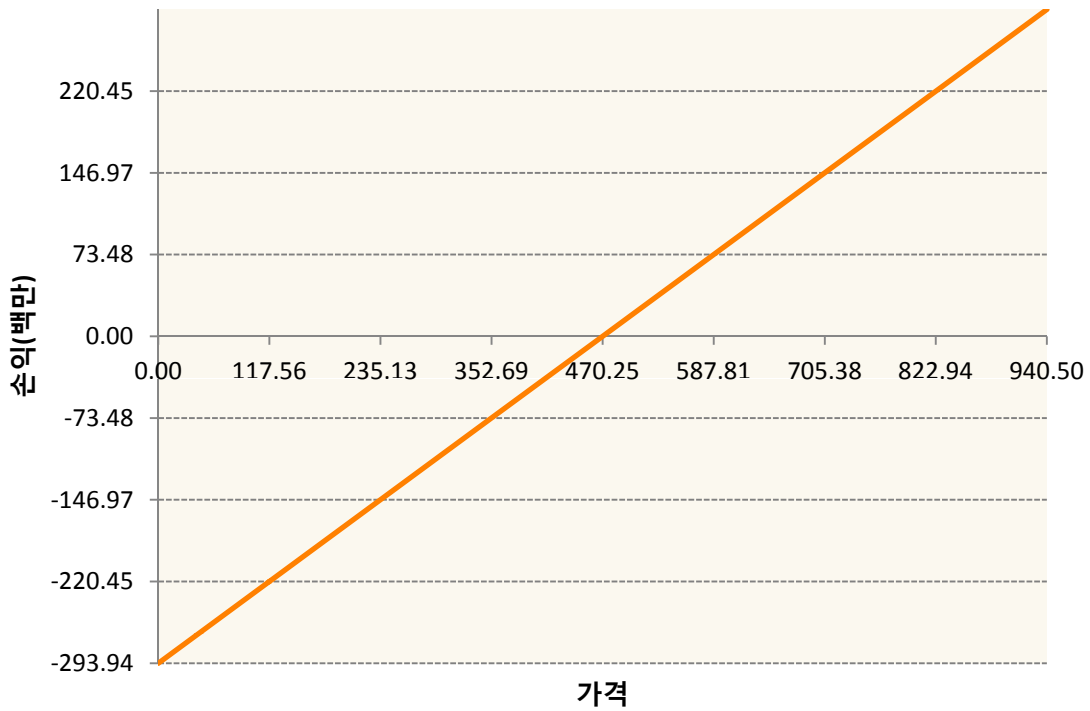


SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





WN9-WHEAT FUTURE(CBT) Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------------|-------------------------|----|
| BON9 | SOYBEAN OIL FUTR Jul19 | 23 |
| CN9 | CORN FUTURE Jul19 | 51 |
| 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 | 23 |
| SMN9 | SOYBEAN MEAL FUTR Jul19 | 27 |
| SN9 | SOYBEAN FUTURE Jul19 | 45 |
| WN9 | WHEAT FUTURE(CBT) Jul19 | 24 |

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

(단위:백만원)

239