

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-31 |
| 기준일 | 2019-05-30 |

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 | 2019-05-31 |
| 기준일 | 2019-05-30 |

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

1,105

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

663

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-31 |
| 기준일 | 2019-05-30 |

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)

| |
|------------|
| 875 |
|------------|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-31 |
| 기준일 | 2019-05-30 |

유로인덱스모(주식-파생형)

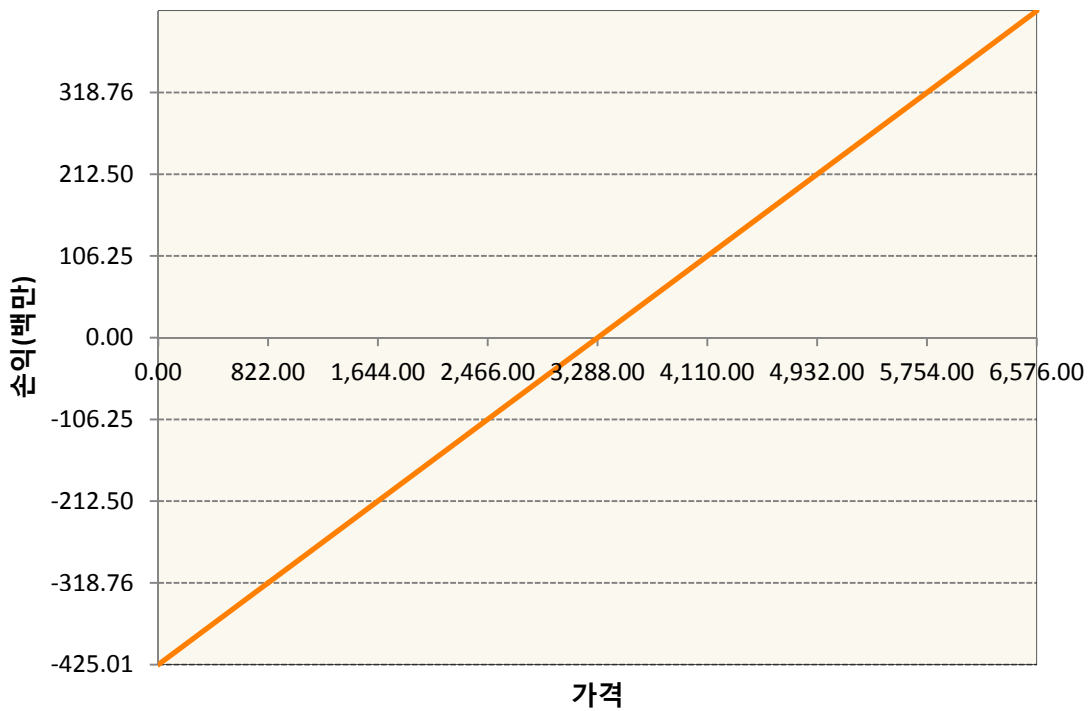
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 425 | 0 | 425 | |

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 | 2019-05-31 |
| 기준일 | 2019-05-30 |

차이나인덱스모(주식-파생형)

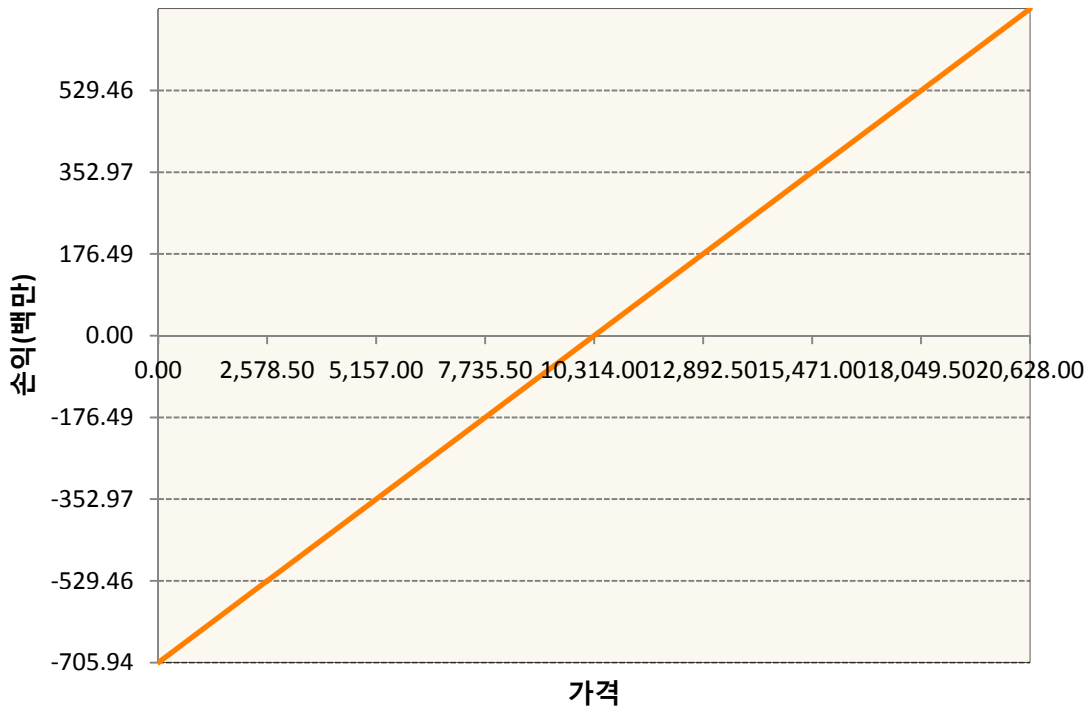
1. 계약금액

(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

HCM9-HSCEI Futures Jun19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------|---------------------|----|
| HCM9 | HSCEI Futures Jun19 | 56 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

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

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-31 |
| 기준일 | 2019-05-30 |

커버드콜모(주식혼합-파생형)

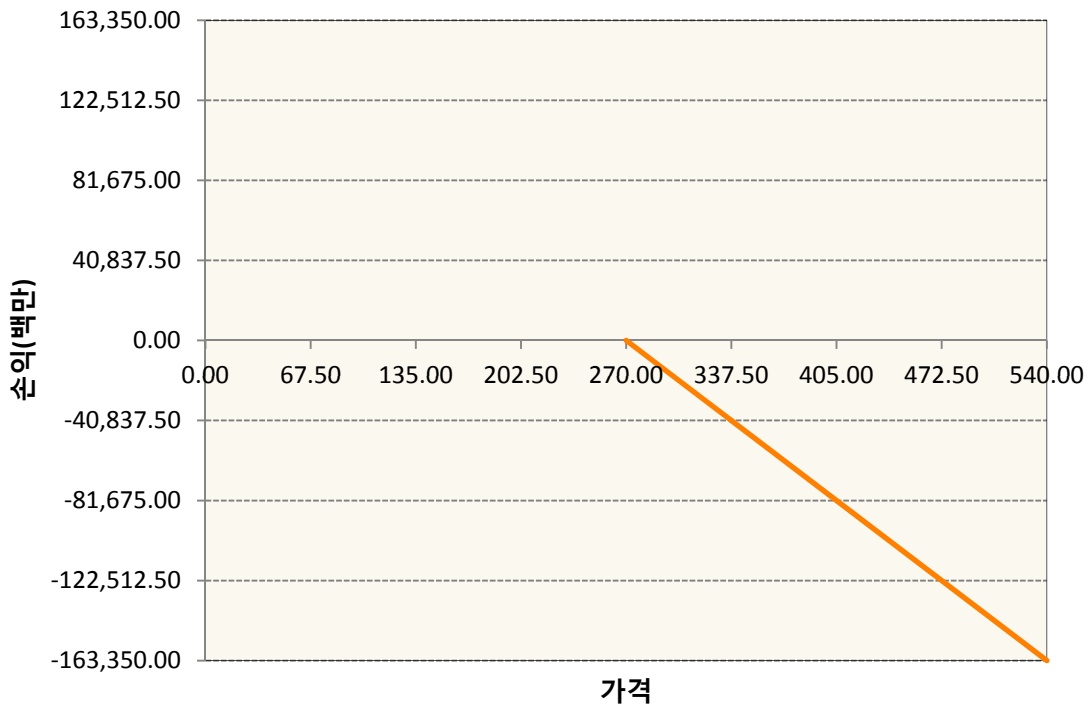
1. 계약금액

(단위:백만원)

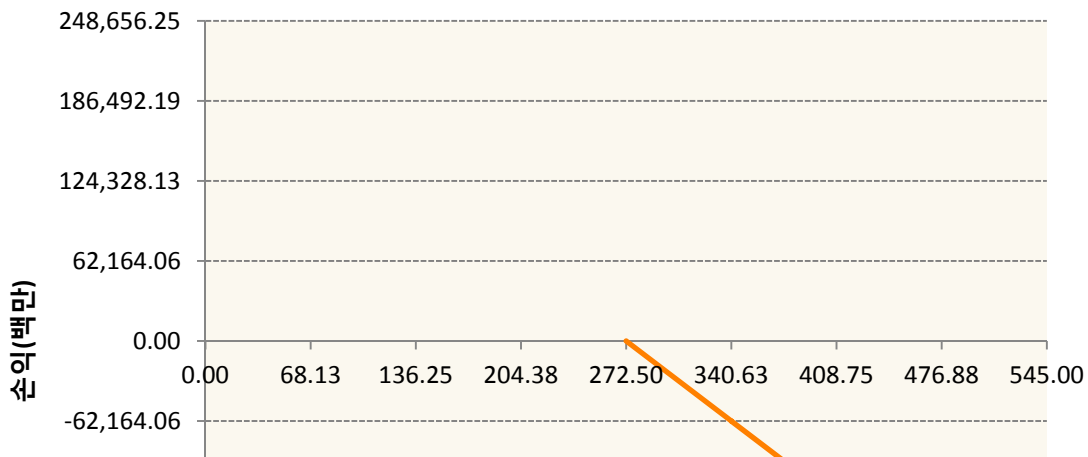
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 614,506 | -614,506 | 장내 |

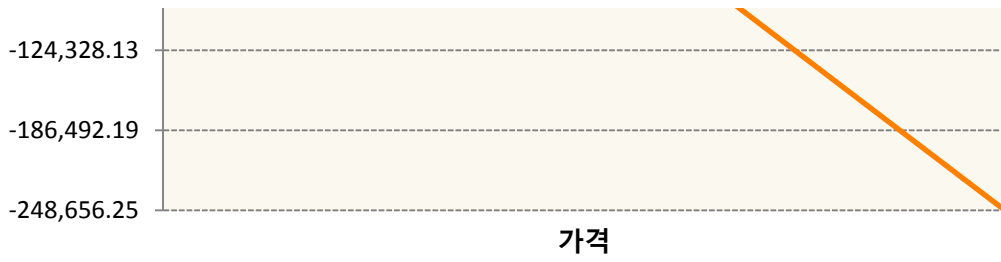
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P62701-2019-06 콜270



KR4201P62727-2019-06 콜272.5





KR4301P62709-2019-06 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4201P62701 | | 2019-06 콜270 | | | | | 8,471 |
|--------------|---------|----------------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 1,710 | 1,702 | 1,688 | 1,666 | 1,632 | 1,588 | 1,532 |
| -5.33% | 1,671 | 1,632 | 1,577 | 1,506 | 1,419 | 1,317 | 1,201 |
| -2.67% | 1,455 | 1,335 | 1,195 | 1,040 | 871 | 691 | 501 |
| 0% | 705 | 476 | 241 | 0 | -245 | -494 | -745 |
| 2.67% | -1,023 | -1,296 | -1,569 | -1,842 | -2,115 | -2,388 | -2,661 |
| 5.33% | -3,869 | -4,082 | -4,306 | -4,537 | -4,775 | -5,019 | -5,266 |
| 8.00% | -7,542 | -7,655 | -7,787 | -7,938 | -8,103 | -8,282 | -8,471 |
| KR4201P62727 | | 2019-06 콜272.5 | | | | | 11,658 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 1,938 | 1,932 | 1,919 | 1,897 | 1,862 | 1,813 | 1,749 |

| | | | | | | | | |
|--------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|--------------|--------|
| -5.33% | 1,908 | 1,871 | 1,815 | 1,737 | 1,636 | 1,514 | 1,372 | |
| -2.67% | 1,714 | 1,580 | 1,417 | 1,228 | 1,015 | 782 | 531 | |
| 0% | 934 | 640 | 327 | 0 | -338 | -686 | -1,042 | |
| 2.67% | -1,098 | -1,508 | -1,919 | -2,331 | -2,743 | -3,155 | -3,568 | |
| 5.33% | -4,809 | -5,181 | -5,561 | -5,948 | -6,339 | -6,734 | -7,133 | |
| 8.00% | -9,968 | -10,195 | -10,449 | -10,726 | -11,022 | -11,334 | -11,658 | |
| KR4301P62709 | | | | | | | 2019-06 풋270 | 14,923 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -14,912 | -14,912 | -14,912 | -14,913 | -14,915 | -14,917 | -14,923 | |
| -5.33% | -9,640 | -9,642 | -9,647 | -9,656 | -9,670 | -9,692 | -9,721 | |
| -2.67% | -4,400 | -4,431 | -4,476 | -4,534 | -4,605 | -4,688 | -4,781 | |
| 0% | 462 | 318 | 164 | 0 | -171 | -347 | -528 | |
| 2.67% | 3,870 | 3,653 | 3,436 | 3,219 | 3,001 | 2,784 | 2,566 | |
| 5.33% | 5,238 | 5,121 | 4,989 | 4,846 | 4,692 | 4,530 | 4,362 | |
| 8.00% | 5,502 | 5,477 | 5,440 | 5,390 | 5,328 | 5,252 | 5,165 | |

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

(단위:백만원)

35,694

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-31 |
| 기준일 | 2019-05-30 |

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

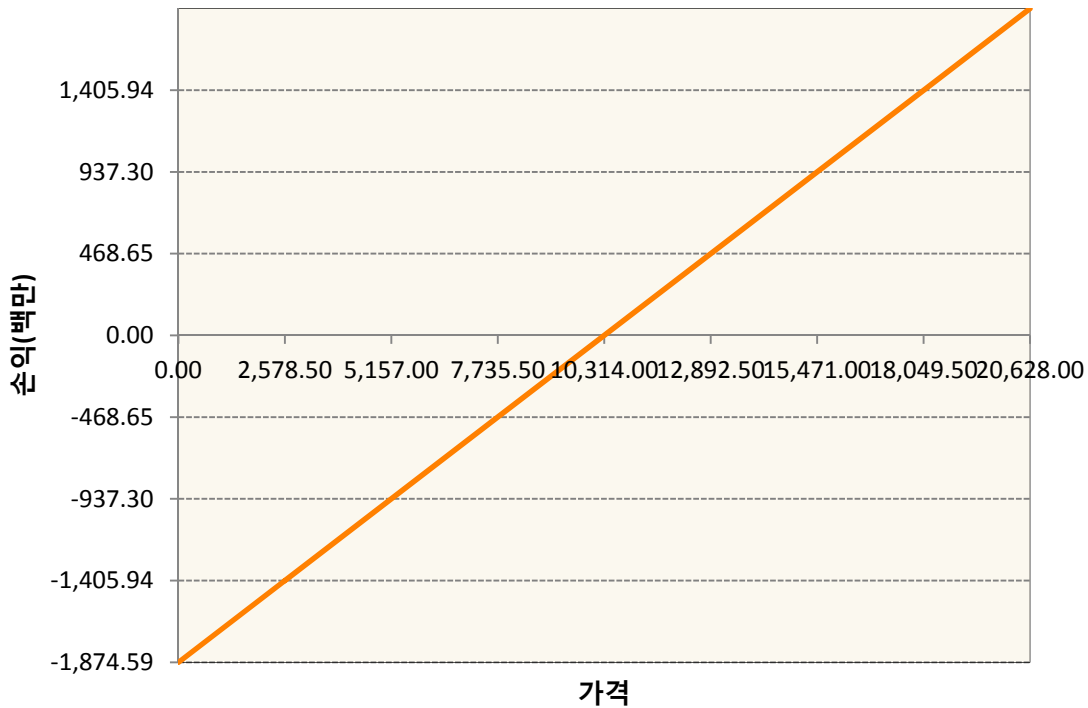
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,875 | 0 | 1,875 | 장내 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 151 | 3,181 | -3,029 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|------------------------------|-----|
| FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E | 254 |
| FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E | 12 |
| HCM9 HSCEI Futures Jun19 | 150 |

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

(단위:백만원)

241

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-31 |
| 기준일 | 2019-05-30 |

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

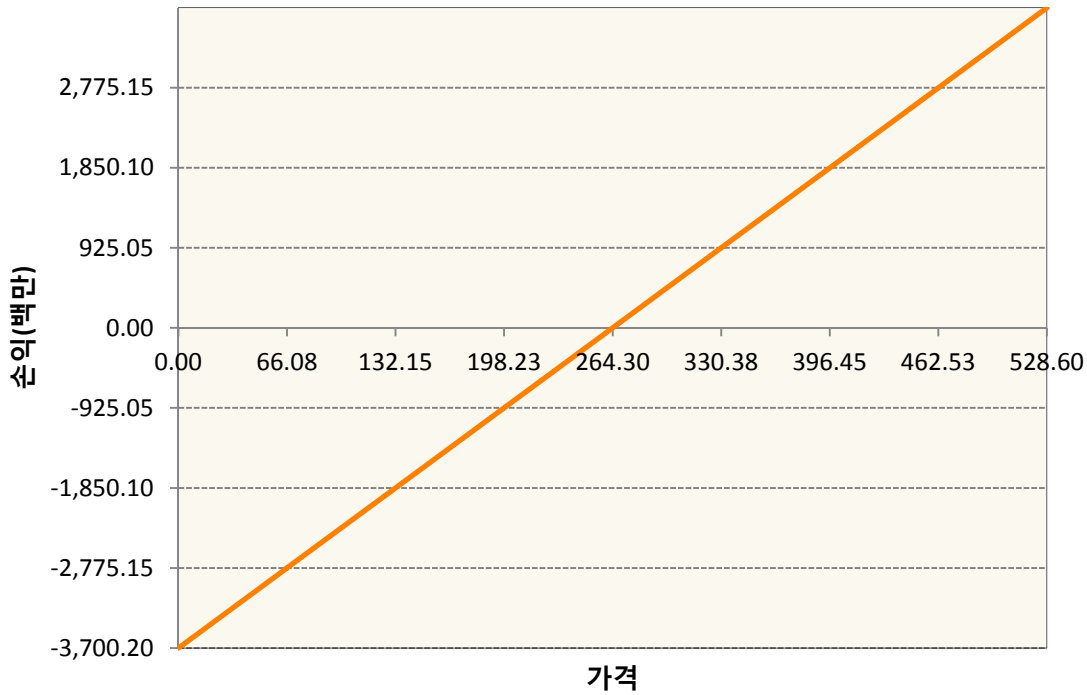
1. 계약금액

(단위:백만원)

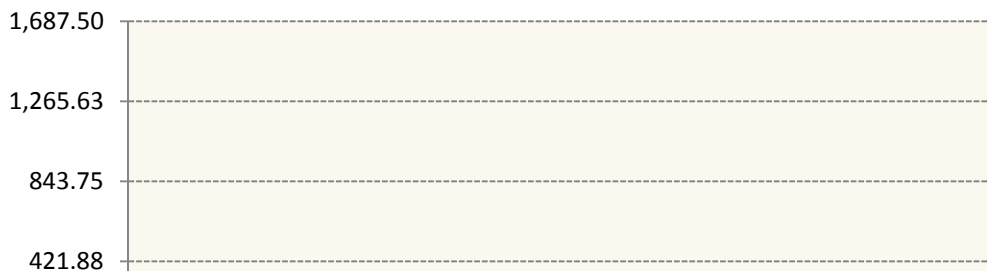
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,700 | 0 | 3,700 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 20,836 | 0 | 20,836 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 21,759 | -21,759 | 장내 |

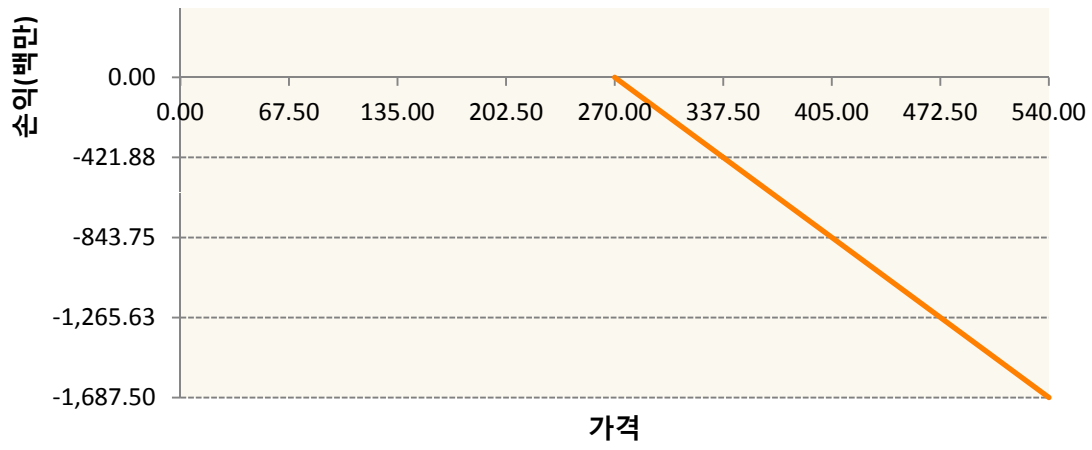
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

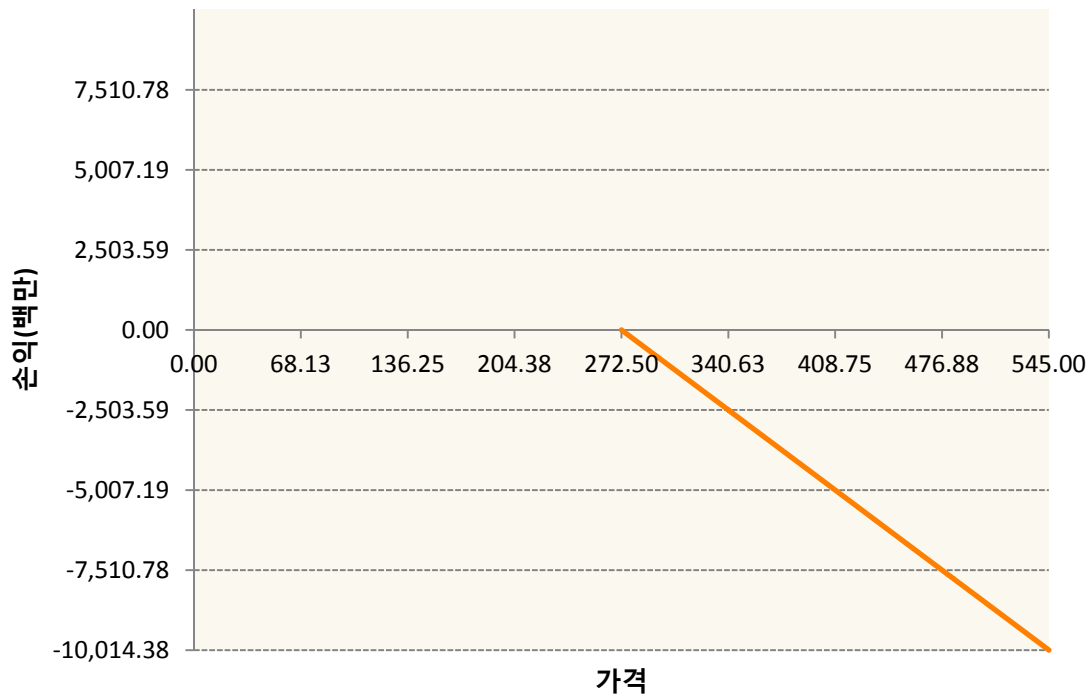


KR4201P62701-2019-06 콜270

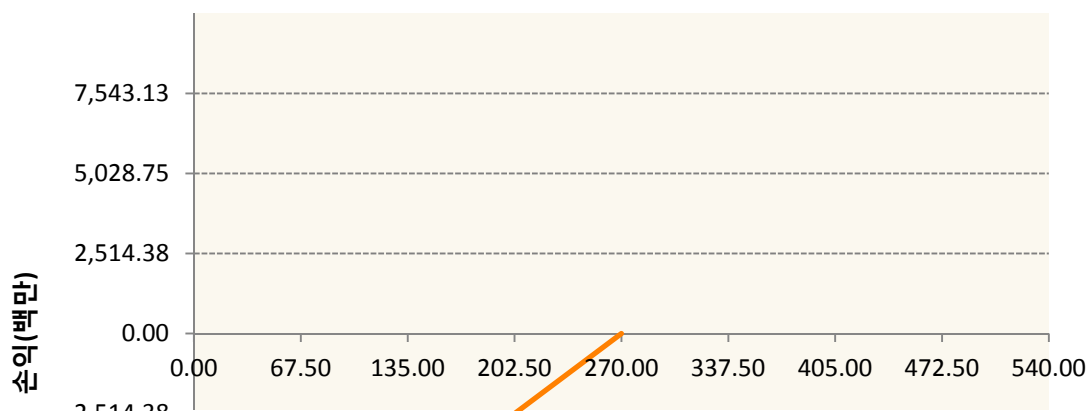


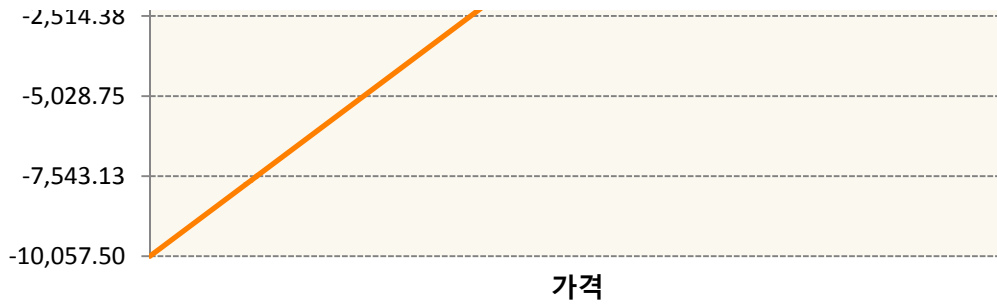


KR4201P62727-2019-06 콜272.5



KR4301P62709-2019-06 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| 2.529E+11 | | UBCSFXC1 INDEX_14 | | | | | | 1,192 |
|--------------|---------|--------------------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -1,192 | -1,192 | -1,192 | -1,192 | -1,192 | -1,192 | -1,192 | |
| -5.33% | -795 | -795 | -795 | -795 | -795 | -795 | -795 | |
| -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% | 795 | 795 | 795 | 795 | 795 | 795 | 795 | |
| 8.00% | 1,192 | 1,192 | 1,192 | 1,192 | 1,192 | 1,192 | 1,192 | |
| 2.529E+11 | | UBCSFXC1 INDEX_15 | | | | | | 603 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -603 | -603 | -603 | -603 | -603 | -603 | -603 | |
| -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% | 603 | 603 | 603 | 603 | 603 | 603 | 603 | |
| 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 | | | | | | 88 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |

| | | | | | | | |
|----------------------------------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| -8.00% | 18 | 18 | 17 | 17 | 17 | 16 | 16 |
| -5.33% | 17 | 17 | 16 | 16 | 15 | 14 | 12 |
| -2.67% | 15 | 14 | 12 | 11 | 9 | 7 | 5 |
| 0% | 7 | 5 | 2 | 0 | -3 | -5 | -8 |
| 2.67% | -11 | -13 | -16 | -19 | -22 | -25 | -27 |
| 5.33% | -40 | -42 | -44 | -47 | -49 | -52 | -54 |
| 8.00% | -78 | -79 | -80 | -82 | -84 | -86 | -88 |
| KR4201P62727 2019-06 콜272.5 | | | | | | | 470 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 78 | 78 | 77 | 76 | 75 | 73 | 70 |
| -5.33% | 77 | 75 | 73 | 70 | 66 | 61 | 55 |
| -2.67% | 69 | 64 | 57 | 49 | 41 | 31 | 21 |
| 0% | 38 | 26 | 13 | 0 | -14 | -28 | -42 |
| 2.67% | -44 | -61 | -77 | -94 | -110 | -127 | -144 |
| 5.33% | -194 | -209 | -224 | -240 | -255 | -271 | -287 |
| 8.00% | -401 | -411 | -421 | -432 | -444 | -456 | -470 |
| KR4301P62709 2019-06 풋270 | | | | | | | 741 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -741 | -741 | -741 | -741 | -741 | -741 | -741 |
| -5.33% | -479 | -479 | -479 | -480 | -480 | -481 | -483 |
| -2.67% | -219 | -220 | -222 | -225 | -229 | -233 | -237 |
| 0% | 23 | 16 | 8 | 0 | -8 | -17 | -26 |
| 2.67% | 192 | 181 | 171 | 160 | 149 | 138 | 127 |
| 5.33% | 260 | 254 | 248 | 241 | 233 | 225 | 217 |
| 8.00% | 273 | 272 | 270 | 268 | 265 | 261 | 257 |

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

(단위:백만원)

3,409

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-31 |
| 기준일 | 2019-05-30 |

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

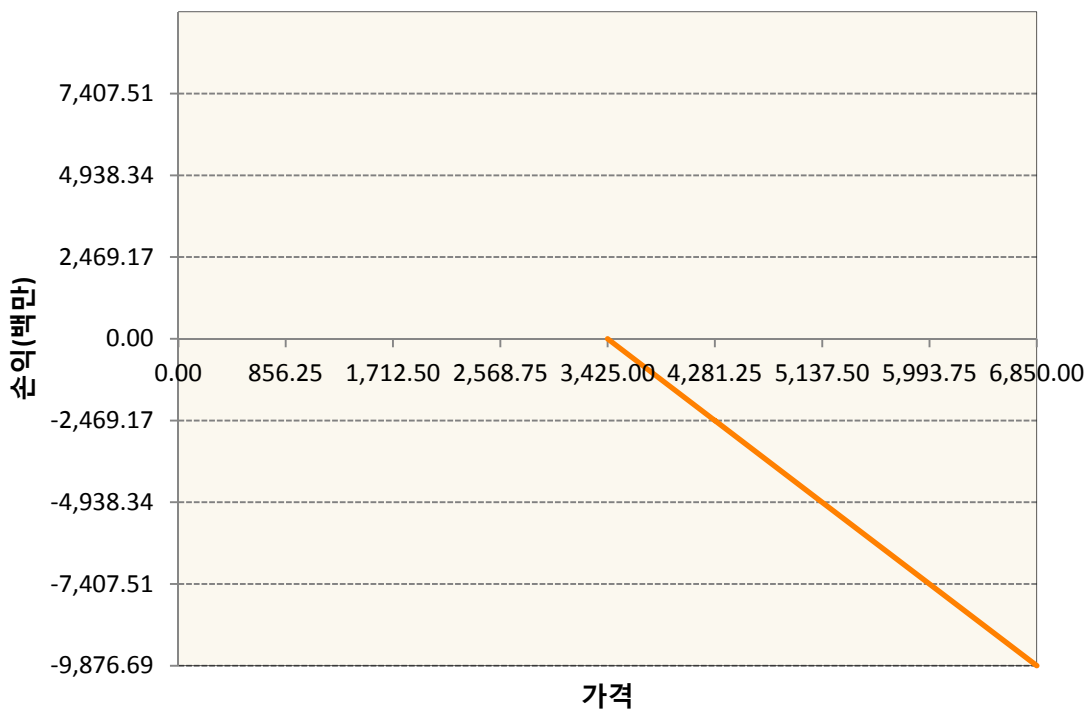
1. 계약금액

(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 | 3,594 | 0 | 3,594 | |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 55,994 | 0 | 55,994 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 20,301 | -20,301 | 장내 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 18,520 | -18,520 | 장외 |

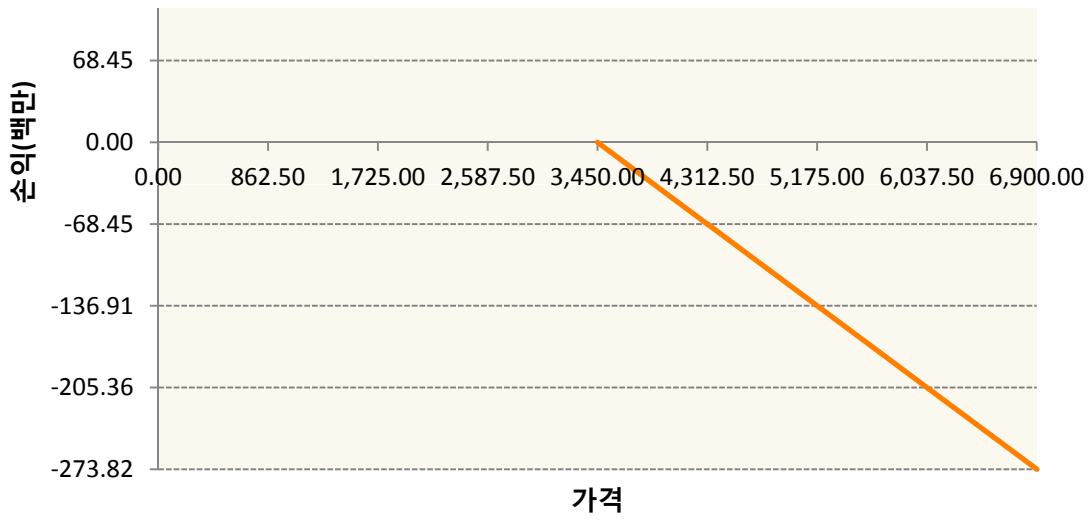
2. 만기시점의 손익구조

OESXM9-C3425-EURO STOXX 50

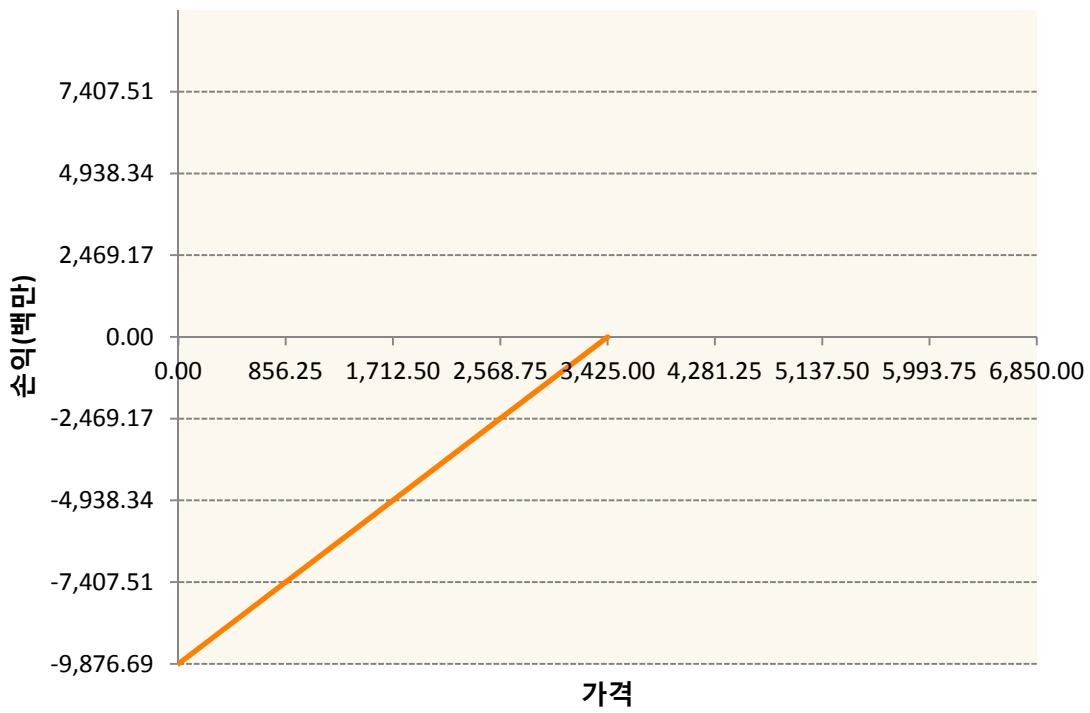


OESXM9-C3450-EURO STOXX 50

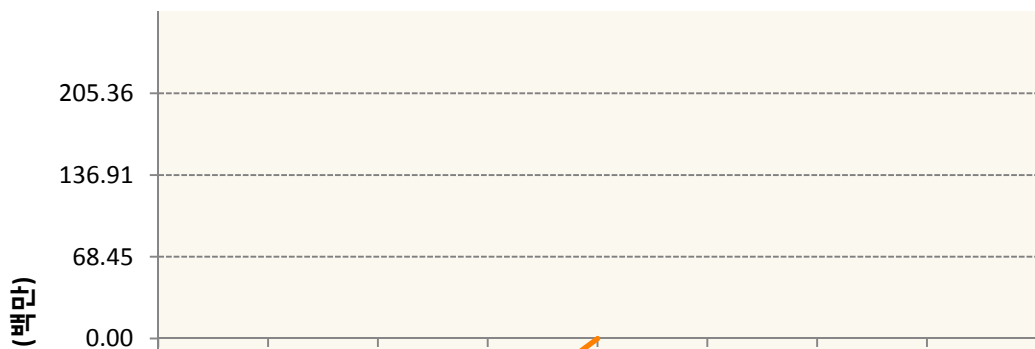


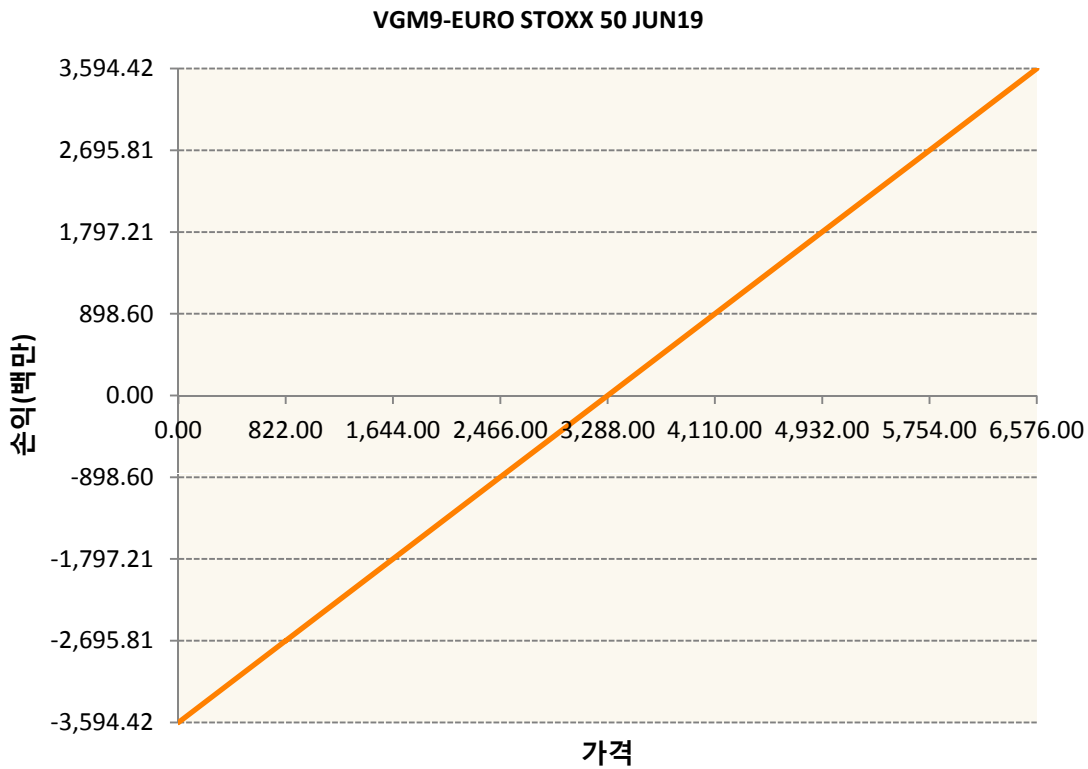
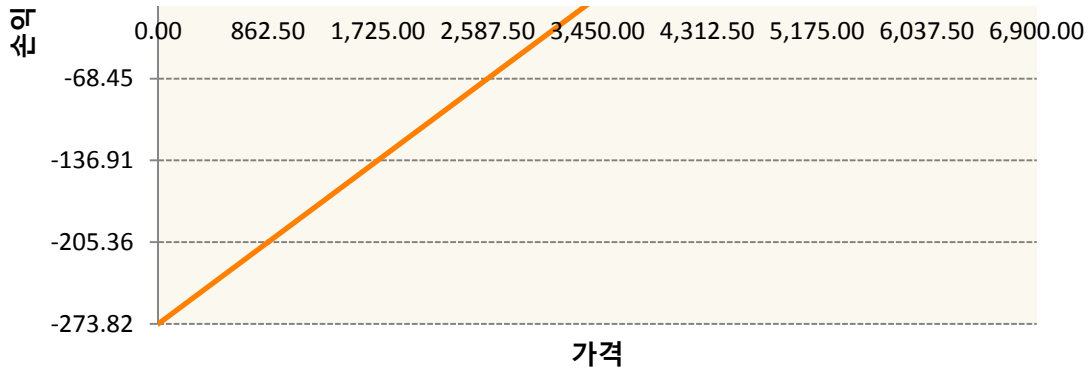


OESXM9-P3425-EURO STOXX 50



OESXM9-P3450-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | |
|---|-----|
| 260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY | 128 |
| FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E | 847 |
| FX21019J01: KRW/EUR 28-06-19E | 212 |
| FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E | 423 |
| OESXM9-C3·EURO STOXX 50 | 790 |
| OESXM9-C3·EURO STOXX 50 | 22 |
| OESXM9-P3·EURO STOXX 50 | 790 |
| OESXM9-P3·EURO STOXX 50 | 22 |
| VGM9 EURO STOXX 50 JUN19 | 288 |

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

(단위:백만원)

2,264

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

(단위:백만원)

1,011

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

(단위:백만원)

89

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

(단위:백만원)

130

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-31 |
| 기준일 | 2019-05-30 |

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

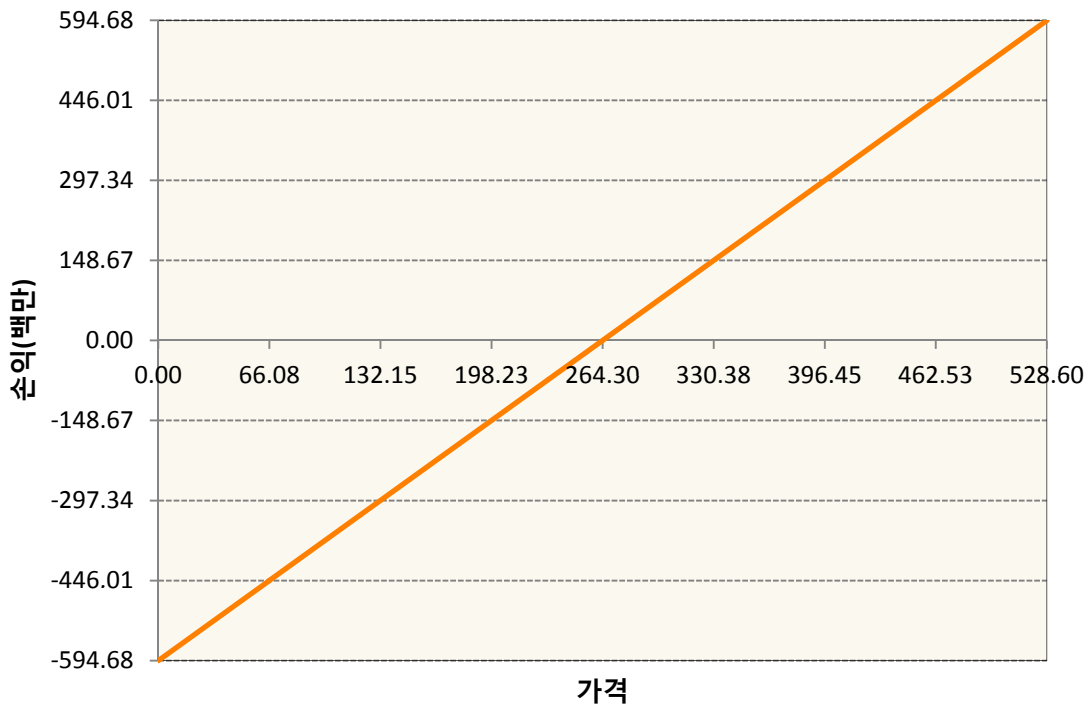
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 595 | 0 | 595 | 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 | 2019-05-31 |
| 기준일 | 2019-05-30 |

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

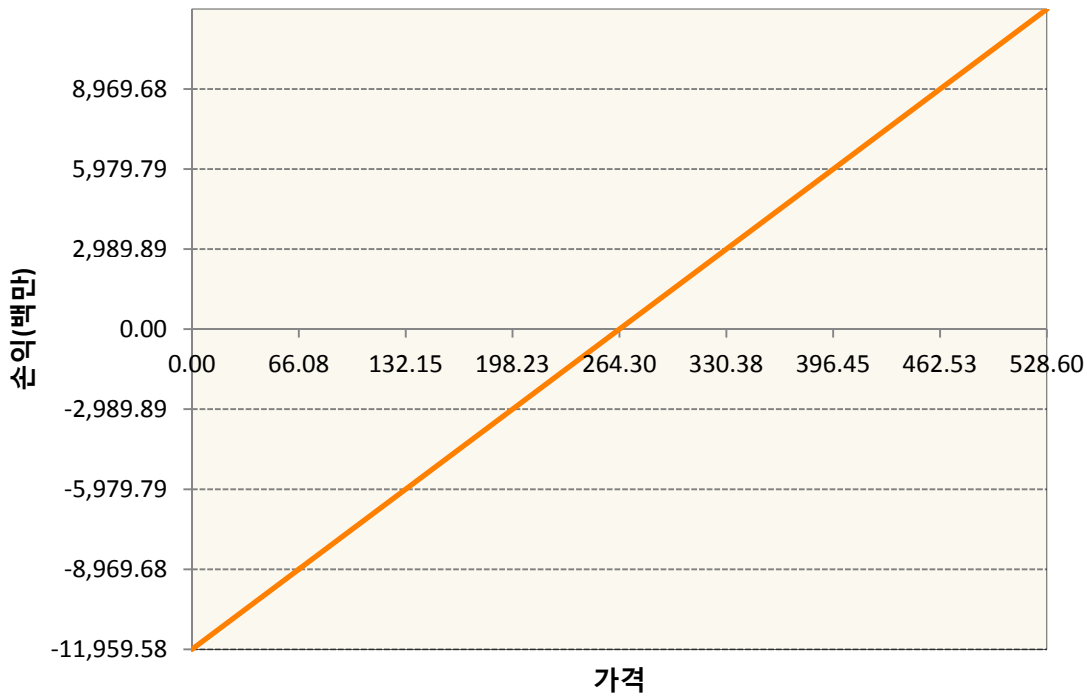
1. 계약금액

(단위:백만원)

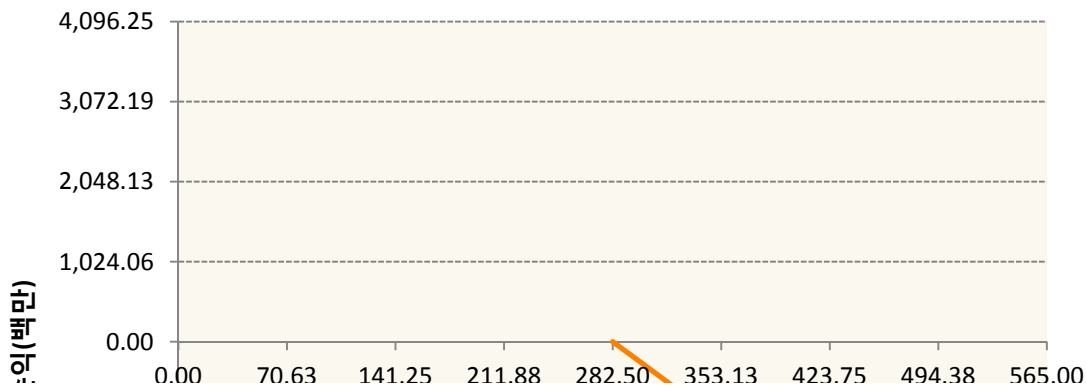
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 11,960 | 0 | 11,960 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 5,081 | 22,906 | -17,825 | 장내 |

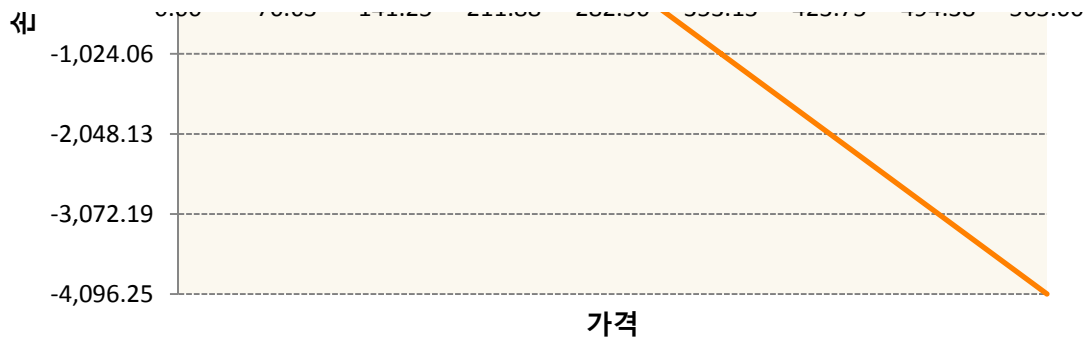
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

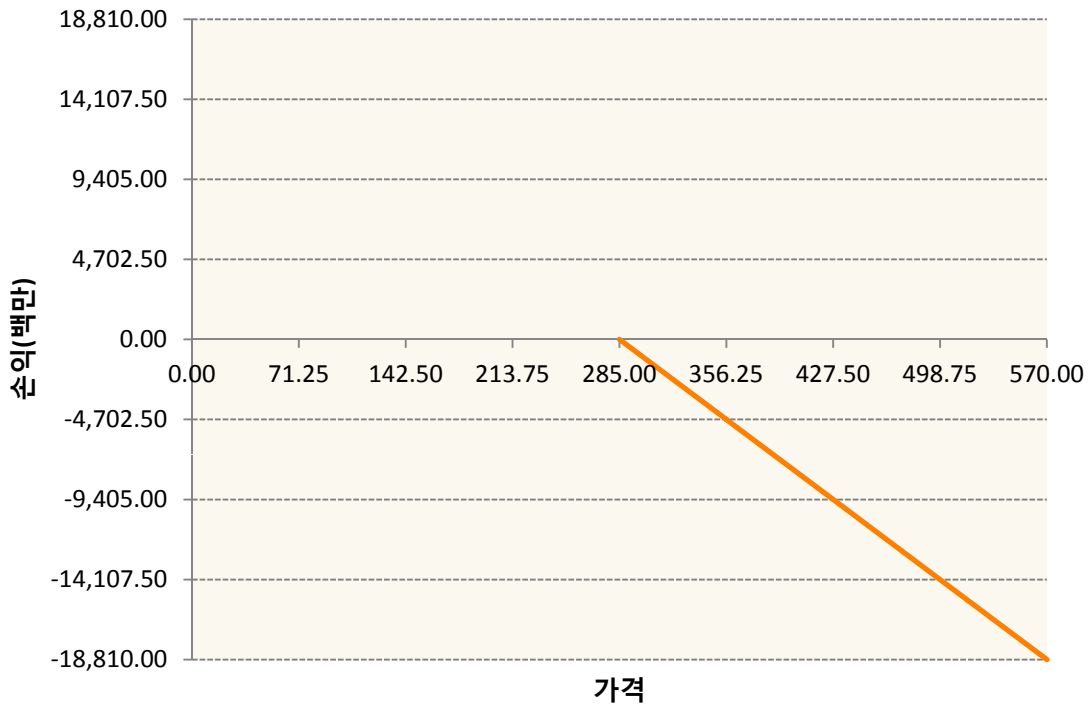


KR4201P62826-2019-06 콜282.5

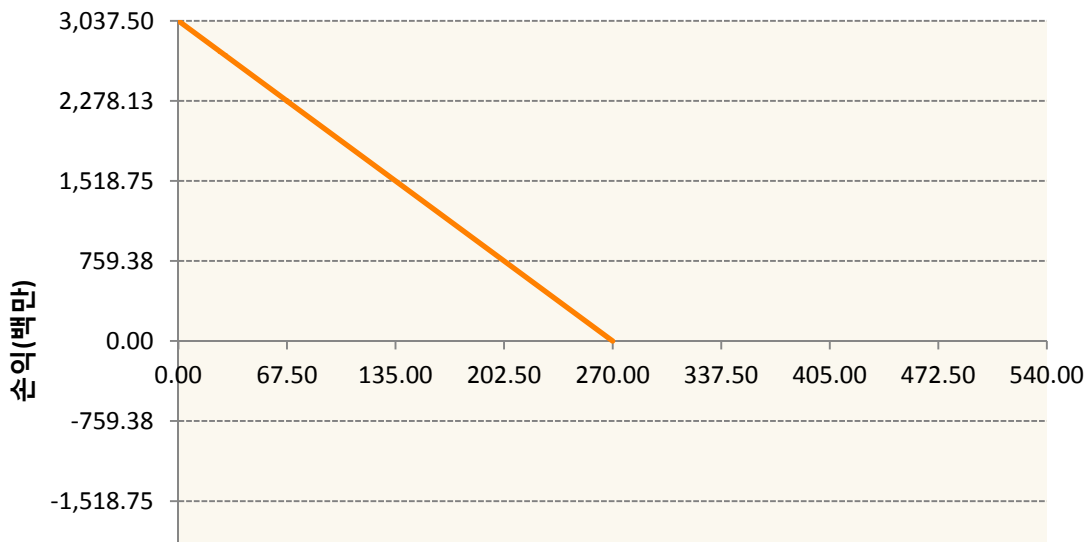


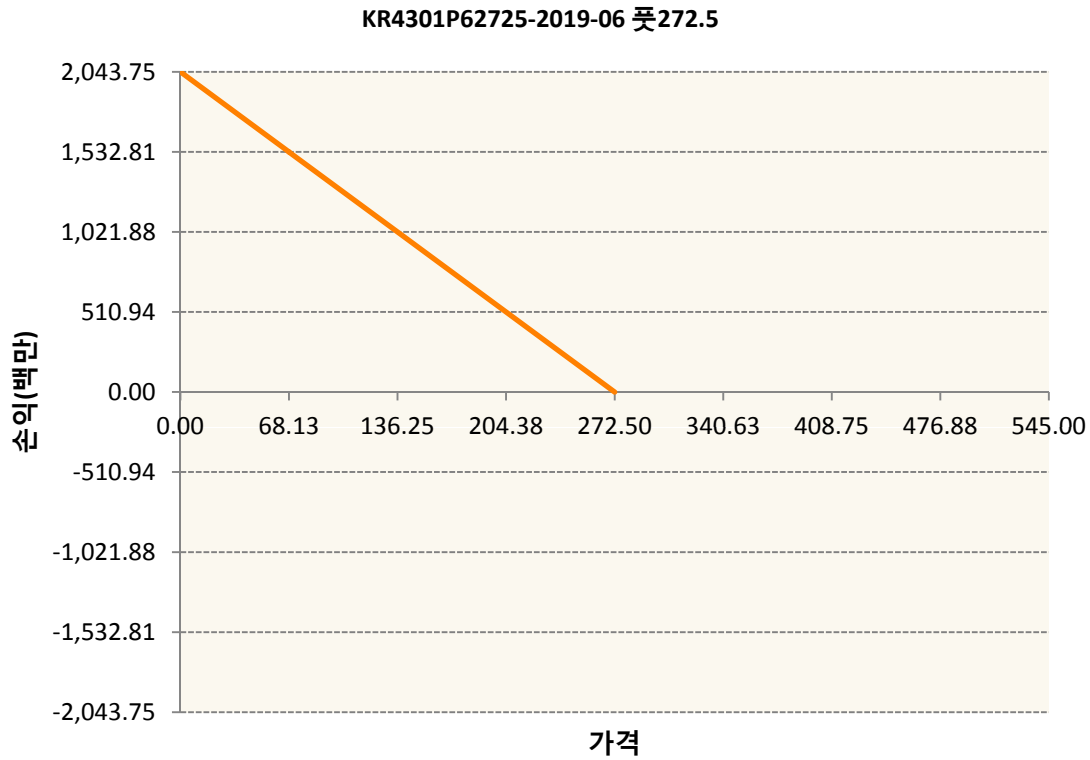
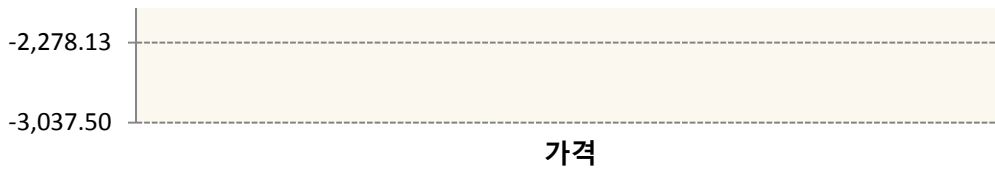


KR4201P62859-2019-06 콜285



KR4301P62709-2019-06 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4101P60004 | | 2019-06 코스피200지수선물 | | | | | | 955 |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
| | | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -955 | -955 | -955 | -955 | -955 | -955 | -955 | |
| -5.33% | -637 | -637 | -637 | -637 | -637 | -637 | -637 | |
| -2.67% | -318 | -318 | -318 | -318 | -318 | -318 | -318 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 318 | 318 | 318 | 318 | 318 | 318 | 318 | |
| 5.33% | 637 | 637 | 637 | 637 | 637 | 637 | 637 | |
| 8.00% | 955 | 955 | 955 | 955 | 955 | 955 | 955 | |
| KR4201P62826 | | 2019-06 콜282.5 | | | | | | 114 |
| | | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 8 | 8 | 8 | 8 | 8 | 8 | 7 | |
| -5.33% | 8 | 8 | 8 | 8 | 7 | 7 | 6 | |
| -2.67% | 8 | 7 | 7 | 6 | 5 | 3 | 1 | |

| | | | | | | | |
|-------|-----|-----|-----|-----|------|------|------|
| 0% | 6 | 4 | 2 | 0 | -3 | -6 | -10 |
| 2.67% | -2 | -6 | -10 | -15 | -20 | -25 | -30 |
| 5.33% | -26 | -32 | -38 | -45 | -51 | -58 | -64 |
| 8.00% | -73 | -80 | -87 | -94 | -100 | -107 | -114 |

KR4201P62859 2019-06 콜285 445

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 25 | 25 | 25 | 25 | 24 | 24 | 23 |
| -5.33% | 25 | 25 | 24 | 24 | 22 | 20 | 18 |
| -2.67% | 24 | 23 | 21 | 18 | 14 | 9 | 2 |
| 0% | 20 | 15 | 8 | 0 | -10 | -22 | -36 |
| 2.67% | -4 | -17 | -33 | -51 | -70 | -90 | -112 |
| 5.33% | -81 | -107 | -133 | -160 | -188 | -216 | -244 |
| 8.00% | -257 | -288 | -320 | -351 | -382 | -414 | -445 |

KR4301P62709 2019-06 풋270 224

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 224 | 224 | 224 | 224 | 224 | 224 | 224 |
| -5.33% | 145 | 145 | 145 | 145 | 145 | 145 | 146 |
| -2.67% | 66 | 66 | 67 | 68 | 69 | 70 | 72 |
| 0% | -7 | -5 | -2 | 0 | 3 | 5 | 8 |
| 2.67% | -58 | -55 | -52 | -48 | -45 | -42 | -38 |
| 5.33% | -79 | -77 | -75 | -73 | -70 | -68 | -65 |
| 8.00% | -83 | -82 | -82 | -81 | -80 | -79 | -77 |

KR4301P62725 2019-06 풋272.5 153

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 153 | 153 | 153 | 153 | 153 | 153 | 153 |
| -5.33% | 100 | 100 | 100 | 100 | 100 | 100 | 100 |
| -2.67% | 47 | 48 | 48 | 48 | 49 | 49 | 50 |
| 0% | -3 | -2 | -1 | 0 | 1 | 3 | 4 |
| 2.67% | -44 | -42 | -40 | -38 | -35 | -33 | -31 |
| 5.33% | -64 | -63 | -61 | -59 | -57 | -55 | -53 |
| 8.00% | -70 | -69 | -69 | -68 | -67 | -66 | -65 |

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

(단위:백만원)

1,436

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-31 |
| 기준일 | 2019-05-30 |

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 1,783 | 0 | 1,783 | |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 17,787 | 0 | 17,787 | |

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 | 2019-05-31 |
| 기준일 | 2019-05-30 |

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 0 | 1,726 | -1,726 | |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 56,645 | 0 | 56,645 | |

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 | 2019-05-31 |
| 기준일 | 2019-05-30 |

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 8,322 | 0 | 8,322 | |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 304,703 | 0 | 304,703 | |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 328,822 | -328,822 | 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 |
| 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 |
| FX21019J043 KRW/USD 03-06-19E | | 571 |
| FX21019J044 KRW/USD 03-06-19E | | 476 |
| FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E | | 285 |
| FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E | | 476 |
| 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 | | 571 |
| FX21019K01 KRW/USD 14-06-19E | | 666 |
| FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E | | 571 |
| FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E | | 476 |
| FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E | | 571 |
| FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E | | 1,427 |
| FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E | | 1,331 |
| FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E | | 476 |
| FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E | | 799 |
| FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E | | 635 |
| FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E | | 476 |

| | |
|------------------------------|-------|
| 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 | 1,522 |
| FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E | 285 |
| FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E | 1,236 |
| FX21019K04 KRW/USD 28-06-19E | 1,293 |
| FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E | 666 |
| FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E | 571 |
| FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E | 761 |
| FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E | 761 |

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

(단위:백만원)

8,796

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-31 |
| 기준일 | 2019-05-30 |

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

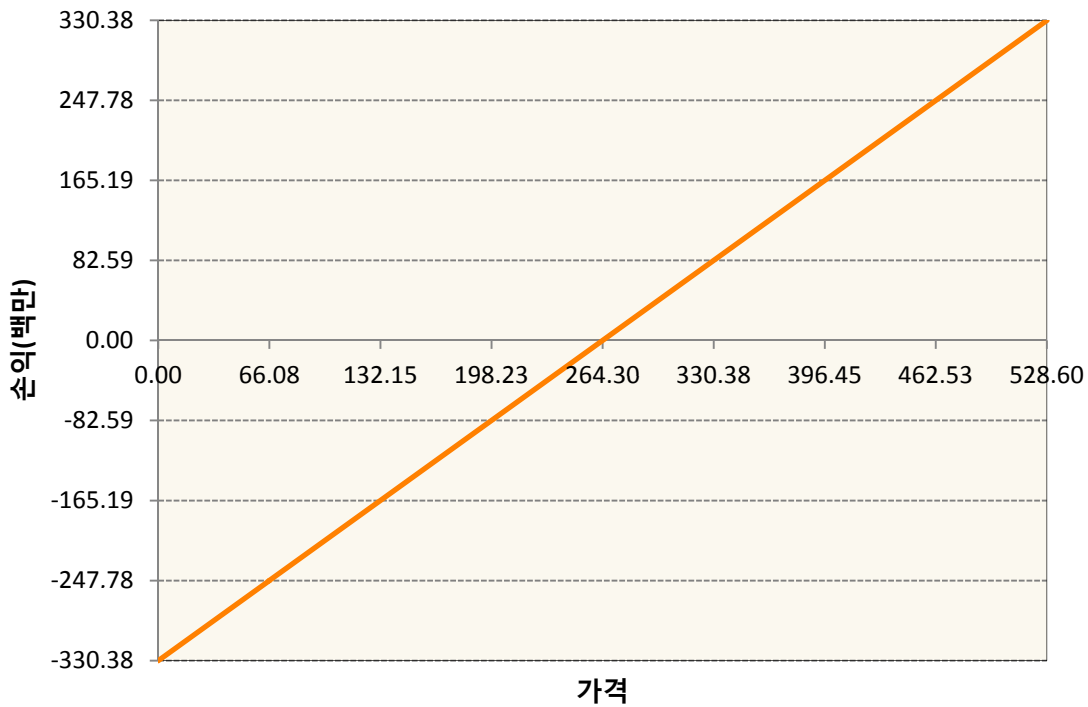
1. 계약금액

(단위:백만원)

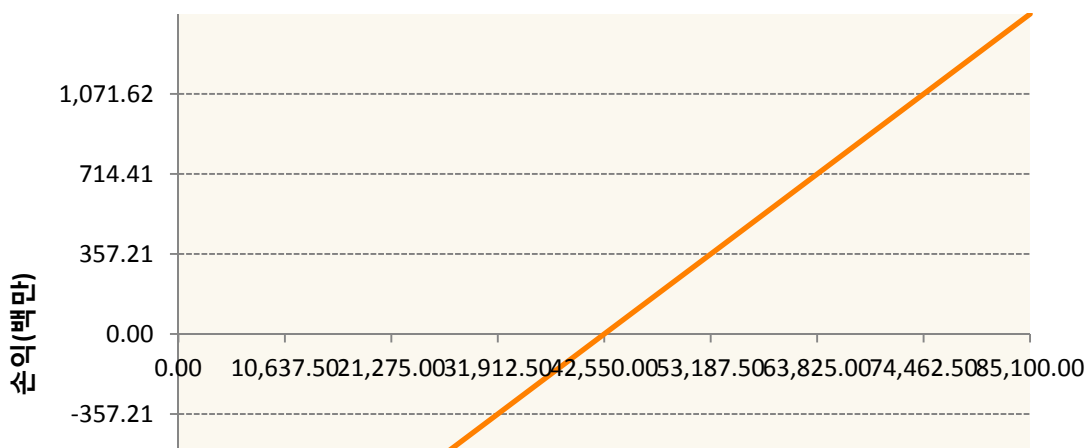
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,759 | 0 | 1,759 | 장내 |

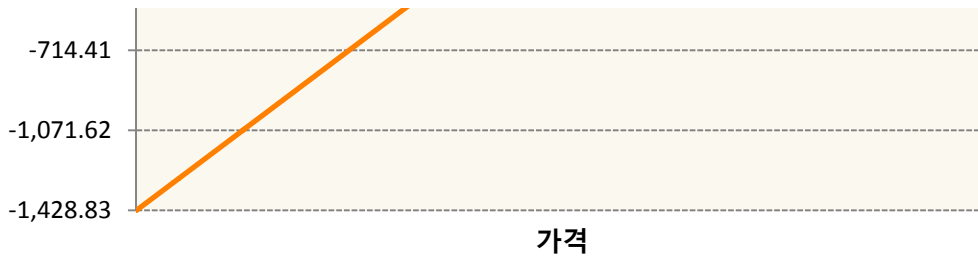
2. 만기시점의 손익구조

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 | | | | | | 114 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -114 | -114 | -114 | -114 | -114 | -114 | -114 | |
| -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% | 114 | 114 | 114 | 114 | 114 | 114 | 114 | |

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

156

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-31 |
| 기준일 | 2019-05-30 |

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

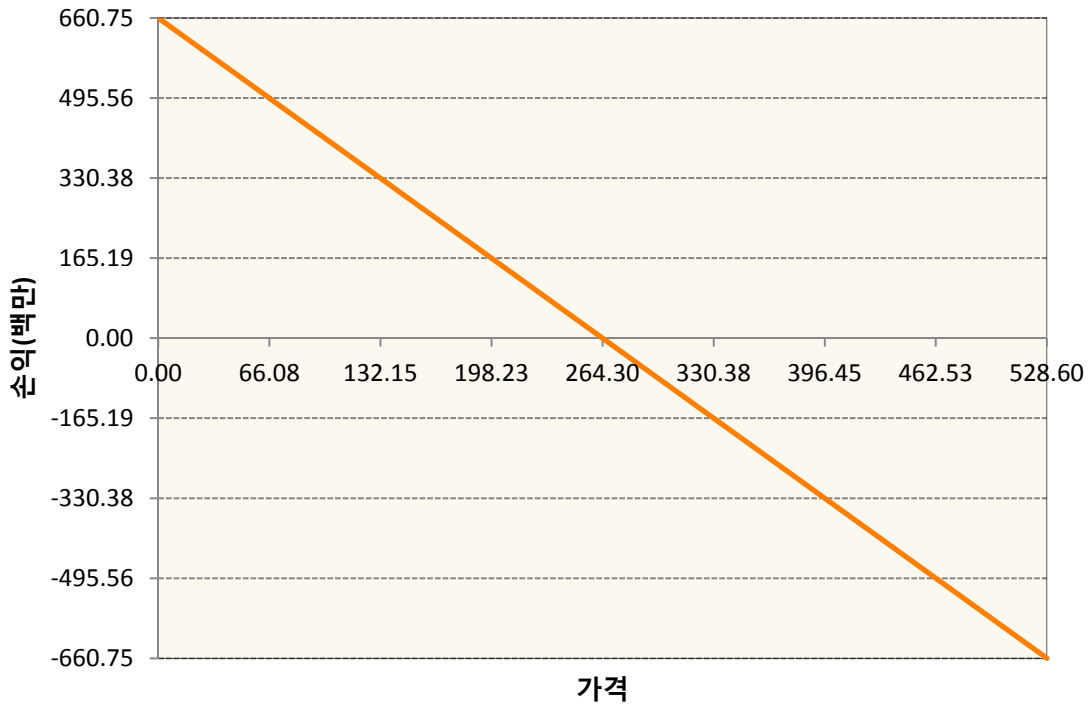
1. 계약금액

(단위:백만원)

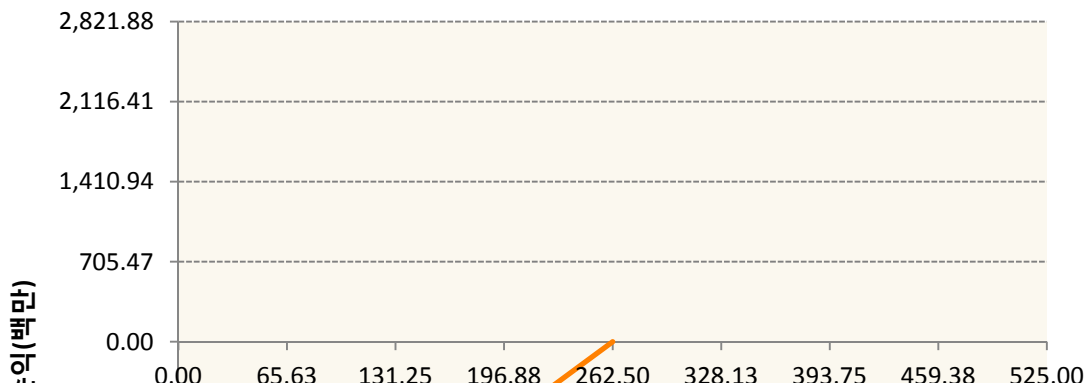
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 661 | -661 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 3,286 | -3,286 | 장내 |

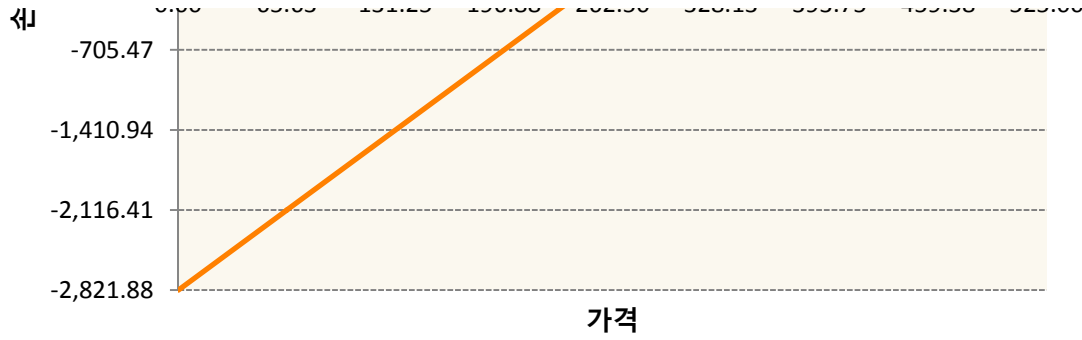
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

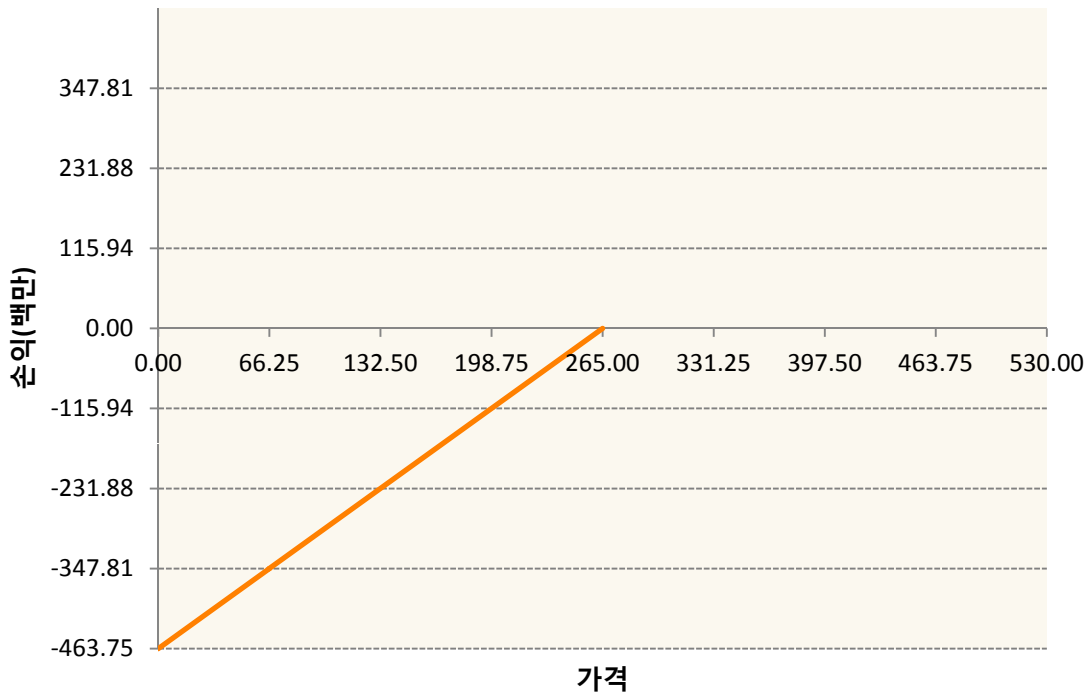


KR4301P62626-2019-06 풋262.5





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 | | | | | | 184 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|--|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -183 | -183 | -183 | -183 | -183 | -183 | -184 |
| -5.33% | -107 | -108 | -109 | -109 | -110 | -112 | -113 |
| -2.67% | -38 | -40 | -42 | -45 | -47 | -50 | -52 |
| 0% | 9 | 6 | 3 | 0 | -3 | -6 | -9 |
| 2.67% | 27 | 25 | 23 | 22 | 20 | 17 | 15 |
| 5.33% | 30 | 29 | 29 | 28 | 28 | 27 | 26 |
| 8.00% | 30 | 30 | 30 | 30 | 29 | 29 | 29 |
| KR4301P62659 2019-06 풋265 | | | | | | | 32 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -32 | -32 | -32 | -32 | -32 | -32 | -32 |
| -5.33% | -20 | -20 | -20 | -20 | -20 | -20 | -20 |
| -2.67% | -8 | -8 | -8 | -9 | -9 | -9 | -10 |
| 0% | 1 | 1 | 0 | 0 | 0 | -1 | -1 |
| 2.67% | 6 | 6 | 5 | 5 | 4 | 4 | 4 |
| 5.33% | 7 | 7 | 7 | 7 | 6 | 6 | 6 |
| 8.00% | 7 | 7 | 7 | 7 | 7 | 7 | 7 |

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

(단위:백만원)

285

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-31 |
| 기준일 | 2019-05-30 |

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

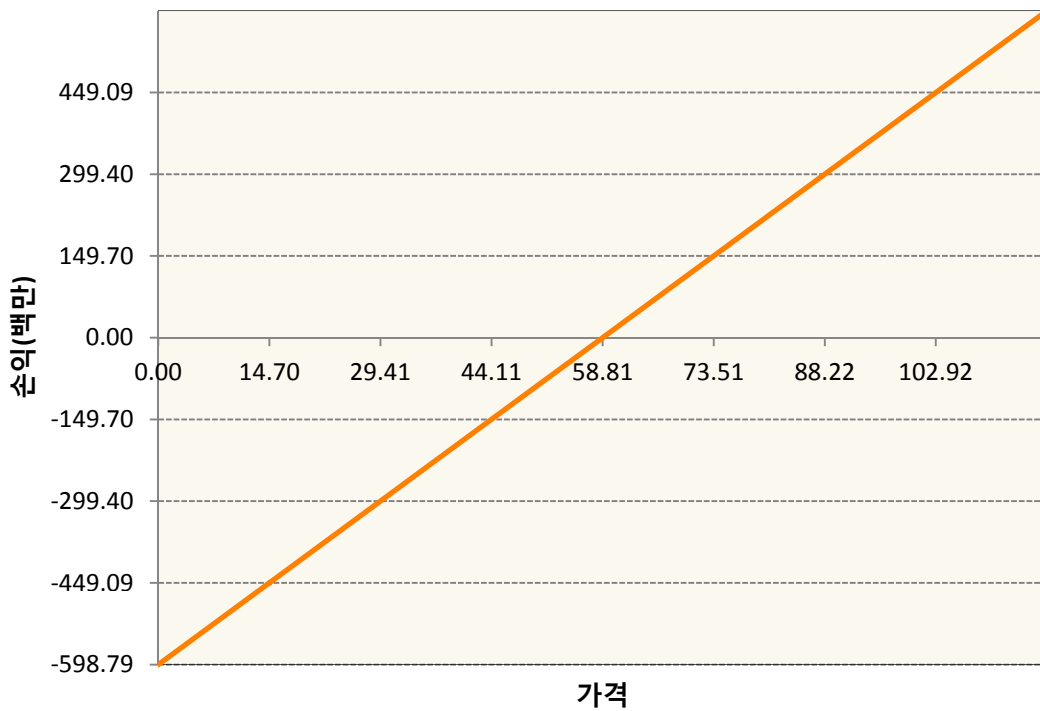
1. 계약금액

(단위:백만원)

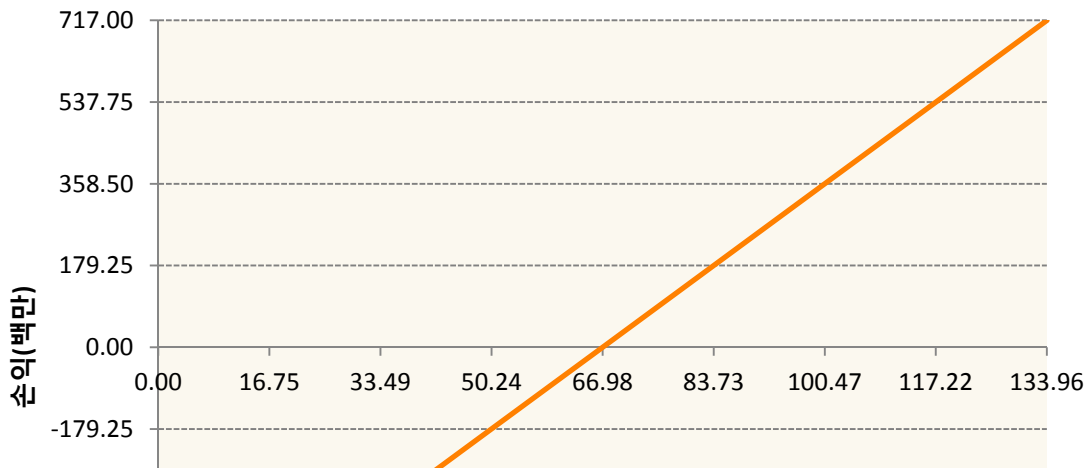
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,677 | 297 | 2,380 | |

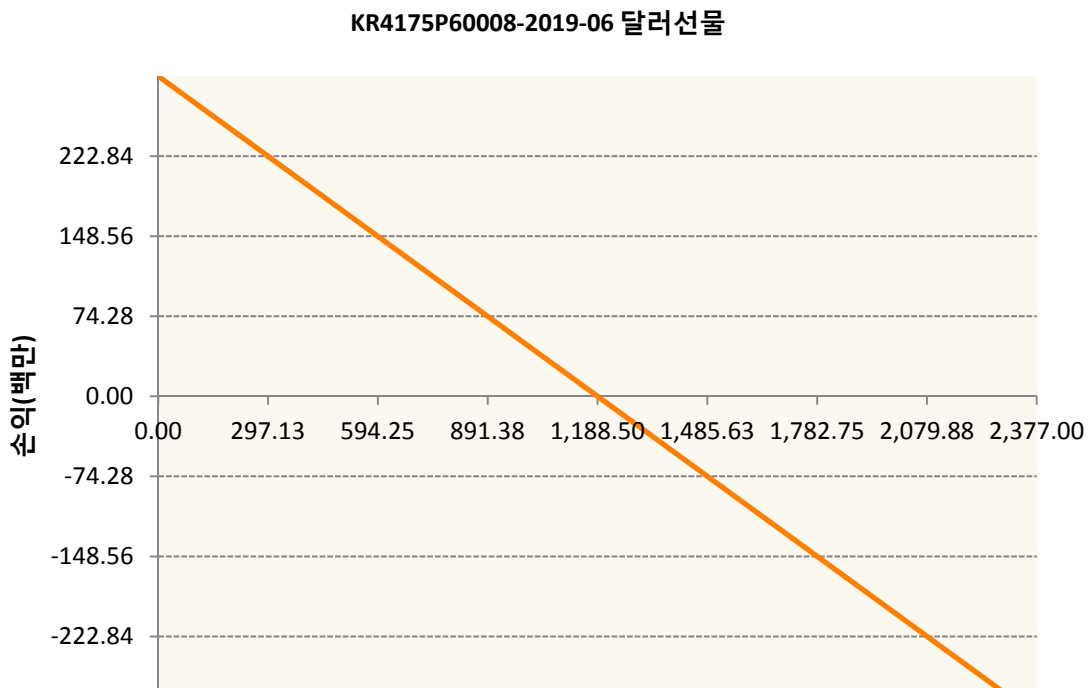
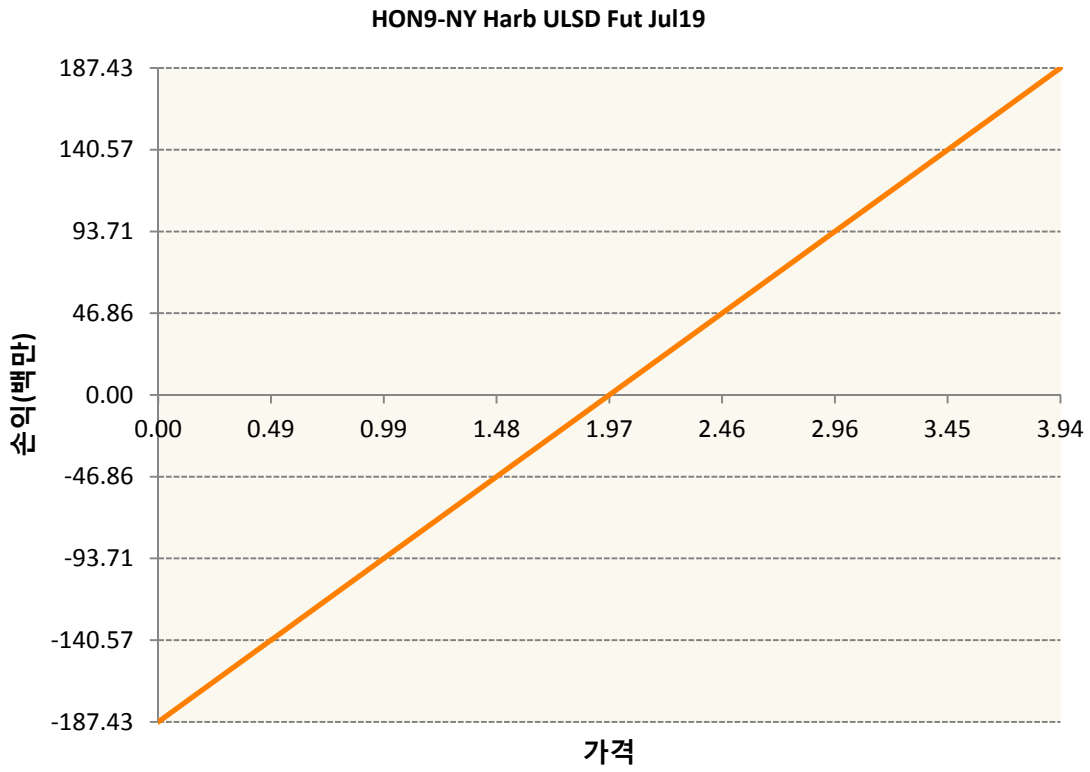
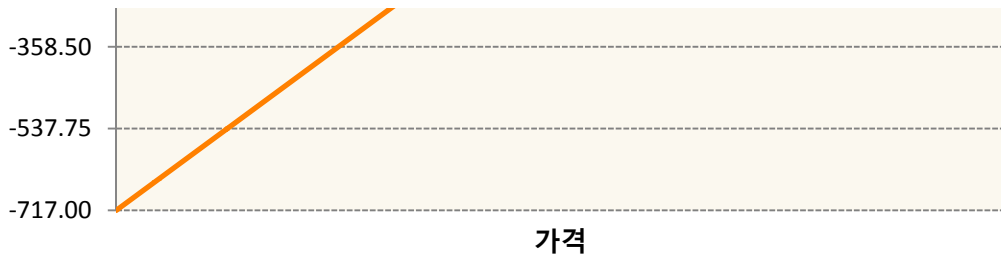
2. 만기시점의 손익구조

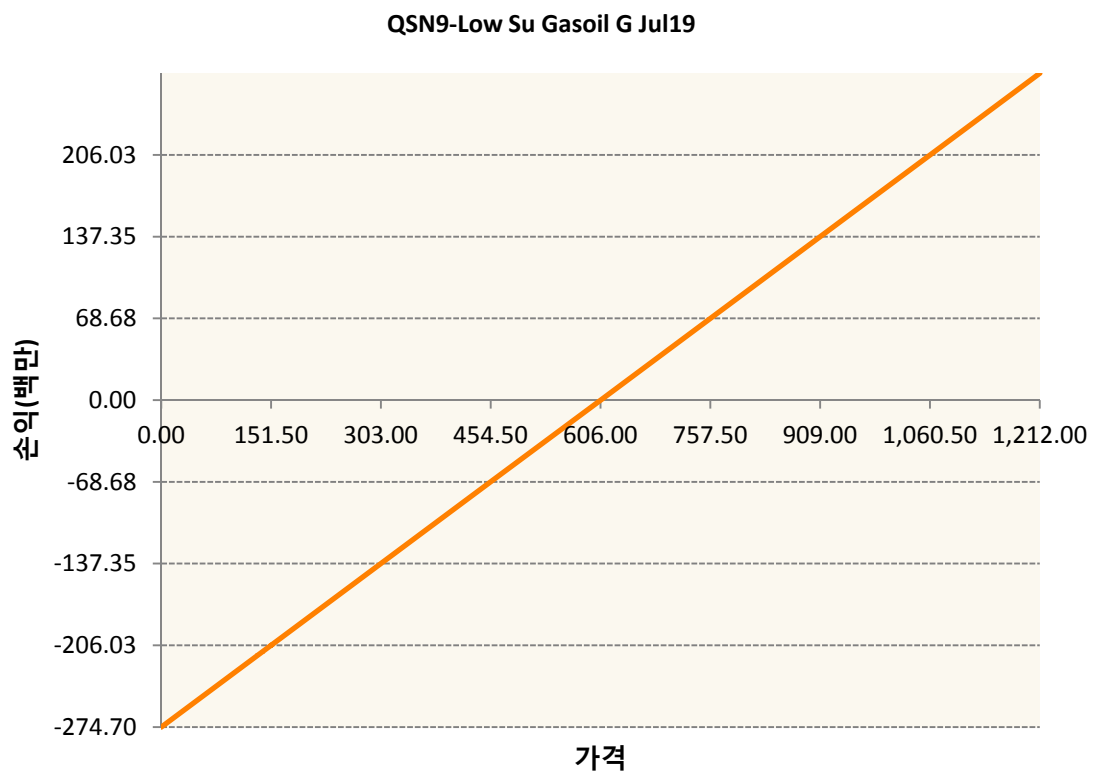
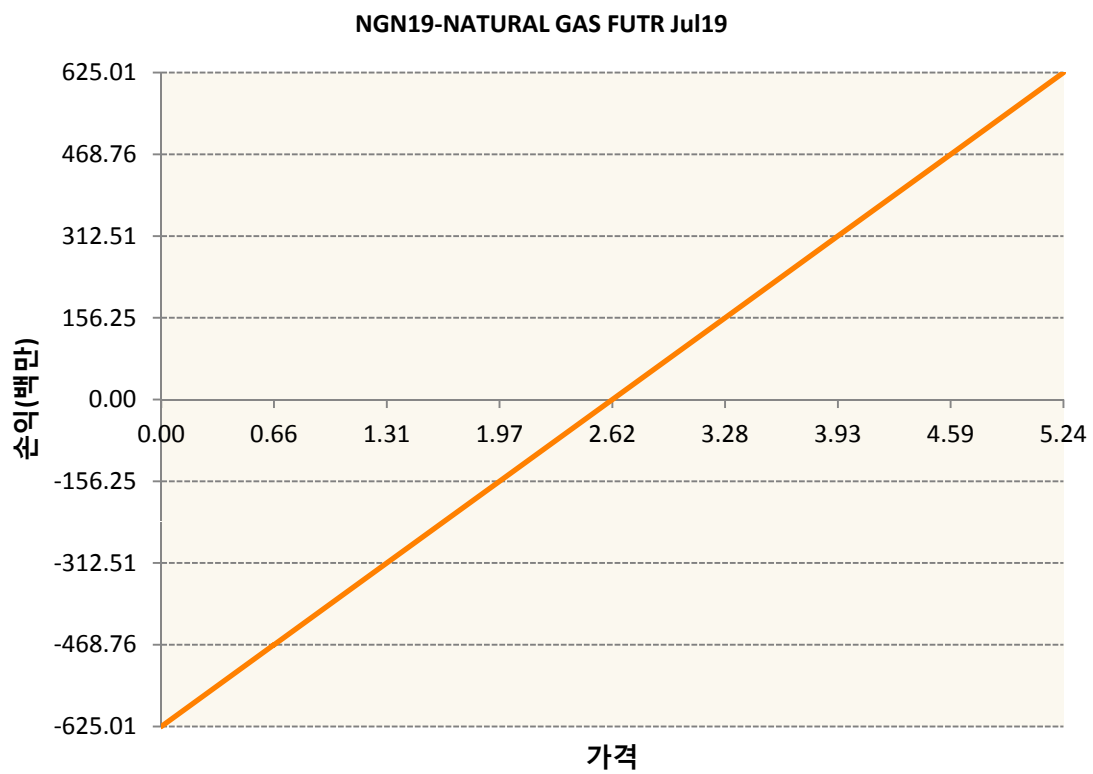
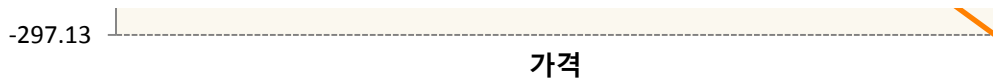
CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19



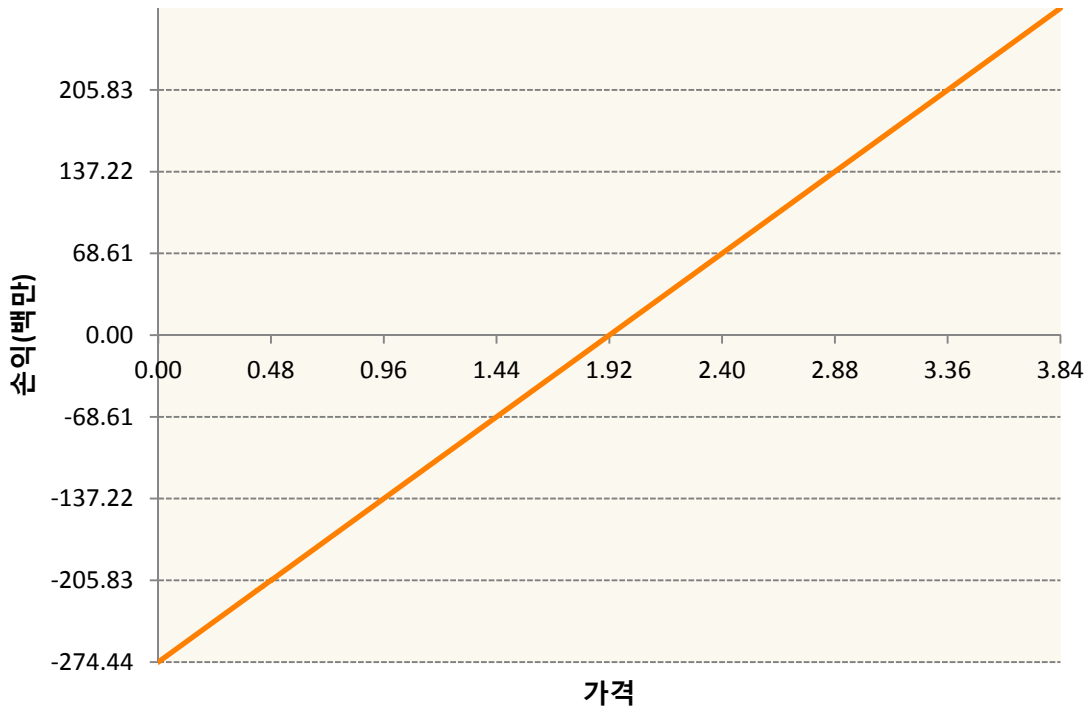
COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19







XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------------|-------------------------|----|
| CLN9 | WTI CRUDE FUTURE Jul19 | 48 |
| COU9 | BRENT CRUDE FUTR Sep19 | 57 |
| HON9 | NY Harb ULSD Fut Jul19 | 15 |
| KR4175P600 | 2019-06 달러선물 | 24 |
| NGN19 | NATURAL GAS FUTR Jul19 | 50 |
| QSN9 | Low Su Gasoil G Jul19 | 22 |
| XBN9 | GASOLINE RBOB FUT Jul19 | 22 |

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

(단위:백만원)

397

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-05-31 |
| 기준일 | 2019-05-30 |

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

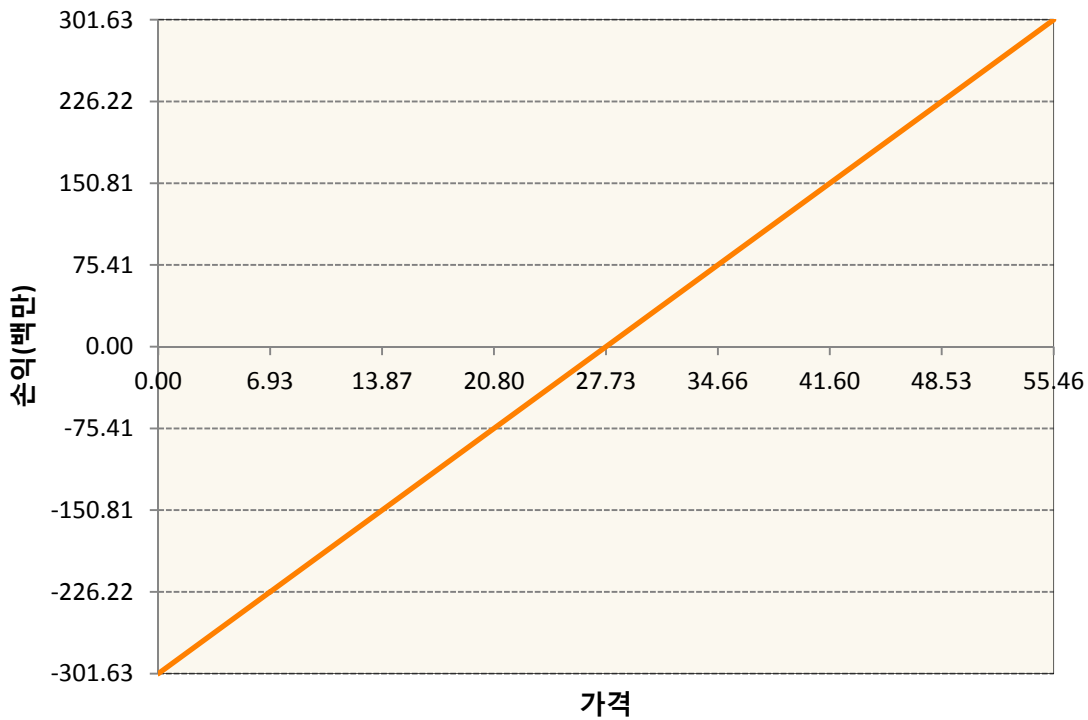
1. 계약금액

(단위:백만원)

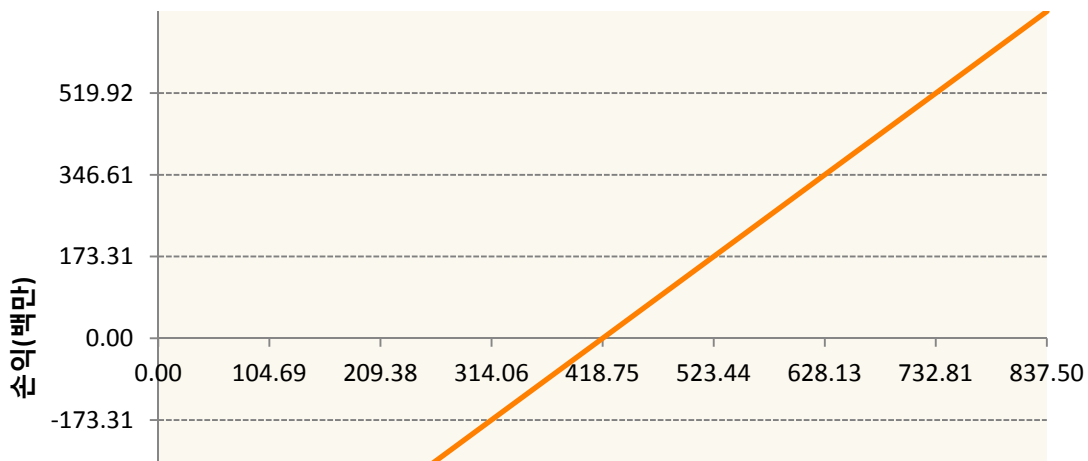
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,072 | 59 | 3,013 | |

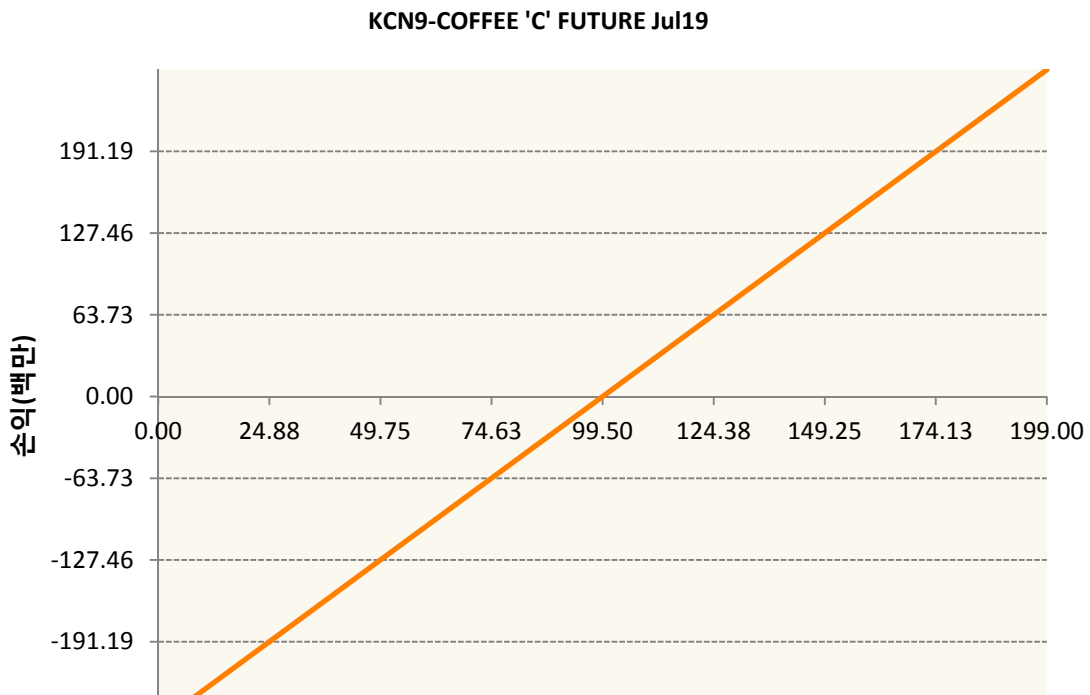
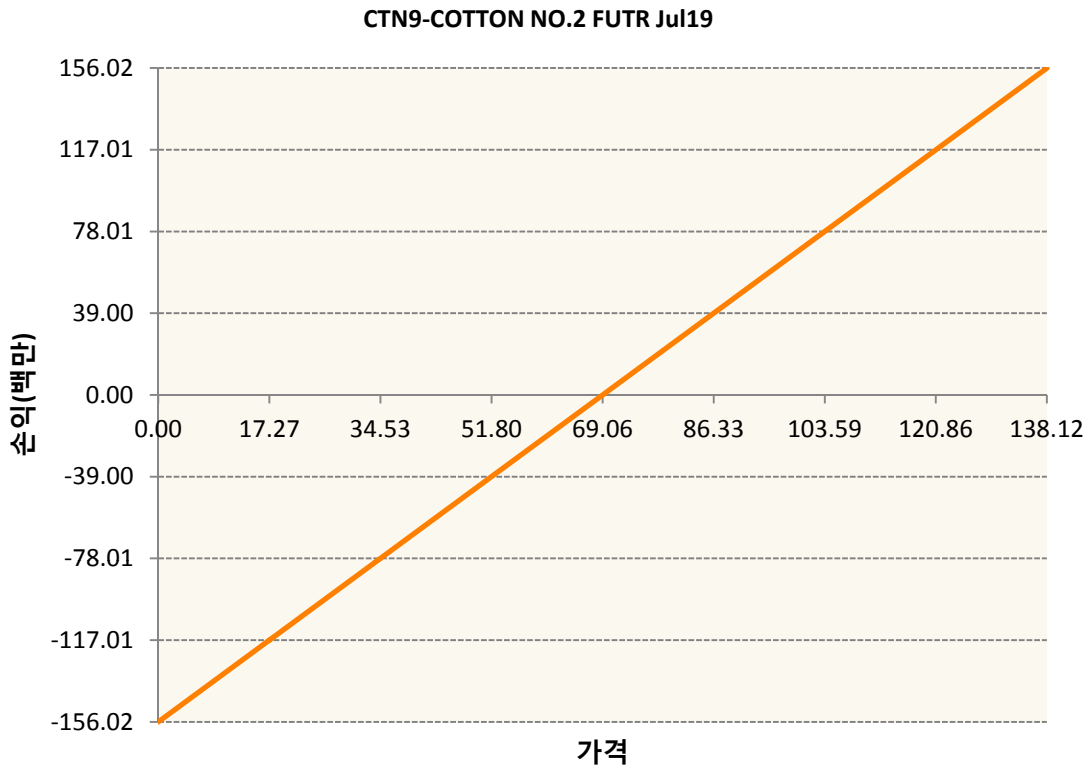
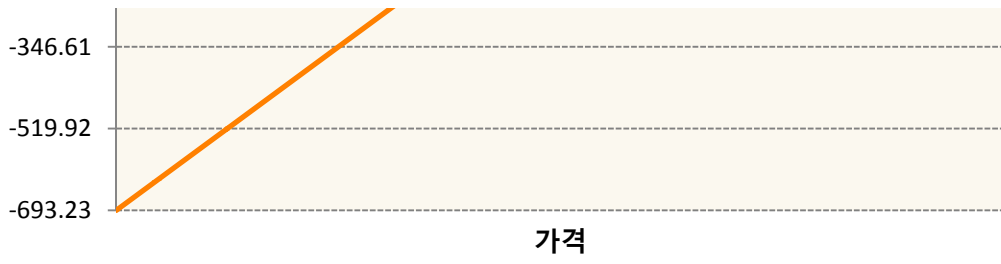
2. 만기시점의 손익구조

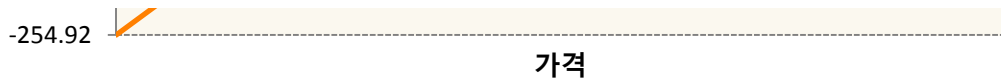
BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19



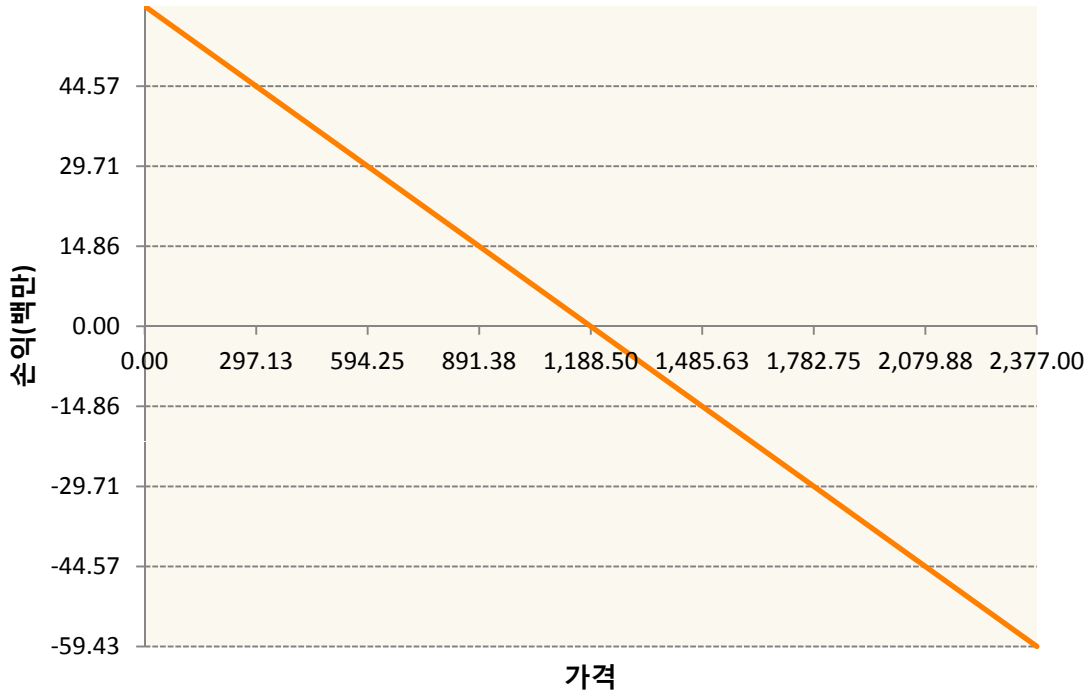
CN9-CORN FUTURE Jul19



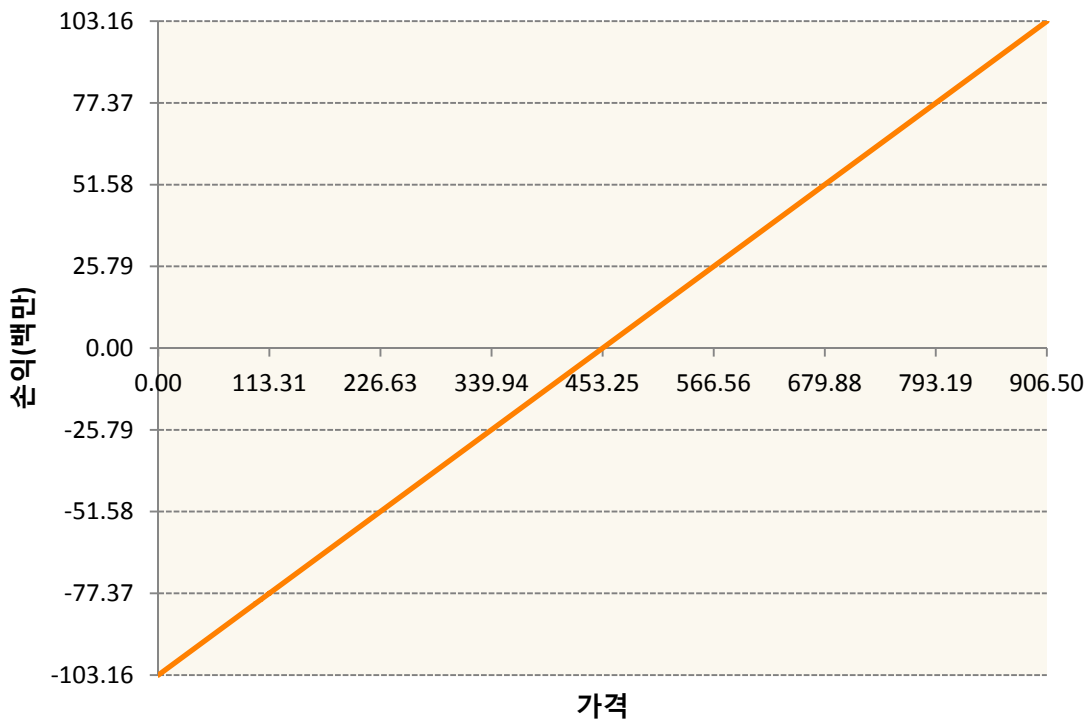




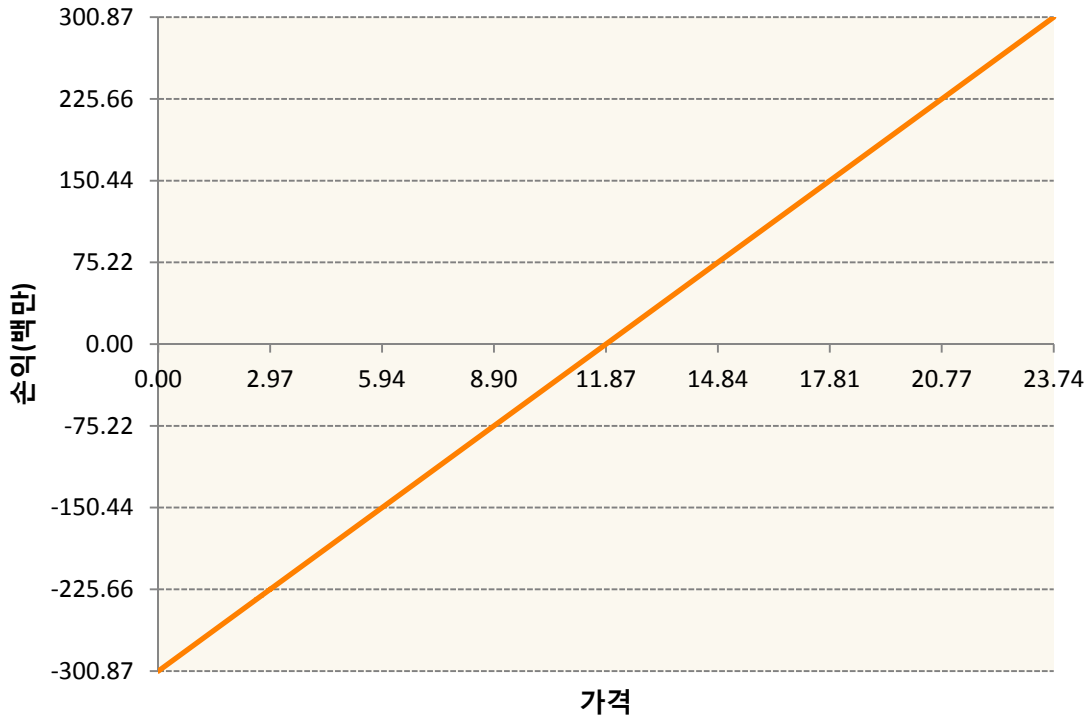
KR4175P60008-2019-06 달러선물



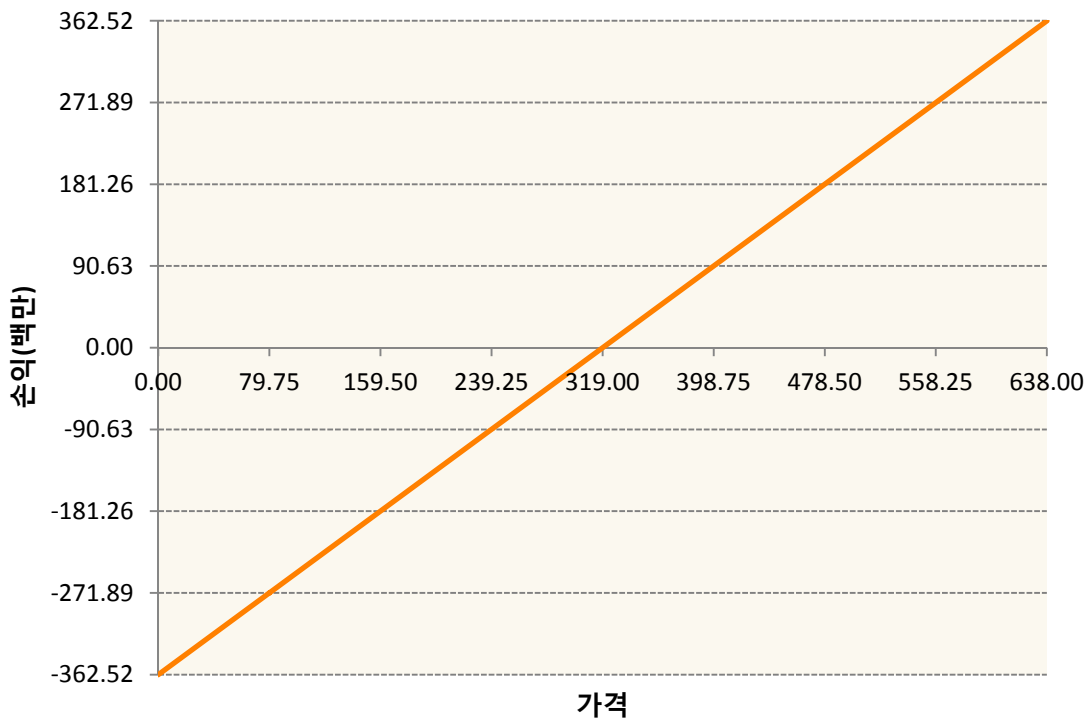
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



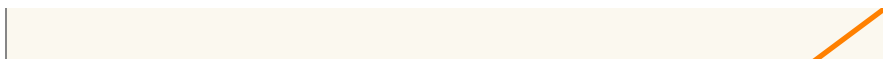
SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

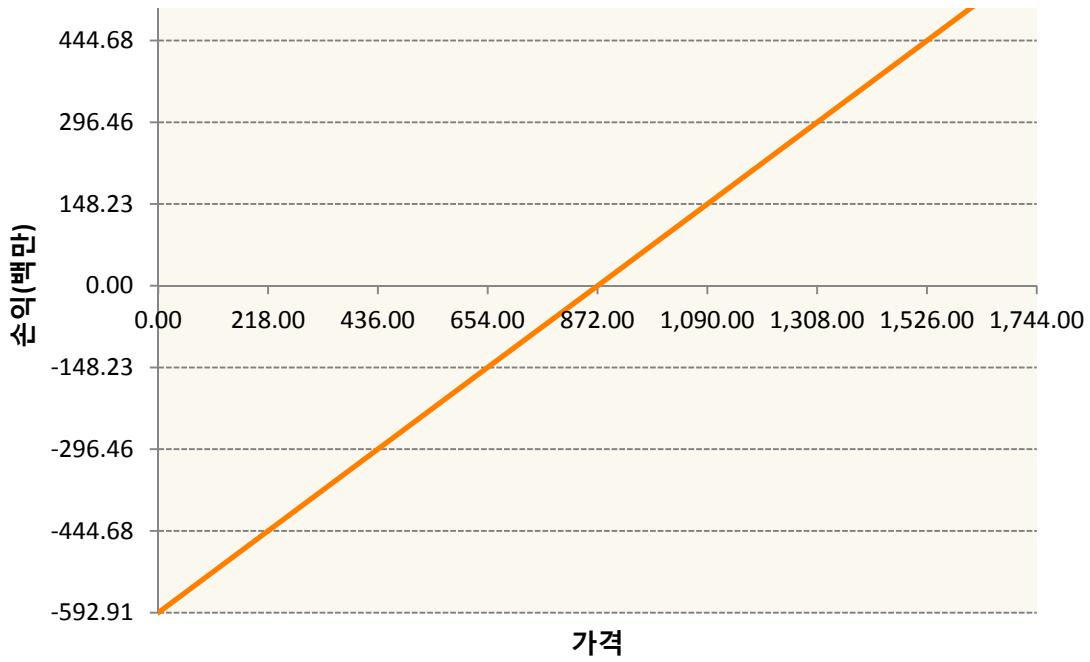


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19

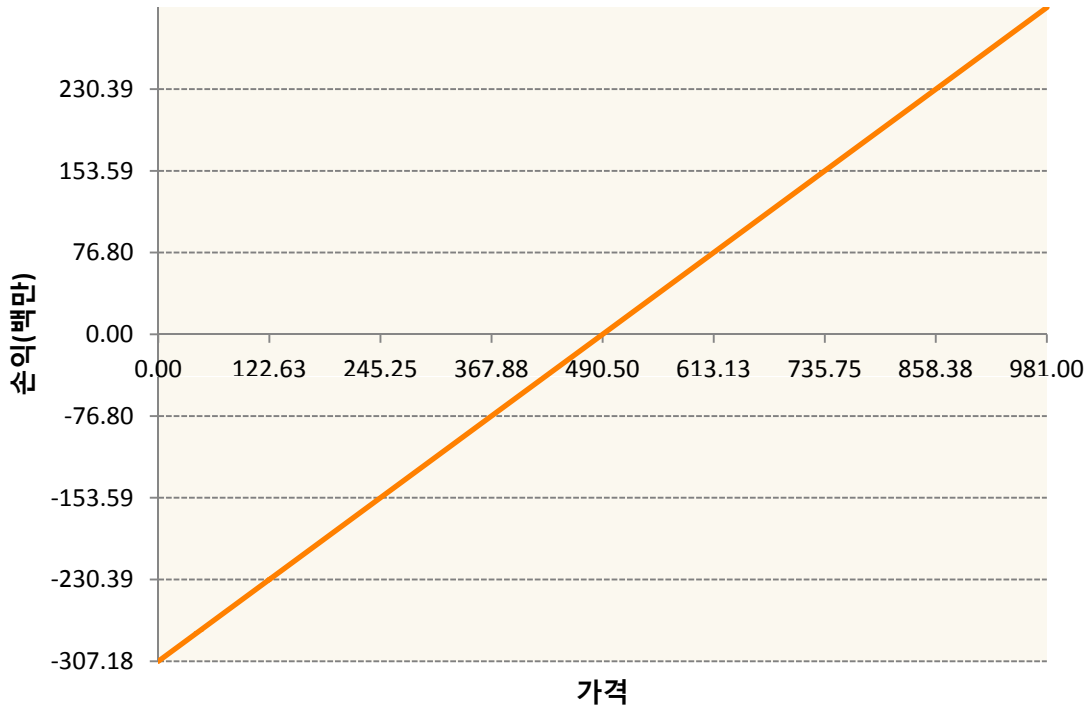


SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





WN9-WHEAT FUTURE(CBT) Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------------|-------------------------|----|
| BON9 | SOYBEAN OIL FUTR Jul19 | 24 |
| CN9 | CORN FUTURE Jul19 | 55 |
| CTN9 | COTTON NO.2 FUTR Jul19 | 12 |
| KCN9 | COFFEE 'C' FUTURE Jul19 | 20 |
| KR4175P600 | 2019-06 달러선물 | 5 |

| | | |
|------|-------------------------|----|
| KWN9 | KC HRW WHEAT FUT Jul19 | 8 |
| SBN9 | SUGAR #11 (WORLD) Jul19 | 24 |
| SMN9 | SOYBEAN MEAL FUTR Jul19 | 29 |
| SN9 | SOYBEAN FUTURE Jul19 | 47 |
| WN9 | WHEAT FUTURE(CBT) Jul19 | 25 |

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

(단위:백만원)

255