

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-06-03 |
| 기준일 | 2019-05-31 |

## 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 | 2019-06-03 |
| 기준일 | 2019-05-31 |

## 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

1,106

\* 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 | 2019-06-03 |
| 기준일 | 2019-05-31 |

## 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) | 297 |
| SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규) | 82  |
| SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)         | 139 |

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

|            |
|------------|
| <b>872</b> |
|------------|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-06-03 |
| 기준일 | 2019-05-31 |

## 유로인덱스모(주식-파생형)

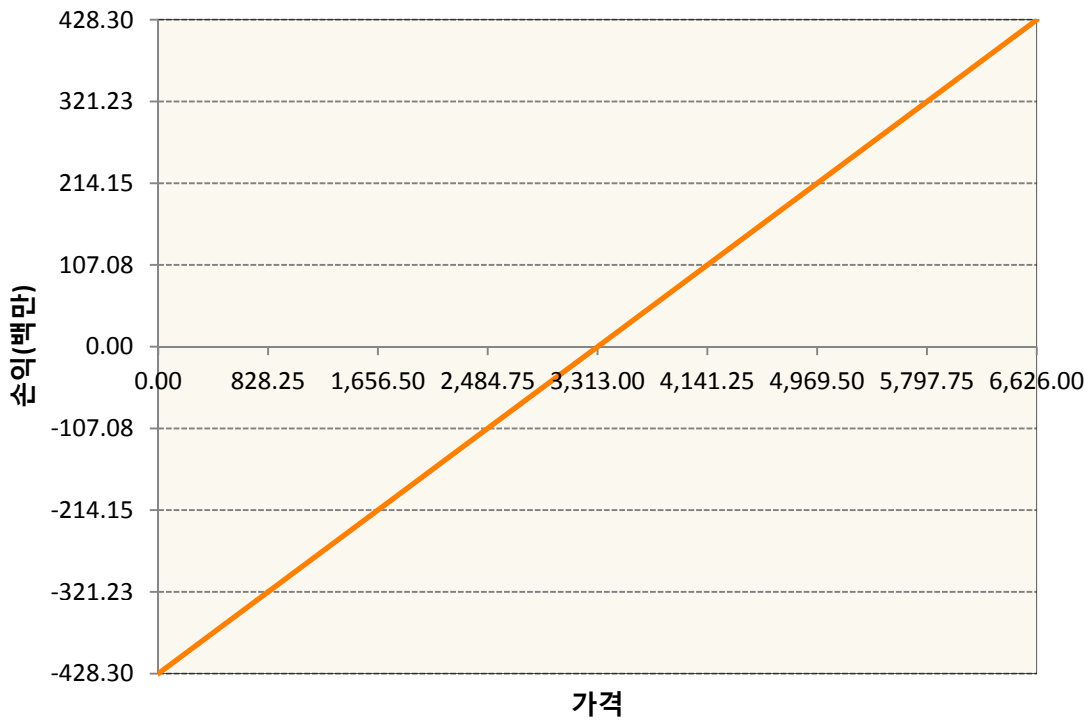
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 428   | 0     | 428       |    |

### 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 | 2019-06-03 |
| 기준일 | 2019-05-31 |

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

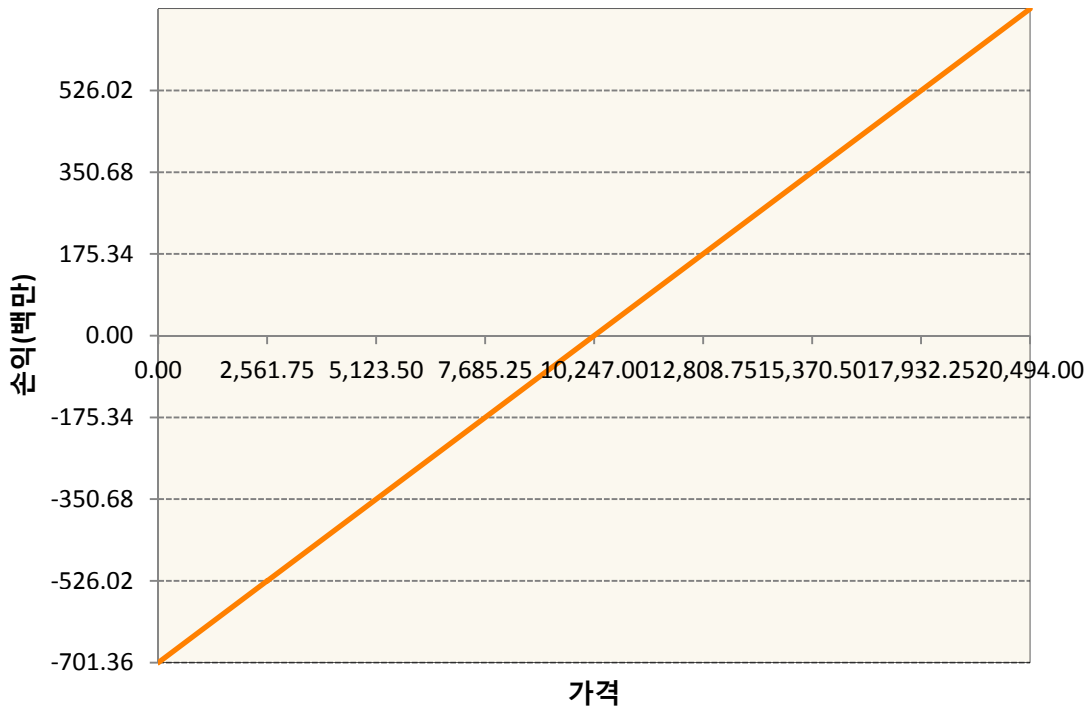
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 701   | 0     | 701       | 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)

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-06-03 |
| 기준일 | 2019-05-31 |

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

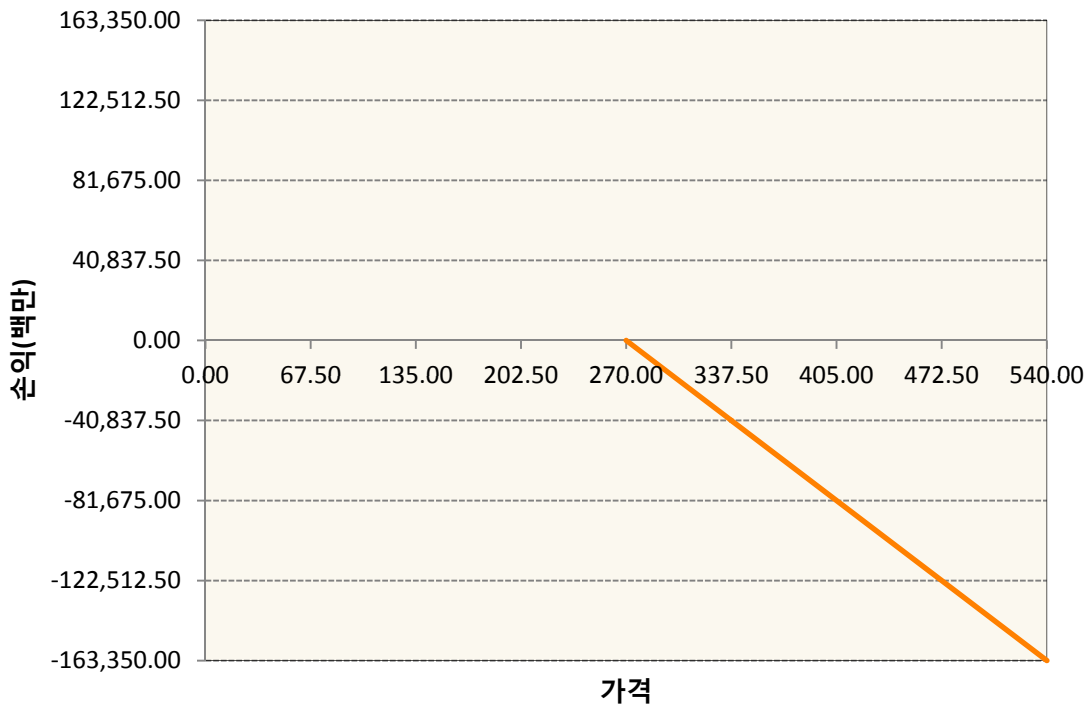
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

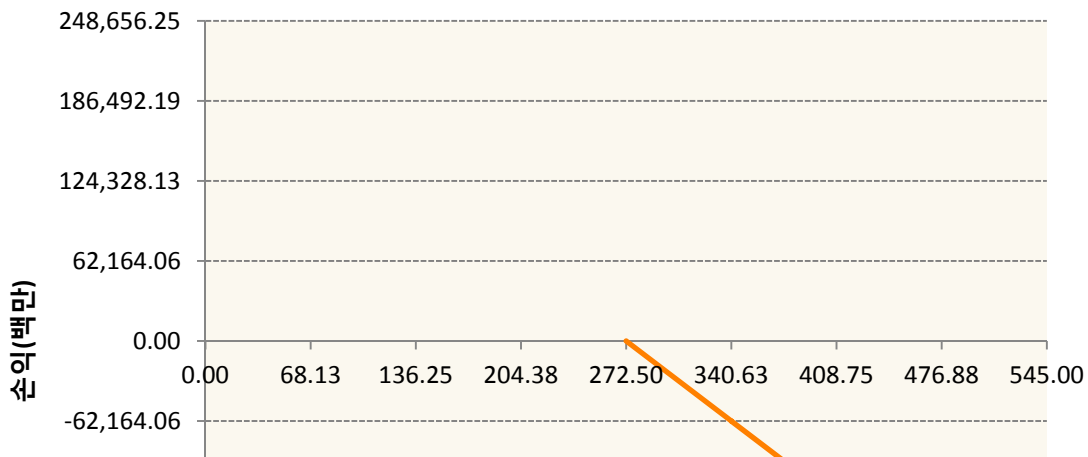
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)   | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0       | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 614,506 | -614,506  | 장내 |

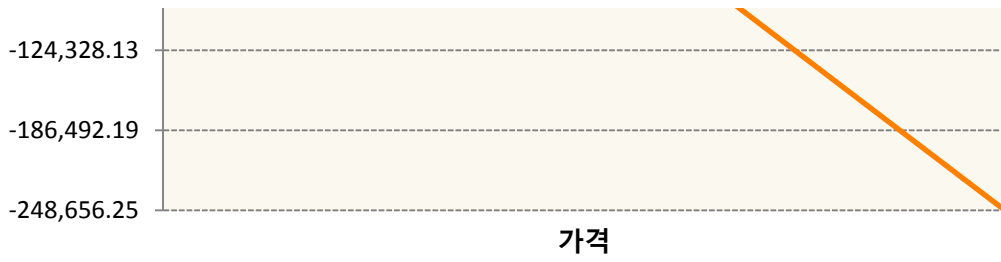
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P62701-2019-06 콜270



KR4201P62727-2019-06 콜272.5





KR4301P62709-2019-06 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4201P62701 |         | 2019-06 콜270   |        |        |        |        | 8,460  |
|--------------|---------|----------------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 기초자산의 변동성    |         |                |        |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00% | -16.67%        | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 1,597   | 1,592          | 1,581  | 1,563  | 1,536  | 1,499  | 1,451  |
| -5.33%       | 1,567   | 1,535          | 1,488  | 1,427  | 1,350  | 1,259  | 1,155  |
| -2.67%       | 1,379   | 1,270          | 1,143  | 1,000  | 843    | 675    | 498    |
| 0%           | 670     | 454            | 230    | 0      | -234   | -472   | -712   |
| 2.67%        | -1,034  | -1,297         | -1,560 | -1,823 | -2,086 | -2,350 | -2,613 |
| 5.33%        | -3,897  | -4,098         | -4,311 | -4,531 | -4,758 | -4,991 | -5,227 |
| 8.00%        | -7,601  | -7,703         | -7,824 | -7,962 | -8,116 | -8,282 | -8,460 |
| KR4201P62727 |         | 2019-06 콜272.5 |        |        |        |        | 11,604 |
| 기초자산의 변동성    |         |                |        |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00% | -16.67%        | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 1,784   | 1,780          | 1,771  | 1,754  | 1,726  | 1,687  | 1,633  |

|                                                |         |         |         |         |         |         |         |
|------------------------------------------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| -5.33%                                         | 1,762   | 1,733   | 1,687   | 1,621   | 1,534   | 1,427   | 1,301   |
| -2.67%                                         | 1,598   | 1,481   | 1,335   | 1,164   | 969     | 755     | 522     |
| 0%                                             | 879     | 603     | 309     | 0       | -321    | -651    | -989    |
| 2.67%                                          | -1,102  | -1,496  | -1,892  | -2,288  | -2,684  | -3,081  | -3,478  |
| 5.33%                                          | -4,817  | -5,173  | -5,537  | -5,907  | -6,283  | -6,662  | -7,045  |
| 8.00%                                          | -10,022 | -10,231 | -10,467 | -10,726 | -11,004 | -11,297 | -11,604 |
| KR4301P62709                      2019-06 풋270 |         |         |         |         |         |         | 14,929  |
| 기초자산의 변동성                                      |         |         |         |         |         |         |         |
| 가격                                             | -25.00% | -16.67% | -8.33%  | 0%      | 8.33%   | 16.67%  | 25.00%  |
| -8.00%                                         | -14,918 | -14,918 | -14,919 | -14,919 | -14,921 | -14,924 | -14,929 |
| -5.33%                                         | -9,646  | -9,648  | -9,653  | -9,662  | -9,677  | -9,698  | -9,727  |
| -2.67%                                         | -4,406  | -4,437  | -4,482  | -4,539  | -4,609  | -4,692  | -4,785  |
| 0%                                             | 460     | 317     | 163     | 0       | -170    | -346    | -527    |
| 2.67%                                          | 3,879   | 3,662   | 3,445   | 3,227   | 3,010   | 2,792   | 2,575   |
| 5.33%                                          | 5,257   | 5,139   | 5,006   | 4,862   | 4,708   | 4,546   | 4,377   |
| 8.00%                                          | 5,523   | 5,498   | 5,461   | 5,411   | 5,348   | 5,272   | 5,185   |

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

(단위:백만원)

**35,646**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-06-03 |
| 기준일 | 2019-05-31 |

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

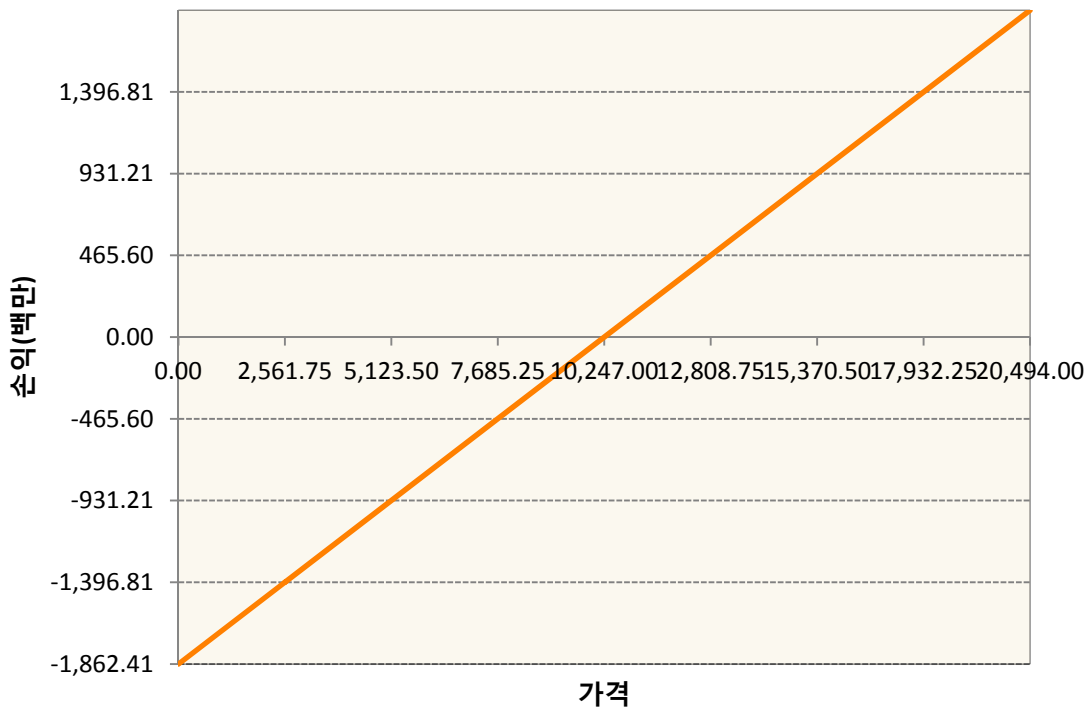
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

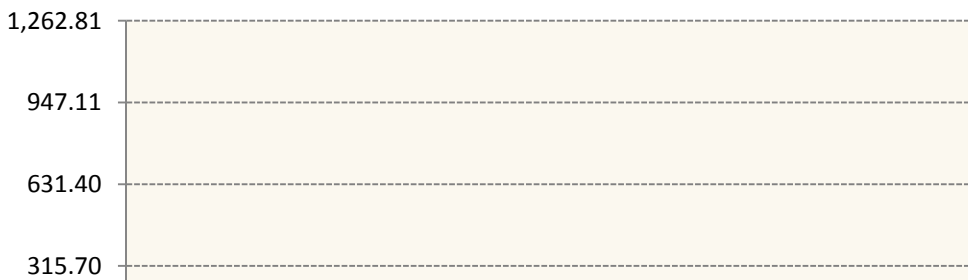
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,862 | 0     | 1,862     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 5,076 | -5,076    | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 152   | 3,187 | -3,036    | 장외 |

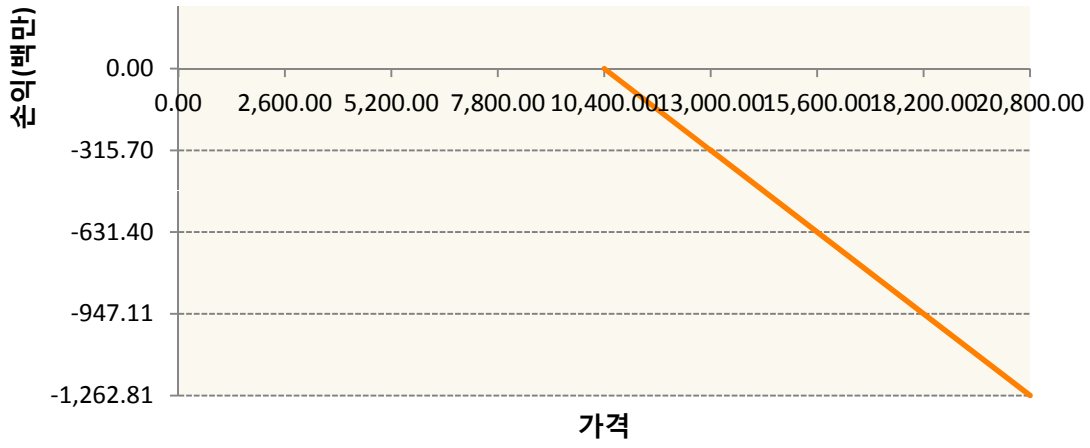
### 2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19

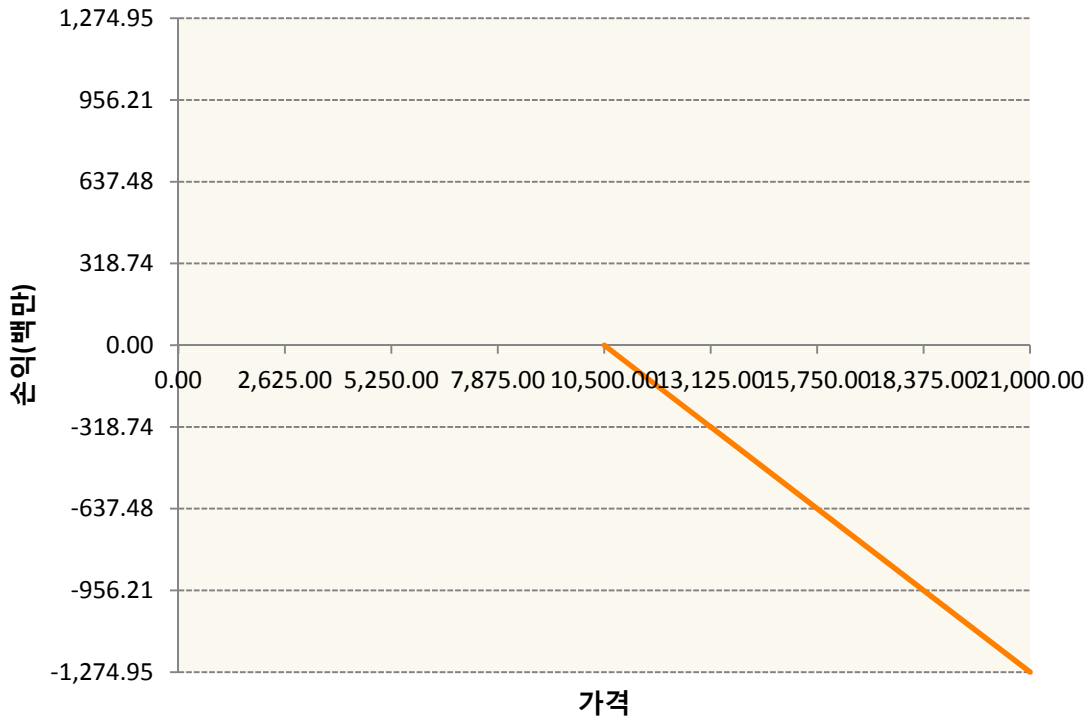


OHHIM9-C104-HSCEI

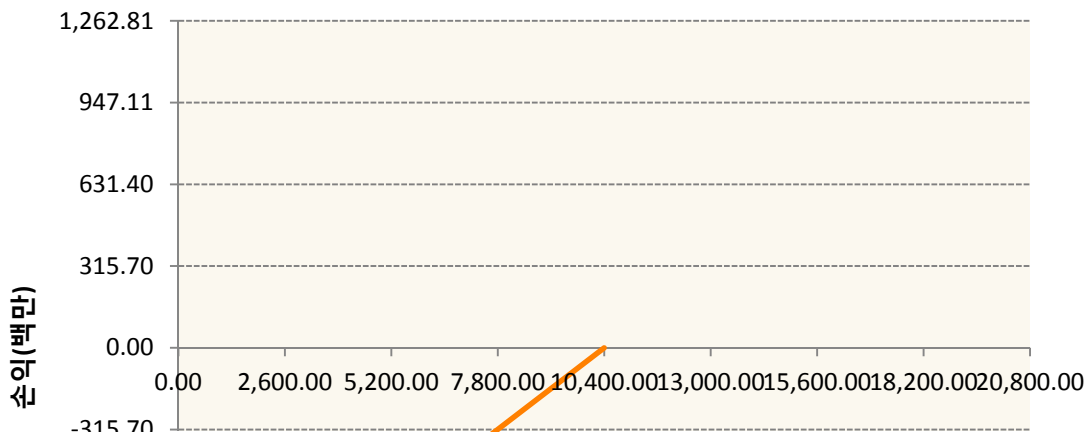


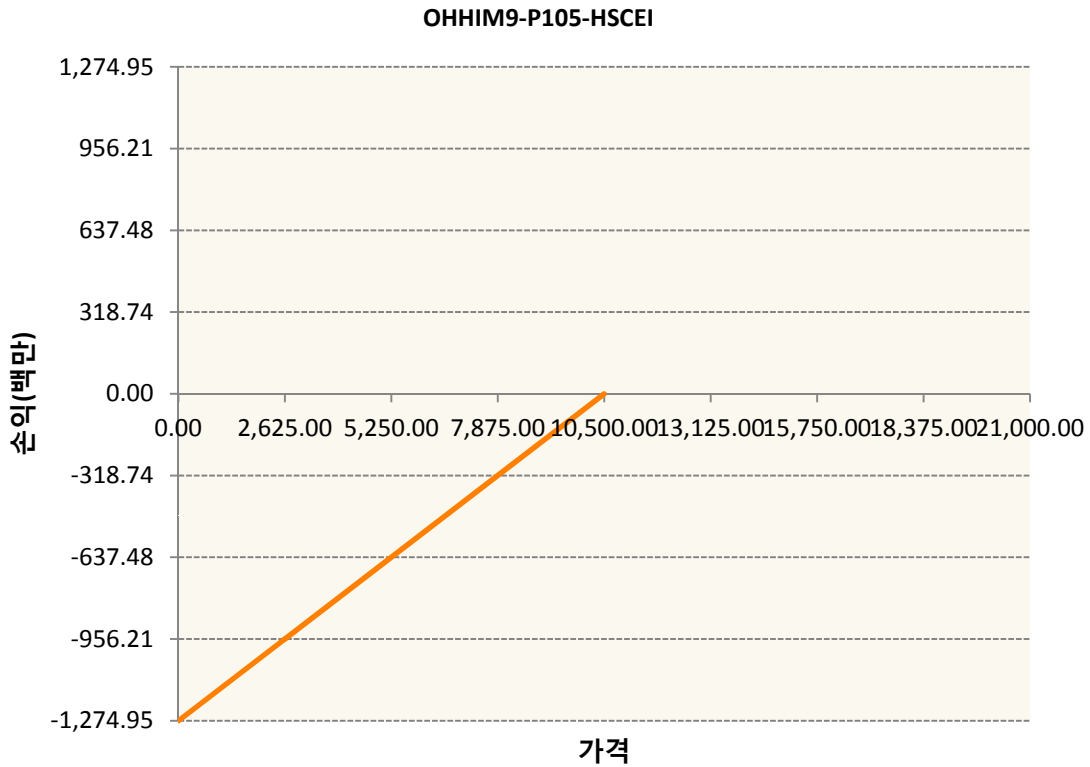


OHHIM9-C105-HSCEI



OHHIM9-P104-HSCEI





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)    | (단위:백만원) |
|------------------------------|----------|
| FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E | 255      |
| FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E | 12       |
| HCM9 HSCEI Futures Jun19     | 149      |
| OHHIM9-C1 HSCEI              | 101      |
| OHHIM9-C1 HSCEI              | 102      |
| OHHIM9-P1 HSCEI              | 101      |
| OHHIM9-P1 HSCEI              | 102      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 654      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-06-03 |
| 기준일 | 2019-05-31 |

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

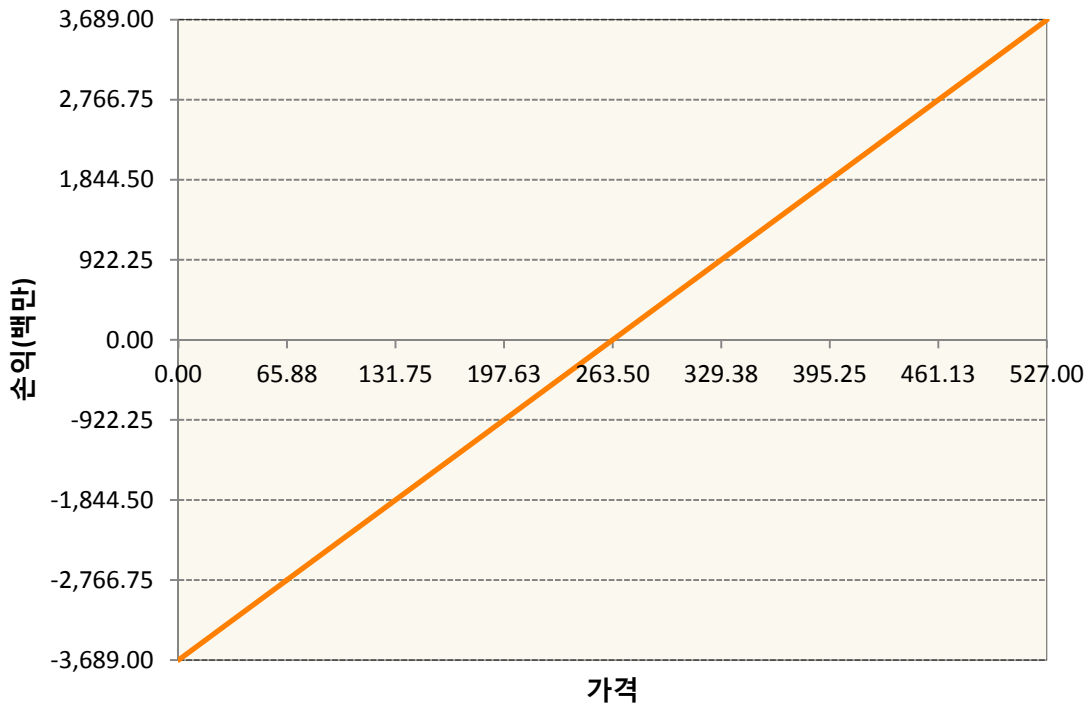
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

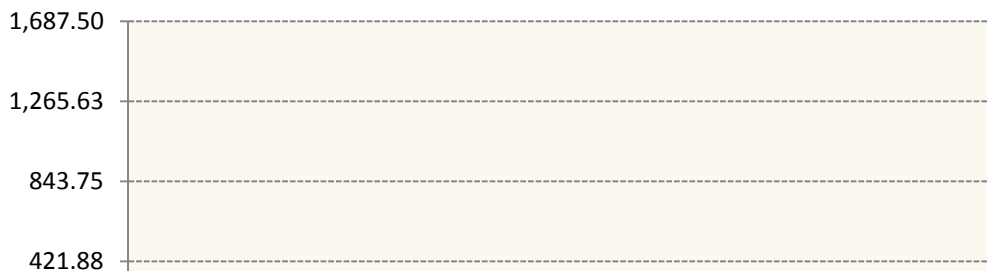
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0      | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑   | 0      | 0      | 0         | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0      | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 3,689  | 0      | 3,689     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 20,836 | 0      | 20,836    | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0      | 21,759 | -21,759   | 장내 |

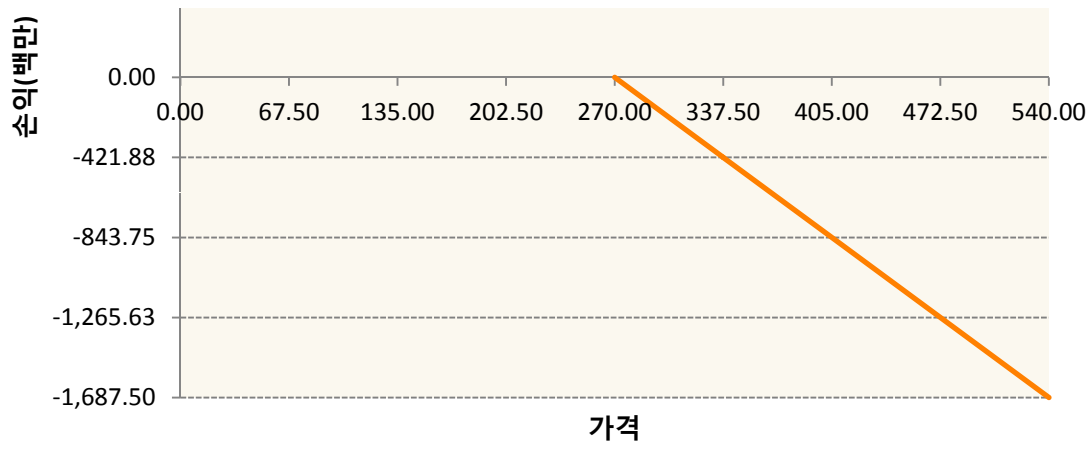
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

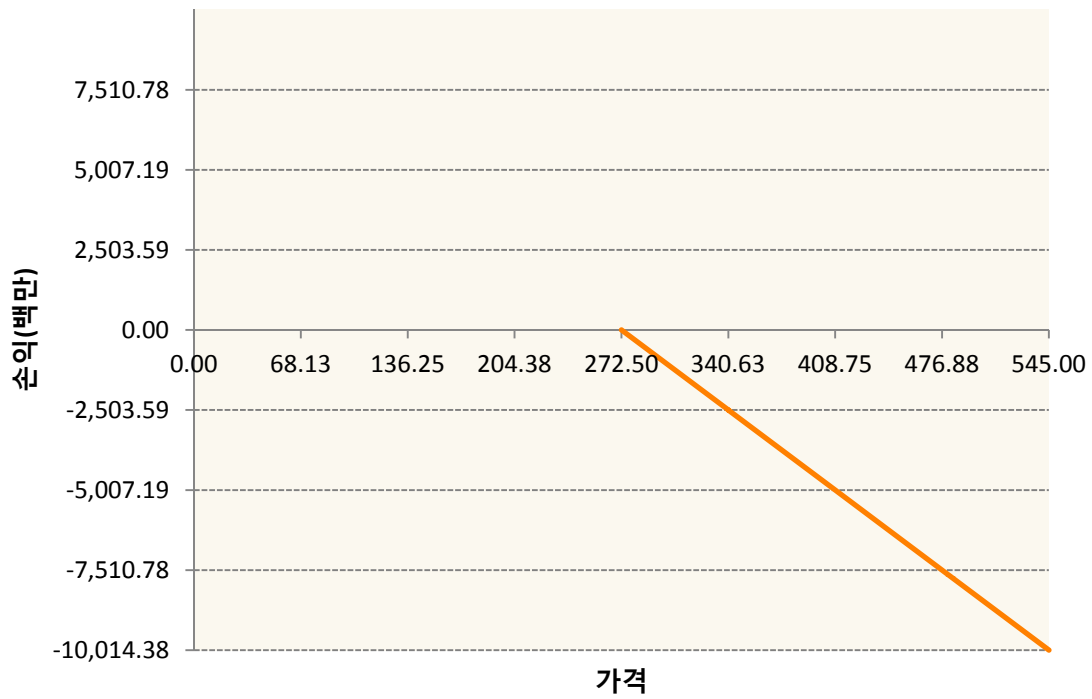


KR4201P62701-2019-06 콜270

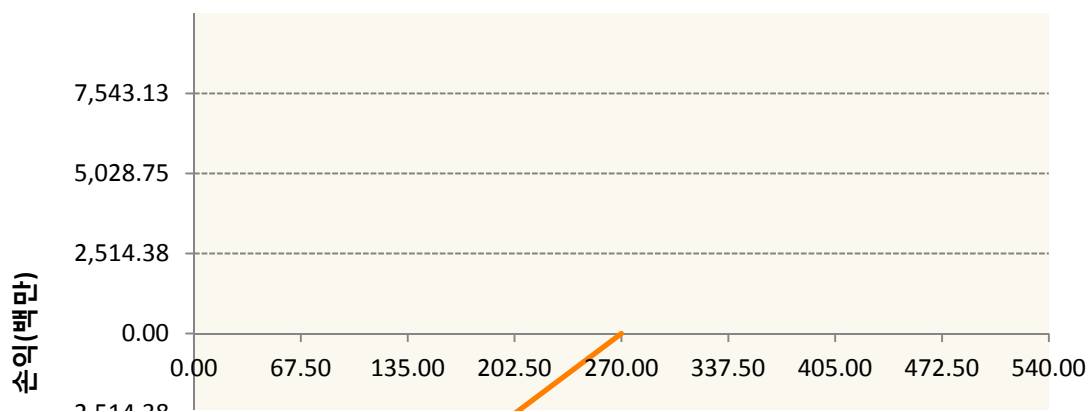


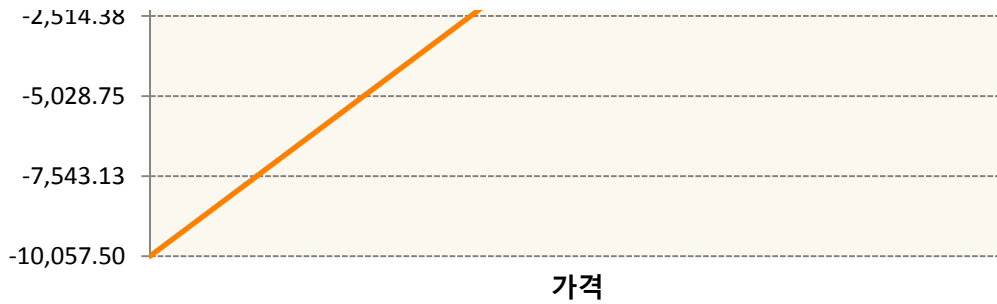


**KR4201P62727-2019-06 콜272.5**



**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       |        |        |        |        |        | 87    |
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |        |        |        |        |       |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |       |

|                                                  |         |         |        |      |       |        |        |
|--------------------------------------------------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| -8.00%                                           | 17      | 16      | 16     | 16   | 16    | 15     | 15     |
| -5.33%                                           | 16      | 16      | 15     | 15   | 14    | 13     | 12     |
| -2.67%                                           | 14      | 13      | 12     | 10   | 9     | 7      | 5      |
| 0%                                               | 7       | 5       | 2      | 0    | -2    | -5     | -7     |
| 2.67%                                            | -11     | -13     | -16    | -19  | -22   | -24    | -27    |
| 5.33%                                            | -40     | -42     | -45    | -47  | -49   | -52    | -54    |
| 8.00%                                            | -79     | -80     | -81    | -82  | -84   | -86    | -87    |
| KR4201P62727                      2019-06 콜272.5 |         |         |        |      |       |        | 467    |
| 기초자산의 변동성                                        |         |         |        |      |       |        |        |
| 가격                                               | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                                           | 72      | 72      | 71     | 71   | 70    | 68     | 66     |
| -5.33%                                           | 71      | 70      | 68     | 65   | 62    | 57     | 52     |
| -2.67%                                           | 64      | 60      | 54     | 47   | 39    | 30     | 21     |
| 0%                                               | 35      | 24      | 12     | 0    | -13   | -26    | -40    |
| 2.67%                                            | -44     | -60     | -76    | -92  | -108  | -124   | -140   |
| 5.33%                                            | -194    | -208    | -223   | -238 | -253  | -268   | -284   |
| 8.00%                                            | -404    | -412    | -422   | -432 | -443  | -455   | -467   |
| 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 | -481  | -482   | -483   |
| -2.67%                                           | -219    | -220    | -223   | -225 | -229  | -233   | -238   |
| 0%                                               | 23      | 16      | 8      | 0    | -8    | -17    | -26    |
| 2.67%                                            | 193     | 182     | 171    | 160  | 149   | 139    | 128    |
| 5.33%                                            | 261     | 255     | 249    | 241  | 234   | 226    | 217    |
| 8.00%                                            | 274     | 273     | 271    | 269  | 266   | 262    | 258    |

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

(단위:백만원)

**3,406**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-06-03 |
| 기준일 | 2019-05-31 |

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

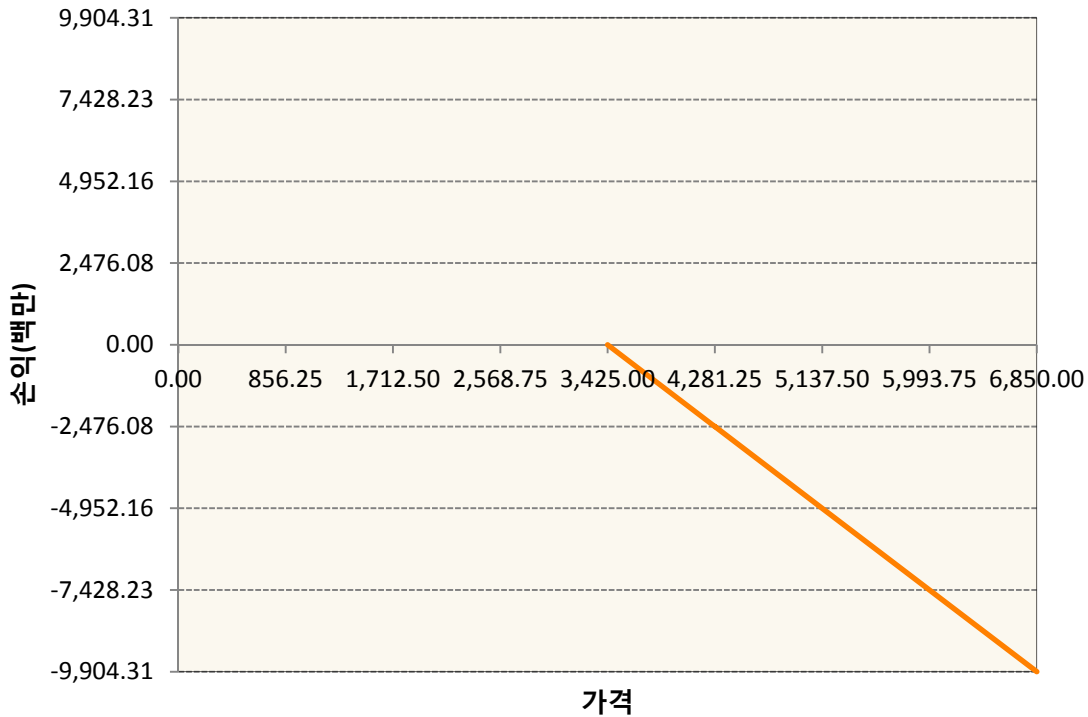
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

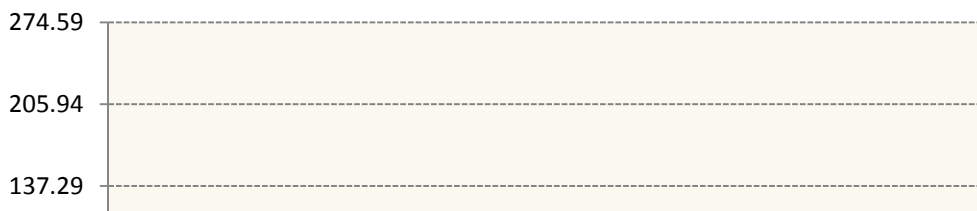
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0      | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 스왑   | 0      | 0      | 0         | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0      | 0      | 0         | 장내 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0      | 0      | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 3,622  | 0      | 3,622     |    |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 56,149 | 0      | 56,149    | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0      | 20,358 | -20,358   | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 18,571 | -18,571   | 장외 |

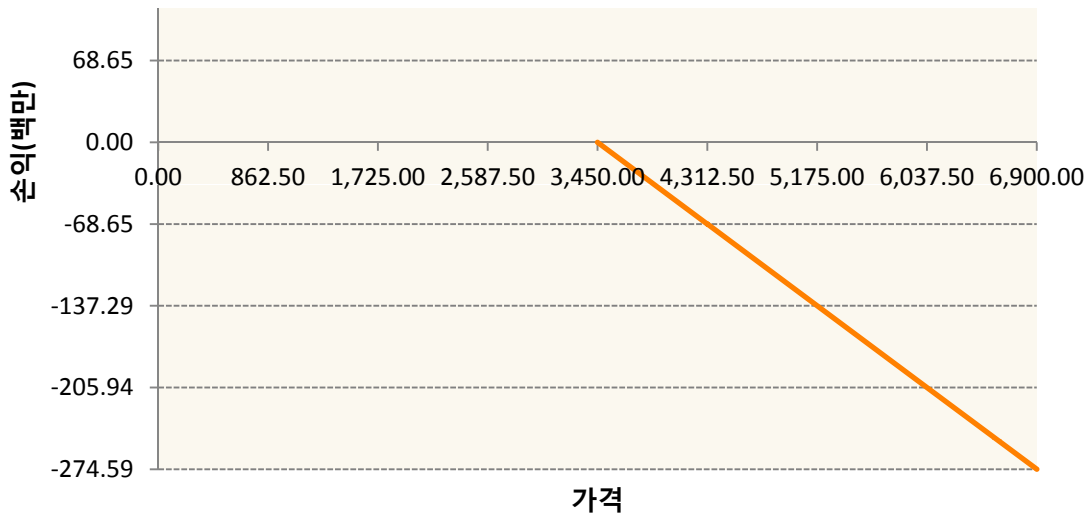
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXM9-C3425-EURO STOXX 50**

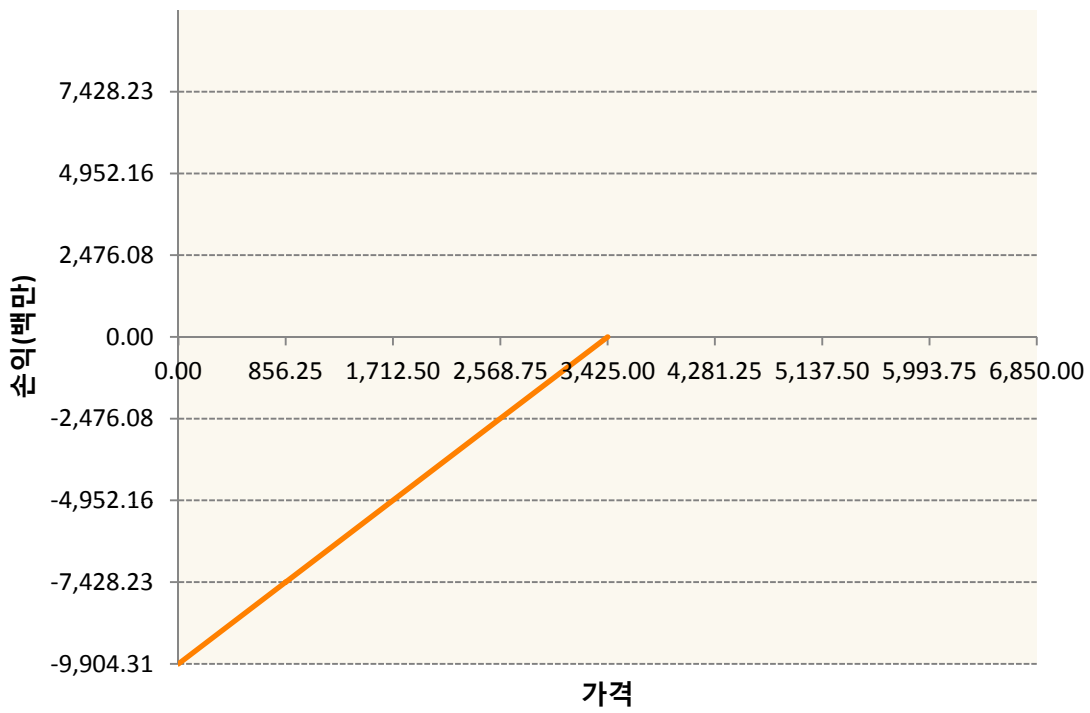


**OESXM9-C3450-EURO STOXX 50**

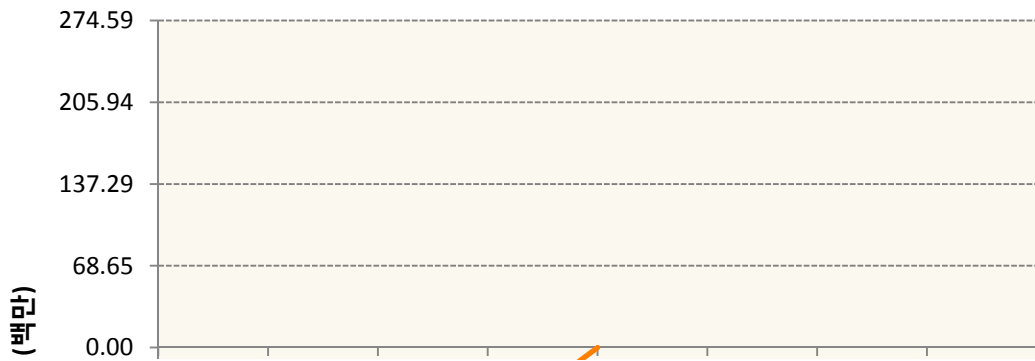


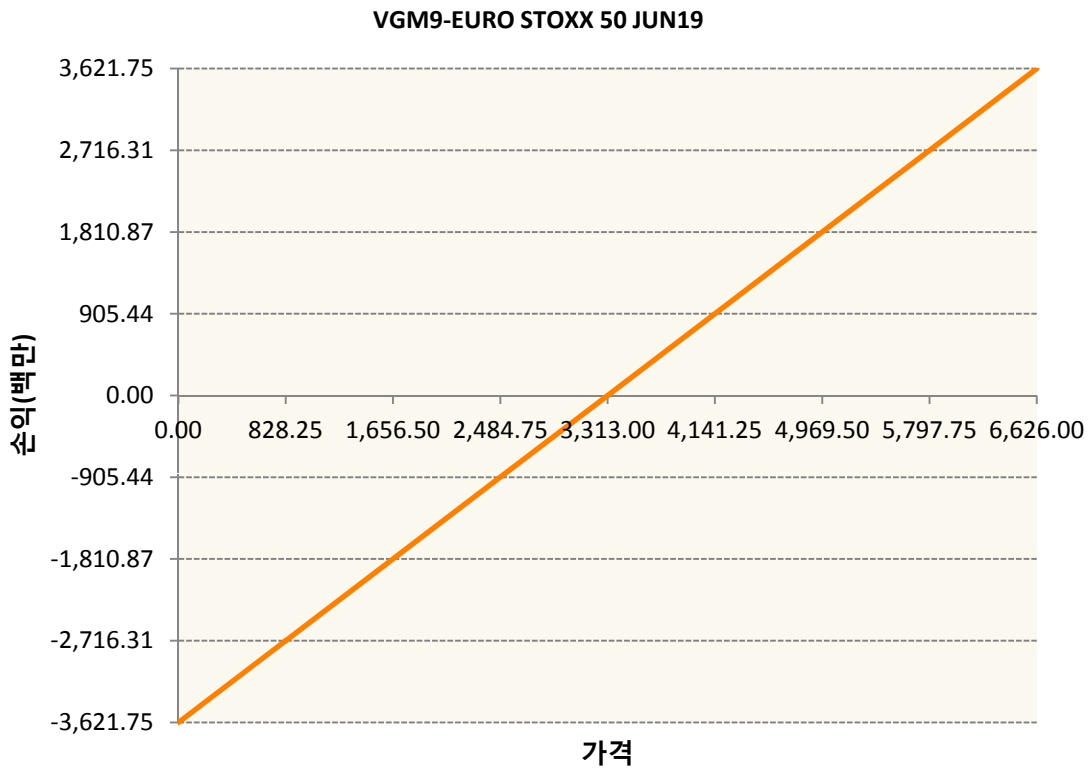
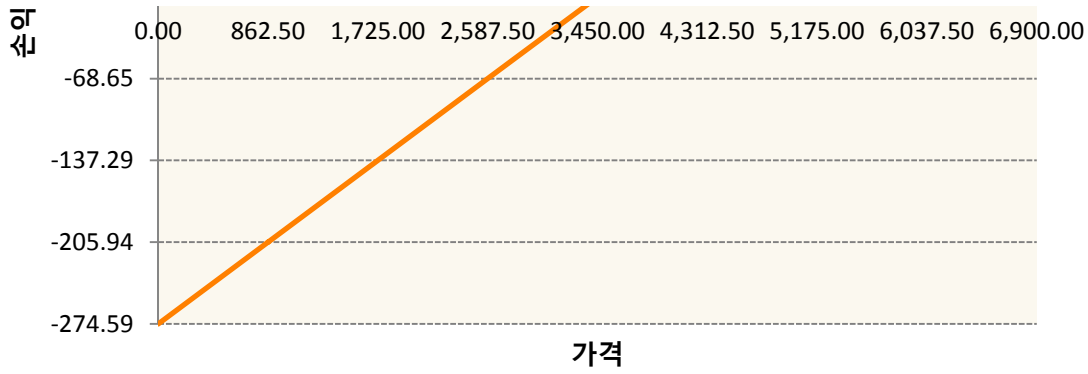


OESXM9-P3425-EURO STOXX 50



OESXM9-P3450-EURO STOXX 50





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)**

|                                         |     |
|-----------------------------------------|-----|
| 260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY | 104 |
| FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E            | 849 |
| FX21019J01: KRW/EUR 28-06-19E           | 212 |
| FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E            | 424 |
| OESXM9-C3·EURO STOXX 50                 | 792 |
| OESXM9-C3·EURO STOXX 50                 | 22  |
| OESXM9-P3·EURO STOXX 50                 | 792 |
| OESXM9-P3·EURO STOXX 50                 | 22  |
| VGM9 EURO STOXX 50 JUN19                | 290 |

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

(단위:백만원)

2,238



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 | 2019-06-03 |
| 기준일 | 2019-05-31 |

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

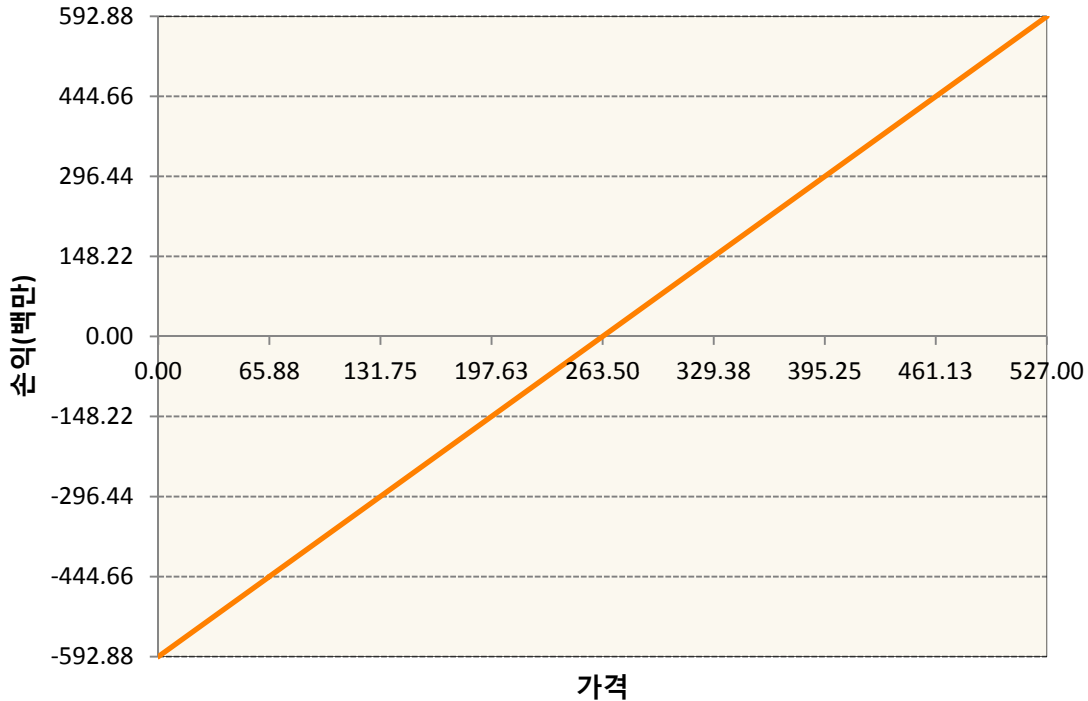
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 593   | 0     | 593       | 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 | 2019-06-03 |
| 기준일 | 2019-05-31 |

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

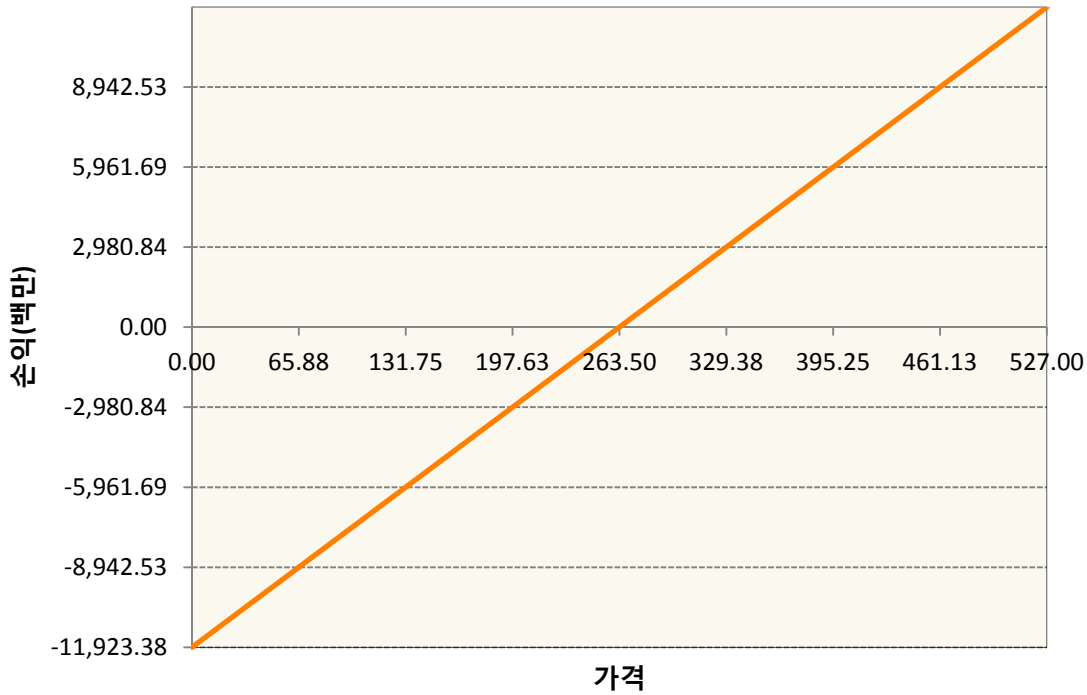
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

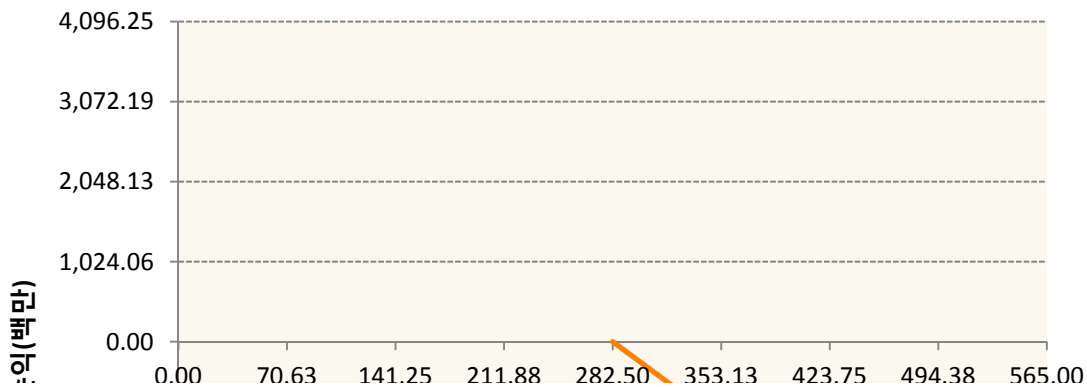
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0      | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0      | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 11,923 | 0      | 11,923    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 5,081  | 22,906 | -17,825   | 장내 |

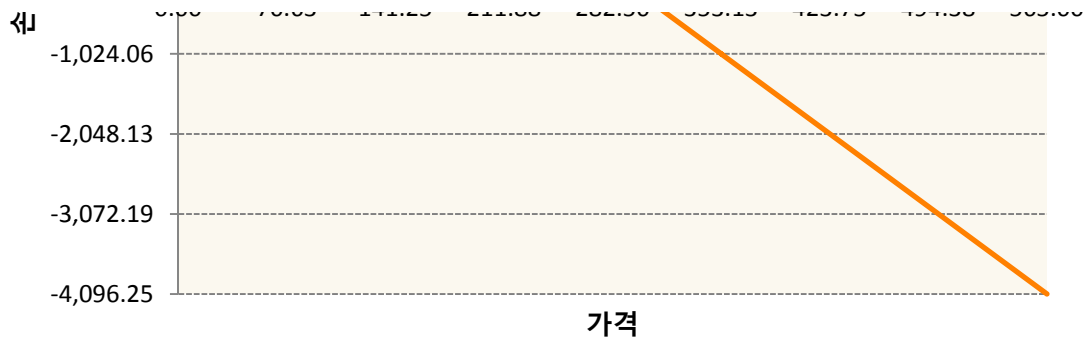
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

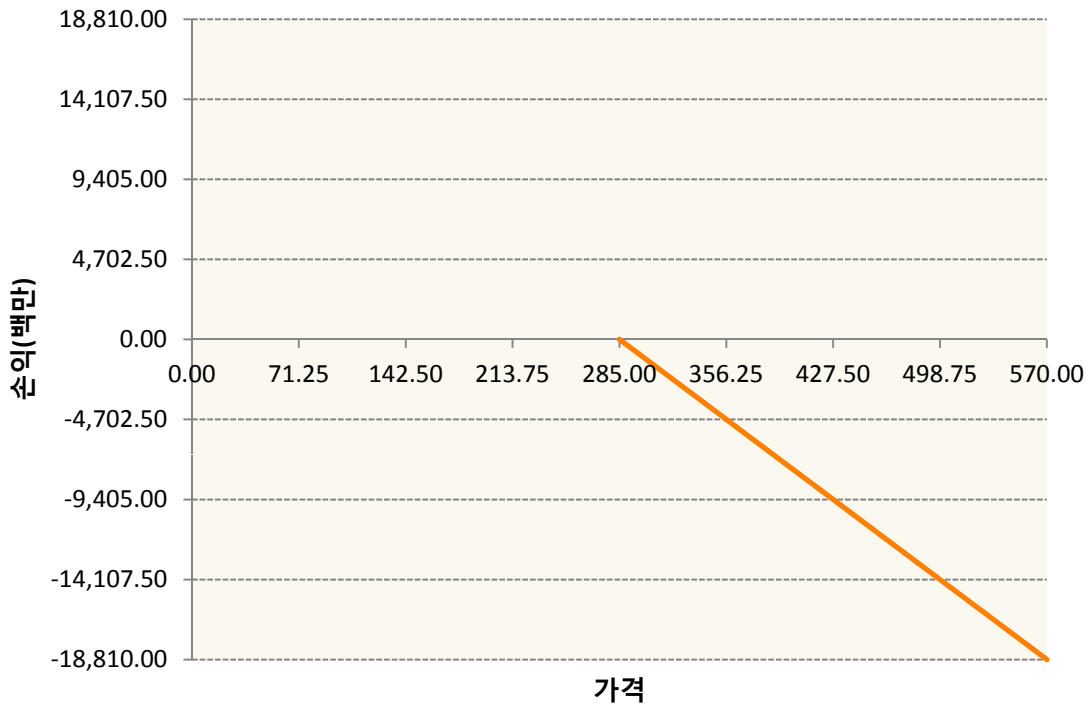


KR4201P62826-2019-06 콜282.5

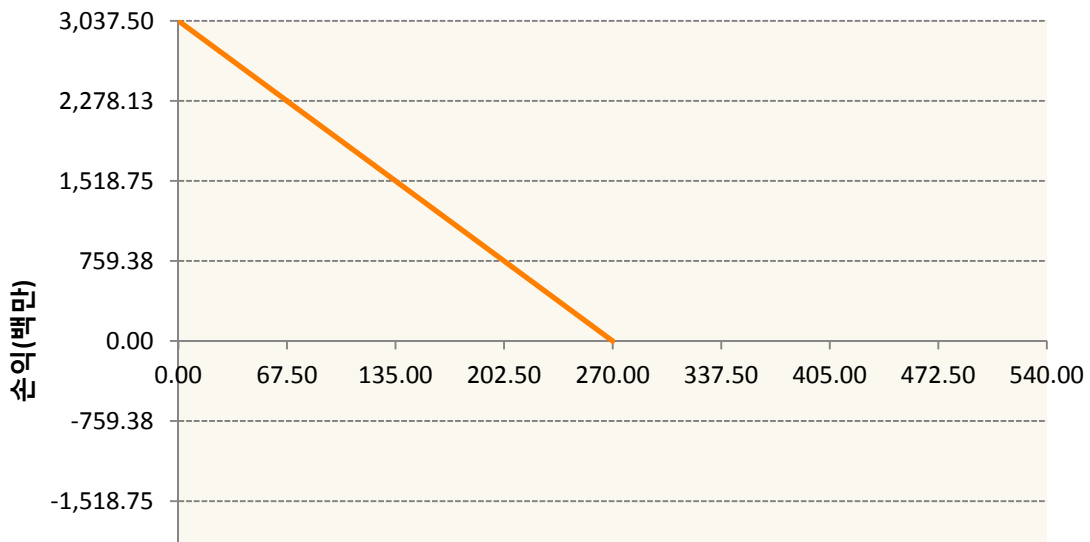


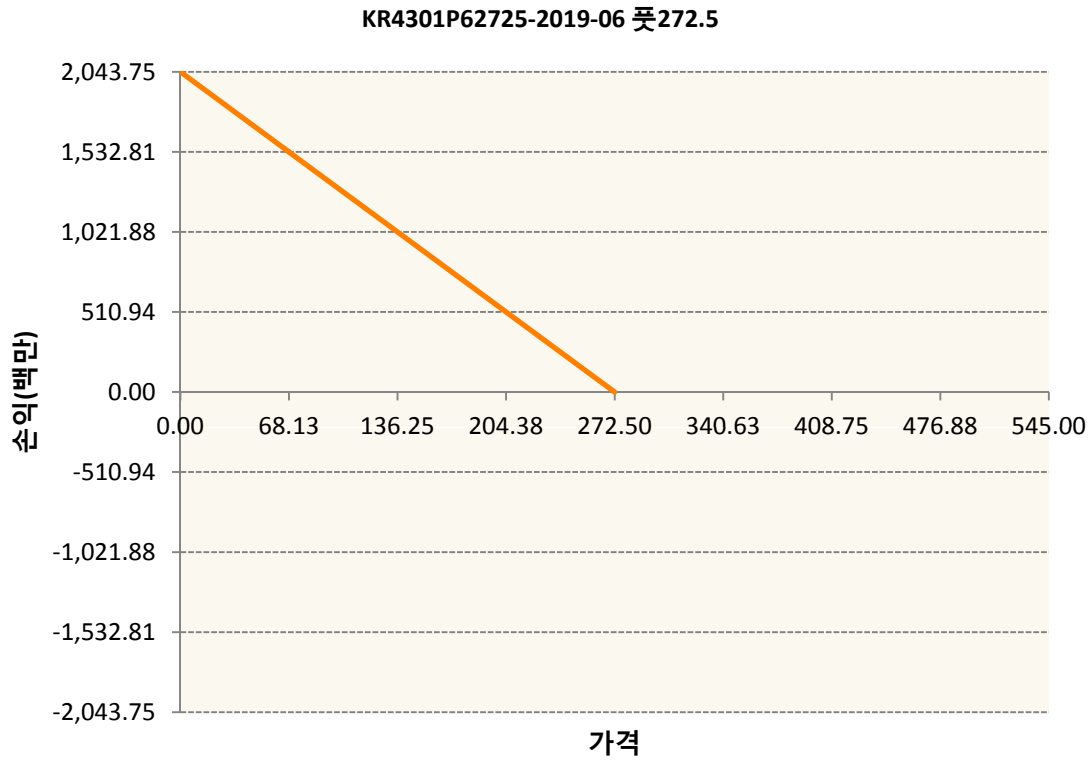
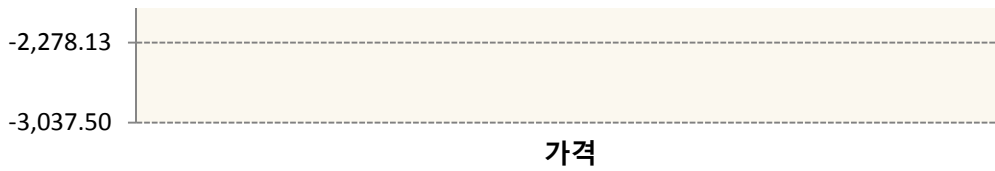


KR4201P62859-2019-06 콜285



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     |        |      |       |        |        | 111 |
|              |         | 기초자산의 변동성          |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | 7       | 7                  | 7      | 7    | 7     | 7      | 6      |     |
| -5.33%       | 7       | 7                  | 7      | 7    | 6     | 6      | 5      |     |
| -2.67%       | 7       | 6                  | 6      | 5    | 4     | 3      | 1      |     |

|       |     |     |     |     |     |      |      |
|-------|-----|-----|-----|-----|-----|------|------|
| 0%    | 5   | 4   | 2   | 0   | -3  | -5   | -9   |
| 2.67% | -2  | -6  | -10 | -14 | -18 | -23  | -28  |
| 5.33% | -25 | -30 | -37 | -43 | -49 | -55  | -61  |
| 8.00% | -72 | -78 | -85 | -91 | -98 | -104 | -111 |

KR4201P62859                      2019-06 콜285                      431

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |      |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | 21      | 21      | 21     | 21   | 20    | 20     | 19     |
| -5.33%    | 21      | 21      | 20     | 20   | 19    | 17     | 15     |
| -2.67%    | 20      | 20      | 18     | 16   | 12    | 8      | 2      |
| 0%        | 17      | 13      | 7      | 0    | -9    | -20    | -32    |
| 2.67%     | -4      | -16     | -30    | -46  | -64   | -83    | -104   |
| 5.33%     | -76     | -100    | -125   | -151 | -178  | -205   | -232   |
| 8.00%     | -249    | -279    | -310   | -340 | -370  | -401   | -431   |

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      | 67      | 67     | 68  | 69    | 70     | 72     |
| 0%        | -7      | -5      | -2     | 0   | 3     | 5      | 8      |
| 2.67%     | -58     | -55     | -52    | -48 | -45   | -42    | -39    |
| 5.33%     | -79     | -77     | -75    | -73 | -71   | -68    | -66    |
| 8.00%     | -83     | -82     | -82    | -81 | -80   | -79    | -78    |

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%     | -65     | -63     | -61    | -59 | -58   | -56    | -54    |
| 8.00%     | -70     | -69     | -69    | -68 | -67   | -66    | -65    |

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

(단위:백만원)

**1,415**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-06-03 |
| 기준일 | 2019-05-31 |

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 17,872 | 0     | 17,872    |    |

### 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 | 2019-06-03 |
| 기준일 | 2019-05-31 |

## 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 | 56,917 | 0     | 56,917    |    |

### 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 | 2019-06-03 |
| 기준일 | 2019-05-31 |

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)   | 매도(2)   | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 7,145   | 0       | 7,145     |    |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0       | 0       | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 313,316 | 0       | 313,316   |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0       | 335,357 | -335,357  | 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 |                                 | 381   |
| FX21019J024 KRW/USD 24-06-19E |                                 | 953   |
| FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E |                                 | 381   |
| FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E |                                 | 76    |
| FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E |                                 | 1,002 |
| FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E |                                 | 1,029 |
| FX21019J043 KRW/USD 03-06-19E |                                 | 572   |
| FX21019J044 KRW/USD 03-06-19E |                                 | 476   |
| FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E  |                                 | 286   |
| FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E  |                                 | 476   |
| FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E  |                                 | 667   |
| FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E  |                                 | 667   |
| FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E  |                                 | 829   |
| FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E  |                                 | 819   |
| FX21019K00 KRW/USD 18-06-19E  |                                 | 572   |
| FX21019K01 KRW/USD 14-06-19E  |                                 | 667   |
| FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E  |                                 | 572   |
| FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E  |                                 | 476   |
| FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E  |                                 | 572   |
| FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E  |                                 | 1,429 |
| FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E  |                                 | 1,334 |
| FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E  |                                 | 476   |
| FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E  |                                 | 800   |
| FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E  |                                 | 636   |
| FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E  |                                 | 476   |

|                              |       |
|------------------------------|-------|
| FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E | 381   |
| FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E | 800   |
| FX21019K02 KRW/USD 24-06-19E | 381   |
| FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E | 953   |
| FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E | 1,524 |
| FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E | 286   |
| FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E | 1,239 |
| FX21019K04 KRW/USD 28-06-19E | 1,296 |
| FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E | 667   |
| FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E | 572   |
| FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E | 762   |
| FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E | 762   |
| FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E | 476   |

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

(단위:백만원)

**8,949**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-06-03 |
| 기준일 | 2019-05-31 |

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

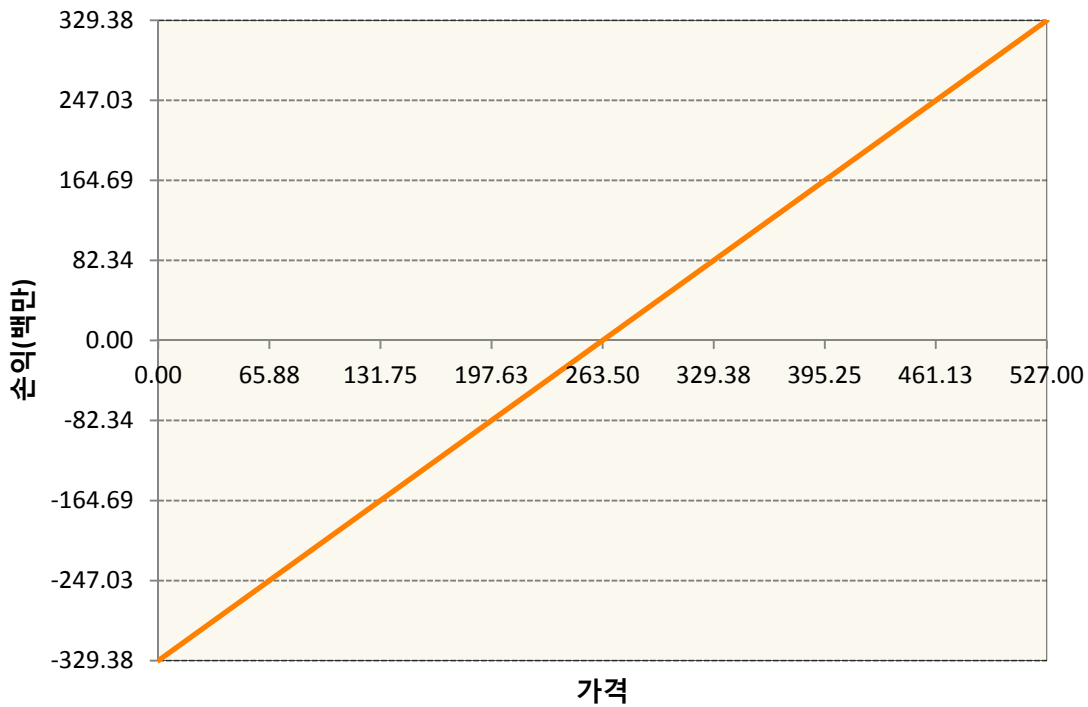
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

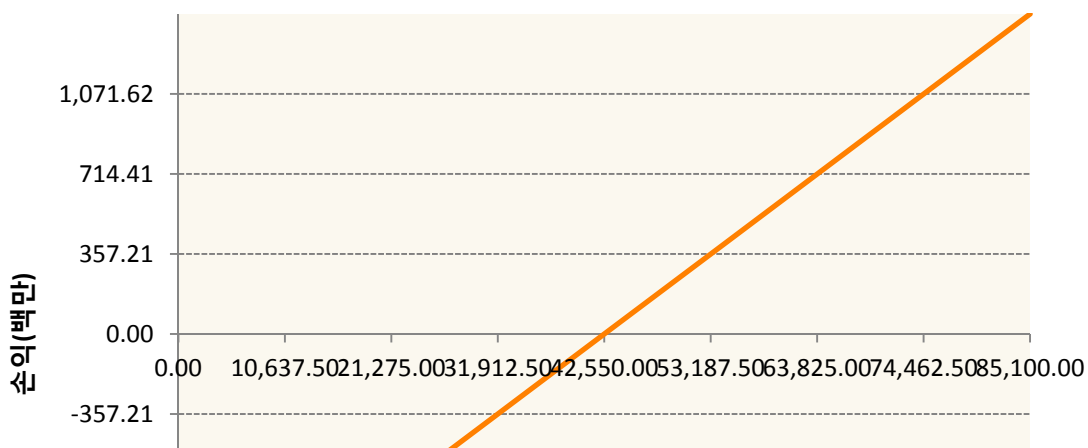
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,758 | 0     | 1,758     | 장내 |

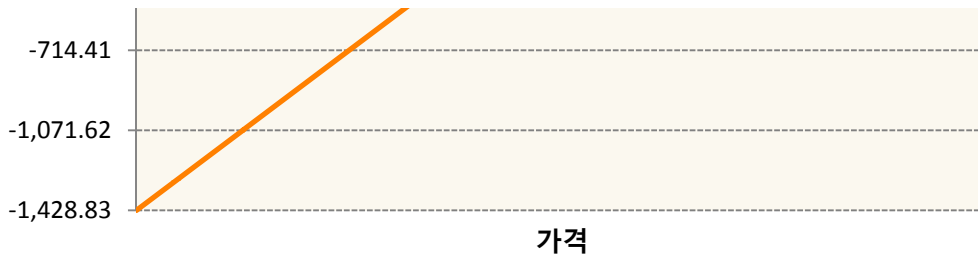
### 2. 만기시점의 손익구조

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 | 2019-06-03 |
| 기준일 | 2019-05-31 |

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

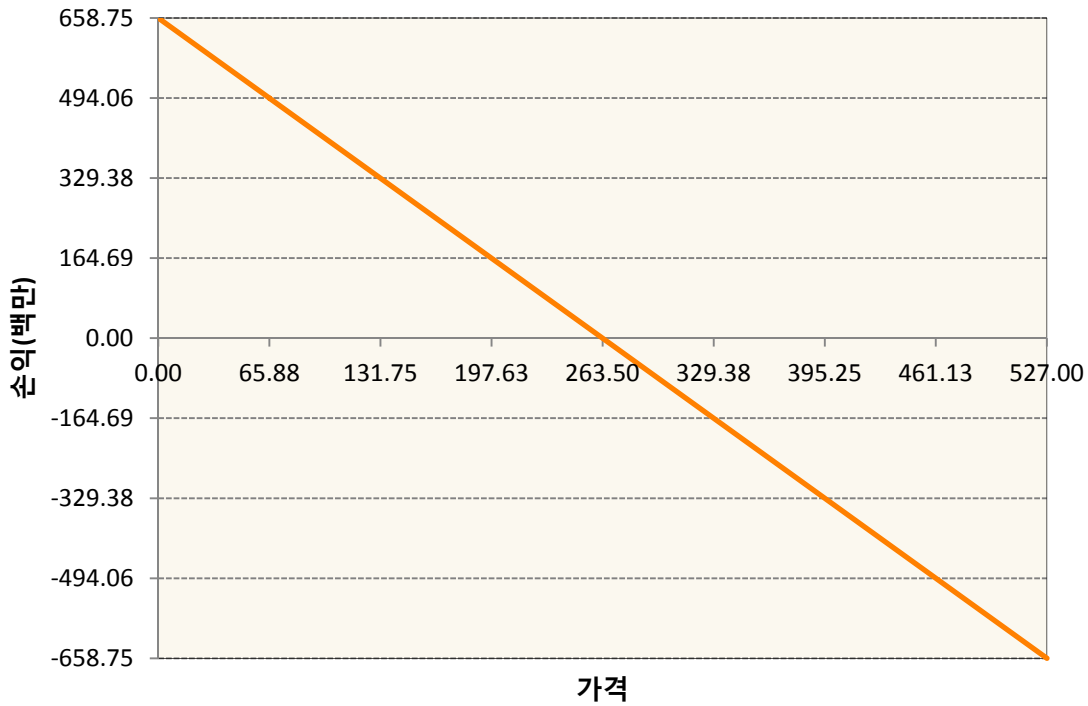
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

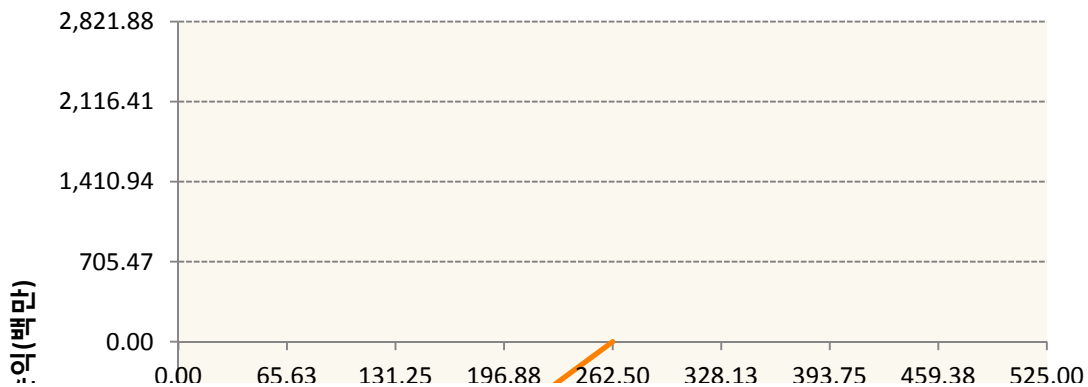
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 0     | 659   | -659      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 3,286 | -3,286    | 장내 |

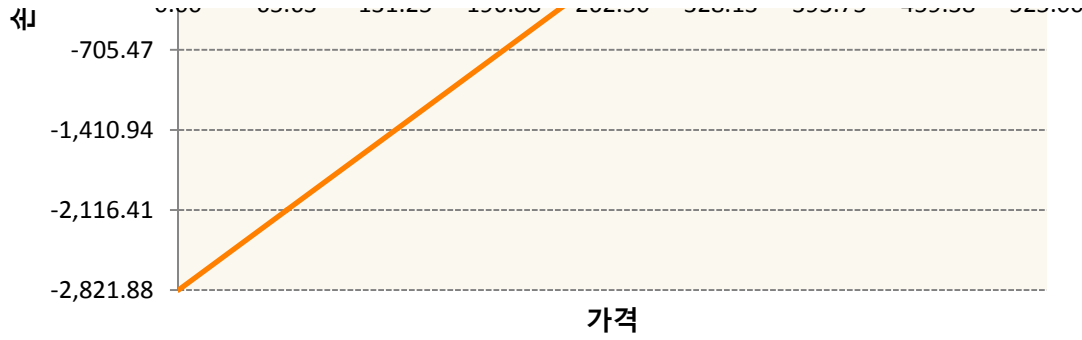
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

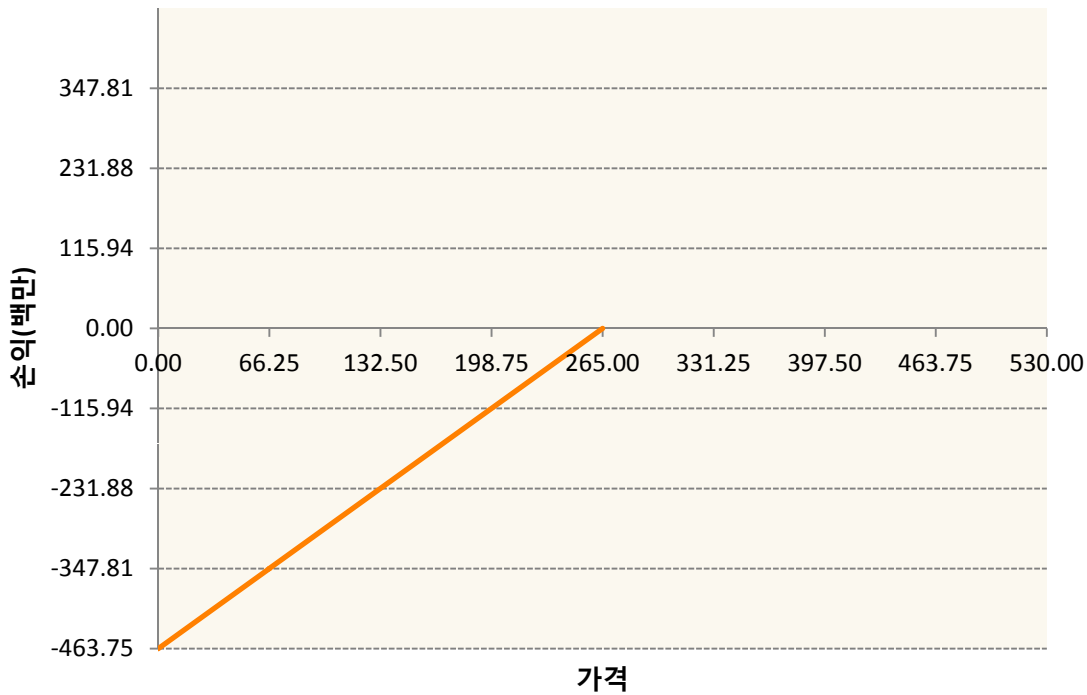


KR4301P62626-2019-06 풋262.5





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%                                         | -108    | -108    | -109   | -110 | -111  | -112   | -113   |
| -2.67%                                         | -38     | -40     | -43    | -45  | -47   | -50    | -52    |
| 0%                                             | 9       | 6       | 3      | 0    | -3    | -6     | -9     |
| 2.67%                                          | 27      | 25      | 24     | 22   | 20    | 18     | 15     |
| 5.33%                                          | 30      | 29      | 29     | 28   | 28    | 27     | 26     |
| 8.00%                                          | 30      | 30      | 30     | 30   | 30    | 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 | 2019-06-03 |
| 기준일 | 2019-05-31 |

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

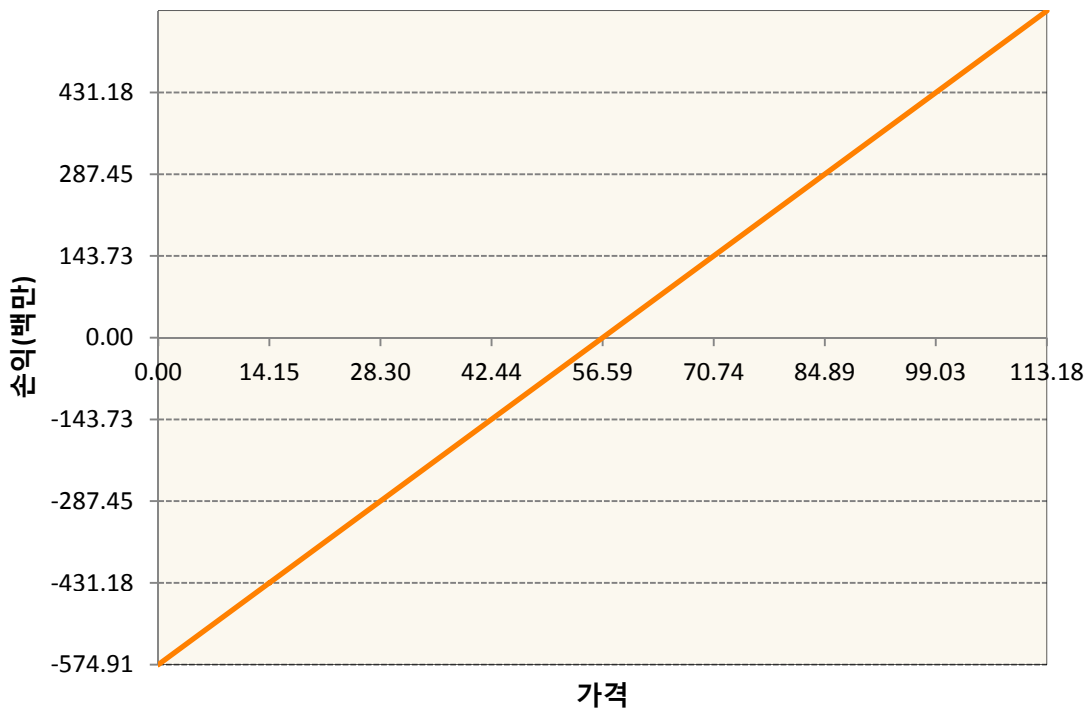
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

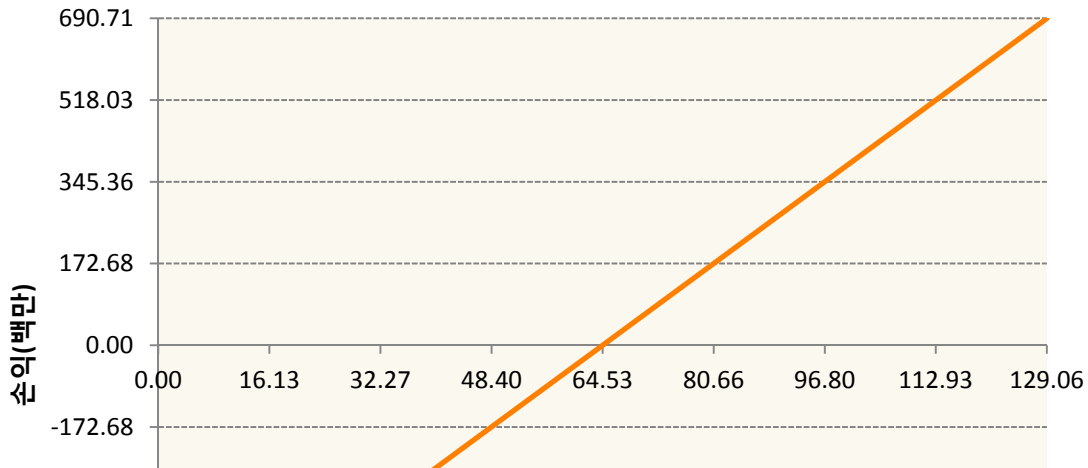
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,589 | 298   | 2,291     |    |

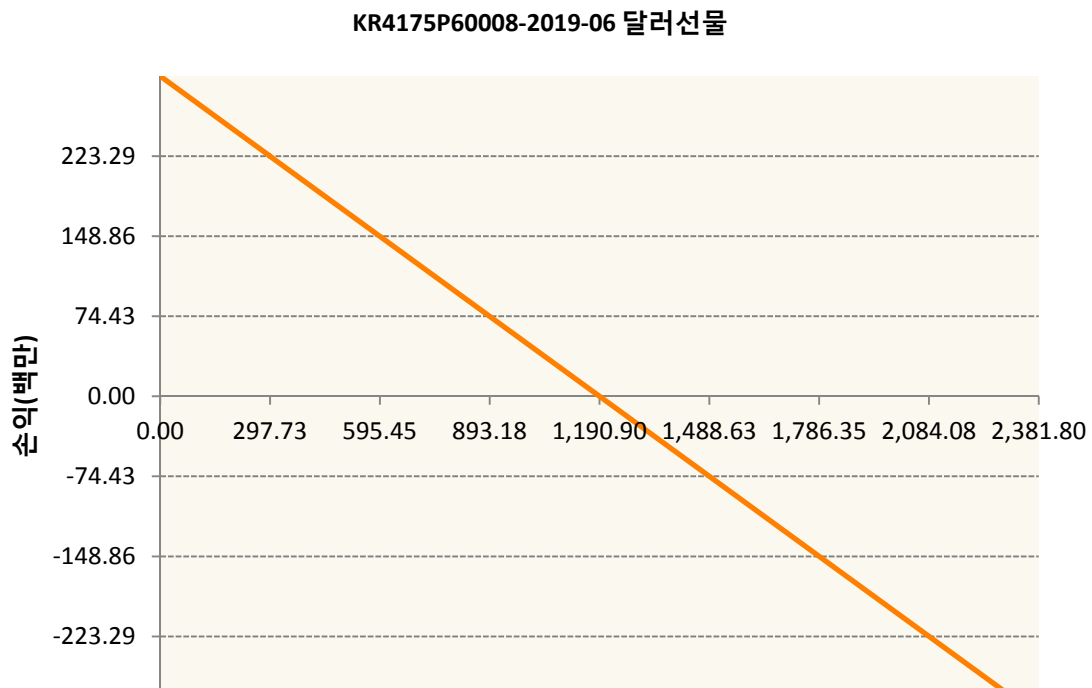
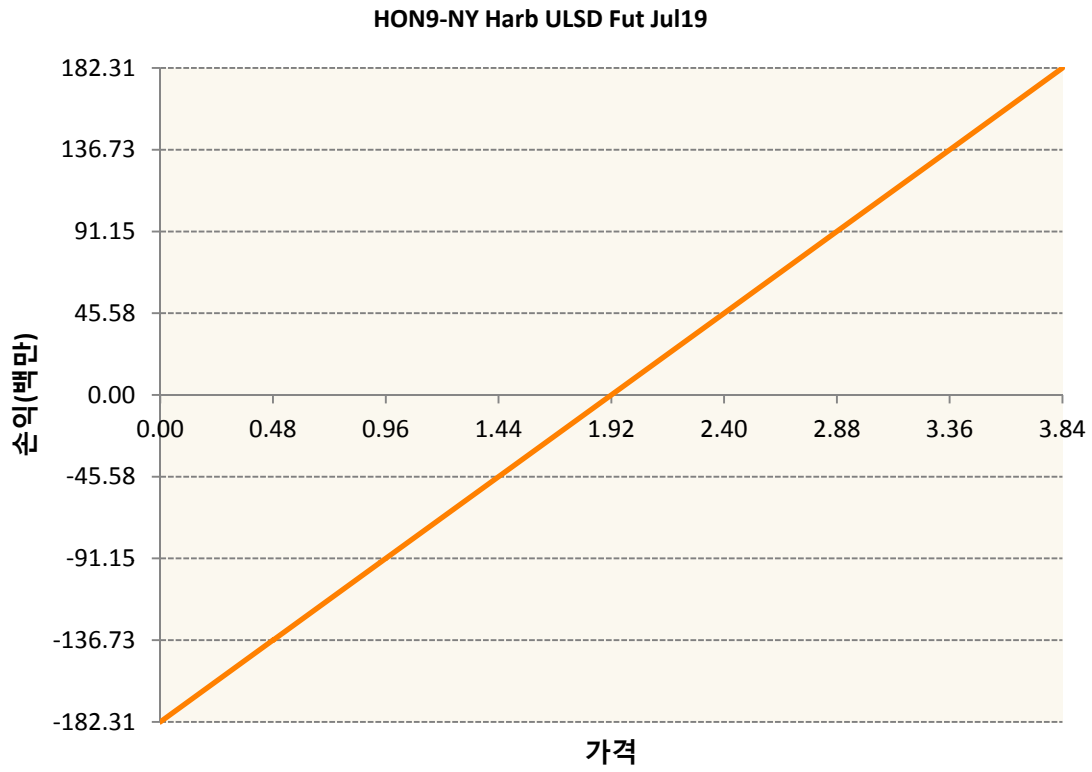
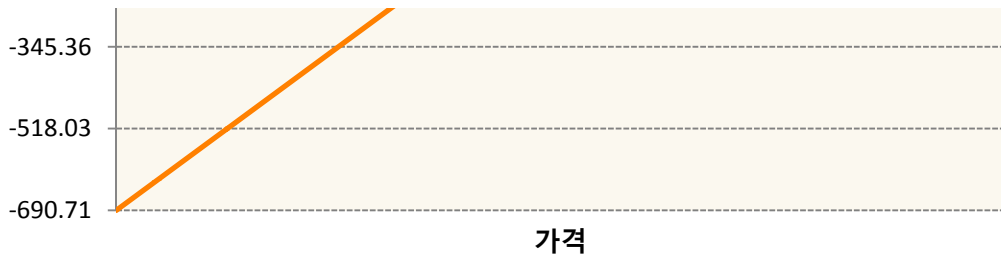
### 2. 만기시점의 손익구조

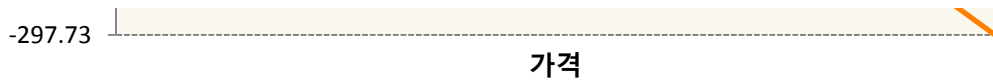
CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19



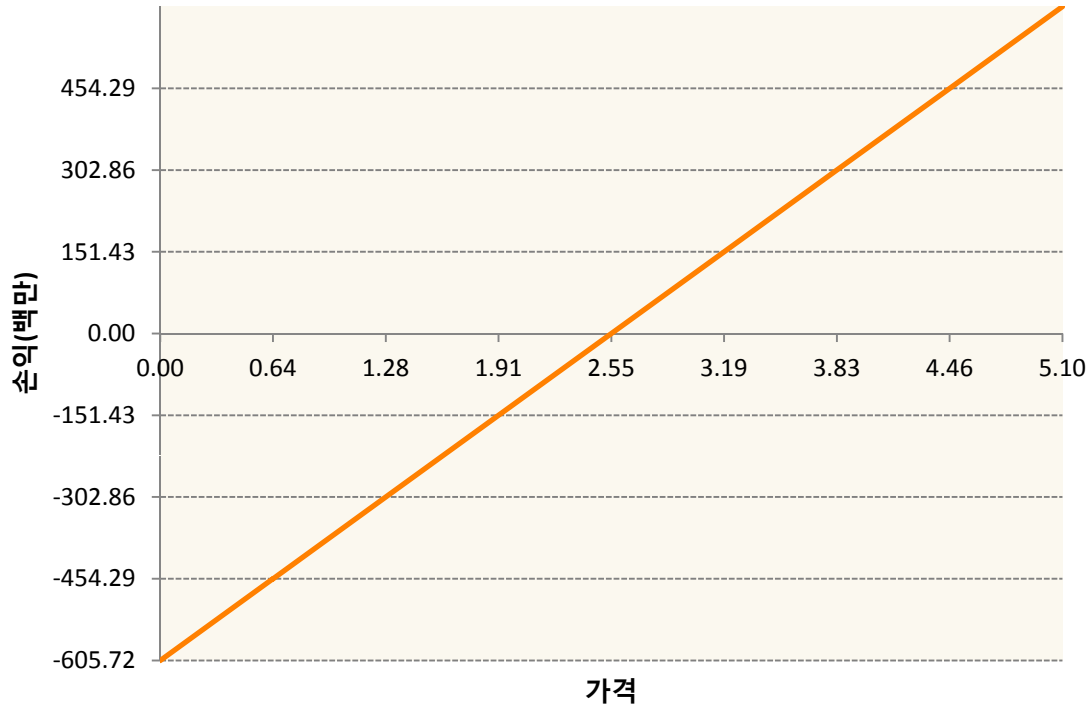
COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19



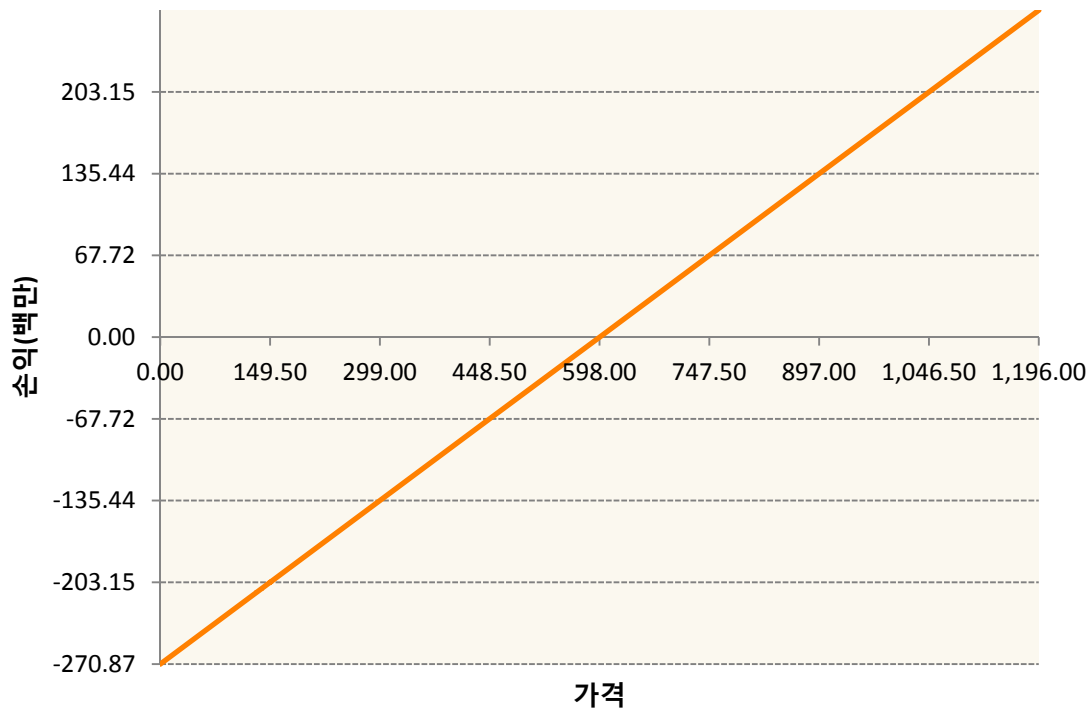




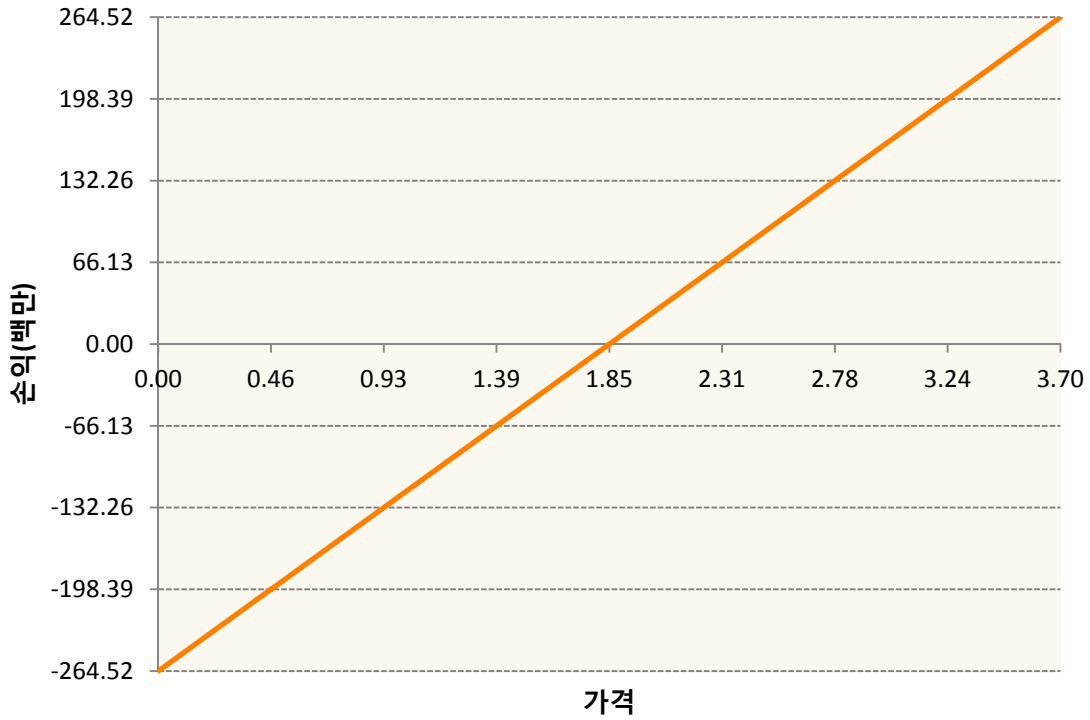
NGN19-NATURAL GAS FUTR Jul19



QSN9-Low Su Gasoil G Jul19



XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|            |                         |    |
|------------|-------------------------|----|
| CLN9       | WTI CRUDE FUTURE Jul19  | 46 |
| COU9       | BRENT CRUDE FUTR Sep19  | 55 |
| HON9       | NY Harb ULSD Fut Jul19  | 15 |
| KR4175P600 | 2019-06 달러선물            | 24 |
| NGN19      | NATURAL GAS FUTR Jul19  | 48 |
| QSN9       | Low Su Gasoil G Jul19   | 22 |
| XBN9       | GASOLINE RBOB FUT Jul19 | 21 |

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

(단위:백만원)

385

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-06-03 |
| 기준일 | 2019-05-31 |

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

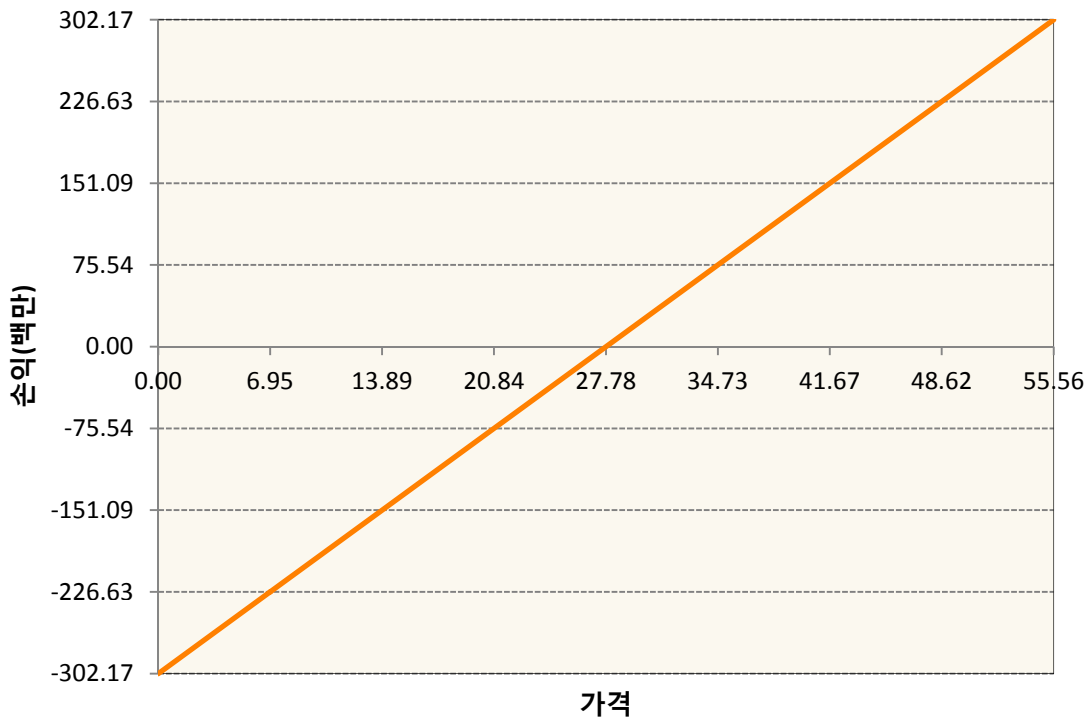
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

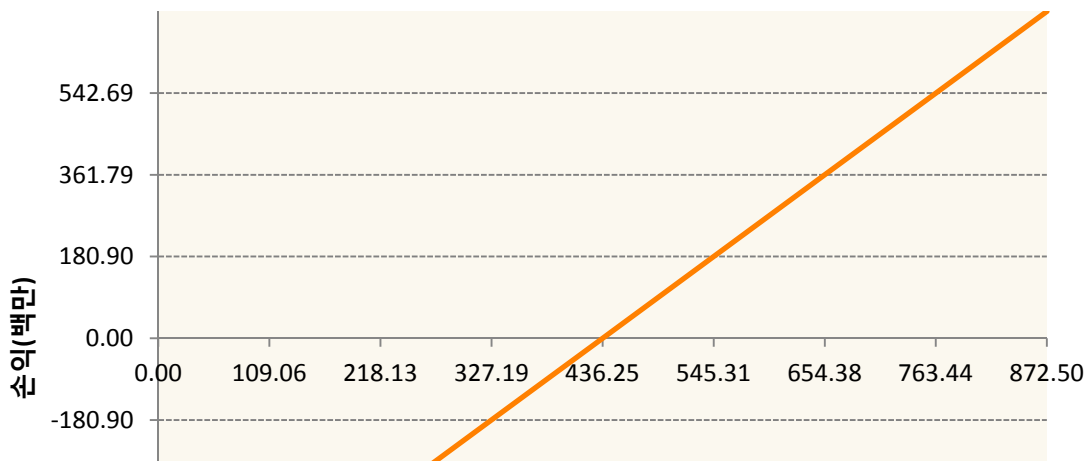
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 3,153 | 60    | 3,093     |    |

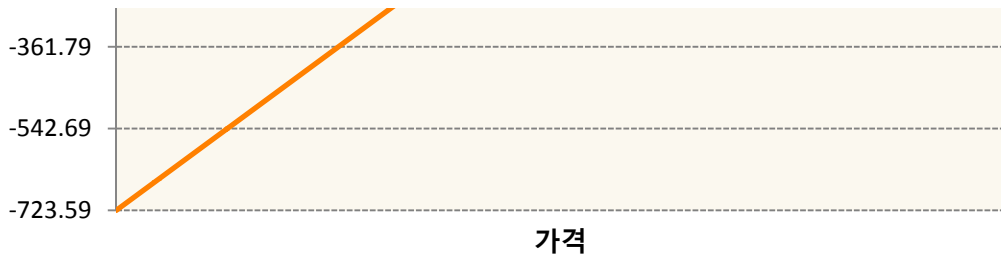
### 2. 만기시점의 손익구조

**BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19**

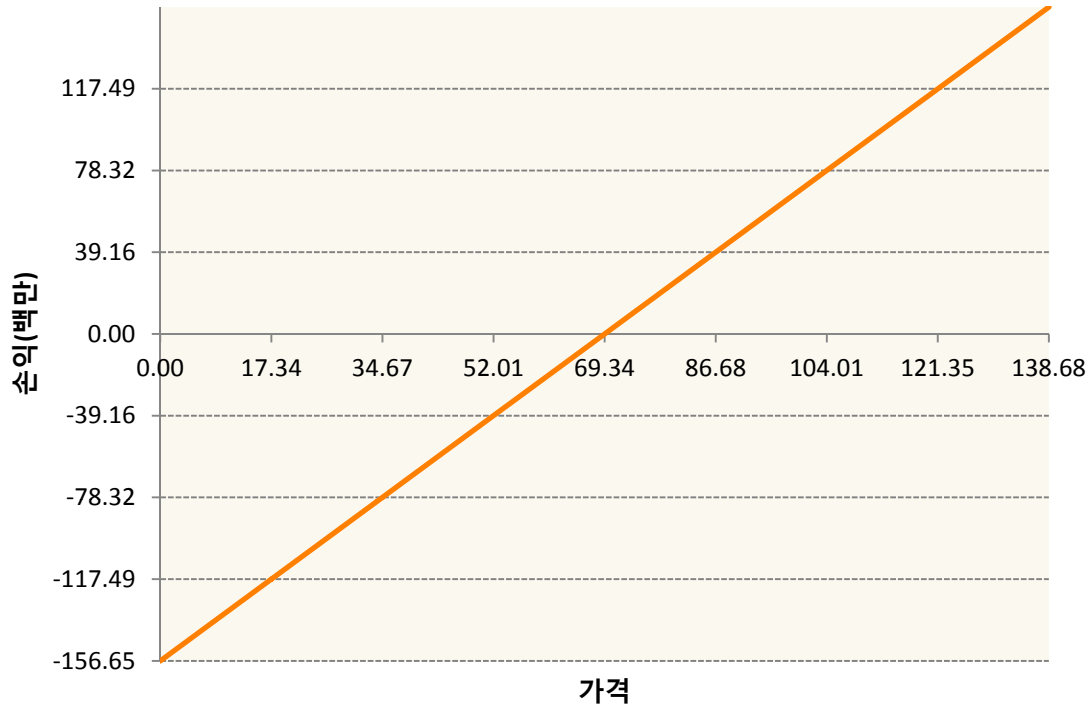


**CN9-CORN FUTURE Jul19**

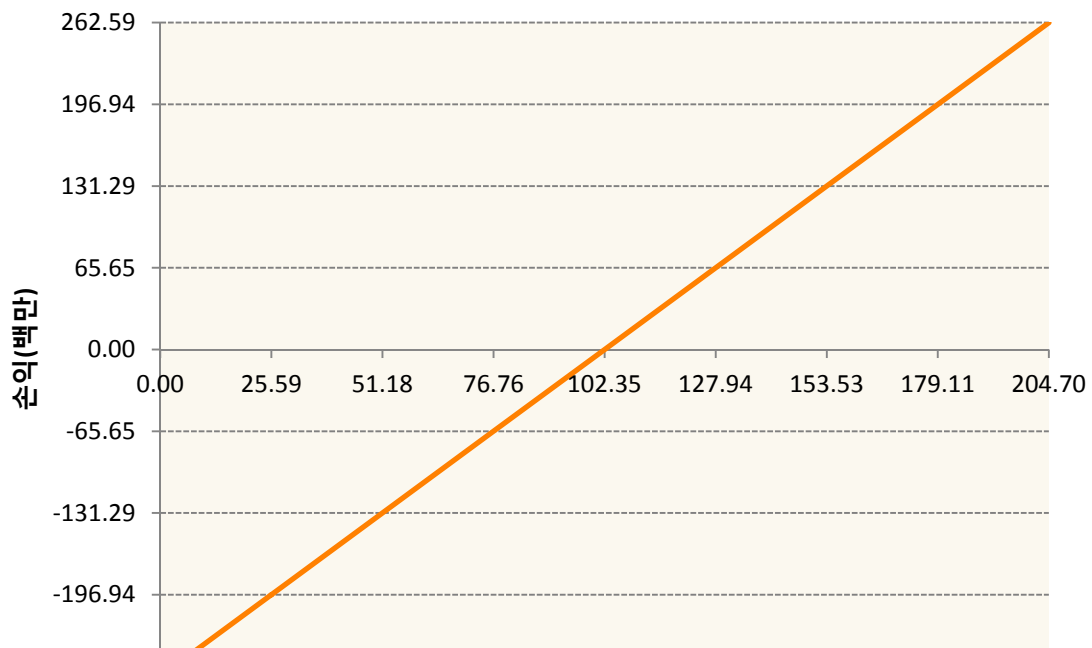


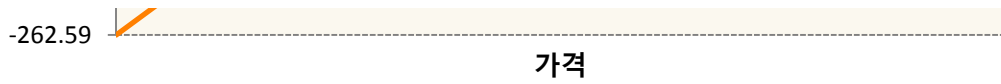


CTN9-COTTON NO.2 FUTR Jul19

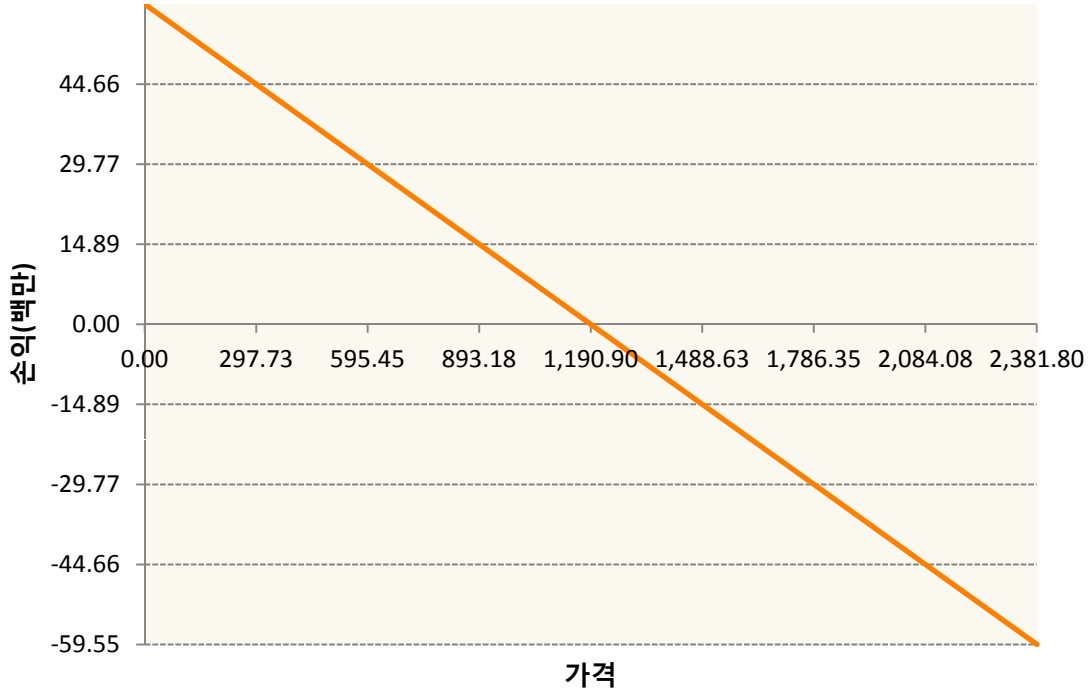


KCN9-COFFEE 'C' FUTURE Jul19

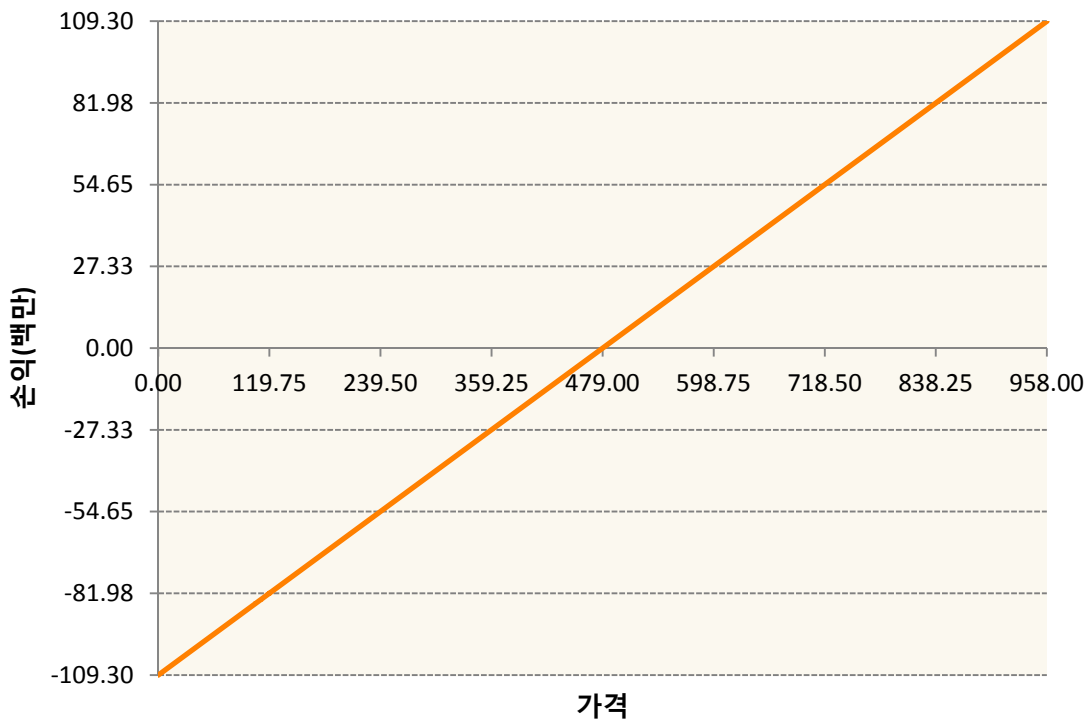




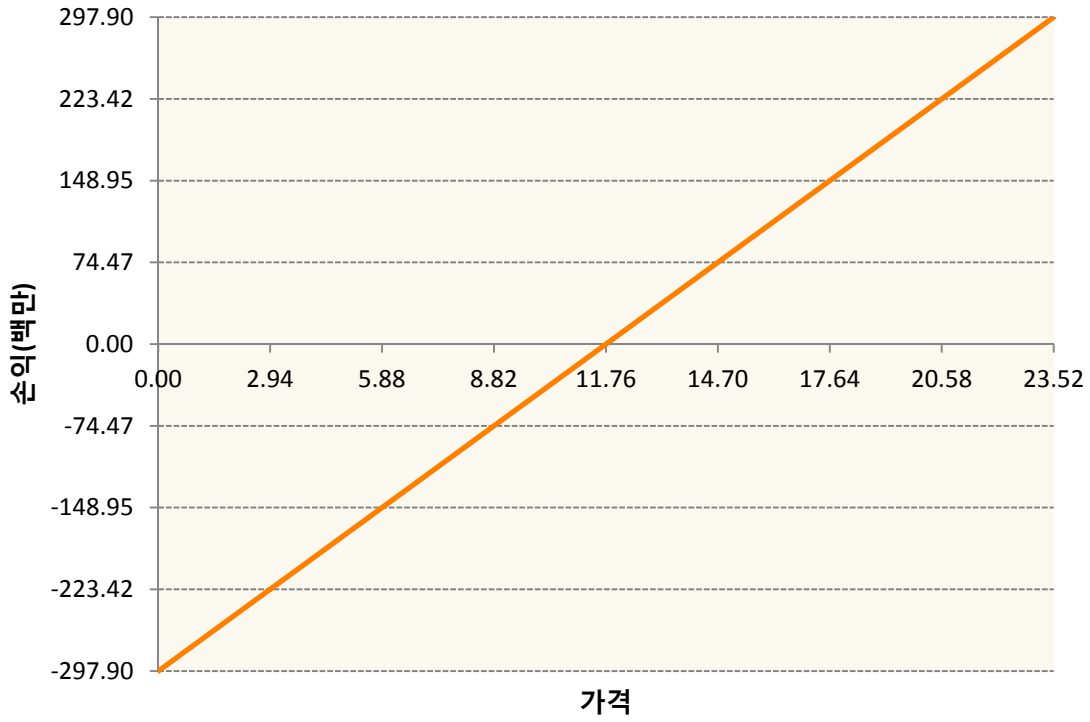
KR4175P60008-2019-06 달러선물



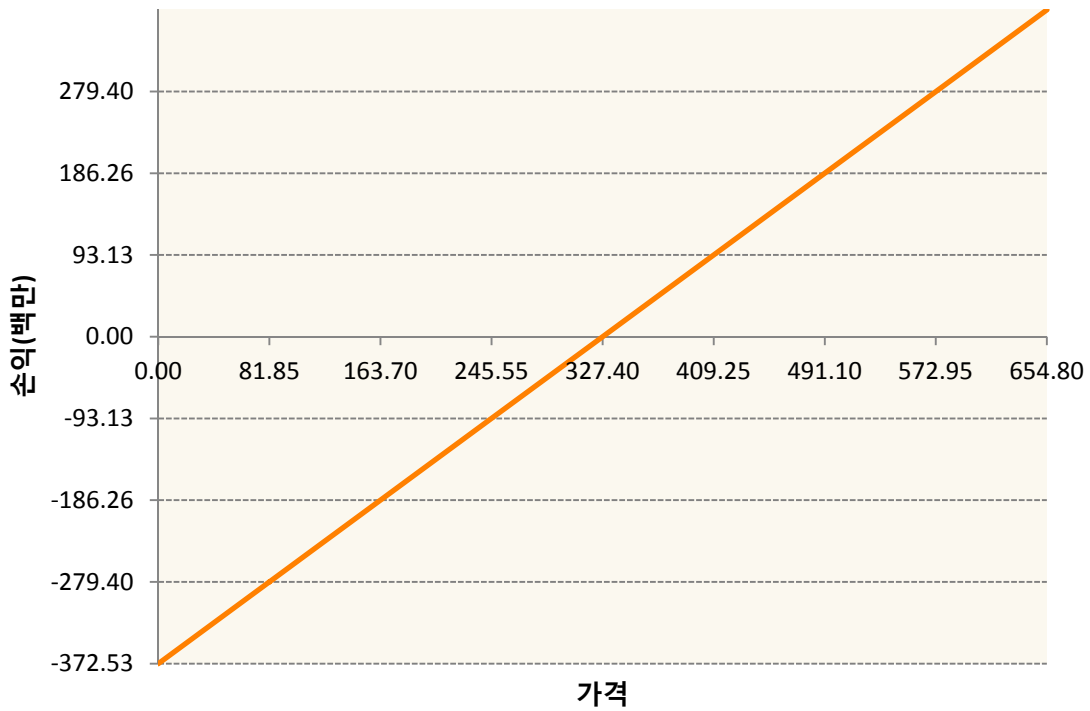
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

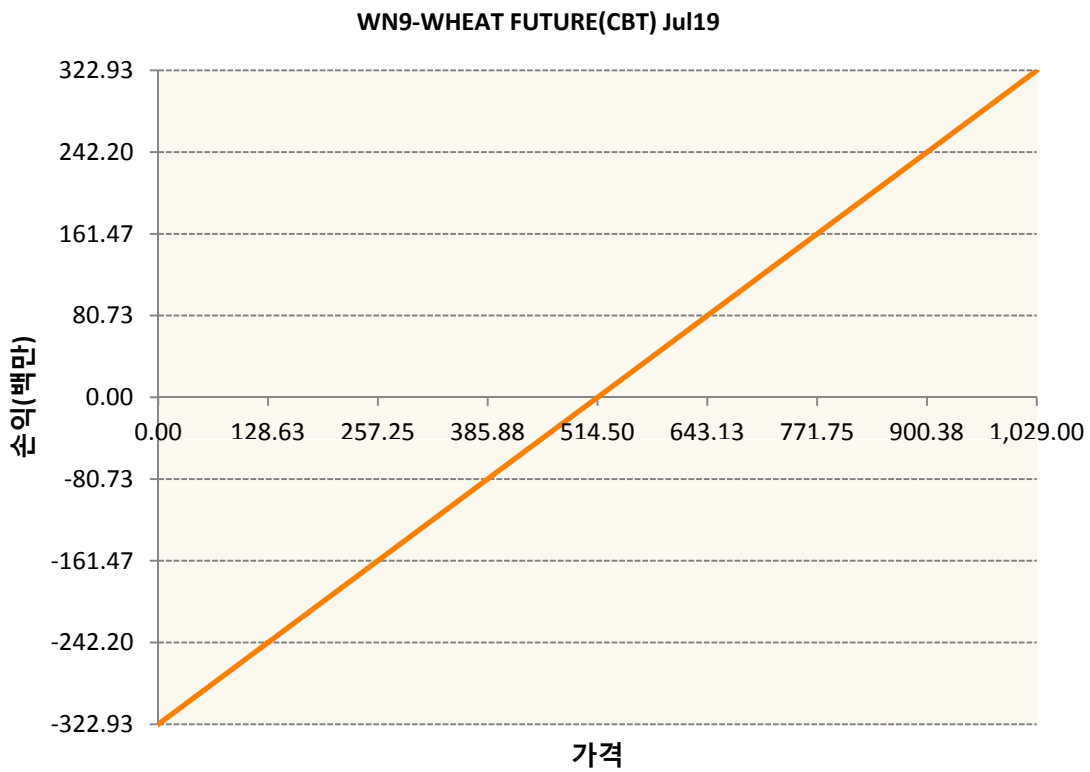
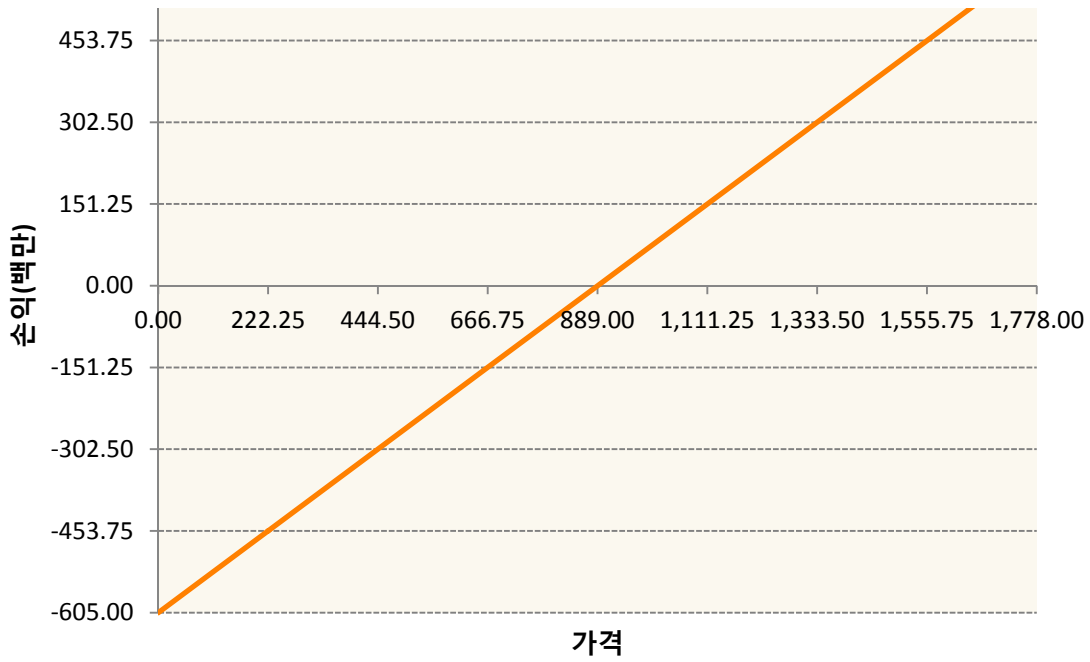


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19



SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

|            |                         |    |
|------------|-------------------------|----|
| BON9       | SOYBEAN OIL FUTR Jul19  | 24 |
| CN9        | CORN FUTURE Jul19       | 58 |
| CTN9       | COTTON NO.2 FUTR Jul19  | 13 |
| KCN9       | COFFEE 'C' FUTURE Jul19 | 21 |
| KR4175P600 | 2019-06 달러선물            | 5  |

|      |                         |    |
|------|-------------------------|----|
| KWN9 | KC HRW WHEAT FUT Jul19  | 9  |
| SBN9 | SUGAR #11 (WORLD) Jul19 | 24 |
| SMN9 | SOYBEAN MEAL FUTR Jul19 | 30 |
| SN9  | SOYBEAN FUTURE Jul19    | 48 |
| WN9  | WHEAT FUTURE(CBT) Jul19 | 26 |

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

(단위:백만원)

**263**