

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-07-10 |
| 기준일 | 2019-07-09 |

## 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 | 2019-07-10 |
| 기준일 | 2019-07-09 |

## 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

1,174

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

672

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-07-10 |
| 기준일 | 2019-07-09 |

## 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   | 6,210 | 0     | 6,210     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                 |     |
|---------------------------------|-----|
| SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(1) | 380 |
| SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2) | 139 |

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

849

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-07-10 |
| 기준일 | 2019-07-09 |

## 유로인덱스모(주식-파생형)

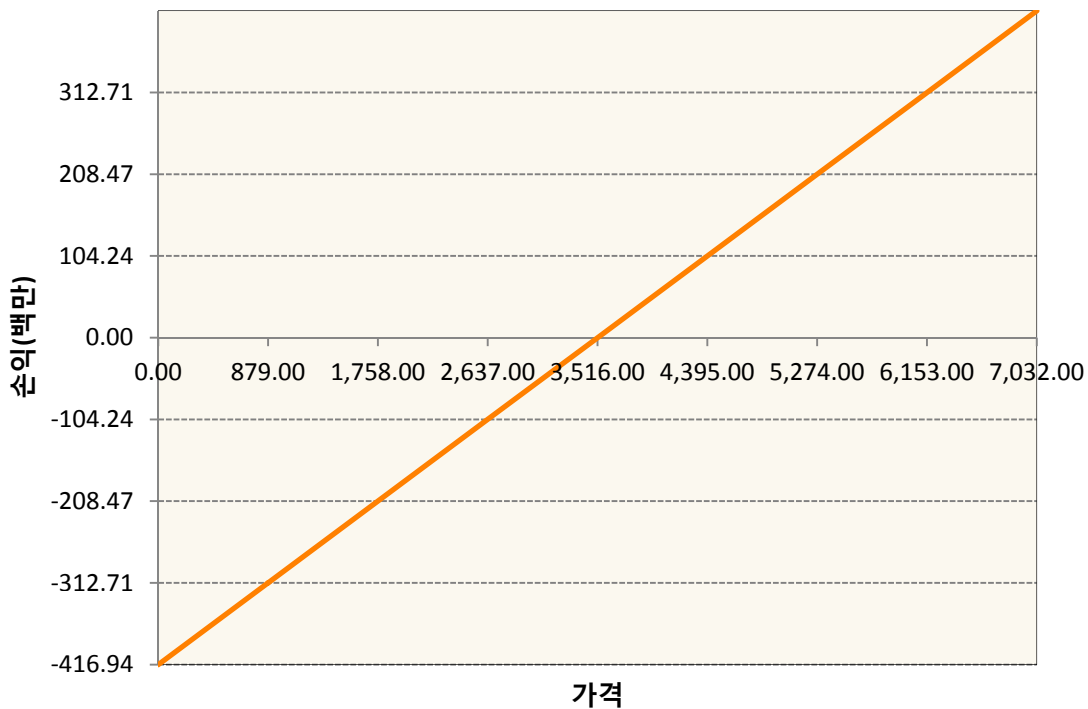
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 417   | 0     | 417       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

VGU9-EURO STOXX 50 Sep19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGU9 | EURO STOXX 50 Sep19 | 33 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 24 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-07-10 |
| 기준일 | 2019-07-09 |

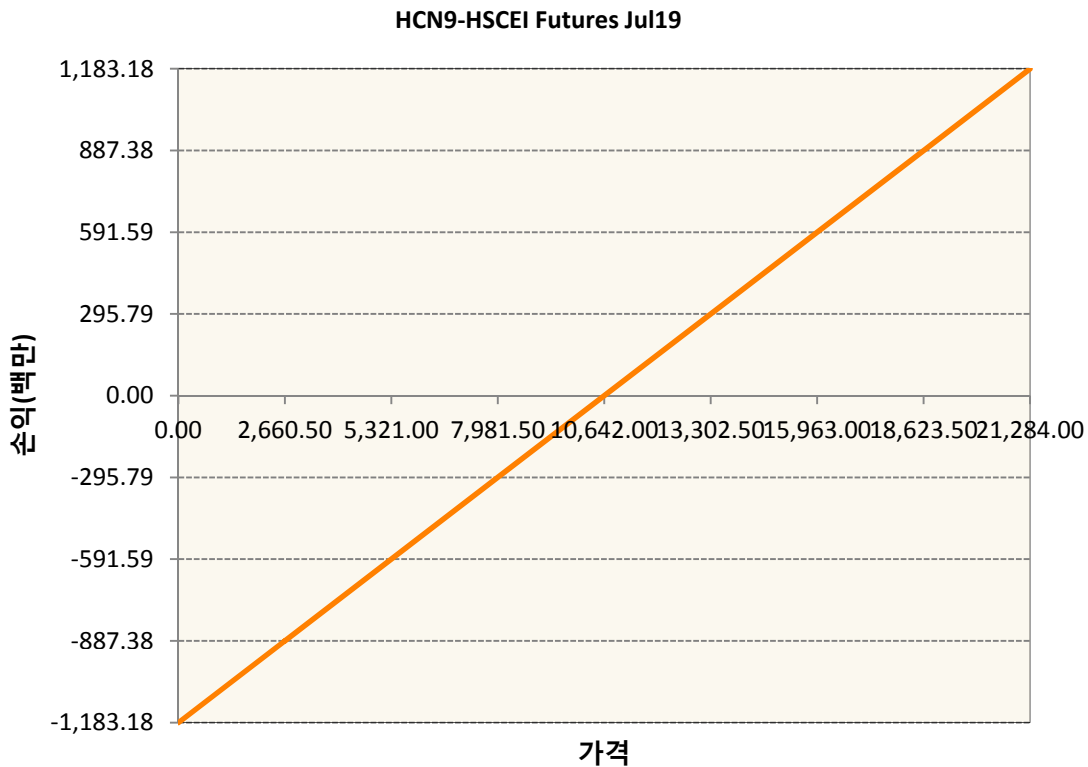
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,183 | 0     | 1,183     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| HCN9 | HSCEI Futures Jul19 | 95 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 96 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-07-10 |
| 기준일 | 2019-07-09 |

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

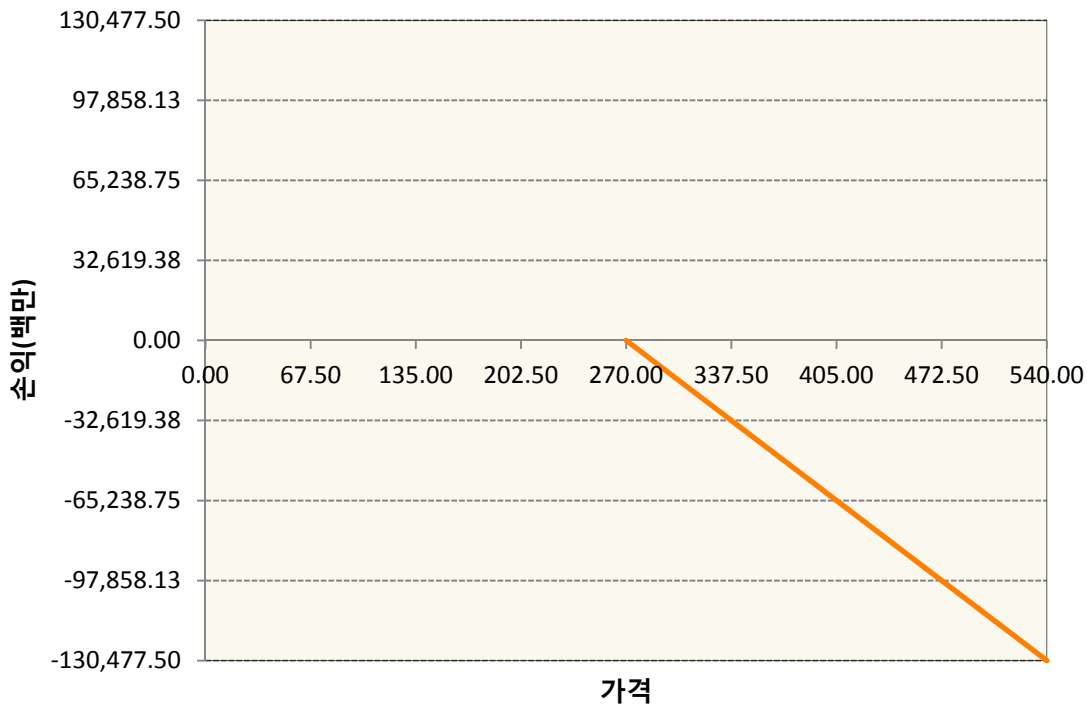
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

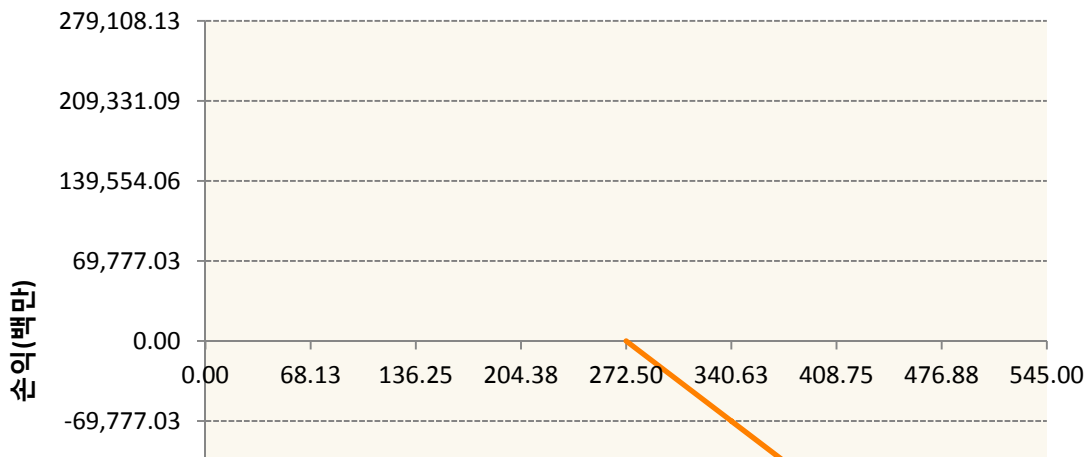
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)   | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0       | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 591,498 | -591,498  | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P72700-2019-07 콜270



KR4201P72726-2019-07 콜272.5





|  |         |         |         |         |         |         |         |
|--|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| -5.33%   | 466     | 466     | 466     | 466     | 466     | 466     | 465     |
| -2.67%   | 465     | 464     | 460     | 453     | 441     | 424     | 401     |
| 0%   | 280     | 198     | 104     | 0       | -112    | -231    | -356    |
| 2.67%  | -2,581  | -2,727  | -2,877  | -3,031  | -3,188  | -3,347  | -3,508  |
| 5.33%  | -9,260  | -9,272  | -9,291  | -9,319  | -9,355  | -9,401  | -9,456  |
| 8.00%  | -16,563 | -16,563 | -16,563 | -16,564 | -16,565 | -16,569 | -16,574 |
| KR4301P72708                      2019-07 풋270 |         |         |         |         |         |         | 14,221  |
| 기초자산의 변동성                                      |         |         |         |         |         |         |         |
| 가격   | -25.00% | -16.67% | -8.33%  | 0%      | 8.33%   | 16.67%  | 25.00%  |
| -8.00%   | -14,221 | -14,221 | -14,221 | -14,221 | -14,221 | -14,221 | -14,221 |
| -5.33%   | -9,412  | -9,412  | -9,412  | -9,412  | -9,412  | -9,412  | -9,412  |
| -2.67%   | -4,602  | -4,602  | -4,602  | -4,602  | -4,603  | -4,603  | -4,604  |
| 0%   | 115     | 80      | 42      | 0       | -44     | -91     | -139    |
| 2.67%  | 1,745   | 1,740   | 1,731   | 1,720   | 1,704   | 1,686   | 1,664   |
| 5.33%  | 1,750   | 1,750   | 1,750   | 1,750   | 1,750   | 1,750   | 1,750   |
| 8.00%  | 1,750   | 1,750   | 1,750   | 1,750   | 1,750   | 1,750   | 1,750   |

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

(단위:백만원)

**49,317**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-07-10 |
| 기준일 | 2019-07-09 |

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

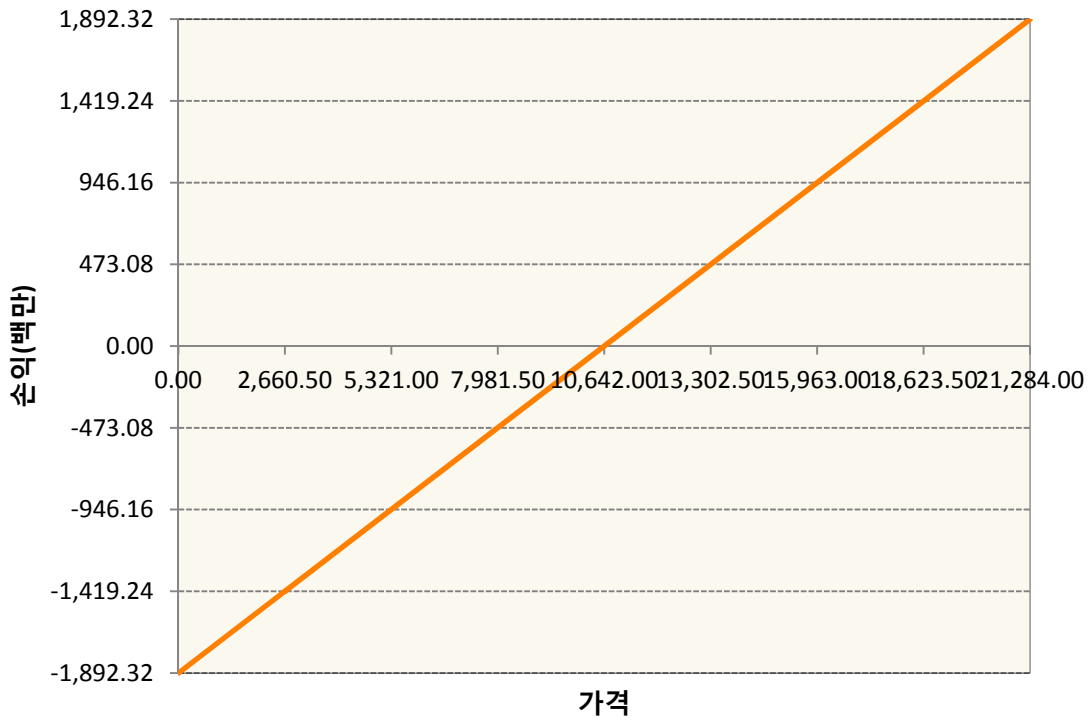
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

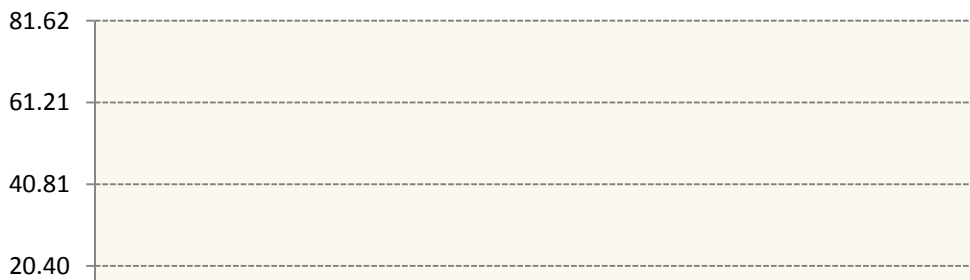
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,892 | 0     | 1,892     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 5,270 | -5,270    | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 151   | 3,174 | -3,023    | 장외 |

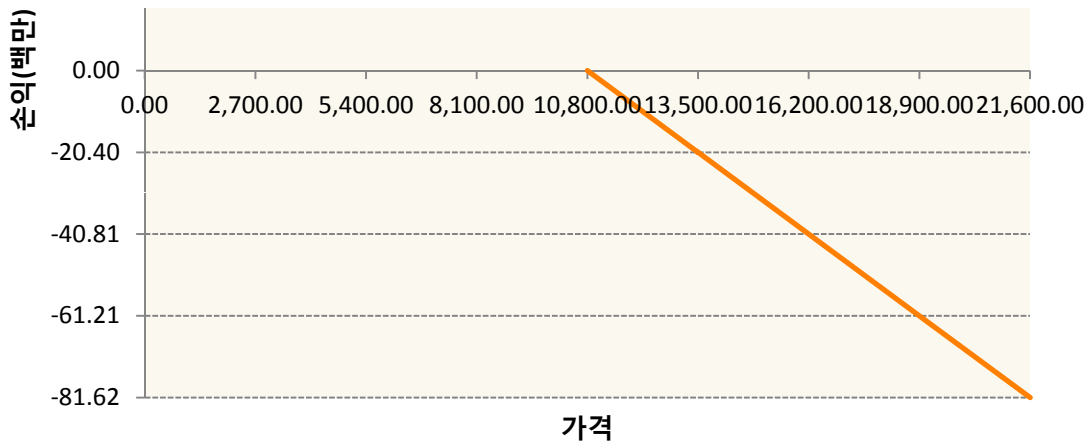
### 2. 만기시점의 손익구조

HCN9-HSCEI Futures Jul19

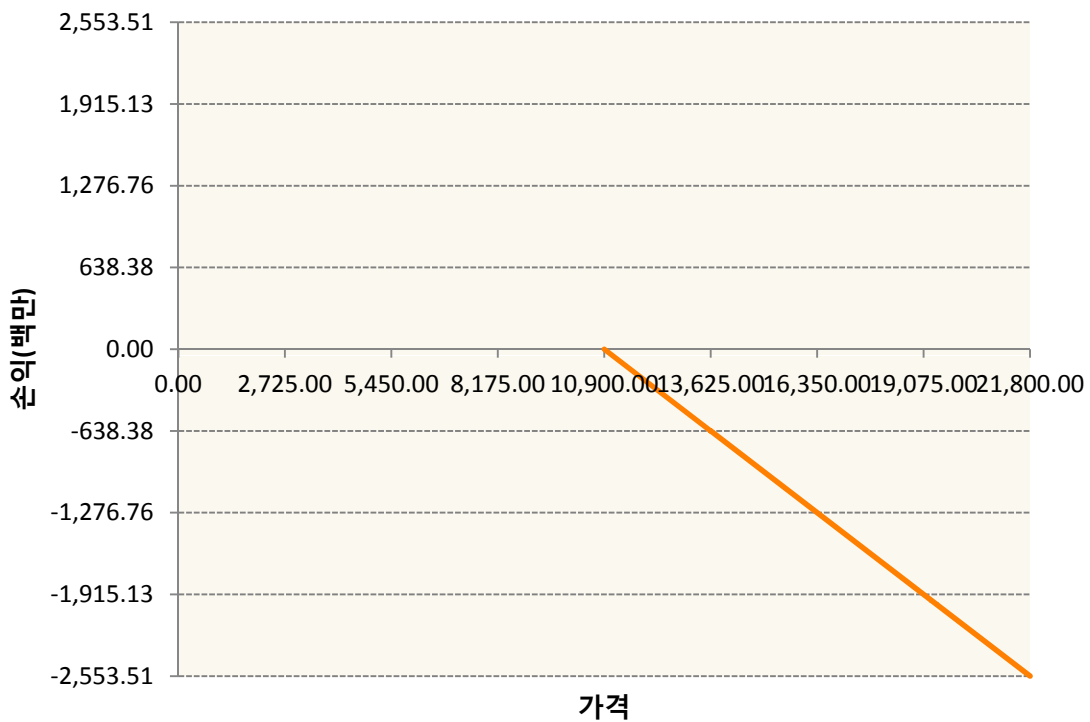


OHHIN9-C108-HSCEI

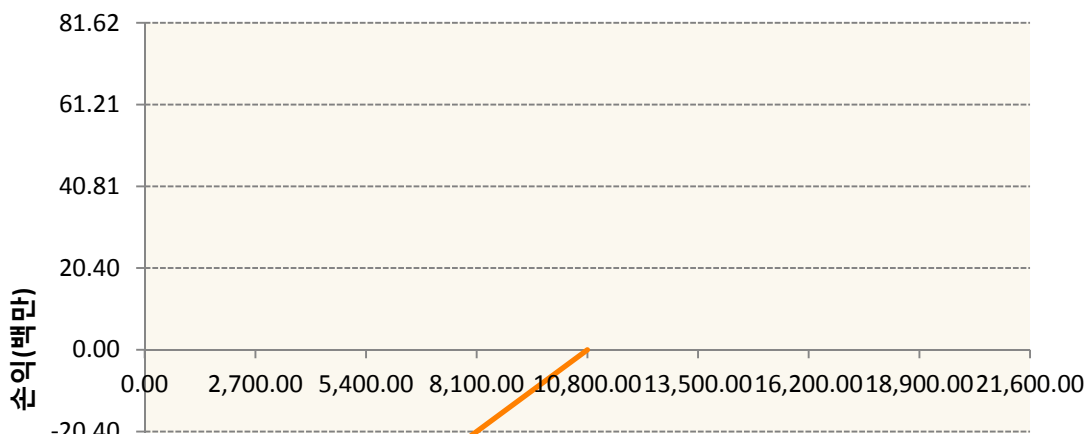


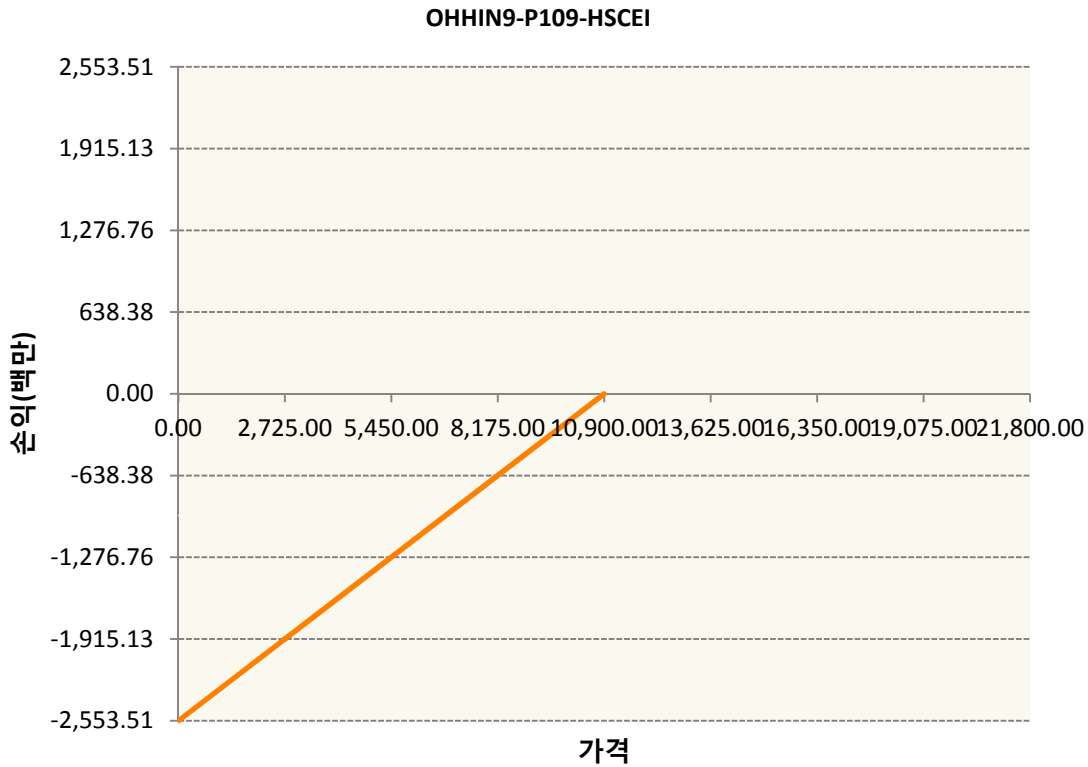


OHHIN9-C109-HSCEI



OHHIN9-P108-HSCEI





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)    | (단위:백만원) |
|------------------------------|----------|
| FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E | 254      |
| FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E | 12       |
| HCN9 HSCEI Futures Jul19     | 151      |
| OHHIN9-C1(HSCEI              | 7        |
| OHHIN9-C1(HSCEI              | 204      |
| OHHIN9-P1(HSCEI              | 7        |
| OHHIN9-P1(HSCEI              | 204      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|--|----------|
|  | 667      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-07-10 |
| 기준일 | 2019-07-09 |

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

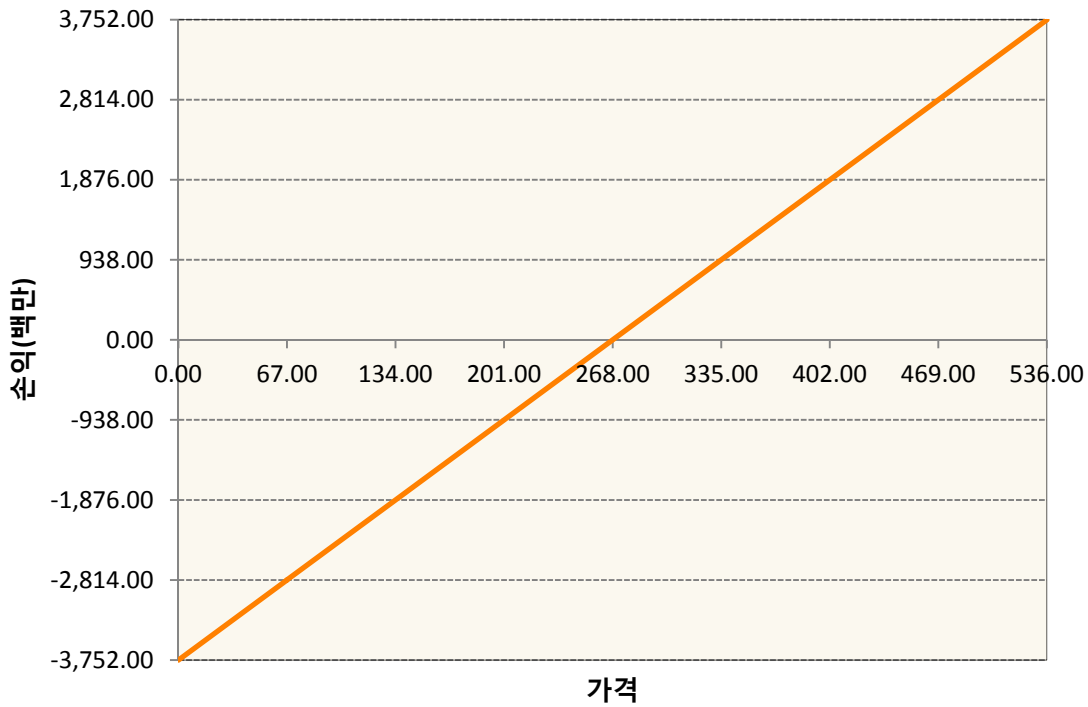
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

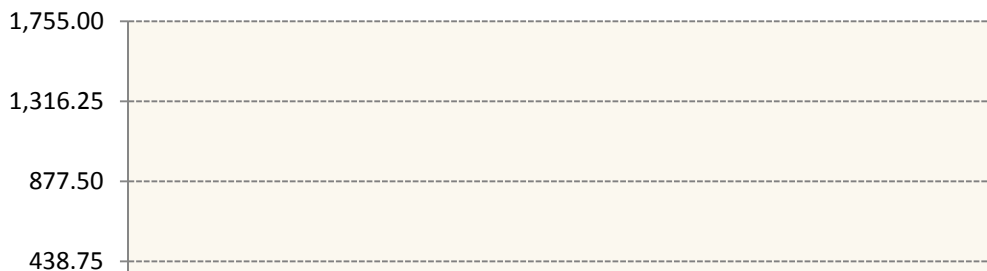
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0      | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑   | 0      | 0      | 0         | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0      | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 3,752  | 0      | 3,752     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 20,836 | 0      | 20,836    | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0      | 20,340 | -20,340   | 장내 |

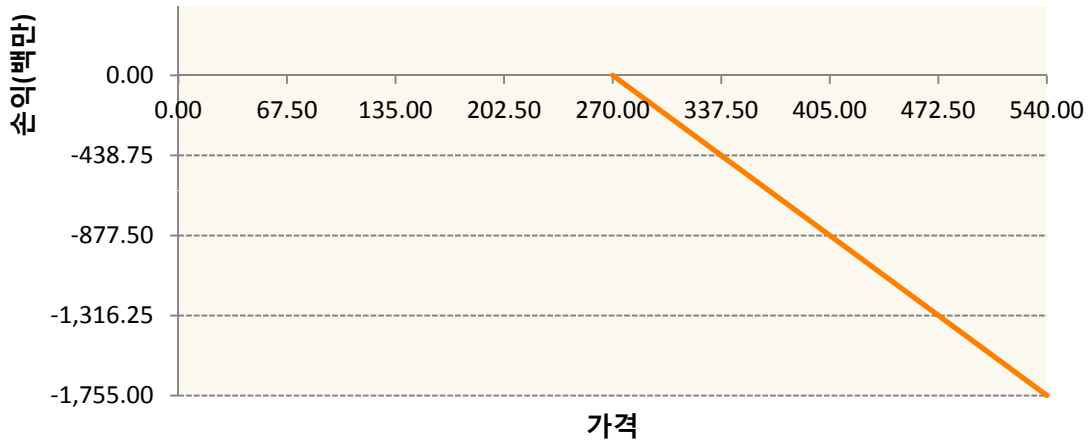
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

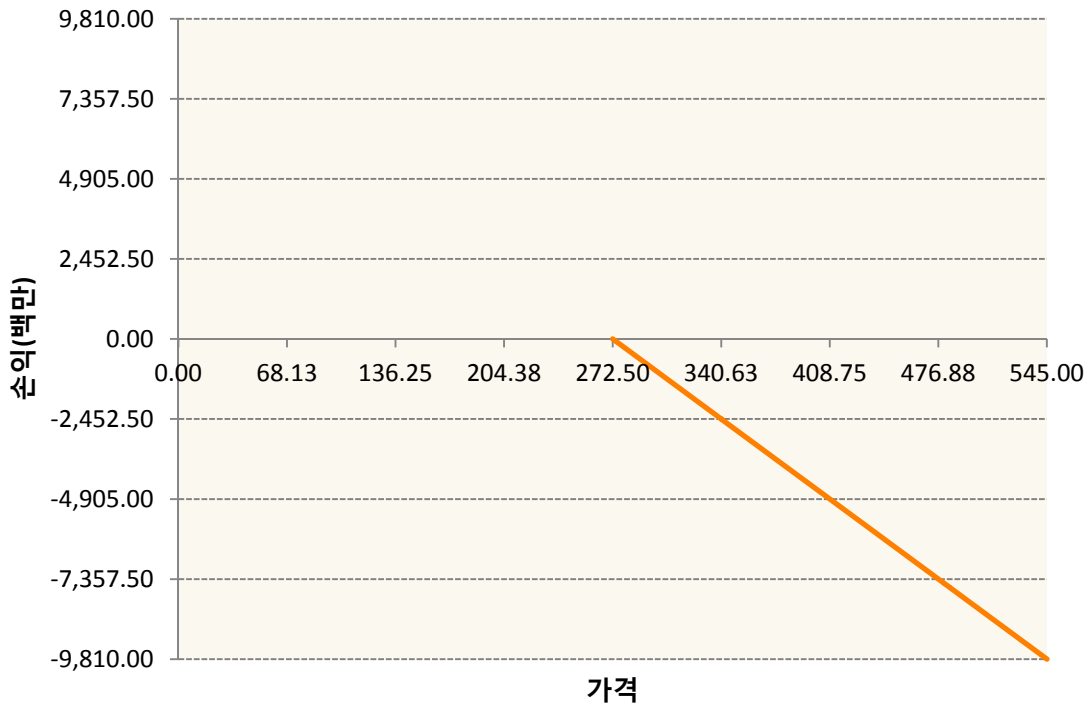


KR4201P72700-2019-07 콜270

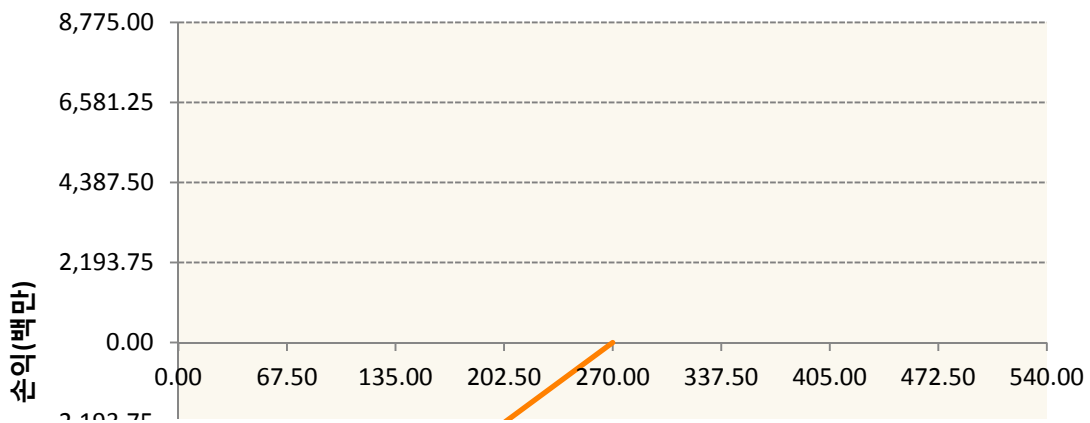




**KR4201P72726-2019-07 콜272.5**



**KR4301P72708-2019-07 풋270**





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

|              |         |                    |        |        |        |        |        |       |
|--------------|---------|--------------------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|
| 2.529E+11    |         | UBCSFXC1 INDEX_14  |        |        |        |        |        | 1,195 |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |        |        |        |        |       |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |       |
| -8.00%       | -1,195  | -1,195             | -1,195 | -1,195 | -1,195 | -1,195 | -1,195 |       |
| -5.33%       | -797    | -797               | -797   | -797   | -797   | -797   | -797   |       |
| -2.67%       | -398    | -398               | -398   | -398   | -398   | -398   | -398   |       |
| 0%           | 0       | 0                  | 0      | 0      | 0      | 0      | 0      |       |
| 2.67%        | 398     | 398                | 398    | 398    | 398    | 398    | 398    |       |
| 5.33%        | 797     | 797                | 797    | 797    | 797    | 797    | 797    |       |
| 8.00%        | 1,195   | 1,195              | 1,195  | 1,195  | 1,195  | 1,195  | 1,195  |       |
| 2.529E+11    |         | UBCSFXC1 INDEX_15  |        |        |        |        |        | 604   |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |        |        |        |        |       |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |       |
| -8.00%       | -604    | -604               | -604   | -604   | -604   | -604   | -604   |       |
| -5.33%       | -403    | -403               | -403   | -403   | -403   | -403   | -403   |       |
| -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%        | 403     | 403                | 403    | 403    | 403    | 403    | 403    |       |
| 8.00%        | 604     | 604                | 604    | 604    | 604    | 604    | 604    |       |
| KR4101P90001 |         | 2019-09 코스피200지수선물 |        |        |        |        |        | 300   |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |        |        |        |        |       |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |       |
| -8.00%       | -300    | -300               | -300   | -300   | -300   | -300   | -300   |       |
| -5.33%       | -200    | -200               | -200   | -200   | -200   | -200   | -200   |       |
| -2.67%       | -100    | -100               | -100   | -100   | -100   | -100   | -100   |       |
| 0%           | 0       | 0                  | 0      | 0      | 0      | 0      | 0      |       |
| 2.67%        | 100     | 100                | 100    | 100    | 100    | 100    | 100    |       |
| 5.33%        | 200     | 200                | 200    | 200    | 200    | 200    | 200    |       |
| 8.00%        | 300     | 300                | 300    | 300    | 300    | 300    | 300    |       |
| KR4201P72700 |         | 2019-07 콜270       |        |        |        |        |        | 117   |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |        |        |        |        |       |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |       |

|  |         |         |        |      |       |        |        |
|--|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| -8.00%   | 7       | 7       | 7      | 7    | 7     | 7      | 7      |
| -5.33%   | 7       | 7       | 7      | 7    | 7     | 7      | 7      |
| -2.67%   | 7       | 7       | 7      | 7    | 6     | 6      | 6      |
| 0%   | 3       | 2       | 1      | 0    | -1    | -2     | -3     |
| 2.67%  | -26     | -26     | -27    | -28  | -28   | -29    | -30    |
| 5.33%  | -71     | -71     | -71    | -71  | -71   | -71    | -72    |
| 8.00%  | -117    | -117    | -117   | -117 | -117  | -117   | -117   |
| KR4201P72726                      2019-07 콜272.5 |         |         |        |      |       |        | 583    |
| 기초자산의 변동성  |         |         |        |      |       |        |        |
| 가격   | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%   | 16      | 16      | 16     | 16   | 16    | 16     | 16     |
| -5.33%   | 16      | 16      | 16     | 16   | 16    | 16     | 16     |
| -2.67%   | 16      | 16      | 16     | 16   | 16    | 15     | 14     |
| 0%   | 10      | 7       | 4      | 0    | -4    | -8     | -13    |
| 2.67%  | -91     | -96     | -101   | -107 | -112  | -118   | -123   |
| 5.33%  | -325    | -326    | -327   | -328 | -329  | -330   | -332   |
| 8.00%  | -582    | -582    | -582   | -582 | -582  | -582   | -583   |
| KR4301P72708                      2019-07 풋270   |         |         |        |      |       |        | 686    |
| 기초자산의 변동성  |         |         |        |      |       |        |        |
| 가격   | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%   | -686    | -686    | -686   | -686 | -686  | -686   | -686   |
| -5.33%   | -454    | -454    | -454   | -454 | -454  | -454   | -454   |
| -2.67%   | -222    | -222    | -222   | -222 | -222  | -222   | -222   |
| 0%   | 6       | 4       | 2      | 0    | -2    | -4     | -7     |
| 2.67%  | 84      | 84      | 84     | 83   | 82    | 81     | 80     |
| 5.33%  | 84      | 84      | 84     | 84   | 84    | 84     | 84     |
| 8.00%  | 84      | 84      | 84     | 84   | 84    | 84     | 84     |

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

(단위:백만원)

**3,831**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-07-10 |
| 기준일 | 2019-07-09 |

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

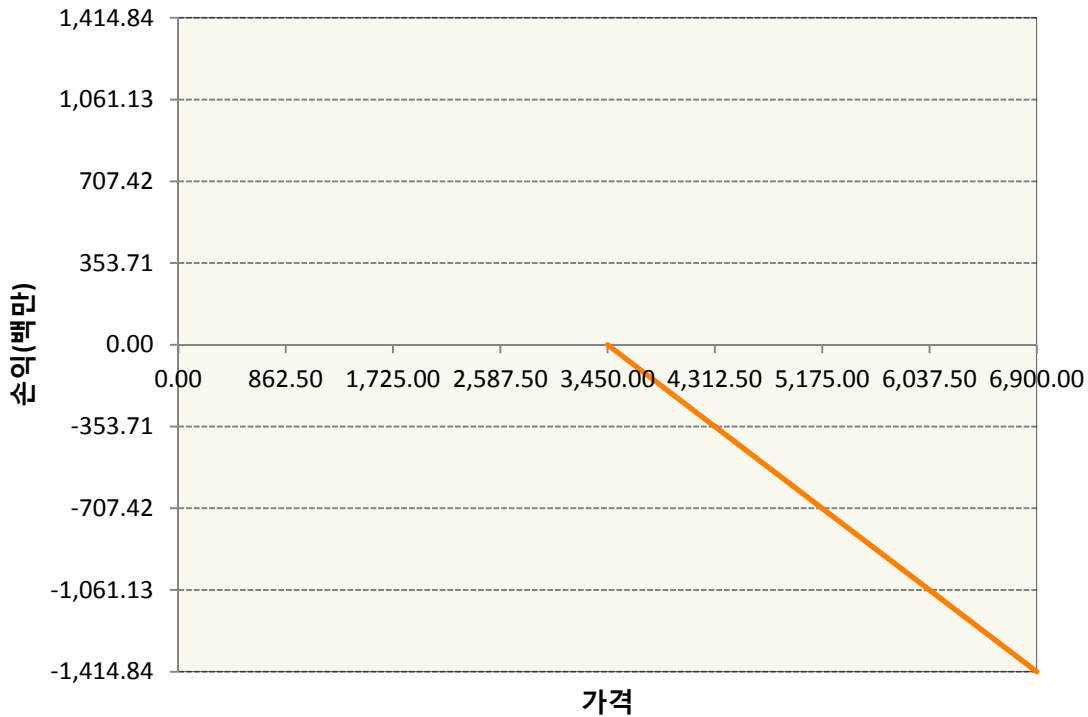
### 1. 계약금액

(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   | 1,342  | 0      | 1,342     |    |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 55,998 | 0      | 55,998    | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0      | 8,622  | -8,622    | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 22,490 | -22,490   | 장외 |

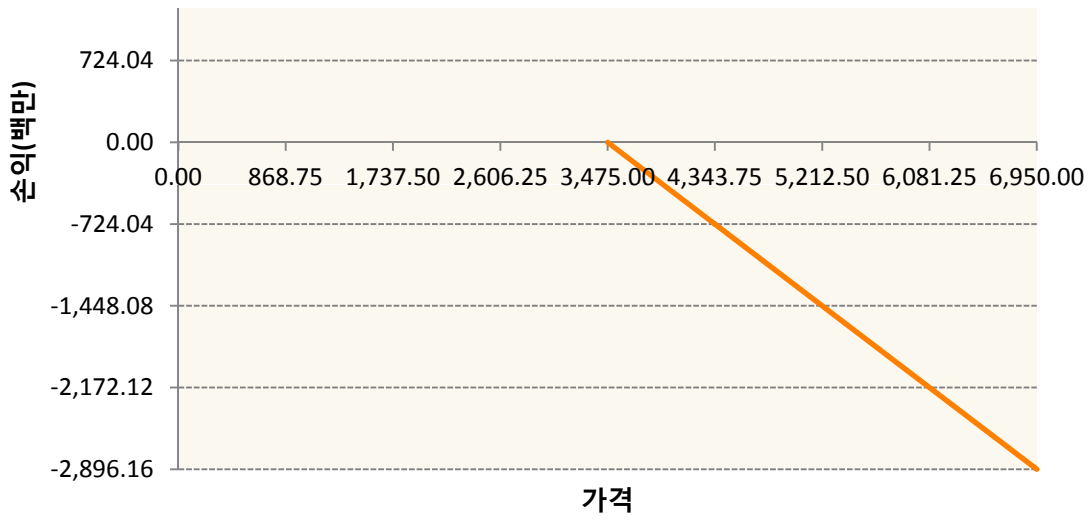
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXN9-C3450-EURO STOXX 50

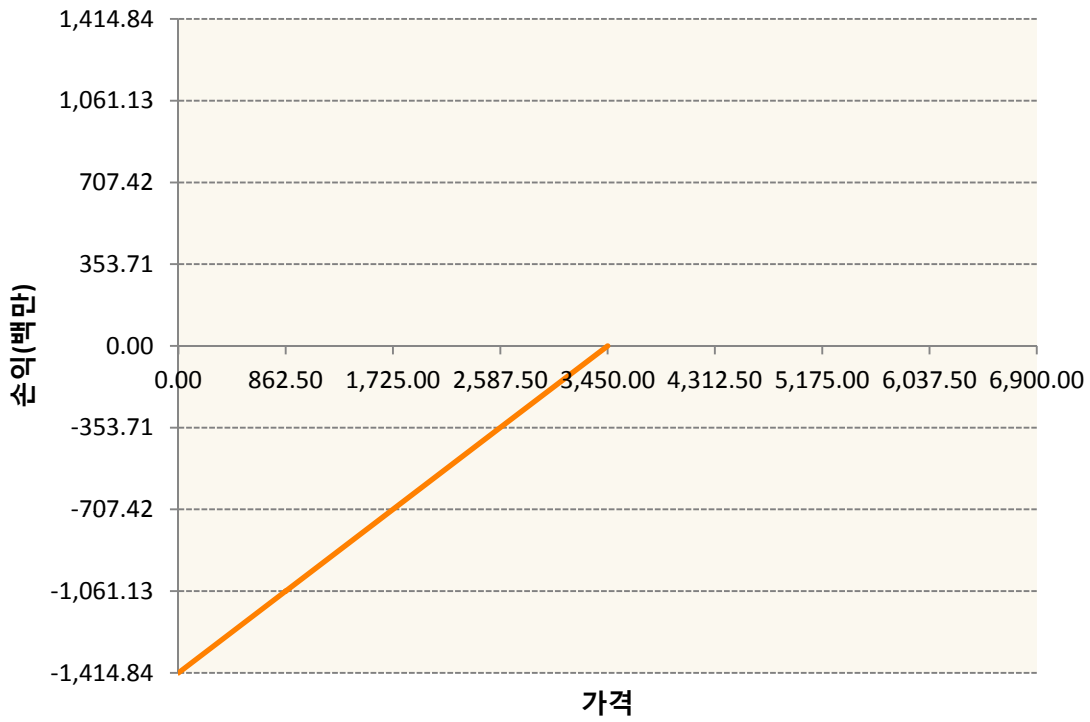


OESXN9-C3475-EURO STOXX 50

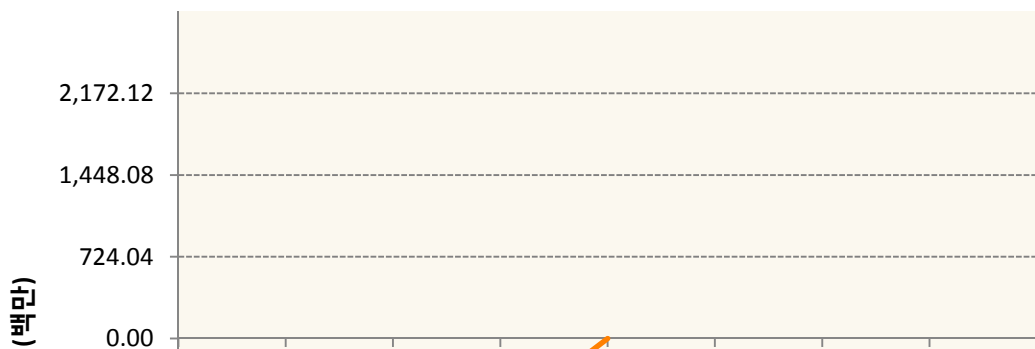


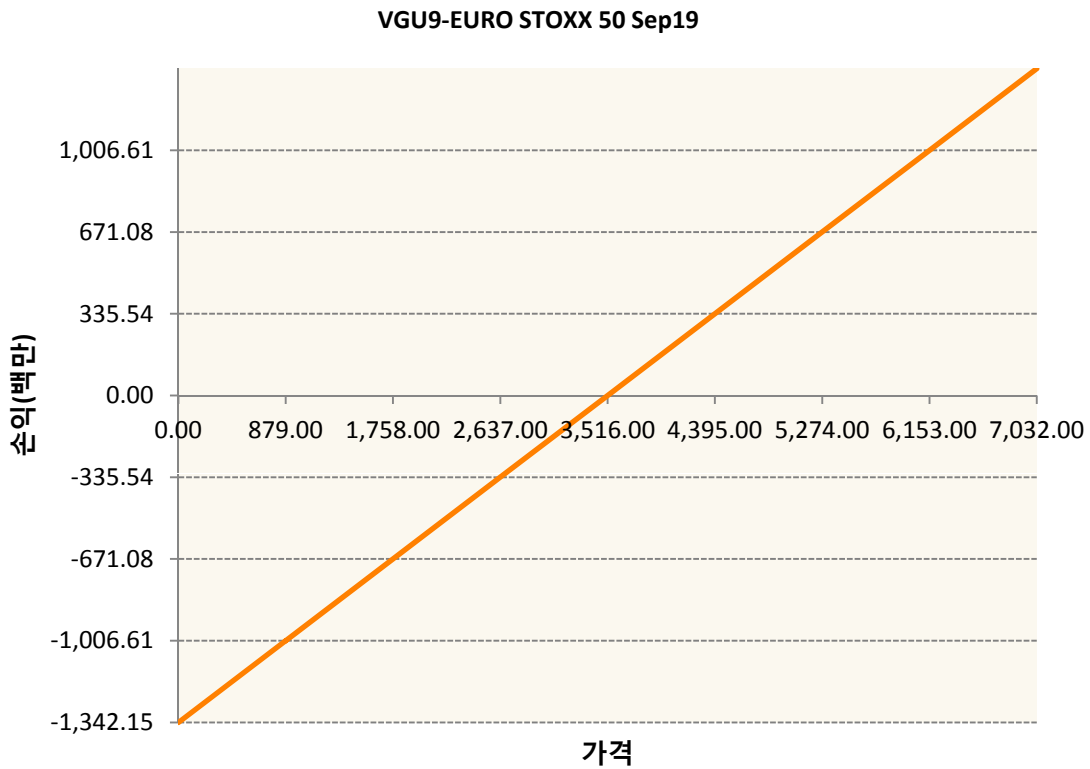
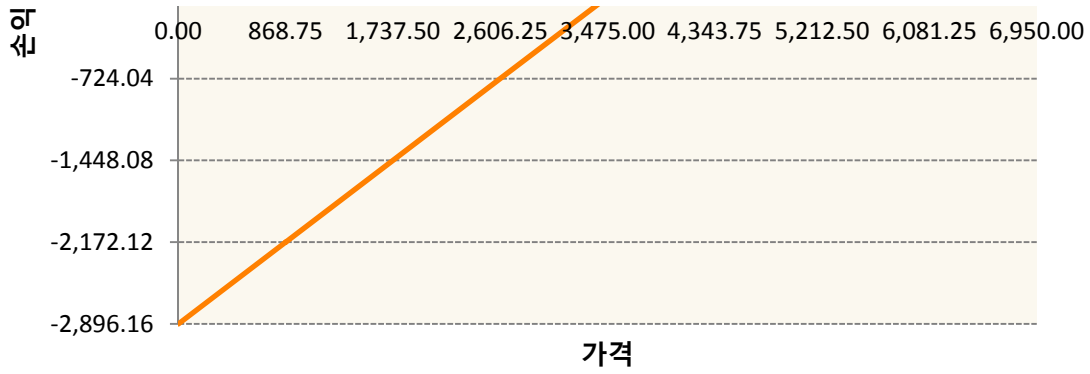


OESXN9-P3450-EURO STOXX 50



OESXN9-P3475-EURO STOXX 50





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

|   |       |
|---|-------|
| 260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY | 100   |
| FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E            | 423   |
| FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E            | 1,058 |
| FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E            | 318   |
| OESXN9-C34 EURO STOXX 50                | 113   |
| OESXN9-C34 EURO STOXX 50                | 232   |
| OESXN9-P34 EURO STOXX 50                | 113   |
| OESXN9-P34 EURO STOXX 50                | 232   |
| VGU9 EURO STOXX 50 Sep19                | 107   |

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

(단위:백만원)

1,509



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

(단위:백만원)

1,004



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

(단위:백만원)

89



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

(단위:백만원)

129

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-07-10 |
| 기준일 | 2019-07-09 |

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

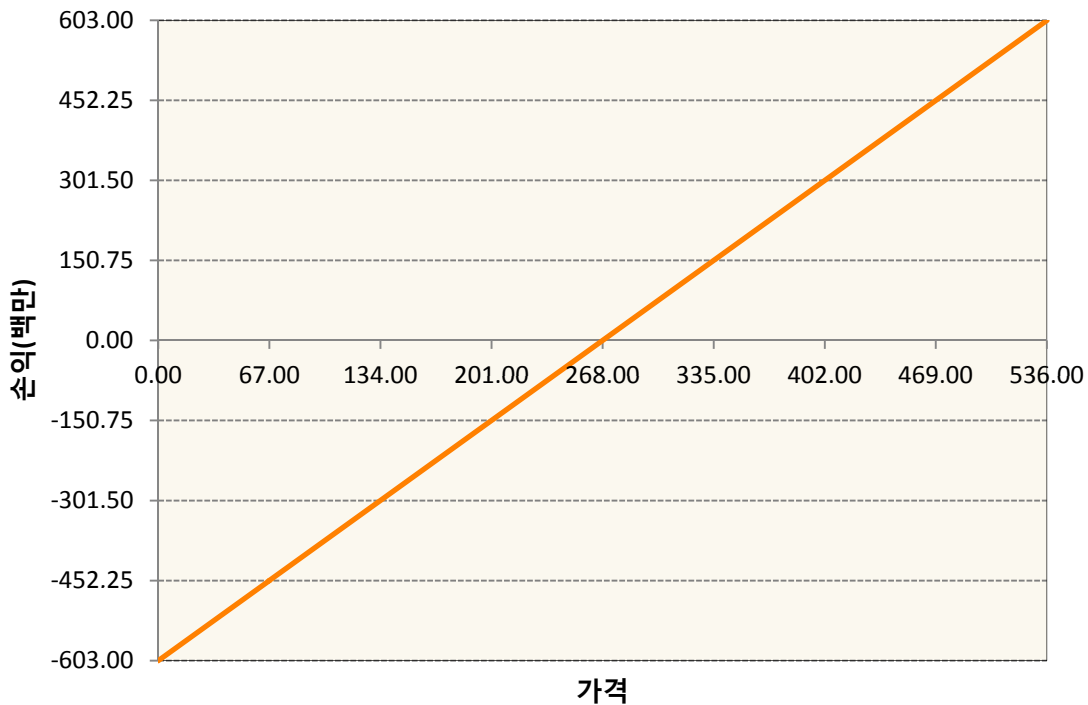
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 603   | 0     | 603       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101P90001 |         | 2019-09 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 | 2019-07-10 |
| 기준일 | 2019-07-09 |

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

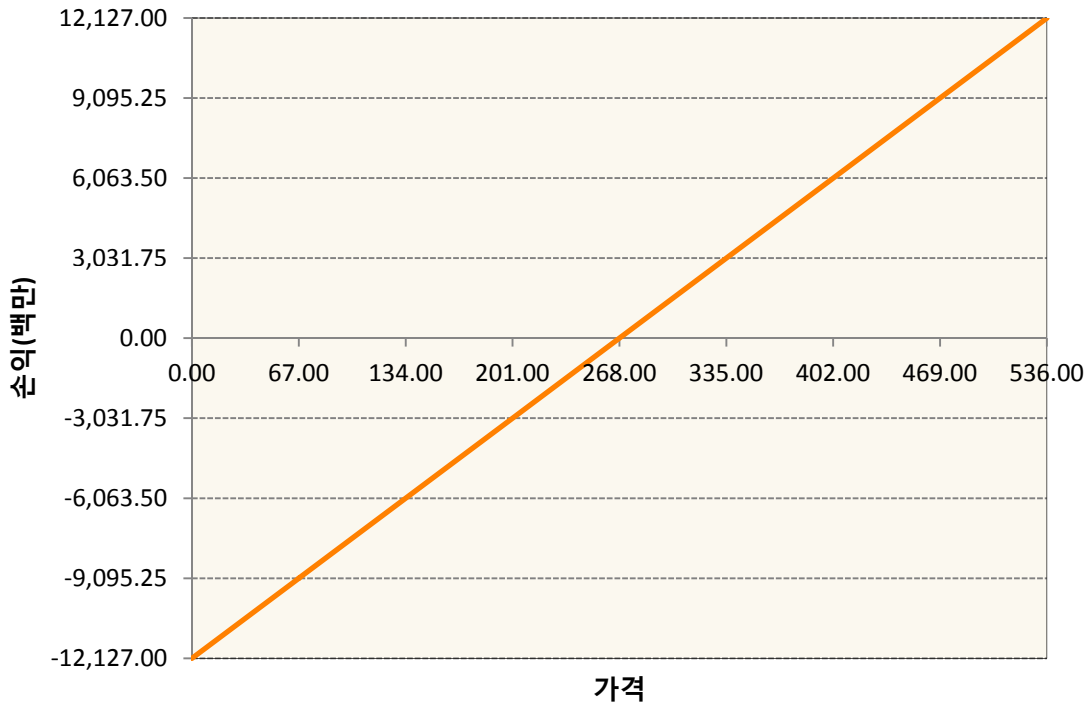
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

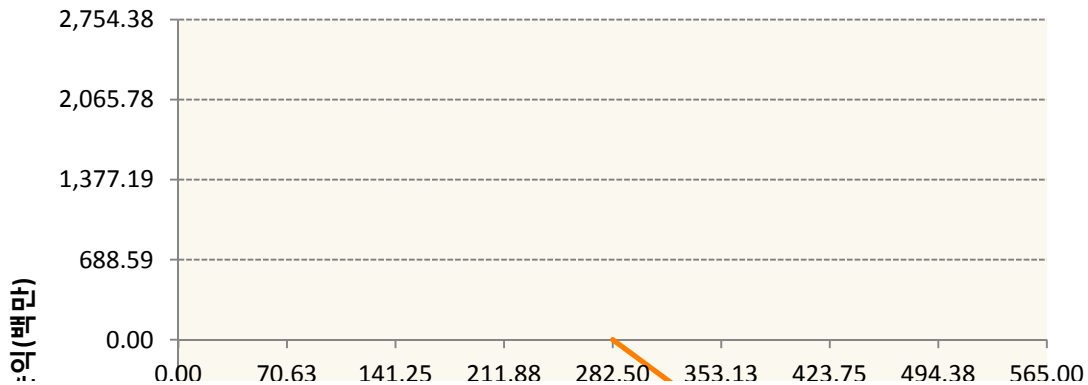
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0      | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0      | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 12,127 | 0      | 12,127    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 1,084  | 22,134 | -21,050   | 장내 |

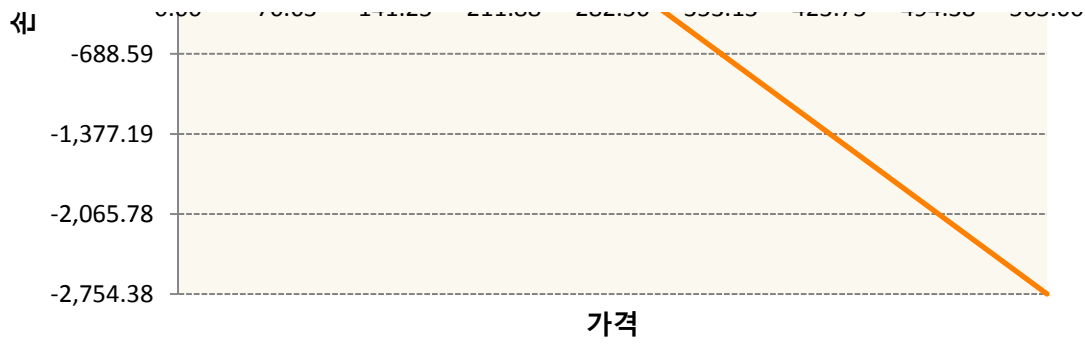
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

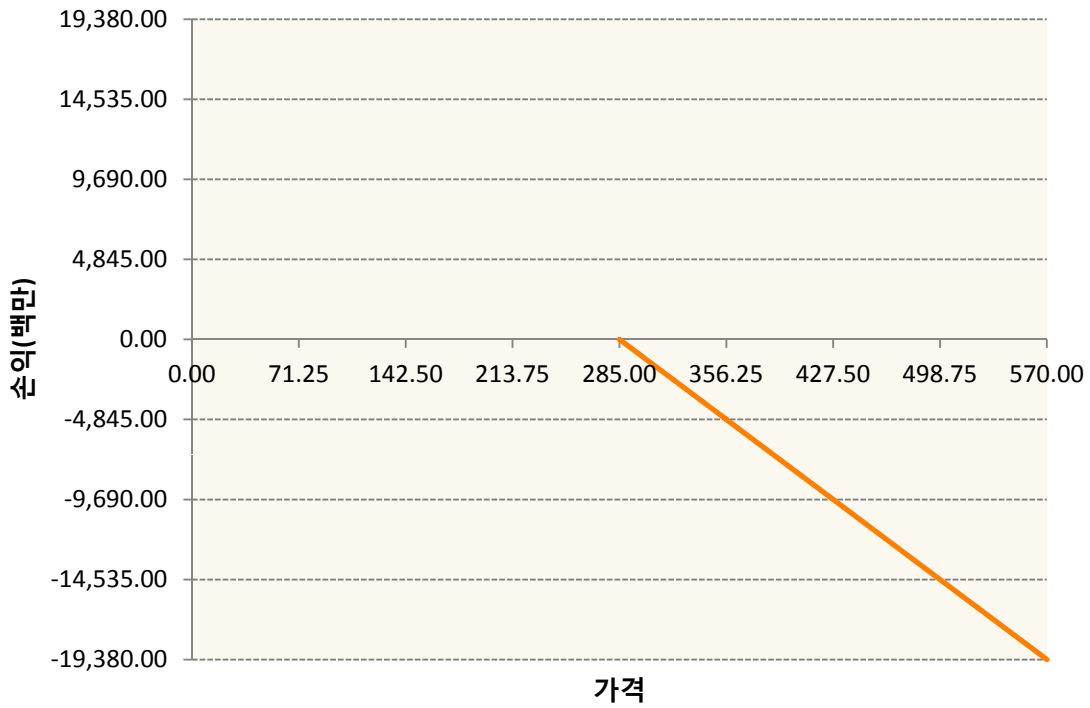


KR4201P72825-2019-07 콜282.5

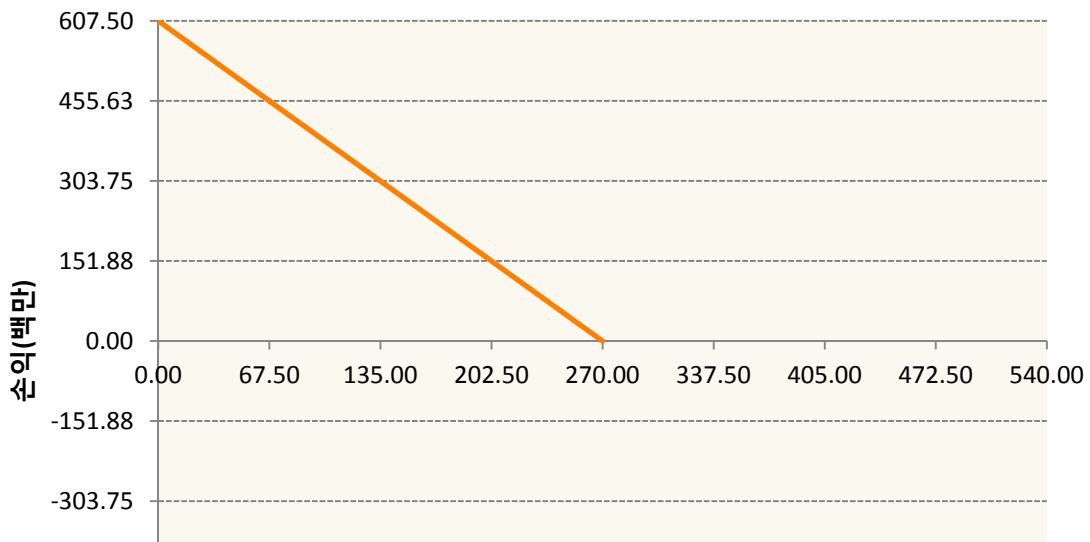


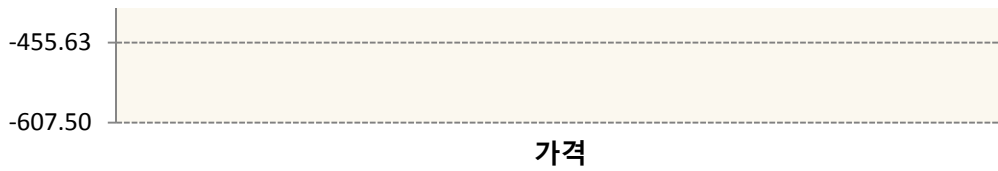


KR4201P72858-2019-07 콜285

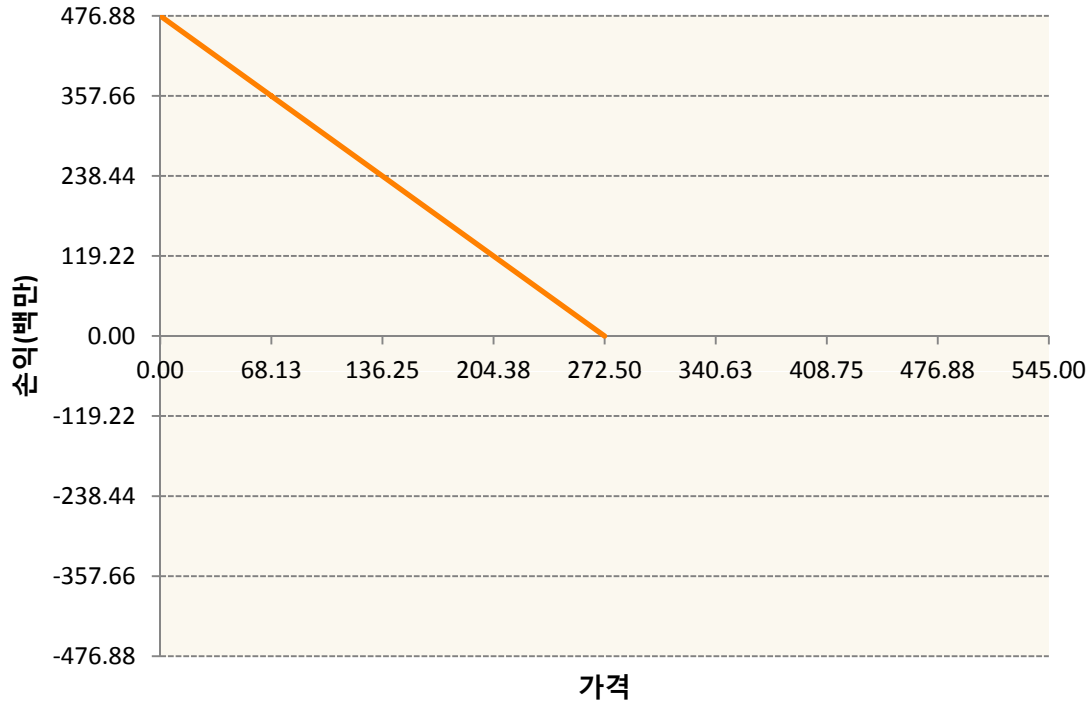


KR4301P72708-2019-07 풋270





KR4301P72724-2019-07 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4101P90001 |         | 2019-09 코스피200지수선물 |        |      |       |        |        | 969 |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | -969    | -969               | -969   | -969 | -969  | -969   | -969   |     |
| -5.33%       | -646    | -646               | -646   | -646 | -646  | -646   | -646   |     |
| -2.67%       | -323    | -323               | -323   | -323 | -323  | -323   | -323   |     |
| 0%           | 0       | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |     |
| 2.67%        | 323     | 323                | 323    | 323  | 323   | 323    | 323    |     |
| 5.33%        | 646     | 646                | 646    | 646  | 646   | 646    | 646    |     |
| 8.00%        | 969     | 969                | 969    | 969  | 969   | 969    | 969    |     |
| KR4201P72825 |         | 2019-07 콜282.5     |        |      |       |        |        | 70  |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | 0       | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |     |
| -5.33%       | 0       | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |     |
| -2.67%       | 0       | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |     |

|       |     |     |     |     |     |     |     |
|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| 0%    | 0   | 0   | 0   | 0   | 0   | 0   | 0   |
| 2.67% | 0   | -1  | -1  | -2  | -2  | -3  | -4  |
| 5.33% | -13 | -15 | -16 | -18 | -20 | -21 | -23 |
| 8.00% | -65 | -66 | -66 | -67 | -68 | -69 | -70 |

KR4201P72858                      2019-07 콜285                      355

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |      |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| -5.33%    | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| -2.67%    | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 0%        | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%     | 0       | -1      | -2     | -3   | -5    | -8     | -11    |
| 5.33%     | -34     | -44     | -53    | -63  | -73   | -84    | -94    |
| 8.00%     | -302    | -309    | -317   | -326 | -335  | -345   | -355   |

KR4301P72708                      2019-07 풋270                      47

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |    |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | 47      | 47      | 47     | 47 | 47    | 47     | 47     |
| -5.33%    | 31      | 31      | 31     | 31 | 31    | 31     | 31     |
| -2.67%    | 15      | 15      | 15     | 15 | 15    | 15     | 15     |
| 0%        | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%     | -6      | -6      | -6     | -6 | -6    | -6     | -6     |
| 5.33%     | -6      | -6      | -6     | -6 | -6    | -6     | -6     |
| 8.00%     | -6      | -6      | -6     | -6 | -6    | -6     | -6     |

KR4301P72724                      2019-07 풋272.5                      37

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |    |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | 37      | 37      | 37     | 37 | 37    | 37     | 37     |
| -5.33%    | 25      | 25      | 25     | 25 | 25    | 25     | 25     |
| -2.67%    | 12      | 12      | 12     | 12 | 12    | 12     | 12     |
| 0%        | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%     | -8      | -8      | -8     | -8 | -8    | -8     | -8     |
| 5.33%     | -8      | -8      | -8     | -8 | -8    | -8     | -8     |
| 8.00%     | -8      | -8      | -8     | -8 | -8    | -8     | -8     |

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

(단위:백만원)

**902**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-07-10 |
| 기준일 | 2019-07-09 |

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 9,090  | 0     | 9,090     |    |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 28,939 | 0     | 28,939    |    |

### 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 | 2019-07-10 |
| 기준일 | 2019-07-09 |

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 0      | 3,254 | -3,254    |    |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 59,561 | 0     | 59,561    |    |

### 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 | 2019-07-10 |
| 기준일 | 2019-07-09 |

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)   | 매도(2)   | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 0       | 0       | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0       | 0       | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 366,178 | 0       | 366,178   |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0       | 421,462 | -421,462  | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                              |                                 |       |
|------------------------------|---------------------------------|-------|
| IE00BD8RGM75                 | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 |       |
| IE00BHNZKL13                 | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 |       |
| FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E |                                 | 472   |
| FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E |                                 | 472   |
| FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E |                                 | 378   |
| FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E |                                 | 793   |
| FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E  |                                 | 283   |
| FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E  |                                 | 944   |
| FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E  |                                 | 189   |
| FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E  |                                 | 878   |
| FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E  |                                 | 1,048 |
| FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E  |                                 | 1,889 |
| FX21019M0(KRW/USD 15-07-19E  |                                 | 472   |
| FX21019M01KRW/USD 15-07-19E  |                                 | 378   |
| FX21019M01KRW/USD 15-07-19E  |                                 | 661   |
| FX21019M01KRW/USD 15-07-19E  |                                 | 944   |
| FX21019M01KRW/USD 15-07-19E  |                                 | 661   |
| FX21019M01KRW/USD 15-07-19E  |                                 | 661   |
| FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E |                                 | 567   |
| FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E |                                 | 3,022 |
| FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E |                                 | 2,267 |
| FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E |                                 | 283   |
| FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E |                                 | 283   |
| FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E |                                 | 793   |
| FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E |                                 | 633   |
| FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E |                                 | 472   |
| FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E |                                 | 1,889 |
| FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E |                                 | 1,889 |

|                              |       |
|------------------------------|-------|
| FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E | 699   |
| FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E | 699   |
| FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E | 1,303 |
| FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E | 2,561 |
| FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E | 3,117 |
| FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E | 2,115 |

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

(단위:백만원)

**11,148**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-07-10 |
| 기준일 | 2019-07-09 |

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

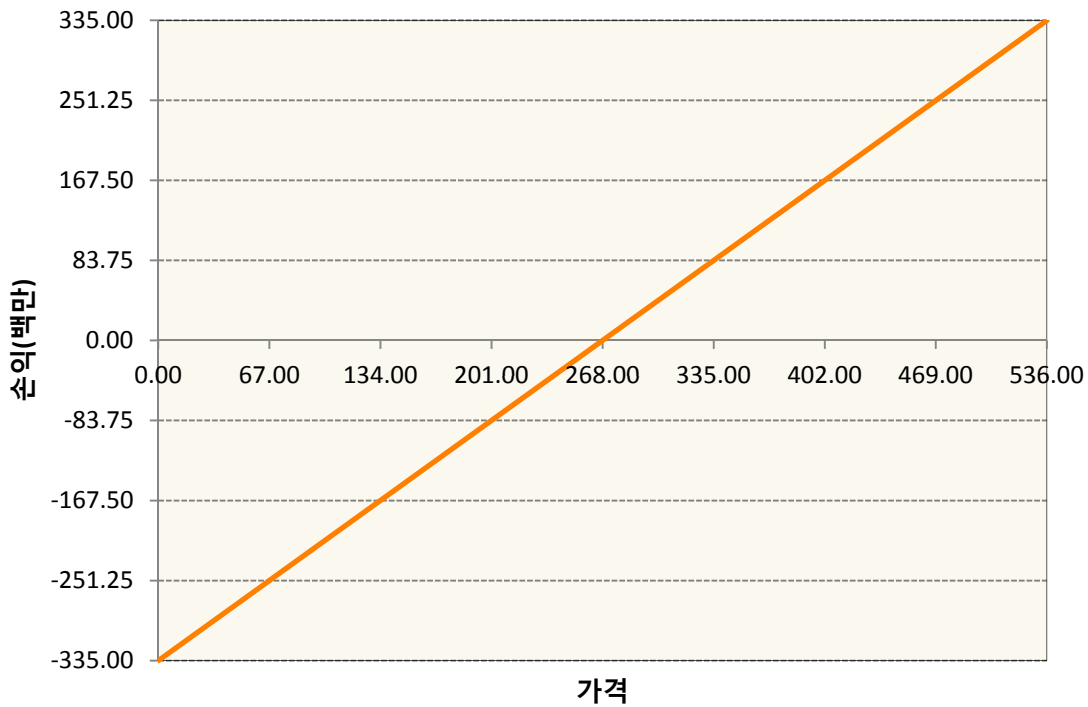
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

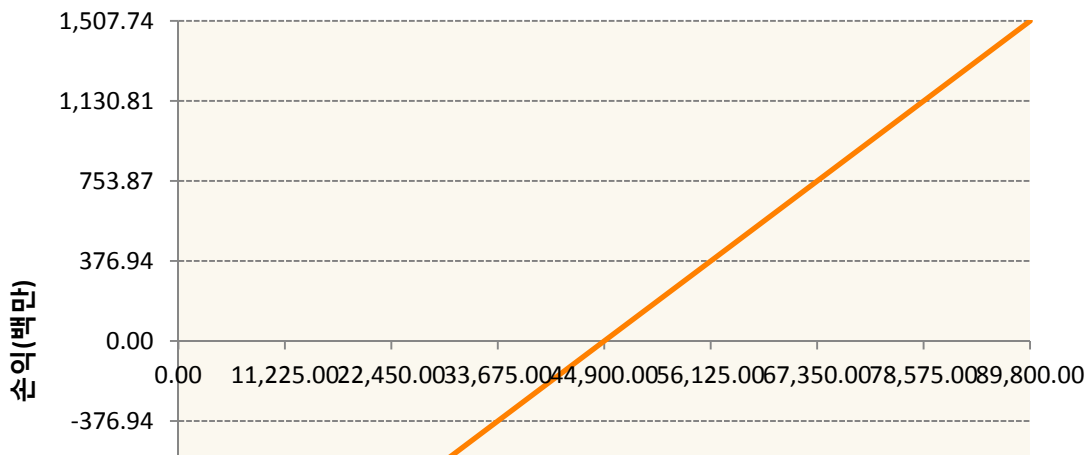
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,843 | 0     | 1,843     | 장내 |

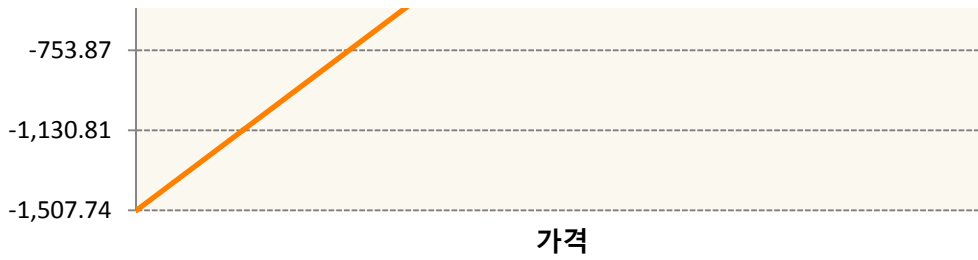
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P70002-2019-07 삼성전자개별선물





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

| KR4101P90001 |         | 2019-09 코스피200지수선물 |        |      |       |        |        | 27  |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | -27     | -27                | -27    | -27  | -27   | -27    | -27    |     |
| -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%        | 27      | 27                 | 27     | 27   | 27    | 27     | 27     |     |
| KR4111P70002 |         | 2019-07 삼성전자개별선물   |        |      |       |        |        | 121 |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | -121    | -121               | -121   | -121 | -121  | -121   | -121   |     |
| -5.33%       | -81     | -81                | -81    | -81  | -81   | -81    | -81    |     |
| -2.67%       | -40     | -40                | -40    | -40  | -40   | -40    | -40    |     |
| 0%           | 0       | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |     |
| 2.67%        | 40      | 40                 | 40     | 40   | 40    | 40     | 40     |     |
| 5.33%        | 81      | 81                 | 81     | 81   | 81    | 81     | 81     |     |
| 8.00%        | 121     | 121                | 121    | 121  | 121   | 121    | 121    |     |

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

**163**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-07-10 |
| 기준일 | 2019-07-09 |

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

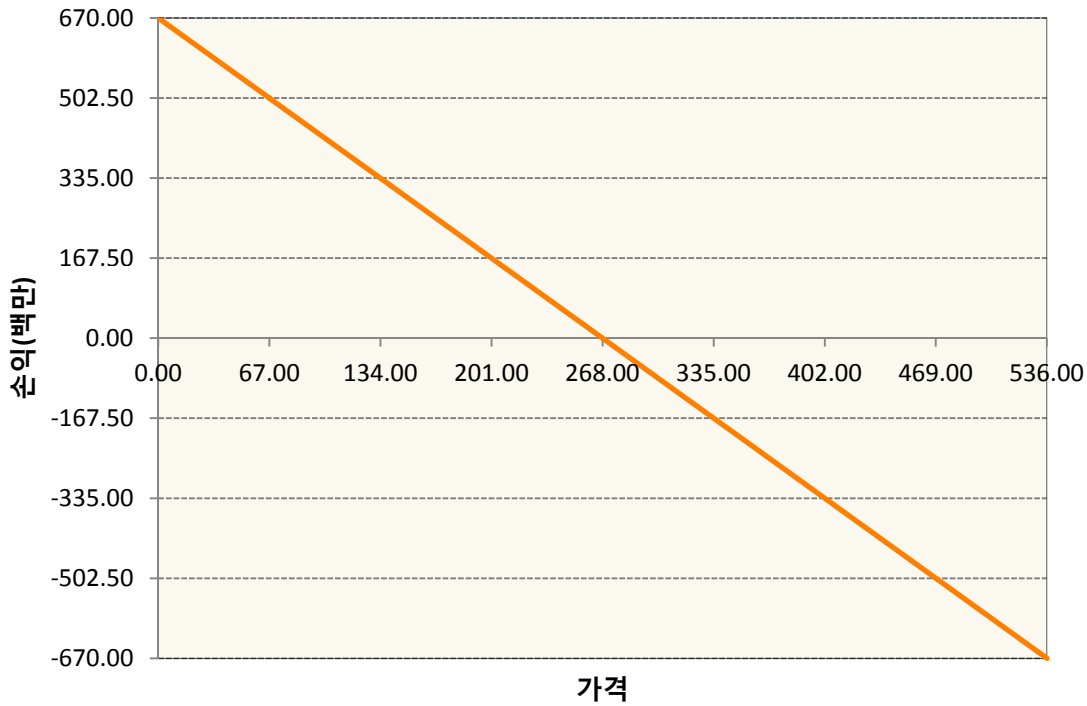
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

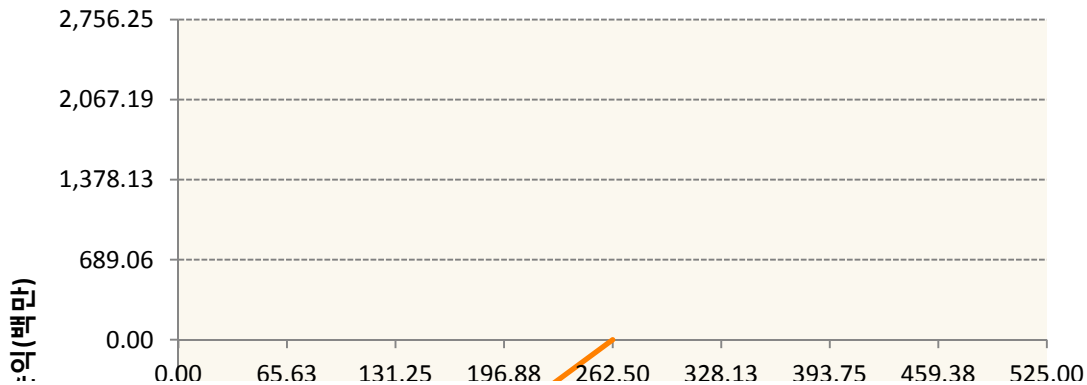
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 0     | 670   | -670      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 3,485 | -3,485    | 장내 |

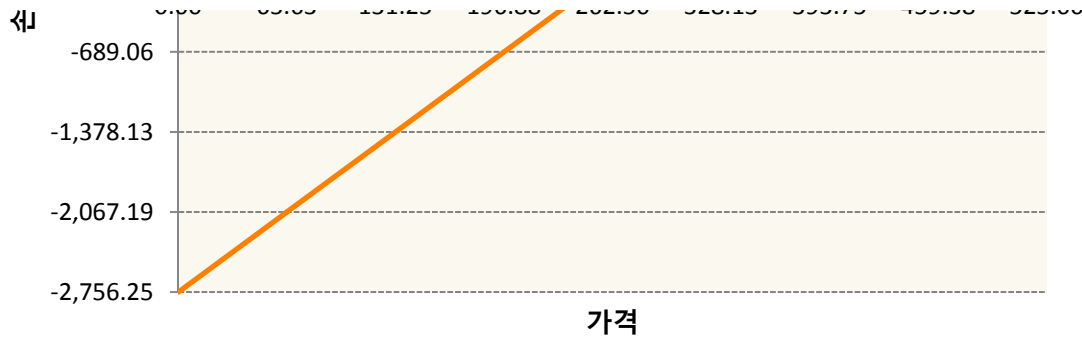
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

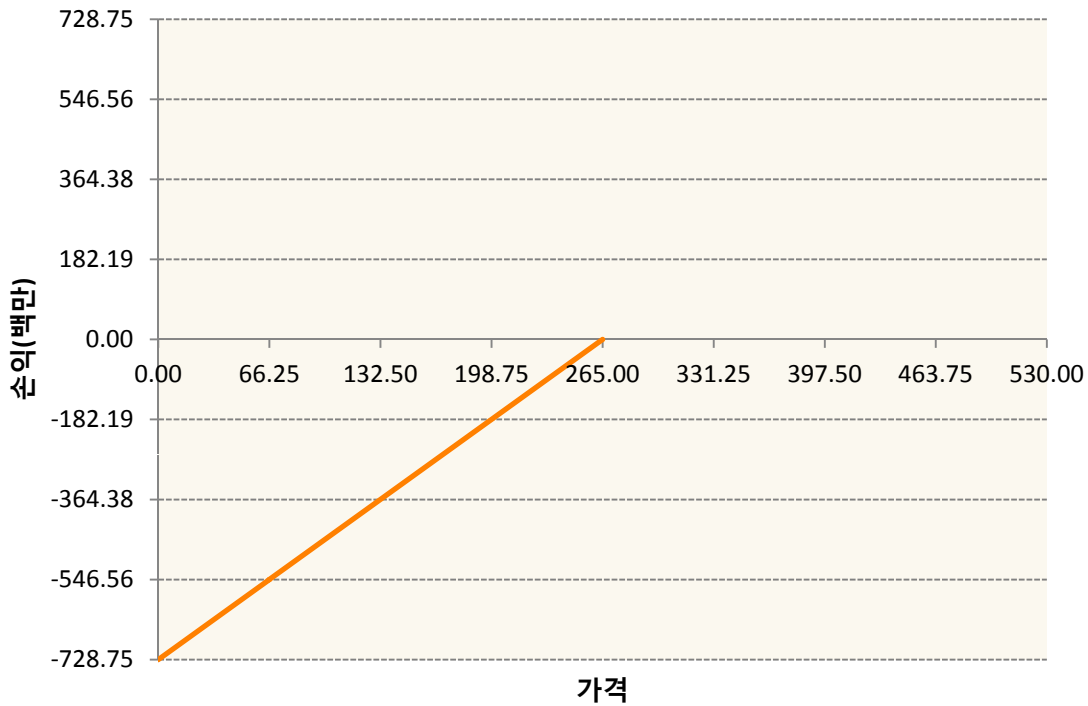


KR4301P72625-2019-07 풋262.5





KR4301P72658-2019-07 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

|              |         |                    |        |     |       |        |        |     |
|--------------|---------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|-----|
| KR4101P90001 |         | 2019-09 코스피200지수선물 |        |     |       |        |        | 54  |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |     |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | 54      | 54                 | 54     | 54  | 54    | 54     | 54     |     |
| -5.33%       | 36      | 36                 | 36     | 36  | 36    | 36     | 36     |     |
| -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%        | -36     | -36                | -36    | -36 | -36   | -36    | -36    |     |
| 8.00%        | -54     | -54                | -54    | -54 | -54   | -54    | -54    |     |
| KR4301P72625 |         | 2019-07 풋262.5     |        |     |       |        |        | 170 |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |     |       |        |        |     |

|        |         |         |        |      |       |        |        |
|--------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격     | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -170    | -170    | -170   | -170 | -170  | -170   | -170   |
| -5.33% | -95     | -95     | -95    | -95  | -95   | -95    | -95    |
| -2.67% | -22     | -22     | -23    | -24  | -25   | -25    | -26    |
| 0%     | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | -1     |
| 2.67%  | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 5.33%  | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 8.00%  | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |

KR4301P72658

2019-07 풋265

51

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |     |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | -51     | -51     | -51    | -51 | -51   | -51    | -51    |
| -5.33%    | -31     | -31     | -31    | -31 | -31   | -31    | -31    |
| -2.67%    | -12     | -12     | -12    | -12 | -12   | -12    | -12    |
| 0%        | 0       | 0       | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%     | 1       | 1       | 1      | 1   | 1     | 1      | 1      |
| 5.33%     | 1       | 1       | 1      | 1   | 1     | 1      | 1      |
| 8.00%     | 1       | 1       | 1      | 1   | 1     | 1      | 1      |

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

(단위:백만원)

265

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-07-10 |
| 기준일 | 2019-07-09 |

## H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 16,527 | 0      | 16,527    |    |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0      | 0      | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 16,527 | 0      | 16,527    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 18,298 | -18,298   | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                              |                                 |     |
|------------------------------|---------------------------------|-----|
| IE00BD8RGM75                 | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 |     |
| FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E |                                 | 142 |
| FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E |                                 | 179 |
| FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E |                                 | 982 |
| FX21019N01 KRW/USD 12-08-19E |                                 | 161 |

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

(단위:백만원)

484

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-07-10 |
| 기준일 | 2019-07-09 |

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

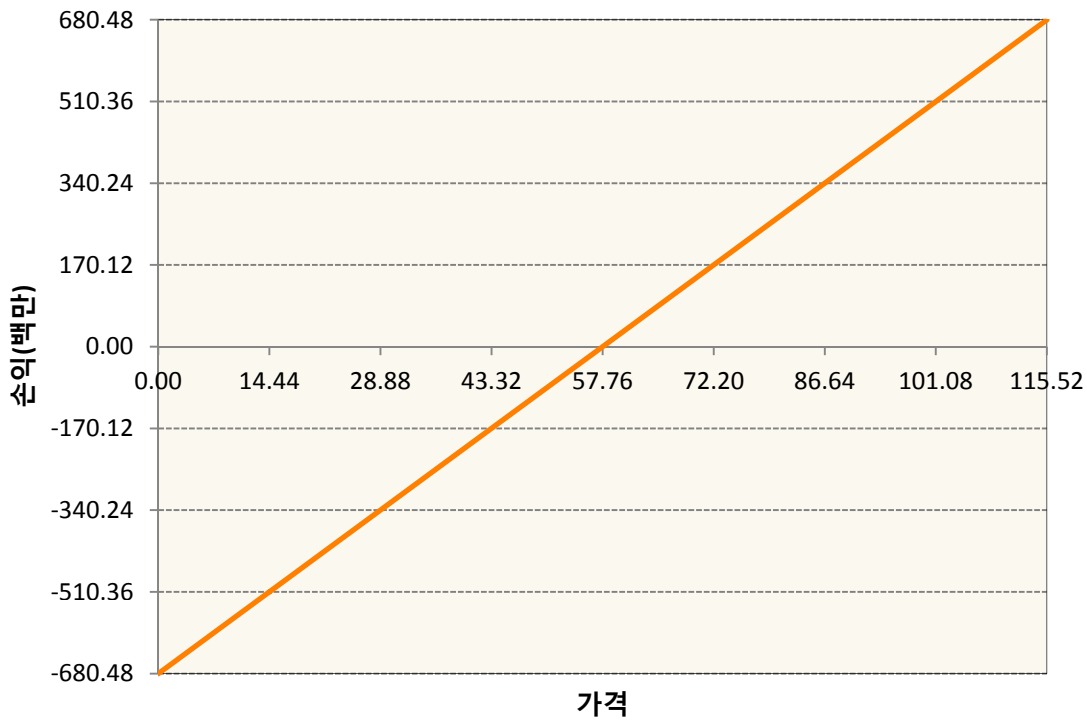
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

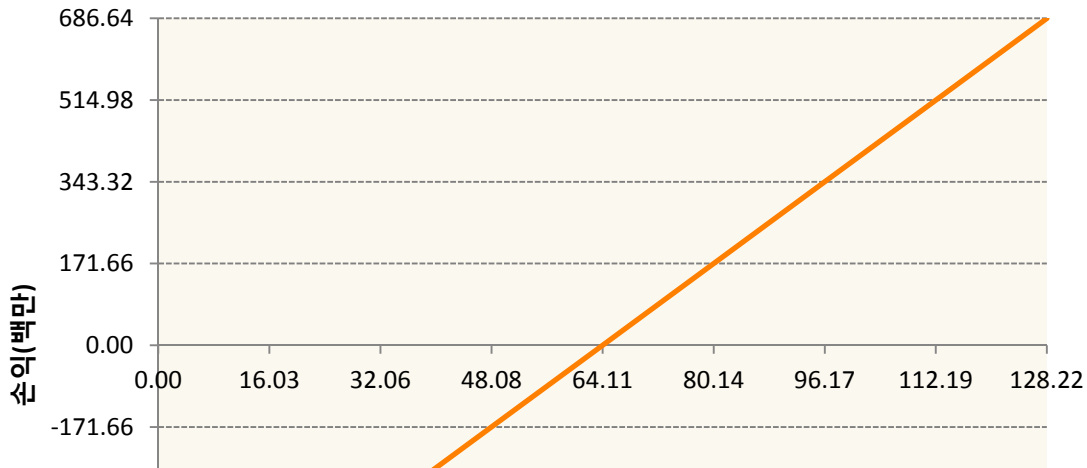
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,727 | 118   | 2,609     |    |

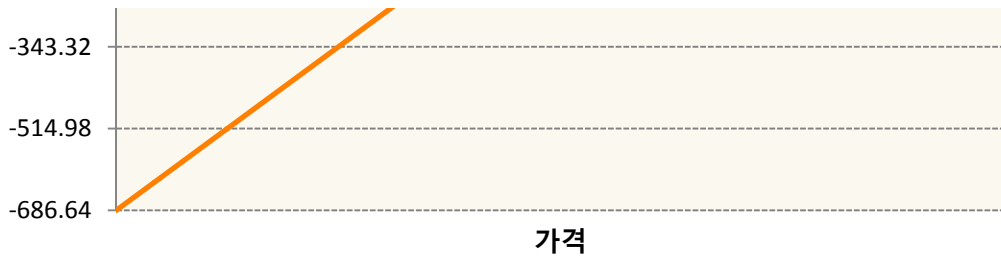
### 2. 만기시점의 손익구조

CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19

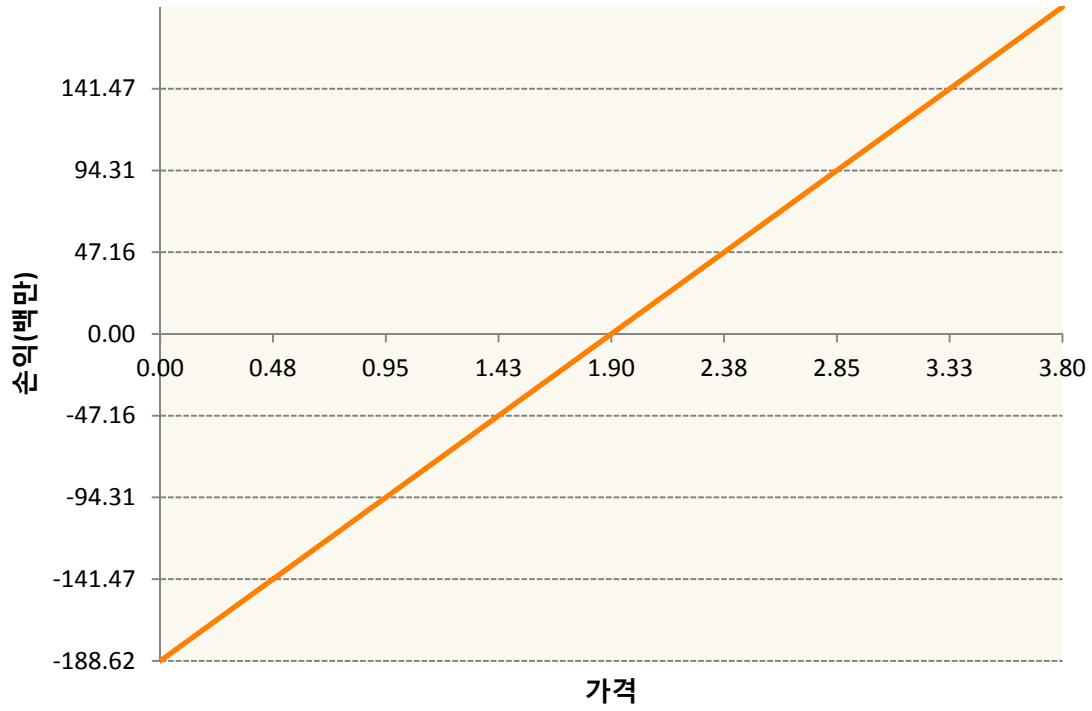


COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19

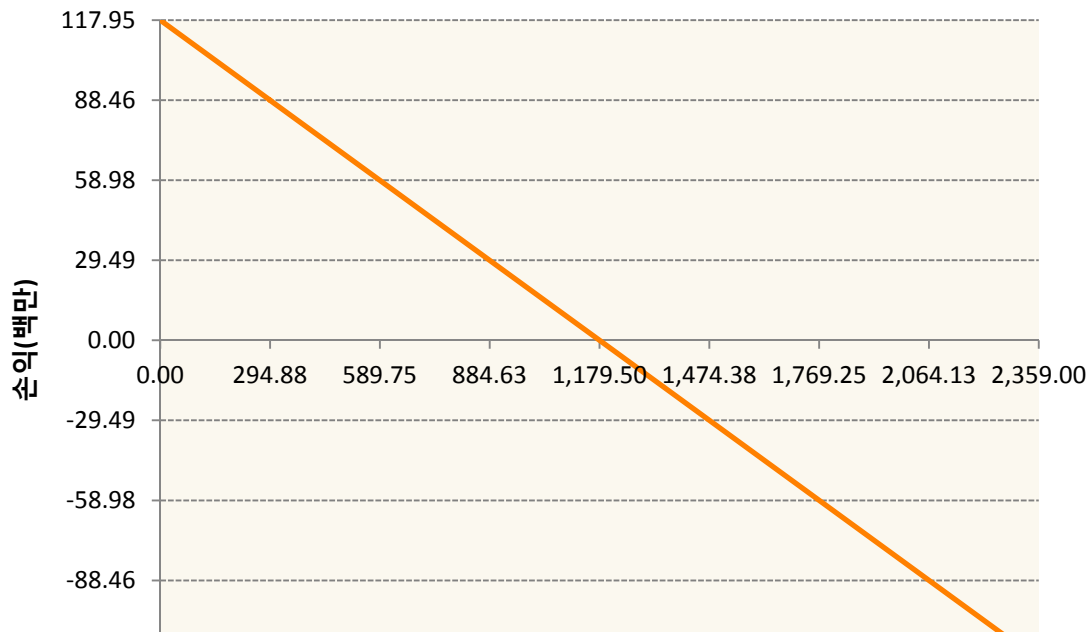


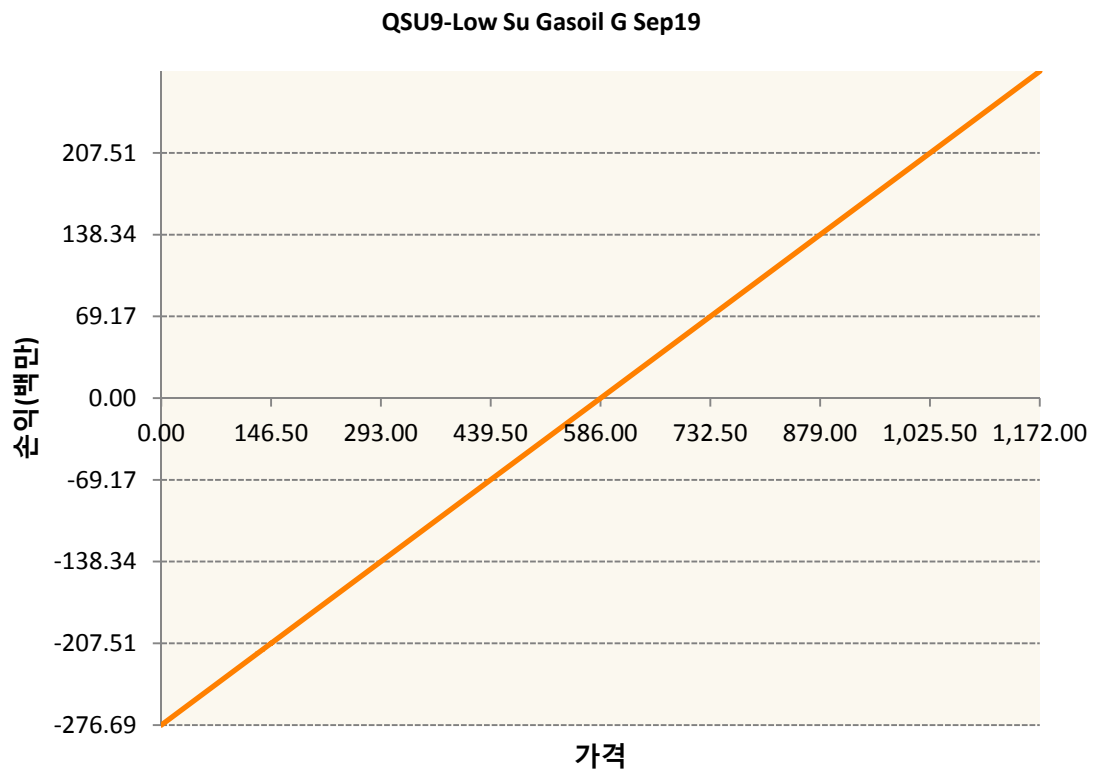
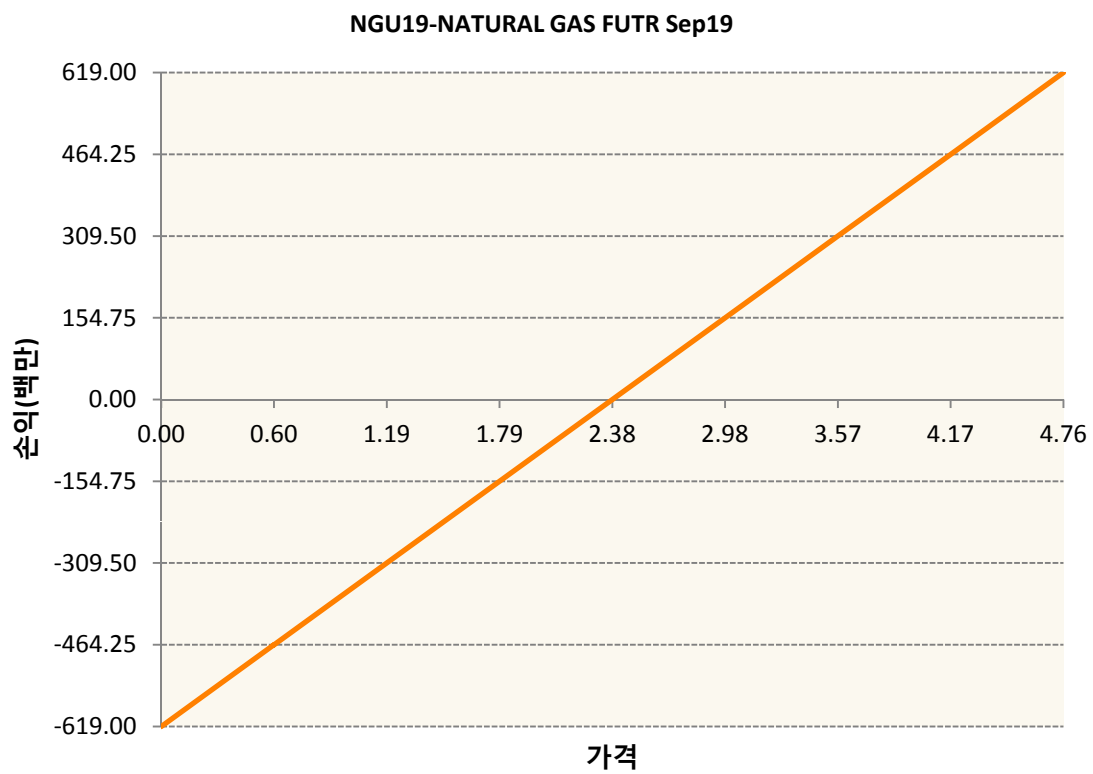
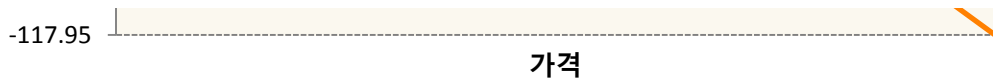


HOU9-NY Harb ULSD Fut Sep19

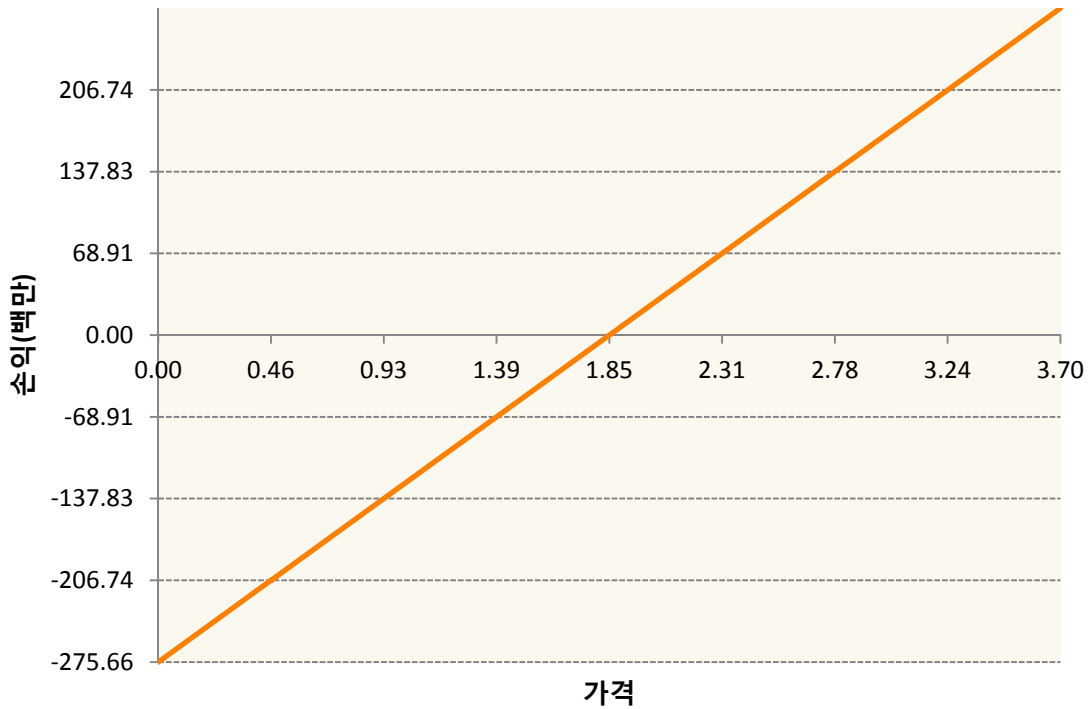


KR4175P70007-2019-07 달러선물





XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

|            |                         |    |
|------------|-------------------------|----|
| CLU9       | WTI CRUDE FUTURE Sep19  | 54 |
| COU9       | BRENT CRUDE FUTR Sep19  | 55 |
| HOU9       | NY Harb ULSD Fut Sep19  | 15 |
| KR4175P700 | 2019-07 달러선물            | 9  |
| NGU19      | NATURAL GAS FUTR Sep19  | 50 |
| QSU9       | Low Su Gasoil G Sep19   | 22 |
| XBU9       | GASOLINE RBOB FUT Sep19 | 22 |

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

404

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-07-10 |
| 기준일 | 2019-07-09 |

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

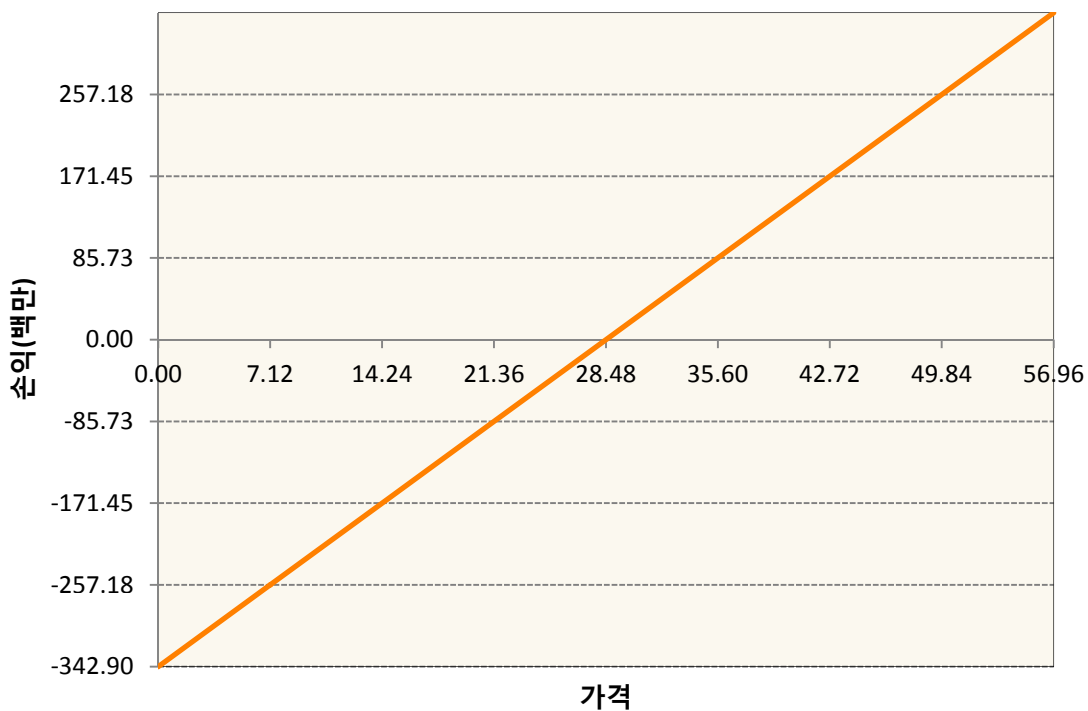
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

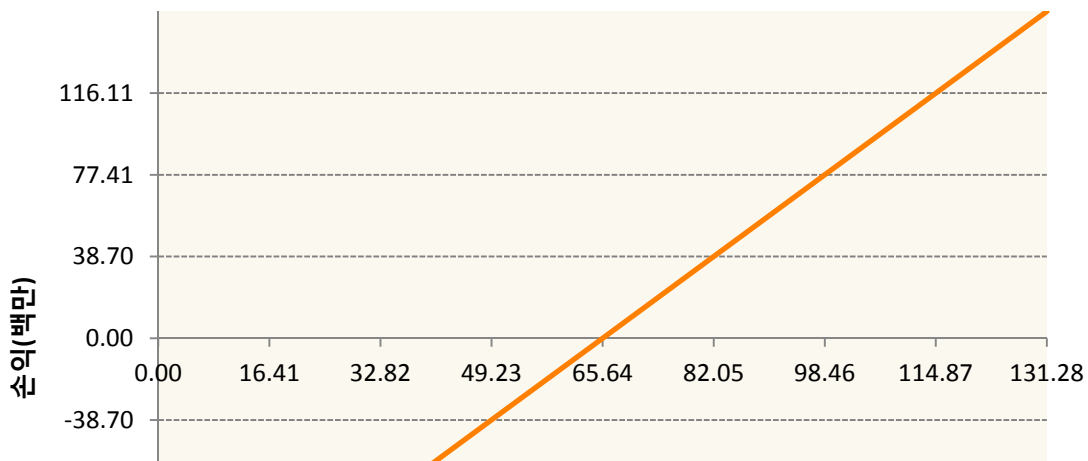
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 3,238 | 201   | 3,037     |    |

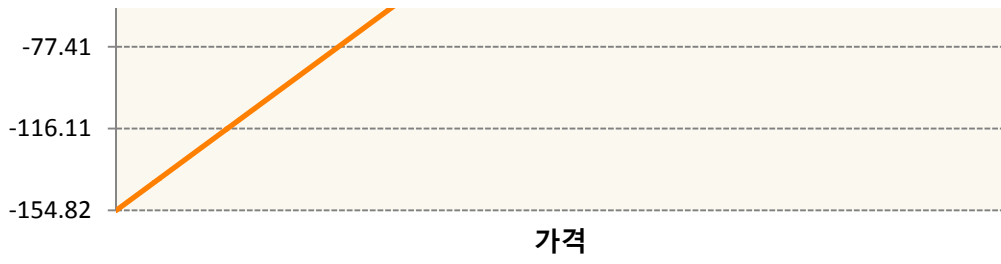
### 2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

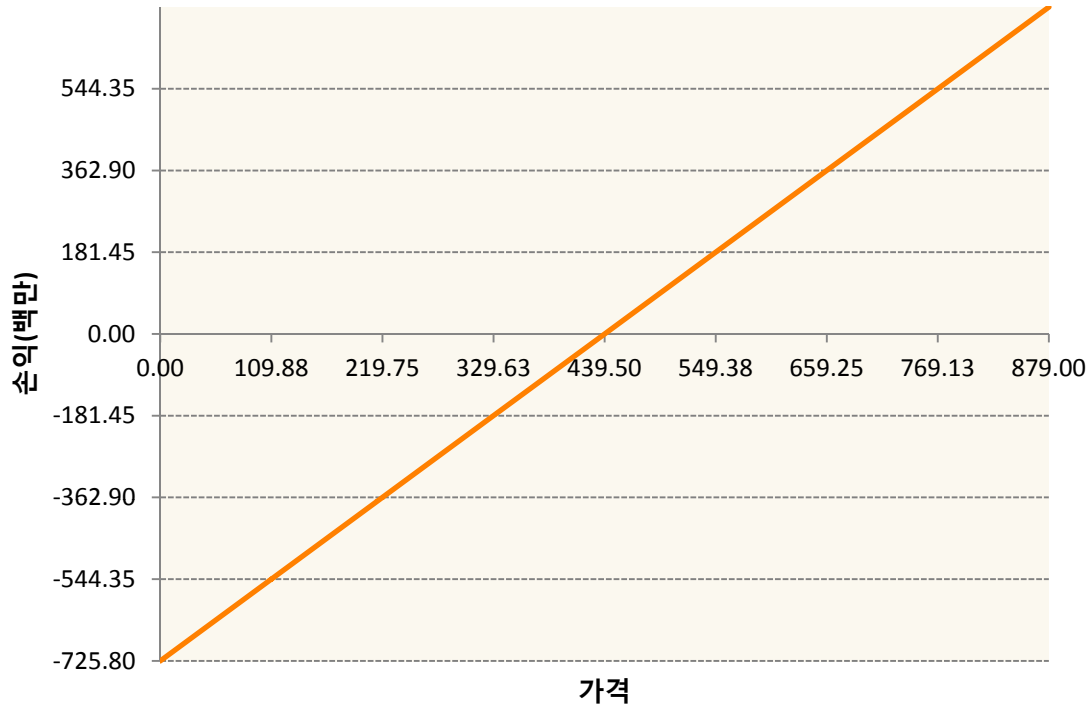


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

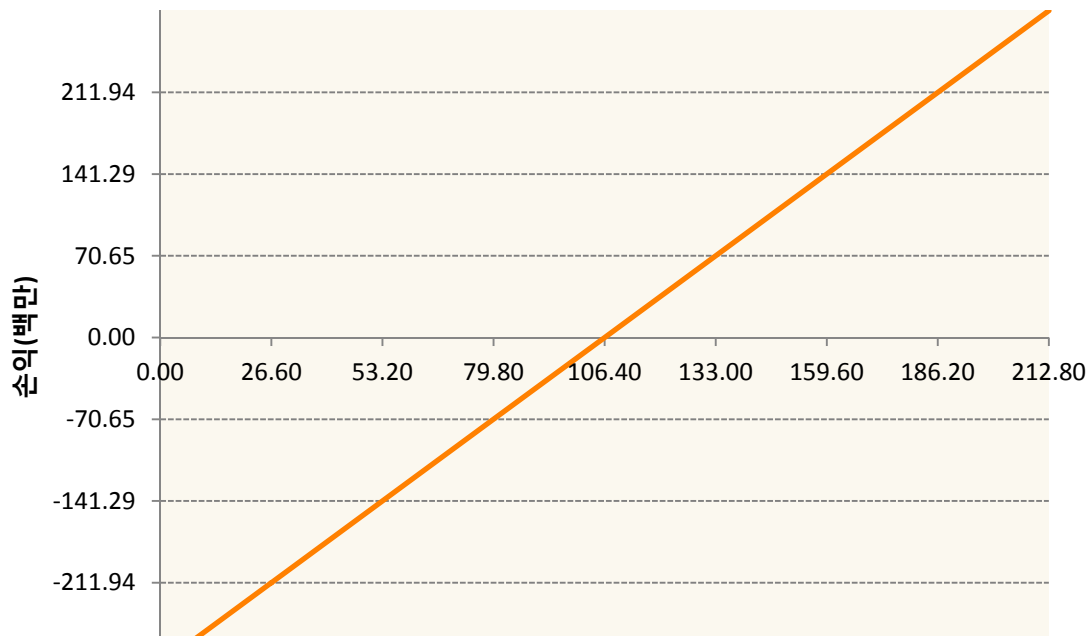


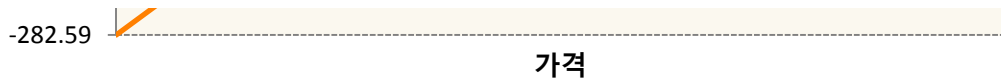


CU9-CORN FUTURE Sep19

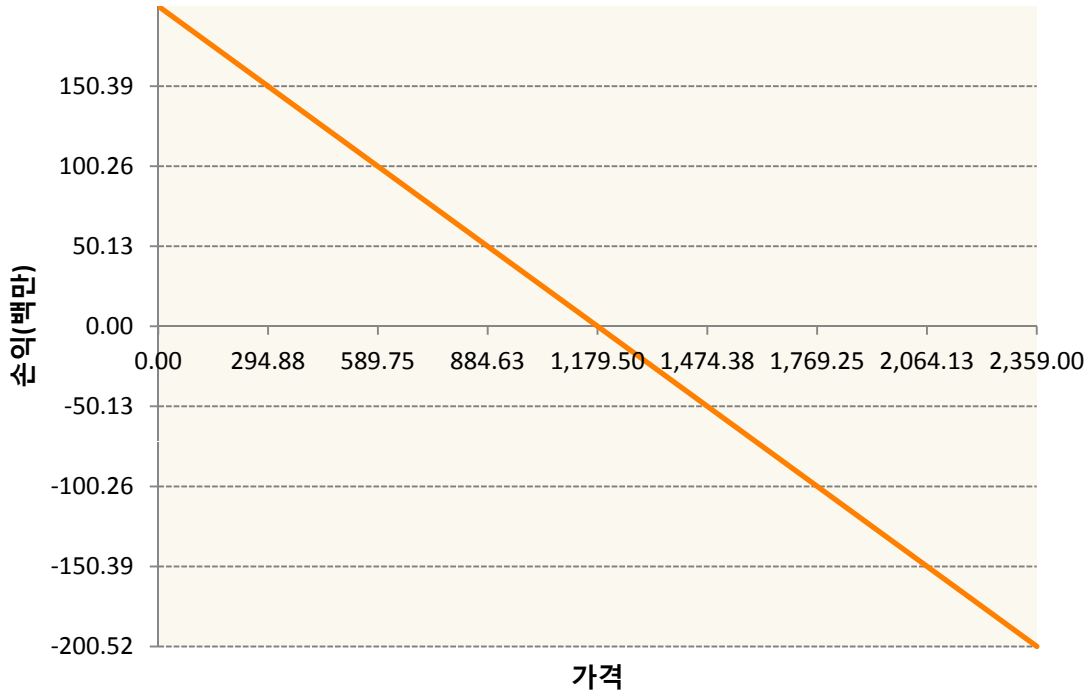


KCU9-COFFEE 'C' FUTURE Sep19

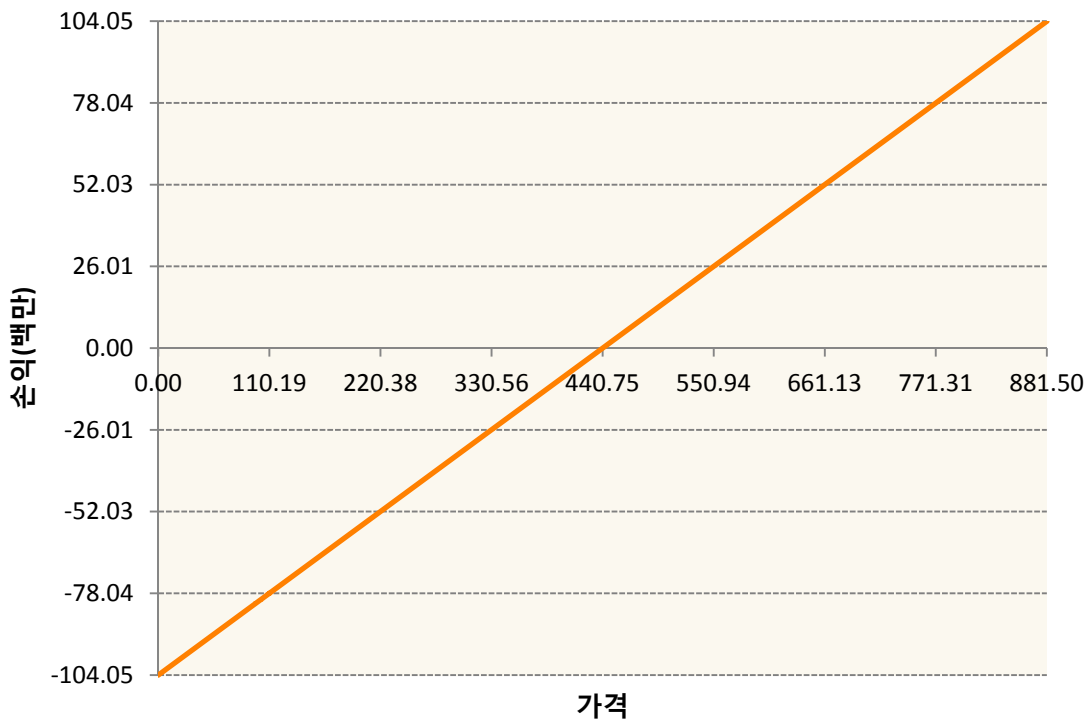




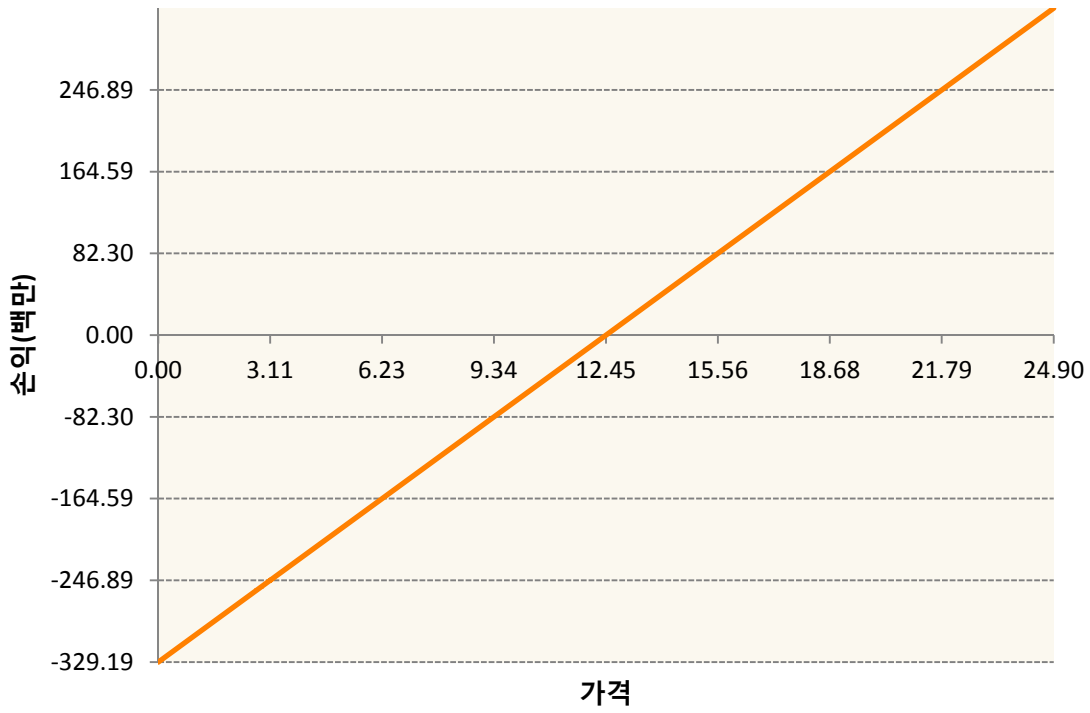
KR4175P70007-2019-07 달러선물



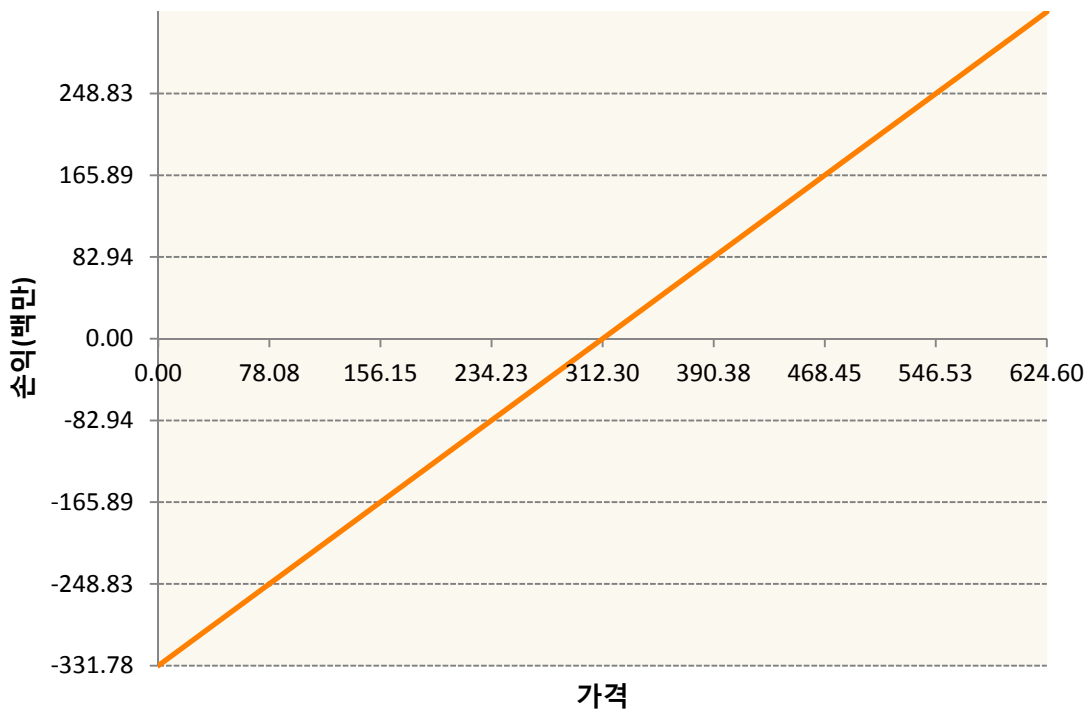
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



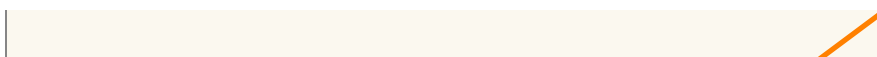
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

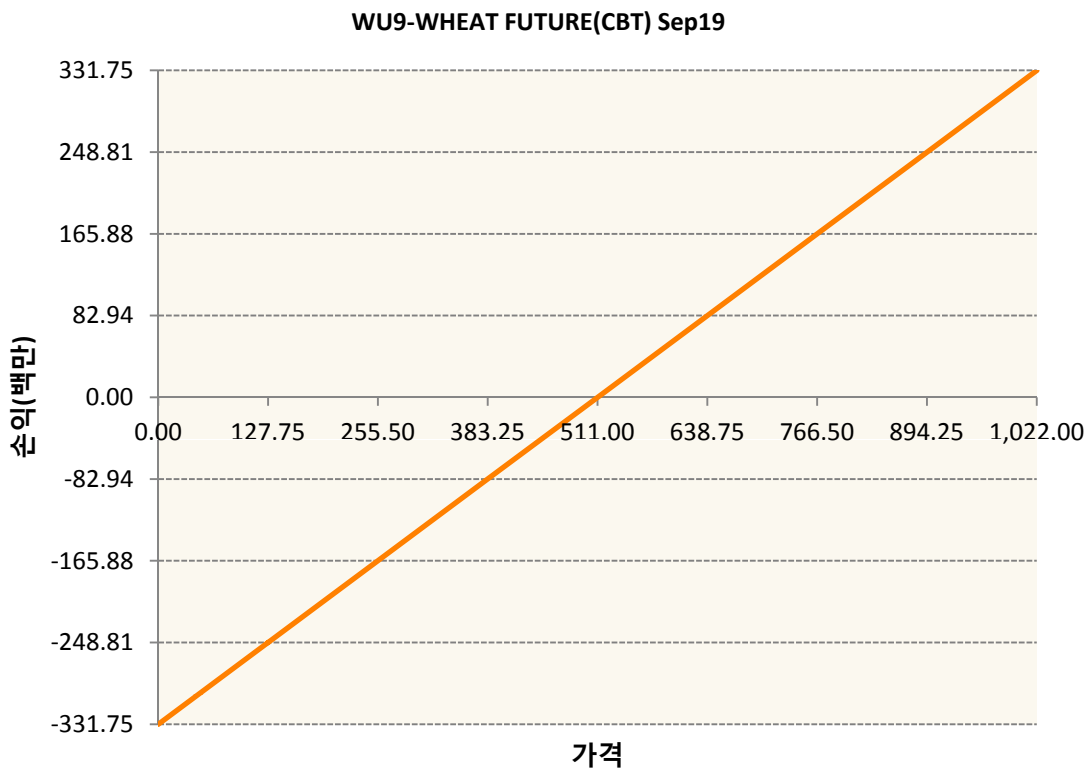
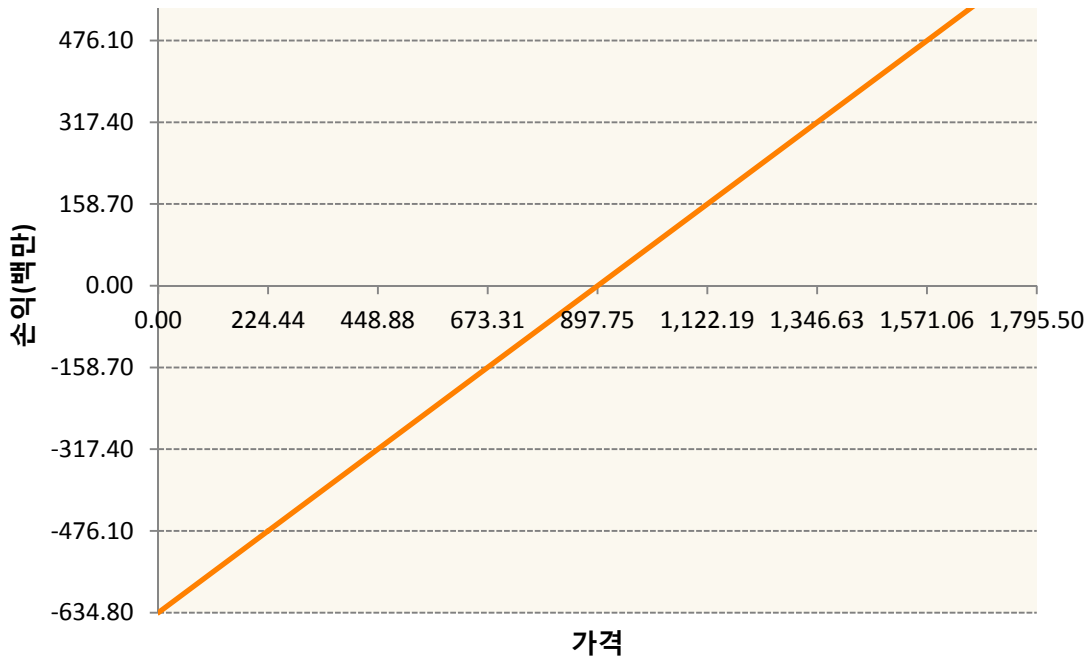


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

|            |                         |    |
|------------|-------------------------|----|
| BOZ9       | SOYBEAN OIL FUTR Dec19  | 27 |
| CTZ9       | COTTON NO.2 FUTR Dec19  | 12 |
| CU9        | CORN FUTURE Sep19       | 58 |
| KCU9       | COFFEE 'C' FUTURE Sep19 | 23 |
| KR4175P700 | 2019-07 달러선물            | 16 |

|      |                         |    |
|------|-------------------------|----|
| KWU9 | KC HRW WHEAT FUT Sep19  | 8  |
| SBV9 | SUGAR #11 (WORLD) Oct19 | 26 |
| SMZ9 | SOYBEAN MEAL FUTR Dec19 | 27 |
| SX9  | SOYBEAN FUTURE Nov19    | 51 |
| WU9  | WHEAT FUTURE(CBT) Sep19 | 27 |

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

(단위:백만원)

**285**