

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-08-14 |
| 기준일 | 2019-08-13 |

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 | 5 | 0 | 5 | 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)

86

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-08-14 |
| 기준일 | 2019-08-13 |

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

1,134

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

640

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-08-14 |
| 기준일 | 2019-08-13 |

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) | 356 |
| SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2) | 130 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|-----|
| 779 |
|-----|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-08-14 |
| 기준일 | 2019-08-13 |

유로인덱스모(주식-파생형)

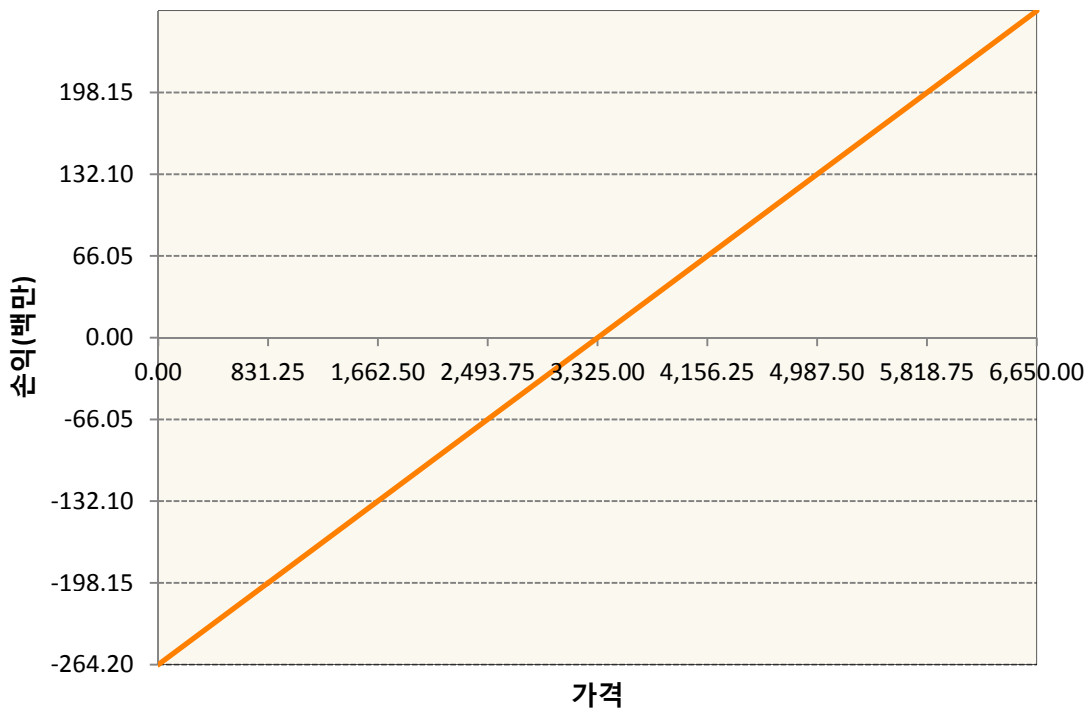
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 264 | 0 | 264 | |

2. 만기시점의 손익구조

VGU9-EURO STOXX 50 Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------|---------------------|----|
| VGU9 | EURO STOXX 50 Sep19 | 21 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

| |
|----|
| 15 |
|----|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-08-14 |
| 기준일 | 2019-08-13 |

차이나인덱스모(주식-파생형)

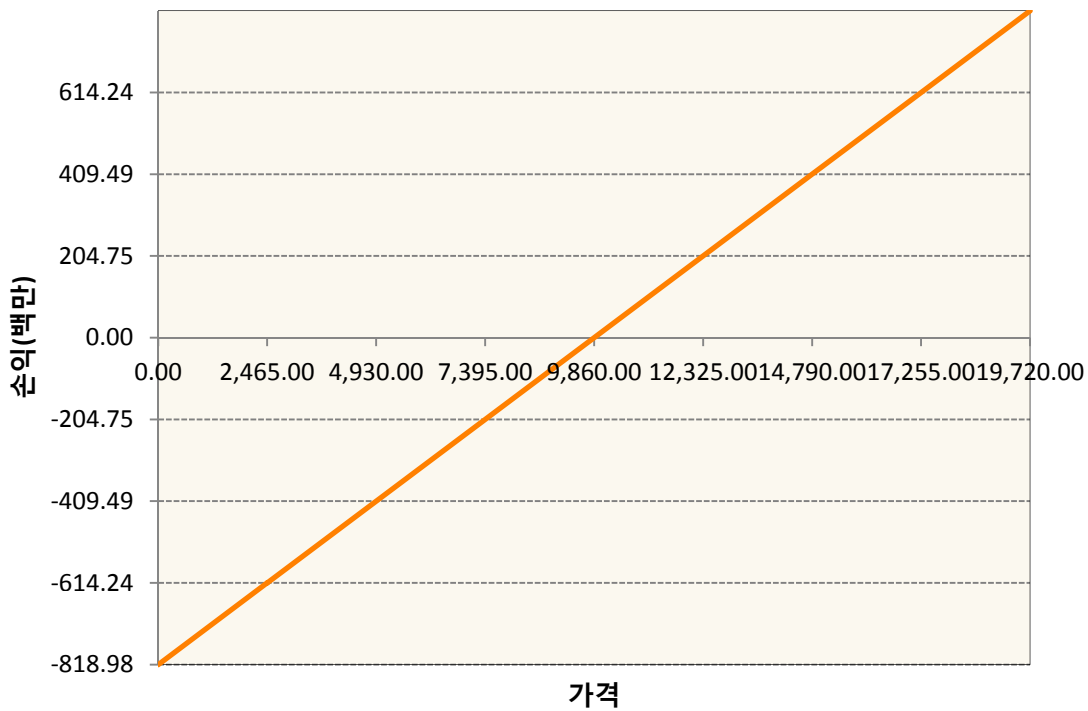
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 819 | 0 | 819 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------|---------------------|----|
| HCQ9 | HSCEI Futures Aug19 | 66 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

| |
|----|
| 62 |
|----|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-08-14 |
| 기준일 | 2019-08-13 |

커버드콜모(주식혼합-파생형)

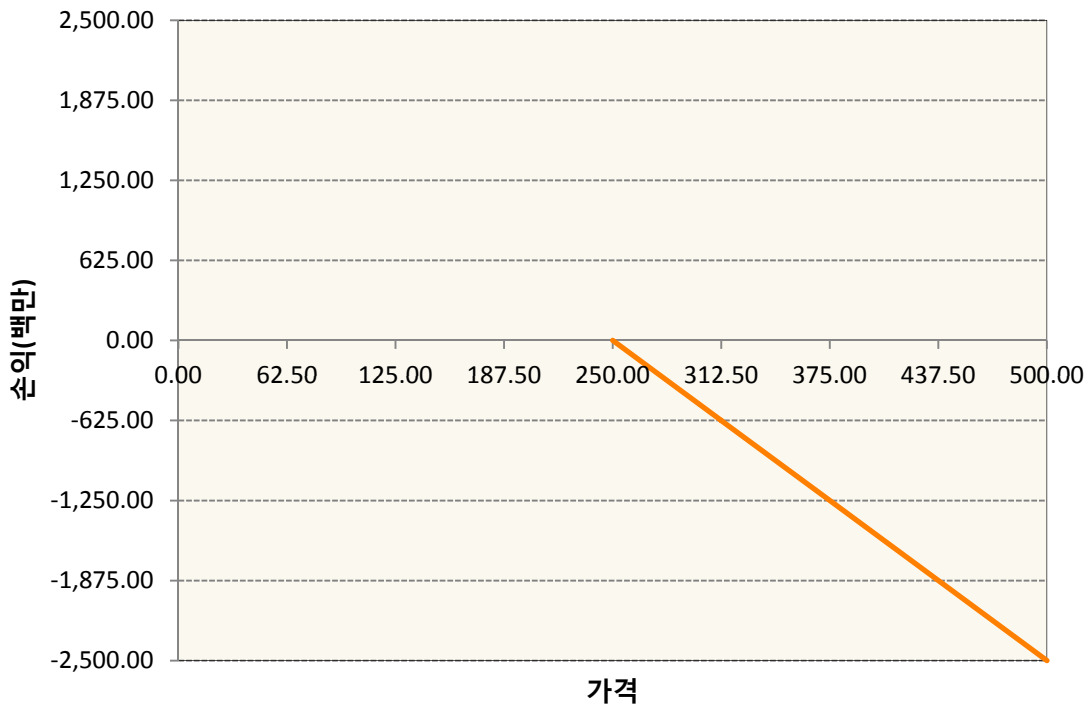
1. 계약금액

(단위:백만원)

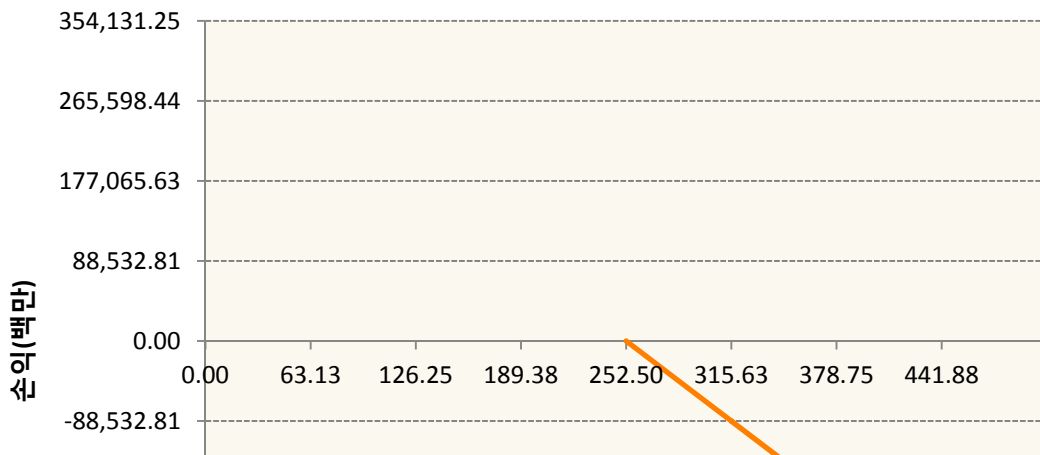
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 523,725 | -523,725 | 장내 |

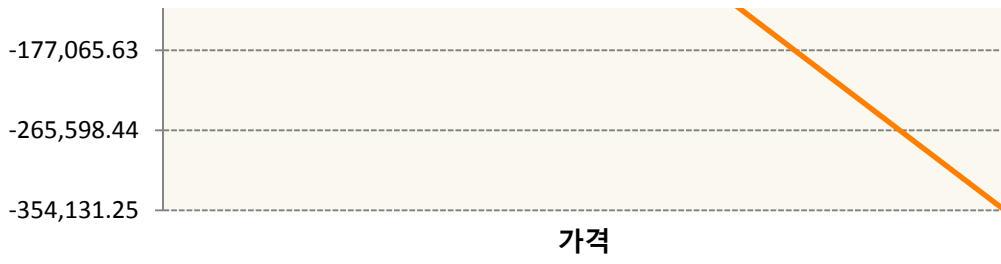
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P92500-2019-09 콜250

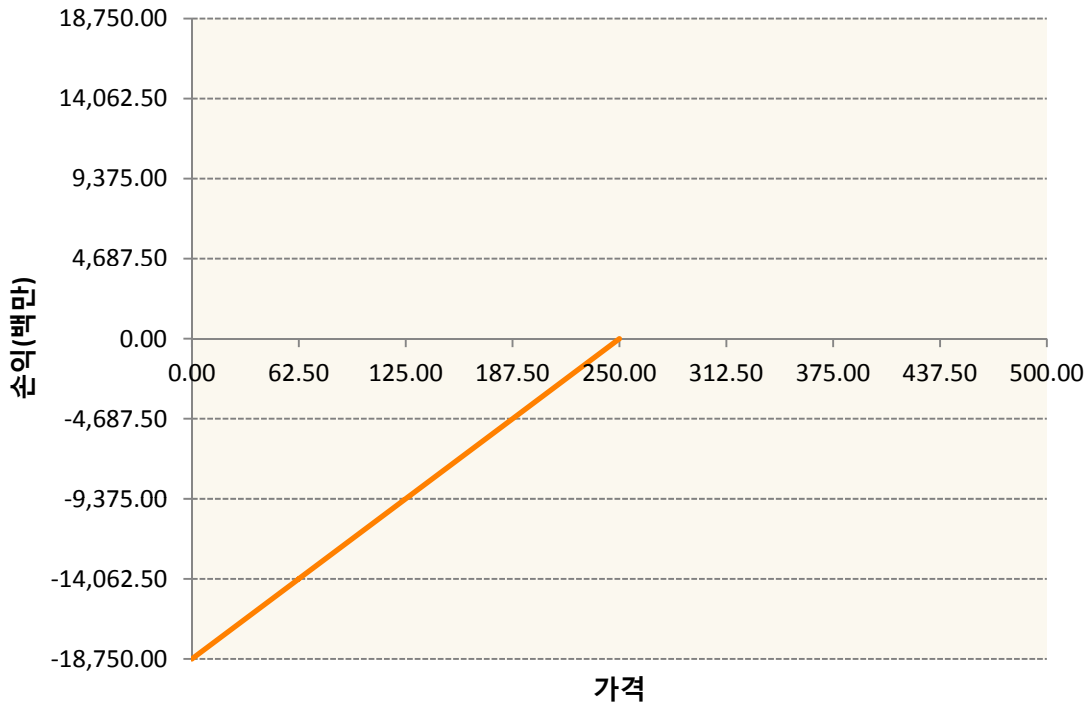


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

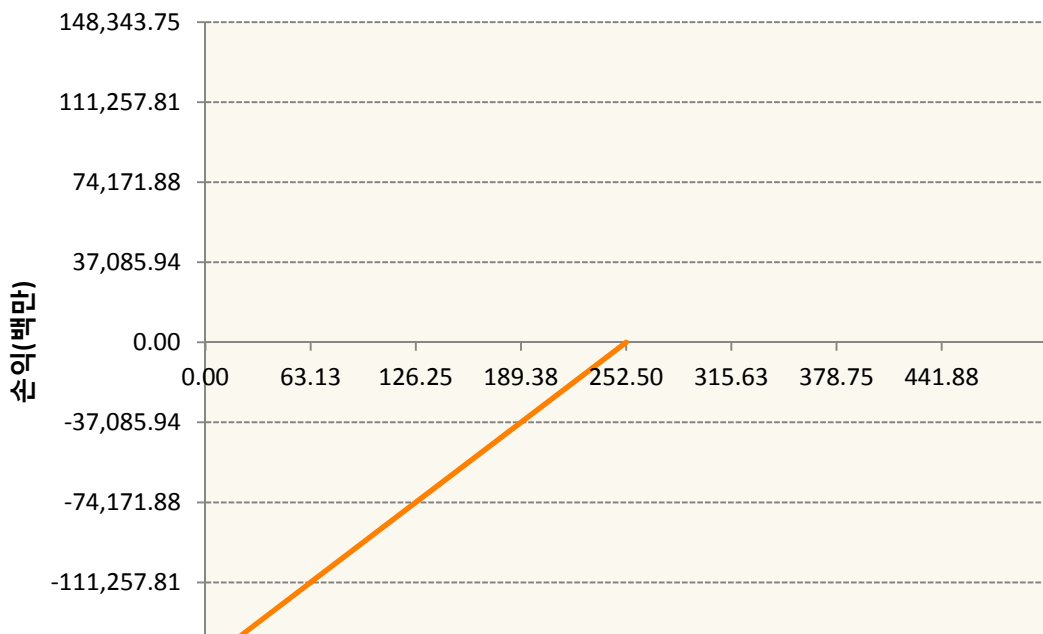




KR4301P92508-2019-09 풋250



KR4301P92524-2019-09 풋252.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4201P92500 | | 2019-09 콜250 | | | | | | 163 |
|--------------|---------|----------------|---------|---------|---------|---------|---------|--------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 78 | 76 | 73 | 70 | 67 | 63 | 60 | |
| -5.33% | 69 | 65 | 61 | 56 | 52 | 47 | 42 | |
| -2.67% | 49 | 44 | 39 | 33 | 28 | 22 | 17 | |
| 0% | 17 | 11 | 6 | 0 | -6 | -11 | -17 | |
| 2.67% | -29 | -34 | -38 | -43 | -49 | -54 | -59 | |
| 5.33% | -85 | -88 | -92 | -95 | -99 | -104 | -108 | |
| 8.00% | -148 | -149 | -151 | -154 | -157 | -160 | -163 | |
| KR4201P92526 | | 2019-09 콜252.5 | | | | | | 21,829 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 9,309 | 9,072 | 8,778 | 8,432 | 8,042 | 7,611 | 7,146 | |
| -5.33% | 8,393 | 7,922 | 7,406 | 6,852 | 6,268 | 5,659 | 5,030 | |
| -2.67% | 6,275 | 5,572 | 4,854 | 4,124 | 3,384 | 2,637 | 1,884 | |
| 0% | 2,415 | 1,610 | 805 | 0 | -805 | -1,610 | -2,414 | |
| 2.67% | -3,356 | -4,080 | -4,819 | -5,571 | -6,332 | -7,101 | -7,875 | |
| 5.33% | -10,750 | -11,270 | -11,835 | -12,438 | -13,070 | -13,726 | -14,403 | |
| 8.00% | -19,229 | -19,533 | -19,897 | -20,316 | -20,782 | -21,288 | -21,829 | |
| KR4301P92508 | | 2019-09 풋250 | | | | | | 1,116 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -1,071 | -1,075 | -1,080 | -1,087 | -1,095 | -1,105 | -1,116 | |
| -5.33% | -591 | -604 | -619 | -635 | -653 | -672 | -692 | |
| -2.67% | -185 | -210 | -236 | -262 | -289 | -315 | -342 | |
| 0% | 83 | 55 | 28 | 0 | -28 | -56 | -84 | |
| 2.67% | 207 | 190 | 171 | 151 | 129 | 107 | 84 | |
| 5.33% | 246 | 240 | 231 | 220 | 208 | 194 | 178 | |
| 8.00% | 254 | 252 | 250 | 246 | 240 | 233 | 225 | |
| KR4301P92524 | | 2019-09 풋252.5 | | | | | | 9,410 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -9,163 | -9,178 | -9,202 | -9,237 | -9,284 | -9,341 | -9,410 | |
| -5.33% | -5,313 | -5,382 | -5,468 | -5,567 | -5,680 | -5,804 | -5,937 | |
| -2.67% | -1,861 | -2,029 | -2,206 | -2,389 | -2,577 | -2,771 | -2,967 | |
| 0% | 673 | 449 | 224 | 0 | -224 | -449 | -673 | |
| 2.67% | 2,037 | 1,863 | 1,681 | 1,492 | 1,297 | 1,098 | 895 | |

| | | | | | | | |
|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 5.33% | 2,537 | 2,456 | 2,358 | 2,245 | 2,119 | 1,982 | 1,835 |
| 8.00% | 2,659 | 2,635 | 2,599 | 2,550 | 2,488 | 2,413 | 2,325 |

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

(단위:백만원)

32,173

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-08-14 |
| 기준일 | 2019-08-13 |

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

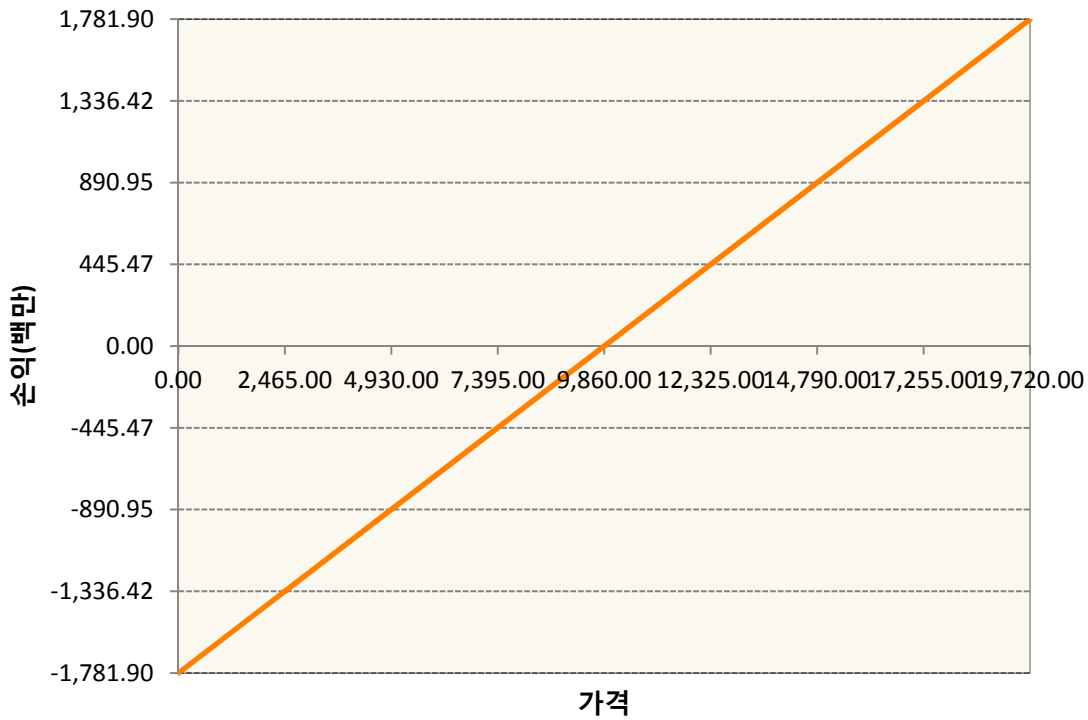
1. 계약금액

(단위:백만원)

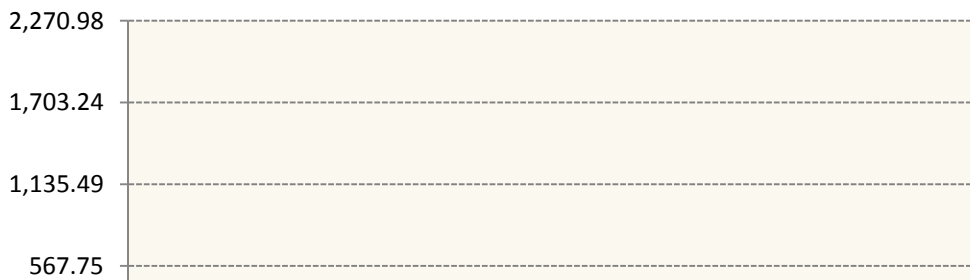
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,782 | 0 | 1,782 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 5,561 | -5,561 | 장내 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 463 | 3,271 | -2,808 | 장외 |

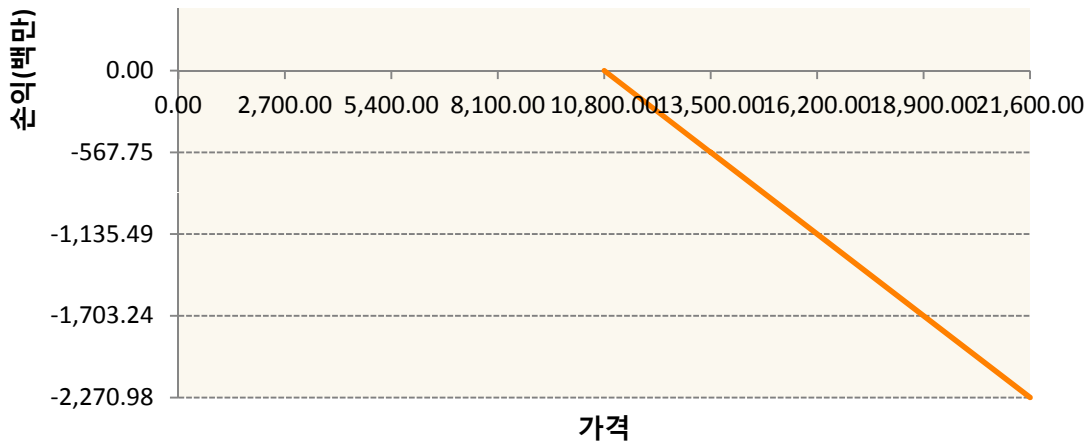
2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19

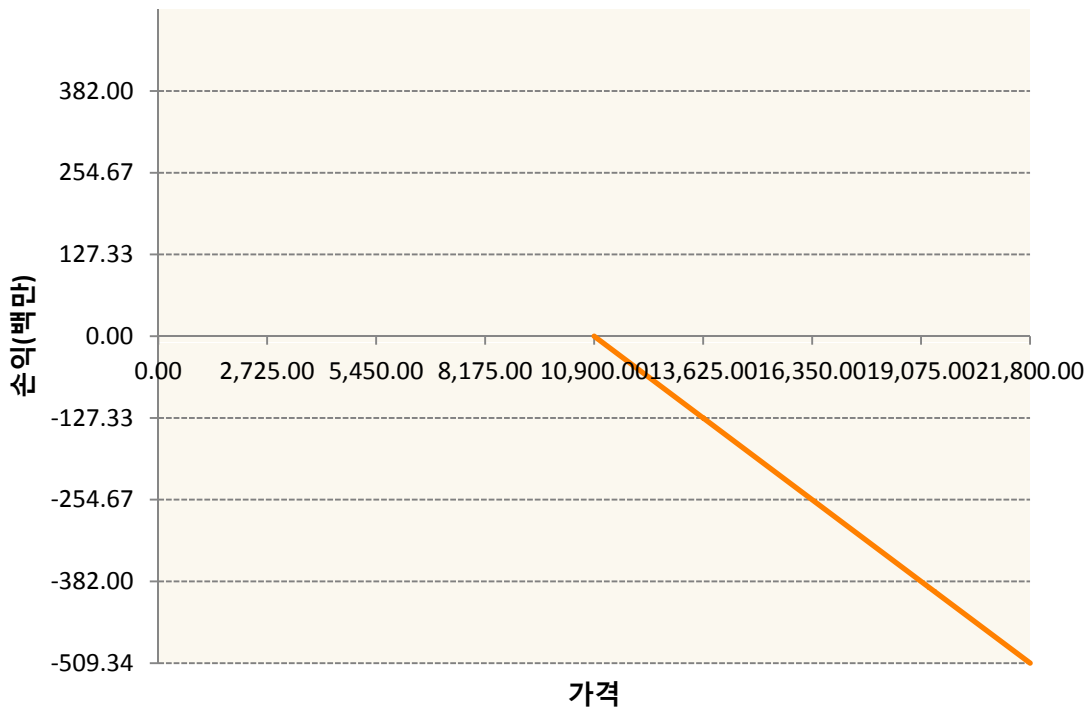


OHHIQ9-C108-HSCEI

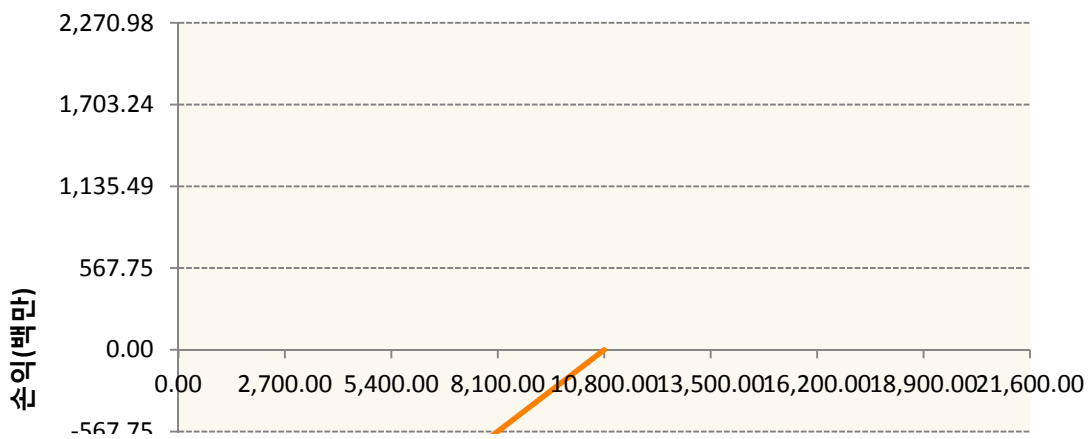


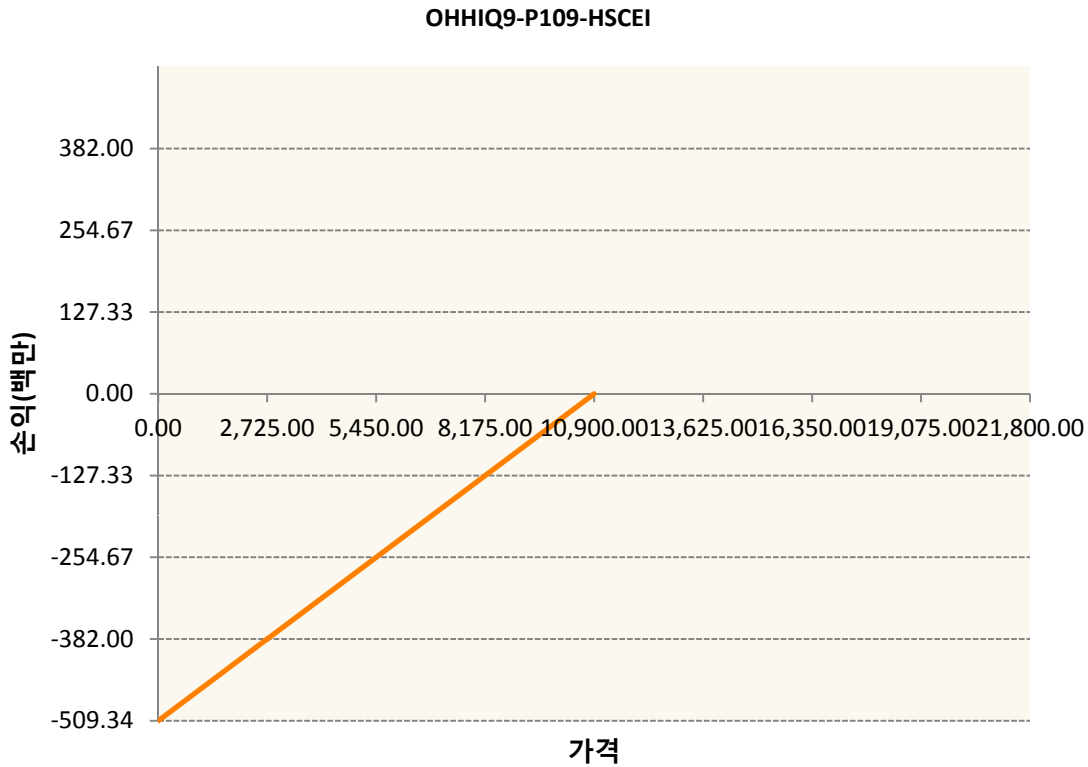


OHHIQ9-C109-HSCEI



OHHIQ9-P108-HSCEI





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | (단위:백만원) |
|------------------------------|----------|
| FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E | 262 |
| FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E | 12 |
| FX21019Q00 HKD/KRW 23-08-19E | 25 |
| HCQ9 HSCEI Futures Aug19 | 143 |
| OHHIQ9-C1(HSCEI | 182 |
| OHHIQ9-C1(HSCEI | 41 |
| OHHIQ9-P1(HSCEI | 182 |
| OHHIQ9-P1(HSCEI | 41 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
| | 656 |

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-08-14 |
| 기준일 | 2019-08-13 |

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

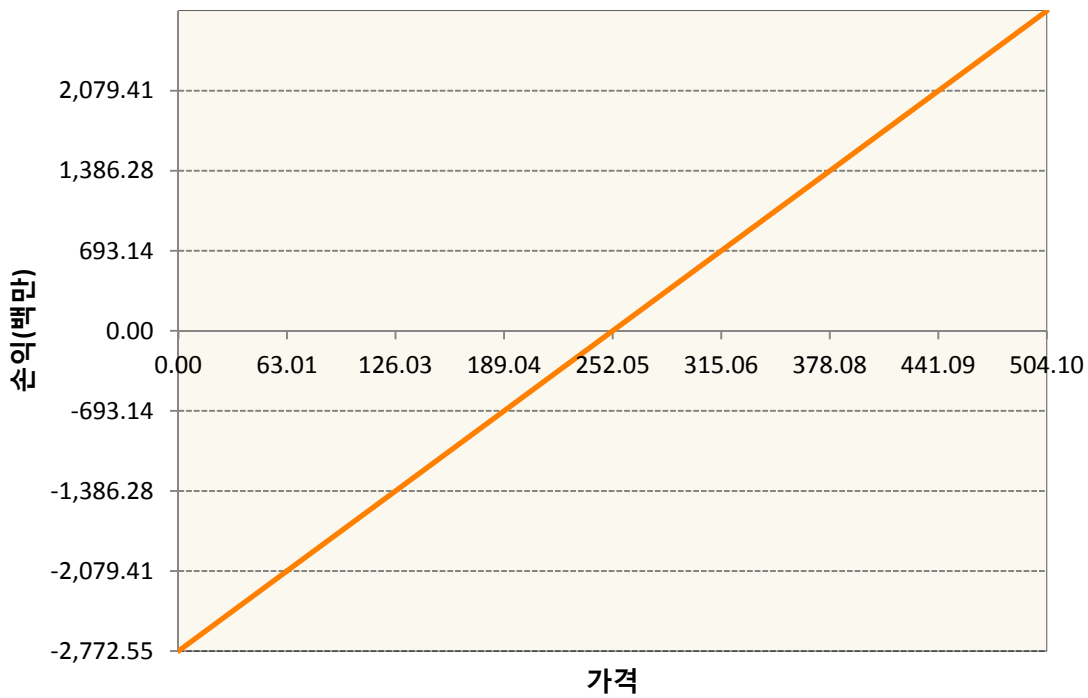
1. 계약금액

(단위:백만원)

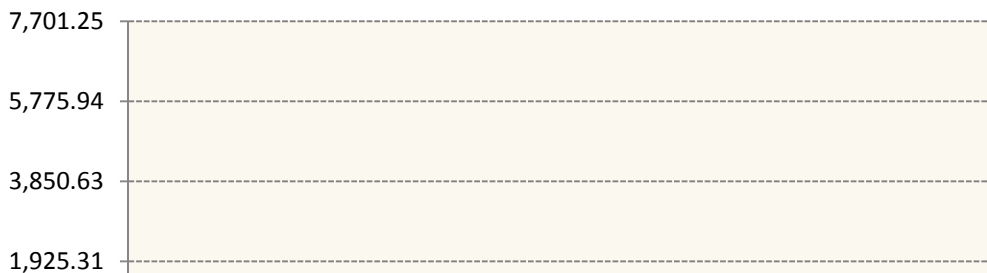
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 2,356 | 0 | 2,356 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,773 | 0 | 2,773 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 20,125 | 0 | 20,125 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 15,018 | -15,018 | 장내 |

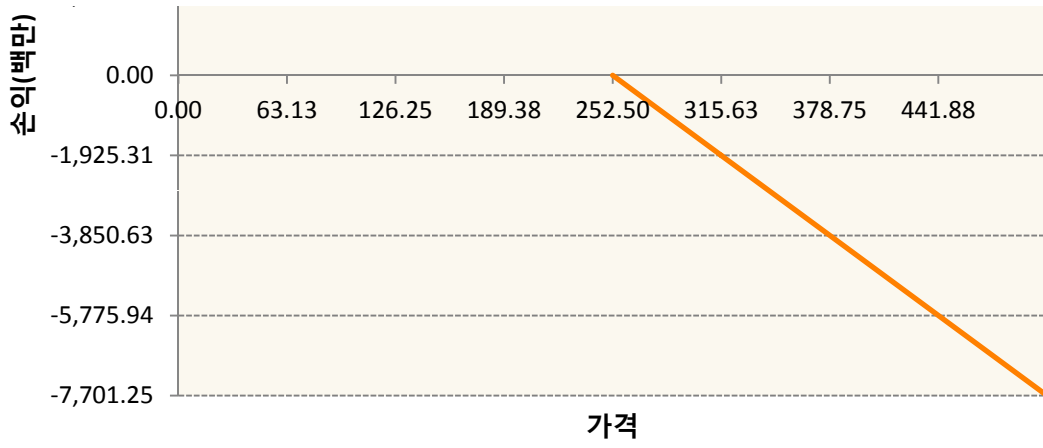
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

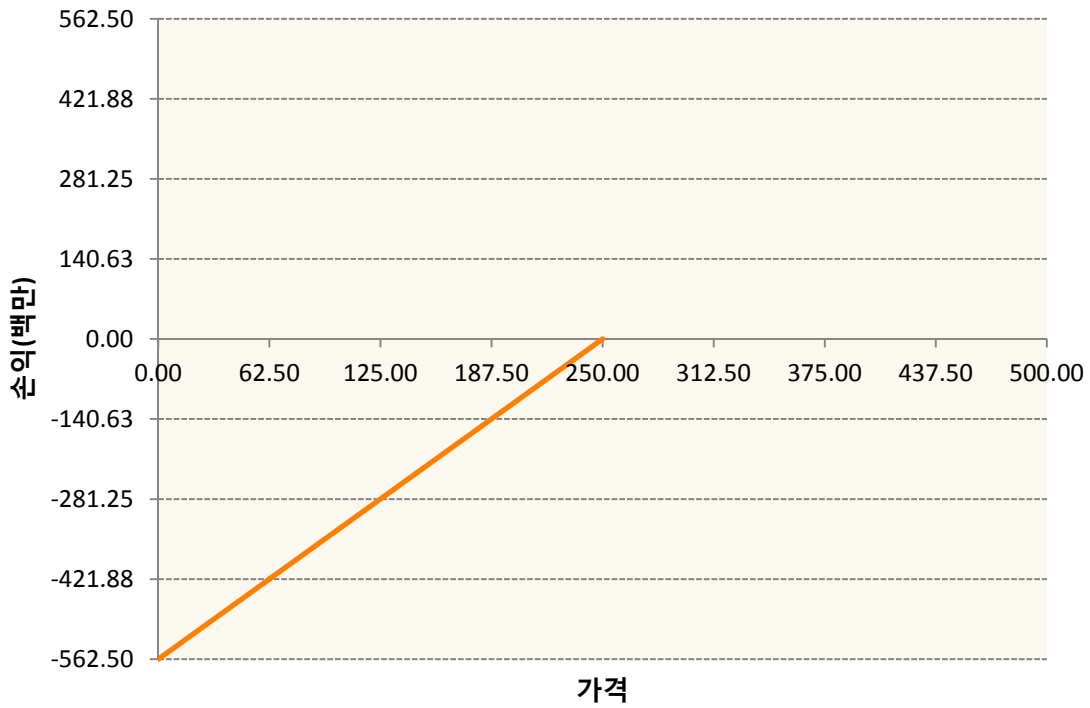


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

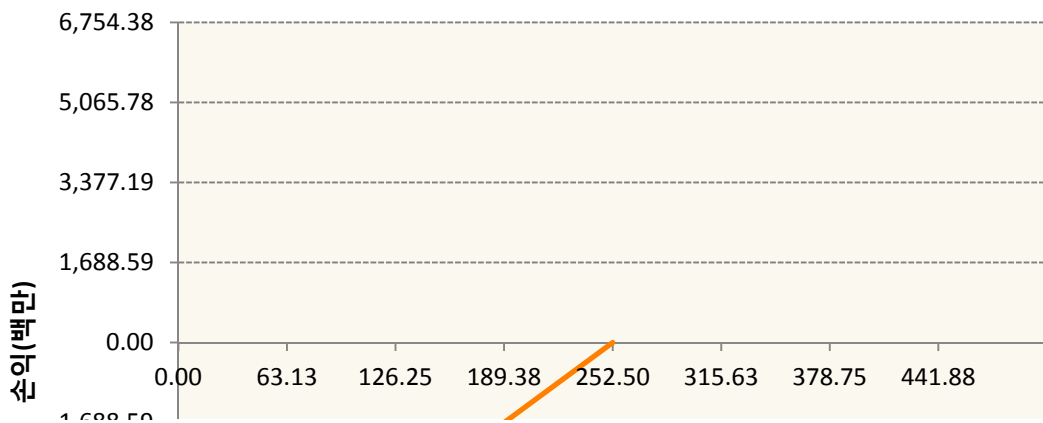




KR4301P92508-2019-09 풋250



KR4301P92524-2019-09 풋252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| 2.529E+11 | | UBCSFXC1 INDEX_16 | | | | | | 1,748 |
|--------------|---------|--------------------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -1,748 | -1,748 | -1,748 | -1,748 | -1,748 | -1,748 | -1,748 | |
| -5.33% | -1,165 | -1,165 | -1,165 | -1,165 | -1,165 | -1,165 | -1,165 | |
| -2.67% | -583 | -583 | -583 | -583 | -583 | -583 | -583 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 583 | 583 | 583 | 583 | 583 | 583 | 583 | |
| 5.33% | 1,165 | 1,165 | 1,165 | 1,165 | 1,165 | 1,165 | 1,165 | |
| 8.00% | 1,748 | 1,748 | 1,748 | 1,748 | 1,748 | 1,748 | 1,748 | |
| KR4101P90001 | | 2019-09 코스피200지수선물 | | | | | | 222 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -222 | -222 | -222 | -222 | -222 | -222 | -222 | |
| -5.33% | -148 | -148 | -148 | -148 | -148 | -148 | -148 | |
| -2.67% | -74 | -74 | -74 | -74 | -74 | -74 | -74 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 74 | 74 | 74 | 74 | 74 | 74 | 74 | |
| 5.33% | 148 | 148 | 148 | 148 | 148 | 148 | 148 | |
| 8.00% | 222 | 222 | 222 | 222 | 222 | 222 | 222 | |
| KR4201P92526 | | 2019-09 콜252.5 | | | | | | 475 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 202 | 197 | 191 | 183 | 175 | 166 | 155 | |
| -5.33% | 183 | 172 | 161 | 149 | 136 | 123 | 109 | |
| -2.67% | 136 | 121 | 106 | 90 | 74 | 57 | 41 | |
| 0% | 53 | 35 | 18 | 0 | -18 | -35 | -53 | |
| 2.67% | -73 | -89 | -105 | -121 | -138 | -154 | -171 | |
| 5.33% | -234 | -245 | -257 | -270 | -284 | -299 | -313 | |
| 8.00% | -418 | -425 | -433 | -442 | -452 | -463 | -475 | |
| KR4301P92508 | | 2019-09 풋250 | | | | | | 33 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |

| | | | | | | | |
|----------------------------------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| -8.00% | -32 | -32 | -32 | -33 | -33 | -33 | -33 |
| -5.33% | -18 | -18 | -19 | -19 | -20 | -20 | -21 |
| -2.67% | -6 | -6 | -7 | -8 | -9 | -9 | -10 |
| 0% | 2 | 2 | 1 | 0 | -1 | -2 | -3 |
| 2.67% | 6 | 6 | 5 | 5 | 4 | 3 | 3 |
| 5.33% | 7 | 7 | 7 | 7 | 6 | 6 | 5 |
| 8.00% | 8 | 8 | 7 | 7 | 7 | 7 | 7 |
| KR4301P92524 2019-09 풋252.5 | | | | | | | 428 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -417 | -418 | -419 | -421 | -423 | -425 | -428 |
| -5.33% | -242 | -245 | -249 | -253 | -259 | -264 | -270 |
| -2.67% | -85 | -92 | -100 | -109 | -117 | -126 | -135 |
| 0% | 31 | 20 | 10 | 0 | -10 | -20 | -31 |
| 2.67% | 93 | 85 | 77 | 68 | 59 | 50 | 41 |
| 5.33% | 116 | 112 | 107 | 102 | 96 | 90 | 84 |
| 8.00% | 121 | 120 | 118 | 116 | 113 | 110 | 106 |

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

(단위:백만원)

2,877

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-08-14 |
| 기준일 | 2019-08-13 |

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

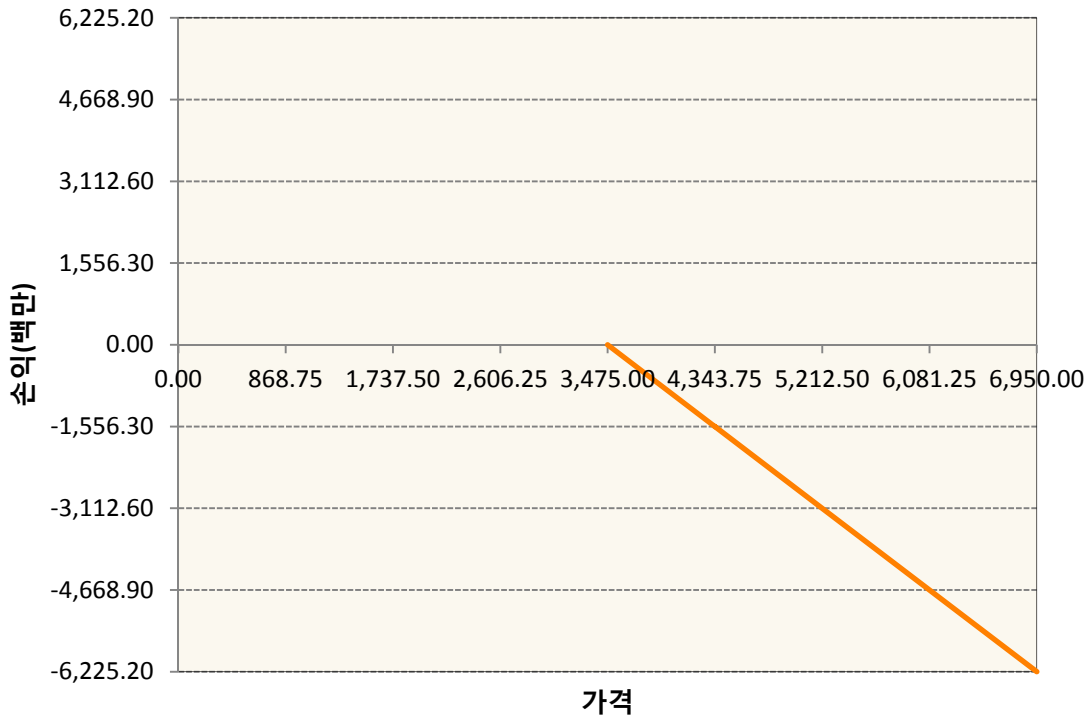
1. 계약금액

(단위:백만원)

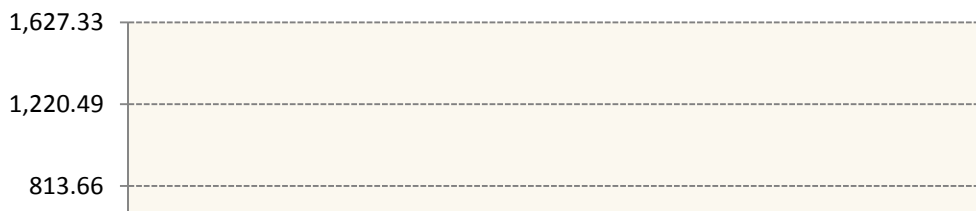
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 지수 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 4,521 | 0 | 4,521 | |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 15,705 | -15,705 | 장내 |
| 누계 | 지수 | 스왑 | 28,912 | 0 | 28,912 | 장외 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 14,769 | 23,248 | -8,479 | 장외 |

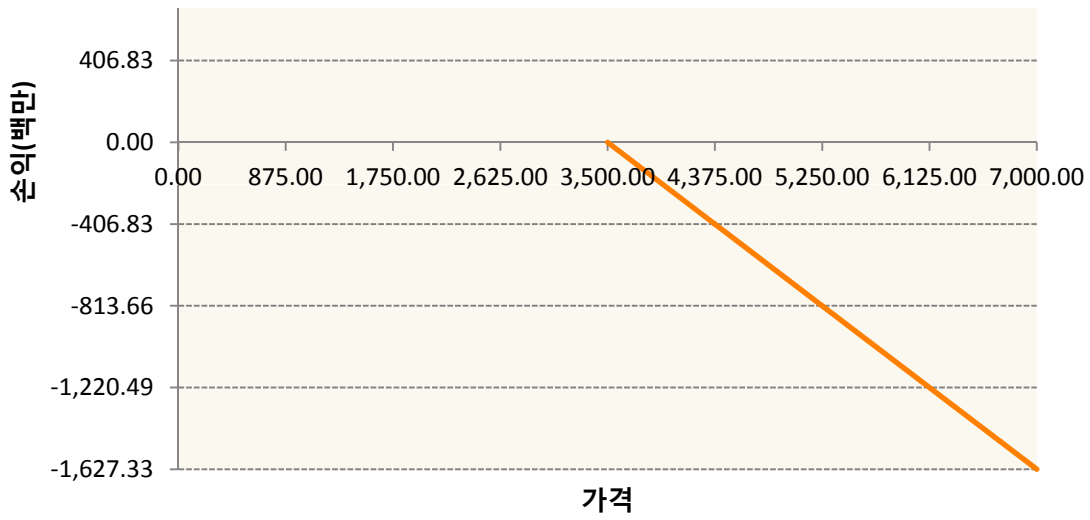
2. 만기시점의 손익구조

OESXQ9-C3475-EURO STOXX 50

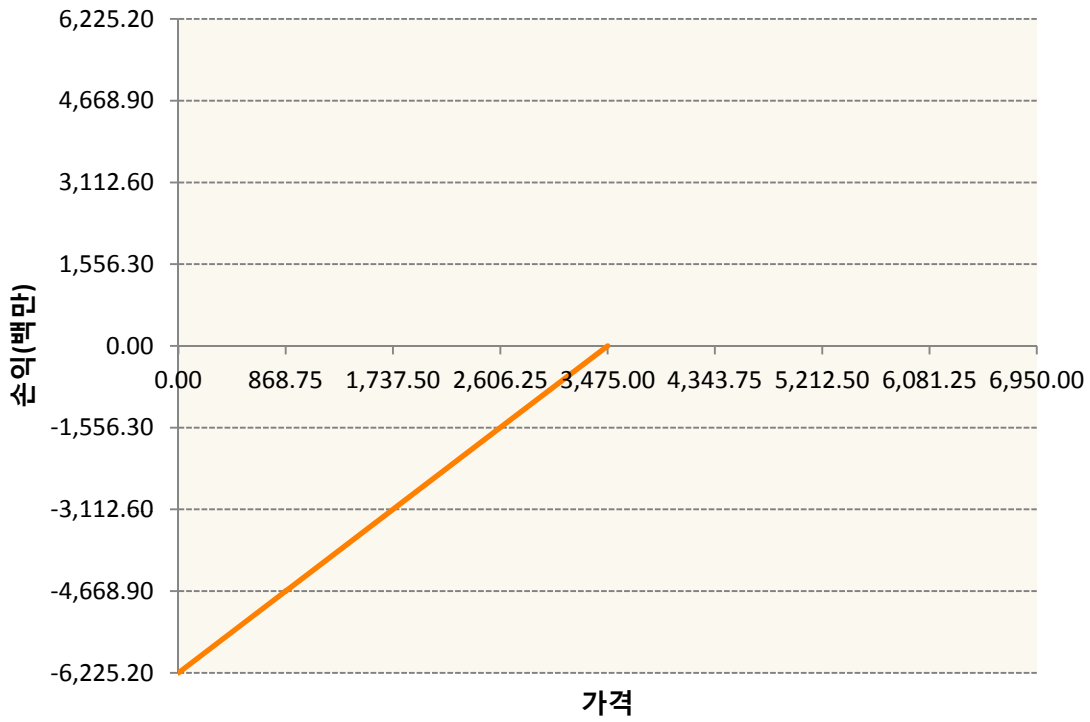


OESXQ9-C3500-EURO STOXX 50

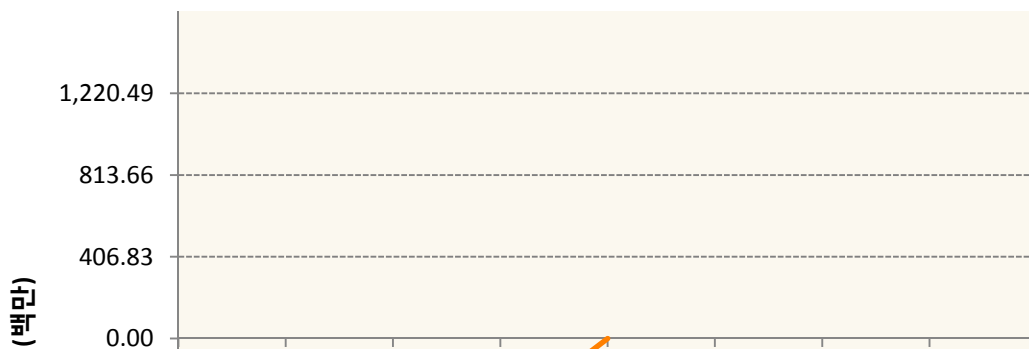


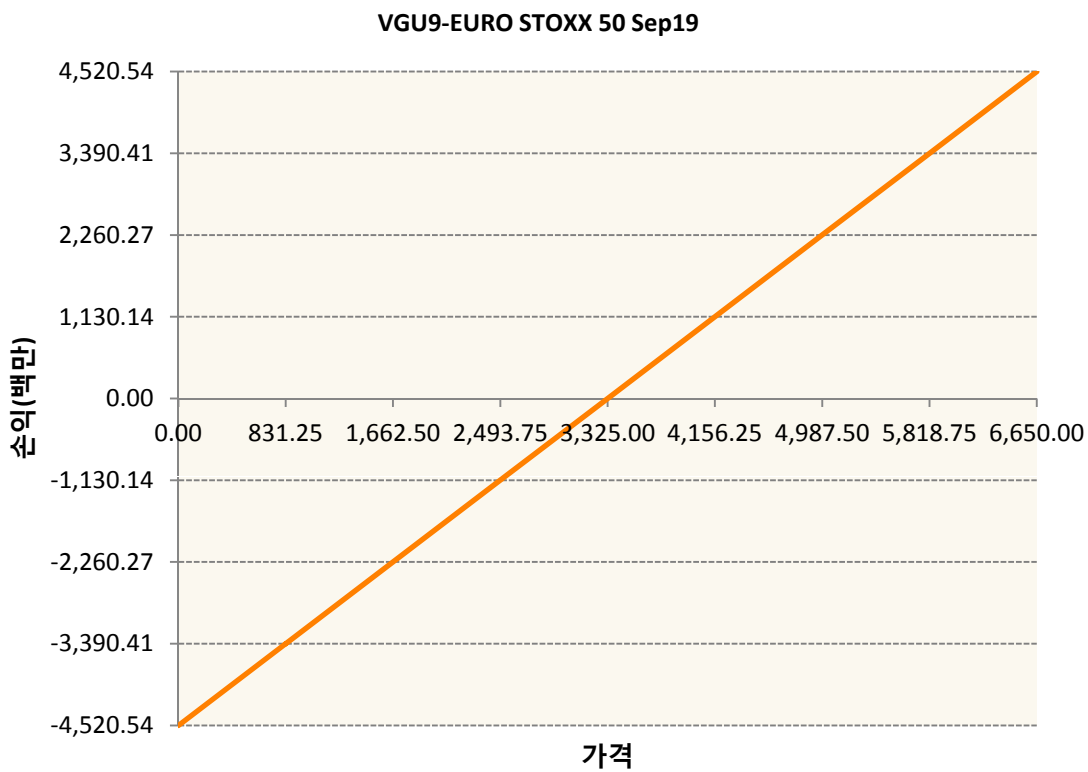
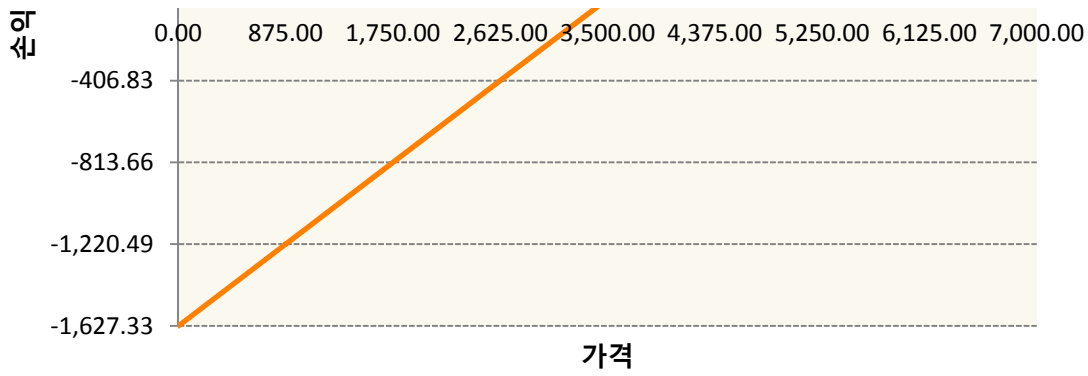


OESXQ9-P3475-EURO STOXX 50



OESXQ9-P3500-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | |
|-----------------------------------------|-------|
| 260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY | 72 |
| FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E | 438 |
| FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E | 1,094 |
| FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E | 328 |
| FX21019N01 EUR/KRW 23-08-19E | 438 |
| FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E | 328 |
| FX21019N04 EUR/KRW 27-09-19E | 241 |
| FX21019Q00 EUR/KRW 27-09-19E | 175 |
| OESXQ9-C34 EURO STOXX 50 | 498 |
| OESXQ9-C35 EURO STOXX 50 | 130 |
| OESXQ9-P34 EURO STOXX 50 | 498 |

OESXQ9-P3! EURO STOXX 50
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19

| |
|-----|
| 130 |
| 362 |

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

(단위:백만원)

2,662

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

(단위:백만원)

921

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-08-14 |
| 기준일 | 2019-08-13 |

ETF스마트레버리지목표전환형9호

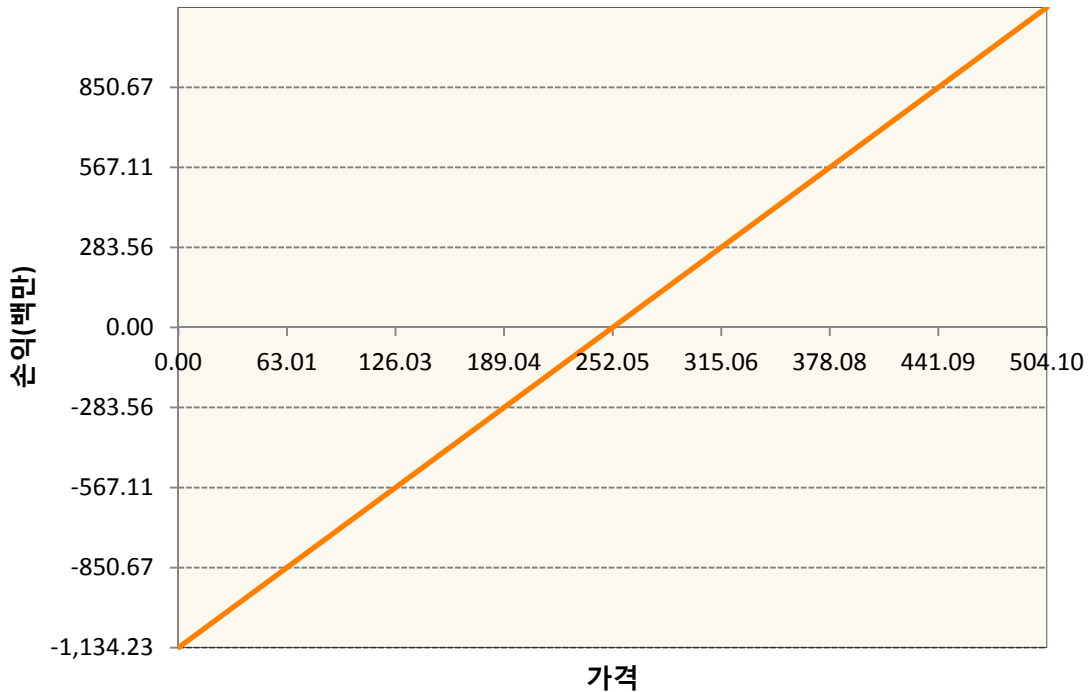
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 63 | -63 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,134 | 0 | 1,134 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101P90001 | | 2019-09 코스피200지수선물 | | | | | | 91 |
|--------------|---------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|----|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -91 | -91 | -91 | -91 | -91 | -91 | -91 | |
| -5.33% | -61 | -61 | -61 | -61 | -61 | -61 | -61 | |
| -2.67% | -30 | -30 | -30 | -30 | -30 | -30 | -30 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | |
| 5.33% | 61 | 61 | 61 | 61 | 61 | 61 | 61 | |
| 8.00% | 91 | 91 | 91 | 91 | 91 | 91 | 91 | |

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

(단위:백만원)

77

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

(단위:백만원)

121

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-08-14 |
| 기준일 | 2019-08-13 |

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

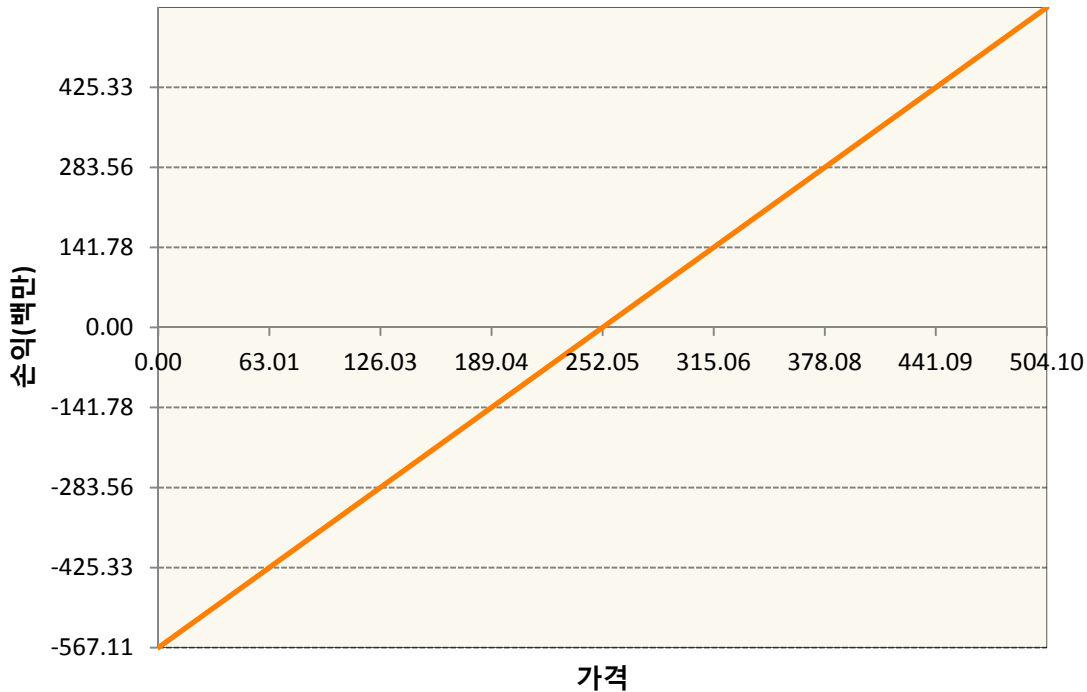
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 567 | 0 | 567 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101P90001 | | 2019-09 코스피200지수선물 | | | | | | 46 |
|--------------|---------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|----|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -46 | -46 | -46 | -46 | -46 | -46 | -46 | |
| -5.33% | -30 | -30 | -30 | -30 | -30 | -30 | -30 | |
| -2.67% | -15 | -15 | -15 | -15 | -15 | -15 | -15 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 15 | 15 | 15 | 15 | 15 | 15 | 15 | |
| 5.33% | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | |
| 8.00% | 46 | 46 | 46 | 46 | 46 | 46 | 46 | |

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

(단위:백만원)

39

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-08-14 |
| 기준일 | 2019-08-13 |

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

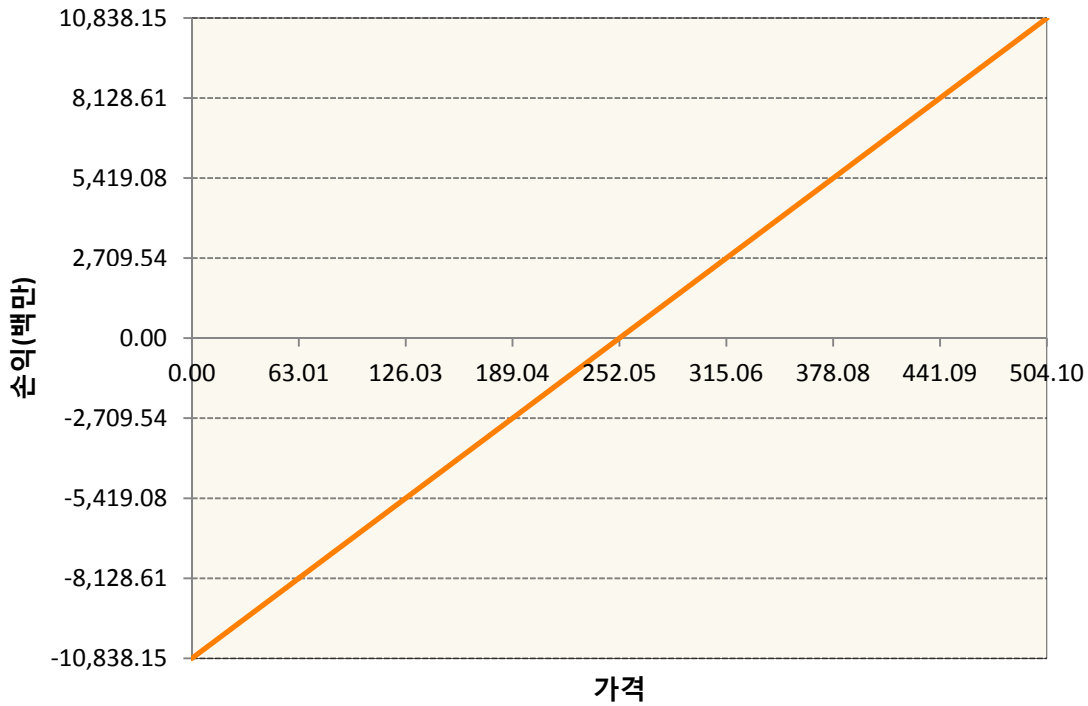
1. 계약금액

(단위:백만원)

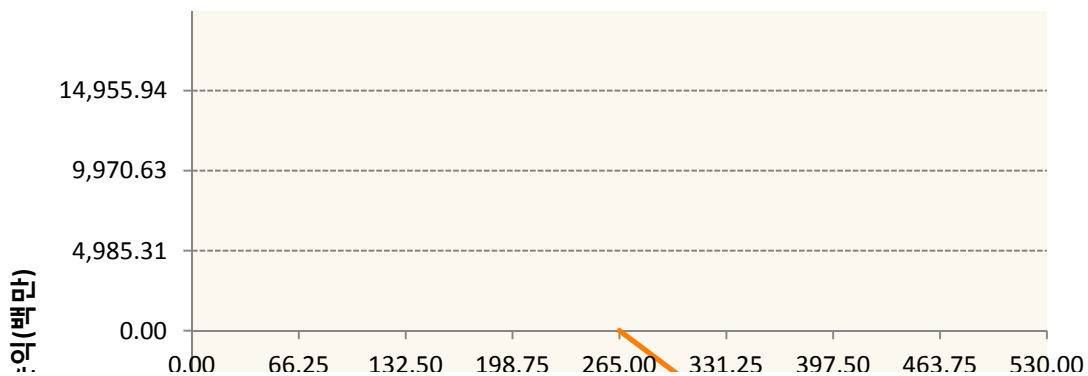
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 10,838 | 0 | 10,838 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 3,659 | 20,075 | -16,416 | 장내 |

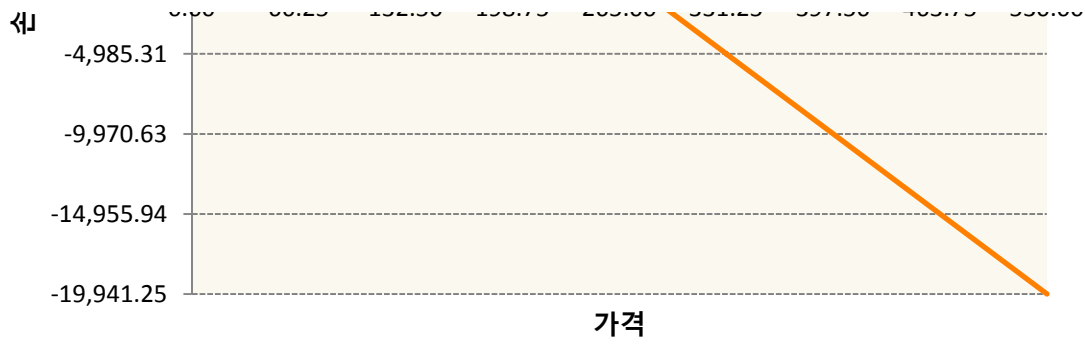
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

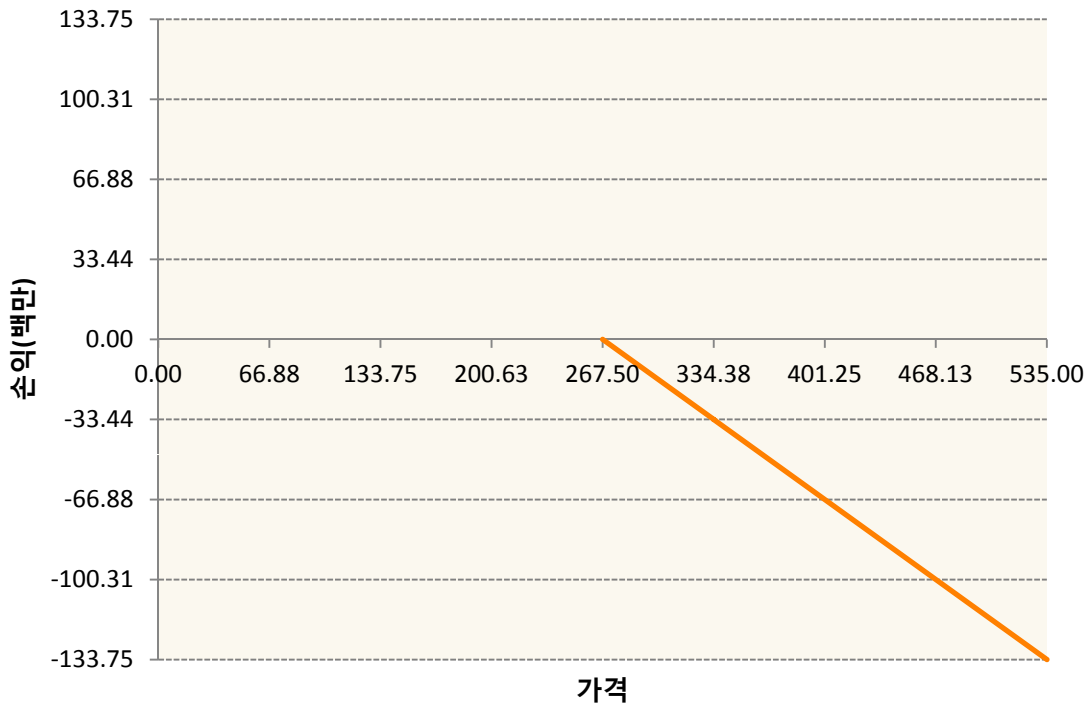


KR4201P92658-2019-09 콜265

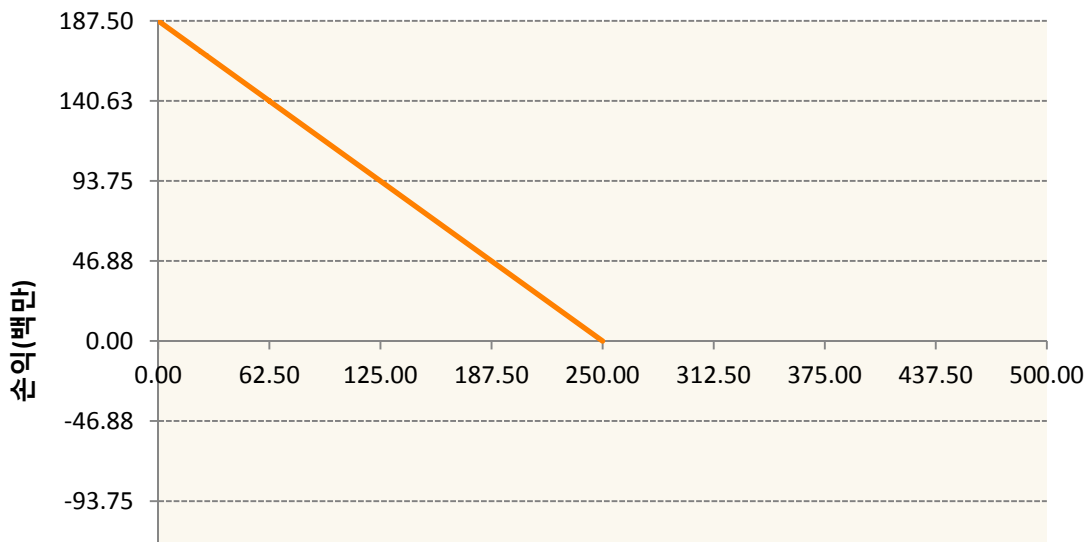


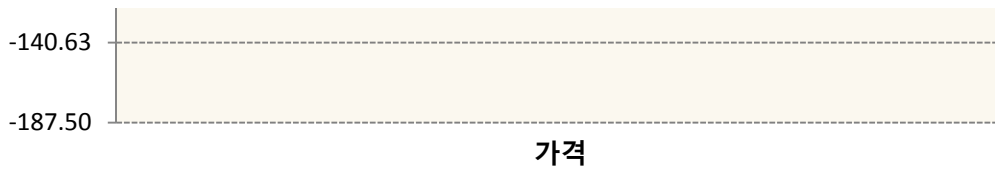


KR4201P92674-2019-09 콜267.5

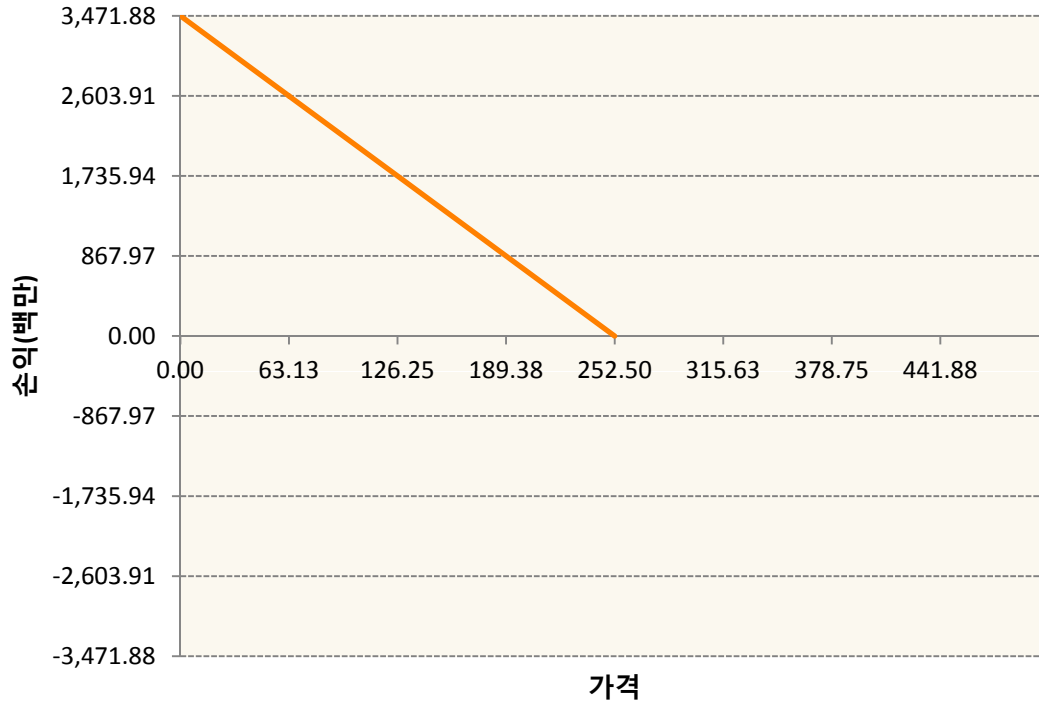


KR4301P92508-2019-09 풋250





KR4301P92524-2019-09 풋252.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4101P90001 | | 2019-09 코스피200지수선물 | | | | | | 870 |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
| | | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -870 | -870 | -870 | -870 | -870 | -870 | -870 | |
| -5.33% | -580 | -580 | -580 | -580 | -580 | -580 | -580 | |
| -2.67% | -290 | -290 | -290 | -290 | -290 | -290 | -290 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 290 | 290 | 290 | 290 | 290 | 290 | 290 | |
| 5.33% | 580 | 580 | 580 | 580 | 580 | 580 | 580 | |
| 8.00% | 870 | 870 | 870 | 870 | 870 | 870 | 870 | |
| KR4201P92658 | | 2019-09 콜265 | | | | | | 831 |
| | | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 188 | 185 | 182 | 176 | 168 | 158 | 146 | |
| -5.33% | 181 | 174 | 164 | 152 | 136 | 119 | 99 | |
| -2.67% | 158 | 141 | 121 | 99 | 74 | 47 | 18 | |

| | | | | | | | |
|-------|------|------|------|------|------|------|------|
| 0% | 96 | 66 | 34 | 0 | -35 | -72 | -109 |
| 2.67% | -35 | -77 | -119 | -161 | -204 | -247 | -290 |
| 5.33% | -259 | -304 | -350 | -395 | -440 | -486 | -531 |
| 8.00% | -580 | -620 | -661 | -702 | -745 | -788 | -831 |

KR4201P92674 2019-09 콜267.5 5

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |
| -5.33% | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |
| -2.67% | 1 | 1 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0 |
| 0% | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | -1 |
| 2.67% | 0 | 0 | -1 | -1 | -1 | -1 | -2 |
| 5.33% | -1 | -2 | -2 | -2 | -3 | -3 | -3 |
| 8.00% | -3 | -4 | -4 | -4 | -4 | -5 | -5 |

KR4301P92508 2019-09 풋250 11

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 11 | 11 | 11 | 11 | 11 | 11 | 11 |
| -5.33% | 6 | 6 | 6 | 6 | 7 | 7 | 7 |
| -2.67% | 2 | 2 | 2 | 3 | 3 | 3 | 3 |
| 0% | -1 | -1 | 0 | 0 | 0 | 1 | 1 |
| 2.67% | -2 | -2 | -2 | -2 | -1 | -1 | -1 |
| 5.33% | -2 | -2 | -2 | -2 | -2 | -2 | -2 |
| 8.00% | -3 | -3 | -2 | -2 | -2 | -2 | -2 |

KR4301P92524 2019-09 풋252.5 220

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 214 | 215 | 215 | 216 | 217 | 219 | 220 |
| -5.33% | 124 | 126 | 128 | 130 | 133 | 136 | 139 |
| -2.67% | 44 | 47 | 52 | 56 | 60 | 65 | 69 |
| 0% | -16 | -11 | -5 | 0 | 5 | 11 | 16 |
| 2.67% | -48 | -44 | -39 | -35 | -30 | -26 | -21 |
| 5.33% | -59 | -57 | -55 | -53 | -50 | -46 | -43 |
| 8.00% | -62 | -62 | -61 | -60 | -58 | -56 | -54 |

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

(단위:백만원)

1,559

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-08-14 |
| 기준일 | 2019-08-13 |

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 | 59,761 | 0 | 59,761 | |

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 | 2019-08-14 |
| 기준일 | 2019-08-13 |

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 | 72,302 | 0 | 72,302 | |

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 | 2019-08-14 |
| 기준일 | 2019-08-13 |

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 3,667 | 0 | 3,667 | |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 465,347 | 0 | 465,347 | |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 460,892 | -460,892 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------------------------------|---------------------------------|-------|
| IE00BD8RGM75 | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 | |
| IE00BHNZKL13 | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 | |
| FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E | | 1,760 |
| FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E | | 2,151 |
| FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E | | 137 |
| FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E | | 587 |
| FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E | | 3,129 |
| FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E | | 3,422 |
| FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E | | 489 |
| FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E | | 978 |
| FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E | | 3,041 |
| FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E | | 1,701 |
| FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E | | 782 |
| FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E | | 1,956 |
| FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E | | 1,956 |
| FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E | | 293 |
| FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E | | 98 |
| FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E | | 724 |
| FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E | | 724 |
| FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E | | 293 |
| FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E | | 684 |
| FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E | | 2,738 |
| FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E | | 1,369 |
| FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E | | 782 |
| FX21019N04 KRW/USD 03-09-19E | | 293 |
| FX21019Q00 KRW/USD 03-09-19E | | 293 |
| FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E | | 489 |
| FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E | | 196 |

| | |
|------------------------------|-------|
| FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E | 293 |
| FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E | 3,227 |
| FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E | 2,190 |
| FX21019Q01 KRW/USD 16-09-19E | 98 |

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

(단위:백만원)

12,105

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-08-14 |
| 기준일 | 2019-08-13 |

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

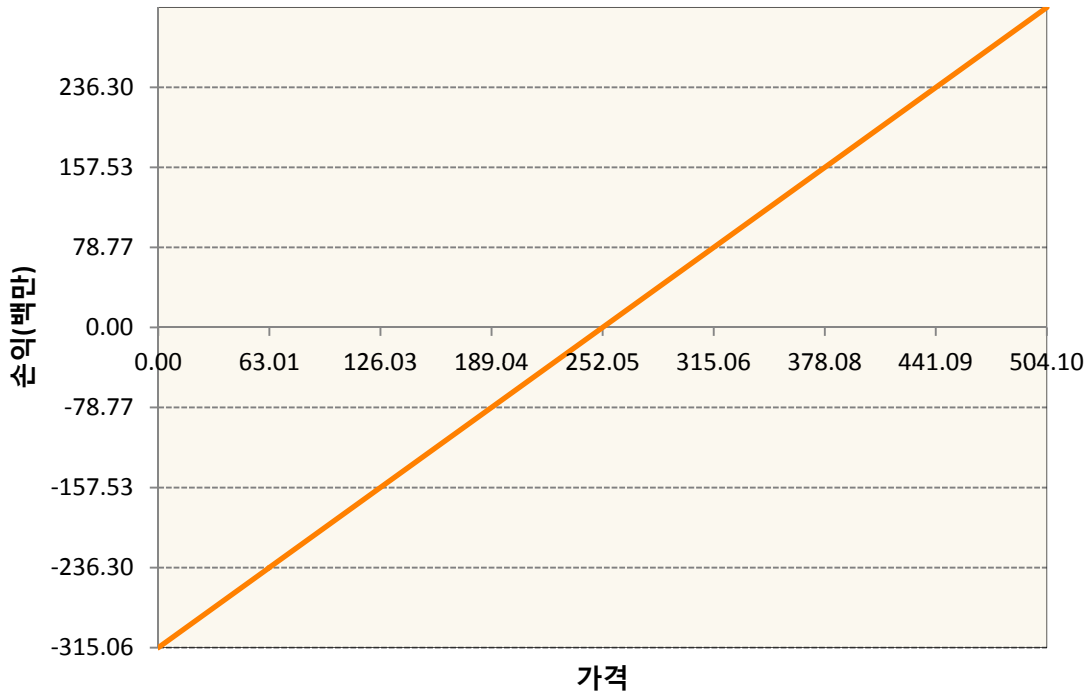
1. 계약금액

(단위:백만원)

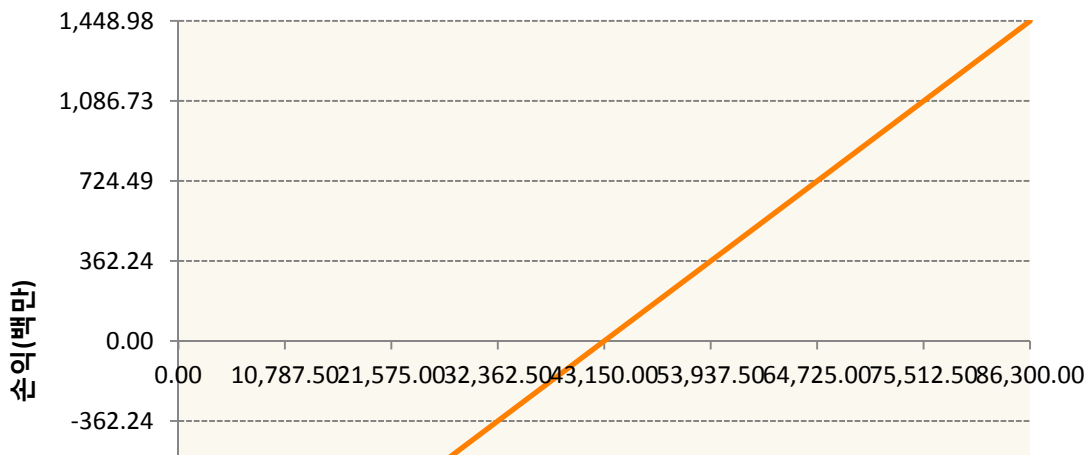
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,764 | 0 | 1,764 | 장내 |

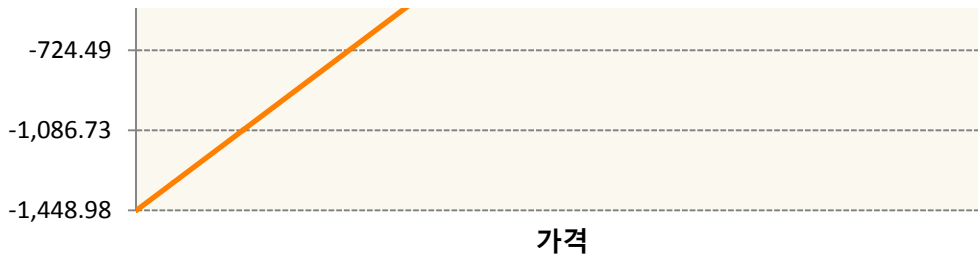
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P90000-2019-09 삼성전자개별선물





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4101P90001 | | 2019-09 코스피200지수선물 | | | | | | 25 |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -25 | -25 | -25 | -25 | -25 | -25 | -25 | |
| -5.33% | -17 | -17 | -17 | -17 | -17 | -17 | -17 | |
| -2.67% | -8 | -8 | -8 | -8 | -8 | -8 | -8 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 8 | 8 | 8 | 8 | 8 | 8 | 8 | |
| 5.33% | 17 | 17 | 17 | 17 | 17 | 17 | 17 | |
| 8.00% | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 | |
| KR4111P90000 | | 2019-09 삼성전자개별선물 | | | | | | 116 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -116 | -116 | -116 | -116 | -116 | -116 | -116 | |
| -5.33% | -77 | -77 | -77 | -77 | -77 | -77 | -77 | |
| -2.67% | -39 | -39 | -39 | -39 | -39 | -39 | -39 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 39 | 39 | 39 | 39 | 39 | 39 | 39 | |
| 5.33% | 77 | 77 | 77 | 77 | 77 | 77 | 77 | |
| 8.00% | 116 | 116 | 116 | 116 | 116 | 116 | 116 | |

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

166

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-08-14 |
| 기준일 | 2019-08-13 |

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

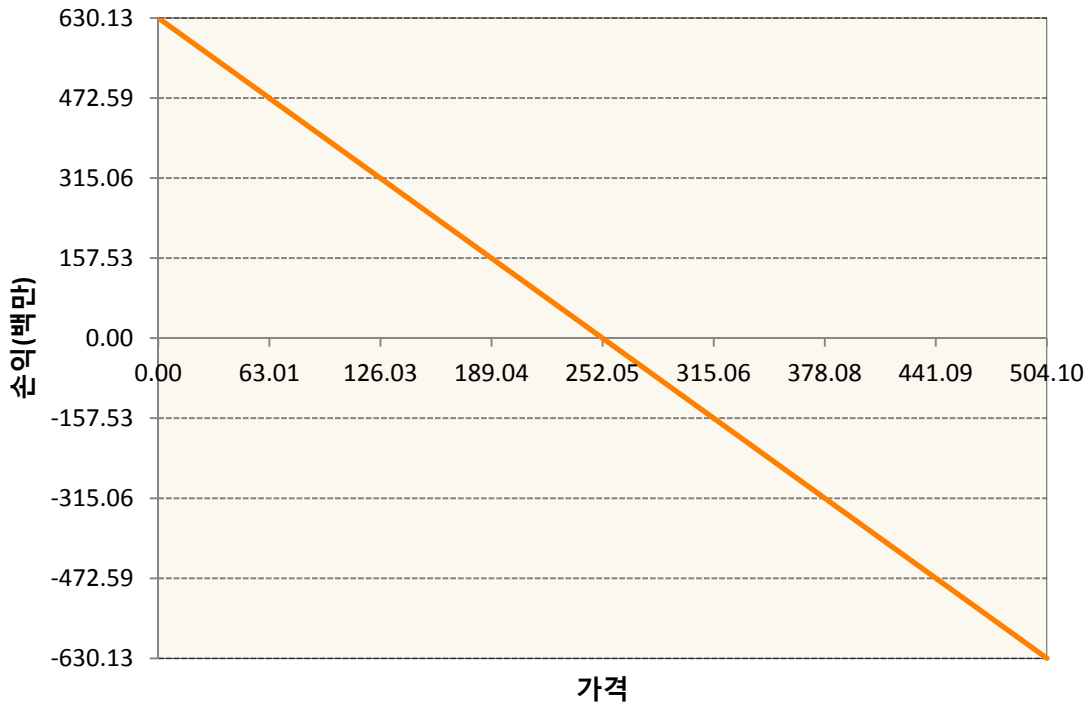
1. 계약금액

(단위:백만원)

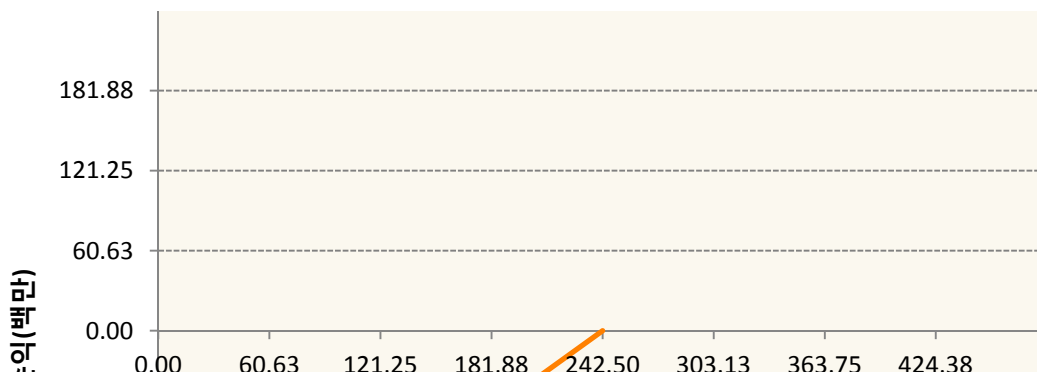
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 62 | -62 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 630 | -630 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 3,550 | -3,550 | 장내 |

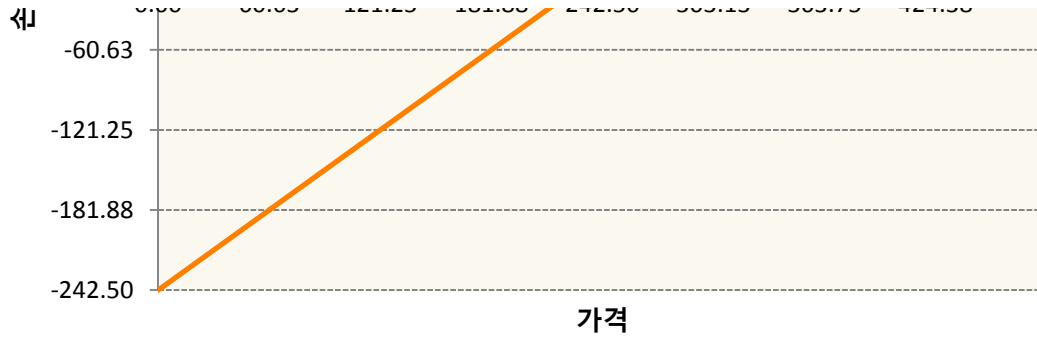
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

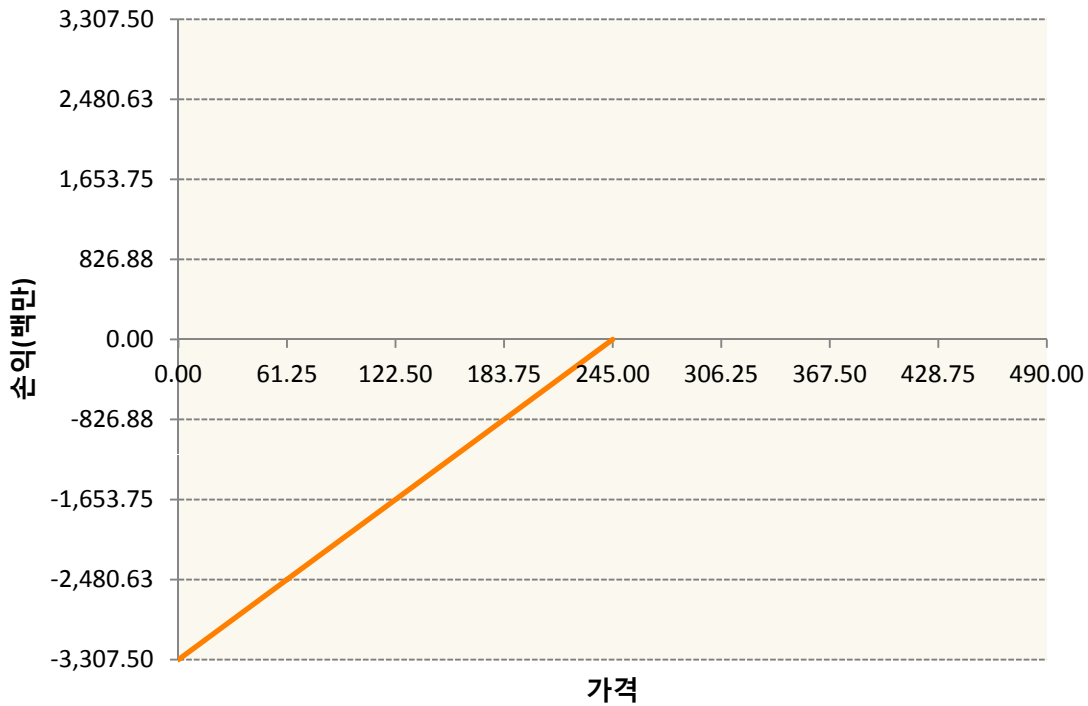


KR4301P92425-2019-09 풋242.5





KR4301P92458-2019-09 풋245



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | | | | | | | |
|--------------|---------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|----|
| KR4101P90001 | | 2019-09 코스피200지수선물 | | | | | | 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% | 34 | 34 | 34 | 34 | 34 | 34 | 34 | |
| -2.67% | 17 | 17 | 17 | 17 | 17 | 17 | 17 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | -17 | -17 | -17 | -17 | -17 | -17 | -17 | |
| 5.33% | -34 | -34 | -34 | -34 | -34 | -34 | -34 | |
| 8.00% | -51 | -51 | -51 | -51 | -51 | -51 | -51 | |
| KR4301P92425 | | 2019-09 풋242.5 | | | | | | 11 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|--------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -9 | -10 | -10 | -10 | -10 | -10 | -11 |
| -5.33% | -4 | -4 | -5 | -5 | -5 | -6 | -6 |
| -2.67% | -1 | -1 | -1 | -2 | -2 | -3 | -3 |
| 0% | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | -1 | -1 |
| 2.67% | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 0 | 0 |
| 5.33% | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |
| 8.00% | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |

KR4301P92458

2019-09 풋245

165

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -150 | -152 | -154 | -156 | -159 | -162 | -165 |
| -5.33% | -72 | -76 | -80 | -85 | -89 | -93 | -98 |
| -2.67% | -17 | -22 | -27 | -32 | -37 | -42 | -47 |
| 0% | 11 | 8 | 4 | 0 | -4 | -8 | -13 |
| 2.67% | 21 | 19 | 17 | 15 | 13 | 10 | 7 |
| 5.33% | 23 | 22 | 22 | 21 | 20 | 18 | 17 |
| 8.00% | 23 | 23 | 23 | 23 | 22 | 22 | 21 |

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

(단위:백만원)

197

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-08-14 |
| 기준일 | 2019-08-13 |

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 489 | 0 | 489 | |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 19,628 | 0 | 19,628 | |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 19,433 | -19,433 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------------------------------|---------------------------------|-----|
| IE00BD8RGM75 | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 | |
| IE00BHNZKL13 | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 | |
| FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E | | 332 |
| FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E | | 166 |
| FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E | | 489 |
| FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E | | 528 |
| FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E | | 39 |

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

(단위:백만원)

| |
|------------|
| 510 |
|------------|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-08-14 |
| 기준일 | 2019-08-13 |

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 390 | 0 | 390 | 장외 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 95 | -95 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|------------------------------|----|
| 2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR) | 31 |
| FX21019N01 KRW/EUR 25-10-19E | 4 |
| FX21019Q00 KRW/EUR 25-10-19E | 4 |

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

(단위:백만원)

| |
|-----------|
| 33 |
|-----------|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-08-14 |
| 기준일 | 2019-08-13 |

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

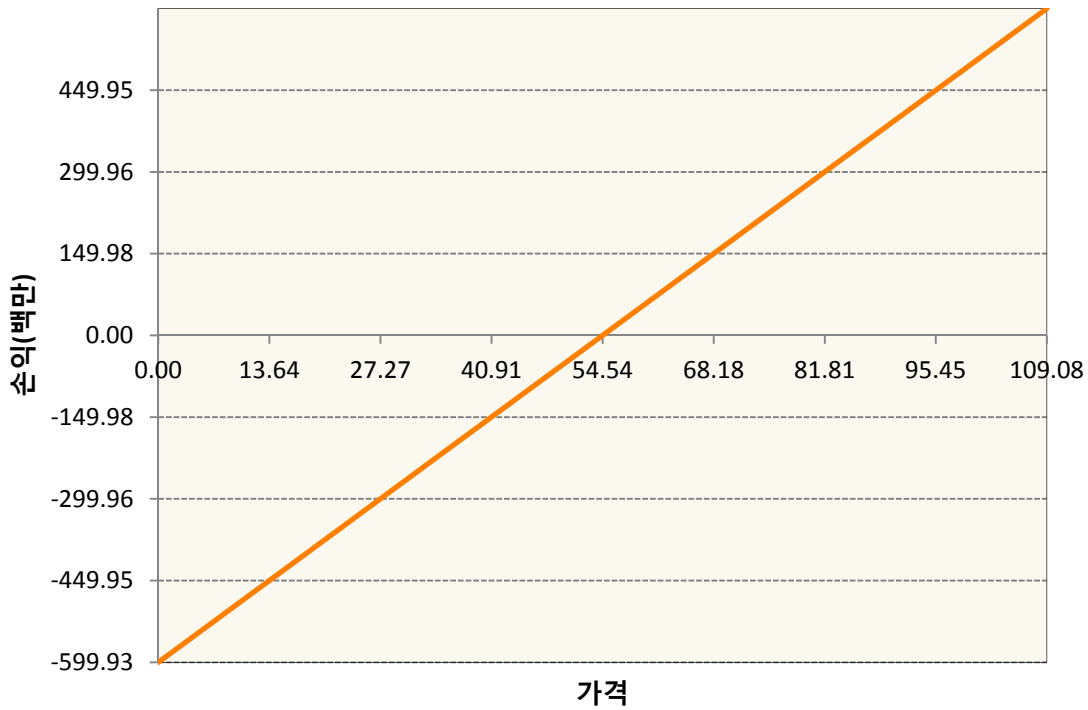
1. 계약금액

(단위:백만원)

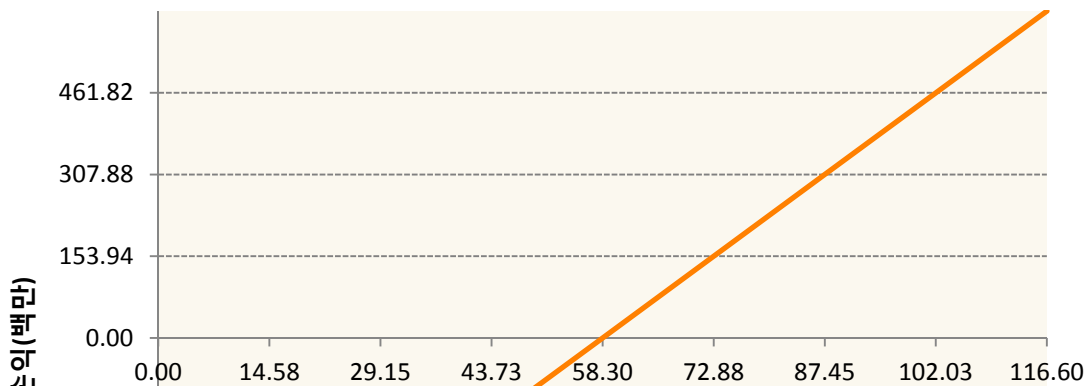
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,184 | 122 | 2,062 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 186 | 0 | 186 | 장내 |

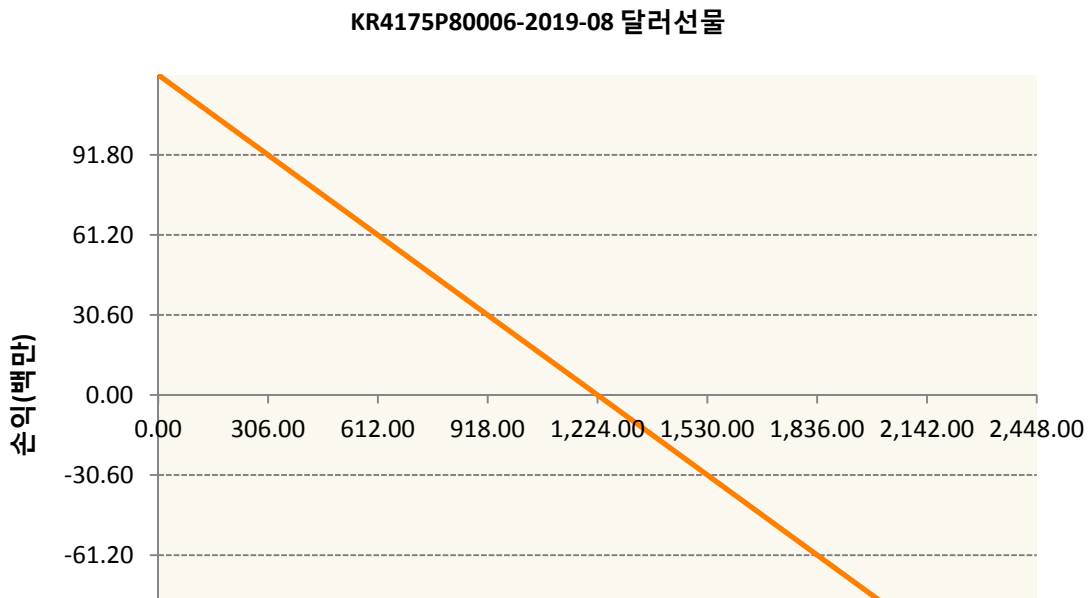
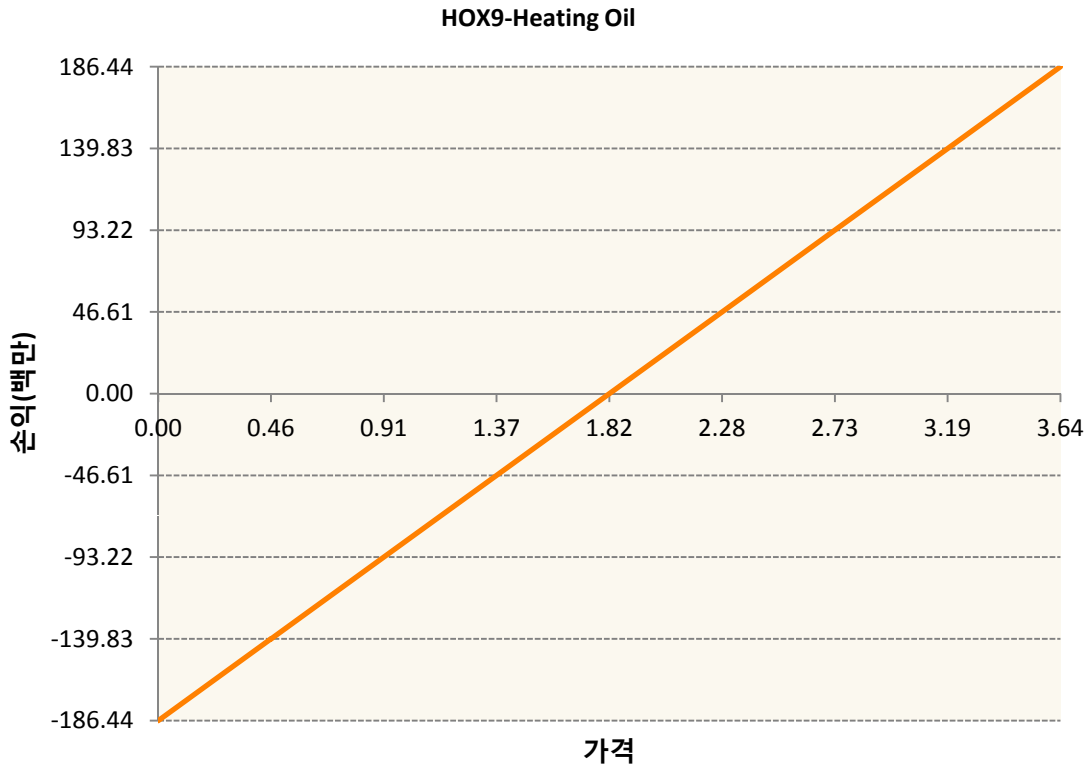
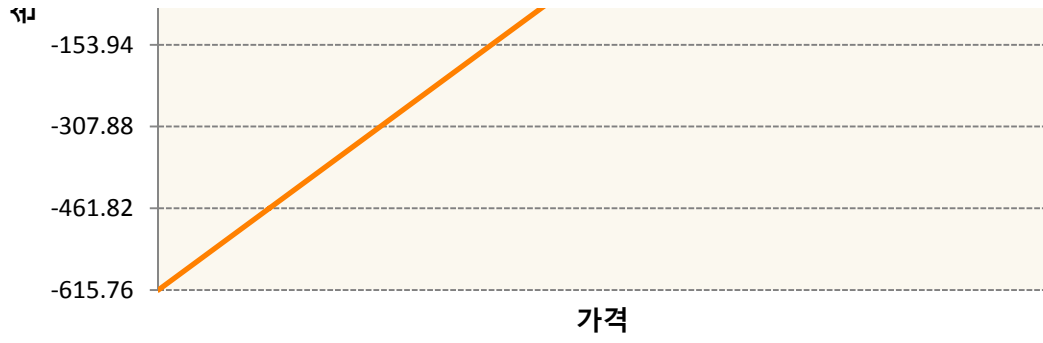
2. 만기시점의 손익구조

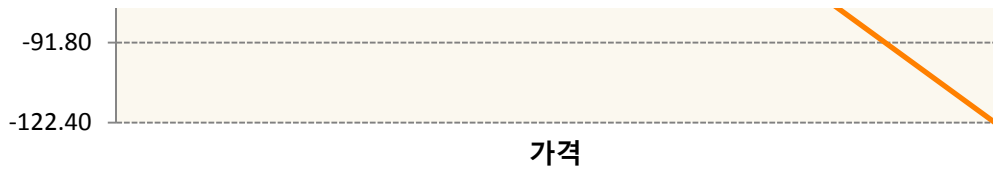
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19



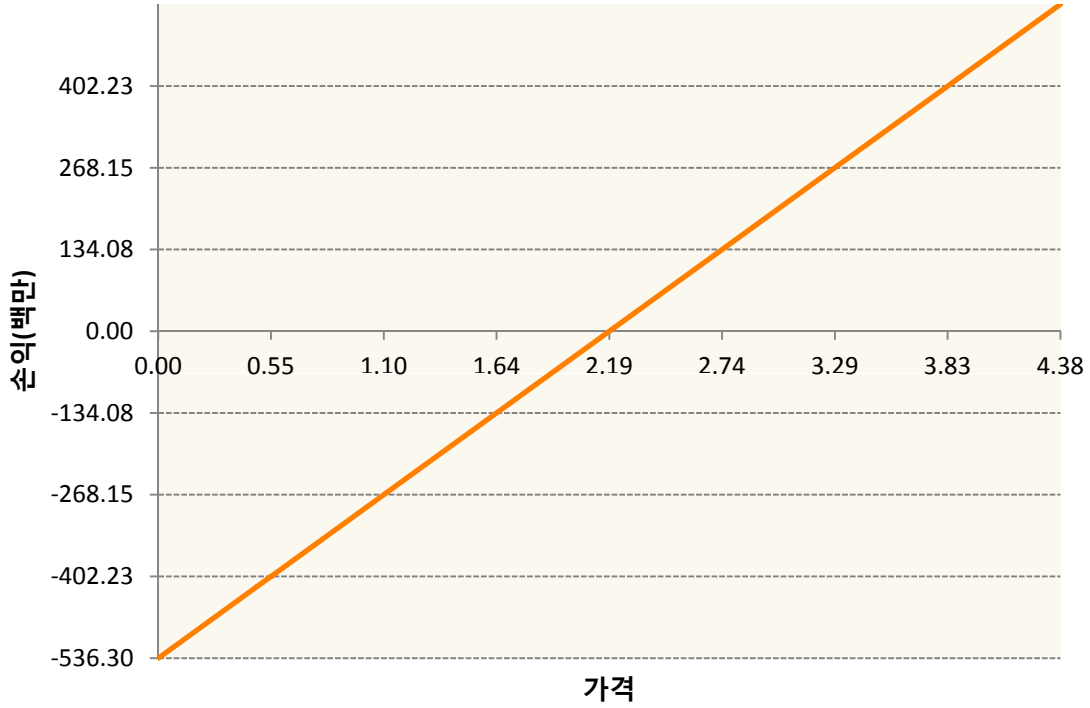
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19



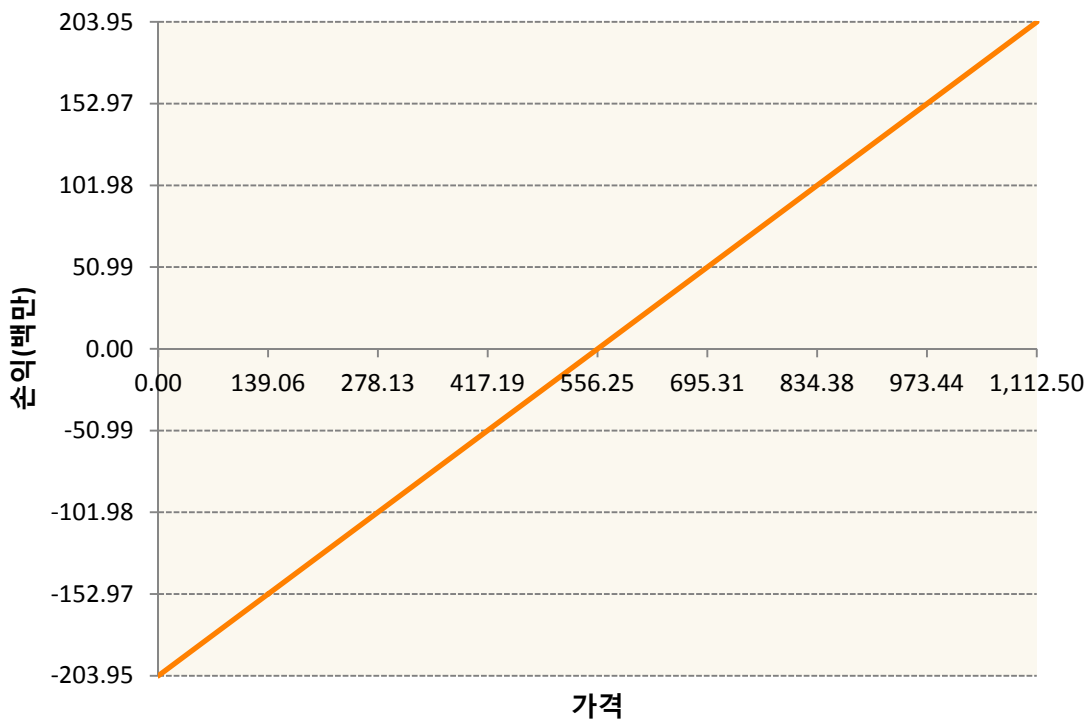


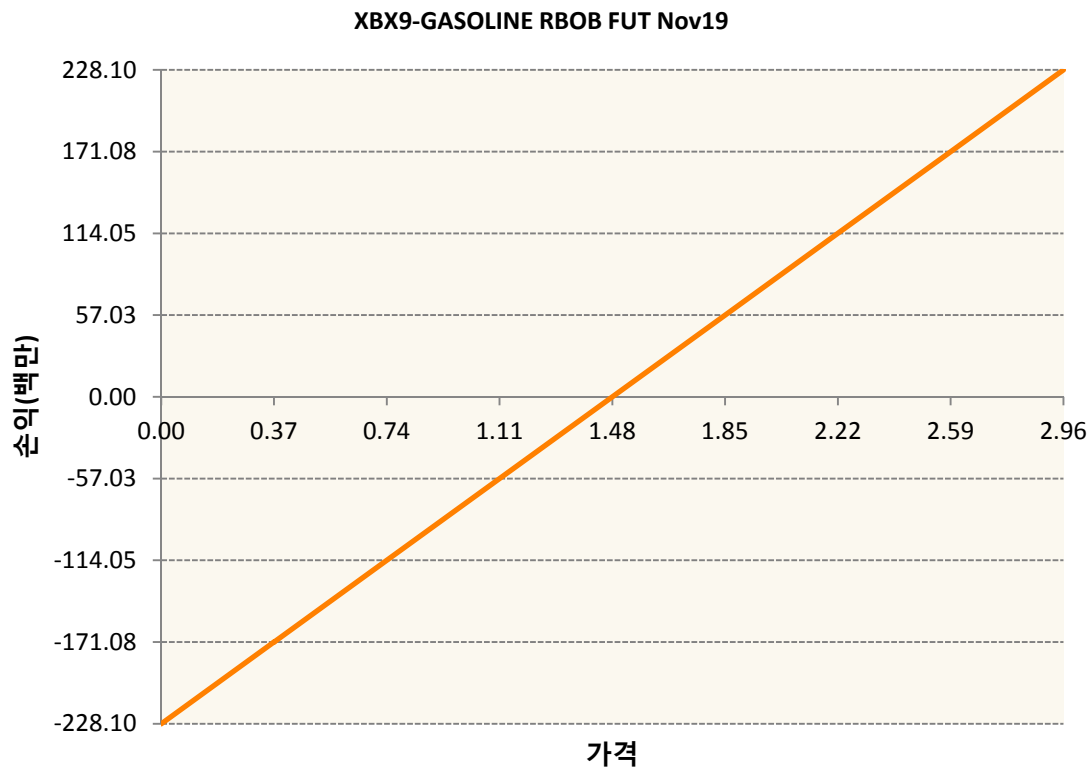


NGX19-NATURAL GAS FUTR Nov19



QSX9-Low Su Gasoil G Nov19





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---------------------------|-------------------------|----------|
| CLX9 | WTI CRUDE FUTURE Nov19 | 48 |
| COX9 | BRENT CRUDE FUTR Nov19 | 49 |
| HOX9 | Heating Oil | 15 |
| KR4175P800 | 2019-08 달러선물 | 10 |
| NGX19 | NATURAL GAS FUTR Nov19 | 43 |
| QSX9 | Low Su Gasoil G Nov19 | 16 |
| XBX9 | GASOLINE RBOB FUT Nov19 | 18 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
| | 361 |

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-08-14 |
| 기준일 | 2019-08-13 |

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

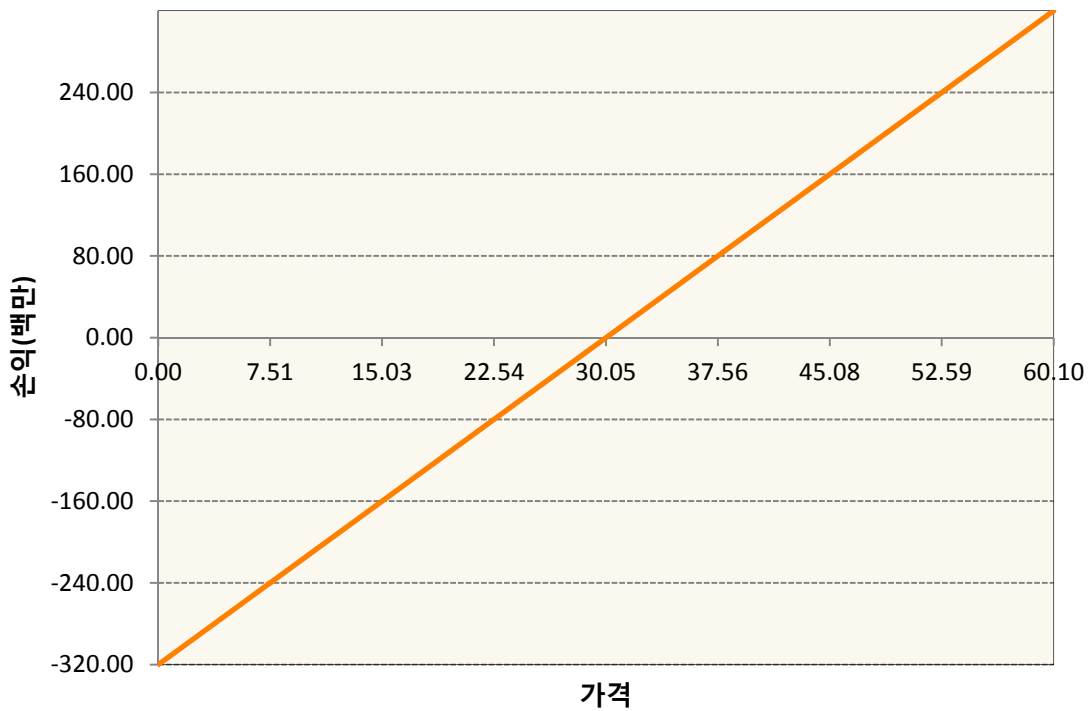
1. 계약금액

(단위:백만원)

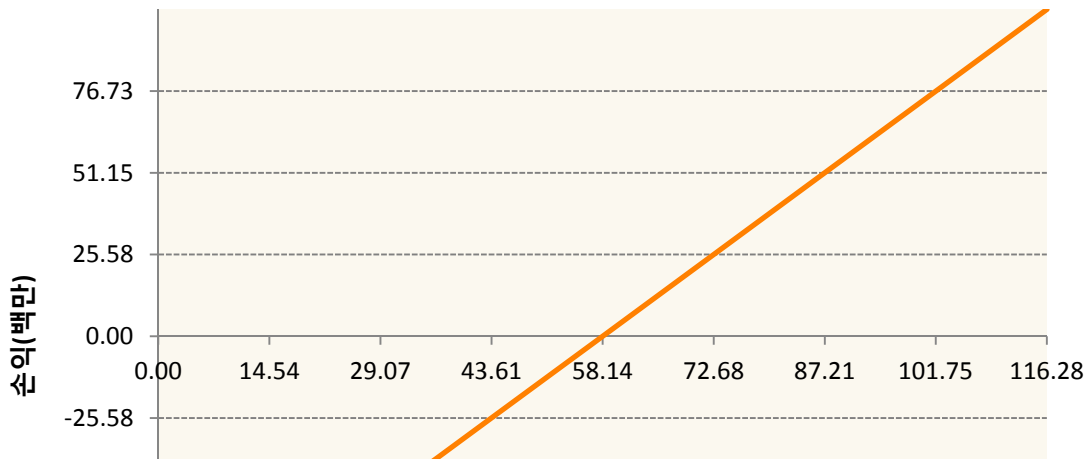
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,796 | 208 | 2,588 | |

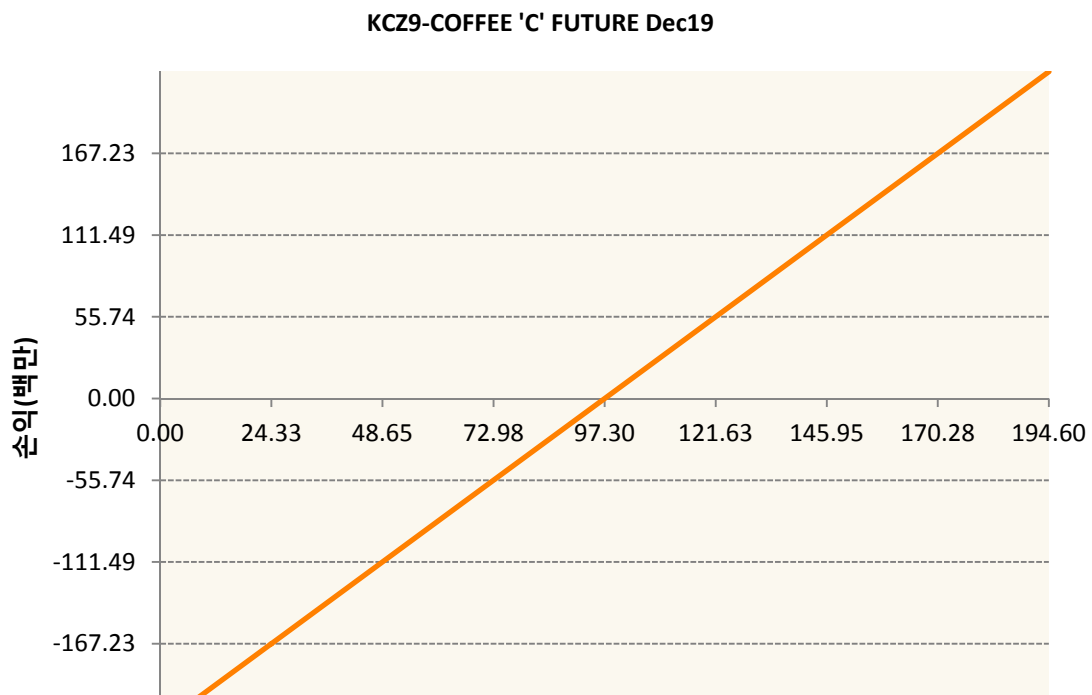
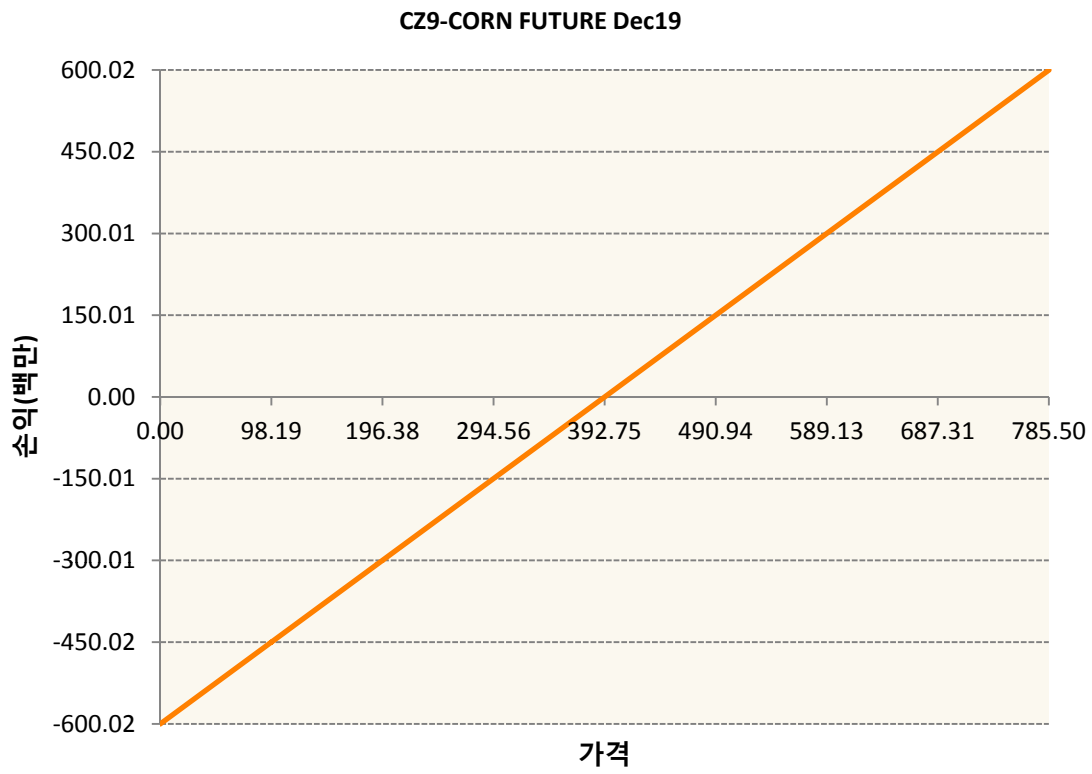
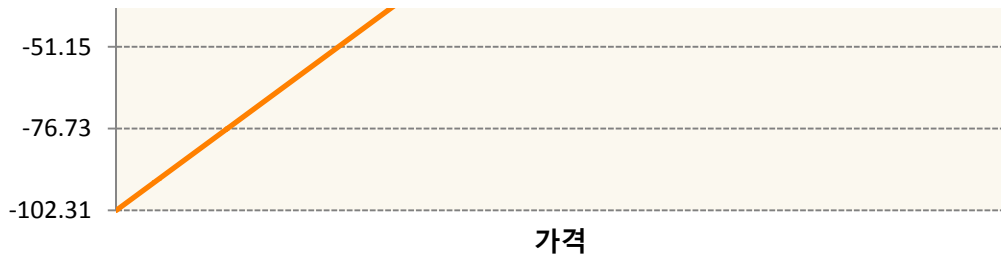
2. 만기시점의 손익구조

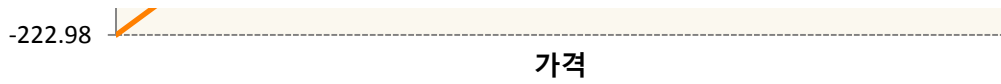
BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19



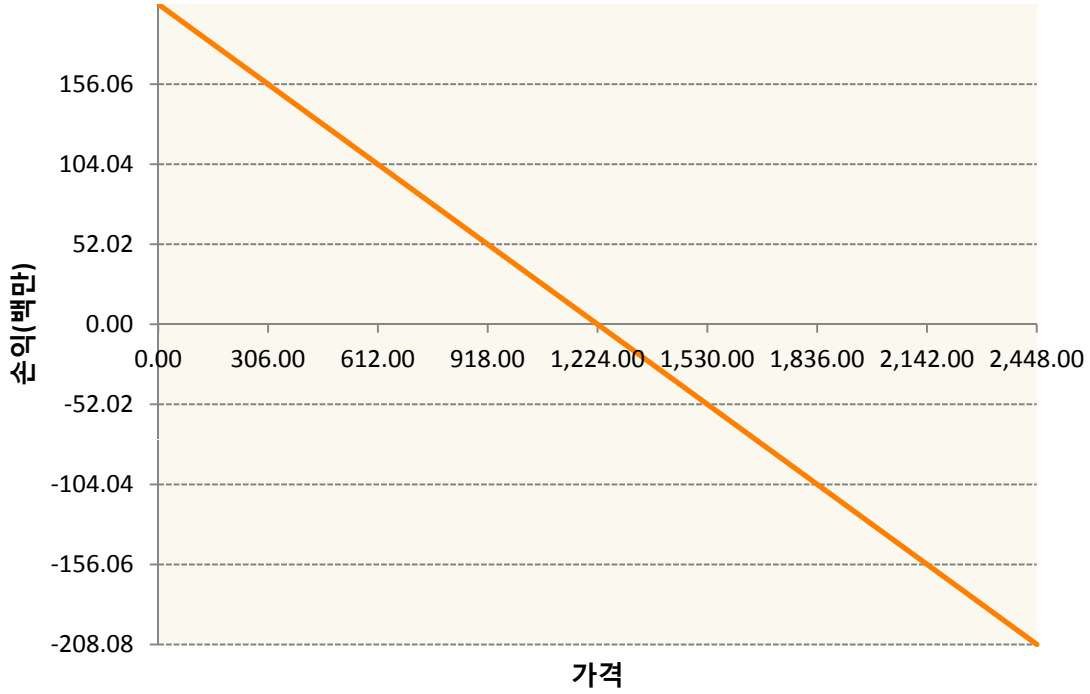
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



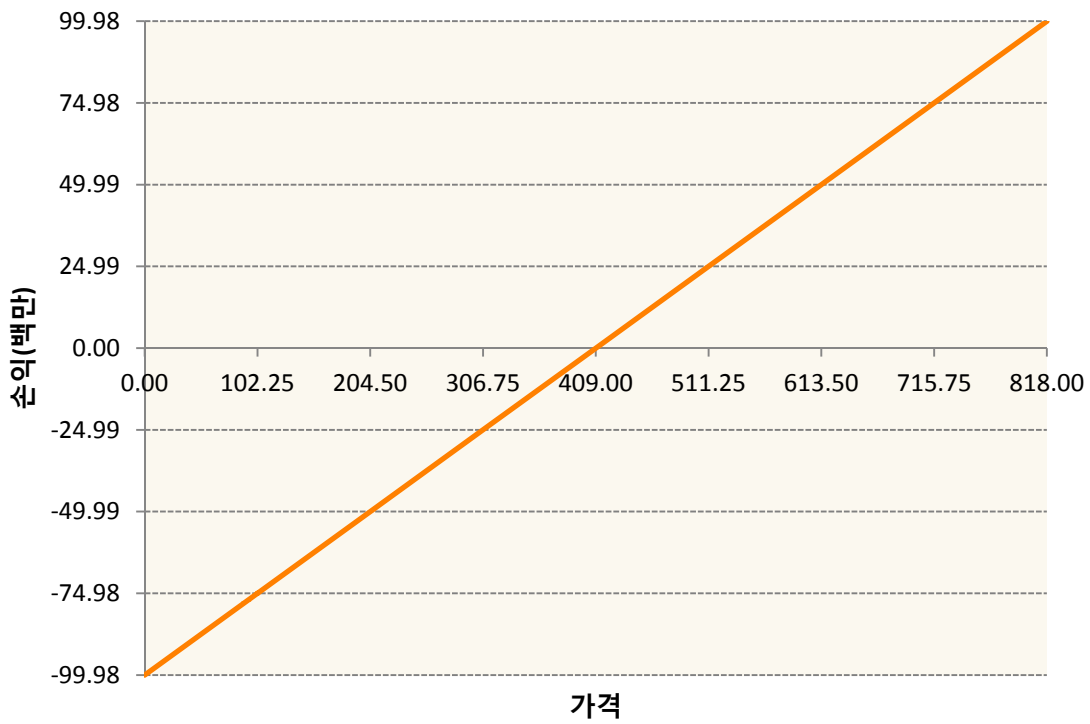




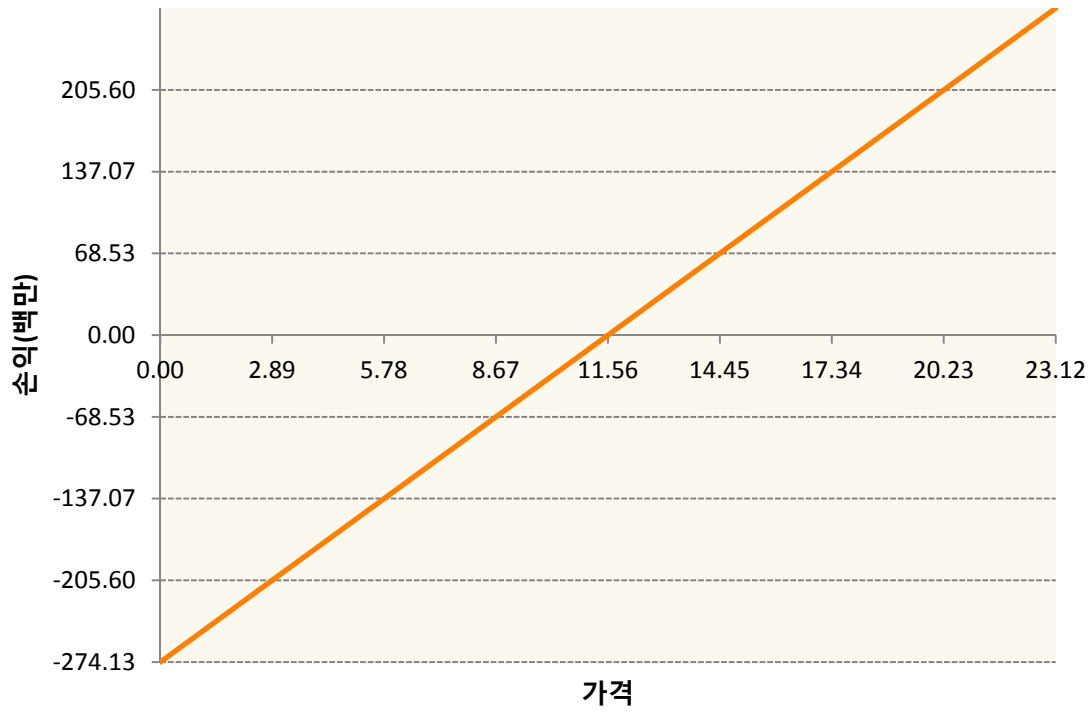
KR4175P80006-2019-08 달러선물



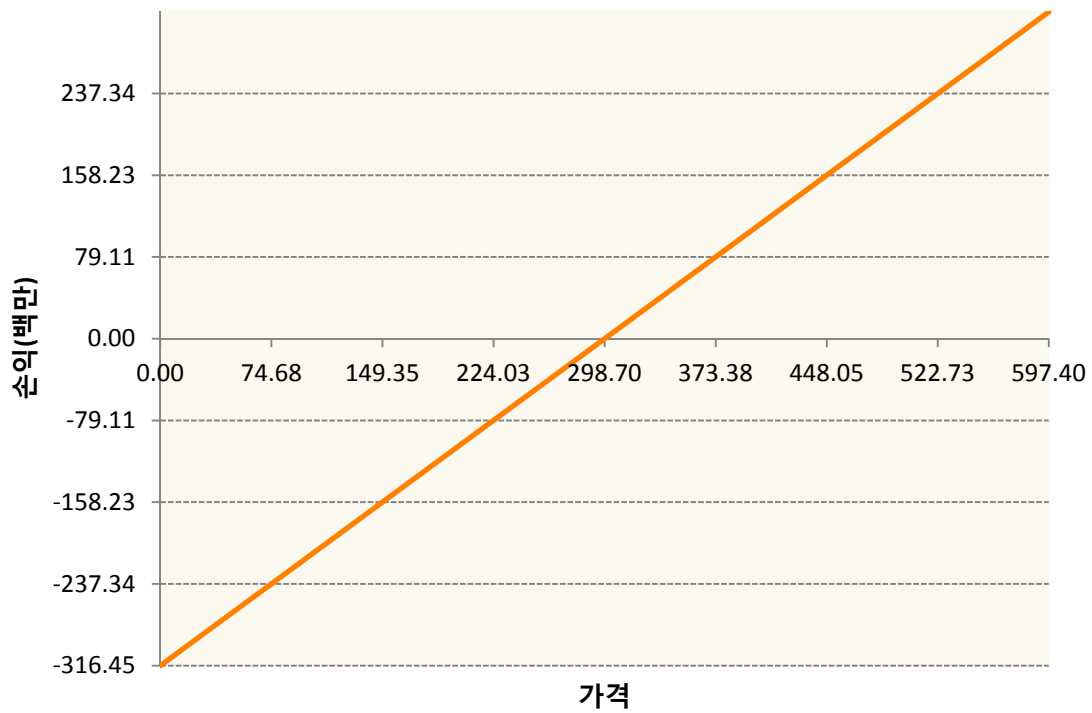
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

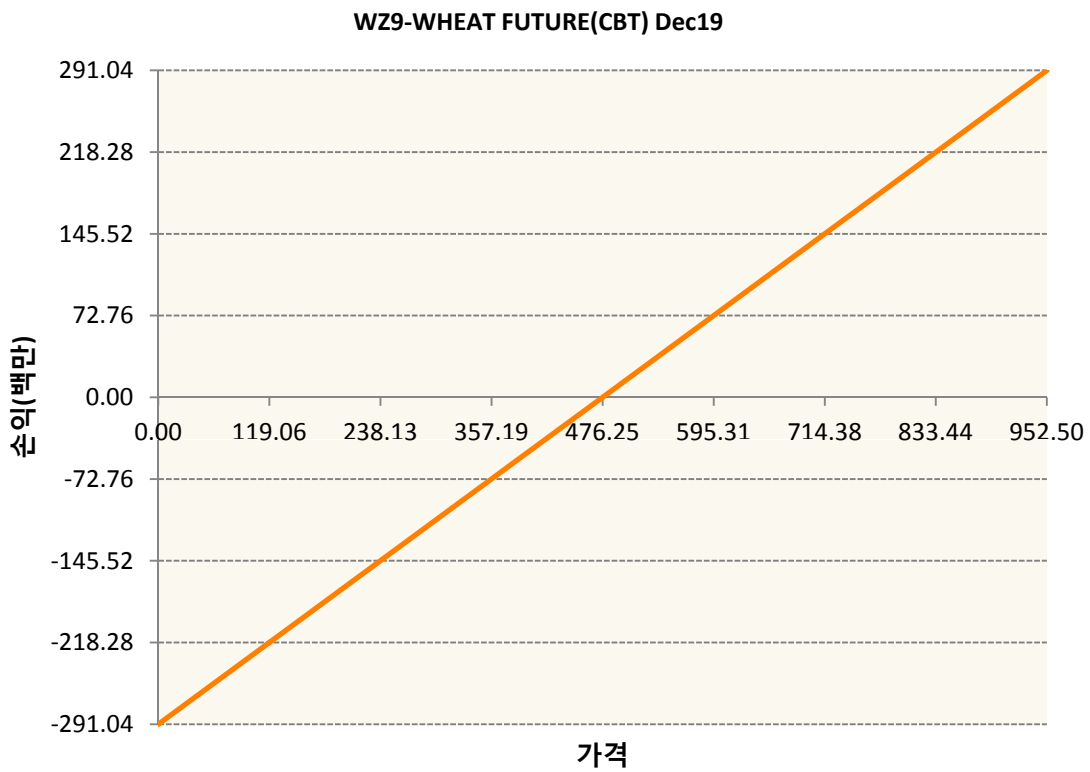
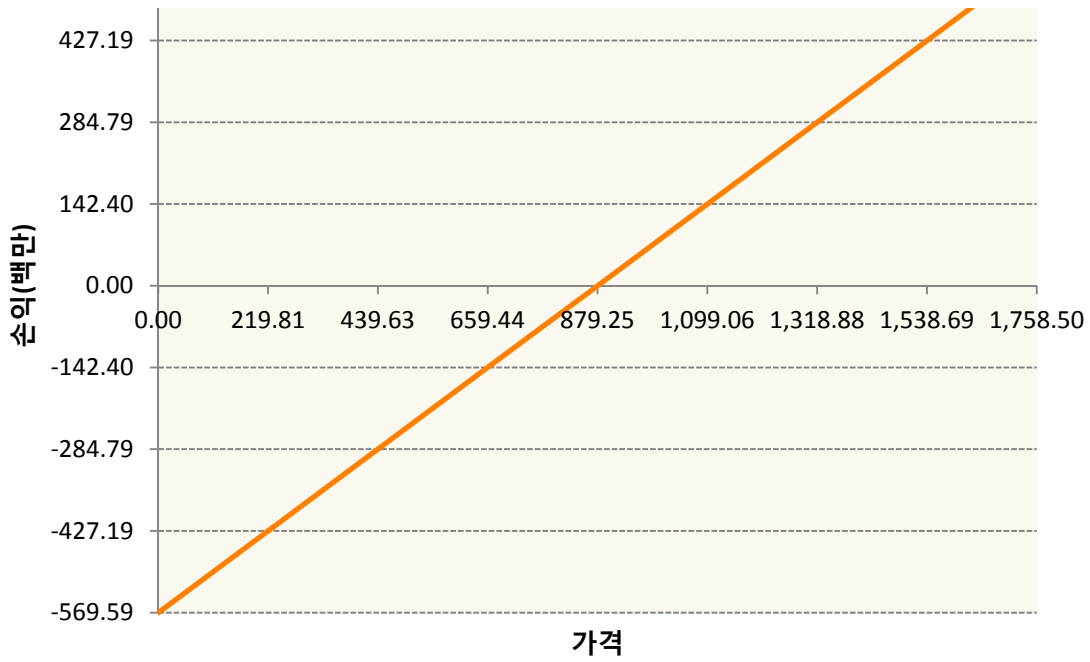


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------------|-------------------------|----|
| BOZ9 | SOYBEAN OIL FUTR Dec19 | 26 |
| CTZ9 | COTTON NO.2 FUTR Dec19 | 8 |
| CZ9 | CORN FUTURE Dec19 | 48 |
| KCZ9 | COFFEE 'C' FUTURE Dec19 | 18 |
| KR4175P800 | 2019-08 달러선물 | 17 |

| | | |
|------|-------------------------|----|
| KWZ9 | KC HRW WHEAT FUT Dec19 | 8 |
| SBV9 | SUGAR #11 (WORLD) Oct19 | 22 |
| SMZ9 | SOYBEAN MEAL FUTR Dec19 | 25 |
| SX9 | SOYBEAN FUTURE Nov19 | 46 |
| WZ9 | WHEAT FUTURE(CBT) Dec19 | 23 |

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

(단위:백만원)

249