

공시일	2019-04-17
기준일	2019-04-16

## 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)

95

공시일	2019-04-17
기준일	2019-04-16

## 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	13,865	0	13,865	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0( 신한MXWO 미래S190222

1,157

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

680

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-04-17
기준일	2019-04-16

## 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)	361
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	99
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	169

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

<b>988</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-04-17
기준일	2019-04-16

## 유로인덱스모(주식-파생형)

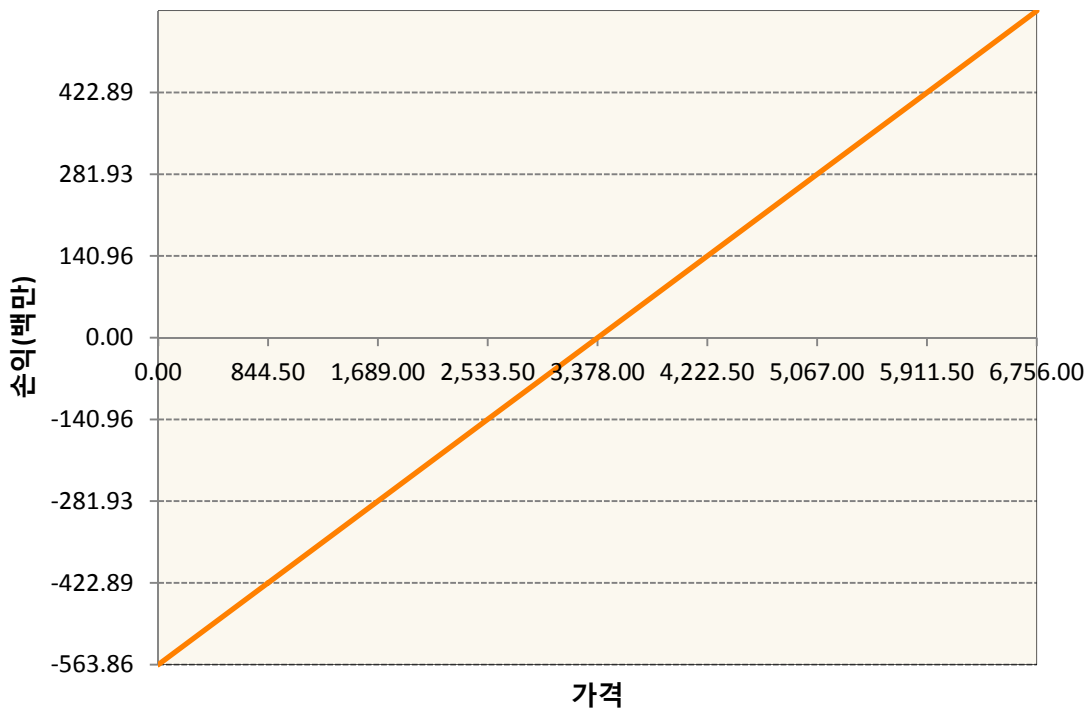
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	564	0	564	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	45
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

32
----

공시일	2019-04-17
기준일	2019-04-16

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

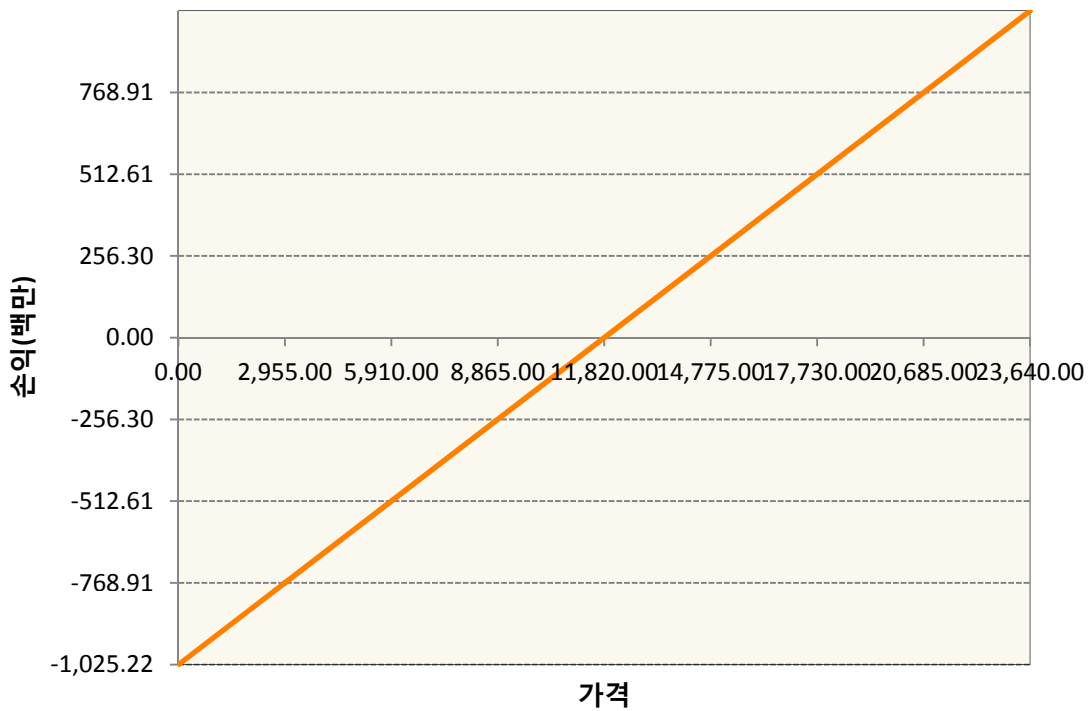
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,025	0	1,025	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCJ9-HSCEI Futures Apr19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ9	HSCEI Futures Apr19	82
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

84

공시일	2019-04-17
기준일	2019-04-16

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

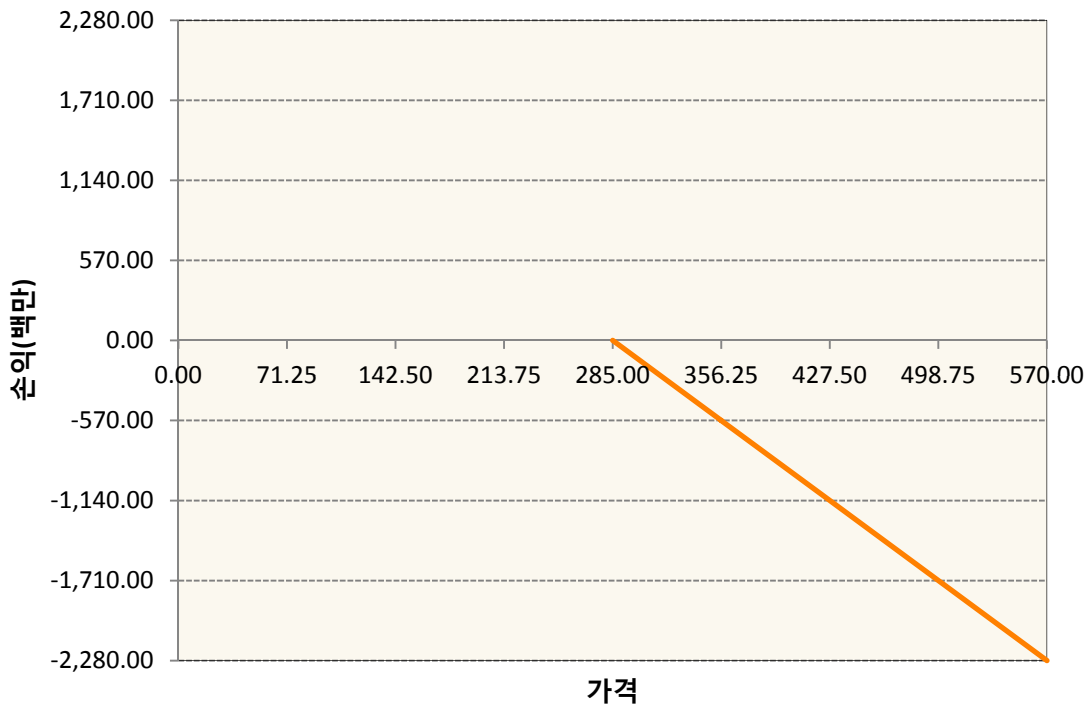
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

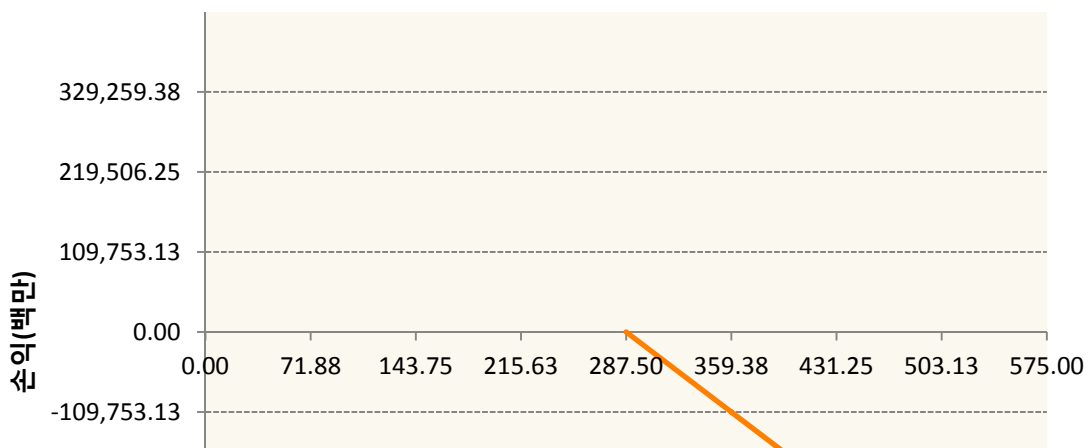
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	674,730	-674,730	장내

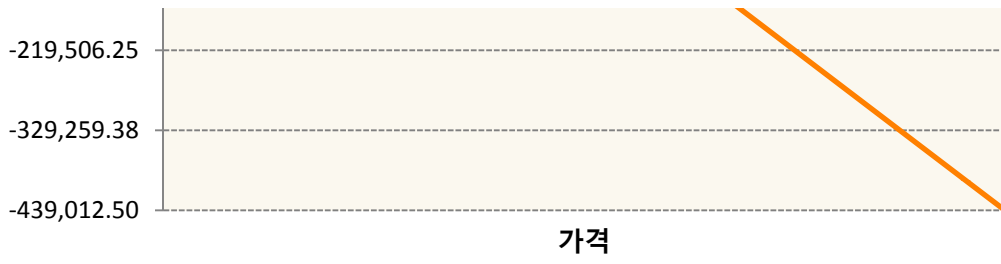
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P52850-2019-05 콜285

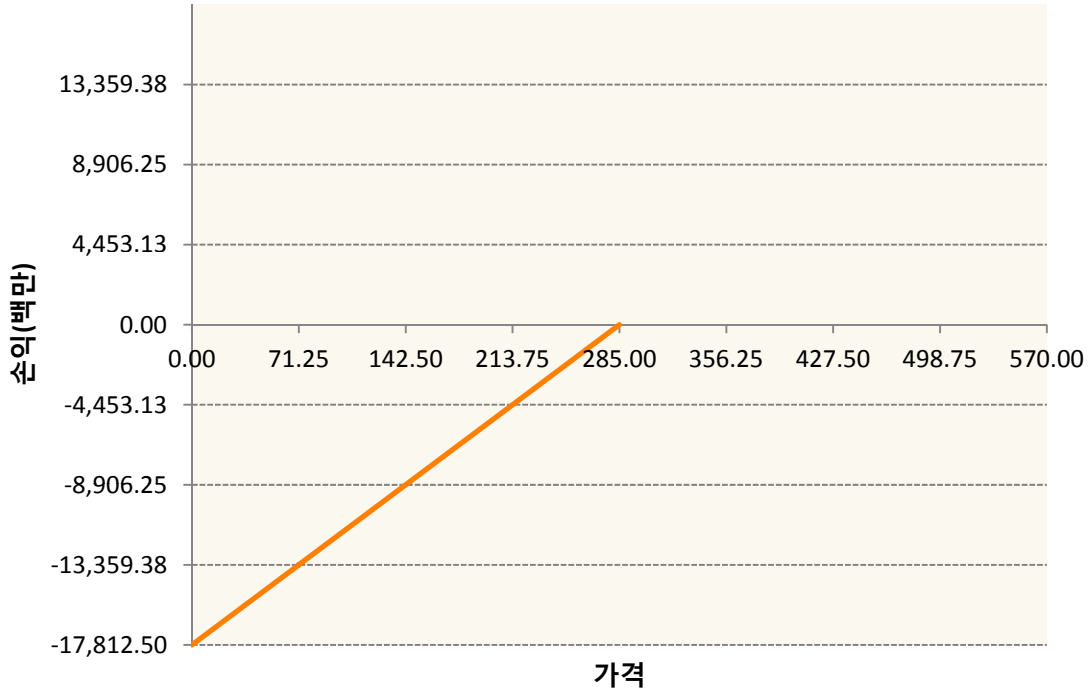


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

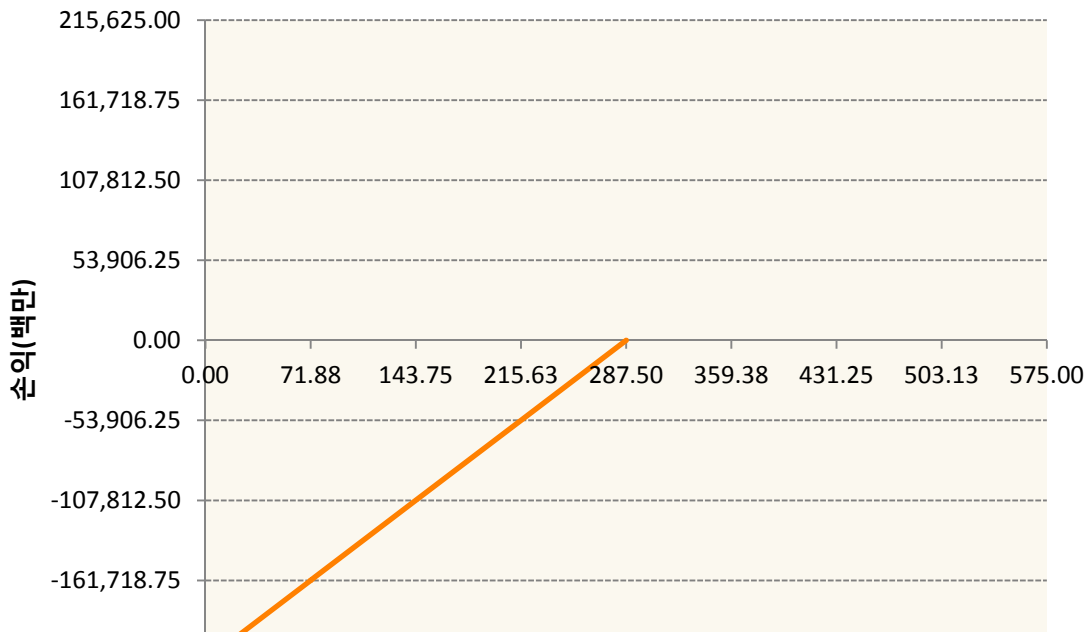




**KR4301P52858-2019-05 풋285**



**KR4301P52874-2019-05 풋287.5**



-215,625.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P52850		2019-05 콜285						159
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	76	74	72	70	68	65	62	
-5.33%	67	64	61	57	53	50	46	
-2.67%	47	43	39	34	30	25	21	
0%	13	8	4	0	-4	-9	-13	
2.67%	-35	-38	-41	-44	-48	-52	-55	
5.33%	-92	-93	-95	-97	-99	-102	-105	
8.00%	-152	-152	-153	-154	-155	-157	-159	
KR4201P52876		2019-05 콜287.5						29,202
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	12,473	12,229	11,924	11,564	11,154	10,702	10,212	
-5.33%	11,285	10,750	10,169	9,552	8,905	8,233	7,541	
-2.67%	8,246	7,446	6,637	5,821	5,000	4,174	3,346	
0%	2,533	1,692	848	0	-850	-1,702	-2,555	
2.67%	-5,858	-6,496	-7,172	-7,878	-8,607	-9,355	-10,119	
5.33%	-16,158	-16,517	-16,941	-17,419	-17,946	-18,512	-19,113	
8.00%	-27,450	-27,604	-27,816	-28,085	-28,408	-28,782	-29,202	
KR4301P52858		2019-05 풋285						1,025
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,011	-1,012	-1,013	-1,015	-1,018	-1,021	-1,025	
-5.33%	-539	-546	-554	-563	-573	-584	-596	
-2.67%	-151	-168	-186	-204	-222	-240	-258	
0%	44	30	15	0	-16	-32	-48	
2.67%	89	85	80	74	67	59	50	
5.33%	93	93	92	91	89	86	83	
8.00%	93	93	93	93	93	92	91	
KR4301P52874		2019-05 풋287.5						13,499
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-13,398	-13,401	-13,408	-13,420	-13,438	-13,465	-13,499	
-5.33%	-7,651	-7,696	-7,757	-7,832	-7,921	-8,022	-8,133	
-2.67%	-2,512	-2,691	-2,878	-3,071	-3,267	-3,468	-3,671	
0%	630	423	213	0	-215	-431	-649	
2.67%	1,591	1,515	1,422	1,313	1,192	1,059	916	

5.33%	1,715	1,705	1,688	1,661	1,623	1,574	1,515
8.00%	1,722	1,721	1,720	1,716	1,709	1,698	1,682

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

(단위:백만원)

**45,383**

공시일	2019-04-17
기준일	2019-04-16

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

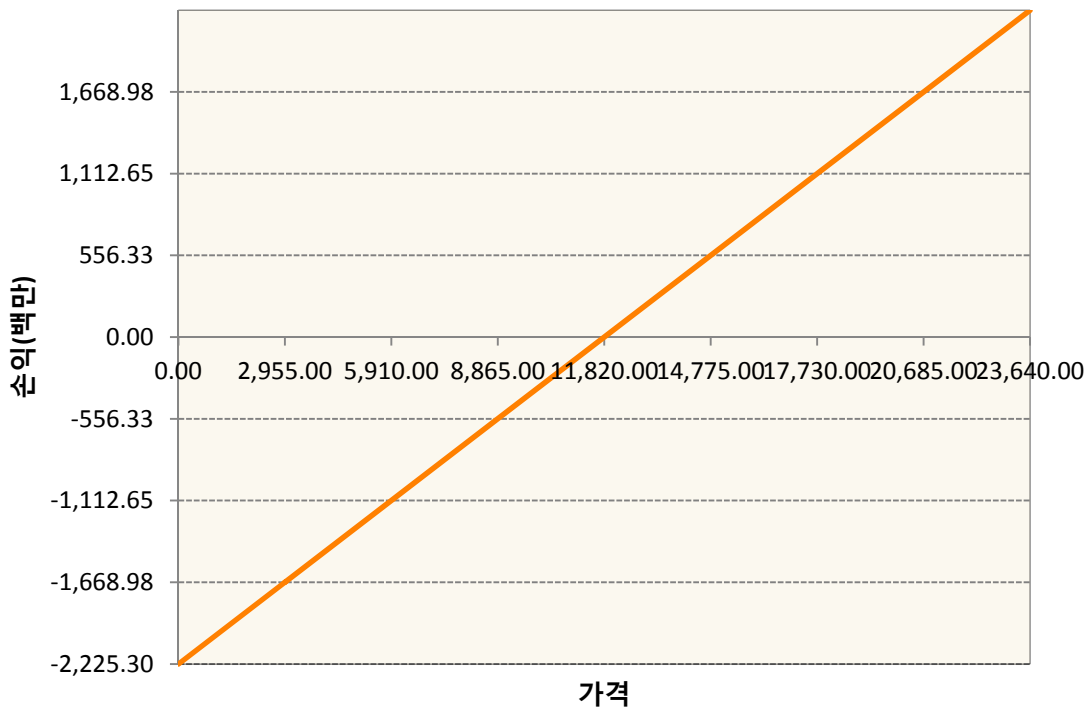
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

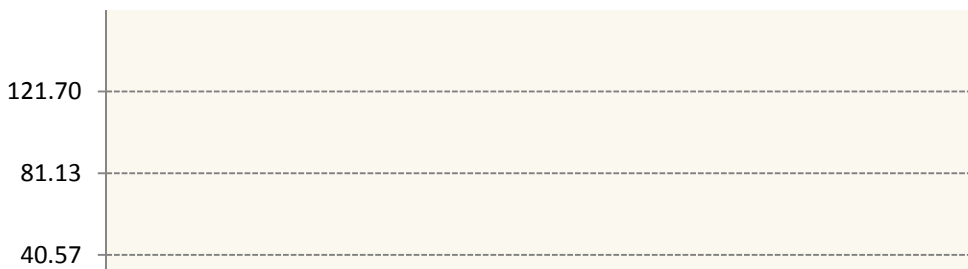
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,225	0	2,225	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,563	-5,563	장내
누계	통화	선도	0	3,042	-3,042	장외

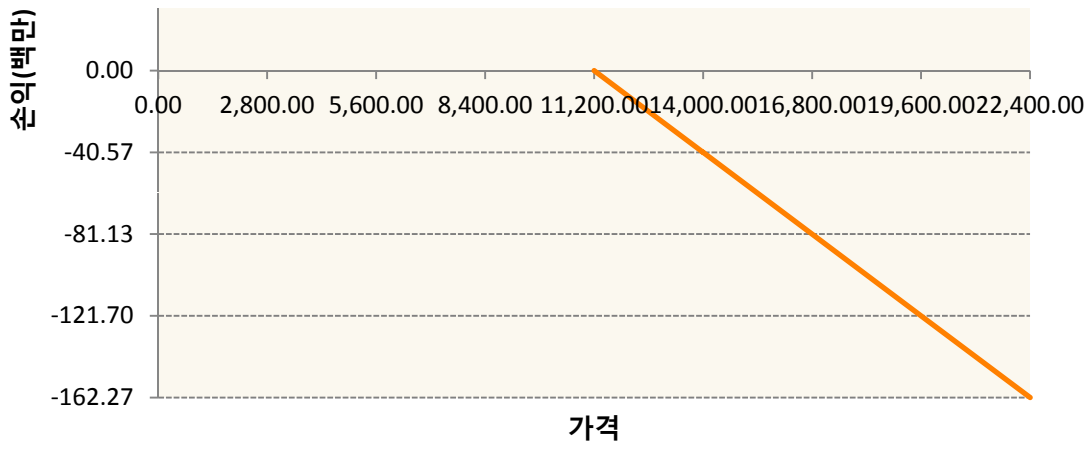
### 2. 만기시점의 손익구조

HCJ9-HSCEI Futures Apr19

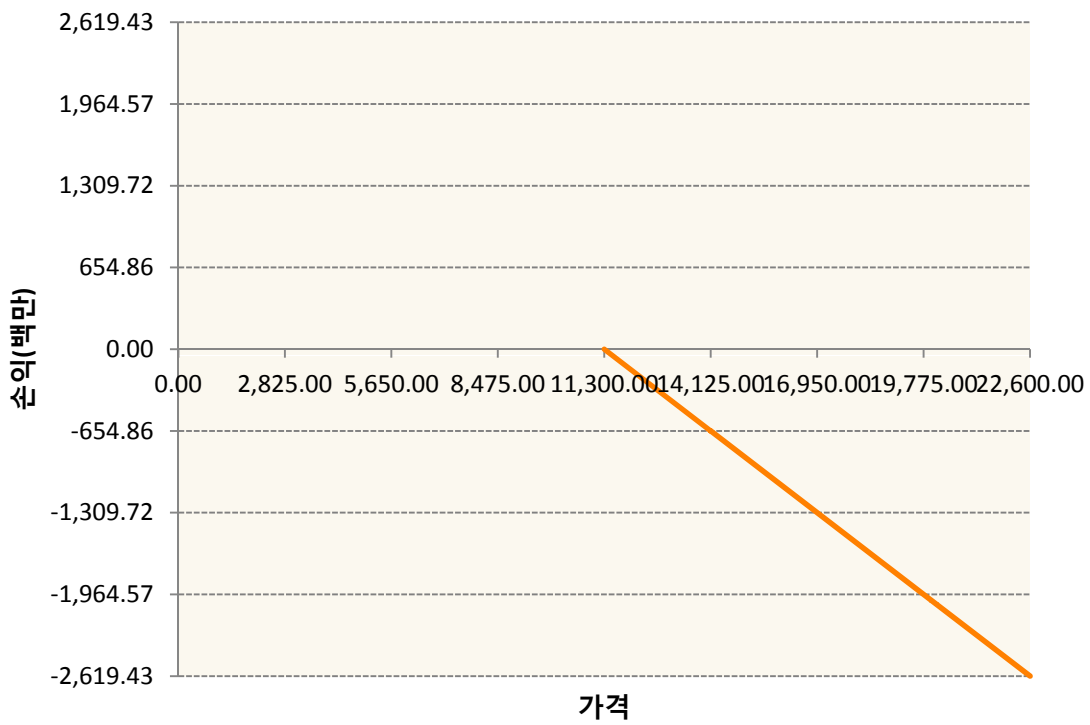


OHHIJ9-C112-HSCEI

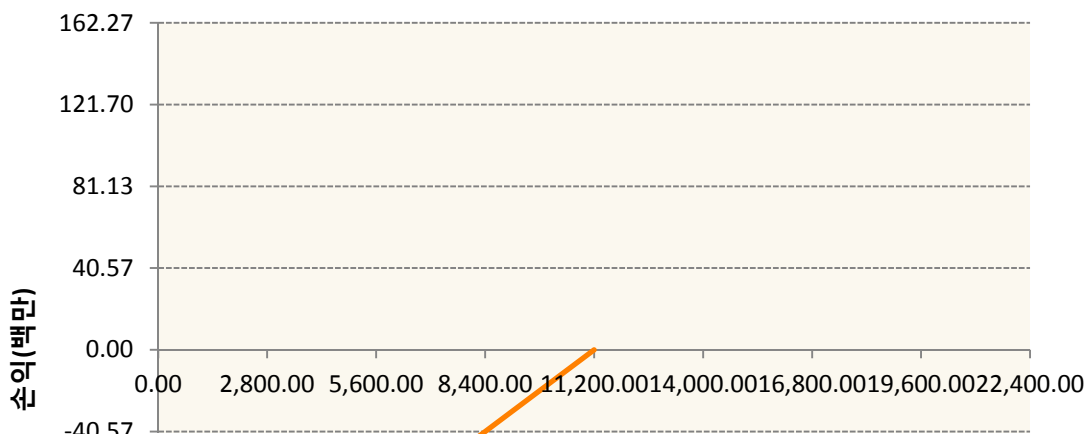


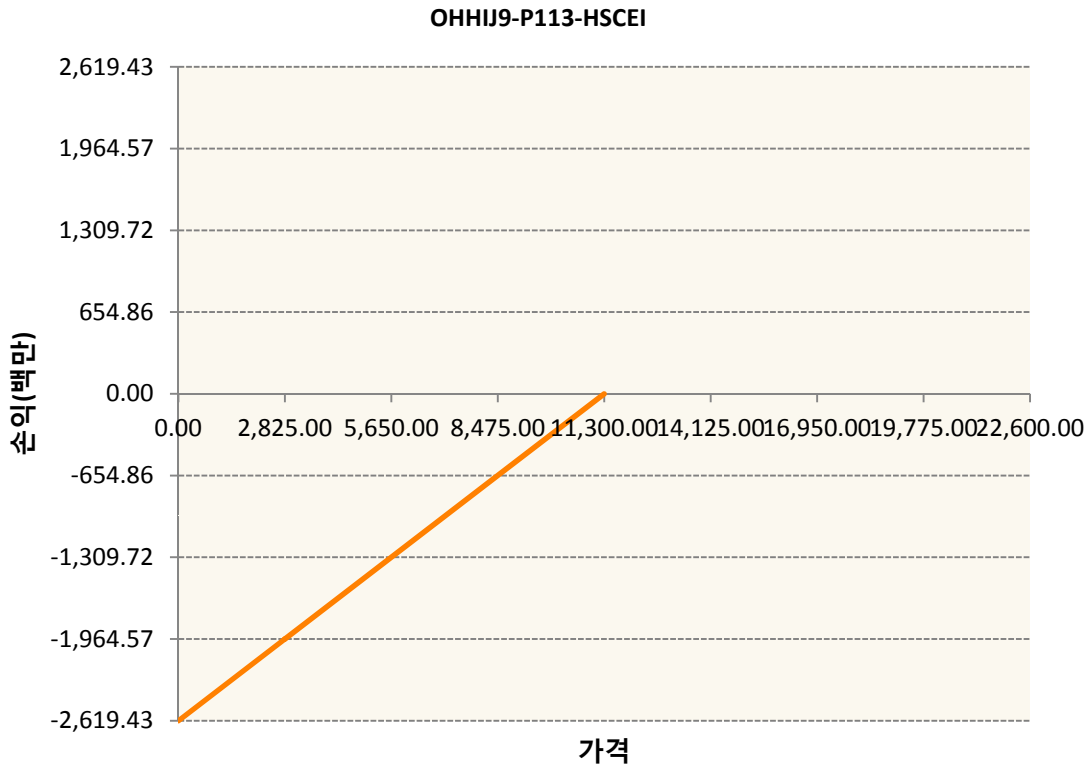
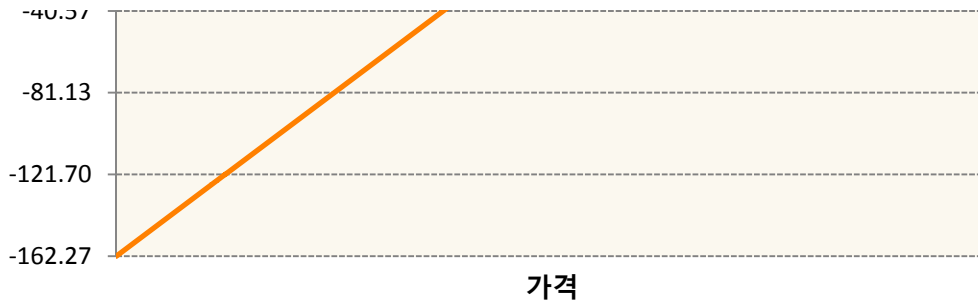


**OHHIJ9-C113-HSCEI**



**OHHIJ9-P112-HSCEI**





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	220
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	23
HCJ9 HSCEI Futures Apr19	178
OHHIJ9-C11 HSCEI	13
OHHIJ9-C11 HSCEI	210
OHHIJ9-P11: HSCEI	13
OHHIJ9-P11: HSCEI	210

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	721

공시일	2019-04-17
기준일	2019-04-16

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

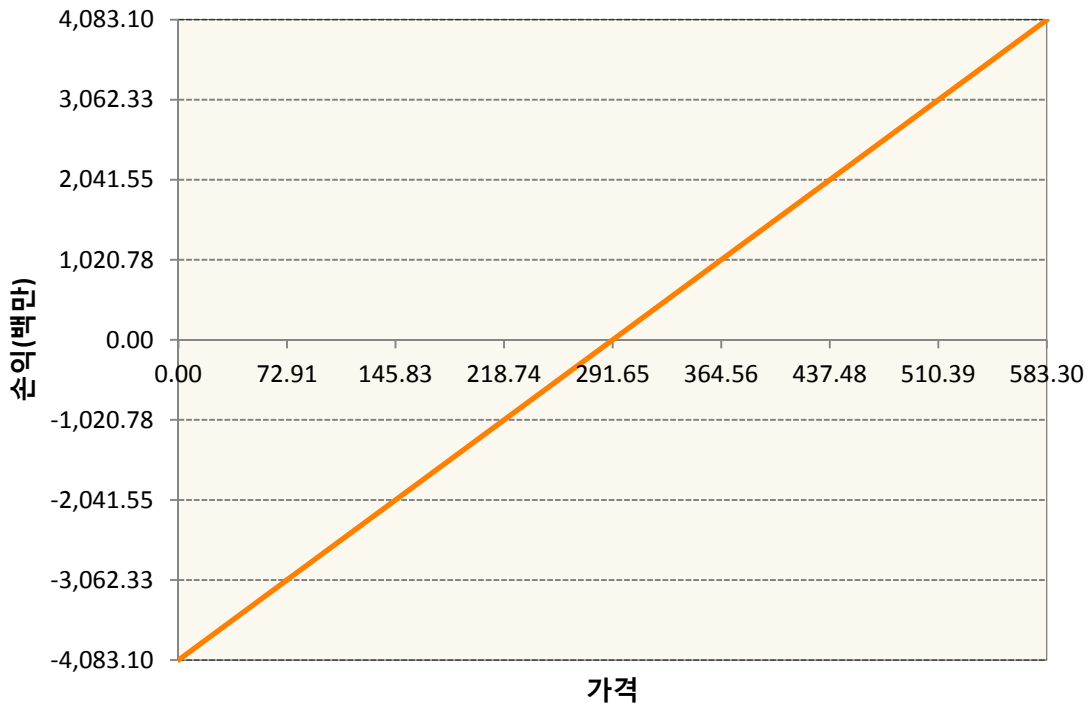
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

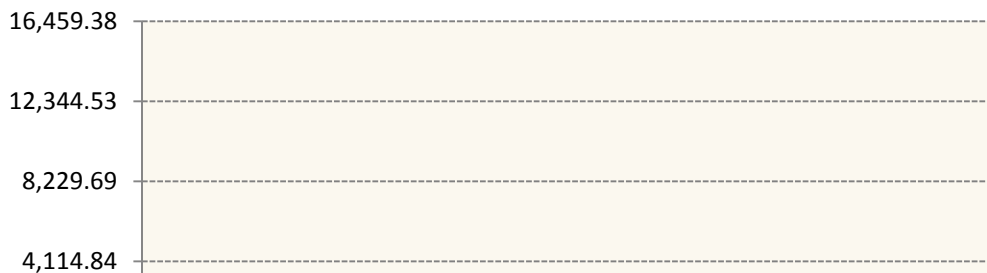
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,083	0	4,083	장내
누계	유가증권	스왑	35,836	0	35,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	33,700	-33,700	장내

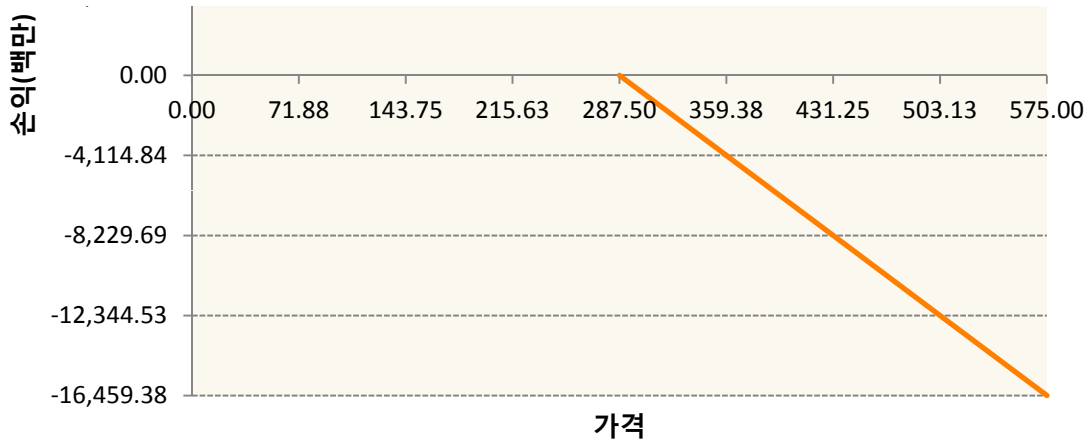
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

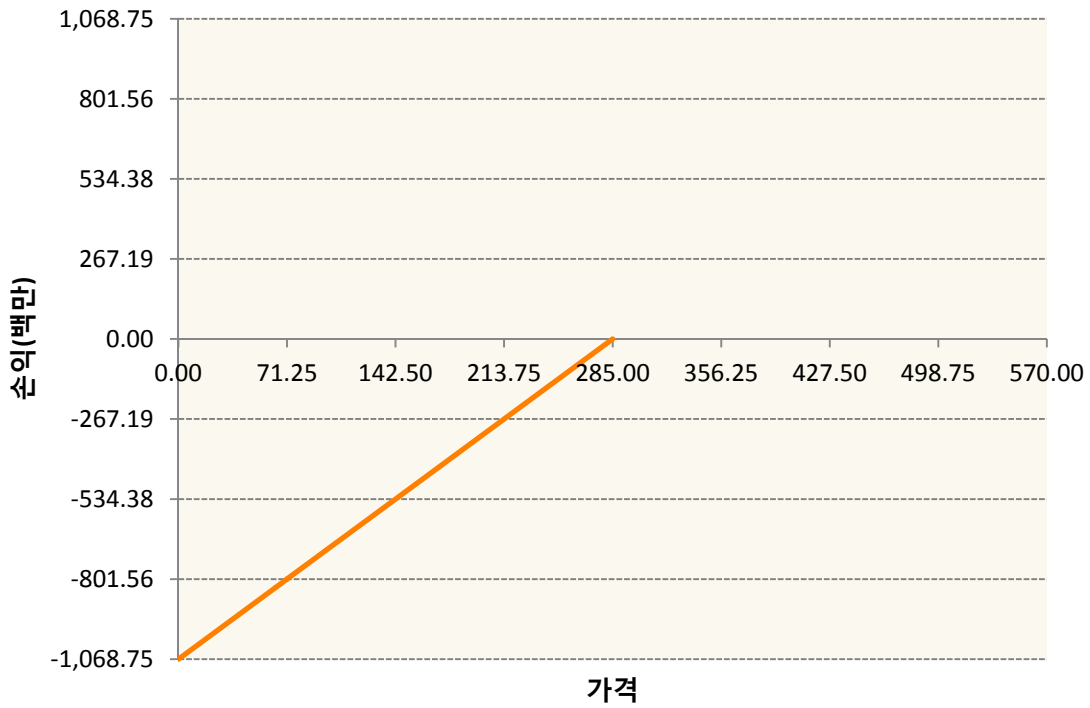


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

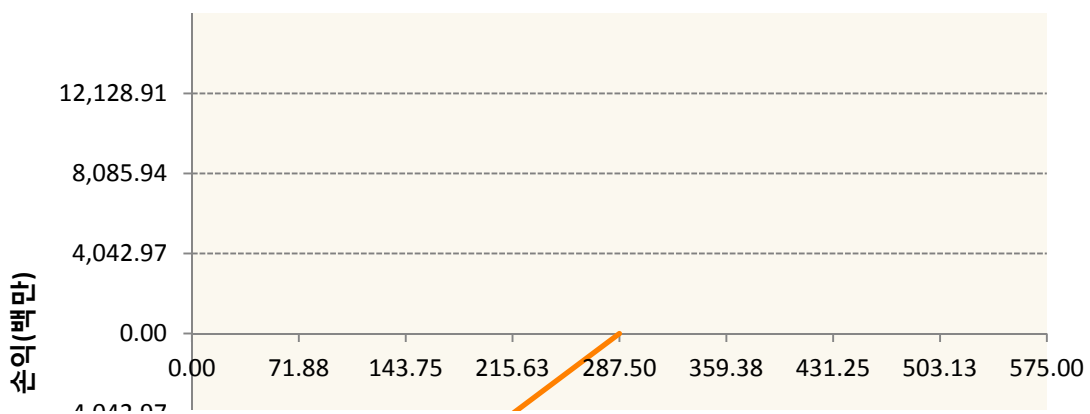




KR4301P52858-2019-05 풋285



KR4301P52874-2019-05 풋287.5





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,438
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,438	-2,438	-2,438	-2,438	-2,438	-2,438	-2,438	
-5.33%	-1,626	-1,626	-1,626	-1,626	-1,626	-1,626	-1,626	
-2.67%	-813	-813	-813	-813	-813	-813	-813	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	813	813	813	813	813	813	813	
5.33%	1,626	1,626	1,626	1,626	1,626	1,626	1,626	
8.00%	2,438	2,438	2,438	2,438	2,438	2,438	2,438	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						592
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-592	-592	-592	-592	-592	-592	-592	
-5.33%	-395	-395	-395	-395	-395	-395	-395	
-2.67%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	197	197	197	197	197	197	197	
5.33%	395	395	395	395	395	395	395	
8.00%	592	592	592	592	592	592	592	
KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						325
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-325	-325	-325	-325	-325	-325	-325	
-5.33%	-217	-217	-217	-217	-217	-217	-217	
-2.67%	-108	-108	-108	-108	-108	-108	-108	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	108	108	108	108	108	108	108	
5.33%	217	217	217	217	217	217	217	
8.00%	325	325	325	325	325	325	325	
KR4201P52876		2019-05 콜287.5						1,095
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	468	458	447	434	418	401	383
-5.33%	423	403	381	358	334	309	283
-2.67%	309	279	249	218	187	157	125
0%	95	63	32	0	-32	-64	-96
2.67%	-220	-244	-269	-295	-323	-351	-379
5.33%	-606	-619	-635	-653	-673	-694	-717
8.00%	-1,029	-1,035	-1,043	-1,053	-1,065	-1,079	-1,095
KR4301P52858                      2019-05 풋285							62
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-62
-5.33%	-32	-33	-33	-34	-34	-35	-36
-2.67%	-9	-10	-11	-12	-13	-14	-16
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	5	5	5	4	4	4	3
5.33%	6	6	6	5	5	5	5
8.00%	6	6	6	6	6	6	5
KR4301P52874                      2019-05 풋287.5							1,012
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,005	-1,005	-1,006	-1,006	-1,008	-1,010	-1,012
-5.33%	-574	-577	-582	-587	-594	-602	-610
-2.67%	-188	-202	-216	-230	-245	-260	-275
0%	47	32	16	0	-16	-32	-49
2.67%	119	114	107	99	89	79	69
5.33%	129	128	127	125	122	118	114
8.00%	129	129	129	129	128	127	126

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

(단위:백만원)

**5,556**

공시일	2019-04-17
기준일	2019-04-16

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

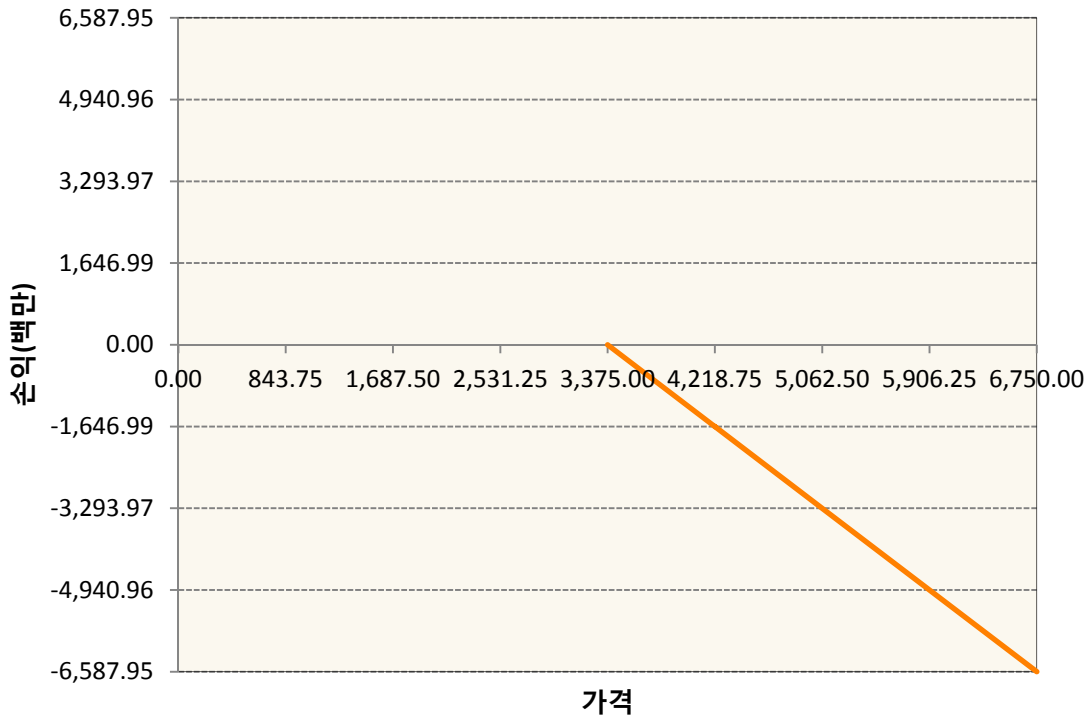
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

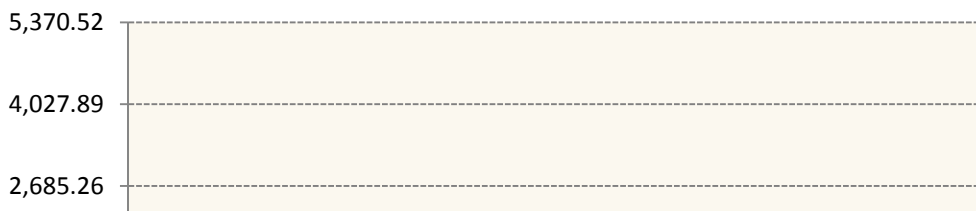
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,205	0	5,205	
누계	유가증권	스왑	60,628	0	60,628	장외
누계	유가증권	옵션	0	23,917	-23,917	장내
누계	통화	선도	0	17,979	-17,979	장외

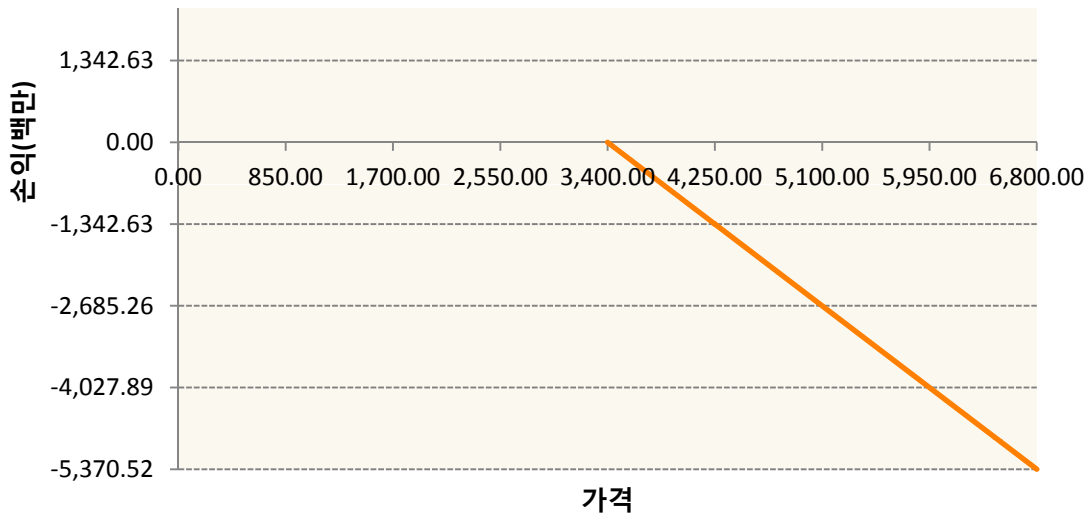
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXJ9-C3375-EURO STOXX 50**

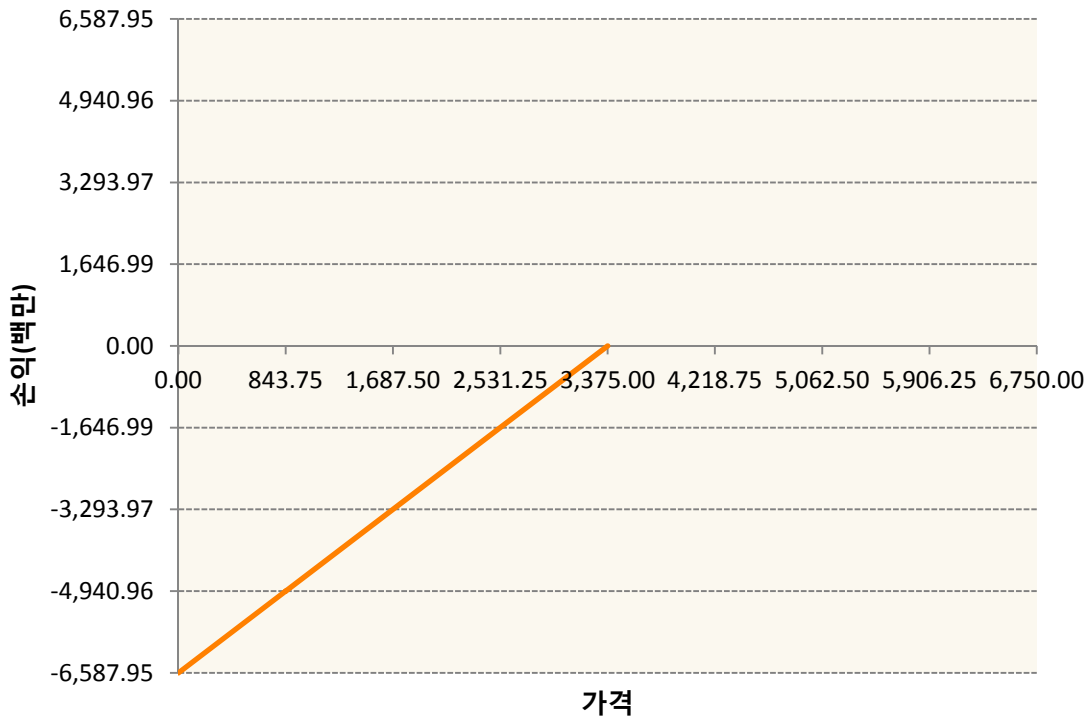


**OESXJ9-C3400-EURO STOXX 50**

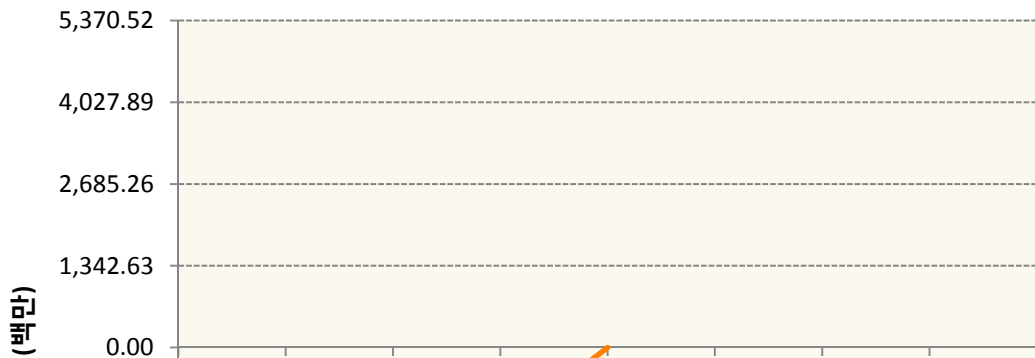


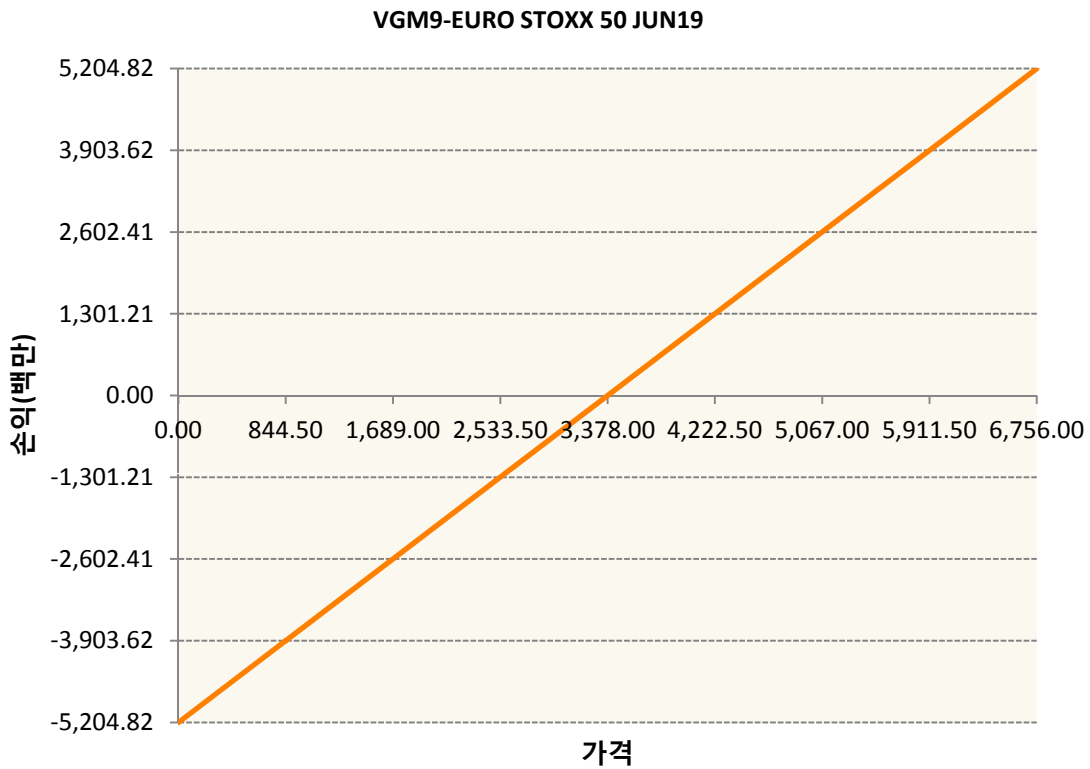
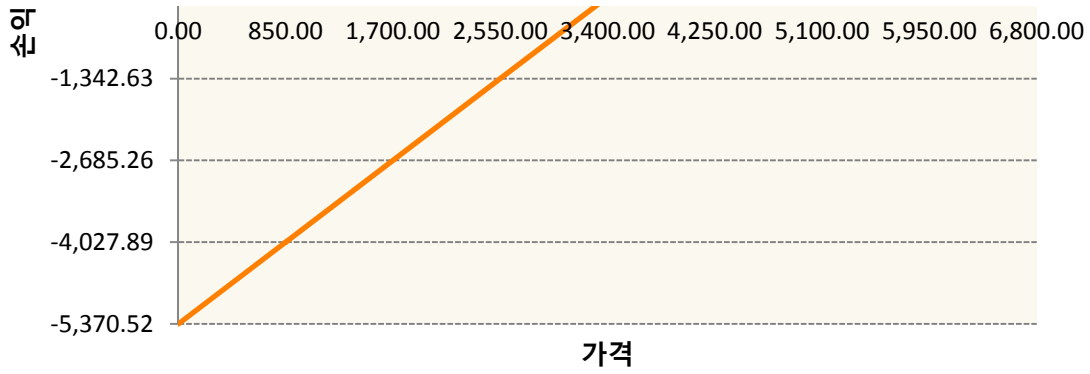


OESXJ9-P3375-EURO STOXX 50



OESXJ9-P3400-EURO STOXX 50





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	209
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	411
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	822
FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E	205
OESXJ9-C33 EURO STOXX 50	527
OESXJ9-C34 EURO STOXX 50	430
OESXJ9-P33 EURO STOXX 50	527
OESXJ9-P34 EURO STOXX 50	430
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	416

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

(단위:백만원)

2,600



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

(단위:백만원)

1,111



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

(단위:백만원)

95



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

(단위:백만원)

138

공시일	2019-04-17
기준일	2019-04-16

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

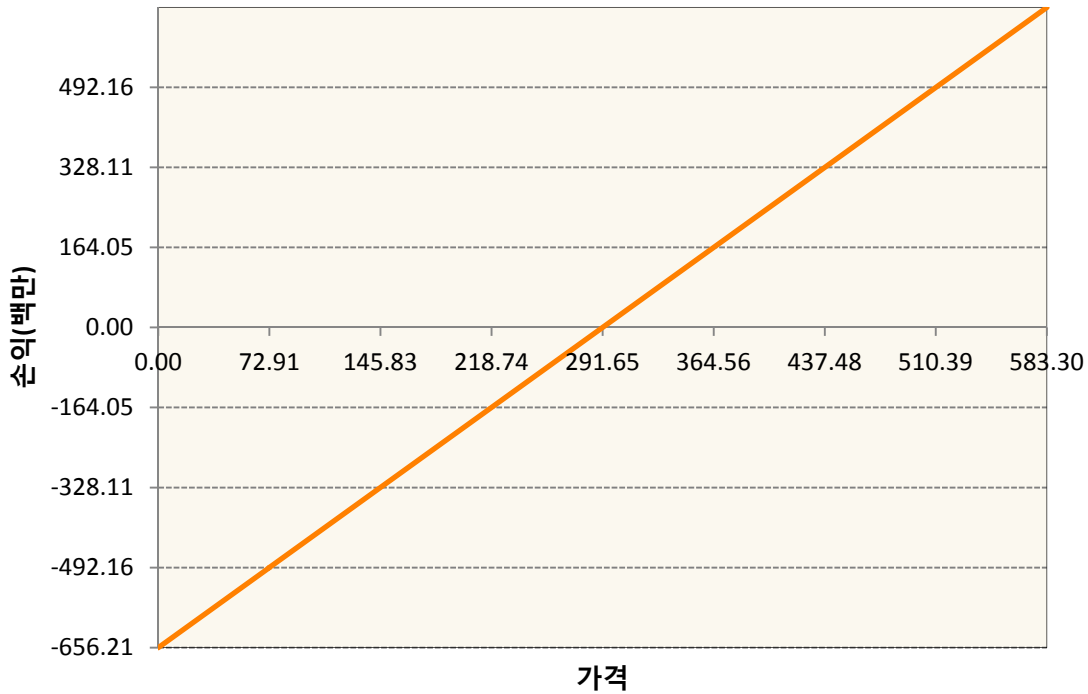
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	656	0	656	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						52
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52	
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	
-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%	35	35	35	35	35	35	35	
8.00%	52	52	52	52	52	52	52	

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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-04-17
기준일	2019-04-16

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

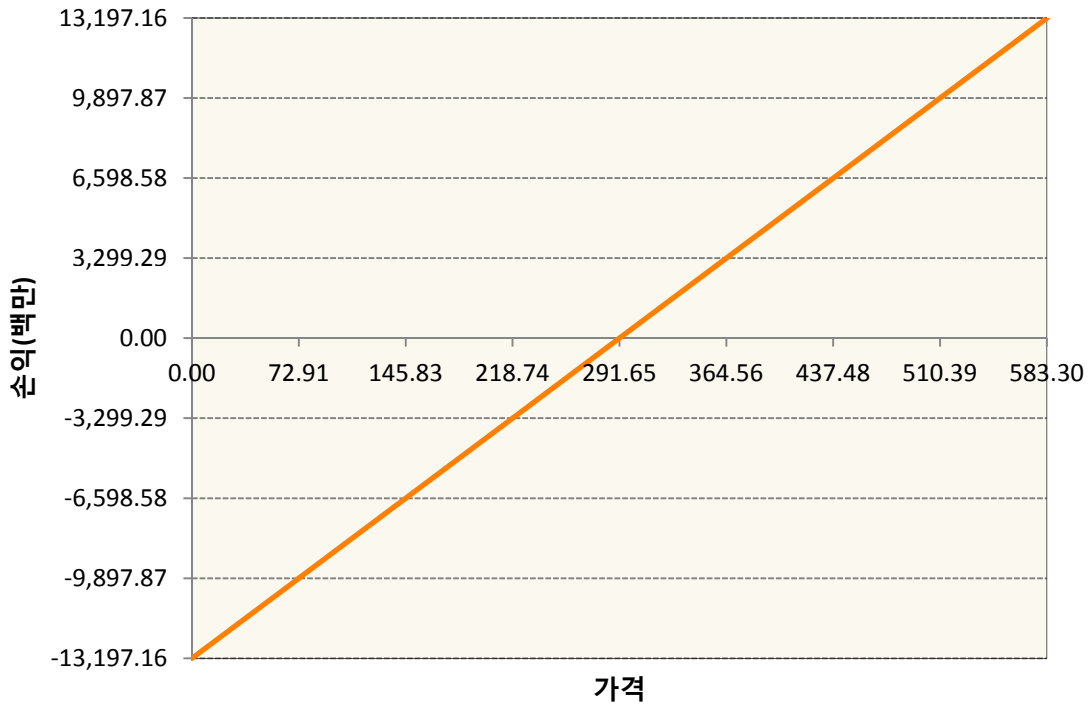
### 1. 계약금액

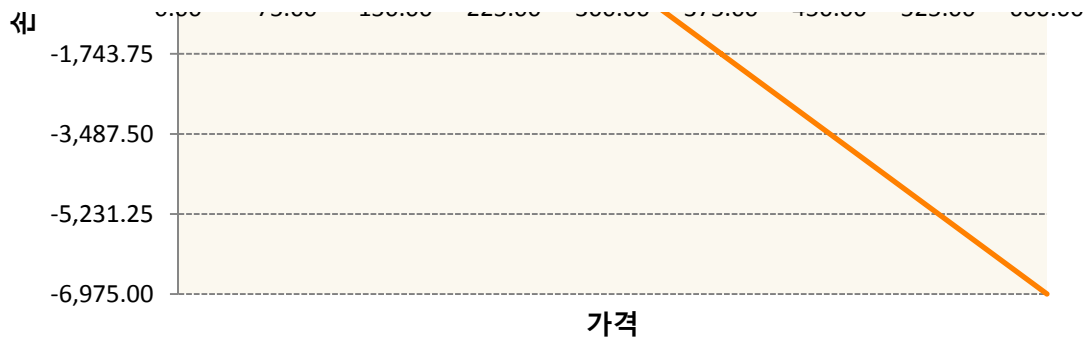
(단위:백만원)

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	13,197	0	13,197	장내
누계	유가증권	옵션	1,437	24,671	-23,234	장내

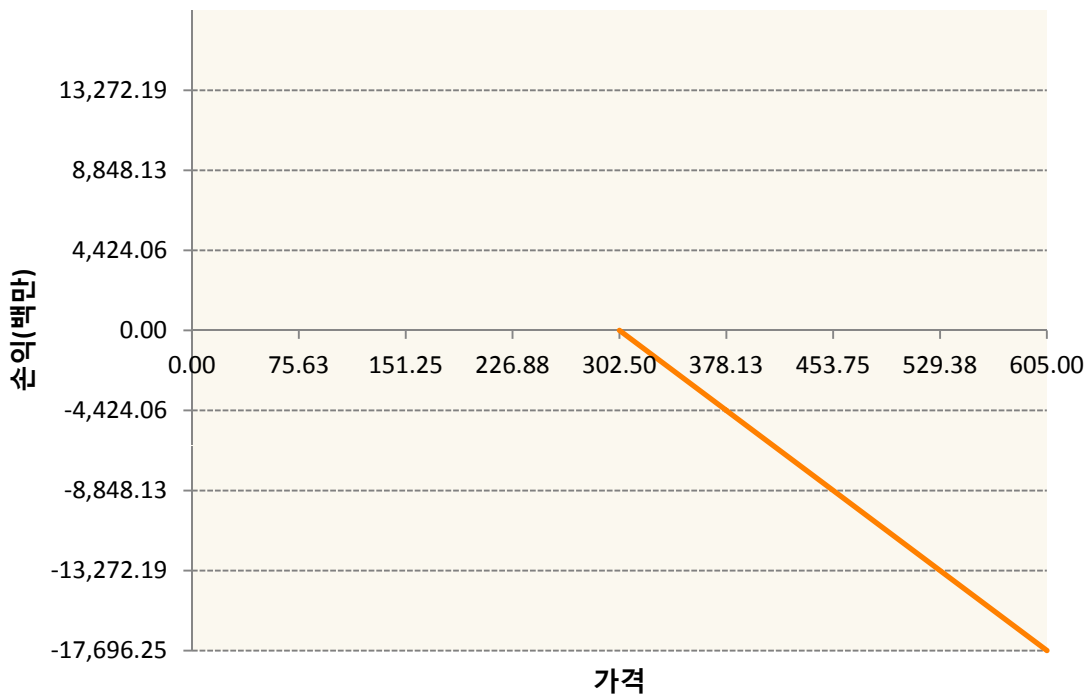
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

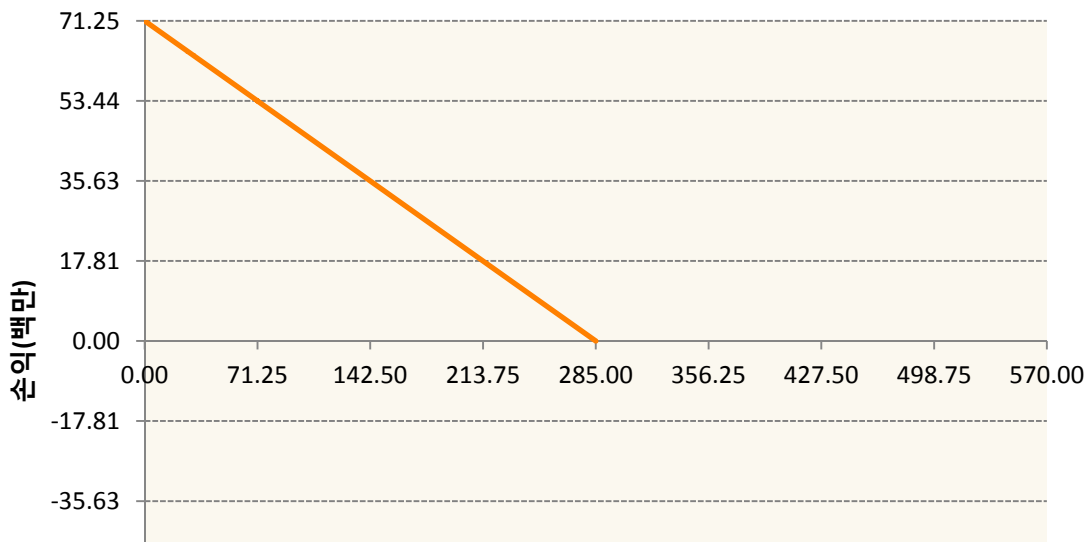


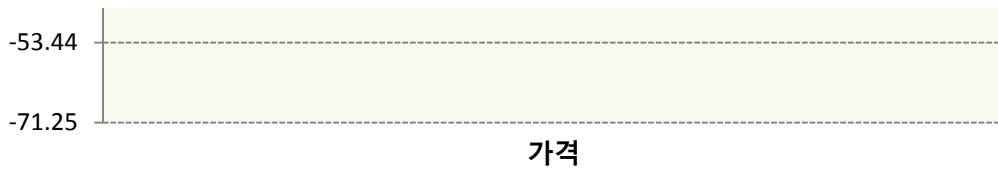


**KR4201P53023-2019-05 콜302.5**

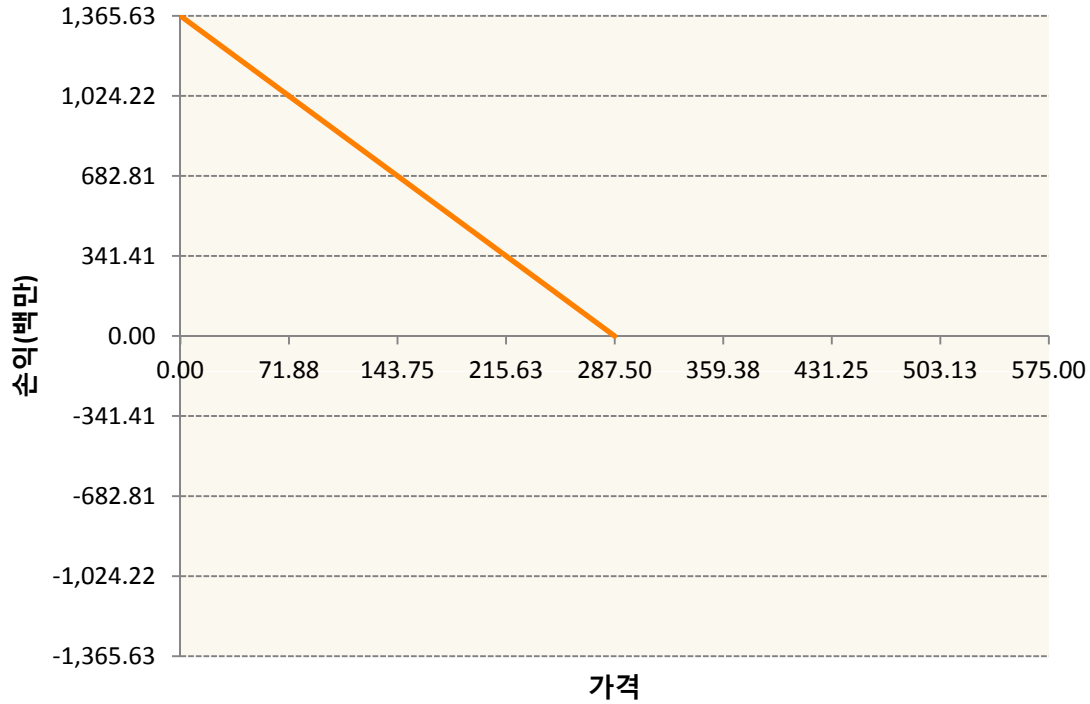


**KR4301P52858-2019-05 풋285**





KR4301P52874-2019-05 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						1,052
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,052	-1,052	-1,052	-1,052	-1,052	-1,052	-1,052	
-5.33%	-701	-701	-701	-701	-701	-701	-701	
-2.67%	-351	-351	-351	-351	-351	-351	-351	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	351	351	351	351	351	351	351	
5.33%	701	701	701	701	701	701	701	
8.00%	1,052	1,052	1,052	1,052	1,052	1,052	1,052	
KR4201P53007		2019-05 콜300						333
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	74	74	73	71	69	66	63	
-5.33%	72	70	66	62	58	52	46	
-2.67%	62	56	49	42	33	24	15	

0%	33	22	11	0	-12	-24	-36
2.67%	-29	-43	-56	-70	-83	-97	-110
5.33%	-132	-145	-158	-170	-184	-197	-210
8.00%	-271	-280	-290	-300	-310	-321	-333
KR4201P53023                      2019-05 콜302.5							774
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	149	148	146	143	139	134	126
-5.33%	146	142	136	128	118	106	92
-2.67%	129	117	103	86	68	48	27
0%	75	51	26	0	-27	-56	-84
2.67%	-52	-85	-118	-152	-185	-219	-252
5.33%	-278	-312	-346	-380	-414	-449	-483
8.00%	-602	-627	-655	-683	-713	-743	-774
KR4301P52858                      2019-05 풋285							4
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4	4	4	4	4	4	4
-5.33%	2	2	2	2	2	2	2
-2.67%	1	1	1	1	1	1	1
0%	0	0	0	0	0	0	0
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
KR4301P52874                      2019-05 풋287.5							85
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	85	85	85	85	85	85	85
-5.33%	48	49	49	50	50	51	52
-2.67%	16	17	18	19	21	22	23
0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-10	-10	-9	-8	-8	-7	-6
5.33%	-11	-11	-11	-11	-10	-10	-10
8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11

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

(단위:백만원)

1,850

공시일	2019-04-17
기준일	2019-04-16

## 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	3,621	0	3,621	

### 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	2019-04-17
기준일	2019-04-16

## 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	25,026	0	25,026	

### 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	2019-04-17
기준일	2019-04-16

## 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	76,767	0	76,767	
누계	통화	선도	0	114,467	-114,467	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019H01 KRW/USD 19-04-19E	145
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	118
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	207
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	254
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E	154
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E	363
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E	427
FX21019H03 KRW/USD 22-04-19E	363
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	363
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	418
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	182
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	454
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	527
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	320
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	273
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E	45
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E	91
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E	91
FX21019J001 KRW/USD 10-05-19E	45
FX21019J002 KRW/USD 10-06-19E	100
FX21019J003 KRW/USD 10-05-19E	154
FX21019J004 KRW/USD 10-05-19E	73
FX21019J005 KRW/USD 10-05-19E	273
FX21019J006 KRW/USD 10-05-19E	227
FX21019J007 KRW/USD 10-05-19E	73
FX21019J011 KRW/USD 20-05-19E	127
FX21019J012 KRW/USD 20-05-19E	18

FX21019J01E KRW/USD 20-05-19E	136
FX21019J01F KRW/USD 20-05-19E	136
FX21019J01G KRW/USD 17-05-19E	1,272
FX21019J01H KRW/USD 17-05-19E	1,363
FX21019J01I KRW/USD 18-06-19E	363

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

(단위:백만원)

**3,127**

공시일	2019-04-17
기준일	2019-04-16

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

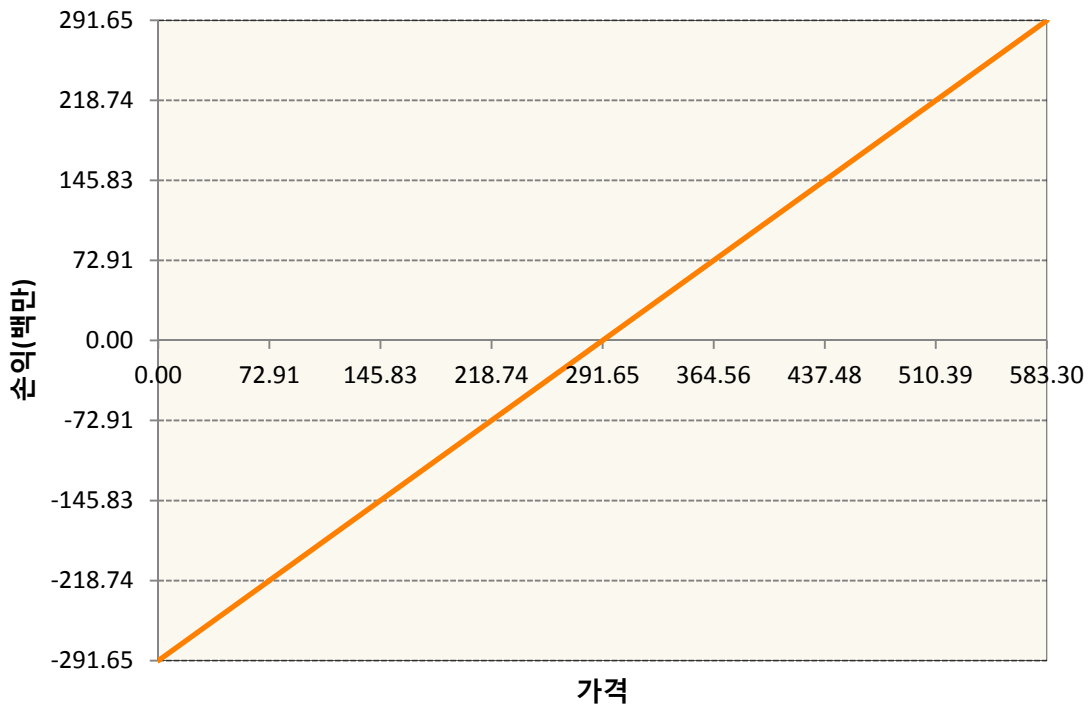
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

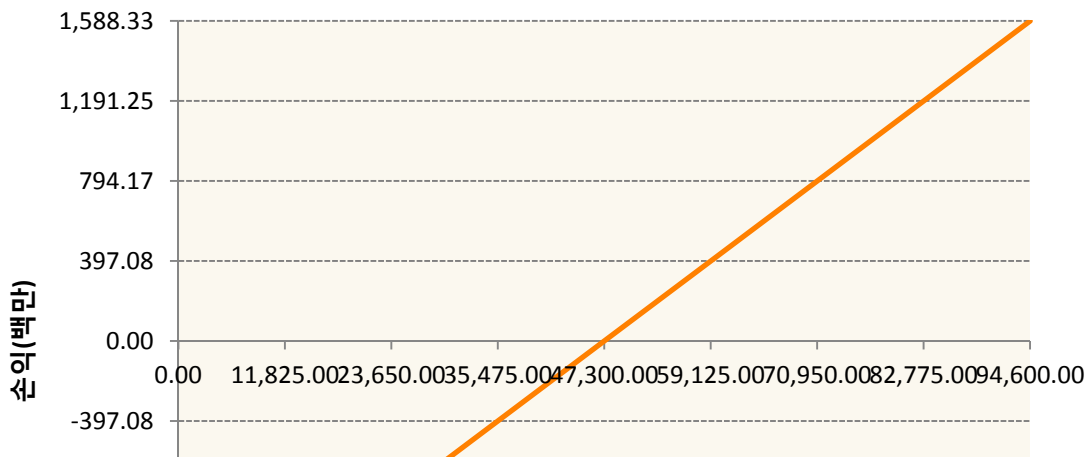
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,880	0	1,880	장내

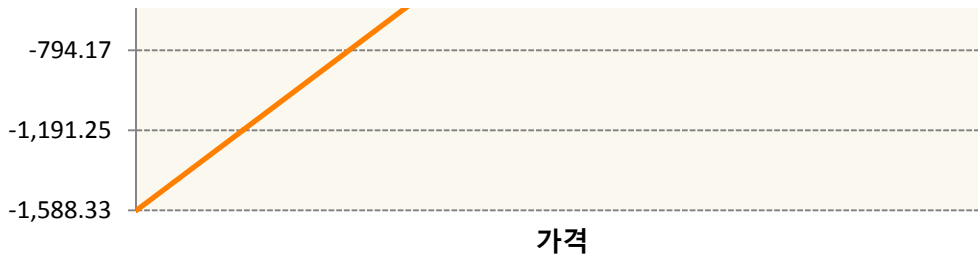
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4111P50004-2019-05 삼성전자개별선물





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

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						23
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23	
-5.33%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	
-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%	15	15	15	15	15	15	15	
8.00%	23	23	23	23	23	23	23	
KR4111P50004		2019-05 삼성전자개별선물						127
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127	
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85	
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	42	42	42	42	42	42	42	
5.33%	85	85	85	85	85	85	85	
8.00%	127	127	127	127	127	127	127	

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

164

공시일	2019-04-17
기준일	2019-04-16

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

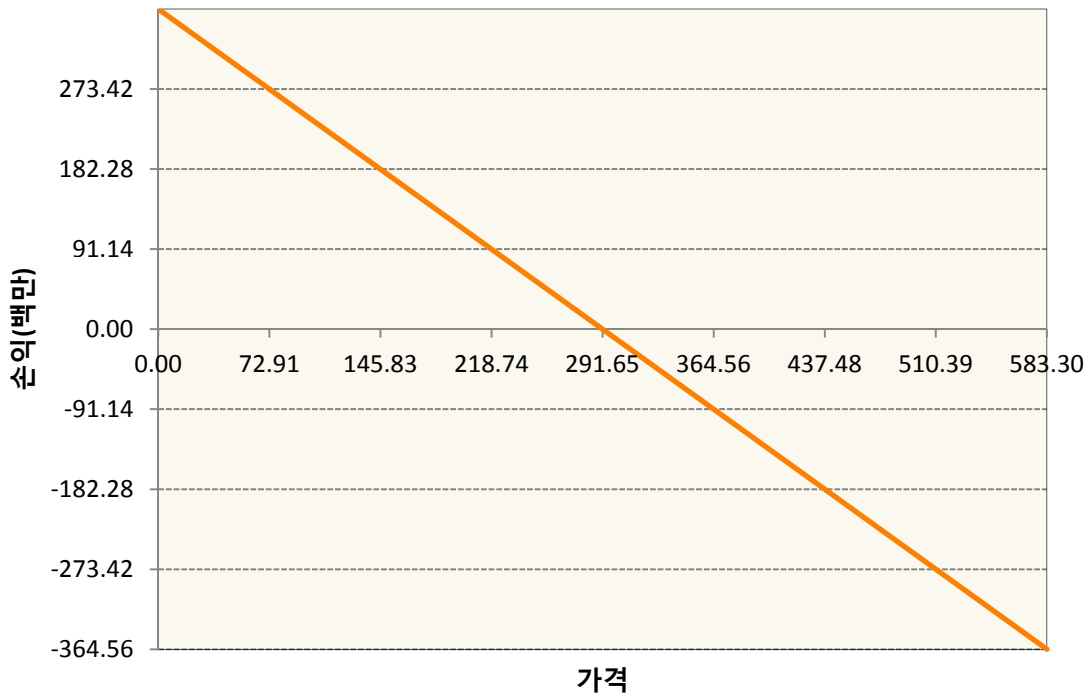
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

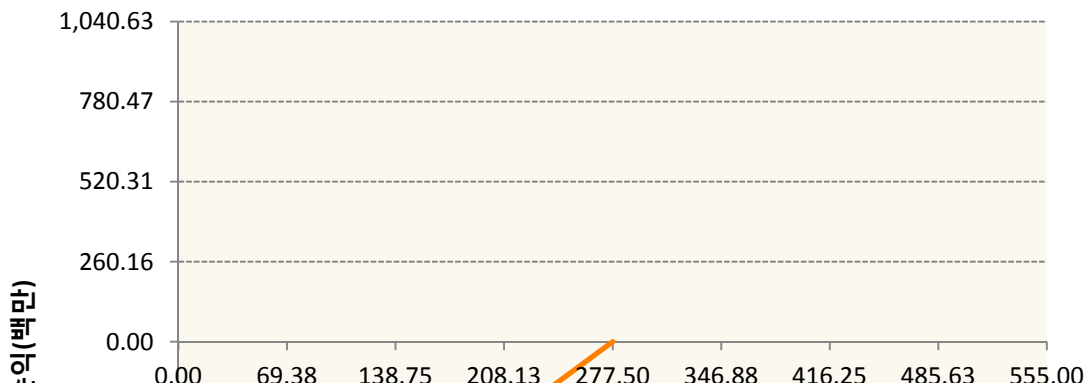
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	210	-210	장내
누계	유가증권	선물	0	365	-365	장내
누계	유가증권	옵션	0	2,231	-2,231	장내

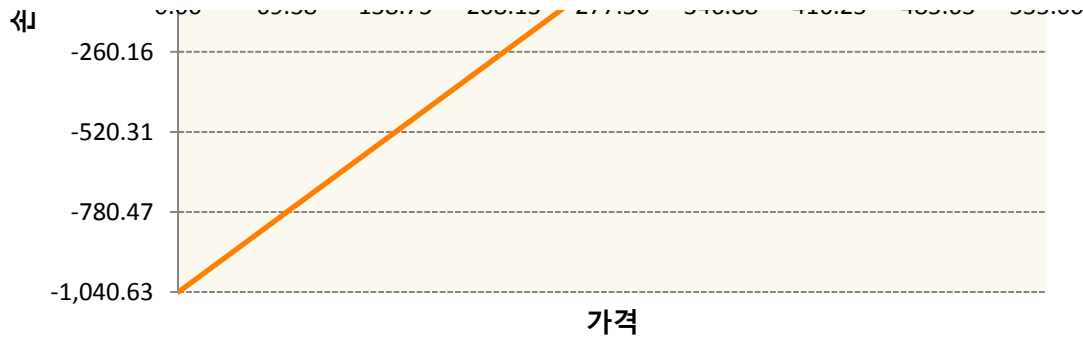
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

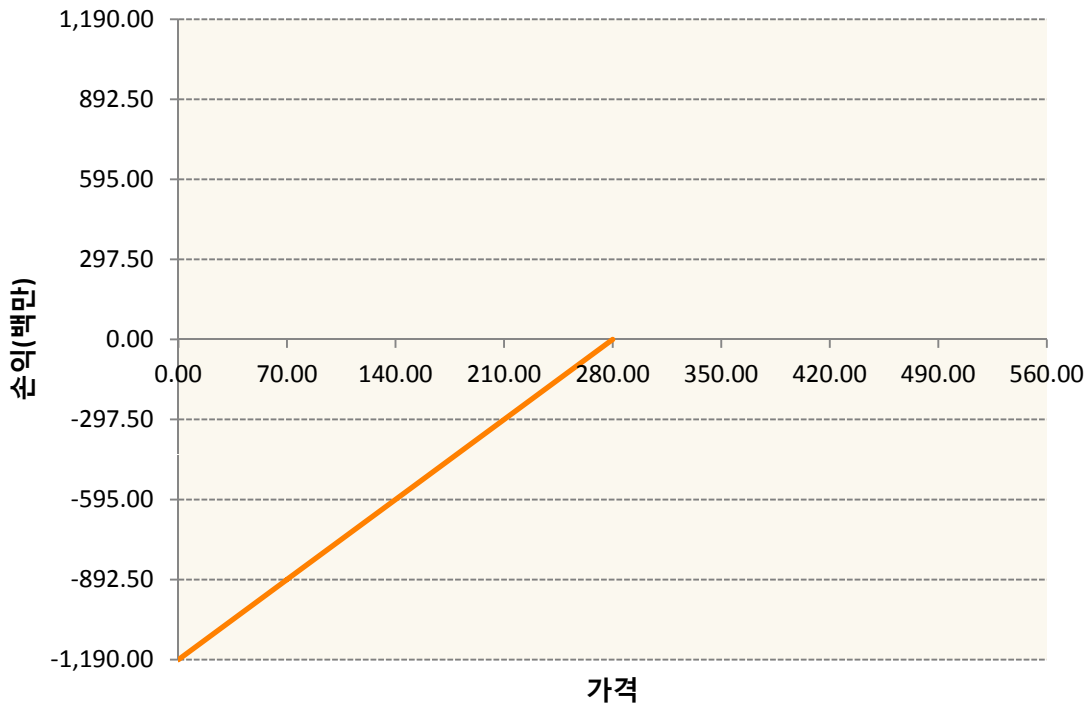


KR4301P52775-2019-05 풋277.5





KR4301P52809-2019-05 풋280



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						29
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	29	29	29	29	29	29	29	
-5.33%	19	19	19	19	19	19	19	
-2.67%	10	10	10	10	10	10	10	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10	
5.33%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
8.00%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29	
KR4301P52775		2019-05 풋277.5						41
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-38	-38	-38	-39	-39	-40	-41
-5.33%	-14	-15	-16	-17	-18	-19	-20
-2.67%	-2	-3	-4	-4	-5	-6	-7
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
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

KR4301P52809

2019-05 풋280

54

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-52	-52	-52	-53	-53	-54	-54
-5.33%	-22	-23	-24	-25	-26	-27	-29
-2.67%	-4	-5	-6	-8	-9	-10	-11
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	2	2	2	2	2	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

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

(단위:백만원)

89

공시일	2019-04-17
기준일	2019-04-16

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

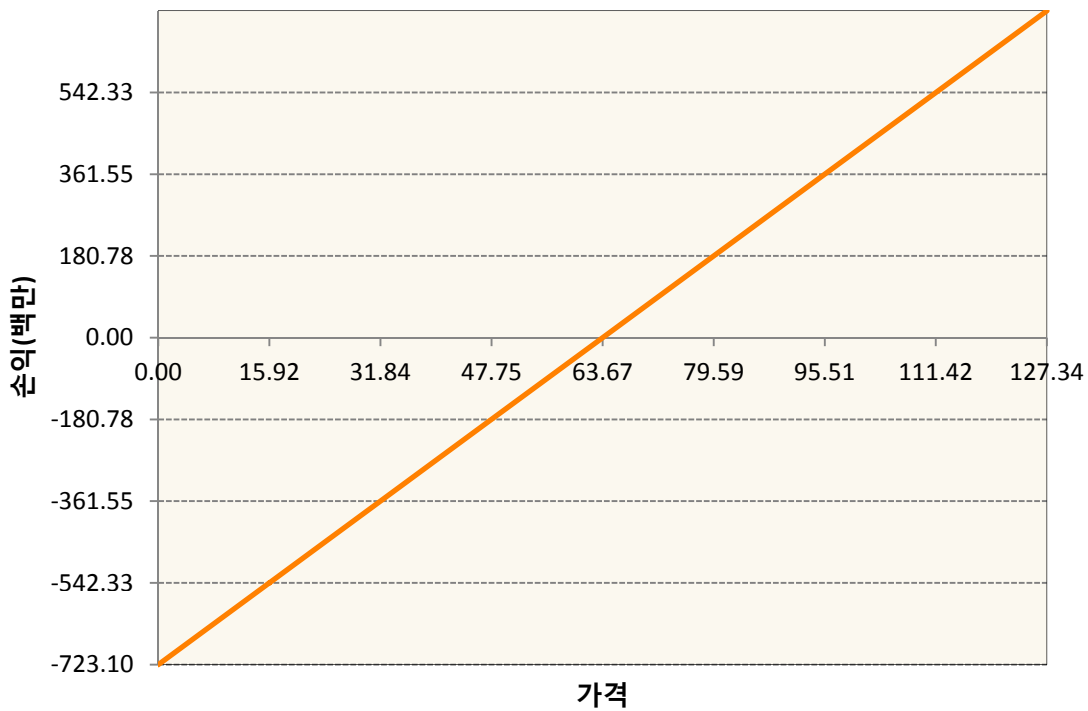
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

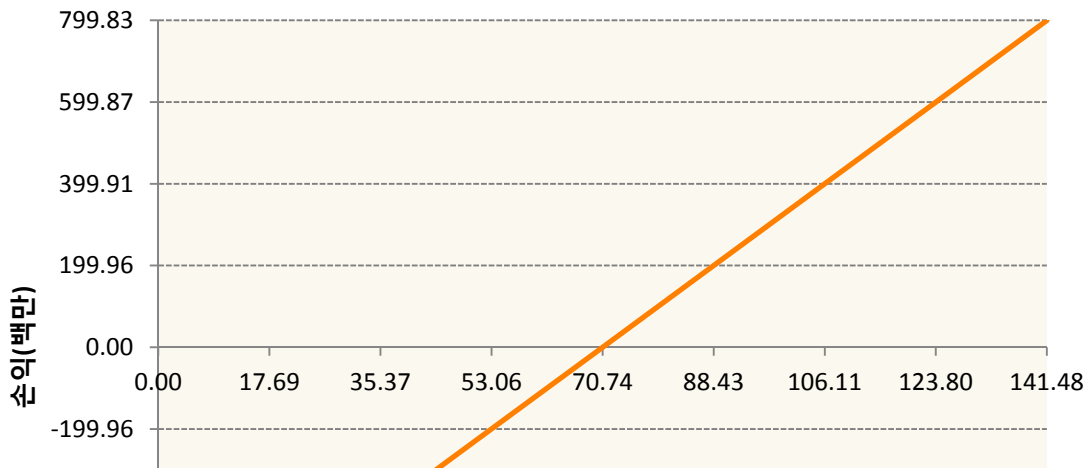
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,964	284	2,680	

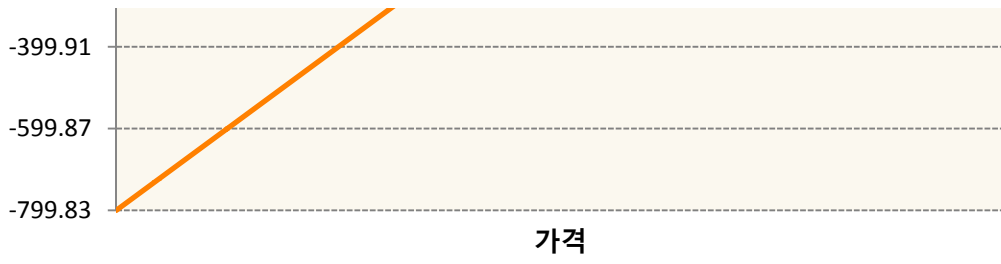
### 2. 만기시점의 손익구조

CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19

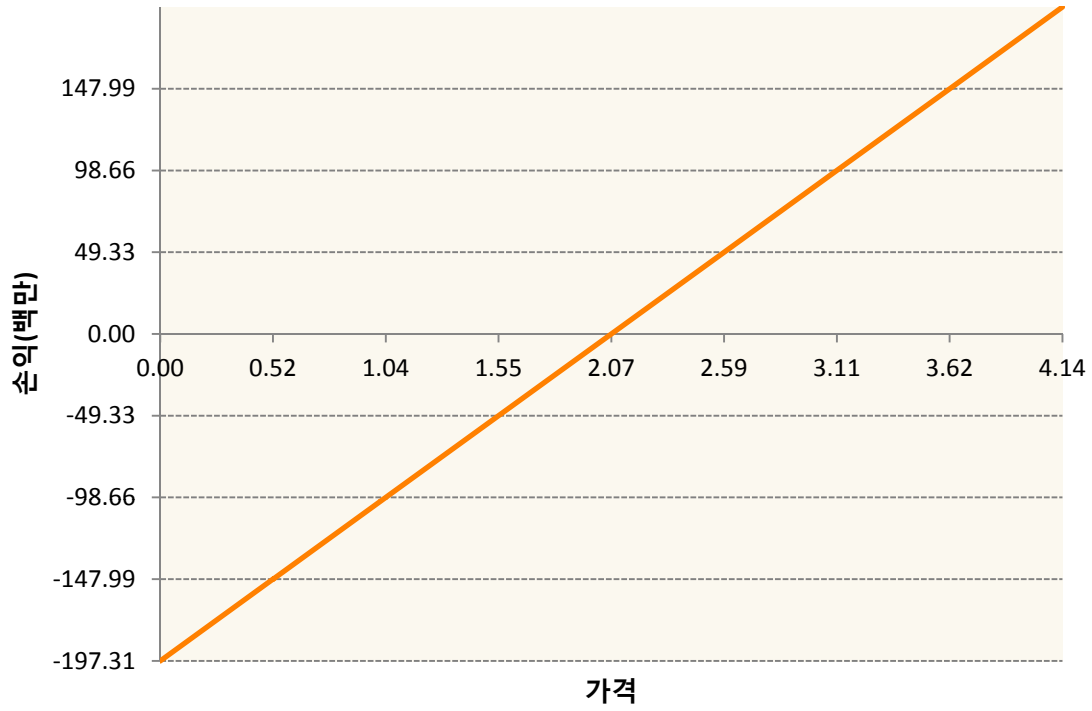


CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19

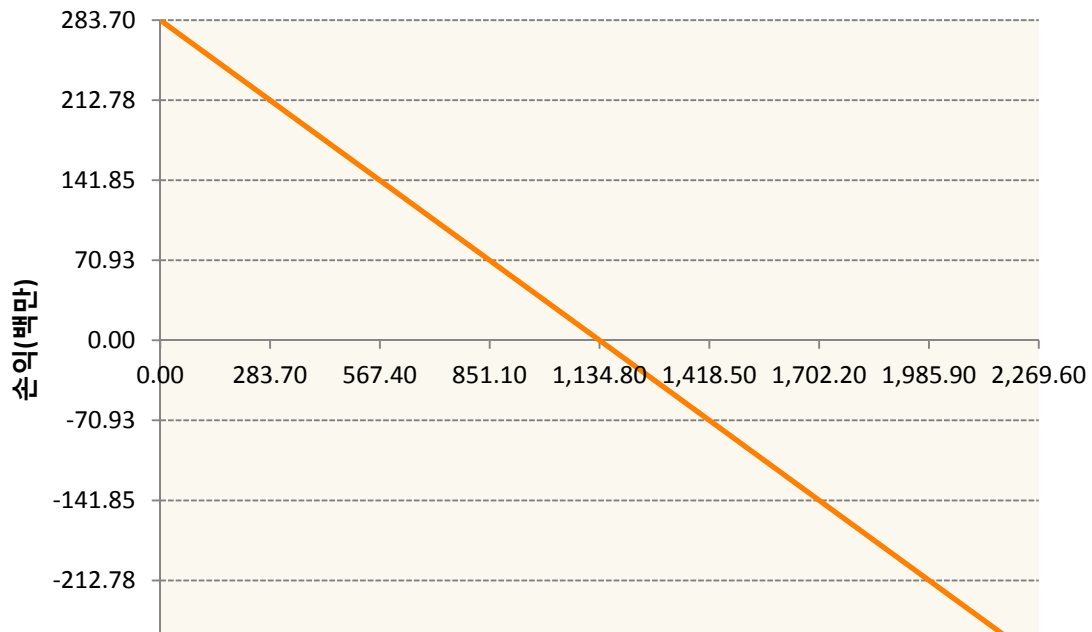


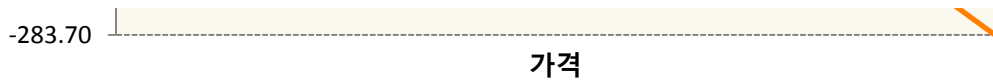


HON9-NY Harb ULSD Fut Jul19

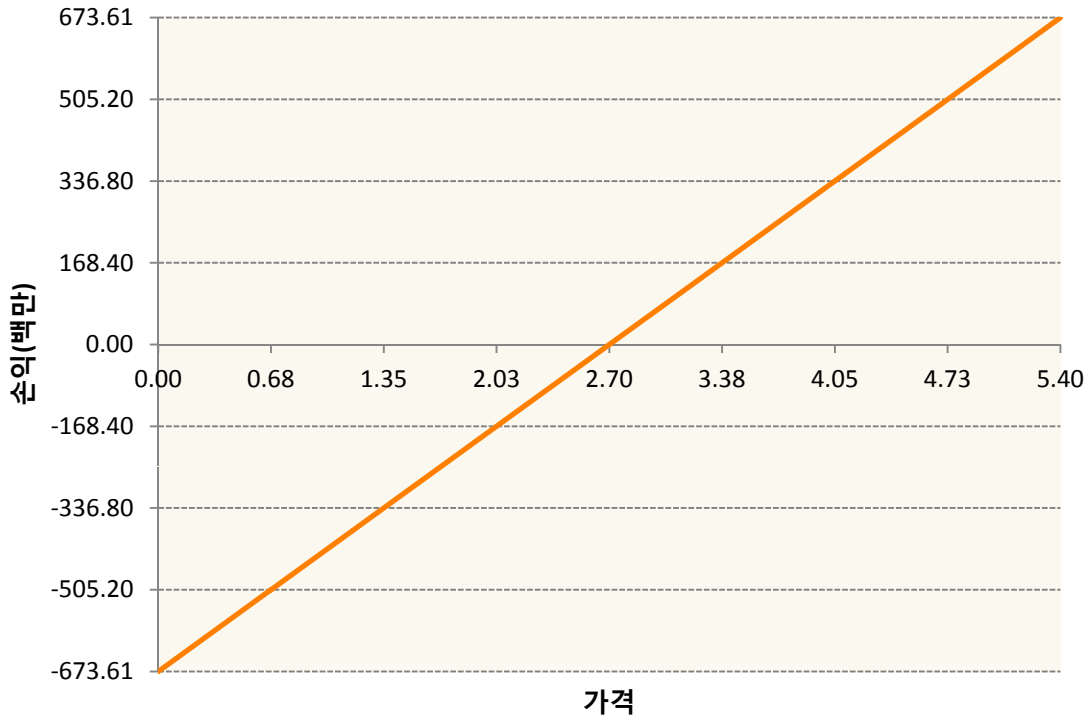


KR4175P50009-2019-05 달러선물

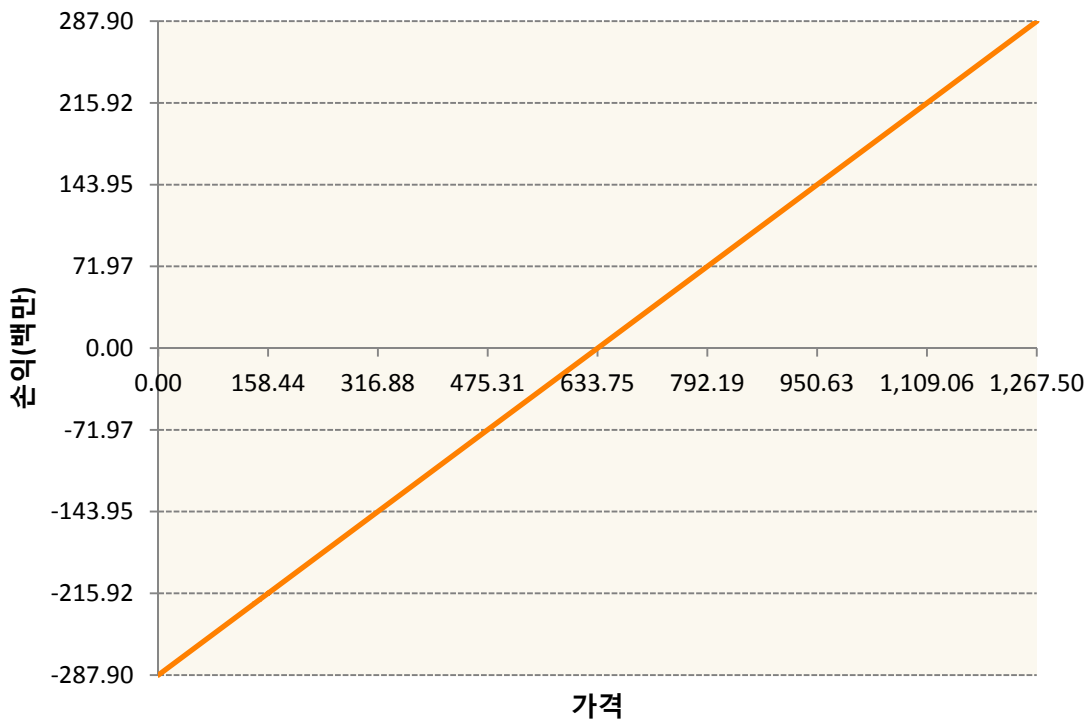




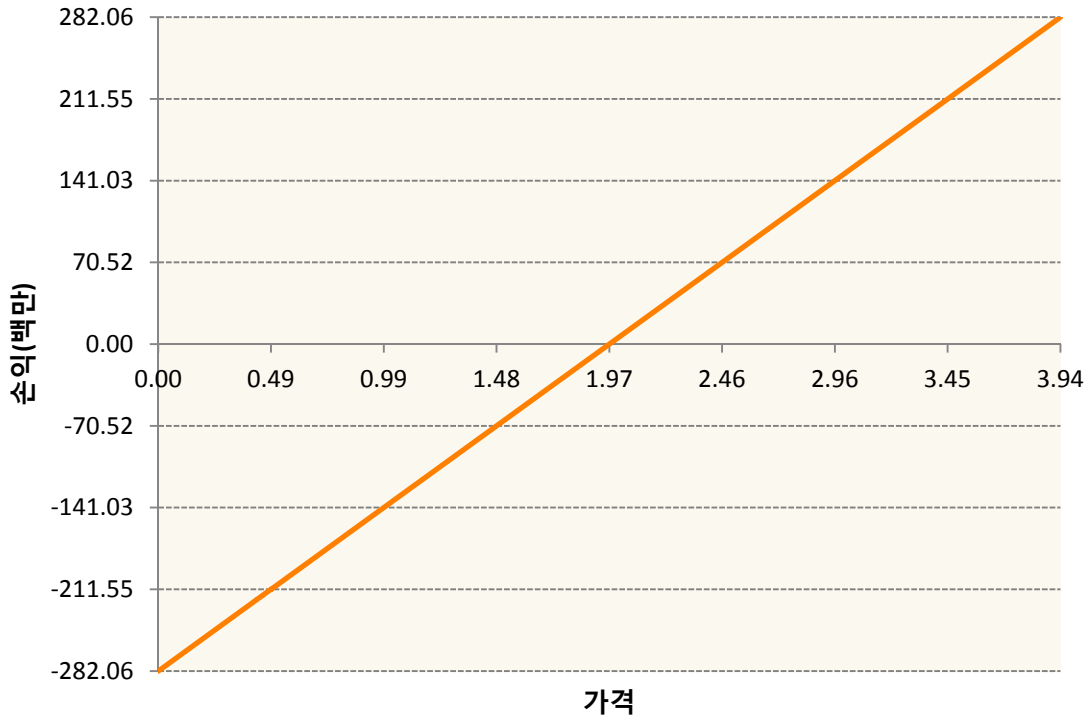
NGN19-NATURAL GAS FUTR Jul19



QSN9-Low Su Gasoil G Jul19



XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN9	WTI CRUDE FUTURE Jul19	58
CON9	BRENT CRUDE FUTR Jul19	64
HON9	NY Harb ULSD Fut Jul19	16
KR4175P500	2019-05 달러선물	23
NGN19	NATURAL GAS FUTR Jul19	54
QSN9	Low Su Gasoil G Jul19	23
XBN9	GASOLINE RBOB FUT Jul19	23

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

(단위:백만원)

440

공시일	2019-04-17
기준일	2019-04-16

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

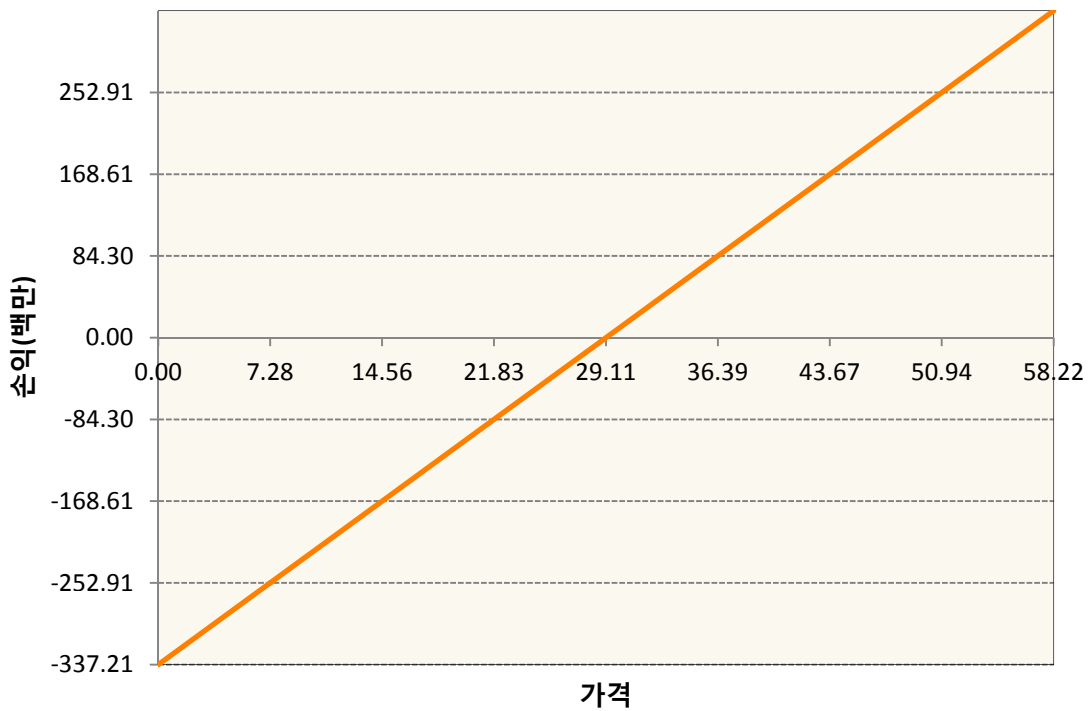
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

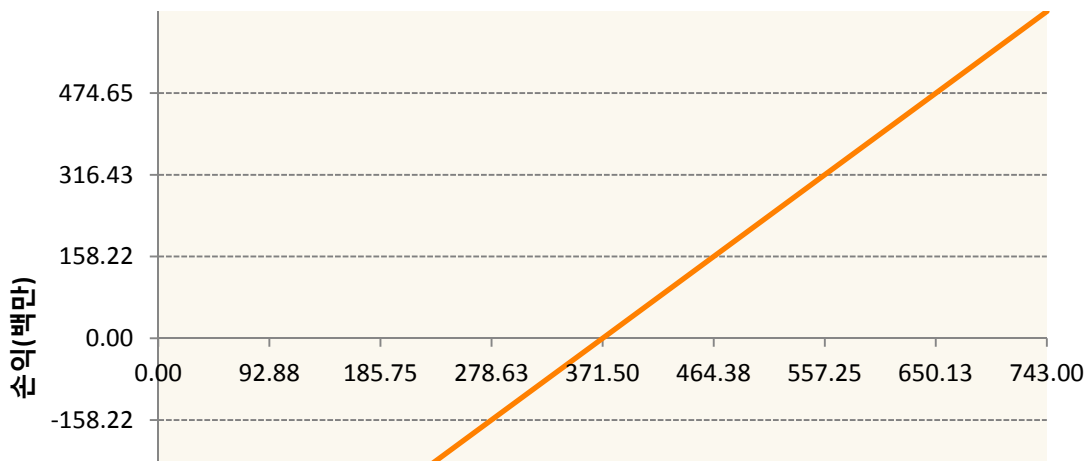
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,248	57	3,192	

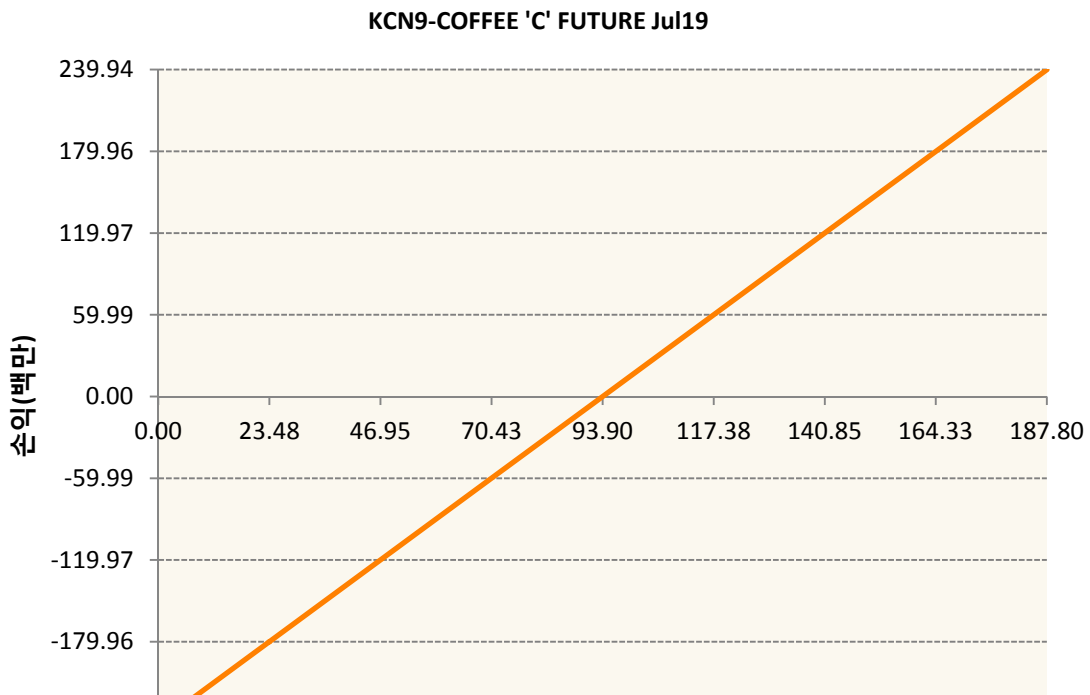
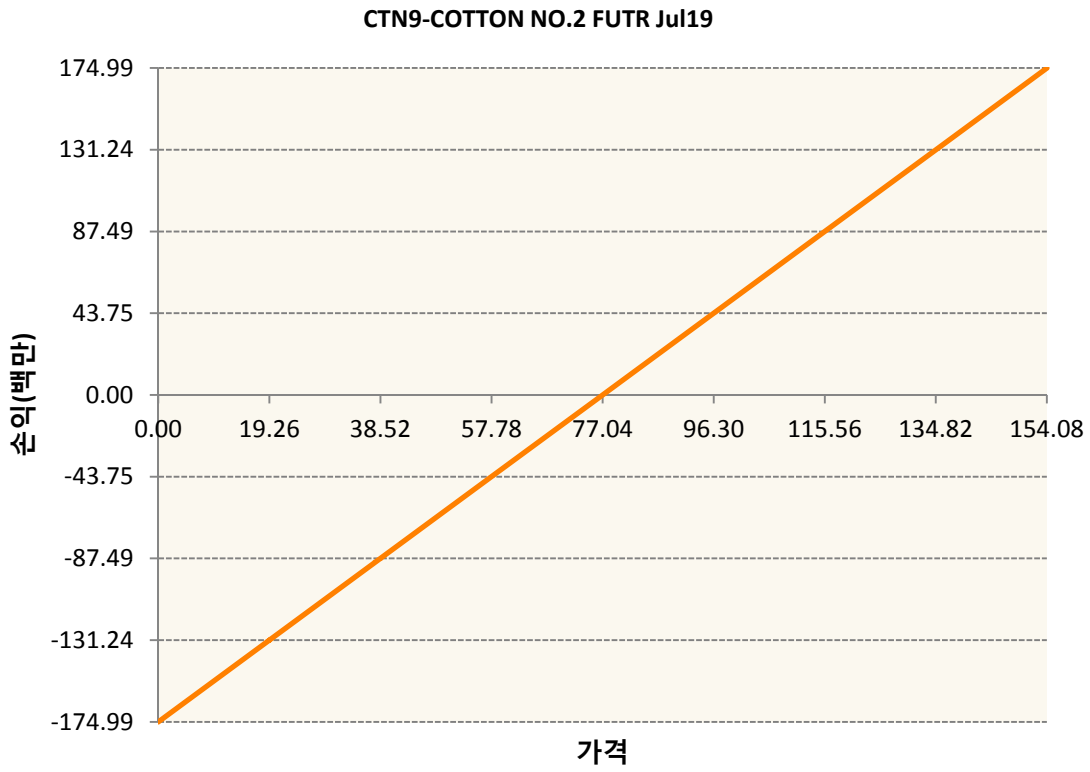
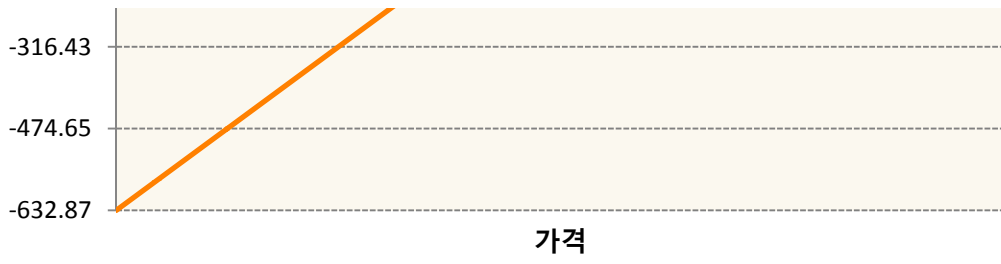
### 2. 만기시점의 손익구조

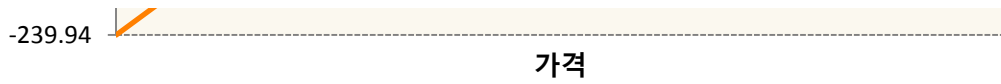
**BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19**



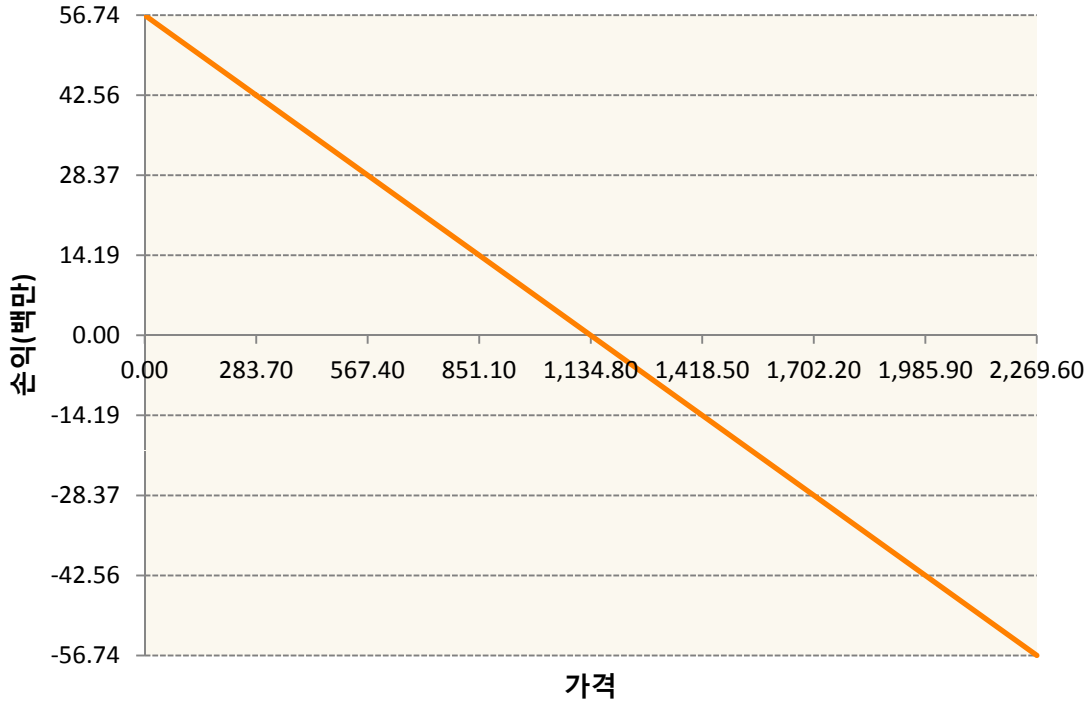
**CN9-CORN FUTURE Jul19**



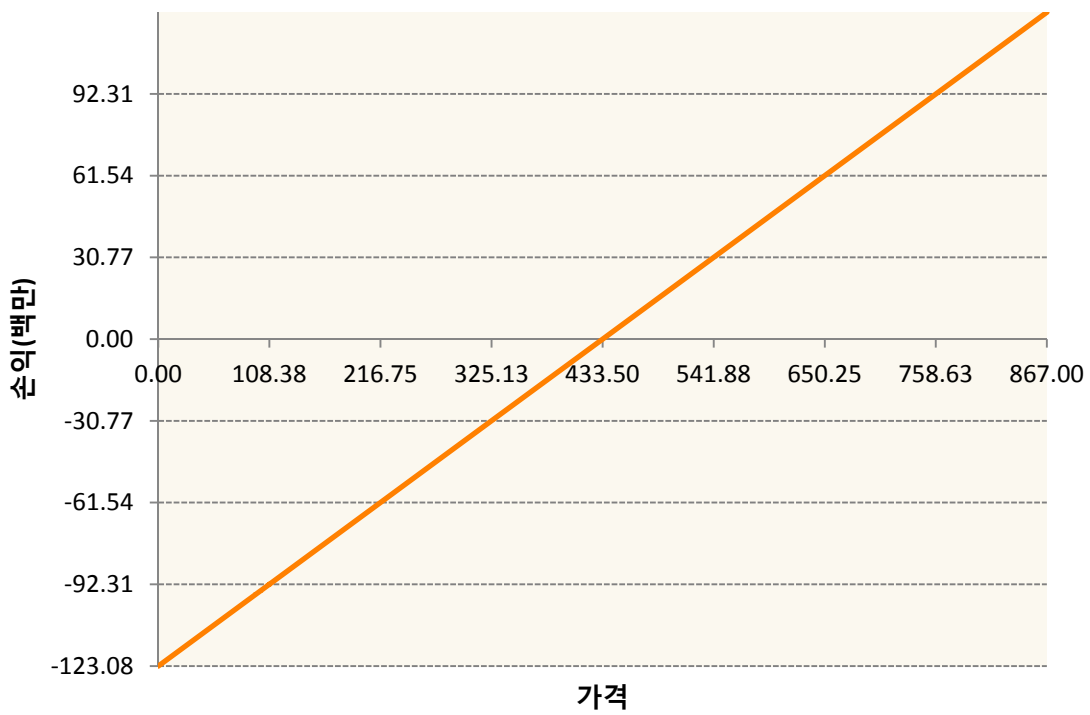




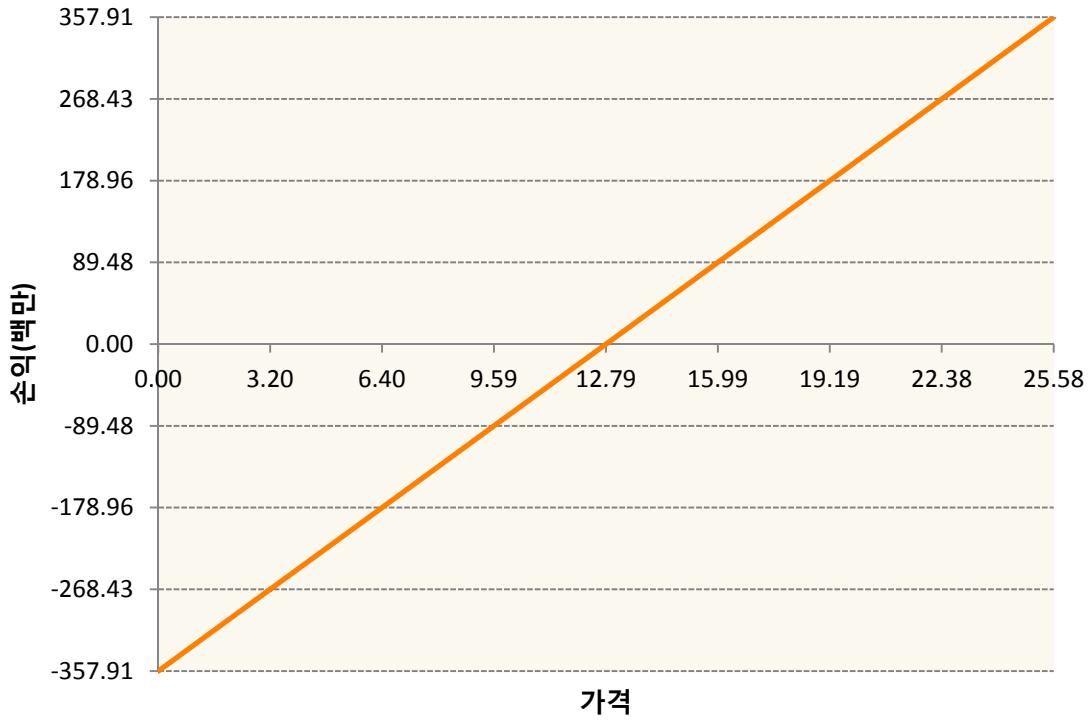
KR4175P50009-2019-05 달러선물



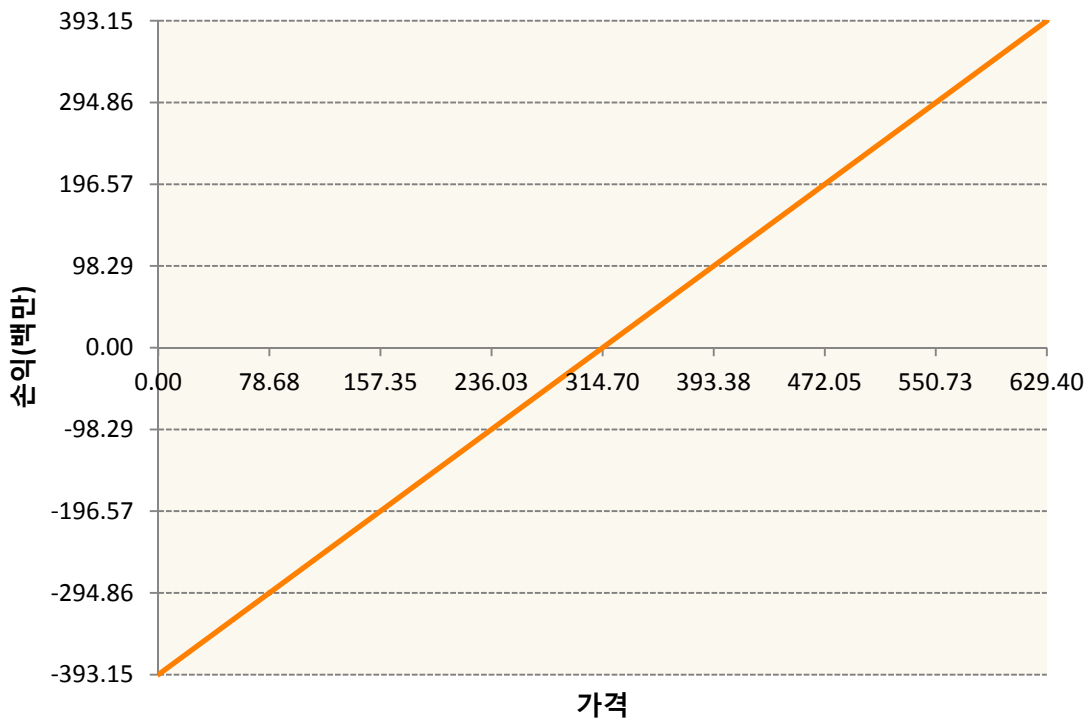
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

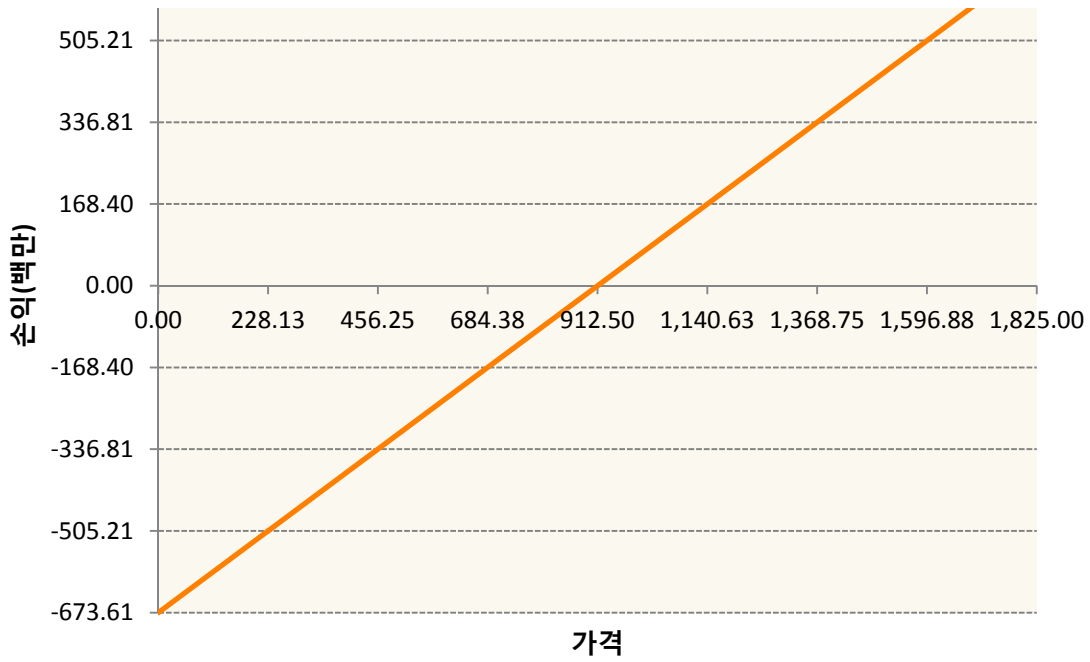


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19

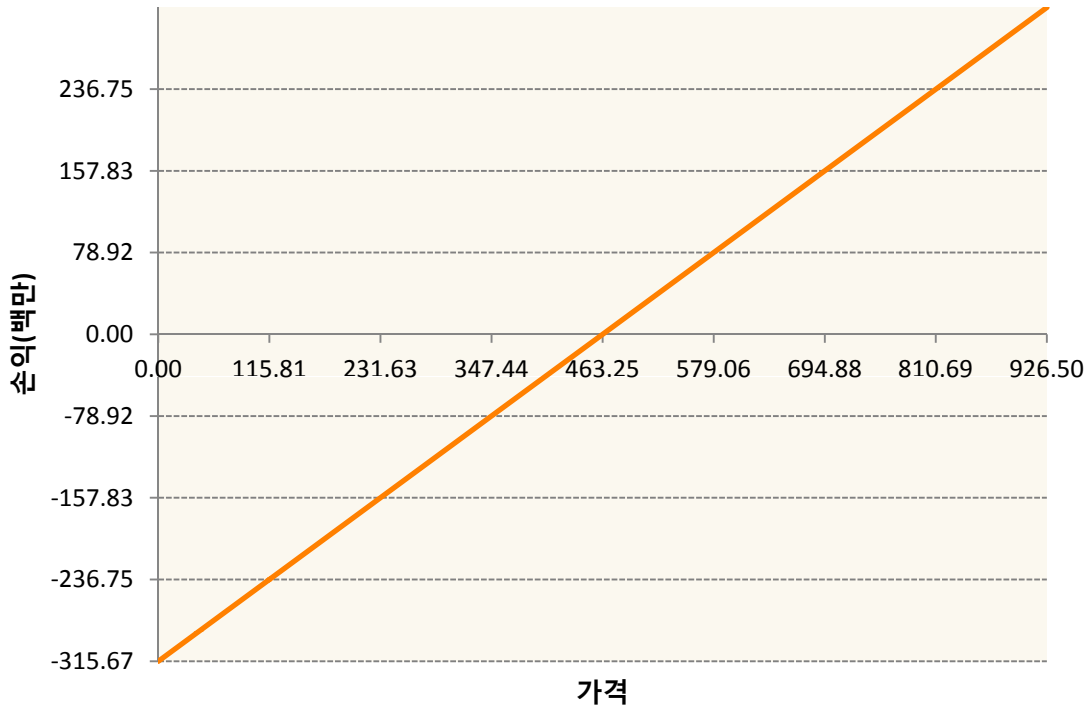


SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





WN9-WHEAT FUTURE(CBT) Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON9	SOYBEAN OIL FUTR Jul19	27
CN9	CORN FUTURE Jul19	51
CTN9	COTTON NO.2 FUTR Jul19	14
KCN9	COFFEE 'C' FUTURE Jul19	19
KR4175P500	2019-05 달러선물	5

KWN9	KC HRW WHEAT FUT Jul19	10
SBN9	SUGAR #11 (WORLD) Jul19	29
SMN9	SOYBEAN MEAL FUTR Jul19	31
SN9	SOYBEAN FUTURE Jul19	54
WN9	WHEAT FUTURE(CBT) Jul19	25

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

(단위:백만원)

**261**