

공시일	2019-04-19
기준일	2019-04-18

## 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)

94

공시일	2019-04-19
기준일	2019-04-18

## 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)

679

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-04-19
기준일	2019-04-18

## 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 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

<b>990</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-04-19
기준일	2019-04-18

## 유로인덱스모(주식-파생형)

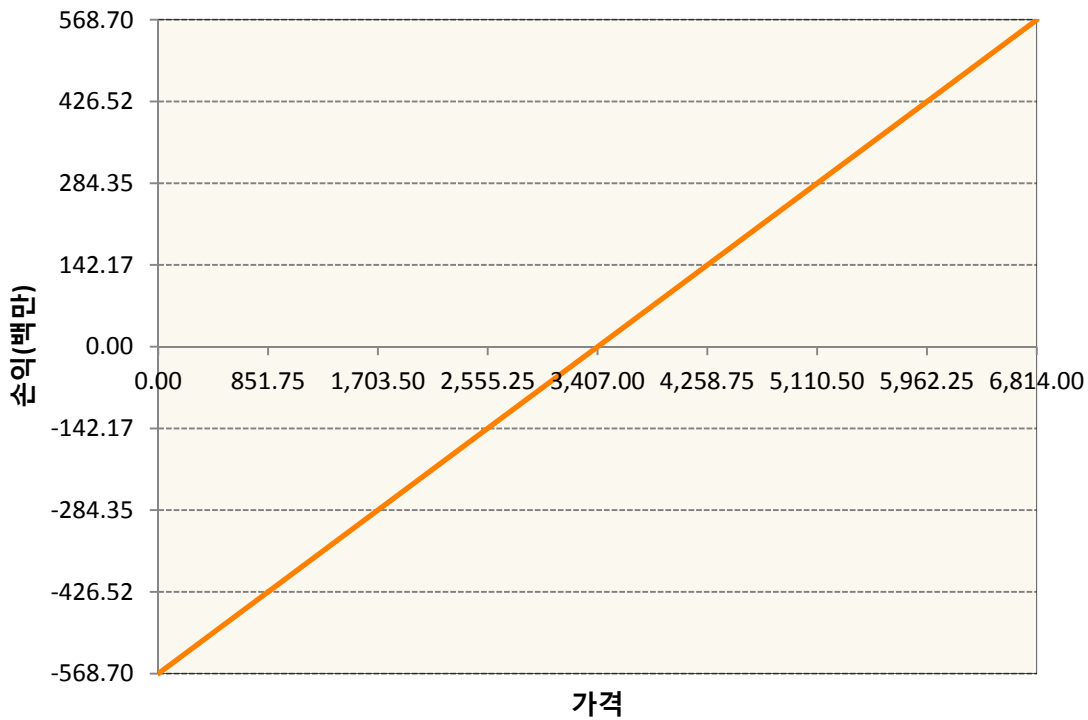
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	569	0	569	

### 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	2019-04-19
기준일	2019-04-18

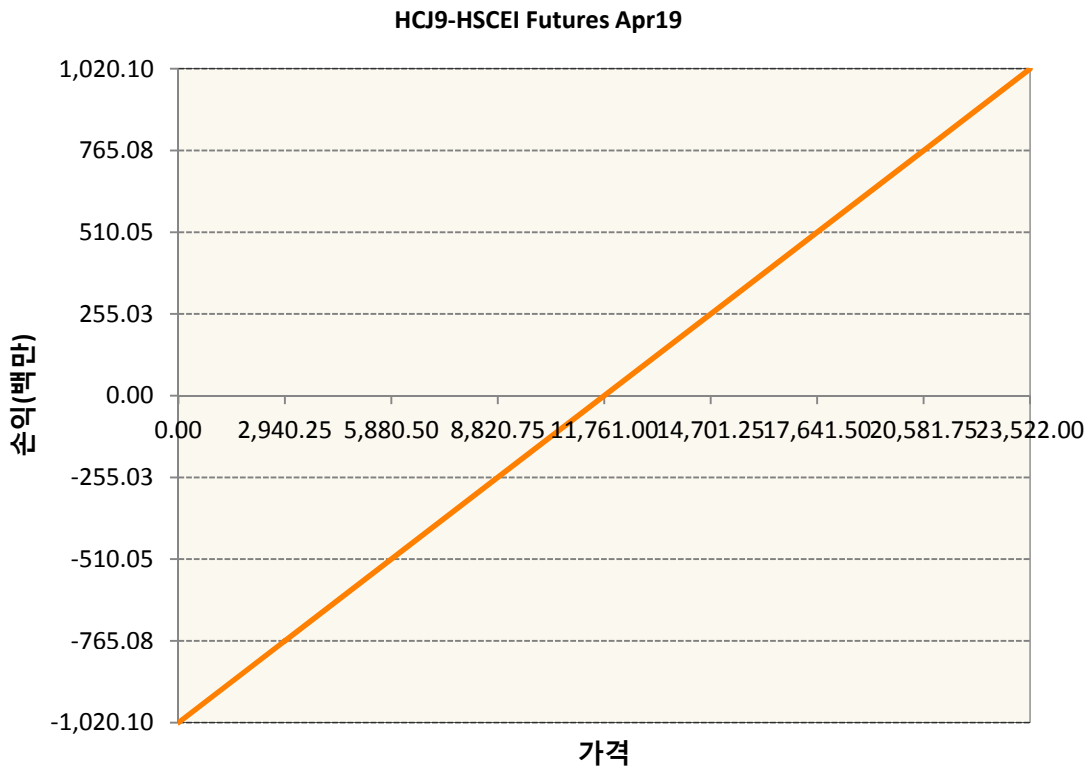
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,020	0	1,020	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

84
----

공시일	2019-04-19
기준일	2019-04-18

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

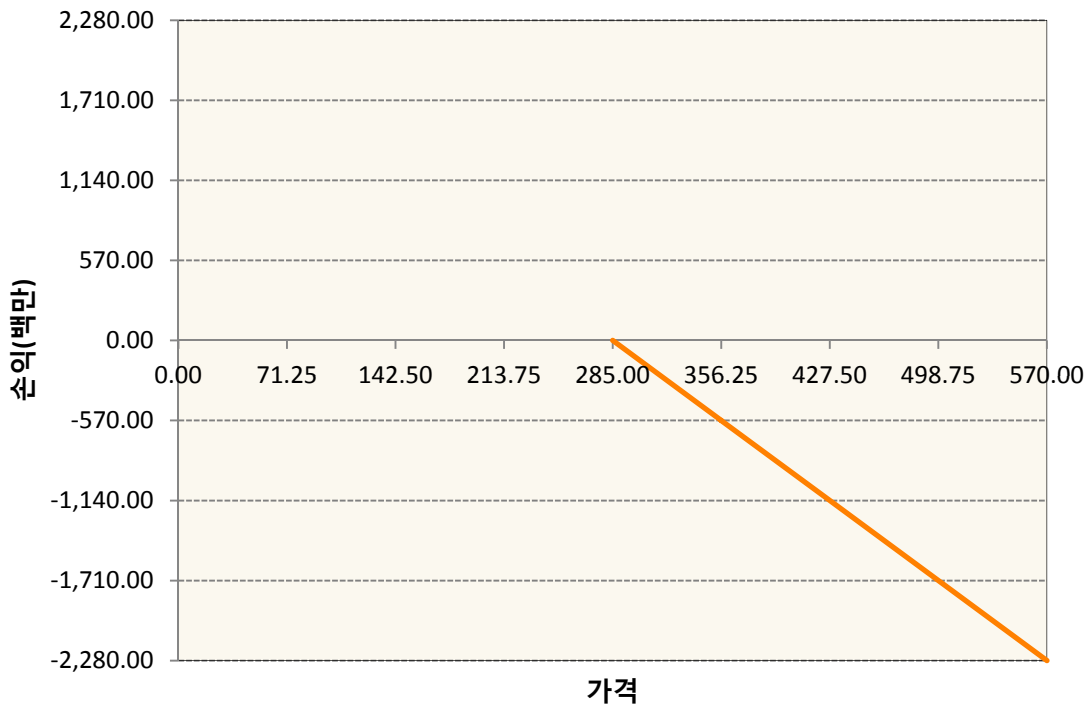
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

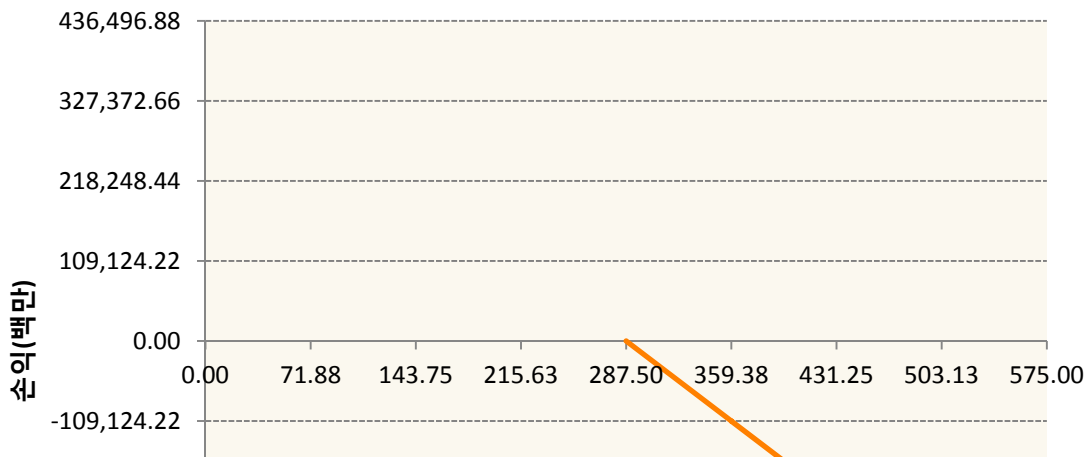
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	2,486	0	2,486	장내
누계	유가증권	옵션	0	672,214	-672,214	장내

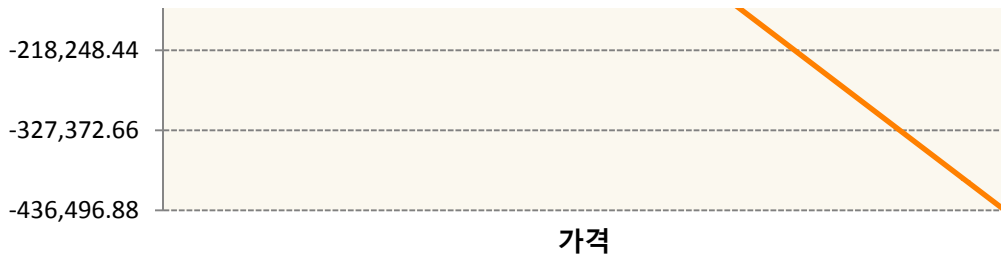
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P52850-2019-05 콜285

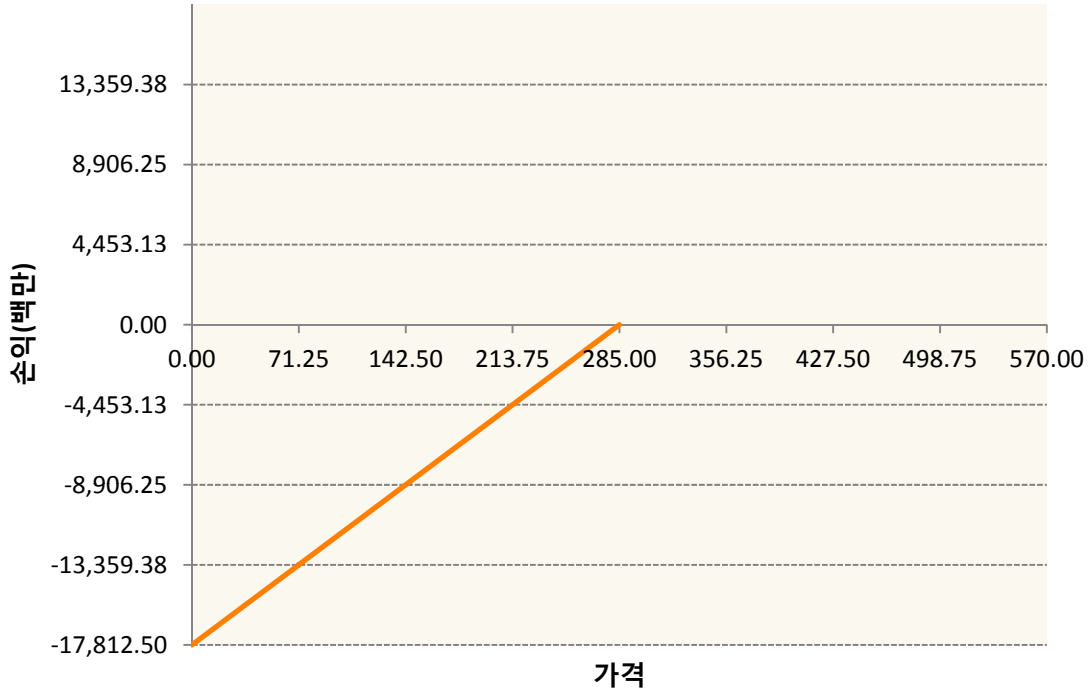


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

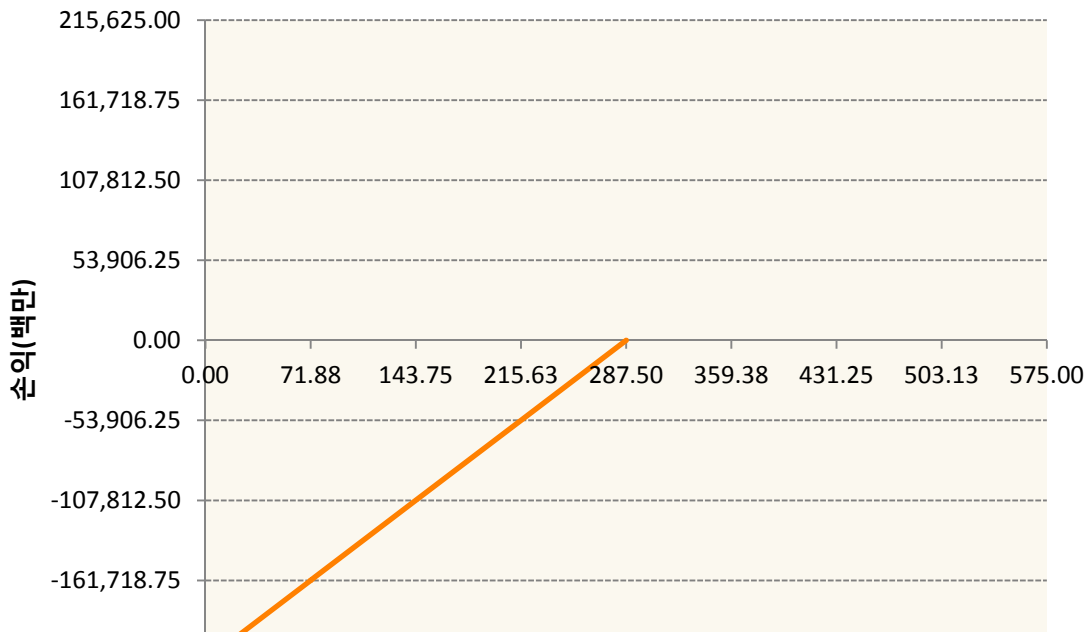




**KR4301P52858-2019-05 풋285**



**KR4301P52874-2019-05 풋287.5**



-215,625.00 

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P52850      2019-05 콜285							145
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	54	53	52	50	49	47	45
-5.33%	50	47	45	42	40	37	34
-2.67%	38	34	30	27	23	19	15
0%	13	9	4	0	-4	-9	-13
2.67%	-27	-30	-34	-38	-42	-46	-50
5.33%	-78	-80	-82	-85	-88	-91	-94
8.00%	-135	-136	-138	-139	-141	-143	-145
KR4201P52876      2019-05 콜287.5							26,140
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,430	8,324	8,171	7,970	7,723	7,432	7,100
-5.33%	7,934	7,619	7,247	6,825	6,359	5,857	5,323
-2.67%	6,280	5,667	5,023	4,355	3,667	2,964	2,247
0%	2,431	1,622	812	0	-812	-1,625	-2,438
2.67%	-4,205	-4,952	-5,713	-6,484	-7,264	-8,050	-8,842
5.33%	-13,284	-13,778	-14,323	-14,908	-15,526	-16,172	-16,840
8.00%	-23,873	-24,115	-24,419	-24,779	-25,189	-25,645	-26,140
KR4301P52858      2019-05 풋285							1,191
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,188	-1,188	-1,188	-1,188	-1,189	-1,190	-1,191
-5.33%	-713	-715	-717	-721	-725	-731	-737
-2.67%	-265	-275	-287	-299	-313	-326	-340
0%	54	36	18	0	-18	-36	-54
2.67%	173	164	154	143	131	118	105
5.33%	191	190	188	184	180	175	169
8.00%	192	192	192	191	191	189	188
KR4301P52874      2019-05 풋287.5							15,157
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-15,133	-15,134	-15,134	-15,136	-15,140	-15,147	-15,157
-5.33%	-9,429	-9,438	-9,453	-9,476	-9,509	-9,551	-9,604
-2.67%	-3,870	-3,952	-4,050	-4,161	-4,284	-4,417	-4,558
0%	631	422	211	0	-212	-425	-638
2.67%	2,793	2,640	2,476	2,305	2,127	1,943	1,755

5.33%	3,256	3,221	3,171	3,108	3,031	2,941	2,840
8.00%	3,295	3,292	3,286	3,274	3,256	3,231	3,196

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

(단위:백만원)

**45,231**

공시일	2019-04-19
기준일	2019-04-18

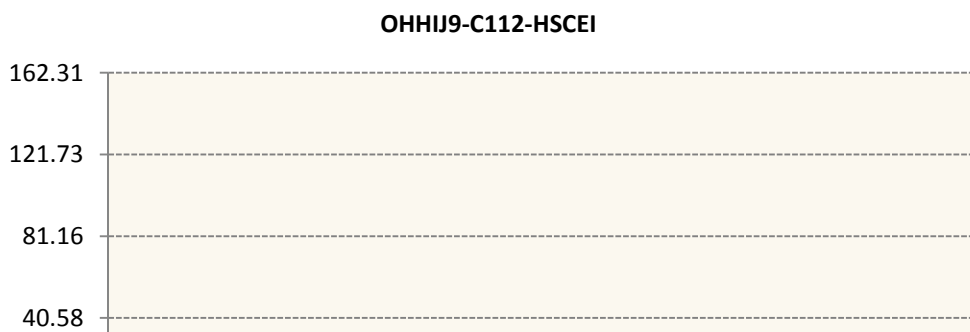
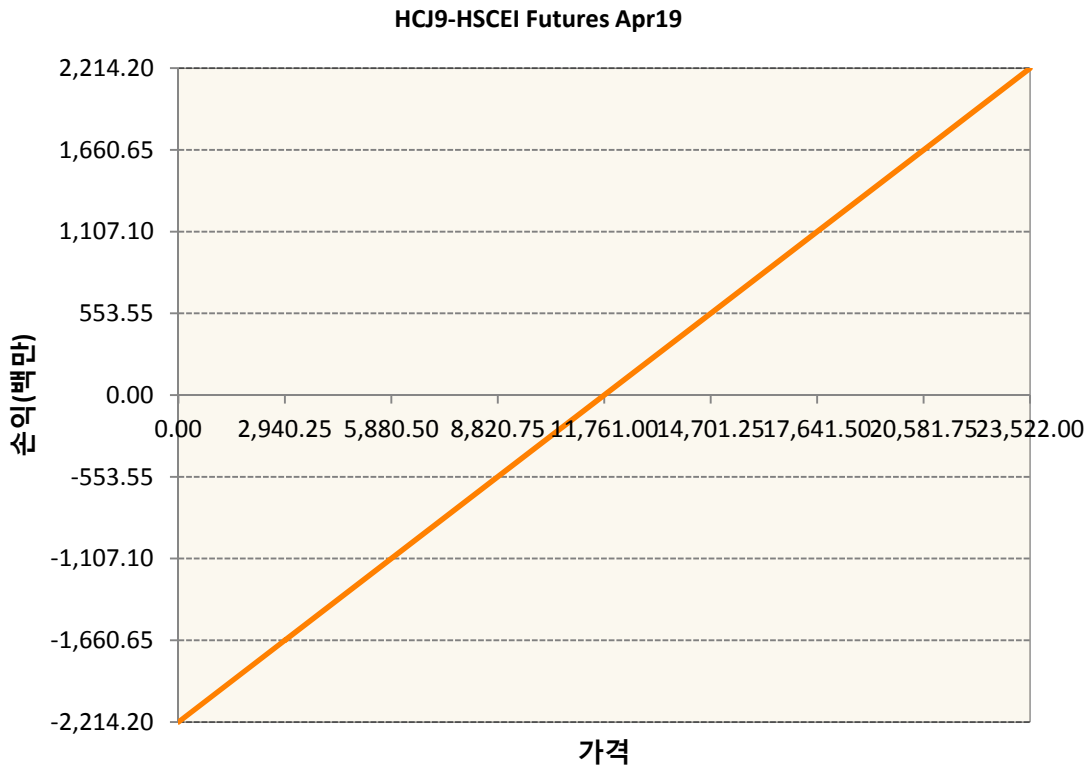
## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

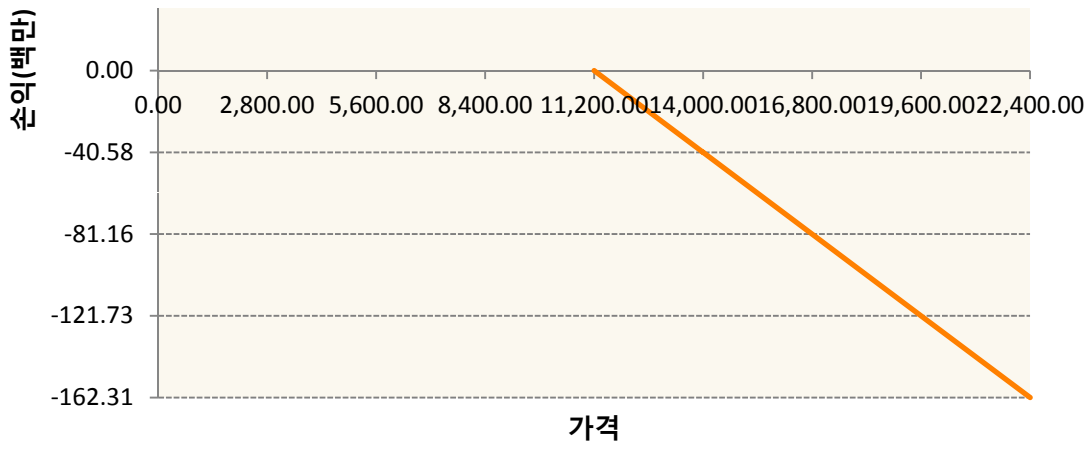
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

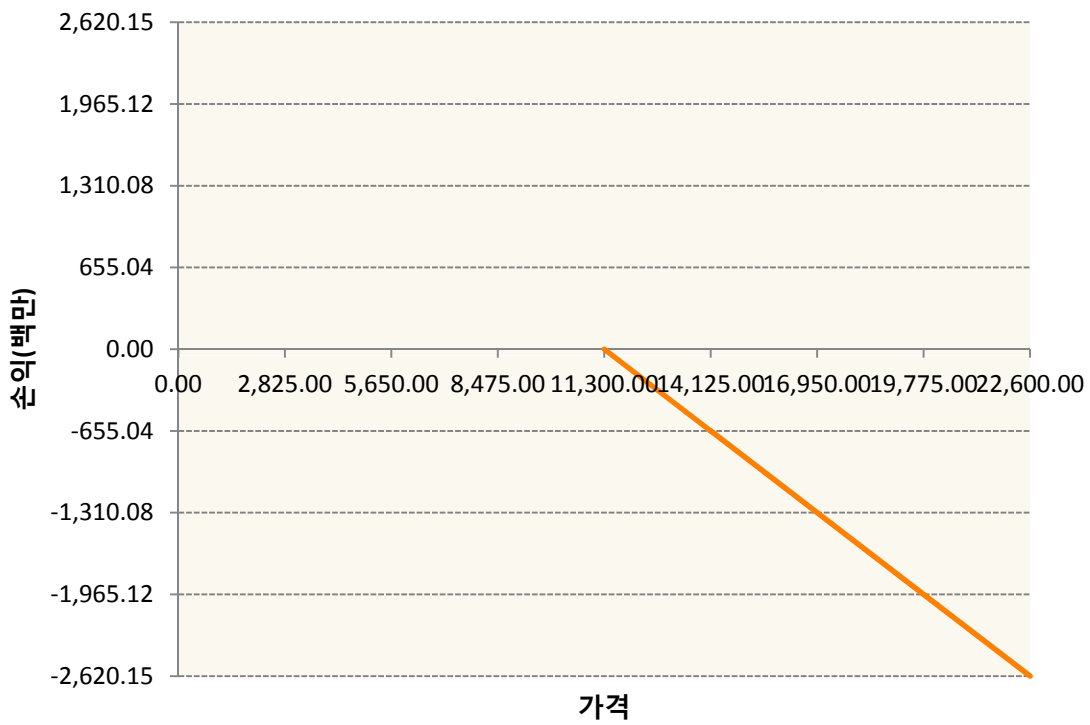
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,214	0	2,214	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,565	-5,565	장내
누계	통화	선도	0	3,044	-3,044	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

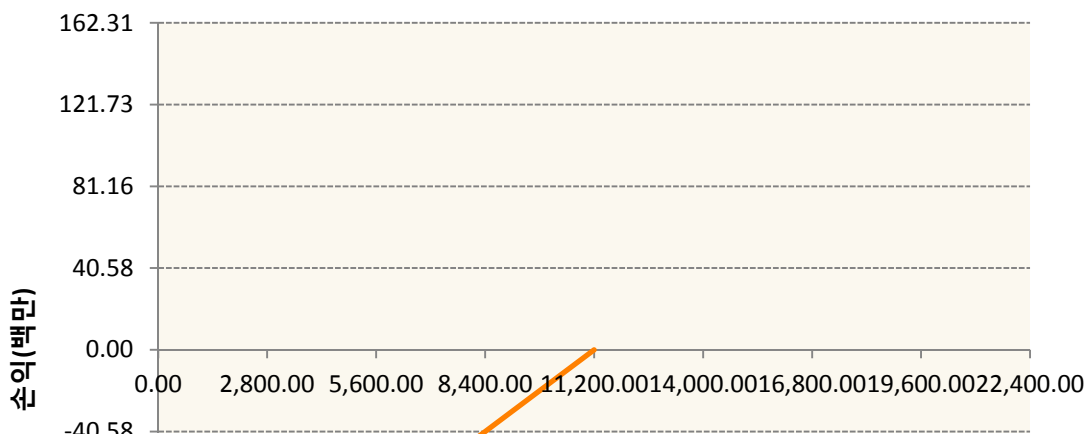


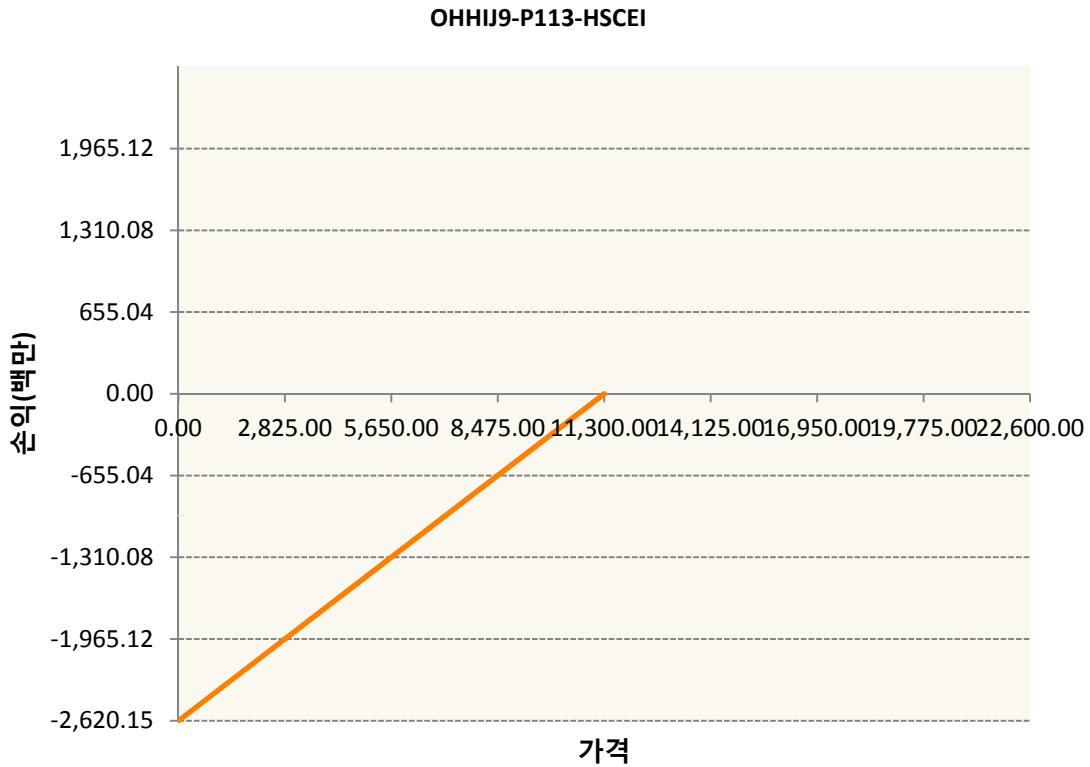
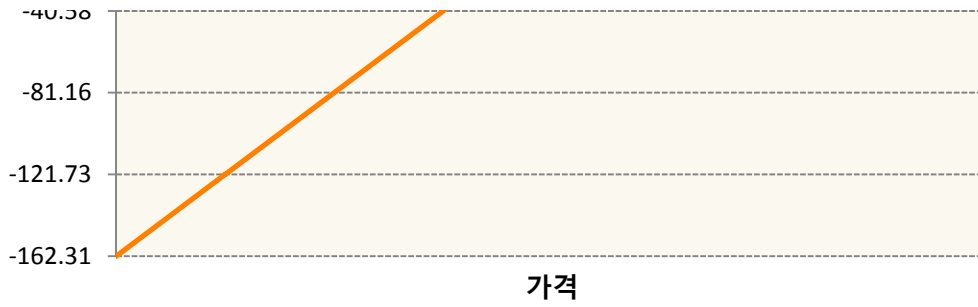


**OHHIJ9-C113-HSCEI**



**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	177
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)
	<b>720</b>

공시일	2019-04-19
기준일	2019-04-18

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

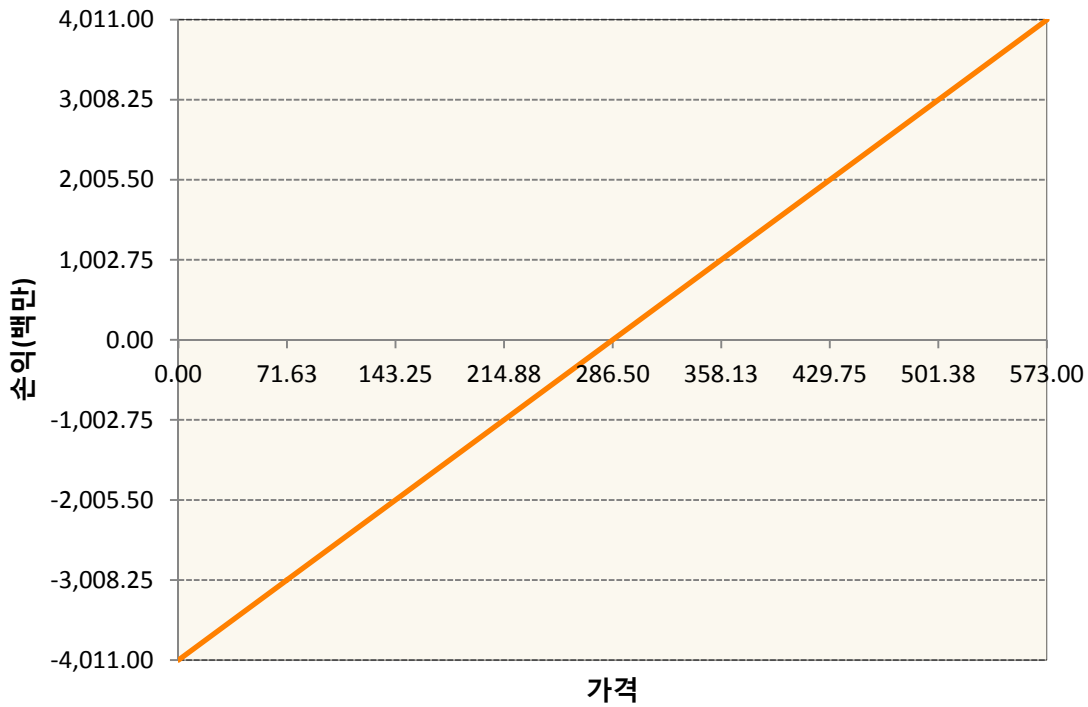
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

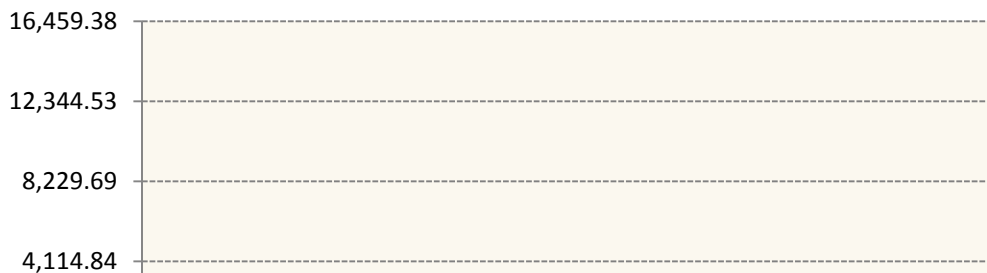
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	427	0	427	장내
누계	유가증권	선물	4,011	0	4,011	장내
누계	유가증권	스왑	35,836	0	35,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	32,694	-32,694	장내

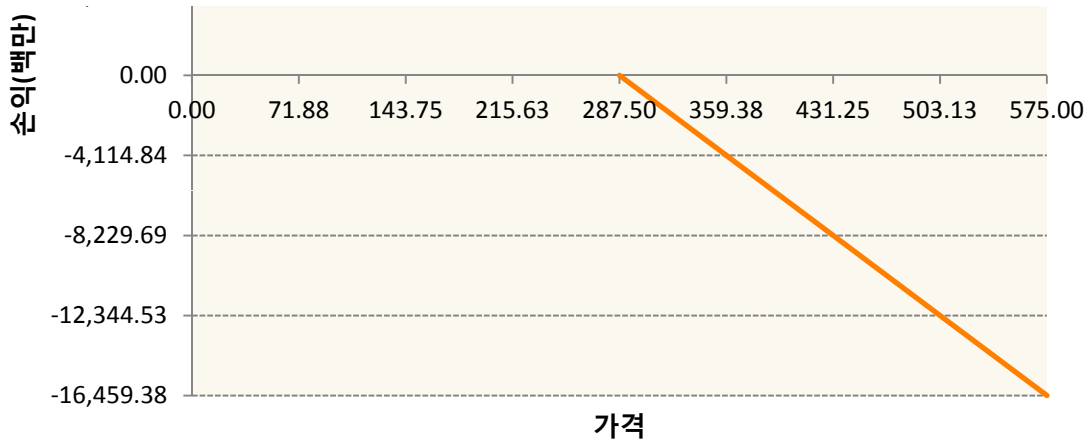
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

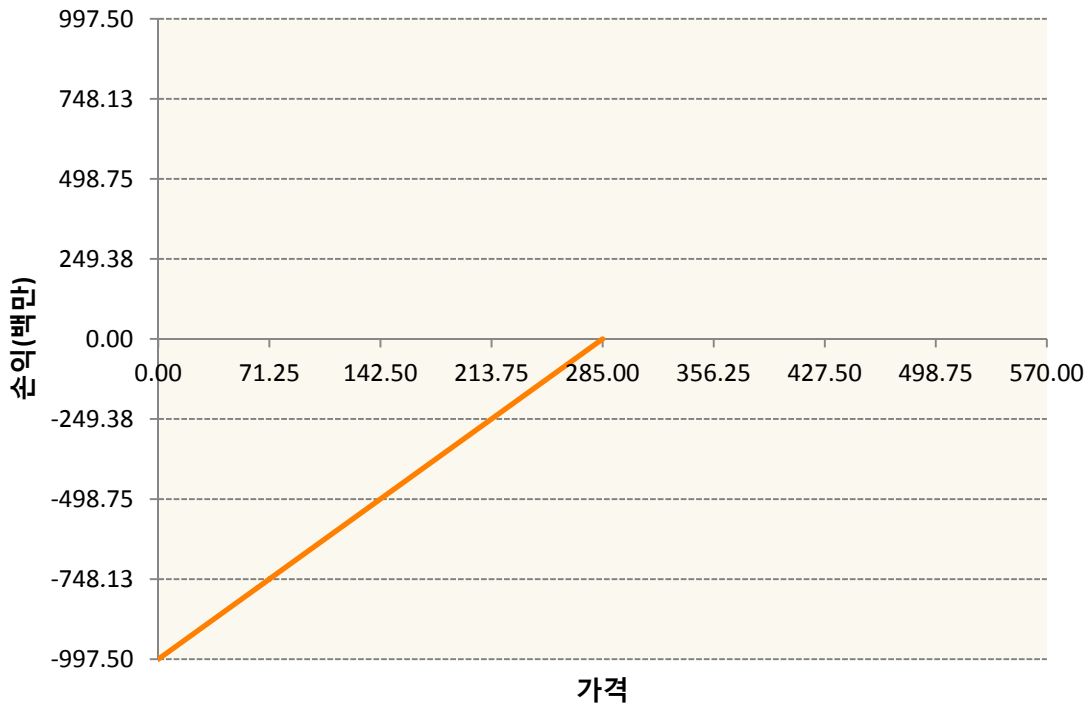


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

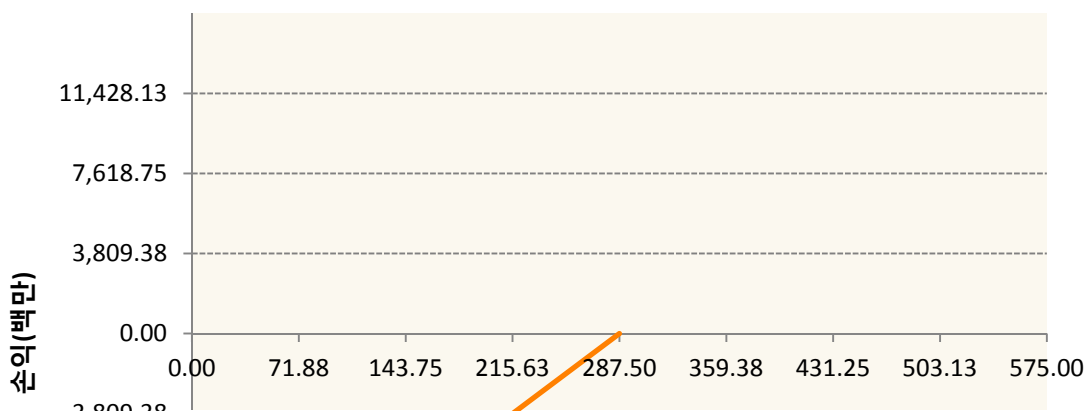


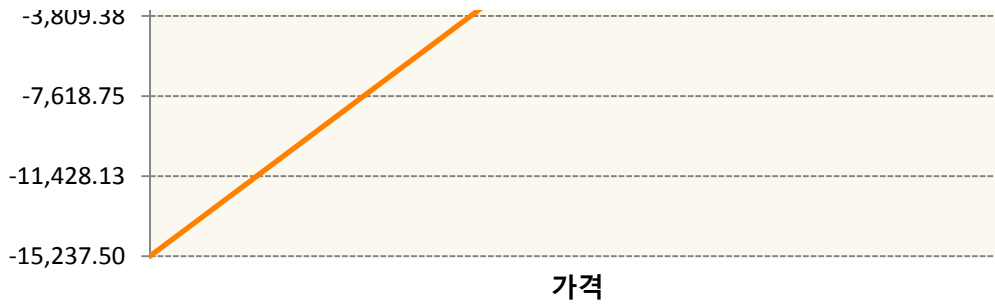


**KR4301P52858-2019-05 풋285**



**KR4301P52874-2019-05 풋287.5**





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,447
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,447	-2,447	-2,447	-2,447	-2,447	-2,447	-2,447	
-5.33%	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632	
-2.67%	-816	-816	-816	-816	-816	-816	-816	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	816	816	816	816	816	816	816	
5.33%	1,632	1,632	1,632	1,632	1,632	1,632	1,632	
8.00%	2,447	2,447	2,447	2,447	2,447	2,447	2,447	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						594
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-594	-594	-594	-594	-594	-594	-594	
-5.33%	-396	-396	-396	-396	-396	-396	-396	
-2.67%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	198	198	198	198	198	198	198	
5.33%	396	396	396	396	396	396	396	
8.00%	594	594	594	594	594	594	594	
KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						320
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-320	-320	-320	-320	-320	-320	-320	
-5.33%	-213	-213	-213	-213	-213	-213	-213	
-2.67%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	107	107	107	107	107	107	107	
5.33%	213	213	213	213	213	213	213	
8.00%	320	320	320	320	320	320	320	
KR4201P52876		2019-05 콜287.5						986
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	318	314	308	301	291	280	268
-5.33%	299	287	273	257	240	221	201
-2.67%	237	214	189	164	138	112	85
0%	92	61	31	0	-31	-61	-92
2.67%	-159	-187	-215	-245	-274	-304	-333
5.33%	-501	-520	-540	-562	-585	-610	-635
8.00%	-900	-909	-921	-934	-950	-967	-986
KR4301P52858                      2019-05 풋285							67

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67
-5.33%	-40	-40	-40	-40	-41	-41	-41
-2.67%	-15	-15	-16	-17	-18	-18	-19
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	10	9	9	8	7	7	6
5.33%	11	11	11	10	10	10	9
8.00%	11	11	11	11	11	11	11

KR4301P52874                      2019-05 풋287.5                      1,071

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,069	-1,069	-1,069	-1,070	-1,070	-1,070	-1,071
-5.33%	-666	-667	-668	-670	-672	-675	-679
-2.67%	-273	-279	-286	-294	-303	-312	-322
0%	45	30	15	0	-15	-30	-45
2.67%	197	187	175	163	150	137	124
5.33%	230	228	224	220	214	208	201
8.00%	233	233	232	231	230	228	226

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

(단위:백만원)

**5,619**

공시일	2019-04-19
기준일	2019-04-18

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

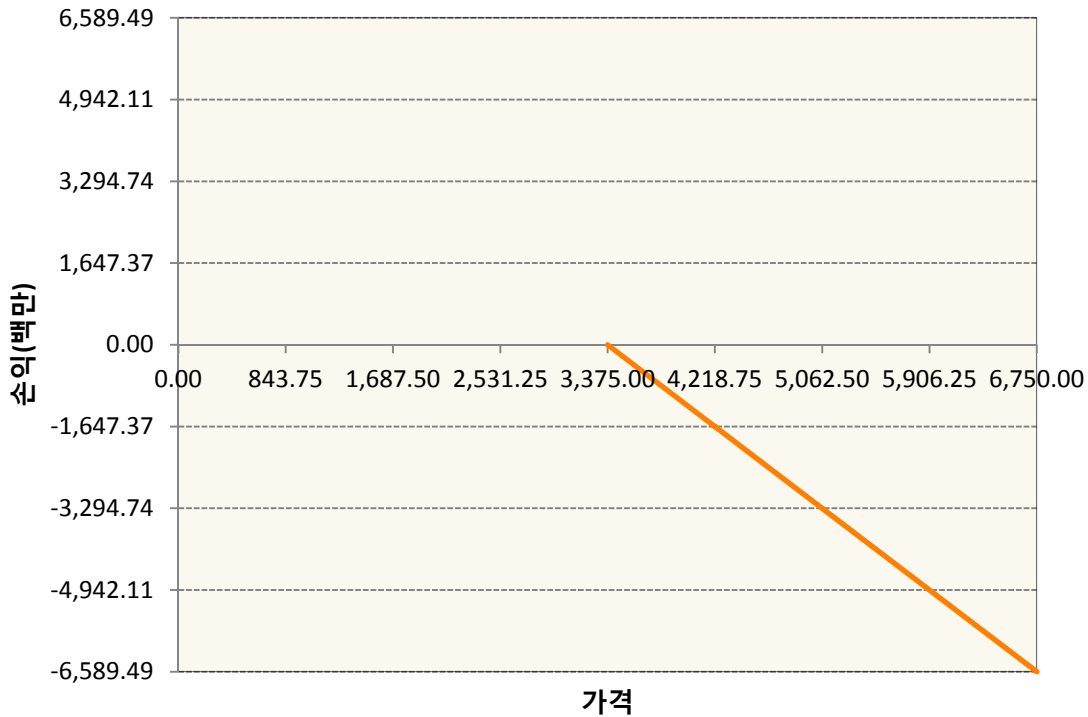
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

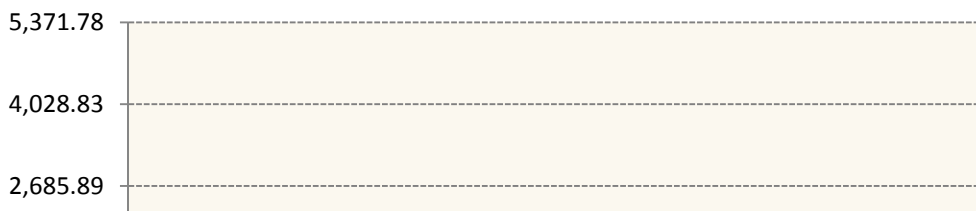
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,250	0	5,250	
누계	유가증권	스왑	60,641	0	60,641	장외
누계	유가증권	옵션	0	23,923	-23,923	장내
누계	통화	선도	0	17,983	-17,983	장외

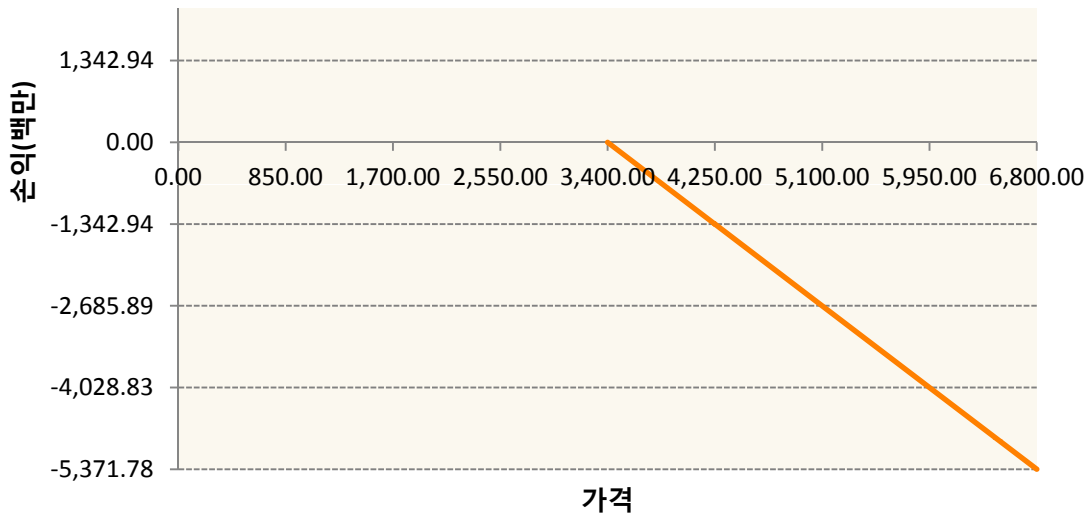
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXJ9-C3375-EURO STOXX 50**

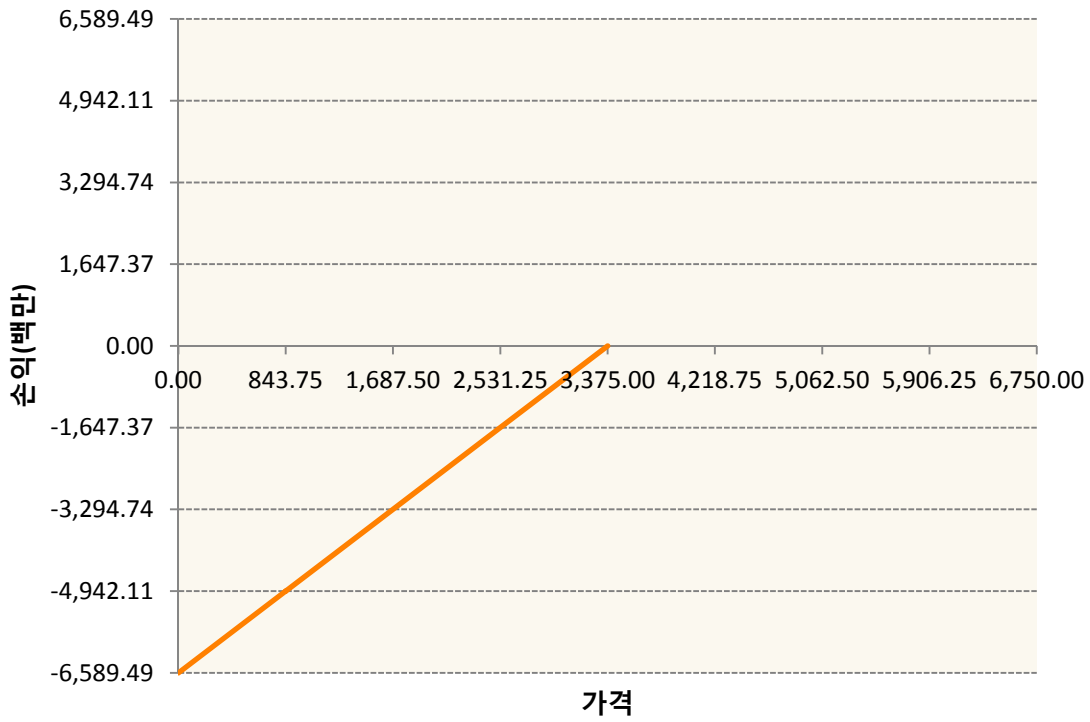


**OESXJ9-C3400-EURO STOXX 50**

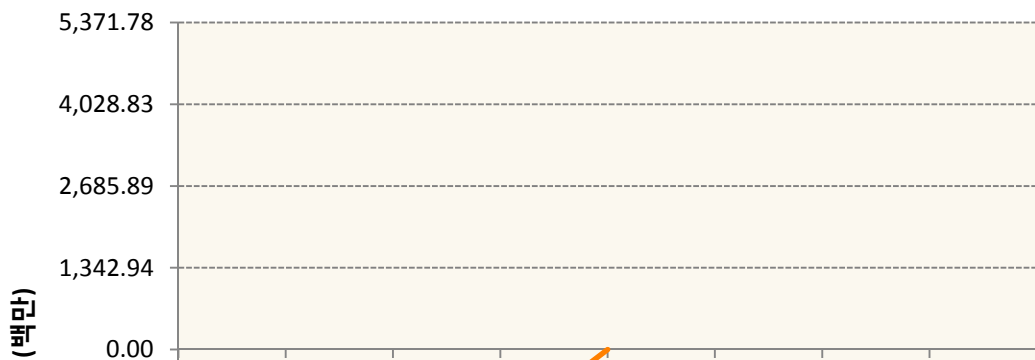


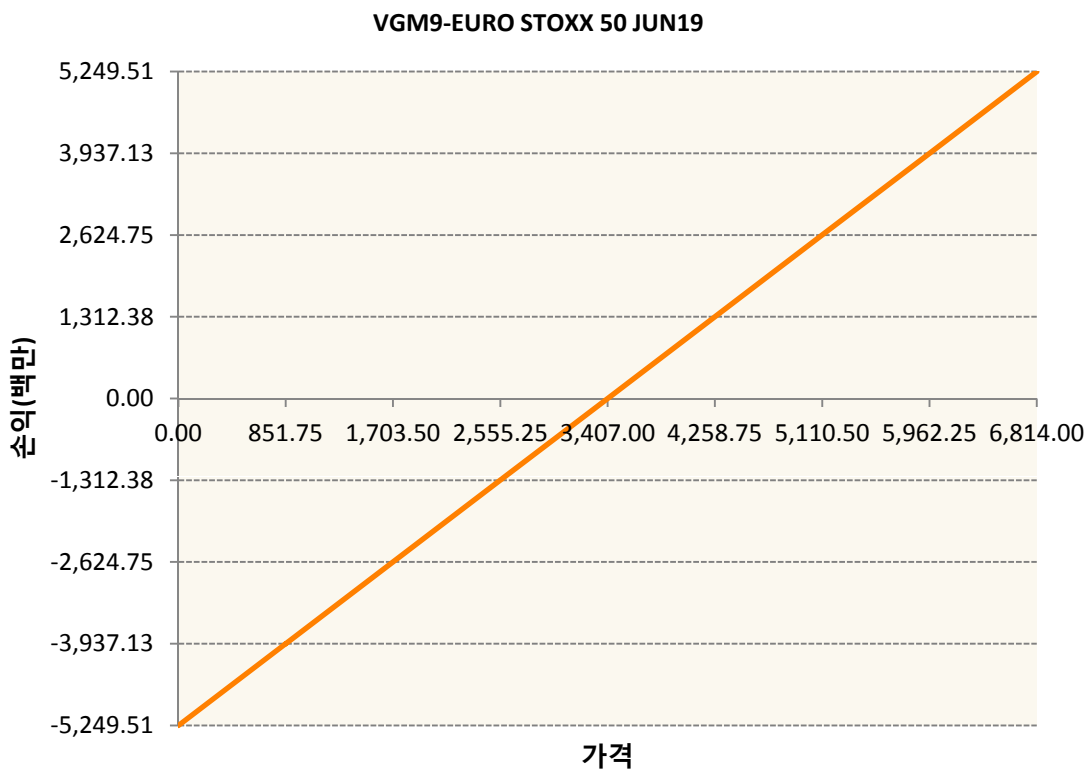
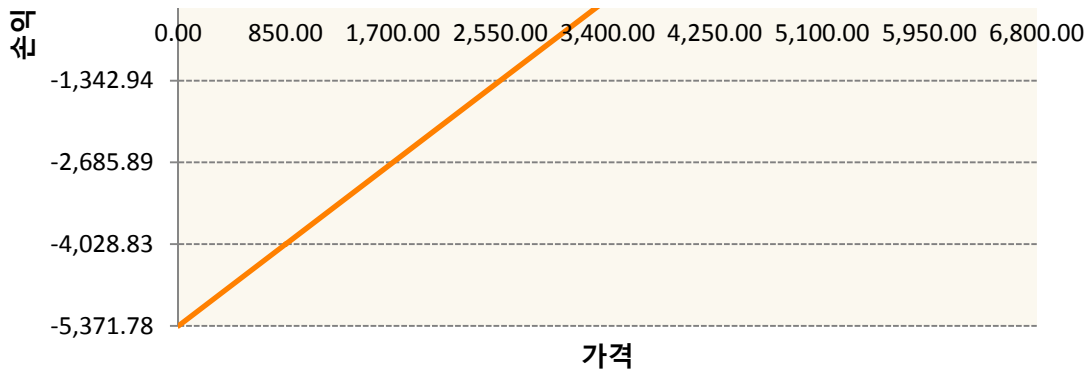


OESXJ9-P3375-EURO STOXX 50



OESXJ9-P3400-EURO STOXX 50





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	210
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	411
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	822
FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E	206
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	420

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

(단위:백만원)

2,600



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

(단위:백만원)

1,098



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

(단위:백만원)

94



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

(단위:백만원)

136

공시일	2019-04-19
기준일	2019-04-18

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

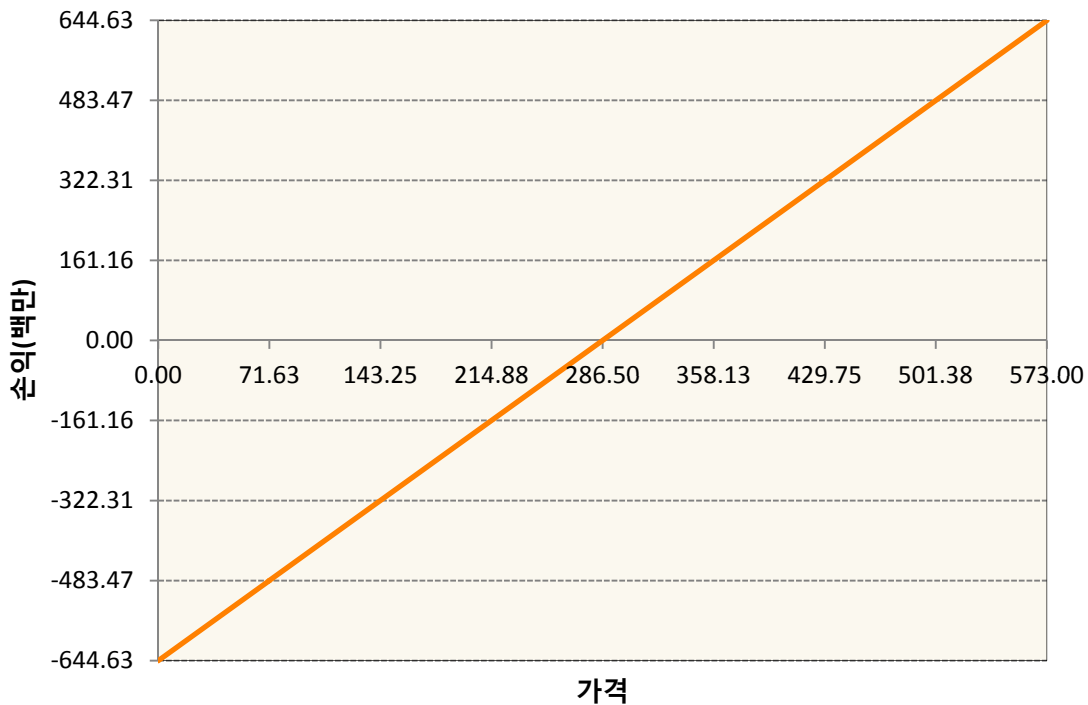
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	645	0	645	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 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	

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

(단위:백만원)

42

공시일	2019-04-19
기준일	2019-04-18

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

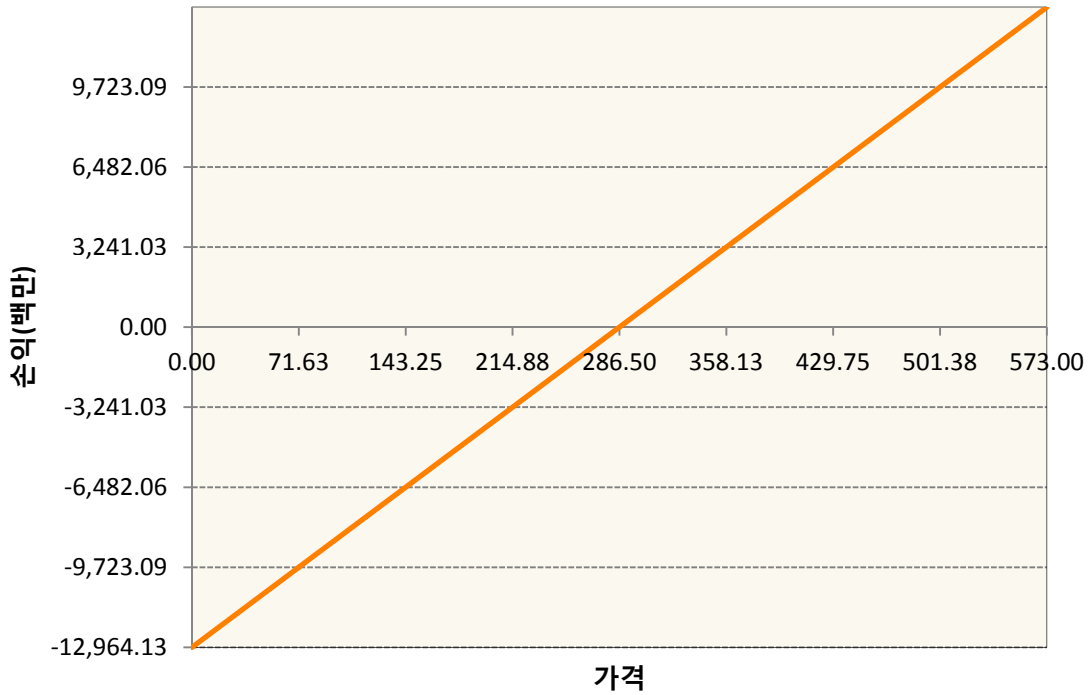
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

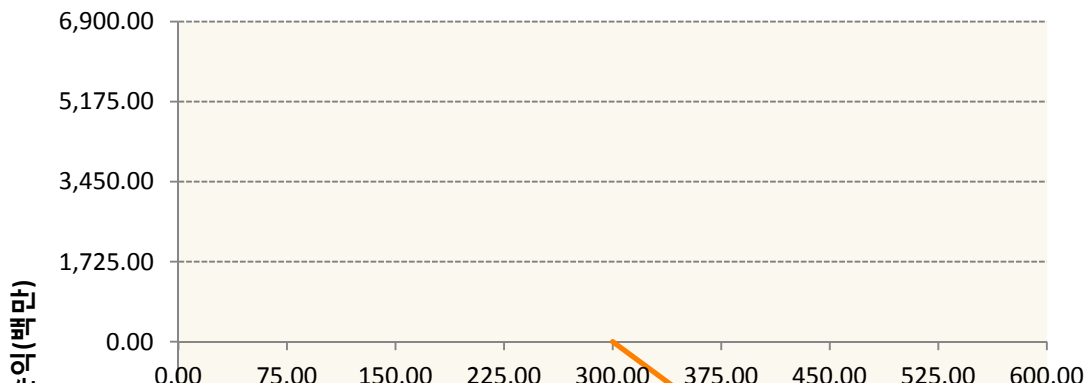
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	377	0	377	장내
누계	유가증권	선물	12,964	0	12,964	장내
누계	유가증권	옵션	1,366	24,294	-22,928	장내

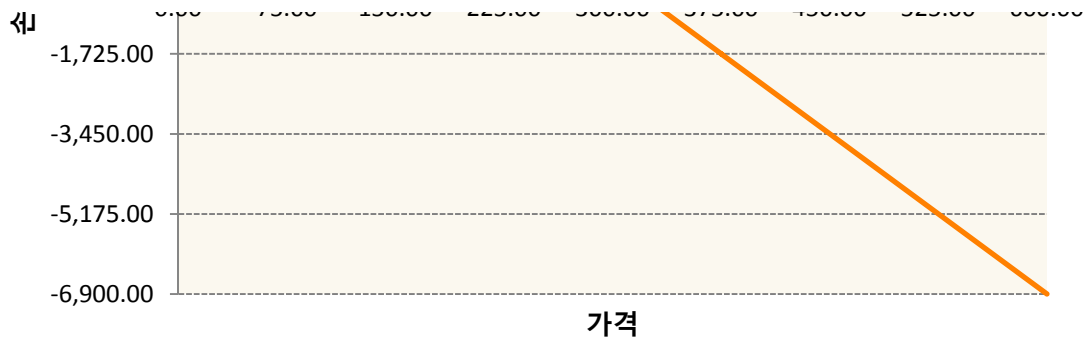
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

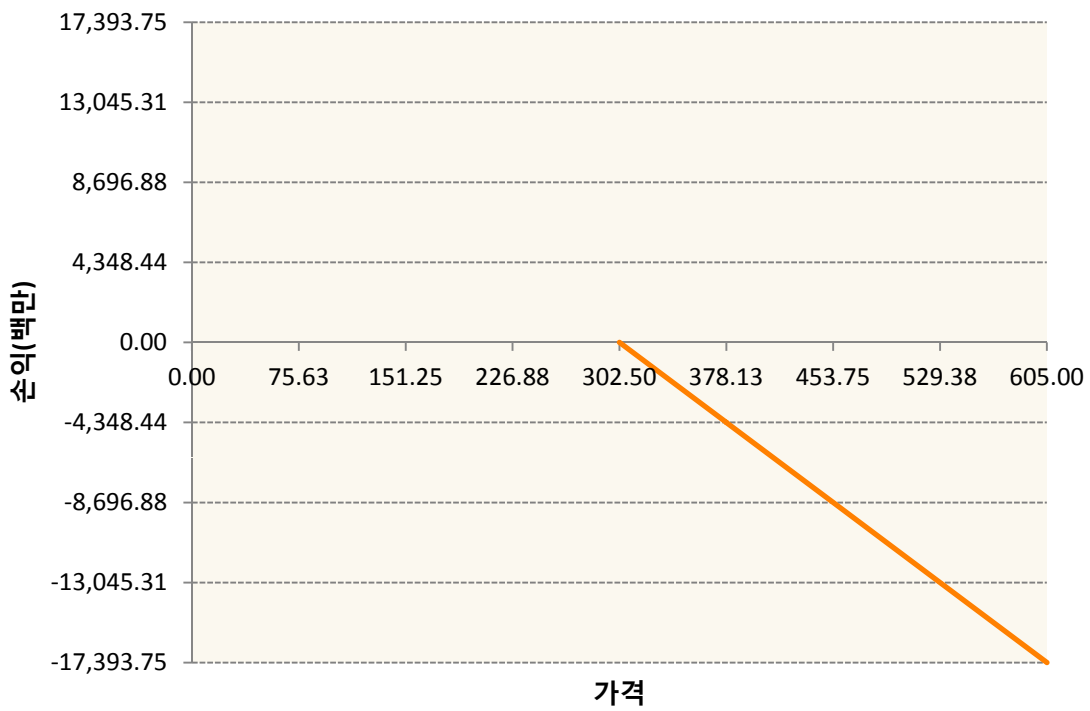


KR4201P53007-2019-05 콜300

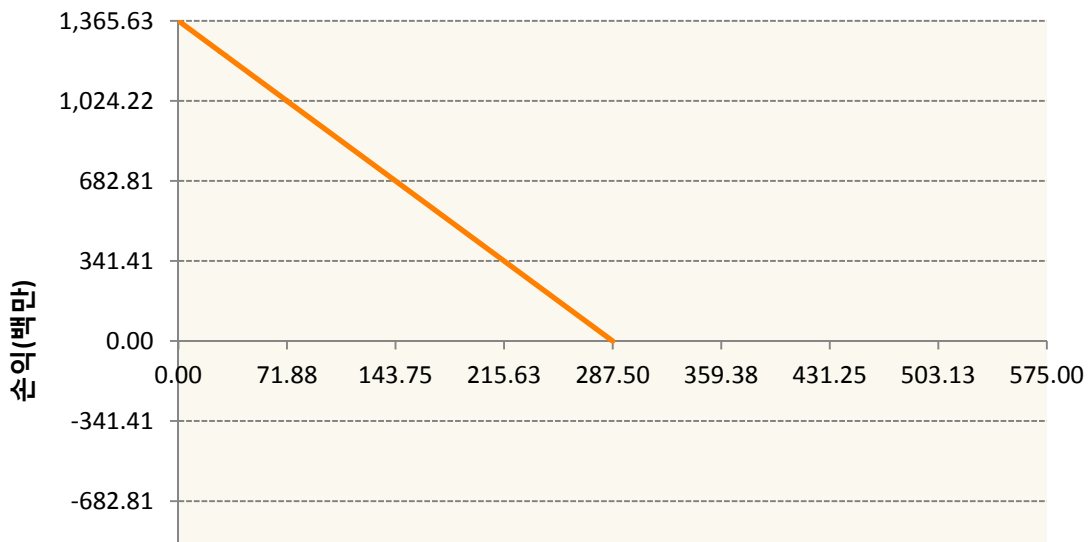


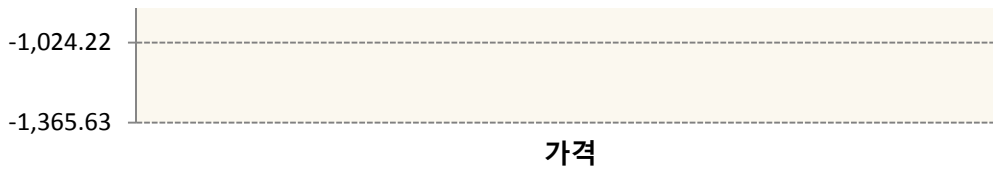


**KR4201P53023-2019-05 콜302.5**



**KR4301P52874-2019-05 풋287.5**





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

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						1,035
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,035	-1,035	-1,035	-1,035	-1,035	-1,035	-1,035	
-5.33%	-690	-690	-690	-690	-690	-690	-690	
-2.67%	-345	-345	-345	-345	-345	-345	-345	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	345	345	345	345	345	345	345	
5.33%	690	690	690	690	690	690	690	
8.00%	1,035	1,035	1,035	1,035	1,035	1,035	1,035	
KR4201P53007		2019-05 콜300						271
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	41	41	40	40	39	37	36	
-5.33%	40	40	38	36	34	30	26	
-2.67%	37	34	30	25	20	14	7	
0%	23	16	8	0	-9	-18	-28	
2.67%	-14	-25	-37	-48	-60	-72	-85	
5.33%	-88	-101	-113	-126	-139	-152	-165	
8.00%	-202	-212	-224	-235	-247	-259	-271	
KR4201P53023		2019-05 콜302.5						612
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	78	78	78	77	75	72	68	
-5.33%	78	76	74	70	65	58	50	
-2.67%	72	67	59	50	39	26	11	
0%	49	35	18	0	-20	-41	-64	
2.67%	-21	-47	-73	-101	-129	-157	-187	
5.33%	-174	-206	-238	-271	-303	-336	-368	
8.00%	-427	-457	-487	-518	-549	-580	-612	
KR4301P52874		2019-05 풋287.5						96
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	96	96	96	96	96	96	96	
-5.33%	60	60	60	60	60	60	61	
-2.67%	25	25	26	26	27	28	29	

0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-18	-17	-16	-15	-13	-12	-11
5.33%	-21	-20	-20	-20	-19	-19	-18
8.00%	-21	-21	-21	-21	-21	-20	-20

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

(단위:백만원)

**1,584**

공시일	2019-04-19
기준일	2019-04-18

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	91	0	91	
누계	유가증권	수익증권	3,711	0	3,711	

### 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	2019-04-19
기준일	2019-04-18

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,842	0	2,842	
누계	유가증권	수익증권	56,249	0	56,249	

### 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	2019-04-19
기준일	2019-04-18

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	37,518	0	37,518	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	115,963	0	115,963	
누계	통화	선도	0	147,422	-147,422	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019H01 KRW/USD 19-04-19E		146
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E		118
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E		207
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E		255
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E		155
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E		364
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E		427
FX21019H03 KRW/USD 22-04-19E		364
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E		364
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E		418
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E		182
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E		455
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E		528
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		155
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	1,273
FX21019J01H KRW/USD 17-05-19E	1,364
FX21019J01I KRW/USD 18-06-19E	364
FX21019J02C KRW/USD 20-05-19E	491
FX21019J02D KRW/USD 20-05-19E	462
FX21019J02E KRW/USD 24-06-19E	910
FX21019J02F KRW/USD 22-05-19E	764

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

(단위:백만원)

**4,008**

공시일	2019-04-19
기준일	2019-04-18

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

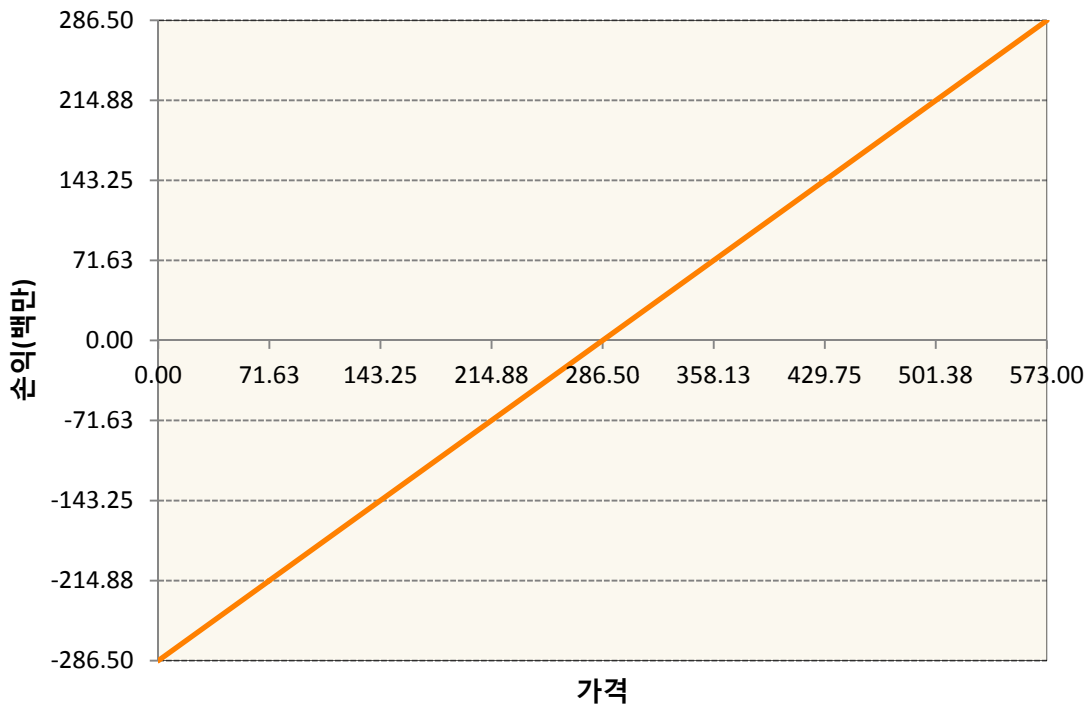
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

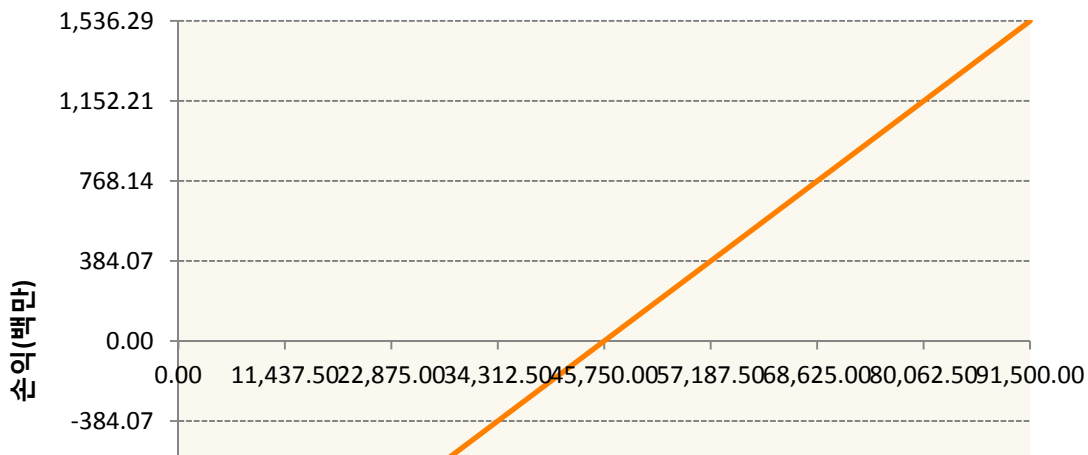
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,823	0	1,823	장내

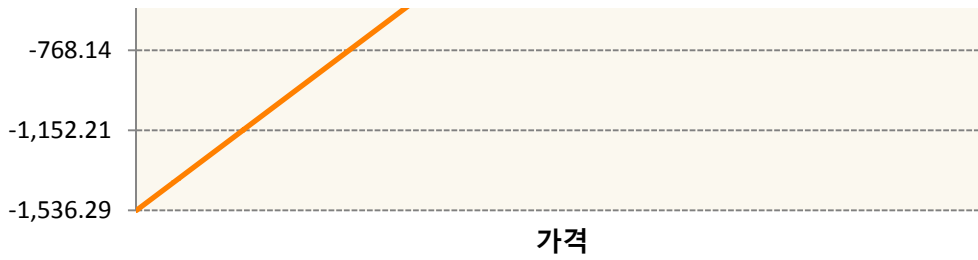
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4111P50004-2019-05 삼성전자개별선물





**3. 시나리오 별 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						122
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-122	-122	-122	-122	-122	-122	-122	
-5.33%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82	
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	41	41	41	41	41	41	41	
5.33%	82	82	82	82	82	82	82	
8.00%	122	122	122	122	122	122	122	

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

**160**

공시일	2019-04-19
기준일	2019-04-18

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

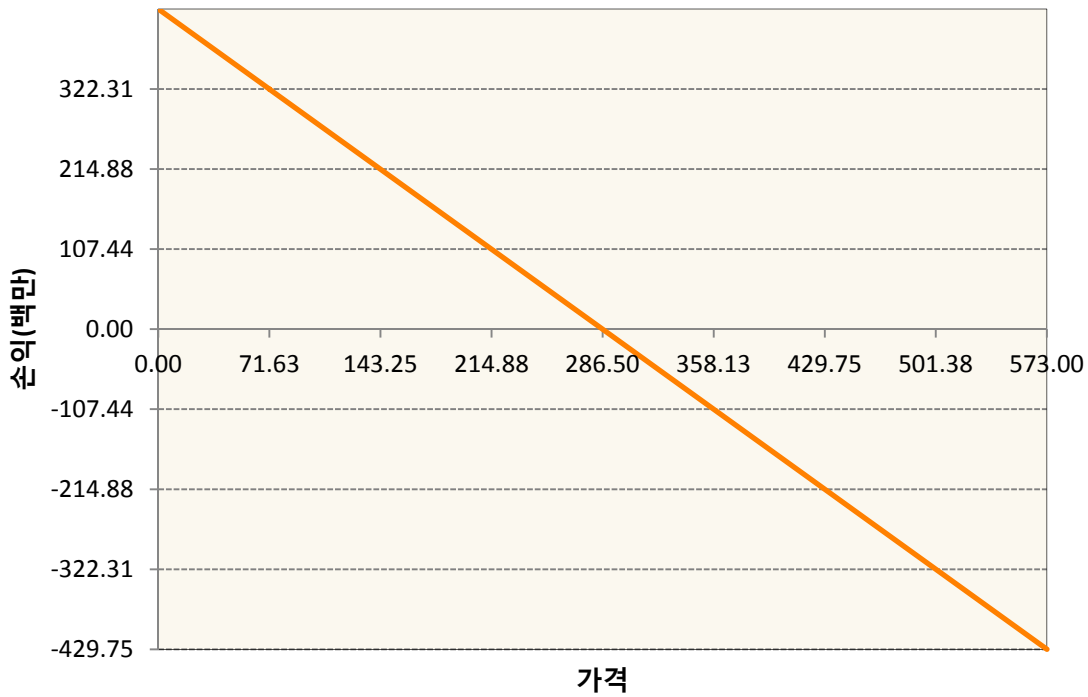
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

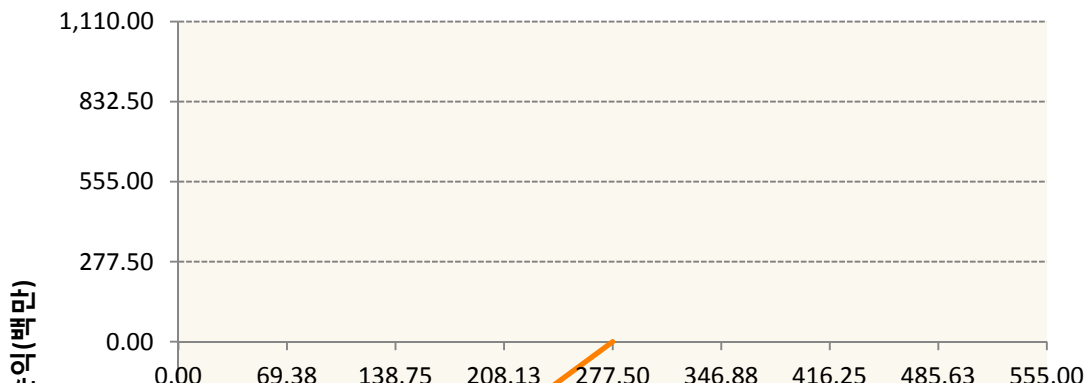
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	140	-140	장내
누계	유가증권	선물	0	430	-430	장내
누계	유가증권	옵션	0	2,370	-2,370	장내

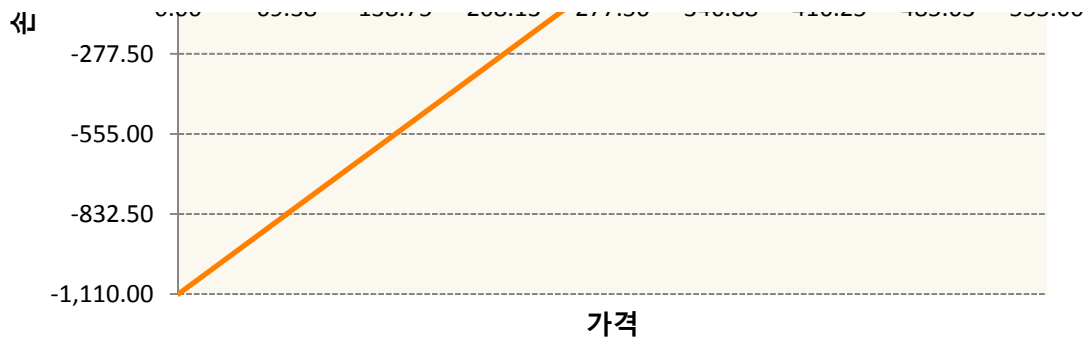
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

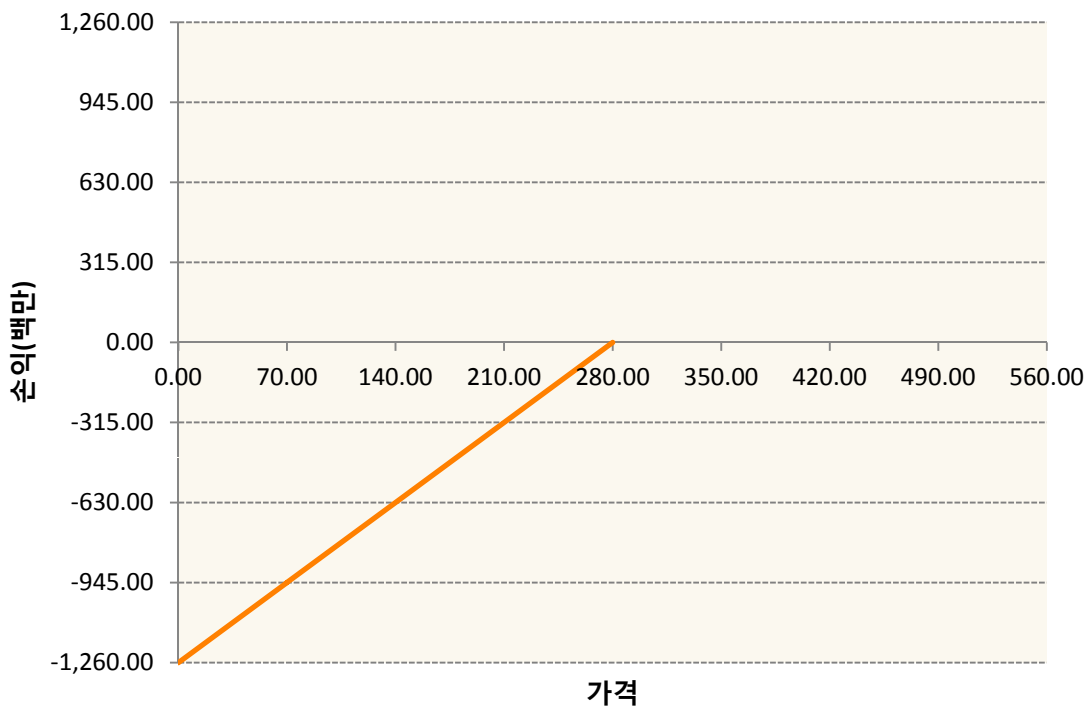


KR4301P52775-2019-05 풋277.5





KR4301P52809-2019-05 풋280



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						34
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	34	34	34	34	34	34	34	
-5.33%	23	23	23	23	23	23	23	
-2.67%	11	11	11	11	11	11	11	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11	
5.33%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23	
8.00%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34	
KR4301P52775		2019-05 풋277.5						57
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-55	-55	-56	-56	-56	-56	-57
-5.33%	-27	-27	-28	-29	-29	-30	-31
-2.67%	-6	-7	-8	-9	-10	-11	-12
0%	2	1	1	0	-1	-2	-2
2.67%	3	3	3	3	2	2	2
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

KR4301P52809

2019-05 풋280

72

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-71	-71	-71	-71	-72	-72	-72
-5.33%	-38	-38	-39	-39	-40	-41	-41
-2.67%	-10	-11	-13	-14	-15	-16	-18
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	6	5	5	5	4	4	3
5.33%	6	6	6	6	6	5	5
8.00%	6	6	6	6	6	6	6

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

(단위:백만원)

146

공시일	2019-04-19
기준일	2019-04-18

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

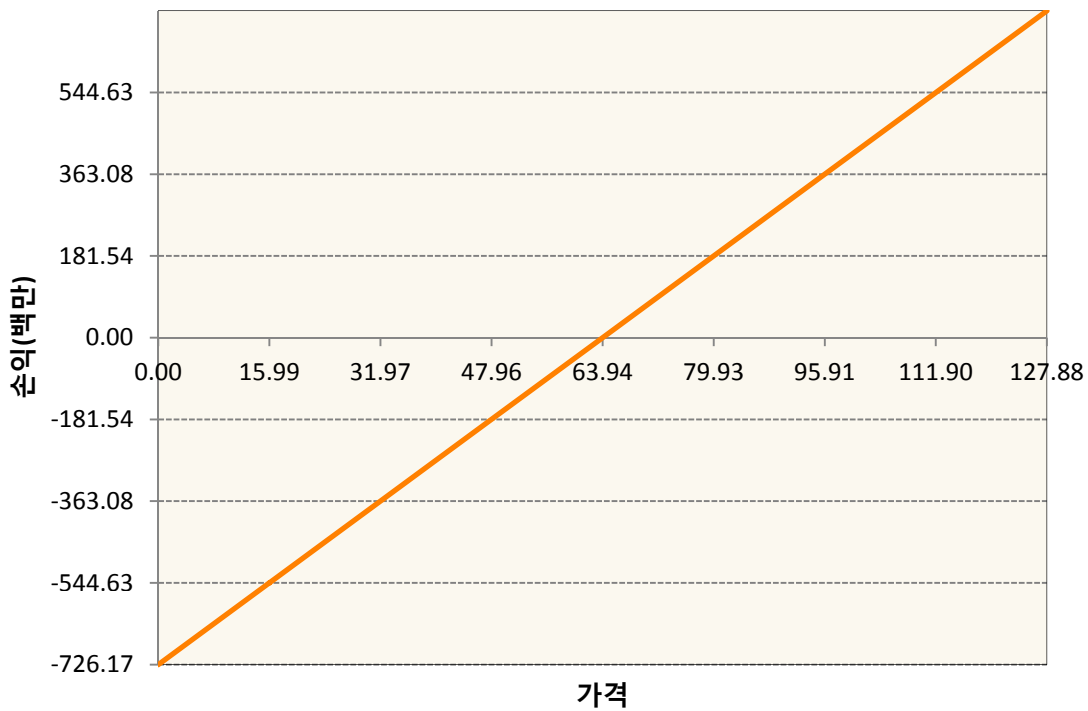
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

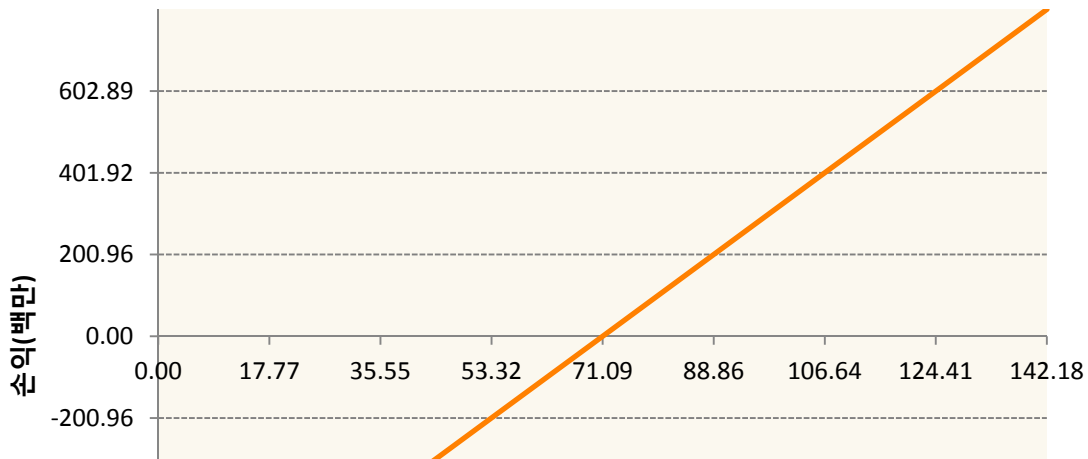
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,958	284	2,674	

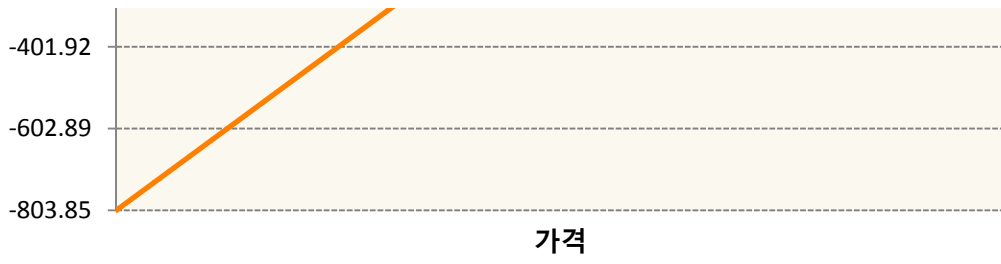
### 2. 만기시점의 손익구조

CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19

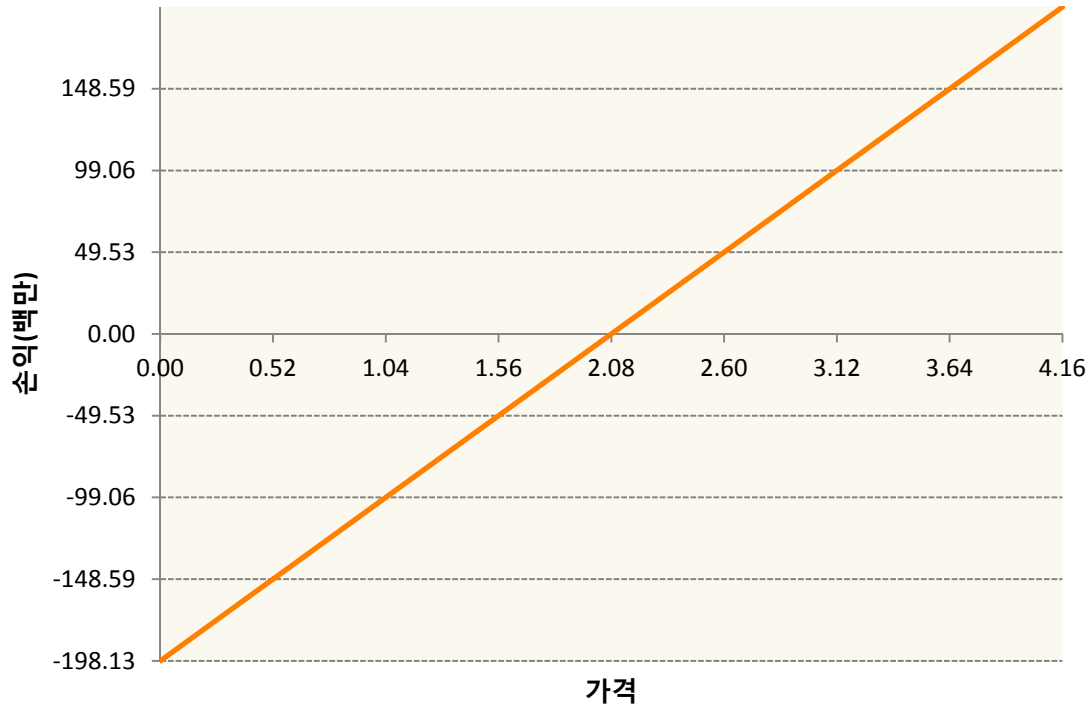


CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19

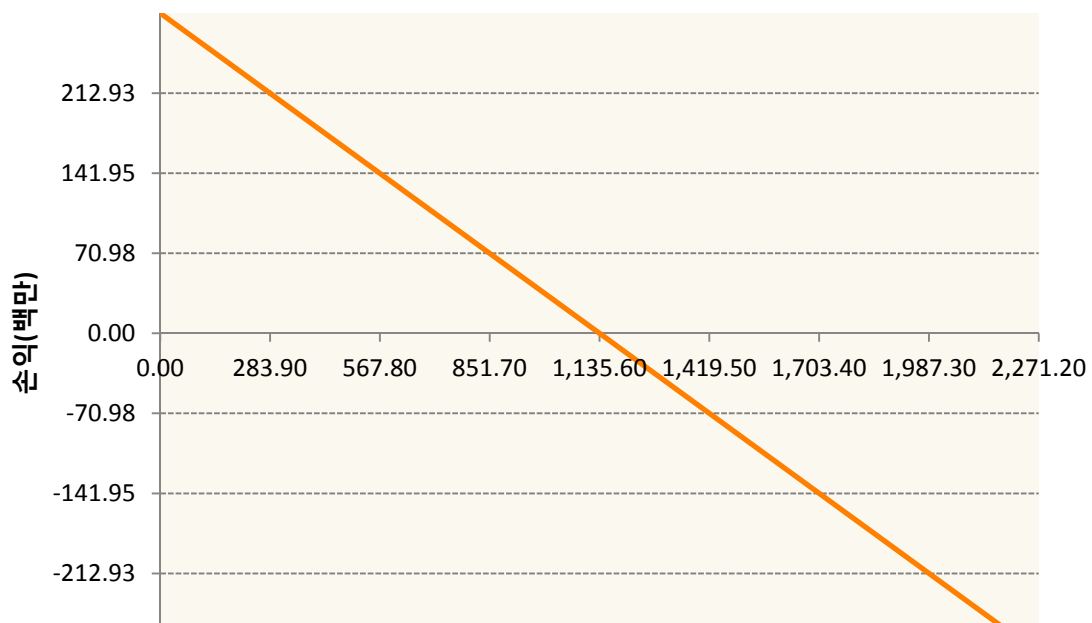


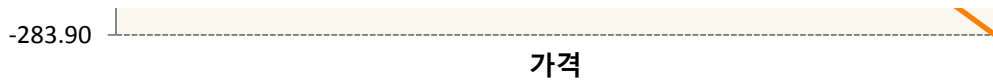


HON9-NY Harb ULSD Fut Jul19

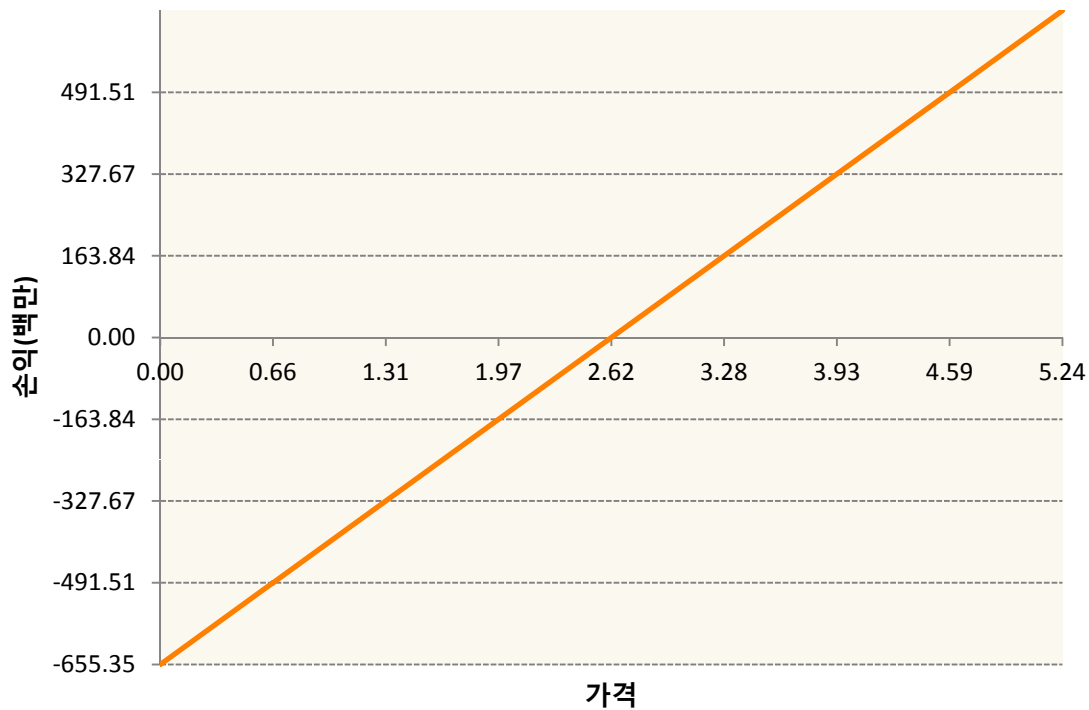


KR4175P50009-2019-05 달러선물

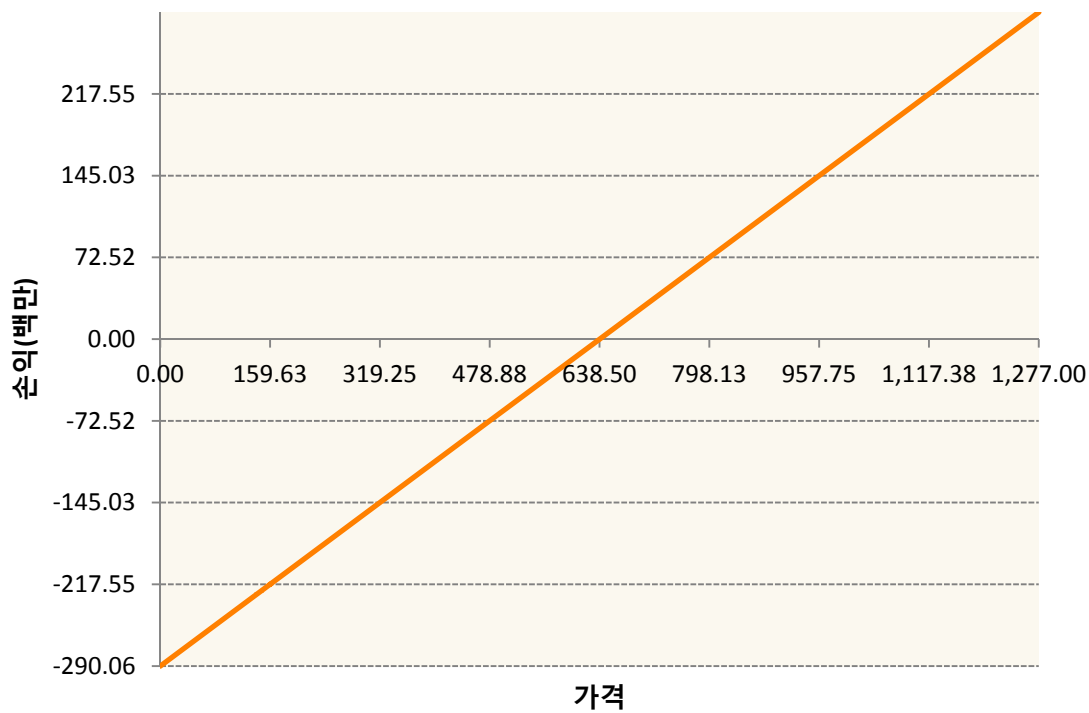




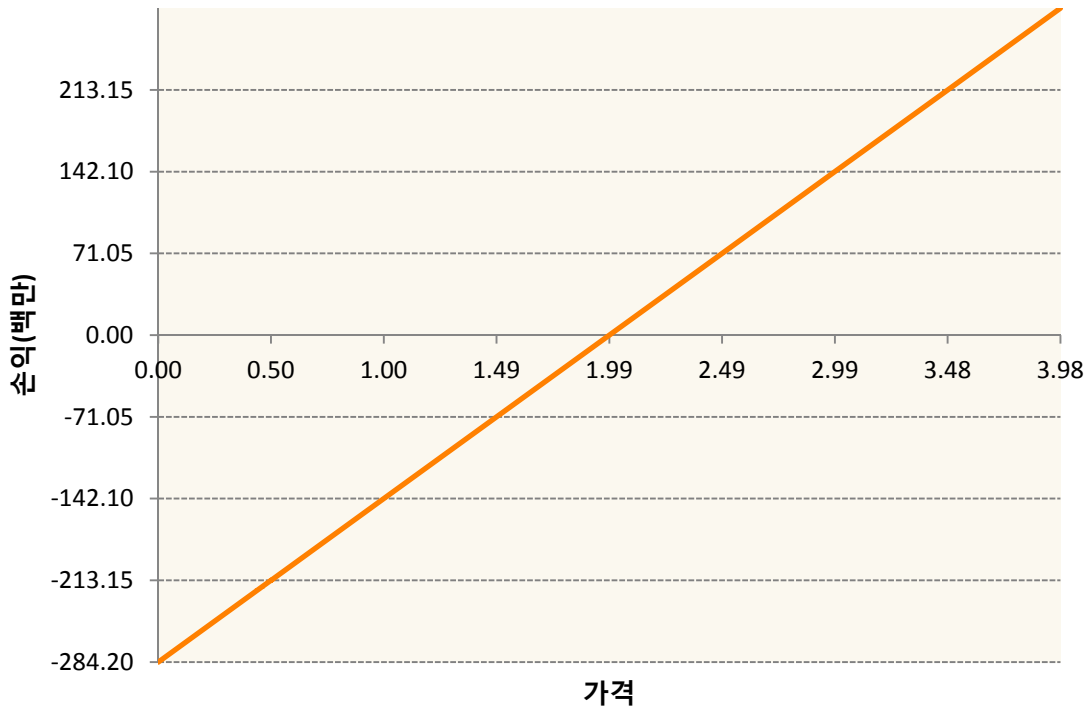
NGN19-NATURAL GAS FUTR Jul19



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	52
QSN9	Low Su Gasoil G Jul19	23
XBN9	GASOLINE RBOB FUT Jul19	23

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

(단위:백만원)

437

공시일	2019-04-19
기준일	2019-04-18

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

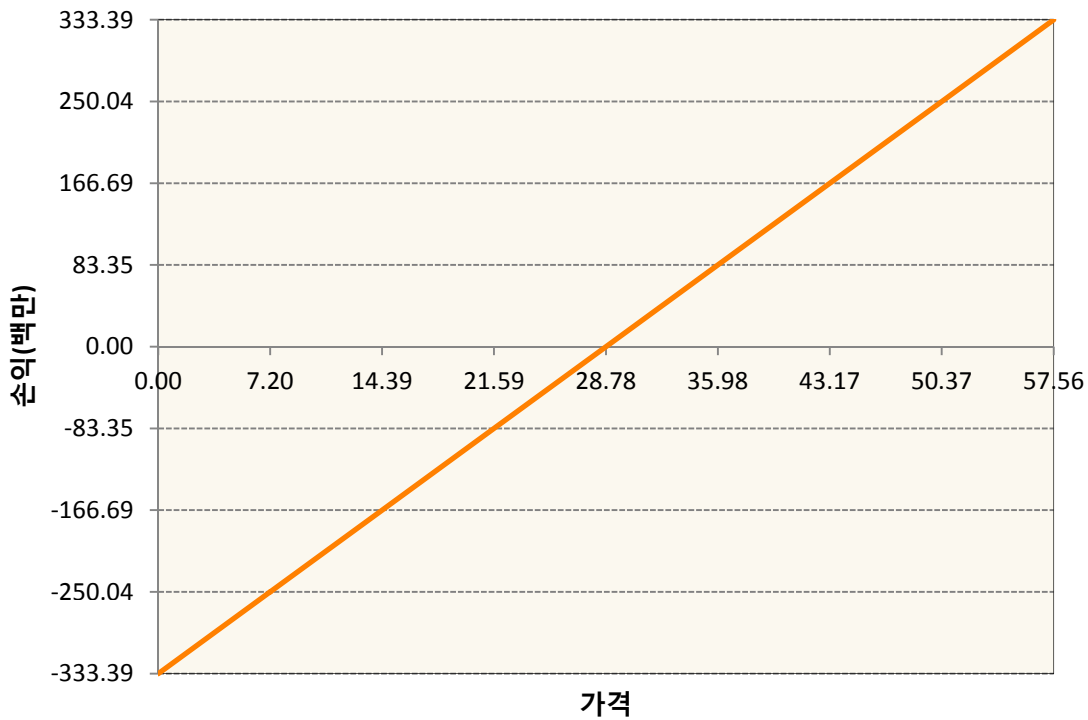
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

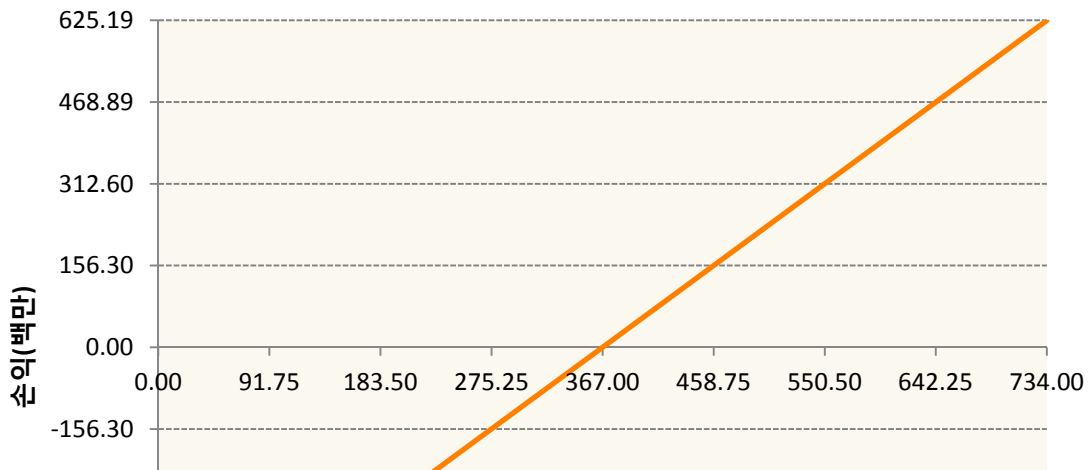
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,189	57	3,132	

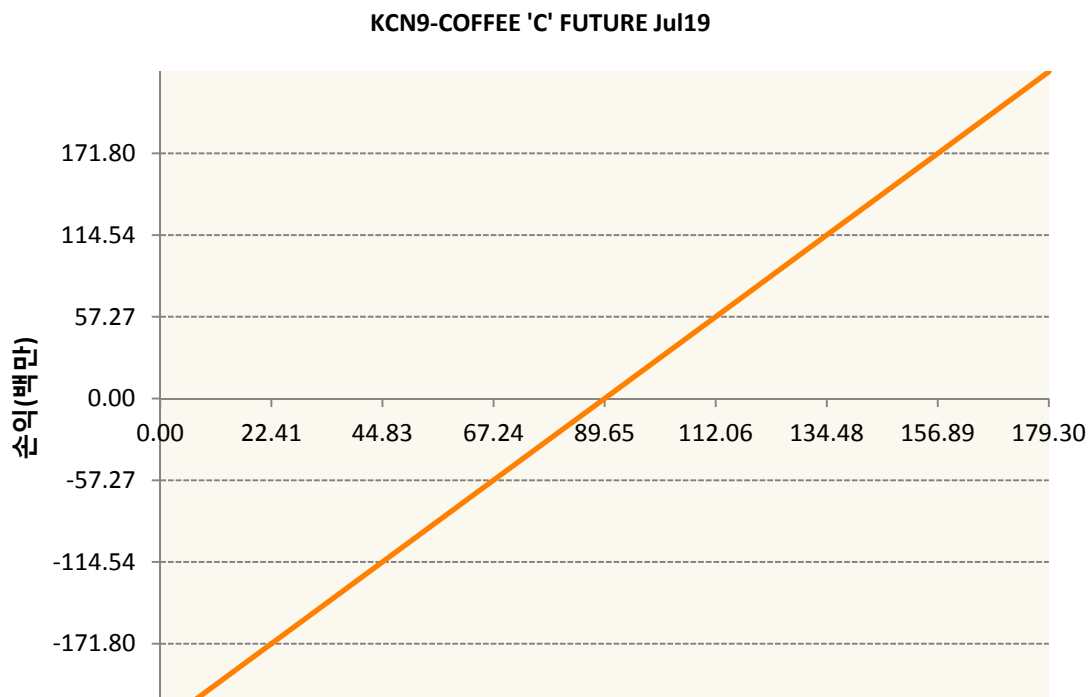
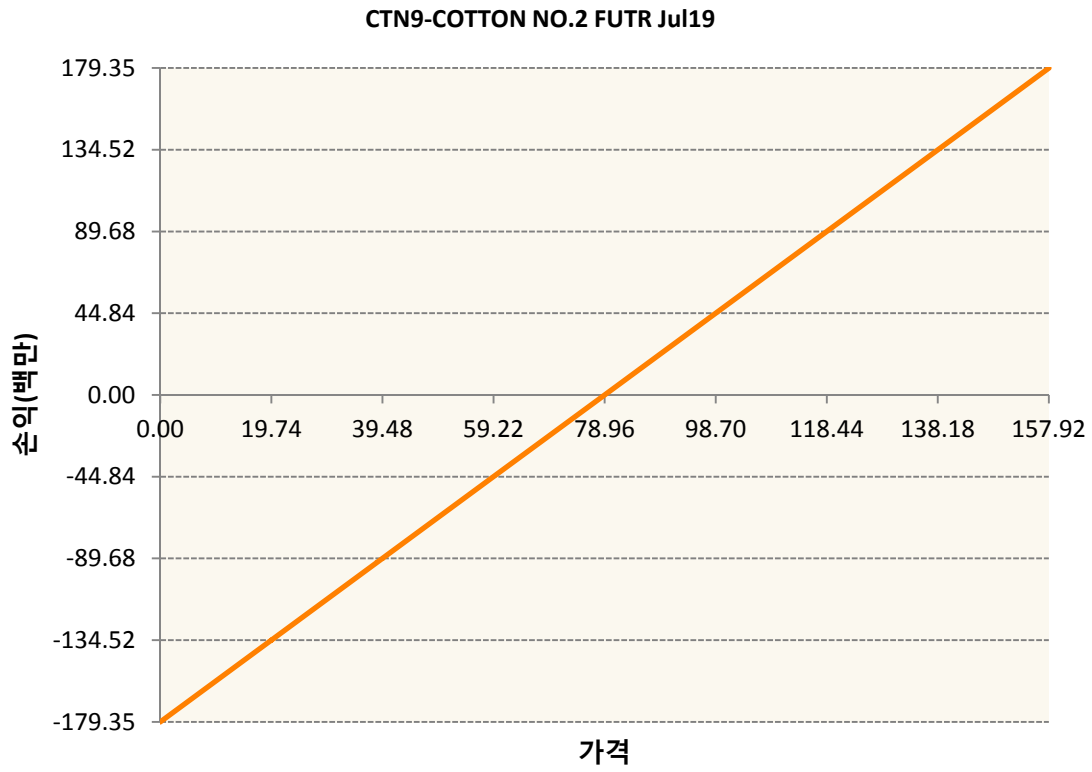
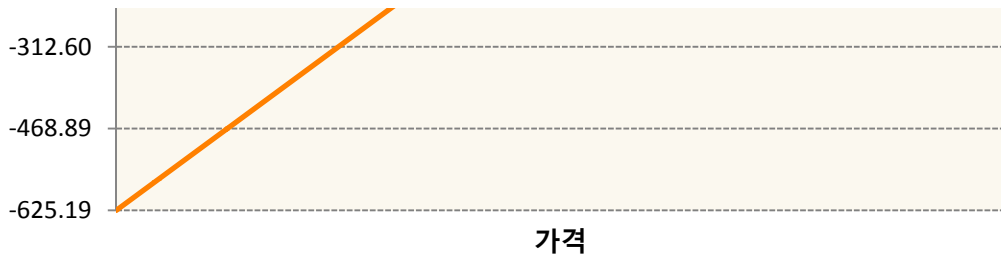
### 2. 만기시점의 손익구조

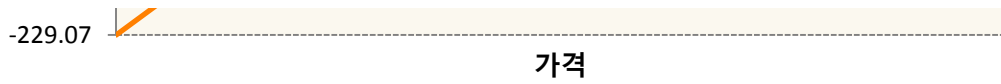
**BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19**



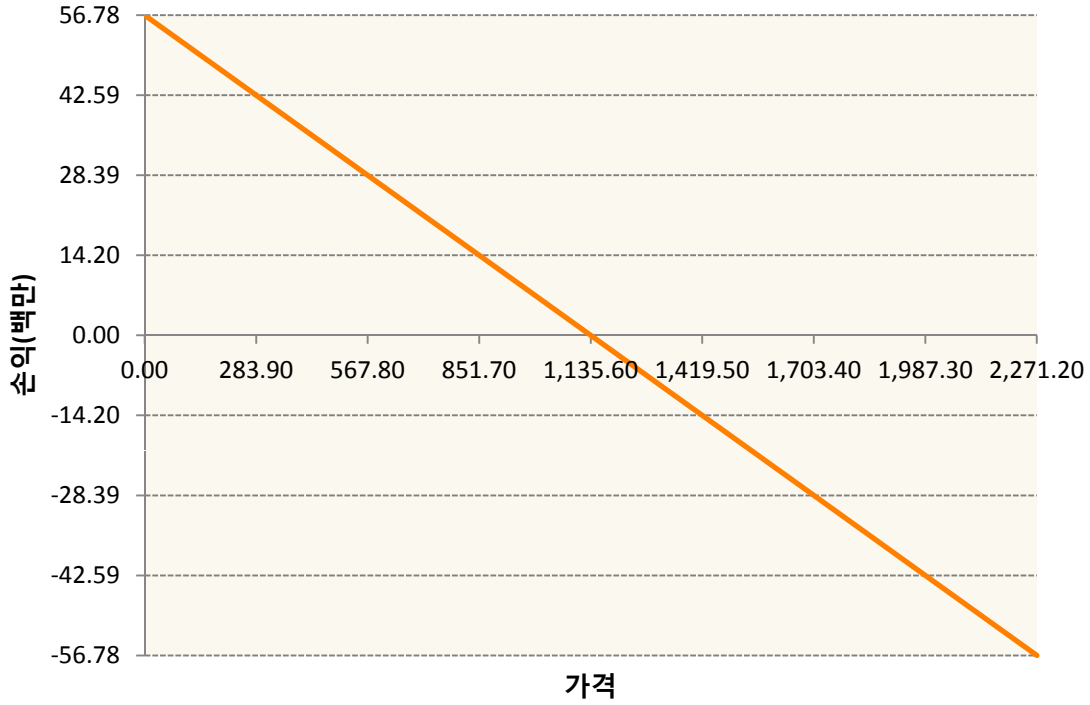
**CN9-CORN FUTURE Jul19**



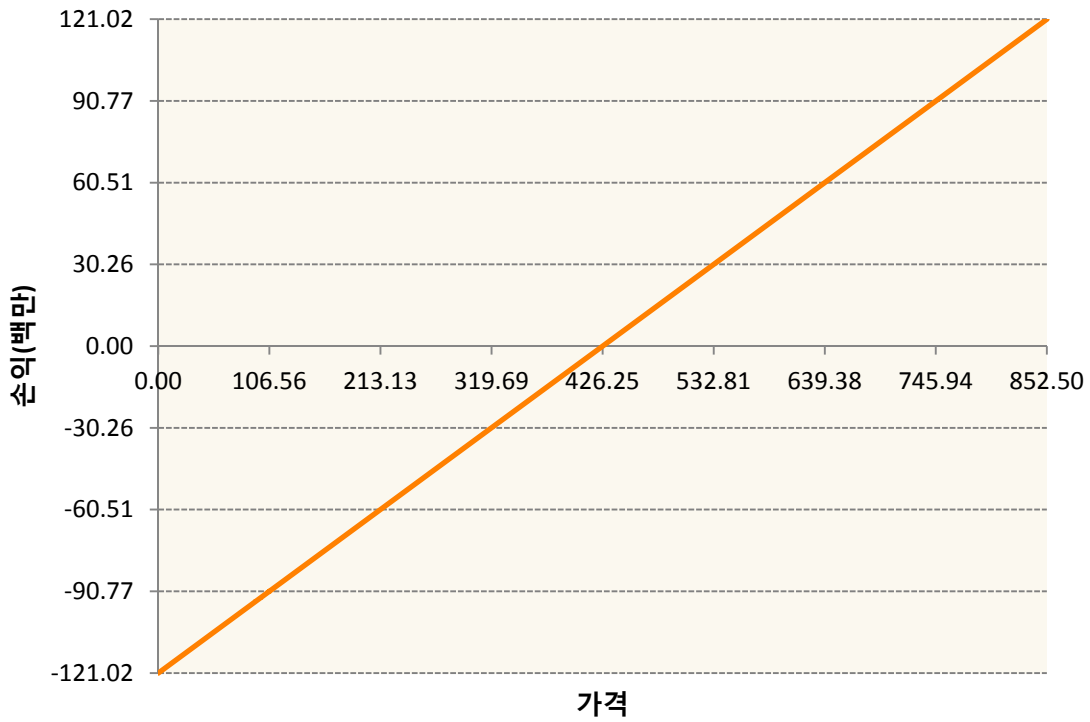




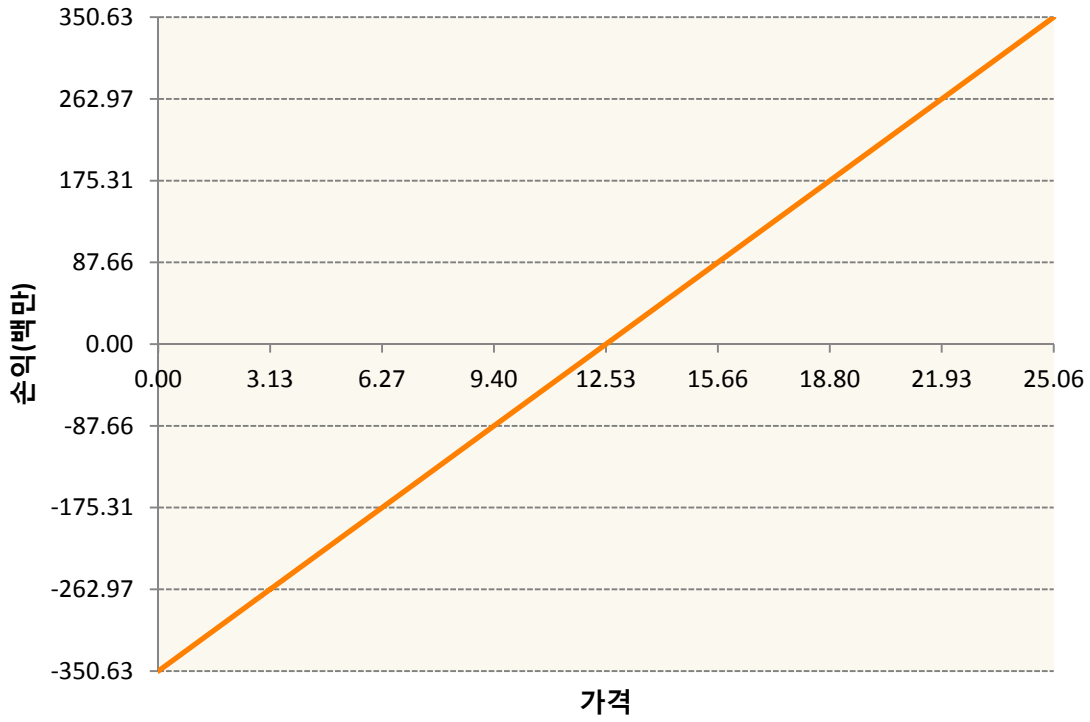
KR4175P50009-2019-05 달러선물



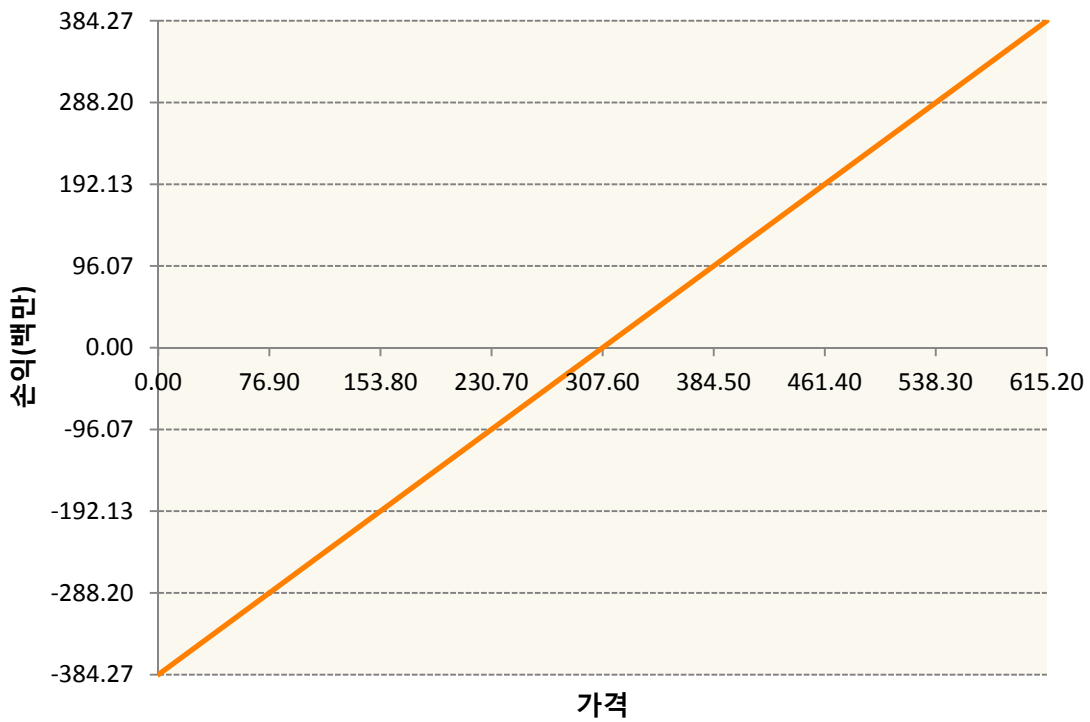
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

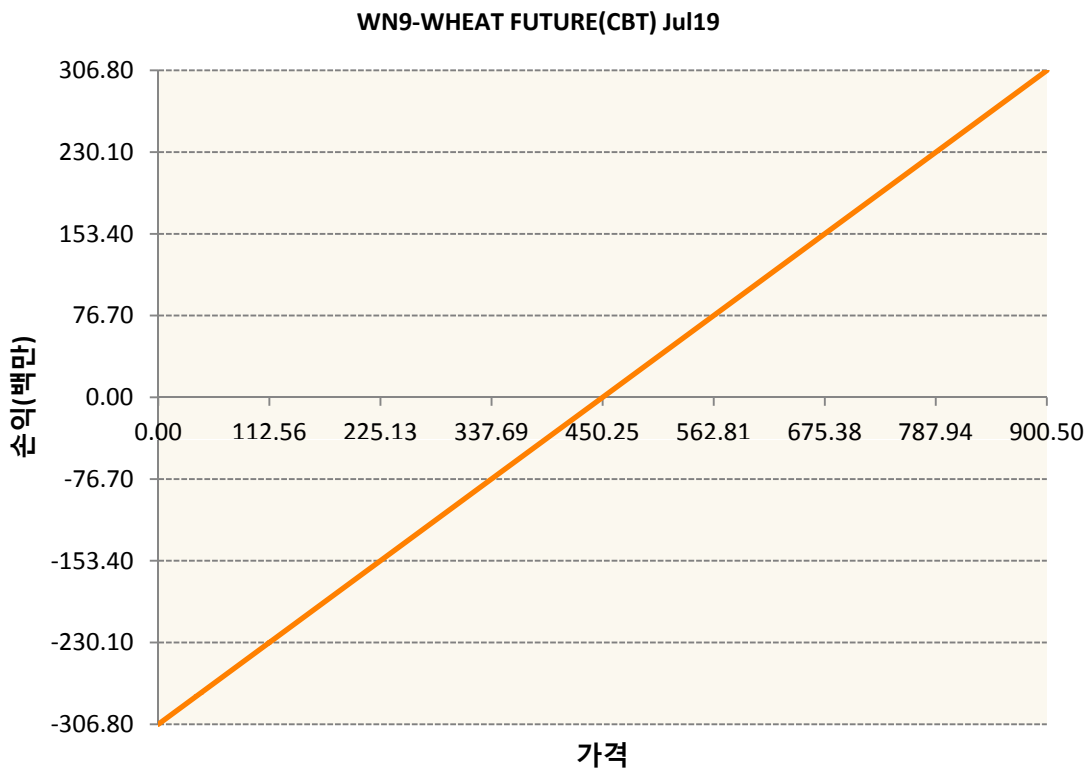
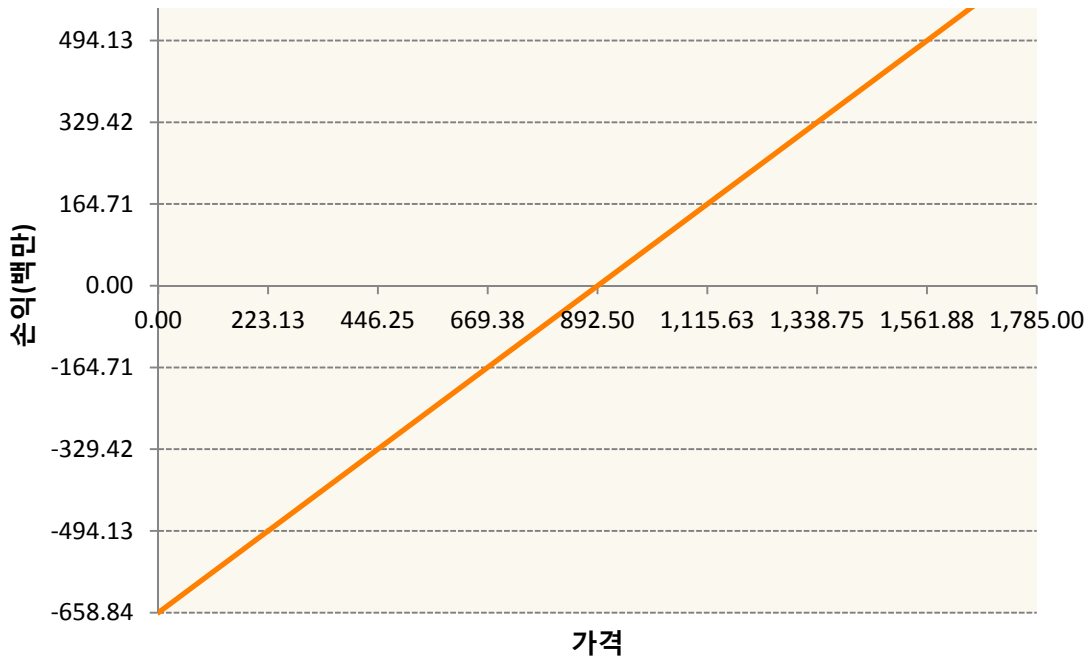


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19



SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BON9	SOYBEAN OIL FUTR Jul19	27
CN9	CORN FUTURE Jul19	50
CTN9	COTTON NO.2 FUTR Jul19	14
KCN9	COFFEE 'C' FUTURE Jul19	18
KR4175P500	2019-05 달러선물	5

KWN9	KC HRW WHEAT FUT Jul19	10
SBN9	SUGAR #11 (WORLD) Jul19	28
SMN9	SOYBEAN MEAL FUTR Jul19	31
SN9	SOYBEAN FUTURE Jul19	53
WN9	WHEAT FUTURE(CBT) Jul19	25

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

(단위:백만원)

**256**