

공시일	2019-04-26
기준일	2019-04-25

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)

93

공시일	2019-04-26
기준일	2019-04-25

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

1,162

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

682

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-04-26
기준일	2019-04-25

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)	340
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	94
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	159

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

933

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-04-26
기준일	2019-04-25

유로인덱스모(주식-파생형)

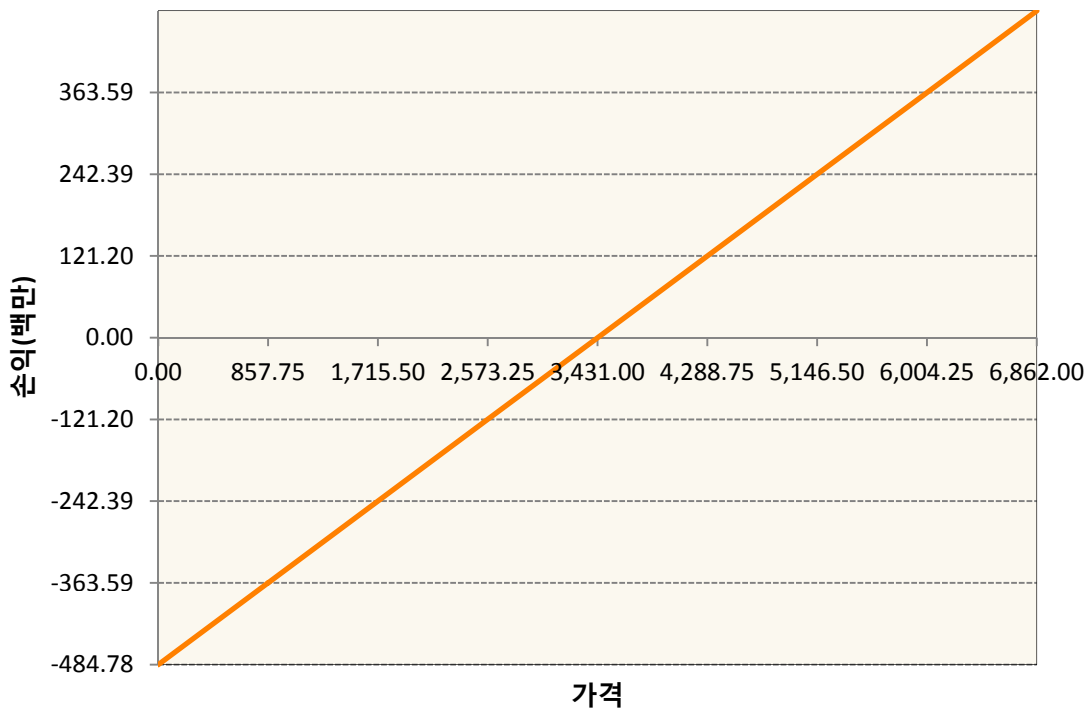
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	485	0	485	

2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	39
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

28

공시일	2019-04-26
기준일	2019-04-25

차이나인덱스모(주식-파생형)

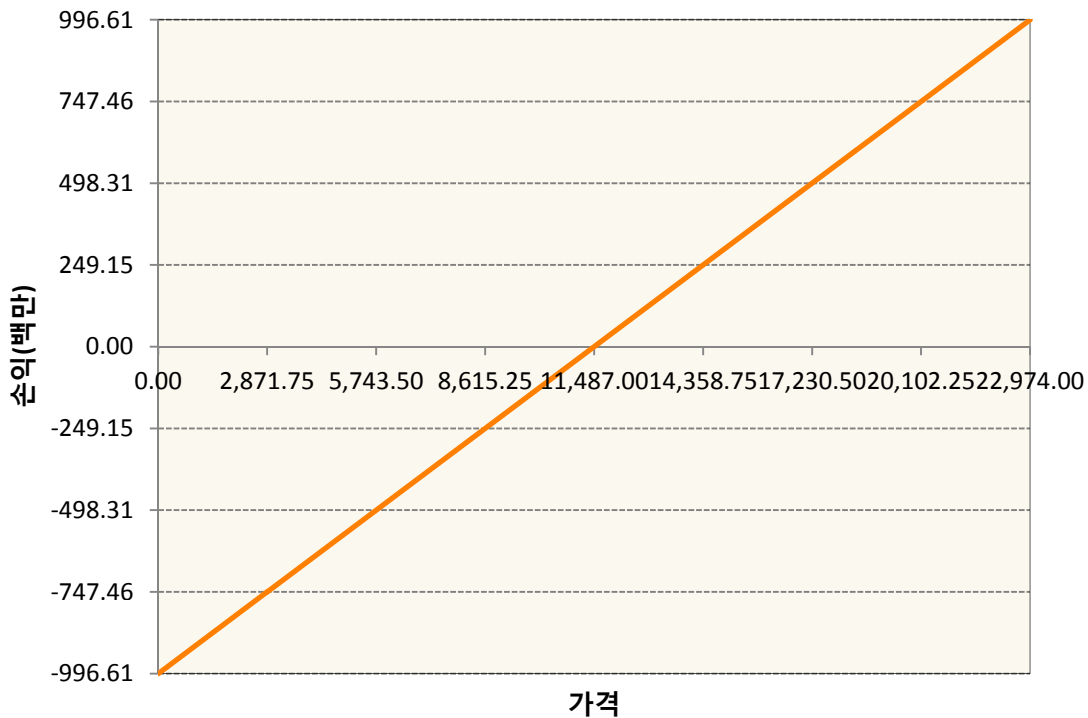
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	997	0	997	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCJ9-HSCEI Futures Apr19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ9	HSCEI Futures Apr19	80
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

82

공시일	2019-04-26
기준일	2019-04-25

커버드콜모(주식혼합-파생형)

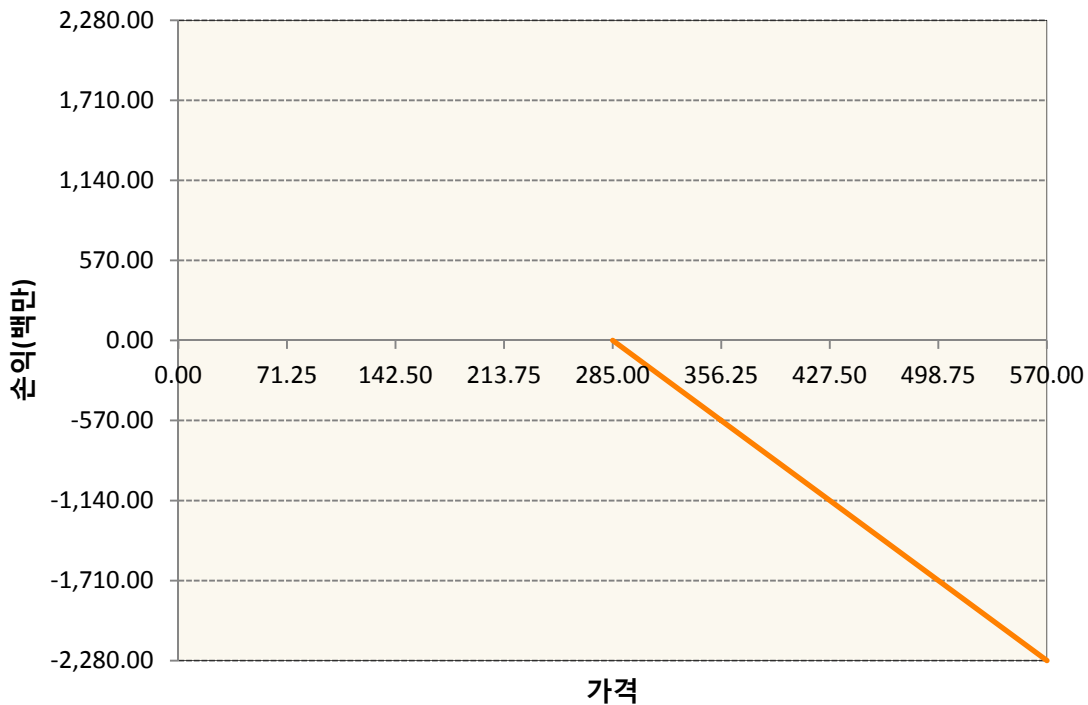
1. 계약금액

(단위:백만원)

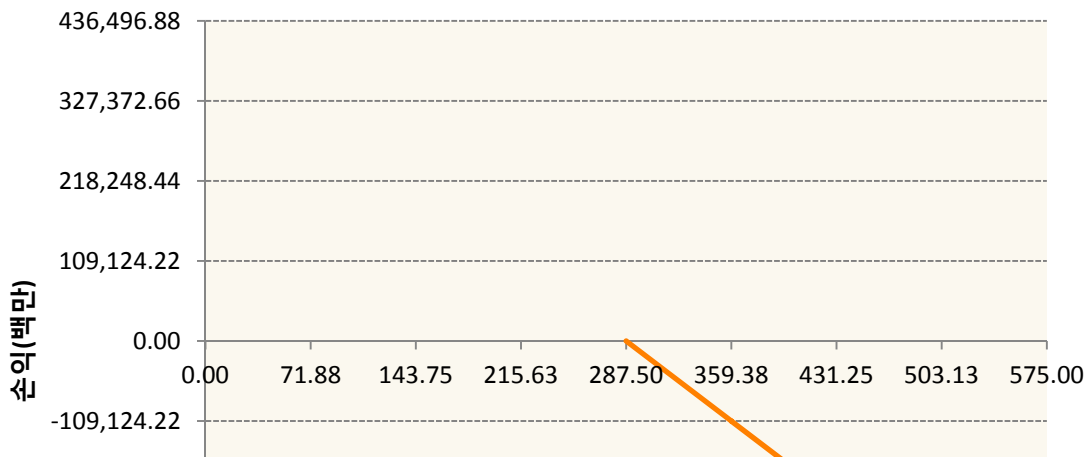
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	672,214	-672,214	장내

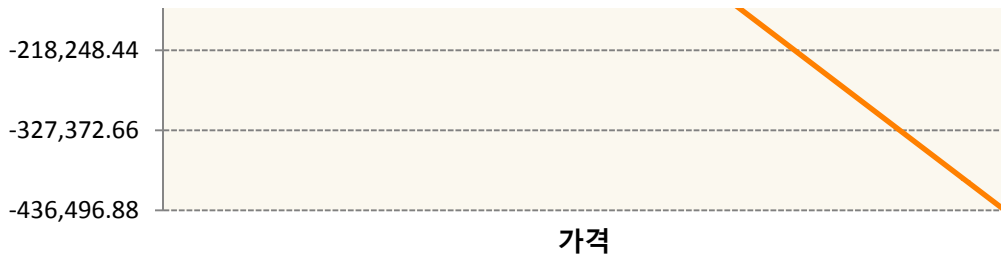
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P52850-2019-05 콜285

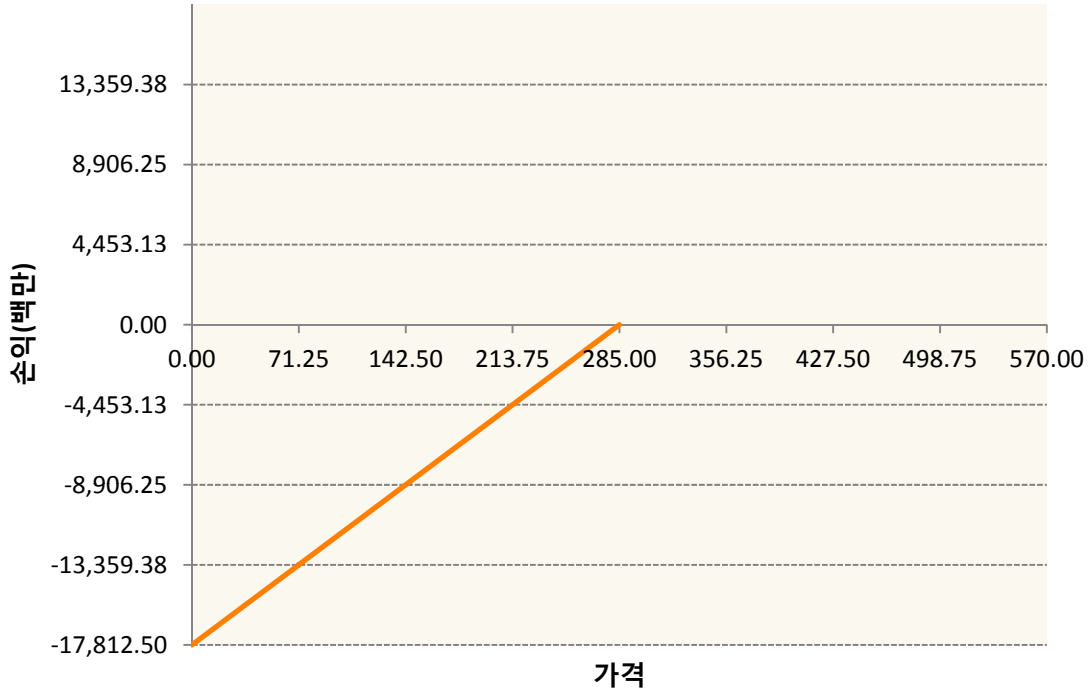


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

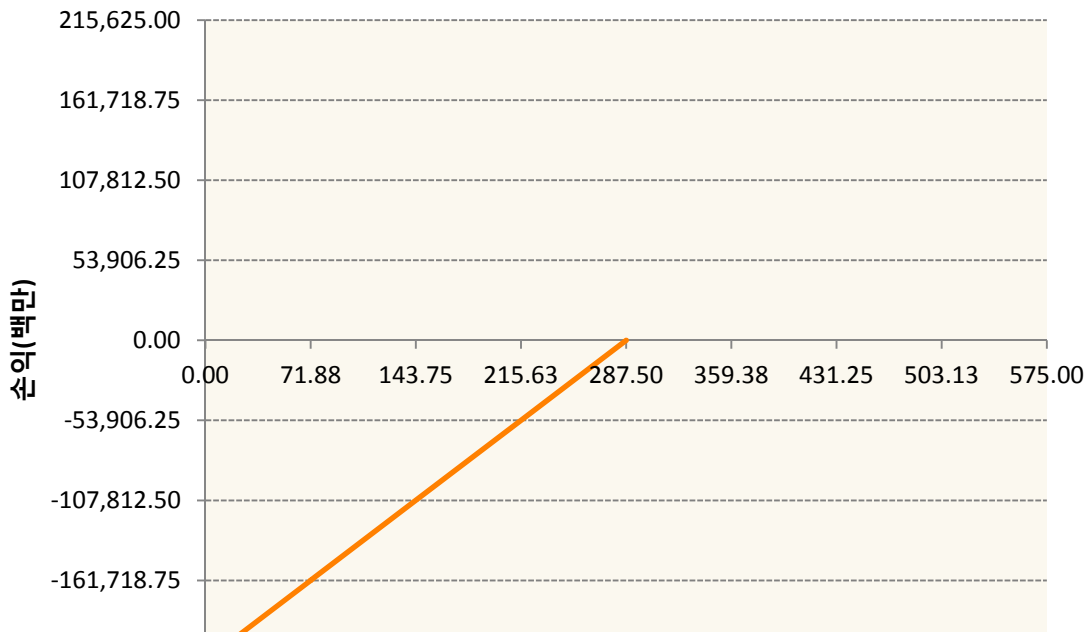




KR4301P52858-2019-05 풋285



KR4301P52874-2019-05 풋287.5



-215,625.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P52850		2019-05 콜285						137
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	36	35	35	34	34	33	32	
-5.33%	34	33	32	31	29	27	25	
-2.67%	28	26	23	21	18	15	12	
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11	
2.67%	-23	-27	-30	-33	-37	-40	-44	
5.33%	-72	-74	-76	-78	-81	-84	-86	
8.00%	-128	-129	-130	-131	-133	-135	-137	
KR4201P52876		2019-05 콜287.5						24,183
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5,269	5,246	5,204	5,137	5,042	4,917	4,760	
-5.33%	5,138	5,017	4,851	4,642	4,391	4,102	3,778	
-2.67%	4,405	4,043	3,637	3,193	2,718	2,217	1,695	
0%	1,938	1,302	655	0	-662	-1,328	-1,999	
2.67%	-3,459	-4,143	-4,832	-5,523	-6,217	-6,913	-7,610	
5.33%	-11,869	-12,336	-12,842	-13,377	-13,937	-14,517	-15,114	
8.00%	-22,224	-22,434	-22,698	-23,009	-23,364	-23,757	-24,183	
KR4301P52858		2019-05 풋285						1,294
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,294	-1,294	-1,294	-1,294	-1,294	-1,294	-1,294	
-5.33%	-823	-823	-823	-824	-825	-826	-828	
-2.67%	-356	-360	-364	-369	-376	-383	-390	
0%	42	28	14	0	-14	-29	-43	
2.67%	227	217	206	195	183	171	158	
5.33%	256	254	252	249	246	241	235	
8.00%	257	257	257	257	256	255	254	
KR4301P52874		2019-05 풋287.5						16,115
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-16,113	-16,113	-16,113	-16,113	-16,114	-16,114	-16,115	
-5.33%	-10,461	-10,462	-10,463	-10,465	-10,470	-10,478	-10,490	
-2.67%	-4,825	-4,842	-4,868	-4,904	-4,950	-5,005	-5,070	
0%	409	280	143	0	-148	-301	-457	
2.67%	3,575	3,413	3,247	3,079	2,908	2,736	2,562	

5.33%	4,322	4,283	4,231	4,167	4,091	4,006	3,911
8.00%	4,372	4,370	4,366	4,357	4,343	4,323	4,296

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

(단위:백만원)

45,263

공시일	2019-04-26
기준일	2019-04-25

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

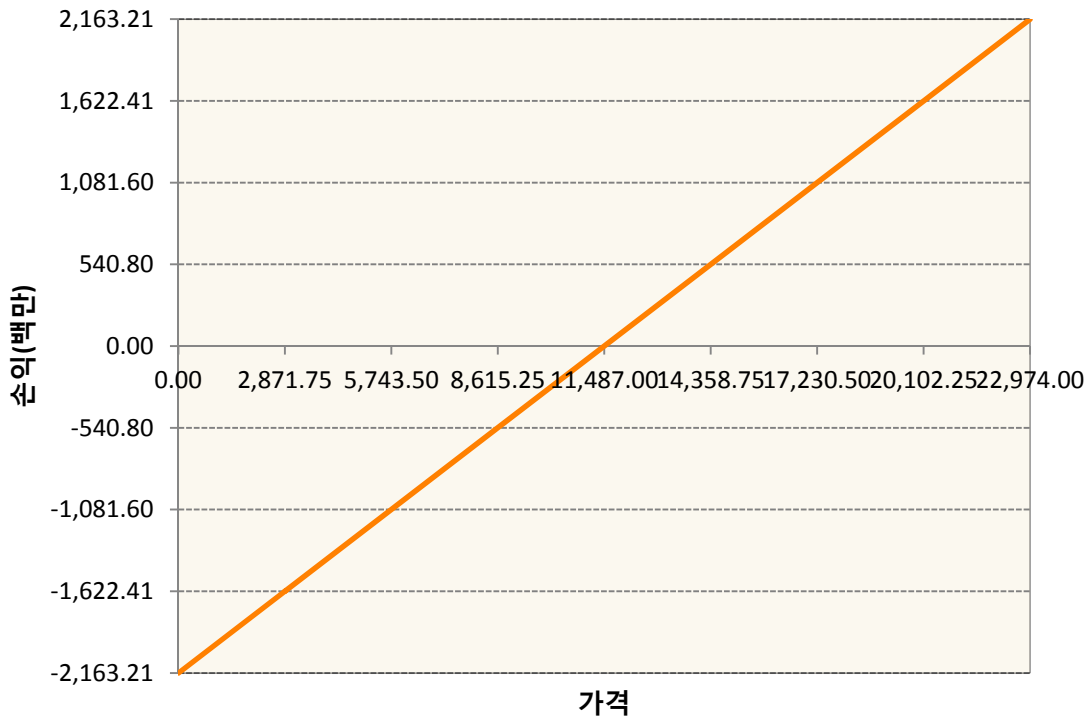
1. 계약금액

(단위:백만원)

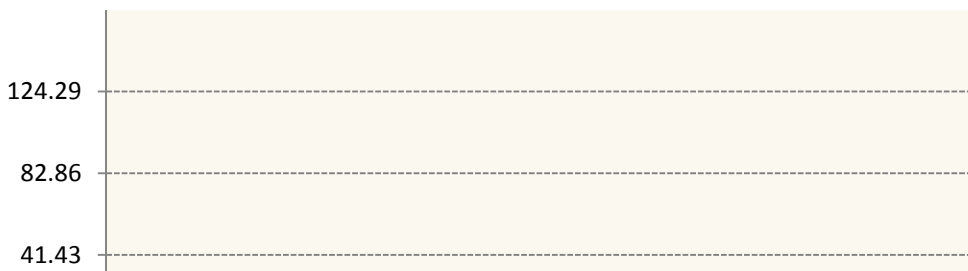
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,163	0	2,163	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,682	-5,682	장내
누계	통화	선도	0	3,107	-3,107	장외

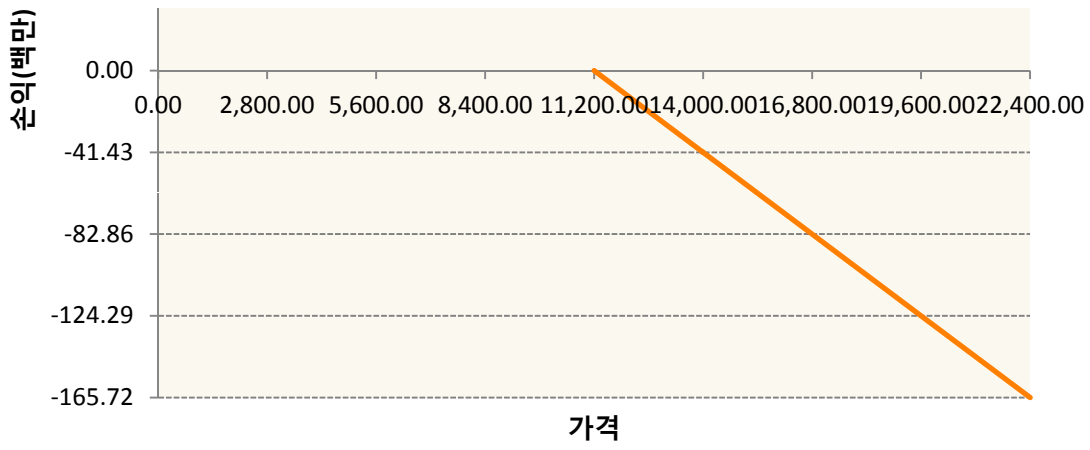
2. 만기시점의 손익구조

HCJ9-HSCEI Futures Apr19

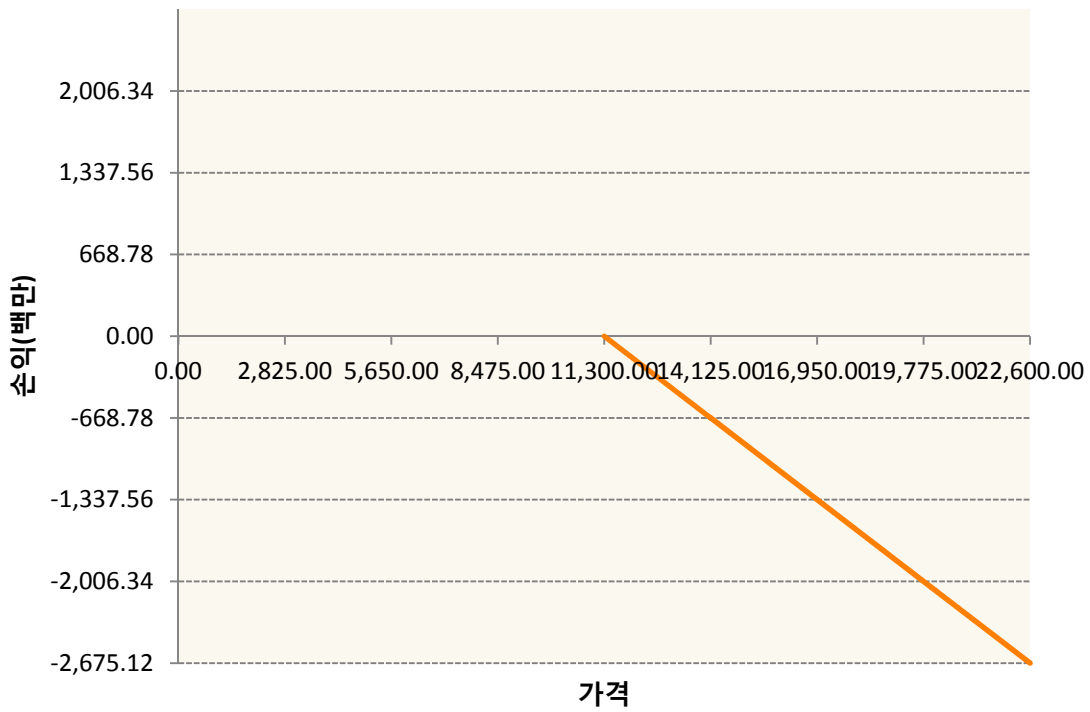


OHHIJ9-C112-HSCEI

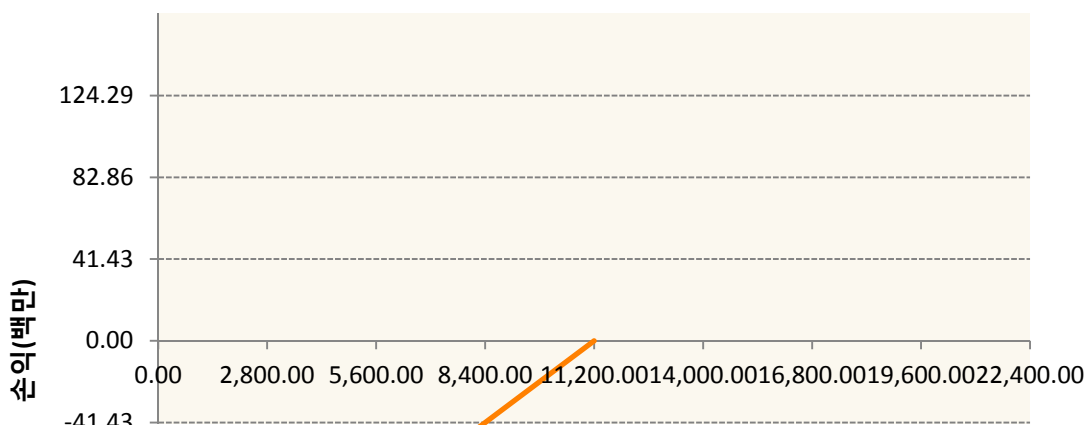


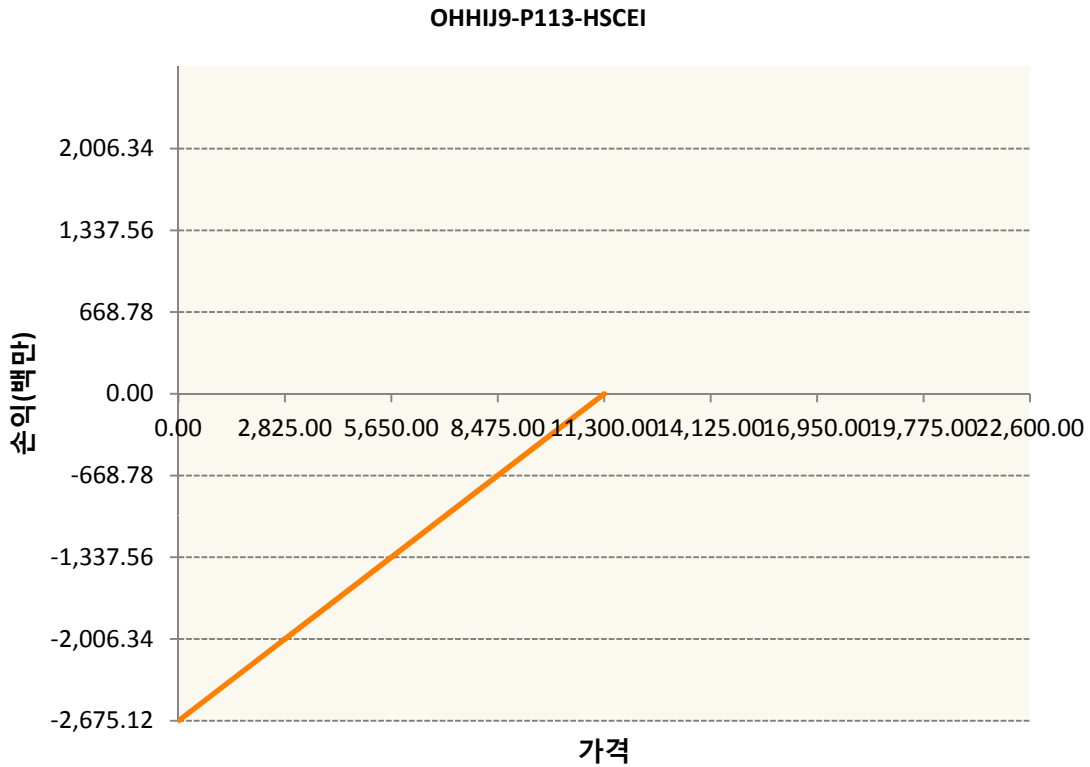
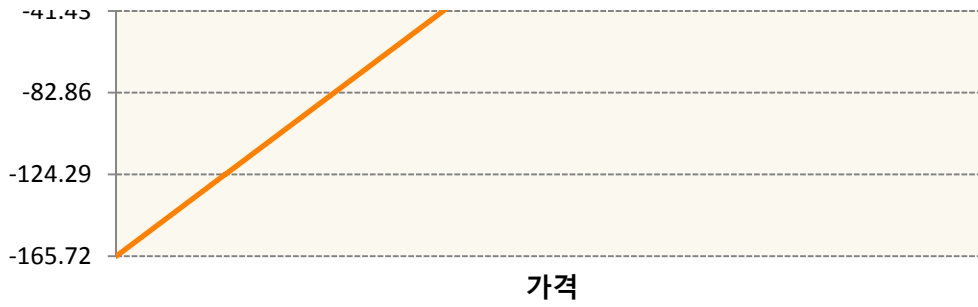


OHHIJ9-C113-HSCEI



OHHIJ9-P112-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	225
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	24
HCJ9 HSCEI Futures Apr19	173
OHHIJ9-C11 HSCEI	13
OHHIJ9-C11 HSCEI	214
OHHIJ9-P11: HSCEI	13
OHHIJ9-P11: HSCEI	214

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	727

공시일	2019-04-26
기준일	2019-04-25

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

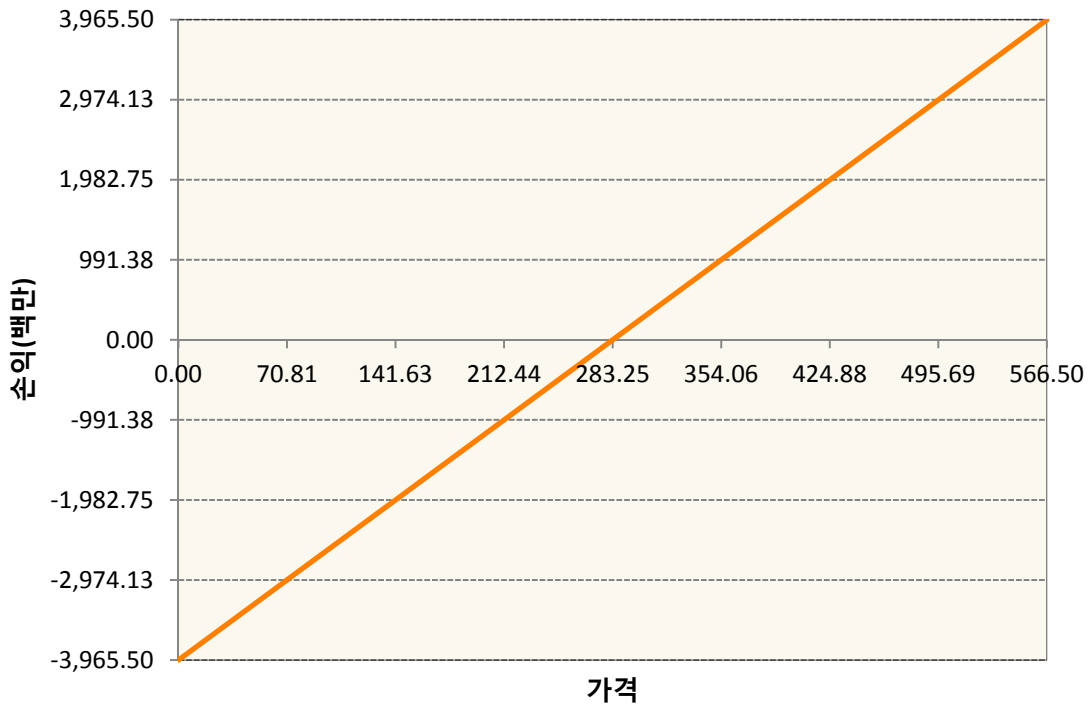
1. 계약금액

(단위:백만원)

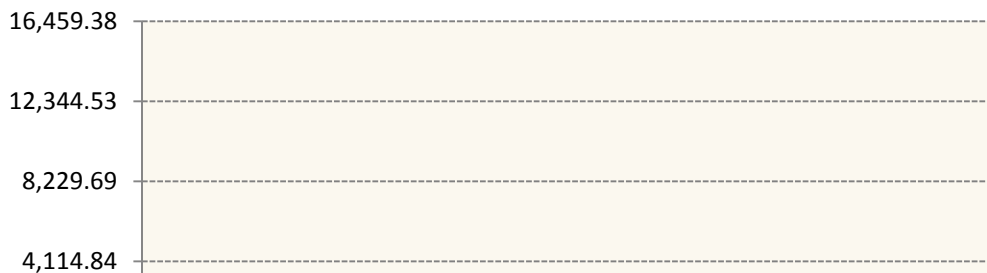
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,966	0	3,966	장내
누계	유가증권	스왑	32,836	0	32,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	32,264	-32,264	장내

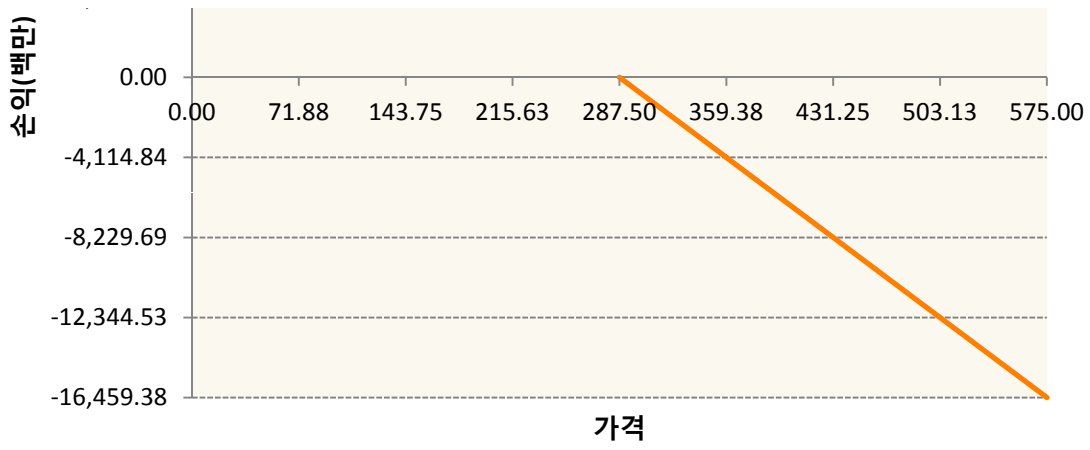
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

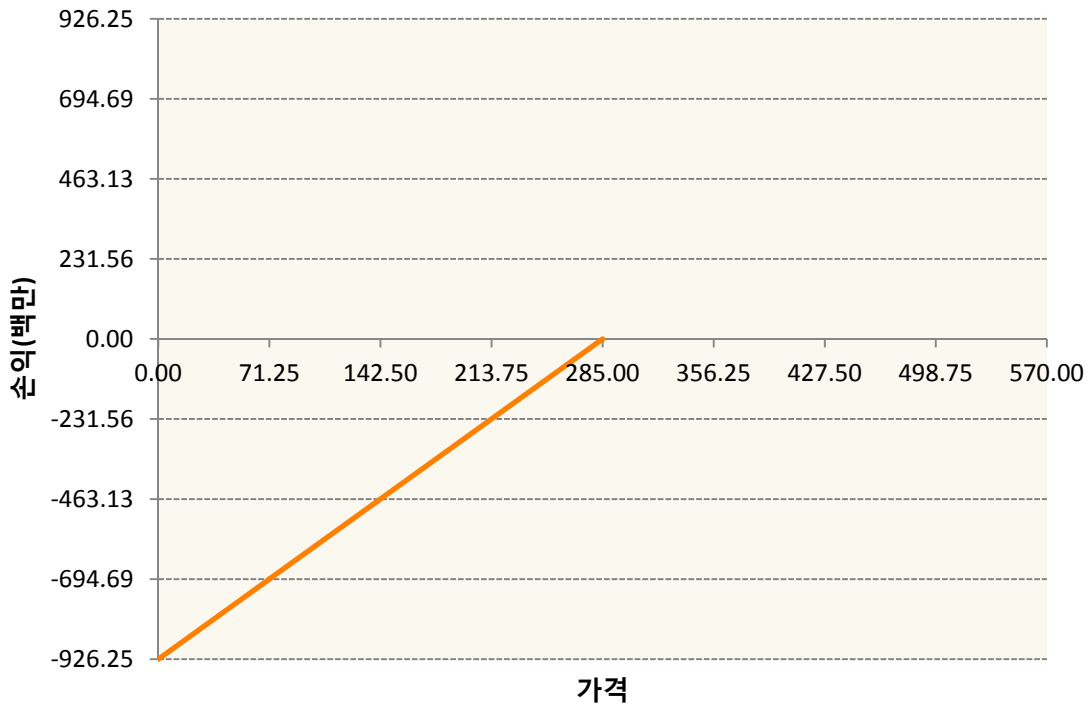


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

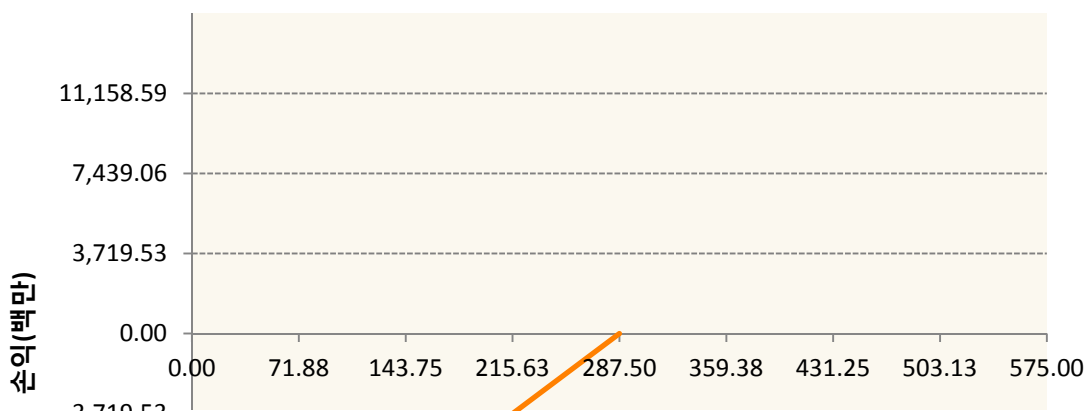




KR4301P52858-2019-05 풋285



KR4301P52874-2019-05 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,207
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,207	-2,207	-2,207	-2,207	-2,207	-2,207	-2,207	
-5.33%	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471	
-2.67%	-736	-736	-736	-736	-736	-736	-736	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	736	736	736	736	736	736	736	
5.33%	1,471	1,471	1,471	1,471	1,471	1,471	1,471	
8.00%	2,207	2,207	2,207	2,207	2,207	2,207	2,207	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						598
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-598	-598	-598	-598	-598	-598	-598	
-5.33%	-399	-399	-399	-399	-399	-399	-399	
-2.67%	-199	-199	-199	-199	-199	-199	-199	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	199	199	199	199	199	199	199	
5.33%	399	399	399	399	399	399	399	
8.00%	598	598	598	598	598	598	598	
KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						317
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-317	-317	-317	-317	-317	-317	-317	
-5.33%	-211	-211	-211	-211	-211	-211	-211	
-2.67%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	106	106	106	106	106	106	106	
5.33%	211	211	211	211	211	211	211	
8.00%	317	317	317	317	317	317	317	
KR4201P52876		2019-05 콜287.5						912
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	199	198	196	194	190	185	179
-5.33%	194	189	183	175	166	155	142
-2.67%	166	152	137	120	102	84	64
0%	73	49	25	0	-25	-50	-75
2.67%	-130	-156	-182	-208	-234	-261	-287
5.33%	-448	-465	-484	-504	-526	-547	-570
8.00%	-838	-846	-856	-868	-881	-896	-912
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%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
-2.67%	-19	-19	-19	-19	-20	-20	-20
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	12	11	11	10	10	9	8
5.33%	13	13	13	13	13	13	12
8.00%	13	13	13	13	13	13	13
KR4301P52874 2019-05 풋287.5							1,112
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,112	-1,112	-1,112	-1,112	-1,112	-1,112	-1,112
-5.33%	-722	-722	-722	-722	-722	-723	-724
-2.67%	-333	-334	-336	-338	-342	-345	-350
0%	28	19	10	0	-10	-21	-32
2.67%	247	236	224	212	201	189	177
5.33%	298	296	292	288	282	276	270
8.00%	302	302	301	301	300	298	296

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

(단위:백만원)

5,414

공시일	2019-04-26
기준일	2019-04-25

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

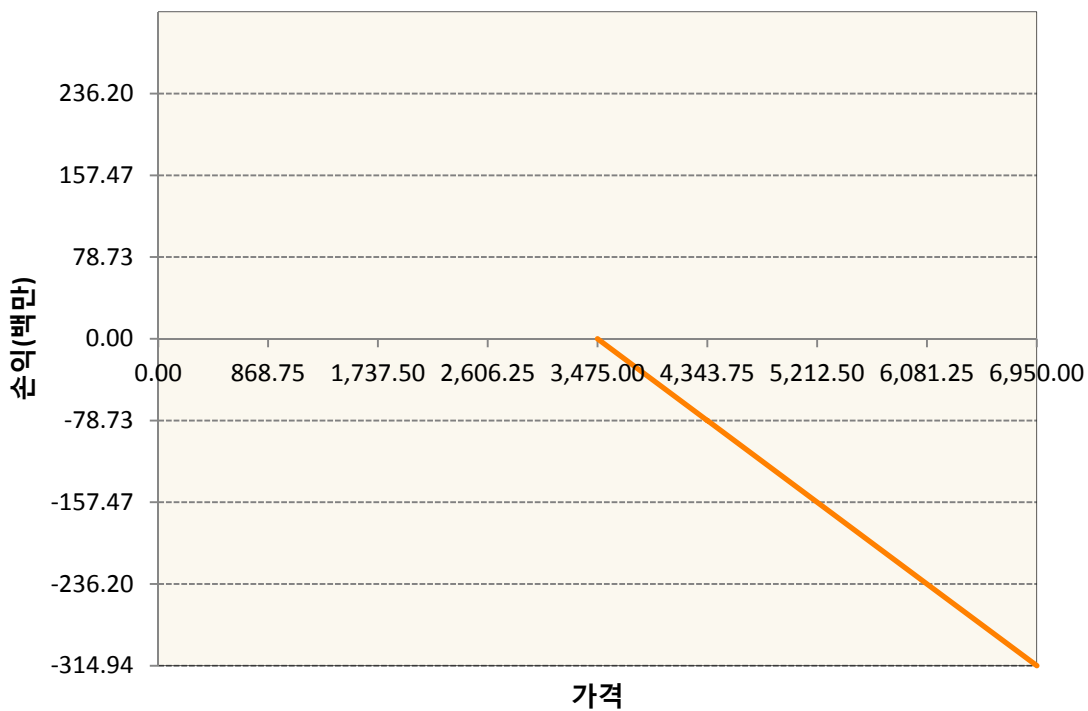
1. 계약금액

(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	2,644	0	2,644	
누계	유가증권	스왑	63,784	0	63,784	장외
누계	유가증권	옵션	0	19,481	-19,481	장내
누계	통화	선도	0	18,126	-18,126	장외

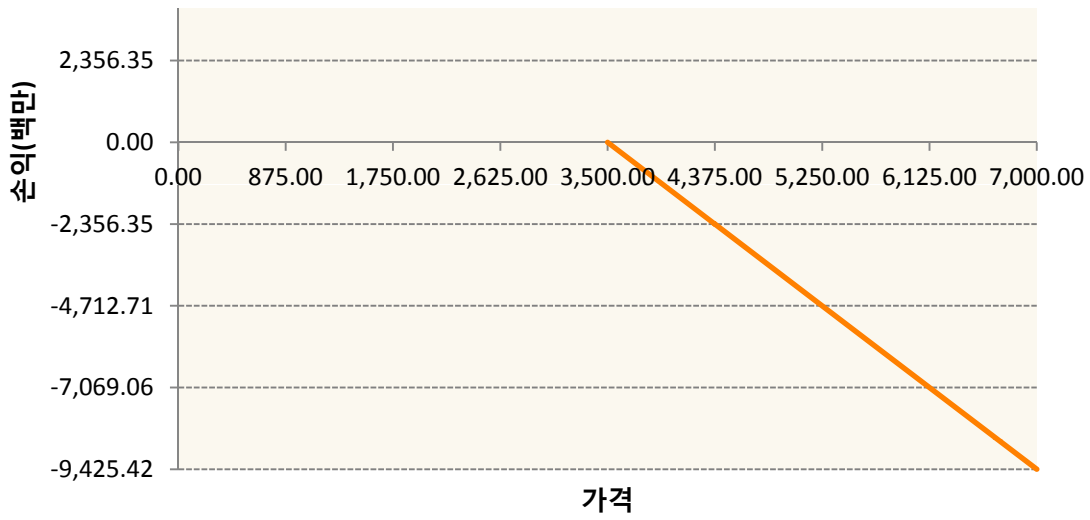
2. 만기시점의 손익구조

OESXK9-C3475-EURO STOXX 50

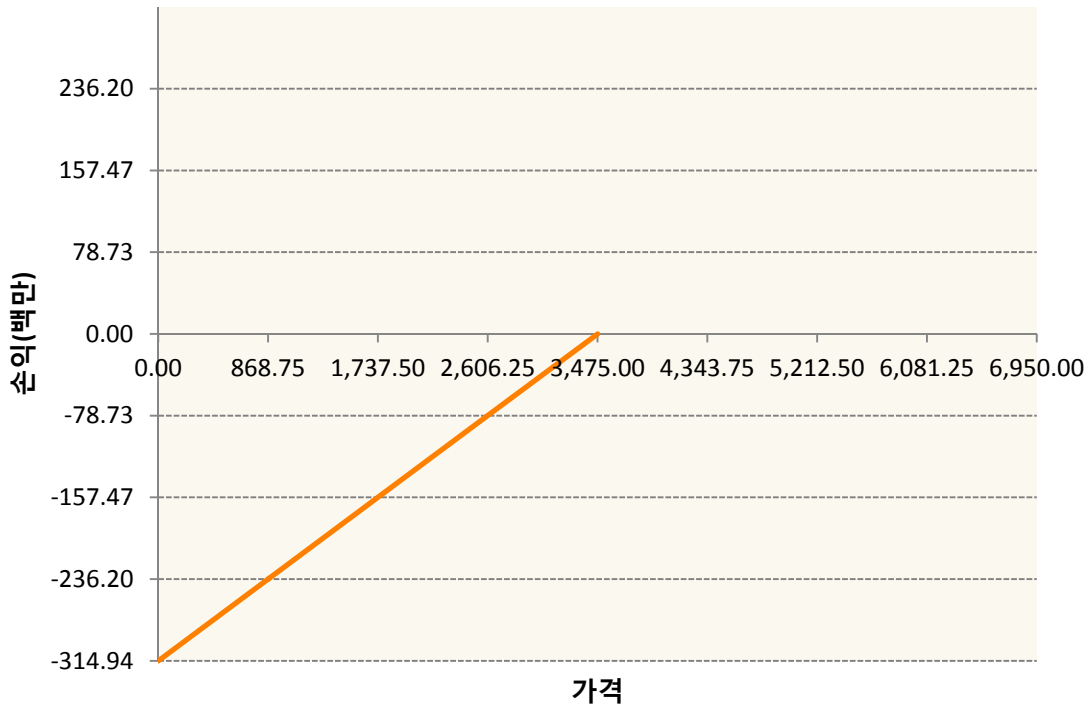


OESXK9-C3500-EURO STOXX 50

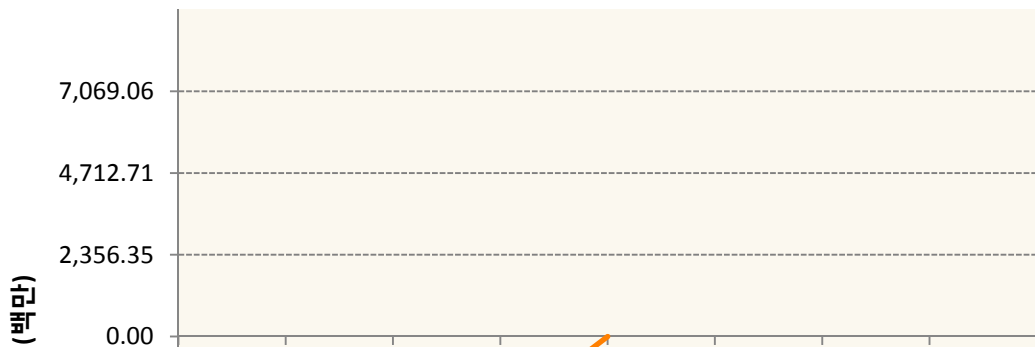


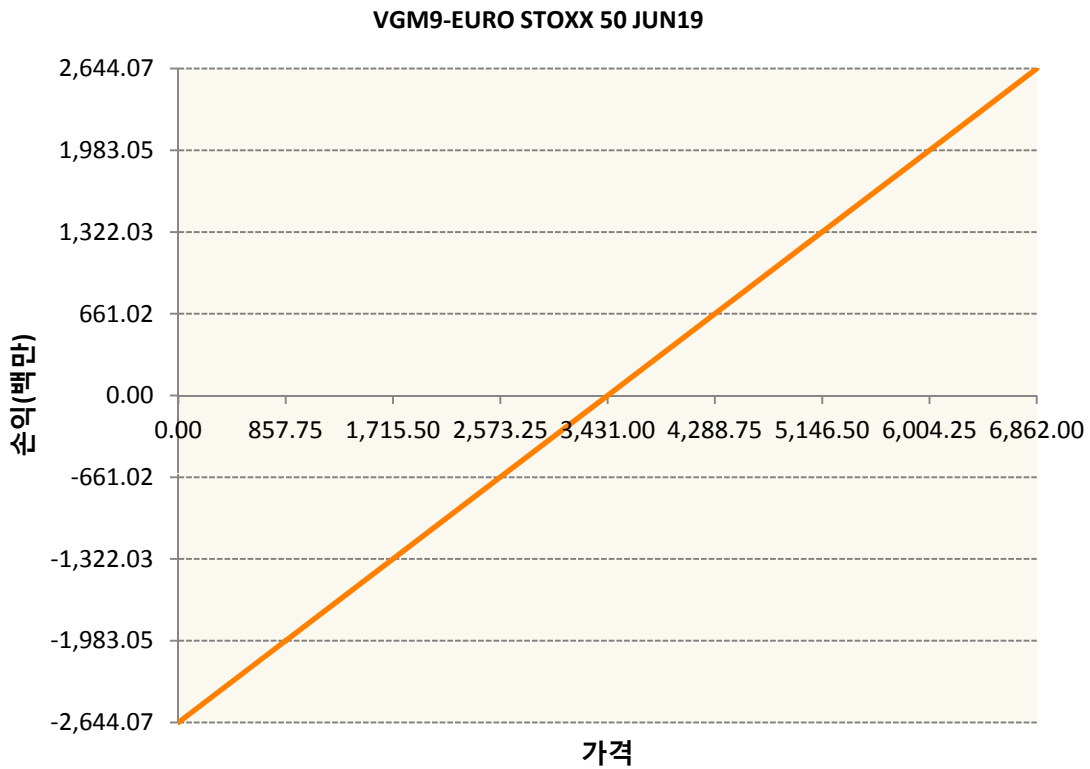
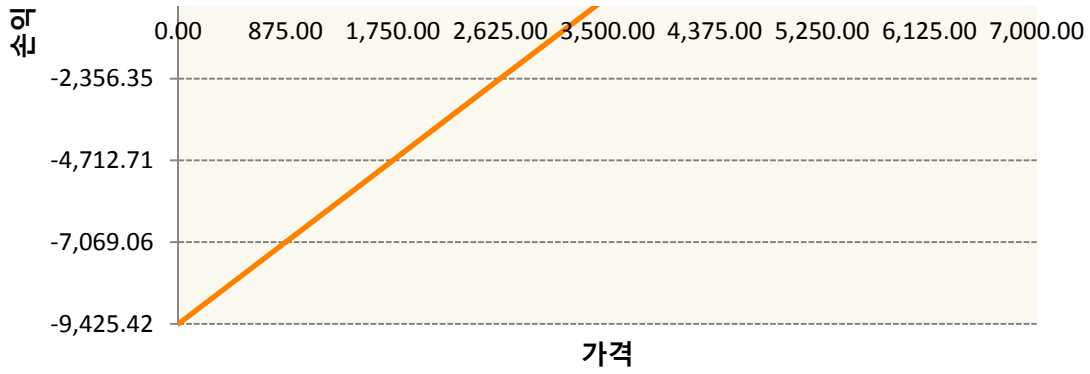


OESXK9-P3475-EURO STOXX 50



OESXK9-P3500-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	5
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	414
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	829
FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E	207
OESXK9-C34 EURO STOXX 50	25
OESXK9-C35 EURO STOXX 50	754
OESXK9-P34 EURO STOXX 50	25
OESXK9-P35 EURO STOXX 50	754
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	212

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

(단위:백만원)

1,996

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

(단위:백만원)

1,088

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

(단위:백만원)

93

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

(단위:백만원)

135

공시일	2019-04-26
기준일	2019-04-25

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

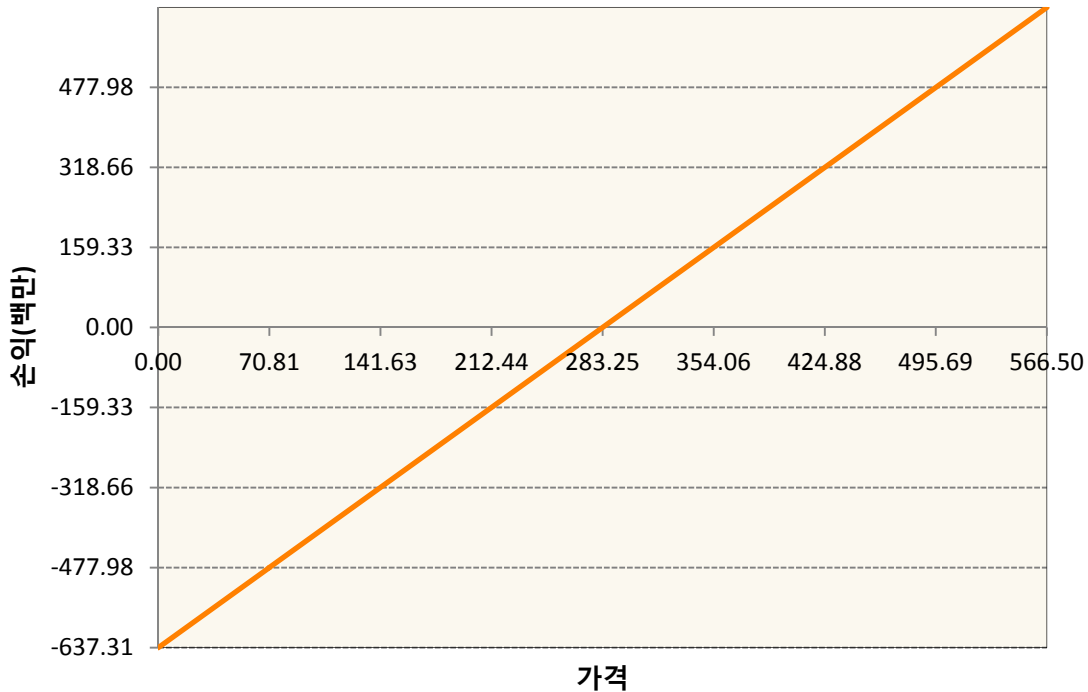
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	637	0	637	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	2019-04-26
기준일	2019-04-25

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

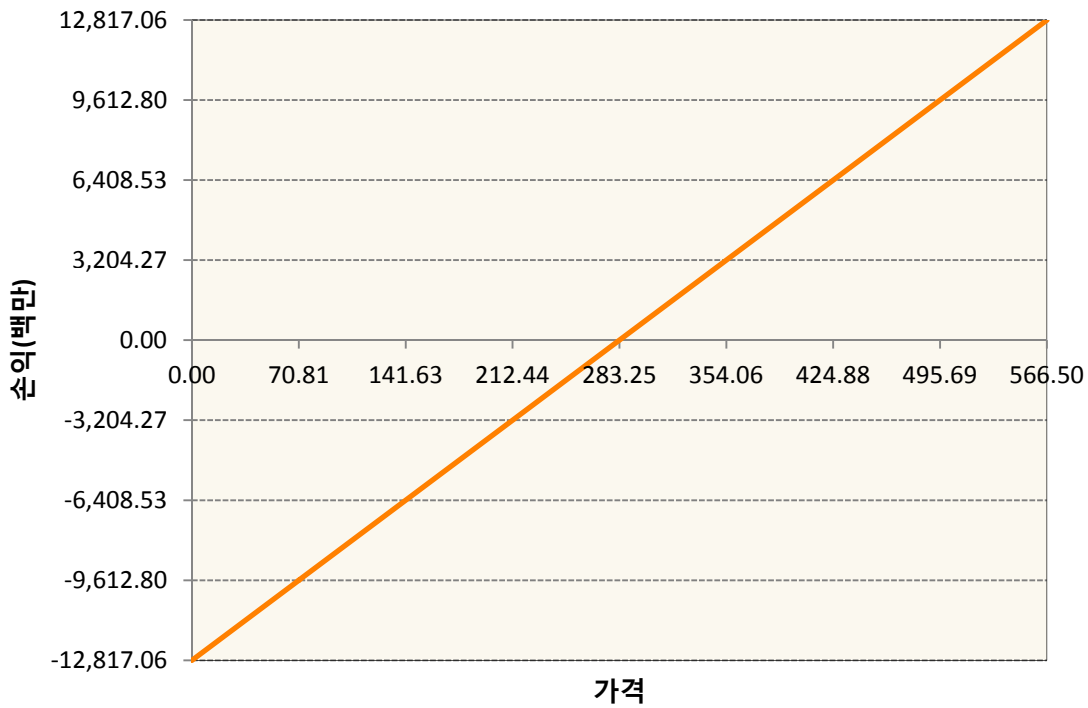
1. 계약금액

(단위:백만원)

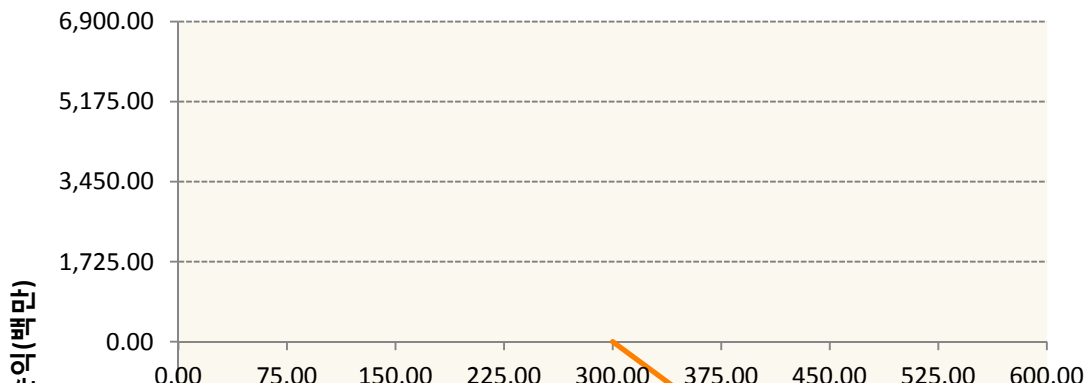
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,817	0	12,817	장내
누계	유가증권	옵션	1,366	24,294	-22,928	장내

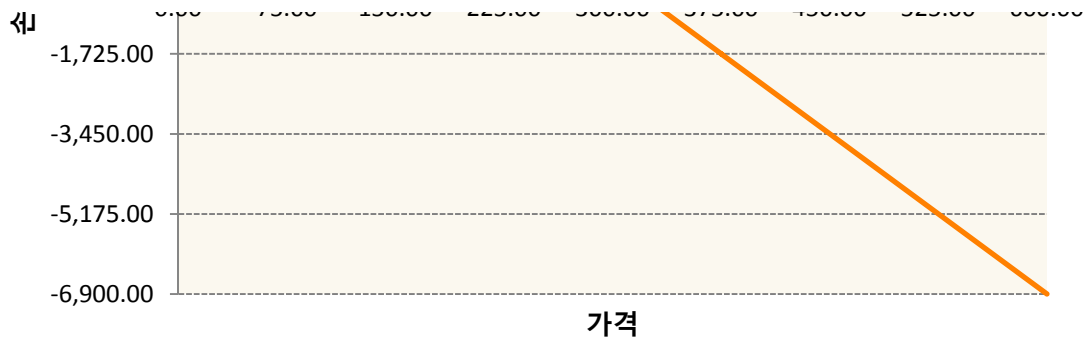
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

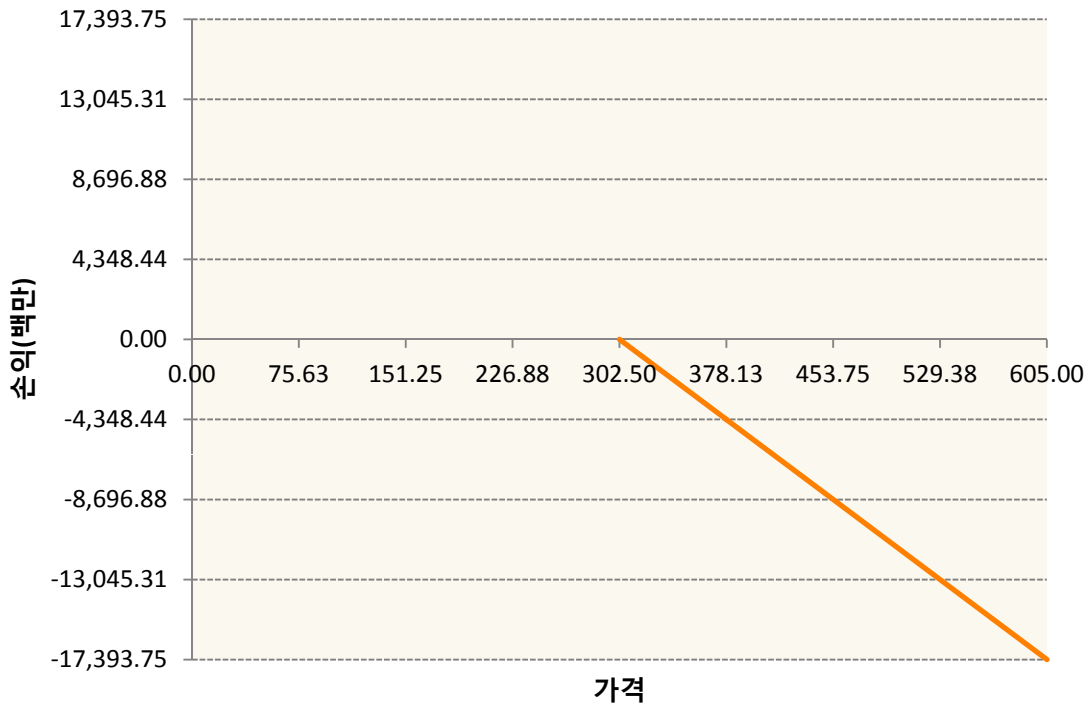


KR4201P53007-2019-05 콜300

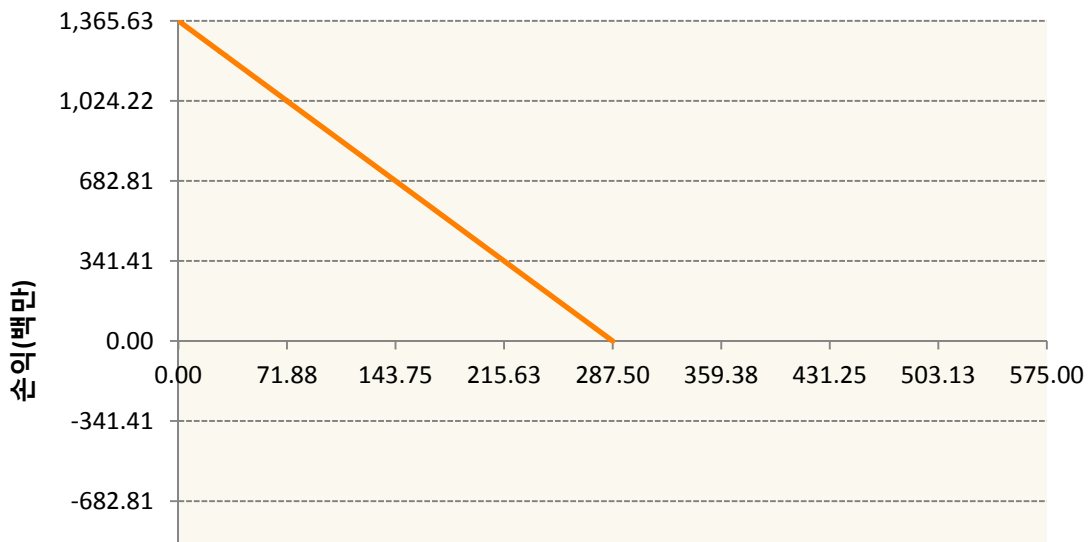


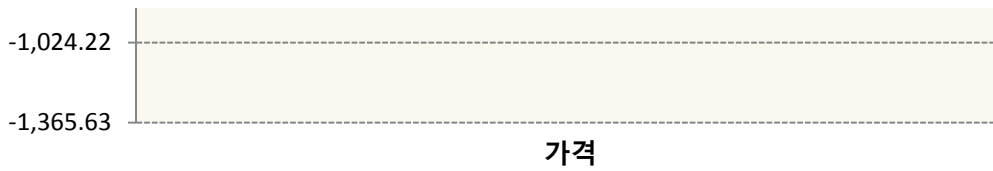


KR4201P53023-2019-05 콜302.5



KR4301P52874-2019-05 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						1,024
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,024	-1,024	-1,024	-1,024	-1,024	-1,024	-1,024	
-5.33%	-683	-683	-683	-683	-683	-683	-683	
-2.67%	-341	-341	-341	-341	-341	-341	-341	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	341	341	341	341	341	341	341	
5.33%	683	683	683	683	683	683	683	
8.00%	1,024	1,024	1,024	1,024	1,024	1,024	1,024	
KR4201P53007		2019-05 콜300						220
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	18	18	18	17	17	17	16	
-5.33%	18	17	17	17	16	15	13	
-2.67%	17	16	15	13	10	7	4	
0%	12	9	5	0	-5	-11	-18	
2.67%	-7	-15	-23	-31	-40	-49	-59	
5.33%	-60	-71	-81	-92	-103	-114	-125	
8.00%	-158	-168	-178	-188	-199	-210	-220	
KR4201P53023		2019-05 콜302.5						481
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	31	31	31	30	30	30	29	
-5.33%	31	30	30	29	28	26	23	
-2.67%	30	28	26	23	18	12	5	
0%	23	17	9	0	-11	-24	-38	
2.67%	-10	-25	-42	-61	-81	-101	-123	
5.33%	-109	-135	-161	-187	-214	-240	-267	
8.00%	-315	-343	-370	-398	-425	-453	-481	
KR4301P52874		2019-05 풋287.5						102
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	102	102	102	102	102	102	102	
-5.33%	66	66	66	66	66	66	66	
-2.67%	31	31	31	31	31	32	32	

0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-23	-22	-21	-19	-18	-17	-16
5.33%	-27	-27	-27	-26	-26	-25	-25
8.00%	-28	-28	-28	-28	-28	-27	-27

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

(단위:백만원)

1,370

공시일	2019-04-26
기준일	2019-04-25

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	186	0	186	
누계	유가증권	수익증권	4,330	0	4,330	

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	2019-04-26
기준일	2019-04-25

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	9,284	0	9,284	
누계	유가증권	수익증권	68,902	0	68,902	

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	2019-04-26
기준일	2019-04-25

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	16,247	0	16,247	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	137,750	0	137,750	
누계	통화	선도	0	166,427	-166,427	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	464
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	538
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	327
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	279
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E	46
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E	93
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E	93
FX21019J001 KRW/USD 10-05-19E	45
FX21019J002 KRW/USD 10-06-19E	102
FX21019J003 KRW/USD 10-05-19E	158
FX21019J004 KRW/USD 10-05-19E	74
FX21019J005 KRW/USD 10-05-19E	279
FX21019J006 KRW/USD 10-05-19E	232
FX21019J007 KRW/USD 10-05-19E	74
FX21019J012 KRW/USD 20-05-19E	130
FX21019J012 KRW/USD 20-05-19E	19
FX21019J013 KRW/USD 20-05-19E	139
FX21019J014 KRW/USD 20-05-19E	139
FX21019J015 KRW/USD 17-05-19E	1,300
FX21019J015 KRW/USD 17-05-19E	1,393
FX21019J015 KRW/USD 18-06-19E	371
FX21019J020 KRW/USD 20-05-19E	501
FX21019J021 KRW/USD 20-05-19E	472
FX21019J022 KRW/USD 24-06-19E	928
FX21019J022 KRW/USD 22-05-19E	780
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E	928
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E	984

FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E

371
74
977
1,003

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

(단위:백만원)

4,537

공시일	2019-04-26
기준일	2019-04-25

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

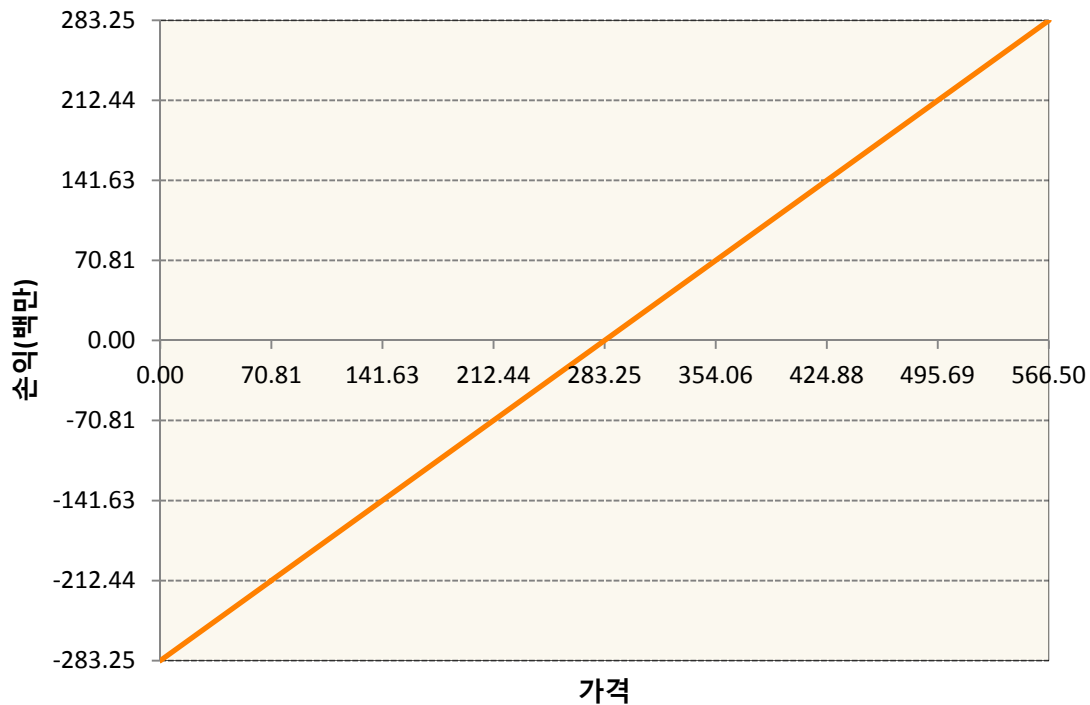
1. 계약금액

(단위:백만원)

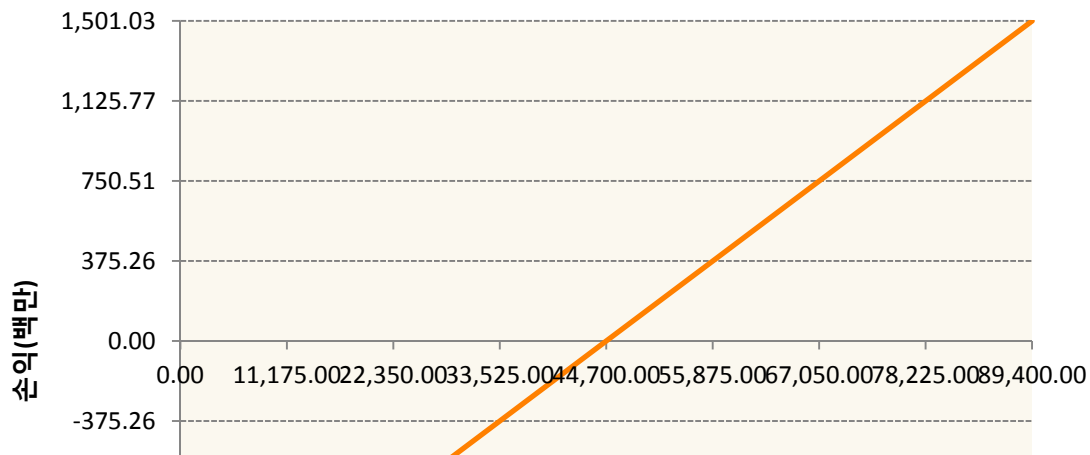
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,784	0	1,784	장내

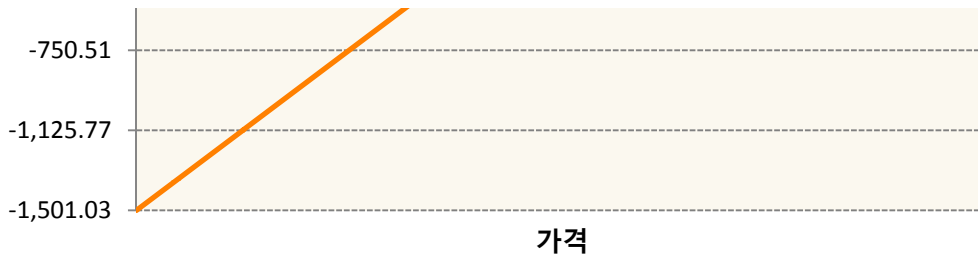
2. 만기시점의 손익구조

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						120
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120	
-5.33%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80	
-2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	40	40	40	40	40	40	40	
5.33%	80	80	80	80	80	80	80	
8.00%	120	120	120	120	120	120	120	

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

157

공시일	2019-04-26
기준일	2019-04-25

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

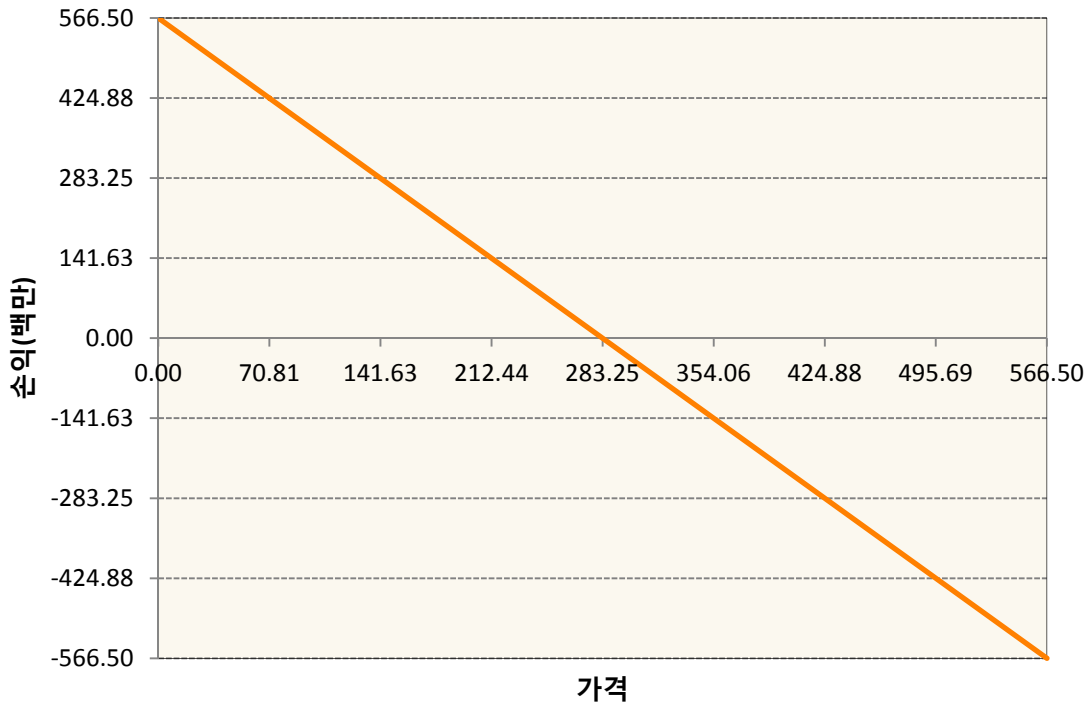
1. 계약금액

(단위:백만원)

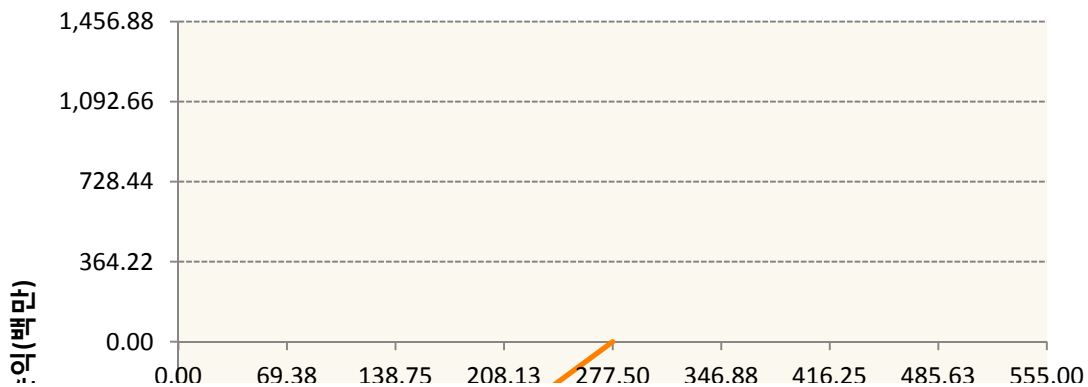
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	567	-567	장내
누계	유가증권	옵션	0	2,997	-2,997	장내

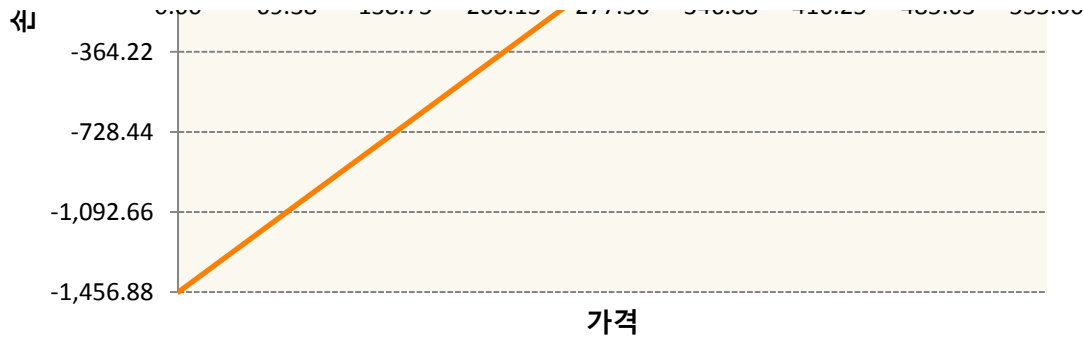
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4301P52775-2019-05 풋277.5





가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
-5.33%	-47	-47	-47	-48	-48	-49	-49
-2.67%	-13	-14	-15	-16	-18	-19	-20
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	5	5	5	4	4	4	3
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

KR4301P52809

2019-05 풋280

100

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-100	-100	-100	-100	-100	-100	-100
-5.33%	-58	-59	-59	-59	-59	-60	-60
-2.67%	-20	-21	-22	-23	-24	-25	-26
0%	4	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	9	9	8	8	7	7	6
5.33%	9	9	9	9	9	9	9
8.00%	9	9	9	9	9	9	9

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

(단위:백만원)

235

공시일	2019-04-26
기준일	2019-04-25

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

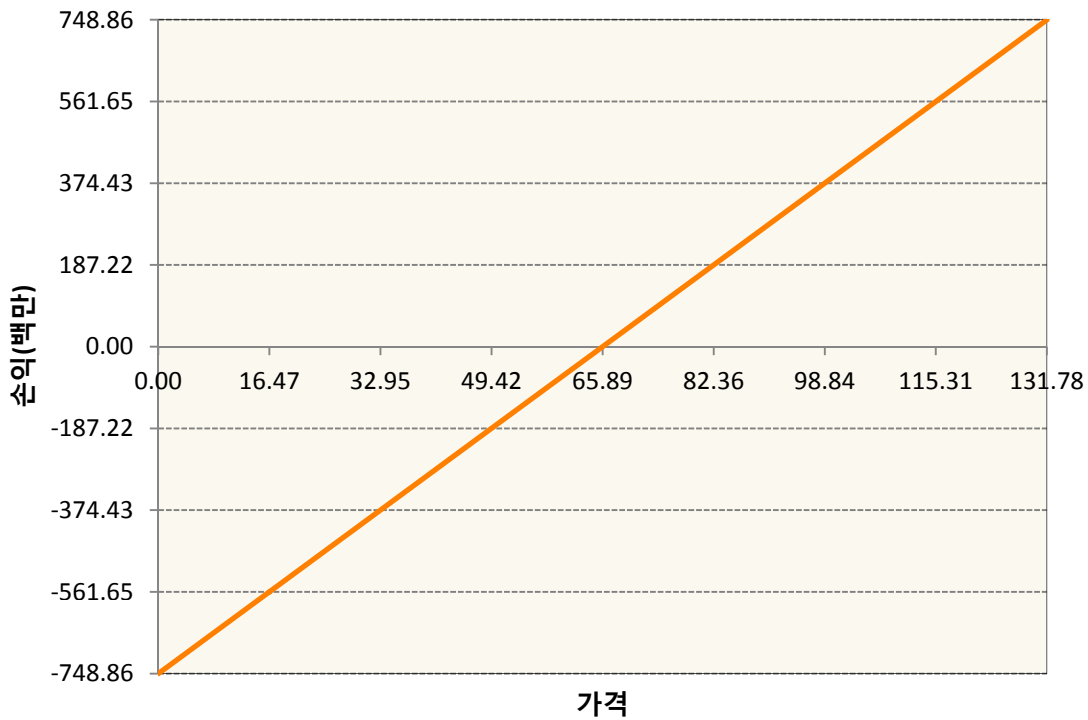
1. 계약금액

(단위:백만원)

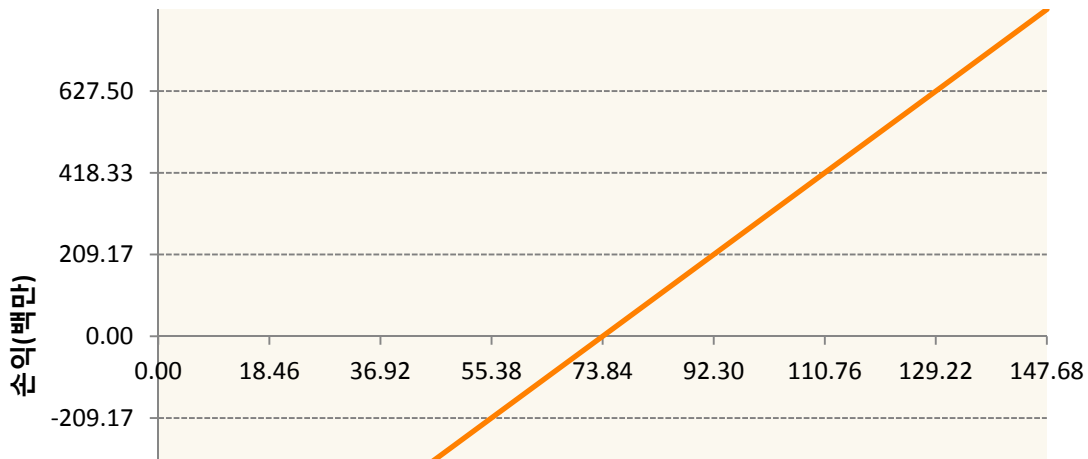
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,012	290	2,722	

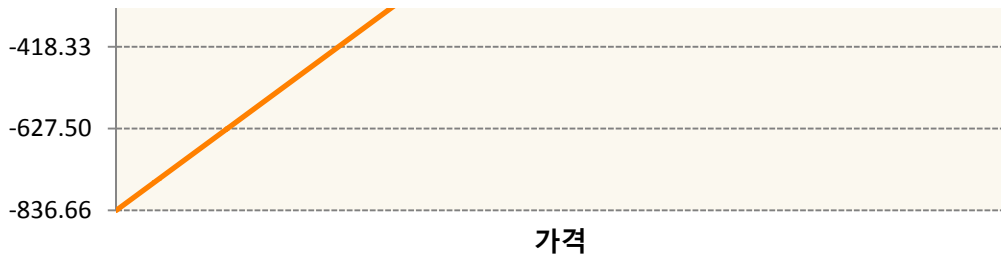
2. 만기시점의 손익구조

CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19

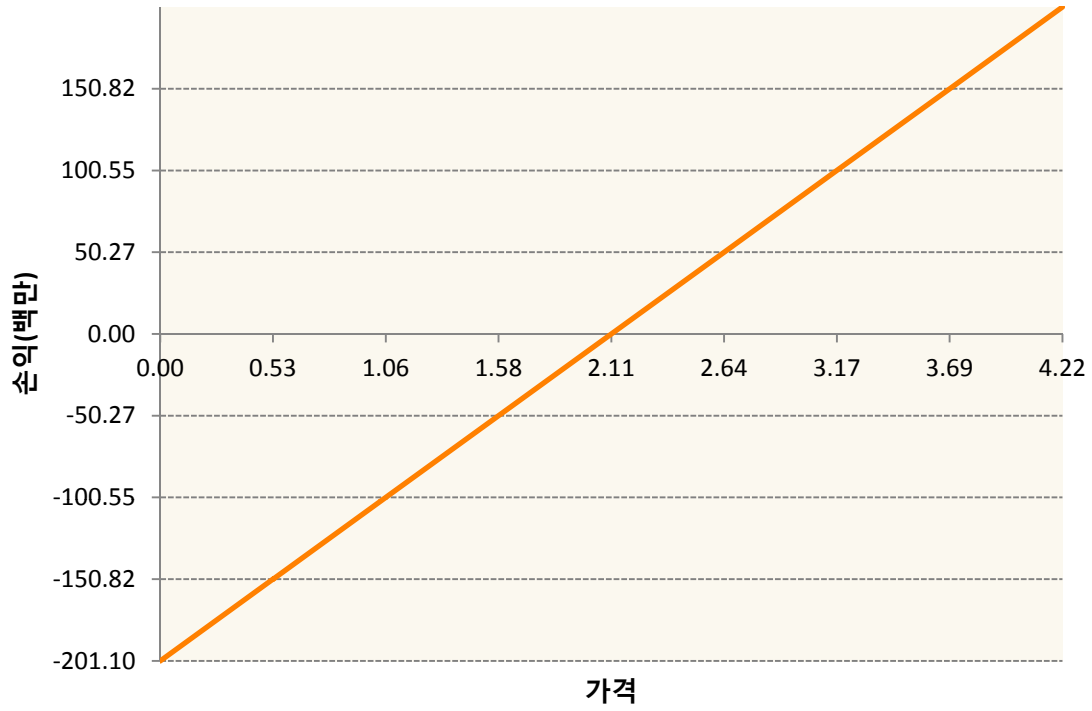


CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19

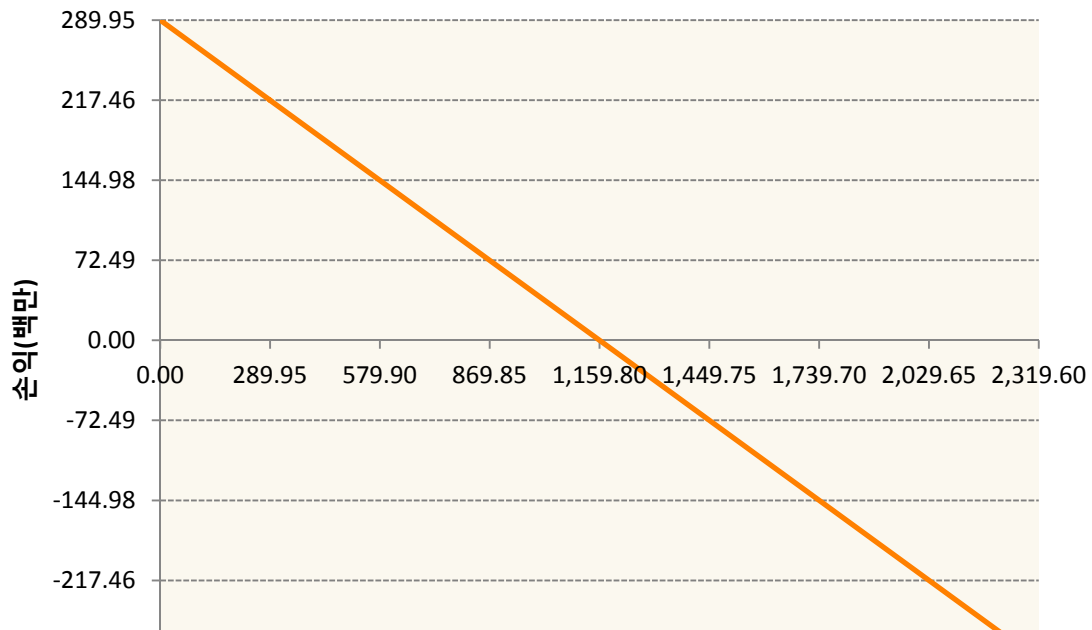


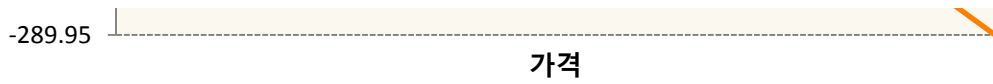


HON9-NY Harb ULSD Fut Jul19

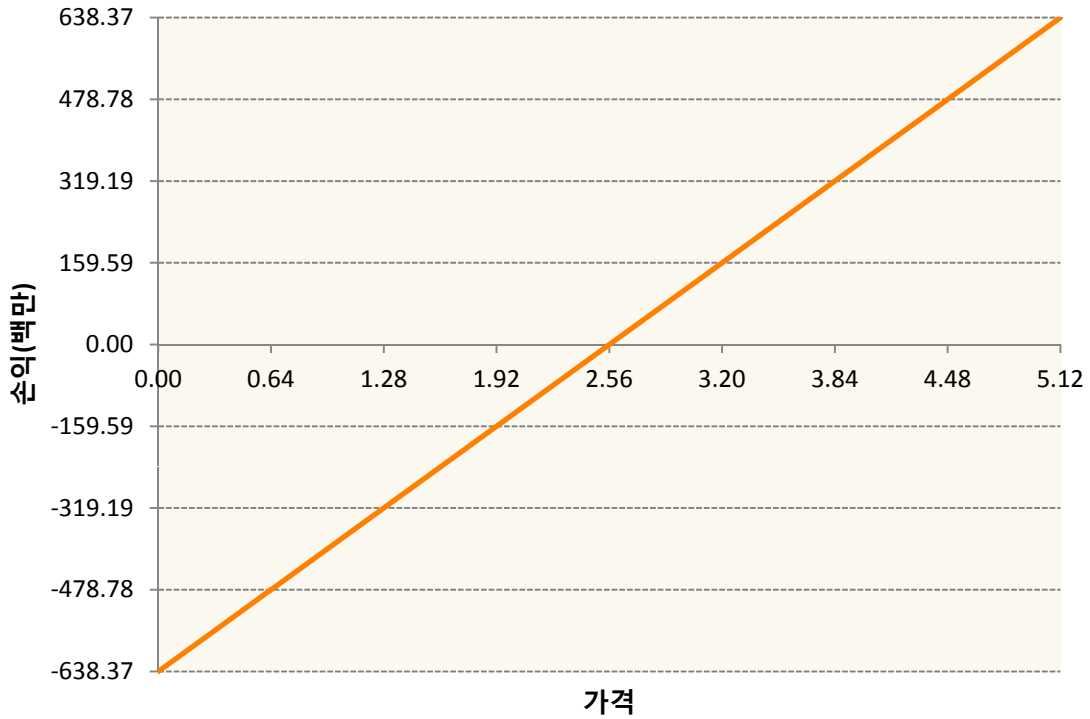


KR4175P50009-2019-05 달러선물

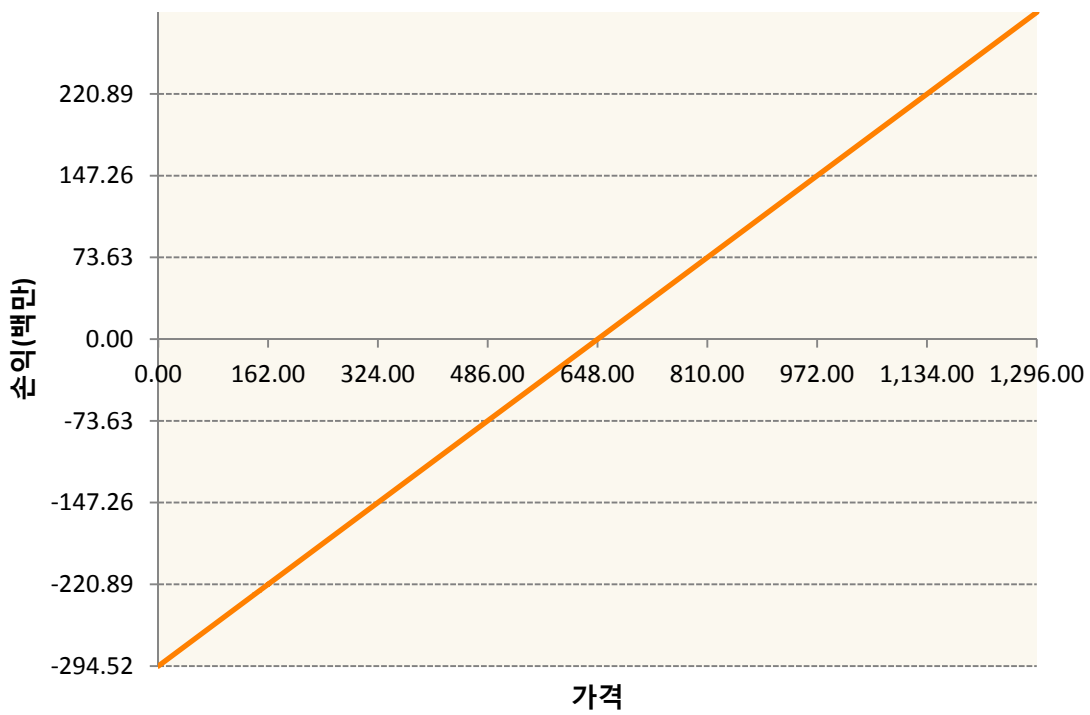




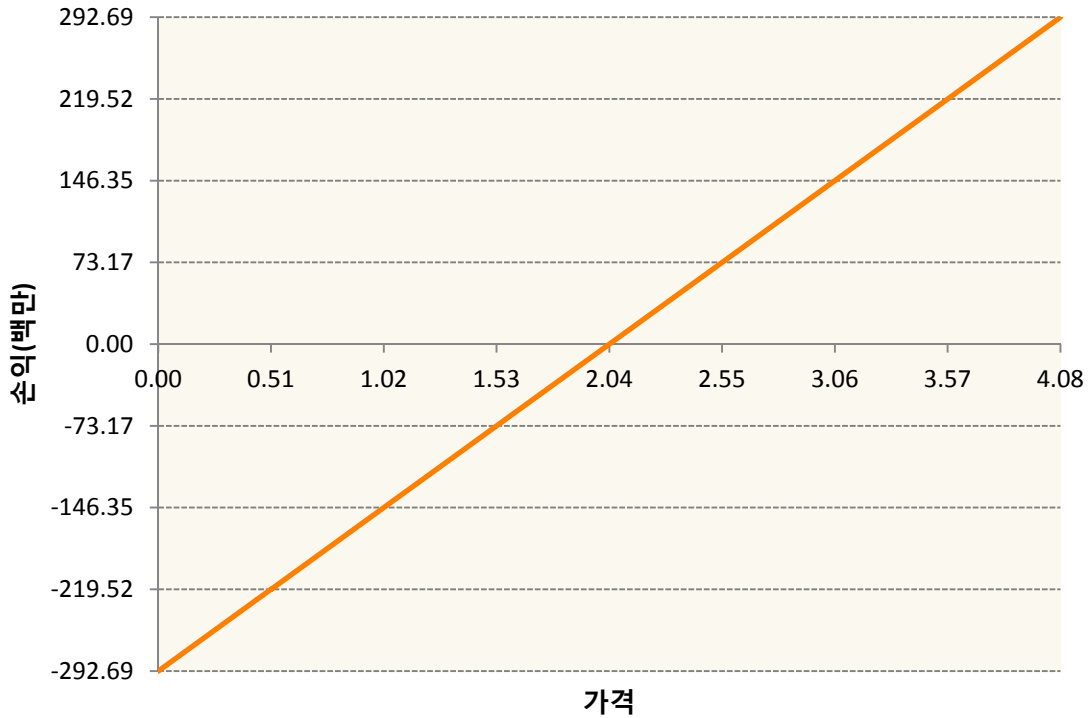
NGN19-NATURAL GAS FUTR Jul19



QSN9-Low Su Gasoil G Jul19



XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN9	WTI CRUDE FUTURE Jul19	60
CON9	BRENT CRUDE FUTR Jul19	67
HON9	NY Harb ULSD Fut Jul19	16
KR4175P500	2019-05 달러선물	23
NGN19	NATURAL GAS FUTR Jul19	51
QSN9	Low Su Gasoil G Jul19	24
XBN9	GASOLINE RBOB FUT Jul19	23

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

443

공시일	2019-04-26
기준일	2019-04-25

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

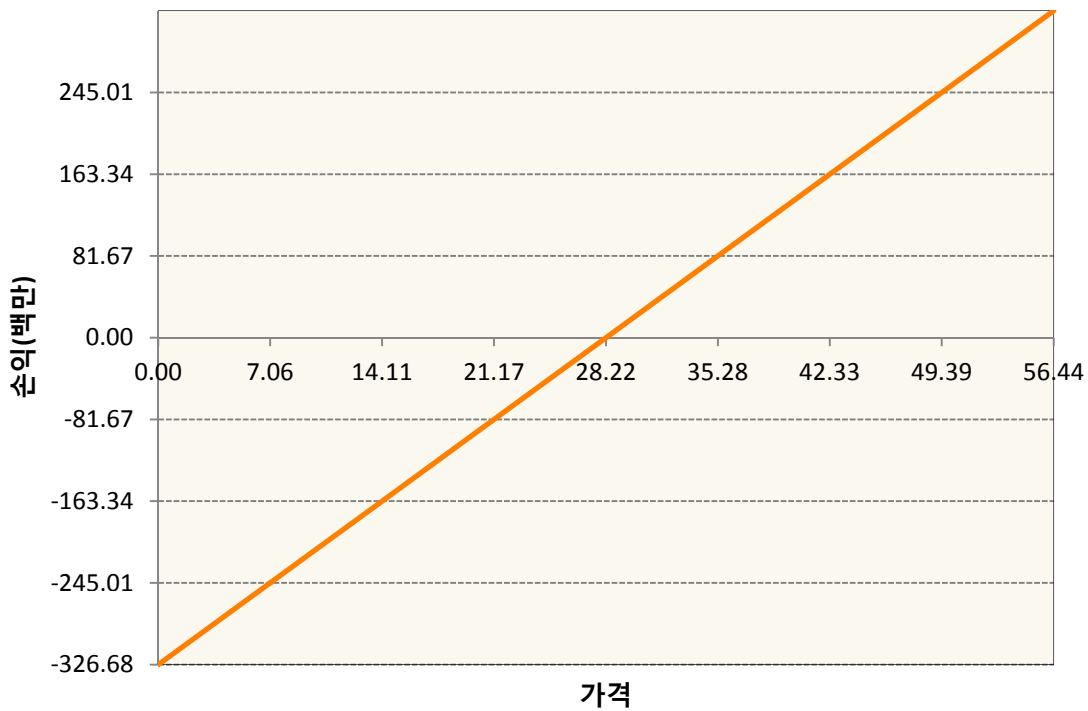
1. 계약금액

(단위:백만원)

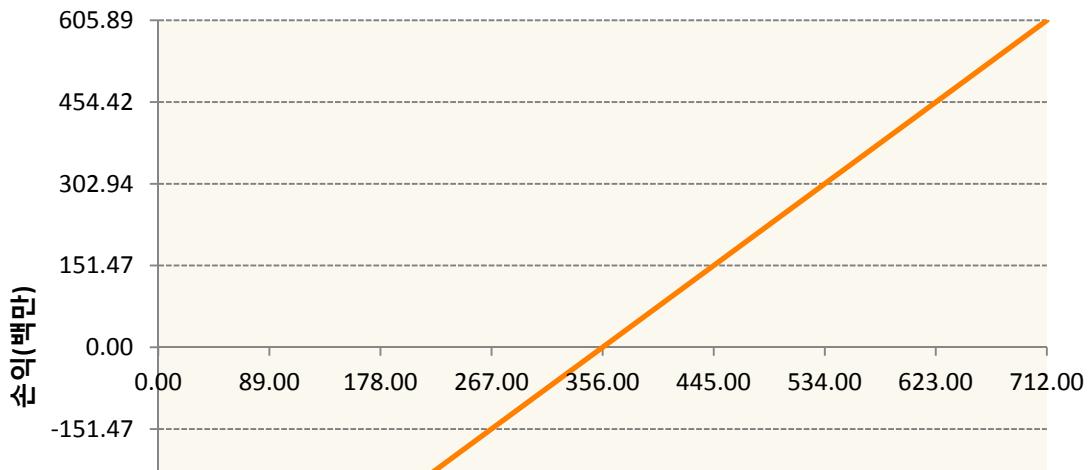
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,140	58	3,082	

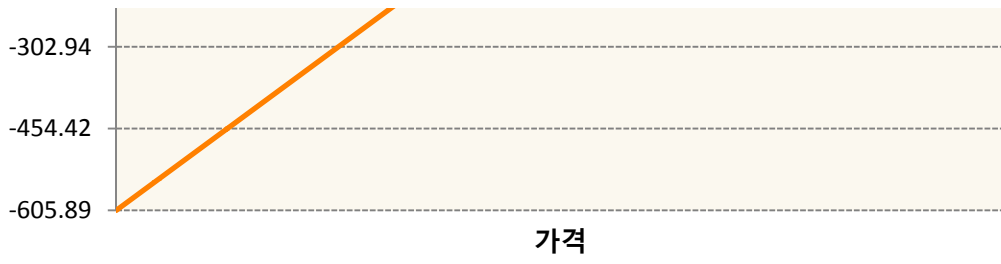
2. 만기시점의 손익구조

BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19

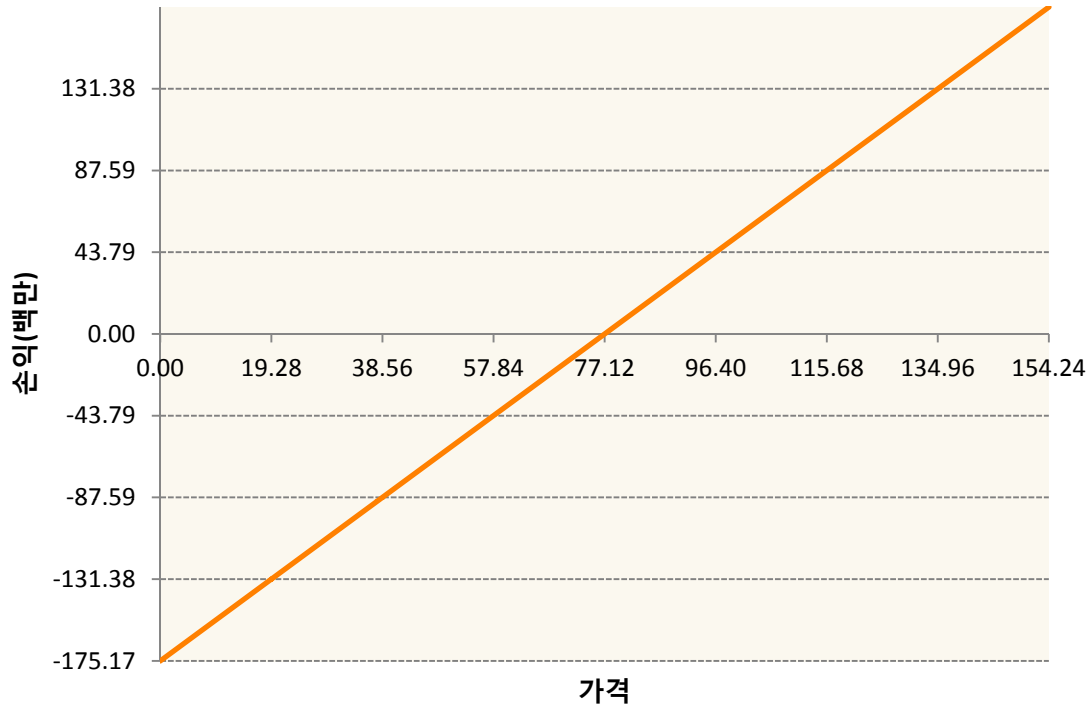


CN9-CORN FUTURE Jul19

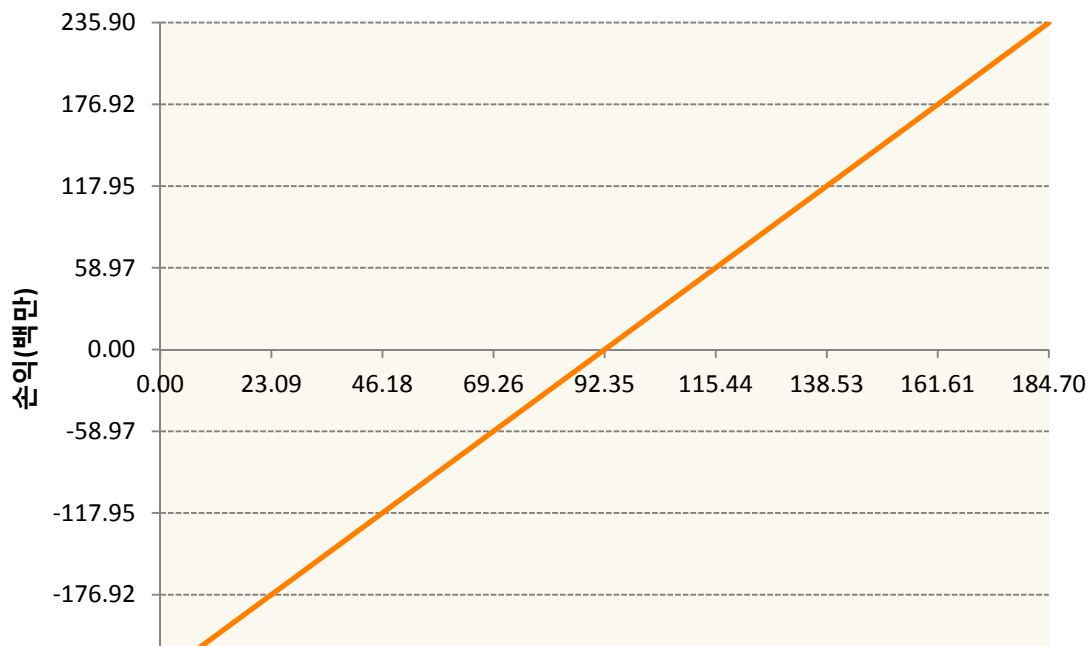


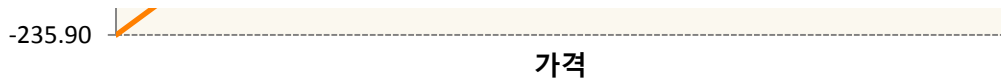


CTN9-COTTON NO.2 FUTR Jul19

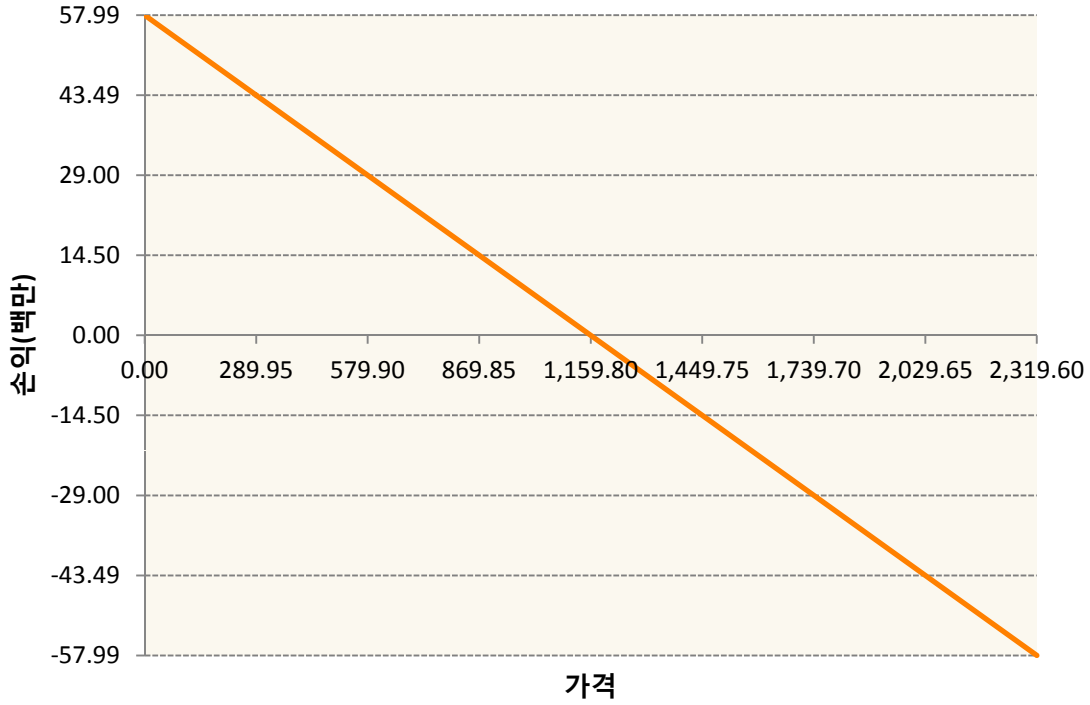


KCN9-COFFEE 'C' FUTURE Jul19

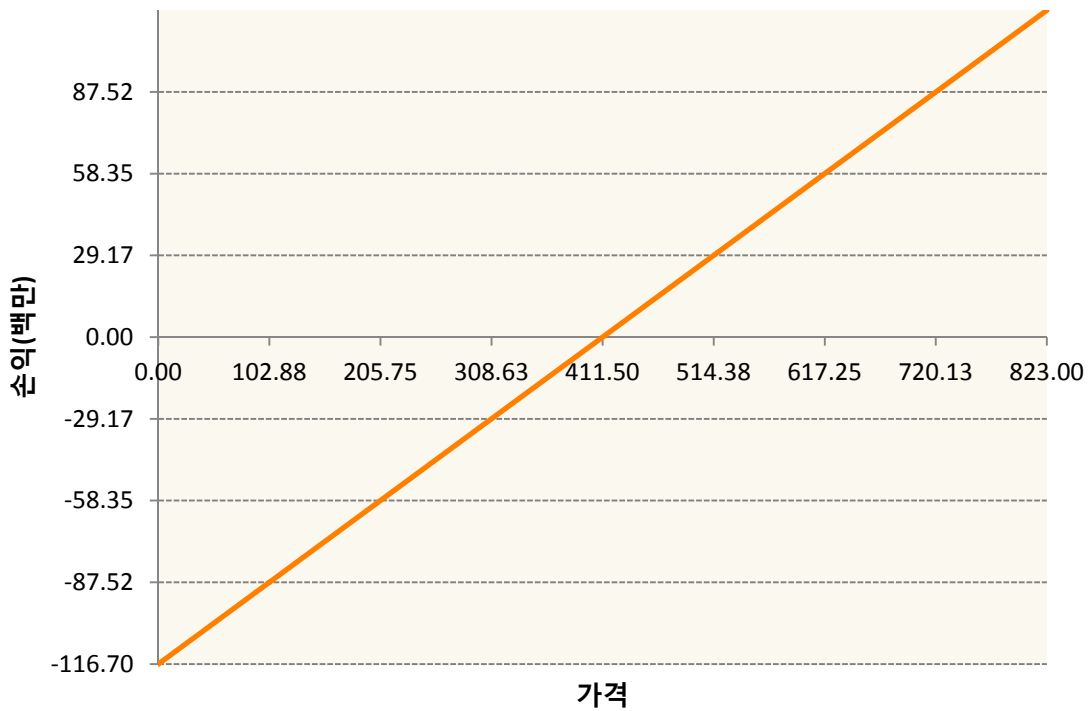




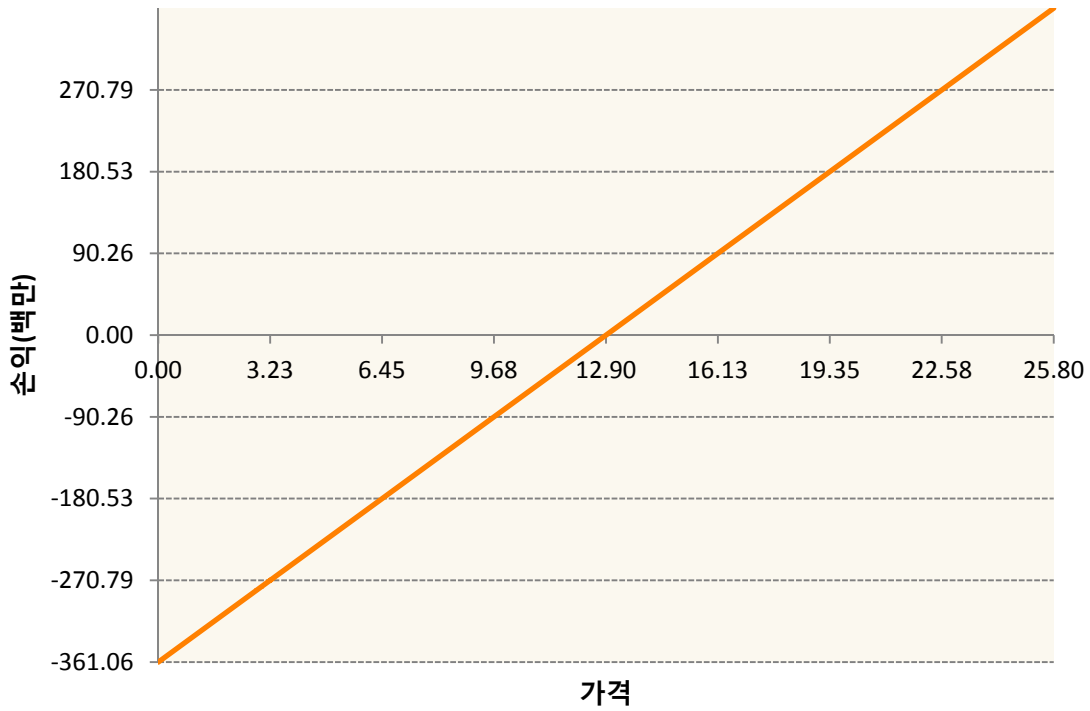
KR4175P50009-2019-05 달러선물



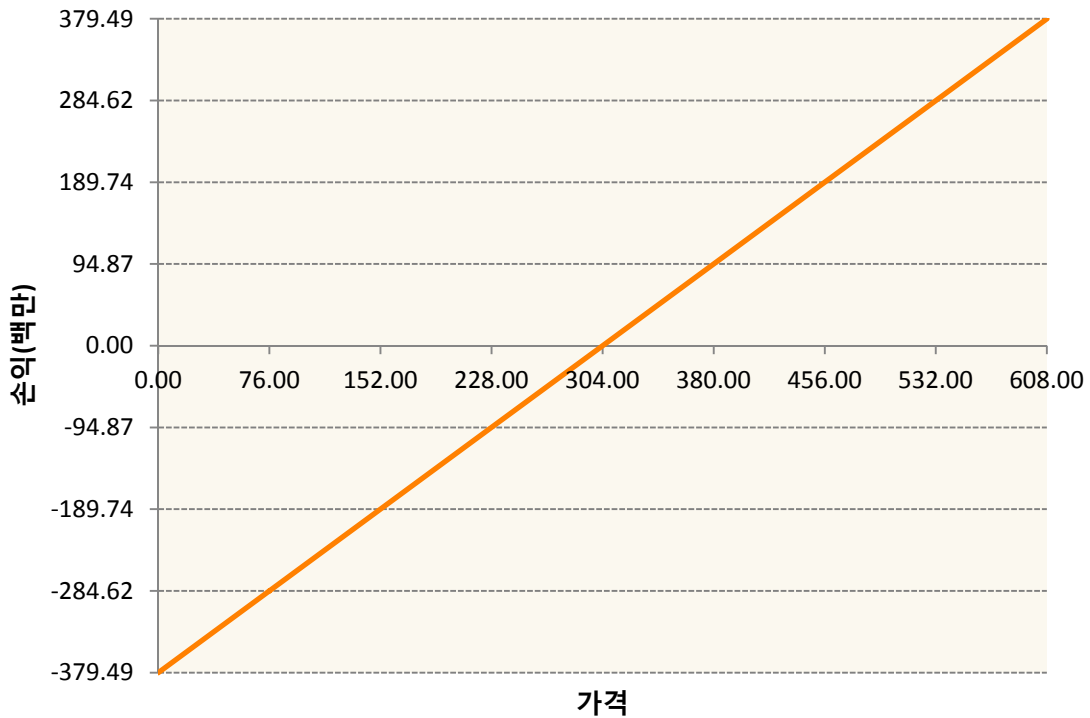
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

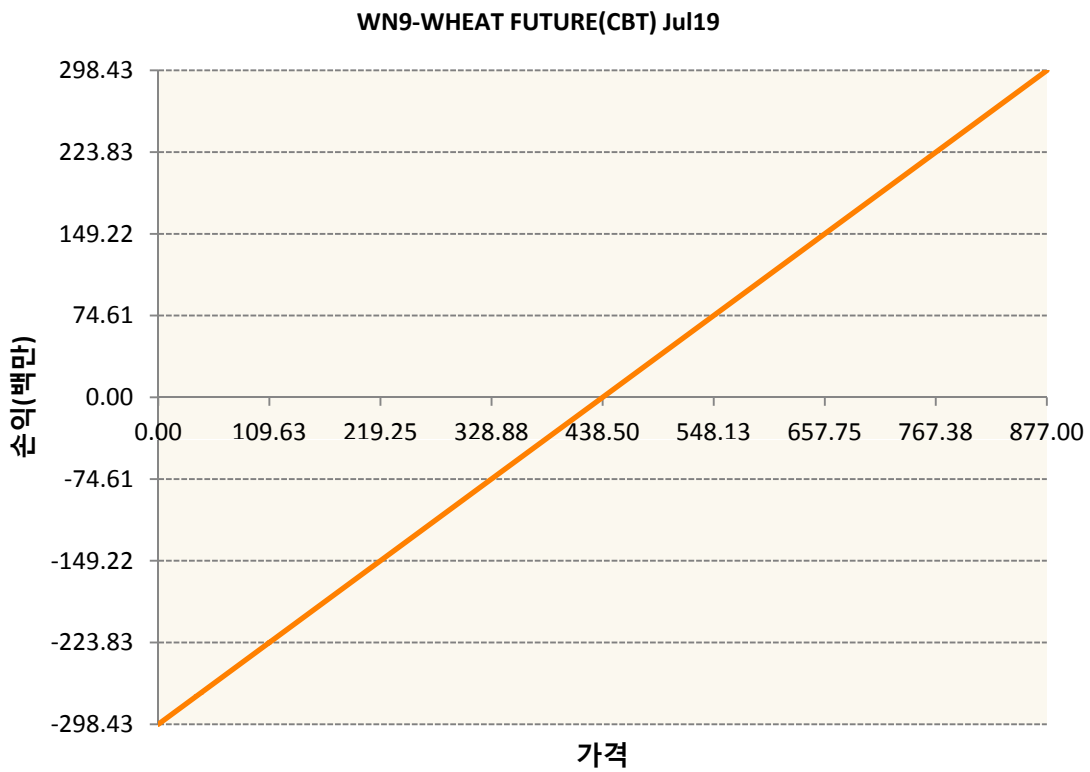
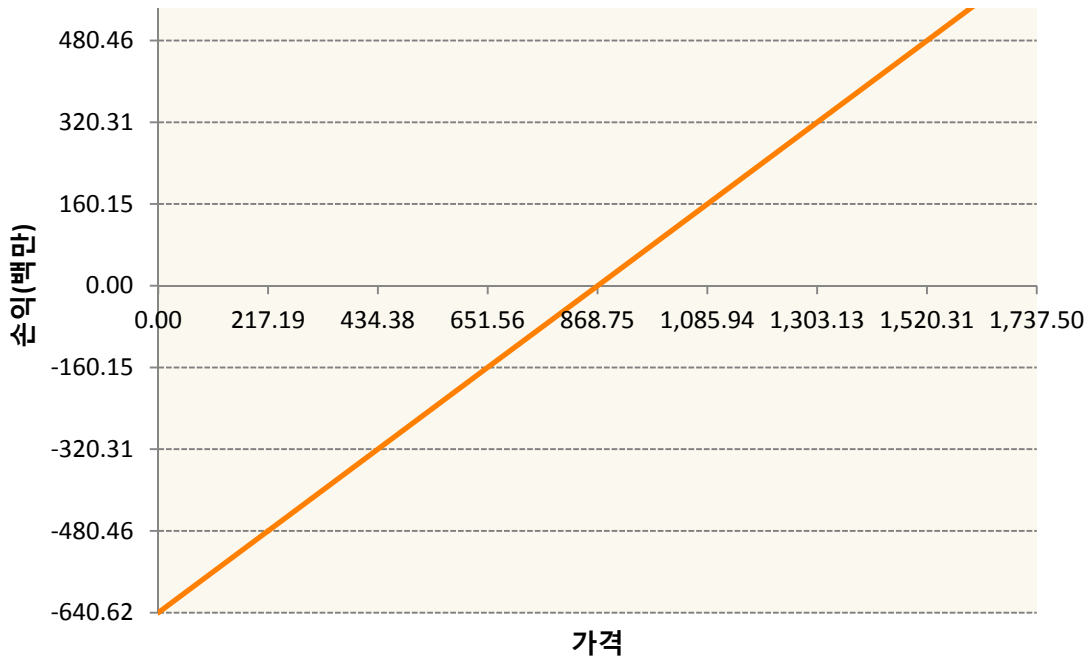


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19



SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BON9	SOYBEAN OIL FUTR Jul19	26
CN9	CORN FUTURE Jul19	48
CTN9	COTTON NO.2 FUTR Jul19	14
KCN9	COFFEE 'C' FUTURE Jul19	19
KR4175P500	2019-05 달러선물	5

KWN9	KC HRW WHEAT FUT Jul19	9
SBN9	SUGAR #11 (WORLD) Jul19	29
SMN9	SOYBEAN MEAL FUTR Jul19	30
SN9	SOYBEAN FUTURE Jul19	51
WN9	WHEAT FUTURE(CBT) Jul19	24

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

(단위:백만원)

254