

공시일	2019-04-29
기준일	2019-04-26

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

공시일	2019-04-29
기준일	2019-04-26

좋은아침펀더멘탈인덱스모(주식)

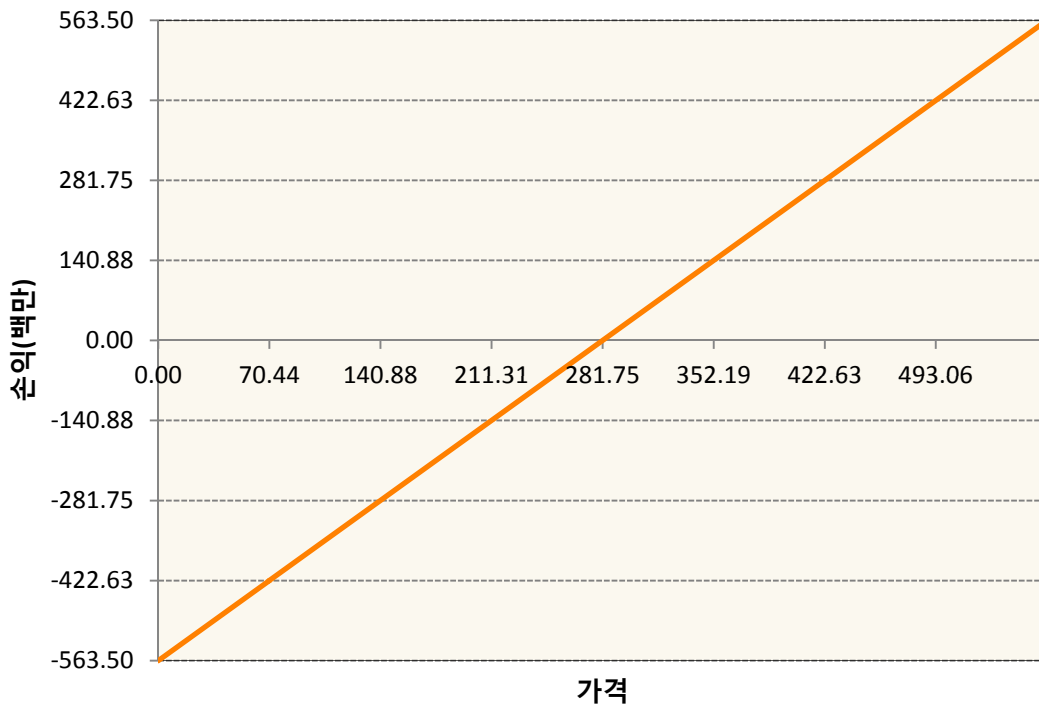
1. 계약금액

(단위:백만원)

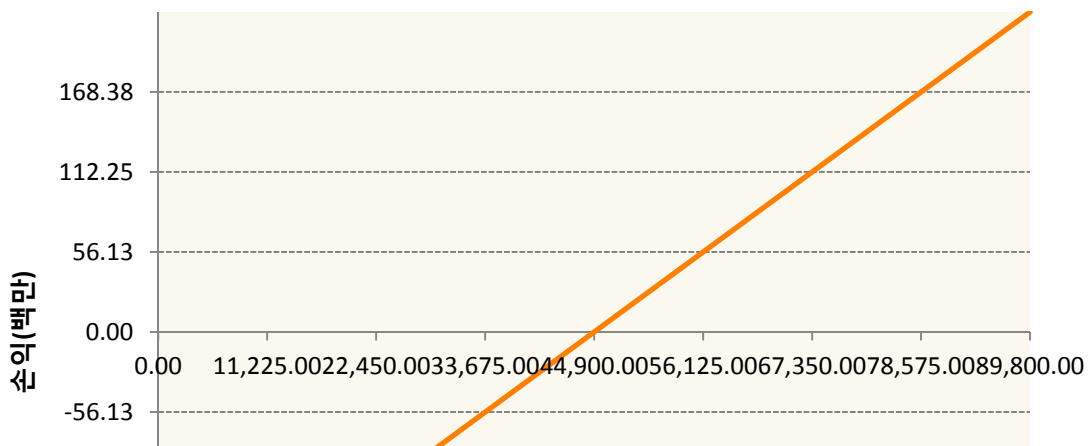
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	788	0	788	장내

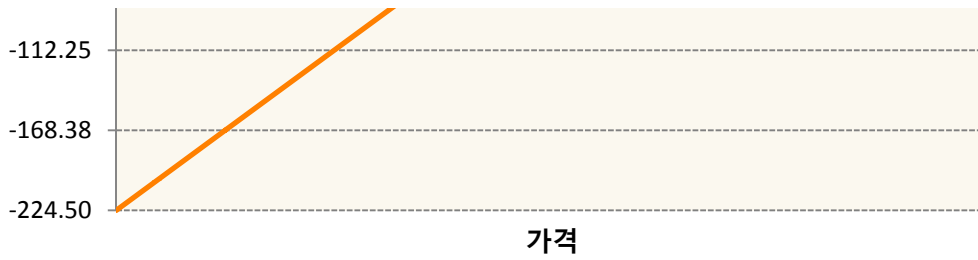
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4111P50004-2019-05 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						45
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45	
-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%	45	45	45	45	45	45	45	
KR4111P50004		2019-05 삼성전자개별선물						18
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
-5.33%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12	
-2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	6	6	6	6	6	6	6	
5.33%	12	12	12	12	12	12	12	
8.00%	18	18	18	18	18	18	18	

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

57

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

(단위:백만원)

92

공시일	2019-04-29
기준일	2019-04-26

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

1,161

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

681

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-04-29
기준일	2019-04-26

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)	337
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	93
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	158

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

936

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-04-29
기준일	2019-04-26

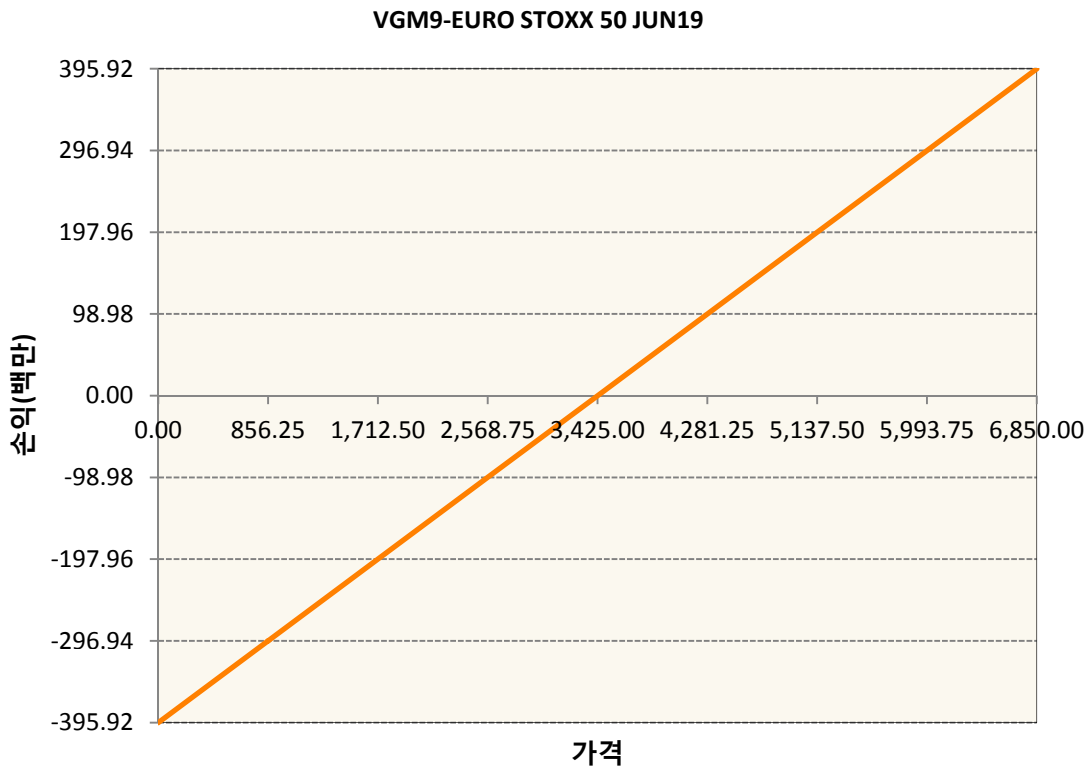
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	396	0	396	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	32
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

23

공시일	2019-04-29
기준일	2019-04-26

차이나인덱스모(주식-파생형)

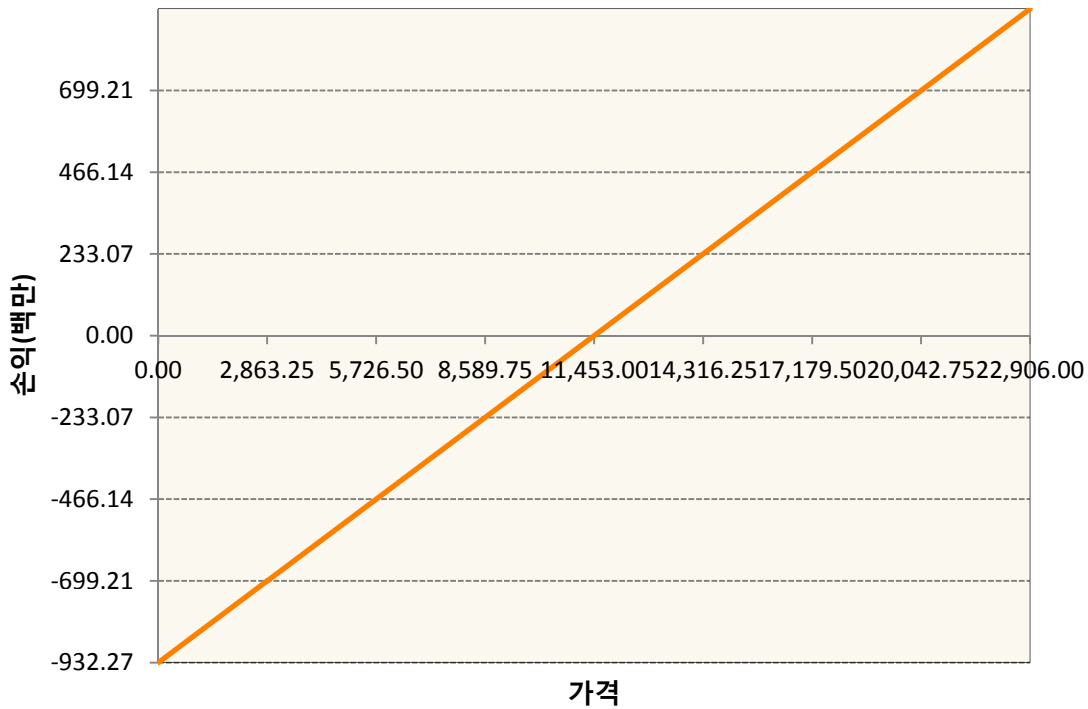
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	932	0	932	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK9	HSCEI Futures May19	75
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

77

공시일	2019-04-29
기준일	2019-04-26

커버드콜모(주식혼합-파생형)

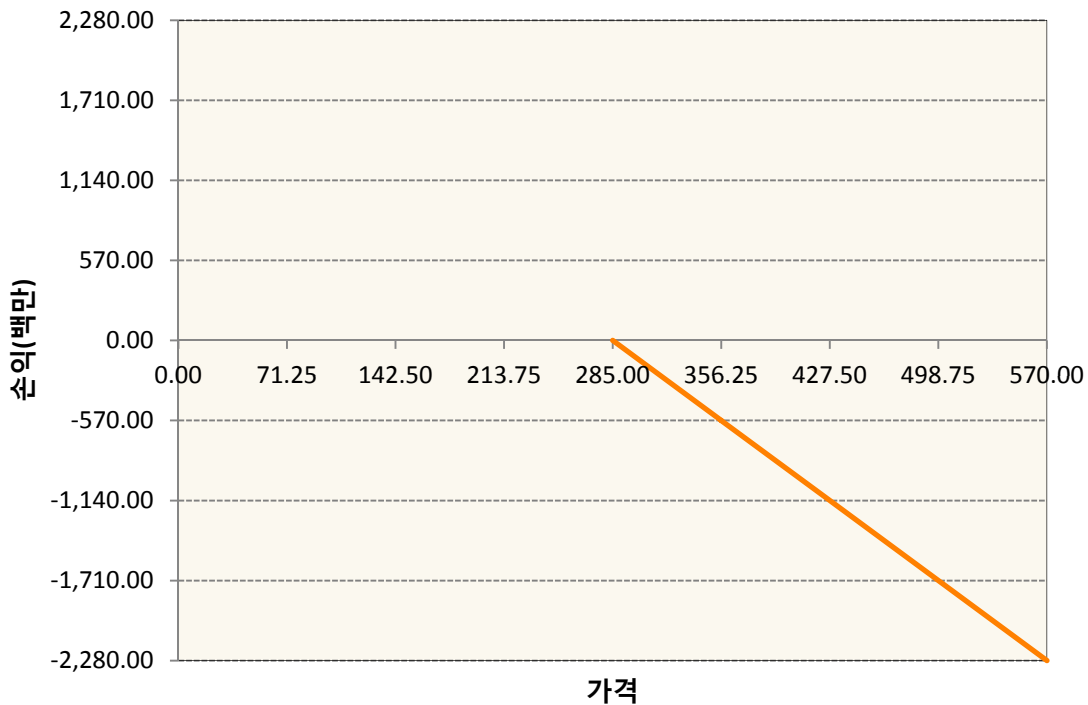
1. 계약금액

(단위:백만원)

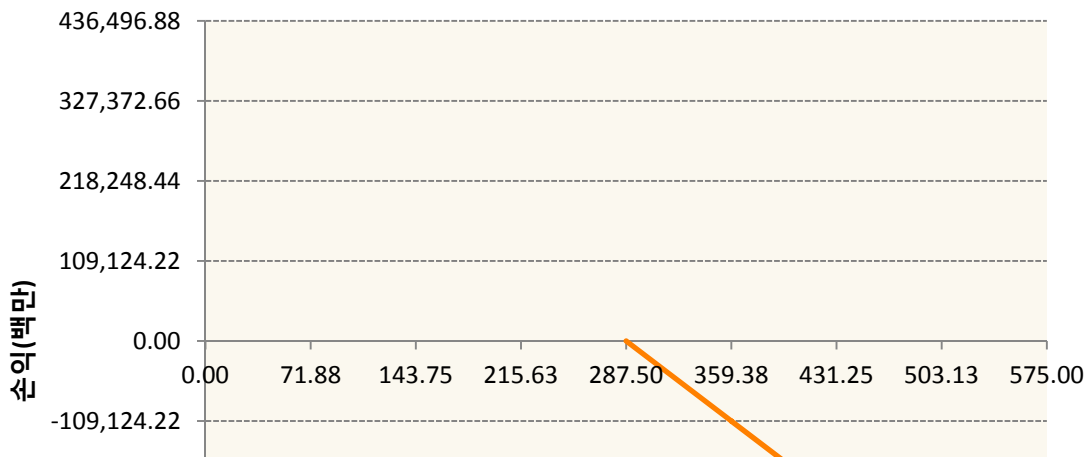
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	672,214	-672,214	장내

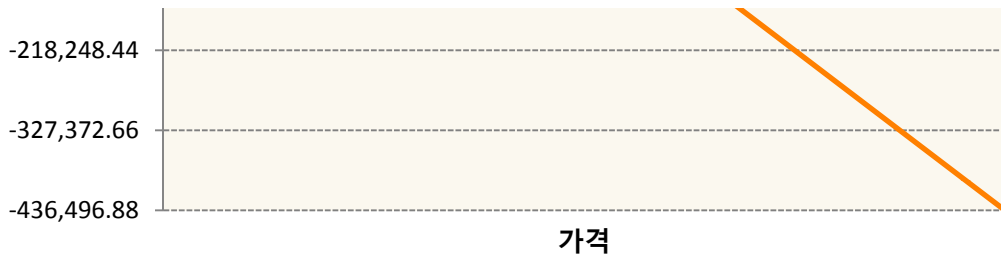
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P52850-2019-05 콜285

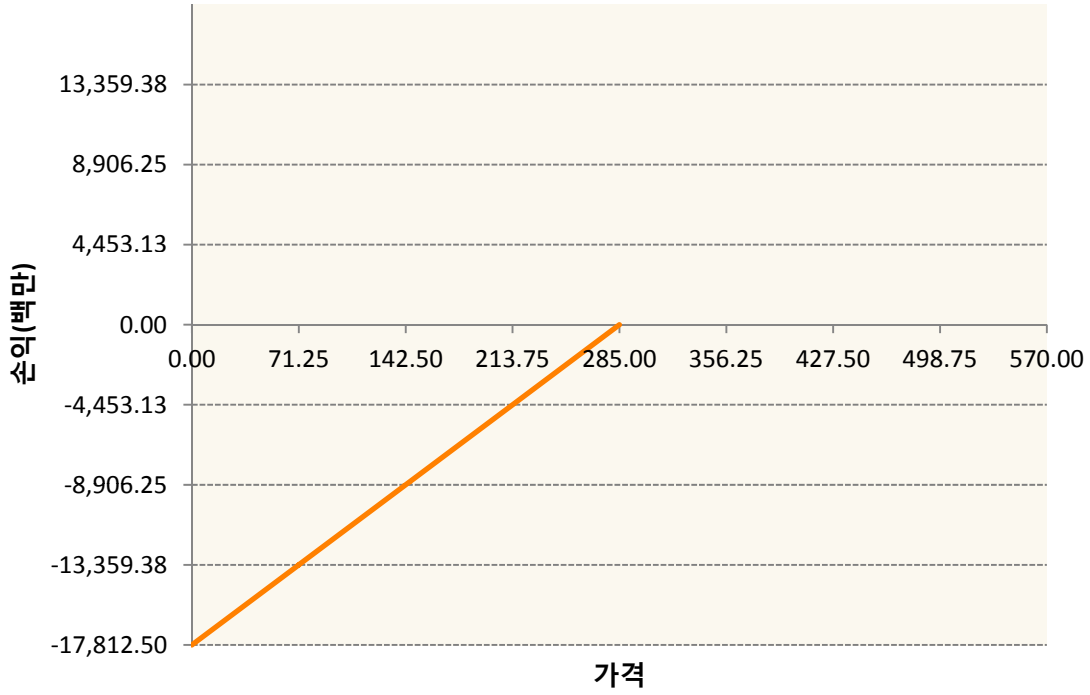


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

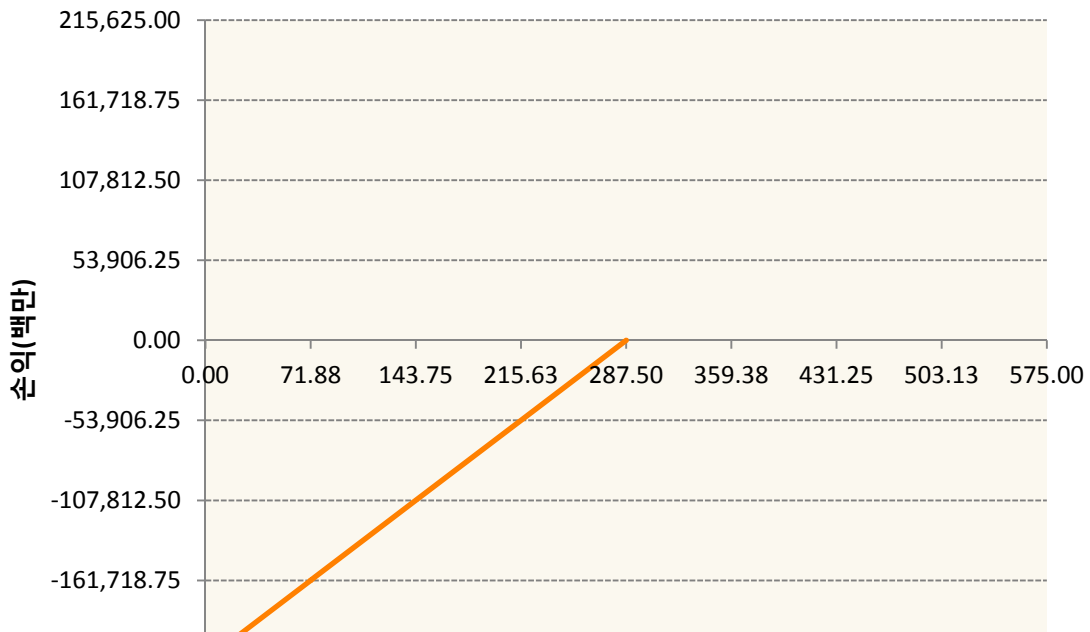




KR4301P52858-2019-05 풋285



KR4301P52874-2019-05 풋287.5



-215,625.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P52850 2019-05 콜285							131
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	29	29	29	28	28	27	26
-5.33%	28	28	27	26	24	23	21
-2.67%	24	22	20	18	15	13	10
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	-20	-24	-27	-31	-34	-37	-41
5.33%	-67	-69	-71	-74	-76	-79	-82
8.00%	-122	-123	-124	-126	-127	-129	-131
KR4201P52876 2019-05 콜287.5							22,963
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,186	4,175	4,151	4,111	4,049	3,962	3,850
-5.33%	4,117	4,041	3,929	3,779	3,591	3,366	3,107
-2.67%	3,639	3,364	3,041	2,677	2,278	1,850	1,396
0%	1,737	1,175	594	0	-605	-1,219	-1,840
2.67%	-2,953	-3,626	-4,300	-4,975	-5,650	-6,326	-7,002
5.33%	-10,836	-11,328	-11,851	-12,398	-12,964	-13,546	-14,142
8.00%	-20,935	-21,163	-21,442	-21,767	-22,132	-22,532	-22,963
KR4301P52858 2019-05 풋285							1,327
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,326	-1,326	-1,326	-1,326	-1,326	-1,326	-1,327
-5.33%	-858	-858	-858	-858	-859	-859	-860
-2.67%	-391	-392	-395	-398	-402	-406	-412
0%	35	24	12	0	-12	-25	-38
2.67%	266	255	243	231	218	206	193
5.33%	308	307	304	300	296	291	285
8.00%	310	310	310	310	309	308	307
KR4301P52874 2019-05 풋287.5							16,354
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-16,353	-16,353	-16,353	-16,353	-16,353	-16,353	-16,354
-5.33%	-10,731	-10,731	-10,731	-10,732	-10,733	-10,736	-10,742
-2.67%	-5,112	-5,119	-5,130	-5,149	-5,174	-5,208	-5,250
0%	299	210	110	0	-118	-241	-371
2.67%	4,040	3,871	3,702	3,532	3,361	3,190	3,019

5.33%	5,082	5,031	4,968	4,893	4,807	4,713	4,610
8.00%	5,159	5,157	5,151	5,140	5,124	5,101	5,072

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

(단위:백만원)

43,721

공시일	2019-04-29
기준일	2019-04-26

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

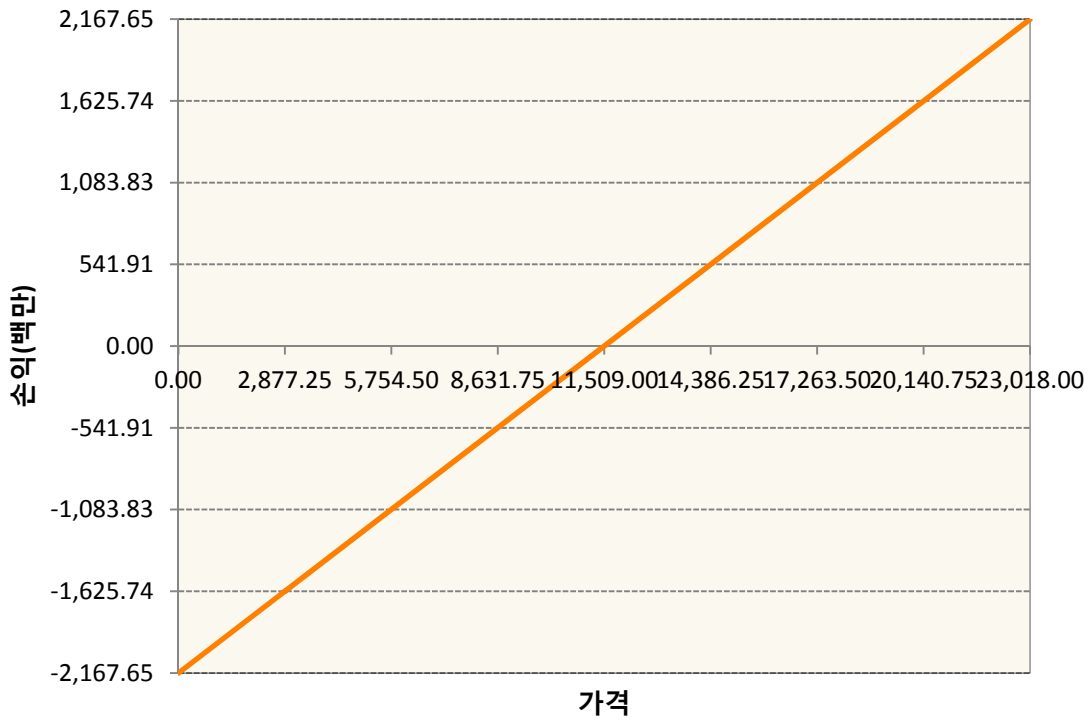
1. 계약금액

(단위:백만원)

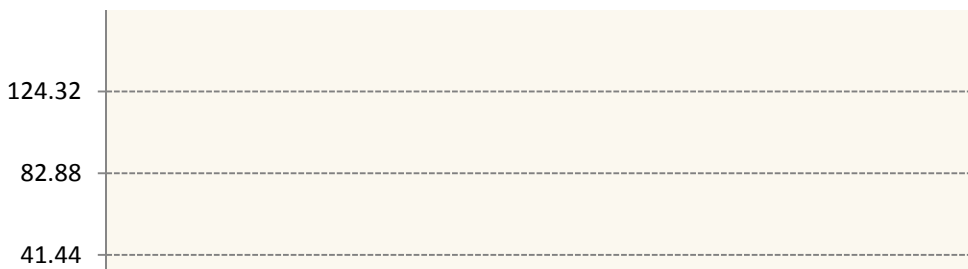
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,168	0	2,168	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,683	-5,683	장내
누계	통화	선도	0	3,108	-3,108	장외

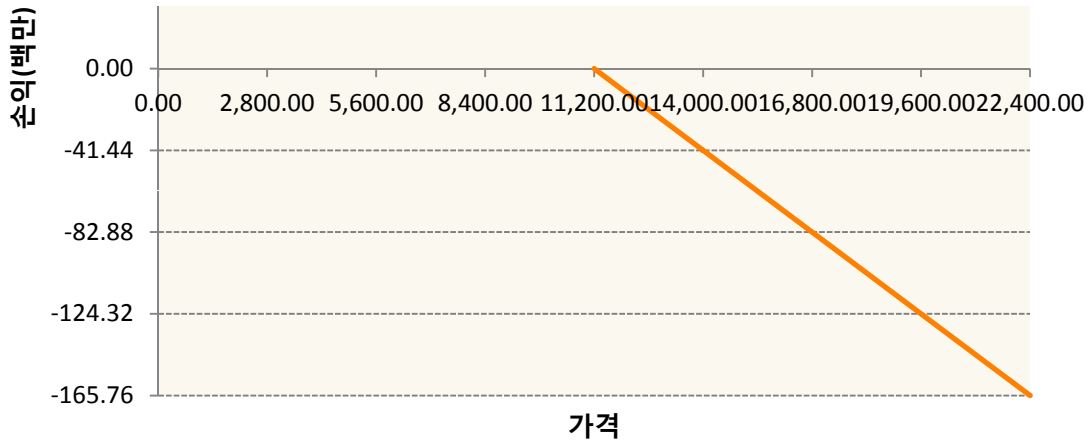
2. 만기시점의 손익구조

HCJ9-HSCEI Futures Apr19

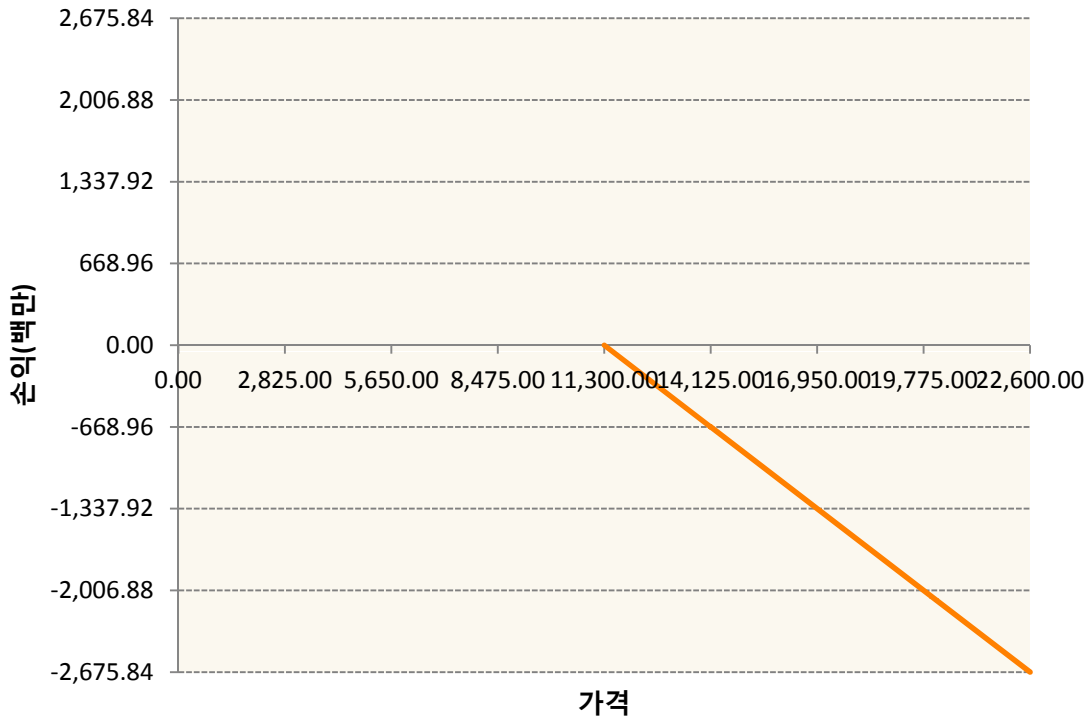


OHHIJ9-C112-HSCEI

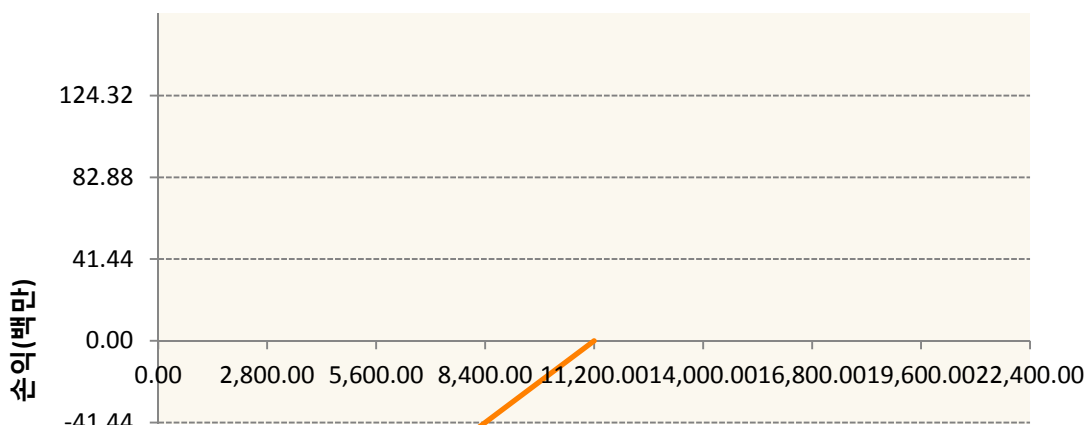


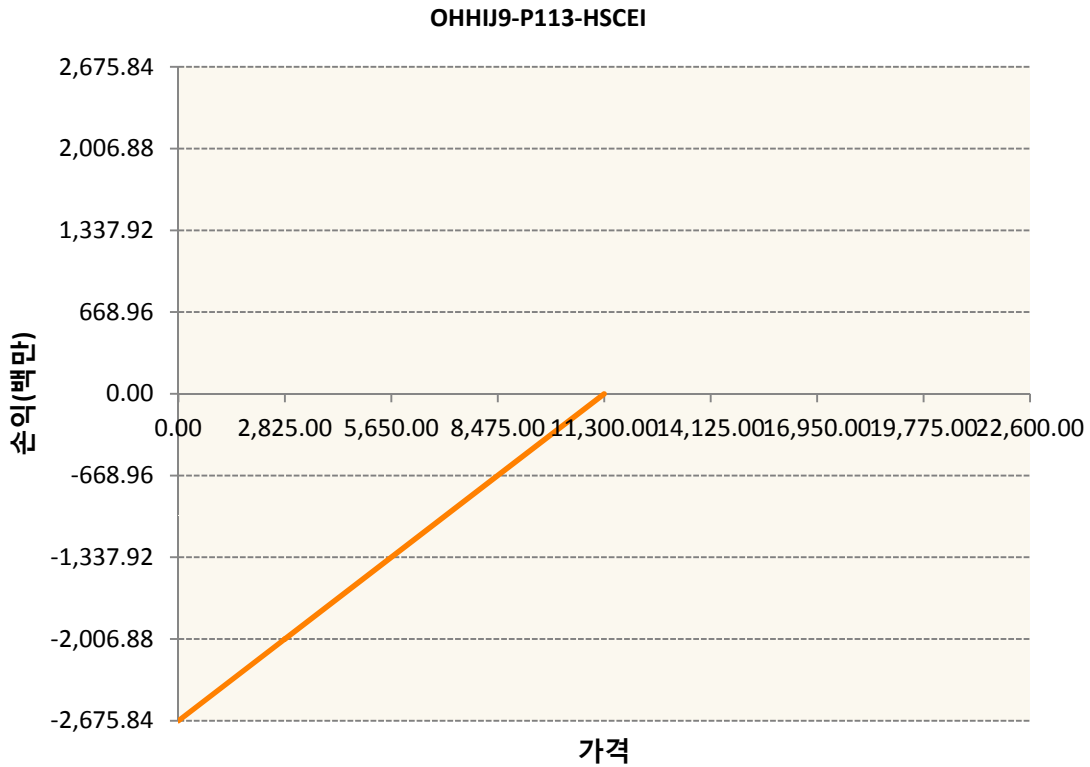
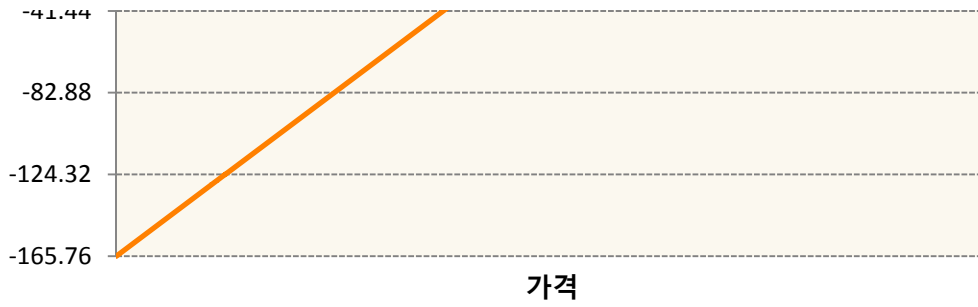


OHHIJ9-C113-HSCEI



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)

729

공시일	2019-04-29
기준일	2019-04-26

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

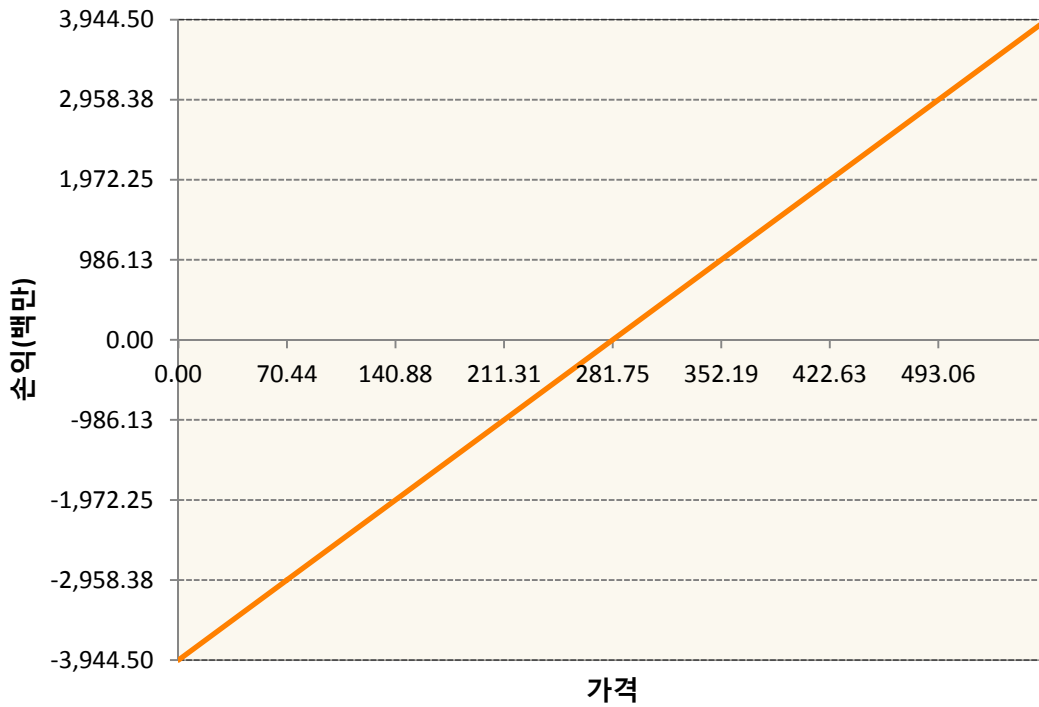
1. 계약금액

(단위:백만원)

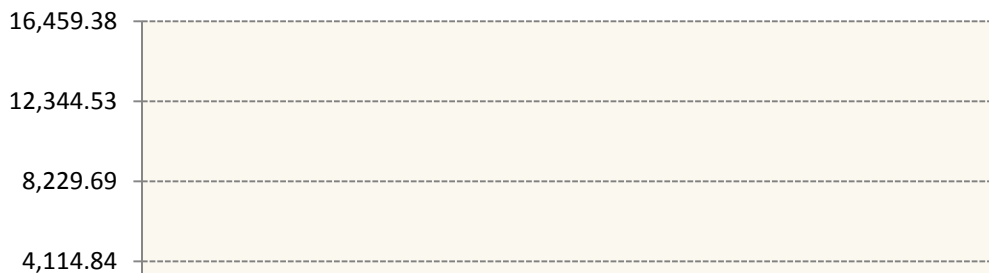
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,945	0	3,945	장내
누계	유가증권	스왑	32,836	0	32,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	32,264	-32,264	장내

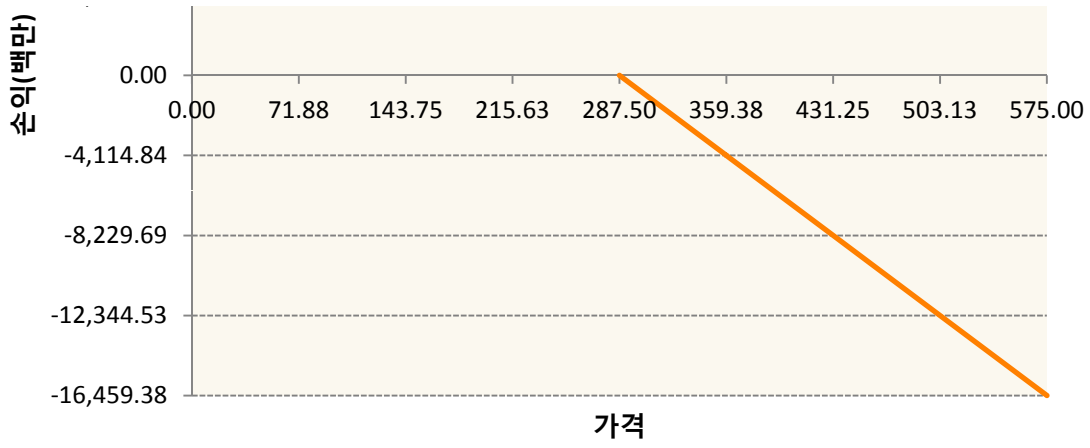
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

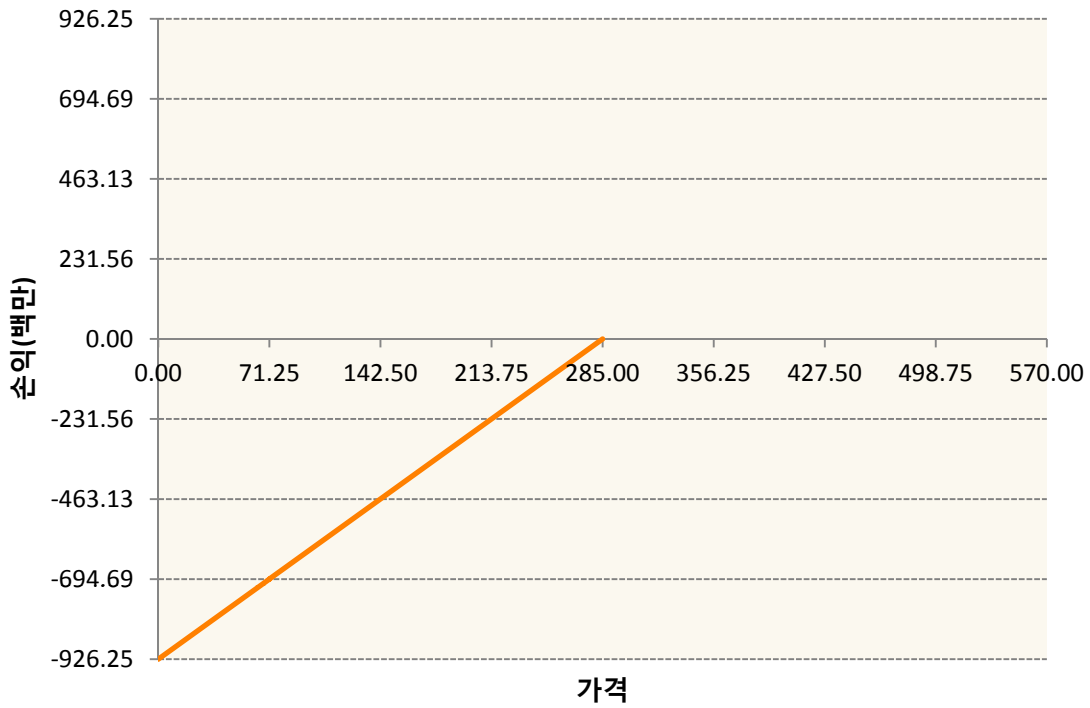


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

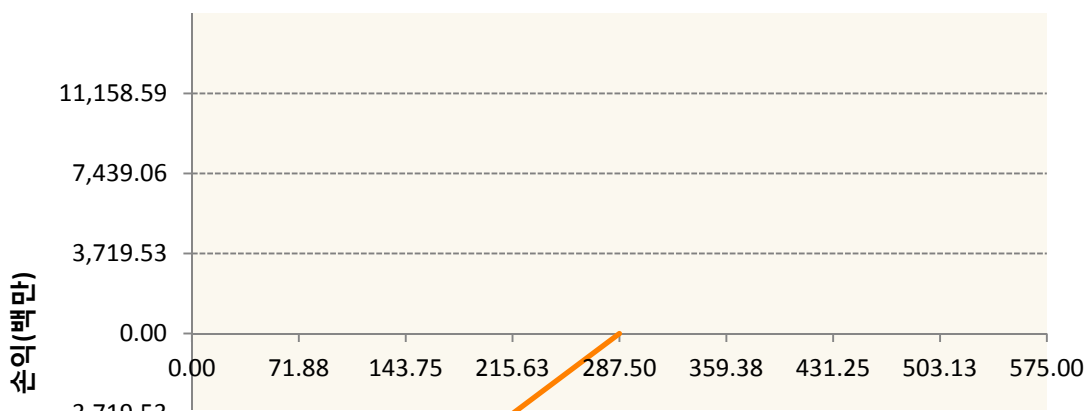


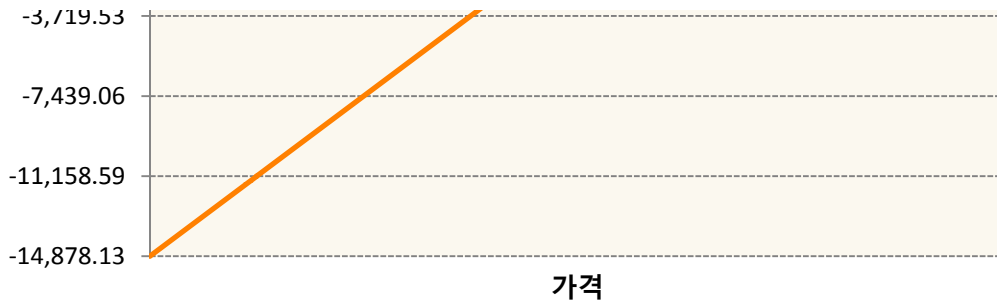


KR4301P52858-2019-05 풋285



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						315
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-315	-315	-315	-315	-315	-315	-315	
-5.33%	-210	-210	-210	-210	-210	-210	-210	
-2.67%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	105	105	105	105	105	105	105	
5.33%	210	210	210	210	210	210	210	
8.00%	315	315	315	315	315	315	315	
KR4201P52876		2019-05 콜287.5						866
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	158	157	157	155	153	149	145
-5.33%	155	152	148	142	135	127	117
-2.67%	137	127	115	101	86	70	53
0%	65	44	22	0	-23	-46	-69
2.67%	-111	-137	-162	-188	-213	-239	-264
5.33%	-409	-427	-447	-467	-489	-511	-533
8.00%	-789	-798	-809	-821	-835	-850	-866
KR4301P52858 2019-05 풋285							69
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69
-5.33%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
-2.67%	-20	-20	-21	-21	-21	-21	-21
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	14	13	13	12	11	11	10
5.33%	16	16	16	16	15	15	15
8.00%	16	16	16	16	16	16	16
KR4301P52874 2019-05 풋287.5							1,128
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128
-5.33%	-740	-740	-740	-740	-741	-741	-741
-2.67%	-353	-353	-354	-355	-357	-359	-362
0%	21	15	8	0	-8	-17	-26
2.67%	279	267	255	244	232	220	208
5.33%	351	347	343	338	332	325	318
8.00%	356	356	355	355	354	352	350

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

(단위:백만원)

5,358

공시일	2019-04-29
기준일	2019-04-26

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

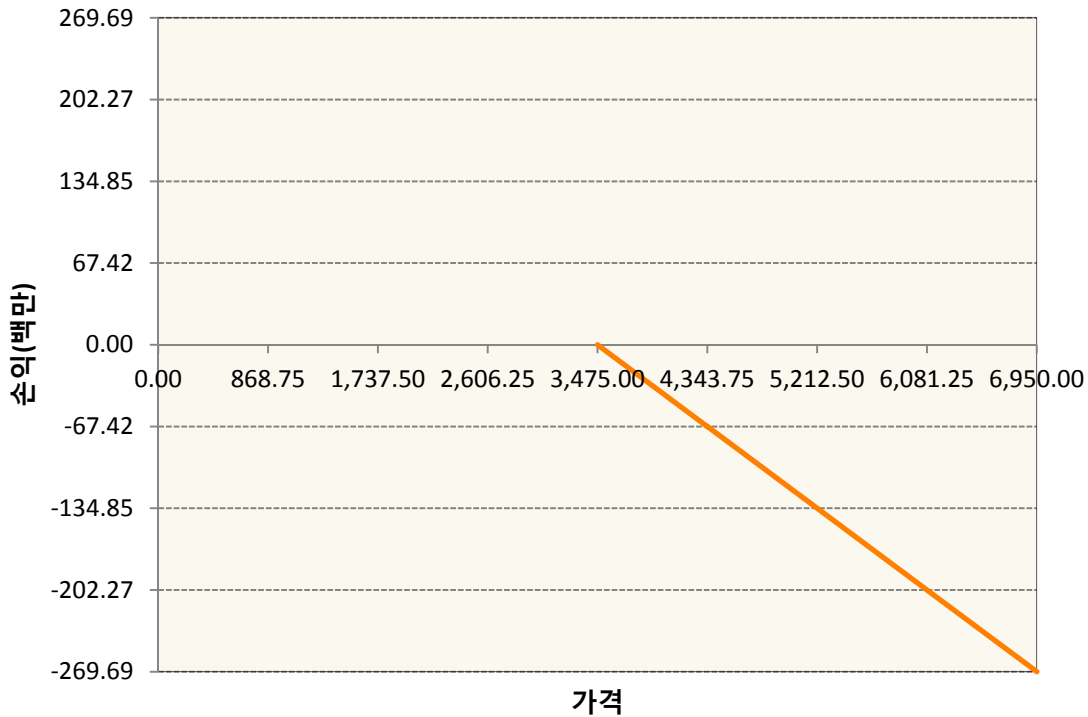
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,584	0	1,584	
누계	유가증권	스왑	63,726	0	63,726	장외
누계	유가증권	옵션	0	17,290	-17,290	장내
누계	통화	선도	0	18,109	-18,109	장외

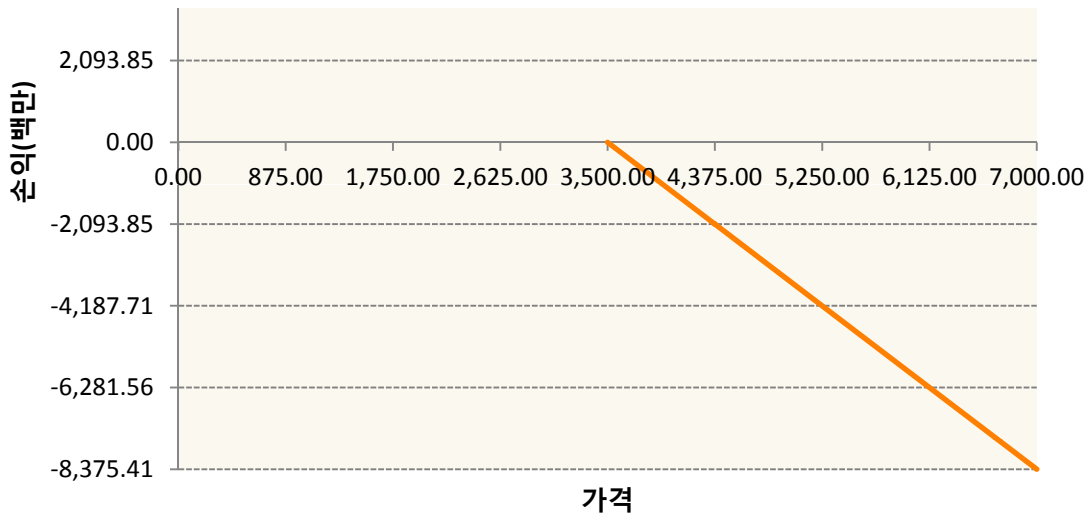
2. 만기시점의 손익구조

OESXK9-C3475-EURO STOXX 50

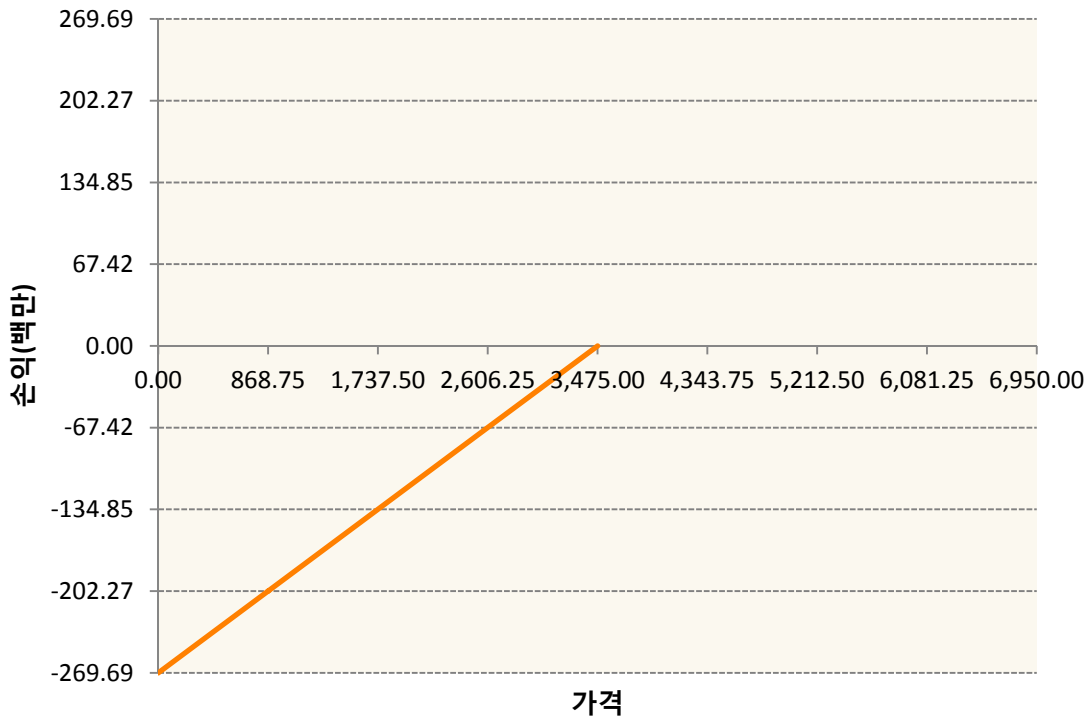


OESXK9-C3500-EURO STOXX 50

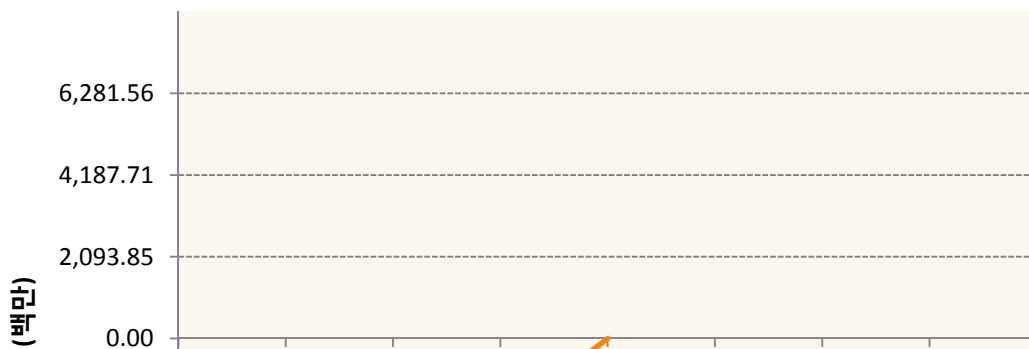


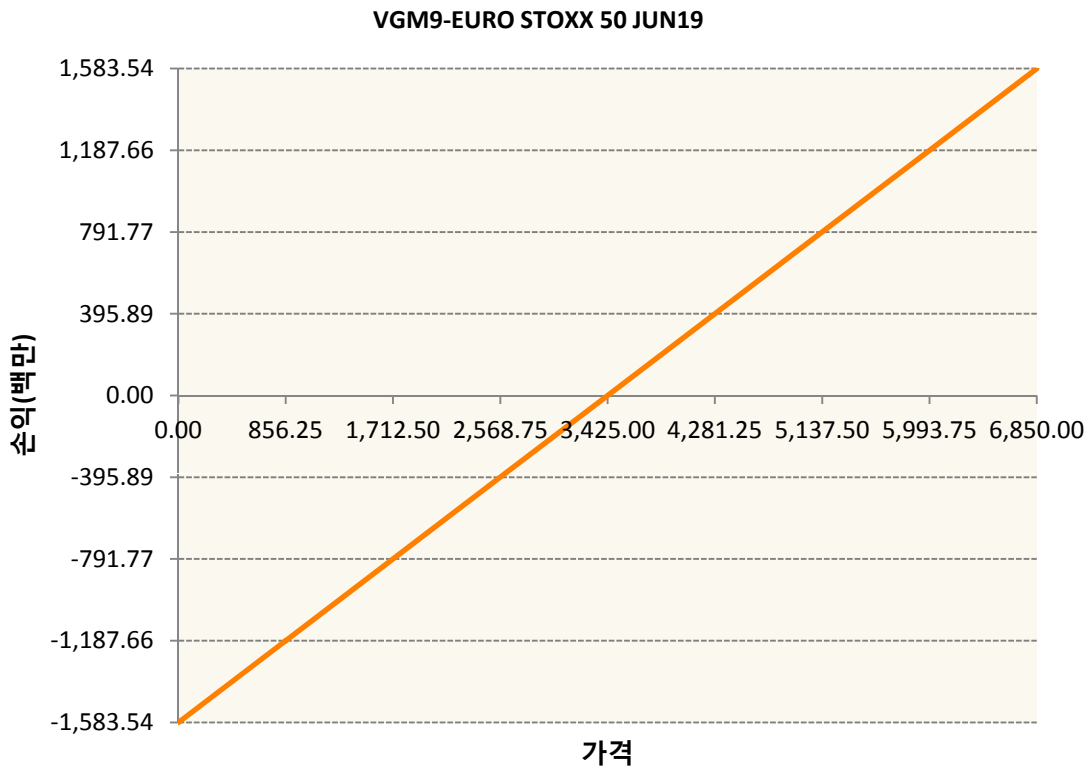
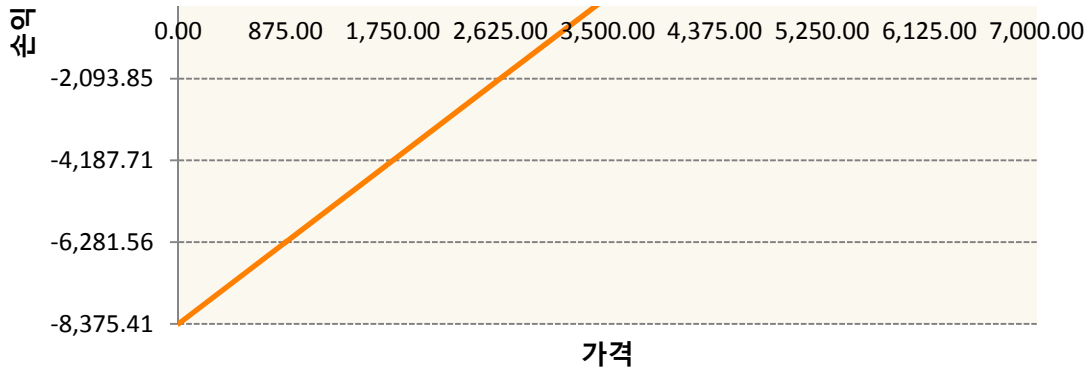


OESXK9-P3475-EURO STOXX 50



OESXK9-P3500-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	3
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	414
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	828
FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E	207
OESXK9-C34 EURO STOXX 50	22
OESXK9-C35 EURO STOXX 50	670
OESXK9-P34 EURO STOXX 50	22
OESXK9-P35 EURO STOXX 50	670
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	127

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

(단위:백만원)

1,811

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

(단위:백만원)

1,078

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

(단위:백만원)

92

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

(단위:백만원)

134

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-04-29
기준일	2019-04-26

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

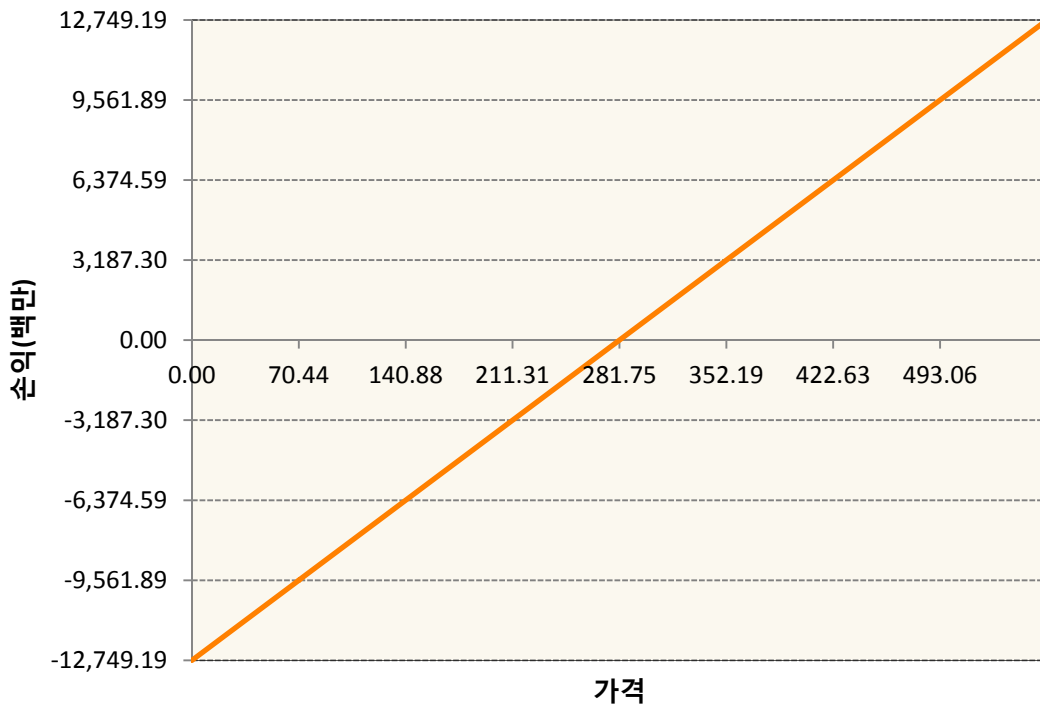
1. 계약금액

(단위:백만원)

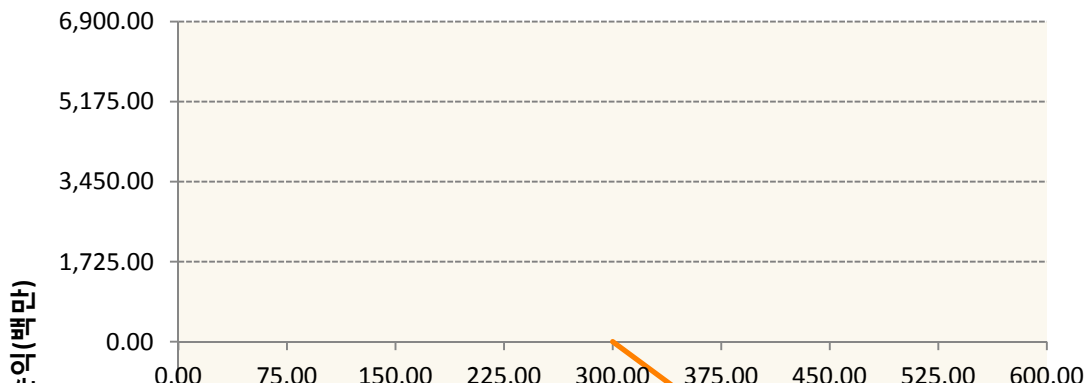
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,749	0	12,749	장내
누계	유가증권	옵션	1,366	24,294	-22,928	장내

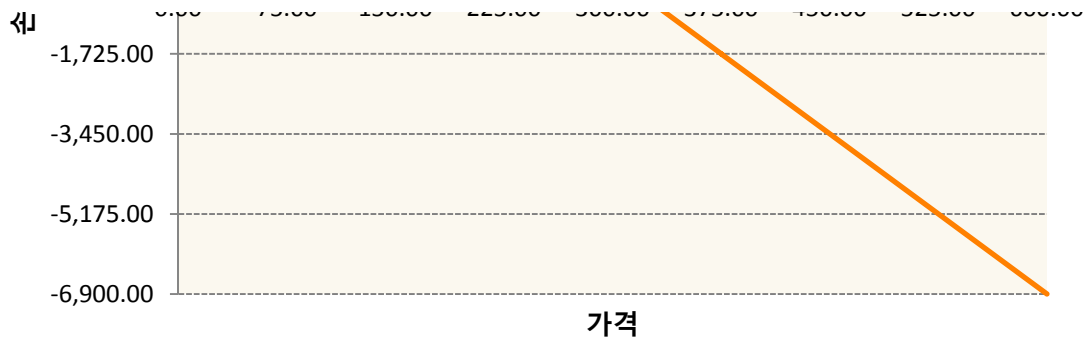
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

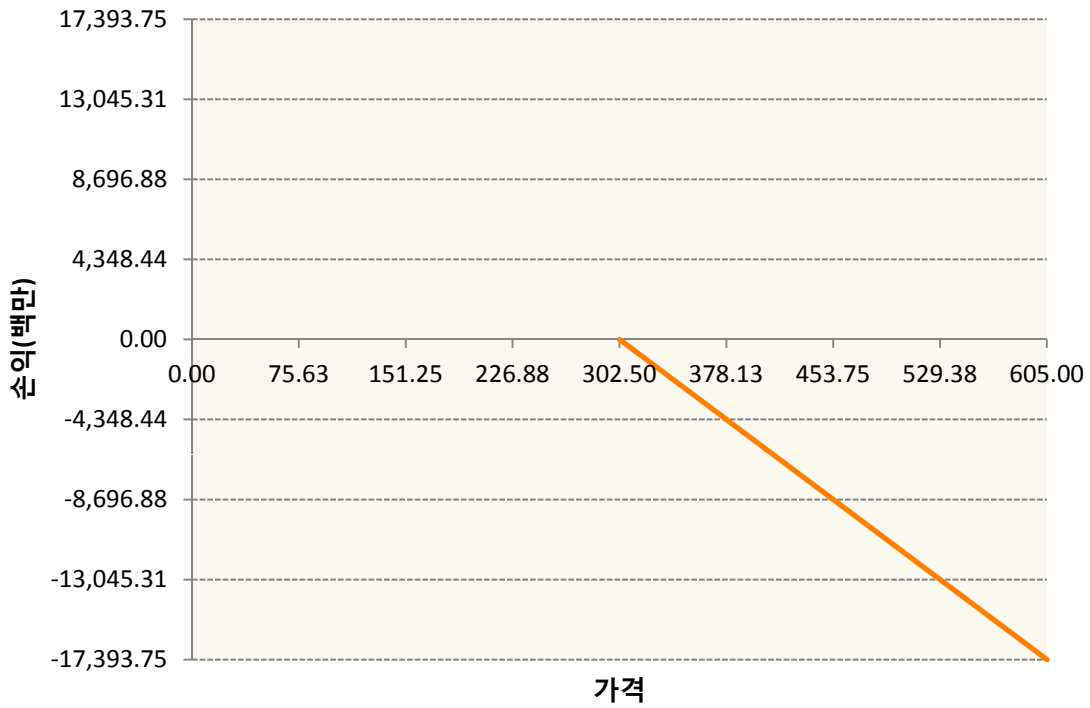


KR4201P53007-2019-05 콜300

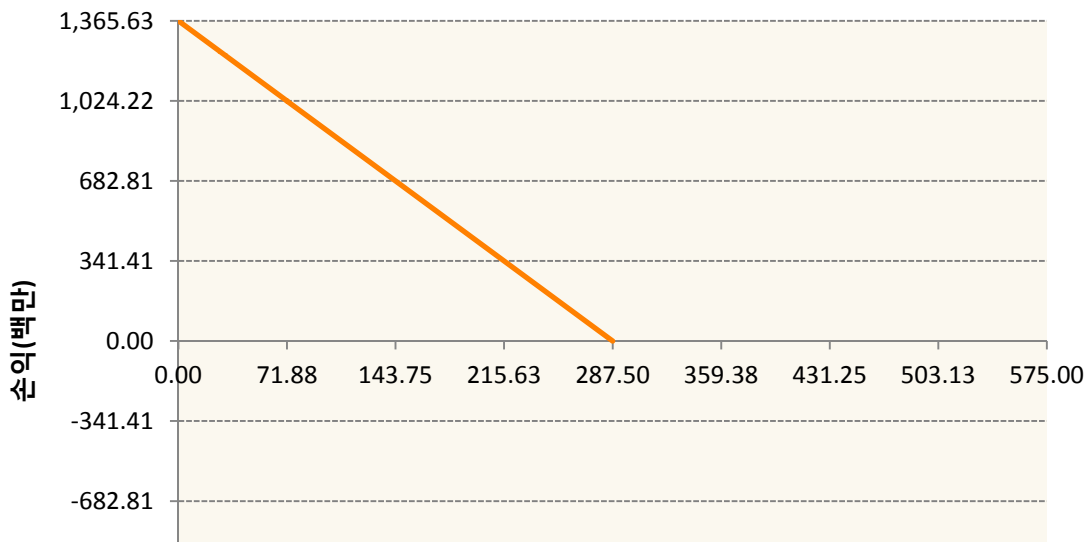


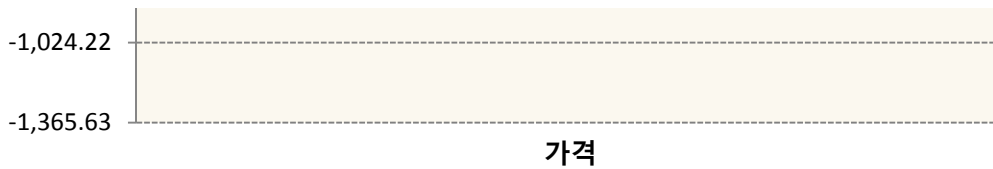


KR4201P53023-2019-05 콜302.5



KR4301P52874-2019-05 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						1,018
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,018	-1,018	-1,018	-1,018	-1,018	-1,018	-1,018	
-5.33%	-679	-679	-679	-679	-679	-679	-679	
-2.67%	-339	-339	-339	-339	-339	-339	-339	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	339	339	339	339	339	339	339	
5.33%	679	679	679	679	679	679	679	
8.00%	1,018	1,018	1,018	1,018	1,018	1,018	1,018	
KR4201P53007		2019-05 콜300						197
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	12	12	12	12	12	12	11	
-5.33%	12	12	12	11	11	10	9	
-2.67%	12	11	10	9	7	5	2	
0%	9	7	4	0	-4	-9	-15	
2.67%	-5	-11	-18	-25	-33	-41	-49	
5.33%	-47	-57	-67	-78	-88	-98	-109	
8.00%	-135	-145	-155	-166	-176	-187	-197	
KR4201P53023		2019-05 콜302.5						424
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	20	20	20	20	20	20	19	
-5.33%	20	20	20	19	19	17	15	
-2.67%	20	19	18	16	12	8	3	
0%	16	12	7	0	-9	-18	-30	
2.67%	-6	-18	-31	-47	-64	-81	-100	
5.33%	-83	-106	-129	-153	-178	-202	-227	
8.00%	-262	-289	-316	-343	-370	-397	-424	
KR4301P52874		2019-05 풋287.5						104
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	104	104	104	104	104	104	104	
-5.33%	68	68	68	68	68	68	68	
-2.67%	32	32	32	33	33	33	33	

0%	-2	-1	-1	0	1	2	2
2.67%	-26	-25	-23	-22	-21	-20	-19
5.33%	-32	-32	-31	-31	-30	-30	-29
8.00%	-33	-33	-33	-33	-32	-32	-32

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

(단위:백만원)

1,279

공시일	2019-04-29
기준일	2019-04-26

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	4,341	0	4,341	

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	2019-04-29
기준일	2019-04-26

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,090	0	2,090	
누계	유가증권	수익증권	71,170	0	71,170	

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	2019-04-29
기준일	2019-04-26

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	4,644	0	4,644	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	142,749	0	142,749	
누계	통화	선도	0	169,982	-169,982	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	539
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	46
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	372
FX21019J020 KRW/USD 20-05-19E	502
FX21019J021 KRW/USD 20-05-19E	472
FX21019J022 KRW/USD 24-06-19E	929
FX21019J022 KRW/USD 22-05-19E	780
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E	929
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E	985

FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E	372
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E	74
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E	977
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E	1,003
FX21019J041 KRW/USD 28-05-19E	279

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

(단위:백만원)

4,686

공시일	2019-04-29
기준일	2019-04-26

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

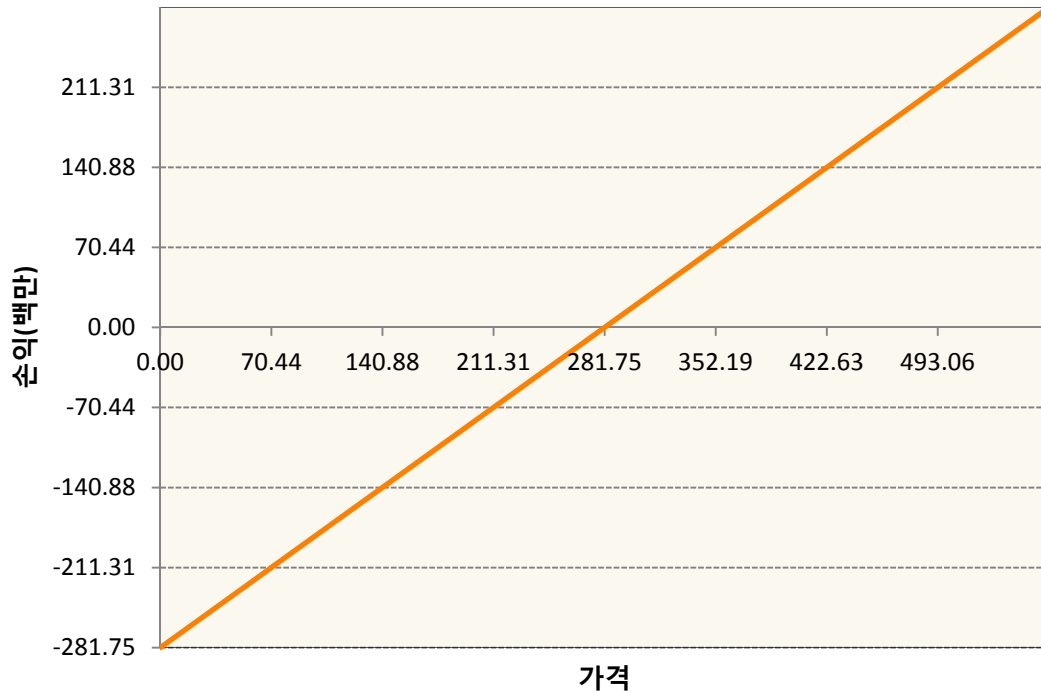
1. 계약금액

(단위:백만원)

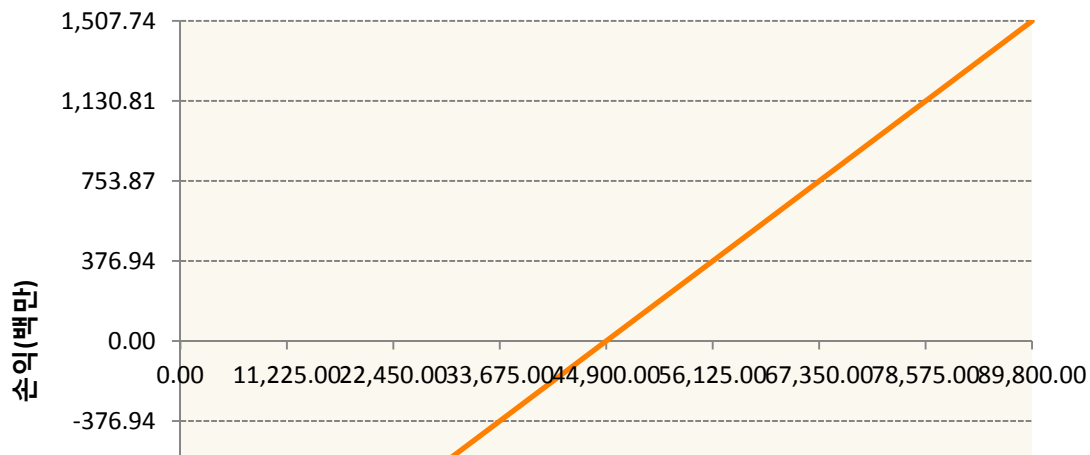
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,789	0	1,789	장내

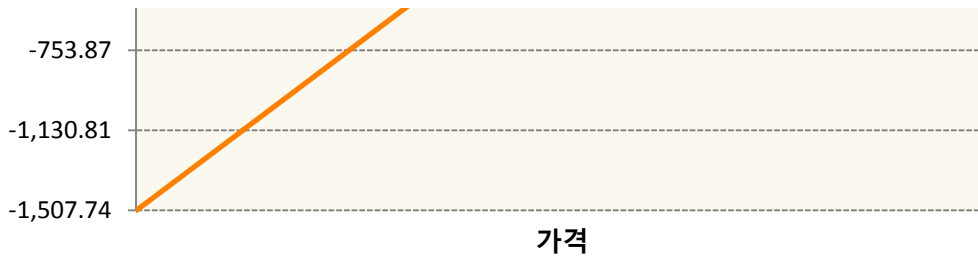
2. 만기시점의 손익구조

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						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)

156

공시일	2019-04-29
기준일	2019-04-26

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

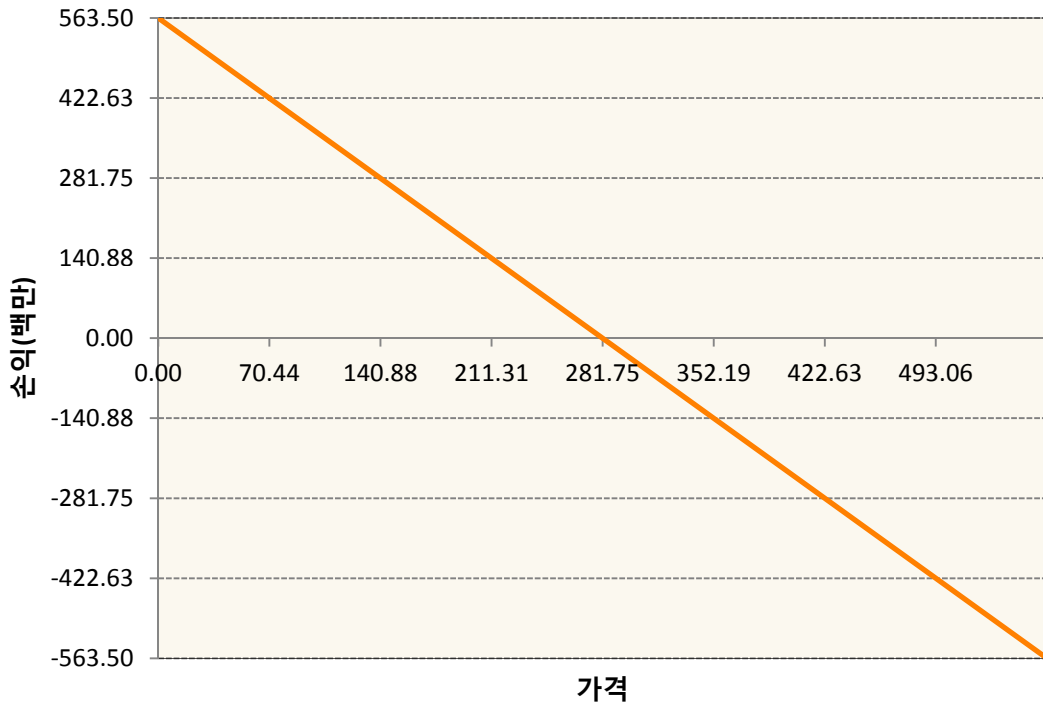
1. 계약금액

(단위:백만원)

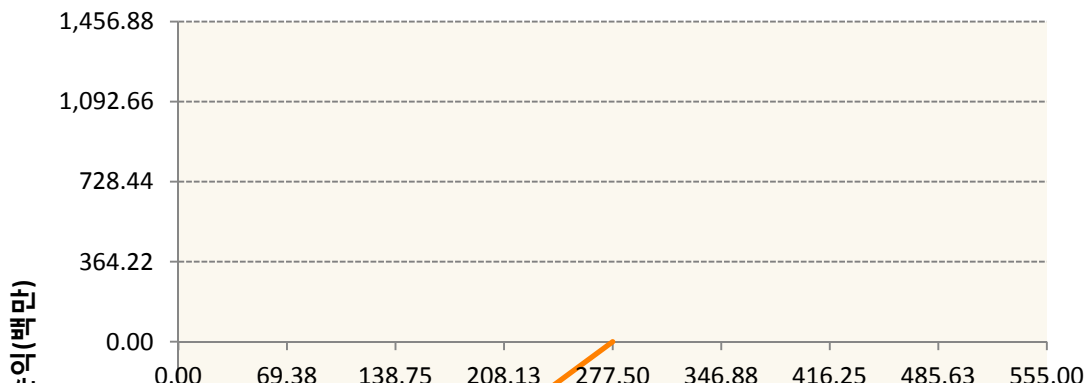
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	564	-564	장내
누계	유가증권	옵션	0	2,997	-2,997	장내

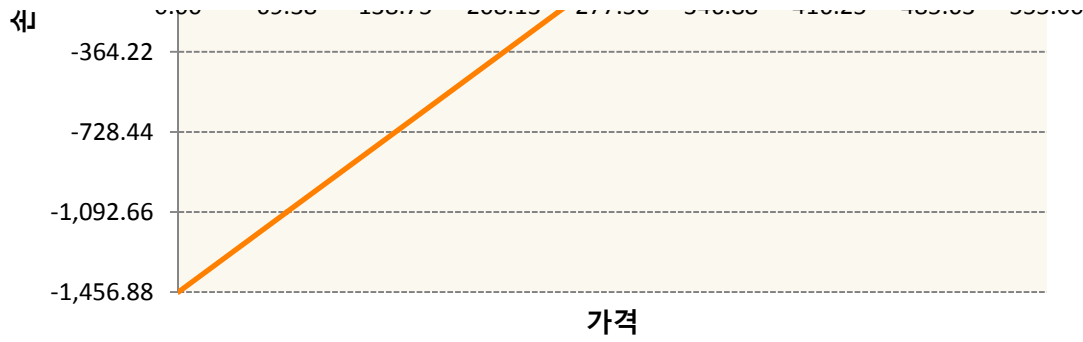
2. 만기시점의 손익구조

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%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
-5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-54	-54
-2.67%	-17	-17	-18	-19	-20	-21	-22
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	6	6	6	6	5	5	4
5.33%	6	6	6	6	6	6	6
8.00%	6	6	6	6	6	6	6

KR4301P52809

2019-05 풋280

105

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-5.33%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-65
-2.67%	-24	-25	-25	-26	-27	-28	-29
0%	4	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	11	11	10	10	9	9	8
5.33%	12	12	11	11	11	11	11
8.00%	12	12	12	12	12	12	12

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

(단위:백만원)

262

공시일	2019-04-29
기준일	2019-04-26

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

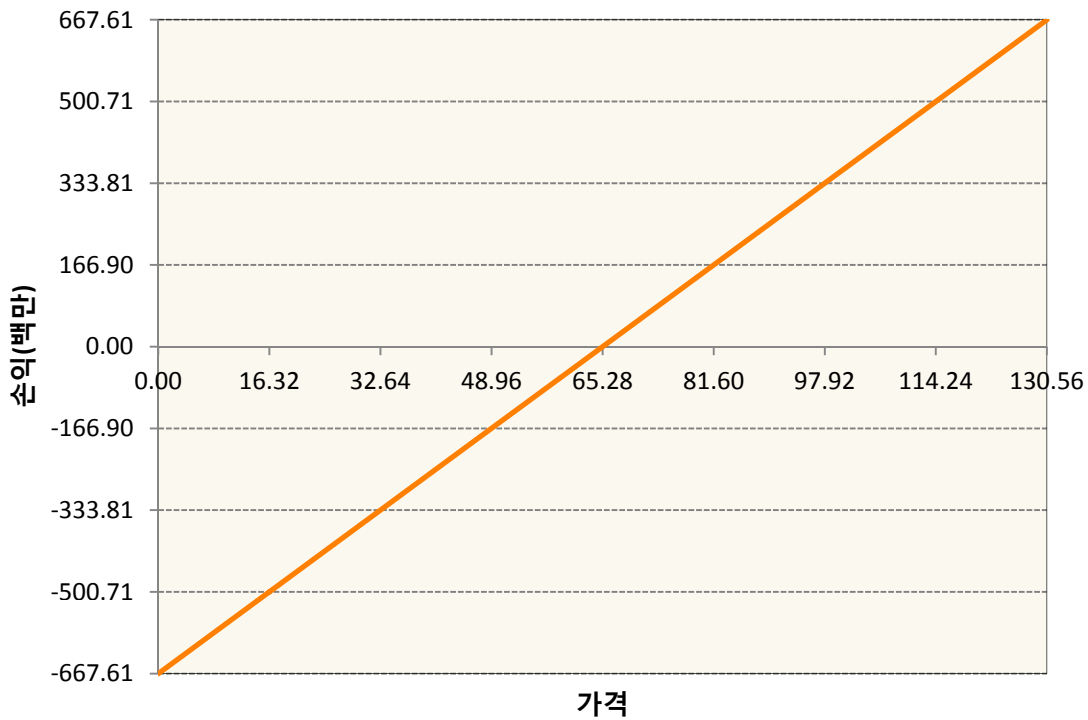
1. 계약금액

(단위:백만원)

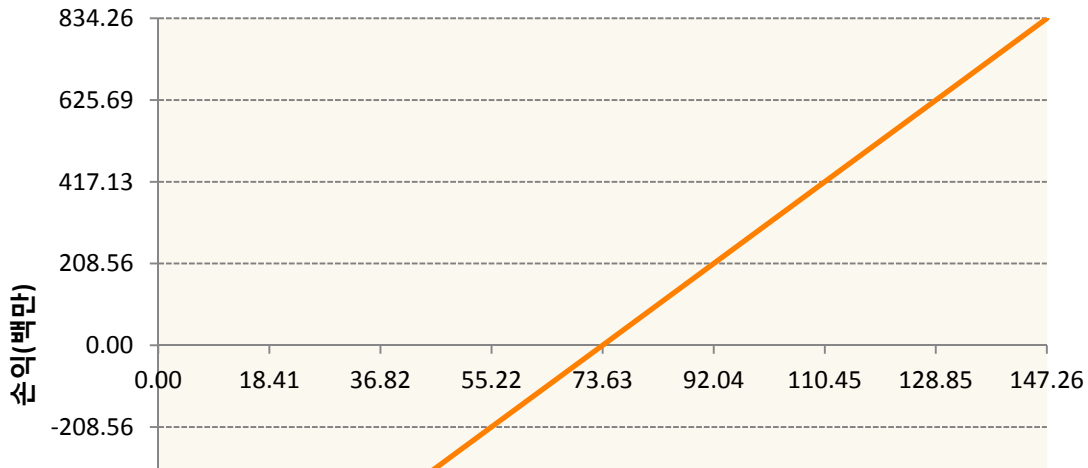
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,941	290	2,651	

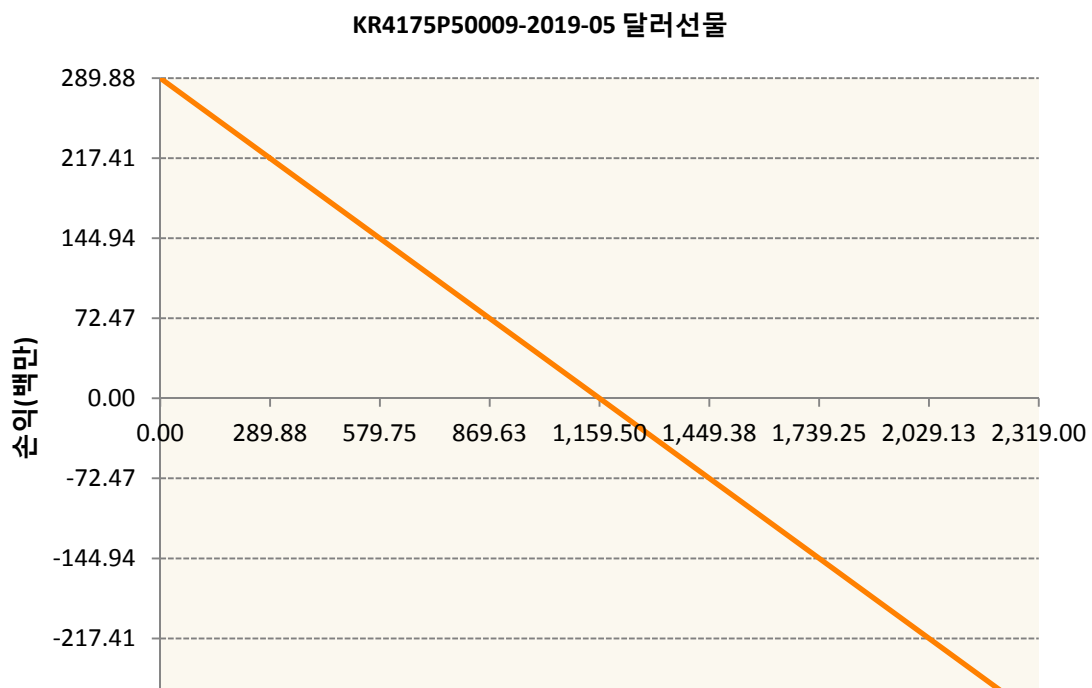
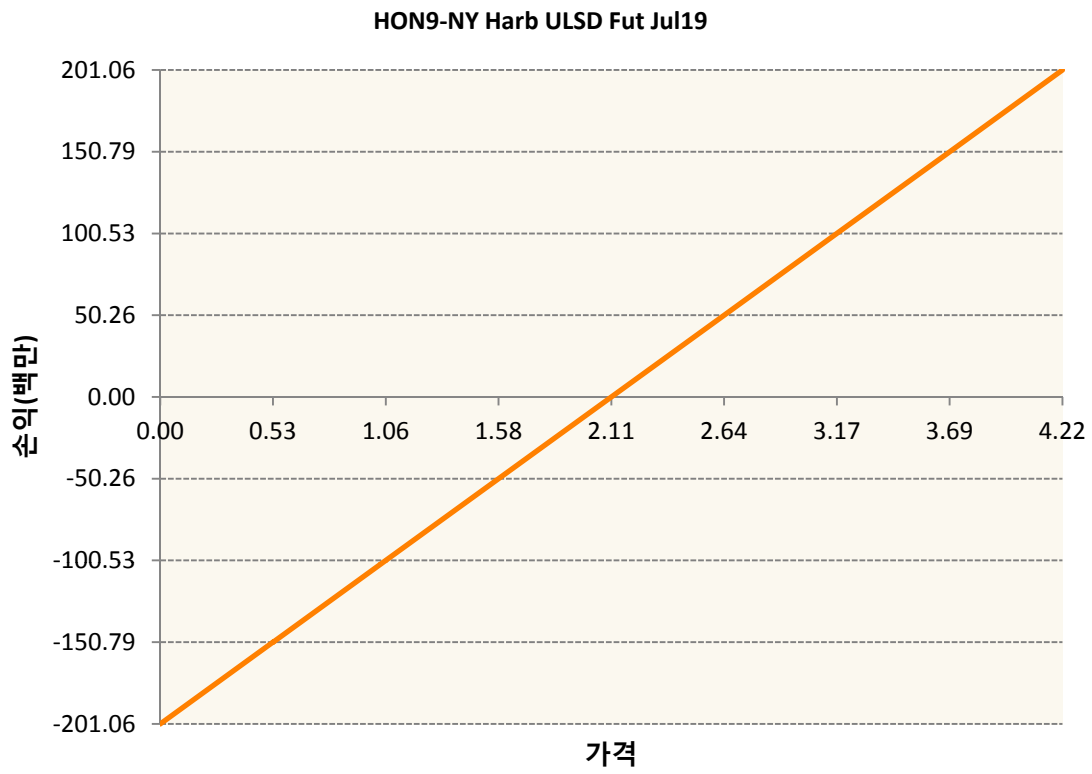
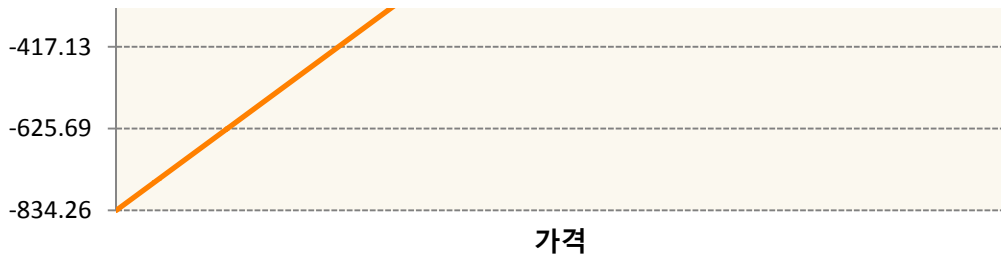
2. 만기시점의 손익구조

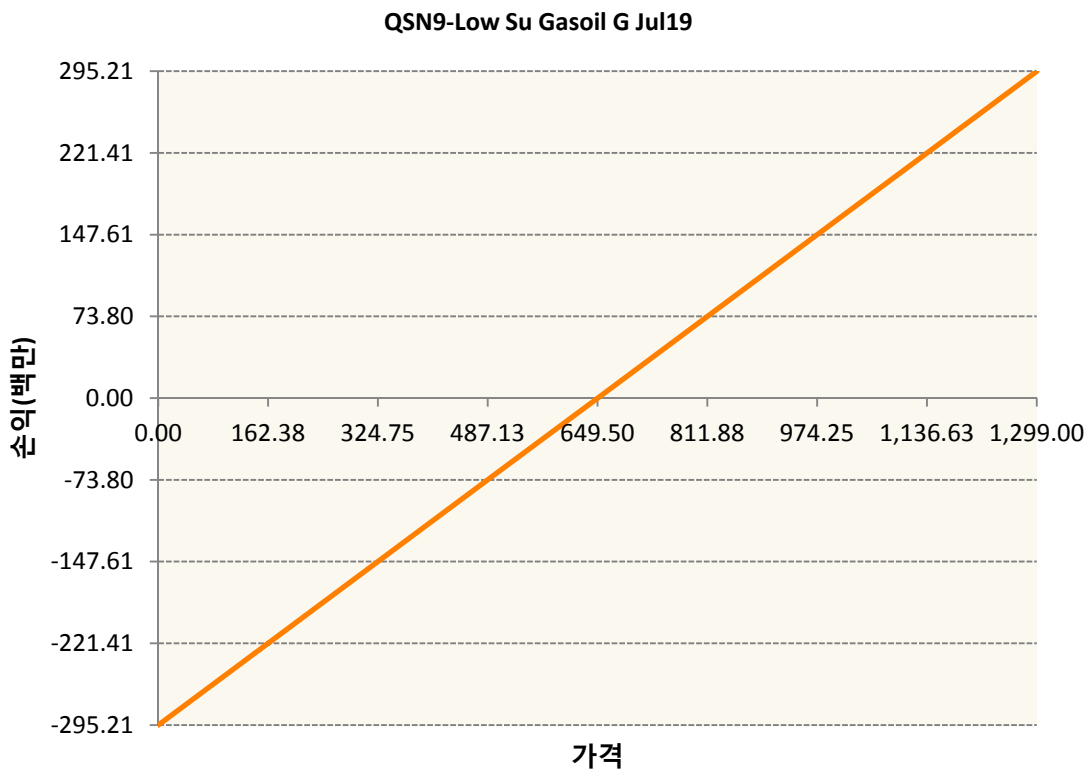
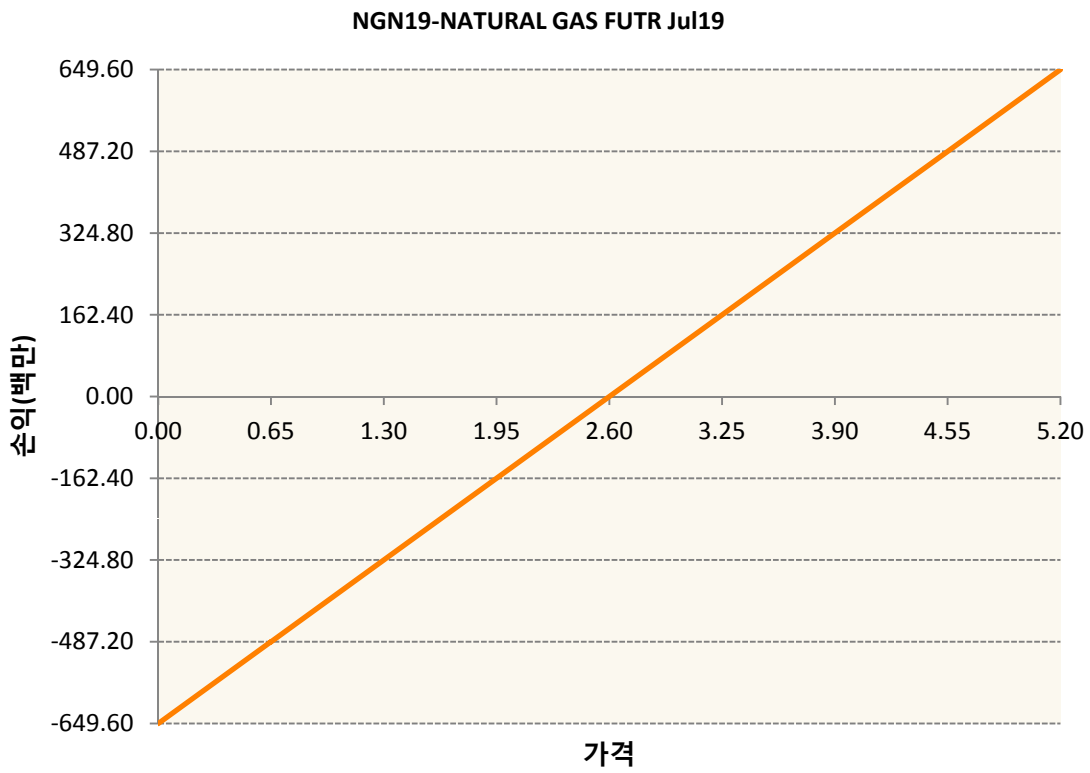
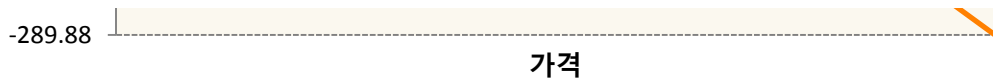
CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19



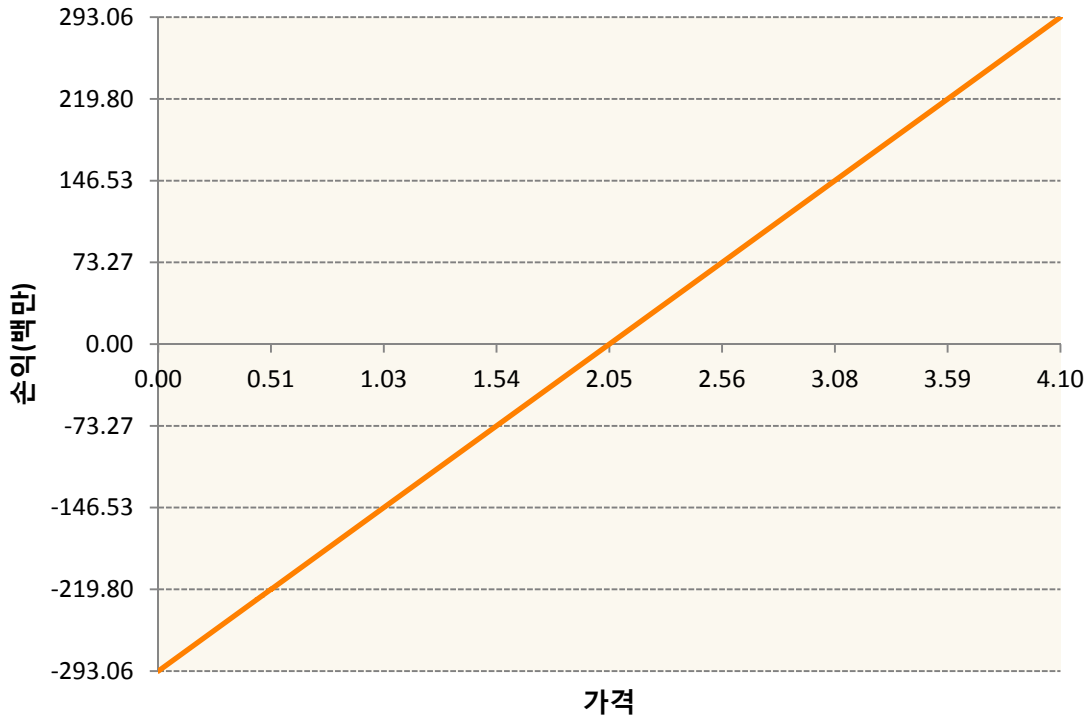
CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19







XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN9	WTI CRUDE FUTURE Jul19	53
CON9	BRENT CRUDE FUTR Jul19	67
HON9	NY Harb ULSD Fut Jul19	16
KR4175P500	2019-05 달러선물	23
NGN19	NATURAL GAS FUTR Jul19	52
QSN9	Low Su Gasoil G Jul19	24
XBN9	GASOLINE RBOB FUT Jul19	23

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

(단위:백만원)

433

공시일	2019-04-29
기준일	2019-04-26

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

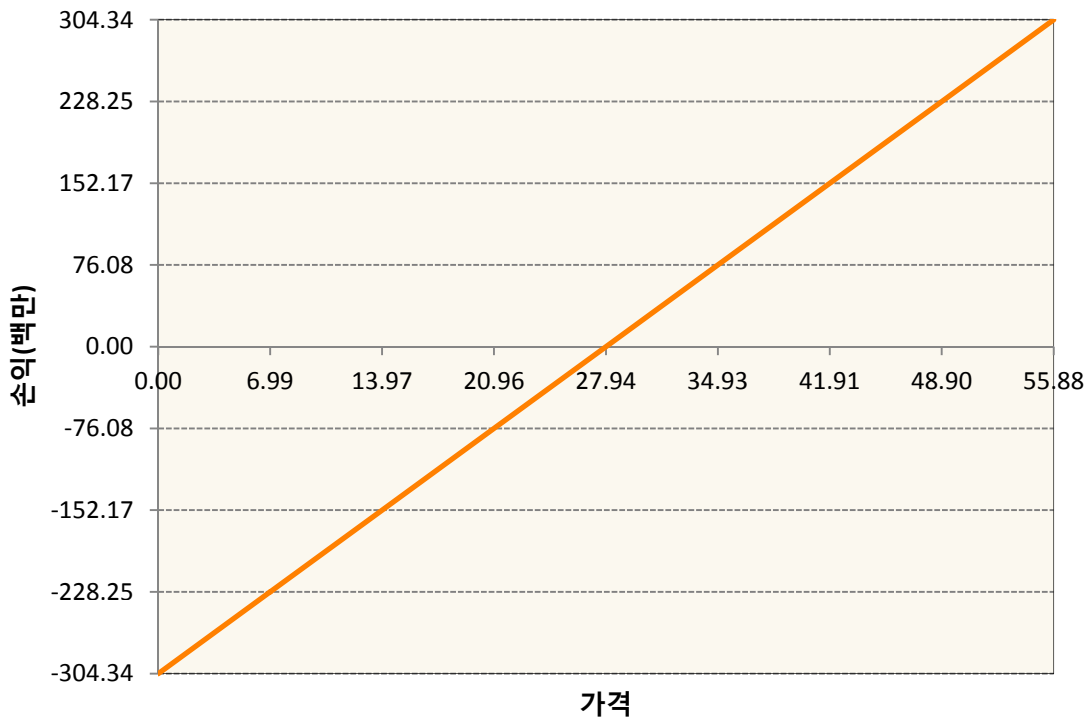
1. 계약금액

(단위:백만원)

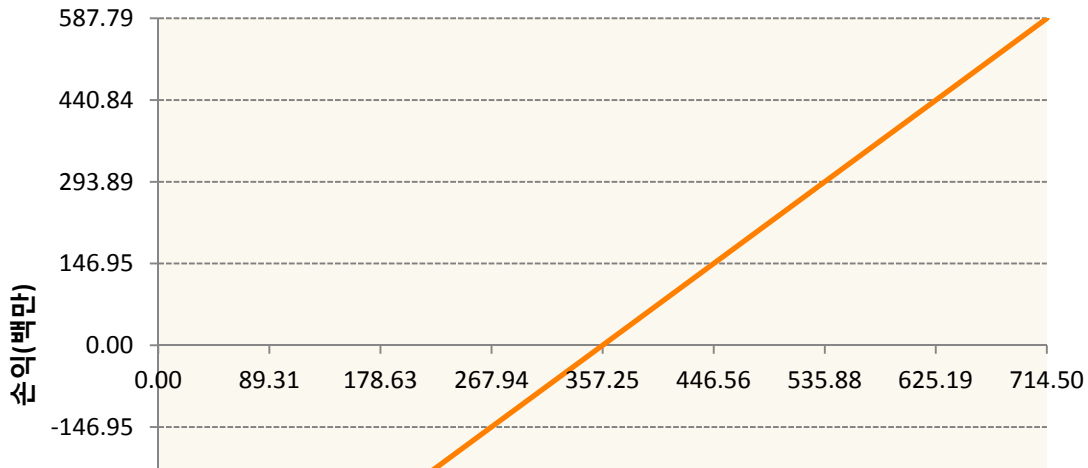
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,072	58	3,014	

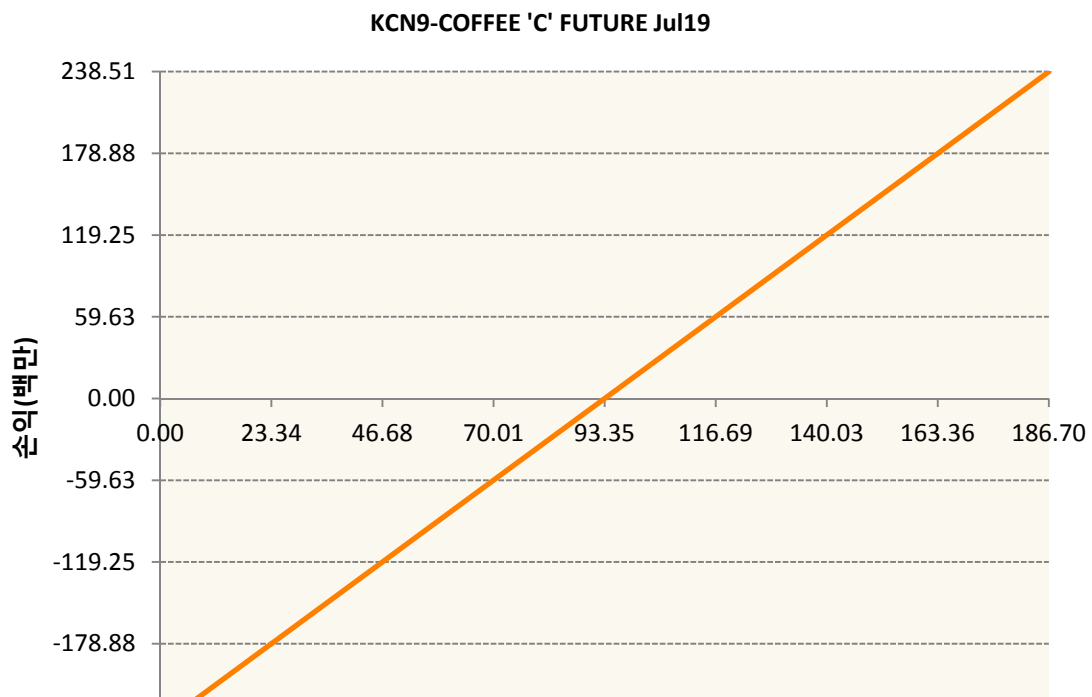
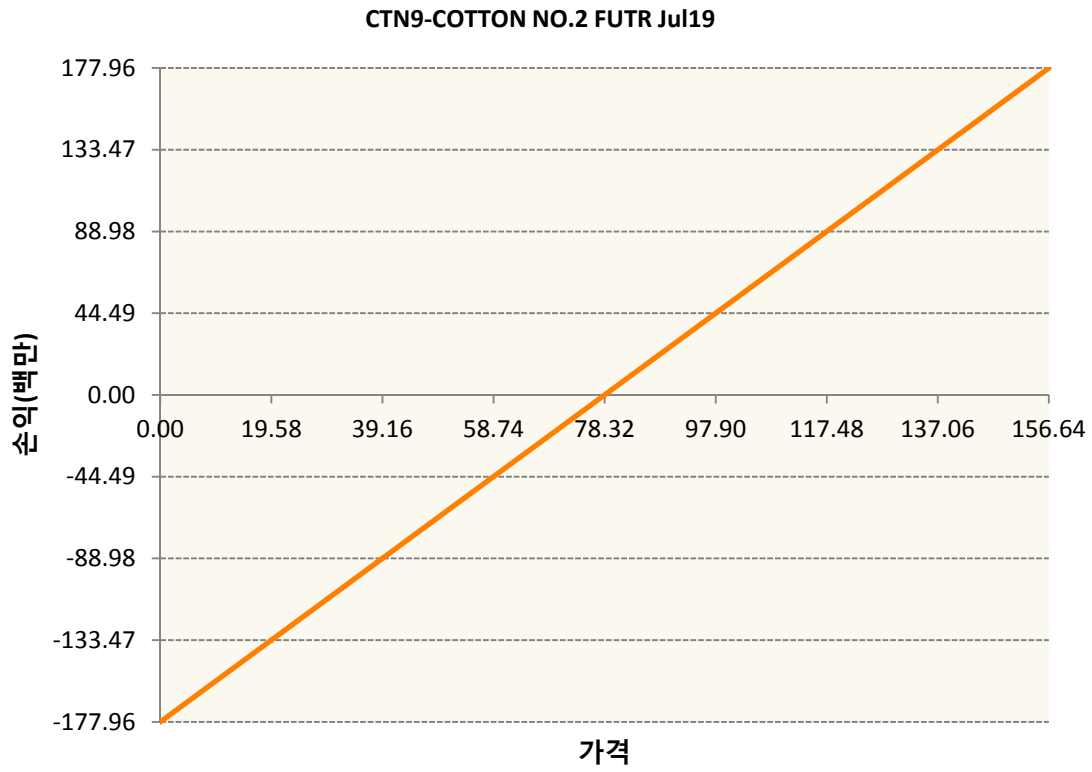
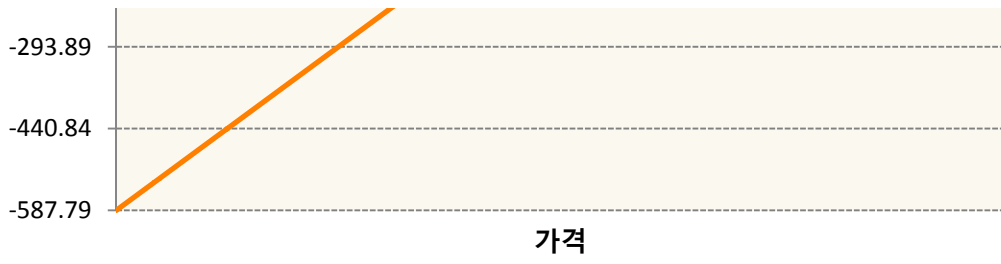
2. 만기시점의 손익구조

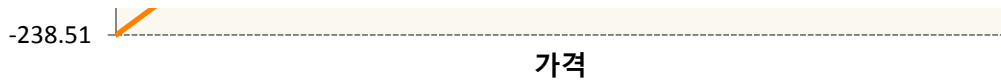
BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19



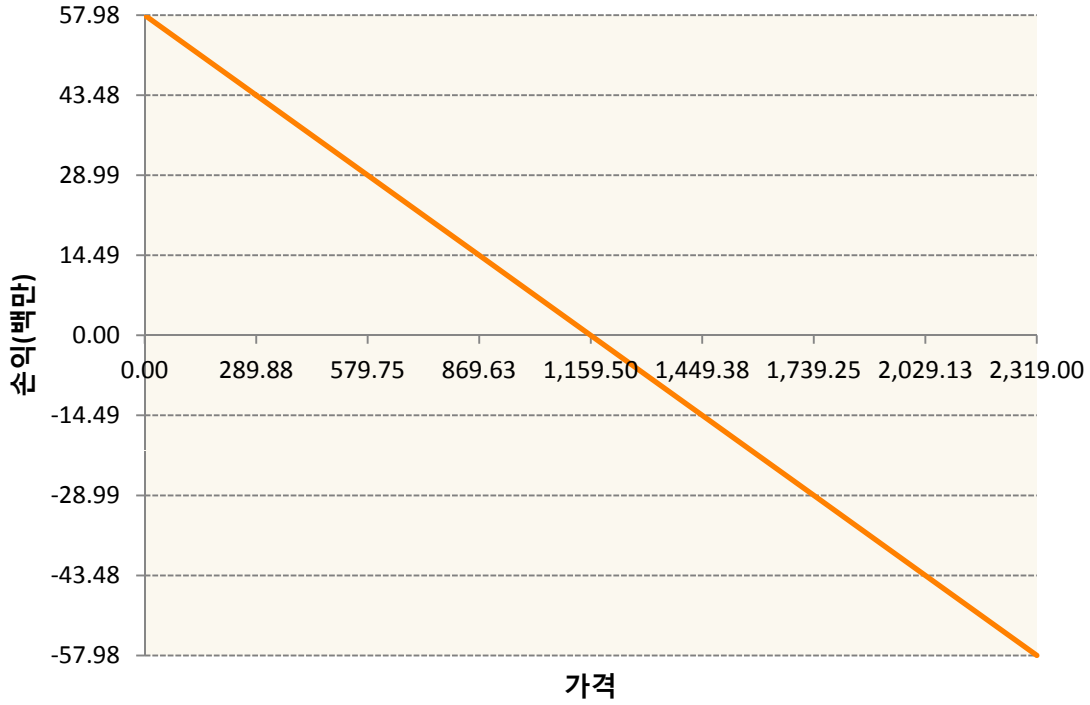
CN9-CORN FUTURE Jul19



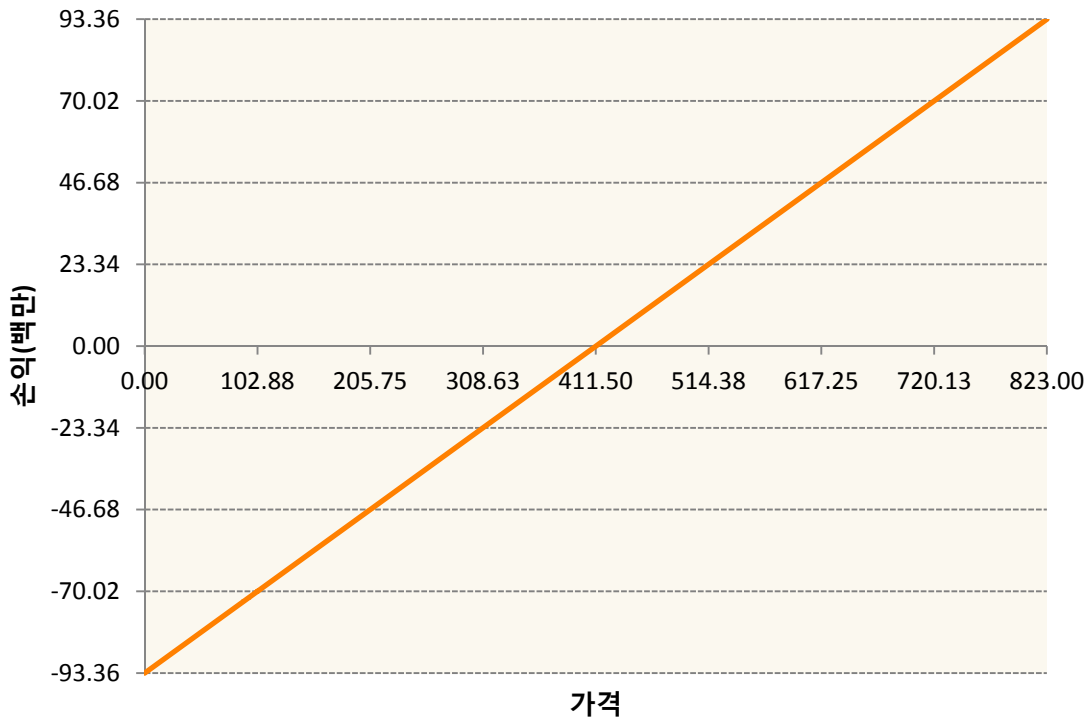




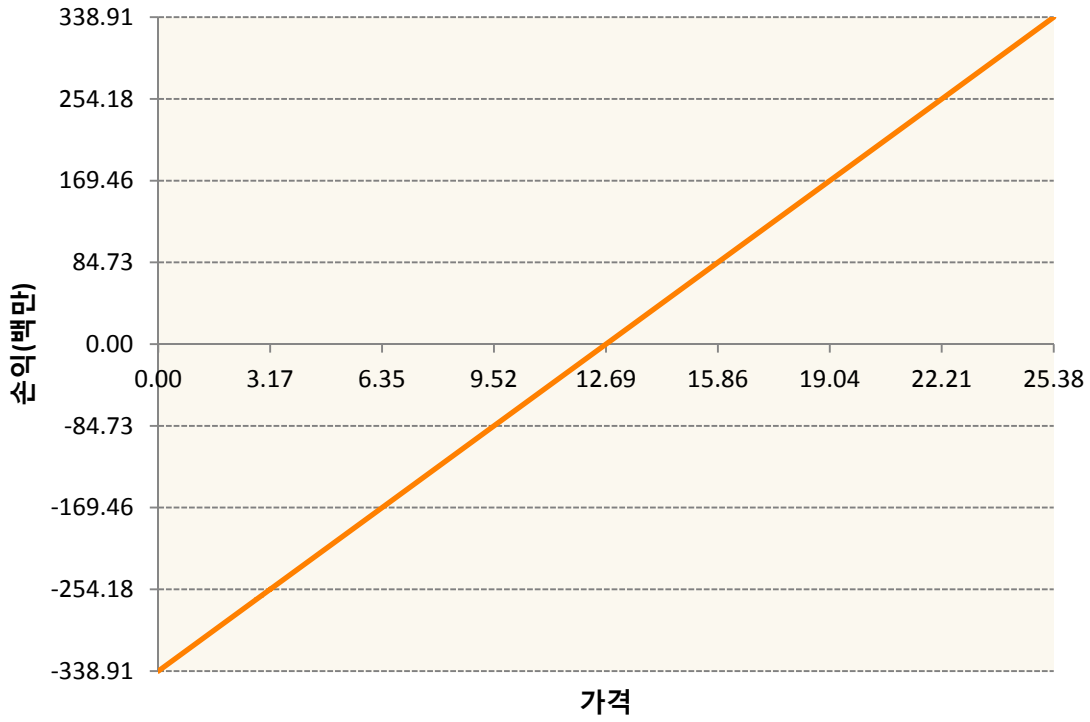
KR4175P50009-2019-05 달러선물



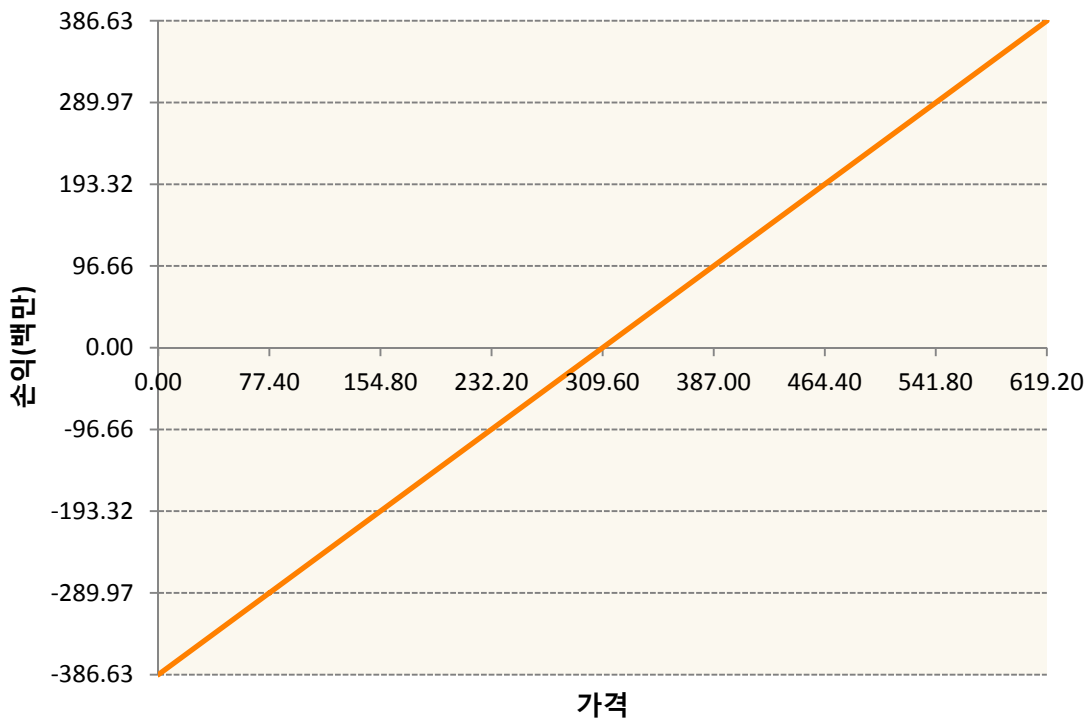
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

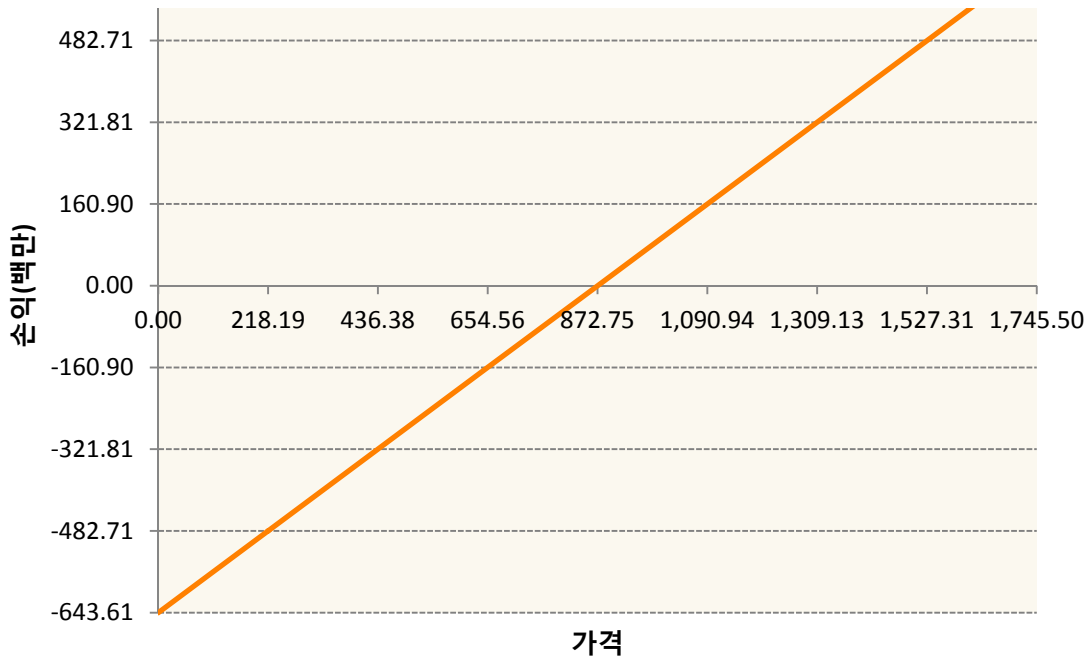


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19

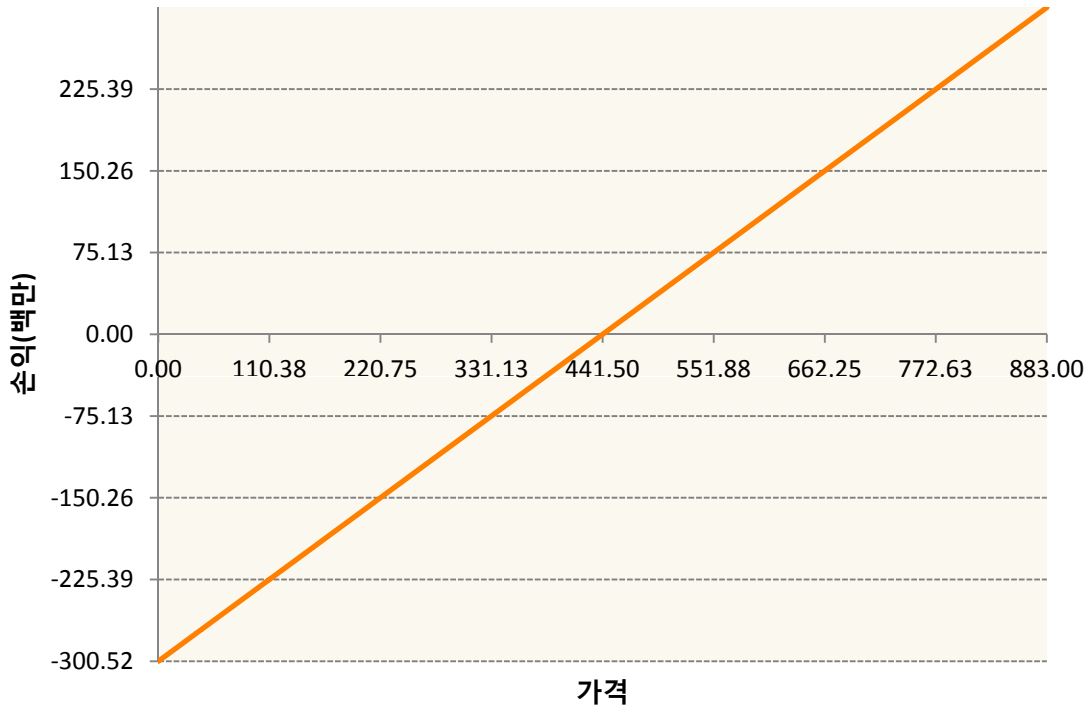


SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





WN9-WHEAT FUTURE(CBT) Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON9	SOYBEAN OIL FUTR Jul19	24
CN9	CORN FUTURE Jul19	47
CTN9	COTTON NO.2 FUTR Jul19	14
KCN9	COFFEE 'C' FUTURE Jul19	19
KR4175P500	2019-05 달러선물	5

KWN9	KC HRW WHEAT FUT Jul19	7
SBN9	SUGAR #11 (WORLD) Jul19	27
SMN9	SOYBEAN MEAL FUTR Jul19	31
SN9	SOYBEAN FUTURE Jul19	51
WN9	WHEAT FUTURE(CBT) Jul19	24

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

(단위:백만원)

247