

공시일	2019-04-30
기준일	2019-04-29

## 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	2019-04-30
기준일	2019-04-29

## 좋은아침펀더멘탈인덱스모(주식)

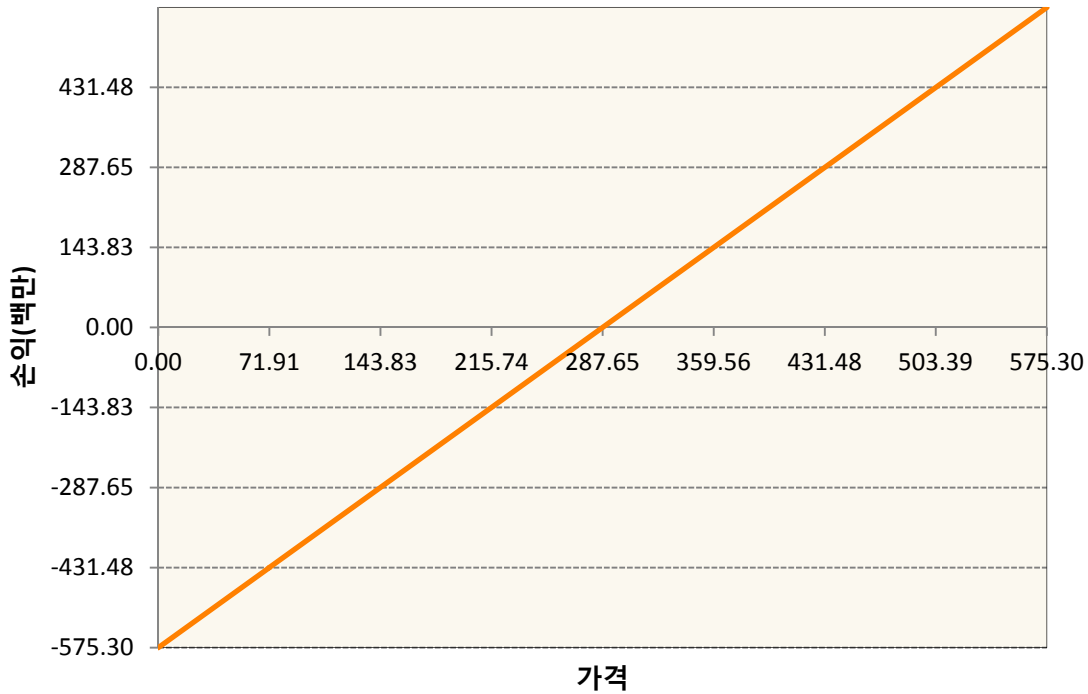
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

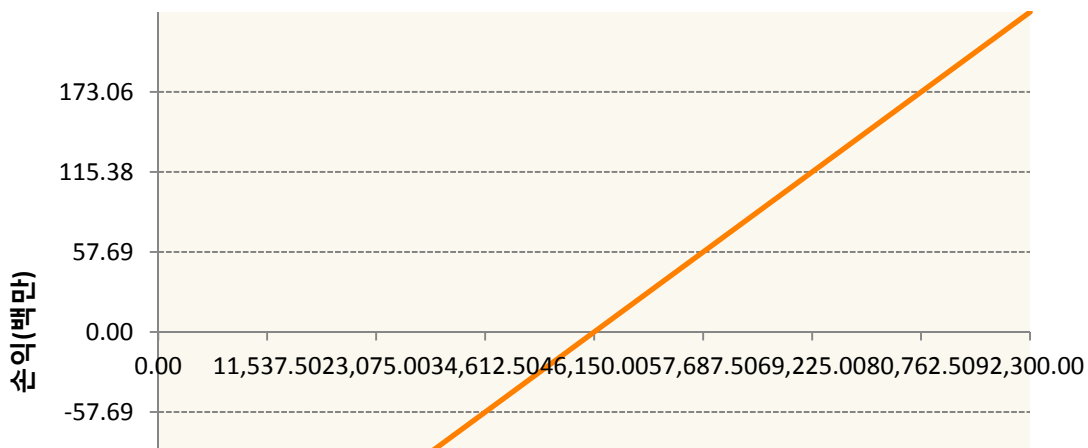
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	806	0	806	장내

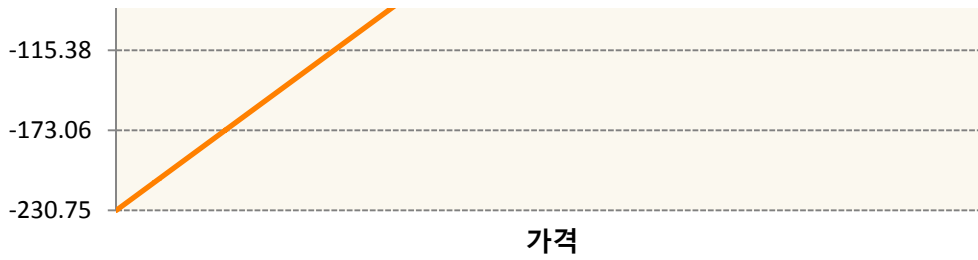
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4111P50004-2019-05 삼성전자개별선물





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

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						46
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46	
-5.33%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31	
-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%	31	31	31	31	31	31	31	
8.00%	46	46	46	46	46	46	46	
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)

59



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

(단위:백만원)

95

공시일	2019-04-30
기준일	2019-04-29

## 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

1,165

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

684

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-04-30
기준일	2019-04-29

## 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)	328
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	90
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	153

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

<b>909</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-04-30
기준일	2019-04-29

## 유로인덱스모(주식-파생형)

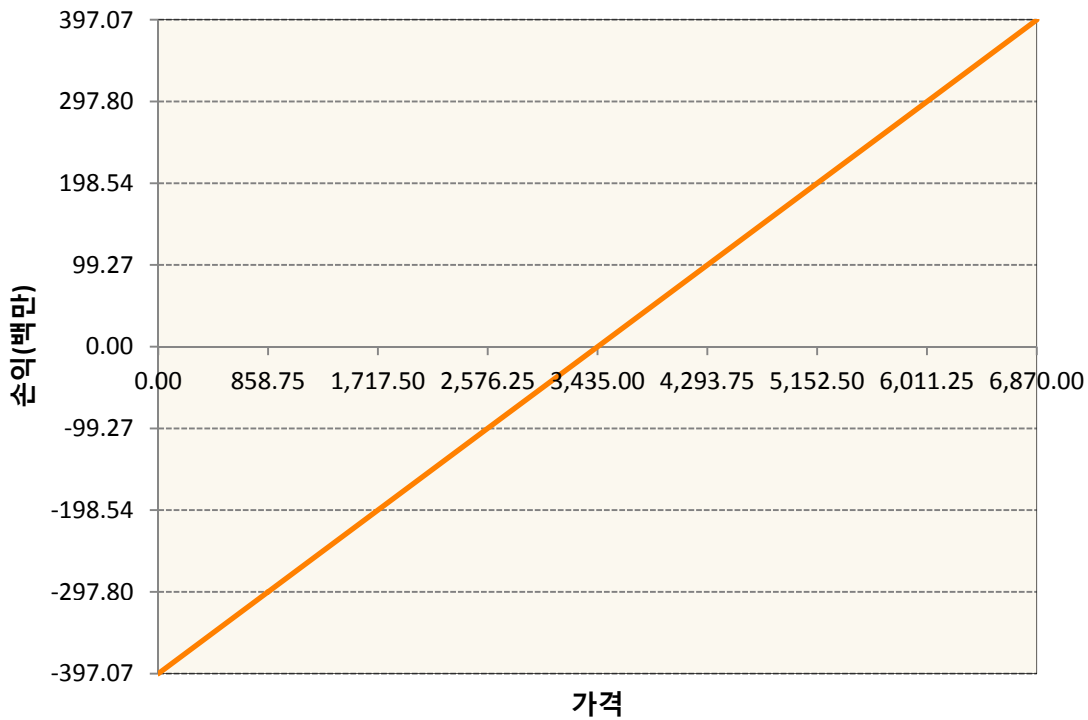
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	397	0	397	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

23
----

공시일	2019-04-30
기준일	2019-04-29

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

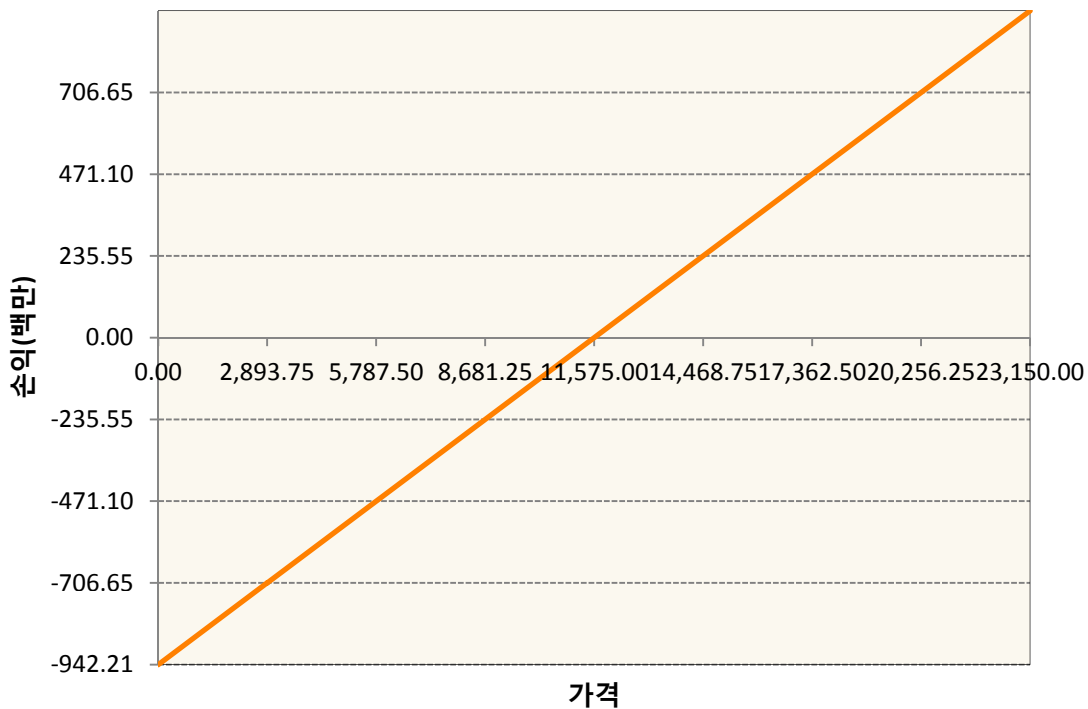
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	942	0	942	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	2019-04-30
기준일	2019-04-29

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

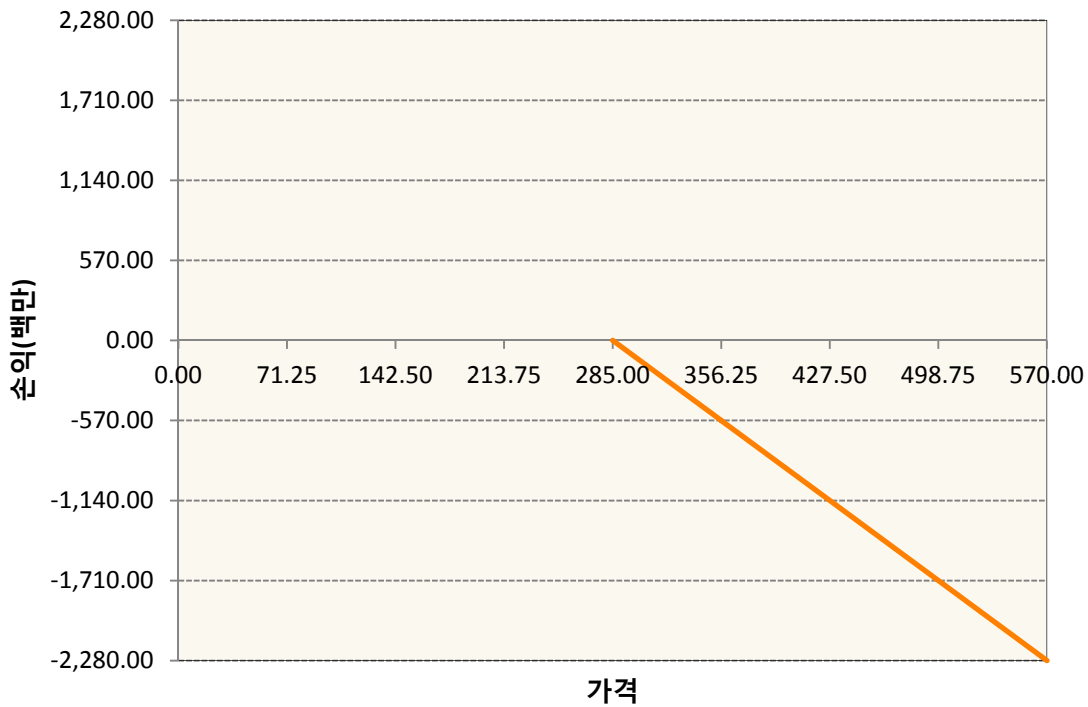
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

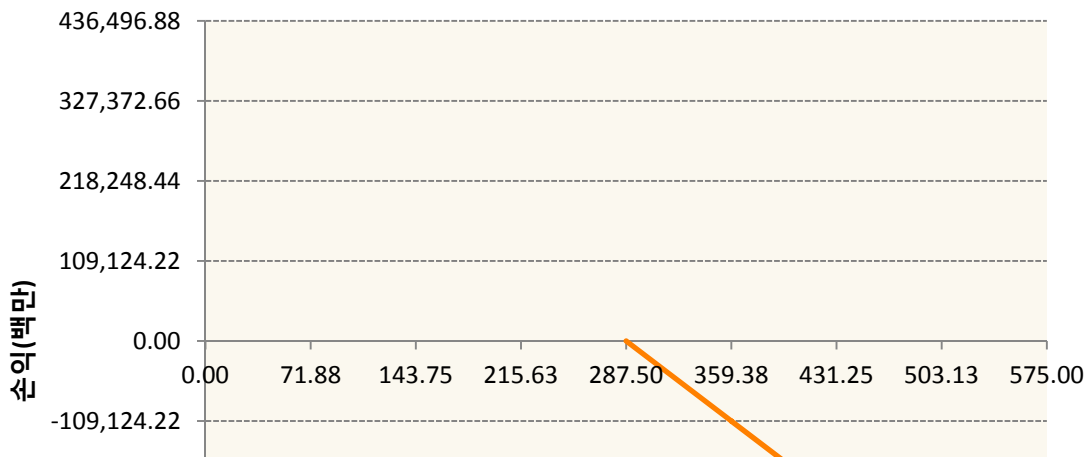
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	672,214	-672,214	장내

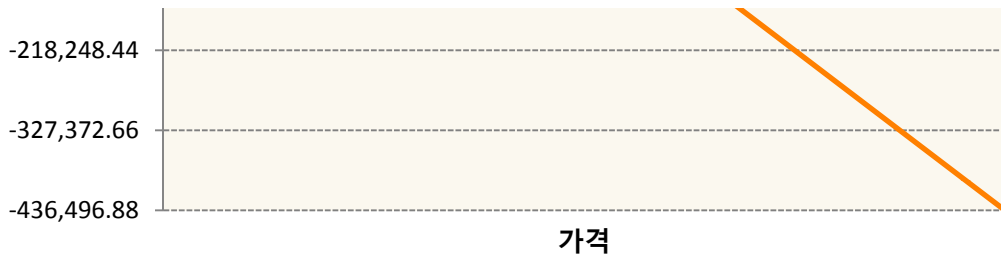
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P52850-2019-05 콜285

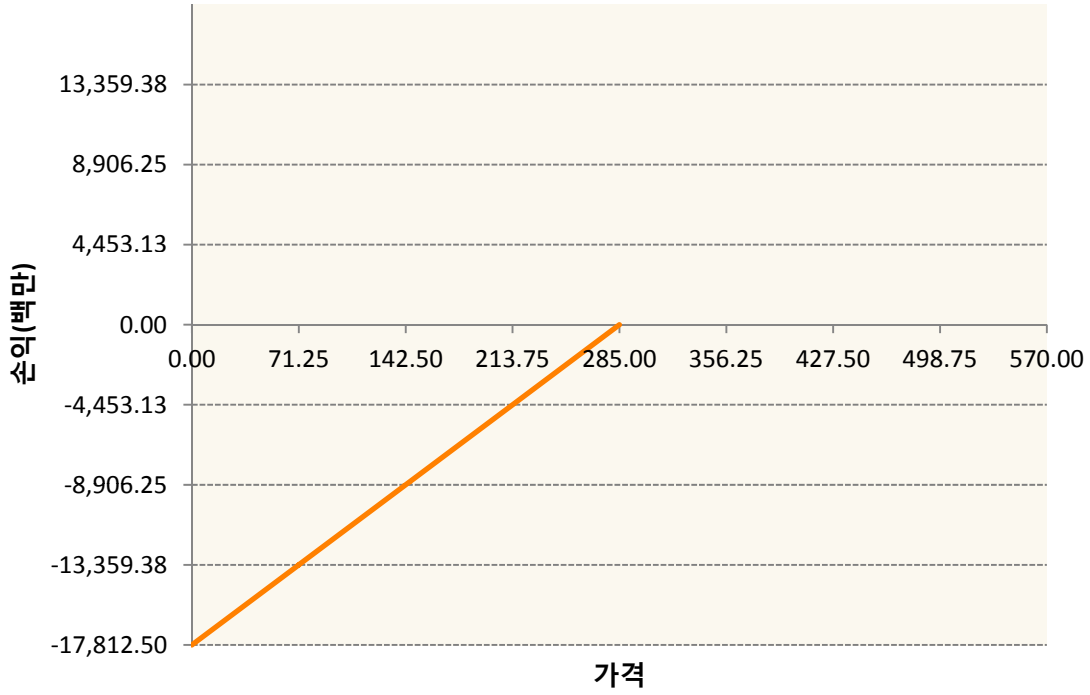


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

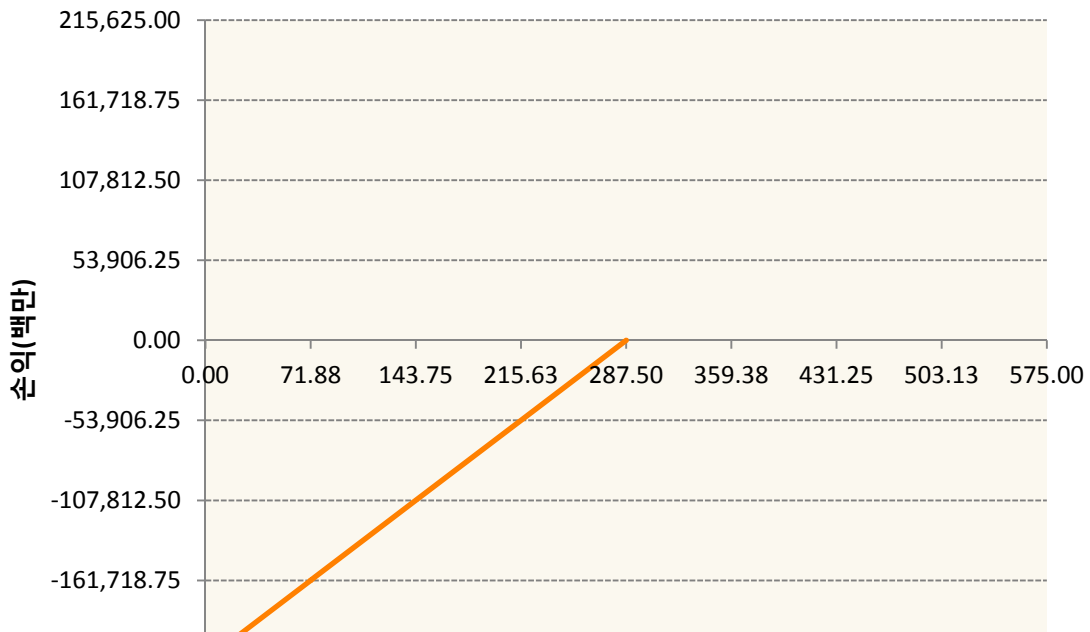




**KR4301P52858-2019-05 풋285**



**KR4301P52874-2019-05 풋287.5**



-215,625.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P52850 2019-05 콜285							155
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	45	45	44	44	43	43	42
-5.33%	43	42	41	40	38	36	34
-2.67%	35	32	30	27	24	21	18
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	-36	-38	-40	-42	-44	-47	-49
5.33%	-92	-93	-94	-95	-96	-98	-99
8.00%	-153	-153	-153	-153	-154	-154	-155
KR4201P52876 2019-05 콜287.5							27,858
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,598	6,580	6,546	6,493	6,416	6,314	6,186
-5.33%	6,447	6,324	6,161	5,960	5,723	5,454	5,156
-2.67%	5,413	5,024	4,605	4,161	3,698	3,219	2,727
0%	1,784	1,189	595	0	-595	-1,190	-1,785
2.67%	-5,606	-6,068	-6,554	-7,058	-7,576	-8,105	-8,644
5.33%	-15,803	-15,996	-16,235	-16,514	-16,829	-17,175	-17,548
8.00%	-27,123	-27,169	-27,243	-27,348	-27,485	-27,655	-27,858
KR4301P52858 2019-05 풋285							1,223
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,222	-1,222	-1,222	-1,222	-1,223	-1,223	-1,223
-5.33%	-745	-745	-745	-746	-747	-748	-750
-2.67%	-279	-284	-291	-298	-306	-314	-323
0%	35	24	12	0	-12	-24	-36
2.67%	99	97	94	91	87	82	76
5.33%	101	101	100	100	100	99	98
8.00%	101	101	101	101	101	101	100
KR4301P52874 2019-05 풋287.5							15,663
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-15,662	-15,662	-15,662	-15,662	-15,663	-15,663	-15,663
-5.33%	-9,930	-9,930	-9,932	-9,934	-9,939	-9,946	-9,957
-2.67%	-4,236	-4,266	-4,306	-4,356	-4,415	-4,482	-4,556
0%	445	297	149	0	-149	-298	-447
2.67%	1,990	1,936	1,871	1,795	1,711	1,620	1,522

5.33%	2,087	2,085	2,081	2,074	2,062	2,045	2,022
8.00%	2,088	2,088	2,088	2,088	2,087	2,086	2,084

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

(단위:백만원)

**51,831**

공시일	2019-04-30
기준일	2019-04-29

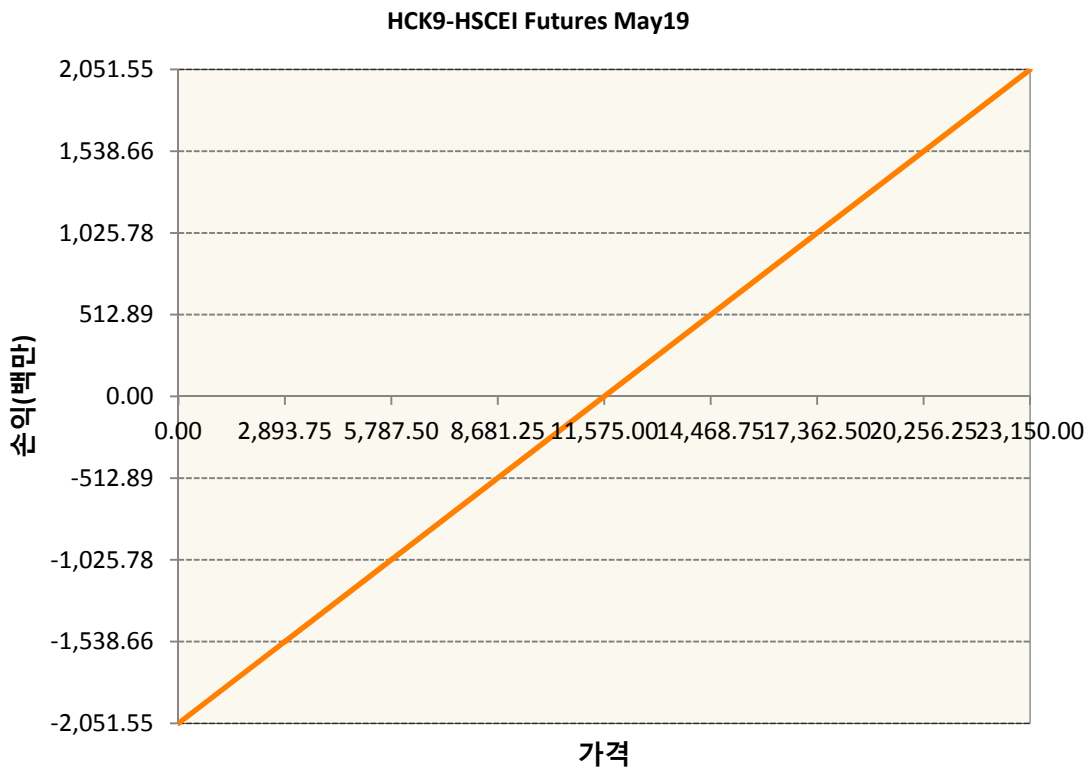
## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,052	0	2,052	장내
누계	통화	선도	0	3,101	-3,101	장외

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	224
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	24
HCK9 HSCEI Futures May19	164

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

(단위:백만원)

253

공시일	2019-04-30
기준일	2019-04-29

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

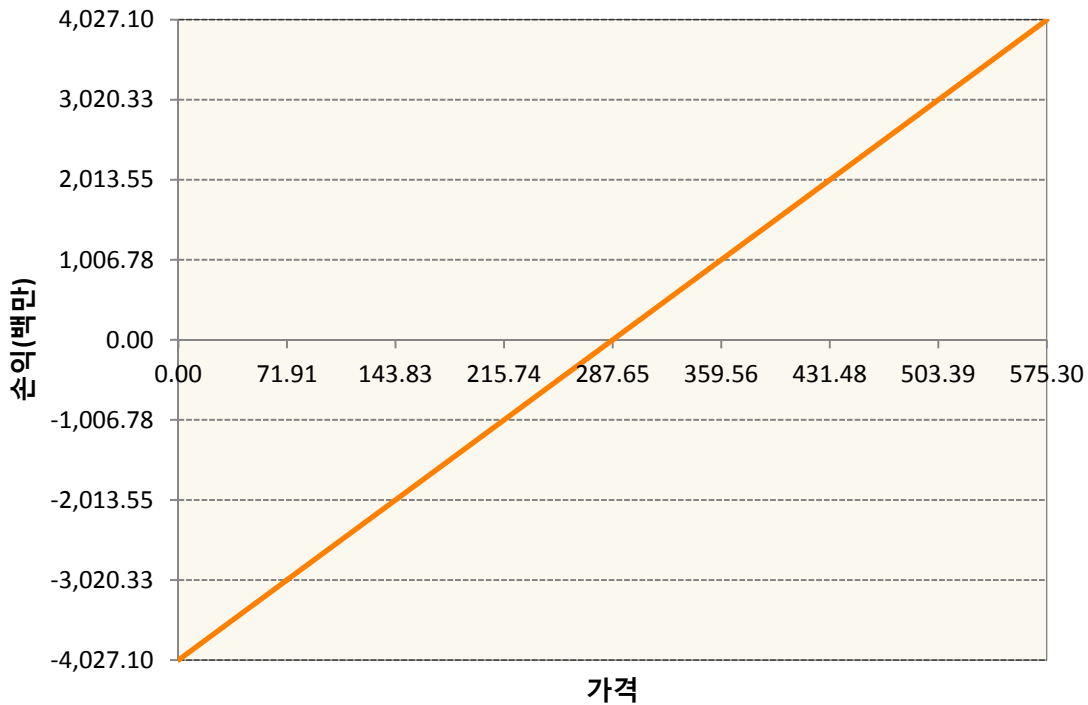
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

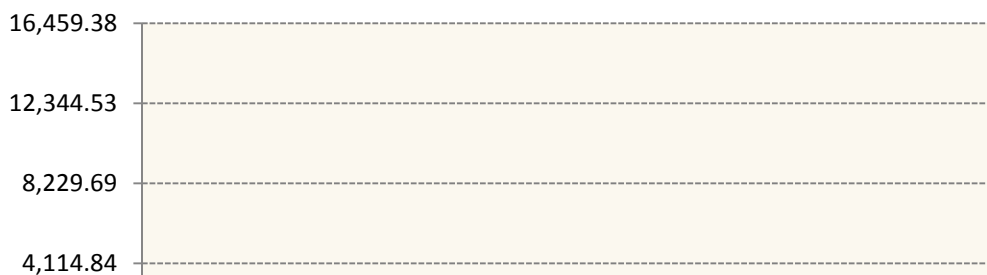
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,027	0	4,027	장내
누계	유가증권	스왑	32,836	0	32,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	32,264	-32,264	장내

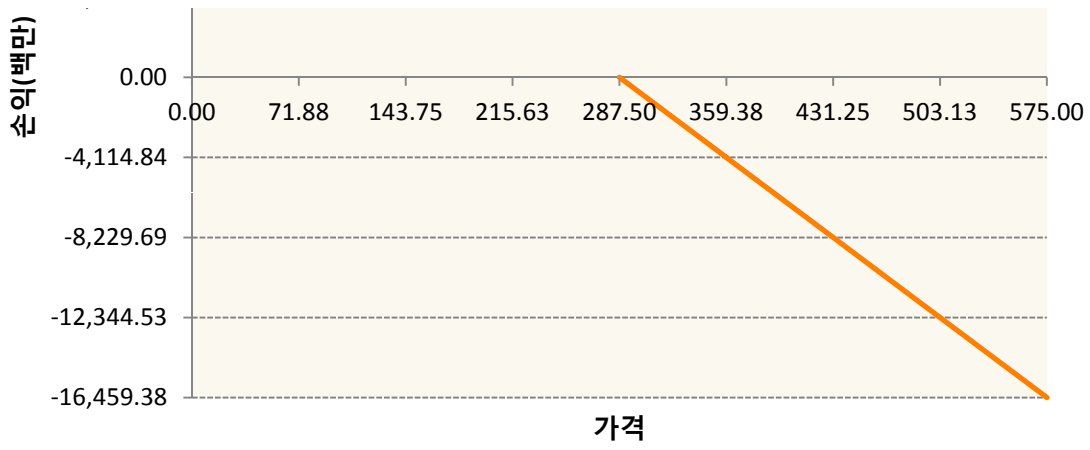
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

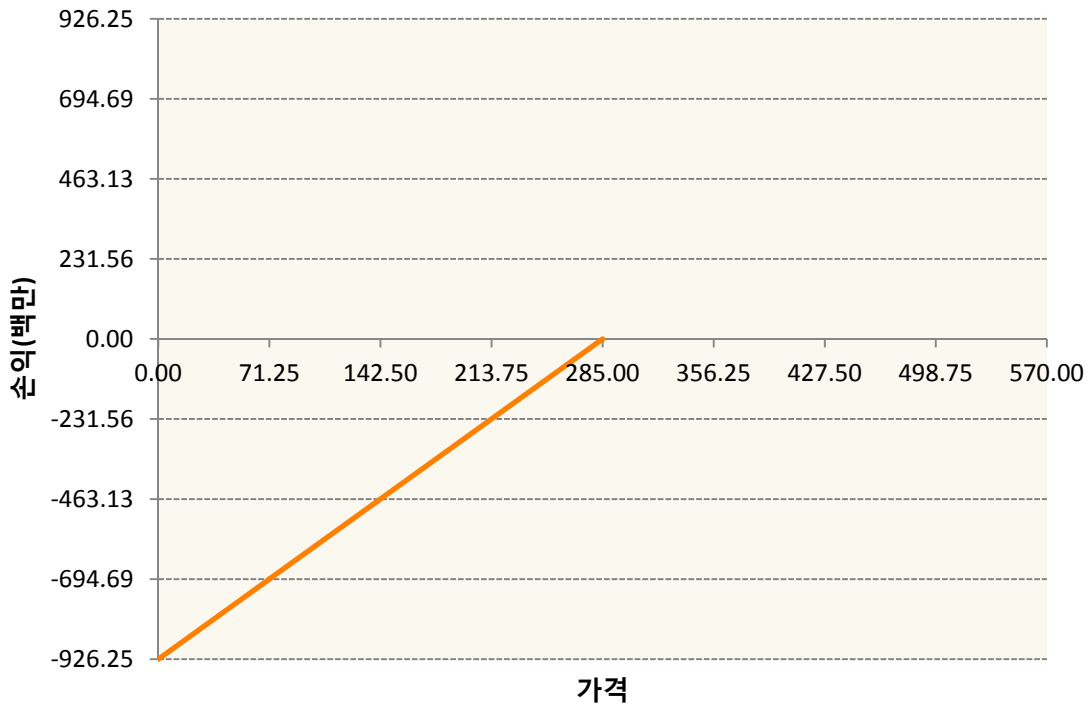


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

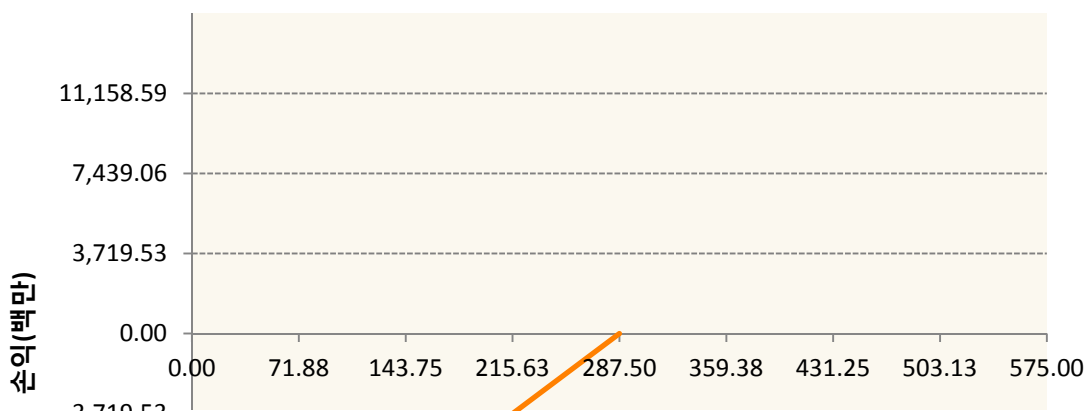




KR4301P52858-2019-05 풋285



KR4301P52874-2019-05 풋287.5





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,205
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,205	-2,205	-2,205	-2,205	-2,205	-2,205	-2,205	
-5.33%	-1,470	-1,470	-1,470	-1,470	-1,470	-1,470	-1,470	
-2.67%	-735	-735	-735	-735	-735	-735	-735	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	735	735	735	735	735	735	735	
5.33%	1,470	1,470	1,470	1,470	1,470	1,470	1,470	
8.00%	2,205	2,205	2,205	2,205	2,205	2,205	2,205	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						597
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-597	-597	-597	-597	-597	-597	-597	
-5.33%	-398	-398	-398	-398	-398	-398	-398	
-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%	398	398	398	398	398	398	398	
8.00%	597	597	597	597	597	597	597	
KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						321
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-321	-321	-321	-321	-321	-321	-321	
-5.33%	-214	-214	-214	-214	-214	-214	-214	
-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%	214	214	214	214	214	214	214	
8.00%	321	321	321	321	321	321	321	
KR4201P52876		2019-05 콜287.5						1,050
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	249	248	247	245	242	238	233
-5.33%	243	238	232	225	216	206	194
-2.67%	204	189	174	157	139	121	103
0%	67	45	22	0	-22	-45	-67
2.67%	-211	-229	-247	-266	-286	-306	-326
5.33%	-596	-603	-612	-623	-635	-648	-662
8.00%	-1,023	-1,024	-1,027	-1,031	-1,036	-1,043	-1,050
KR4301P52858                      2019-05 풋285							64
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64
-5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-16	-16	-17
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	5	5	5	5	4	4	4
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	5	5	5	5	5	5	5
KR4301P52874                      2019-05 풋287.5							1,081
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,081	-1,081	-1,081	-1,081	-1,081	-1,081	-1,081
-5.33%	-685	-685	-685	-685	-686	-686	-687
-2.67%	-292	-294	-297	-301	-305	-309	-314
0%	31	20	10	0	-10	-21	-31
2.67%	137	134	129	124	118	112	105
5.33%	144	144	144	143	142	141	140
8.00%	144	144	144	144	144	144	144

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

(단위:백만원)

**5,676**

공시일	2019-04-30
기준일	2019-04-29

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

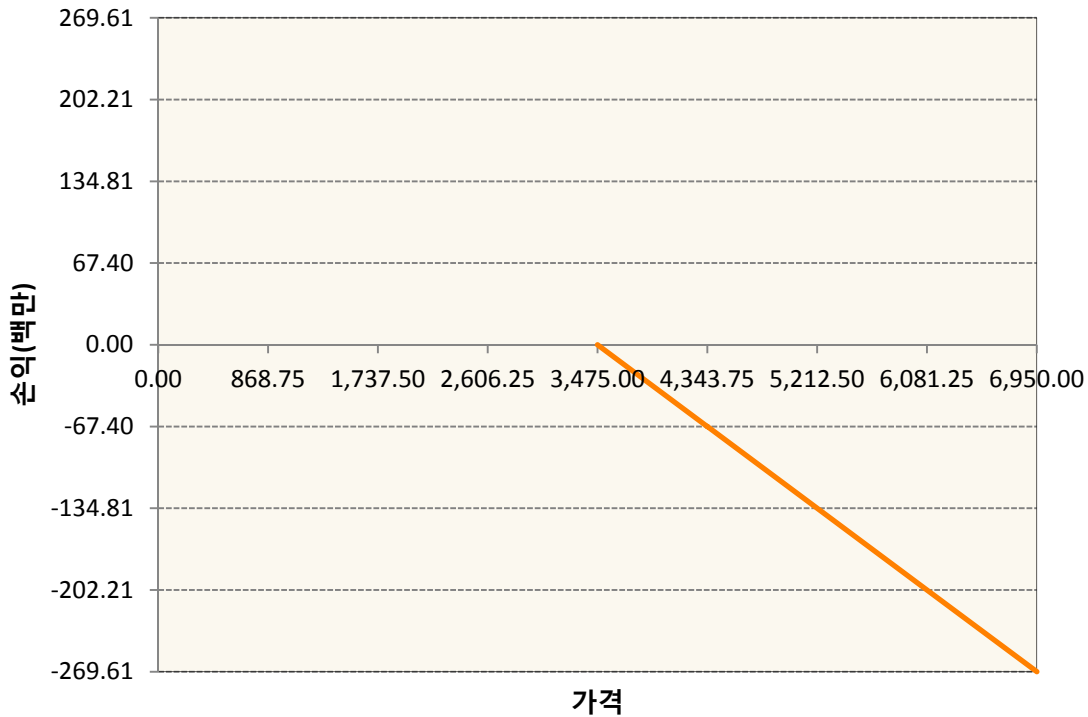
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

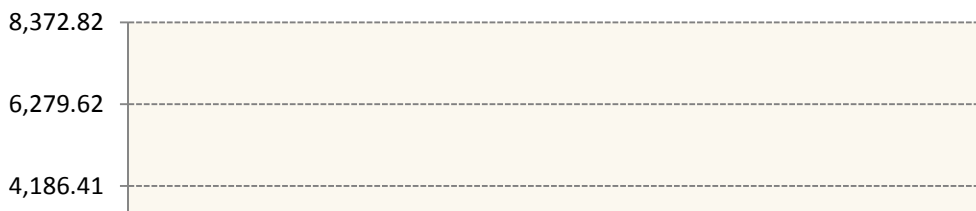
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,588	0	1,588	
누계	유가증권	스왑	63,706	0	63,706	장외
누계	유가증권	옵션	0	17,285	-17,285	장내
누계	통화	선도	0	18,104	-18,104	장외

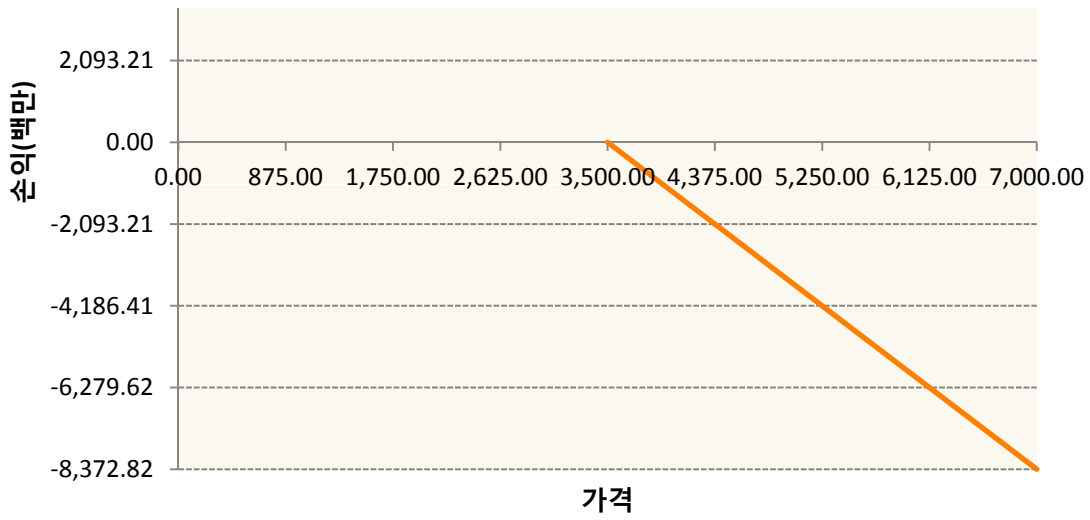
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXK9-C3475-EURO STOXX 50**

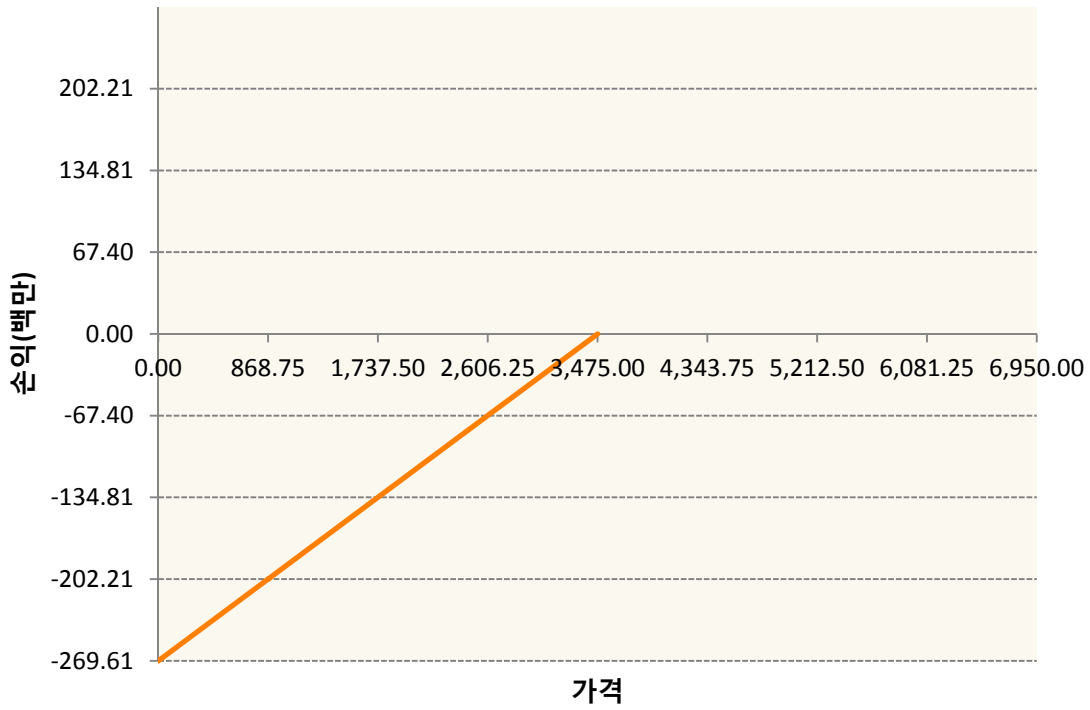


**OESXK9-C3500-EURO STOXX 50**

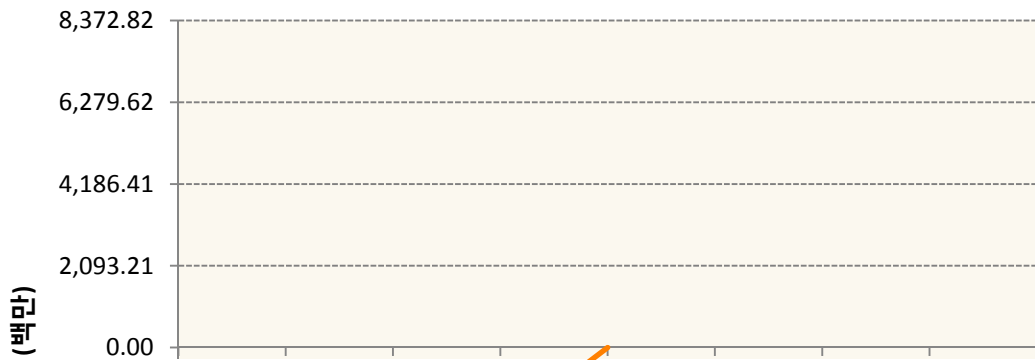


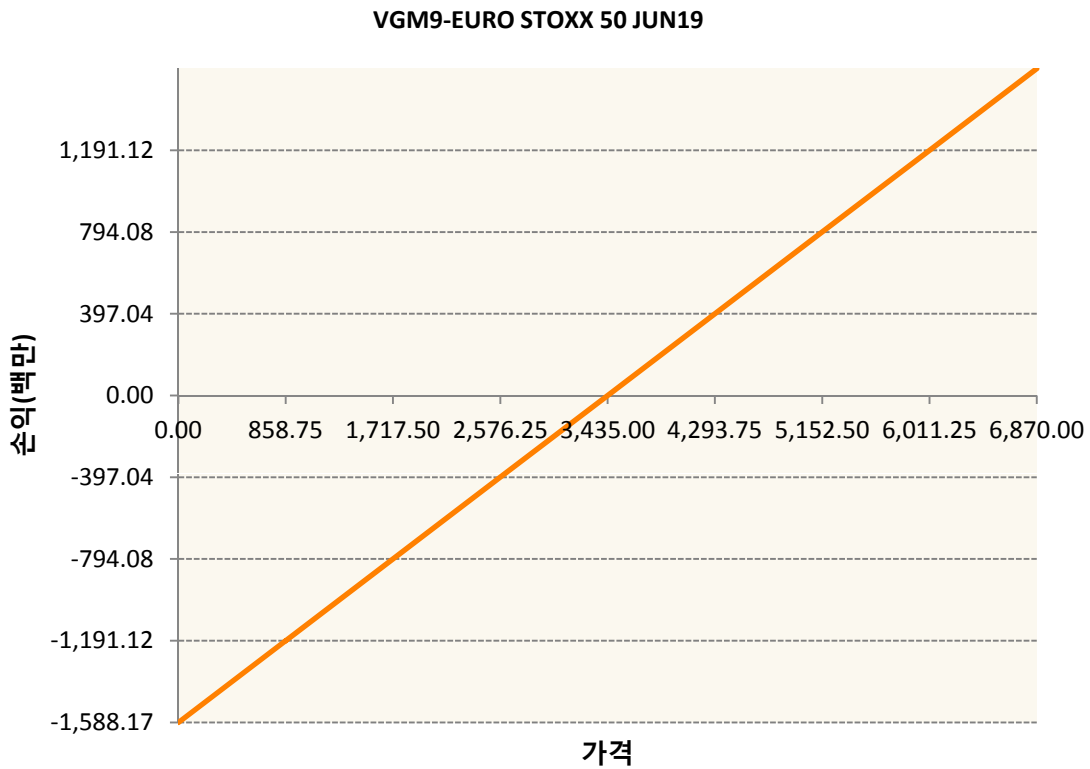
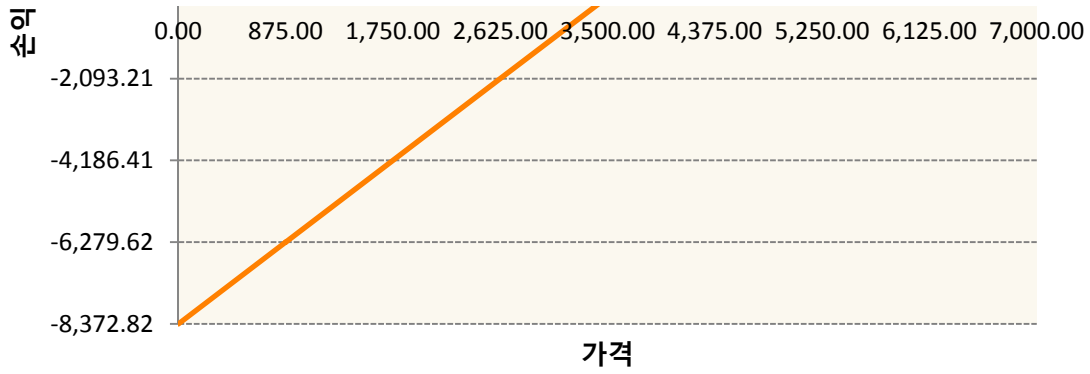


**OESXK9-P3475-EURO STOXX 50**



**OESXK9-P3500-EURO STOXX 50**





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	10
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)

1,817



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

(단위:백만원)

1,109



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

(단위:백만원)

95



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

(단위:백만원)

137



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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-04-30
기준일	2019-04-29

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

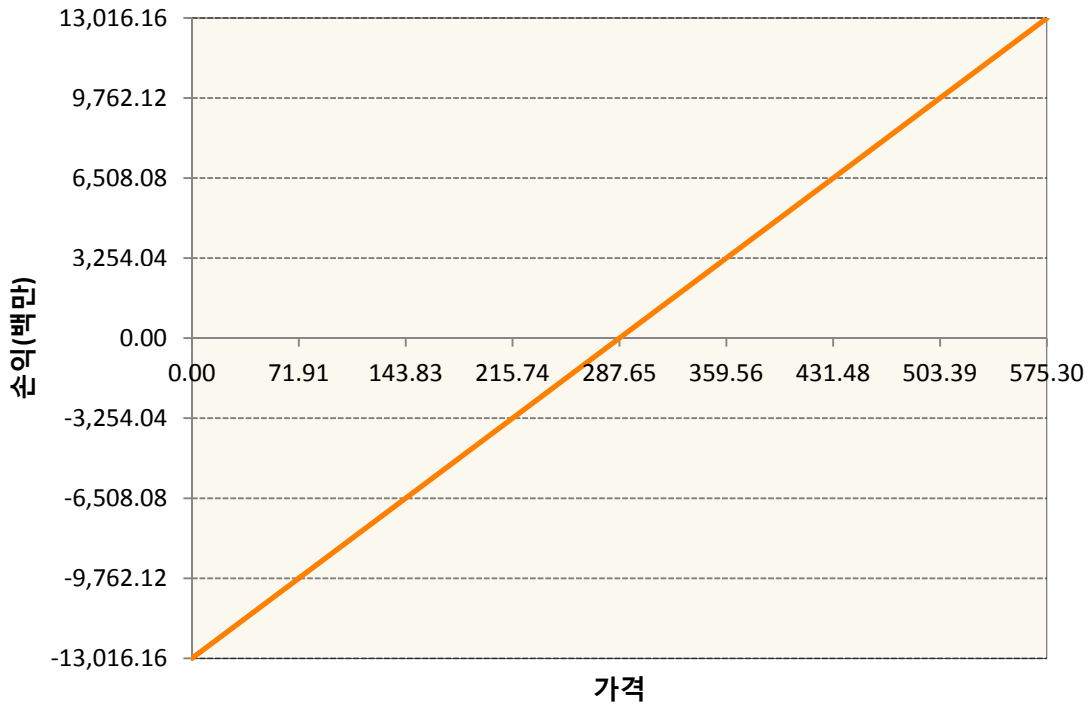
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

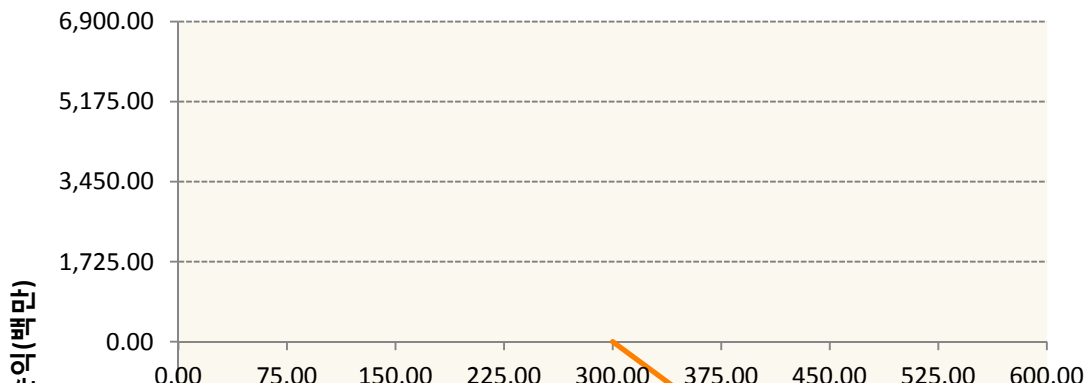
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,016	0	13,016	장내
누계	유가증권	옵션	1,366	24,294	-22,928	장내

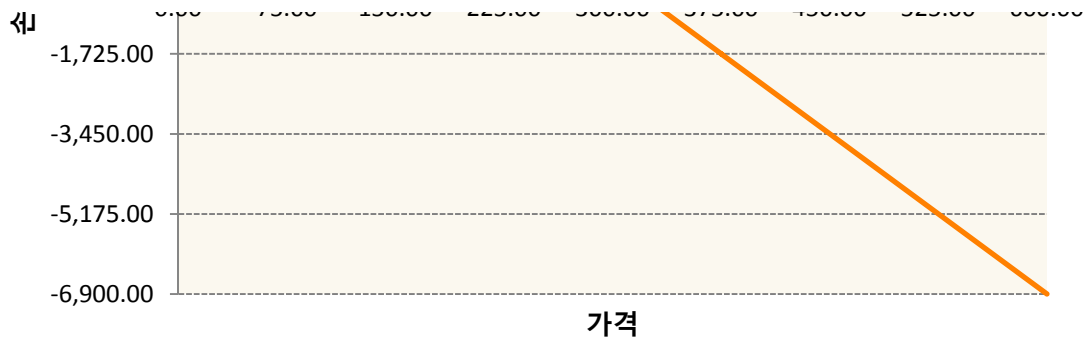
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

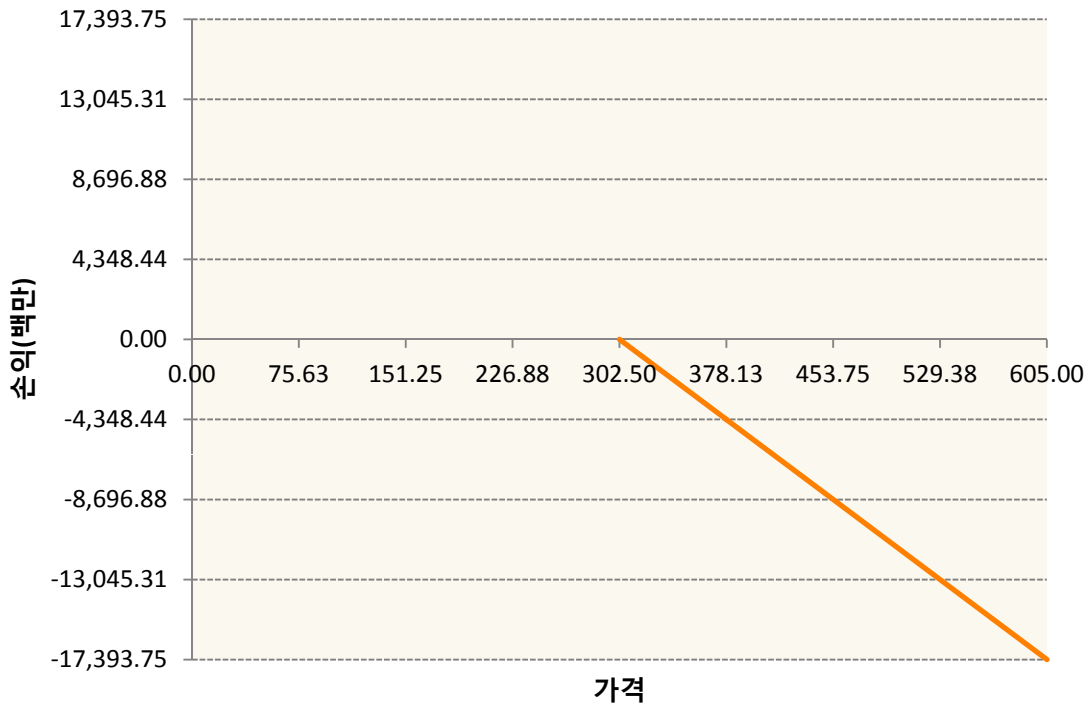


KR4201P53007-2019-05 콜300

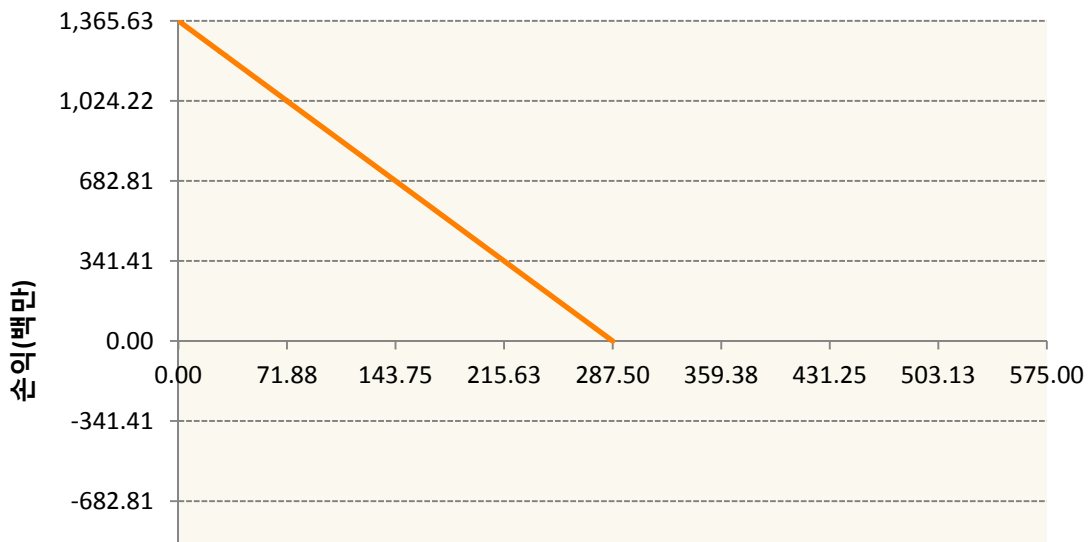


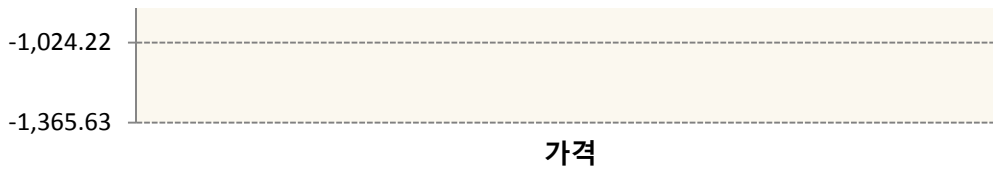


**KR4201P53023-2019-05 콜302.5**



**KR4301P52874-2019-05 풋287.5**





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

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						1,038
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,038	-1,038	-1,038	-1,038	-1,038	-1,038	-1,038	
-5.33%	-692	-692	-692	-692	-692	-692	-692	
-2.67%	-346	-346	-346	-346	-346	-346	-346	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	346	346	346	346	346	346	346	
5.33%	692	692	692	692	692	692	692	
8.00%	1,038	1,038	1,038	1,038	1,038	1,038	1,038	
KR4201P53007		2019-05 콜300						263
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	19	19	19	19	19	19	18	
-5.33%	19	19	19	18	18	17	16	
-2.67%	18	18	16	15	13	10	7	
0%	13	9	5	0	-5	-11	-17	
2.67%	-16	-24	-32	-40	-49	-57	-66	
5.33%	-92	-101	-110	-120	-129	-138	-148	
8.00%	-221	-227	-233	-240	-247	-255	-263	
KR4201P53023		2019-05 콜302.5						573
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	32	32	32	32	32	31	31	
-5.33%	32	32	31	31	30	29	26	
-2.67%	31	30	28	25	21	16	10	
0%	23	17	9	0	-11	-23	-36	
2.67%	-23	-40	-58	-76	-95	-115	-135	
5.33%	-170	-193	-217	-241	-265	-288	-312	
8.00%	-452	-470	-490	-510	-531	-552	-573	
KR4301P52874		2019-05 풋287.5						99
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	99	99	99	99	99	99	99	
-5.33%	63	63	63	63	63	63	63	
-2.67%	27	27	27	28	28	28	29	

0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-13	-12	-12	-11	-11	-10	-10
5.33%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
8.00%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13

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

(단위:백만원)

**1,503**

공시일	2019-04-30
기준일	2019-04-29

## 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	4,321	0	4,321	

### 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	2019-04-30
기준일	2019-04-29

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,317	0	2,317	
누계	유가증권	수익증권	73,165	0	73,165	

### 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	2019-04-30
기준일	2019-04-29

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	4,634	0	4,634	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	146,739	0	146,739	
누계	통화	선도	0	156,502	-156,502	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
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		278
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		1,298
FX21019J015 KRW/USD 17-05-19E		1,390
FX21019J015 KRW/USD 18-06-19E		371
FX21019J020 KRW/USD 20-05-19E		500
FX21019J021 KRW/USD 20-05-19E		471
FX21019J022 KRW/USD 24-06-19E		927
FX21019J022 KRW/USD 22-05-19E		779
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		927
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		982
FX21019J032 KRW/USD 26-06-19E		371
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		74
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		975
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E		1,001

FX21019J041 KRW/USD 28-05-19E

278

FX21019J042 KRW/USD 03-06-19E

556

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

(단위:백만원)

**4,312**

공시일	2019-04-30
기준일	2019-04-29

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

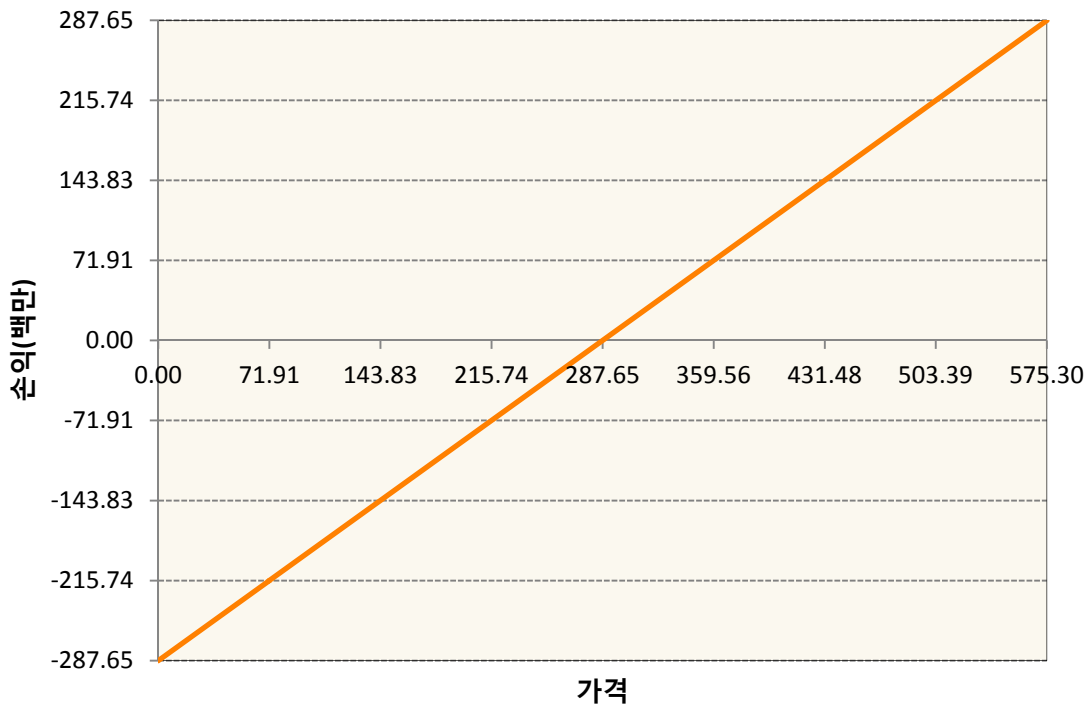
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

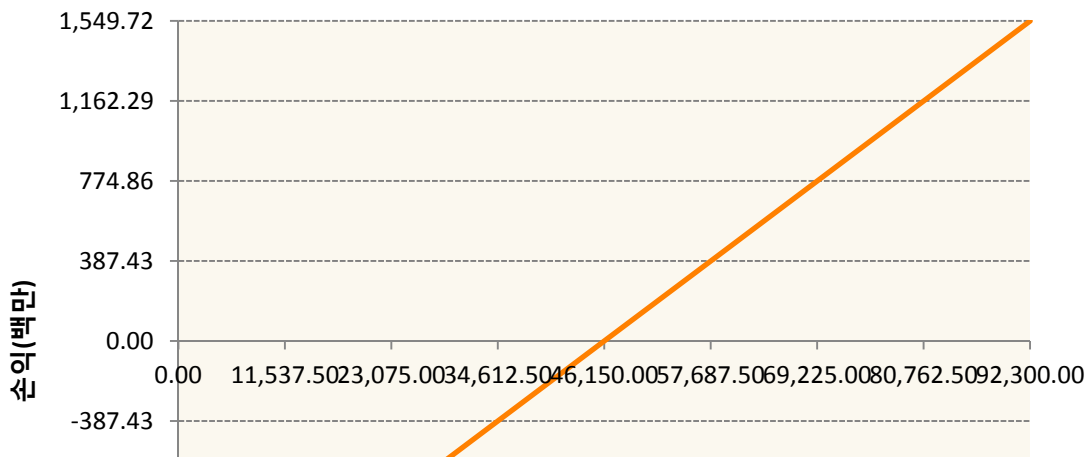
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,837	0	1,837	장내

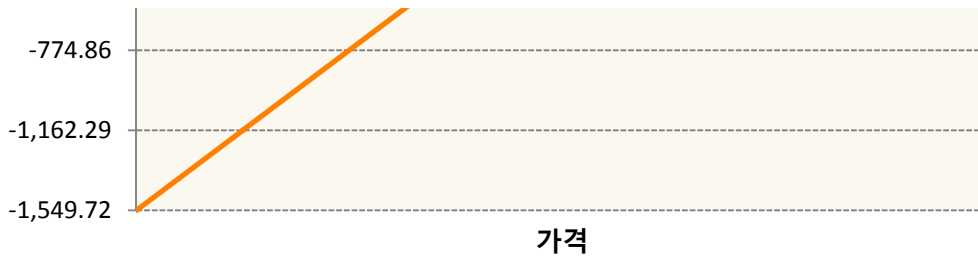
### 2. 만기시점의 손익구조

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						124
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124	
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83	
-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%	83	83	83	83	83	83	83	
8.00%	124	124	124	124	124	124	124	

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

**162**

공시일	2019-04-30
기준일	2019-04-29

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

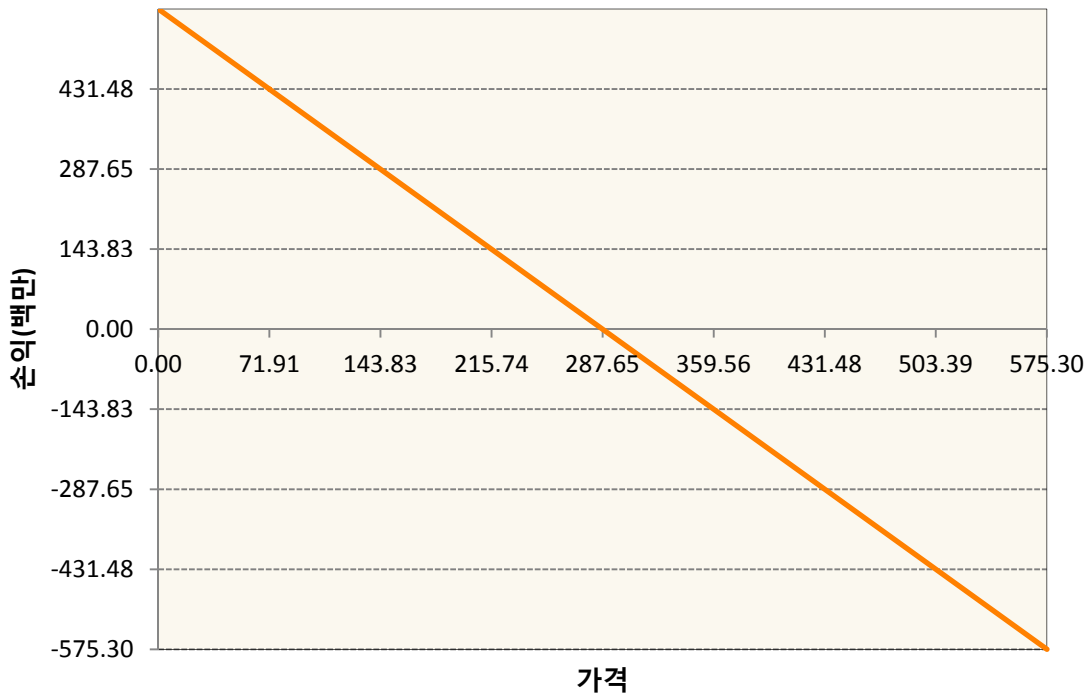
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

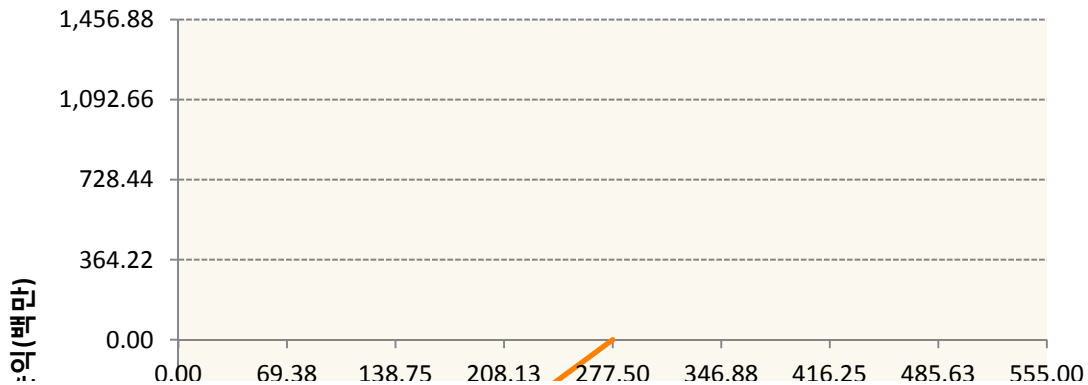
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	70	-70	장내
누계	유가증권	선물	0	575	-575	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,067	-3,067	장내

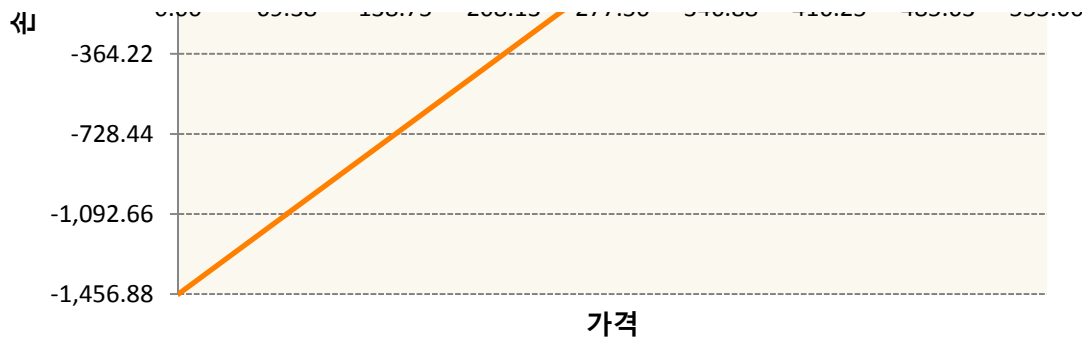
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

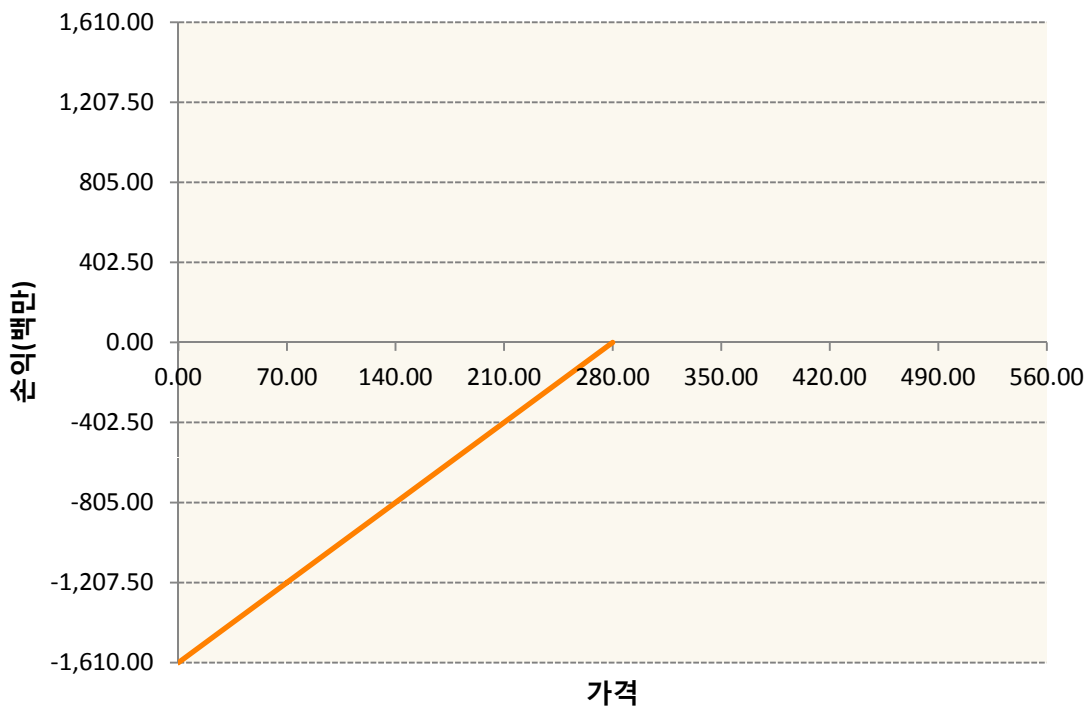


KR4301P52775-2019-05 풋277.5





KR4301P52809-2019-05 풋280



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						46
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	46	46	46	46	46	46	46	
-5.33%	31	31	31	31	31	31	31	
-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%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31	
8.00%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46	
KR4301P52775		2019-05 풋277.5						71
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71
-5.33%	-32	-32	-33	-33	-34	-34	-35
-2.67%	-5	-6	-7	-8	-9	-10	-11
0%	1	0	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

91

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
-5.33%	-47	-47	-48	-48	-48	-49	-49
-2.67%	-11	-12	-13	-14	-15	-16	-17
0%	1	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	2	2	2	2	2	2	2
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)

163

공시일	2019-04-30
기준일	2019-04-29

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

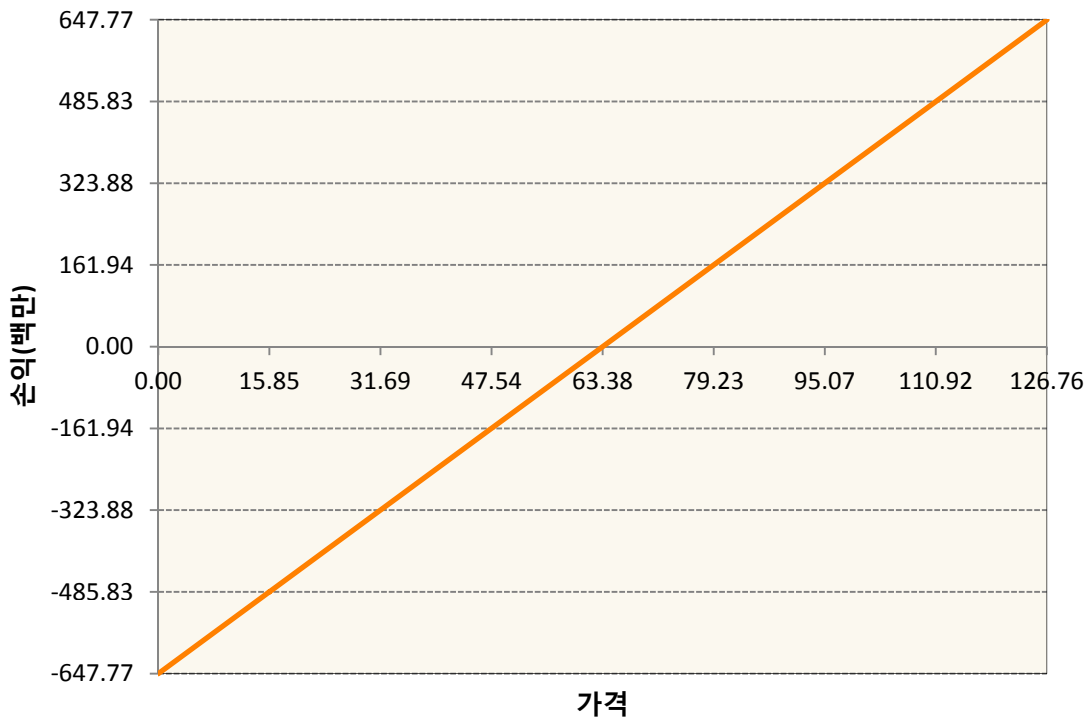
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

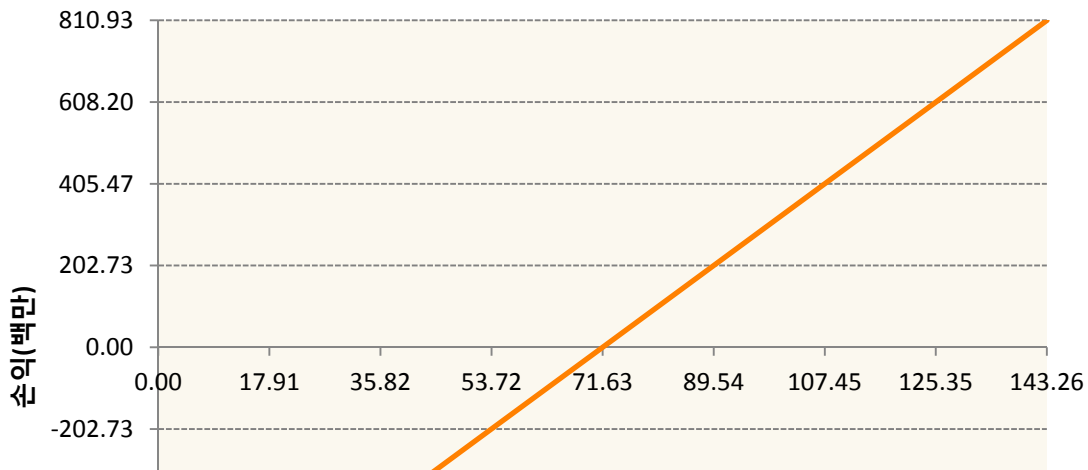
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,884	290	2,595	

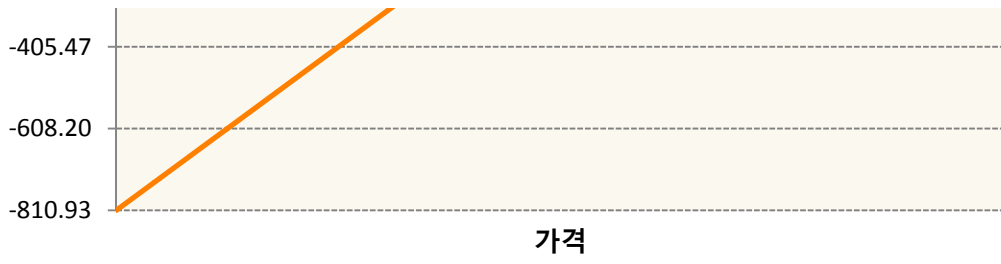
### 2. 만기시점의 손익구조

CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19

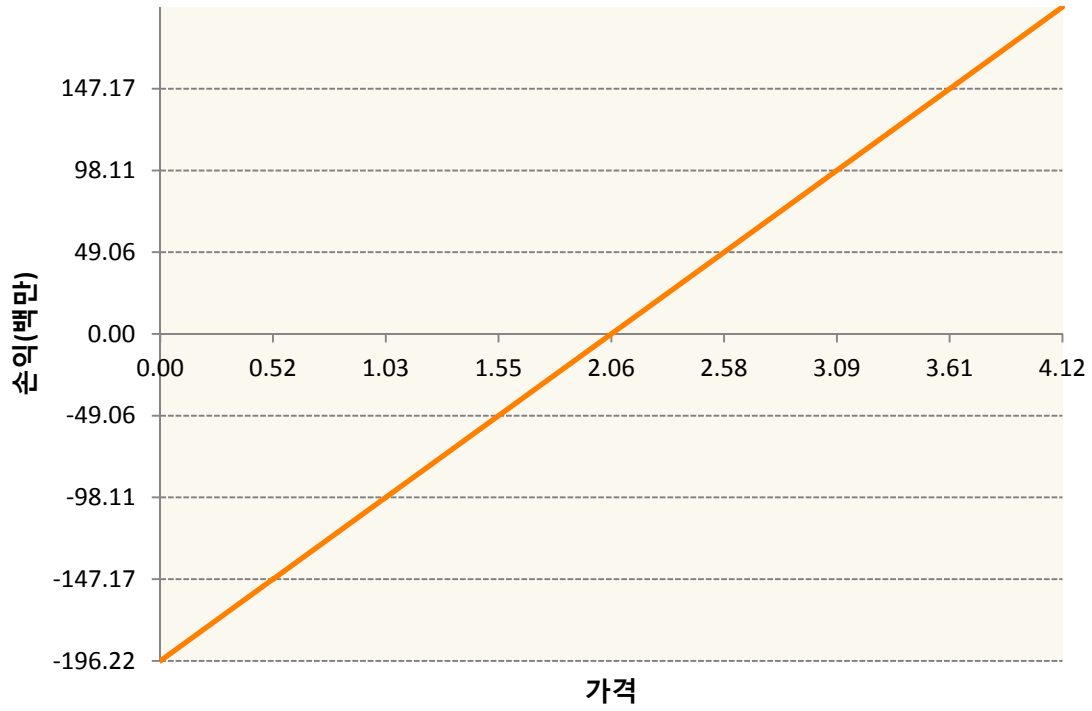


CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19

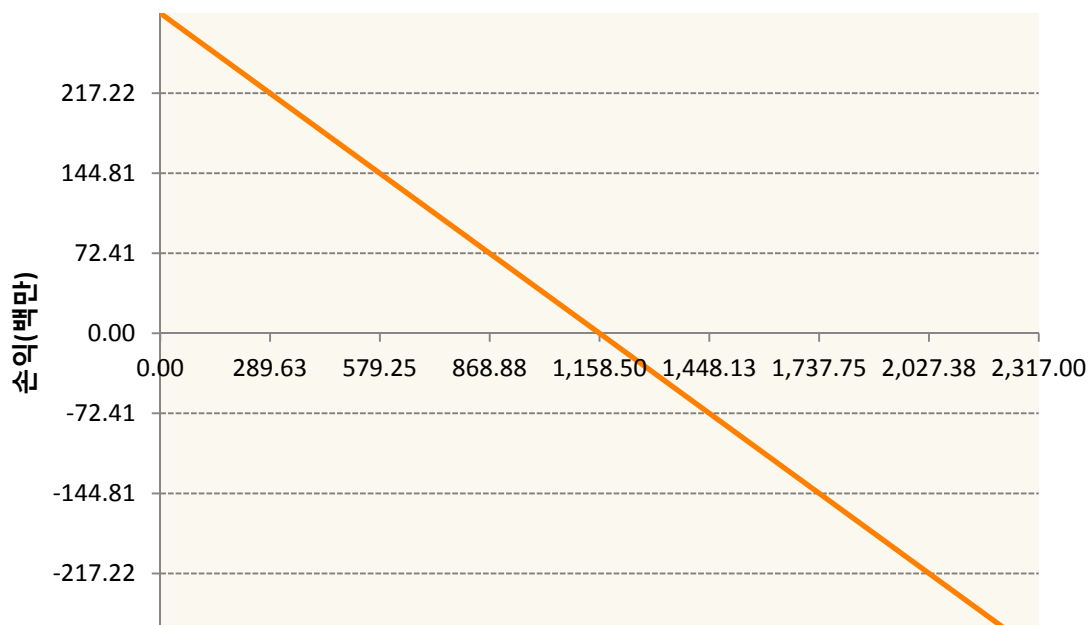


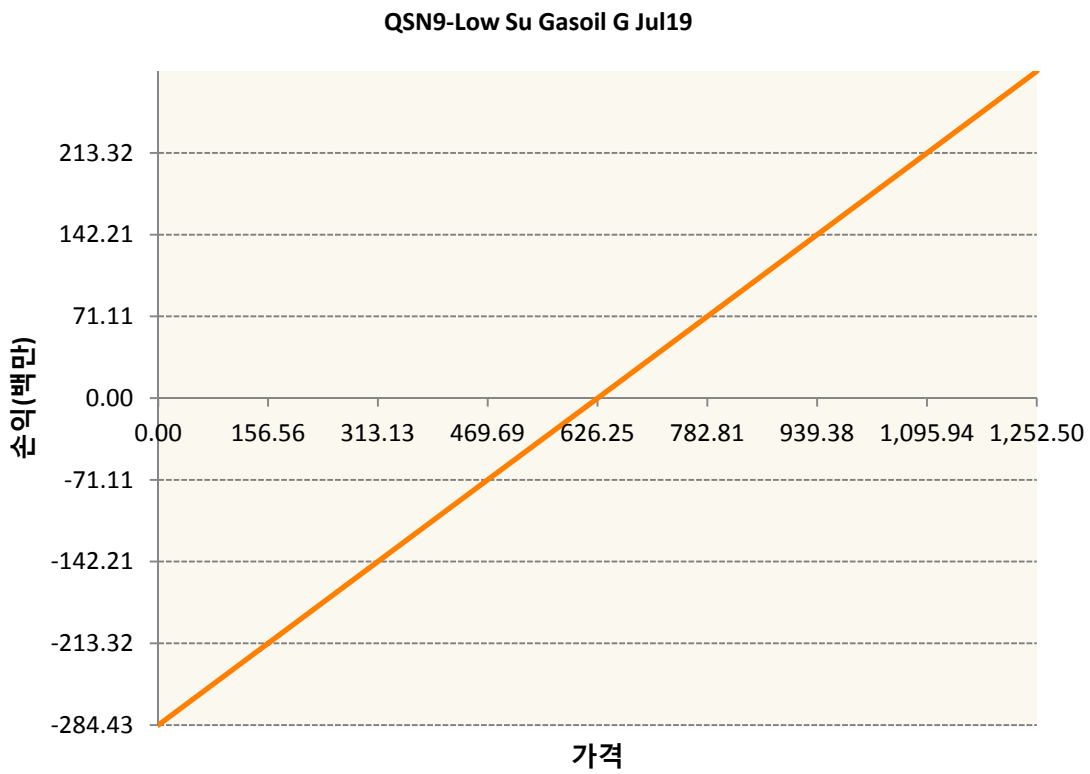
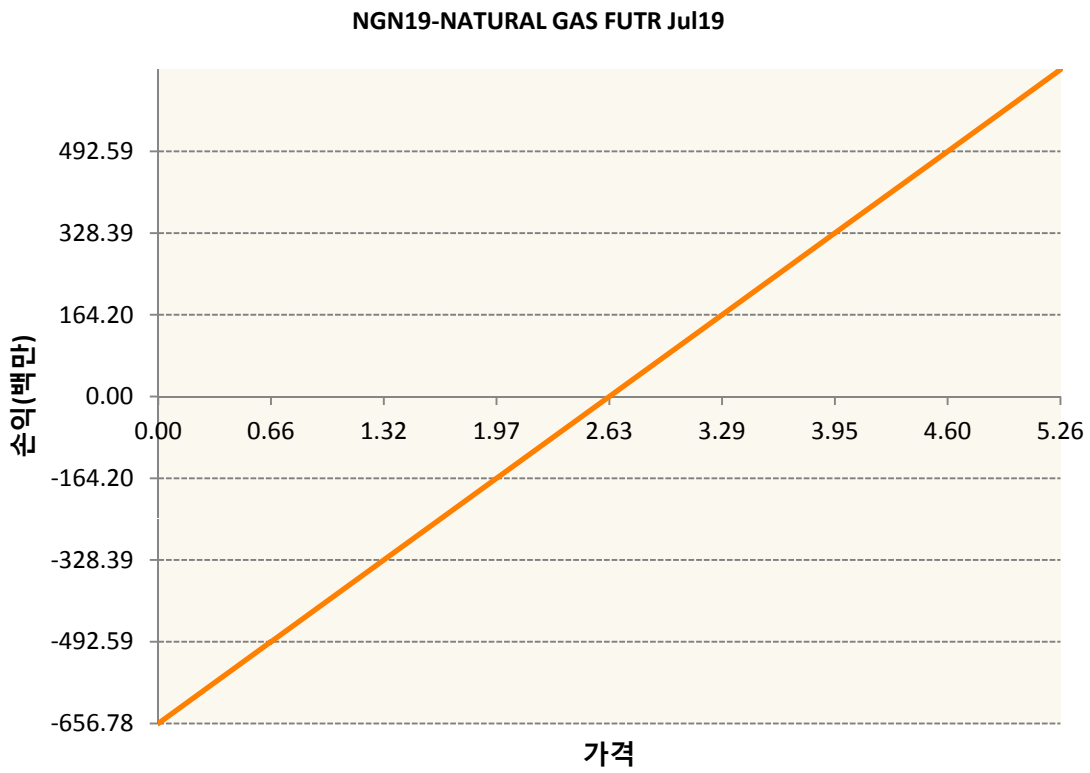
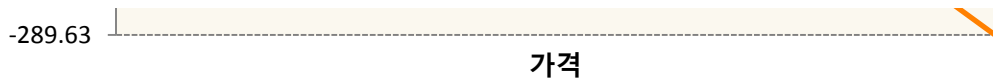


HON9-NY Harb ULSD Fut Jul19

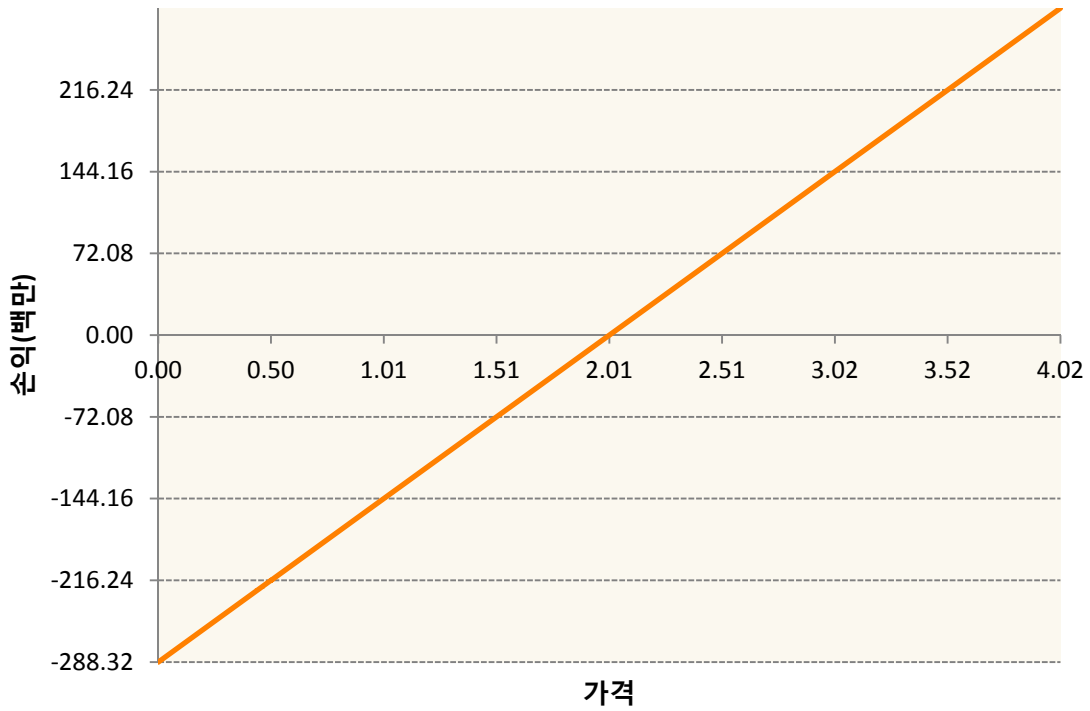


KR4175P50009-2019-05 달러선물





XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN9	WTI CRUDE FUTURE Jul19	52
CON9	BRENT CRUDE FUTR Jul19	65
HON9	NY Harb ULSD Fut Jul19	16
KR4175P500	2019-05 달러선물	23
NGN19	NATURAL GAS FUTR Jul19	53
QSN9	Low Su Gasoil G Jul19	23
XBN9	GASOLINE RBOB FUT Jul19	23

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

(단위:백만원)

427

공시일	2019-04-30
기준일	2019-04-29

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

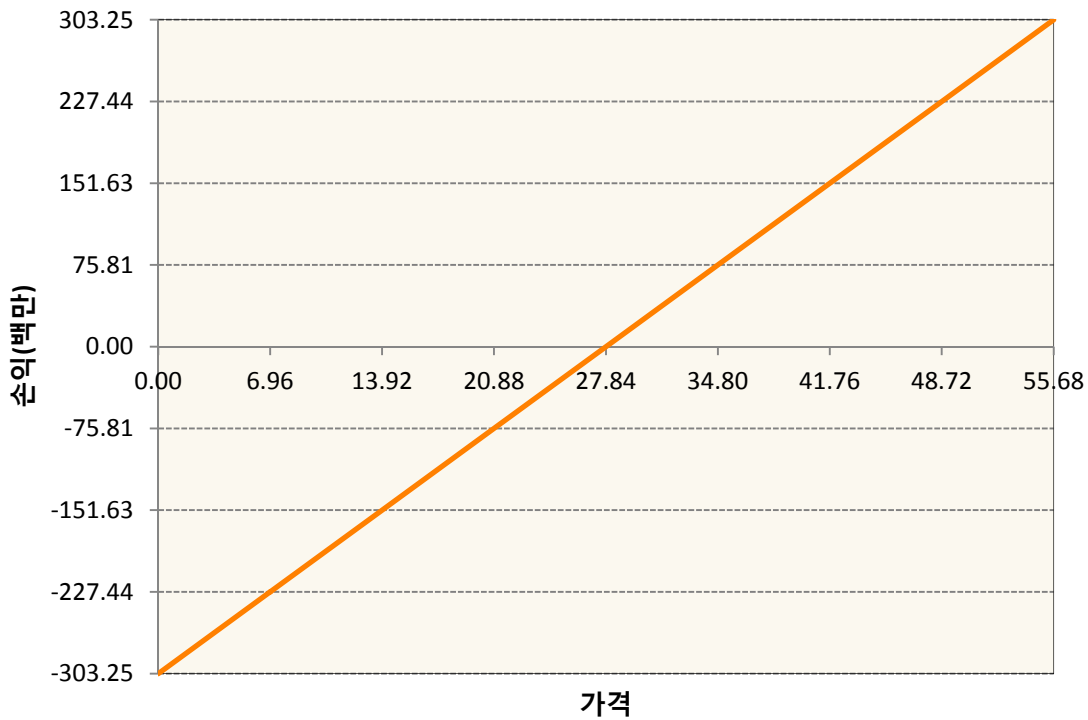
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

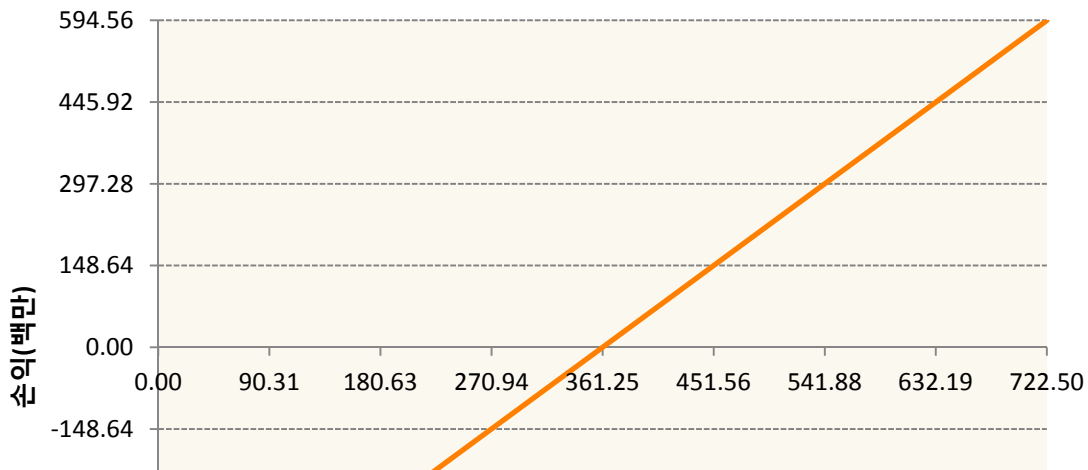
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,065	58	3,007	

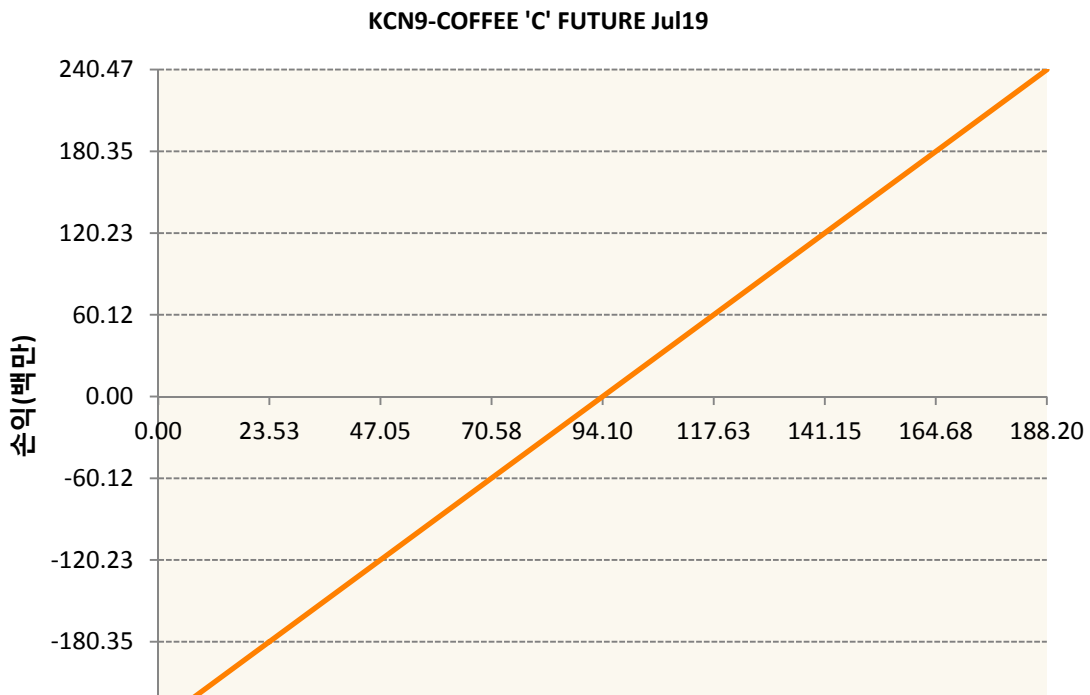
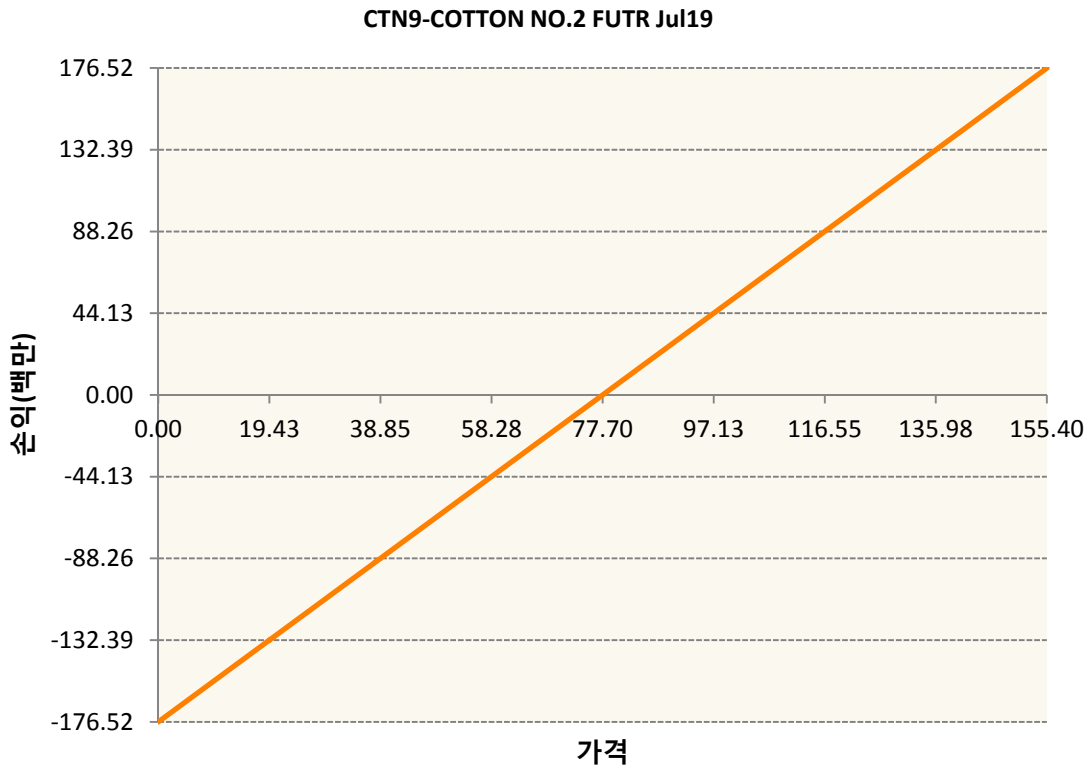
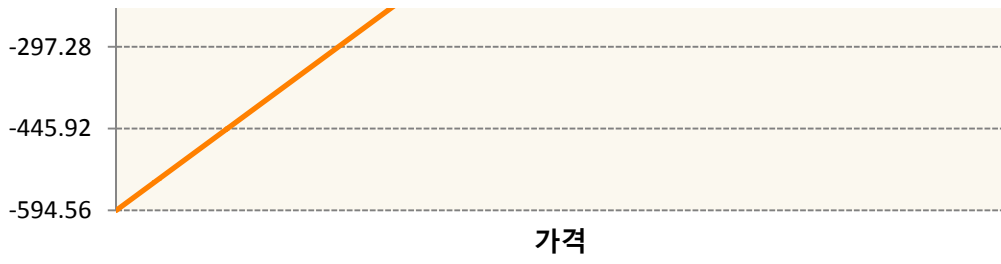
### 2. 만기시점의 손익구조

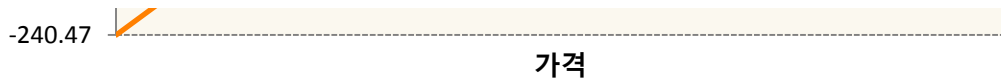
**BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19**



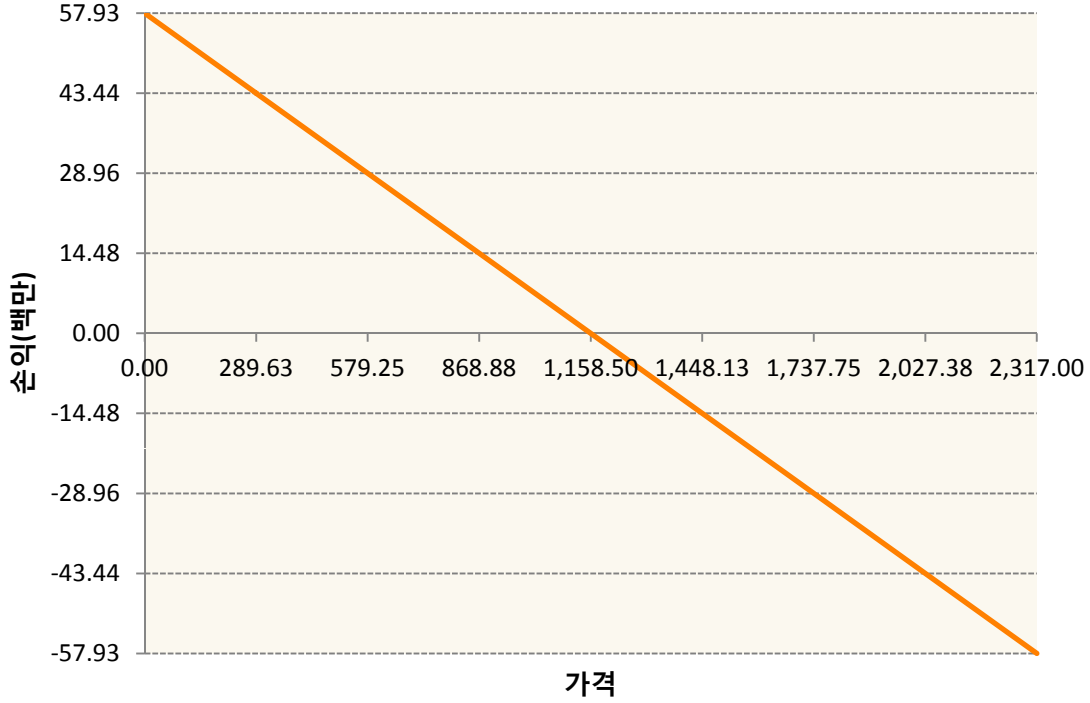
**CN9-CORN FUTURE Jul19**



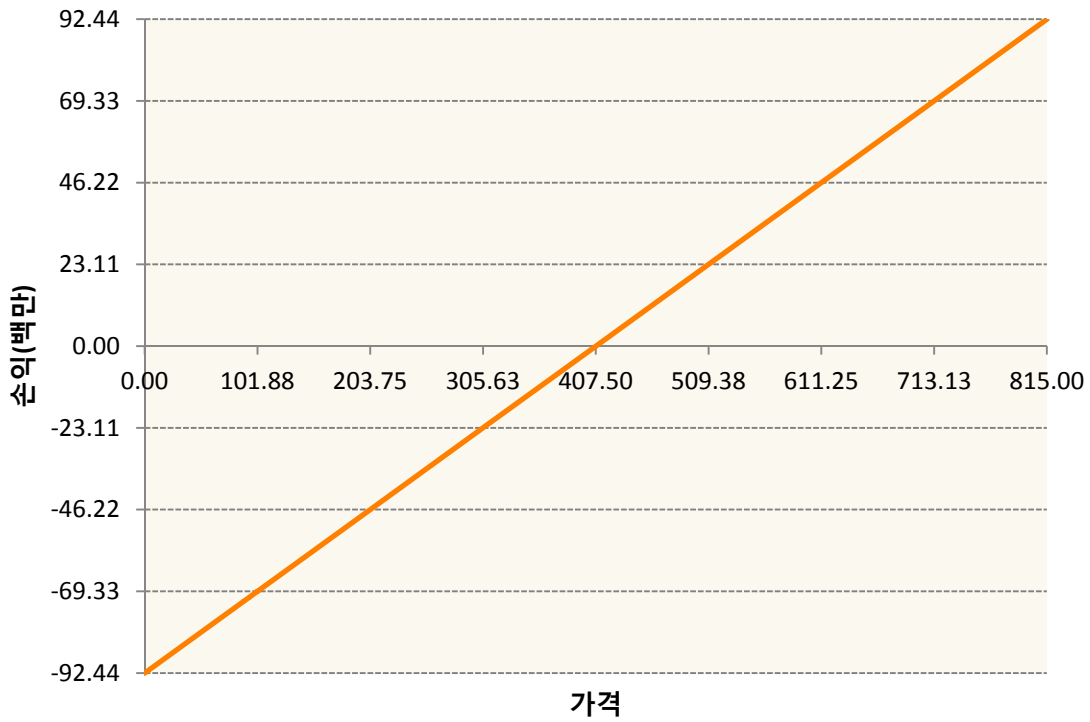




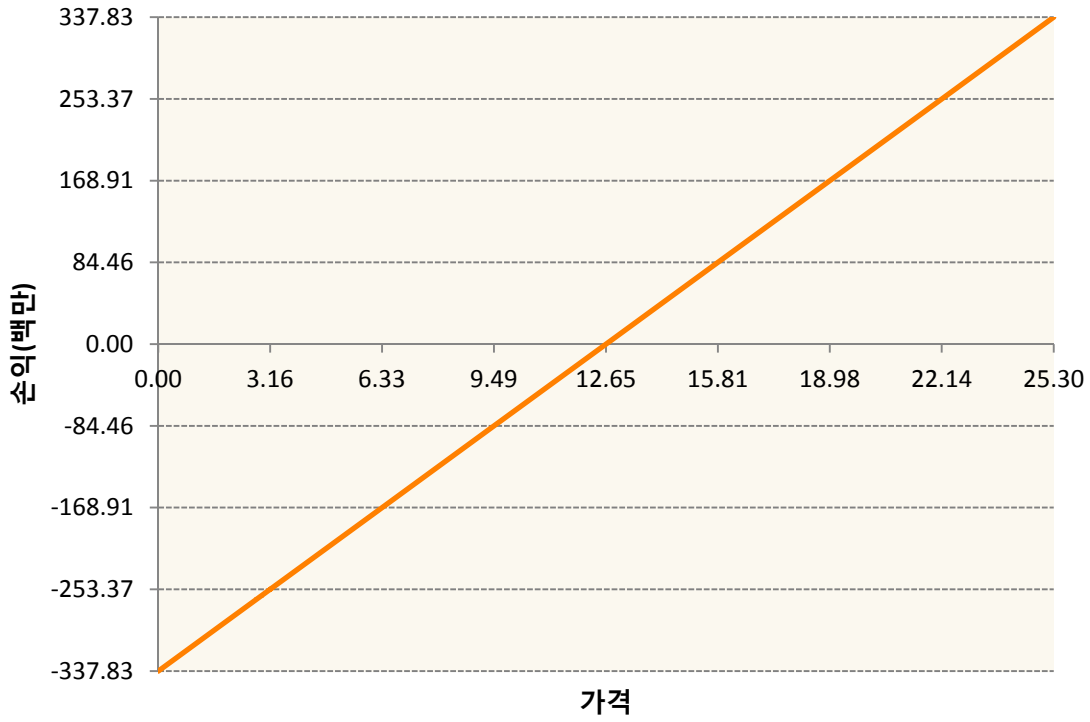
KR4175P50009-2019-05 달러선물



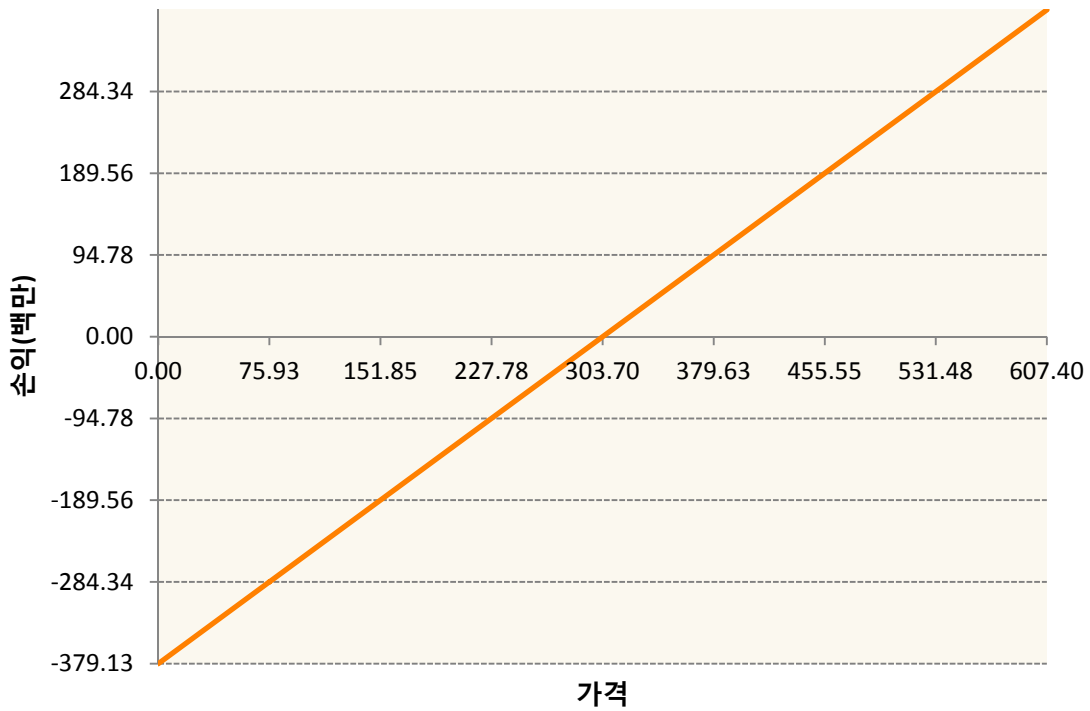
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

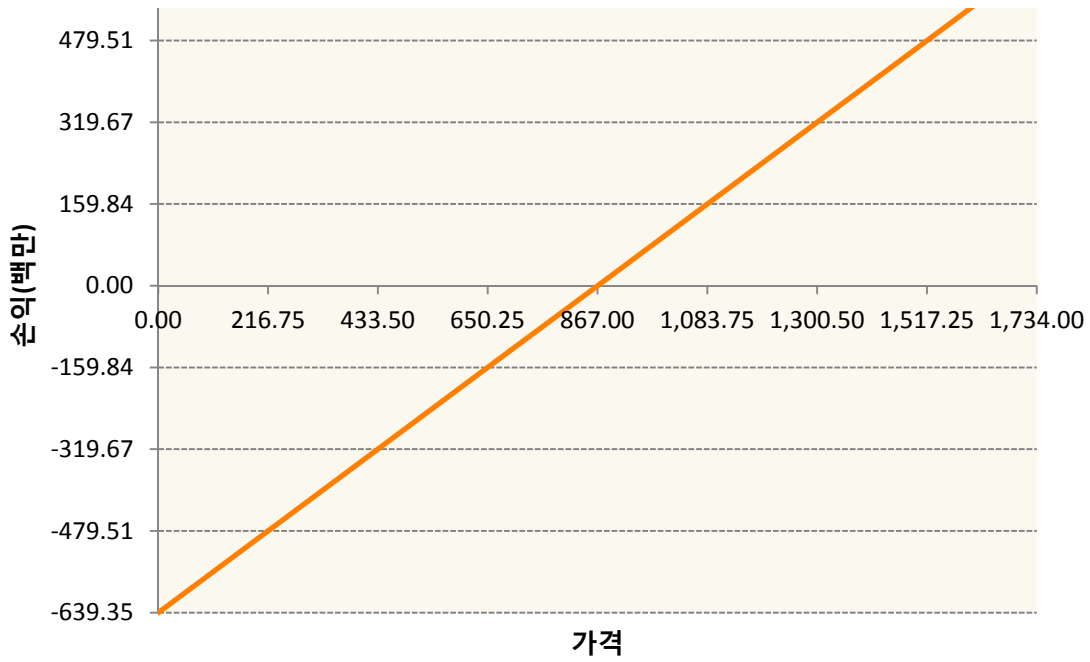


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19

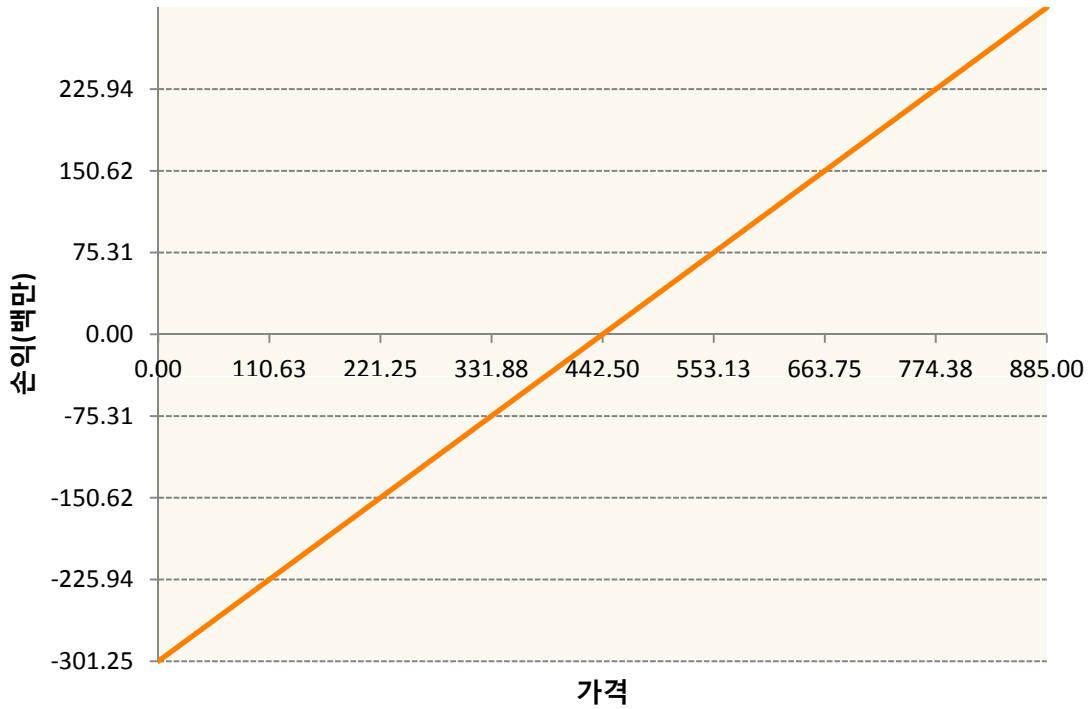


SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





WN9-WHEAT FUTURE(CBT) Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON9	SOYBEAN OIL FUTR Jul19	24
CN9	CORN FUTURE Jul19	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	7
SBN9	SUGAR #11 (WORLD) Jul19	27
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)

247