

공시일	2019-05-02
기준일	2019-04-30

## 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	2019-05-02
기준일	2019-04-30

## 좋은아침펀더멘탈인덱스모(주식)

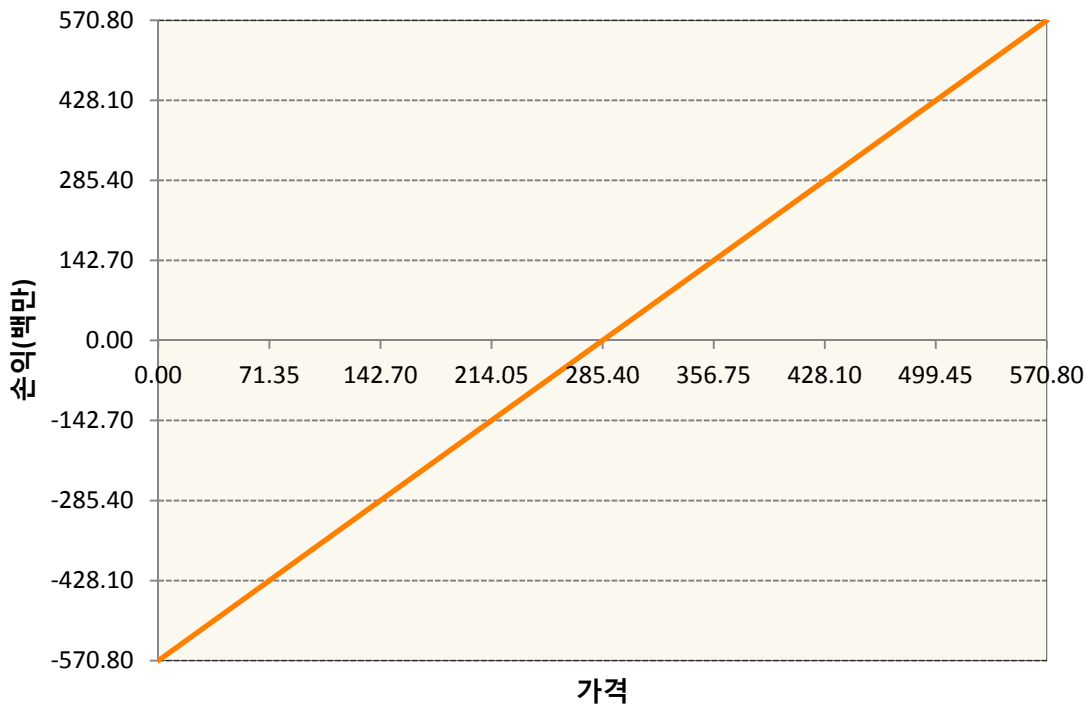
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

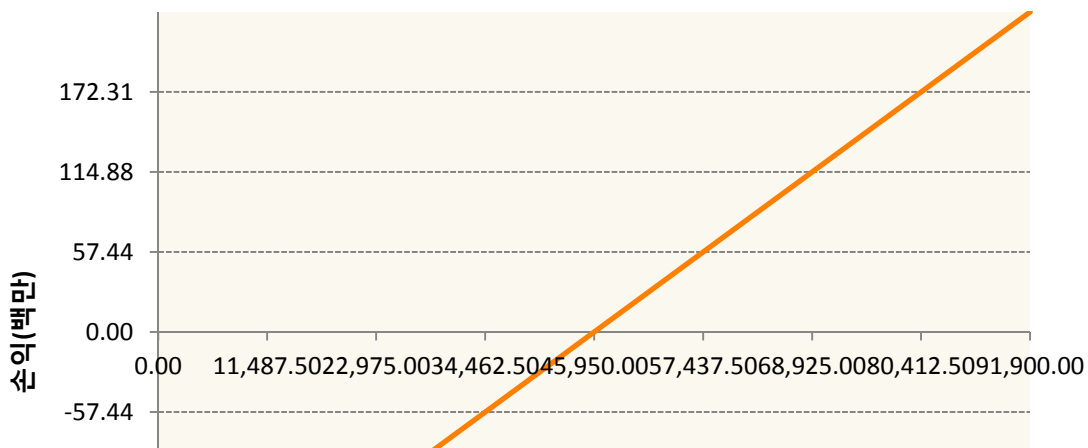
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	801	0	801	장내

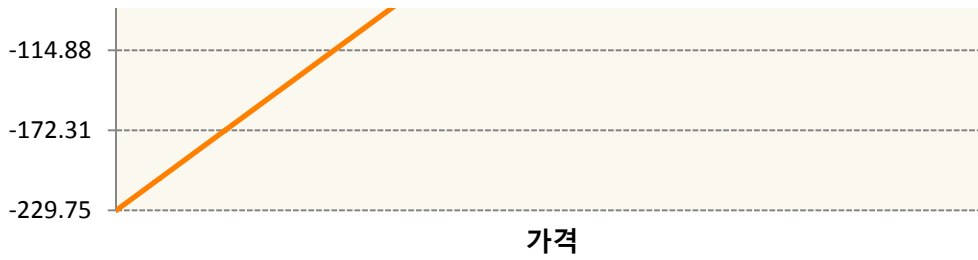
### 2. 만기시점의 손익구조

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%	-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%	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)

94

공시일	2019-05-02
기준일	2019-04-30

## 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

1,167

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

685

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-05-02
기준일	2019-04-30

## 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)	331
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	91
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	155

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

<b>918</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-05-02
기준일	2019-04-30

## 유로인덱스모(주식-파생형)

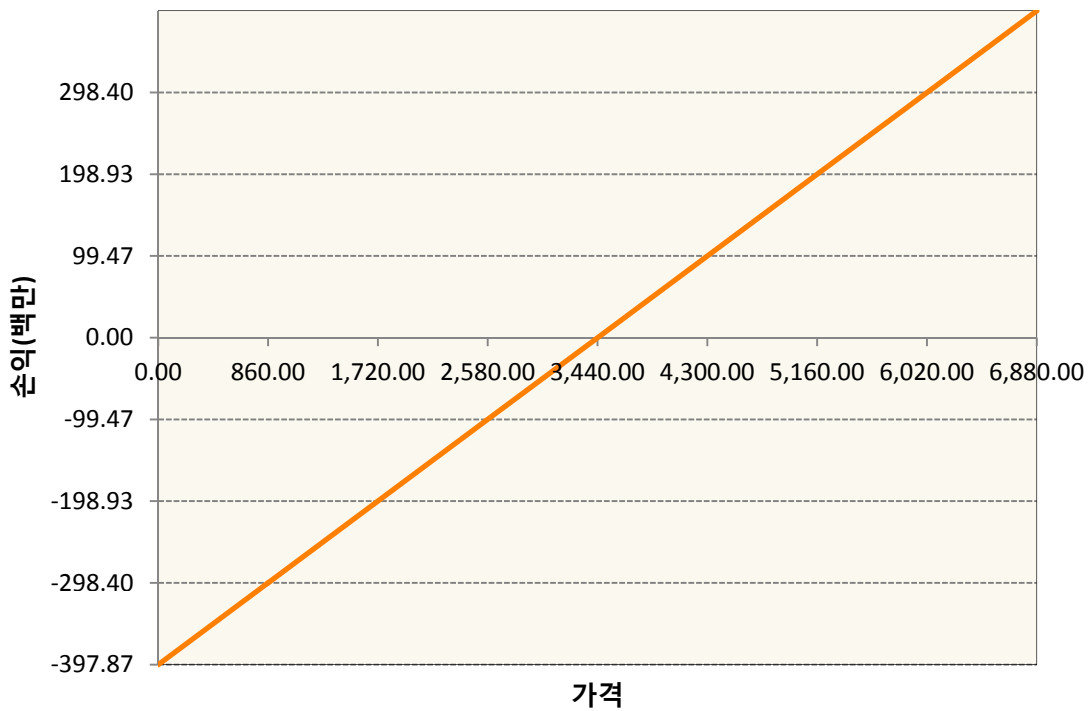
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	398	0	398	

### 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	2019-05-02
기준일	2019-04-30

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

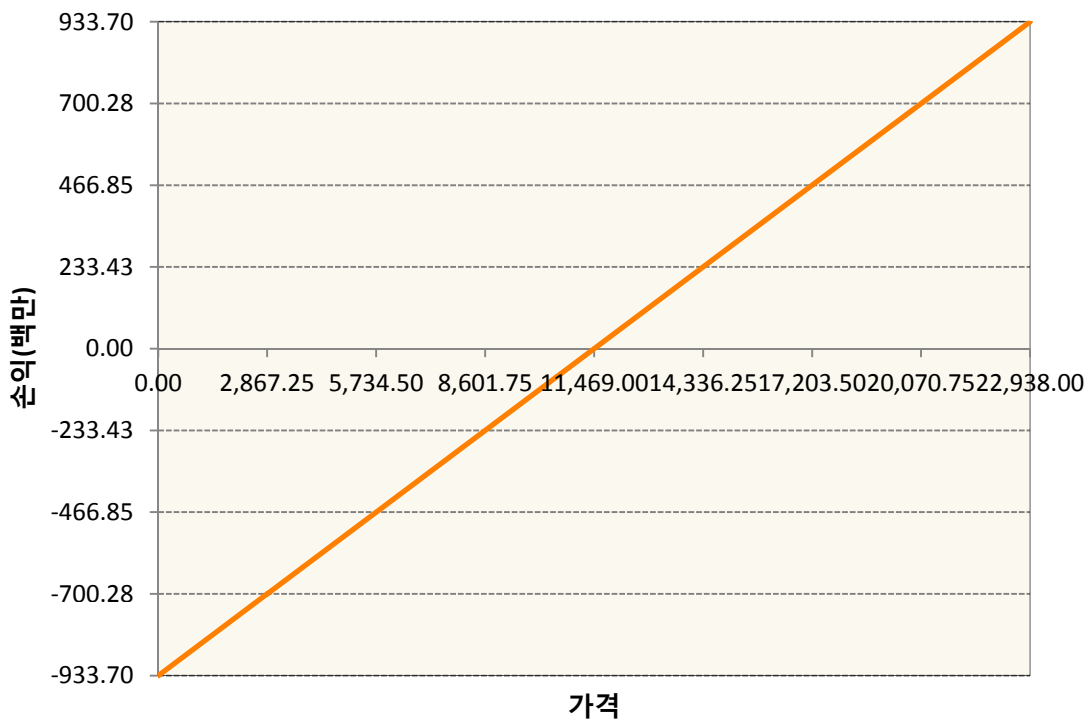
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	934	0	934	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	2019-05-02
기준일	2019-04-30

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

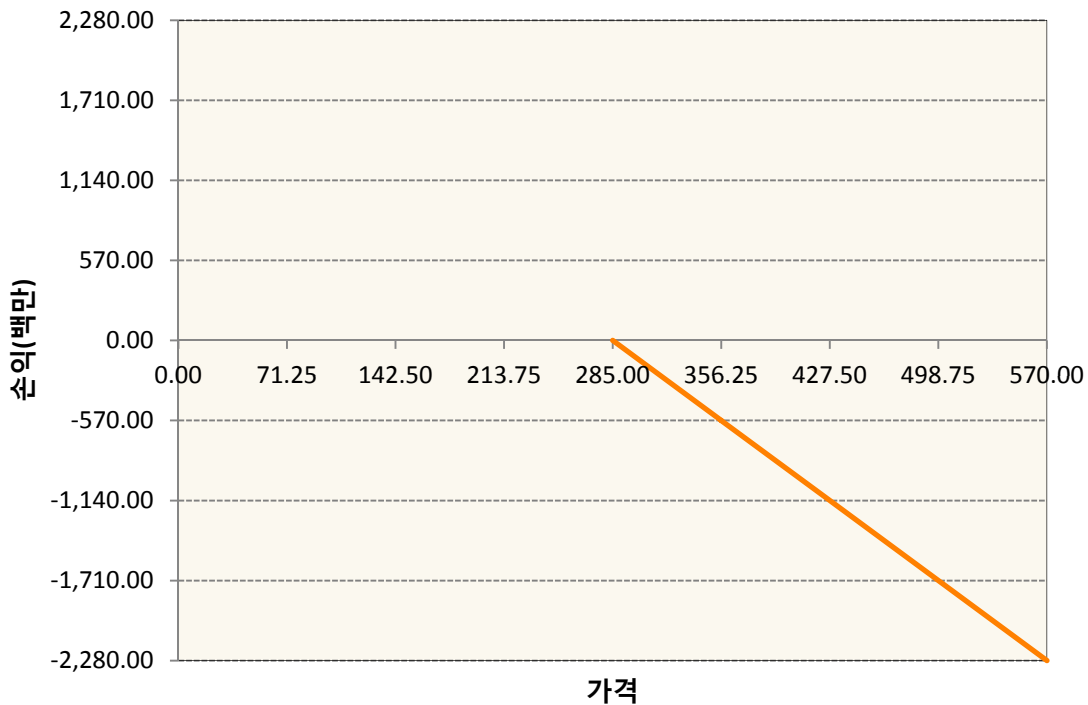
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

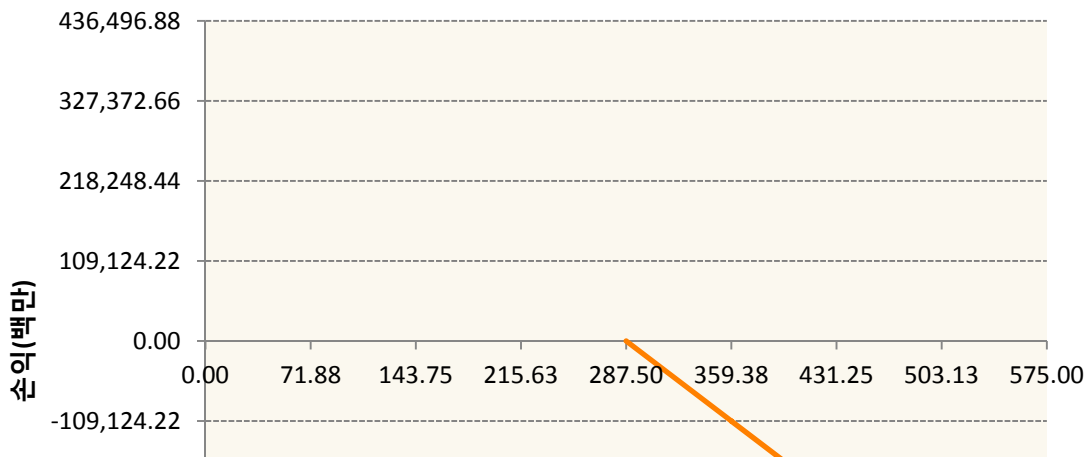
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	672,214	-672,214	장내

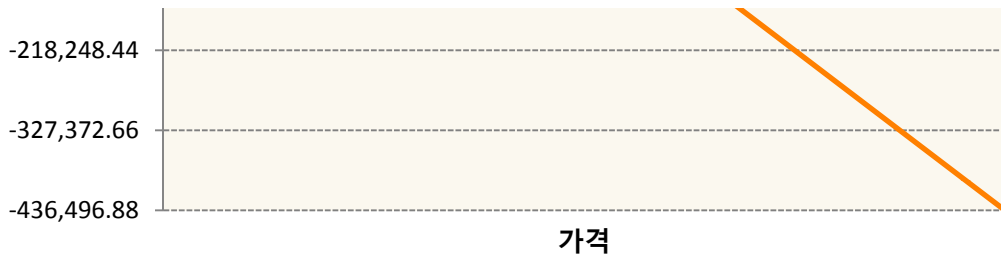
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P52850-2019-05 콜285

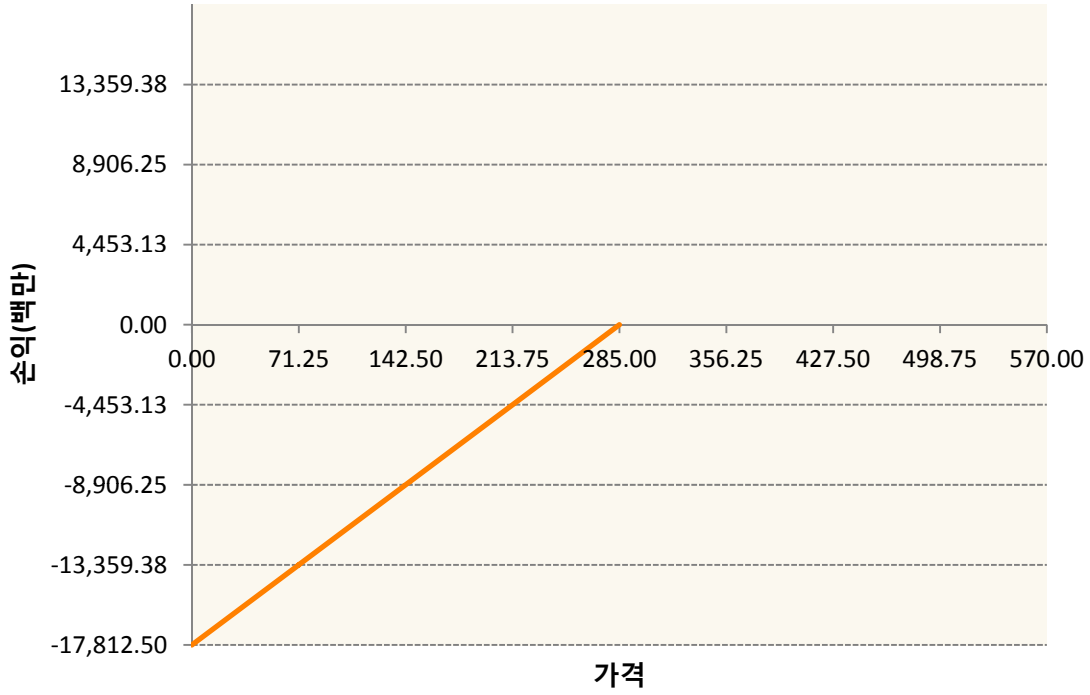


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

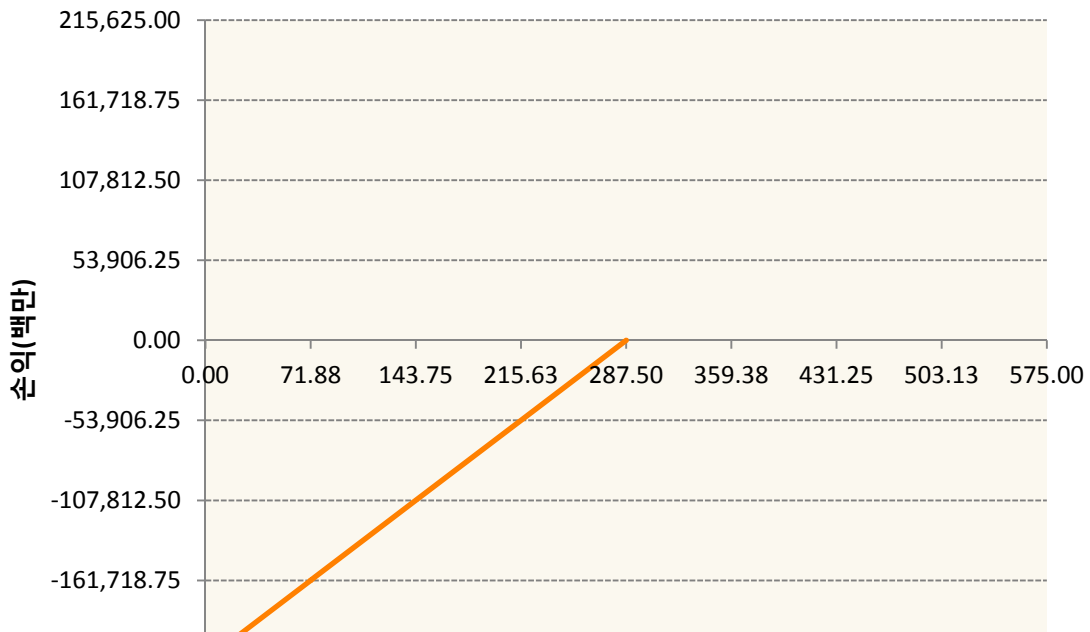




**KR4301P52858-2019-05 풋285**



**KR4301P52874-2019-05 풋287.5**



-215,625.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P52850 2019-05 콜285							149
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	35	35	35	35	34	34	33
-5.33%	34	34	33	32	31	30	28
-2.67%	29	27	25	23	20	18	15
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	-32	-34	-36	-38	-41	-43	-46
5.33%	-87	-87	-88	-89	-91	-92	-94
8.00%	-146	-146	-147	-147	-148	-148	-149
KR4201P52876 2019-05 콜287.5							26,474
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,996	4,989	4,975	4,948	4,906	4,846	4,765
-5.33%	4,933	4,867	4,769	4,640	4,478	4,285	4,064
-2.67%	4,332	4,049	3,728	3,377	3,000	2,600	2,183
0%	1,638	1,096	550	0	-552	-1,106	-1,662
2.67%	-4,812	-5,303	-5,809	-6,325	-6,850	-7,381	-7,918
5.33%	-14,529	-14,753	-15,019	-15,322	-15,656	-16,019	-16,404
8.00%	-25,683	-25,737	-25,820	-25,935	-26,083	-26,263	-26,474
KR4301P52858 2019-05 풋285							1,285
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,285	-1,285	-1,285	-1,285	-1,285	-1,285	-1,285
-5.33%	-810	-810	-810	-810	-811	-811	-812
-2.67%	-339	-342	-345	-349	-354	-360	-366
0%	36	24	12	0	-12	-24	-36
2.67%	141	138	134	129	124	117	111
5.33%	146	146	146	145	145	144	143
8.00%	146	146	146	146	146	146	146
KR4301P52874 2019-05 풋287.5							16,171
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-16,171	-16,171	-16,171	-16,171	-16,171	-16,171	-16,171
-5.33%	-10,476	-10,476	-10,476	-10,476	-10,478	-10,480	-10,485
-2.67%	-4,789	-4,800	-4,817	-4,841	-4,873	-4,912	-4,958
0%	375	253	128	0	-130	-262	-396
2.67%	2,663	2,582	2,493	2,395	2,292	2,184	2,071

5.33%	2,867	2,863	2,855	2,843	2,825	2,801	2,770
8.00%	2,869	2,869	2,869	2,869	2,868	2,866	2,863

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

(단위:백만원)

**51,046**

공시일	2019-05-02
기준일	2019-04-30

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

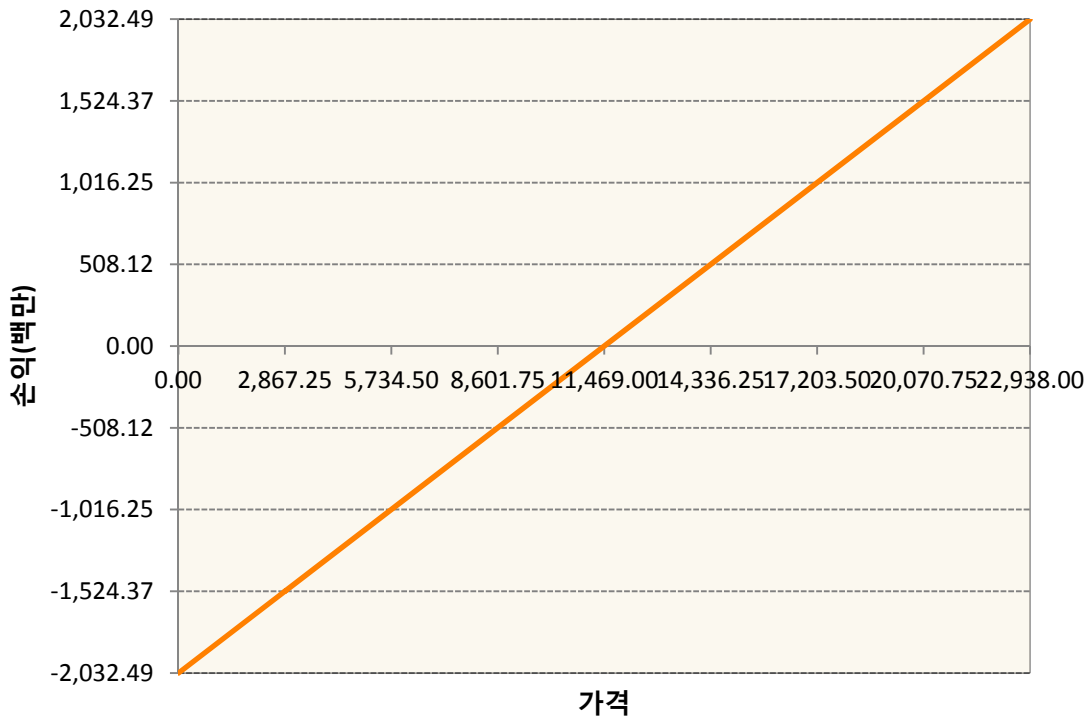
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

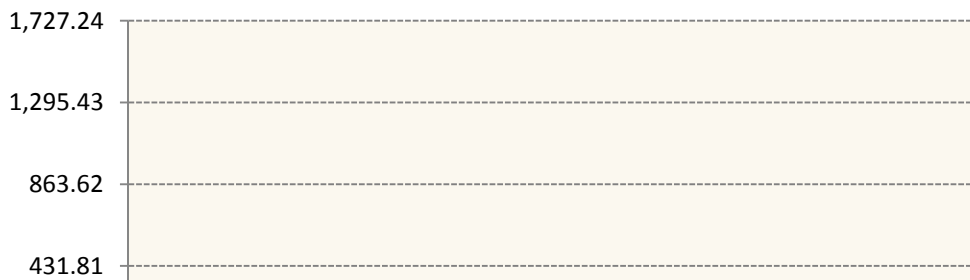
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,032	0	2,032	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,545	-5,545	장내
누계	통화	선도	0	3,127	-3,127	장외

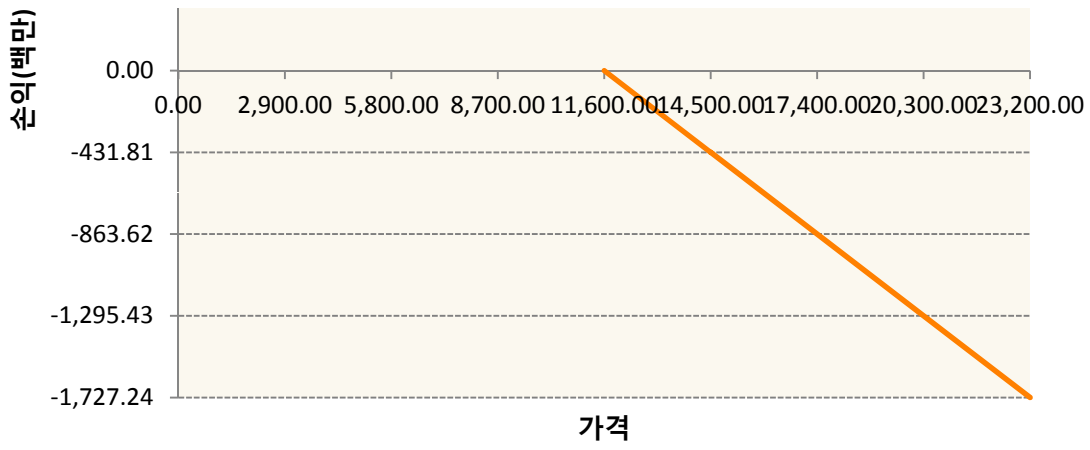
### 2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19

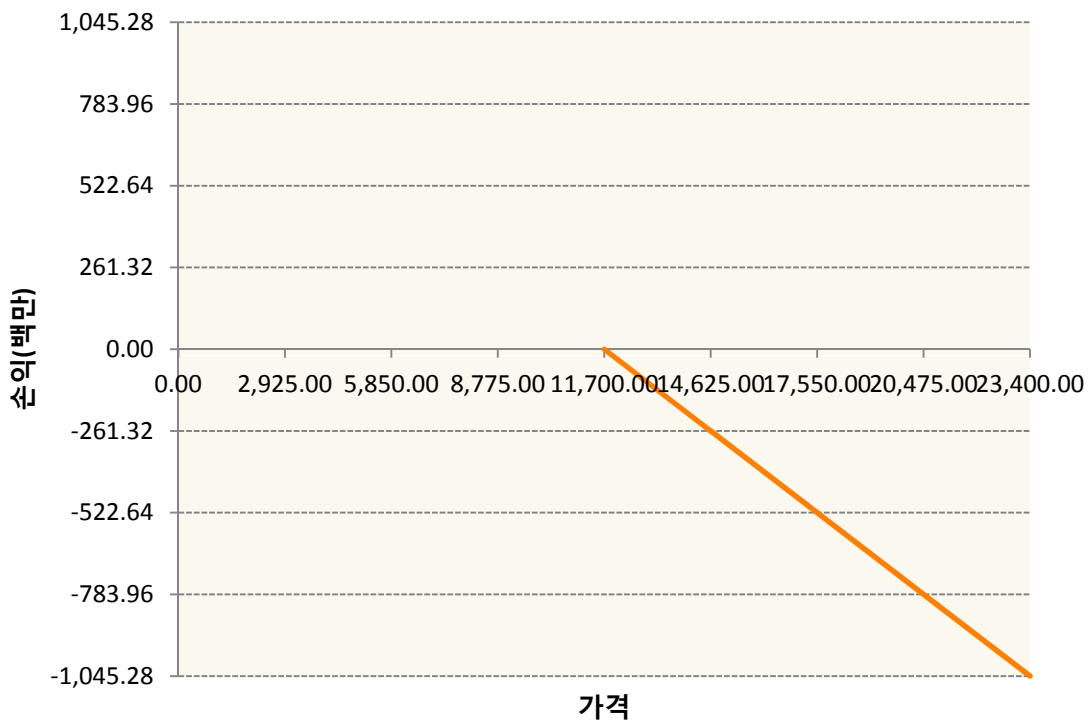


OHHIK9-C116-HSCEI

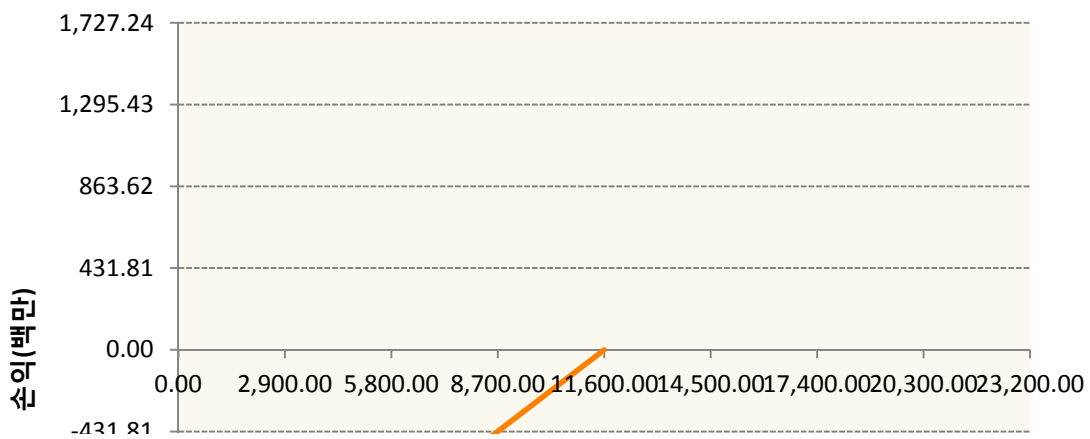


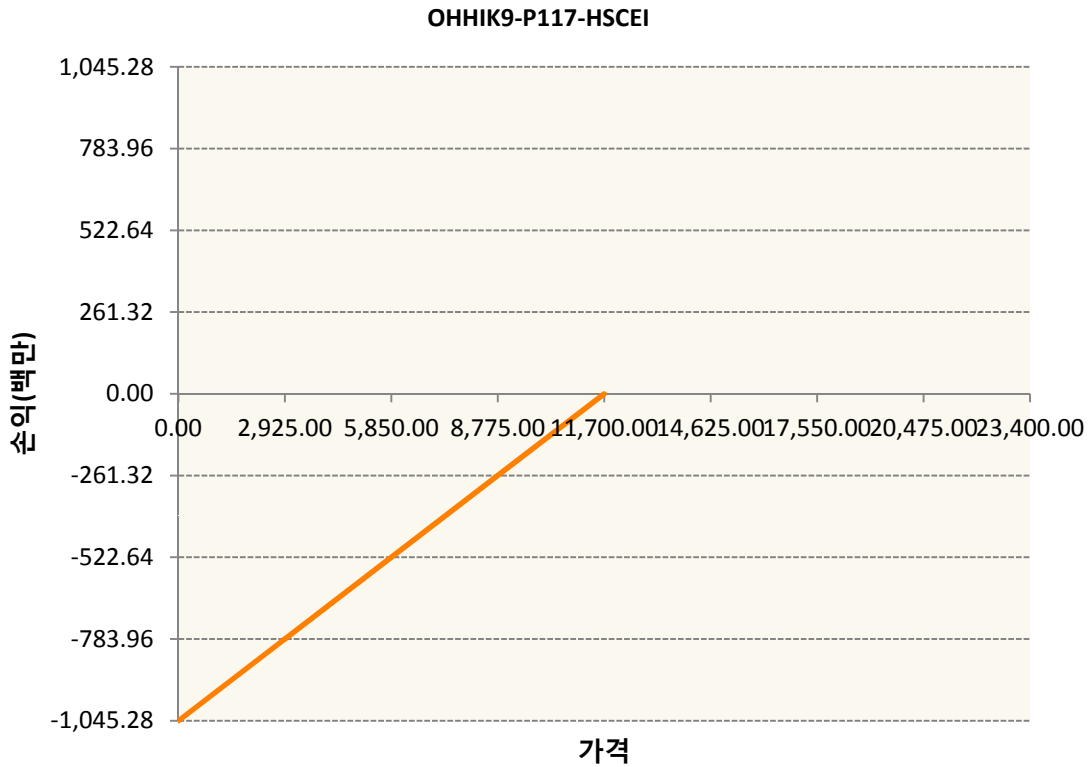


OHHIK9-C117-HSCEI



OHHIK9-P116-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E		226
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E		24
HCK9 HSCEI Futures May19		163
OHHIK9-C11 HSCEI		138
OHHIK9-C11 HSCEI		84
OHHIK9-P11 HSCEI		138
OHHIK9-P11 HSCEI		84

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	707

공시일	2019-05-02
기준일	2019-04-30

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

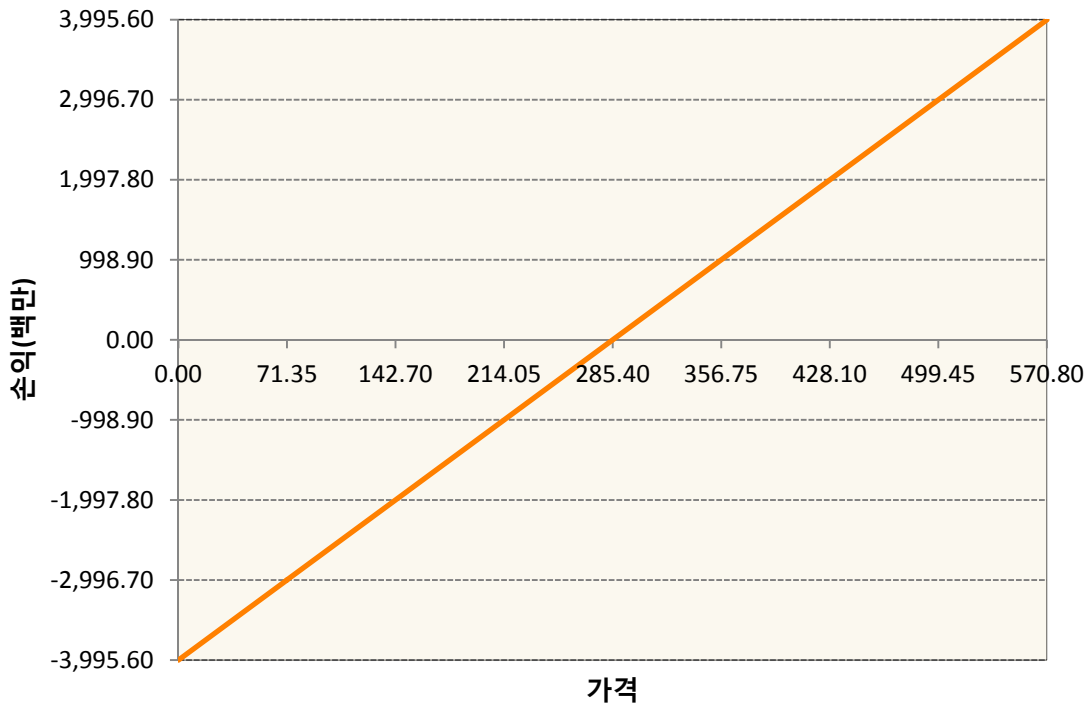
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

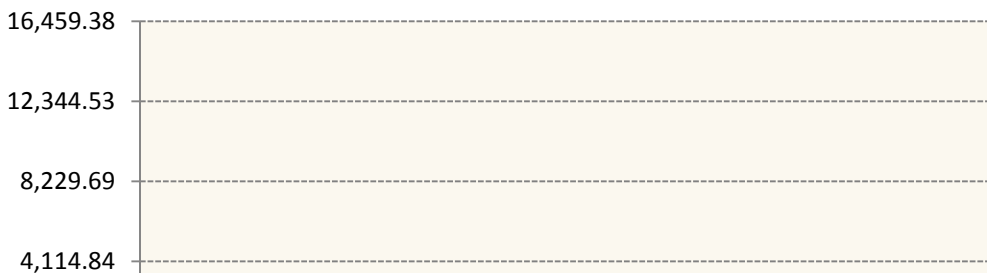
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	1,063	0	1,063	장내
누계	유가증권	선물	3,996	0	3,996	장내
누계	유가증권	스왑	32,836	0	32,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	31,186	-31,186	장내

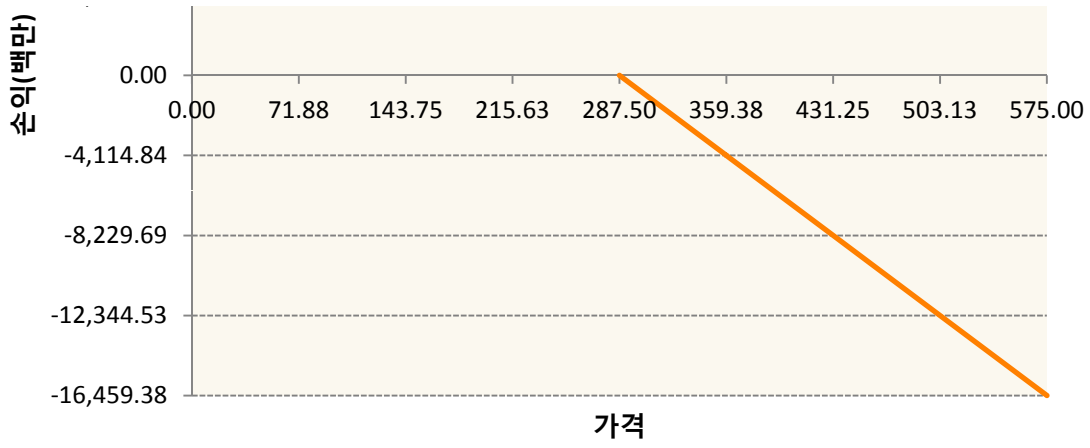
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

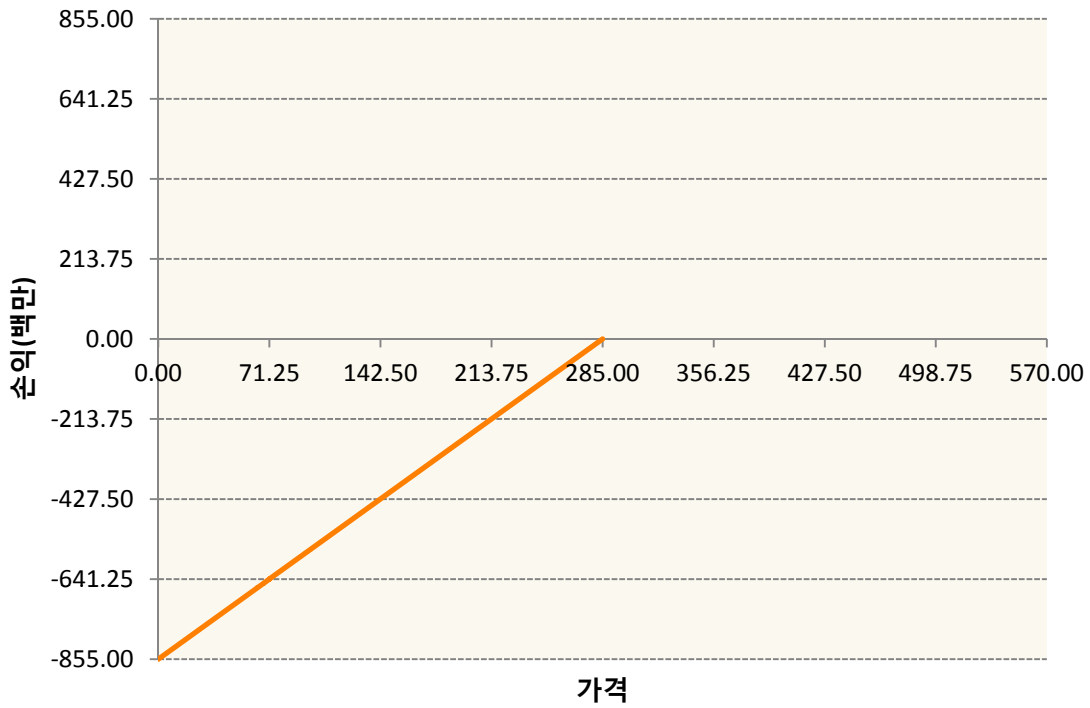


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

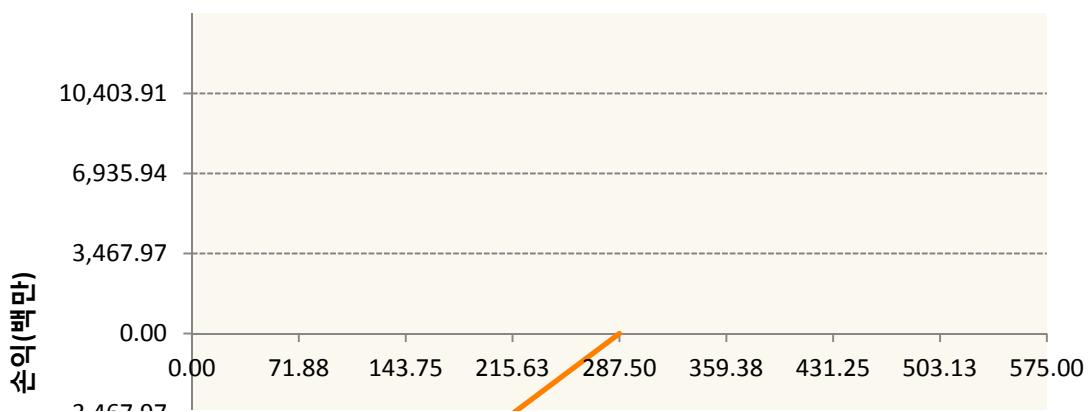


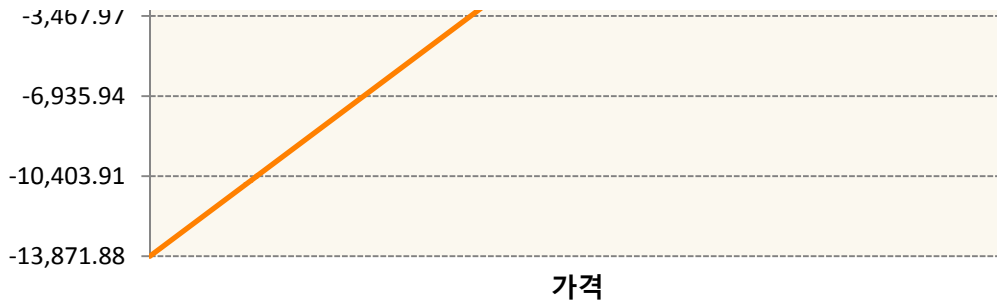


KR4301P52858-2019-05 풋285



KR4301P52874-2019-05 풋287.5





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,206
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,206	-2,206	-2,206	-2,206	-2,206	-2,206	-2,206	
-5.33%	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471	
-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%	1,471	1,471	1,471	1,471	1,471	1,471	1,471	
8.00%	2,206	2,206	2,206	2,206	2,206	2,206	2,206	
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%	-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%	598	598	598	598	598	598	598	
KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						319
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-319	-319	-319	-319	-319	-319	-319	
-5.33%	-213	-213	-213	-213	-213	-213	-213	
-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%	213	213	213	213	213	213	213	
8.00%	319	319	319	319	319	319	319	
KR4201P52876		2019-05 콜287.5						998
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	188	188	188	187	185	183	180
-5.33%	186	184	180	175	169	162	153
-2.67%	163	153	141	127	113	98	82
0%	62	41	21	0	-21	-42	-63
2.67%	-181	-200	-219	-239	-258	-278	-299
5.33%	-548	-556	-566	-578	-590	-604	-619
8.00%	-968	-970	-974	-978	-984	-990	-998
KR4301P52858                      2019-05 풋285							62
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
-5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-2.67%	-16	-16	-17	-17	-17	-17	-18
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	7	7	6	6	6	6	5
5.33%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	7	7	7	7	7	7	7
KR4301P52874                      2019-05 풋287.5							1,040
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,040	-1,040	-1,040	-1,040	-1,040	-1,040	-1,040
-5.33%	-674	-674	-674	-674	-674	-674	-675
-2.67%	-308	-309	-310	-311	-313	-316	-319
0%	24	16	8	0	-8	-17	-25
2.67%	171	166	160	154	147	140	133
5.33%	184	184	184	183	182	180	178
8.00%	185	185	185	185	184	184	184

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

(단위:백만원)

**5,575**

공시일	2019-05-02
기준일	2019-04-30

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

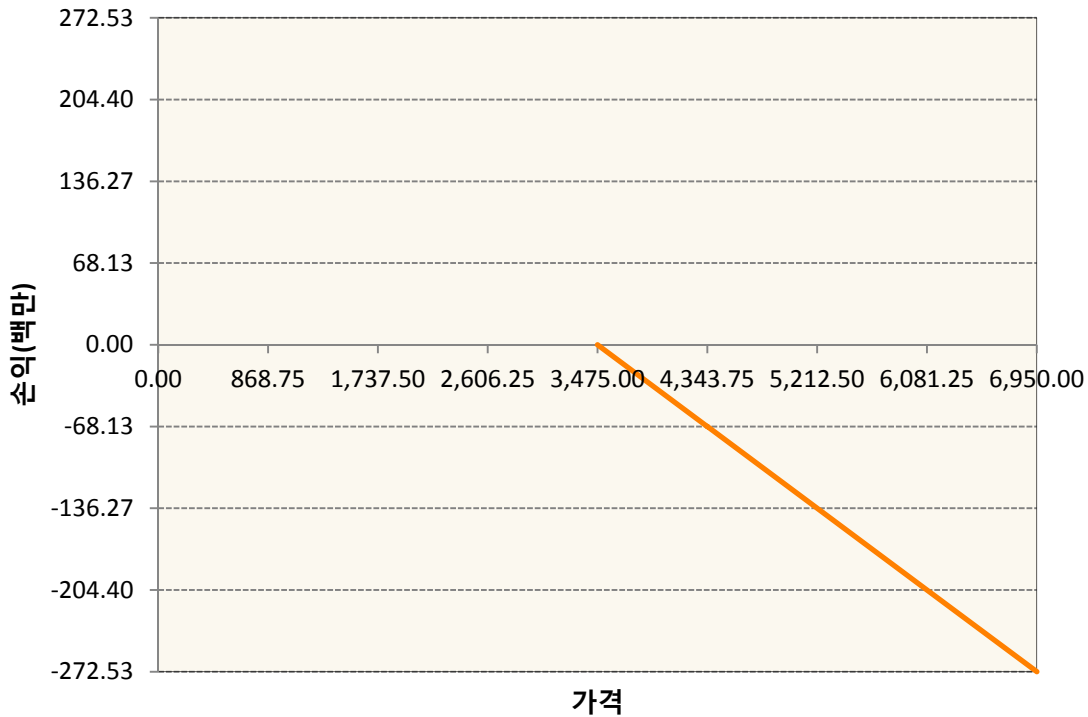
### 1. 계약금액

(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	1,591	0	1,591	
누계	유가증권	스왑	64,394	0	64,394	장외
누계	유가증권	옵션	0	17,472	-17,472	장내
누계	통화	선도	0	18,299	-18,299	장외

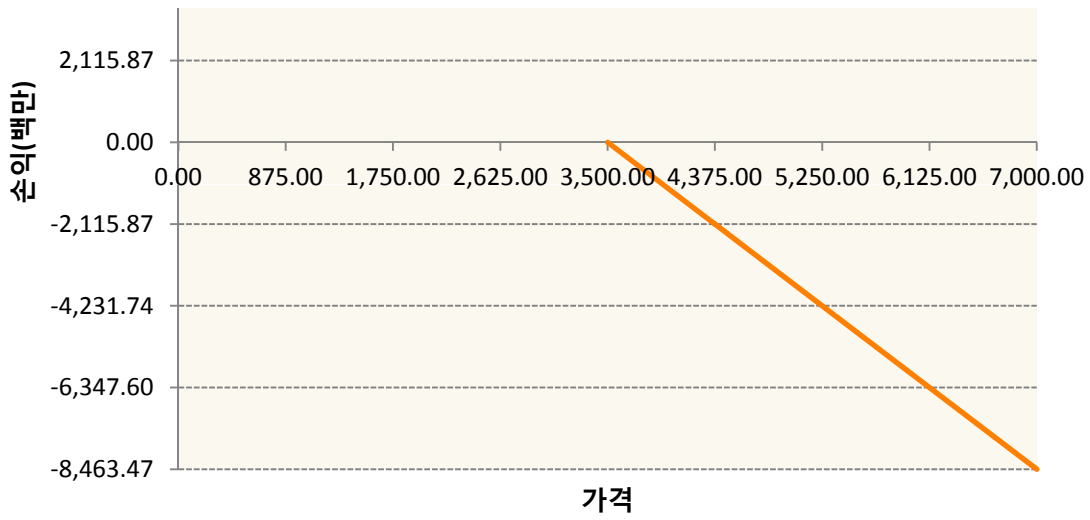
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXK9-C3475-EURO STOXX 50

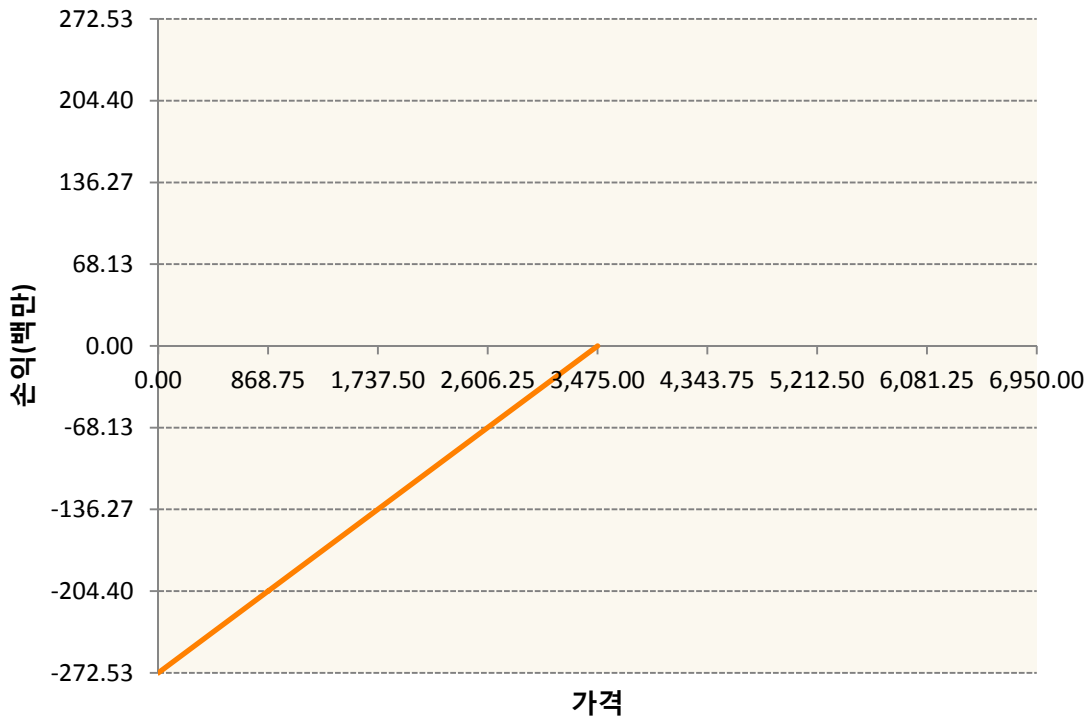


OESXK9-C3500-EURO STOXX 50

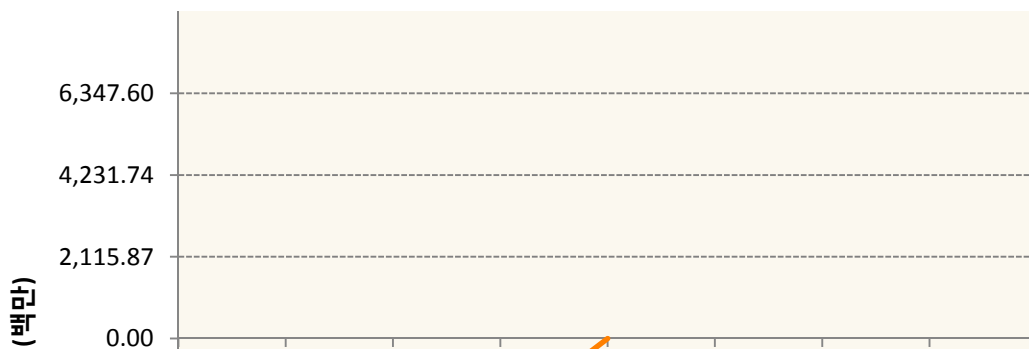


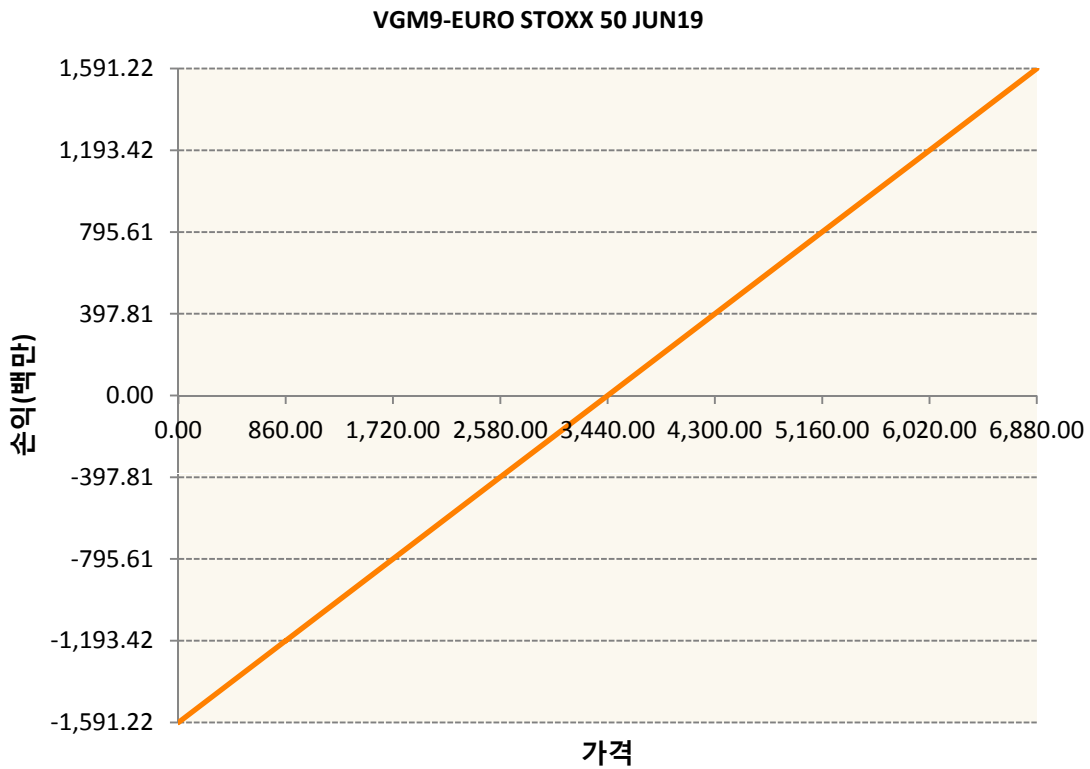
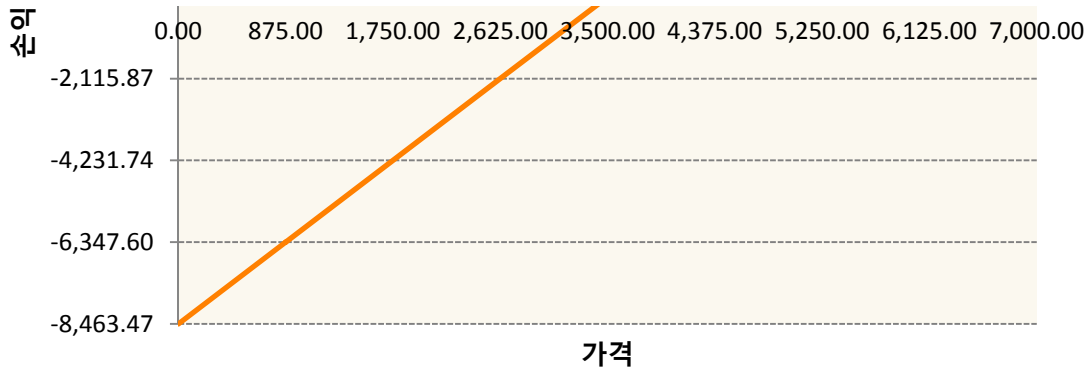


OESXK9-P3475-EURO STOXX 50



OESXK9-P3500-EURO STOXX 50





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	10
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	418
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	837
FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E	209
OESXK9-C34 EURO STOXX 50	22
OESXK9-C35 EURO STOXX 50	677
OESXK9-P34 EURO STOXX 50	22
OESXK9-P35 EURO STOXX 50	677
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	127

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

(단위:백만원)

1,835



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

(단위:백만원)

1,102



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

(단위:백만원)

94



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

(단위:백만원)

137

공시일	2019-05-02
기준일	2019-04-30

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

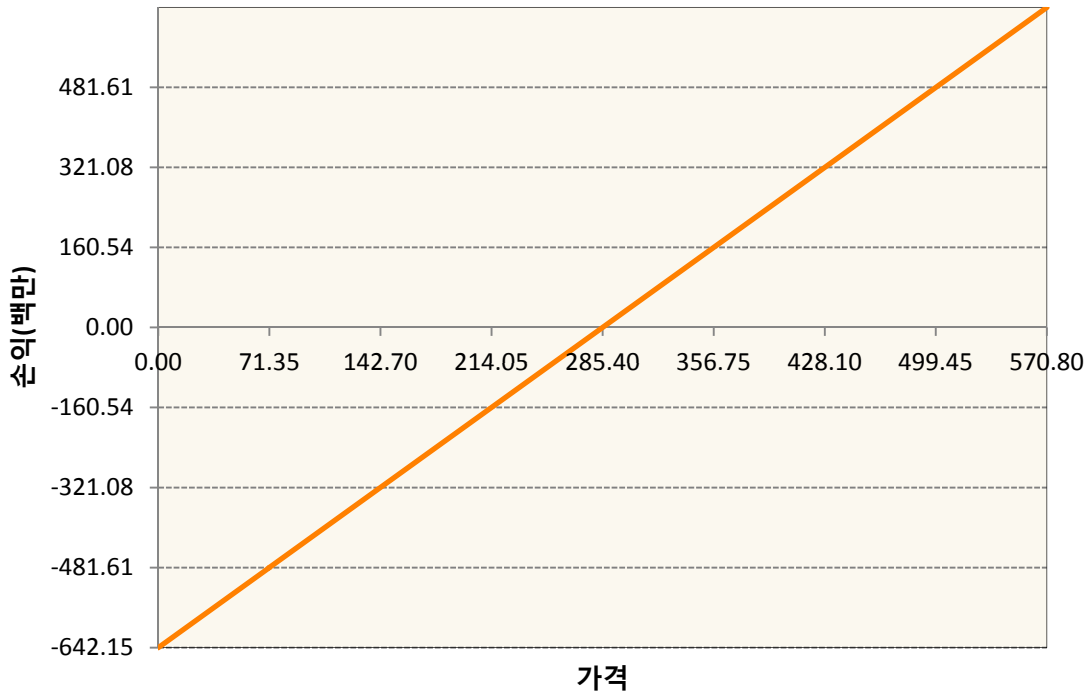
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	642	0	642	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	2019-05-02
기준일	2019-04-30

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

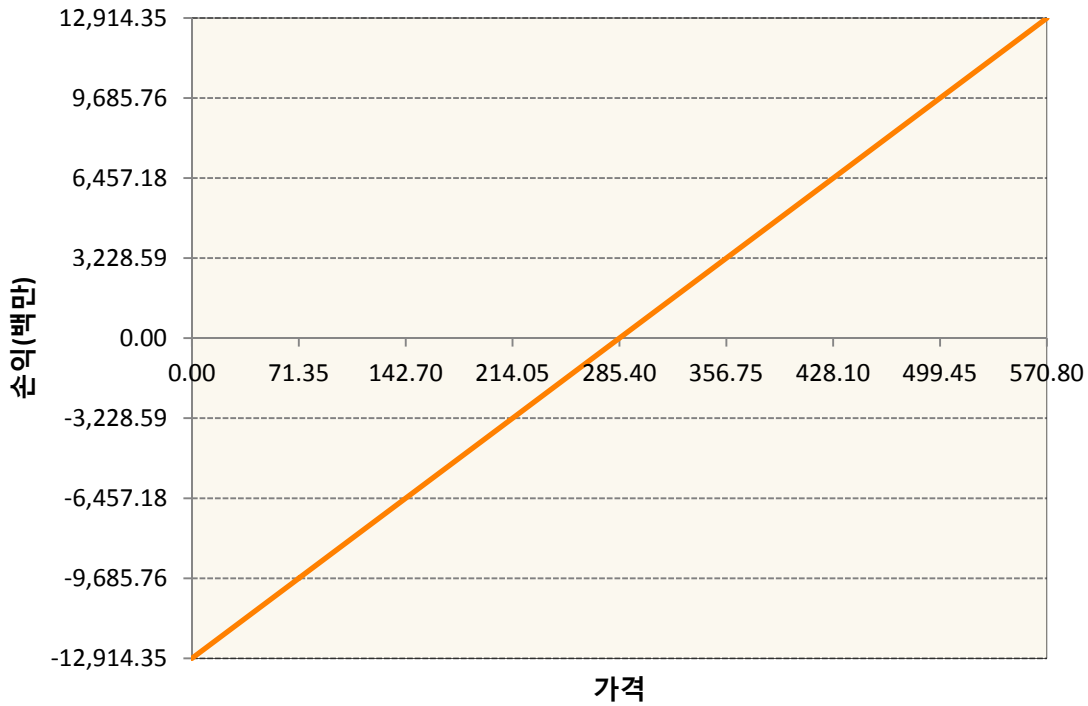
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

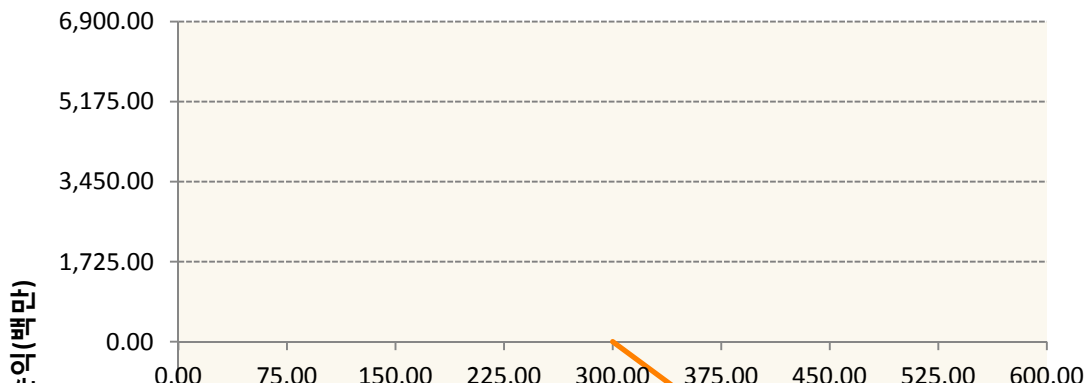
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,914	0	12,914	장내
누계	유가증권	옵션	1,366	24,294	-22,928	장내

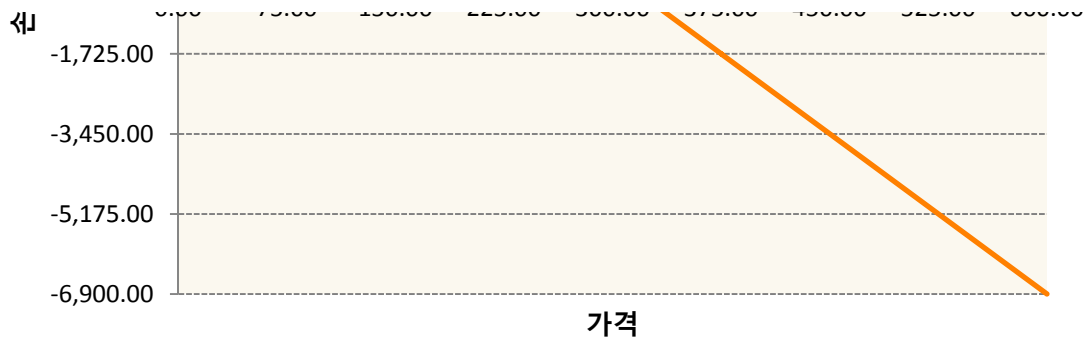
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

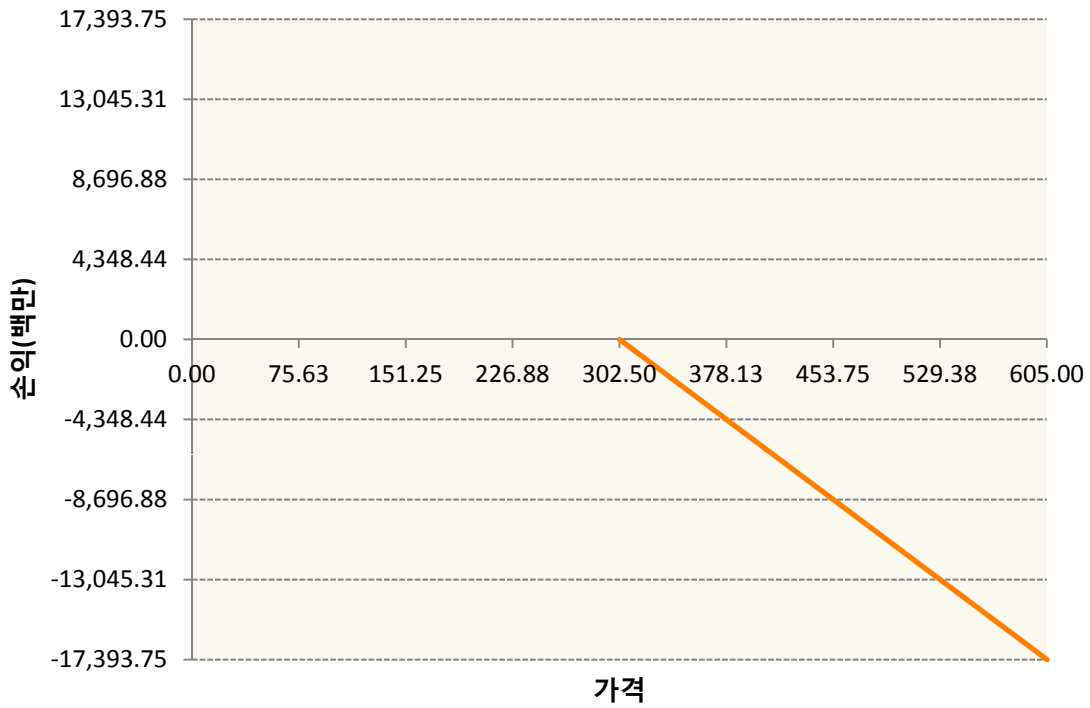


KR4201P53007-2019-05 콜300

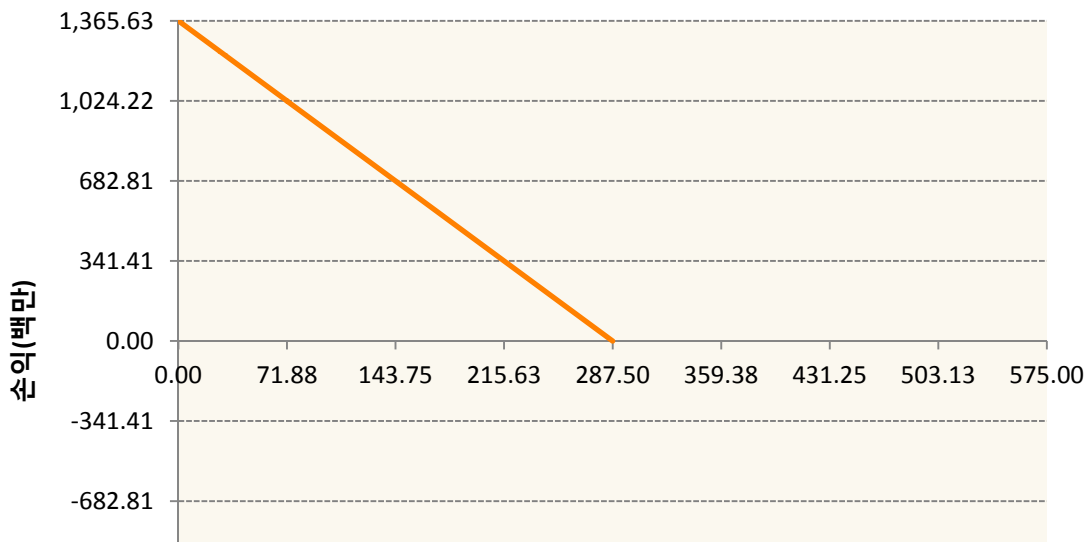


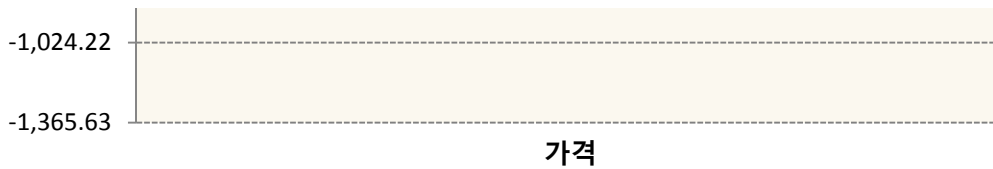


**KR4201P53023-2019-05 콜302.5**



**KR4301P52874-2019-05 풋287.5**





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

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						1,031
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,031	-1,031	-1,031	-1,031	-1,031	-1,031	-1,031	
-5.33%	-688	-688	-688	-688	-688	-688	-688	
-2.67%	-344	-344	-344	-344	-344	-344	-344	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	344	344	344	344	344	344	344	
5.33%	688	688	688	688	688	688	688	
8.00%	1,031	1,031	1,031	1,031	1,031	1,031	1,031	
KR4201P53007		2019-05 콜300						231
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	12	12	12	12	11	11	11	
-5.33%	12	12	11	11	11	11	10	
-2.67%	11	11	10	9	8	6	4	
0%	8	6	3	0	-4	-8	-13	
2.67%	-10	-16	-23	-30	-37	-45	-53	
5.33%	-70	-79	-88	-97	-106	-115	-124	
8.00%	-187	-194	-201	-208	-216	-223	-231	
KR4201P53023		2019-05 콜302.5						494
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%	18	18	18	18	17	17	16	
-2.67%	18	17	17	15	13	10	6	
0%	14	11	6	0	-7	-16	-26	
2.67%	-13	-26	-40	-55	-70	-87	-104	
5.33%	-123	-145	-167	-189	-211	-233	-256	
8.00%	-370	-390	-410	-431	-451	-473	-494	
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%	30	30	31	31	31	31	31	

0%	-2	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-17	-16	-16	-15	-15	-14	-13
5.33%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
8.00%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18

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

(단위:백만원)

**1,364**

공시일	2019-05-02
기준일	2019-04-30

## 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	4,367	0	4,367	

### 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	2019-05-02
기준일	2019-04-30

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,519	0	1,519	
누계	유가증권	수익증권	75,461	0	75,461	

### 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	2019-05-02
기준일	2019-04-30

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,505	0	3,505	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	151,801	0	151,801	
누계	통화	선도	0	163,653	-163,653	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E		47
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		103
FX21019J003 KRW/USD 10-05-19E		159
FX21019J004 KRW/USD 10-05-19E		75
FX21019J005 KRW/USD 10-05-19E		280
FX21019J006 KRW/USD 10-05-19E		234
FX21019J007 KRW/USD 10-05-19E		75
FX21019J012 KRW/USD 20-05-19E		131
FX21019J012 KRW/USD 20-05-19E		19
FX21019J013 KRW/USD 20-05-19E		140
FX21019J014 KRW/USD 20-05-19E		140
FX21019J015 KRW/USD 17-05-19E		1,308
FX21019J015 KRW/USD 17-05-19E		1,402
FX21019J015 KRW/USD 18-06-19E		374
FX21019J020 KRW/USD 20-05-19E		505
FX21019J021 KRW/USD 20-05-19E		475
FX21019J022 KRW/USD 24-06-19E		935
FX21019J022 KRW/USD 22-05-19E		785
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		935
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		991
FX21019J032 KRW/USD 26-06-19E		374
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		75
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		983
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E		1,009

FX21019J041 KRW/USD 28-05-19E  
FX21019J042 KRW/USD 03-06-19E  
FX21019J044 KRW/USD 03-06-19E

280
561
467

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

(단위:백만원)

<b>4,504</b>
--------------

공시일	2019-05-02
기준일	2019-04-30

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

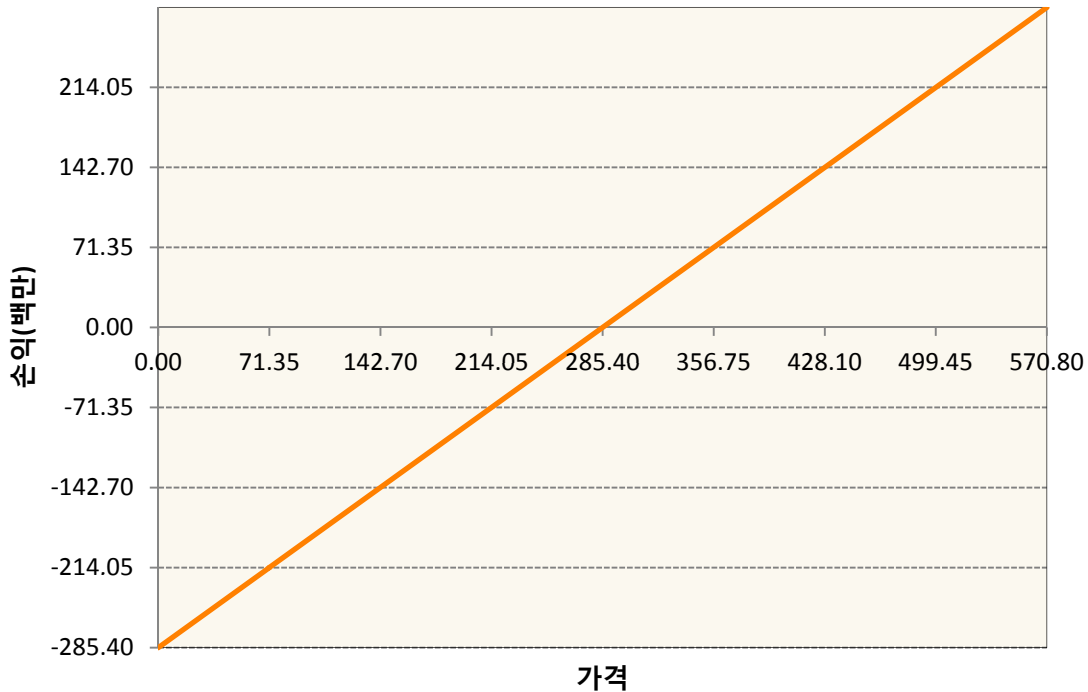
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

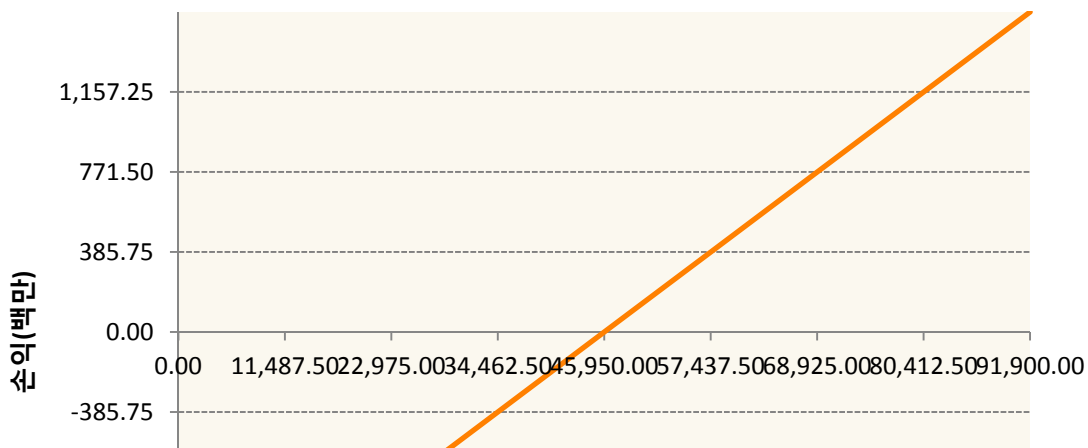
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,828	0	1,828	장내

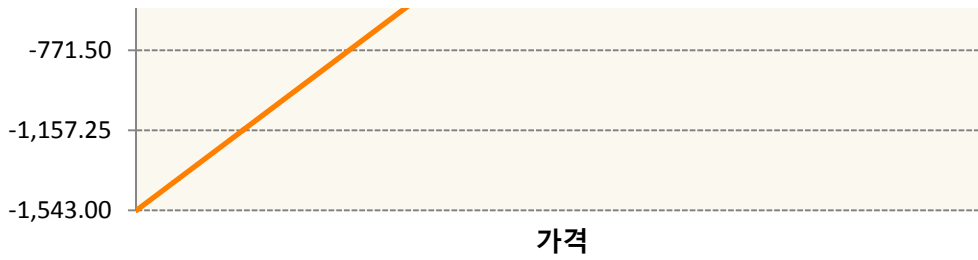
### 2. 만기시점의 손익구조

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						123
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123	
-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%	123	123	123	123	123	123	123	

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

**161**

공시일	2019-05-02
기준일	2019-04-30

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

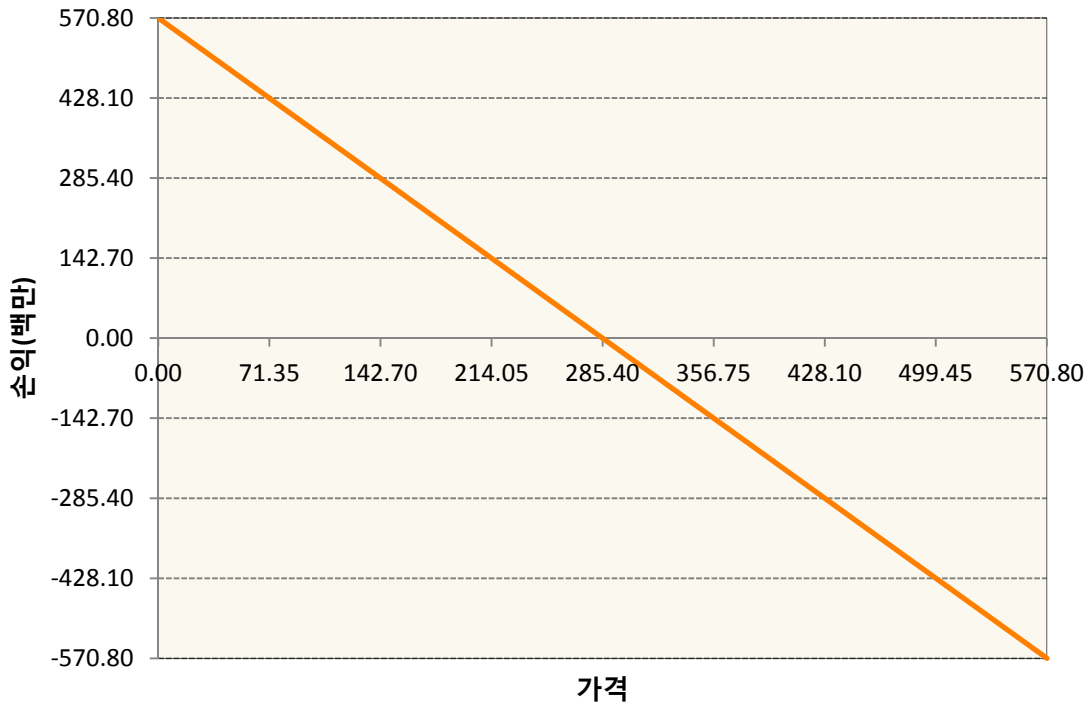
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

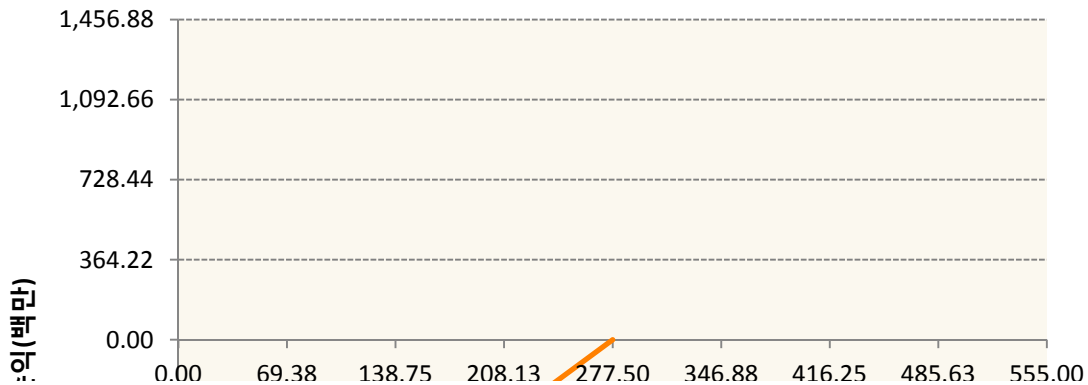
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	571	-571	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,067	-3,067	장내

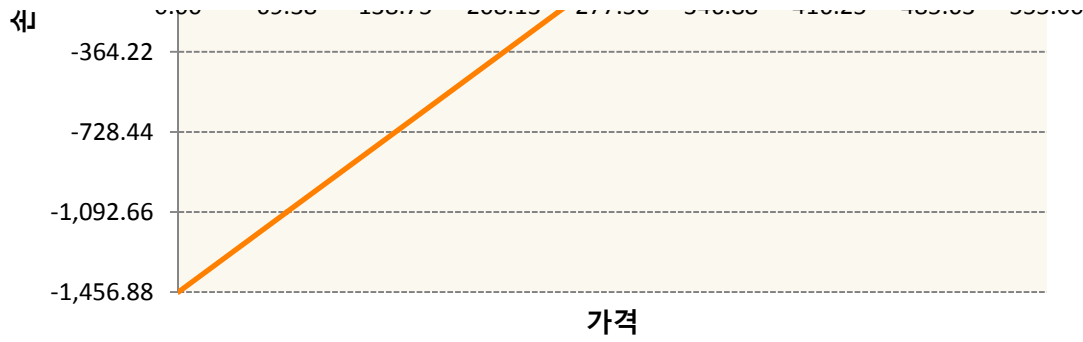
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

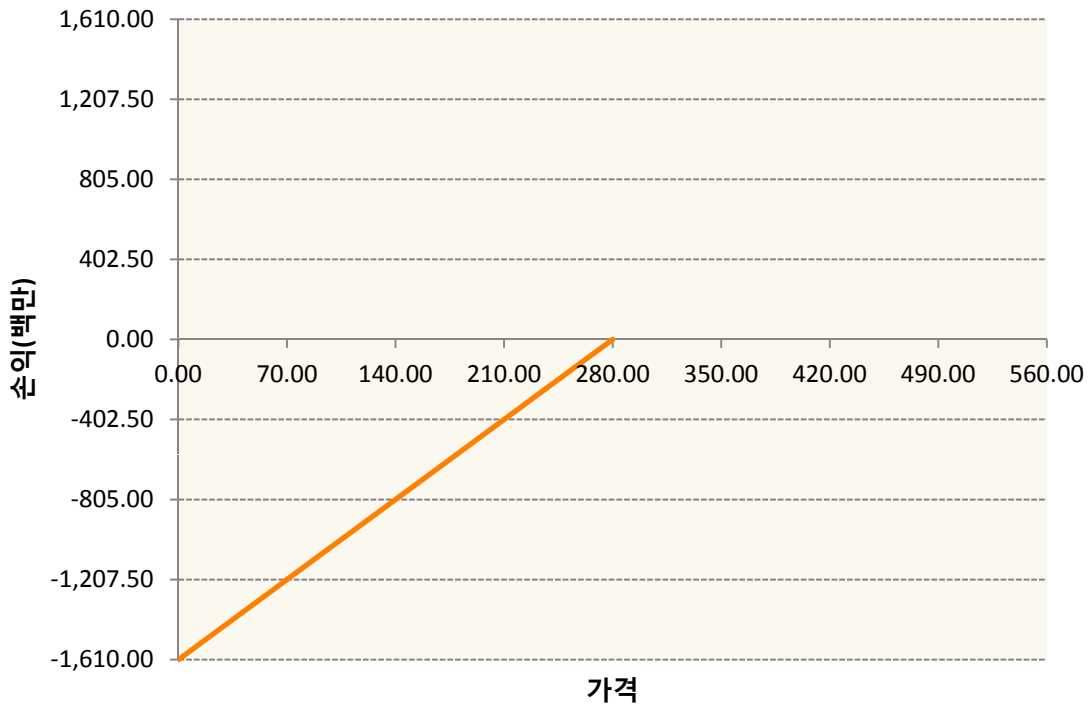


KR4301P52775-2019-05 풋277.5





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%	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%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46	
KR4301P52775		2019-05 풋277.5						80
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-79	-79	-79	-80	-80	-80	-80
-5.33%	-40	-40	-40	-41	-41	-41	-42
-2.67%	-8	-9	-10	-11	-12	-13	-14
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

KR4301P52809

2019-05 풋280

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%	-56	-56	-56	-56	-56	-57	-57
-2.67%	-16	-17	-18	-19	-20	-20	-21
0%	2	1	1	0	-1	-2	-2
2.67%	3	3	3	3	3	3	3
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

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

(단위:백만원)

**203**

공시일	2019-05-02
기준일	2019-04-30

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

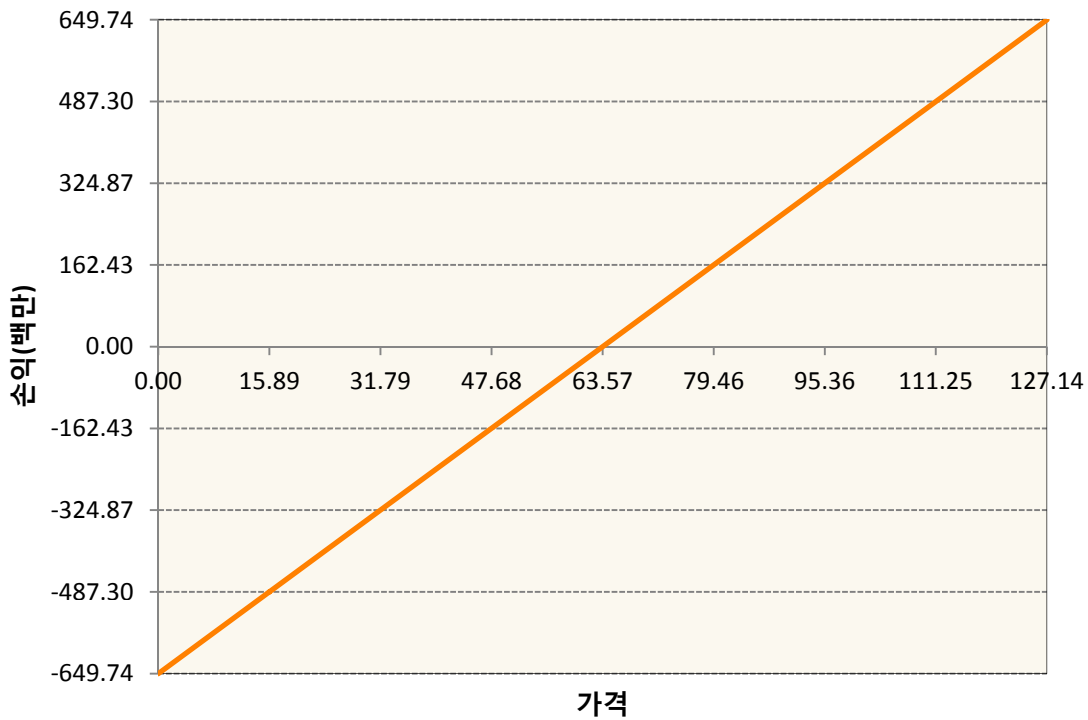
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

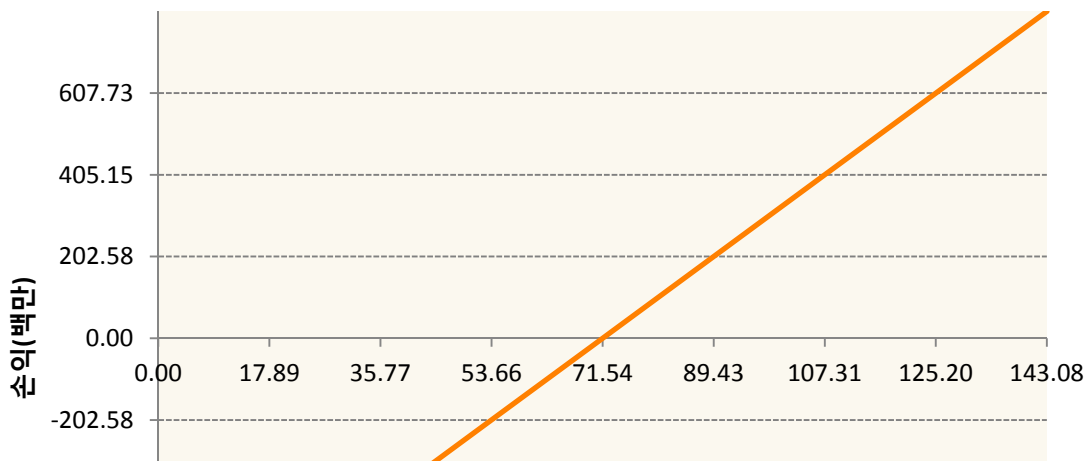
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,889	292	2,597	

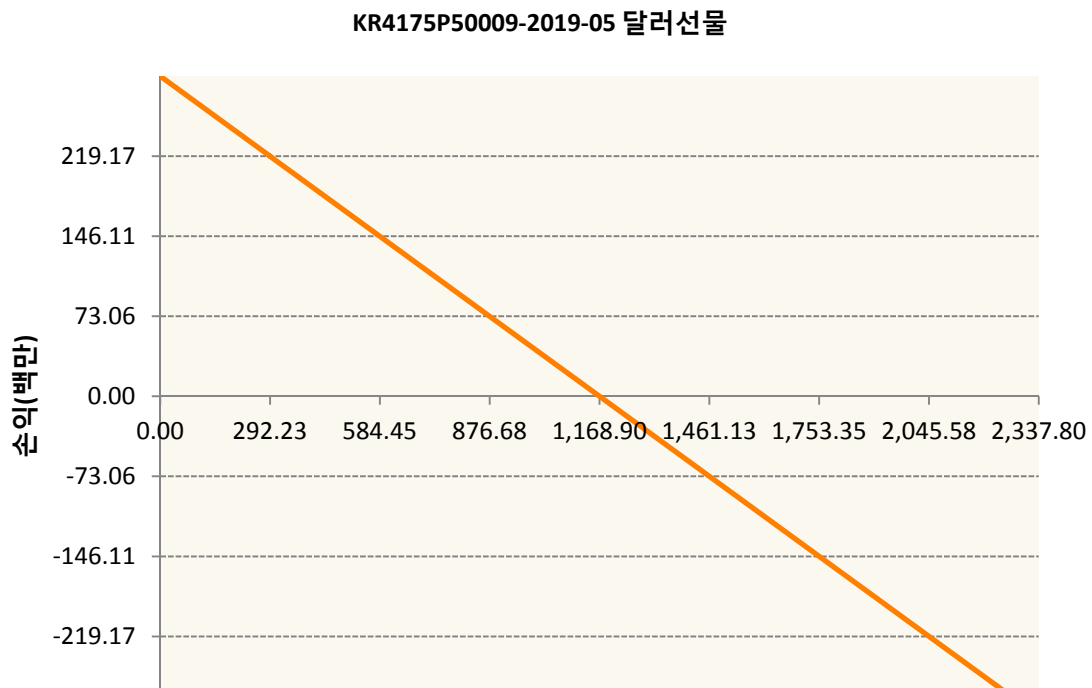
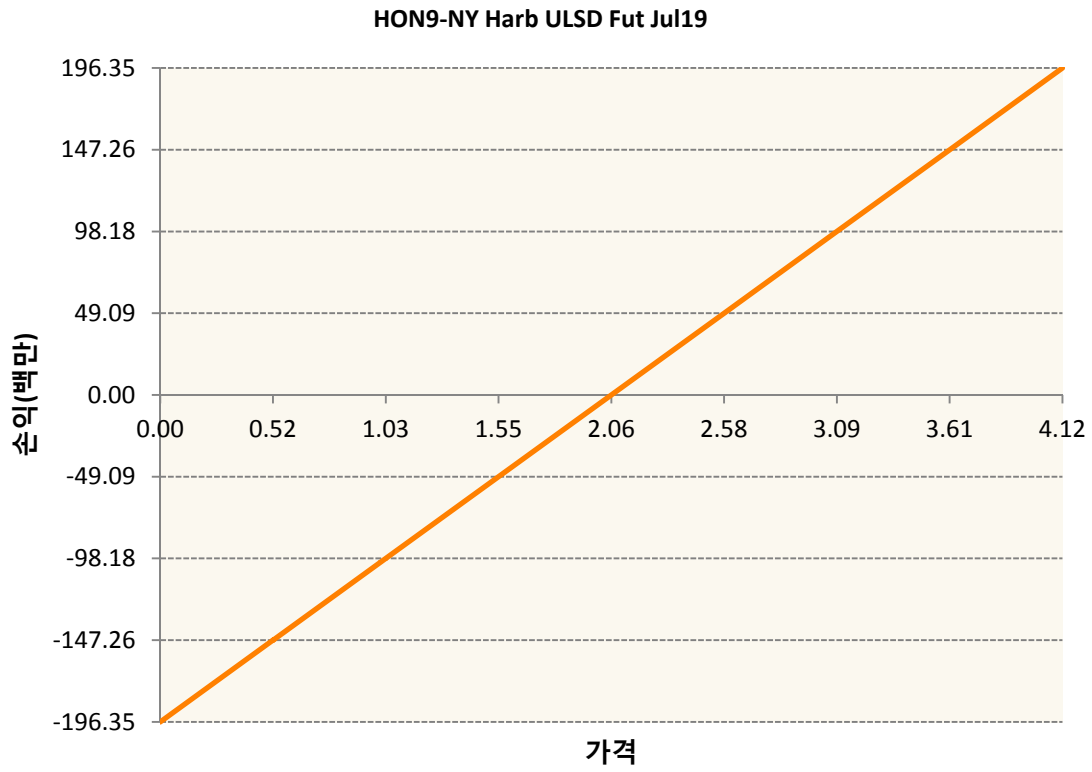
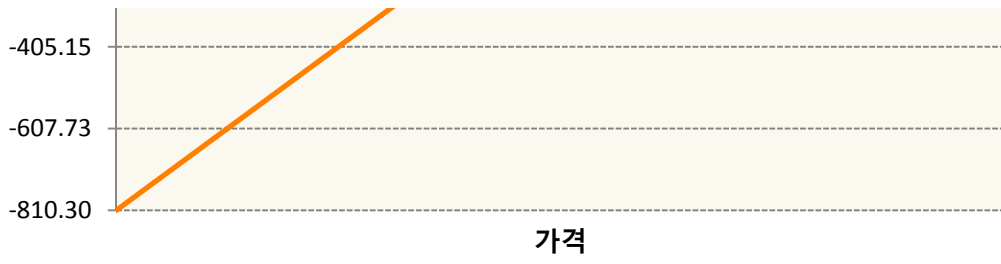
### 2. 만기시점의 손익구조

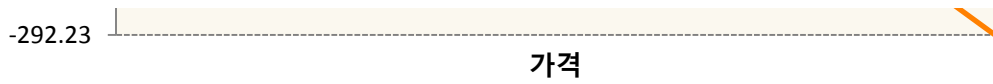
CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19



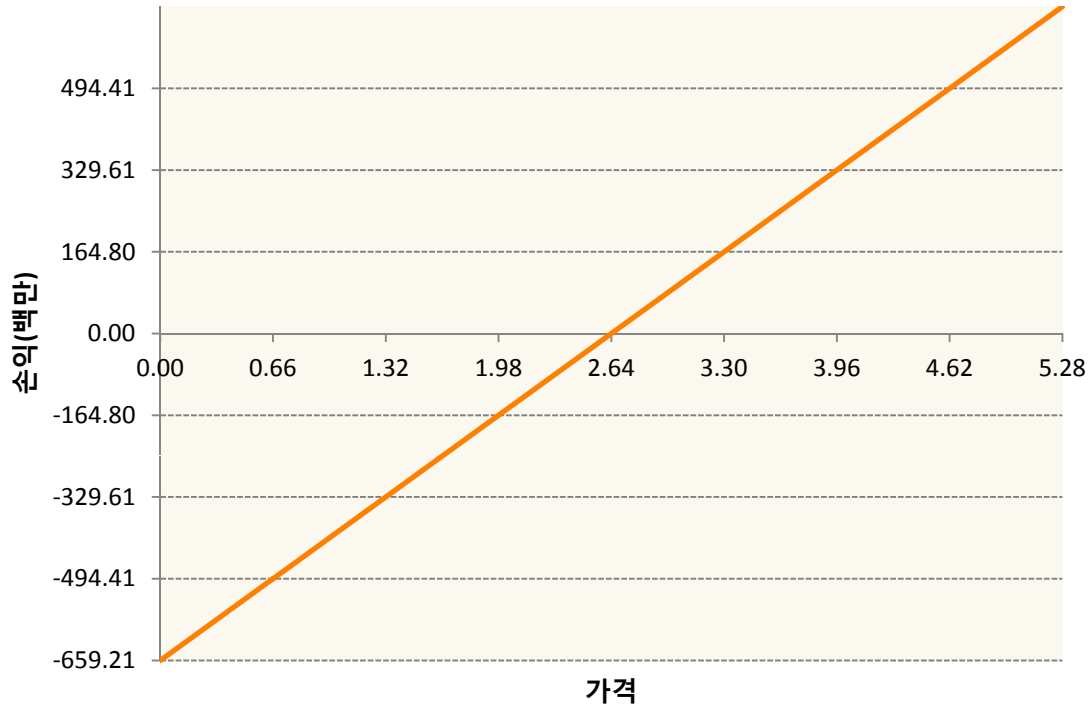
CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19



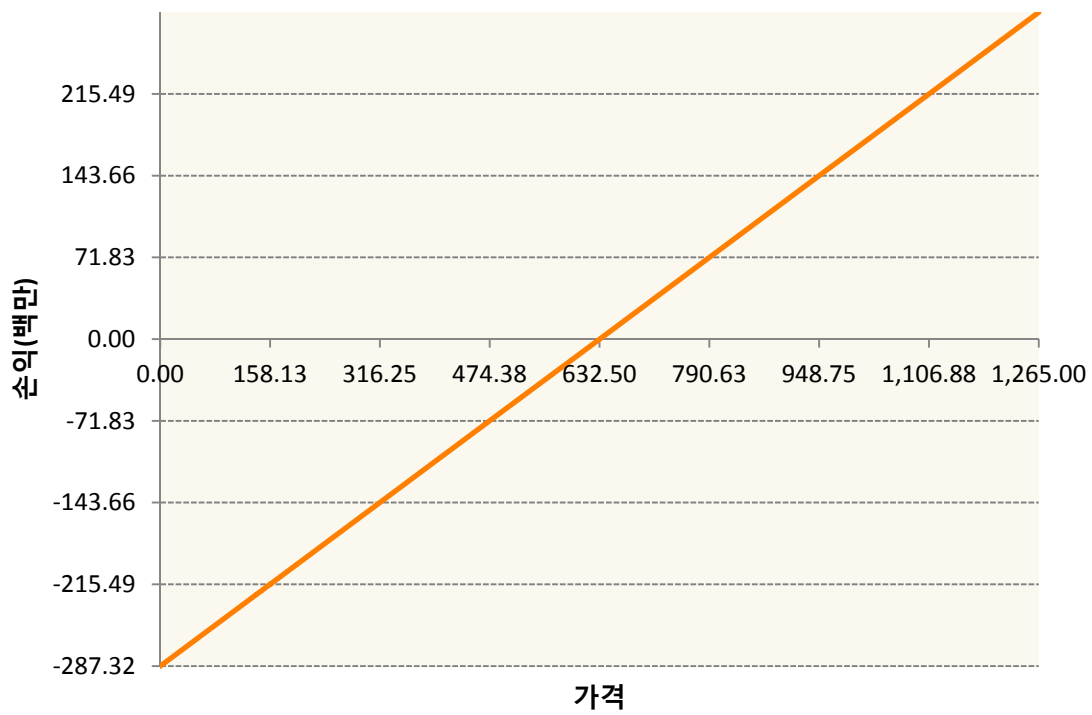




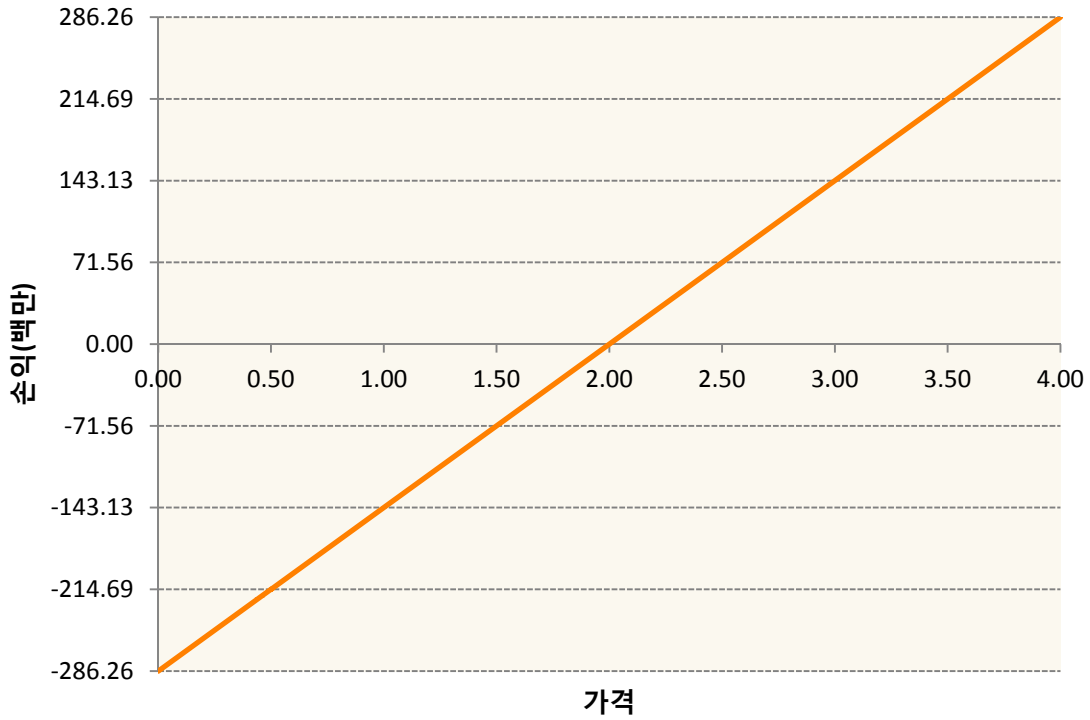
NGN19-NATURAL GAS FUTR Jul19



QSN9-Low Su Gasoil G Jul19



XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN9	WTI CRUDE FUTURE Jul19	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)

428

공시일	2019-05-02
기준일	2019-04-30

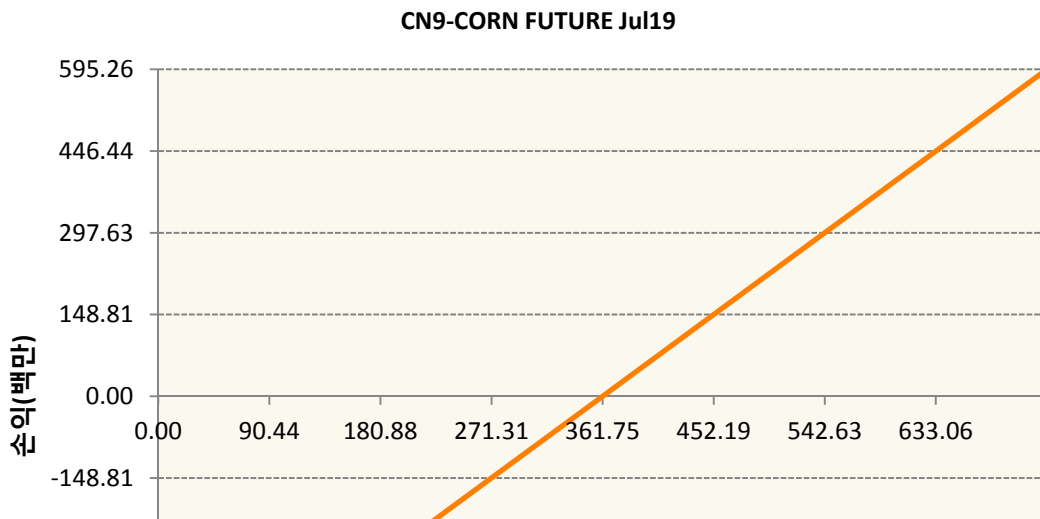
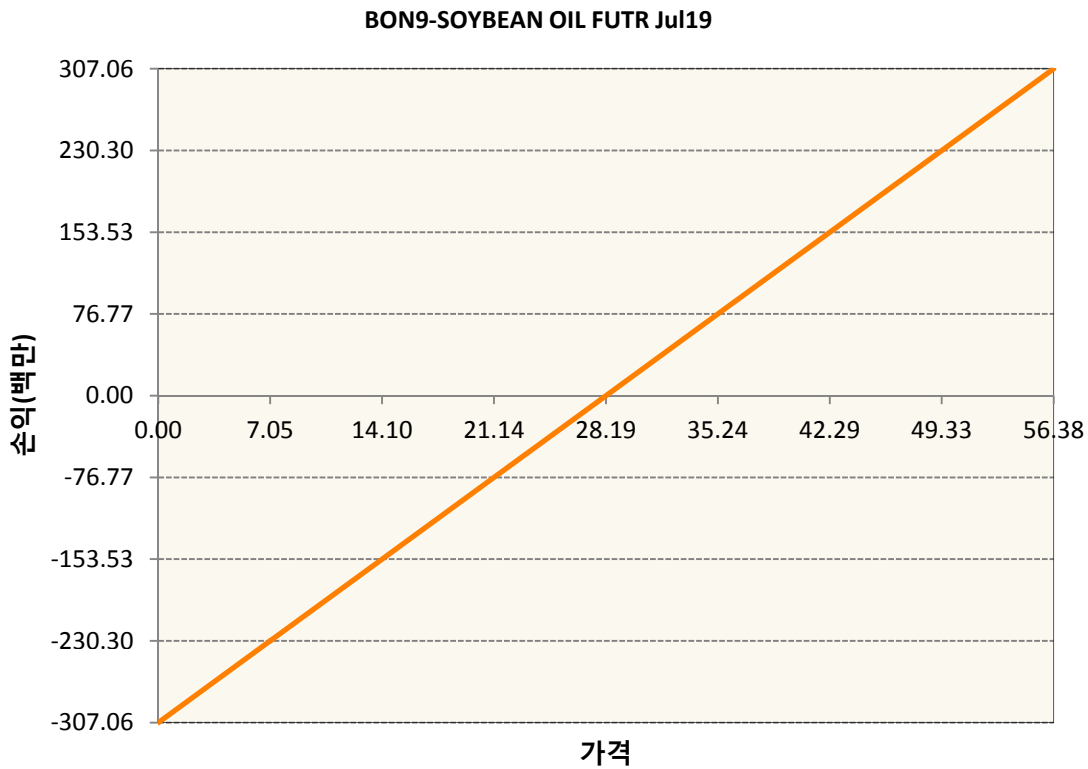
## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

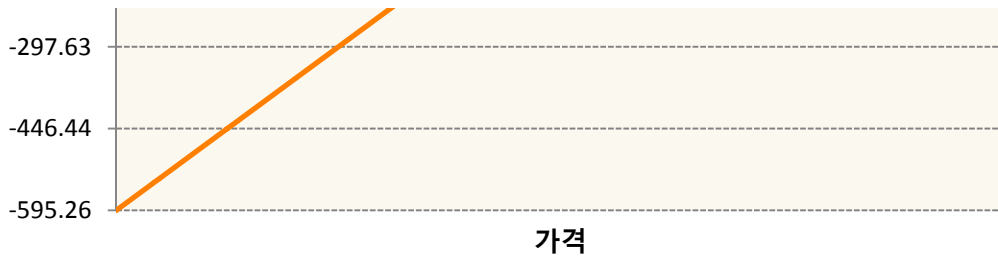
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

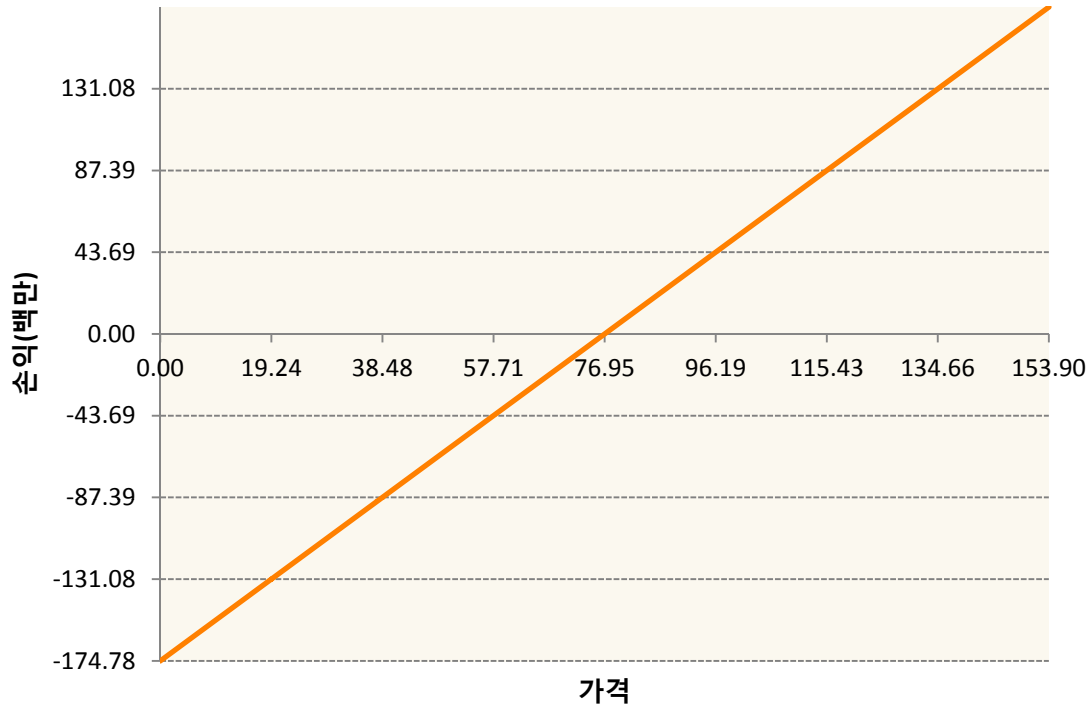
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,038	58	2,980	

### 2. 만기시점의 손익구조

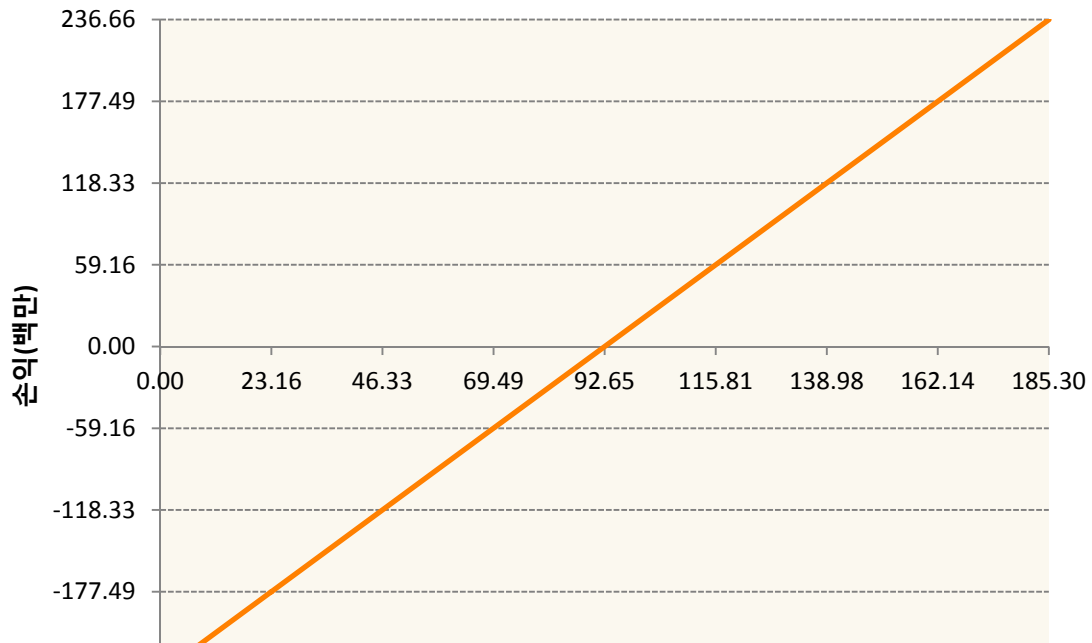


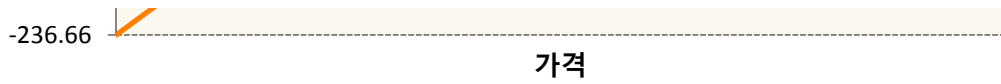


CTN9-COTTON NO.2 FUTR Jul19

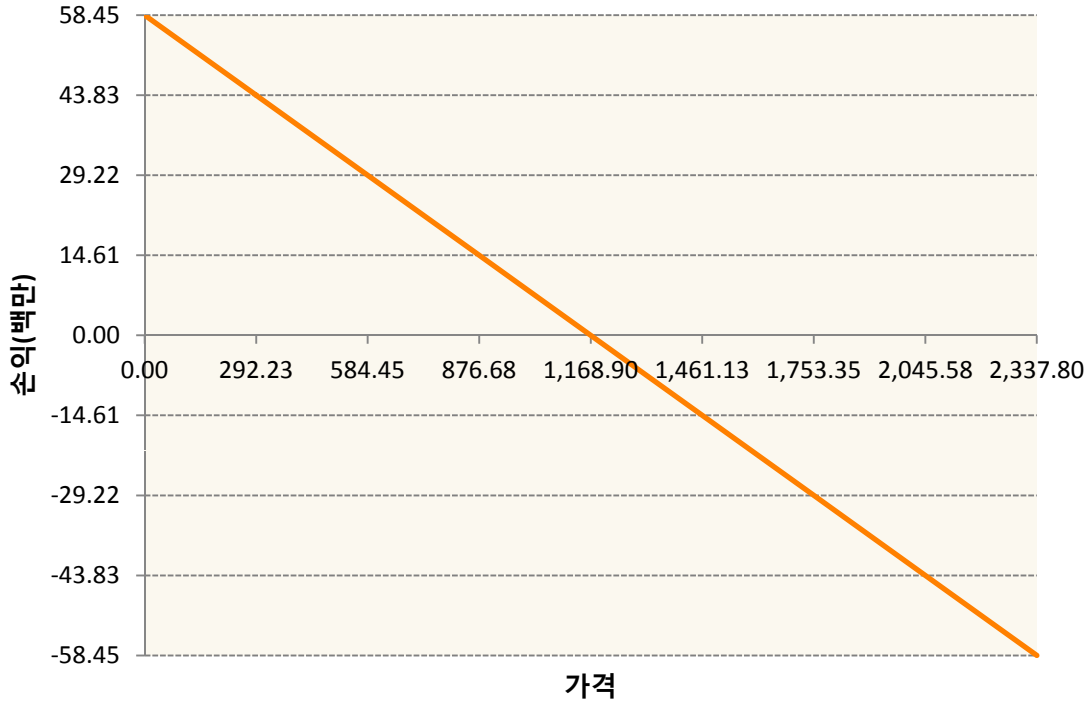


KCN9-COFFEE 'C' FUTURE Jul19

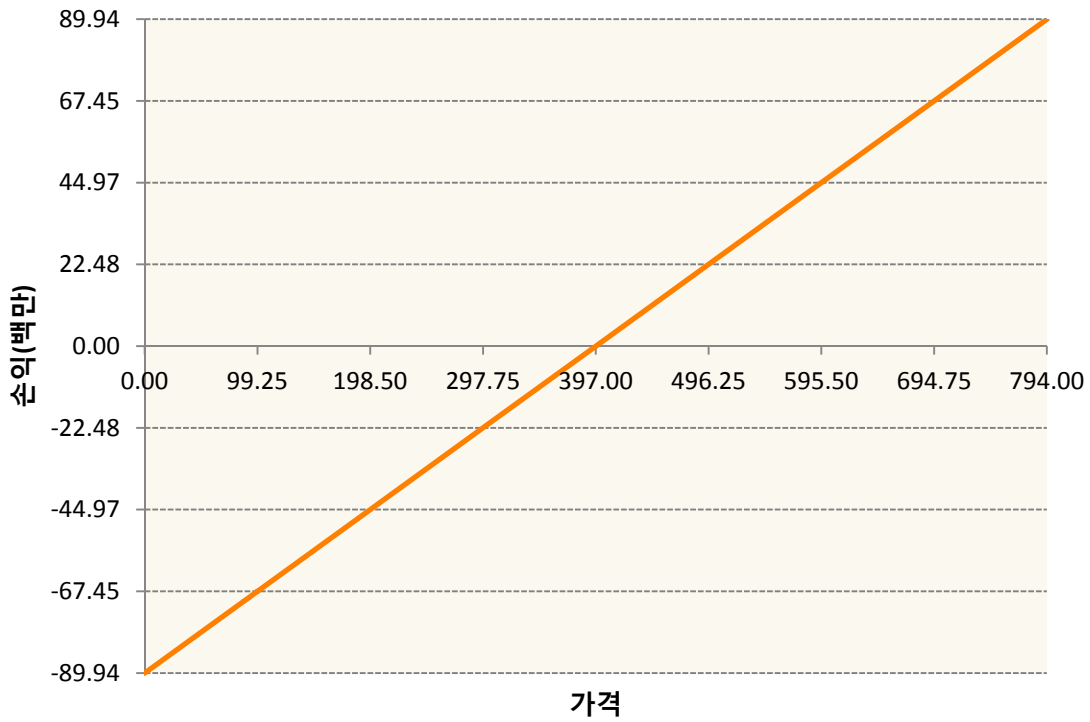




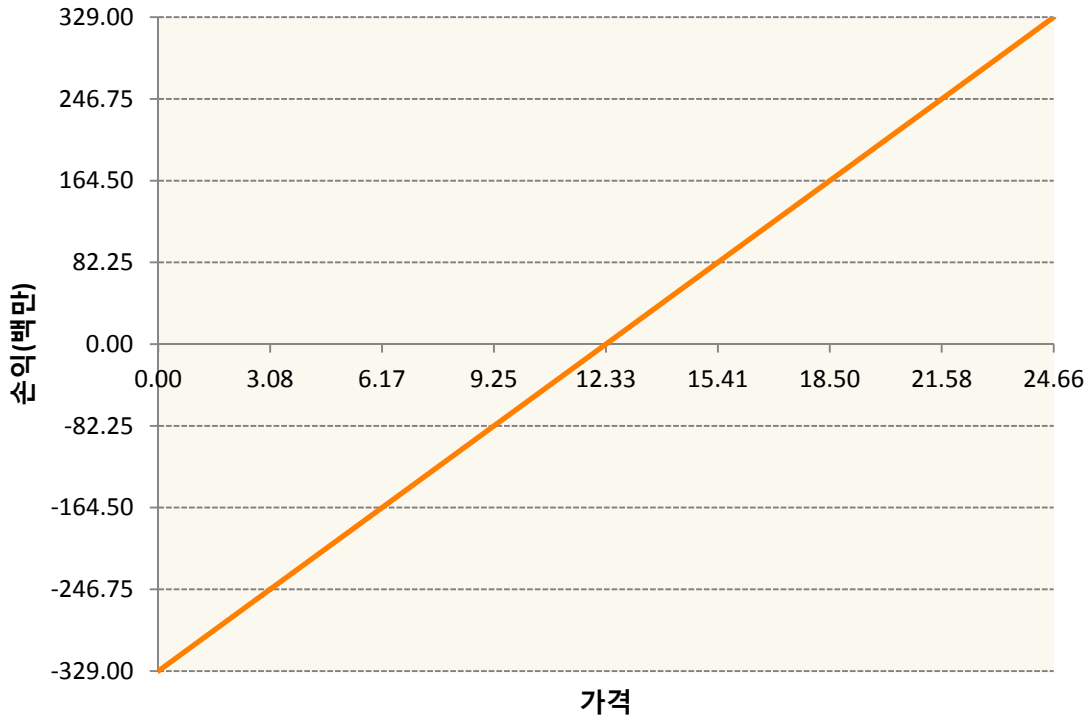
KR4175P50009-2019-05 달러선물



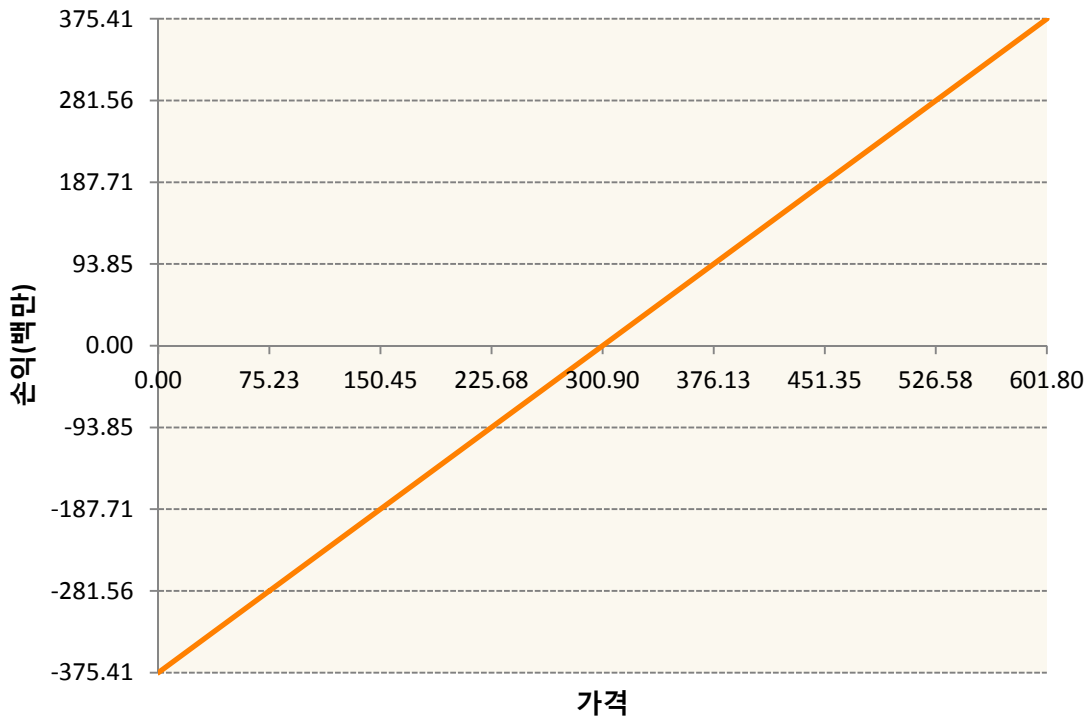
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

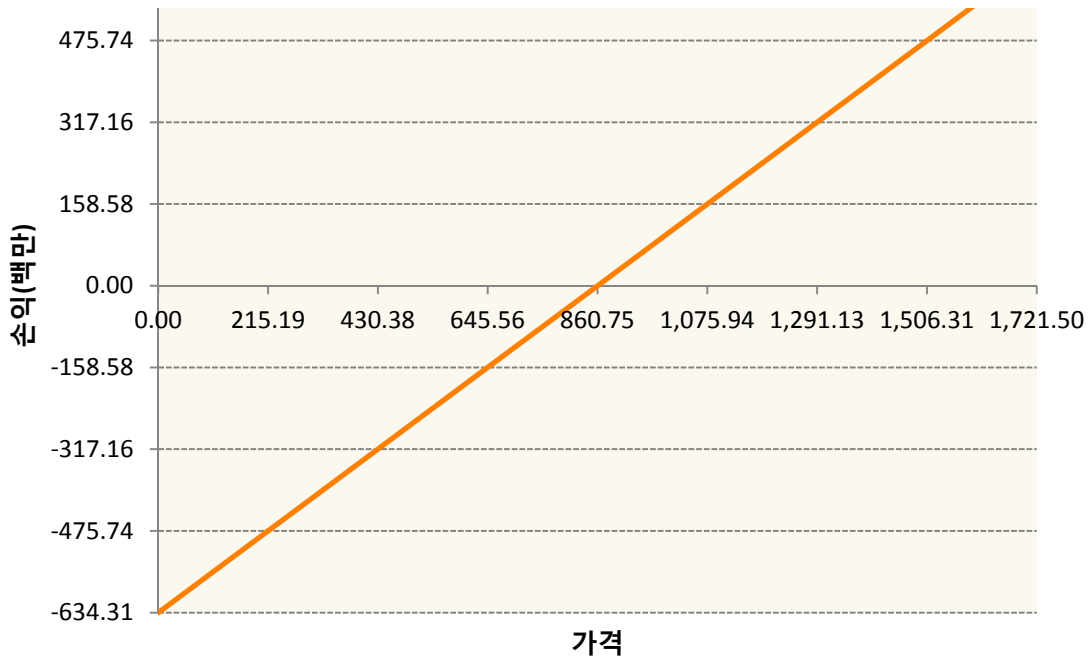


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19

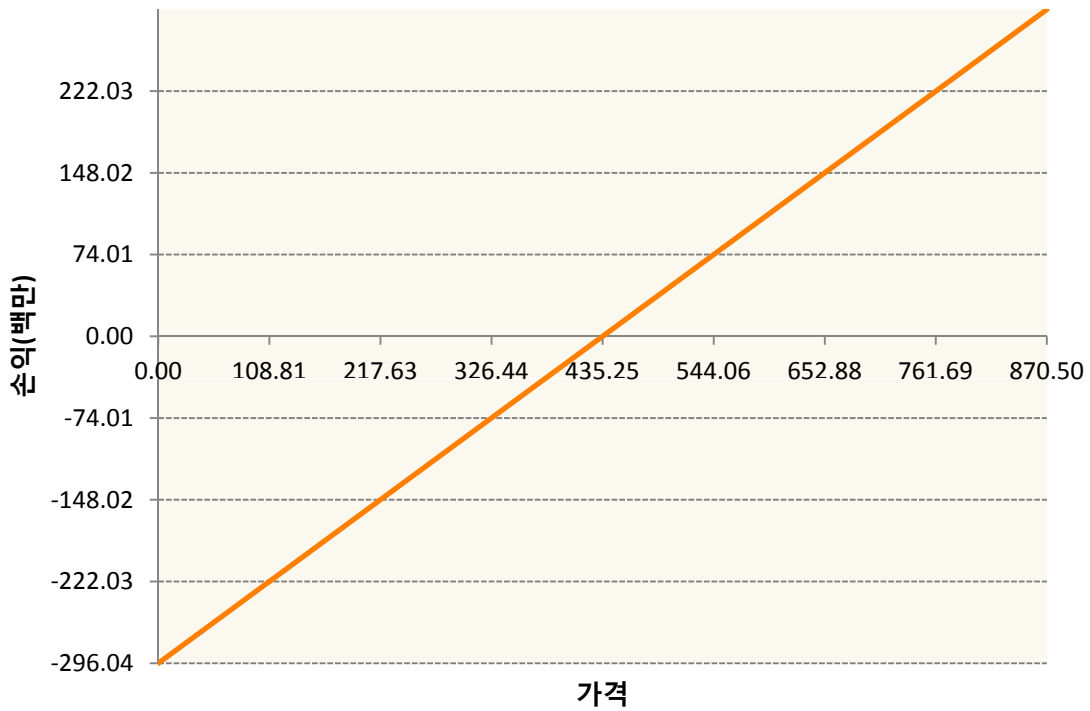


SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





WN9-WHEAT FUTURE(CBT) Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON9	SOYBEAN OIL FUTR Jul19	25
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	26
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)

**244**