

공시일	2019-05-03
기준일	2019-05-02

## 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)

95

공시일	2019-05-03
기준일	2019-05-02

## 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

1,164

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

683

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-05-03
기준일	2019-05-02

## 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)	330
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>917</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-05-03
기준일	2019-05-02

## 유로인덱스모(주식-파생형)

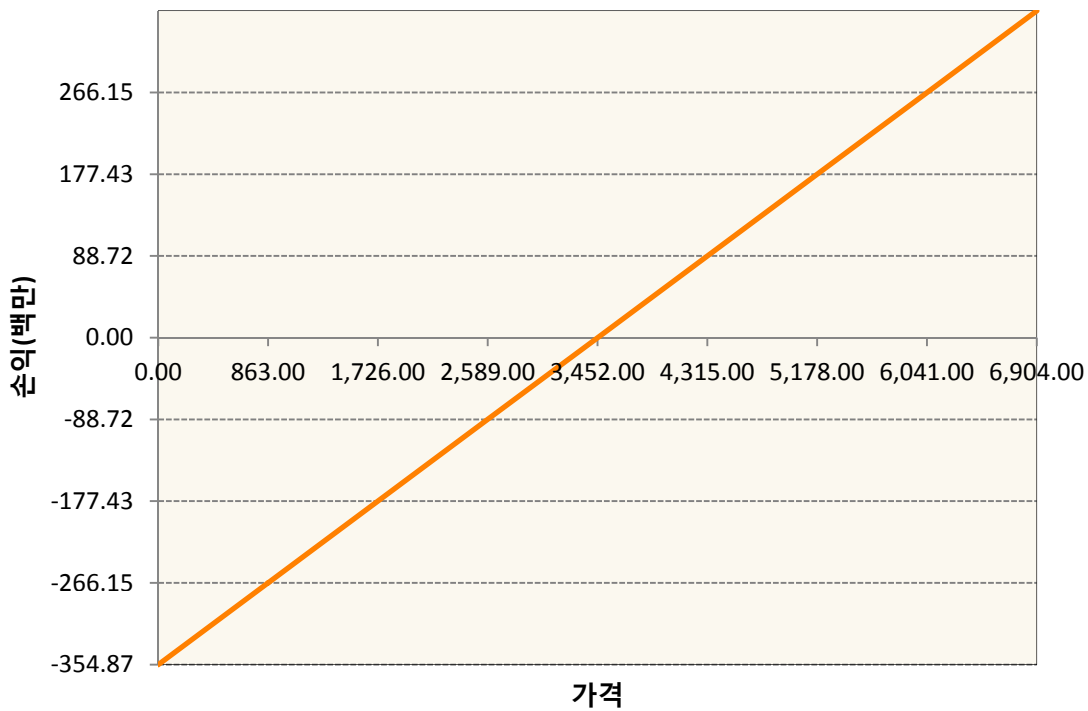
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	355	0	355	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	28
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

20
----

공시일	2019-05-03
기준일	2019-05-02

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

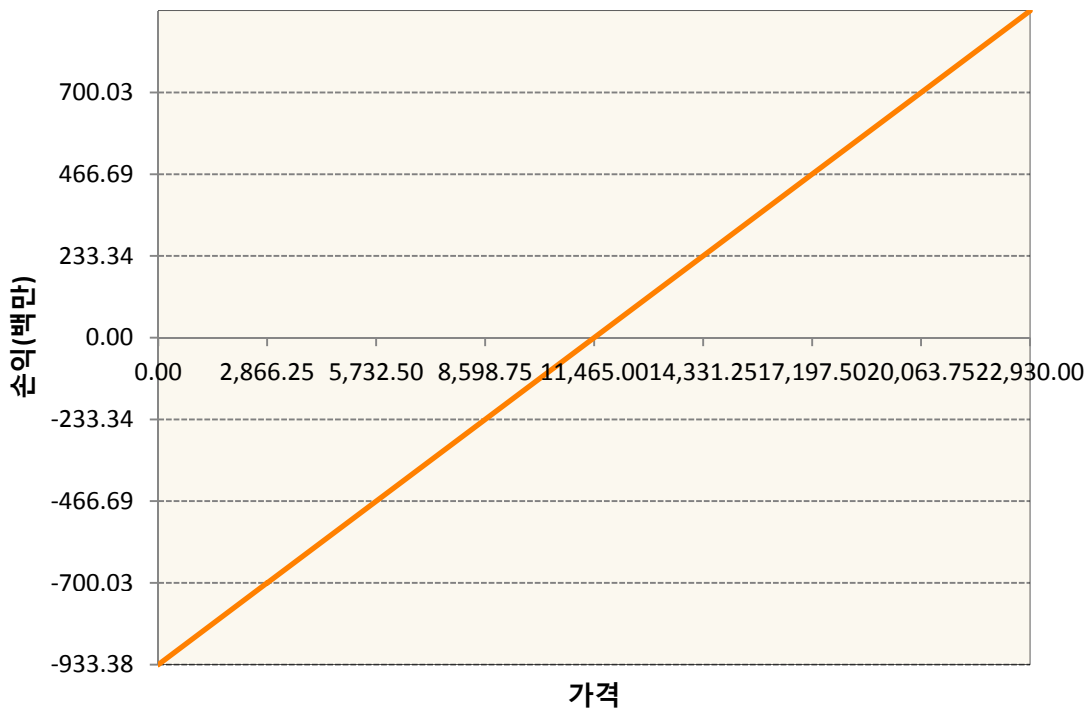
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	933	0	933	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	2019-05-03
기준일	2019-05-02

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

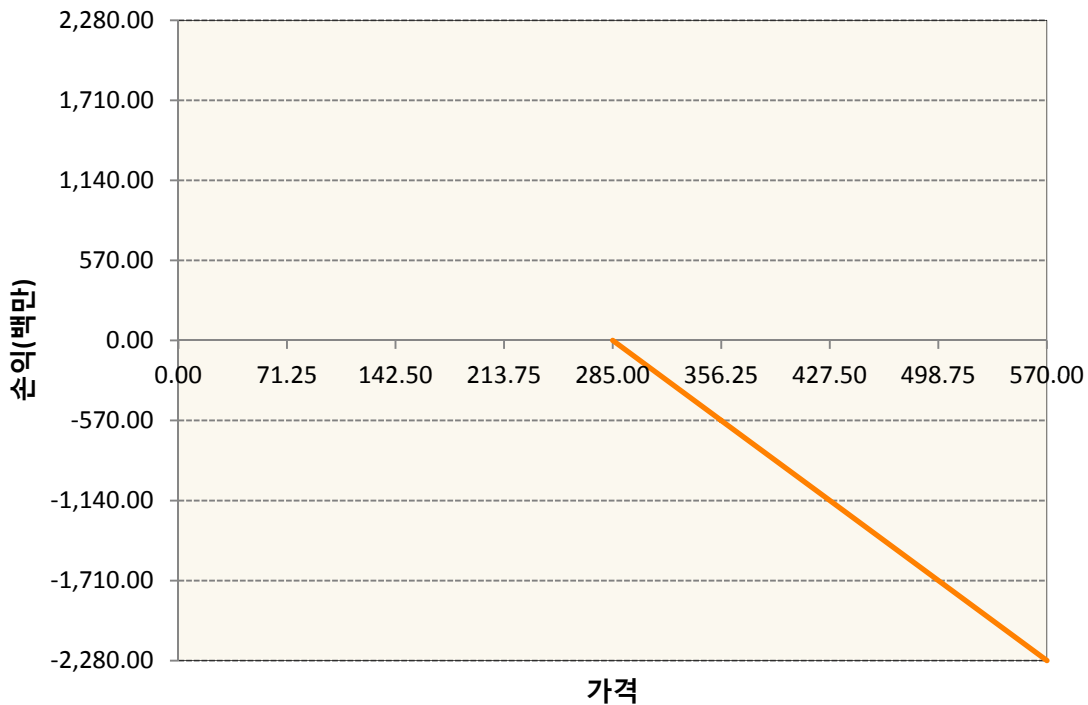
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

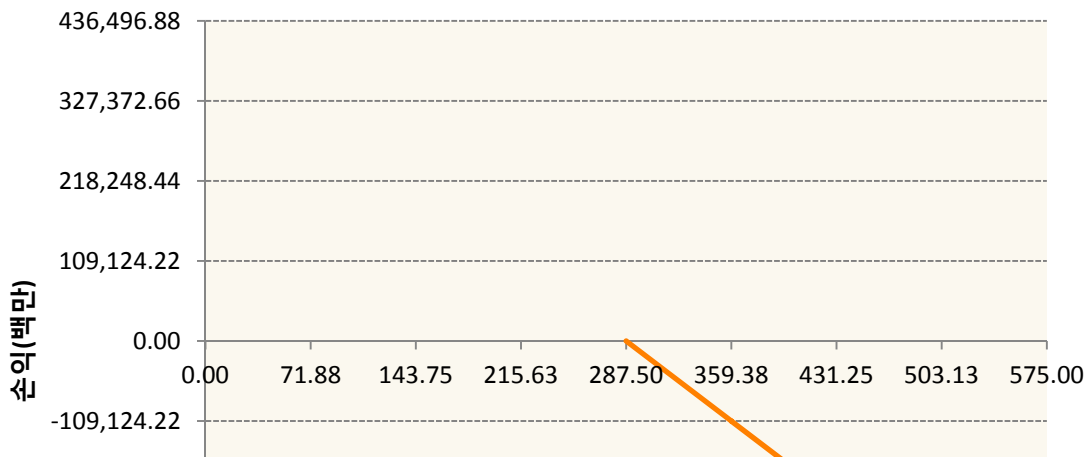
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	672,214	-672,214	장내

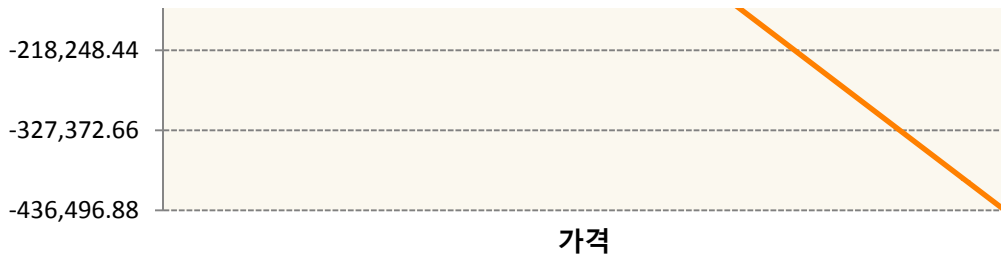
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P52850-2019-05 콜285

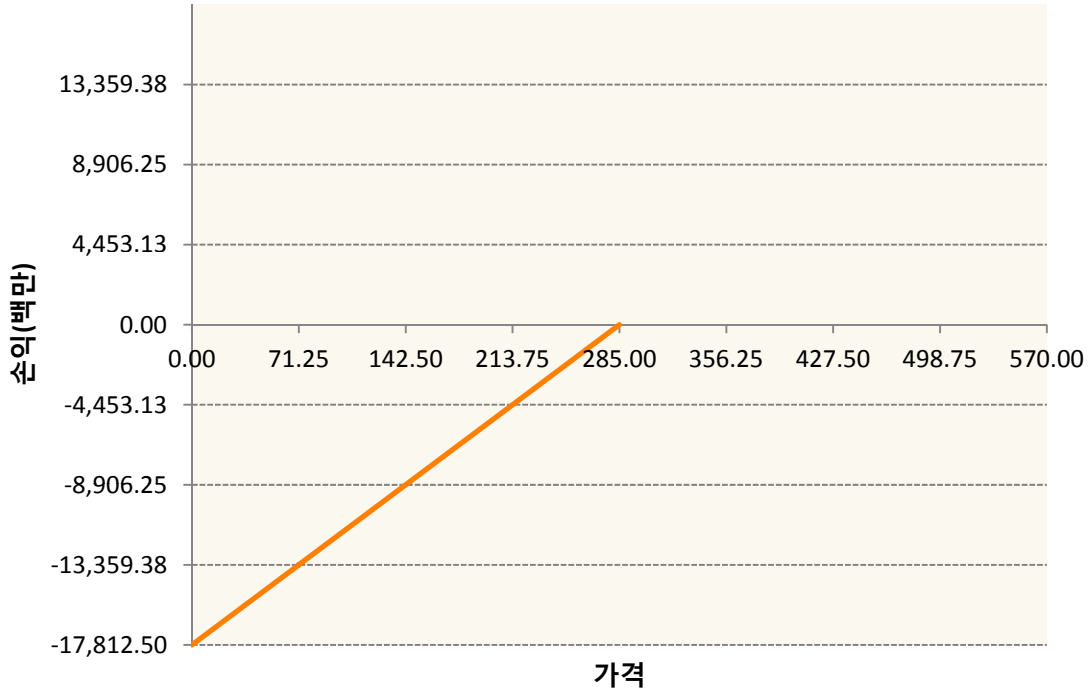


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

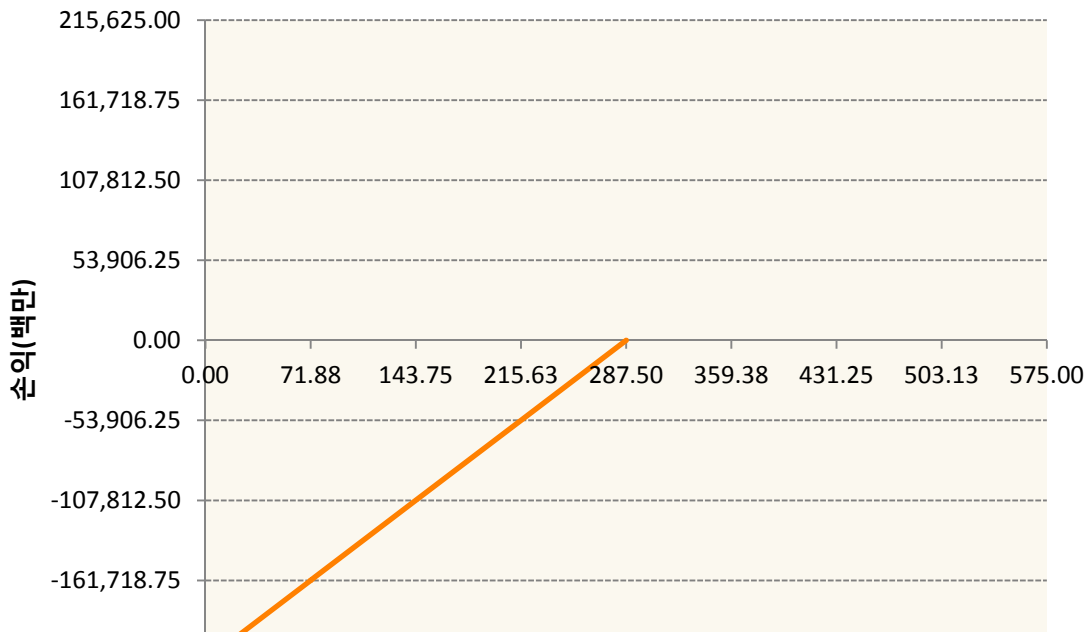




**KR4301P52858-2019-05 풋285**



**KR4301P52874-2019-05 풋287.5**



-215,625.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P52850		2019-05 콜285						157
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	36	36	36	36	36	35	35	
-5.33%	36	35	34	34	33	32	30	
-2.67%	30	28	26	24	22	20	18	
0%	8	5	3	0	-3	-5	-8	
2.67%	-37	-39	-40	-42	-44	-46	-48	
5.33%	-95	-95	-96	-96	-97	-98	-99	
8.00%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-157	
KR4201P52876		2019-05 콜287.5						27,979
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5,008	5,005	4,998	4,983	4,959	4,922	4,870	
-5.33%	4,968	4,922	4,852	4,755	4,631	4,480	4,303	
-2.67%	4,419	4,168	3,884	3,572	3,238	2,884	2,515	
0%	1,484	991	496	0	-497	-994	-1,492	
2.67%	-5,752	-6,127	-6,523	-6,935	-7,362	-7,799	-8,245	
5.33%	-16,170	-16,288	-16,443	-16,632	-16,852	-17,100	-17,374	
8.00%	-27,597	-27,614	-27,645	-27,695	-27,766	-27,861	-27,979	
KR4301P52858		2019-05 풋285						1,264
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,264	-1,264	-1,264	-1,264	-1,264	-1,264	-1,264	
-5.33%	-787	-787	-787	-788	-788	-788	-789	
-2.67%	-315	-318	-322	-326	-331	-336	-342	
0%	31	21	11	0	-11	-21	-32	
2.67%	97	96	94	91	88	85	80	
5.33%	98	98	98	98	98	97	97	
8.00%	98	98	98	98	98	98	98	
KR4301P52874		2019-05 풋287.5						16,076
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-16,076	-16,076	-16,076	-16,076	-16,076	-16,076	-16,076	
-5.33%	-10,356	-10,356	-10,356	-10,356	-10,357	-10,359	-10,362	
-2.67%	-4,645	-4,656	-4,673	-4,696	-4,727	-4,765	-4,809	
0%	370	248	125	0	-125	-251	-378	
2.67%	2,068	2,025	1,972	1,911	1,842	1,766	1,684	

5.33%	2,142	2,141	2,139	2,136	2,130	2,120	2,107
8.00%	2,142	2,142	2,142	2,142	2,142	2,141	2,141

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

(단위:백만원)

**54,527**

공시일	2019-05-03
기준일	2019-05-02

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

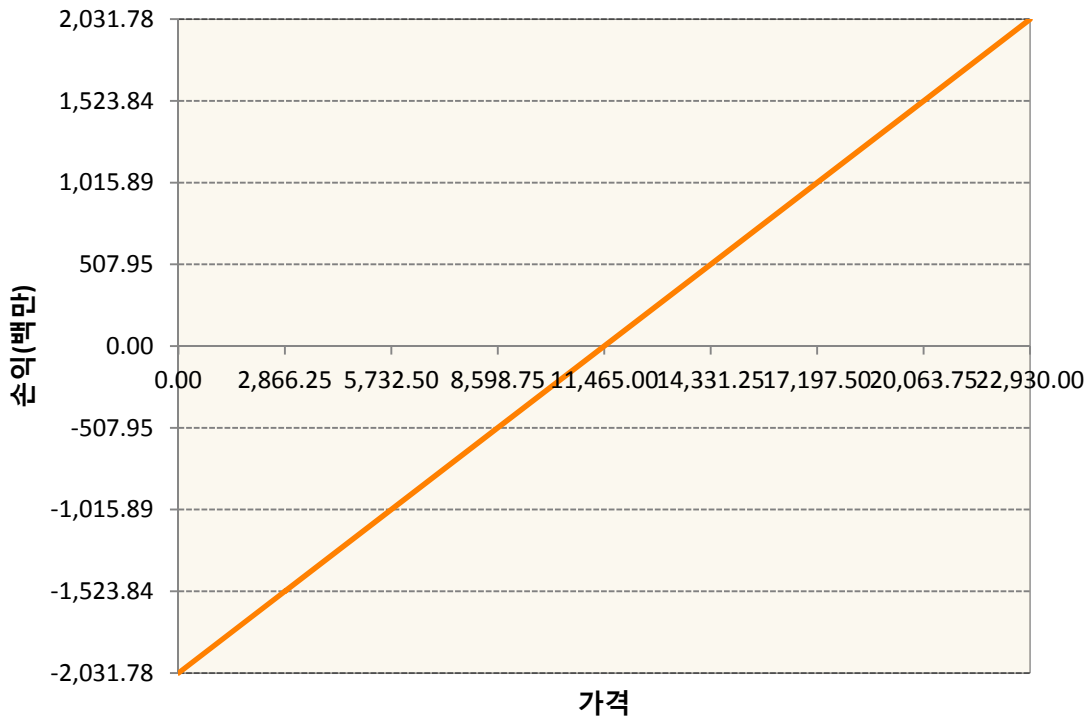
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

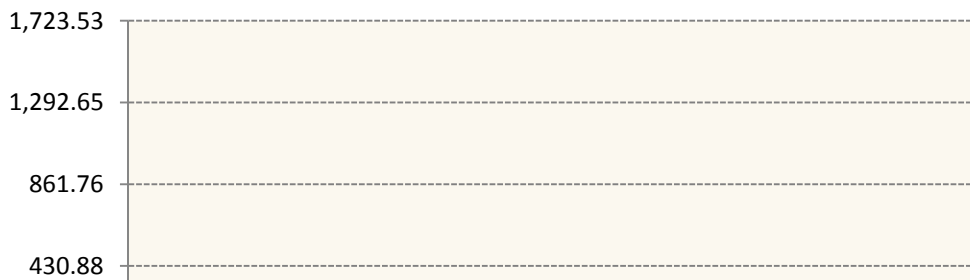
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,032	0	2,032	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,533	-5,533	장내
누계	통화	선도	0	3,120	-3,120	장외

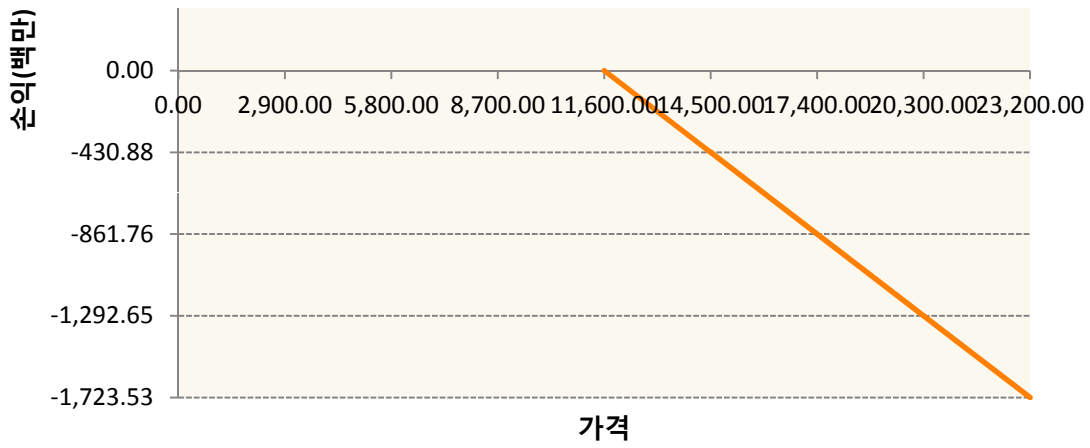
### 2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19

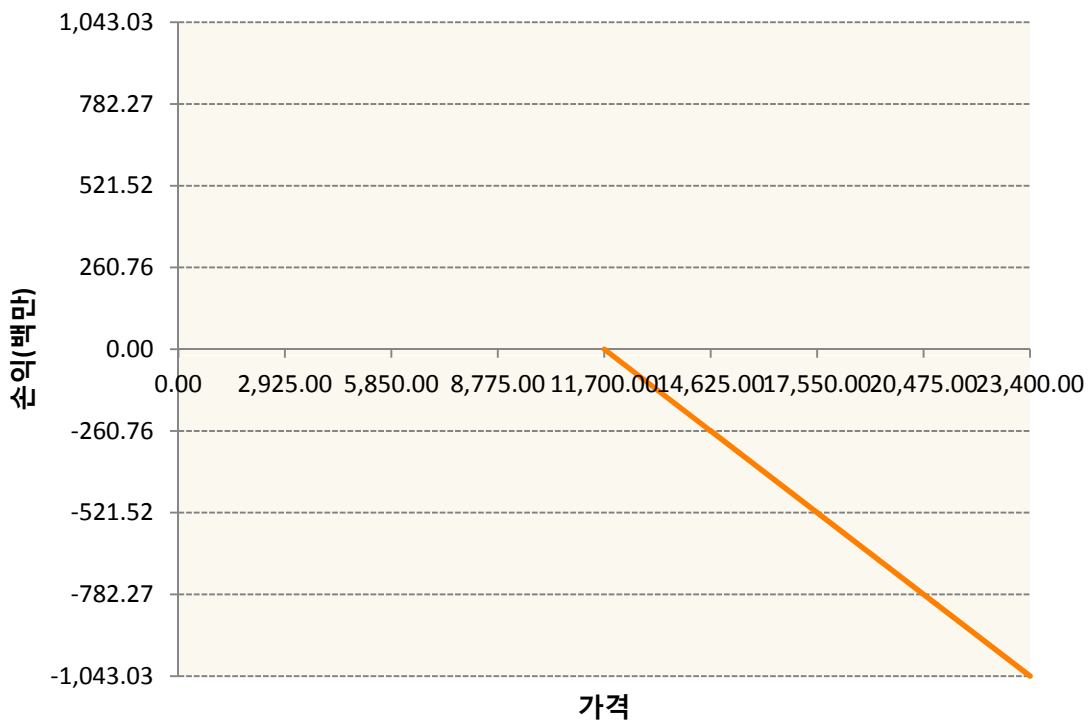


OHHIK9-C116-HSCEI

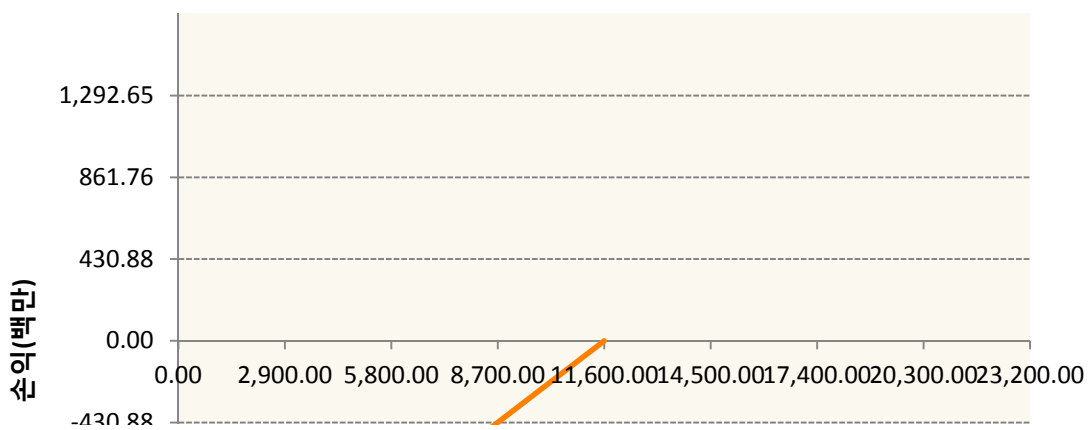


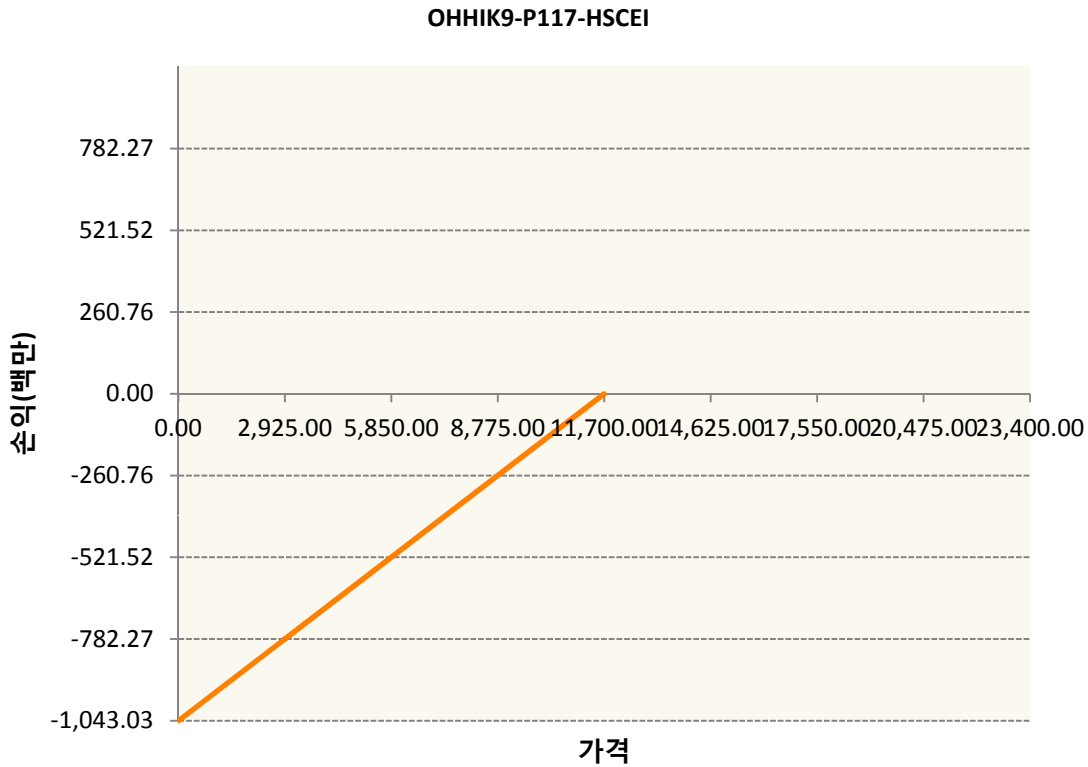


OHHIK9-C117-HSCEI



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	83
OHHIK9-P11 HSCEI	138
OHHIK9-P11 HSCEI	83

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	706

공시일	2019-05-03
기준일	2019-05-02

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

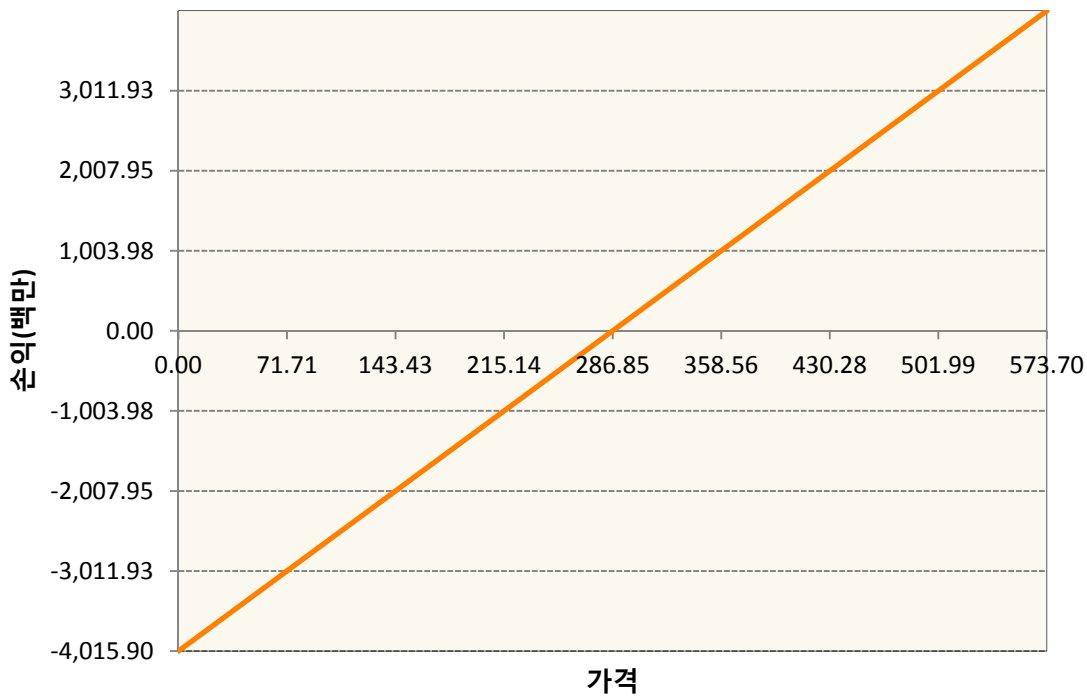
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

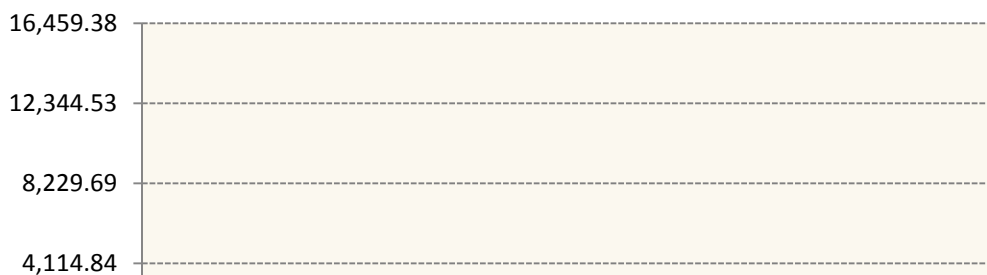
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,016	0	4,016	장내
누계	유가증권	스왑	32,836	0	32,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	31,186	-31,186	장내

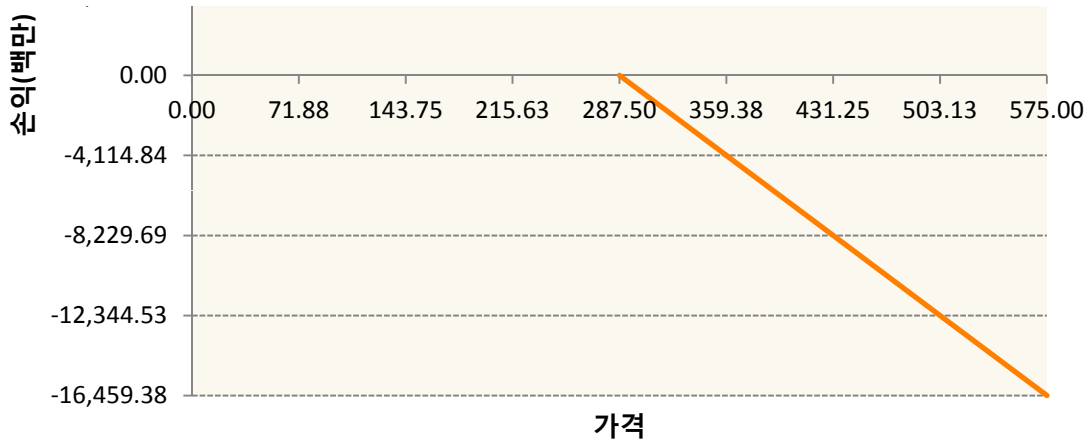
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

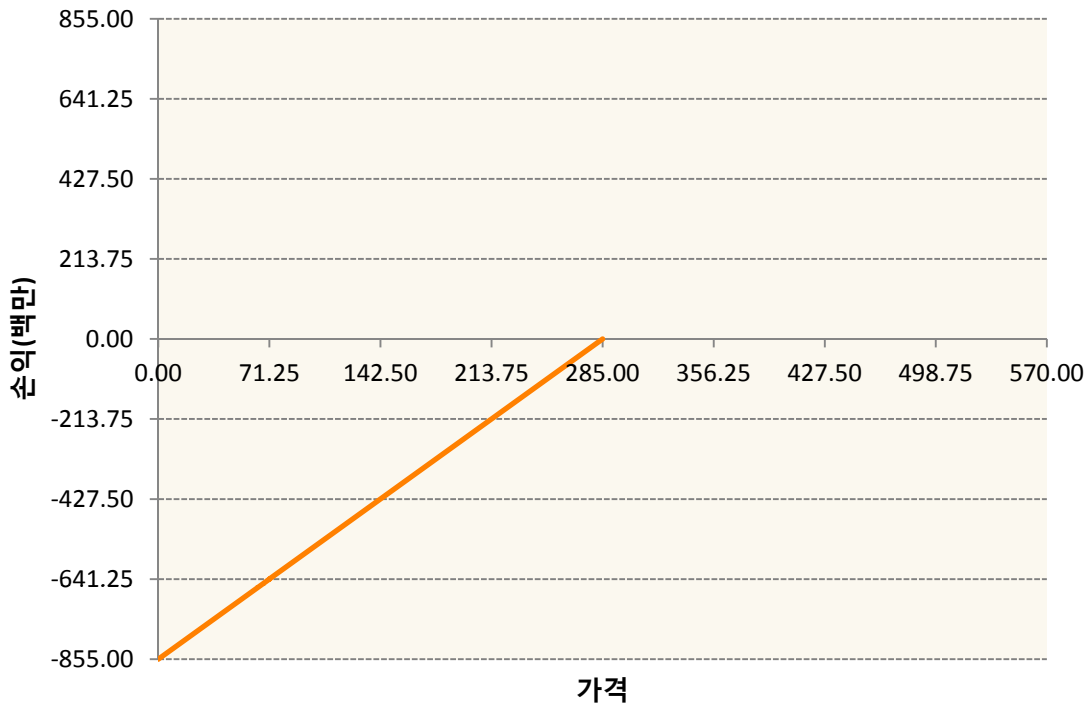


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

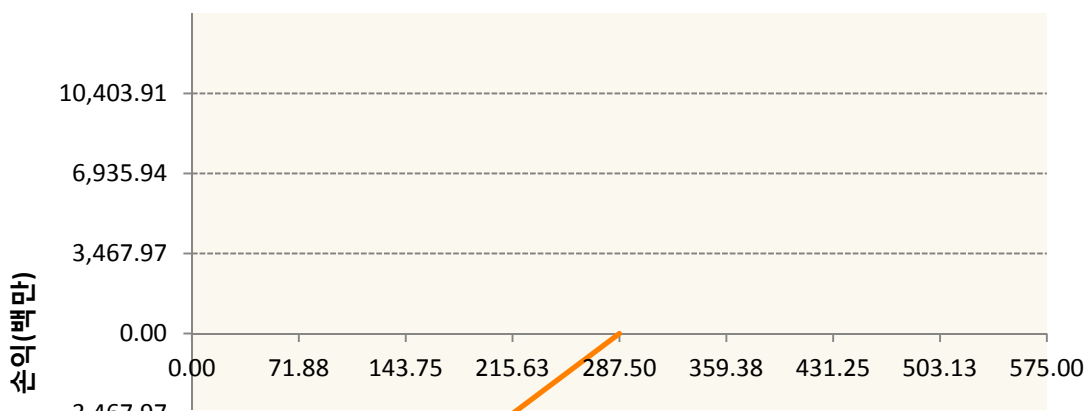


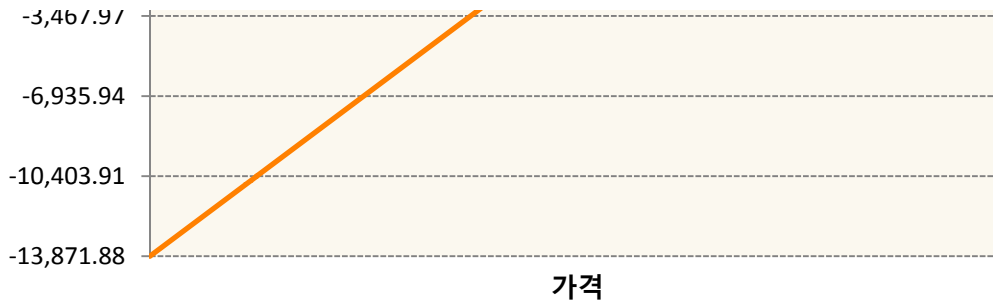


KR4301P52858-2019-05 풋285



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						320
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-320	-320	-320	-320	-320	-320	-320	
-5.33%	-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%	320	320	320	320	320	320	320	
KR4201P52876		2019-05 콜287.5						1,055
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	189	189	188	188	187	186	184
-5.33%	187	186	183	179	175	169	162
-2.67%	167	157	146	135	122	109	95
0%	56	37	19	0	-19	-37	-56
2.67%	-217	-231	-246	-262	-278	-294	-311
5.33%	-610	-614	-620	-627	-635	-645	-655
8.00%	-1,041	-1,041	-1,042	-1,044	-1,047	-1,051	-1,055
KR4301P52858                      2019-05 풋285							61
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61
-5.33%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
-2.67%	-15	-15	-15	-16	-16	-16	-16
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	5	5	5	4	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							1,034
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,034	-1,034	-1,034	-1,034	-1,034	-1,034	-1,034
-5.33%	-666	-666	-666	-666	-666	-666	-667
-2.67%	-299	-300	-301	-302	-304	-307	-309
0%	24	16	8	0	-8	-16	-24
2.67%	133	130	127	123	118	114	108
5.33%	138	138	138	137	137	136	136
8.00%	138	138	138	138	138	138	138

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

(단위:백만원)

**5,719**

공시일	2019-05-03
기준일	2019-05-02

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

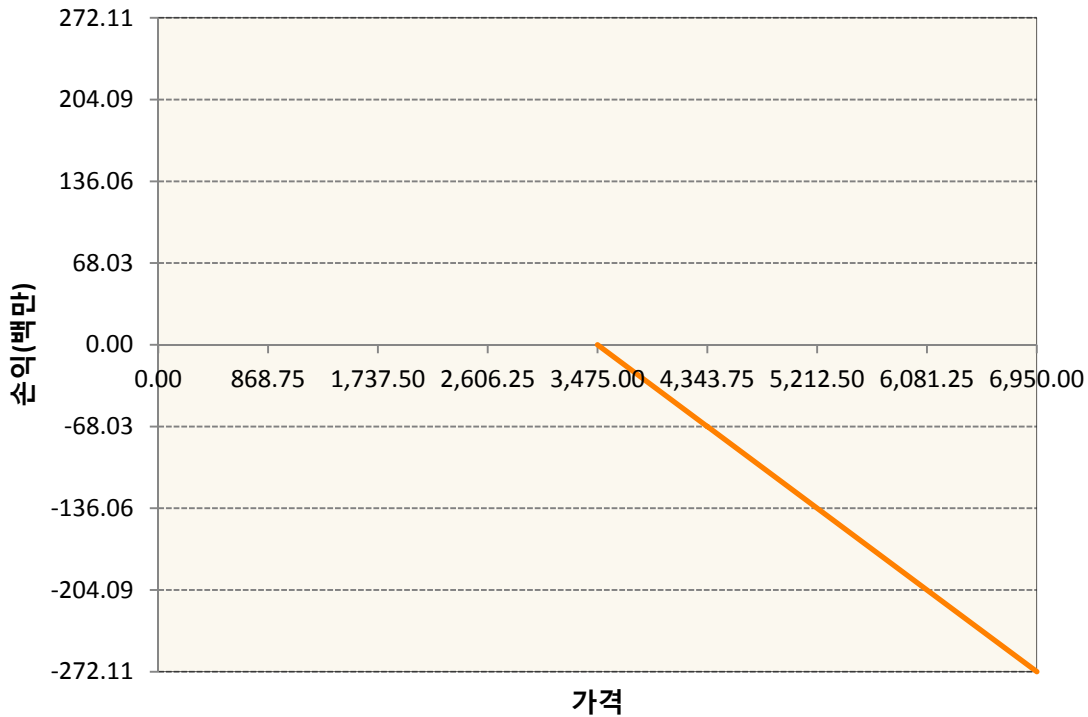
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

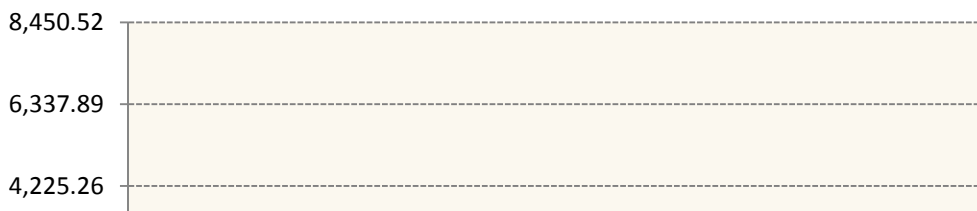
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,597	0	1,597	
누계	유가증권	스왑	64,297	0	64,297	장외
누계	유가증권	옵션	0	17,445	-17,445	장내
누계	통화	선도	0	18,272	-18,272	장외

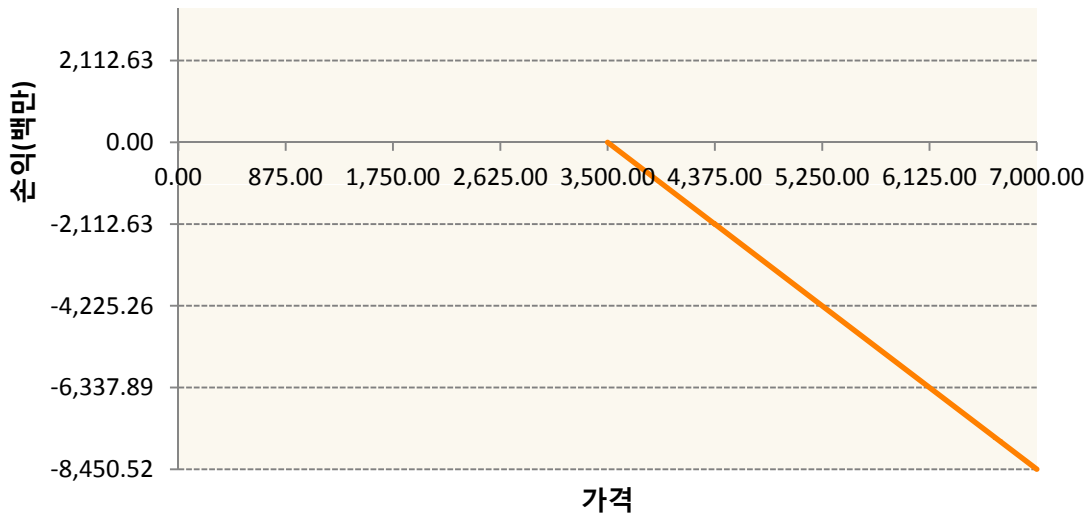
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXK9-C3475-EURO STOXX 50**

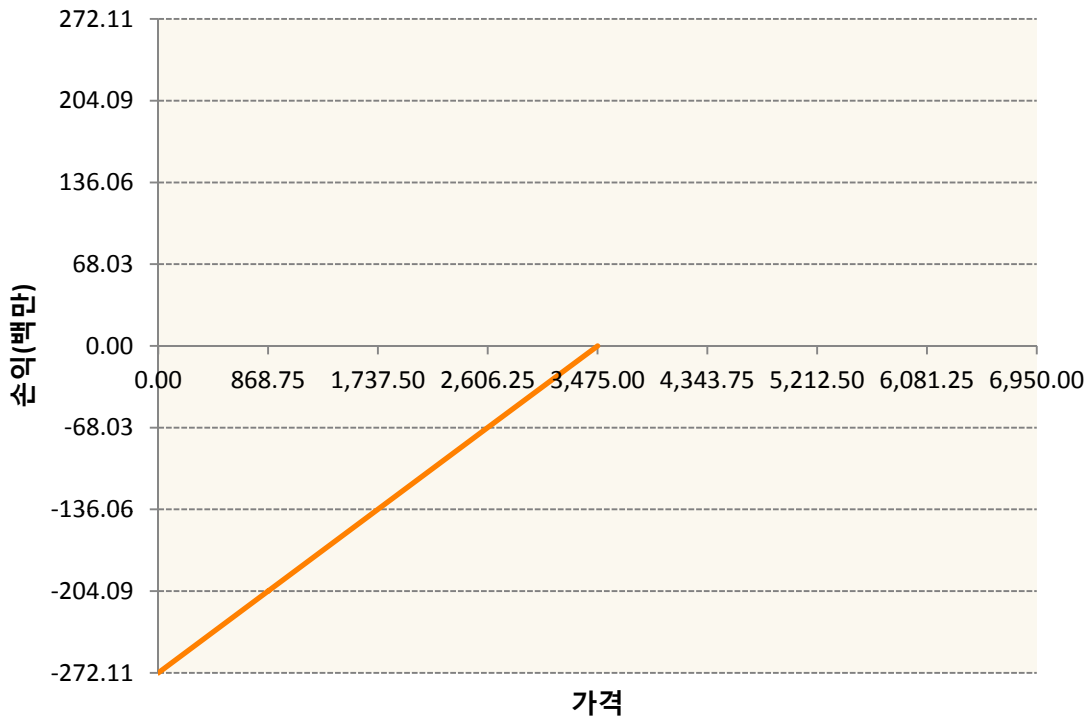


**OESXK9-C3500-EURO STOXX 50**

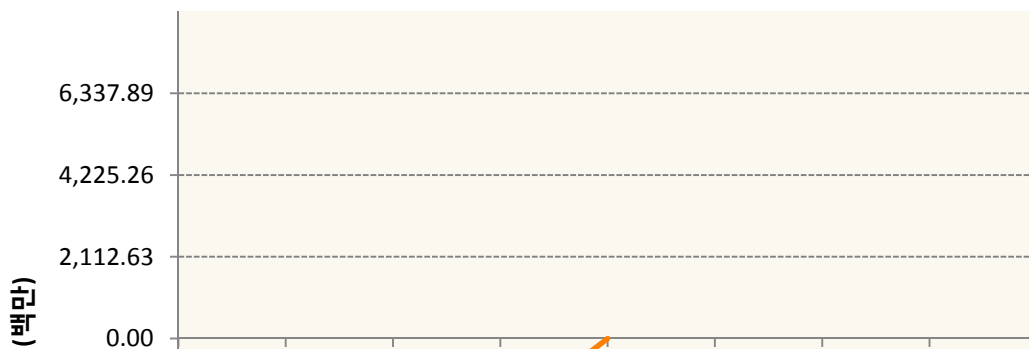


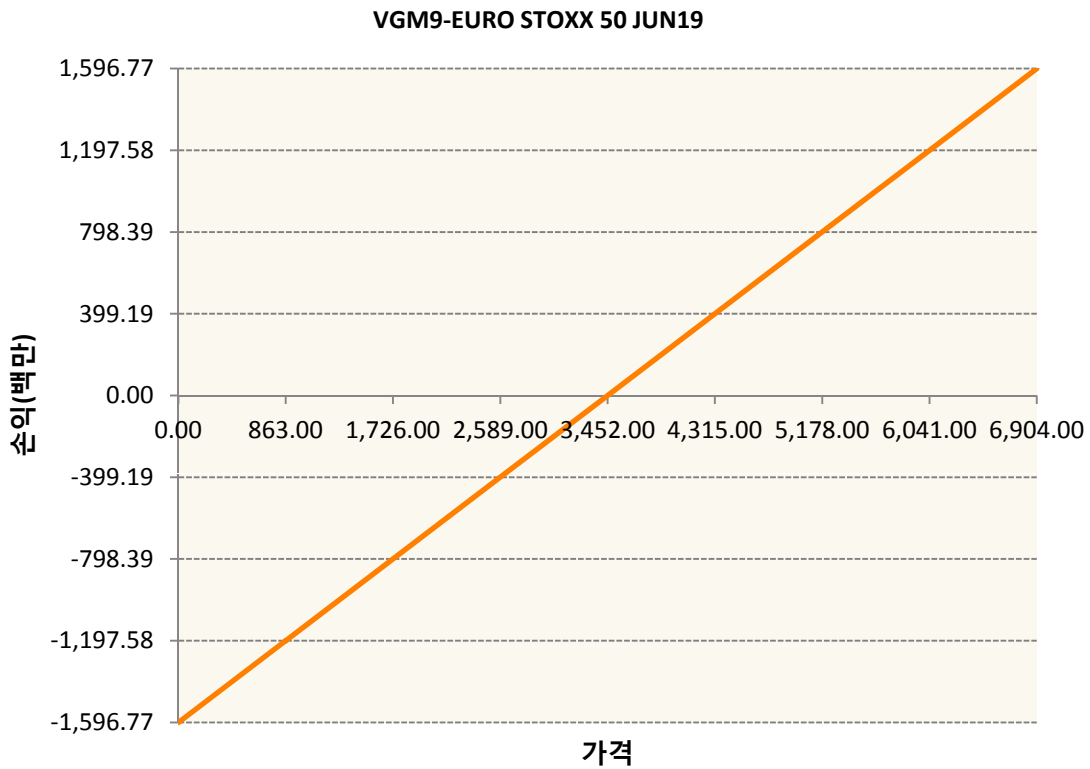
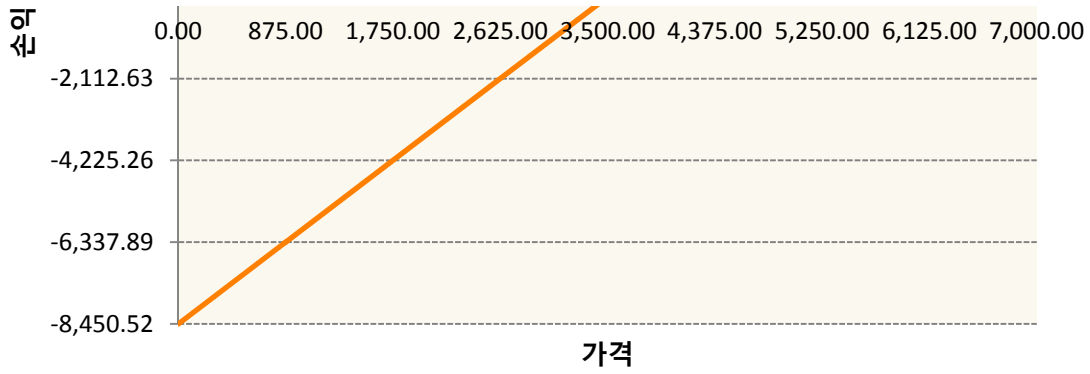


OESXK9-P3475-EURO STOXX 50



OESXK9-P3500-EURO STOXX 50





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	29
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	418
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	835
FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E	209
OESXK9-C34 EURO STOXX 50	22
OESXK9-C35 EURO STOXX 50	676
OESXK9-P34 EURO STOXX 50	22
OESXK9-P35 EURO STOXX 50	676
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	128

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

(단위:백만원)

1,854



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

(단위:백만원)

1,107



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

(단위:백만원)

95



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

(단위:백만원)

137

공시일	2019-05-03
기준일	2019-05-02

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

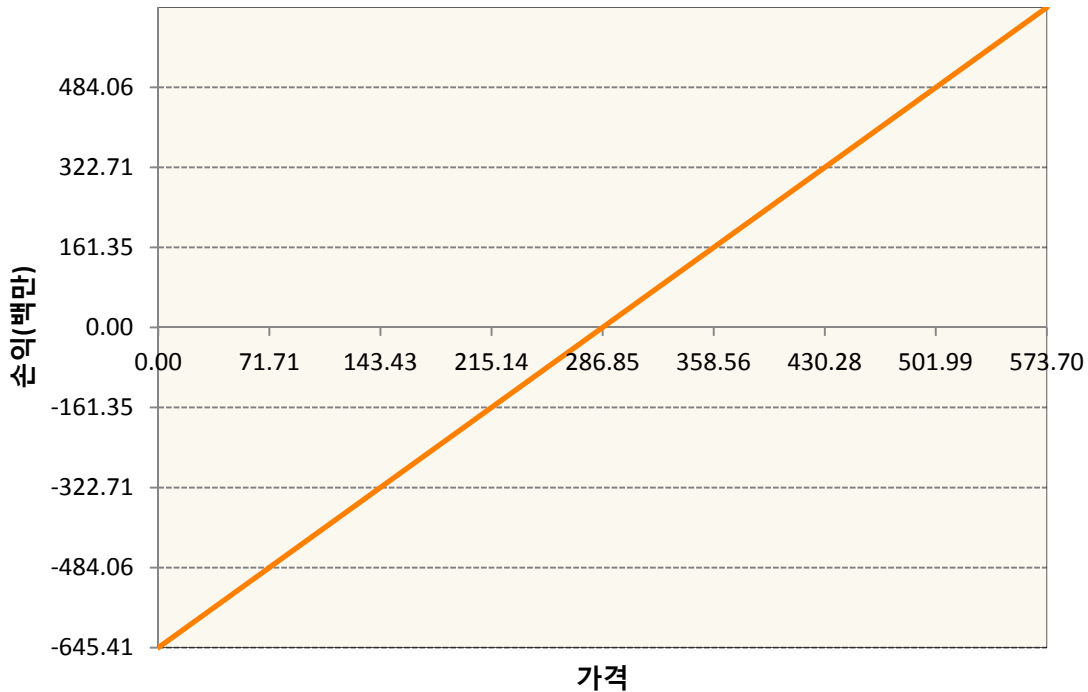
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

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

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						52
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52	
-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%	52	52	52	52	52	52	52	

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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-05-03
기준일	2019-05-02

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

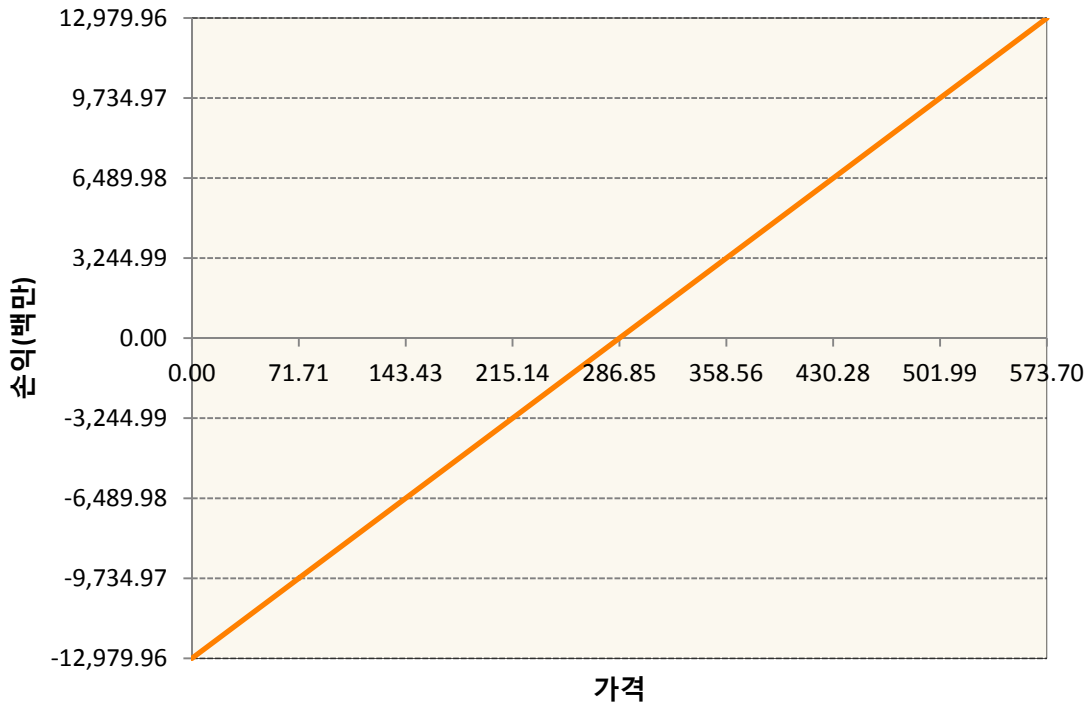
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

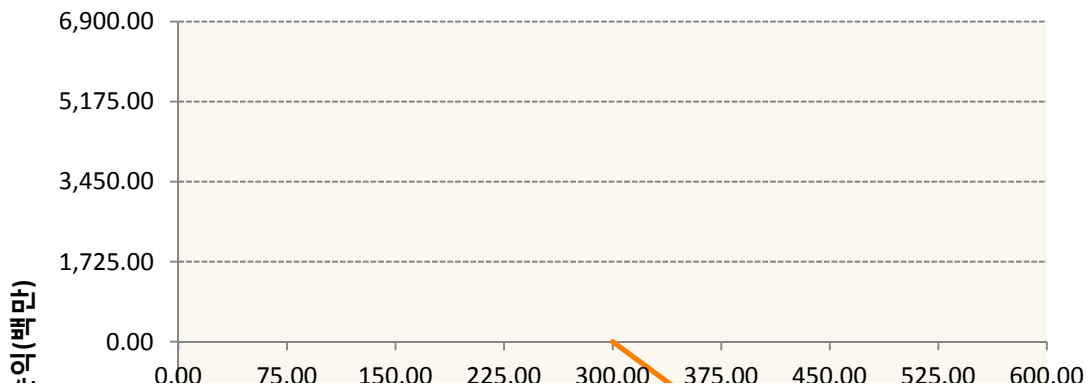
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,980	0	12,980	장내
누계	유가증권	옵션	1,366	24,294	-22,928	장내

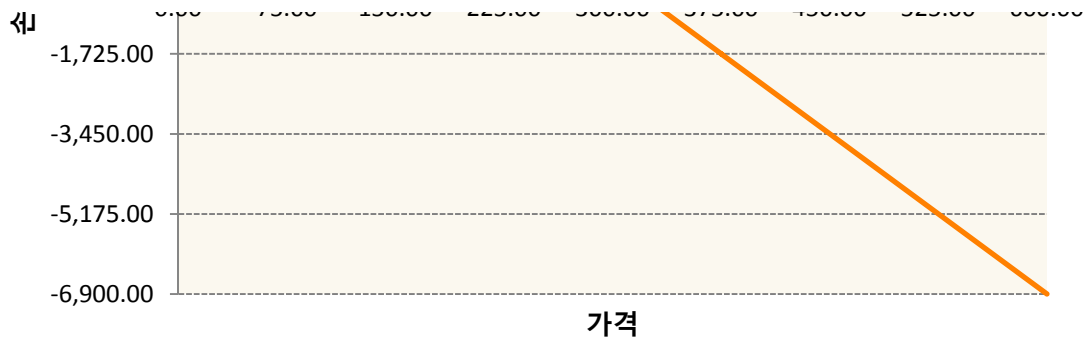
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

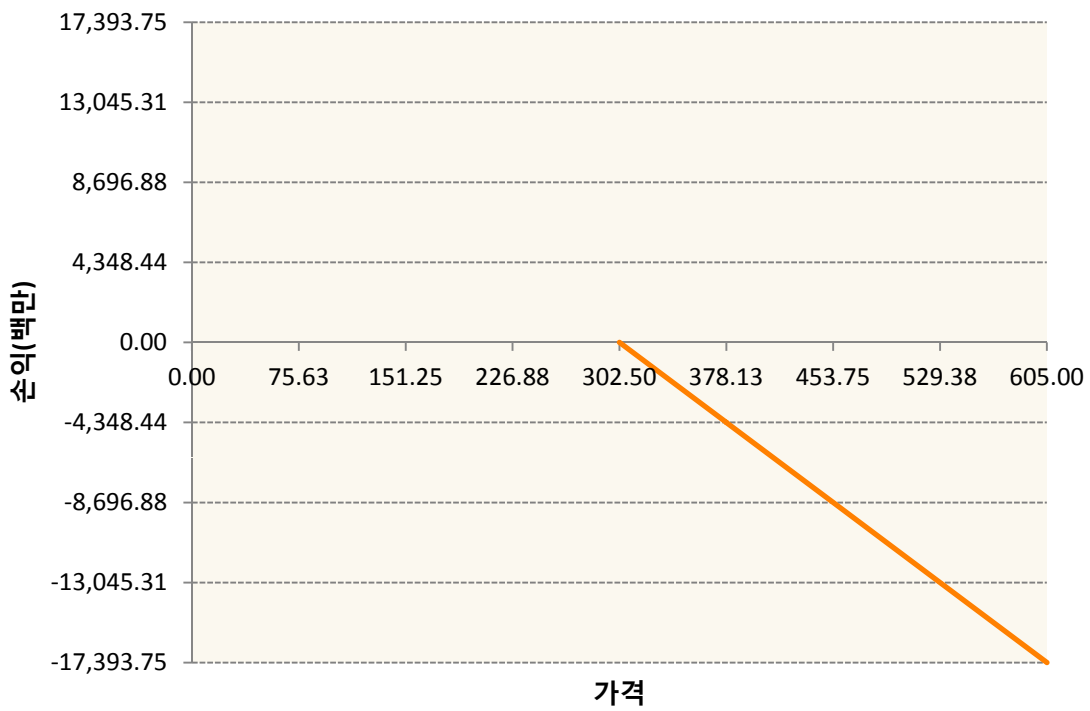


KR4201P53007-2019-05 콜300

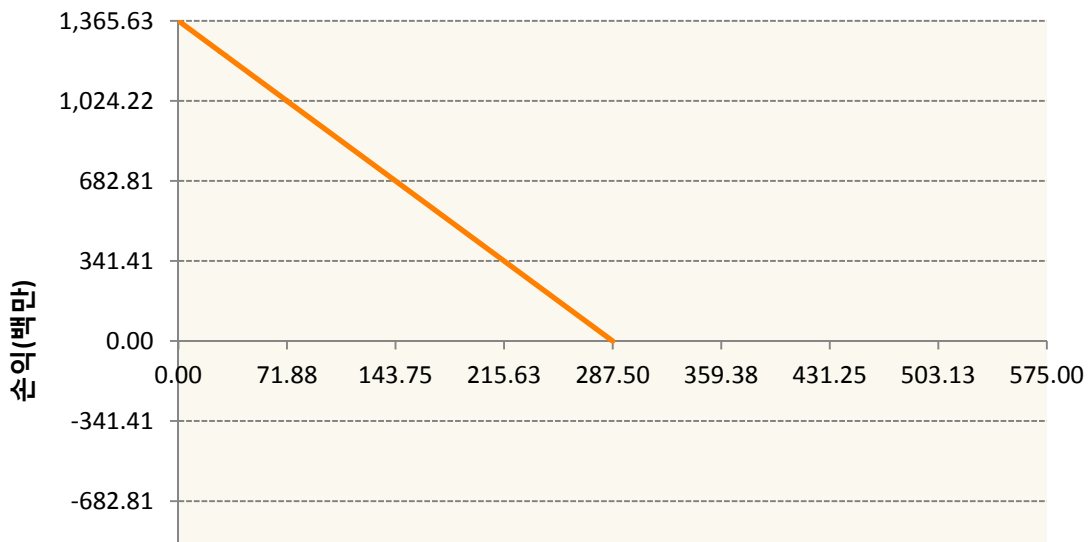


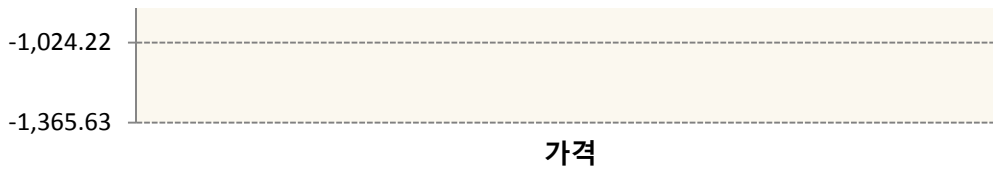


KR4201P53023-2019-05 콜302.5



KR4301P52874-2019-05 풋287.5





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

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						1,036
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,036	-1,036	-1,036	-1,036	-1,036	-1,036	-1,036	
-5.33%	-691	-691	-691	-691	-691	-691	-691	
-2.67%	-345	-345	-345	-345	-345	-345	-345	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	345	345	345	345	345	345	345	
5.33%	691	691	691	691	691	691	691	
8.00%	1,036	1,036	1,036	1,036	1,036	1,036	1,036	
KR4201P53007		2019-05 콜300						242
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	9	9	9	9	9	9	9	
-5.33%	9	9	9	9	9	9	8	
-2.67%	9	9	8	8	7	6	4	
0%	7	5	3	0	-3	-7	-11	
2.67%	-12	-17	-24	-30	-37	-43	-50	
5.33%	-79	-87	-95	-103	-111	-119	-126	
8.00%	-209	-213	-218	-224	-230	-236	-242	
KR4201P53023		2019-05 콜302.5						512
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	13	13	13	13	13	13	13	
-5.33%	13	13	13	13	13	13	12	
-2.67%	13	13	13	12	10	8	6	
0%	11	8	5	0	-6	-13	-21	
2.67%	-15	-26	-39	-52	-66	-81	-96	
5.33%	-135	-155	-175	-195	-215	-235	-255	
8.00%	-412	-427	-443	-460	-477	-494	-512	
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%	29	29	30	30	30	30	30	

0%	-2	-2	-1	0	1	2	2
2.67%	-13	-13	-12	-12	-12	-11	-11
5.33%	-14	-14	-14	-14	-13	-13	-13
8.00%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14

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

(단위:백만원)

**1,364**

공시일	2019-05-03
기준일	2019-05-02

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	210	0	210	
누계	유가증권	수익증권	4,574	0	4,574	

### 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	2019-05-03
기준일	2019-05-02

## H2O글로벌본드(UH)(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	75,410	0	75,410	

### 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	2019-05-03
기준일	2019-05-02

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	12,823	0	12,823	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	164,530	0	164,530	
누계	통화	선도	0	166,800	-166,800	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		233
FX21019J007 KRW/USD 10-05-19E		75
FX21019J011 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		1,306
FX21019J016 KRW/USD 17-05-19E		1,399
FX21019J017 KRW/USD 18-06-19E		373
FX21019J020 KRW/USD 20-05-19E		504
FX21019J021 KRW/USD 20-05-19E		474
FX21019J022 KRW/USD 24-06-19E		933
FX21019J023 KRW/USD 22-05-19E		783
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		933
FX21019J031 KRW/USD 28-05-19E		989
FX21019J032 KRW/USD 26-06-19E		373
FX21019J033 KRW/USD 28-06-19E		75
FX21019J034 KRW/USD 28-06-19E		981
FX21019J035 KRW/USD 26-06-19E		1,007

FX21019J041 KRW/USD 28-05-19E  
FX21019J042 KRW/USD 03-06-19E  
FX21019J044 KRW/USD 03-06-19E  
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E

280
560
466
280

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

(단위:백만원)

<b>4,597</b>
--------------

공시일	2019-05-03
기준일	2019-05-02

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

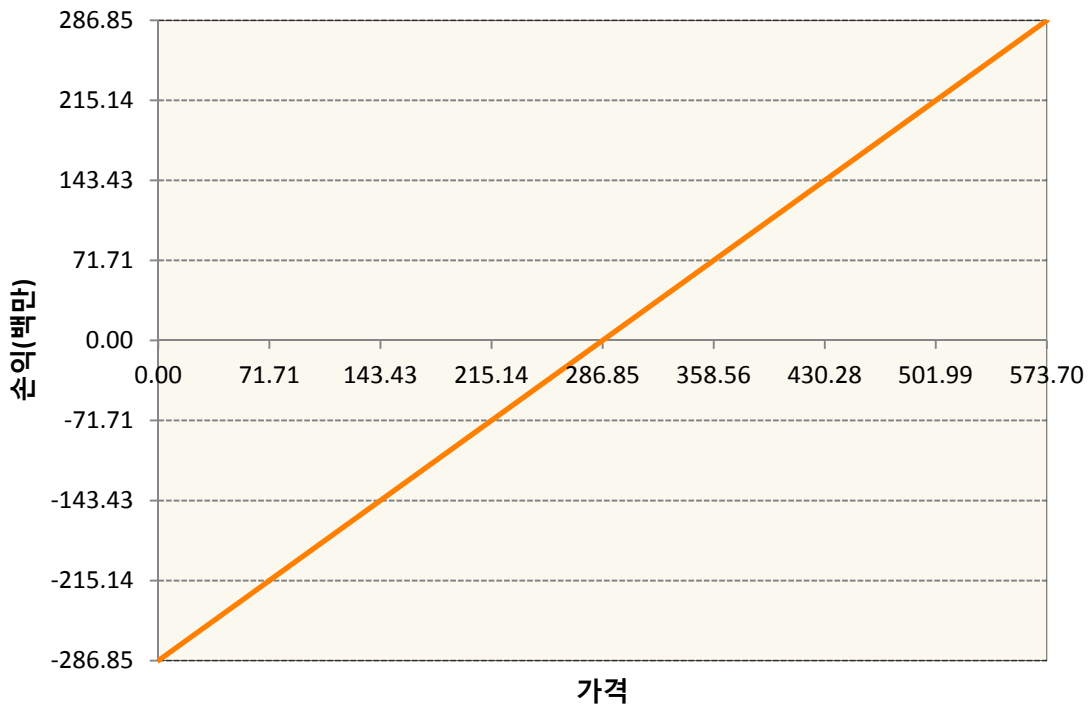
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

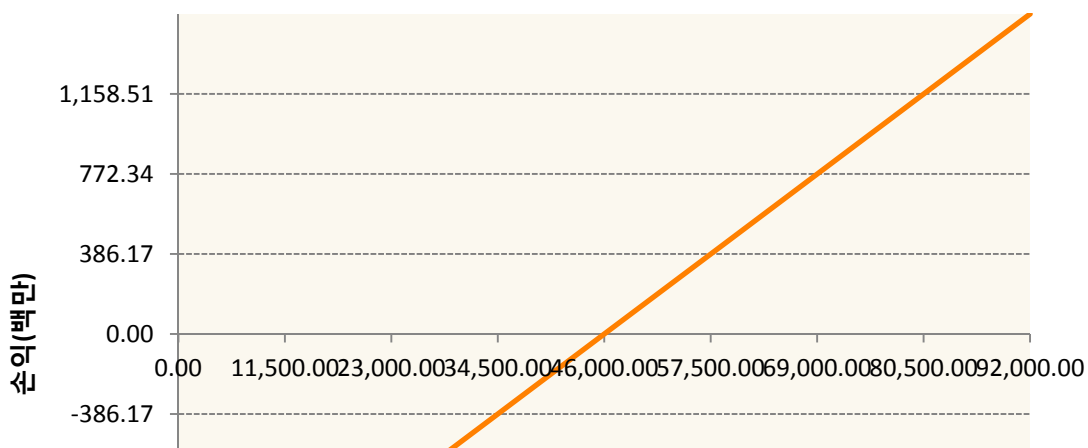
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,832	0	1,832	장내

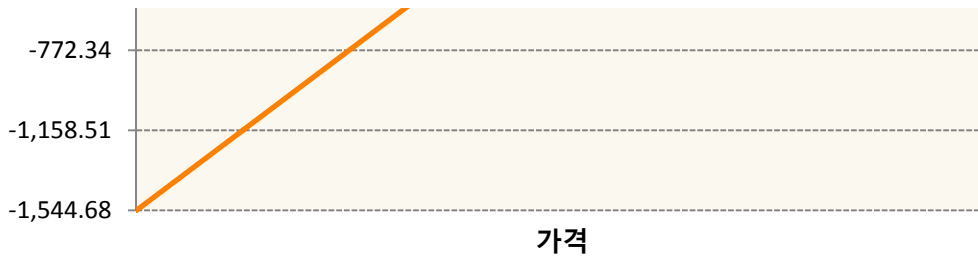
### 2. 만기시점의 손익구조

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)

**162**

공시일	2019-05-03
기준일	2019-05-02

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

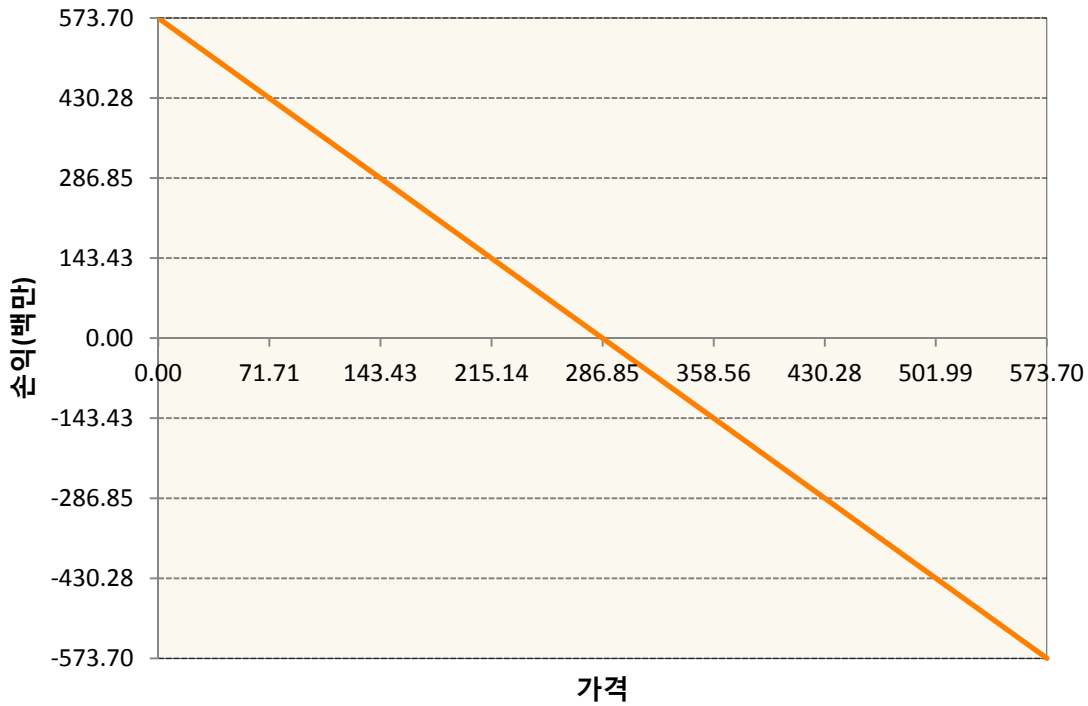
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

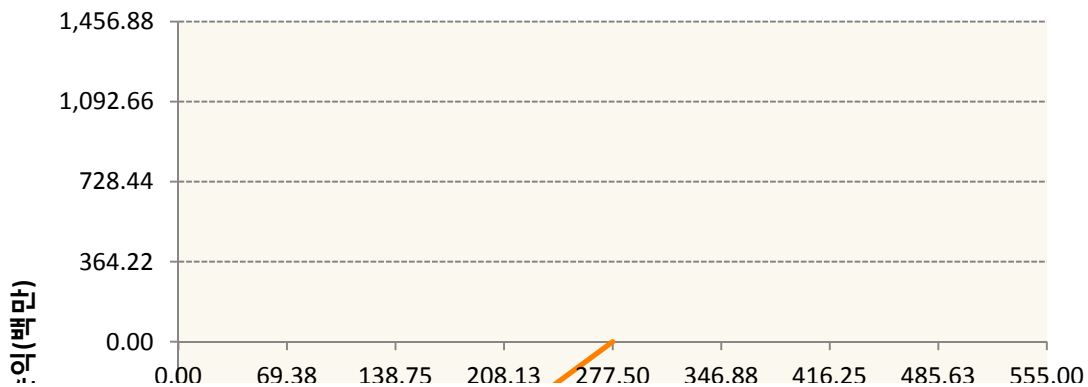
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	574	-574	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,067	-3,067	장내

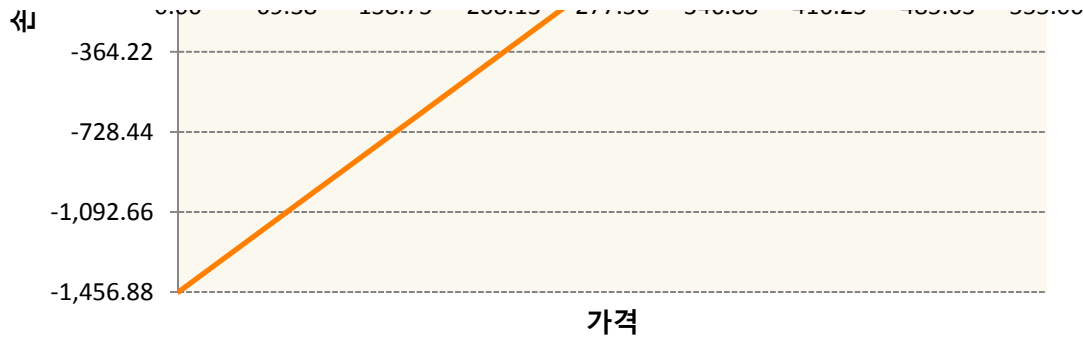
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

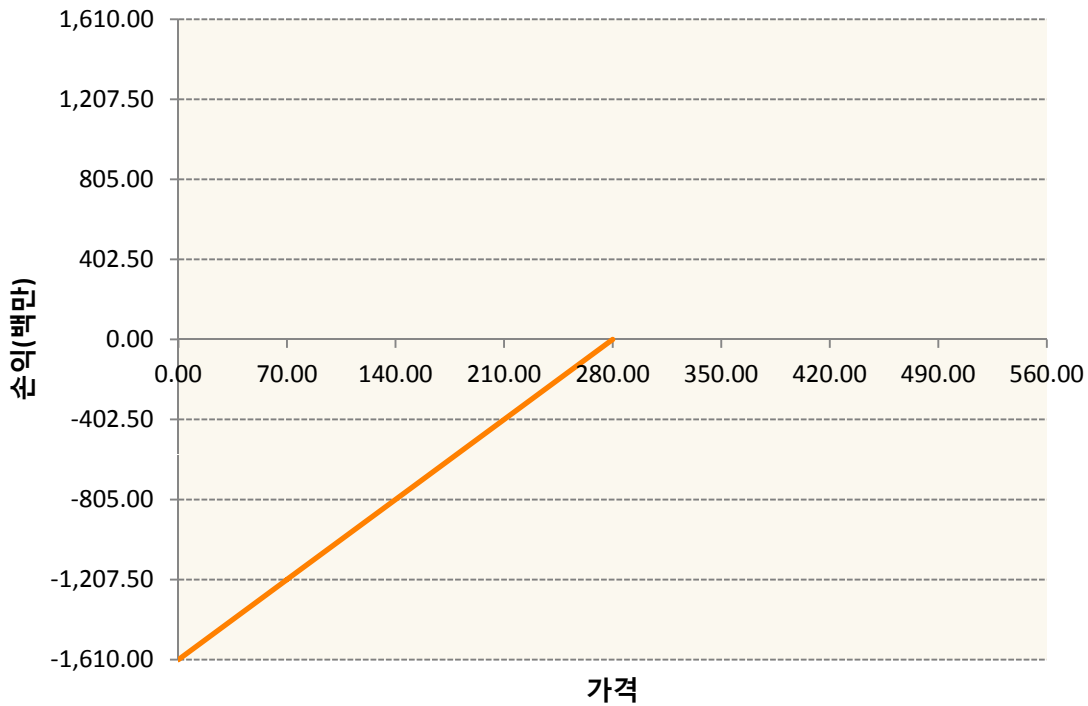


KR4301P52775-2019-05 풋277.5





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						75
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-5.33%	-35	-35	-35	-36	-36	-36	-37
-2.67%	-5	-6	-7	-8	-9	-9	-10
0%	0	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	1	1	1	1	0	0	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

KR4301P52809

2019-05 풋280

95

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-95	-95	-95	-95	-95	-95	-95
-5.33%	-51	-51	-51	-51	-52	-52	-52
-2.67%	-12	-13	-14	-15	-16	-17	-18
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	2	2	2	2	2	2	1
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)

172

공시일	2019-05-03
기준일	2019-05-02

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

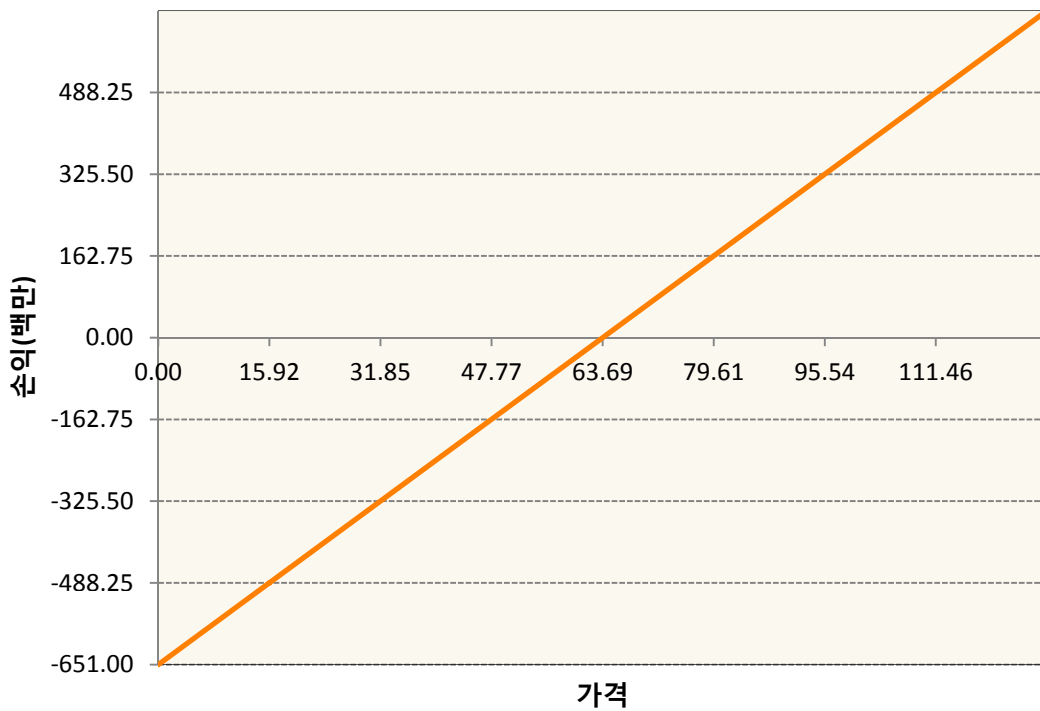
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

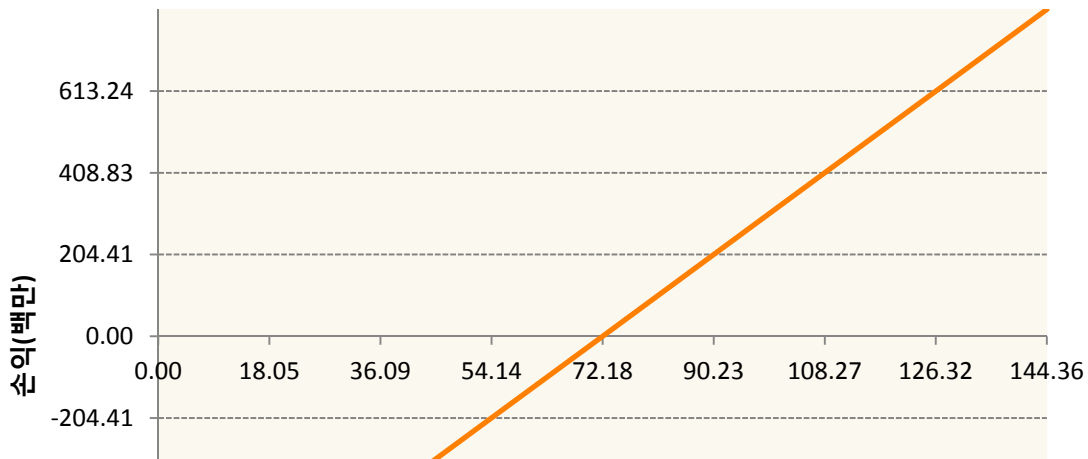
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,913	291	2,622	

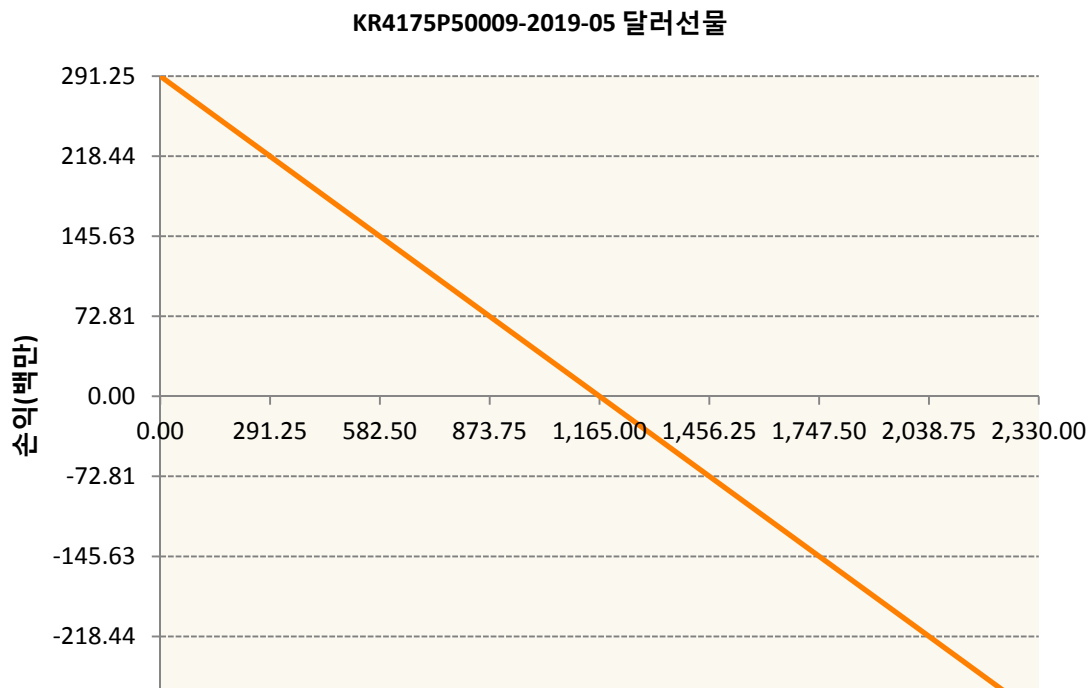
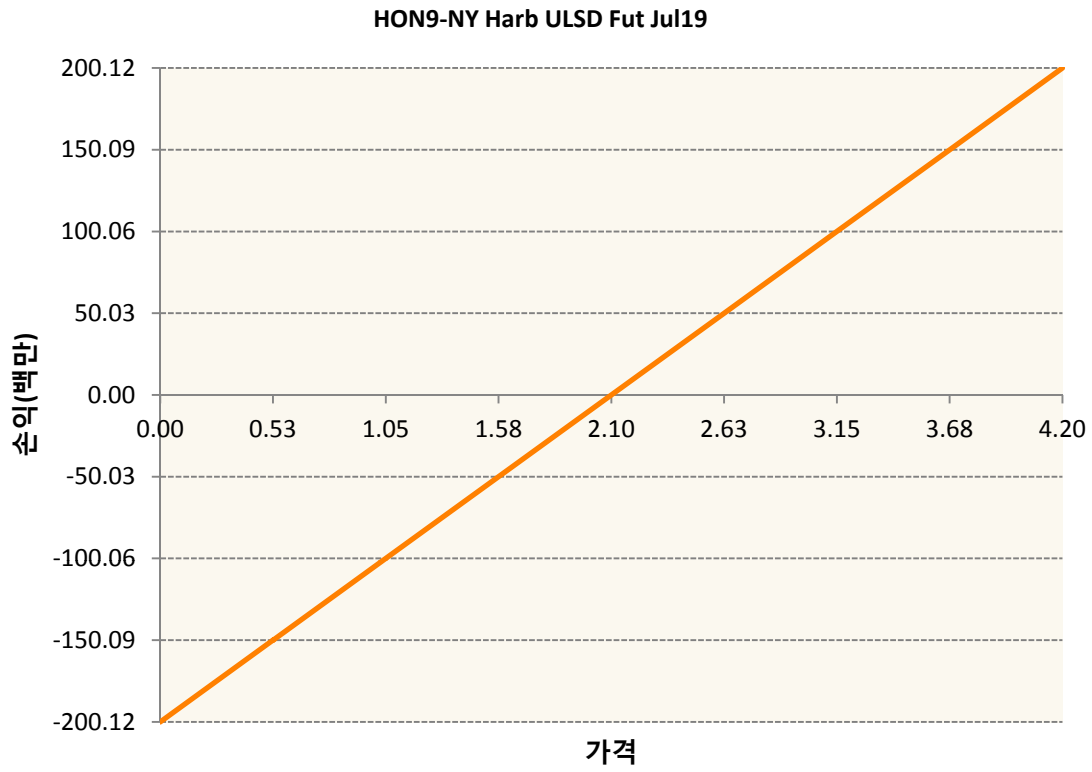
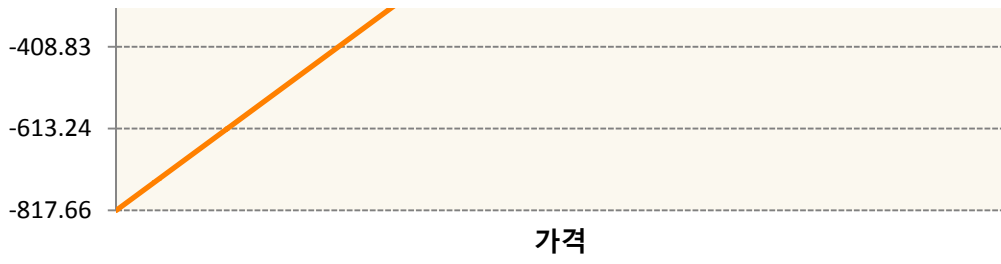
### 2. 만기시점의 손익구조

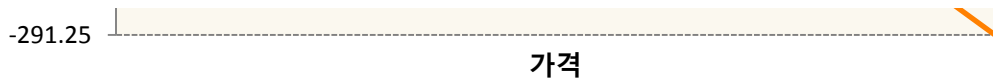
CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19



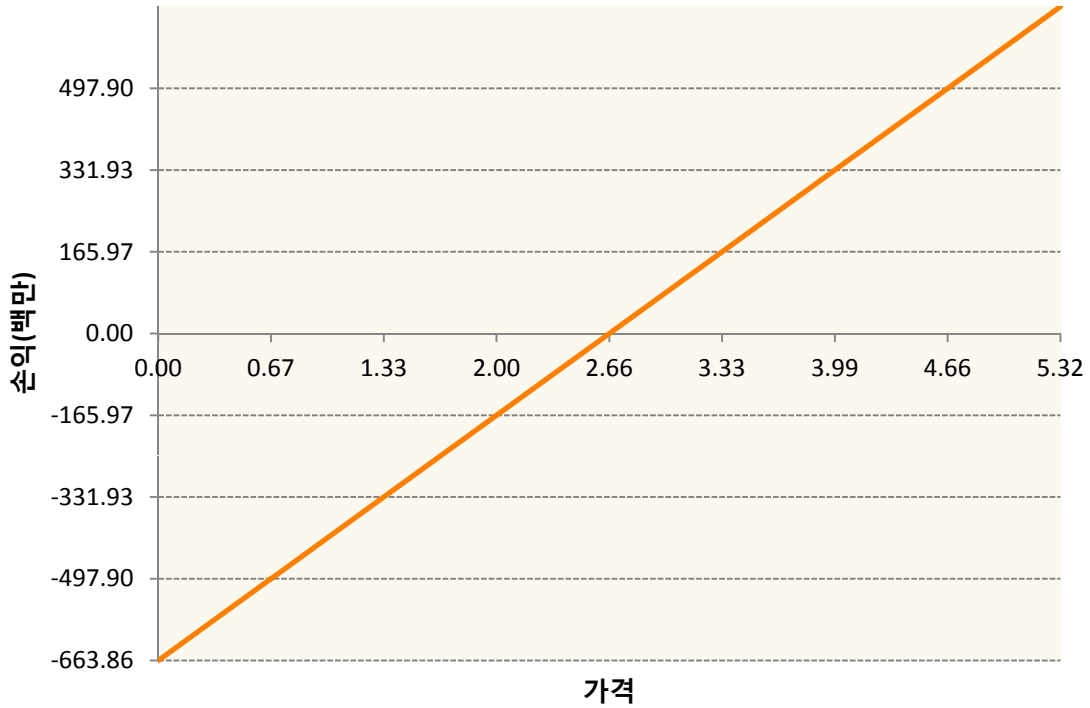
CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19



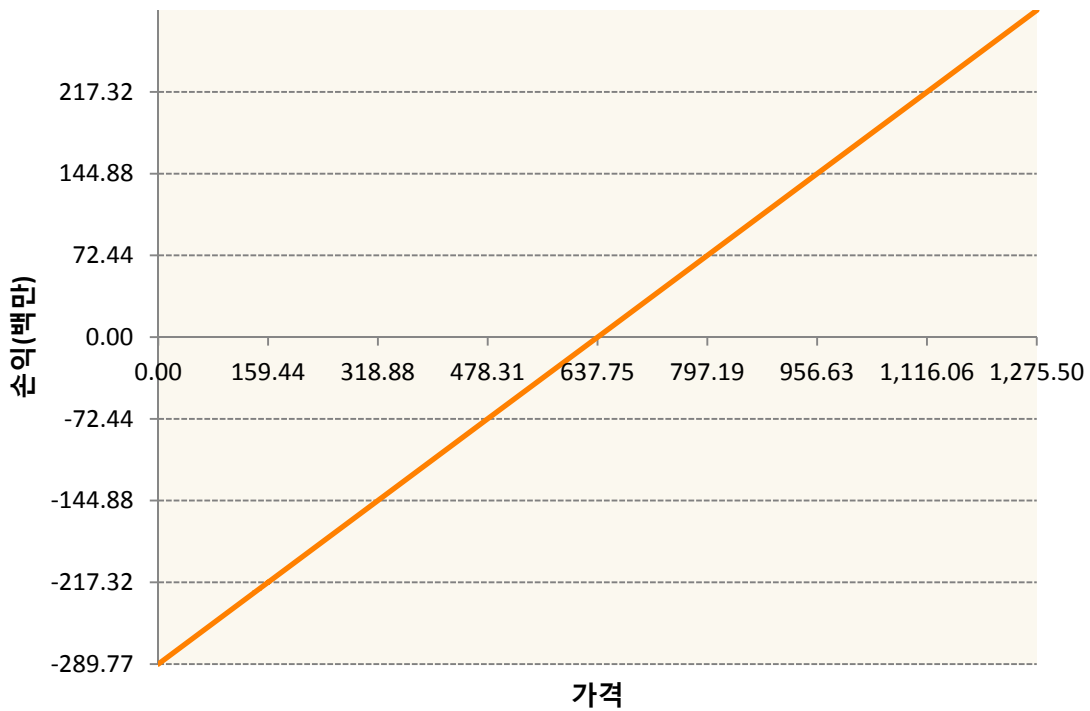




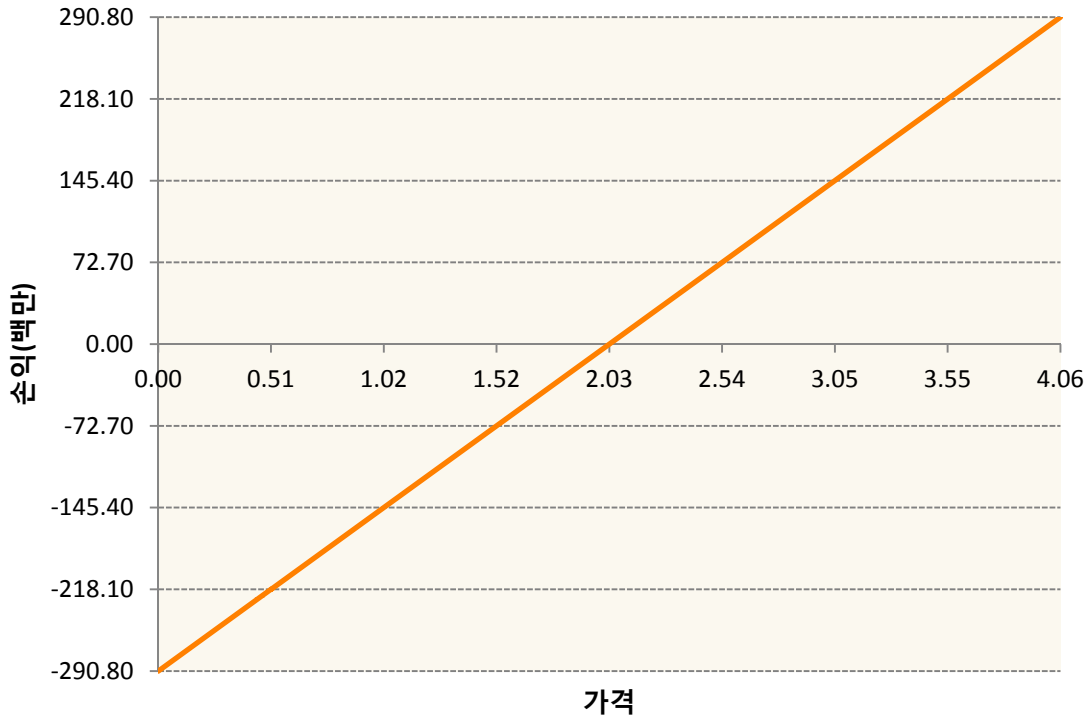
NGN19-NATURAL GAS FUTR Jul19



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)

431

공시일	2019-05-03
기준일	2019-05-02

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

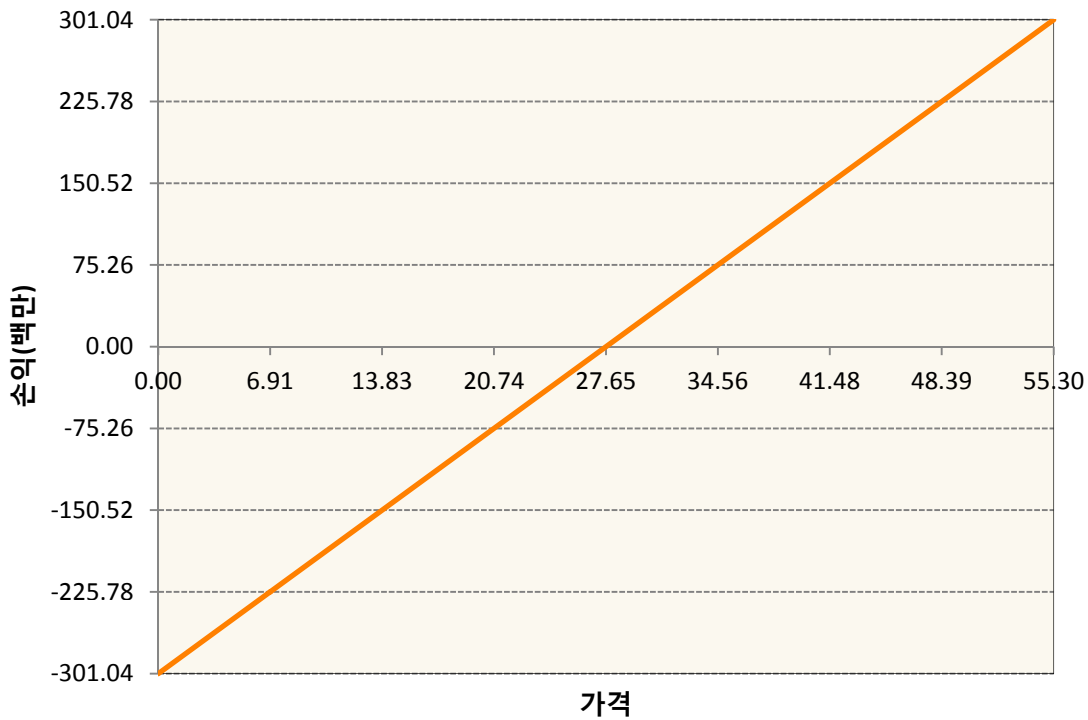
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

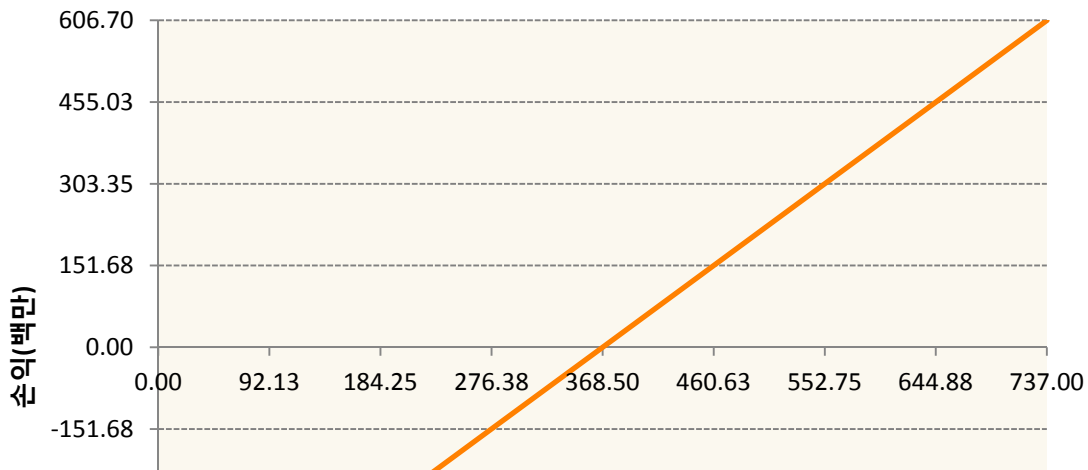
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,030	58	2,972	

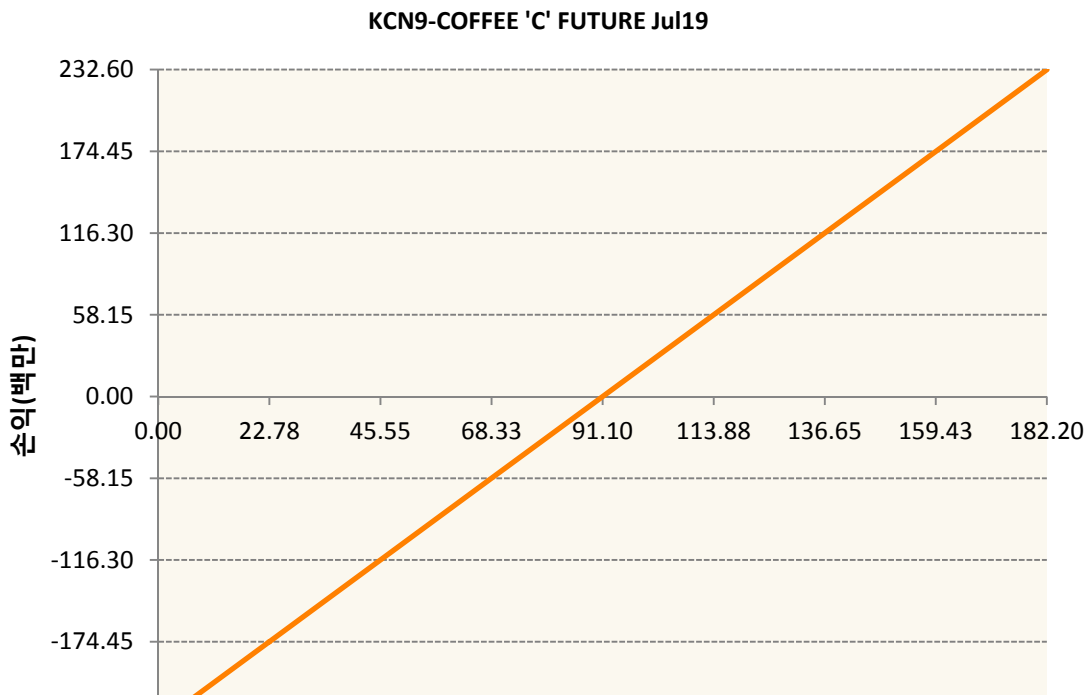
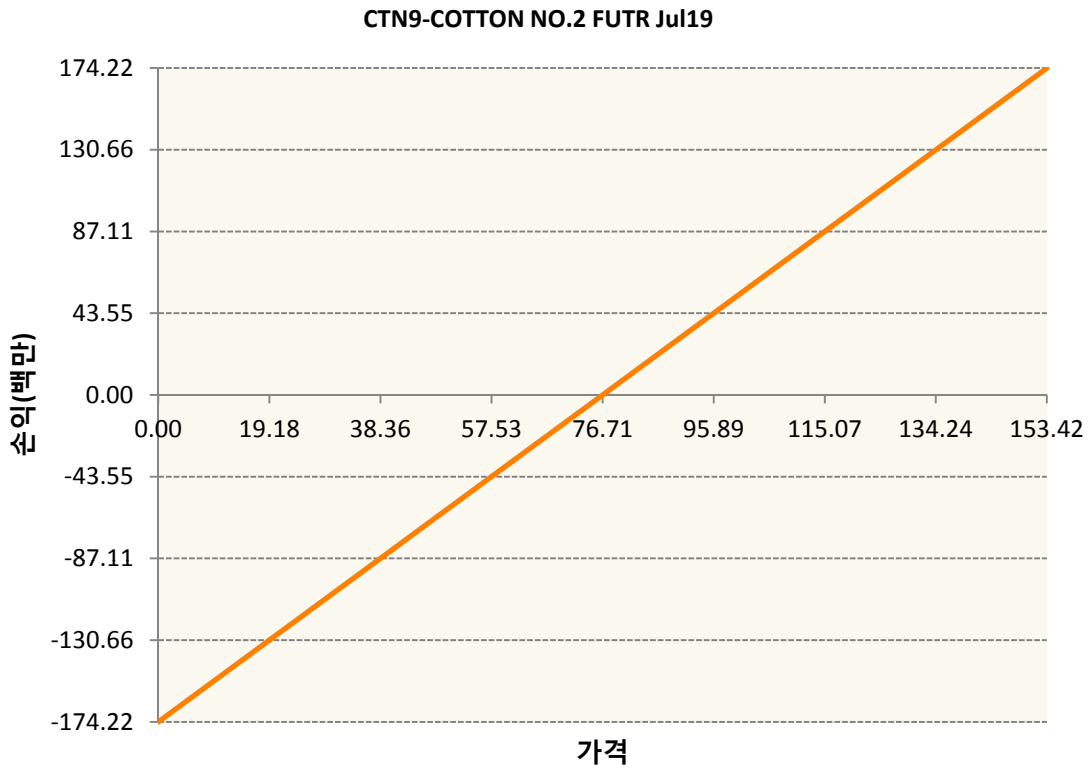
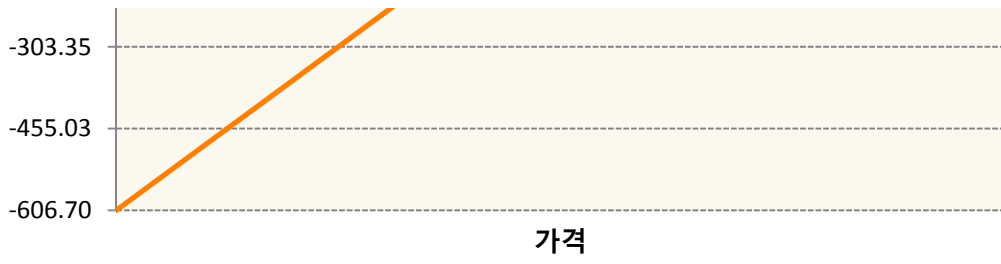
### 2. 만기시점의 손익구조

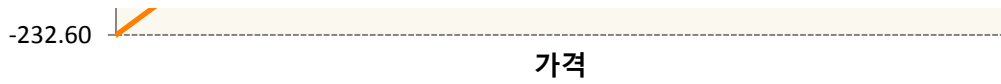
**BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19**



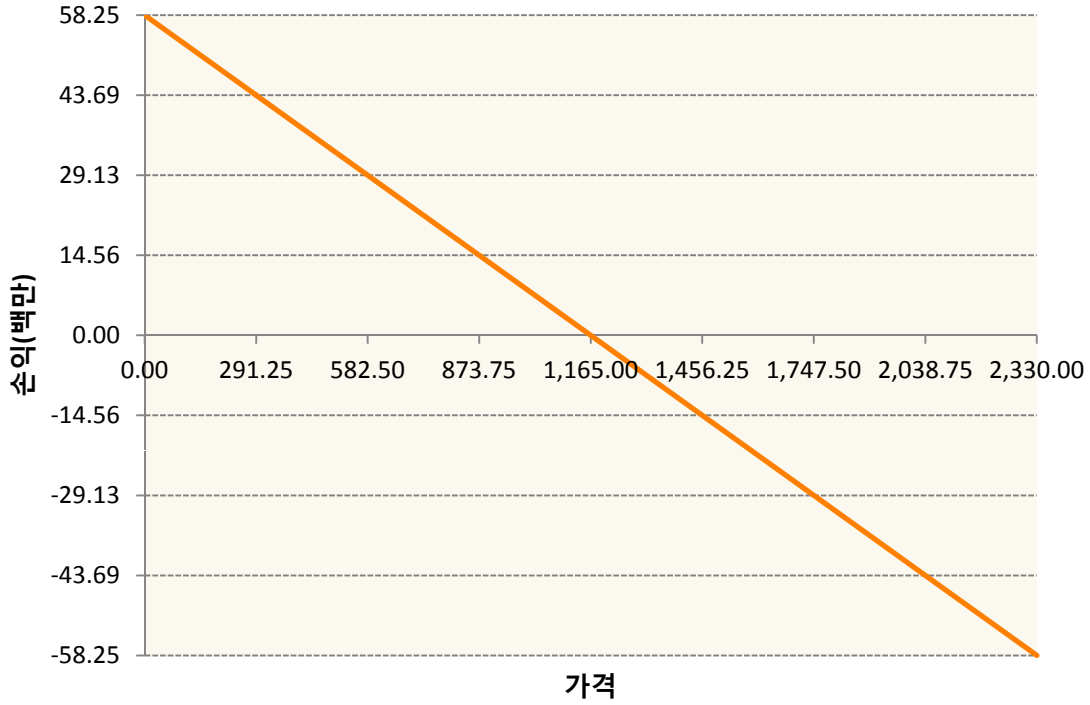
**CN9-CORN FUTURE Jul19**



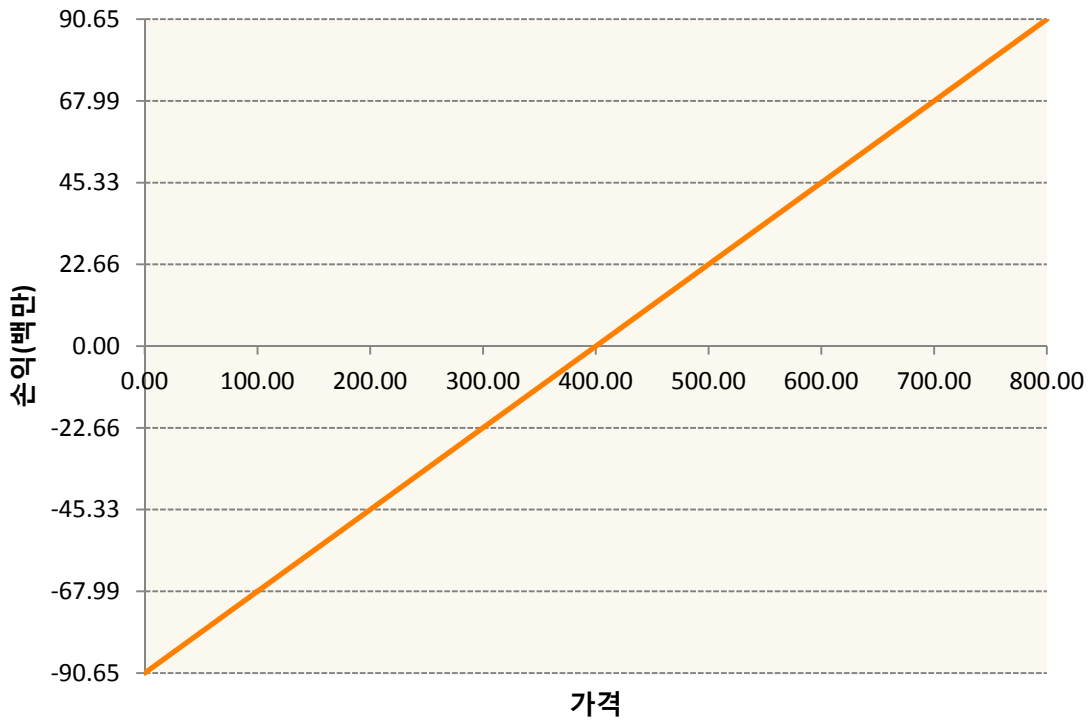




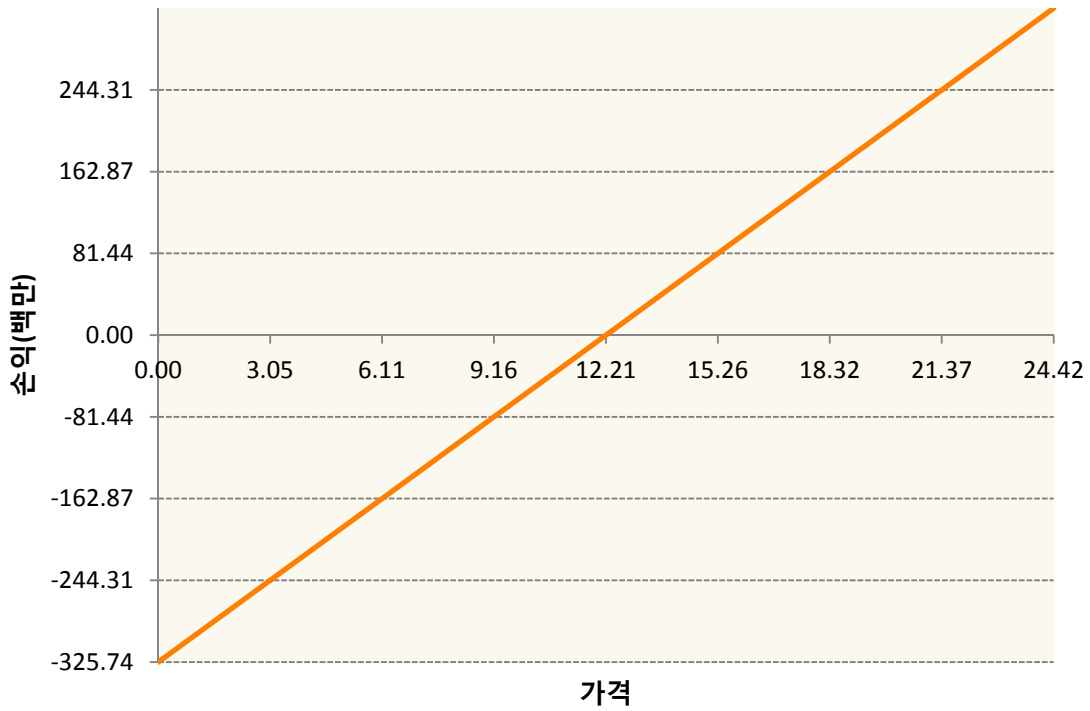
KR4175P50009-2019-05 달러선물



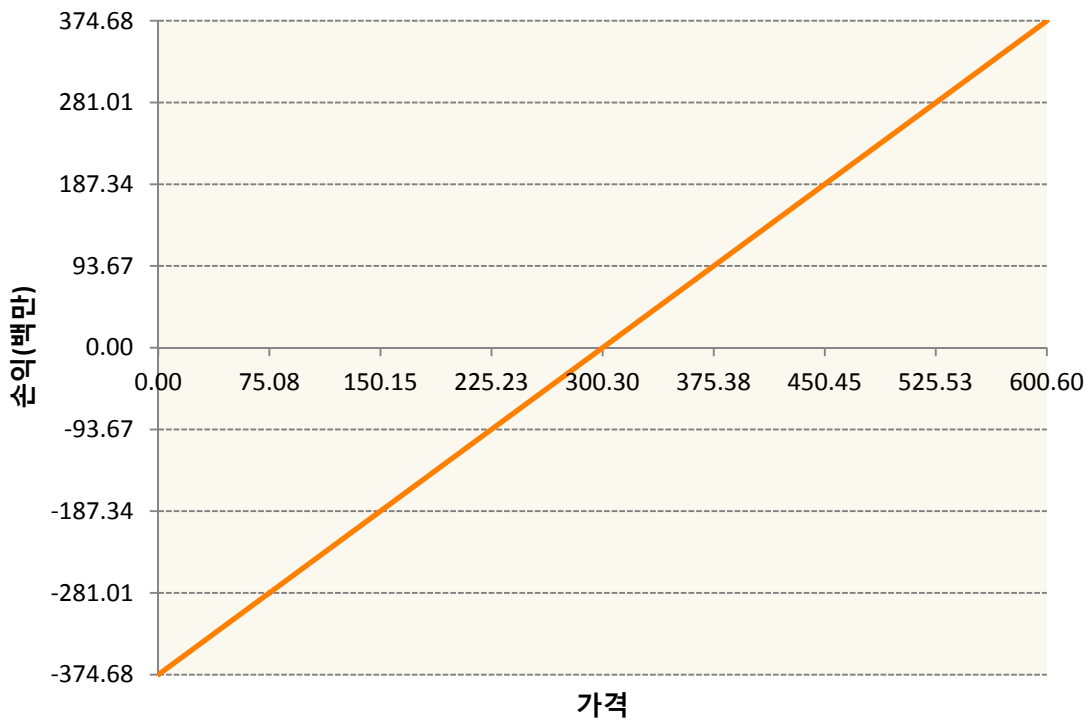
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

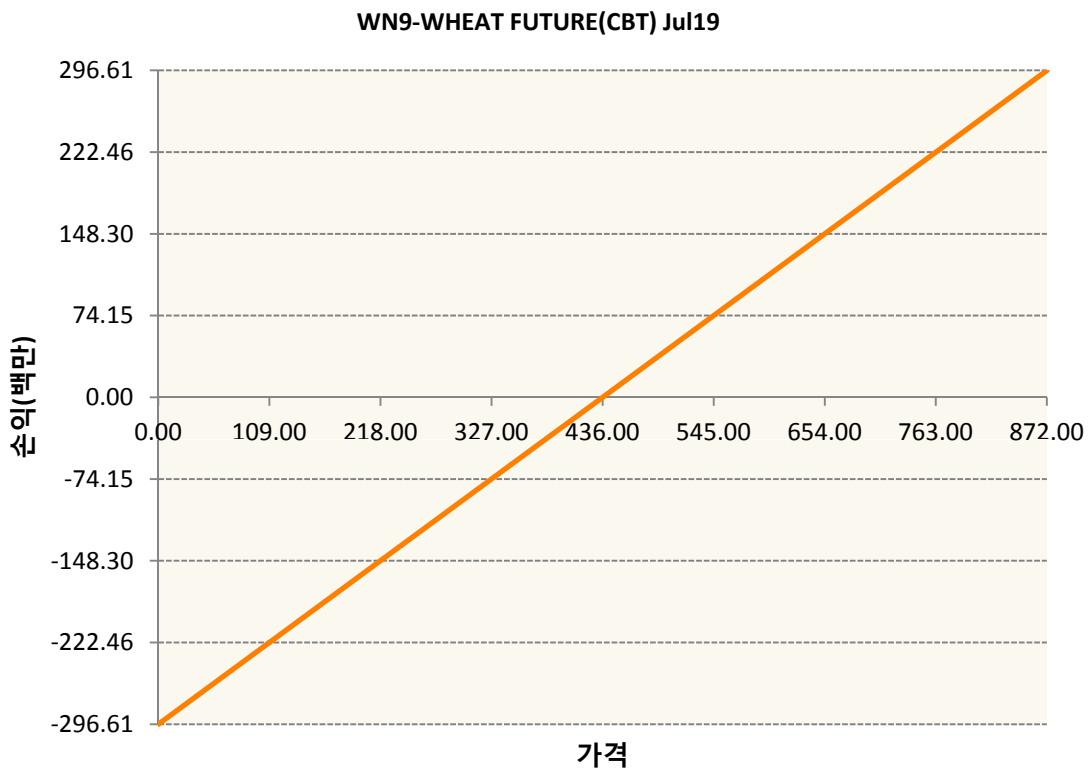
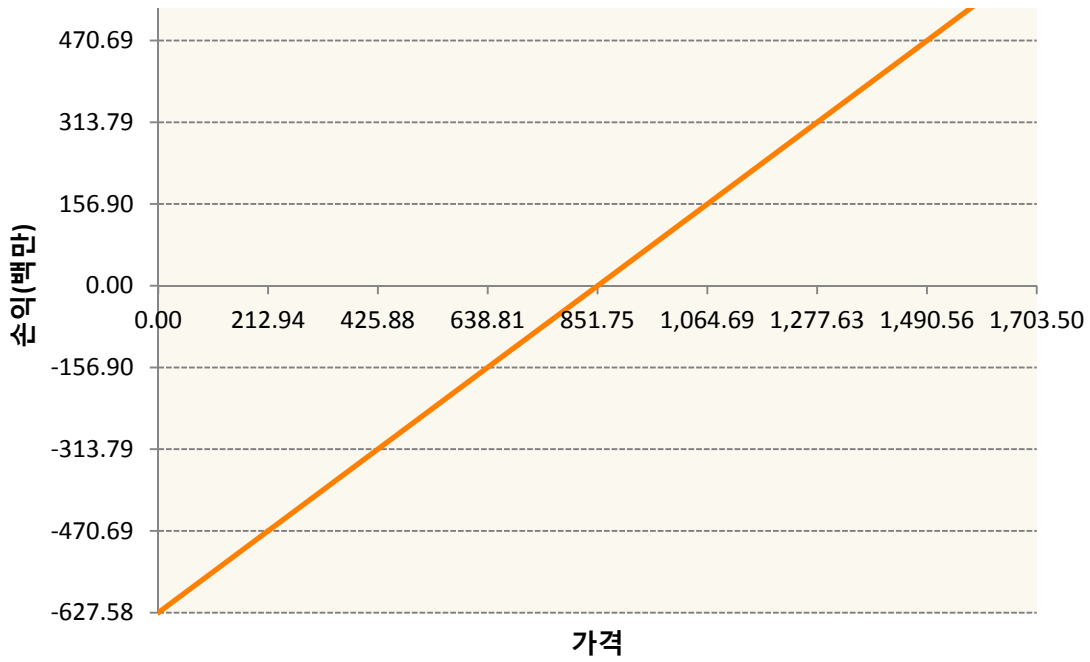


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19



SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BON9	SOYBEAN OIL FUTR Jul19	24
CN9	CORN FUTURE Jul19	49
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	50
WN9	WHEAT FUTURE(CBT) Jul19	24

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

(단위:백만원)

**244**