

공시일	2019-05-08
기준일	2019-05-07

포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6	0	6	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

93

공시일	2019-05-08
기준일	2019-05-07

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

1,163

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

682

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-05-08
기준일	2019-05-07

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)	307
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	85
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	144

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

851

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-05-08
기준일	2019-05-07

유로인덱스모(주식-파생형)

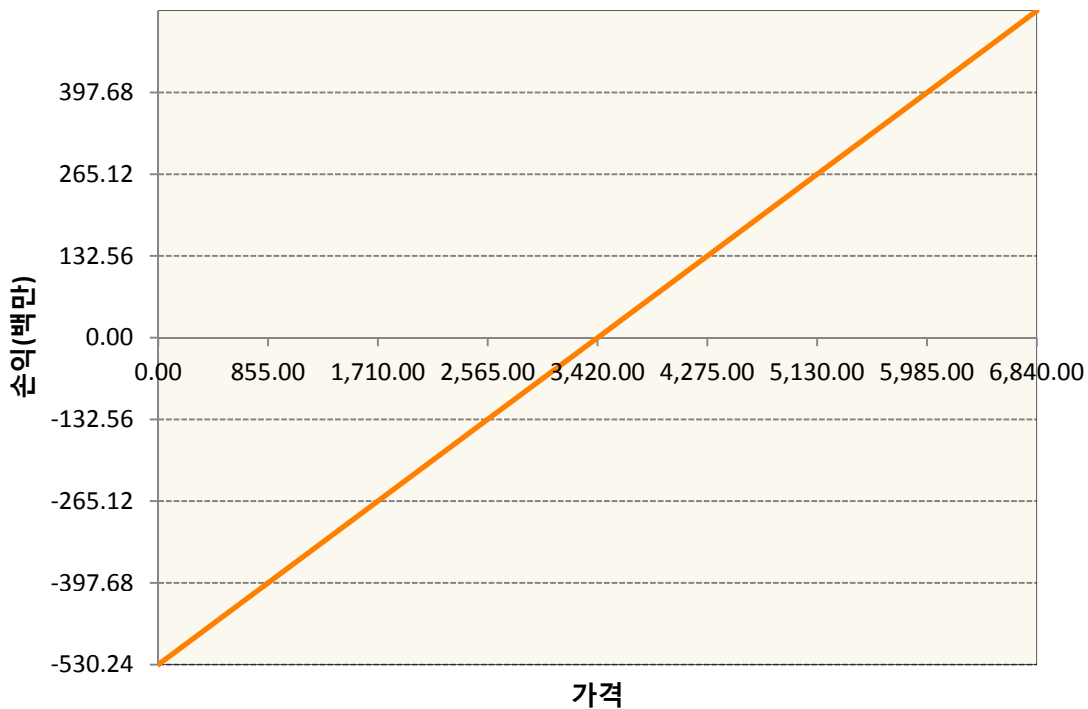
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	530	0	530	

2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	42
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

30

공시일	2019-05-08
기준일	2019-05-07

차이나인덱스모(주식-파생형)

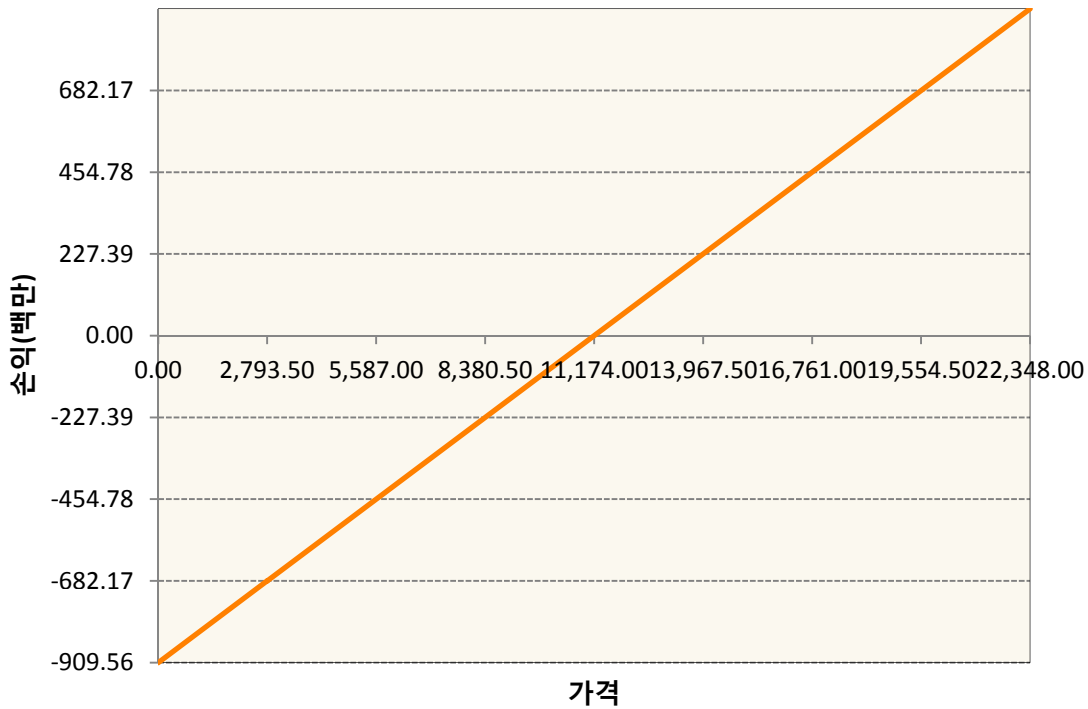
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	910	0	910	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK9	HSCEI Futures May19	73
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

75

공시일	2019-05-08
기준일	2019-05-07

커버드콜모(주식혼합-파생형)

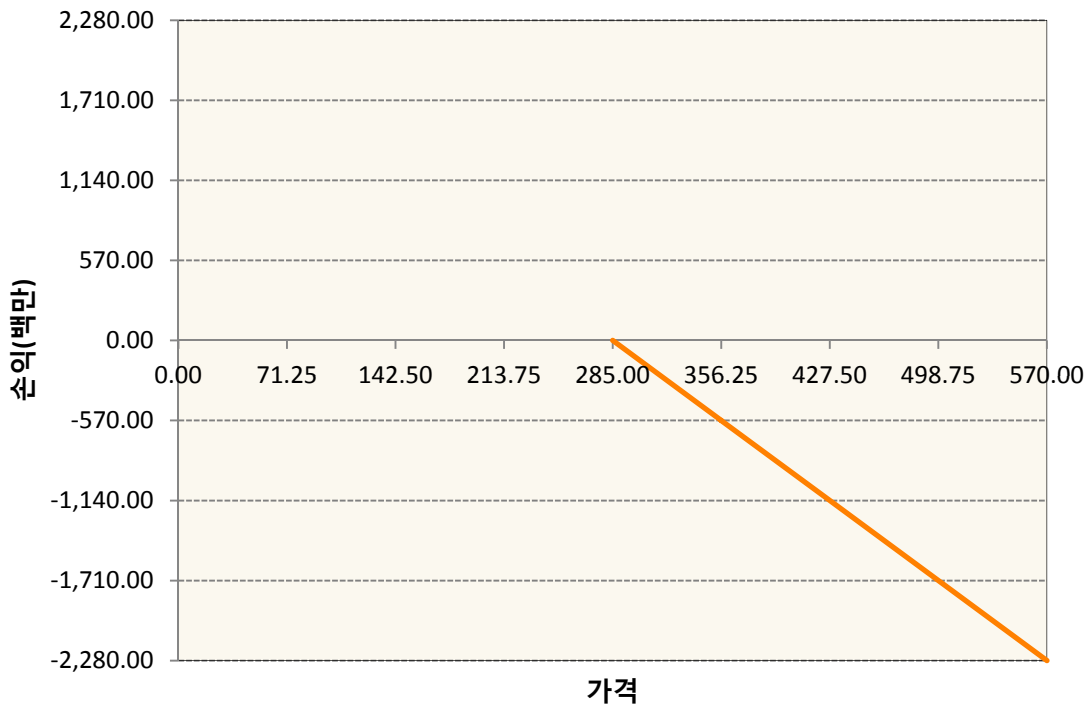
1. 계약금액

(단위:백만원)

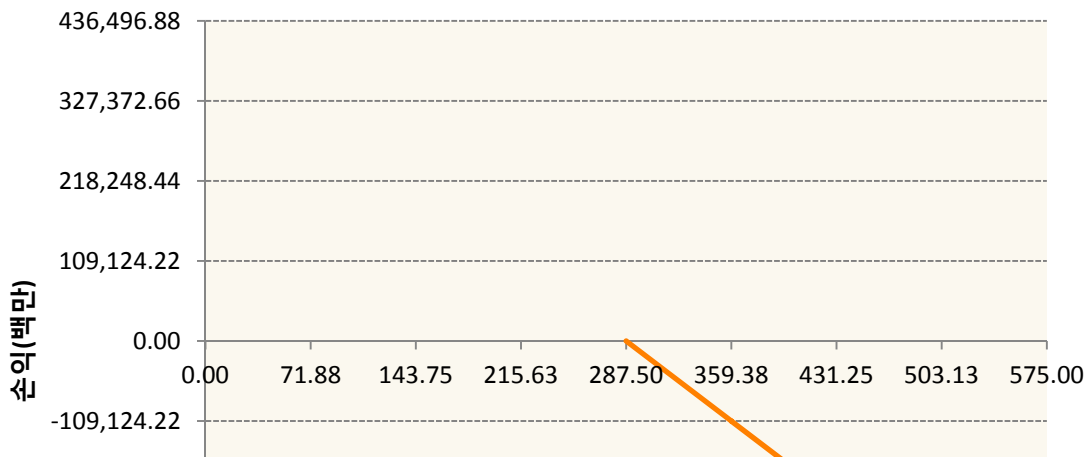
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	672,214	-672,214	장내

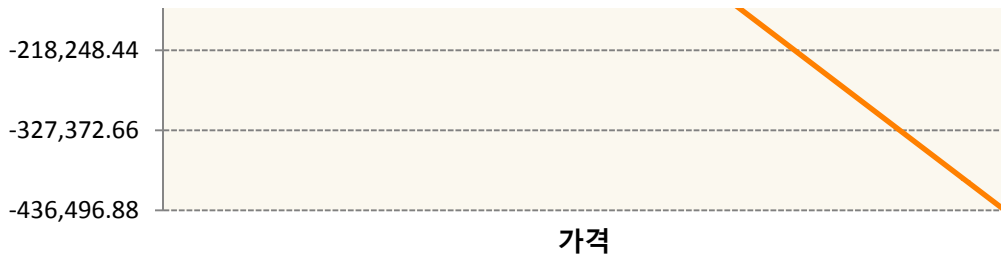
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P52850-2019-05 콜285

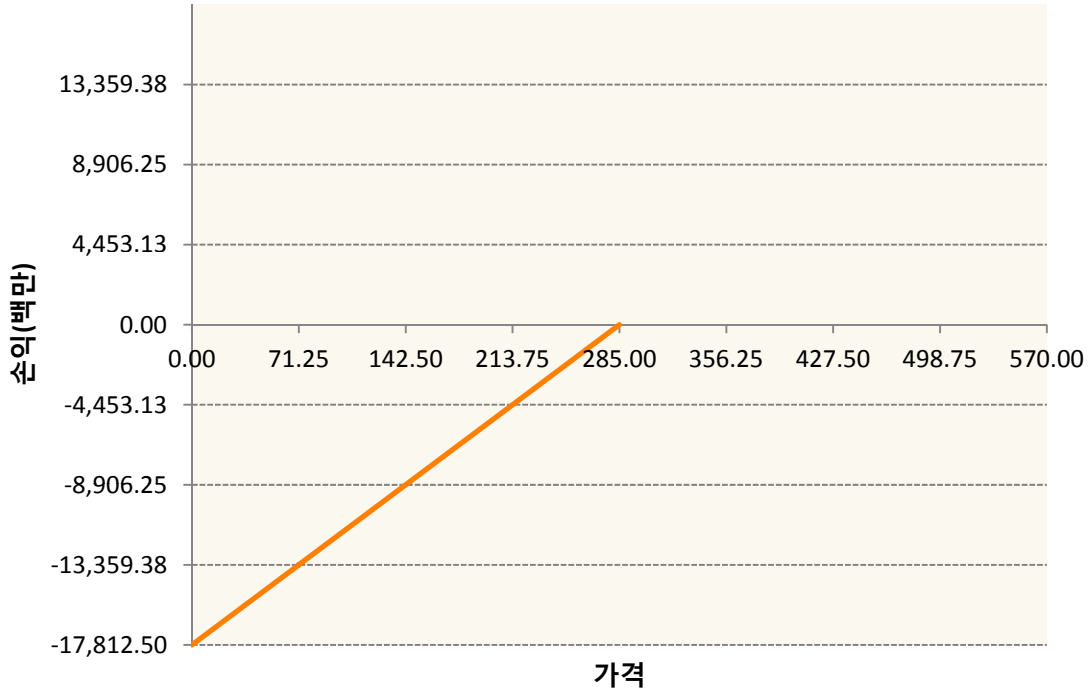


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

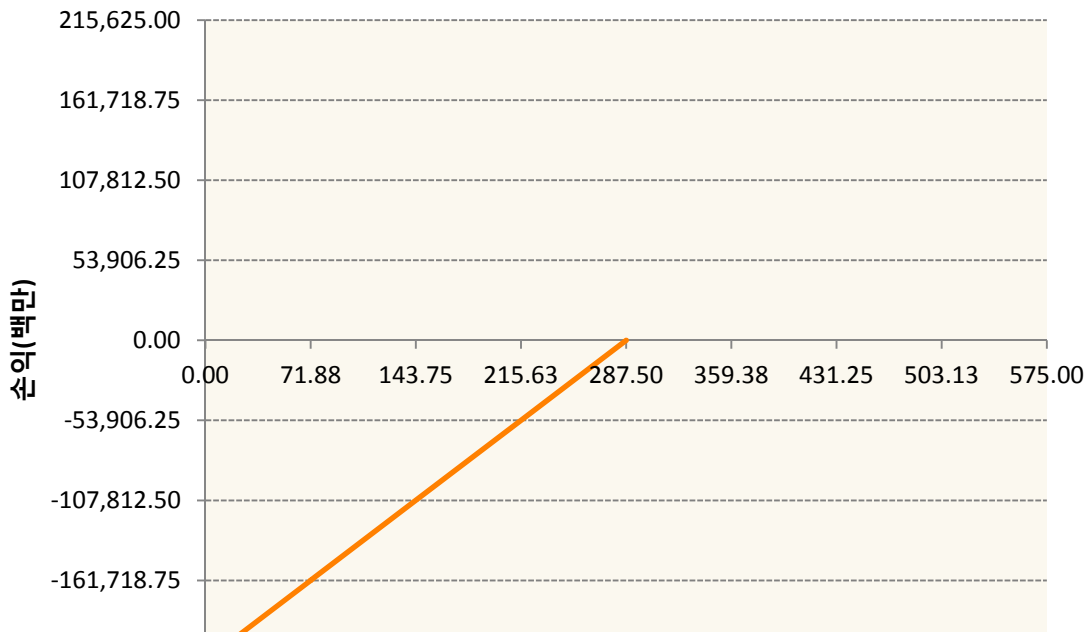




KR4301P52858-2019-05 풋285



KR4301P52874-2019-05 풋287.5



-215,625.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P52850		2019-05 콜285						144
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	6	6	6	6	6	6	6	
-5.33%	6	6	6	6	6	6	6	
-2.67%	6	6	6	6	6	5	5	
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3	
2.67%	-27	-28	-29	-30	-32	-33	-34	
5.33%	-84	-84	-85	-85	-85	-85	-85	
8.00%	-144	-144	-144	-144	-144	-144	-144	
KR4201P52876		2019-05 콜287.5						24,302
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	482	482	482	482	482	482	482	
-5.33%	482	482	482	482	482	482	481	
-2.67%	482	481	477	471	460	442	417	
0%	327	237	127	0	-143	-299	-467	
2.67%	-3,074	-3,333	-3,594	-3,857	-4,121	-4,386	-4,652	
5.33%	-12,917	-12,951	-13,001	-13,067	-13,149	-13,247	-13,360	
8.00%	-24,270	-24,270	-24,271	-24,274	-24,279	-24,288	-24,302	
KR4301P52858		2019-05 풋285						1,397
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,397	-1,397	-1,397	-1,397	-1,397	-1,397	-1,397	
-5.33%	-928	-928	-928	-928	-928	-928	-928	
-2.67%	-459	-459	-459	-459	-459	-459	-459	
0%	7	5	3	0	-3	-6	-10	
2.67%	238	236	234	231	228	225	222	
5.33%	241	241	241	241	241	241	241	
8.00%	241	241	241	241	241	241	241	
KR4301P52874		2019-05 풋287.5						16,861
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-16,861	-16,861	-16,861	-16,861	-16,861	-16,861	-16,861	
-5.33%	-11,236	-11,236	-11,236	-11,236	-11,236	-11,236	-11,236	
-2.67%	-5,610	-5,610	-5,610	-5,610	-5,610	-5,610	-5,610	
0%	14	11	7	0	-10	-24	-40	
2.67%	4,366	4,301	4,235	4,167	4,098	4,028	3,957	

5.33%	4,664	4,664	4,664	4,663	4,661	4,658	4,654
8.00%	4,664	4,664	4,664	4,664	4,664	4,664	4,664

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

(단위:백만원)

45,549

공시일	2019-05-08
기준일	2019-05-07

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

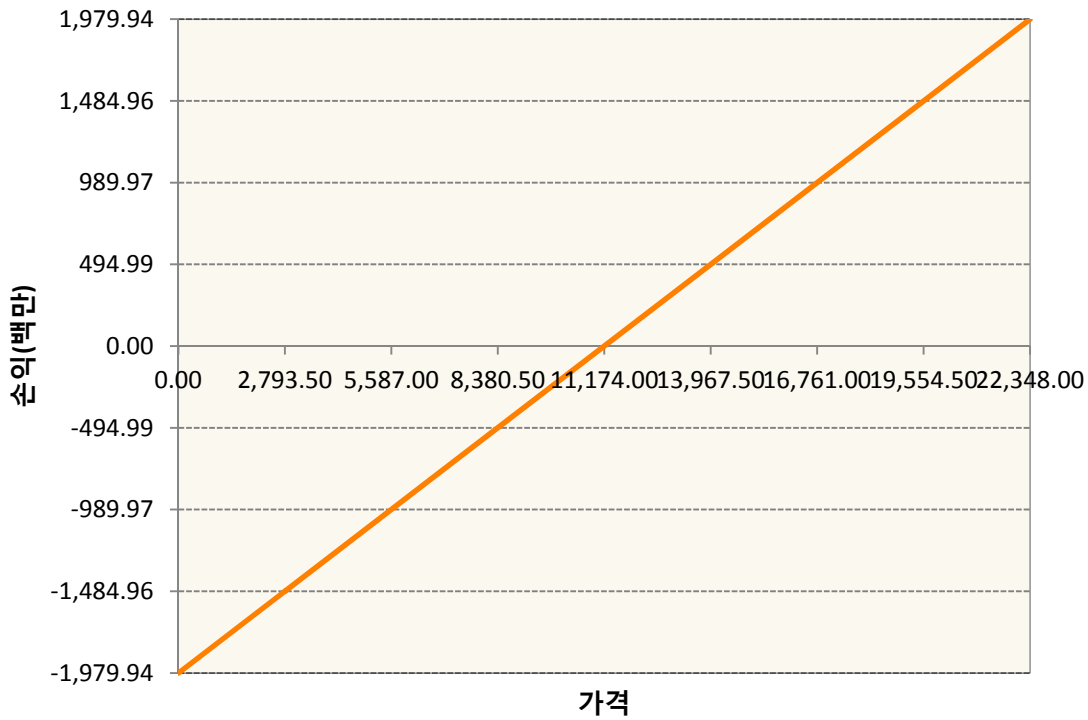
1. 계약금액

(단위:백만원)

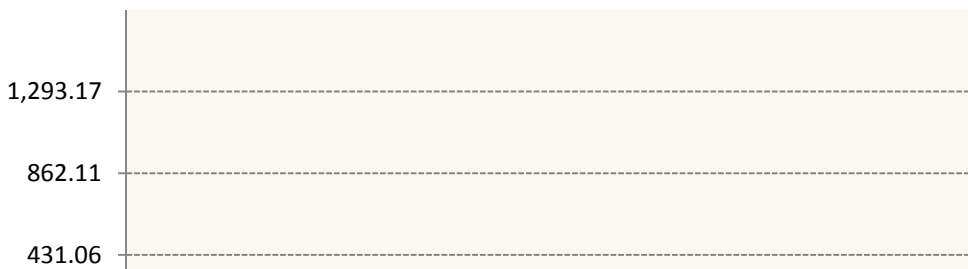
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,980	0	1,980	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,535	-5,535	장내
누계	통화	선도	0	3,122	-3,122	장외

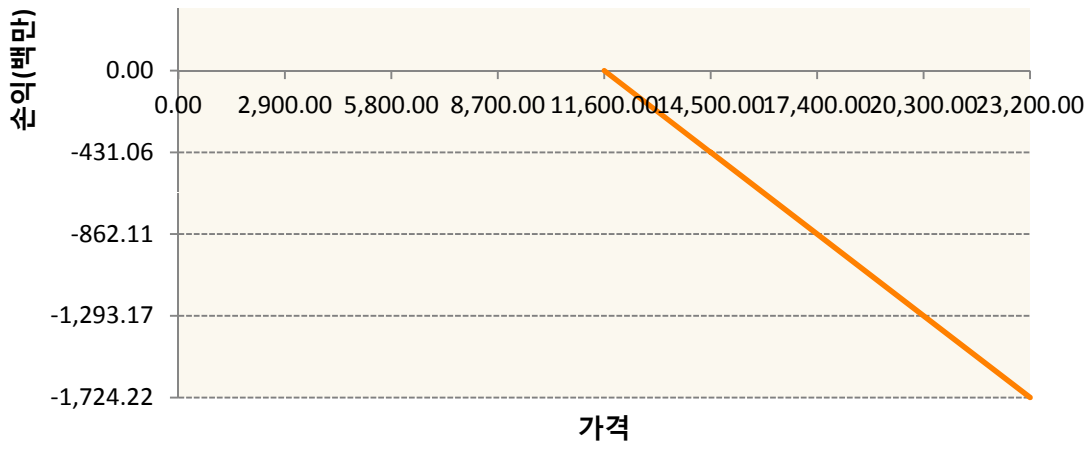
2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19

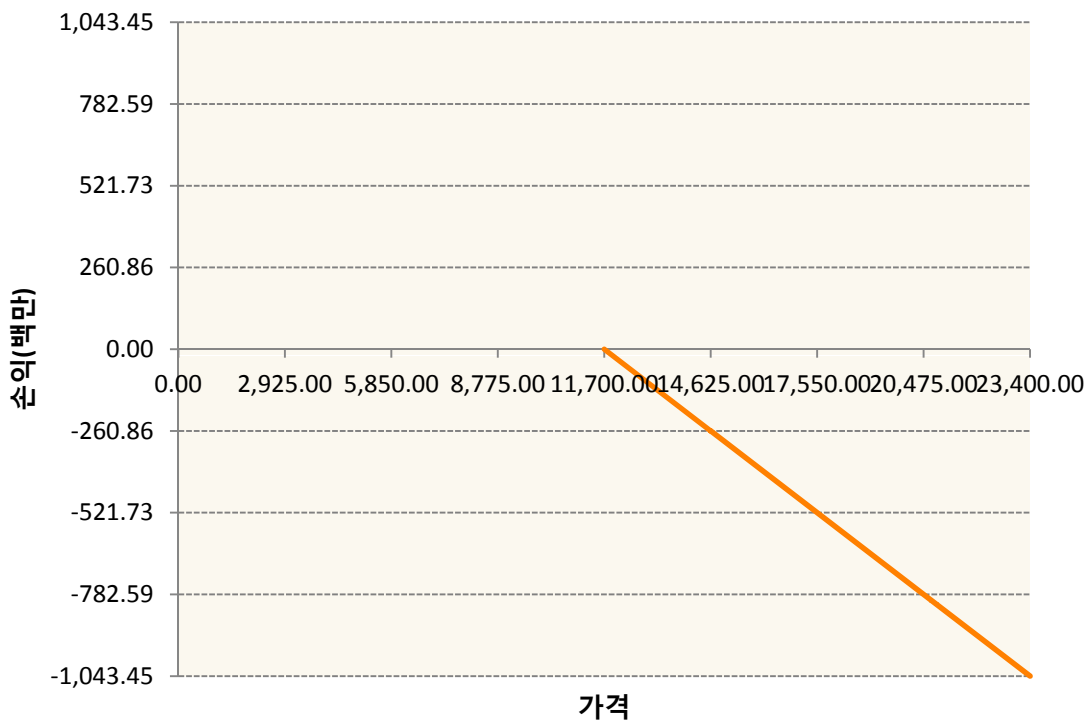


OHHIK9-C116-HSCEI

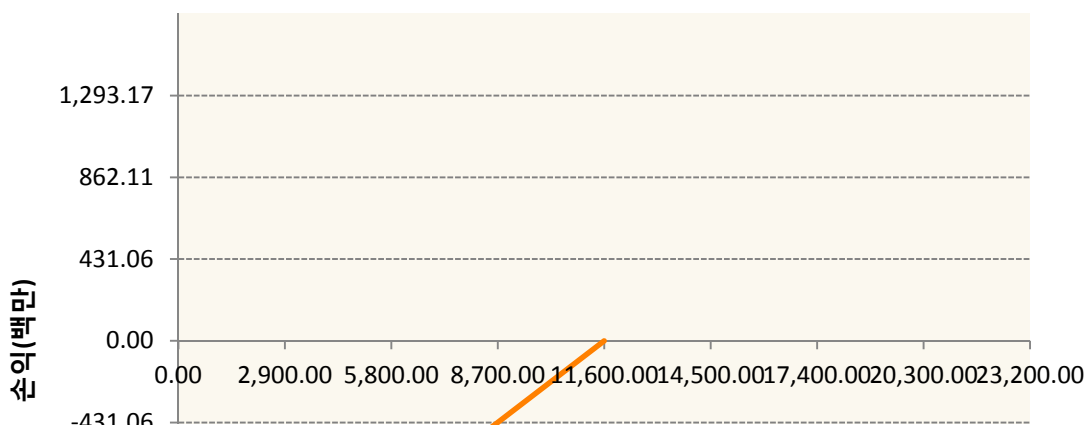


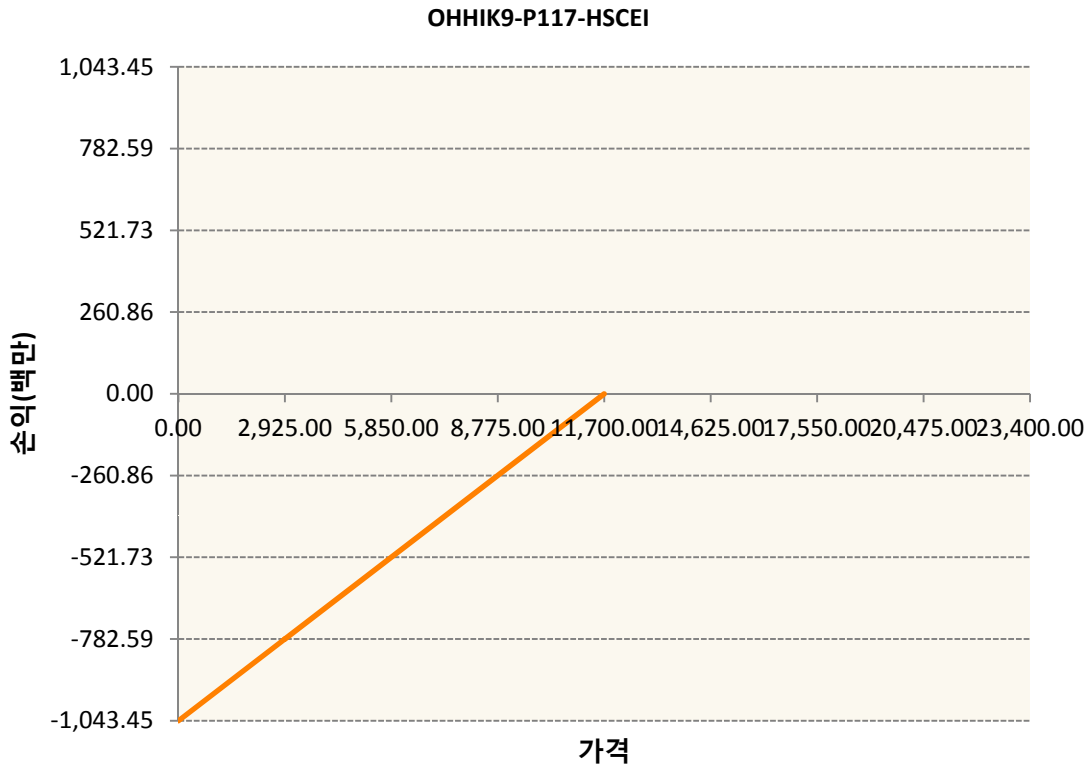


OHHIK9-C117-HSCEI



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	158
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)
	707

공시일	2019-05-08
기준일	2019-05-07

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

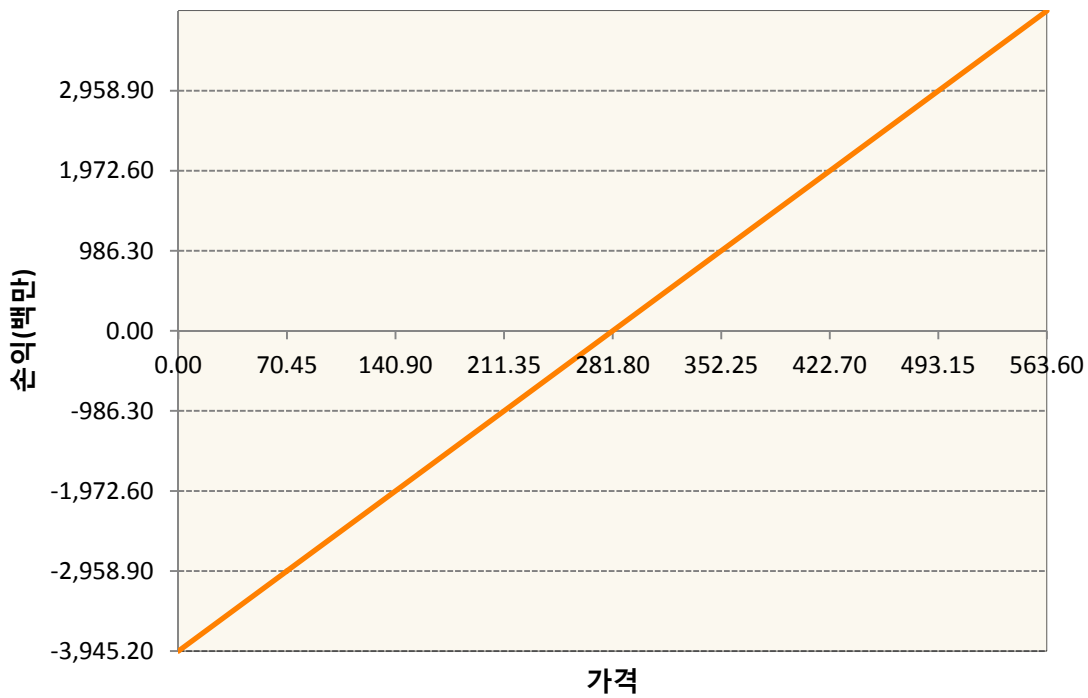
1. 계약금액

(단위:백만원)

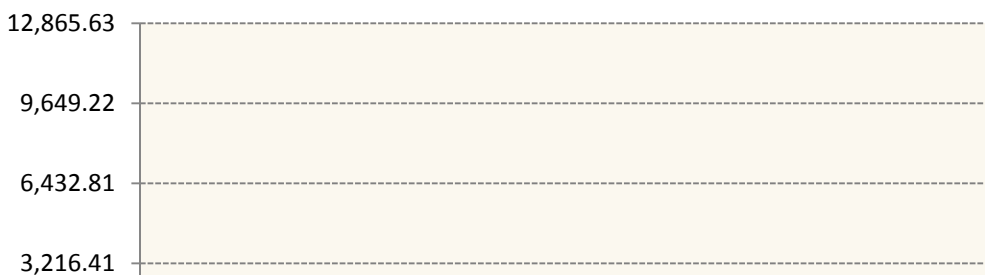
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,945	0	3,945	장내
누계	유가증권	스왑	32,836	0	32,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	27,593	-27,593	장내

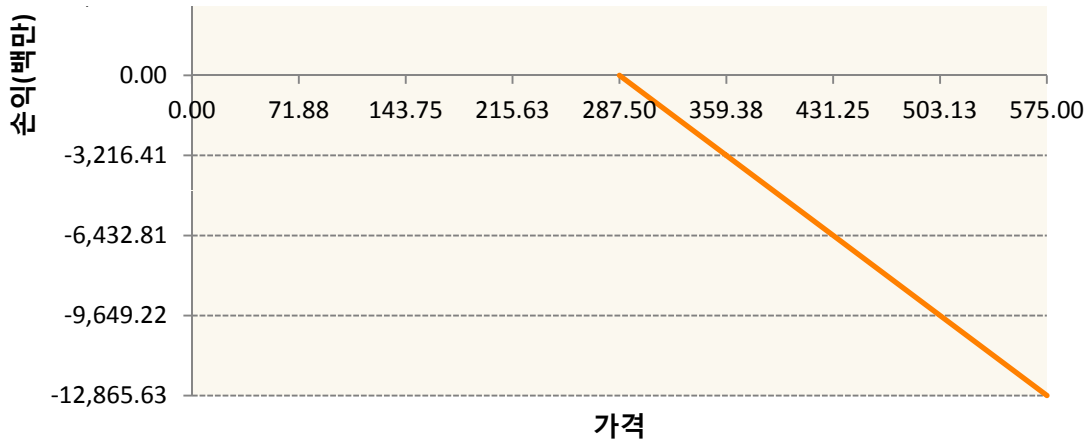
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

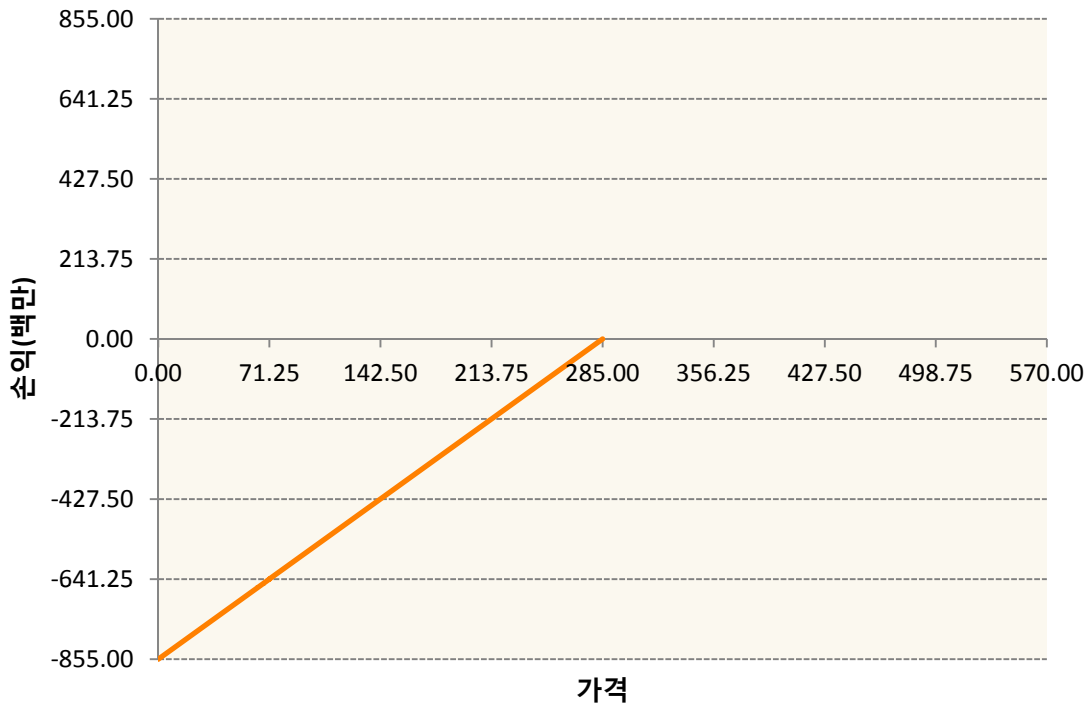


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

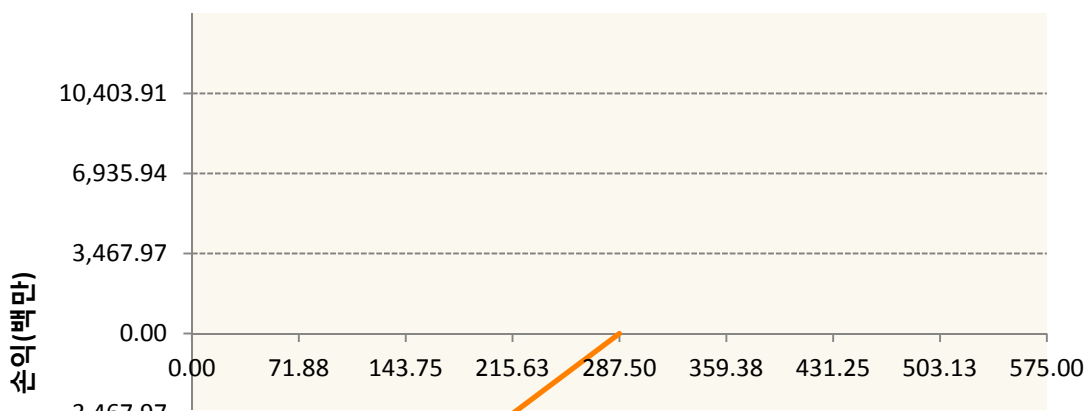


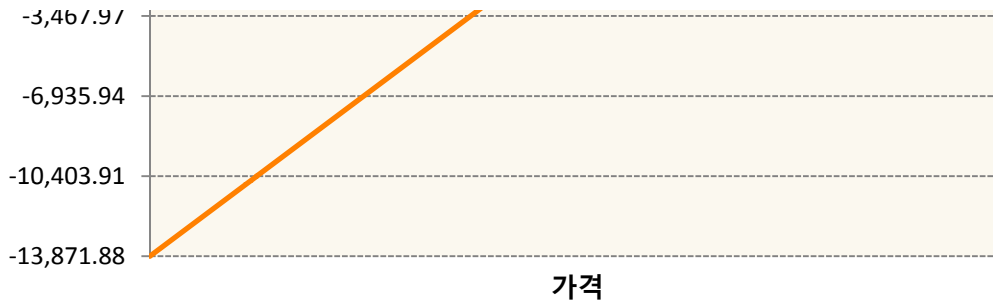


KR4301P52858-2019-05 풋285



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						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						716
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	14	14	14	14	14	14	14
-5.33%	14	14	14	14	14	14	14
-2.67%	14	14	14	14	14	13	12
0%	10	7	4	0	-4	-9	-14
2.67%	-91	-98	-106	-114	-121	-129	-137
5.33%	-381	-382	-383	-385	-388	-390	-394
8.00%	-715	-715	-715	-715	-716	-716	-716
KR4301P52858 2019-05 풋285							67
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67
-5.33%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
-2.67%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	11	11	11	11	11	11	11
5.33%	12	12	12	12	12	12	12
8.00%	12	12	12	12	12	12	12
KR4301P52874 2019-05 풋287.5							1,085
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085
-5.33%	-723	-723	-723	-723	-723	-723	-723
-2.67%	-361	-361	-361	-361	-361	-361	-361
0%	1	1	0	0	-1	-2	-3
2.67%	281	277	272	268	264	259	255
5.33%	300	300	300	300	300	300	299
8.00%	300	300	300	300	300	300	300

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

(단위:백만원)

5,178

공시일	2019-05-08
기준일	2019-05-07

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

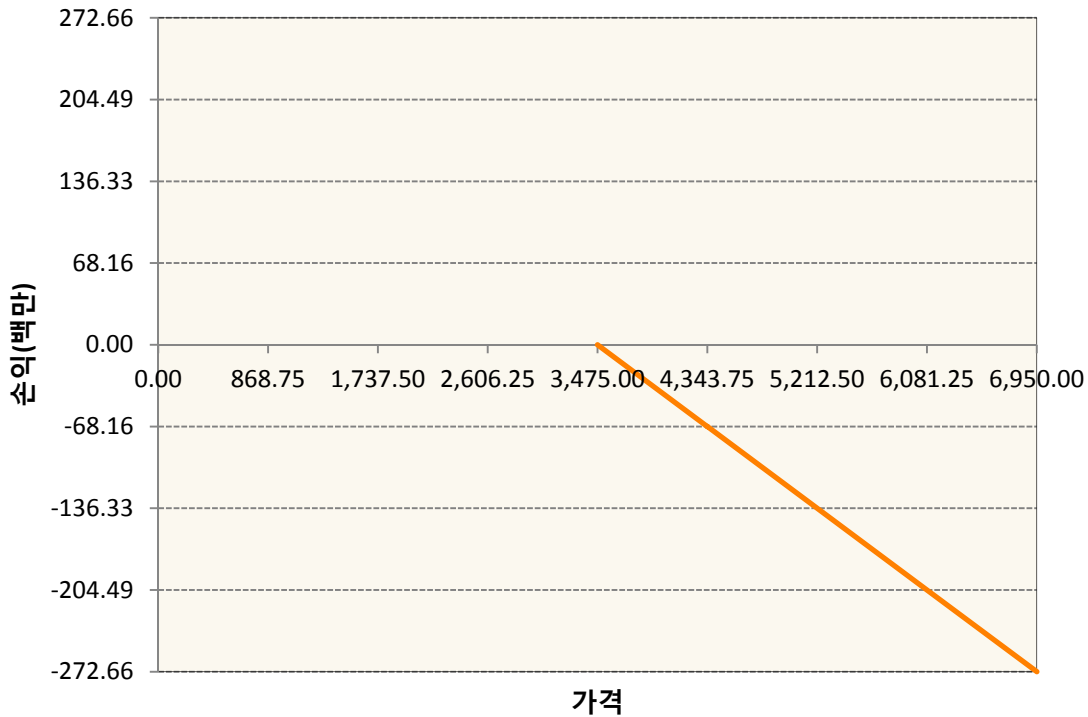
1. 계약금액

(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	1,582	0	1,582	
누계	유가증권	스왑	64,424	0	64,424	장외
누계	유가증권	옵션	0	17,480	-17,480	장내
누계	통화	선도	0	18,308	-18,308	장외

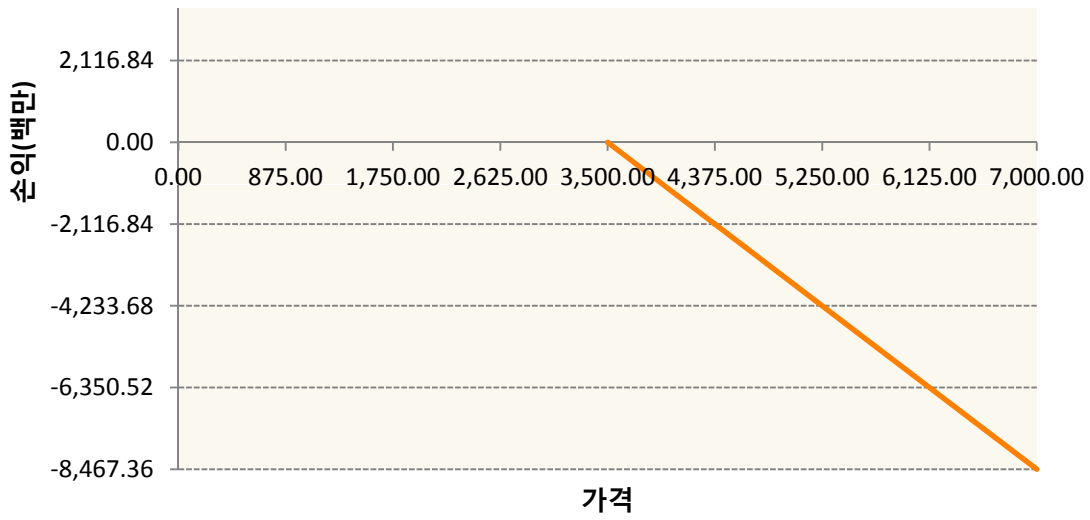
2. 만기시점의 손익구조

OESXK9-C3475-EURO STOXX 50

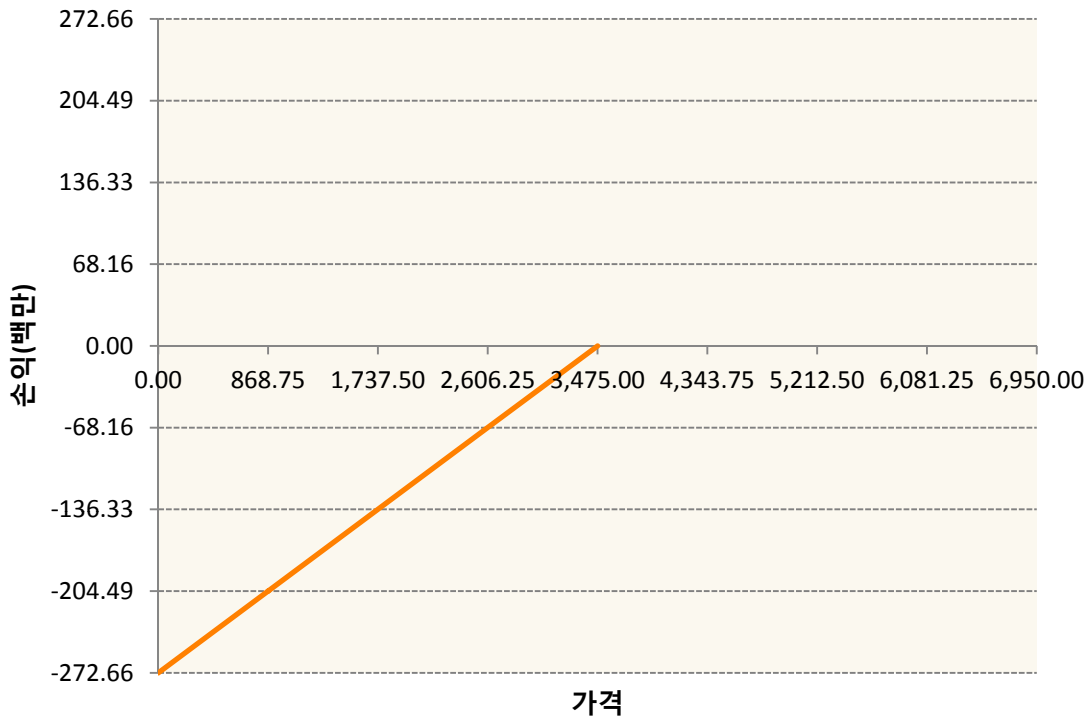


OESXK9-C3500-EURO STOXX 50

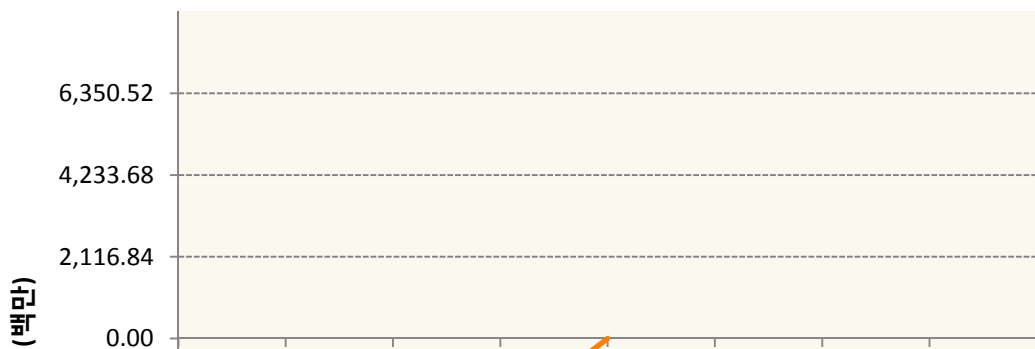


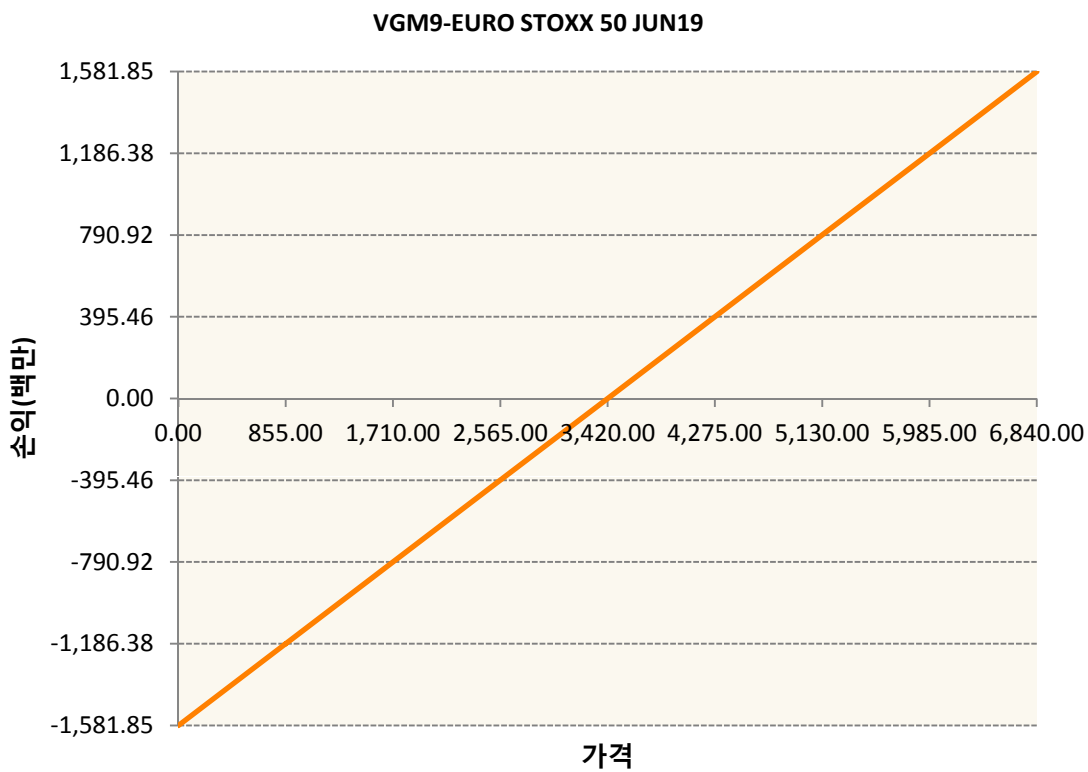
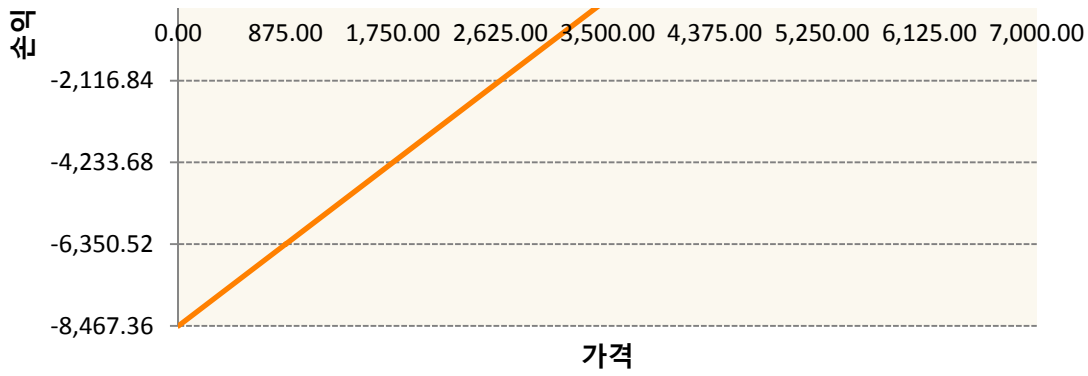


OESXK9-P3475-EURO STOXX 50



OESXK9-P3500-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	16
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)

1,837

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

(단위:백만원)

1,090

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

(단위:백만원)

93

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

(단위:백만원)

135

공시일	2019-05-08
기준일	2019-05-07

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

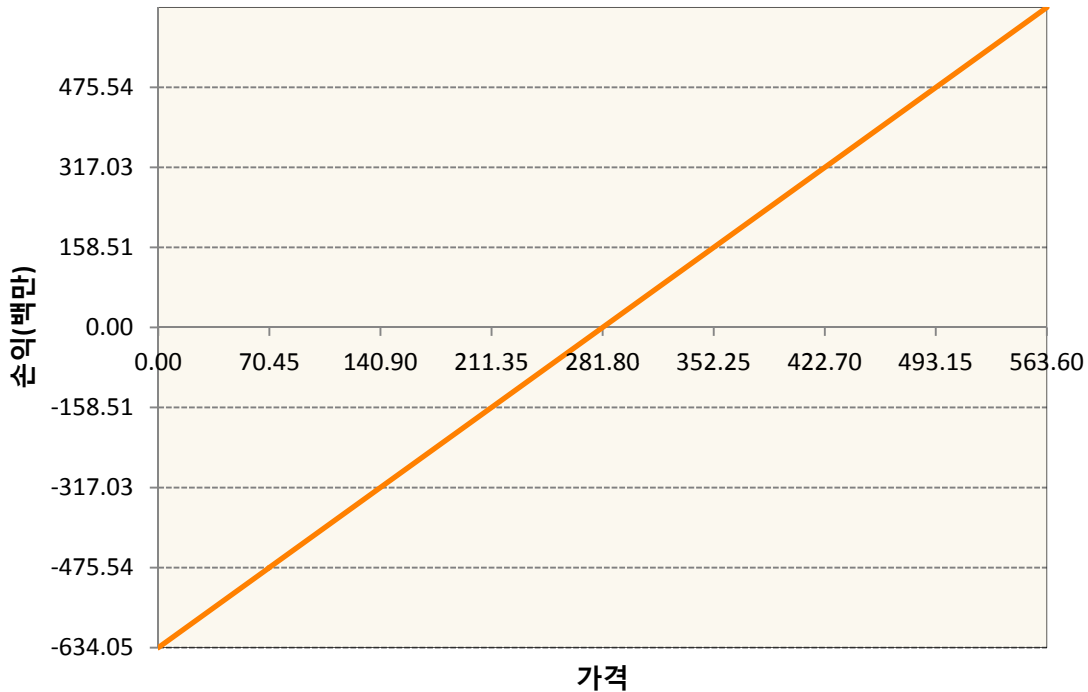
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	634	0	634	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	2019-05-08
기준일	2019-05-07

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

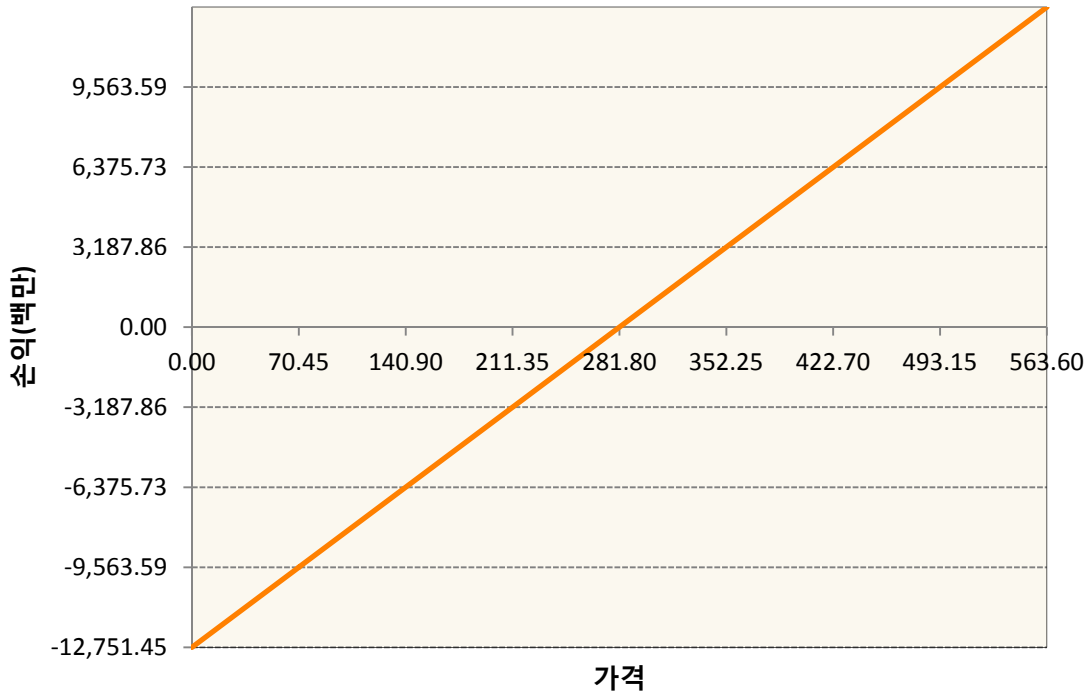
1. 계약금액

(단위:백만원)

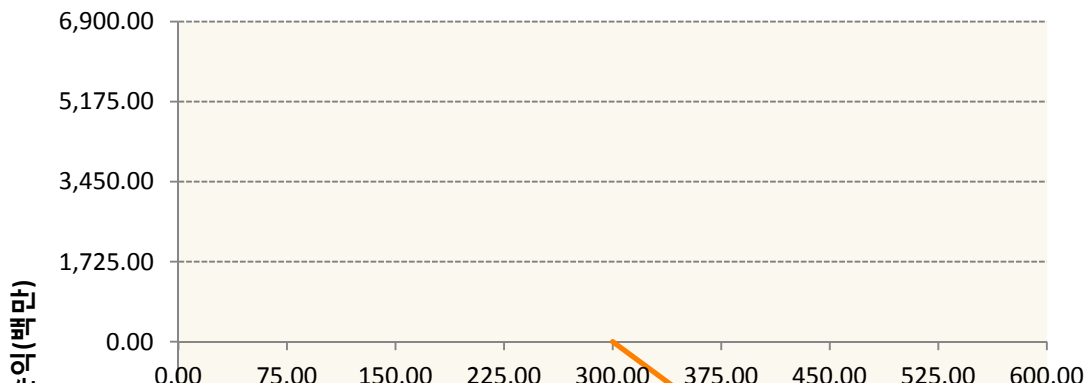
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,751	0	12,751	장내
누계	유가증권	옵션	1,366	24,294	-22,928	장내

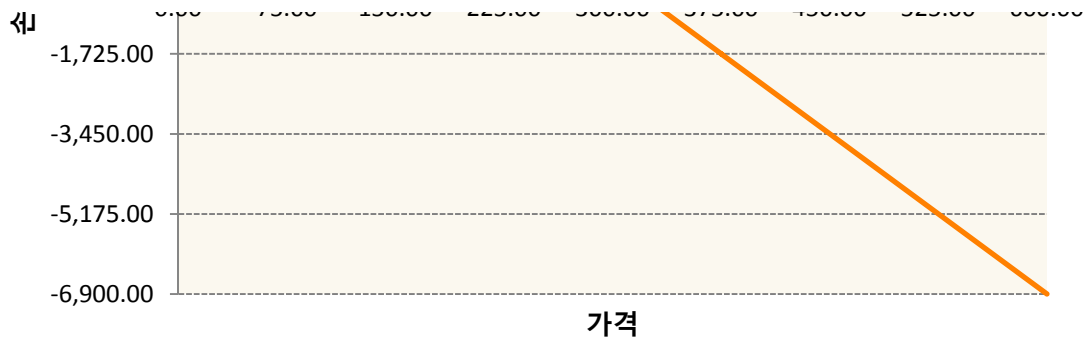
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

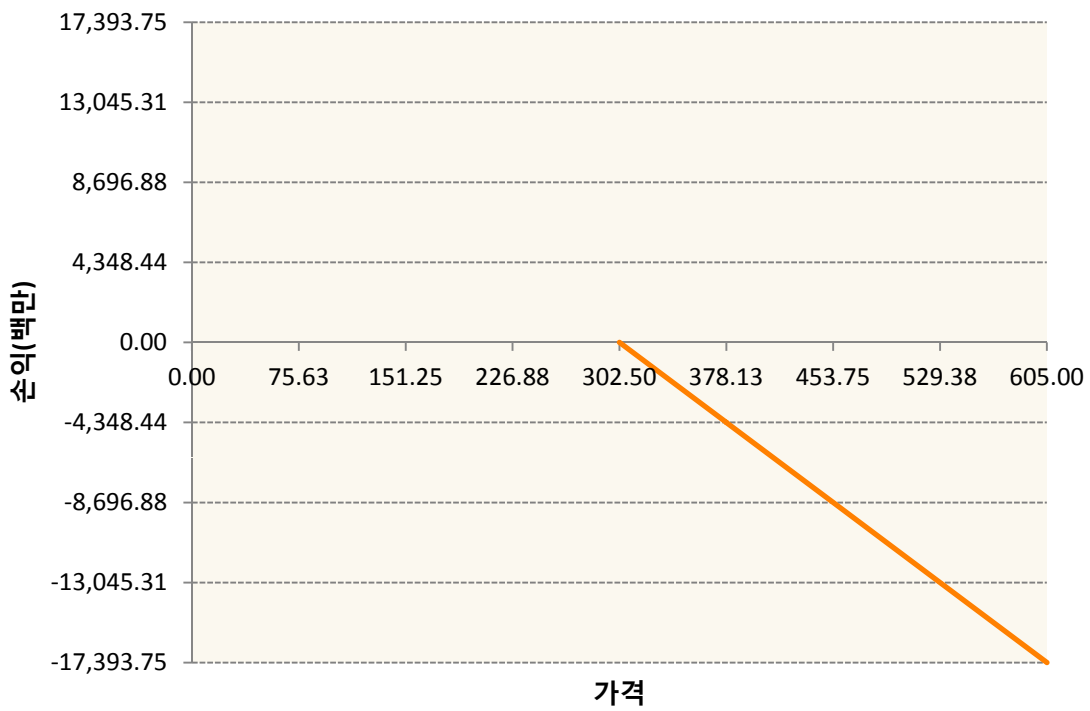


KR4201P53007-2019-05 콜300

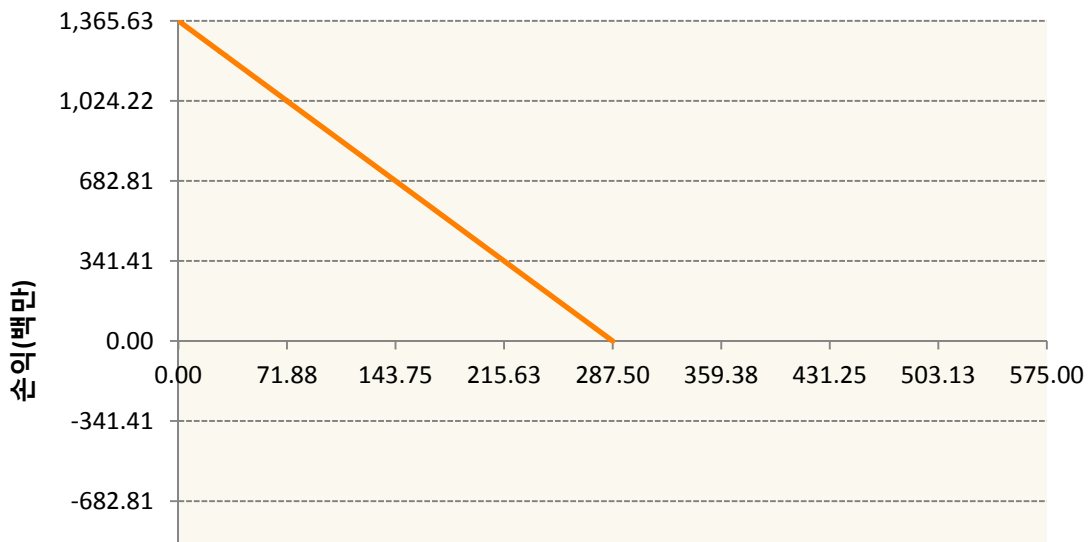


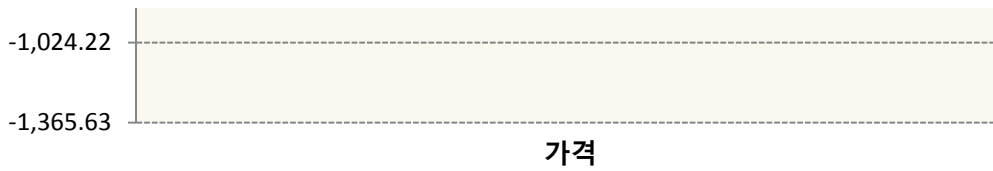


KR4201P53023-2019-05 콜302.5



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						118
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0	
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0	
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	0	0	-1	-1	-2	-2	-3	
5.33%	-10	-13	-16	-19	-23	-26	-30	
8.00%	-97	-100	-103	-107	-110	-114	-118	
KR4201P53023		2019-05 콜302.5						202
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0	
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0	
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	0	0	0	-1	-1	-2	-3	
5.33%	-7	-11	-16	-22	-28	-34	-41	
8.00%	-139	-150	-160	-171	-181	-192	-202	
KR4301P52874		2019-05 풋287.5						107
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	107	107	107	107	107	107	107	
-5.33%	71	71	71	71	71	71	71	
-2.67%	36	36	36	36	36	36	36	

0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-28	-27	-27	-26	-26	-26	-25
5.33%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-29
8.00%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30

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

(단위:백만원)

946

공시일	2019-05-08
기준일	2019-05-07

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	4,592	0	4,592	

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	2019-05-08
기준일	2019-05-07

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	75,713	0	75,713	

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	2019-05-08
기준일	2019-05-07

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	165,189	0	165,189	
누계	통화	선도	0	189,078	-189,078	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		1,400
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		784
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		982
FX21019J035 KRW/USD 26-06-19E		1,008

FX21019J041 KRW/USD 28-05-19E	280
FX21019J042 KRW/USD 03-06-19E	560
FX21019J044 KRW/USD 03-06-19E	467
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E	280
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E	467
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E	653
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E	653

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

(단위:백만원)

5,186

공시일	2019-05-08
기준일	2019-05-07

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

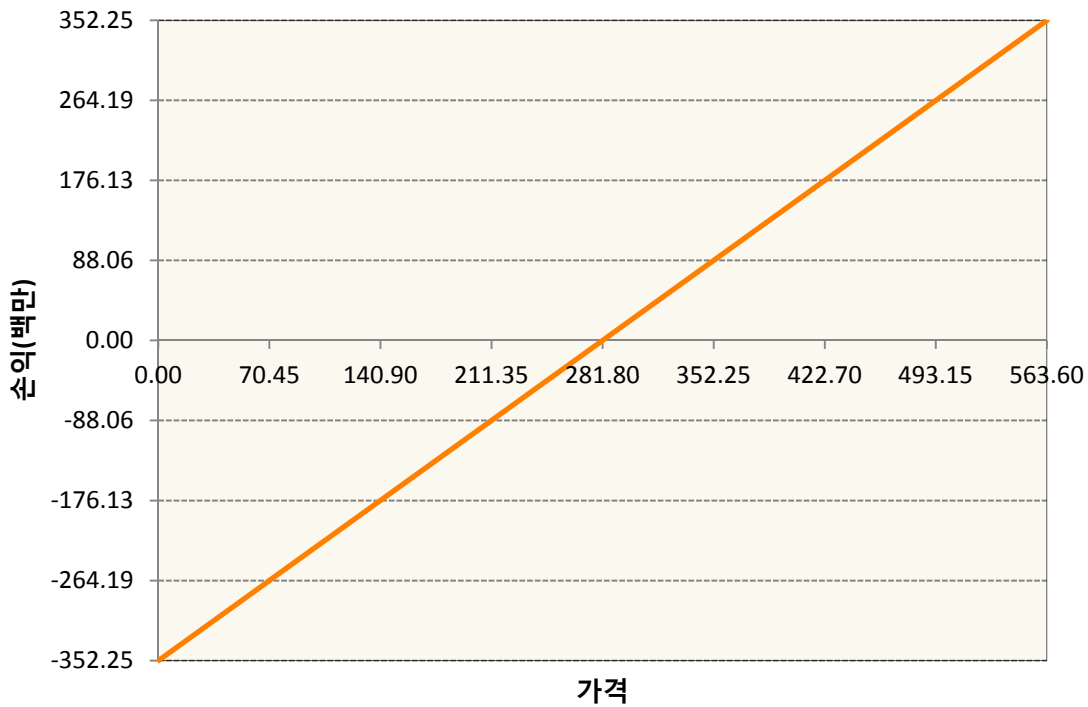
1. 계약금액

(단위:백만원)

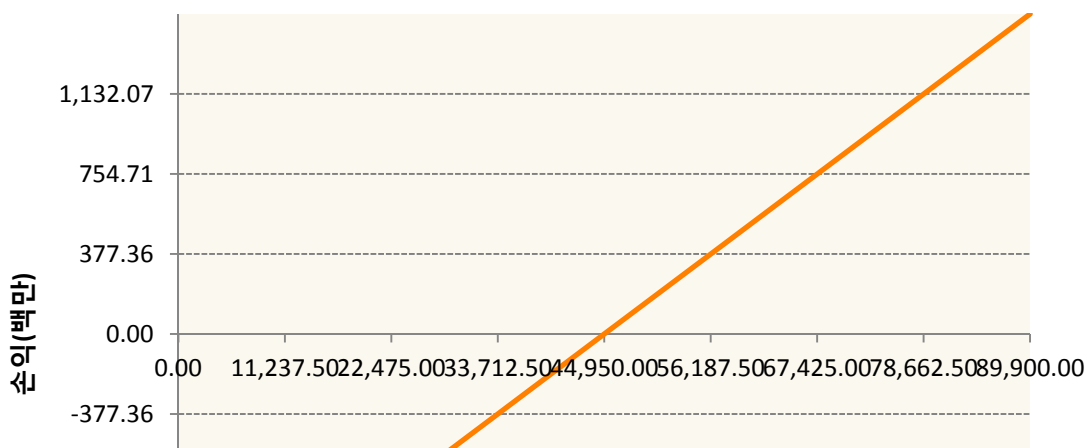
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	70	0	70	장내
누계	유가증권	선물	1,862	0	1,862	장내

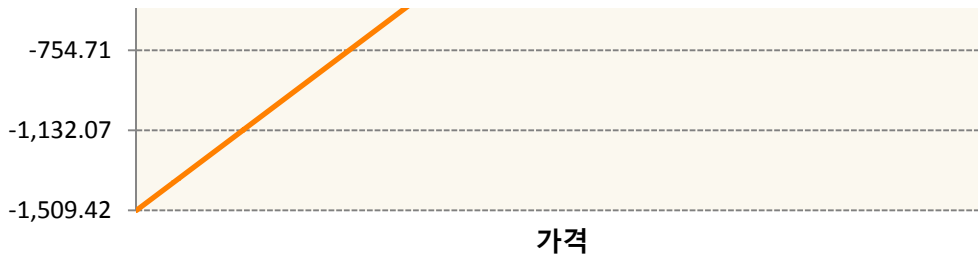
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4111P50004-2019-05 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						28
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28	
-5.33%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
-2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	9	9	9	9	9	9	9	
5.33%	19	19	19	19	19	19	19	
8.00%	28	28	28	28	28	28	28	
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)

163

공시일	2019-05-08
기준일	2019-05-07

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

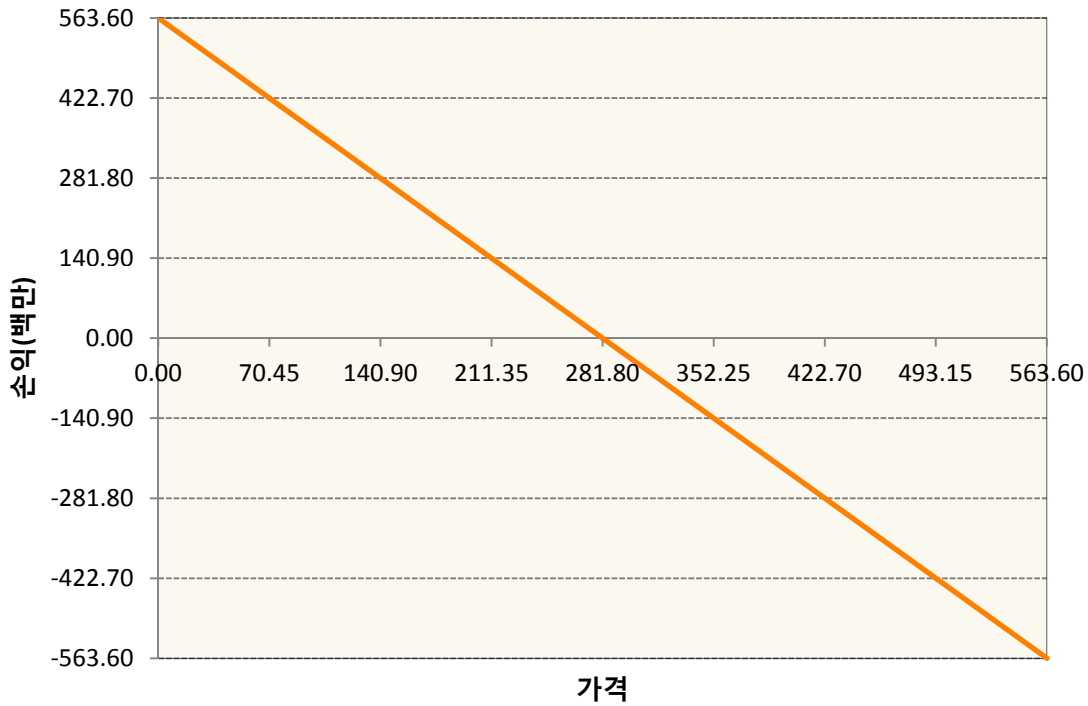
1. 계약금액

(단위:백만원)

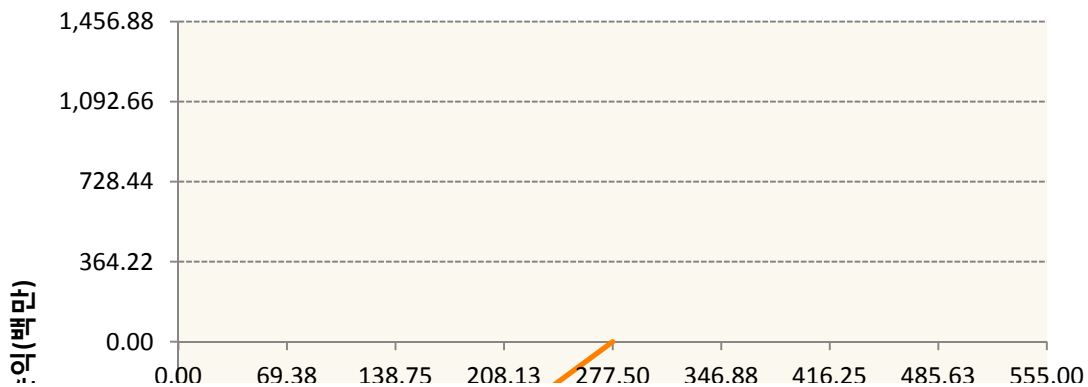
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	564	-564	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,137	-3,137	장내

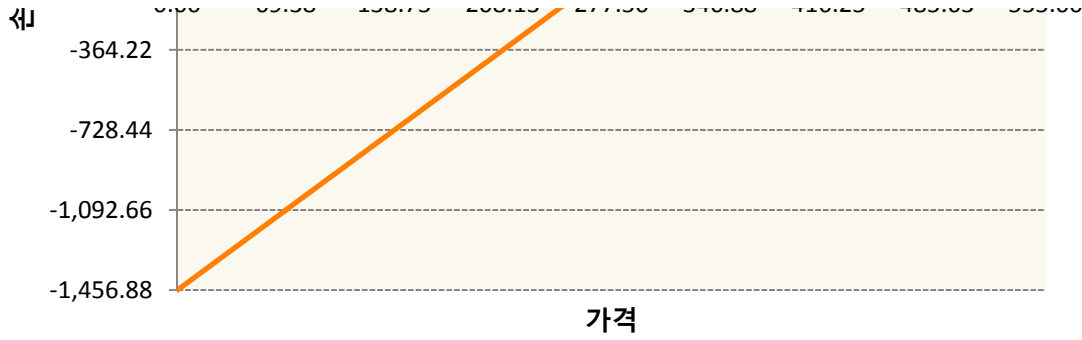
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

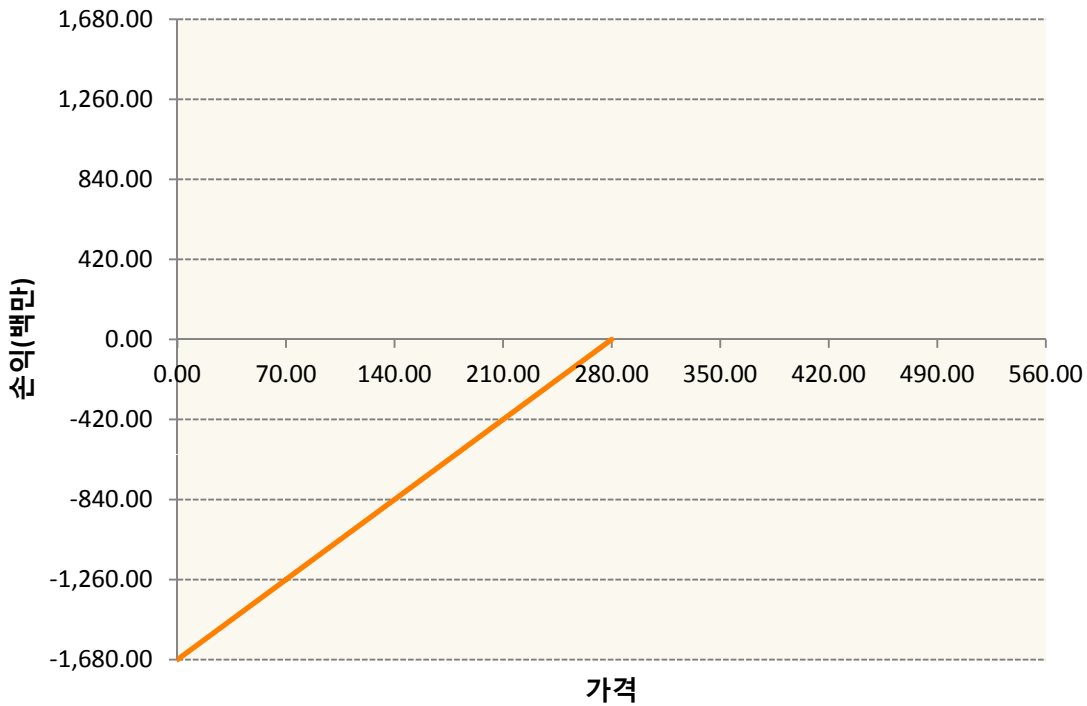


KR4301P52775-2019-05 풋277.5





KR4301P52809-2019-05 풋280



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						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	
KR4301P52775		2019-05 풋277.5						97
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97
-5.33%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-2.67%	-19	-19	-19	-19	-20	-20	-20
0%	1	0	0	0	0	0	-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

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%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
-2.67%	-33	-33	-33	-33	-34	-34	-34
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

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

(단위:백만원)

335

공시일	2019-05-08
기준일	2019-05-07

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

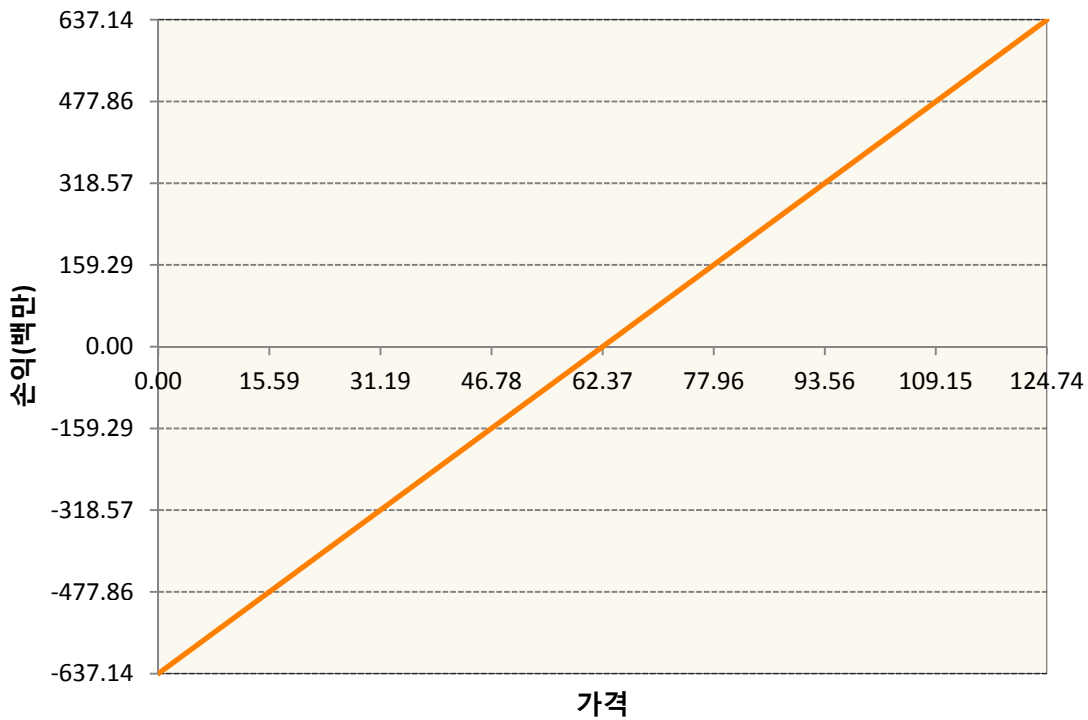
1. 계약금액

(단위:백만원)

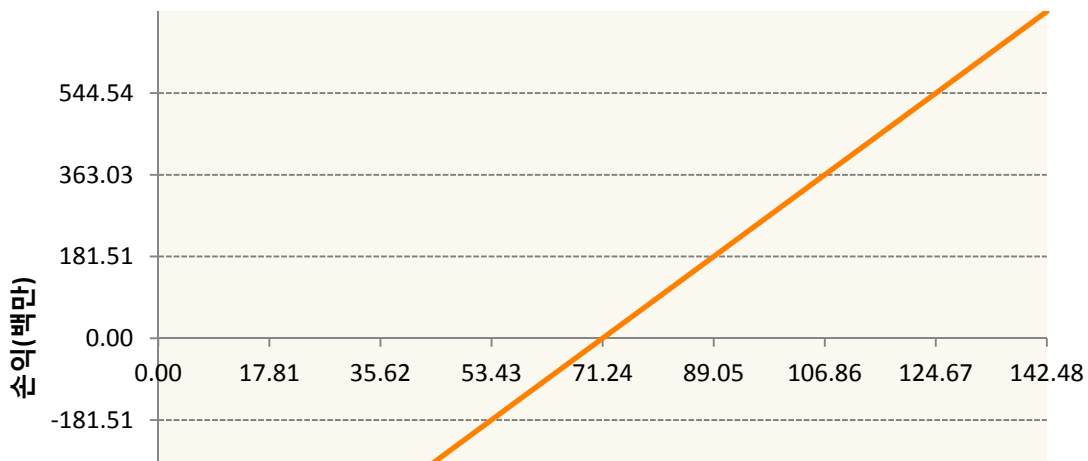
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,741	292	2,449	

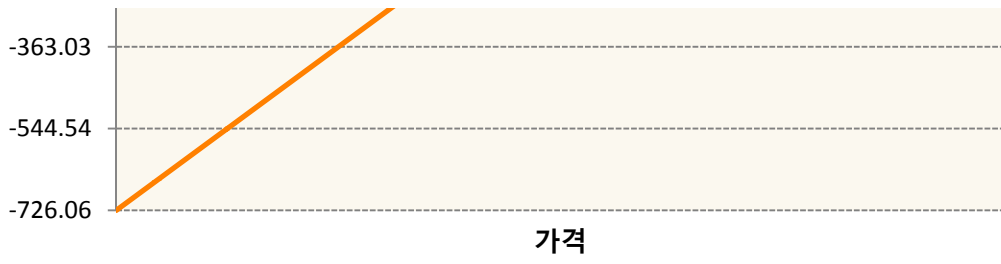
2. 만기시점의 손익구조

CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19

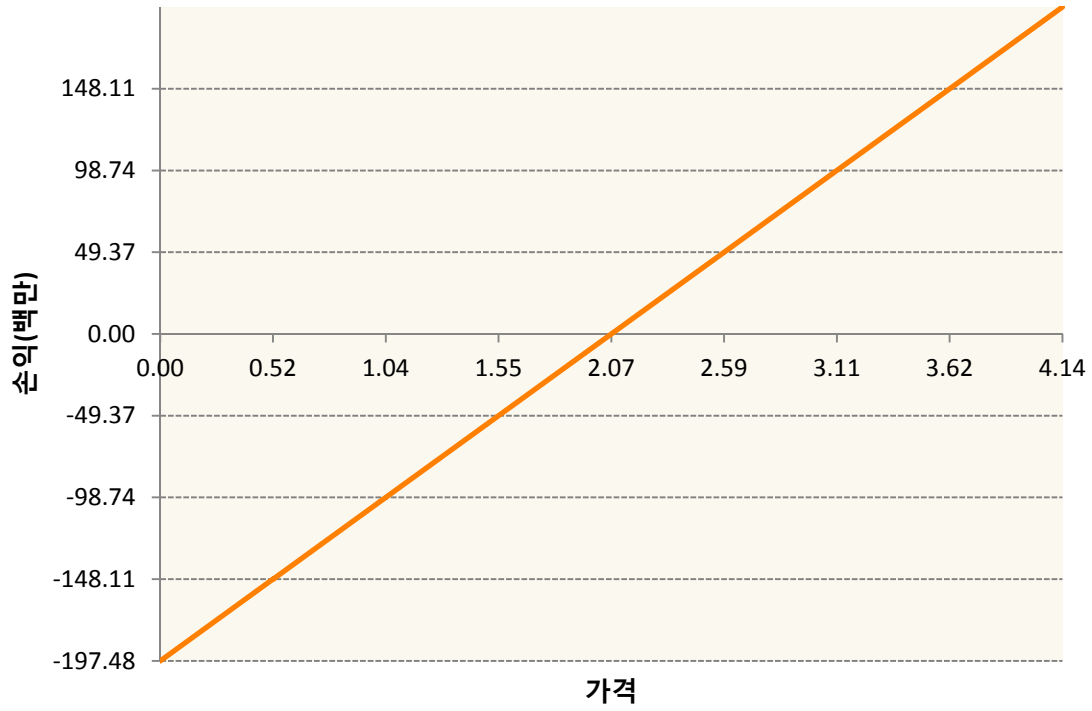


CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19

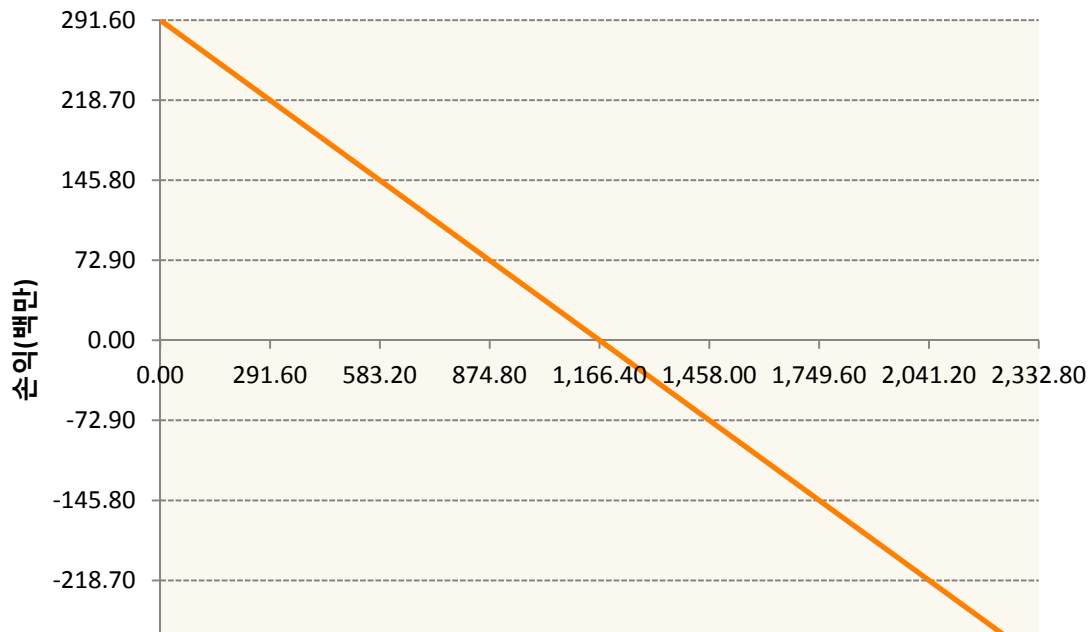


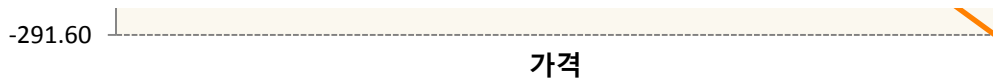


HON9-NY Harb ULSD Fut Jul19

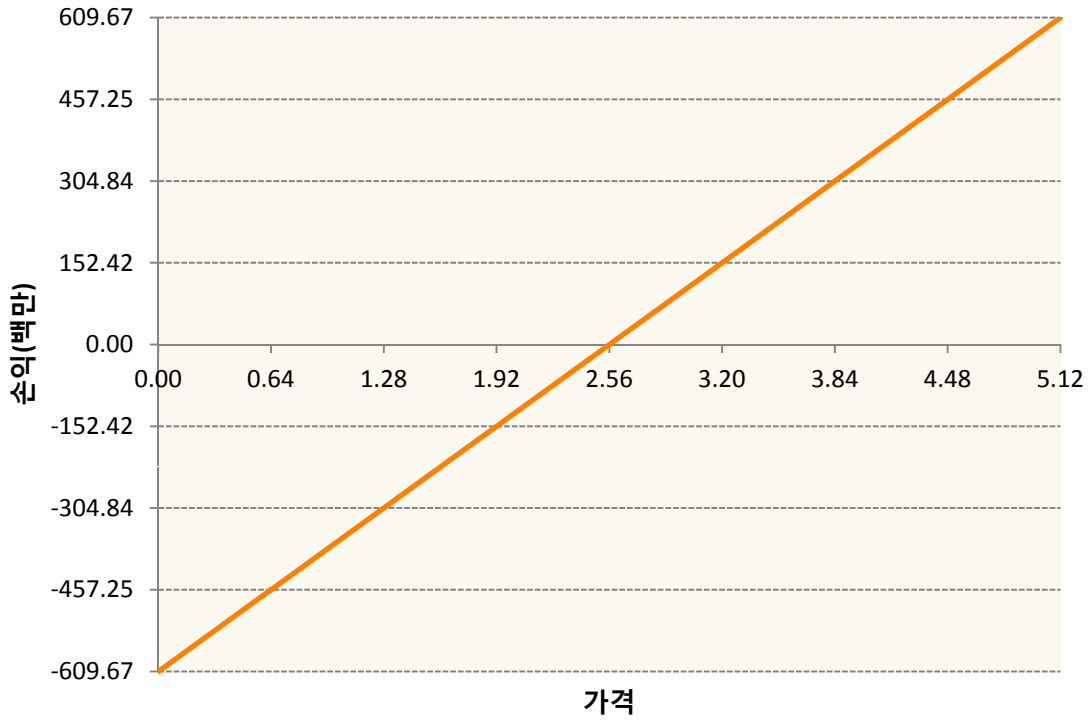


KR4175P50009-2019-05 달러선물

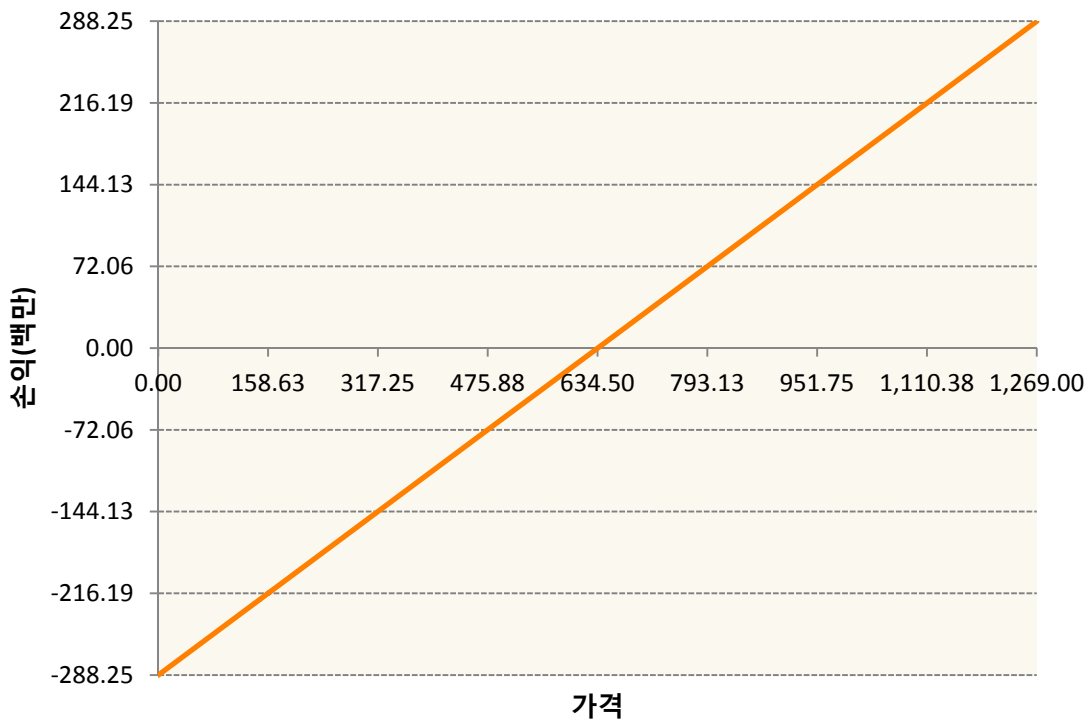




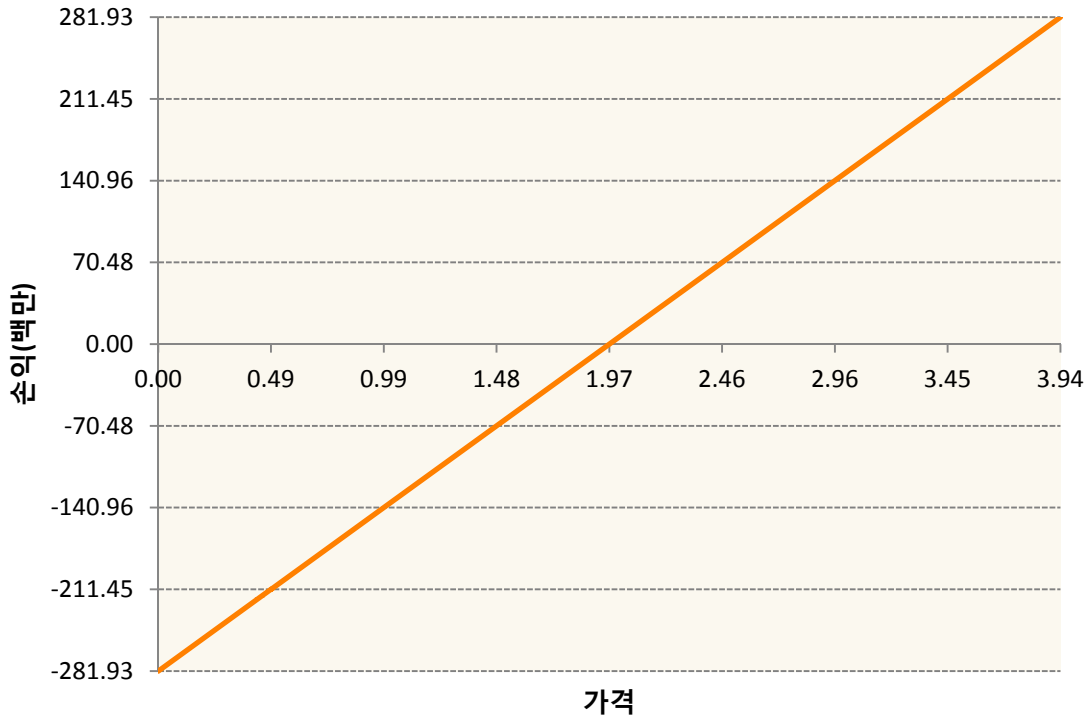
NGN19-NATURAL GAS FUTR Jul19



QSN9-Low Su Gasoil G Jul19



XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN9	WTI CRUDE FUTURE Jul19	51
CON9	BRENT CRUDE FUTR Jul19	58
HON9	NY Harb ULSD Fut Jul19	16
KR4175P500	2019-05 달러선물	23
NGN19	NATURAL GAS FUTR Jul19	49
QSN9	Low Su Gasoil G Jul19	23
XBN9	GASOLINE RBOB FUT Jul19	23

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

404

공시일	2019-05-08
기준일	2019-05-07

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

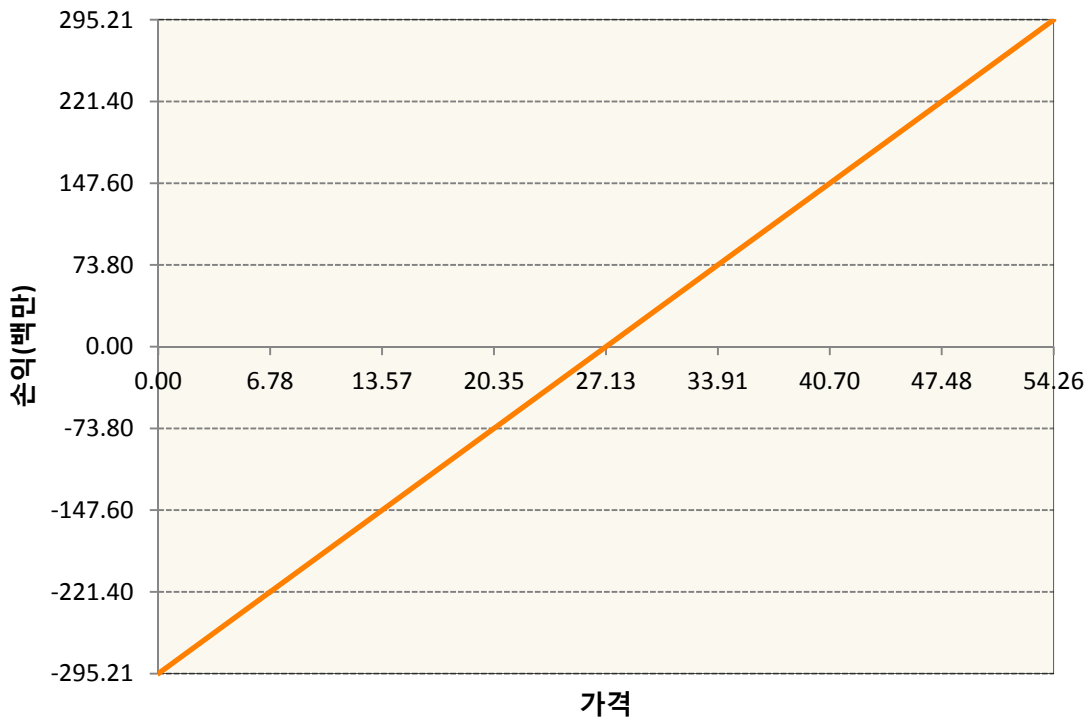
1. 계약금액

(단위:백만원)

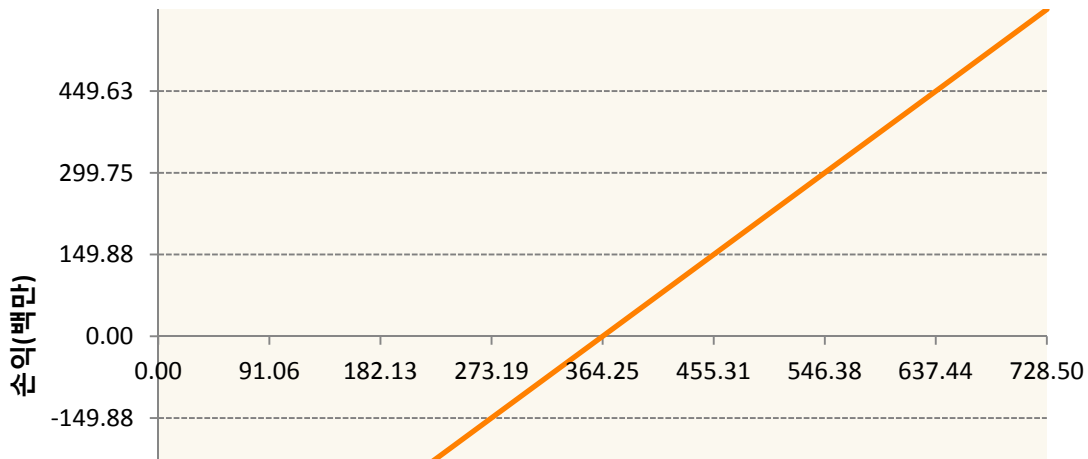
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,858	58	2,799	

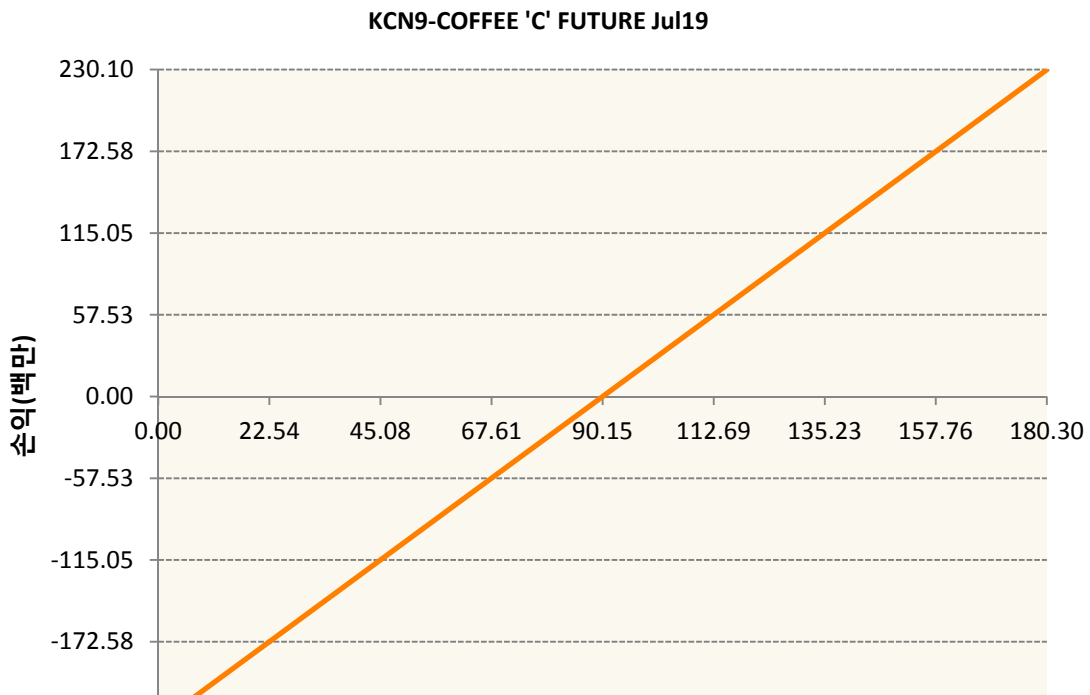
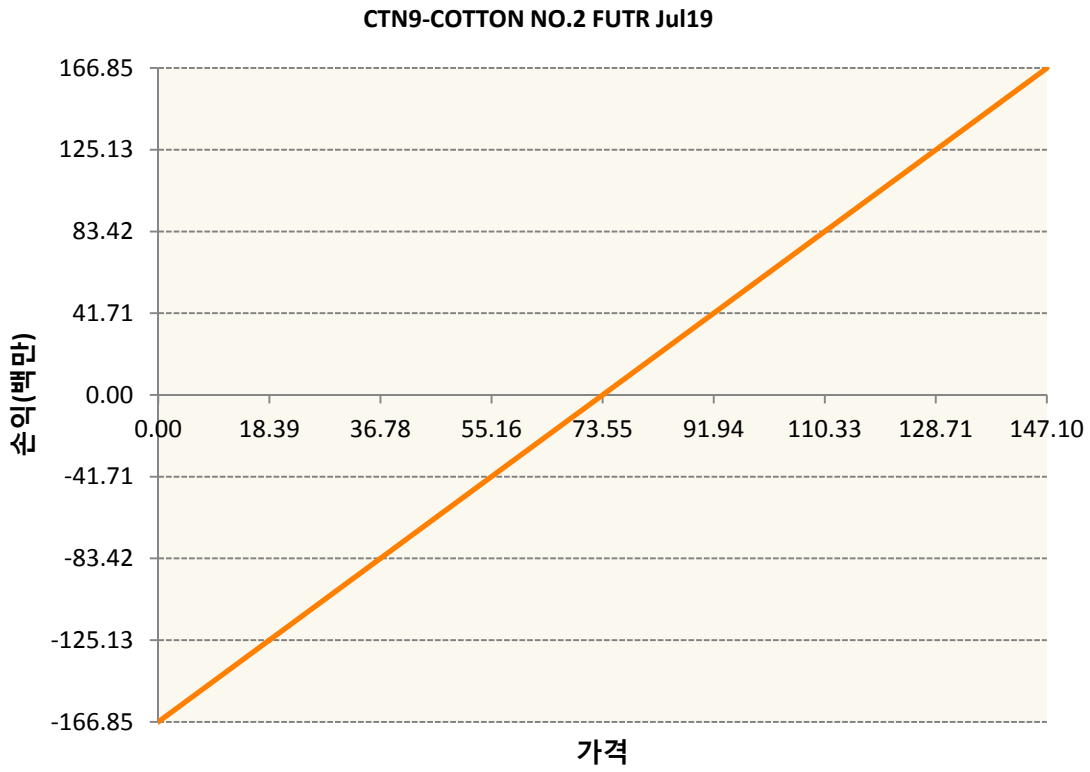
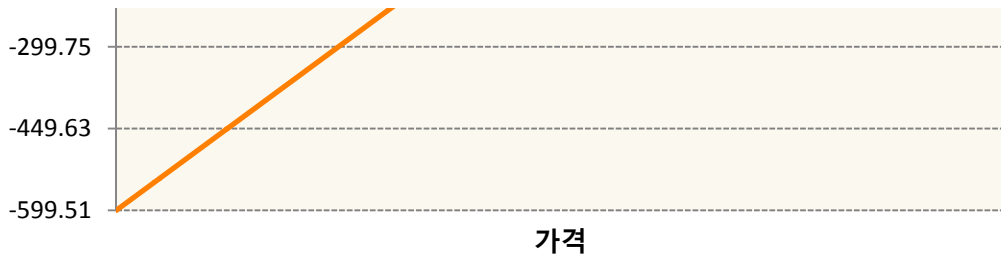
2. 만기시점의 손익구조

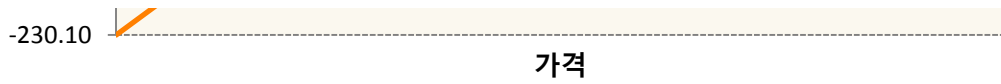
BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19



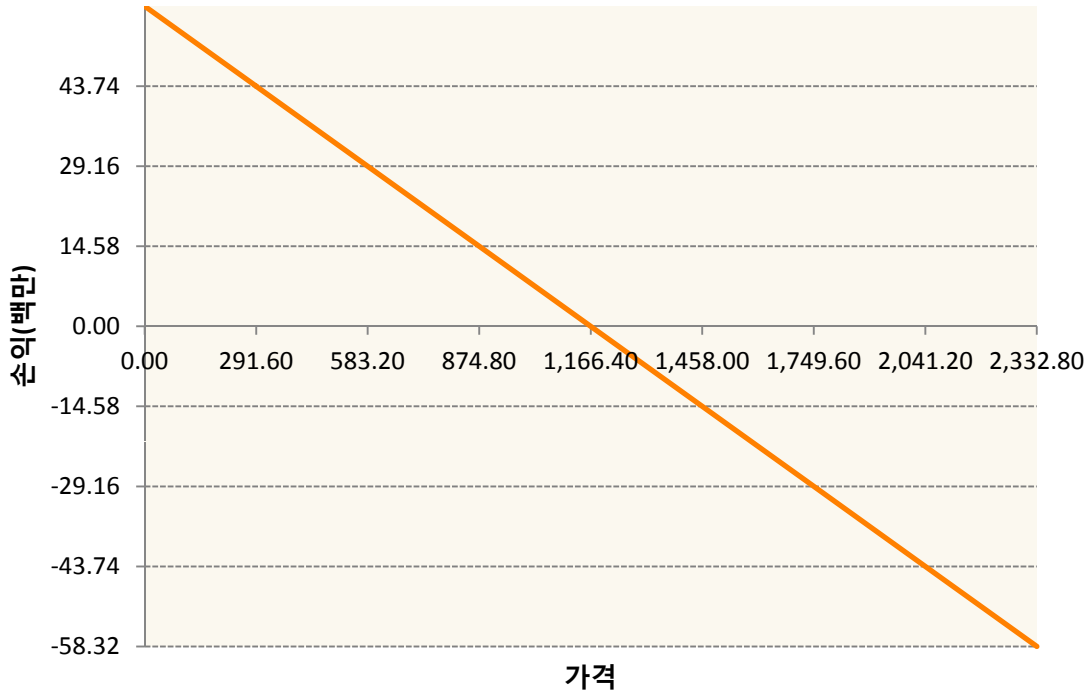
CN9-CORN FUTURE Jul19



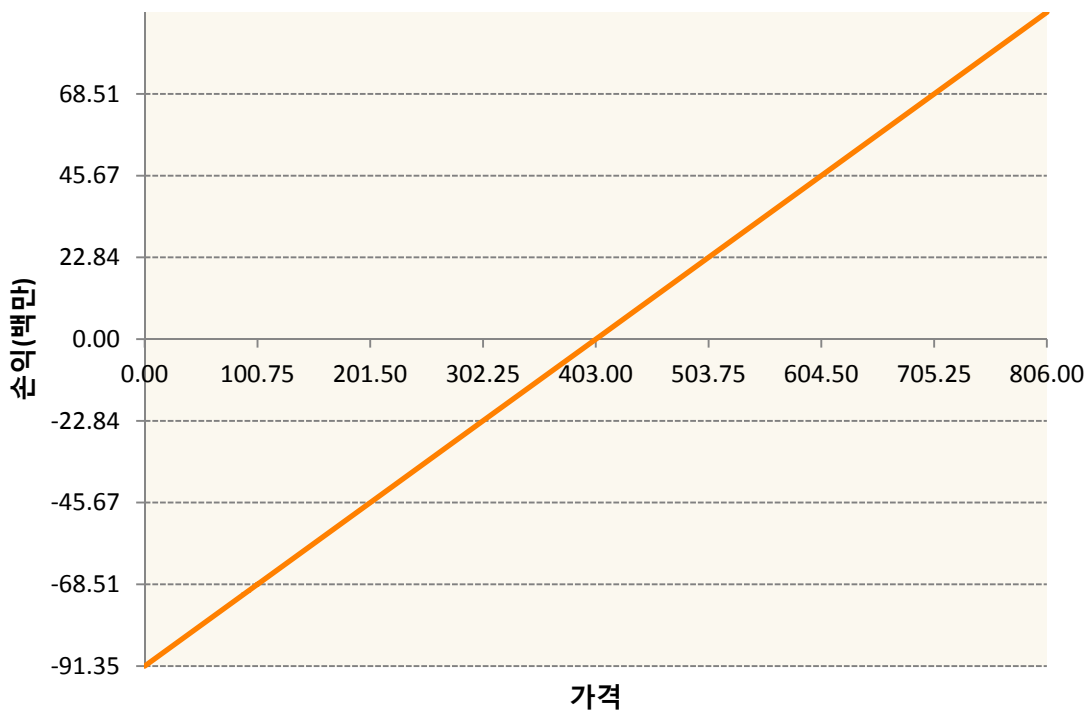




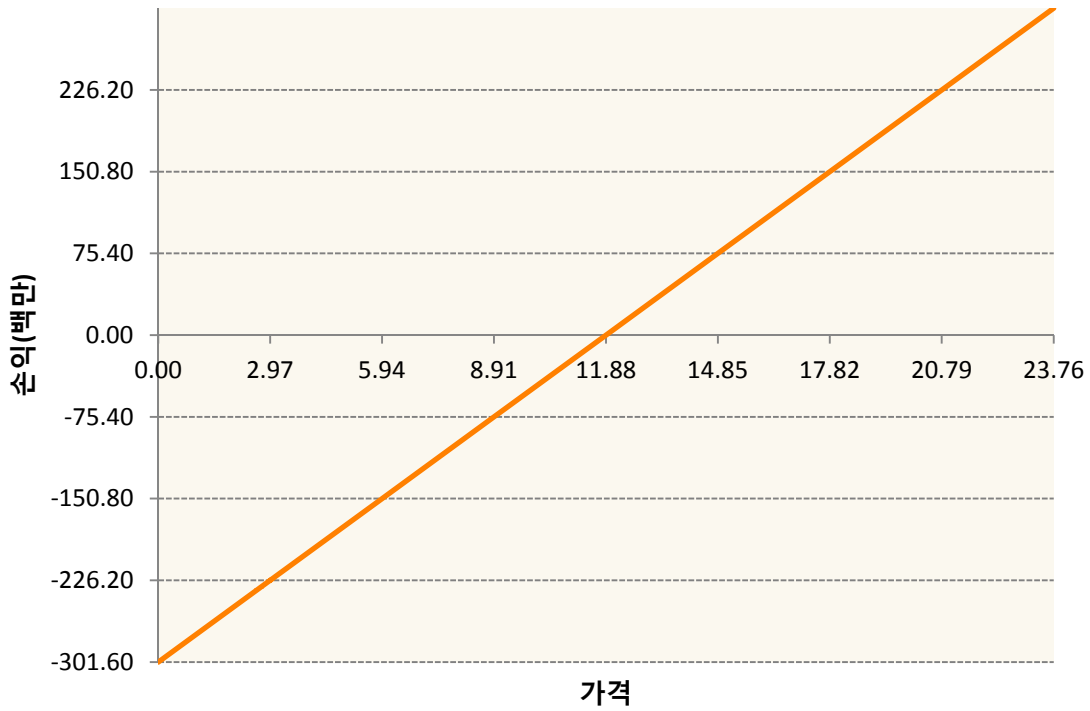
KR4175P50009-2019-05 달러선물



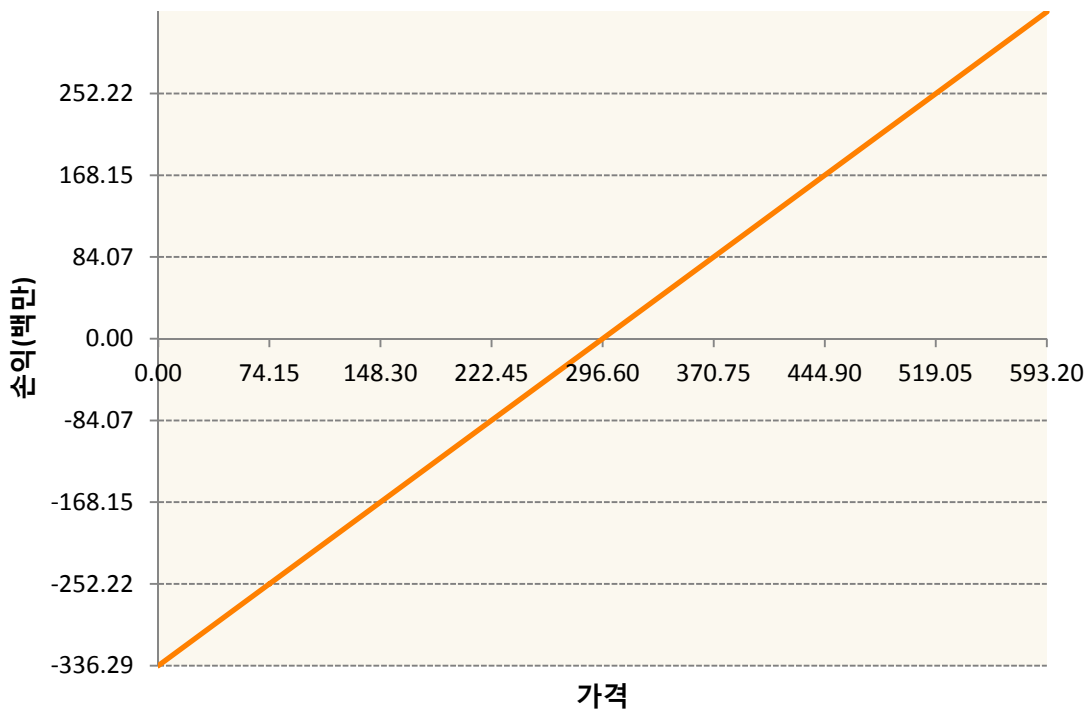
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

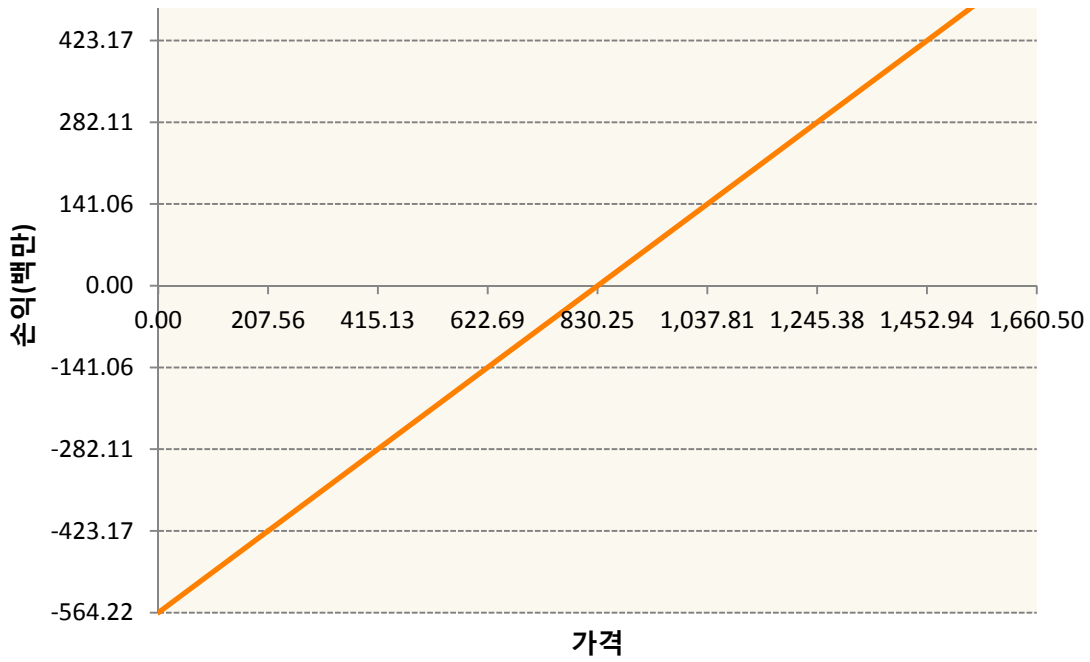


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19

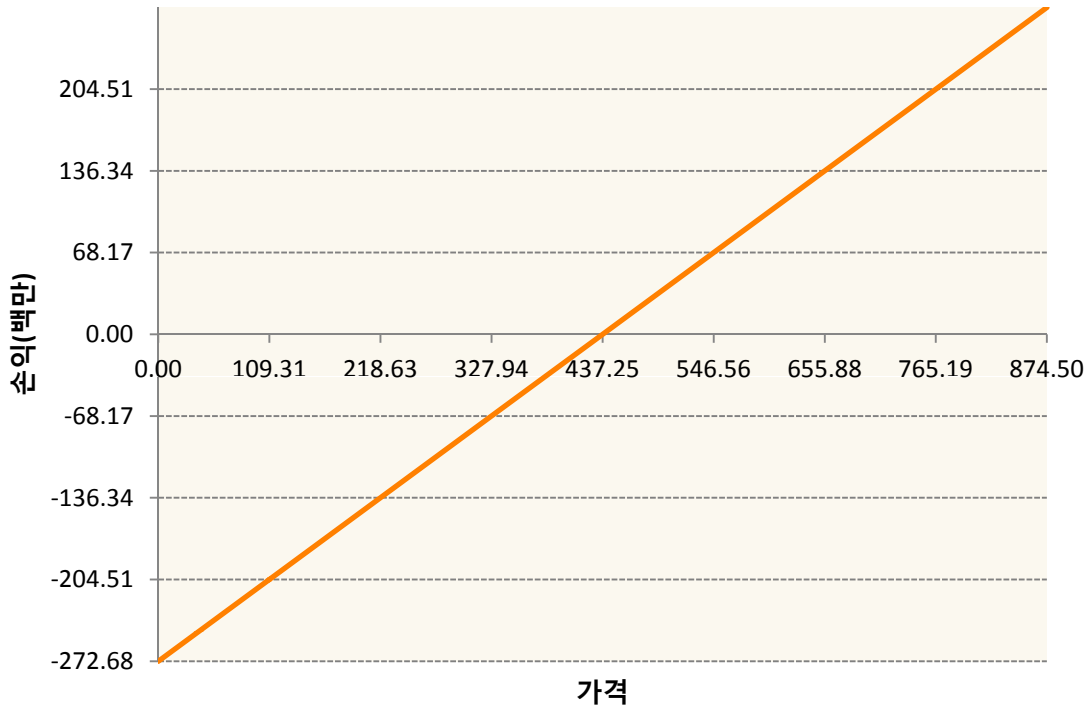


SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





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	13
KCN9	COFFEE 'C' FUTURE Jul19	18
KR4175P500	2019-05 달러선물	5

KWN9	KC HRW WHEAT FUT Jul19	7
SBN9	SUGAR #11 (WORLD) Jul19	24
SMN9	SOYBEAN MEAL FUTR Jul19	27
SN9	SOYBEAN FUTURE Jul19	45
WN9	WHEAT FUTURE(CBT) Jul19	22

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

(단위:백만원)

231