

공시일	2019-05-09
기준일	2019-05-08

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)

92

공시일	2019-05-09
기준일	2019-05-08

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

1,145

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

675

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-05-09
기준일	2019-05-08

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)	306
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	84
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	143

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

871

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-05-09
기준일	2019-05-08

유로인덱스모(주식-파생형)

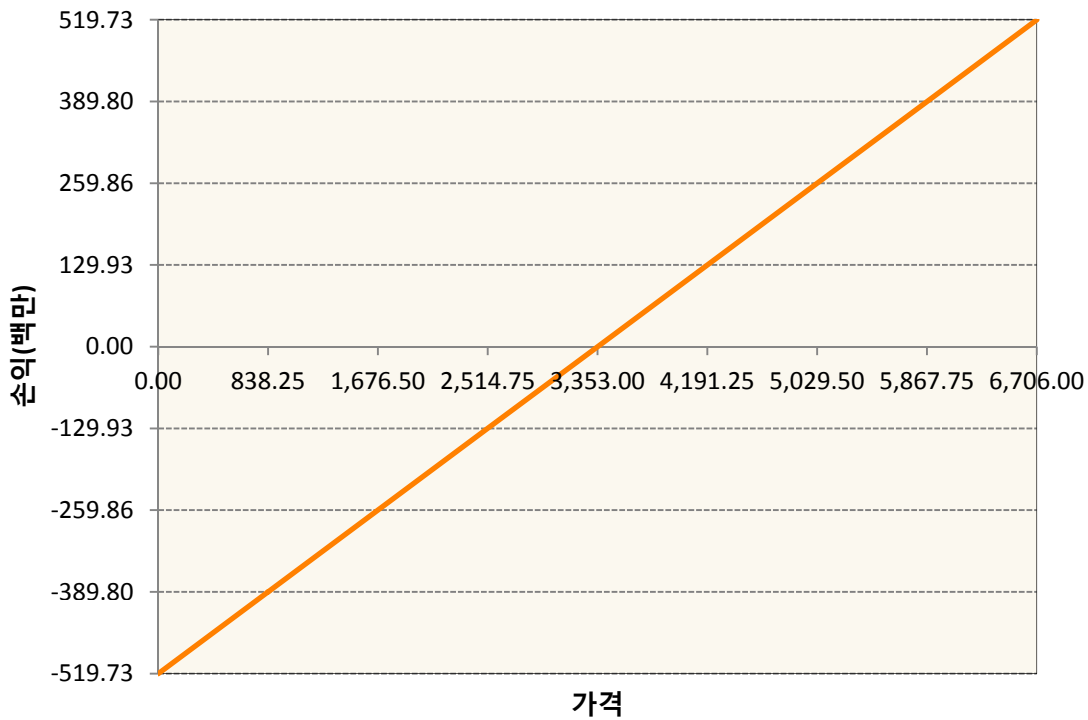
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	520	0	520	

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	2019-05-09
기준일	2019-05-08

차이나인덱스모(주식-파생형)

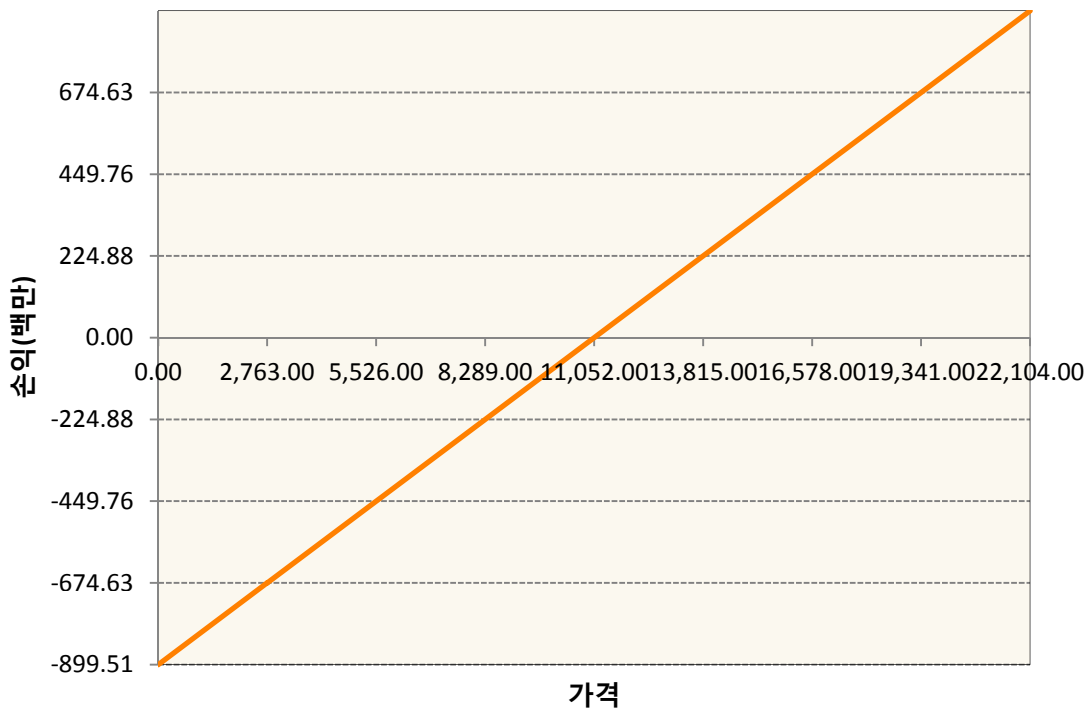
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	900	0	900	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK9	HSCEI Futures May19	72
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

74

공시일	2019-05-09
기준일	2019-05-08

커버드콜모(주식혼합-파생형)

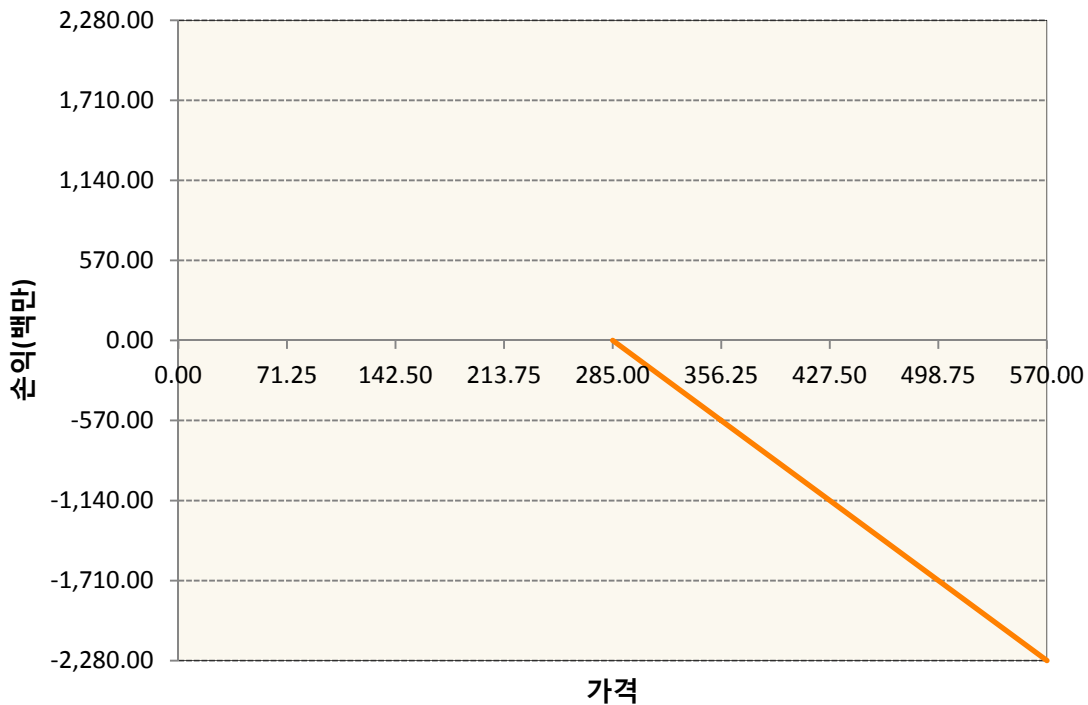
1. 계약금액

(단위:백만원)

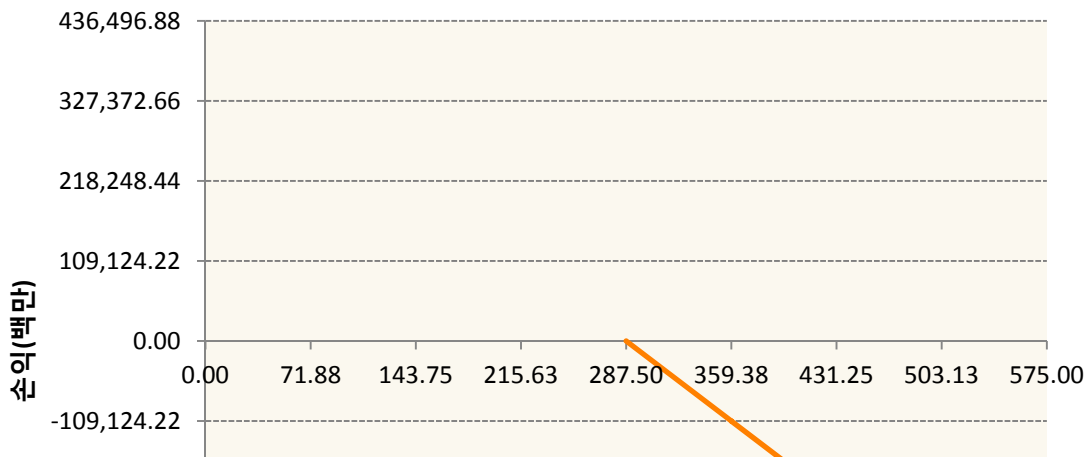
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	672,214	-672,214	장내

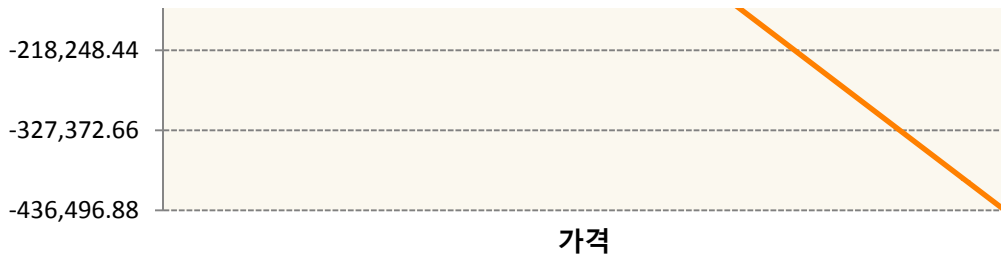
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P52850-2019-05 콜285

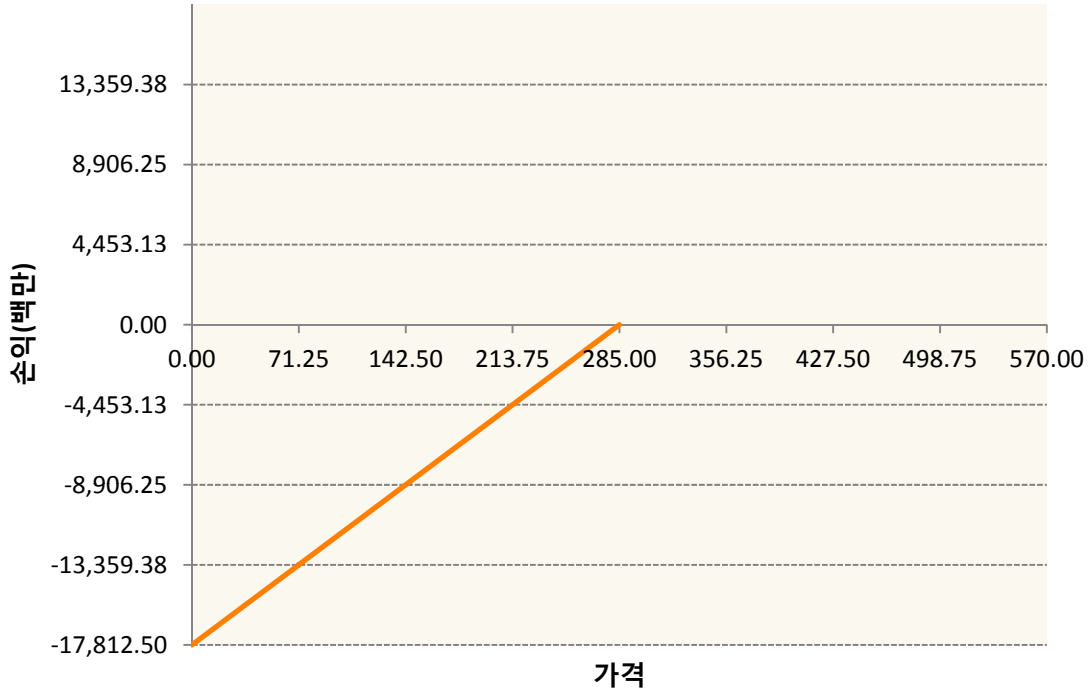


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

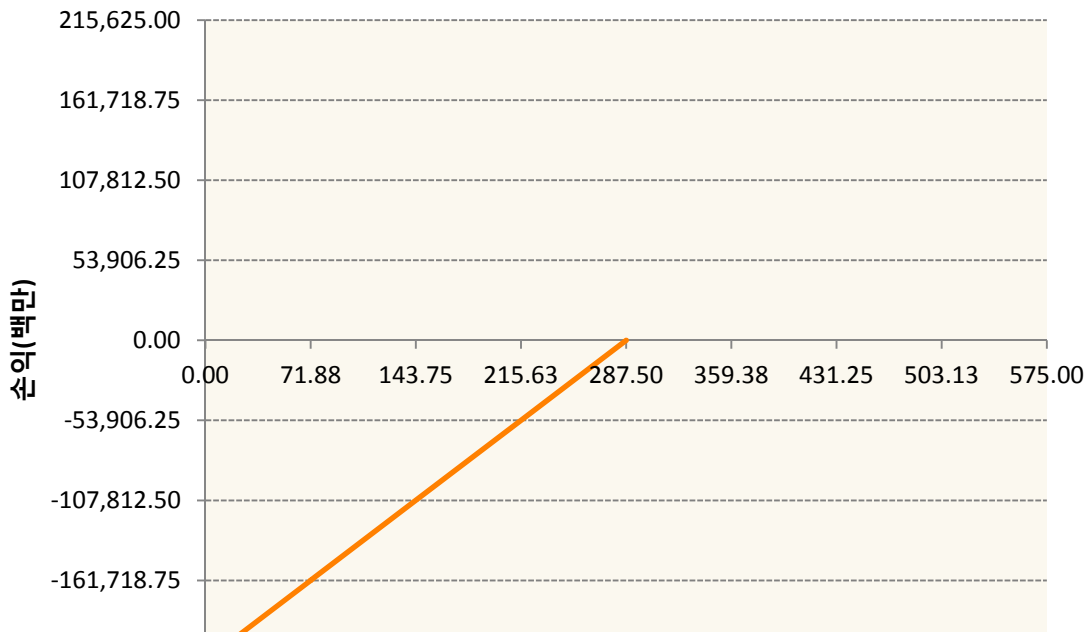




KR4301P52858-2019-05 풋285



KR4301P52874-2019-05 풋287.5



-215,625.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P52850		2019-05 콜285						139
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1	
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1	
-2.67%	1	1	1	1	1	1	1	
0%	1	1	0	0	0	-1	-2	
2.67%	-22	-22	-23	-24	-25	-26	-26	
5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-80	
8.00%	-139	-139	-139	-139	-139	-139	-139	
KR4201P52876		2019-05 콜287.5						22,806
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	55	55	55	55	55	55	55	
-5.33%	55	55	55	55	55	55	55	
-2.67%	55	55	55	55	55	54	53	
0%	49	40	24	0	-33	-75	-126	
2.67%	-1,766	-1,959	-2,151	-2,343	-2,536	-2,728	-2,920	
5.33%	-11,469	-11,478	-11,493	-11,517	-11,550	-11,593	-11,645	
8.00%	-22,804	-22,804	-22,804	-22,804	-22,804	-22,805	-22,806	
KR4301P52858		2019-05 풋285						1,400
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,400	-1,400	-1,400	-1,400	-1,400	-1,400	-1,400	
-5.33%	-933	-933	-933	-933	-933	-933	-933	
-2.67%	-466	-466	-466	-466	-466	-466	-466	
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2	
2.67%	301	300	298	295	293	290	287	
5.33%	304	304	304	304	304	304	304	
8.00%	304	304	304	304	304	304	304	
KR4301P52874		2019-05 풋287.5						16,808
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-16,808	-16,808	-16,808	-16,808	-16,808	-16,808	-16,808	
-5.33%	-11,205	-11,205	-11,205	-11,205	-11,205	-11,205	-11,205	
-2.67%	-5,602	-5,602	-5,602	-5,602	-5,602	-5,602	-5,602	
0%	0	0	0	0	0	-1	-3	
2.67%	5,045	4,988	4,931	4,875	4,818	4,761	4,704	

5.33%	5,516	5,516	5,516	5,516	5,515	5,515	5,513
8.00%	5,516	5,516	5,516	5,516	5,516	5,516	5,516

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

(단위:백만원)

36,639

공시일	2019-05-09
기준일	2019-05-08

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

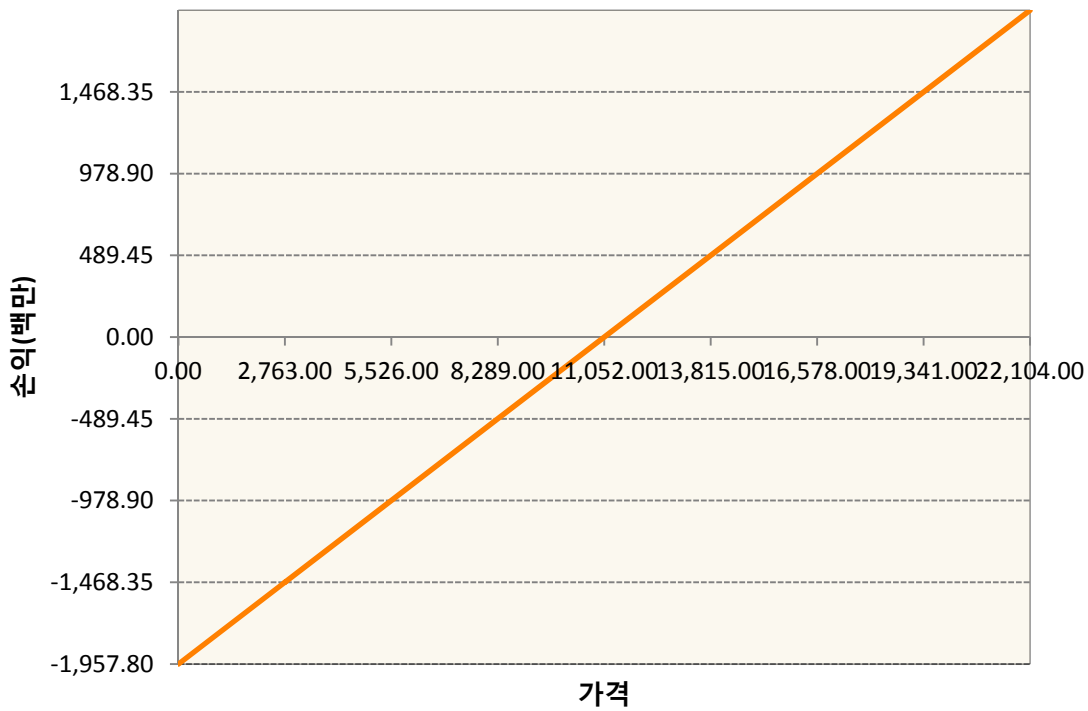
1. 계약금액

(단위:백만원)

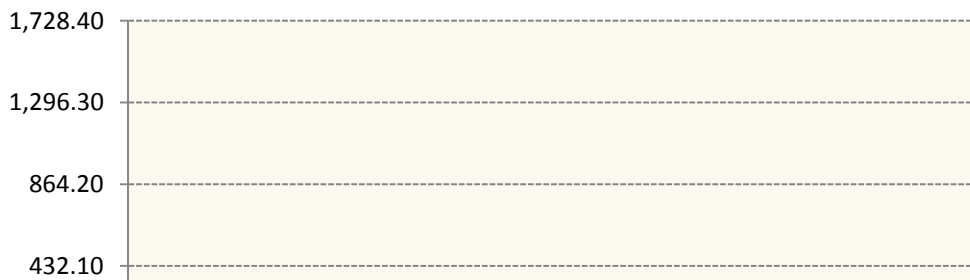
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,958	0	1,958	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,549	-5,549	장내
누계	통화	선도	0	3,129	-3,129	장외

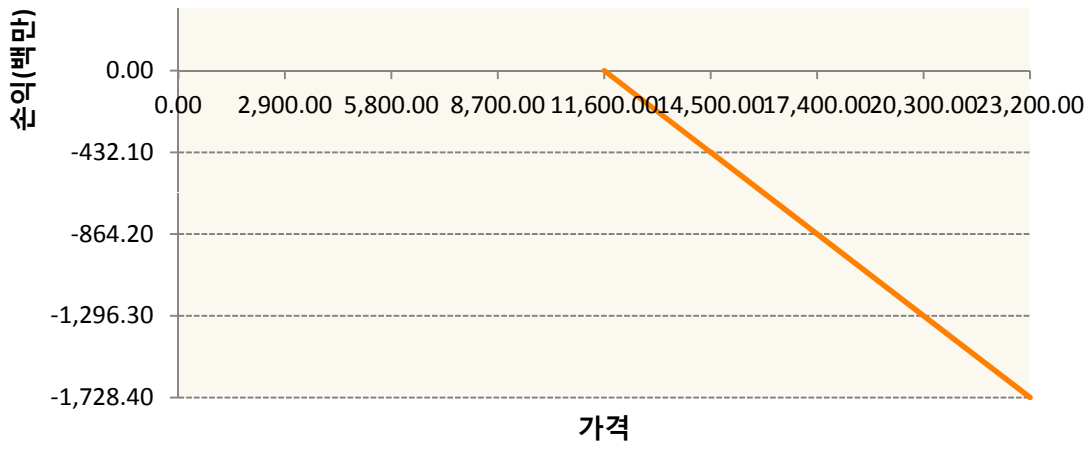
2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19

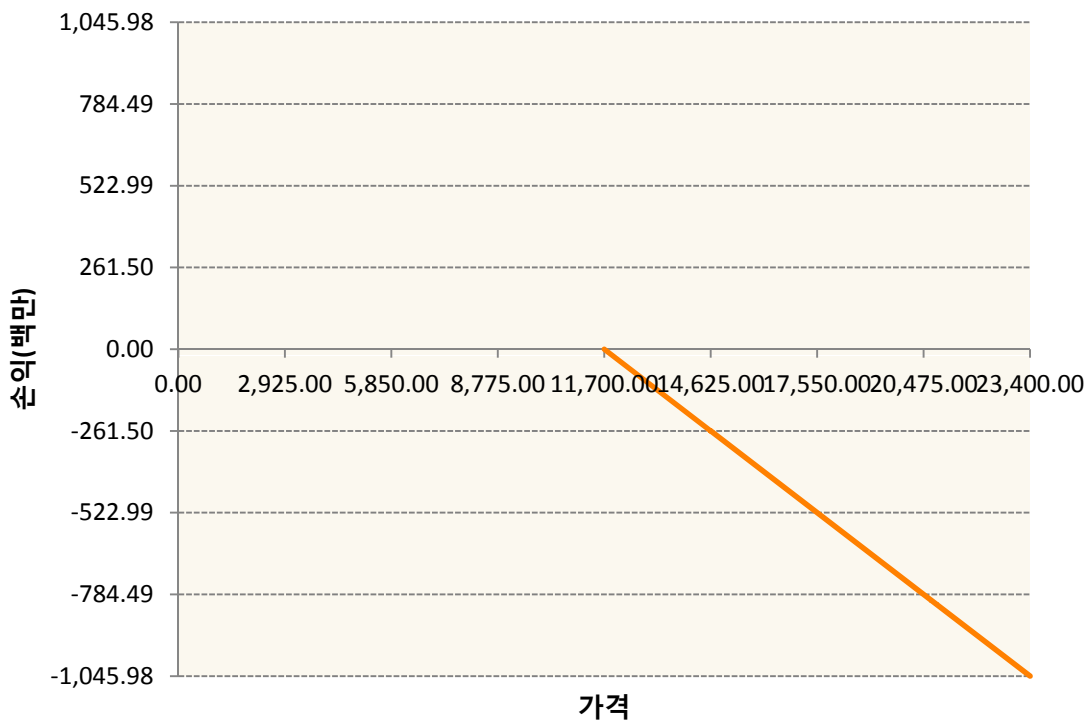


OHHIK9-C116-HSCEI

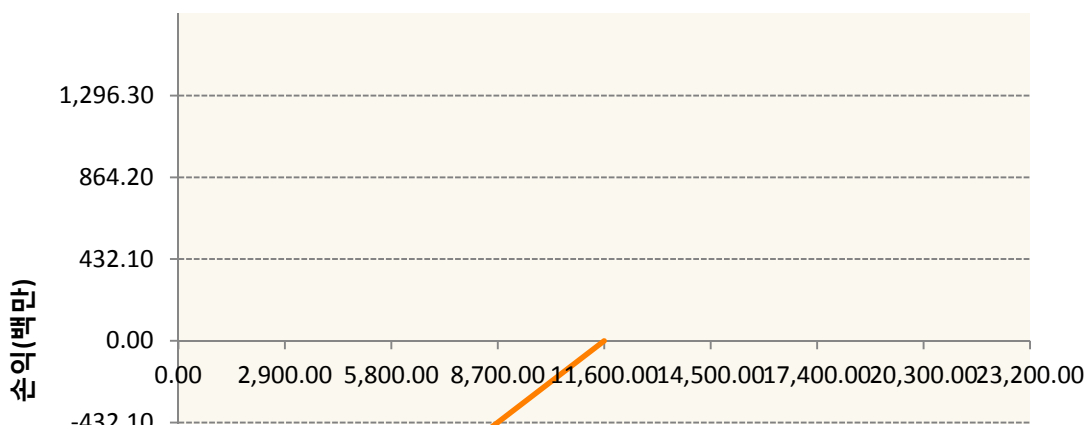


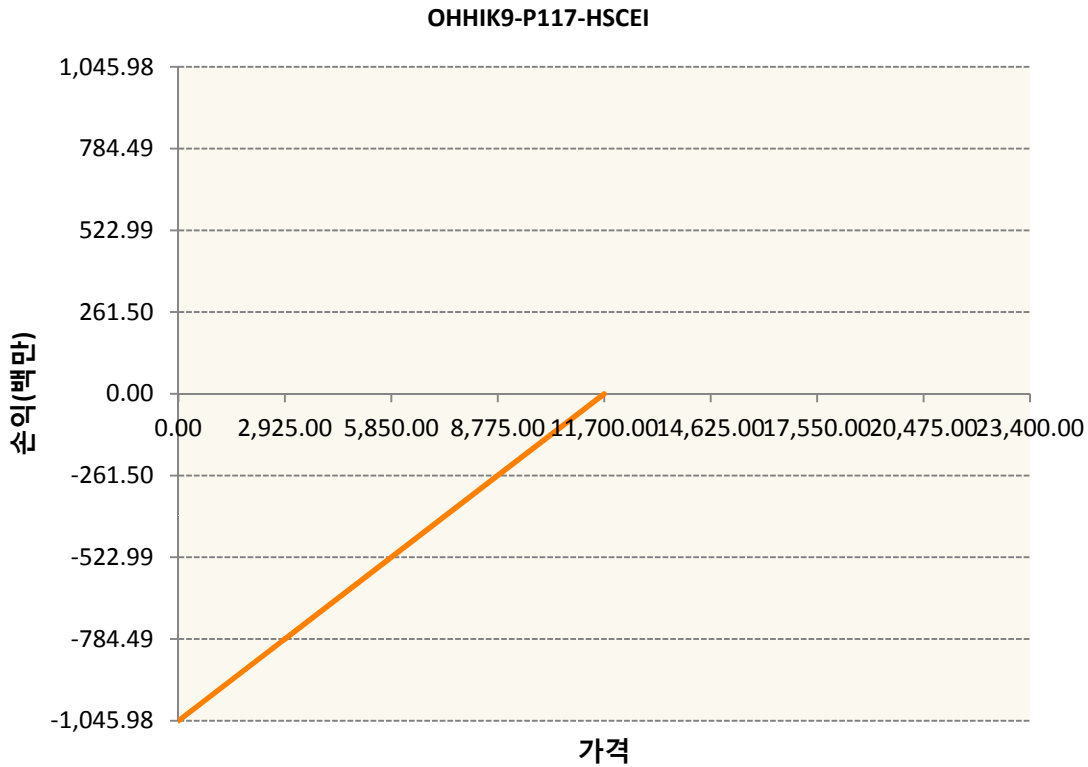


OHHIK9-C117-HSCEI



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	157
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)

704

공시일	2019-05-09
기준일	2019-05-08

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

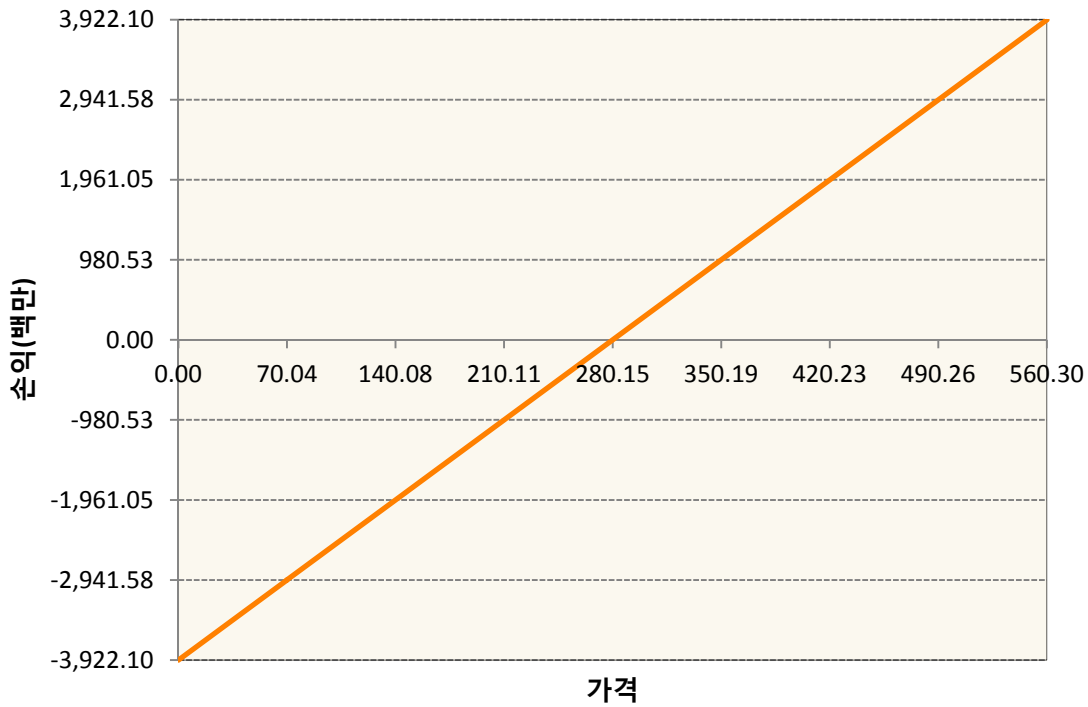
1. 계약금액

(단위:백만원)

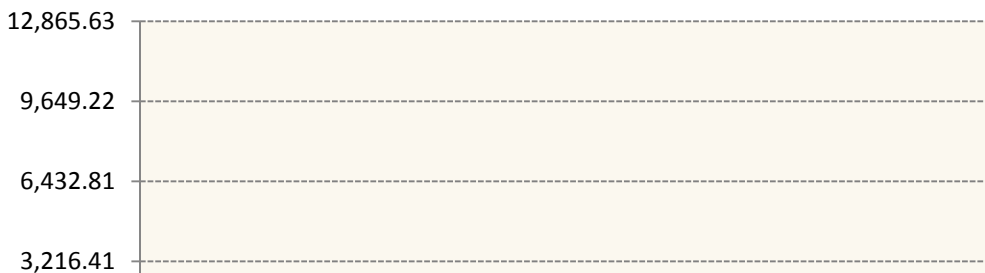
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	6,000	-6,000	장외
신규	유가증권	옵션	210	0	210	장내
누계	유가증권	선물	3,922	0	3,922	장내
누계	유가증권	스왑	26,836	0	26,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	27,377	-27,377	장내

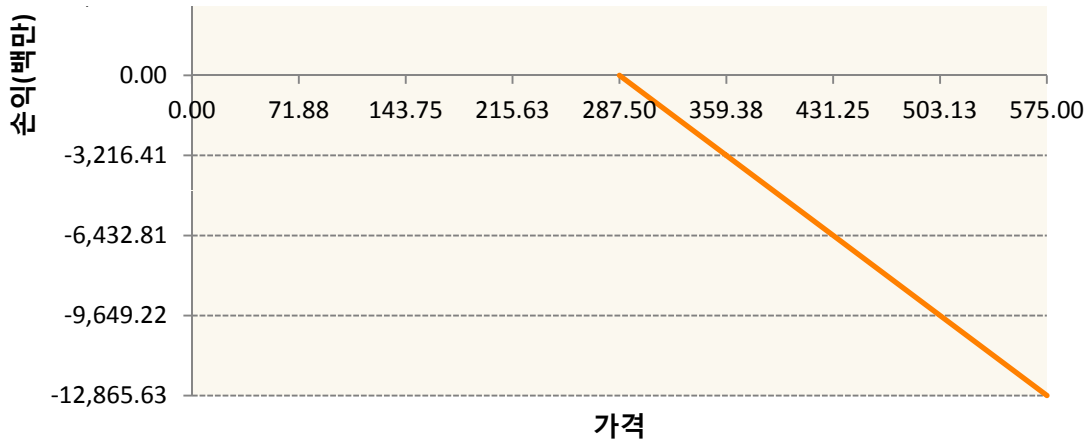
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

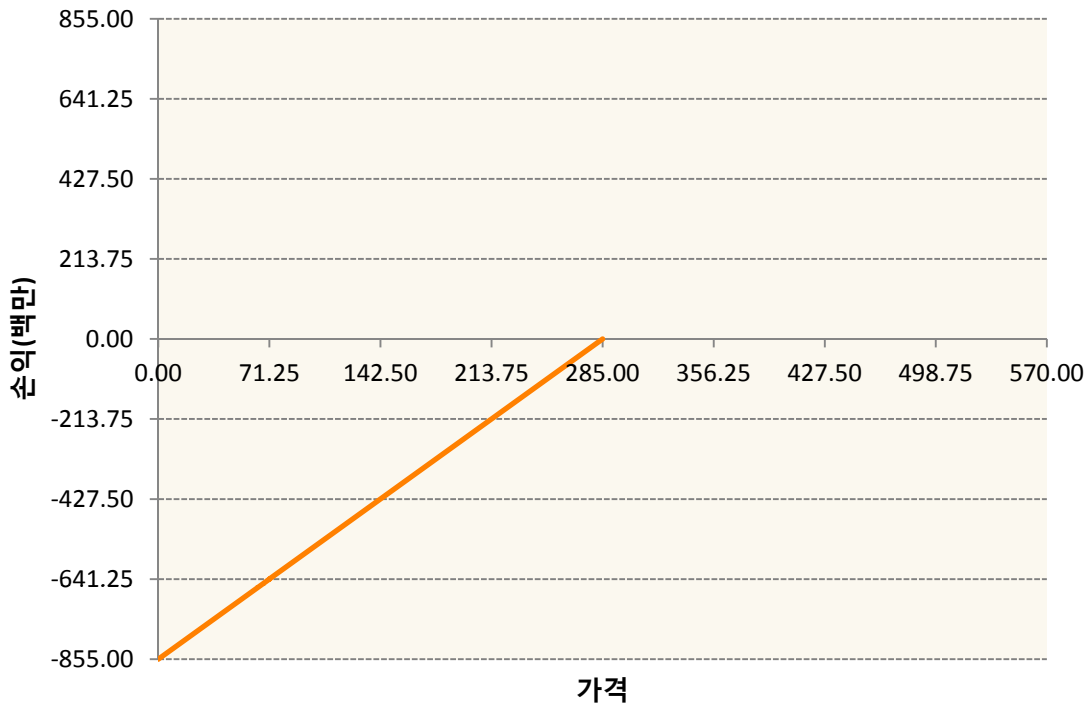


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

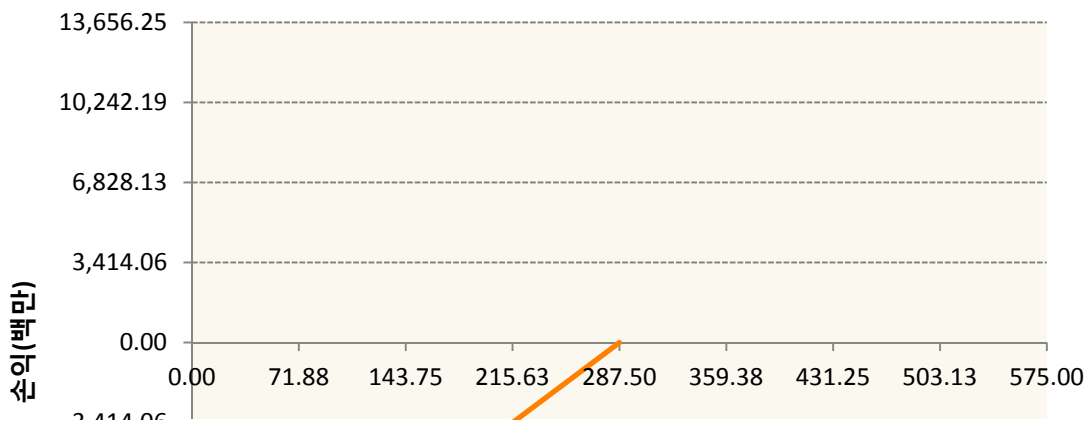


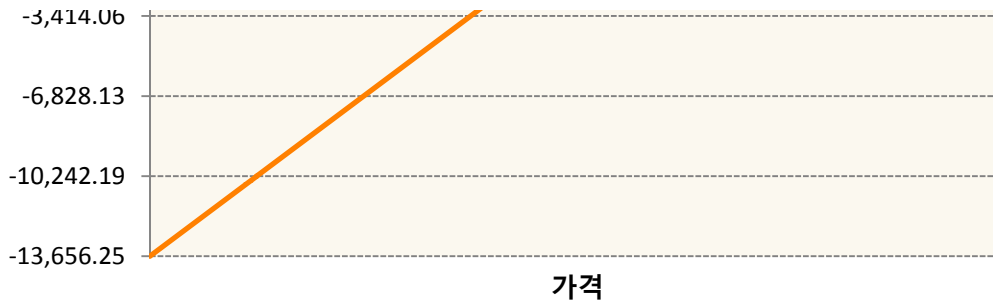


KR4301P52858-2019-05 풋285



KR4301P52874-2019-05 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,694
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,694	-1,694	-1,694	-1,694	-1,694	-1,694	-1,694	
-5.33%	-1,129	-1,129	-1,129	-1,129	-1,129	-1,129	-1,129	
-2.67%	-565	-565	-565	-565	-565	-565	-565	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	565	565	565	565	565	565	565	
5.33%	1,129	1,129	1,129	1,129	1,129	1,129	1,129	
8.00%	1,694	1,694	1,694	1,694	1,694	1,694	1,694	
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						314
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-314	-314	-314	-314	-314	-314	-314	
-5.33%	-209	-209	-209	-209	-209	-209	-209	
-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%	209	209	209	209	209	209	209	
8.00%	314	314	314	314	314	314	314	
KR4201P52876		2019-05 콜287.5						672
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	2	2	2	2	2	2	2
-5.33%	2	2	2	2	2	2	2
-2.67%	2	2	2	2	2	2	2
0%	1	1	1	0	-1	-2	-4
2.67%	-52	-58	-63	-69	-75	-80	-86
5.33%	-338	-338	-339	-339	-340	-342	-343
8.00%	-672	-672	-672	-672	-672	-672	-672
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%	14	14	14	14	14	14	14
5.33%	15	15	15	15	15	15	15
8.00%	15	15	15	15	15	15	15
KR4301P52874 2019-05 풋287.5							1,064
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,064	-1,064	-1,064	-1,064	-1,064	-1,064	-1,064
-5.33%	-710	-710	-710	-710	-710	-710	-710
-2.67%	-355	-355	-355	-355	-355	-355	-355
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	320	316	312	309	305	302	298
5.33%	349	349	349	349	349	349	349
8.00%	349	349	349	349	349	349	349

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

(단위:백만원)

4,316

공시일	2019-05-09
기준일	2019-05-08

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

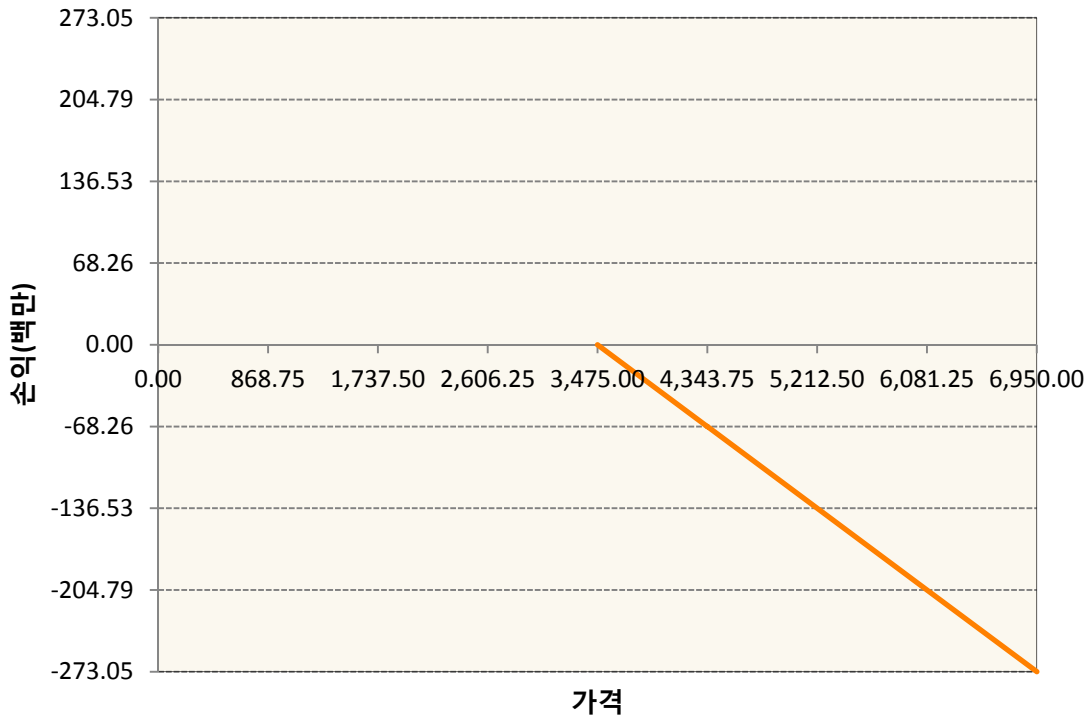
1. 계약금액

(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	1,550	0	1,550	
누계	유가증권	스왑	64,518	0	64,518	장외
누계	유가증권	옵션	0	17,505	-17,505	장내
누계	통화	선도	0	18,335	-18,335	장외

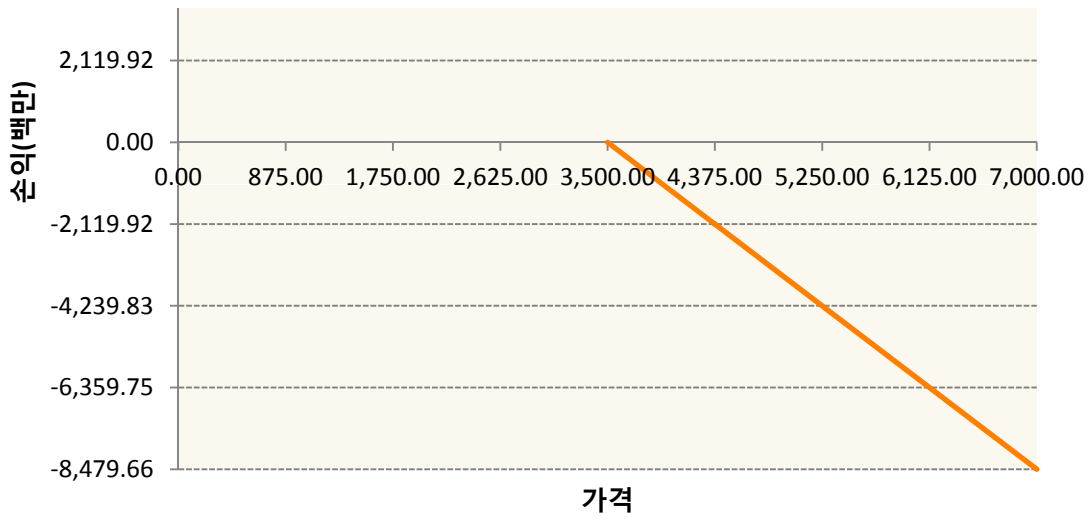
2. 만기시점의 손익구조

OESXK9-C3475-EURO STOXX 50

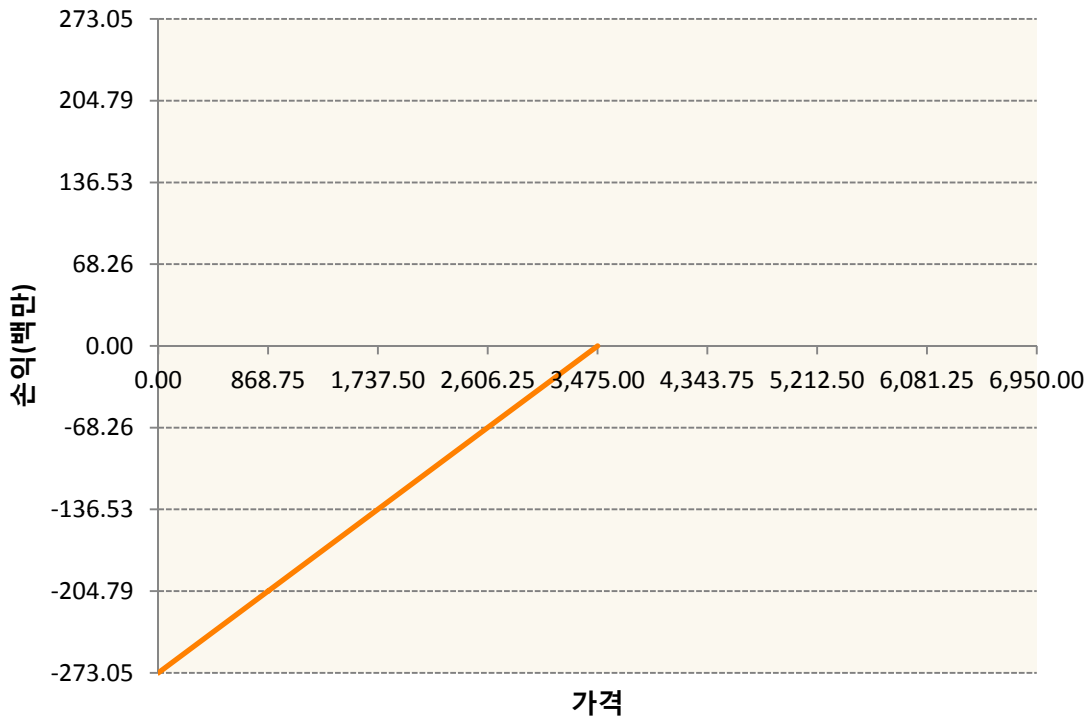


OESXK9-C3500-EURO STOXX 50

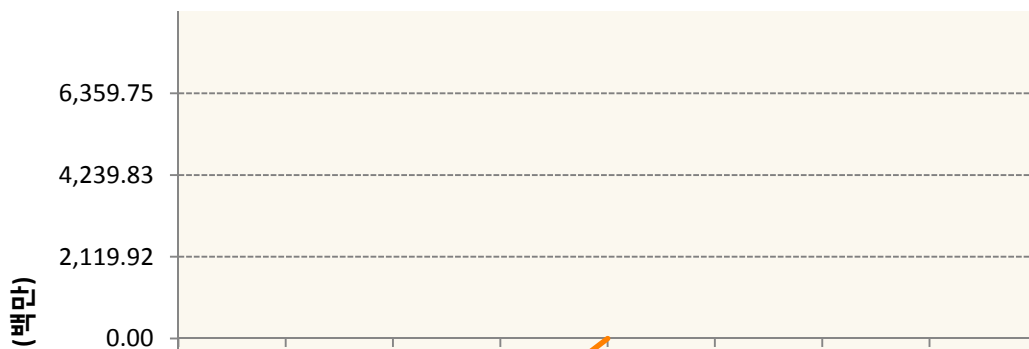


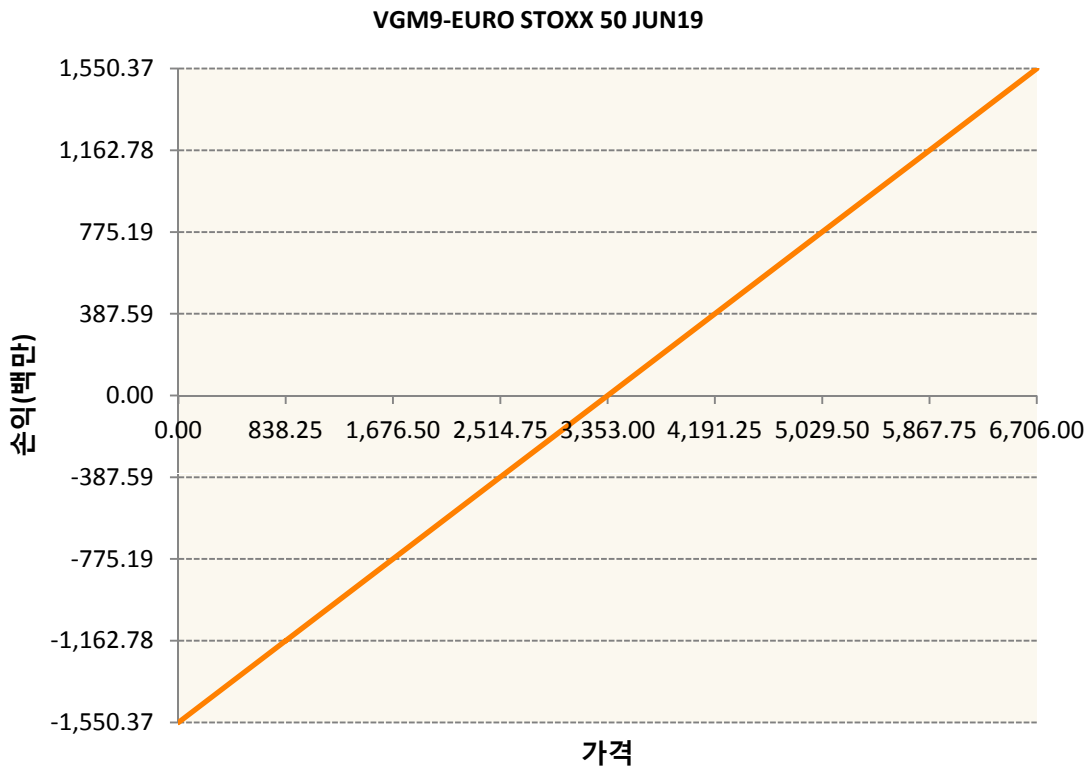
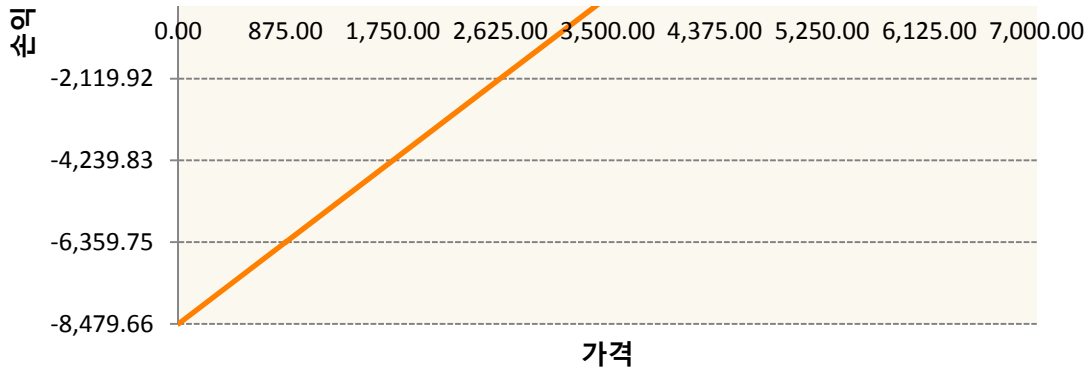


OESXK9-P3475-EURO STOXX 50



OESXK9-P3500-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	96
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	419
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	838
FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E	210
OESXK9-C34 EURO STOXX 50	22
OESXK9-C35 EURO STOXX 50	678
OESXK9-P34 EURO STOXX 50	22
OESXK9-P35 EURO STOXX 50	678
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	124

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

(단위:백만원)

1,925

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

(단위:백만원)

1,081

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

(단위:백만원)

92

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

(단위:백만원)

134

공시일	2019-05-09
기준일	2019-05-08

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

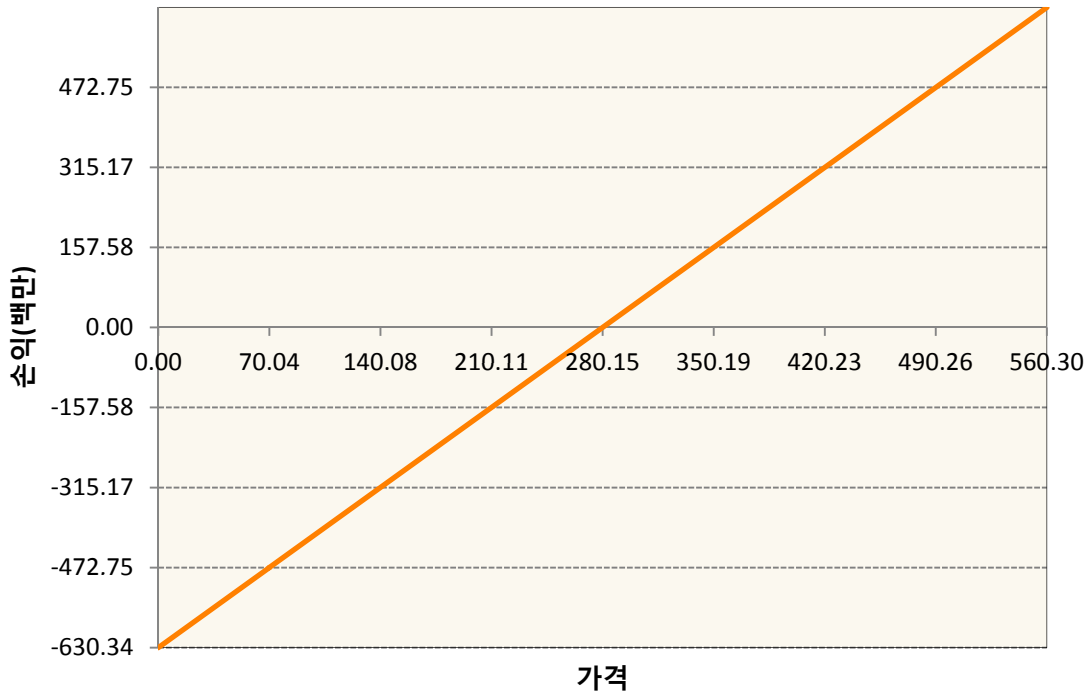
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	630	0	630	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						50
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	
-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%	50	50	50	50	50	50	50	

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

(단위:백만원)

42

공시일	2019-05-09
기준일	2019-05-08

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

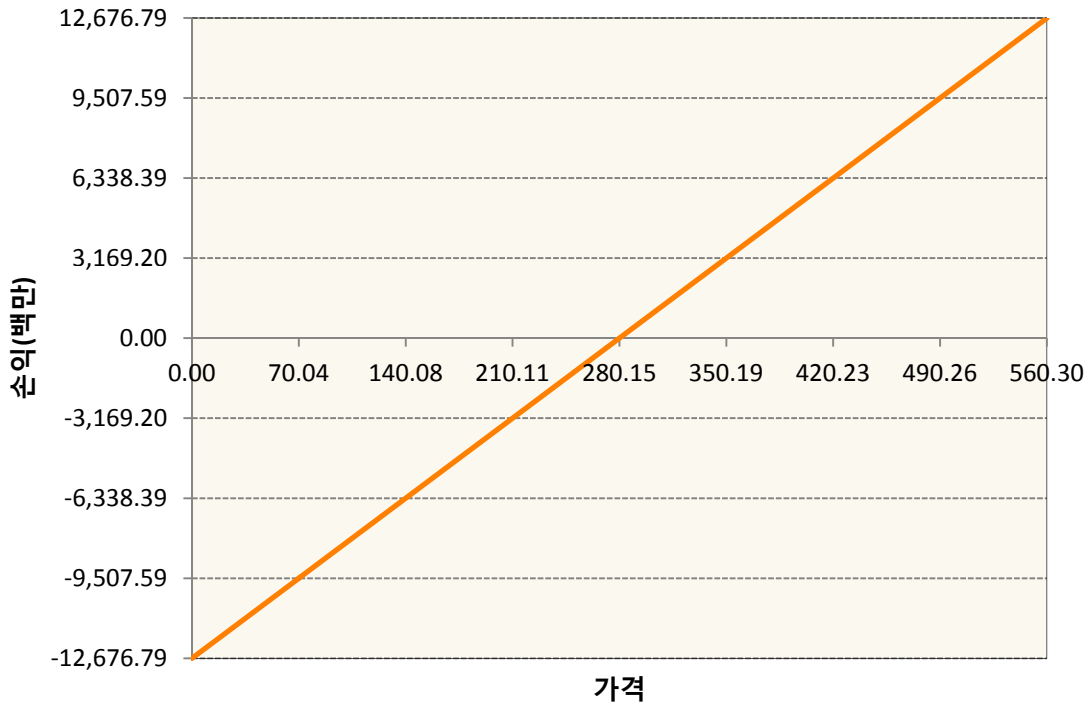
1. 계약금액

(단위:백만원)

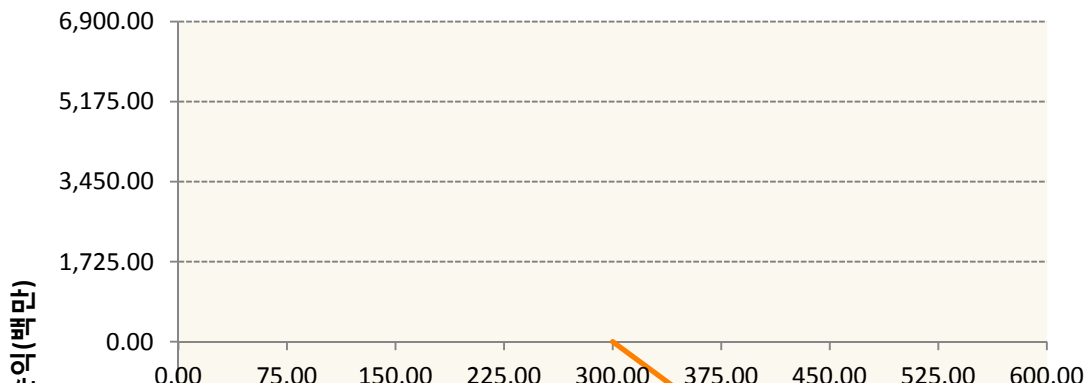
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,677	0	12,677	장내
누계	유가증권	옵션	1,366	24,294	-22,928	장내

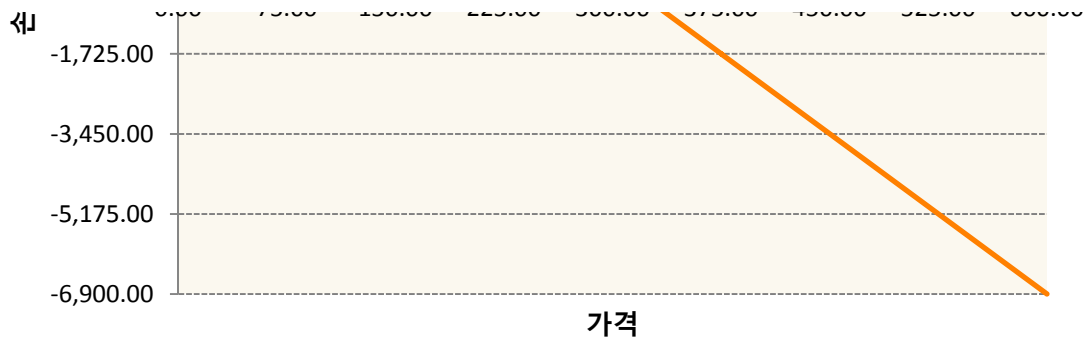
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

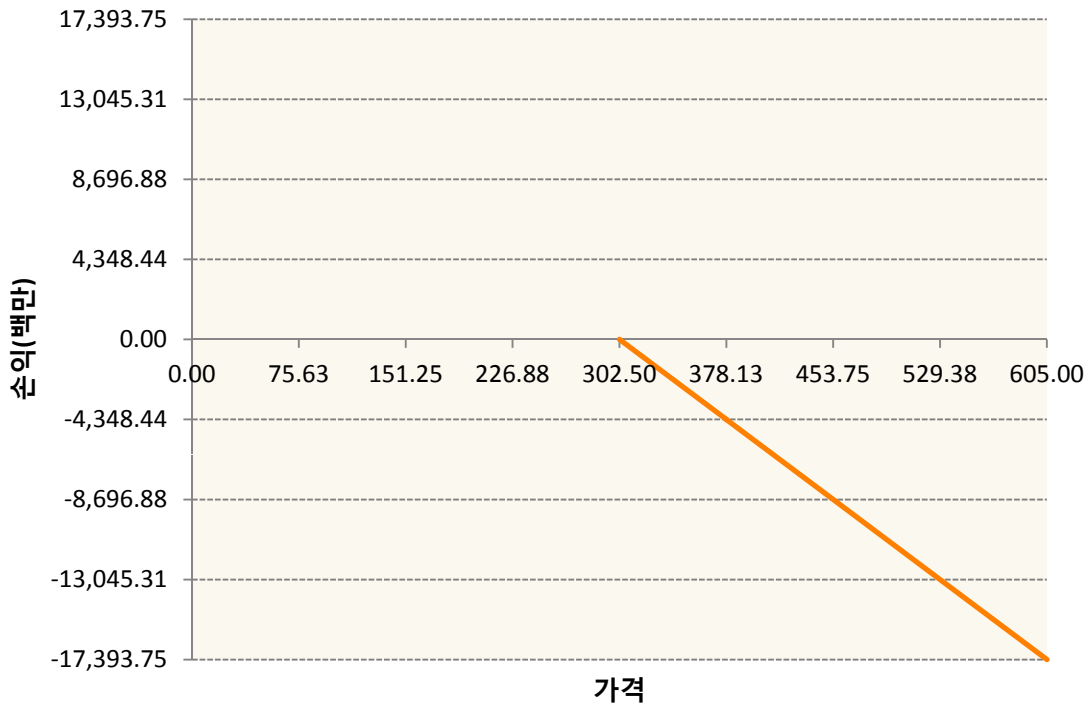


KR4201P53007-2019-05 콜300

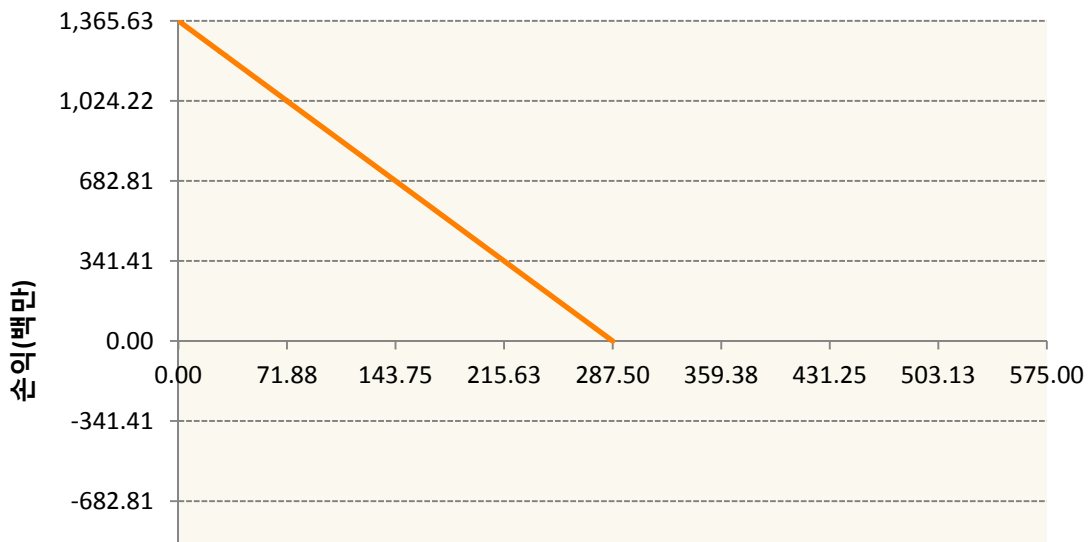


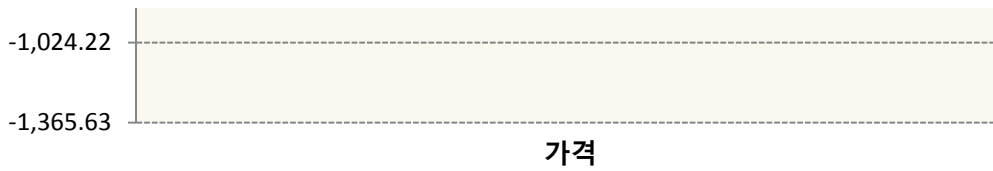


KR4201P53023-2019-05 콜302.5



KR4301P52874-2019-05 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						1,014
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,014	-1,014	-1,014	-1,014	-1,014	-1,014	-1,014	
-5.33%	-676	-676	-676	-676	-676	-676	-676	
-2.67%	-338	-338	-338	-338	-338	-338	-338	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	338	338	338	338	338	338	338	
5.33%	676	676	676	676	676	676	676	
8.00%	1,014	1,014	1,014	1,014	1,014	1,014	1,014	
KR4201P53007		2019-05 콜300						81
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	0	0	0	0	
5.33%	-1	-2	-3	-5	-6	-8	-10	
8.00%	-66	-69	-71	-73	-76	-78	-81	
KR4201P53023		2019-05 콜302.5						117
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	0	0	0	0	
5.33%	0	-1	-2	-3	-4	-6	-8	
8.00%	-71	-78	-86	-94	-101	-109	-117	
KR4301P52874		2019-05 풋287.5						106
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	106	106	106	106	106	106	106	
-5.33%	71	71	71	71	71	71	71	
-2.67%	35	35	35	35	35	35	35	

0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-32	-32	-31	-31	-31	-30	-30
5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
8.00%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35

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

(단위:백만원)

933

공시일	2019-05-09
기준일	2019-05-08

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	117	0	117	
누계	유가증권	수익증권	4,716	0	4,716	

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	2019-05-09
기준일	2019-05-08

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,508	0	3,508	
누계	유가증권	수익증권	79,331	0	79,331	

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	2019-05-09
기준일	2019-05-08

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	5,847	0	5,847	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	171,276	0	171,276	
누계	통화	선도	0	209,779	-209,779	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E		47
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E		94
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E		94
FX21019J001 KRW/USD 10-05-19E		46
FX21019J004 KRW/USD 10-06-19E		103
FX21019J006 KRW/USD 10-05-19E		159
FX21019J007 KRW/USD 10-05-19E		75
FX21019J008 KRW/USD 10-05-19E		281
FX21019J008 KRW/USD 10-05-19E		234
FX21019J009 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
FX21019J016 KRW/USD 20-05-19E		140
FX21019J019 KRW/USD 17-05-19E		1,310
FX21019J019 KRW/USD 17-05-19E		1,403
FX21019J019 KRW/USD 18-06-19E		374
FX21019J020 KRW/USD 20-05-19E		505
FX21019J021 KRW/USD 20-05-19E		475
FX21019J024 KRW/USD 24-06-19E		936
FX21019J024 KRW/USD 22-05-19E		786
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		936
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		992
FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E		374
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		75
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		984

FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E	1,010
FX21019J041 KRW/USD 28-05-19E	281
FX21019J043 KRW/USD 03-06-19E	561
FX21019J044 KRW/USD 03-06-19E	468
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E	281
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E	468
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E	655
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E	655
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E	814
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E	805

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

(단위:백만원)

5,753

공시일	2019-05-09
기준일	2019-05-08

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

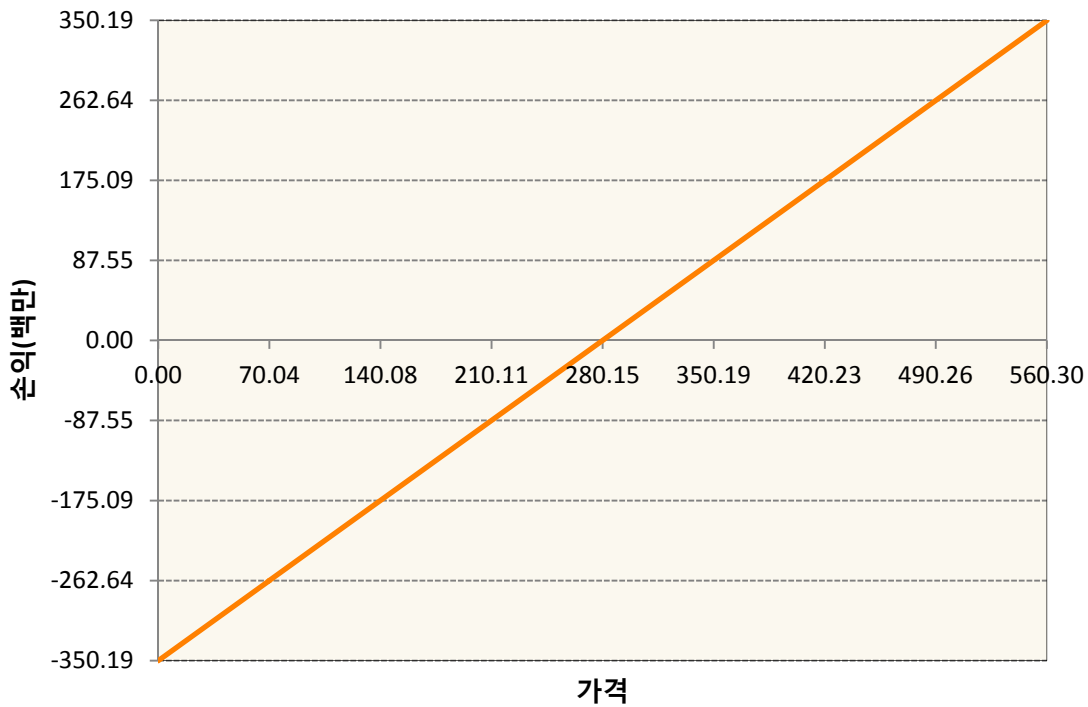
1. 계약금액

(단위:백만원)

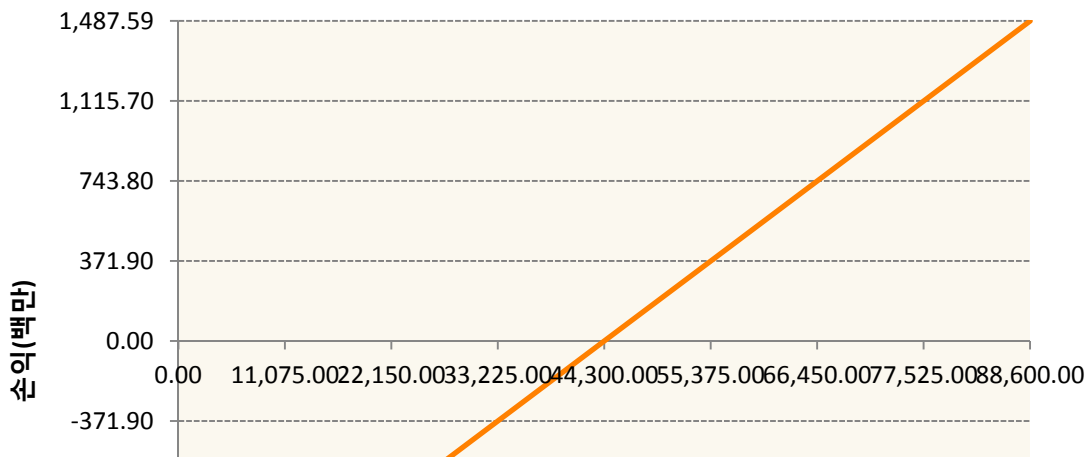
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,498	0	1,498	장내
누계	유가증권	선물	1,838	0	1,838	장내

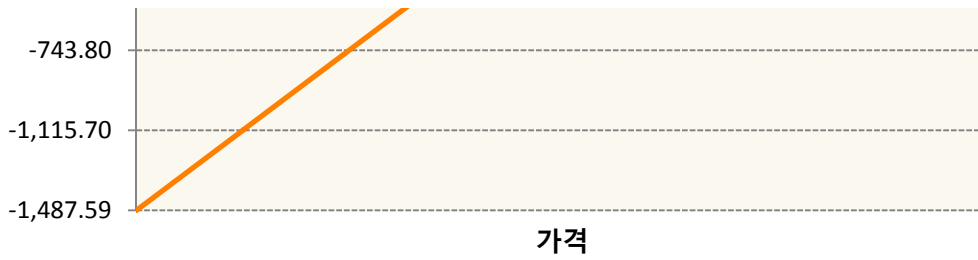
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4111P60003-2019-06 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	

KR4111P60003		2019-06 삼성전자개별선물						119
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119	
-5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79	
-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%	79	79	79	79	79	79	79	
8.00%	119	119	119	119	119	119	119	

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

160

공시일	2019-05-09
기준일	2019-05-08

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

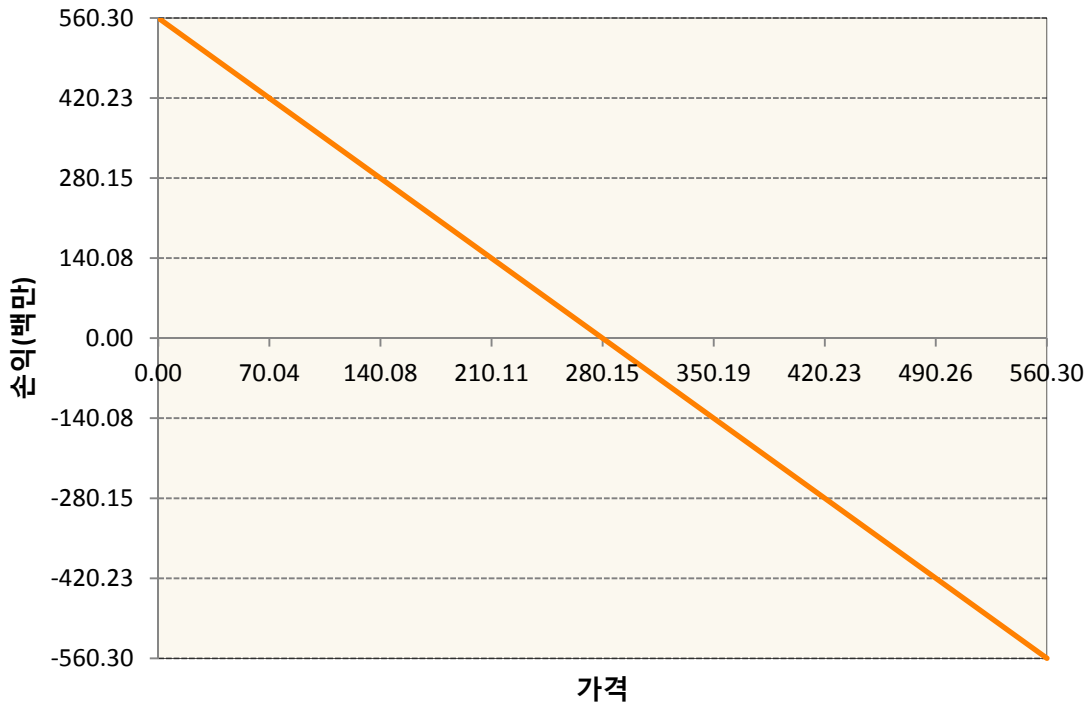
1. 계약금액

(단위:백만원)

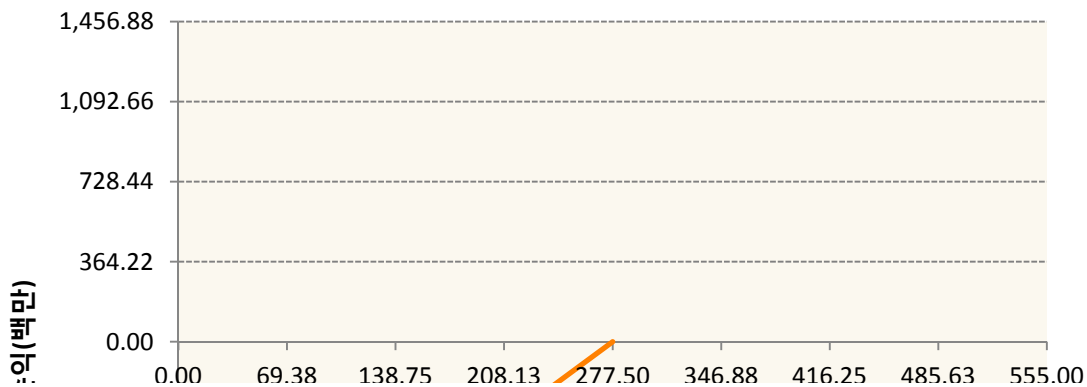
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	560	-560	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,137	-3,137	장내

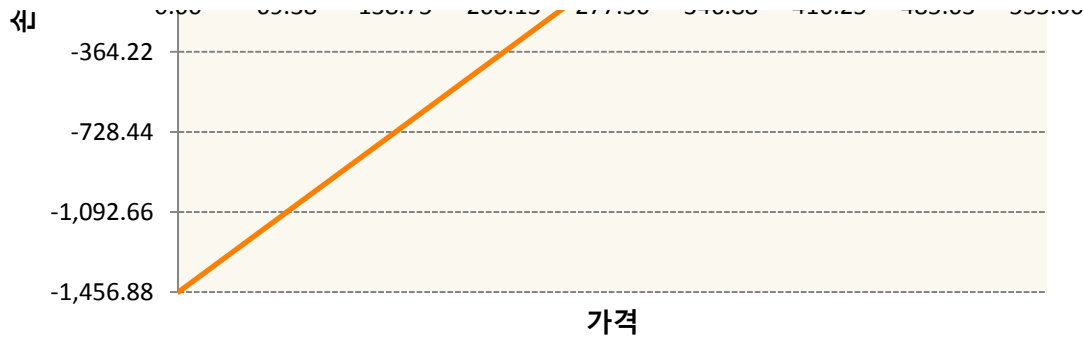
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

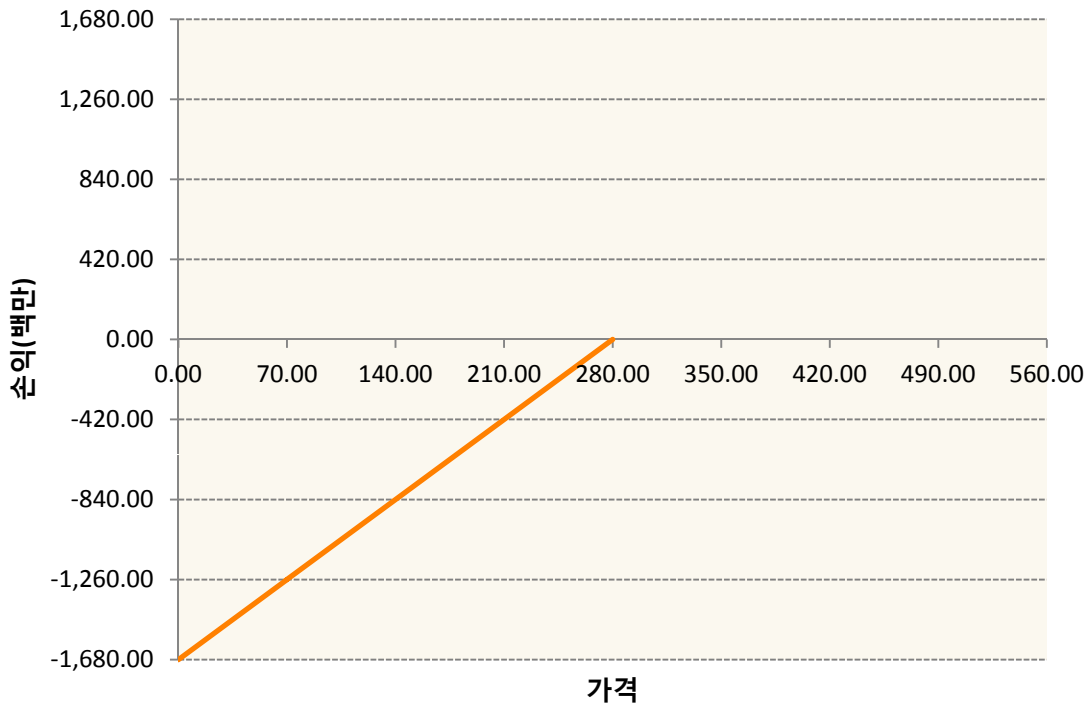


KR4301P52775-2019-05 풋277.5





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						103
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-103	-103	-103	-103	-103	-103	-103
-5.33%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
0%	0	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

129

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-129	-129	-129	-129	-129	-129	-129
-5.33%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	5	5	5	5	5	5	5
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

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

(단위:백만원)

388

공시일	2019-05-09
기준일	2019-05-08

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

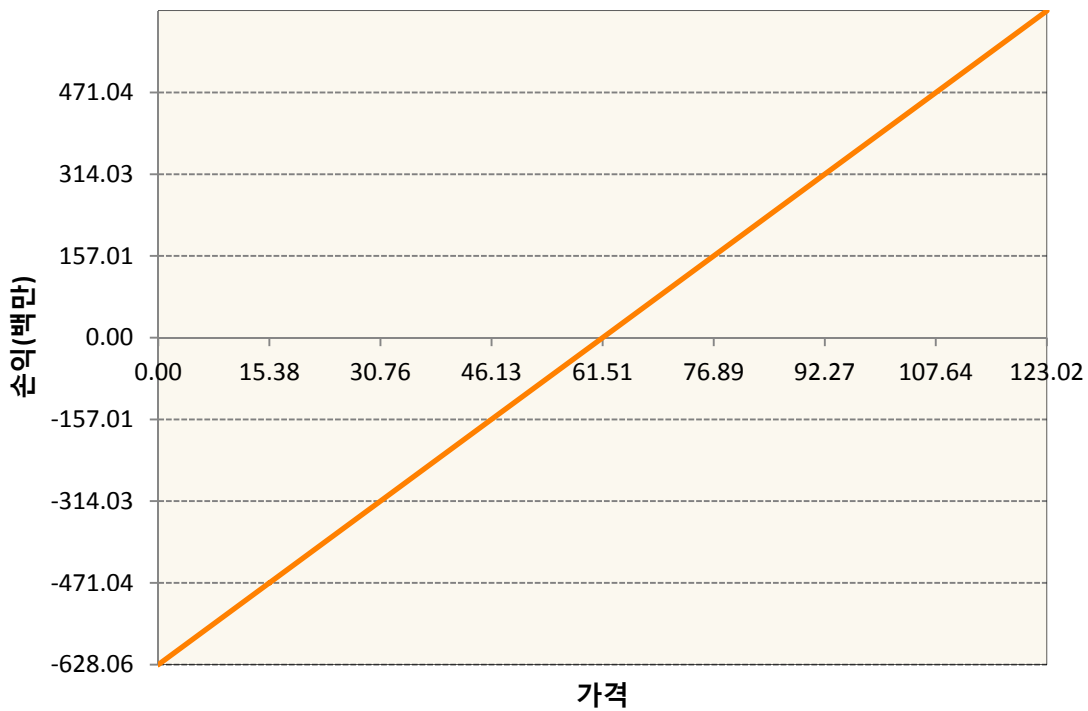
1. 계약금액

(단위:백만원)

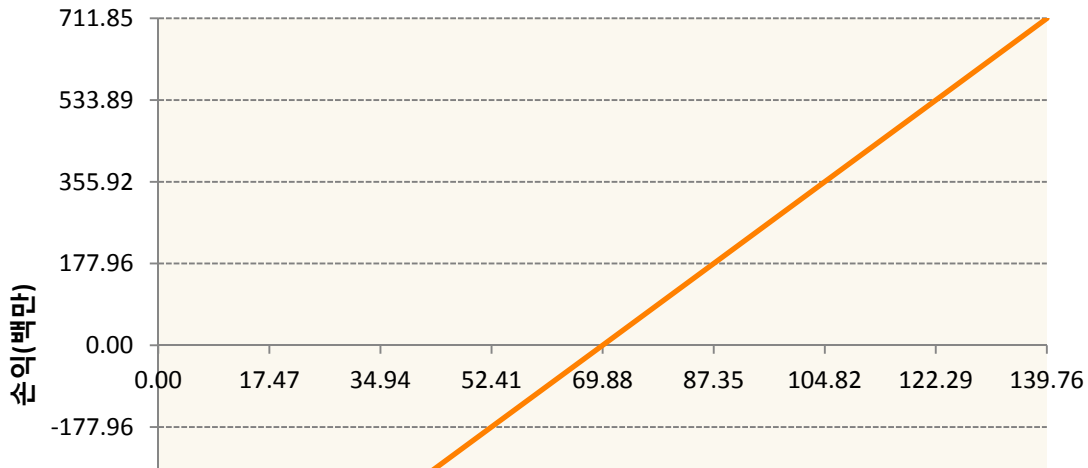
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,707	292	2,415	

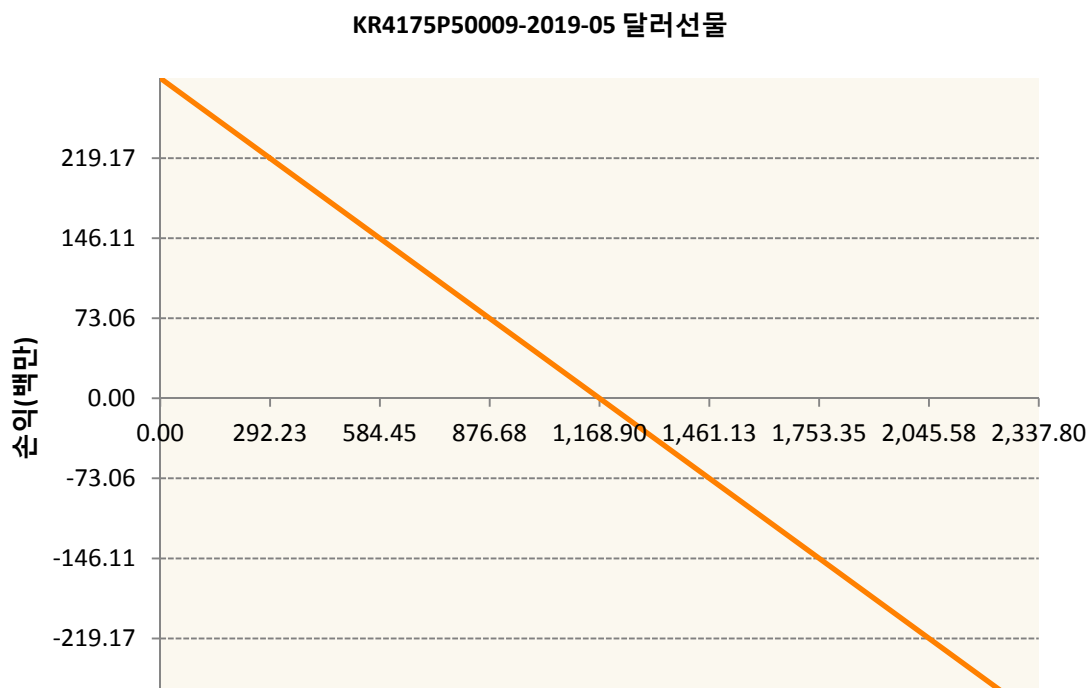
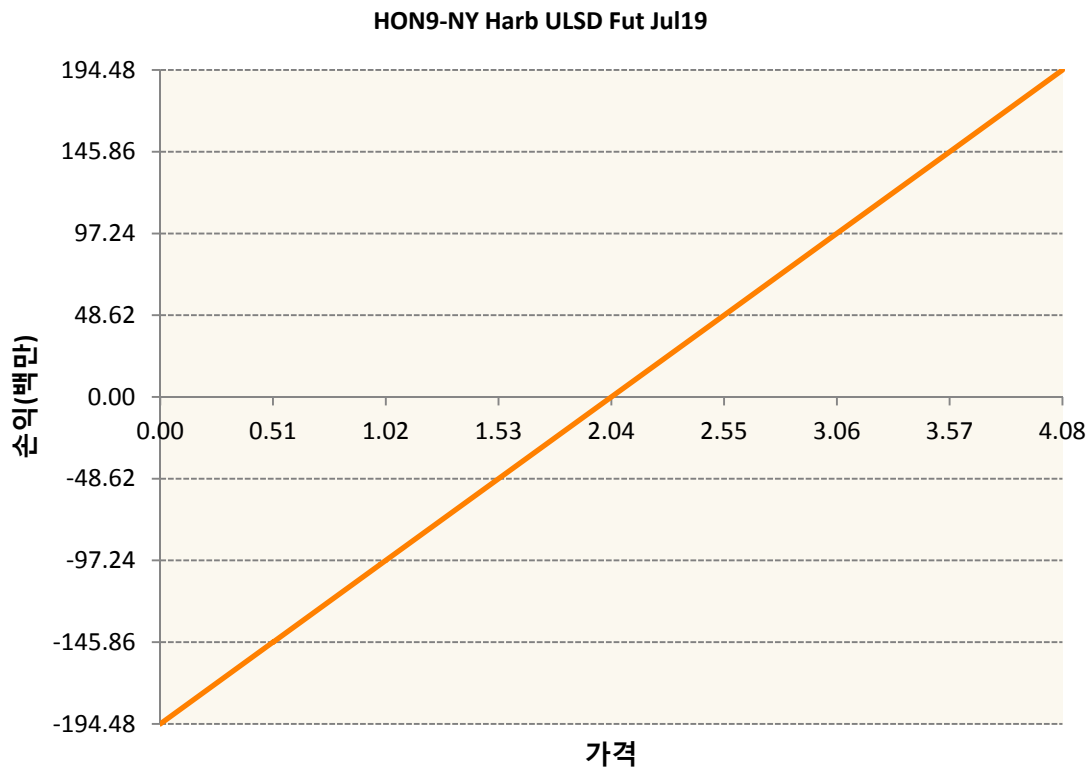
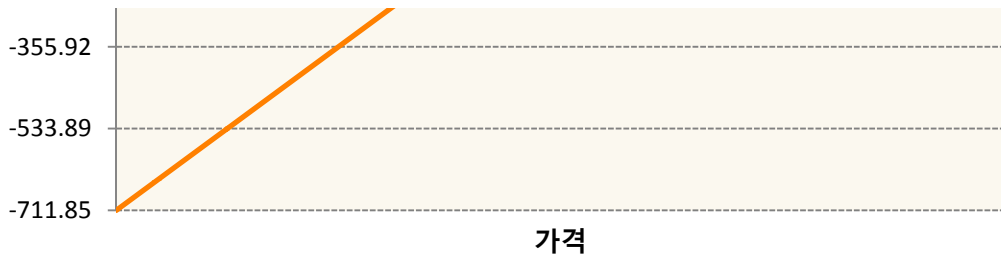
2. 만기시점의 손익구조

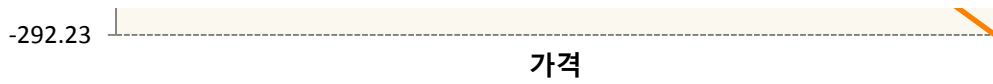
CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19



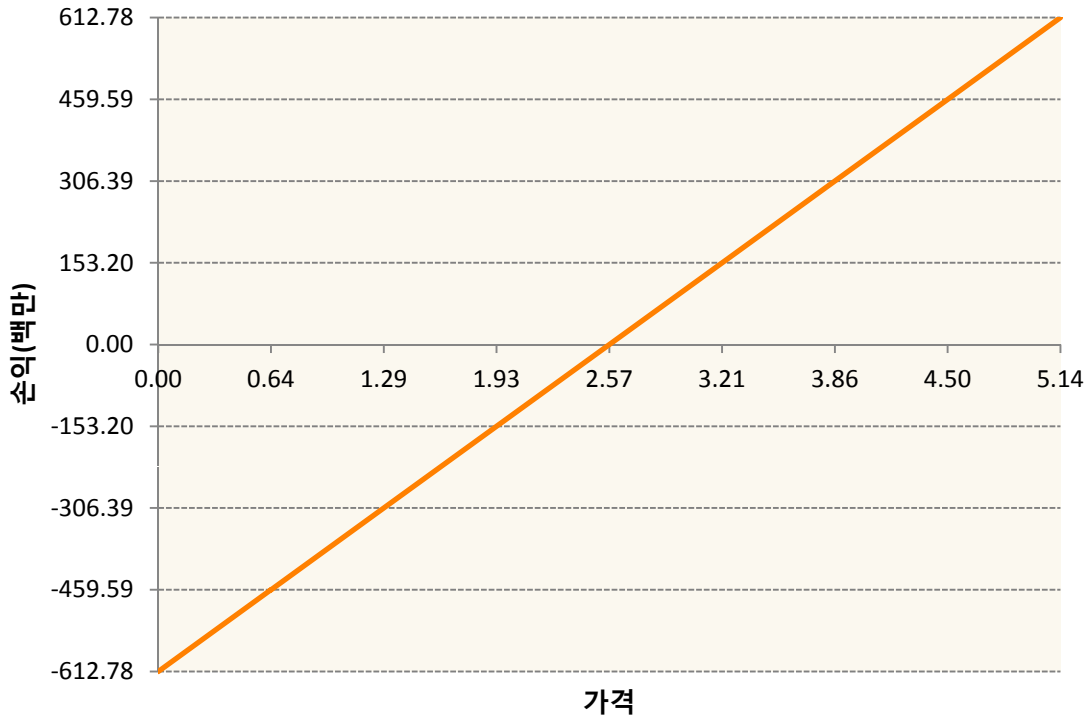
CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19



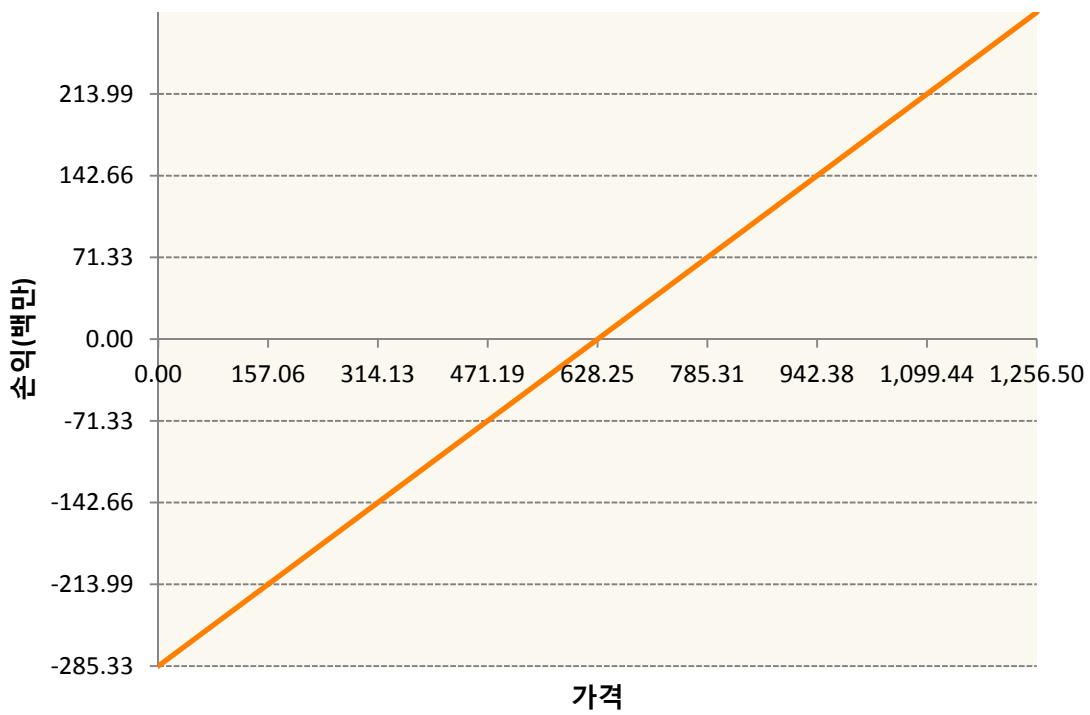




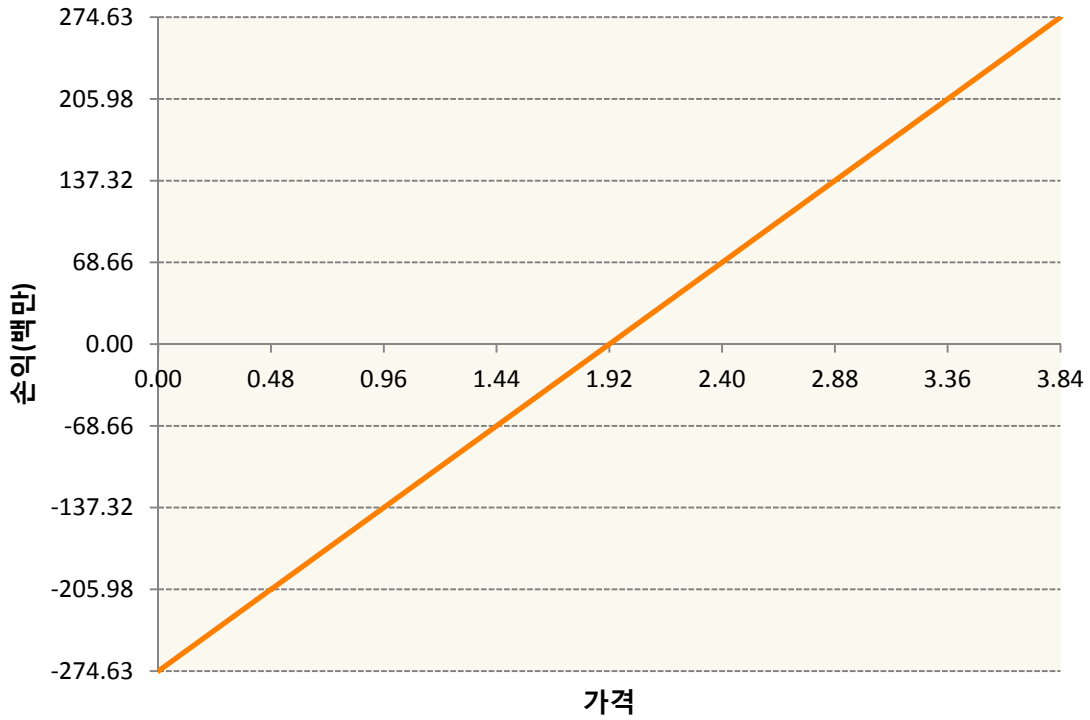
NGN19-NATURAL GAS FUTR Jul19



QSN9-Low Su Gasoil G Jul19



XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN9	WTI CRUDE FUTURE Jul19	50
CON9	BRENT CRUDE FUTR Jul19	57
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	22

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

399

공시일	2019-05-09
기준일	2019-05-08

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

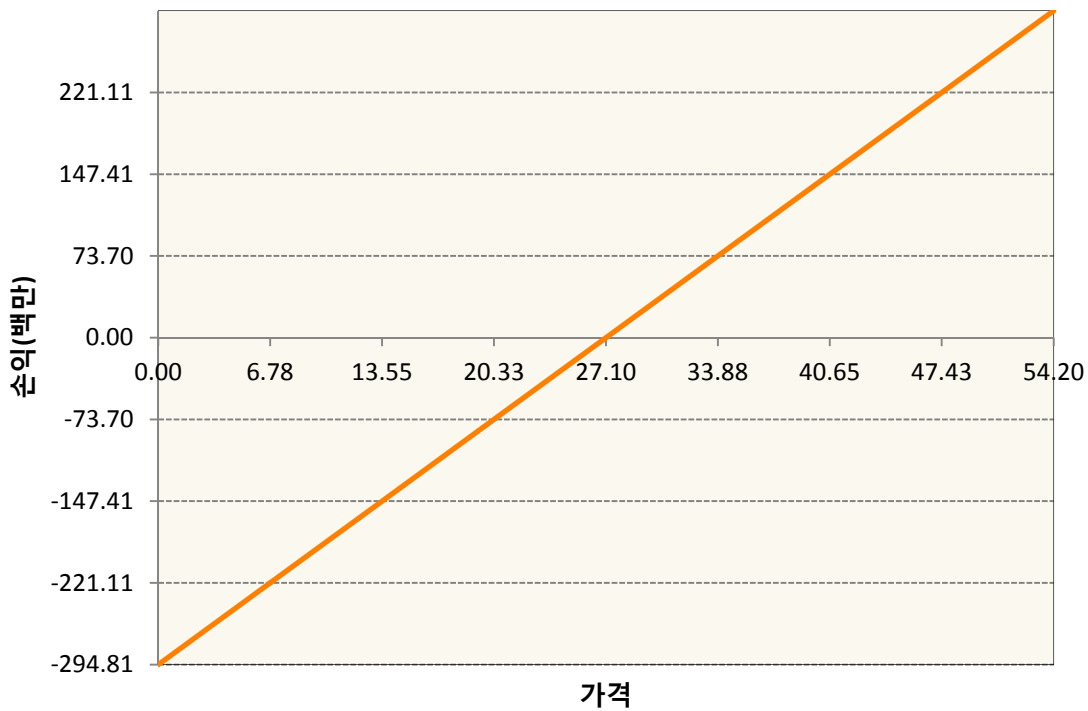
1. 계약금액

(단위:백만원)

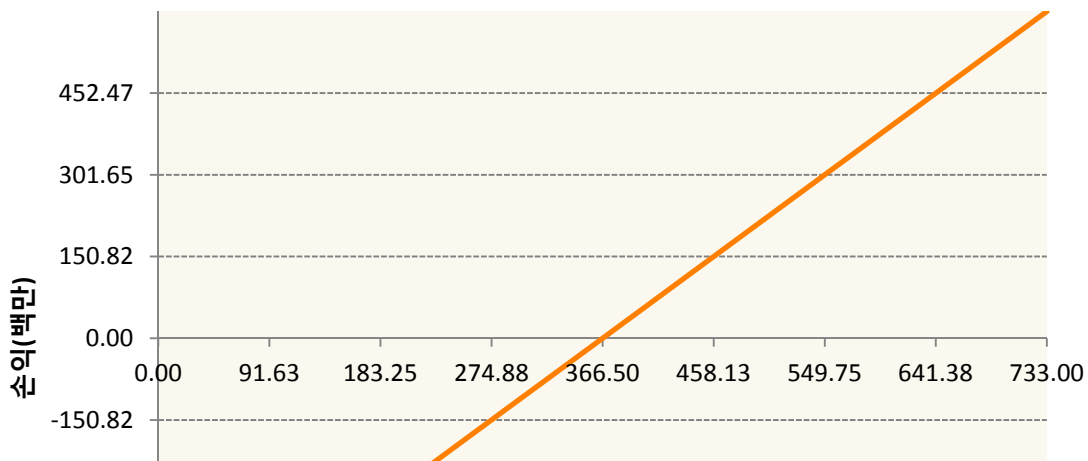
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,854	58	2,796	

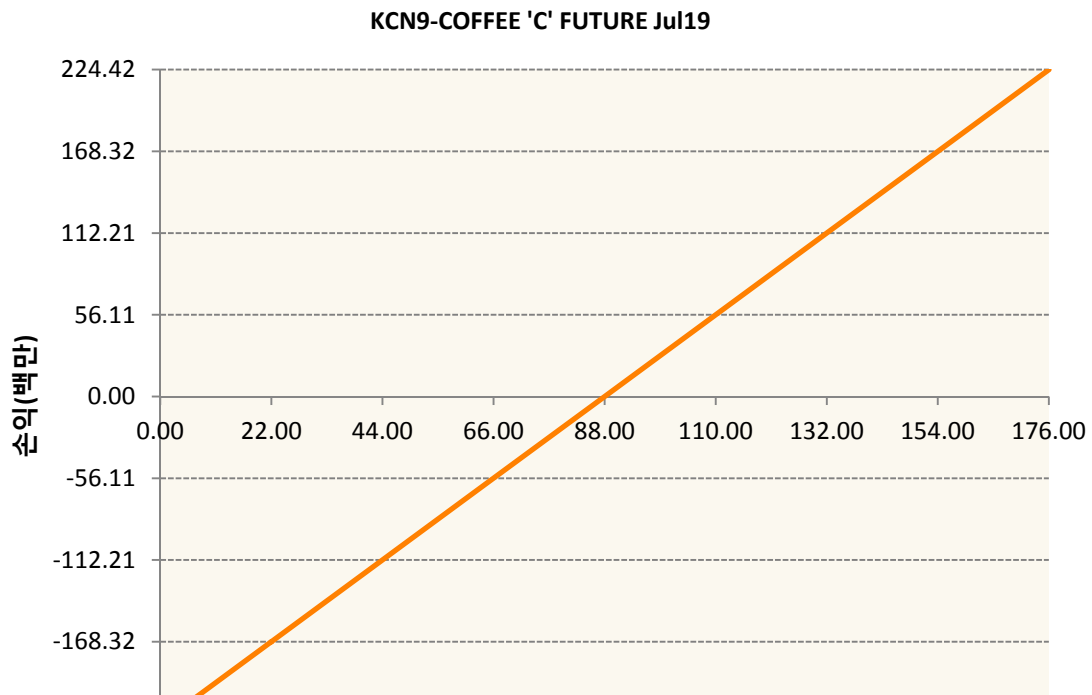
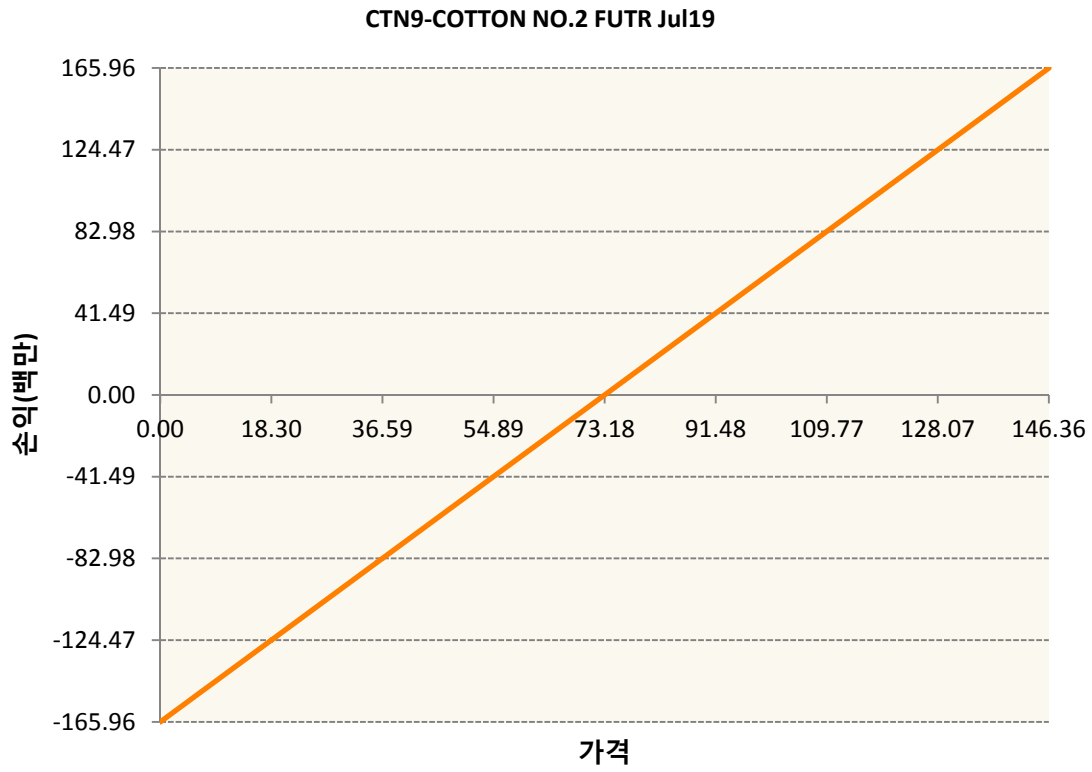
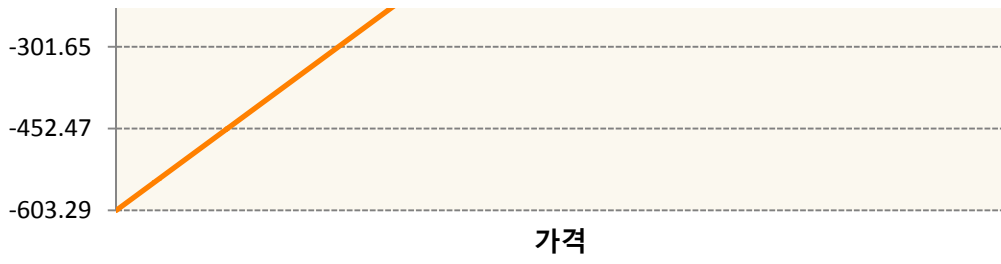
2. 만기시점의 손익구조

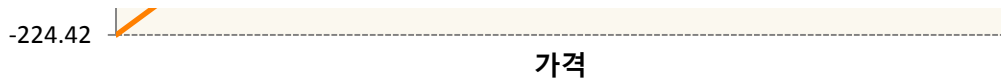
BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19



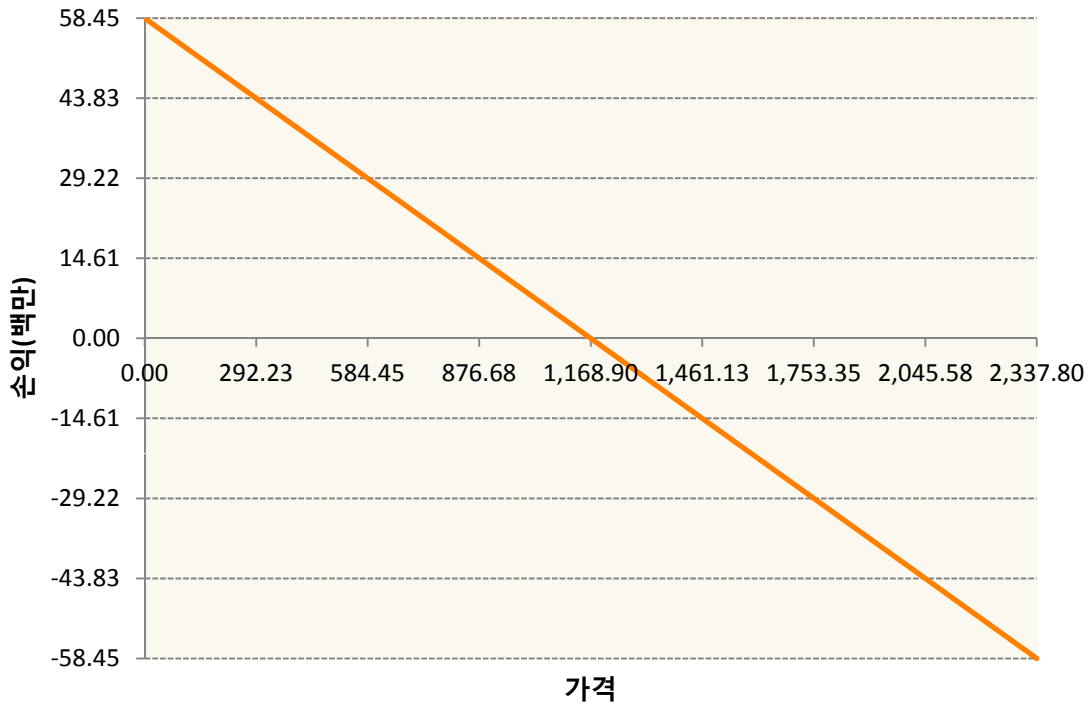
CN9-CORN FUTURE Jul19



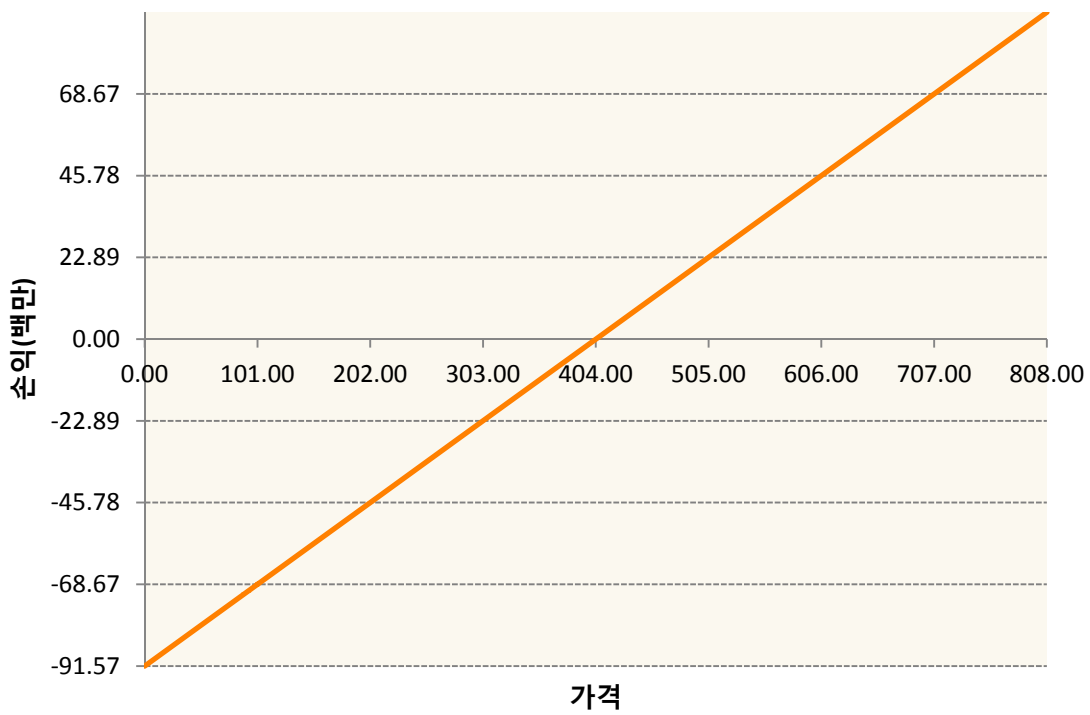




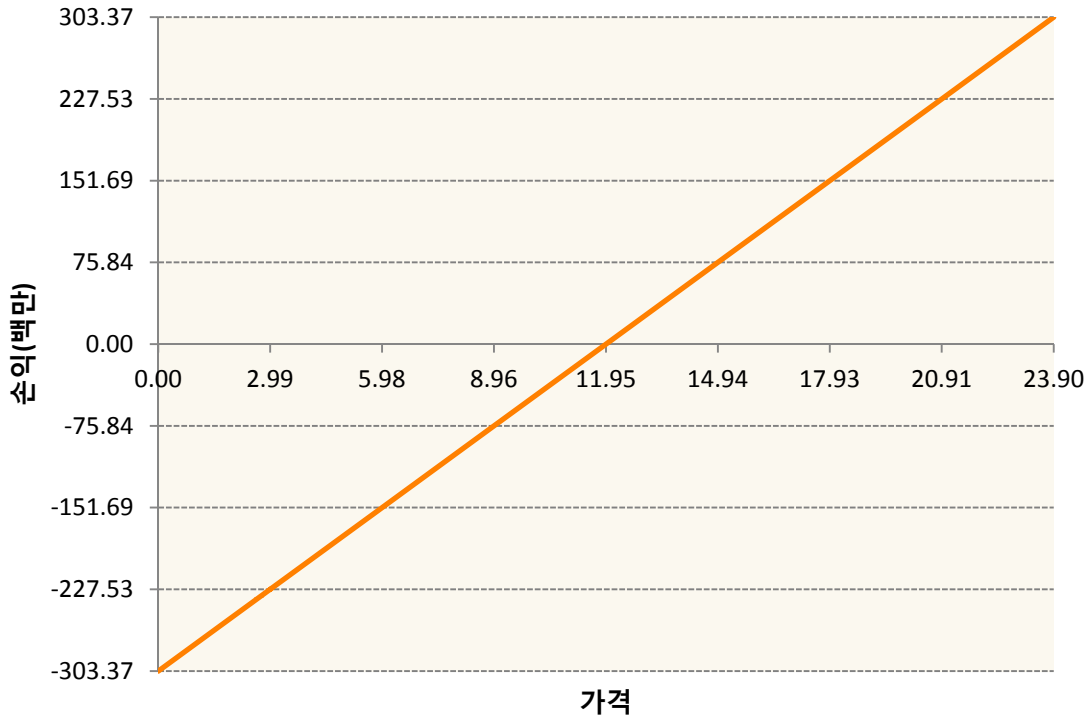
KR4175P50009-2019-05 달러선물



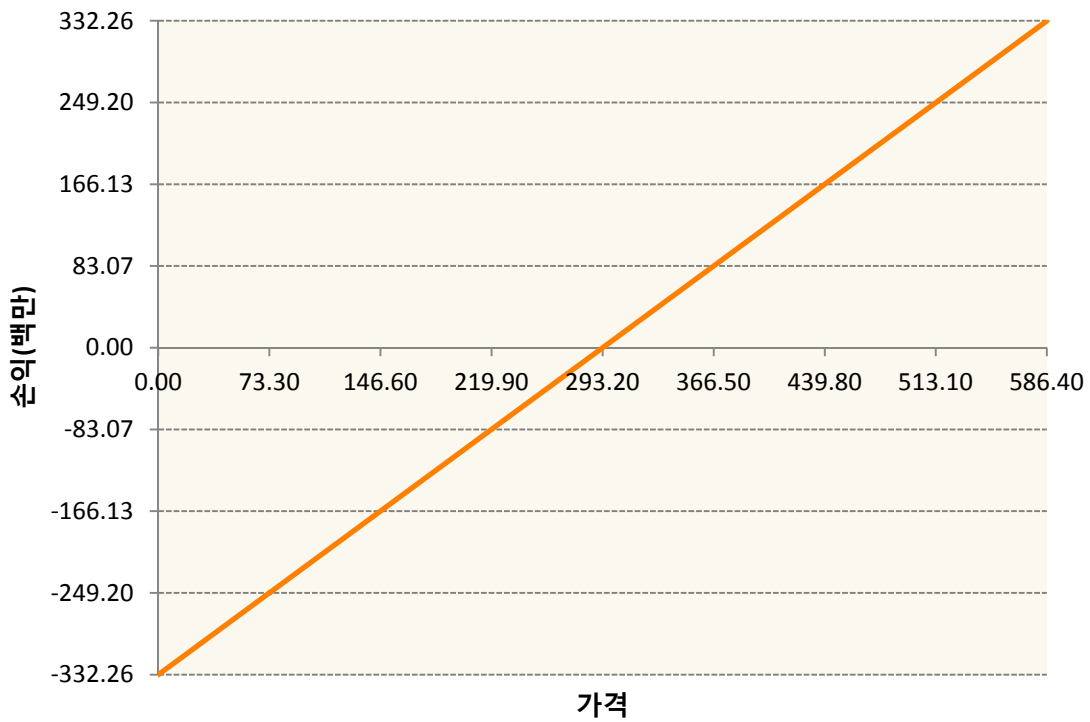
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



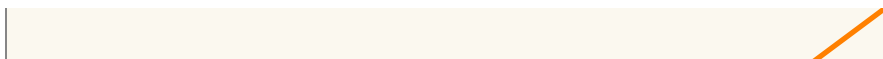
SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

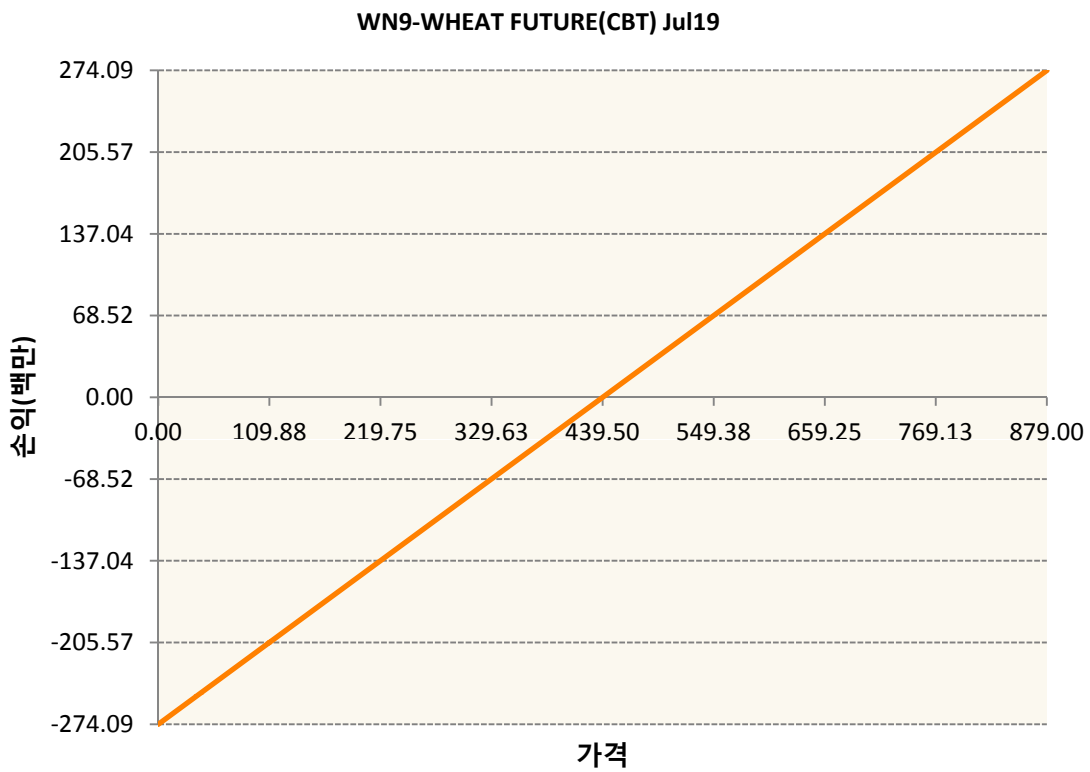
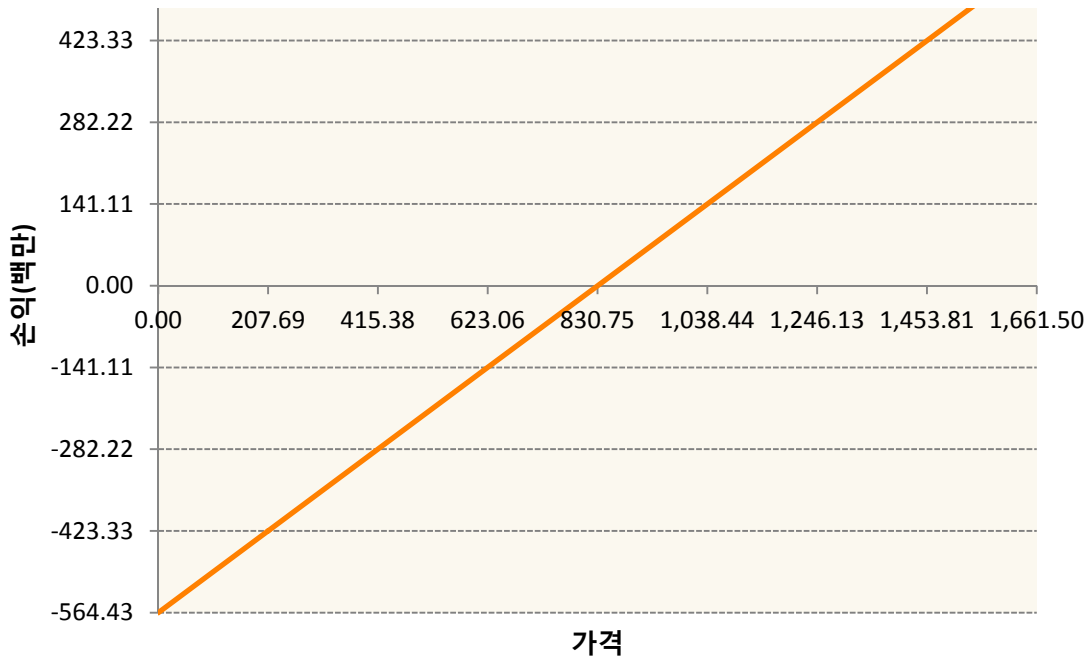


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19



SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON9	SOYBEAN OIL FUTR Jul19	24
CN9	CORN FUTURE Jul19	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)

230