

공시일	2019-05-13
기준일	2019-05-10

## 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	2019-05-13
기준일	2019-05-10

## 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

1,137

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

671

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-05-13
기준일	2019-05-10

## 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)	313
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	86
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	146

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

<b>892</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-05-13
기준일	2019-05-10

## 유로인덱스모(주식-파생형)

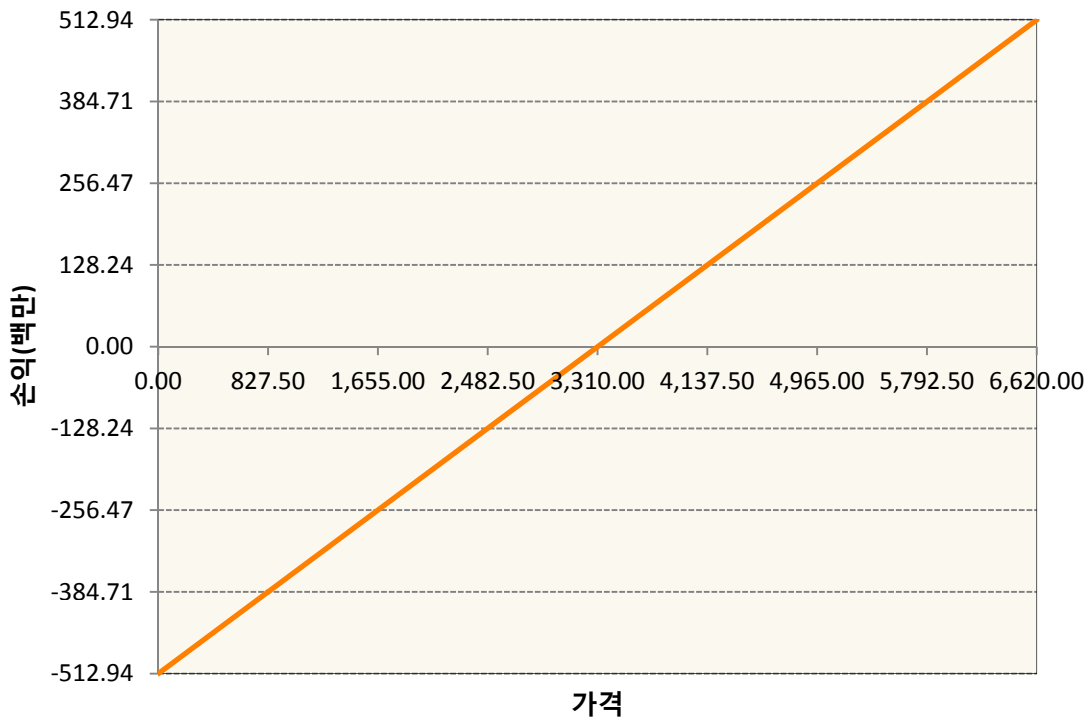
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	513	0	513	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	41
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

29
----

공시일	2019-05-13
기준일	2019-05-10

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

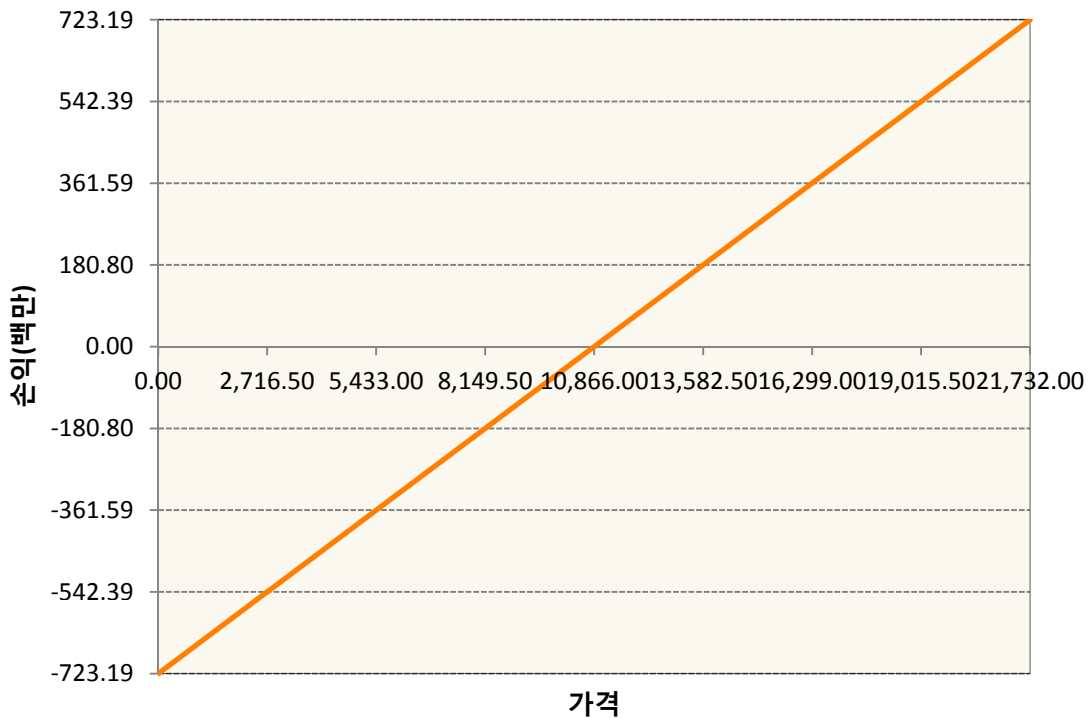
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	723	0	723	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK9	HSCEI Futures May19	58
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

60
----

공시일	2019-05-13
기준일	2019-05-10

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

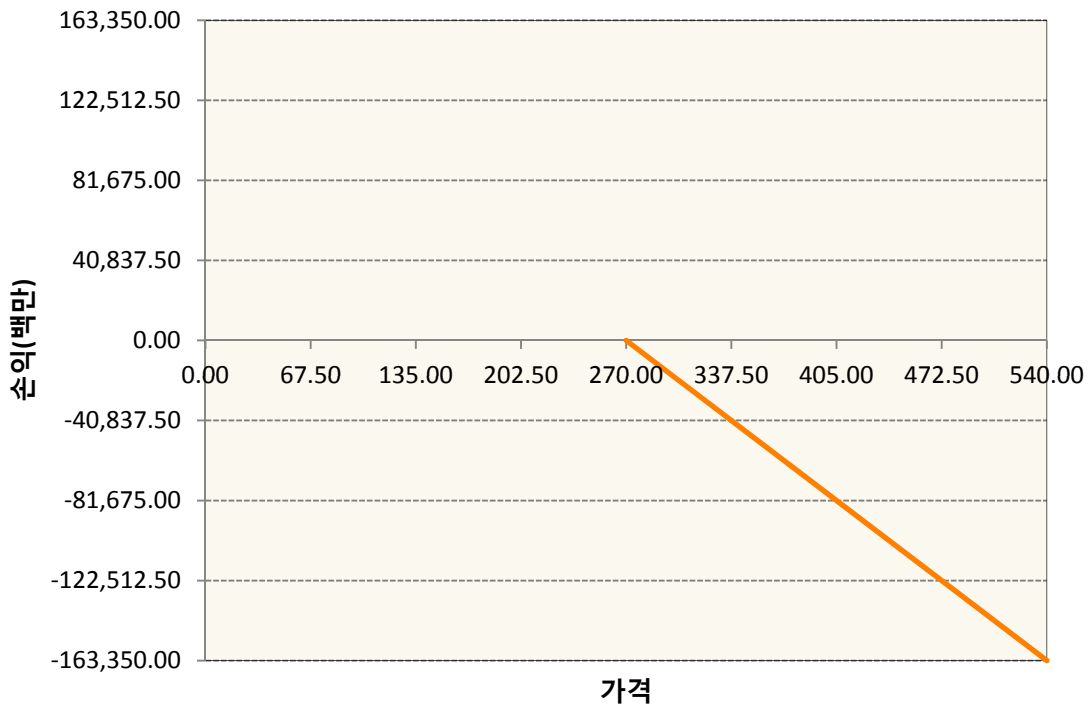
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

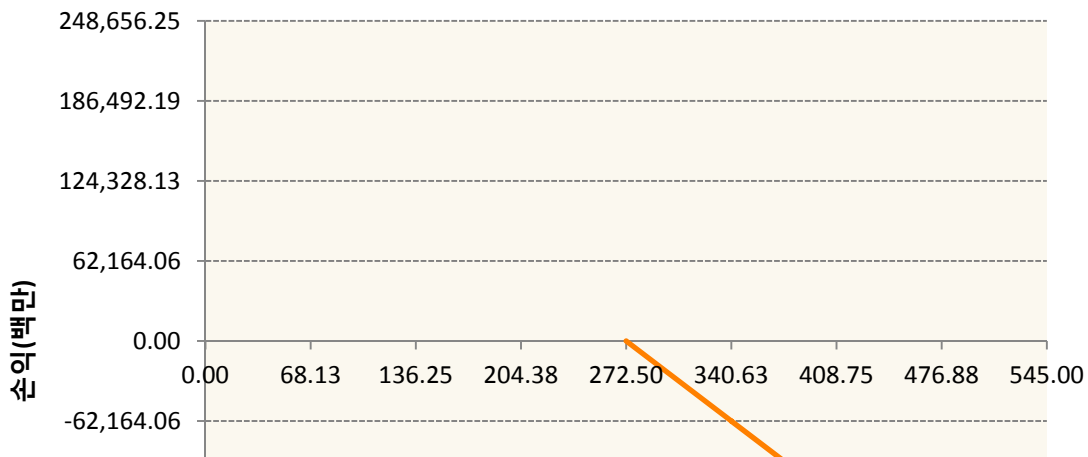
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	488,760	-488,760	장내
누계	유가증권	옵션	0	614,506	-614,506	장내

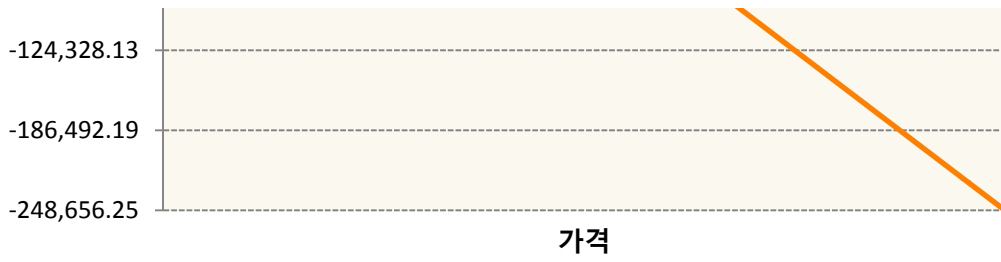
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P62701-2019-06 콜270

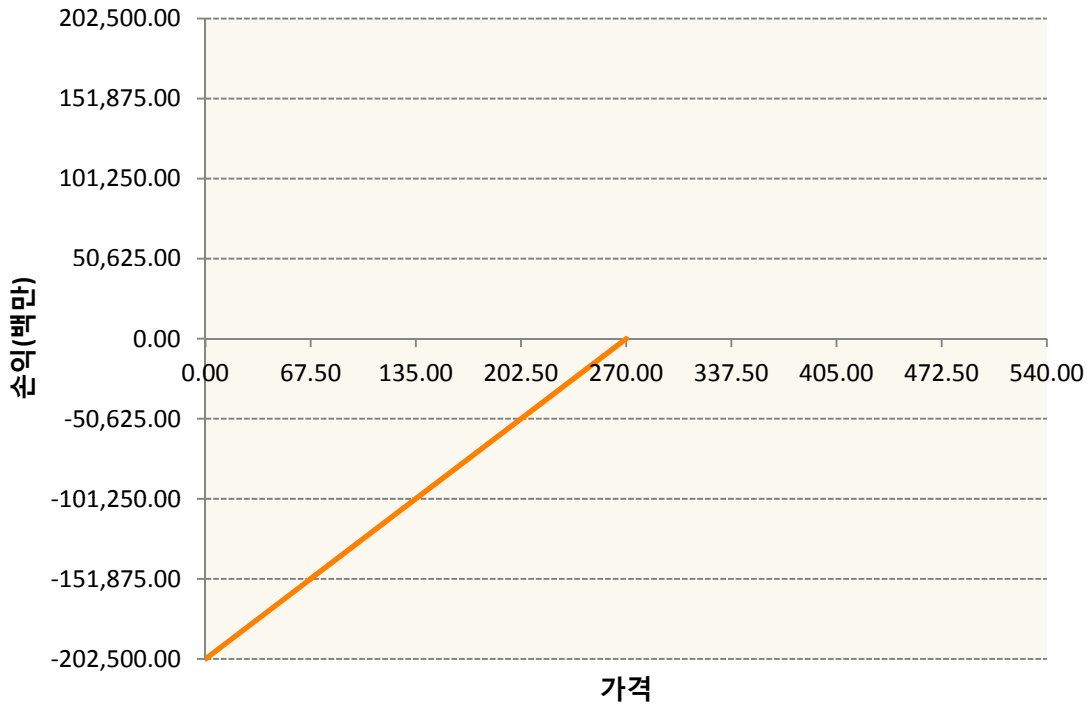


KR4201P62727-2019-06 콜272.5





KR4301P62709-2019-06 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P62701		2019-06 콜270					10,372
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,344	5,145	4,917	4,665	4,393	4,104	3,800
-5.33%	4,648	4,332	3,999	3,652	3,295	2,930	2,557
-2.67%	3,347	2,940	2,530	2,117	1,702	1,285	866
0%	1,294	863	432	0	-432	-864	-1,296
2.67%	-1,517	-1,900	-2,292	-2,691	-3,097	-3,507	-3,920
5.33%	-4,963	-5,251	-5,562	-5,892	-6,238	-6,597	-6,966
8.00%	-8,852	-9,038	-9,256	-9,503	-9,773	-10,064	-10,372
KR4201P62727		2019-06 콜272.5					15,014
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,121	6,870	6,574	6,238	5,868	5,469	5,045

-5.33%	6,297	5,873	5,416	4,932	4,428	3,906	3,370
-2.67%	4,668	4,087	3,493	2,891	2,282	1,668	1,050
0%	1,970	1,313	657	0	-657	-1,313	-1,969
2.67%	-1,885	-2,504	-3,131	-3,764	-4,403	-5,045	-5,689
5.33%	-6,770	-7,264	-7,788	-8,333	-8,897	-9,475	-10,065
8.00%	-12,424	-12,763	-13,148	-13,571	-14,027	-14,509	-15,014
KR4301P62709                      2019-06 풋270							11,984
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11,174	-11,252	-11,355	-11,481	-11,630	-11,798	-11,984
-5.33%	-6,146	-6,346	-6,569	-6,810	-7,067	-7,337	-7,618
-2.67%	-1,896	-2,227	-2,565	-2,908	-3,254	-3,603	-3,955
0%	1,108	739	370	0	-370	-741	-1,112
2.67%	2,787	2,504	2,205	1,895	1,574	1,247	913
5.33%	3,506	3,351	3,169	2,962	2,735	2,491	2,231
8.00%	3,740	3,678	3,592	3,481	3,346	3,190	3,014

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

(단위:백만원)

**35,484**

공시일	2019-05-13
기준일	2019-05-10

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

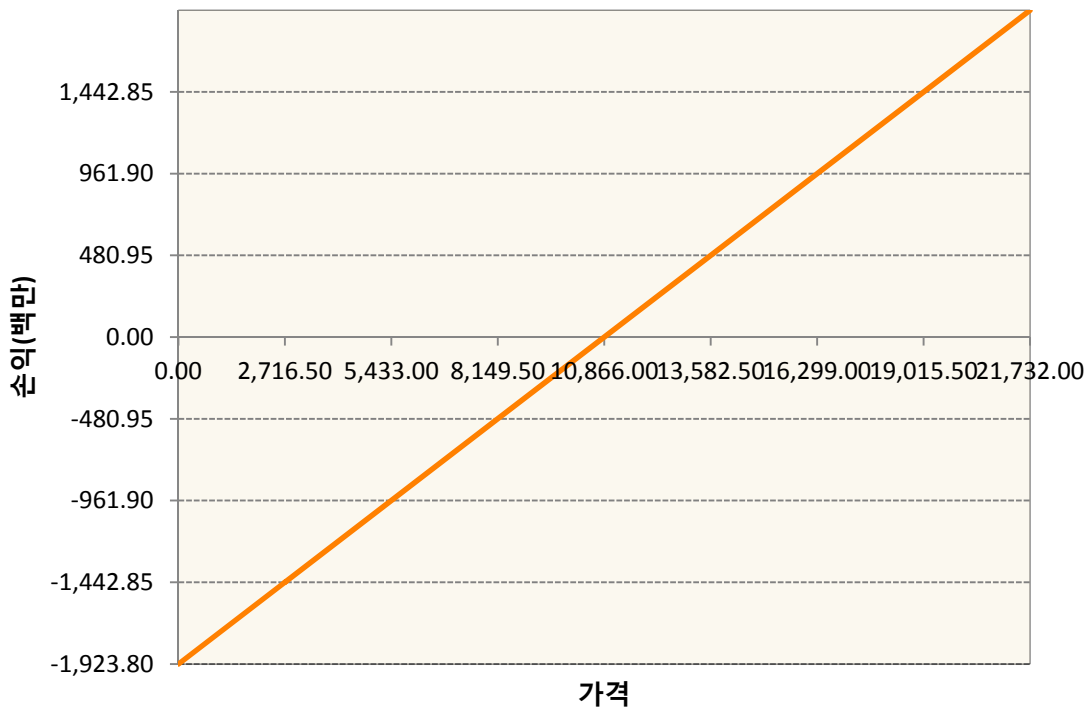
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

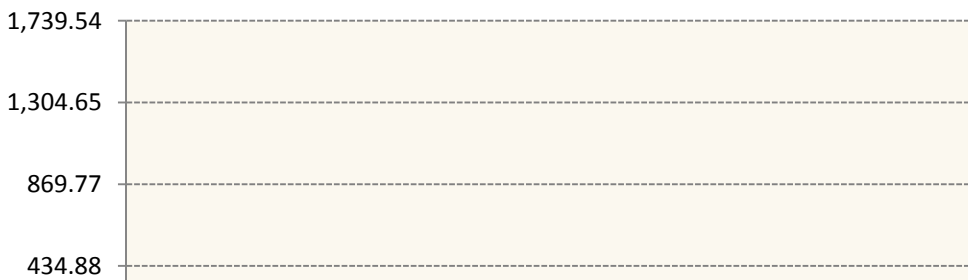
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,924	0	1,924	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,585	-5,585	장내
누계	통화	선도	0	3,149	-3,149	장외

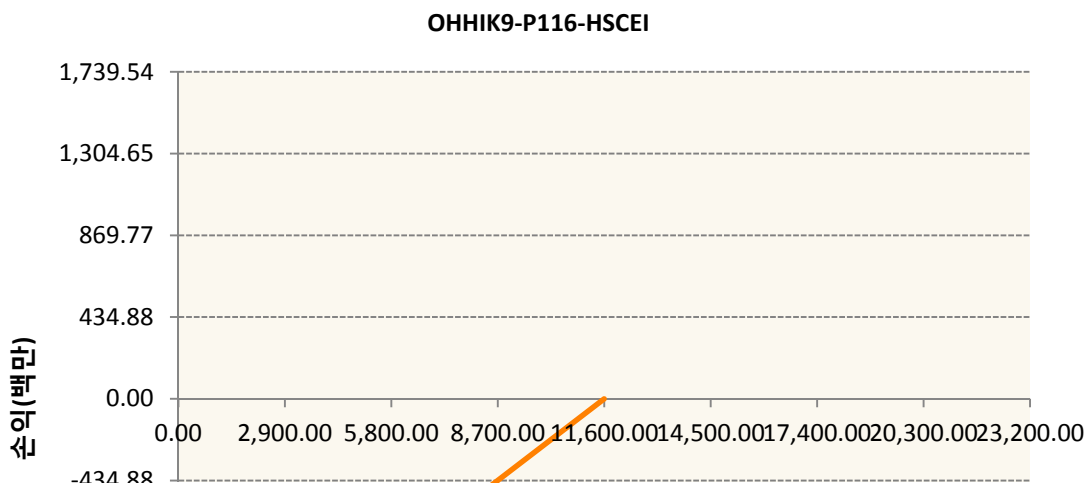
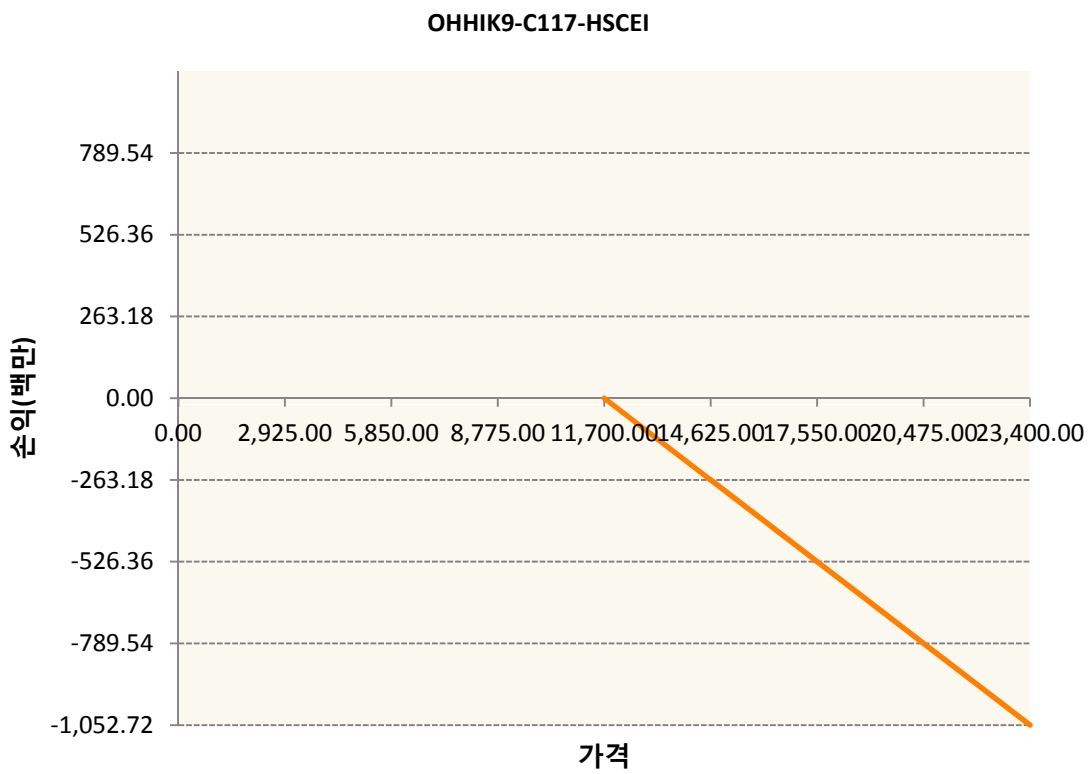
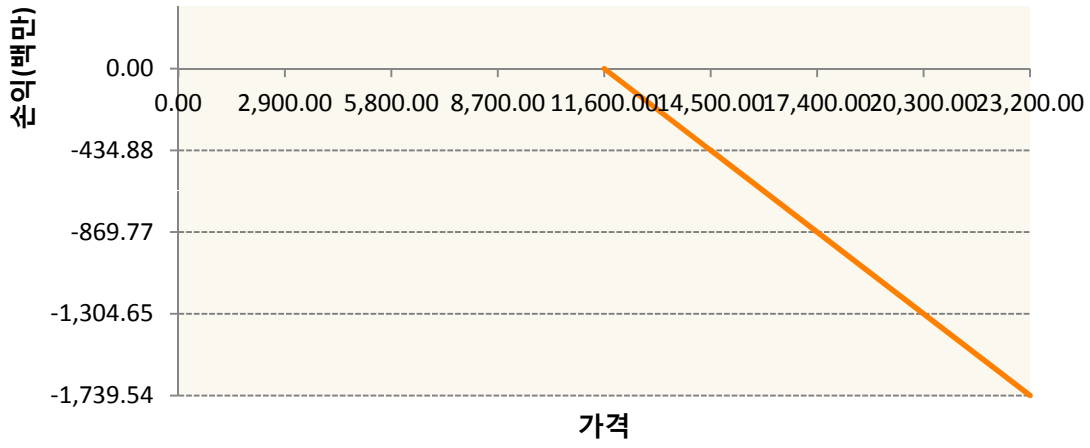
### 2. 만기시점의 손익구조

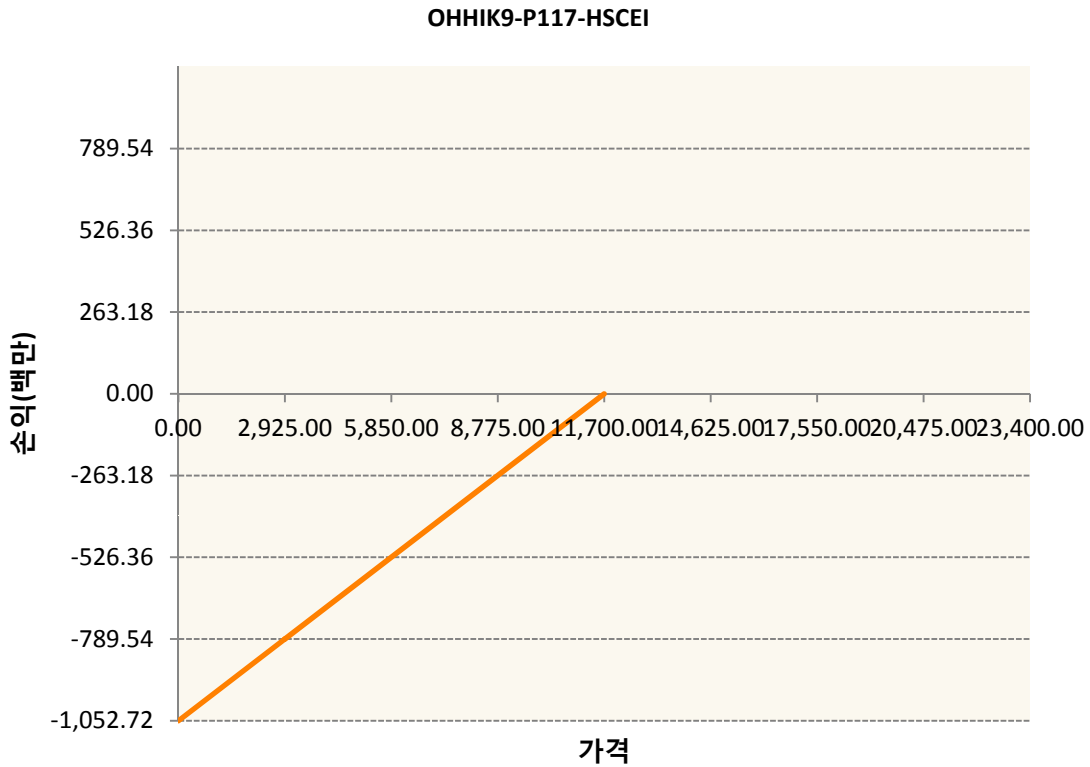
HCK9-HSCEI Futures May19



OHHIK9-C116-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	228
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	24
HCK9 HSCEI Futures May19	154
OHHIK9-C11 HSCEI	139
OHHIK9-C11 HSCEI	84
OHHIK9-P11 HSCEI	139
OHHIK9-P11 HSCEI	84

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	705

공시일	2019-05-13
기준일	2019-05-10

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

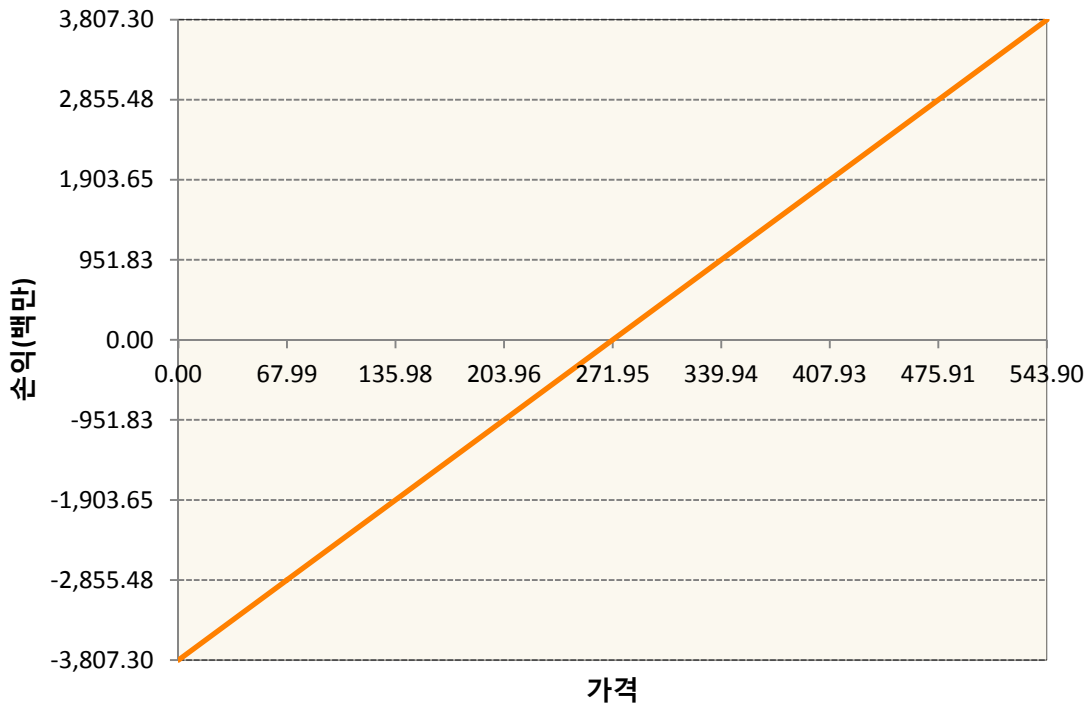
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

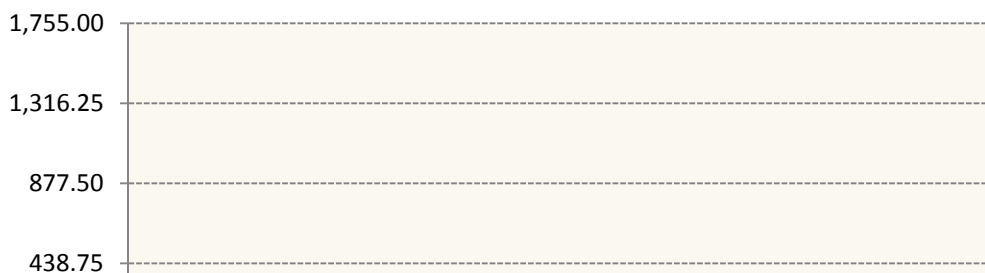
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	332	26,316	-25,984	장내
누계	유가증권	선물	3,807	0	3,807	장내
누계	유가증권	스왑	26,836	0	26,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,476	-25,476	장내

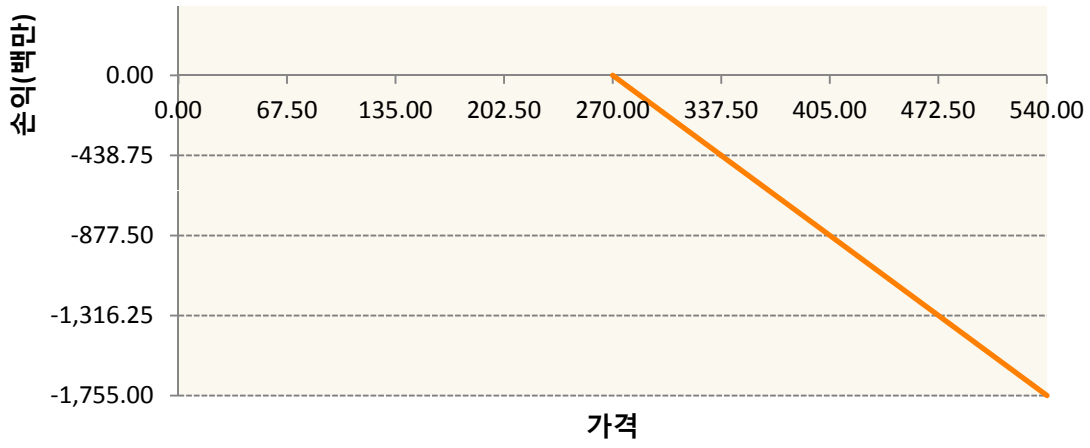
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

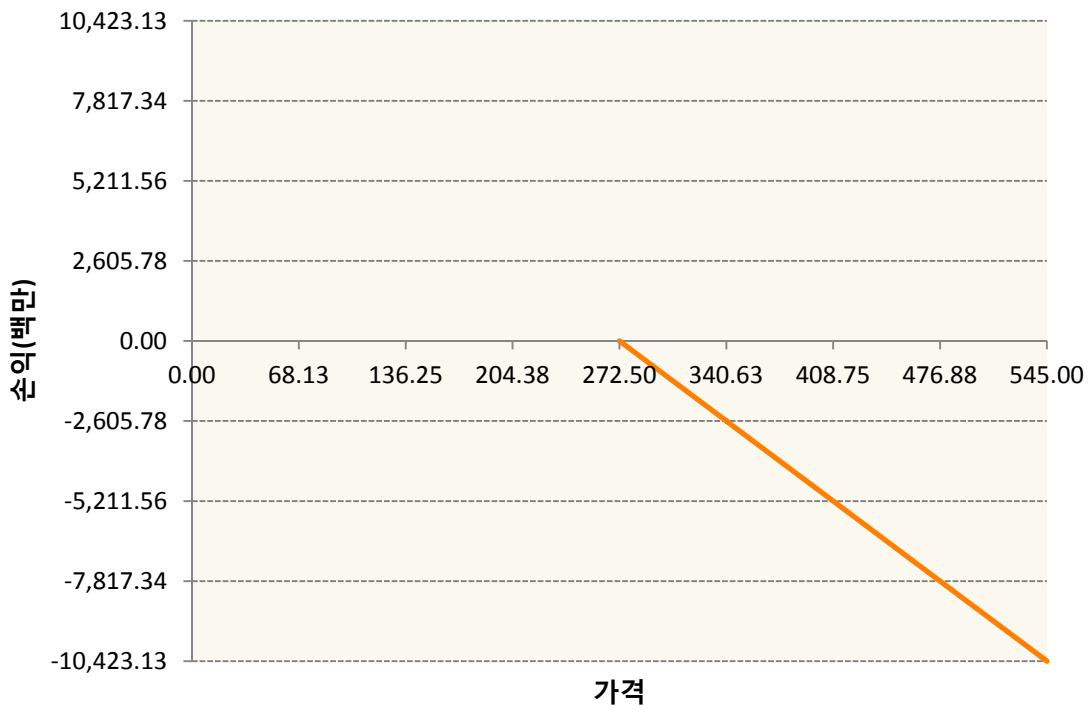


KR4201P62701-2019-06 콜270

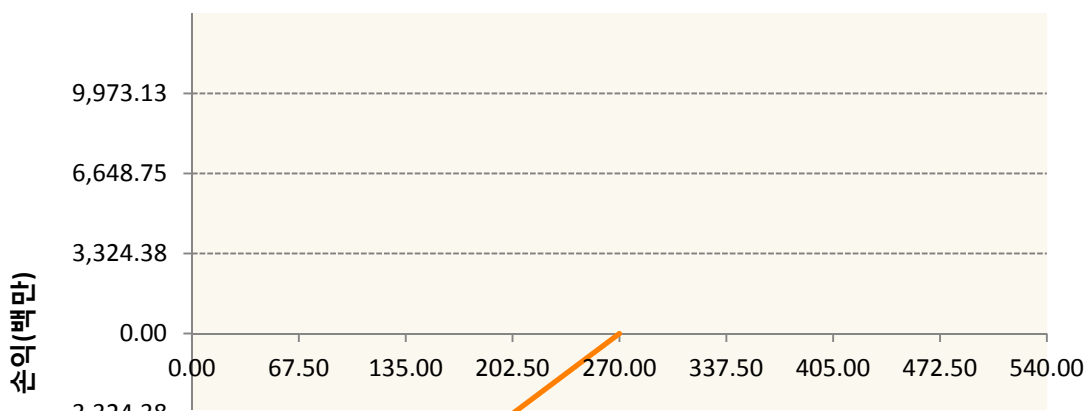




KR4201P62727-2019-06 콜272.5



KR4301P62709-2019-06 풋270





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,691
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,691	-1,691	-1,691	-1,691	-1,691	-1,691	-1,691	
-5.33%	-1,127	-1,127	-1,127	-1,127	-1,127	-1,127	-1,127	
-2.67%	-564	-564	-564	-564	-564	-564	-564	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	564	564	564	564	564	564	564	
5.33%	1,127	1,127	1,127	1,127	1,127	1,127	1,127	
8.00%	1,691	1,691	1,691	1,691	1,691	1,691	1,691	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						597
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-597	-597	-597	-597	-597	-597	-597	
-5.33%	-398	-398	-398	-398	-398	-398	-398	
-2.67%	-199	-199	-199	-199	-199	-199	-199	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	199	199	199	199	199	199	199	
5.33%	398	398	398	398	398	398	398	
8.00%	597	597	597	597	597	597	597	
KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						305
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-305	-305	-305	-305	-305	-305	-305	
-5.33%	-203	-203	-203	-203	-203	-203	-203	
-2.67%	-102	-102	-102	-102	-102	-102	-102	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	102	102	102	102	102	102	102	
5.33%	203	203	203	203	203	203	203	
8.00%	305	305	305	305	305	305	305	
KR4201P62701		2019-06 콜270						111
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	57	55	53	50	47	44	41
-5.33%	50	47	43	39	35	31	27
-2.67%	36	32	27	23	18	14	9
0%	14	9	5	0	-5	-9	-14
2.67%	-16	-20	-25	-29	-33	-38	-42
5.33%	-53	-56	-60	-63	-67	-71	-75
8.00%	-95	-97	-99	-102	-105	-108	-111

KR4201P62727                      2019-06 콜272.5                      629

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	298	288	276	261	246	229	211
-5.33%	264	246	227	207	186	164	141
-2.67%	196	171	146	121	96	70	44
0%	83	55	28	0	-28	-55	-83
2.67%	-79	-105	-131	-158	-185	-211	-238
5.33%	-284	-305	-326	-349	-373	-397	-422
8.00%	-521	-535	-551	-569	-588	-608	-629

KR4301P62709                      2019-06 풋270                      787

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-734	-739	-746	-754	-764	-775	-787
-5.33%	-404	-417	-431	-447	-464	-482	-500
-2.67%	-125	-146	-168	-191	-214	-237	-260
0%	73	49	24	0	-24	-49	-73
2.67%	183	164	145	124	103	82	60
5.33%	230	220	208	195	180	164	146
8.00%	246	242	236	229	220	209	198

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

(단위:백만원)

**4,006**

공시일	2019-05-13
기준일	2019-05-10

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

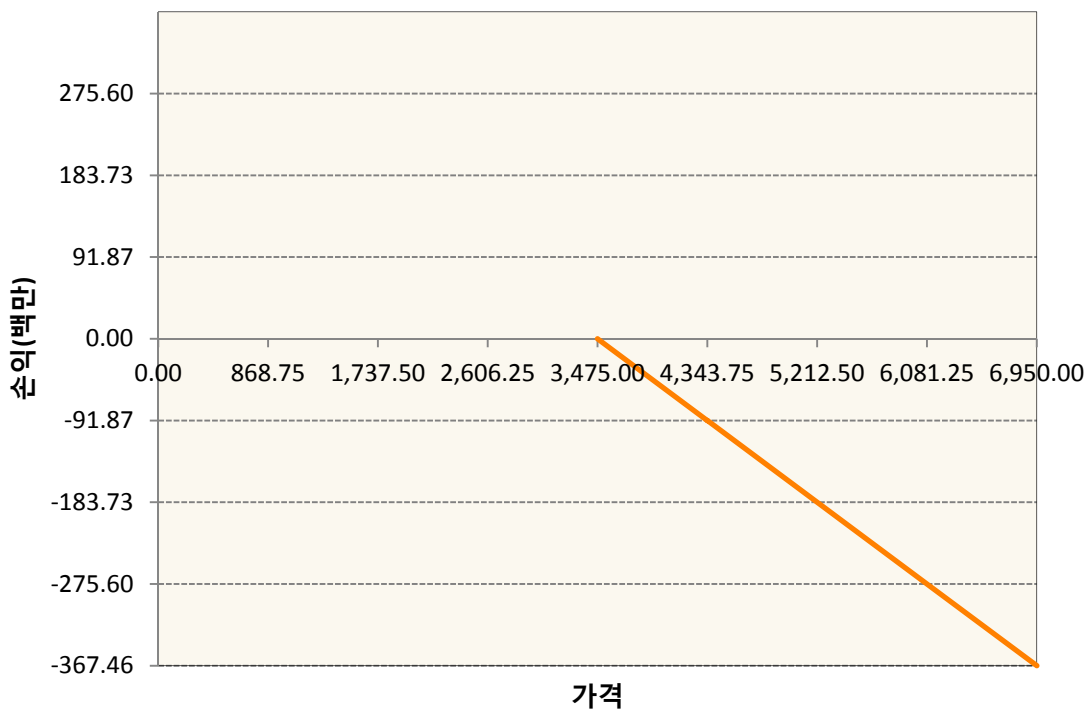
### 1. 계약금액

(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	4,766	0	4,766	
누계	유가증권	스왑	55,949	0	55,949	장외
누계	유가증권	옵션	0	24,514	-24,514	장내
누계	통화	선도	0	18,505	-18,505	장외

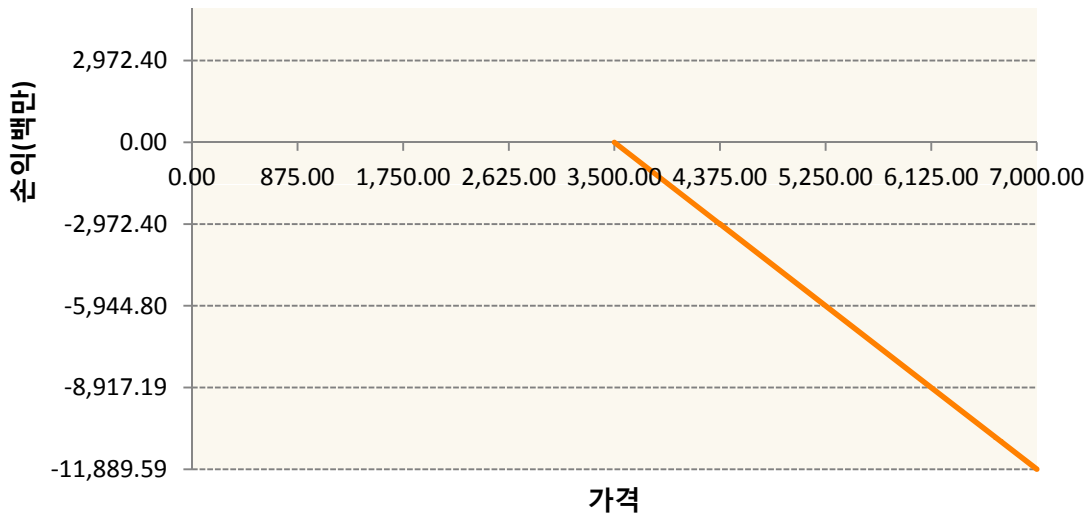
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXK9-C3475-EURO STOXX 50

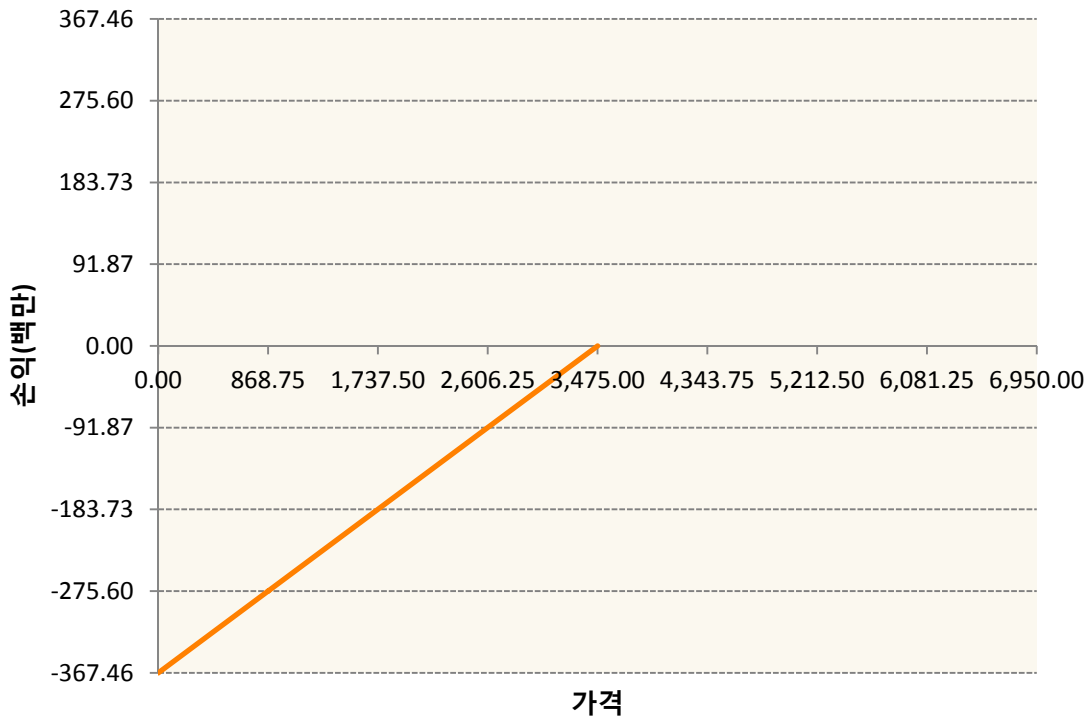


OESXK9-C3500-EURO STOXX 50

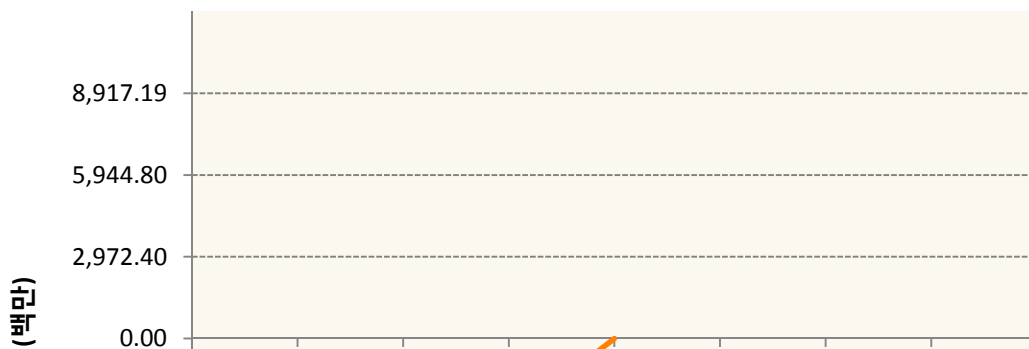


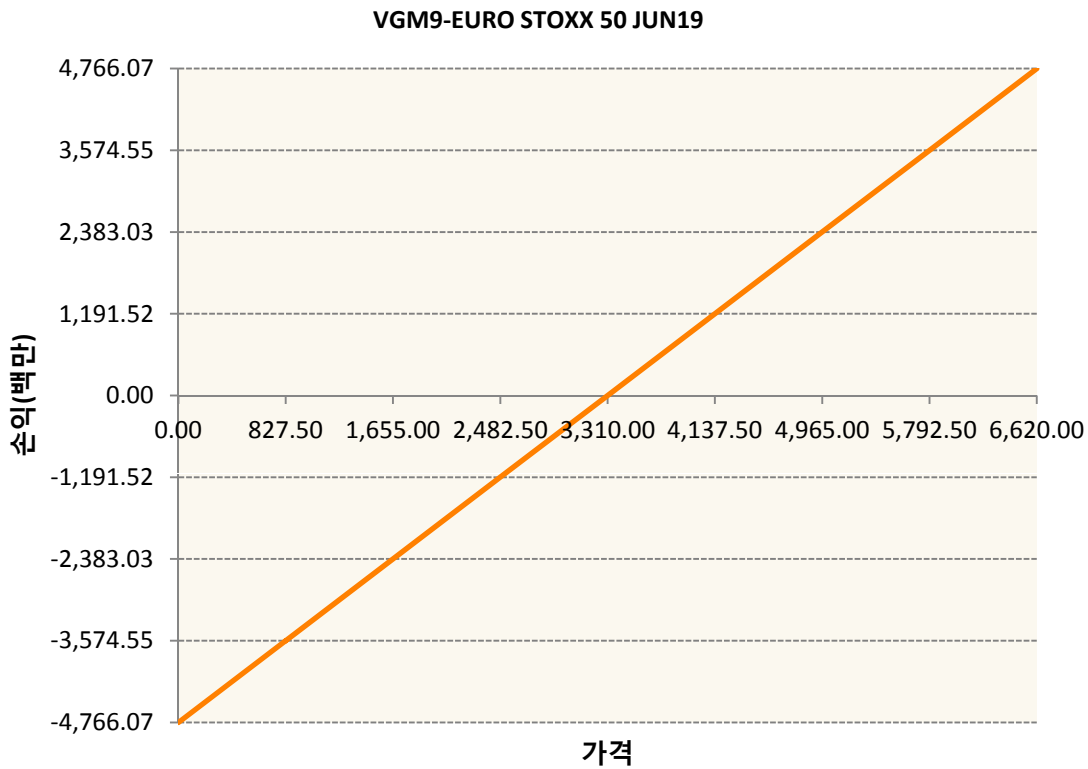
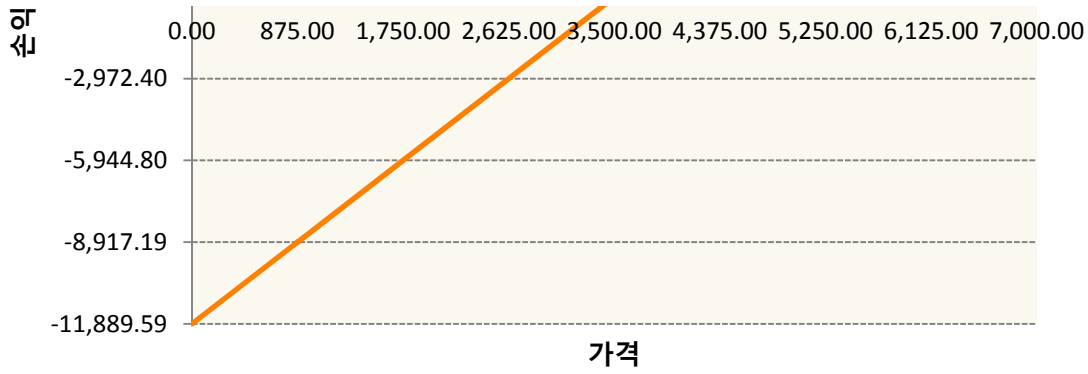


OESXK9-P3475-EURO STOXX 50



OESXK9-P3500-EURO STOXX 50





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	136
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	423
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	846
FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E	211
OESXK9-C34 EURO STOXX 50	29
OESXK9-C35 EURO STOXX 50	951
OESXK9-P34 EURO STOXX 50	29
OESXK9-P35 EURO STOXX 50	951
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	381

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

(단위:백만원)

2,569



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

(단위:백만원)

1,073



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

(단위:백만원)

92



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

(단위:백만원)

133

공시일	2019-05-13
기준일	2019-05-10

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

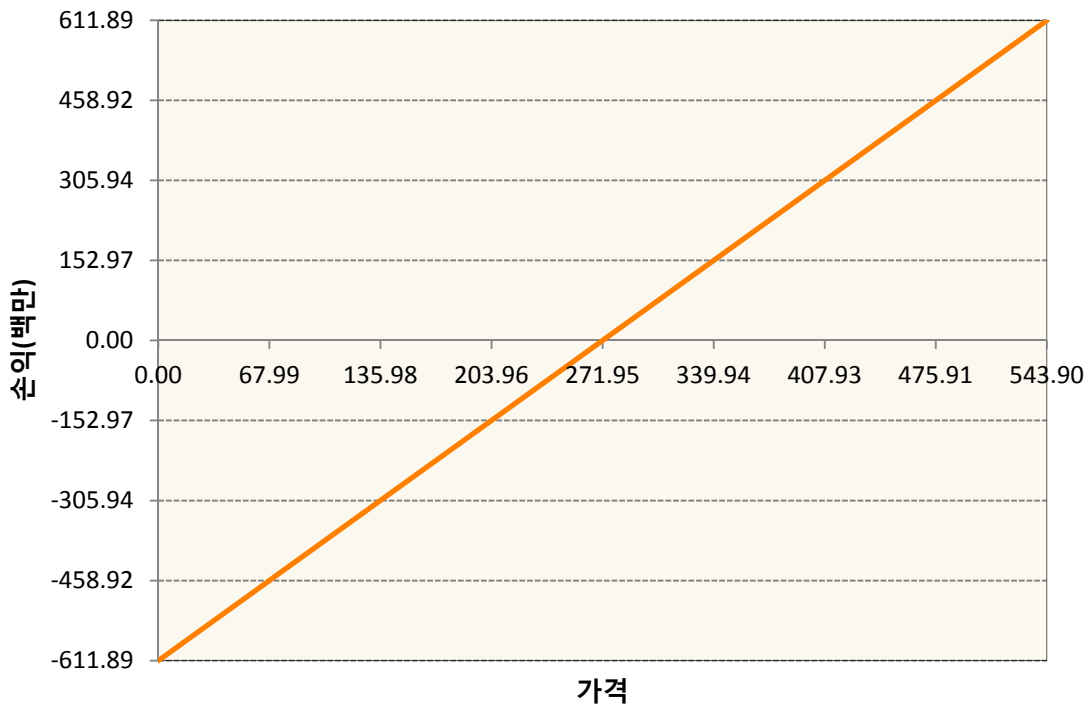
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	612	0	612	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						49
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	16	16	16	16	16	16	16	
5.33%	33	33	33	33	33	33	33	
8.00%	49	49	49	49	49	49	49	

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-05-13
기준일	2019-05-10

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

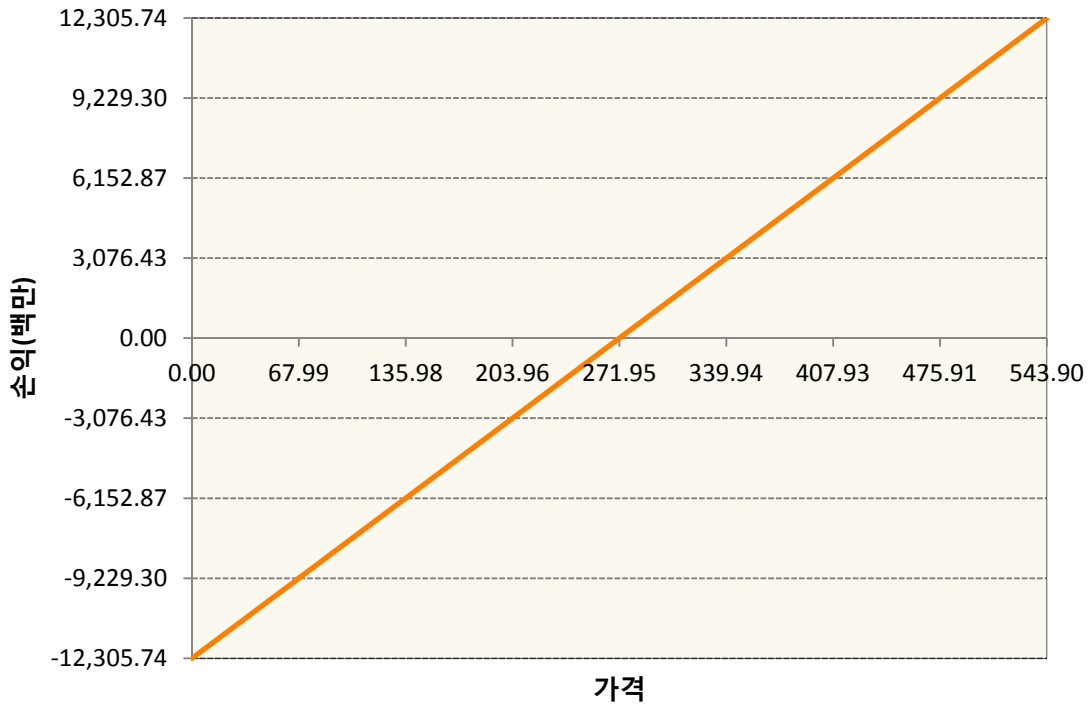
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

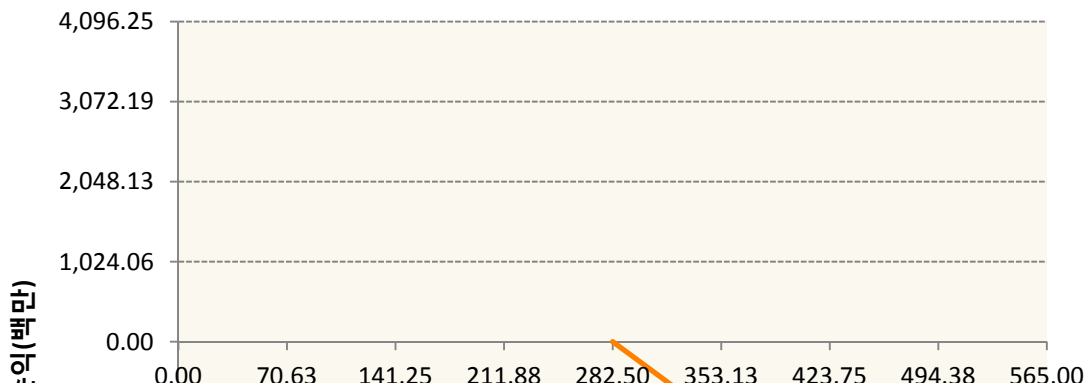
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	4,992	23,015	-18,023	장내
누계	유가증권	선물	12,306	0	12,306	장내
누계	유가증권	옵션	5,081	22,906	-17,825	장내

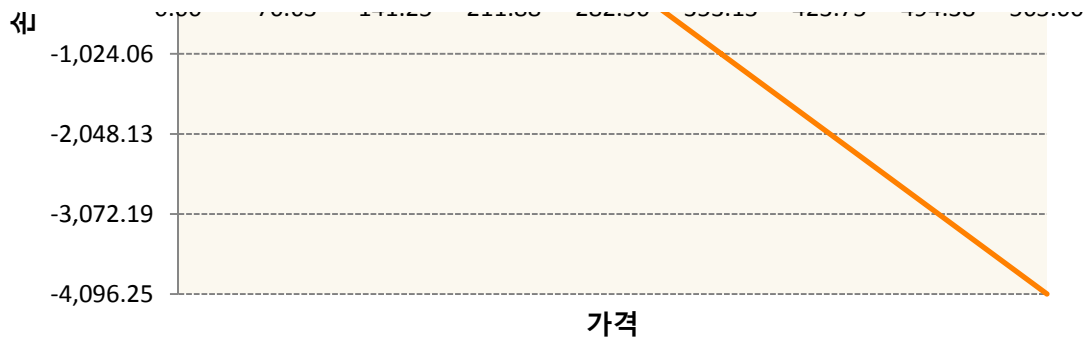
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

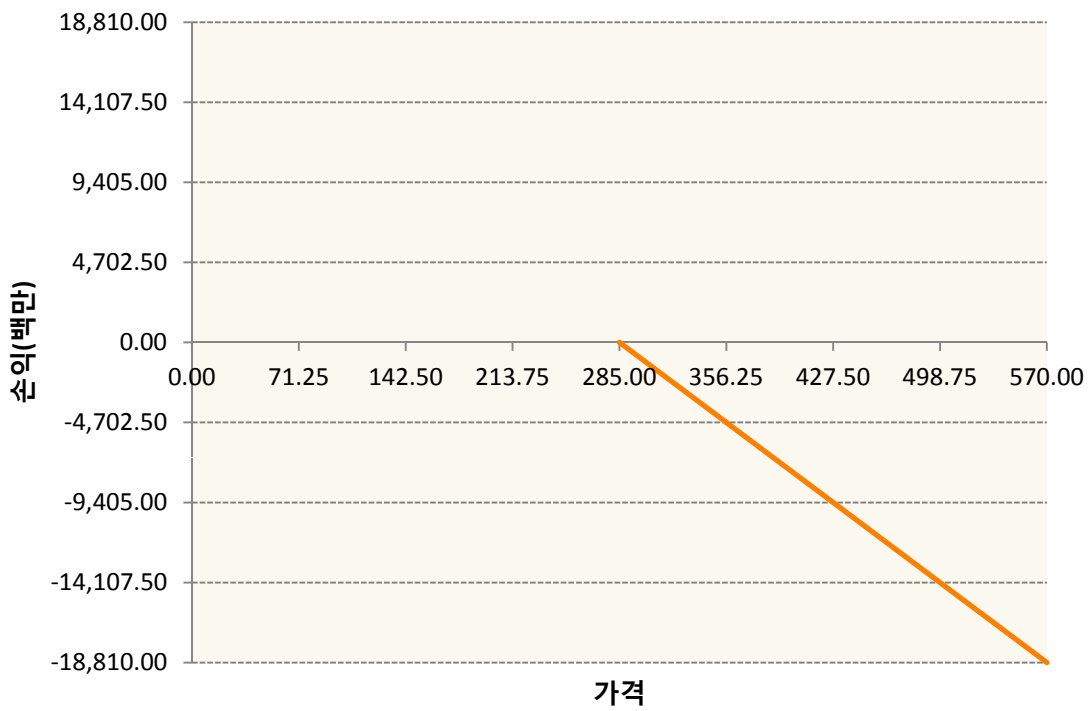


KR4201P62826-2019-06 콜282.5

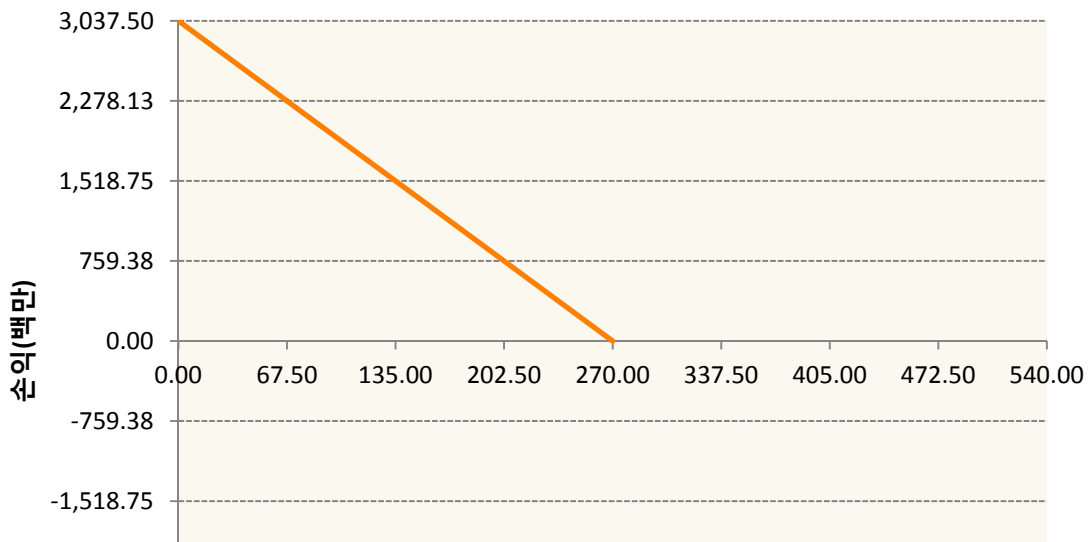


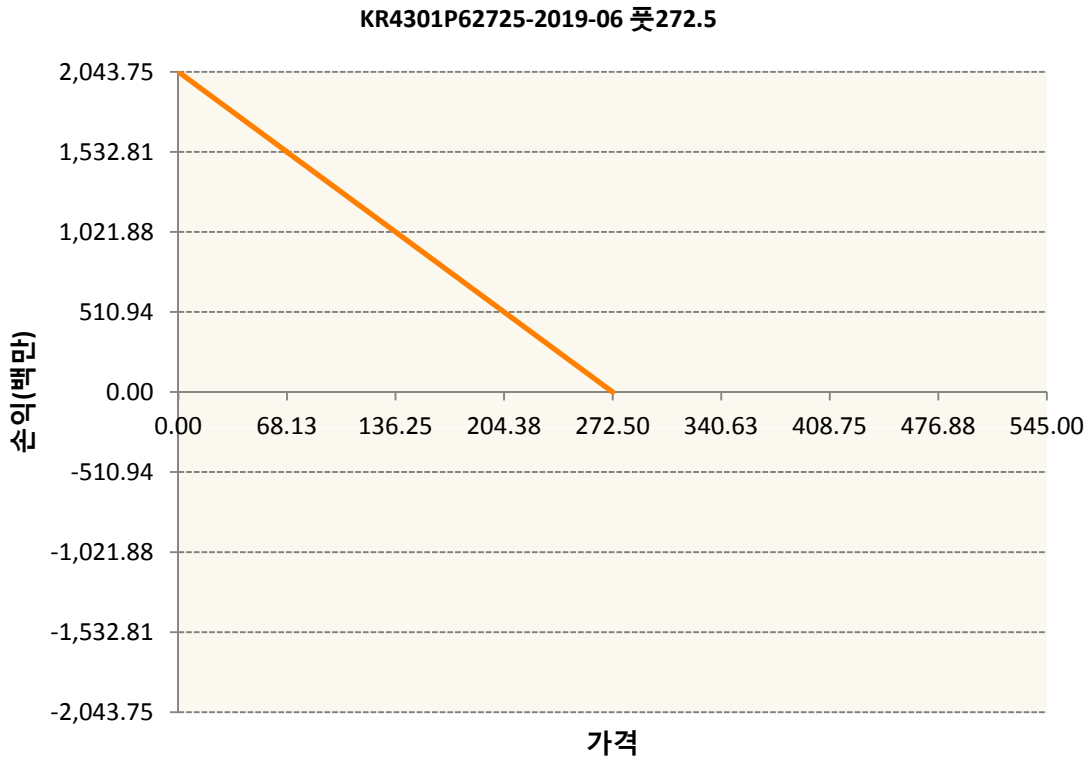
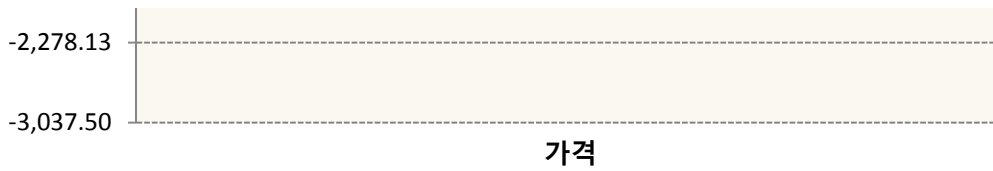


KR4201P62859-2019-06 콜285



KR4301P62709-2019-06 풋270





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

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						985
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-985	-985	-985	-985	-985	-985	-985	
-5.33%	-657	-657	-657	-657	-657	-657	-657	
-2.67%	-328	-328	-328	-328	-328	-328	-328	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	328	328	328	328	328	328	328	
5.33%	657	657	657	657	657	657	657	
8.00%	985	985	985	985	985	985	985	
KR4201P62826		2019-06 콜282.5						193
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	63	62	60	57	53	49	45	
-5.33%	59	56	51	47	41	35	29	
-2.67%	49	43	36	29	21	13	5	

0%	27	19	9	0	-10	-19	-29
2.67%	-9	-20	-31	-41	-52	-62	-73
5.33%	-64	-74	-85	-96	-107	-117	-128
8.00%	-135	-144	-154	-163	-173	-183	-193

KR4201P62859                      2019-06 콜285                      826

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	245	239	231	220	207	191	172
-5.33%	231	218	202	182	160	135	108
-2.67%	194	170	143	113	81	47	11
0%	116	79	40	0	-41	-84	-127
2.67%	-26	-73	-120	-167	-215	-263	-311
5.33%	-246	-296	-345	-395	-445	-495	-544
8.00%	-544	-589	-636	-682	-730	-777	-826

KR4301P62709                      2019-06 풋270                      180

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	168	169	170	172	174	177	180
-5.33%	92	95	99	102	106	110	114
-2.67%	28	33	38	44	49	54	59
0%	-17	-11	-6	0	6	11	17
2.67%	-42	-38	-33	-28	-24	-19	-14
5.33%	-53	-50	-48	-44	-41	-37	-33
8.00%	-56	-55	-54	-52	-50	-48	-45

KR4301P62725                      2019-06 풋272.5                      127

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	121	121	122	123	124	126	127
-5.33%	69	71	72	74	77	79	82
-2.67%	23	26	29	33	36	39	43
0%	-11	-7	-4	0	4	7	11
2.67%	-32	-29	-26	-22	-19	-15	-12
5.33%	-42	-40	-38	-36	-33	-30	-27
8.00%	-46	-45	-44	-43	-41	-39	-37

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

(단위:백만원)

**1,850**

공시일	2019-05-13
기준일	2019-05-10

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,471	0	1,471	
누계	유가증권	수익증권	6,186	0	6,186	

### 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	2019-05-13
기준일	2019-05-10

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	7,886	0	7,886	
누계	유가증권	수익증권	87,266	0	87,266	

### 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	2019-05-13
기준일	2019-05-10

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	26,483	0	26,483	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	197,836	0	197,836	
누계	통화	선도	0	212,566	-212,566	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019J004 KRW/USD 10-06-19E		104
FX21019J012 KRW/USD 20-05-19E		132
FX21019J012 KRW/USD 20-05-19E		19
FX21019J013 KRW/USD 20-05-19E		141
FX21019J016 KRW/USD 20-05-19E		141
FX21019J019 KRW/USD 17-05-19E		1,318
FX21019J019 KRW/USD 17-05-19E		1,412
FX21019J019 KRW/USD 18-06-19E		377
FX21019J020 KRW/USD 20-05-19E		508
FX21019J021 KRW/USD 20-05-19E		478
FX21019J024 KRW/USD 24-06-19E		942
FX21019J024 KRW/USD 22-05-19E		791
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		942
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		998
FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E		377
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		75
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		991
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E		1,017
FX21019J041 KRW/USD 28-05-19E		282
FX21019J043 KRW/USD 03-06-19E		565
FX21019J044 KRW/USD 03-06-19E		471
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		282
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		471
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		659
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		659
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		819

FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E  
FX21019K00 KRW/USD 18-06-19E  
FX21019K01 KRW/USD 14-06-19E

810
565
659

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

(단위:백만원)

<b>5,836</b>
--------------

공시일	2019-05-13
기준일	2019-05-10

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

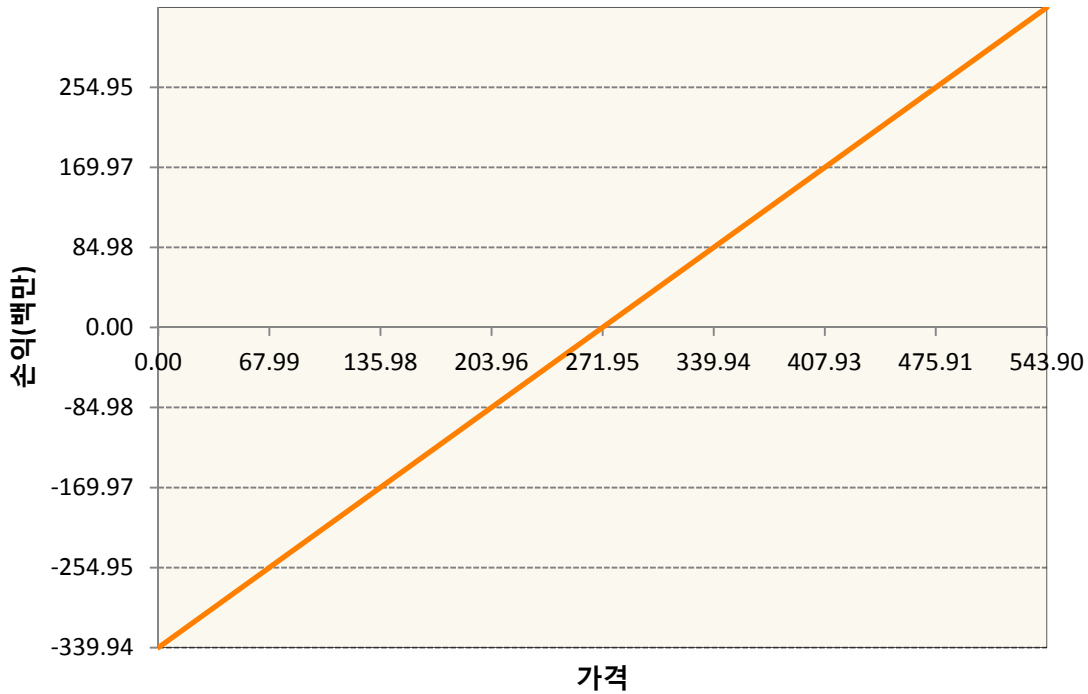
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

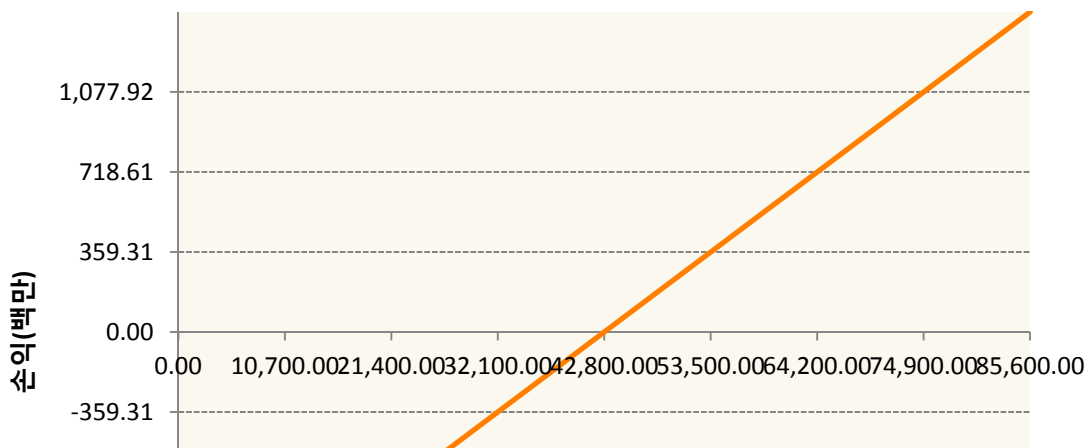
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,777	0	1,777	장내

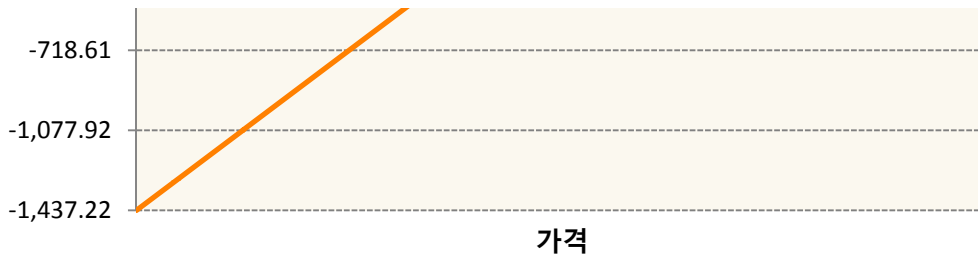
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4111P60003-2019-06 삼성전자개별선물





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

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						27
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27	
-5.33%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
-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%	18	18	18	18	18	18	18	
8.00%	27	27	27	27	27	27	27	
KR4111P60003		2019-06 삼성전자개별선물						115
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-115	-115	-115	-115	-115	-115	-115	
-5.33%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77	
-2.67%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	38	38	38	38	38	38	38	
5.33%	77	77	77	77	77	77	77	
8.00%	115	115	115	115	115	115	115	

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

**158**

공시일	2019-05-13
기준일	2019-05-10

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

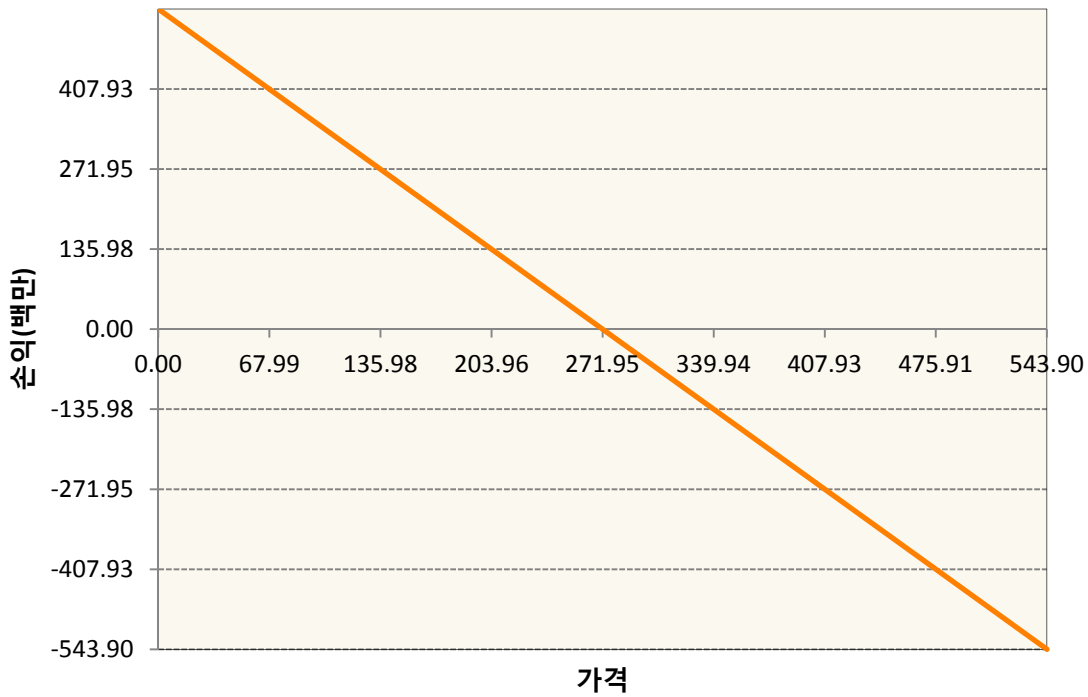
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

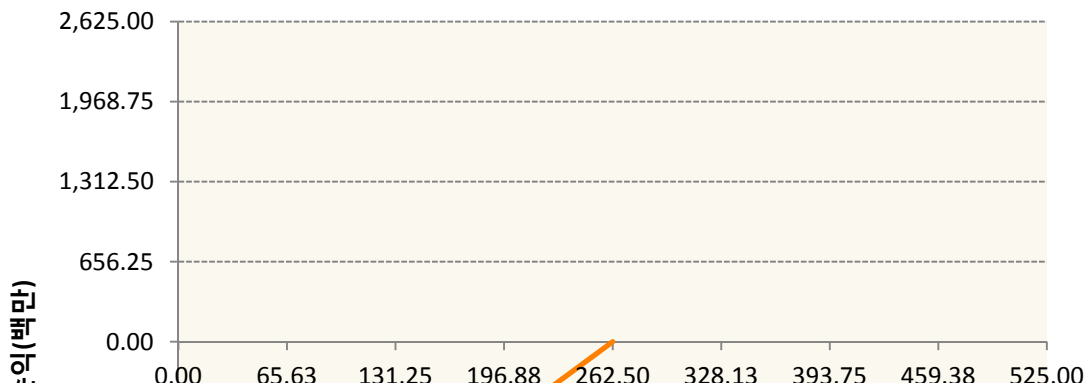
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	917	927	-9	장내
누계	유가증권	선물	0	544	-544	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,023	-3,023	장내

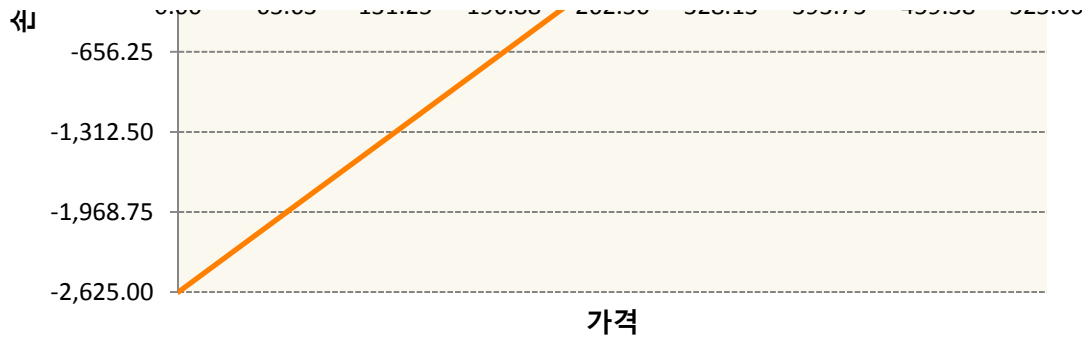
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

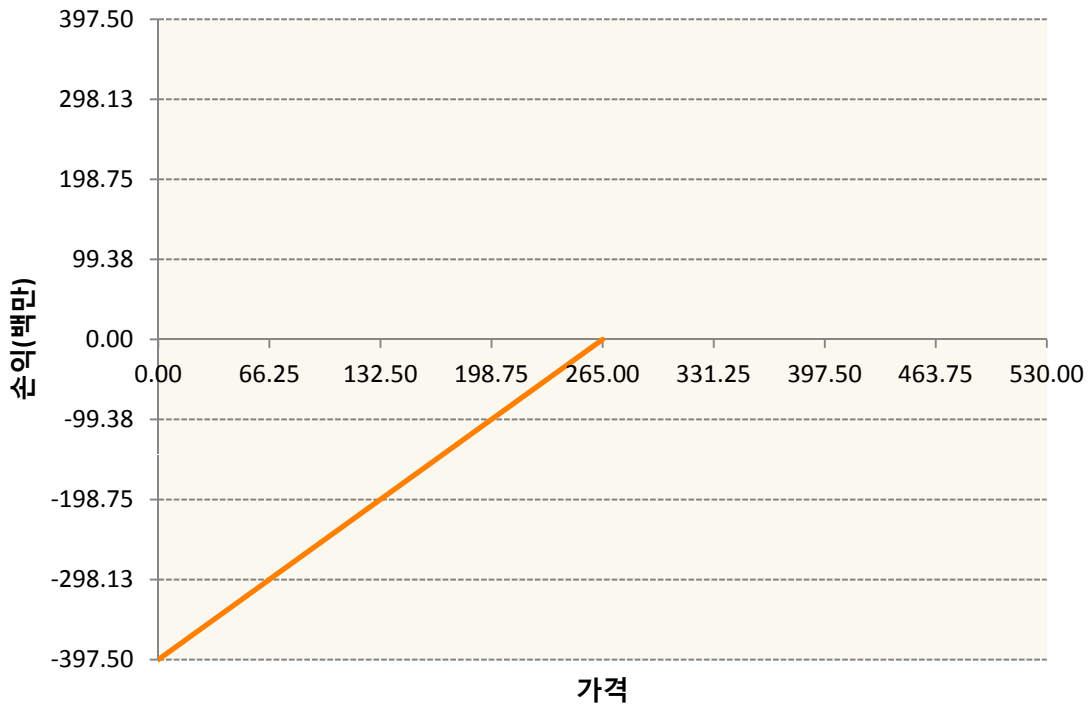


KR4301P62626-2019-06 풋262.5





KR4301P62659-2019-06 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						44
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	44	44	44	44	44	44	44	
-5.33%	29	29	29	29	29	29	29	
-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%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29	
8.00%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44	
KR4301P62626		2019-06 풋262.5						125
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-106	-109	-112	-115	-118	-122	-125
-5.33%	-50	-54	-58	-63	-67	-72	-77
-2.67%	-10	-15	-20	-25	-29	-34	-39
0%	11	8	4	0	-4	-8	-13
2.67%	20	18	16	13	11	8	4
5.33%	23	22	21	20	18	16	14
8.00%	23	23	23	22	22	21	19
KR4301P62659                      2019-06 풋265							21
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-18	-19	-19	-19	-20	-20	-21
-5.33%	-9	-10	-10	-11	-11	-12	-13
-2.67%	-2	-3	-4	-4	-5	-6	-7
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	4	3	3	3	2	2	1
5.33%	4	4	4	4	4	3	3
8.00%	5	5	4	4	4	4	4

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

(단위:백만원)

163

공시일	2019-05-13
기준일	2019-05-10

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

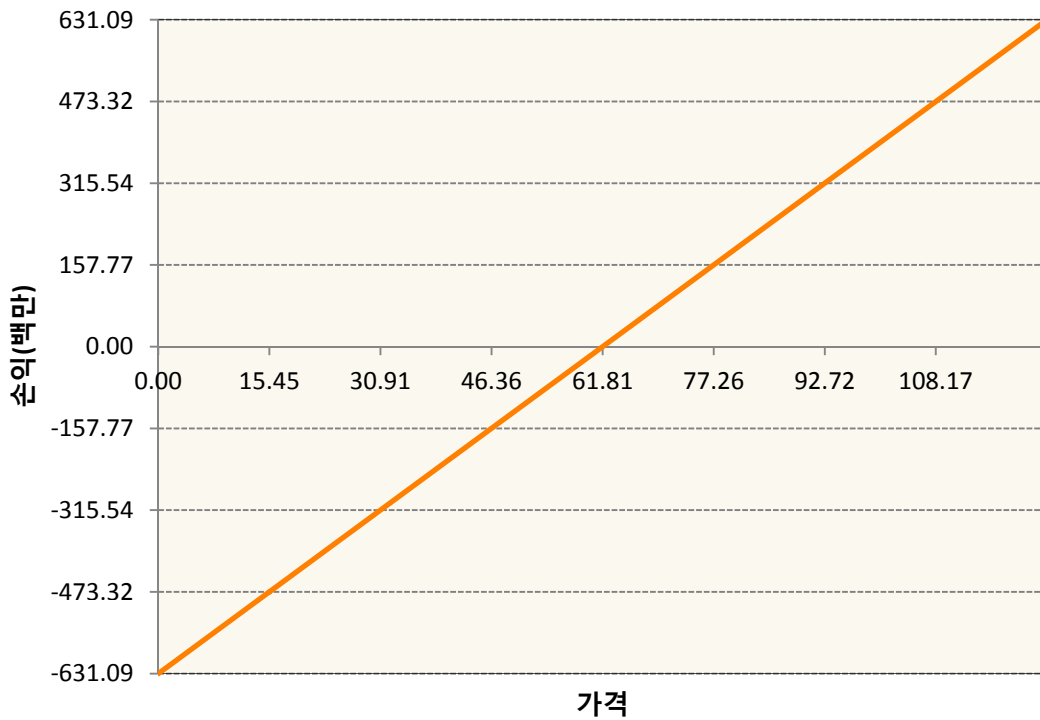
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

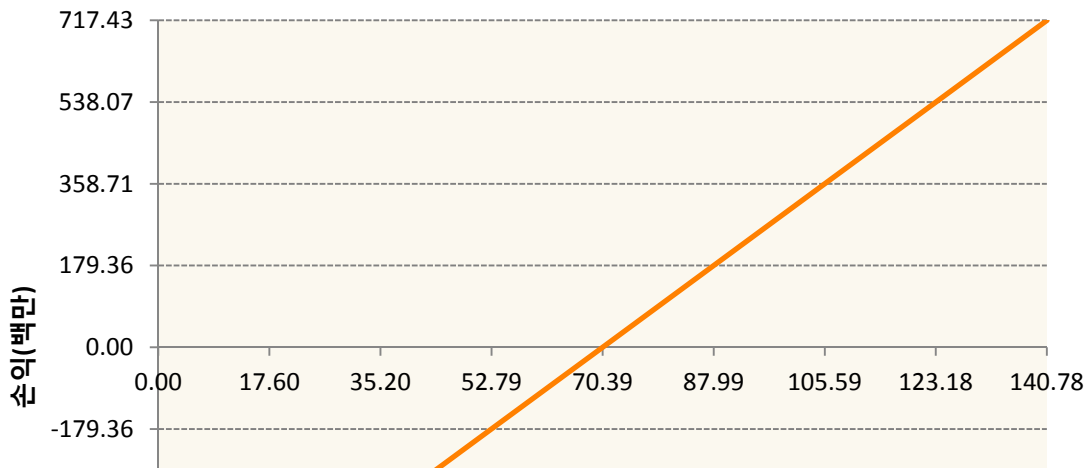
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,733	294	2,439	

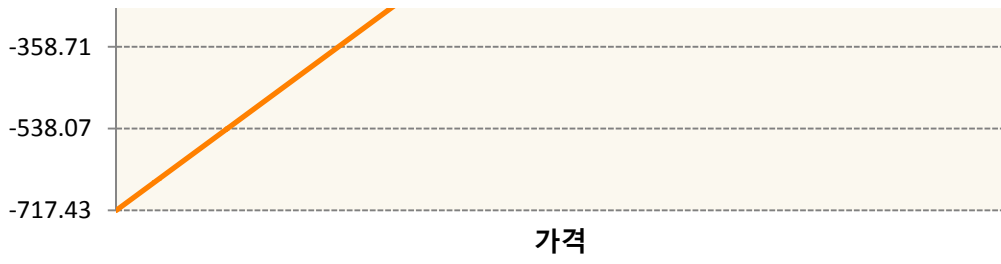
### 2. 만기시점의 손익구조

**CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19**

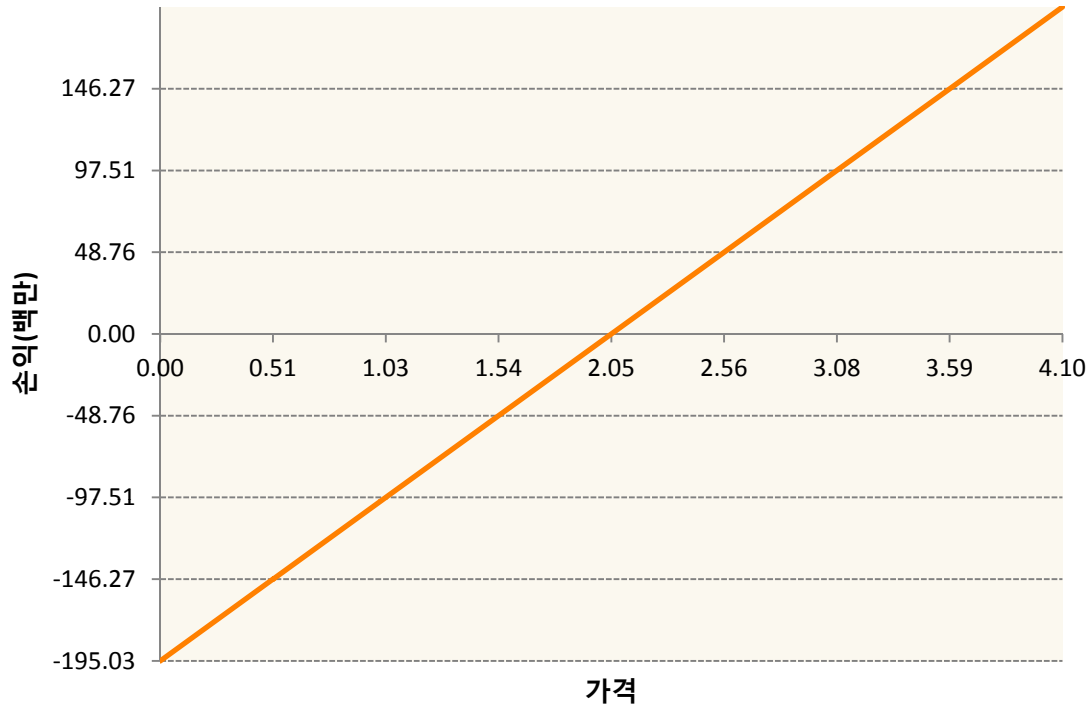


**CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19**

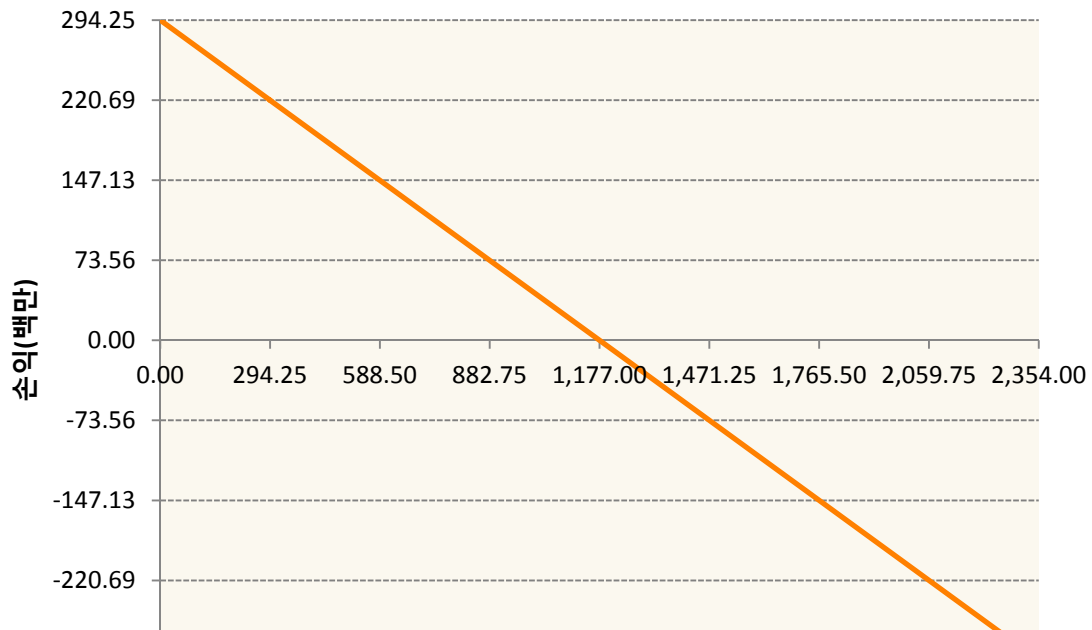


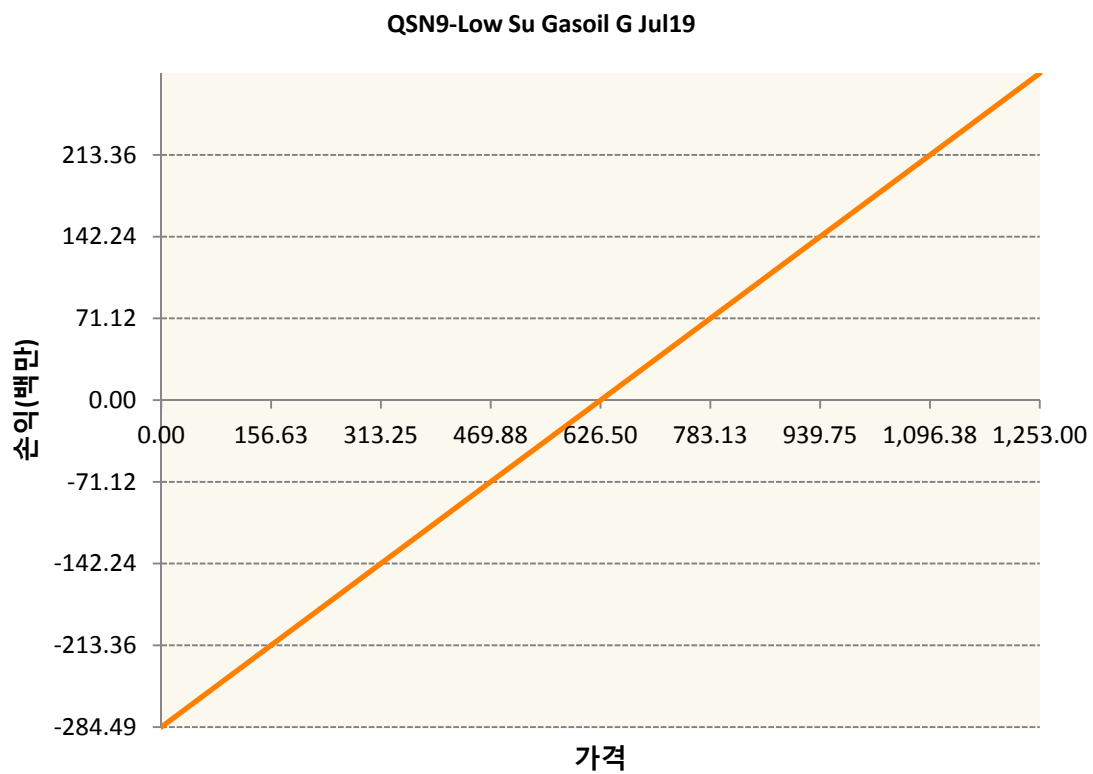
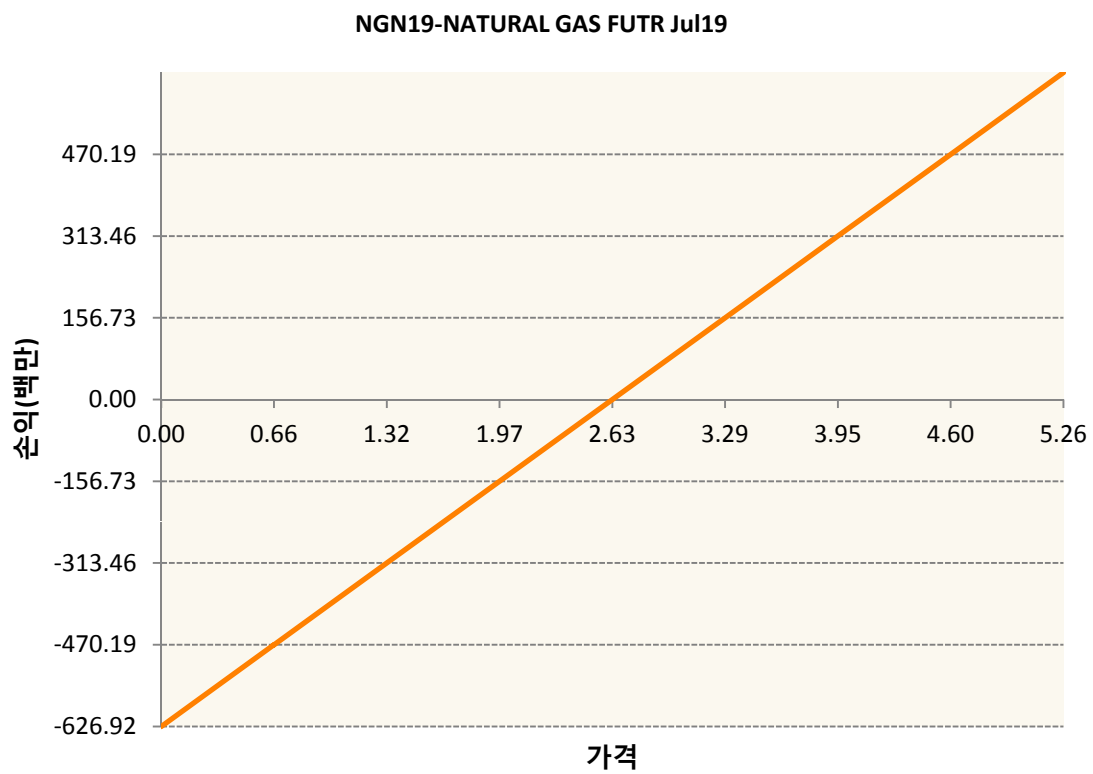
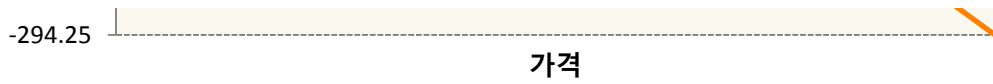


HON9-NY Harb ULSD Fut Jul19

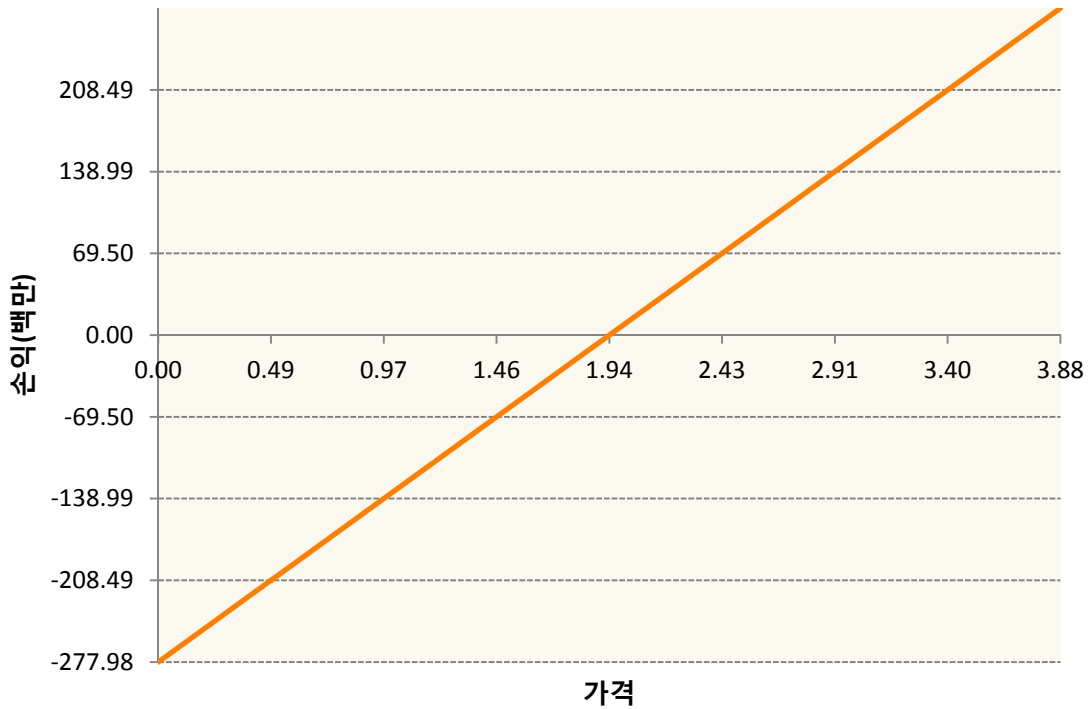


KR4175P50009-2019-05 달러선물





XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN9	WTI CRUDE FUTURE Jul19	50
CON9	BRENT CRUDE FUTR Jul19	57
HON9	NY Harb ULSD Fut Jul19	16
KR4175P500	2019-05 달러선물	24
NGN19	NATURAL GAS FUTR Jul19	50
QSN9	Low Su Gasoil G Jul19	23
XBN9	GASOLINE RBOB FUT Jul19	22

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

403

공시일	2019-05-13
기준일	2019-05-10

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

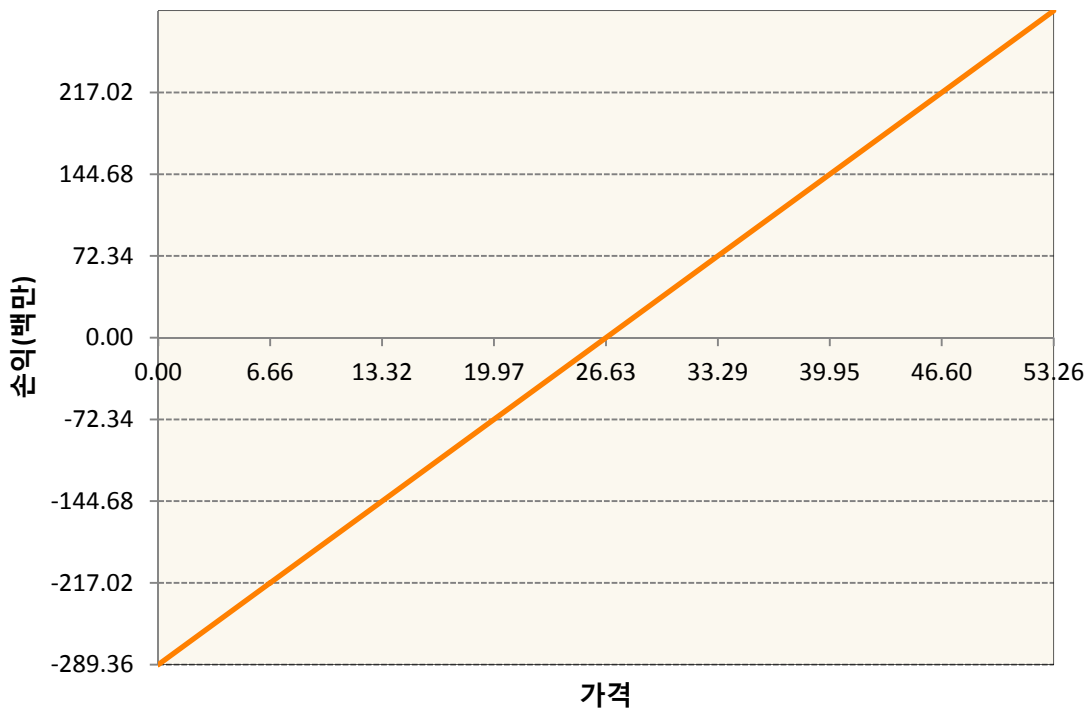
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

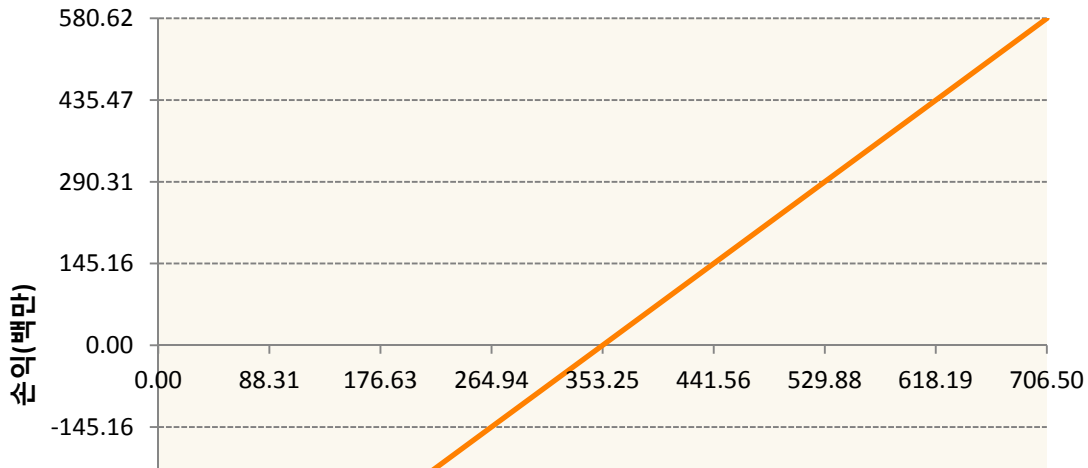
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,796	59	2,737	

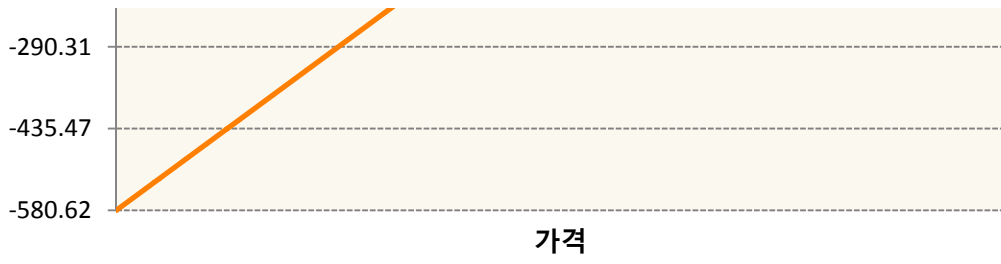
### 2. 만기시점의 손익구조

**BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19**

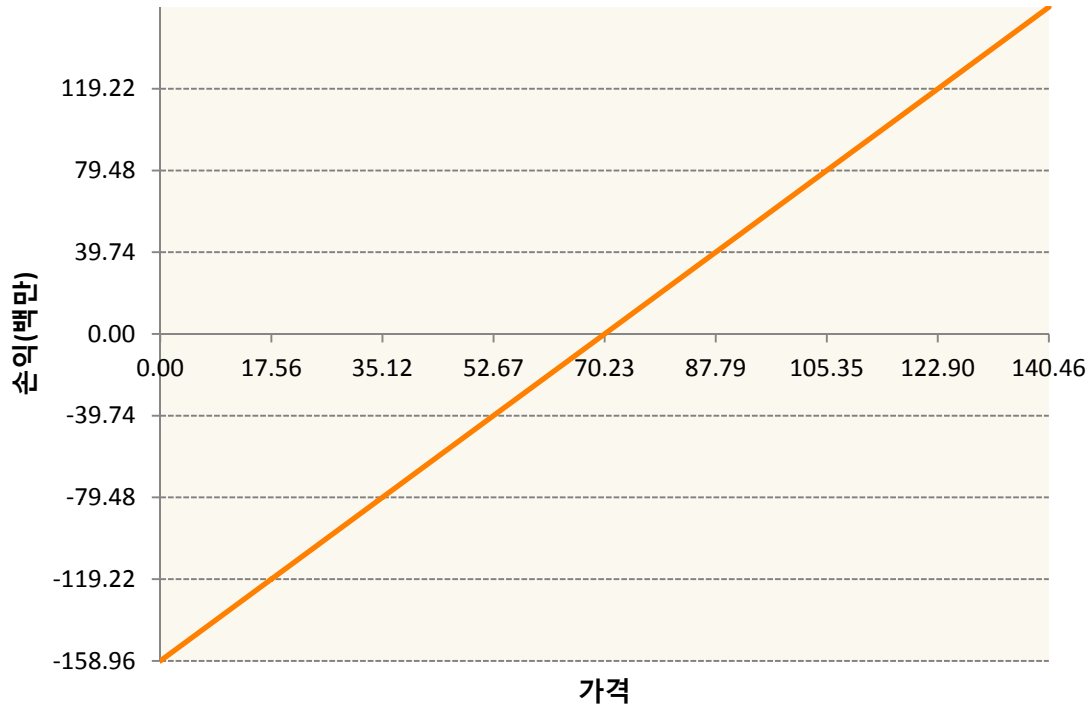


**CN9-CORN FUTURE Jul19**

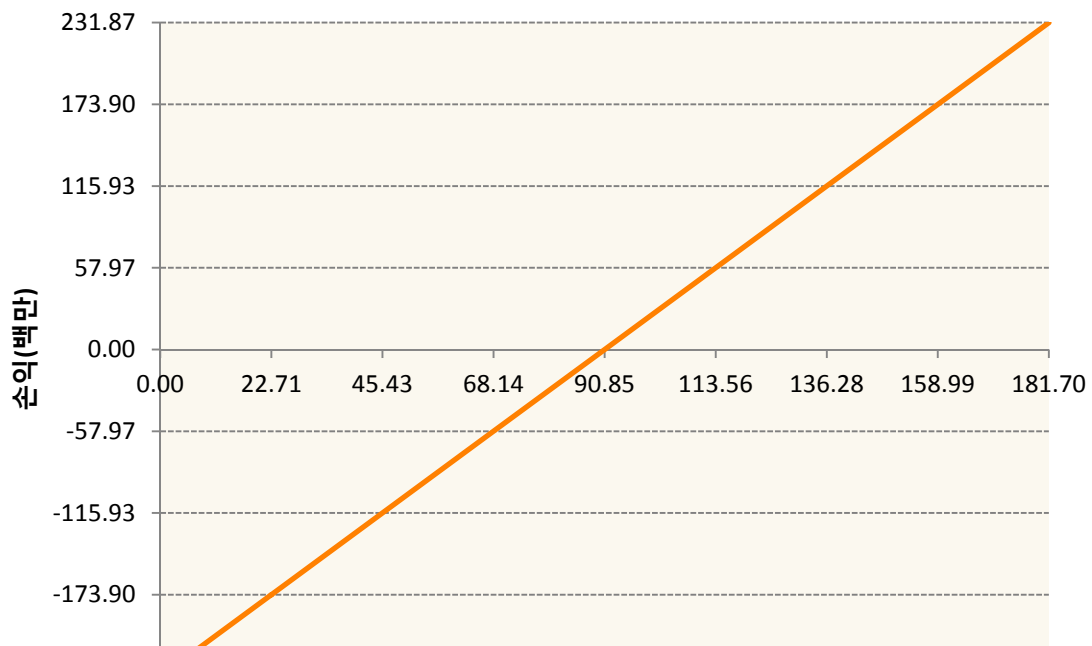


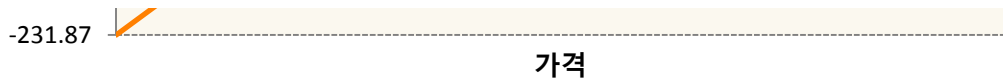


CTN9-COTTON NO.2 FUTR Jul19

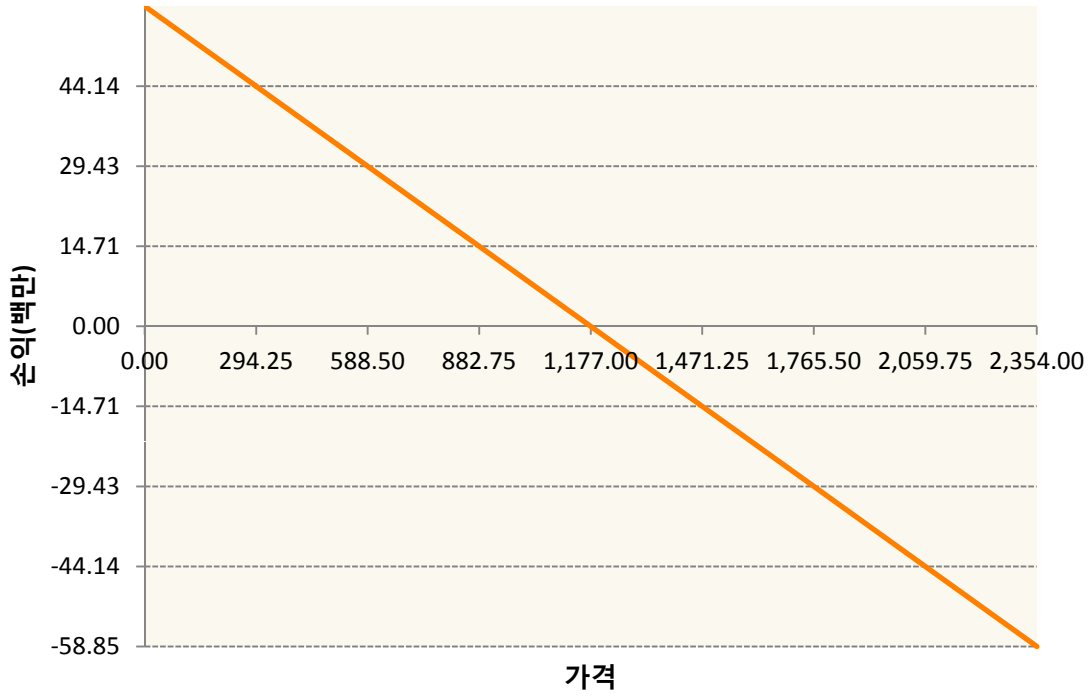


KCN9-COFFEE 'C' FUTURE Jul19

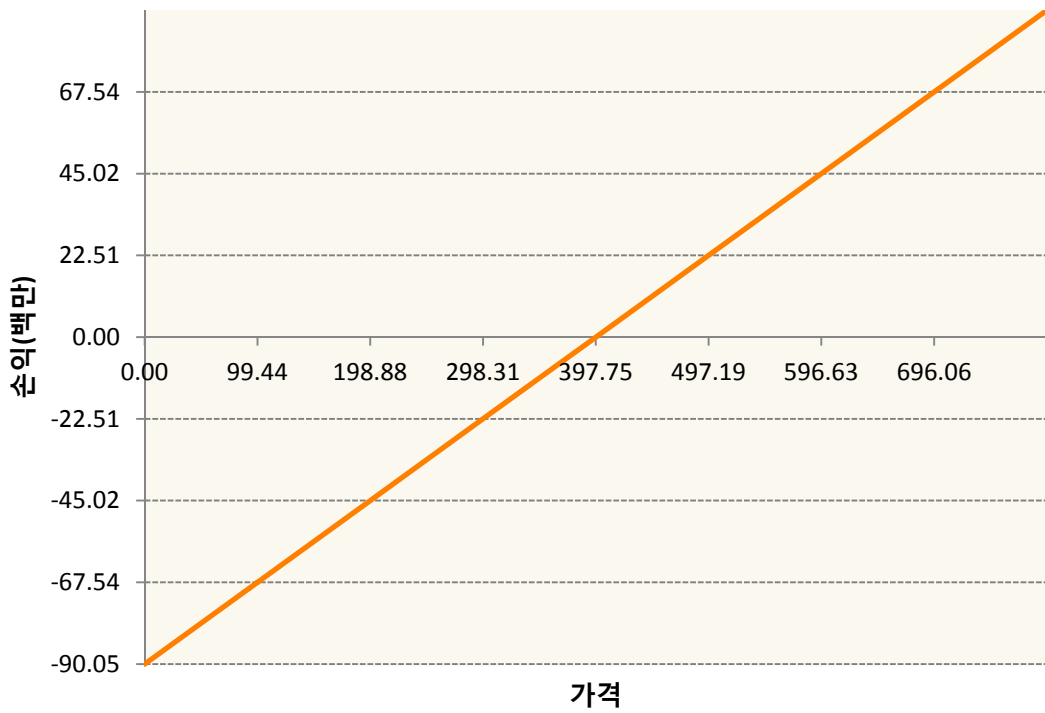




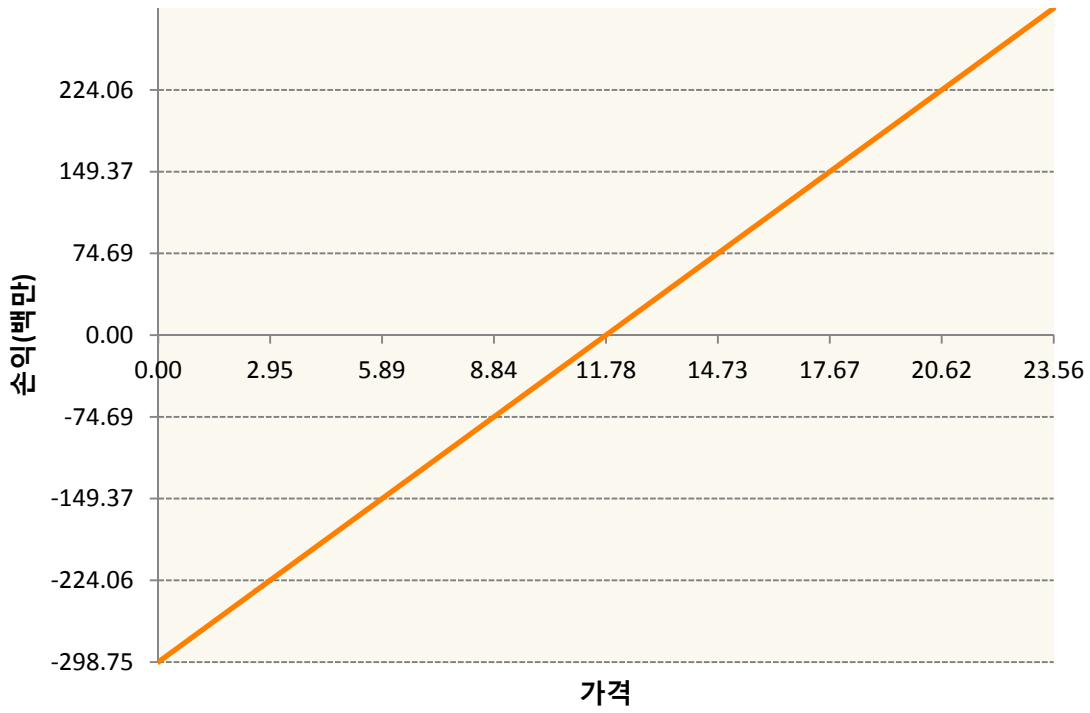
KR4175P50009-2019-05 달러선물



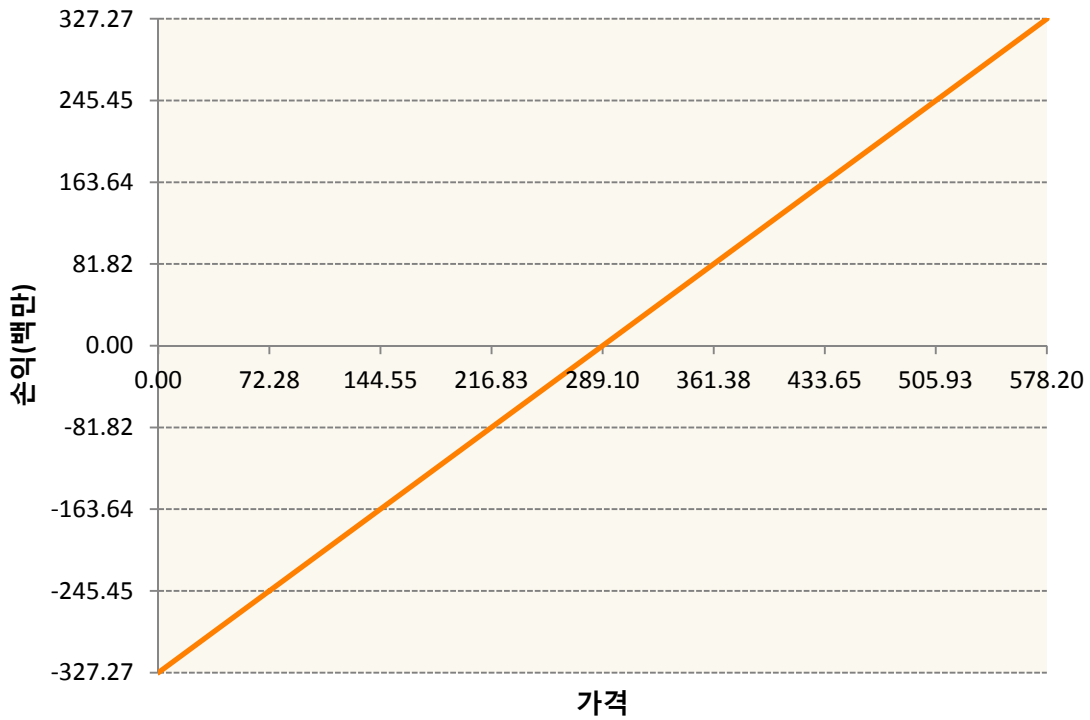
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



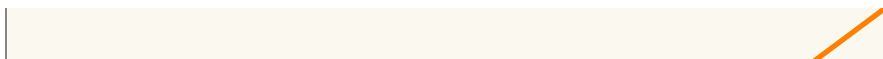
SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

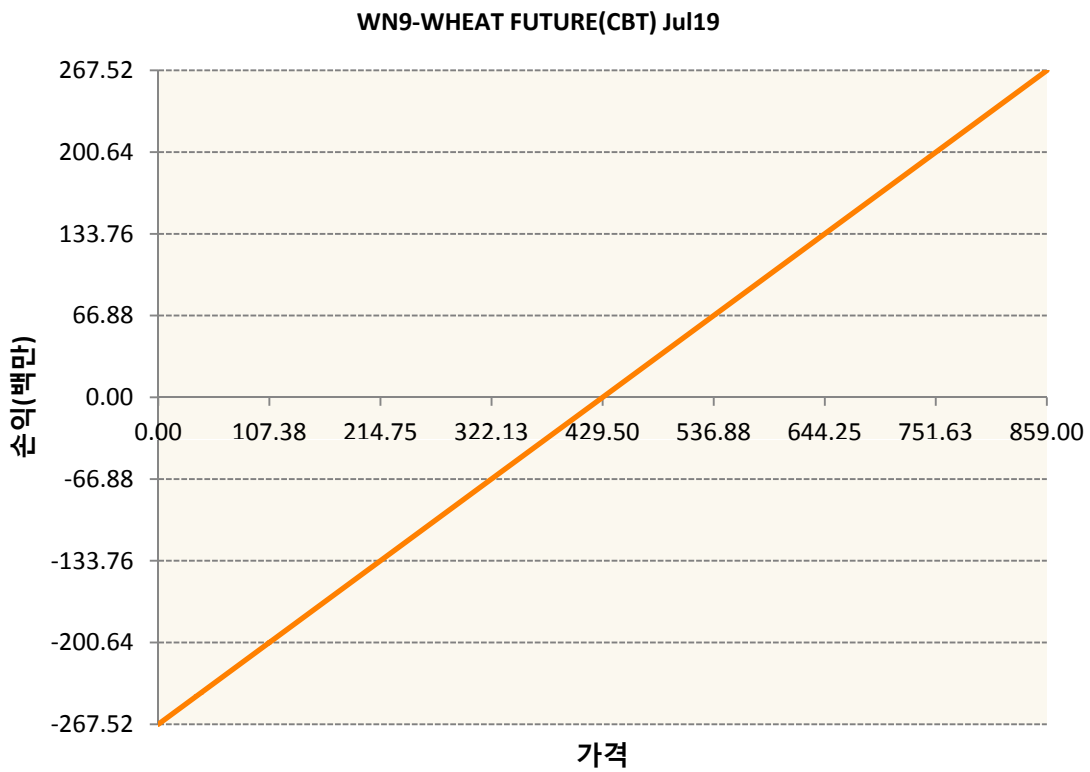
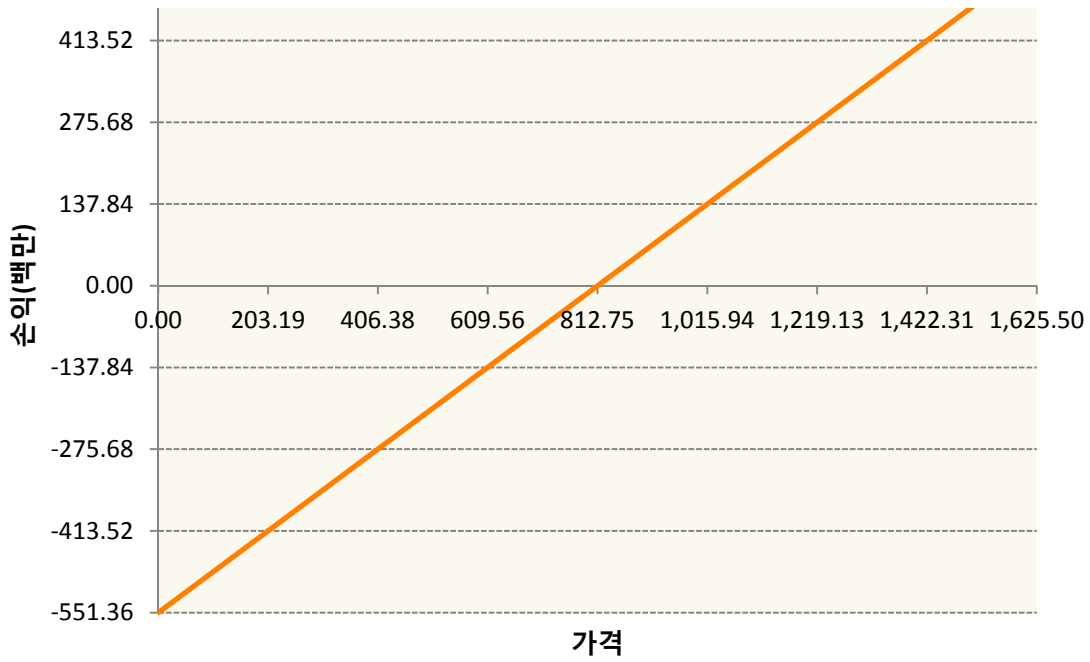


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19



SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BON9	SOYBEAN OIL FUTR Jul19	23
CN9	CORN FUTURE Jul19	46
CTN9	COTTON NO.2 FUTR Jul19	13
KCN9	COFFEE 'C' FUTURE Jul19	19
KR4175P500	2019-05 달러선물	5

KWN9	KC HRW WHEAT FUT Jul19	7
SBN9	SUGAR #11 (WORLD) Jul19	24
SMN9	SOYBEAN MEAL FUTR Jul19	26
SN9	SOYBEAN FUTURE Jul19	44
WN9	WHEAT FUTURE(CBT) Jul19	21

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

(단위:백만원)

227