

공시일	2019-05-14
기준일	2019-05-13

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)

91

공시일	2019-05-14
기준일	2019-05-13

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

1,141

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

674

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-05-14
기준일	2019-05-13

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)

879

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-05-14
기준일	2019-05-13

유로인덱스모(주식-파생형)

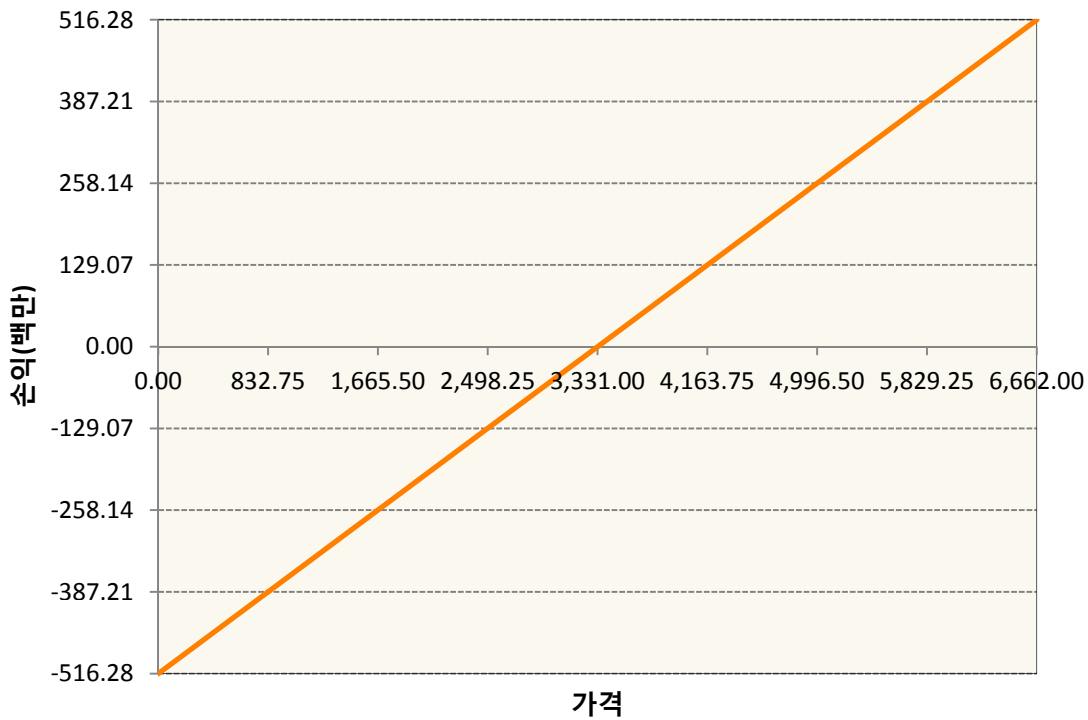
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	516	0	516	

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)

30

공시일	2019-05-14
기준일	2019-05-13

차이나인덱스모(주식-파생형)

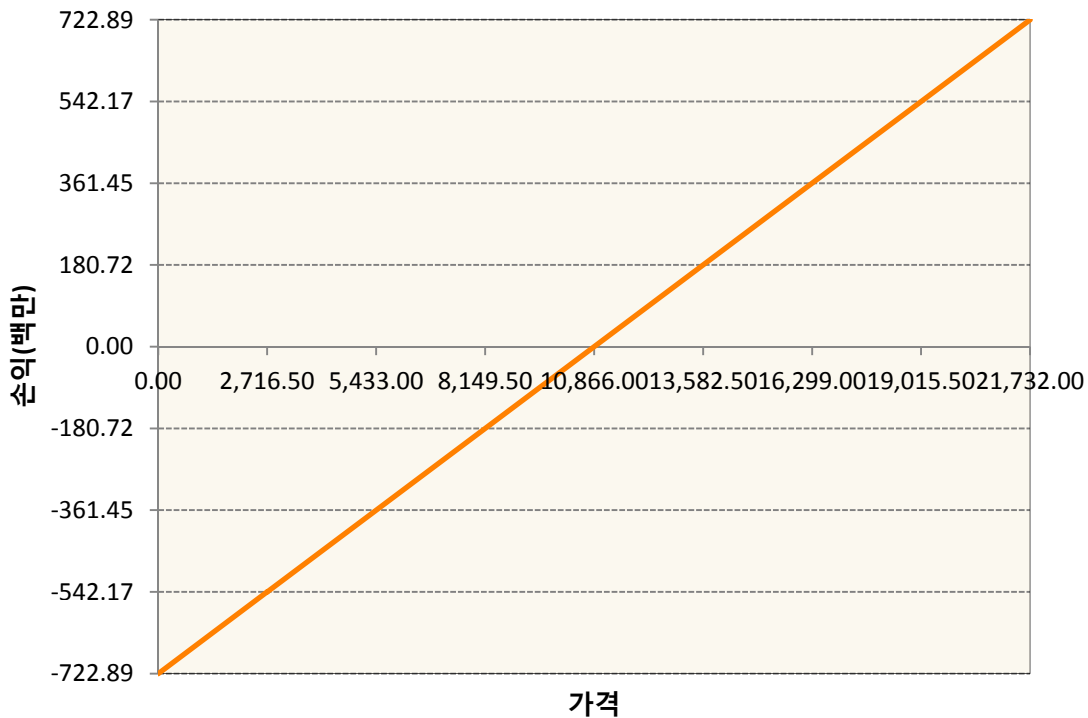
1. 계약금액

(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	2019-05-14
기준일	2019-05-13

커버드콜모(주식혼합-파생형)

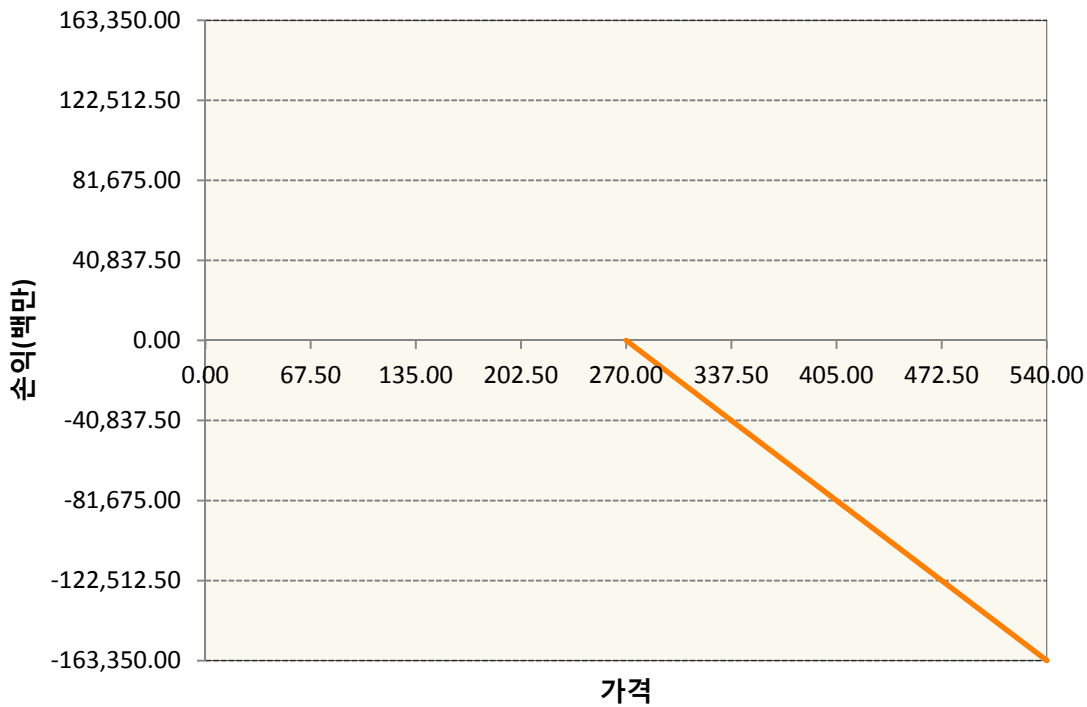
1. 계약금액

(단위:백만원)

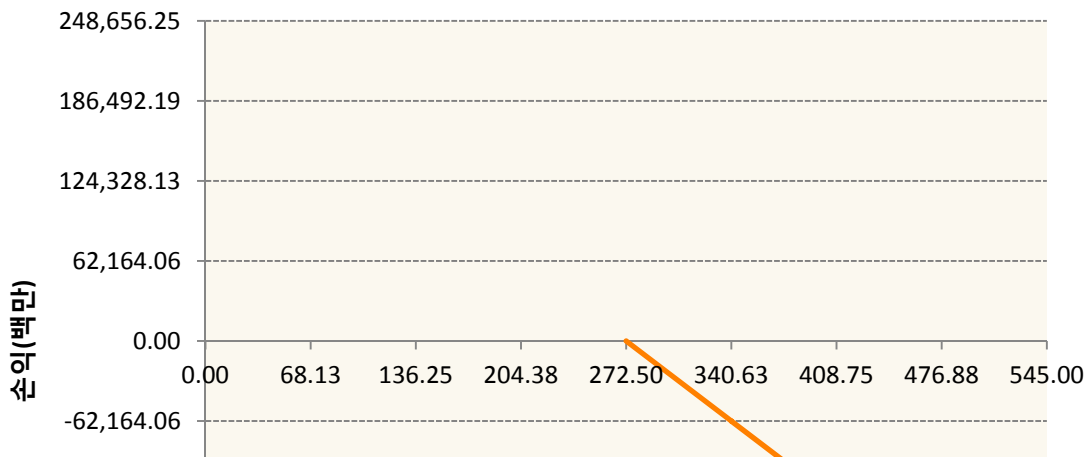
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	614,506	-614,506	장내

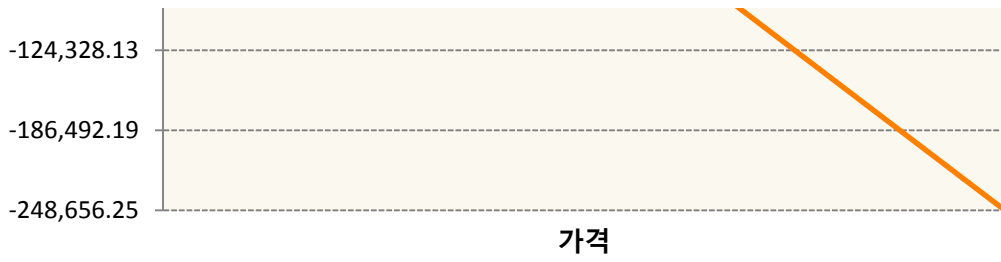
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P62701-2019-06 콜270



KR4201P62727-2019-06 콜272.5





KR4301P62709-2019-06 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201P62701		2019-06 콜270					9,688	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4,307	4,171	4,006	3,815	3,601	3,368	3,117	
-5.33%	3,853	3,607	3,338	3,050	2,747	2,432	2,106	
-2.67%	2,897	2,543	2,179	1,809	1,433	1,052	668	
0%	1,238	826	413	0	-413	-826	-1,240	
2.67%	-1,205	-1,601	-2,000	-2,403	-2,809	-3,216	-3,625	
5.33%	-4,362	-4,678	-5,012	-5,360	-5,718	-6,085	-6,459	
8.00%	-8,052	-8,266	-8,509	-8,777	-9,065	-9,369	-9,688	
KR4201P62727		2019-06 콜272.5					13,908	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5,622	5,459	5,253	5,006	4,723	4,408	4,064	

-5.33%	5,107	4,791	4,434	4,043	3,626	3,184	2,724
-2.67%	3,954	3,465	2,955	2,428	1,888	1,337	778
0%	1,837	1,228	615	0	-617	-1,235	-1,855
2.67%	-1,436	-2,060	-2,687	-3,314	-3,943	-4,573	-5,203
5.33%	-5,838	-6,370	-6,922	-7,488	-8,065	-8,651	-9,244
8.00%	-11,144	-11,528	-11,951	-12,406	-12,886	-13,388	-13,908
KR4301P62709 2019-06 풋270							12,885
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,384	-12,421	-12,475	-12,549	-12,642	-12,755	-12,885
-5.33%	-7,208	-7,331	-7,479	-7,650	-7,841	-8,048	-8,270
-2.67%	-2,547	-2,807	-3,081	-3,367	-3,661	-3,964	-4,272
0%	1,058	706	353	0	-353	-707	-1,061
2.67%	3,288	2,971	2,646	2,315	1,980	1,642	1,301
5.33%	4,341	4,144	3,924	3,685	3,429	3,161	2,881
8.00%	4,711	4,625	4,513	4,376	4,217	4,037	3,840

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

(단위:백만원)

34,849

공시일	2019-05-14
기준일	2019-05-13

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

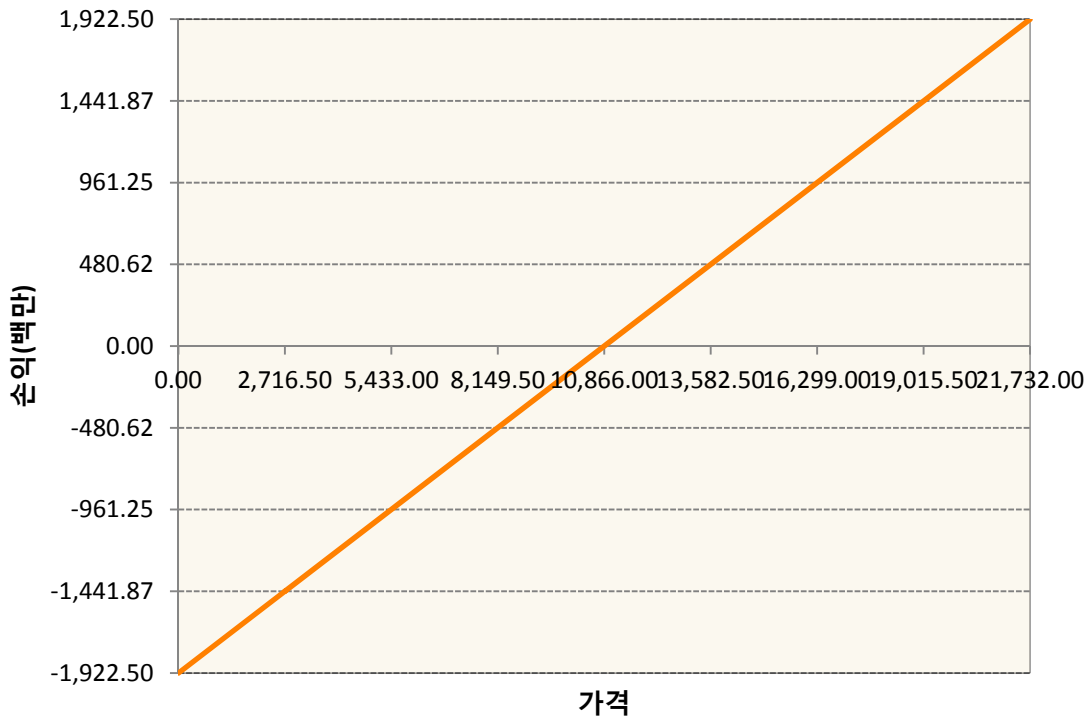
1. 계약금액

(단위:백만원)

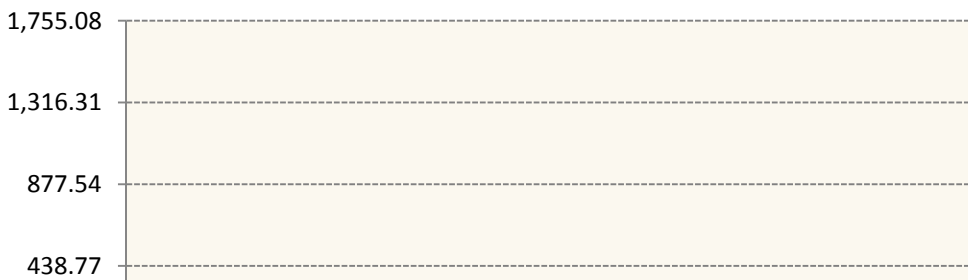
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,922	0	1,922	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,634	-5,634	장내
누계	통화	선도	0	3,178	-3,178	장외

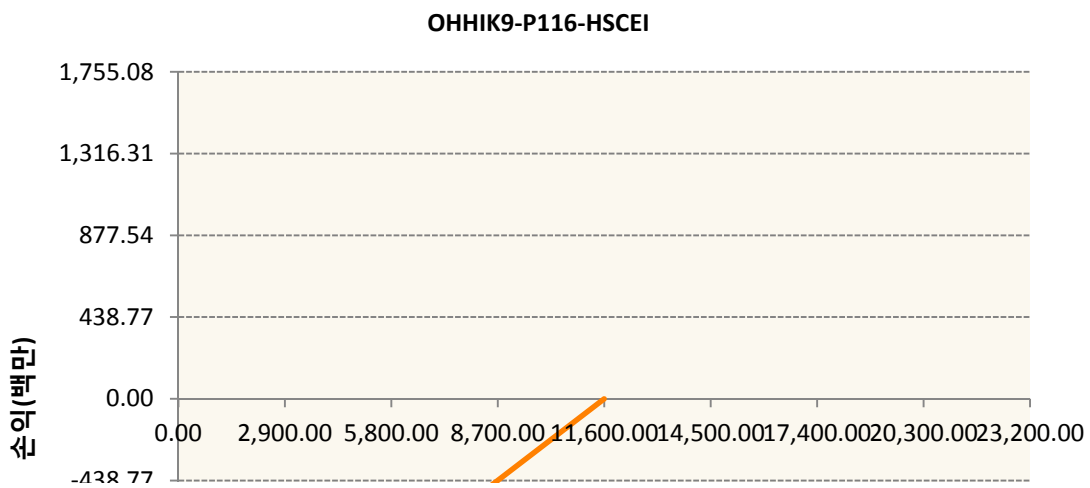
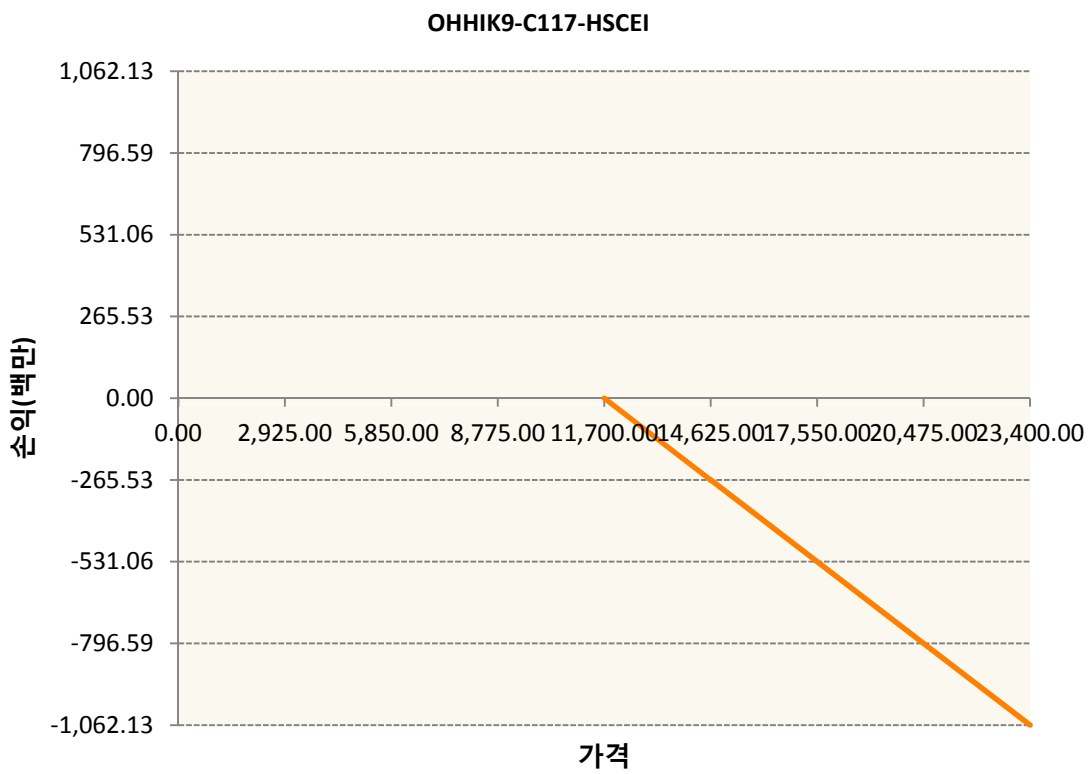
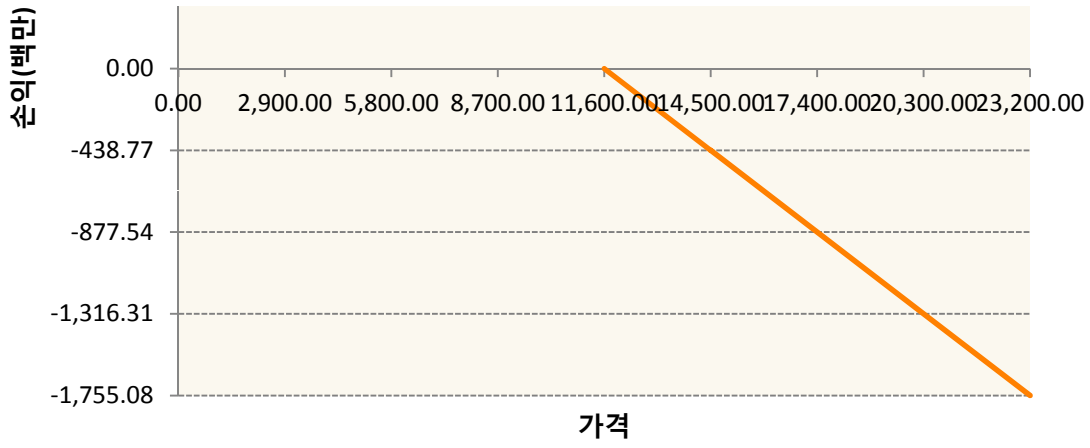
2. 만기시점의 손익구조

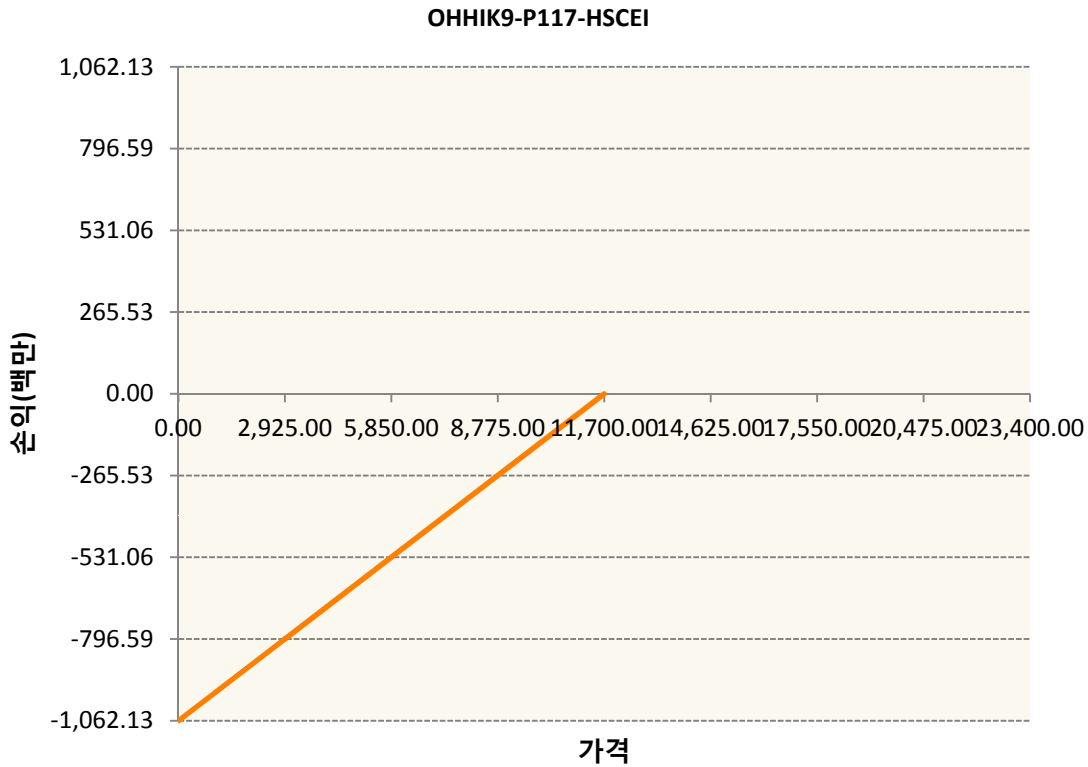
HCK9-HSCEI Futures May19



OHHIK9-C116-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	230
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	24
HCK9 HSCEI Futures May19	154
OHHIK9-C11 HSCEI	140
OHHIK9-C11 HSCEI	85
OHHIK9-P11 HSCEI	140
OHHIK9-P11 HSCEI	85

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	712

공시일	2019-05-14
기준일	2019-05-13

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

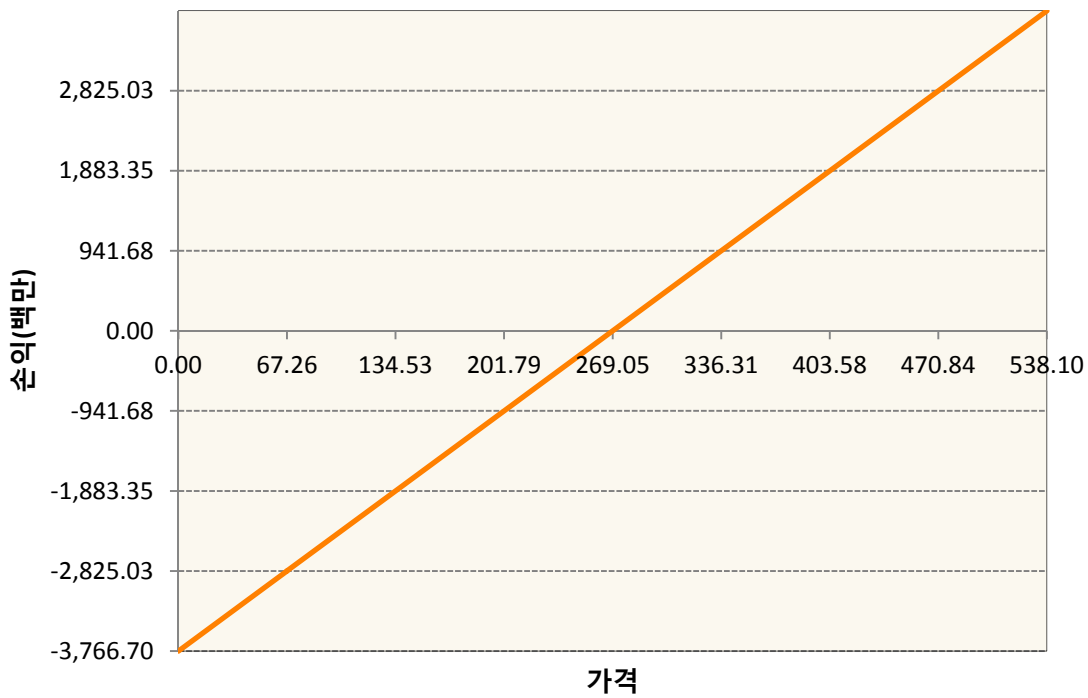
1. 계약금액

(단위:백만원)

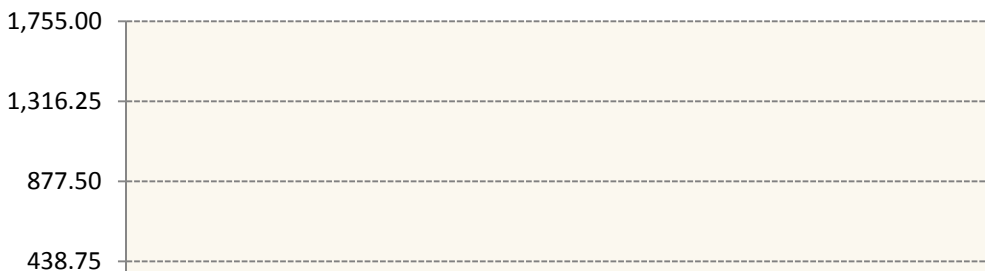
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,767	0	3,767	장내
누계	유가증권	스왑	26,836	0	26,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,476	-25,476	장내

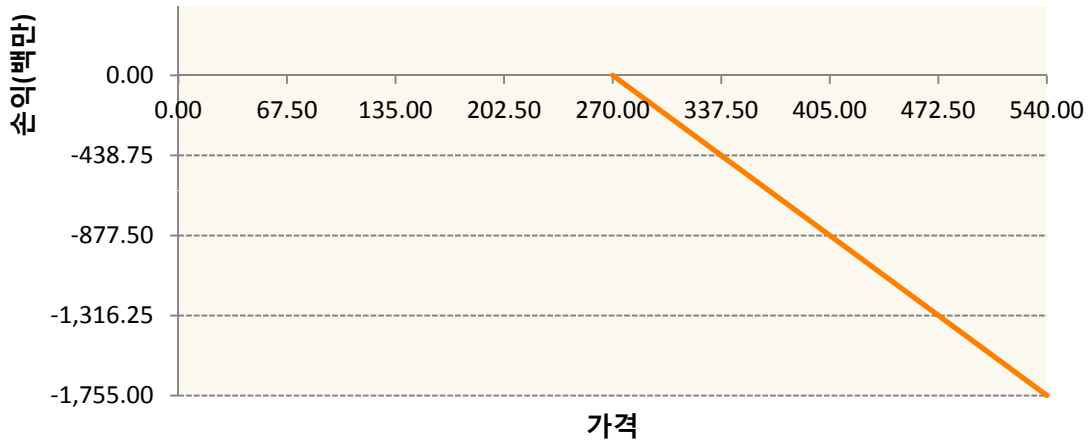
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

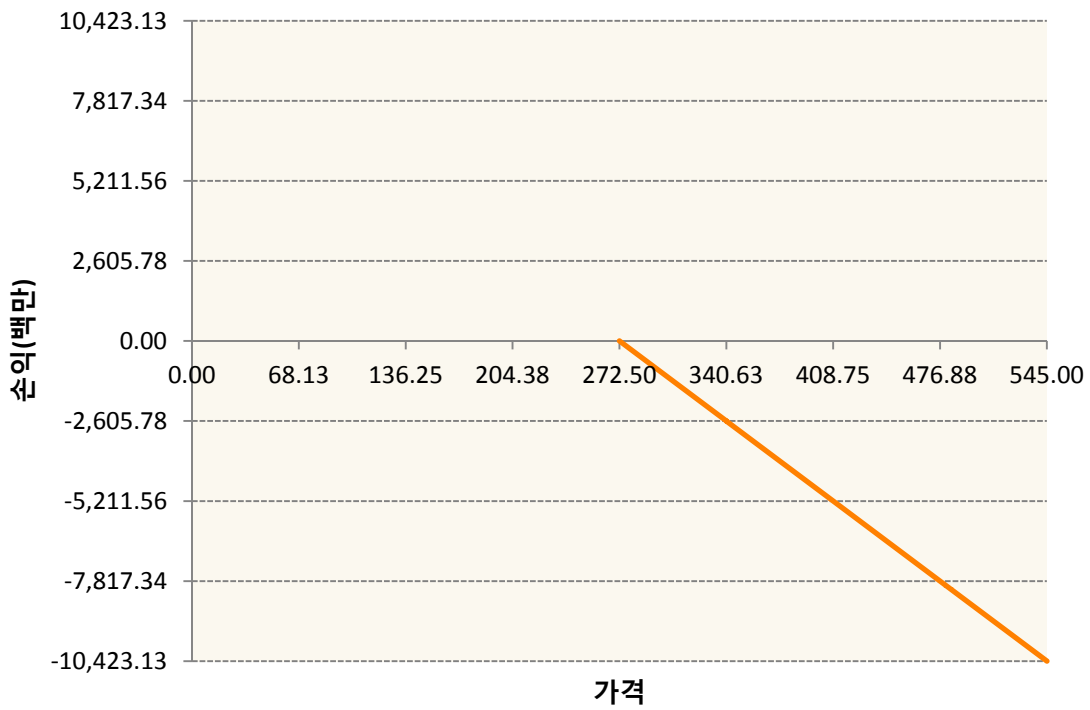


KR4201P62701-2019-06 콜270

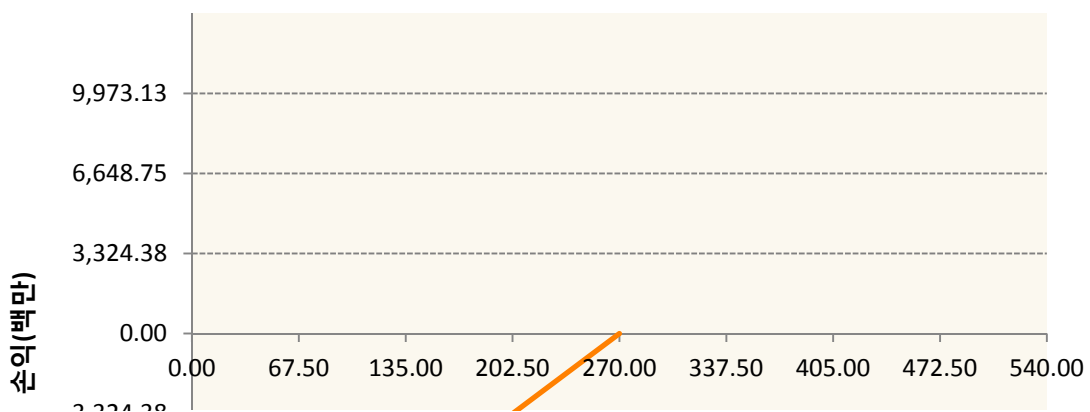


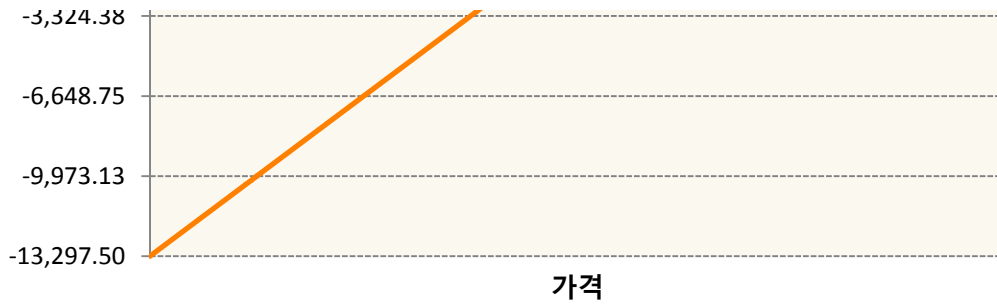


KR4201P62727-2019-06 콜272.5



KR4301P62709-2019-06 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,702
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,702	-1,702	-1,702	-1,702	-1,702	-1,702	-1,702	
-5.33%	-1,135	-1,135	-1,135	-1,135	-1,135	-1,135	-1,135	
-2.67%	-567	-567	-567	-567	-567	-567	-567	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	567	567	567	567	567	567	567	
5.33%	1,135	1,135	1,135	1,135	1,135	1,135	1,135	
8.00%	1,702	1,702	1,702	1,702	1,702	1,702	1,702	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						601
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-601	-601	-601	-601	-601	-601	-601	
-5.33%	-400	-400	-400	-400	-400	-400	-400	
-2.67%	-200	-200	-200	-200	-200	-200	-200	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	200	200	200	200	200	200	200	
5.33%	400	400	400	400	400	400	400	
8.00%	601	601	601	601	601	601	601	
KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						301
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-301	-301	-301	-301	-301	-301	-301	
-5.33%	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-201	
-2.67%	-100	-100	-100	-100	-100	-100	-100	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	100	100	100	100	100	100	100	
5.33%	201	201	201	201	201	201	201	
8.00%	301	301	301	301	301	301	301	
KR4201P62701		2019-06 콜270						104
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	46	45	43	41	39	36	33
-5.33%	41	39	36	33	30	26	23
-2.67%	31	27	23	19	15	11	7
0%	13	9	4	0	-4	-9	-13
2.67%	-13	-17	-21	-26	-30	-35	-39
5.33%	-47	-50	-54	-58	-61	-65	-69
8.00%	-87	-89	-91	-94	-97	-101	-104

KR4201P62727 2019-06 콜272.5 583

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	236	229	220	210	198	185	170
-5.33%	214	201	186	169	152	133	114
-2.67%	166	145	124	102	79	56	33
0%	77	51	26	0	-26	-52	-78
2.67%	-60	-86	-113	-139	-165	-192	-218
5.33%	-245	-267	-290	-314	-338	-363	-387
8.00%	-467	-483	-501	-520	-540	-561	-583

KR4301P62709 2019-06 풋270 846

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-813	-816	-819	-824	-830	-838	-846
-5.33%	-473	-481	-491	-502	-515	-528	-543
-2.67%	-167	-184	-202	-221	-240	-260	-281
0%	69	46	23	0	-23	-46	-70
2.67%	216	195	174	152	130	108	85
5.33%	285	272	258	242	225	208	189
8.00%	309	304	296	287	277	265	252

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

(단위:백만원)

4,052

공시일	2019-05-14
기준일	2019-05-13

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

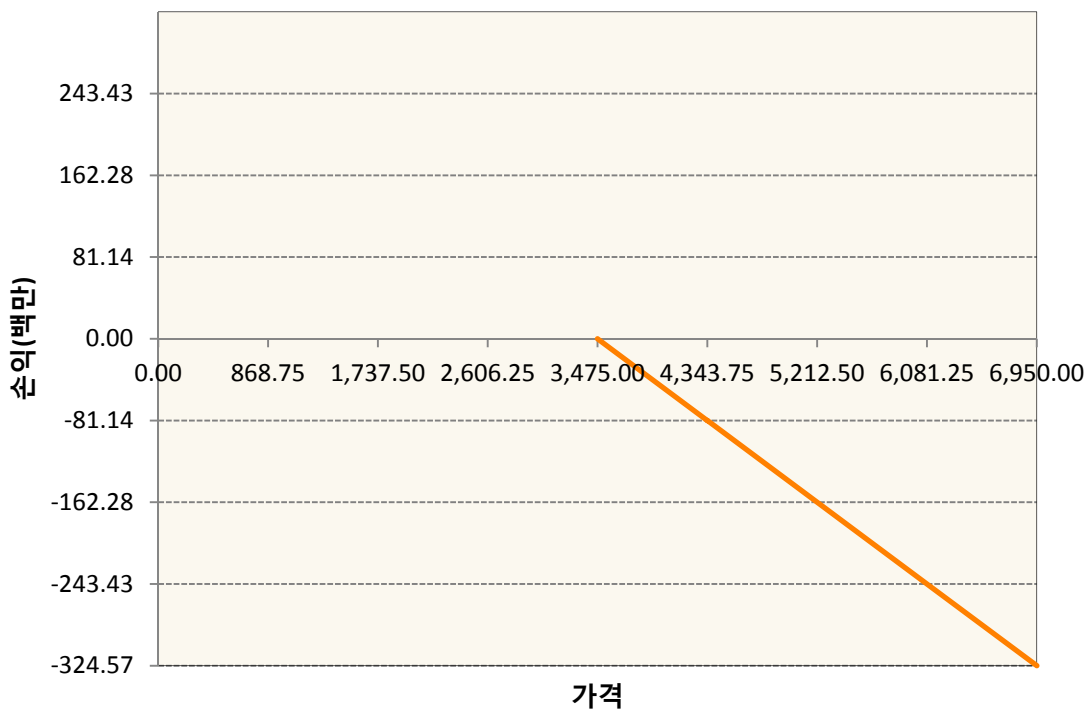
1. 계약금액

(단위:백만원)

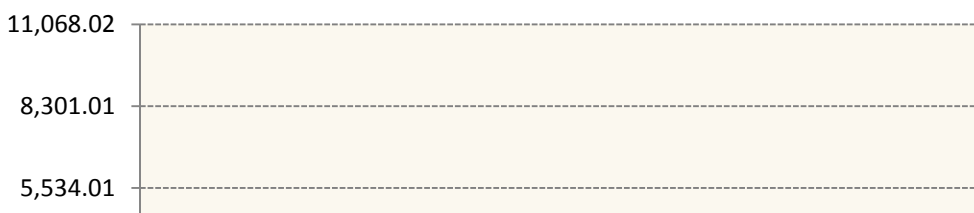
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,797	0	4,797	
누계	유가증권	스왑	56,479	0	56,479	장외
누계	유가증권	옵션	0	22,785	-22,785	장내
누계	통화	선도	0	18,680	-18,680	장외

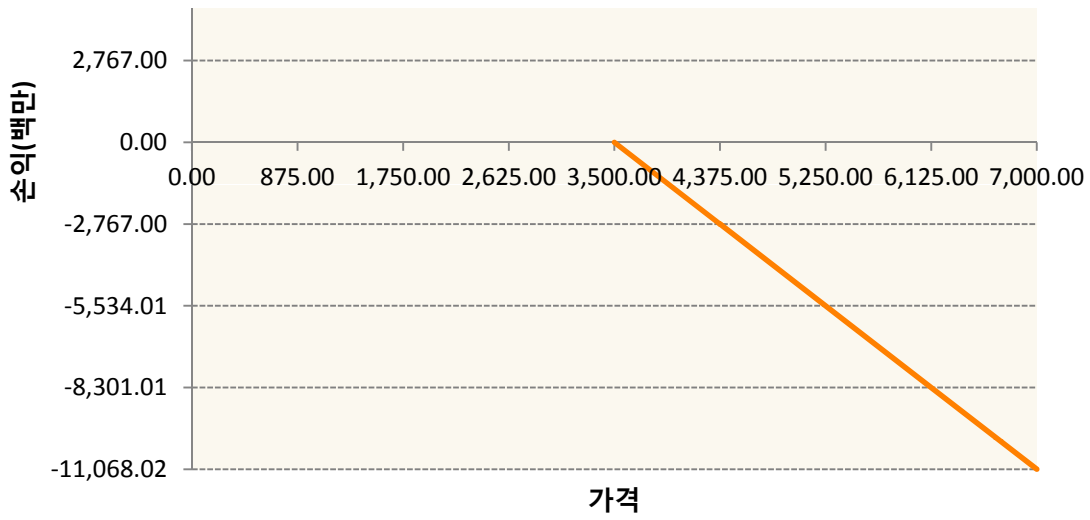
2. 만기시점의 손익구조

OESXK9-C3475-EURO STOXX 50

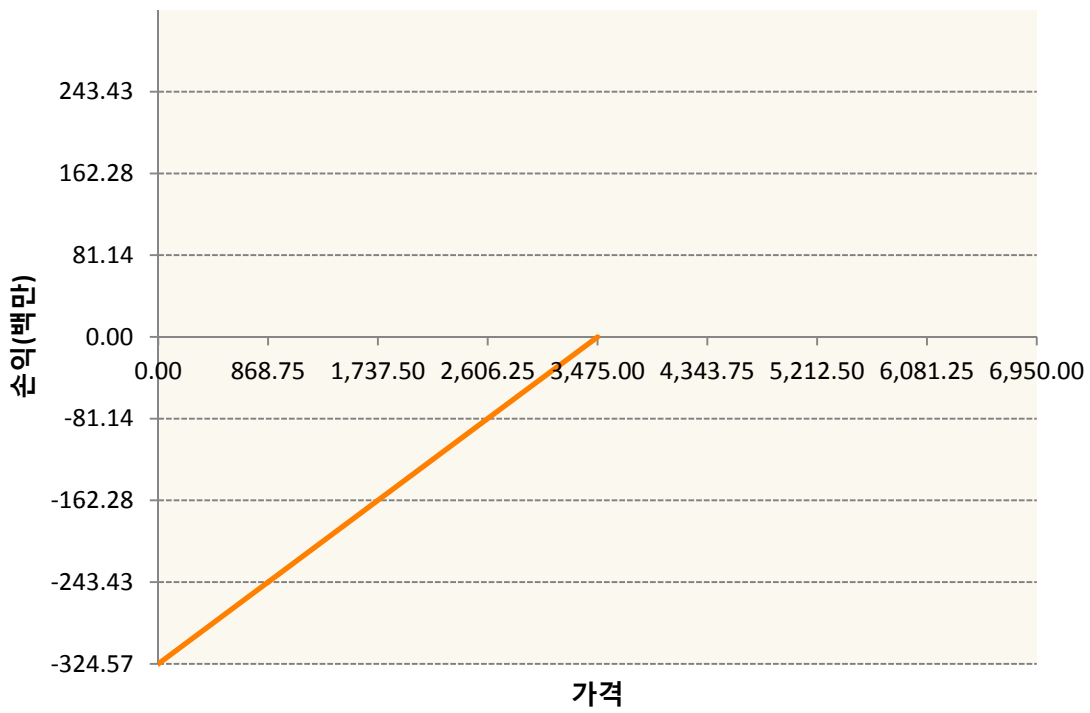


OESXK9-C3500-EURO STOXX 50



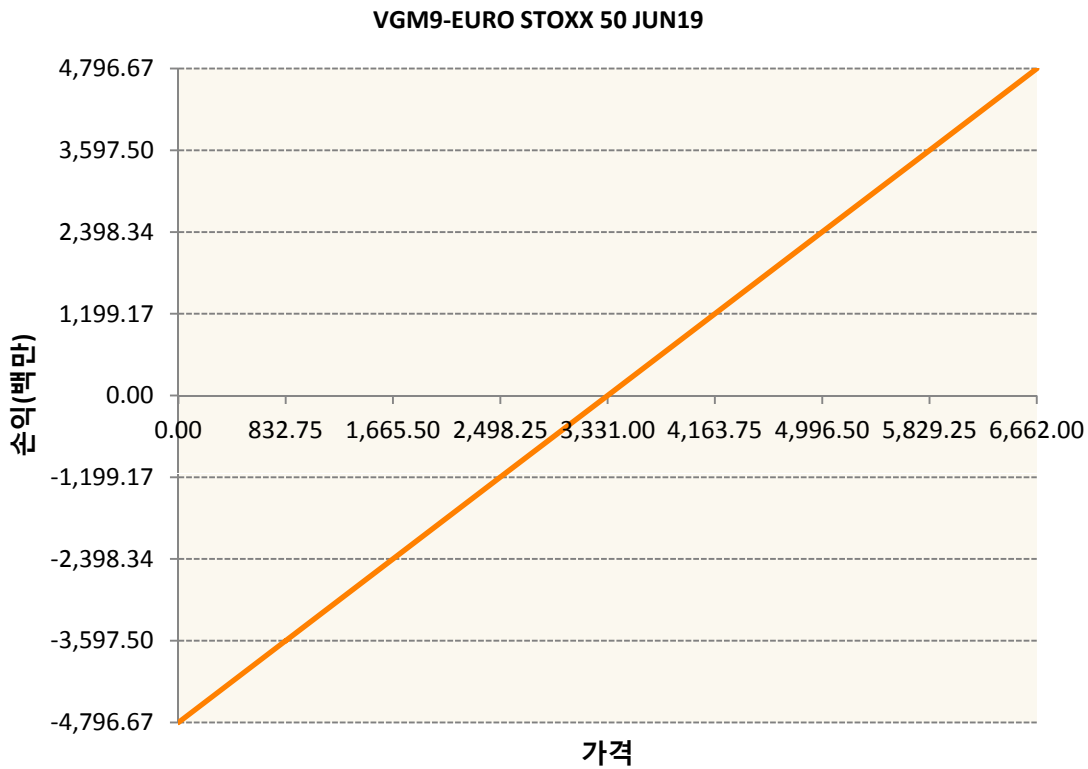
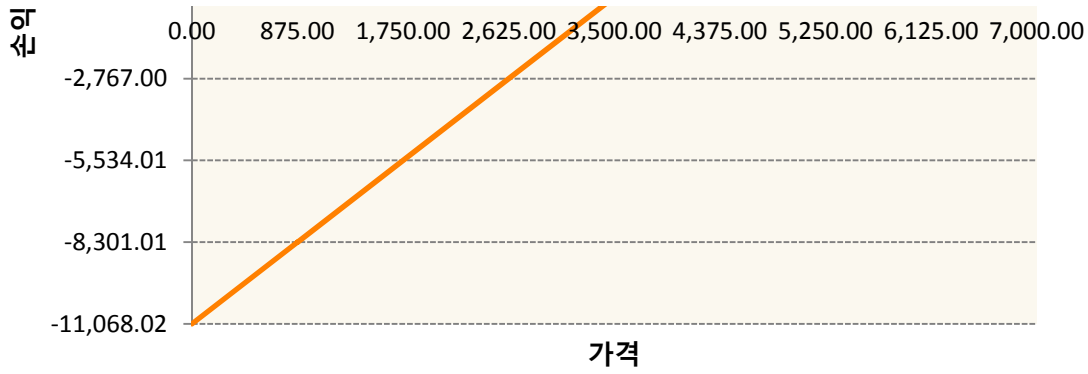


OESXK9-P3475-EURO STOXX 50



OESXK9-P3500-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	123
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	427
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	854
FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E	213
OESXK9-C34 EURO STOXX 50	26
OESXK9-C35 EURO STOXX 50	885
OESXK9-P34 EURO STOXX 50	26
OESXK9-P35 EURO STOXX 50	885
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	384

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

(단위:백만원)

2,447

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

(단위:백만원)

1,064

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

(단위:백만원)

91

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

(단위:백만원)

132

공시일	2019-05-14
기준일	2019-05-13

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

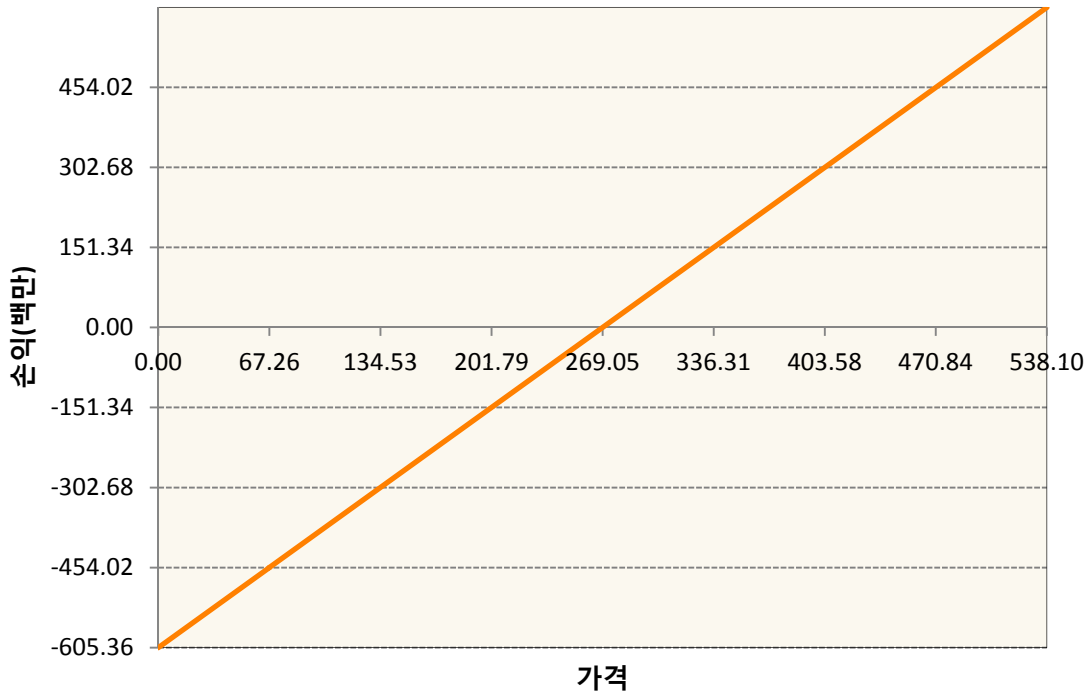
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	605	0	605	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						48
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48	
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
-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%	32	32	32	32	32	32	32	
8.00%	48	48	48	48	48	48	48	

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-05-14
기준일	2019-05-13

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

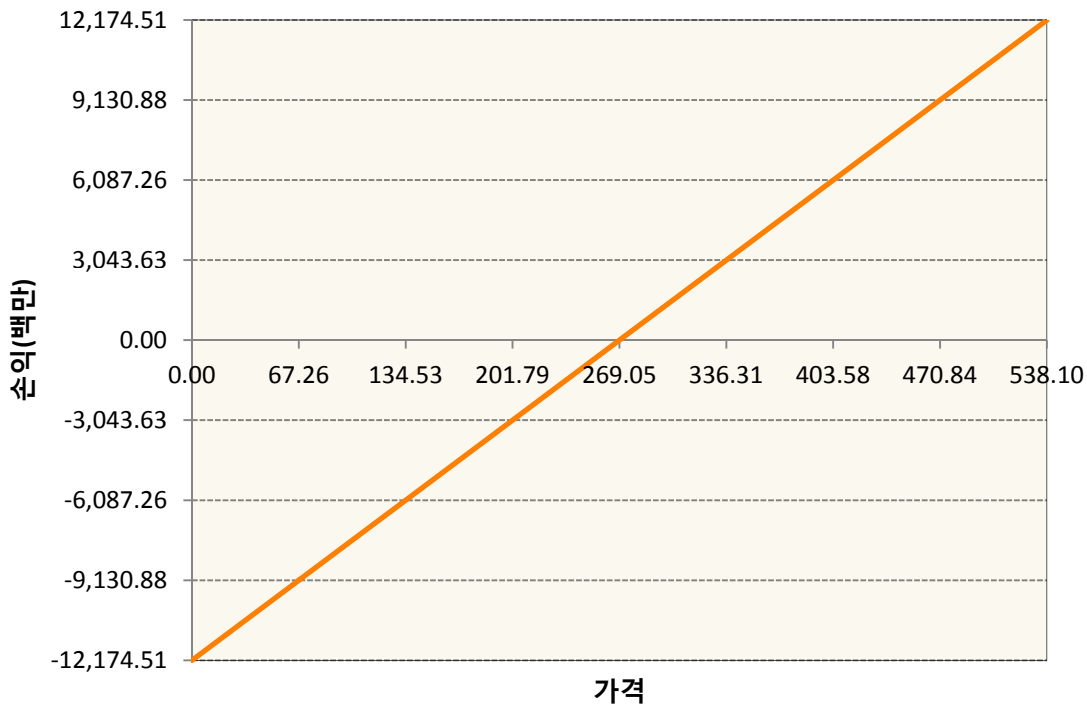
1. 계약금액

(단위:백만원)

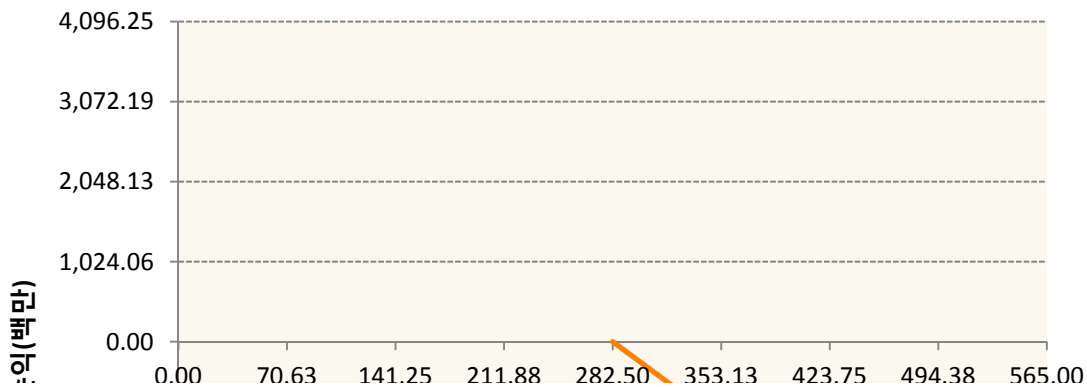
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,175	0	12,175	장내
누계	유가증권	옵션	5,081	22,906	-17,825	장내

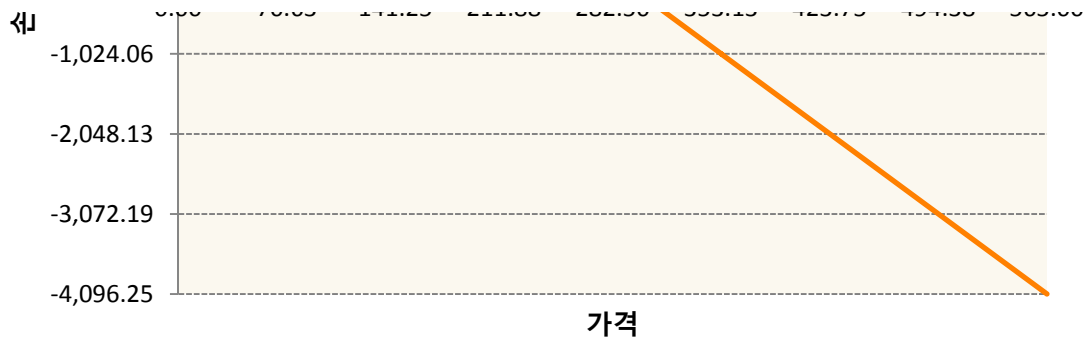
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

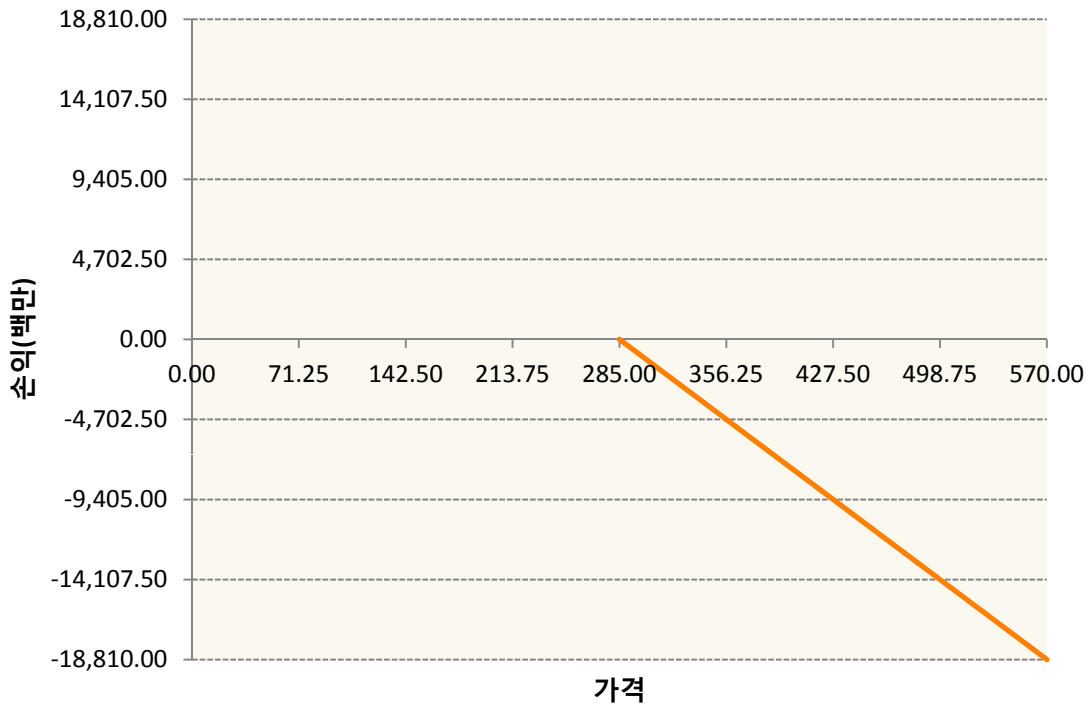


KR4201P62826-2019-06 콜282.5

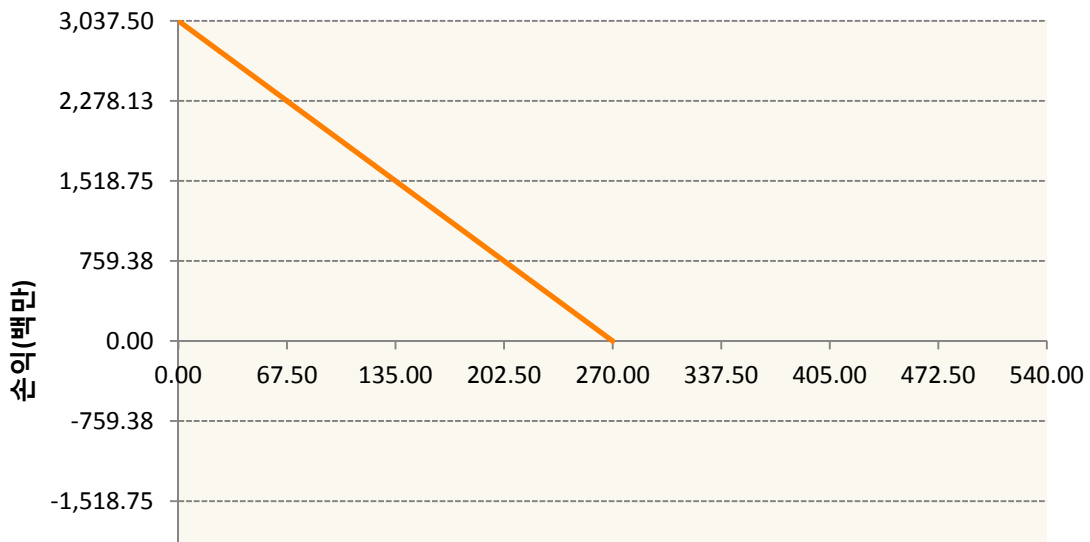


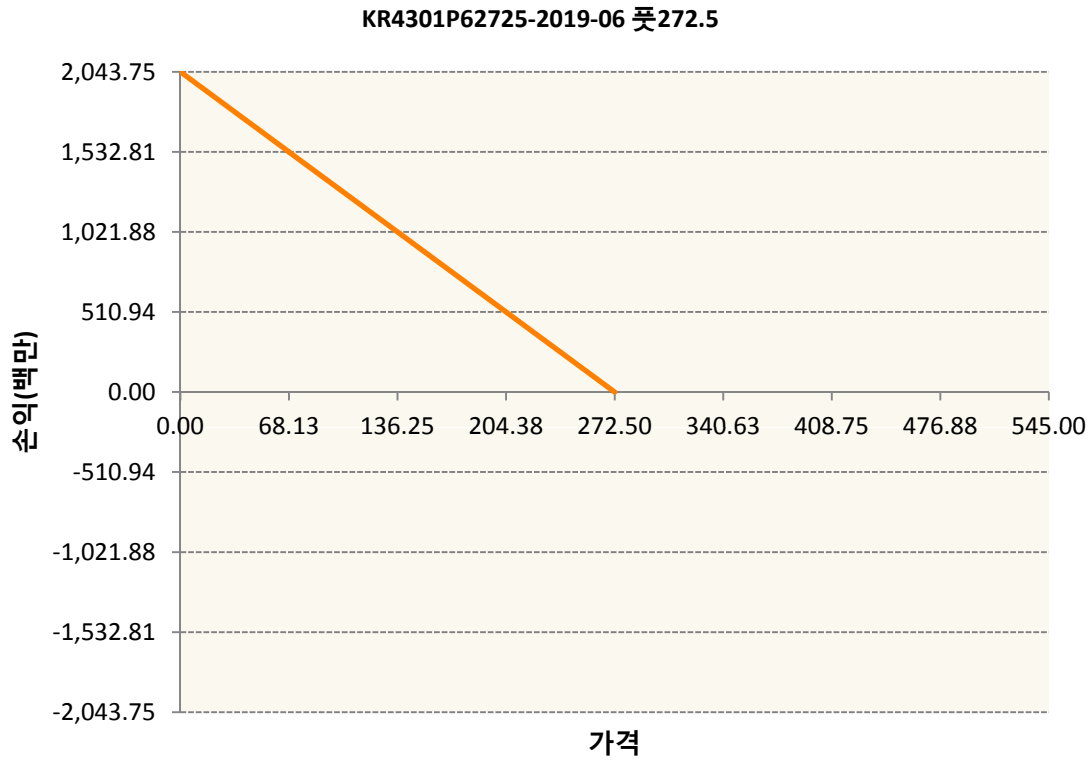
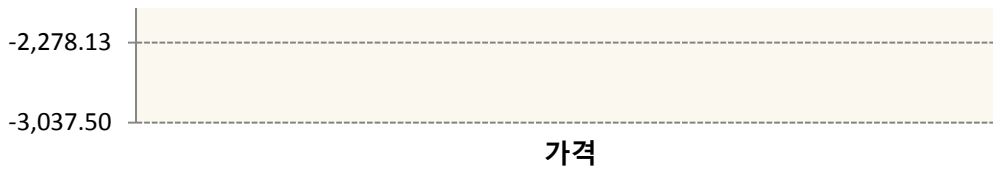


KR4201P62859-2019-06 콜285



KR4301P62709-2019-06 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						973
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-973	-973	-973	-973	-973	-973	-973	
-5.33%	-649	-649	-649	-649	-649	-649	-649	
-2.67%	-324	-324	-324	-324	-324	-324	-324	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	324	324	324	324	324	324	324	
5.33%	649	649	649	649	649	649	649	
8.00%	973	973	973	973	973	973	973	
KR4201P62826		2019-06 콜282.5						172
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	46	45	44	42	39	37	33	
-5.33%	44	41	39	35	31	26	21	
-2.67%	37	33	28	22	16	9	2	

0%	23	16	8	0	-8	-17	-26
2.67%	-5	-15	-24	-34	-44	-54	-64
5.33%	-50	-60	-71	-81	-92	-102	-112
8.00%	-113	-122	-132	-142	-152	-162	-172
KR4201P62859 2019-06 콜285							726
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	173	170	166	159	150	139	125
-5.33%	166	158	148	134	118	99	78
-2.67%	145	129	109	86	60	33	3
0%	93	65	33	0	-35	-72	-109
2.67%	-11	-51	-93	-135	-179	-222	-266
5.33%	-187	-235	-282	-329	-377	-424	-472
8.00%	-445	-491	-538	-585	-632	-679	-726
KR4301P62709 2019-06 풋270							193
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	186	186	187	188	190	191	193
-5.33%	108	110	112	115	118	121	124
-2.67%	38	42	46	51	55	59	64
0%	-16	-11	-5	0	5	11	16
2.67%	-49	-45	-40	-35	-30	-25	-20
5.33%	-65	-62	-59	-55	-51	-47	-43
8.00%	-71	-69	-68	-66	-63	-61	-58
KR4301P62725 2019-06 풋272.5							135
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	131	132	132	133	133	134	135
-5.33%	79	80	81	82	84	86	88
-2.67%	30	32	35	37	40	42	45
0%	-10	-7	-3	0	3	7	10
2.67%	-37	-34	-30	-27	-23	-20	-16
5.33%	-52	-49	-46	-44	-41	-38	-35
8.00%	-57	-56	-54	-53	-51	-49	-46

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

(단위:백만원)

1,741

공시일	2019-05-14
기준일	2019-05-13

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,069	0	1,069	
누계	유가증권	수익증권	7,281	0	7,281	

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	2019-05-14
기준일	2019-05-13

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,188	0	1,188	
누계	유가증권	수익증권	88,821	0	88,821	

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	2019-05-14
기준일	2019-05-13

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	7,125	0	7,125	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	205,793	0	205,793	
누계	통화	선도	0	221,588	-221,588	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		105
FX21019J012 KRW/USD 20-05-19E		133
FX21019J012 KRW/USD 20-05-19E		19
FX21019J013 KRW/USD 20-05-19E		143
FX21019J016 KRW/USD 20-05-19E		143
FX21019J019 KRW/USD 17-05-19E		1,330
FX21019J019 KRW/USD 17-05-19E		1,425
FX21019J019 KRW/USD 18-06-19E		380
FX21019J020 KRW/USD 20-05-19E		513
FX21019J021 KRW/USD 20-05-19E		483
FX21019J024 KRW/USD 24-06-19E		950
FX21019J024 KRW/USD 22-05-19E		798
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		950
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		1,007
FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E		380
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		76
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		999
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E		1,026
FX21019J041 KRW/USD 28-05-19E		285
FX21019J043 KRW/USD 03-06-19E		570
FX21019J044 KRW/USD 03-06-19E		475
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		285
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		475
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		665
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		665
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		827

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

817
570
665
570

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

(단위:백만원)

6,023

공시일	2019-05-14
기준일	2019-05-13

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

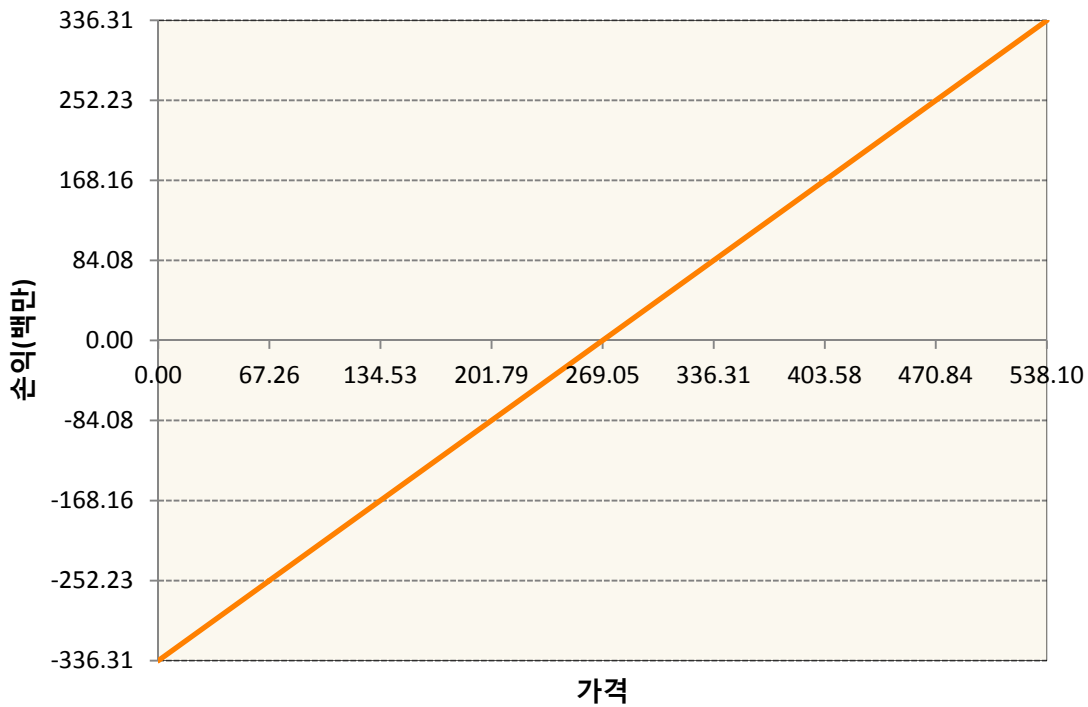
1. 계약금액

(단위:백만원)

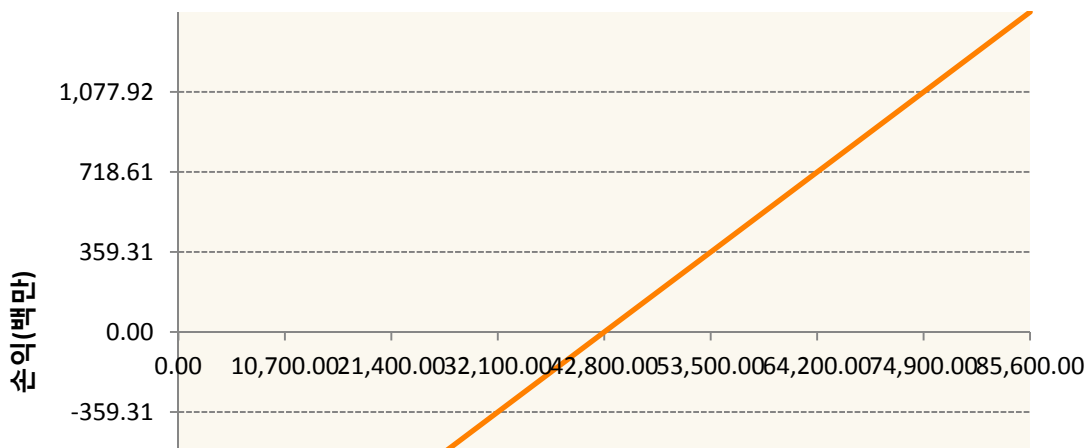
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,774	0	1,774	장내

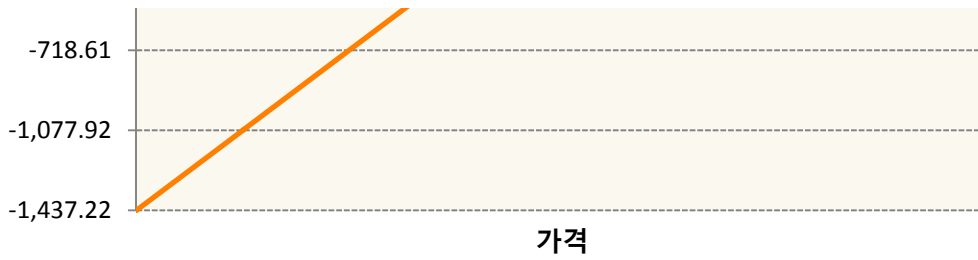
2. 만기시점의 손익구조

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%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76	
-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%	76	76	76	76	76	76	76	
8.00%	115	115	115	115	115	115	115	

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

156

공시일	2019-05-14
기준일	2019-05-13

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

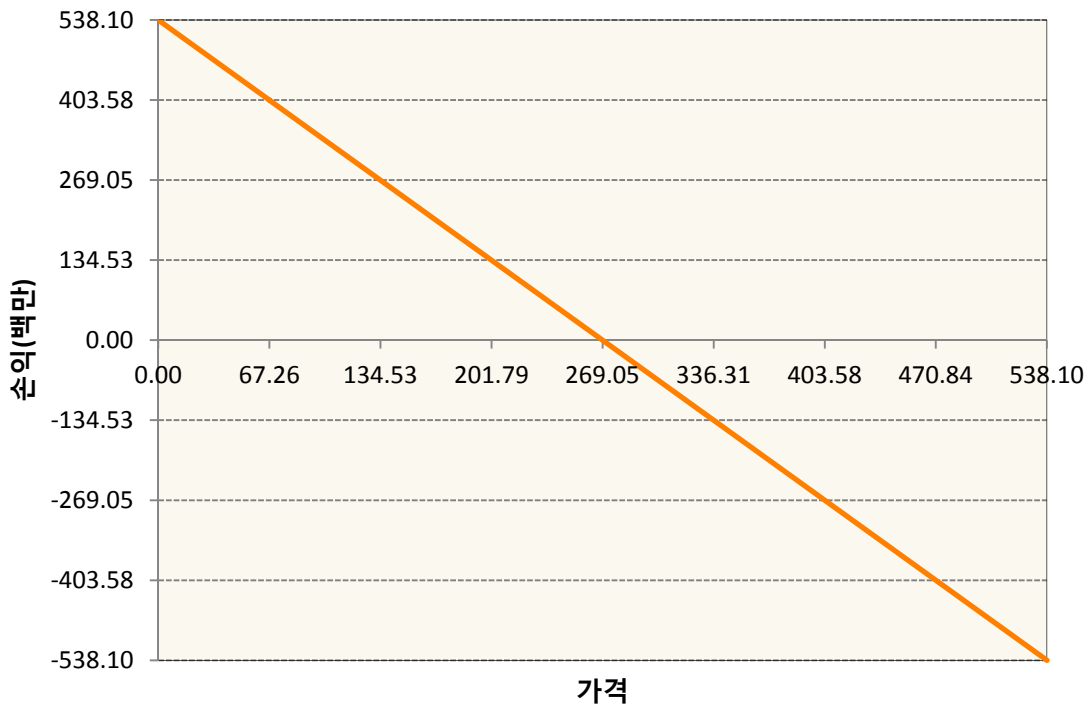
1. 계약금액

(단위:백만원)

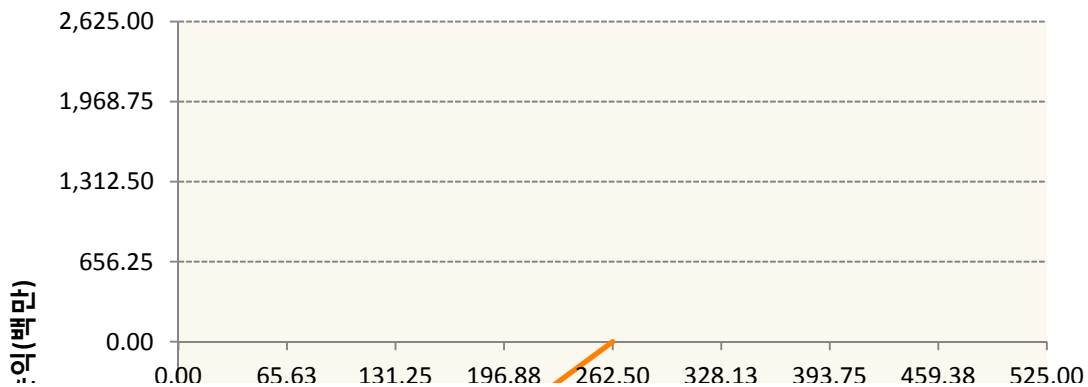
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	67	-67	장내
누계	유가증권	선물	0	538	-538	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,089	-3,089	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

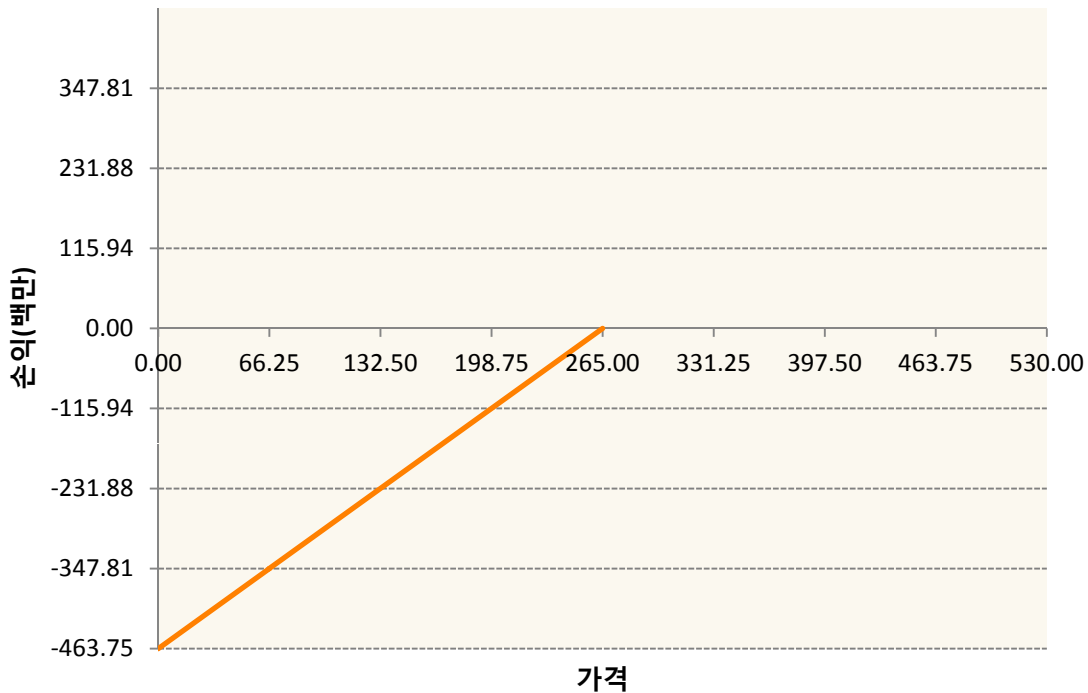


KR4301P62626-2019-06 풋262.5





KR4301P62659-2019-06 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						43
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	43	43	43	43	43	43	43	
-5.33%	29	29	29	29	29	29	29	
-2.67%	14	14	14	14	14	14	14	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14	
5.33%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29	
8.00%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43	
KR4301P62626		2019-06 풋262.5						140
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-126	-128	-129	-132	-134	-137	-140
-5.33%	-64	-67	-71	-75	-78	-82	-86
-2.67%	-16	-21	-25	-30	-35	-39	-44
0%	12	8	4	0	-4	-9	-13
2.67%	25	23	20	17	14	11	7
5.33%	30	29	27	26	24	22	19
8.00%	31	30	30	29	28	27	26
KR4301P62659 2019-06 풋265							26
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-25	-25	-25	-25	-26	-26	-26
-5.33%	-13	-14	-14	-15	-15	-16	-17
-2.67%	-4	-5	-5	-6	-7	-8	-9
0%	2	2	1	0	-1	-2	-2
2.67%	5	5	4	4	3	2	2
5.33%	7	6	6	6	5	5	4
8.00%	7	7	7	7	6	6	6

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

(단위:백만원)

191

공시일	2019-05-14
기준일	2019-05-13

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

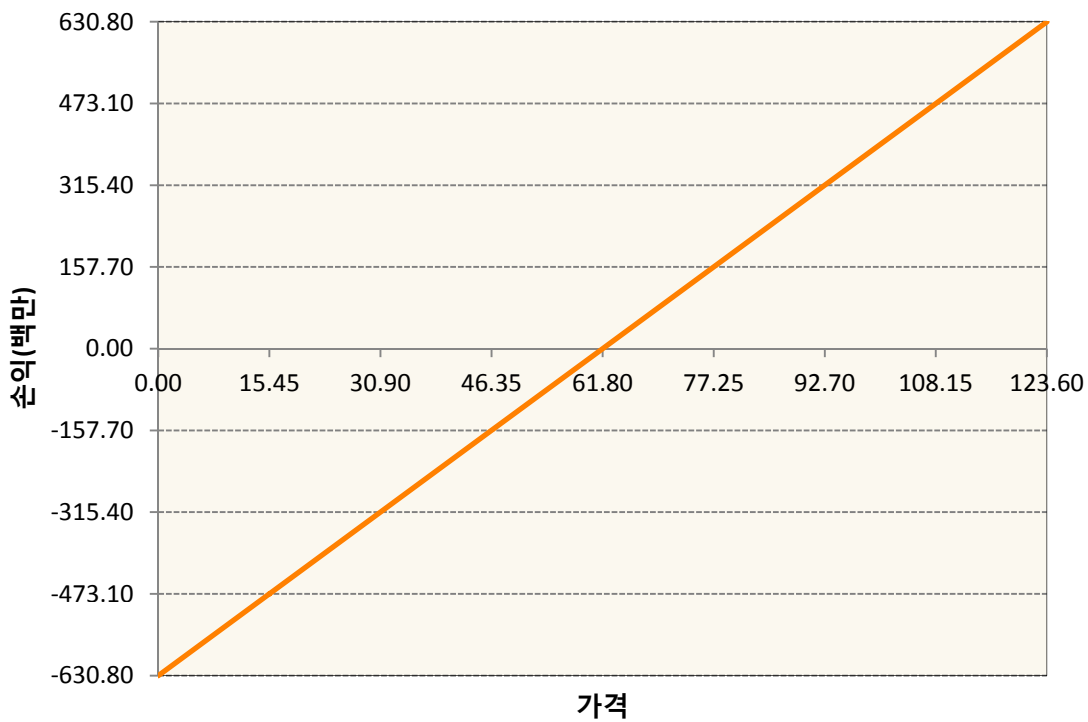
1. 계약금액

(단위:백만원)

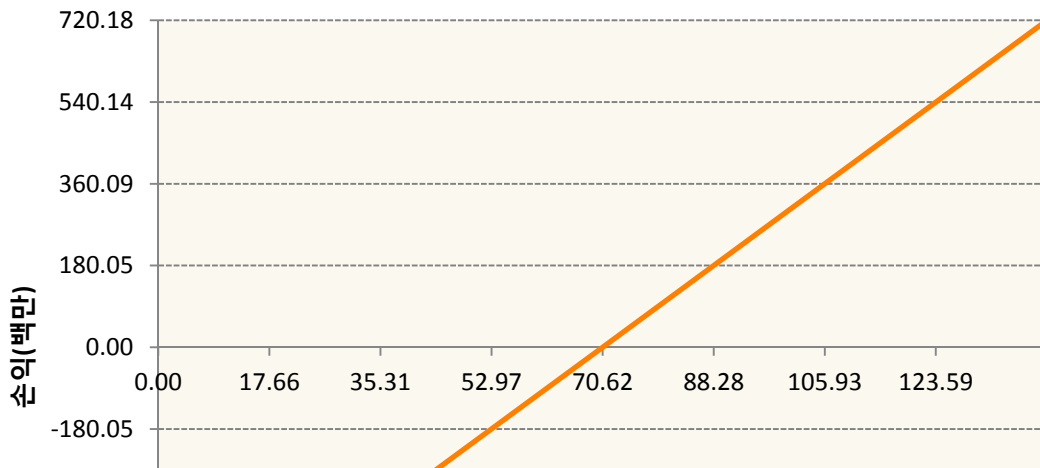
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,747	297	2,450	

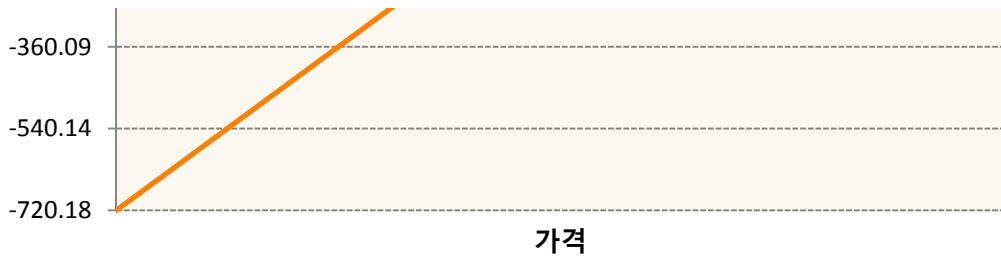
2. 만기시점의 손익구조

CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19

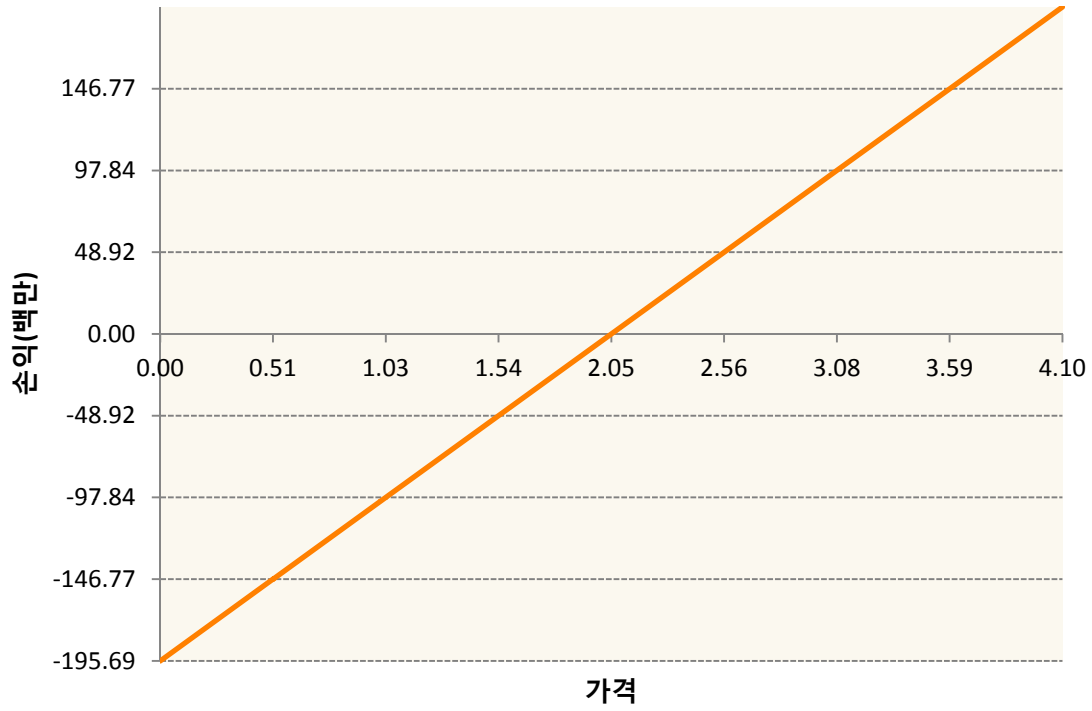


CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19

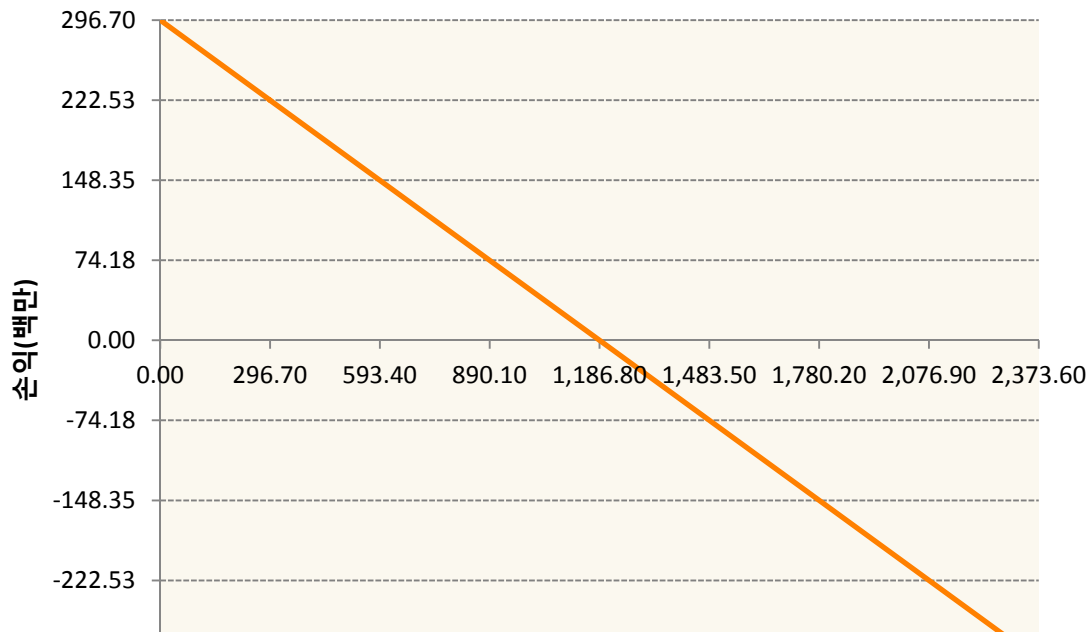


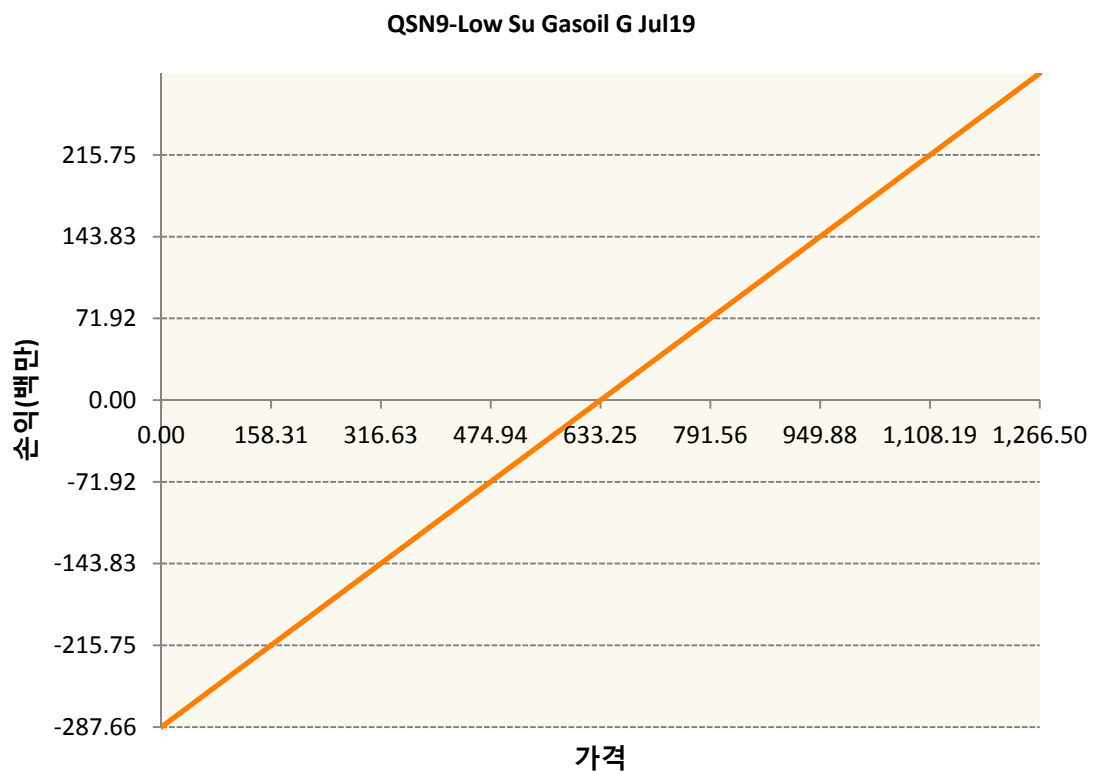
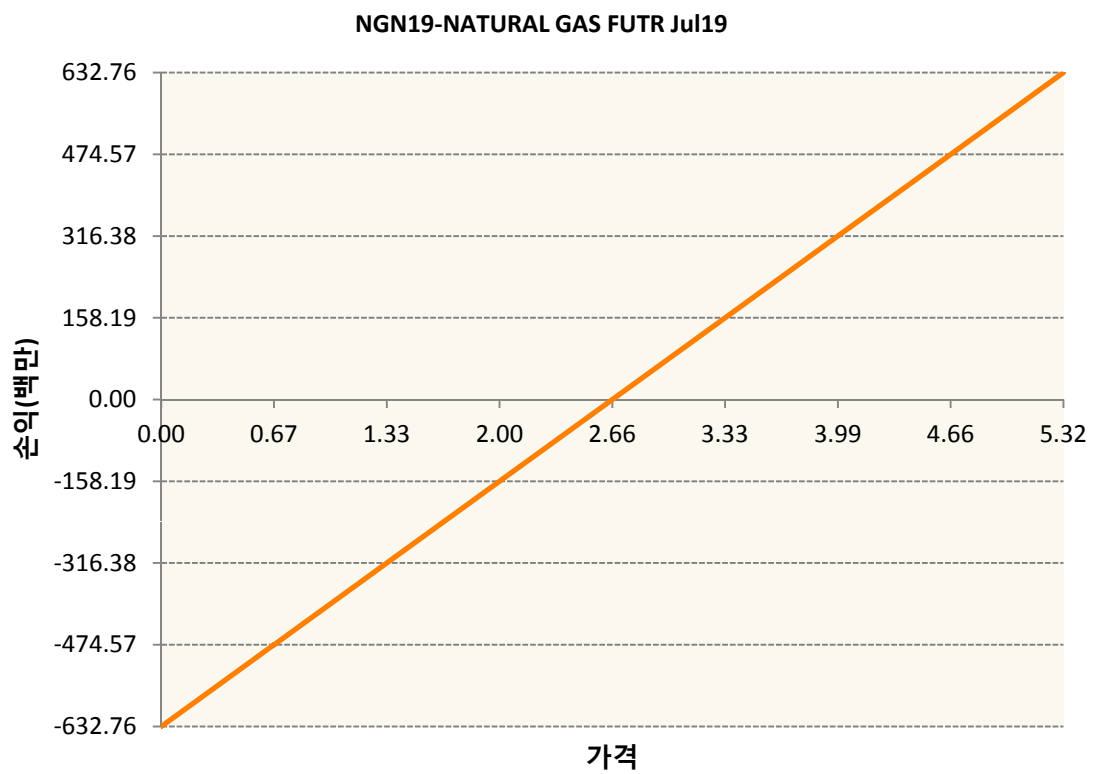
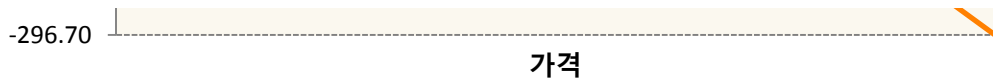


HON9-NY Harb ULSD Fut Jul19

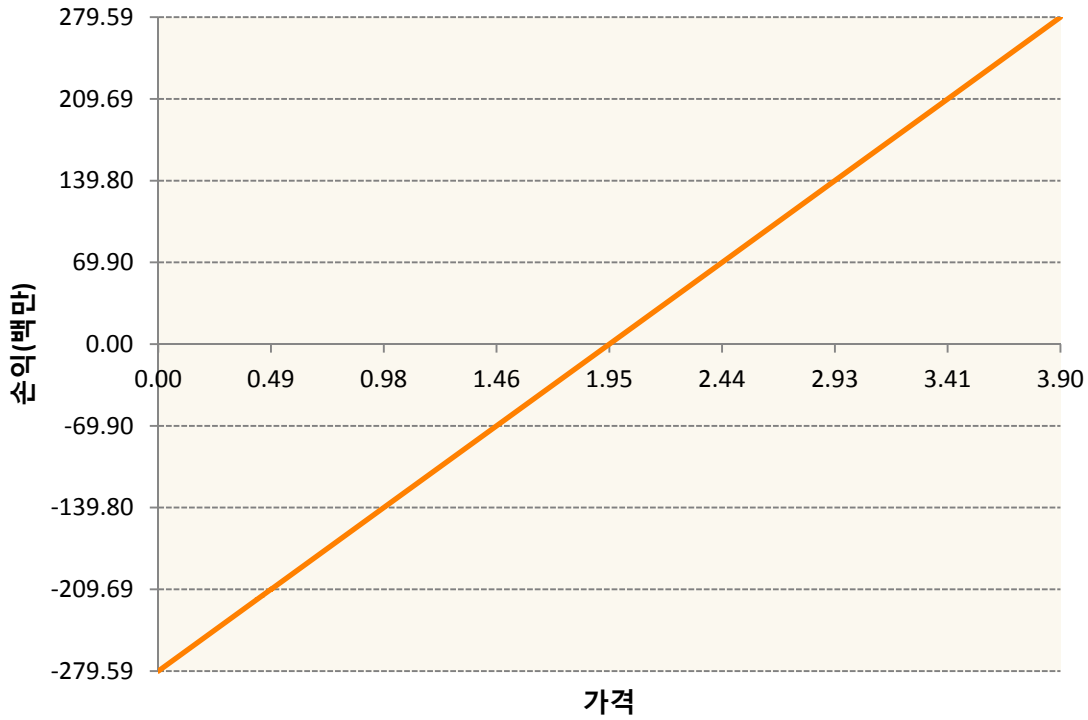


KR4175P50009-2019-05 달러선물





XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN9	WTI CRUDE FUTURE Jul19	50
CON9	BRENT CRUDE FUTR Jul19	58
HON9	NY Harb ULSD Fut Jul19	16
KR4175P500	2019-05 달러선물	24
NGN19	NATURAL GAS FUTR Jul19	51
QSN9	Low Su Gasoil G Jul19	23
XBN9	GASOLINE RBOB FUT Jul19	22

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

405

공시일	2019-05-14
기준일	2019-05-13

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

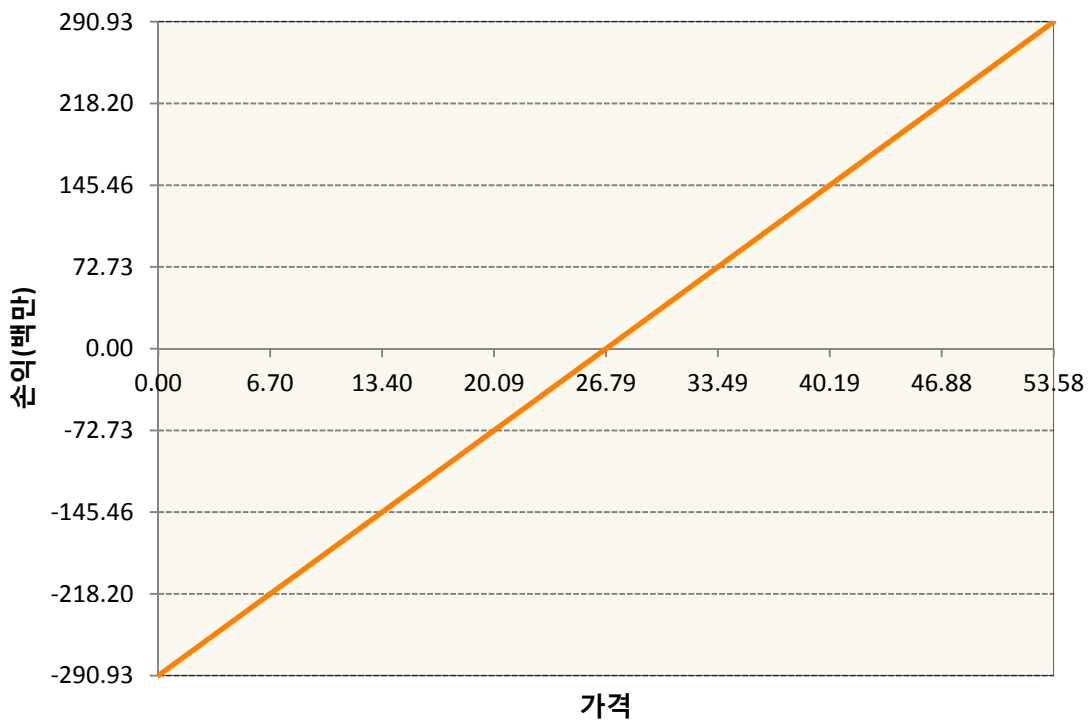
1. 계약금액

(단위:백만원)

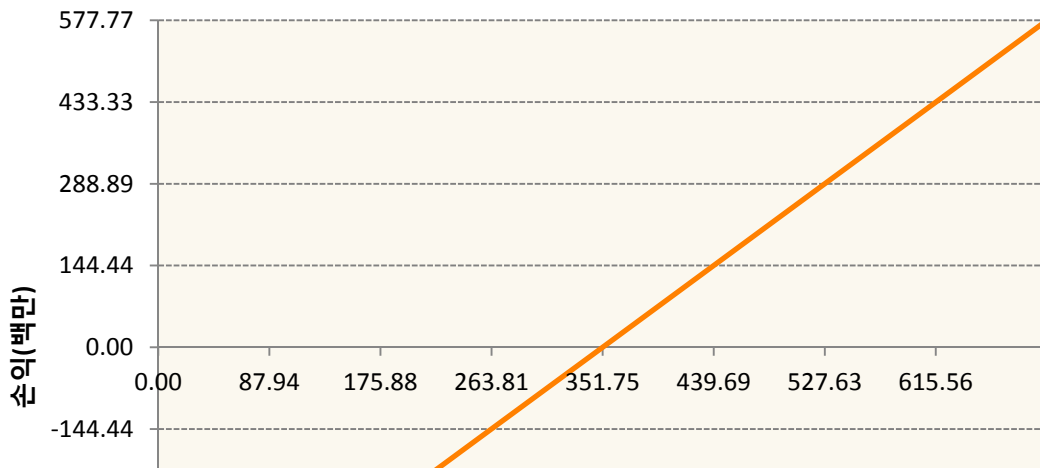
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,777	59	2,717	

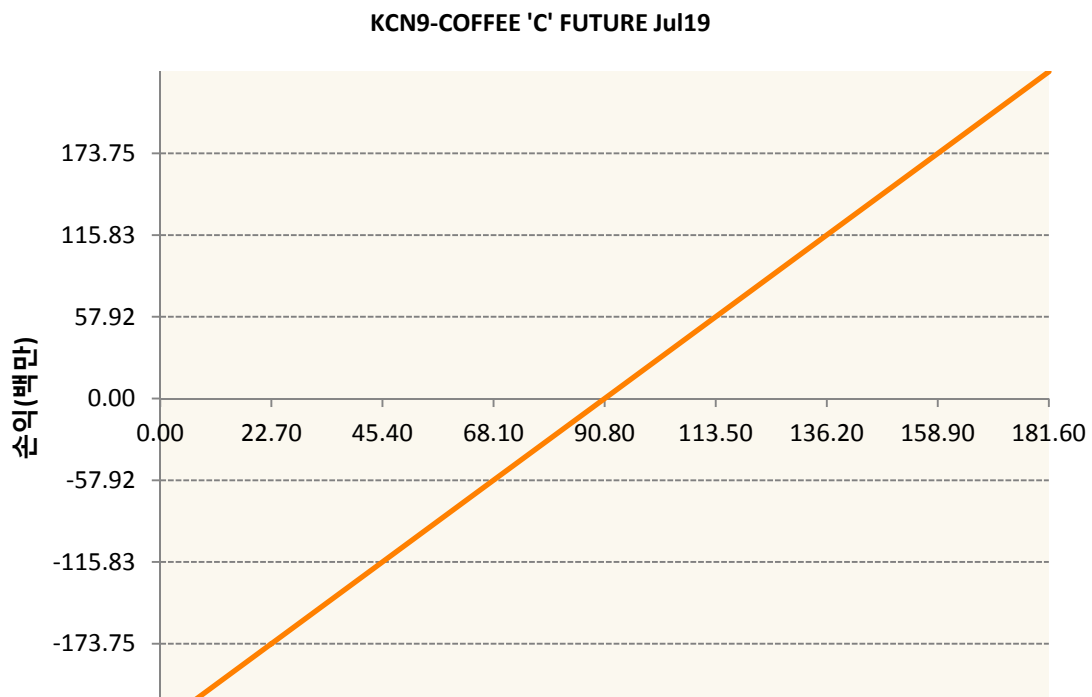
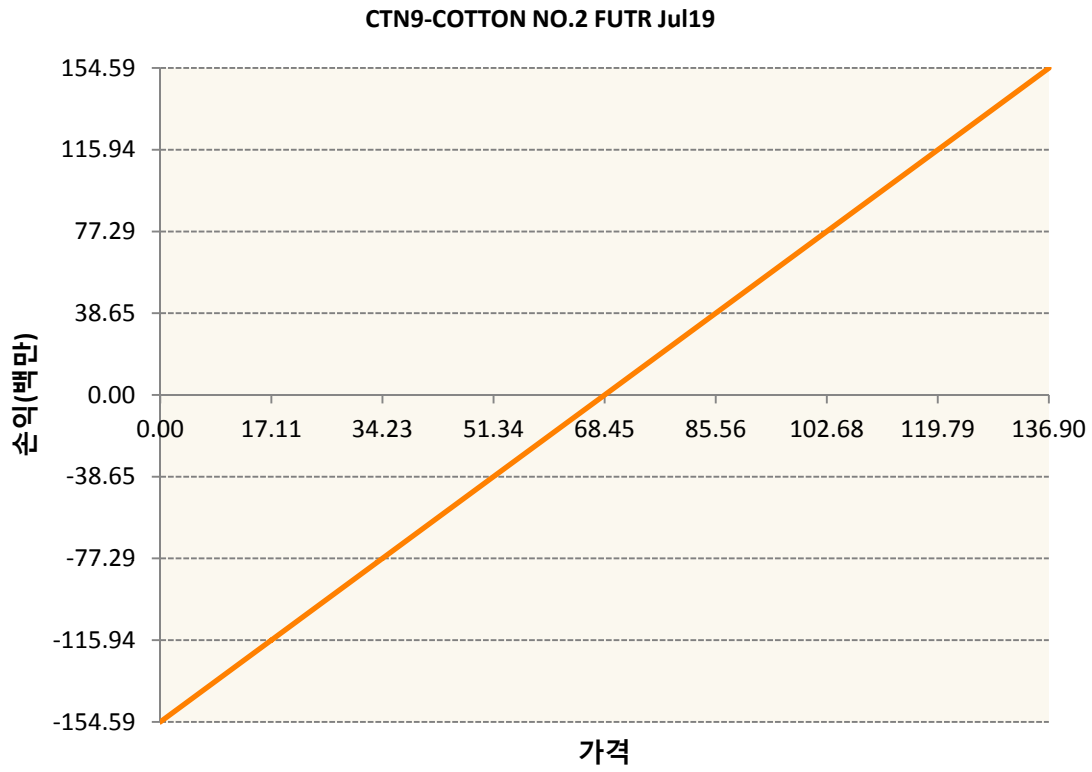
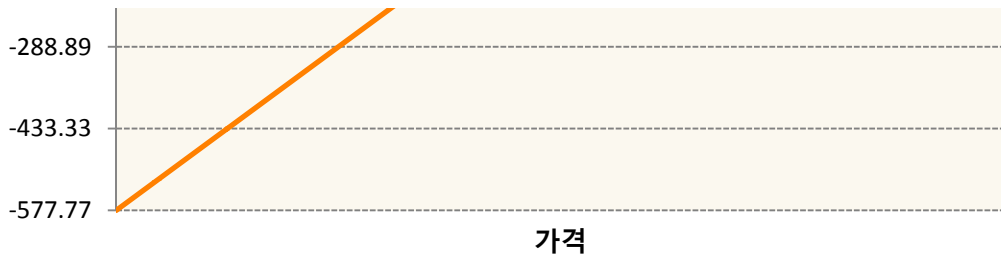
2. 만기시점의 손익구조

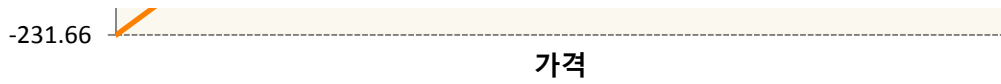
BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19



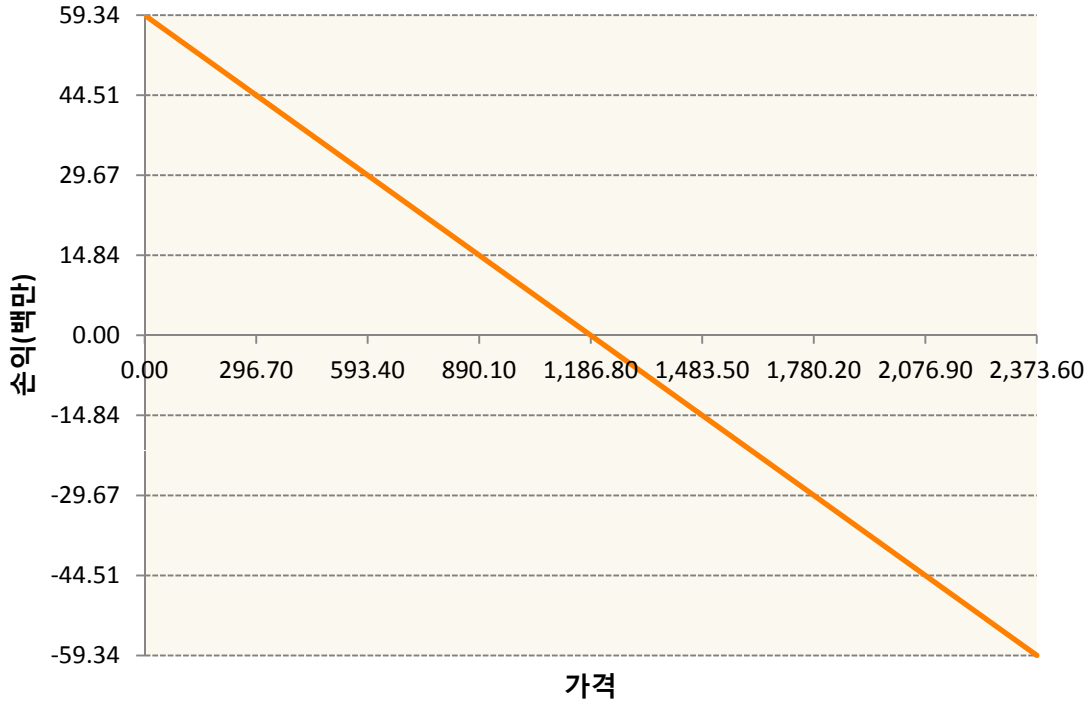
CN9-CORN FUTURE Jul19



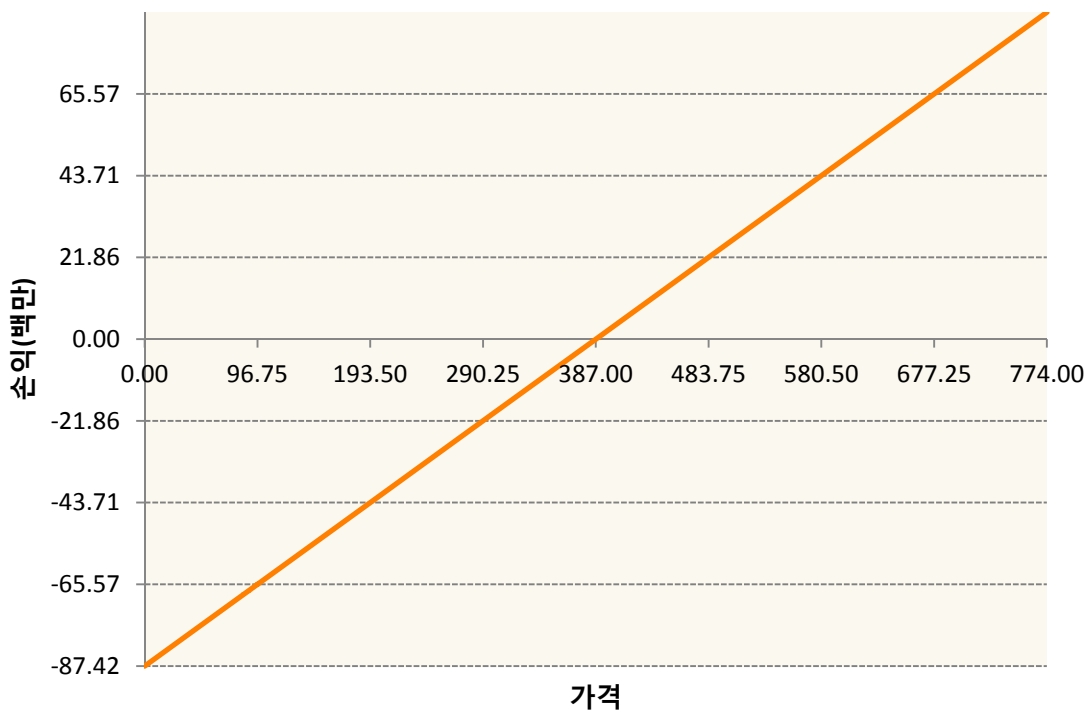




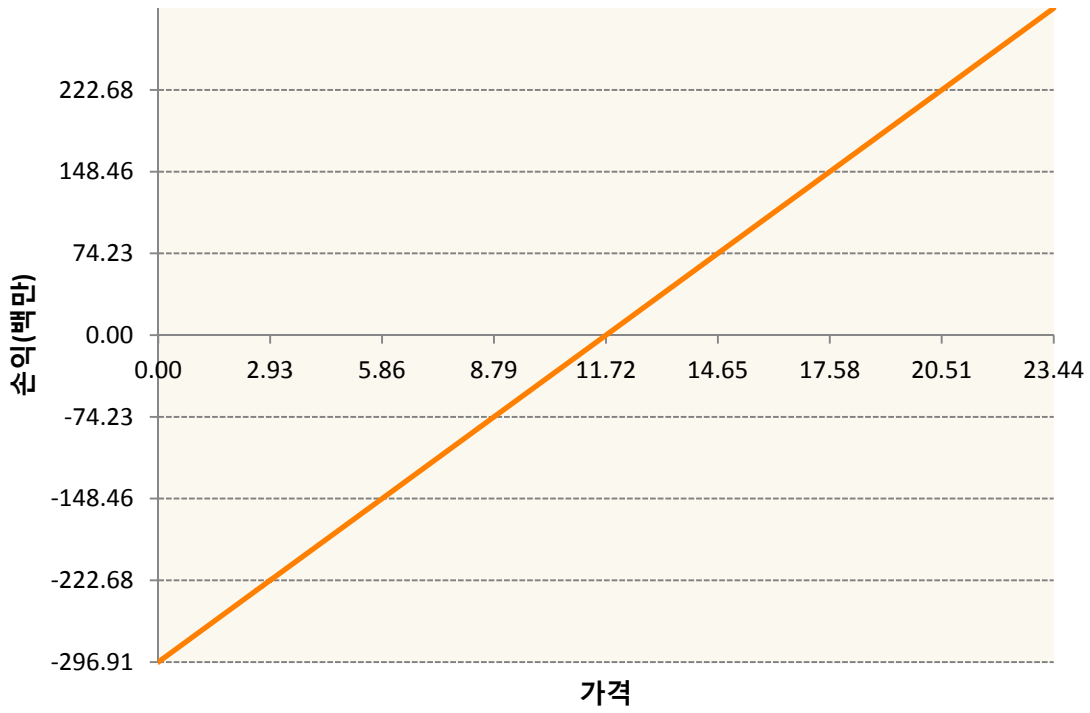
KR4175P50009-2019-05 달러선물



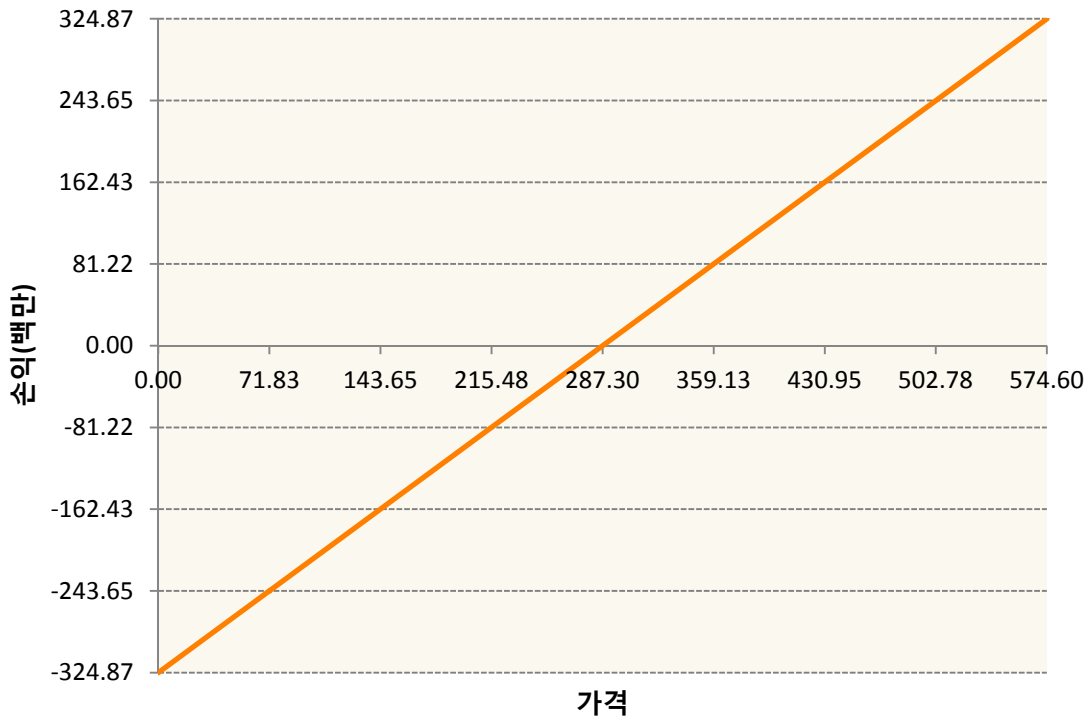
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



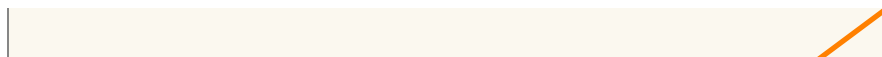
SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

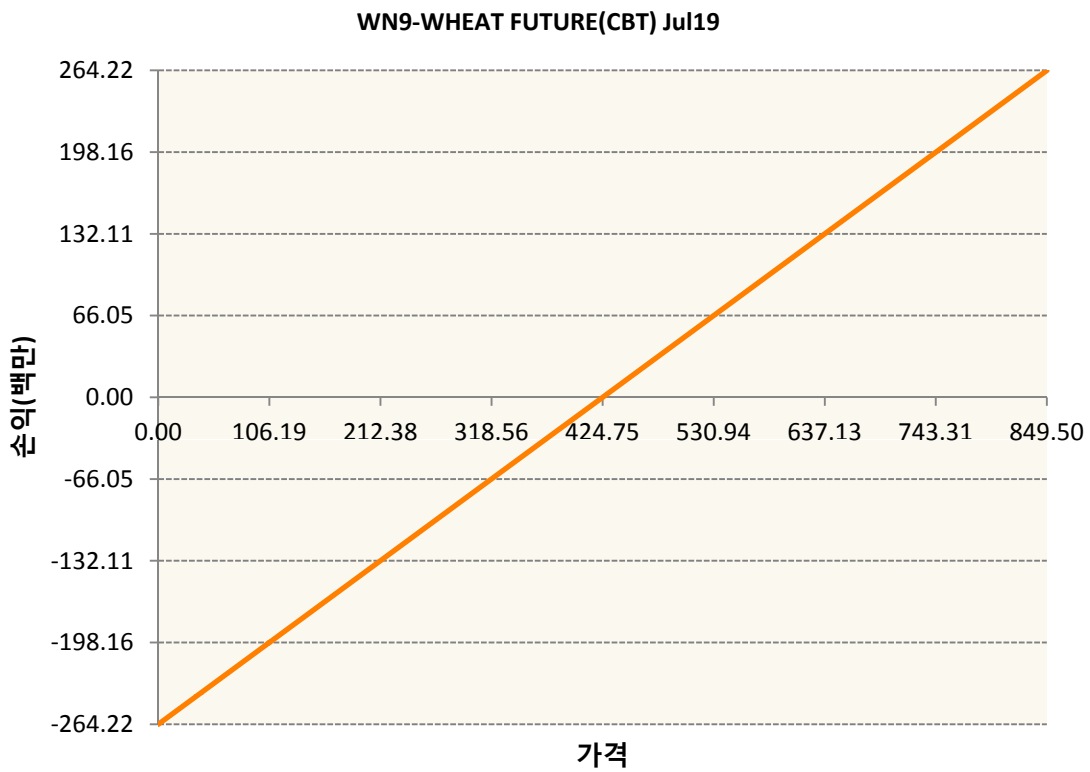
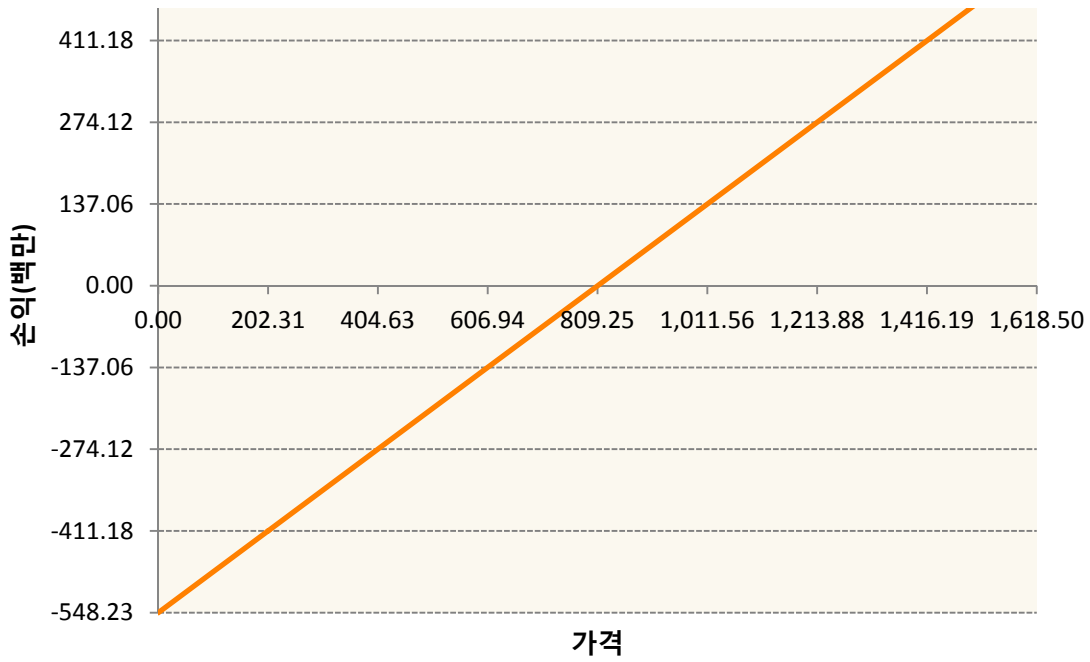


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19



SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BON9	SOYBEAN OIL FUTR Jul19	23
CN9	CORN FUTURE Jul19	46
CTN9	COTTON NO.2 FUTR Jul19	12
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)

225