

공시일	2019-05-17
기준일	2019-05-16

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)

90

공시일	2019-05-17
기준일	2019-05-16

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

1,133

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

676

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-05-17
기준일	2019-05-16

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)	311
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)

897

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-05-17
기준일	2019-05-16

유로인덱스모(주식-파생형)

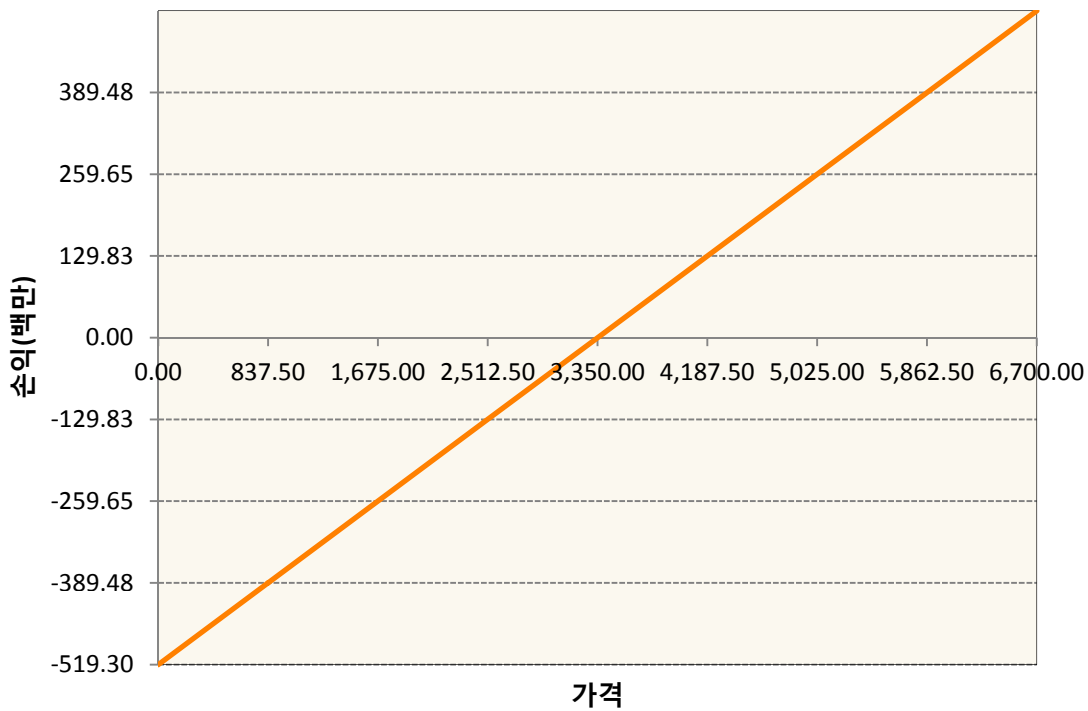
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	519	0	519	

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	2019-05-17
기준일	2019-05-16

차이나인덱스모(주식-파생형)

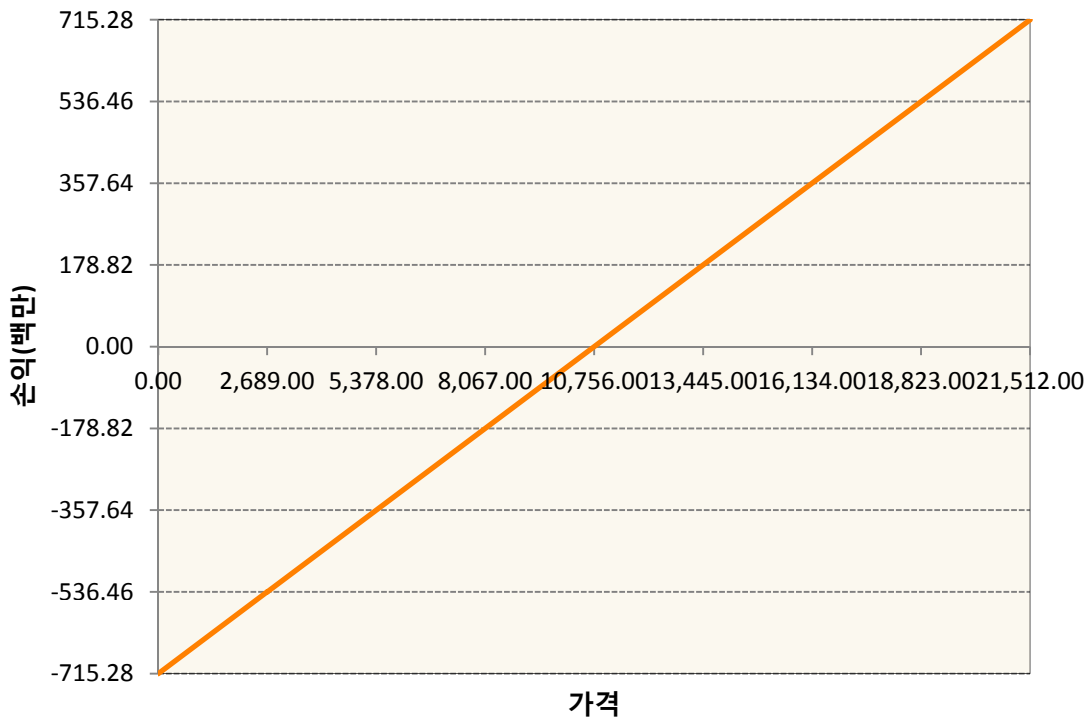
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	715	0	715	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK9	HSCEI Futures May19	57
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

59

공시일	2019-05-17
기준일	2019-05-16

커버드콜모(주식혼합-파생형)

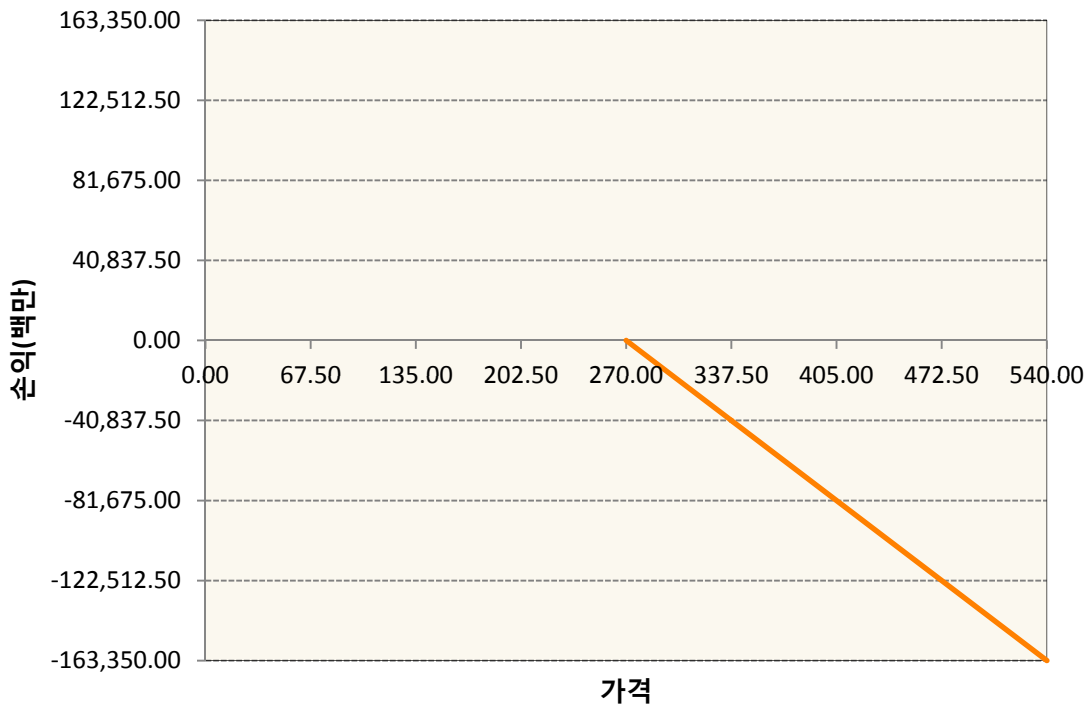
1. 계약금액

(단위:백만원)

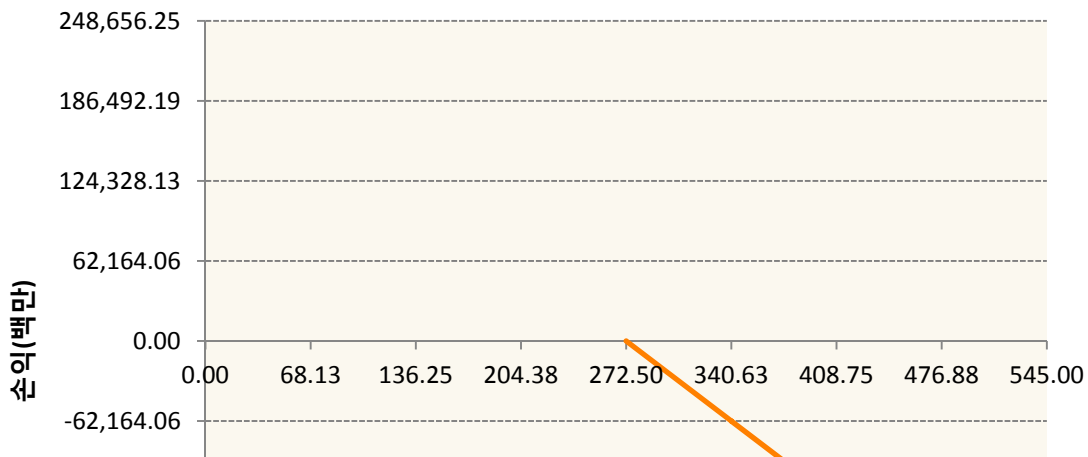
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	614,506	-614,506	장내

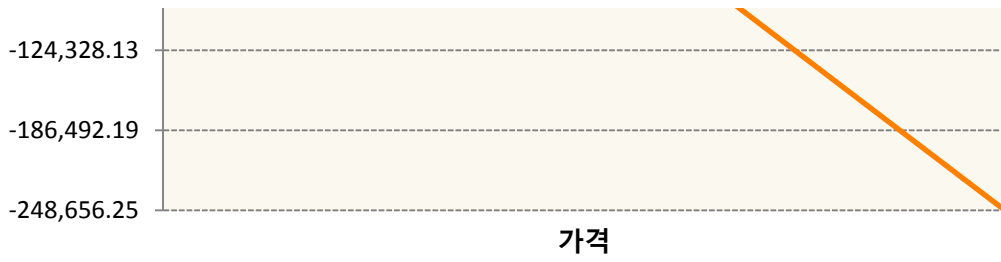
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P62701-2019-06 콜270



KR4201P62727-2019-06 콜272.5





KR4301P62709-2019-06 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P62701		2019-06 콜270					9,053
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,282	3,209	3,110	2,988	2,843	2,679	2,496
-5.33%	3,030	2,866	2,676	2,464	2,234	1,987	1,728
-2.67%	2,386	2,109	1,817	1,513	1,199	877	550
0%	1,095	732	367	0	-369	-738	-1,109
2.67%	-1,015	-1,390	-1,766	-2,143	-2,521	-2,900	-3,279
5.33%	-3,931	-4,243	-4,568	-4,902	-5,244	-5,592	-5,945
8.00%	-7,479	-7,691	-7,929	-8,187	-8,462	-8,752	-9,053
KR4201P62727		2019-06 콜272.5					12,849
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,153	4,071	3,955	3,805	3,622	3,408	3,166

-5.33%	3,887	3,688	3,448	3,173	2,866	2,532	2,175
-2.67%	3,153	2,789	2,395	1,976	1,538	1,084	617
0%	1,577	1,060	534	0	-539	-1,083	-1,630
2.67%	-1,160	-1,739	-2,318	-2,897	-3,476	-4,055	-4,634
5.33%	-5,144	-5,664	-6,196	-6,737	-7,284	-7,837	-8,394
8.00%	-10,186	-10,568	-10,982	-11,421	-11,881	-12,358	-12,849
KR4301P62709 2019-06 풋270							13,798
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-13,612	-13,619	-13,633	-13,657	-13,691	-13,738	-13,798
-5.33%	-8,349	-8,395	-8,459	-8,542	-8,642	-8,760	-8,893
-2.67%	-3,342	-3,494	-3,666	-3,855	-4,058	-4,273	-4,498
0%	851	572	288	0	-290	-583	-877
2.67%	3,613	3,316	3,016	2,715	2,413	2,109	1,804
5.33%	4,920	4,730	4,521	4,298	4,062	3,817	3,564
8.00%	5,344	5,267	5,168	5,048	4,908	4,751	4,578

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

(단위:백만원)

34,736

공시일	2019-05-17
기준일	2019-05-16

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

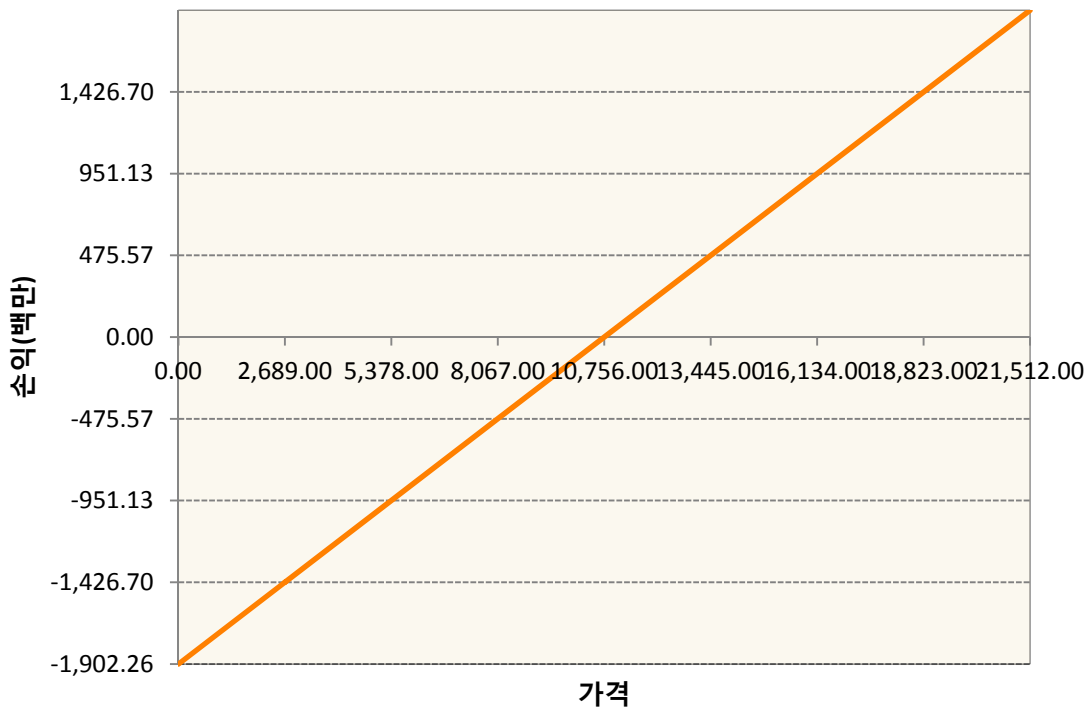
1. 계약금액

(단위:백만원)

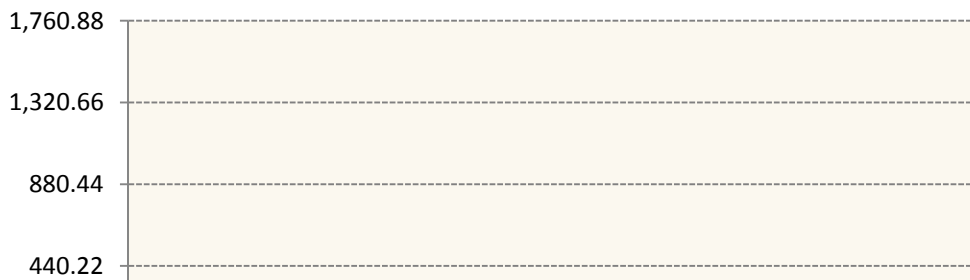
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,902	0	1,902	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,653	-5,653	장내
누계	통화	선도	0	3,188	-3,188	장외

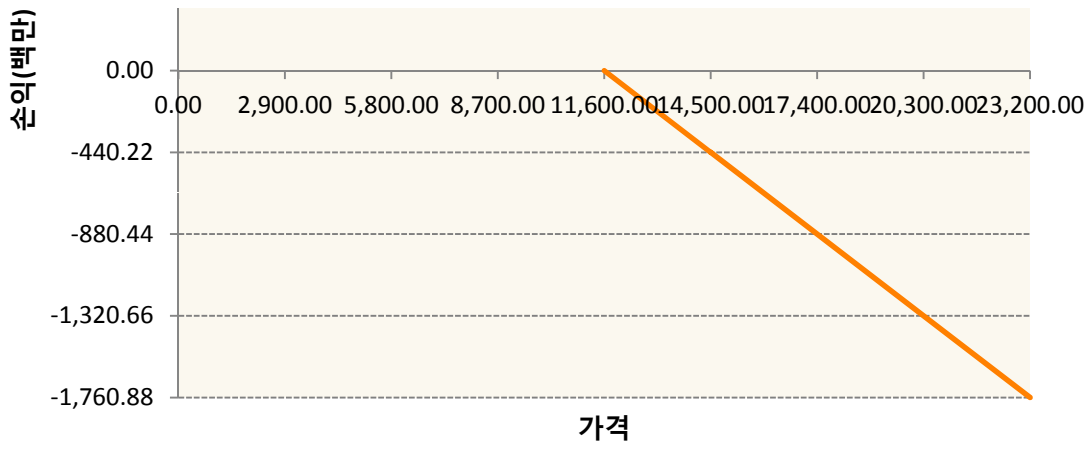
2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19

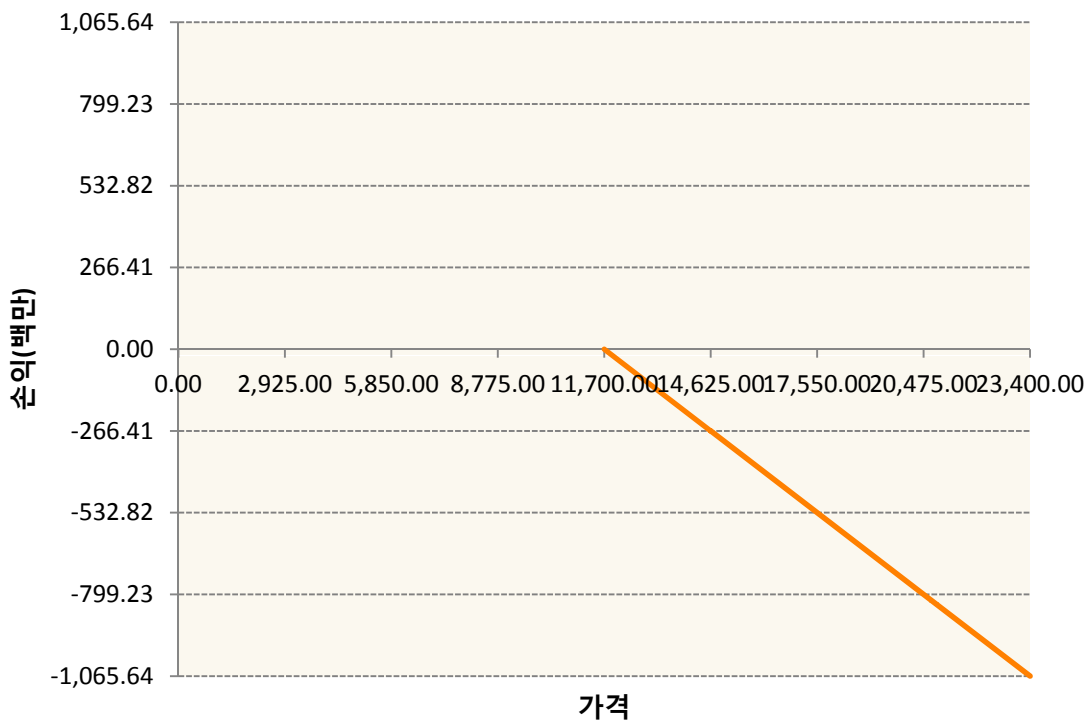


OHHIK9-C116-HSCEI

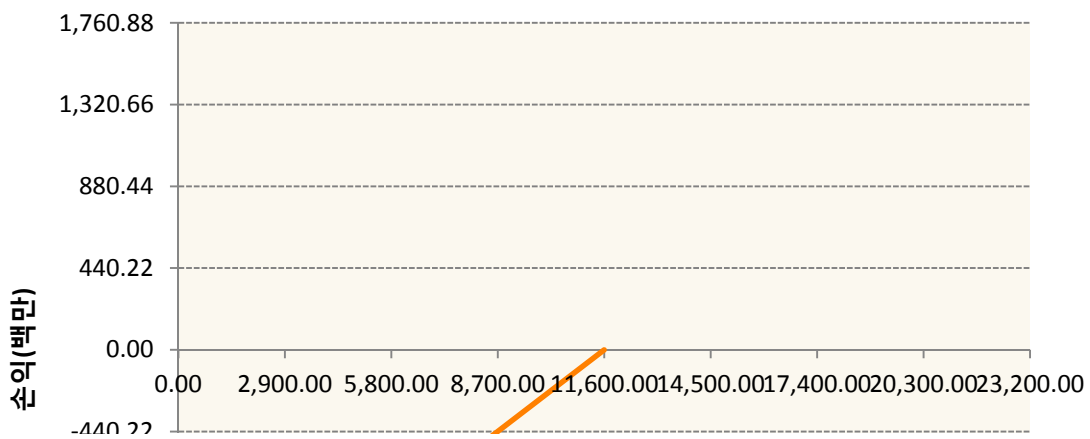


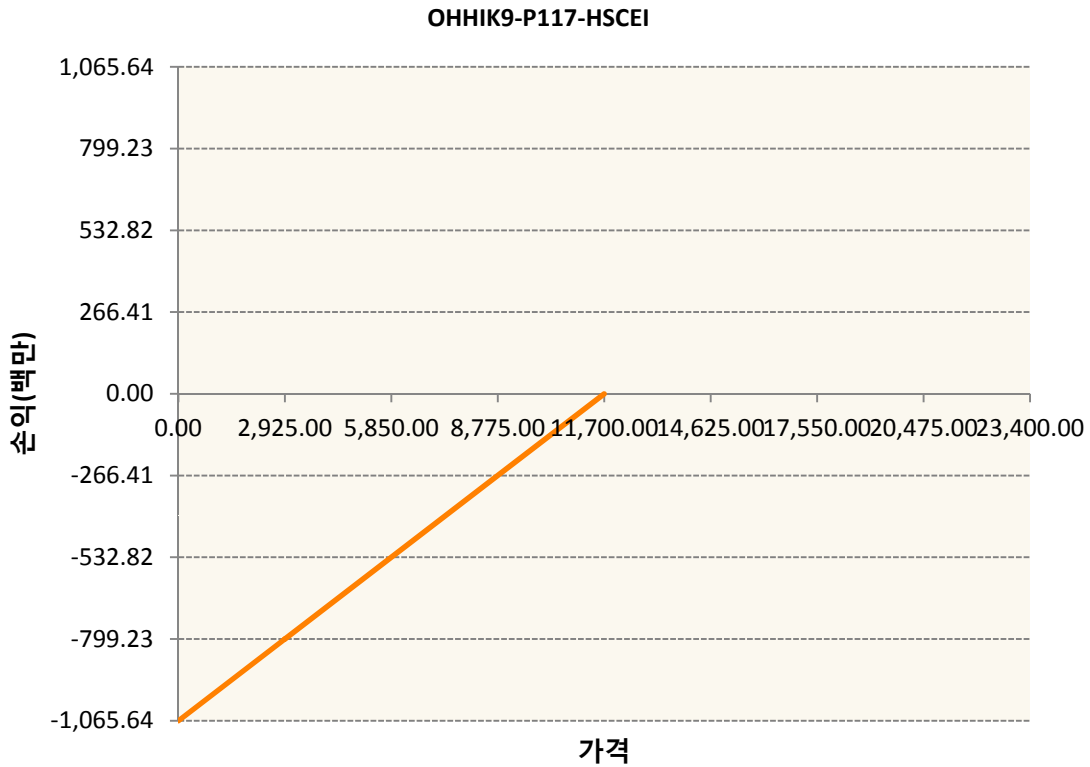


OHHIK9-C117-HSCEI



OHHIK9-P116-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	231
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	24
HCK9 HSCEI Futures May19	152
OHHIK9-C11 HSCEI	141
OHHIK9-C11 HSCEI	85
OHHIK9-P11 HSCEI	141
OHHIK9-P11 HSCEI	85

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

708

공시일	2019-05-17
기준일	2019-05-16

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

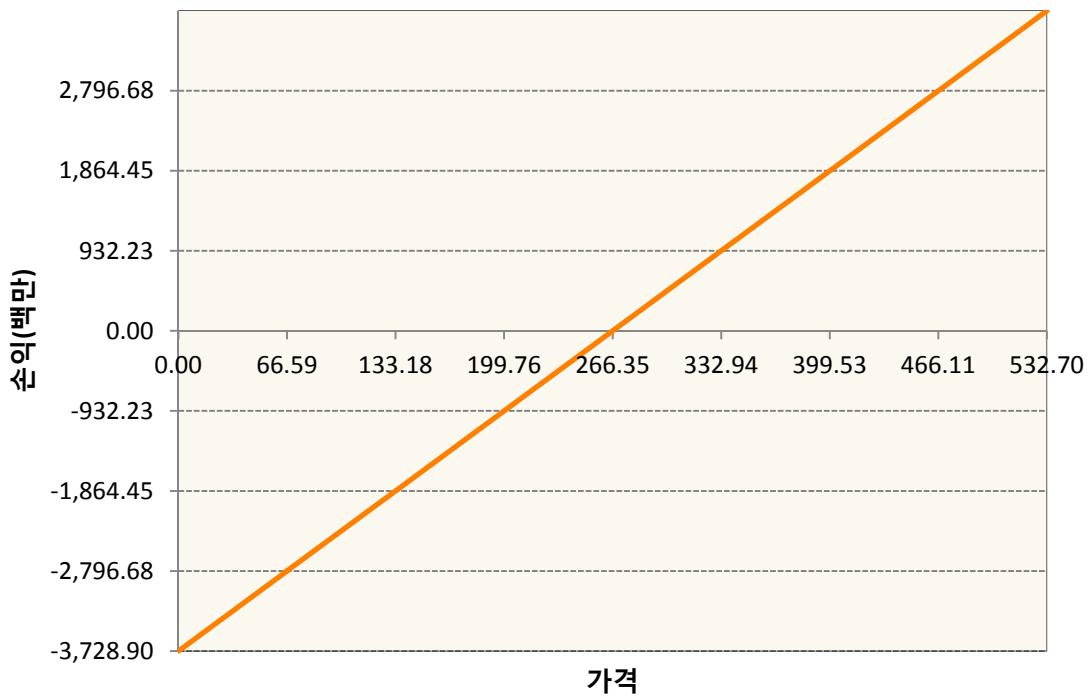
1. 계약금액

(단위:백만원)

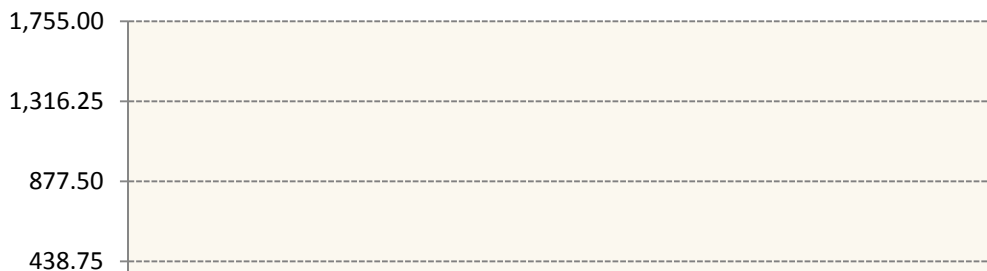
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,729	0	3,729	장내
누계	유가증권	스왑	26,836	0	26,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,476	-25,476	장내

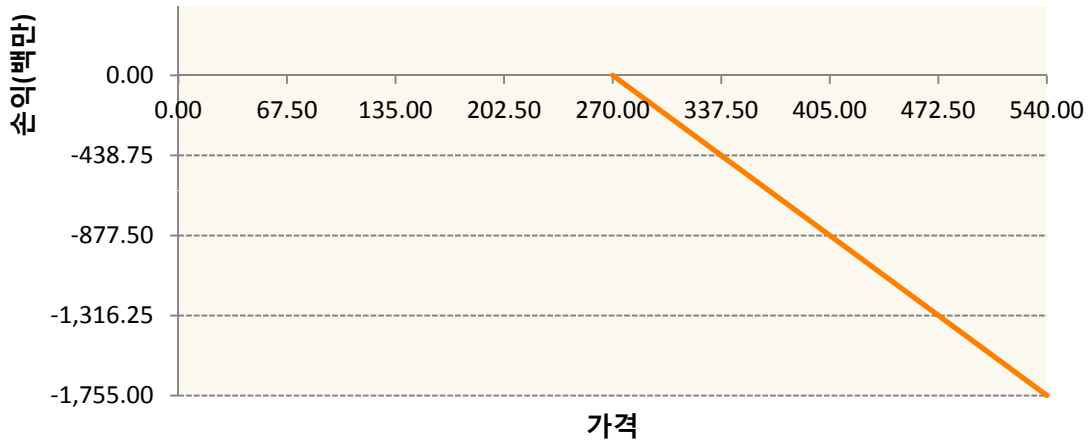
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

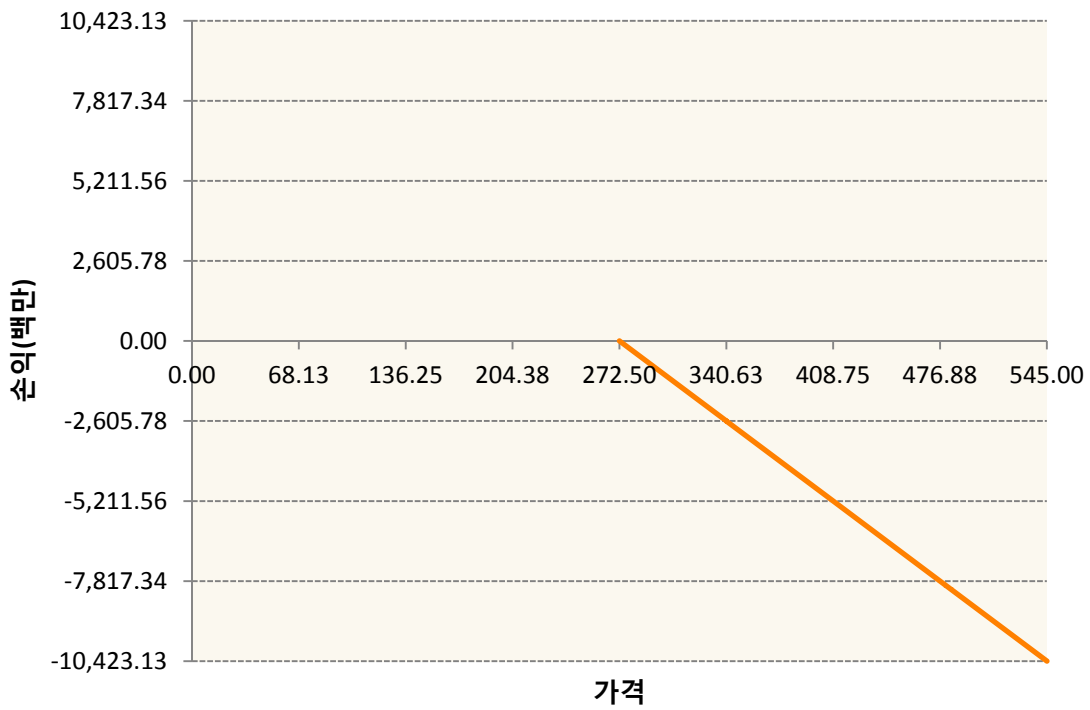


KR4201P62701-2019-06 콜270

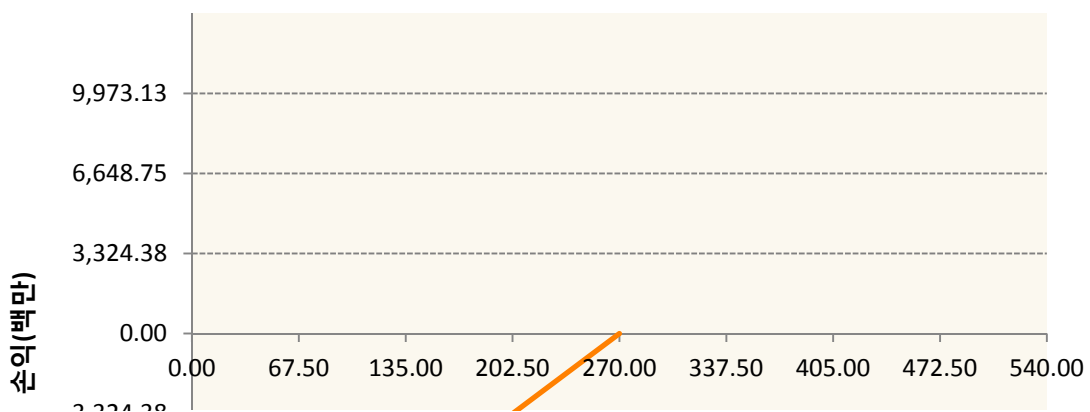


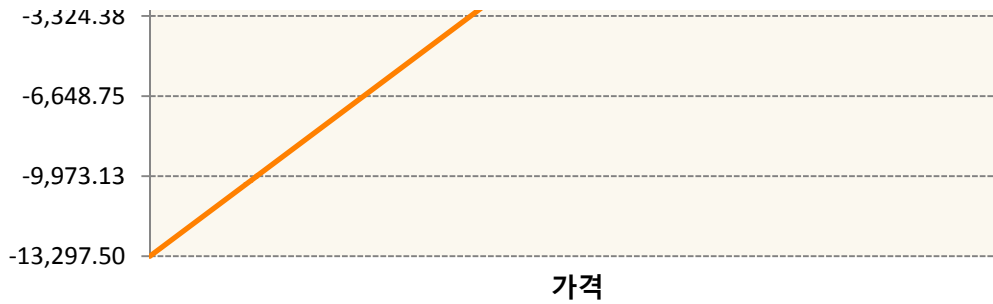


KR4201P62727-2019-06 콜272.5



KR4301P62709-2019-06 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,706
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,706	-1,706	-1,706	-1,706	-1,706	-1,706	-1,706	
-5.33%	-1,137	-1,137	-1,137	-1,137	-1,137	-1,137	-1,137	
-2.67%	-569	-569	-569	-569	-569	-569	-569	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	569	569	569	569	569	569	569	
5.33%	1,137	1,137	1,137	1,137	1,137	1,137	1,137	
8.00%	1,706	1,706	1,706	1,706	1,706	1,706	1,706	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						602
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-602	-602	-602	-602	-602	-602	-602	
-5.33%	-401	-401	-401	-401	-401	-401	-401	
-2.67%	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-201	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	201	201	201	201	201	201	201	
5.33%	401	401	401	401	401	401	401	
8.00%	602	602	602	602	602	602	602	
KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						298
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-298	-298	-298	-298	-298	-298	-298	
-5.33%	-199	-199	-199	-199	-199	-199	-199	
-2.67%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	99	99	99	99	99	99	99	
5.33%	199	199	199	199	199	199	199	
8.00%	298	298	298	298	298	298	298	
KR4201P62701		2019-06 콜270						97
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	35	34	33	32	31	29	27
-5.33%	33	31	29	26	24	21	19
-2.67%	26	23	20	16	13	9	6
0%	12	8	4	0	-4	-8	-12
2.67%	-11	-15	-19	-23	-27	-31	-35
5.33%	-42	-46	-49	-53	-56	-60	-64
8.00%	-80	-83	-85	-88	-91	-94	-97

KR4201P62727 2019-06 콜272.5 539

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	174	171	166	159	152	143	133
-5.33%	163	155	145	133	120	106	91
-2.67%	132	117	100	83	64	45	26
0%	66	44	22	0	-23	-45	-68
2.67%	-49	-73	-97	-121	-146	-170	-194
5.33%	-216	-237	-260	-282	-305	-328	-352
8.00%	-427	-443	-460	-479	-498	-518	-539

KR4301P62709 2019-06 풋270 906

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-894	-894	-895	-897	-899	-902	-906
-5.33%	-548	-551	-555	-561	-568	-575	-584
-2.67%	-219	-229	-241	-253	-266	-281	-295
0%	56	38	19	0	-19	-38	-58
2.67%	237	218	198	178	158	138	118
5.33%	323	311	297	282	267	251	234
8.00%	351	346	339	331	322	312	301

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

(단위:백만원)

4,111

공시일	2019-05-17
기준일	2019-05-16

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

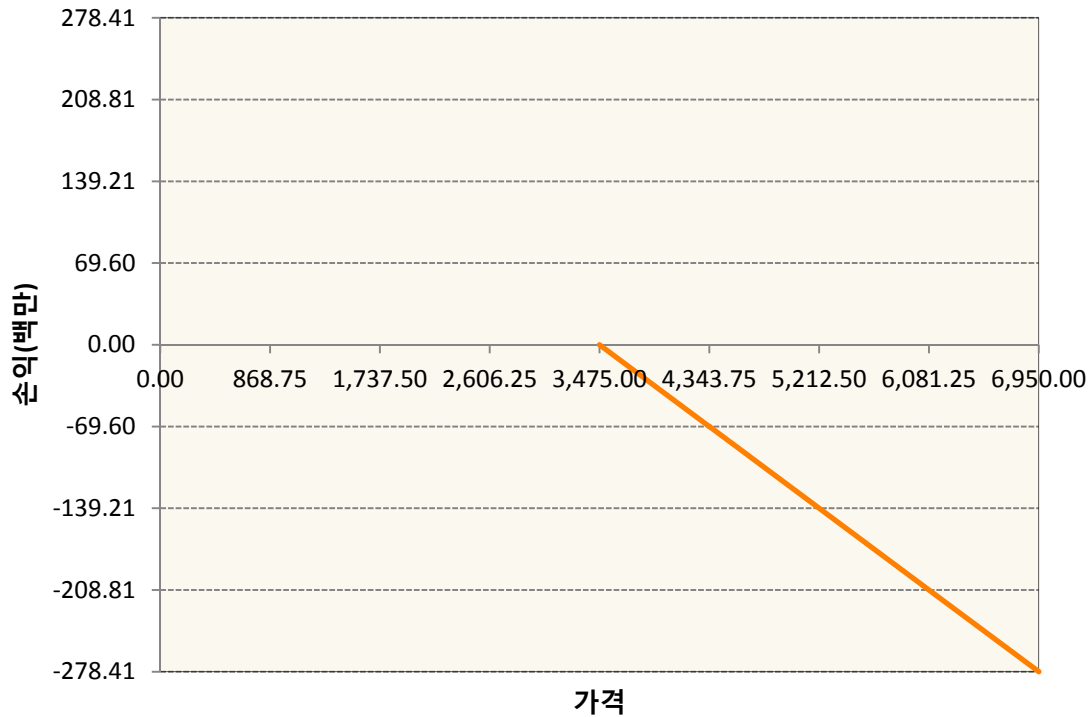
1. 계약금액

(단위:백만원)

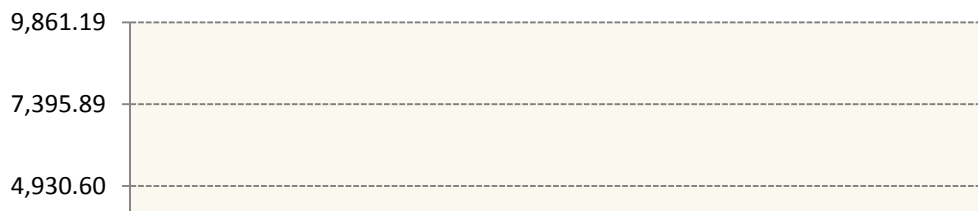
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,662	0	3,662	
누계	유가증권	스왑	56,523	0	56,523	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,279	-20,279	장내
누계	통화	선도	0	18,694	-18,694	장외

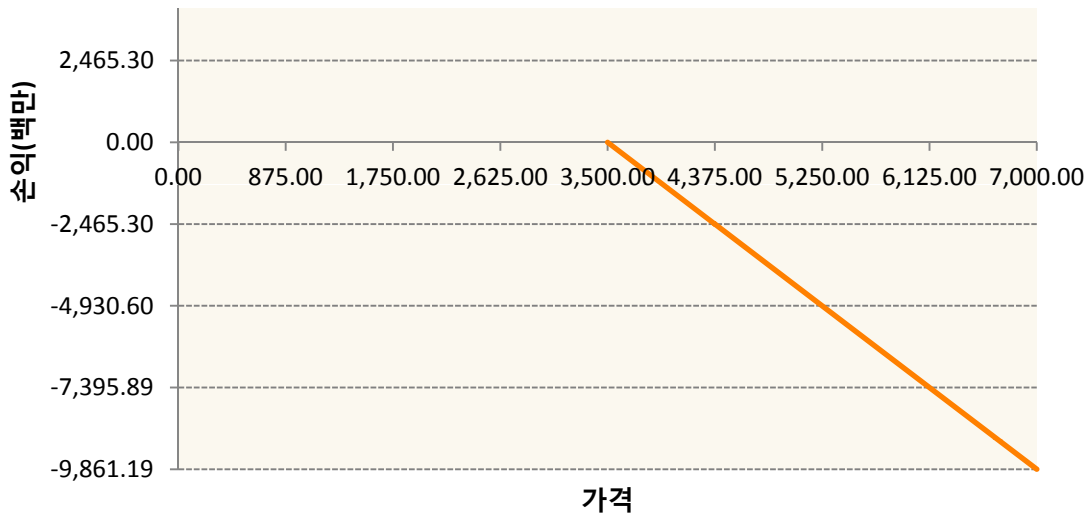
2. 만기시점의 손익구조

OESXK9-C3475-EURO STOXX 50

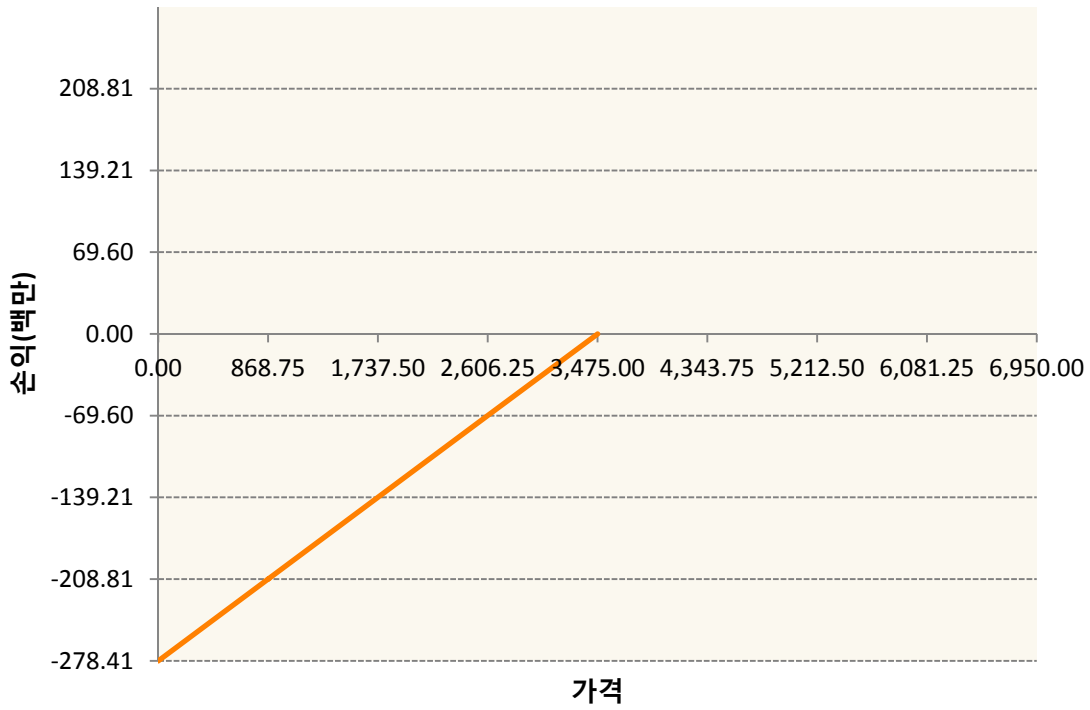


OESXK9-C3500-EURO STOXX 50

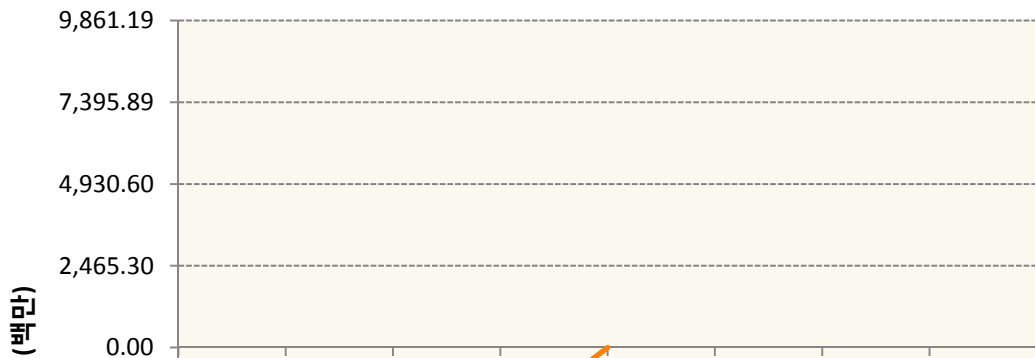


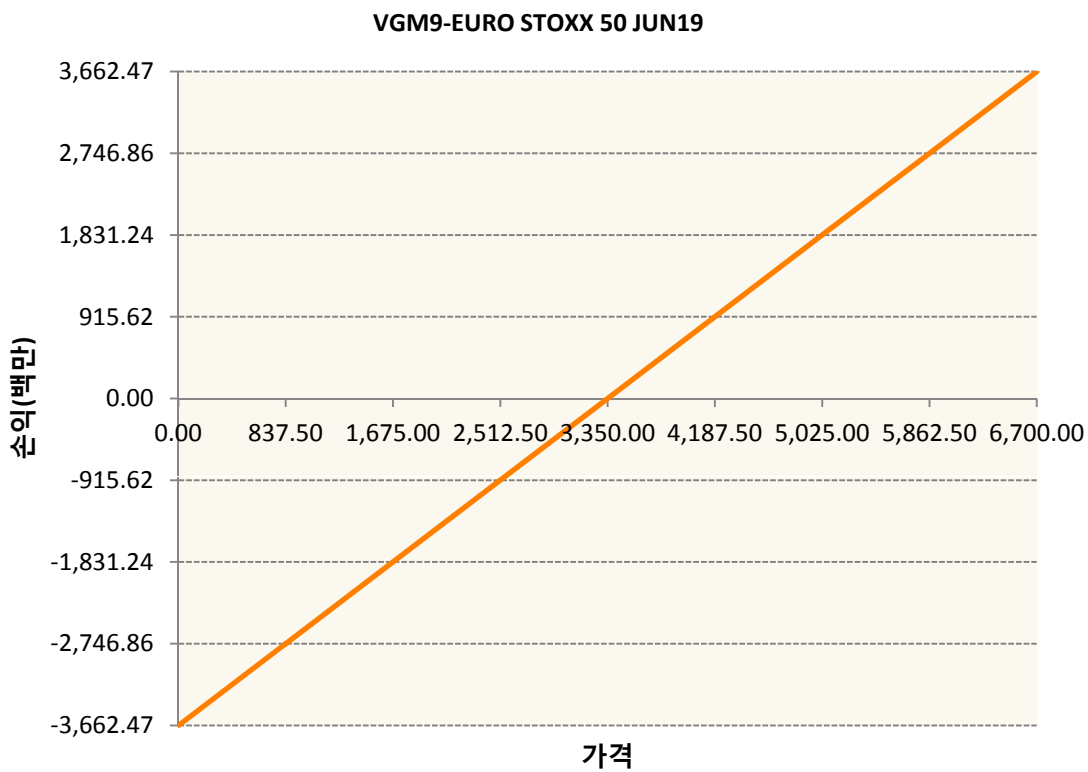
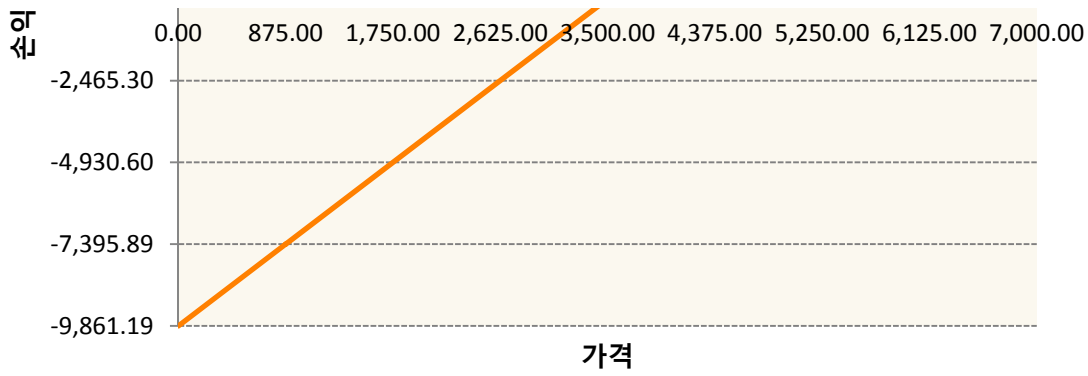


OESXK9-P3475-EURO STOXX 50



OESXK9-P3500-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	87
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	427
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	855
FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E	214
OESXK9-C34 EURO STOXX 50	22
OESXK9-C35 EURO STOXX 50	789
OESXK9-P34 EURO STOXX 50	22
OESXK9-P35 EURO STOXX 50	789
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	293

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

(단위:백만원)

2,211

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

(단위:백만원)

1,022

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

(단위:백만원)

90

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

(단위:백만원)

131

공시일	2019-05-17
기준일	2019-05-16

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

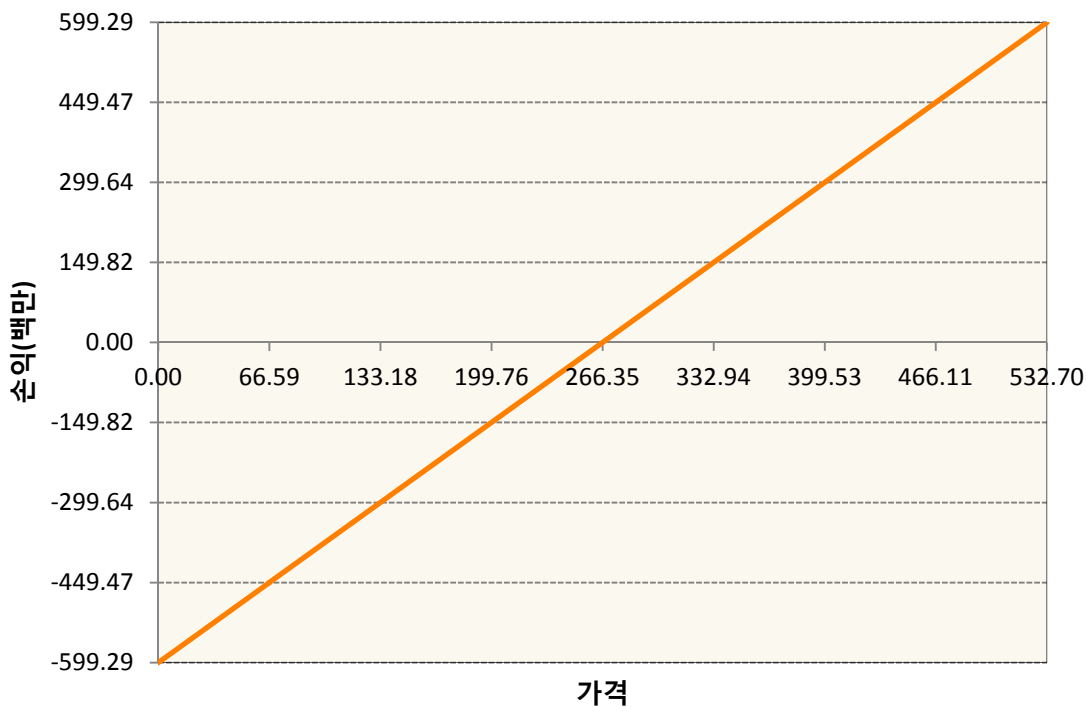
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	599	0	599	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	2019-05-17
기준일	2019-05-16

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

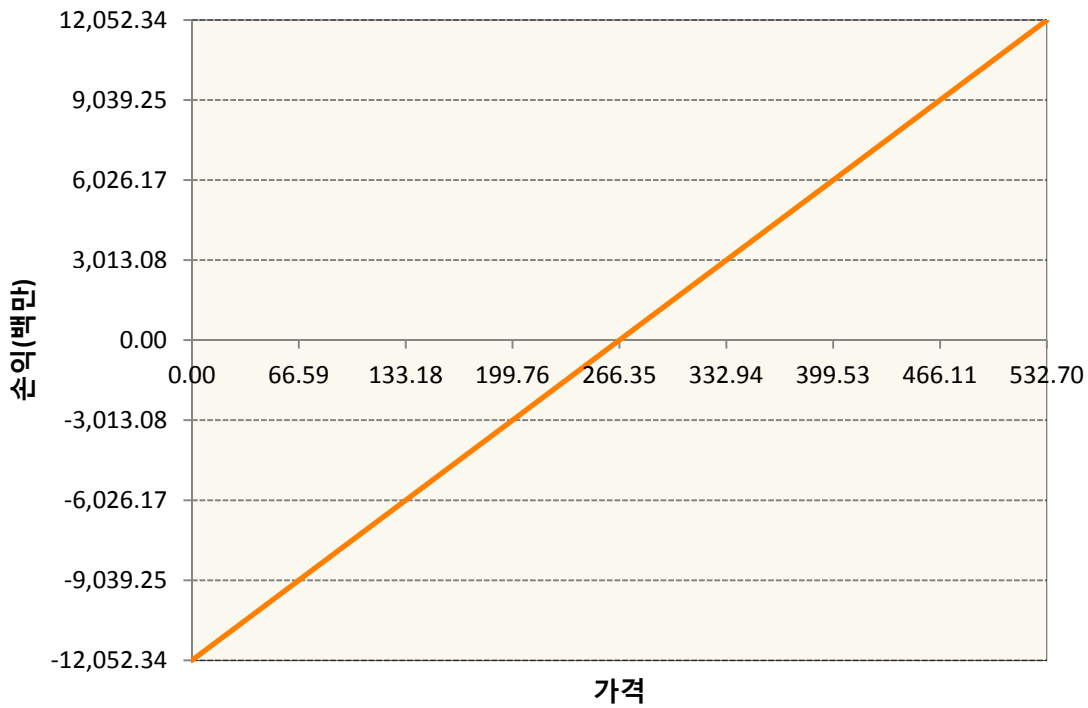
1. 계약금액

(단위:백만원)

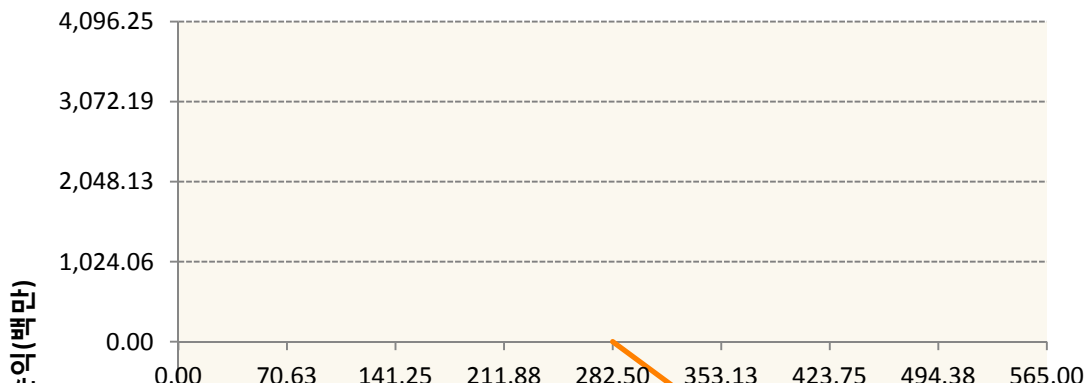
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,052	0	12,052	장내
누계	유가증권	옵션	5,081	22,906	-17,825	장내

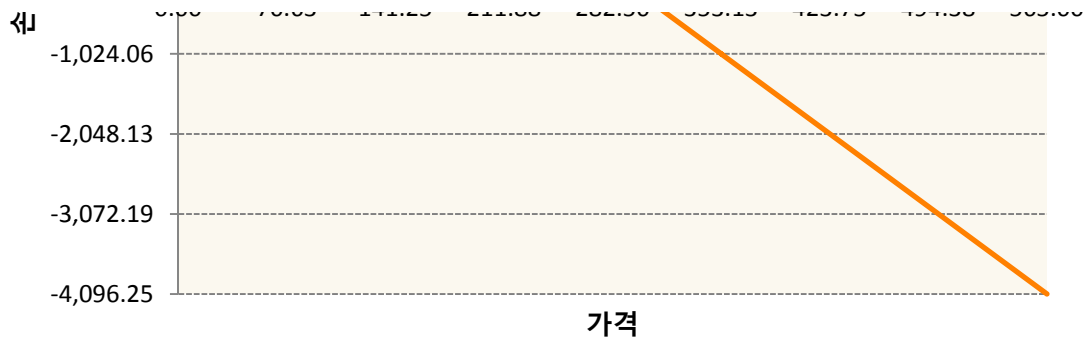
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

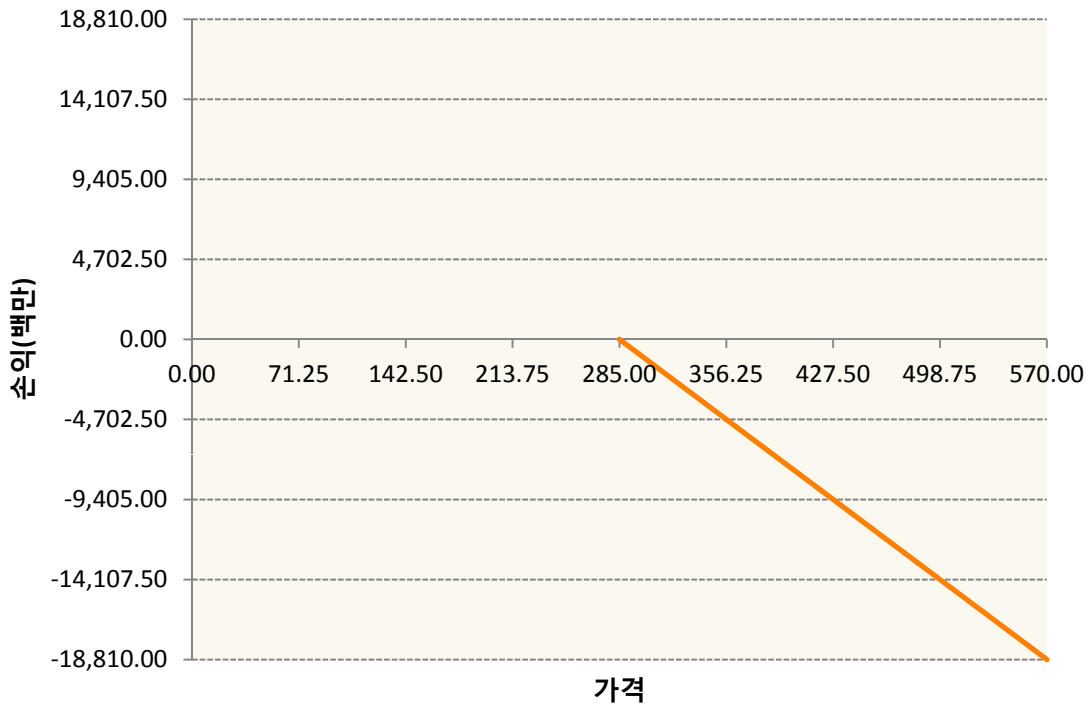


KR4201P62826-2019-06 콜282.5

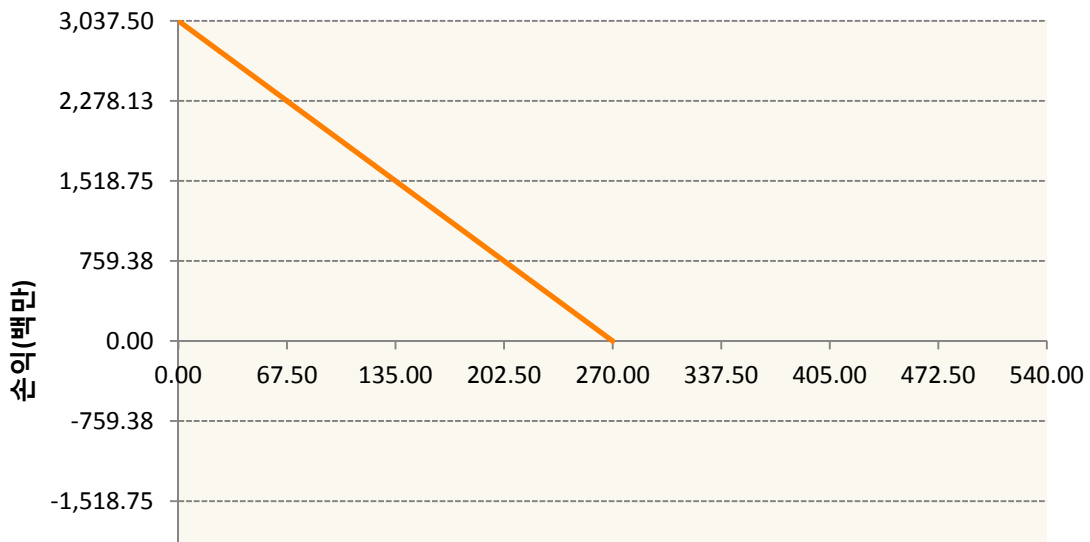


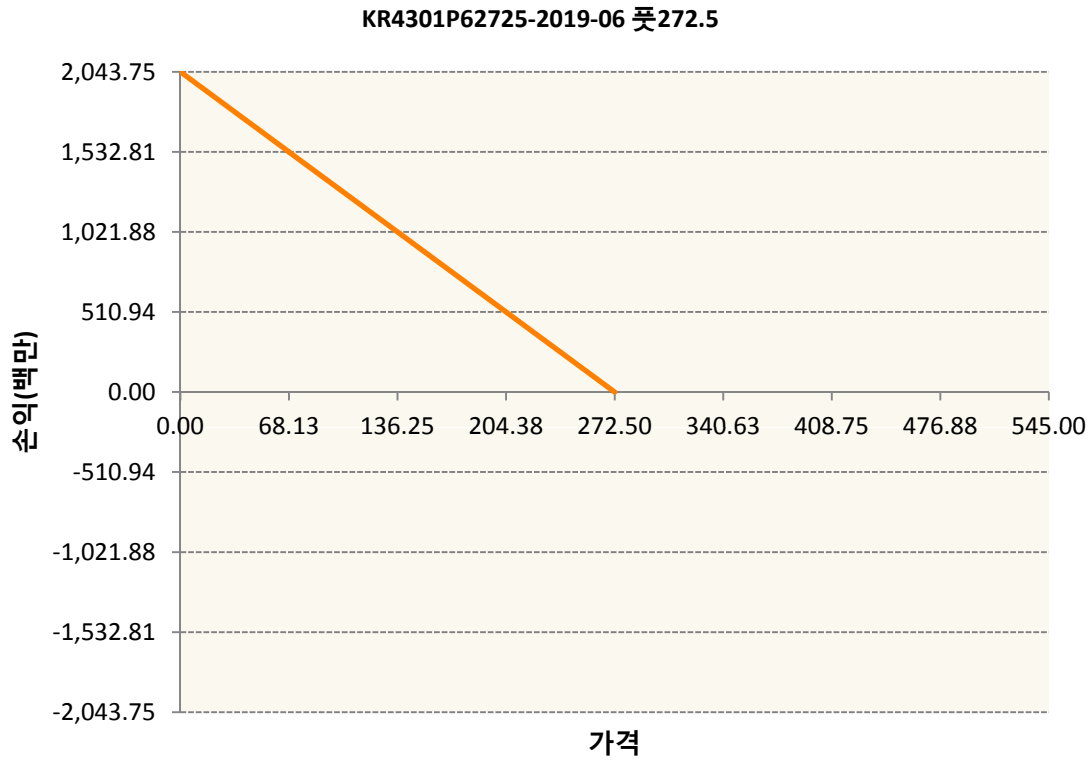
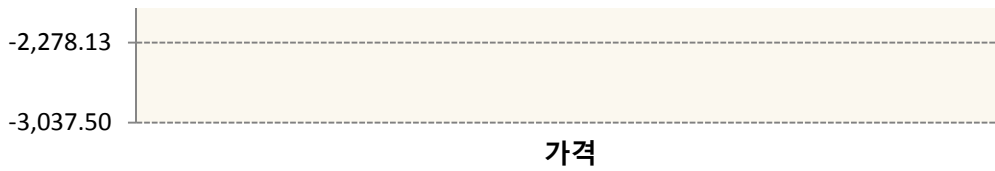


KR4201P62859-2019-06 콜285



KR4301P62709-2019-06 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						963
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-963	-963	-963	-963	-963	-963	-963	
-5.33%	-642	-642	-642	-642	-642	-642	-642	
-2.67%	-321	-321	-321	-321	-321	-321	-321	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	321	321	321	321	321	321	321	
5.33%	642	642	642	642	642	642	642	
8.00%	963	963	963	963	963	963	963	
KR4201P62826		2019-06 콜282.5						150
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	29	29	29	28	26	25	23	
-5.33%	29	28	26	24	21	18	15	
-2.67%	26	23	20	16	11	7	1	

0%	17	12	6	0	-7	-13	-21
2.67%	-3	-11	-19	-27	-35	-44	-52
5.33%	-39	-48	-58	-67	-77	-86	-95
8.00%	-94	-103	-113	-122	-131	-141	-150
KR4201P62859 2019-06 콜285							623
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	107	106	104	101	97	90	82
-5.33%	105	101	96	88	79	67	53
-2.67%	95	86	74	59	42	22	0
0%	66	47	25	0	-27	-55	-86
2.67%	-4	-36	-69	-104	-140	-176	-214
5.33%	-140	-182	-223	-265	-307	-350	-392
8.00%	-361	-404	-448	-492	-535	-579	-623
KR4301P62709 2019-06 풋270							207
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	204	204	204	205	205	206	207
-5.33%	125	126	127	128	130	131	133
-2.67%	50	52	55	58	61	64	67
0%	-13	-9	-4	0	4	9	13
2.67%	-54	-50	-45	-41	-36	-32	-27
5.33%	-74	-71	-68	-64	-61	-57	-53
8.00%	-80	-79	-78	-76	-74	-71	-69
KR4301P62725 2019-06 풋272.5							143
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	142	142	142	142	143	143	143
-5.33%	89	90	90	91	91	92	93
-2.67%	38	39	40	42	44	45	47
0%	-8	-5	-3	0	3	5	8
2.67%	-41	-38	-34	-31	-28	-25	-22
5.33%	-58	-56	-54	-51	-48	-46	-43
8.00%	-65	-64	-63	-61	-59	-57	-55

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

(단위:백만원)

1,633

공시일	2019-05-17
기준일	2019-05-16

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	238	0	238	
누계	유가증권	수익증권	10,176	0	10,176	

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	2019-05-17
기준일	2019-05-16

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	596	0	596	
누계	유가증권	수익증권	60,168	0	60,168	

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	2019-05-17
기준일	2019-05-16

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	5,957	0	5,957	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	229,426	0	229,426	
누계	통화	선도	0	293,919	-293,919	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		1,334
FX21019J019 KRW/USD 17-05-19E		1,430
FX21019J019 KRW/USD 18-06-19E		381
FX21019J020 KRW/USD 20-05-19E		515
FX21019J021 KRW/USD 20-05-19E		484
FX21019J024 KRW/USD 24-06-19E		953
FX21019J024 KRW/USD 22-05-19E		801
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		953
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		1,010
FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E		381
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		76
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		1,003
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E		1,029
FX21019J041 KRW/USD 28-05-19E		286
FX21019J043 KRW/USD 03-06-19E		572
FX21019J044 KRW/USD 03-06-19E		477
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		286
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		477
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		667
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		667
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		829

FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E	820
FX21019K00 KRW/USD 18-06-19E	572
FX21019K01 KRW/USD 14-06-19E	667
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E	572
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E	477
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E	572
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E	1,430
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E	1,334
FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E	477
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E	801
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E	637

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

(단위:백만원)

7,968

공시일	2019-05-17
기준일	2019-05-16

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

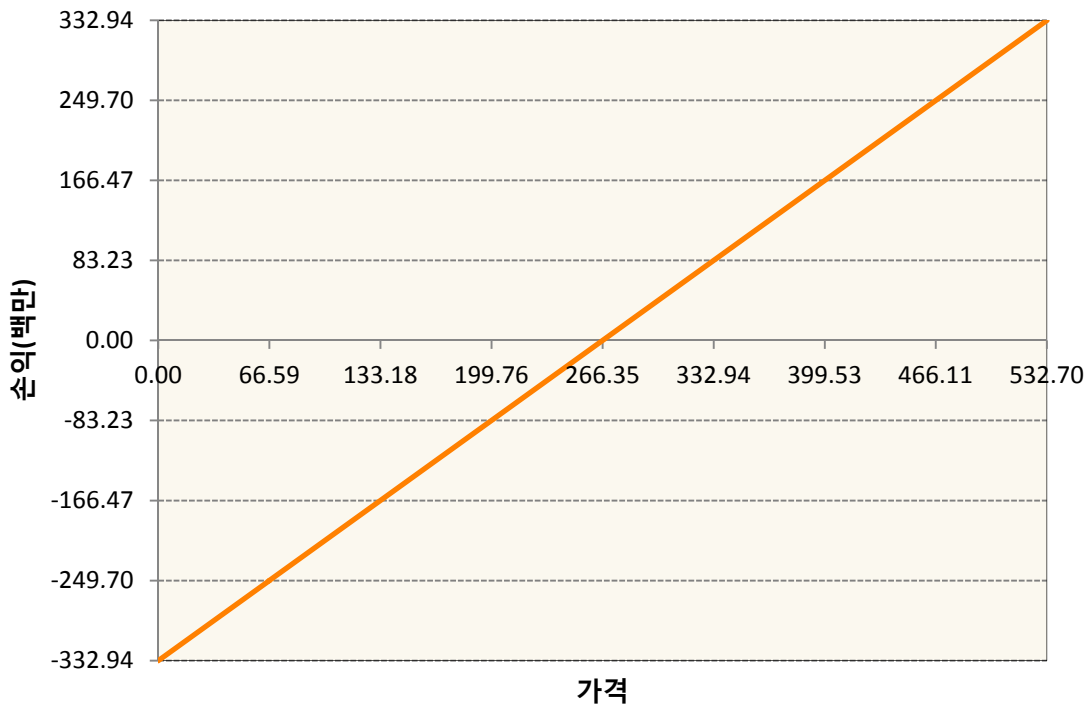
1. 계약금액

(단위:백만원)

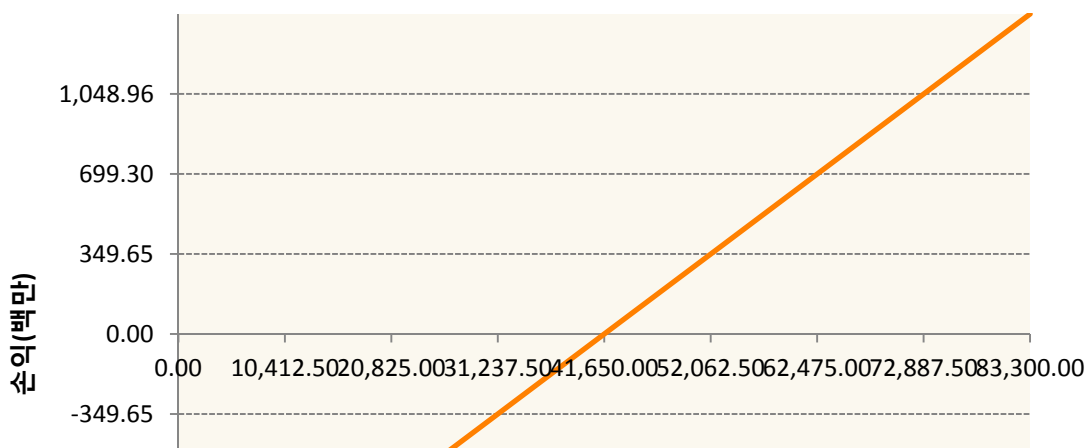
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,732	0	1,732	장내

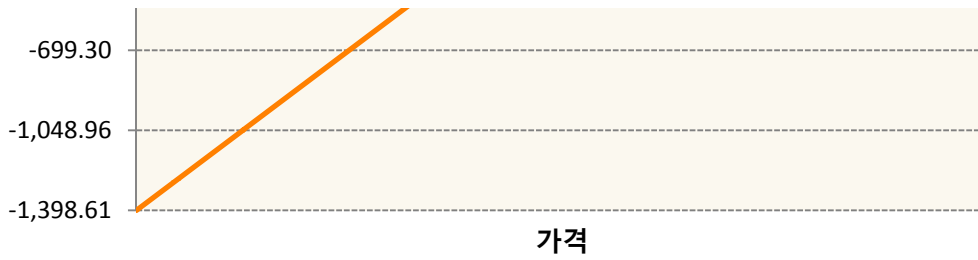
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4111P60003-2019-06 삼성전자개별선물





3. 시나리오 별 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						112
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-112	-112	-112	-112	-112	-112	-112	
-5.33%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74	
-2.67%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	37	37	37	37	37	37	37	
5.33%	74	74	74	74	74	74	74	
8.00%	112	112	112	112	112	112	112	

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

153

공시일	2019-05-17
기준일	2019-05-16

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

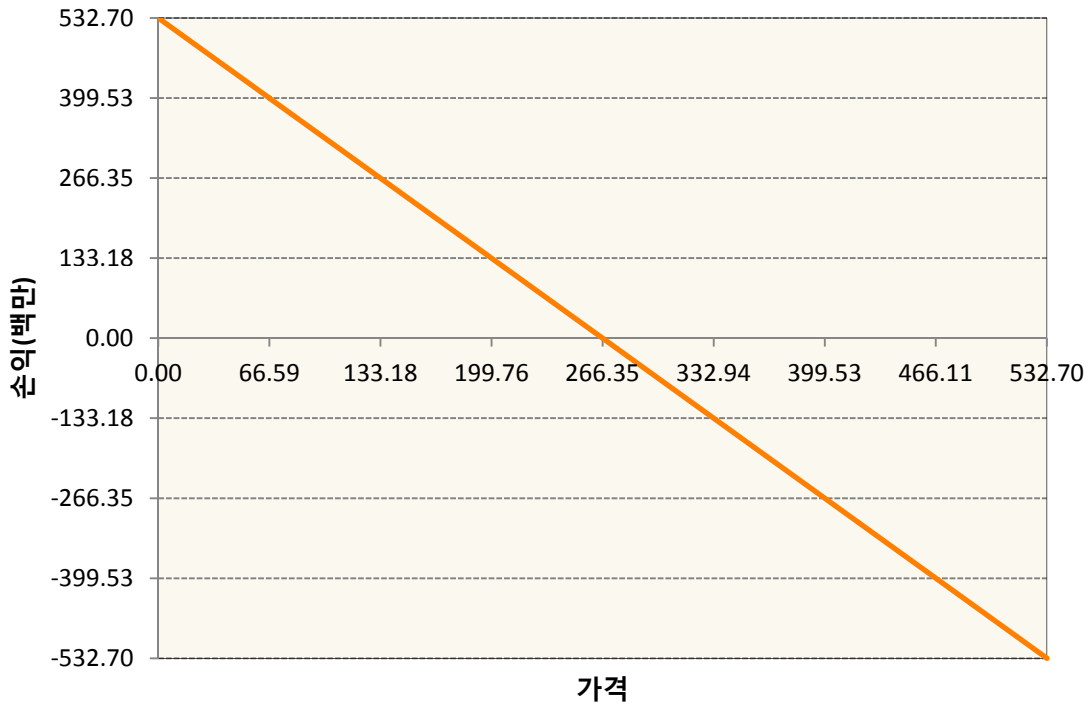
1. 계약금액

(단위:백만원)

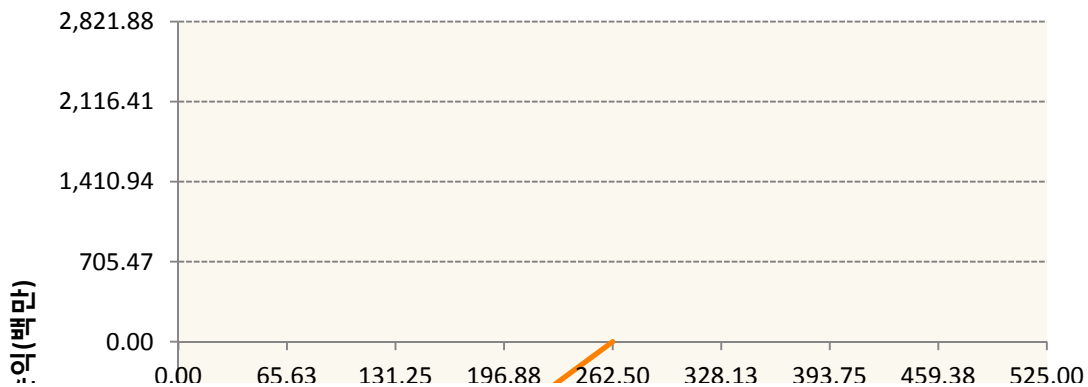
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	200	-200	장내
누계	유가증권	선물	0	533	-533	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,352	-3,352	장내

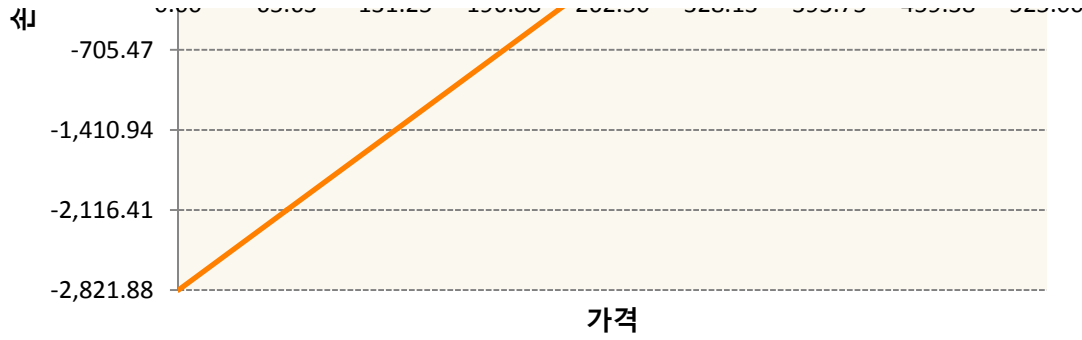
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

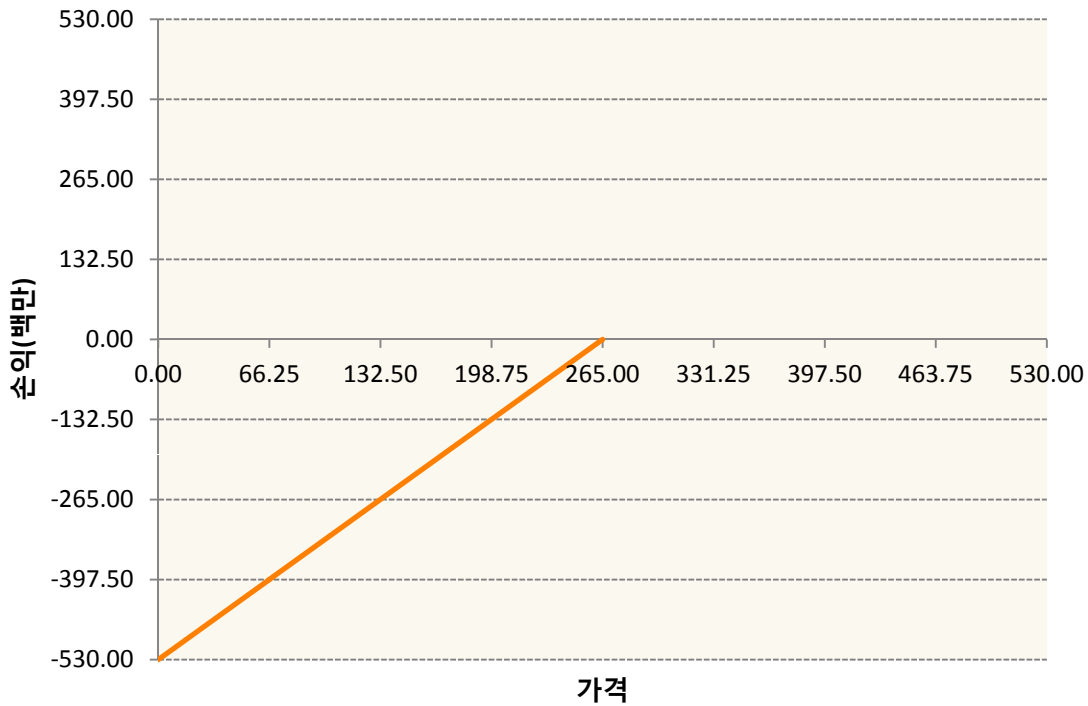


KR4301P62626-2019-06 풋262.5





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%	28	28	28	28	28	28	28	
-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%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28	
8.00%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43	
KR4301P62626		2019-06 풋262.5						165
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-157	-158	-159	-160	-161	-163	-165
-5.33%	-86	-88	-90	-93	-96	-99	-102
-2.67%	-26	-30	-34	-38	-42	-46	-50
0%	12	8	4	0	-4	-8	-13
2.67%	30	27	24	21	18	15	12
5.33%	35	34	33	31	29	27	25
8.00%	36	36	35	35	34	33	32
KR4301P62659 2019-06 풋265							33
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32	-32	-32	-32	-32	-33	-33
-5.33%	-18	-19	-19	-19	-20	-20	-21
-2.67%	-6	-7	-8	-8	-9	-10	-10
0%	2	2	1	0	-1	-2	-2
2.67%	7	6	6	5	4	4	3
5.33%	8	8	8	8	7	7	6
8.00%	9	9	9	8	8	8	8

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

(단위:백만원)

233

공시일	2019-05-17
기준일	2019-05-16

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

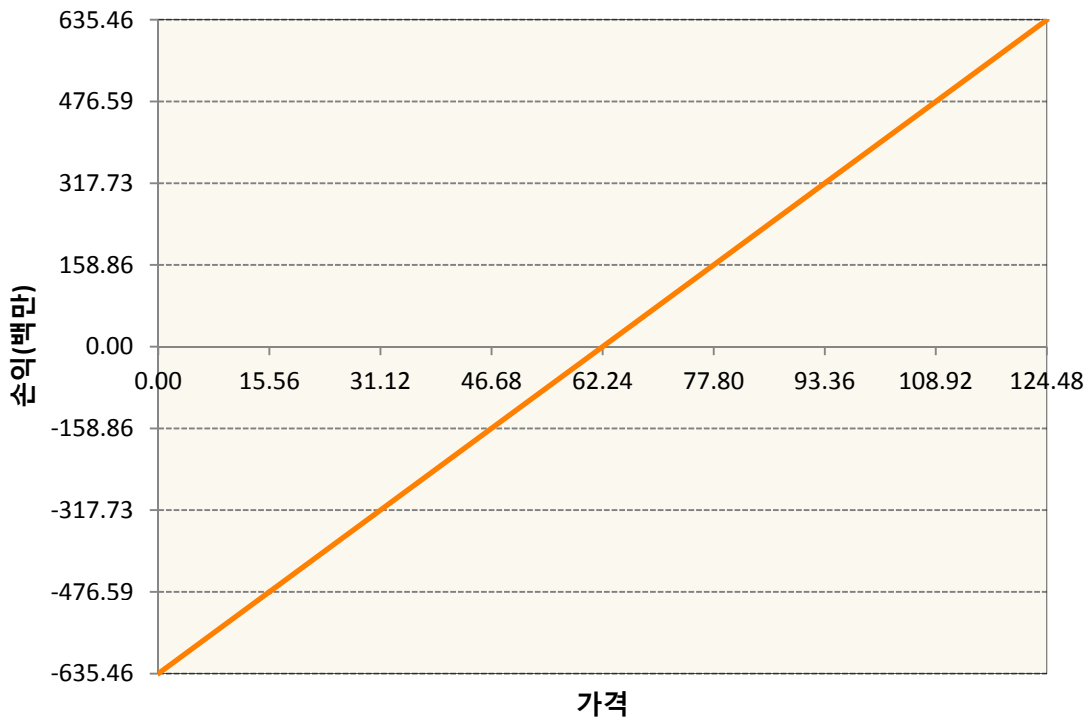
1. 계약금액

(단위:백만원)

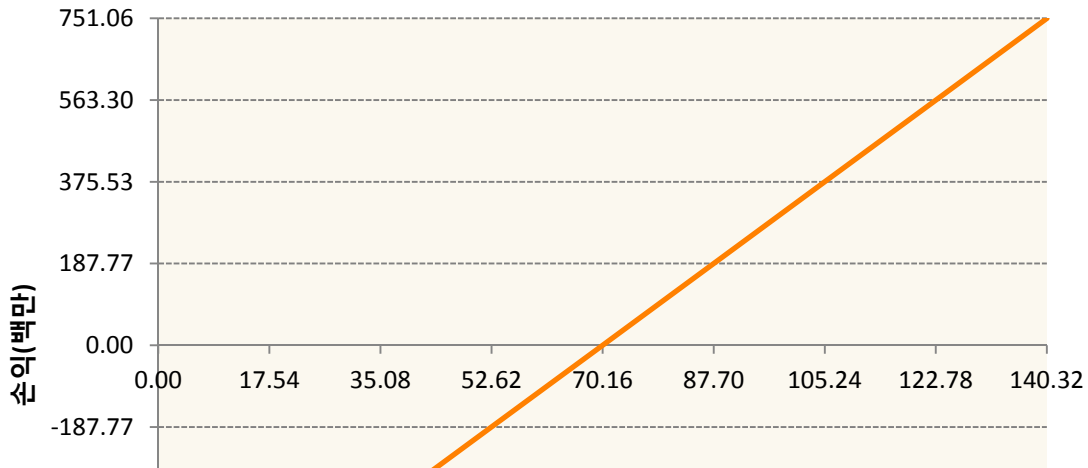
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,791	298	2,493	

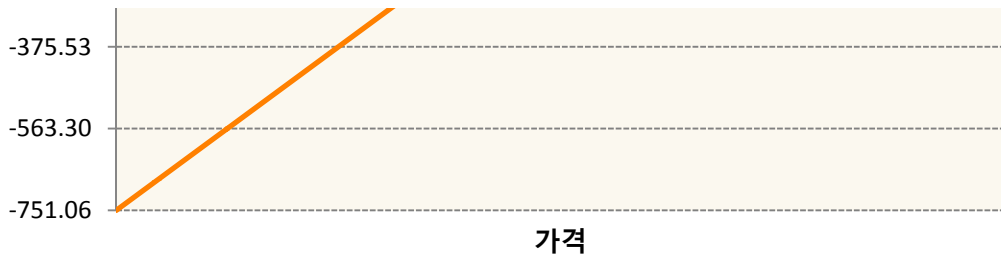
2. 만기시점의 손익구조

CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19

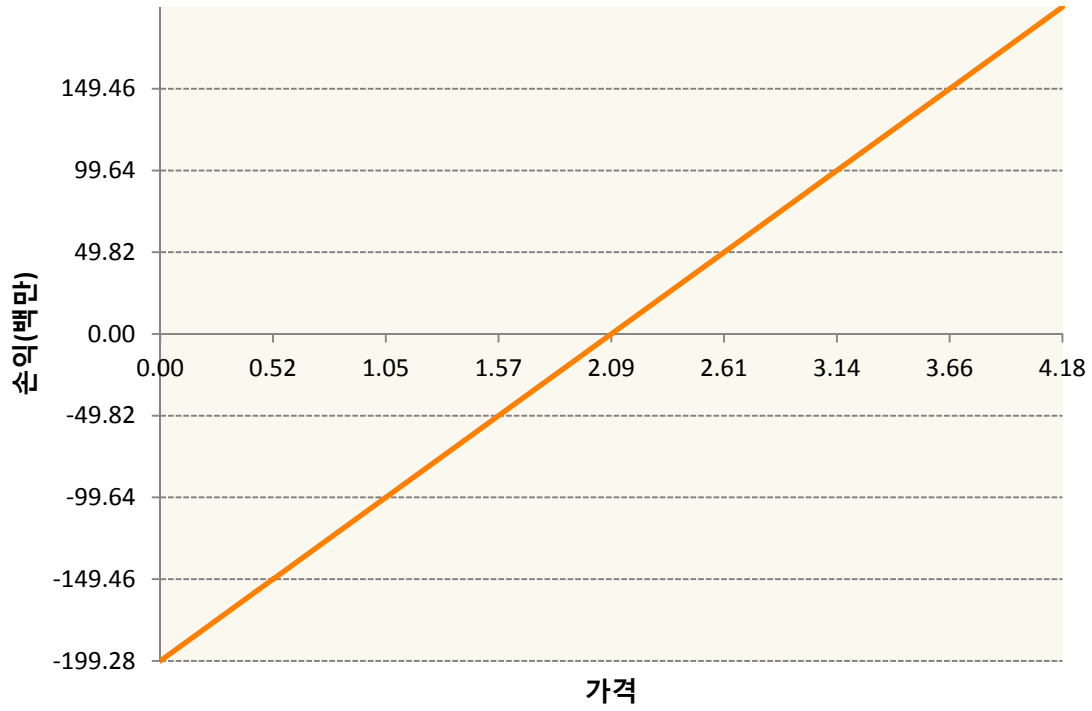


COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19

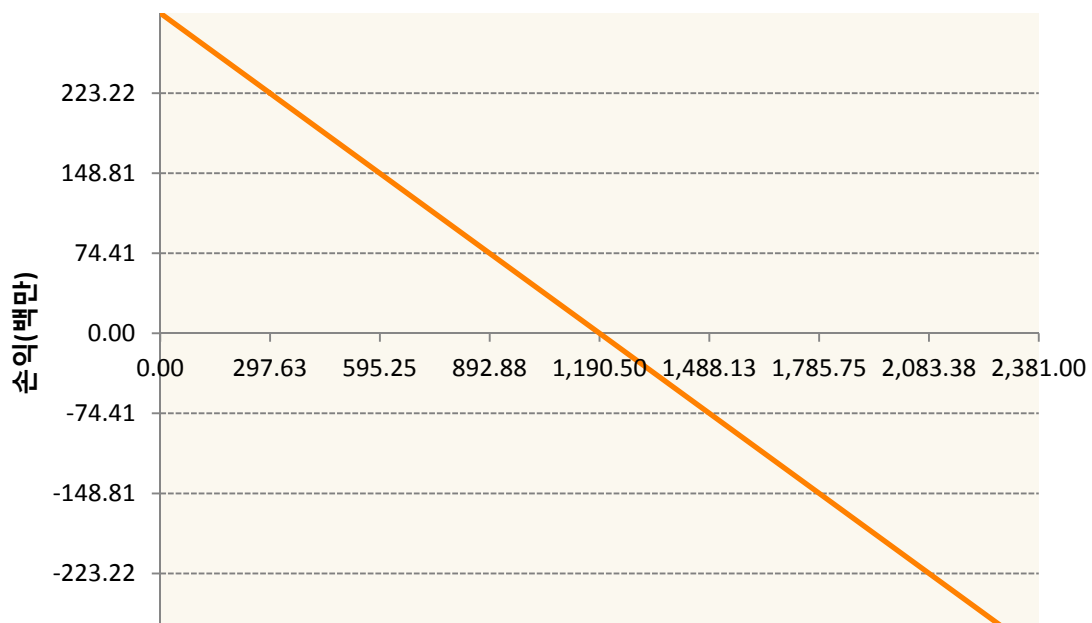


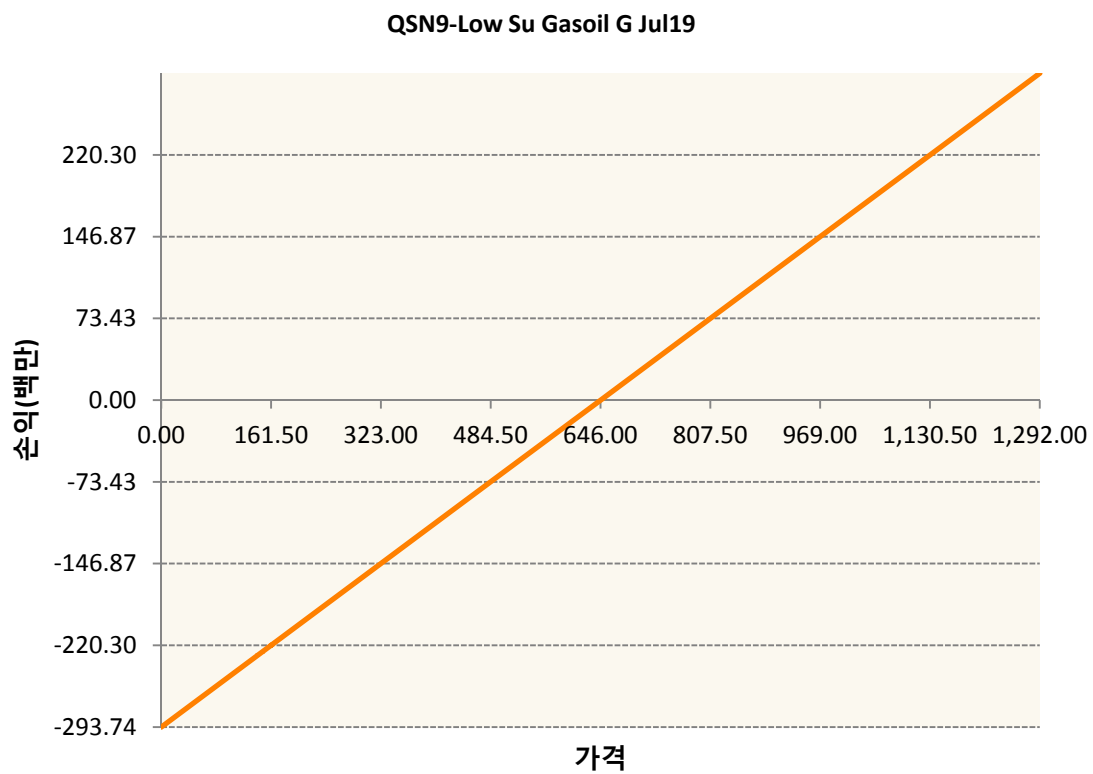
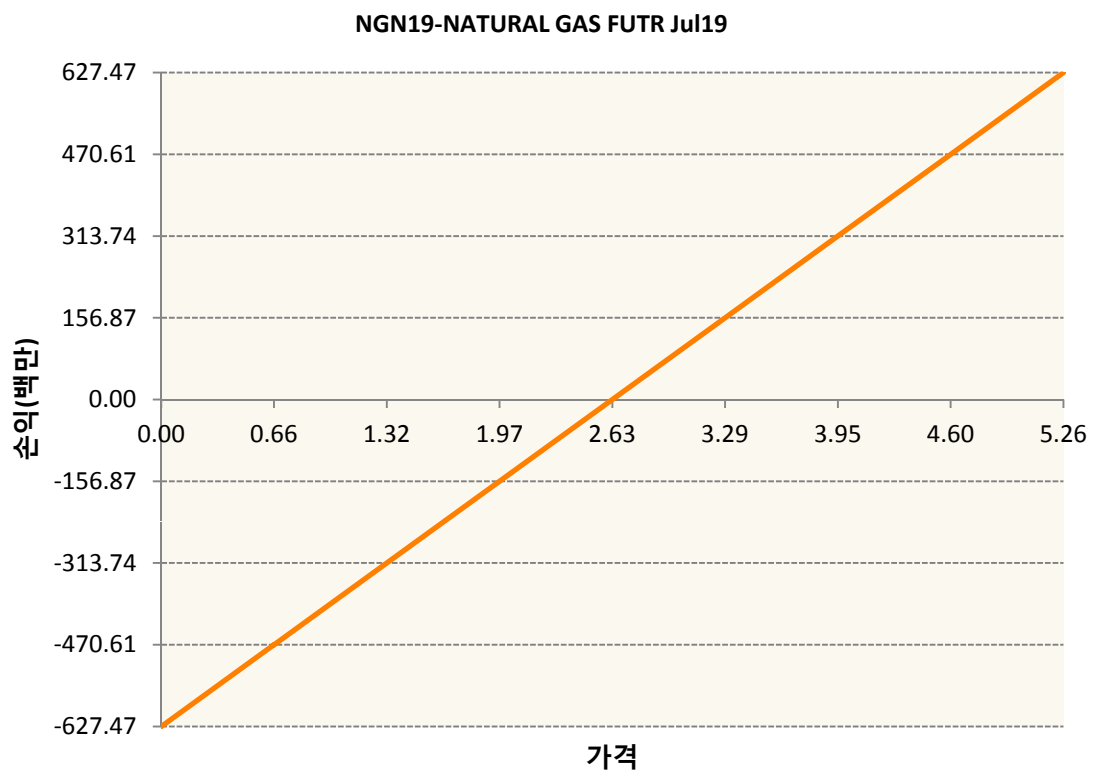
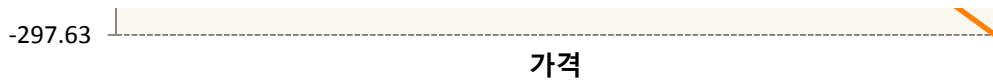


HON9-NY Harb ULSD Fut Jul19

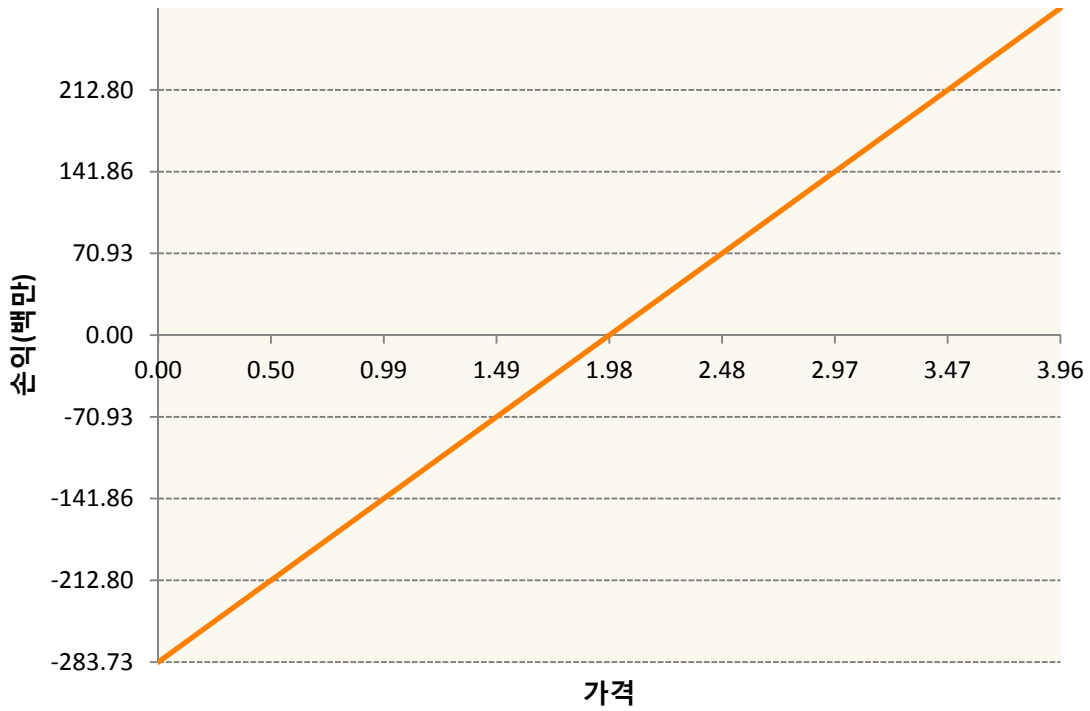


KR4175P50009-2019-05 달러선물





XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN9	WTI CRUDE FUTURE Jul19	51
COU9	BRENT CRUDE FUTR Sep19	60
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	23

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

(단위:백만원)

410

공시일	2019-05-17
기준일	2019-05-16

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

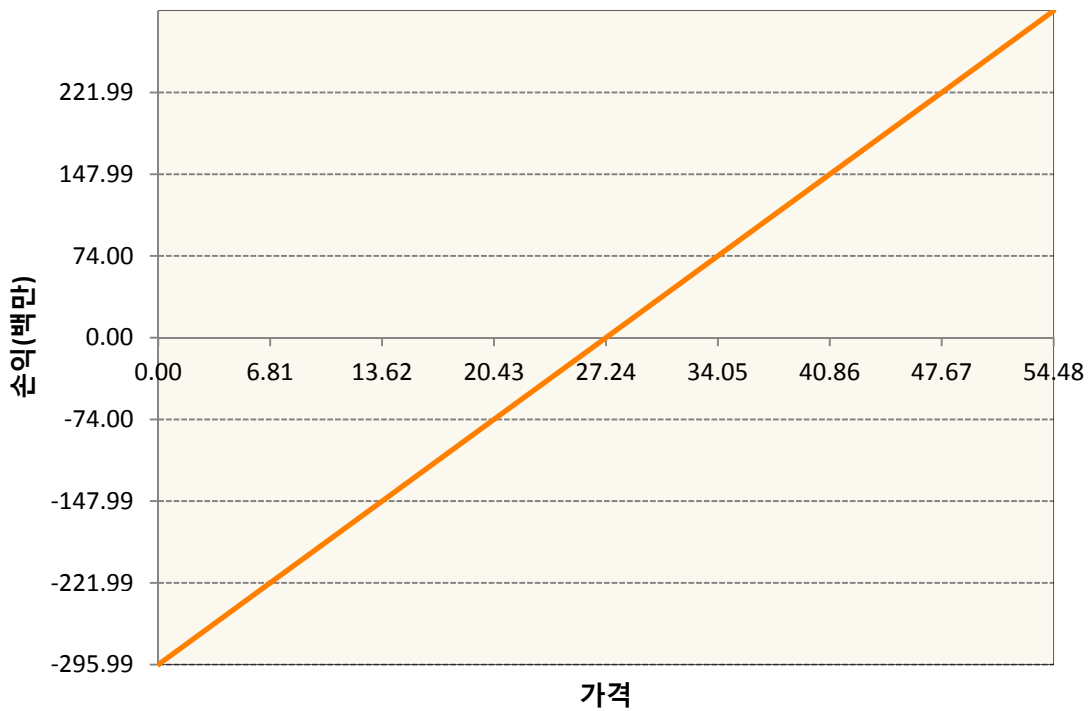
1. 계약금액

(단위:백만원)

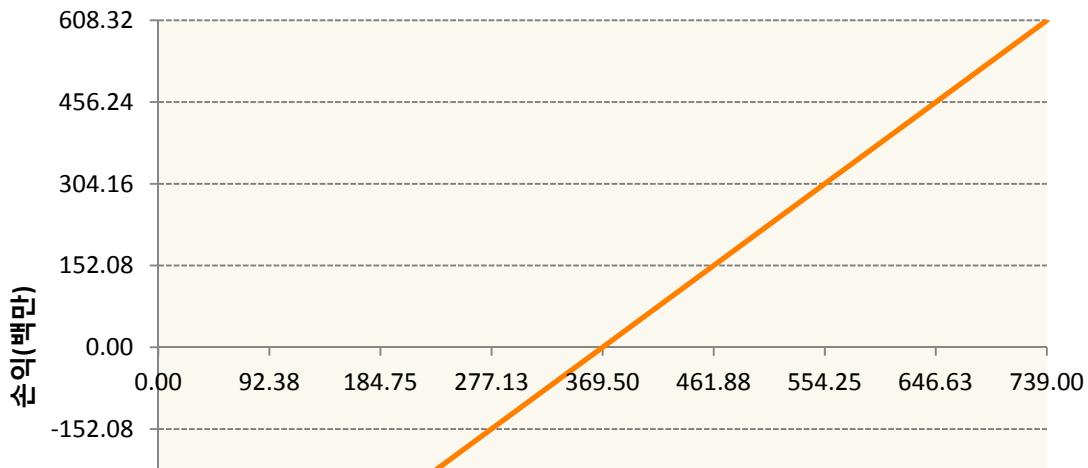
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,864	60	2,805	

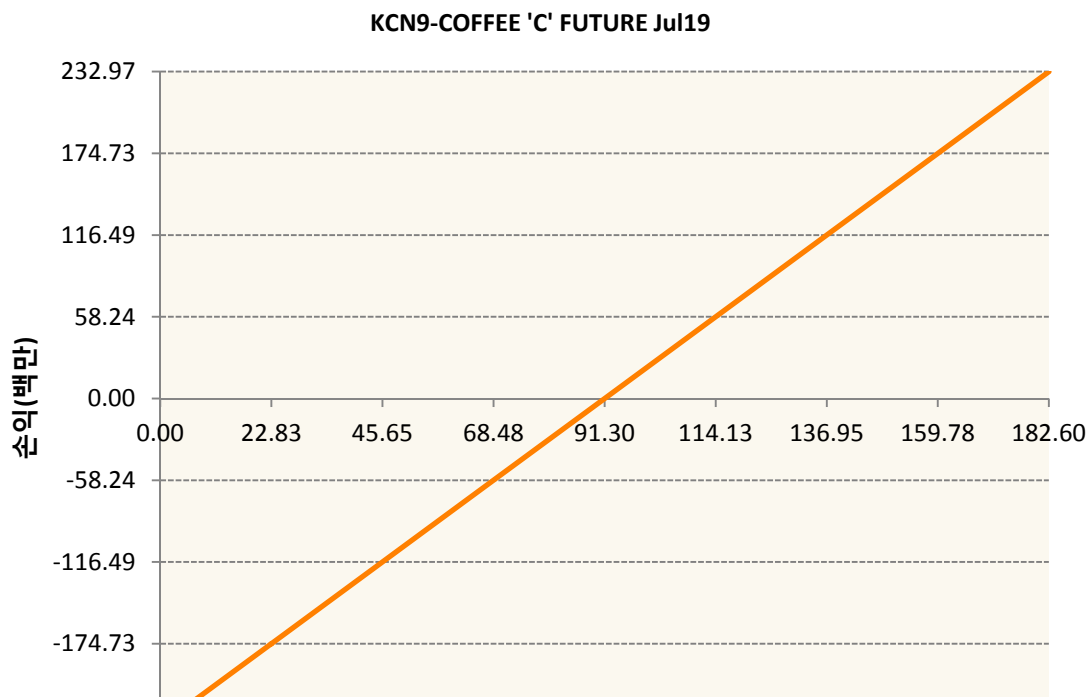
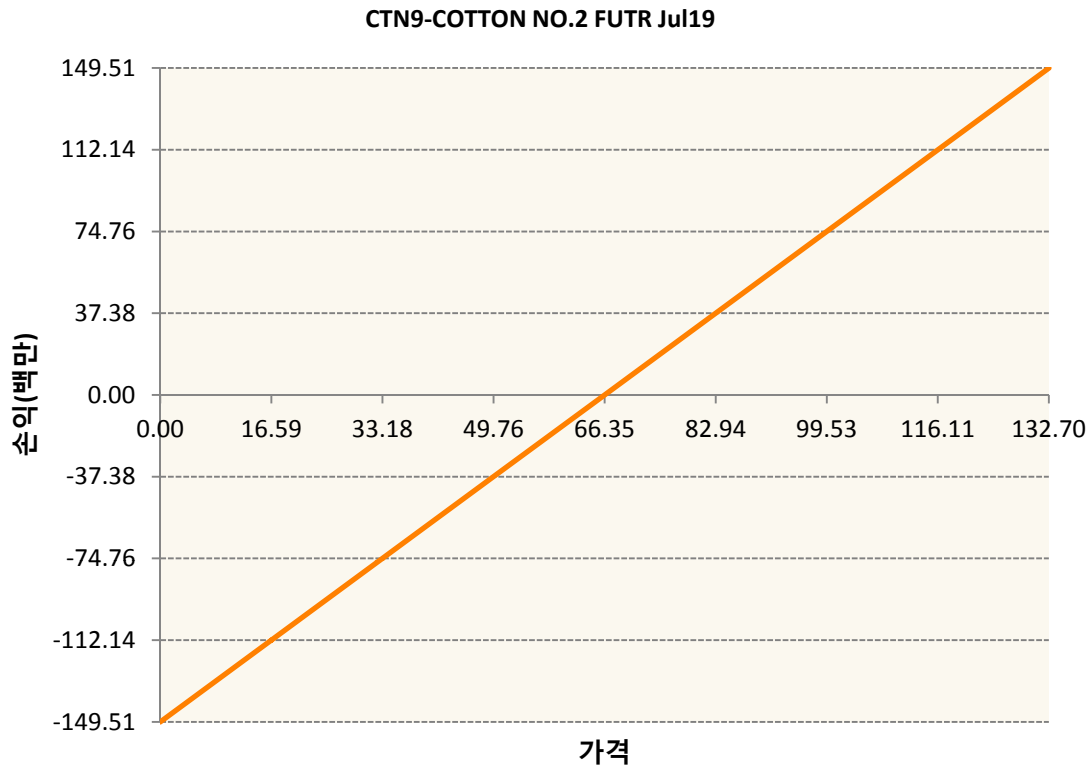
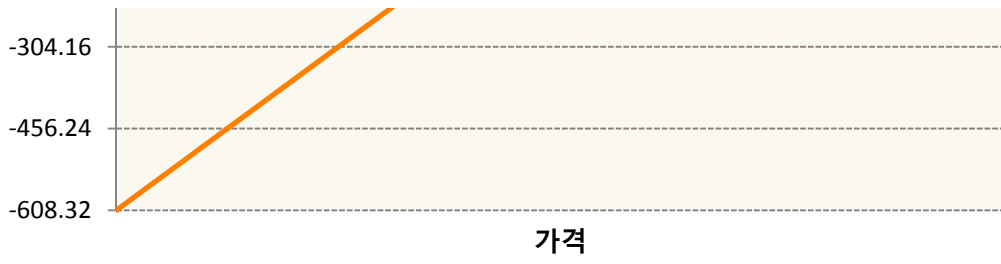
2. 만기시점의 손익구조

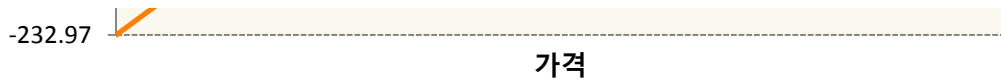
BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19



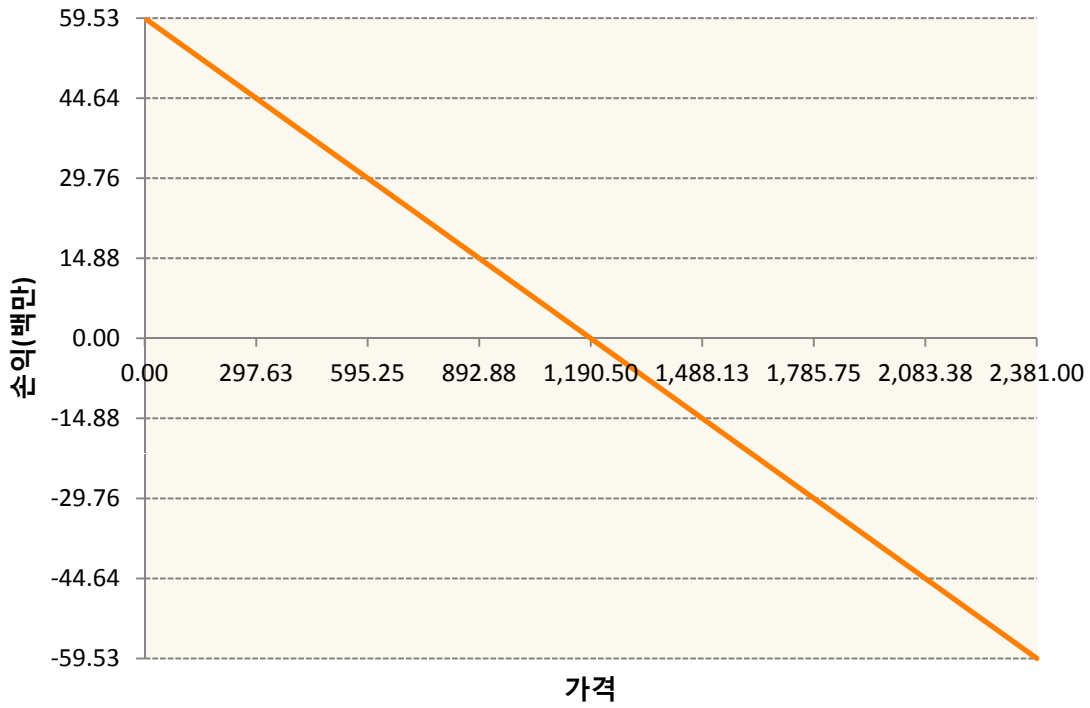
CN9-CORN FUTURE Jul19



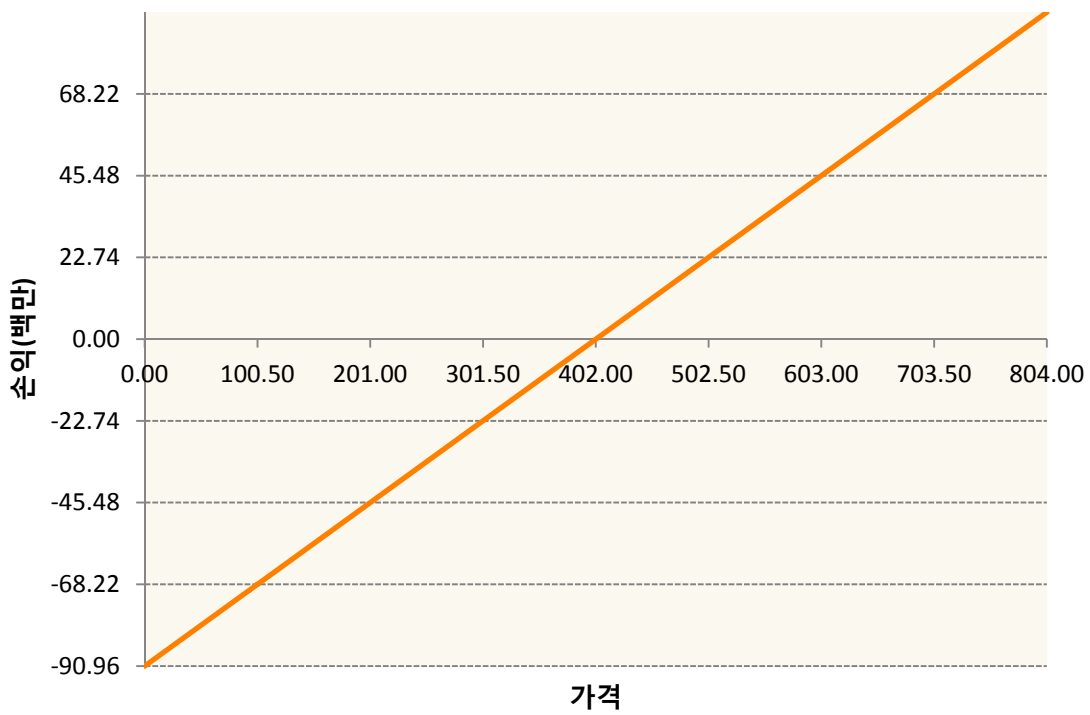




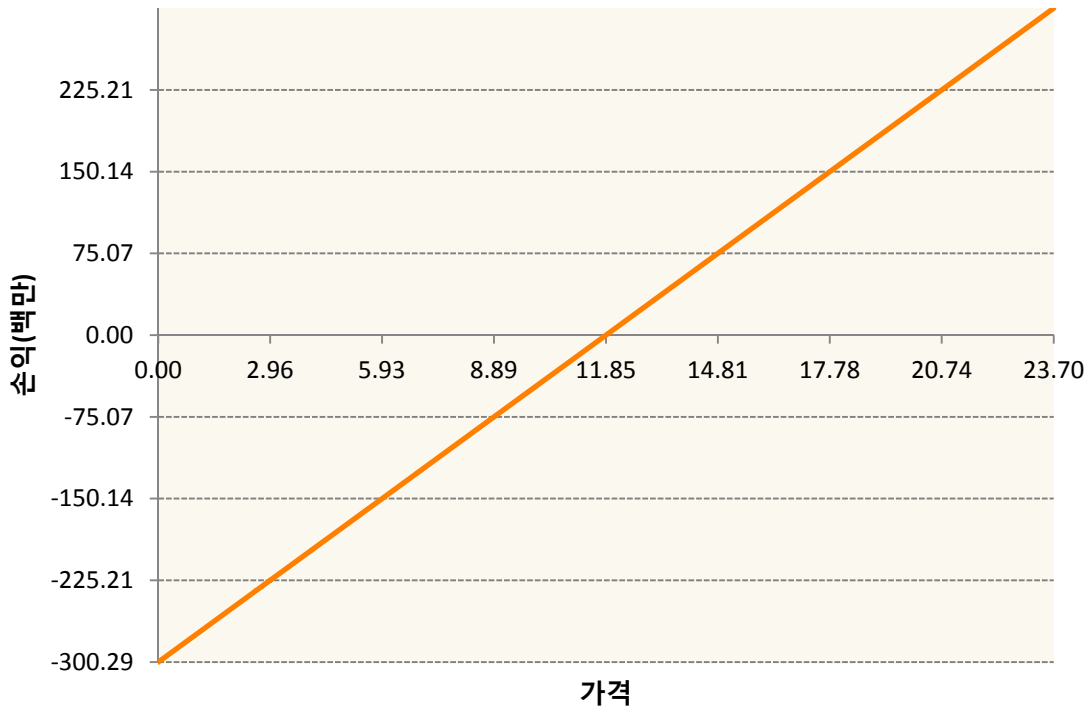
KR4175P50009-2019-05 달러선물



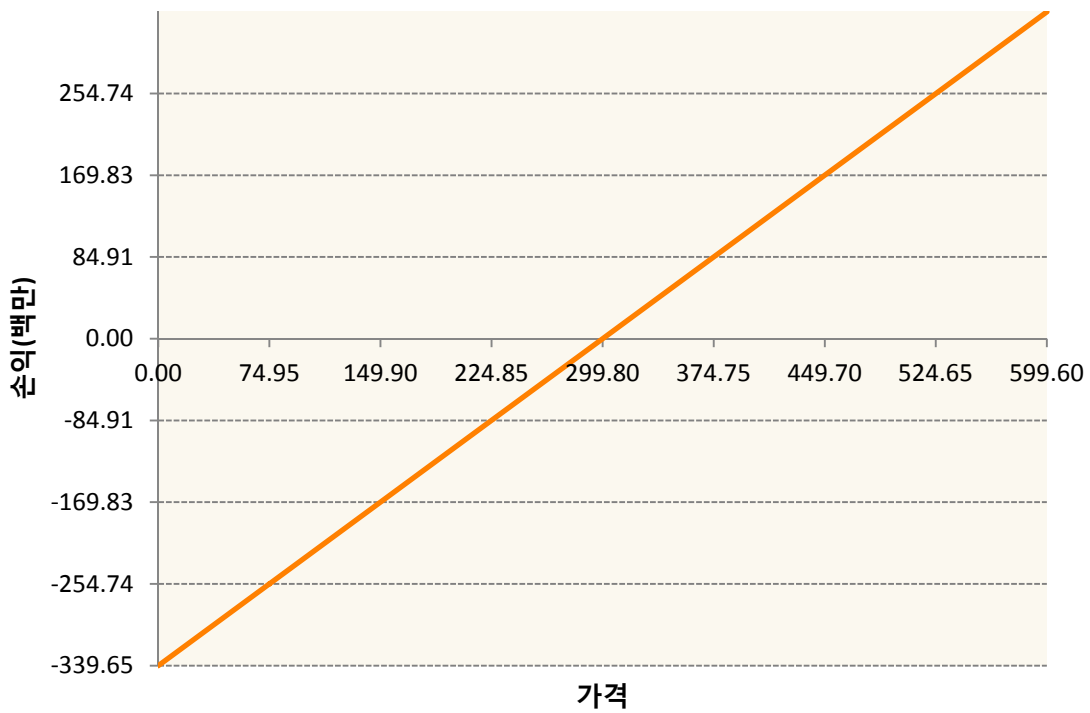
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



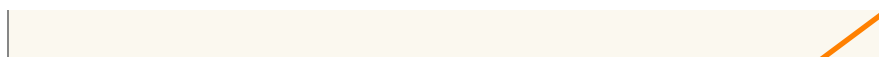
SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

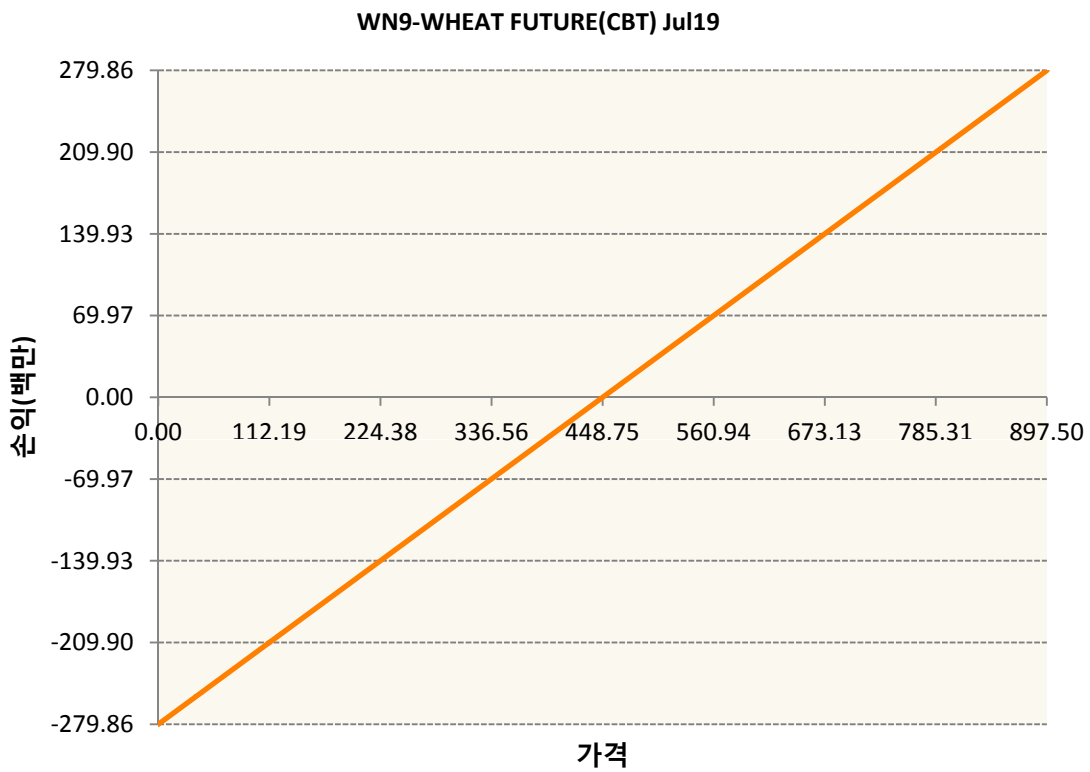
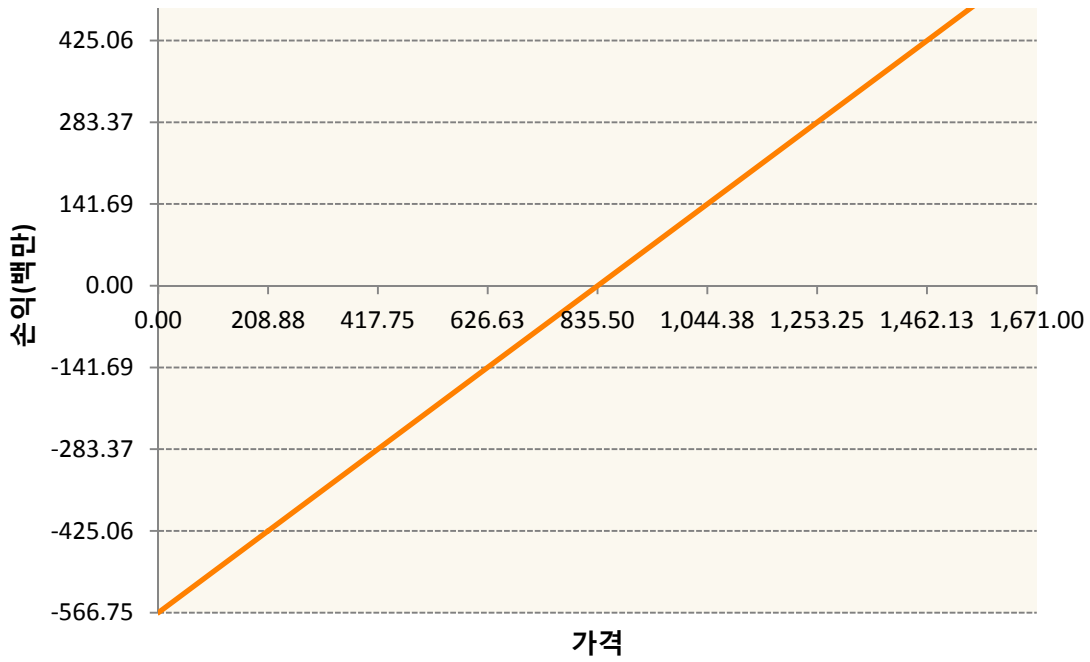


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19



SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON9	SOYBEAN OIL FUTR Jul19	24
CN9	CORN FUTURE Jul19	49
CTN9	COTTON NO.2 FUTR Jul19	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	27
SN9	SOYBEAN FUTURE Jul19	45
WN9	WHEAT FUTURE(CBT) Jul19	22

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

(단위:백만원)

234