

공시일	2019-05-24
기준일	2019-05-23

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	2019-05-24
기준일	2019-05-23

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	14,160	0	14,160	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S190522

1,130

* 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	2019-05-24
기준일	2019-05-23

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)	294
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	81
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	138

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

856

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-05-24
기준일	2019-05-23

유로인덱스모(주식-파생형)

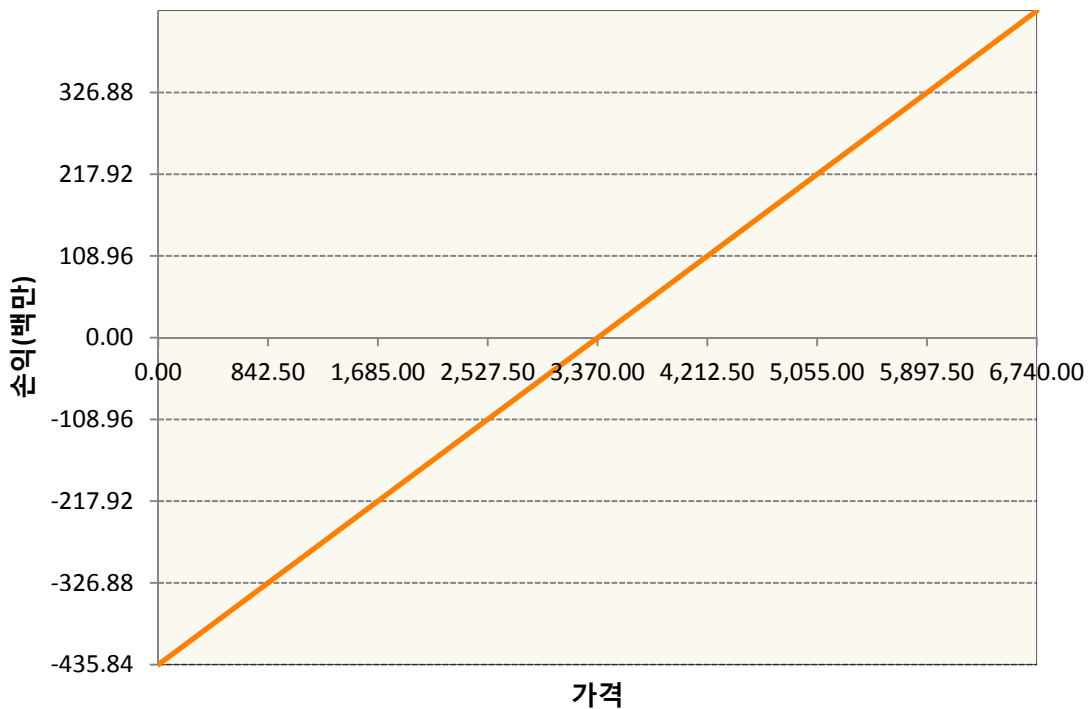
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	436	0	436	

2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	35
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

25

공시일	2019-05-24
기준일	2019-05-23

차이나인덱스모(주식-파생형)

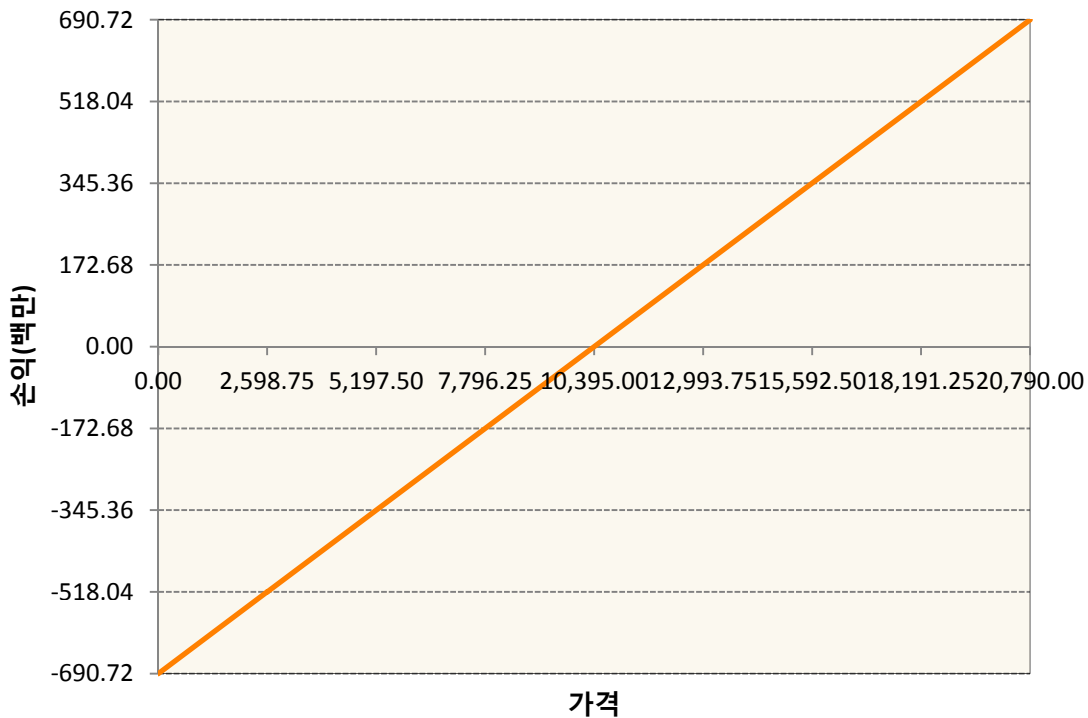
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	691	0	691	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK9	HSCEI Futures May19	55
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

57

공시일	2019-05-24
기준일	2019-05-23

커버드콜모(주식혼합-파생형)

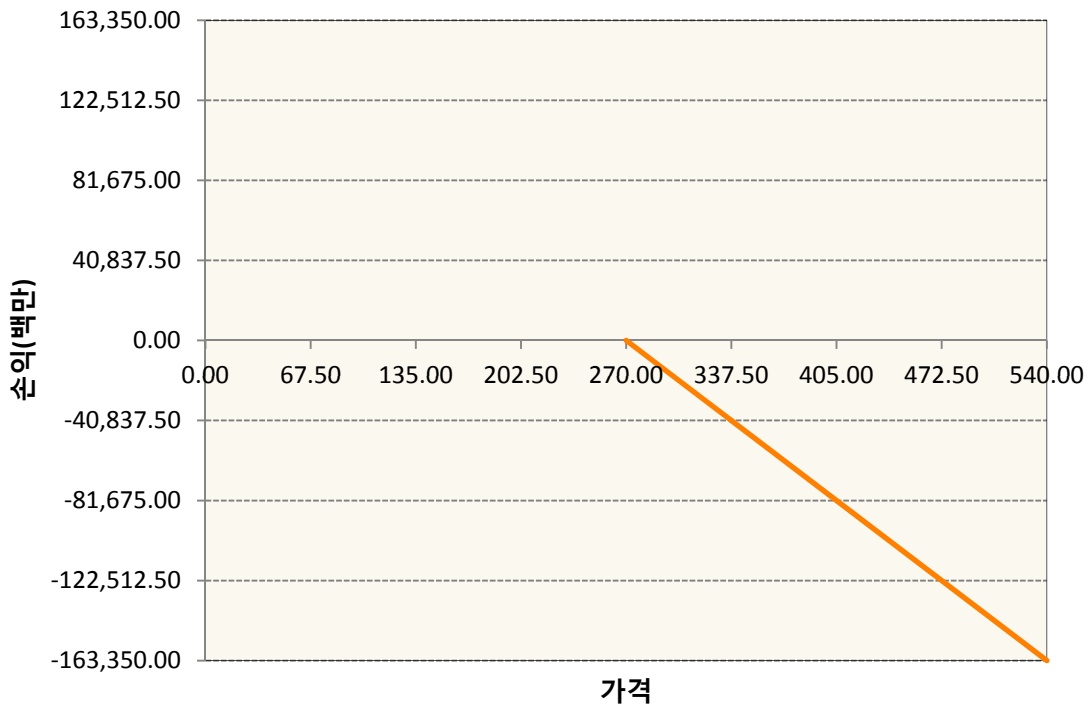
1. 계약금액

(단위:백만원)

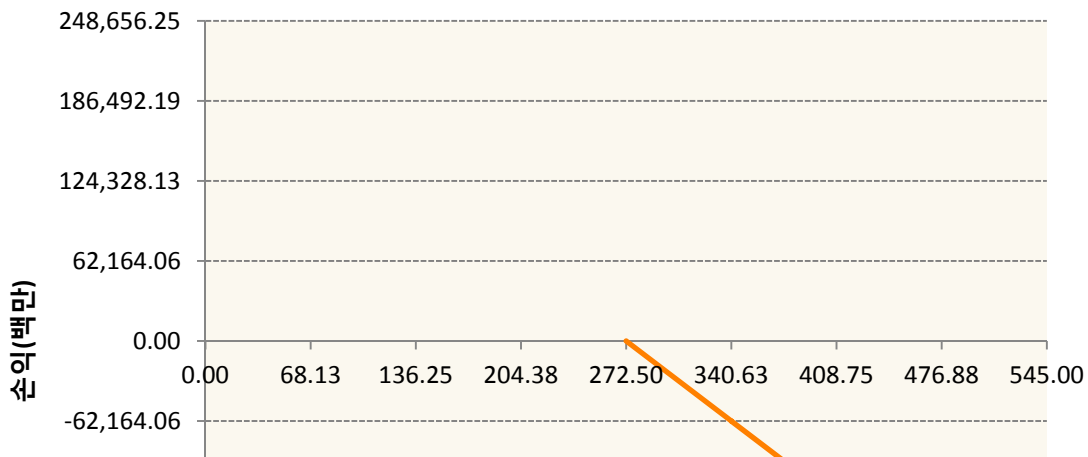
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	614,506	-614,506	장내

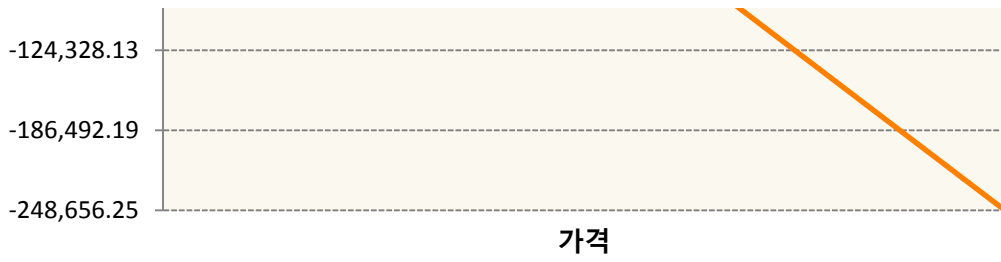
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P62701-2019-06 콜270



KR4201P62727-2019-06 콜272.5





KR4301P62709-2019-06 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201P62701		2019-06 콜270					9,168
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,881	2,839	2,778	2,699	2,601	2,485	2,352
-5.33%	2,712	2,595	2,455	2,294	2,115	1,921	1,713
-2.67%	2,179	1,952	1,710	1,456	1,192	920	641
0%	955	639	320	0	-322	-644	-968
2.67%	-1,202	-1,525	-1,850	-2,176	-2,504	-2,832	-3,161
5.33%	-4,266	-4,514	-4,777	-5,051	-5,334	-5,624	-5,920
8.00%	-7,985	-8,132	-8,303	-8,495	-8,705	-8,930	-9,168
KR4201P62727		2019-06 콜272.5					12,924
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,532	3,490	3,424	3,332	3,214	3,069	2,900

-5.33%	3,369	3,236	3,069	2,868	2,639	2,384	2,105
-2.67%	2,799	2,512	2,195	1,854	1,493	1,116	725
0%	1,361	916	462	0	-467	-939	-1,414
2.67%	-1,383	-1,887	-2,392	-2,897	-3,403	-3,908	-4,413
5.33%	-5,545	-5,974	-6,418	-6,872	-7,335	-7,804	-8,279
8.00%	-10,847	-11,127	-11,440	-11,781	-12,144	-12,526	-12,924
KR4301P62709 2019-06 풋270							14,086
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-13,999	-14,001	-14,006	-14,015	-14,031	-14,054	-14,086
-5.33%	-8,698	-8,721	-8,757	-8,806	-8,870	-8,948	-9,039
-2.67%	-3,582	-3,693	-3,822	-3,967	-4,126	-4,296	-4,476
0%	729	490	247	0	-249	-501	-754
2.67%	3,412	3,164	2,913	2,659	2,403	2,146	1,887
5.33%	4,481	4,351	4,203	4,038	3,861	3,673	3,475
8.00%	4,734	4,698	4,645	4,576	4,491	4,390	4,274

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

(단위:백만원)

36,277

공시일	2019-05-24
기준일	2019-05-23

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

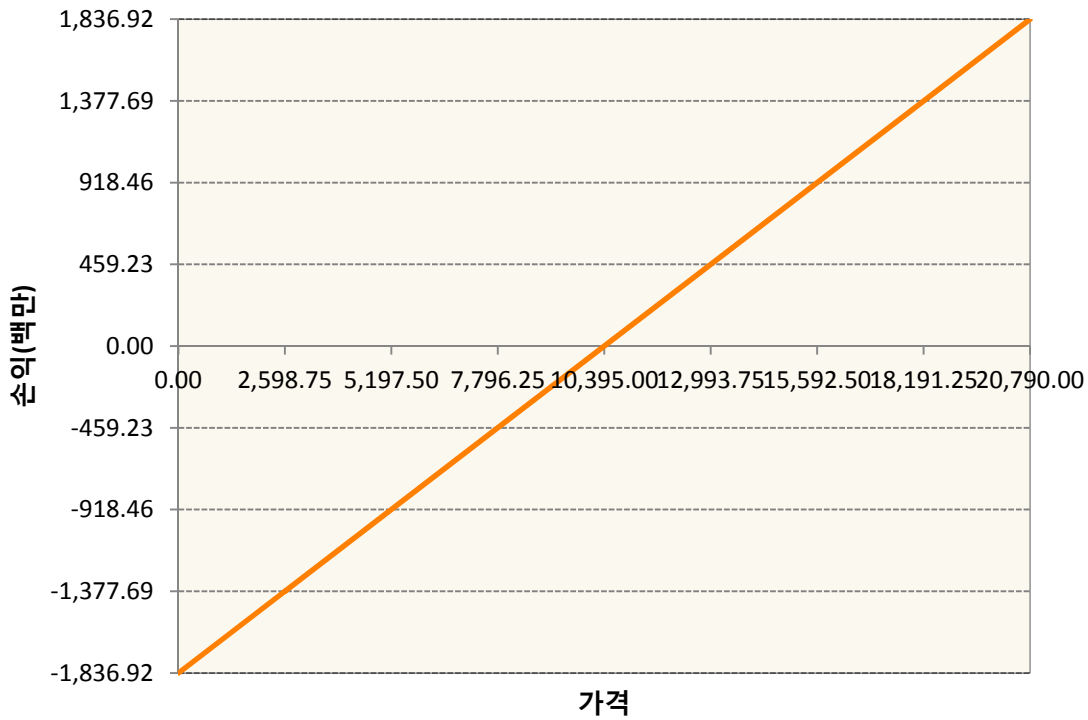
1. 계약금액

(단위:백만원)

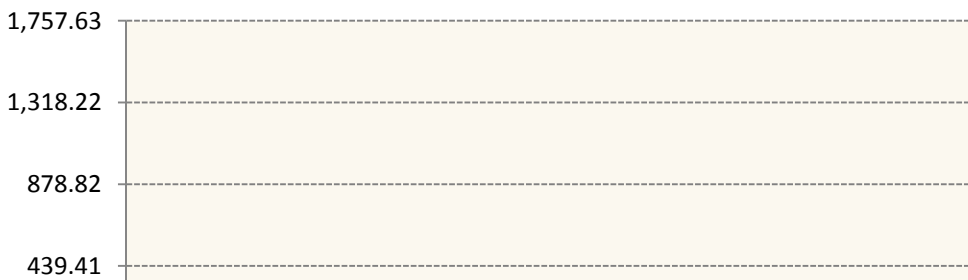
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,837	0	1,837	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,643	-5,643	장내
누계	통화	선도	152	6,364	-6,212	장외

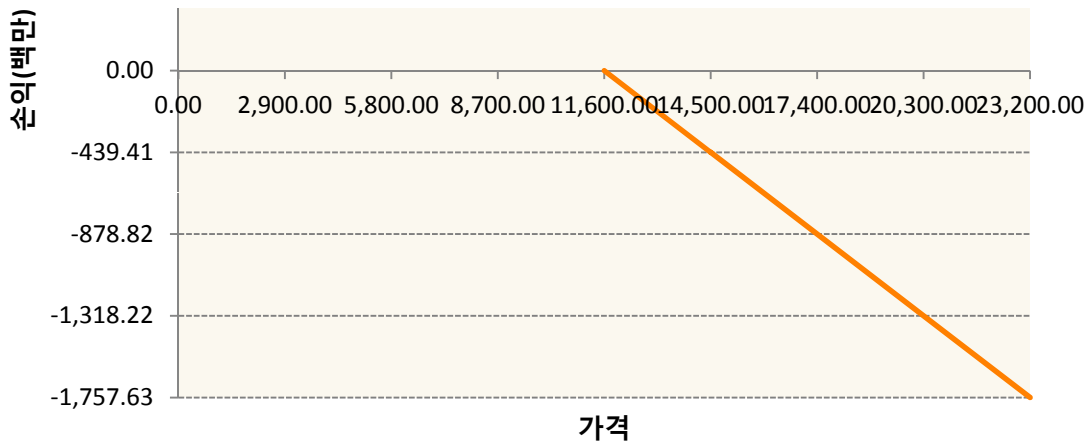
2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19

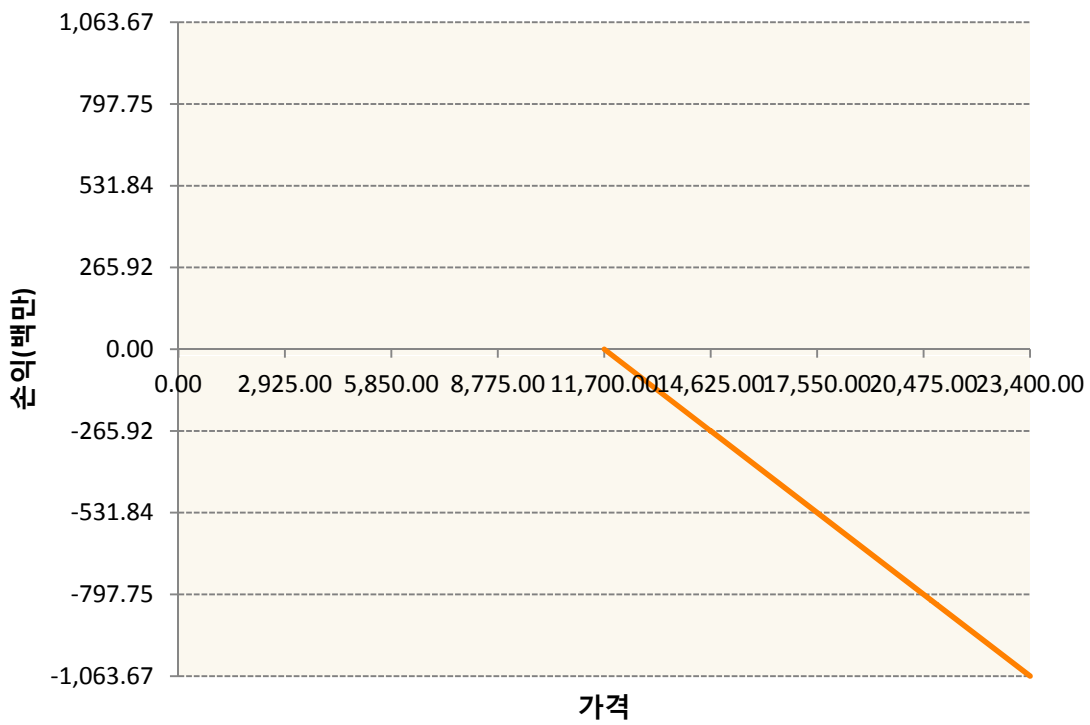


OHHIK9-C116-HSCEI

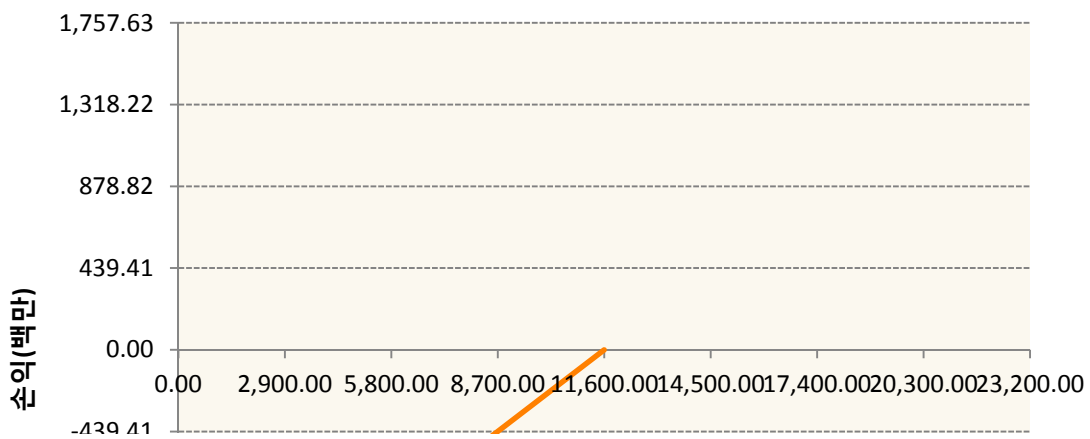


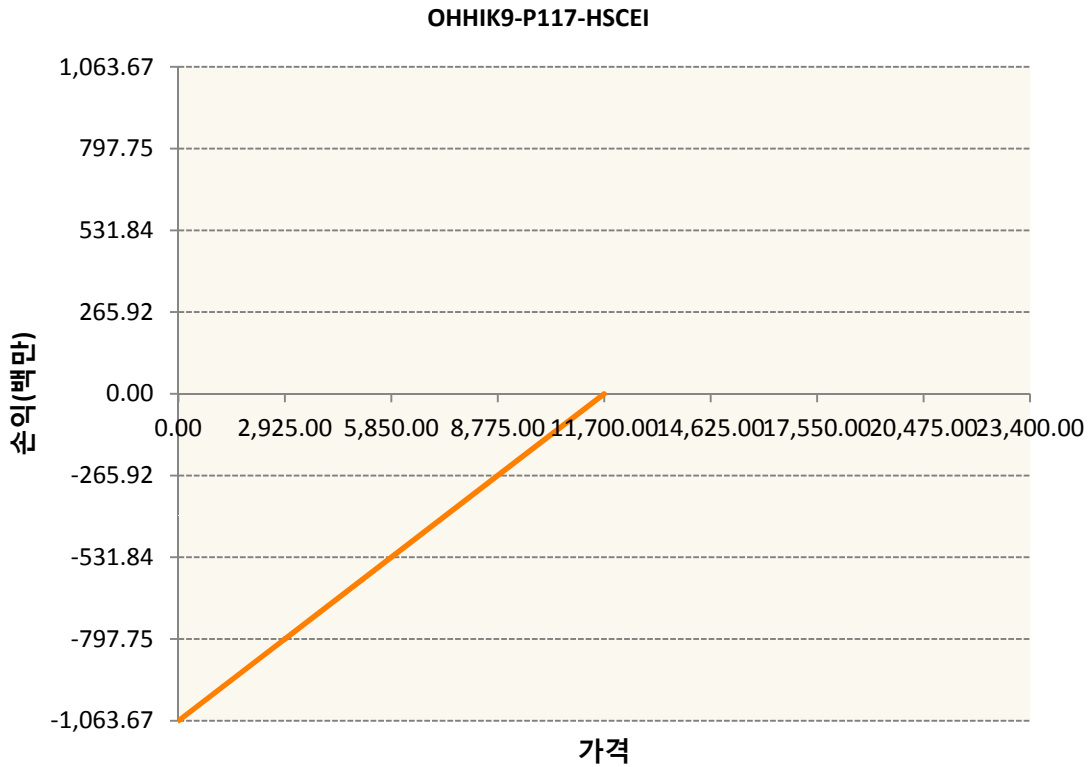


OHHIK9-C117-HSCEI



OHHIK9-P116-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	230
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	24
FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	255
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E	12
HCK9 HSCEI Futures May19	147
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)

공시일	2019-05-24
기준일	2019-05-23

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

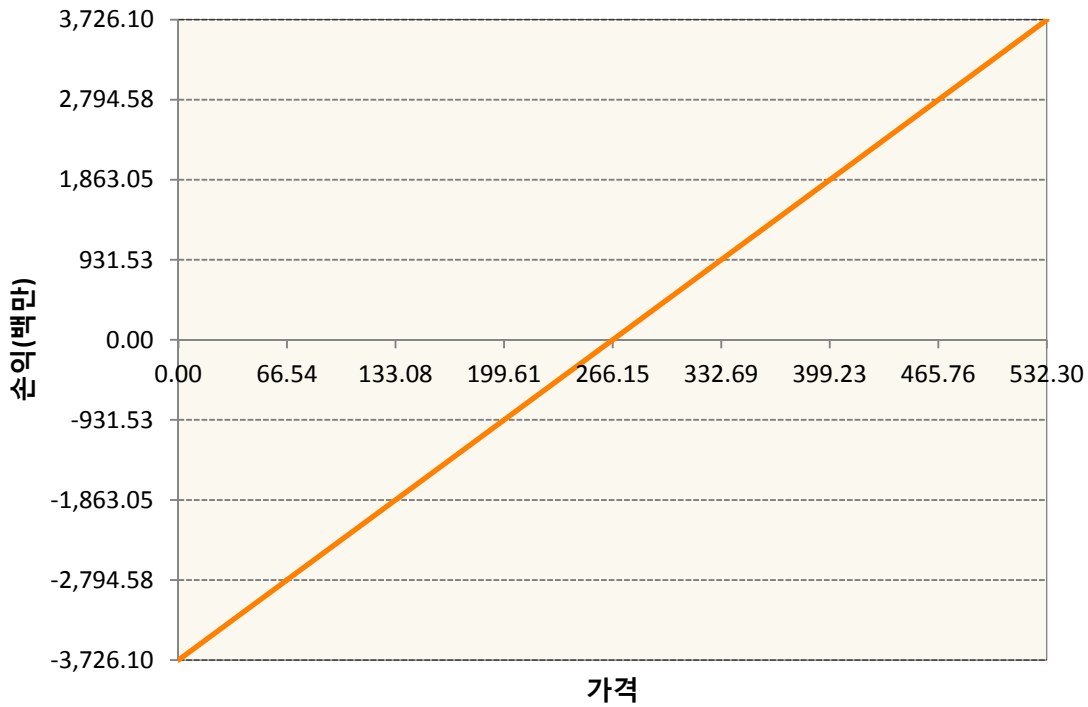
1. 계약금액

(단위:백만원)

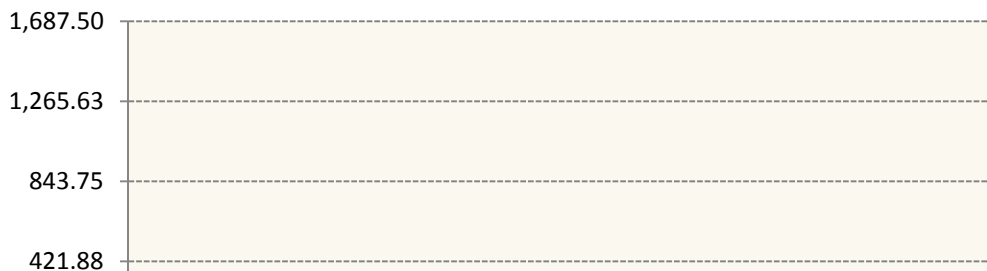
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,726	0	3,726	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	21,759	-21,759	장내

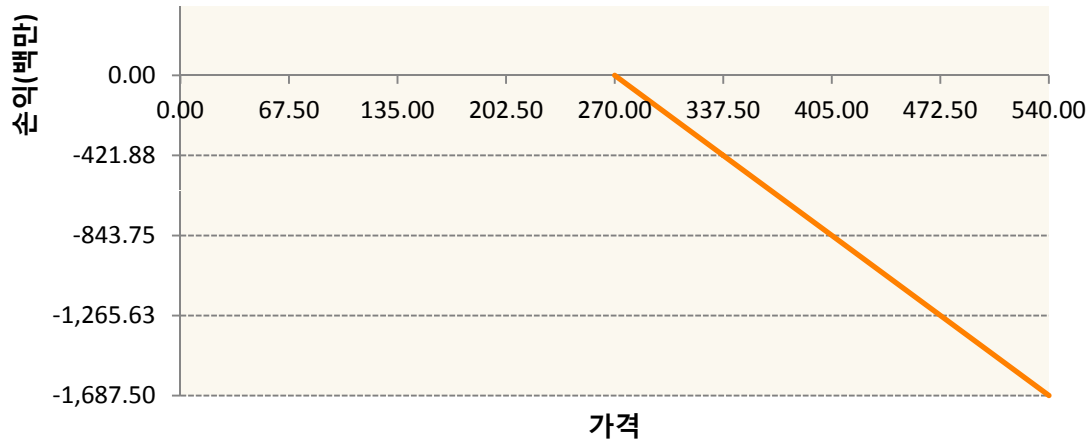
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

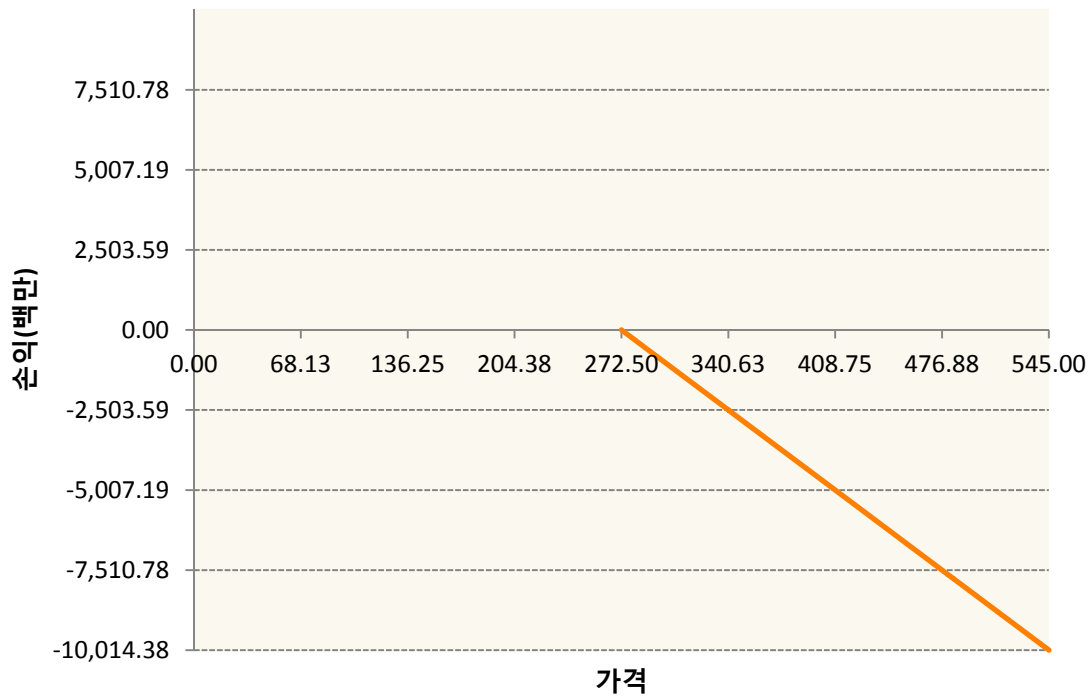


KR4201P62701-2019-06 콜270

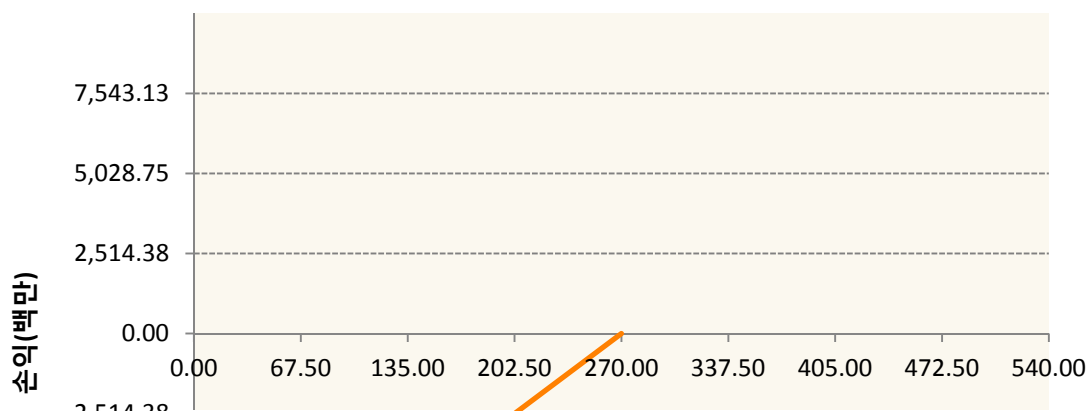


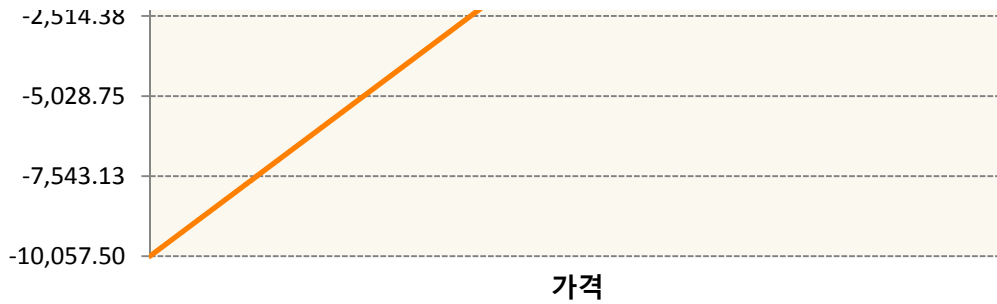


KR4201P62727-2019-06 콜272.5



KR4301P62709-2019-06 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,191
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,191	-1,191	-1,191	-1,191	-1,191	-1,191	-1,191	
-5.33%	-794	-794	-794	-794	-794	-794	-794	
-2.67%	-397	-397	-397	-397	-397	-397	-397	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	397	397	397	397	397	397	397	
5.33%	794	794	794	794	794	794	794	
8.00%	1,191	1,191	1,191	1,191	1,191	1,191	1,191	
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%	-402	-402	-402	-402	-402	-402	-402	
-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%	402	402	402	402	402	402	402	
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						95
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	30	29	29	28	27	26	24
-5.33%	28	27	25	24	22	20	18
-2.67%	23	20	18	15	12	10	7
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	-12	-16	-19	-22	-26	-29	-33
5.33%	-44	-47	-49	-52	-55	-58	-61
8.00%	-82	-84	-86	-88	-90	-92	-95
KR4201P62727 2019-06 콜272.5							521
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	142	141	138	134	129	124	117
-5.33%	136	130	124	116	106	96	85
-2.67%	113	101	88	75	60	45	29
0%	55	37	19	0	-19	-38	-57
2.67%	-56	-76	-96	-117	-137	-157	-178
5.33%	-223	-241	-258	-277	-295	-314	-333
8.00%	-437	-448	-461	-474	-489	-504	-521
KR4301P62709 2019-06 풋270							700
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-695	-695	-696	-696	-697	-698	-700
-5.33%	-432	-433	-435	-437	-441	-444	-449
-2.67%	-178	-183	-190	-197	-205	-213	-222
0%	36	24	12	0	-12	-25	-37
2.67%	169	157	145	132	119	107	94
5.33%	223	216	209	201	192	182	173
8.00%	235	233	231	227	223	218	212

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

(단위:백만원)

3,394

공시일	2019-05-24
기준일	2019-05-23

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

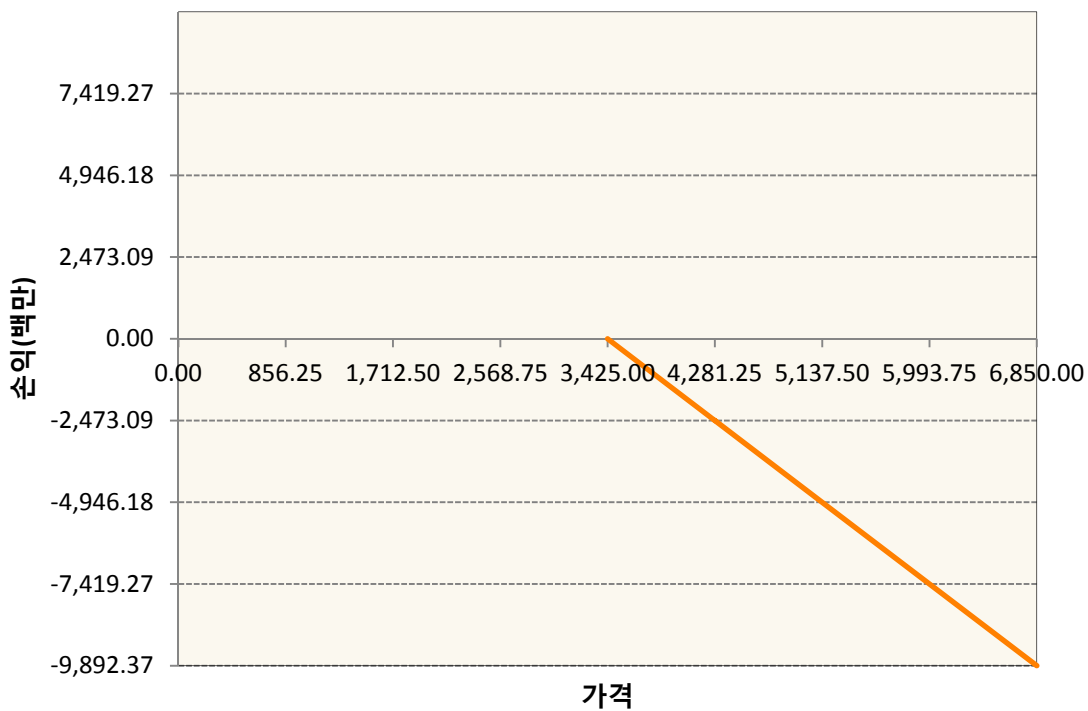
1. 계약금액

(단위:백만원)

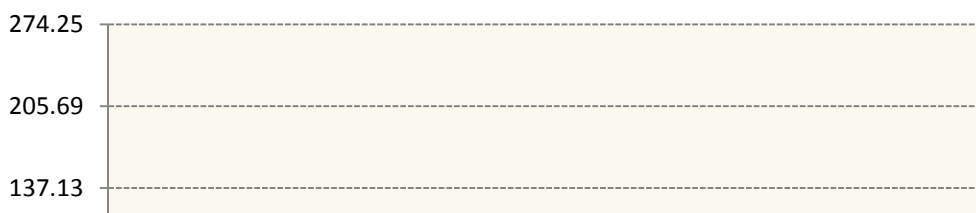
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,685	0	3,685	
누계	유가증권	스왑	56,081	0	56,081	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,333	-20,333	장내
누계	통화	선도	0	23,848	-23,848	장외

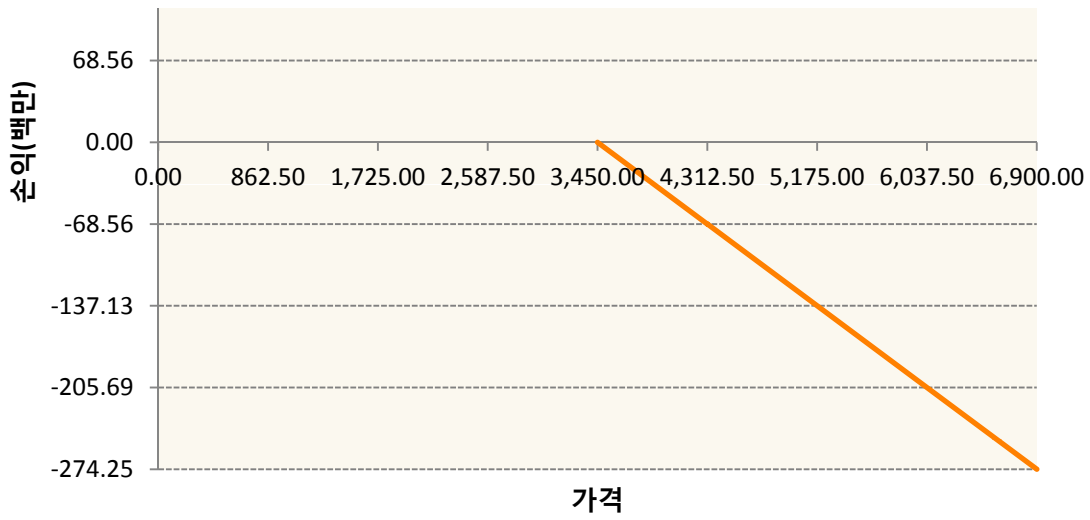
2. 만기시점의 손익구조

OESXM9-C3425-EURO STOXX 50

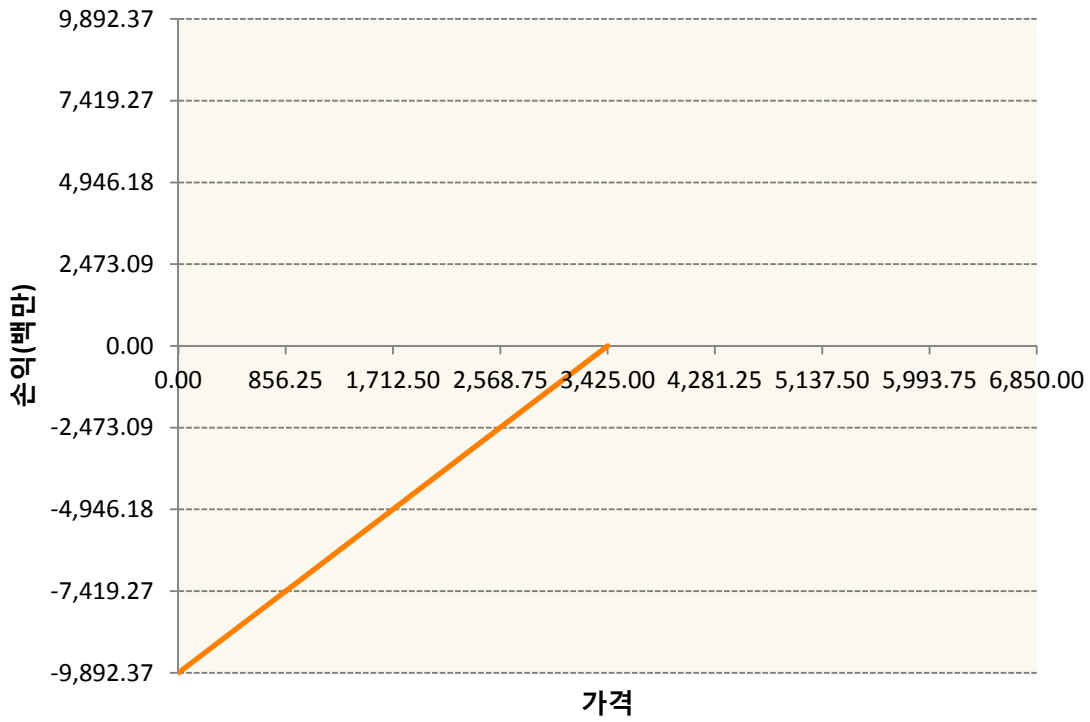


OESXM9-C3450-EURO STOXX 50

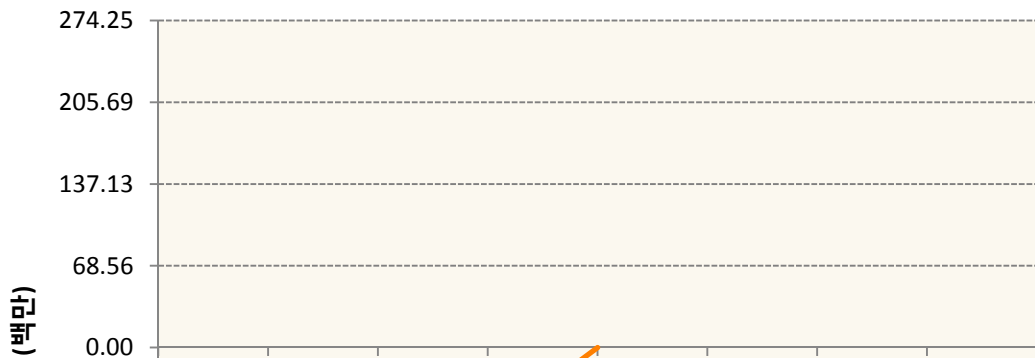


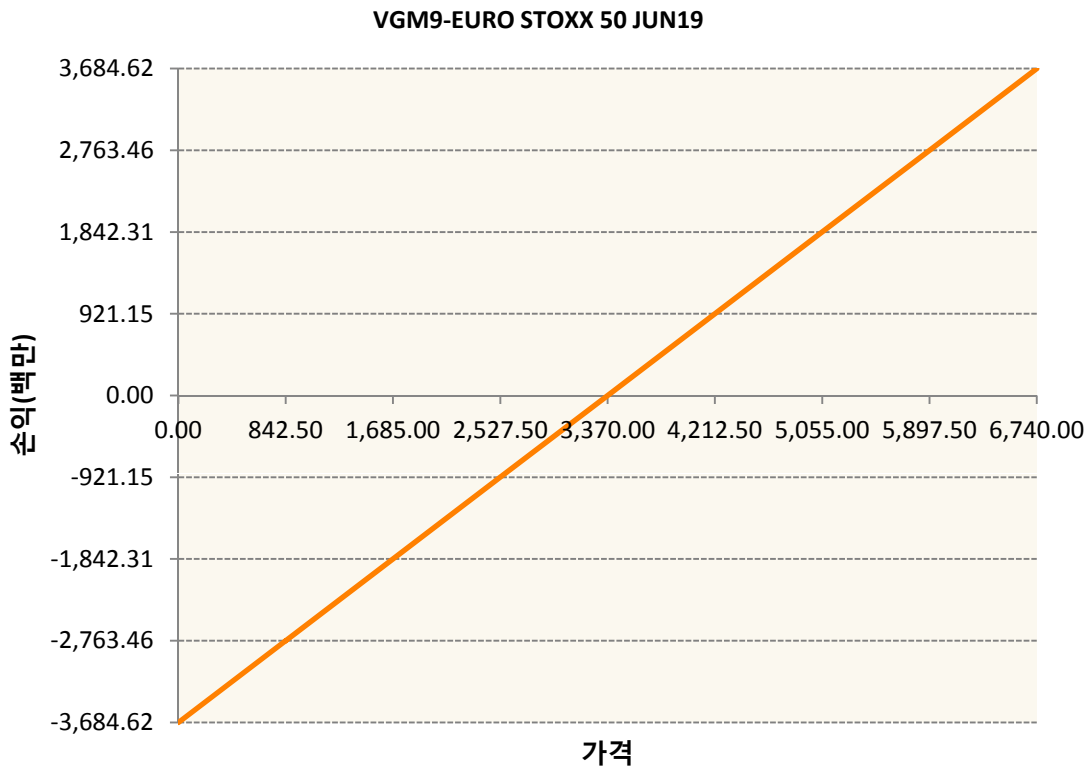
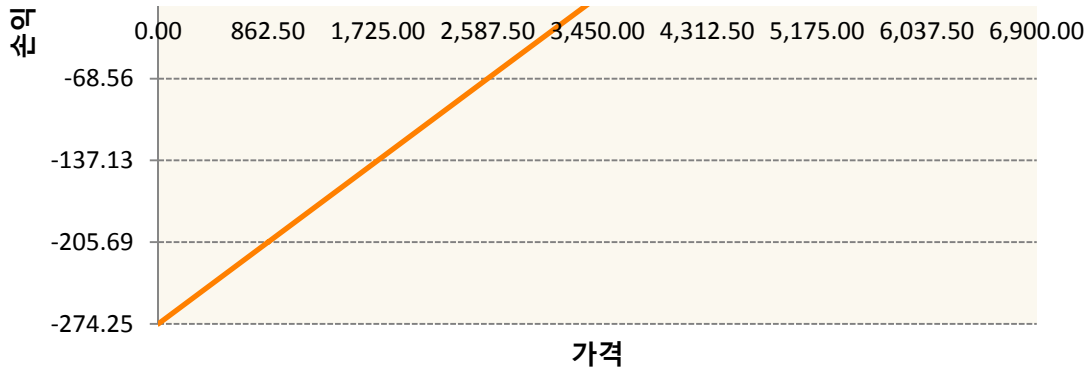


OESXM9-P3425-EURO STOXX 50



OESXM9-P3450-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	48
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	424
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	848
FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E	212
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	424
OESXM9-C3 EURO STOXX 50	791
OESXM9-C3 EURO STOXX 50	22
OESXM9-P3 EURO STOXX 50	791
OESXM9-P3 EURO STOXX 50	22
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	295

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

(단위:백만원)

2,382

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

(단위:백만원)

1,020

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

(단위:백만원)

90

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

(단위:백만원)

130

공시일	2019-05-24
기준일	2019-05-23

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

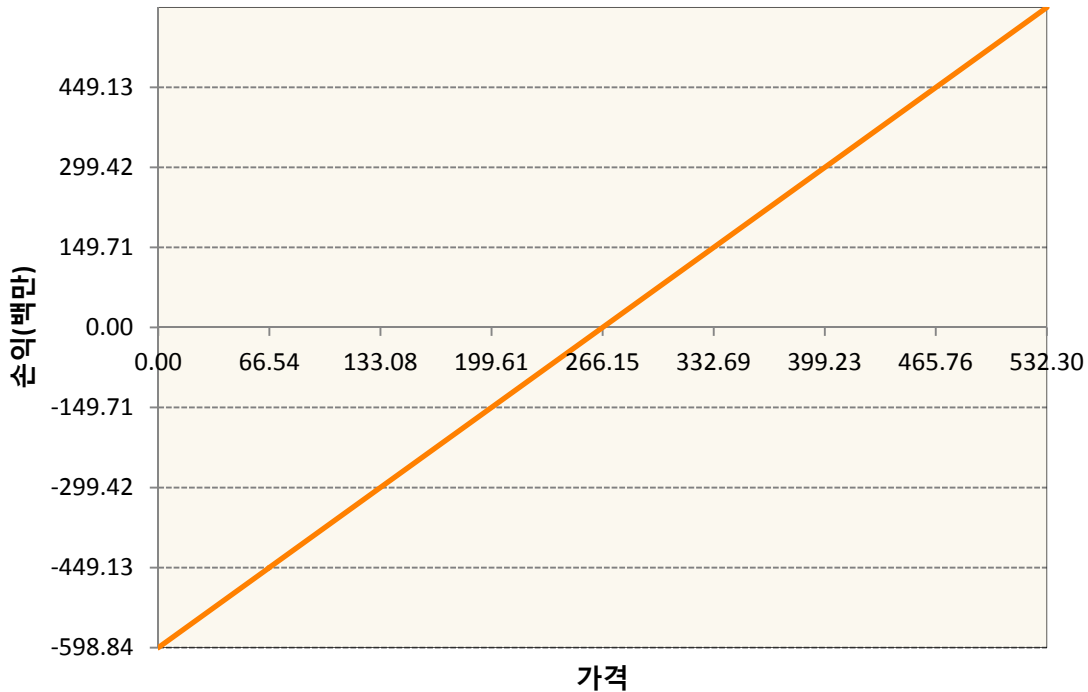
1. 계약금액

(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)

40

공시일	2019-05-24
기준일	2019-05-23

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

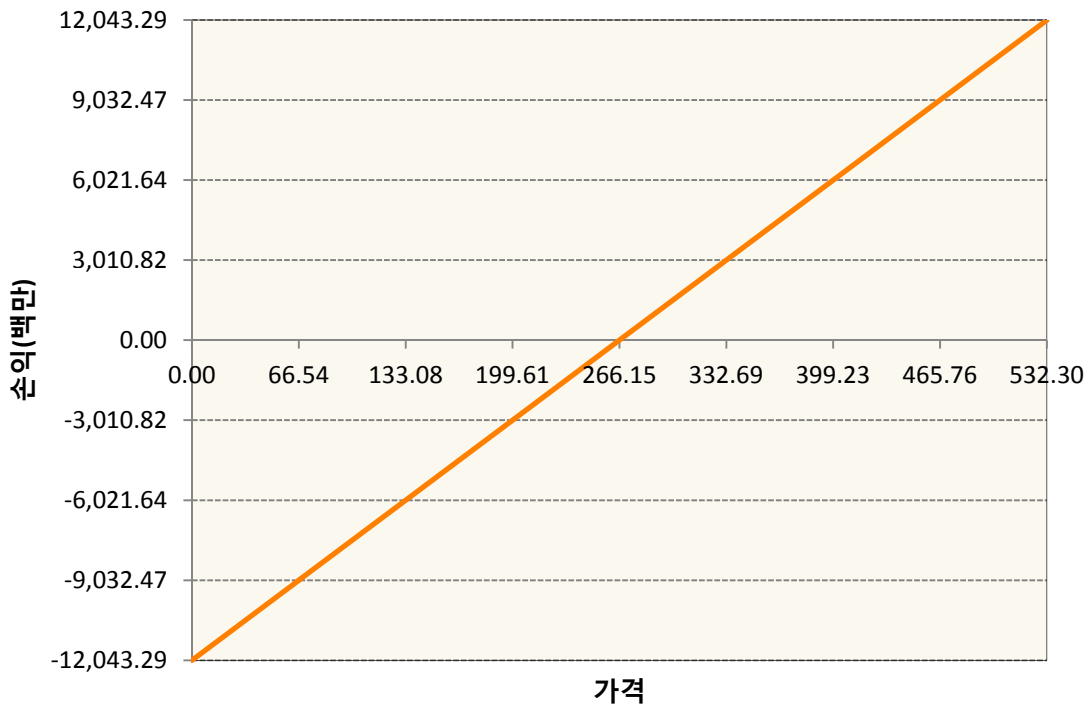
1. 계약금액

(단위:백만원)

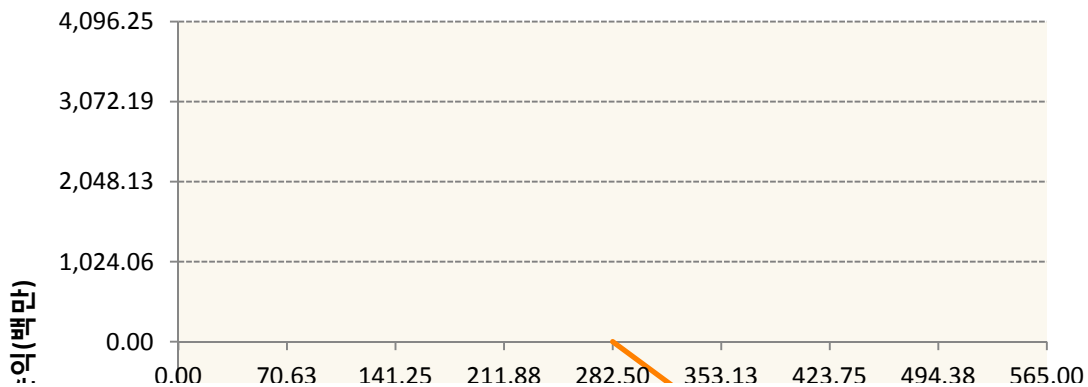
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,043	0	12,043	장내
누계	유가증권	옵션	5,081	22,906	-17,825	장내

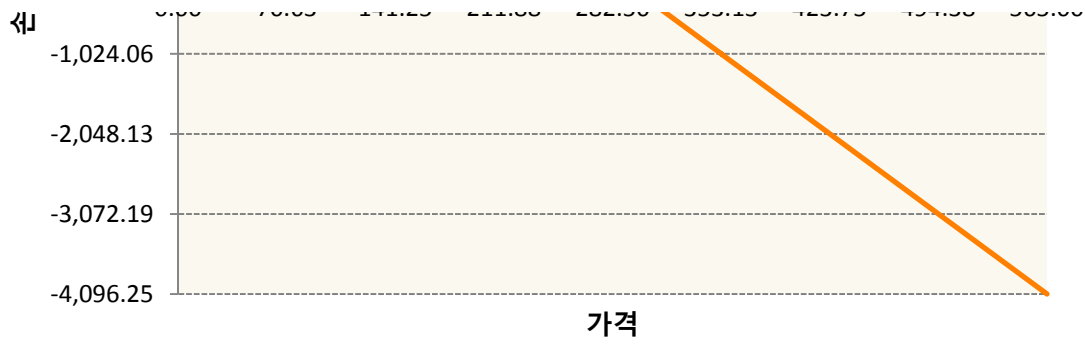
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

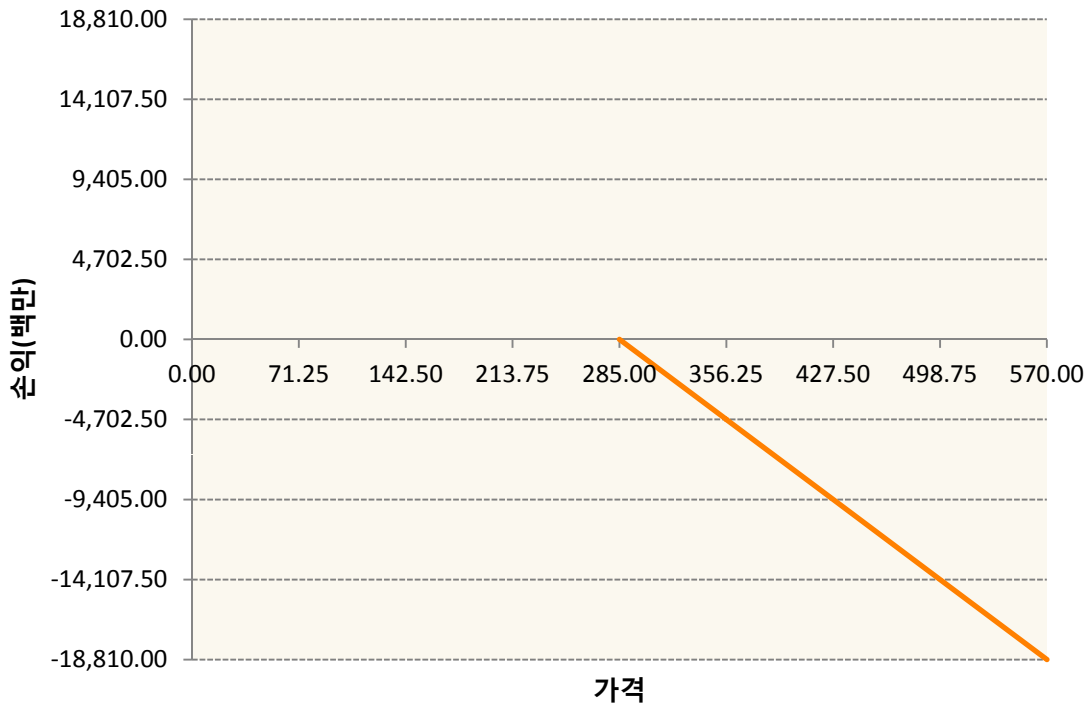


KR4201P62826-2019-06 콜282.5

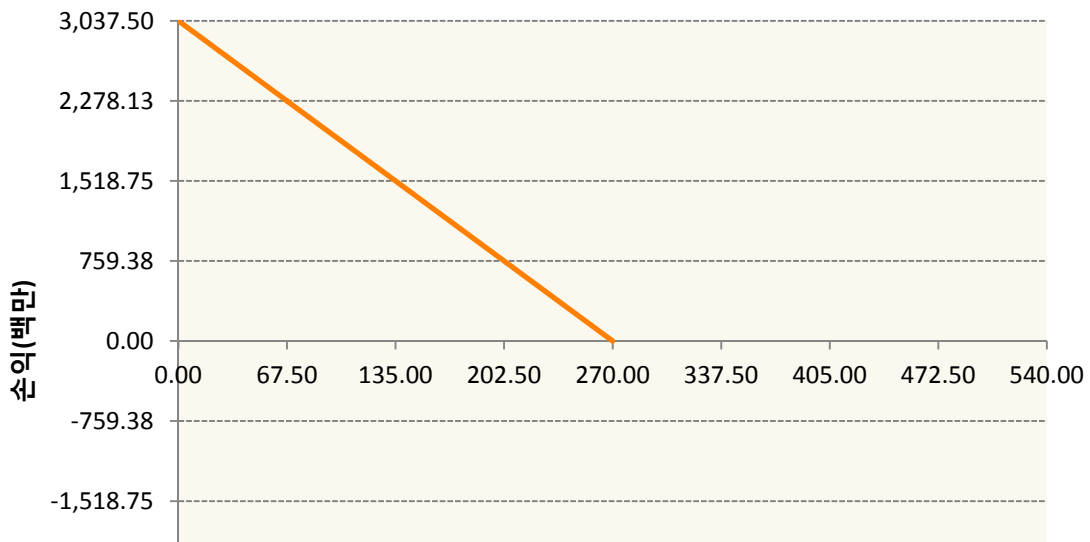


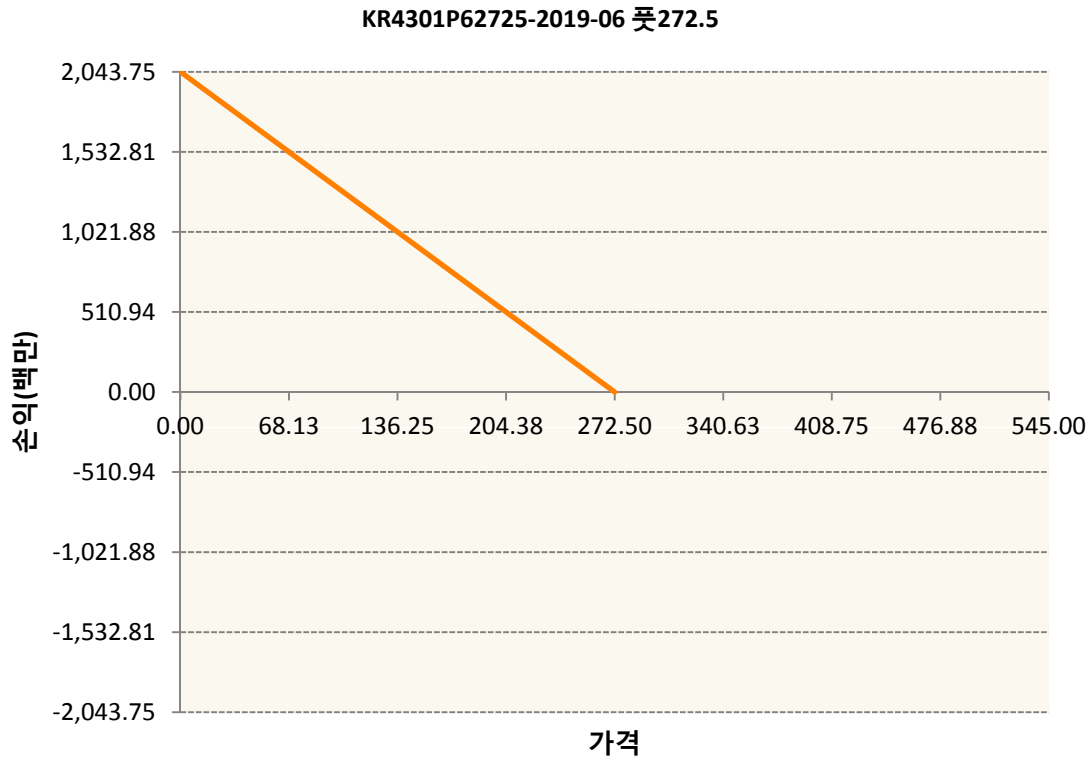
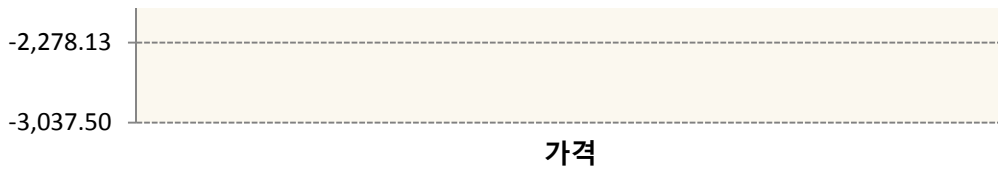


KR4201P62859-2019-06 콜285



KR4301P62709-2019-06 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						964
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-964	-964	-964	-964	-964	-964	-964	
-5.33%	-643	-643	-643	-643	-643	-643	-643	
-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%	643	643	643	643	643	643	643	
8.00%	964	964	964	964	964	964	964	
KR4201P62826		2019-06 콜282.5						144
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	21	21	21	21	20	19	18	
-5.33%	21	21	20	19	17	15	13	
-2.67%	19	18	16	13	10	6	2	

0%	13	9	5	0	-5	-11	-17
2.67%	-4	-11	-17	-24	-32	-39	-46
5.33%	-39	-47	-56	-64	-72	-80	-89
8.00%	-96	-104	-112	-120	-128	-136	-144
KR4201P62859 2019-06 콜285							589
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	74	74	73	72	70	67	62
-5.33%	73	72	69	65	60	52	43
-2.67%	69	63	56	46	34	20	4
0%	49	35	19	0	-21	-43	-68
2.67%	-9	-35	-62	-91	-122	-153	-185
5.33%	-138	-173	-210	-246	-283	-320	-357
8.00%	-362	-399	-437	-475	-513	-551	-589
KR4301P62709 2019-06 풋270							211
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	210	210	210	210	210	211	211
-5.33%	130	131	131	132	133	134	136
-2.67%	54	55	57	60	62	64	67
0%	-11	-7	-4	0	4	8	11
2.67%	-51	-47	-44	-40	-36	-32	-28
5.33%	-67	-65	-63	-61	-58	-55	-52
8.00%	-71	-70	-70	-69	-67	-66	-64
KR4301P62725 2019-06 풋272.5							146
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	146	146	146	146	146	146	146
-5.33%	93	93	93	93	94	94	95
-2.67%	41	41	42	43	45	46	47
0%	-6	-4	-2	0	2	5	7
2.67%	-39	-37	-34	-31	-29	-26	-23
5.33%	-55	-53	-51	-49	-47	-45	-43
8.00%	-60	-59	-58	-57	-56	-55	-53

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

(단위:백만원)

1,595

공시일	2019-05-24
기준일	2019-05-23

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	297	0	297	
누계	유가증권	수익증권	16,628	0	16,628	

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	2019-05-24
기준일	2019-05-23

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	60,629	0	60,629	

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	2019-05-24
기준일	2019-05-23

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	9,514	0	9,514	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	259,796	0	259,796	
누계	통화	선도	3,568	290,878	-287,311	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
FX21019J019 KRW/USD 18-06-19E		381
FX21019J024 KRW/USD 24-06-19E		951
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		951
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		1,008
FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E		381
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		76
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		1,001
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E		1,027
FX21019J041 KRW/USD 28-05-19E		285
FX21019J043 KRW/USD 03-06-19E		571
FX21019J044 KRW/USD 03-06-19E		476
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		285
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		476
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		666
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		666
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		828
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		818
FX21019K00 KRW/USD 18-06-19E		571
FX21019K01 KRW/USD 14-06-19E		666
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		571
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		476
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		571
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,427
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,332
FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E		476

FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E	799
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E	636
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E	476
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E	381
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E	799
FX21019K02 KRW/USD 24-06-19E	381
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E	951
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E	1,522
FX21019K03 USD/KRW 28-05-19E	285
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E	285

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

(단위:백만원)

7,878

공시일	2019-05-24
기준일	2019-05-23

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

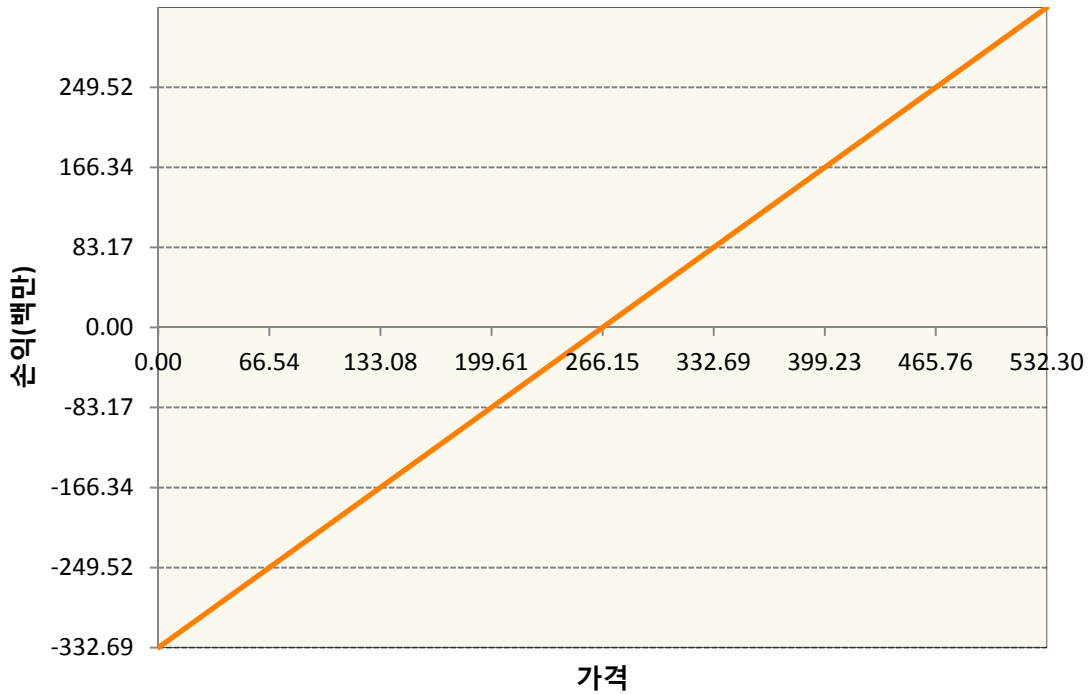
1. 계약금액

(단위:백만원)

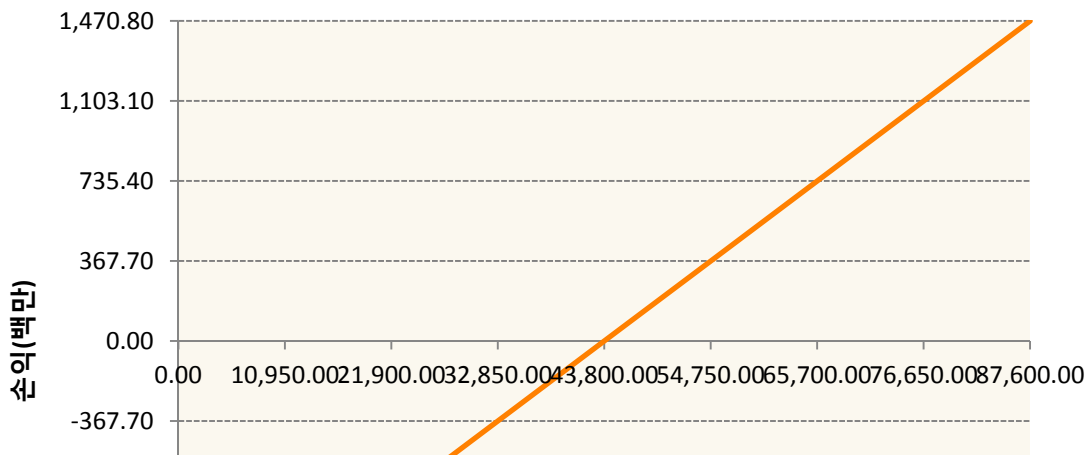
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,803	0	1,803	장내

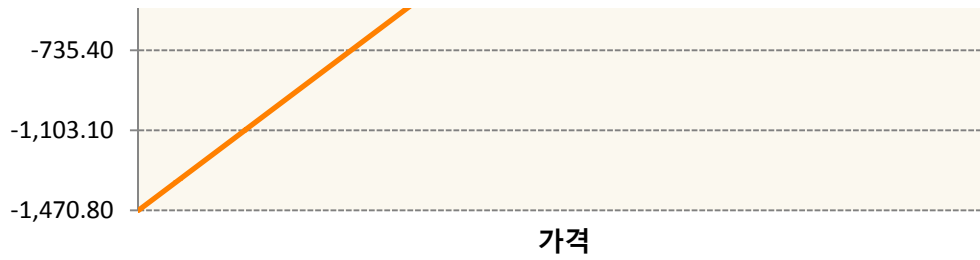
2. 만기시점의 손익구조

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						118
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118	
-5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79	
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	39	39	39	39	39	39	39	
5.33%	79	79	79	79	79	79	79	
8.00%	118	118	118	118	118	118	118	

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

160

공시일	2019-05-24
기준일	2019-05-23

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

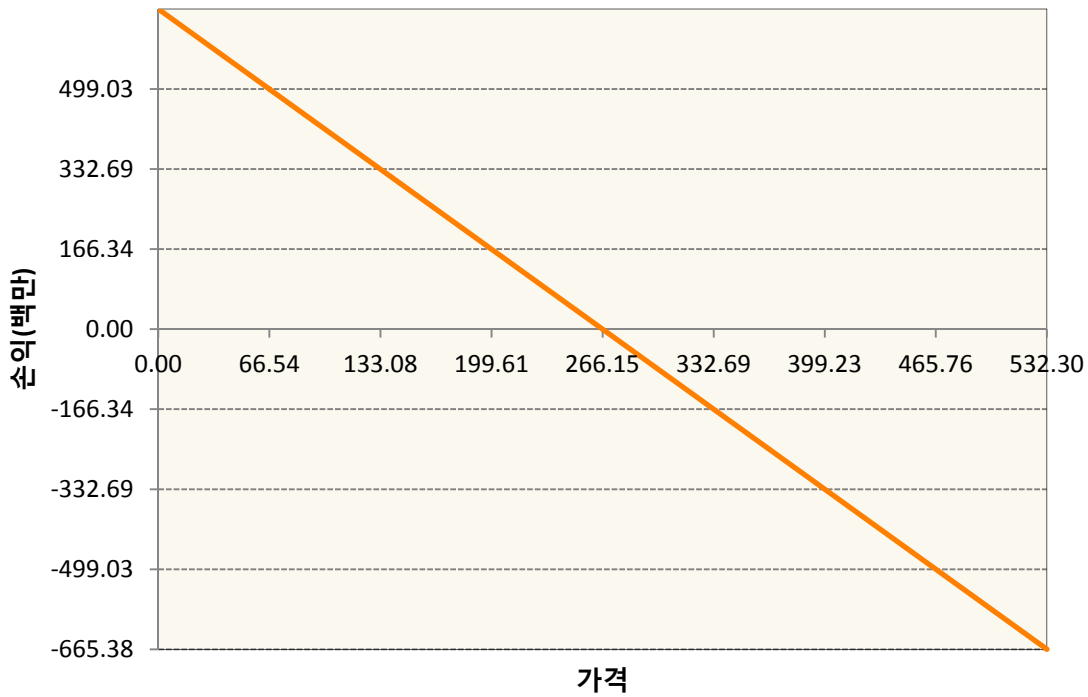
1. 계약금액

(단위:백만원)

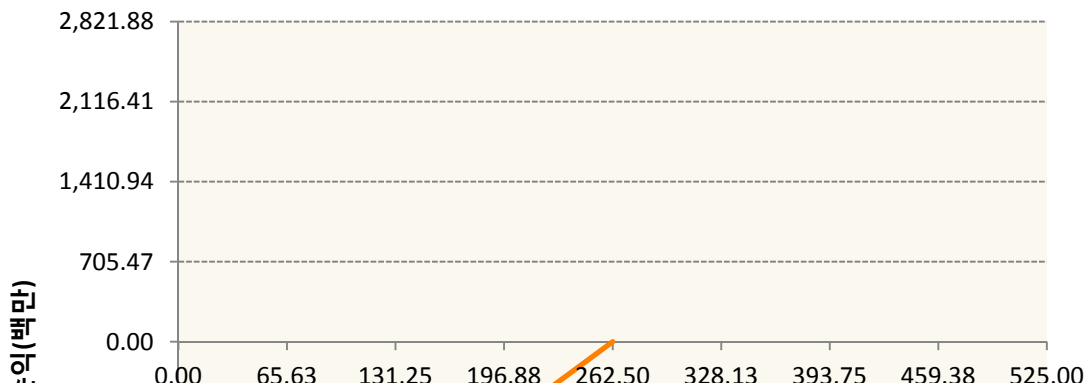
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	665	-665	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,352	-3,352	장내

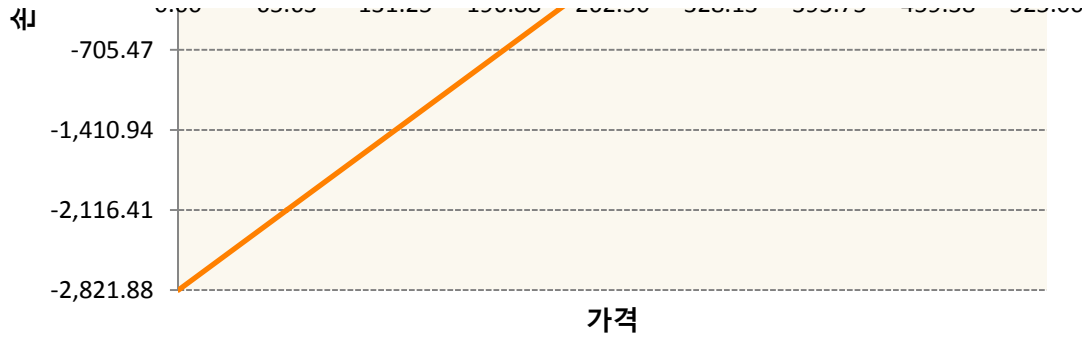
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

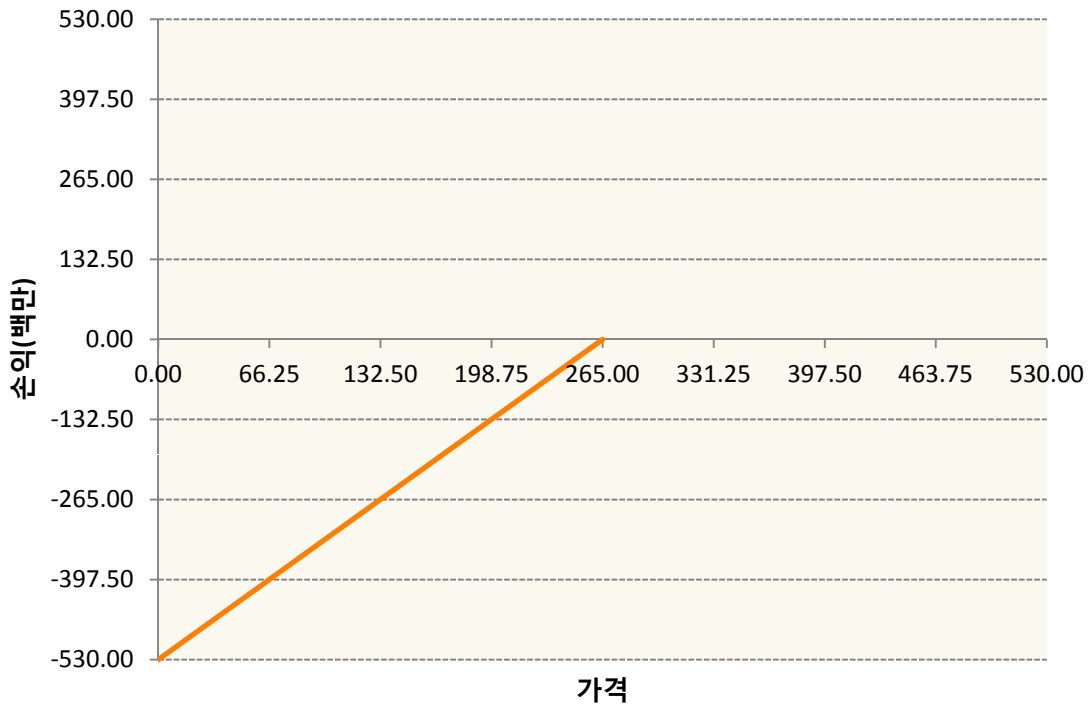


KR4301P62626-2019-06 풋262.5





KR4301P62659-2019-06 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						53
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	53	53	53	53	53	53	53	
-5.33%	36	36	36	36	36	36	36	
-2.67%	18	18	18	18	18	18	18	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	
8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53	
KR4301P62626		2019-06 풋262.5						166
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-161	-162	-162	-163	-164	-165	-166
-5.33%	-88	-89	-91	-93	-96	-98	-101
-2.67%	-27	-30	-34	-37	-40	-44	-48
0%	10	7	3	0	-4	-7	-11
2.67%	24	23	21	18	16	14	11
5.33%	27	27	26	25	24	23	21
8.00%	27	27	27	27	27	26	26

KR4301P62659

2019-06 풋265

33

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-5.33%	-19	-19	-19	-20	-20	-20	-21
-2.67%	-7	-7	-8	-8	-9	-9	-10
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	6	6	5	5	4	3	3
5.33%	7	7	7	6	6	6	5
8.00%	7	7	7	7	7	7	7

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

(단위:백만원)

247

공시일	2019-05-24
기준일	2019-05-23

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

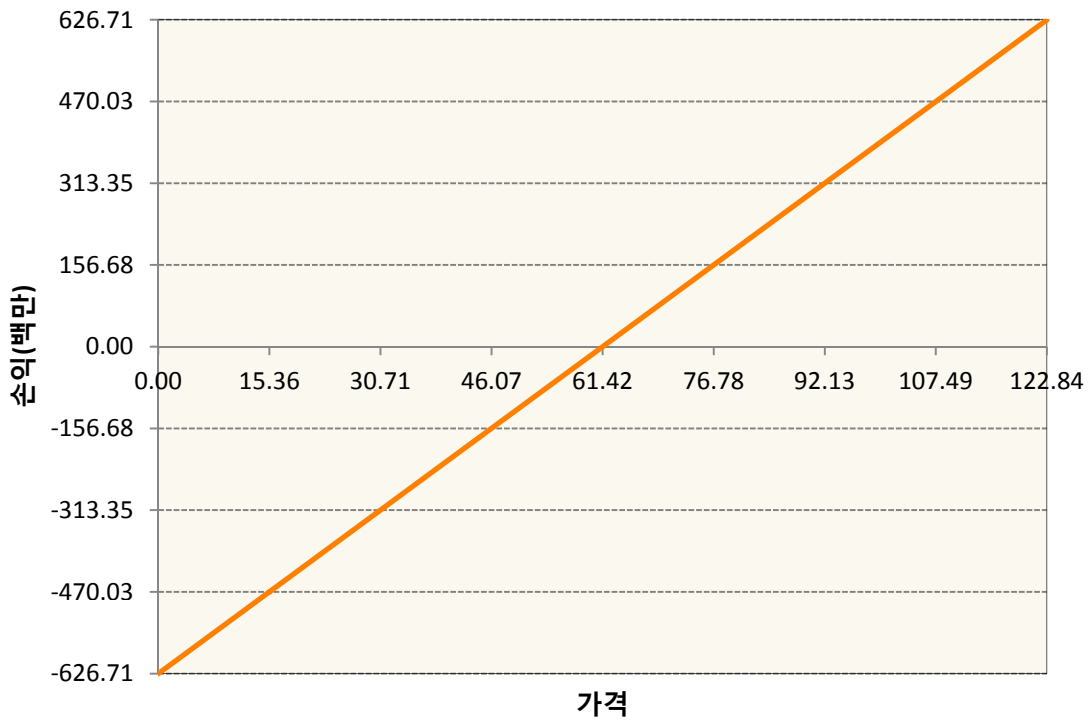
1. 계약금액

(단위:백만원)

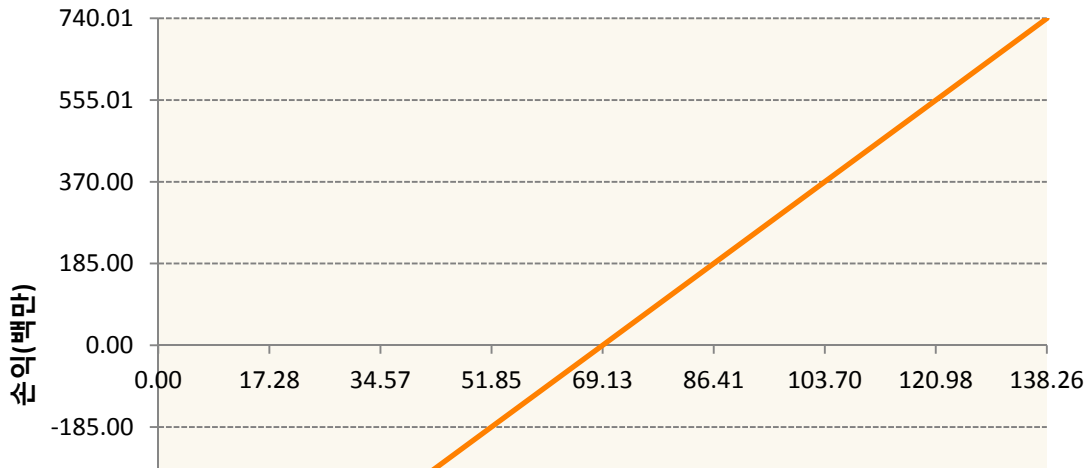
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,740	297	2,442	

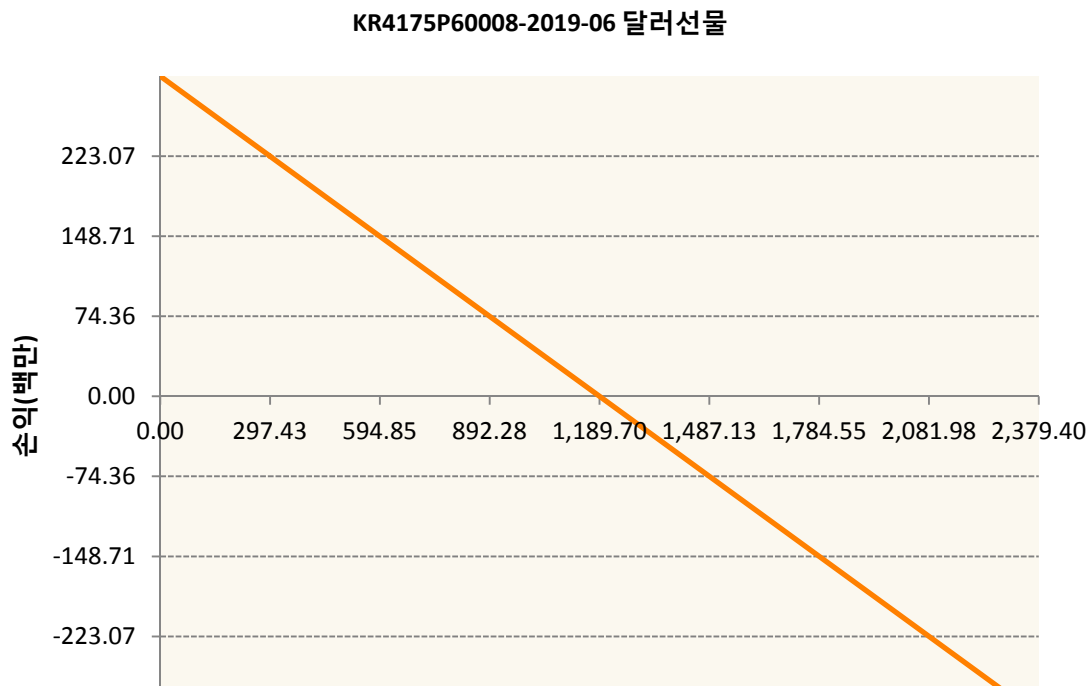
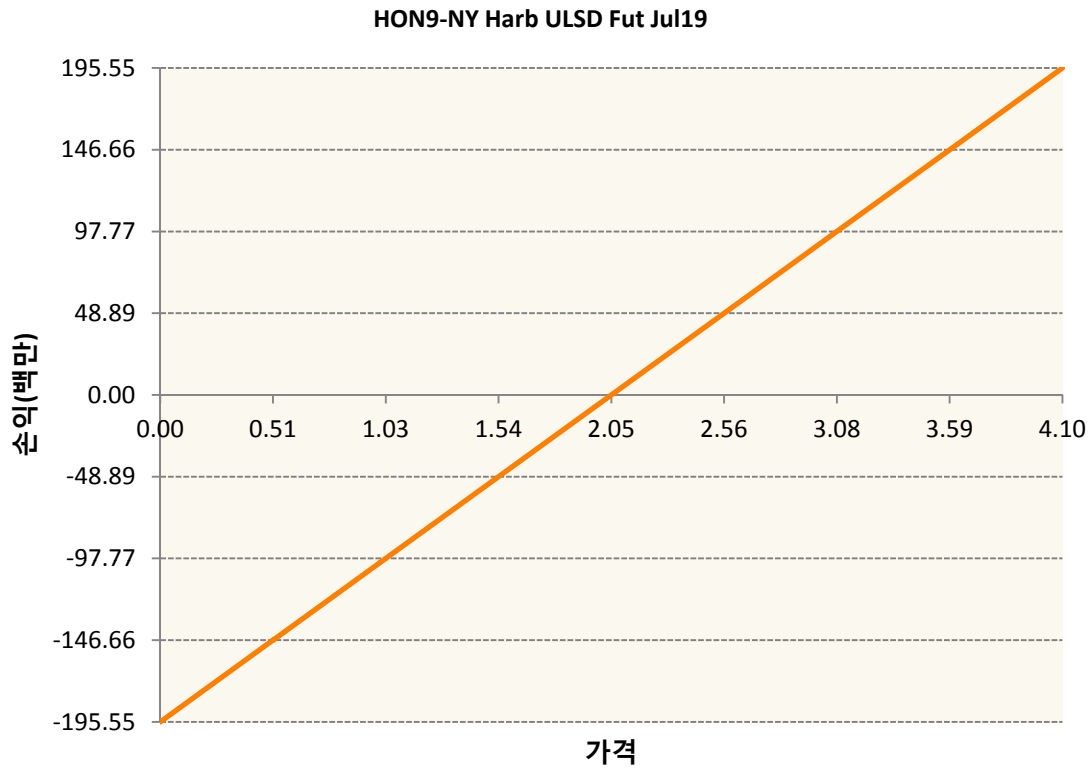
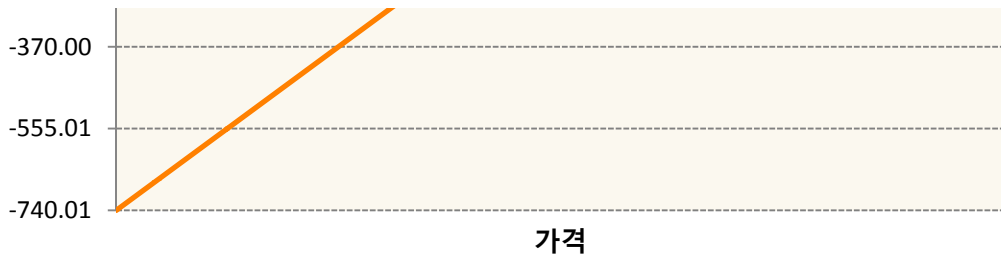
2. 만기시점의 손익구조

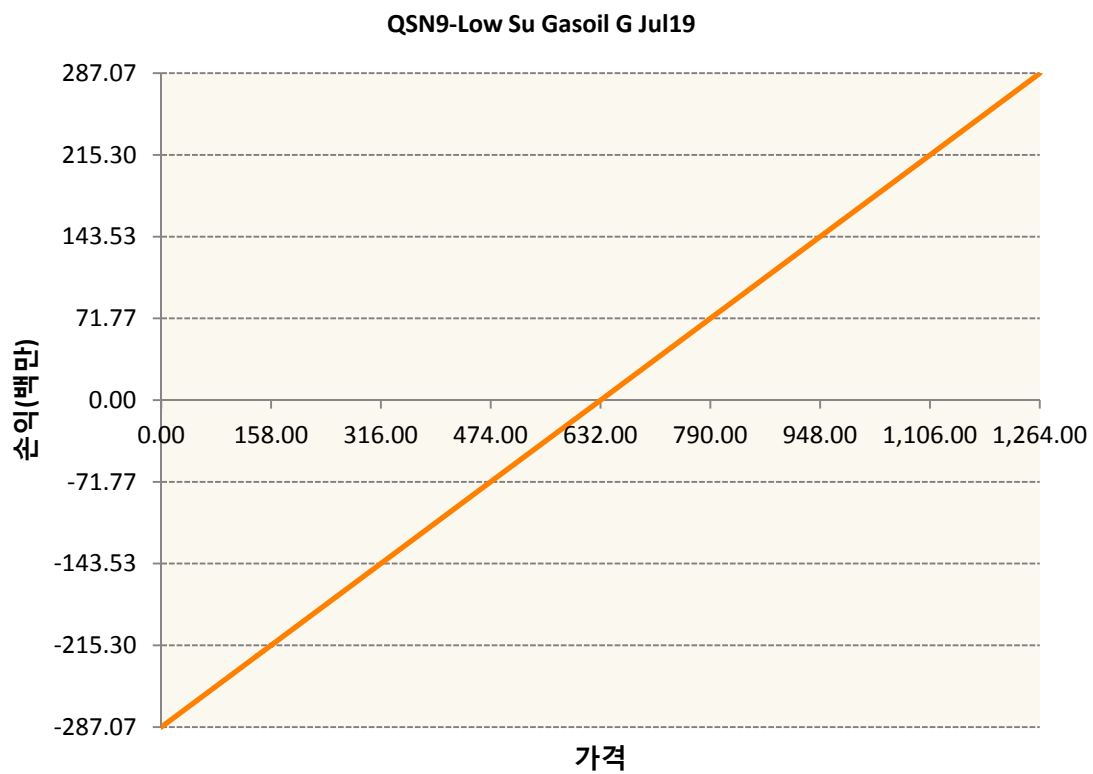
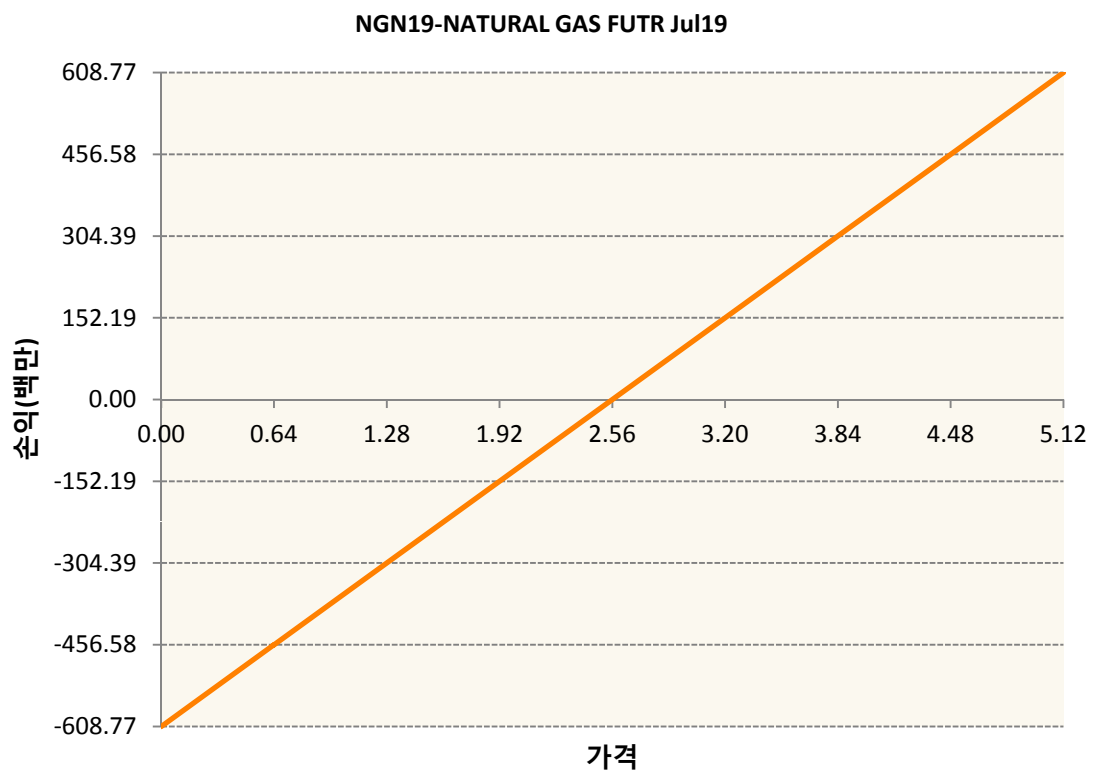
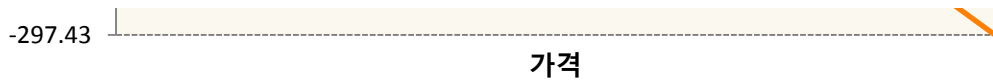
CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19



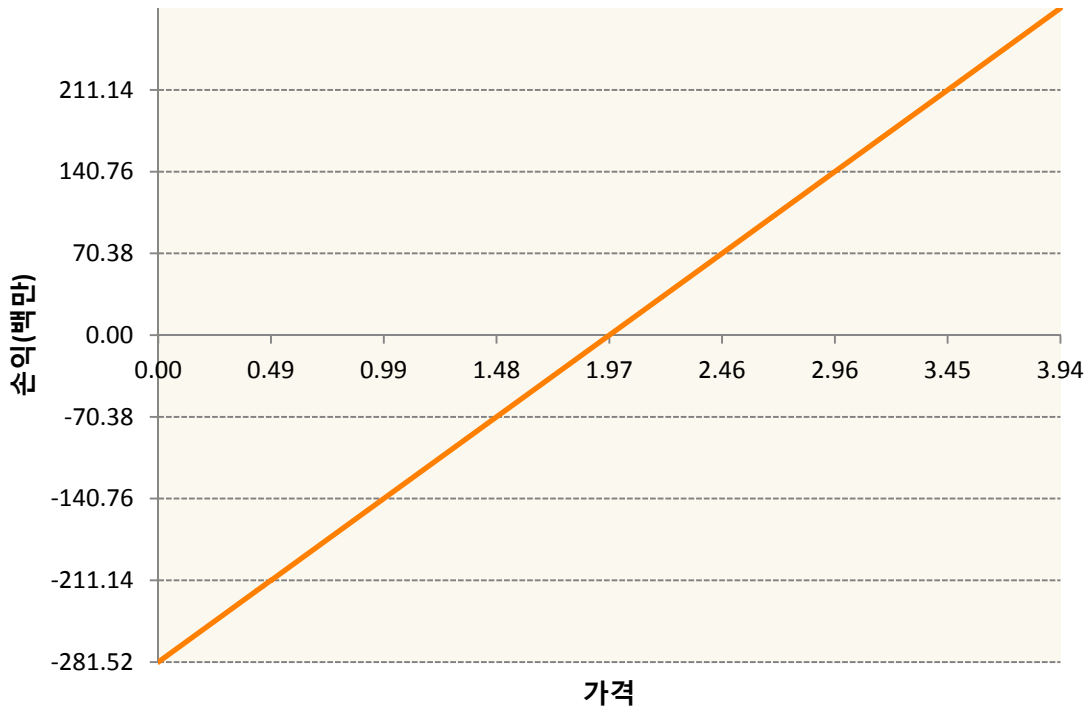
COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19







XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN9	WTI CRUDE FUTURE Jul19	50
COU9	BRENT CRUDE FUTR Sep19	59
HON9	NY Harb ULSD Fut Jul19	16
KR4175P600	2019-06 달러선물	24
NGN19	NATURAL GAS FUTR Jul19	49
QSN9	Low Su Gasoil G Jul19	23
XBN9	GASOLINE RBOB FUT Jul19	23

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

(단위:백만원)

401

공시일	2019-05-24
기준일	2019-05-23

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

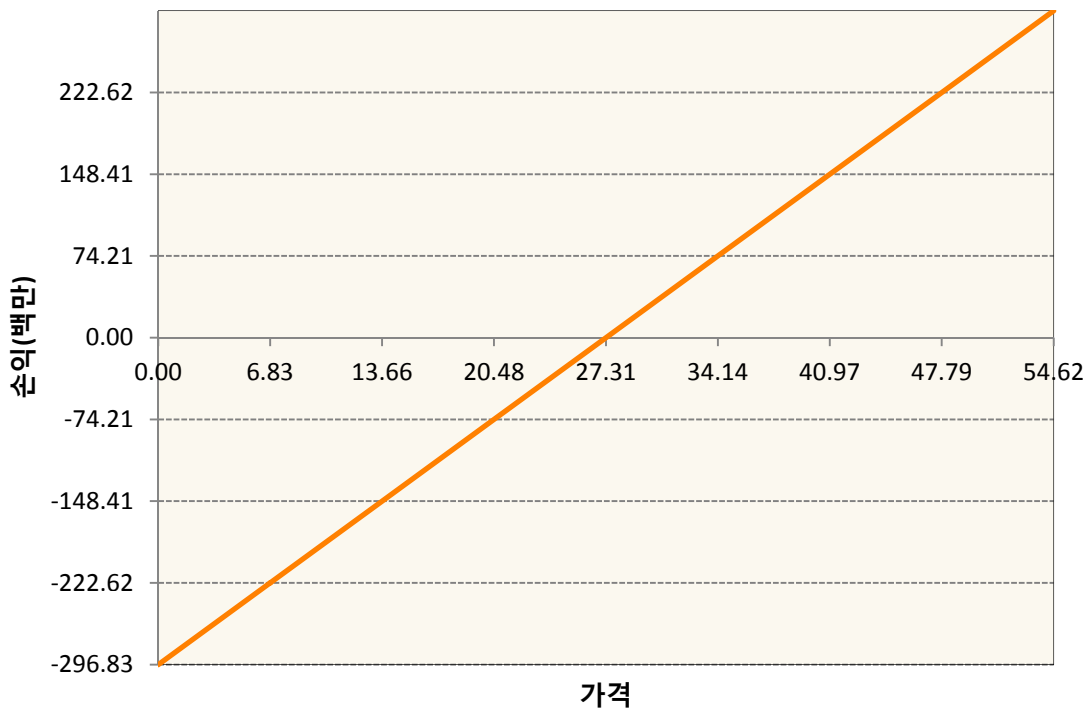
1. 계약금액

(단위:백만원)

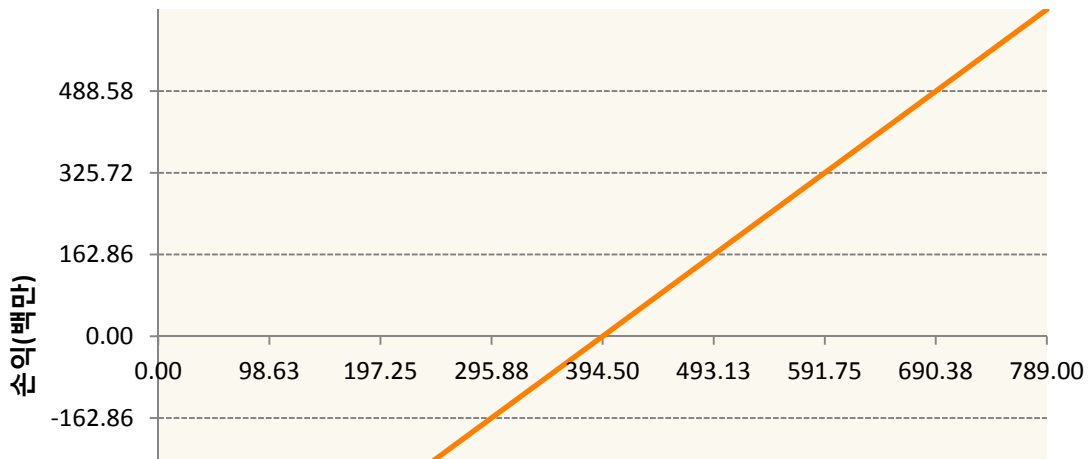
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,921	59	2,861	

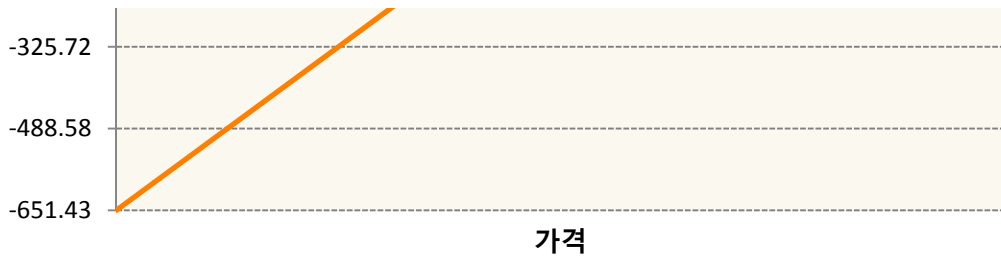
2. 만기시점의 손익구조

BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19

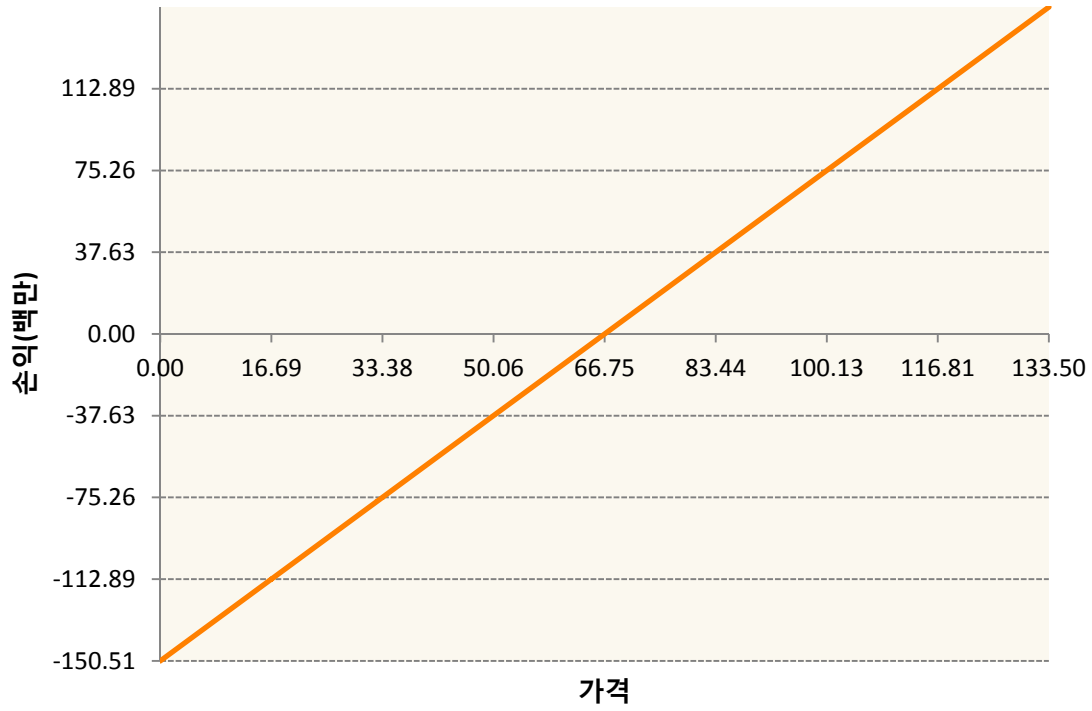


CN9-CORN FUTURE Jul19

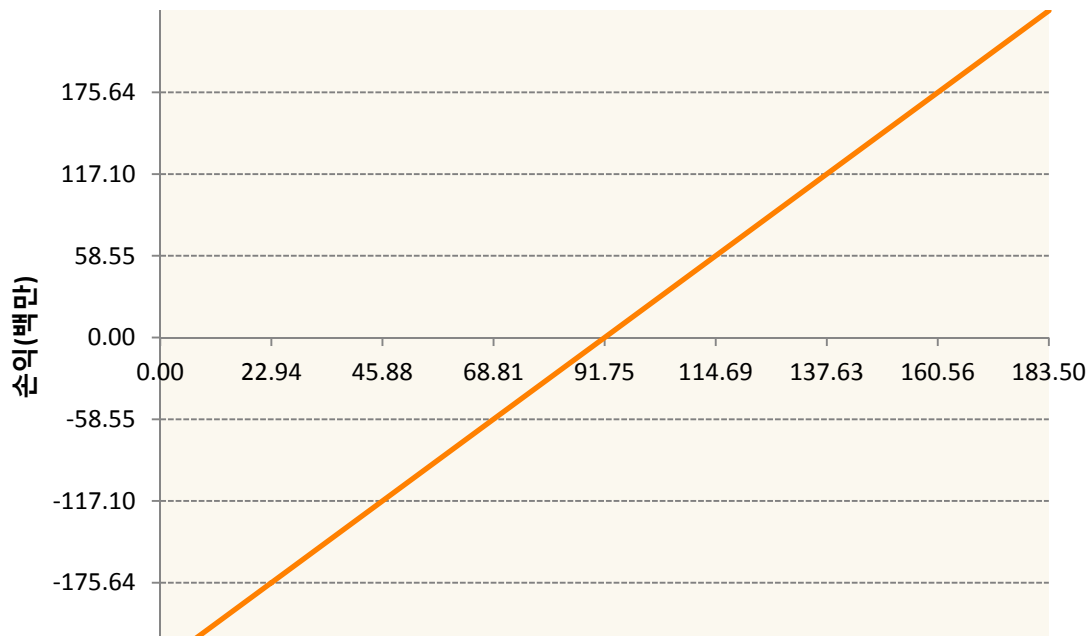


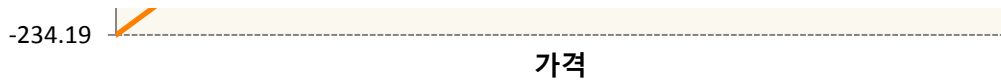


CTN9-COTTON NO.2 FUTR Jul19

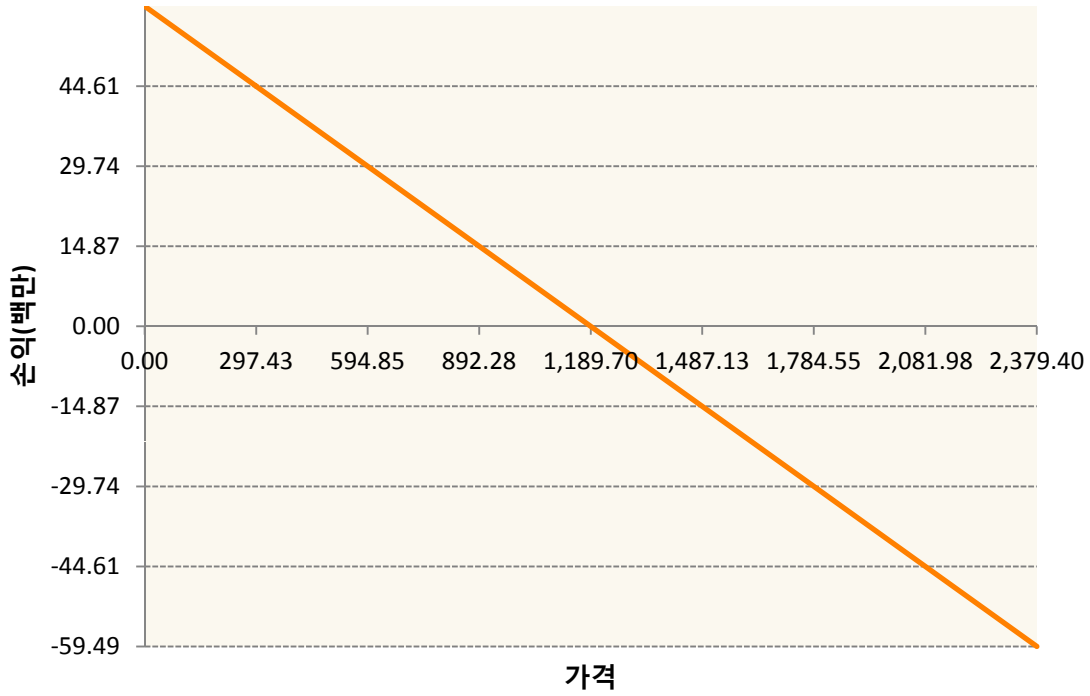


KCN9-COFFEE 'C' FUTURE Jul19

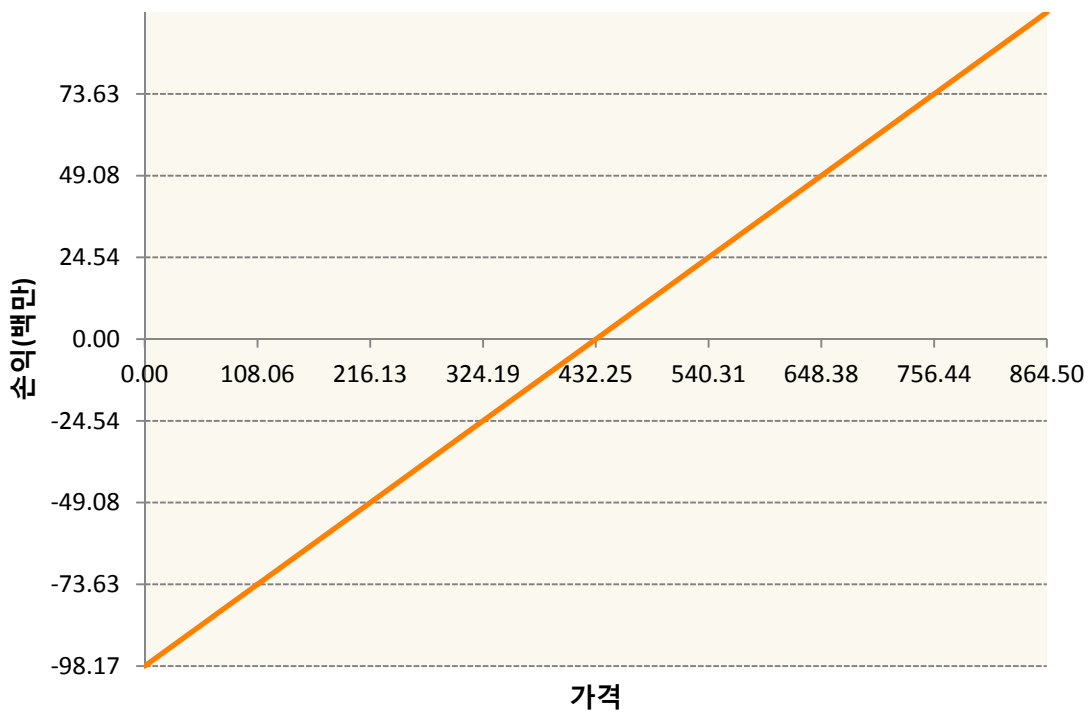




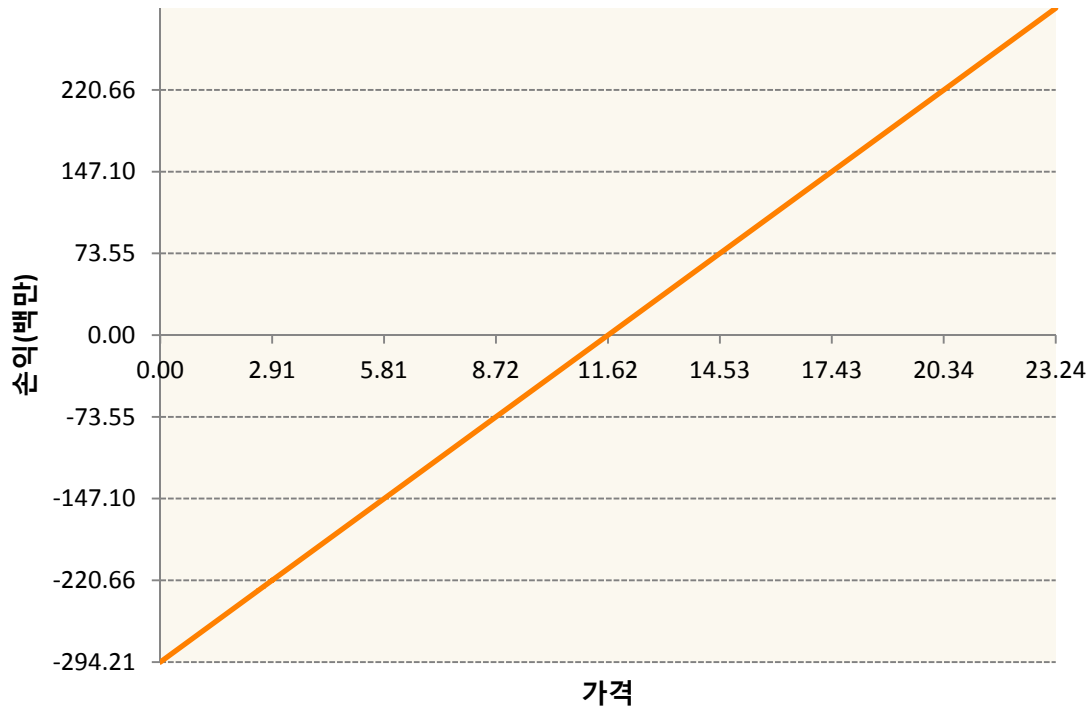
KR4175P60008-2019-06 달러선물



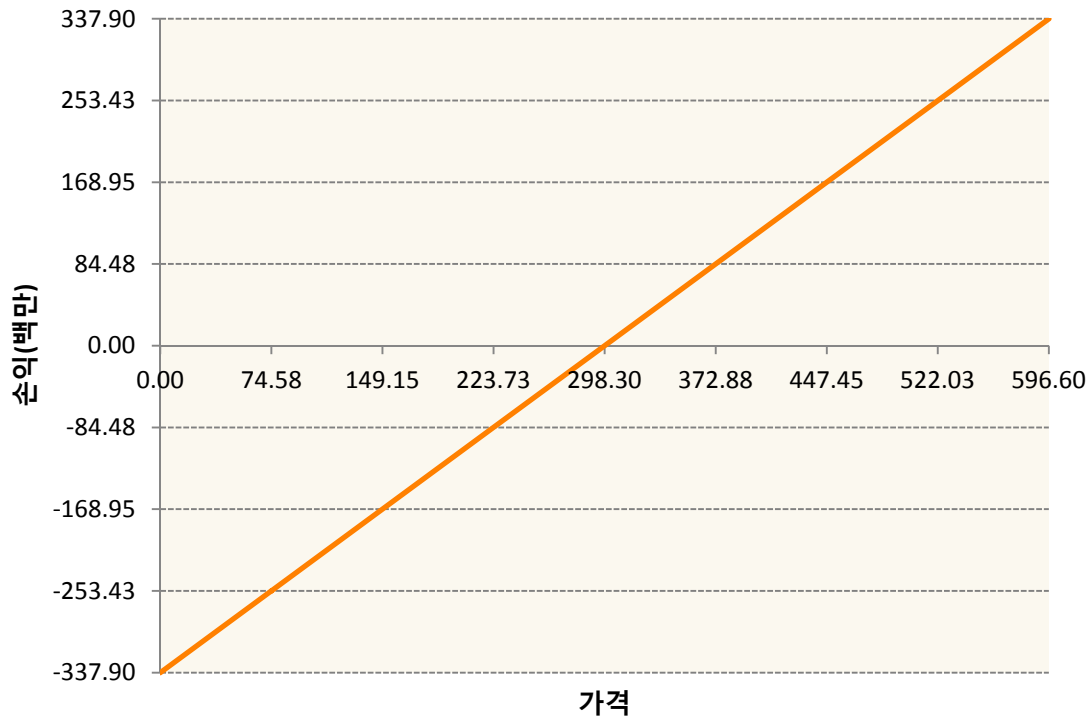
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



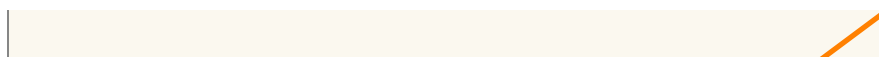
SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

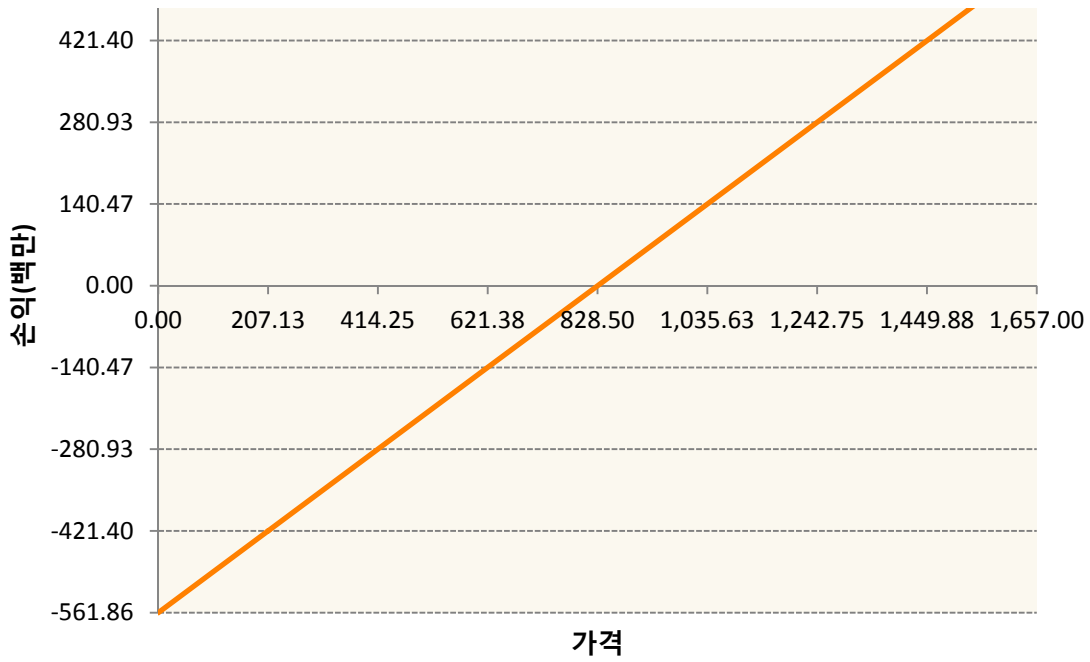


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19

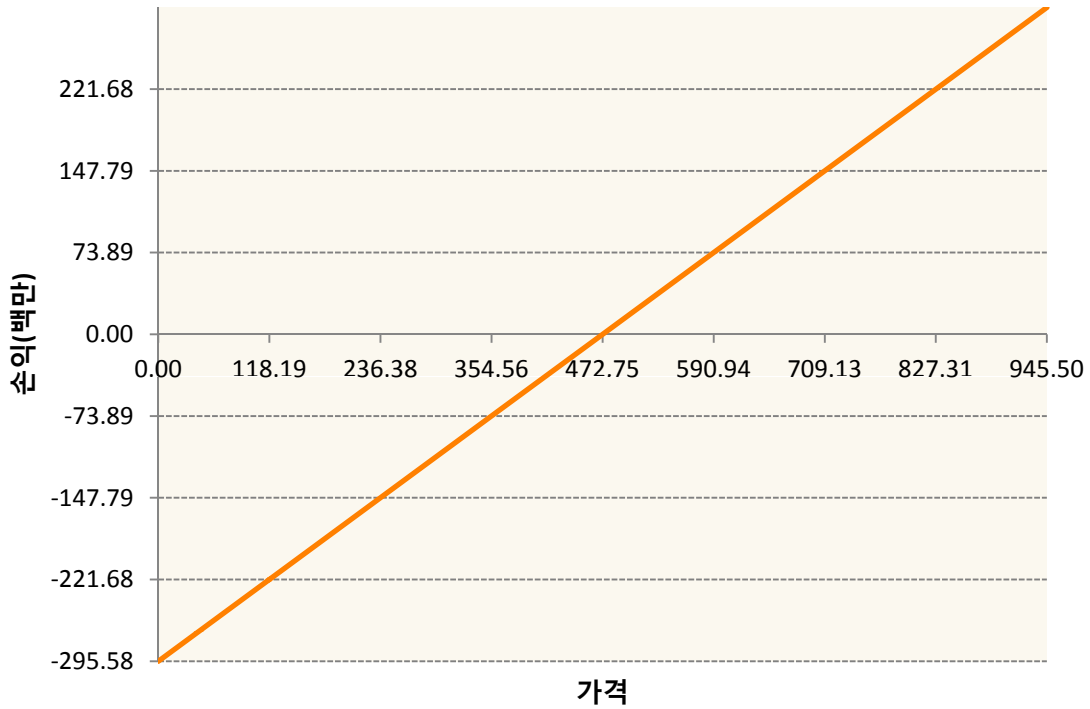


SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





WN9-WHEAT FUTURE(CBT) Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON9	SOYBEAN OIL FUTR Jul19	24
CN9	CORN FUTURE Jul19	52
CTN9	COTTON NO.2 FUTR Jul19	12
KCN9	COFFEE 'C' FUTURE Jul19	19
KR4175P600	2019-06 달러선물	5

KWN9	KC HRW WHEAT FUT Jul19	8
SBN9	SUGAR #11 (WORLD) Jul19	24
SMN9	SOYBEAN MEAL FUTR Jul19	27
SN9	SOYBEAN FUTURE Jul19	45
WN9	WHEAT FUTURE(CBT) Jul19	24

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

(단위:백만원)

240