

공시일	2019-05-28
기준일	2019-05-27

## 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)

89

공시일	2019-05-28
기준일	2019-05-27

## 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

1,121

\* 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	2019-05-28
기준일	2019-05-27

## 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)	301
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	83
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	141

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

<b>879</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-05-28
기준일	2019-05-27

## 유로인덱스모(주식-파생형)

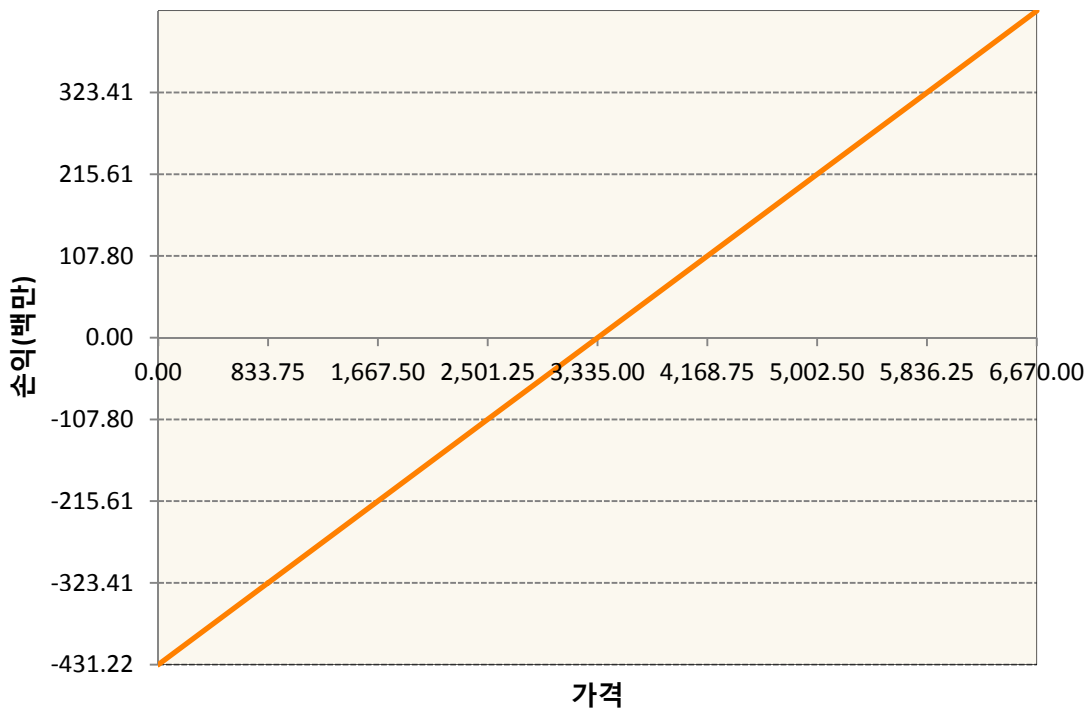
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	431	0	431	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	34
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

25
----

공시일	2019-05-28
기준일	2019-05-27

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

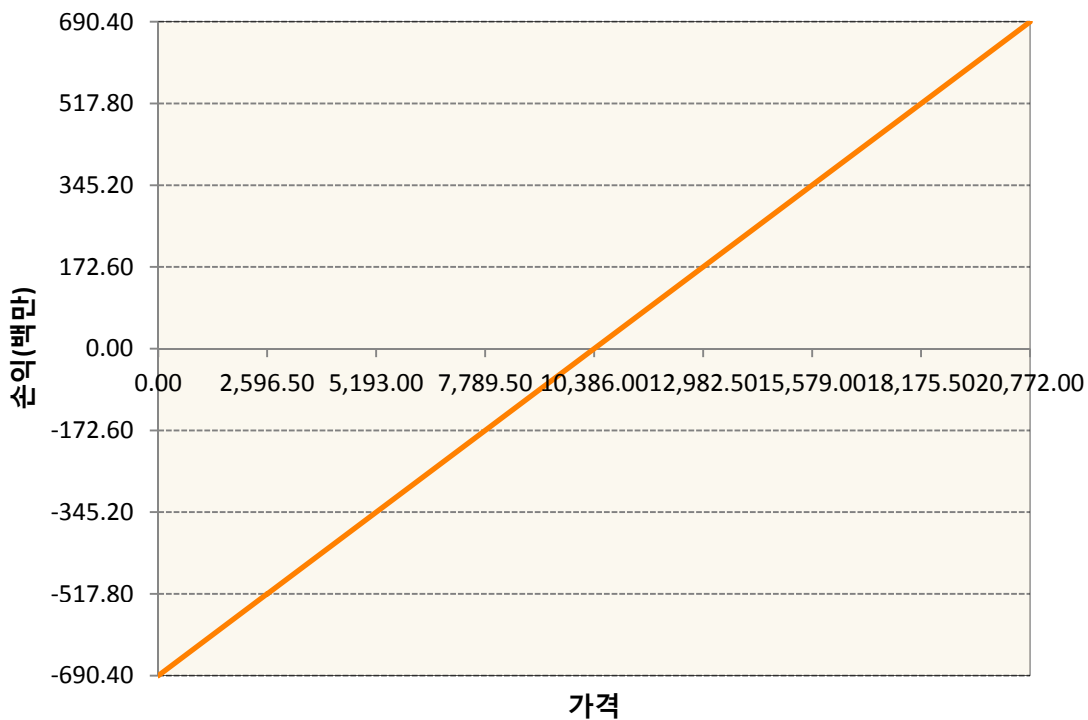
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	690	0	690	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	2019-05-28
기준일	2019-05-27

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

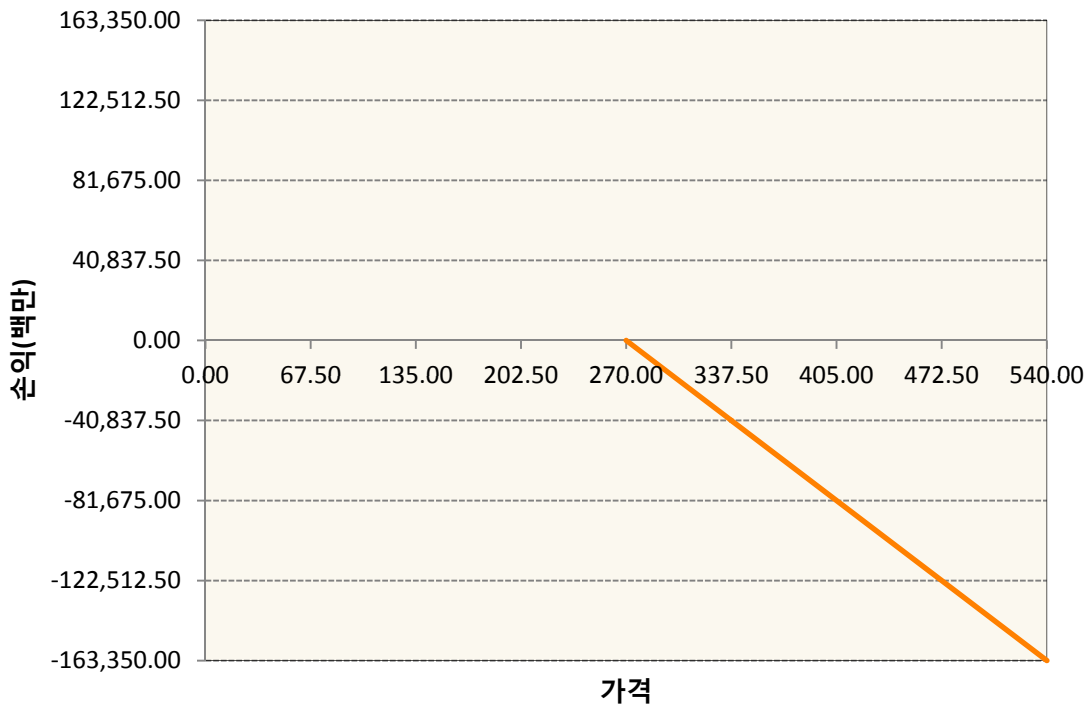
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

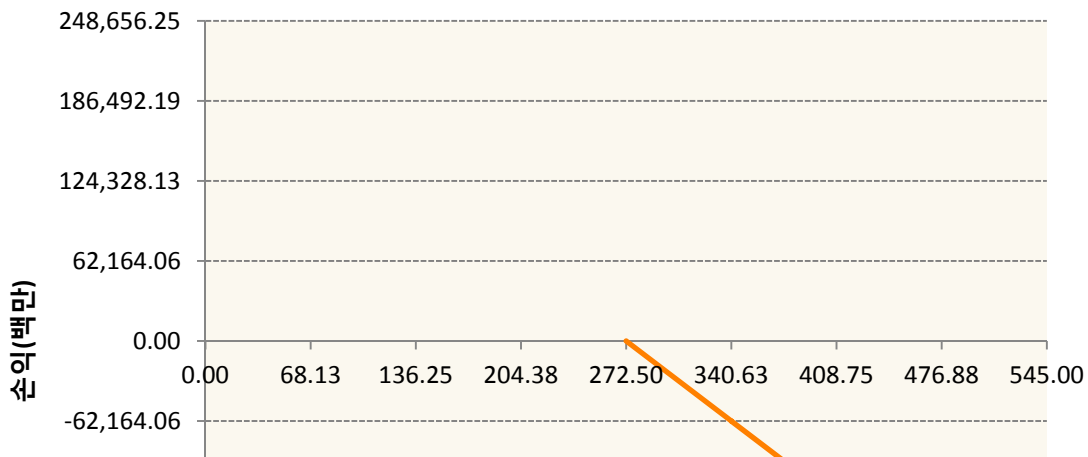
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	614,506	-614,506	장내

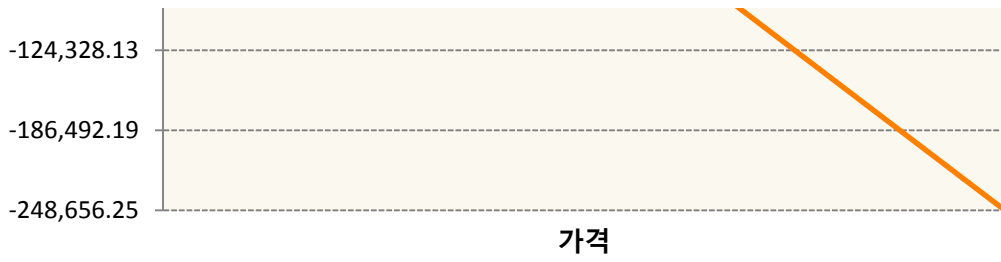
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P62701-2019-06 콜270



KR4201P62727-2019-06 콜272.5





KR4301P62709-2019-06 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P62701		2019-06 콜270					8,616
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,100	2,083	2,055	2,014	1,959	1,889	1,804
-5.33%	2,026	1,961	1,877	1,773	1,651	1,513	1,361
-2.67%	1,711	1,551	1,372	1,178	971	753	527
0%	810	545	275	0	-278	-559	-842
2.67%	-1,029	-1,329	-1,630	-1,930	-2,231	-2,532	-2,833
5.33%	-3,887	-4,127	-4,378	-4,637	-4,903	-5,174	-5,449
8.00%	-7,514	-7,653	-7,814	-7,993	-8,188	-8,396	-8,616
KR4201P62727		2019-06 콜272.5					11,974
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,470	2,455	2,427	2,383	2,321	2,239	2,137

-5.33%	2,406	2,339	2,245	2,124	1,977	1,804	1,609
-2.67%	2,097	1,909	1,688	1,441	1,170	879	571
0%	1,107	753	383	0	-392	-793	-1,199
2.67%	-1,132	-1,587	-2,043	-2,499	-2,955	-3,411	-3,867
5.33%	-4,915	-5,326	-5,747	-6,174	-6,607	-7,043	-7,484
8.00%	-10,023	-10,291	-10,588	-10,909	-11,249	-11,605	-11,974
KR4301P62709                      2019-06 풋270							14,587
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,551	-14,552	-14,553	-14,556	-14,562	-14,572	-14,587
-5.33%	-9,274	-9,282	-9,298	-9,321	-9,355	-9,400	-9,456
-2.67%	-4,077	-4,139	-4,218	-4,314	-4,424	-4,547	-4,682
0%	591	403	205	0	-211	-427	-646
2.67%	3,794	3,548	3,302	3,055	2,808	2,560	2,312
5.33%	5,183	5,037	4,876	4,702	4,517	4,325	4,125
8.00%	5,523	5,481	5,423	5,348	5,258	5,153	5,035

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

(단위:백만원)

**35,371**

공시일	2019-05-28
기준일	2019-05-27

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

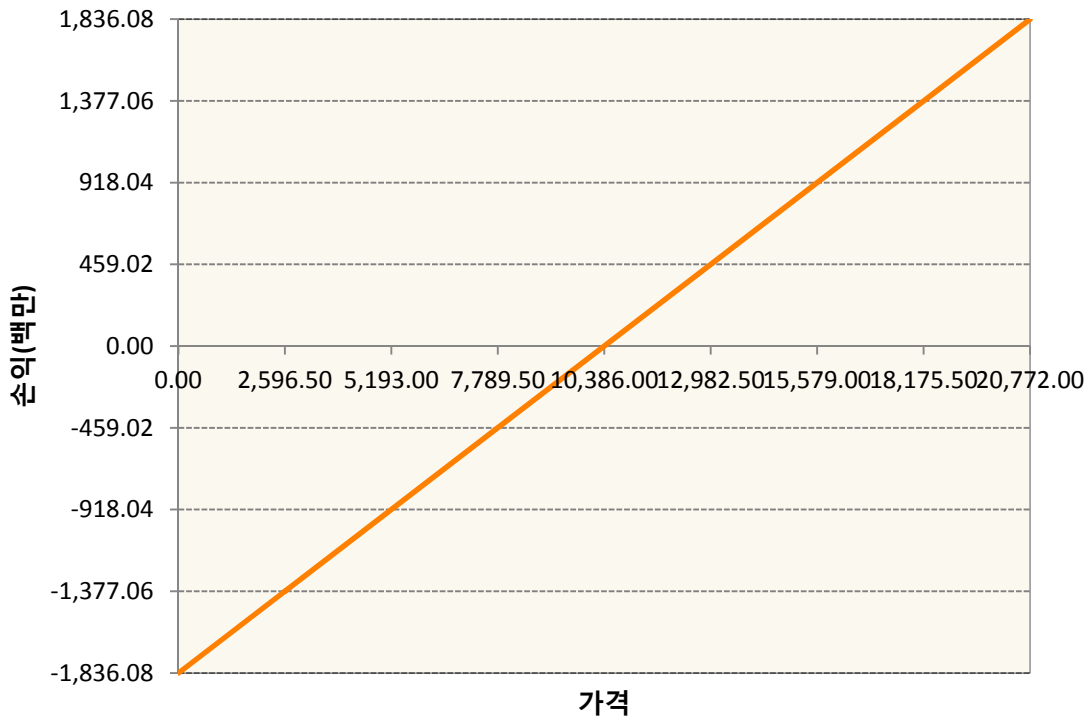
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

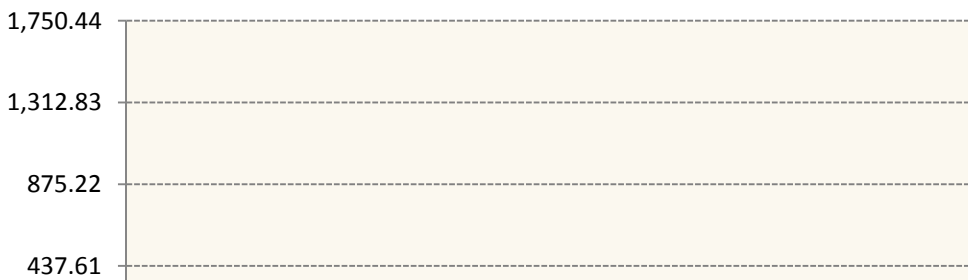
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,836	0	1,836	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,620	-5,620	장내
누계	통화	선도	151	3,169	-3,018	장외

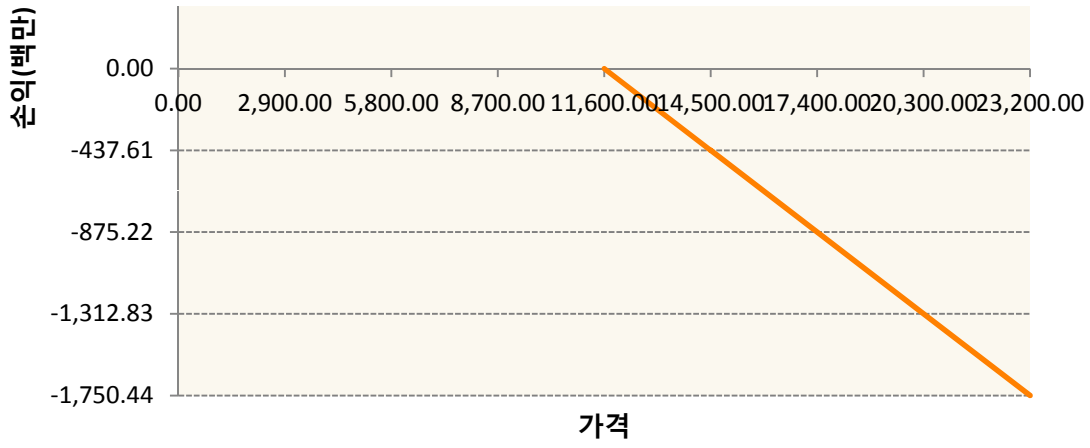
### 2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19

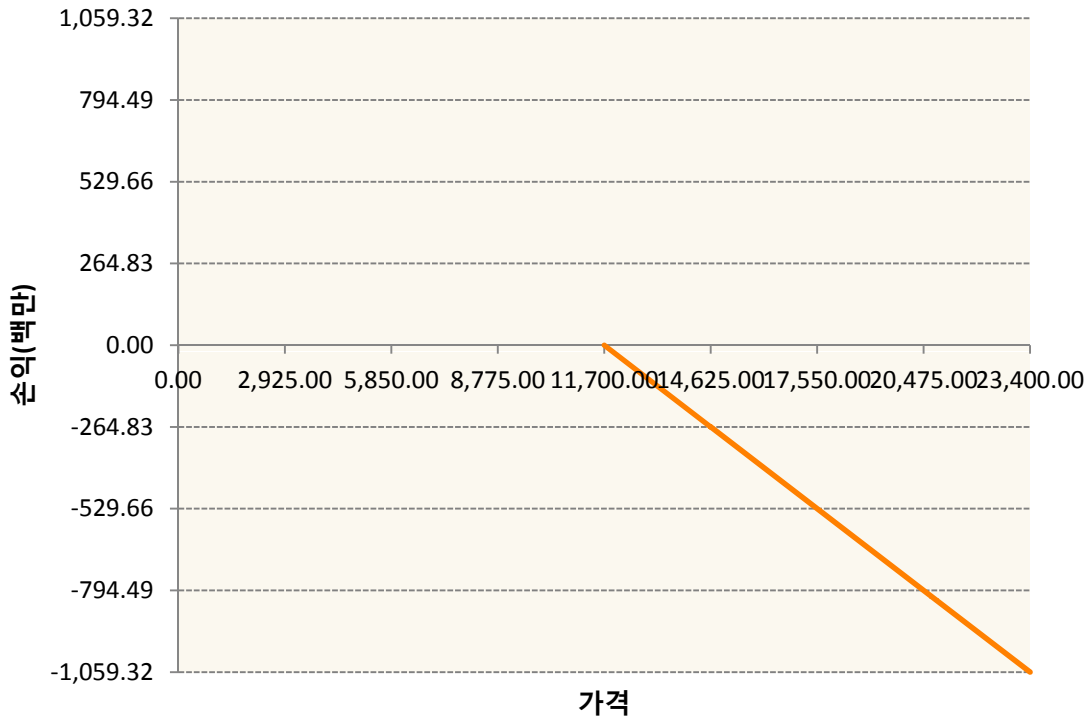


OHHIK9-C116-HSCEI

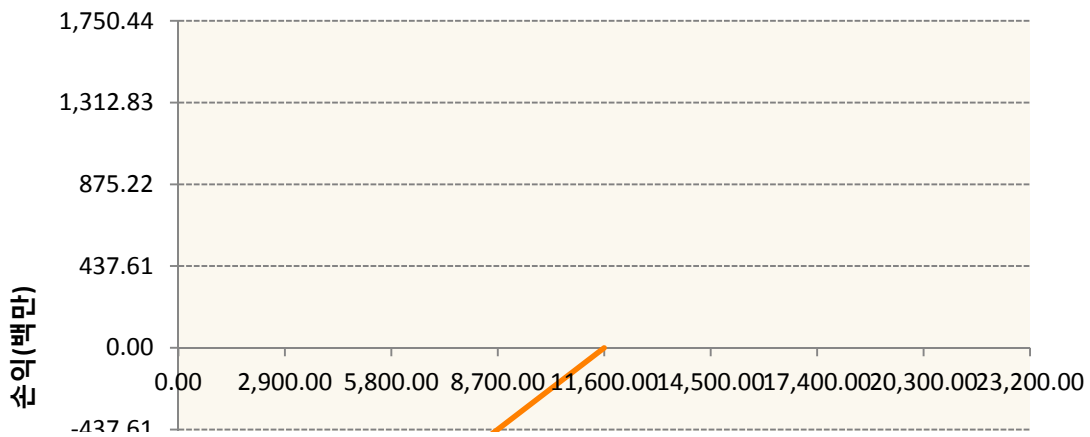


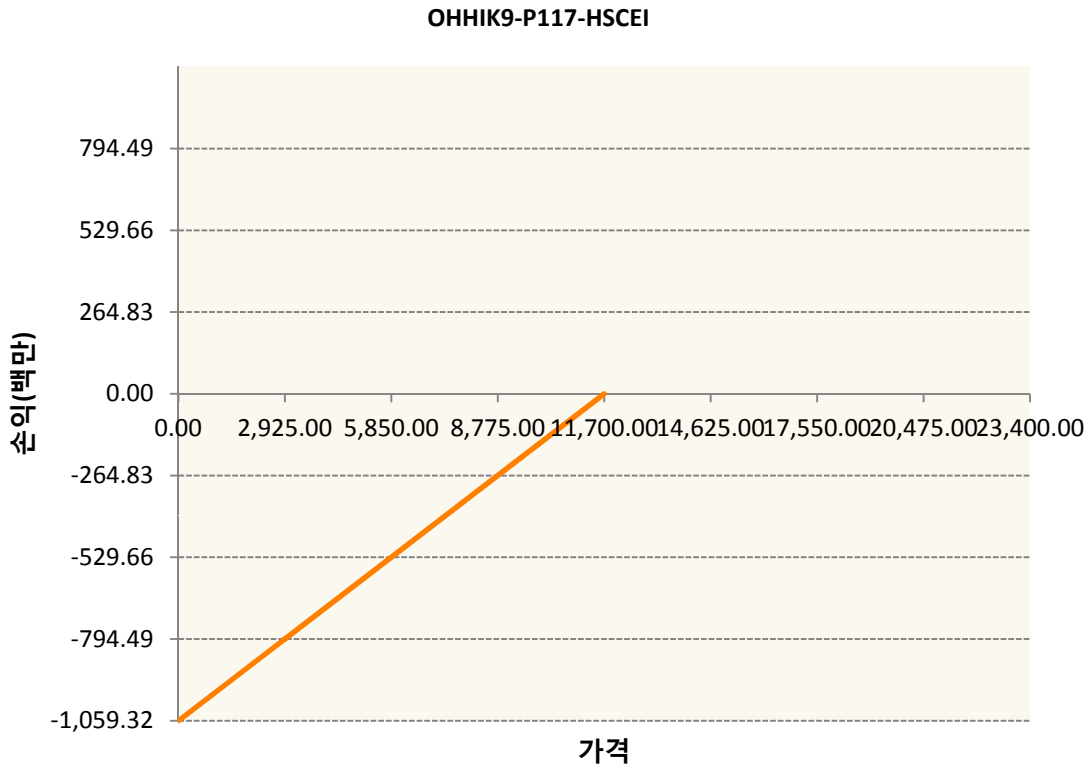


OHHIK9-C117-HSCEI



OHHIK9-P116-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	254
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E	12
HCK9 HSCEI Futures May19	147
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)
	700

공시일	2019-05-28
기준일	2019-05-27

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

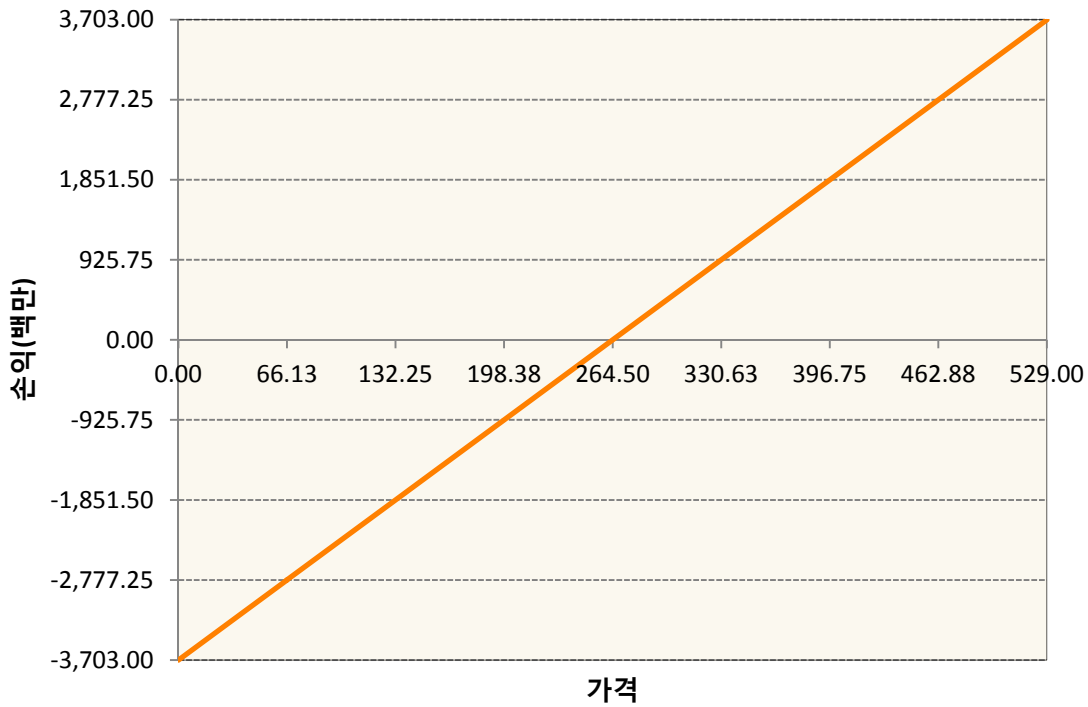
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

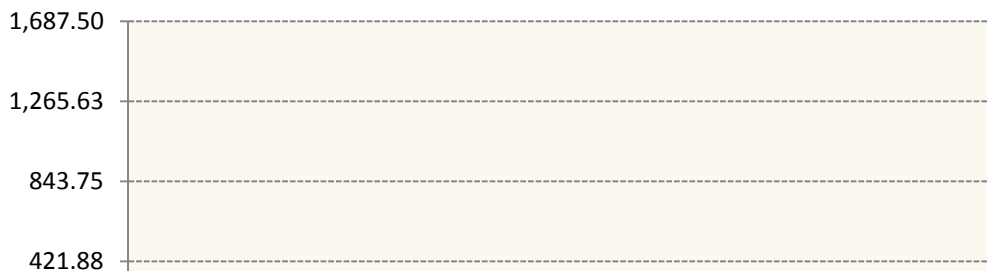
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,703	0	3,703	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	21,759	-21,759	장내

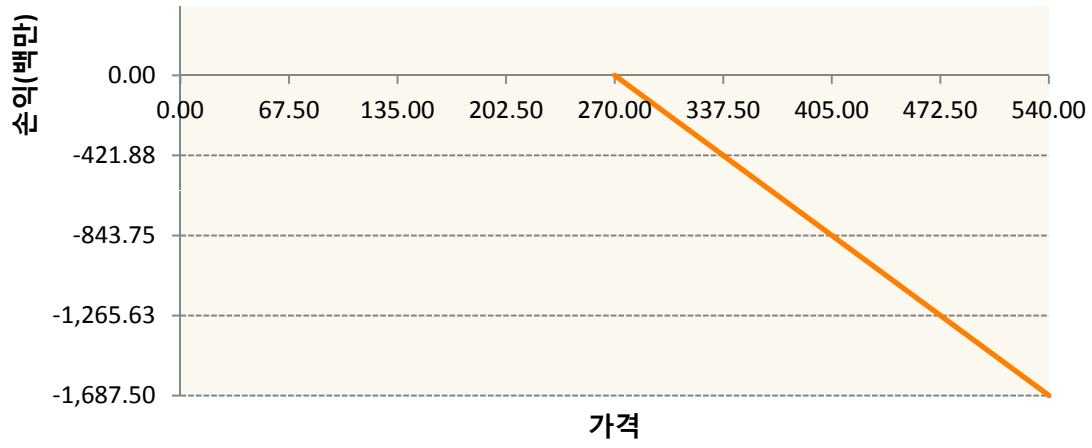
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

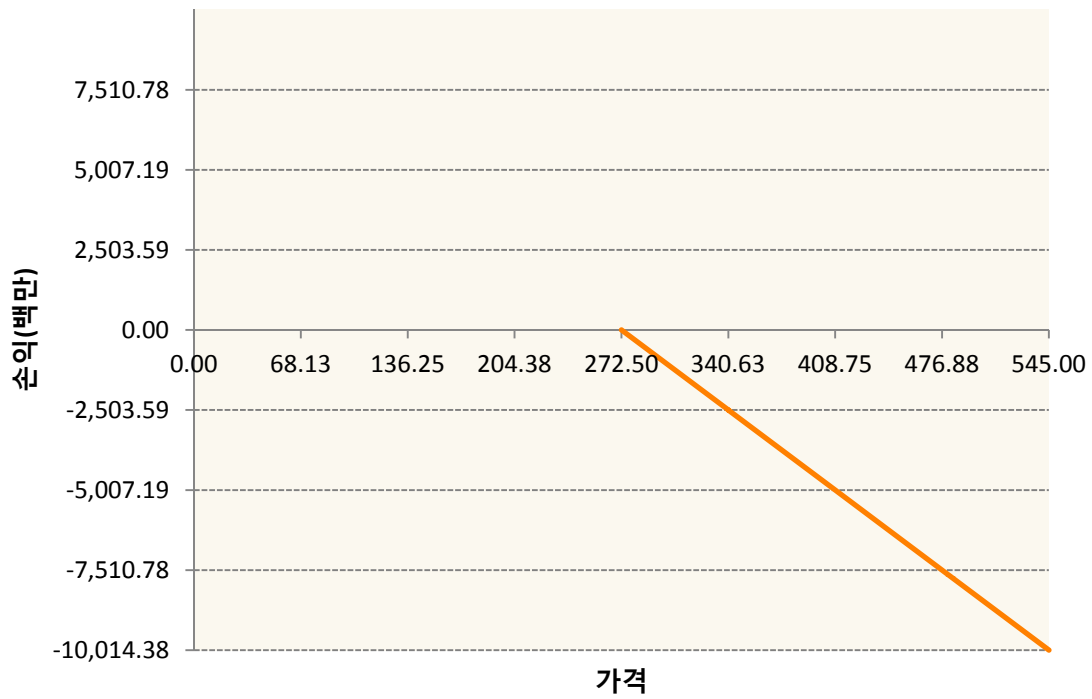


KR4201P62701-2019-06 콜270

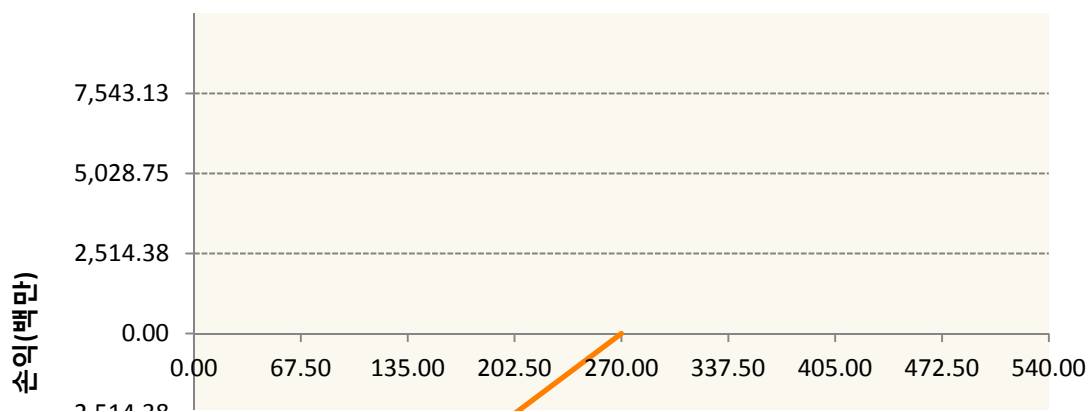


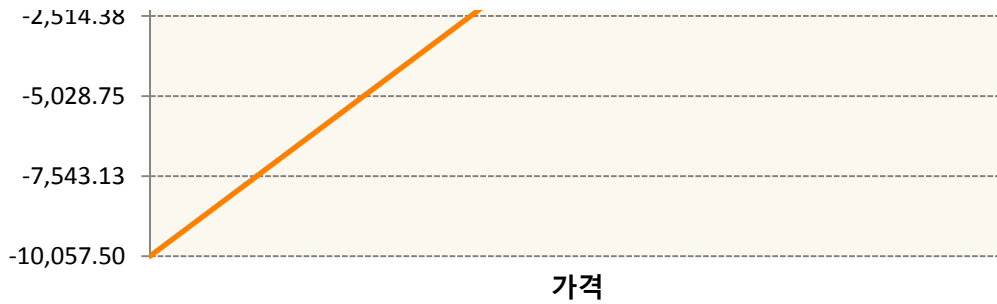


**KR4201P62727-2019-06 콜272.5**



**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						296
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-296	-296	-296	-296	-296	-296	-296	
-5.33%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197	
-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%	197	197	197	197	197	197	197	
8.00%	296	296	296	296	296	296	296	
KR4201P62701		2019-06 콜270						89
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	22	22	21	21	20	20	19
-5.33%	21	20	19	18	17	16	14
-2.67%	18	16	14	12	10	8	5
0%	8	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	-11	-14	-17	-20	-23	-26	-29
5.33%	-40	-43	-45	-48	-51	-53	-56
8.00%	-78	-79	-81	-83	-85	-87	-89
KR4201P62727                      2019-06 콜272.5							482
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	99	99	98	96	93	90	86
-5.33%	97	94	90	86	80	73	65
-2.67%	84	77	68	58	47	35	23
0%	45	30	15	0	-16	-32	-48
2.67%	-46	-64	-82	-101	-119	-137	-156
5.33%	-198	-215	-231	-249	-266	-284	-301
8.00%	-404	-414	-426	-439	-453	-467	-482
KR4301P62709                      2019-06 풋270							724
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-723	-723	-723	-723	-723	-724	-724
-5.33%	-461	-461	-462	-463	-465	-467	-470
-2.67%	-203	-206	-210	-214	-220	-226	-233
0%	29	20	10	0	-10	-21	-32
2.67%	188	176	164	152	139	127	115
5.33%	257	250	242	234	224	215	205
8.00%	274	272	269	266	261	256	250

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

(단위:백만원)

**3,382**

공시일	2019-05-28
기준일	2019-05-27

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

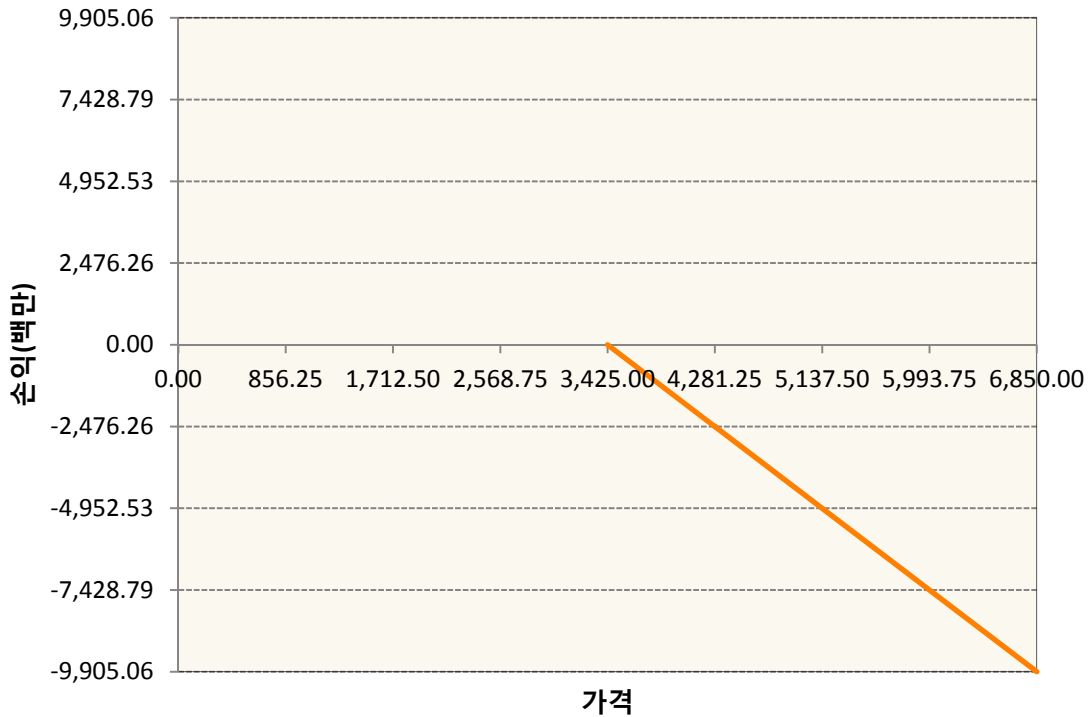
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

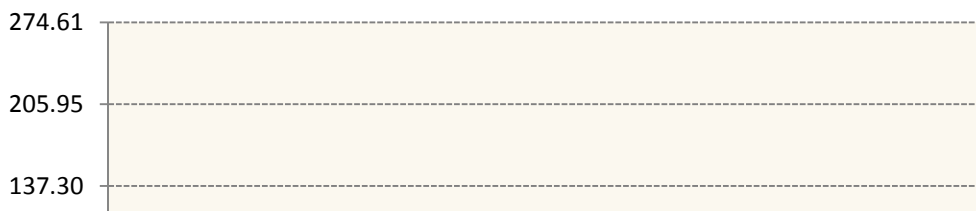
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,646	0	3,646	
누계	유가증권	스왑	56,155	0	56,155	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,359	-20,359	장내
누계	통화	선도	0	18,573	-18,573	장외

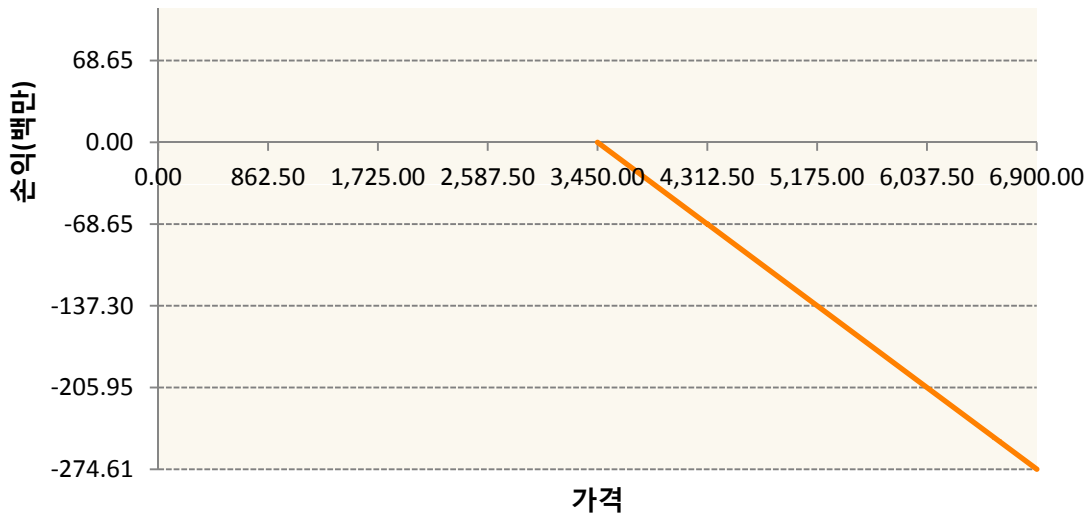
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXM9-C3425-EURO STOXX 50**

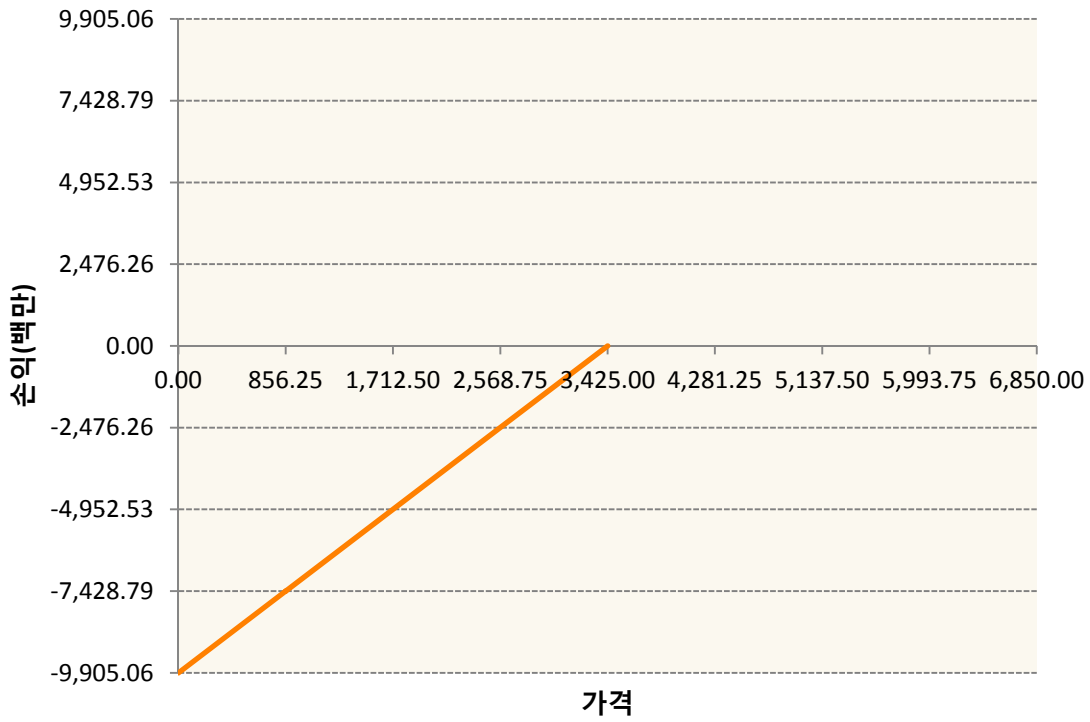


**OESXM9-C3450-EURO STOXX 50**

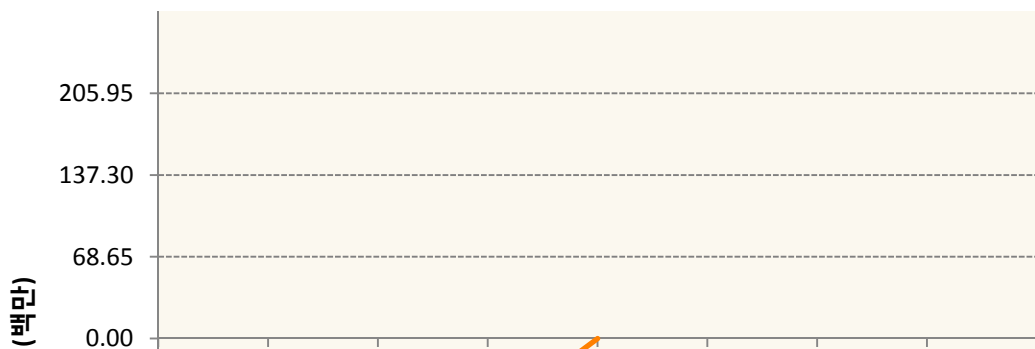


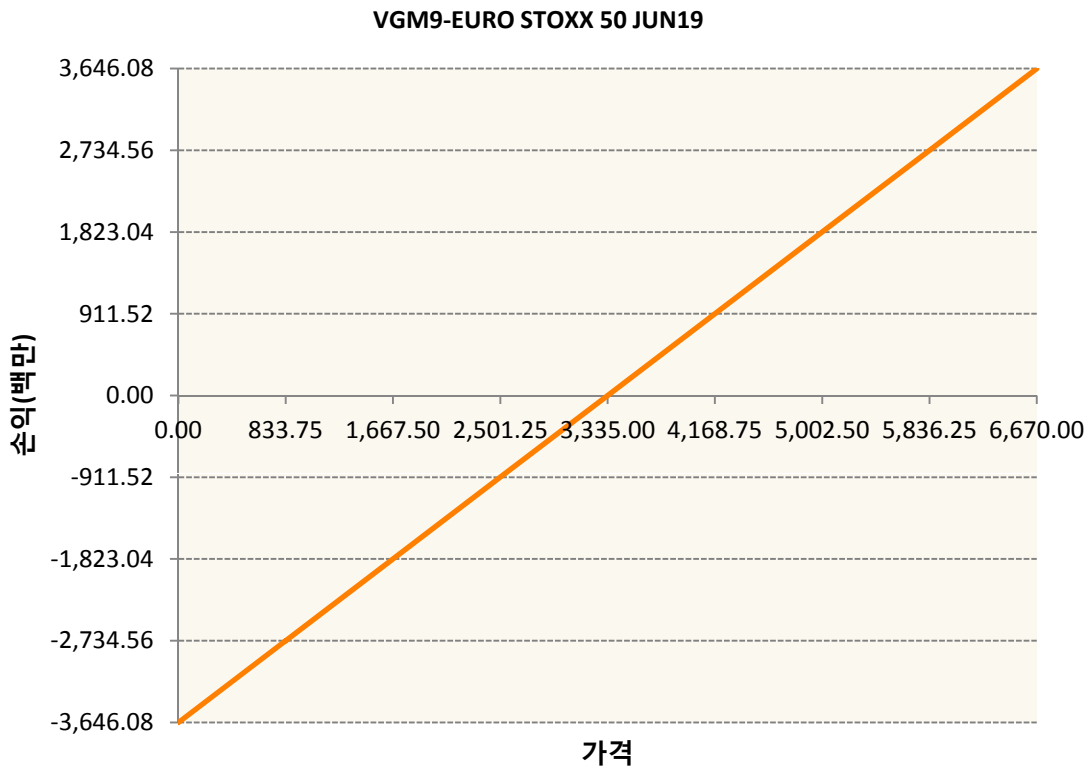
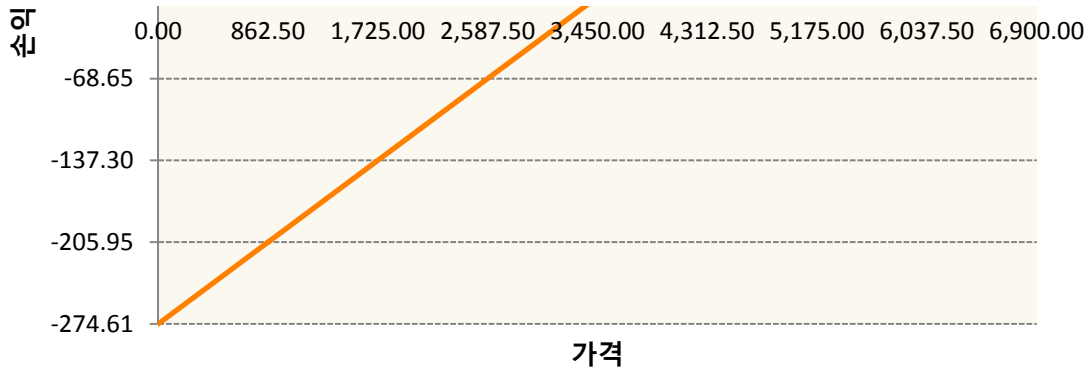


OESXM9-P3425-EURO STOXX 50



OESXM9-P3450-EURO STOXX 50





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	80
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	849
FX21019J01: KRW/EUR 28-06-19E	212
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	425
OESXM9-C3·EURO STOXX 50	792
OESXM9-C3·EURO STOXX 50	22
OESXM9-P3·EURO STOXX 50	792
OESXM9-P3·EURO STOXX 50	22
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	292

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

(단위:백만원)

2,212



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

(단위:백만원)

1,013



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

(단위:백만원)

89



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

(단위:백만원)

129

공시일	2019-05-28
기준일	2019-05-27

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

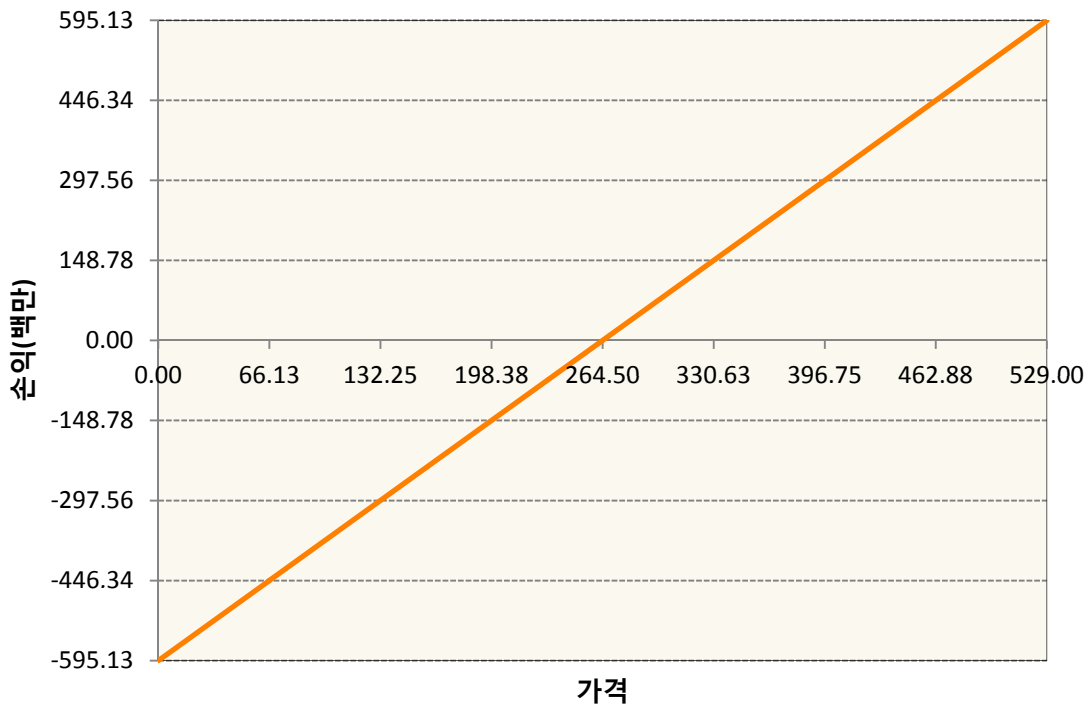
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	595	0	595	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	2019-05-28
기준일	2019-05-27

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

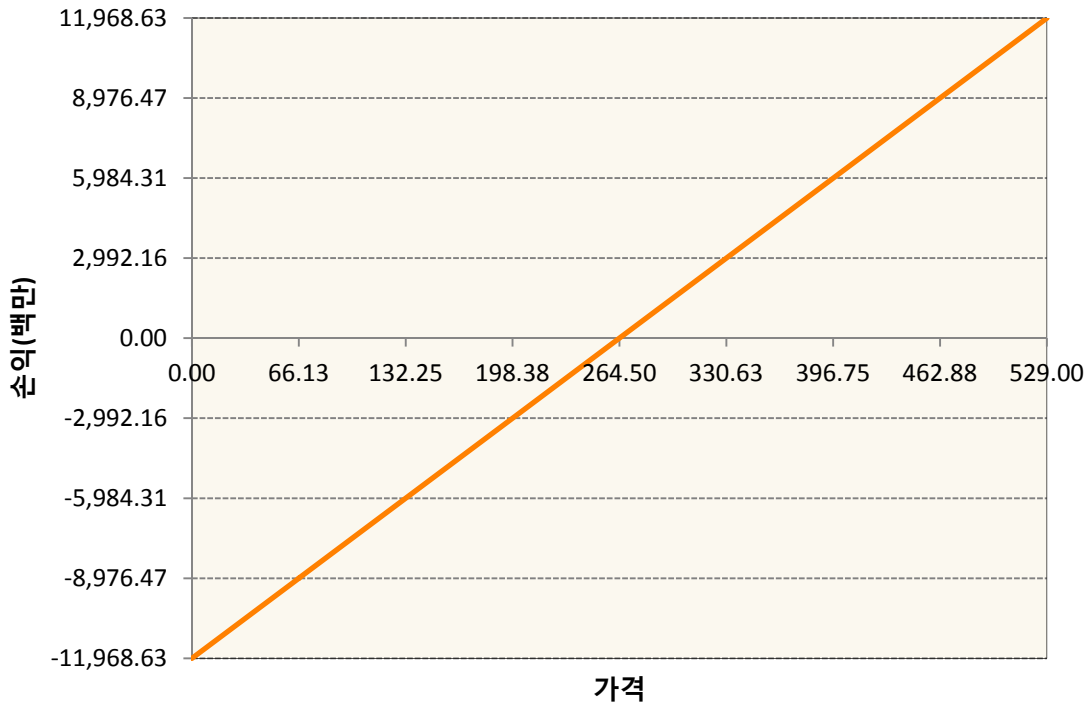
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

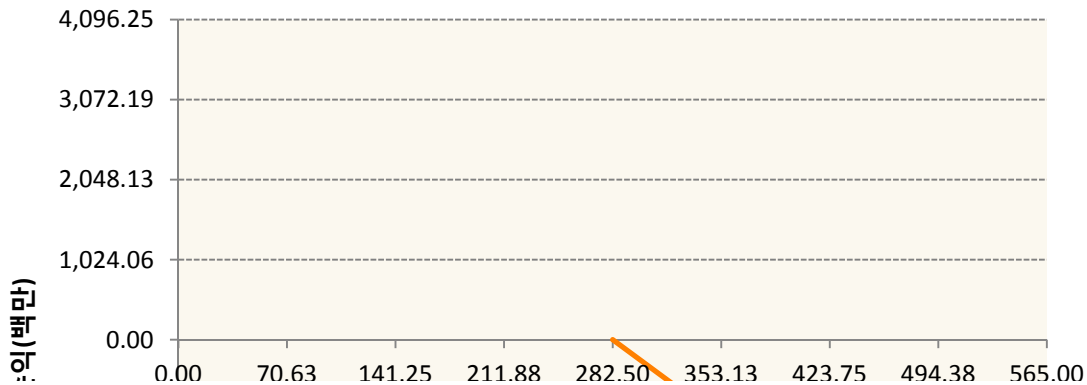
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,969	0	11,969	장내
누계	유가증권	옵션	5,081	22,906	-17,825	장내

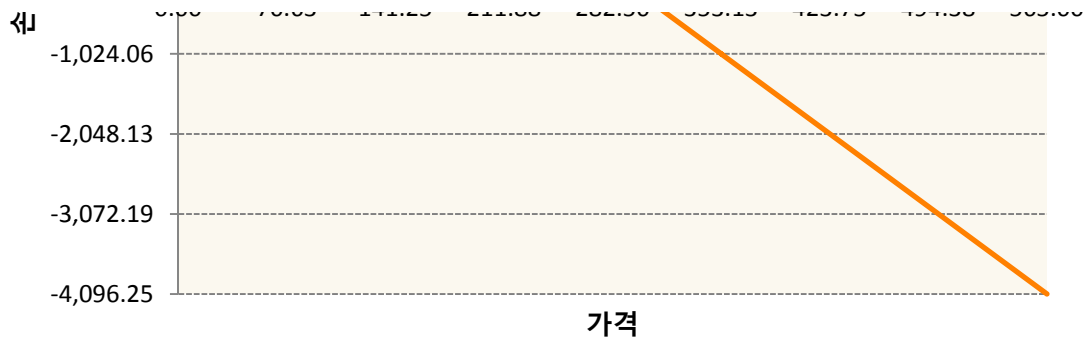
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

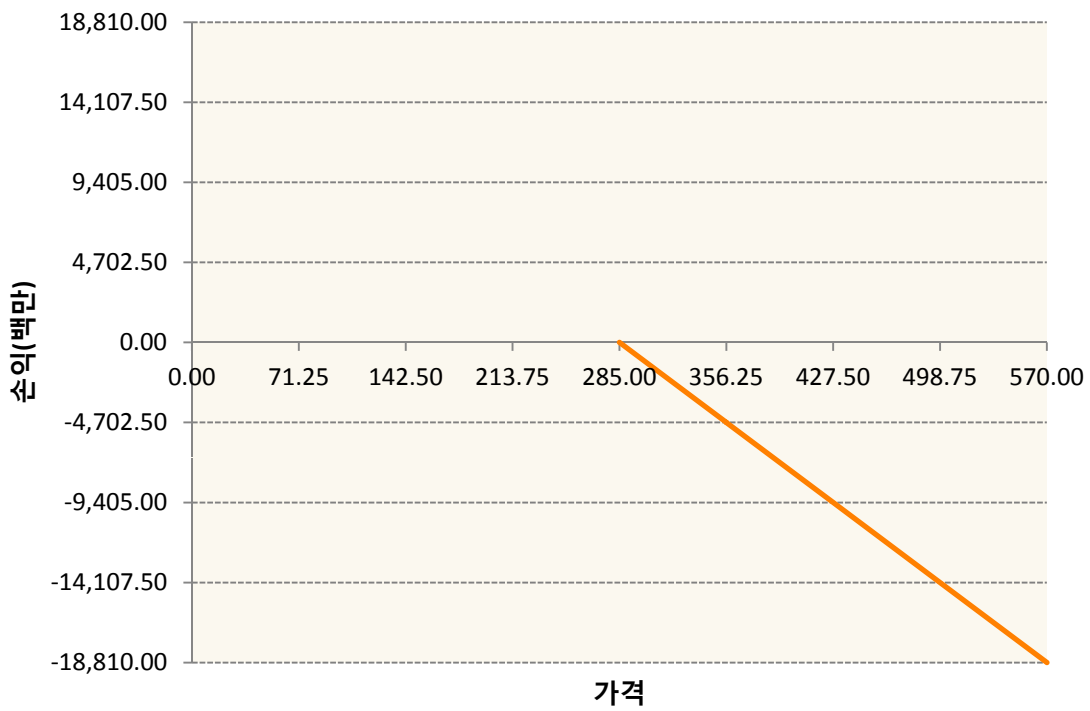


KR4201P62826-2019-06 콜282.5

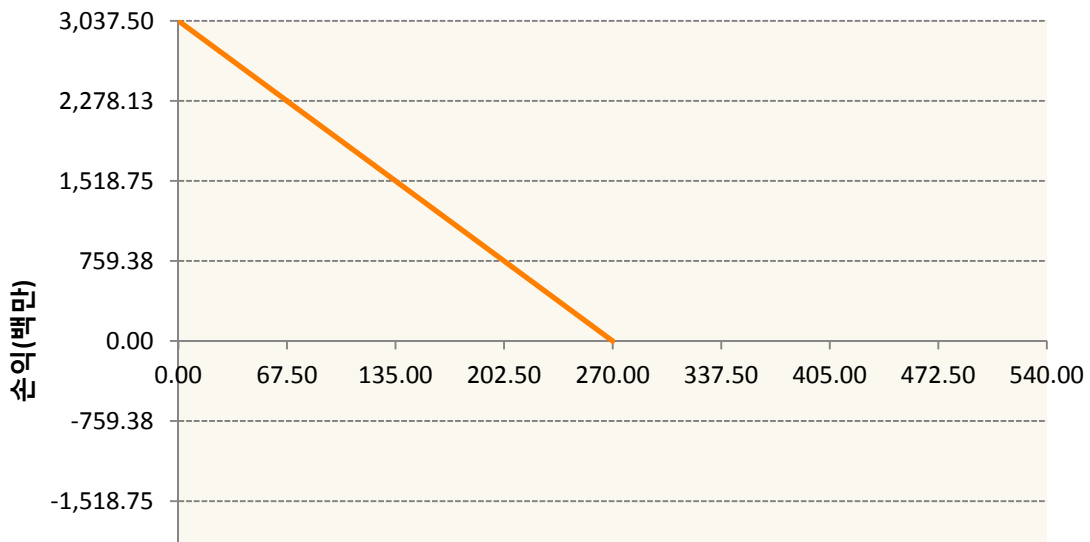


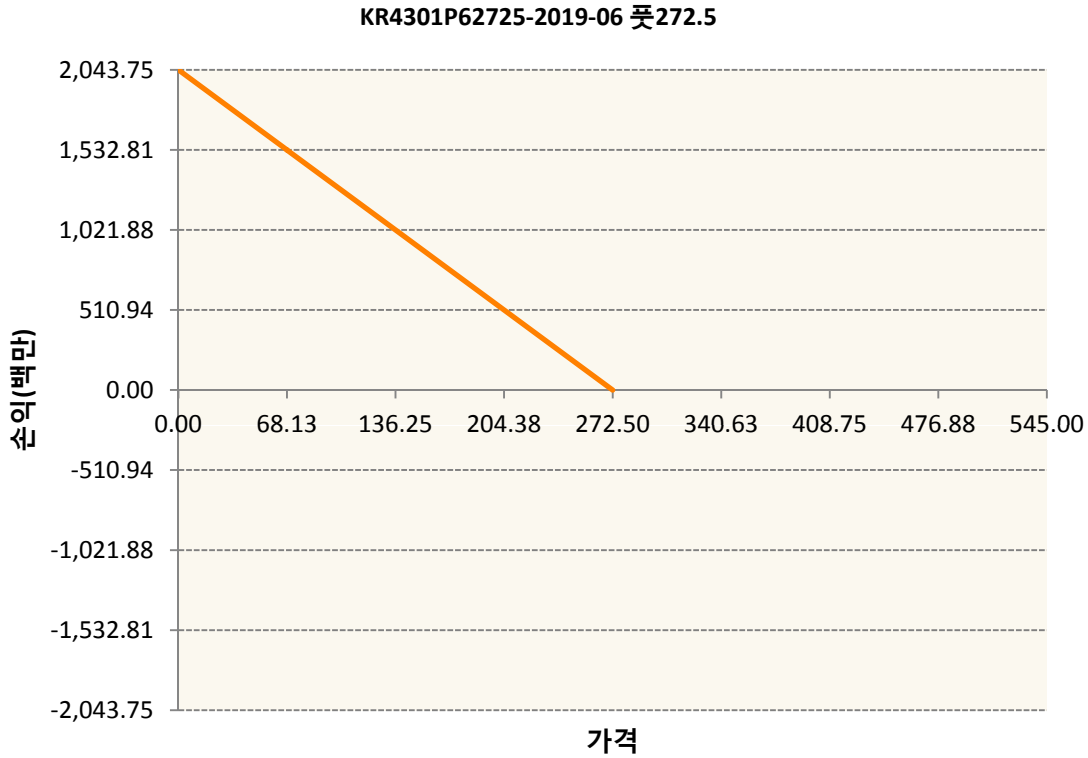
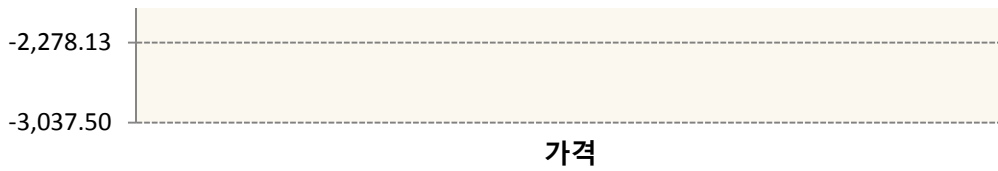


KR4201P62859-2019-06 콜285



KR4301P62709-2019-06 풋270





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

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						957
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-957	-957	-957	-957	-957	-957	-957	
-5.33%	-638	-638	-638	-638	-638	-638	-638	
-2.67%	-319	-319	-319	-319	-319	-319	-319	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	319	319	319	319	319	319	319	
5.33%	638	638	638	638	638	638	638	
8.00%	957	957	957	957	957	957	957	
KR4201P62826		2019-06 콜282.5						124
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	12	12	12	12	12	11	11	
-5.33%	12	12	12	11	10	9	8	
-2.67%	12	11	10	8	6	4	1	

0%	8	6	3	0	-4	-8	-12
2.67%	-2	-7	-13	-18	-24	-30	-36
5.33%	-30	-37	-44	-51	-58	-66	-73
8.00%	-79	-87	-94	-102	-109	-117	-124
KR4201P62859                      2019-06 콜285							495
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	40	40	40	40	39	38	36
-5.33%	40	40	39	37	35	31	26
-2.67%	39	36	33	28	21	12	2
0%	30	22	12	0	-14	-30	-48
2.67%	-4	-22	-43	-65	-88	-113	-139
5.33%	-98	-128	-158	-189	-221	-253	-285
8.00%	-287	-321	-356	-391	-425	-460	-495
KR4301P62709                      2019-06 풋270							219
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	218	218	218	218	218	219	219
-5.33%	139	139	139	140	140	141	142
-2.67%	61	62	63	65	66	68	70
0%	-9	-6	-3	0	3	6	10
2.67%	-57	-53	-50	-46	-42	-38	-35
5.33%	-78	-76	-73	-71	-68	-65	-62
8.00%	-83	-82	-81	-80	-79	-77	-76
KR4301P62725                      2019-06 풋272.5							150
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	150	150	150	150	150	150	150
-5.33%	97	97	97	97	98	98	98
-2.67%	45	45	46	46	47	48	49
0%	-5	-3	-2	0	2	4	6
2.67%	-43	-40	-38	-35	-33	-30	-28
5.33%	-63	-61	-59	-57	-55	-52	-50
8.00%	-69	-68	-67	-66	-65	-64	-62

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

(단위:백만원)

1,489

공시일	2019-05-28
기준일	2019-05-27

## H2O글로벌본드(USD)(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	15,726	0	15,726	

### 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	2019-05-28
기준일	2019-05-27

## 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	60,152	0	60,152	

### 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	2019-05-28
기준일	2019-05-27

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	288,537	0	288,537	
누계	통화	선도	3,554	321,236	-317,683	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
FX21019J019 KRW/USD 18-06-19E		379
FX21019J024 KRW/USD 24-06-19E		948
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		948
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		1,004
FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E		379
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		76
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		997
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E		1,023
FX21019J041 KRW/USD 28-05-19E		284
FX21019J043 KRW/USD 03-06-19E		569
FX21019J044 KRW/USD 03-06-19E		474
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		284
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		474
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		663
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		663
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		824
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		815
FX21019K00 KRW/USD 18-06-19E		569
FX21019K01 KRW/USD 14-06-19E		663
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		569
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		474
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		569
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,421
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,327
FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E		474

FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E	796
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E	633
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E	474
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E	379
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E	796
FX21019K02 KRW/USD 24-06-19E	379
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E	948
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E	1,516
FX21019K03 USD/KRW 28-05-19E	284
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E	284
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E	1,232
FX21019K04 KRW/USD 28-06-19E	1,289

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

(단위:백만원)

**8,636**

공시일	2019-05-28
기준일	2019-05-27

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

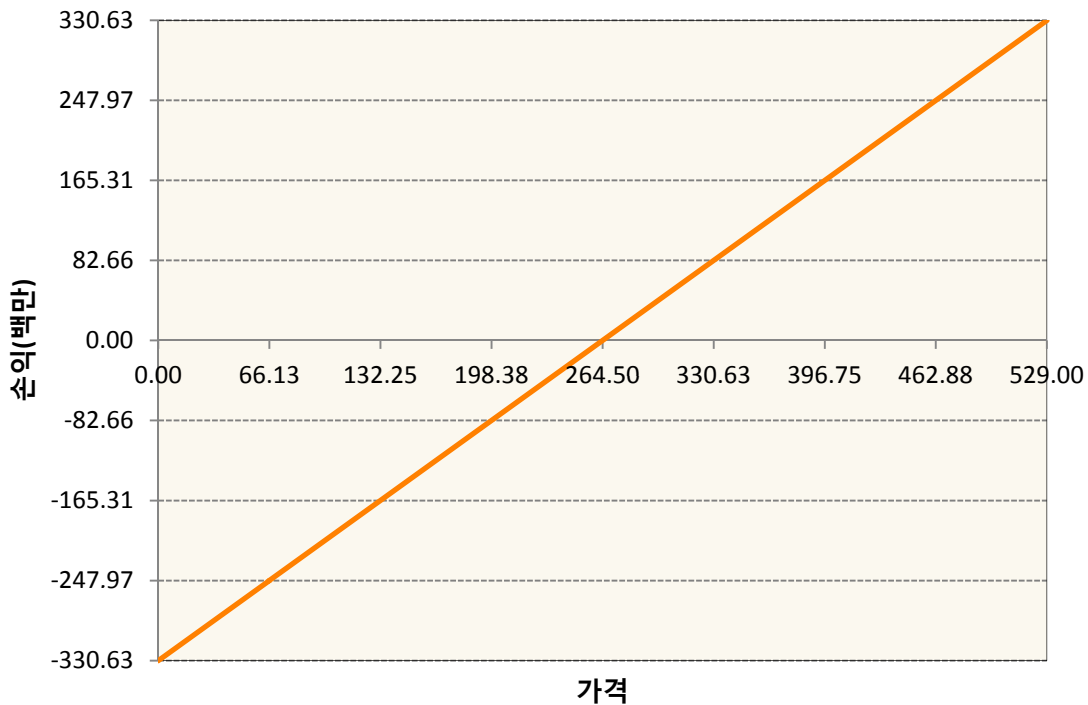
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

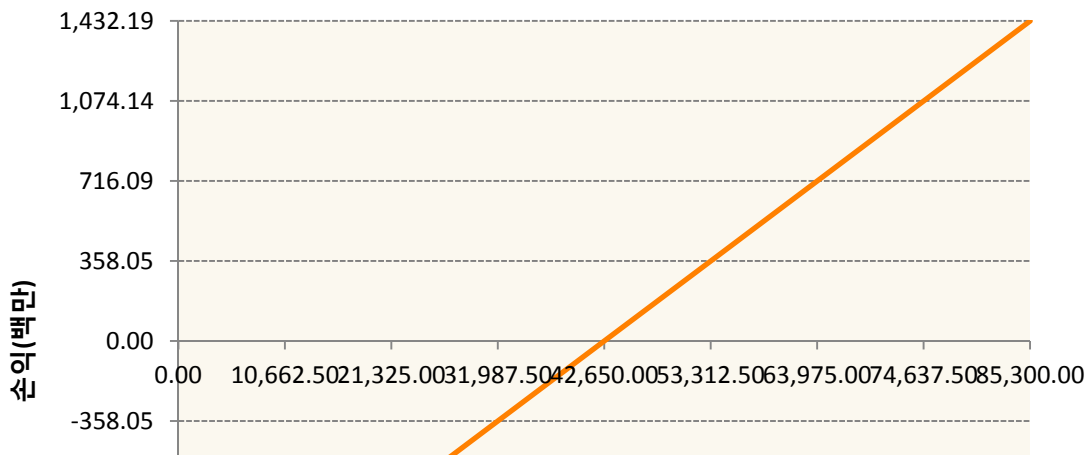
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,763	0	1,763	장내

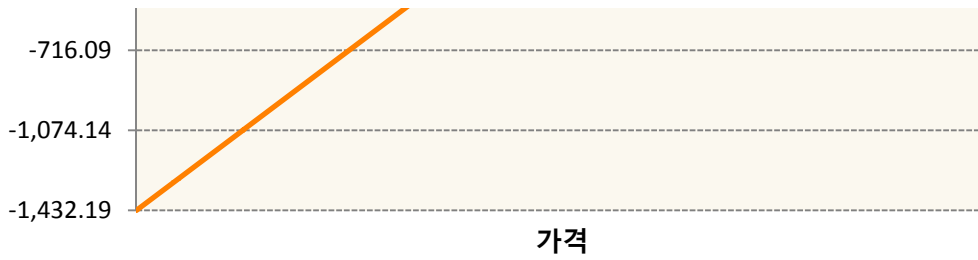
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4111P60003-2019-06 삼성전자개별선물





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

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						26
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26	
-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%	26	26	26	26	26	26	26	
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)

**157**

공시일	2019-05-28
기준일	2019-05-27

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

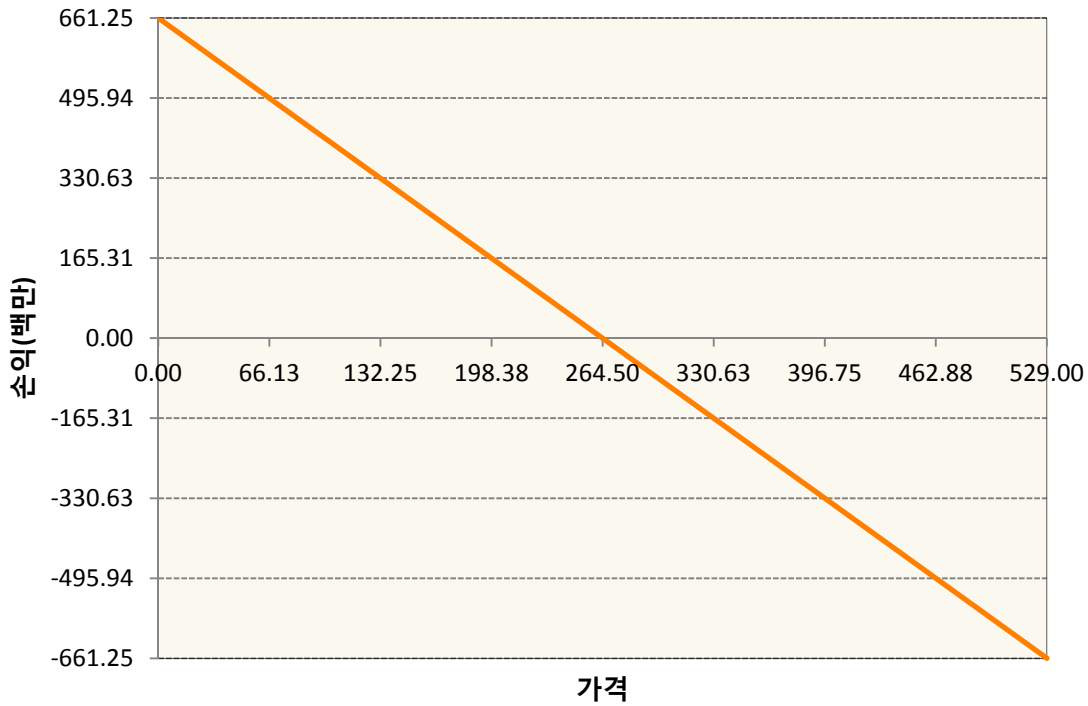
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

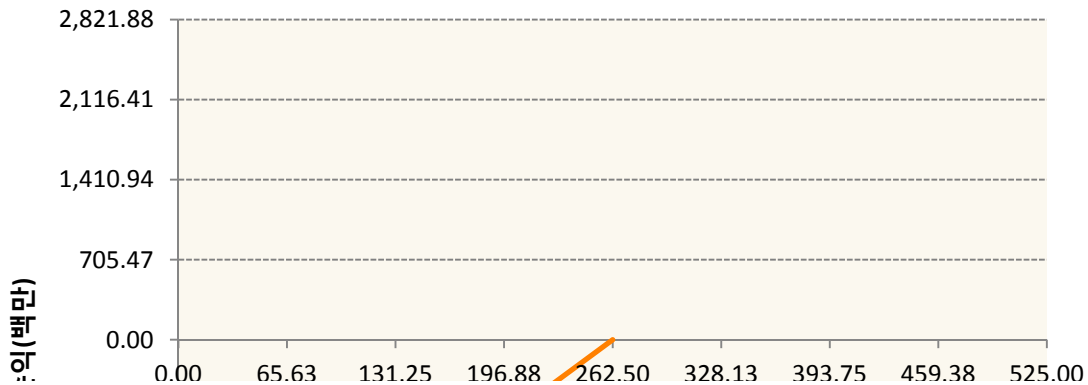
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	661	-661	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,352	-3,352	장내

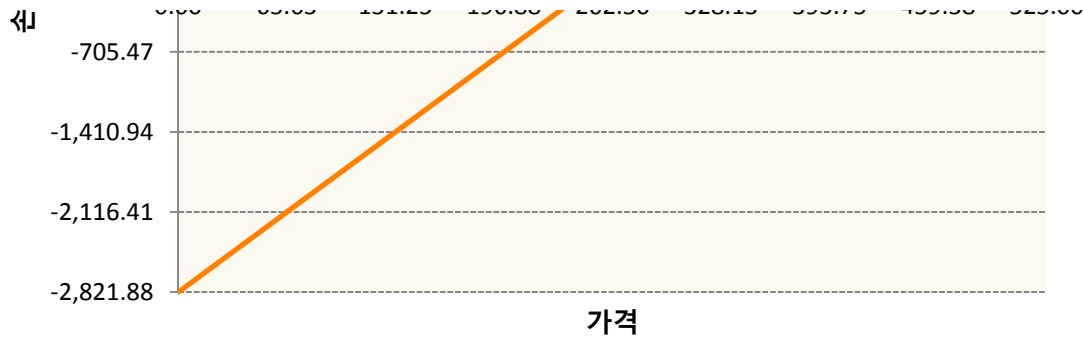
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

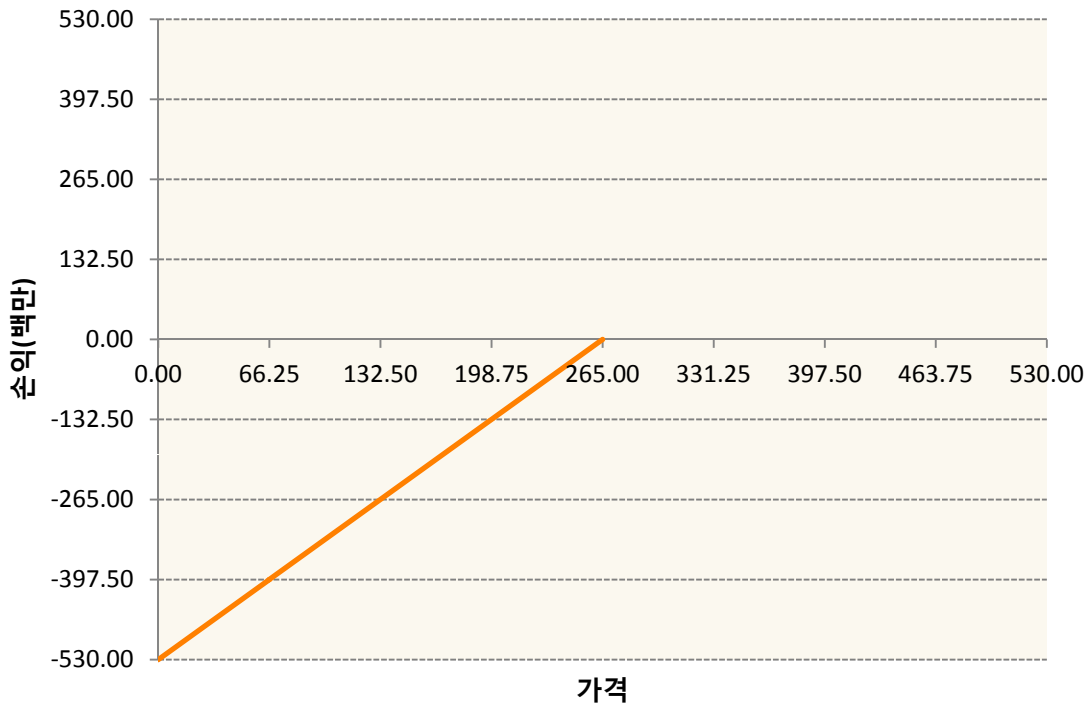


KR4301P62626-2019-06 풋262.5





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%	35	35	35	35	35	35	35	
-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%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	
8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53	
KR4301P62626		2019-06 풋262.5						178
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-175	-175	-175	-176	-176	-177	-178
-5.33%	-101	-102	-103	-104	-106	-107	-109
-2.67%	-34	-37	-40	-43	-46	-49	-52
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	28	26	24	22	20	17	14
5.33%	32	32	31	30	29	28	26
8.00%	33	33	33	32	32	32	31
KR4301P62659                      2019-06 풋265							35
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-5.33%	-21	-21	-21	-22	-22	-22	-22
-2.67%	-8	-8	-9	-9	-10	-10	-11
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	7	6	6	5	5	4	4
5.33%	8	8	8	8	7	7	7
8.00%	9	8	8	8	8	8	8

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

(단위:백만원)

**273**

공시일	2019-05-28
기준일	2019-05-27

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

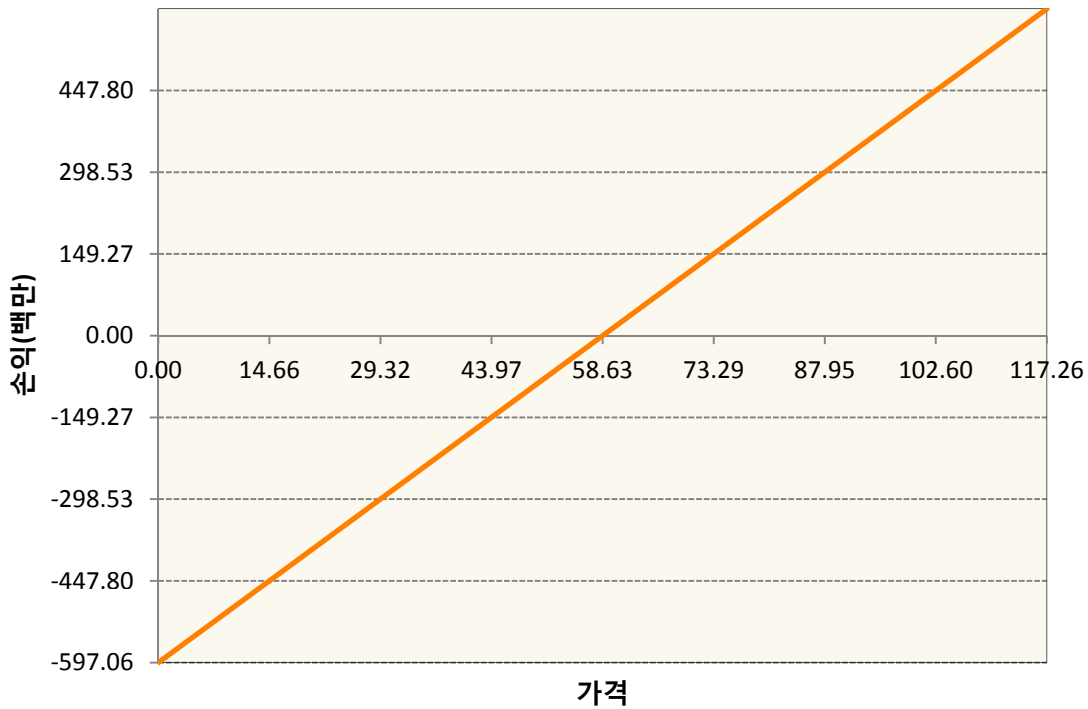
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

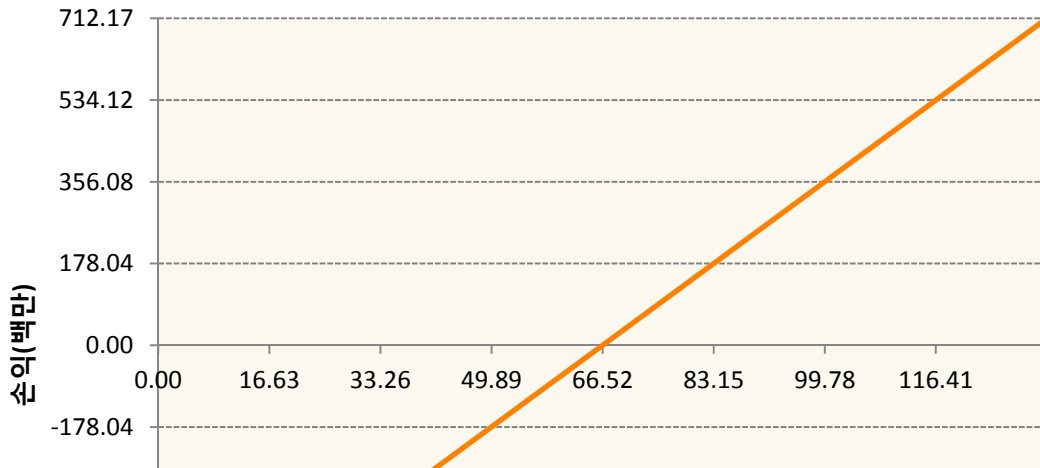
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,666	296	2,370	

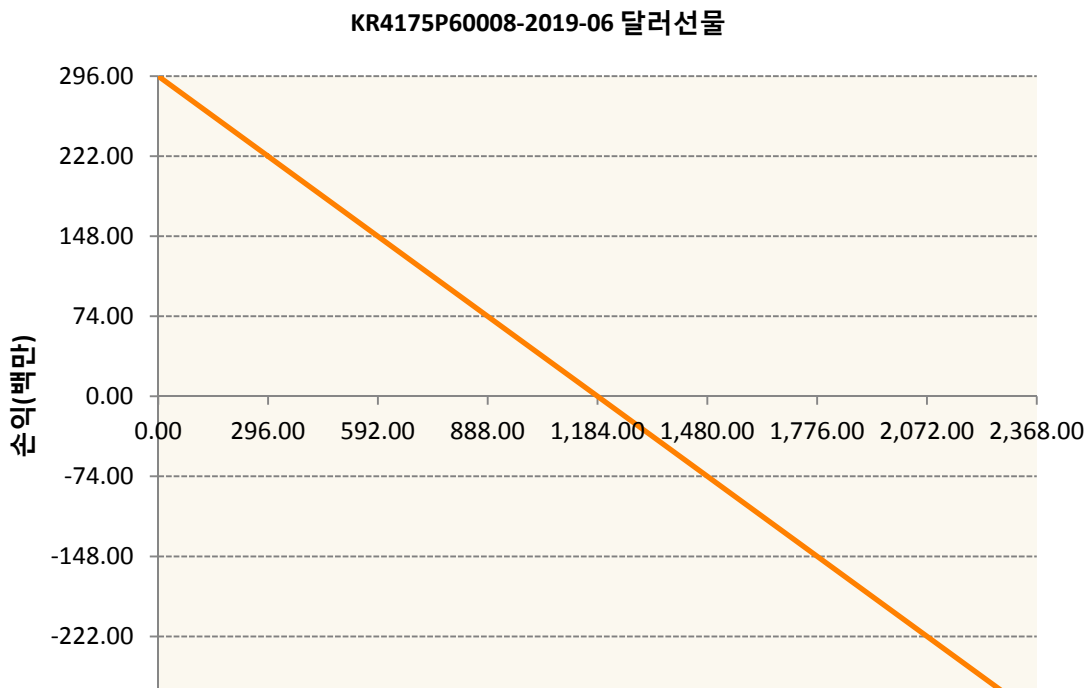
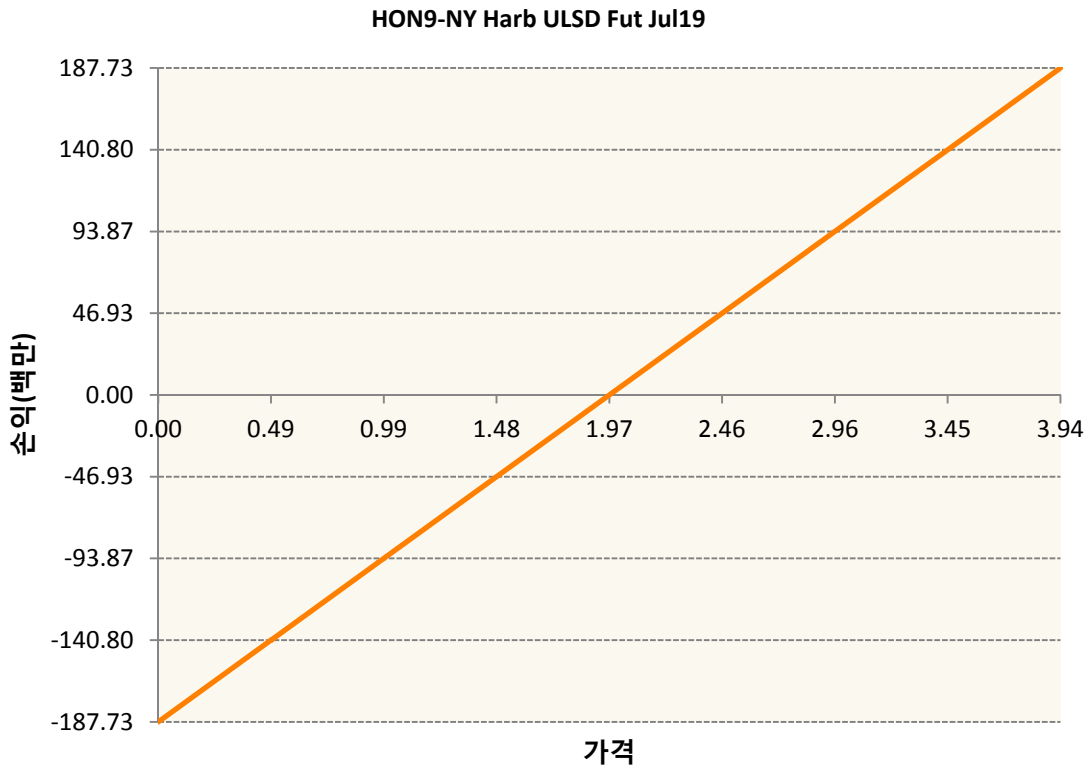
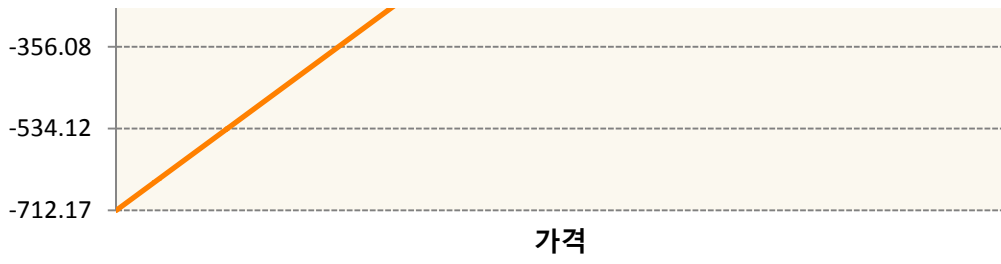
### 2. 만기시점의 손익구조

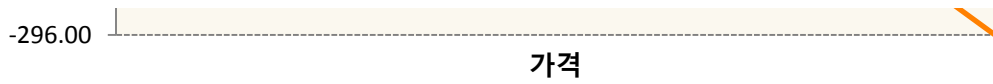
CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19



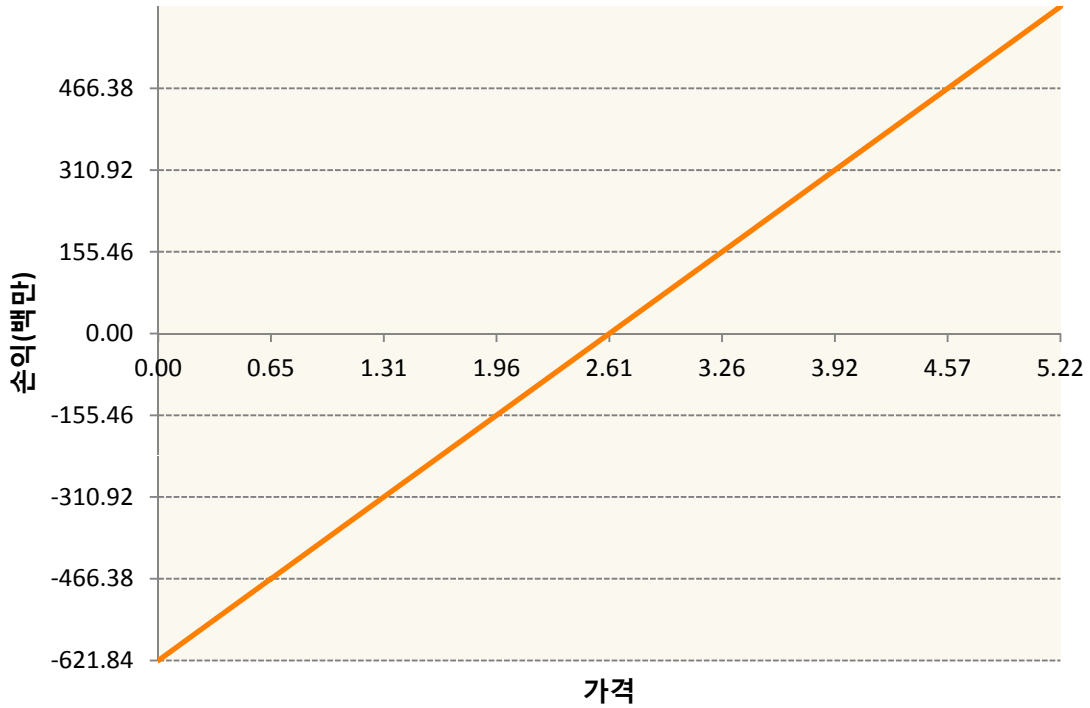
COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19



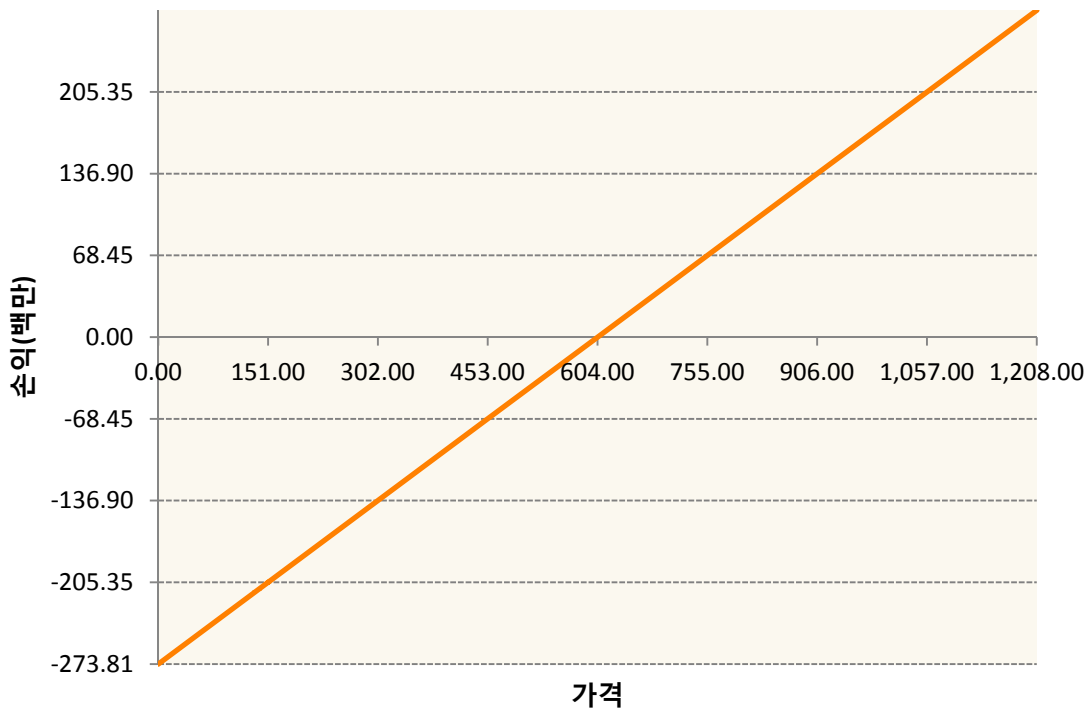




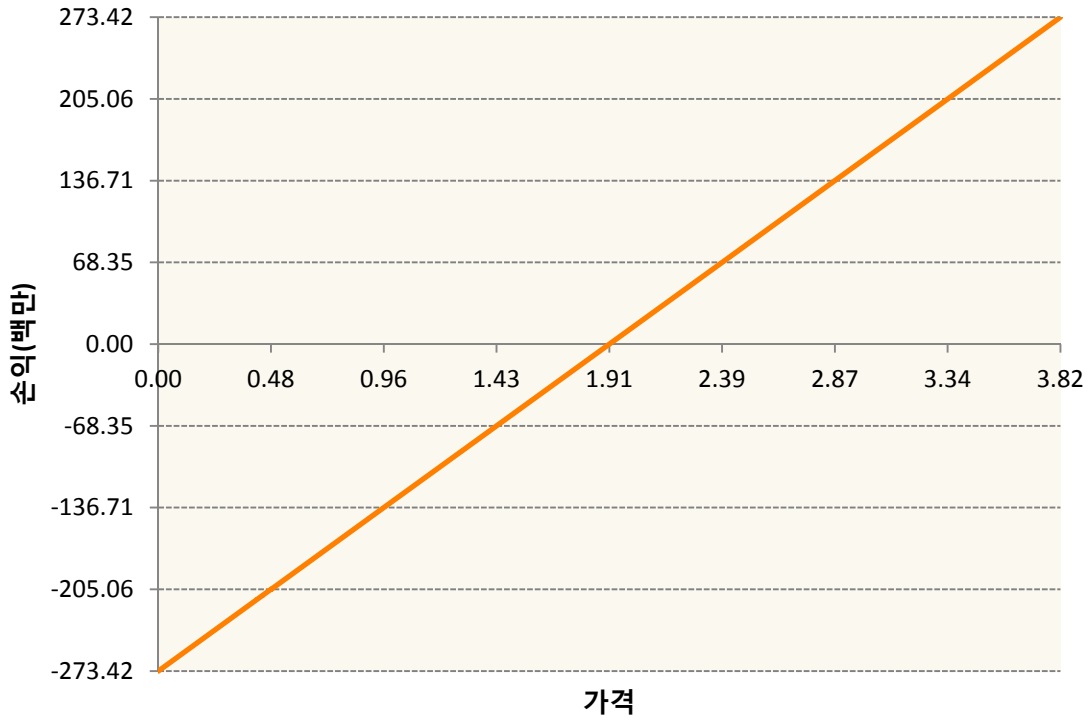
NGN19-NATURAL GAS FUTR Jul19



QSN9-Low Su Gasoil G Jul19



XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN9	WTI CRUDE FUTURE Jul19	48
COU9	BRENT CRUDE FUTR Sep19	57
HON9	NY Harb ULSD Fut Jul19	15
KR4175P600	2019-06 달러선물	24
NGN19	NATURAL GAS FUTR Jul19	50
QSN9	Low Su Gasoil G Jul19	22
XBN9	GASOLINE RBOB FUT Jul19	22

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

(단위:백만원)

395

공시일	2019-05-28
기준일	2019-05-27

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

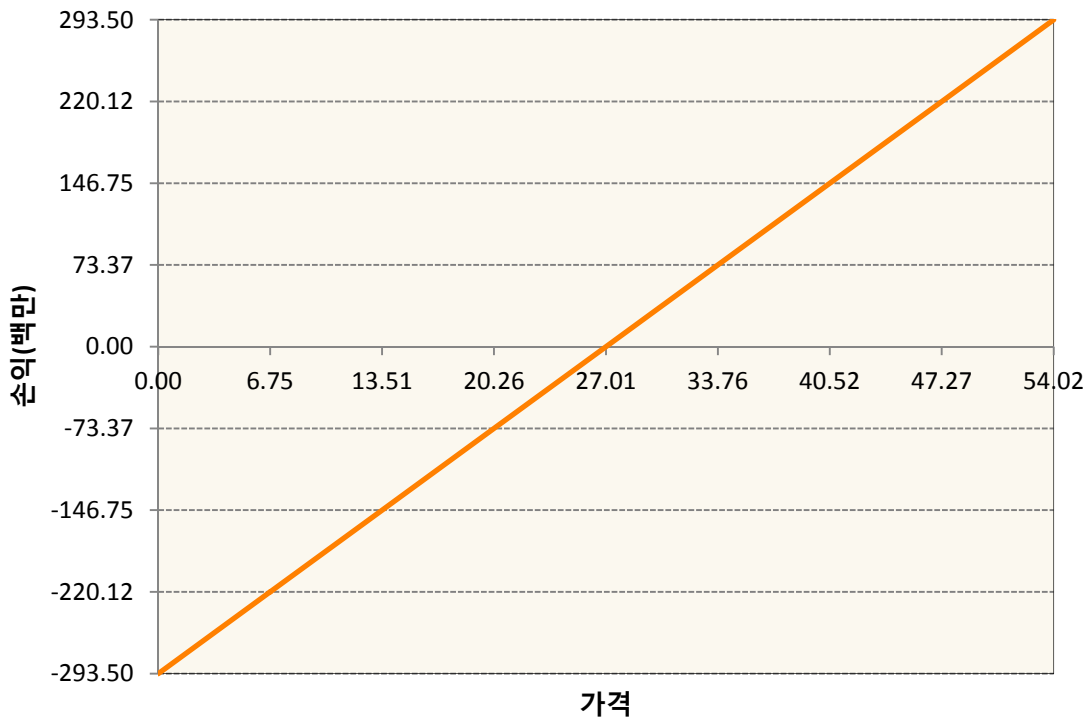
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

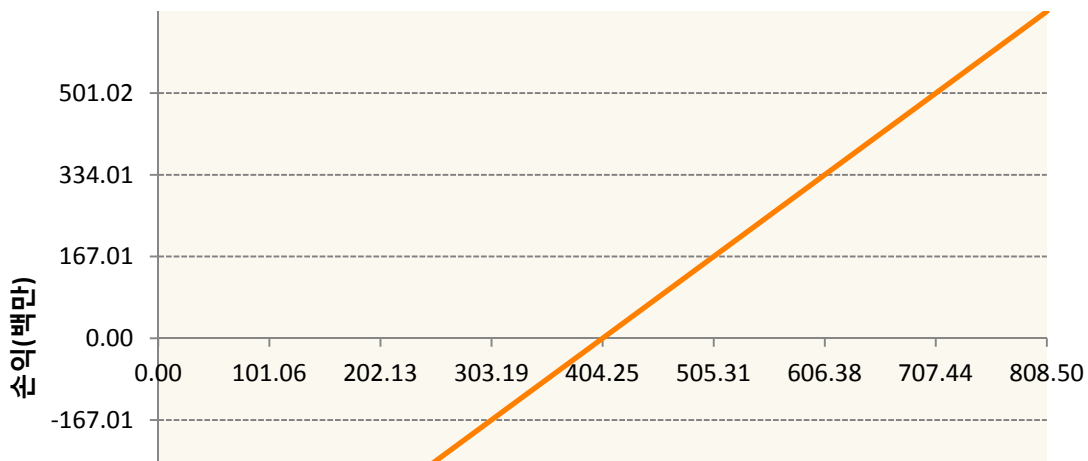
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,960	59	2,901	

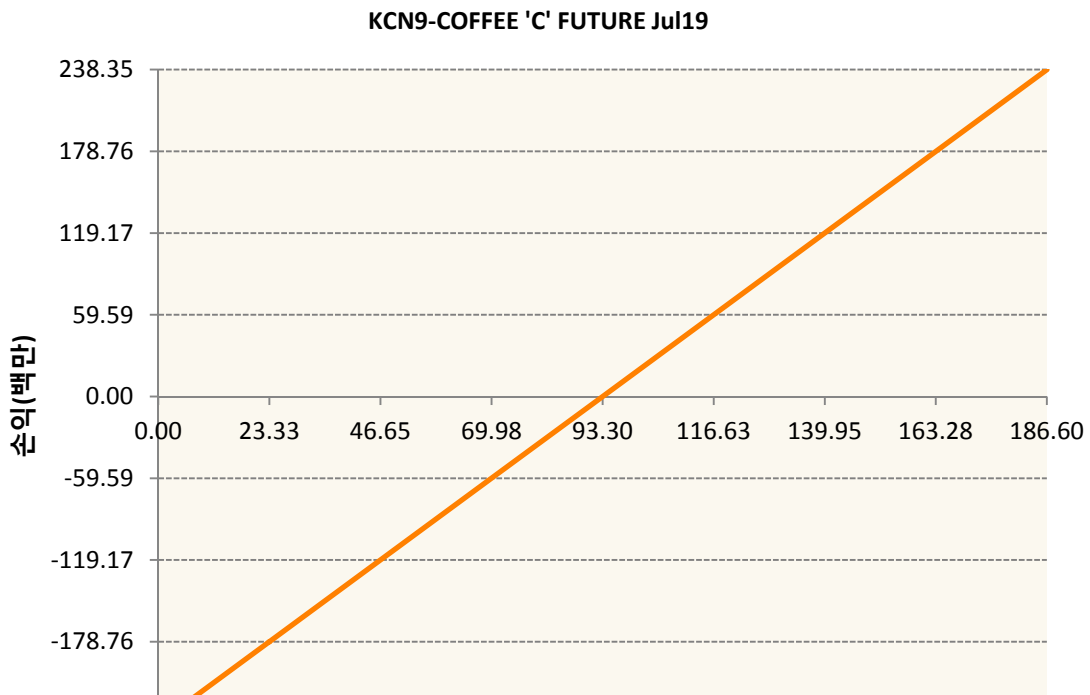
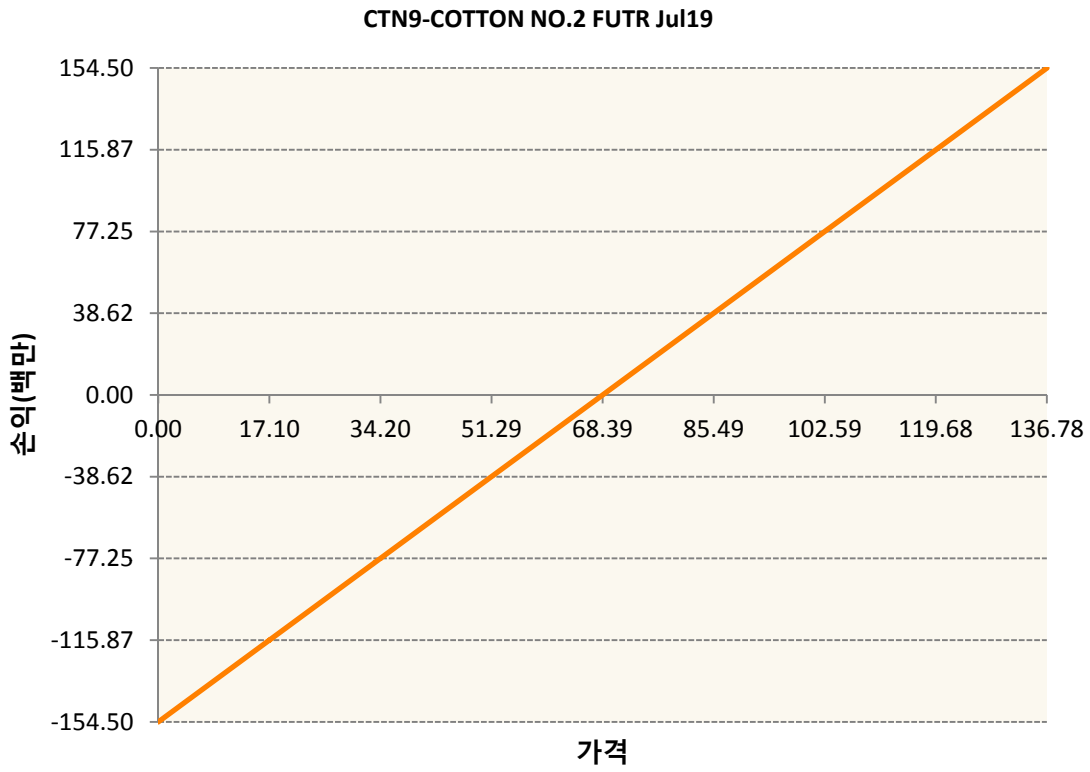
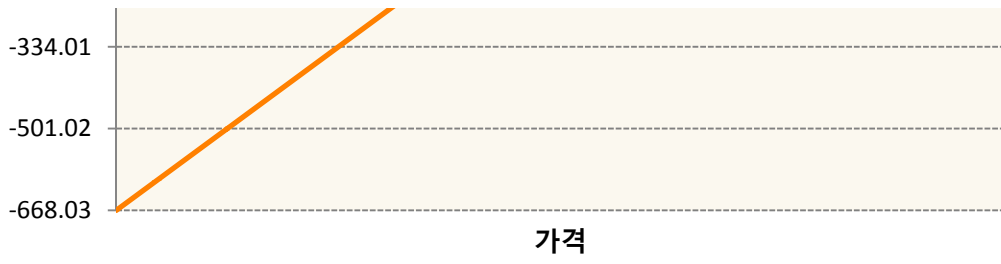
### 2. 만기시점의 손익구조

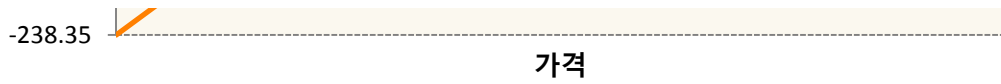
**BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19**



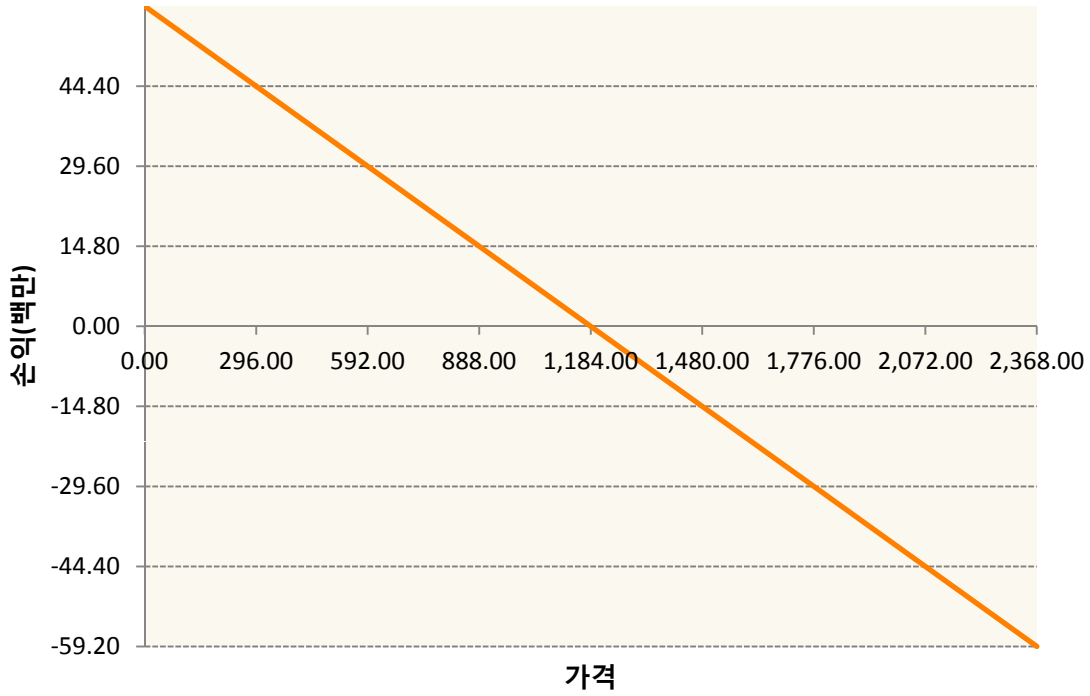
**CN9-CORN FUTURE Jul19**



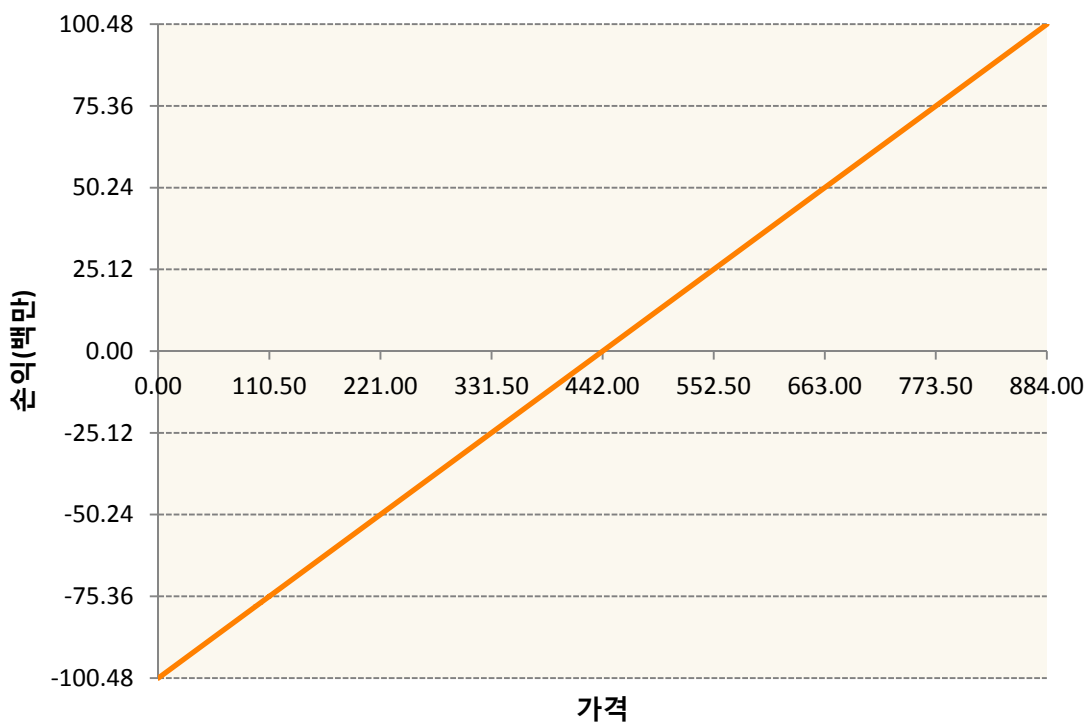




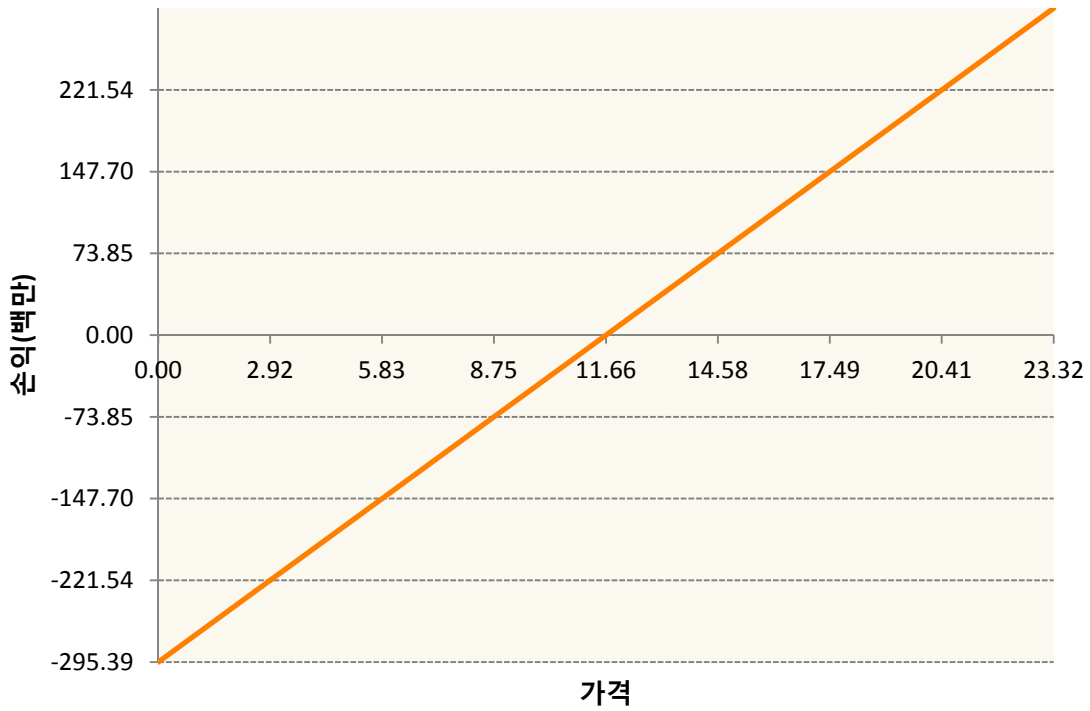
KR4175P60008-2019-06 달러선물



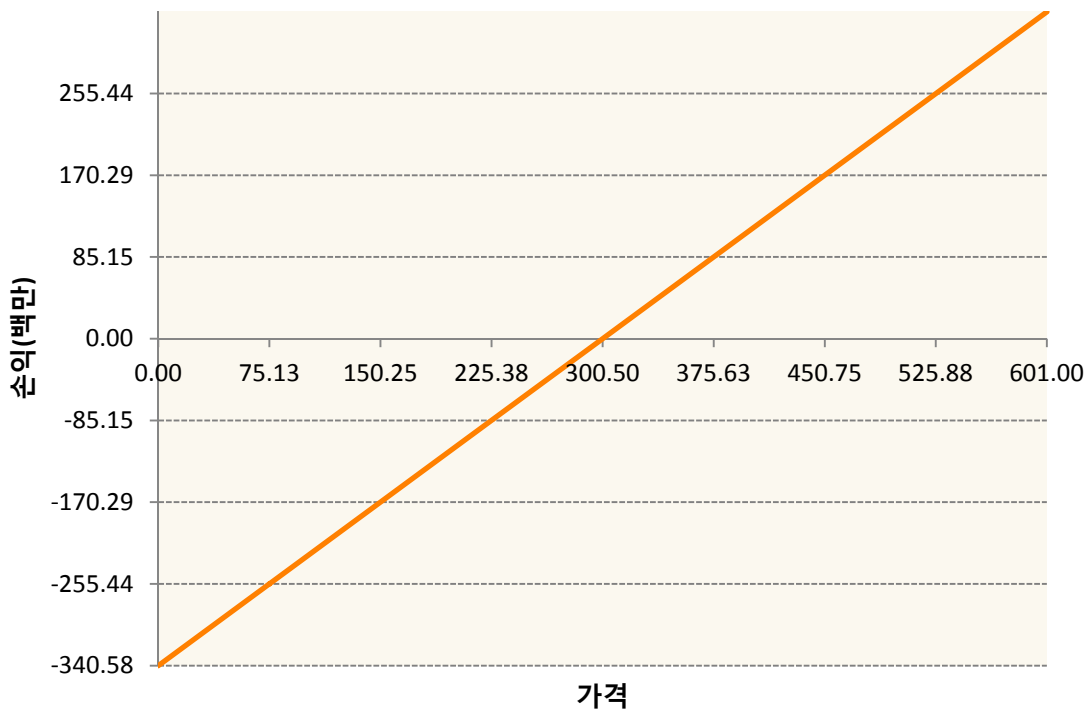
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

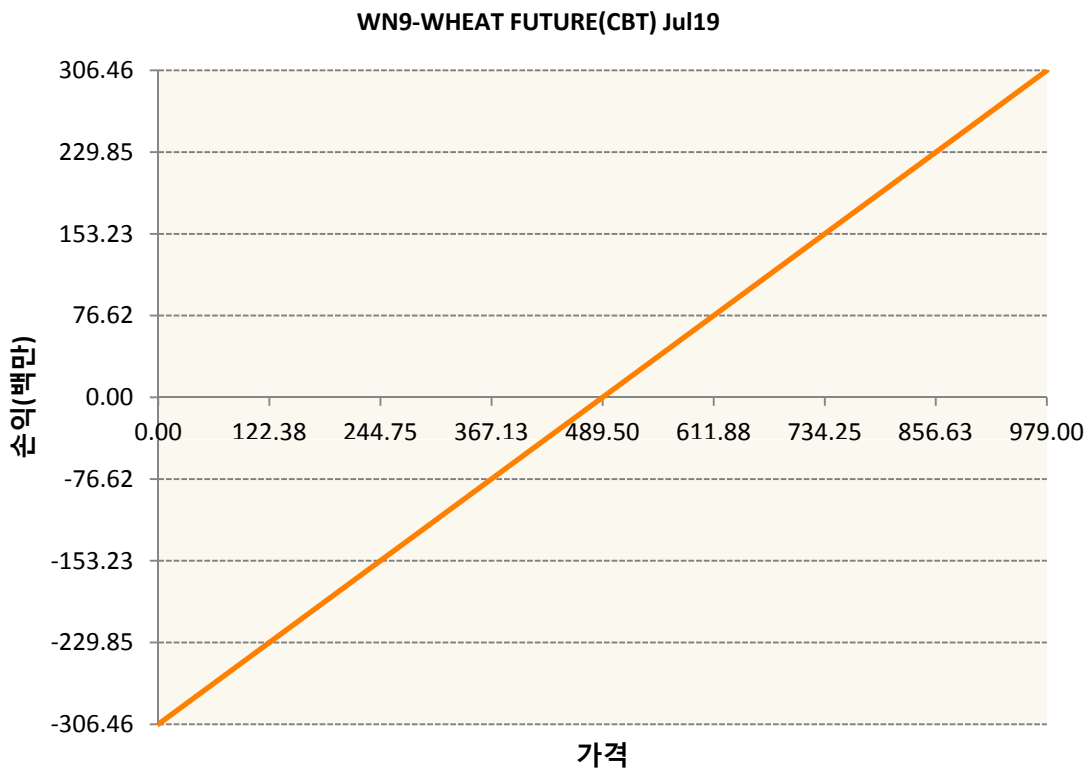
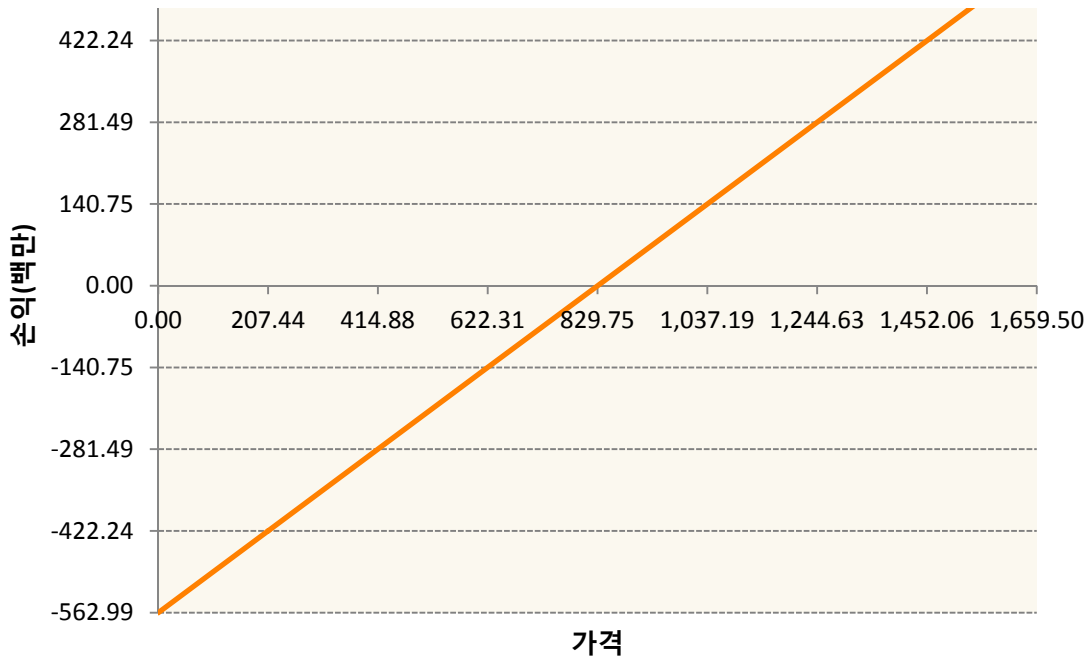


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19



SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BON9	SOYBEAN OIL FUTR Jul19	23
CN9	CORN FUTURE Jul19	53
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	25

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

(단위:백만원)

**245**