

공시일	2019-05-29
기준일	2019-05-28

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	2019-05-29
기준일	2019-05-28

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

1,122

* 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	2019-05-29
기준일	2019-05-28

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)	300
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)

880

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-05-29
기준일	2019-05-28

유로인덱스모(주식-파생형)

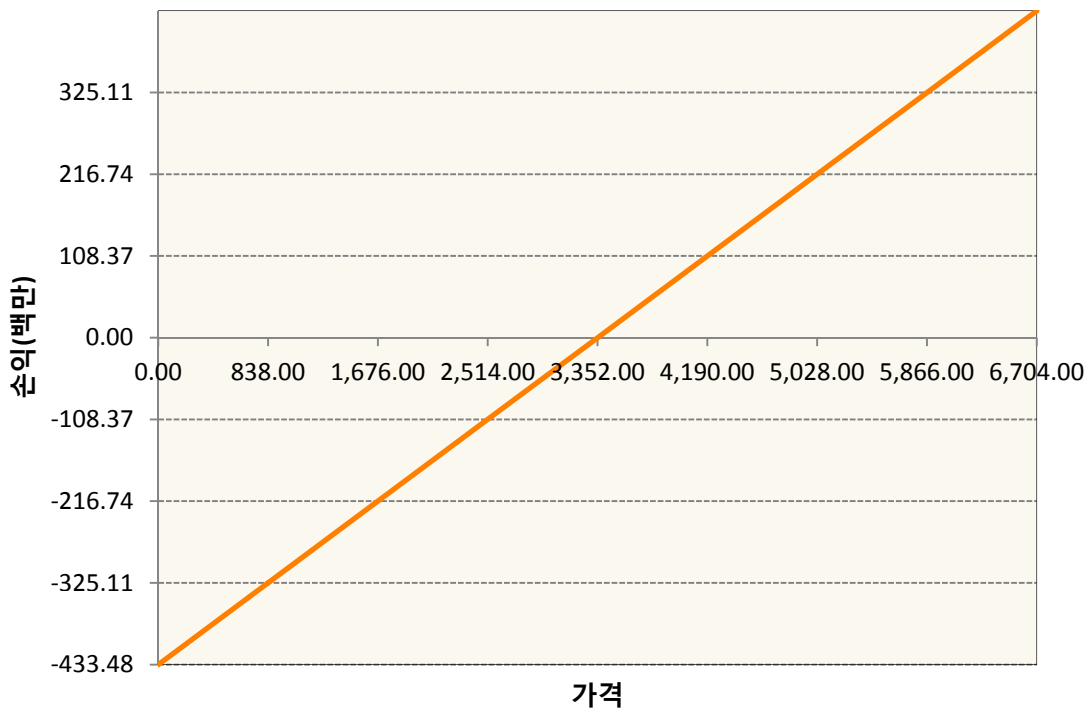
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	433	0	433	

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	2019-05-29
기준일	2019-05-28

차이나인덱스모(주식-파생형)

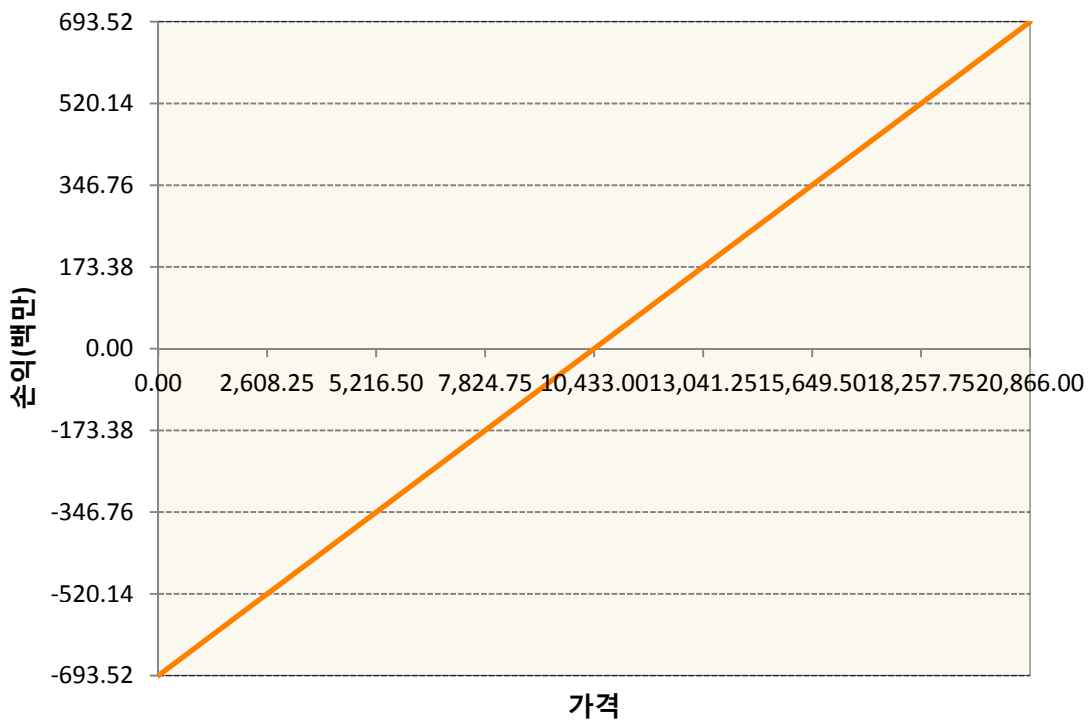
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	694	0	694	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	2019-05-29
기준일	2019-05-28

커버드콜모(주식혼합-파생형)

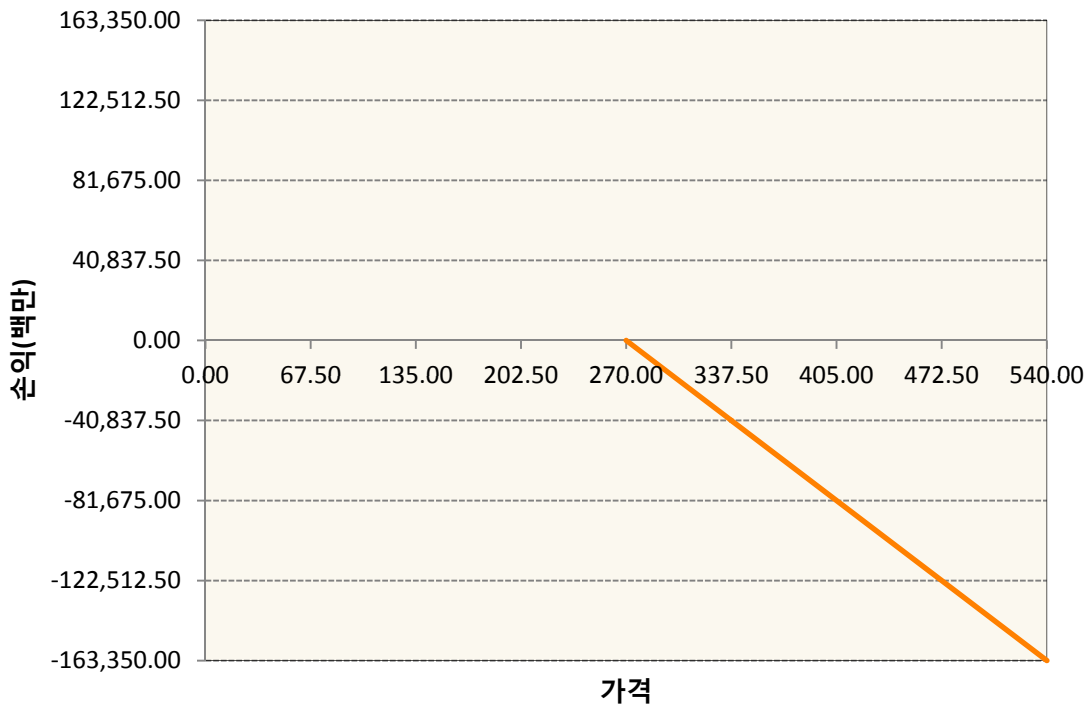
1. 계약금액

(단위:백만원)

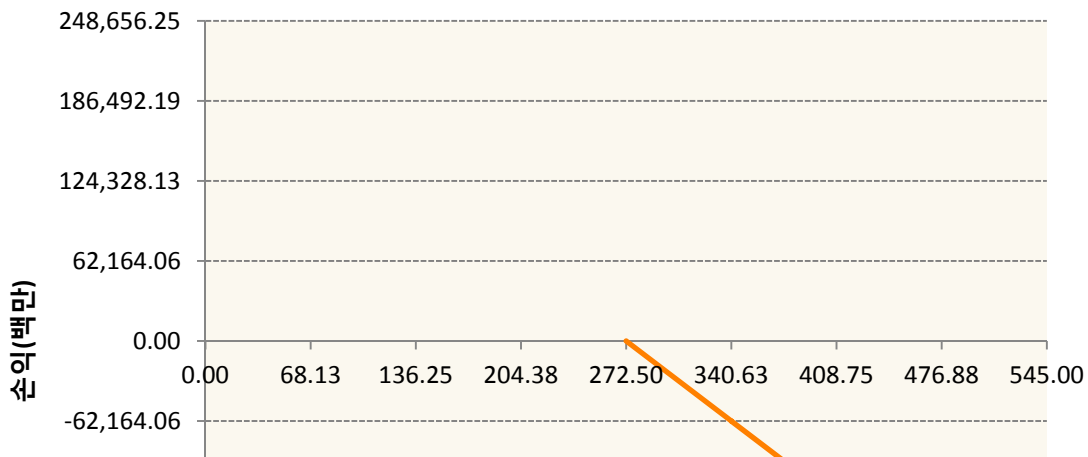
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	614,506	-614,506	장내

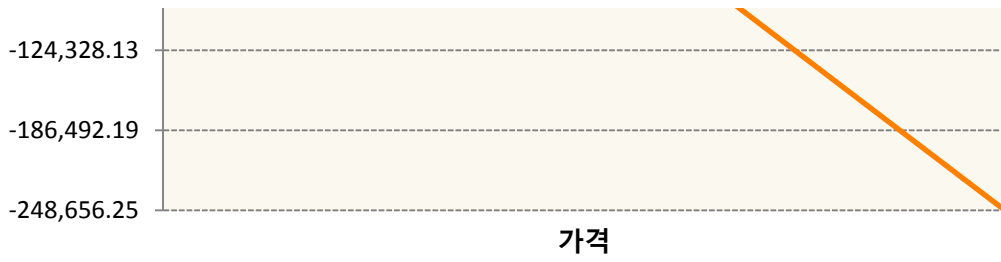
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P62701-2019-06 콜270



KR4201P62727-2019-06 콜272.5





KR4301P62709-2019-06 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P62701		2019-06 콜270					8,710
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,076	2,061	2,036	1,998	1,948	1,883	1,804
-5.33%	2,007	1,947	1,867	1,769	1,653	1,522	1,376
-2.67%	1,699	1,544	1,371	1,183	982	771	552
0%	792	533	268	0	-272	-546	-822
2.67%	-1,087	-1,378	-1,669	-1,960	-2,252	-2,544	-2,836
5.33%	-4,009	-4,234	-4,471	-4,717	-4,971	-5,230	-5,494
8.00%	-7,694	-7,818	-7,964	-8,129	-8,310	-8,504	-8,710
KR4201P62727		2019-06 콜272.5					12,096
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,425	2,412	2,387	2,348	2,292	2,217	2,123

-5.33%	2,367	2,305	2,218	2,105	1,966	1,803	1,618
-2.67%	2,070	1,889	1,678	1,439	1,178	897	599
0%	1,081	735	373	0	-383	-773	-1,169
2.67%	-1,199	-1,643	-2,086	-2,530	-2,975	-3,419	-3,863
5.33%	-5,069	-5,461	-5,863	-6,273	-6,689	-7,109	-7,533
8.00%	-10,273	-10,519	-10,793	-11,092	-11,411	-11,746	-12,096
KR4301P62709 2019-06 풋270							14,597
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,566	-14,566	-14,567	-14,570	-14,575	-14,584	-14,597
-5.33%	-9,282	-9,289	-9,303	-9,325	-9,357	-9,400	-9,453
-2.67%	-4,076	-4,137	-4,214	-4,307	-4,414	-4,535	-4,666
0%	585	398	202	0	-208	-420	-635
2.67%	3,721	3,483	3,245	3,005	2,765	2,524	2,284
5.33%	5,018	4,885	4,737	4,575	4,403	4,222	4,033
8.00%	5,310	5,276	5,226	5,161	5,082	4,988	4,881

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

(단위:백만원)

35,830

공시일	2019-05-29
기준일	2019-05-28

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

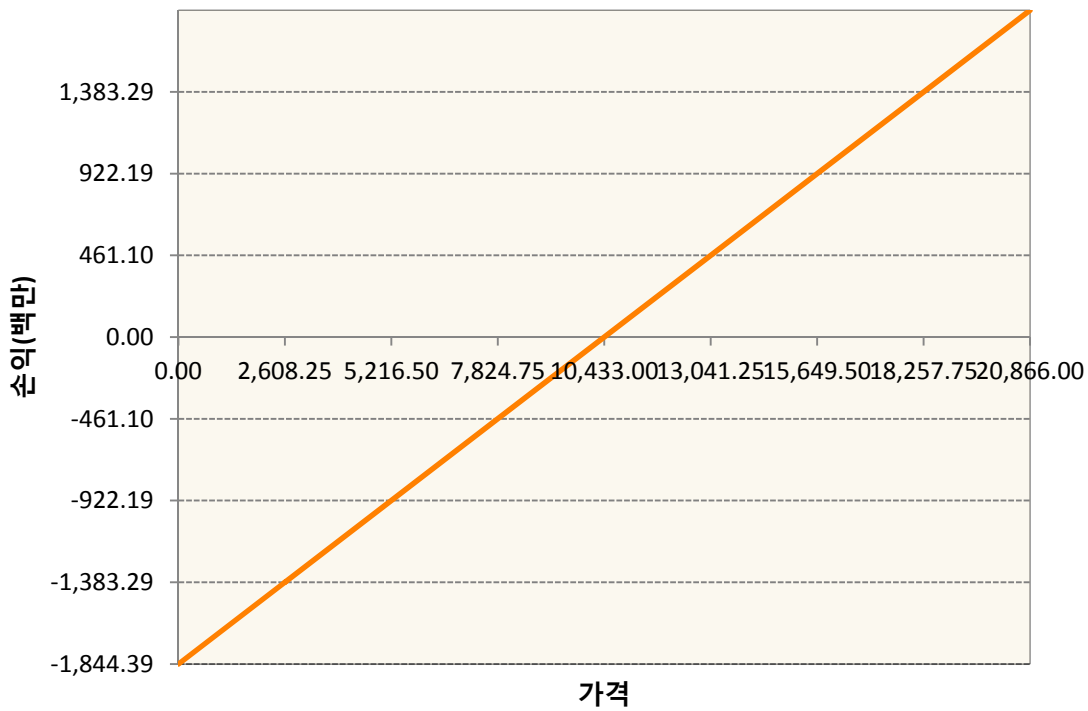
1. 계약금액

(단위:백만원)

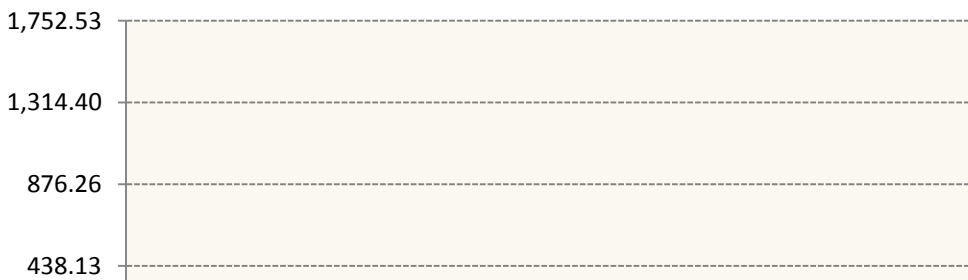
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,844	0	1,844	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,626	-5,626	장내
누계	통화	선도	151	3,173	-3,022	장외

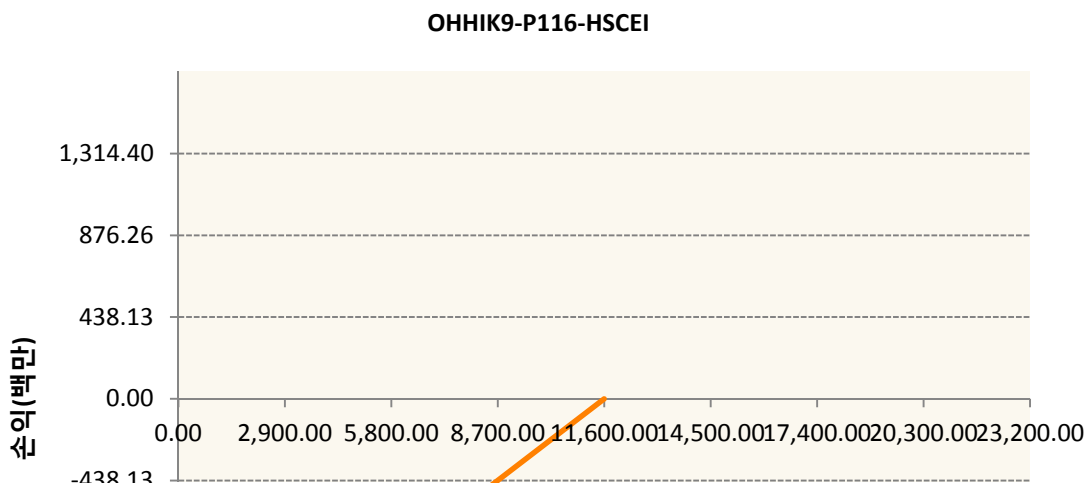
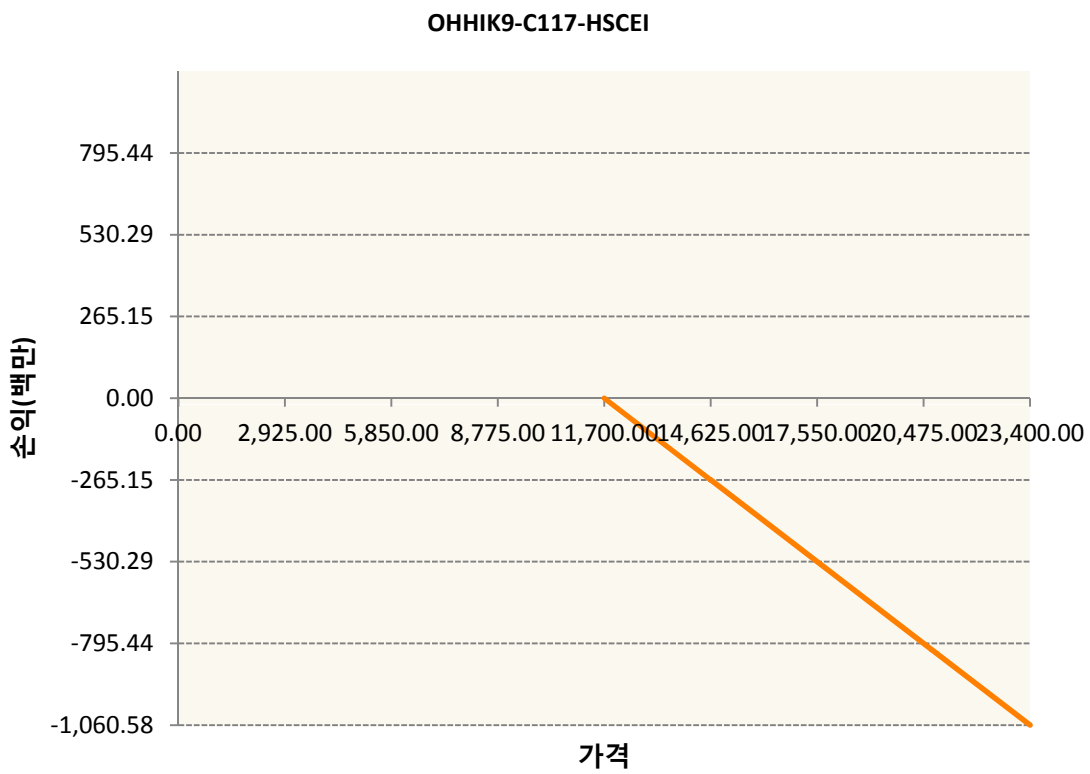
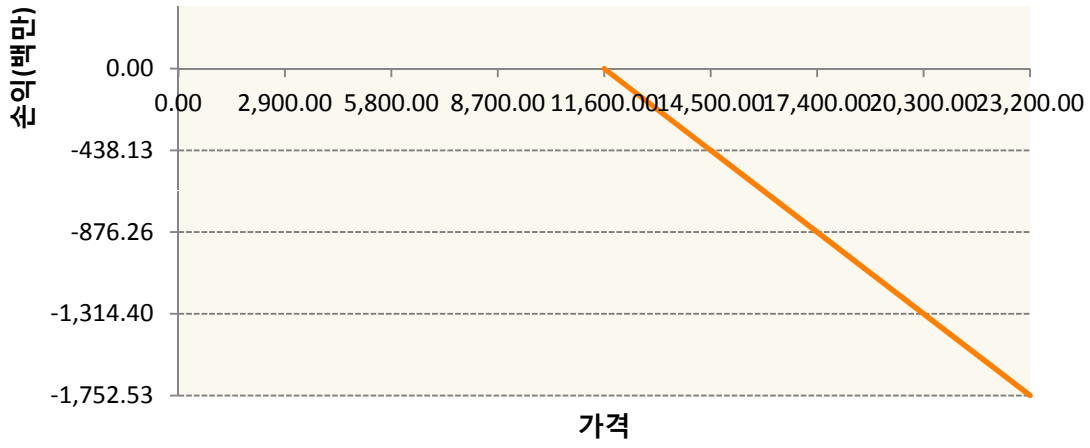
2. 만기시점의 손익구조

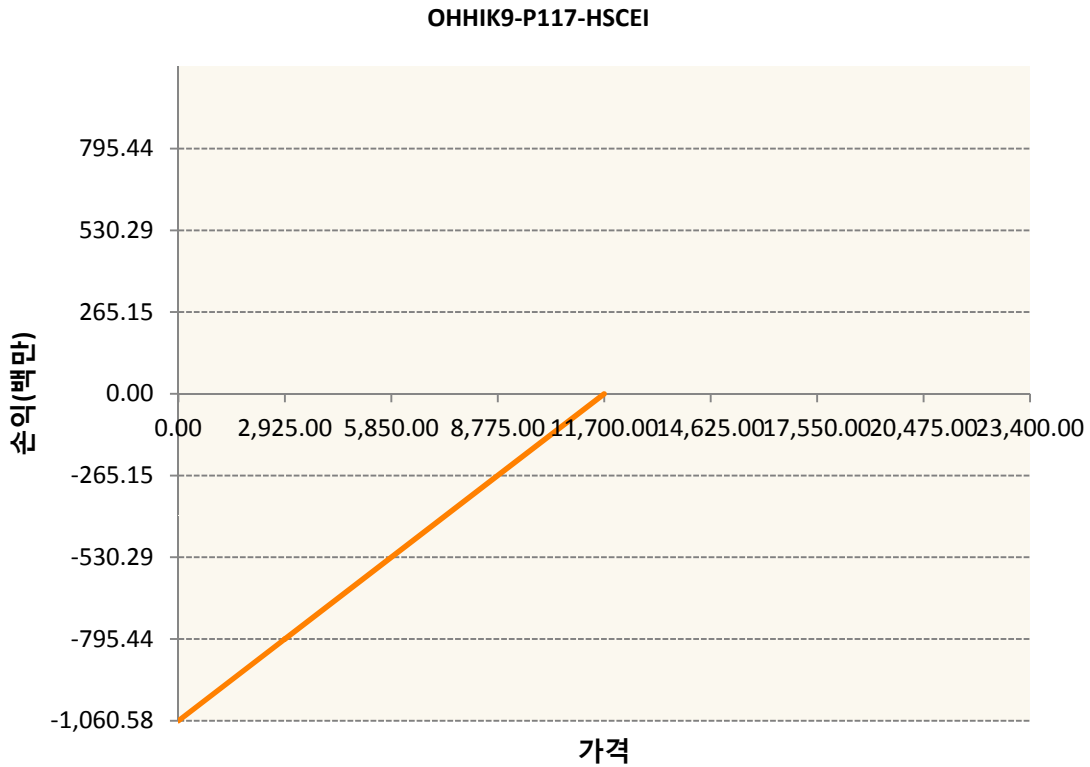
HCK9-HSCEI Futures May19



OHHIK9-C116-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		148
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)
	701

공시일	2019-05-29
기준일	2019-05-28

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

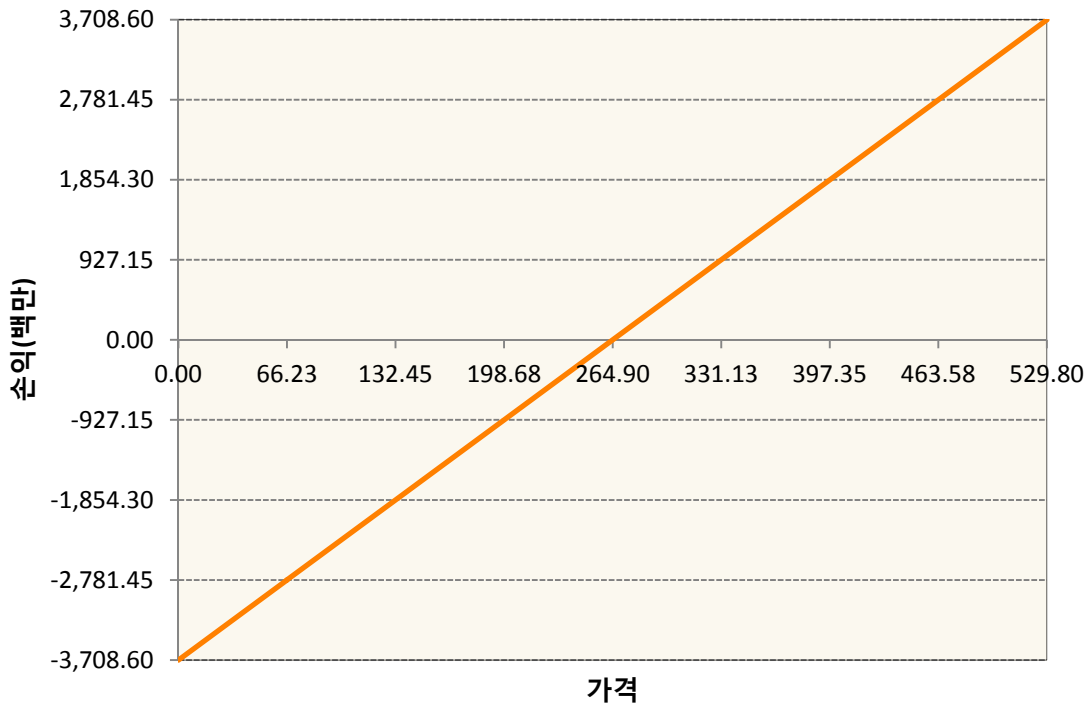
1. 계약금액

(단위:백만원)

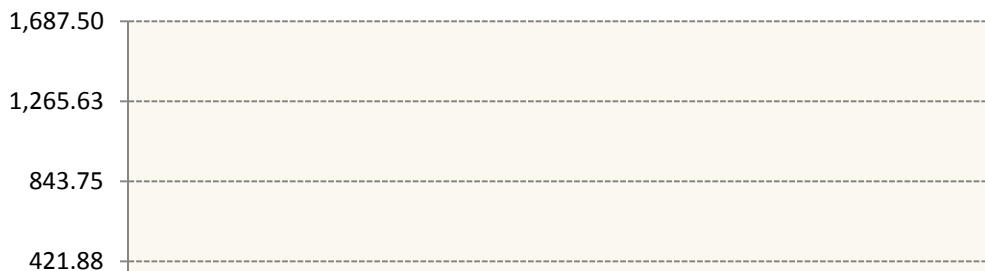
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,709	0	3,709	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	21,759	-21,759	장내

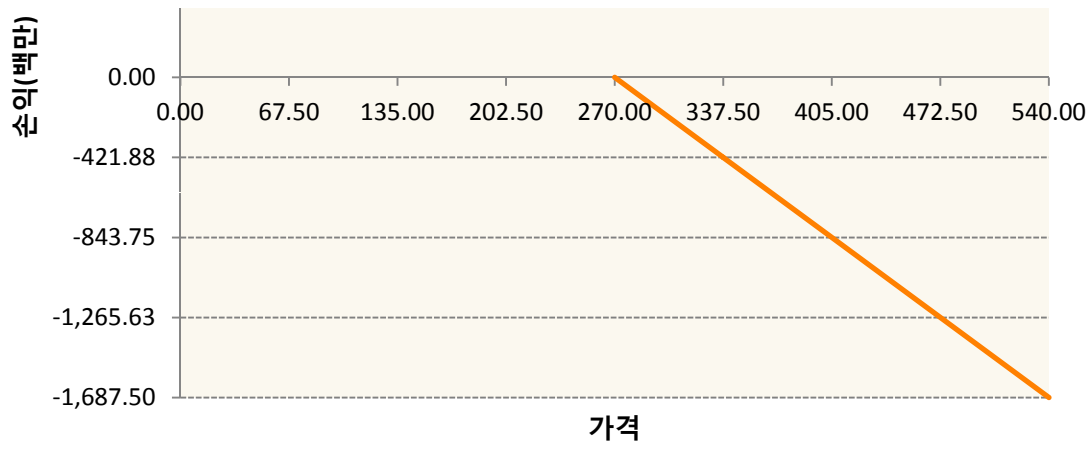
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

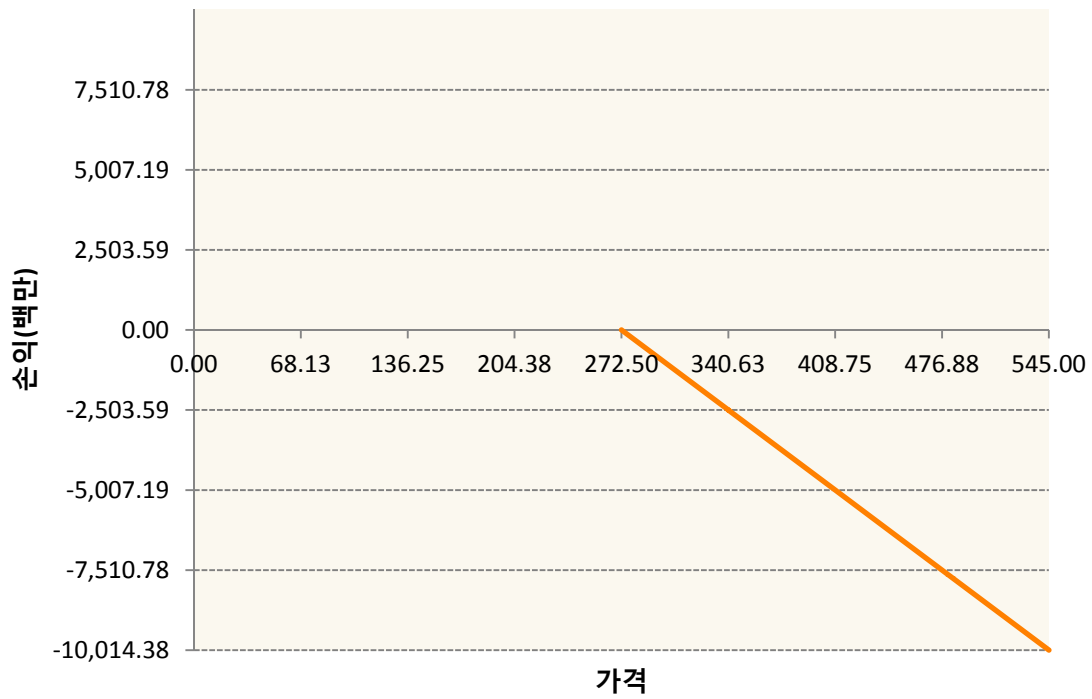


KR4201P62701-2019-06 콜270

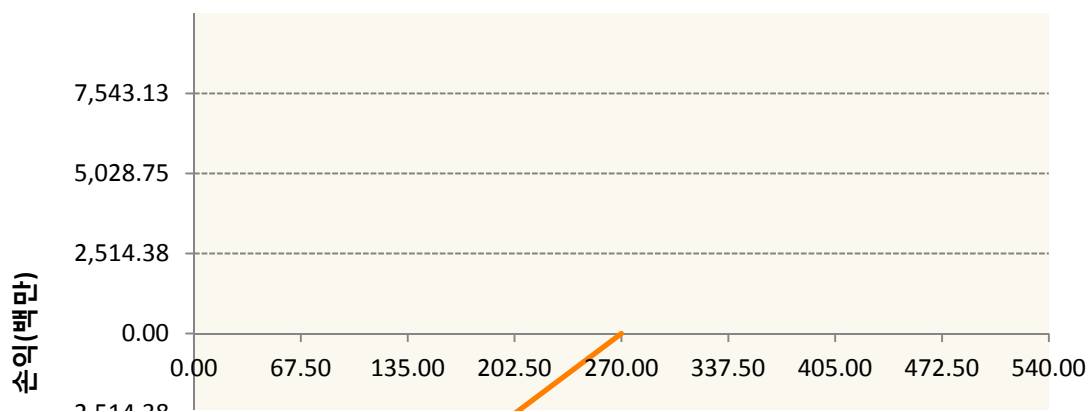


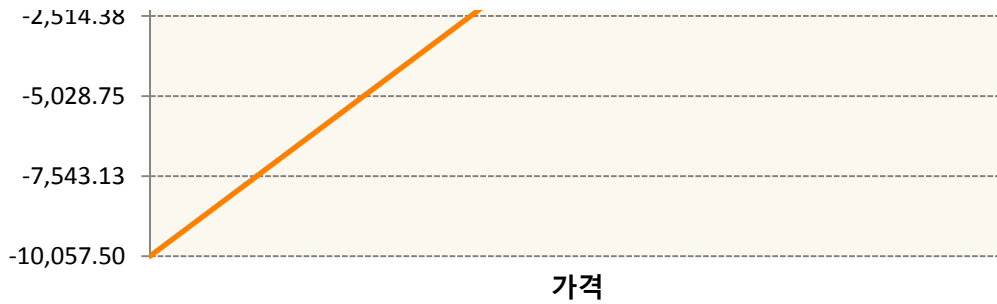


KR4201P62727-2019-06 콜272.5



KR4301P62709-2019-06 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,189
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,189	-1,189	-1,189	-1,189	-1,189	-1,189	-1,189	
-5.33%	-793	-793	-793	-793	-793	-793	-793	
-2.67%	-396	-396	-396	-396	-396	-396	-396	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	396	396	396	396	396	396	396	
5.33%	793	793	793	793	793	793	793	
8.00%	1,189	1,189	1,189	1,189	1,189	1,189	1,189	
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						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%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198	
-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%	198	198	198	198	198	198	198	
8.00%	296	296	296	296	296	296	296	
KR4201P62701		2019-06 콜270						90
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	21	21	21	21	20	19	19
-5.33%	21	20	19	18	17	16	14
-2.67%	18	16	14	12	10	8	6
0%	8	6	3	0	-3	-6	-8
2.67%	-11	-14	-17	-20	-23	-26	-29
5.33%	-41	-44	-46	-49	-51	-54	-57
8.00%	-79	-81	-82	-84	-86	-88	-90

KR4201P62727 2019-06 콜272.5 487

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	98	97	96	95	92	89	85
-5.33%	95	93	89	85	79	73	65
-2.67%	83	76	68	58	47	36	24
0%	44	30	15	0	-15	-31	-47
2.67%	-48	-66	-84	-102	-120	-138	-156
5.33%	-204	-220	-236	-253	-269	-286	-303
8.00%	-414	-424	-435	-447	-460	-473	-487

KR4301P62709 2019-06 풋270 725

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-723	-723	-723	-724	-724	-724	-725
-5.33%	-461	-461	-462	-463	-465	-467	-469
-2.67%	-202	-205	-209	-214	-219	-225	-232
0%	29	20	10	0	-10	-21	-32
2.67%	185	173	161	149	137	125	113
5.33%	249	243	235	227	219	210	200
8.00%	264	262	260	256	252	248	242

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

(단위:백만원)

3,395

공시일	2019-05-29
기준일	2019-05-28

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

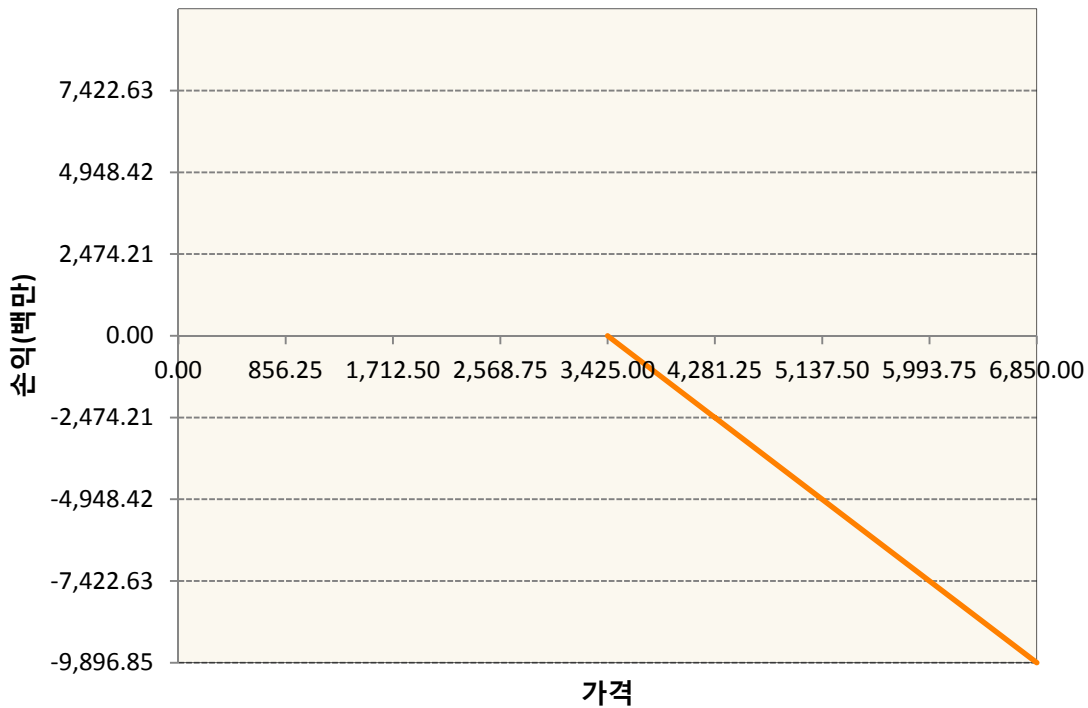
1. 계약금액

(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	3,665	0	3,665	
누계	유가증권	스왑	56,107	0	56,107	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,342	-20,342	장내
누계	통화	선도	0	18,557	-18,557	장외

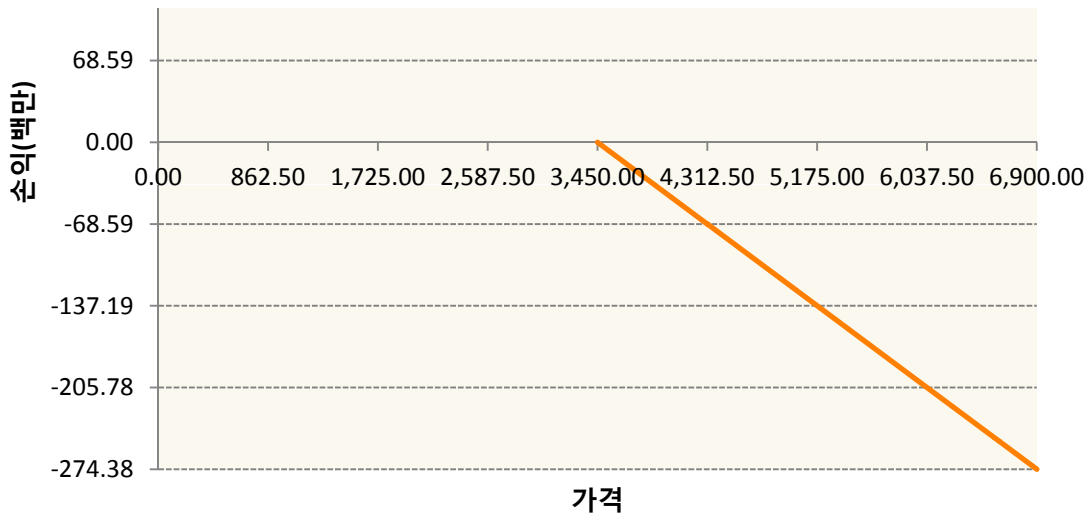
2. 만기시점의 손익구조

OESXM9-C3425-EURO STOXX 50

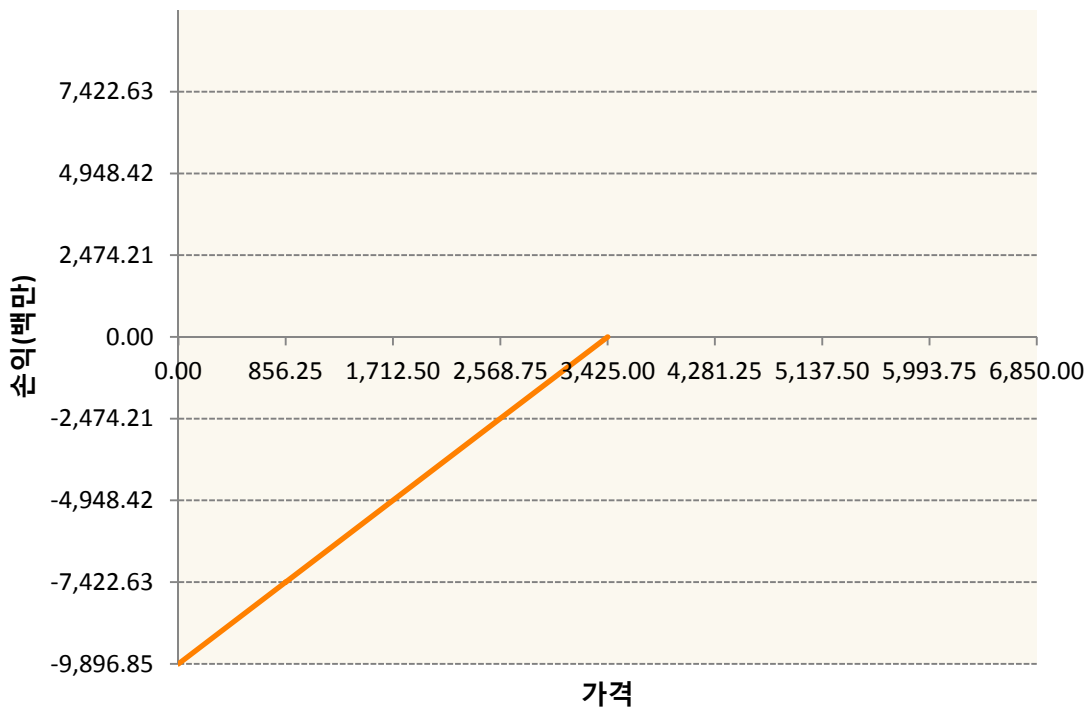


OESXM9-C3450-EURO STOXX 50

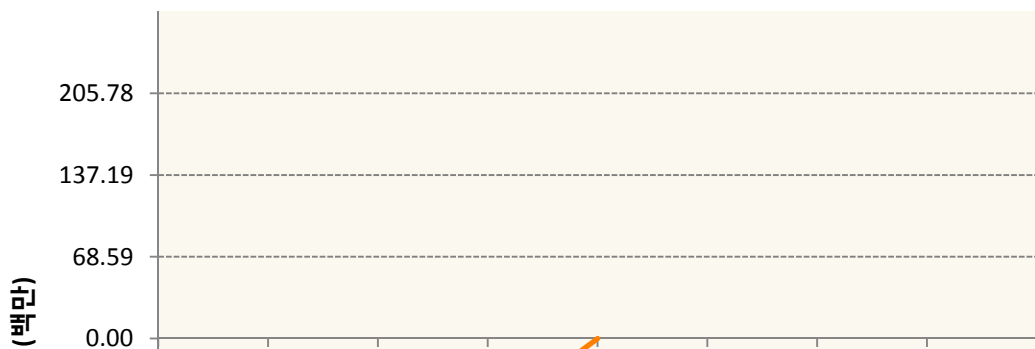


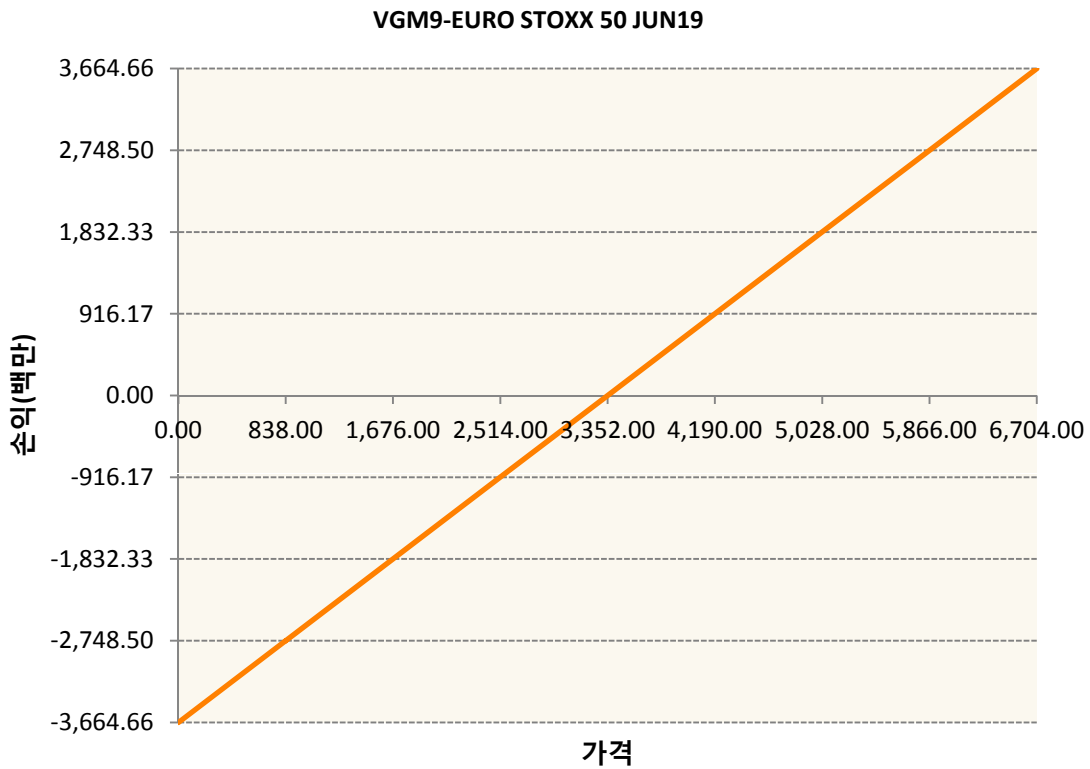
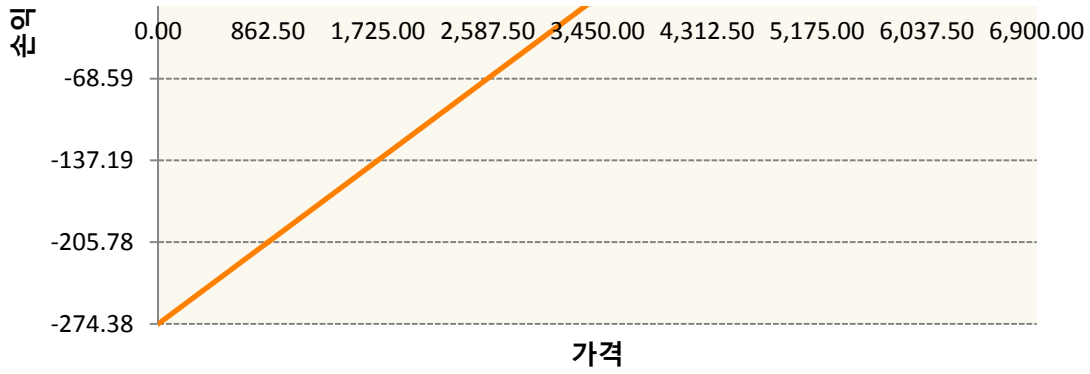


OESXM9-P3425-EURO STOXX 50



OESXM9-P3450-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	62
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	792
OESXM9-C3·EURO STOXX 50	22
OESXM9-P3·EURO STOXX 50	792
OESXM9-P3·EURO STOXX 50	22
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	293

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

(단위:백만원)

2,193

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

(단위:백만원)

1,014

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

(단위:백만원)

89

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

(단위:백만원)

130

공시일	2019-05-29
기준일	2019-05-28

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

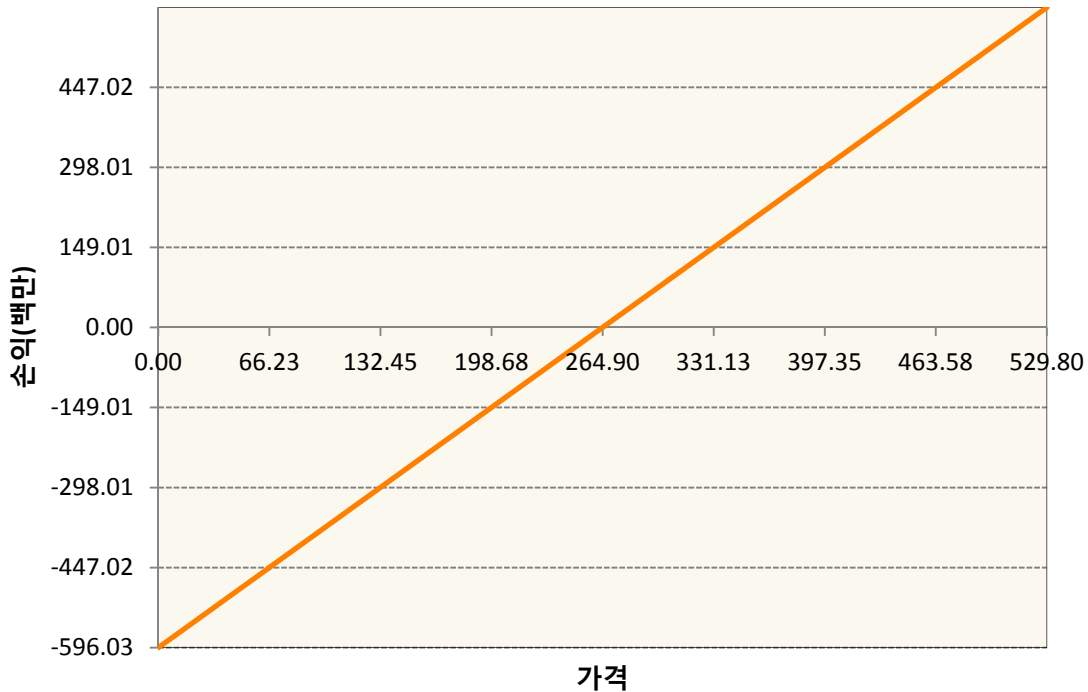
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	596	0	596	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	2019-05-29
기준일	2019-05-28

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

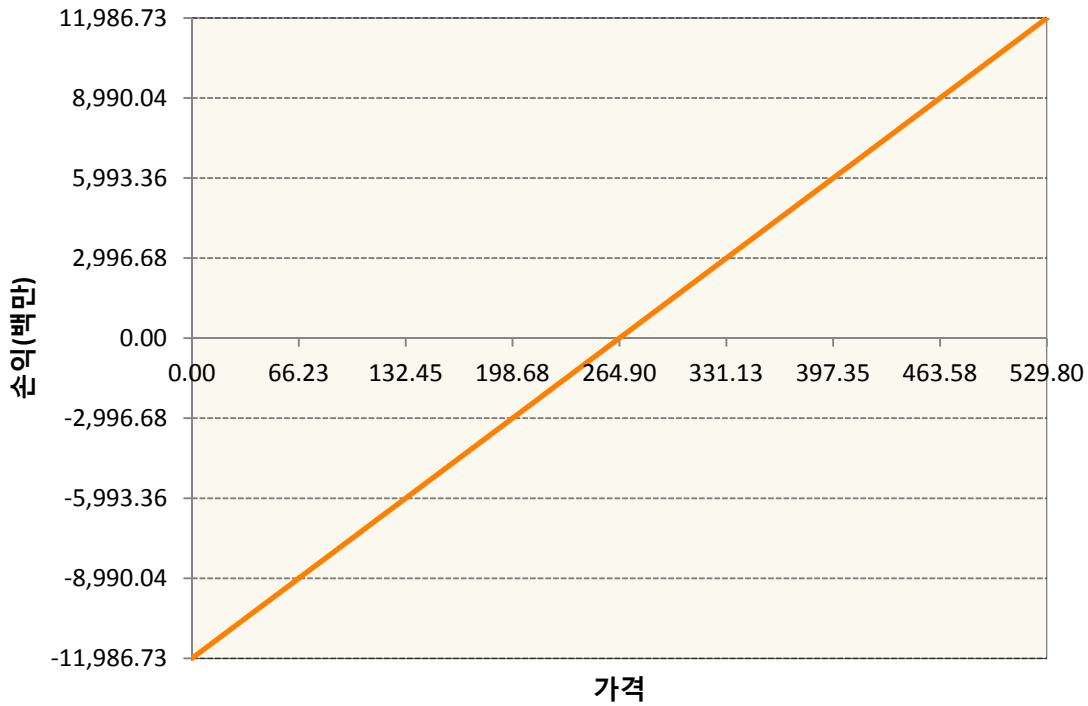
1. 계약금액

(단위:백만원)

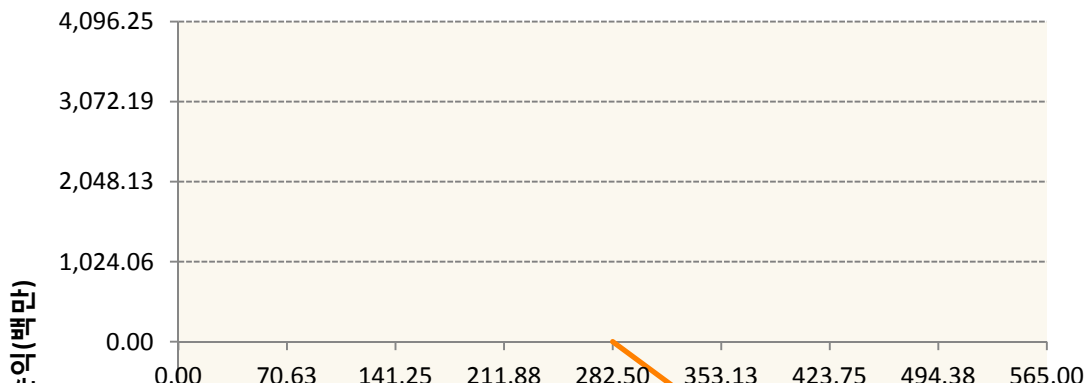
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,987	0	11,987	장내
누계	유가증권	옵션	5,081	22,906	-17,825	장내

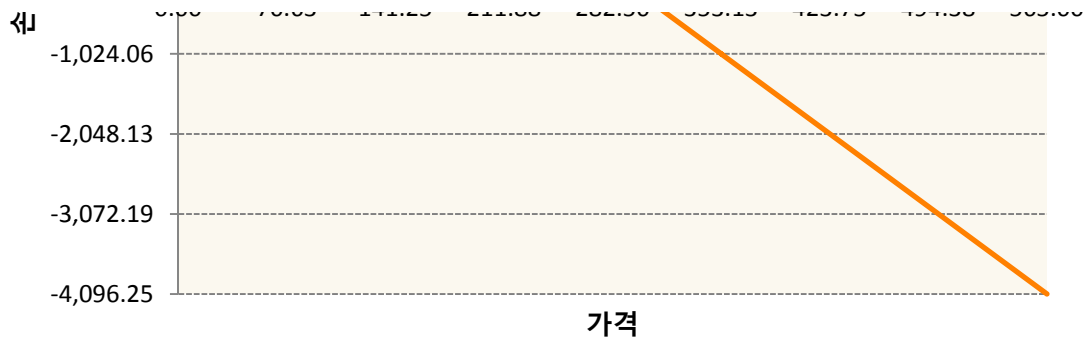
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

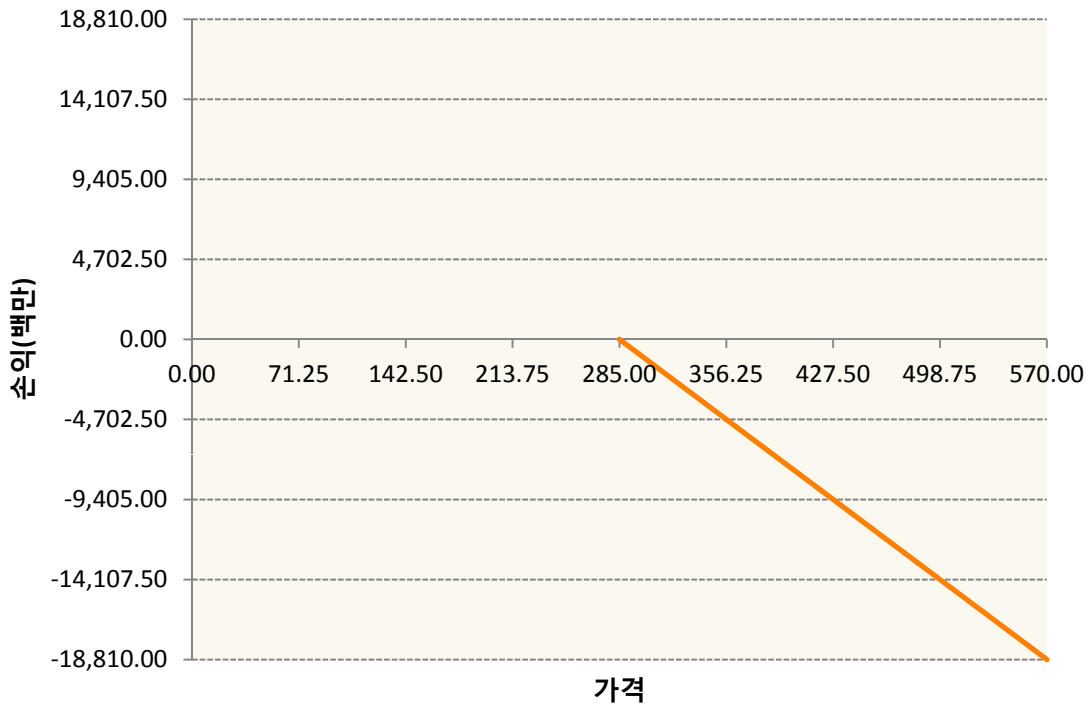


KR4201P62826-2019-06 콜282.5

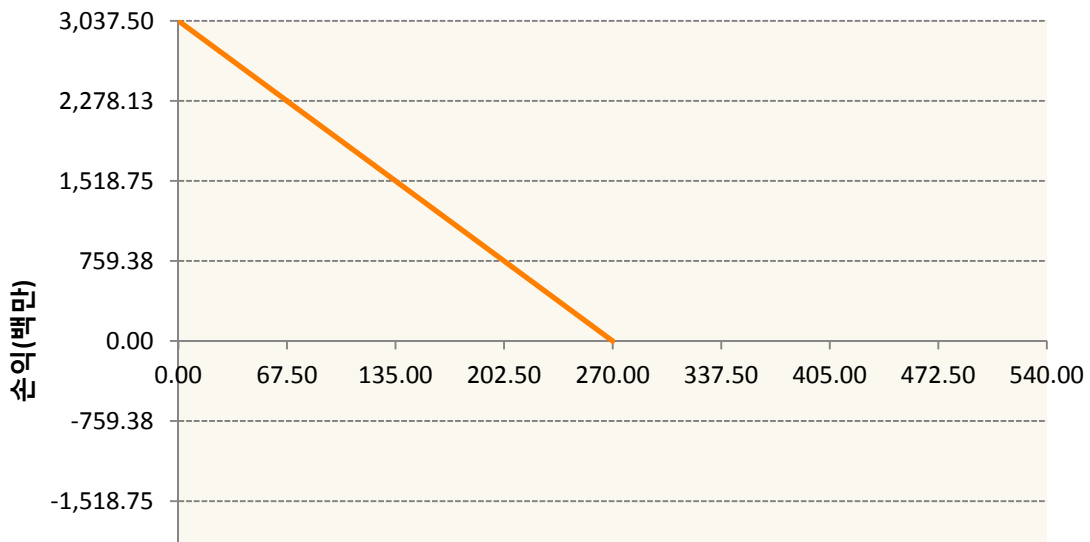


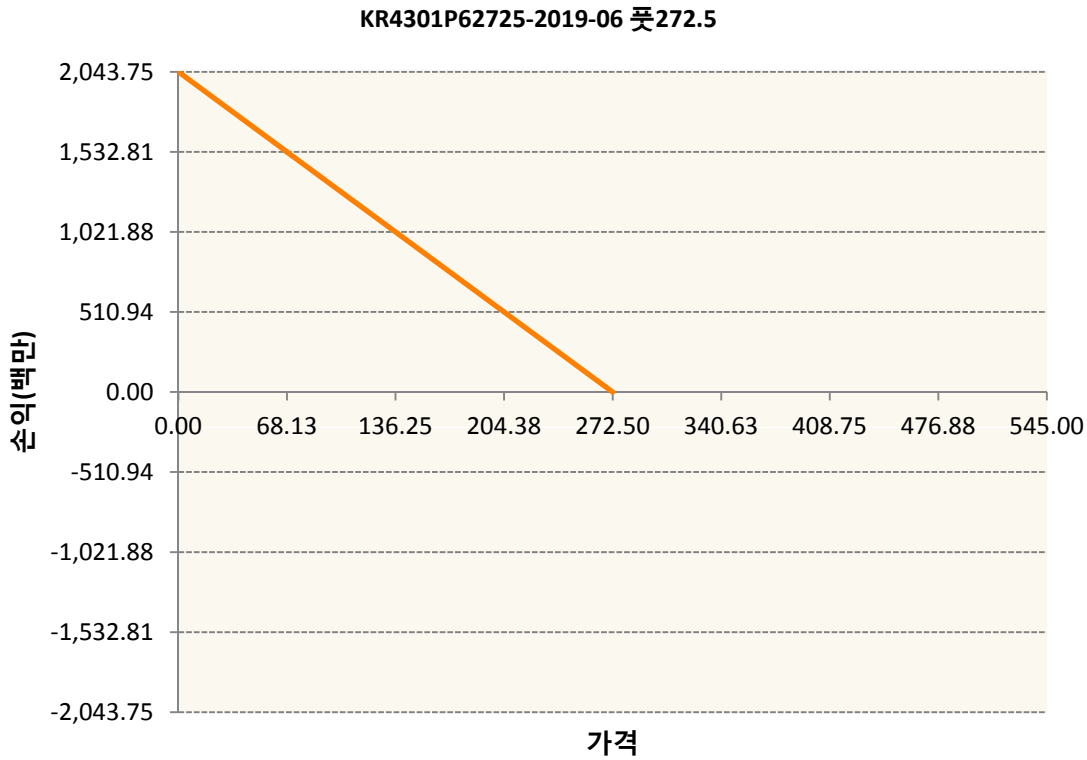
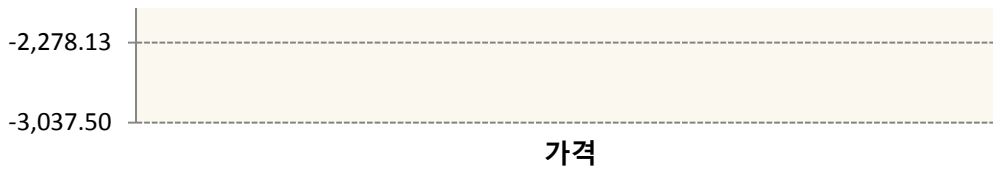


KR4201P62859-2019-06 콜285



KR4301P62709-2019-06 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						958
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-958	-958	-958	-958	-958	-958	-958	
-5.33%	-639	-639	-639	-639	-639	-639	-639	
-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%	639	639	639	639	639	639	639	
8.00%	958	958	958	958	958	958	958	
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	11	11	11	10	
-5.33%	12	11	11	11	10	9	8	
-2.67%	11	10	9	8	6	4	1	

0%	8	6	3	0	-4	-8	-12
2.67%	-3	-7	-13	-18	-24	-29	-35
5.33%	-30	-37	-44	-51	-58	-65	-72
8.00%	-81	-88	-95	-103	-110	-117	-124
KR4201P62859 2019-06 콜285							494
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	38	38	38	37	37	36	34
-5.33%	38	37	36	35	33	29	25
-2.67%	36	34	31	26	20	12	3
0%	28	21	12	0	-14	-29	-46
2.67%	-5	-23	-42	-64	-87	-111	-136
5.33%	-99	-129	-158	-189	-219	-251	-282
8.00%	-292	-326	-359	-393	-427	-461	-494
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	219	219	219	219	219
-5.33%	139	139	140	140	140	141	142
-2.67%	61	62	63	65	66	68	70
0%	-9	-6	-3	0	3	6	10
2.67%	-56	-52	-49	-45	-41	-38	-34
5.33%	-75	-73	-71	-69	-66	-63	-60
8.00%	-80	-79	-78	-77	-76	-75	-73
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	98	98	98	98
-2.67%	45	45	46	46	47	48	49
0%	-5	-3	-2	0	2	4	6
2.67%	-42	-40	-38	-35	-33	-30	-28
5.33%	-61	-60	-58	-56	-54	-51	-49
8.00%	-67	-66	-65	-64	-63	-62	-61

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

(단위:백만원)

1,485

공시일	2019-05-29
기준일	2019-05-28

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	237	0	237	
누계	유가증권	수익증권	16,026	0	16,026	

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	2019-05-29
기준일	2019-05-28

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	593	2,530	-1,937	
누계	유가증권	수익증권	58,456	0	58,456	

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	2019-05-29
기준일	2019-05-28

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	7,115	0	7,115	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	296,809	0	296,809	
누계	통화	선도	0	301,905	-301,905	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		949
FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E		379
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		76
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		998
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E		1,025
FX21019J043 KRW/USD 03-06-19E		569
FX21019J044 KRW/USD 03-06-19E		474
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		285
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		474
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		664
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		664
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		825
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		816
FX21019K00 KRW/USD 18-06-19E		569
FX21019K01 KRW/USD 14-06-19E		664
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		1,423
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,328
FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E		474
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E		797
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E		634
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		474

FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E	379
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E	797
FX21019K02 KRW/USD 24-06-19E	379
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E	949
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E	1,518
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E	285
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E	1,233
FX21019K04 KRW/USD 28-06-19E	1,290
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	664

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

(단위:백만원)

8,058

공시일	2019-05-29
기준일	2019-05-28

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

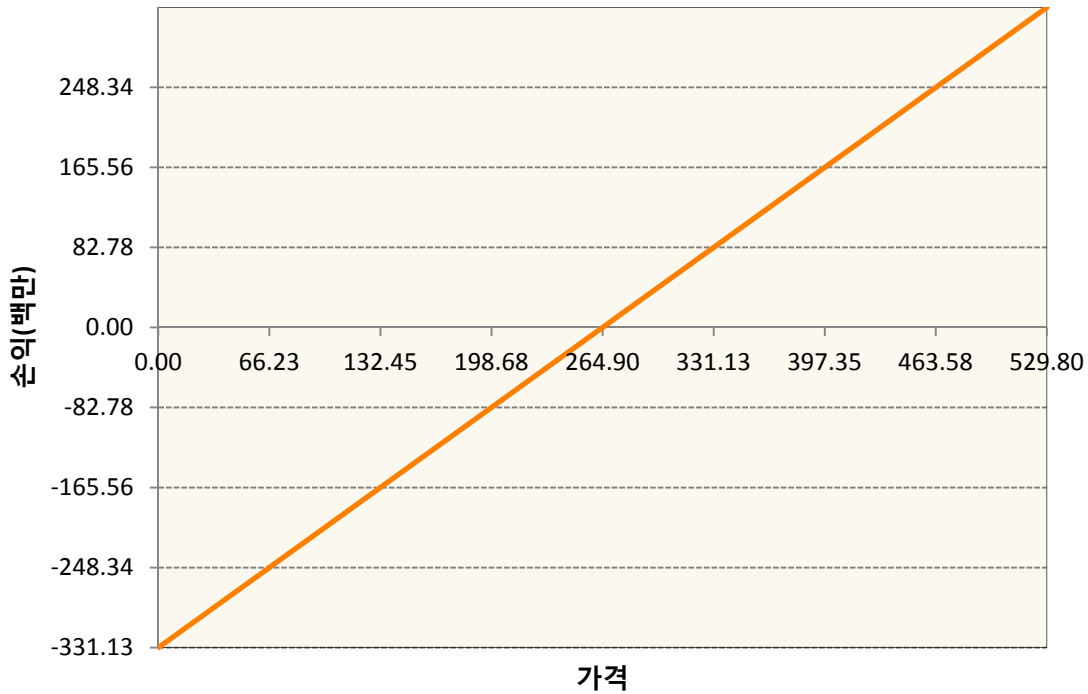
1. 계약금액

(단위:백만원)

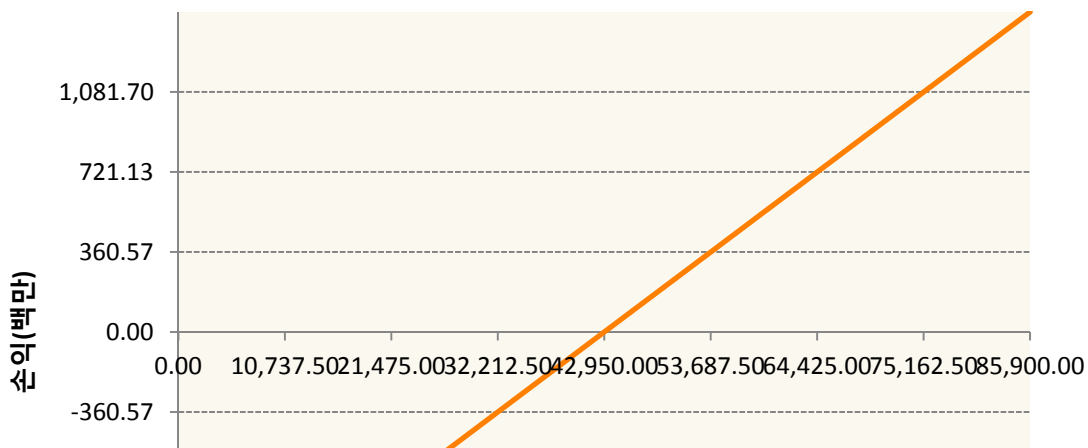
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,773	0	1,773	장내

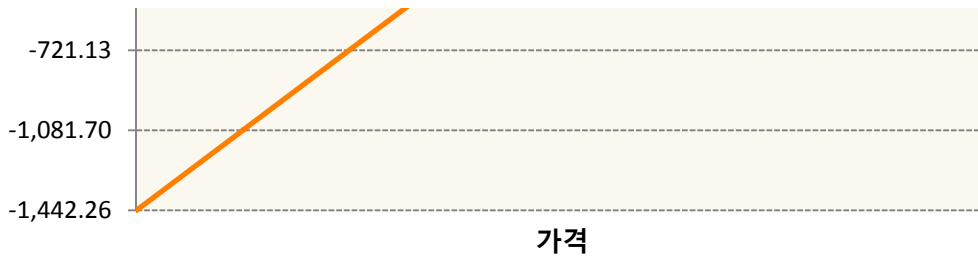
2. 만기시점의 손익구조

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						114
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-114	-114	-114	-114	-114	-114	-114	
-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%	114	114	114	114	114	114	114	

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

156

공시일	2019-05-29
기준일	2019-05-28

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

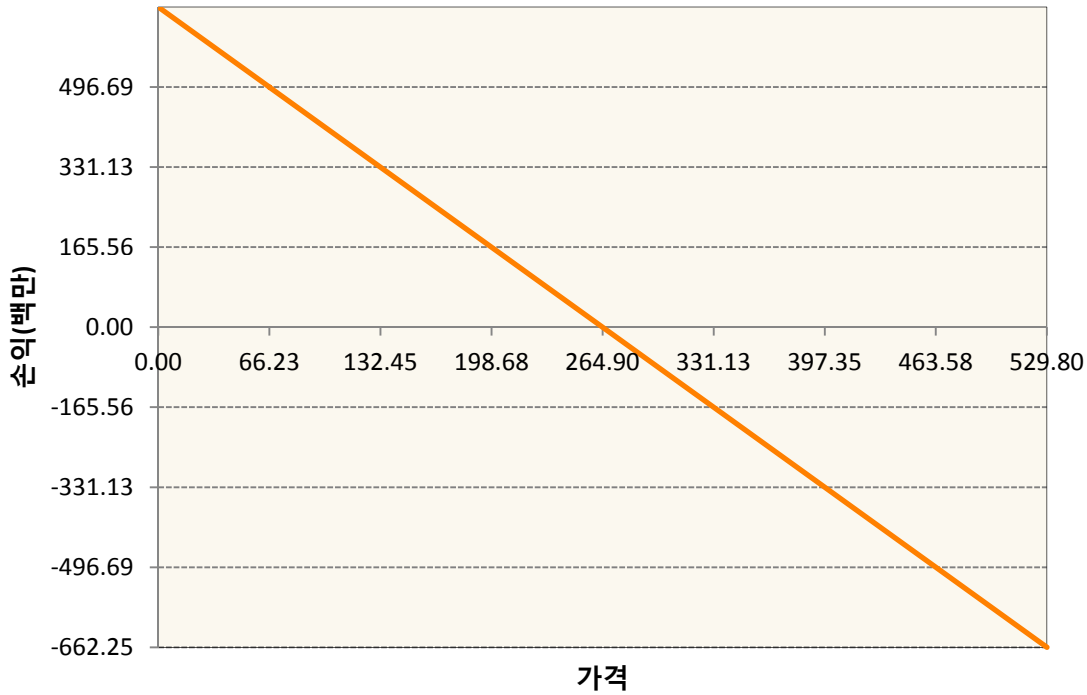
1. 계약금액

(단위:백만원)

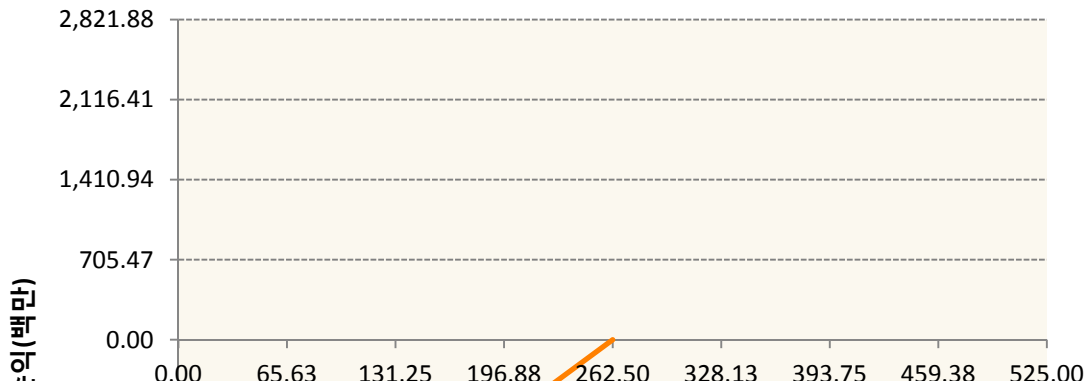
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	662	-662	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,352	-3,352	장내

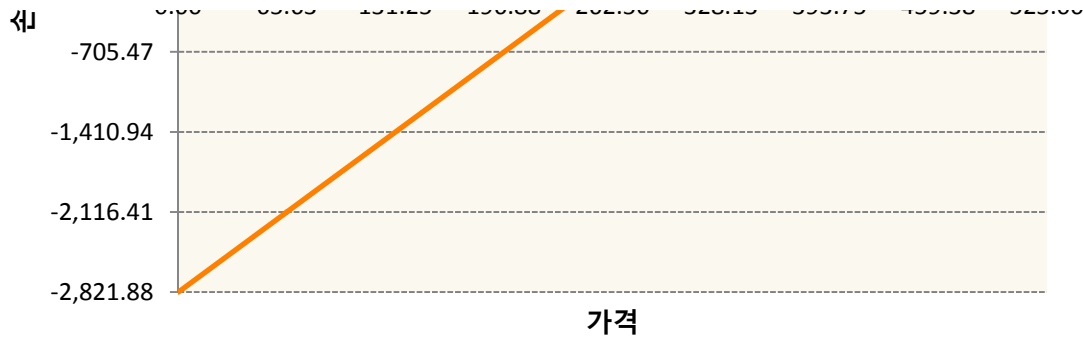
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

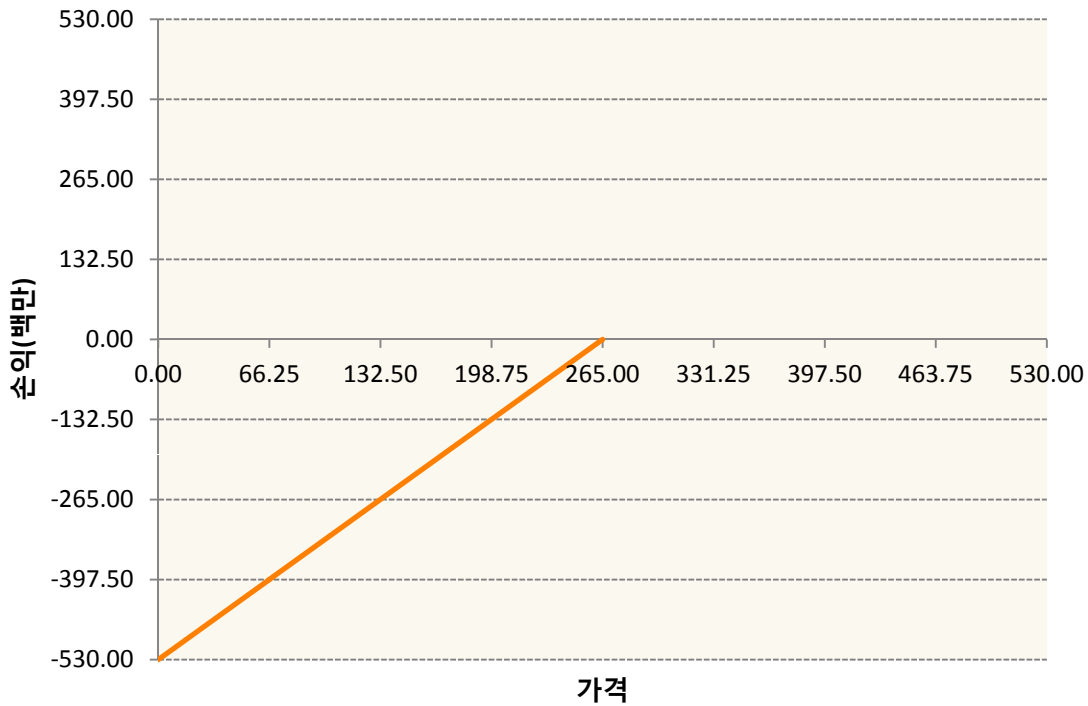


KR4301P62626-2019-06 풋262.5





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						177
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-174	-175	-175	-175	-175	-176	-177
-5.33%	-100	-101	-102	-103	-105	-106	-108
-2.67%	-34	-36	-39	-42	-45	-48	-51
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	27	25	23	21	19	16	14
5.33%	30	30	29	28	27	26	25
8.00%	30	30	30	30	30	29	29
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	-21	-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	7	7	7	6
8.00%	8	8	8	8	8	8	8

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

(단위:백만원)

272

공시일	2019-05-29
기준일	2019-05-28

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

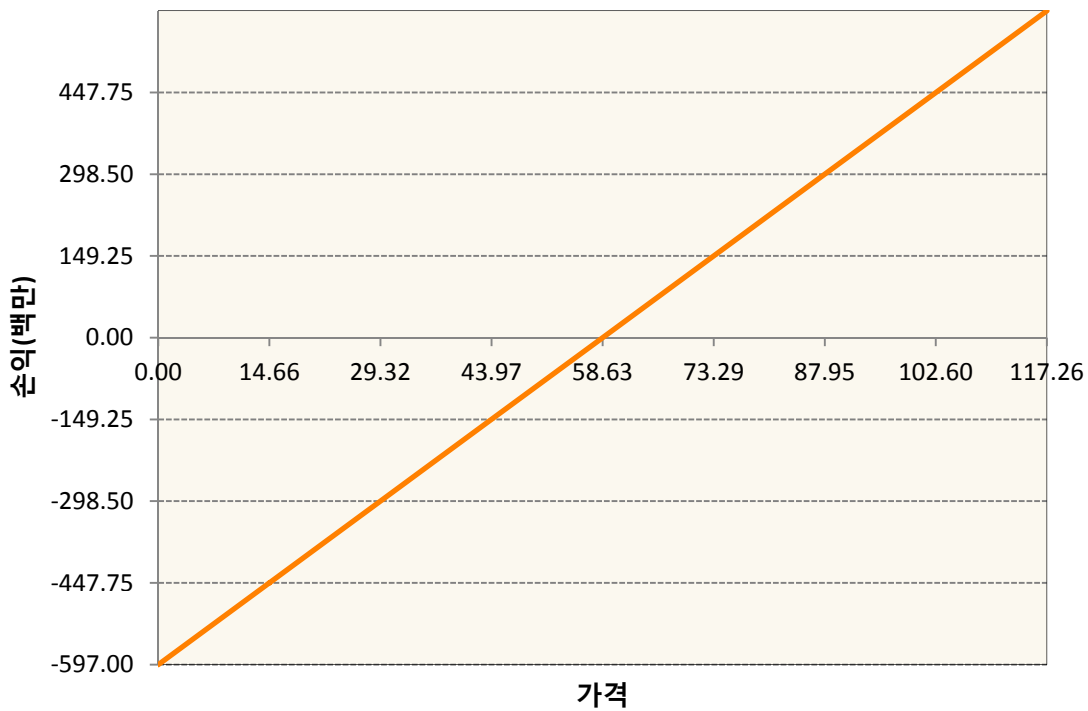
1. 계약금액

(단위:백만원)

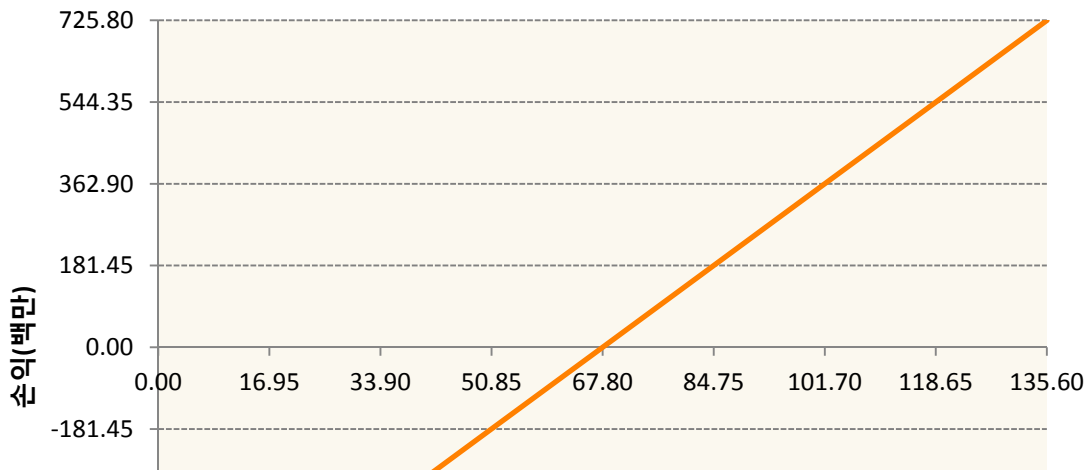
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,687	296	2,390	

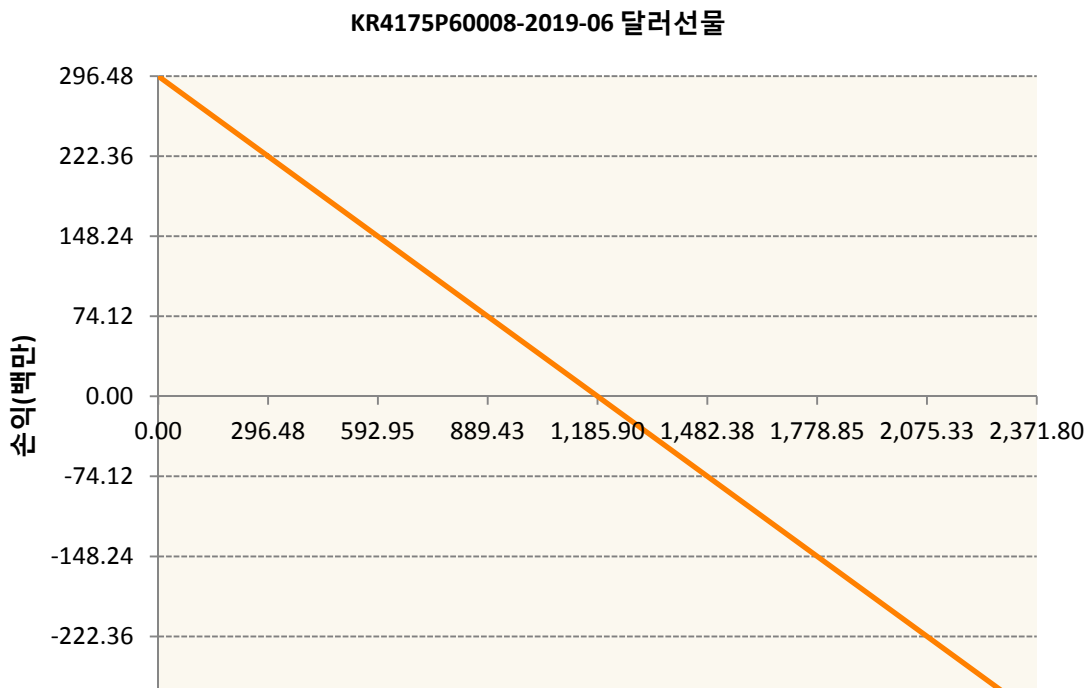
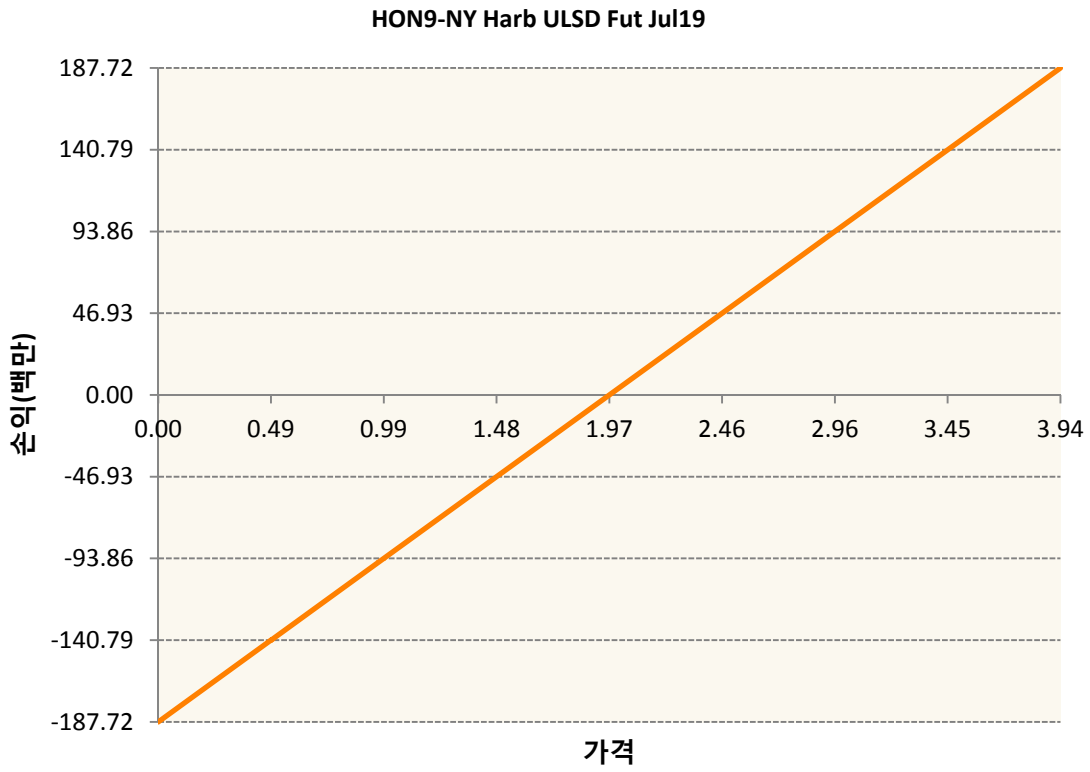
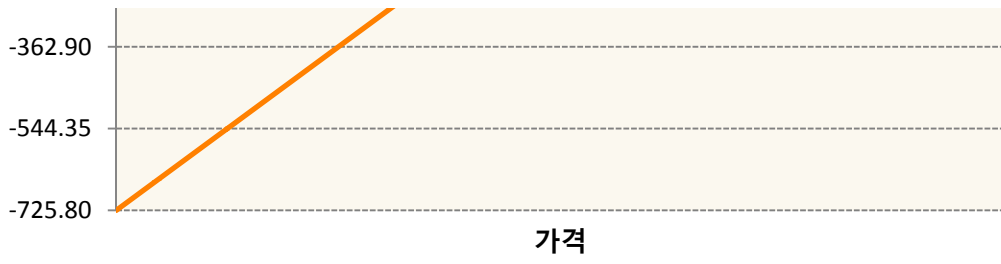
2. 만기시점의 손익구조

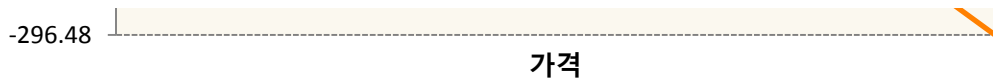
CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19



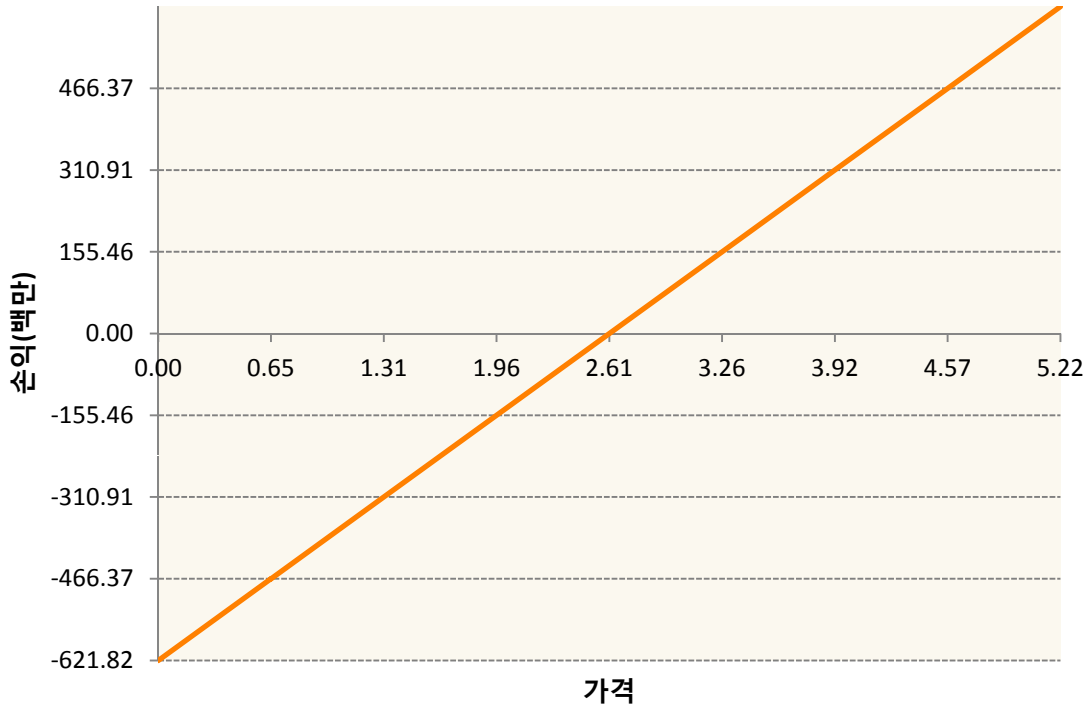
COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19



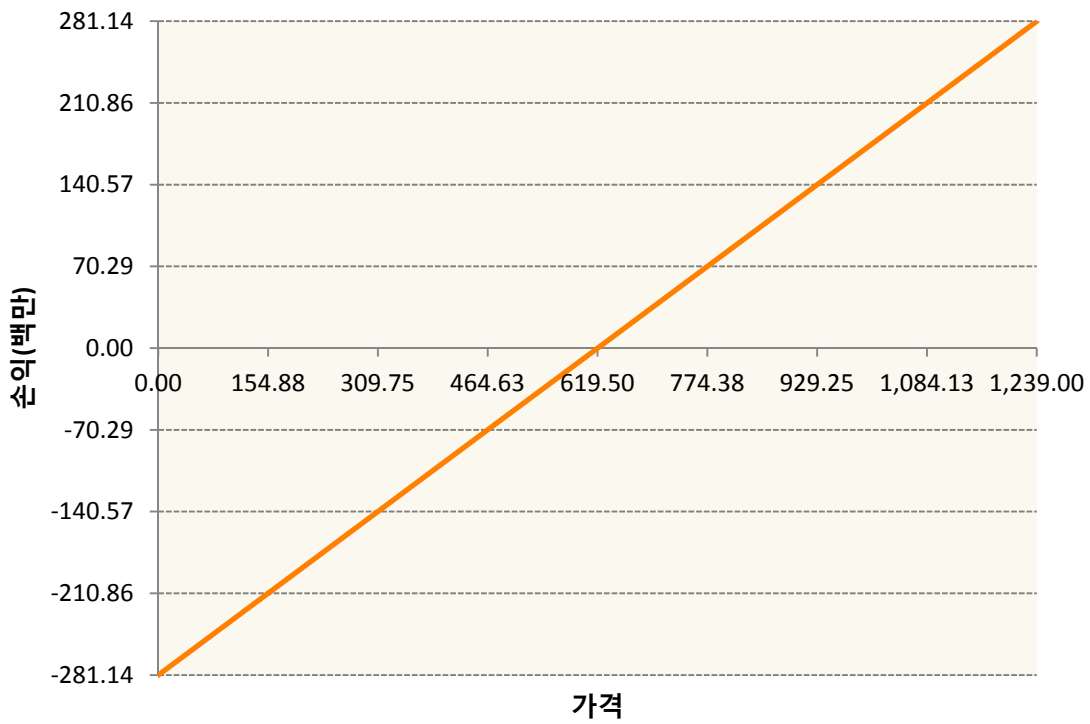




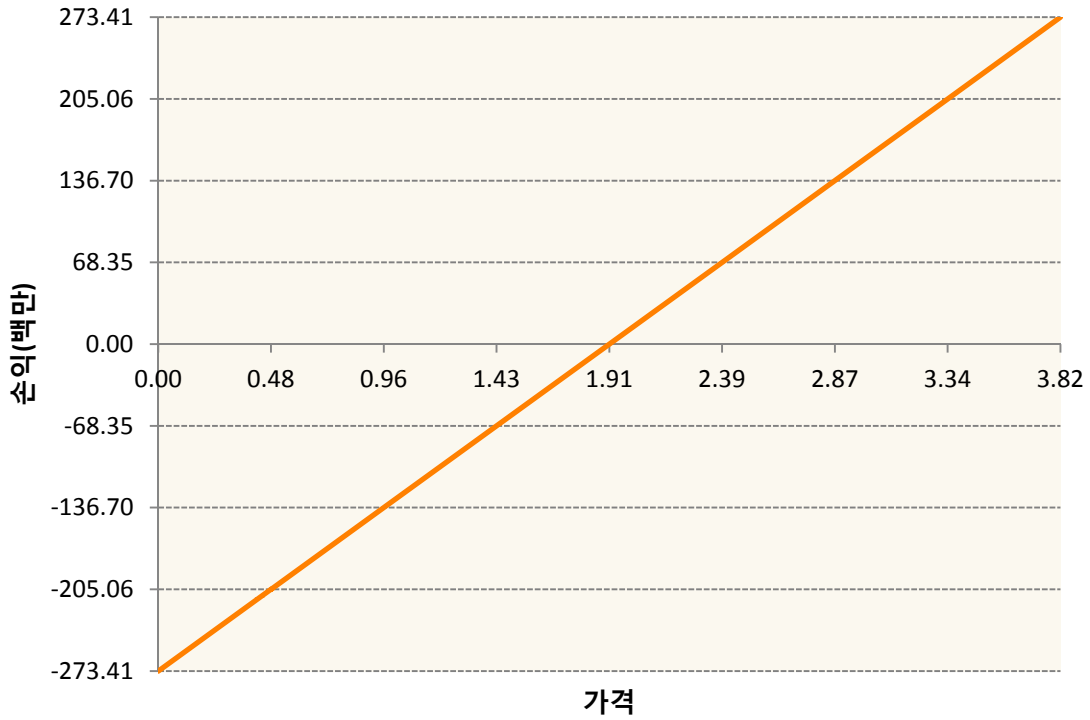
NGN19-NATURAL GAS FUTR Jul19



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	58
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)

398

공시일	2019-05-29
기준일	2019-05-28

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

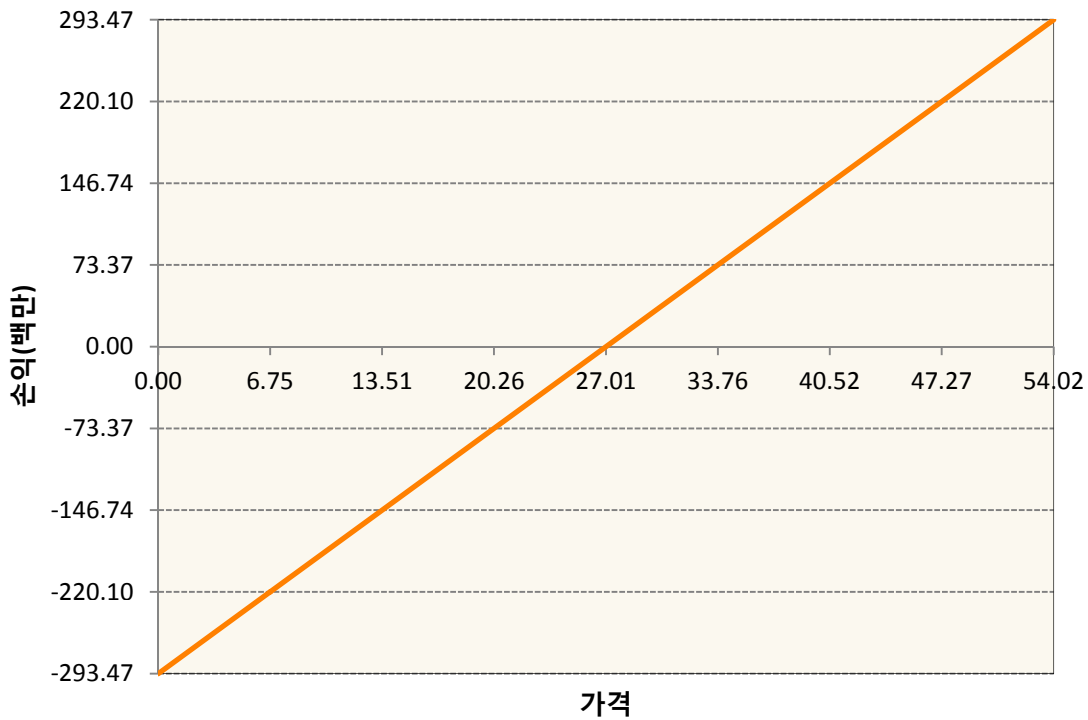
1. 계약금액

(단위:백만원)

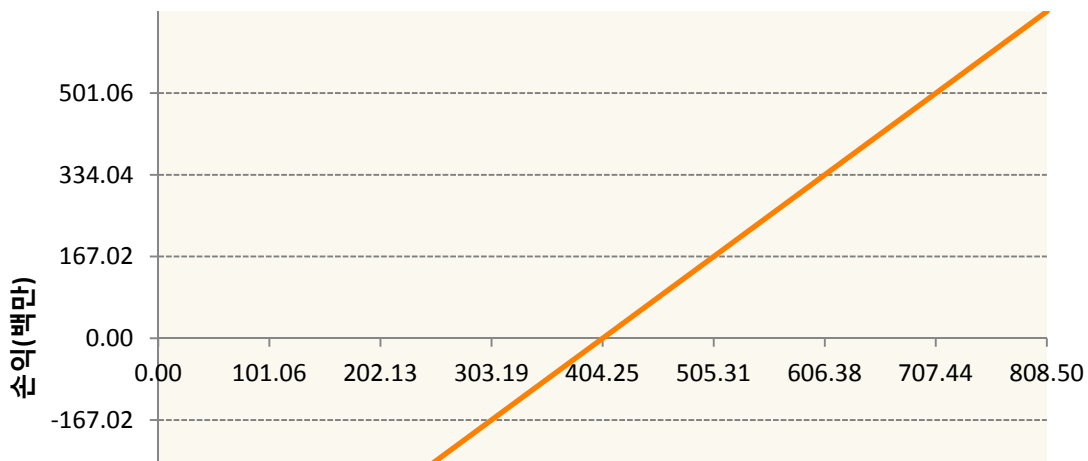
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,960	59	2,901	

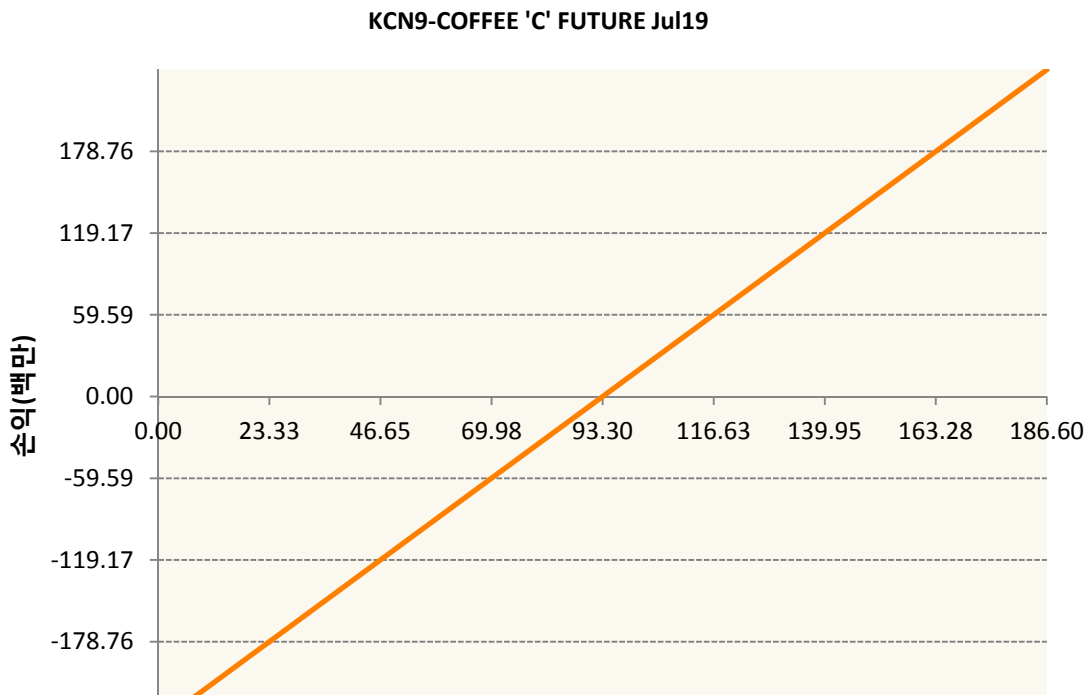
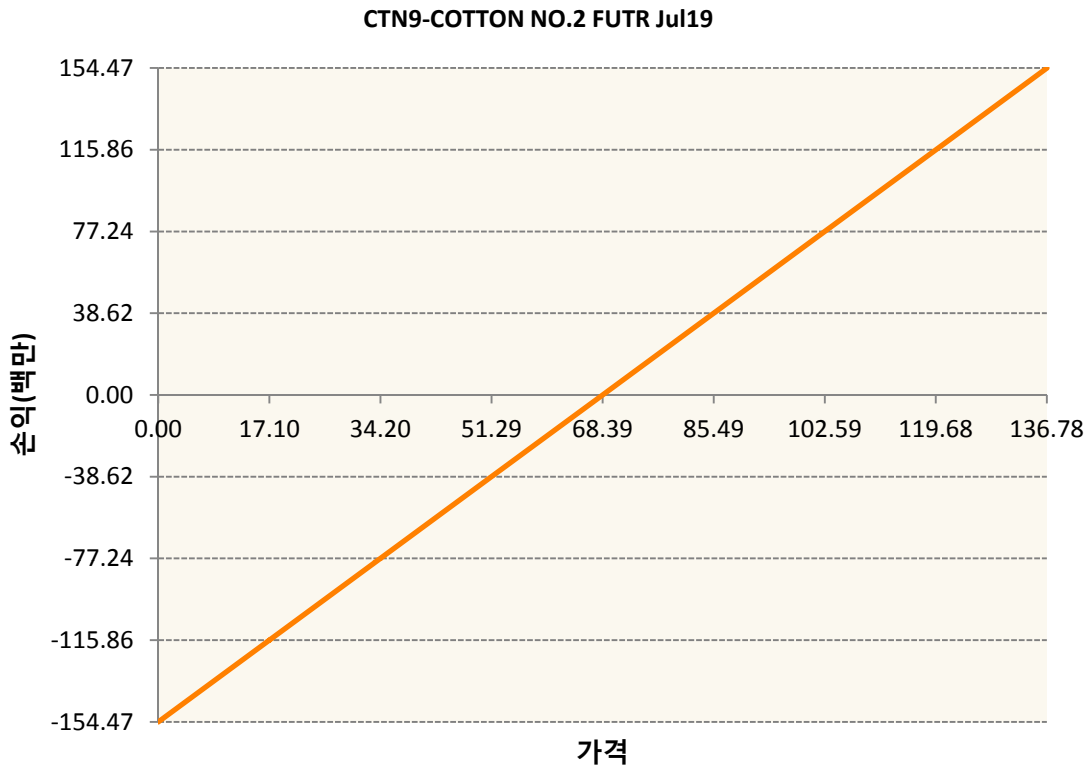
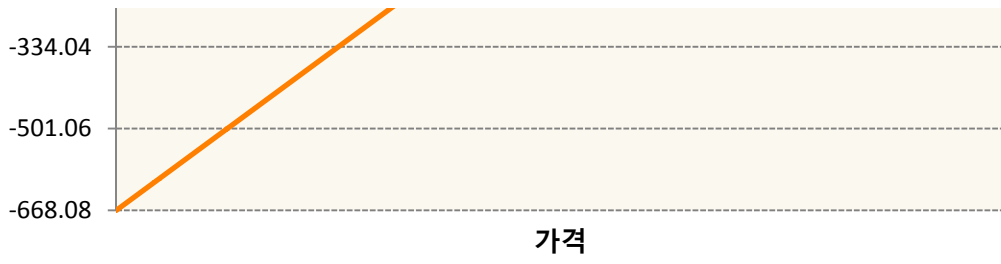
2. 만기시점의 손익구조

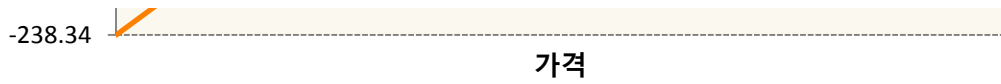
BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19



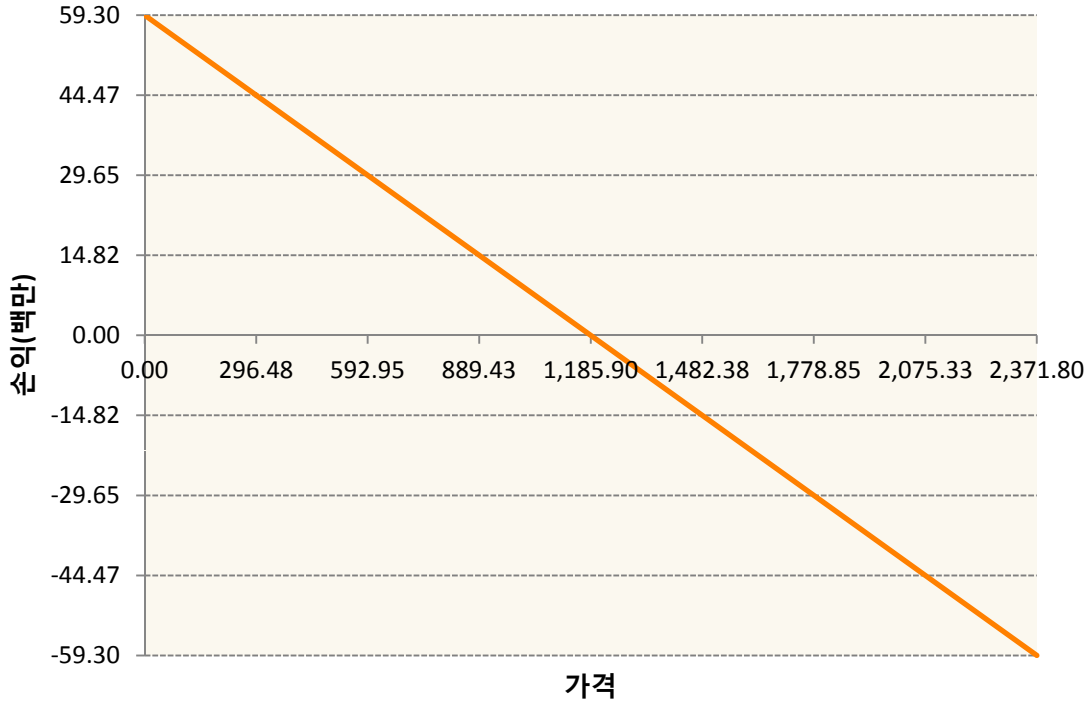
CN9-CORN FUTURE Jul19



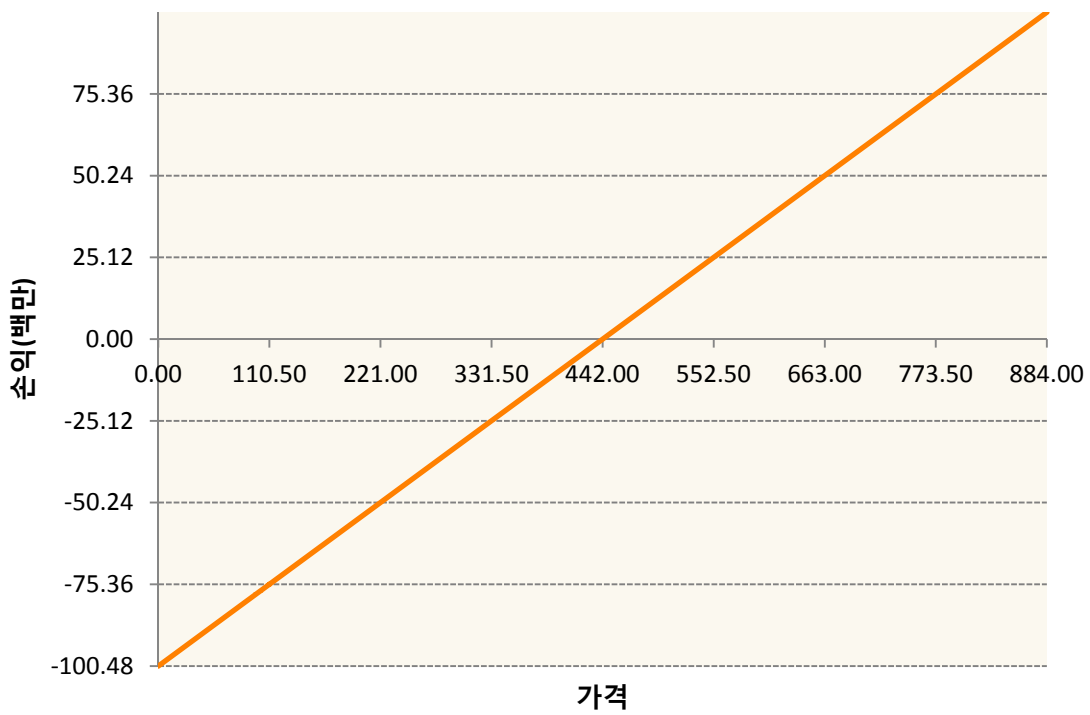




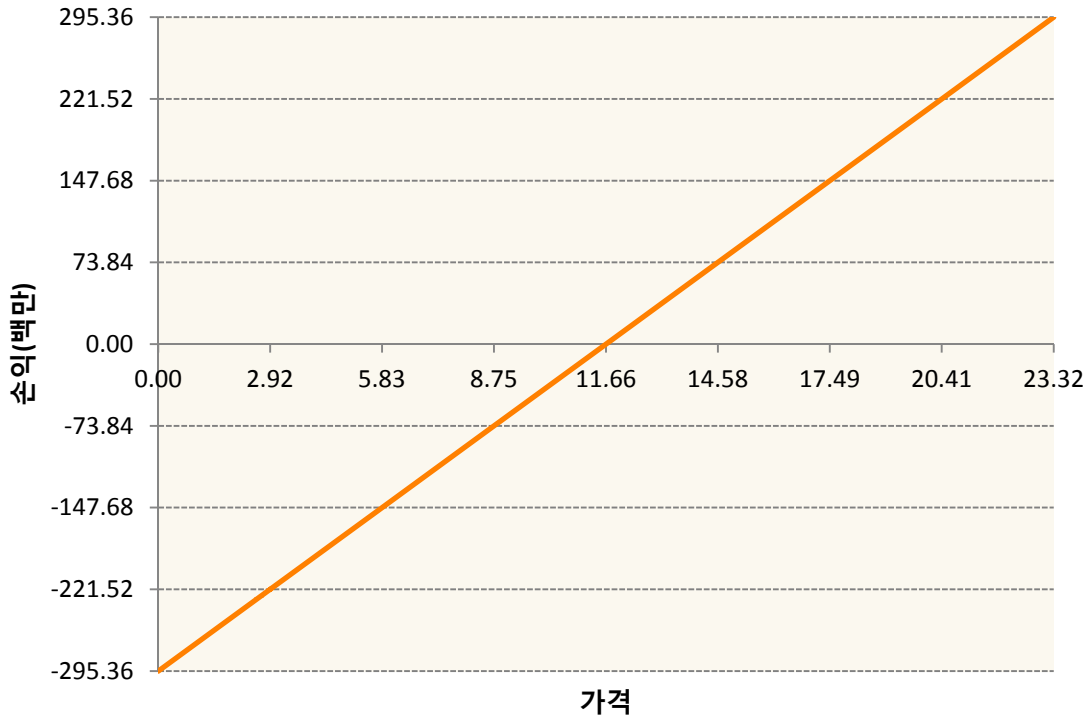
KR4175P60008-2019-06 달러선물



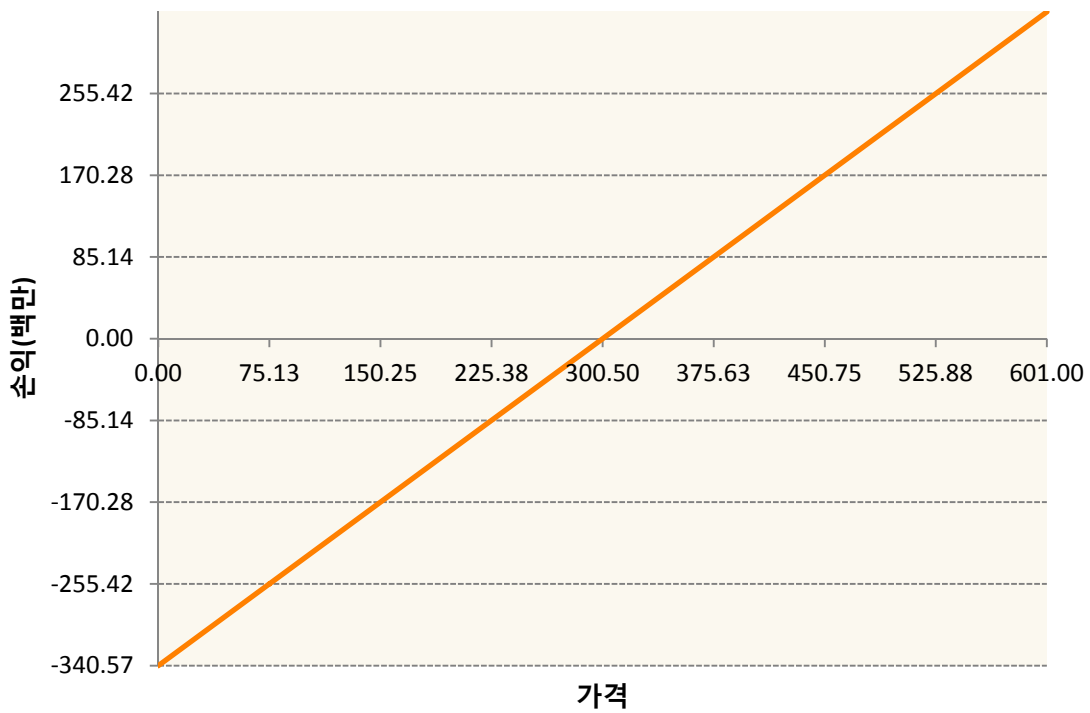
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

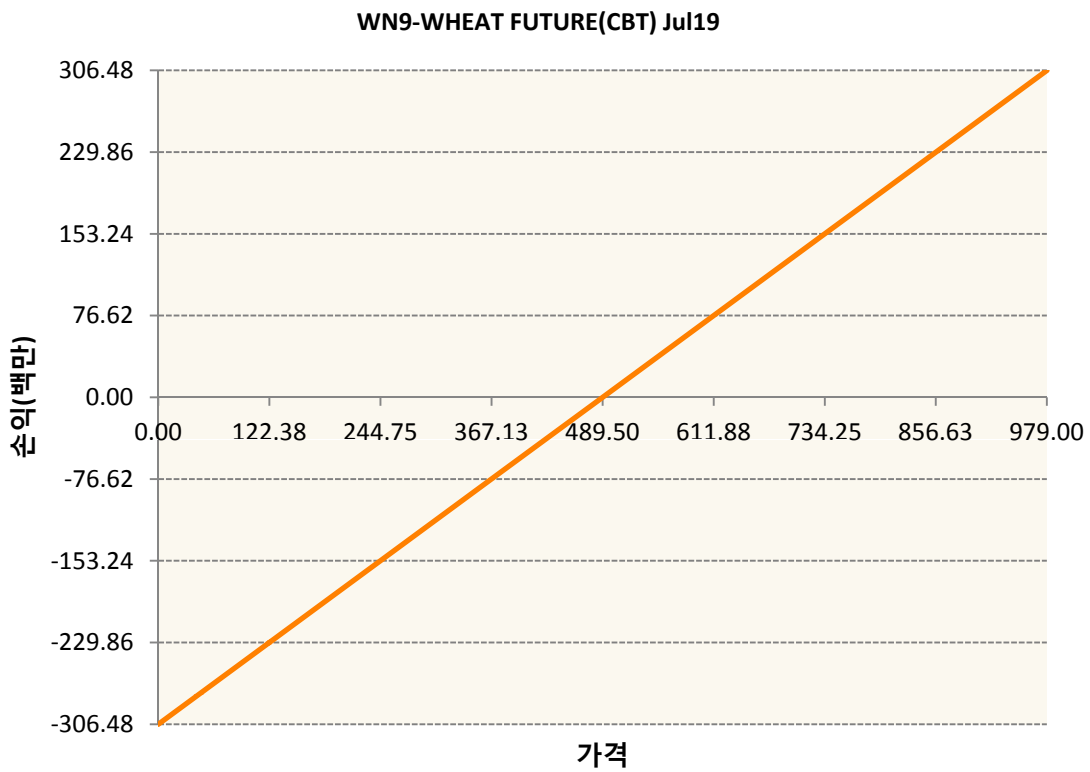
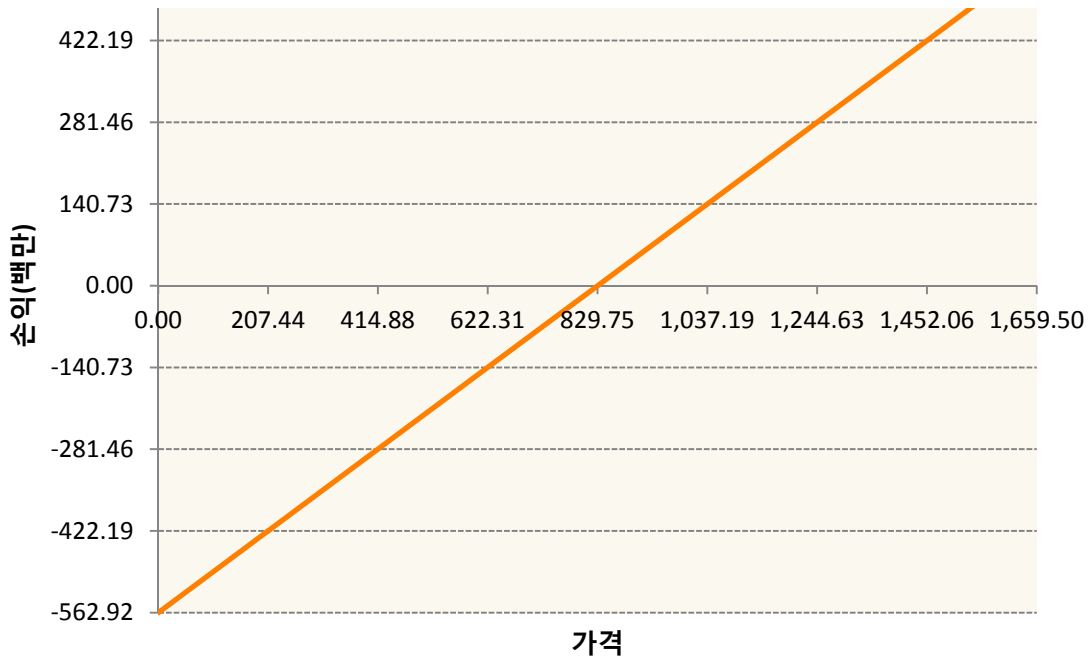


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19



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