

공시일	2019-05-30
기준일	2019-05-29

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)

88

공시일	2019-05-30
기준일	2019-05-29

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

1,115

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

668

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-05-30
기준일	2019-05-29

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)

881

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-05-30
기준일	2019-05-29

유로인덱스모(주식-파생형)

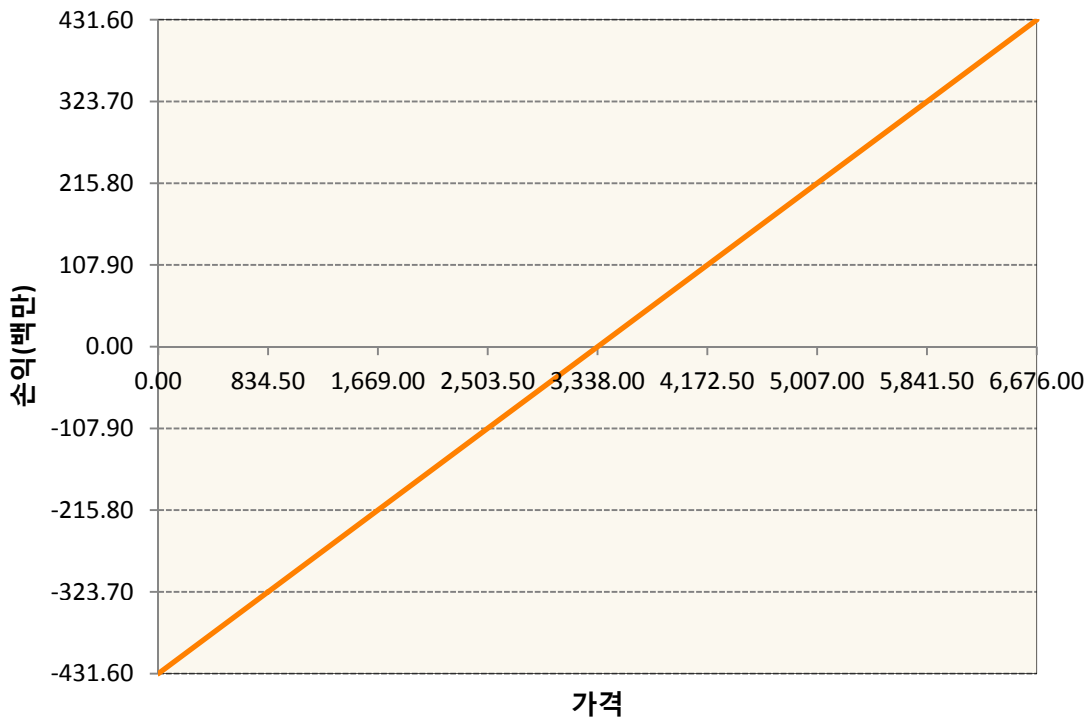
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	432	0	432	

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	2019-05-30
기준일	2019-05-29

차이나인덱스모(주식-파생형)

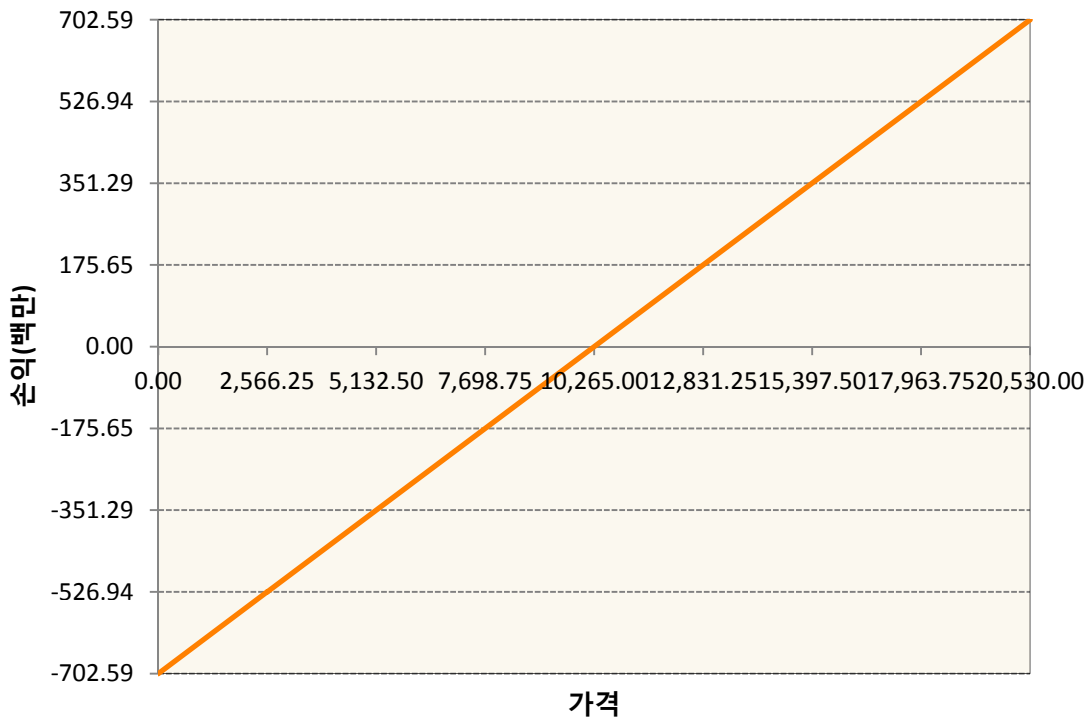
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	703	0	703	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM9	HSCEI Futures Jun19	56
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

58

공시일	2019-05-30
기준일	2019-05-29

커버드콜모(주식혼합-파생형)

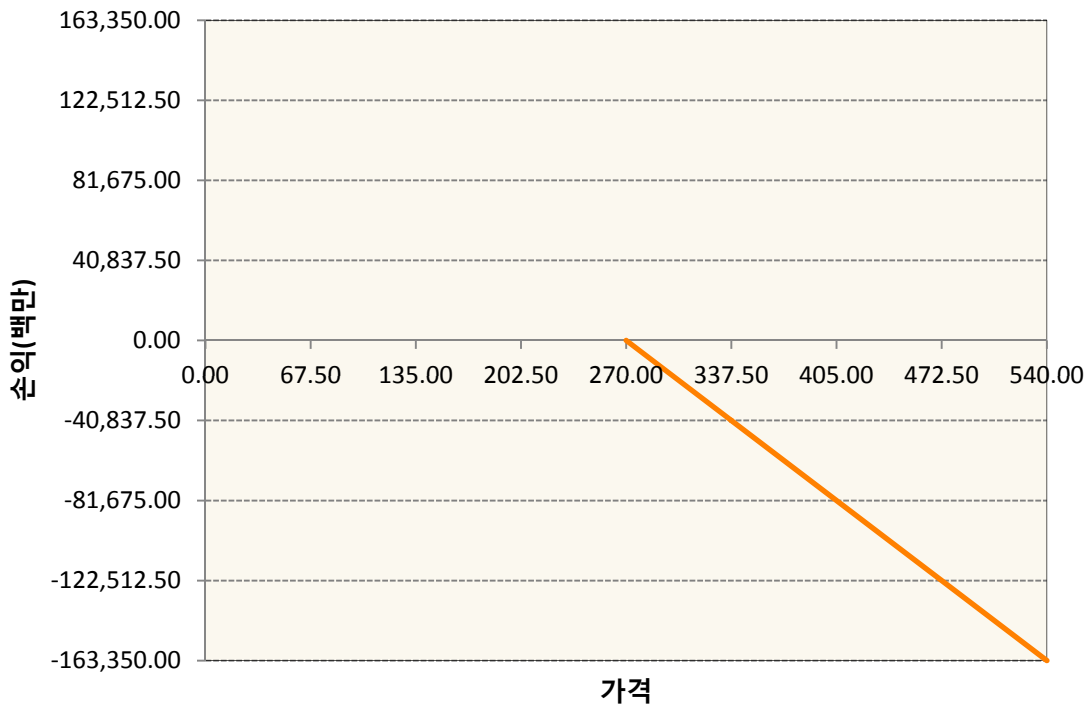
1. 계약금액

(단위:백만원)

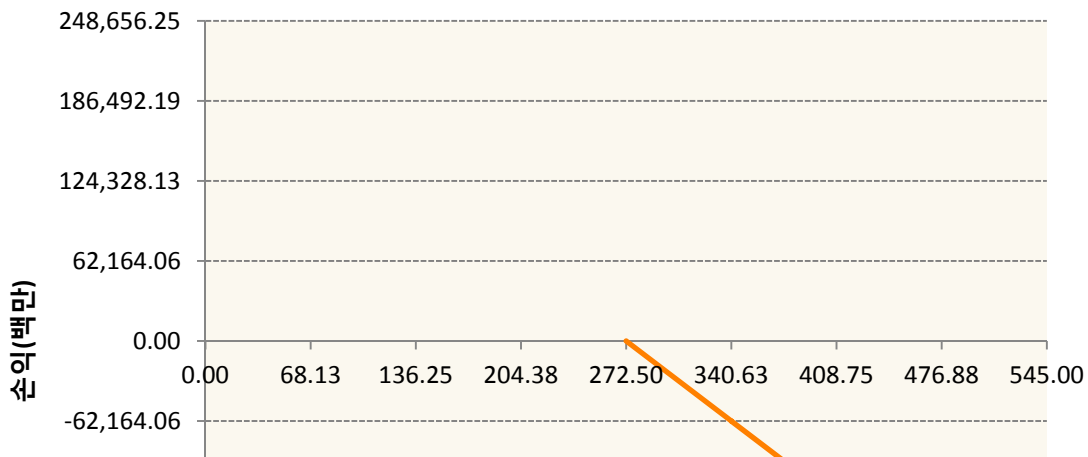
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	614,506	-614,506	장내

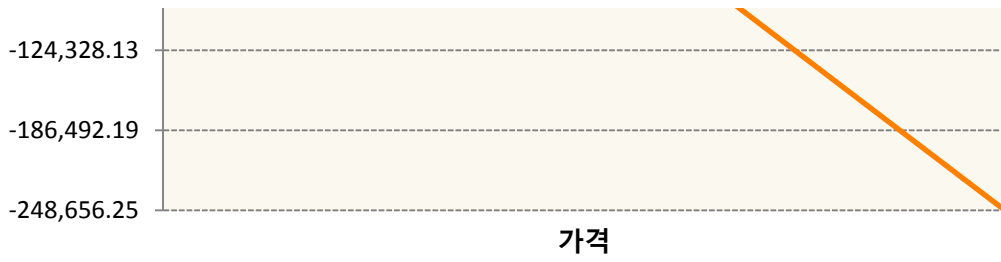
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P62701-2019-06 콜270



KR4201P62727-2019-06 콜272.5





KR4301P62709-2019-06 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201P62701		2019-06 콜270					7,634
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,348	1,343	1,332	1,314	1,287	1,249	1,200
-5.33%	1,324	1,295	1,252	1,193	1,119	1,029	926
-2.67%	1,180	1,084	967	832	682	518	343
0%	644	440	225	0	-232	-471	-715
2.67%	-697	-976	-1,256	-1,536	-1,817	-2,098	-2,379
5.33%	-3,100	-3,358	-3,620	-3,886	-4,156	-4,427	-4,701
8.00%	-6,436	-6,601	-6,783	-6,979	-7,188	-7,407	-7,634
KR4201P62727		2019-06 콜272.5					10,404
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,514	1,510	1,500	1,482	1,454	1,412	1,355

-5.33%	1,495	1,468	1,425	1,361	1,277	1,171	1,044
-2.67%	1,368	1,265	1,131	970	784	575	346
0%	826	574	297	0	-313	-641	-979
2.67%	-705	-1,103	-1,507	-1,915	-2,325	-2,739	-3,154
5.33%	-3,748	-4,169	-4,593	-5,019	-5,445	-5,873	-6,301
8.00%	-8,320	-8,628	-8,956	-9,301	-9,658	-10,027	-10,404
KR4301P62709 2019-06 풋270							15,016
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-15,006	-15,006	-15,006	-15,006	-15,008	-15,011	-15,016
-5.33%	-9,784	-9,786	-9,790	-9,798	-9,811	-9,830	-9,857
-2.67%	-4,582	-4,605	-4,640	-4,687	-4,748	-4,821	-4,906
0%	392	276	145	0	-156	-320	-493
2.67%	4,354	4,125	3,894	3,663	3,431	3,198	2,965
5.33%	6,463	6,274	6,077	5,874	5,665	5,452	5,237
8.00%	7,095	7,026	6,940	6,837	6,720	6,590	6,449

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

(단위:백만원)

32,400

공시일	2019-05-30
기준일	2019-05-29

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

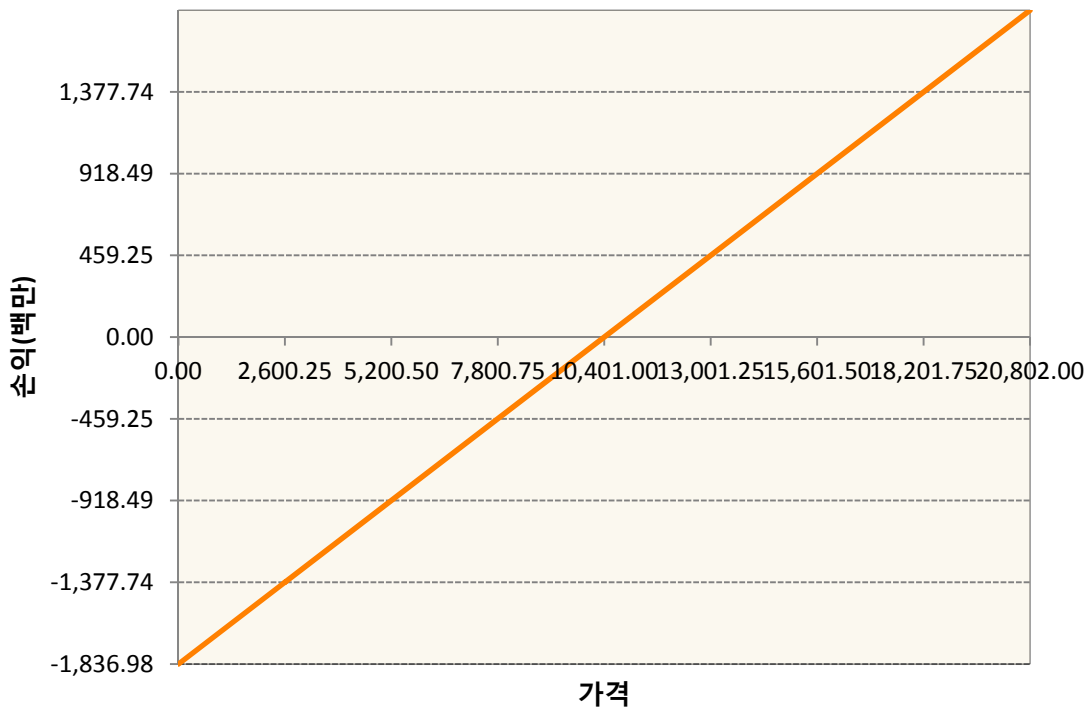
1. 계약금액

(단위:백만원)

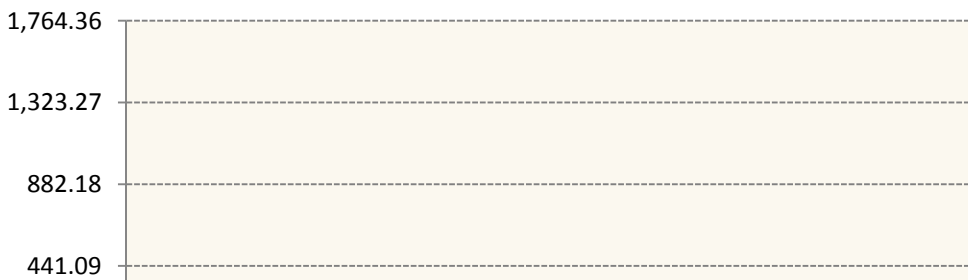
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,837	0	1,837	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,664	-5,664	장내
누계	통화	선도	152	3,194	-3,042	장외

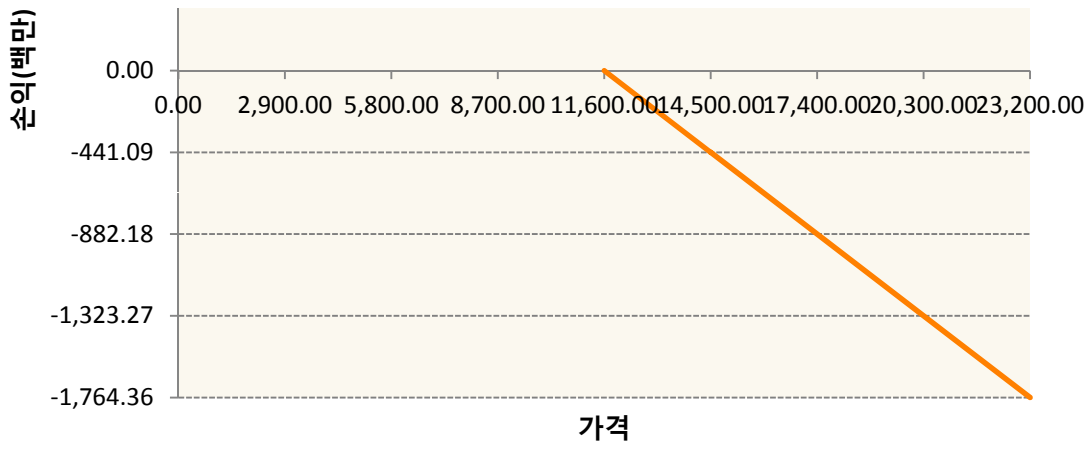
2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19

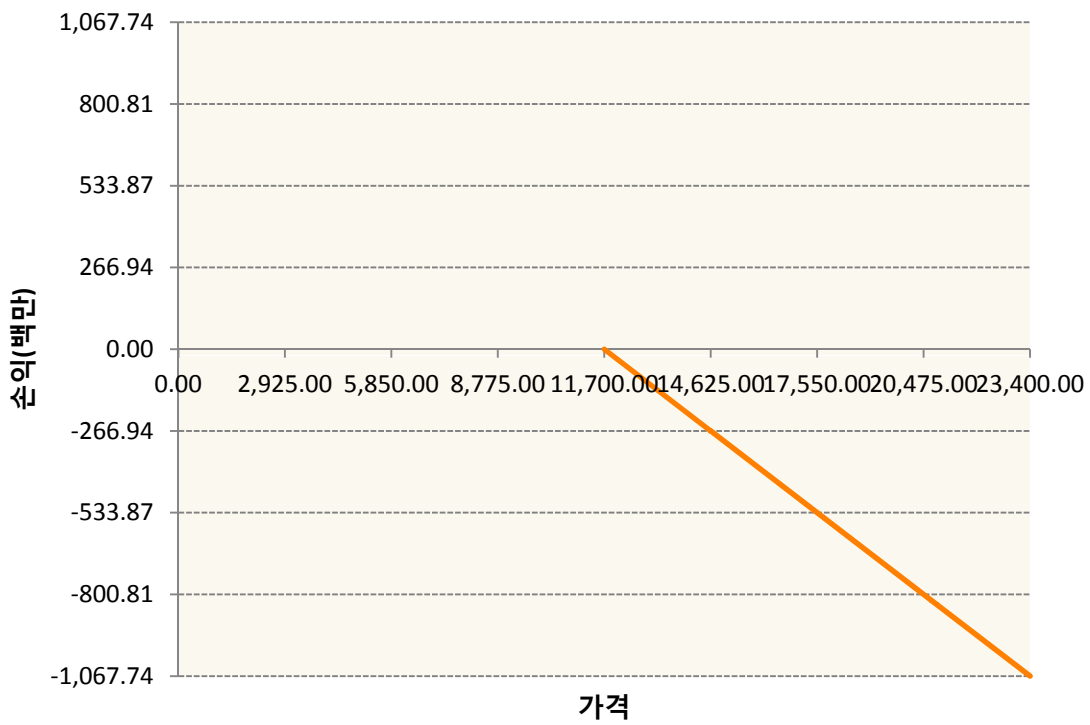


OHHIK9-C116-HSCEI

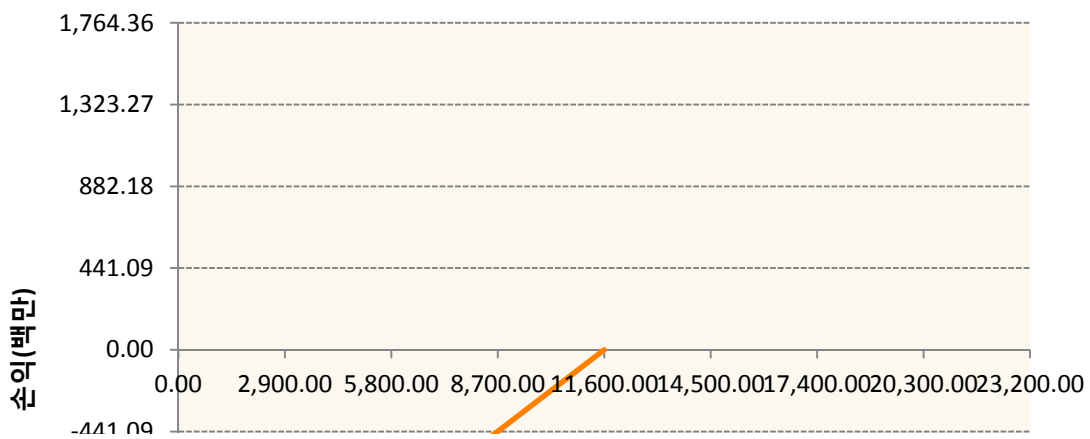


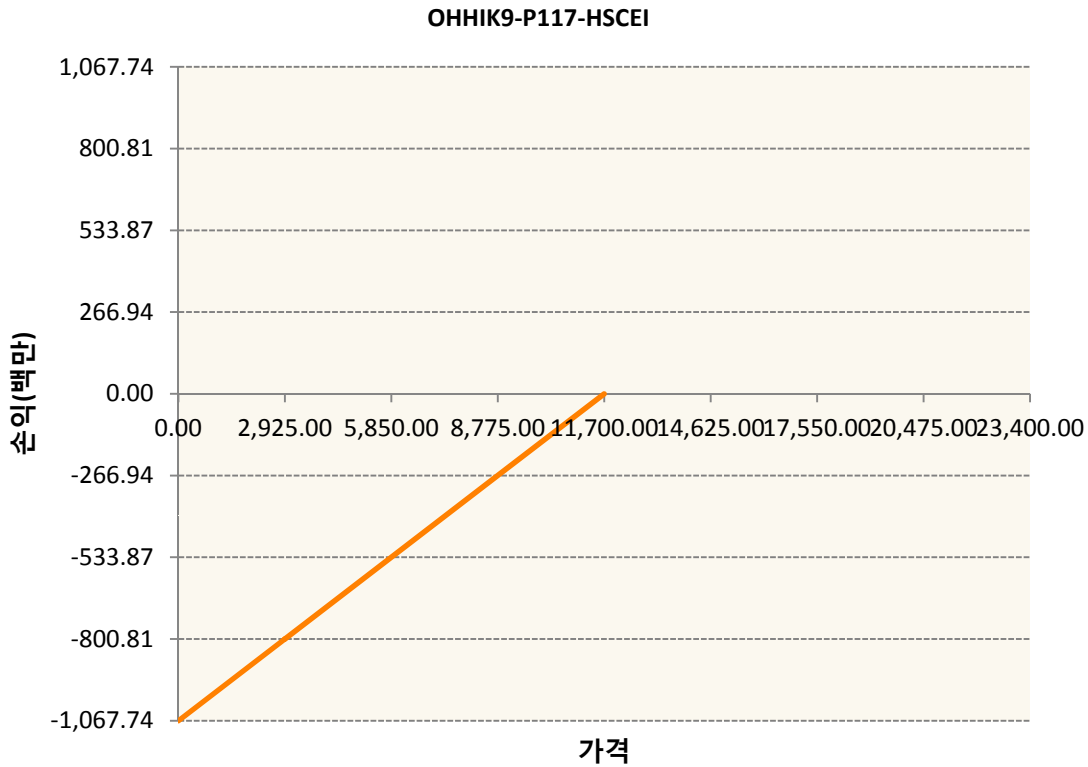


OHHIK9-C117-HSCEI



OHHIK9-P116-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	256
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)
	705

공시일	2019-05-30
기준일	2019-05-29

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

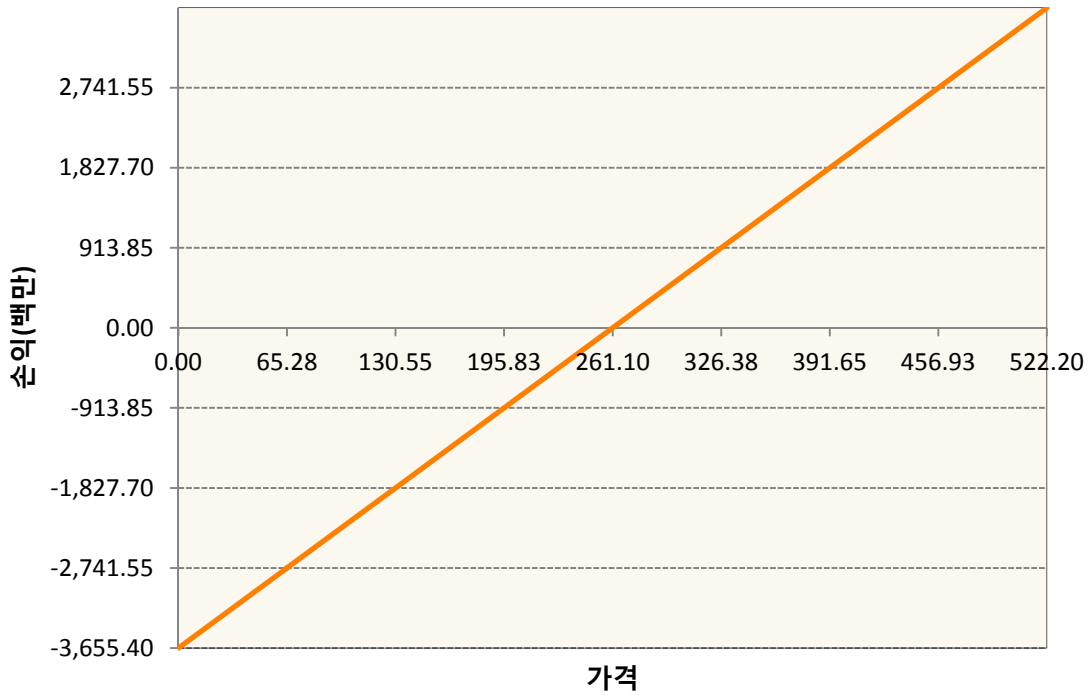
1. 계약금액

(단위:백만원)

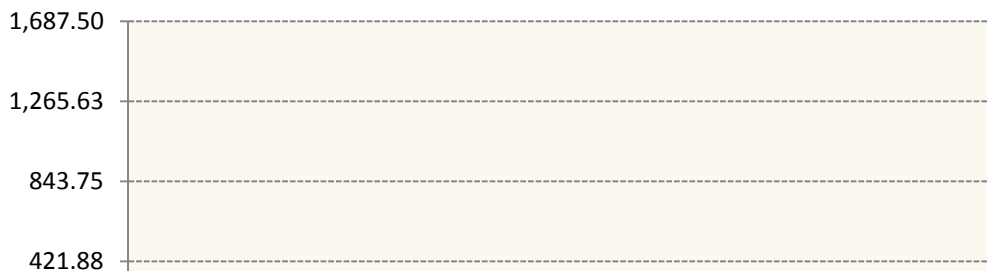
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,655	0	3,655	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	21,759	-21,759	장내

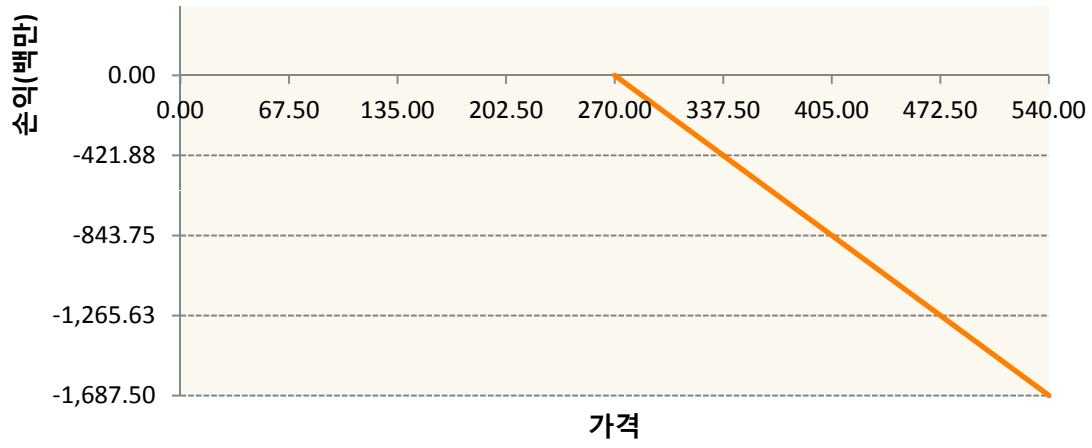
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

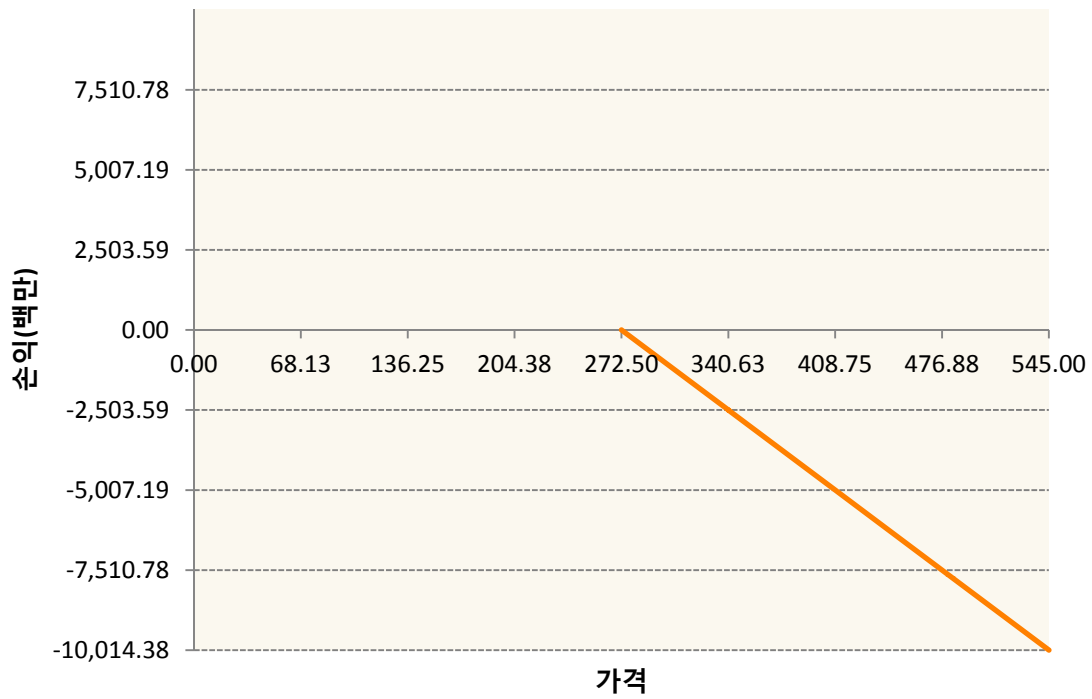


KR4201P62701-2019-06 콜270

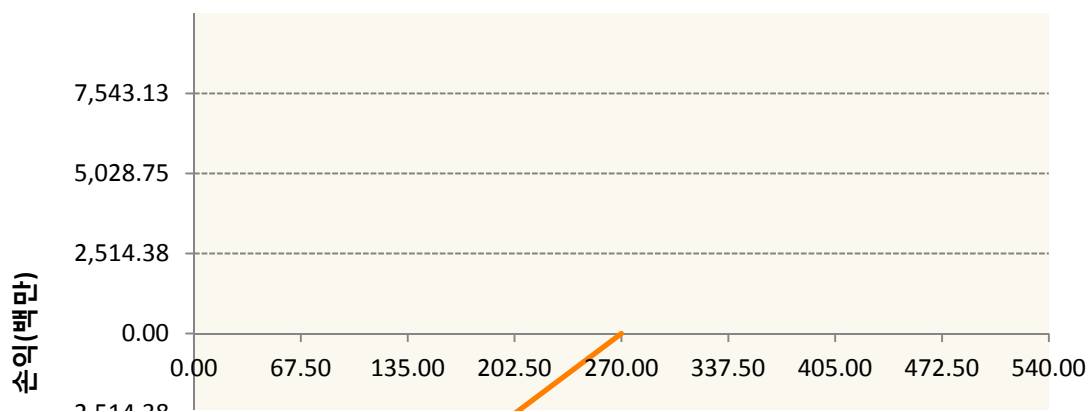


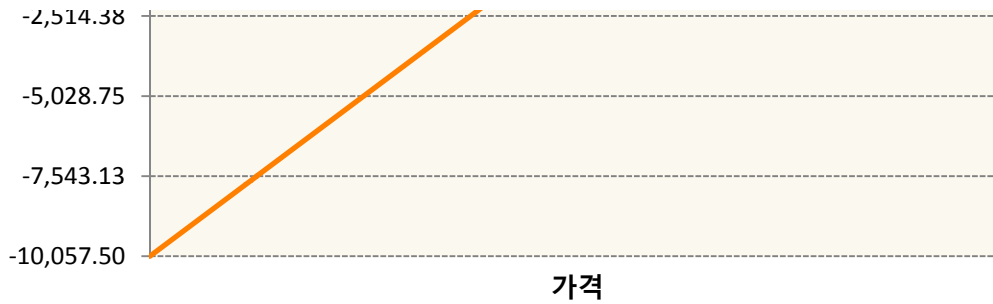


KR4201P62727-2019-06 콜272.5



KR4301P62709-2019-06 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,192
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,192	-1,192	-1,192	-1,192	-1,192	-1,192	-1,192	
-5.33%	-795	-795	-795	-795	-795	-795	-795	
-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%	795	795	795	795	795	795	795	
8.00%	1,192	1,192	1,192	1,192	1,192	1,192	1,192	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						603
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-603	-603	-603	-603	-603	-603	-603	
-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%	603	603	603	603	603	603	603	
KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						293
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-293	-293	-293	-293	-293	-293	-293	
-5.33%	-195	-195	-195	-195	-195	-195	-195	
-2.67%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	98	98	98	98	98	98	98	
5.33%	195	195	195	195	195	195	195	
8.00%	293	293	293	293	293	293	293	
KR4201P62701		2019-06 콜270						79
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	14	14	14	14	13	13	12
-5.33%	14	13	13	12	12	11	10
-2.67%	12	11	10	9	7	5	4
0%	7	5	2	0	-2	-5	-7
2.67%	-7	-10	-13	-16	-19	-22	-25
5.33%	-32	-35	-37	-40	-43	-46	-49
8.00%	-66	-68	-70	-72	-74	-77	-79

KR4201P62727 2019-06 콜272.5 419

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	61	61	60	60	59	57	55
-5.33%	60	59	57	55	51	47	42
-2.67%	55	51	46	39	32	23	14
0%	33	23	12	0	-13	-26	-39
2.67%	-28	-44	-61	-77	-94	-110	-127
5.33%	-151	-168	-185	-202	-219	-237	-254
8.00%	-335	-347	-361	-375	-389	-404	-419

KR4301P62709 2019-06 풋270 746

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-745	-745	-745	-745	-745	-746	-746
-5.33%	-486	-486	-486	-487	-487	-488	-490
-2.67%	-228	-229	-230	-233	-236	-239	-244
0%	19	14	7	0	-8	-16	-24
2.67%	216	205	193	182	170	159	147
5.33%	321	312	302	292	281	271	260
8.00%	352	349	345	340	334	327	320

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

(단위:백만원)

3,306

공시일	2019-05-30
기준일	2019-05-29

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

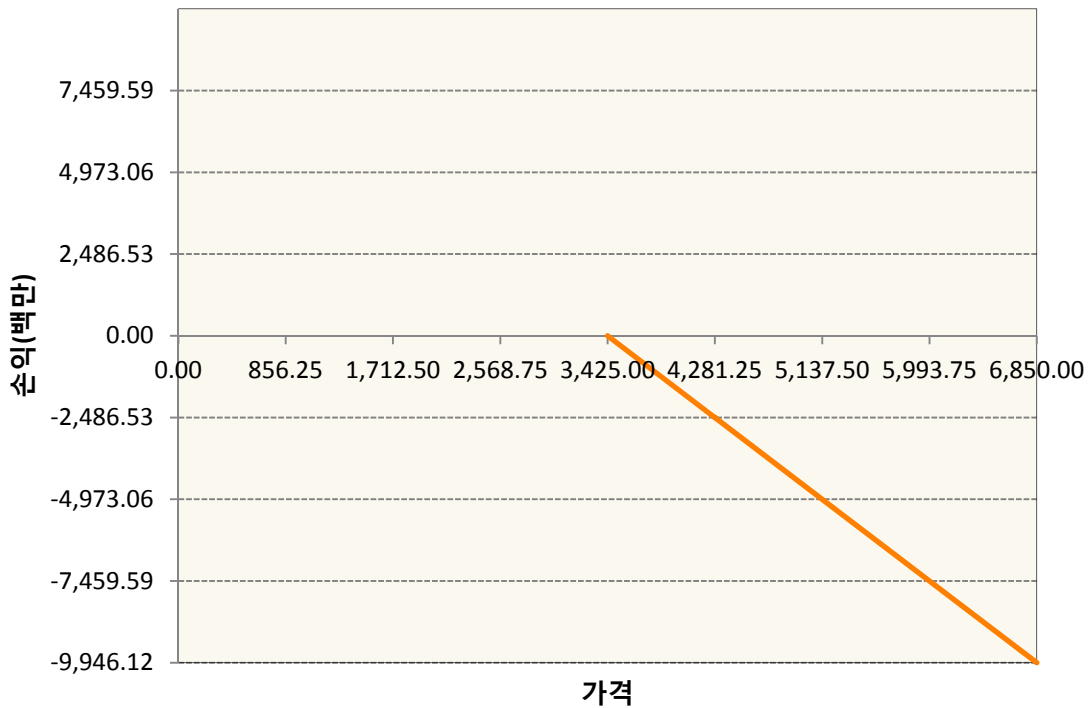
1. 계약금액

(단위:백만원)

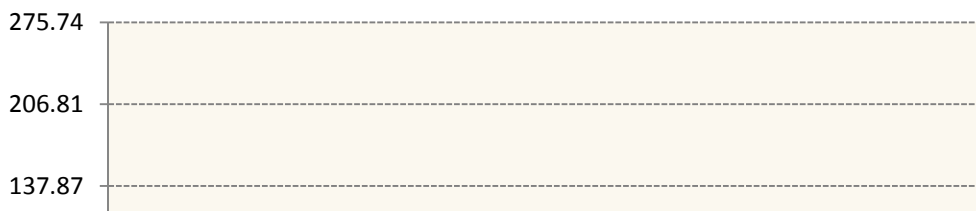
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,649	0	3,649	
누계	유가증권	스왑	56,386	0	56,386	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,444	-20,444	장내
누계	통화	선도	0	18,649	-18,649	장외

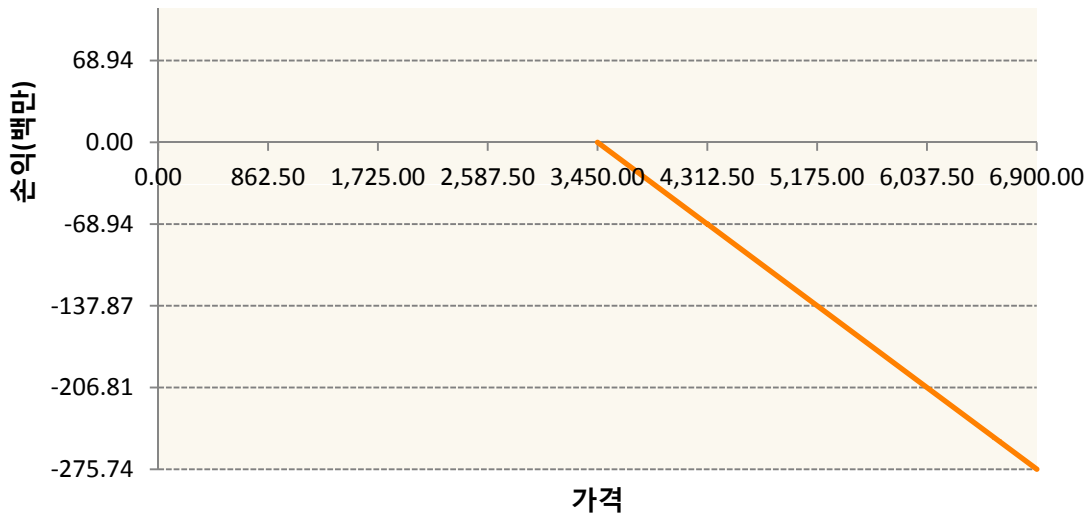
2. 만기시점의 손익구조

OESXM9-C3425-EURO STOXX 50

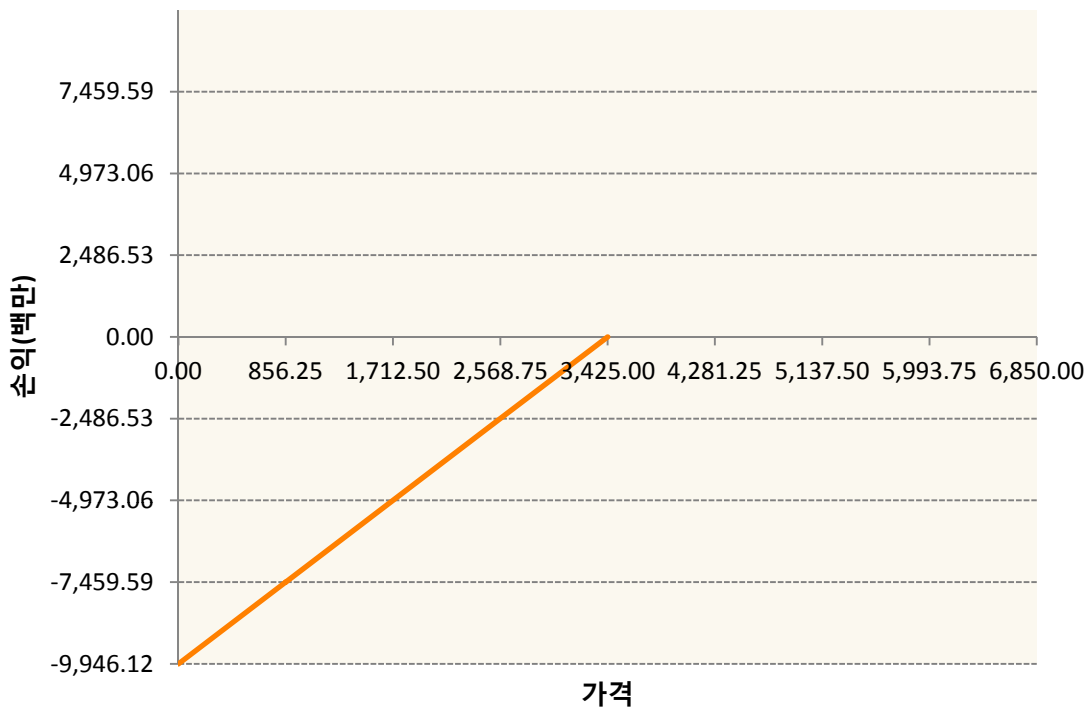


OESXM9-C3450-EURO STOXX 50

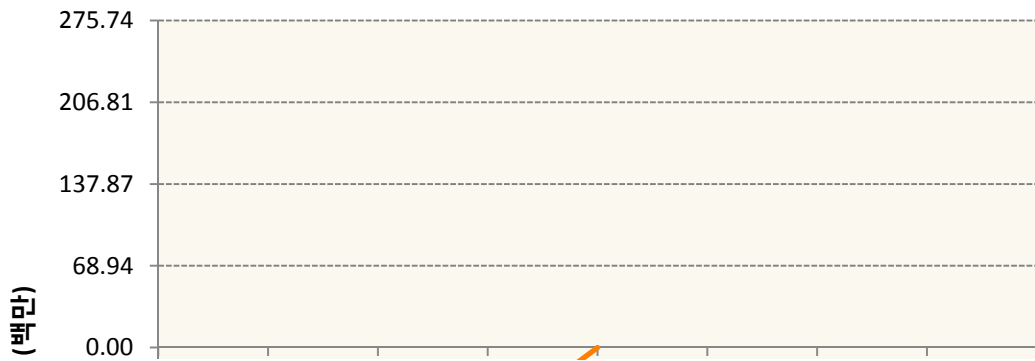


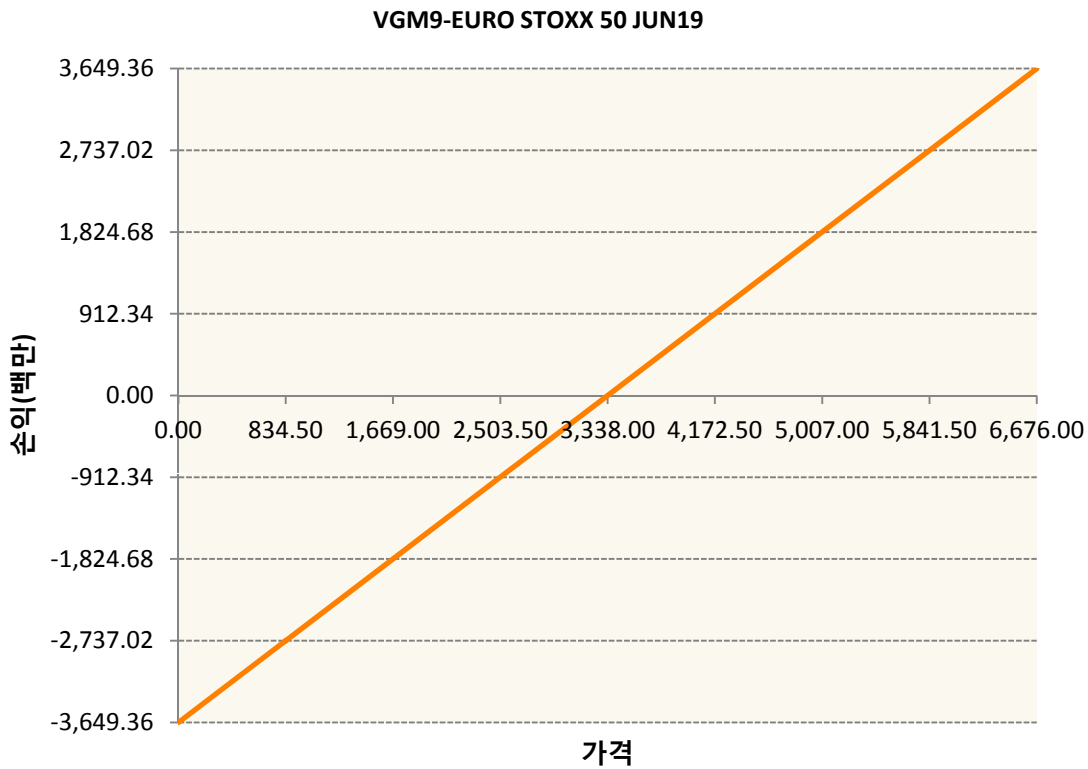
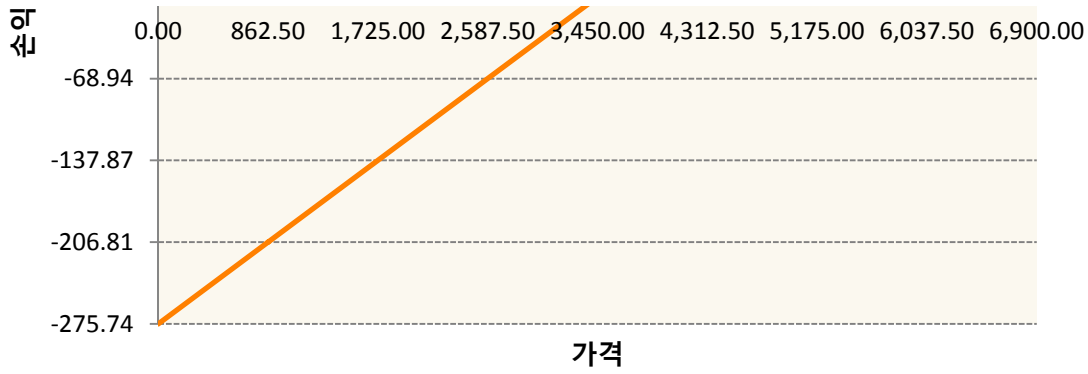


OESXM9-P3425-EURO STOXX 50



OESXM9-P3450-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	76
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	853
FX21019J01: KRW/EUR 28-06-19E	213
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	426
OESXM9-C3·EURO STOXX 50	796
OESXM9-C3·EURO STOXX 50	22
OESXM9-P3·EURO STOXX 50	796
OESXM9-P3·EURO STOXX 50	22
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	292

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

(단위:백만원)

2,218

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

(단위:백만원)

1,000

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

(단위:백만원)

88

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

(단위:백만원)

128

공시일	2019-05-30
기준일	2019-05-29

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

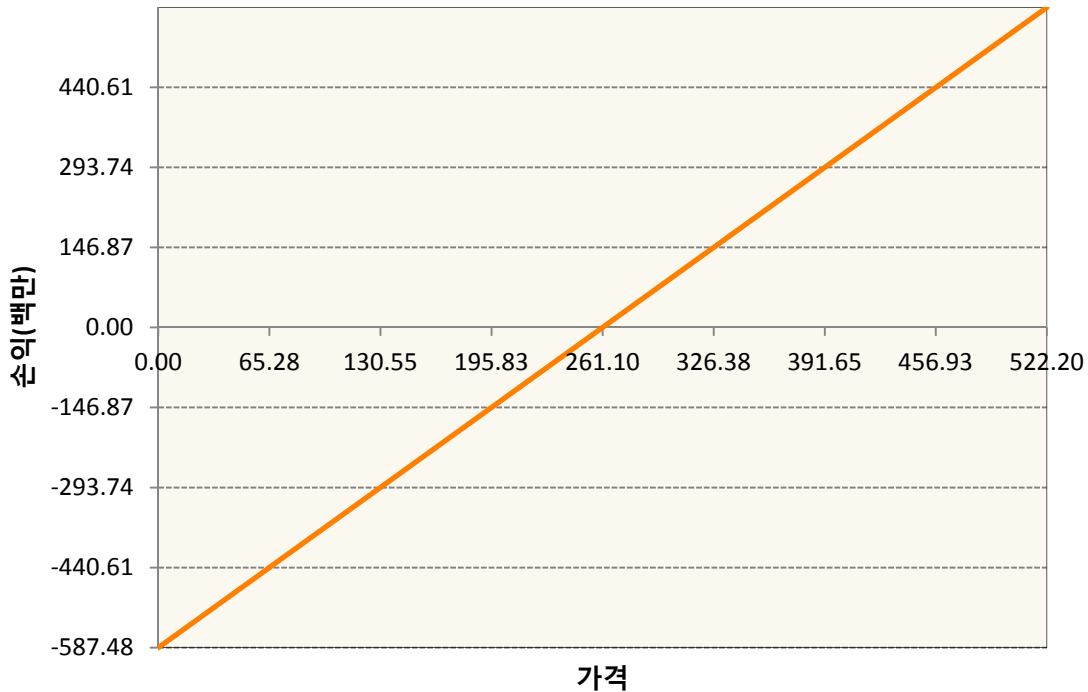
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	587	0	587	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						47
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47	
-5.33%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31	
-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%	31	31	31	31	31	31	31	
8.00%	47	47	47	47	47	47	47	

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

(단위:백만원)

40

공시일	2019-05-30
기준일	2019-05-29

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

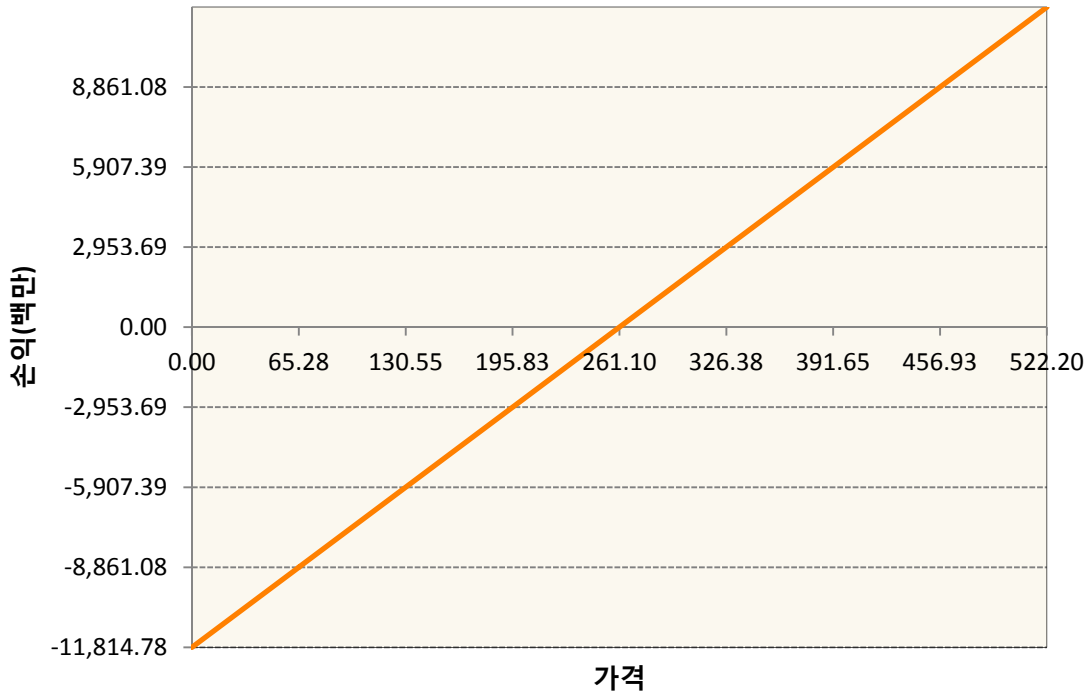
1. 계약금액

(단위:백만원)

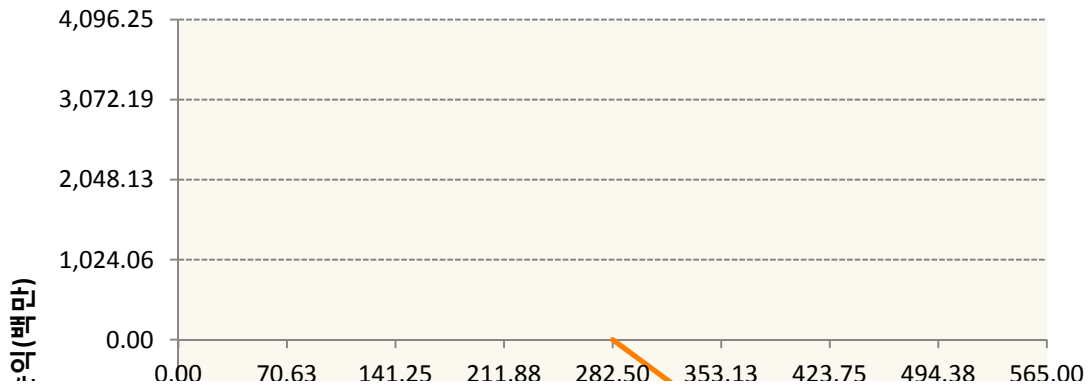
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,815	0	11,815	장내
누계	유가증권	옵션	5,081	22,906	-17,825	장내

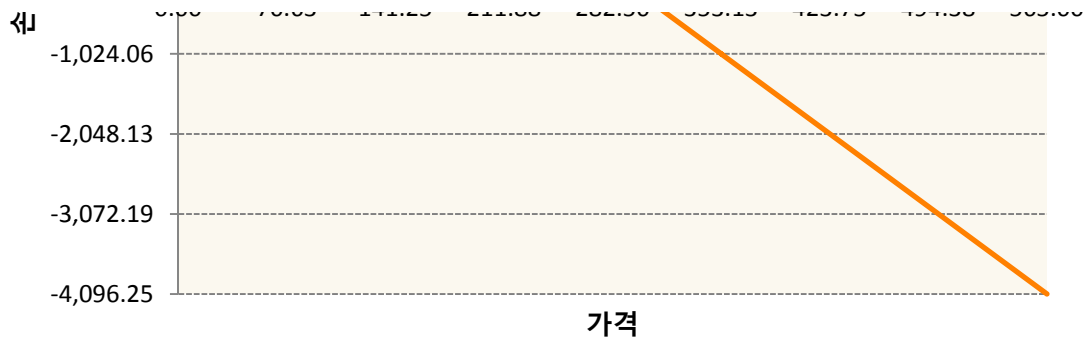
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

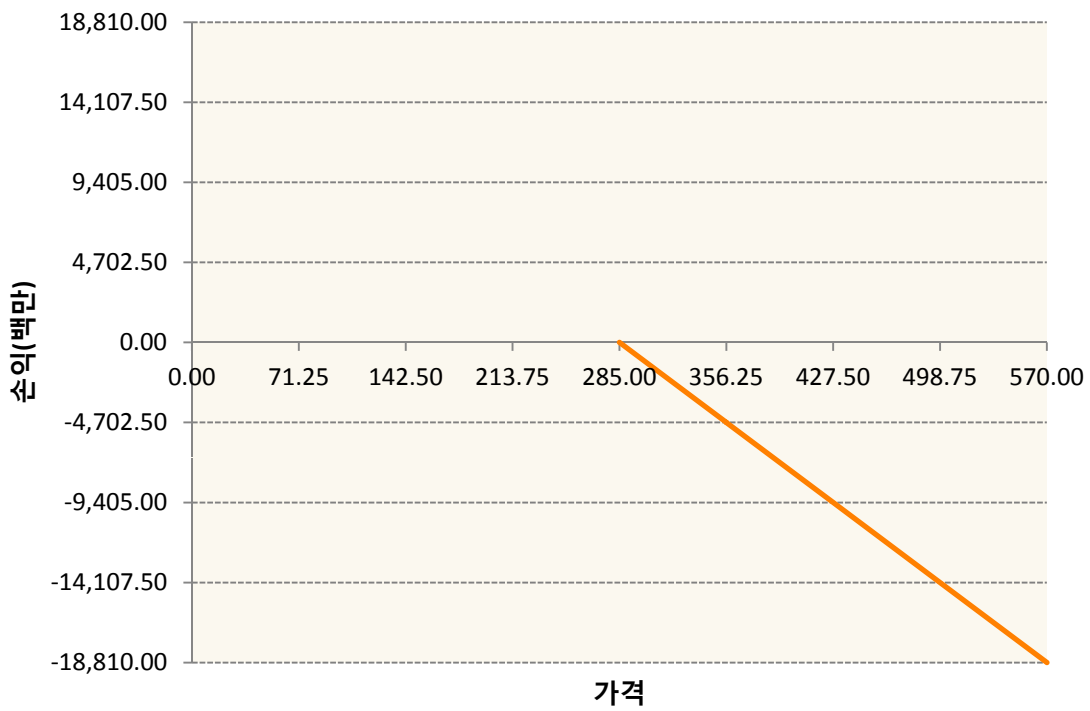


KR4201P62826-2019-06 콜282.5

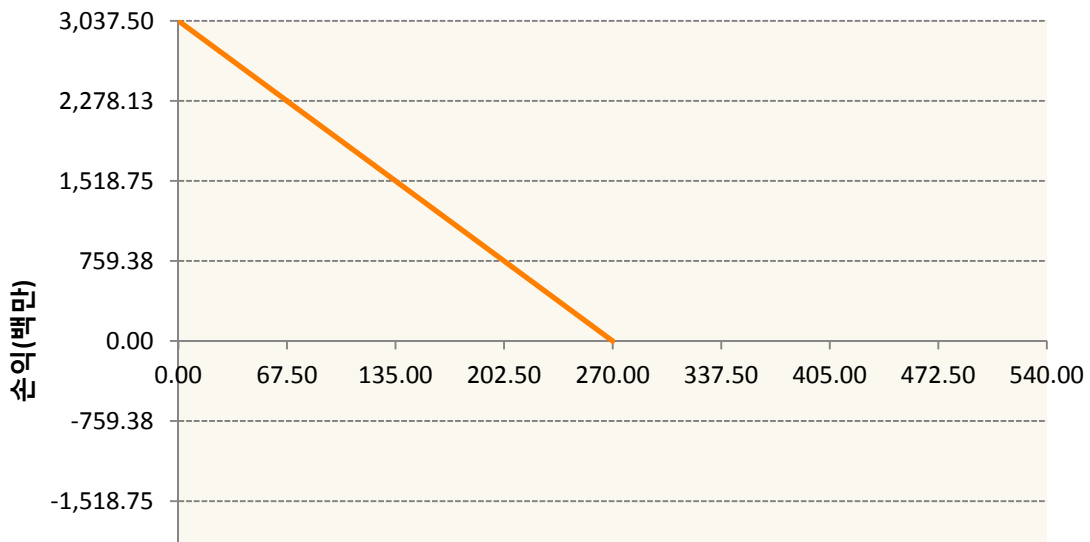


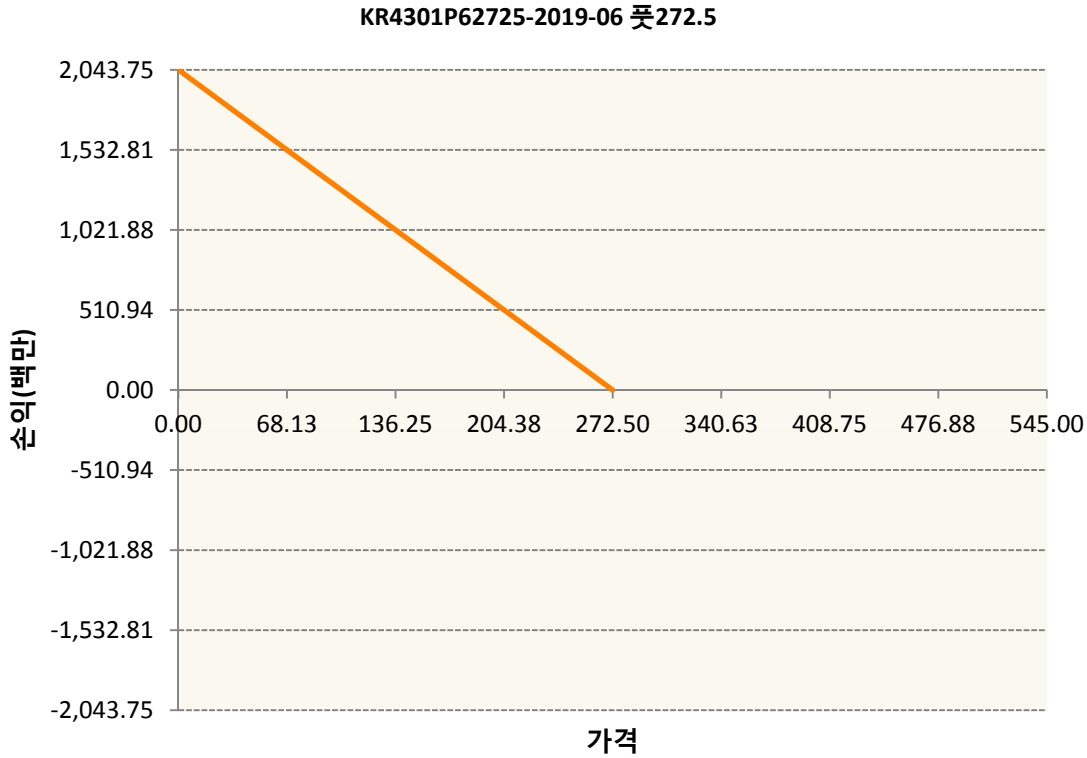
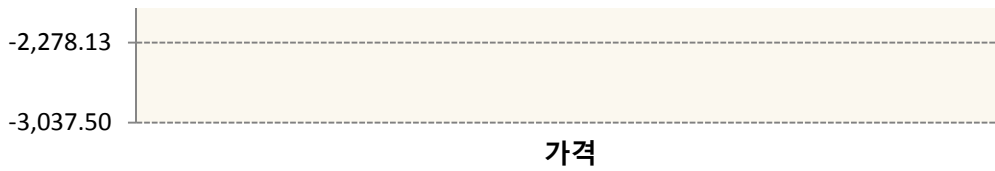


KR4201P62859-2019-06 콜285



KR4301P62709-2019-06 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						946
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-946	-946	-946	-946	-946	-946	-946	
-5.33%	-631	-631	-631	-631	-631	-631	-631	
-2.67%	-315	-315	-315	-315	-315	-315	-315	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	315	315	315	315	315	315	315	
5.33%	631	631	631	631	631	631	631	
8.00%	946	946	946	946	946	946	946	
KR4201P62826		2019-06 콜282.5						98
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	6	6	6	6	6	6	6	
-5.33%	6	6	6	6	5	5	4	
-2.67%	6	6	5	4	3	2	0	

0%	5	4	2	0	-2	-5	-8
2.67%	-1	-4	-8	-12	-16	-21	-26
5.33%	-18	-24	-30	-36	-42	-48	-55
8.00%	-56	-63	-70	-77	-84	-91	-98
KR4201P62859 2019-06 콜285							381
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19	19	19	19	18	18	17
-5.33%	19	19	18	18	17	15	13
-2.67%	18	18	16	14	11	6	0
0%	16	12	7	0	-9	-19	-31
2.67%	0	-11	-24	-39	-56	-75	-95
5.33%	-55	-77	-101	-127	-153	-180	-207
8.00%	-190	-221	-253	-285	-317	-349	-381
KR4301P62709 2019-06 풋270							225
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	225	225	225	225	225	225	225
-5.33%	147	147	147	147	147	147	148
-2.67%	69	69	70	70	71	72	74
0%	-6	-4	-2	0	2	5	7
2.67%	-65	-62	-58	-55	-51	-48	-44
5.33%	-97	-94	-91	-88	-85	-82	-79
8.00%	-106	-105	-104	-103	-101	-99	-97
KR4301P62725 2019-06 풋272.5							153
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	153	153	153	153	153	153	153
-5.33%	100	100	100	101	101	101	101
-2.67%	48	48	49	49	49	50	50
0%	-3	-2	-1	0	1	3	4
2.67%	-47	-45	-43	-41	-39	-37	-34
5.33%	-75	-73	-71	-68	-66	-64	-61
8.00%	-86	-85	-83	-82	-80	-79	-77

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

(단위:백만원)

1,375

공시일	2019-05-30
기준일	2019-05-29

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	16,136	0	16,136	

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	2019-05-30
기준일	2019-05-29

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	58,855	0	58,855	

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	2019-05-30
기준일	2019-05-29

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	298,836	0	298,836	
누계	통화	선도	0	311,130	-311,130	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		382
FX21019J024 KRW/USD 24-06-19E		955
FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E		382
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		76
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		1,005
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E		1,032
FX21019J043 KRW/USD 03-06-19E		573
FX21019J044 KRW/USD 03-06-19E		478
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		287
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		478
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		669
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		669
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		831
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		821
FX21019K00 KRW/USD 18-06-19E		573
FX21019K01 KRW/USD 14-06-19E		669
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		573
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		478
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		573
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,433
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,337
FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E		478
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E		802
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E		638
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		478

FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E	382
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E	802
FX21019K02 KRW/USD 24-06-19E	382
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E	955
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E	1,528
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E	287
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E	1,242
FX21019K04 KRW/USD 28-06-19E	1,299
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	669
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	573

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

(단위:백만원)

8,313

공시일	2019-05-30
기준일	2019-05-29

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

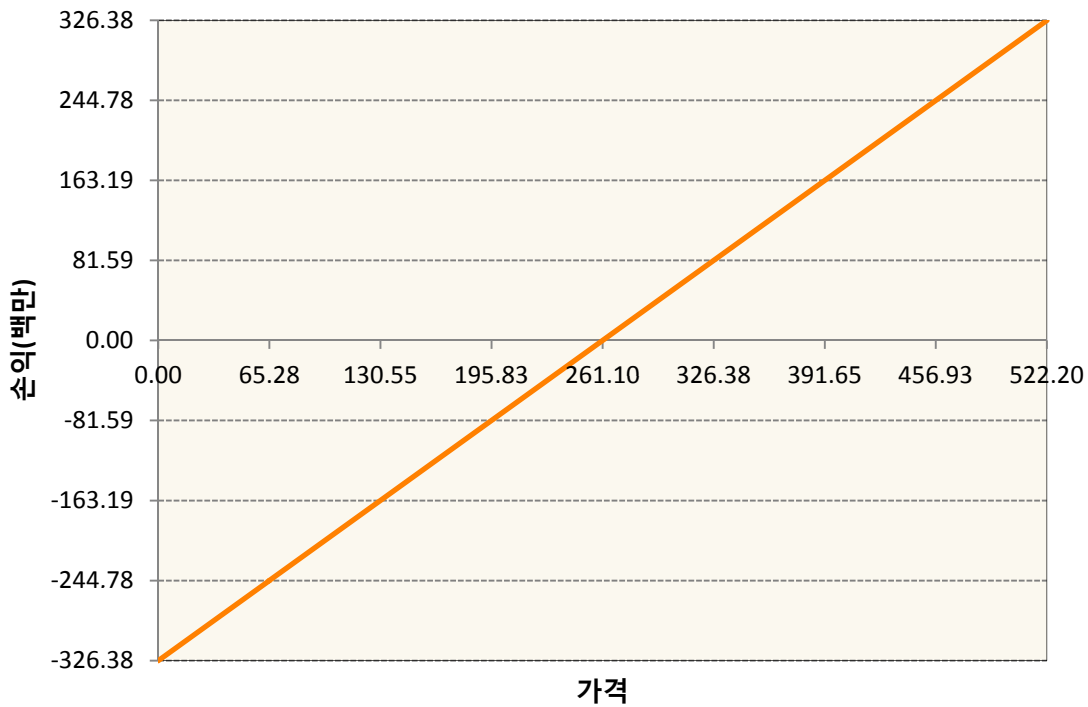
1. 계약금액

(단위:백만원)

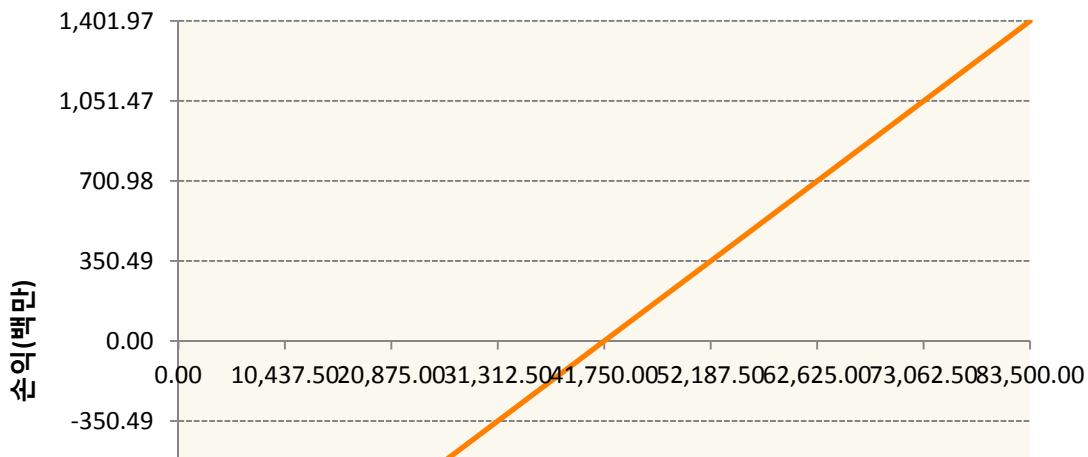
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,728	0	1,728	장내

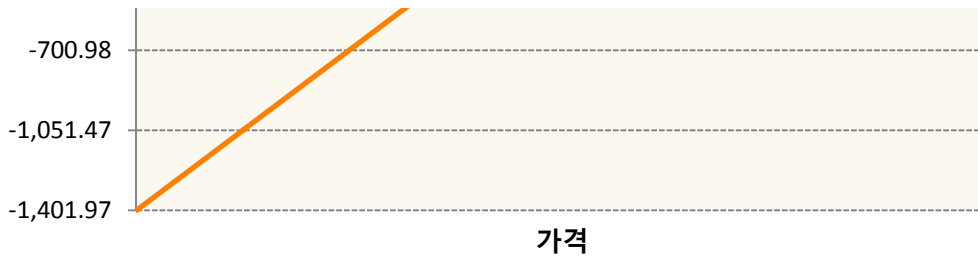
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4111P60003-2019-06 삼성전자개별선물





3. 시나리오 별 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%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
-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%	17	17	17	17	17	17	17	
8.00%	26	26	26	26	26	26	26	

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%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75	
-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%	75	75	75	75	75	75	75	
8.00%	112	112	112	112	112	112	112	

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

154

공시일	2019-05-30
기준일	2019-05-29

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

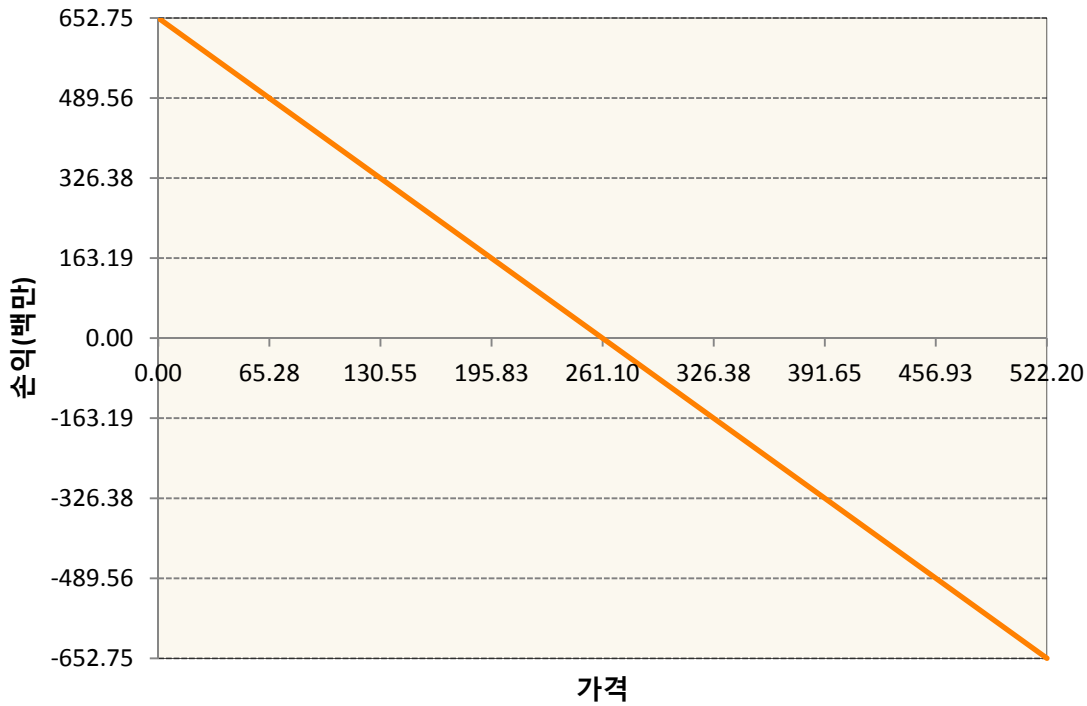
1. 계약금액

(단위:백만원)

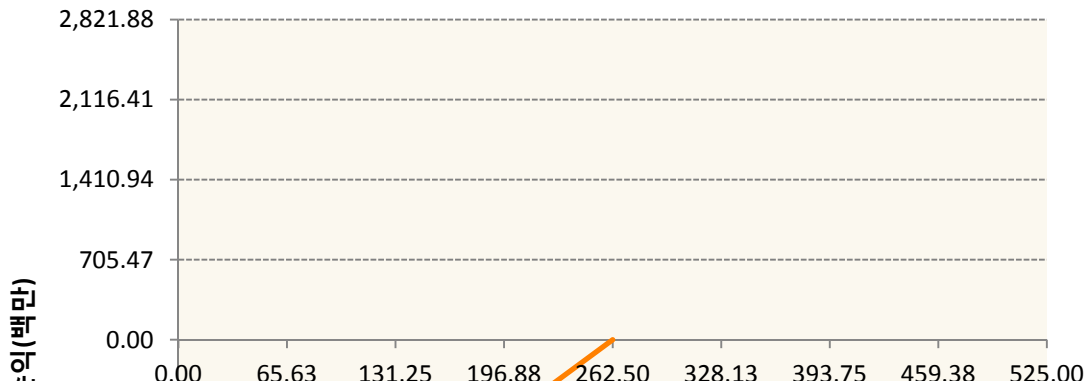
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	65	0	65	장내
누계	유가증권	선물	0	653	-653	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,286	-3,286	장내

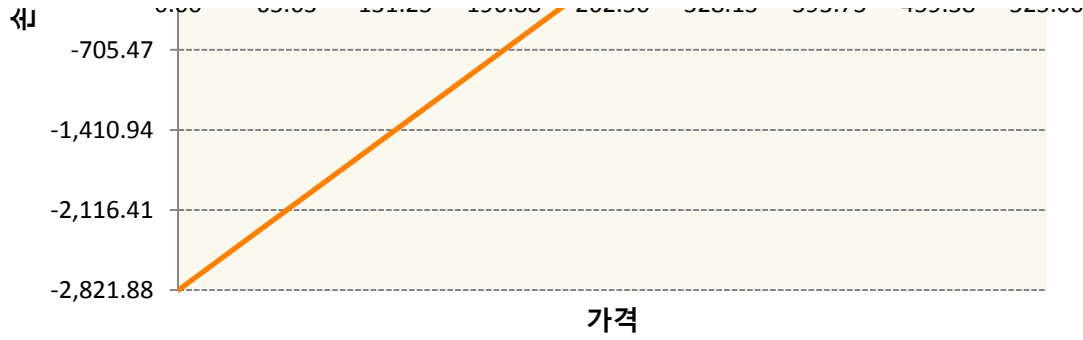
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

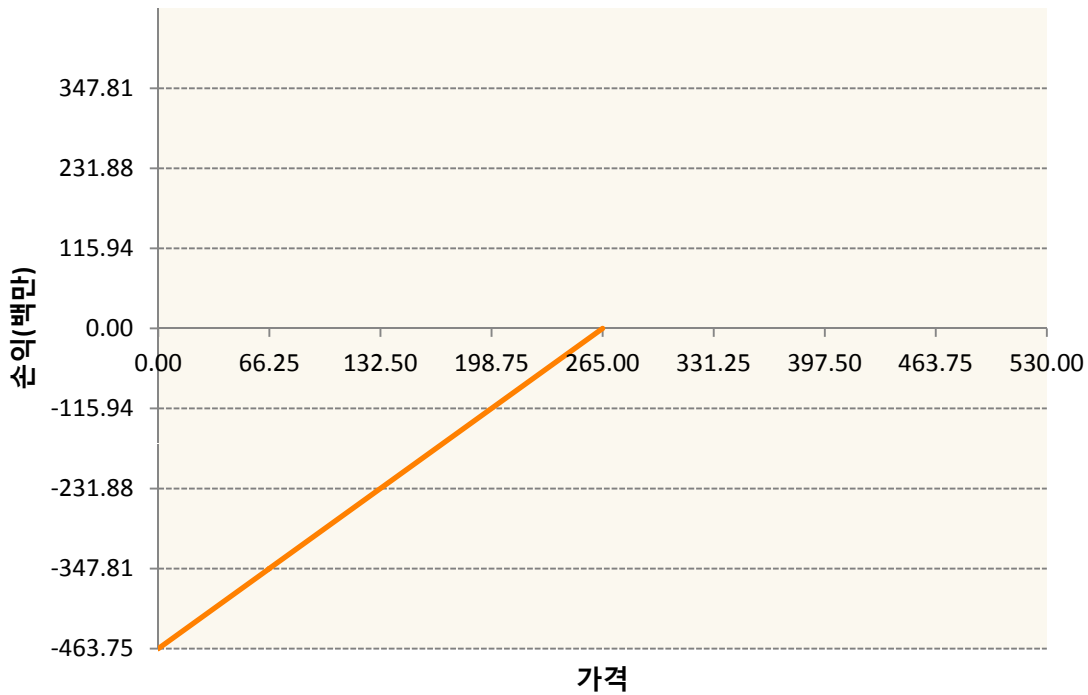


KR4301P62626-2019-06 풋262.5





KR4301P62659-2019-06 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						52
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	52	52	52	52	52	52	52	
-5.33%	35	35	35	35	35	35	35	
-2.67%	17	17	17	17	17	17	17	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	
8.00%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52	
KR4301P62626		2019-06 풋262.5						192
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-191	-191	-191	-191	-192	-192	-192
-5.33%	-117	-117	-118	-118	-119	-120	-121
-2.67%	-46	-47	-49	-51	-54	-56	-58
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	38	35	33	30	27	24	21
5.33%	45	45	43	42	41	39	37
8.00%	46	46	46	46	45	45	44
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%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-2.67%	-9	-9	-9	-9	-10	-10	-10
0%	1	1	0	0	0	-1	-2
2.67%	8	7	7	6	6	5	5
5.33%	10	10	9	9	9	8	8
8.00%	10	10	10	10	10	10	10

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

(단위:백만원)

299

공시일	2019-05-30
기준일	2019-05-29

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

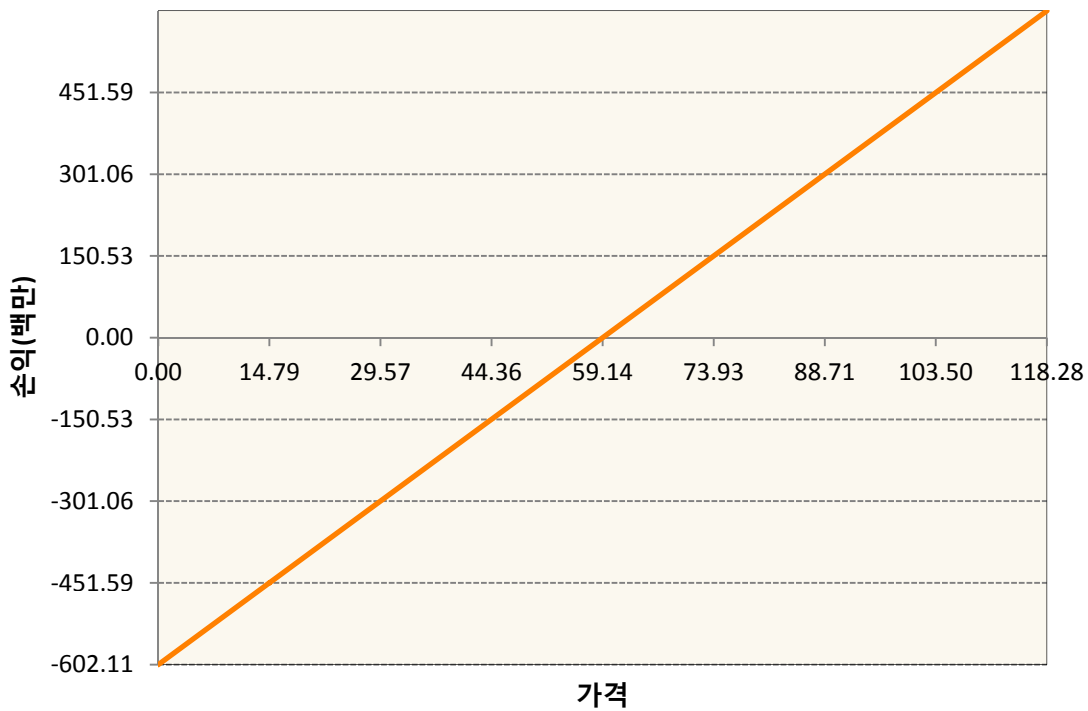
1. 계약금액

(단위:백만원)

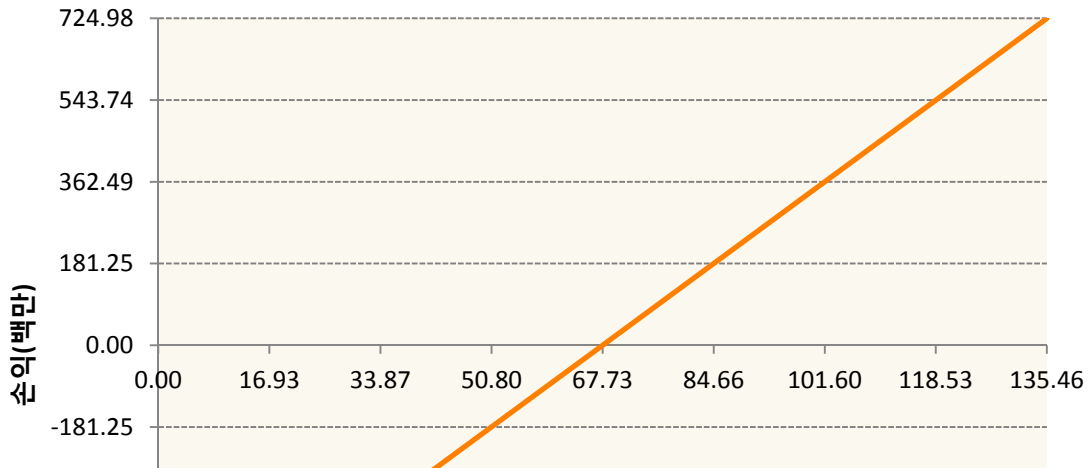
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,689	299	2,390	

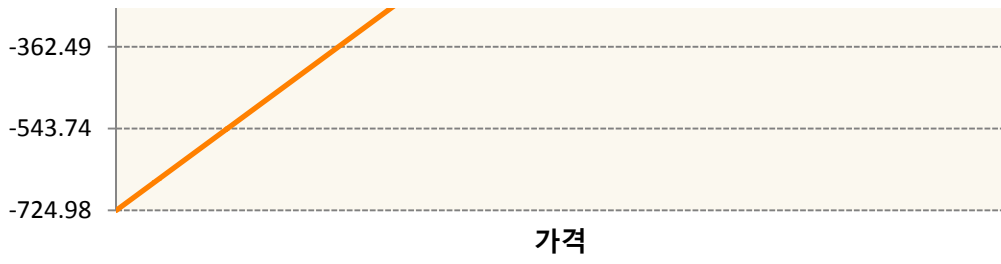
2. 만기시점의 손익구조

CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19

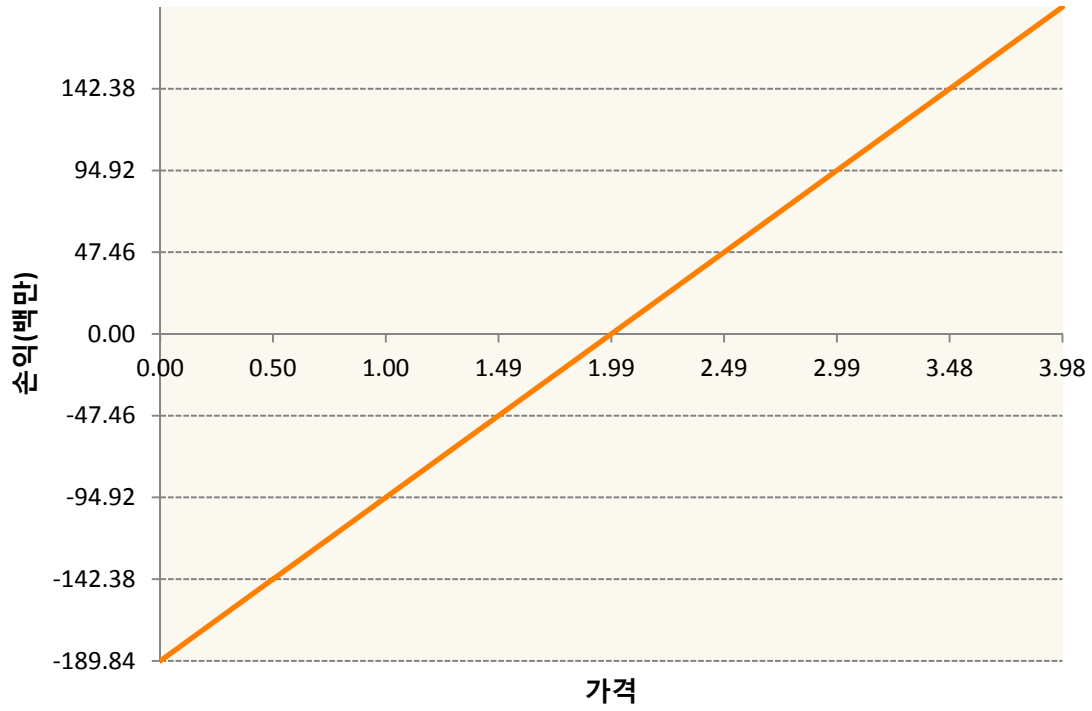


COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19

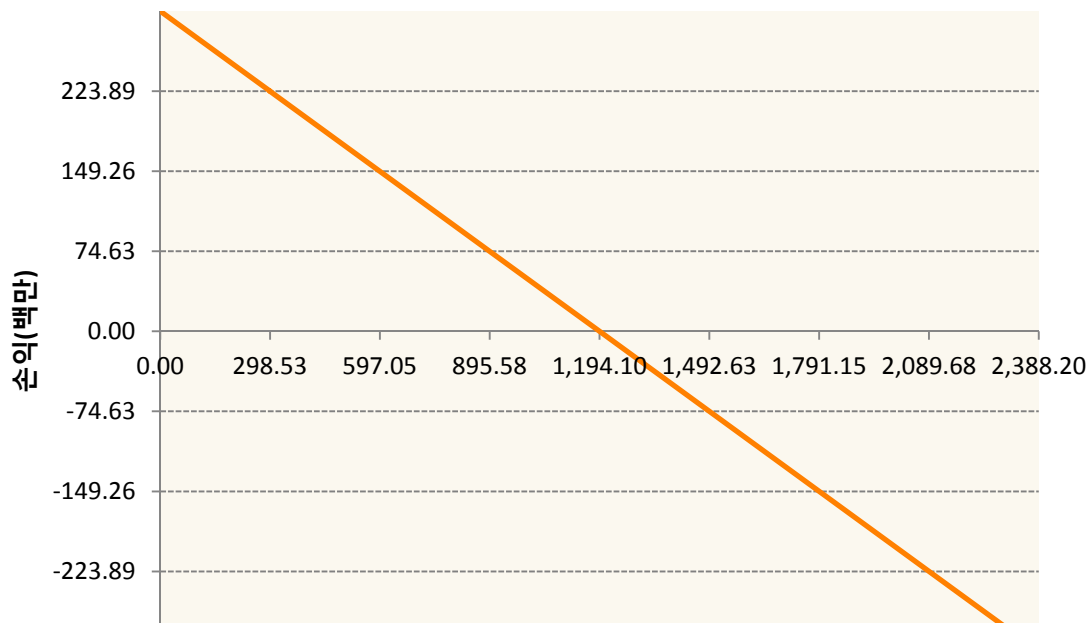


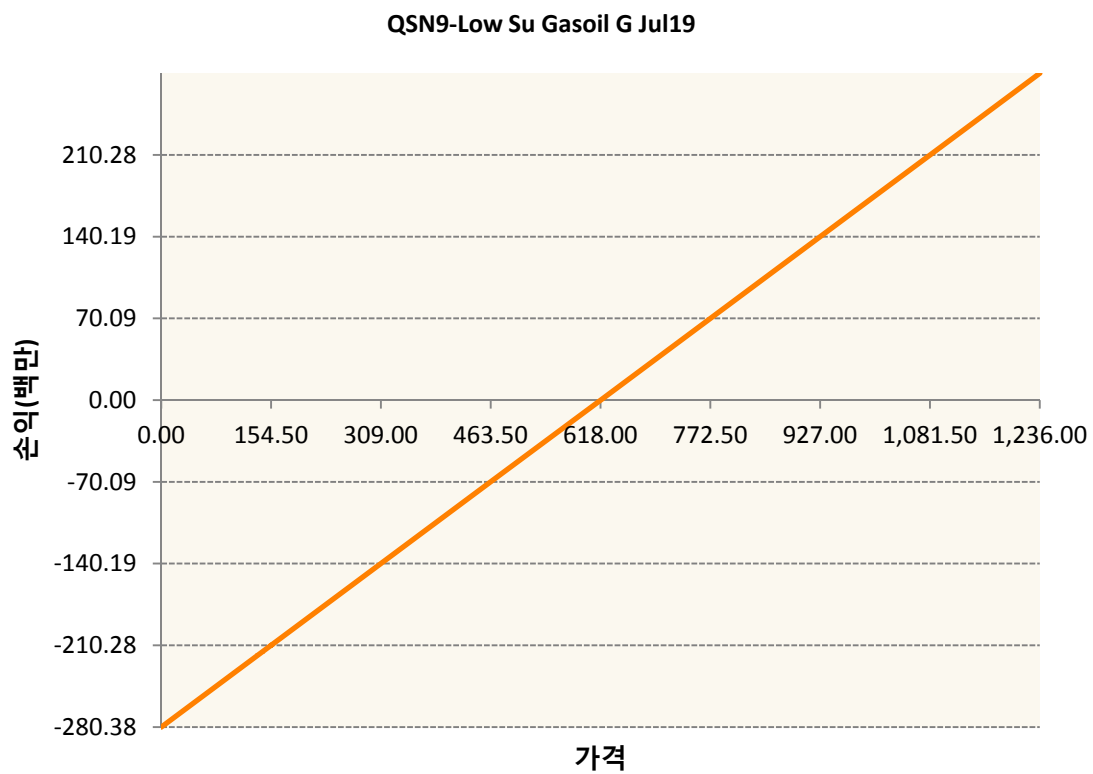
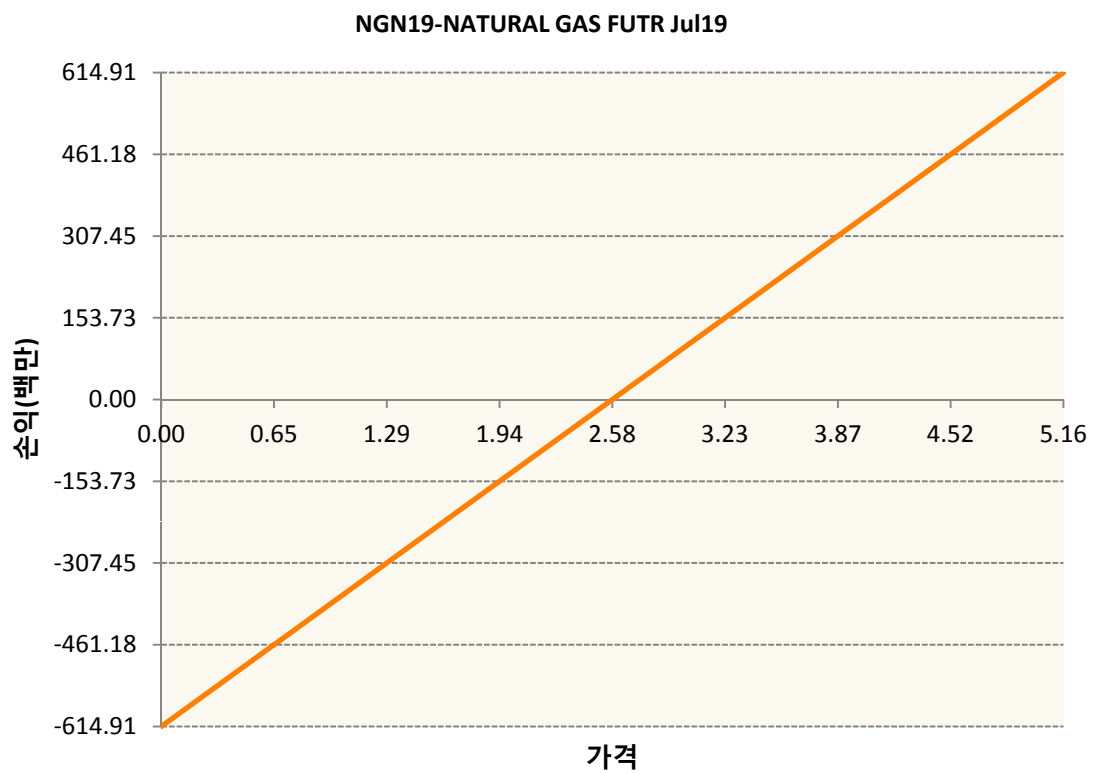
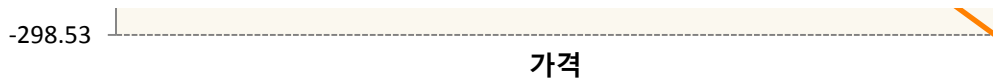


HON9-NY Harb ULSD Fut Jul19

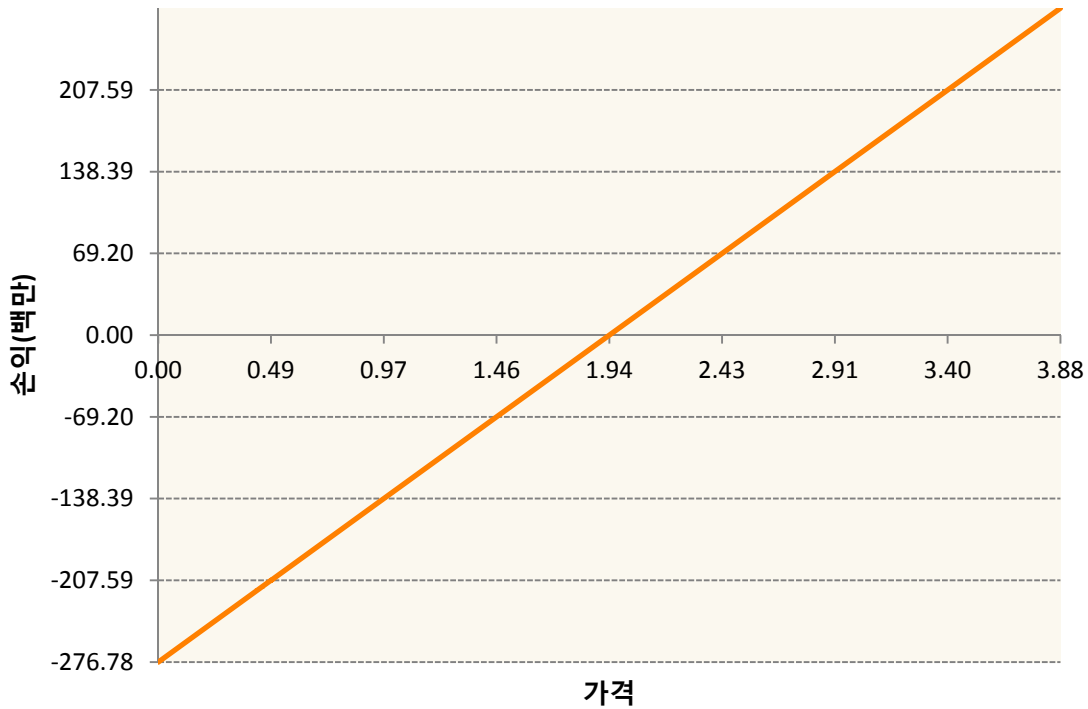


KR4175P60008-2019-06 달러선물





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	49
QSN9	Low Su Gasoil G Jul19	22
XBN9	GASOLINE RBOB FUT Jul19	22

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

397

공시일	2019-05-30
기준일	2019-05-29

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

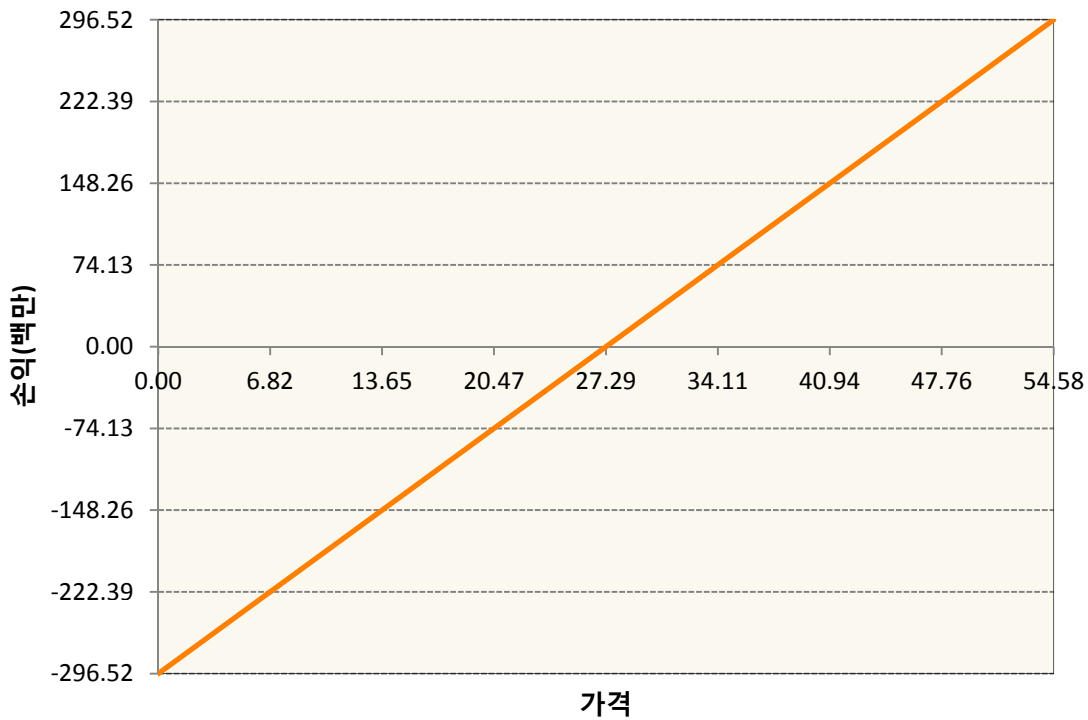
1. 계약금액

(단위:백만원)

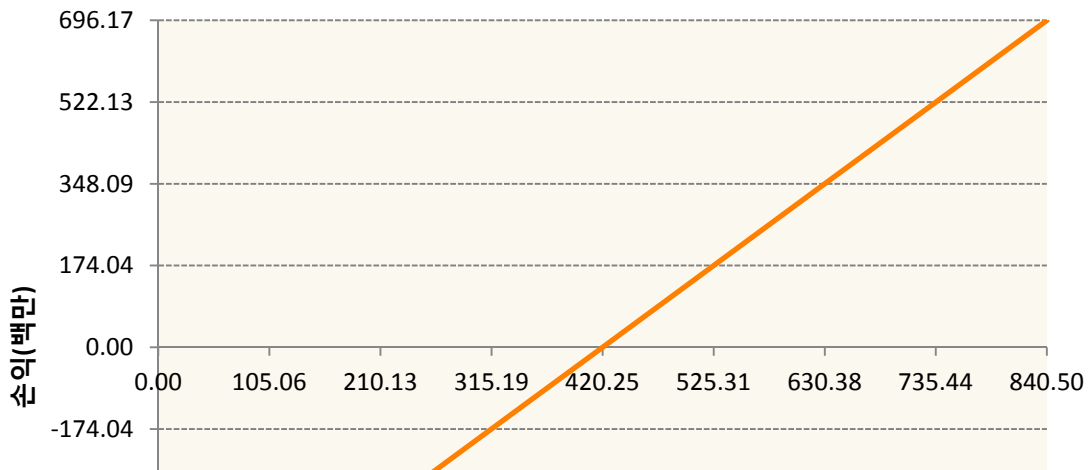
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,051	60	2,991	

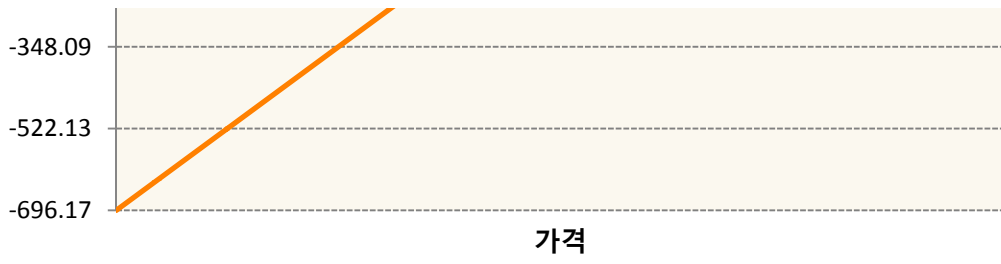
2. 만기시점의 손익구조

BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19

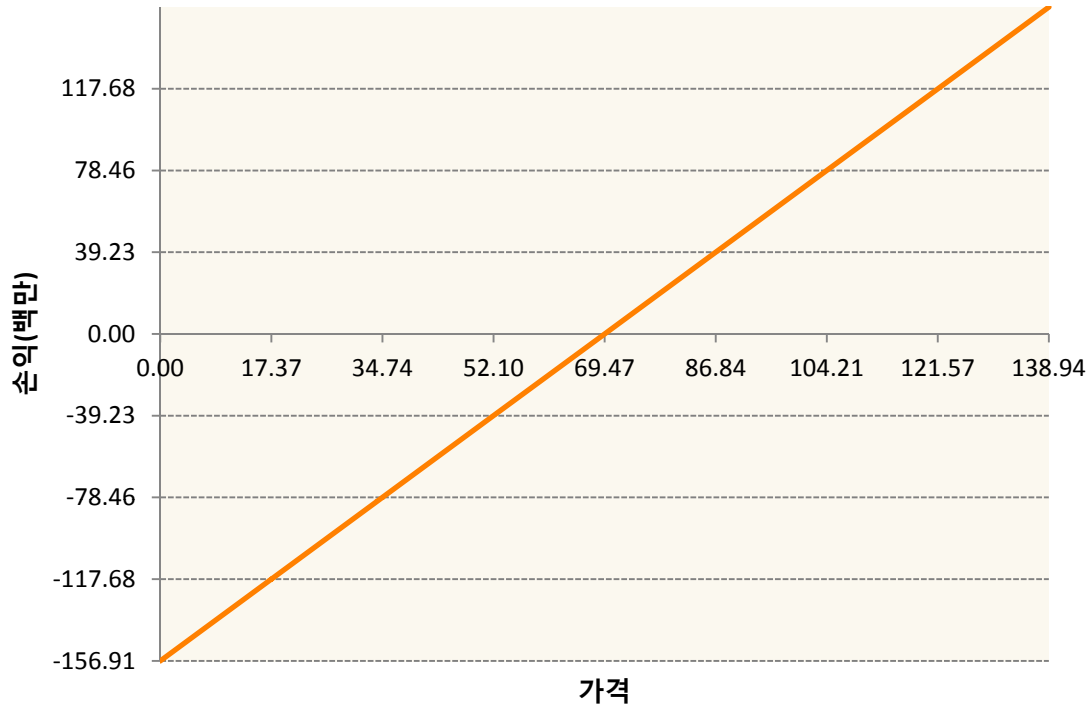


CN9-CORN FUTURE Jul19

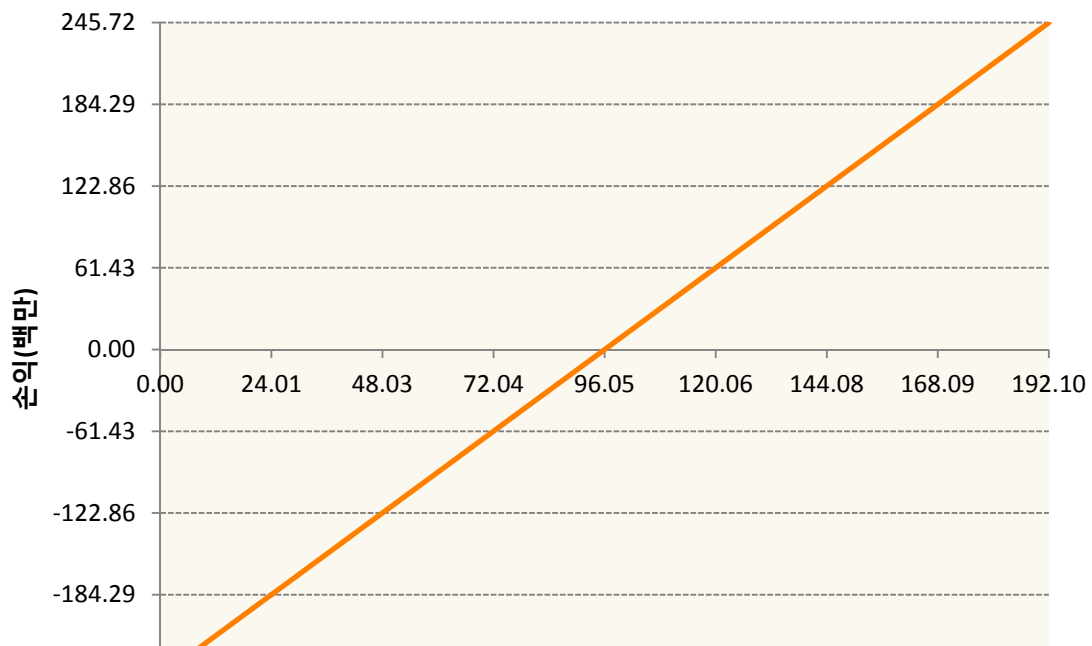


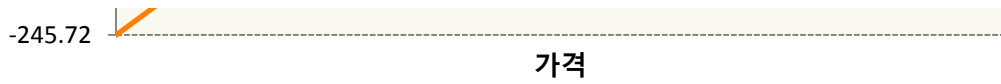


CTN9-COTTON NO.2 FUTR Jul19

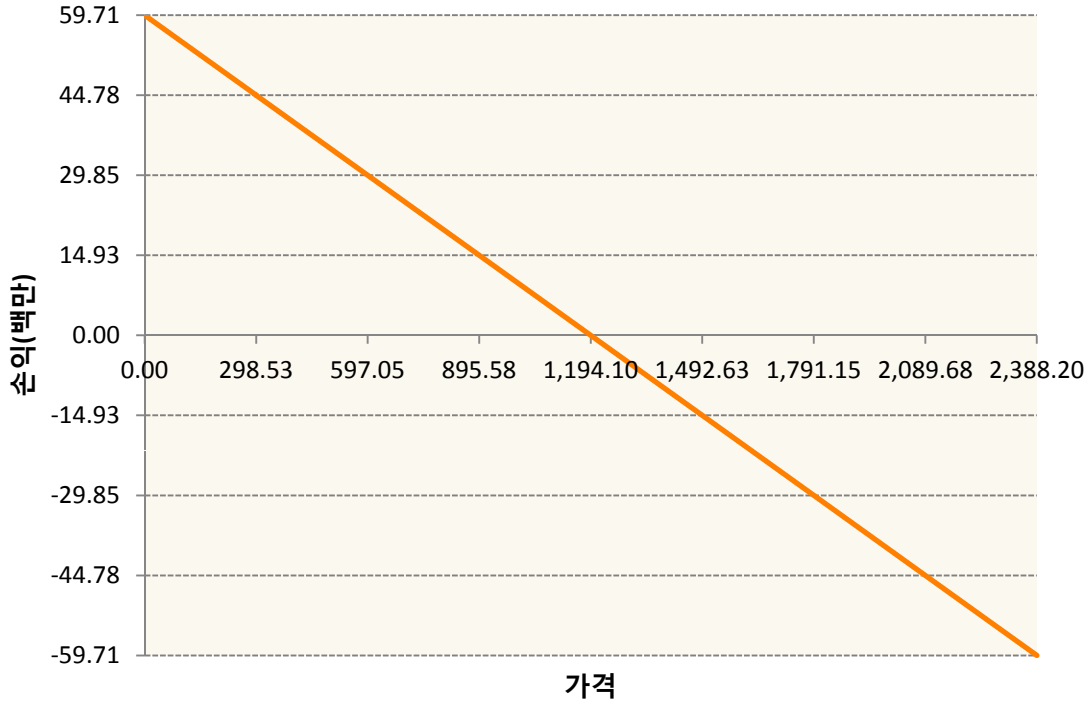


KCN9-COFFEE 'C' FUTURE Jul19

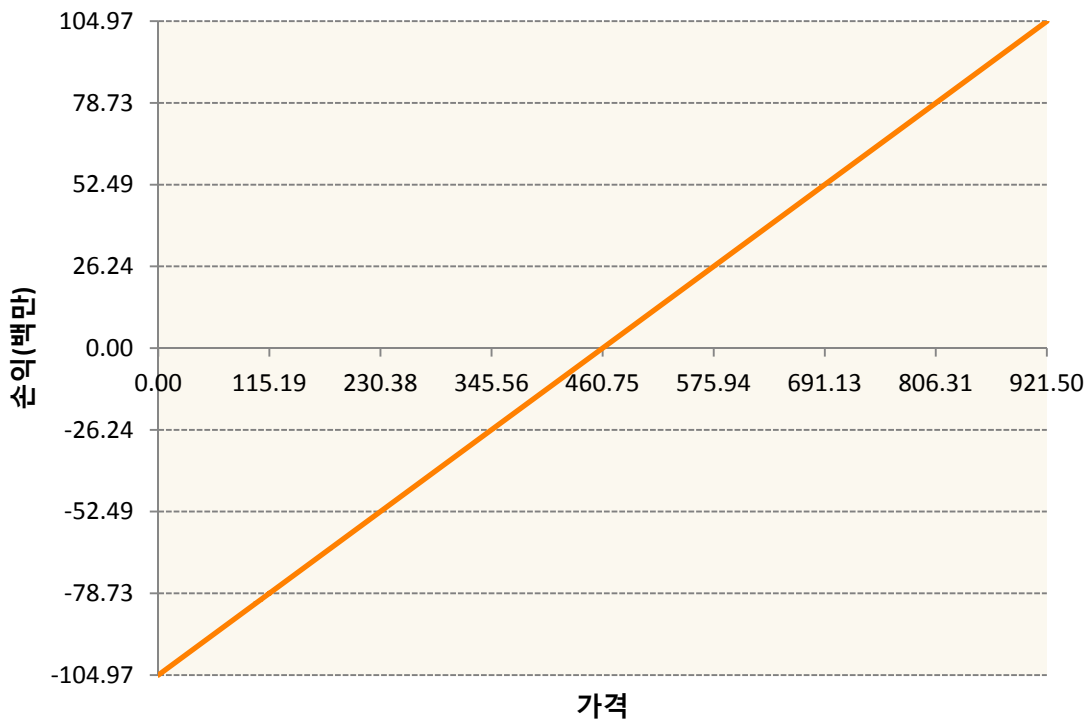




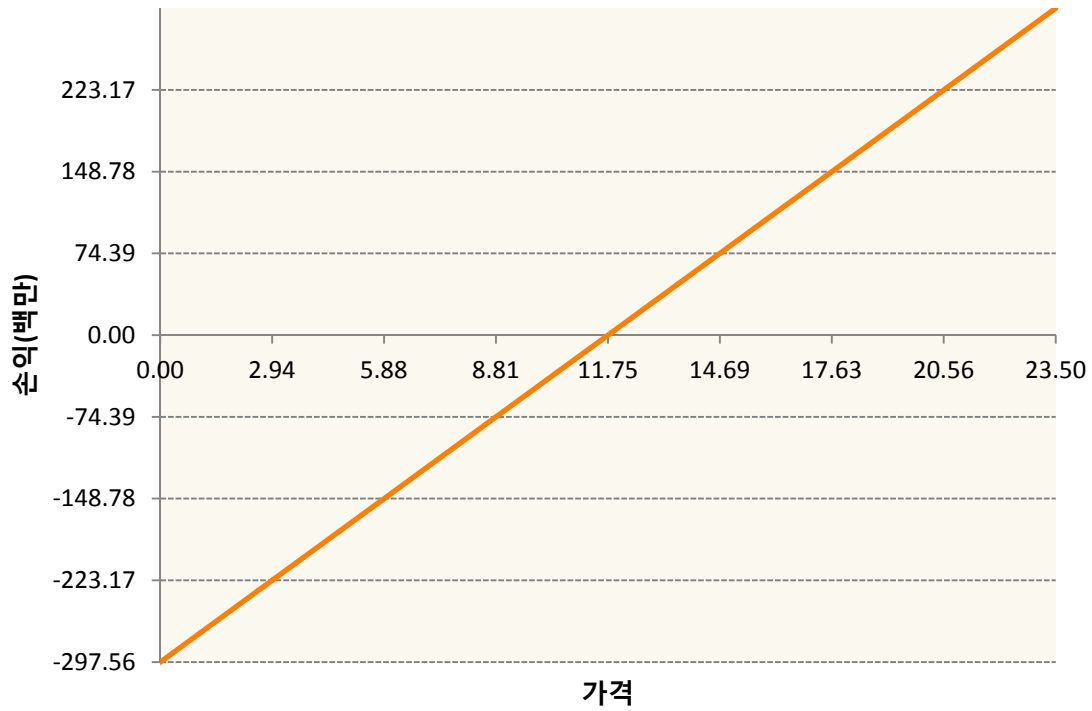
KR4175P60008-2019-06 달러선물



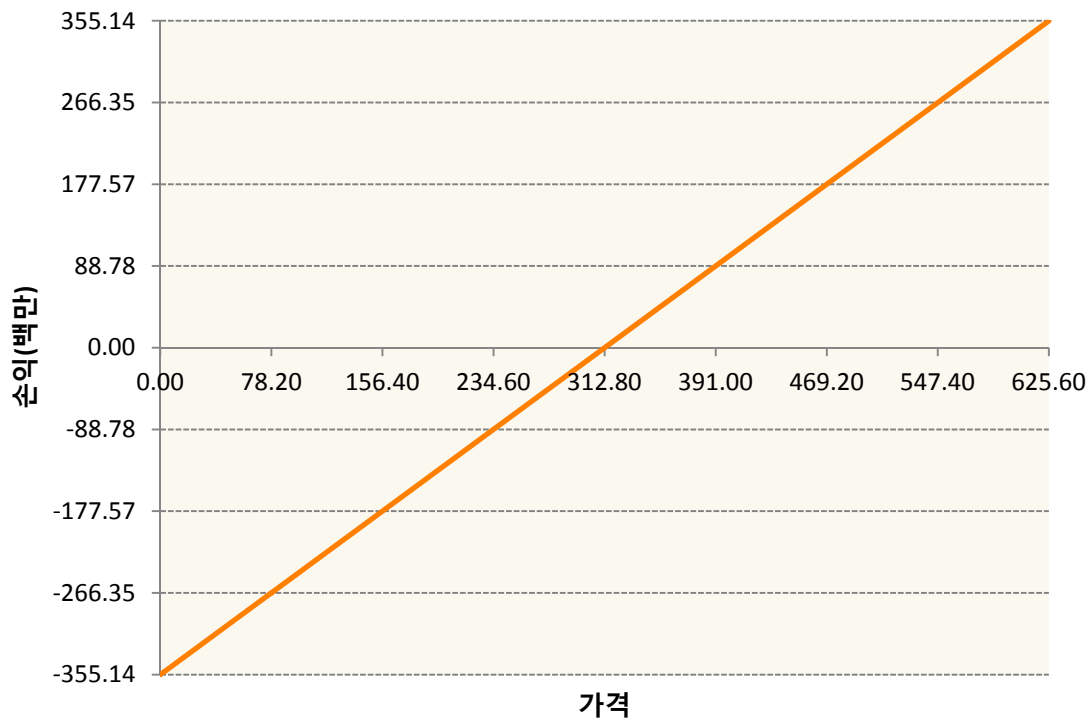
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



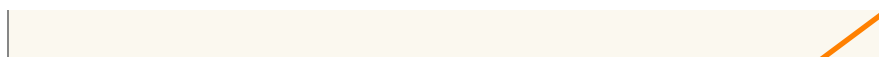
SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

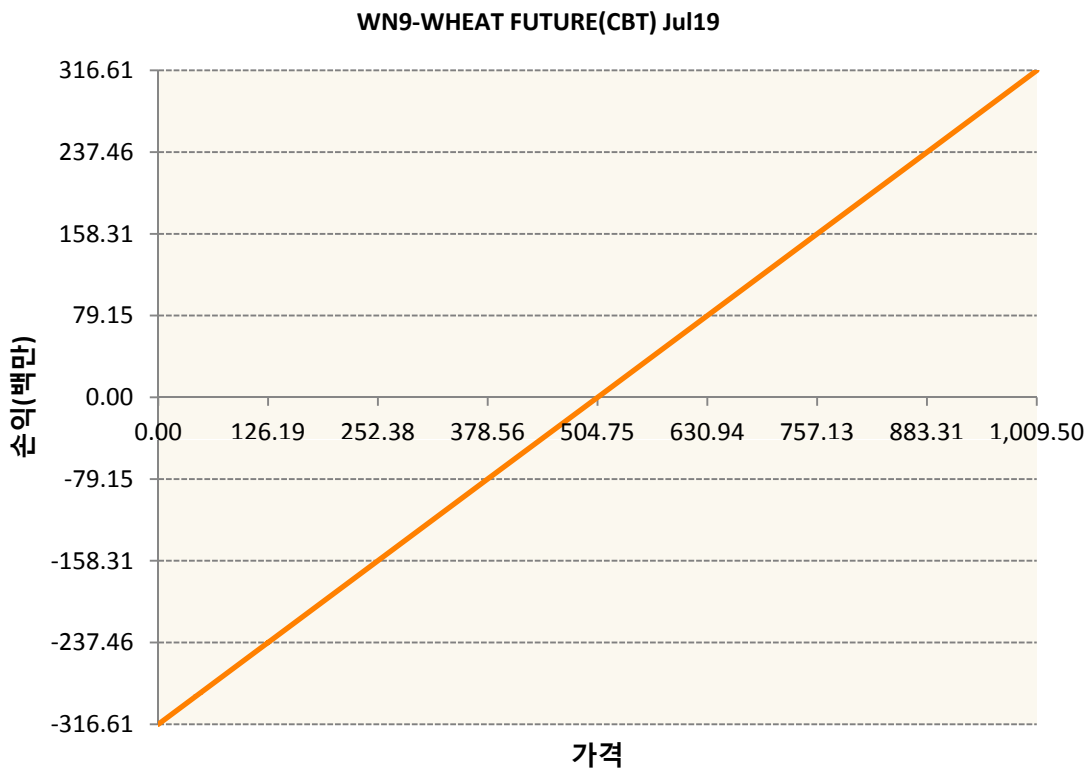
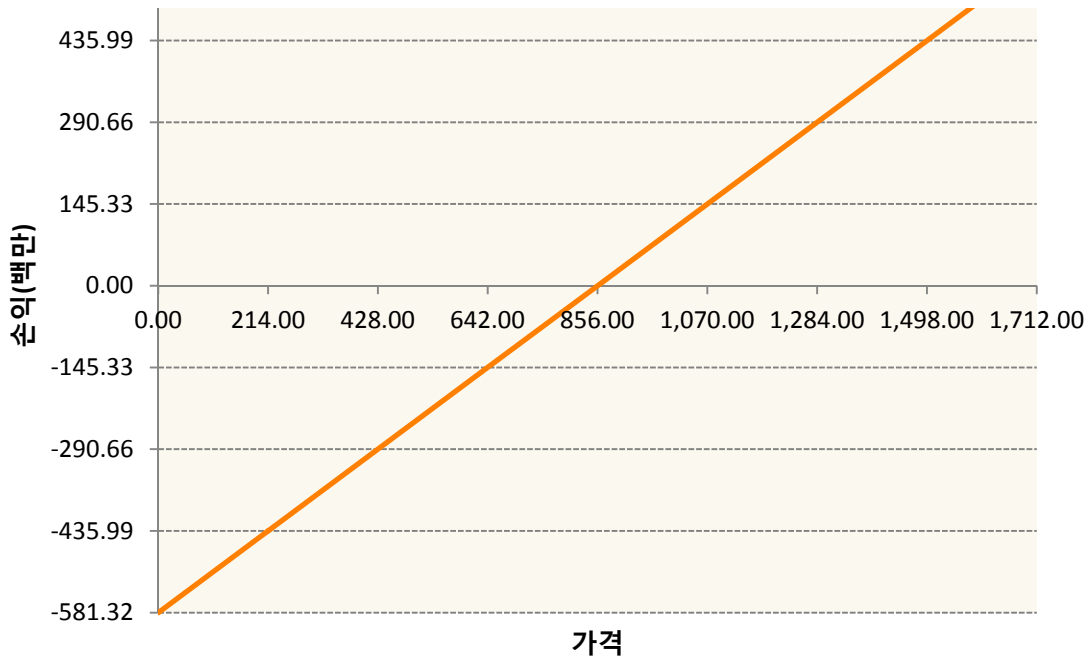


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19



SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON9	SOYBEAN OIL FUTR Jul19	24
CN9	CORN FUTURE Jul19	56
CTN9	COTTON NO.2 FUTR Jul19	13
KCN9	COFFEE 'C' FUTURE Jul19	20
KR4175P600	2019-06 달러선물	5

KWN9	KC HRW WHEAT FUT Jul19	8
SBN9	SUGAR #11 (WORLD) Jul19	24
SMN9	SOYBEAN MEAL FUTR Jul19	28
SN9	SOYBEAN FUTURE Jul19	47
WN9	WHEAT FUTURE(CBT) Jul19	25

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

(단위:백만원)

253