

공시일	2019-04-22
기준일	2019-04-19

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)

94

공시일	2019-04-22
기준일	2019-04-19

SMART합성-MSCI선진국증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	13,865	0	13,865	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S190222

1,157

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

679

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-04-22
기준일	2019-04-19

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)	364
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	100
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	171

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,000

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-04-22
기준일	2019-04-19

유로인덱스모(주식-파생형)

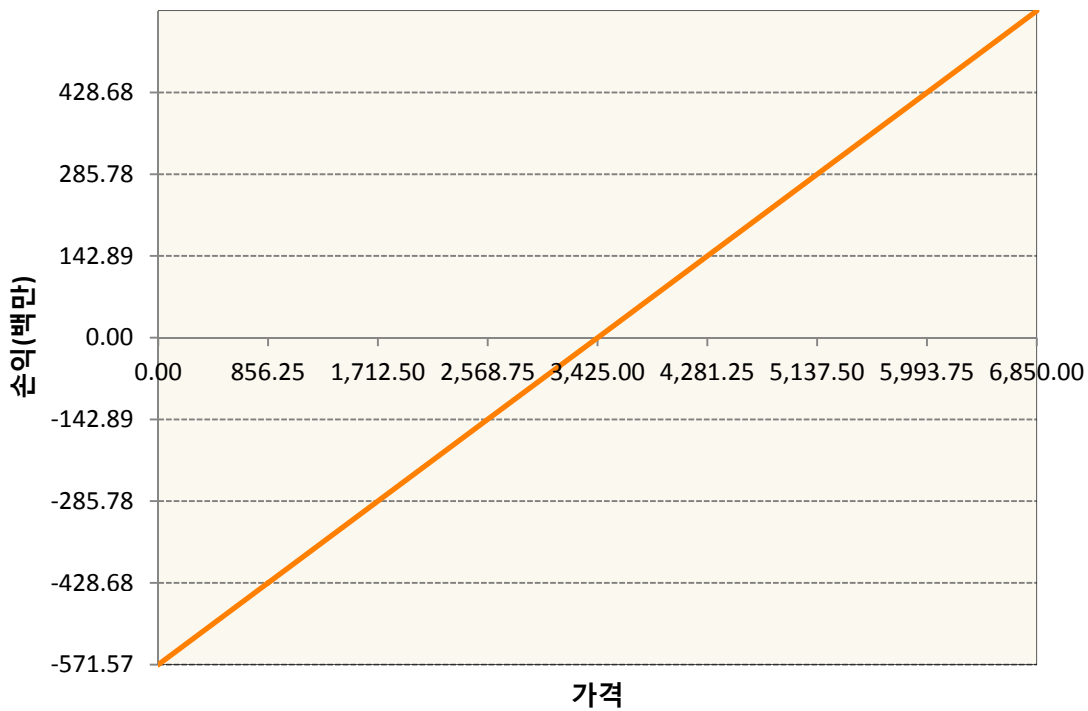
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	572	0	572	

2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	46
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

33

공시일	2019-04-22
기준일	2019-04-19

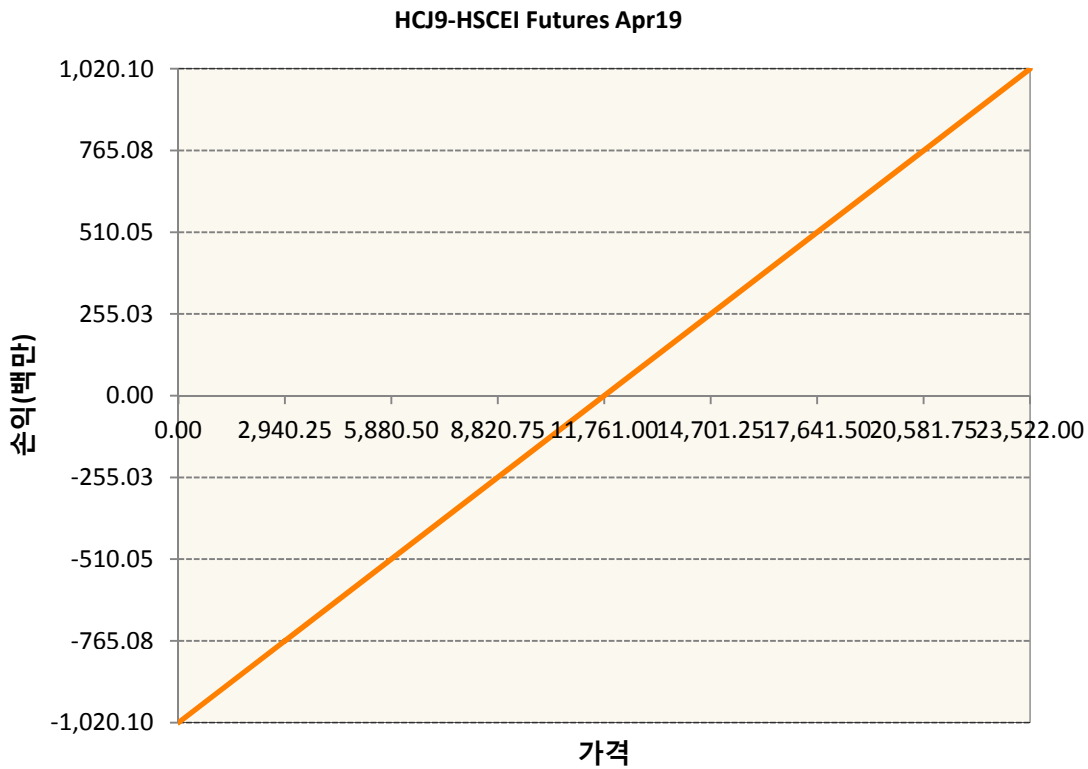
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,020	0	1,020	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ9	HSCEI Futures Apr19	82
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

84

공시일	2019-04-22
기준일	2019-04-19

커버드콜모(주식혼합-파생형)

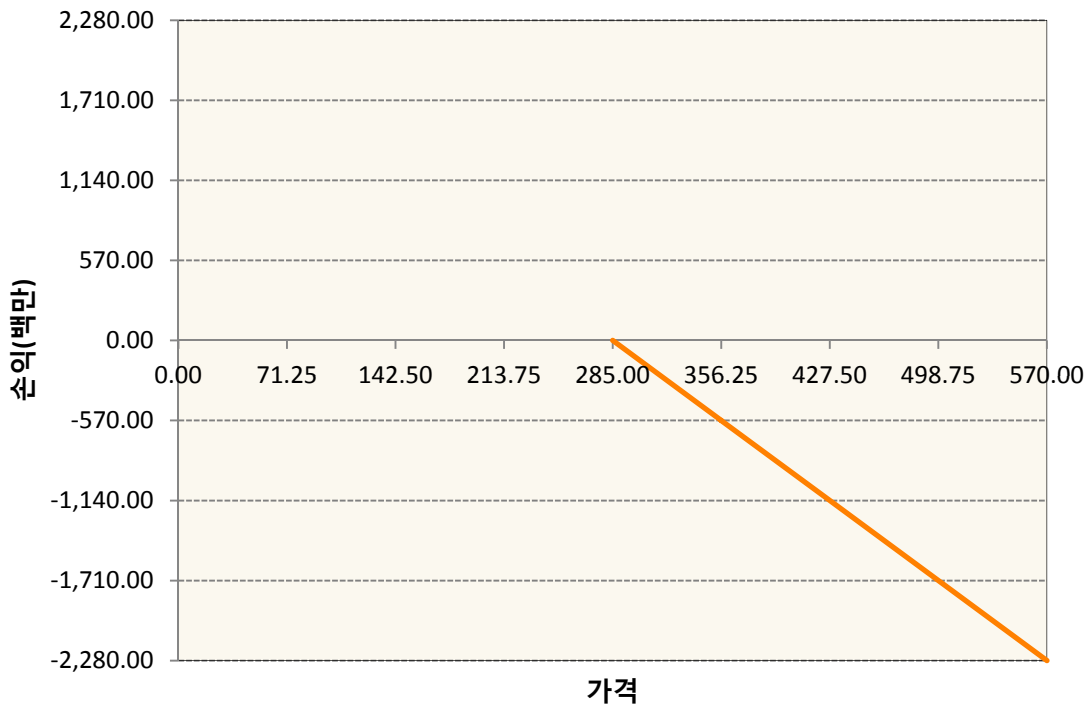
1. 계약금액

(단위:백만원)

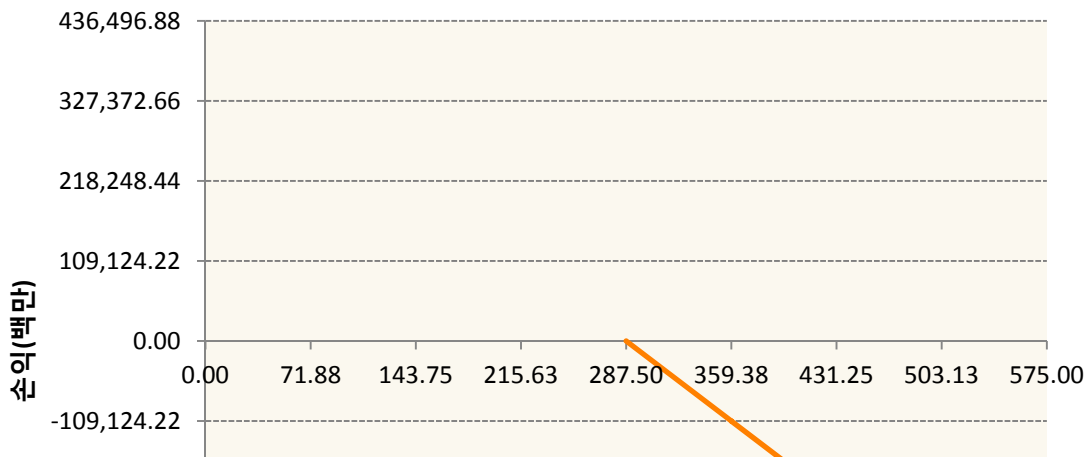
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	672,214	-672,214	장내

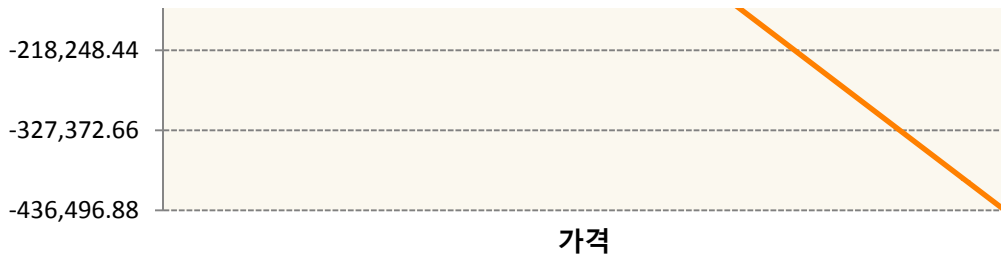
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P52850-2019-05 콜285

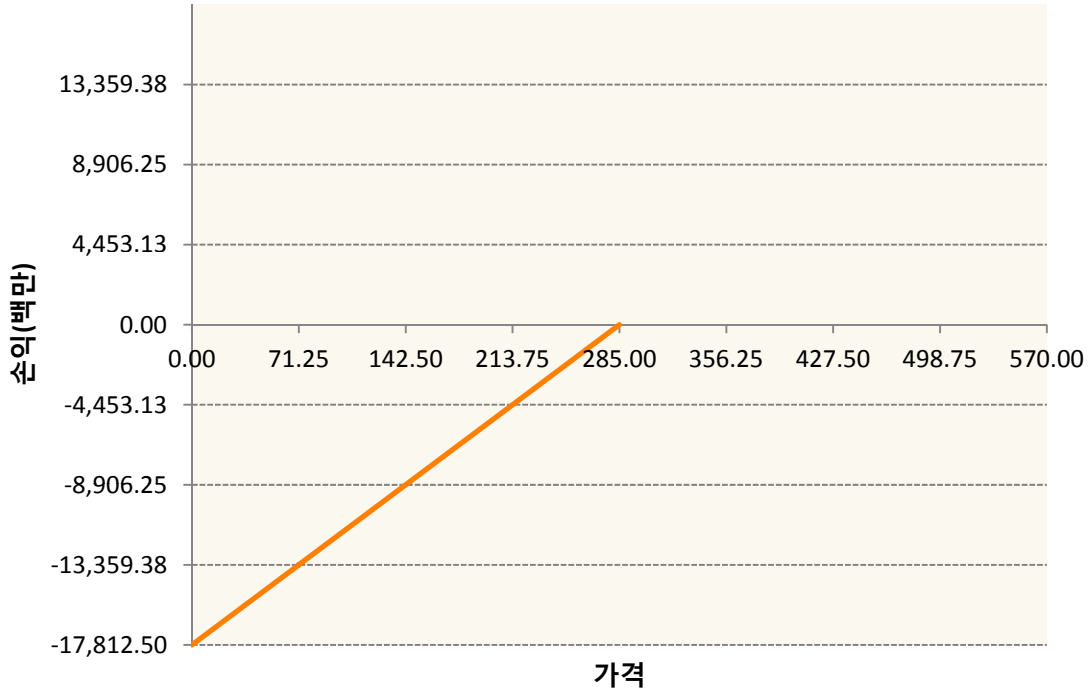


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

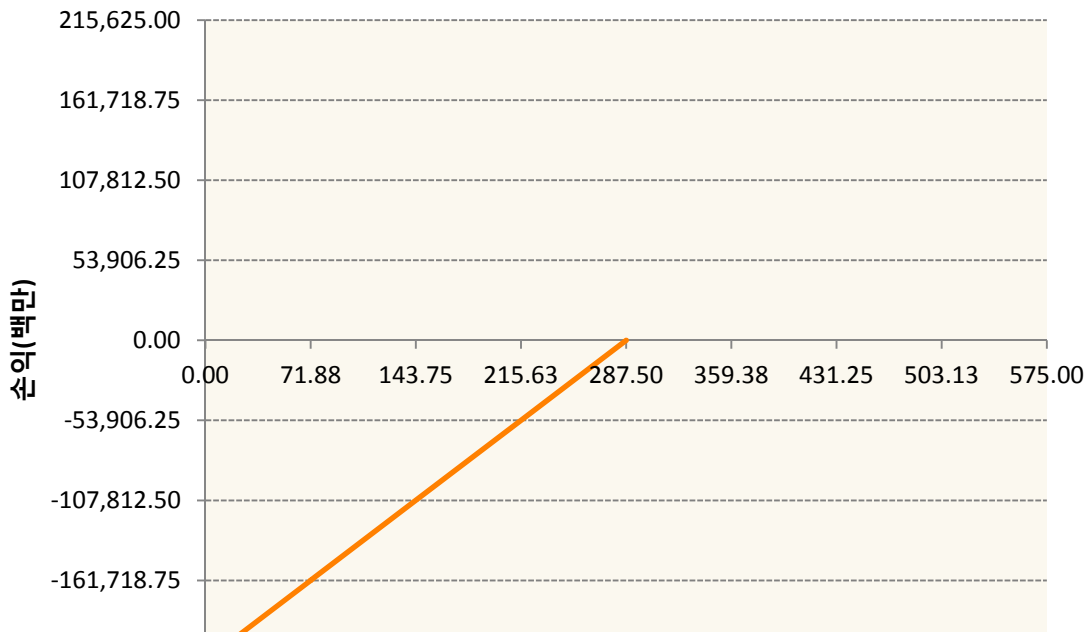




KR4301P52858-2019-05 풋285



KR4301P52874-2019-05 풋287.5



-215,625.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P52850		2019-05 콜285						146
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	53	52	51	50	48	46	45	
-5.33%	49	47	45	42	39	37	34	
-2.67%	37	34	30	27	23	19	15	
0%	12	8	4	0	-4	-8	-13	
2.67%	-28	-31	-34	-38	-42	-46	-49	
5.33%	-79	-81	-83	-86	-89	-91	-94	
8.00%	-137	-138	-139	-140	-142	-144	-146	
KR4201P52876		2019-05 콜287.5						26,248
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	8,243	8,149	8,012	7,829	7,602	7,332	7,021	
-5.33%	7,788	7,494	7,144	6,744	6,302	5,823	5,312	
-2.67%	6,192	5,601	4,980	4,333	3,668	2,986	2,292	
0%	2,368	1,580	790	0	-791	-1,583	-2,375	
2.67%	-4,315	-5,036	-5,772	-6,519	-7,275	-8,037	-8,805	
5.33%	-13,482	-13,947	-14,462	-15,019	-15,609	-16,227	-16,868	
8.00%	-24,146	-24,364	-24,641	-24,973	-25,356	-25,782	-26,248	
KR4301P52858		2019-05 풋285						1,198
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,195	-1,195	-1,195	-1,195	-1,196	-1,196	-1,198	
-5.33%	-720	-721	-723	-726	-730	-735	-740	
-2.67%	-269	-278	-289	-301	-313	-326	-339	
0%	51	34	17	0	-17	-34	-51	
2.67%	165	157	148	138	127	116	103	
5.33%	180	179	177	175	172	167	162	
8.00%	181	181	181	180	180	179	178	
KR4301P52874		2019-05 풋287.5						15,242
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-15,226	-15,226	-15,226	-15,227	-15,230	-15,235	-15,242	
-5.33%	-9,518	-9,524	-9,536	-9,554	-9,581	-9,617	-9,662	
-2.67%	-3,935	-4,008	-4,096	-4,197	-4,310	-4,433	-4,564	
0%	604	404	202	0	-203	-407	-610	
2.67%	2,717	2,577	2,426	2,267	2,100	1,929	1,752	

5.33%	3,125	3,097	3,057	3,004	2,938	2,860	2,771
8.00%	3,154	3,152	3,148	3,140	3,126	3,106	3,079

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

(단위:백만원)

45,835

공시일	2019-04-22
기준일	2019-04-19

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

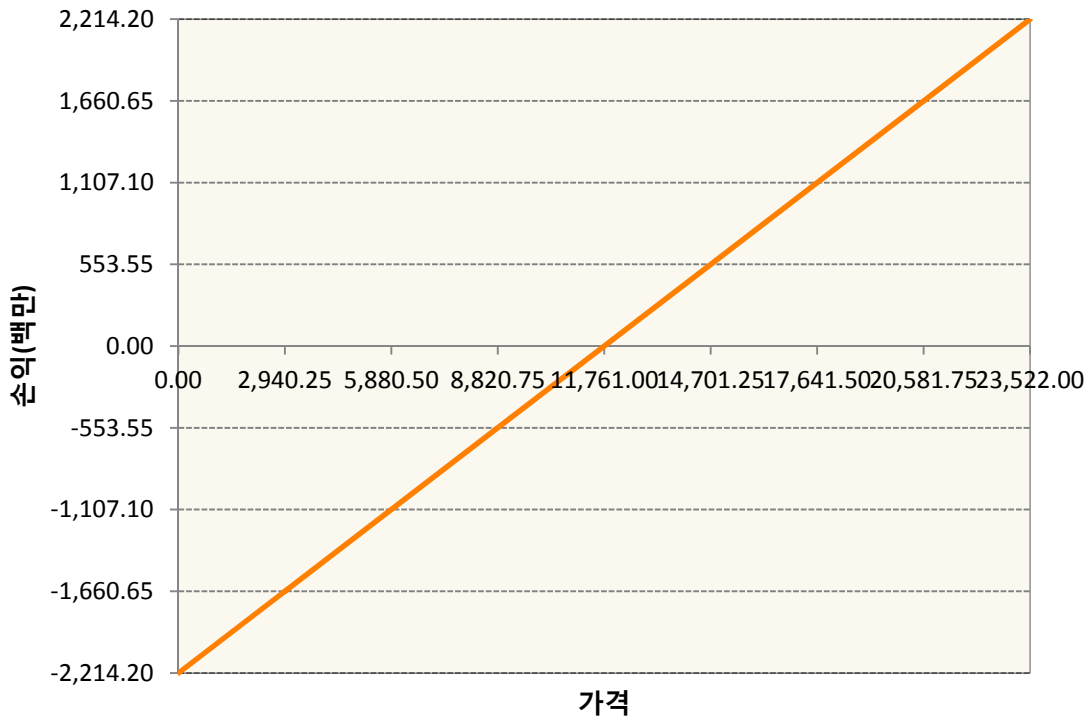
1. 계약금액

(단위:백만원)

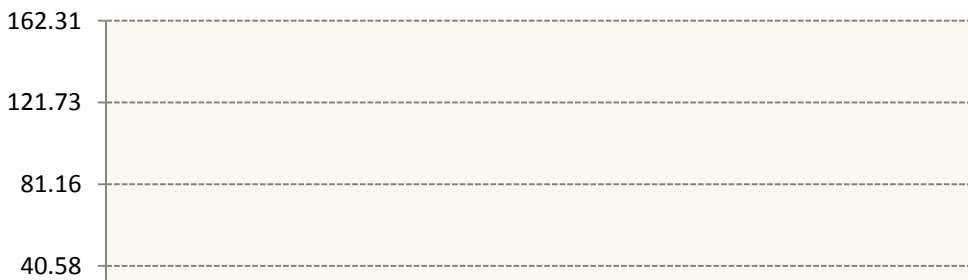
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,214	0	2,214	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,565	-5,565	장내
누계	통화	선도	0	3,044	-3,044	장외

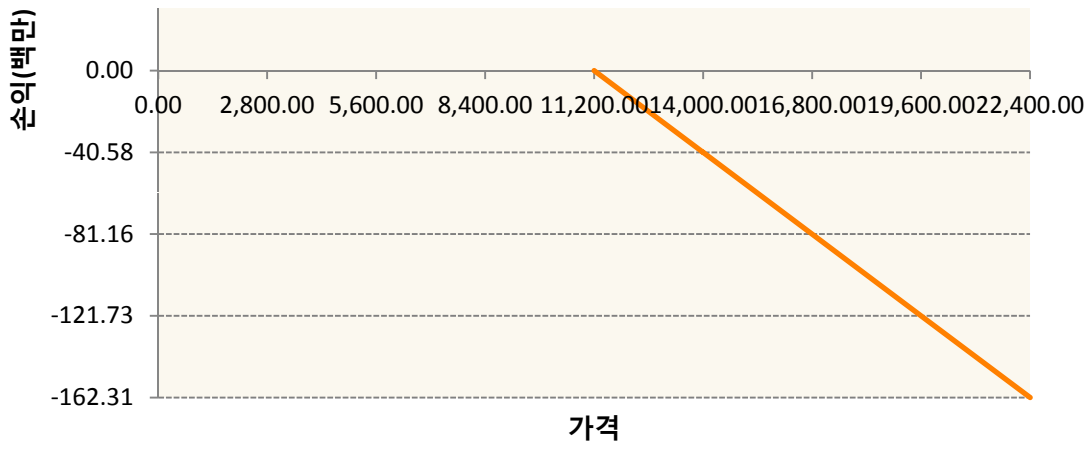
2. 만기시점의 손익구조

HCJ9-HSCEI Futures Apr19

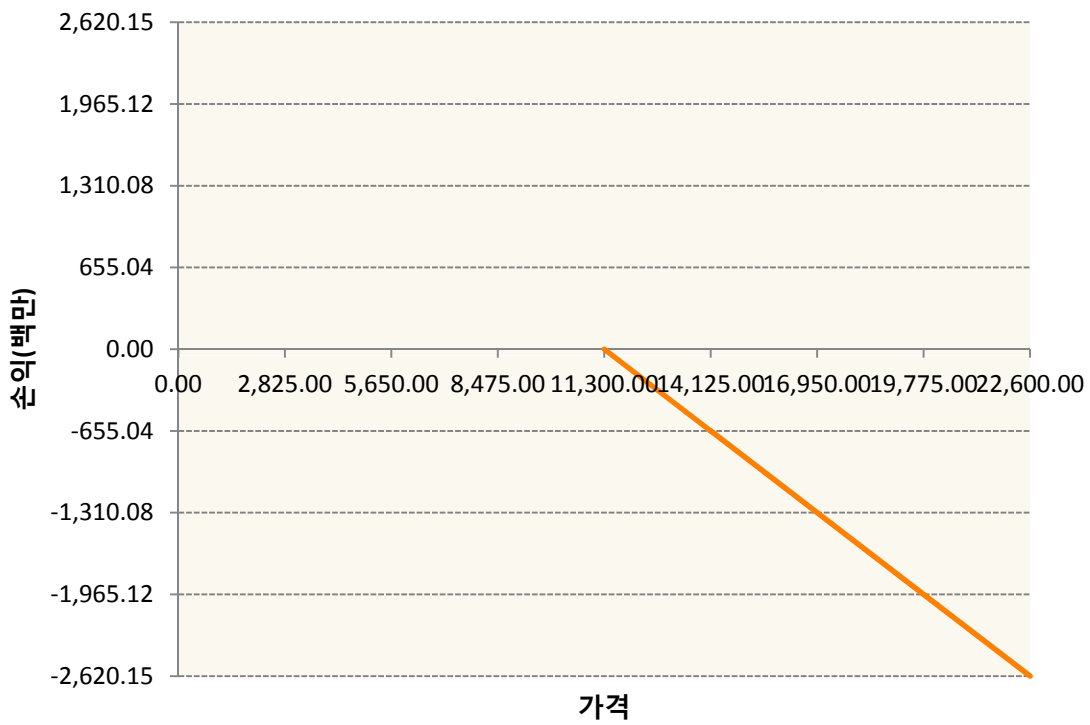


OHHIJ9-C112-HSCEI

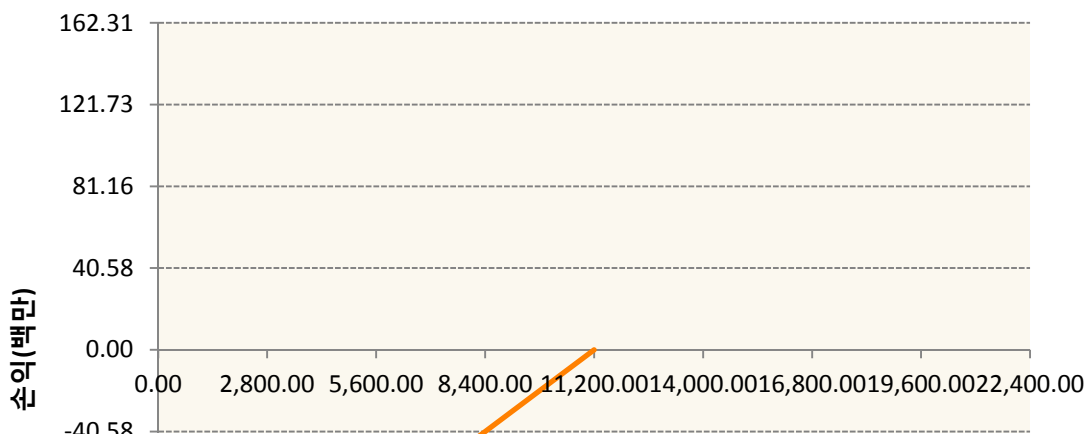


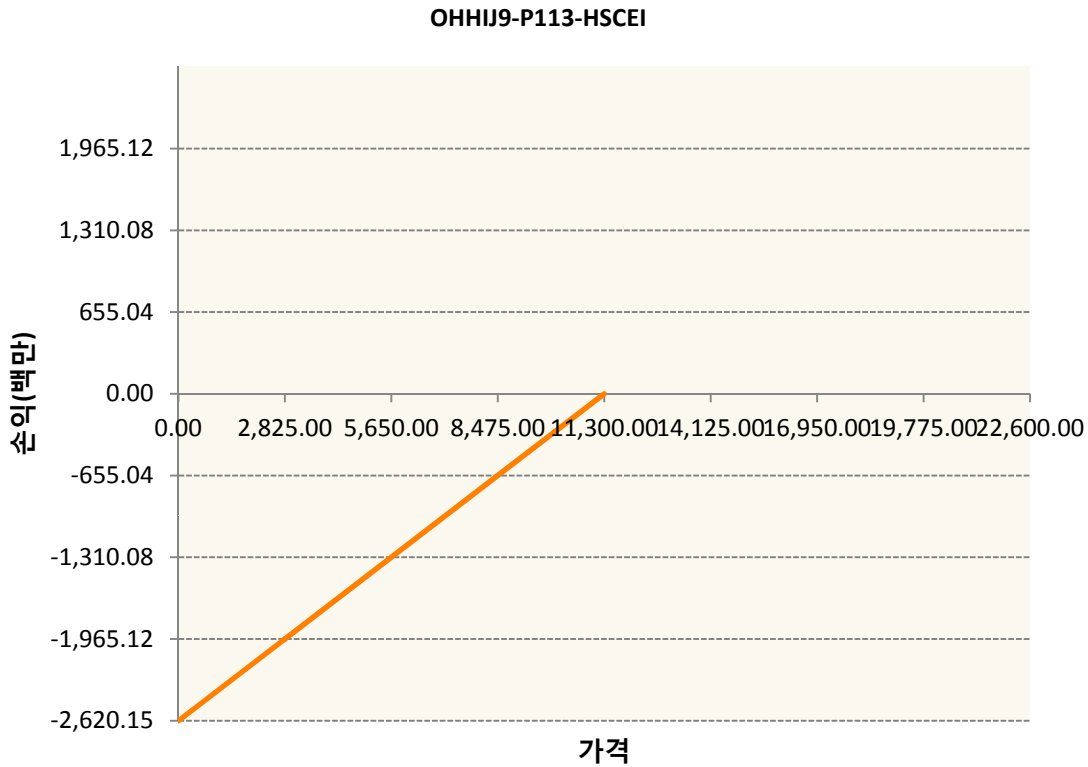
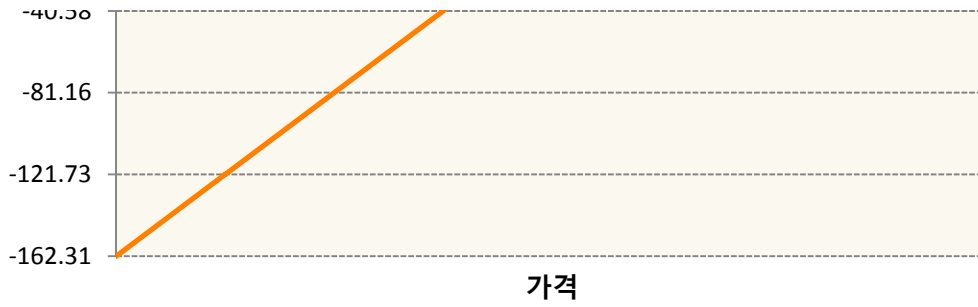


OHHIJ9-C113-HSCEI



OHHIJ9-P112-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	220
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	23
HCJ9 HSCEI Futures Apr19	177
OHHIJ9-C11 HSCEI	13
OHHIJ9-C11 HSCEI	210
OHHIJ9-P11: HSCEI	13
OHHIJ9-P11: HSCEI	210

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	719

공시일	2019-04-22
기준일	2019-04-19

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

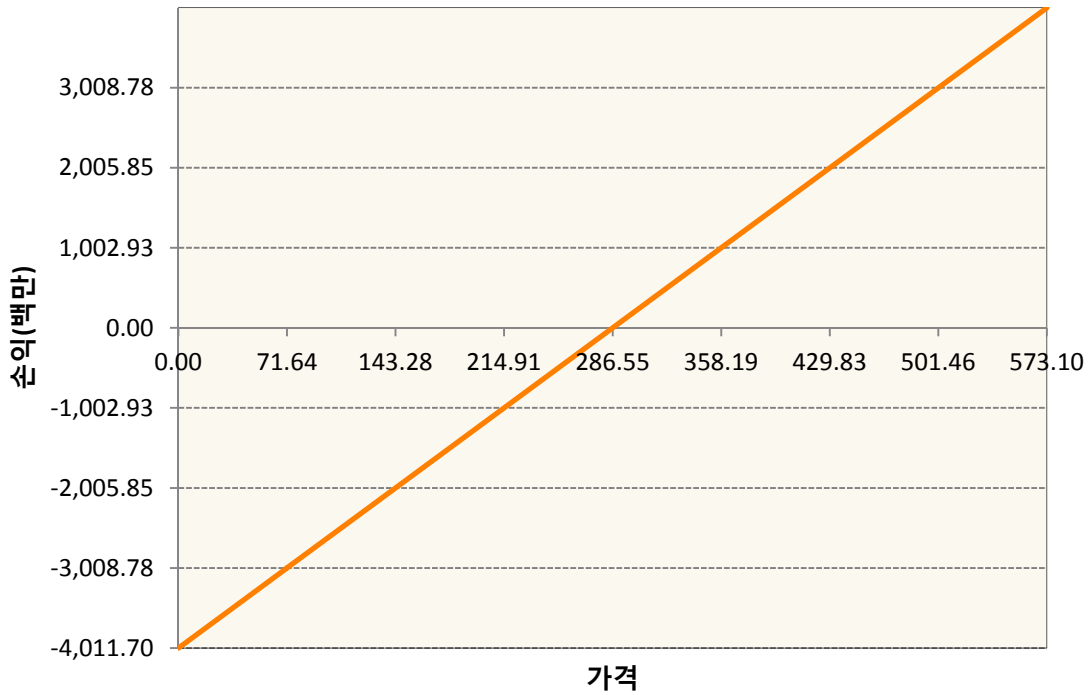
1. 계약금액

(단위:백만원)

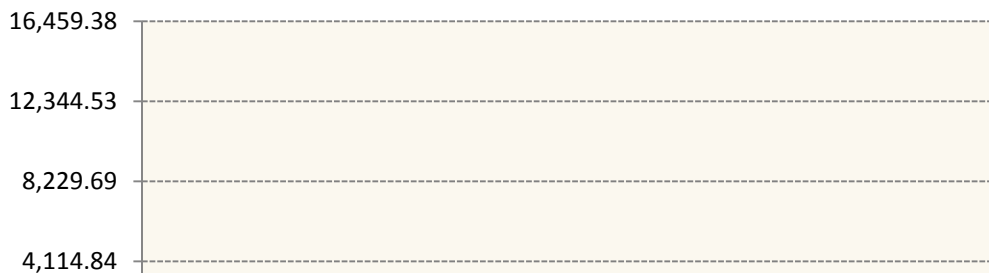
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,012	0	4,012	장내
누계	유가증권	스왑	35,836	0	35,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	32,694	-32,694	장내

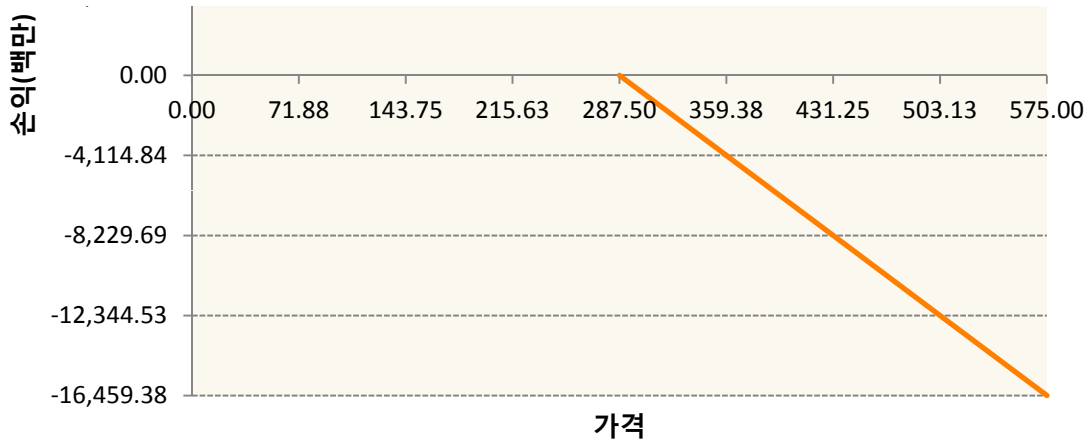
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

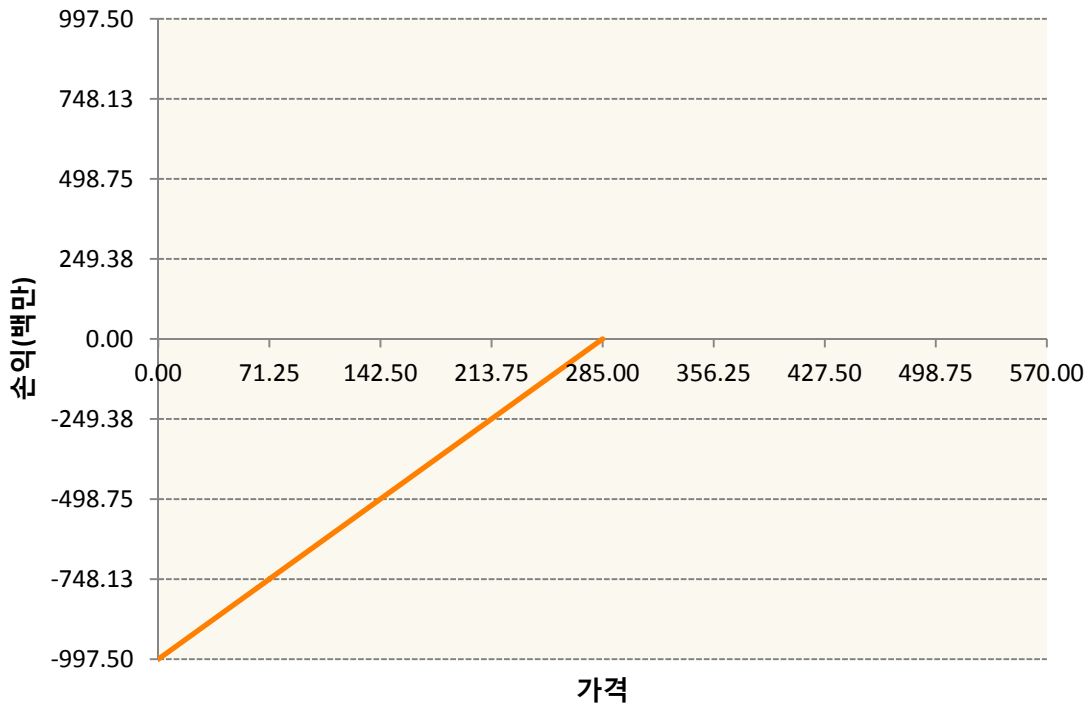


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

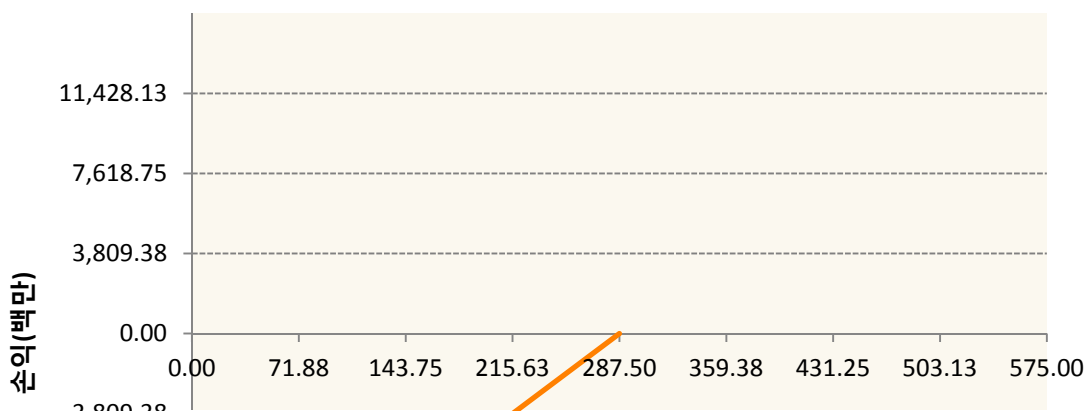




KR4301P52858-2019-05 풋285



KR4301P52874-2019-05 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,448
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,448	-2,448	-2,448	-2,448	-2,448	-2,448	-2,448	
-5.33%	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632	
-2.67%	-816	-816	-816	-816	-816	-816	-816	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	816	816	816	816	816	816	816	
5.33%	1,632	1,632	1,632	1,632	1,632	1,632	1,632	
8.00%	2,448	2,448	2,448	2,448	2,448	2,448	2,448	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						594
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-594	-594	-594	-594	-594	-594	-594	
-5.33%	-396	-396	-396	-396	-396	-396	-396	
-2.67%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	198	198	198	198	198	198	198	
5.33%	396	396	396	396	396	396	396	
8.00%	594	594	594	594	594	594	594	
KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						320
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-320	-320	-320	-320	-320	-320	-320	
-5.33%	-213	-213	-213	-213	-213	-213	-213	
-2.67%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	107	107	107	107	107	107	107	
5.33%	213	213	213	213	213	213	213	
8.00%	320	320	320	320	320	320	320	
KR4201P52876		2019-05 콜287.5						990
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	311	307	302	295	287	276	265
-5.33%	294	283	269	254	238	220	200
-2.67%	233	211	188	163	138	113	86
0%	89	60	30	0	-30	-60	-90
2.67%	-163	-190	-218	-246	-274	-303	-332
5.33%	-508	-526	-545	-566	-589	-612	-636
8.00%	-910	-919	-929	-942	-956	-972	-990
KR4301P52858 2019-05 풋285							67
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67
-5.33%	-40	-40	-41	-41	-41	-41	-41
-2.67%	-15	-16	-16	-17	-18	-18	-19
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	9	9	8	8	7	6	6
5.33%	10	10	10	10	10	9	9
8.00%	10	10	10	10	10	10	10
KR4301P52874 2019-05 풋287.5							1,077
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,076	-1,076	-1,076	-1,076	-1,076	-1,077	-1,077
-5.33%	-673	-673	-674	-675	-677	-680	-683
-2.67%	-278	-283	-289	-297	-305	-313	-323
0%	43	29	14	0	-14	-29	-43
2.67%	192	182	171	160	148	136	124
5.33%	221	219	216	212	208	202	196
8.00%	223	223	222	222	221	220	218

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

(단위:백만원)

5,654

공시일	2019-04-22
기준일	2019-04-19

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

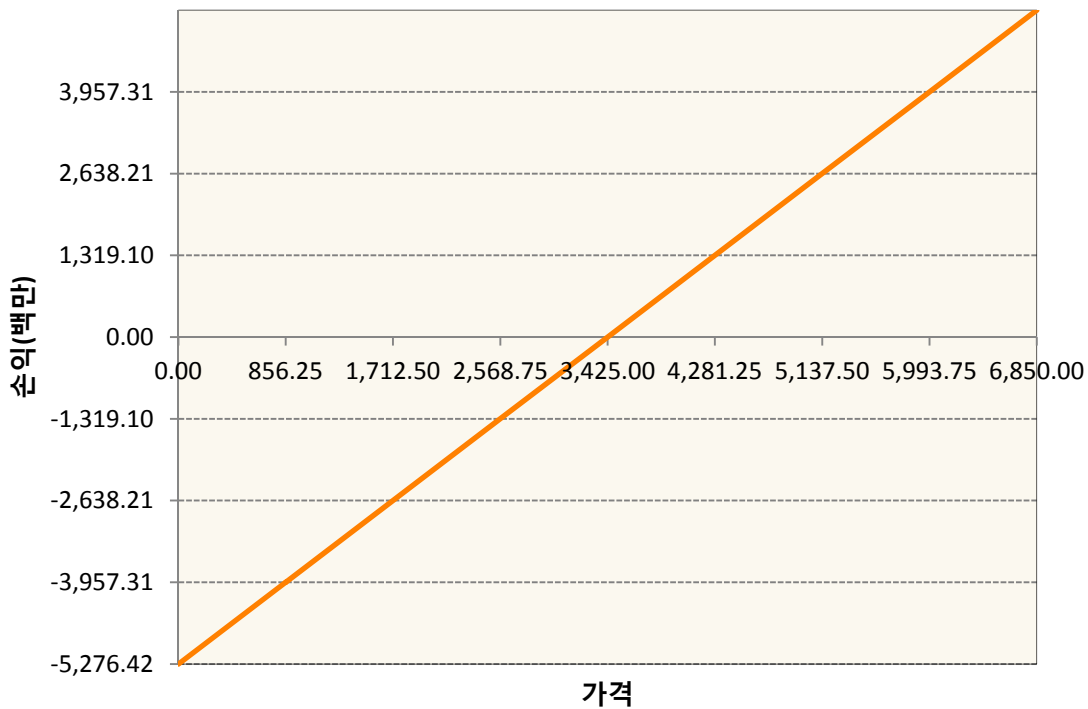
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	2	0	2	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,276	0	5,276	
누계	유가증권	스왑	62,991	0	62,991	장외
누계	통화	선도	0	17,901	-17,901	장외

2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	0
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	409
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	818
FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E	205
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	422

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

(단위:백만원)

1,023

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

(단위:백만원)

1,098

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

(단위:백만원)

94

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

(단위:백만원)

136

공시일	2019-04-22
기준일	2019-04-19

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

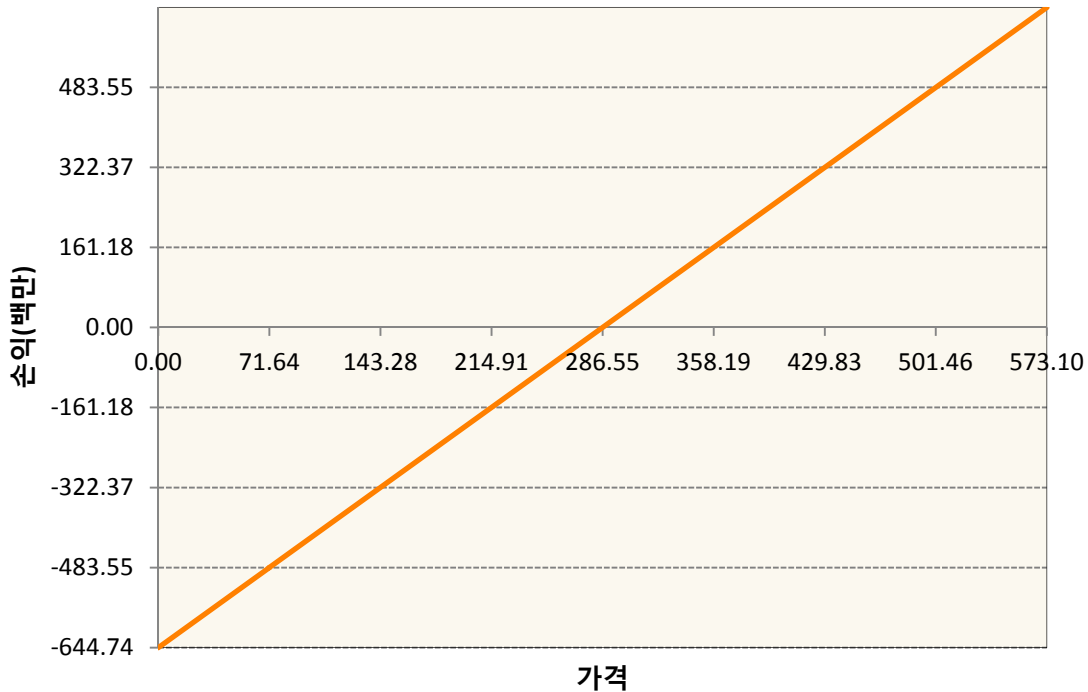
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	645	0	645	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						51
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51	
-5.33%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34	
-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%	34	34	34	34	34	34	34	
8.00%	51	51	51	51	51	51	51	

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

(단위:백만원)

42

공시일	2019-04-22
기준일	2019-04-19

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

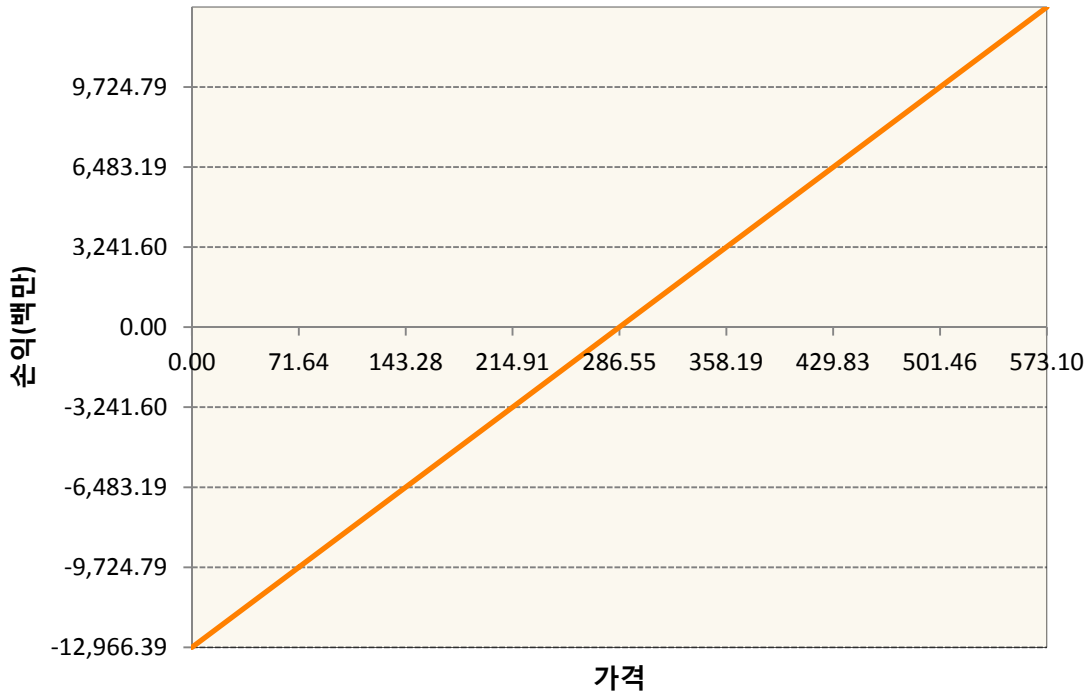
1. 계약금액

(단위:백만원)

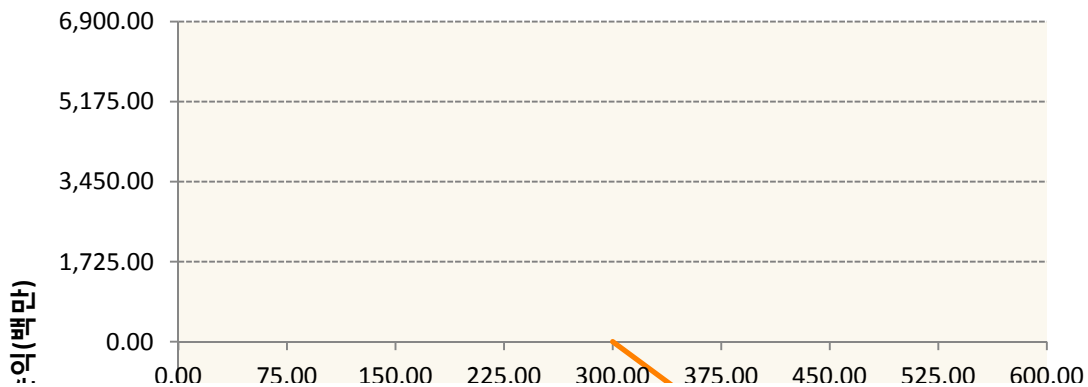
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,966	0	12,966	장내
누계	유가증권	옵션	1,366	24,294	-22,928	장내

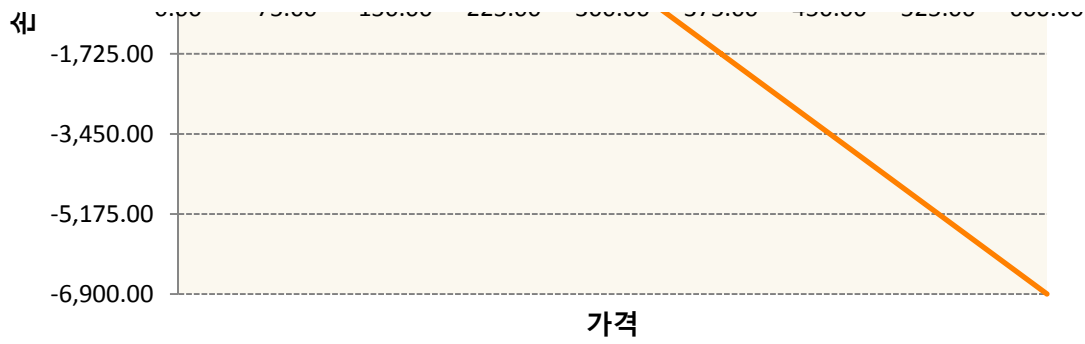
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

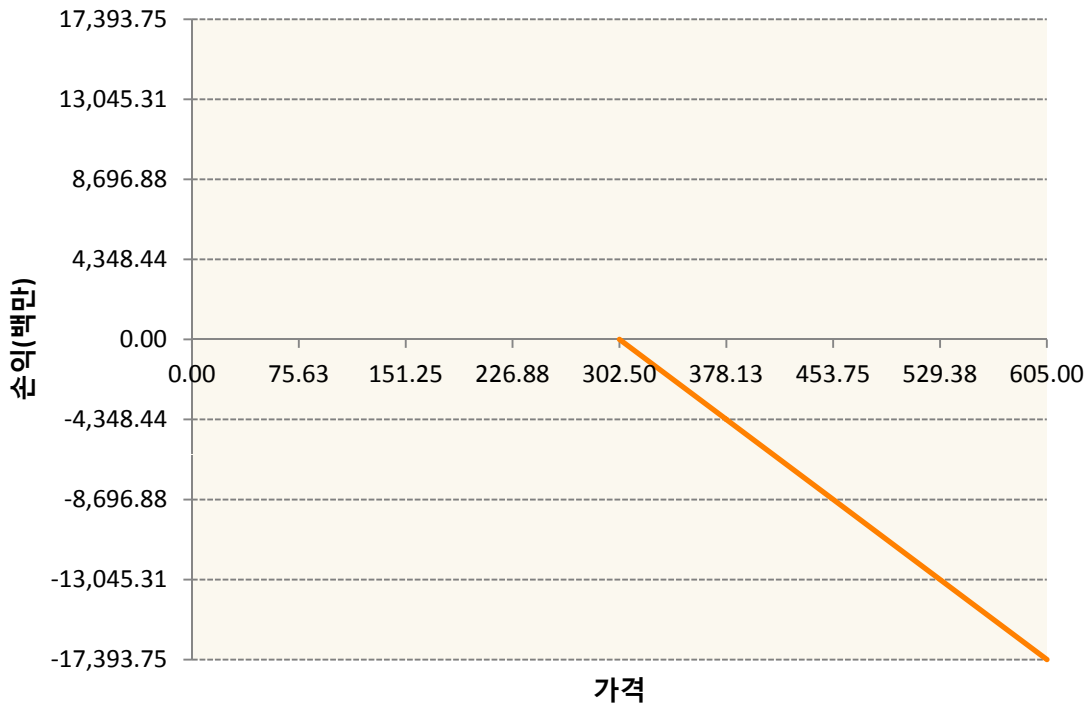


KR4201P53007-2019-05 콜300

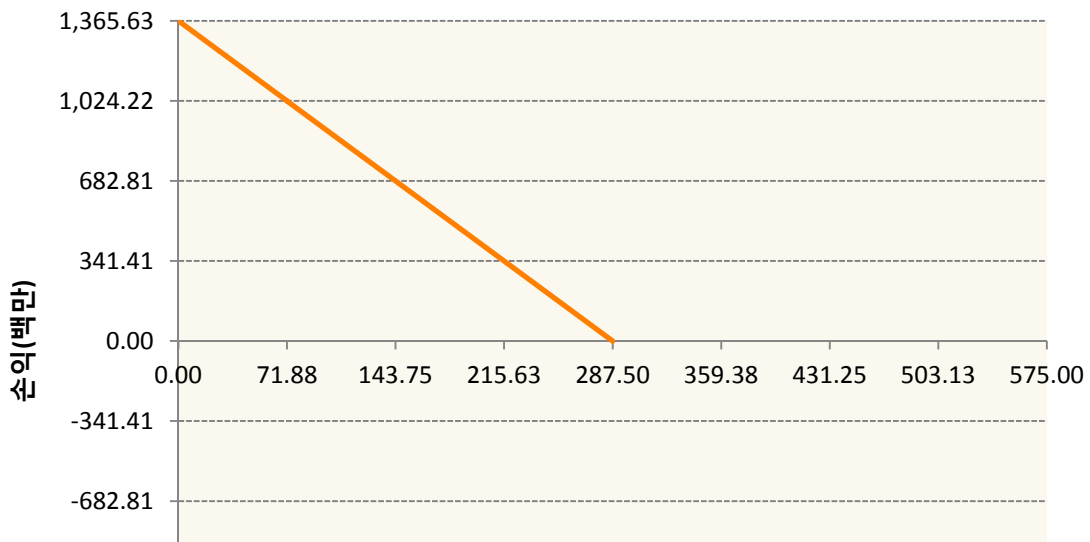


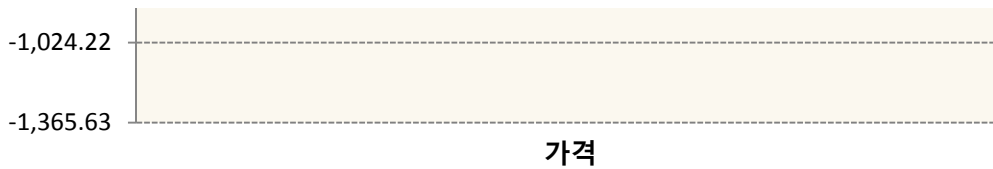


KR4201P53023-2019-05 콜302.5



KR4301P52874-2019-05 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						1,035
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,035	-1,035	-1,035	-1,035	-1,035	-1,035	-1,035	
-5.33%	-690	-690	-690	-690	-690	-690	-690	
-2.67%	-345	-345	-345	-345	-345	-345	-345	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	345	345	345	345	345	345	345	
5.33%	690	690	690	690	690	690	690	
8.00%	1,035	1,035	1,035	1,035	1,035	1,035	1,035	
KR4201P53007		2019-05 콜300						270
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	39	38	38	38	37	36	34	
-5.33%	38	37	36	34	32	29	25	
-2.67%	35	32	29	24	19	13	7	
0%	22	16	8	0	-9	-18	-27	
2.67%	-14	-25	-36	-48	-59	-71	-83	
5.33%	-88	-101	-113	-126	-138	-151	-164	
8.00%	-203	-213	-224	-235	-246	-258	-270	
KR4201P53023		2019-05 콜302.5						608
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	73	73	73	72	70	68	65	
-5.33%	72	71	69	66	61	56	48	
-2.67%	68	63	56	48	37	25	11	
0%	46	33	17	0	-19	-39	-61	
2.67%	-22	-46	-72	-99	-126	-154	-182	
5.33%	-173	-205	-236	-268	-300	-331	-363	
8.00%	-428	-457	-487	-516	-546	-577	-608	
KR4301P52874		2019-05 풋287.5						97
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	96	96	96	96	96	96	97	
-5.33%	60	60	60	61	61	61	61	
-2.67%	25	25	26	27	27	28	29	

0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-17	-16	-15	-14	-13	-12	-11
5.33%	-20	-20	-19	-19	-19	-18	-18
8.00%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20

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

(단위:백만원)

1,577

공시일	2019-04-22
기준일	2019-04-19

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	3,717	0	3,717	

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	2019-04-22
기준일	2019-04-19

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	56,332	0	56,332	

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	2019-04-22
기준일	2019-04-19

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	116,135	0	116,135	
누계	통화	선도	0	138,349	-138,349	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E		155
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E		364
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E		427
FX21019H03 KRW/USD 22-04-19E		364
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E		364
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E		418
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E		182
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E		455
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E		528
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E		320
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E		273
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E		45
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E		91
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E		91
FX21019J001 KRW/USD 10-05-19E		45
FX21019J002 KRW/USD 10-06-19E		100
FX21019J003 KRW/USD 10-05-19E		155
FX21019J004 KRW/USD 10-05-19E		73
FX21019J005 KRW/USD 10-05-19E		273
FX21019J006 KRW/USD 10-05-19E		227
FX21019J007 KRW/USD 10-05-19E		73
FX21019J012 KRW/USD 20-05-19E		127
FX21019J013 KRW/USD 20-05-19E		18
FX21019J014 KRW/USD 20-05-19E		136
FX21019J015 KRW/USD 20-05-19E		136
FX21019J016 KRW/USD 17-05-19E		1,273
FX21019J017 KRW/USD 17-05-19E		1,364

FX21019J019 KRW/USD 18-06-19E	364
FX21019J020 KRW/USD 20-05-19E	491
FX21019J021 KRW/USD 20-05-19E	462
FX21019J022 KRW/USD 24-06-19E	910
FX21019J023 KRW/USD 22-05-19E	764

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

(단위:백만원)

3,761

공시일	2019-04-22
기준일	2019-04-19

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

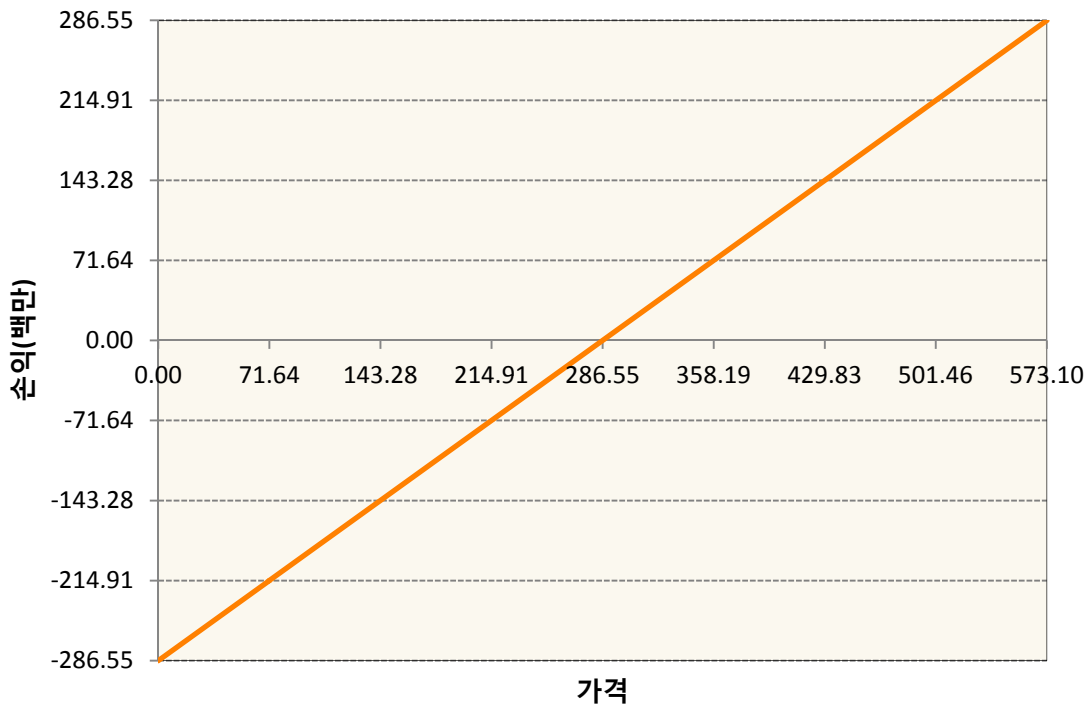
1. 계약금액

(단위:백만원)

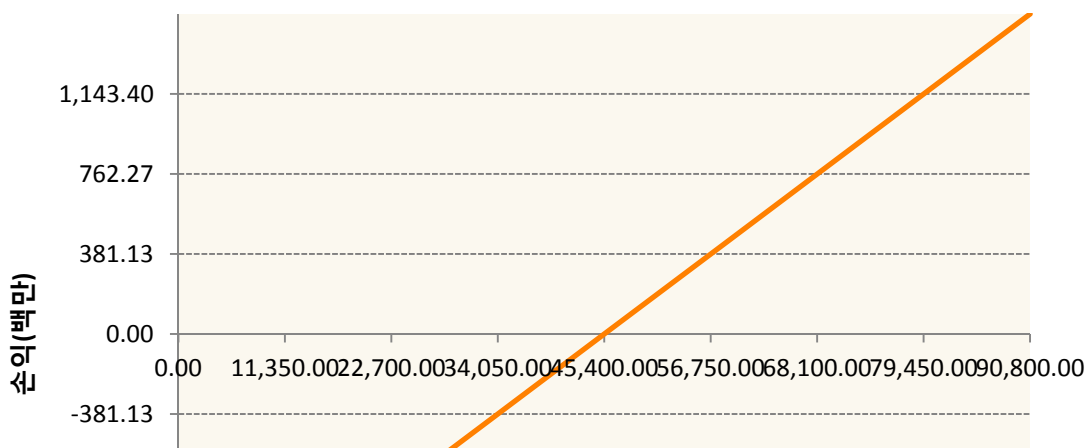
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,811	0	1,811	장내

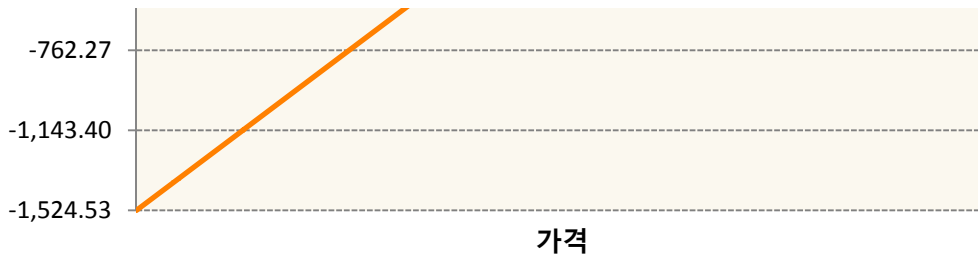
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4111P50004-2019-05 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						23
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23	
-5.33%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	
-2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	8	8	8	8	8	8	8	
5.33%	15	15	15	15	15	15	15	
8.00%	23	23	23	23	23	23	23	
KR4111P50004		2019-05 삼성전자개별선물						122
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-122	-122	-122	-122	-122	-122	-122	
-5.33%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81	
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	41	41	41	41	41	41	41	
5.33%	81	81	81	81	81	81	81	
8.00%	122	122	122	122	122	122	122	

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

159

공시일	2019-04-22
기준일	2019-04-19

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

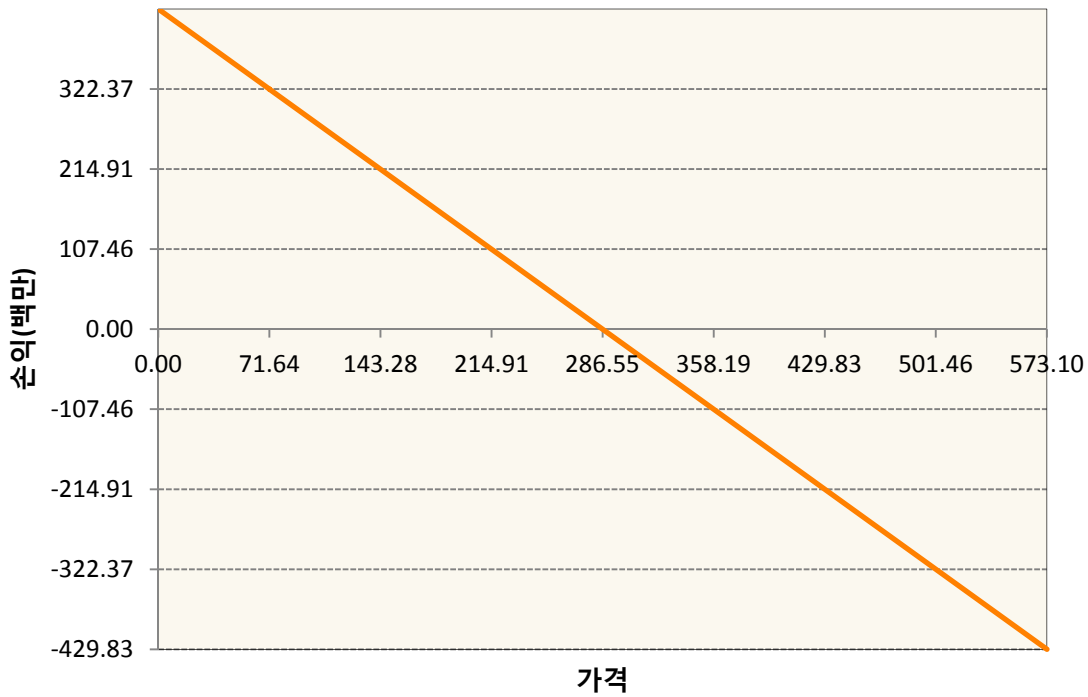
1. 계약금액

(단위:백만원)

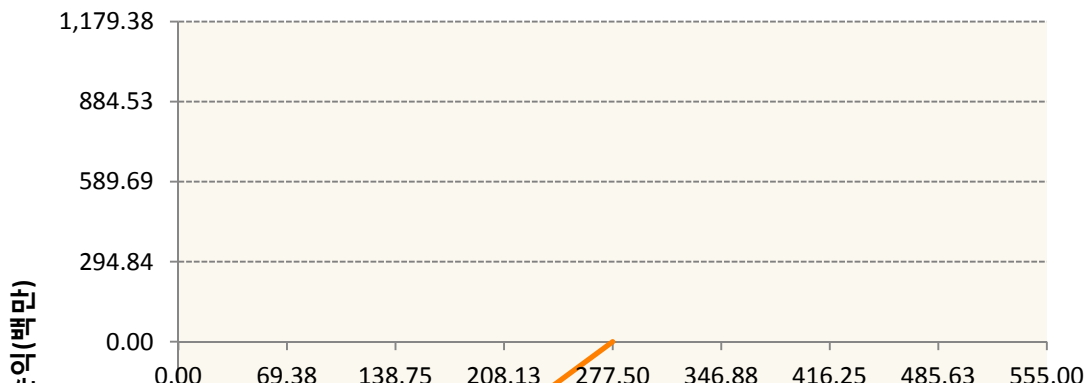
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	70	-70	장내
누계	유가증권	선물	0	430	-430	장내
누계	유가증권	옵션	0	2,439	-2,439	장내

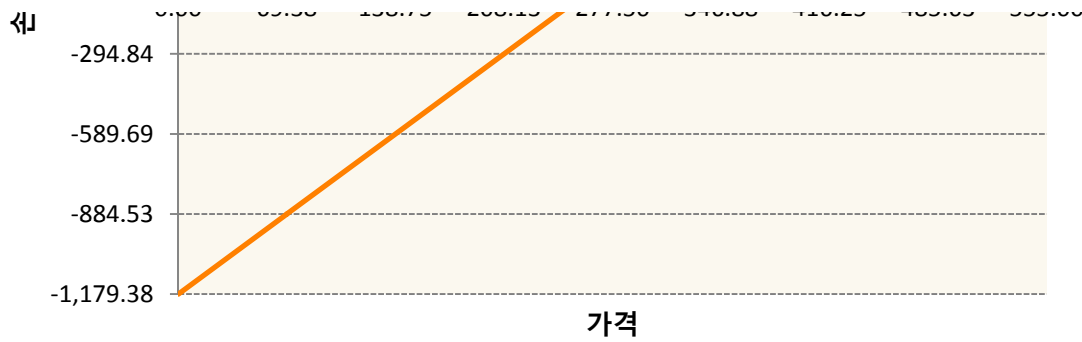
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

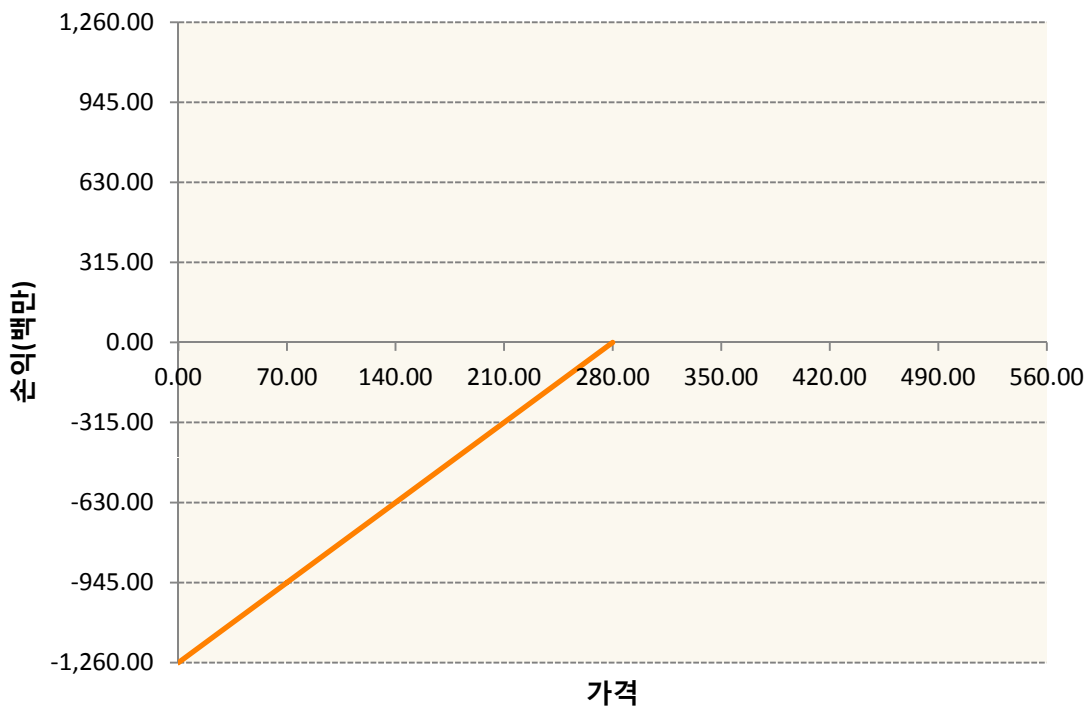


KR4301P52775-2019-05 풋277.5





KR4301P52809-2019-05 풋280



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						34
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	34	34	34	34	34	34	34	
-5.33%	23	23	23	23	23	23	23	
-2.67%	11	11	11	11	11	11	11	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11	
5.33%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23	
8.00%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34	
KR4301P52775		2019-05 풋277.5						60
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-59	-59	-59	-59	-60	-60	-60
-5.33%	-28	-29	-29	-30	-31	-32	-33
-2.67%	-6	-7	-8	-9	-11	-12	-13
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	3	3	3	2	2	2	2
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

KR4301P52809

2019-05 풋280

72

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-71	-71	-72	-72	-72	-72	-72
-5.33%	-38	-38	-39	-39	-40	-41	-41
-2.67%	-10	-11	-13	-14	-15	-16	-17
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	5	5	5	4	4	4	3
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

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

(단위:백만원)

148

공시일	2019-04-22
기준일	2019-04-19

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

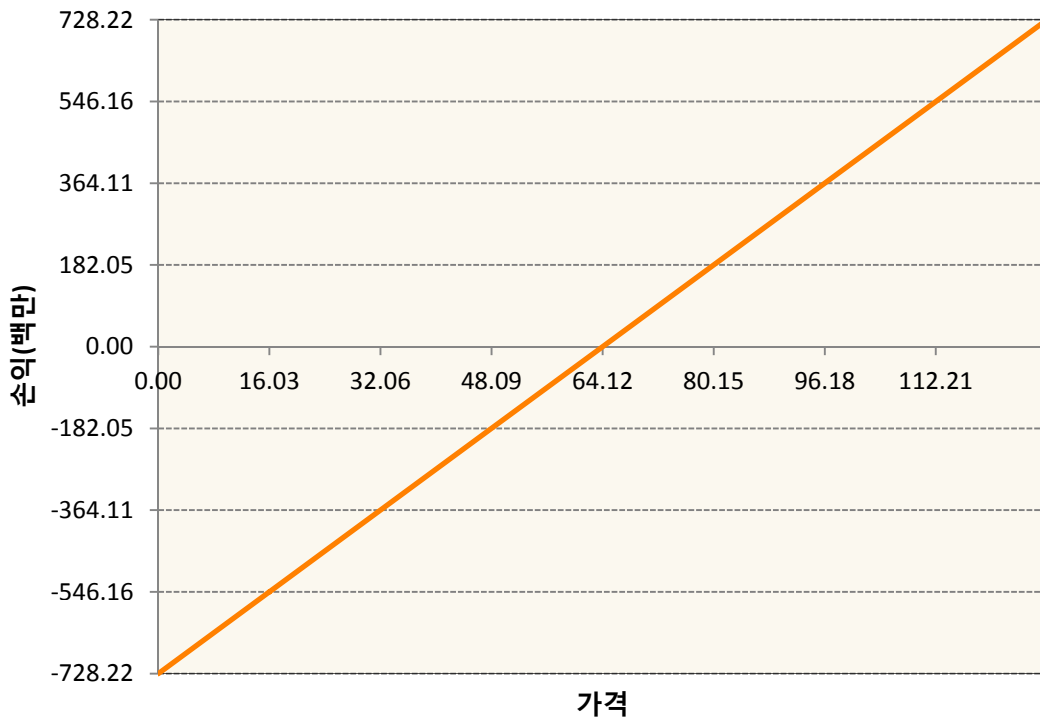
1. 계약금액

(단위:백만원)

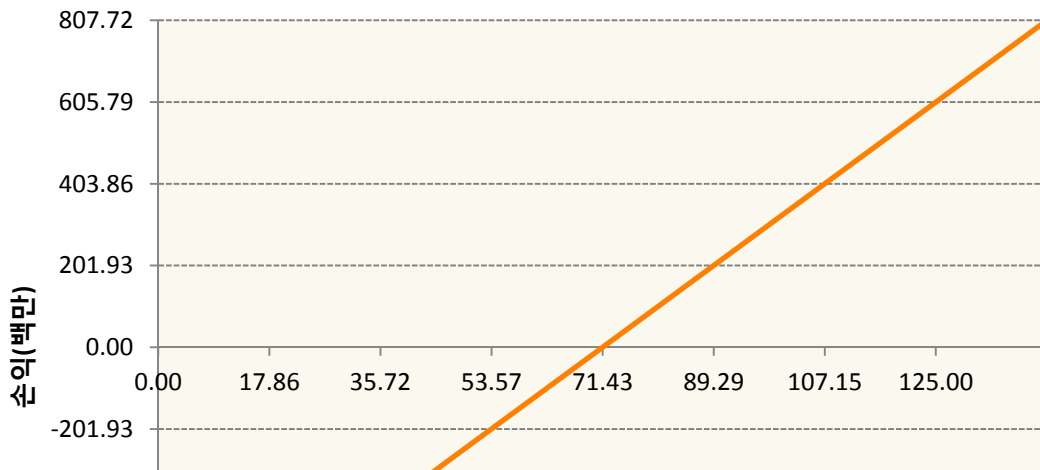
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,960	284	2,677	

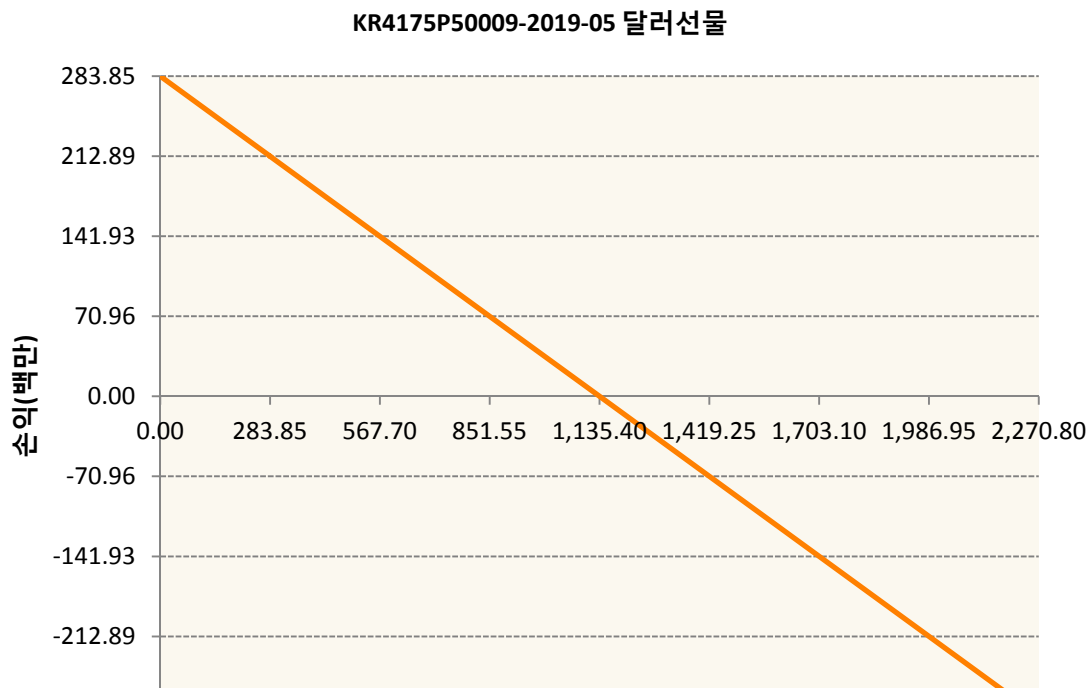
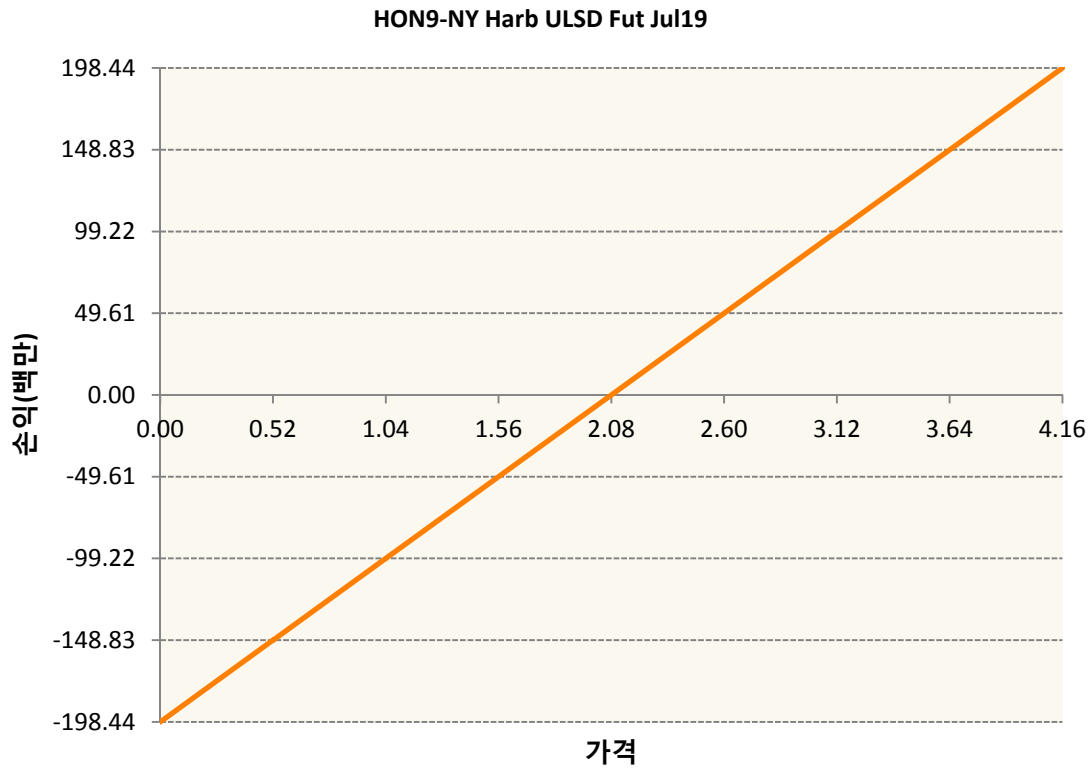
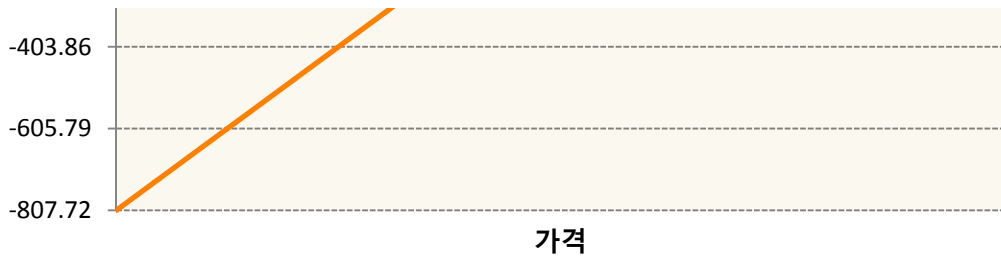
2. 만기시점의 손익구조

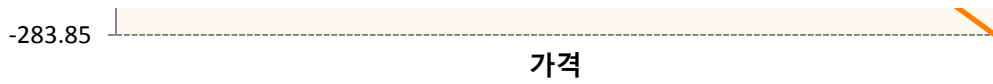
CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19



CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19

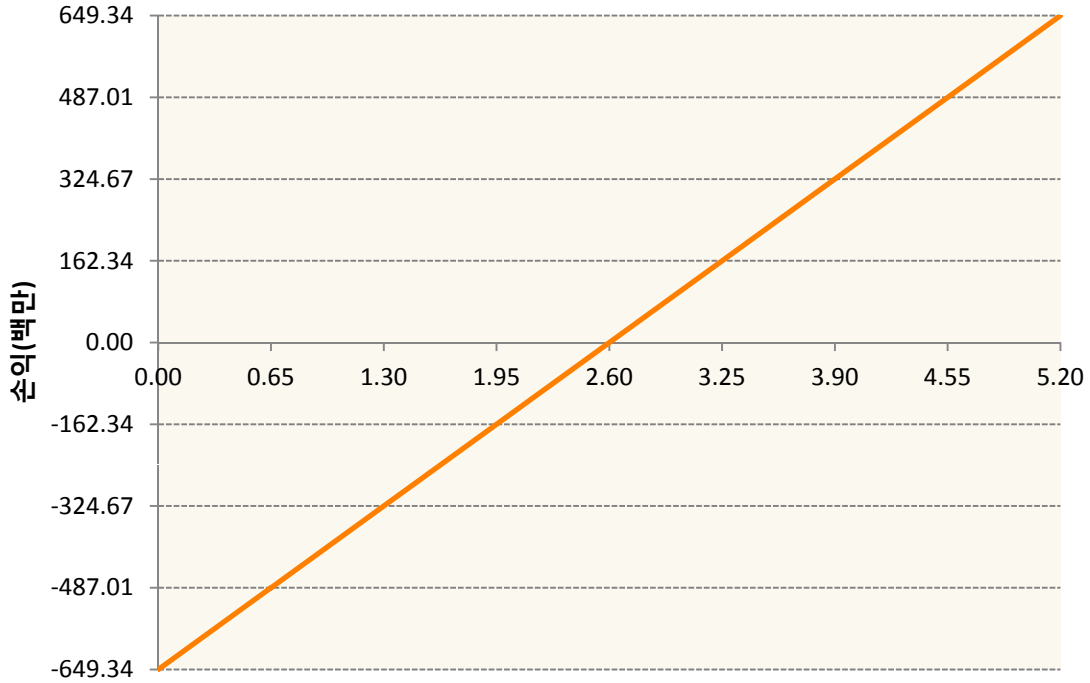






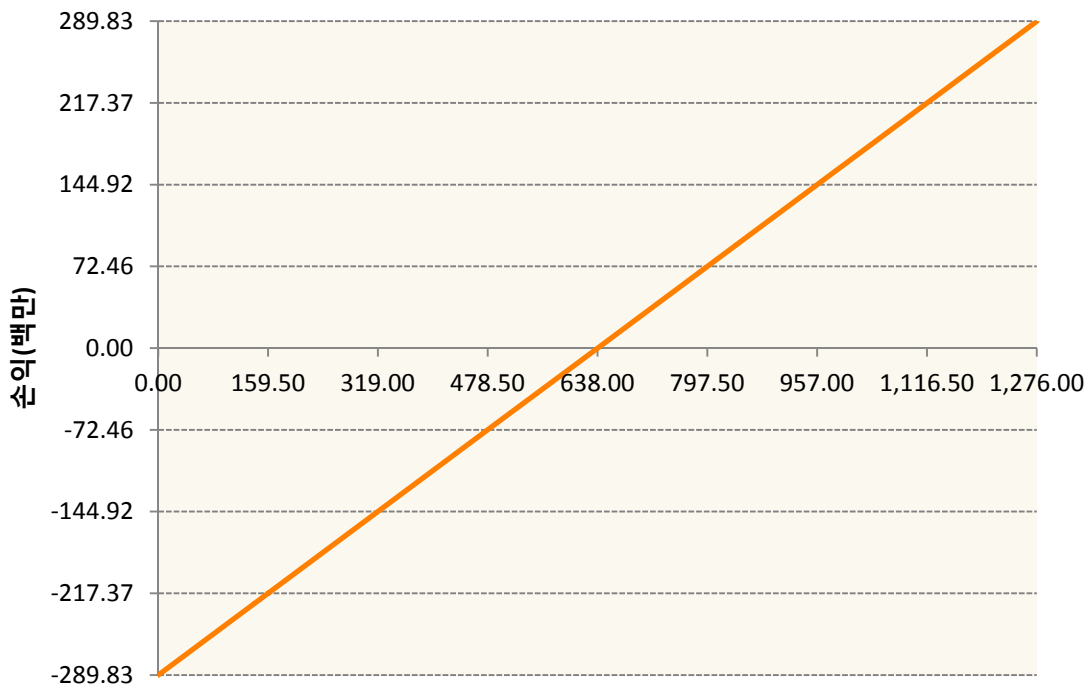
가격

NGN19-NATURAL GAS FUTR Jul19



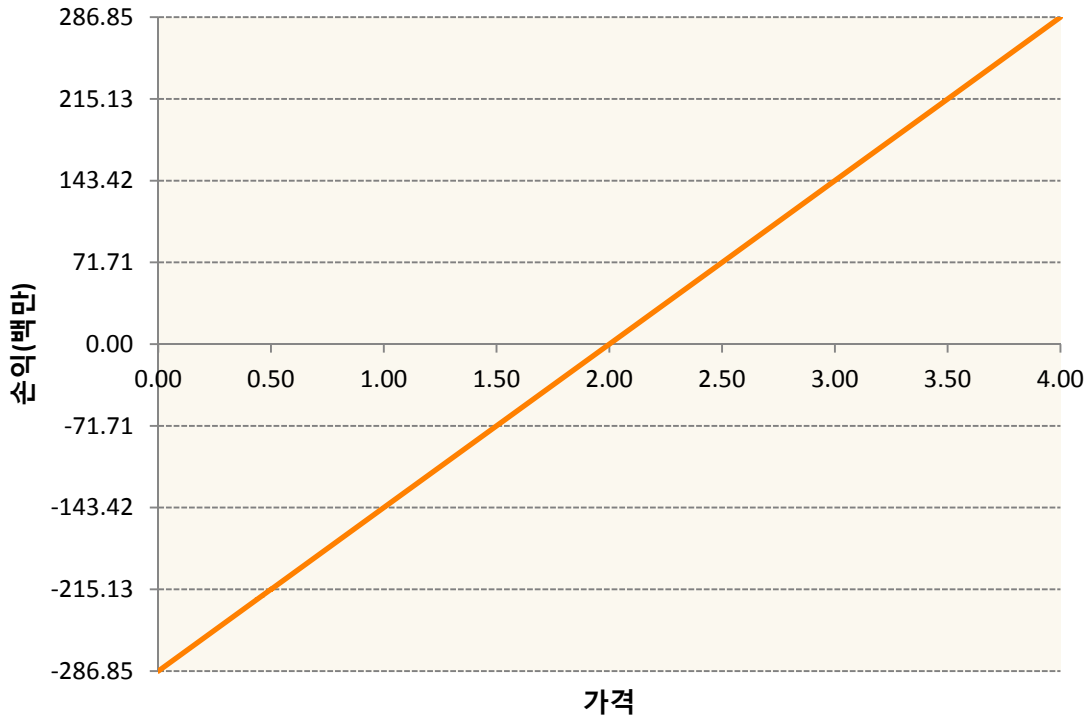
가격

QSN9-Low Su Gasoil G Jul19



가격

XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN9	WTI CRUDE FUTURE Jul19	58
CON9	BRENT CRUDE FUTR Jul19	65
HON9	NY Harb ULSD Fut Jul19	16
KR4175P500	2019-05 달러선물	23
NGN19	NATURAL GAS FUTR Jul19	52
QSN9	Low Su Gasoil G Jul19	23
XBN9	GASOLINE RBOB FUT Jul19	23

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

(단위:백만원)

436

공시일	2019-04-22
기준일	2019-04-19

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

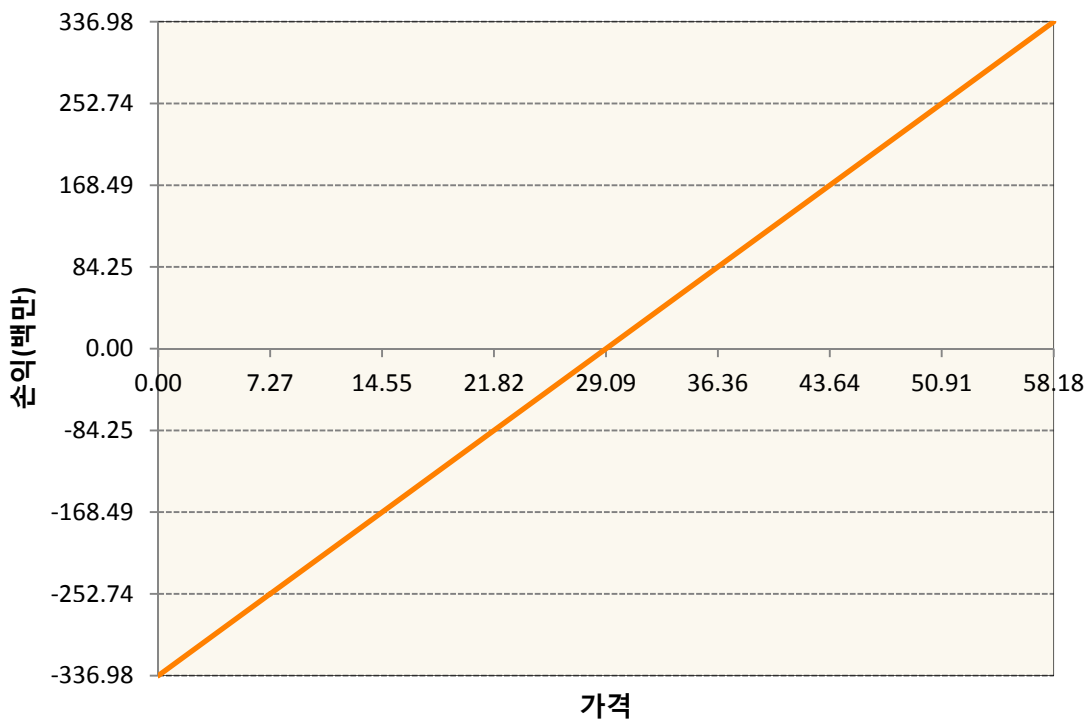
1. 계약금액

(단위:백만원)

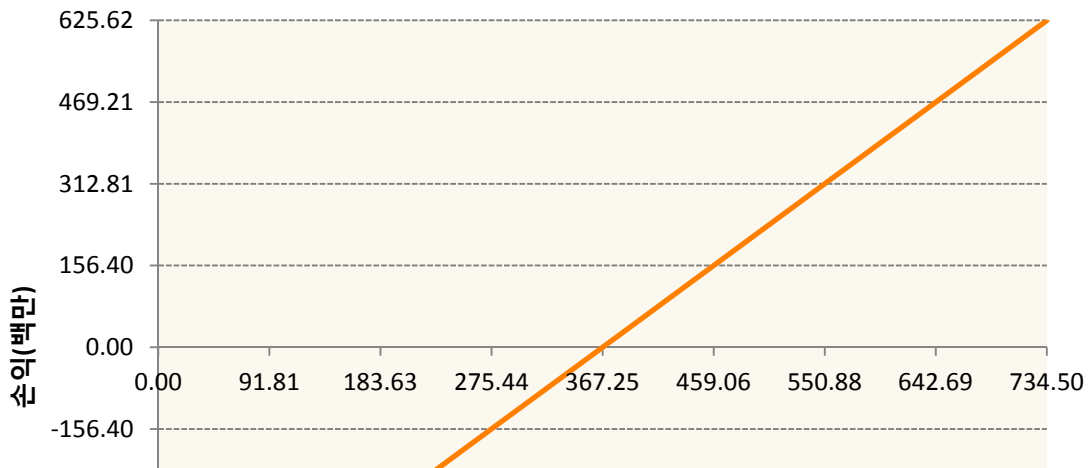
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,211	57	3,154	

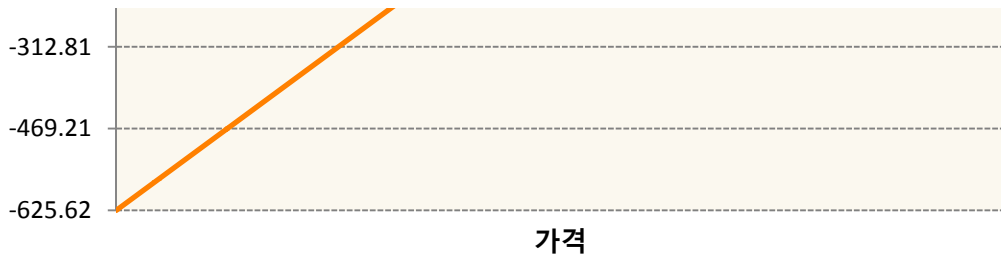
2. 만기시점의 손익구조

BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19

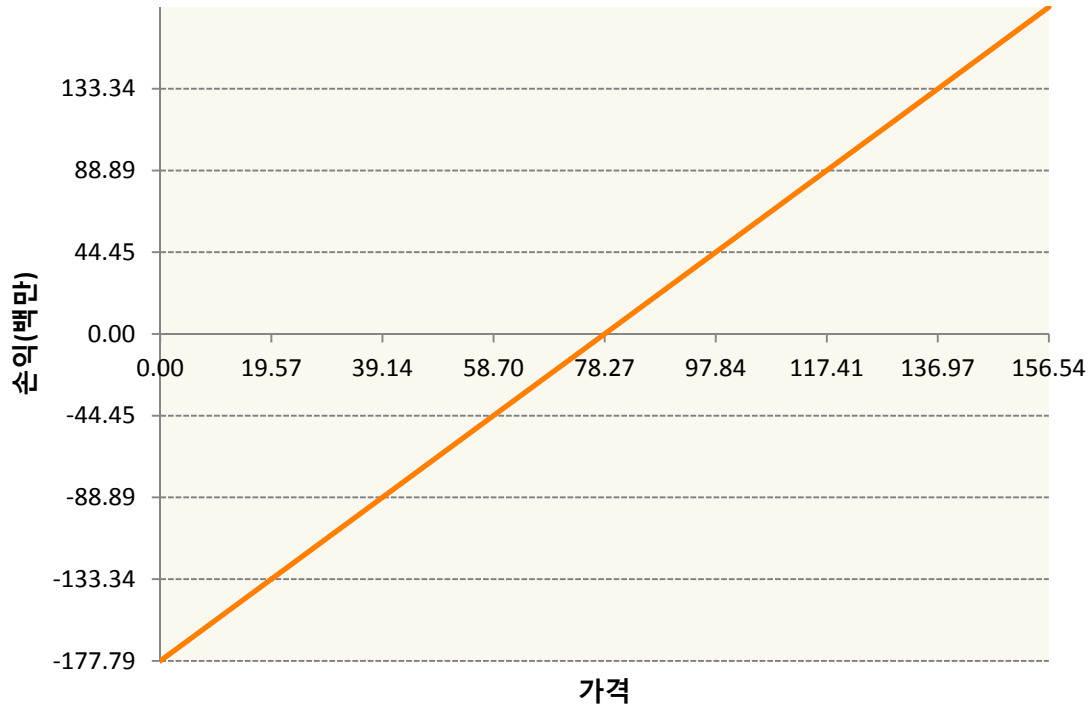


CN9-CORN FUTURE Jul19

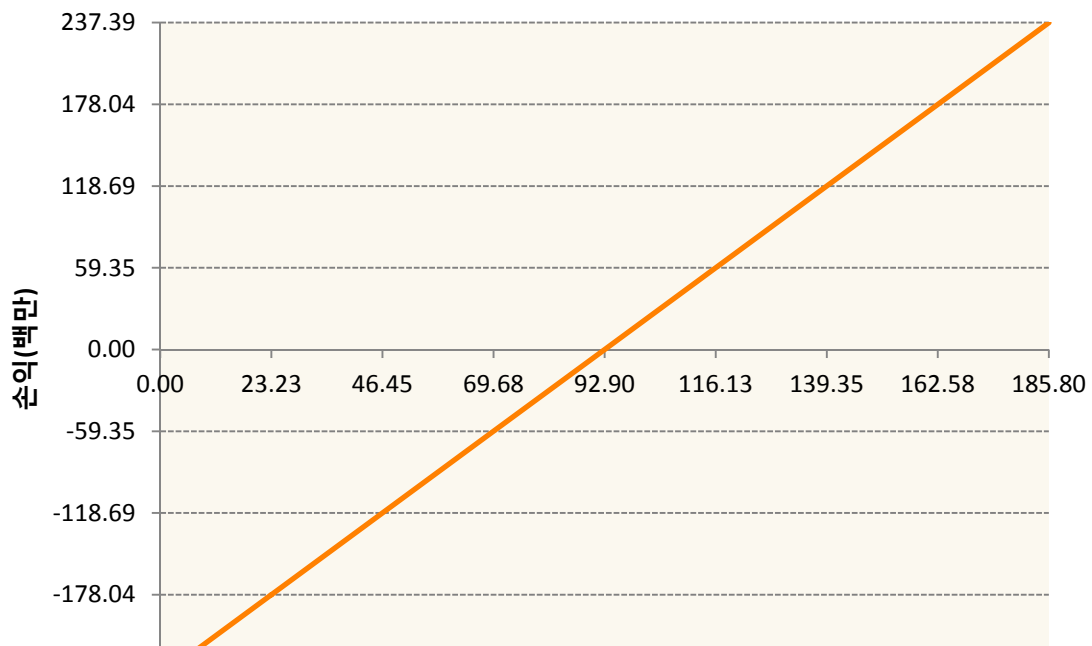


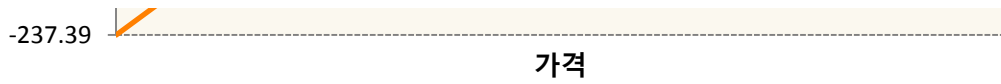


CTN9-COTTON NO.2 FUTR Jul19

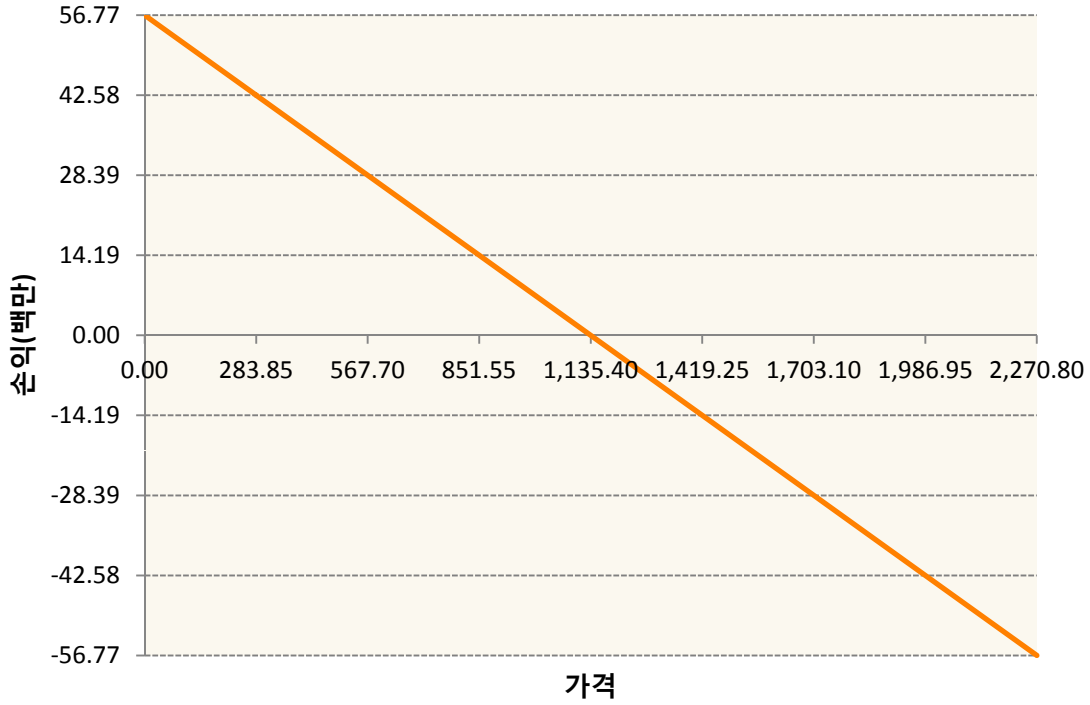


KCN9-COFFEE 'C' FUTURE Jul19

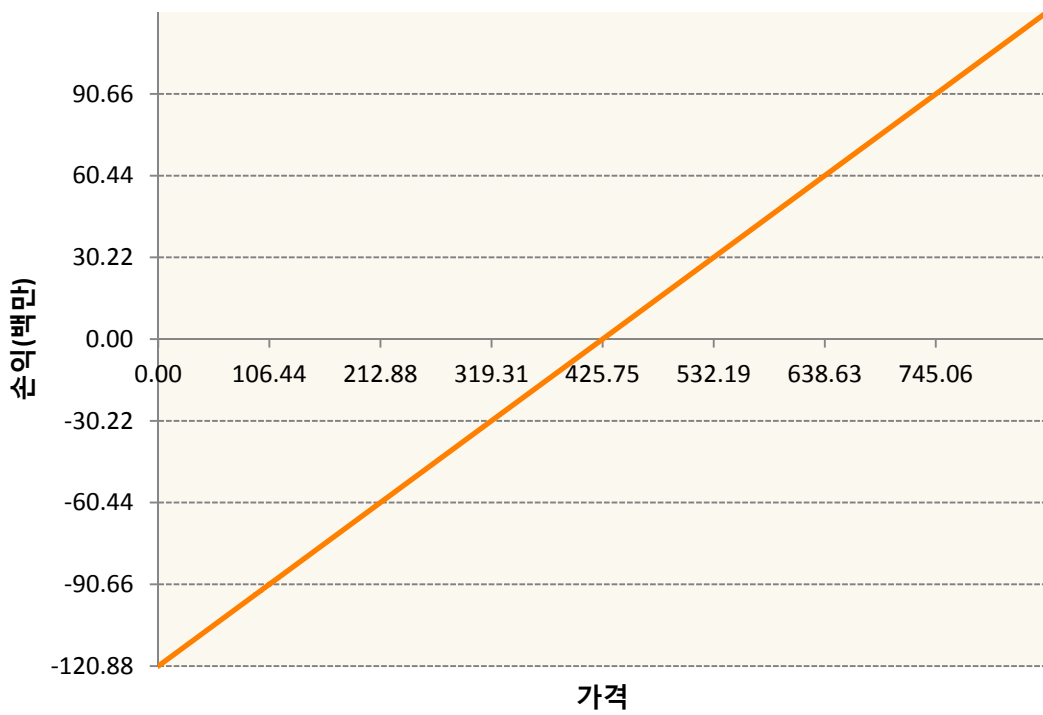




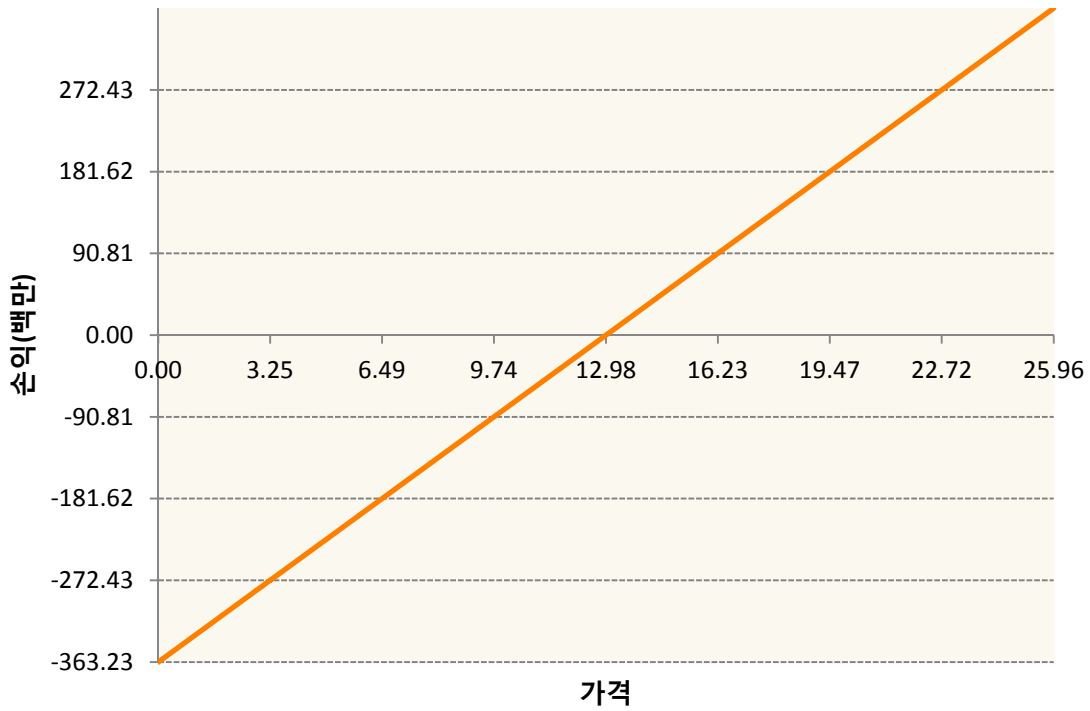
KR4175P50009-2019-05 달러선물



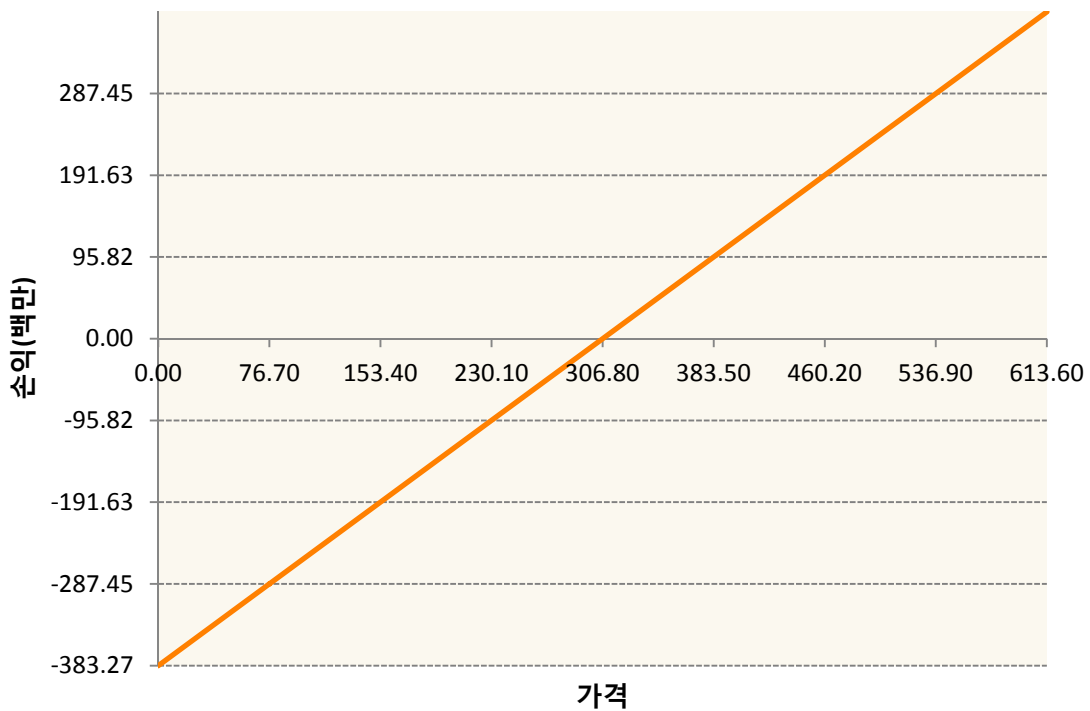
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

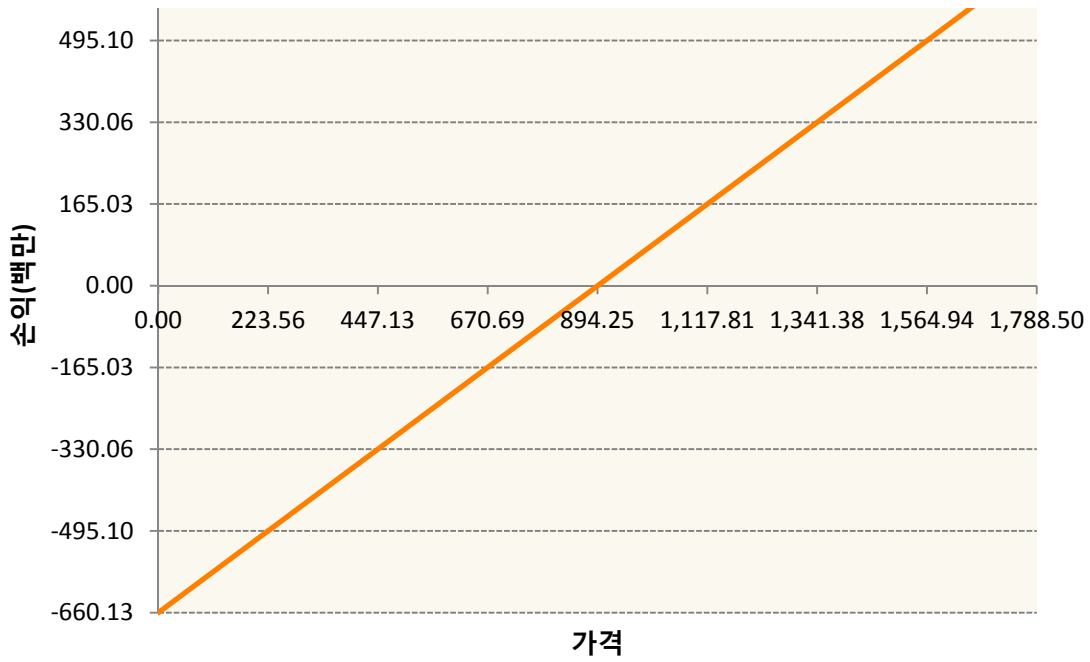


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19

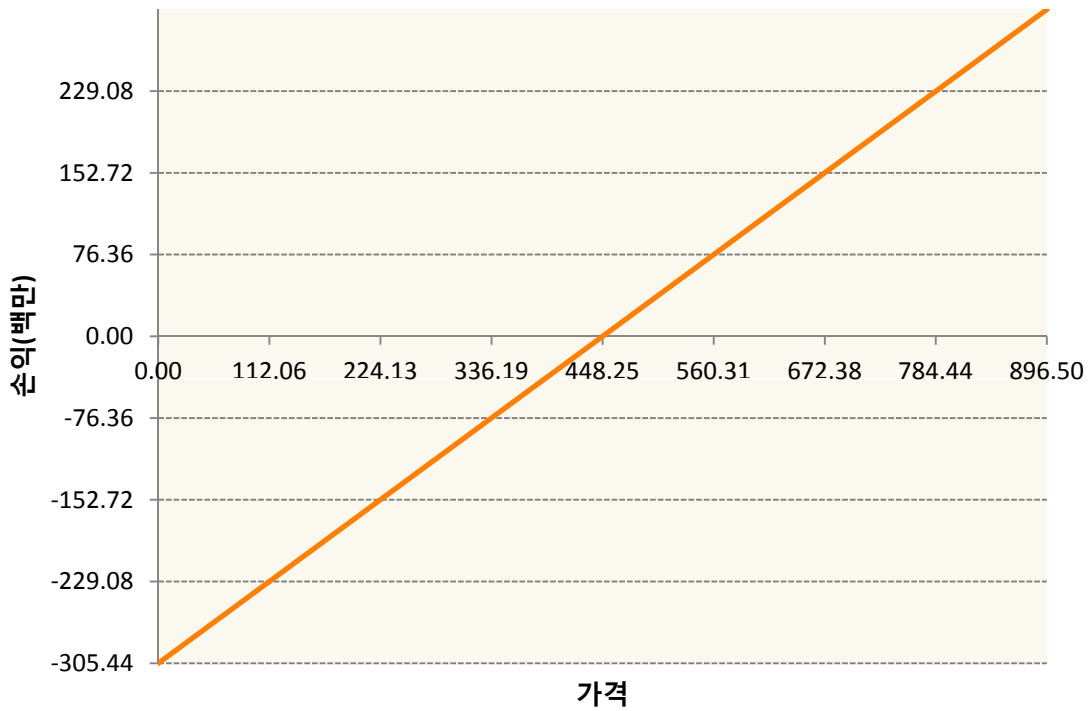


SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





WN9-WHEAT FUTURE(CBT) Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON9	SOYBEAN OIL FUTR Jul19	27
CN9	CORN FUTURE Jul19	50
CTN9	COTTON NO.2 FUTR Jul19	14
KCN9	COFFEE 'C' FUTURE Jul19	19
KR4175P500	2019-05 달러선물	5

KWN9	KC HRW WHEAT FUT Jul19	10
SBN9	SUGAR #11 (WORLD) Jul19	29
SMN9	SOYBEAN MEAL FUTR Jul19	31
SN9	SOYBEAN FUTURE Jul19	53
WN9	WHEAT FUTURE(CBT) Jul19	24

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

(단위:백만원)

259