

공시일	2019-04-23
기준일	2019-04-22

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	2019-04-23
기준일	2019-04-22

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	2019-04-23
기준일	2019-04-22

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)	358
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	99
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	167

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

981

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-04-23
기준일	2019-04-22

유로인덱스모(주식-파생형)

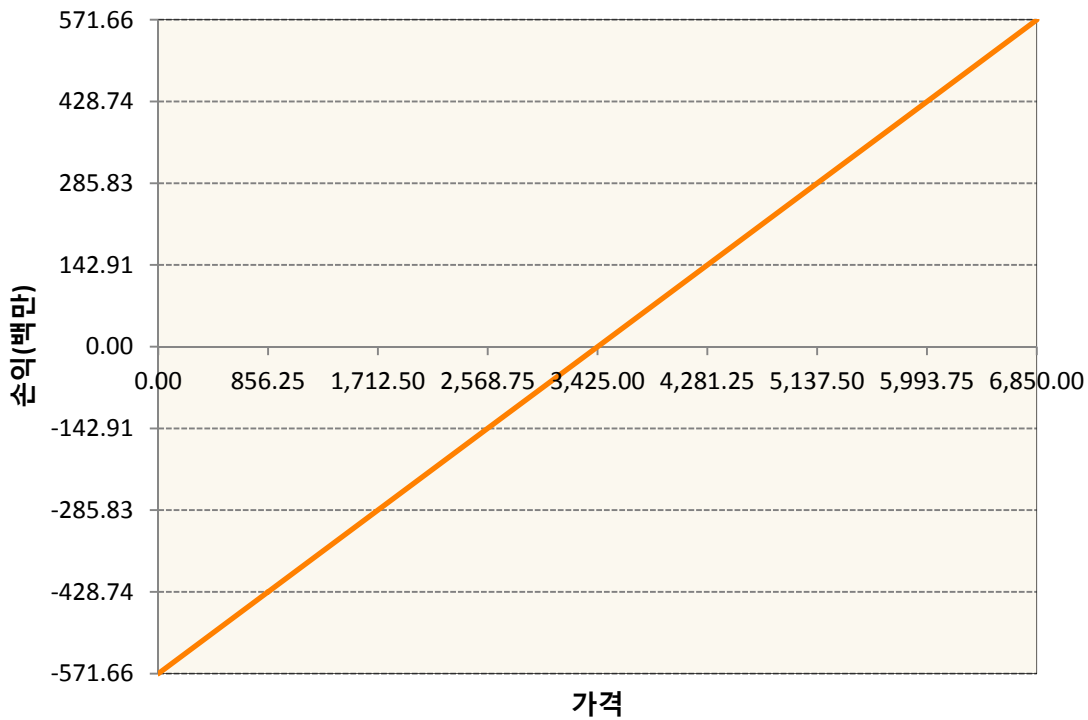
1. 계약금액

(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	2019-04-23
기준일	2019-04-22

차이나인덱스모(주식-파생형)

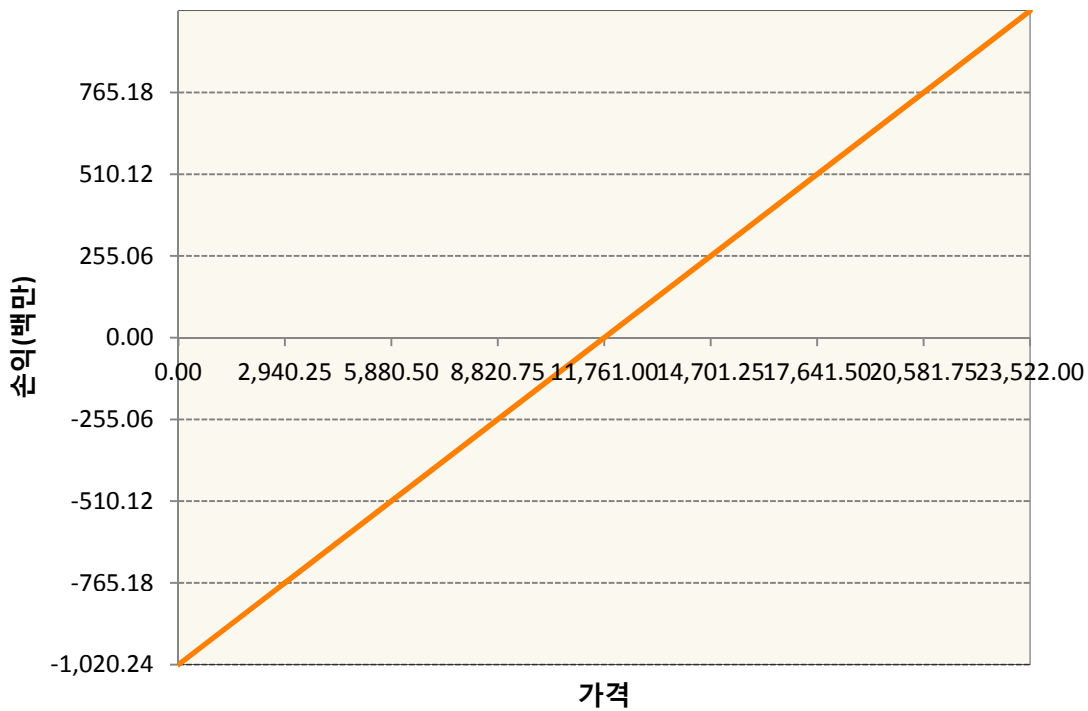
1. 계약금액

(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

HCJ9-HSCEI Futures Apr19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

84

공시일	2019-04-23
기준일	2019-04-22

커버드콜모(주식혼합-파생형)

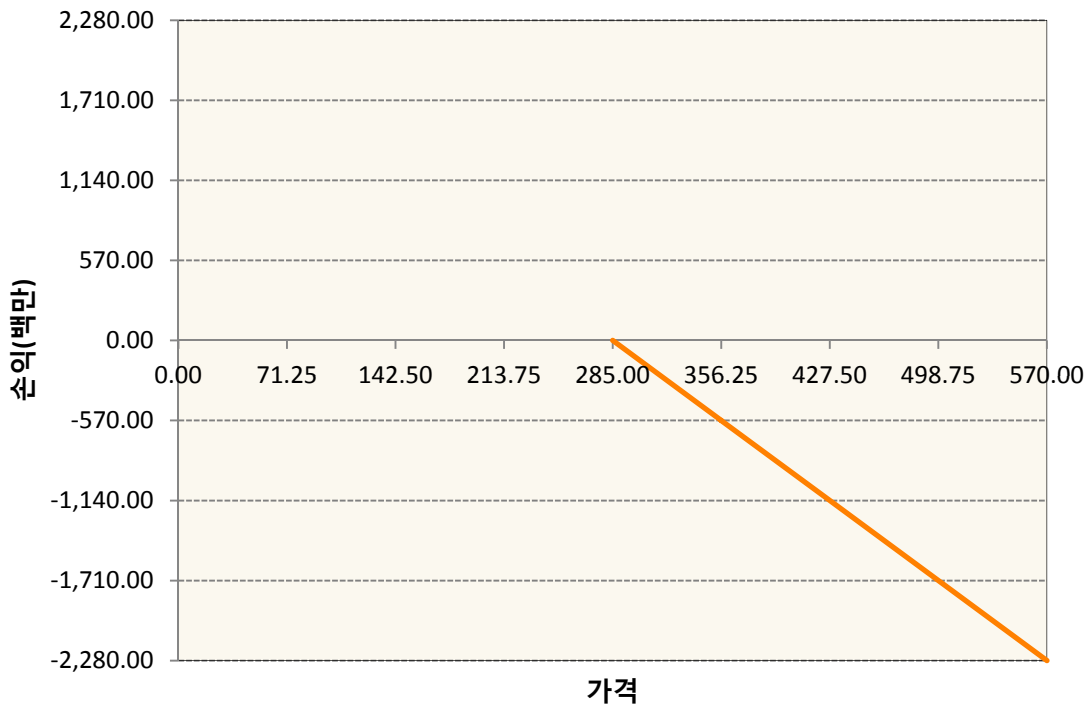
1. 계약금액

(단위:백만원)

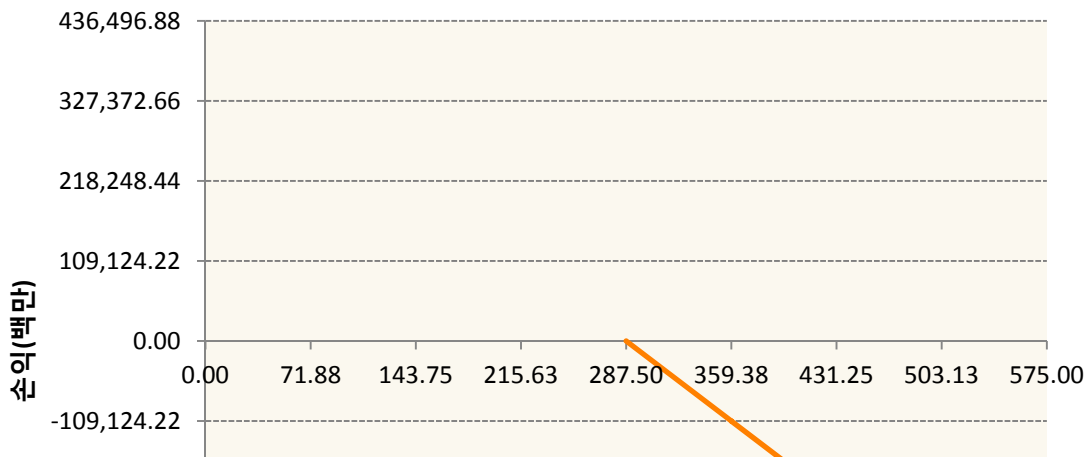
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	672,214	-672,214	장내

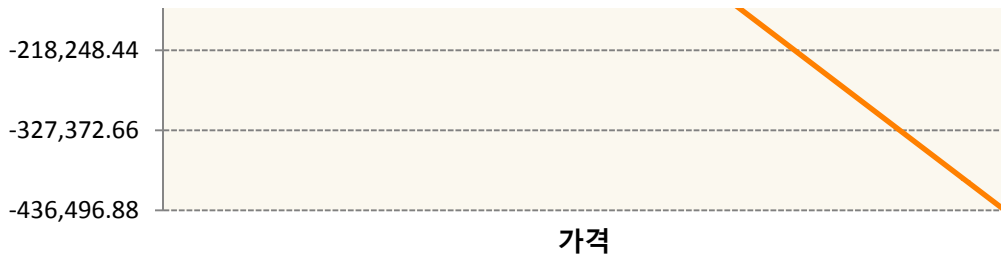
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P52850-2019-05 콜285

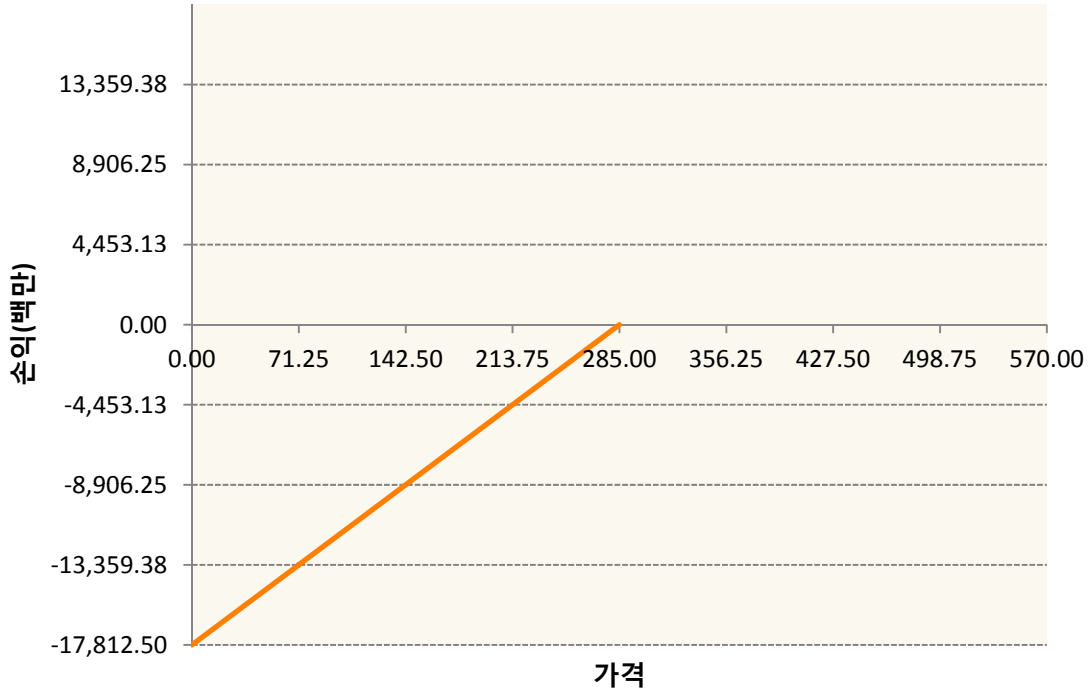


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

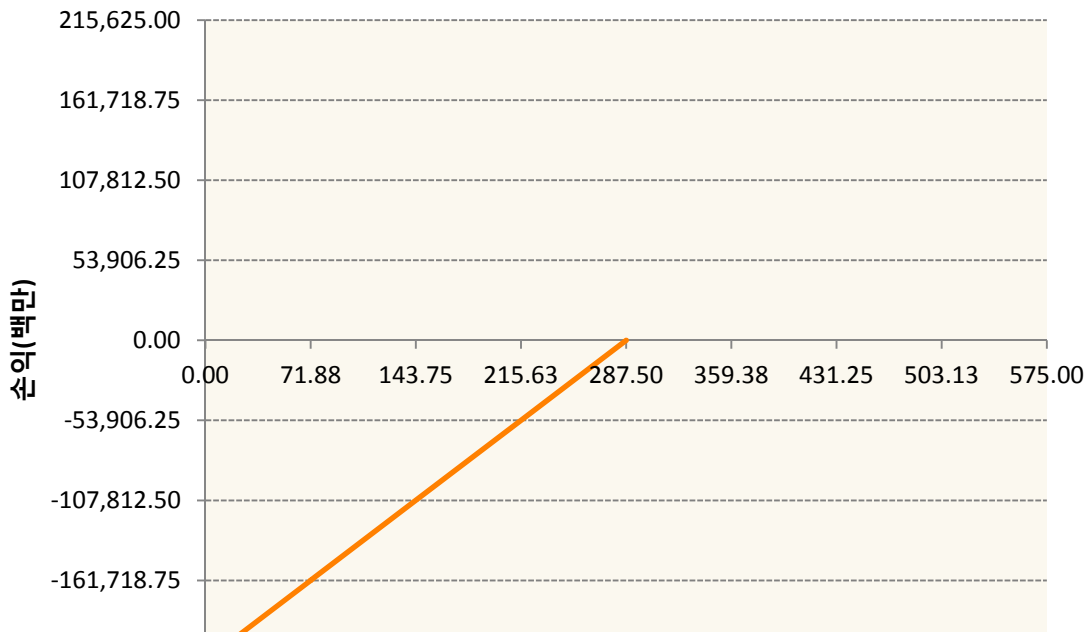




KR4301P52858-2019-05 풋285



KR4301P52874-2019-05 풋287.5



-215,625.00

가격

3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P52850 2019-05 콜285								147
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	49	49	48	47	46	45	43	
-5.33%	46	45	43	41	38	36	33	
-2.67%	36	33	30	26	23	19	16	
0%	12	8	4	0	-4	-8	-12	
2.67%	-29	-32	-35	-39	-42	-45	-49	
5.33%	-82	-83	-85	-87	-90	-92	-95	
8.00%	-140	-141	-142	-143	-144	-145	-147	
KR4201P52876 2019-05 콜287.5								26,424
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	7,597	7,535	7,438	7,303	7,129	6,917	6,668	
-5.33%	7,259	7,025	6,739	6,406	6,031	5,619	5,176	
-2.67%	5,868	5,345	4,789	4,208	3,606	2,987	2,355	
0%	2,196	1,466	733	0	-734	-1,469	-2,204	
2.67%	-4,535	-5,193	-5,867	-6,553	-7,247	-7,950	-8,658	
5.33%	-13,886	-14,281	-14,726	-15,212	-15,733	-16,282	-16,855	
8.00%	-24,710	-24,874	-25,090	-25,358	-25,672	-26,029	-26,424	
KR4301P52858 2019-05 풋285								1,210
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,208	-1,208	-1,208	-1,209	-1,209	-1,209	-1,210	
-5.33%	-733	-734	-735	-737	-740	-744	-748	
-2.67%	-277	-285	-295	-305	-316	-328	-340	
0%	48	32	16	0	-16	-32	-48	
2.67%	156	149	142	133	123	113	102	
5.33%	168	167	166	164	162	158	154	
8.00%	168	168	168	168	168	167	166	
KR4301P52874 2019-05 풋287.5								15,395
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-15,386	-15,386	-15,386	-15,387	-15,388	-15,391	-15,395	
-5.33%	-9,676	-9,679	-9,687	-9,699	-9,718	-9,744	-9,778	
-2.67%	-4,059	-4,118	-4,191	-4,276	-4,373	-4,480	-4,596	
0%	563	377	189	0	-190	-380	-570	
2.67%	2,641	2,517	2,382	2,238	2,087	1,930	1,769	

5.33%	2,987	2,967	2,937	2,896	2,844	2,780	2,706
8.00%	3,005	3,004	3,002	2,997	2,988	2,975	2,956

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

(단위:백만원)

46,978

공시일	2019-04-23
기준일	2019-04-22

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

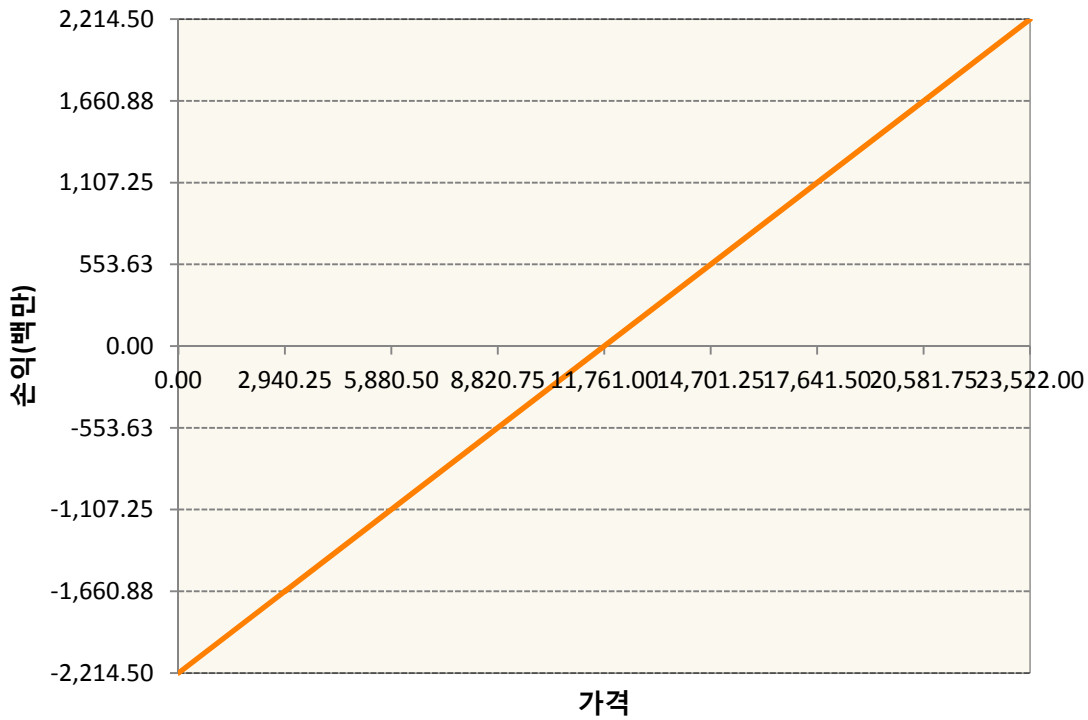
1. 계약금액

(단위:백만원)

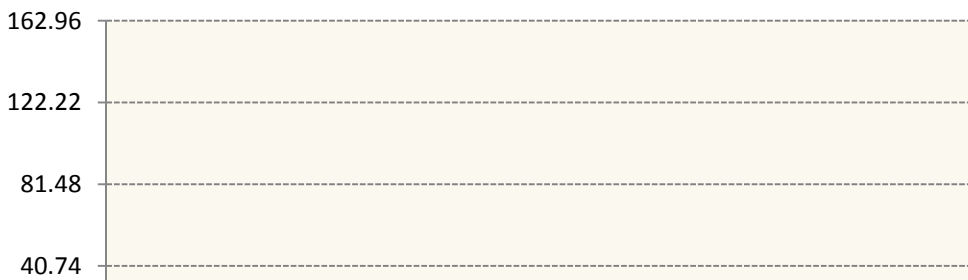
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,215	0	2,215	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,587	-5,587	장내
누계	통화	선도	0	3,056	-3,056	장외

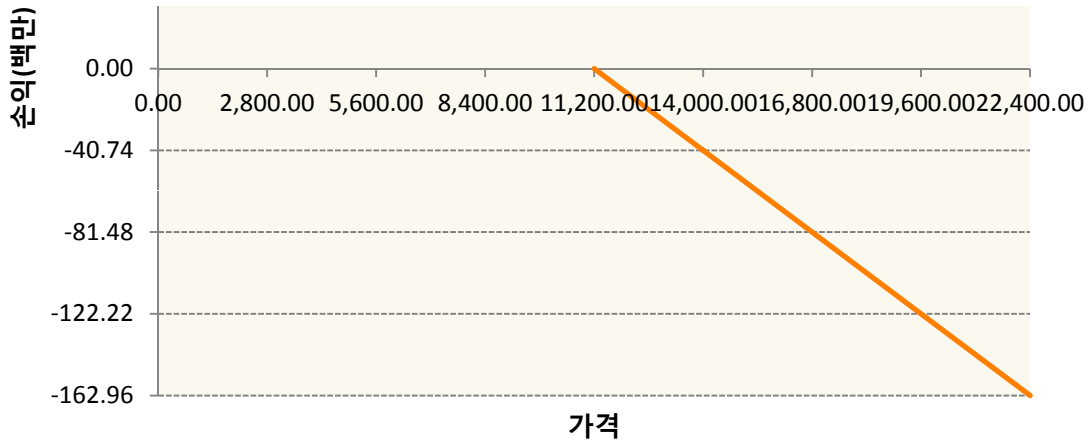
2. 만기시점의 손익구조

HCJ9-HSCEI Futures Apr19

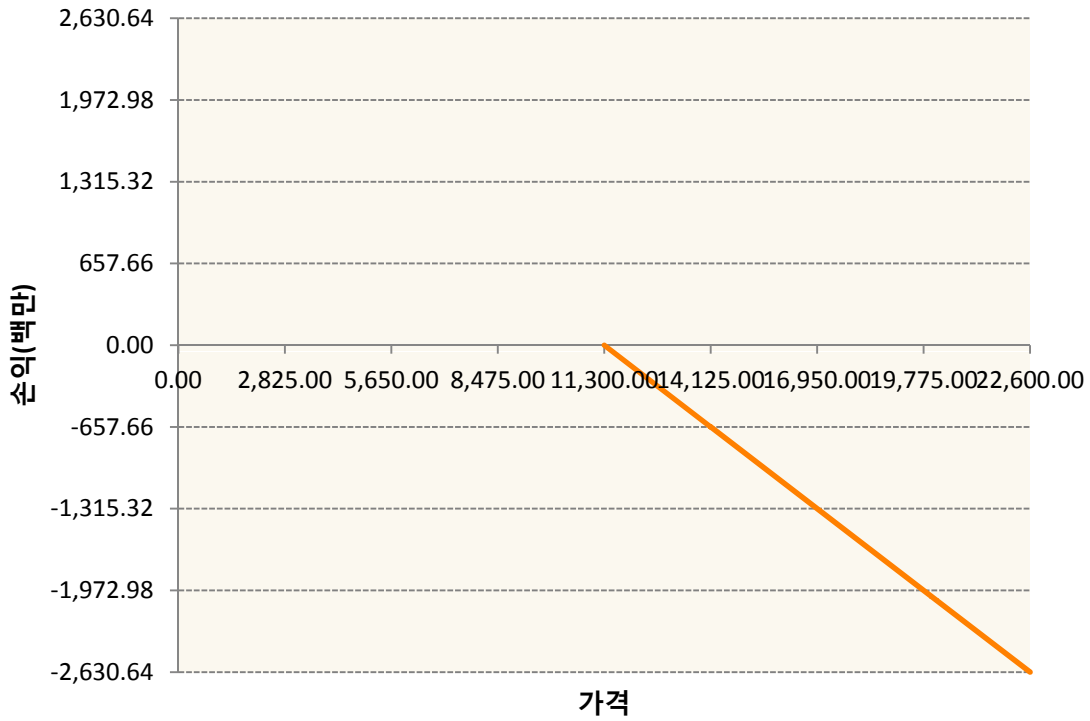


OHHIJ9-C112-HSCEI

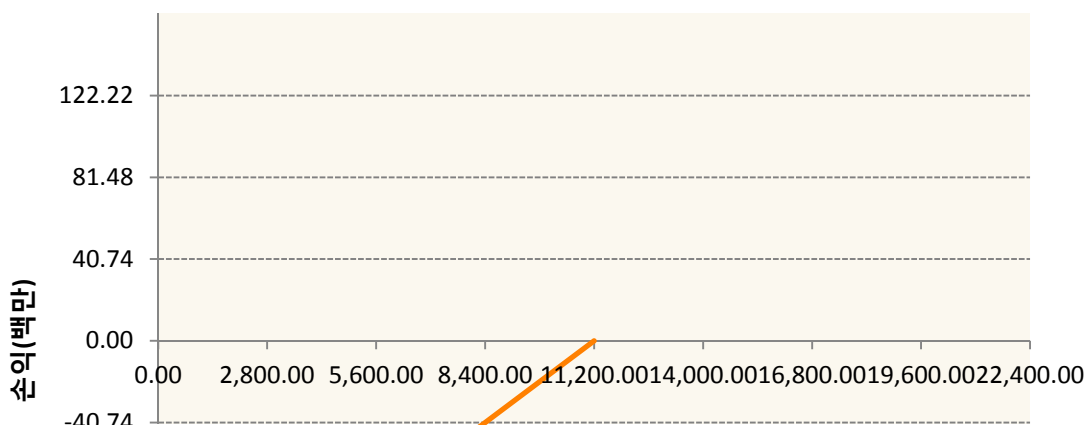


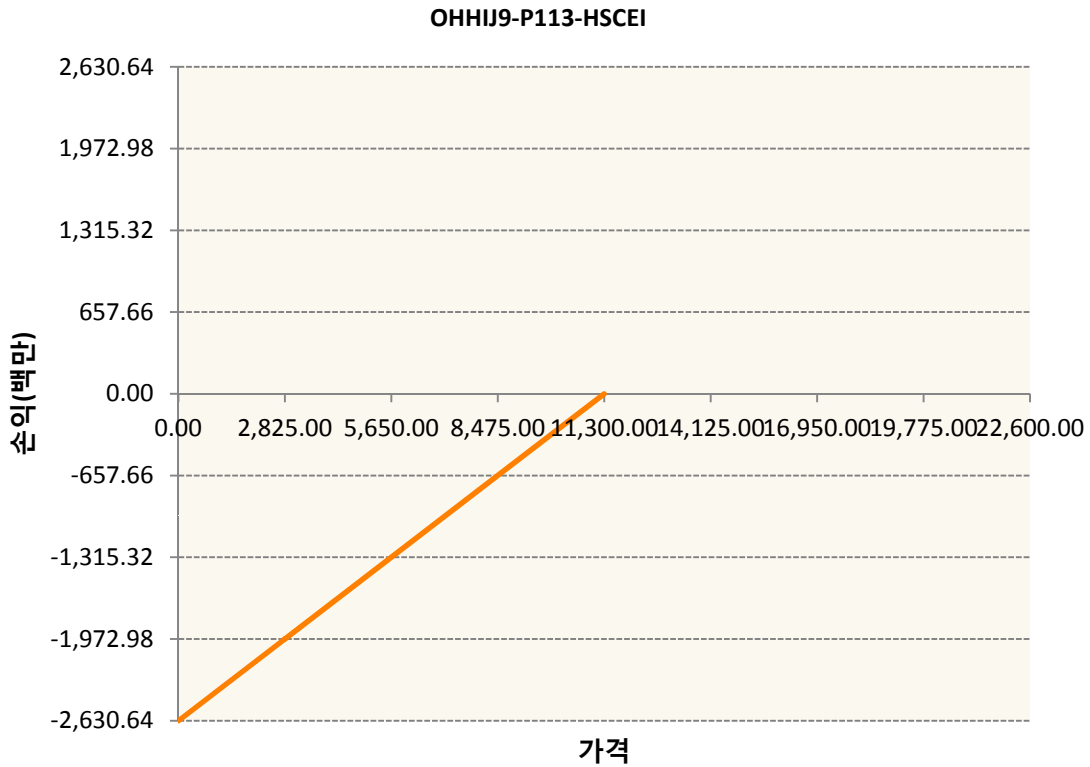


OHHIJ9-C113-HSCEI



OHHIJ9-P112-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	221
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)
	722

공시일	2019-04-23
기준일	2019-04-22

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

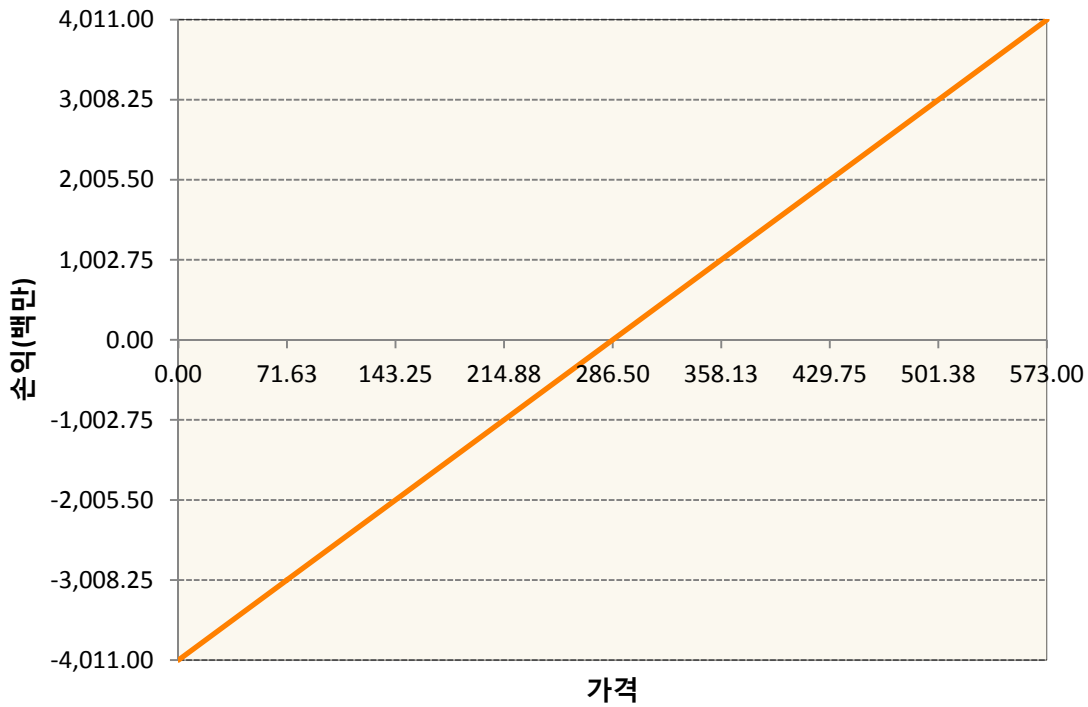
1. 계약금액

(단위:백만원)

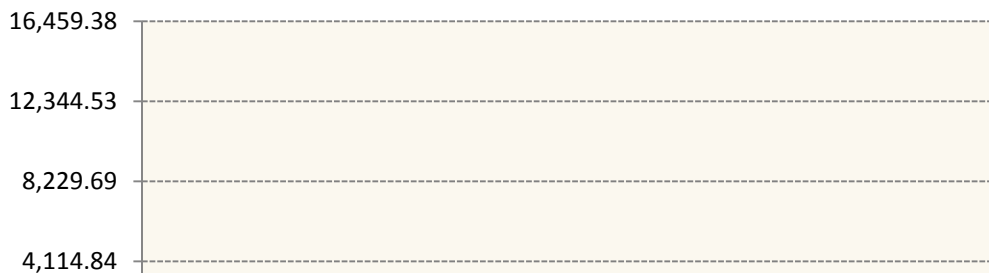
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	213	0	213	장내
누계	유가증권	선물	4,011	0	4,011	장내
누계	유가증권	스왑	35,836	0	35,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	32,479	-32,479	장내

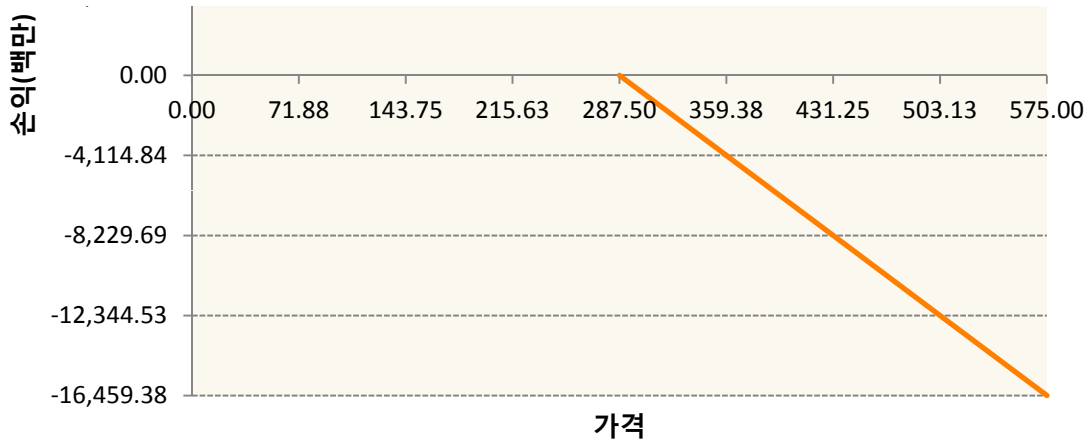
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

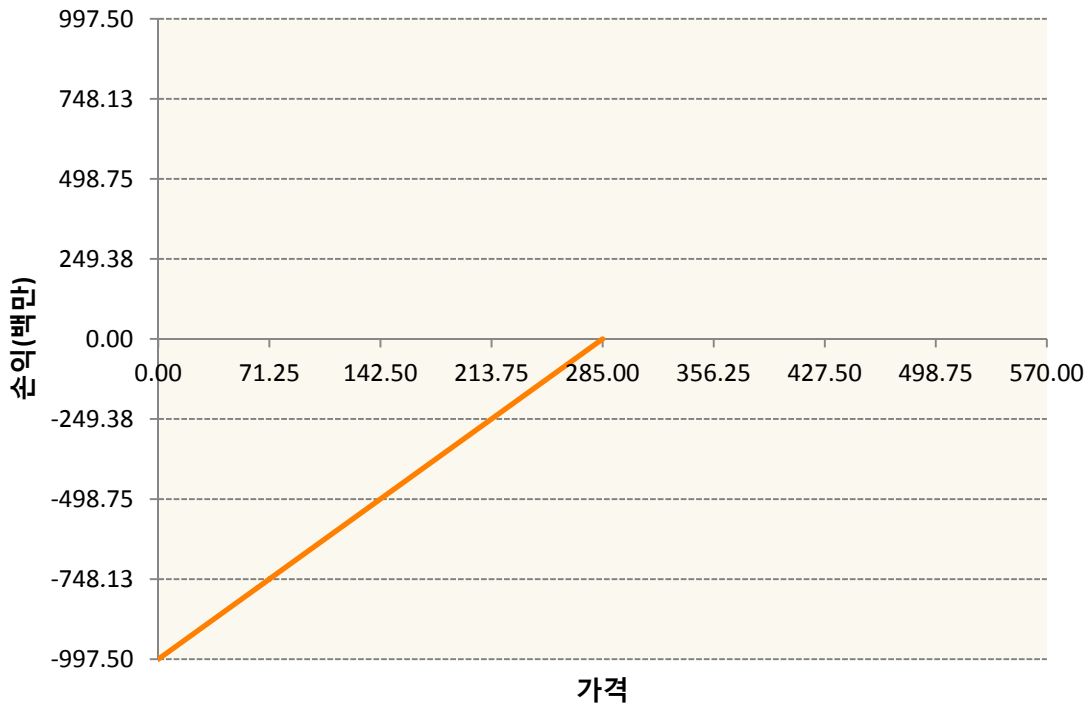


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

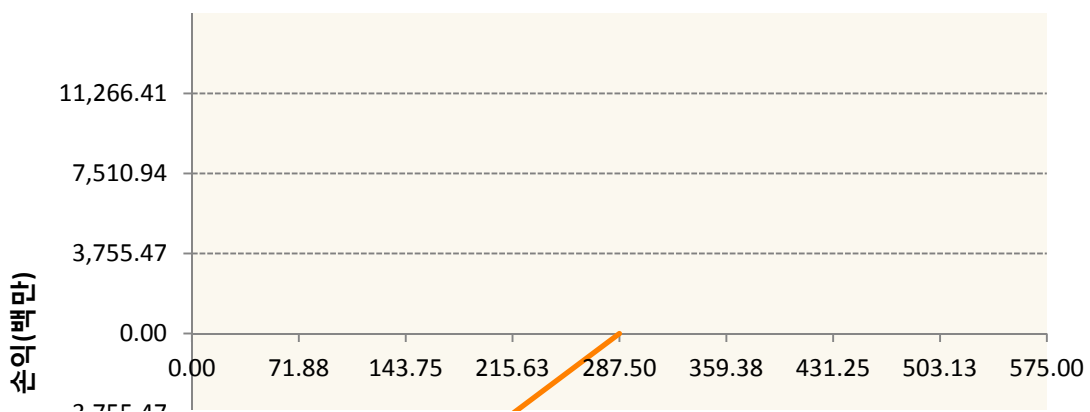


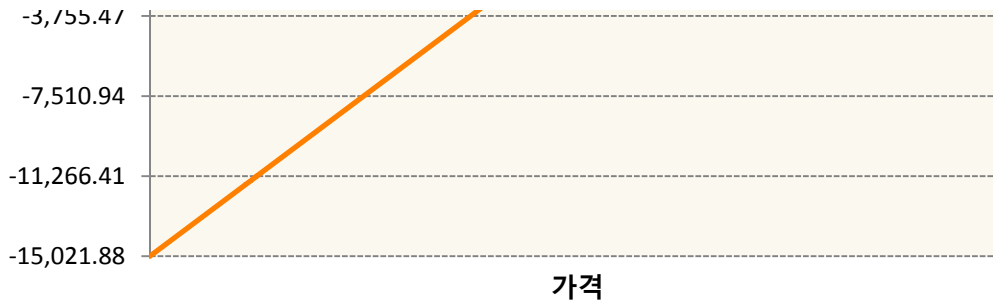


KR4301P52858-2019-05 풋285



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						996
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

공시일	2019-04-23
기준일	2019-04-22

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

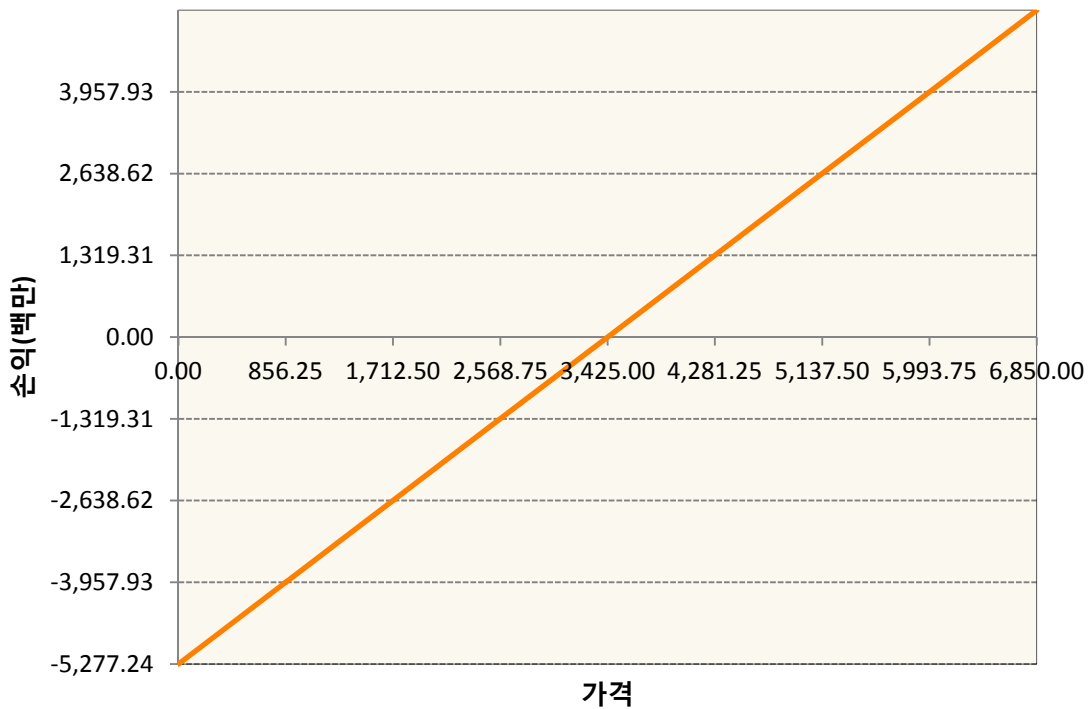
1. 계약금액

(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	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,277	0	5,277	
누계	유가증권	스왑	63,229	0	63,229	장외
누계	통화	선도	0	17,968	-17,968	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	411
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	821
FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E	205
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	422

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

(단위:백만원)

1,026

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	2019-04-23
기준일	2019-04-22

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

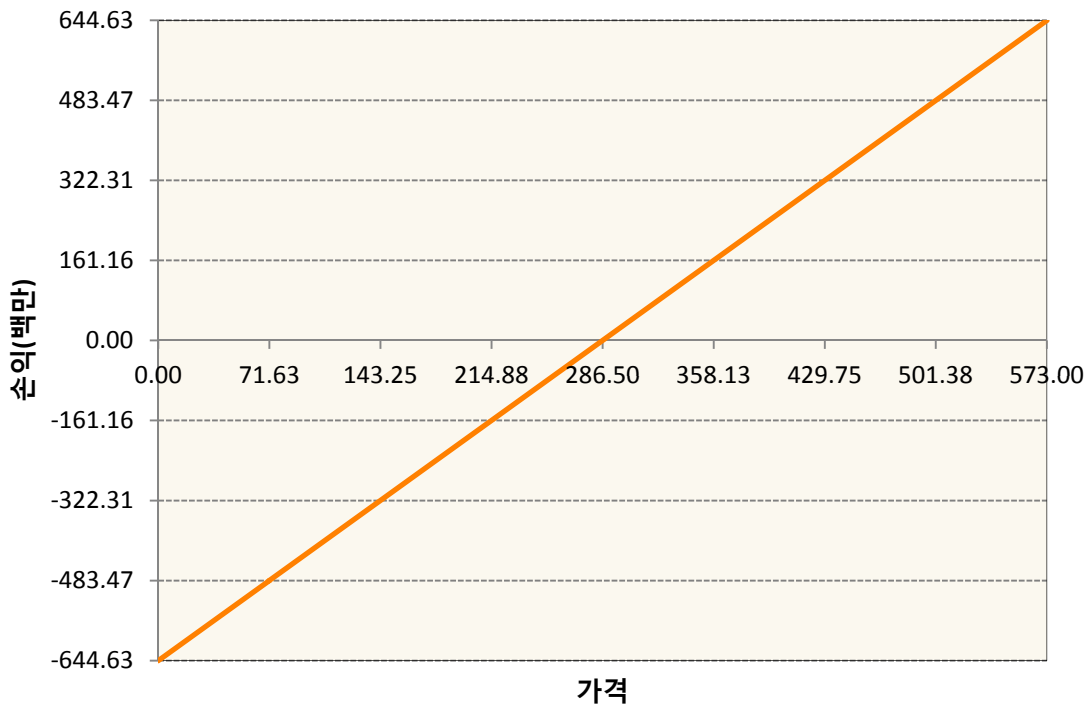
1. 계약금액

(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	2019-04-23
기준일	2019-04-22

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

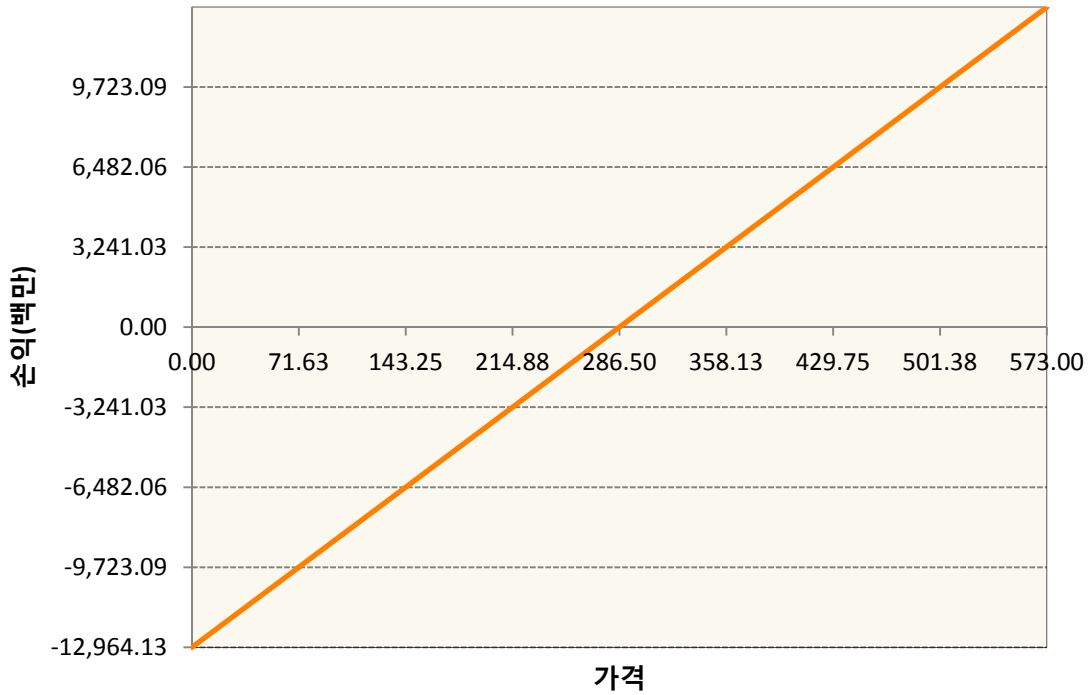
1. 계약금액

(단위:백만원)

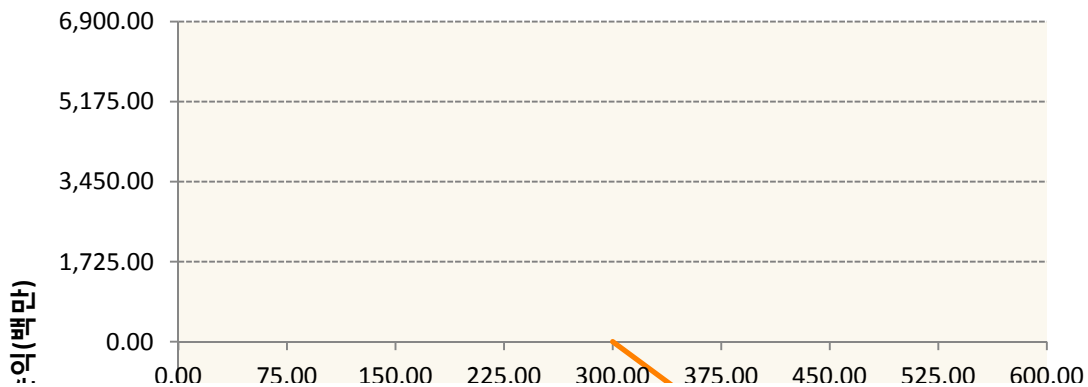
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,964	0	12,964	장내
누계	유가증권	옵션	1,366	24,294	-22,928	장내

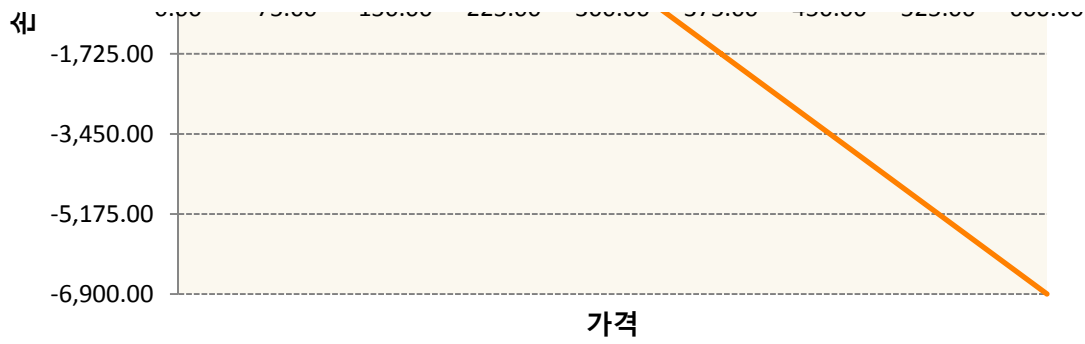
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

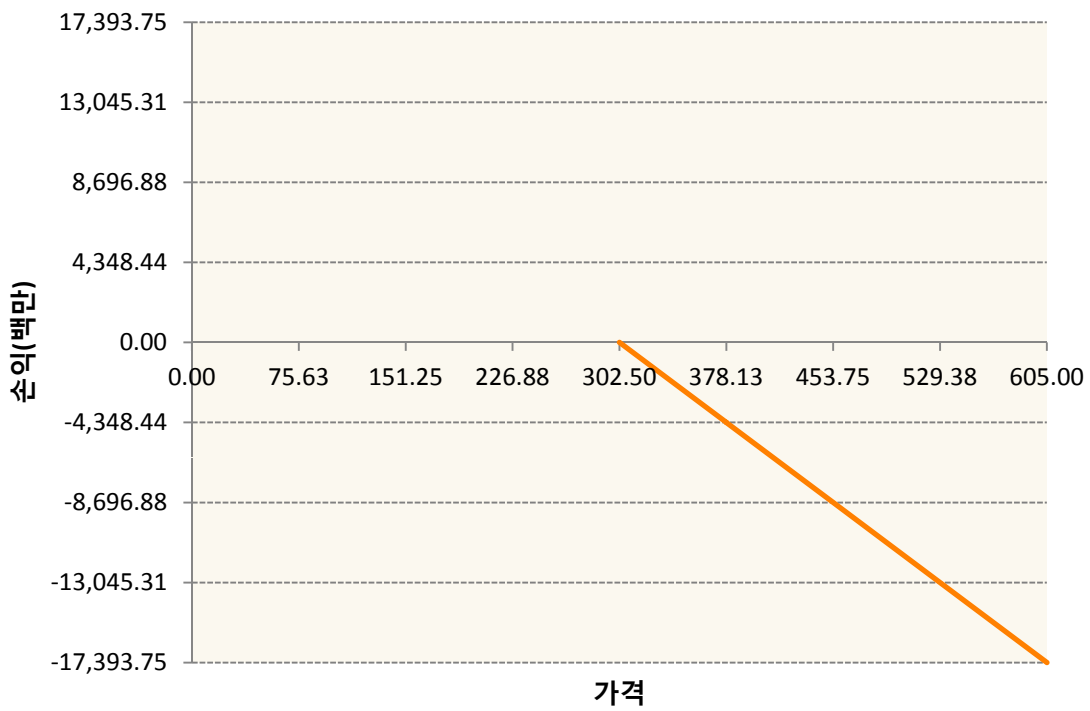


KR4201P53007-2019-05 콜300

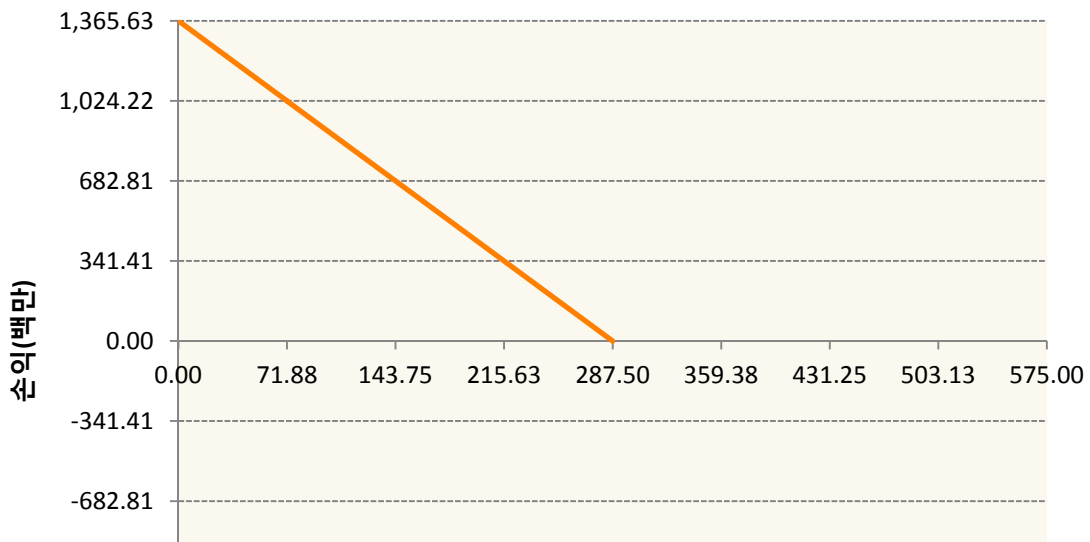


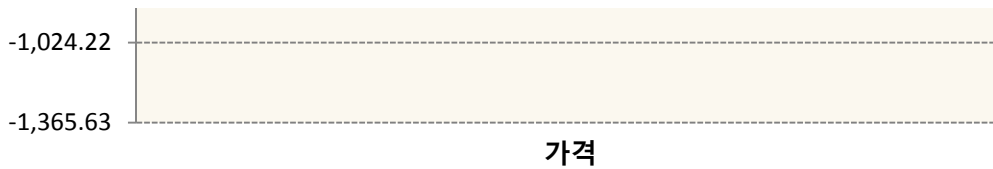


KR4201P53023-2019-05 콜302.5



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						264
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	32	32	31	31	31	30	29	
-5.33%	31	31	30	29	27	25	22	
-2.67%	29	27	25	21	17	12	7	
0%	19	13	7	0	-8	-16	-24	
2.67%	-14	-24	-34	-45	-55	-66	-77	
5.33%	-87	-98	-110	-122	-133	-145	-157	
8.00%	-204	-213	-222	-232	-243	-253	-264	
KR4201P53023		2019-05 콜302.5						589
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	58	58	58	57	56	55	53	
-5.33%	58	57	56	54	51	46	41	
-2.67%	55	52	47	40	32	22	11	
0%	38	27	15	0	-16	-34	-53	
2.67%	-22	-44	-67	-91	-115	-141	-166	
5.33%	-168	-197	-226	-256	-285	-314	-344	
8.00%	-425	-451	-478	-505	-533	-561	-589	
KR4301P52874		2019-05 풋287.5						98
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	97	97	97	97	97	97	98	
-5.33%	61	61	61	61	62	62	62	
-2.67%	26	26	27	27	28	28	29	

0%	-4	-2	-1	0	1	2	4
2.67%	-17	-16	-15	-14	-13	-12	-11
5.33%	-19	-19	-19	-18	-18	-18	-17
8.00%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19

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

(단위:백만원)

1,546

공시일	2019-04-23
기준일	2019-04-22

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	3,732	0	3,732	

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	2019-04-23
기준일	2019-04-22

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	56,560	0	56,560	

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	2019-04-23
기준일	2019-04-22

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	116,604	0	116,604	
누계	통화	선도	0	122,472	-122,472	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	365
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	420
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	183
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	457
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	530
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	321
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	274
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E	46
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	274
FX21019J006 KRW/USD 10-05-19E	228
FX21019J007 KRW/USD 10-05-19E	73
FX21019J012 KRW/USD 20-05-19E	128
FX21019J013 KRW/USD 20-05-19E	18
FX21019J014 KRW/USD 20-05-19E	137
FX21019J015 KRW/USD 20-05-19E	137
FX21019J016 KRW/USD 17-05-19E	1,278
FX21019J017 KRW/USD 17-05-19E	1,370
FX21019J018 KRW/USD 18-06-19E	365
FX21019J020 KRW/USD 20-05-19E	493
FX21019J021 KRW/USD 20-05-19E	464
FX21019J022 KRW/USD 24-06-19E	913

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

(단위:백만원)

3,329

공시일	2019-04-23
기준일	2019-04-22

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

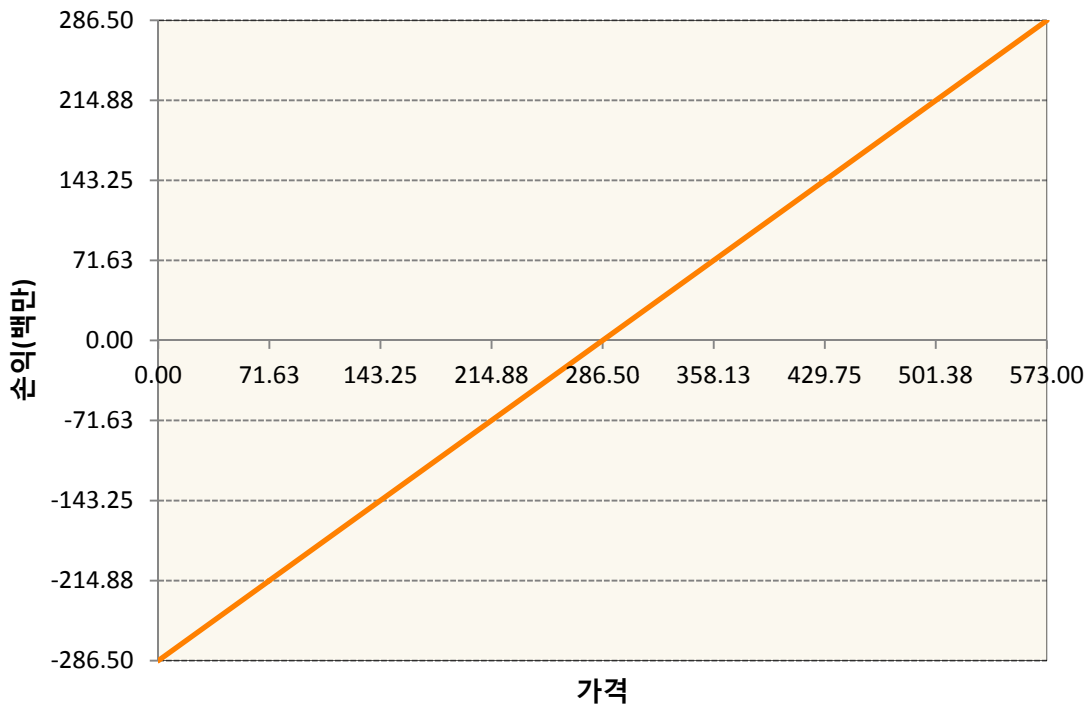
1. 계약금액

(단위:백만원)

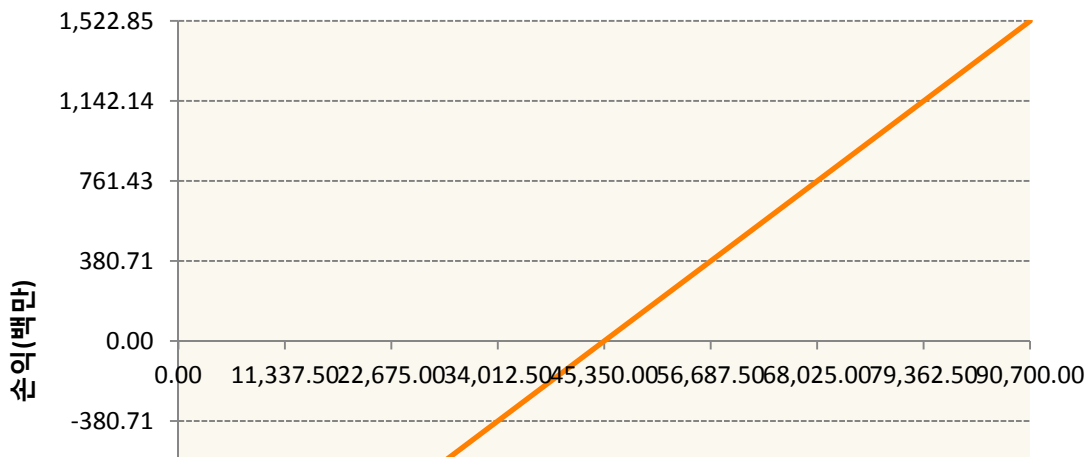
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,809	0	1,809	장내

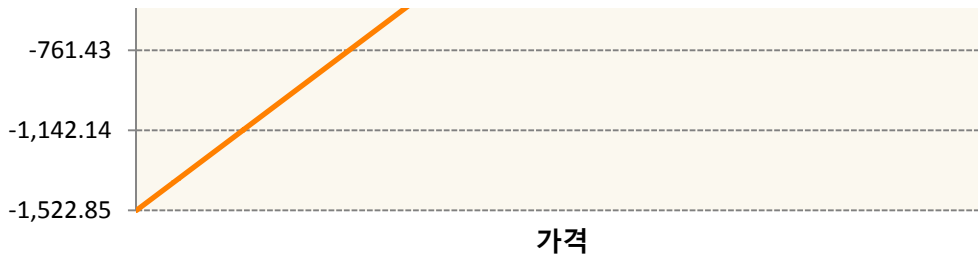
2. 만기시점의 손익구조

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	2019-04-23
기준일	2019-04-22

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

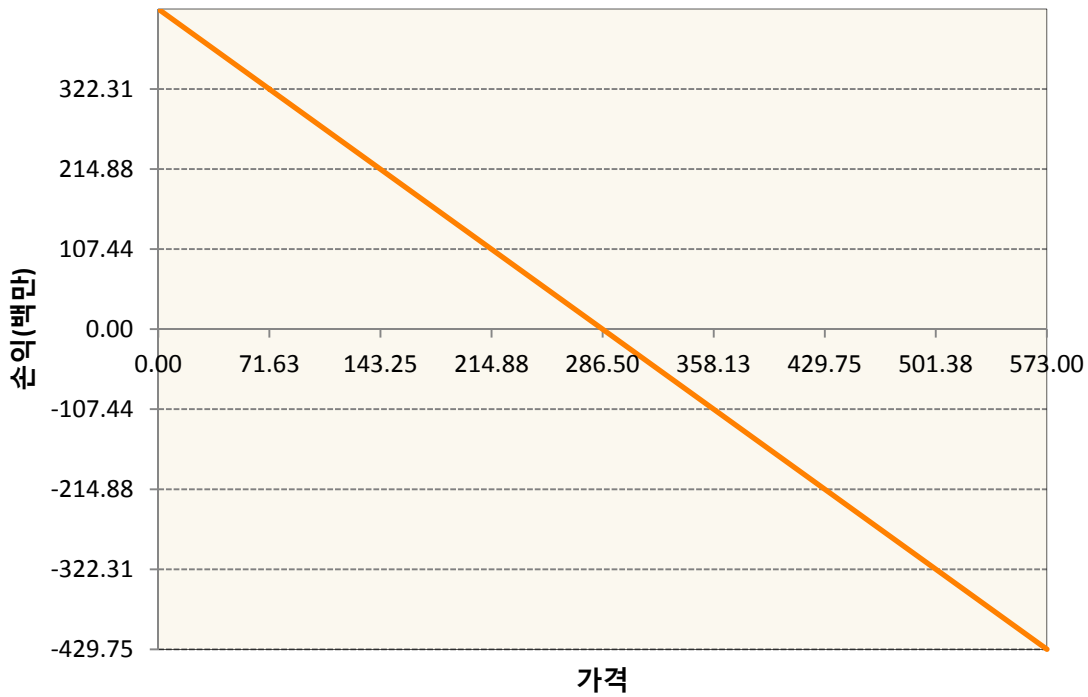
1. 계약금액

(단위:백만원)

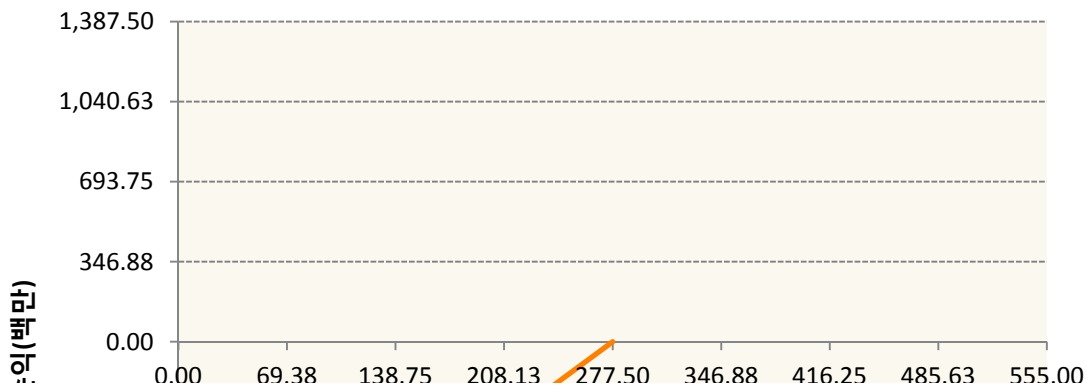
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	419	-419	장내
누계	유가증권	선물	0	430	-430	장내
누계	유가증권	옵션	0	2,858	-2,858	장내

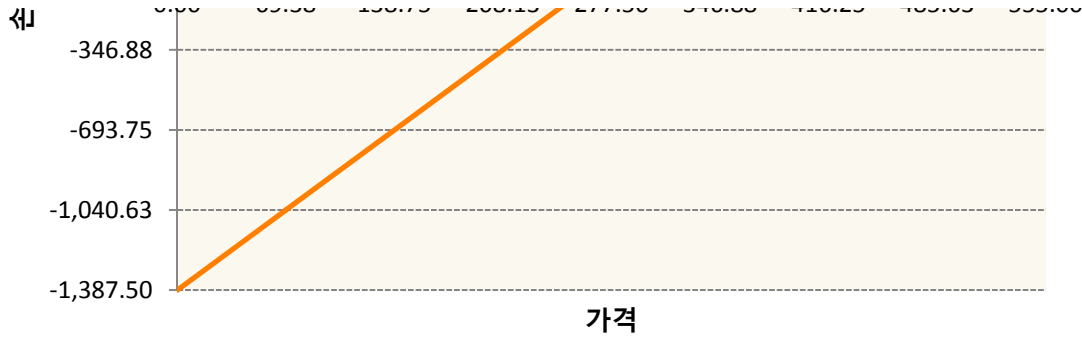
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

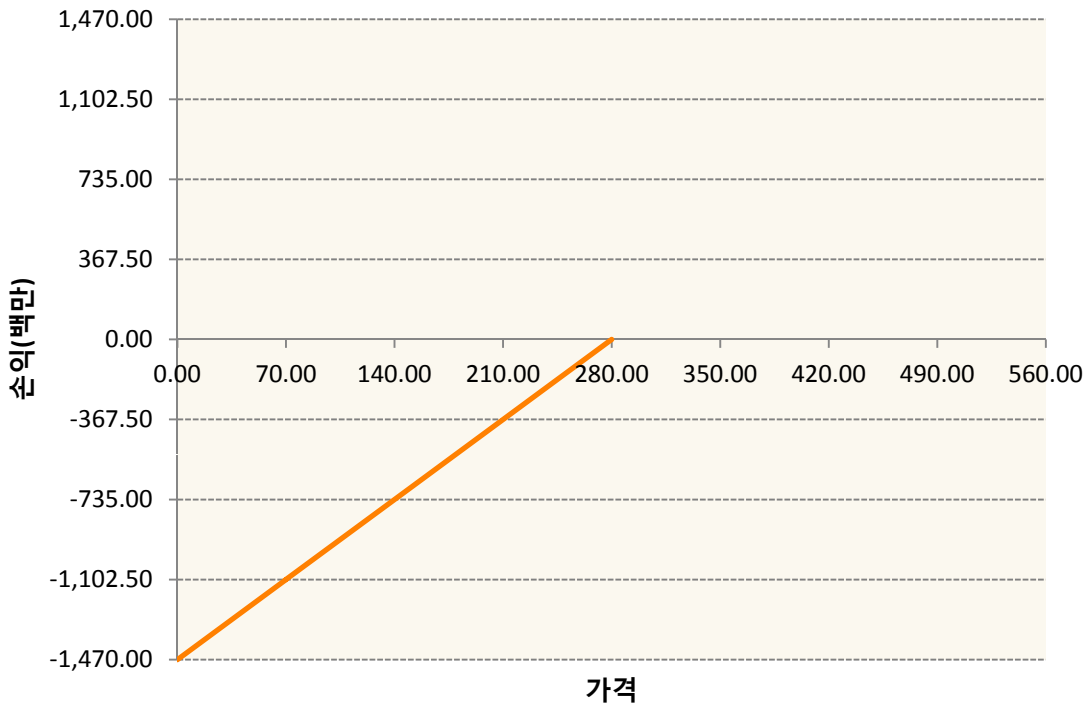


KR4301P52775-2019-05 풋277.5





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						71
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-70	-70	-70	-70	-70	-71	-71
-5.33%	-33	-34	-35	-35	-36	-37	-38
-2.67%	-7	-8	-9	-11	-12	-13	-14
0%	2	1	1	0	-1	-2	-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

85

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-84	-84	-84	-84	-84	-85	-85
-5.33%	-45	-45	-46	-46	-47	-47	-48
-2.67%	-12	-13	-15	-16	-17	-18	-20
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)

168

공시일	2019-04-23
기준일	2019-04-22

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

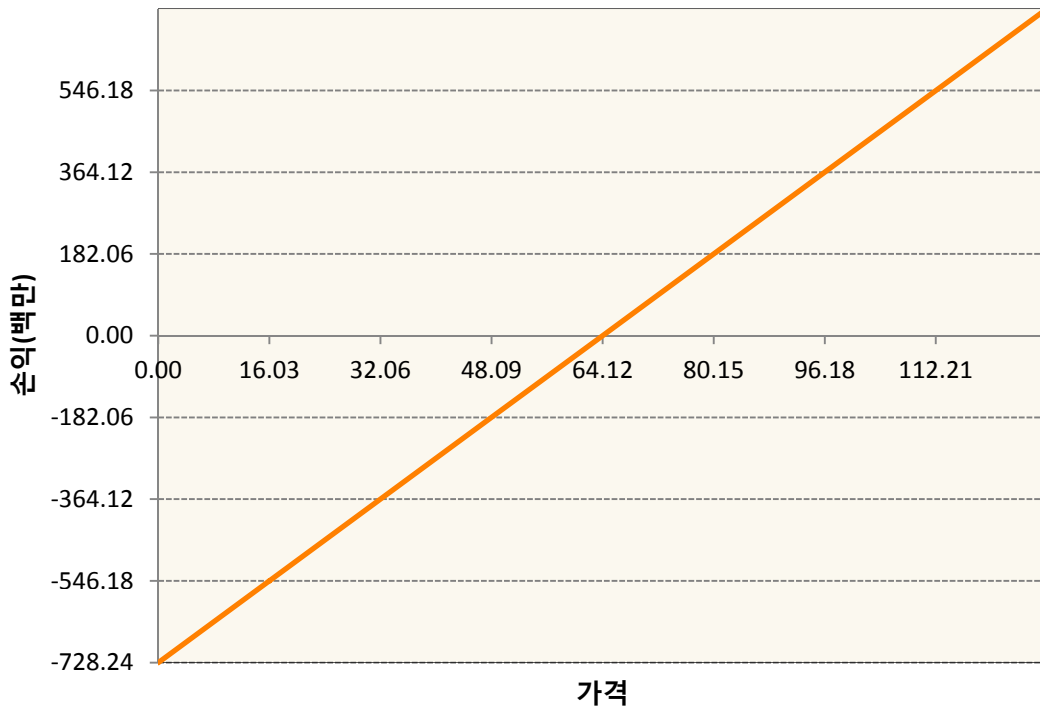
1. 계약금액

(단위:백만원)

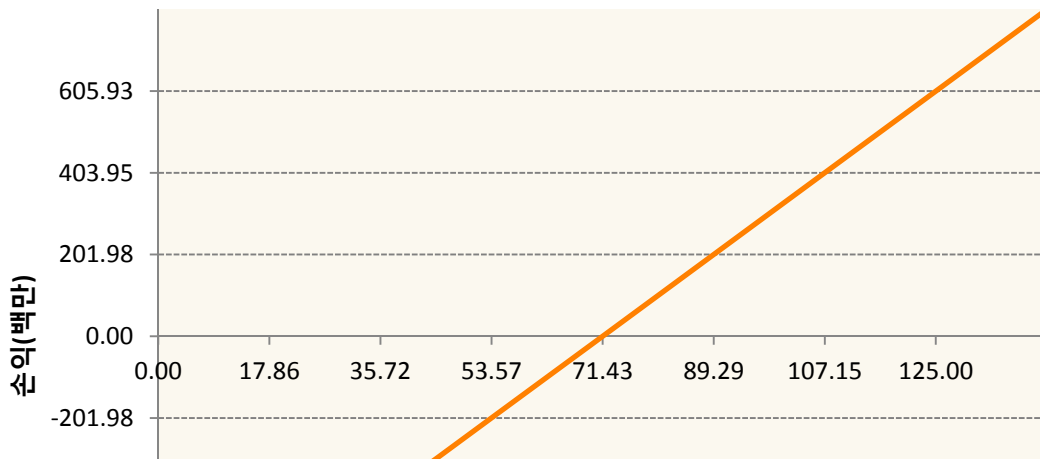
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,961	285	2,675	

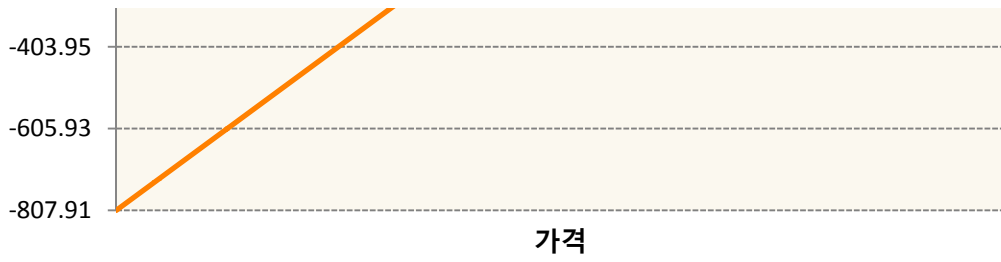
2. 만기시점의 손익구조

CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19

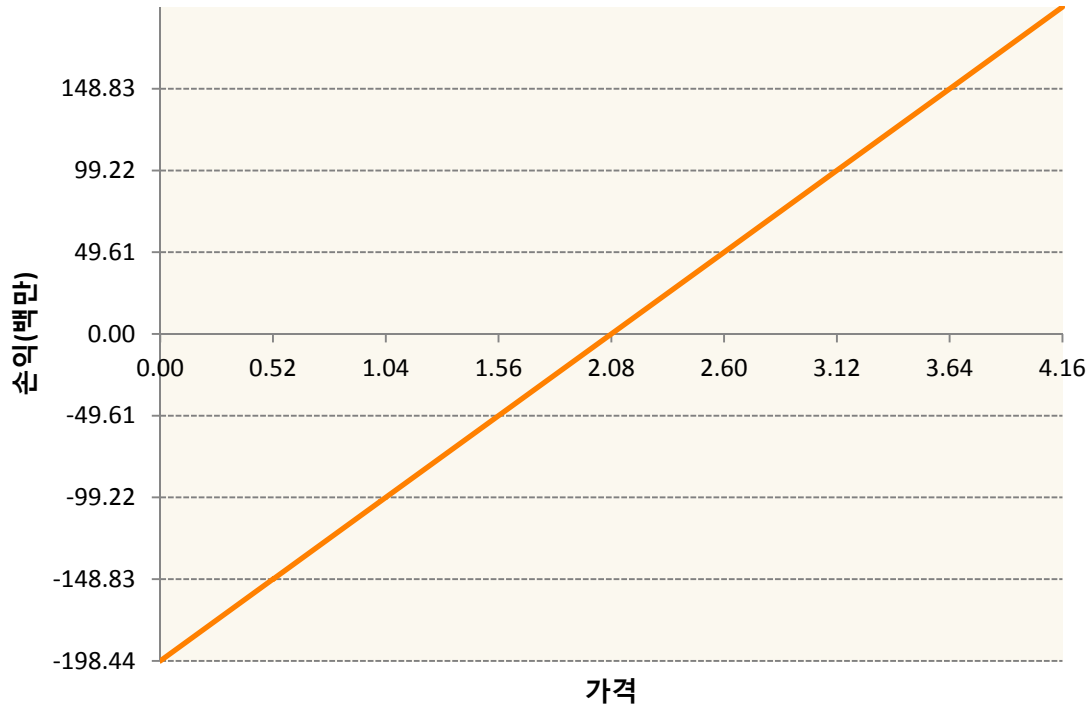


CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19

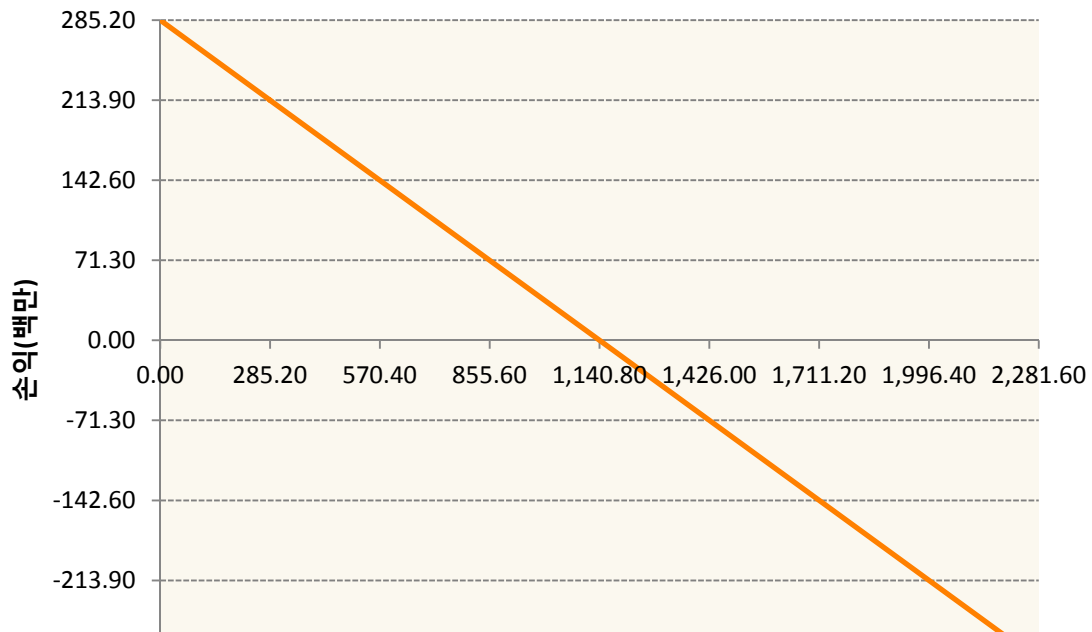


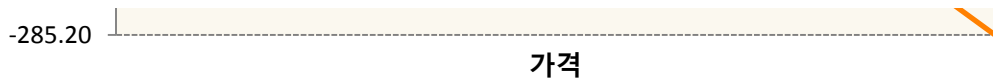


HON9-NY Harb ULSD Fut Jul19



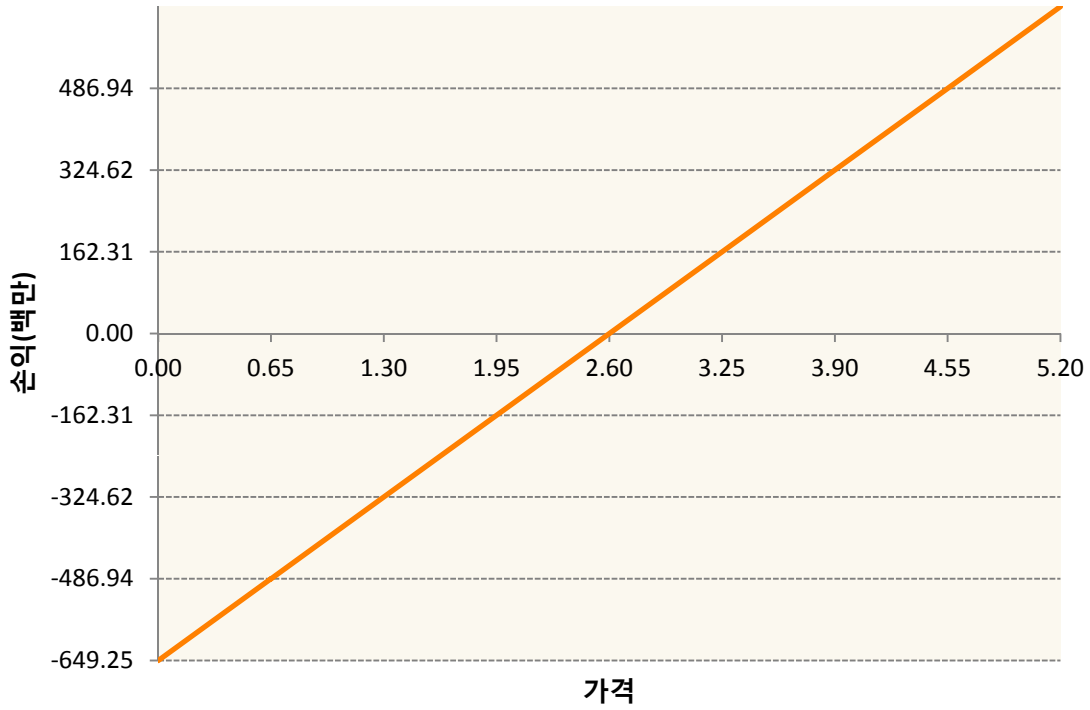
KR4175P50009-2019-05 달러선물





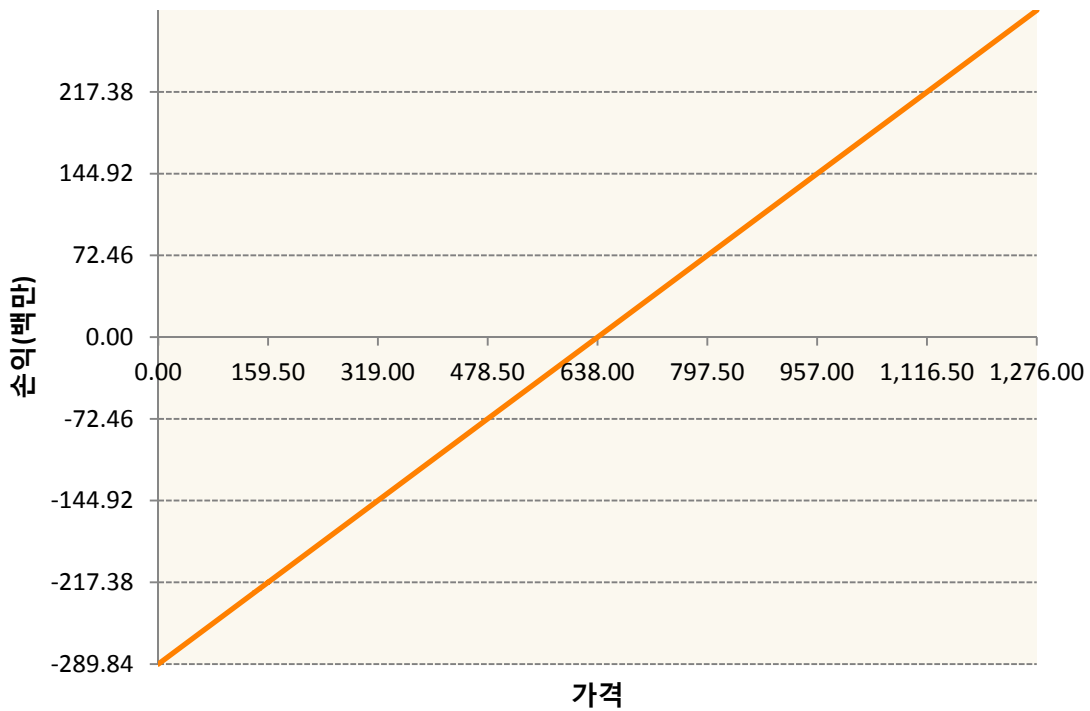
가격

NGN19-NATURAL GAS FUTR Jul19



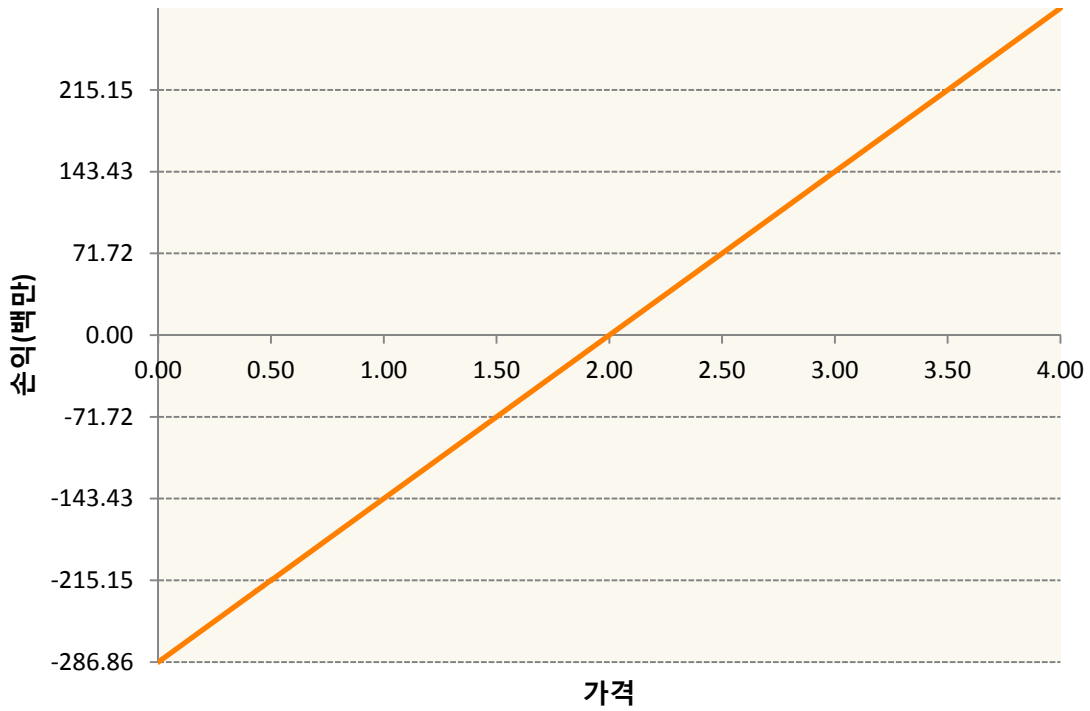
가격

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	2019-04-23
기준일	2019-04-22

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

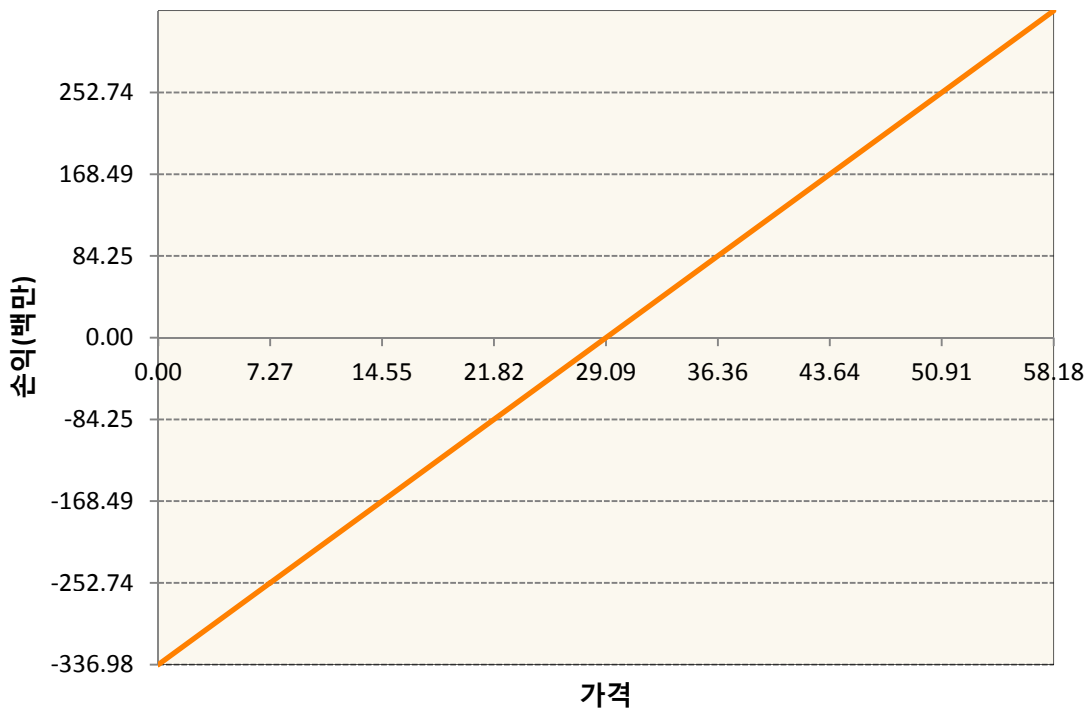
1. 계약금액

(단위:백만원)

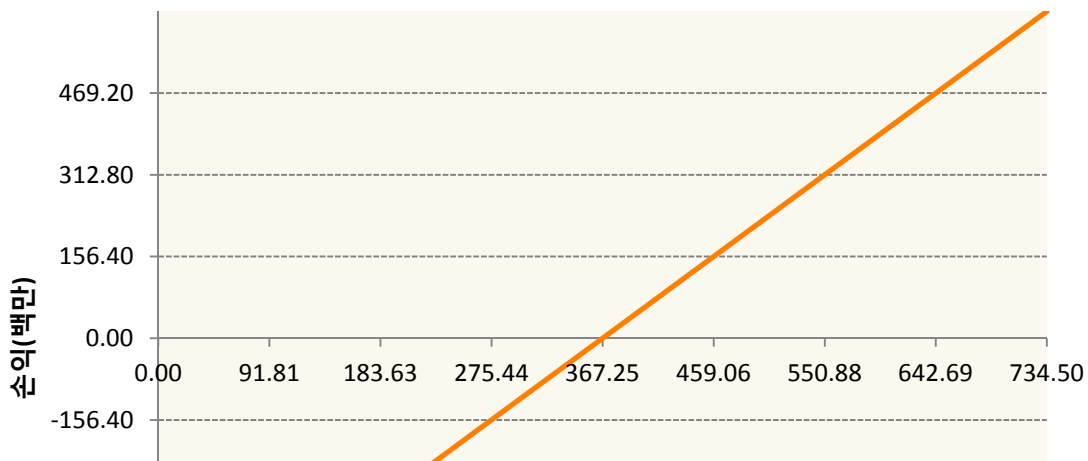
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,211	57	3,154	

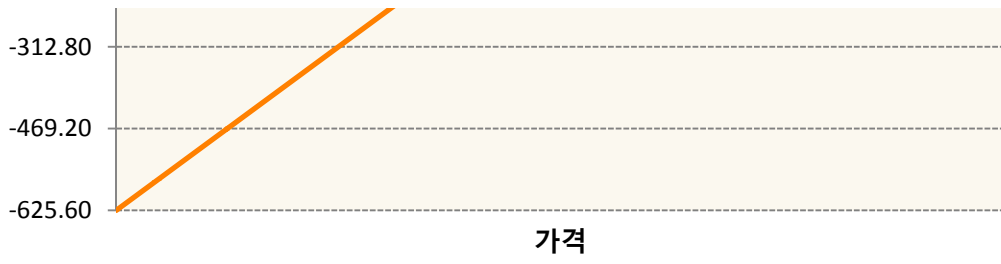
2. 만기시점의 손익구조

BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19

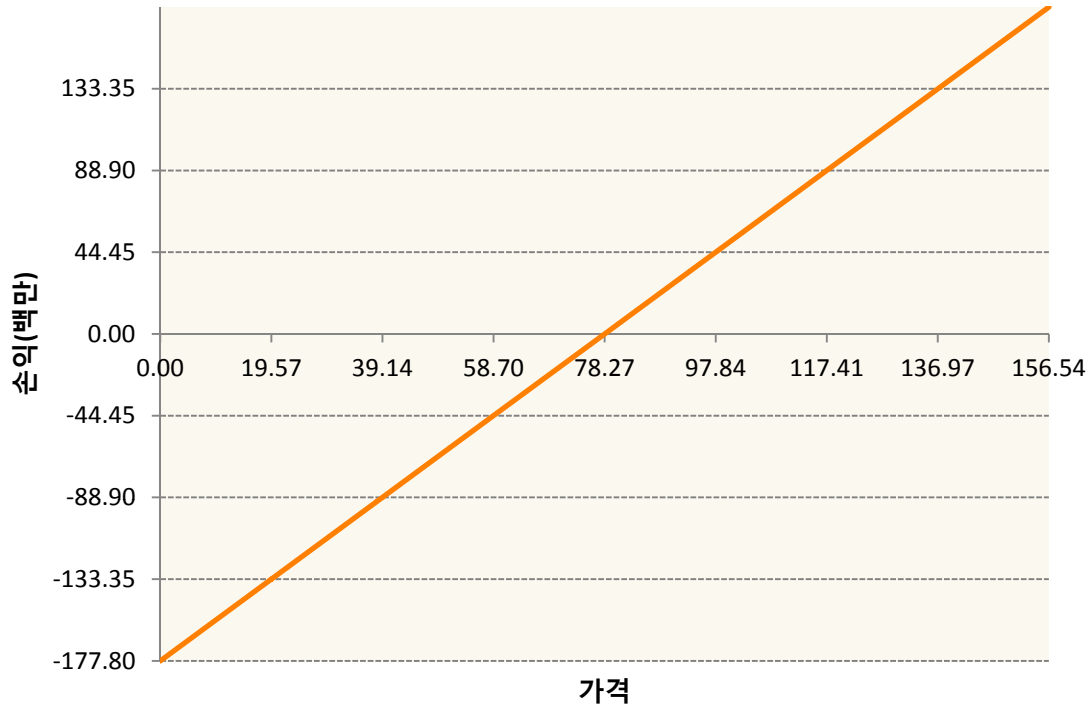


CN9-CORN FUTURE Jul19

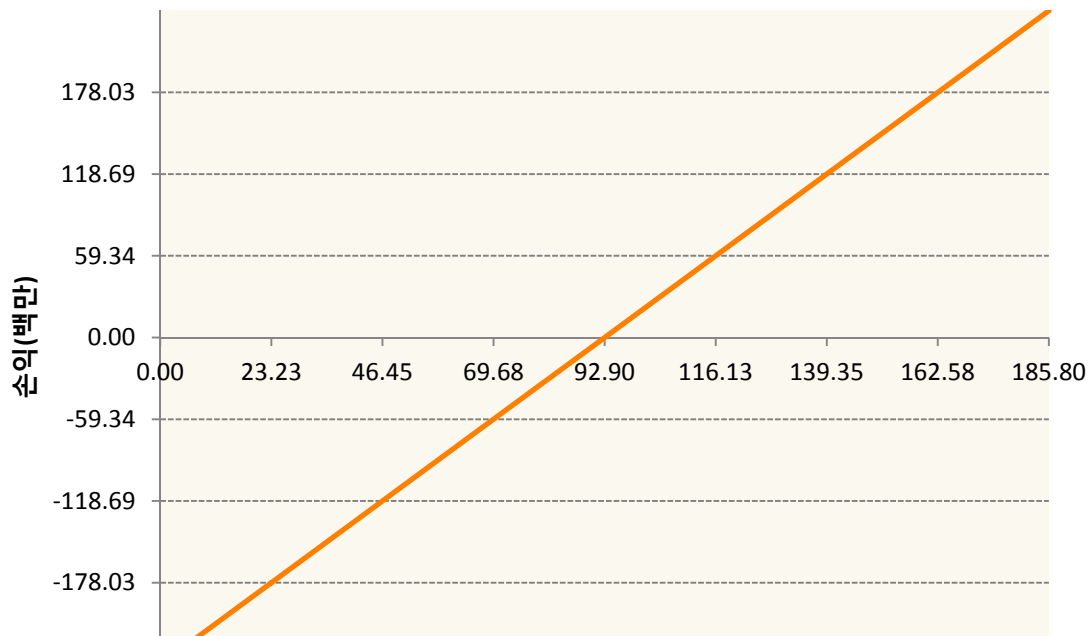


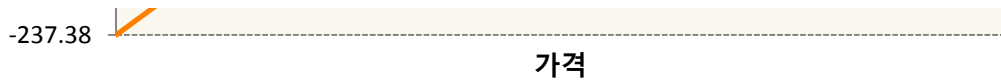


CTN9-COTTON NO.2 FUTR Jul19

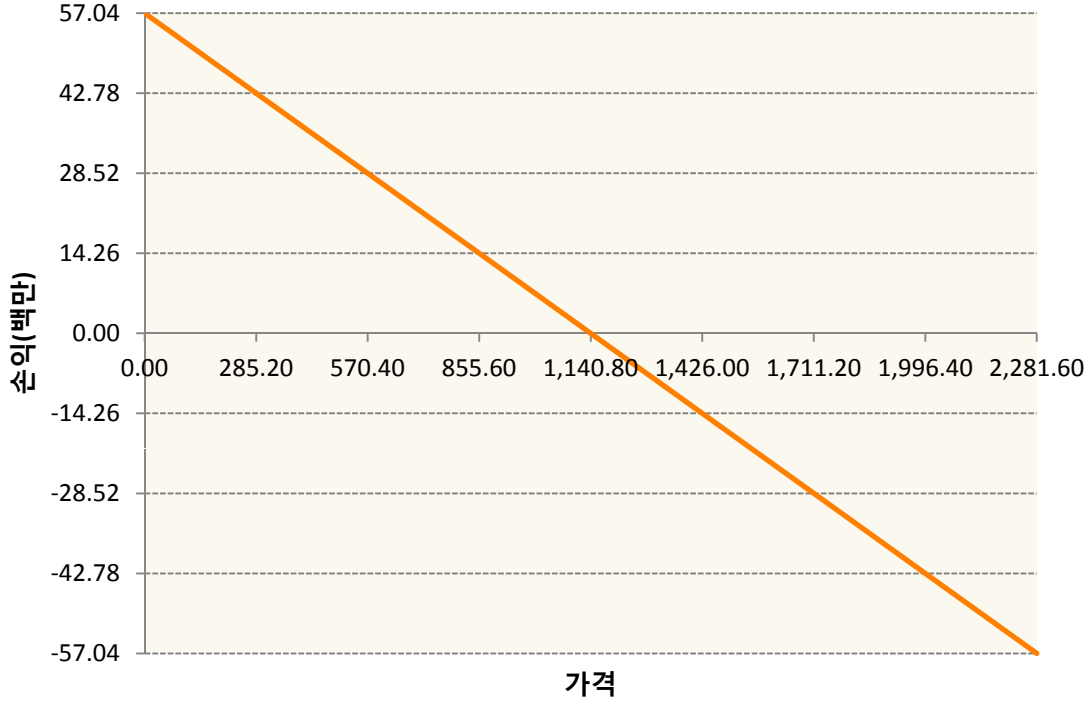


KCN9-COFFEE 'C' FUTURE Jul19

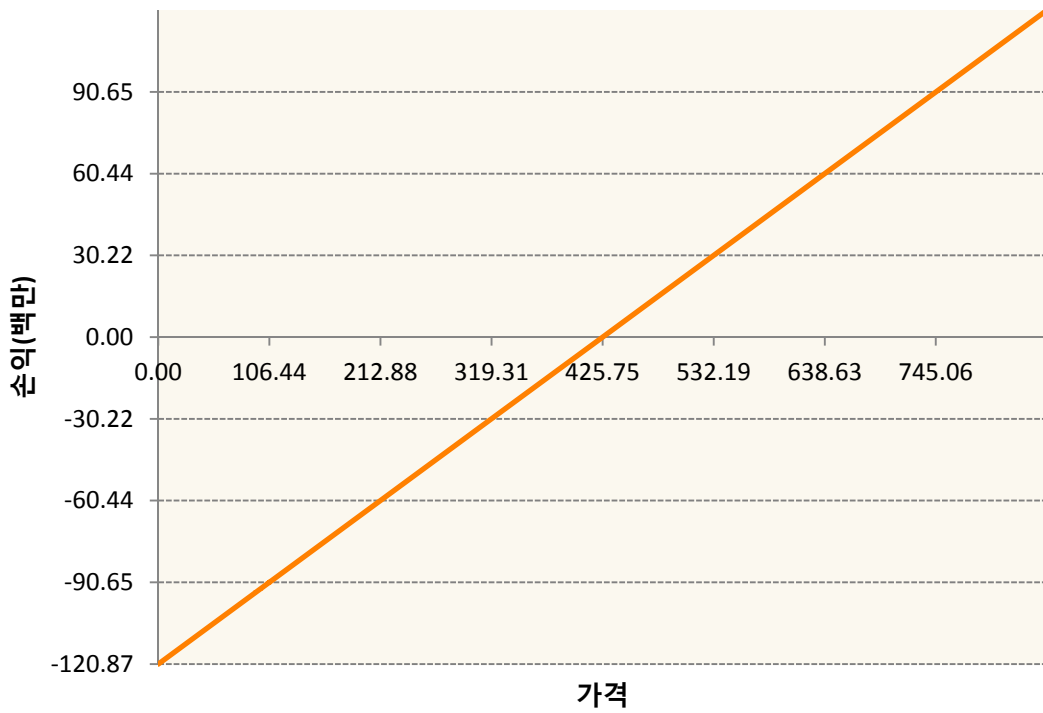




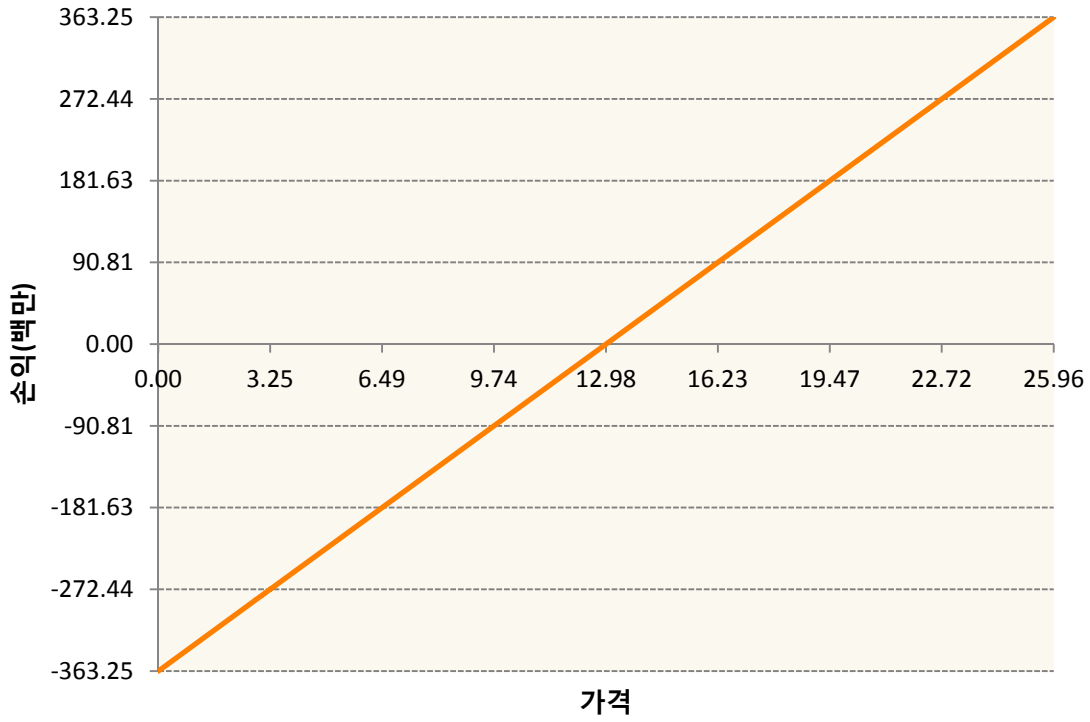
KR4175P50009-2019-05 달러선물



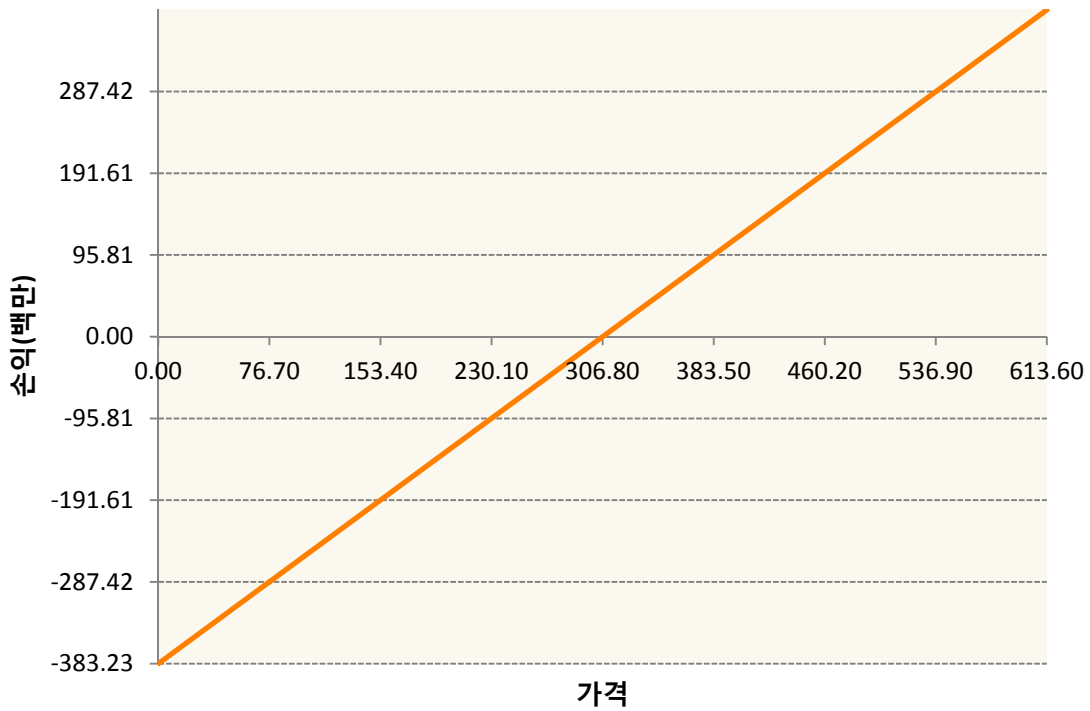
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



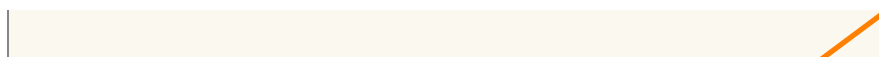
SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

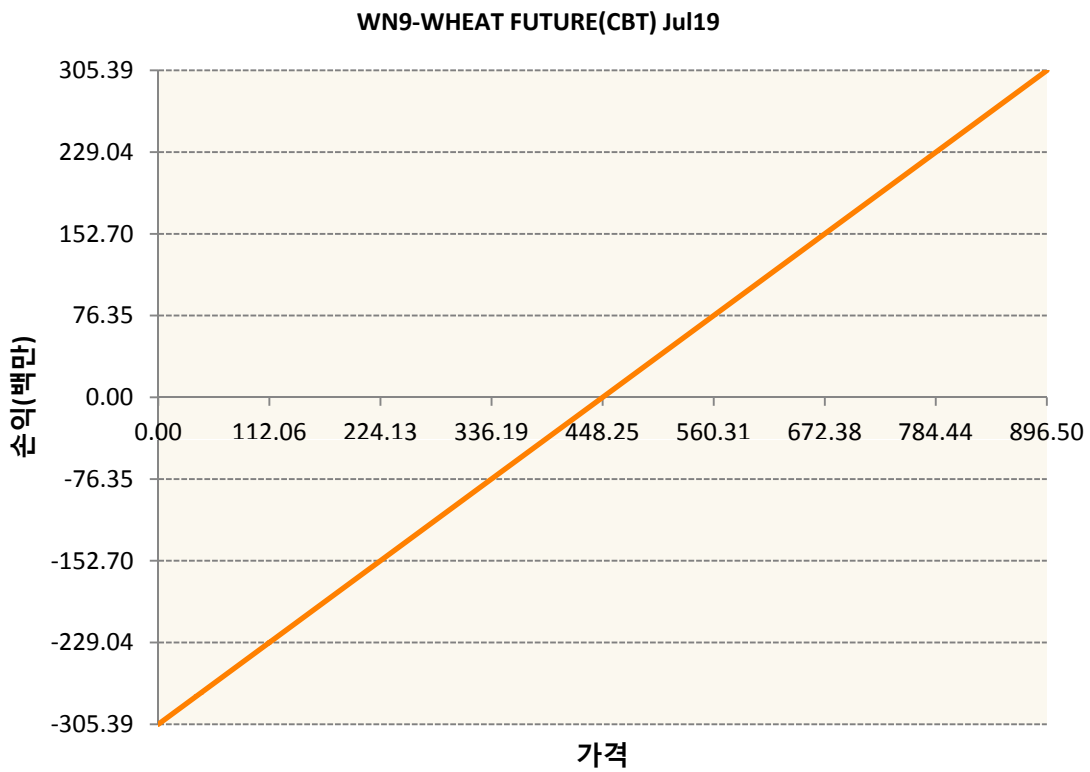
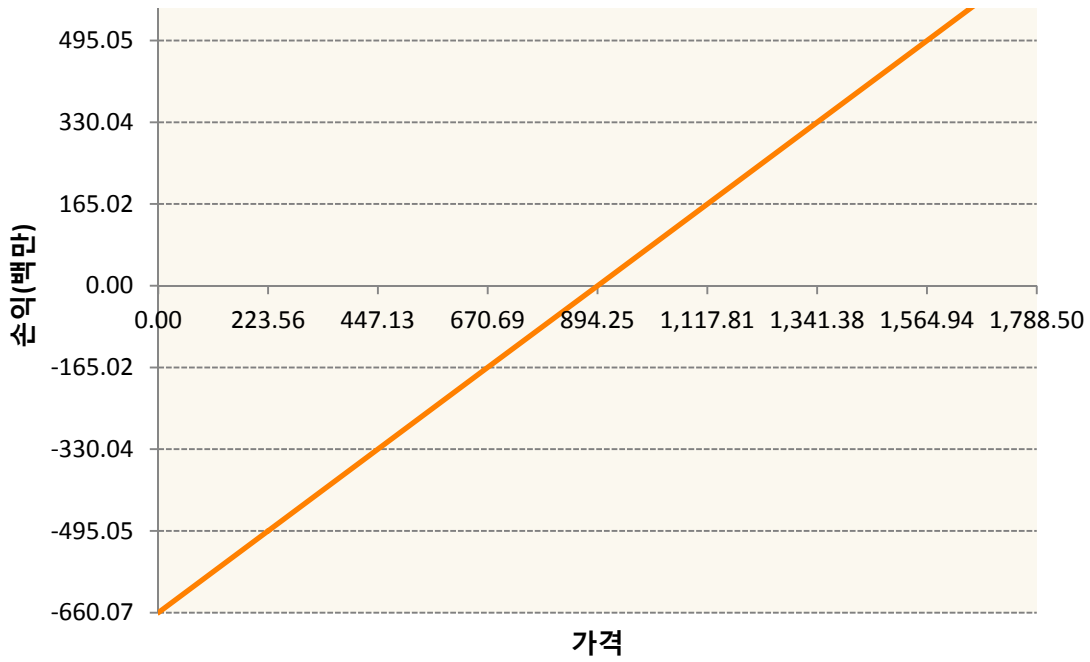


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19



SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





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