

공시일	2019-04-24
기준일	2019-04-23

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	2019-04-24
기준일	2019-04-23

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

1,158

* 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	2019-04-24
기준일	2019-04-23

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)	351
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	97
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	165

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

966

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-04-24
기준일	2019-04-23

유로인덱스모(주식-파생형)

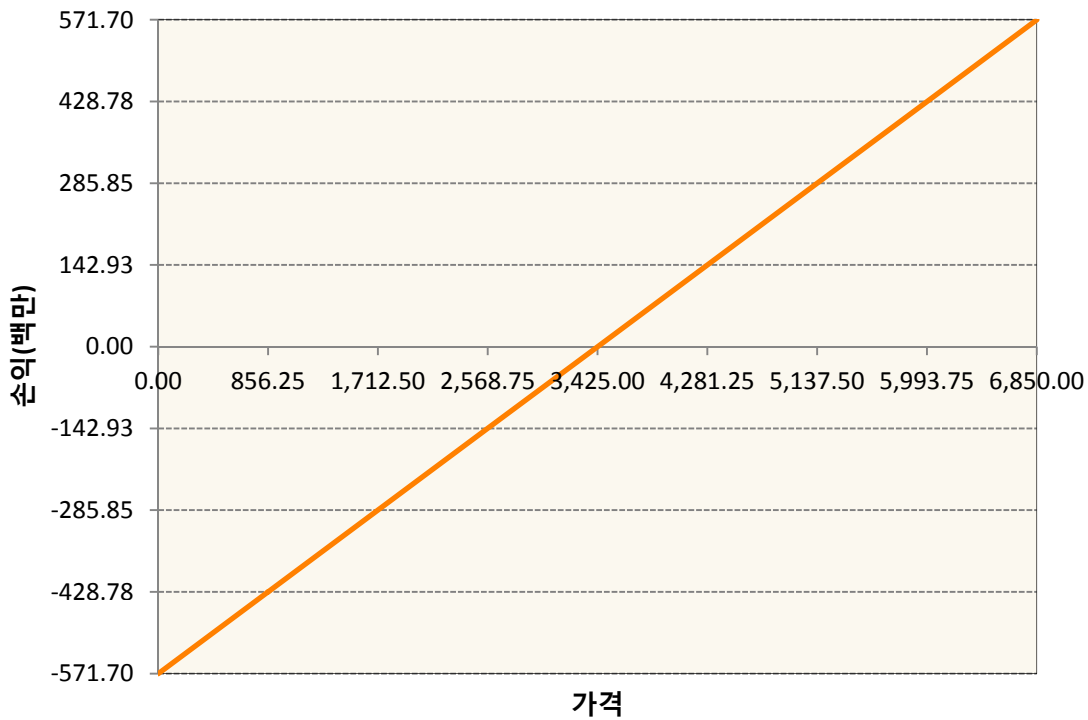
1. 계약금액

(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	2019-04-24
기준일	2019-04-23

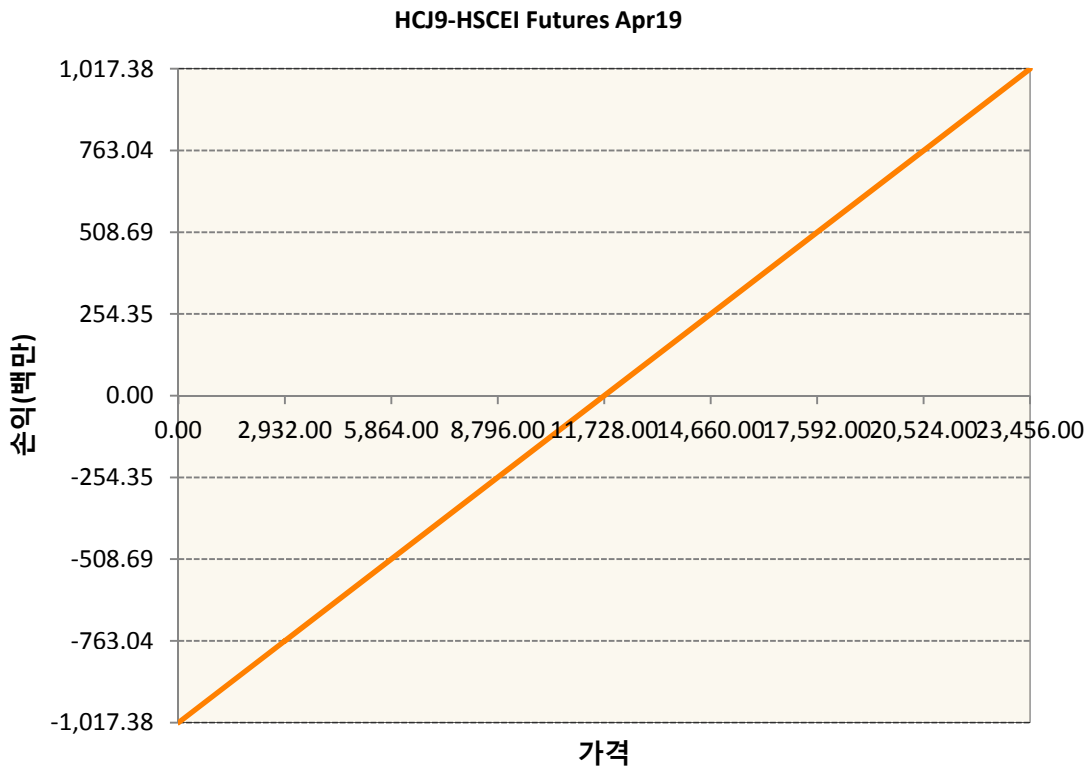
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,017	0	1,017	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ9	HSCEI Futures Apr19	81
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

83

공시일	2019-04-24
기준일	2019-04-23

커버드콜모(주식혼합-파생형)

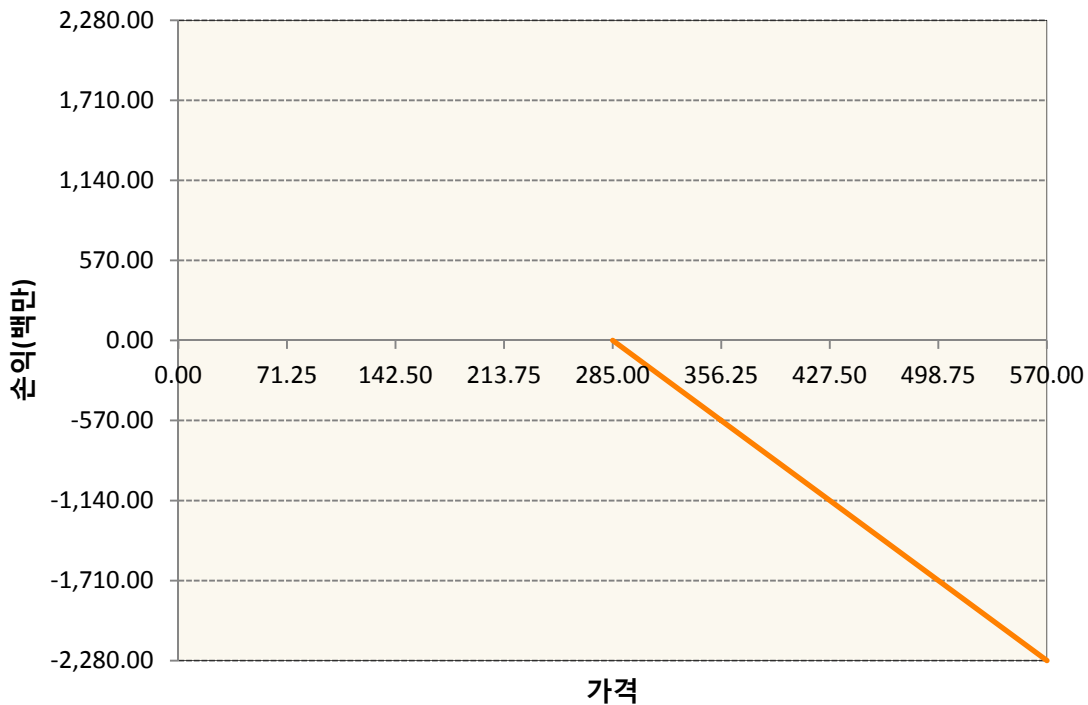
1. 계약금액

(단위:백만원)

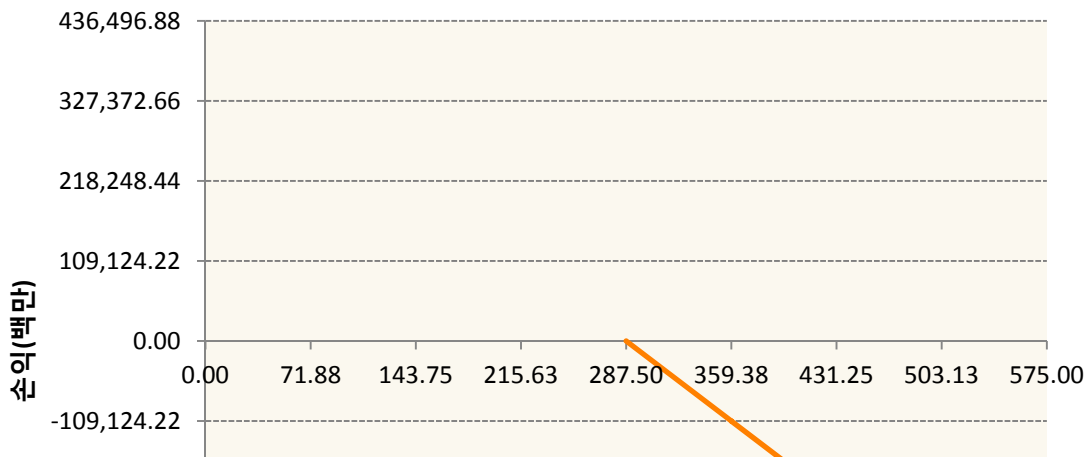
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	672,214	-672,214	장내

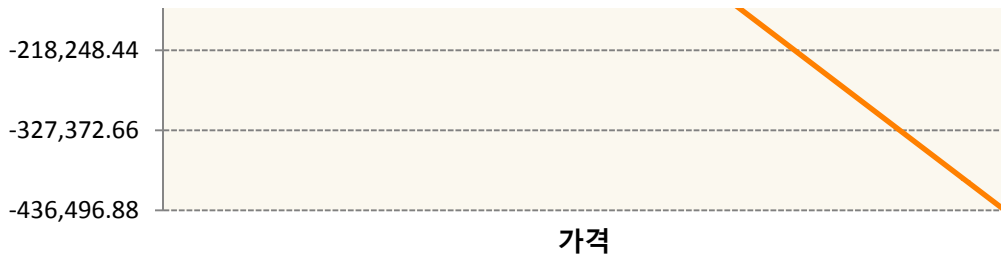
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P52850-2019-05 콜285

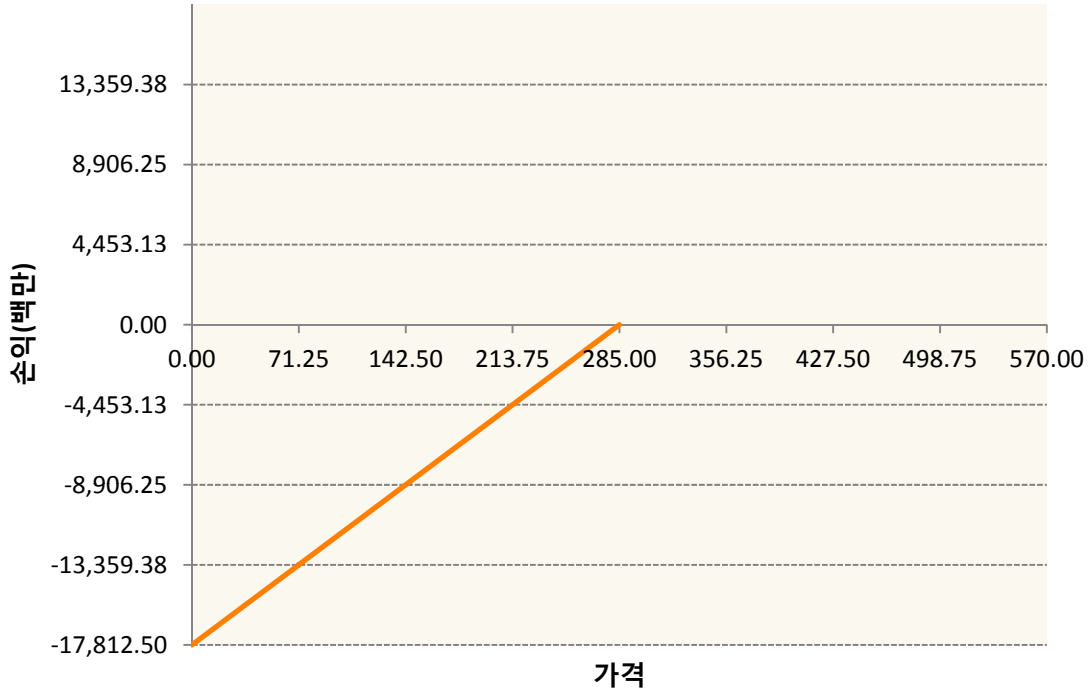


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

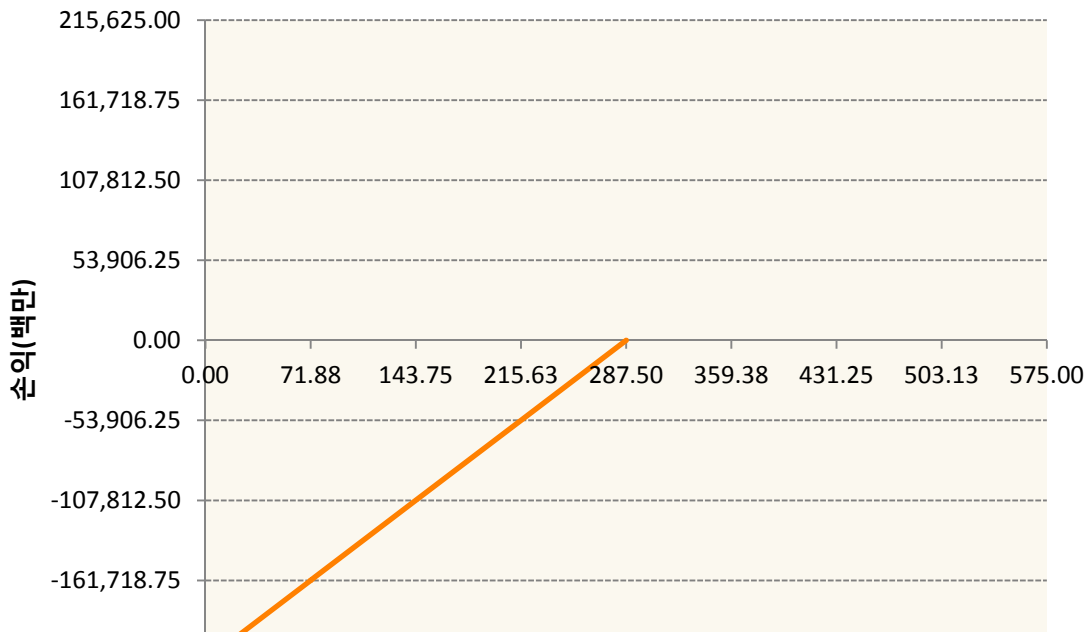




KR4301P52858-2019-05 풋285



KR4301P52874-2019-05 풋287.5



-215,625.00

가격

3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P52850 2019-05 콜285							150
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	51	50	50	49	48	46	45
-5.33%	48	46	44	42	40	37	35
-2.67%	37	34	30	27	24	20	17
0%	11	8	4	0	-4	-8	-11
2.67%	-31	-34	-37	-40	-43	-46	-50
5.33%	-85	-86	-88	-90	-92	-94	-96
8.00%	-144	-144	-145	-146	-147	-148	-150
KR4201P52876 2019-05 콜287.5							26,928
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,827	7,765	7,670	7,538	7,368	7,160	6,916
-5.33%	7,478	7,244	6,958	6,626	6,253	5,846	5,407
-2.67%	6,020	5,494	4,938	4,359	3,761	3,148	2,522
0%	2,159	1,440	720	0	-720	-1,441	-2,162
2.67%	-4,853	-5,474	-6,114	-6,769	-7,434	-8,109	-8,791
5.33%	-14,450	-14,802	-15,205	-15,650	-16,132	-16,644	-17,183
8.00%	-25,419	-25,554	-25,738	-25,970	-26,248	-26,569	-26,928
KR4301P52858 2019-05 풋285							1,196
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	-1,195	-1,195	-1,196
-5.33%	-718	-719	-721	-723	-726	-730	-734
-2.67%	-264	-273	-283	-294	-305	-317	-329
0%	46	31	15	0	-15	-31	-46
2.67%	139	133	127	119	111	102	92
5.33%	147	147	146	145	143	140	137
8.00%	147	147	147	147	147	147	146
KR4301P52874 2019-05 풋287.5							15,288
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-15,279	-15,279	-15,279	-15,280	-15,281	-15,283	-15,288
-5.33%	-9,557	-9,560	-9,568	-9,581	-9,601	-9,627	-9,662
-2.67%	-3,941	-4,005	-4,082	-4,172	-4,272	-4,382	-4,499
0%	561	374	187	0	-188	-376	-564
2.67%	2,421	2,313	2,194	2,065	1,928	1,784	1,634

5.33%	2,686	2,672	2,650	2,618	2,576	2,523	2,461
8.00%	2,697	2,696	2,695	2,692	2,686	2,676	2,662

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

(단위:백만원)

47,674

공시일	2019-04-24
기준일	2019-04-23

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

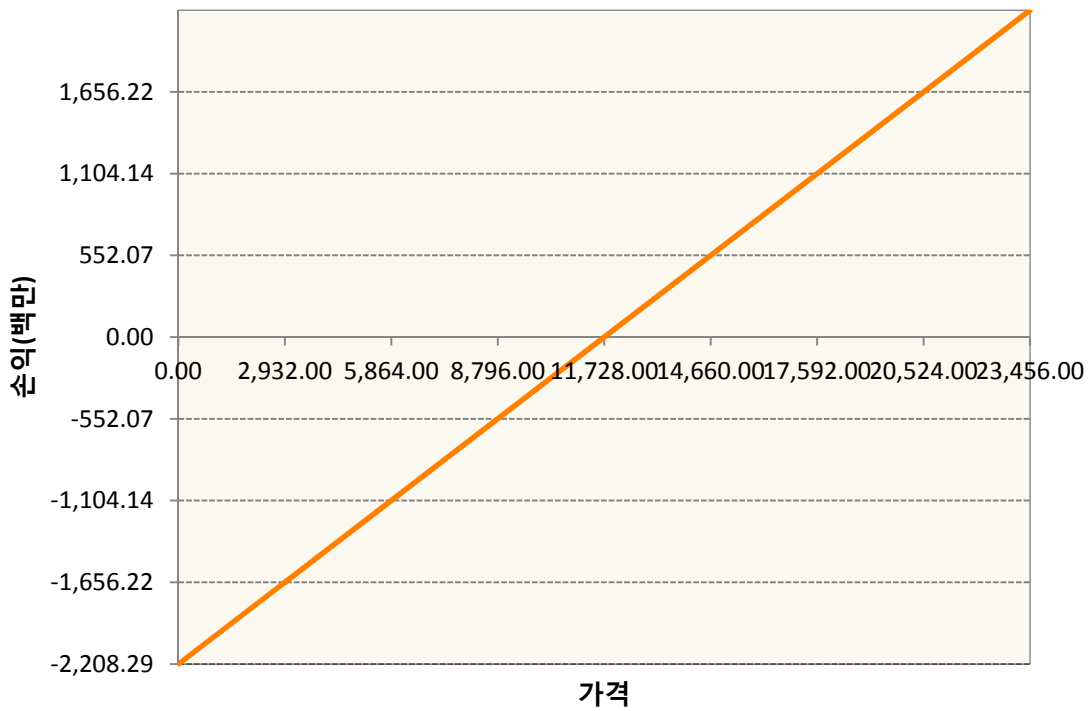
1. 계약금액

(단위:백만원)

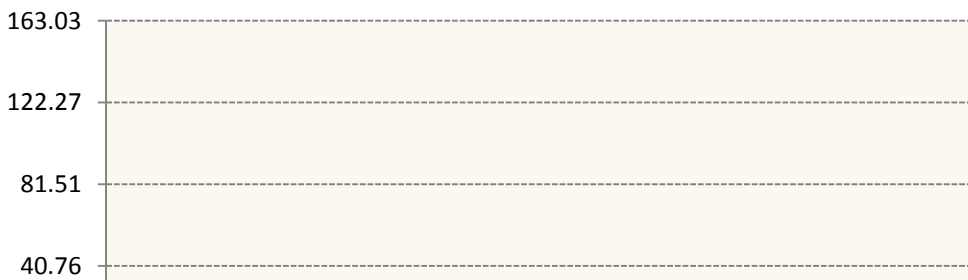
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,208	0	2,208	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,590	-5,590	장내
누계	통화	선도	0	3,057	-3,057	장외

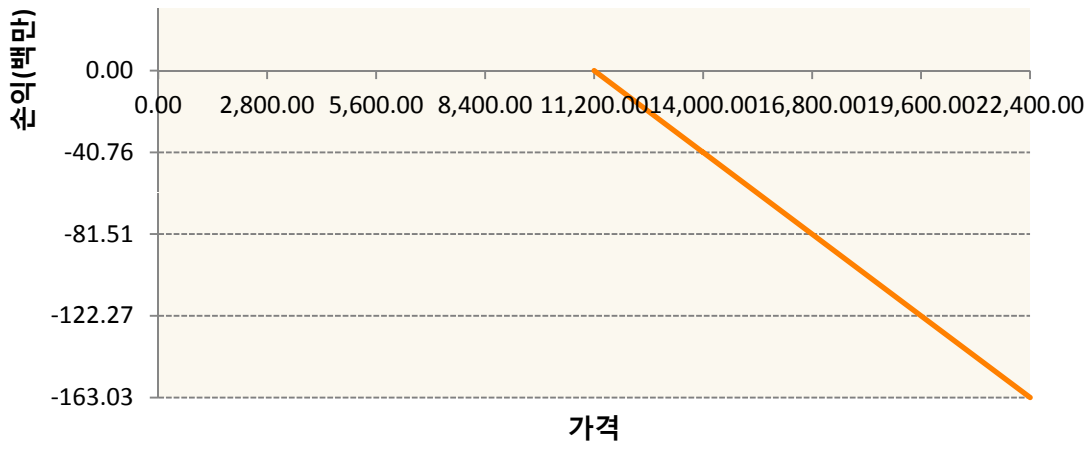
2. 만기시점의 손익구조

HCJ9-HSCEI Futures Apr19

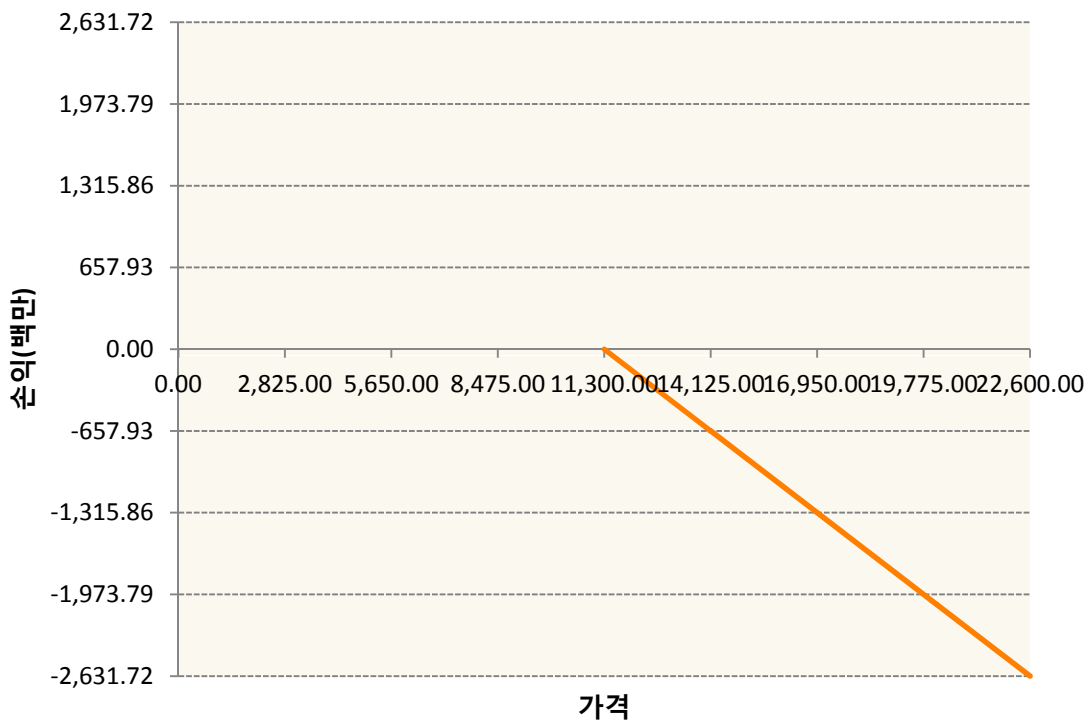


OHHIJ9-C112-HSCEI

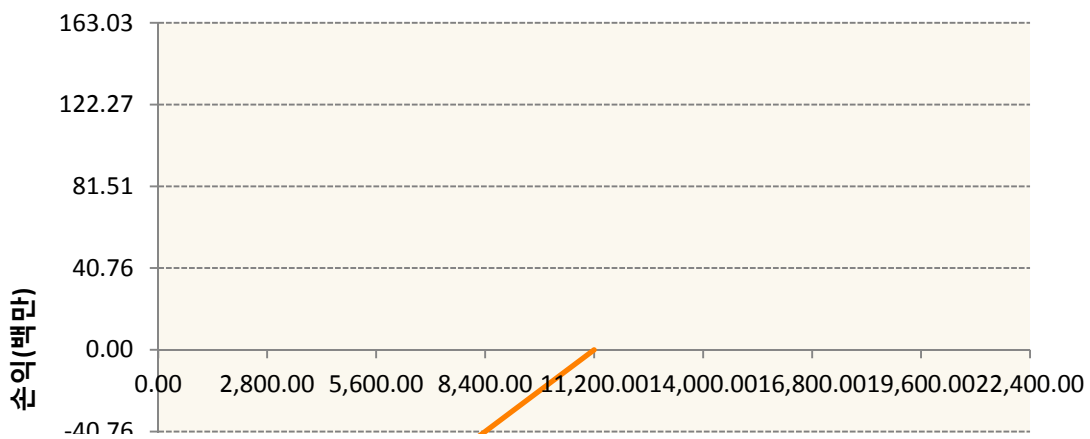


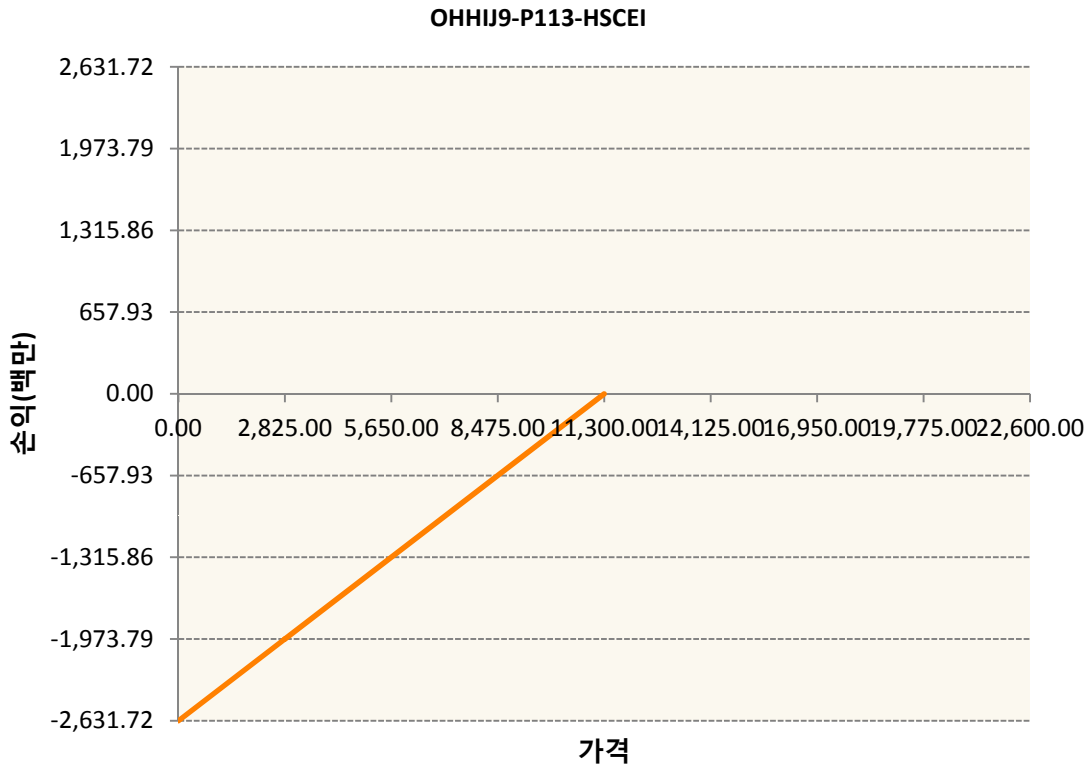
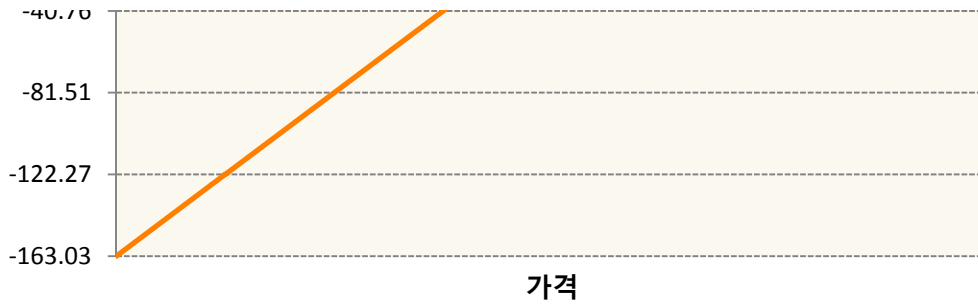


OHHIJ9-C113-HSCEI



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	211
OHHIJ9-P11: HSCEI	13
OHHIJ9-P11: HSCEI	211

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	722

공시일	2019-04-24
기준일	2019-04-23

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

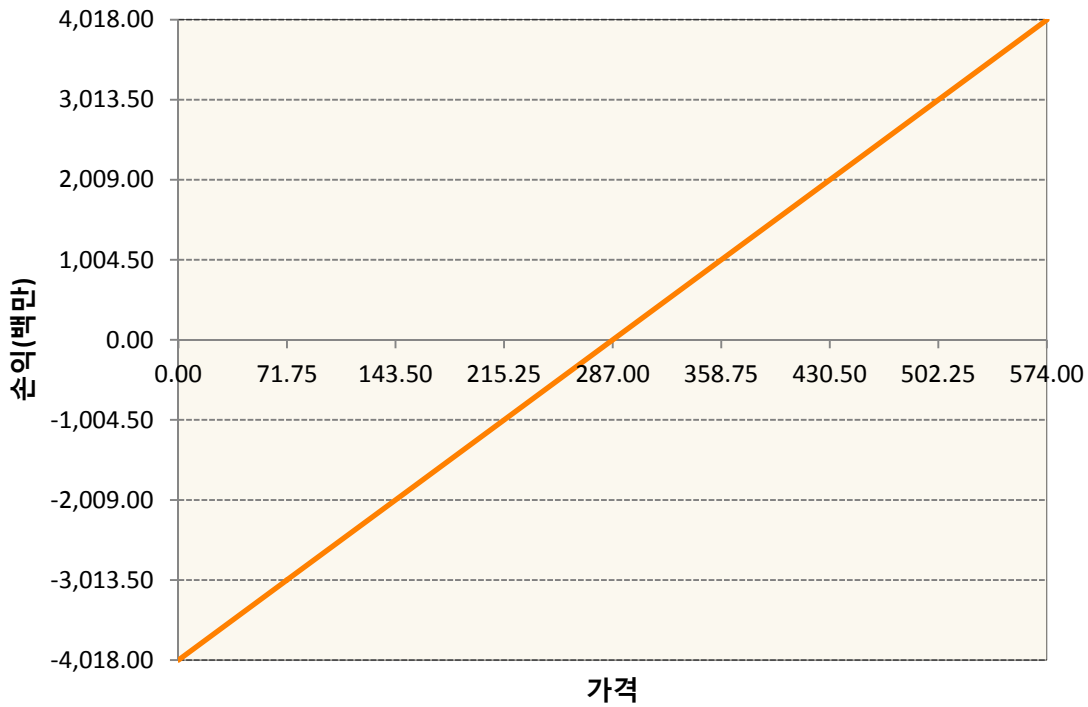
1. 계약금액

(단위:백만원)

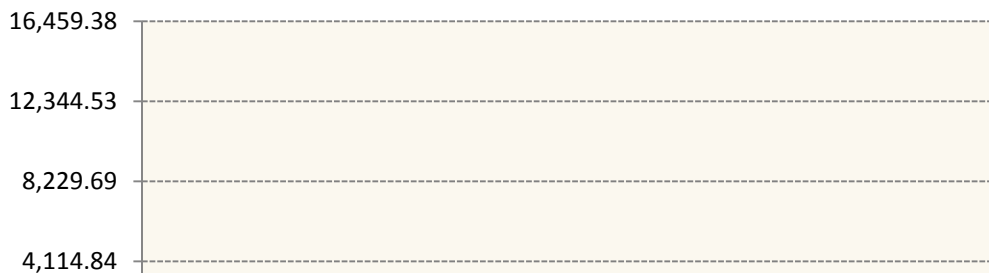
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	3,000	-3,000	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,018	0	4,018	장내
누계	유가증권	스왑	32,836	0	32,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	32,479	-32,479	장내

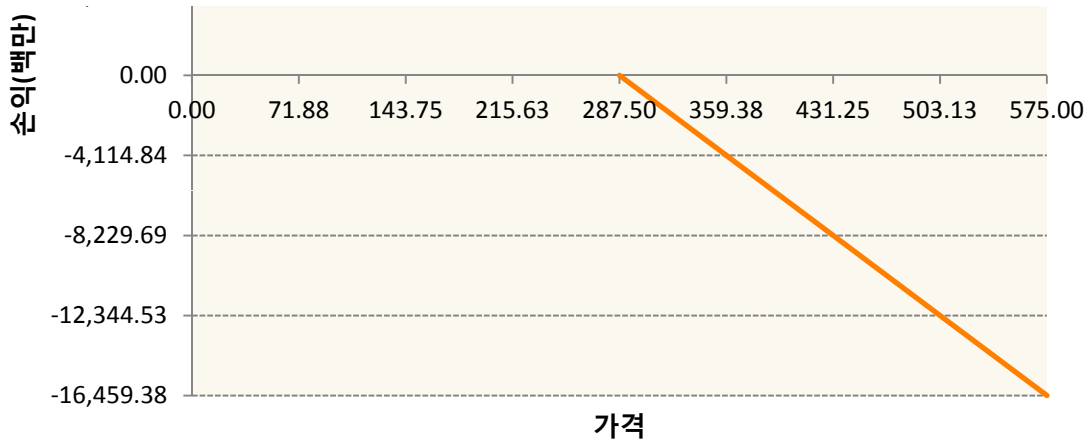
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

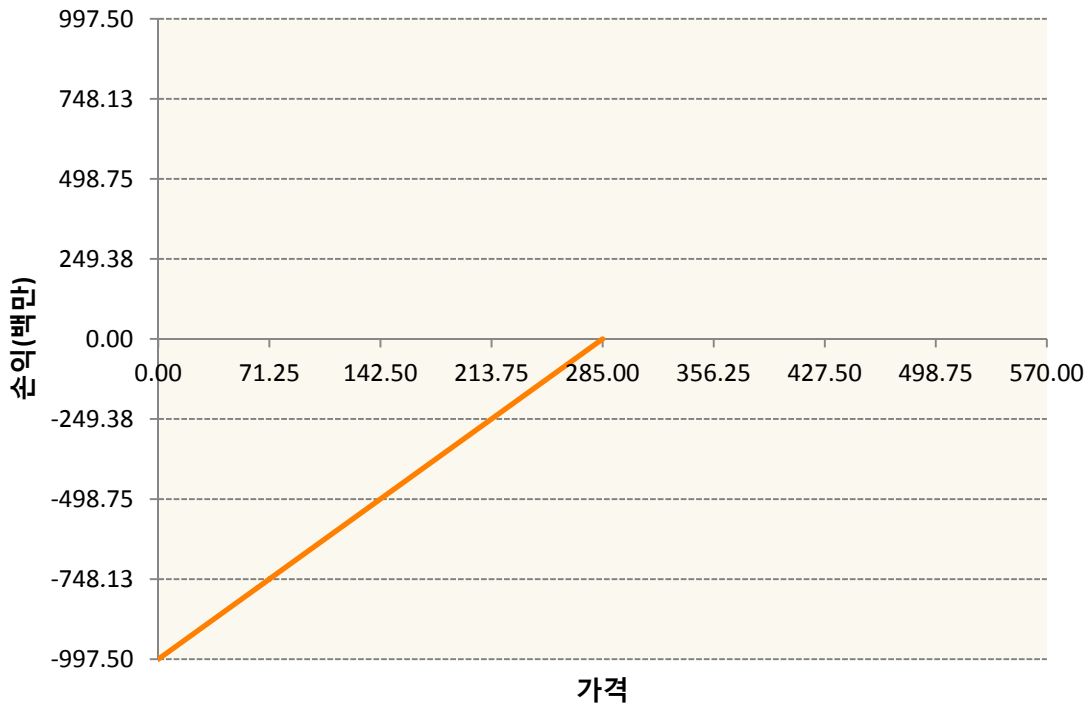


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

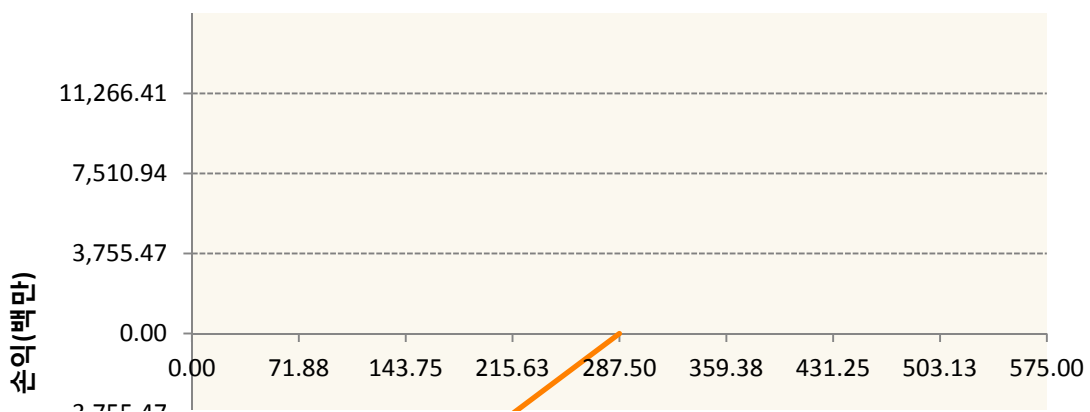


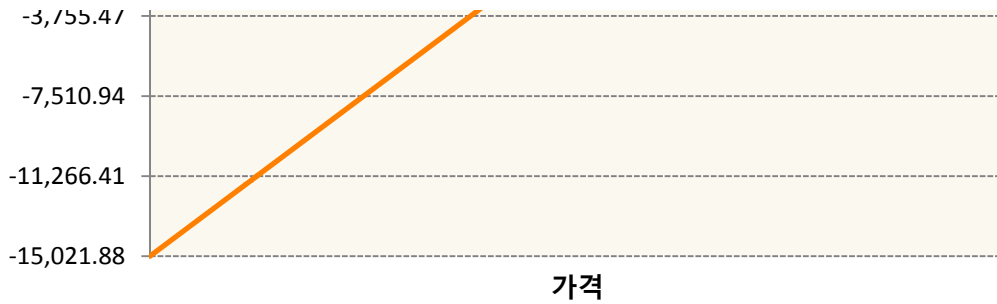


KR4301P52858-2019-05 풋285



KR4301P52874-2019-05 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,198
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,198	-2,198	-2,198	-2,198	-2,198	-2,198	-2,198	
-5.33%	-1,466	-1,466	-1,466	-1,466	-1,466	-1,466	-1,466	
-2.67%	-733	-733	-733	-733	-733	-733	-733	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	733	733	733	733	733	733	733	
5.33%	1,466	1,466	1,466	1,466	1,466	1,466	1,466	
8.00%	2,198	2,198	2,198	2,198	2,198	2,198	2,198	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						596
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-596	-596	-596	-596	-596	-596	-596	
-5.33%	-397	-397	-397	-397	-397	-397	-397	
-2.67%	-199	-199	-199	-199	-199	-199	-199	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	199	199	199	199	199	199	199	
5.33%	397	397	397	397	397	397	397	
8.00%	596	596	596	596	596	596	596	
KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						321
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-321	-321	-321	-321	-321	-321	-321	
-5.33%	-214	-214	-214	-214	-214	-214	-214	
-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%	214	214	214	214	214	214	214	
8.00%	321	321	321	321	321	321	321	
KR4201P52876		2019-05 콜287.5						1,015
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	295	293	289	284	278	270	261
-5.33%	282	273	262	250	236	220	204
-2.67%	227	207	186	164	142	119	95
0%	81	54	27	0	-27	-54	-82
2.67%	-183	-206	-231	-255	-280	-306	-331
5.33%	-545	-558	-573	-590	-608	-628	-648
8.00%	-958	-964	-971	-979	-990	-1,002	-1,015
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	-40	-40	-41	-41	-41
-2.67%	-15	-15	-16	-16	-17	-18	-18
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	8	7	7	7	6	6	5
5.33%	8	8	8	8	8	8	8
8.00%	8	8	8	8	8	8	8
KR4301P52874 2019-05 풋287.5							1,065
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,064	-1,064	-1,064	-1,064	-1,065	-1,065	-1,065
-5.33%	-666	-666	-667	-667	-669	-671	-673
-2.67%	-275	-279	-284	-291	-298	-305	-313
0%	39	26	13	0	-13	-26	-39
2.67%	169	161	153	144	134	124	114
5.33%	187	186	185	182	179	176	171
8.00%	188	188	188	188	187	186	185

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

(단위:백만원)

5,470

공시일	2019-04-24
기준일	2019-04-23

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

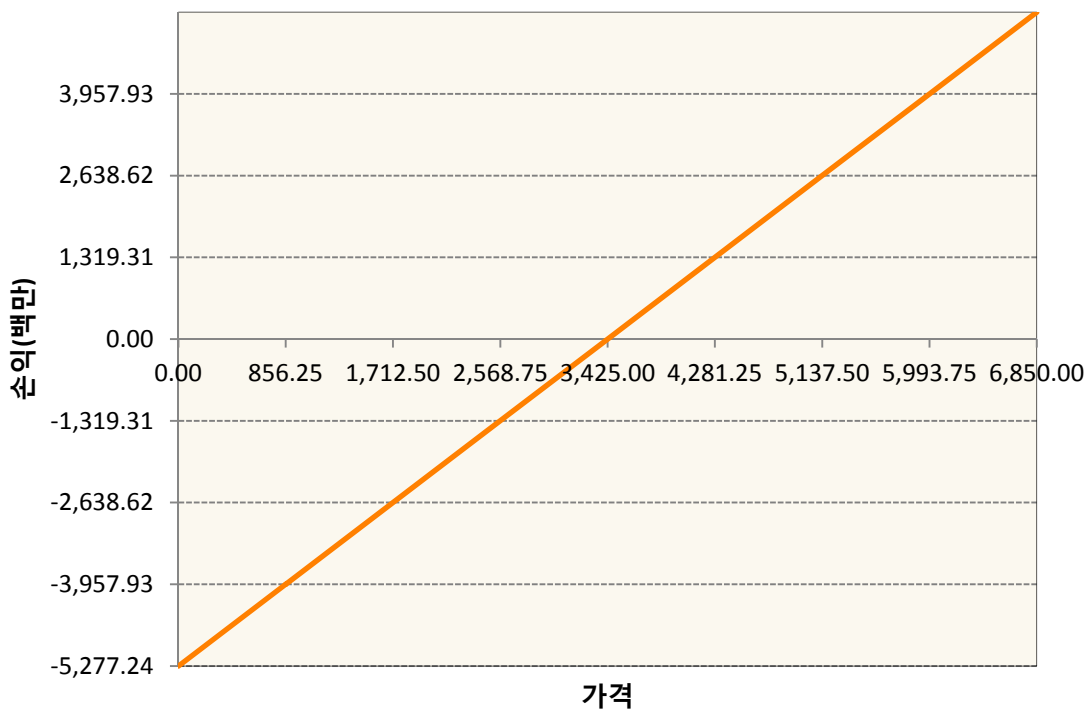
1. 계약금액

(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	63,243	0	63,243	장외
누계	통화	선도	0	17,972	-17,972	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	822
FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E	205
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	422

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

(단위:백만원)

1,027

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

(단위:백만원)

1,099

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

(단위:백만원)

94

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

(단위:백만원)

136

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

(단위:백만원)

42

공시일	2019-04-24
기준일	2019-04-23

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

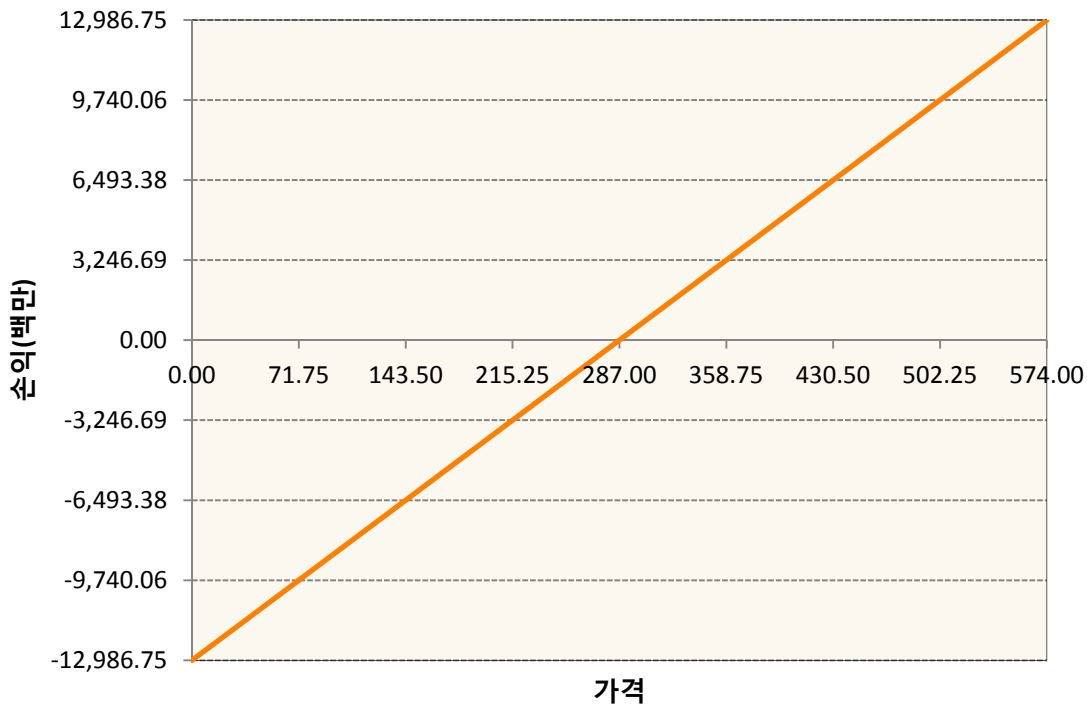
1. 계약금액

(단위:백만원)

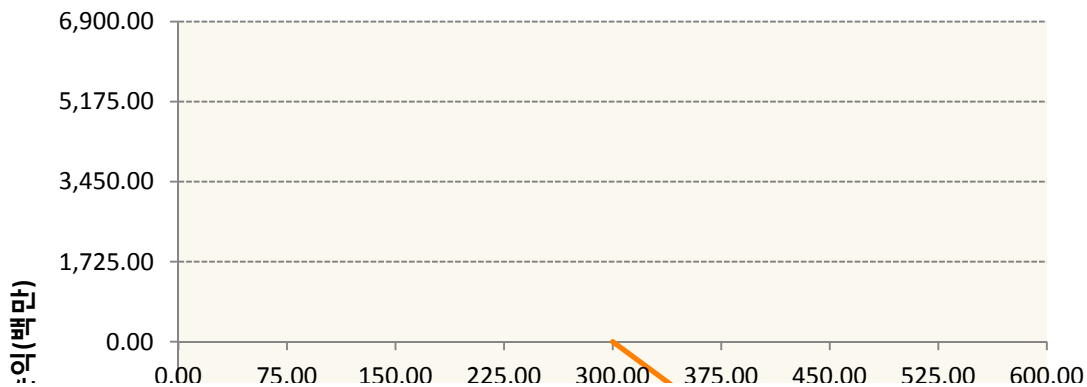
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,987	0	12,987	장내
누계	유가증권	옵션	1,366	24,294	-22,928	장내

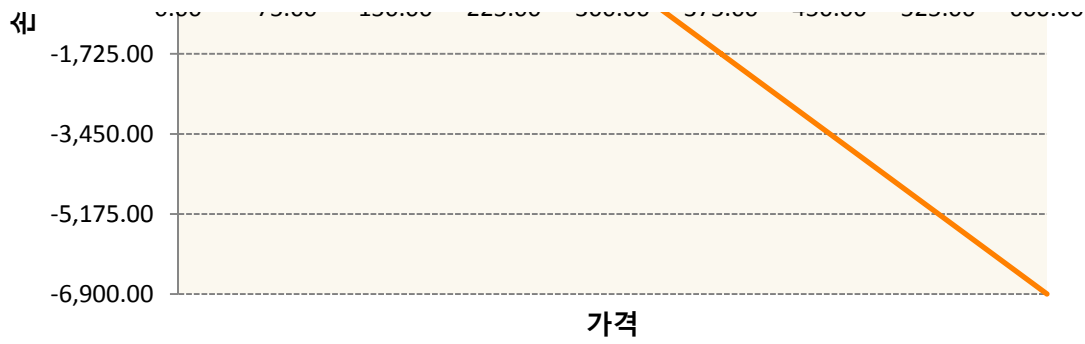
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

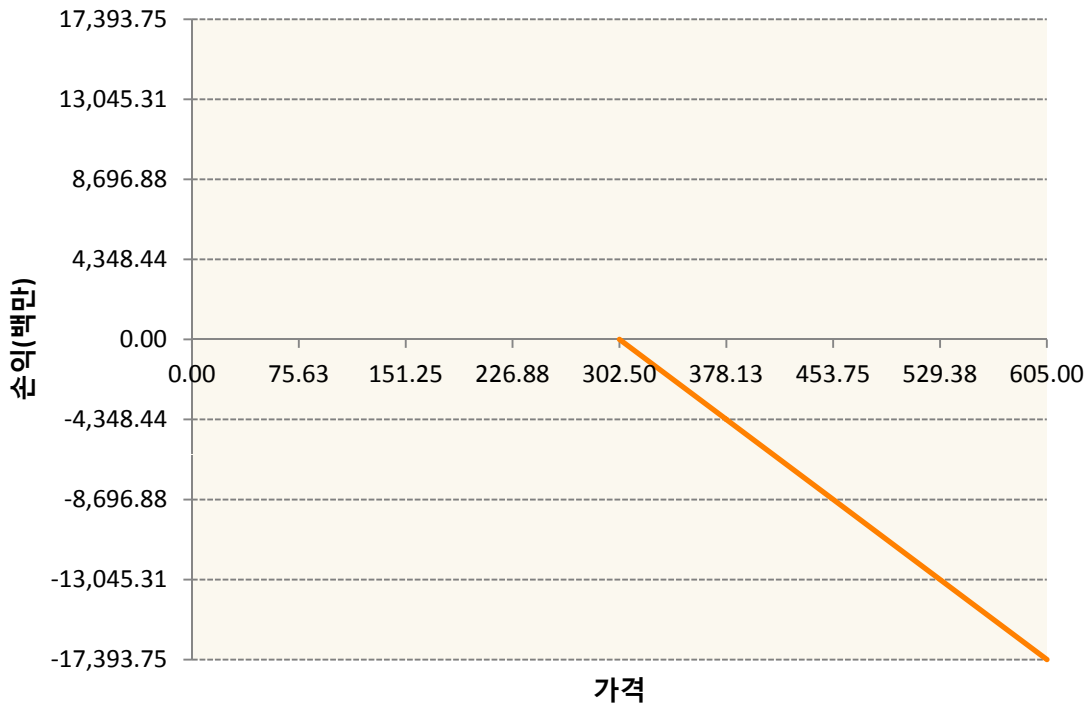


KR4201P53007-2019-05 콜300

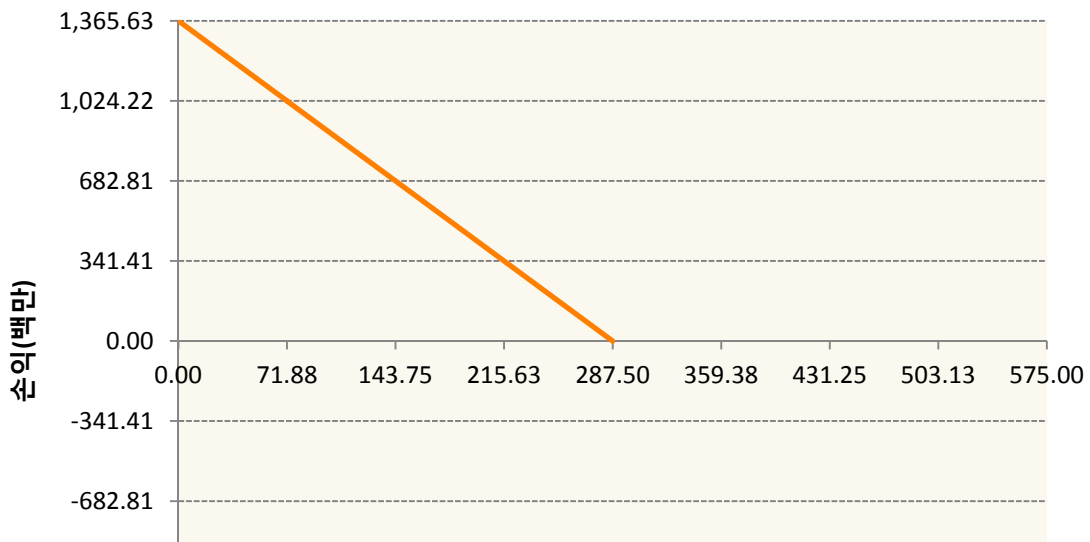


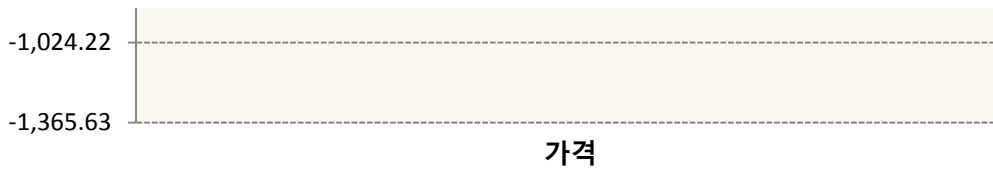


KR4201P53023-2019-05 콜302.5



KR4301P52874-2019-05 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						1,037
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,037	-1,037	-1,037	-1,037	-1,037	-1,037	-1,037	
-5.33%	-691	-691	-691	-691	-691	-691	-691	
-2.67%	-346	-346	-346	-346	-346	-346	-346	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	346	346	346	346	346	346	346	
5.33%	691	691	691	691	691	691	691	
8.00%	1,037	1,037	1,037	1,037	1,037	1,037	1,037	
KR4201P53007		2019-05 콜300						270
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	32	32	32	32	31	30	29	
-5.33%	32	31	31	30	28	26	23	
-2.67%	30	28	25	22	18	13	8	
0%	19	13	7	0	-8	-15	-24	
2.67%	-16	-26	-36	-46	-57	-68	-78	
5.33%	-92	-103	-115	-126	-137	-149	-160	
8.00%	-213	-222	-231	-240	-250	-260	-270	
KR4201P53023		2019-05 콜302.5						603
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	59	59	58	58	57	56	54	
-5.33%	58	58	57	55	52	47	42	
-2.67%	55	52	47	41	33	23	12	
0%	38	27	15	0	-16	-34	-52	
2.67%	-25	-47	-70	-94	-118	-143	-169	
5.33%	-178	-207	-236	-265	-293	-322	-351	
8.00%	-446	-471	-496	-522	-549	-576	-603	
KR4301P52874		2019-05 풋287.5						97
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	97	97	97	97	97	97	97	
-5.33%	61	61	61	61	61	61	61	
-2.67%	25	25	26	26	27	28	28	

0%	-4	-2	-1	0	1	2	4
2.67%	-15	-15	-14	-13	-12	-11	-10
5.33%	-17	-17	-17	-17	-16	-16	-16
8.00%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17

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

(단위:백만원)

1,567

공시일	2019-04-24
기준일	2019-04-23

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	3,733	0	3,733	

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	2019-04-24
기준일	2019-04-23

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	56,575	0	56,575	

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	2019-04-24
기준일	2019-04-23

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	116,635	0	116,635	
누계	통화	선도	0	146,025	-146,025	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	322
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	1,279
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

FX21019J02(KRW/USD 22-05-19E
FX21019J03(KRW/USD 28-05-19E
FX21019J03(KRW/USD 28-05-19E

767
913
968

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

(단위:백만원)

3,972

공시일	2019-04-24
기준일	2019-04-23

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

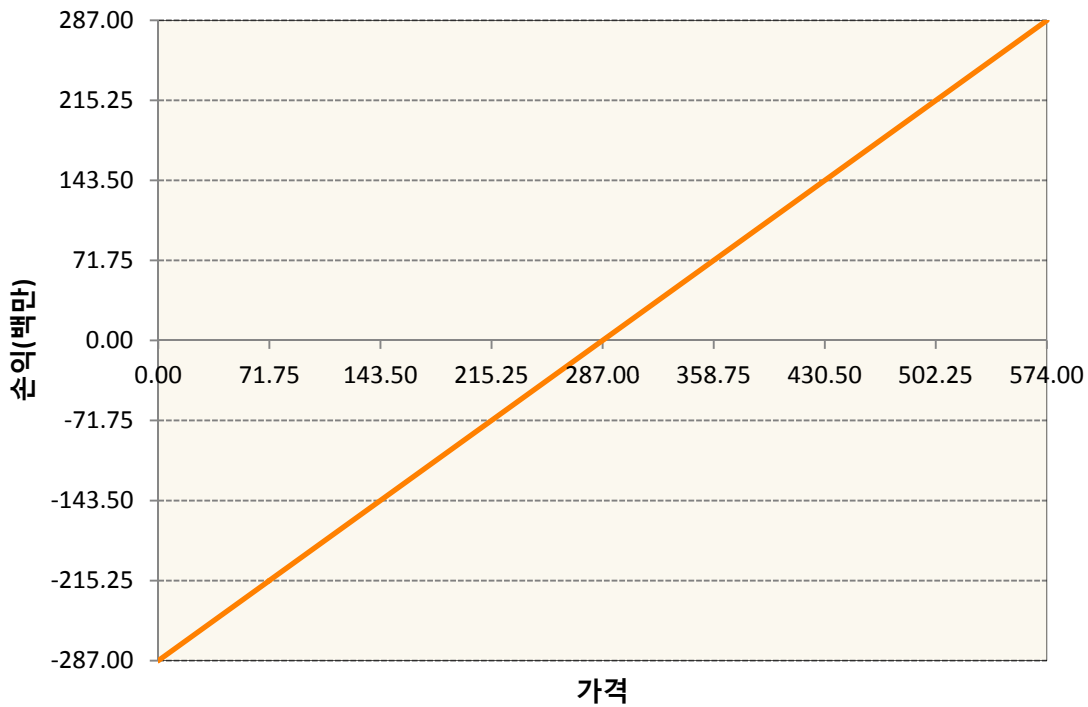
1. 계약금액

(단위:백만원)

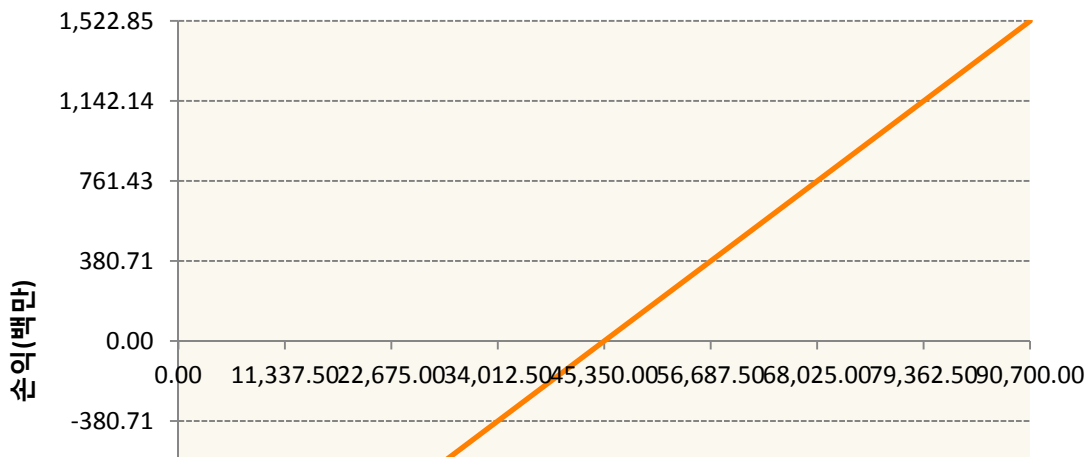
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,810	0	1,810	장내

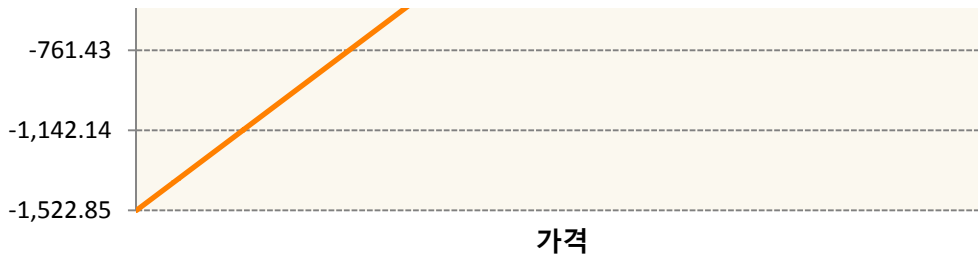
2. 만기시점의 손익구조

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						121
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-121	-121	-121	-121	-121	-121	-121	
-5.33%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81	
-2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	40	40	40	40	40	40	40	
5.33%	81	81	81	81	81	81	81	
8.00%	121	121	121	121	121	121	121	

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

158

공시일	2019-04-24
기준일	2019-04-23

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

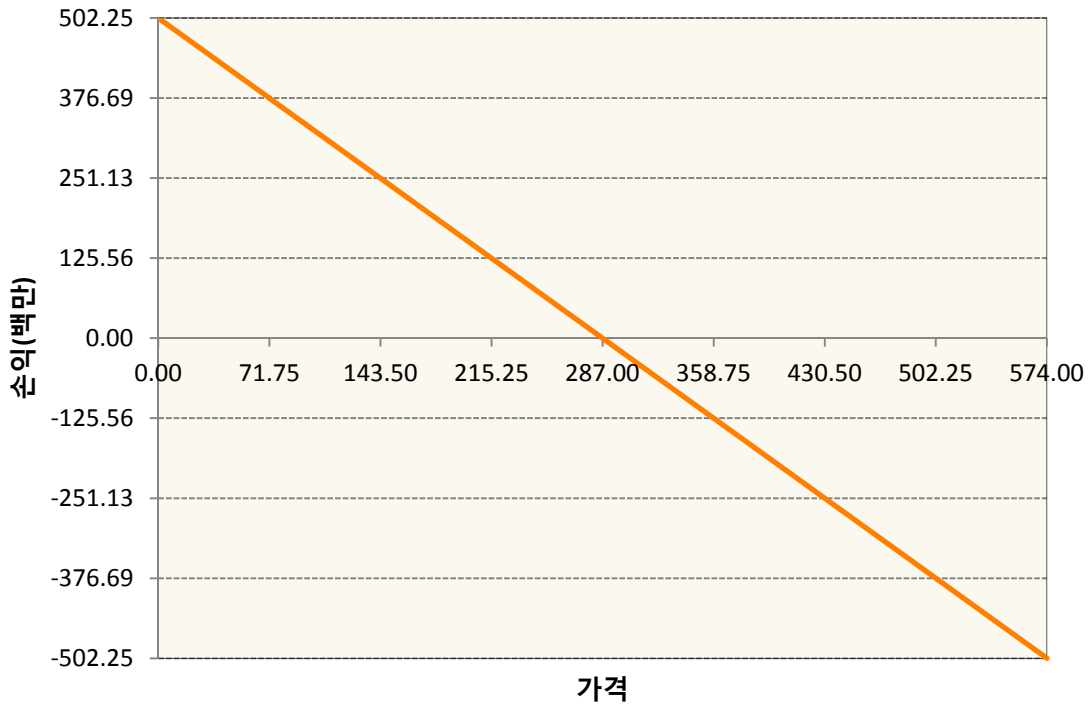
1. 계약금액

(단위:백만원)

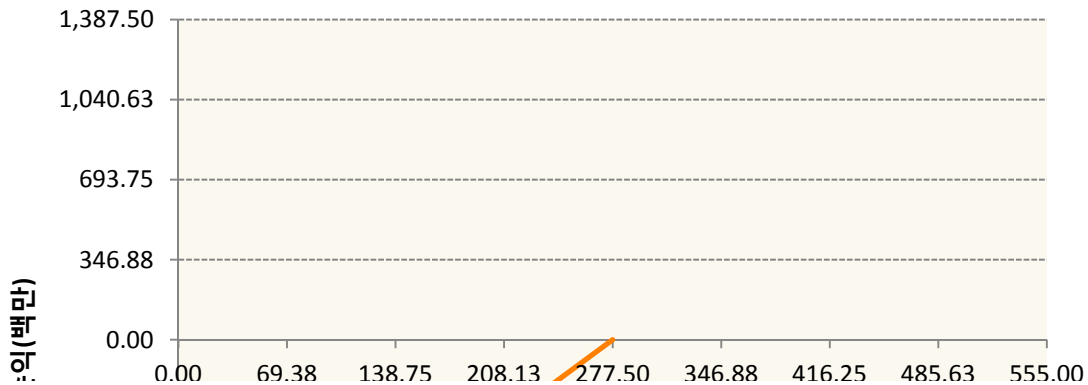
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	72	-72	장내
신규	유가증권	옵션	0	70	-70	장내
누계	유가증권	선물	0	502	-502	장내
누계	유가증권	옵션	0	2,928	-2,928	장내

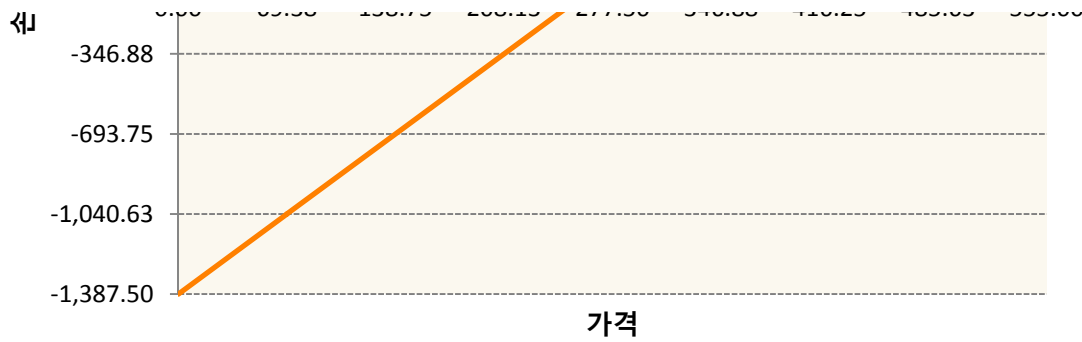
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

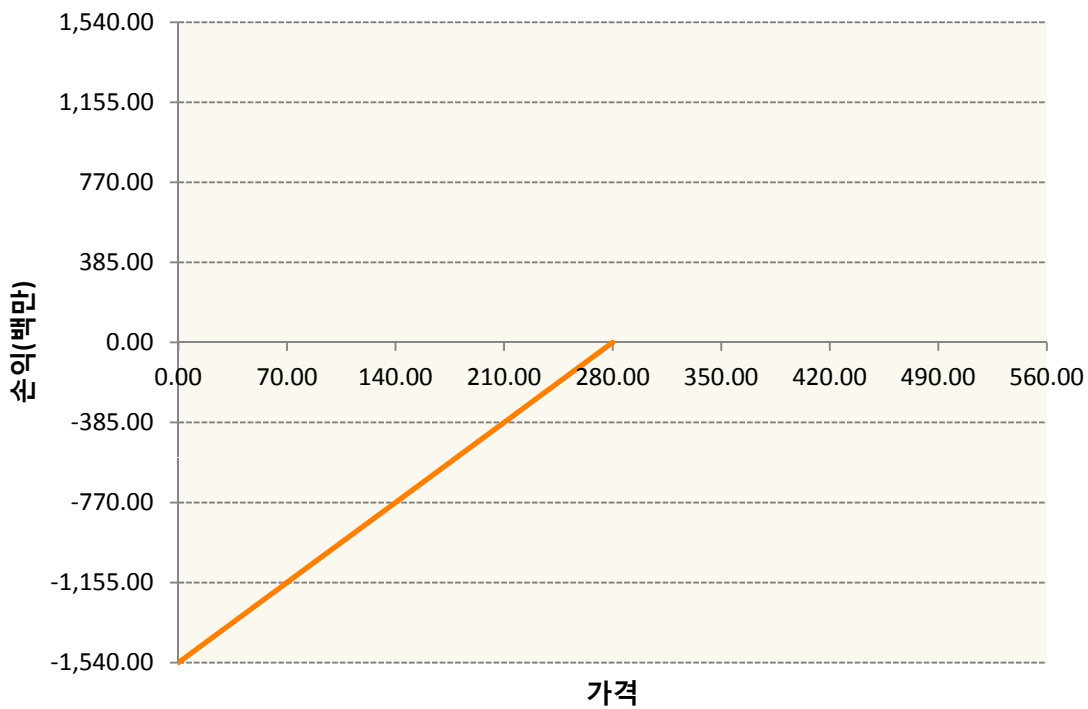


KR4301P52775-2019-05 풋277.5





KR4301P52809-2019-05 풋280



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						40
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	40	40	40	40	40	40	40	
-5.33%	27	27	27	27	27	27	27	
-2.67%	13	13	13	13	13	13	13	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13	
5.33%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27	
8.00%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40	
KR4301P52775		2019-05 풋277.5						69
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-68	-68	-68	-68	-68	-69	-69
-5.33%	-31	-32	-33	-33	-34	-35	-36
-2.67%	-6	-7	-8	-10	-11	-12	-13
0%	1	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	2	2	2	2	2	2	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

KR4301P52809

2019-05 풋280

87

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-86	-86	-86	-86	-86	-87	-87
-5.33%	-45	-45	-46	-46	-47	-48	-49
-2.67%	-11	-13	-14	-15	-17	-18	-19
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	4	4	4	4	4	3	3
5.33%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

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

(단위:백만원)

167

공시일	2019-04-24
기준일	2019-04-23

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

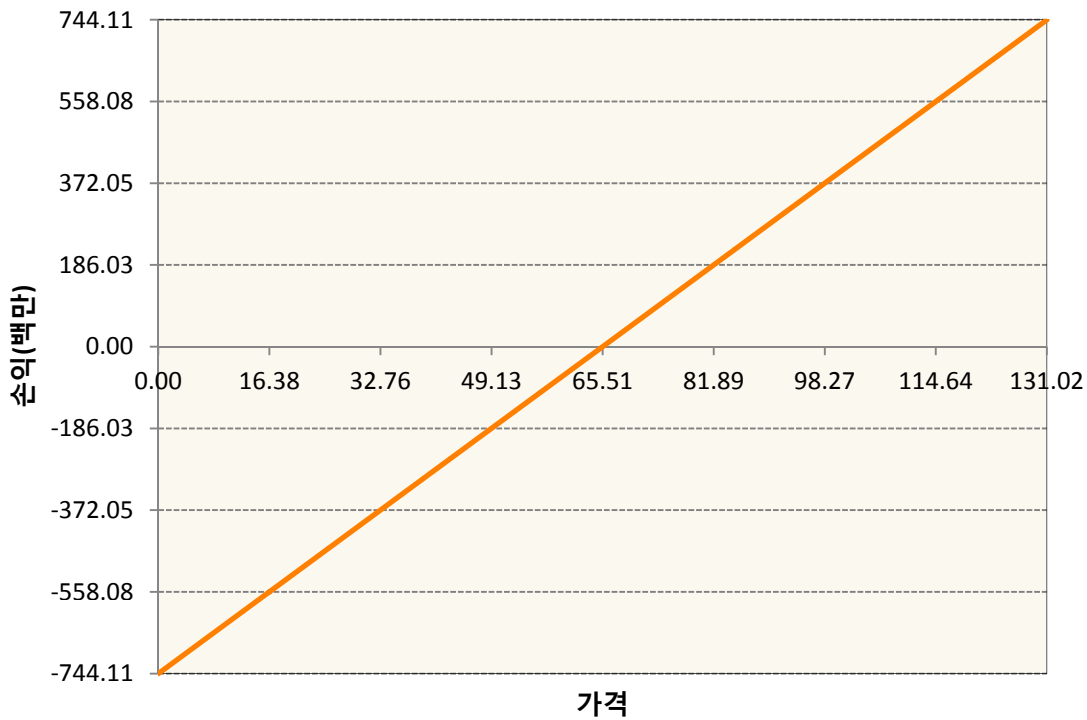
1. 계약금액

(단위:백만원)

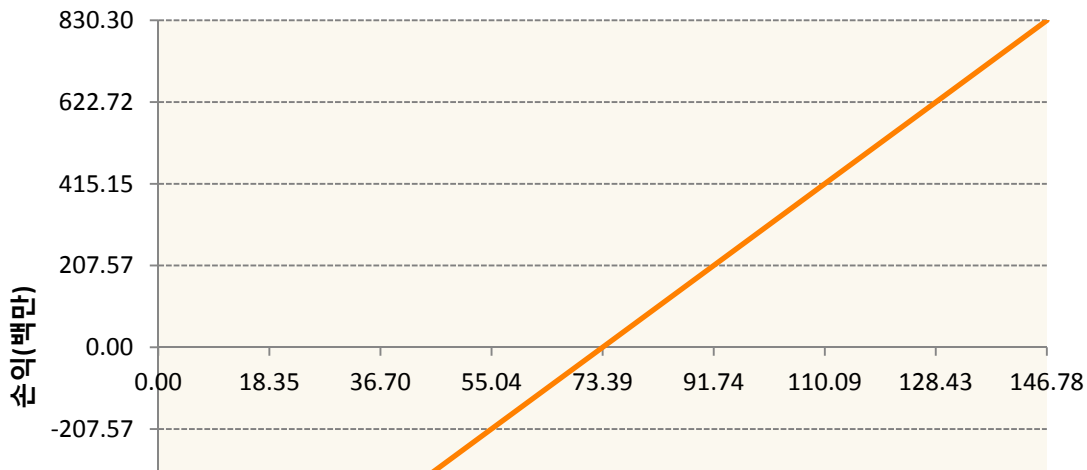
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,018	285	2,733	

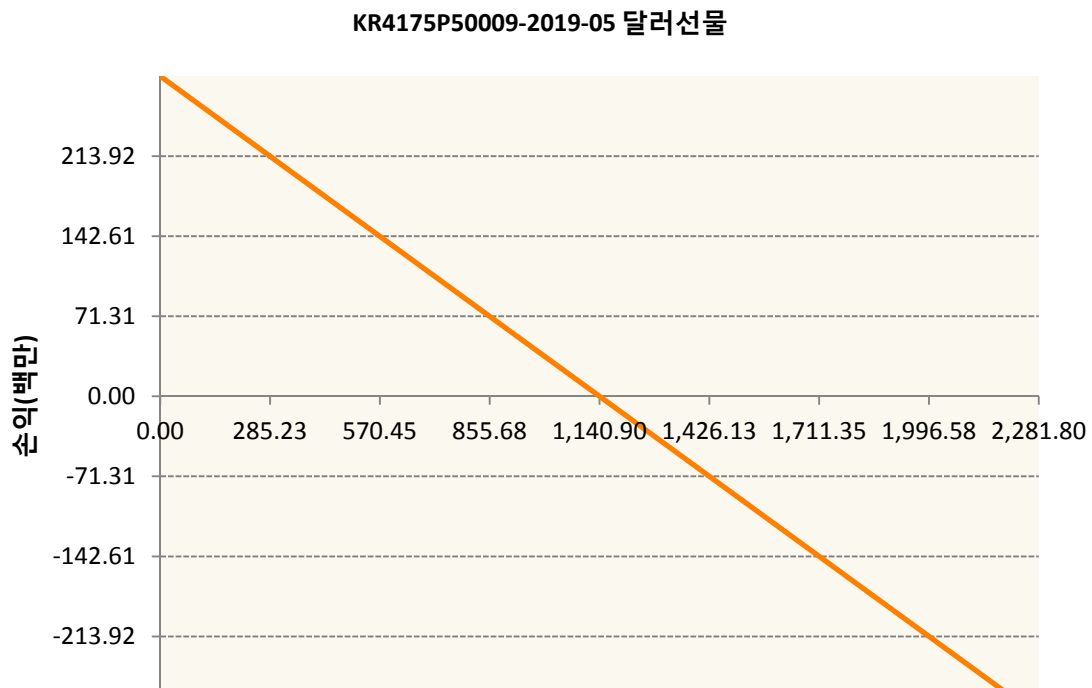
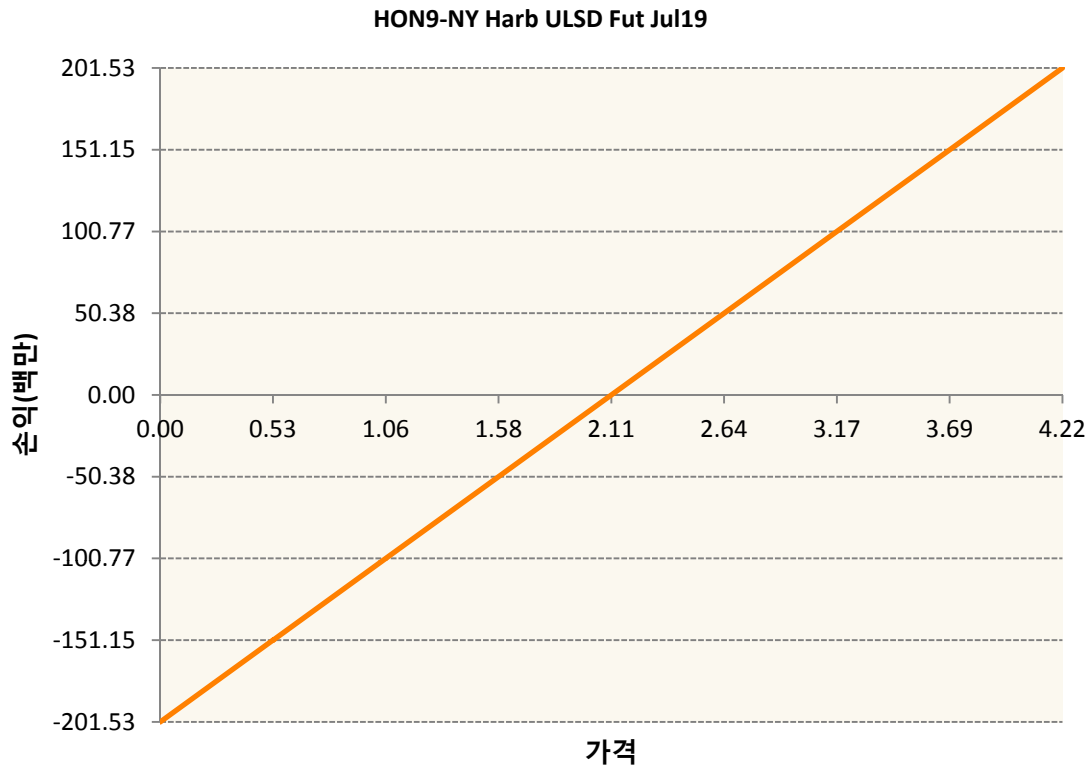
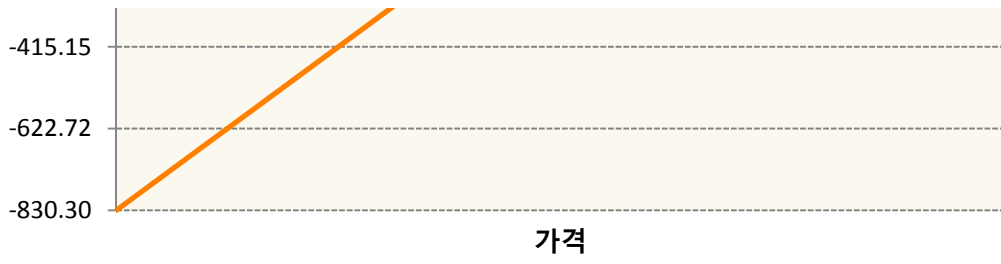
2. 만기시점의 손익구조

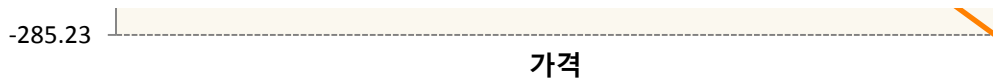
CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19



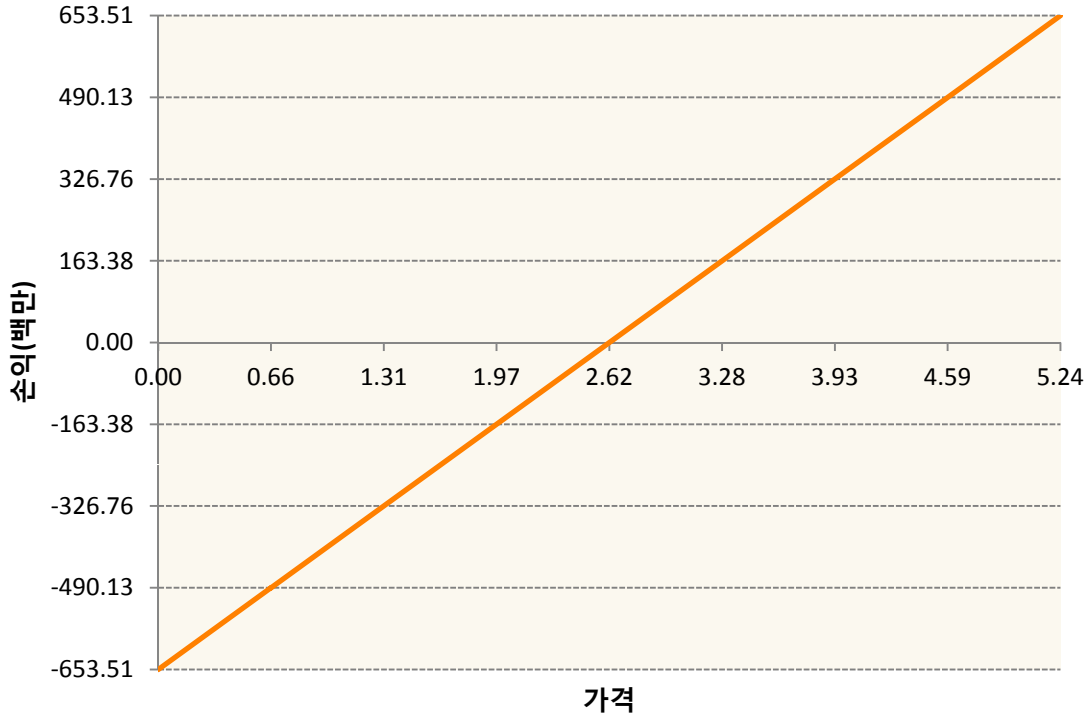
CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19



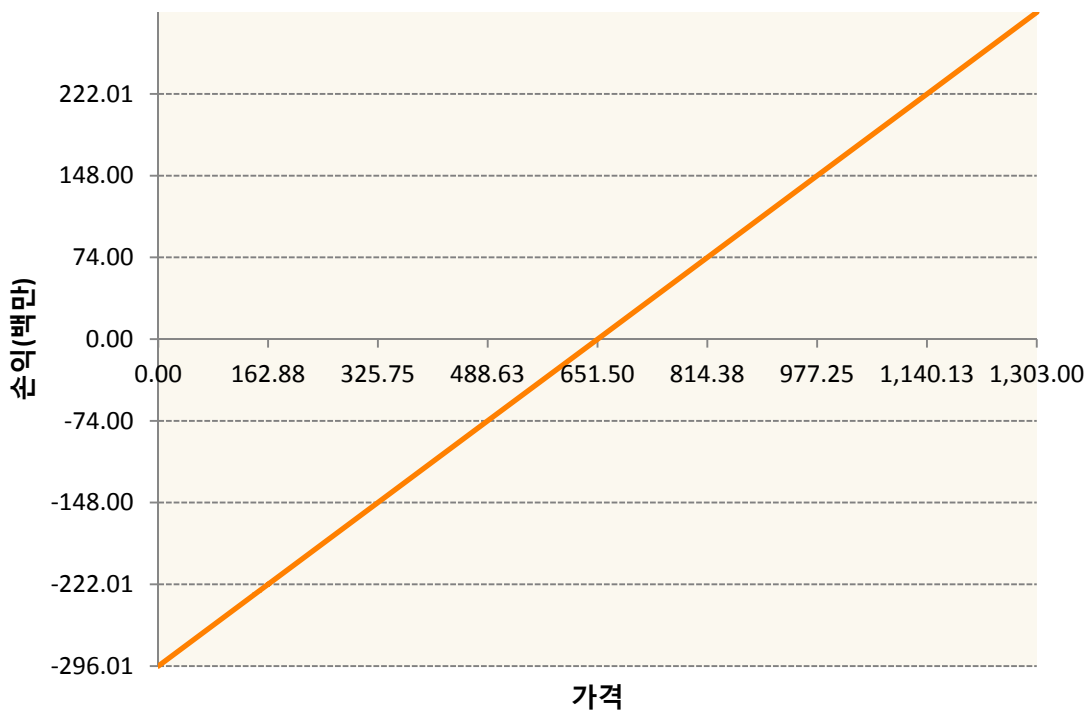




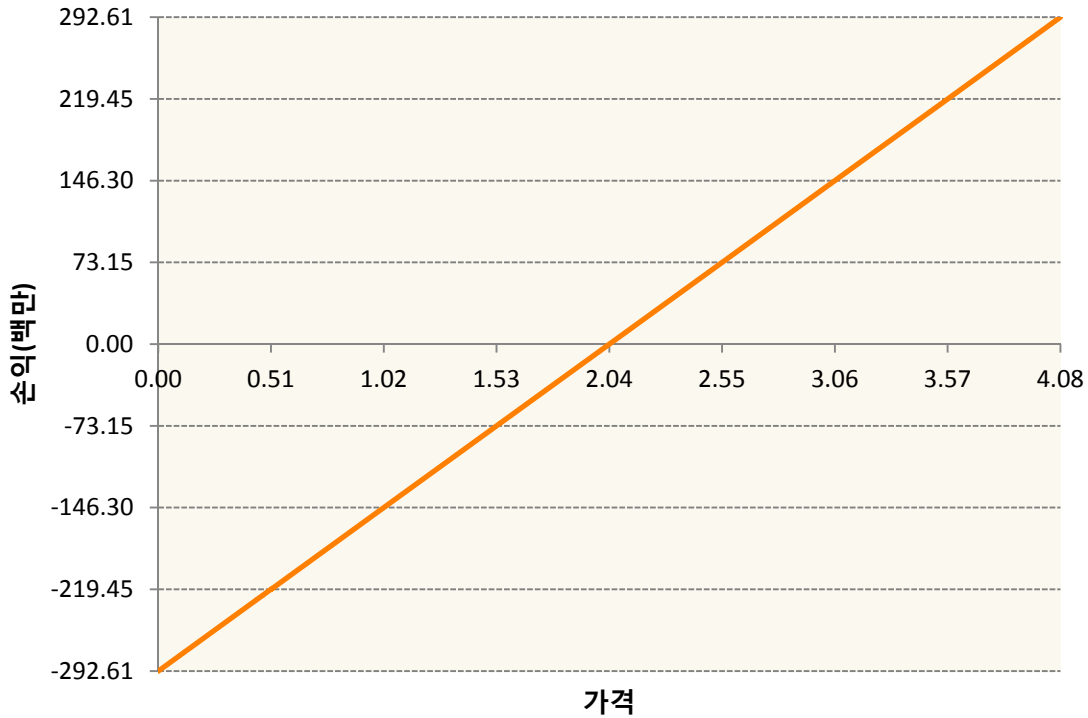
NGN19-NATURAL GAS FUTR Jul19



QSN9-Low Su Gasoil G Jul19



XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN9	WTI CRUDE FUTURE Jul19	60
CON9	BRENT CRUDE FUTR Jul19	66
HON9	NY Harb ULSD Fut Jul19	16
KR4175P500	2019-05 달러선물	23
NGN19	NATURAL GAS FUTR Jul19	52
QSN9	Low Su Gasoil G Jul19	24
XBN9	GASOLINE RBOB FUT Jul19	23

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

445

공시일	2019-04-24
기준일	2019-04-23

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

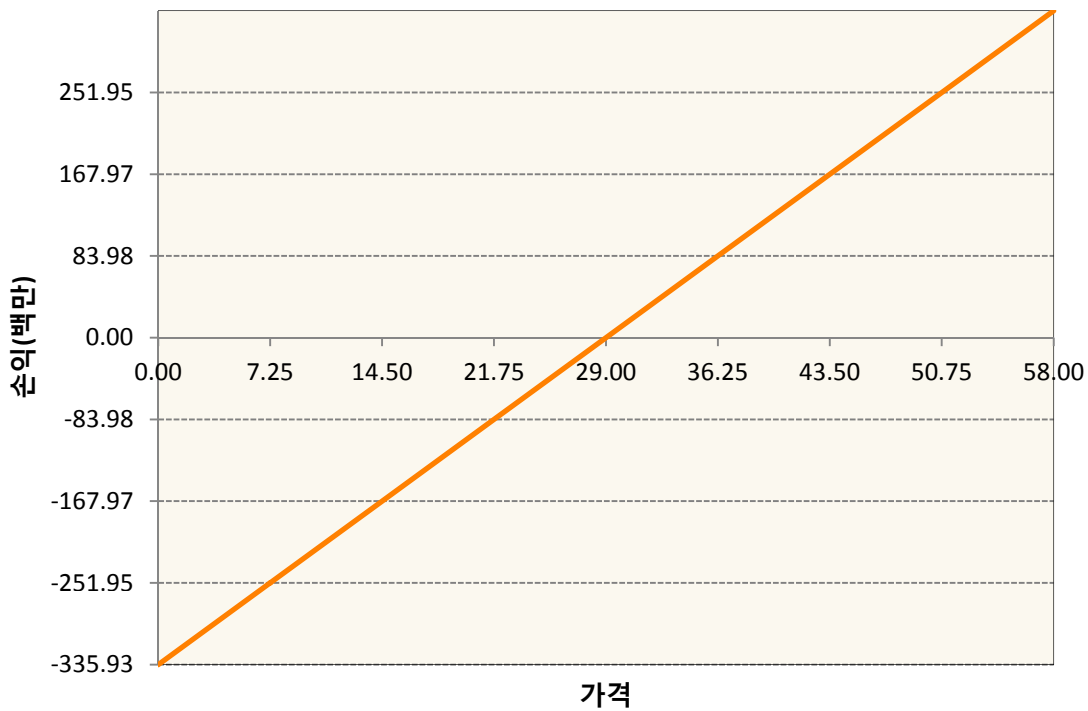
1. 계약금액

(단위:백만원)

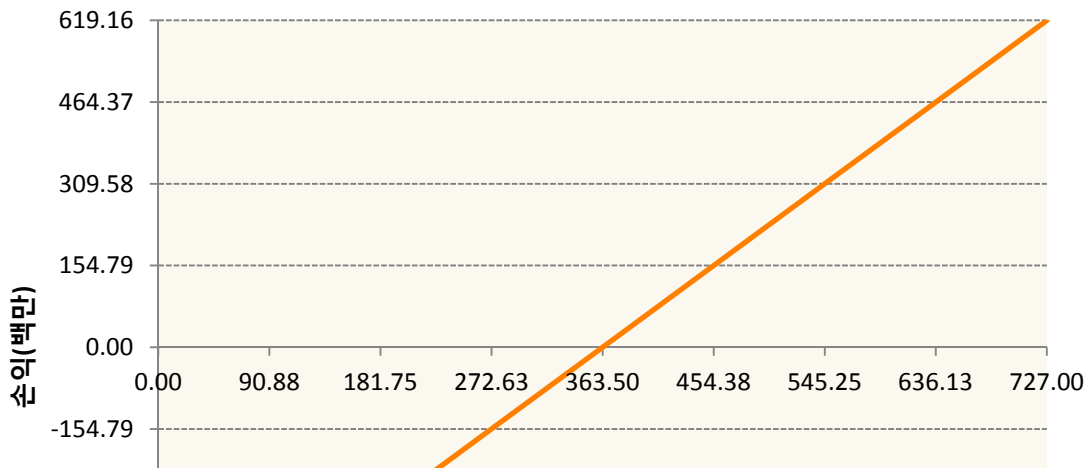
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,187	57	3,130	

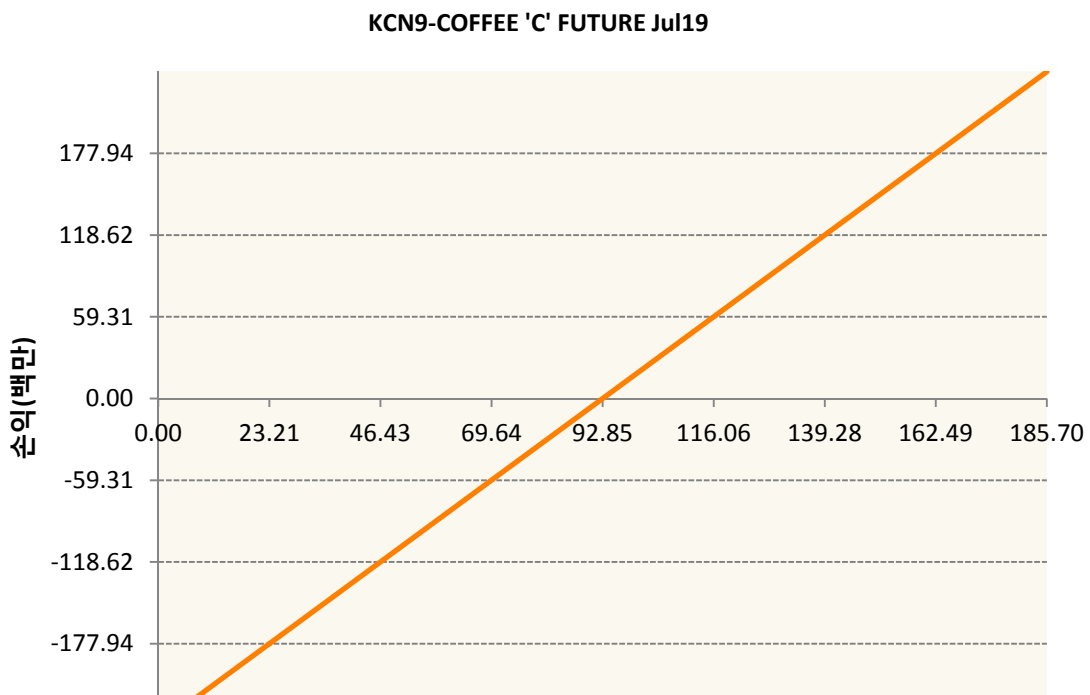
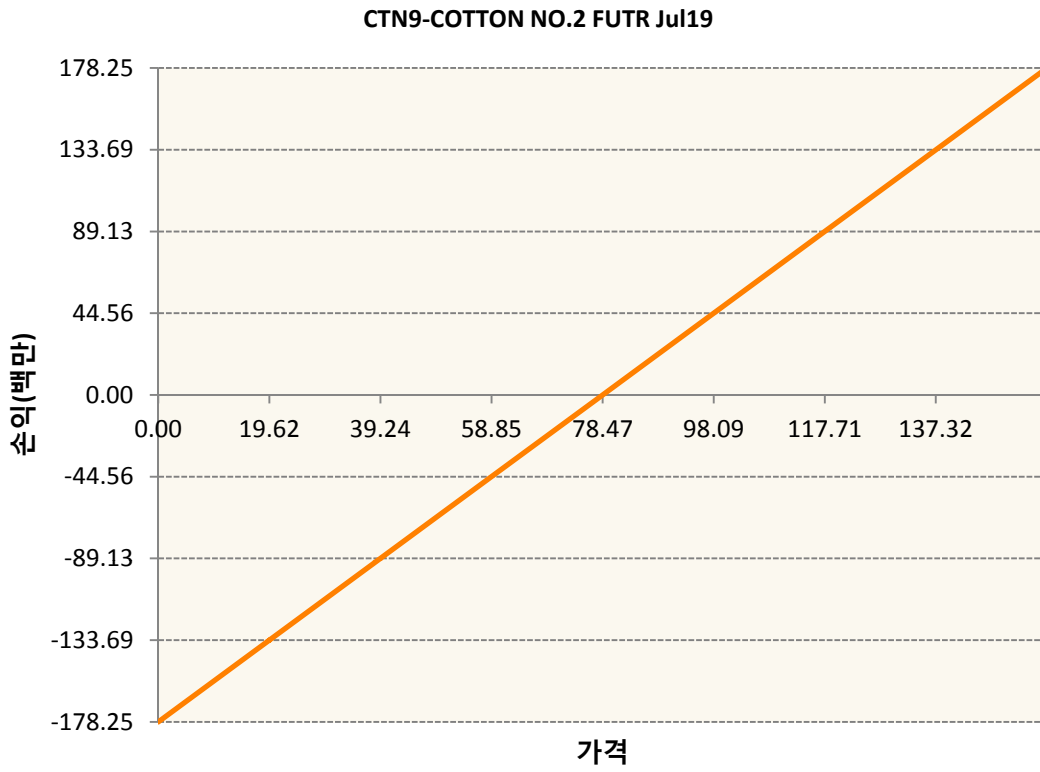
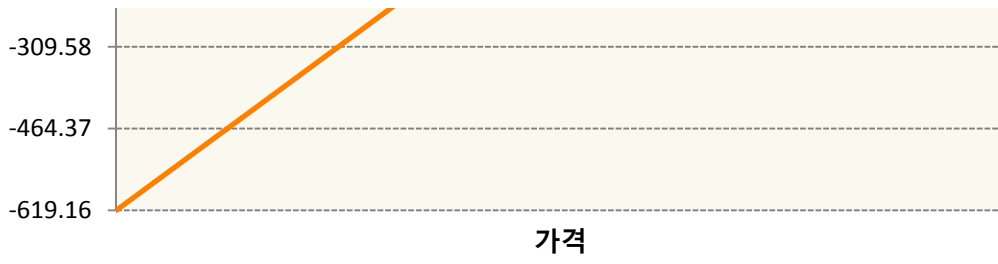
2. 만기시점의 손익구조

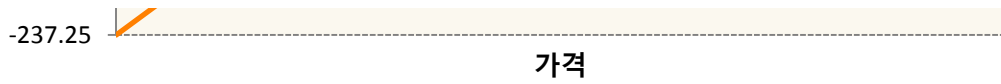
BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19



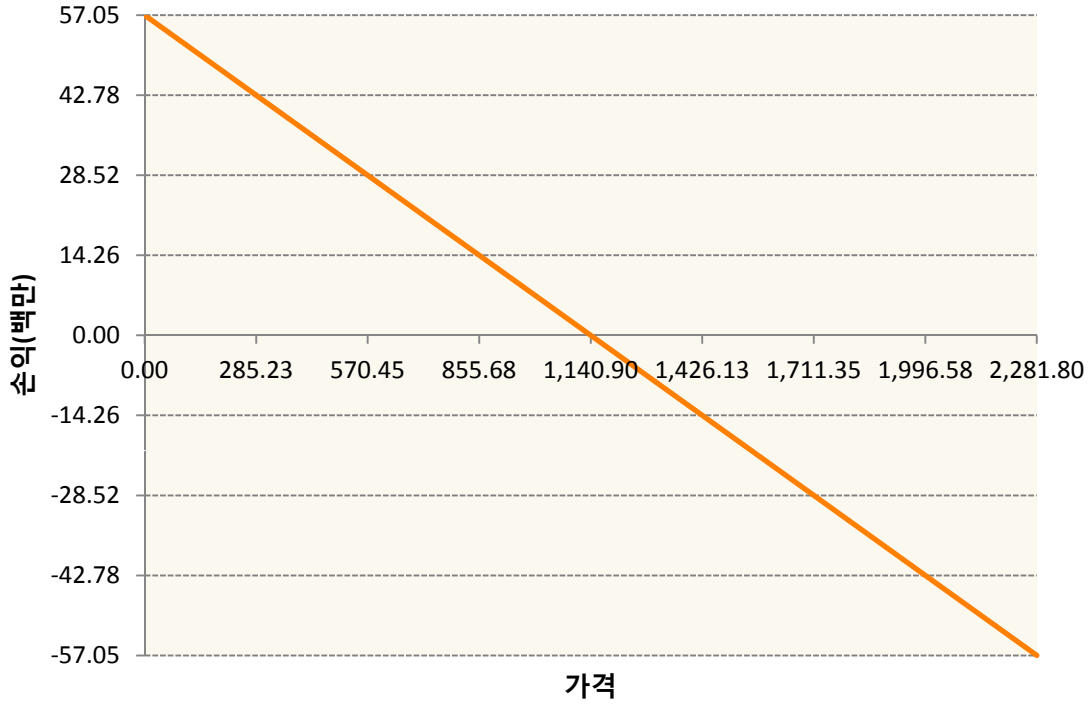
CN9-CORN FUTURE Jul19



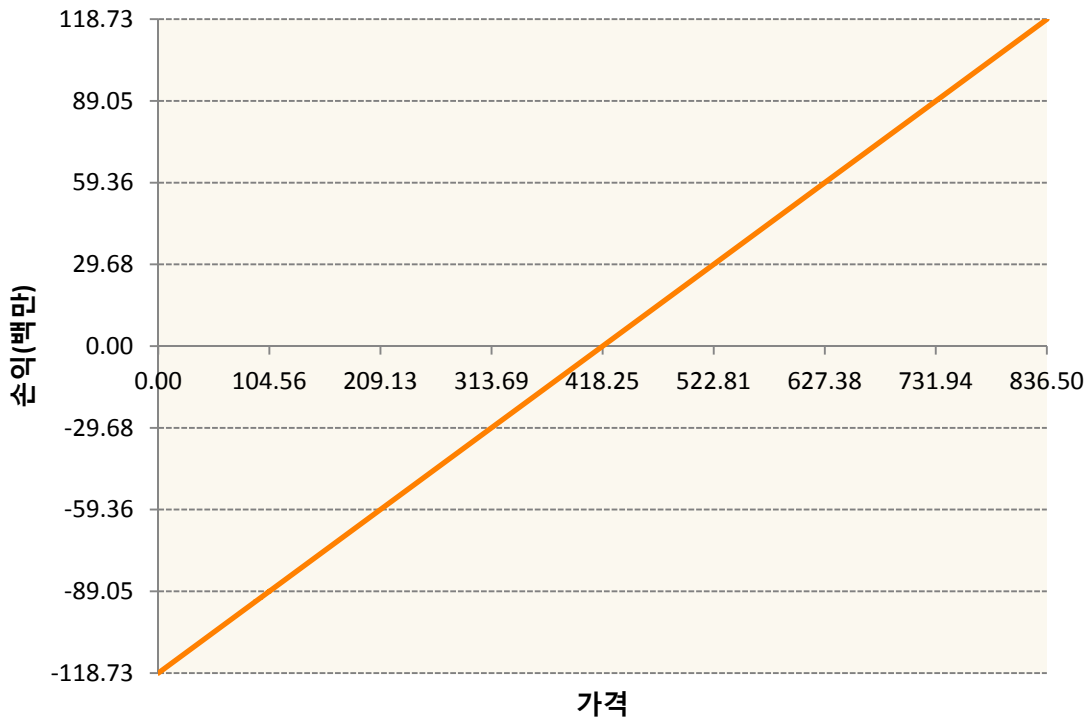




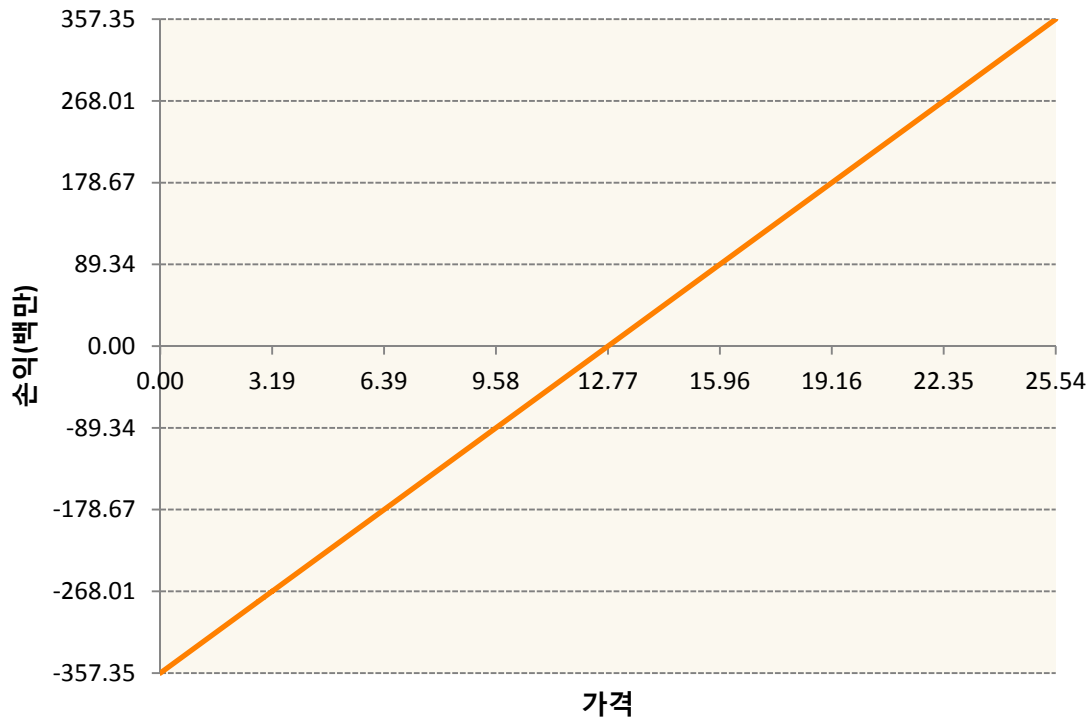
KR4175P50009-2019-05 달러선물



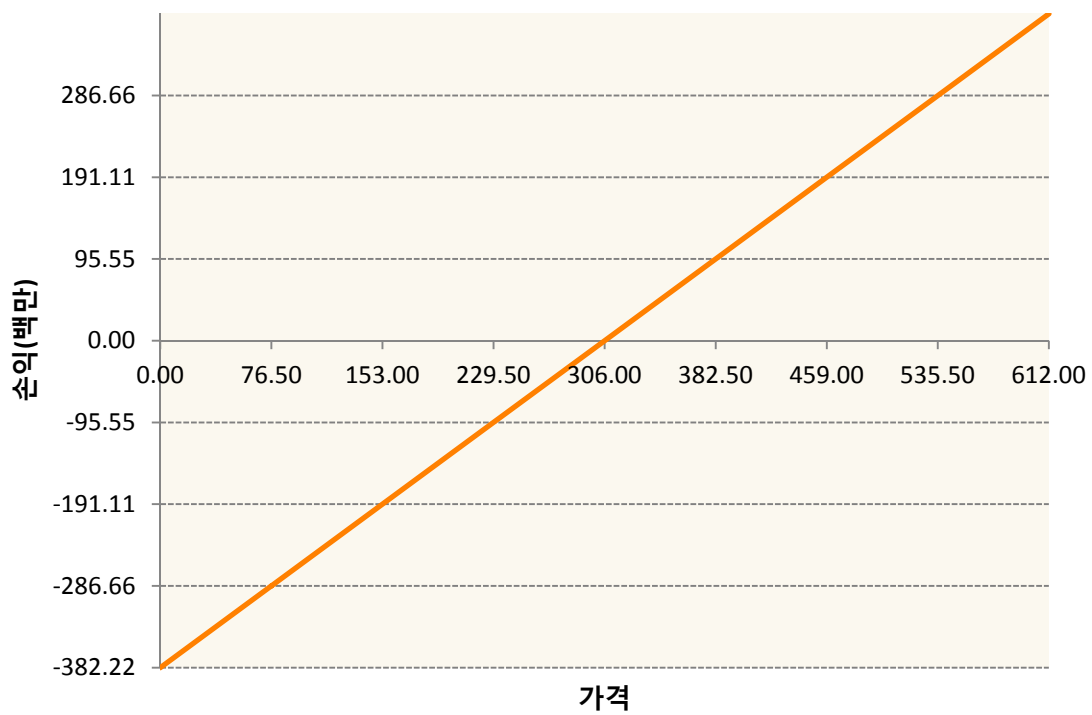
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



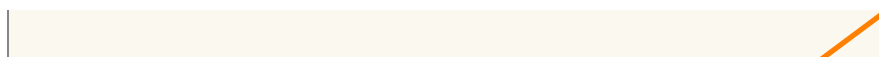
SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

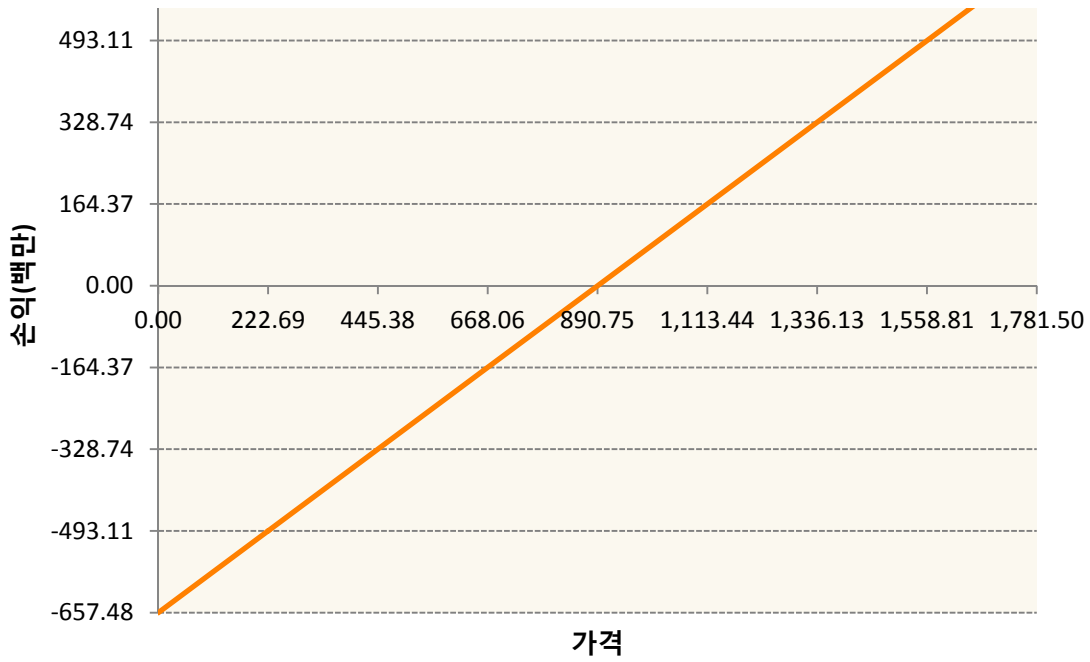


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19

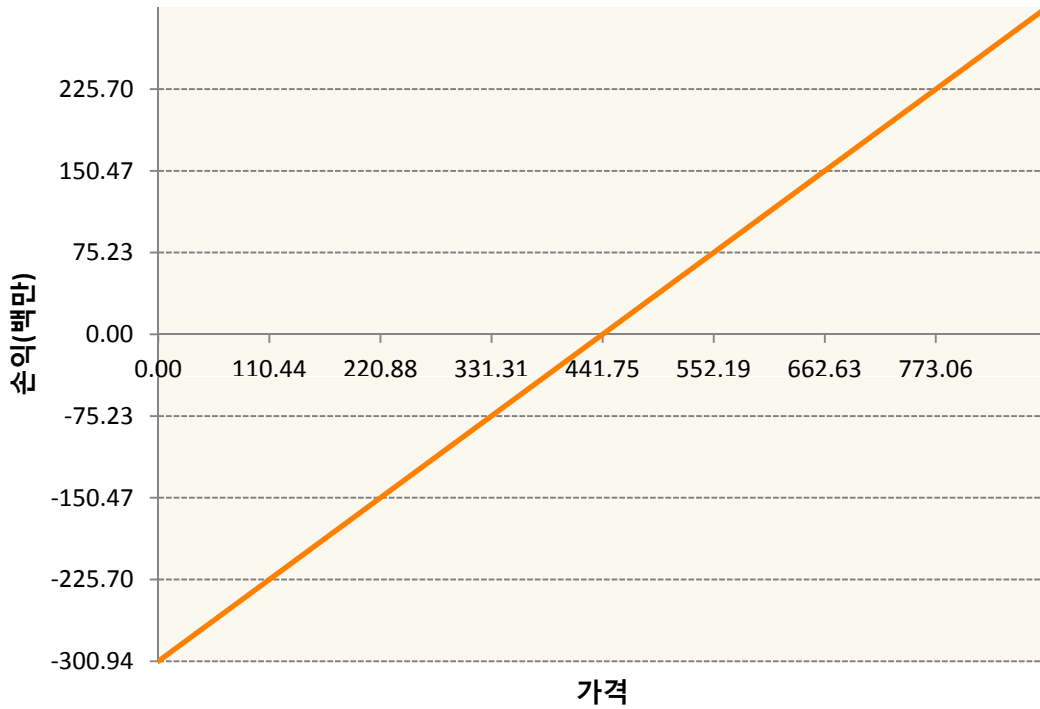


SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





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	9
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)

257