

공시일	2019-04-25
기준일	2019-04-24

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)

93

공시일	2019-04-25
기준일	2019-04-24

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

1,165

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

684

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-04-25
기준일	2019-04-24

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)	356
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	98
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	166

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

979

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-04-25
기준일	2019-04-24

유로인덱스모(주식-파생형)

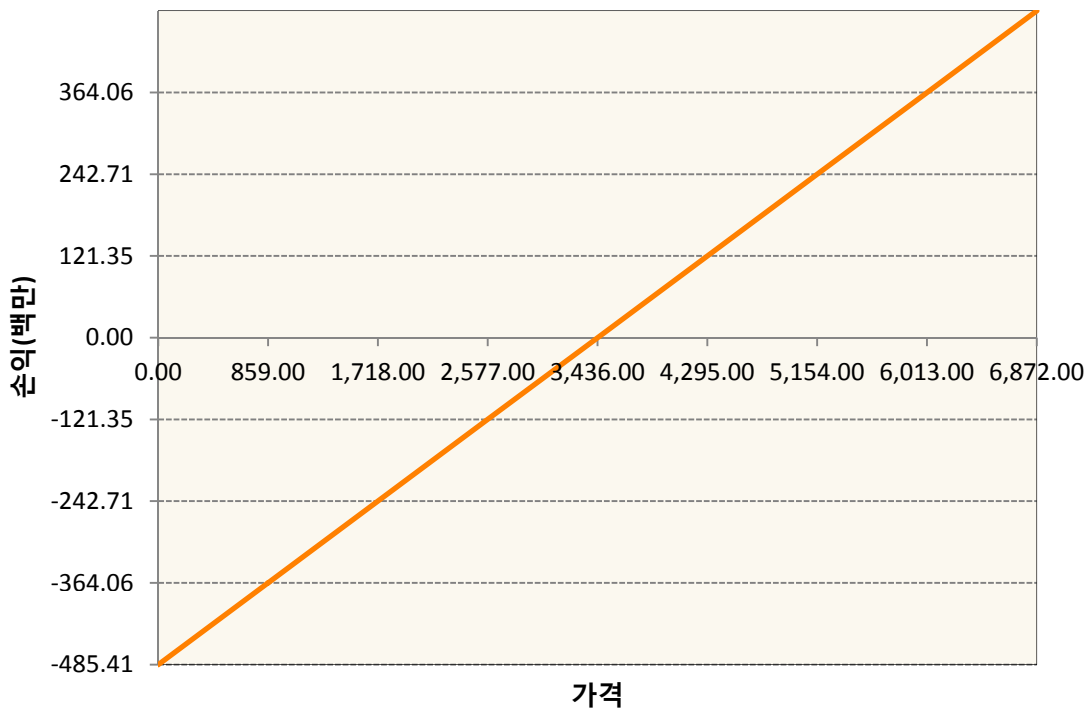
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	485	0	485	

2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	39
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

28

공시일	2019-04-25
기준일	2019-04-24

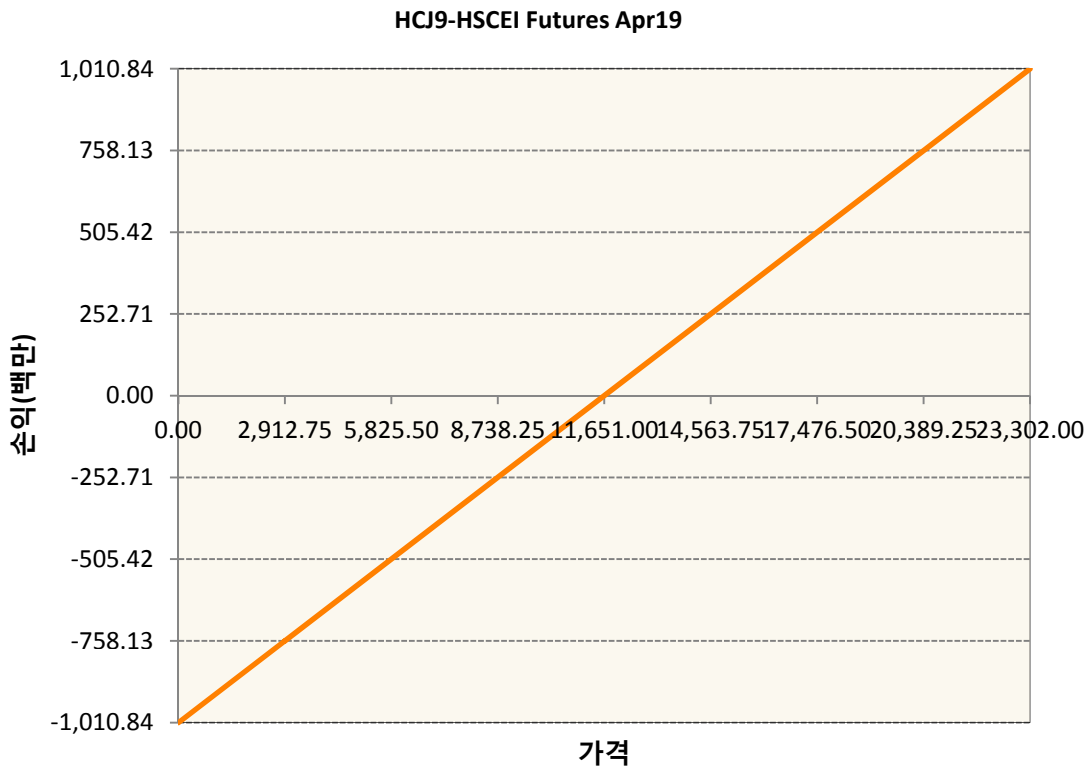
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,011	0	1,011	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	2019-04-25
기준일	2019-04-24

커버드콜모(주식혼합-파생형)

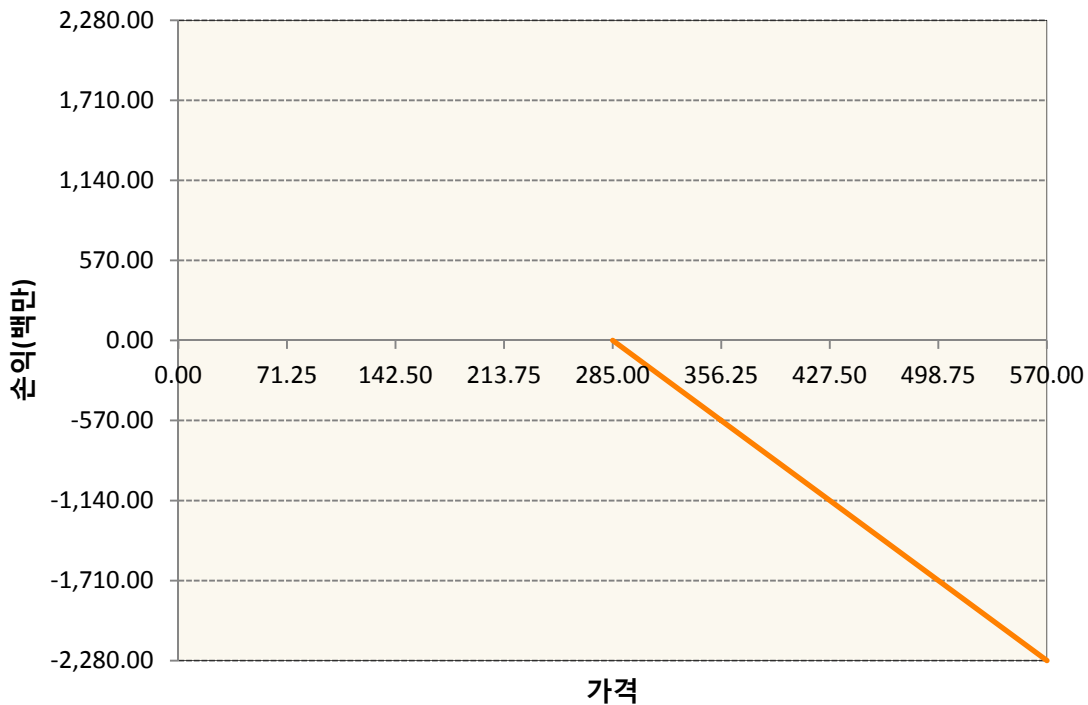
1. 계약금액

(단위:백만원)

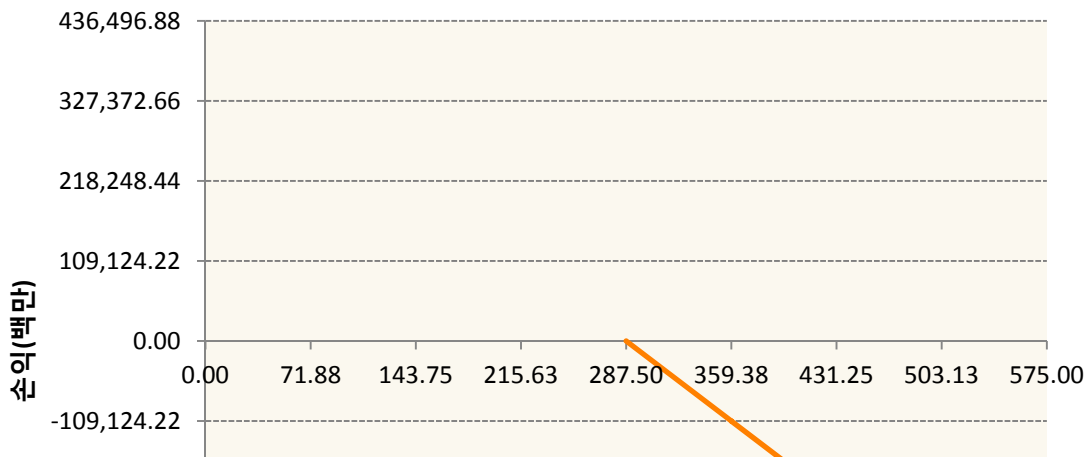
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	672,214	-672,214	장내

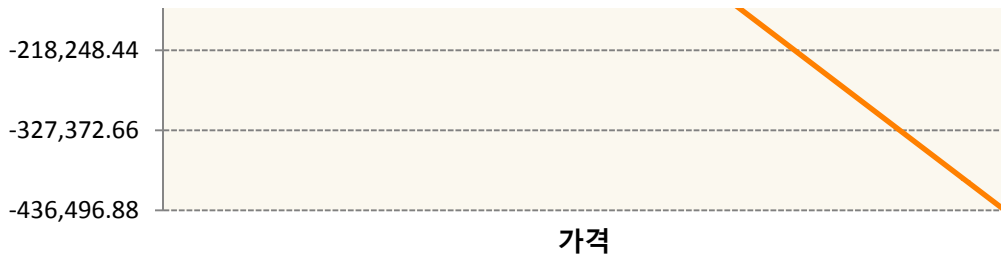
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P52850-2019-05 콜285

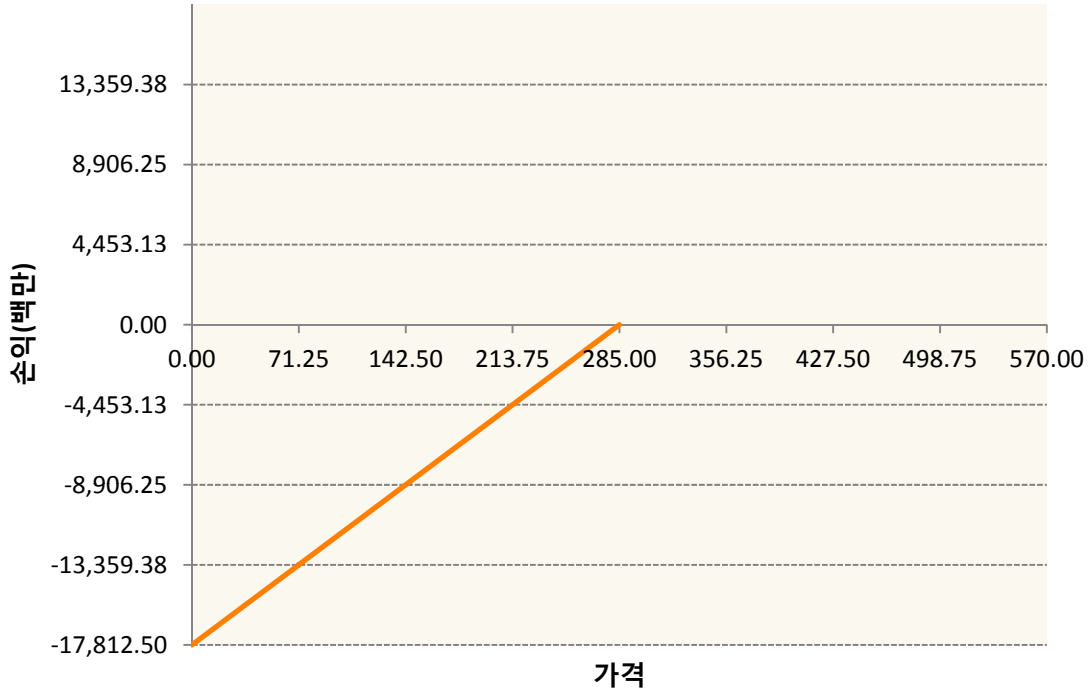


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

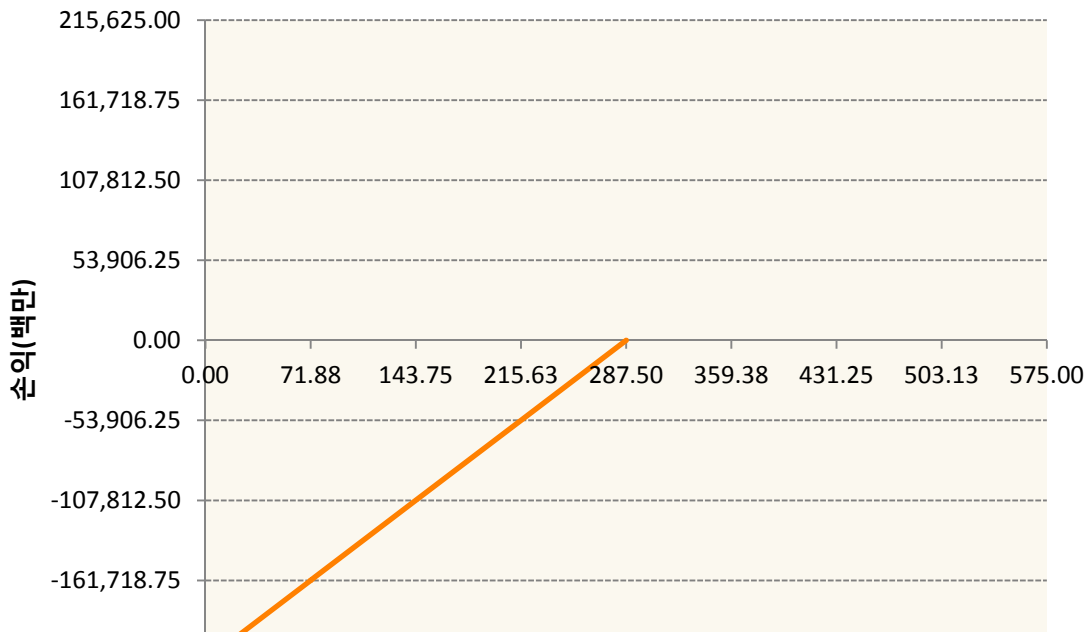




KR4301P52858-2019-05 풋285



KR4301P52874-2019-05 풋287.5



-215,625.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P52850		2019-05 콜285						140
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	39	38	38	37	37	36	35	
-5.33%	37	36	35	33	31	29	27	
-2.67%	30	28	25	22	19	16	13	
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11	
2.67%	-25	-28	-32	-35	-38	-42	-45	
5.33%	-75	-77	-79	-81	-84	-86	-89	
8.00%	-133	-133	-134	-135	-137	-138	-140	
KR4201P52876		2019-05 콜287.5						24,884
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5,781	5,752	5,702	5,625	5,518	5,378	5,206	
-5.33%	5,618	5,477	5,290	5,058	4,784	4,473	4,127	
-2.67%	4,755	4,359	3,921	3,448	2,948	2,424	1,880	
0%	1,994	1,336	671	0	-675	-1,353	-2,034	
2.67%	-3,797	-4,467	-5,144	-5,826	-6,512	-7,201	-7,893	
5.33%	-12,533	-12,967	-13,443	-13,952	-14,489	-15,049	-15,628	
8.00%	-23,070	-23,255	-23,493	-23,780	-24,110	-24,479	-24,884	
KR4301P52858		2019-05 풋285						1,273
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,272	-1,272	-1,272	-1,273	-1,273	-1,273	-1,273	
-5.33%	-800	-800	-801	-802	-803	-805	-807	
-2.67%	-335	-340	-345	-352	-359	-368	-377	
0%	45	30	15	0	-15	-30	-45	
2.67%	205	196	186	176	164	153	140	
5.33%	228	227	225	222	219	215	210	
8.00%	229	229	228	228	228	227	226	
KR4301P52874		2019-05 풋287.5						15,945
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-15,942	-15,942	-15,942	-15,942	-15,942	-15,943	-15,945	
-5.33%	-10,273	-10,274	-10,276	-10,280	-10,287	-10,299	-10,316	
-2.67%	-4,632	-4,658	-4,695	-4,743	-4,802	-4,871	-4,950	
0%	463	314	159	0	-163	-329	-497	
2.67%	3,302	3,149	2,990	2,826	2,659	2,490	2,318	

5.33%	3,907	3,874	3,829	3,772	3,704	3,625	3,536
8.00%	3,944	3,943	3,939	3,931	3,919	3,901	3,877

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

(단위:백만원)

46,051

공시일	2019-04-25
기준일	2019-04-24

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

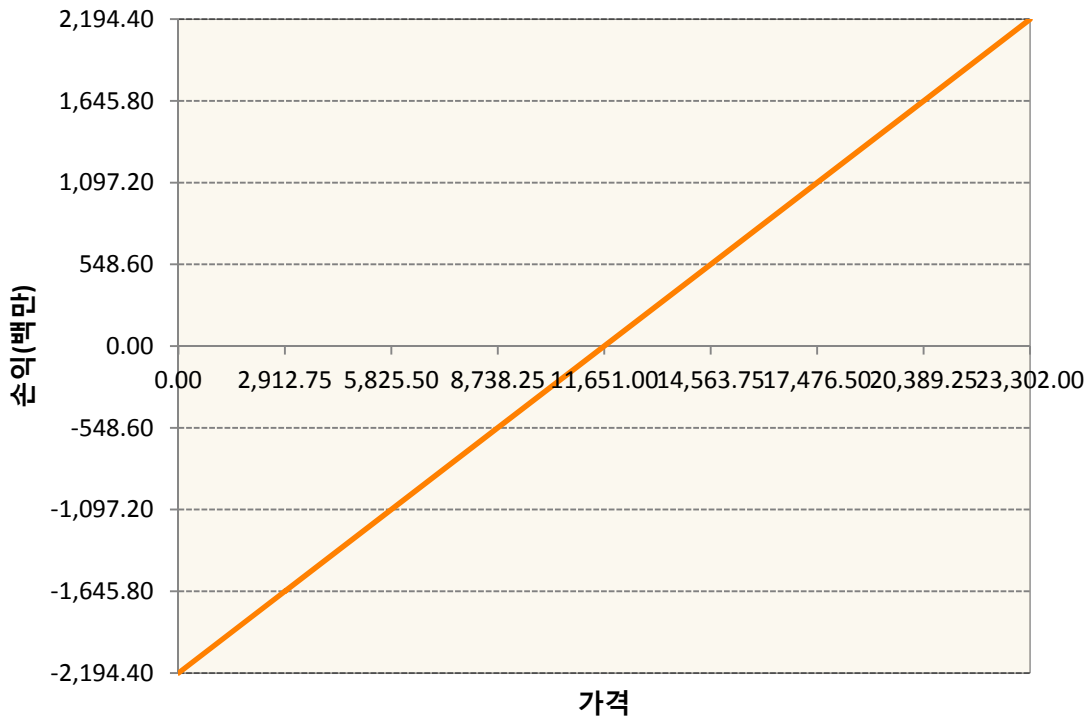
1. 계약금액

(단위:백만원)

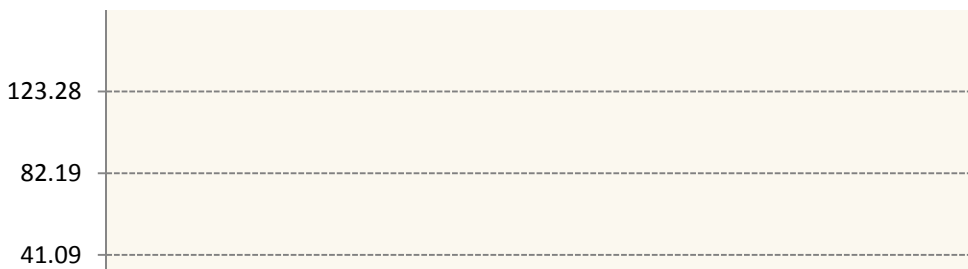
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,194	0	2,194	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,636	-5,636	장내
누계	통화	선도	0	3,082	-3,082	장외

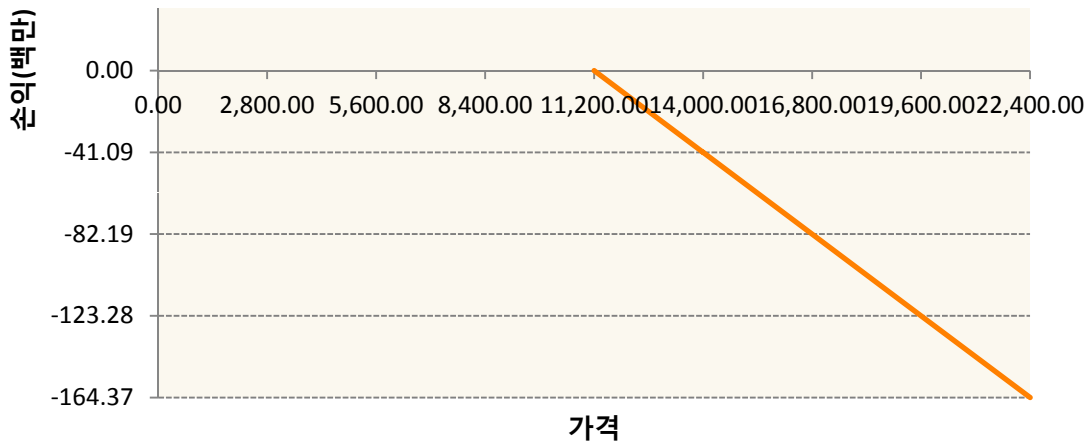
2. 만기시점의 손익구조

HCJ9-HSCEI Futures Apr19

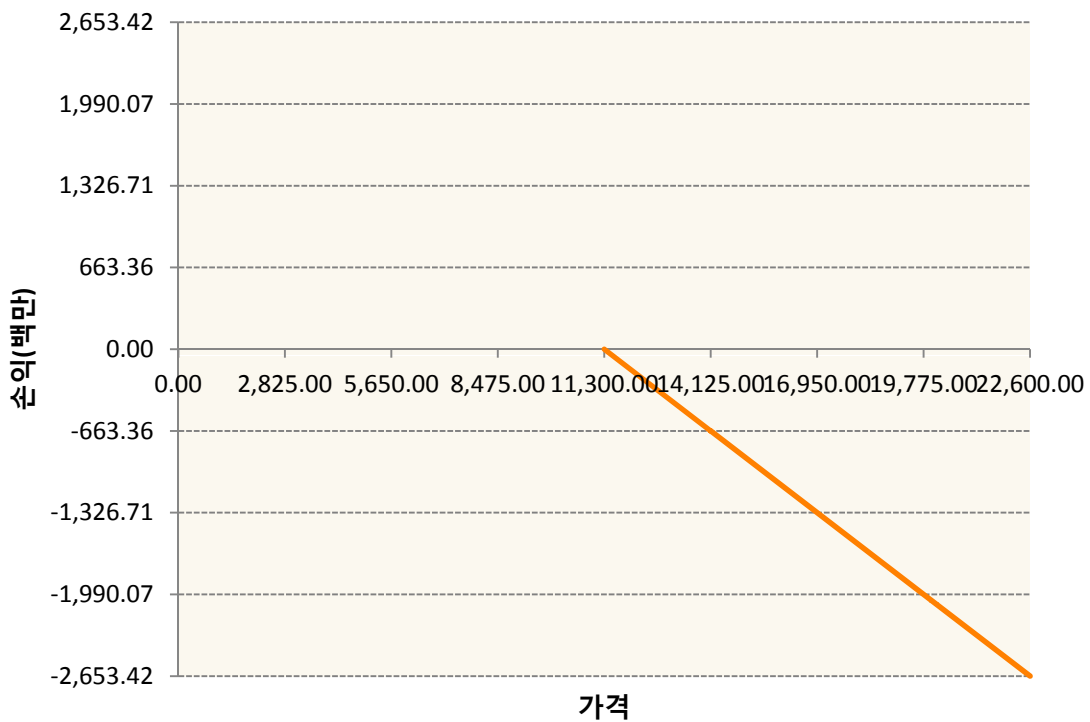


OHHIJ9-C112-HSCEI

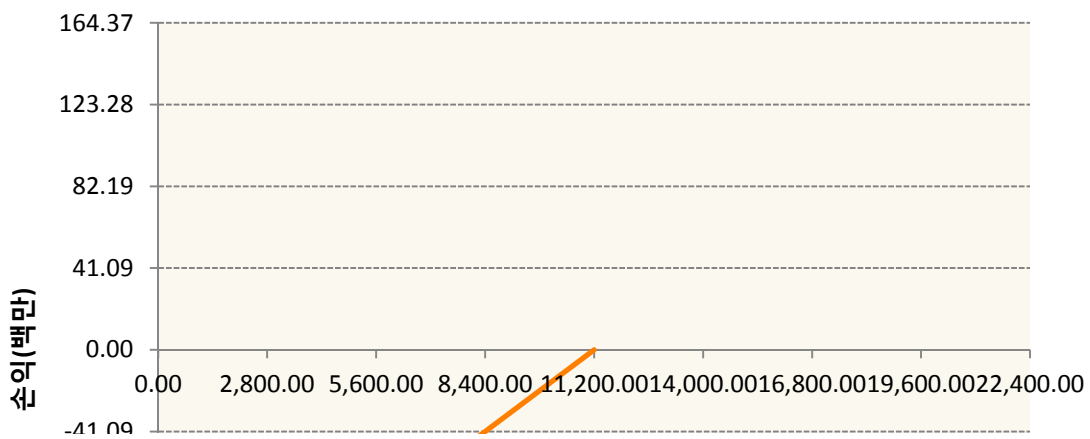


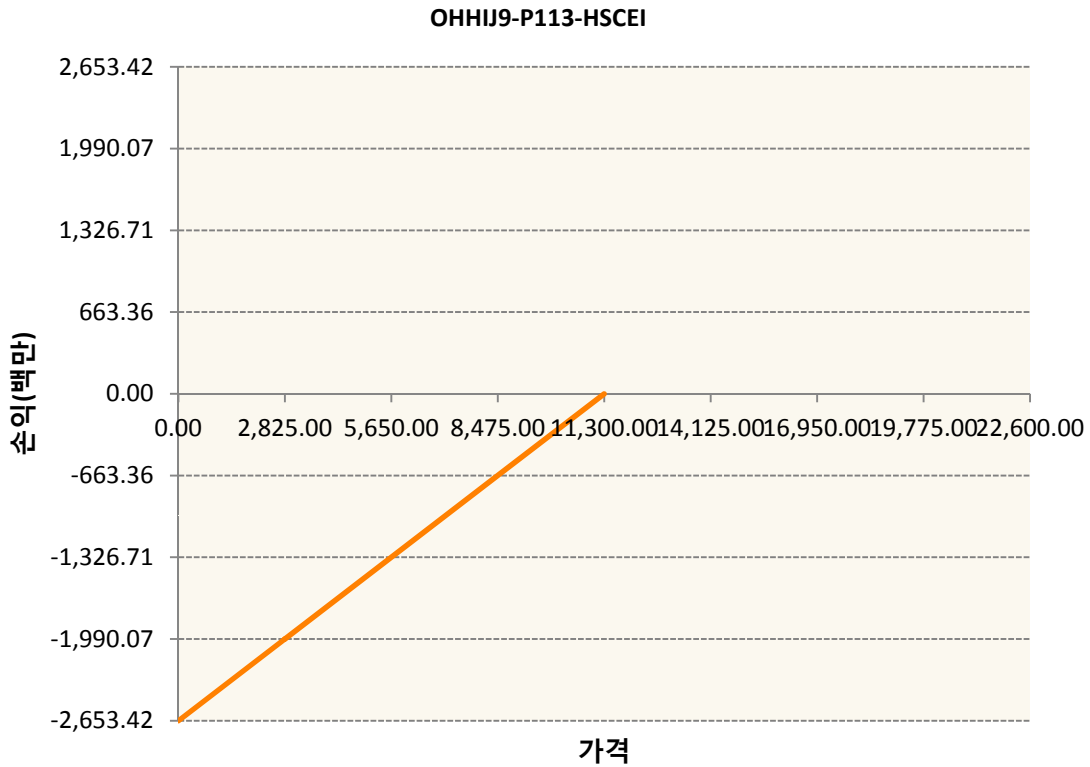


OHHIJ9-C113-HSCEI



OHHIJ9-P112-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	223
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	23
HCJ9 HSCEI Futures Apr19	176
OHHIJ9-C11 HSCEI	13
OHHIJ9-C11 HSCEI	212
OHHIJ9-P11: HSCEI	13
OHHIJ9-P11: HSCEI	212

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	725

공시일	2019-04-25
기준일	2019-04-24

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

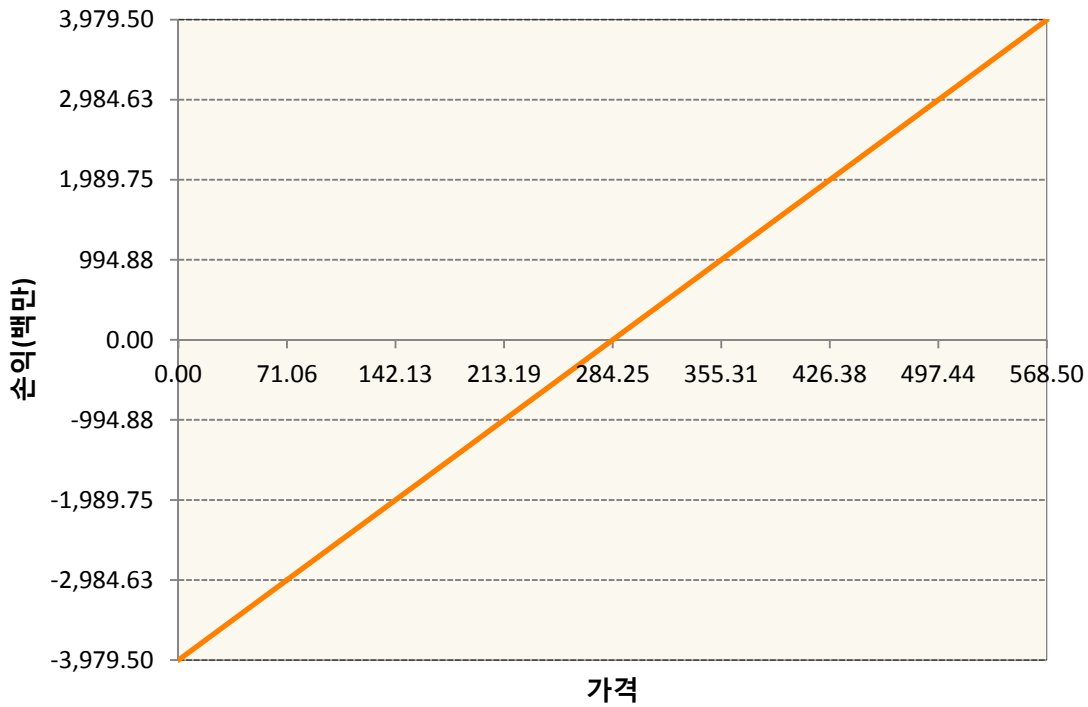
1. 계약금액

(단위:백만원)

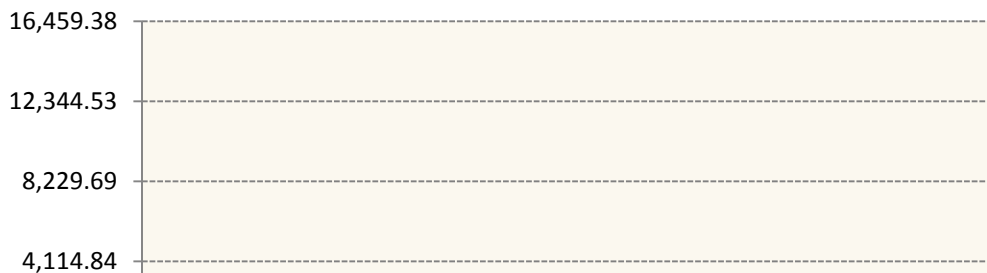
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	212	0	212	장내
누계	유가증권	선물	3,980	0	3,980	장내
누계	유가증권	스왑	32,836	0	32,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	32,264	-32,264	장내

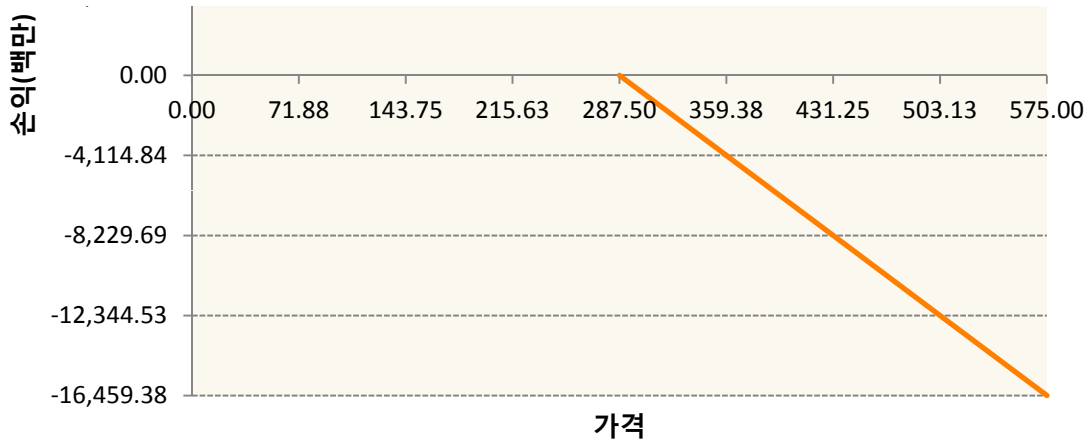
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

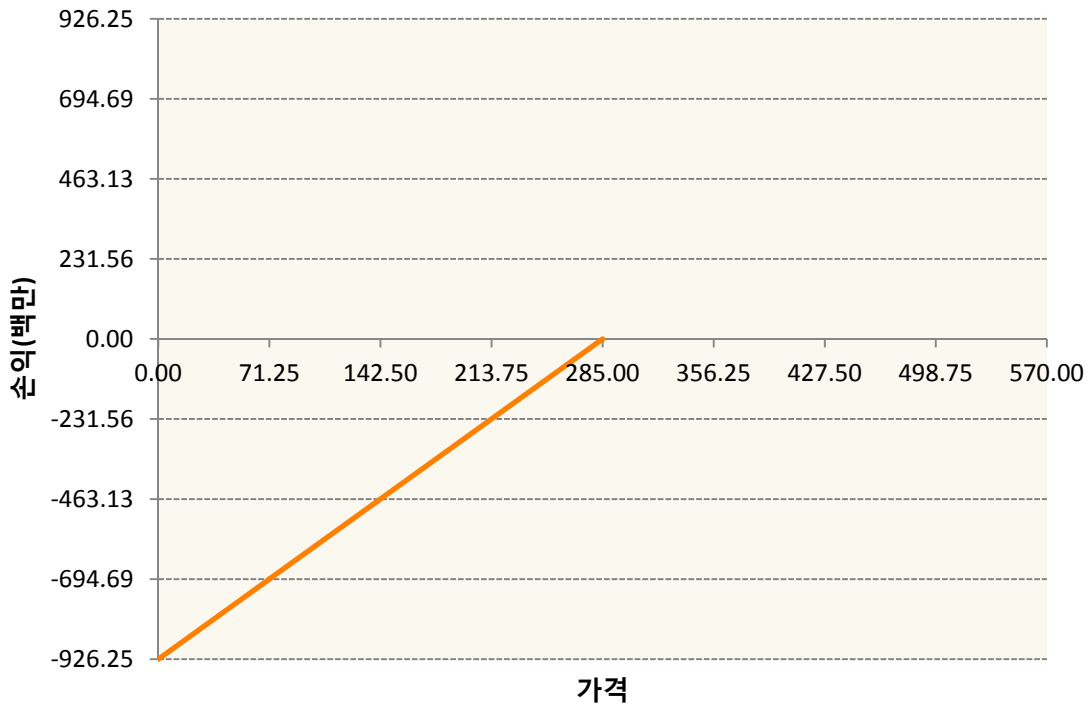


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

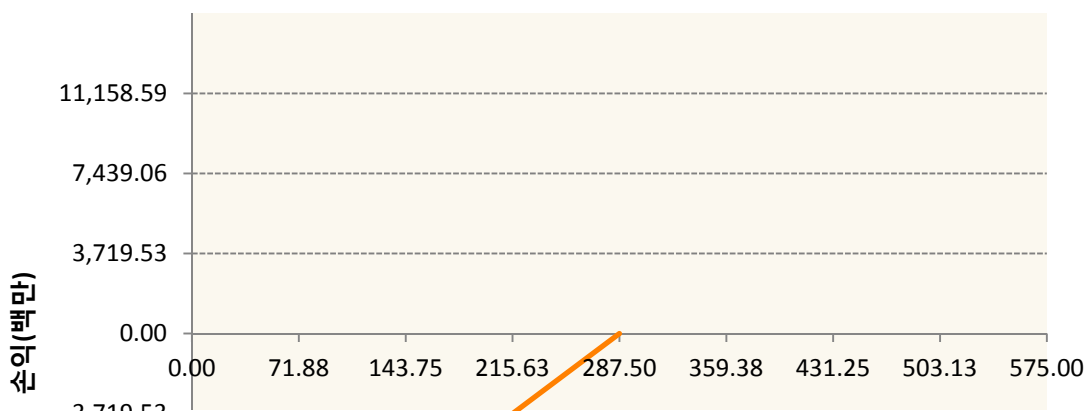




KR4301P52858-2019-05 풋285



KR4301P52874-2019-05 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,203
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,203	-2,203	-2,203	-2,203	-2,203	-2,203	-2,203	
-5.33%	-1,469	-1,469	-1,469	-1,469	-1,469	-1,469	-1,469	
-2.67%	-734	-734	-734	-734	-734	-734	-734	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	734	734	734	734	734	734	734	
5.33%	1,469	1,469	1,469	1,469	1,469	1,469	1,469	
8.00%	2,203	2,203	2,203	2,203	2,203	2,203	2,203	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						597
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-597	-597	-597	-597	-597	-597	-597	
-5.33%	-398	-398	-398	-398	-398	-398	-398	
-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%	398	398	398	398	398	398	398	
8.00%	597	597	597	597	597	597	597	
KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						318
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-318	-318	-318	-318	-318	-318	-318	
-5.33%	-212	-212	-212	-212	-212	-212	-212	
-2.67%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	106	106	106	106	106	106	106	
5.33%	212	212	212	212	212	212	212	
8.00%	318	318	318	318	318	318	318	
KR4201P52876		2019-05 콜287.5						938
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	218	217	215	212	208	203	196
-5.33%	212	207	199	191	180	169	156
-2.67%	179	164	148	130	111	91	71
0%	75	50	25	0	-25	-51	-77
2.67%	-143	-168	-194	-220	-246	-272	-298
5.33%	-473	-489	-507	-526	-546	-567	-589
8.00%	-870	-877	-886	-897	-909	-923	-938
KR4301P52858 2019-05 풋285							66
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
-5.33%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
-2.67%	-17	-18	-18	-18	-19	-19	-20
0%	2	2	1	0	-1	-2	-2
2.67%	11	10	10	9	9	8	7
5.33%	12	12	12	12	11	11	11
8.00%	12	12	12	12	12	12	12
KR4301P52874 2019-05 풋287.5							1,100
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,100	-1,100	-1,100	-1,100	-1,100	-1,100	-1,100
-5.33%	-709	-709	-709	-709	-710	-711	-712
-2.67%	-320	-321	-324	-327	-331	-336	-342
0%	32	22	11	0	-11	-23	-34
2.67%	228	217	206	195	183	172	160
5.33%	270	267	264	260	256	250	244
8.00%	272	272	272	271	270	269	267

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

(단위:백만원)

5,432

공시일	2019-04-25
기준일	2019-04-24

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

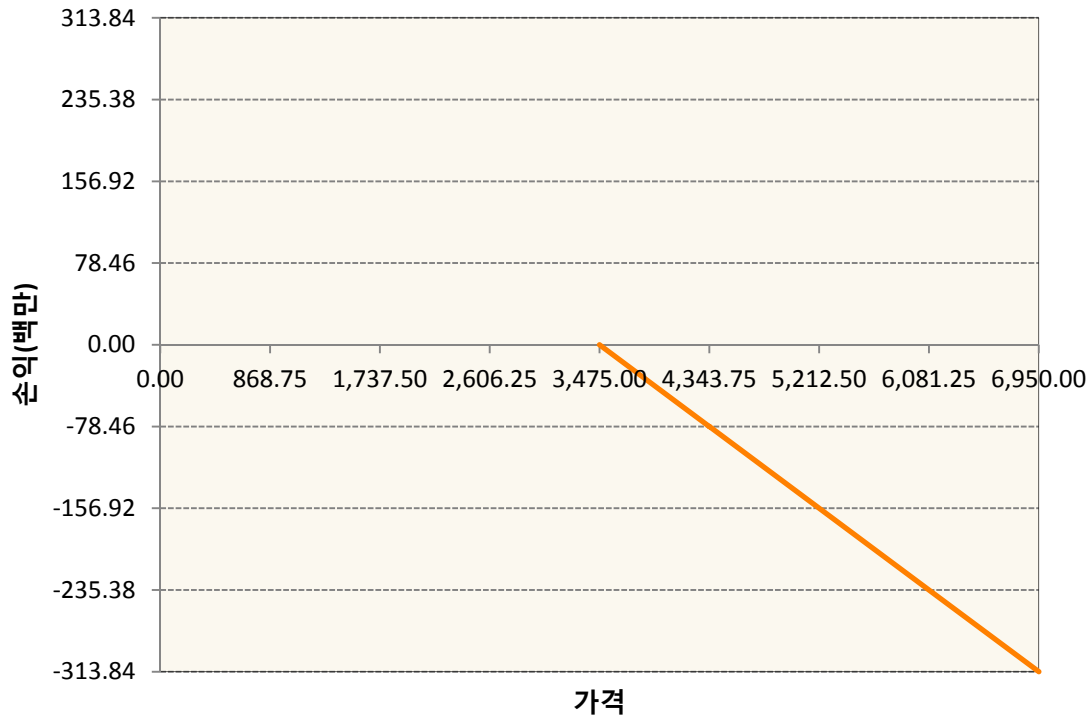
1. 계약금액

(단위:백만원)

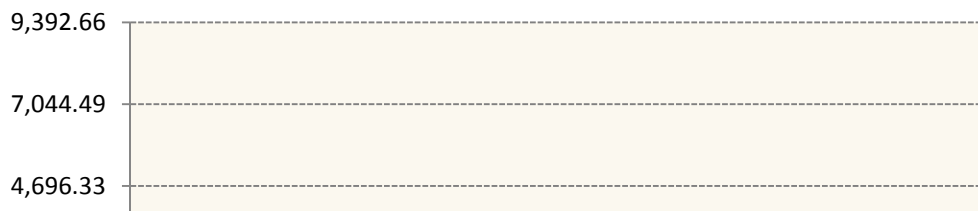
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,648	0	2,648	
누계	유가증권	스왑	63,563	0	63,563	장외
누계	유가증권	옵션	0	19,413	-19,413	장내
누계	통화	선도	0	18,063	-18,063	장외

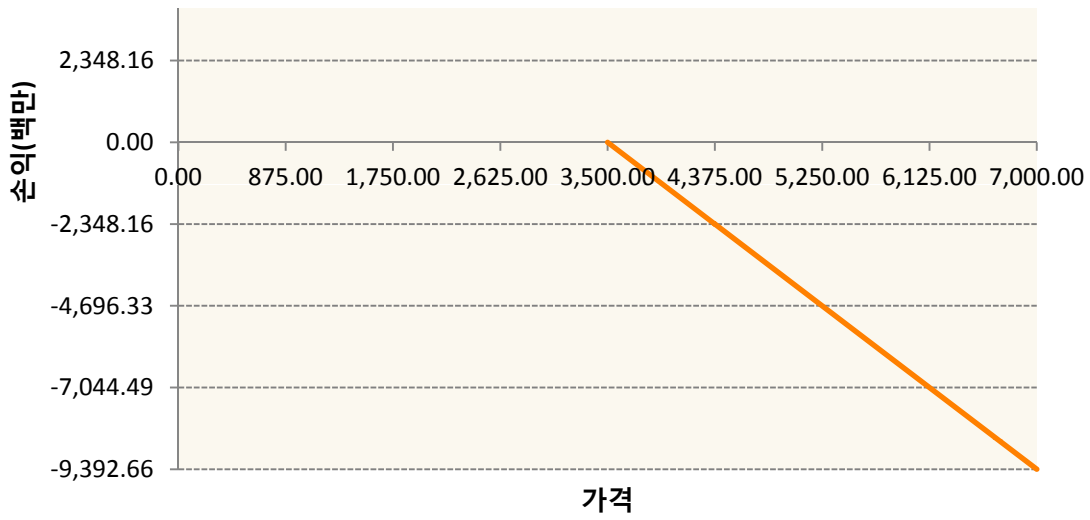
2. 만기시점의 손익구조

OESXK9-C3475-EURO STOXX 50

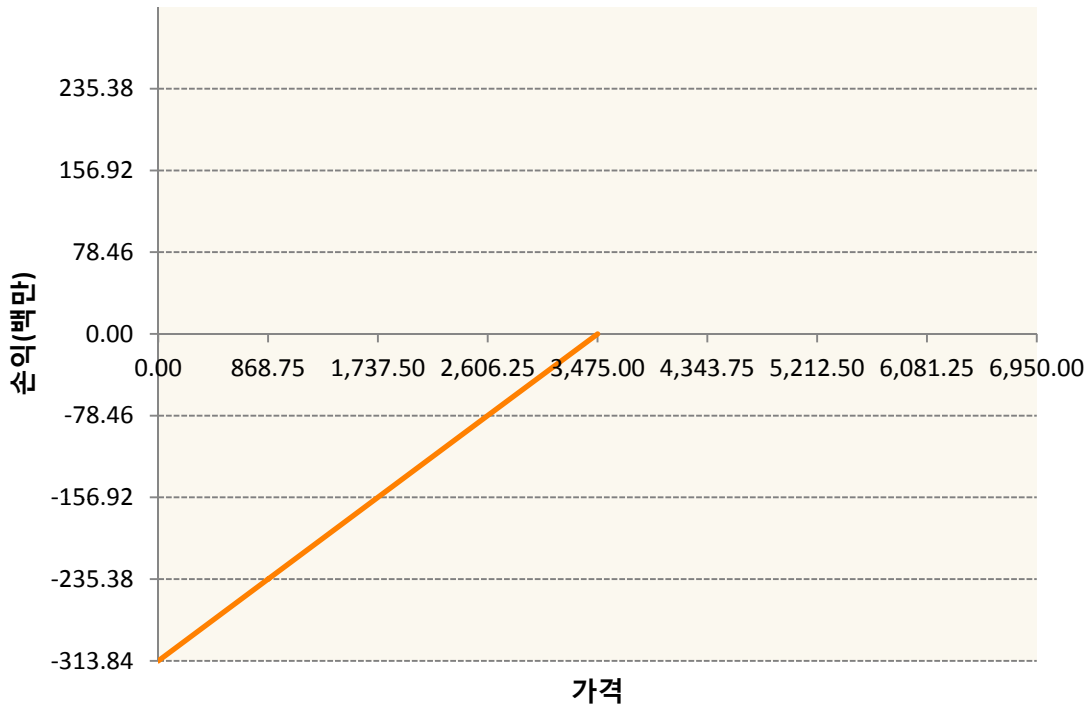


OESXK9-C3500-EURO STOXX 50

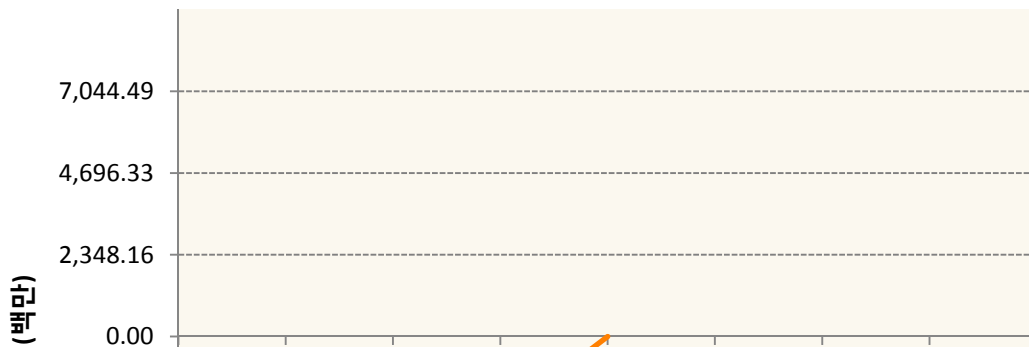


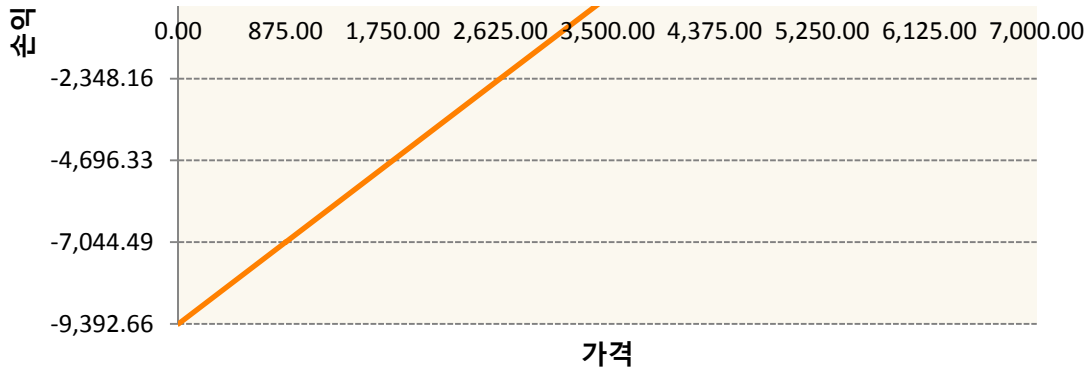


OESXK9-P3475-EURO STOXX 50

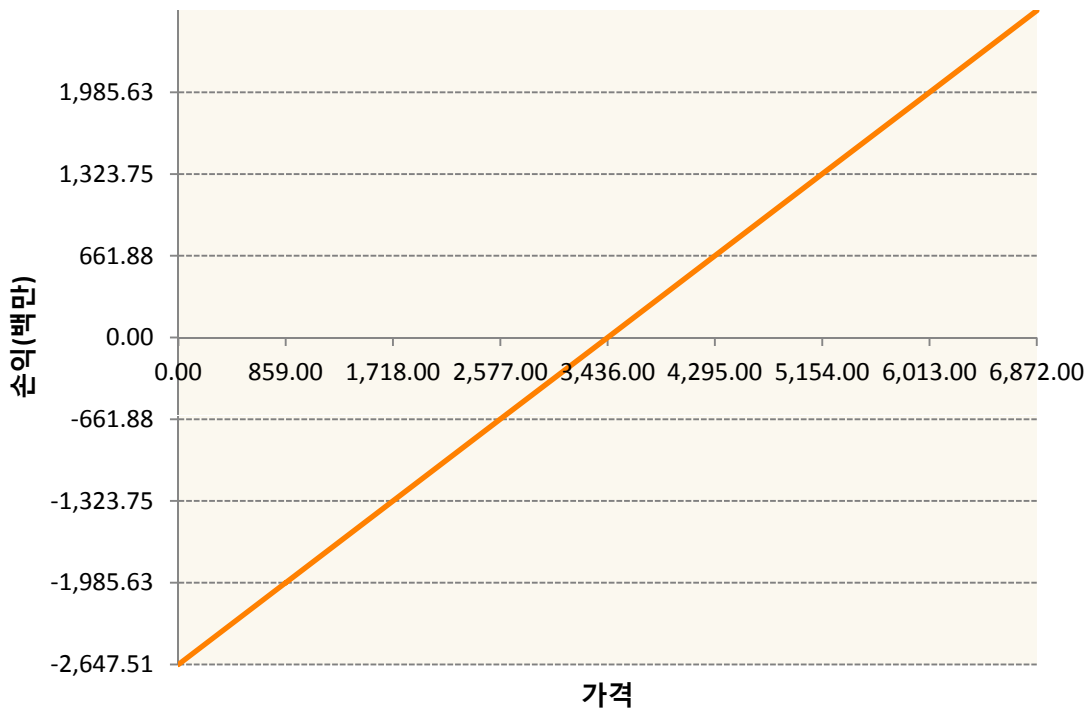


OESXK9-P3500-EURO STOXX 50





VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	6
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	413
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	826
FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E	206
OESXK9-C34 EURO STOXX 50	25
OESXK9-C35 EURO STOXX 50	751
OESXK9-P34 EURO STOXX 50	25
OESXK9-P35 EURO STOXX 50	751
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	212

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

(단위:백만원)

1,993

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

(단위:백만원)

1,091

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

(단위:백만원)

93

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

(단위:백만원)

135

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

(단위:백만원)

42

공시일	2019-04-25
기준일	2019-04-24

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

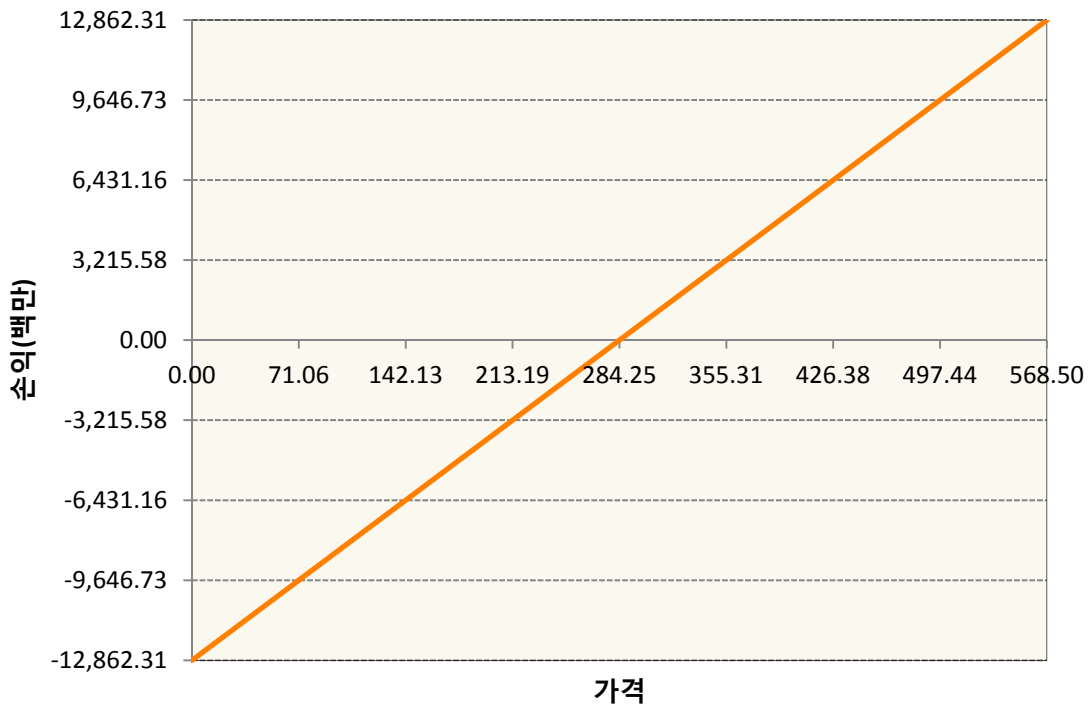
1. 계약금액

(단위:백만원)

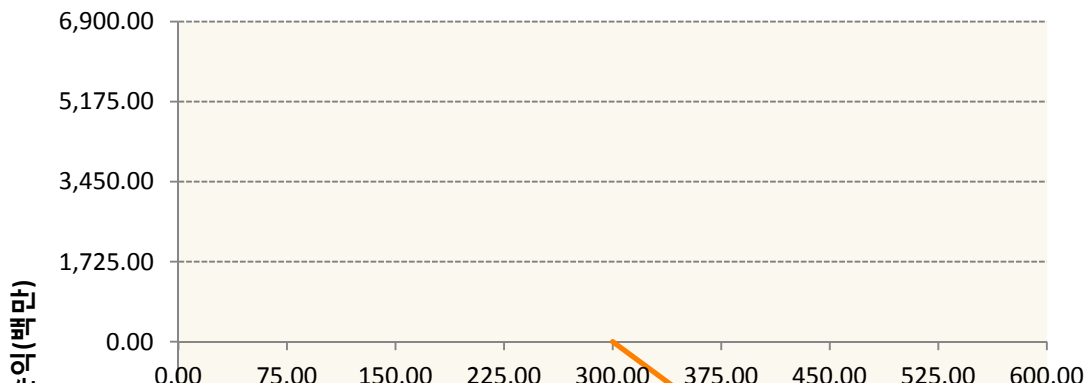
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,862	0	12,862	장내
누계	유가증권	옵션	1,366	24,294	-22,928	장내

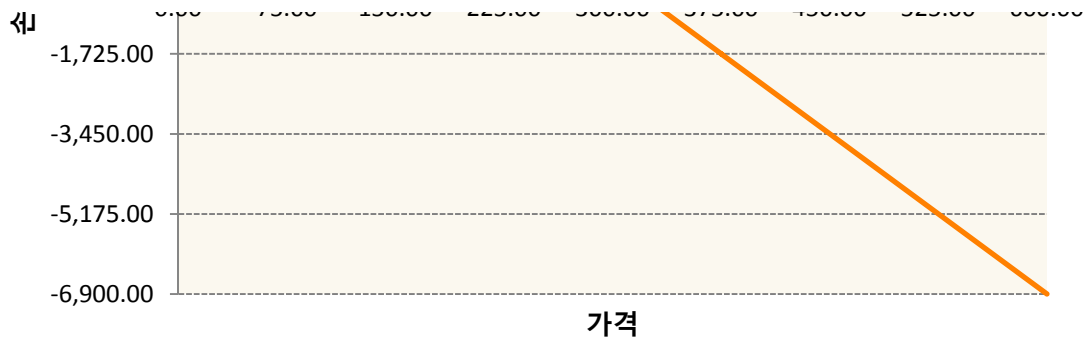
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

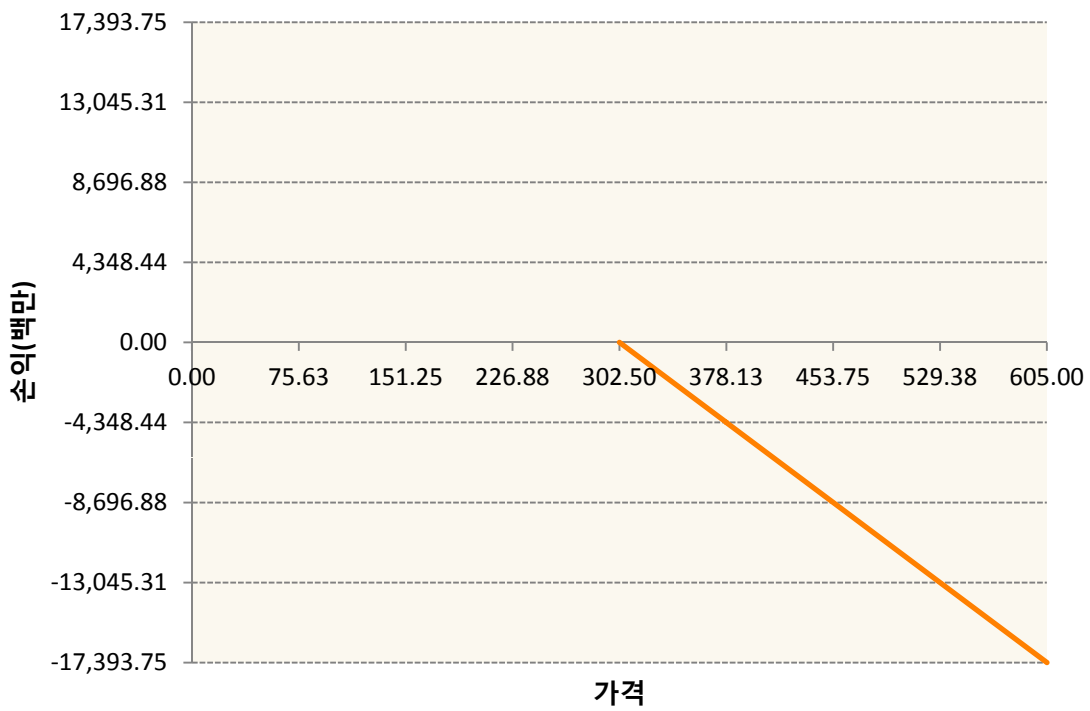


KR4201P53007-2019-05 콜300

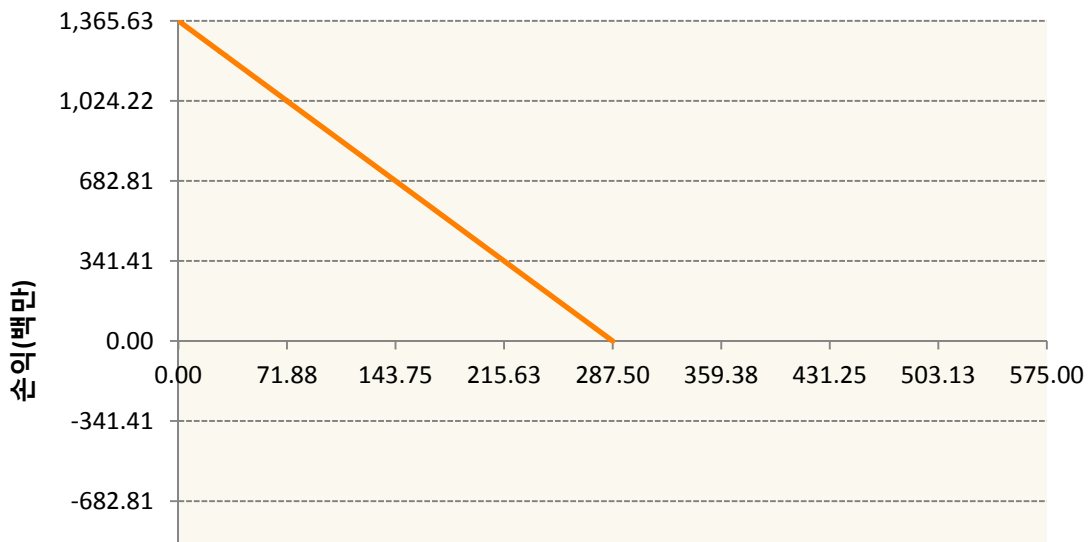


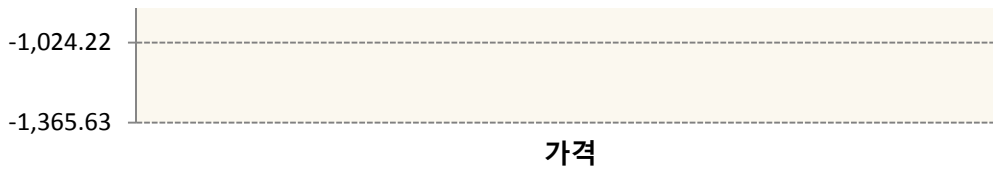


KR4201P53023-2019-05 콜302.5



KR4301P52874-2019-05 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						1,027
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,027	-1,027	-1,027	-1,027	-1,027	-1,027	-1,027	
-5.33%	-685	-685	-685	-685	-685	-685	-685	
-2.67%	-342	-342	-342	-342	-342	-342	-342	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	342	342	342	342	342	342	342	
5.33%	685	685	685	685	685	685	685	
8.00%	1,027	1,027	1,027	1,027	1,027	1,027	1,027	
KR4201P53007		2019-05 콜300						232
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	20	20	20	20	20	19	19	
-5.33%	20	20	19	19	18	17	15	
-2.67%	19	18	17	14	12	8	4	
0%	14	10	5	0	-6	-12	-19	
2.67%	-9	-17	-26	-35	-44	-53	-63	
5.33%	-67	-78	-89	-100	-111	-122	-133	
8.00%	-170	-180	-190	-200	-211	-221	-232	
KR4201P53023		2019-05 콜302.5						508
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	35	35	35	35	35	34	33	
-5.33%	35	35	34	33	32	29	26	
-2.67%	34	33	30	26	21	14	6	
0%	26	19	10	0	-12	-26	-41	
2.67%	-12	-29	-48	-67	-88	-110	-132	
5.33%	-123	-150	-176	-203	-230	-258	-285	
8.00%	-345	-371	-398	-426	-453	-480	-508	
KR4301P52874		2019-05 풋287.5						101
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	101	101	101	101	101	101	101	
-5.33%	65	65	65	65	65	65	65	
-2.67%	29	29	30	30	30	31	31	

0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-21	-20	-19	-18	-17	-16	-15
5.33%	-25	-25	-24	-24	-23	-23	-22
8.00%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25

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

(단위:백만원)

1,412

공시일	2019-04-25
기준일	2019-04-24

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	345	0	345	
누계	유가증권	수익증권	4,116	0	4,116	

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	2019-04-25
기준일	2019-04-24

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,072	0	2,072	
누계	유가증권	수익증권	59,216	0	59,216	

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	2019-04-25
기준일	2019-04-24

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,877	0	2,877	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	120,683	0	120,683	
누계	통화	선도	0	151,792	-151,792	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	368
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	424
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	184
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	460
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	534
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	324
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	276
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E	46
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E	92
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E	92
FX21019J001 KRW/USD 10-05-19E	45
FX21019J002 KRW/USD 10-06-19E	101
FX21019J003 KRW/USD 10-05-19E	157
FX21019J004 KRW/USD 10-05-19E	74
FX21019J005 KRW/USD 10-05-19E	276
FX21019J006 KRW/USD 10-05-19E	230
FX21019J007 KRW/USD 10-05-19E	74
FX21019J012 KRW/USD 20-05-19E	129
FX21019J013 KRW/USD 20-05-19E	18
FX21019J014 KRW/USD 20-05-19E	138
FX21019J015 KRW/USD 20-05-19E	138
FX21019J016 KRW/USD 17-05-19E	1,289
FX21019J017 KRW/USD 17-05-19E	1,381
FX21019J018 KRW/USD 18-06-19E	368
FX21019J020 KRW/USD 20-05-19E	497
FX21019J021 KRW/USD 20-05-19E	468
FX21019J022 KRW/USD 24-06-19E	921

FX21019J02 KRW/USD 22-05-19E
FX21019J03 KRW/USD 28-05-19E
FX21019J03 KRW/USD 28-05-19E
FX21019J03 KRW/USD 26-06-19E

773
921
976
368

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

(단위:백만원)

4,128

공시일	2019-04-25
기준일	2019-04-24

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

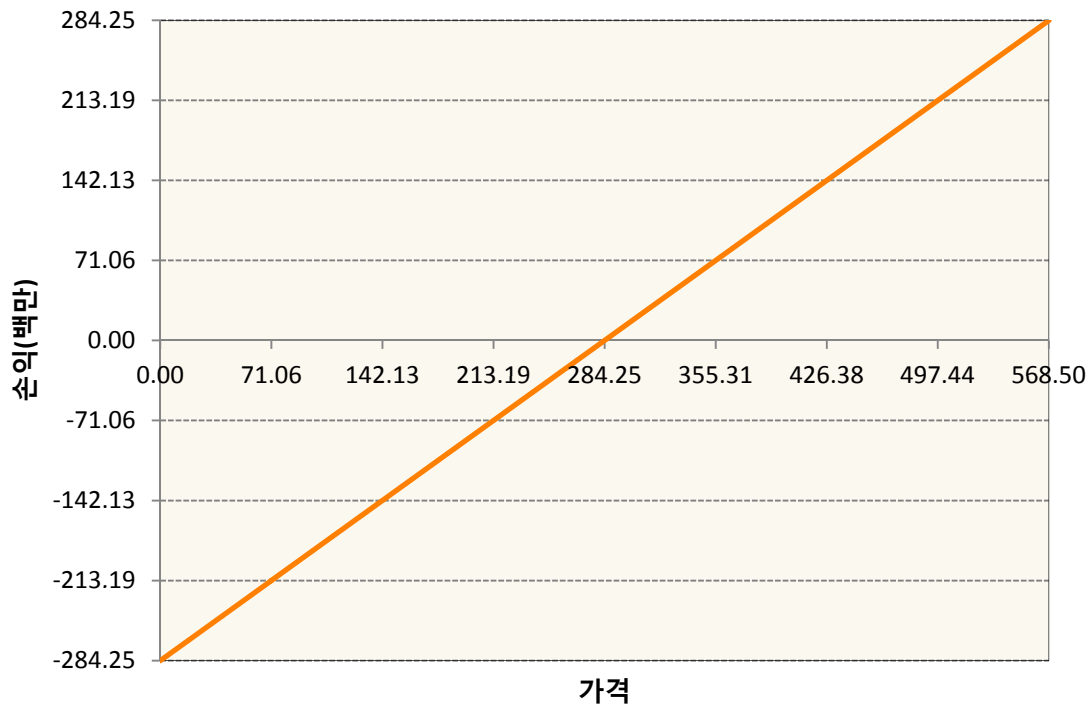
1. 계약금액

(단위:백만원)

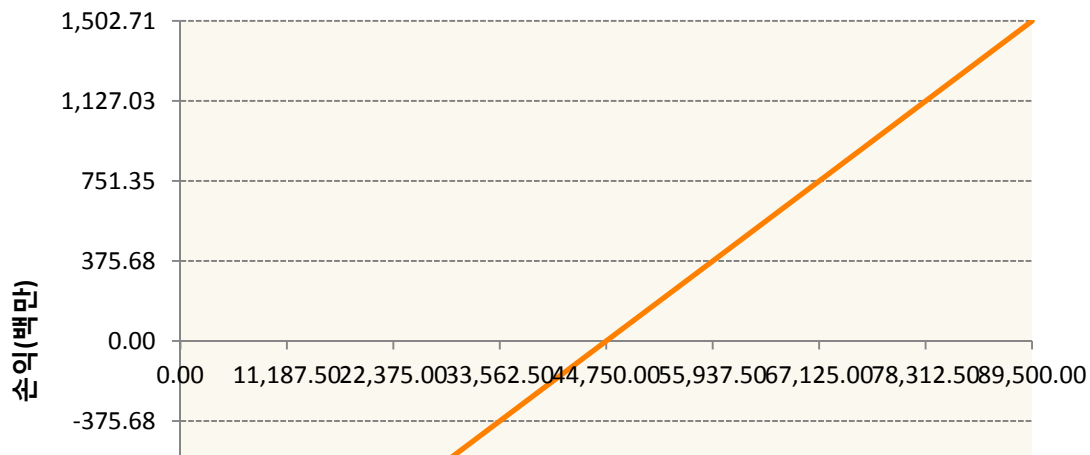
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,787	0	1,787	장내

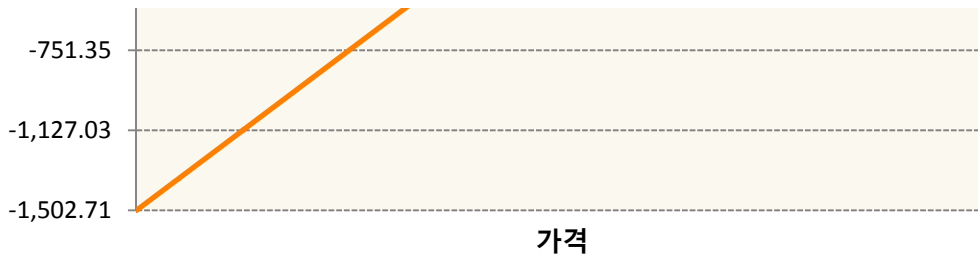
2. 만기시점의 손익구조

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						120
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120	
-5.33%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80	
-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%	80	80	80	80	80	80	80	
8.00%	120	120	120	120	120	120	120	

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

157

공시일	2019-04-25
기준일	2019-04-24

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

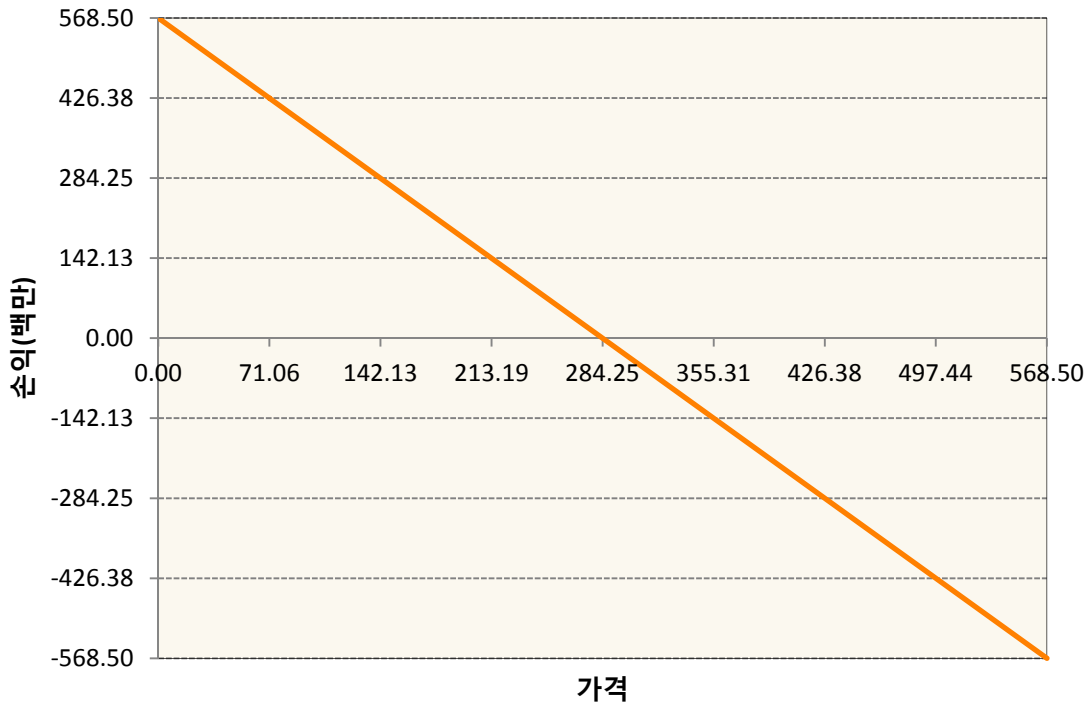
1. 계약금액

(단위:백만원)

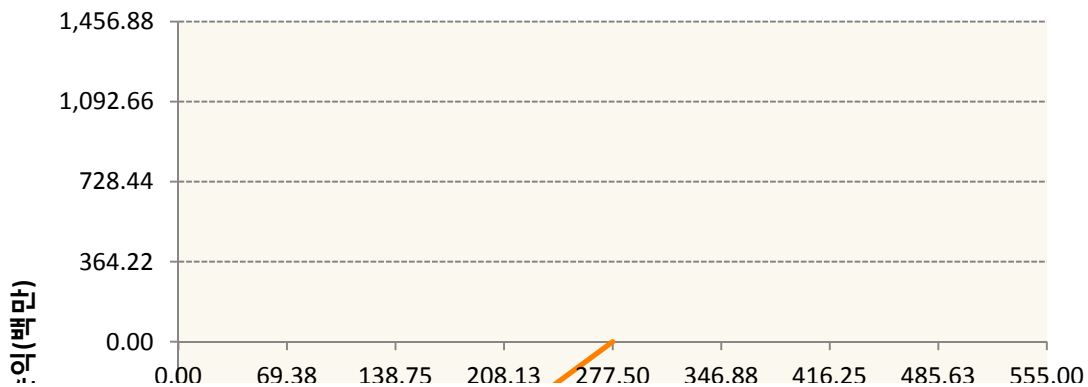
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	72	-72	장내
신규	유가증권	옵션	0	70	-70	장내
누계	유가증권	선물	0	569	-569	장내
누계	유가증권	옵션	0	2,997	-2,997	장내

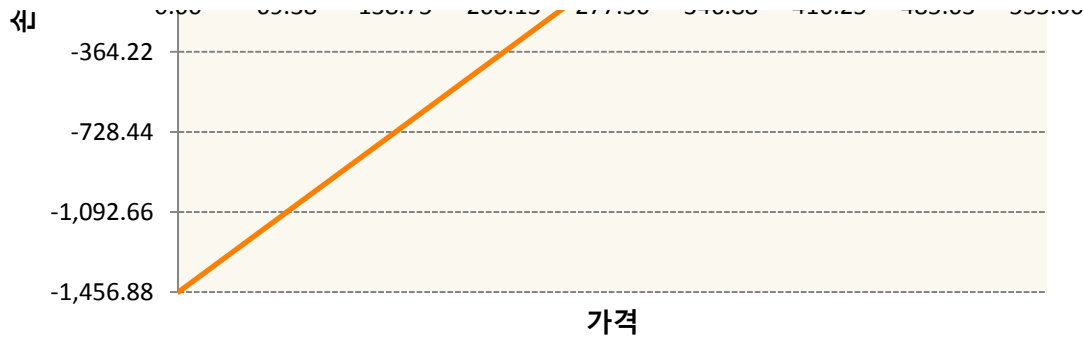
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

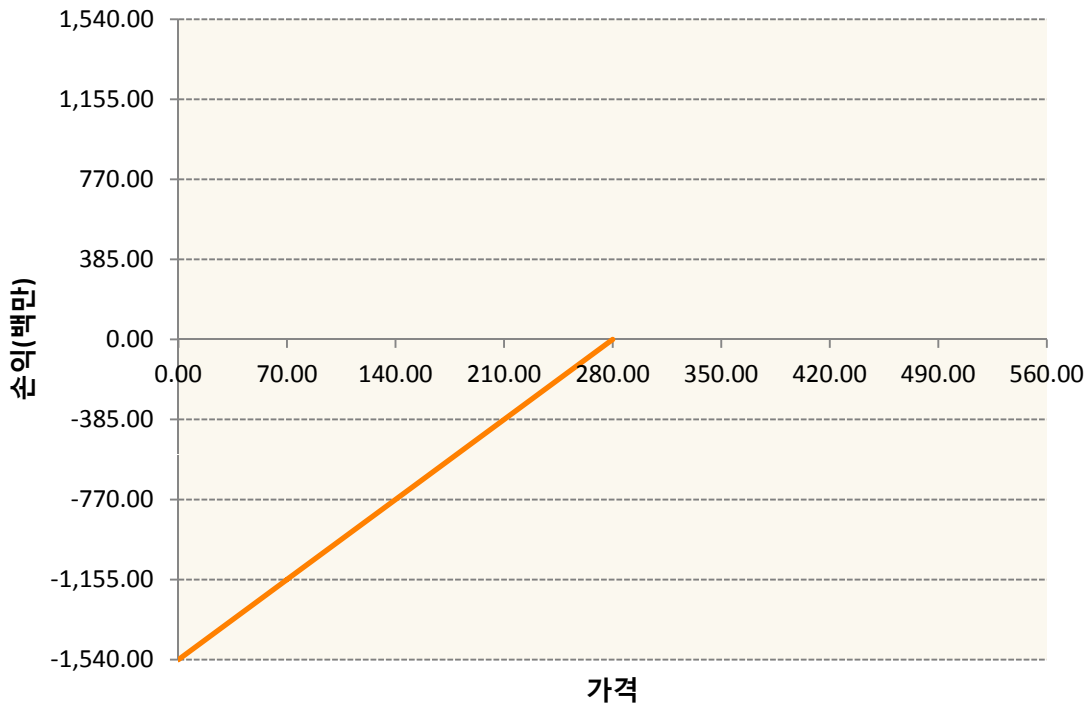


KR4301P52775-2019-05 풋277.5





KR4301P52809-2019-05 풋280



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						45
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	45	45	45	45	45	45	45	
-5.33%	30	30	30	30	30	30	30	
-2.67%	15	15	15	15	15	15	15	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	
5.33%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30	
8.00%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45	
KR4301P52775		2019-05 풋277.5						83
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-5.33%	-43	-44	-44	-45	-45	-46	-47
-2.67%	-11	-12	-14	-15	-16	-17	-18
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	4	4	4	4	3	3	3
5.33%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

KR4301P52809

2019-05 풋280

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%	-55	-55	-56	-56	-56	-57	-57
-2.67%	-18	-19	-20	-21	-22	-23	-24
0%	3	2	1	0	-1	-2	-4
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

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

(단위:백만원)

220

공시일	2019-04-25
기준일	2019-04-24

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

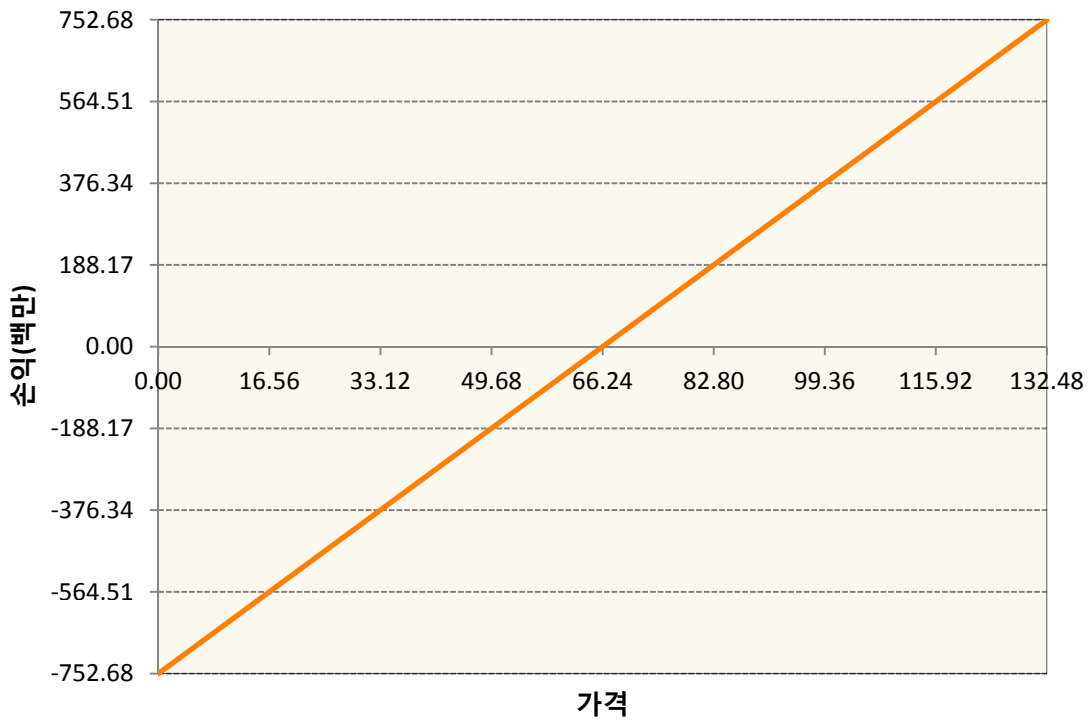
1. 계약금액

(단위:백만원)

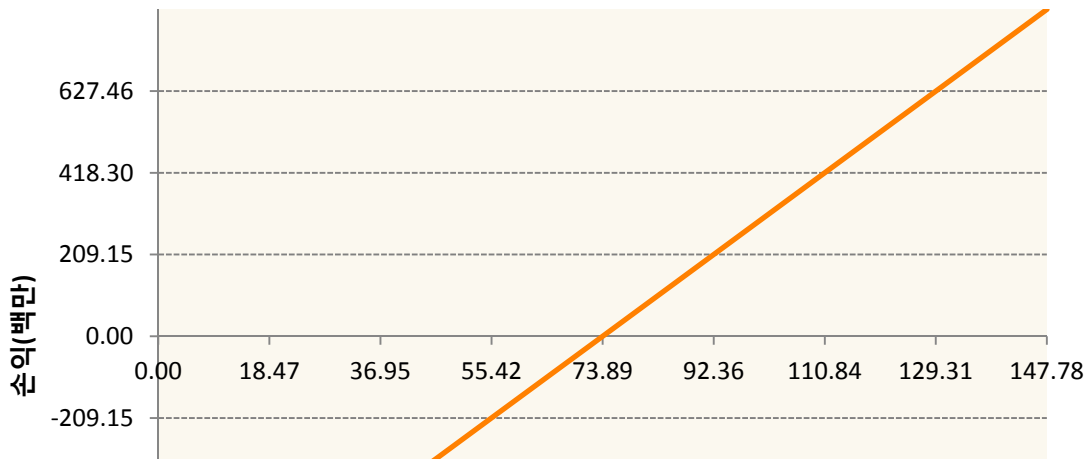
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,020	287	2,733	

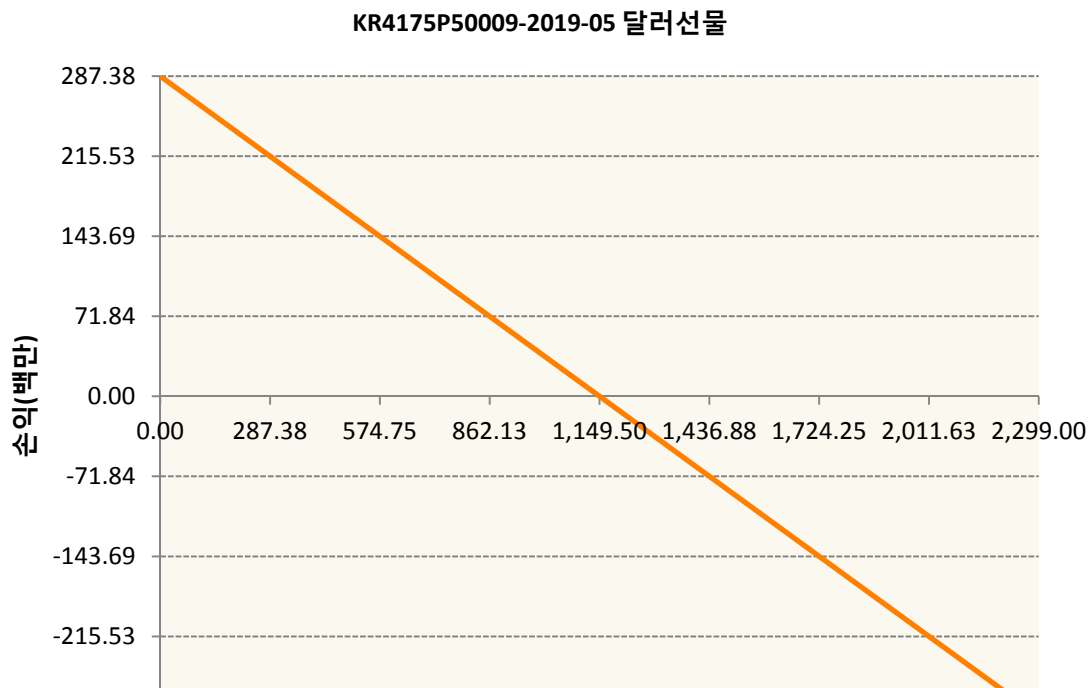
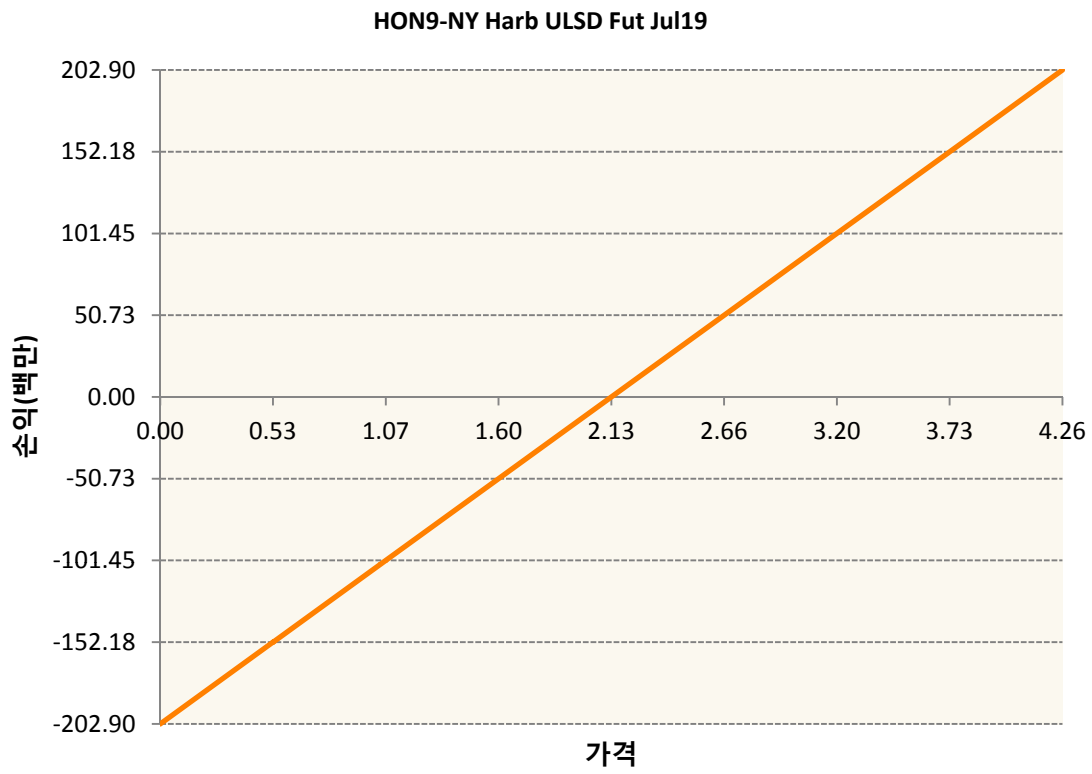
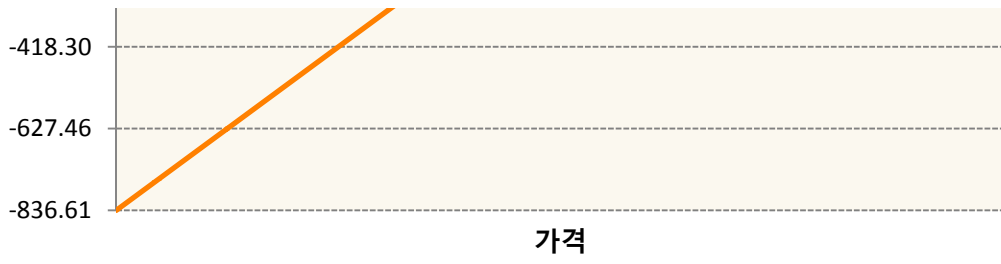
2. 만기시점의 손익구조

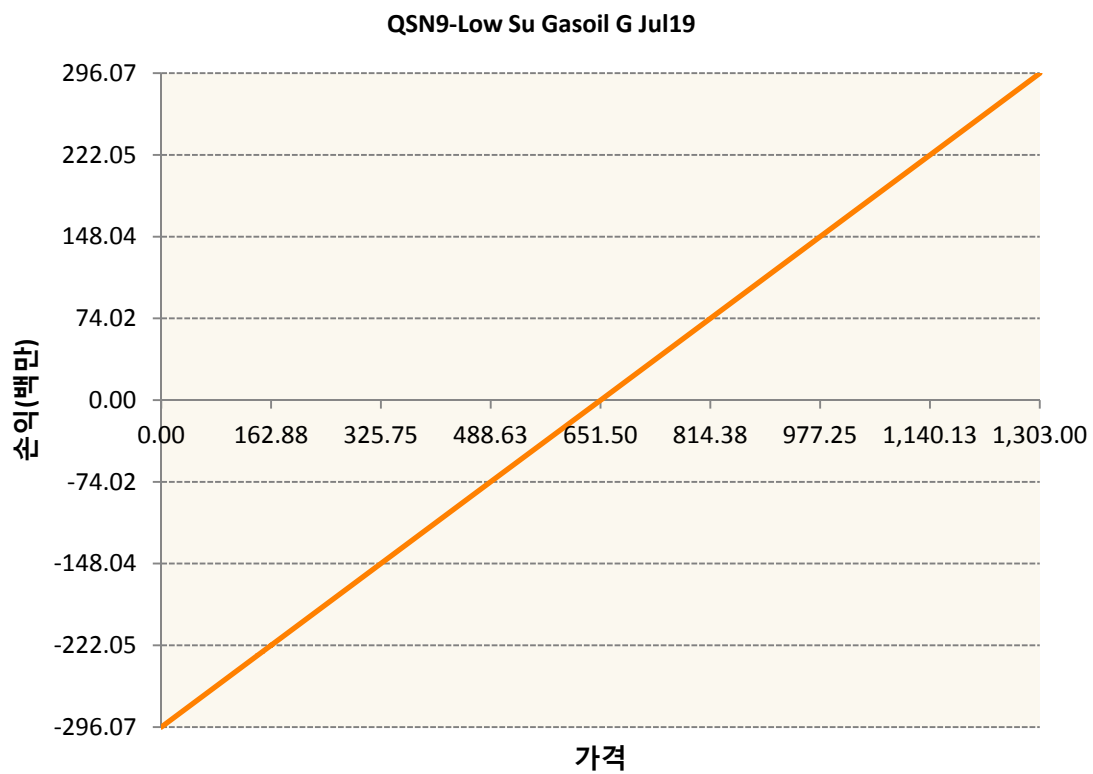
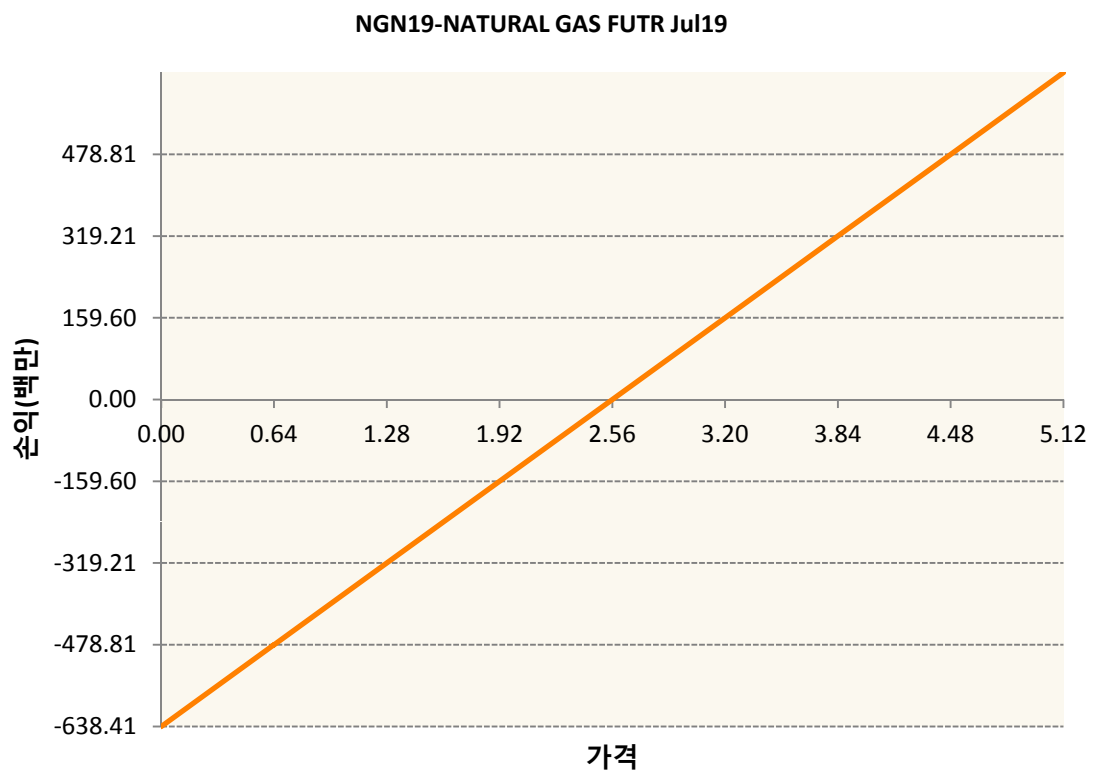
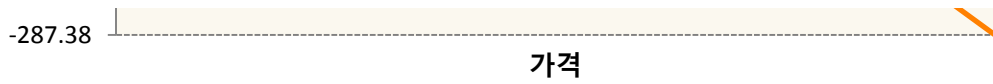
CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19



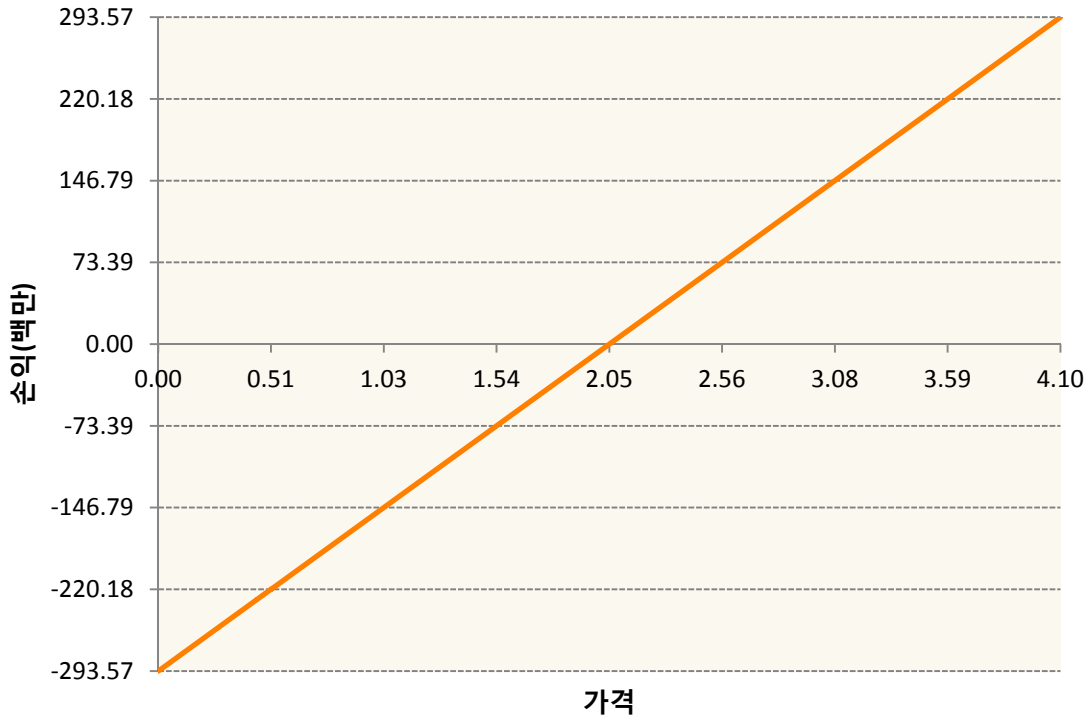
CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19







XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN9	WTI CRUDE FUTURE Jul19	60
CON9	BRENT CRUDE FUTR Jul19	67
HON9	NY Harb ULSD Fut Jul19	16
KR4175P500	2019-05 달러선물	23
NGN19	NATURAL GAS FUTR Jul19	51
QSN9	Low Su Gasoil G Jul19	24
XBN9	GASOLINE RBOB FUT Jul19	23

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

(단위:백만원)

444

공시일	2019-04-25
기준일	2019-04-24

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

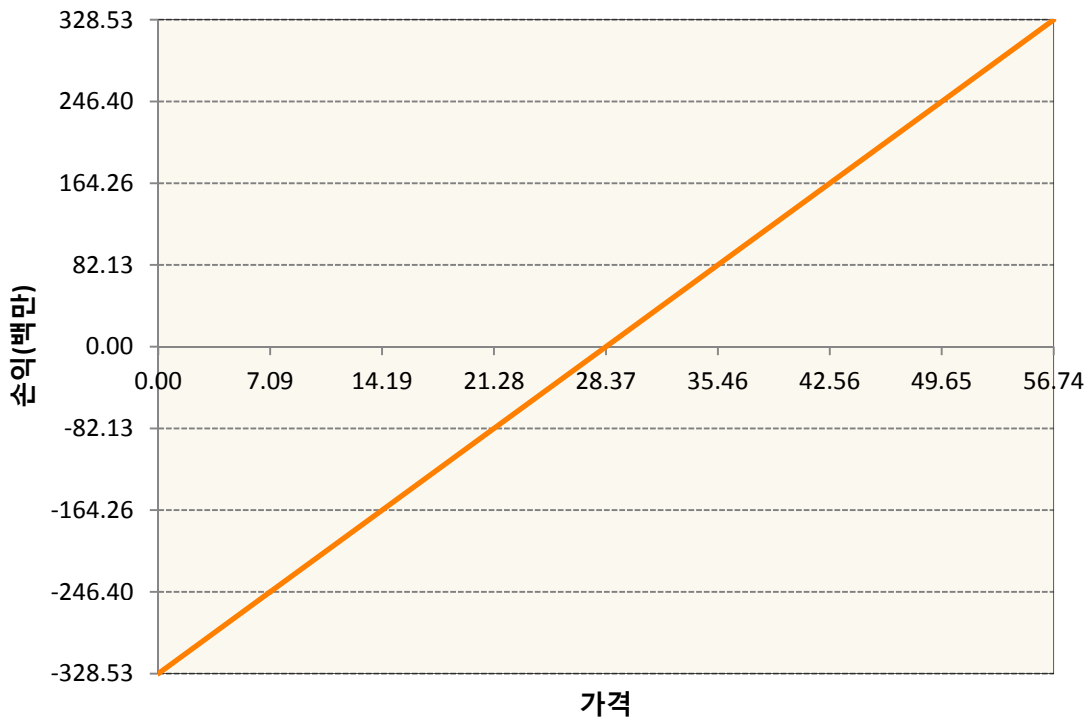
1. 계약금액

(단위:백만원)

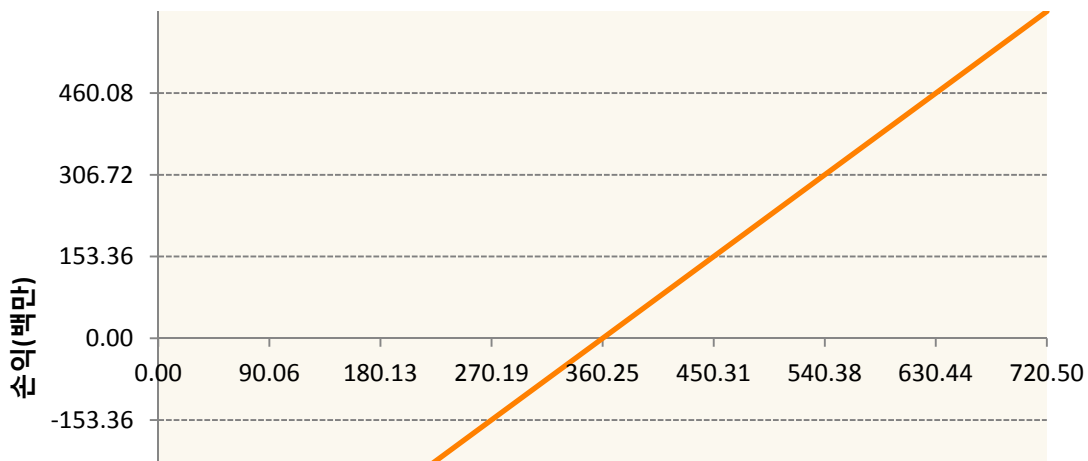
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,167	57	3,109	

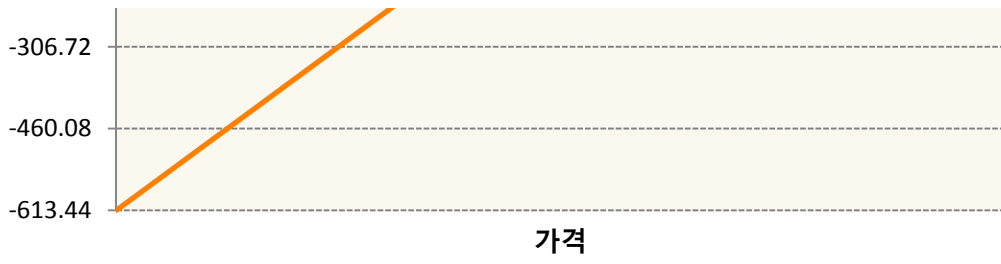
2. 만기시점의 손익구조

BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19

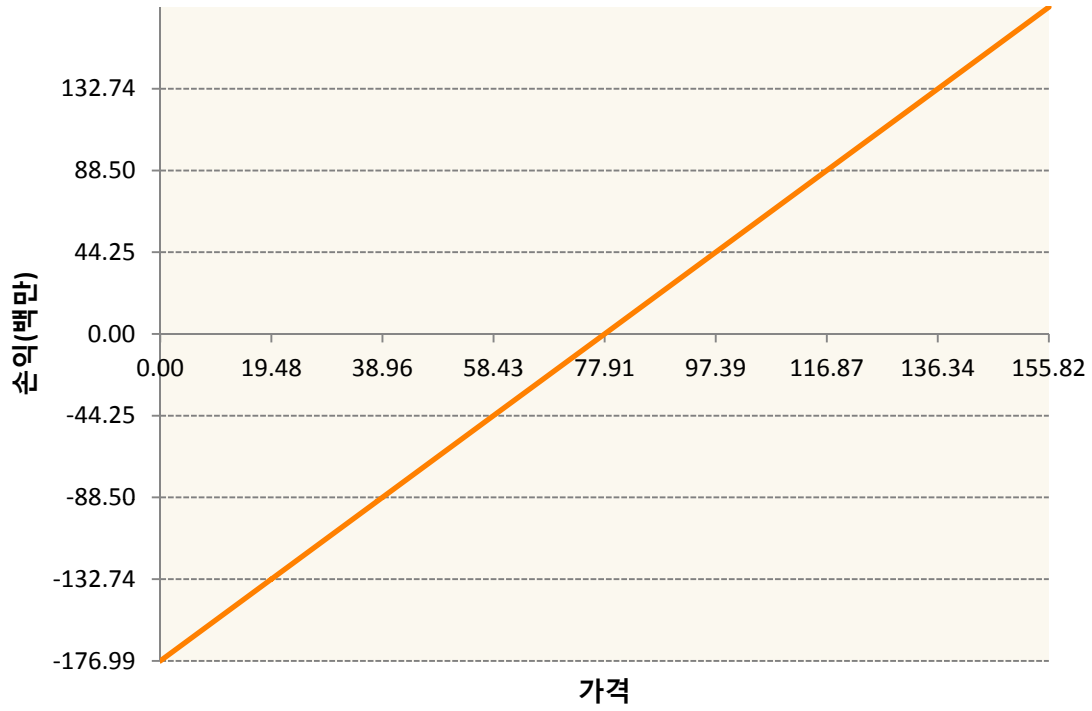


CN9-CORN FUTURE Jul19

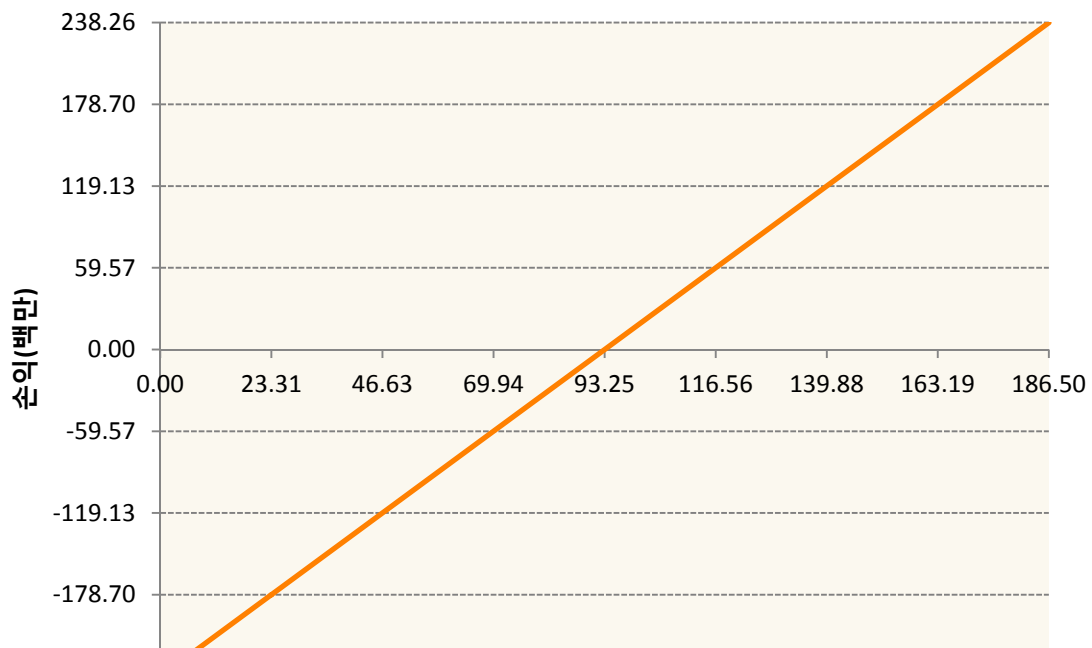


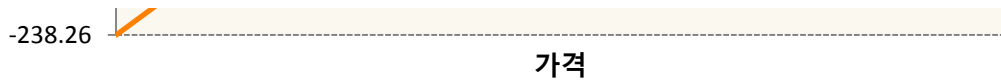


CTN9-COTTON NO.2 FUTR Jul19

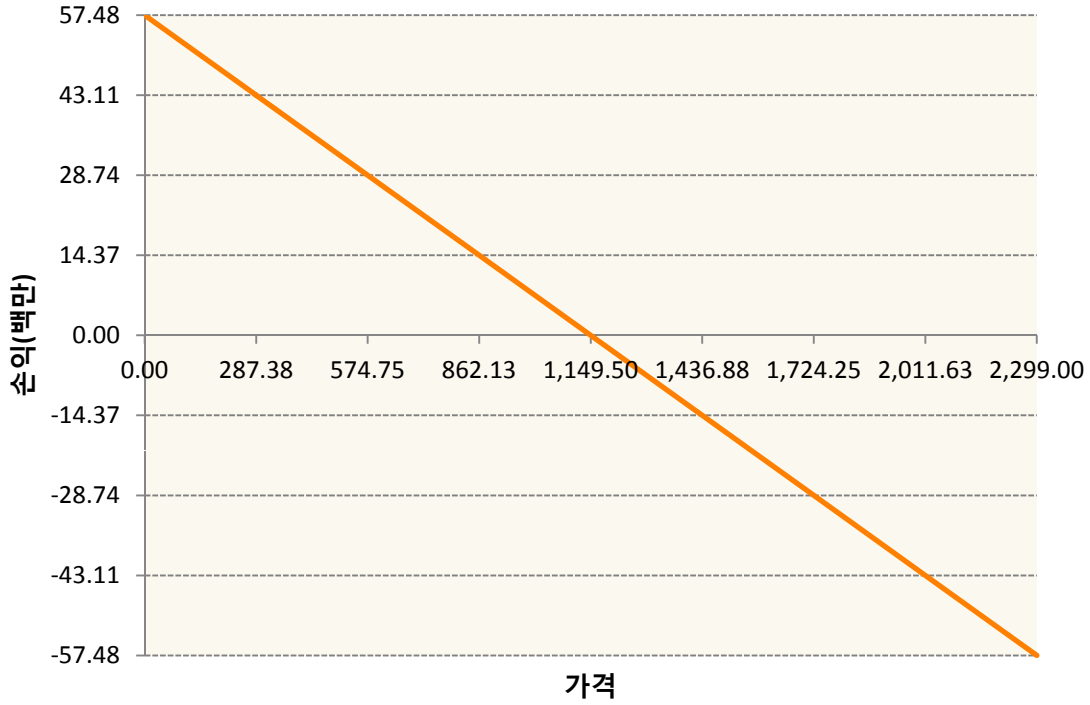


KCN9-COFFEE 'C' FUTURE Jul19

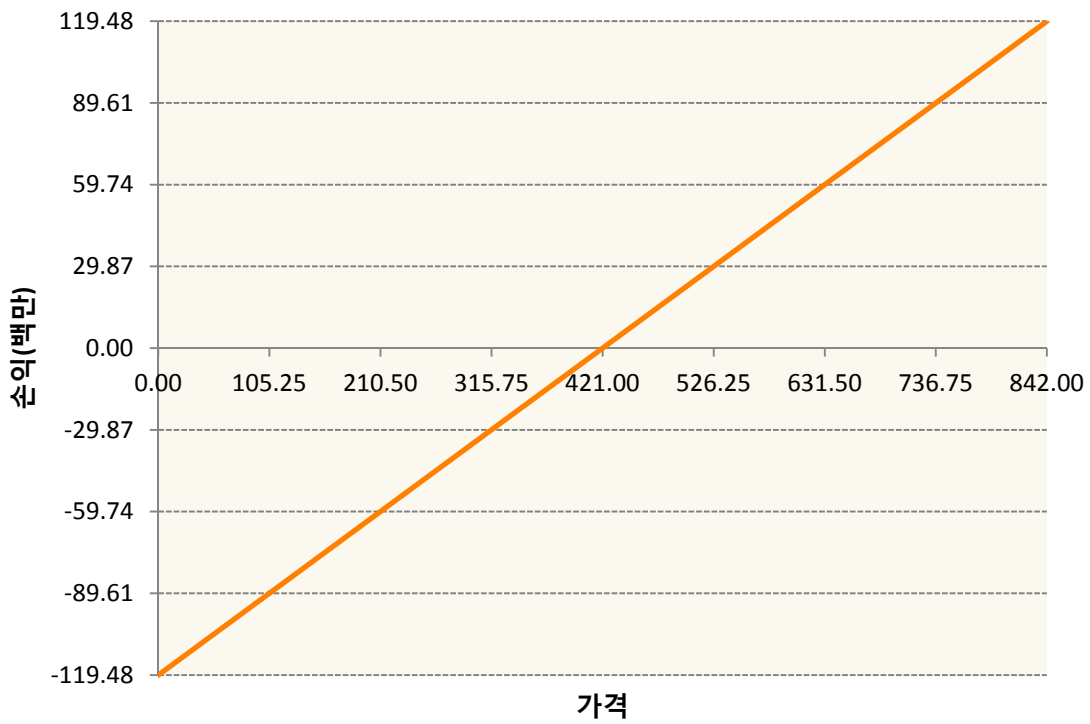




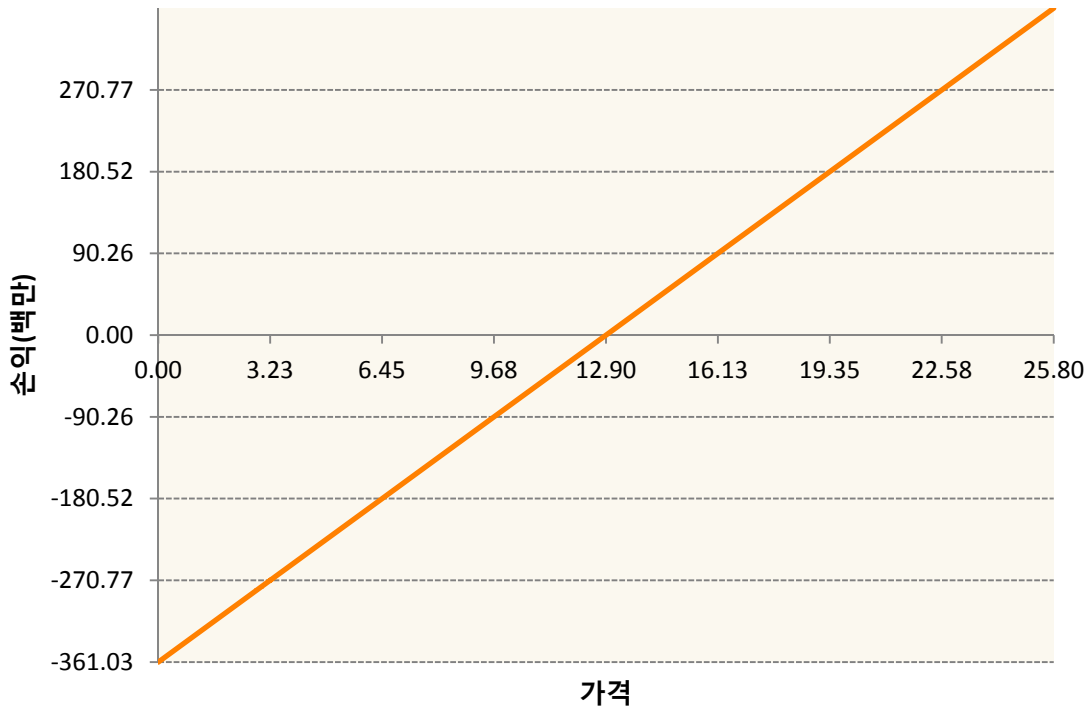
KR4175P50009-2019-05 달러선물



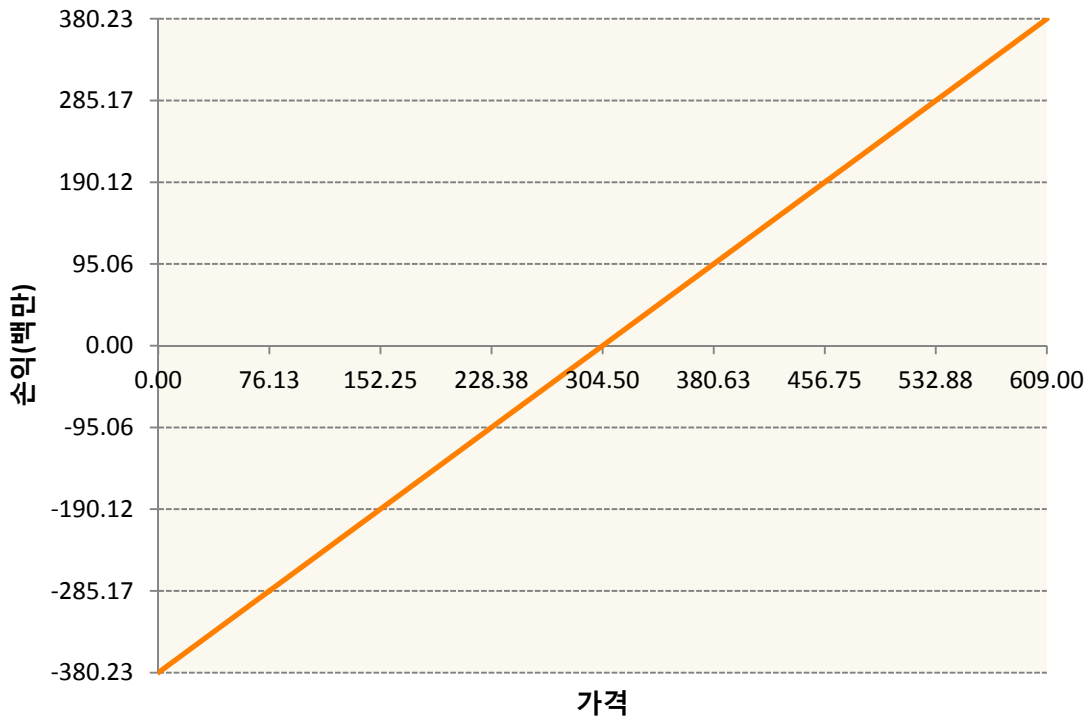
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



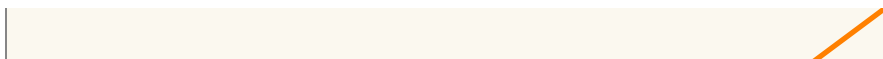
SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

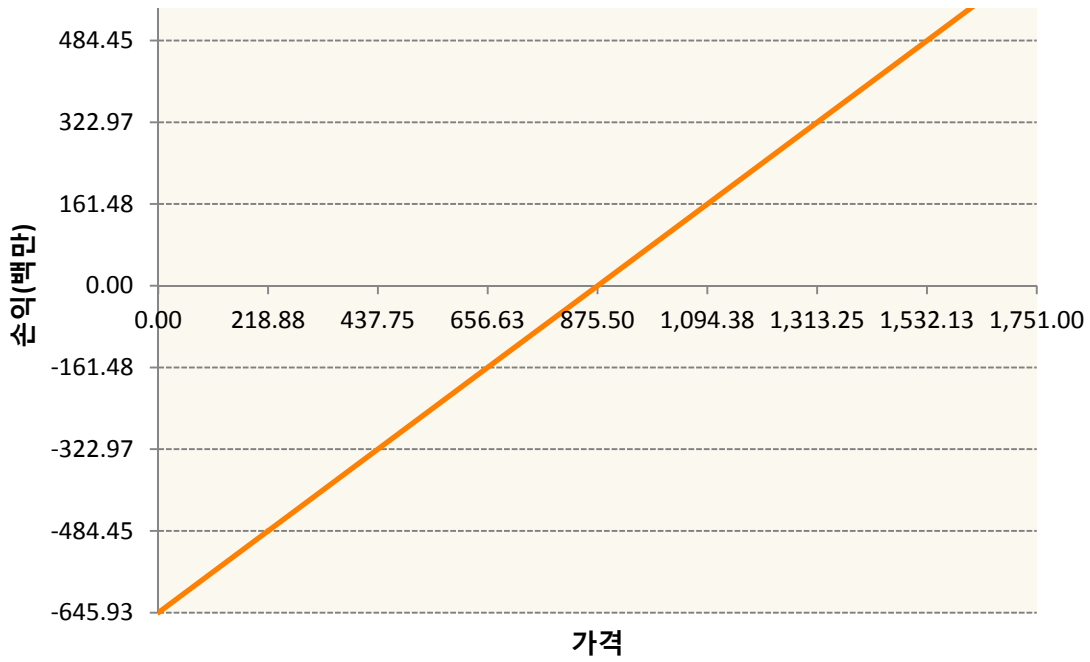


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19

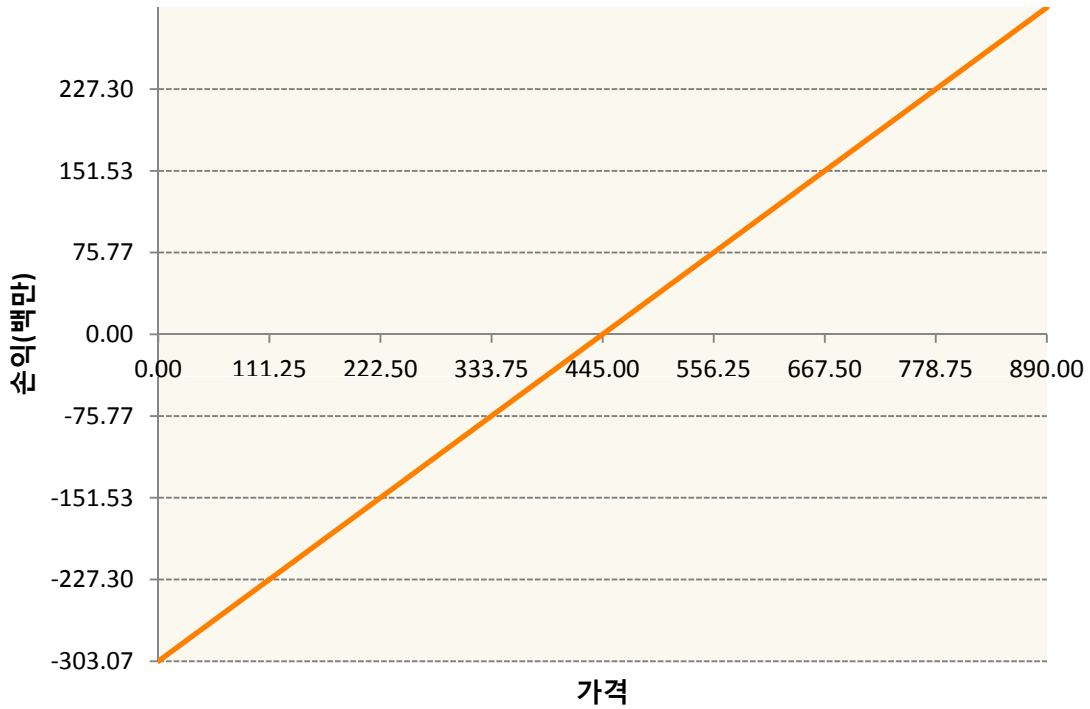


SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





WN9-WHEAT FUTURE(CBT) Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON9	SOYBEAN OIL FUTR Jul19	26
CN9	CORN FUTURE Jul19	49
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	30
SN9	SOYBEAN FUTURE Jul19	52
WN9	WHEAT FUTURE(CBT) Jul19	24

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

(단위:백만원)

256