

공시일	2019-05-07
기준일	2019-05-03

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	2019-05-07
기준일	2019-05-03

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

1,159

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

680

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-05-07
기준일	2019-05-03

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)	330
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	91
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	155

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

914

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-05-07
기준일	2019-05-03

유로인덱스모(주식-파생형)

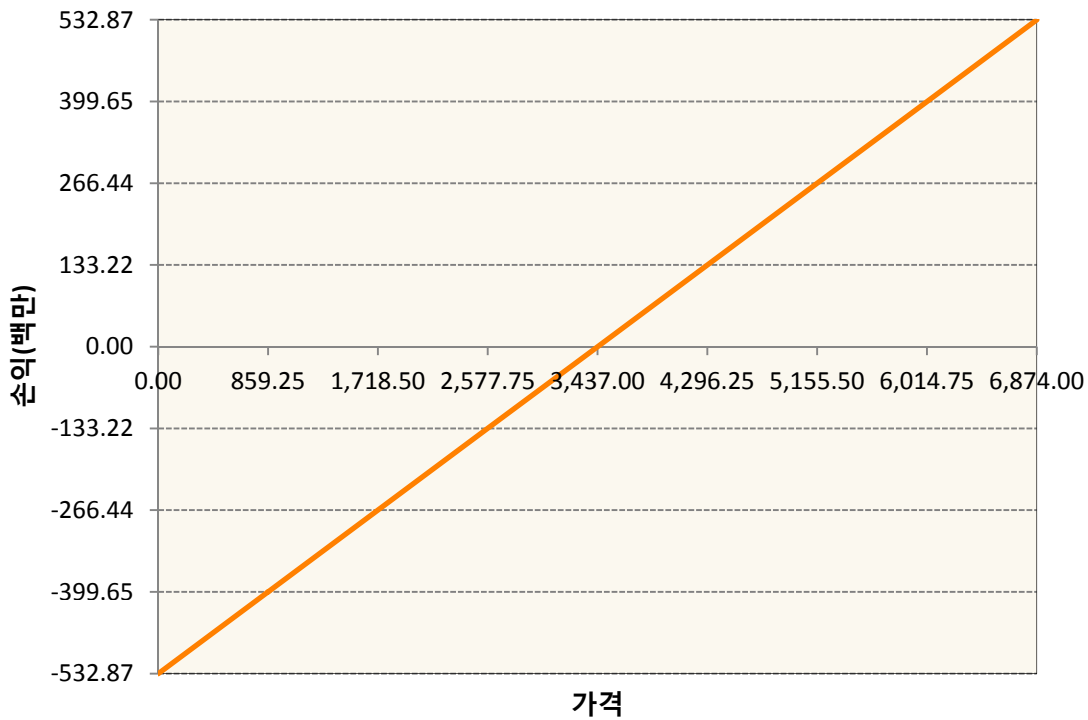
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	533	0	533	

2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	43
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

30

공시일	2019-05-07
기준일	2019-05-03

차이나인덱스모(주식-파생형)

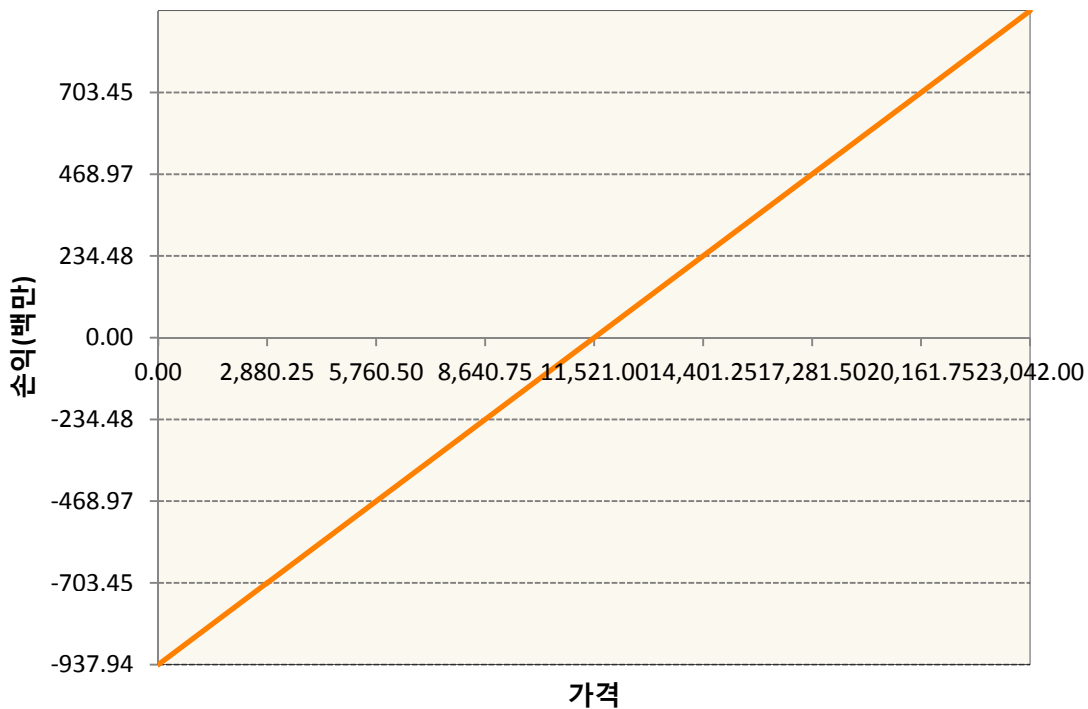
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	938	0	938	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK9	HSCEI Futures May19	75
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

77

공시일	2019-05-07
기준일	2019-05-03

커버드콜모(주식혼합-파생형)

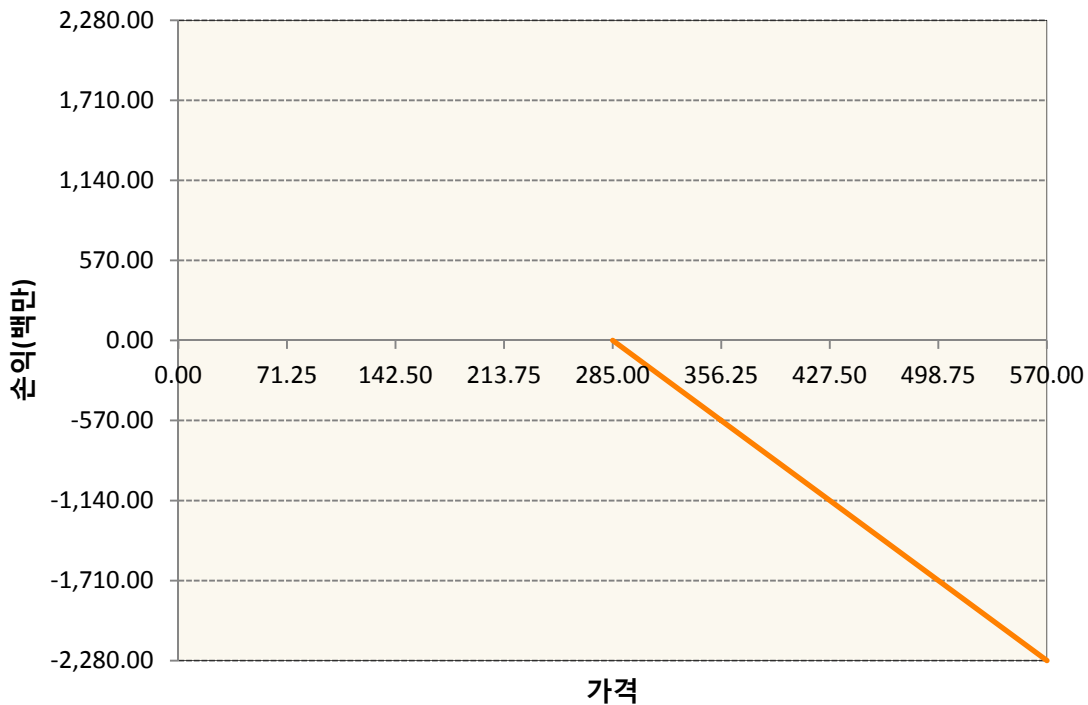
1. 계약금액

(단위:백만원)

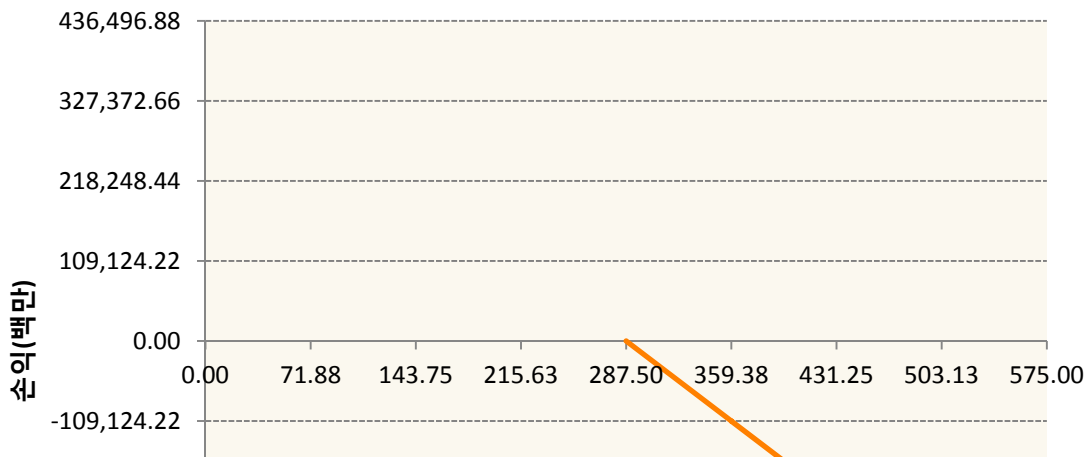
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	672,214	-672,214	장내

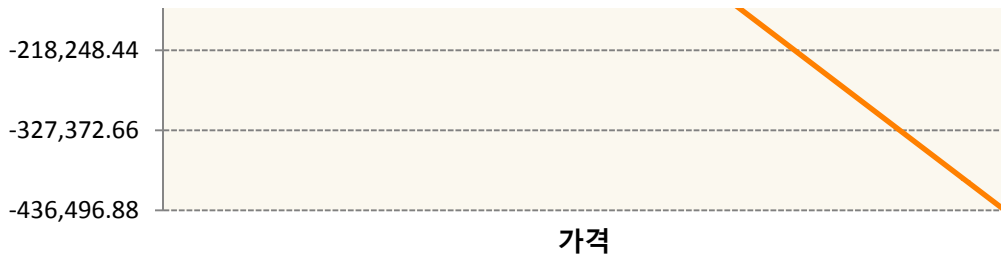
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P52850-2019-05 콜285

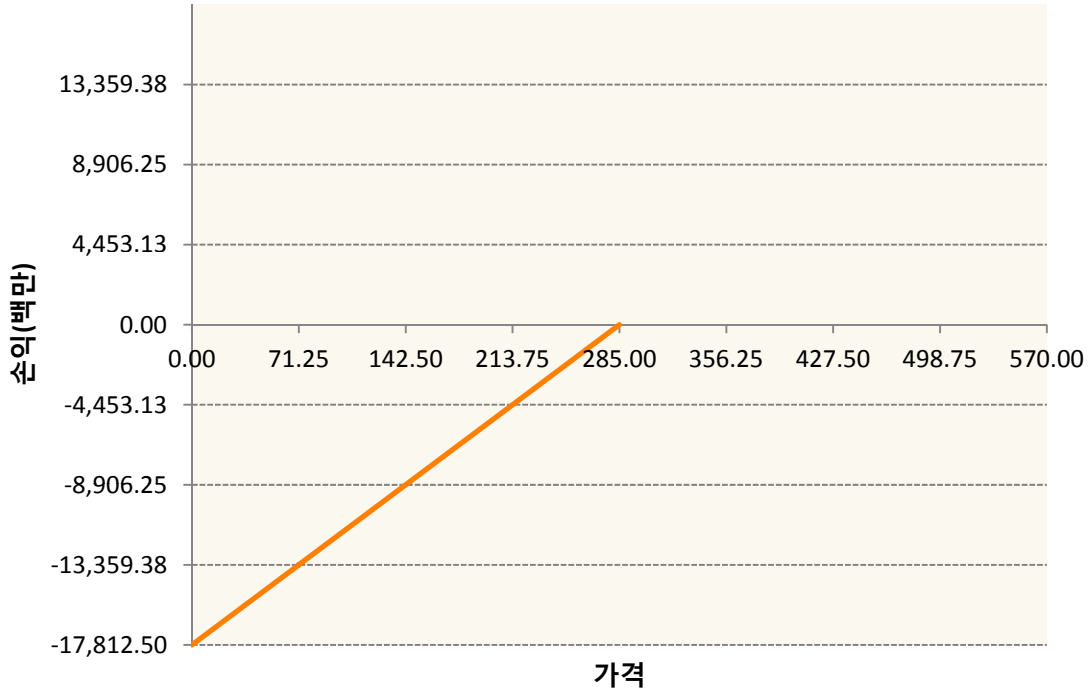


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

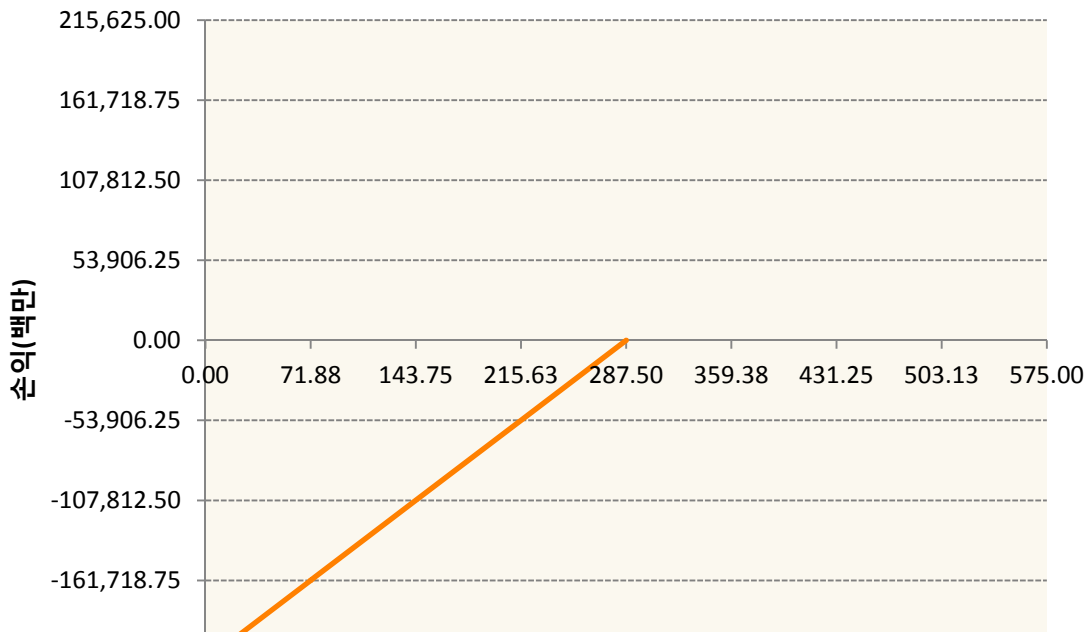




KR4301P52858-2019-05 풋285



KR4301P52874-2019-05 풋287.5



-215,625.00

가격

3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P52850 2019-05 콜285							148
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	24	24	24	24	24	24	24
-5.33%	24	24	24	23	23	22	21
-2.67%	22	21	19	18	16	15	13
0%	7	5	2	0	-2	-5	-7
2.67%	-31	-33	-35	-37	-39	-41	-43
5.33%	-87	-87	-88	-88	-89	-90	-92
8.00%	-147	-147	-147	-147	-147	-148	-148
KR4201P52876 2019-05 콜287.5							25,916
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,112	3,112	3,110	3,107	3,100	3,088	3,068
-5.33%	3,105	3,093	3,069	3,031	2,974	2,899	2,803
-2.67%	2,915	2,787	2,626	2,434	2,215	1,971	1,707
0%	1,235	833	420	0	-427	-858	-1,294
2.67%	-4,506	-4,919	-5,341	-5,772	-6,207	-6,648	-7,092
5.33%	-14,246	-14,397	-14,584	-14,801	-15,047	-15,316	-15,607
8.00%	-25,489	-25,511	-25,549	-25,606	-25,686	-25,789	-25,916
KR4301P52858 2019-05 풋285							1,335
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,335	-1,335	-1,335	-1,335	-1,335	-1,335	-1,335
-5.33%	-862	-862	-862	-862	-862	-862	-863
-2.67%	-390	-391	-392	-393	-395	-398	-401
0%	29	19	10	0	-10	-19	-29
2.67%	163	161	157	153	148	142	137
5.33%	168	168	168	168	167	167	166
8.00%	168	168	168	168	168	168	168
KR4301P52874 2019-05 풋287.5							16,570
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-16,570	-16,570	-16,570	-16,570	-16,570	-16,570	-16,570
-5.33%	-10,899	-10,899	-10,899	-10,899	-10,899	-10,899	-10,900
-2.67%	-5,228	-5,230	-5,233	-5,238	-5,247	-5,260	-5,277
0%	240	166	86	0	-91	-185	-283
2.67%	3,106	3,028	2,943	2,853	2,758	2,660	2,559

5.33%	3,335	3,332	3,328	3,320	3,308	3,292	3,270
8.00%	3,336	3,336	3,336	3,336	3,335	3,335	3,334

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

(단위:백만원)

51,699

공시일	2019-05-07
기준일	2019-05-03

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

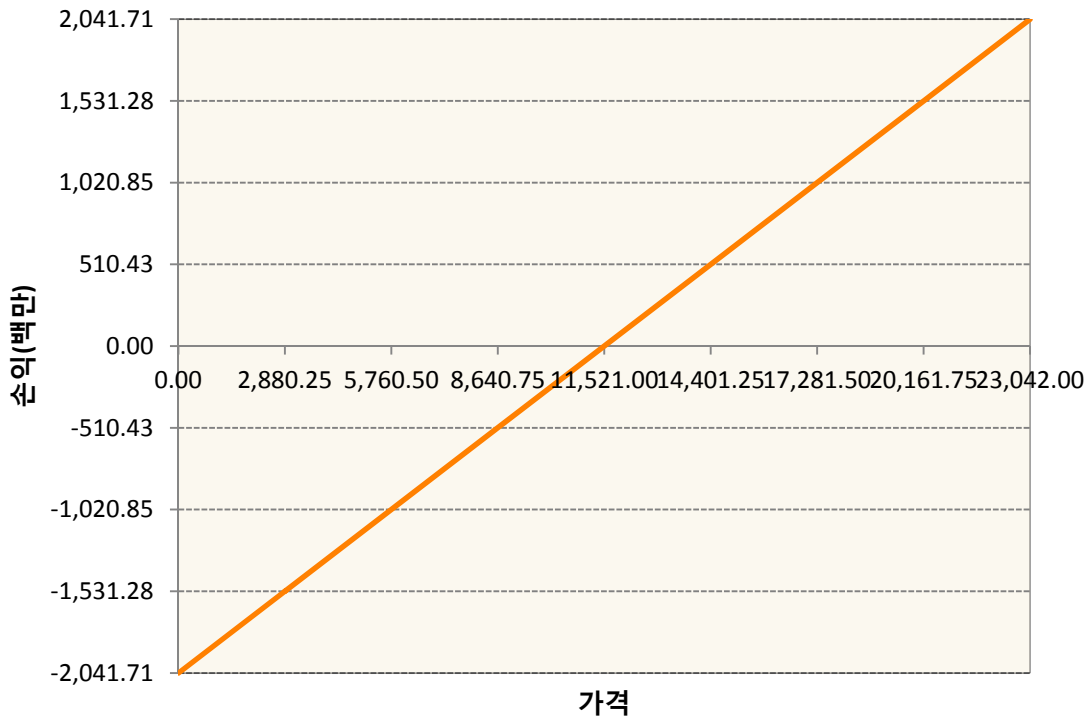
1. 계약금액

(단위:백만원)

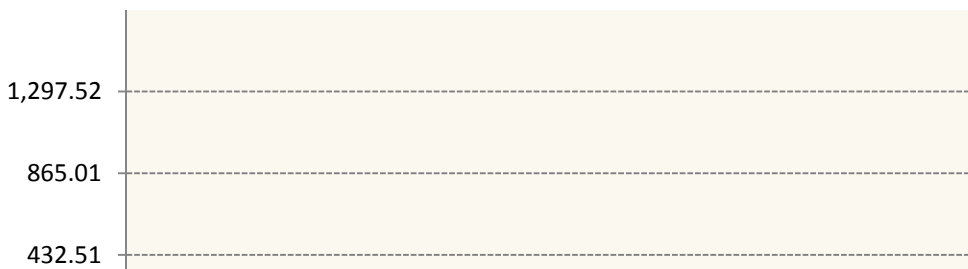
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,042	0	2,042	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,554	-5,554	장내
누계	통화	선도	0	3,132	-3,132	장외

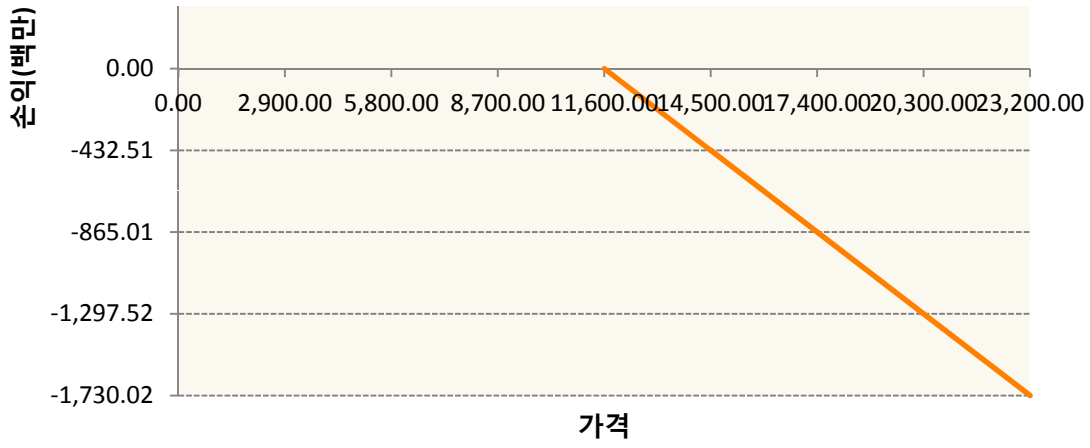
2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19

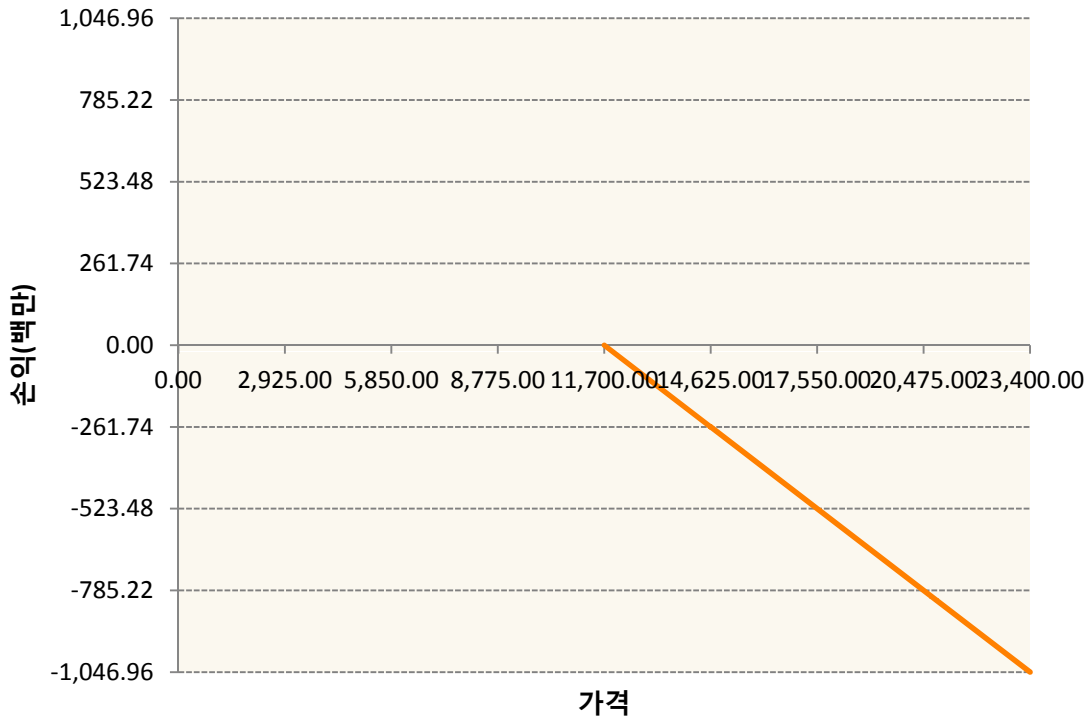


OHHIK9-C116-HSCEI

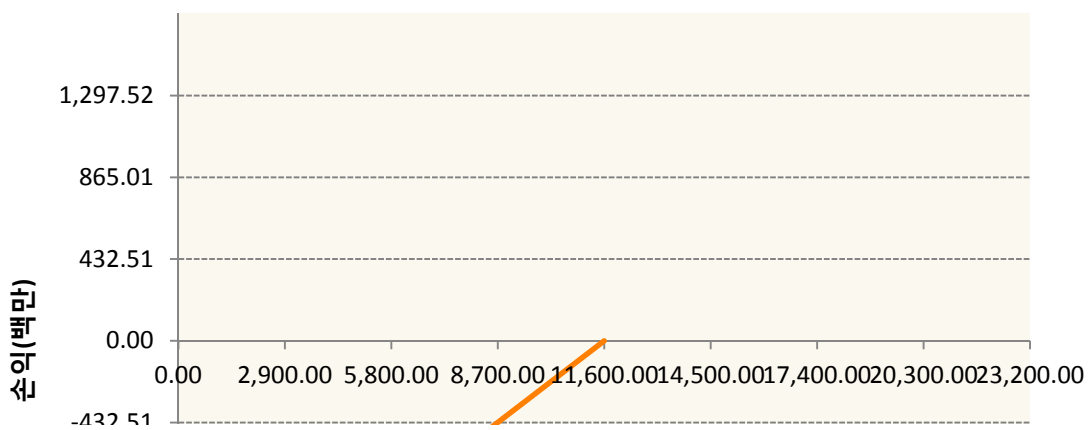


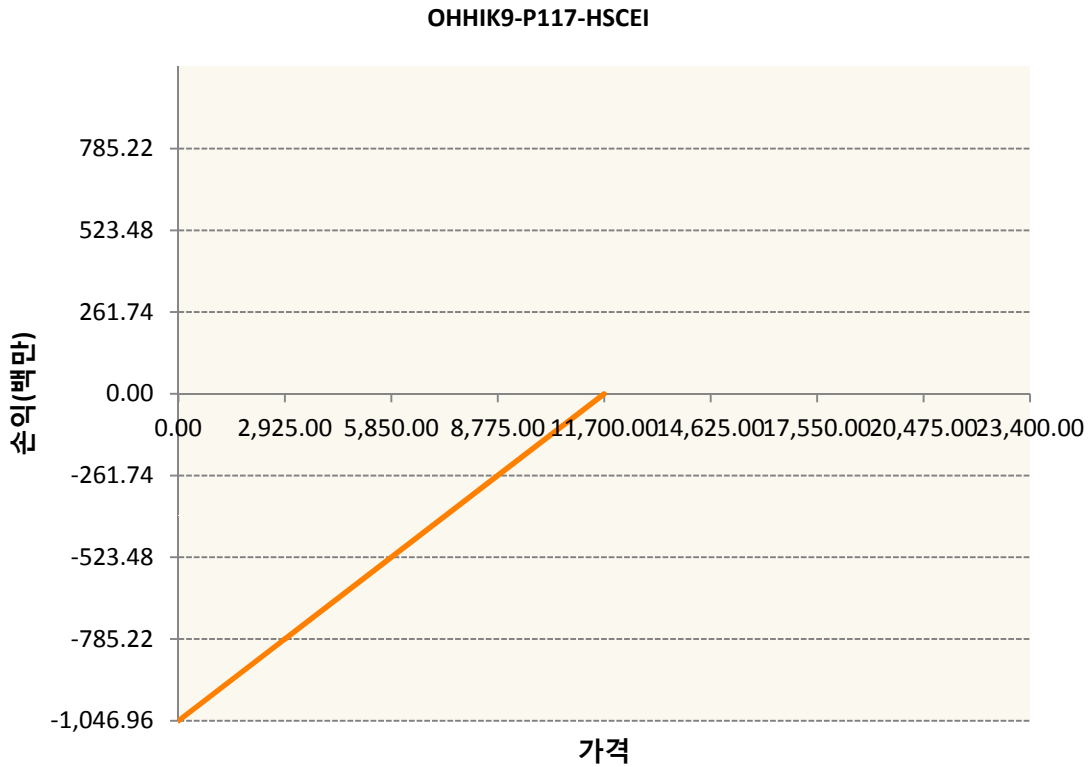


OHHIK9-C117-HSCEI



OHHIK9-P116-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	227
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	24
HCK9 HSCEI Futures May19	163
OHHIK9-C11 HSCEI	138
OHHIK9-C11 HSCEI	84
OHHIK9-P11 HSCEI	138
OHHIK9-P11 HSCEI	84

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	709

공시일	2019-05-07
기준일	2019-05-03

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

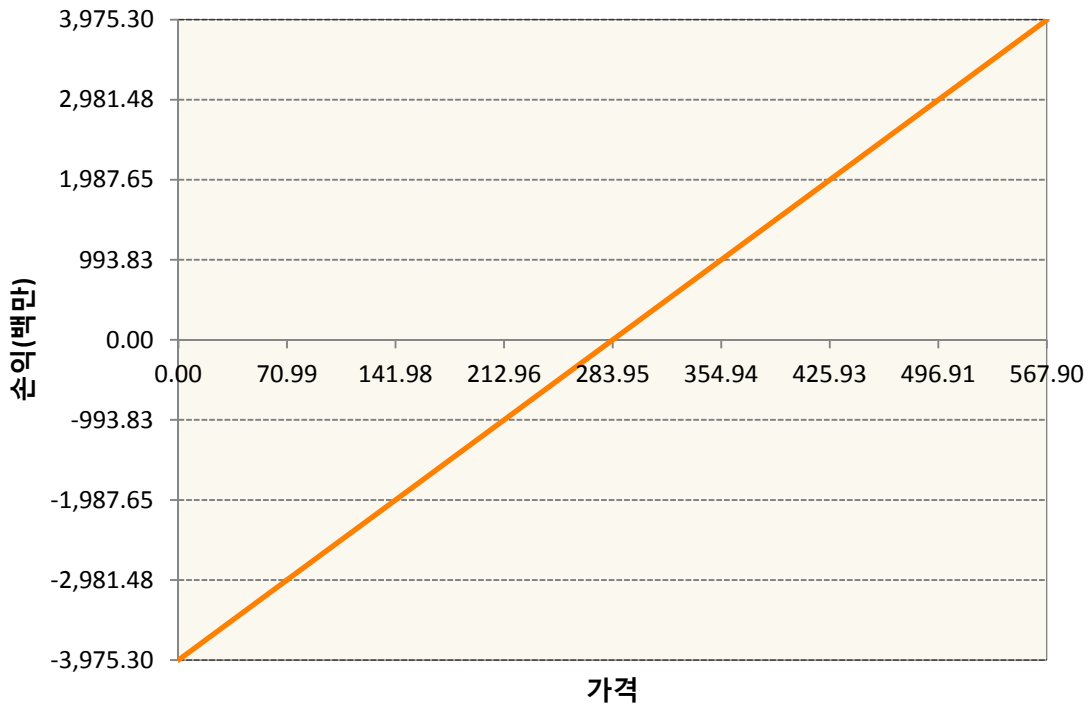
1. 계약금액

(단위:백만원)

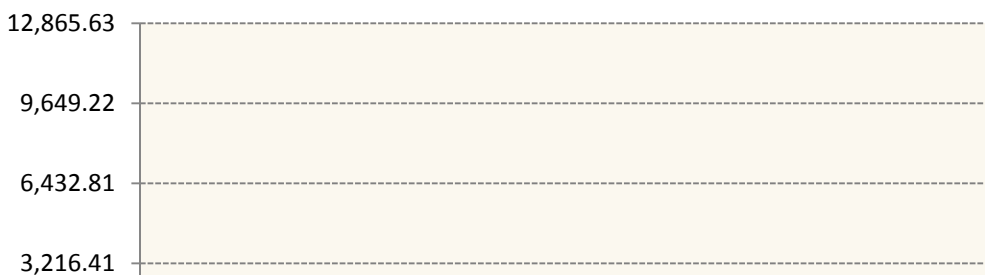
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	3,586	0	3,586	장내
누계	유가증권	선물	3,975	0	3,975	장내
누계	유가증권	스왑	32,836	0	32,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	27,593	-27,593	장내

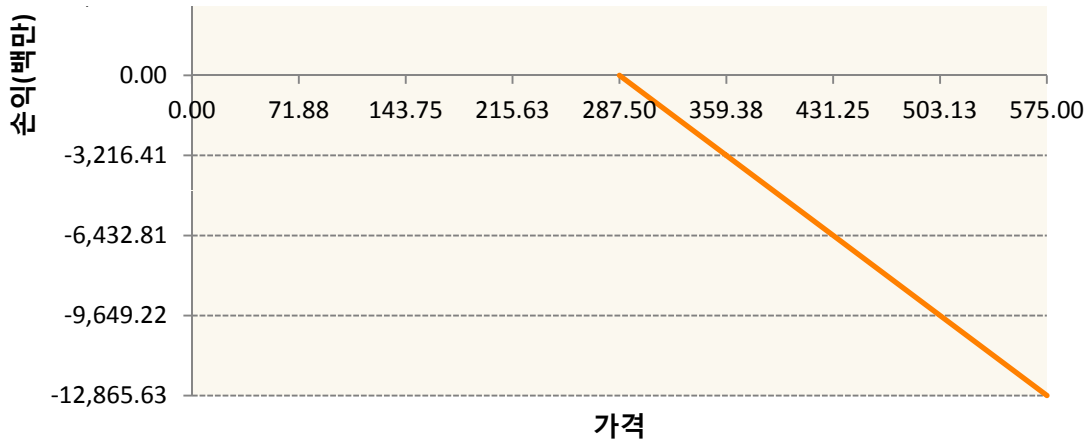
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

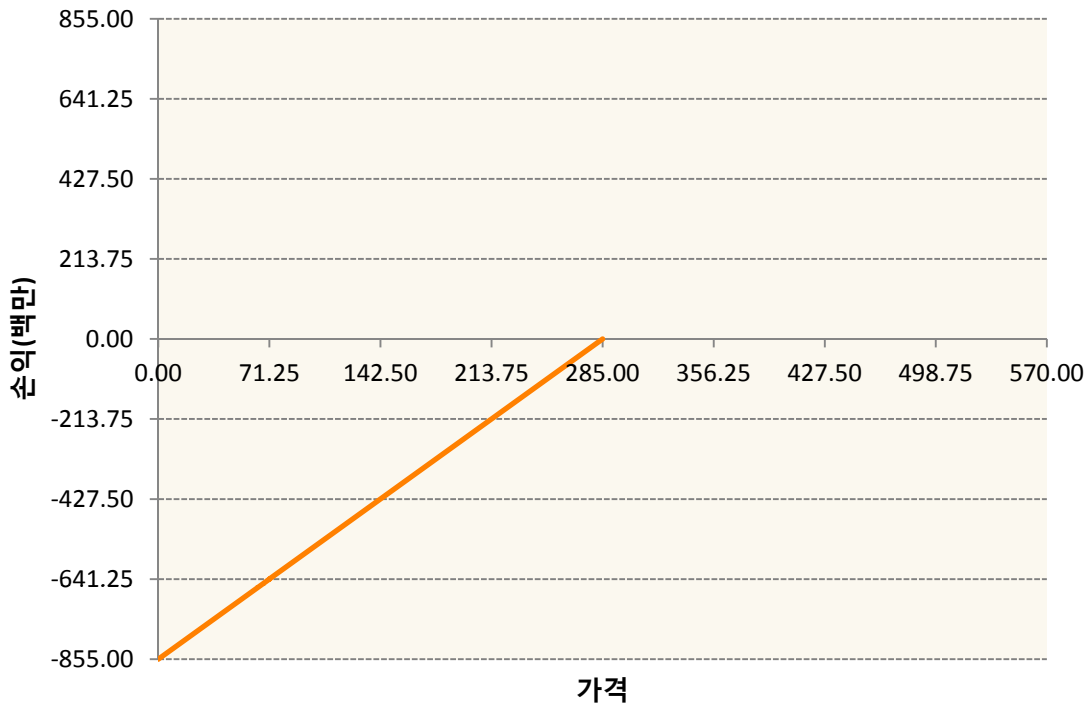


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

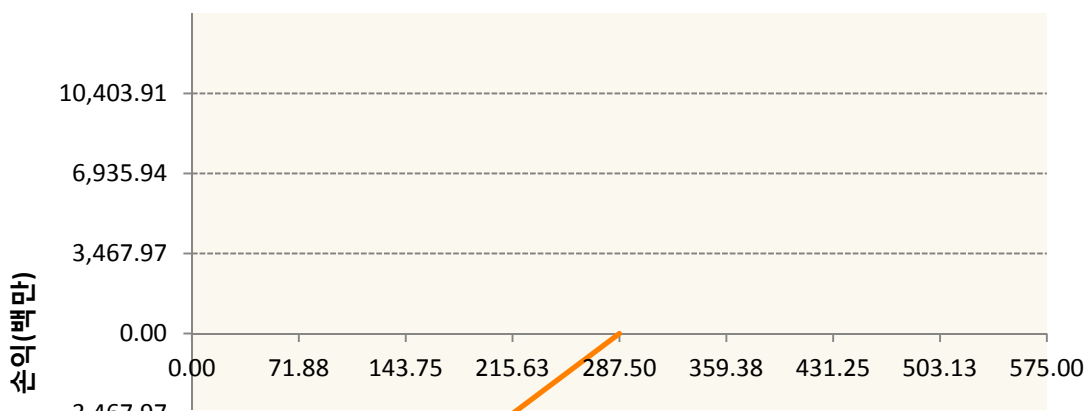




KR4301P52858-2019-05 풋285



KR4301P52874-2019-05 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,206
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,206	-2,206	-2,206	-2,206	-2,206	-2,206	-2,206	
-5.33%	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471	
-2.67%	-735	-735	-735	-735	-735	-735	-735	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	735	735	735	735	735	735	735	
5.33%	1,471	1,471	1,471	1,471	1,471	1,471	1,471	
8.00%	2,206	2,206	2,206	2,206	2,206	2,206	2,206	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						598
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-598	-598	-598	-598	-598	-598	-598	
-5.33%	-399	-399	-399	-399	-399	-399	-399	
-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%	399	399	399	399	399	399	399	
8.00%	598	598	598	598	598	598	598	
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						764
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

공시일	2019-05-07
기준일	2019-05-03

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

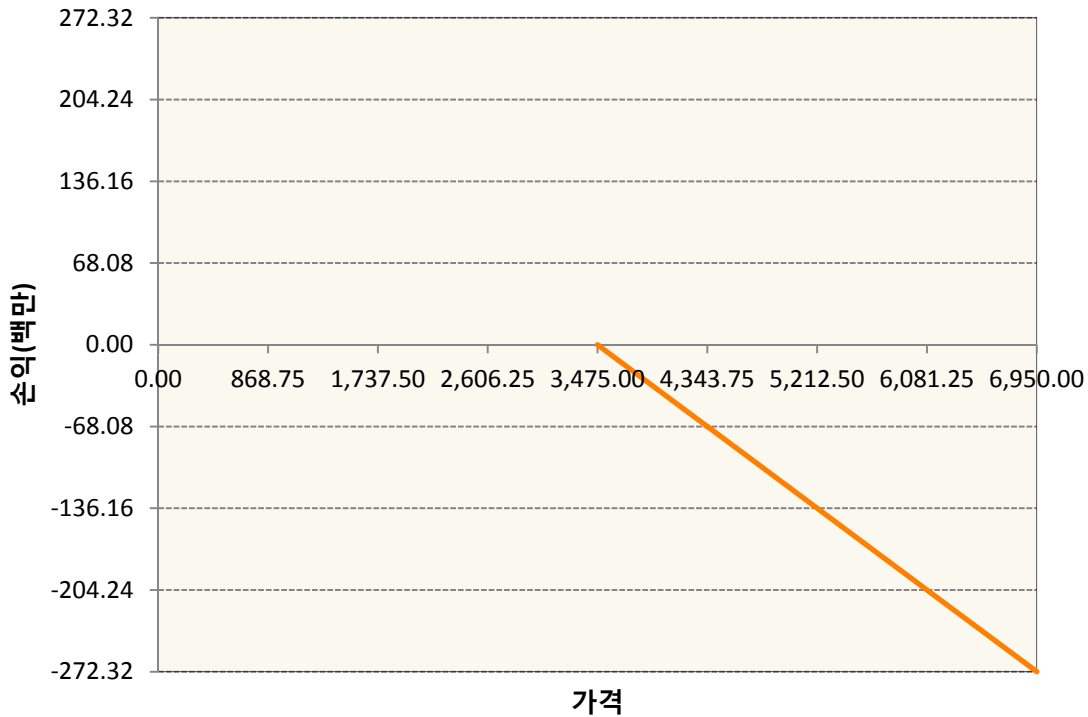
1. 계약금액

(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	1,590	0	1,590	
누계	유가증권	스왑	64,347	0	64,347	장외
누계	유가증권	옵션	0	17,459	-17,459	장내
누계	통화	선도	0	18,286	-18,286	장외

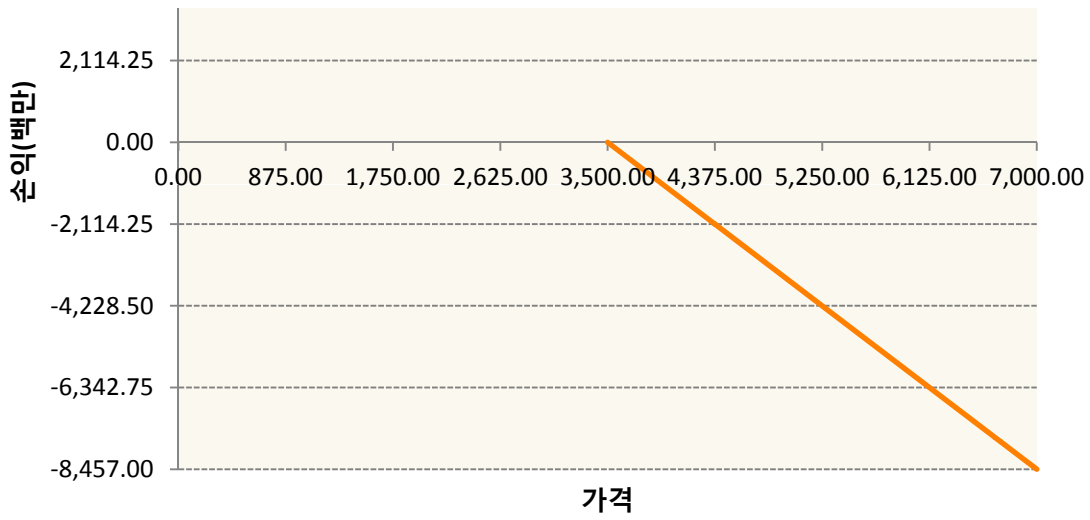
2. 만기시점의 손익구조

OESXK9-C3475-EURO STOXX 50

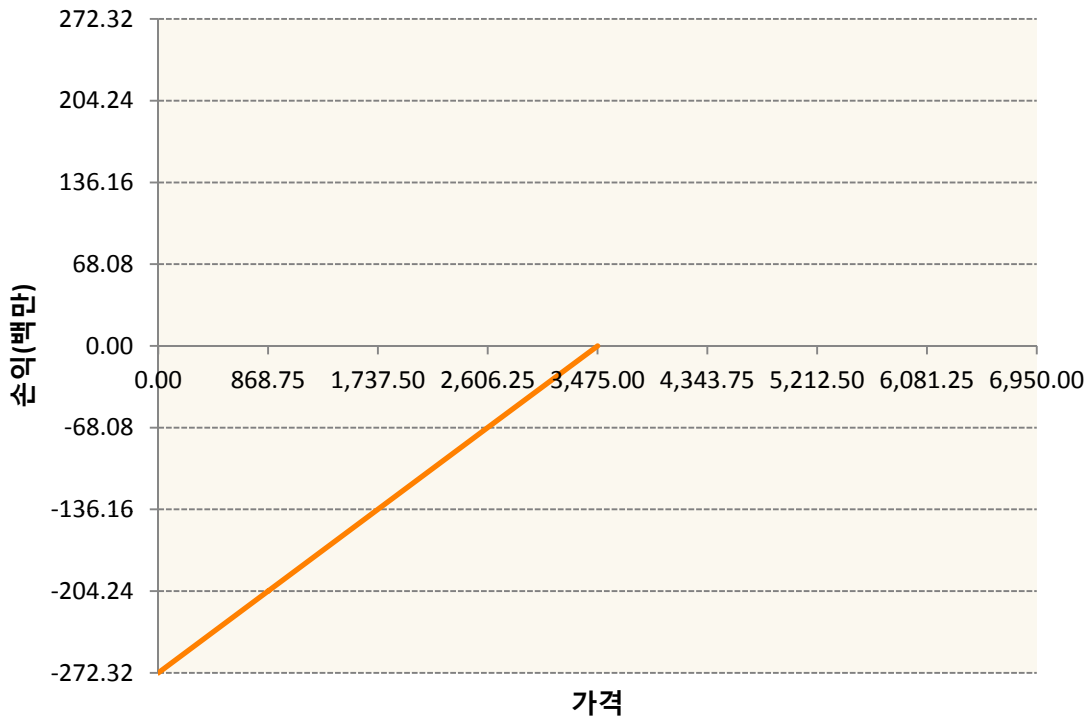


OESXK9-C3500-EURO STOXX 50

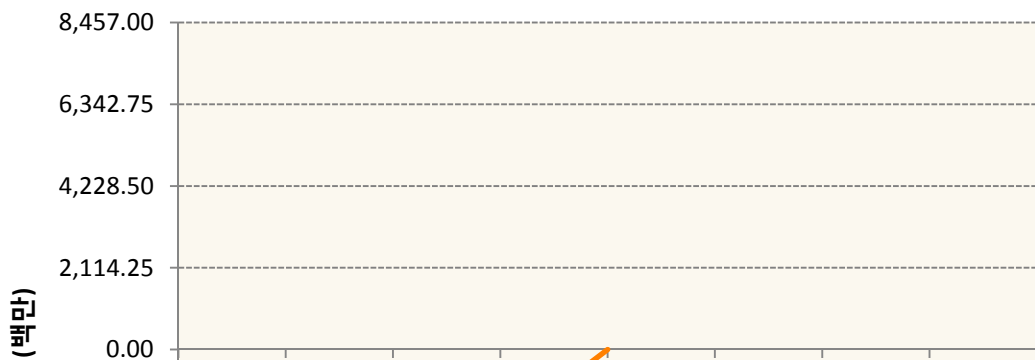


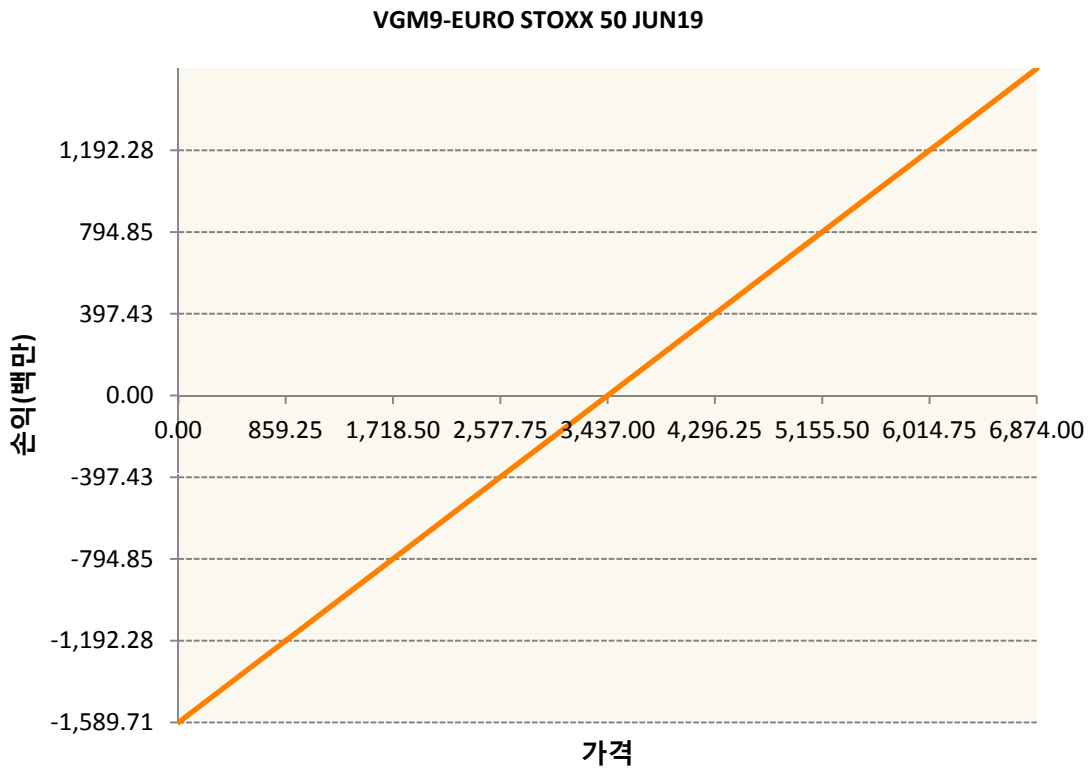
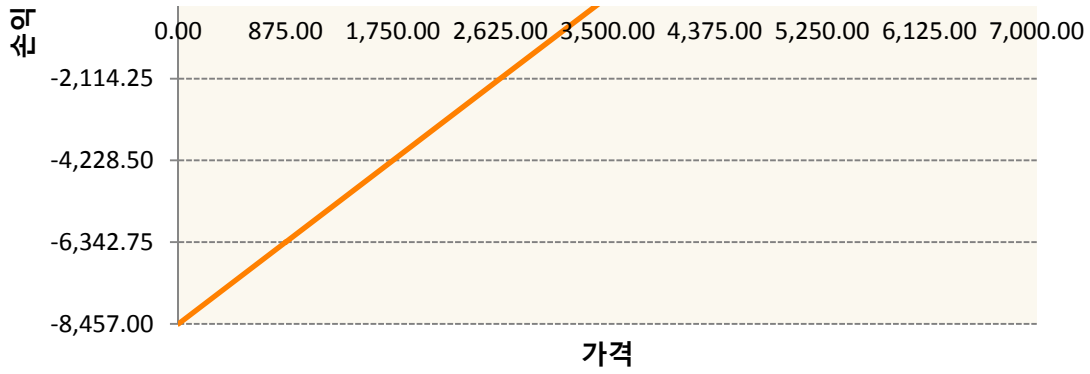


OESXK9-P3475-EURO STOXX 50



OESXK9-P3500-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	10
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	418
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	836
FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E	209
OESXK9-C34 EURO STOXX 50	22
OESXK9-C35 EURO STOXX 50	677
OESXK9-P34 EURO STOXX 50	22
OESXK9-P35 EURO STOXX 50	677
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	127

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

(단위:백만원)

1,834

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	2019-05-07
기준일	2019-05-03

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

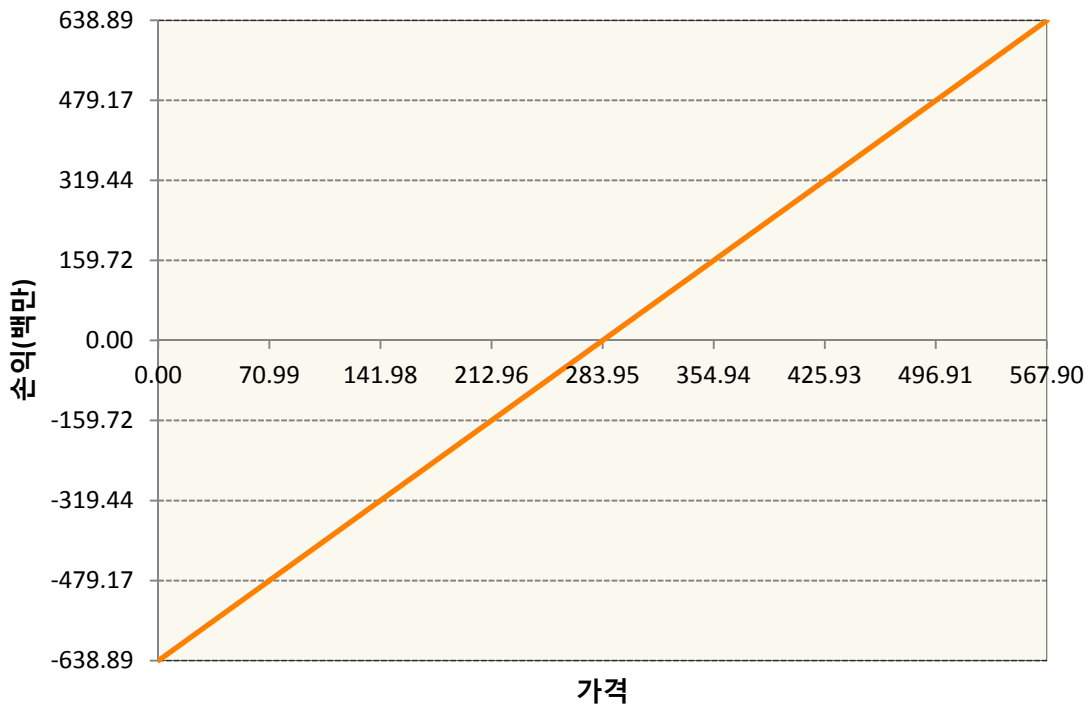
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	639	0	639	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	2019-05-07
기준일	2019-05-03

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

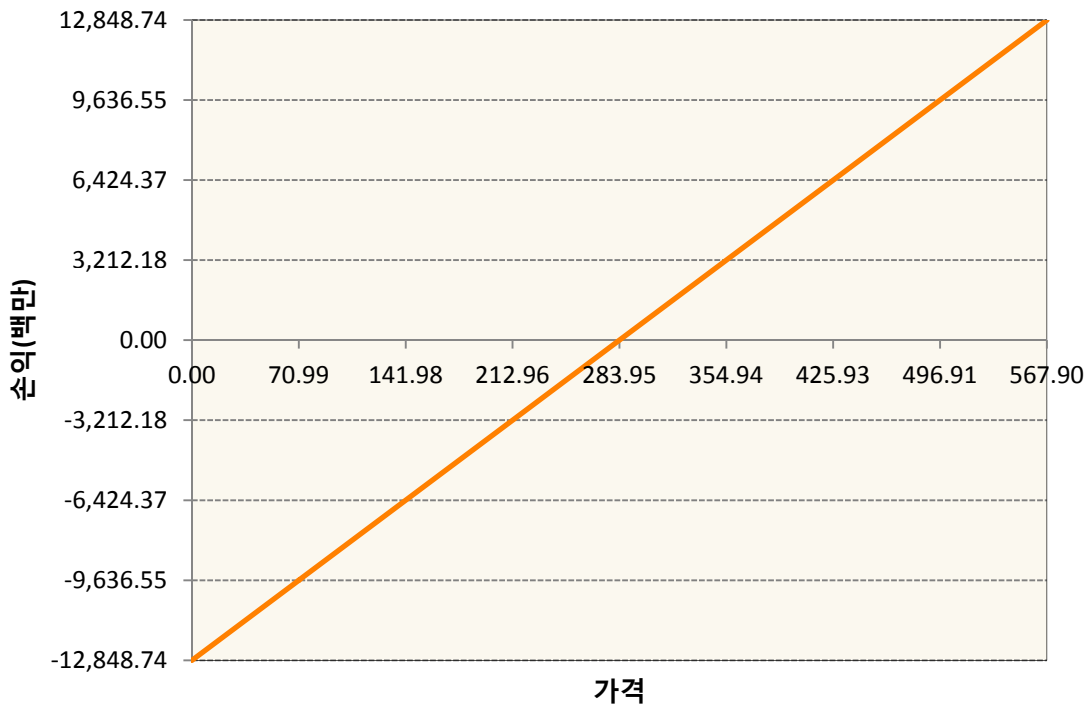
1. 계약금액

(단위:백만원)

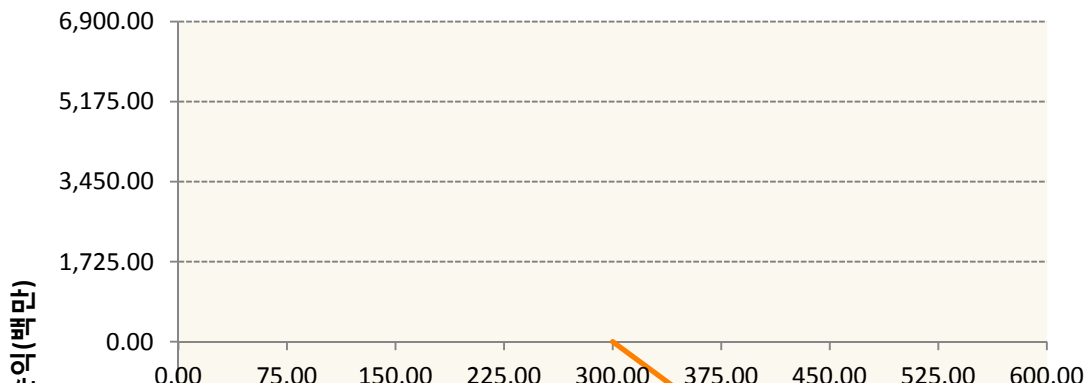
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,849	0	12,849	장내
누계	유가증권	옵션	1,366	24,294	-22,928	장내

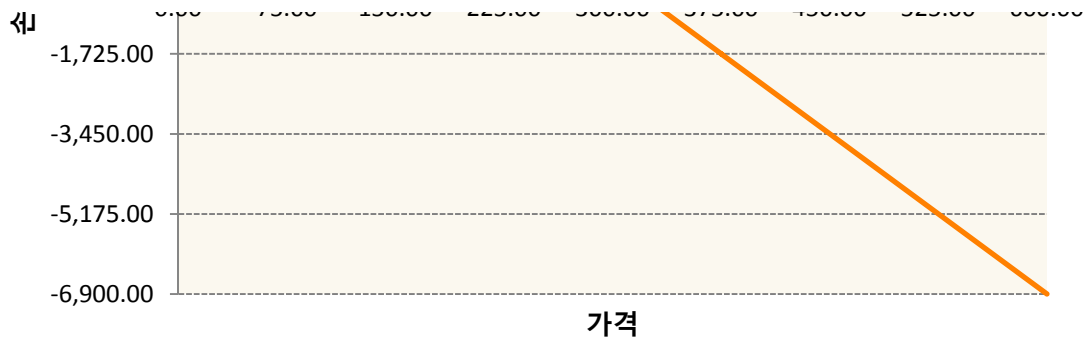
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

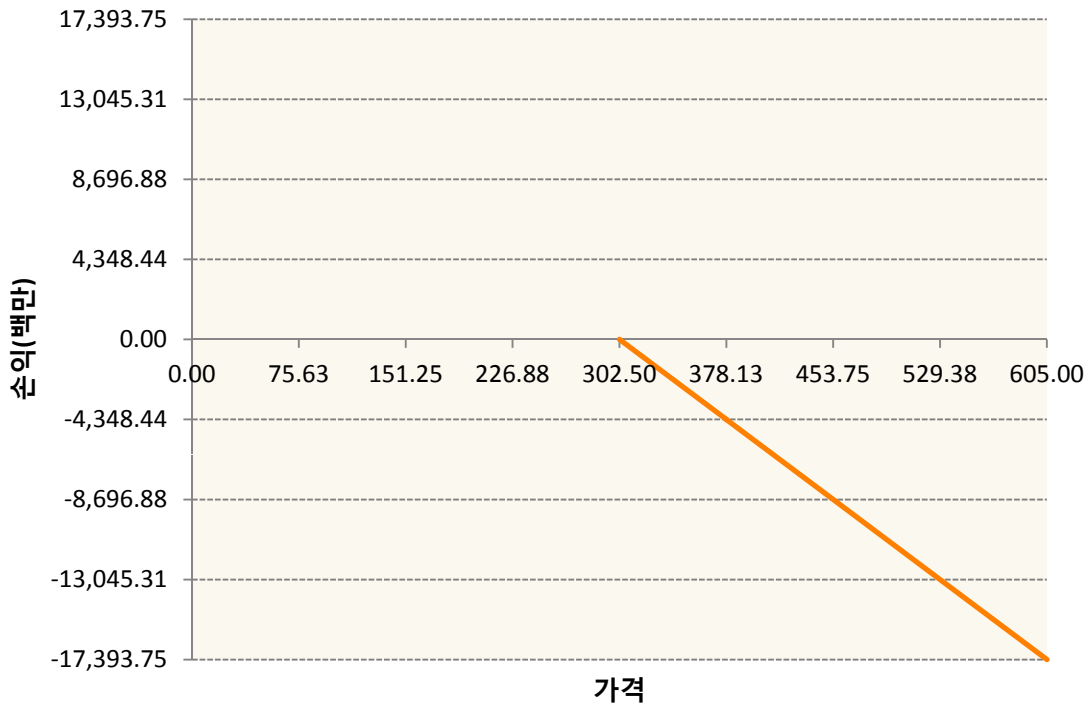


KR4201P53007-2019-05 콜300

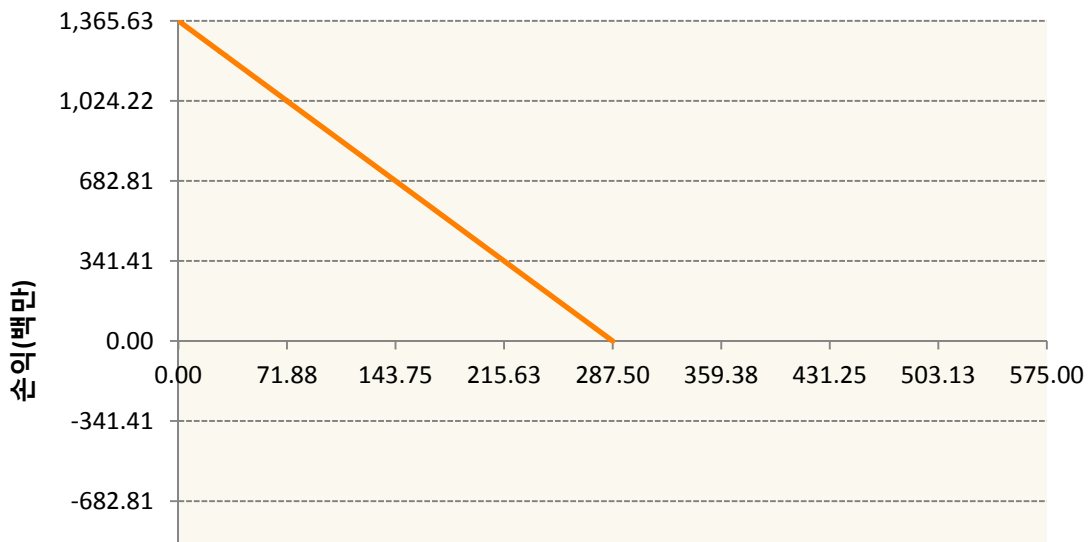


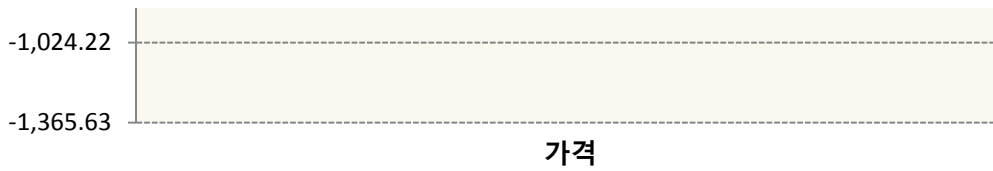


KR4201P53023-2019-05 콜302.5



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						196
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4	4	4	4	4	4	4	
-5.33%	4	4	4	4	3	3	3	
-2.67%	4	3	3	3	3	2	2	
0%	3	2	1	0	-2	-4	-6	
2.67%	-5	-9	-13	-17	-22	-27	-33	
5.33%	-49	-57	-64	-71	-79	-86	-93	
8.00%	-160	-165	-171	-177	-183	-189	-196	
KR4201P53023		2019-05 콜302.5						400
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5	5	5	5	5	5	5	
-5.33%	5	5	5	5	5	4	4	
-2.67%	5	5	4	4	4	3	2	
0%	4	3	2	0	-3	-7	-11	
2.67%	-5	-11	-19	-27	-37	-47	-58	
5.33%	-76	-92	-109	-126	-143	-161	-178	
8.00%	-296	-313	-330	-347	-364	-382	-400	
KR4301P52874		2019-05 풋287.5						105
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	105	105	105	105	105	105	105	
-5.33%	69	69	69	69	69	69	69	
-2.67%	33	33	33	33	33	33	33	

0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-20	-19	-19	-18	-17	-17	-16
5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
8.00%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21

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

(단위:백만원)

1,182

공시일	2019-05-07
기준일	2019-05-03

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	4,602	0	4,602	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2019-05-07
기준일	2019-05-03

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	75,867	0	75,867	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2019-05-07
기준일	2019-05-03

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	165,527	0	165,527	
누계	통화	선도	0	173,265	-173,265	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E		47
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E		94
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E		94
FX21019J001 KRW/USD 10-05-19E		46
FX21019J002 KRW/USD 10-06-19E		103
FX21019J003 KRW/USD 10-05-19E		159
FX21019J004 KRW/USD 10-05-19E		75
FX21019J005 KRW/USD 10-05-19E		281
FX21019J006 KRW/USD 10-05-19E		234
FX21019J007 KRW/USD 10-05-19E		75
FX21019J011 KRW/USD 20-05-19E		131
FX21019J012 KRW/USD 20-05-19E		19
FX21019J013 KRW/USD 20-05-19E		140
FX21019J014 KRW/USD 20-05-19E		140
FX21019J015 KRW/USD 17-05-19E		1,310
FX21019J016 KRW/USD 17-05-19E		1,404
FX21019J017 KRW/USD 18-06-19E		374
FX21019J020 KRW/USD 20-05-19E		505
FX21019J021 KRW/USD 20-05-19E		475
FX21019J022 KRW/USD 24-06-19E		936
FX21019J023 KRW/USD 22-05-19E		786
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		936
FX21019J031 KRW/USD 28-05-19E		992
FX21019J032 KRW/USD 26-06-19E		374
FX21019J033 KRW/USD 28-06-19E		75
FX21019J034 KRW/USD 28-06-19E		985
FX21019J035 KRW/USD 26-06-19E		1,011

FX21019J041 KRW/USD 28-05-19E	281
FX21019J043 KRW/USD 03-06-19E	562
FX21019J044 KRW/USD 03-06-19E	468
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E	281
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E	468

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

(단위:백만원)

4,774

공시일	2019-05-07
기준일	2019-05-03

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

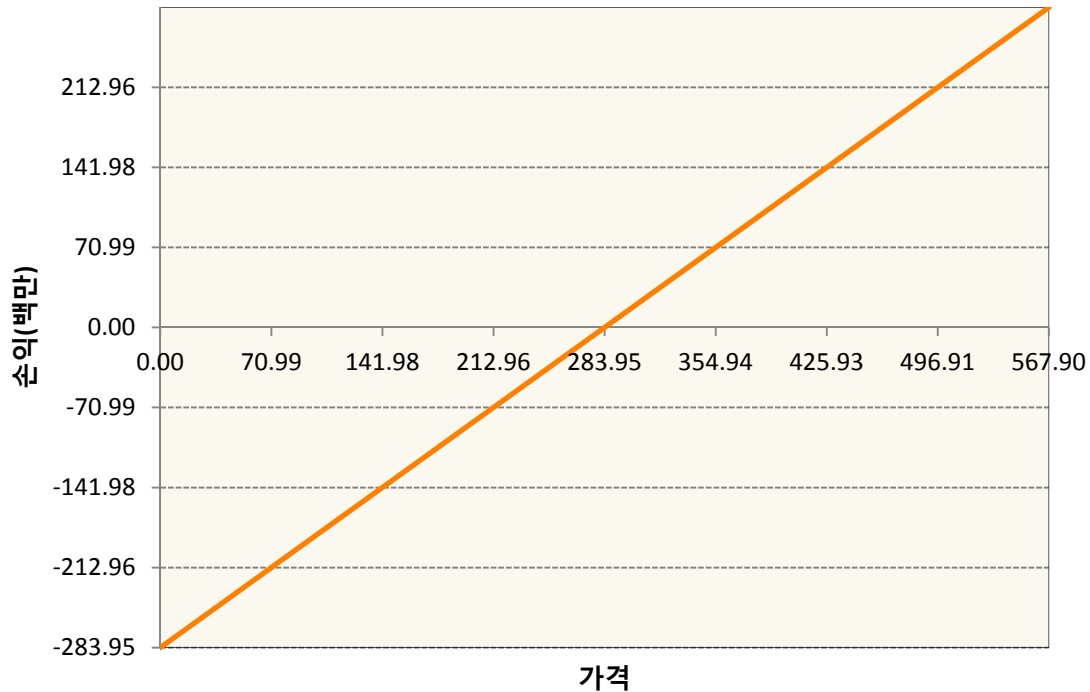
1. 계약금액

(단위:백만원)

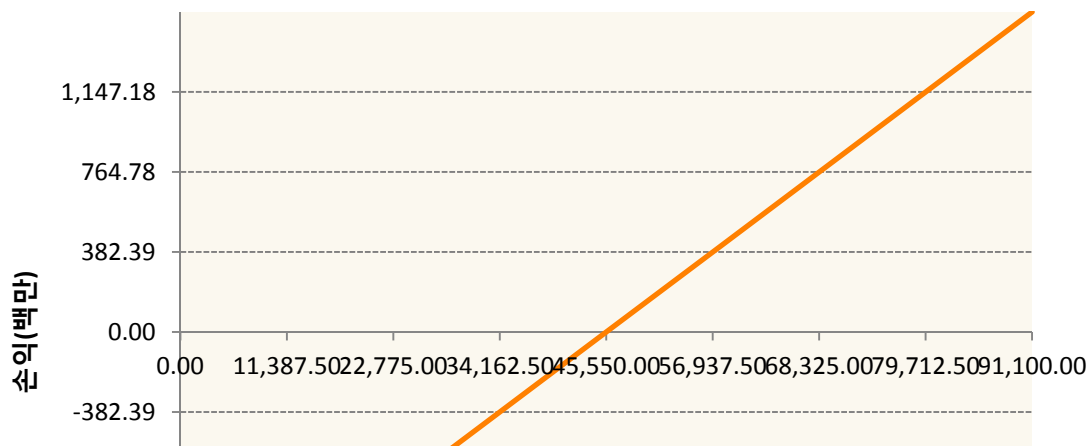
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,814	0	1,814	장내

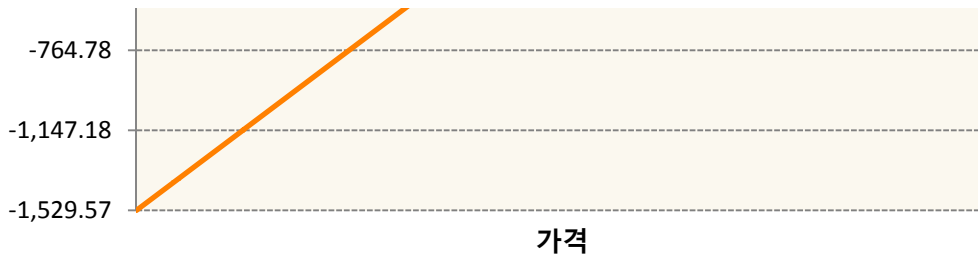
2. 만기시점의 손익구조

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	2019-05-07
기준일	2019-05-03

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

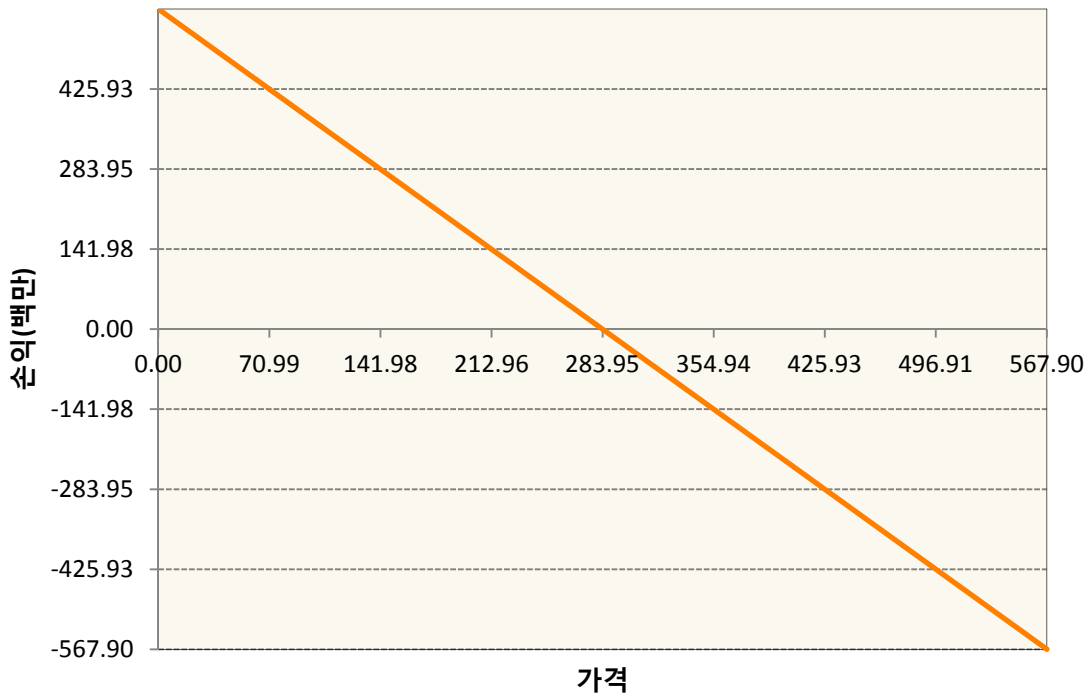
1. 계약금액

(단위:백만원)

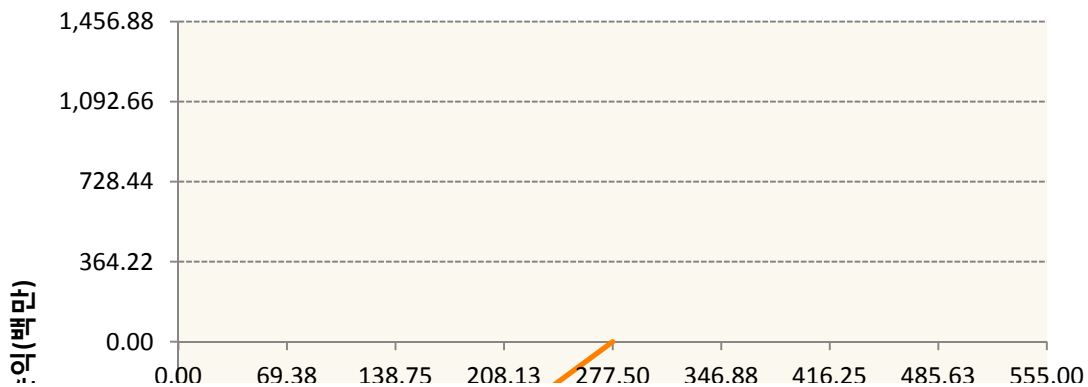
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	70	-70	장내
누계	유가증권	선물	0	568	-568	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,137	-3,137	장내

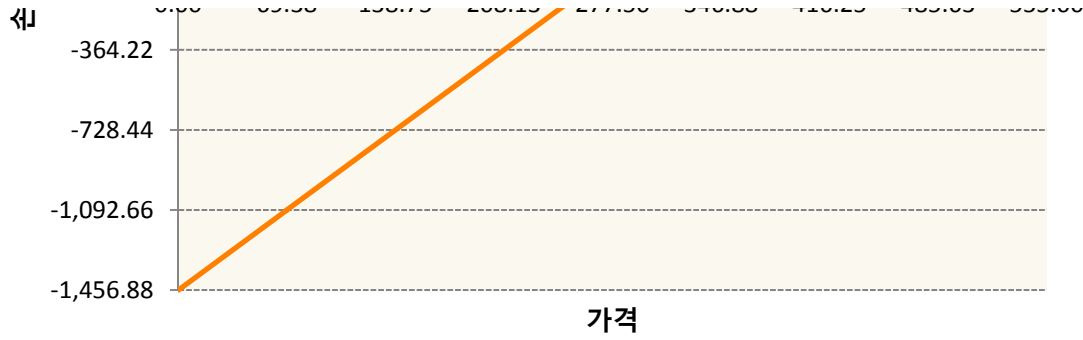
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

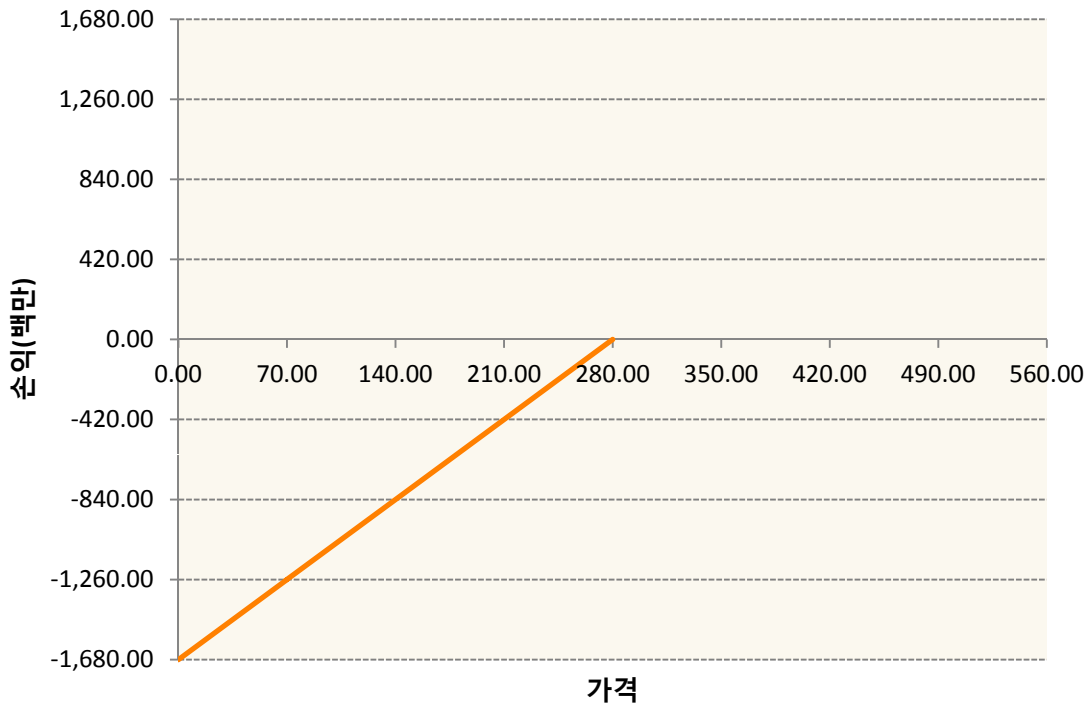


KR4301P52775-2019-05 풋277.5





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						86
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
-5.33%	-46	-46	-46	-46	-46	-47	-47
-2.67%	-11	-11	-12	-13	-14	-14	-15
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

KR4301P52809

2019-05 풋280

111

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111
-5.33%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
-2.67%	-21	-22	-22	-23	-24	-24	-25
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
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)

241

공시일	2019-05-07
기준일	2019-05-03

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

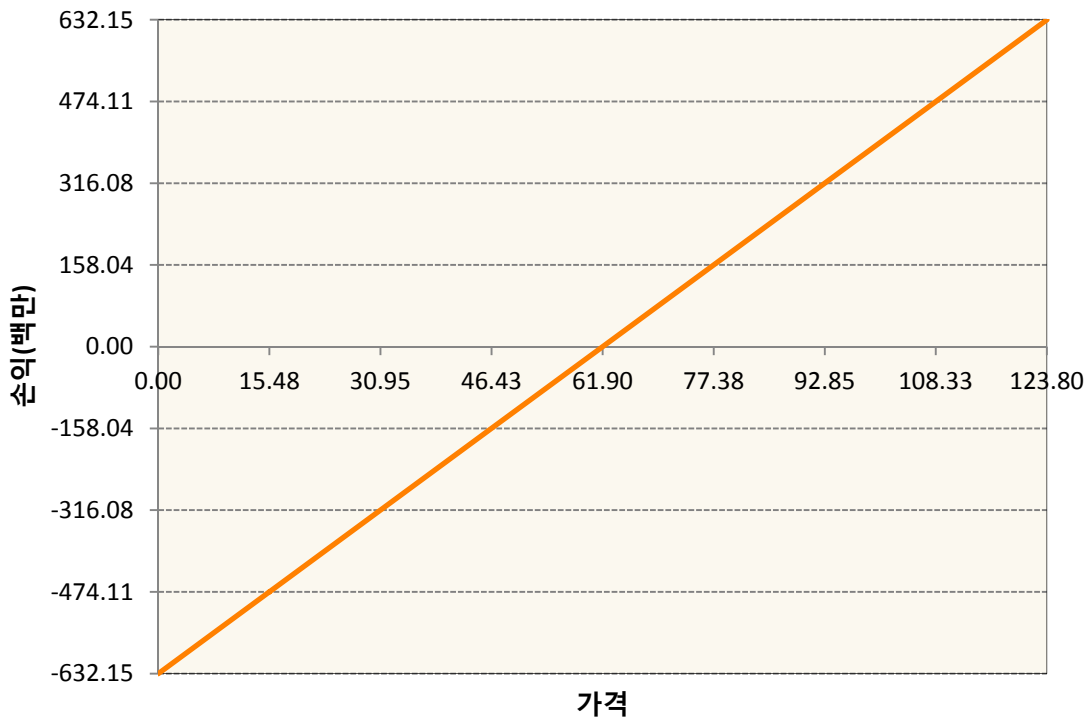
1. 계약금액

(단위:백만원)

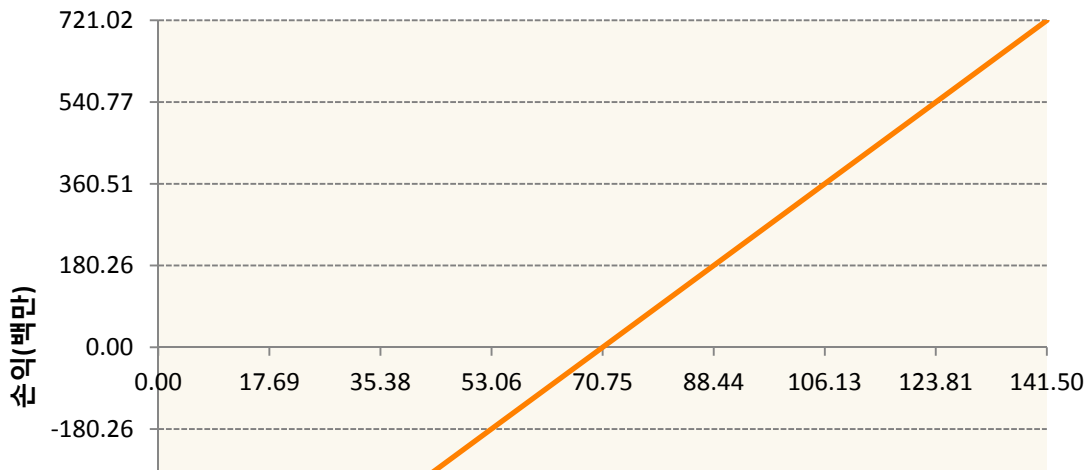
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,748	292	2,455	

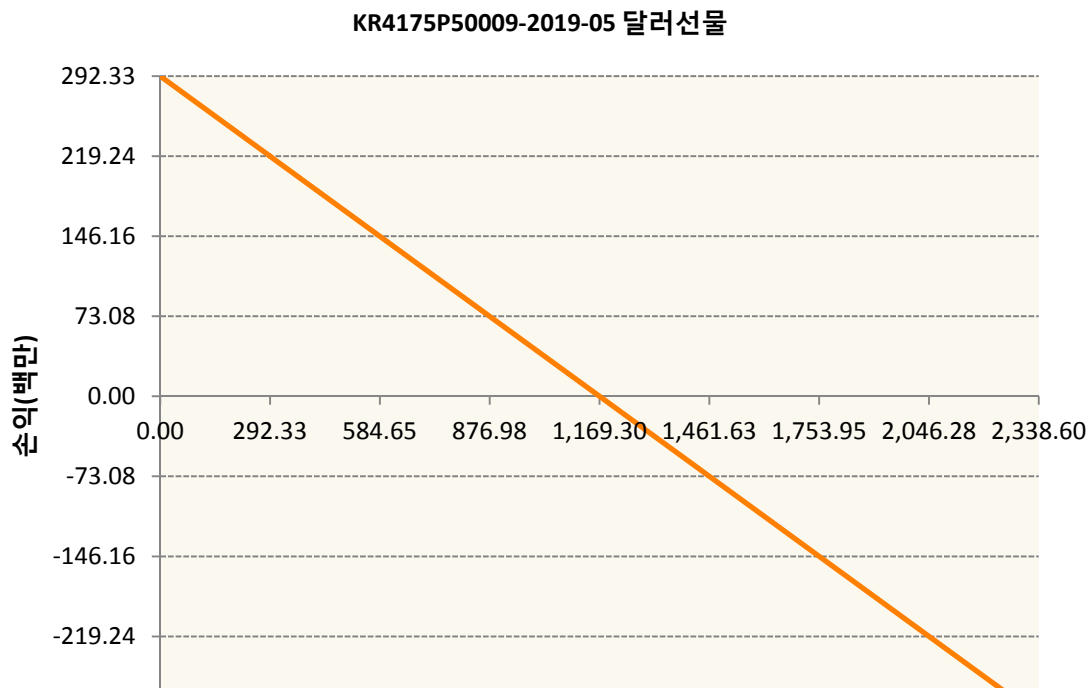
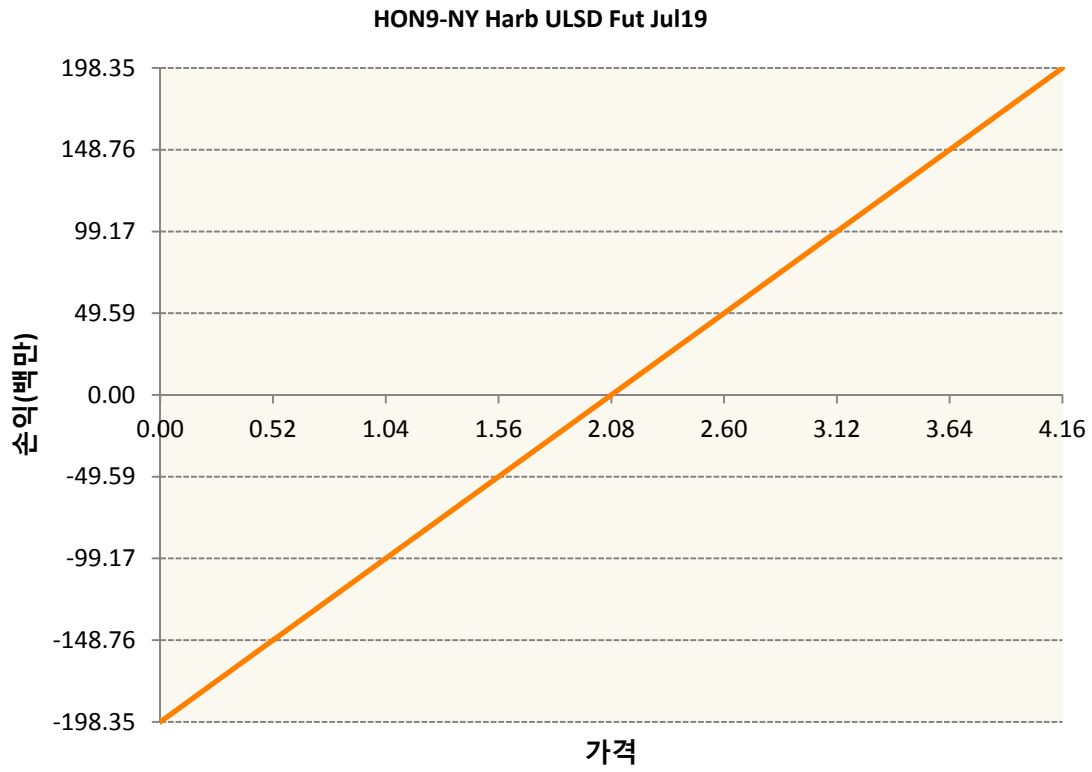
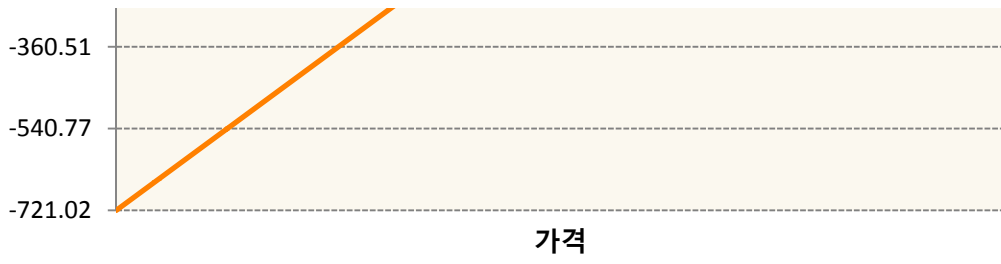
2. 만기시점의 손익구조

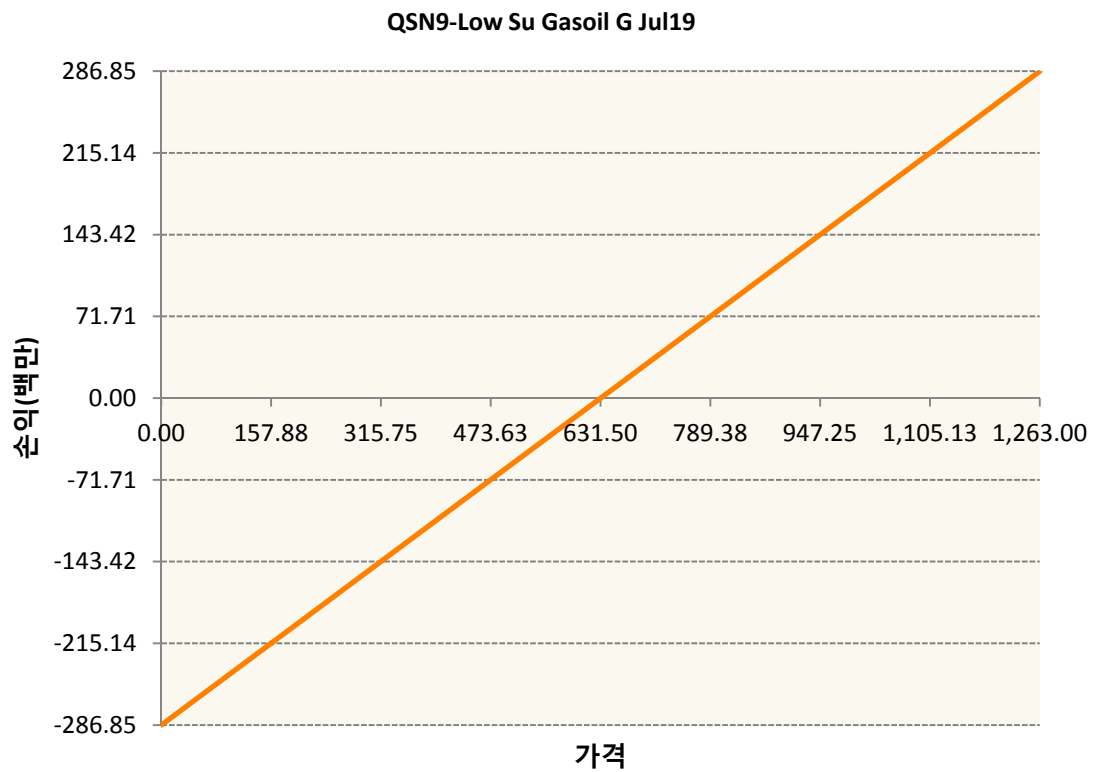
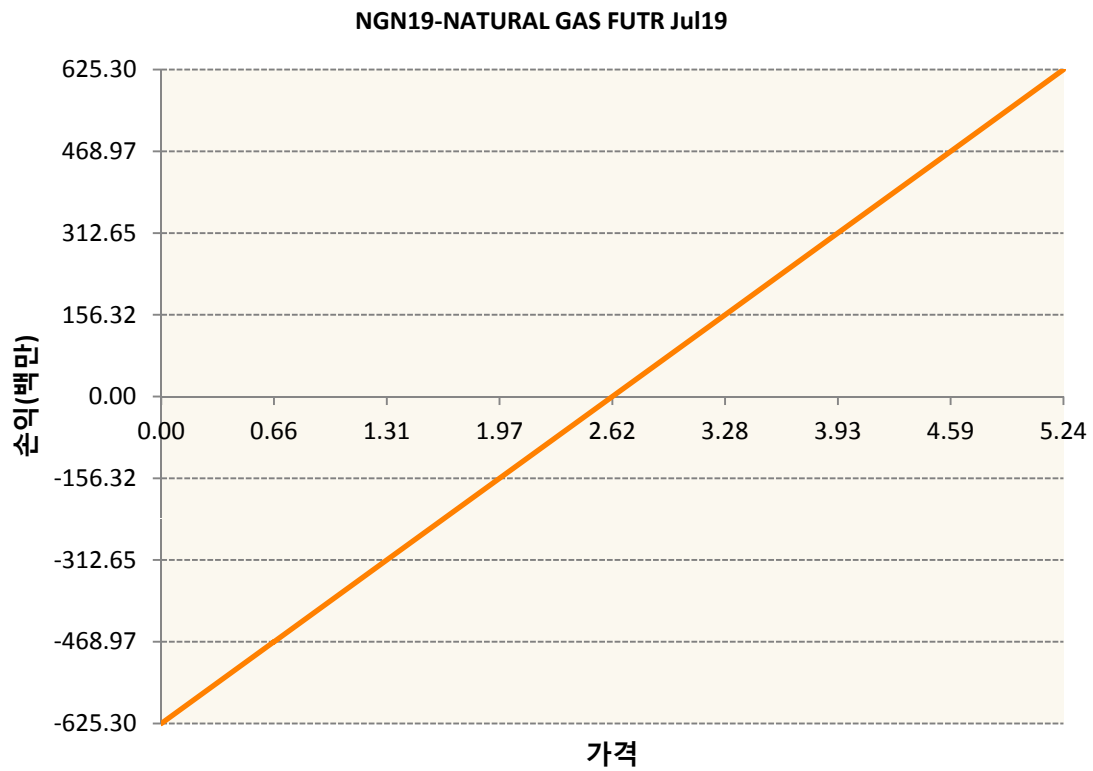
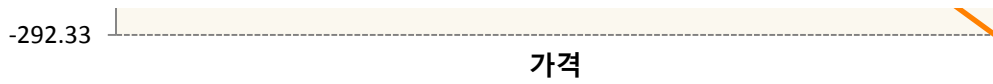
CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19



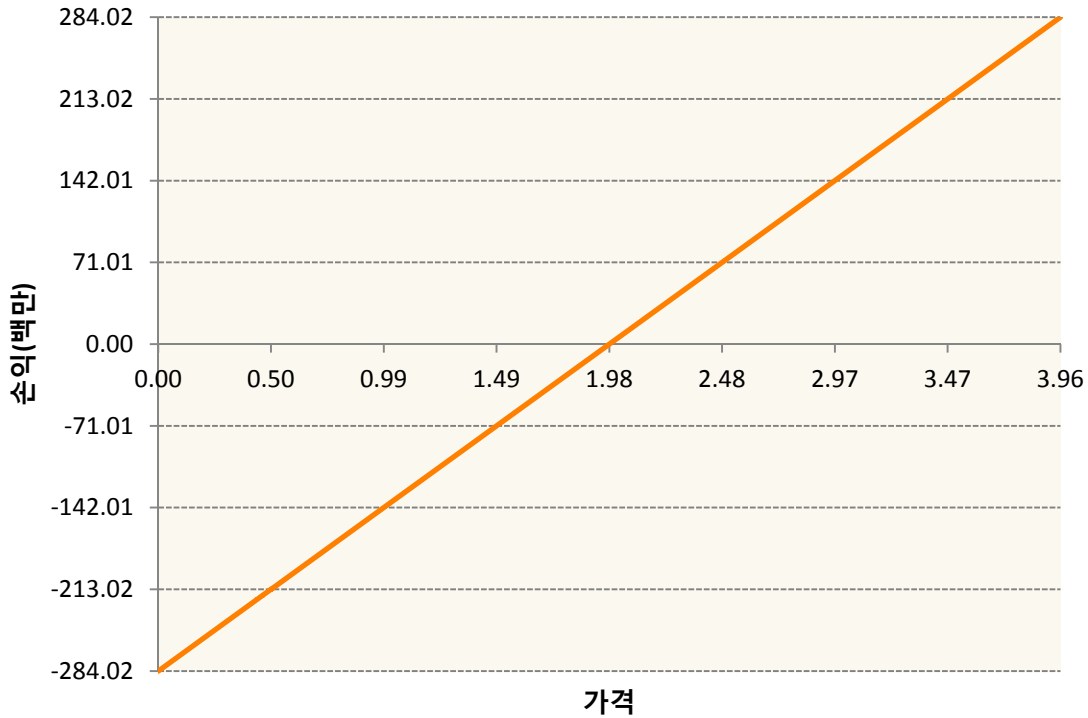
CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19







XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN9	WTI CRUDE FUTURE Jul19	51
CON9	BRENT CRUDE FUTR Jul19	58
HON9	NY Harb ULSD Fut Jul19	16
KR4175P500	2019-05 달러선물	23
NGN19	NATURAL GAS FUTR Jul19	50
QSN9	Low Su Gasoil G Jul19	23
XBN9	GASOLINE RBOB FUT Jul19	23

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

406

공시일	2019-05-07
기준일	2019-05-03

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

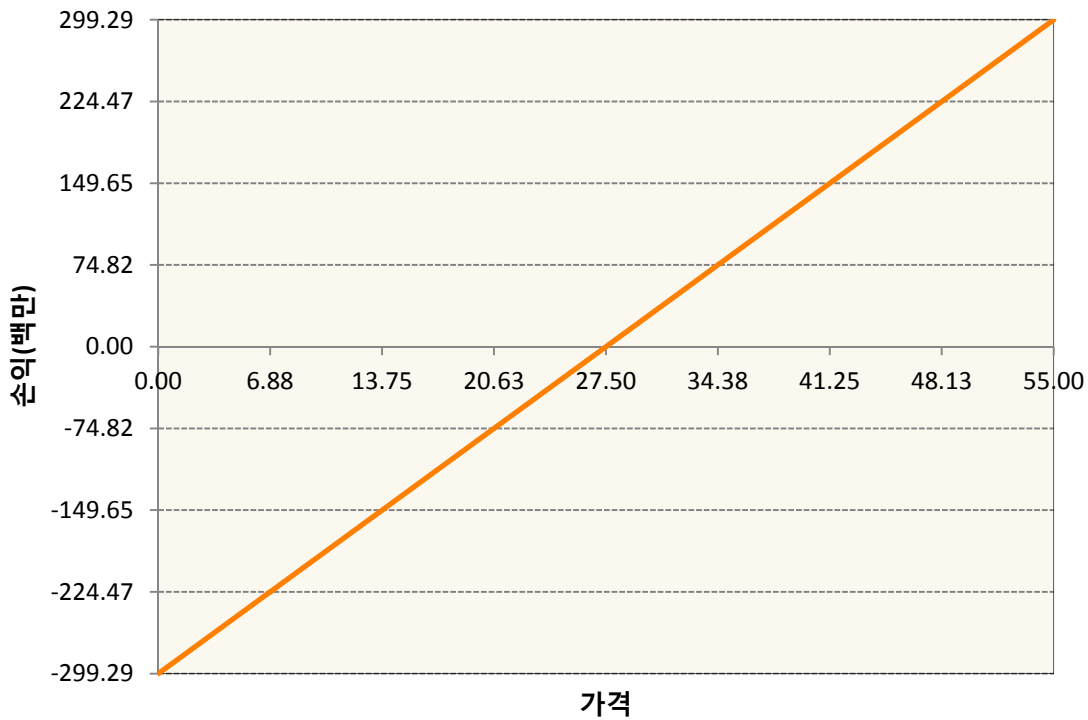
1. 계약금액

(단위:백만원)

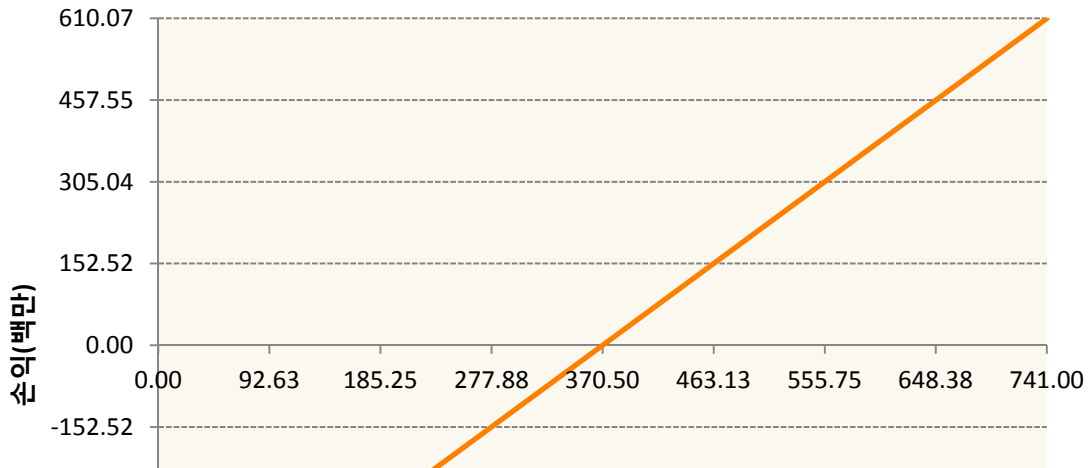
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,904	58	2,845	

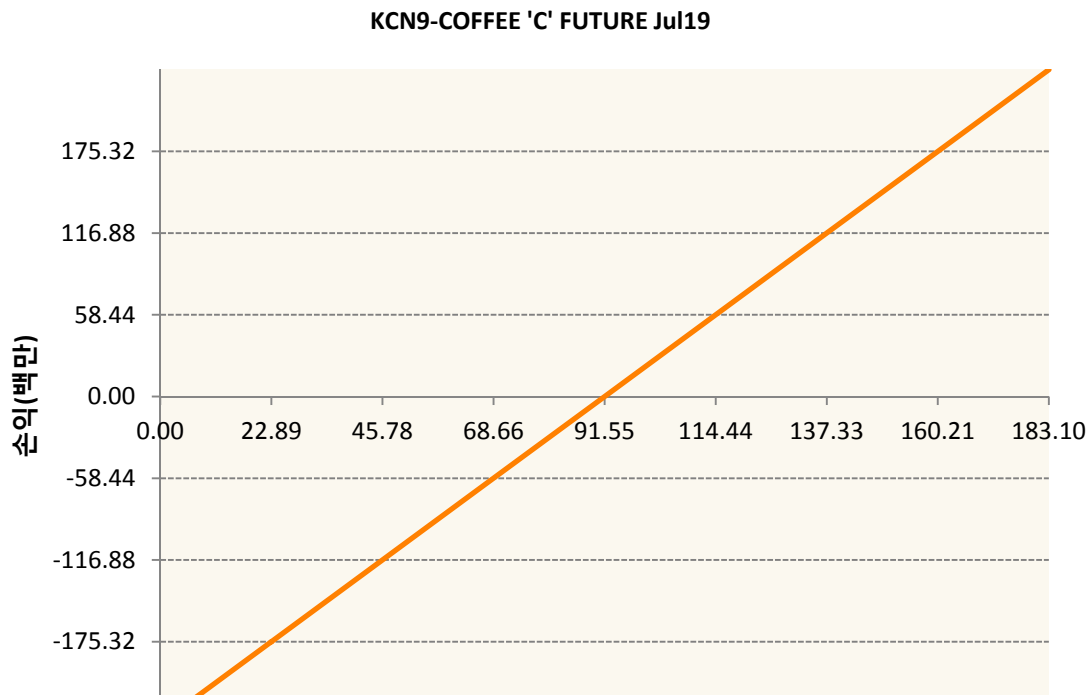
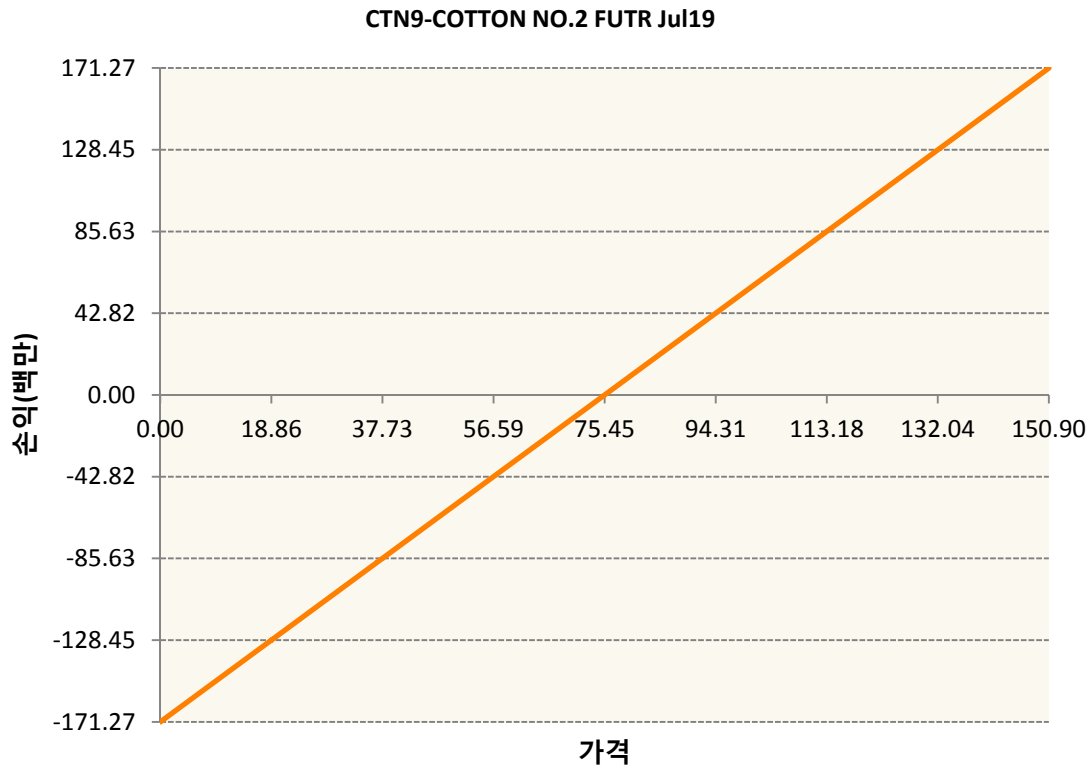
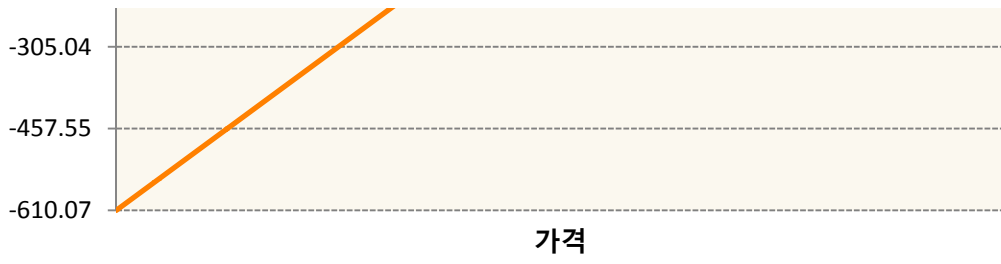
2. 만기시점의 손익구조

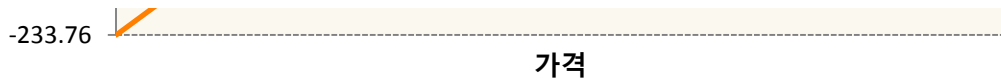
BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19



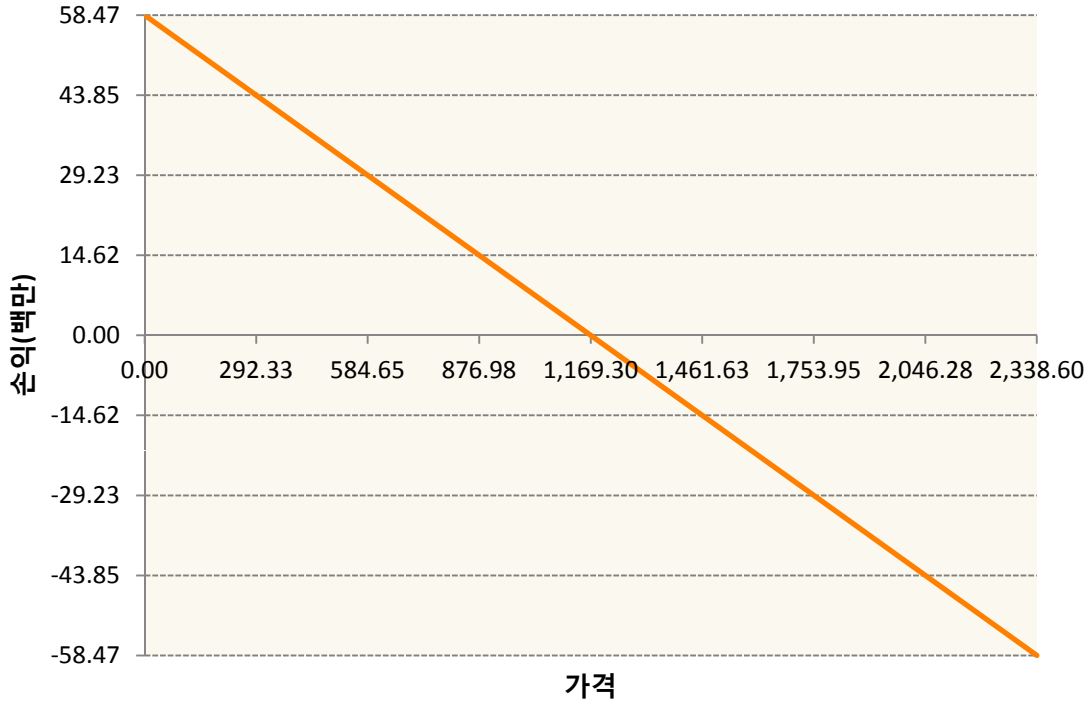
CN9-CORN FUTURE Jul19



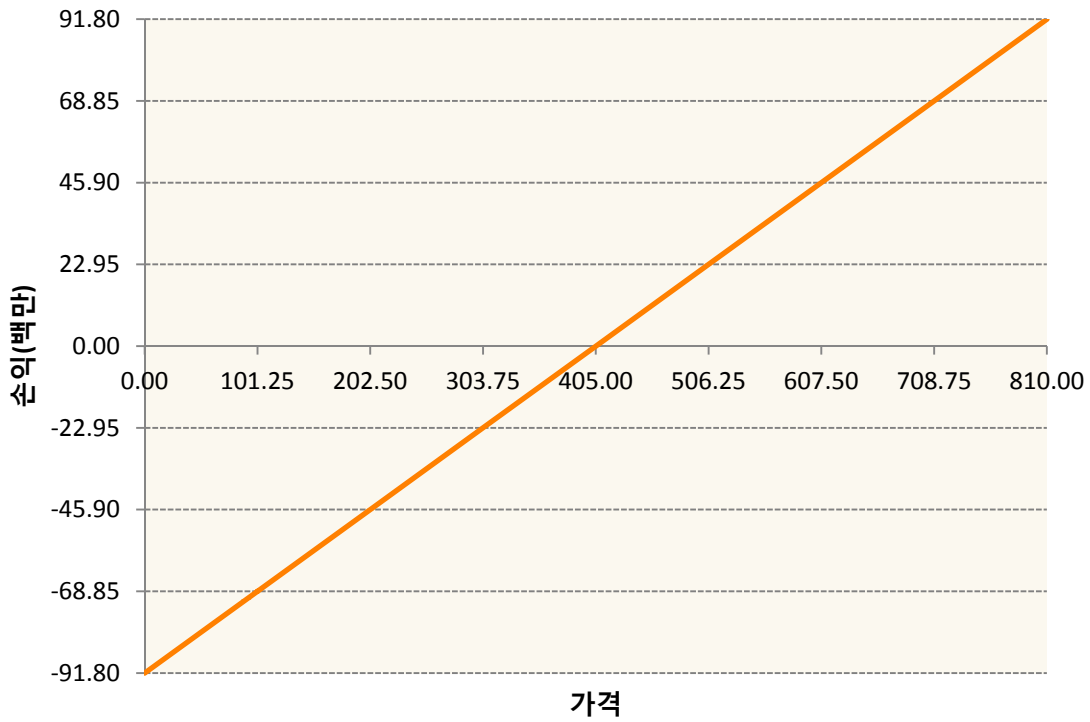




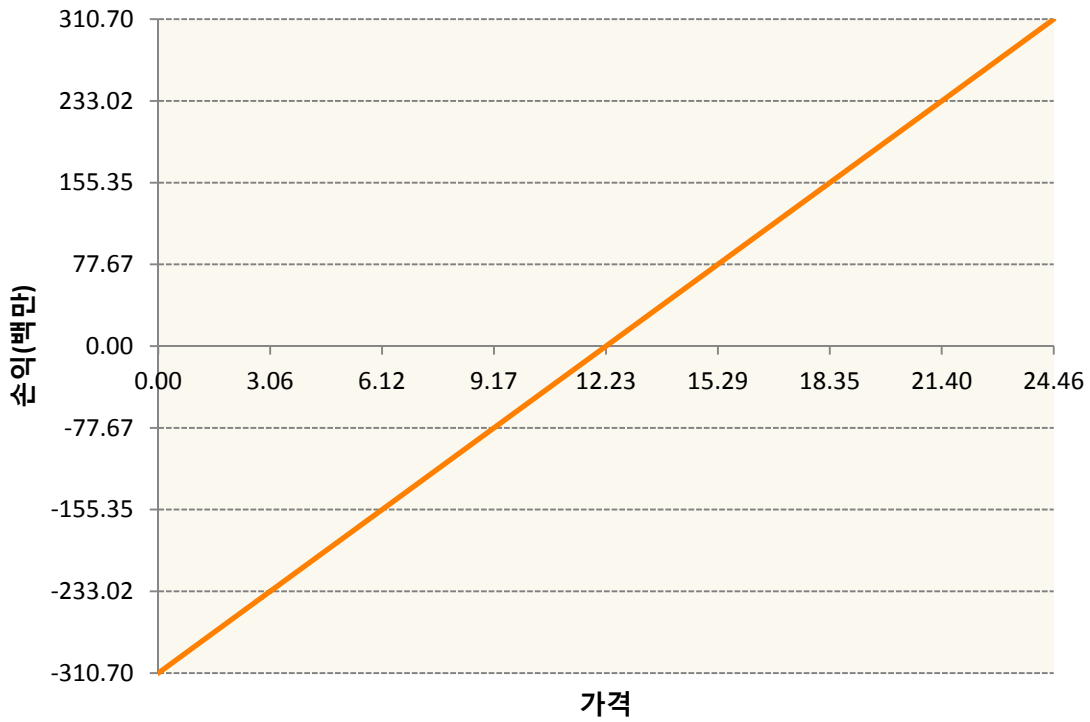
KR4175P50009-2019-05 달러선물



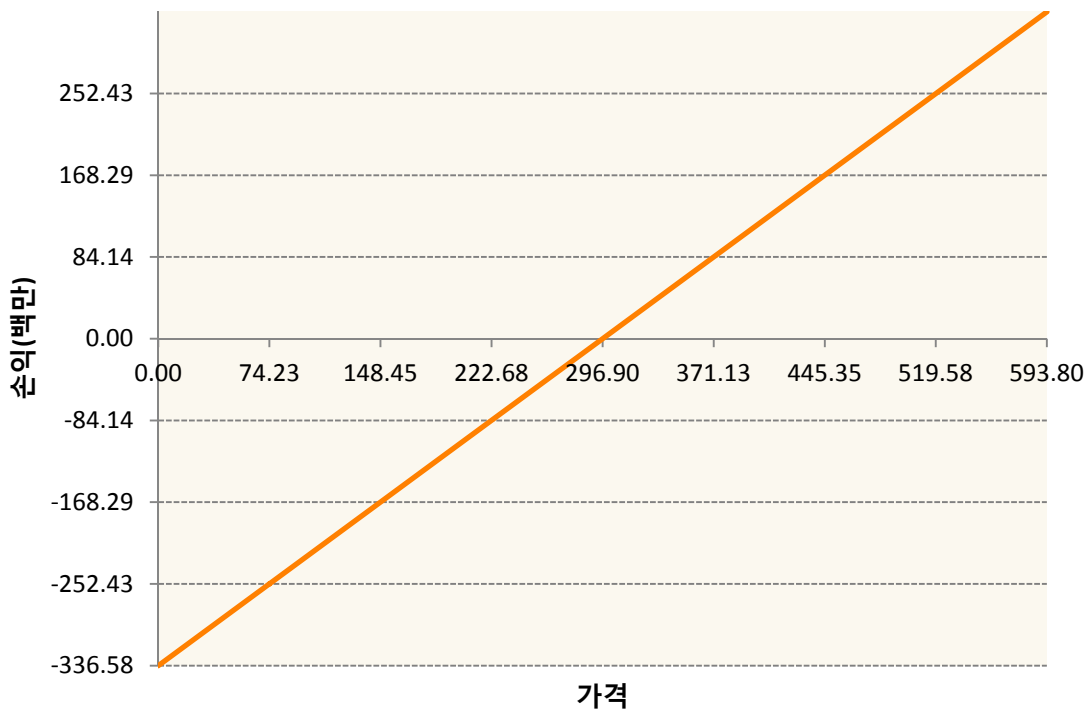
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



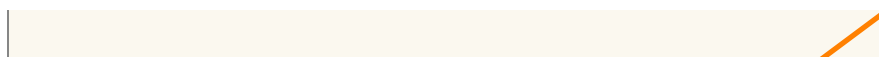
SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

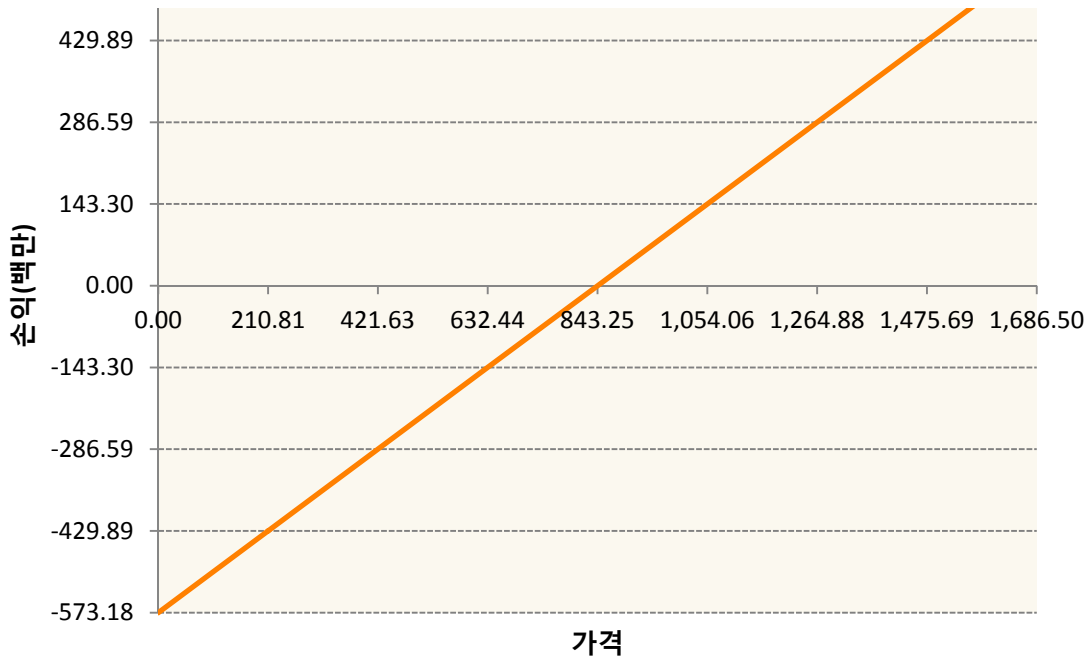


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19

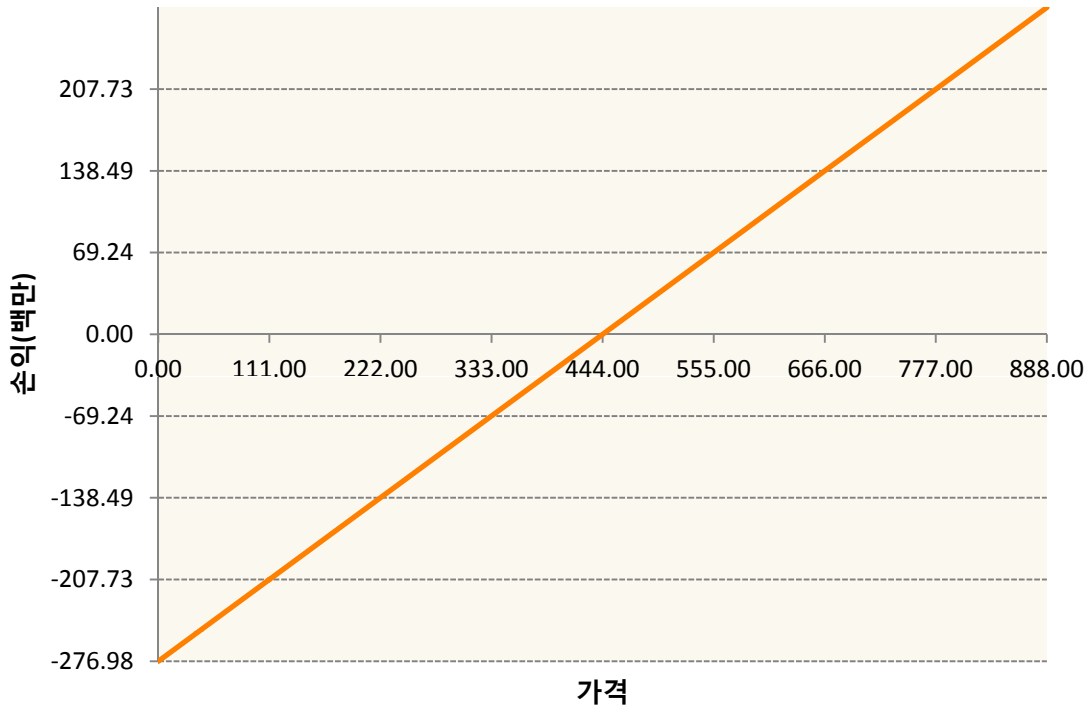


SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





WN9-WHEAT FUTURE(CBT) Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON9	SOYBEAN OIL FUTR Jul19	24
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	7
SBN9	SUGAR #11 (WORLD) Jul19	25
SMN9	SOYBEAN MEAL FUTR Jul19	27
SN9	SOYBEAN FUTURE Jul19	46
WN9	WHEAT FUTURE(CBT) Jul19	22

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

(단위:백만원)

235