

공시일	2019-05-10
기준일	2019-05-09

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)

92

공시일	2019-05-10
기준일	2019-05-09

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

1,143

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

674

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-05-10
기준일	2019-05-09

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)	300
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	83
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	141

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

855

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-05-10
기준일	2019-05-09

유로인덱스모(주식-파생형)

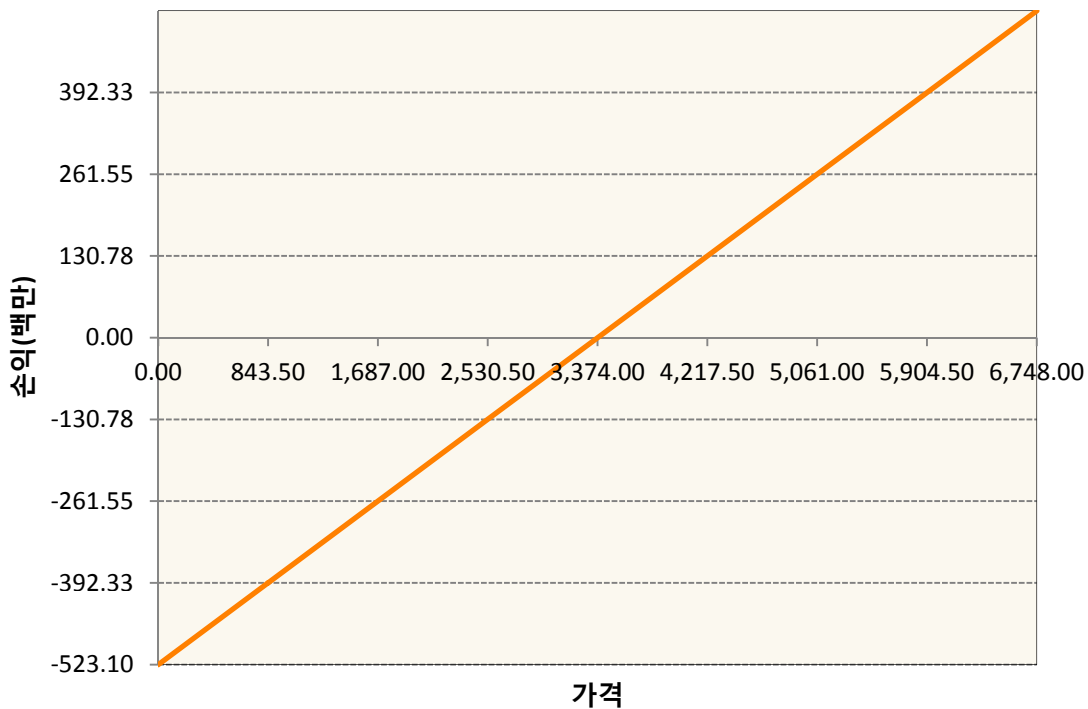
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	523	0	523	

2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	42
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

30

공시일	2019-05-10
기준일	2019-05-09

차이나인덱스모(주식-파생형)

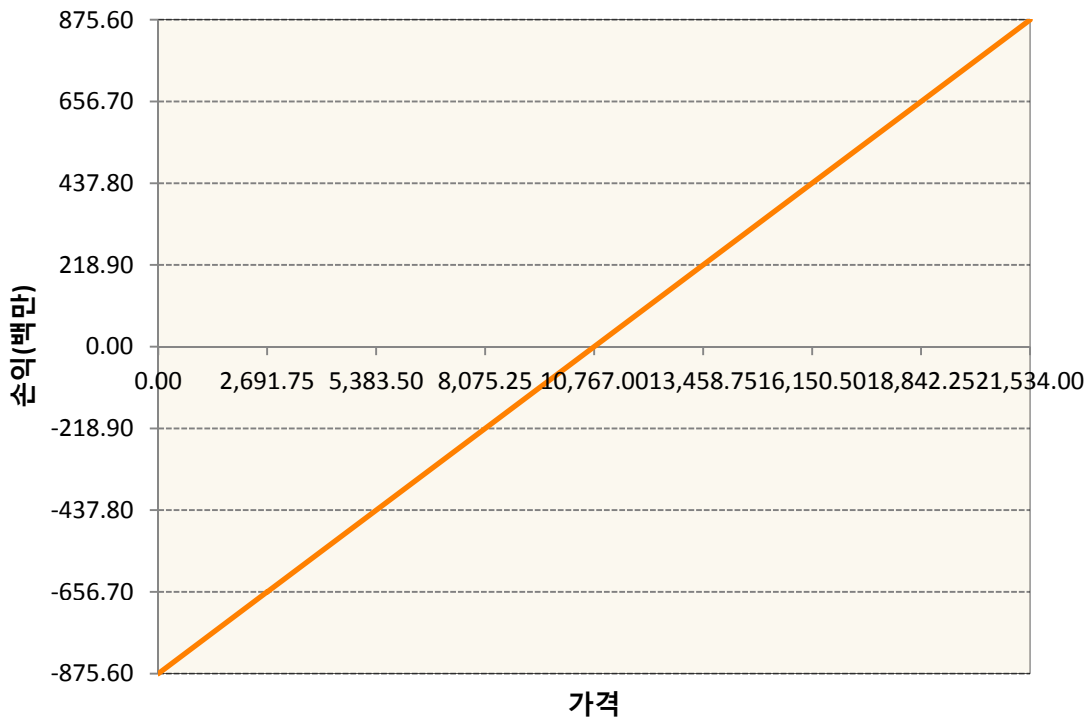
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	876	0	876	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK9	HSCEI Futures May19	70
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

72

공시일	2019-05-10
기준일	2019-05-09

커버드콜모(주식혼합-파생형)

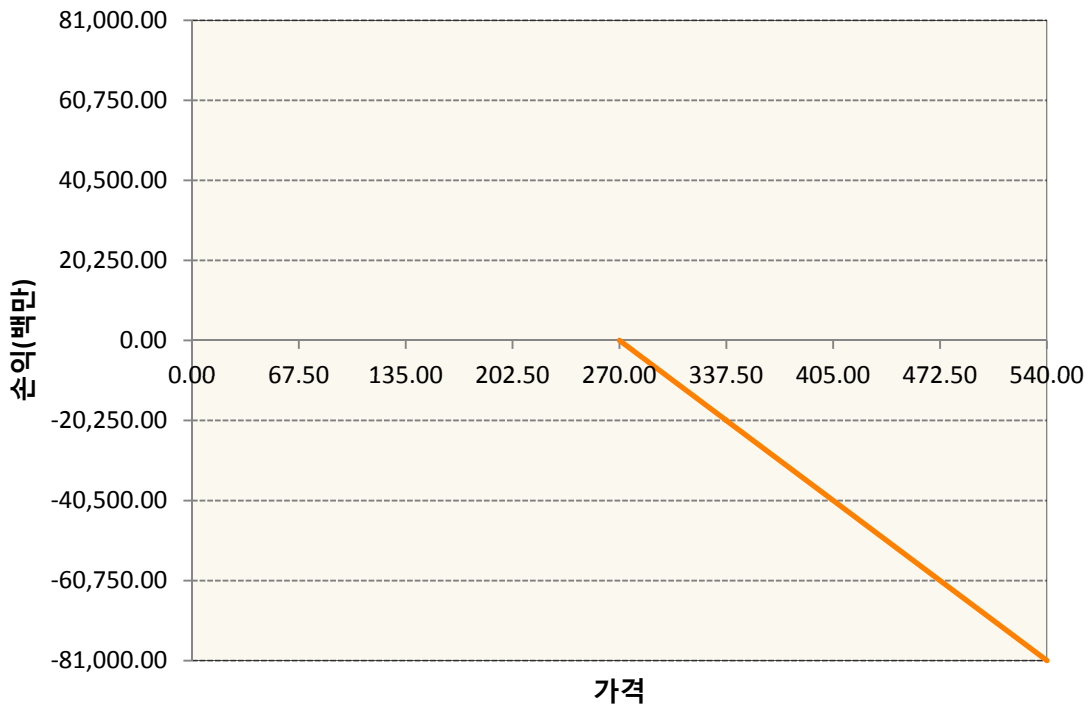
1. 계약금액

(단위:백만원)

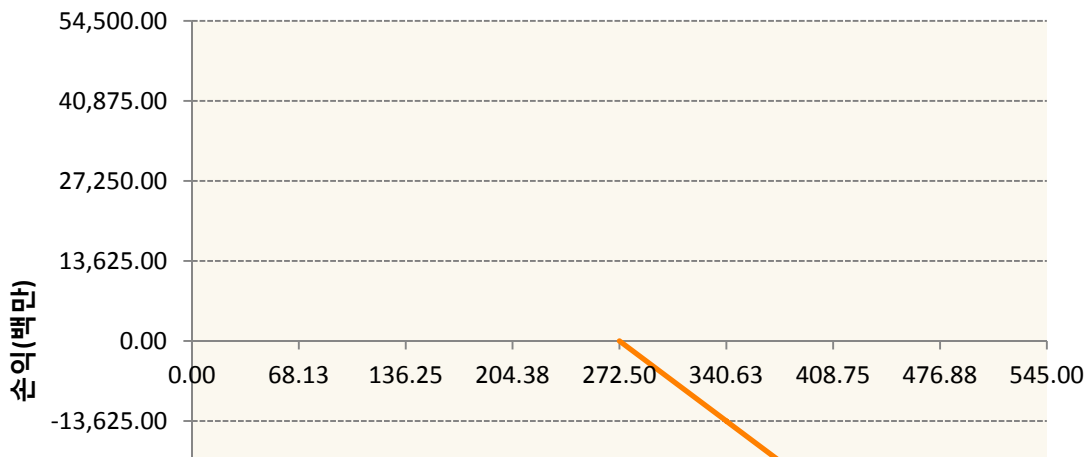
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	208,349	-208,349	장내
누계	유가증권	옵션	0	204,469	-204,469	장내

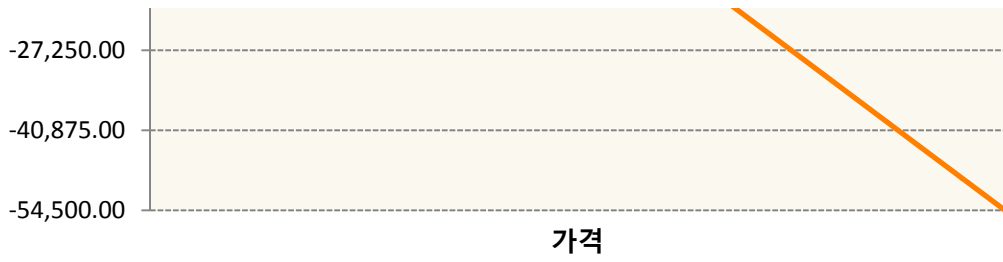
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P62701-2019-06 콜270

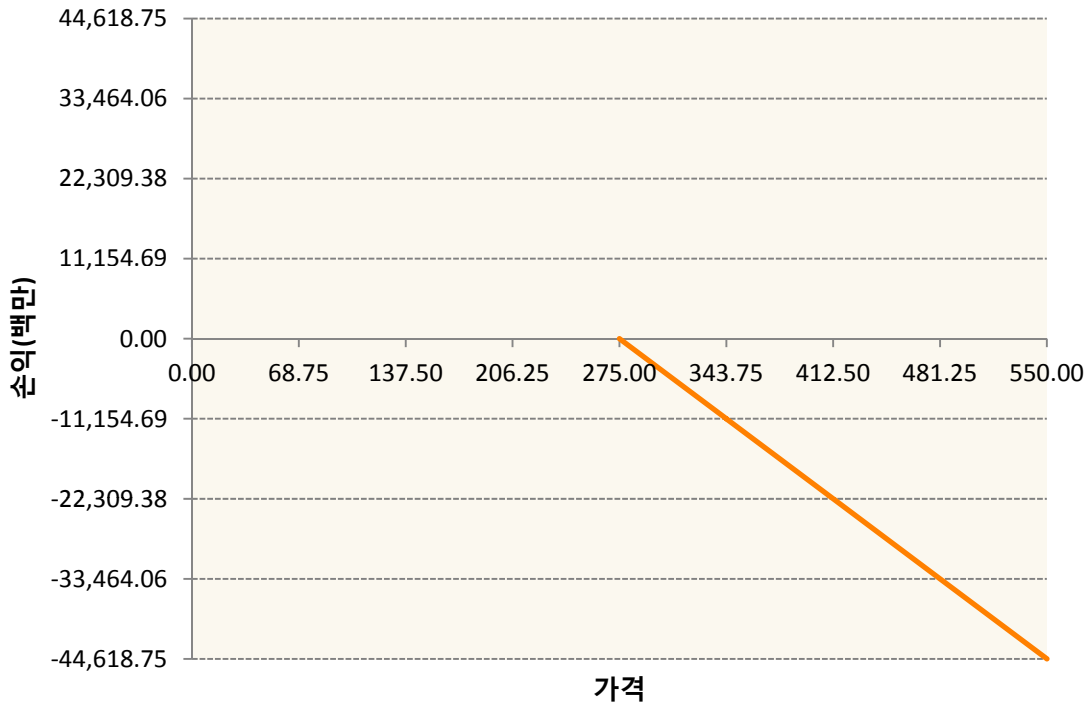


KR4201P62727-2019-06 콜272.5

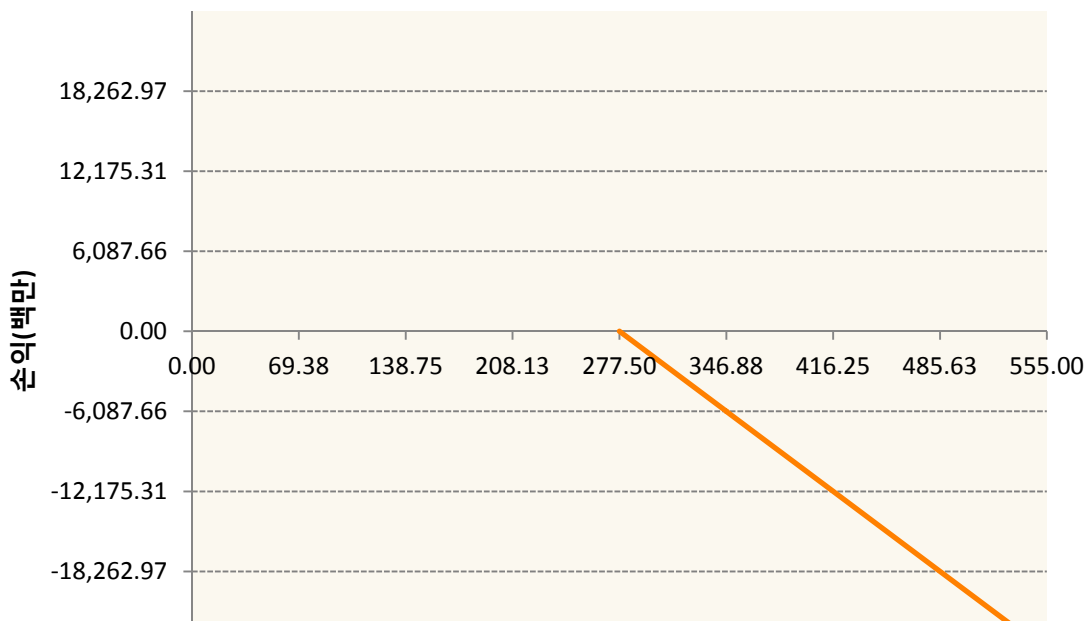




KR4201P62750-2019-06 콜275



KR4201P62776-2019-06 콜277.5



-24,350.63

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P62701 2019-06 콜270							5,038
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,496	2,406	2,301	2,184	2,057	1,921	1,777
-5.33%	2,188	2,041	1,884	1,719	1,549	1,374	1,195
-2.67%	1,596	1,401	1,202	1,002	801	598	394
0%	639	426	213	0	-213	-426	-639
2.67%	-697	-891	-1,089	-1,289	-1,492	-1,697	-1,903
5.33%	-2,360	-2,509	-2,668	-2,837	-3,012	-3,193	-3,379
8.00%	-4,255	-4,353	-4,467	-4,595	-4,733	-4,881	-5,038
KR4201P62727 2019-06 콜272.5							3,216
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,462	1,413	1,353	1,285	1,209	1,127	1,038
-5.33%	1,303	1,216	1,122	1,022	916	806	693
-2.67%	978	856	730	602	473	341	209
0%	427	285	142	0	-142	-285	-427
2.67%	-378	-516	-654	-794	-935	-1,076	-1,217
5.33%	-1,415	-1,527	-1,645	-1,767	-1,893	-2,022	-2,152
8.00%	-2,629	-2,708	-2,796	-2,892	-2,995	-3,103	-3,216
KR4201P62750 2019-06 콜275							2,487
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,034	1,001	961	913	858	798	732
-5.33%	935	874	807	733	654	571	484
-2.67%	722	631	535	437	336	234	130
0%	341	228	114	0	-114	-229	-344
2.67%	-241	-358	-474	-591	-708	-825	-942
5.33%	-1,020	-1,121	-1,225	-1,331	-1,439	-1,549	-1,660
8.00%	-1,959	-2,033	-2,115	-2,202	-2,293	-2,389	-2,487
KR4201P62776 2019-06 콜277.5							1,276
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	483	469	451	429	403	374	342
-5.33%	443	415	383	347	309	267	224
-2.67%	351	307	259	210	158	106	52
0%	178	119	60	0	-61	-121	-183
2.67%	-99	-163	-227	-291	-355	-419	-483

5.33%	-484	-543	-603	-664	-725	-787	-849
8.00%	-963	-1,010	-1,059	-1,111	-1,164	-1,220	-1,276

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

(단위:백만원)

11,042

공시일	2019-05-10
기준일	2019-05-09

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

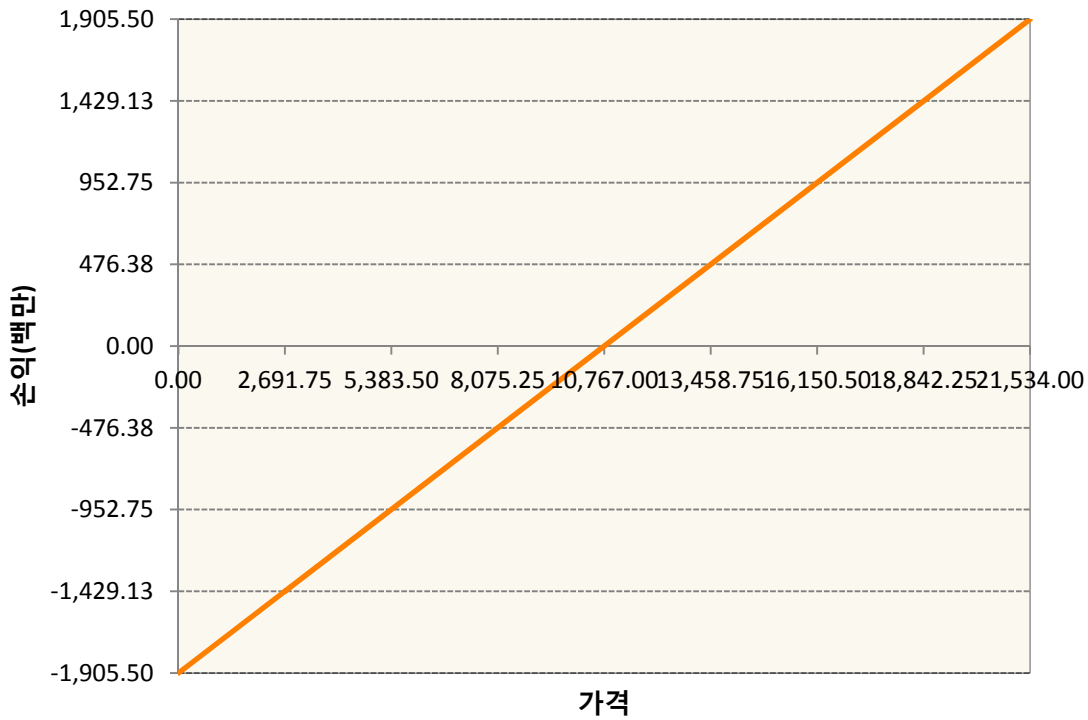
1. 계약금액

(단위:백만원)

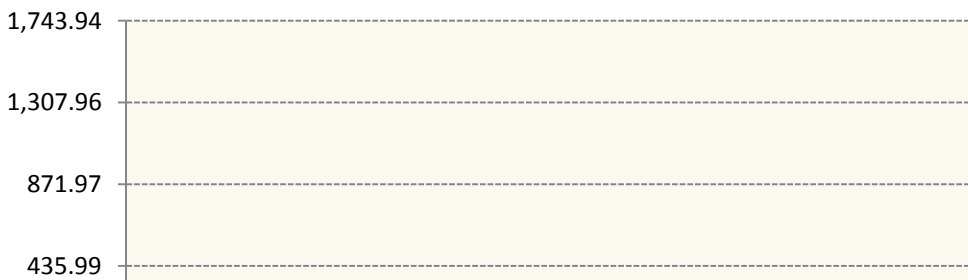
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,906	0	1,906	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,599	-5,599	장내
누계	통화	선도	0	3,157	-3,157	장외

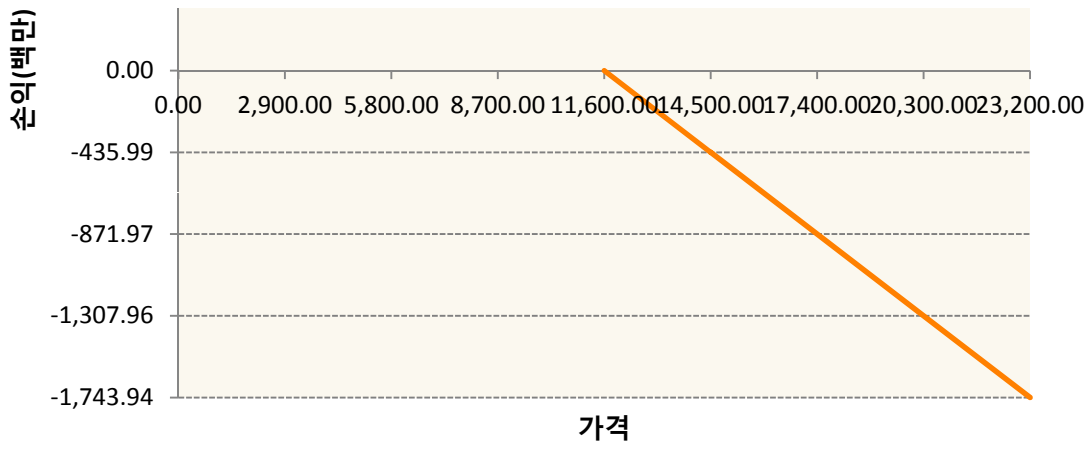
2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19

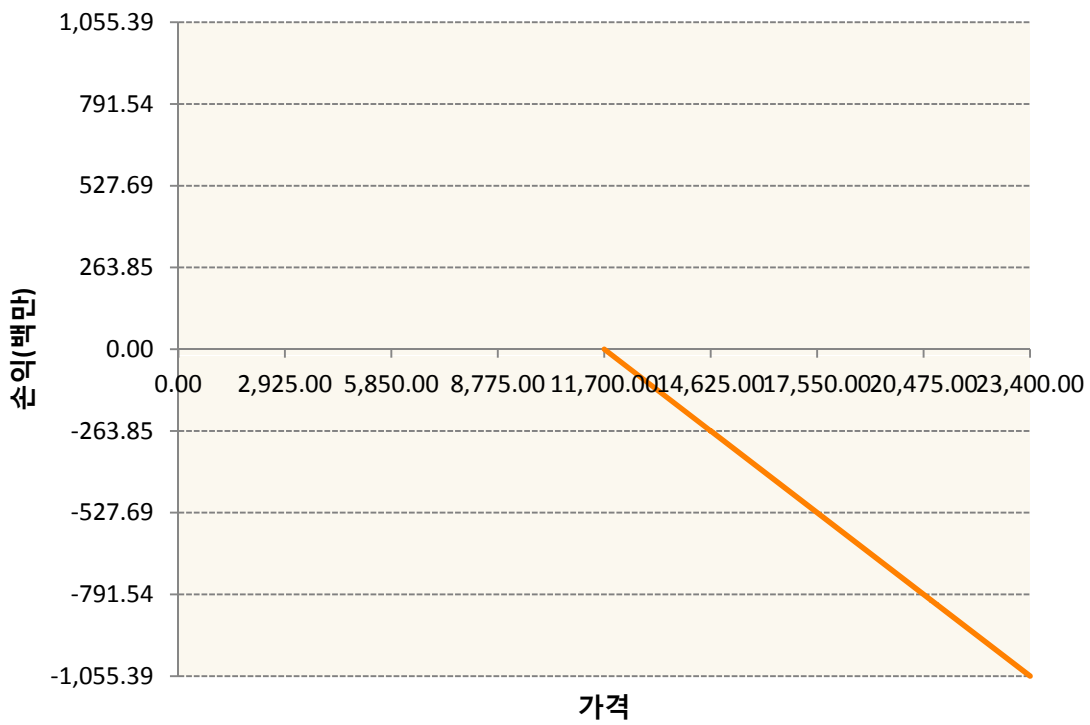


OHHIK9-C116-HSCEI

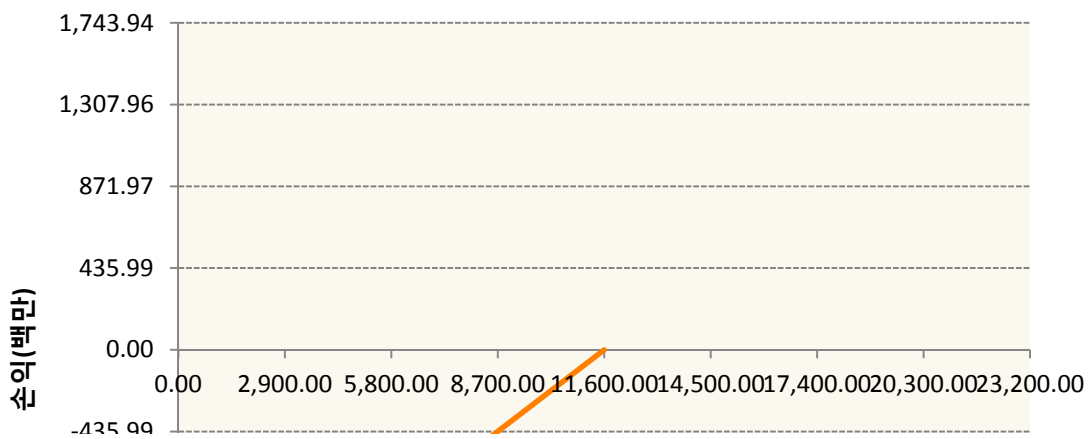


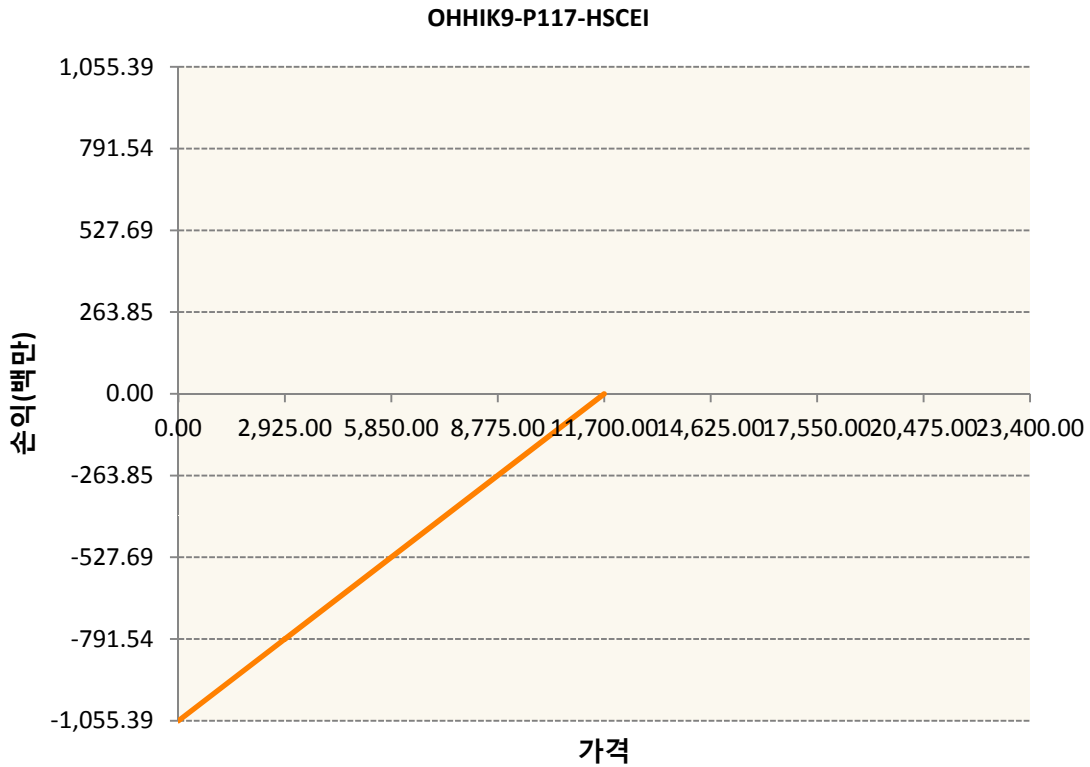


OHHIK9-C117-HSCEI



OHHIK9-P116-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	229
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	24
HCK9 HSCEI Futures May19	152
OHHIK9-C11 HSCEI	140
OHHIK9-C11 HSCEI	84
OHHIK9-P11 HSCEI	140
OHHIK9-P11 HSCEI	84

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

705

5.33%	1,129	1,129	1,129	1,129	1,129	1,129	1,129
8.00%	1,694	1,694	1,694	1,694	1,694	1,694	1,694
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%	-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%	598	598	598	598	598	598	598
KR4101P60004 2019-06 코스피200지수선물							304
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-304	-304	-304	-304	-304	-304	-304
-5.33%	-202	-202	-202	-202	-202	-202	-202
-2.67%	-101	-101	-101	-101	-101	-101	-101
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	101	101	101	101	101	101	101
5.33%	202	202	202	202	202	202	202
8.00%	304	304	304	304	304	304	304

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

(단위:백만원)

2,548

공시일	2019-05-10
기준일	2019-05-09

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

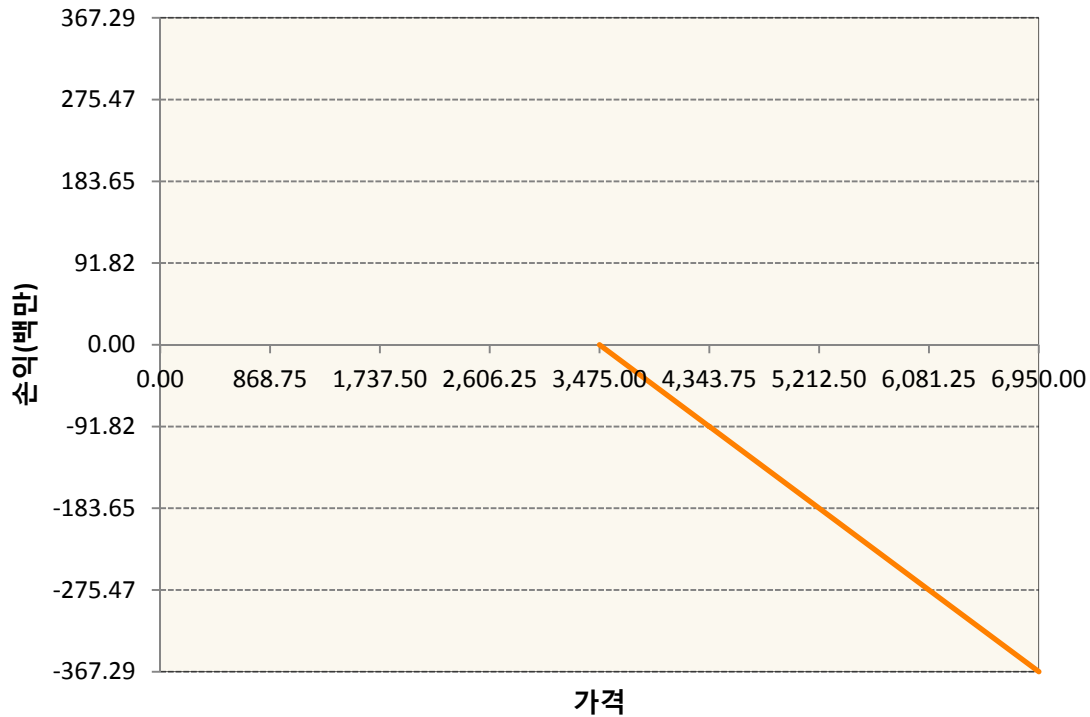
1. 계약금액

(단위:백만원)

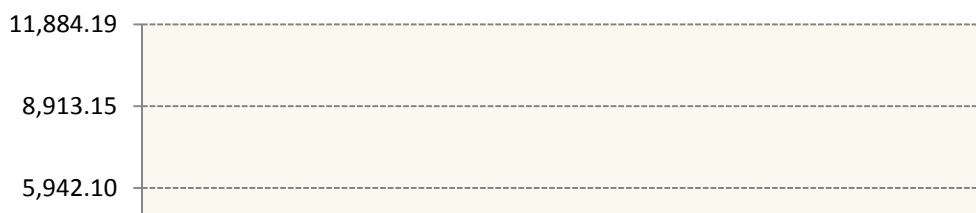
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	7	-7	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,859	0	4,859	
누계	유가증권	스왑	55,925	0	55,925	장외
누계	유가증권	옵션	0	24,503	-24,503	장내
누계	통화	선도	0	18,497	-18,497	장외

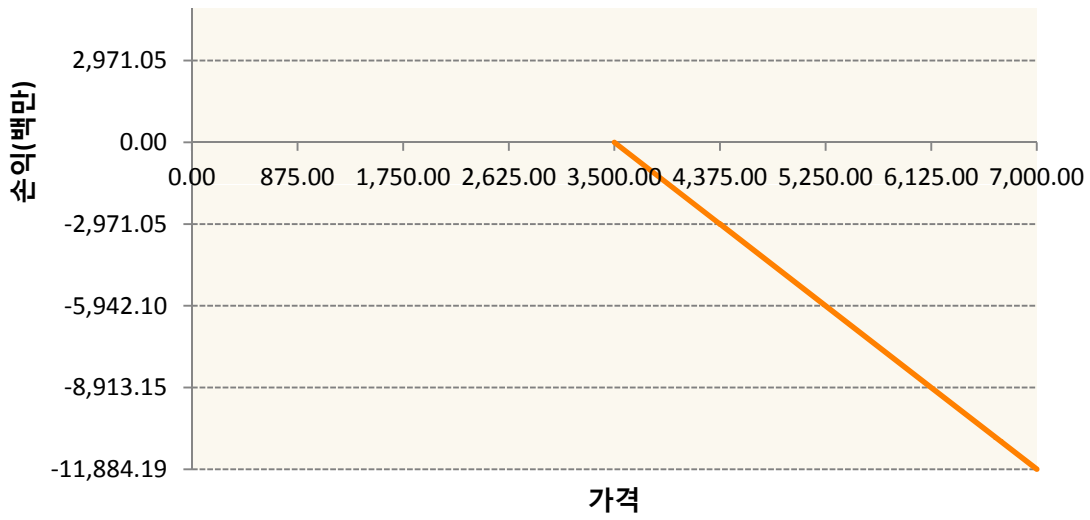
2. 만기시점의 손익구조

OESXK9-C3475-EURO STOXX 50

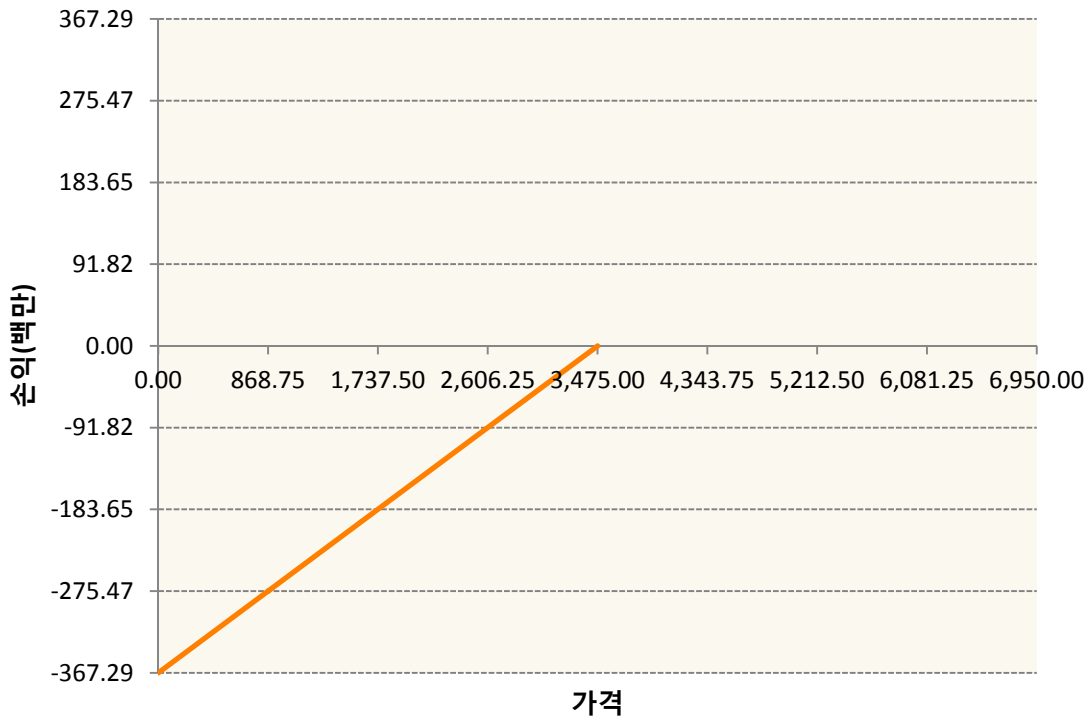


OESXK9-C3500-EURO STOXX 50

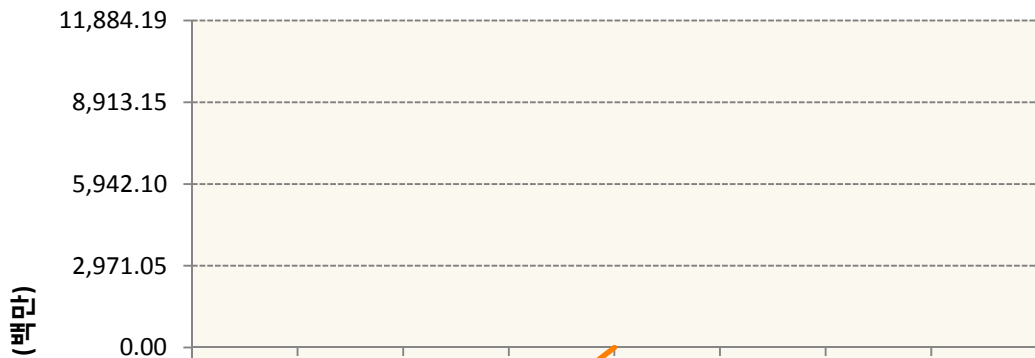


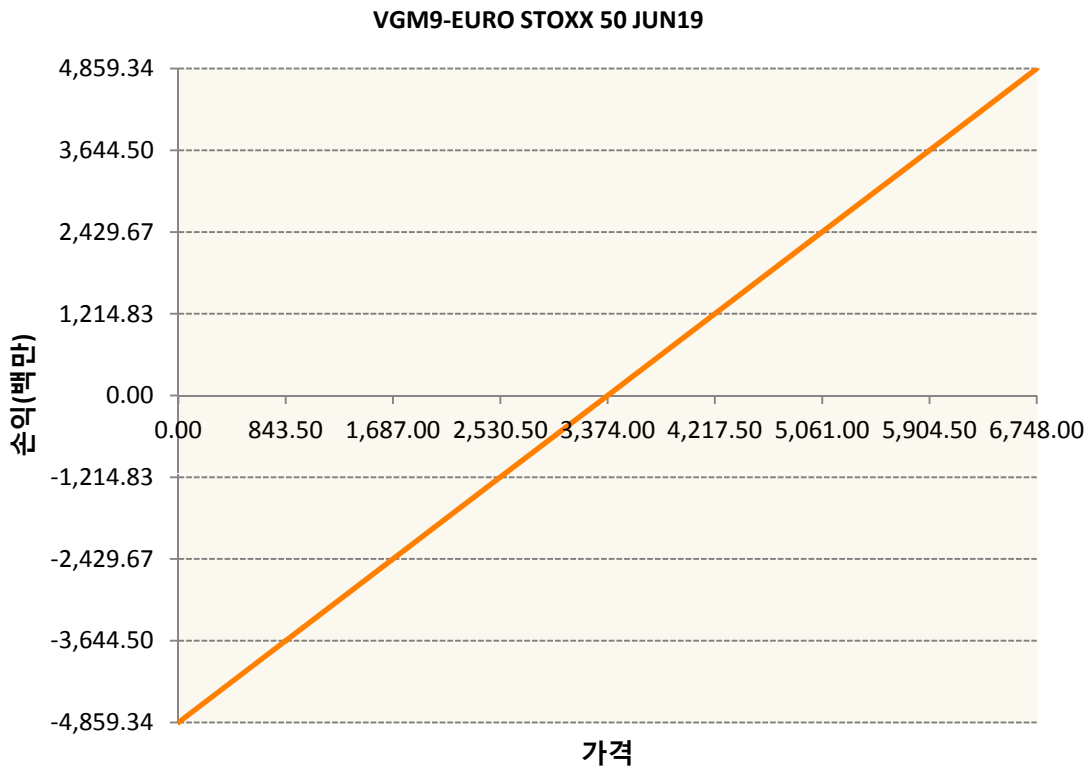
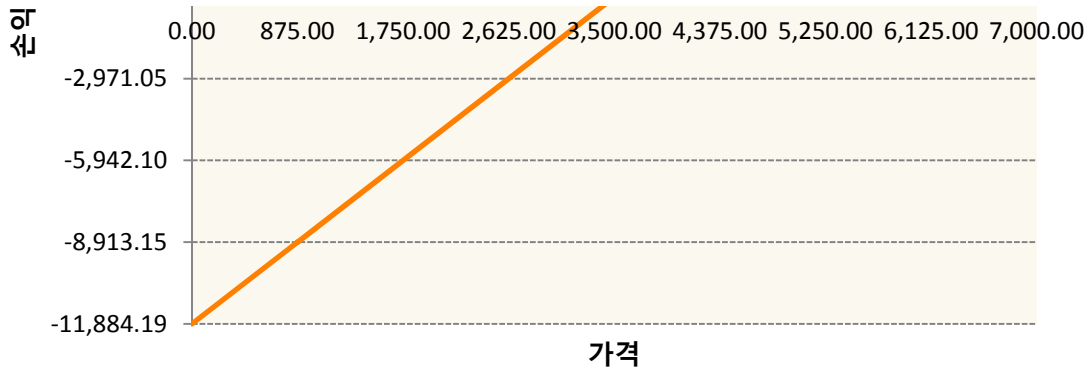


OESXK9-P3475-EURO STOXX 50



OESXK9-P3500-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	66
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	423
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	846
FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E	211
OESXK9-C34 EURO STOXX 50	29
OESXK9-C35 EURO STOXX 50	951
OESXK9-P34 EURO STOXX 50	29
OESXK9-P35 EURO STOXX 50	951
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	389

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

(단위:백만원)

2,489

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

(단위:백만원)

1,071

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

(단위:백만원)

92

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

(단위:백만원)

133

공시일	2019-05-10
기준일	2019-05-09

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

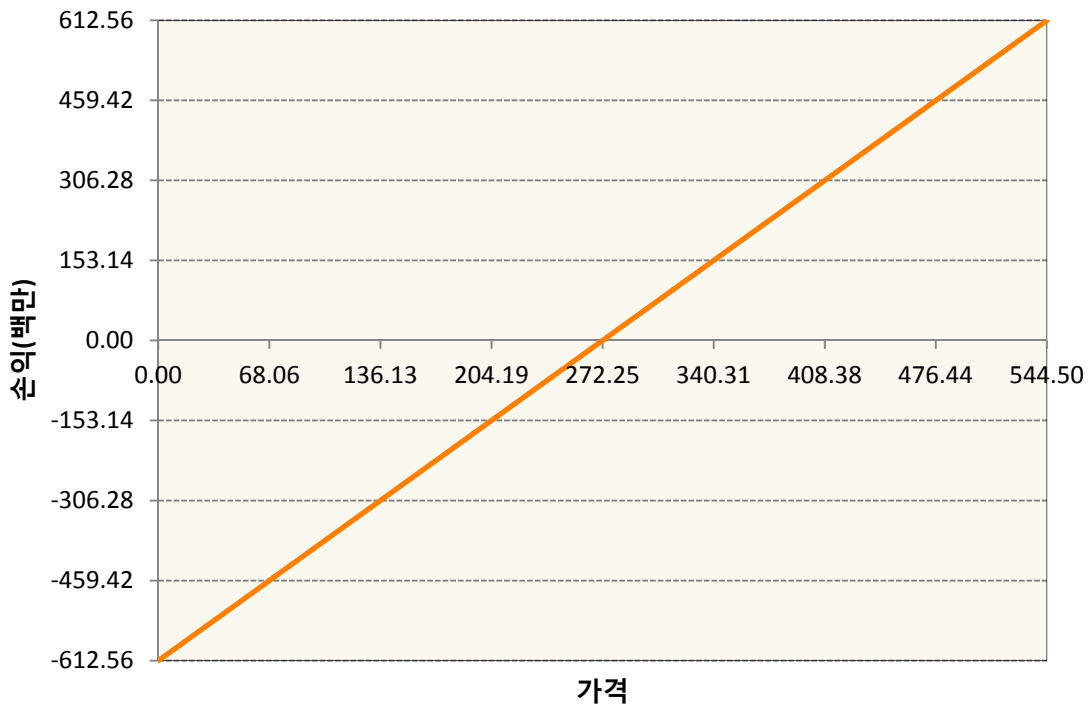
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	613	0	613	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						49
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	16	16	16	16	16	16	16	
5.33%	33	33	33	33	33	33	33	
8.00%	49	49	49	49	49	49	49	

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-05-10
기준일	2019-05-09

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

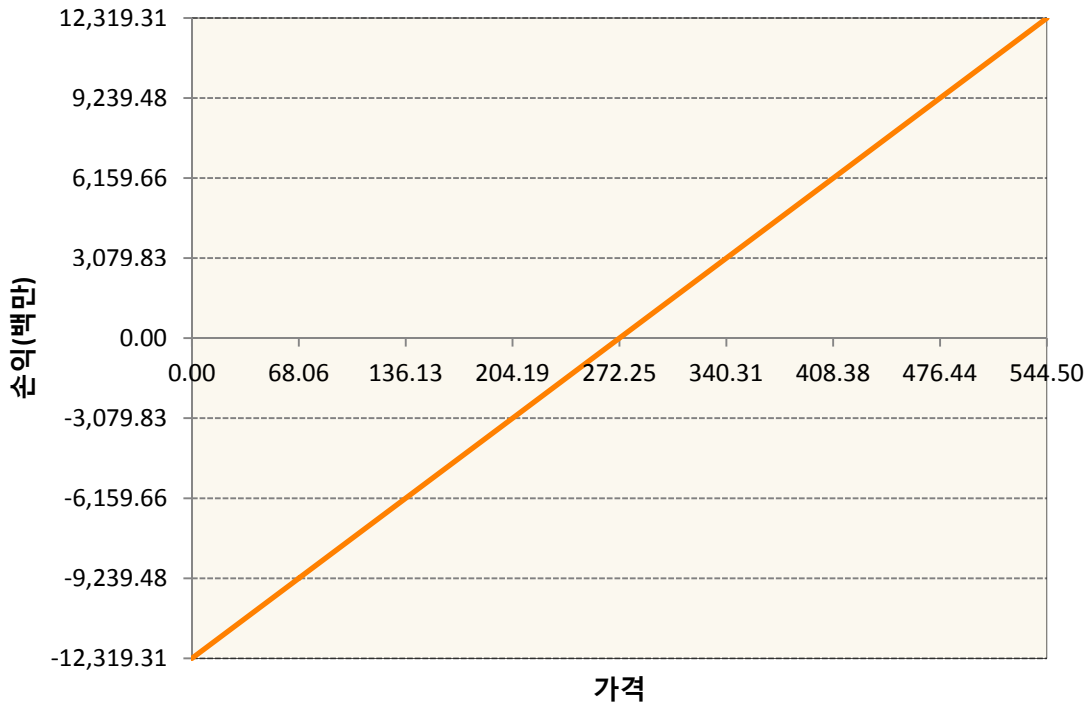
1. 계약금액

(단위:백만원)

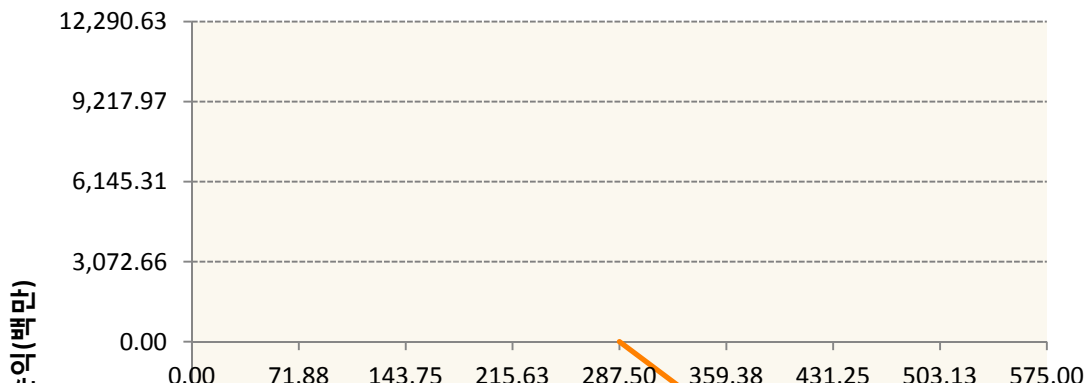
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	4,225	25,044	-20,818	장내
누계	유가증권	선물	12,319	0	12,319	장내
누계	유가증권	옵션	4,331	24,978	-20,647	장내

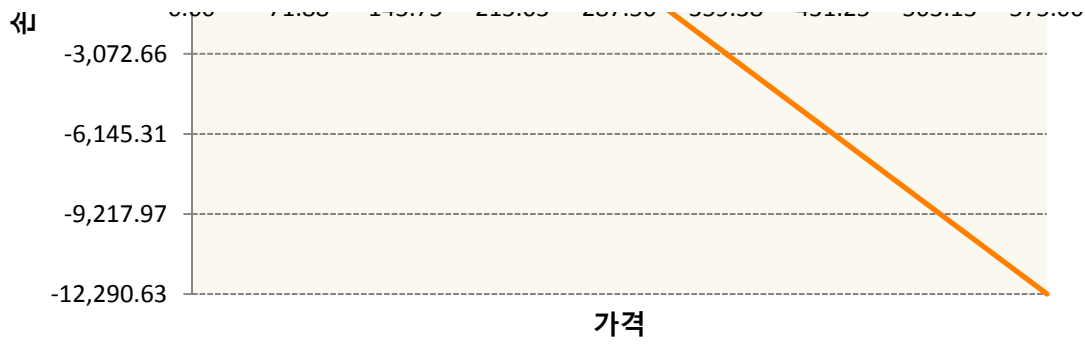
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

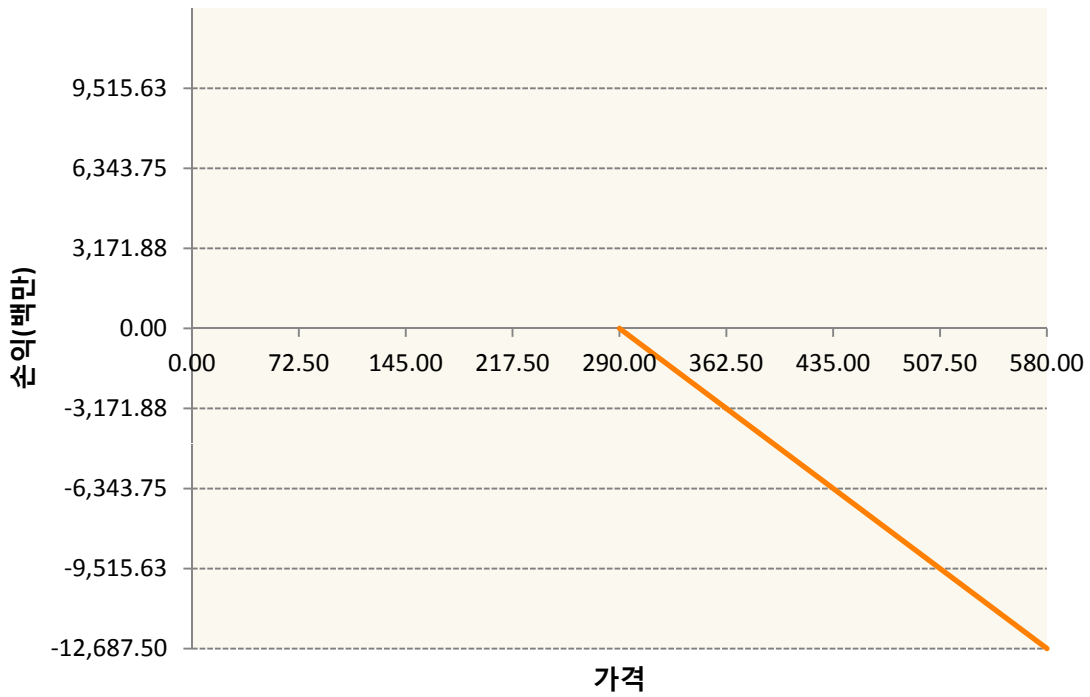


KR4201P62875-2019-06 콜287.5

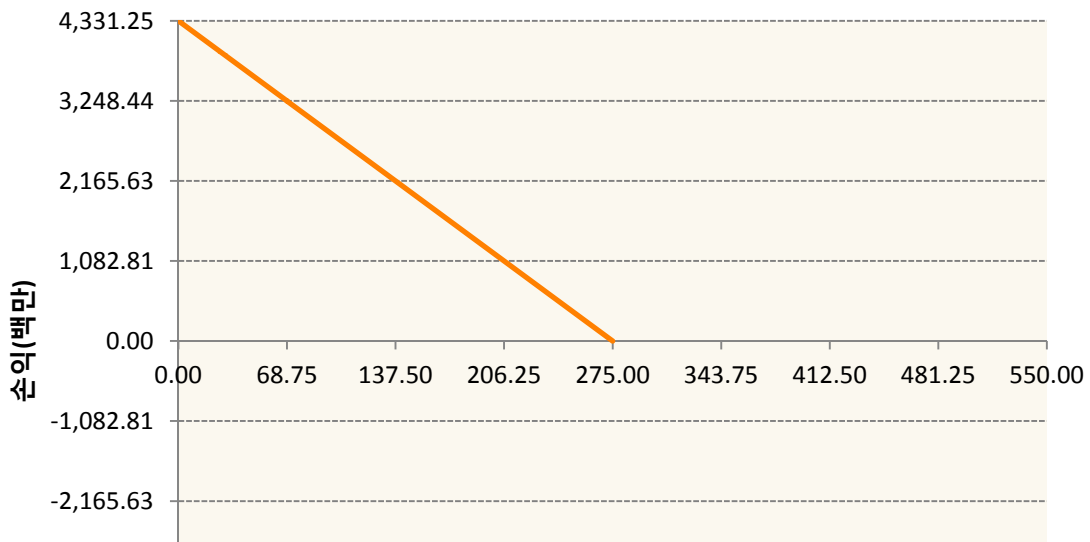


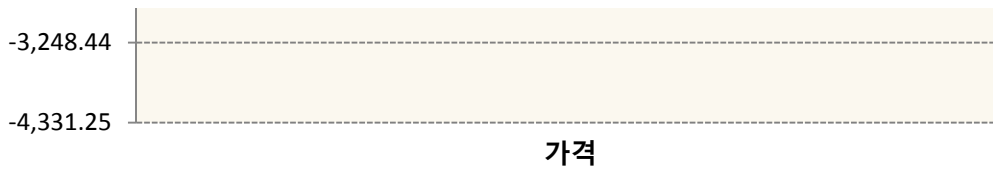


KR4201P62909-2019-06 콜290



KR4301P62758-2019-06 풋275





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						981
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-981	-981	-981	-981	-981	-981	-981	
-5.33%	-654	-654	-654	-654	-654	-654	-654	
-2.67%	-327	-327	-327	-327	-327	-327	-327	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	327	327	327	327	327	327	327	
5.33%	654	654	654	654	654	654	654	
8.00%	981	981	981	981	981	981	981	
KR4201P62875		2019-06 콜287.5						480
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	121	119	115	110	103	95	85	
-5.33%	116	110	102	92	81	67	53	
-2.67%	100	89	74	58	41	21	1	
0%	64	45	23	0	-24	-49	-75	
2.67%	-6	-33	-61	-90	-119	-149	-179	
5.33%	-122	-154	-186	-218	-250	-282	-314	
8.00%	-289	-320	-352	-384	-416	-448	-480	
KR4201P62909		2019-06 콜290						454
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	103	101	98	94	88	81	72	
-5.33%	99	95	88	80	69	57	44	
-2.67%	88	78	65	51	35	17	-3	
0%	59	41	21	0	-23	-47	-72	
2.67%	0	-26	-53	-81	-110	-139	-168	
5.33%	-102	-134	-166	-198	-230	-263	-296	
8.00%	-255	-288	-321	-354	-388	-421	-454	
KR4301P62758		2019-06 풋275						289
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	282	282	283	284	285	287	289	
-5.33%	170	172	174	176	180	183	187	
-2.67%	66	70	75	80	85	90	96	

0%	-21	-14	-7	0	7	14	21
2.67%	-79	-72	-65	-57	-50	-43	-35
5.33%	-109	-104	-99	-93	-87	-81	-75
8.00%	-121	-119	-116	-112	-108	-104	-99

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

(단위:백만원)

1,735

공시일	2019-05-10
기준일	2019-05-09

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	4,746	0	4,746	

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	2019-05-10
기준일	2019-05-09

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	79,831	0	79,831	

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	2019-05-10
기준일	2019-05-09

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	172,357	0	172,357	
누계	통화	선도	0	218,723	-218,723	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 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
FX21019J004 KRW/USD 10-06-19E		104
FX21019J006 KRW/USD 10-05-19E		160
FX21019J007 KRW/USD 10-05-19E		76
FX21019J008 KRW/USD 10-05-19E		283
FX21019J008 KRW/USD 10-05-19E		236
FX21019J009 KRW/USD 10-05-19E		76
FX21019J012 KRW/USD 20-05-19E		132
FX21019J012 KRW/USD 20-05-19E		19
FX21019J013 KRW/USD 20-05-19E		142
FX21019J016 KRW/USD 20-05-19E		142
FX21019J019 KRW/USD 17-05-19E		1,321
FX21019J019 KRW/USD 17-05-19E		1,416
FX21019J019 KRW/USD 18-06-19E		378
FX21019J020 KRW/USD 20-05-19E		510
FX21019J021 KRW/USD 20-05-19E		479
FX21019J024 KRW/USD 24-06-19E		944
FX21019J024 KRW/USD 22-05-19E		793
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		944
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		1,000
FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E		378
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		76
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		993

FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E	1,019
FX21019J041 KRW/USD 28-05-19E	283
FX21019J043 KRW/USD 03-06-19E	566
FX21019J044 KRW/USD 03-06-19E	472
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E	283
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E	472
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E	661
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E	661
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E	821
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E	812
FX21019K00 KRW/USD 18-06-19E	566

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

(단위:백만원)

5,998

공시일	2019-05-10
기준일	2019-05-09

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

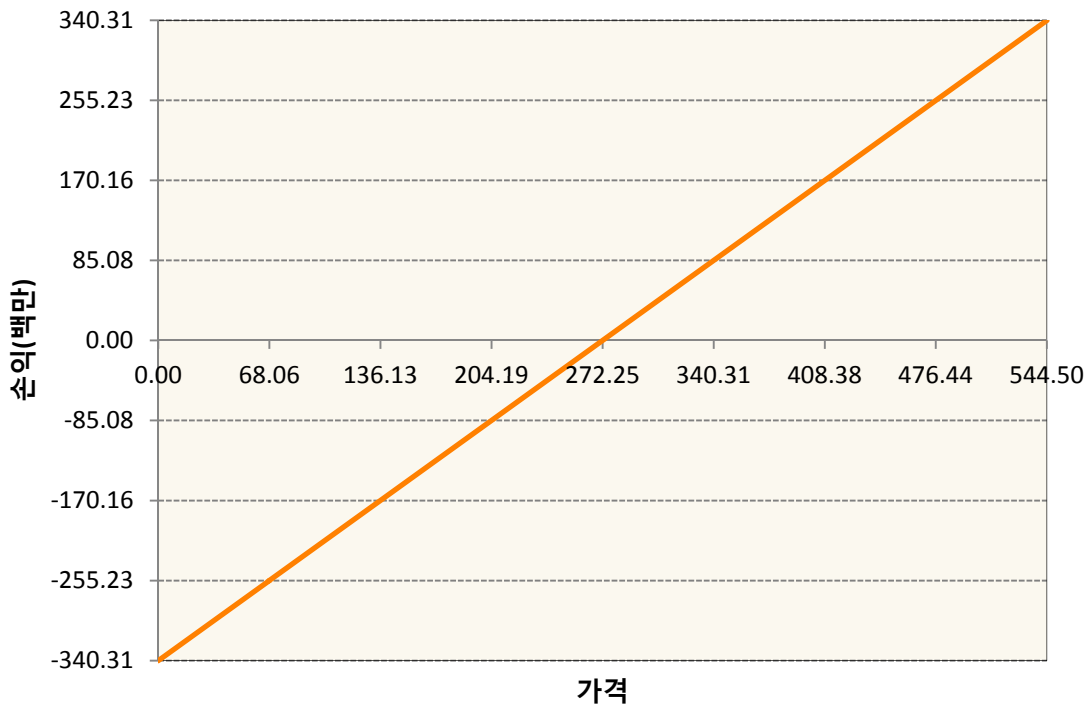
1. 계약금액

(단위:백만원)

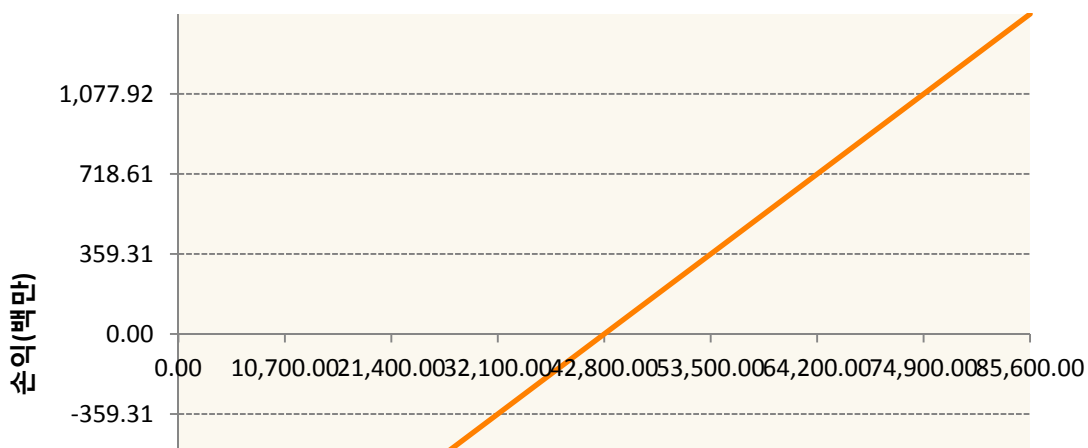
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,778	0	1,778	장내

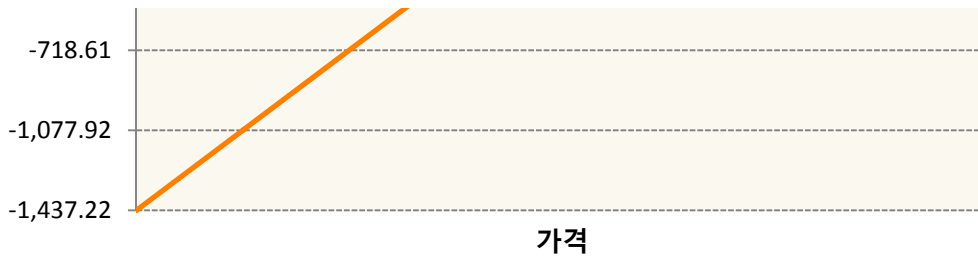
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4111P60003-2019-06 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						27
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27	
-5.33%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
-2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	9	9	9	9	9	9	9	
5.33%	18	18	18	18	18	18	18	
8.00%	27	27	27	27	27	27	27	
KR4111P60003		2019-06 삼성전자개별선물						114
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-114	-114	-114	-114	-114	-114	-114	
-5.33%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76	
-2.67%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	38	38	38	38	38	38	38	
5.33%	76	76	76	76	76	76	76	
8.00%	114	114	114	114	114	114	114	

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

156

공시일	2019-05-10
기준일	2019-05-09

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

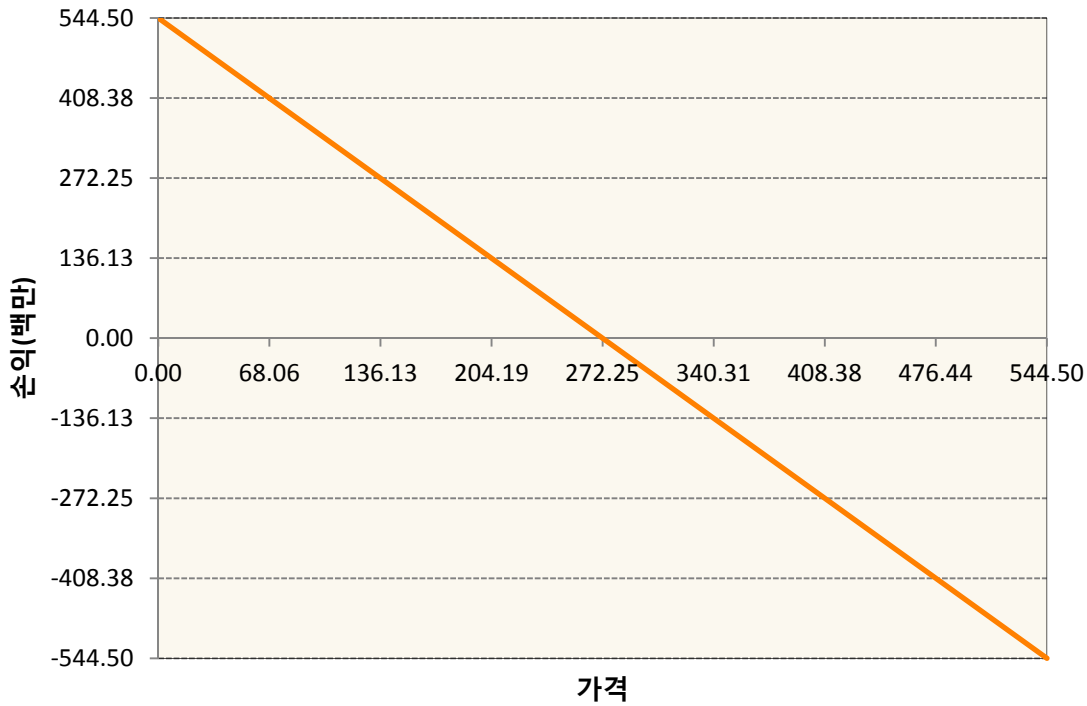
1. 계약금액

(단위:백만원)

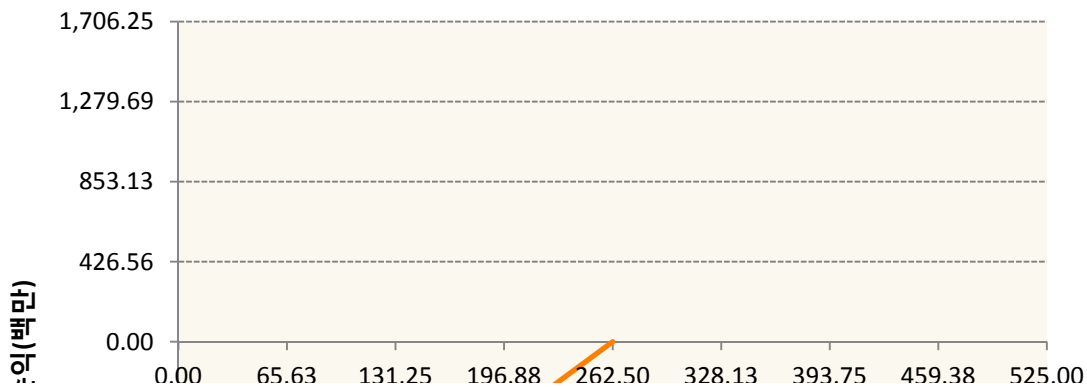
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	3,064	-3,064	장내
누계	유가증권	선물	0	545	-545	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,031	-3,031	장내

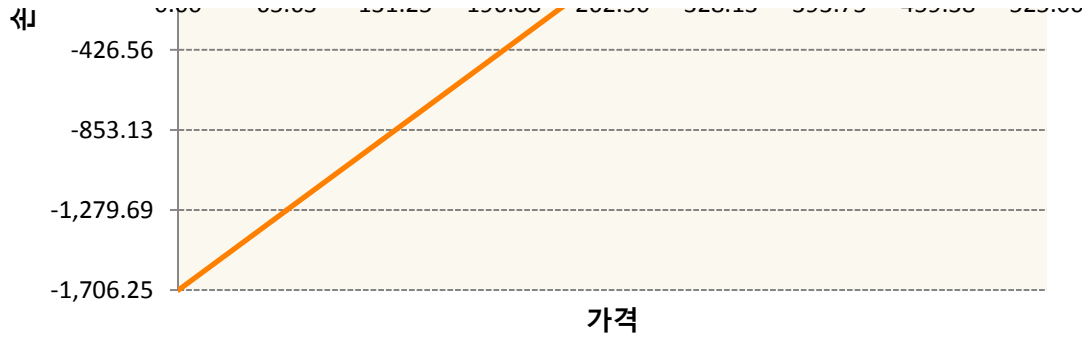
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

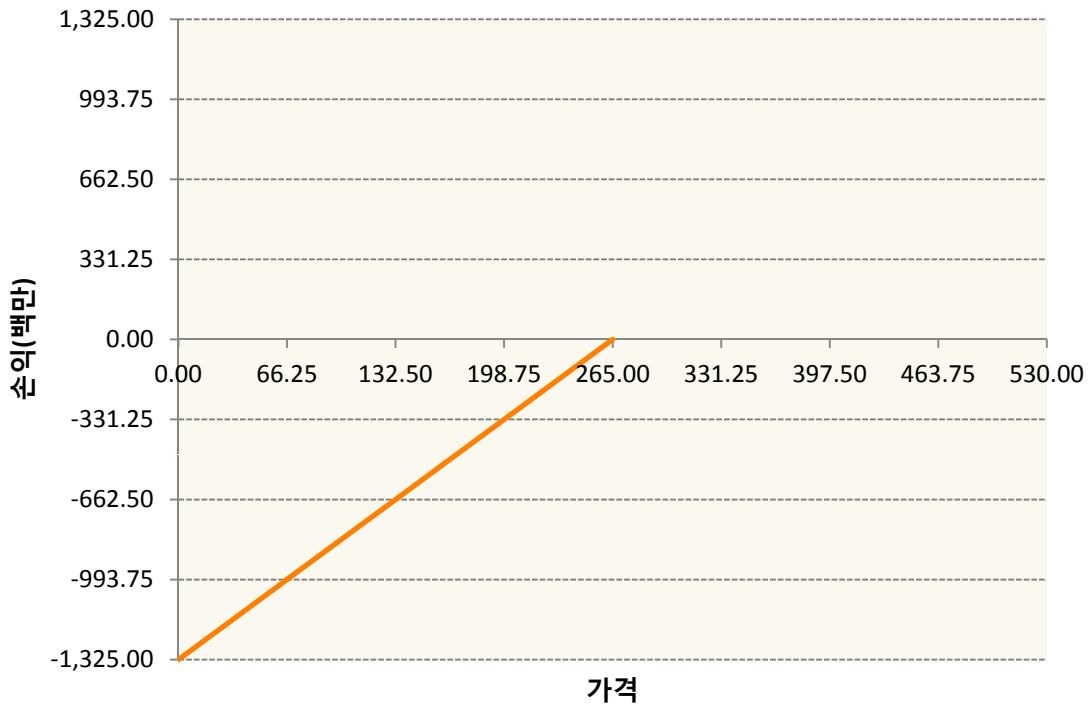


KR4301P62626-2019-06 풋262.5





KR4301P62659-2019-06 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						43
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	43	43	43	43	43	43	43	
-5.33%	29	29	29	29	29	29	29	
-2.67%	14	14	14	14	14	14	14	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14	
5.33%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29	
8.00%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43	
KR4301P62626		2019-06 풋262.5						84
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-74	-76	-77	-79	-80	-82	-84
-5.33%	-36	-38	-41	-43	-46	-48	-51
-2.67%	-8	-11	-14	-17	-20	-23	-26
0%	7	5	2	0	-3	-5	-8
2.67%	13	12	10	9	7	5	3
5.33%	15	14	14	13	12	11	10
8.00%	15	15	15	14	14	13	13
KR4301P62659 2019-06 풋265							71
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-65	-66	-66	-67	-69	-70	-71
-5.33%	-33	-35	-36	-38	-40	-42	-44
-2.67%	-9	-11	-13	-15	-18	-20	-22
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	13	12	10	9	7	6	4
5.33%	15	14	14	13	12	11	10
8.00%	15	15	15	15	14	14	13

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

(단위:백만원)

177

공시일	2019-05-10
기준일	2019-05-09

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

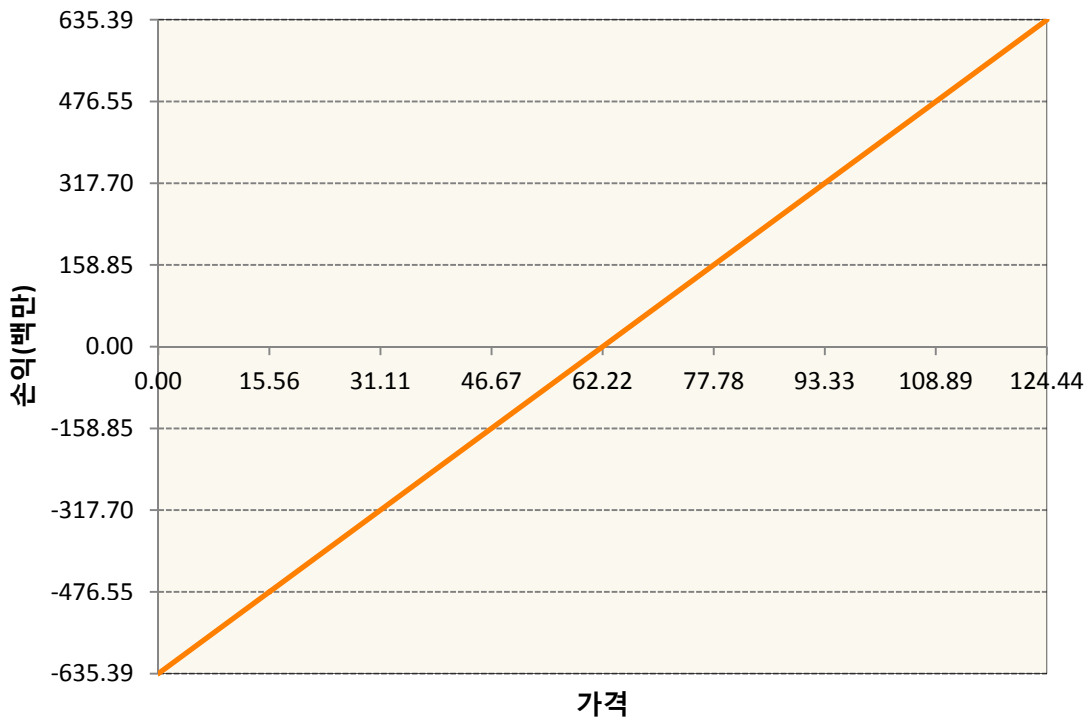
1. 계약금액

(단위:백만원)

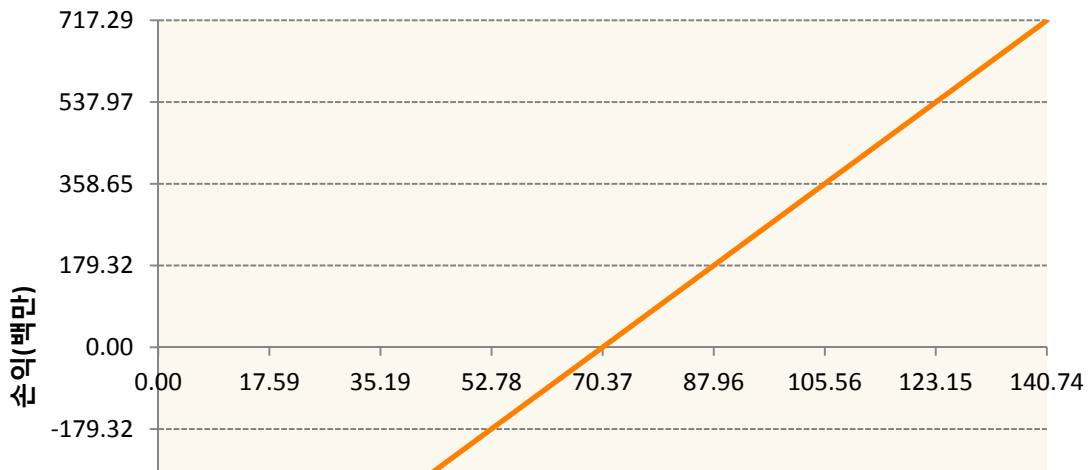
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,745	295	2,450	

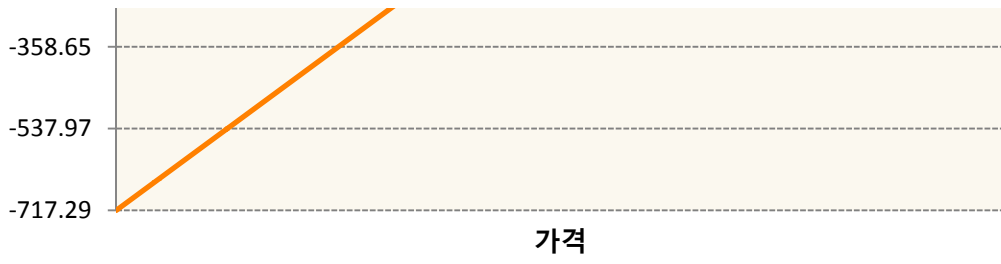
2. 만기시점의 손익구조

CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19

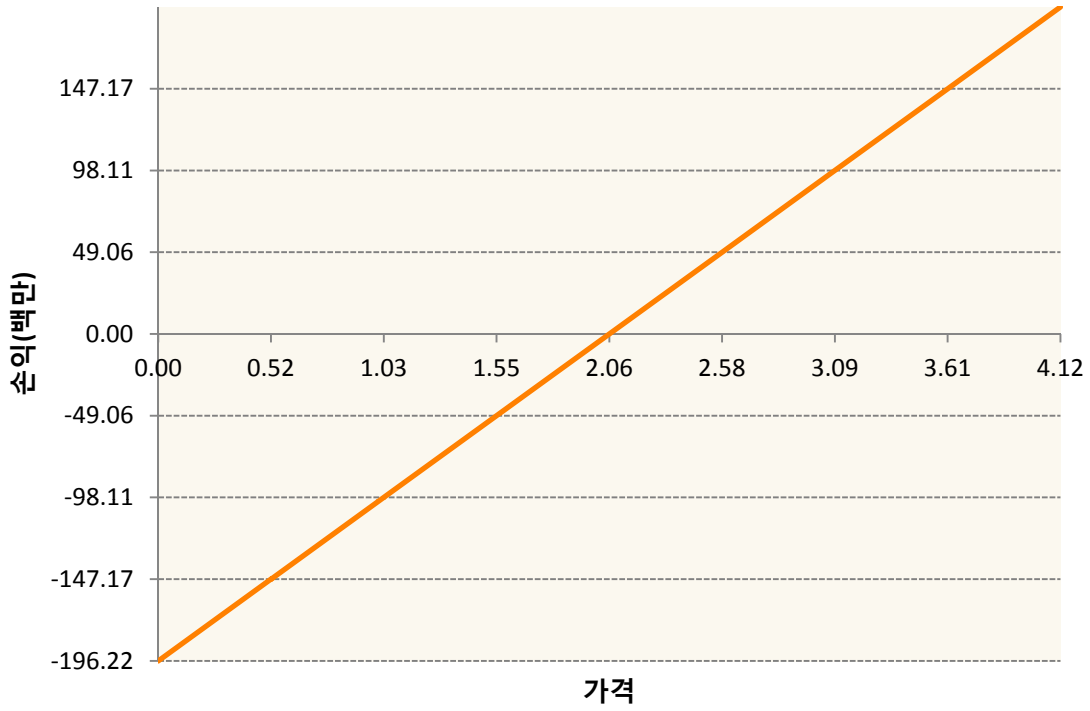


CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19

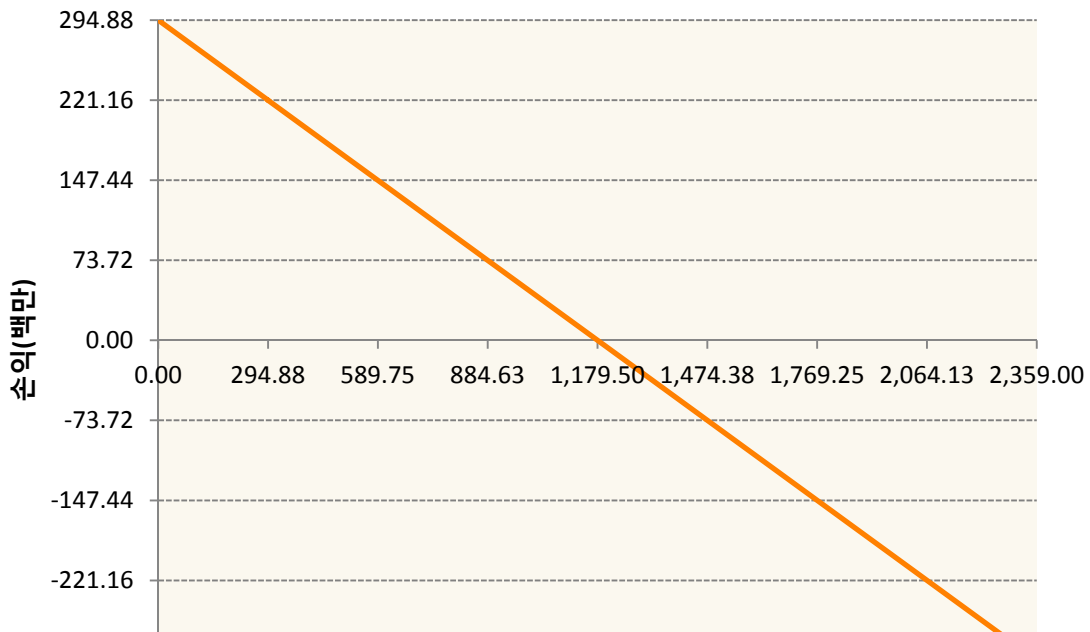


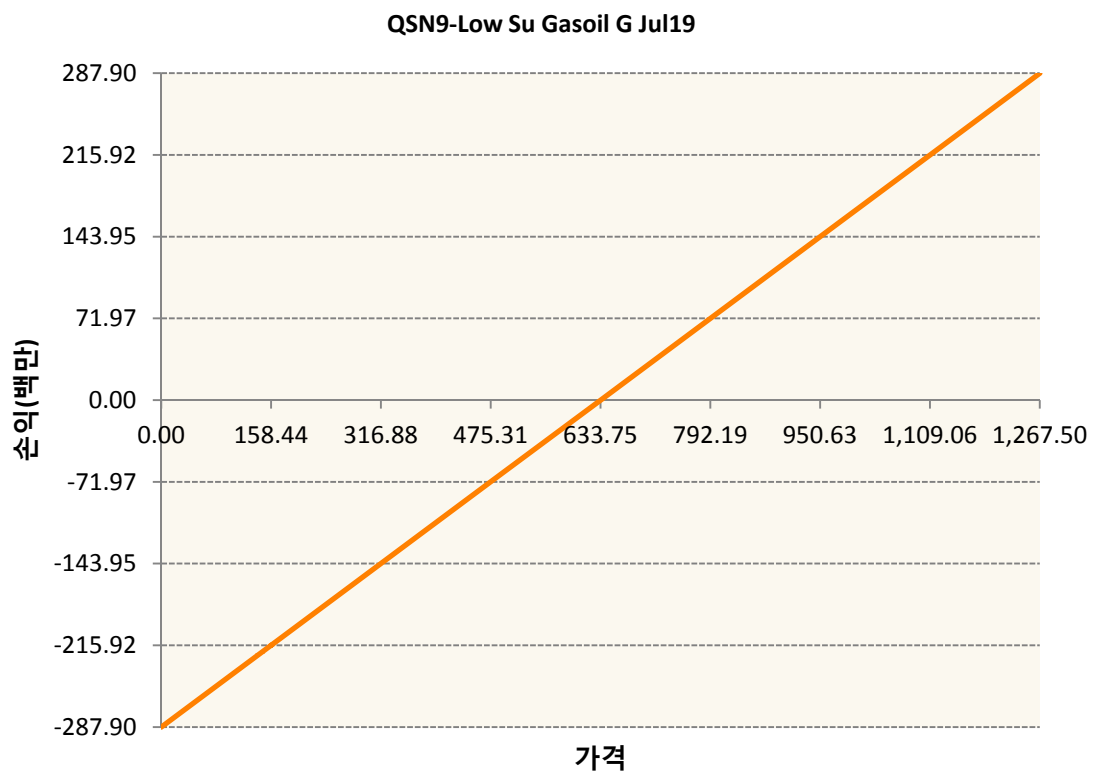
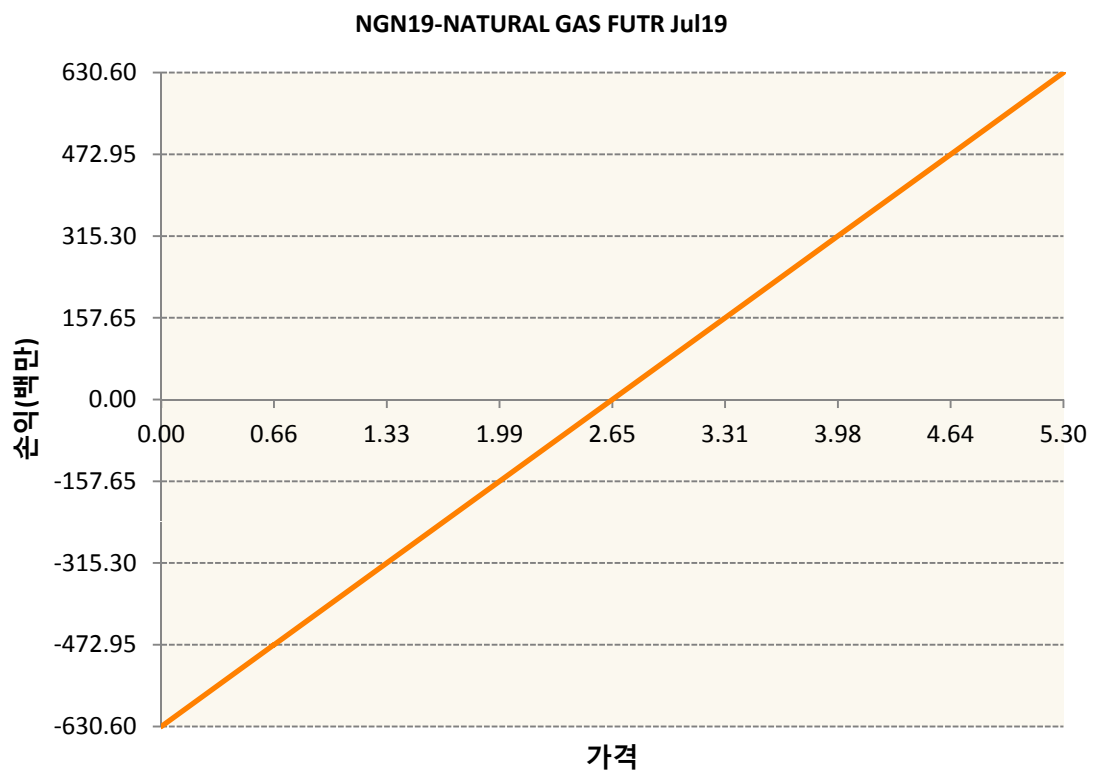
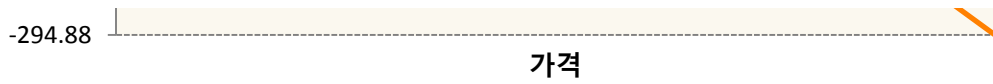


HON9-NY Harb ULSD Fut Jul19

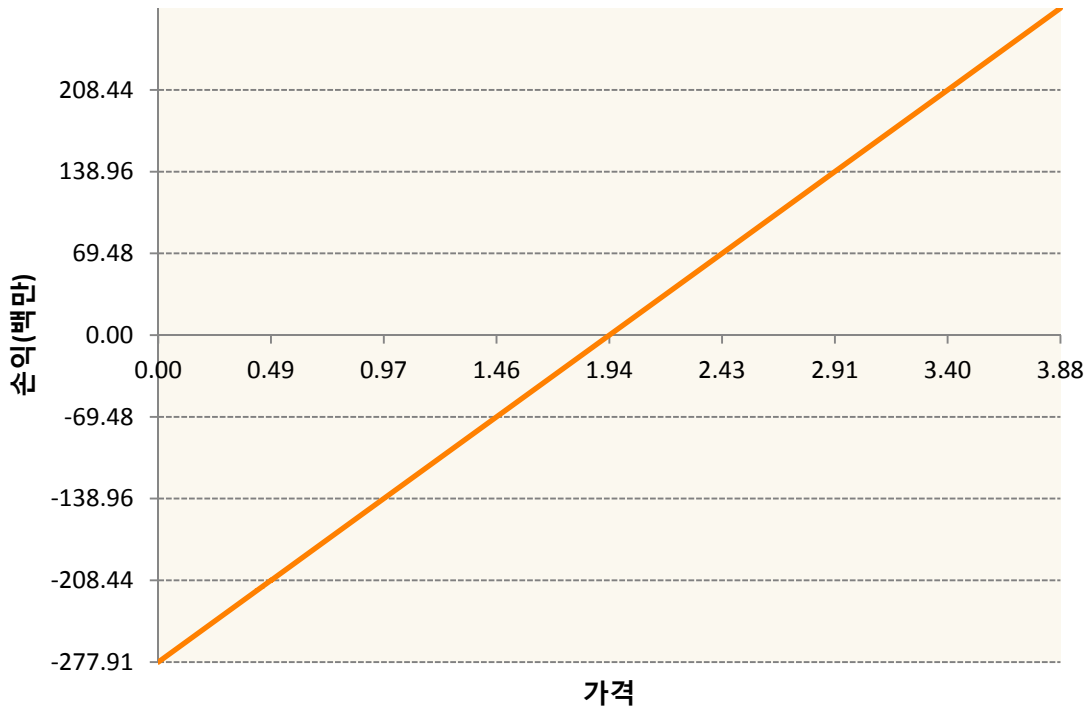


KR4175P50009-2019-05 달러선물





XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN9	WTI CRUDE FUTURE Jul19	51
CON9	BRENT CRUDE FUTR Jul19	57
HON9	NY Harb ULSD Fut Jul19	16
KR4175P500	2019-05 달러선물	24
NGN19	NATURAL GAS FUTR Jul19	50
QSN9	Low Su Gasoil G Jul19	23
XBN9	GASOLINE RBOB FUT Jul19	22

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

405

공시일	2019-05-10
기준일	2019-05-09

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

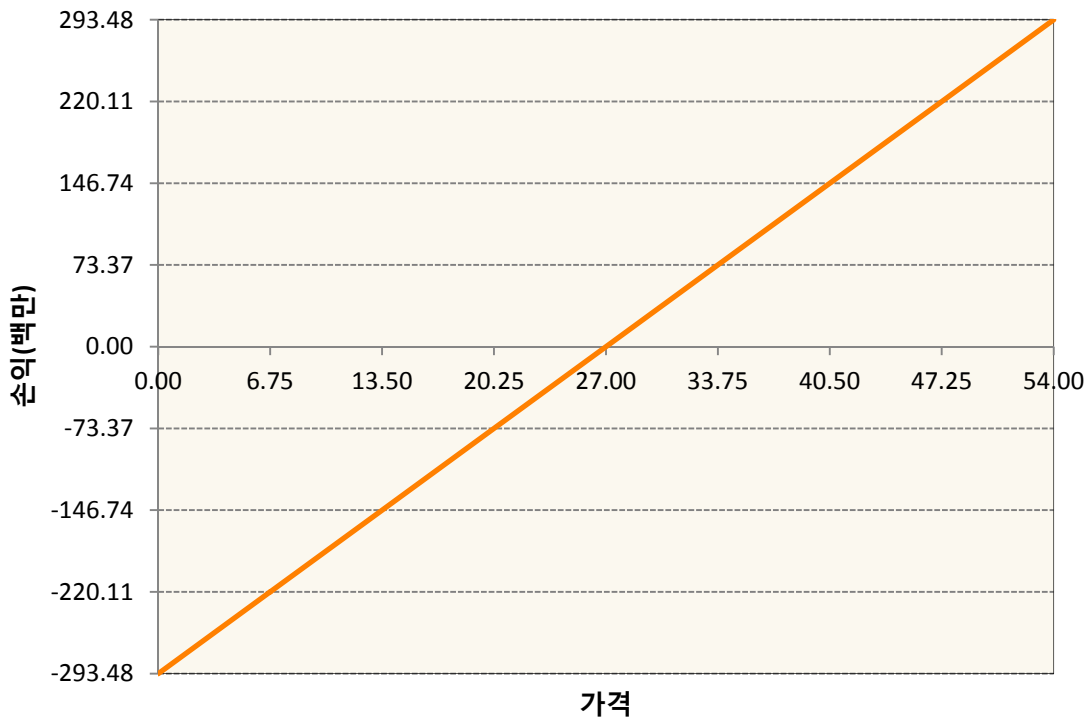
1. 계약금액

(단위:백만원)

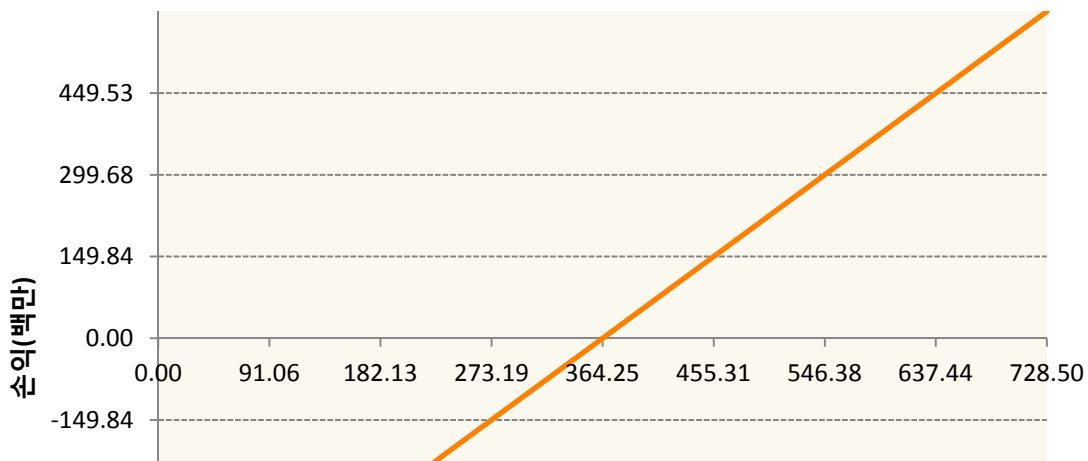
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,836	59	2,777	

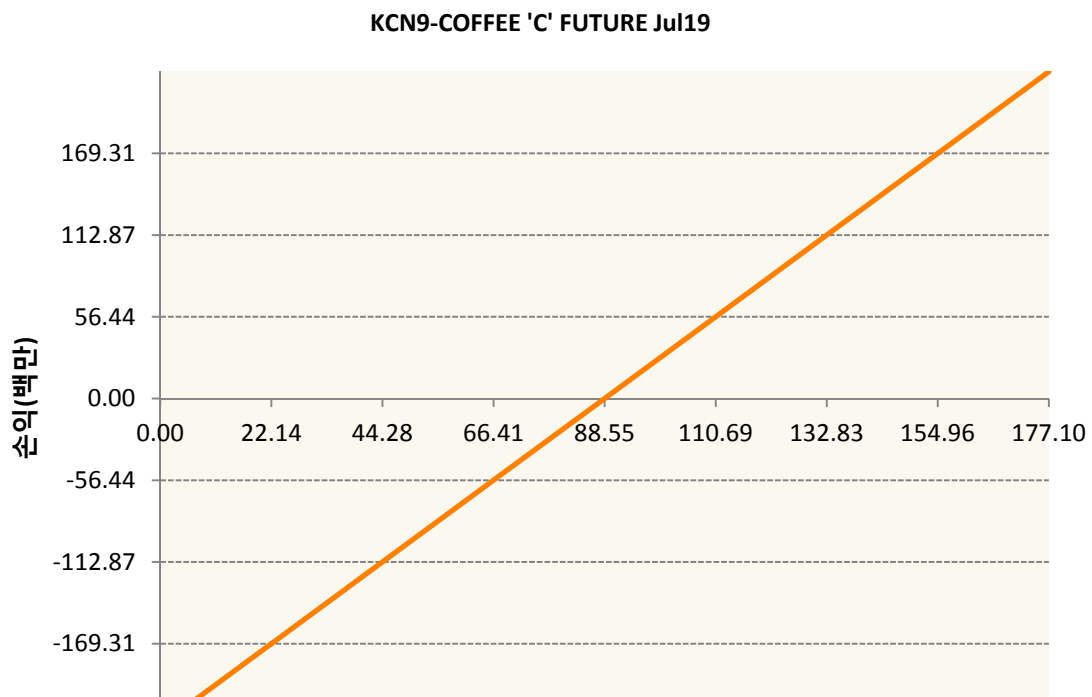
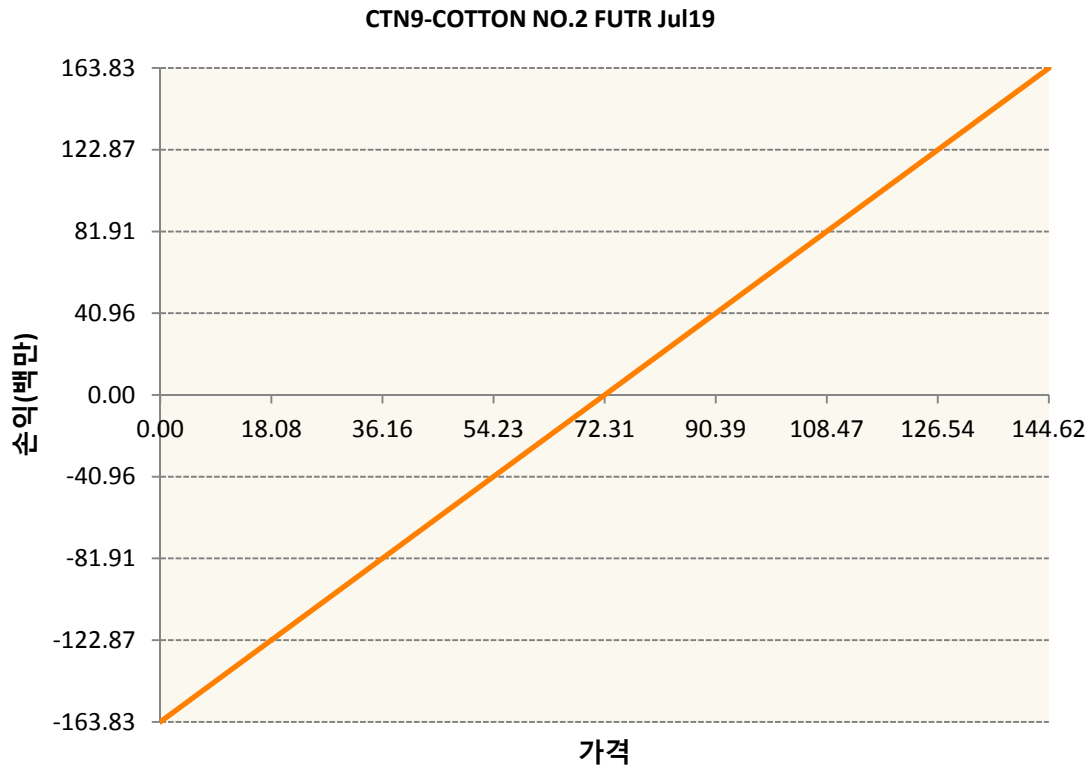
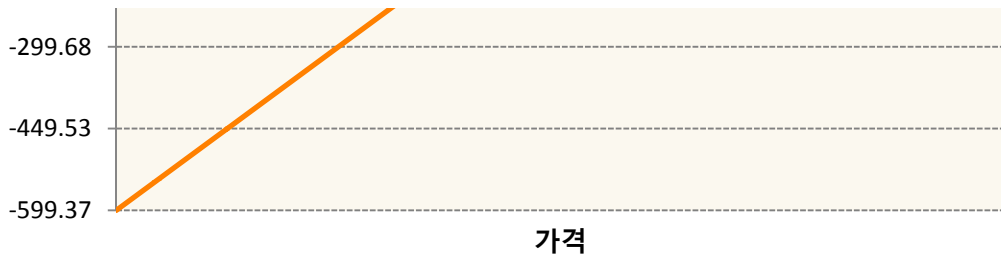
2. 만기시점의 손익구조

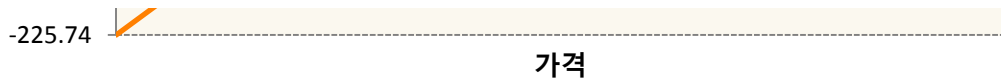
BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19



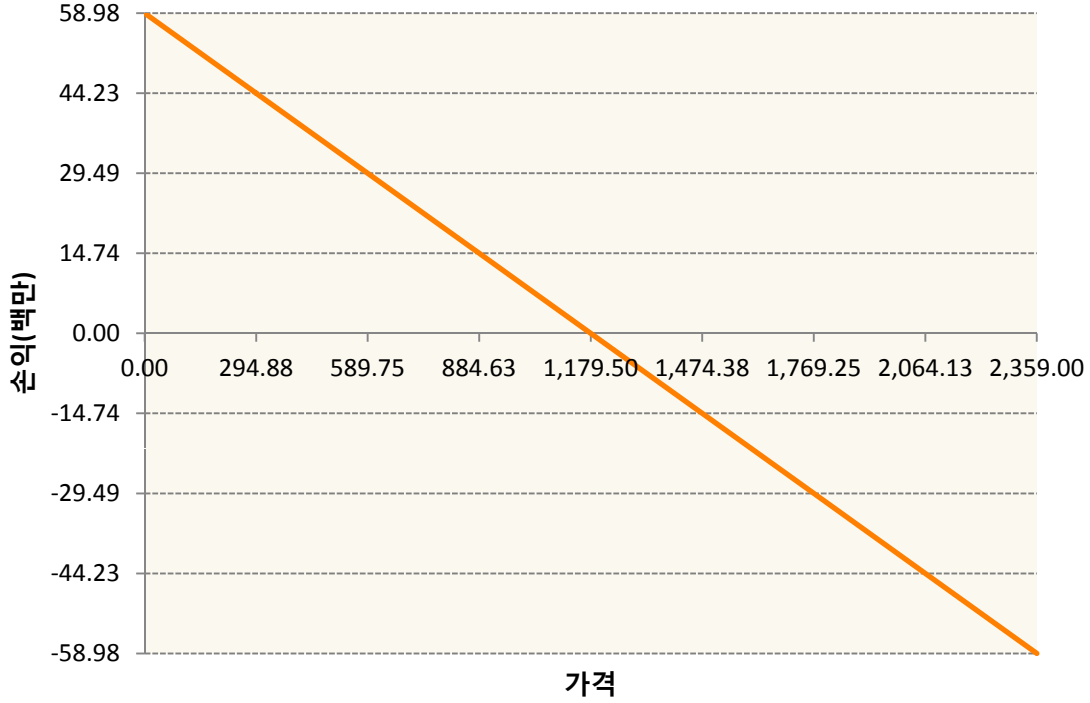
CN9-CORN FUTURE Jul19



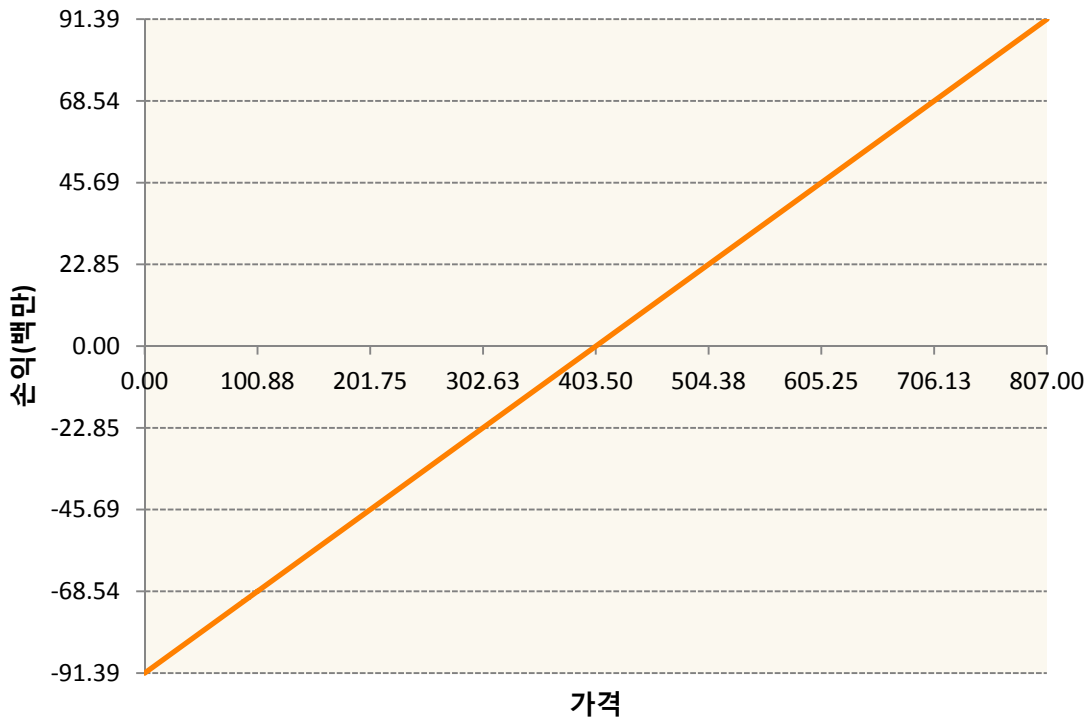




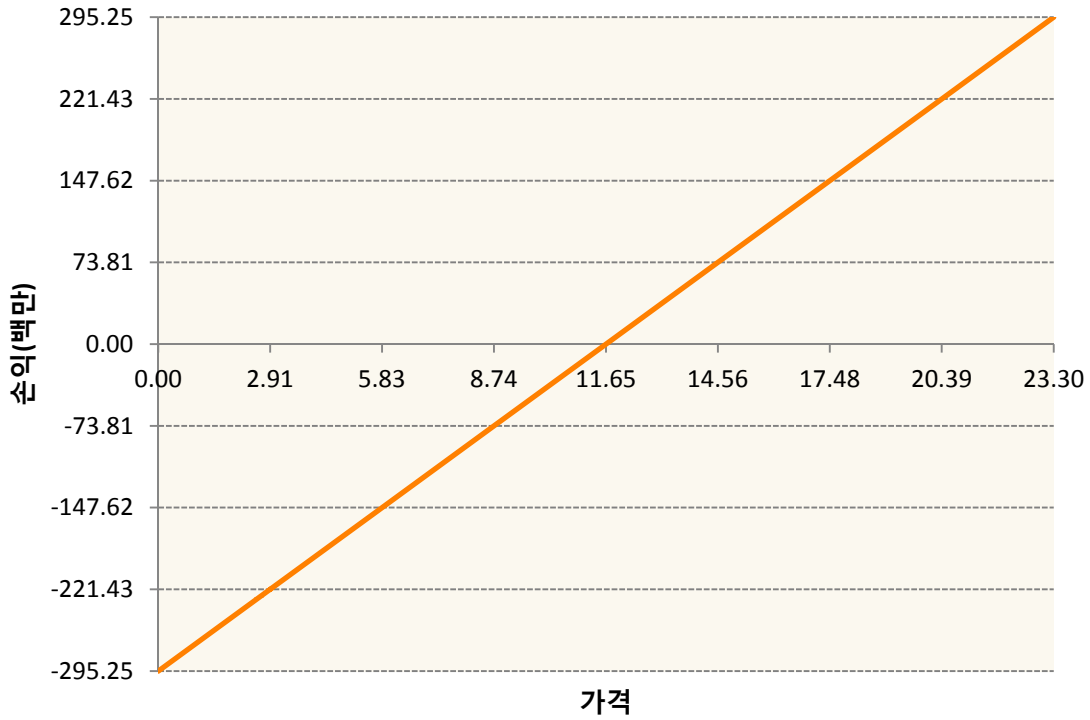
KR4175P50009-2019-05 달러선물



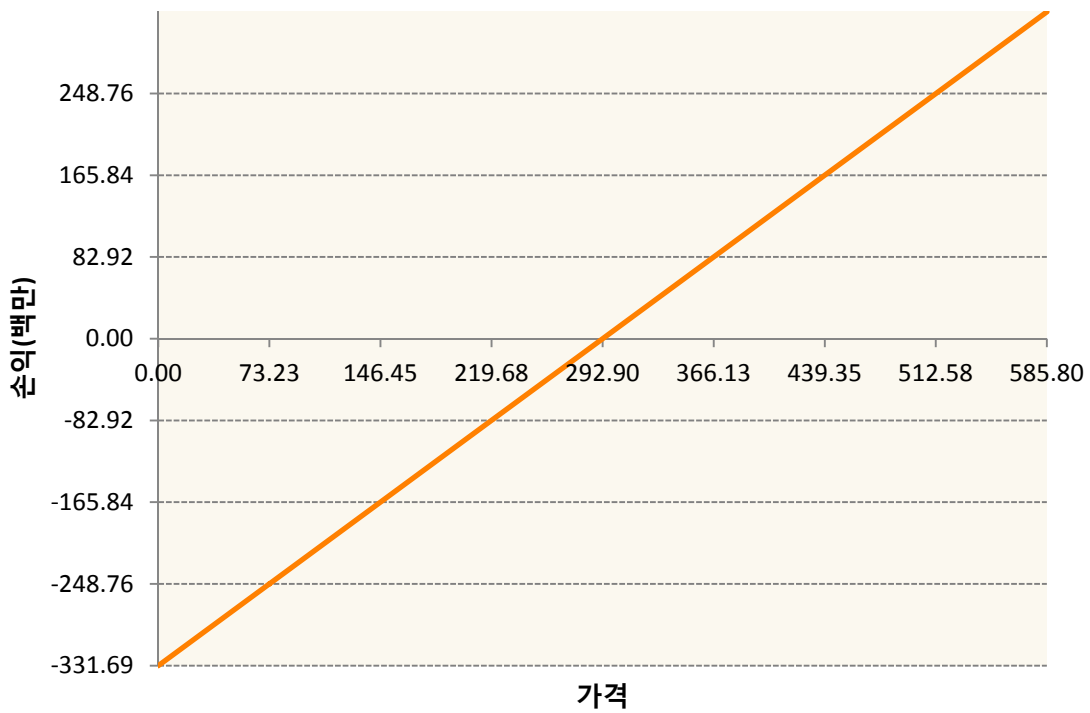
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



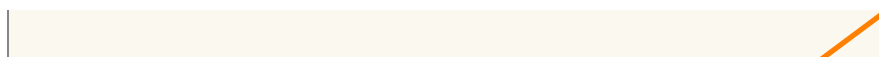
SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

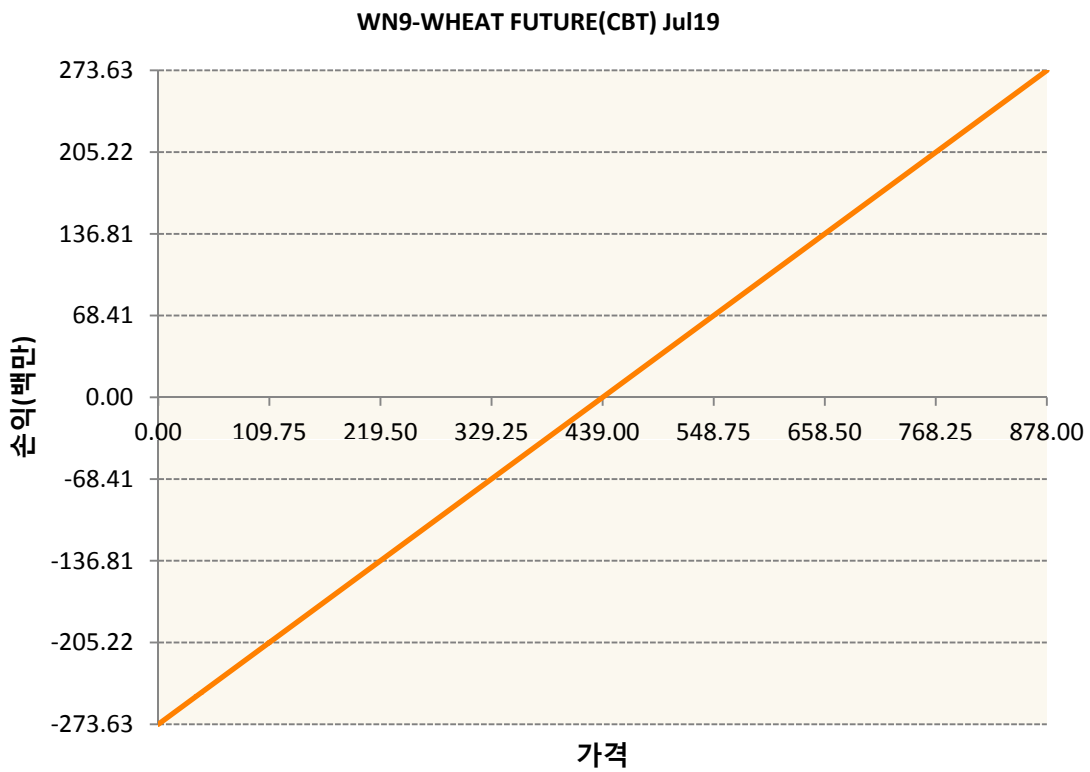
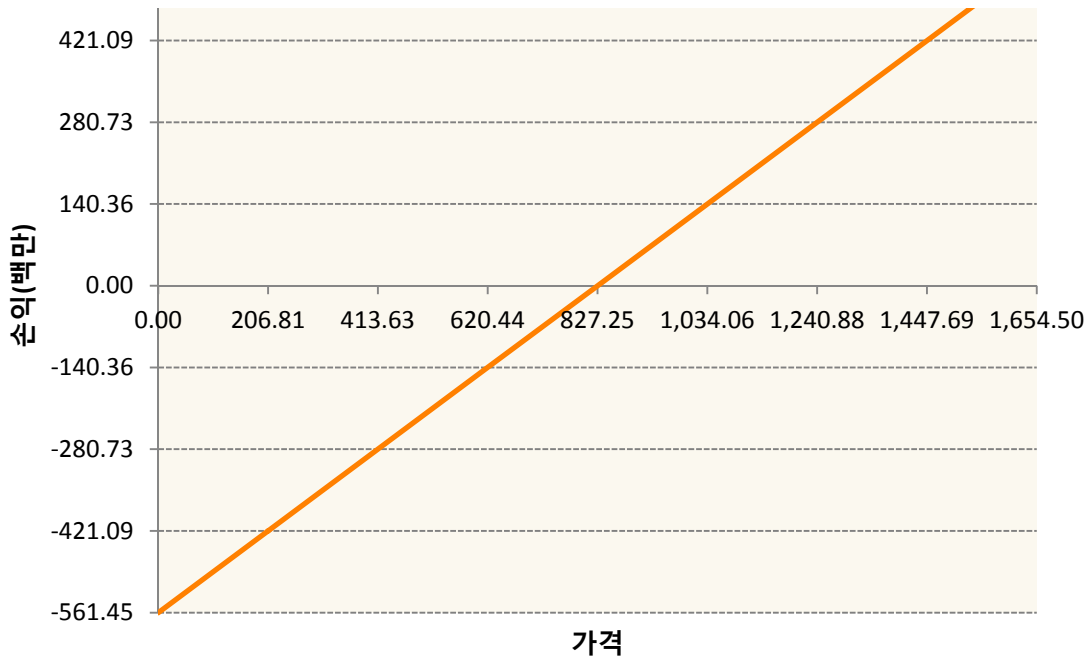


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19



SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON9	SOYBEAN OIL FUTR Jul19	23
CN9	CORN FUTURE Jul19	48
CTN9	COTTON NO.2 FUTR Jul19	13
KCN9	COFFEE 'C' FUTURE Jul19	18
KR4175P500	2019-05 달러선물	5

KWN9	KC HRW WHEAT FUT Jul19	7
SBN9	SUGAR #11 (WORLD) Jul19	24
SMN9	SOYBEAN MEAL FUTR Jul19	27
SN9	SOYBEAN FUTURE Jul19	45
WN9	WHEAT FUTURE(CBT) Jul19	22

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

(단위:백만원)

229