

공시일	2019-05-15
기준일	2019-05-14

## 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)

91

공시일	2019-05-15
기준일	2019-05-14

## 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

1,119

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

666

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-05-15
기준일	2019-05-14

## 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)	303
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	83
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	142

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

<b>871</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-05-15
기준일	2019-05-14

## 유로인덱스모(주식-파생형)

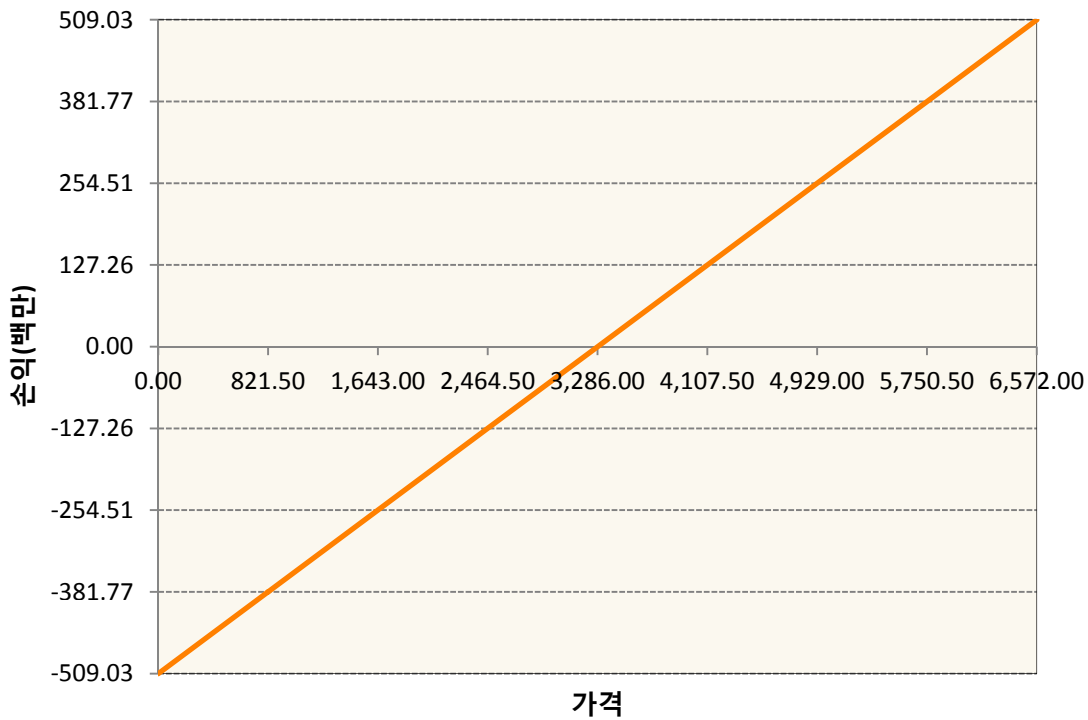
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	509	0	509	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	41
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

29
----

공시일	2019-05-15
기준일	2019-05-14

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

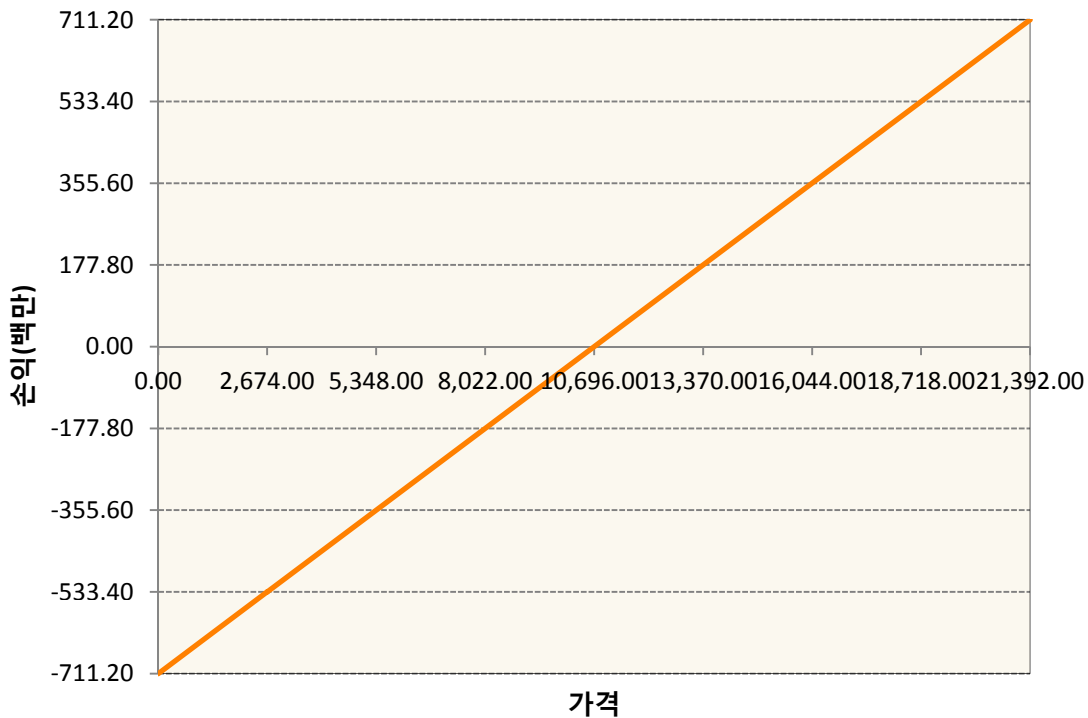
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	711	0	711	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK9	HSCEI Futures May19	57
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

59
----

공시일	2019-05-15
기준일	2019-05-14

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

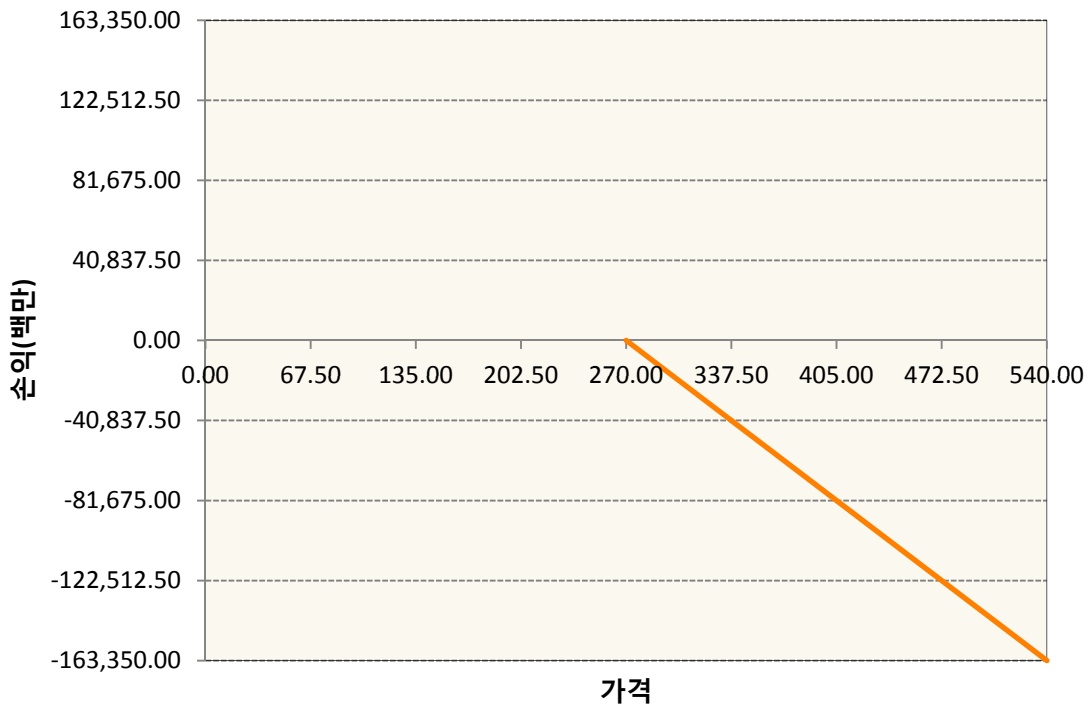
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

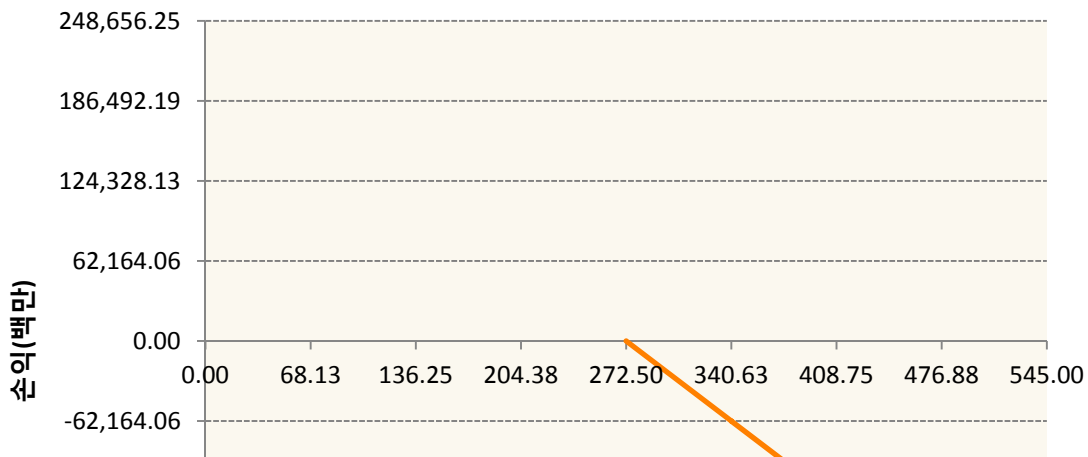
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	614,506	-614,506	장내

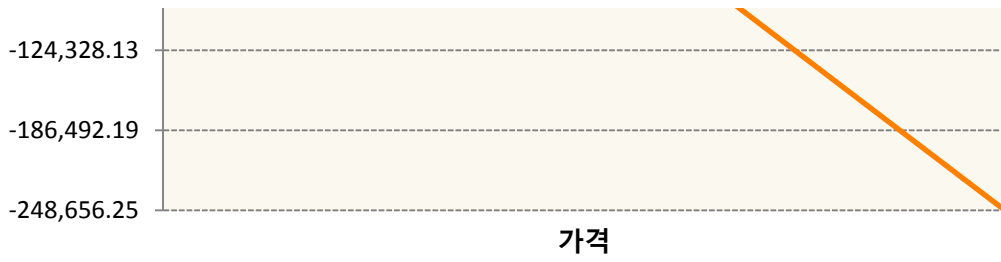
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P62701-2019-06 콜270



KR4201P62727-2019-06 콜272.5





KR4301P62709-2019-06 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P62701		2019-06 콜270					9,665
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,025	3,916	3,780	3,620	3,437	3,235	3,015
-5.33%	3,641	3,427	3,190	2,934	2,662	2,377	2,082
-2.67%	2,764	2,440	2,106	1,764	1,417	1,064	708
0%	1,160	774	387	0	-387	-775	-1,162
2.67%	-1,277	-1,646	-2,020	-2,396	-2,776	-3,157	-3,540
5.33%	-4,468	-4,756	-5,061	-5,380	-5,710	-6,049	-6,395
8.00%	-8,209	-8,394	-8,607	-8,845	-9,102	-9,376	-9,665
KR4201P62727		2019-06 콜272.5					13,829
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,185	5,059	4,893	4,690	4,453	4,184	3,888

-5.33%	4,763	4,494	4,186	3,844	3,474	3,081	2,667
-2.67%	3,730	3,289	2,825	2,344	1,849	1,342	826
0%	1,715	1,146	575	0	-577	-1,155	-1,734
2.67%	-1,523	-2,108	-2,695	-3,284	-3,874	-4,464	-5,056
5.33%	-5,958	-6,448	-6,958	-7,481	-8,017	-8,561	-9,113
8.00%	-11,337	-11,677	-12,054	-12,463	-12,898	-13,355	-13,829
KR4301P62709                      2019-06 풋270							13,008
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,586	-12,614	-12,658	-12,719	-12,798	-12,895	-13,008
-5.33%	-7,379	-7,485	-7,616	-7,768	-7,940	-8,128	-8,332
-2.67%	-2,654	-2,895	-3,150	-3,418	-3,695	-3,979	-4,270
0%	1,013	676	338	0	-339	-678	-1,017
2.67%	3,258	2,954	2,643	2,326	2,005	1,681	1,354
5.33%	4,282	4,100	3,895	3,671	3,431	3,178	2,914
8.00%	4,622	4,547	4,448	4,325	4,181	4,017	3,835

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

(단위:백만원)

**35,272**

공시일	2019-05-15
기준일	2019-05-14

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

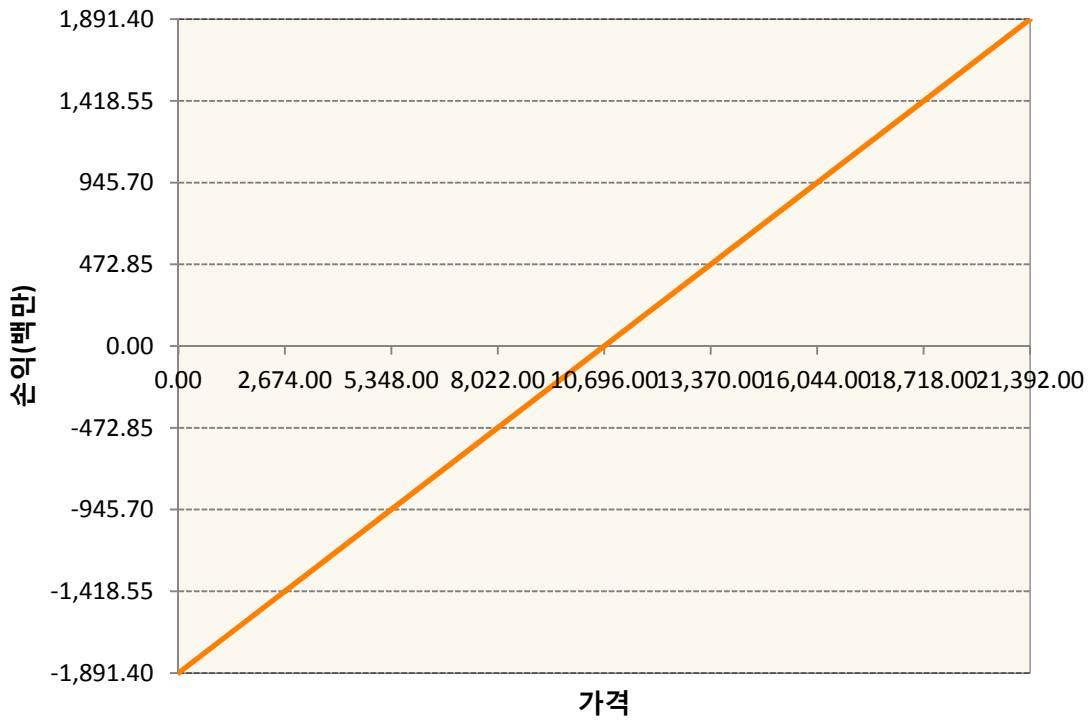
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

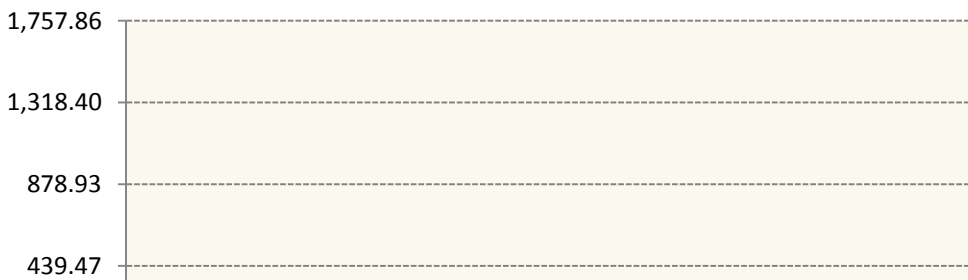
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,891	0	1,891	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,643	-5,643	장내
누계	통화	선도	0	3,182	-3,182	장외

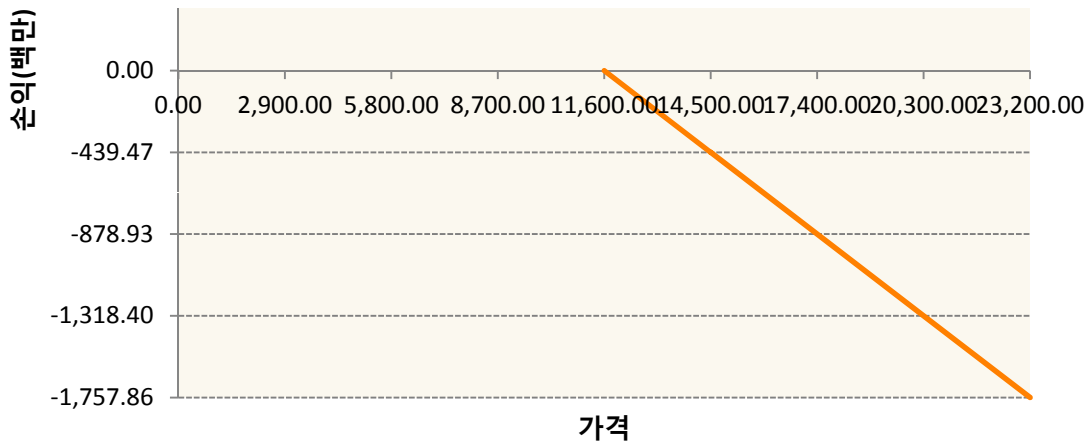
### 2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19

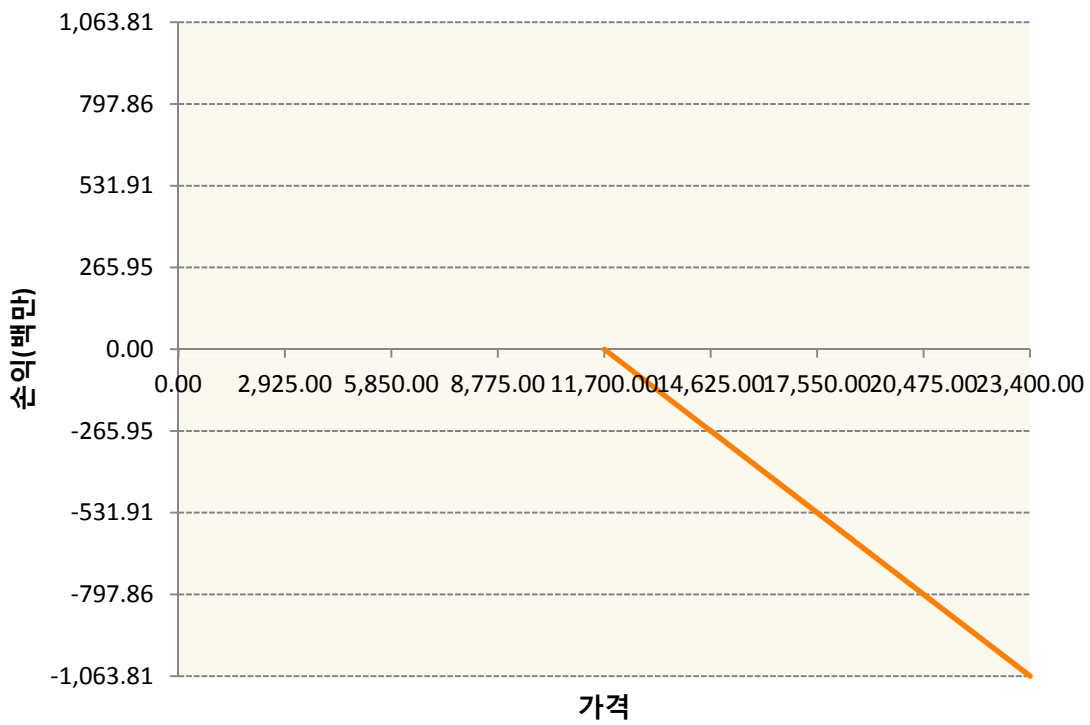


OHHIK9-C116-HSCEI

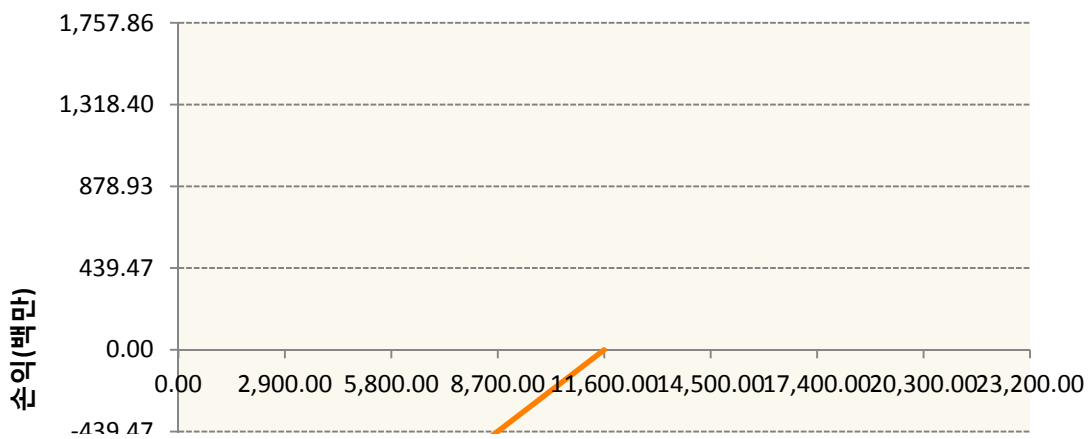


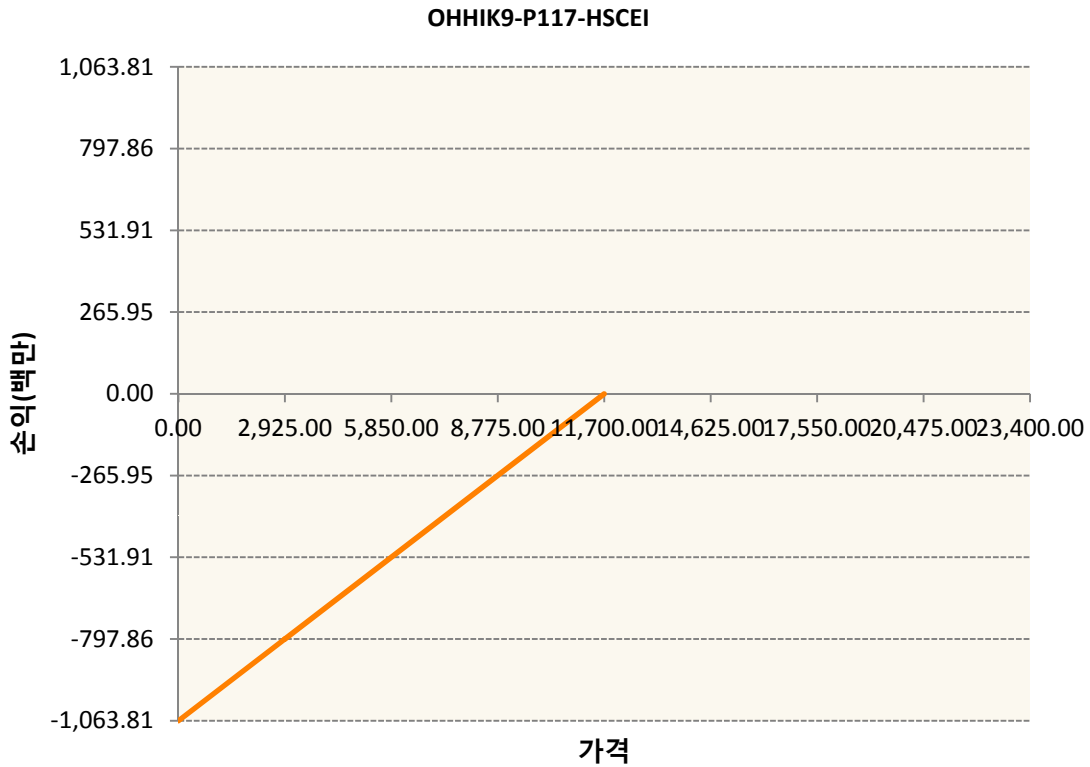


**OHHIK9-C117-HSCEI**



**OHHIK9-P116-HSCEI**





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	230
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	24
HCK9 HSCEI Futures May19	151
OHHIK9-C11 HSCEI	141
OHHIK9-C11 HSCEI	85
OHHIK9-P11 HSCEI	141
OHHIK9-P11 HSCEI	85

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

<b>710</b>
------------

공시일	2019-05-15
기준일	2019-05-14

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

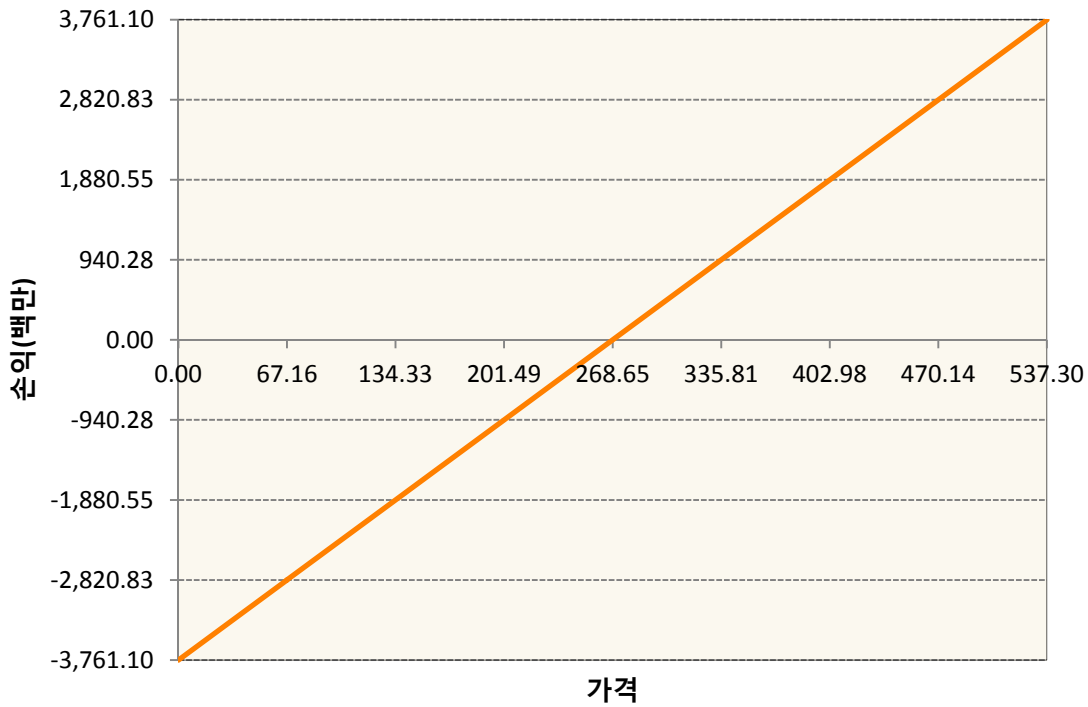
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

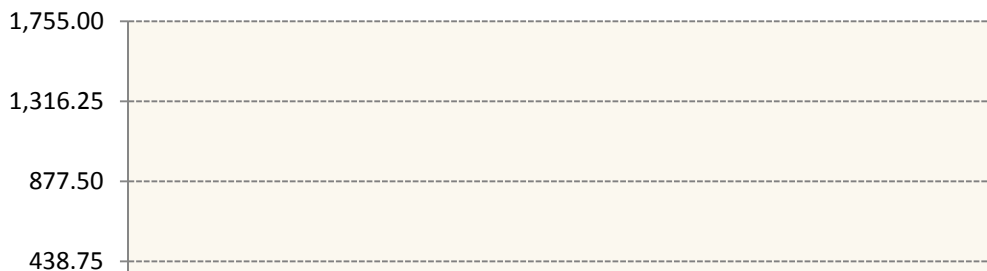
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,761	0	3,761	장내
누계	유가증권	스왑	26,836	0	26,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,476	-25,476	장내

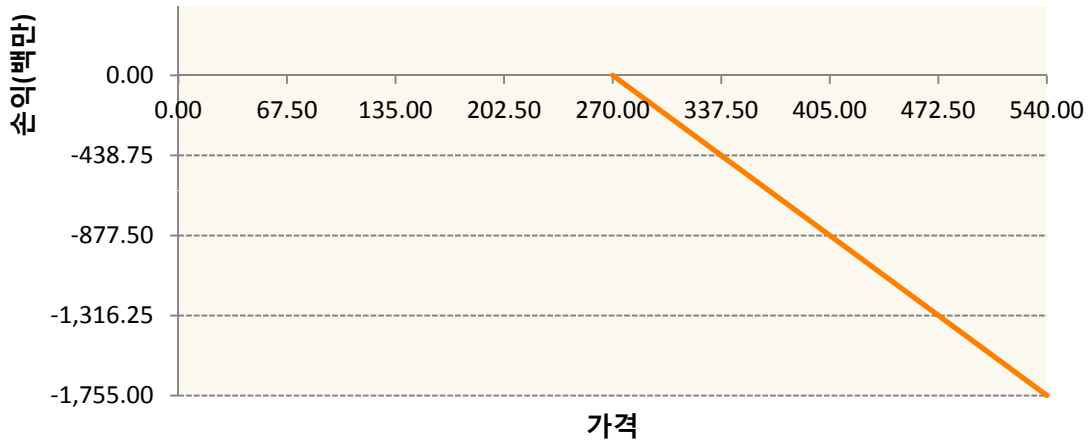
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

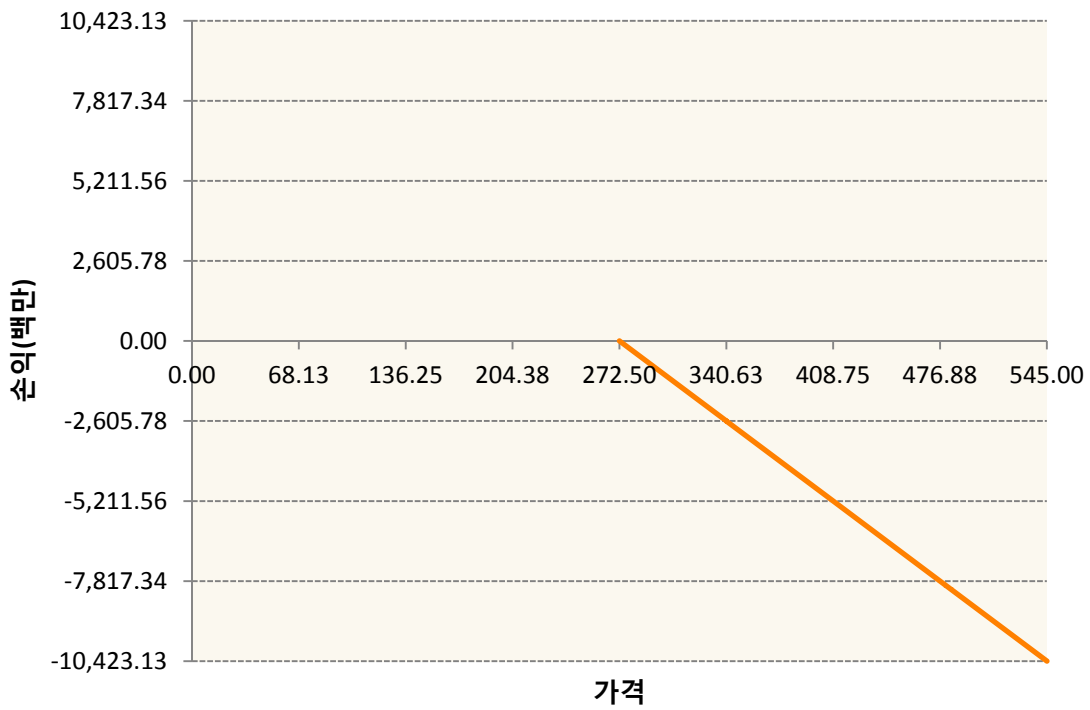


KR4201P62701-2019-06 콜270

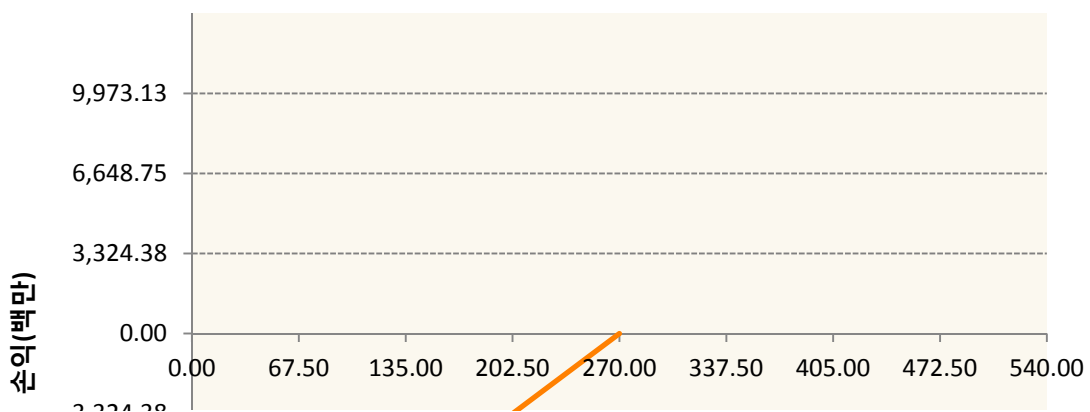


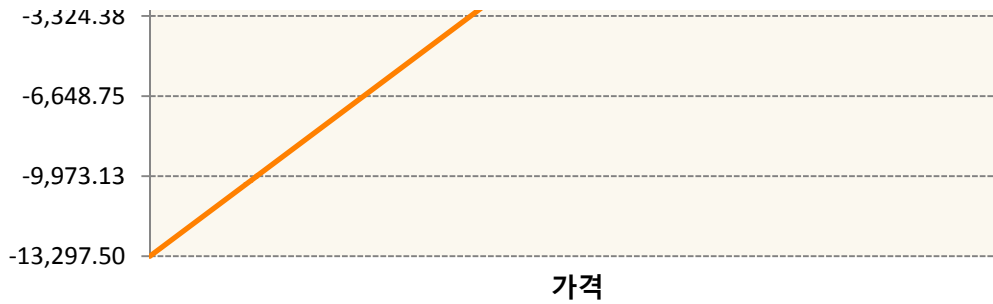


KR4201P62727-2019-06 콜272.5



KR4301P62709-2019-06 풋270





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,704
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,704	-1,704	-1,704	-1,704	-1,704	-1,704	-1,704	
-5.33%	-1,136	-1,136	-1,136	-1,136	-1,136	-1,136	-1,136	
-2.67%	-568	-568	-568	-568	-568	-568	-568	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	568	568	568	568	568	568	568	
5.33%	1,136	1,136	1,136	1,136	1,136	1,136	1,136	
8.00%	1,704	1,704	1,704	1,704	1,704	1,704	1,704	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						601
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-601	-601	-601	-601	-601	-601	-601	
-5.33%	-401	-401	-401	-401	-401	-401	-401	
-2.67%	-200	-200	-200	-200	-200	-200	-200	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	200	200	200	200	200	200	200	
5.33%	401	401	401	401	401	401	401	
8.00%	601	601	601	601	601	601	601	
KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						301
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-301	-301	-301	-301	-301	-301	-301	
-5.33%	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-201	
-2.67%	-100	-100	-100	-100	-100	-100	-100	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	100	100	100	100	100	100	100	
5.33%	201	201	201	201	201	201	201	
8.00%	301	301	301	301	301	301	301	
KR4201P62701		2019-06 콜270						104
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	43	42	41	39	37	35	32
-5.33%	39	37	34	32	29	26	22
-2.67%	30	26	23	19	15	11	8
0%	12	8	4	0	-4	-8	-12
2.67%	-14	-18	-22	-26	-30	-34	-38
5.33%	-48	-51	-54	-58	-61	-65	-69
8.00%	-88	-90	-92	-95	-98	-101	-104
KR4201P62727                      2019-06 콜272.5							580
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	217	212	205	197	187	175	163
-5.33%	200	188	175	161	146	129	112
-2.67%	156	138	118	98	77	56	35
0%	72	48	24	0	-24	-48	-73
2.67%	-64	-88	-113	-138	-162	-187	-212
5.33%	-250	-270	-292	-314	-336	-359	-382
8.00%	-475	-489	-505	-522	-541	-560	-580
KR4301P62709                      2019-06 풋270							854
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-826	-828	-831	-835	-840	-847	-854
-5.33%	-485	-492	-500	-510	-521	-534	-547
-2.67%	-174	-190	-207	-224	-243	-261	-280
0%	67	44	22	0	-22	-45	-67
2.67%	214	194	174	153	132	110	89
5.33%	281	269	256	241	225	209	191
8.00%	304	299	292	284	275	264	252

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

(단위:백만원)

**4,076**

공시일	2019-05-15
기준일	2019-05-14

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

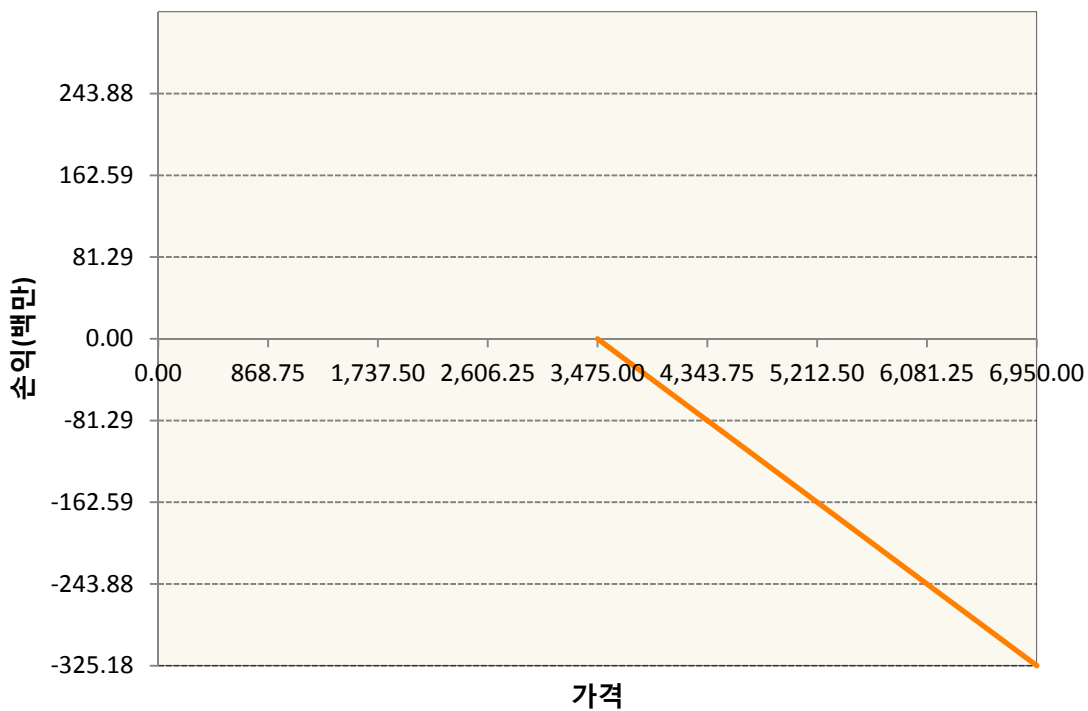
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

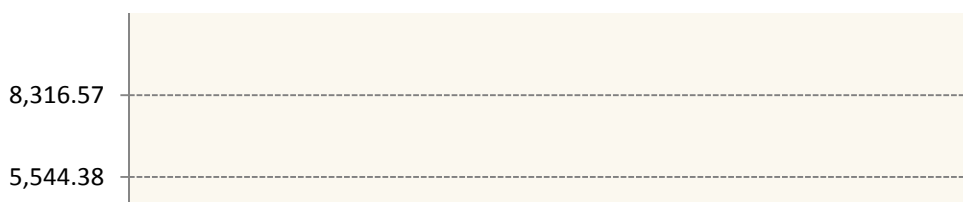
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,730	0	4,730	
누계	유가증권	스왑	56,587	0	56,587	장외
누계	유가증권	옵션	0	22,828	-22,828	장내
누계	통화	선도	0	18,716	-18,716	장외

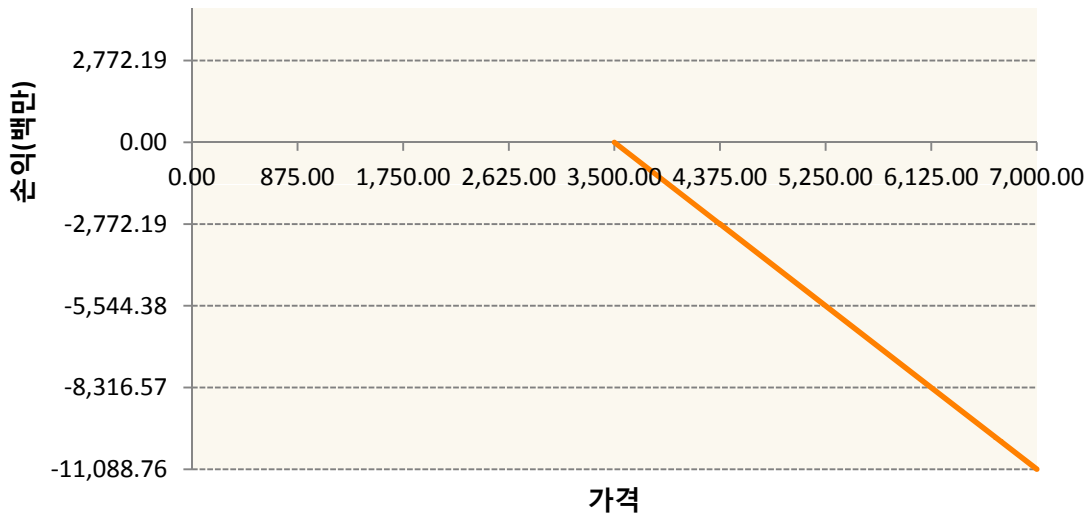
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXK9-C3475-EURO STOXX 50

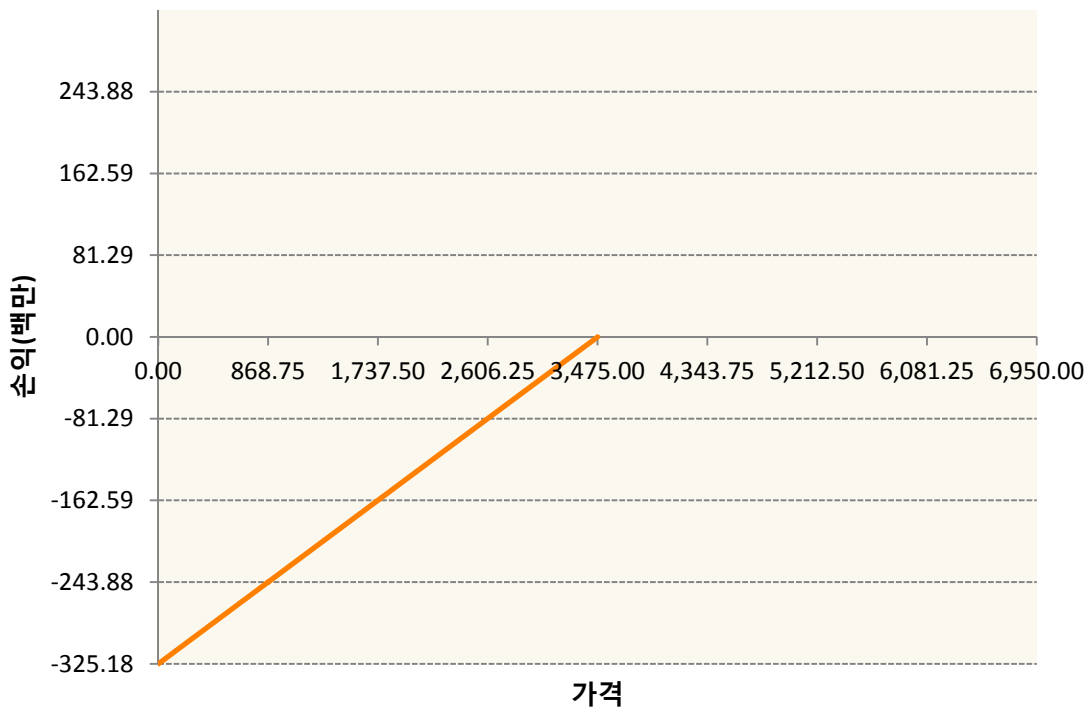


OESXK9-C3500-EURO STOXX 50

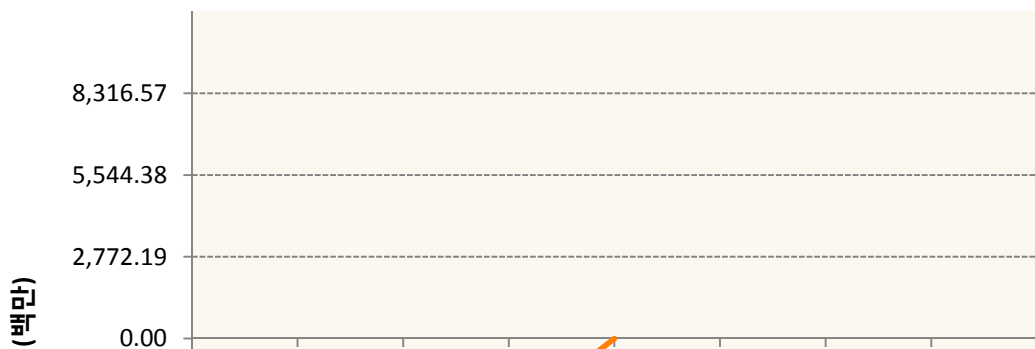


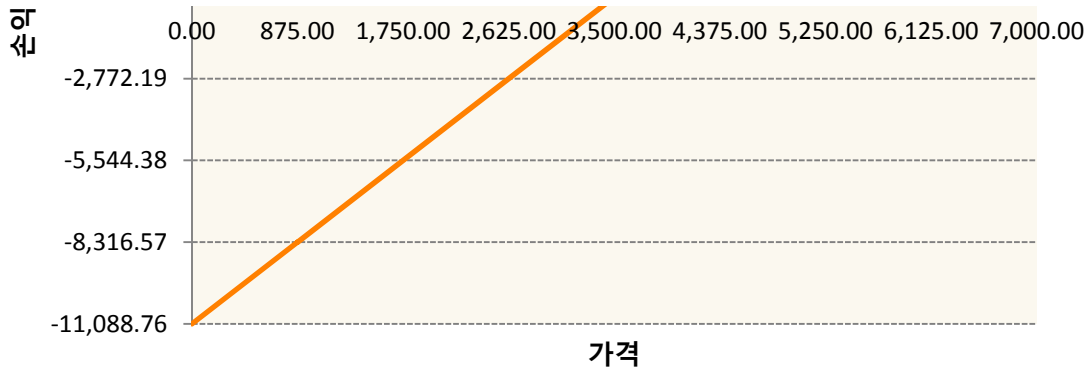


OESXK9-P3475-EURO STOXX 50

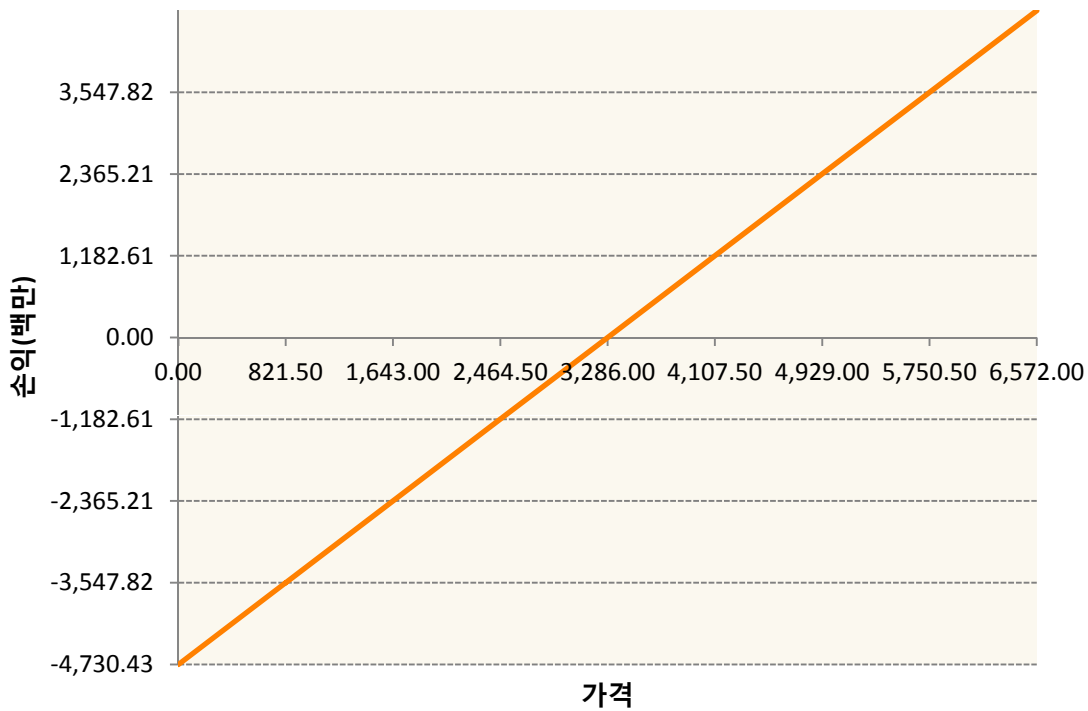


OESXK9-P3500-EURO STOXX 50





VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	174
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	428
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	856
FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E	214
OESXK9-C34 EURO STOXX 50	26
OESXK9-C35 EURO STOXX 50	887
OESXK9-P34 EURO STOXX 50	26
OESXK9-P35 EURO STOXX 50	887
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	378

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

(단위:백만원)

2,510



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

(단위:백만원)

1,030



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

(단위:백만원)

91



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

(단위:백만원)

132



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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-05-15
기준일	2019-05-14

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

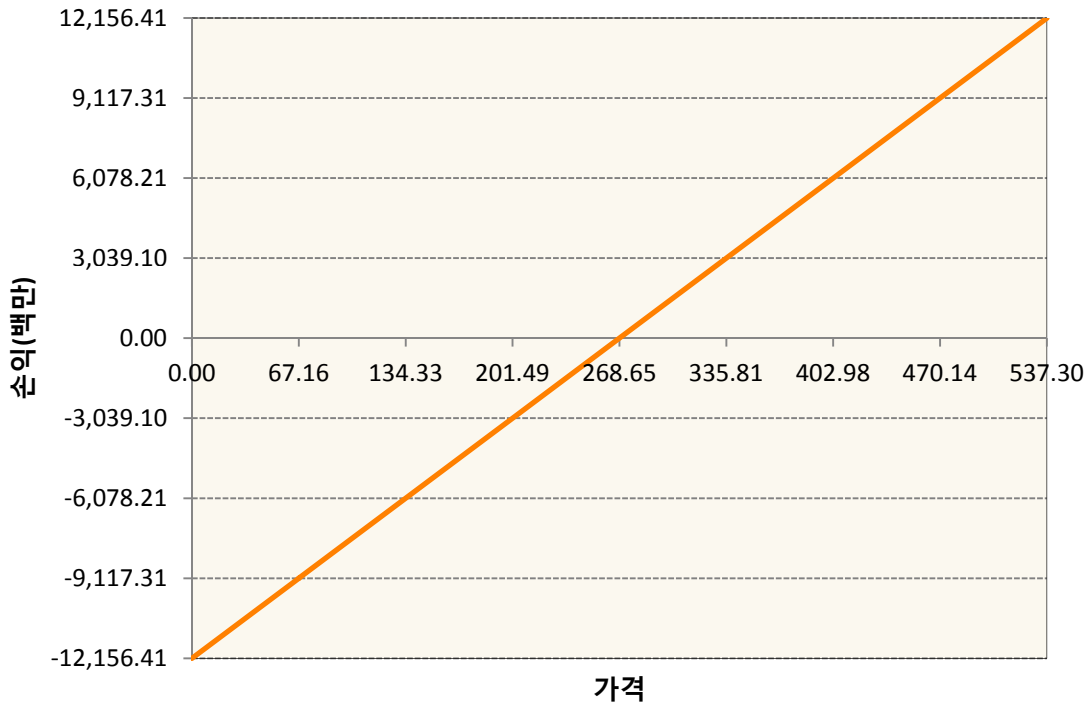
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

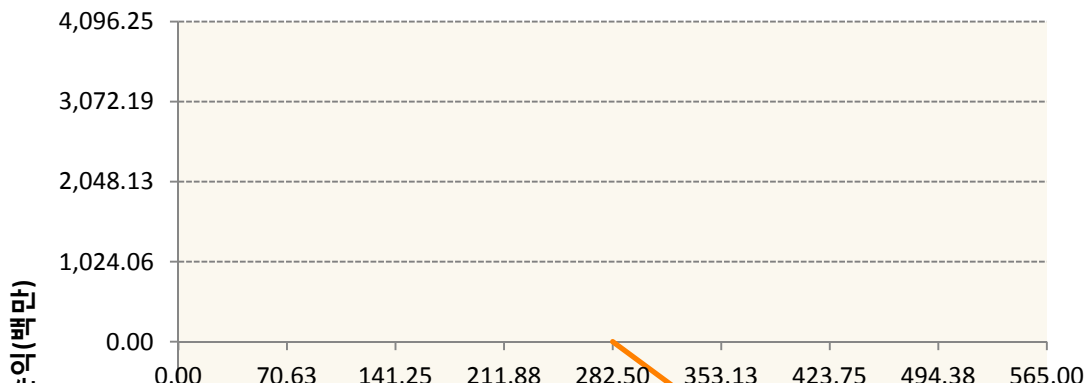
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,156	0	12,156	장내
누계	유가증권	옵션	5,081	22,906	-17,825	장내

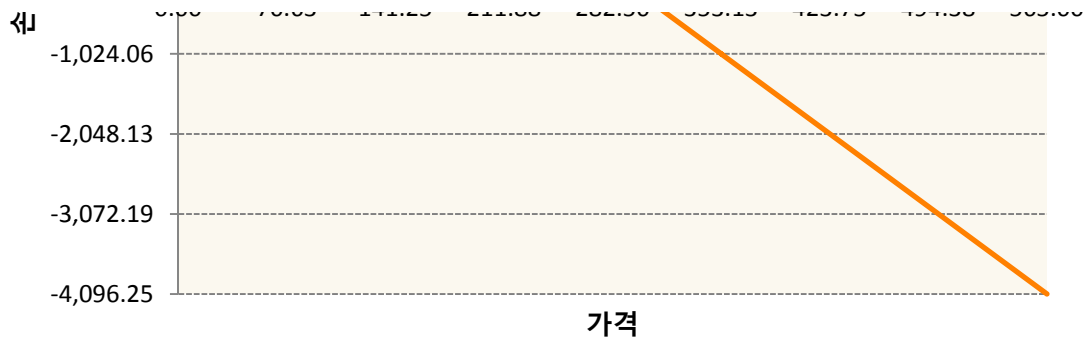
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

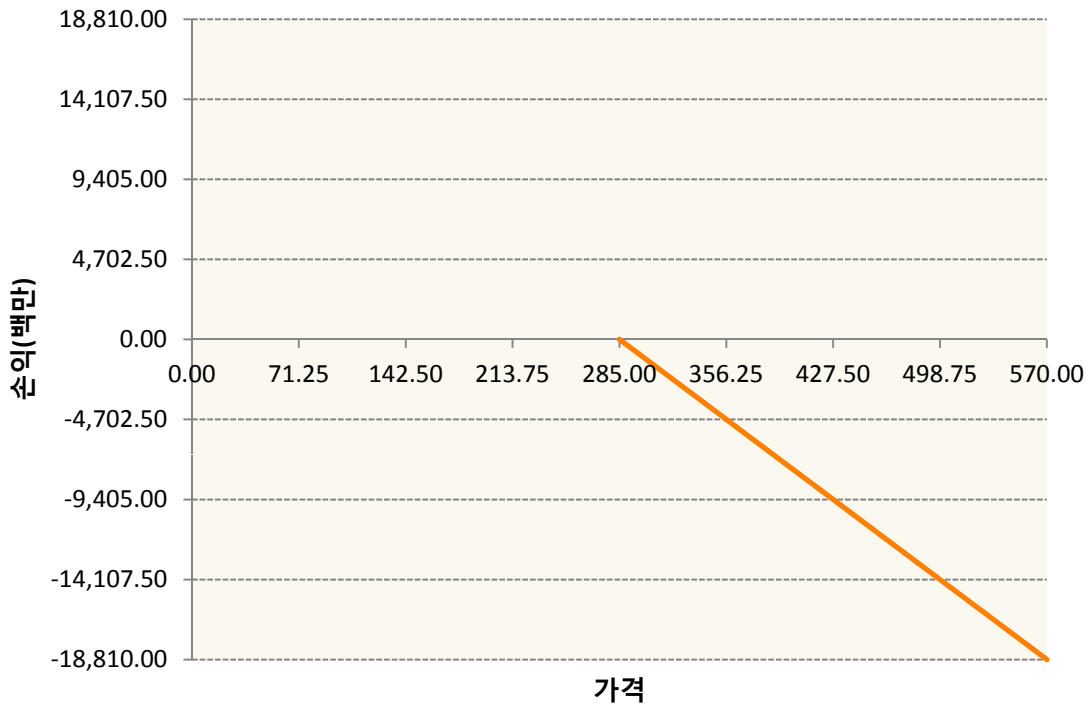


KR4201P62826-2019-06 콜282.5

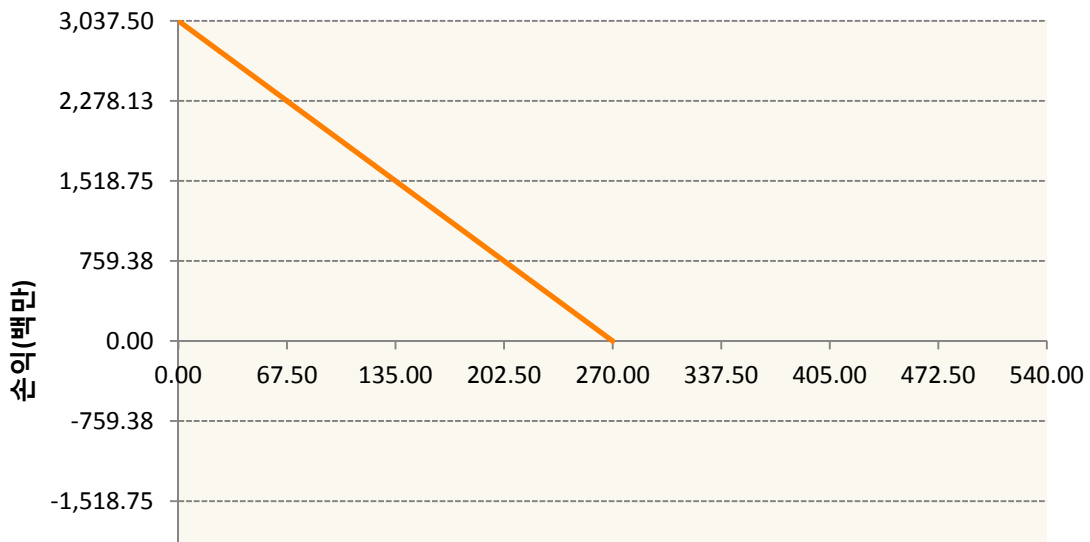


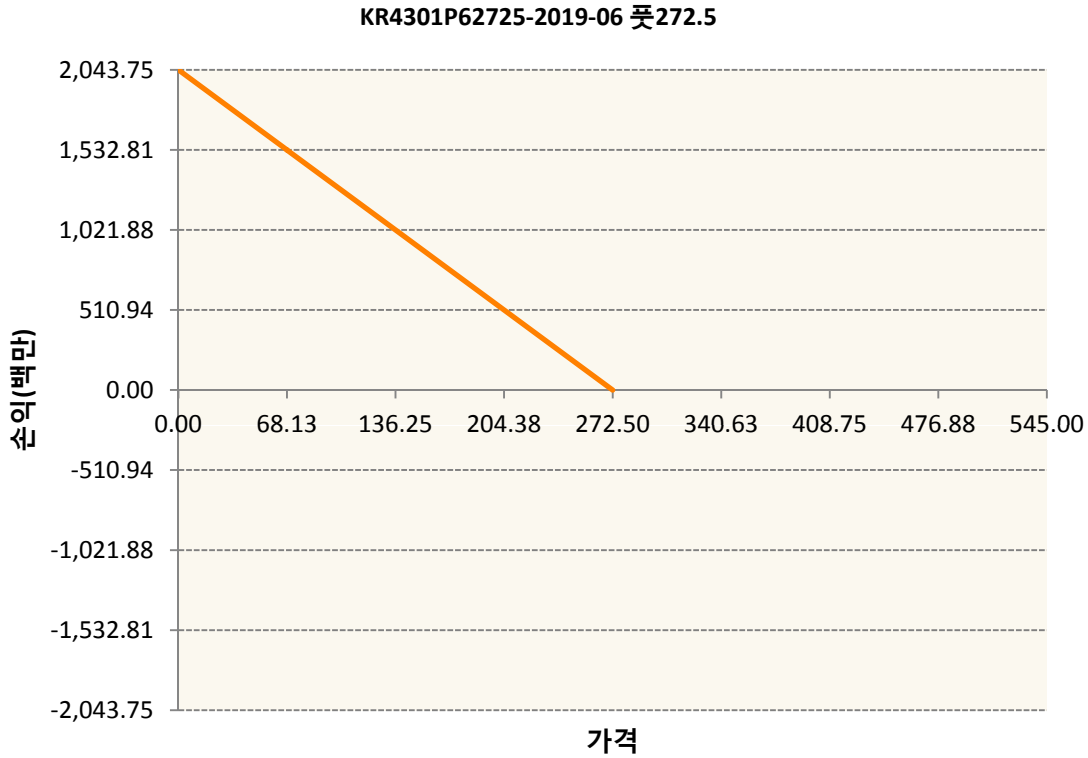
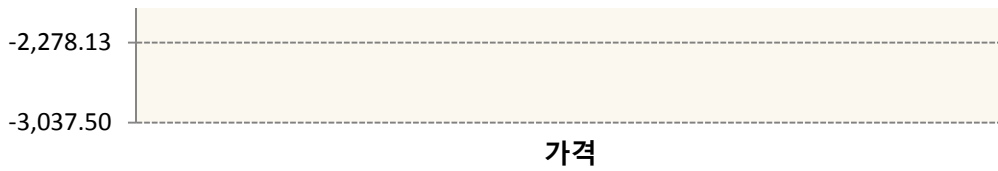


**KR4201P62859-2019-06 콜285**



**KR4301P62709-2019-06 풋270**





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						972
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-972	-972	-972	-972	-972	-972	-972	
-5.33%	-648	-648	-648	-648	-648	-648	-648	
-2.67%	-324	-324	-324	-324	-324	-324	-324	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	324	324	324	324	324	324	324	
5.33%	648	648	648	648	648	648	648	
8.00%	972	972	972	972	972	972	972	
KR4201P62826		2019-06 콜282.5						168
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	40	39	38	37	35	33	30	
-5.33%	38	37	34	31	28	24	20	
-2.67%	33	30	25	20	15	9	3	

0%	20	14	7	0	-8	-15	-23
2.67%	-6	-14	-23	-32	-41	-51	-60
5.33%	-49	-59	-69	-79	-89	-98	-108
8.00%	-112	-121	-130	-140	-149	-158	-168

KR4201P62859                      2019-06 콜285                      703

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	147	145	142	137	131	122	111
-5.33%	142	137	129	118	105	90	72
-2.67%	126	113	96	77	55	31	5
0%	82	57	30	0	-32	-65	-99
2.67%	-13	-50	-88	-128	-167	-208	-249
5.33%	-183	-228	-272	-316	-361	-405	-450
8.00%	-440	-483	-527	-571	-615	-659	-703

KR4301P62709                      2019-06 풋270                      195

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	189	189	190	191	192	193	195
-5.33%	111	112	114	117	119	122	125
-2.67%	40	43	47	51	55	60	64
0%	-15	-10	-5	0	5	10	15
2.67%	-49	-44	-40	-35	-30	-25	-20
5.33%	-64	-61	-58	-55	-51	-48	-44
8.00%	-69	-68	-67	-65	-63	-60	-58

KR4301P62725                      2019-06 풋272.5                      136

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	133	134	134	134	135	136	136
-5.33%	81	81	82	84	85	87	88
-2.67%	31	33	35	38	40	43	45
0%	-10	-6	-3	0	3	7	10
2.67%	-37	-34	-30	-27	-24	-20	-17
5.33%	-51	-49	-46	-44	-41	-38	-35
8.00%	-56	-55	-54	-52	-51	-49	-47

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

(단위:백만원)

**1,718**

공시일	2019-05-15
기준일	2019-05-14

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,379	0	2,379	
누계	유가증권	수익증권	9,683	0	9,683	

### 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	2019-05-15
기준일	2019-05-14

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,189	0	1,189	
누계	유가증권	수익증권	90,286	0	90,286	

### 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	2019-05-15
기준일	2019-05-14

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	8,326	0	8,326	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	214,758	0	214,758	
누계	통화	선도	0	227,889	-227,889	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019J004 KRW/USD 10-06-19E		105
FX21019J012 KRW/USD 20-05-19E		133
FX21019J012 KRW/USD 20-05-19E		19
FX21019J013 KRW/USD 20-05-19E		143
FX21019J016 KRW/USD 20-05-19E		143
FX21019J019 KRW/USD 17-05-19E		1,332
FX21019J019 KRW/USD 17-05-19E		1,427
FX21019J019 KRW/USD 18-06-19E		381
FX21019J020 KRW/USD 20-05-19E		514
FX21019J021 KRW/USD 20-05-19E		483
FX21019J024 KRW/USD 24-06-19E		952
FX21019J024 KRW/USD 22-05-19E		799
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		952
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		1,009
FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E		381
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		76
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		1,001
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E		1,028
FX21019J041 KRW/USD 28-05-19E		285
FX21019J043 KRW/USD 03-06-19E		571
FX21019J044 KRW/USD 03-06-19E		476
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		285
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		476
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		666
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		666
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		828

FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E	818
FX21019K00 KRW/USD 18-06-19E	571
FX21019K01 KRW/USD 14-06-19E	666
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E	571
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E	476

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

(단위:백만원)

**6,169**

공시일	2019-05-15
기준일	2019-05-14

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

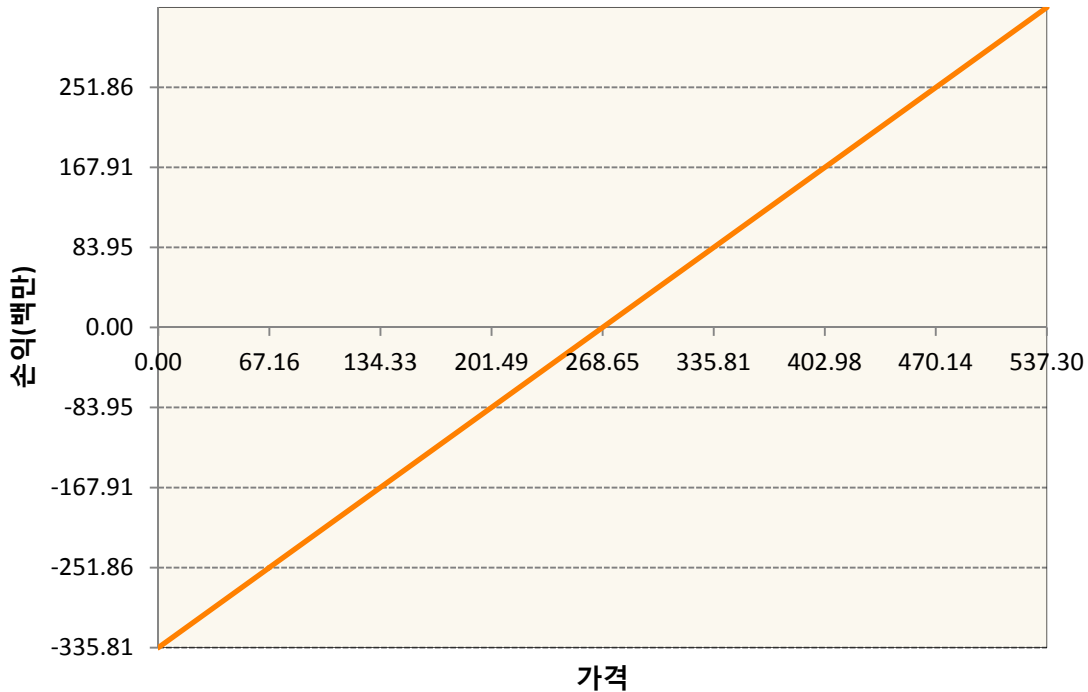
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

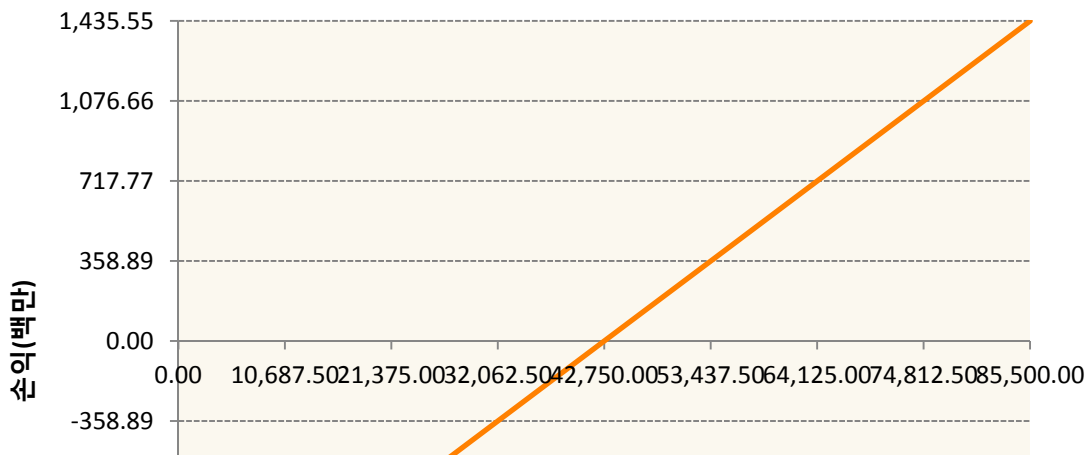
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,771	0	1,771	장내

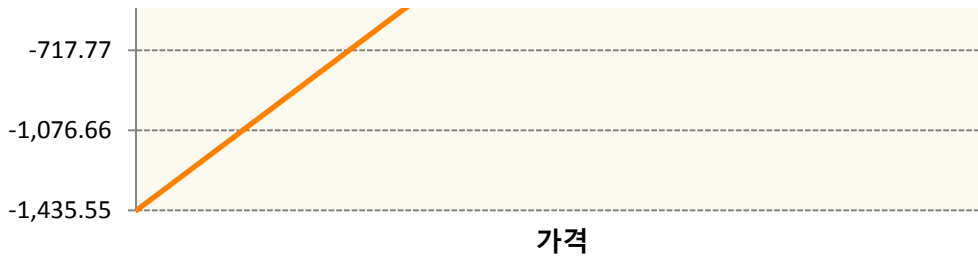
### 2. 만기시점의 손익구조

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						115
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-115	-115	-115	-115	-115	-115	-115	
-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%	115	115	115	115	115	115	115	

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

**156**

공시일	2019-05-15
기준일	2019-05-14

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

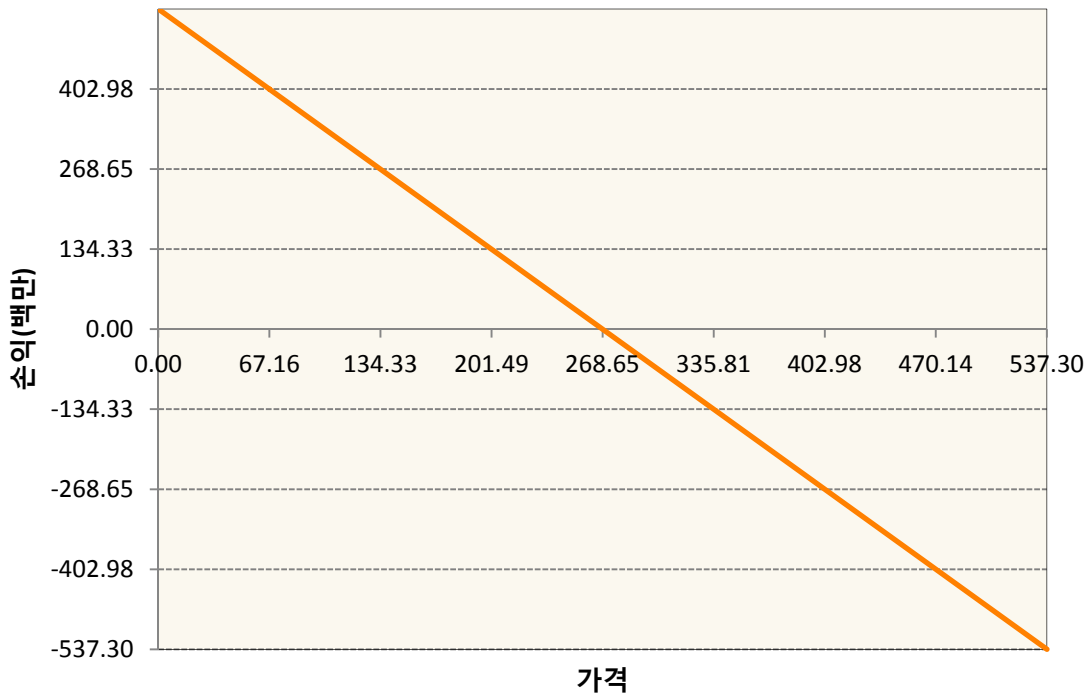
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

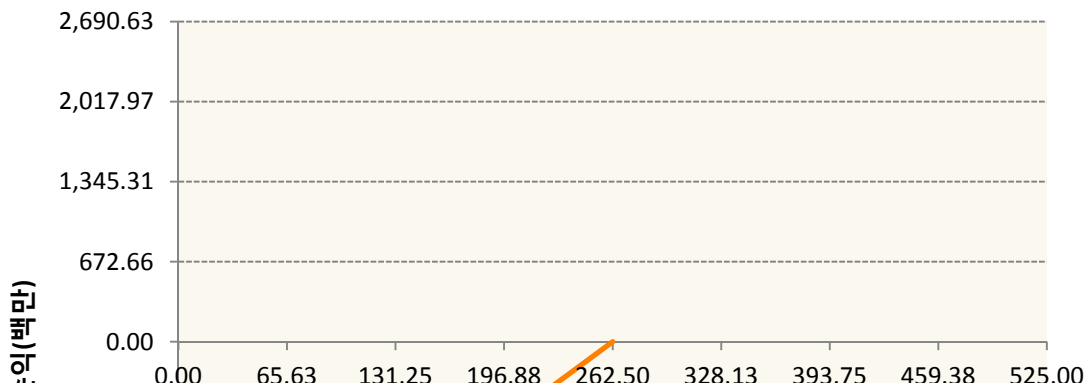
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	67	-67	장내
누계	유가증권	선물	0	537	-537	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,154	-3,154	장내

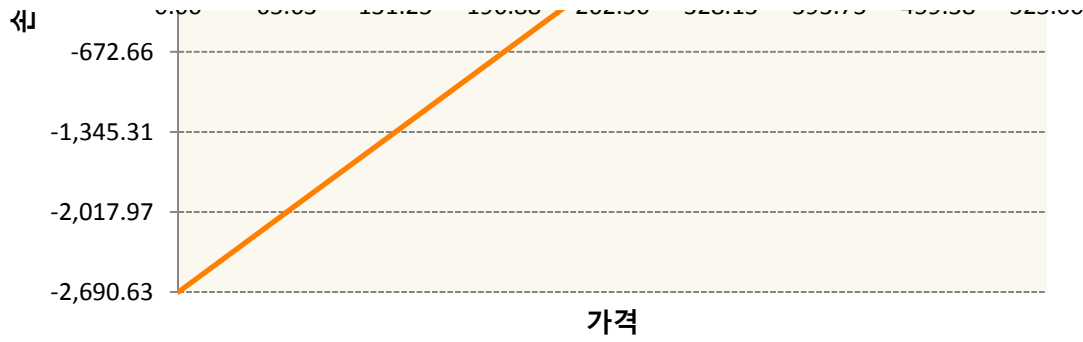
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

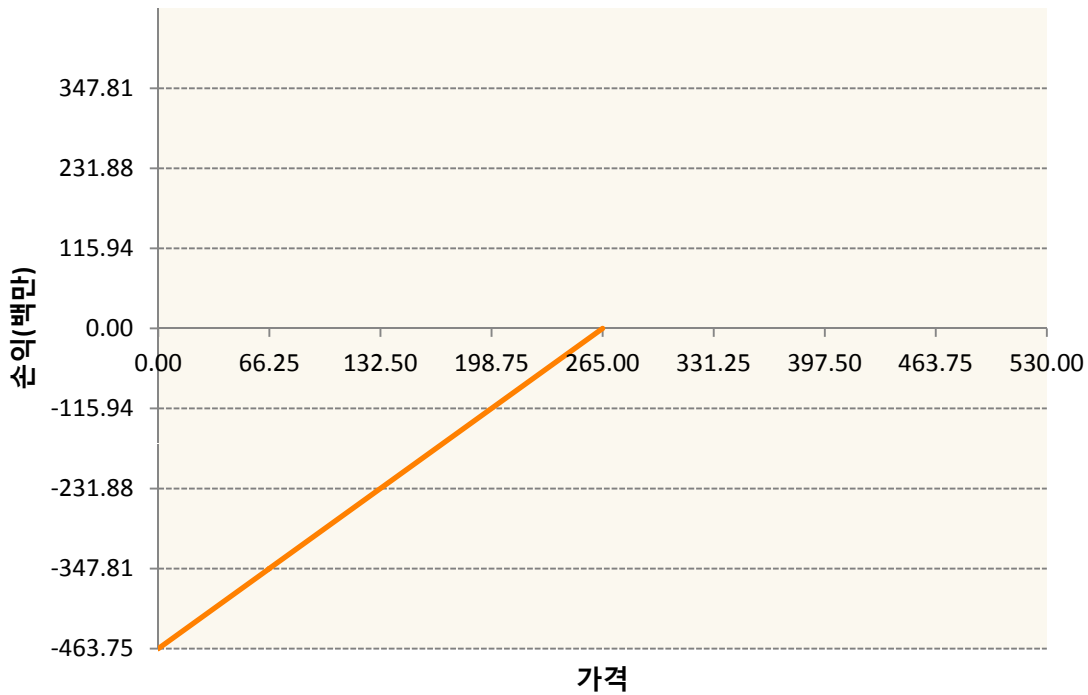


KR4301P62626-2019-06 풋262.5





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						144
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-132	-133	-135	-137	-139	-141	-144
-5.33%	-67	-70	-74	-77	-81	-85	-89
-2.67%	-17	-22	-26	-31	-35	-40	-45
0%	12	8	4	0	-4	-8	-13
2.67%	25	23	20	17	14	11	8
5.33%	29	28	27	26	24	22	19
8.00%	30	30	29	29	28	27	26
KR4301P62659                      2019-06 풋265							27
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-25	-25	-25	-26	-26	-26	-27
-5.33%	-13	-14	-14	-15	-15	-16	-17
-2.67%	-4	-5	-5	-6	-7	-8	-8
0%	2	2	1	0	-1	-2	-2
2.67%	5	5	4	4	3	2	2
5.33%	6	6	6	6	5	5	4
8.00%	7	7	7	6	6	6	6

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

(단위:백만원)

**196**

공시일	2019-05-15
기준일	2019-05-14

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

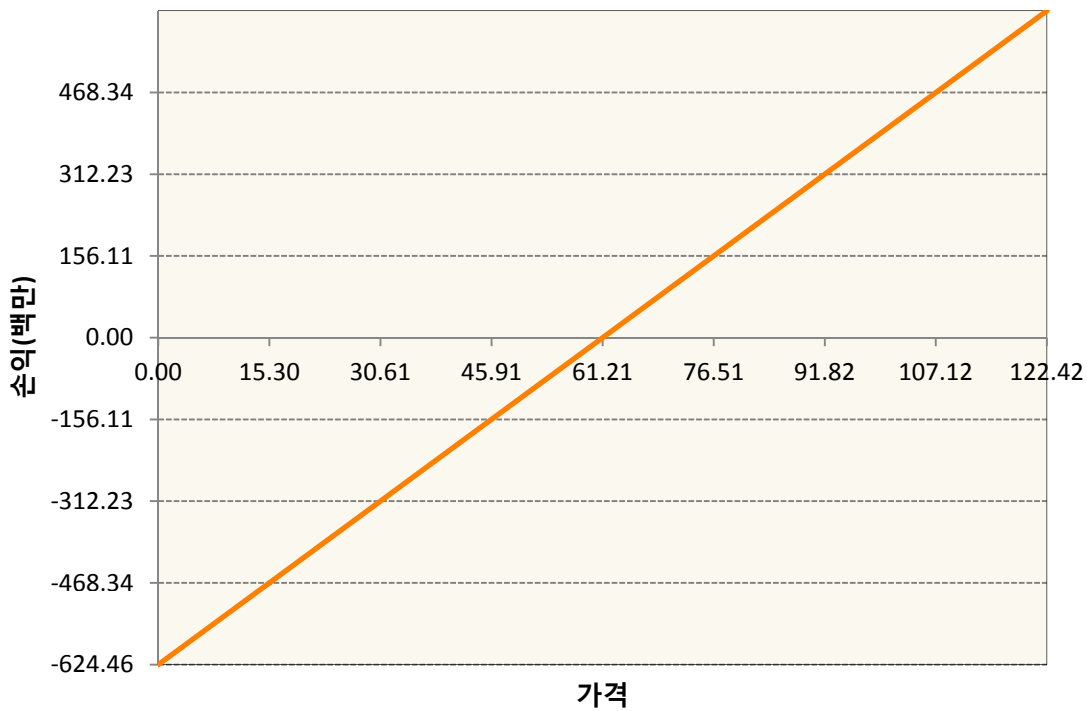
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

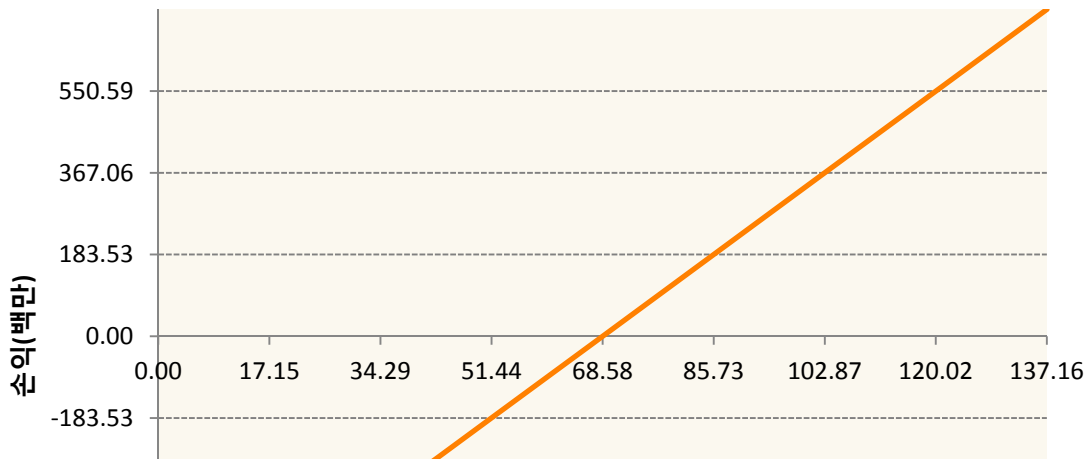
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,750	297	2,453	

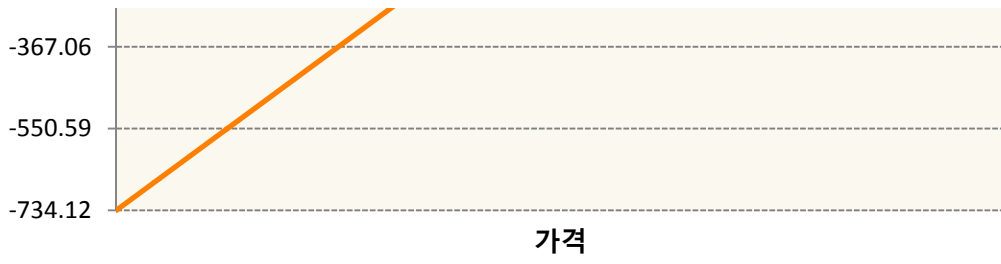
### 2. 만기시점의 손익구조

CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19

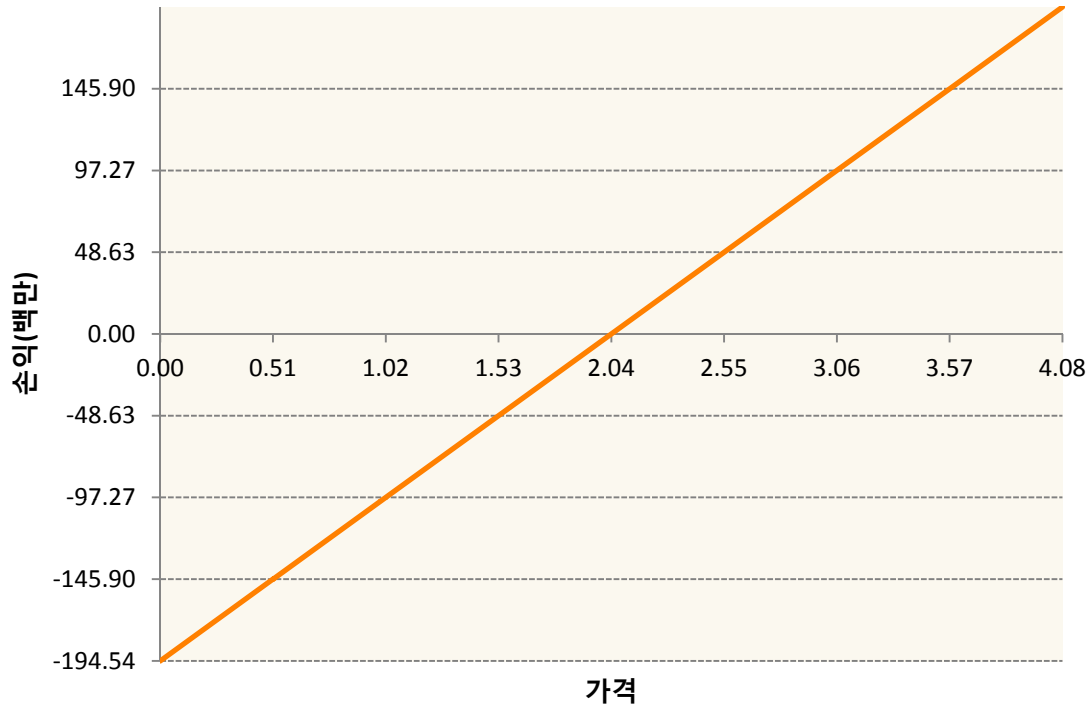


COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19

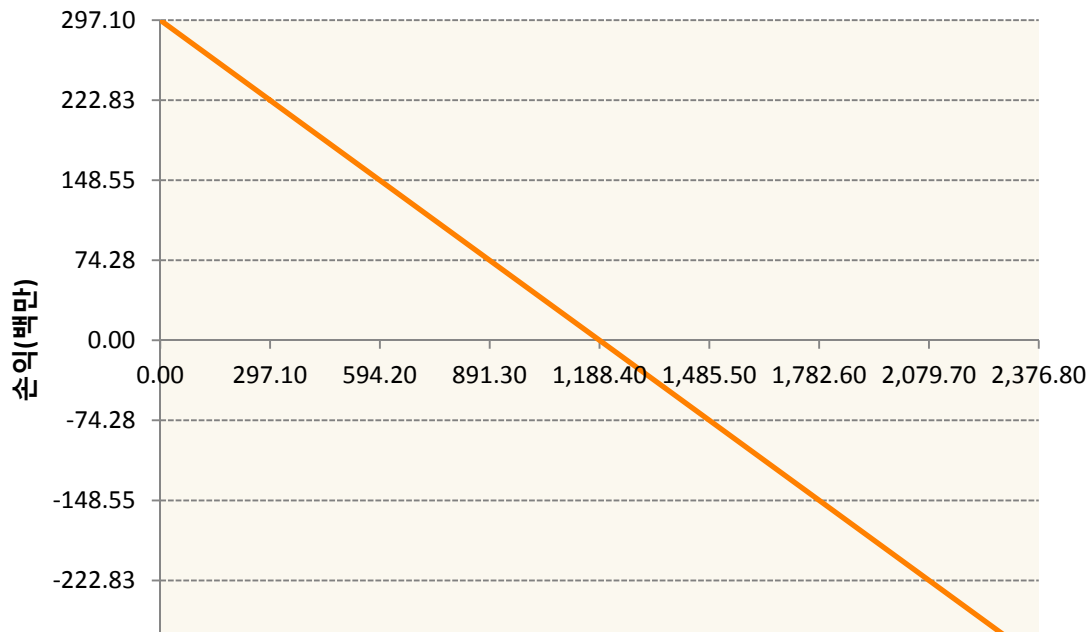


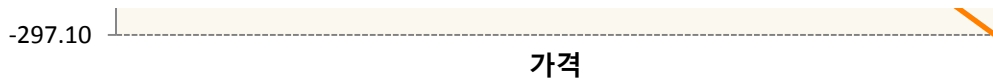


HON9-NY Harb ULSD Fut Jul19

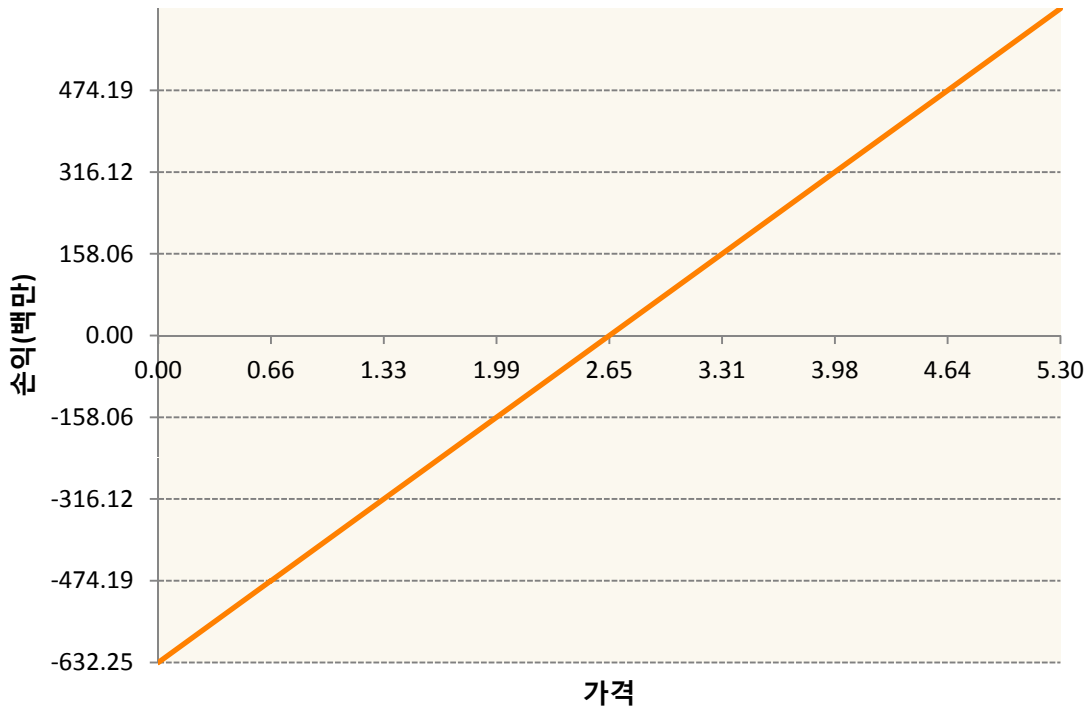


KR4175P50009-2019-05 달러선물

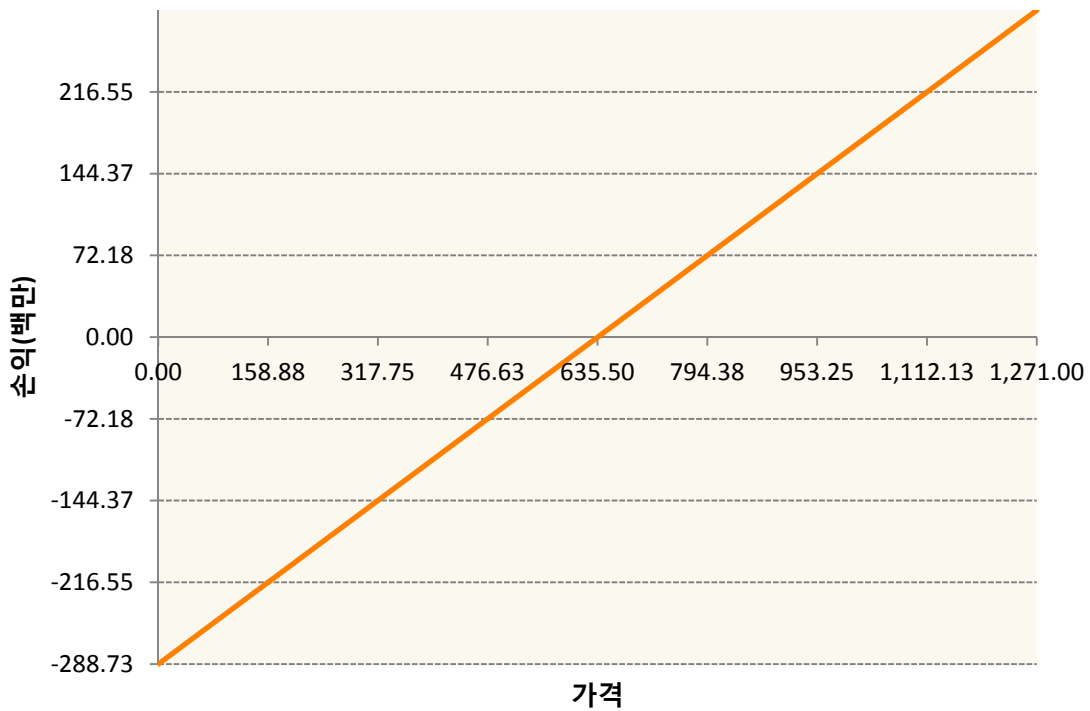




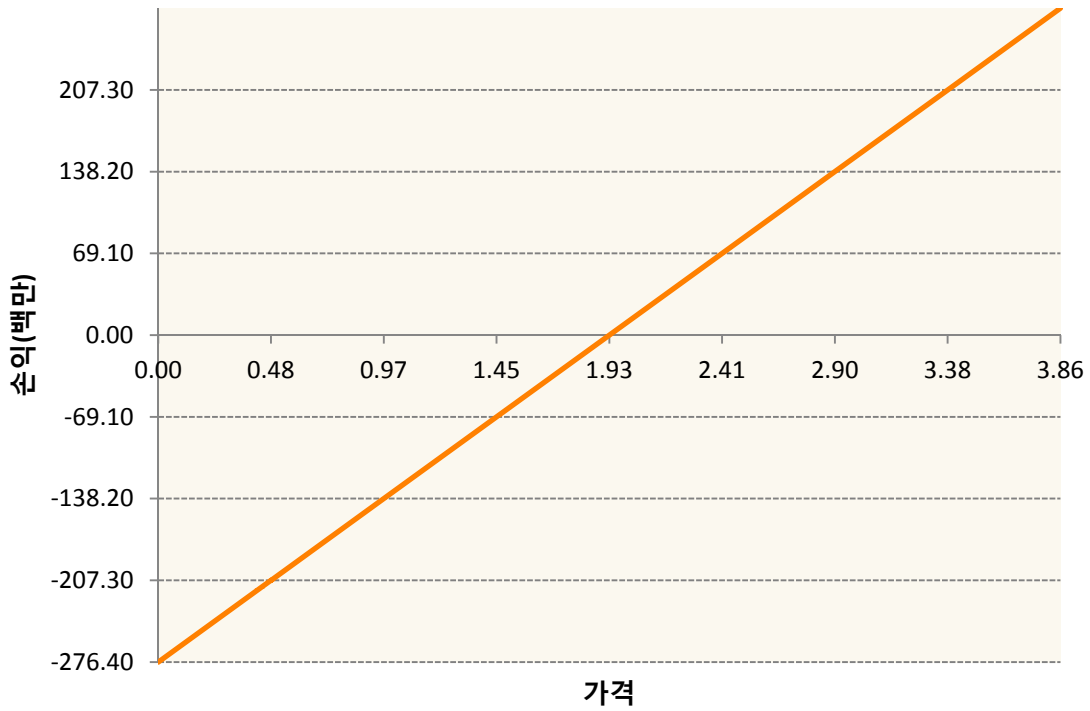
NGN19-NATURAL GAS FUTR Jul19



QSN9-Low Su Gasoil G Jul19



XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN9	WTI CRUDE FUTURE Jul19	50
COU9	BRENT CRUDE FUTR Sep19	59
HON9	NY Harb ULSD Fut Jul19	16
KR4175P500	2019-05 달러선물	24
NGN19	NATURAL GAS FUTR Jul19	51
QSN9	Low Su Gasoil G Jul19	23
XBN9	GASOLINE RBOB FUT Jul19	22

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

(단위:백만원)

405

공시일	2019-05-15
기준일	2019-05-14

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

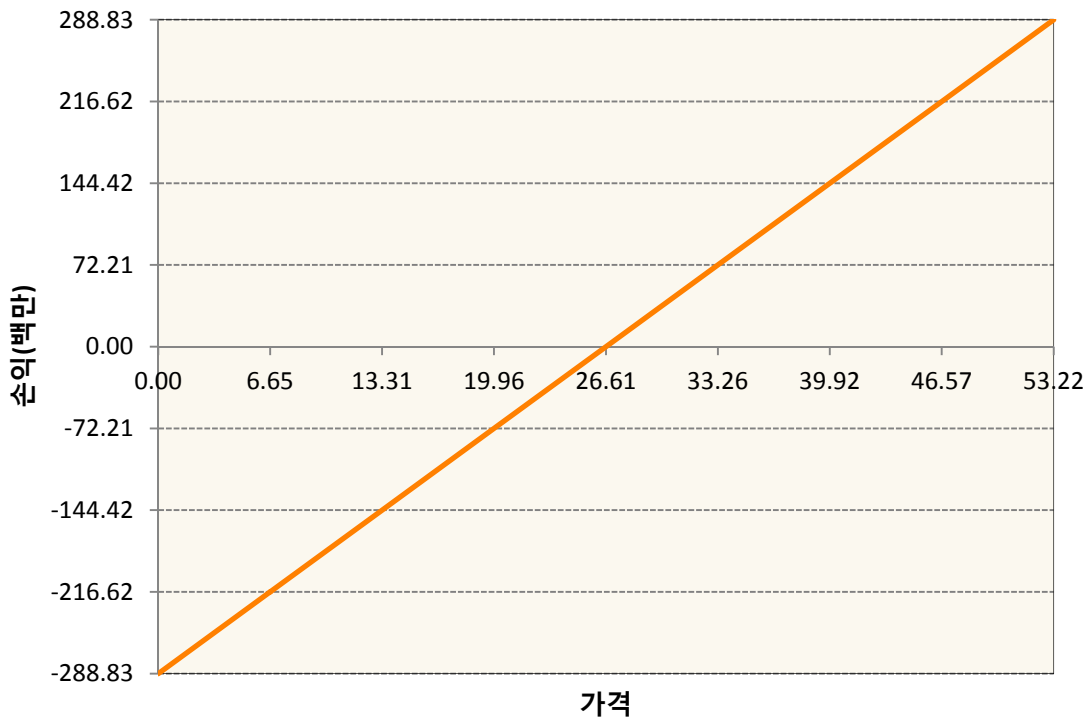
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

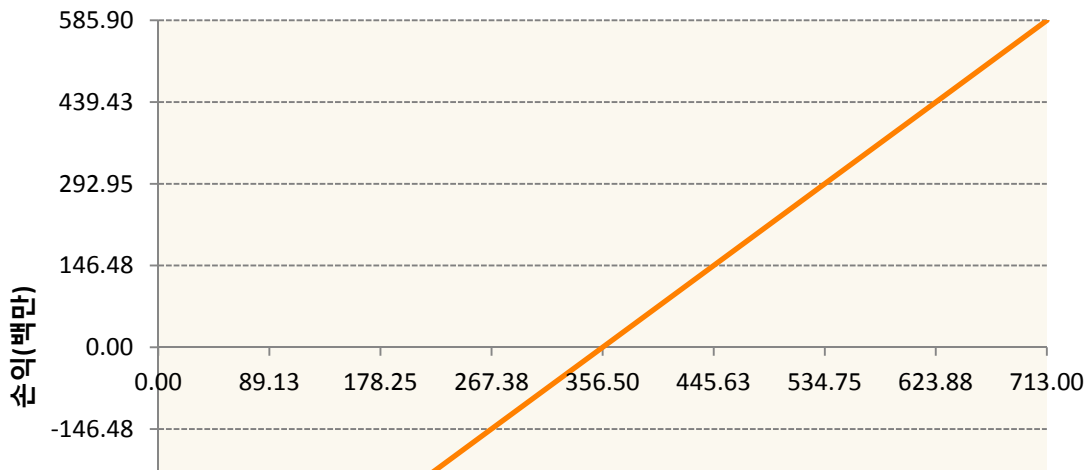
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,781	59	2,721	

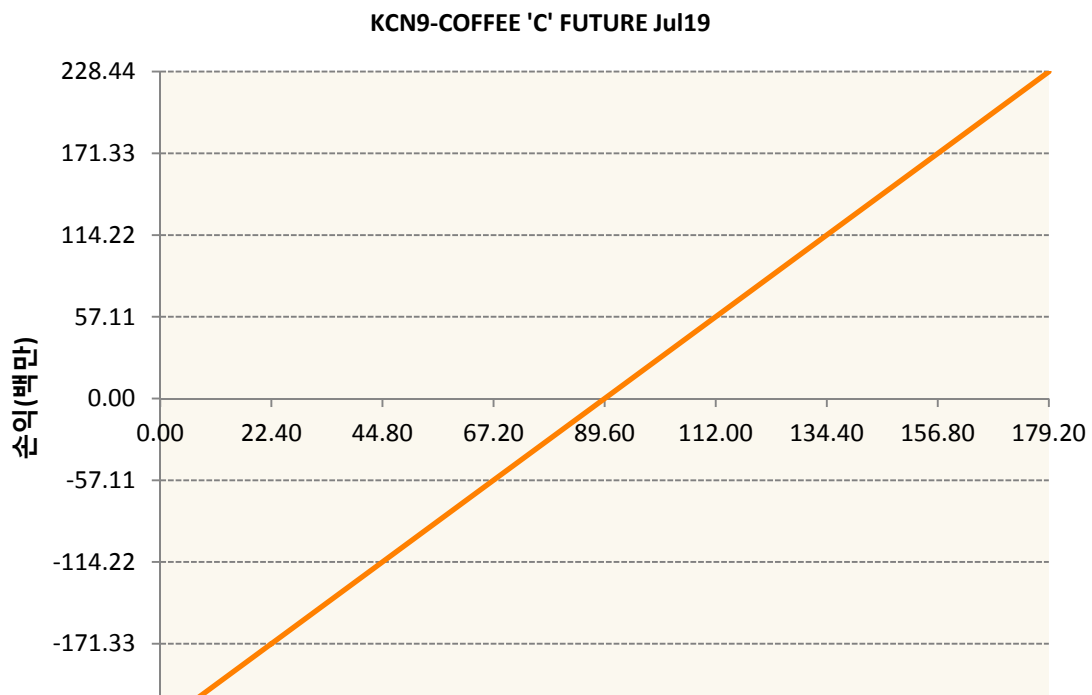
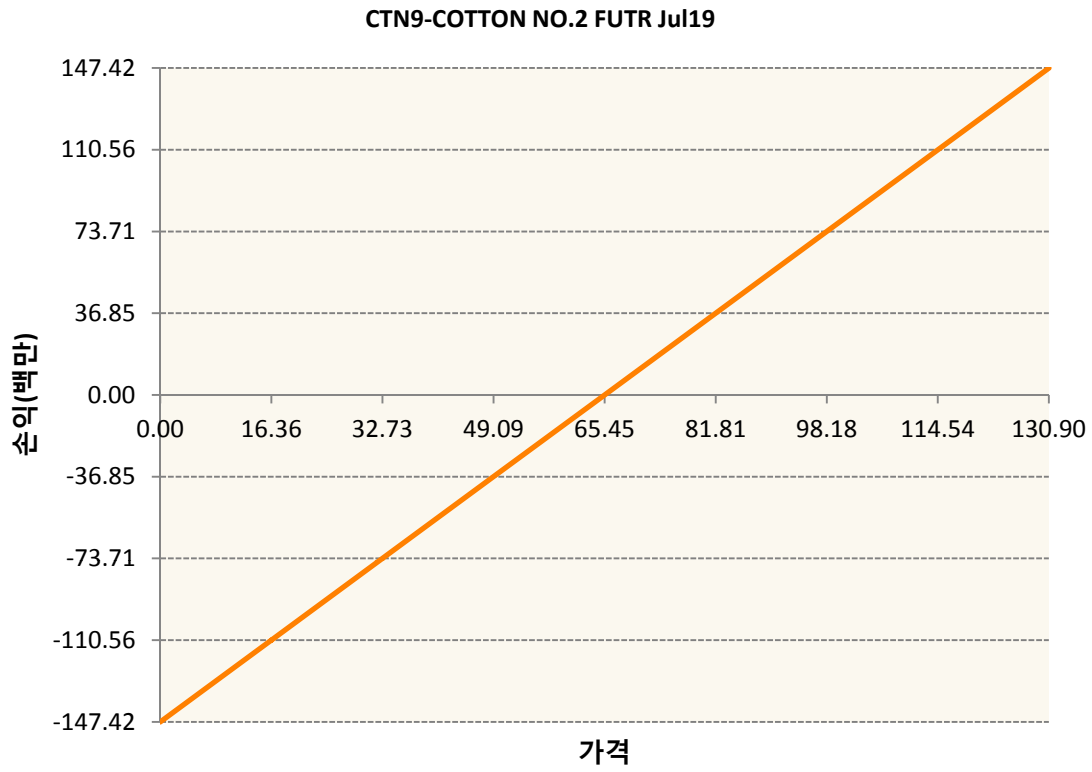
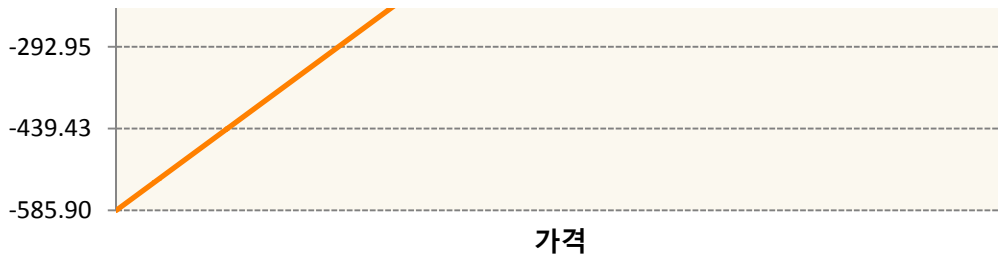
### 2. 만기시점의 손익구조

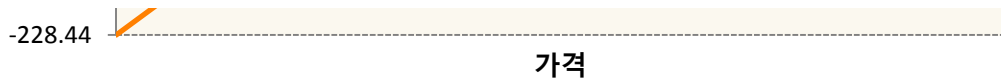
**BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19**



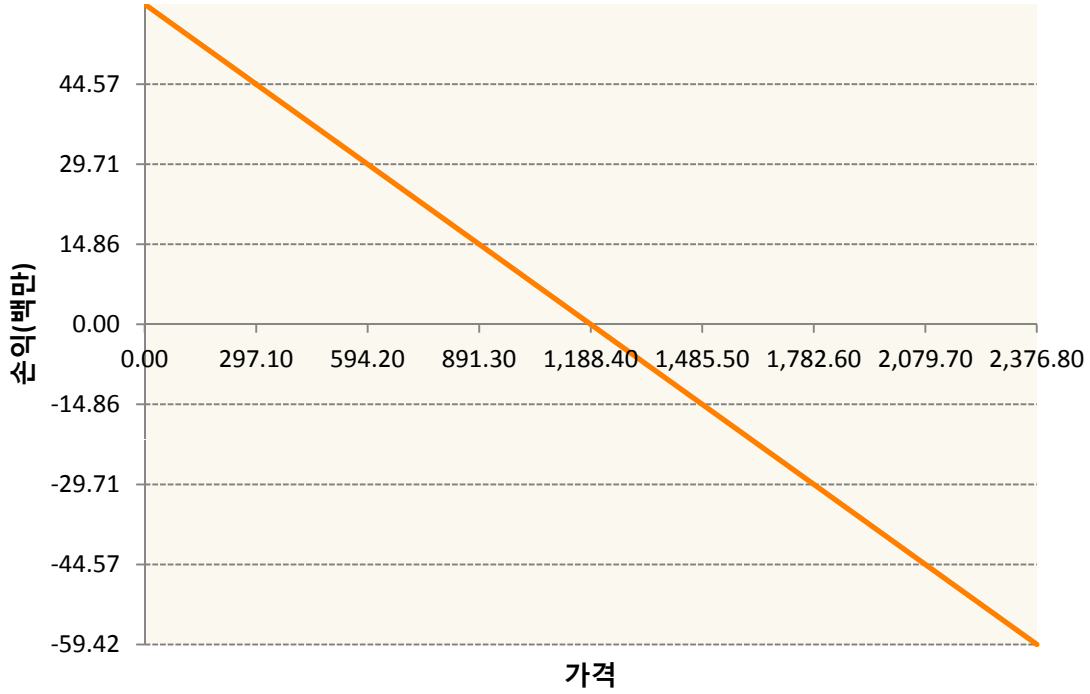
**CN9-CORN FUTURE Jul19**



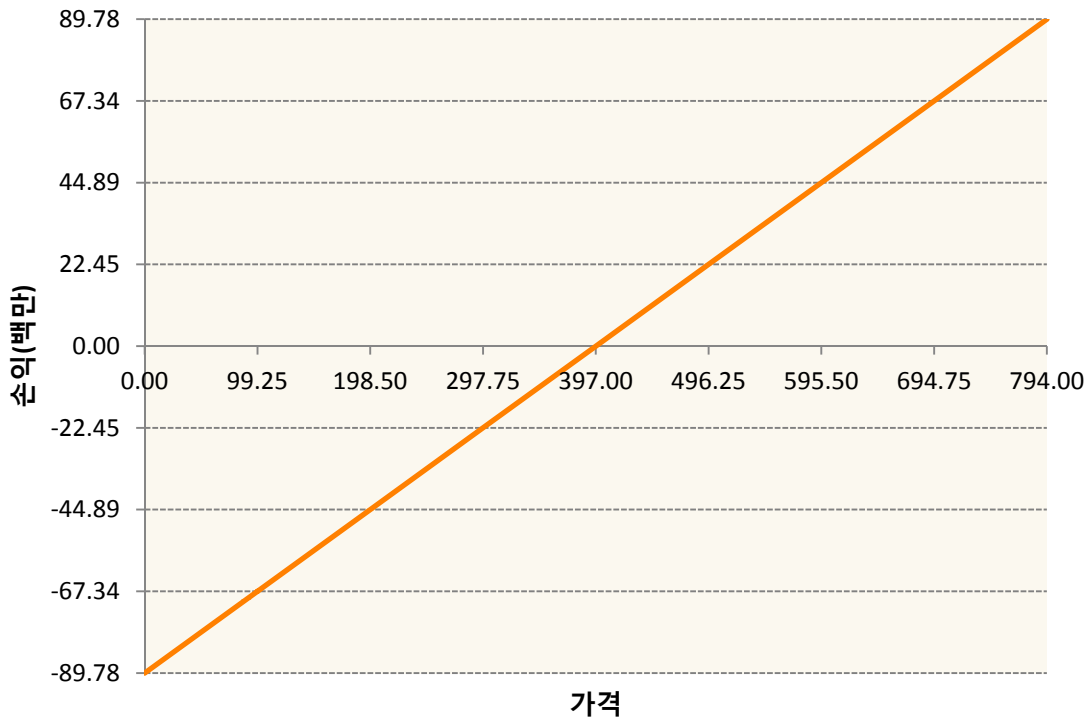




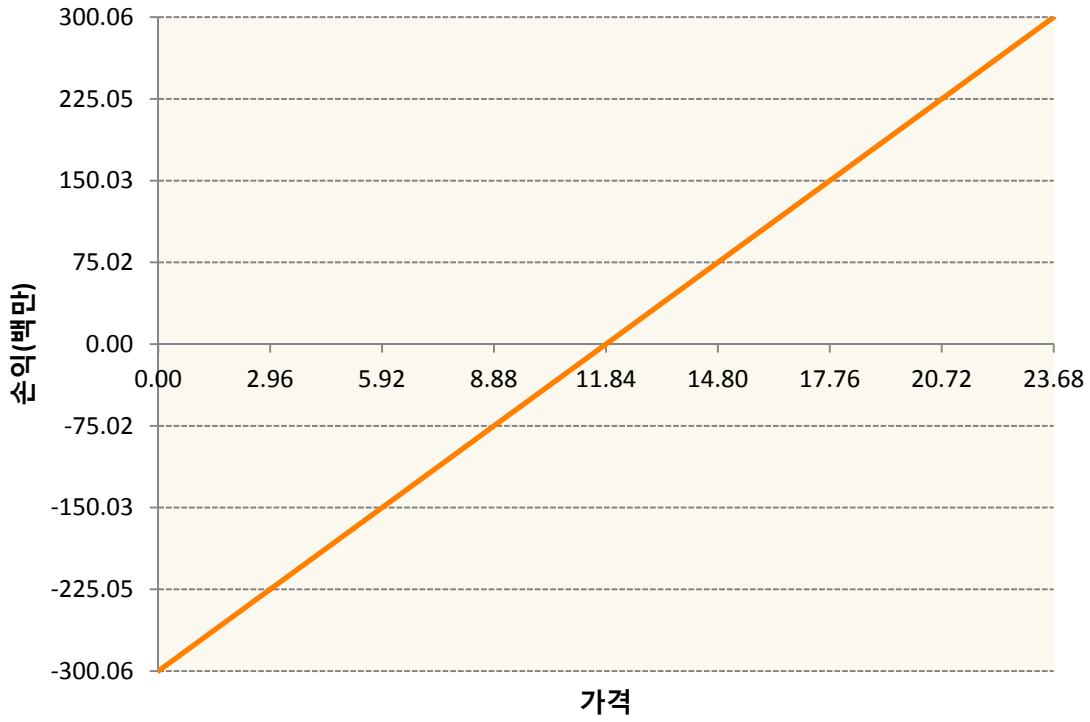
KR4175P50009-2019-05 달러선물



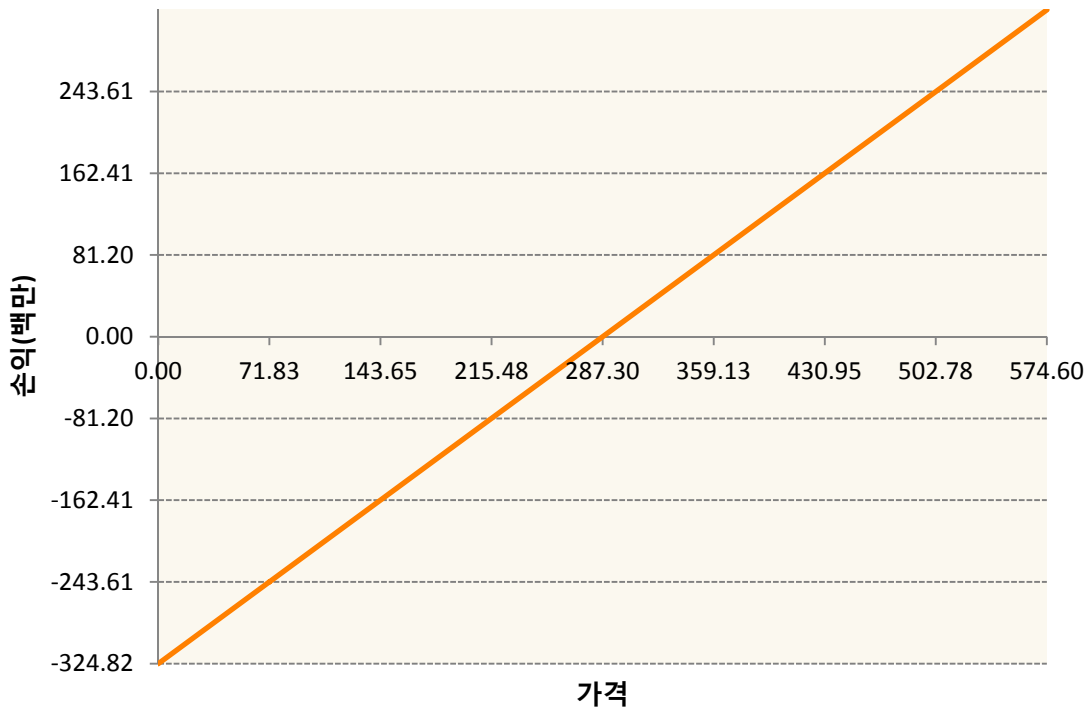
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

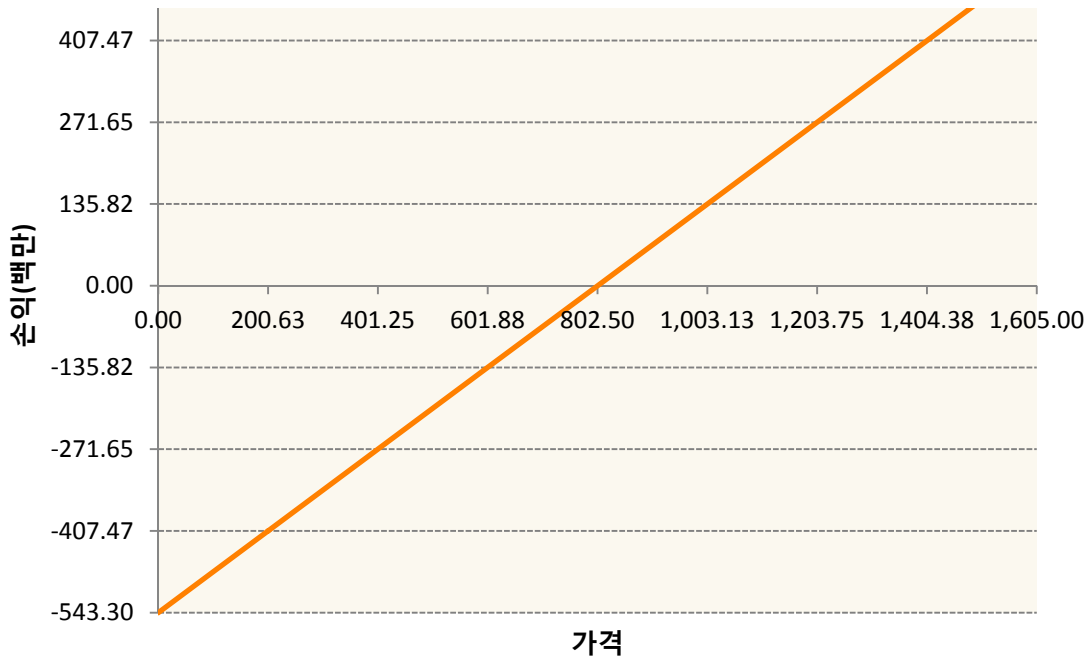


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19

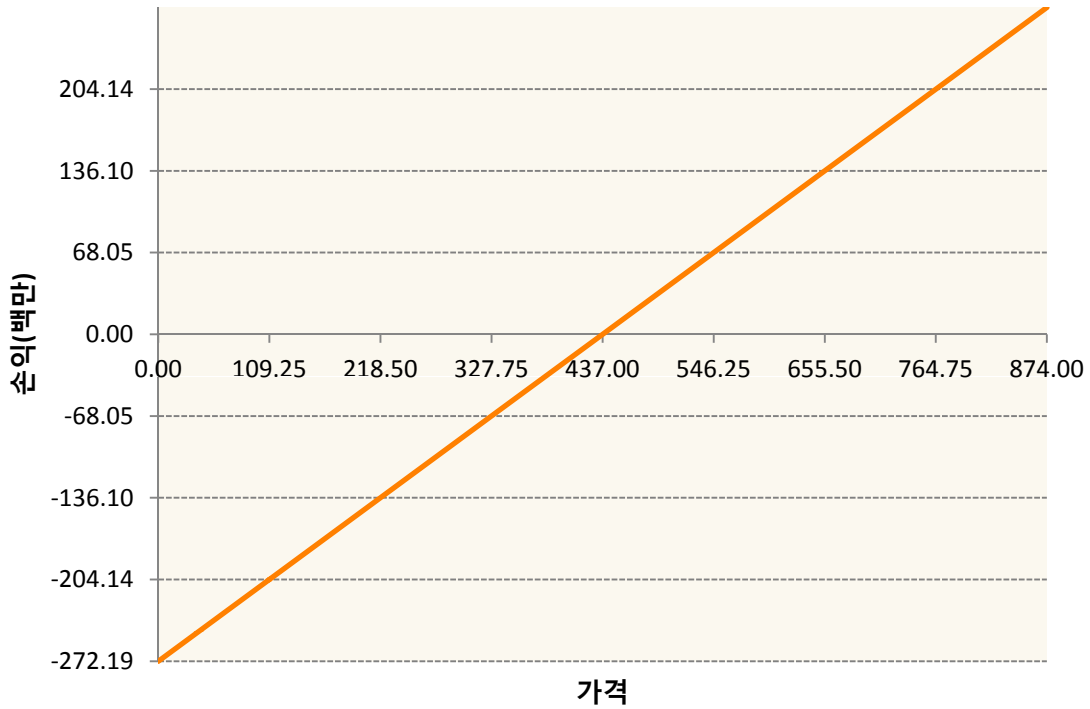


SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





WN9-WHEAT FUTURE(CBT) Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON9	SOYBEAN OIL FUTR Jul19	23
CN9	CORN FUTURE Jul19	47
CTN9	COTTON NO.2 FUTR Jul19	12
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	26
SN9	SOYBEAN FUTURE Jul19	43
WN9	WHEAT FUTURE(CBT) Jul19	22

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

(단위:백만원)

**226**