

공시일	2019-05-16
기준일	2019-05-15

## 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	2019-05-16
기준일	2019-05-15

## 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

1,126

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

671

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-05-16
기준일	2019-05-15

## 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)	309
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	85
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	145

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

<b>890</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-05-16
기준일	2019-05-15

## 유로인덱스모(주식-파생형)

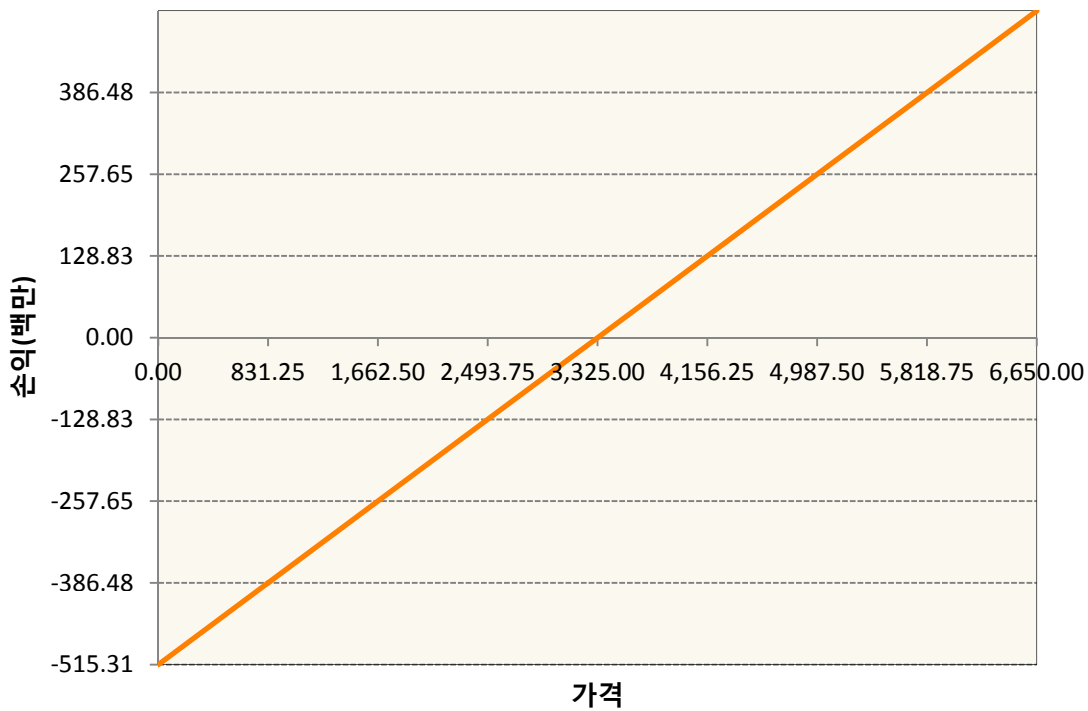
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	515	0	515	

### 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)

30
----

공시일	2019-05-16
기준일	2019-05-15

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

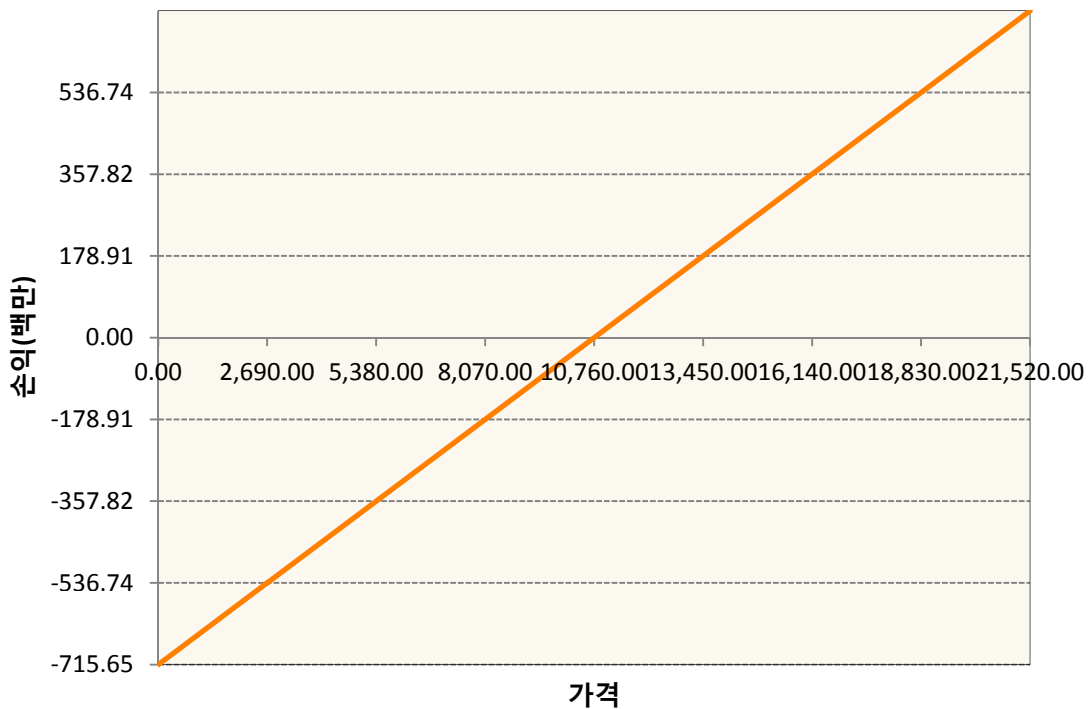
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	716	0	716	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	2019-05-16
기준일	2019-05-15

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

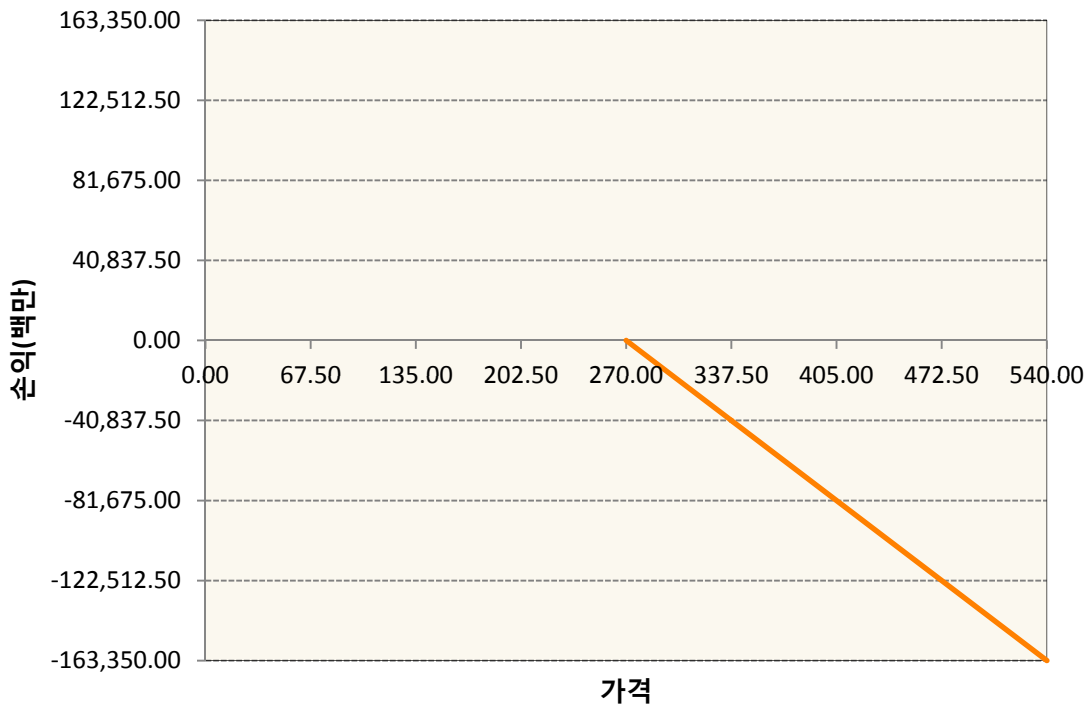
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

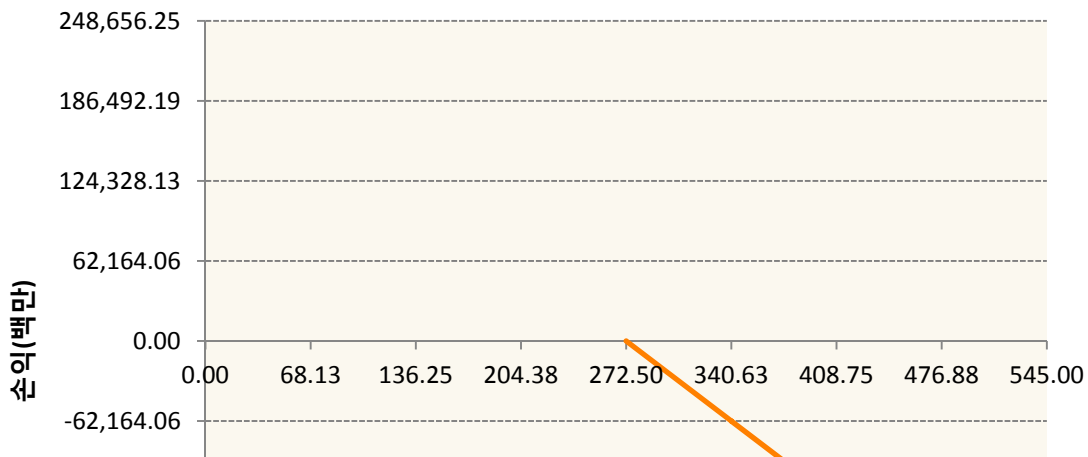
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	614,506	-614,506	장내

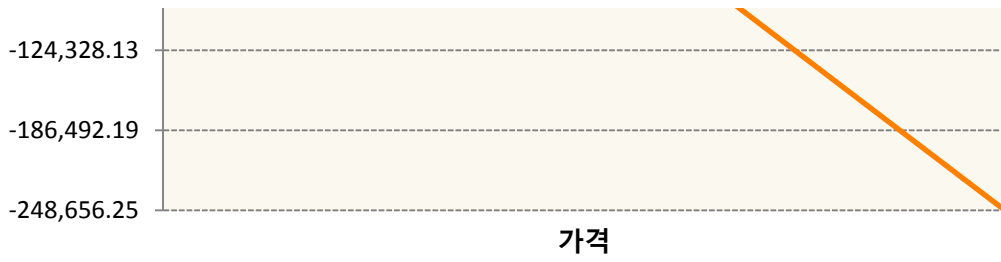
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P62701-2019-06 콜270

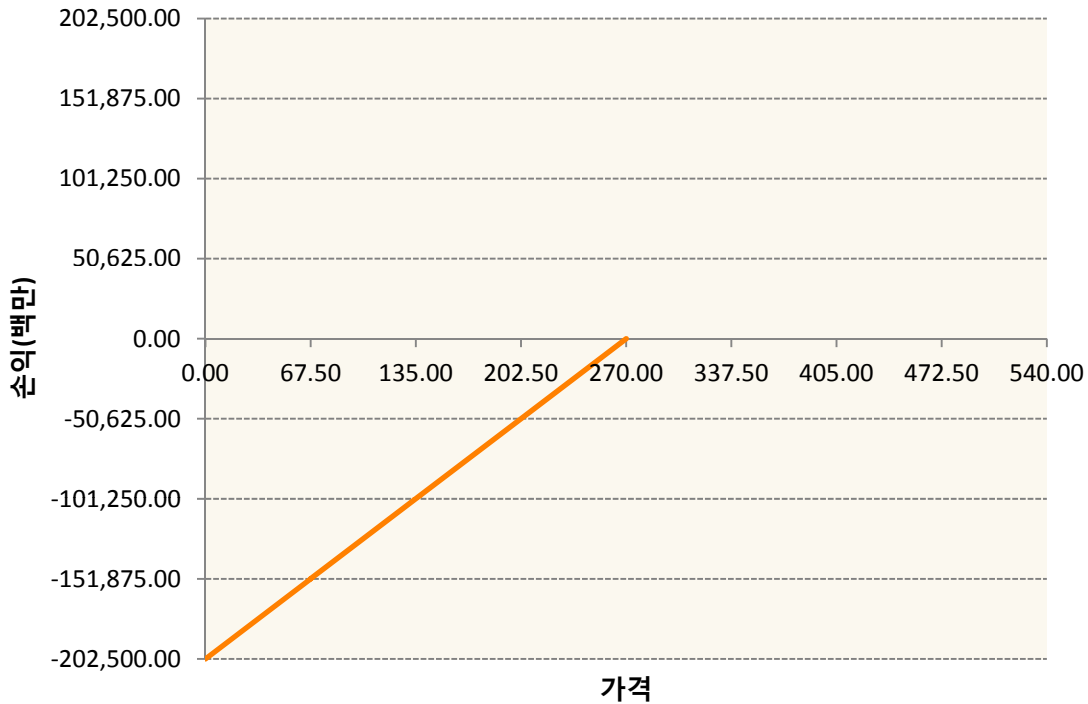


KR4201P62727-2019-06 콜272.5





KR4301P62709-2019-06 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P62701		2019-06 콜270					9,921
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,221	4,109	3,971	3,808	3,624	3,421	3,202
-5.33%	3,806	3,587	3,346	3,087	2,814	2,529	2,234
-2.67%	2,858	2,531	2,196	1,855	1,509	1,158	805
0%	1,139	759	380	0	-380	-759	-1,139
2.67%	-1,440	-1,790	-2,145	-2,506	-2,870	-3,236	-3,606
5.33%	-4,768	-5,027	-5,307	-5,602	-5,911	-6,229	-6,557
8.00%	-8,613	-8,772	-8,959	-9,170	-9,403	-9,654	-9,921
KR4201P62727		2019-06 콜272.5					14,218
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,438	5,308	5,140	4,935	4,696	4,427	4,131

-5.33%	4,983	4,707	4,393	4,047	3,675	3,281	2,867
-2.67%	3,866	3,418	2,950	2,467	1,972	1,467	954
0%	1,698	1,134	568	0	-569	-1,138	-1,709
2.67%	-1,745	-2,307	-2,873	-3,441	-4,012	-4,584	-5,158
5.33%	-6,395	-6,845	-7,319	-7,810	-8,315	-8,832	-9,358
8.00%	-11,952	-12,248	-12,585	-12,955	-13,353	-13,776	-14,218
KR4301P62709                      2019-06 풋270							12,911
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,548	-12,570	-12,607	-12,659	-12,727	-12,811	-12,911
-5.33%	-7,309	-7,407	-7,527	-7,668	-7,827	-8,002	-8,191
-2.67%	-2,589	-2,821	-3,066	-3,322	-3,585	-3,855	-4,131
0%	952	635	317	0	-317	-635	-952
2.67%	2,952	2,691	2,421	2,142	1,858	1,568	1,274
5.33%	3,748	3,615	3,458	3,281	3,086	2,877	2,654
8.00%	3,966	3,921	3,858	3,774	3,670	3,548	3,409

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

(단위:백만원)

**36,199**

공시일	2019-05-16
기준일	2019-05-15

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

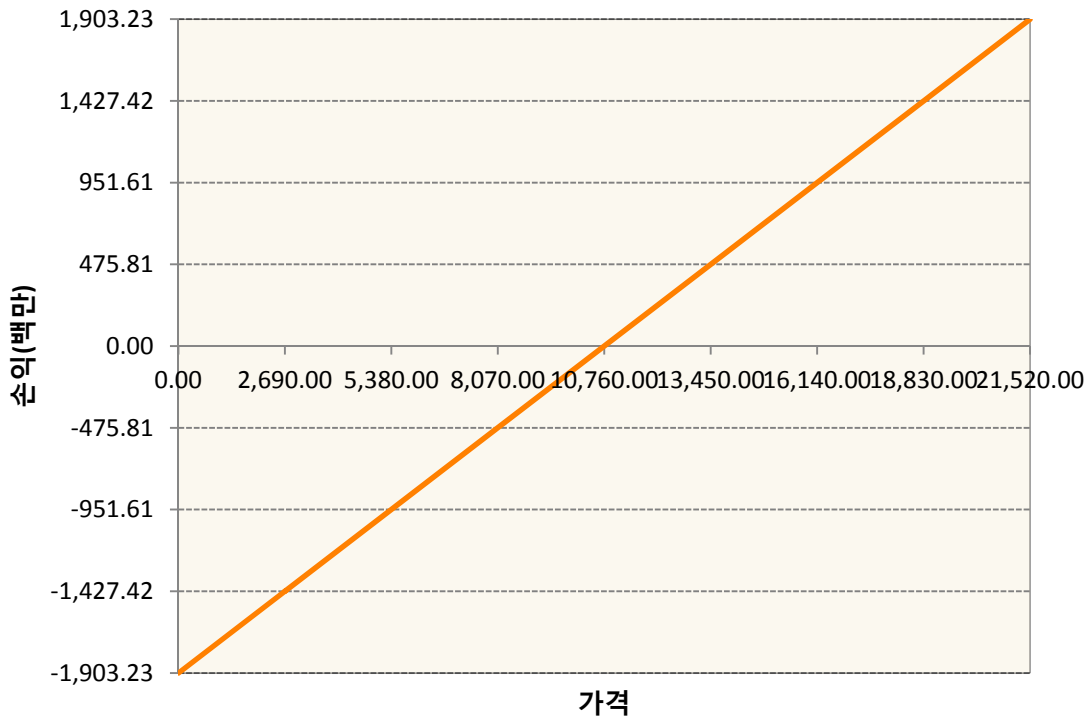
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

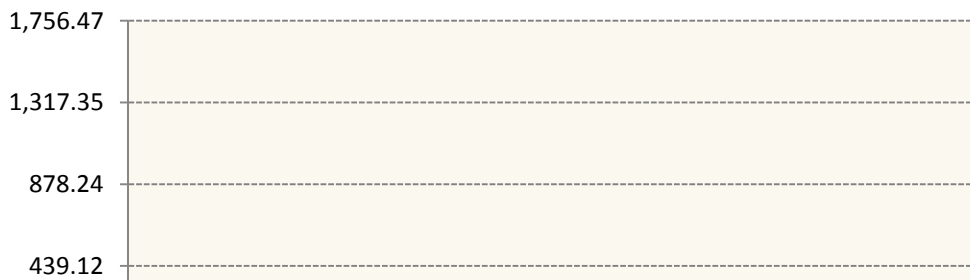
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,903	0	1,903	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,639	-5,639	장내
누계	통화	선도	0	3,180	-3,180	장외

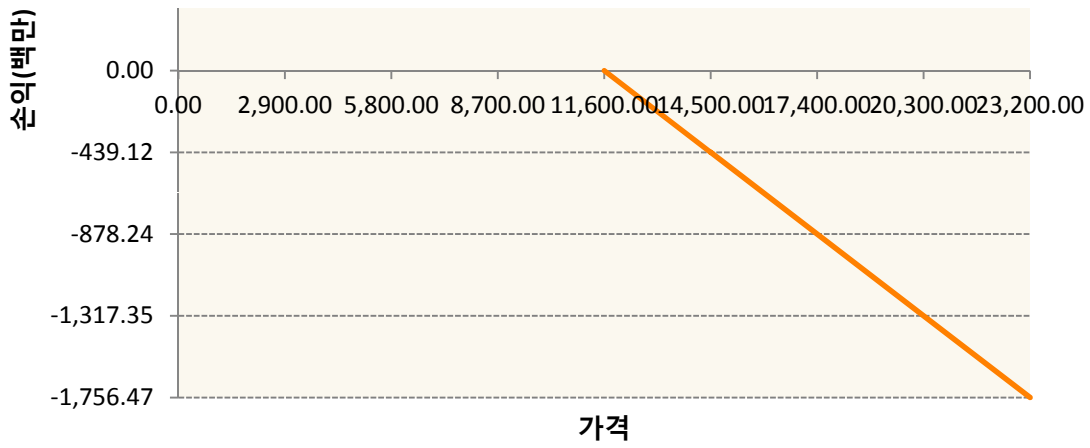
### 2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19

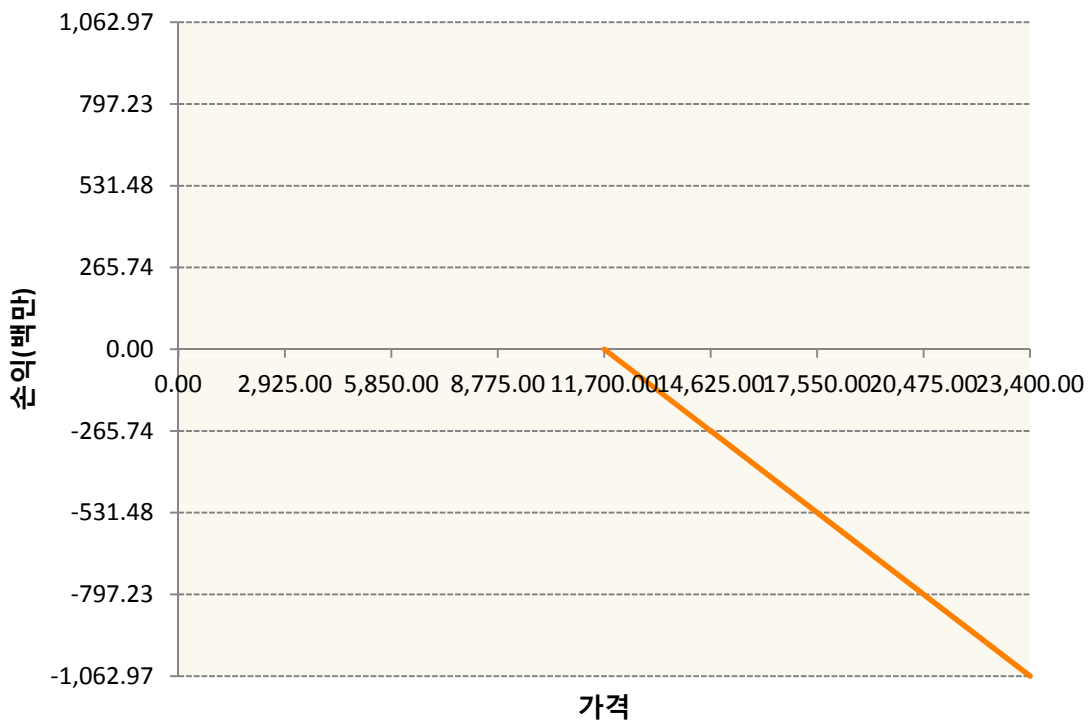


OHHIK9-C116-HSCEI

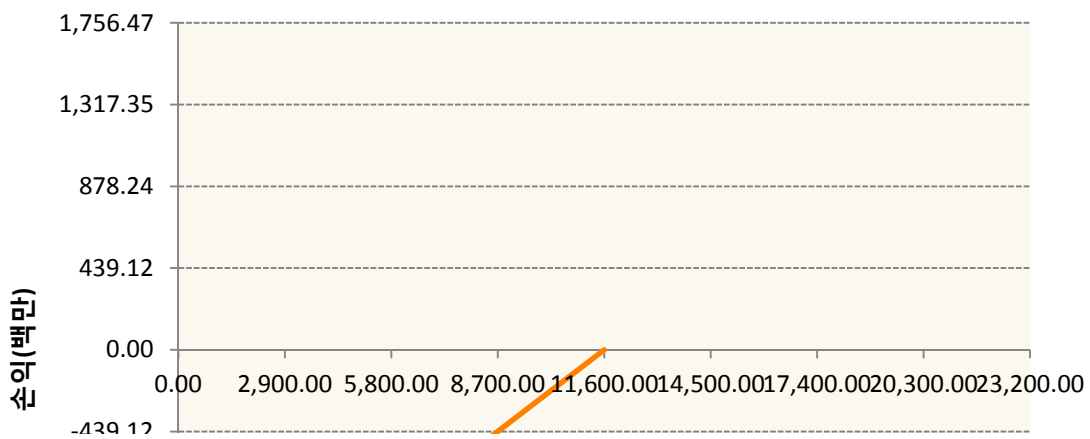


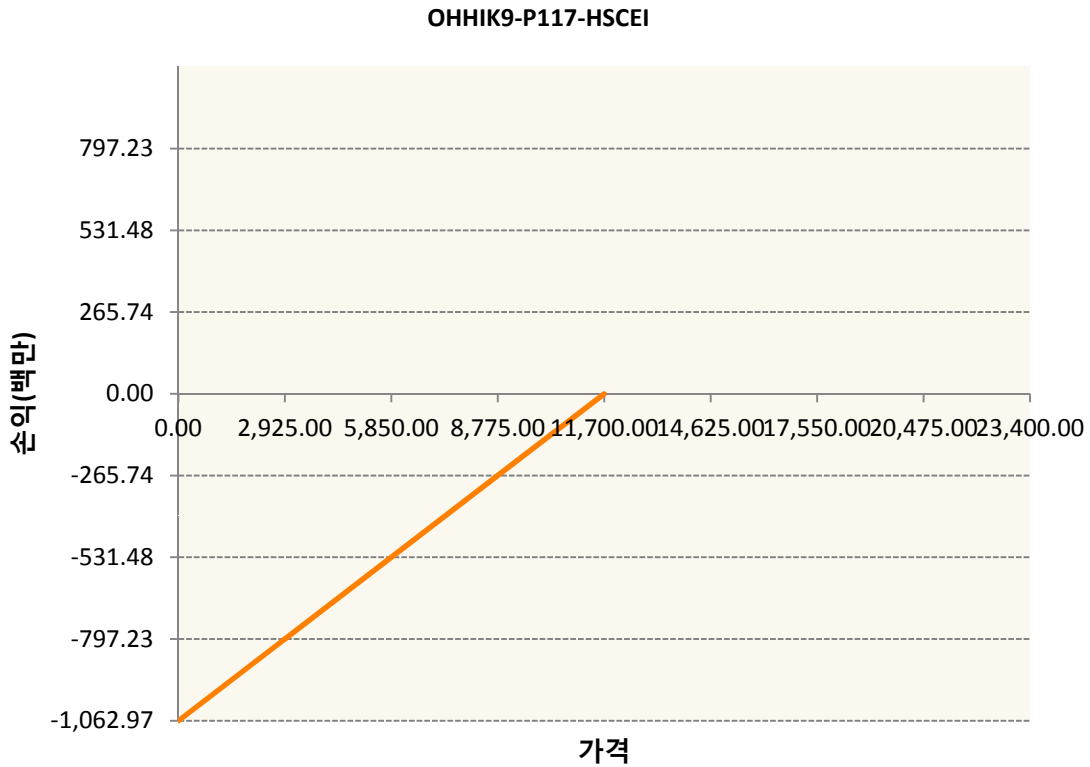


OHHIK9-C117-HSCEI



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	152
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)
	706

공시일	2019-05-16
기준일	2019-05-15

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

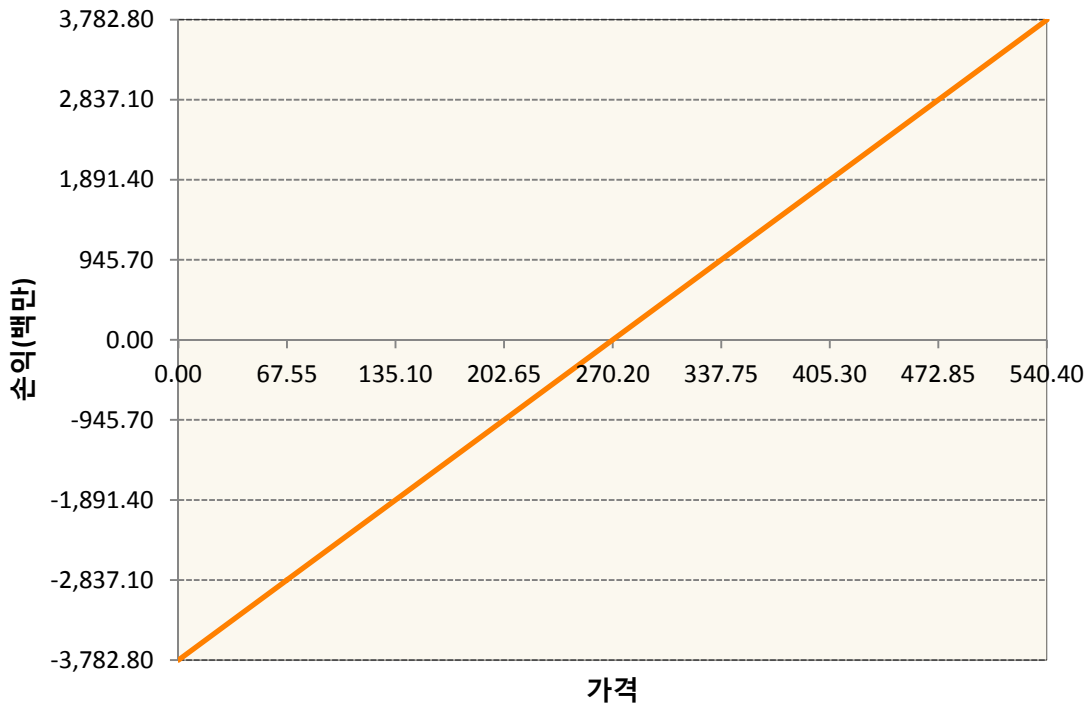
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

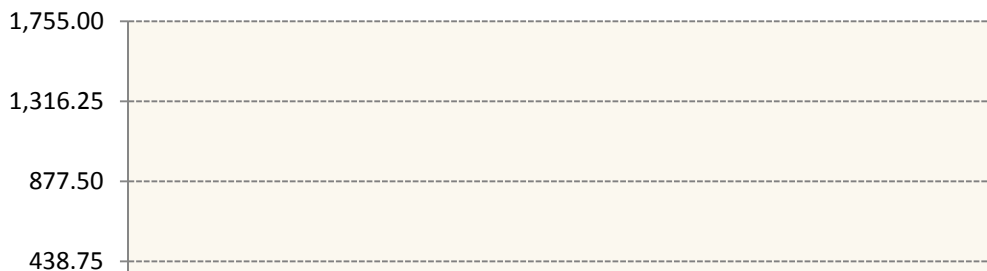
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,783	0	3,783	장내
누계	유가증권	스왑	26,836	0	26,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,476	-25,476	장내

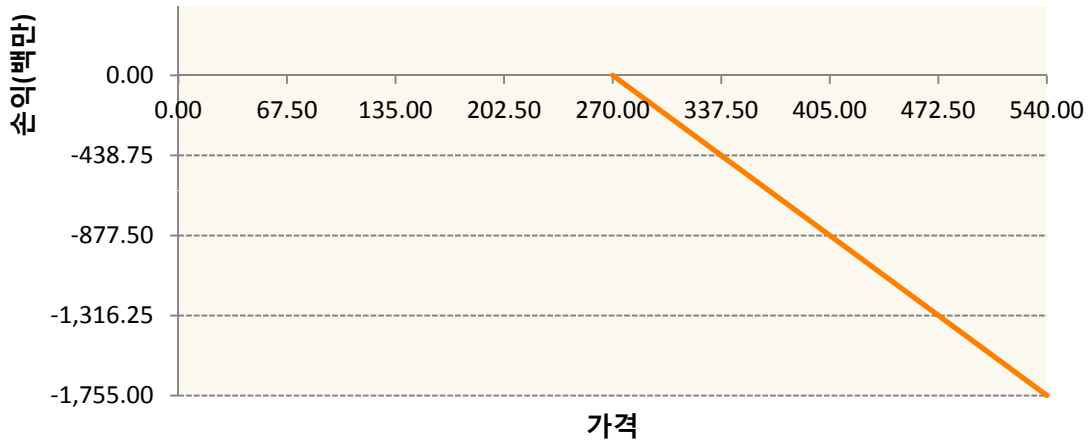
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

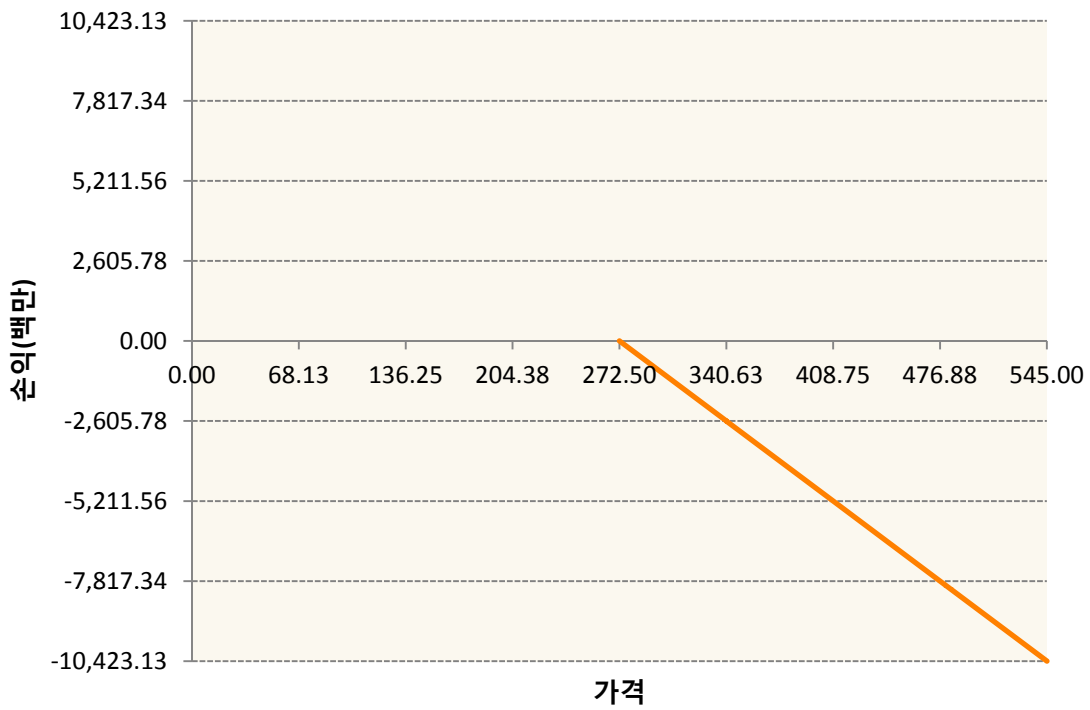


KR4201P62701-2019-06 콜270

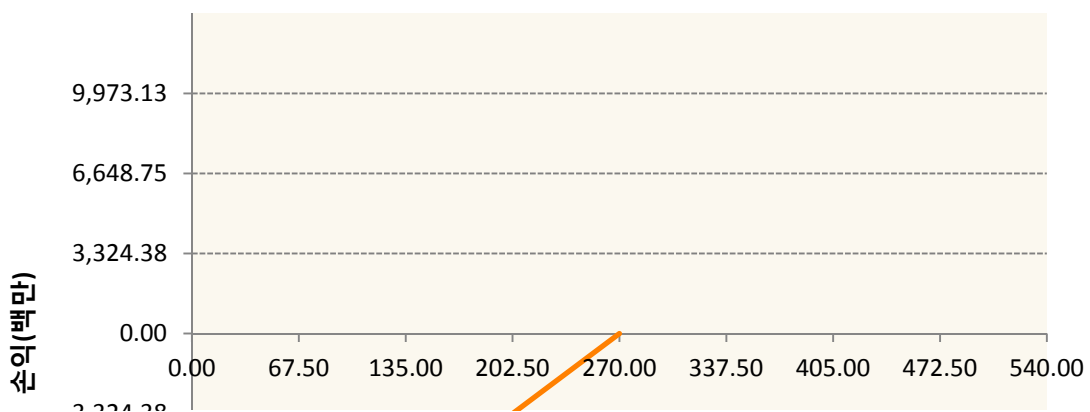


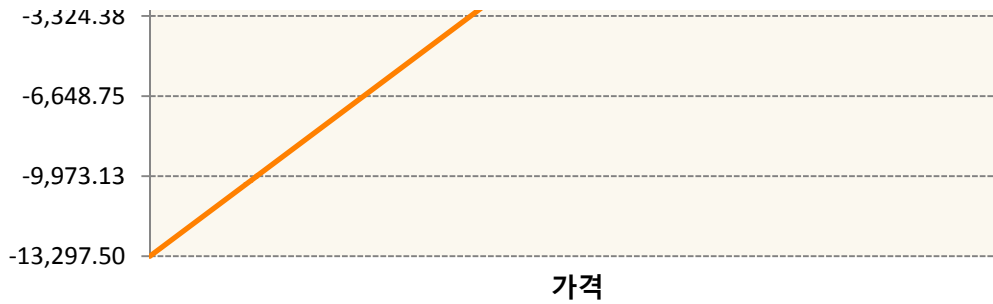


KR4201P62727-2019-06 콜272.5



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						302
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-302	-302	-302	-302	-302	-302	-302	
-5.33%	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-201	
-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%	201	201	201	201	201	201	201	
8.00%	302	302	302	302	302	302	302	
KR4201P62701		2019-06 콜270						107
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	45	44	43	41	39	37	34
-5.33%	41	39	36	33	30	27	24
-2.67%	31	27	24	20	16	12	9
0%	12	8	4	0	-4	-8	-12
2.67%	-15	-19	-23	-27	-31	-35	-39
5.33%	-51	-54	-57	-60	-64	-67	-70
8.00%	-93	-94	-96	-99	-101	-104	-107
KR4201P62727                      2019-06 콜272.5							596
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	228	223	215	207	197	186	173
-5.33%	209	197	184	170	154	138	120
-2.67%	162	143	124	103	83	61	40
0%	71	48	24	0	-24	-48	-72
2.67%	-73	-97	-120	-144	-168	-192	-216
5.33%	-268	-287	-307	-327	-349	-370	-392
8.00%	-501	-513	-528	-543	-560	-577	-596
KR4301P62709                      2019-06 풋270							848
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-824	-825	-828	-831	-836	-841	-848
-5.33%	-480	-486	-494	-504	-514	-525	-538
-2.67%	-170	-185	-201	-218	-235	-253	-271
0%	62	42	21	0	-21	-42	-63
2.67%	194	177	159	141	122	103	84
5.33%	246	237	227	215	203	189	174
8.00%	260	258	253	248	241	233	224

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

(단위:백만원)

**4,102**

공시일	2019-05-16
기준일	2019-05-15

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

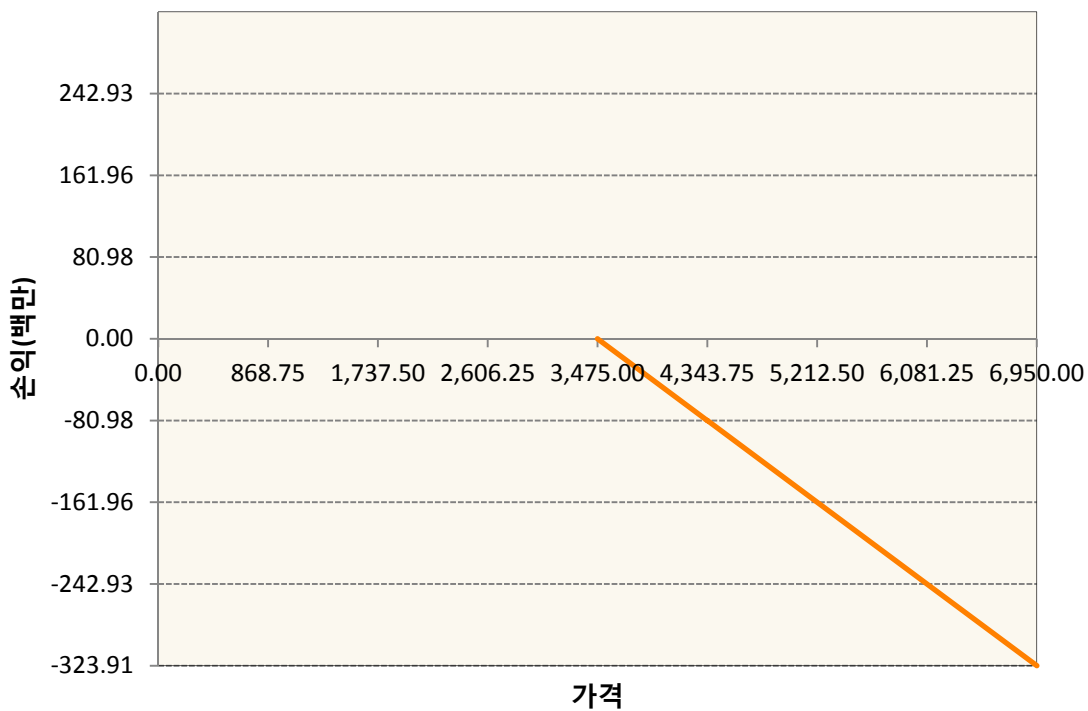
### 1. 계약금액

(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	4,788	0	4,788	
누계	유가증권	스왑	56,365	0	56,365	장외
누계	유가증권	옵션	0	22,739	-22,739	장내
누계	통화	선도	0	18,642	-18,642	장외

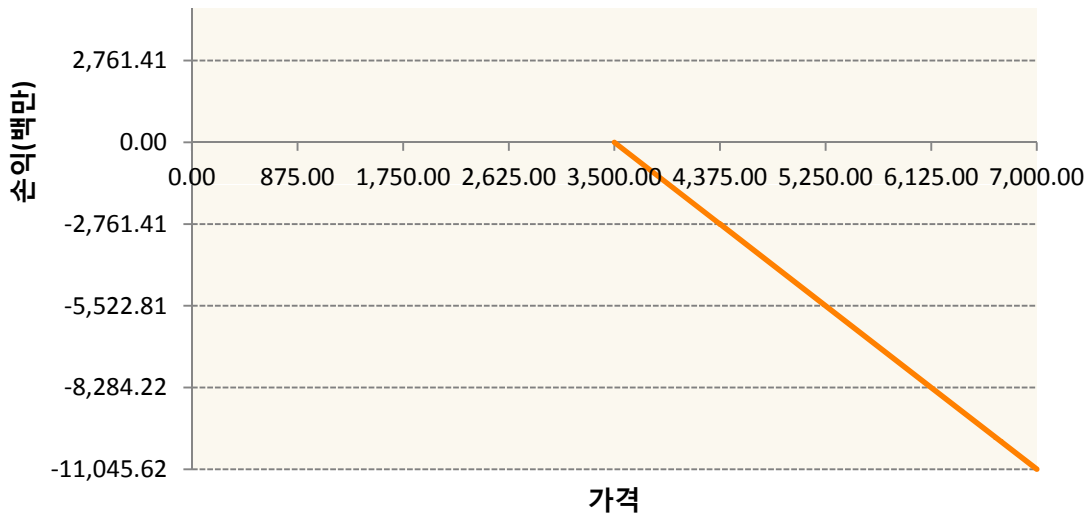
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXK9-C3475-EURO STOXX 50

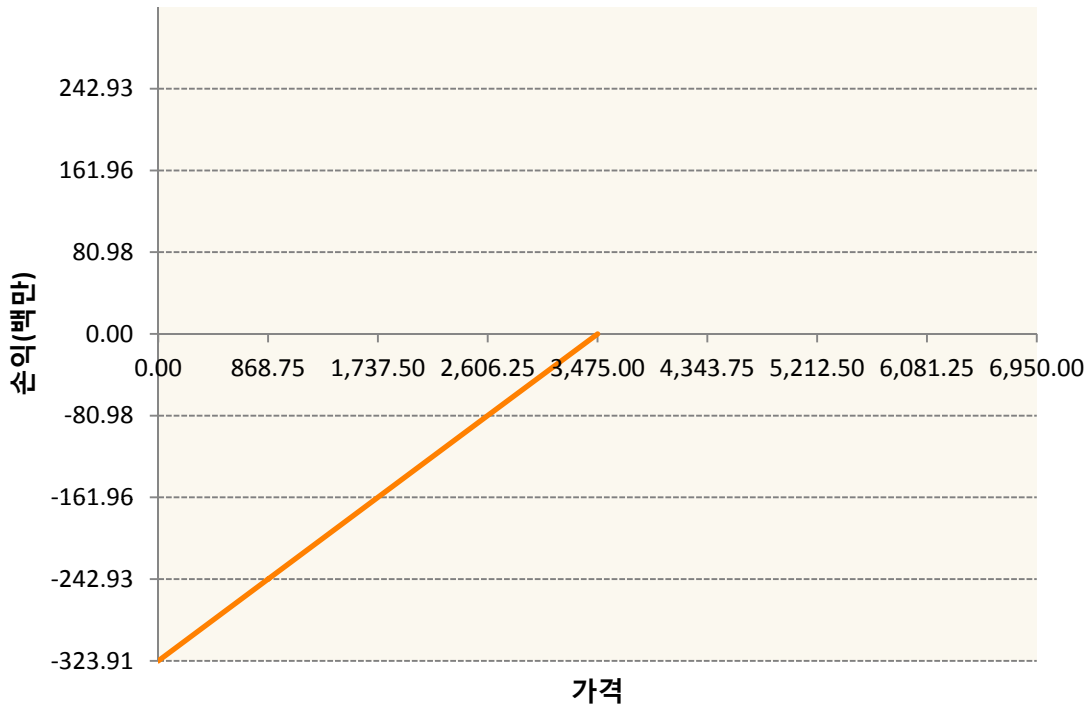


OESXK9-C3500-EURO STOXX 50



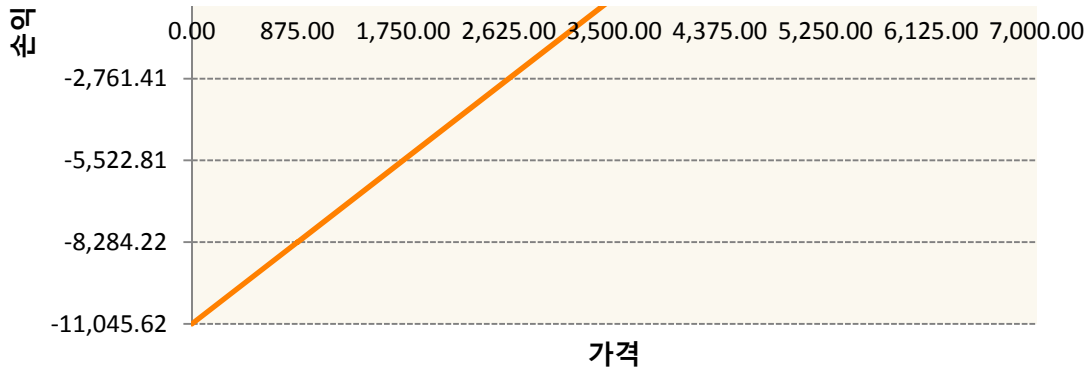


OESXK9-P3475-EURO STOXX 50

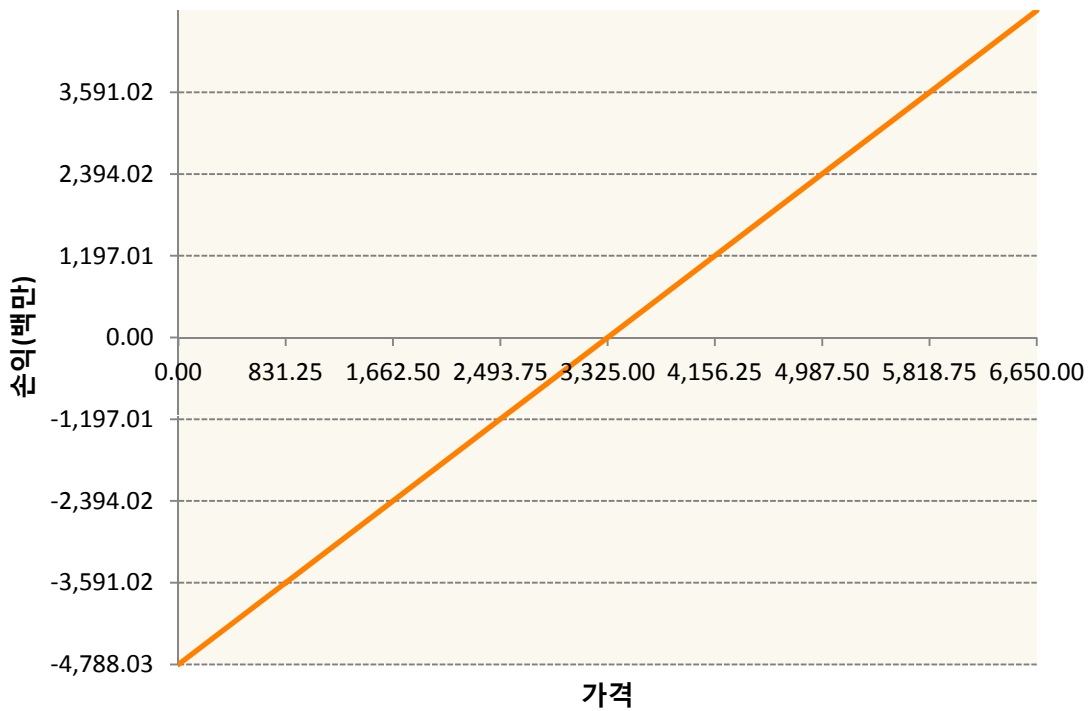


OESXK9-P3500-EURO STOXX 50





VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	116
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	426
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	852
FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E	213
OESXK9-C34 EURO STOXX 50	26
OESXK9-C35 EURO STOXX 50	884
OESXK9-P34 EURO STOXX 50	26
OESXK9-P35 EURO STOXX 50	884
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	383

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

(단위:백만원)

2,447



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

(단위:백만원)

1,032



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	2019-05-16
기준일	2019-05-15

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

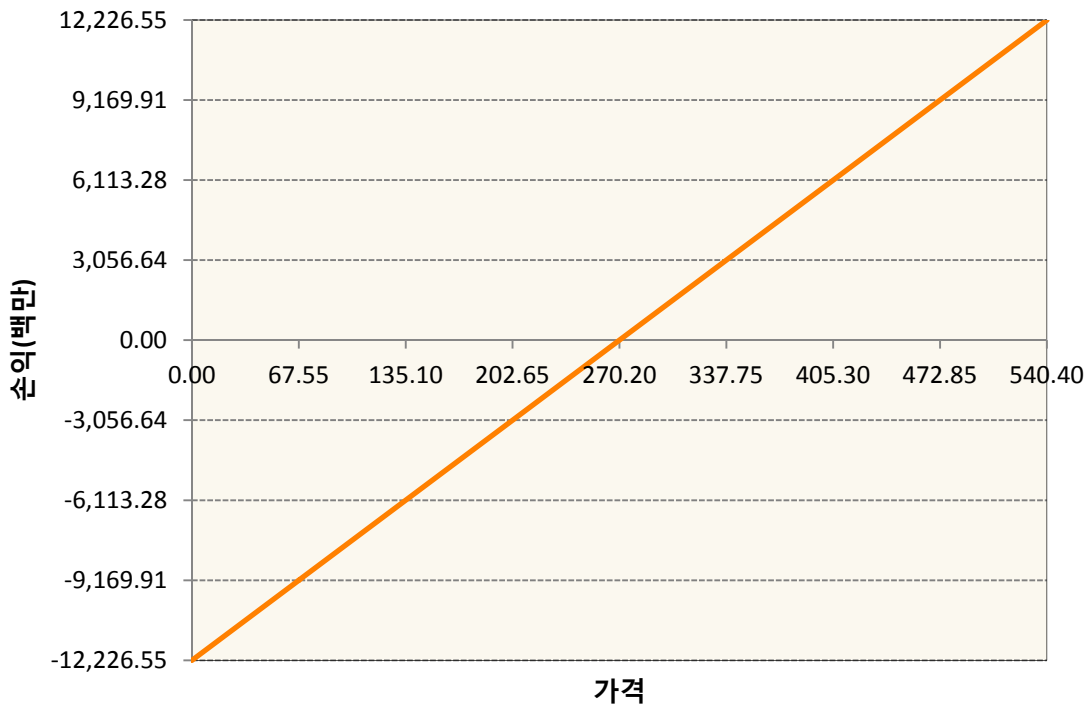
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

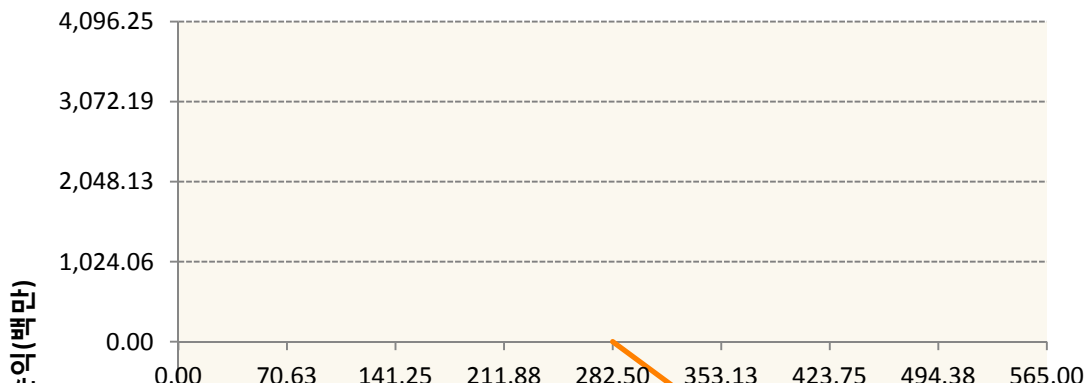
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,227	0	12,227	장내
누계	유가증권	옵션	5,081	22,906	-17,825	장내

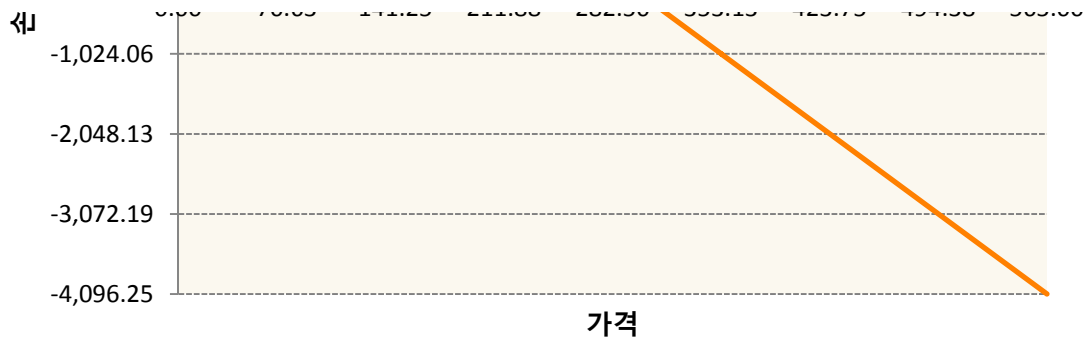
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

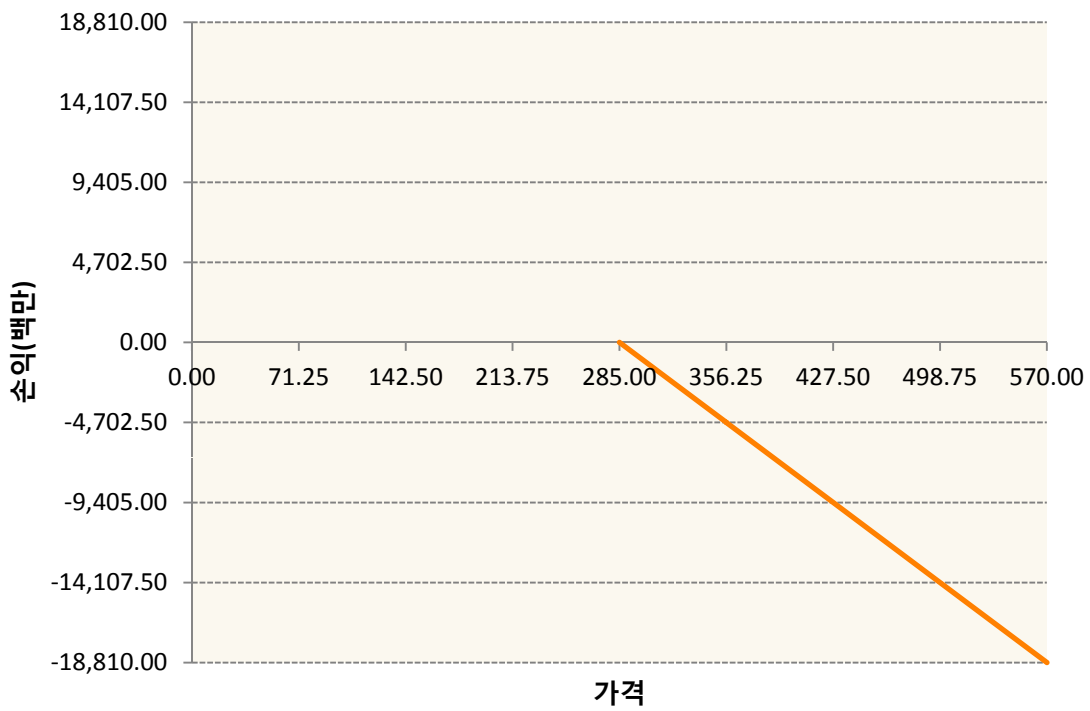


KR4201P62826-2019-06 콜282.5

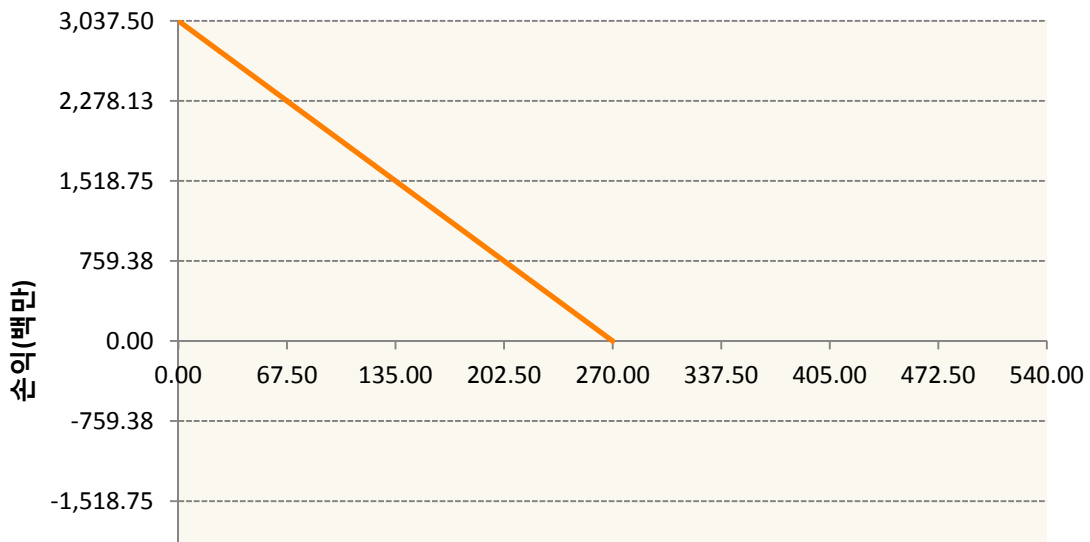


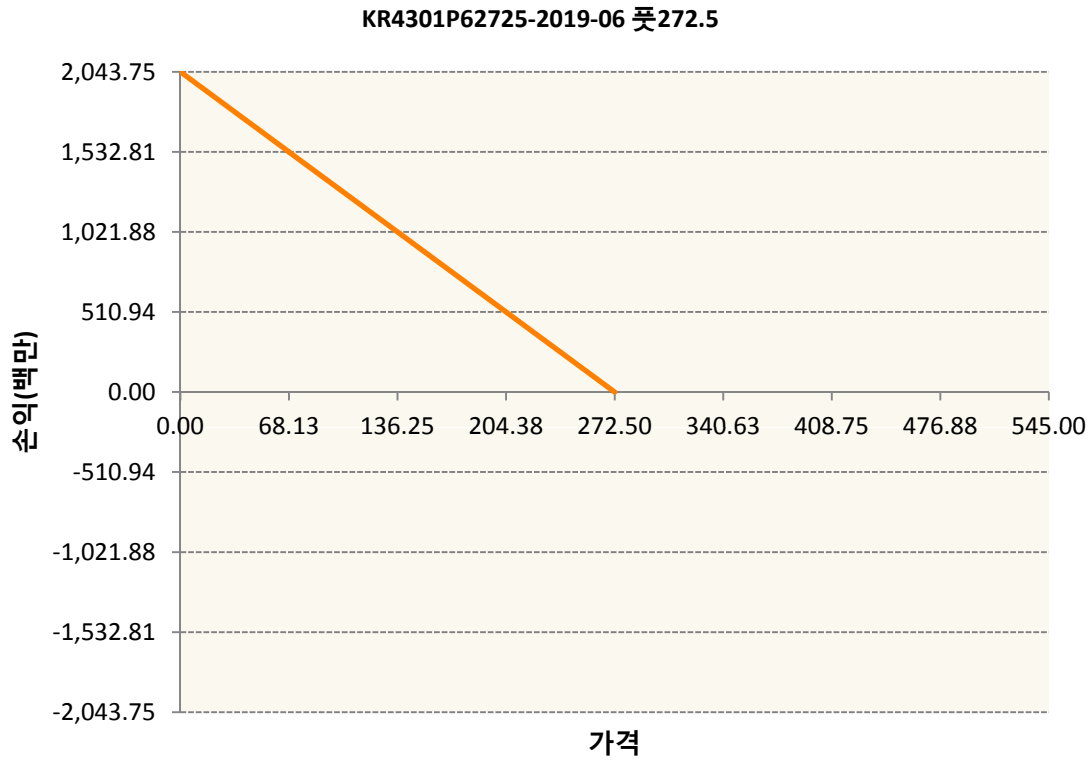
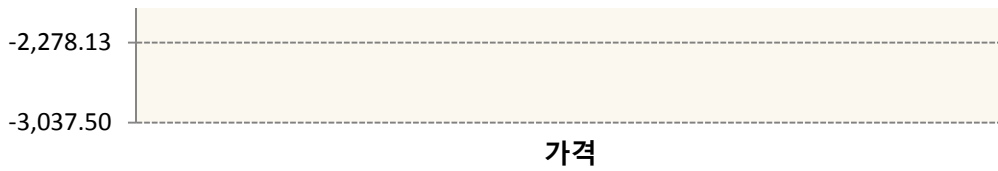


KR4201P62859-2019-06 콜285



KR4301P62709-2019-06 풋270





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

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						976
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-976	-976	-976	-976	-976	-976	-976	
-5.33%	-651	-651	-651	-651	-651	-651	-651	
-2.67%	-325	-325	-325	-325	-325	-325	-325	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	325	325	325	325	325	325	325	
5.33%	651	651	651	651	651	651	651	
8.00%	976	976	976	976	976	976	976	
KR4201P62826		2019-06 콜282.5						173
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	41	41	40	39	37	35	32	
-5.33%	40	38	36	33	30	26	21	
-2.67%	34	31	26	21	16	10	4	

0%	21	14	7	0	-8	-15	-23
2.67%	-7	-16	-25	-34	-43	-52	-61
5.33%	-54	-64	-73	-83	-92	-102	-111
8.00%	-121	-129	-138	-146	-155	-164	-173
KR4201P62859                      2019-06 콜285							727
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	153	151	148	144	137	128	118
-5.33%	148	143	135	124	111	95	78
-2.67%	131	117	101	81	59	35	9
0%	84	58	30	0	-32	-65	-99
2.67%	-20	-57	-95	-134	-174	-214	-255
5.33%	-202	-246	-289	-333	-377	-420	-464
8.00%	-474	-515	-557	-599	-641	-684	-727
KR4301P62709                      2019-06 풋270							194
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	188	189	189	190	191	192	194
-5.33%	110	111	113	115	117	120	123
-2.67%	39	42	46	50	54	58	62
0%	-14	-10	-5	0	5	10	14
2.67%	-44	-40	-36	-32	-28	-24	-19
5.33%	-56	-54	-52	-49	-46	-43	-40
8.00%	-59	-59	-58	-57	-55	-53	-51
KR4301P62725                      2019-06 풋272.5							136
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	134	134	134	134	135	135	136
-5.33%	80	81	82	83	84	86	87
-2.67%	31	33	35	37	39	42	44
0%	-9	-6	-3	0	3	6	9
2.67%	-35	-32	-29	-25	-22	-19	-16
5.33%	-46	-44	-42	-40	-38	-35	-33
8.00%	-50	-49	-48	-47	-46	-44	-42

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

(단위:백만원)

**1,746**

공시일	2019-05-16
기준일	2019-05-15

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	238	0	238	
누계	유가증권	수익증권	9,904	0	9,904	

### 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	2019-05-16
기준일	2019-05-15

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	30,763	-30,763	
누계	유가증권	수익증권	59,375	0	59,375	

### 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	2019-05-16
기준일	2019-05-15

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	8,320	0	8,320	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	222,726	0	222,726	
누계	통화	선도	0	269,337	-269,337	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		1,331
FX21019J019 KRW/USD 17-05-19E		1,426
FX21019J019 KRW/USD 18-06-19E		380
FX21019J020 KRW/USD 20-05-19E		513
FX21019J021 KRW/USD 20-05-19E		483
FX21019J024 KRW/USD 24-06-19E		951
FX21019J024 KRW/USD 22-05-19E		799
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		951
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		1,008
FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E		380
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		76
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		1,000
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E		1,027
FX21019J041 KRW/USD 28-05-19E		285
FX21019J043 KRW/USD 03-06-19E		571
FX21019J044 KRW/USD 03-06-19E		475
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		285
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		475
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		666
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		666
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		827

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	475
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E	571
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E	1,426
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E	1,331

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

(단위:백만원)

**7,299**

공시일	2019-05-16
기준일	2019-05-15

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

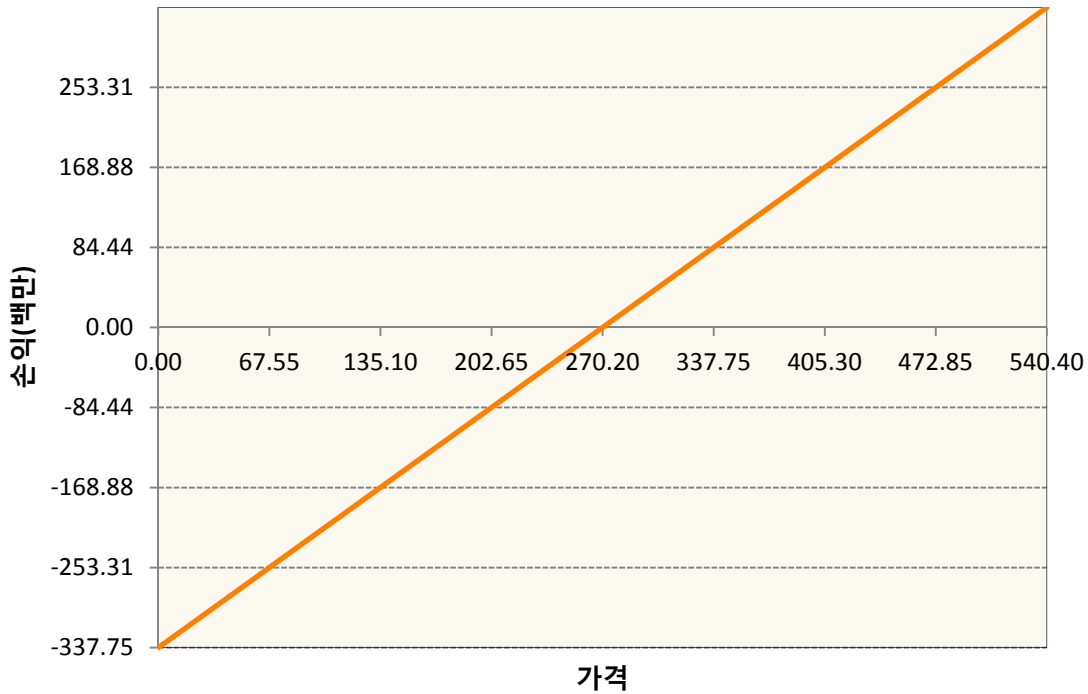
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

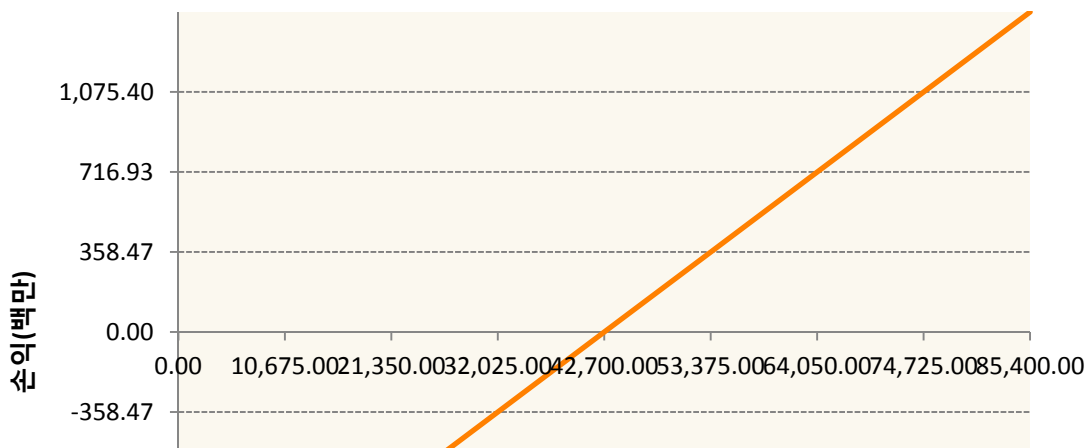
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,772	0	1,772	장내

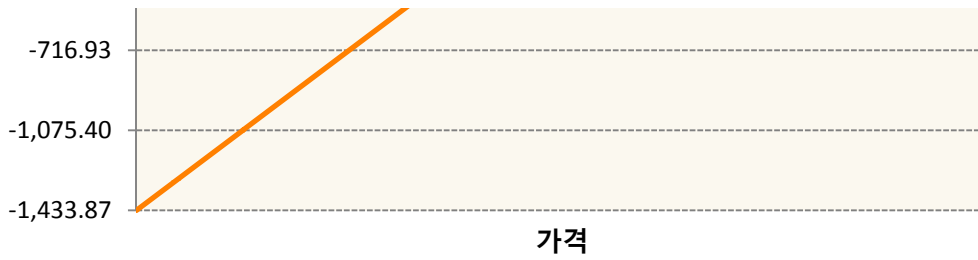
### 2. 만기시점의 손익구조

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)

**155**

공시일	2019-05-16
기준일	2019-05-15

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

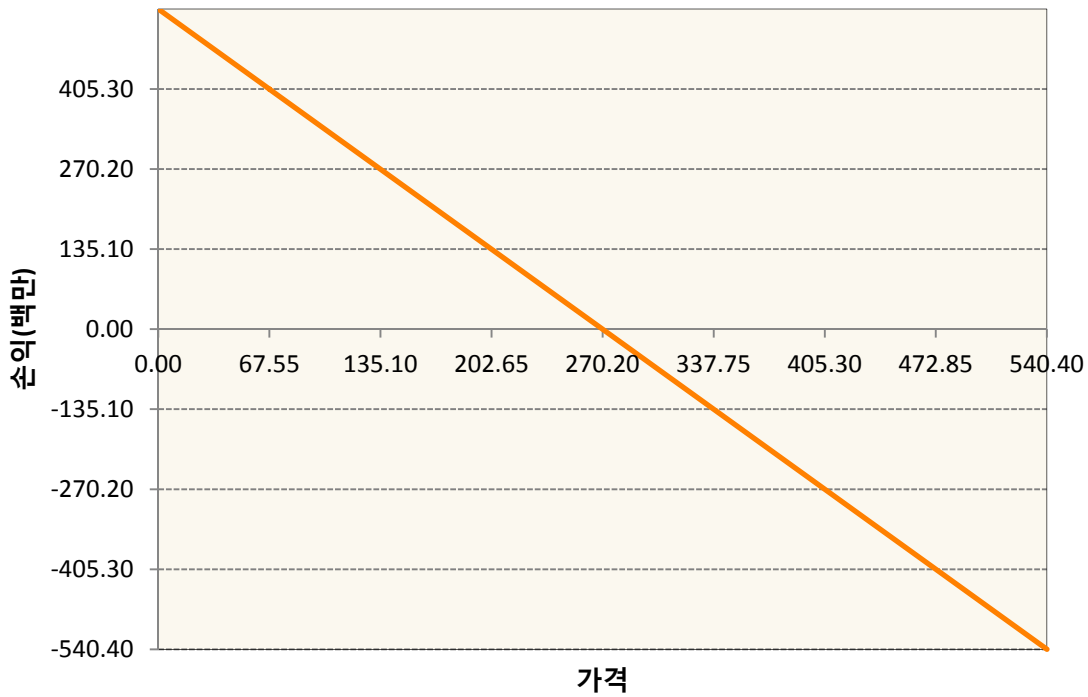
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

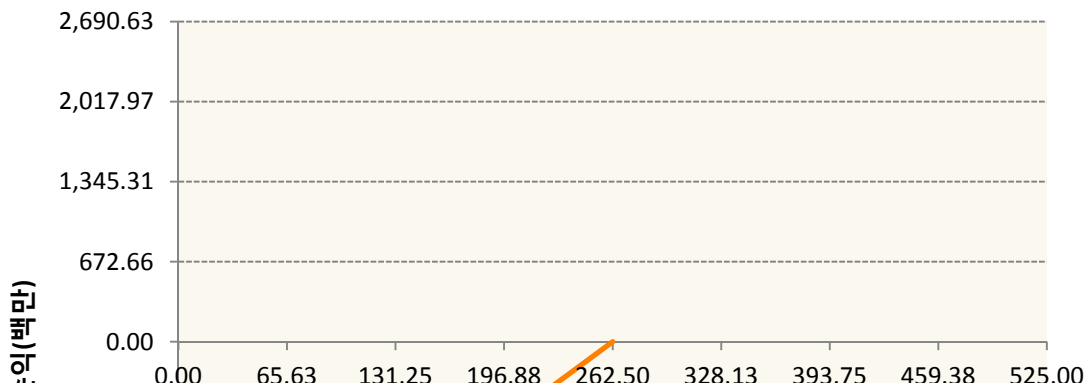
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	540	-540	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,154	-3,154	장내

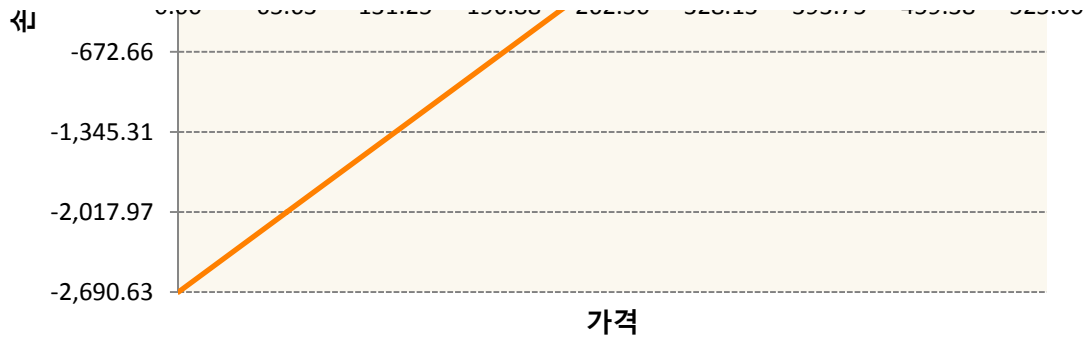
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

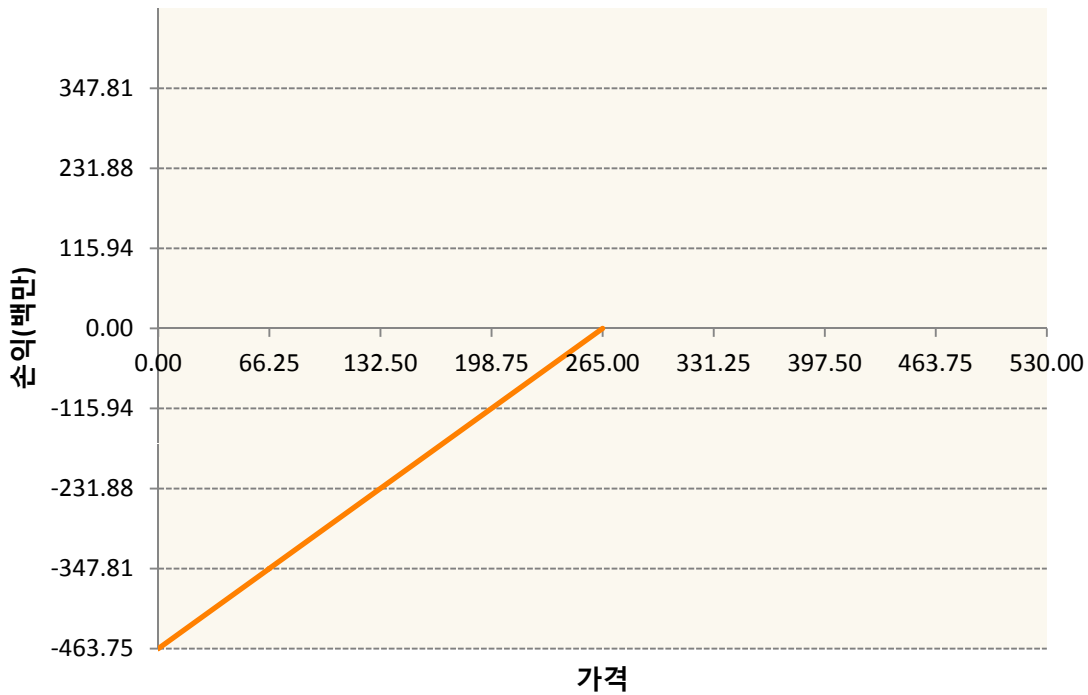


KR4301P62626-2019-06 풋262.5





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						140
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-128	-129	-131	-133	-135	-137	-140
-5.33%	-64	-67	-70	-73	-77	-80	-84
-2.67%	-16	-20	-24	-28	-33	-37	-41
0%	10	7	4	0	-4	-8	-11
2.67%	20	19	17	15	12	9	7
5.33%	23	22	22	21	19	18	16
8.00%	23	23	23	23	22	22	21
KR4301P62659                      2019-06 풋265							26
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-25	-25	-25	-25	-25	-26	-26
-5.33%	-13	-13	-14	-14	-15	-15	-16
-2.67%	-4	-4	-5	-6	-7	-7	-8
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	5	4	4	3	3	2	2
5.33%	5	5	5	5	4	4	4
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

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

(단위:백만원)

**189**

공시일	2019-05-16
기준일	2019-05-15

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

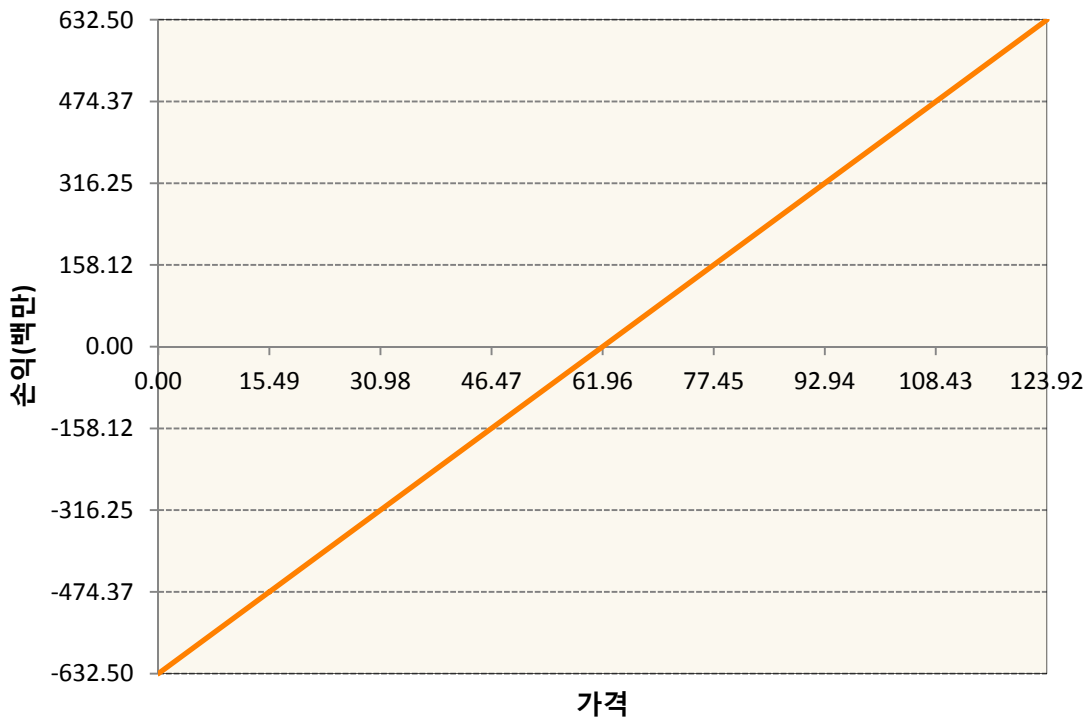
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

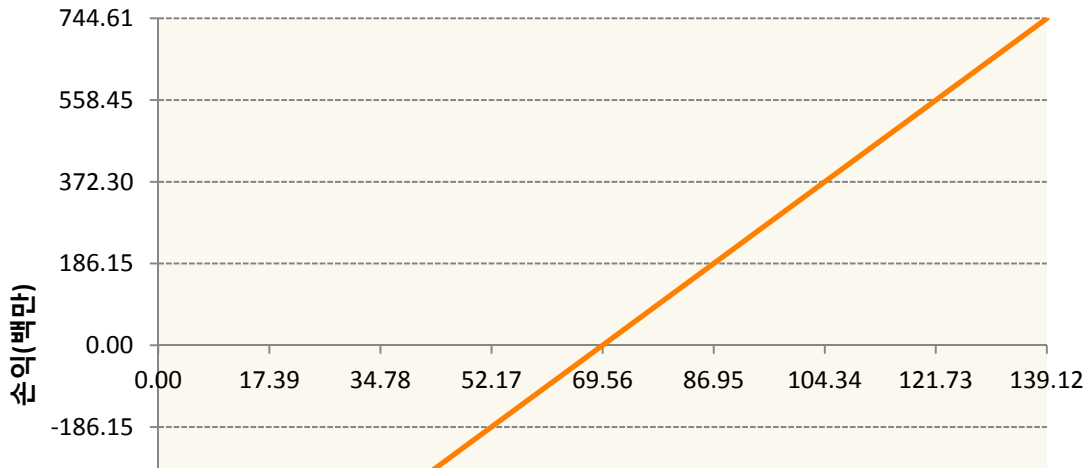
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,782	297	2,485	

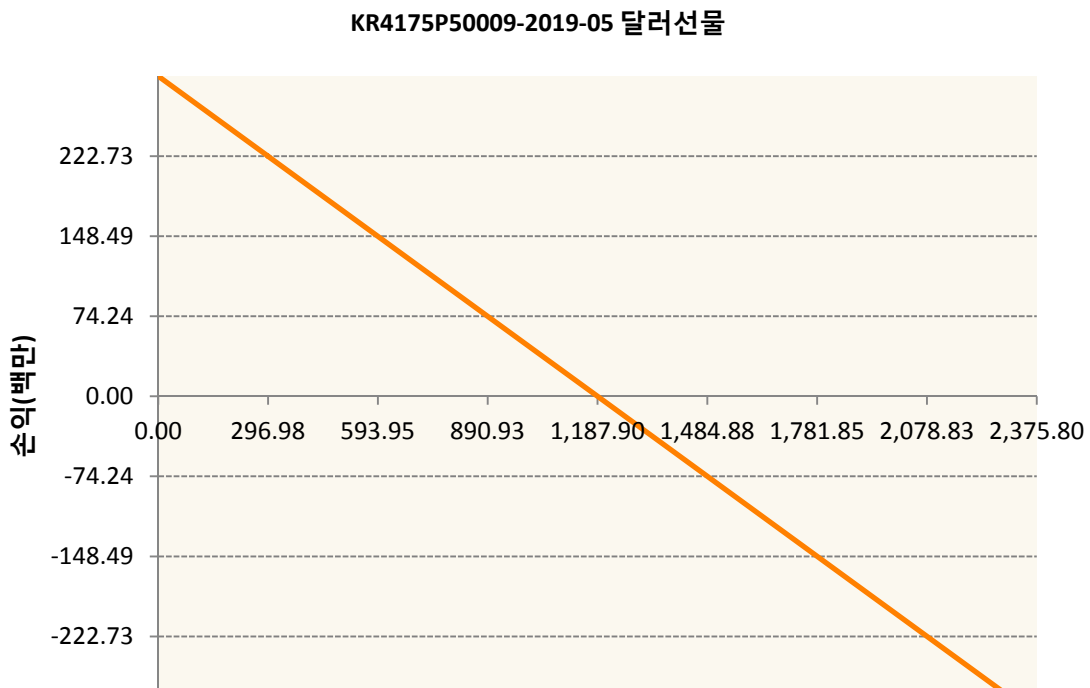
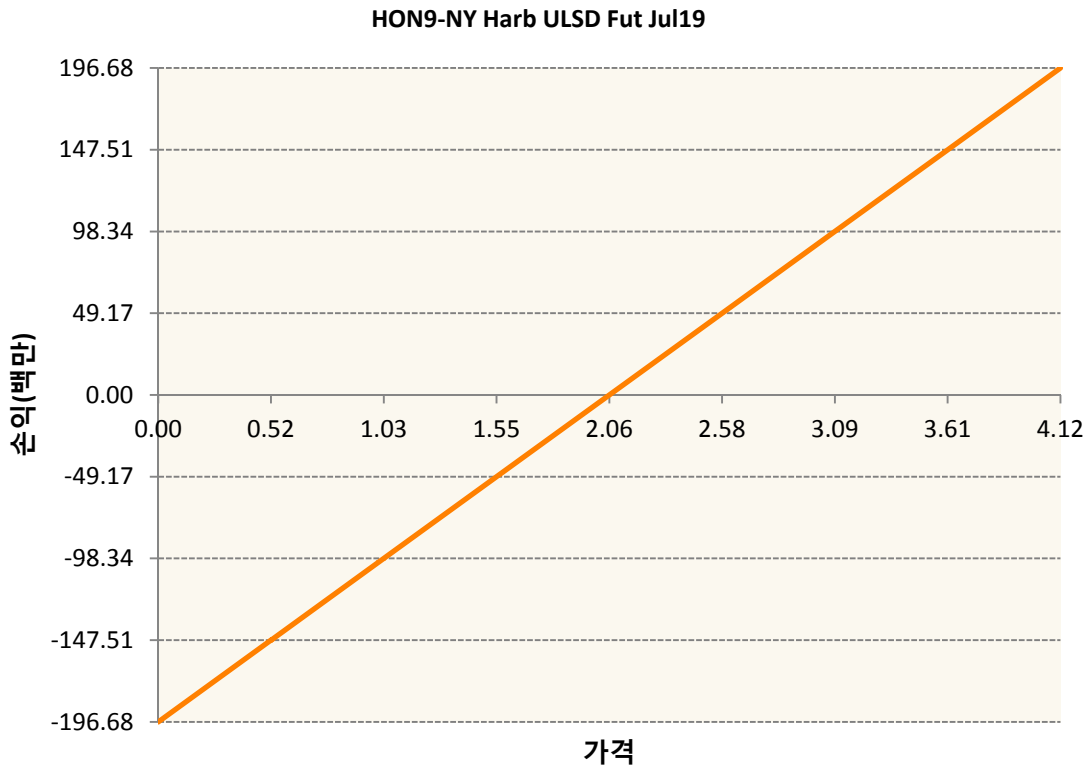
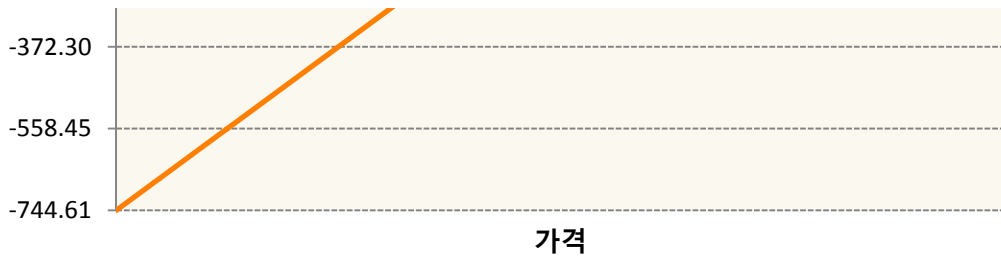
### 2. 만기시점의 손익구조

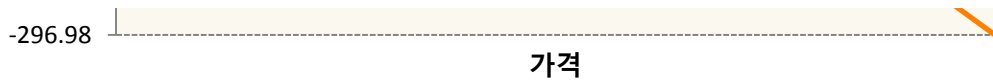
**CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19**



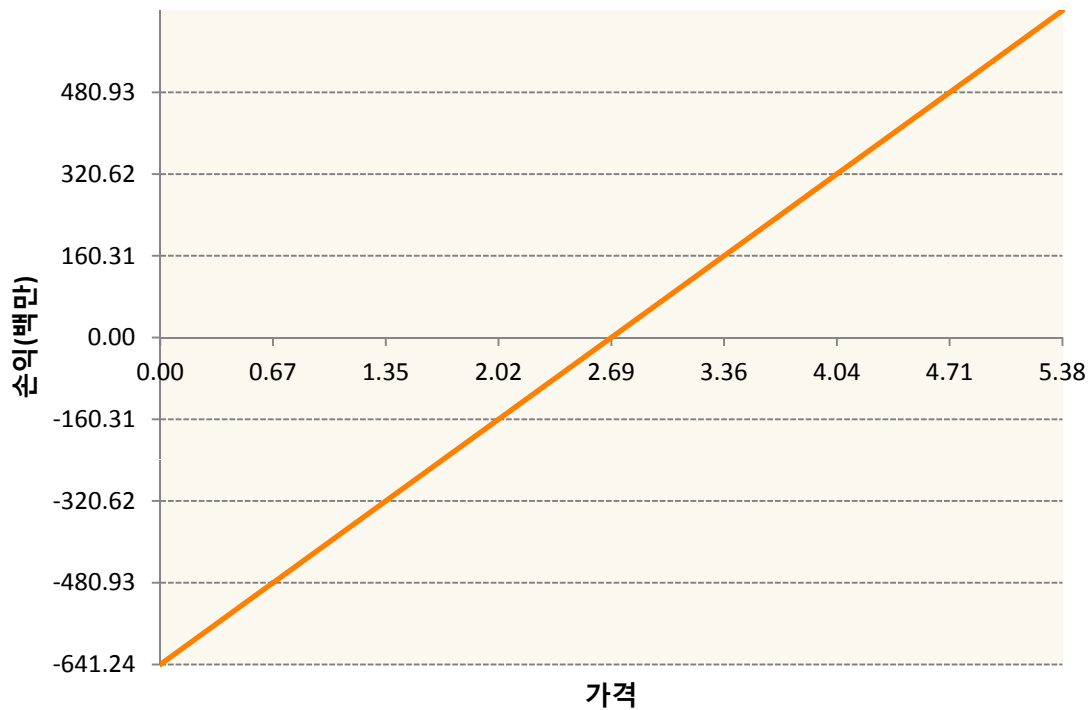
**COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19**



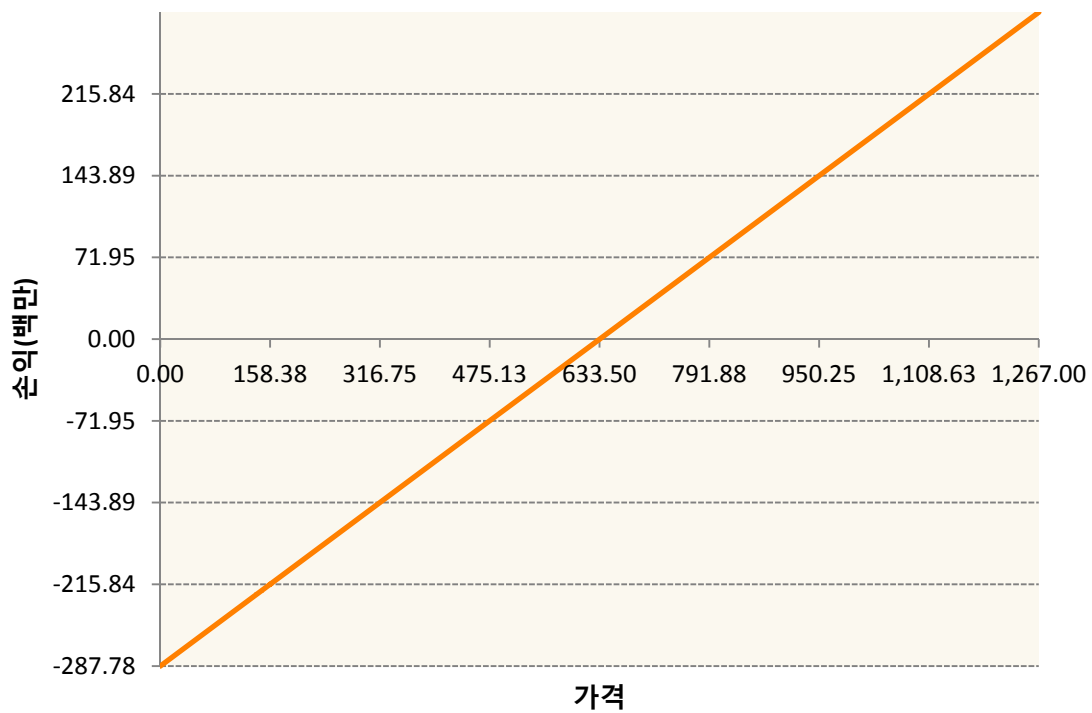




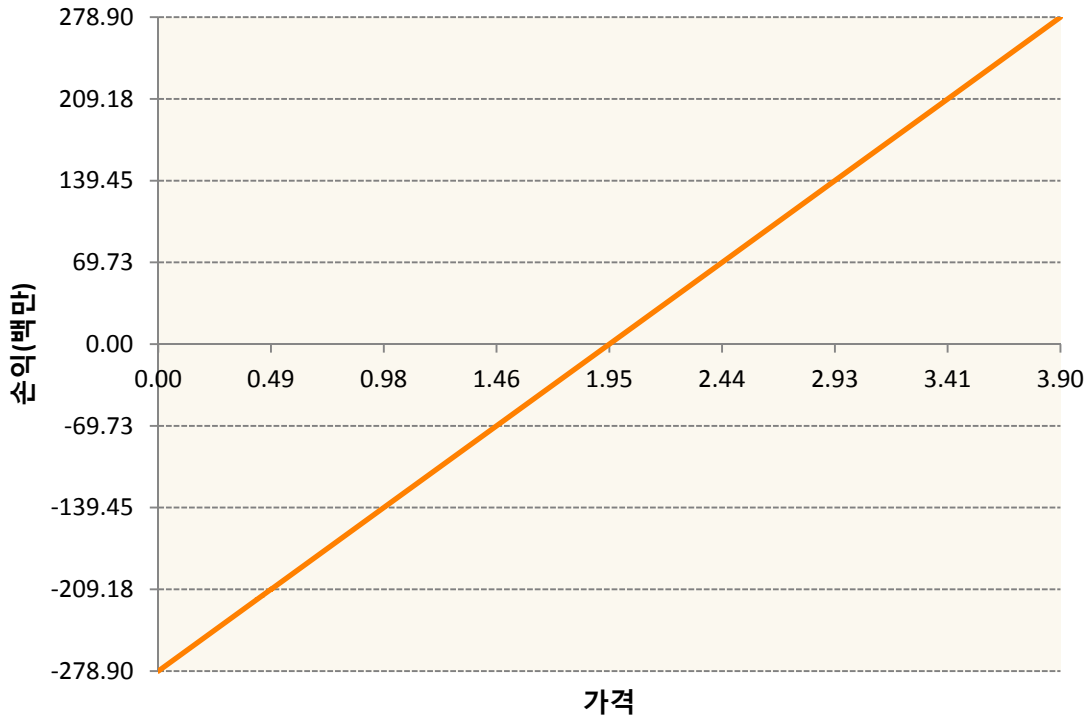
NGN19-NATURAL GAS FUTR Jul19



QSN9-Low Su Gasoil G Jul19



XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN9	WTI CRUDE FUTURE Jul19	51
COU9	BRENT CRUDE FUTR Sep19	60
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)

409

공시일	2019-05-16
기준일	2019-05-15

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

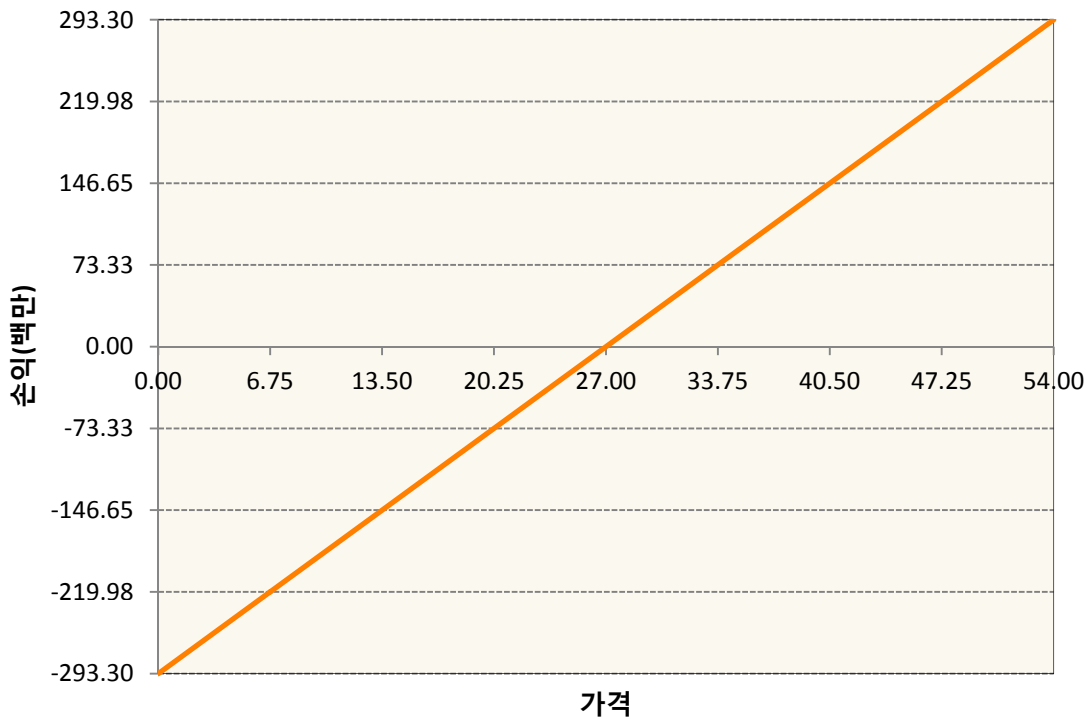
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

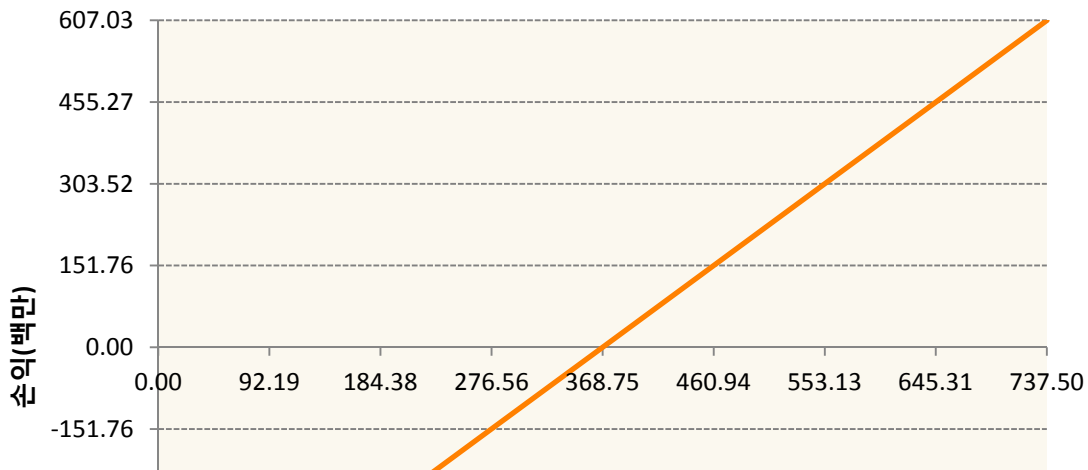
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,860	59	2,800	

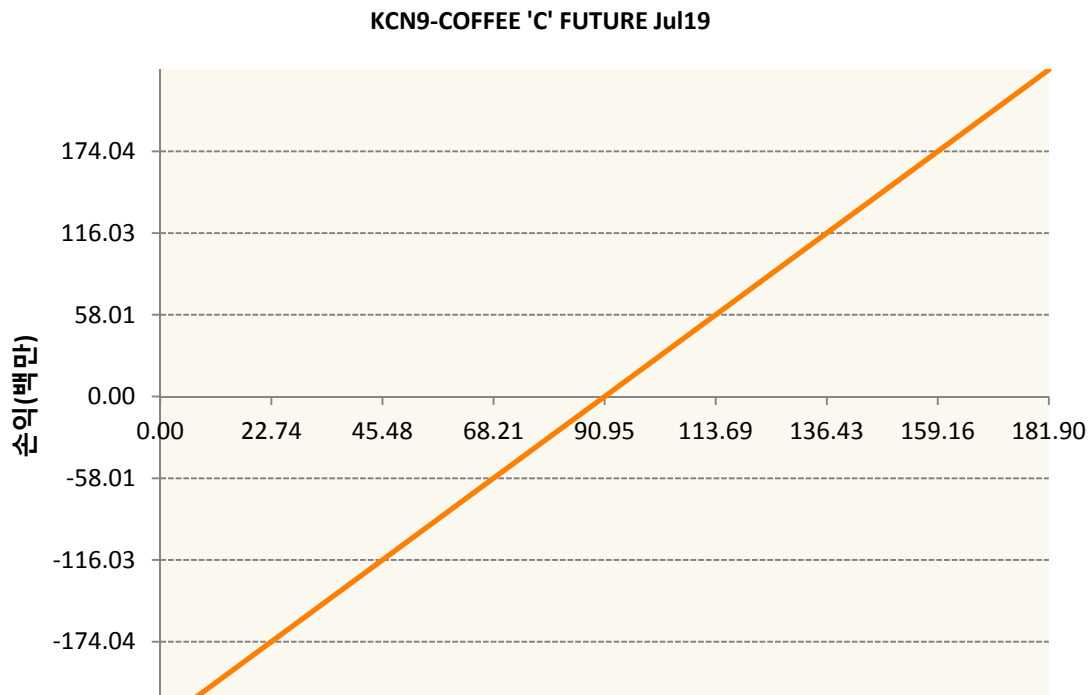
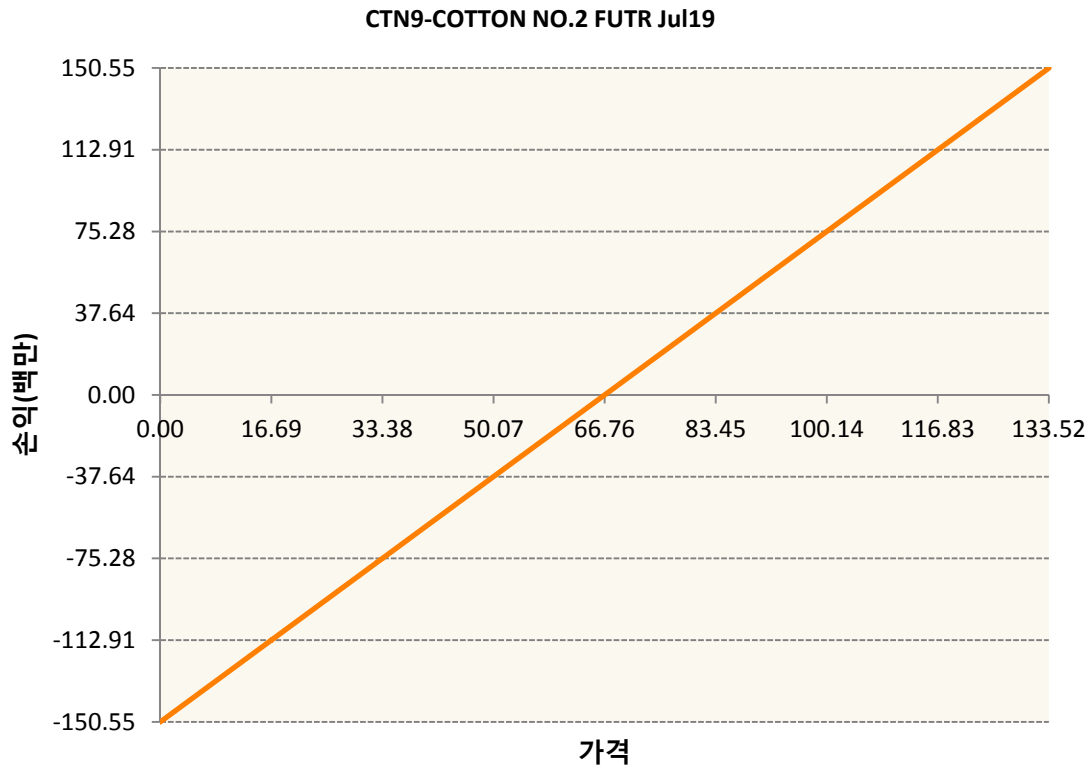
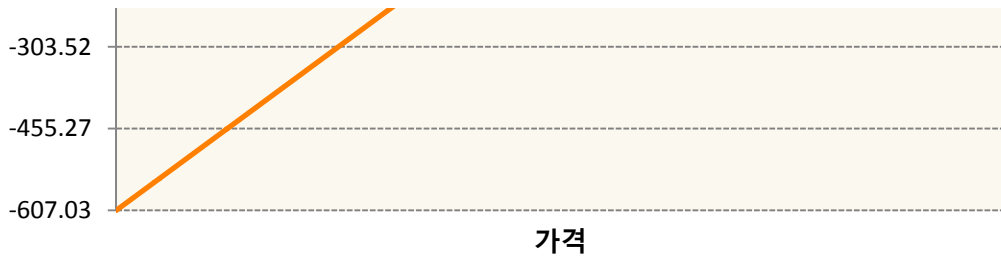
### 2. 만기시점의 손익구조

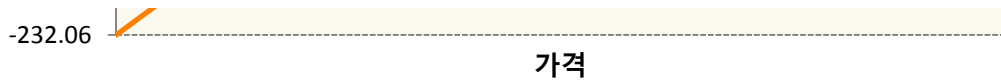
**BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19**



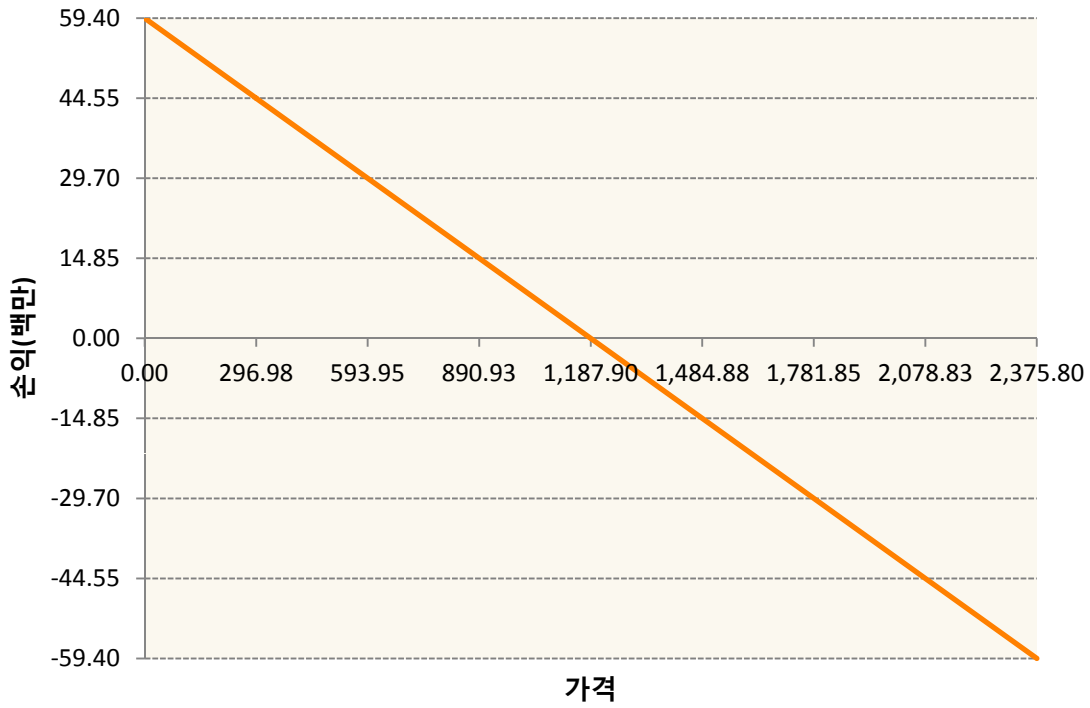
**CN9-CORN FUTURE Jul19**



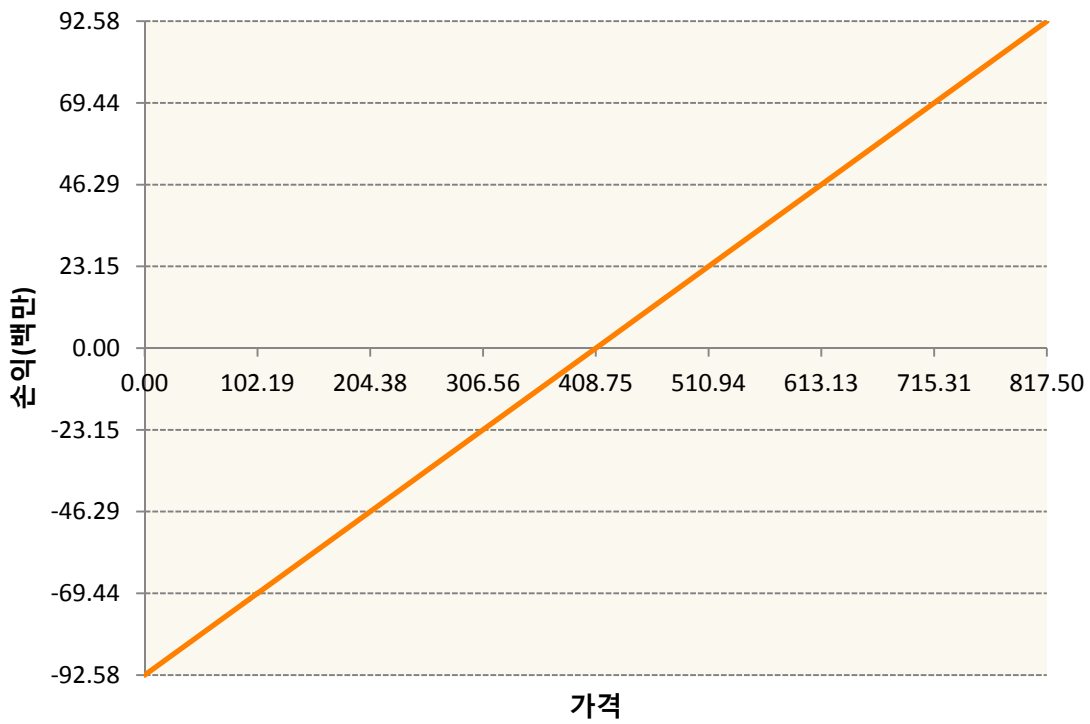




KR4175P50009-2019-05 달러선물



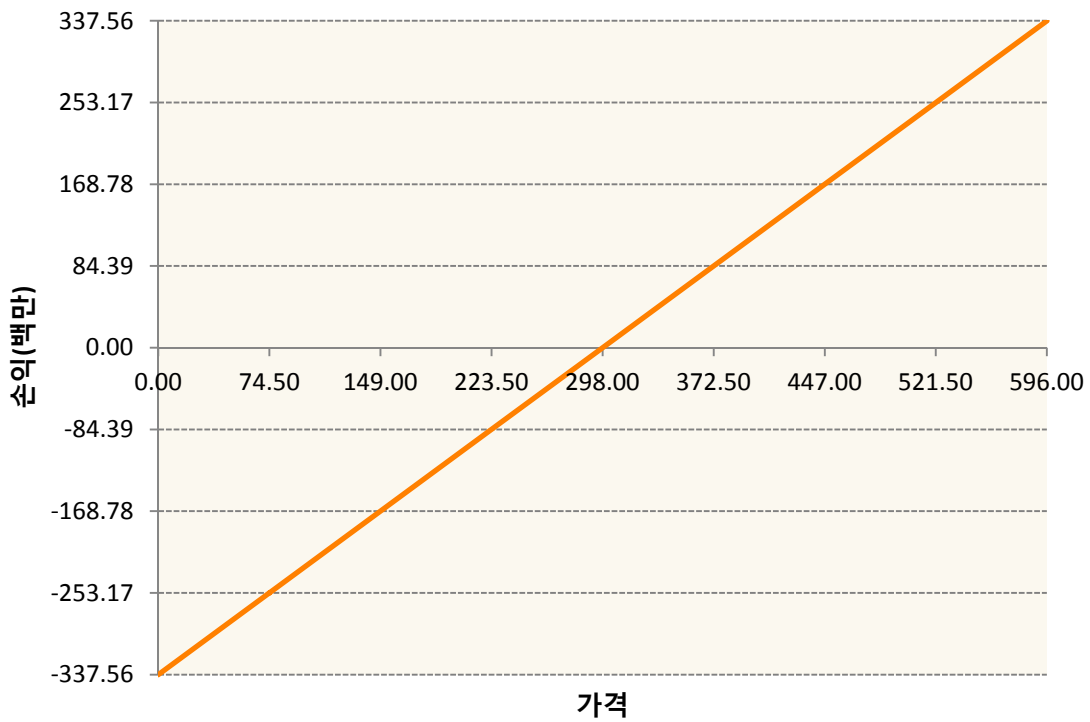
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

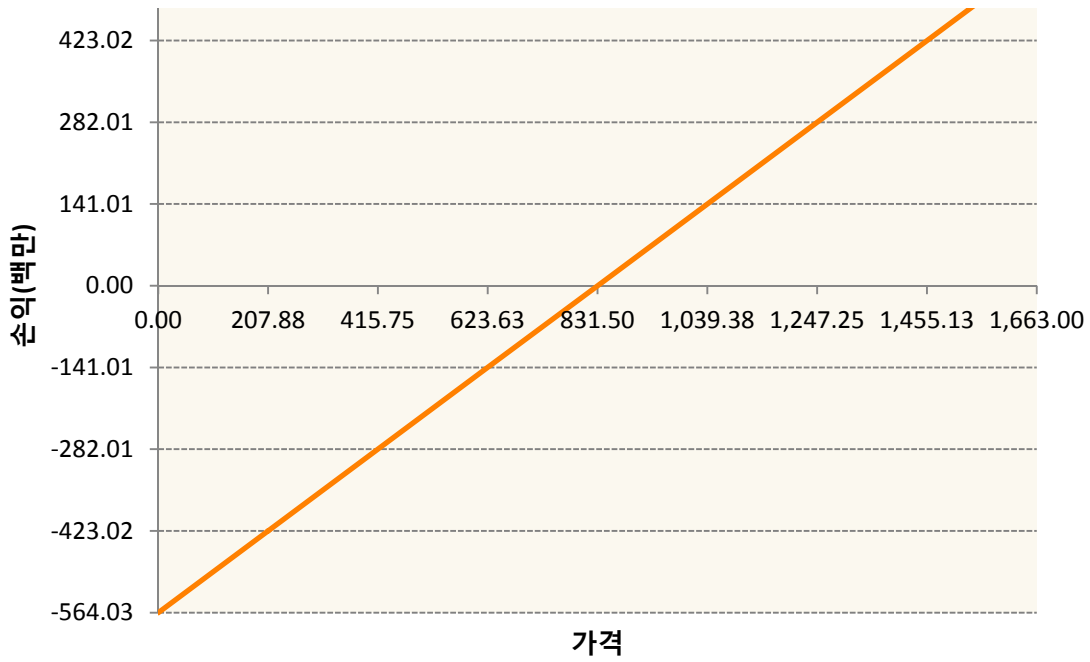


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19

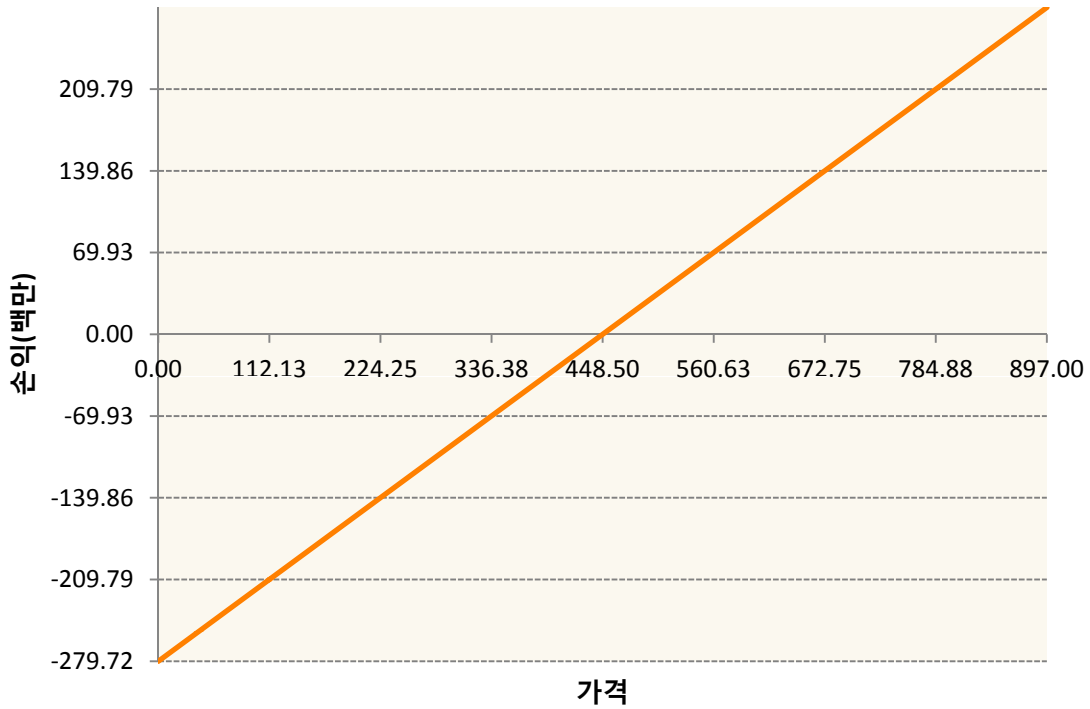


SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





WN9-WHEAT FUTURE(CBT) Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON9	SOYBEAN OIL FUTR Jul19	23
CN9	CORN FUTURE Jul19	49
CTN9	COTTON NO.2 FUTR Jul19	12
KCN9	COFFEE 'C' FUTURE Jul19	19
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)

**233**