

공시일	2019-05-21
기준일	2019-05-20

## 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)

90

공시일	2019-05-21
기준일	2019-05-20

## 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

1,137

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

679

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-05-21
기준일	2019-05-20

## 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)	298
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	82
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	139

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

<b>865</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-05-21
기준일	2019-05-20

## 유로인덱스모(주식-파생형)

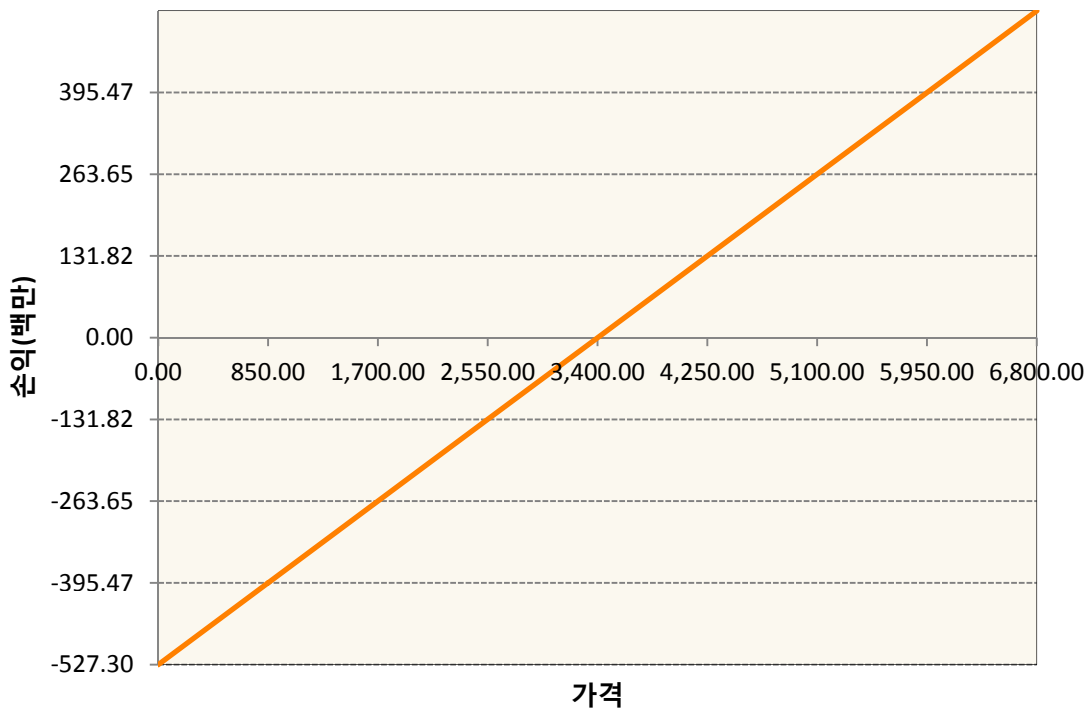
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	527	0	527	

### 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)

31
----

공시일	2019-05-21
기준일	2019-05-20

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

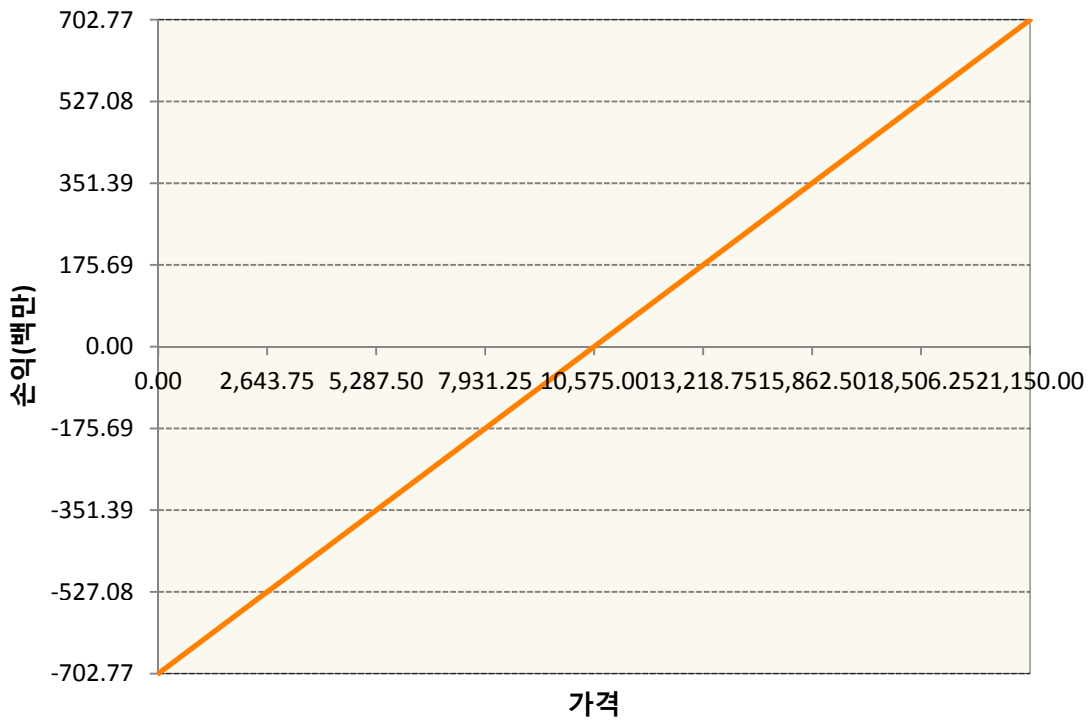
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	703	0	703	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK9	HSCEI Futures May19	56
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

58
----

공시일	2019-05-21
기준일	2019-05-20

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

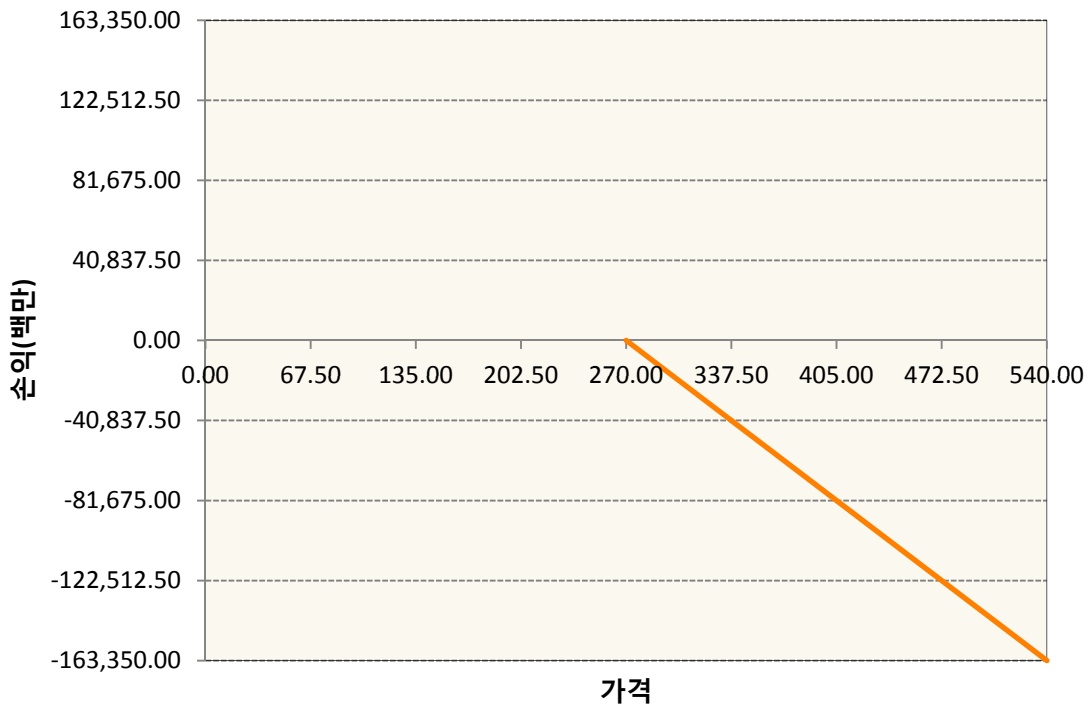
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

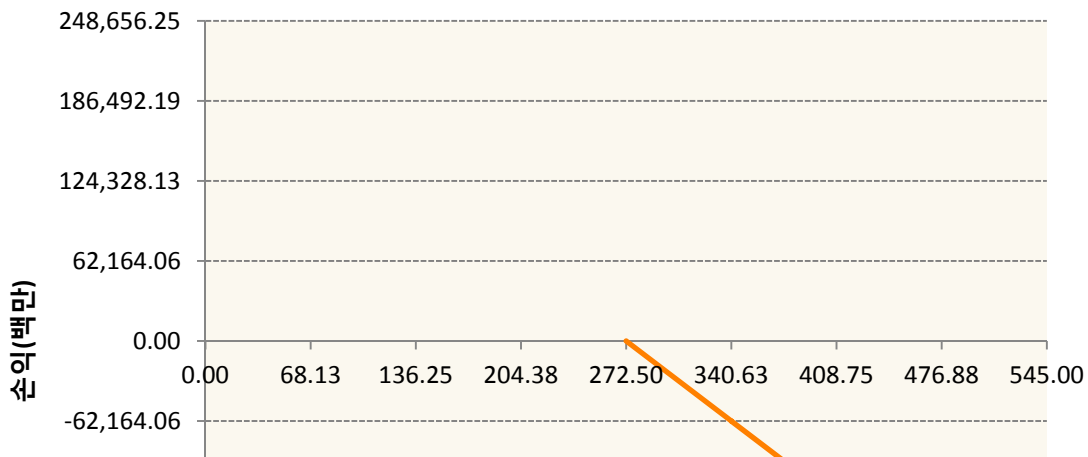
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	614,506	-614,506	장내

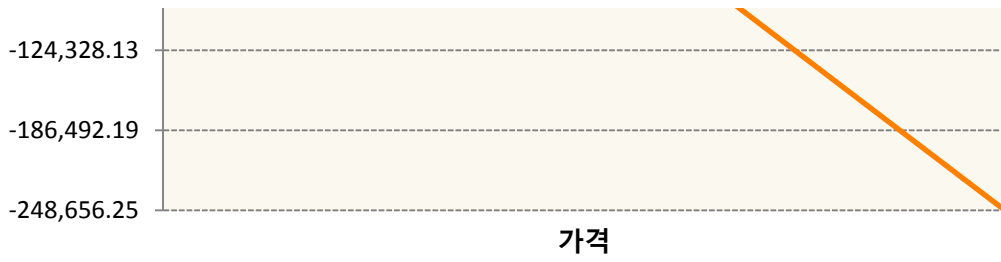
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P62701-2019-06 콜270



KR4201P62727-2019-06 콜272.5





KR4301P62709-2019-06 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201P62701		2019-06 콜270					8,783
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,774	2,727	2,661	2,574	2,467	2,341	2,197
-5.33%	2,606	2,484	2,338	2,170	1,982	1,778	1,559
-2.67%	2,107	1,876	1,628	1,366	1,092	810	519
0%	991	665	334	0	-336	-675	-1,014
2.67%	-972	-1,324	-1,676	-2,029	-2,382	-2,735	-3,089
5.33%	-3,807	-4,102	-4,407	-4,721	-5,042	-5,367	-5,697
8.00%	-7,330	-7,525	-7,744	-7,982	-8,236	-8,504	-8,783
KR4201P62727		2019-06 콜272.5					12,372
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,429	3,381	3,306	3,204	3,073	2,914	2,728

-5.33%	3,262	3,122	2,944	2,733	2,490	2,219	1,924
-2.67%	2,719	2,427	2,101	1,749	1,374	982	574
0%	1,401	946	478	0	-486	-978	-1,474
2.67%	-1,091	-1,628	-2,166	-2,703	-3,241	-3,778	-4,316
5.33%	-4,915	-5,407	-5,908	-6,416	-6,929	-7,447	-7,968
8.00%	-9,893	-10,249	-10,634	-11,043	-11,471	-11,915	-12,372
KR4301P62709                      2019-06 풋270							14,246
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,162	-14,164	-14,168	-14,177	-14,192	-14,215	-14,246
-5.33%	-8,887	-8,907	-8,940	-8,985	-9,045	-9,120	-9,208
-2.67%	-3,759	-3,857	-3,975	-4,111	-4,262	-4,426	-4,602
0%	711	481	243	0	-248	-499	-754
2.67%	3,732	3,460	3,187	2,913	2,638	2,363	2,087
5.33%	5,117	4,946	4,759	4,558	4,347	4,127	3,899
8.00%	5,517	5,456	5,377	5,278	5,162	5,030	4,884

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

(단위:백만원)

**34,932**

공시일	2019-05-21
기준일	2019-05-20

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

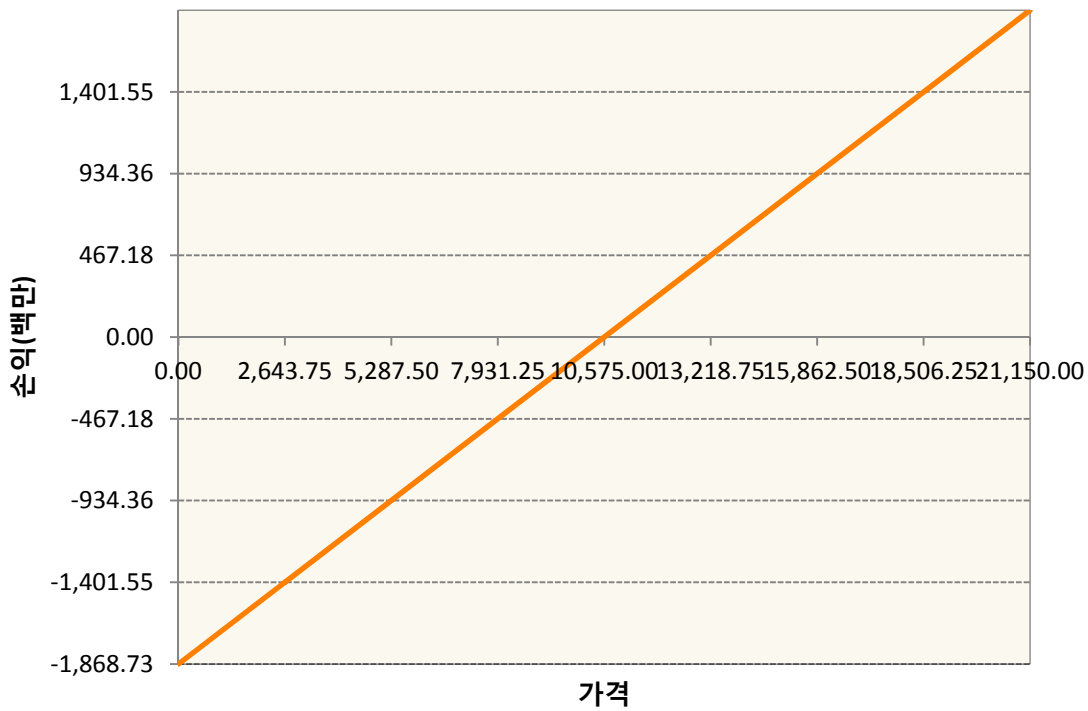
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

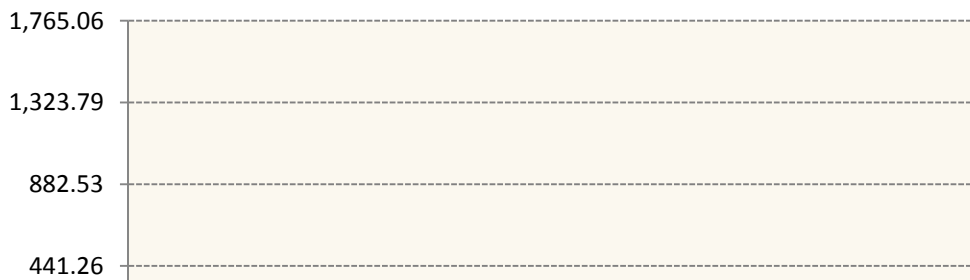
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,869	0	1,869	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,666	-5,666	장내
누계	통화	선도	0	3,195	-3,195	장외

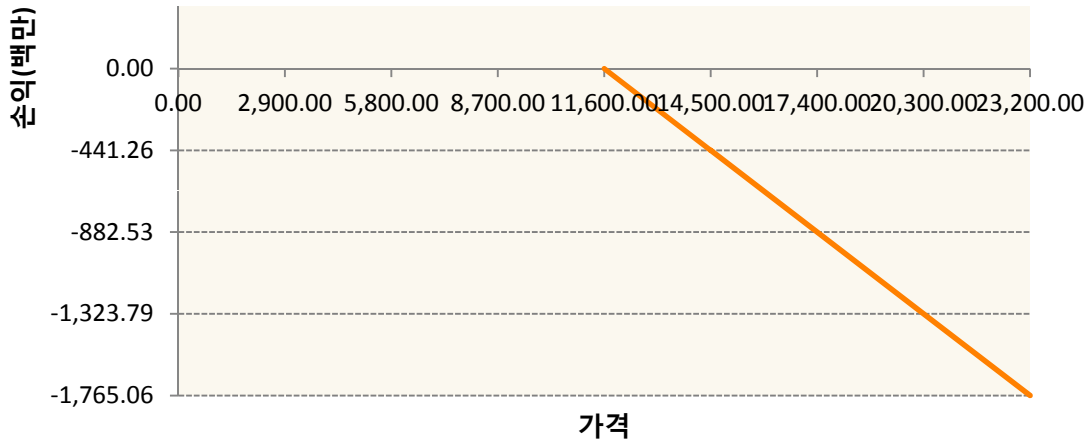
### 2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19

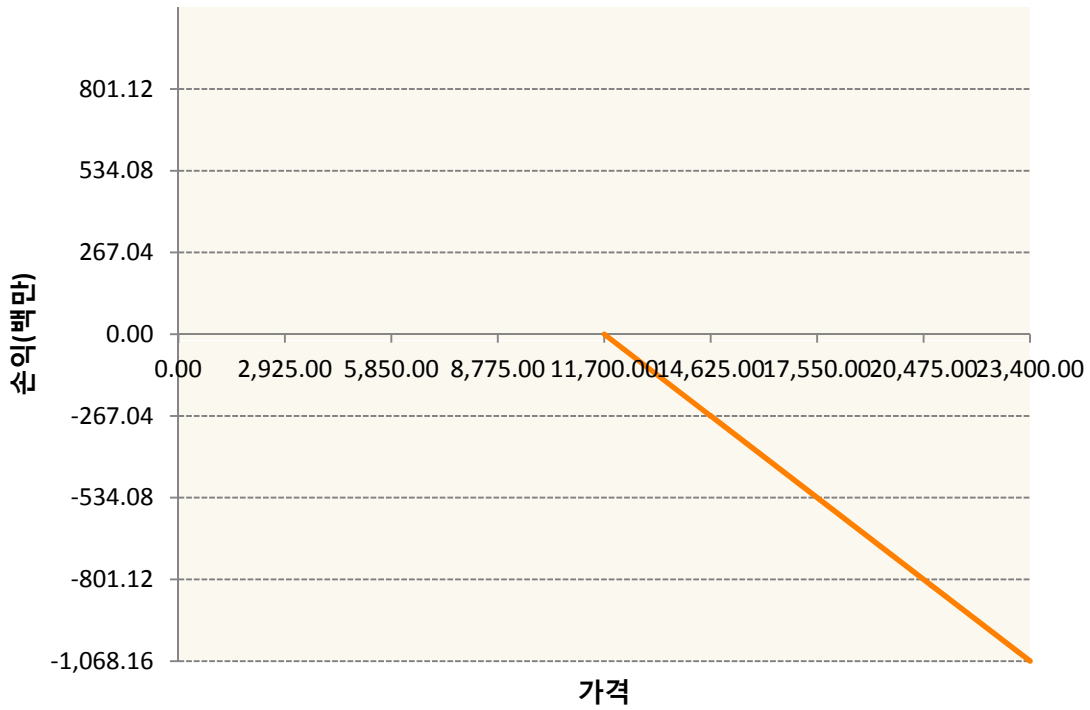


OHHIK9-C116-HSCEI

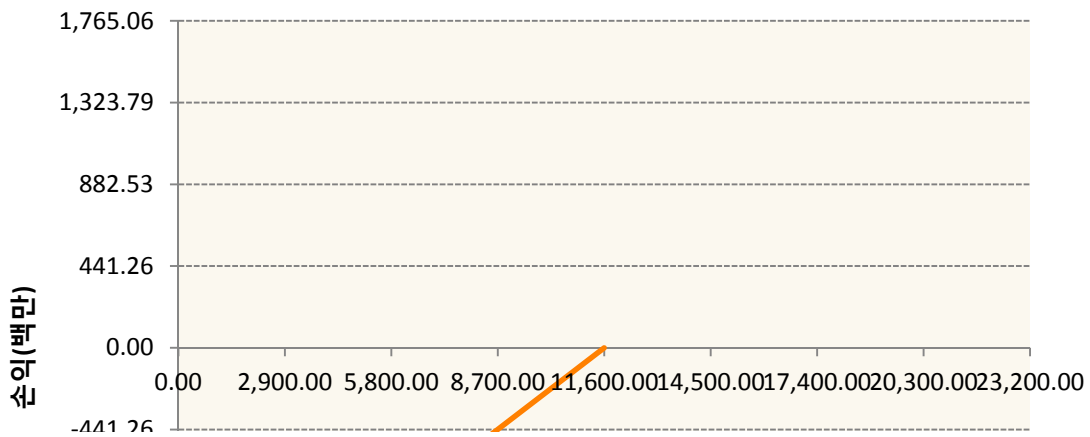


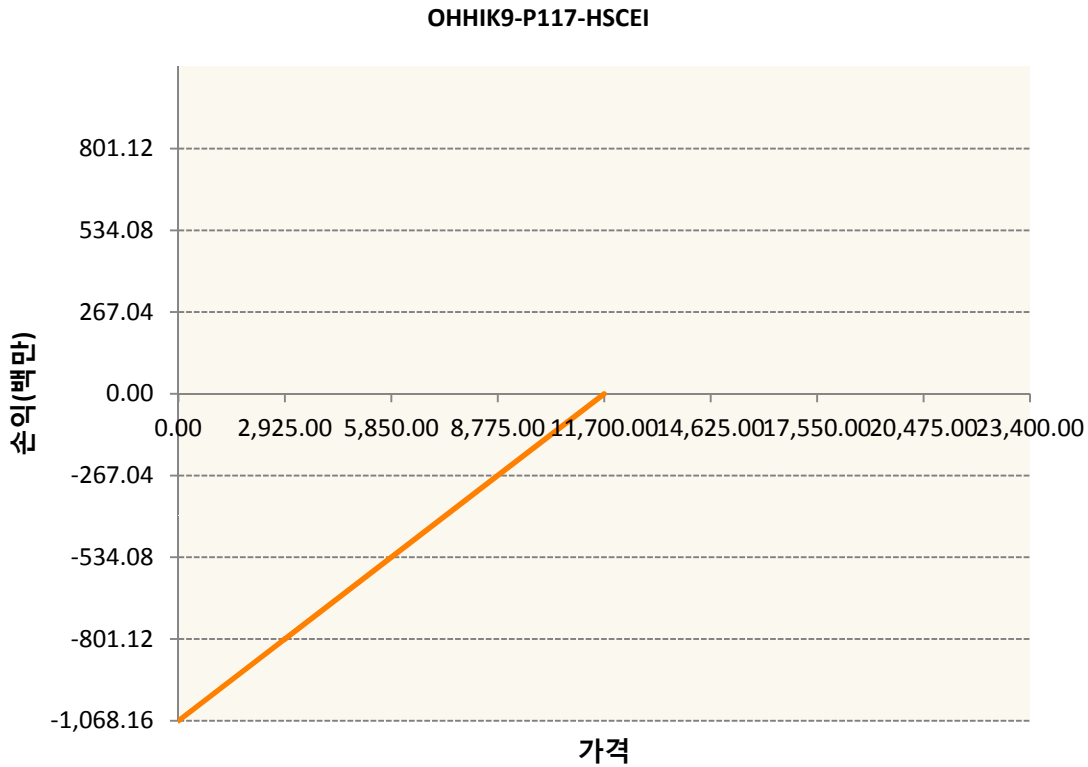


OHHIK9-C117-HSCEI



OHHIK9-P116-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E		231
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E		24
HCK9 HSCEI Futures May19		150
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)
		705

공시일	2019-05-21
기준일	2019-05-20

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

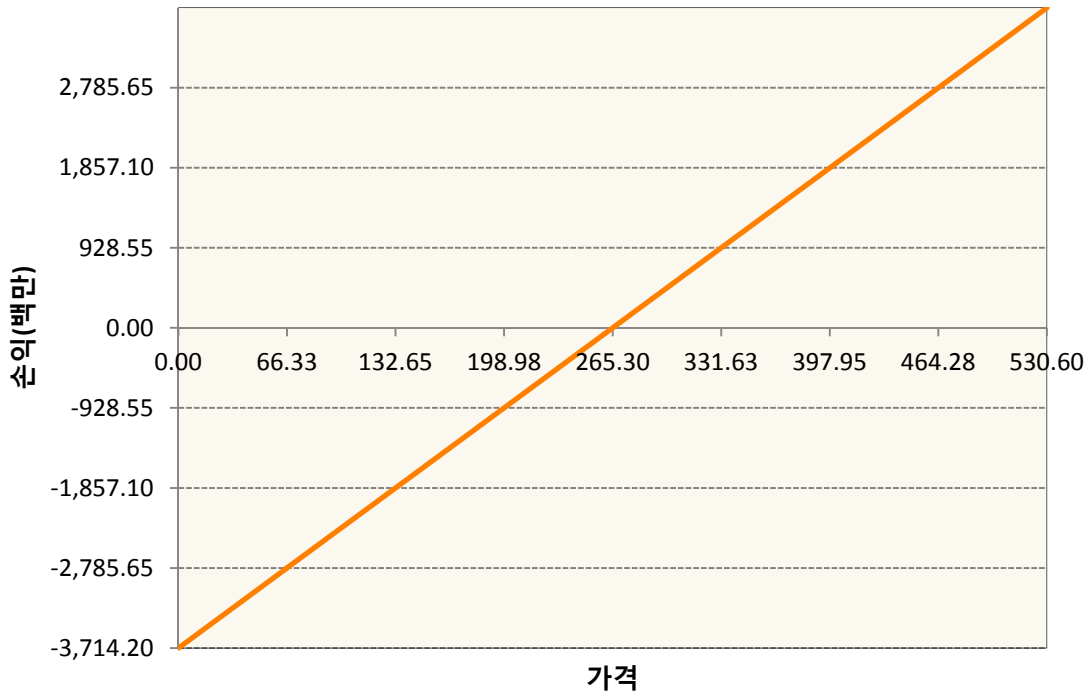
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

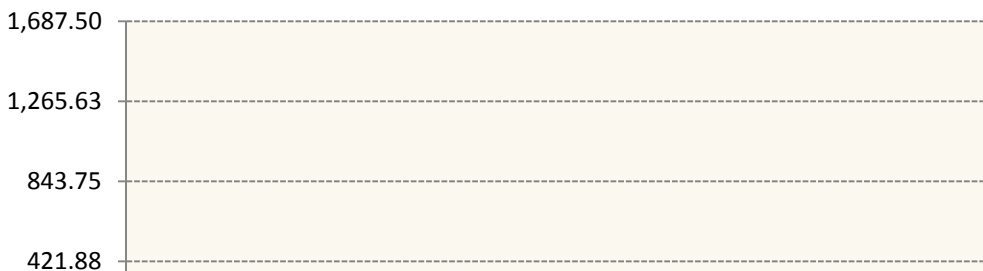
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,714	0	3,714	장내
누계	유가증권	스왑	26,836	0	26,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	21,759	-21,759	장내

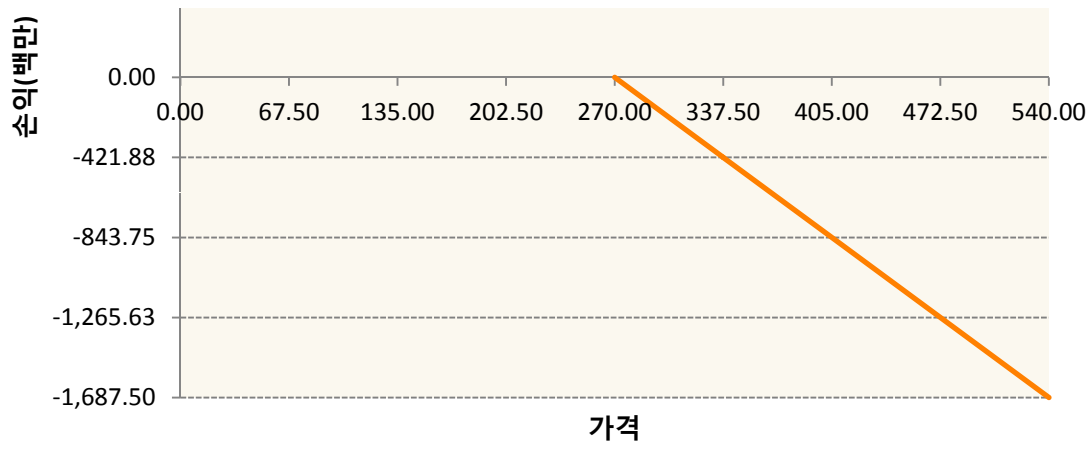
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

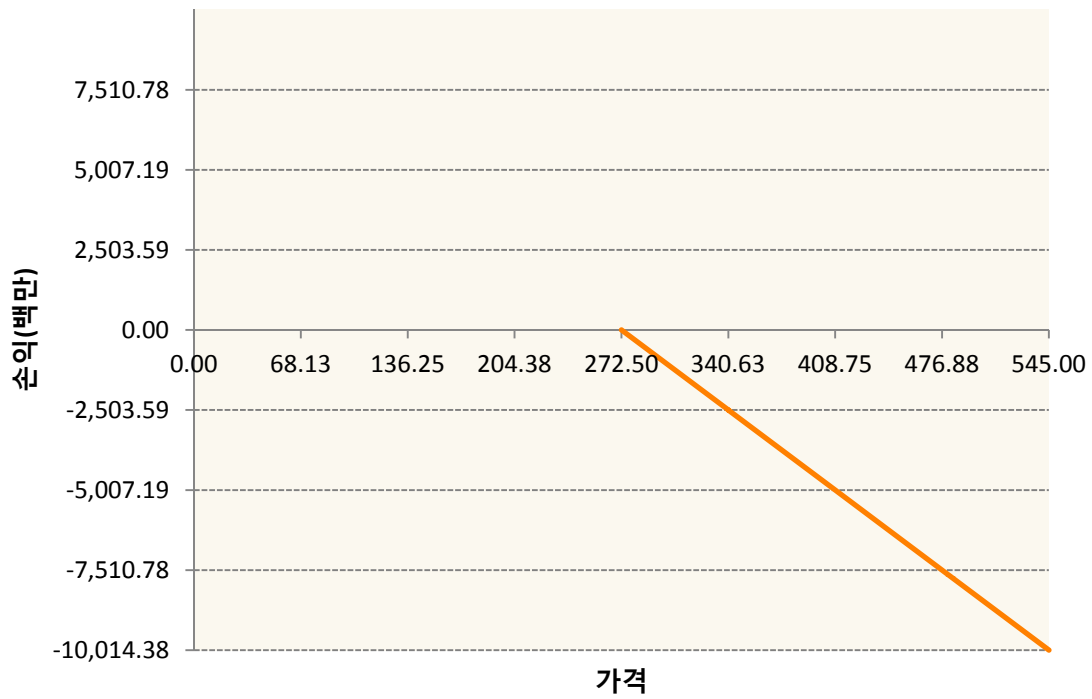


KR4201P62701-2019-06 콜270

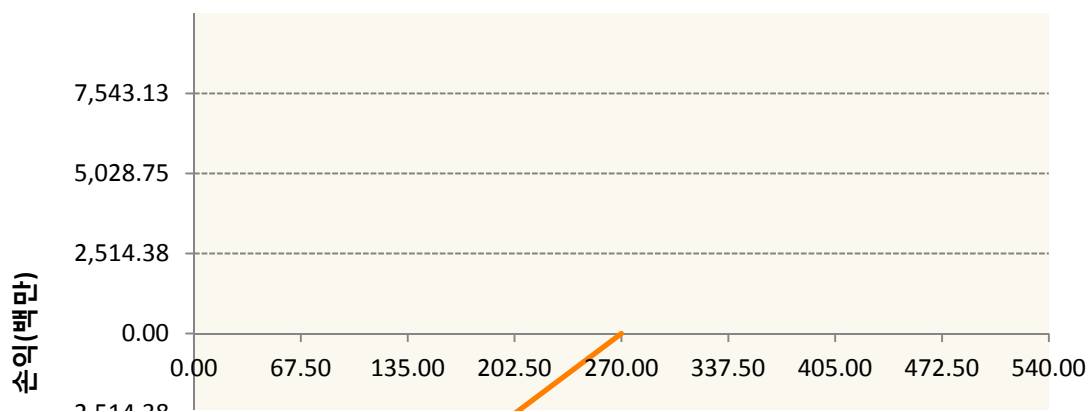


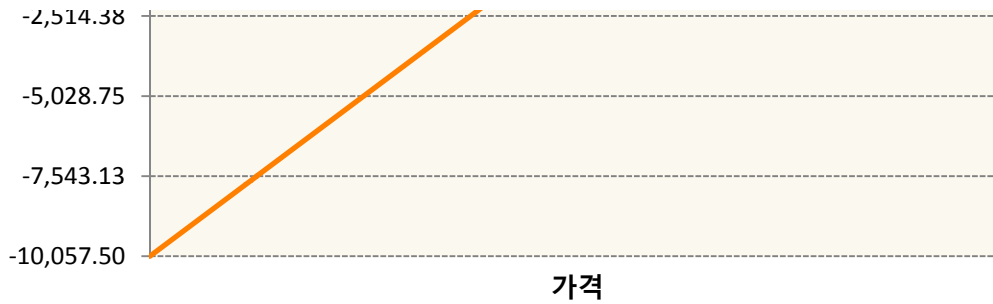


**KR4201P62727-2019-06 콜272.5**



**KR4301P62709-2019-06 풋270**





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,707
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,707	-1,707	-1,707	-1,707	-1,707	-1,707	-1,707	
-5.33%	-1,138	-1,138	-1,138	-1,138	-1,138	-1,138	-1,138	
-2.67%	-569	-569	-569	-569	-569	-569	-569	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	569	569	569	569	569	569	569	
5.33%	1,138	1,138	1,138	1,138	1,138	1,138	1,138	
8.00%	1,707	1,707	1,707	1,707	1,707	1,707	1,707	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						602
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-602	-602	-602	-602	-602	-602	-602	
-5.33%	-402	-402	-402	-402	-402	-402	-402	
-2.67%	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-201	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	201	201	201	201	201	201	201	
5.33%	402	402	402	402	402	402	402	
8.00%	602	602	602	602	602	602	602	
KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						297
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-297	-297	-297	-297	-297	-297	-297	
-5.33%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198	
-2.67%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	99	99	99	99	99	99	99	
5.33%	198	198	198	198	198	198	198	
8.00%	297	297	297	297	297	297	297	
KR4201P62701		2019-06 콜270						91
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	29	28	27	27	25	24	23
-5.33%	27	26	24	22	20	18	16
-2.67%	22	19	17	14	11	8	5
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	-10	-14	-17	-21	-25	-28	-32
5.33%	-39	-42	-46	-49	-52	-55	-59
8.00%	-76	-78	-80	-82	-85	-88	-91

KR4201P62727                      2019-06 콜272.5                      498

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	138	136	133	129	124	117	110
-5.33%	131	126	119	110	100	89	77
-2.67%	110	98	85	70	55	40	23
0%	56	38	19	0	-20	-39	-59
2.67%	-44	-66	-87	-109	-131	-152	-174
5.33%	-198	-218	-238	-258	-279	-300	-321
8.00%	-398	-413	-428	-445	-462	-480	-498

KR4301P62709                      2019-06 풋270                      708

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-703	-703	-704	-704	-705	-706	-708
-5.33%	-441	-442	-444	-446	-449	-453	-457
-2.67%	-187	-192	-197	-204	-212	-220	-229
0%	35	24	12	0	-12	-25	-37
2.67%	185	172	158	145	131	117	104
5.33%	254	246	236	226	216	205	194
8.00%	274	271	267	262	256	250	243

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

(단위:백만원)

**3,874**

공시일	2019-05-21
기준일	2019-05-20

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

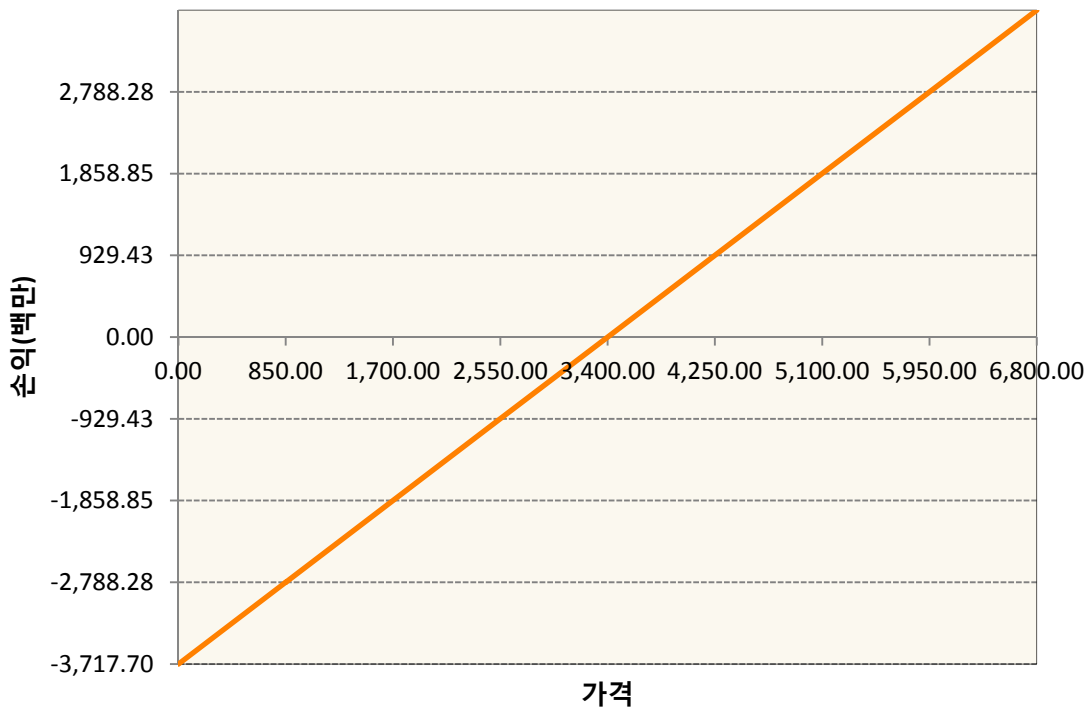
### 1. 계약금액

(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	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,718	0	3,718	
누계	유가증권	스왑	56,400	0	56,400	장외
누계	통화	선도	0	18,654	-18,654	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	28
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	426
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	853
FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E	213
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	297

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

(단위:백만원)

978



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

(단위:백만원)

1,016



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

(단위:백만원)

90



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

(단위:백만원)

130



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

(단위:백만원)

40

공시일	2019-05-21
기준일	2019-05-20

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

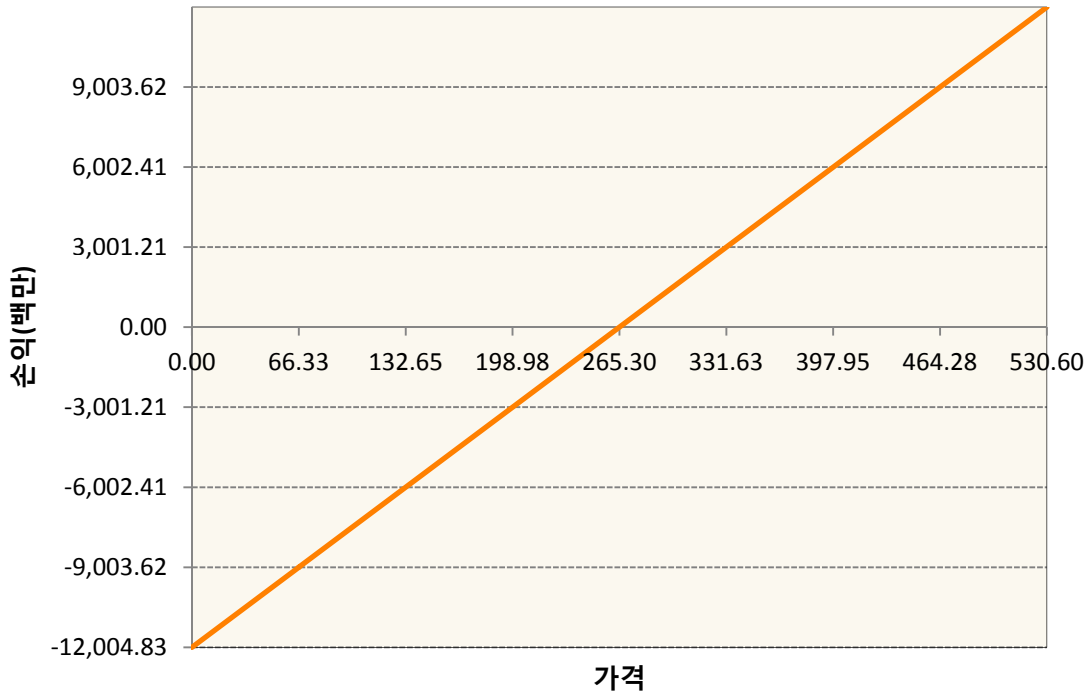
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

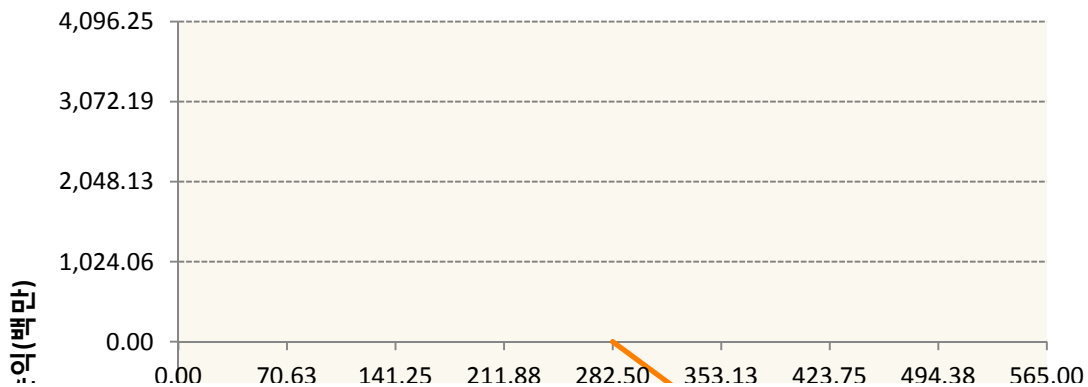
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,005	0	12,005	장내
누계	유가증권	옵션	5,081	22,906	-17,825	장내

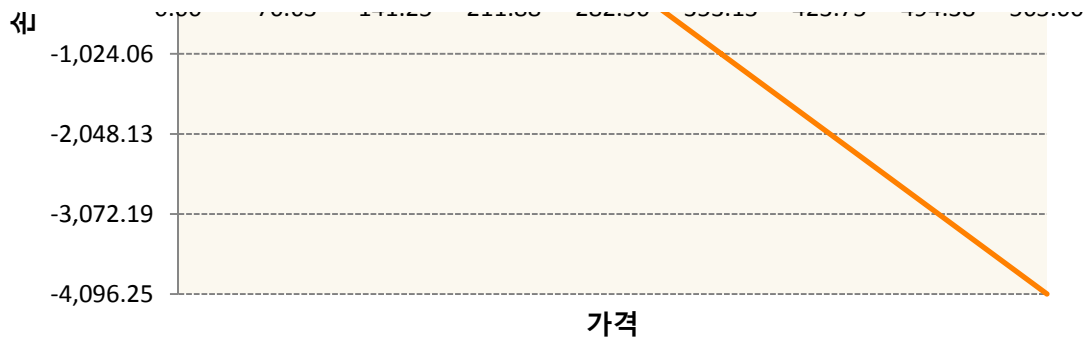
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

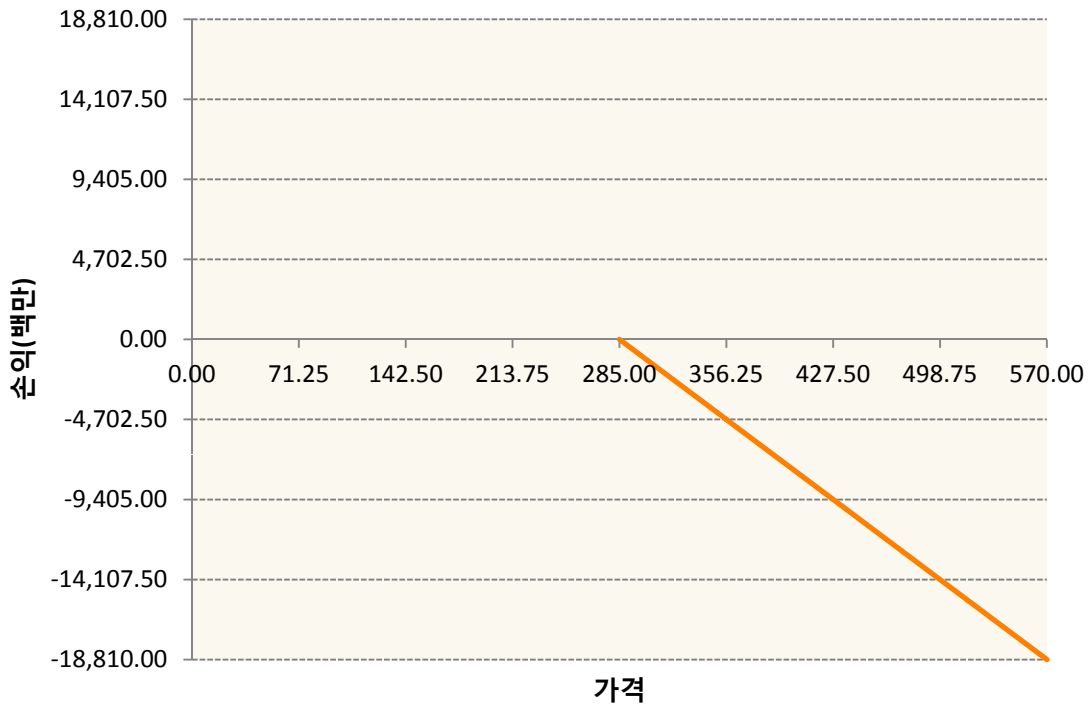


KR4201P62826-2019-06 콜282.5

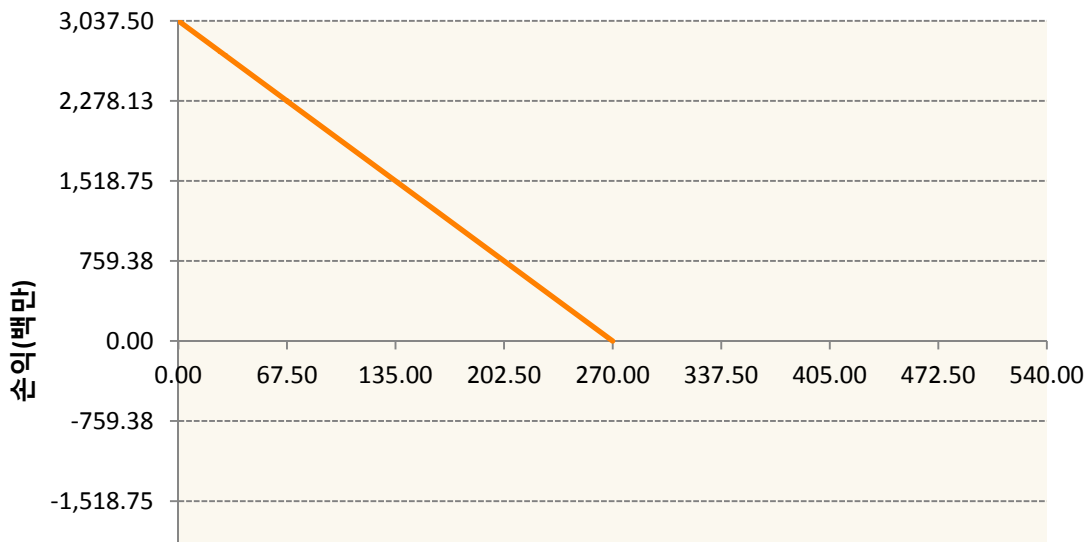


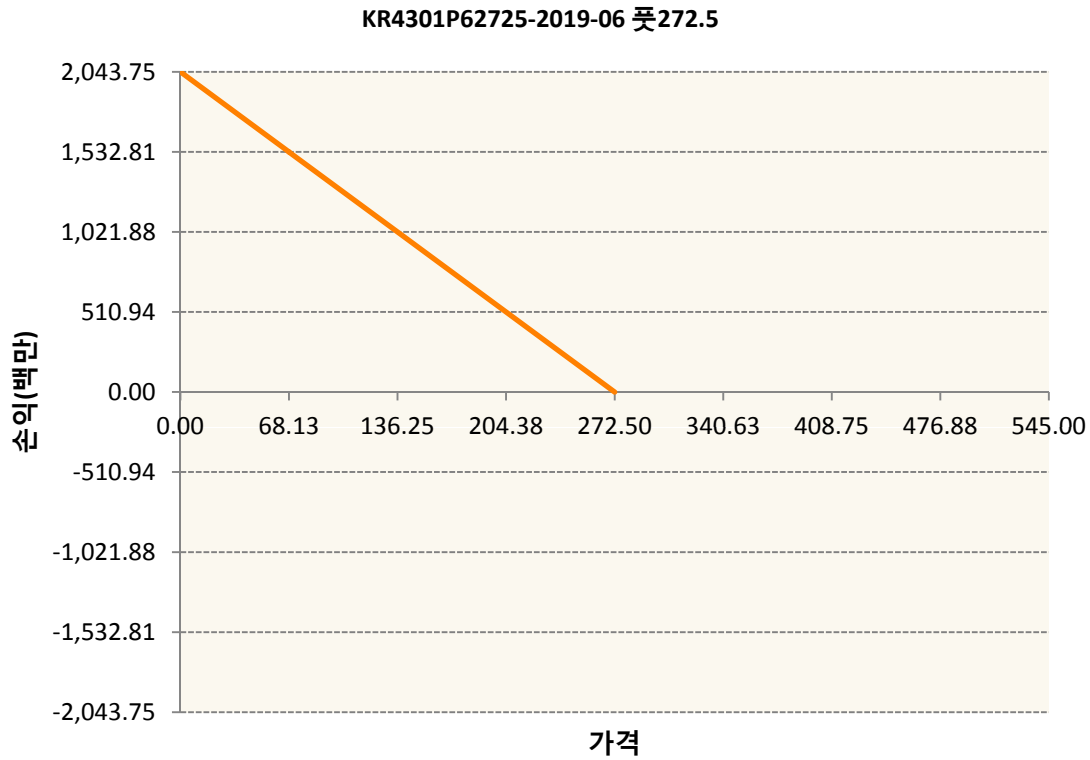
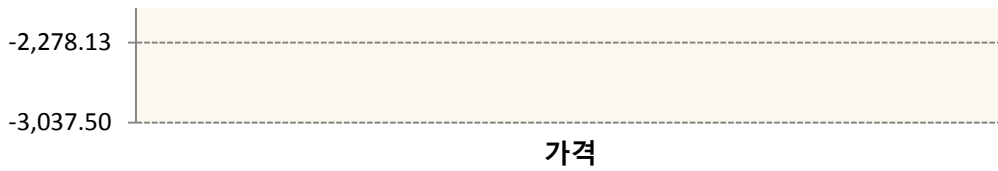


**KR4201P62859-2019-06 콜285**



**KR4301P62709-2019-06 풋270**





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

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						959
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-959	-959	-959	-959	-959	-959	-959	
-5.33%	-639	-639	-639	-639	-639	-639	-639	
-2.67%	-320	-320	-320	-320	-320	-320	-320	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	320	320	320	320	320	320	320	
5.33%	639	639	639	639	639	639	639	
8.00%	959	959	959	959	959	959	959	
KR4201P62826		2019-06 콜282.5						139
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	22	22	21	21	20	19	18	
-5.33%	21	21	20	19	17	15	12	
-2.67%	20	18	16	13	9	5	1	

0%	13	10	5	0	-5	-11	-17
2.67%	-2	-9	-16	-23	-31	-38	-46
5.33%	-34	-43	-51	-60	-69	-77	-86
8.00%	-86	-95	-104	-112	-121	-130	-139
KR4201P62859                      2019-06 콜285							569
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	77	76	76	74	71	67	62
-5.33%	76	74	71	66	60	52	41
-2.67%	71	65	56	46	33	18	1
0%	51	37	20	0	-22	-46	-71
2.67%	-3	-29	-58	-88	-119	-151	-184
5.33%	-121	-157	-195	-233	-271	-310	-349
8.00%	-324	-365	-406	-446	-487	-528	-569
KR4301P62709                      2019-06 풋270							214
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	212	212	213	213	213	213	214
-5.33%	133	134	134	135	136	137	138
-2.67%	56	58	60	62	64	66	69
0%	-11	-7	-4	0	4	7	11
2.67%	-56	-52	-48	-44	-40	-35	-31
5.33%	-77	-74	-71	-68	-65	-62	-58
8.00%	-83	-82	-81	-79	-77	-75	-73
KR4301P62725                      2019-06 풋272.5							147
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	147	147	147	147	147	147	147
-5.33%	94	94	94	94	95	95	96
-2.67%	42	42	43	44	45	47	48
0%	-6	-4	-2	0	2	4	7
2.67%	-42	-39	-36	-34	-31	-28	-25
5.33%	-61	-59	-57	-54	-52	-49	-47
8.00%	-68	-67	-66	-64	-63	-61	-59

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

(단위:백만원)

**1,577**

공시일	2019-05-21
기준일	2019-05-20

## 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	10,778	0	10,778	

### 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	2019-05-21
기준일	2019-05-20

## 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	60,542	0	60,542	

### 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	2019-05-21
기준일	2019-05-20

## 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	238,045	0	238,045	
누계	통화	선도	0	262,724	-262,724	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
FX21019J019 KRW/USD 18-06-19E		382
FX21019J024 KRW/USD 24-06-19E		955
FX21019J024 KRW/USD 22-05-19E		803
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		955
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		1,013
FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E		382
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		76
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		1,005
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E		1,032
FX21019J041 KRW/USD 28-05-19E		287
FX21019J043 KRW/USD 03-06-19E		573
FX21019J044 KRW/USD 03-06-19E		478
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		287
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		478
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		669
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		669
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		831
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		822
FX21019K00 KRW/USD 18-06-19E		573
FX21019K01 KRW/USD 14-06-19E		669
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		573
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		478
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		573
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,433
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,338

FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E	478
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E	803
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E	638
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E	478
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E	382
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E	803

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

(단위:백만원)

**7,119**

공시일	2019-05-21
기준일	2019-05-20

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

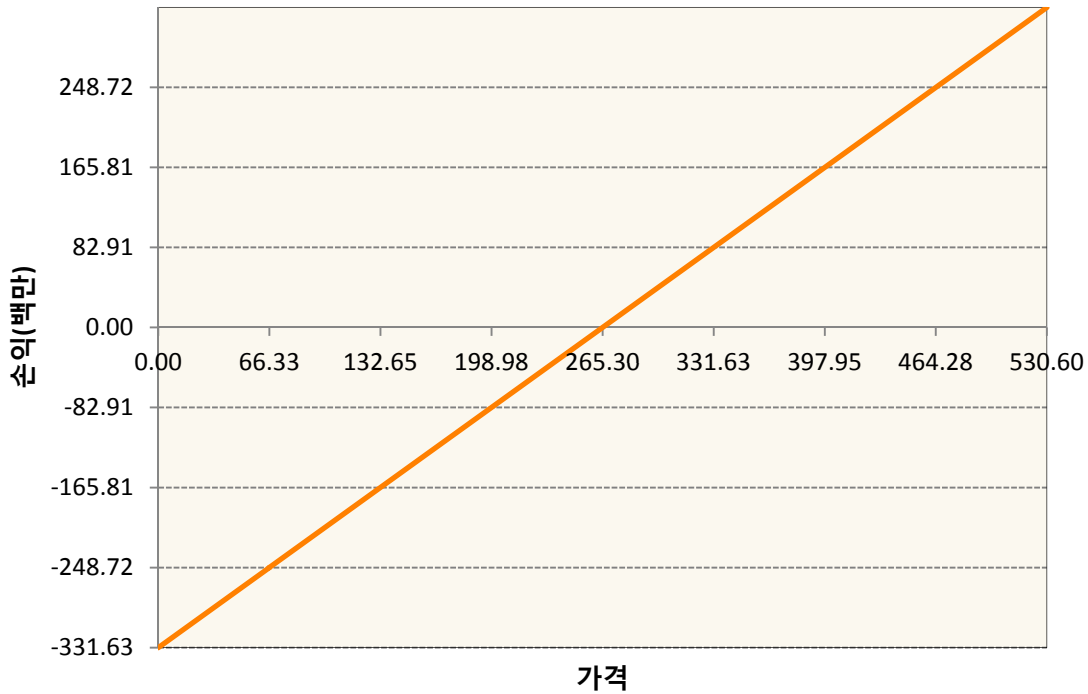
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

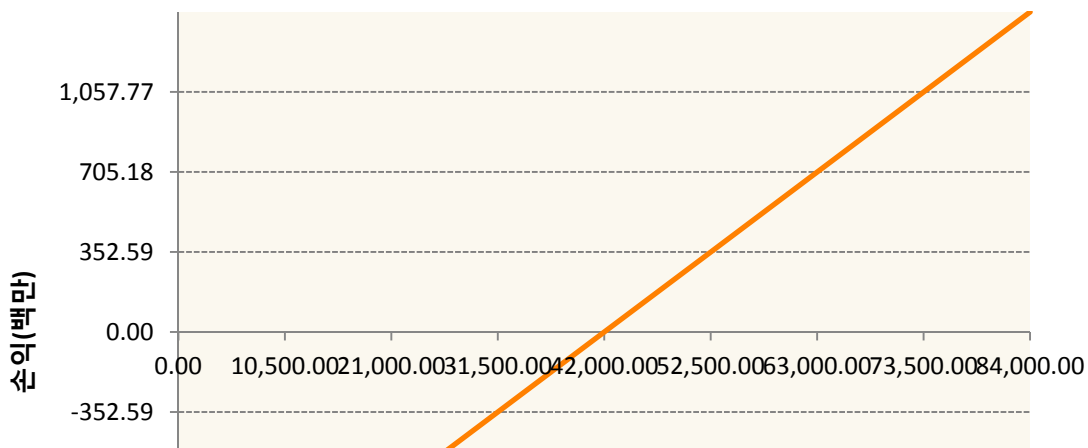
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,742	0	1,742	장내

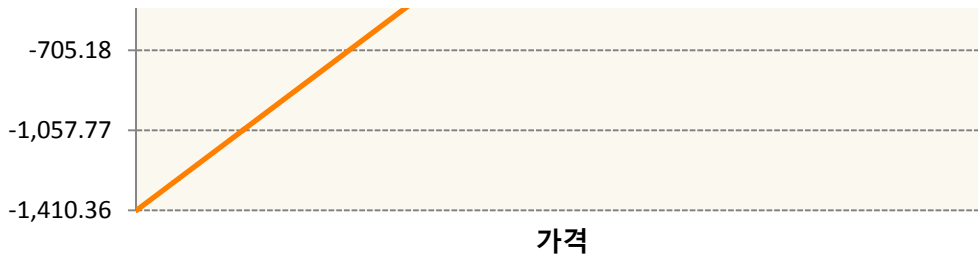
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4111P60003-2019-06 삼성전자개별선물





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

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						26
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26	
-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%	26	26	26	26	26	26	26	
KR4111P60003		2019-06 삼성전자개별선물						113
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-113	-113	-113	-113	-113	-113	-113	
-5.33%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75	
-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%	75	75	75	75	75	75	75	
8.00%	113	113	113	113	113	113	113	

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

**153**

공시일	2019-05-21
기준일	2019-05-20

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

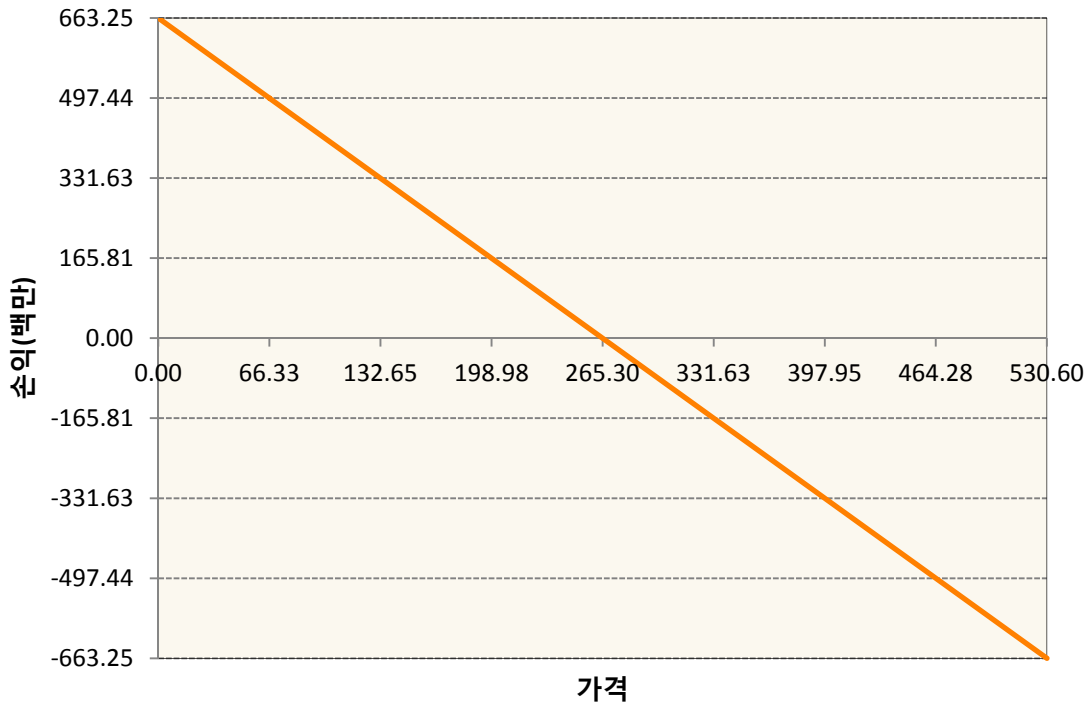
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

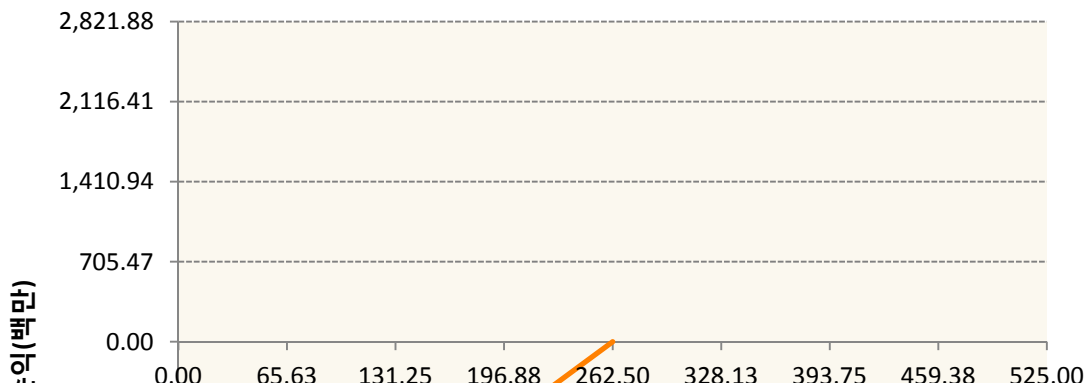
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	663	-663	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,352	-3,352	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

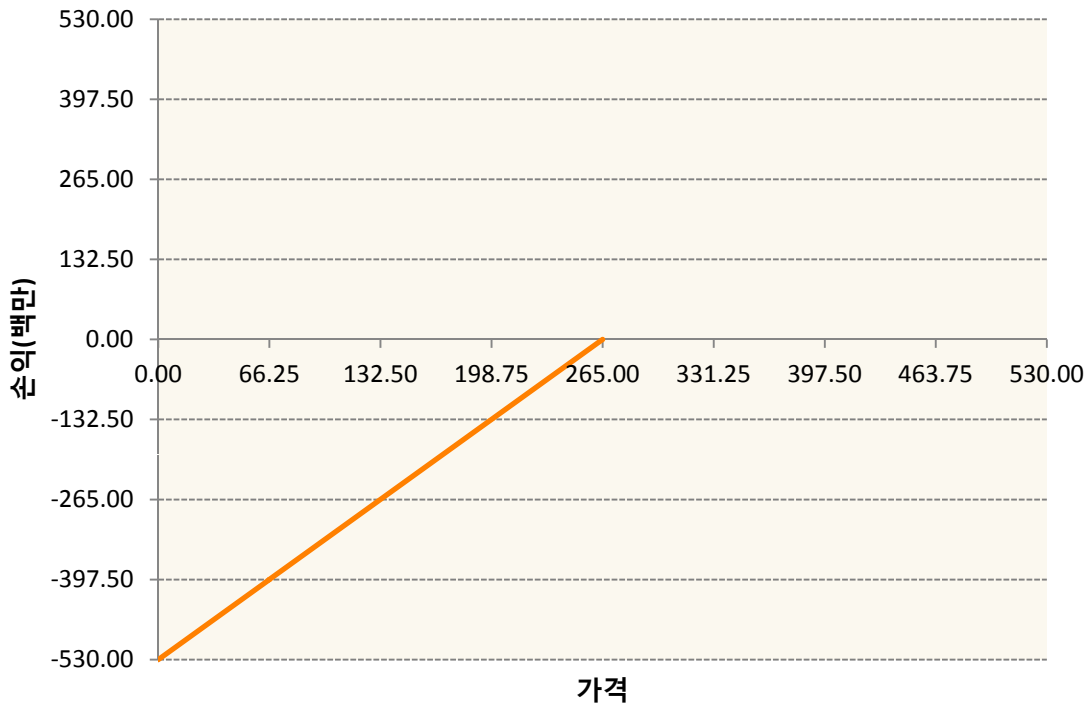


KR4301P62626-2019-06 풋262.5





KR4301P62659-2019-06 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						53
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	53	53	53	53	53	53	53	
-5.33%	35	35	35	35	35	35	35	
-2.67%	18	18	18	18	18	18	18	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	
8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53	
KR4301P62626		2019-06 풋262.5						172
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-168	-168	-168	-169	-170	-171	-172
-5.33%	-94	-96	-97	-99	-101	-104	-106
-2.67%	-31	-34	-37	-41	-44	-48	-51
0%	11	8	4	0	-4	-8	-11
2.67%	30	27	25	22	19	16	13
5.33%	34	34	33	31	30	28	26
8.00%	35	35	35	34	34	33	32
KR4301P62659                      2019-06 풋265							34
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
-5.33%	-20	-20	-20	-21	-21	-21	-22
-2.67%	-7	-8	-8	-9	-9	-10	-11
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	7	6	6	5	5	4	3
5.33%	9	8	8	8	7	7	7
8.00%	9	9	9	9	8	8	8

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

(단위:백만원)

**259**

공시일	2019-05-21
기준일	2019-05-20

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

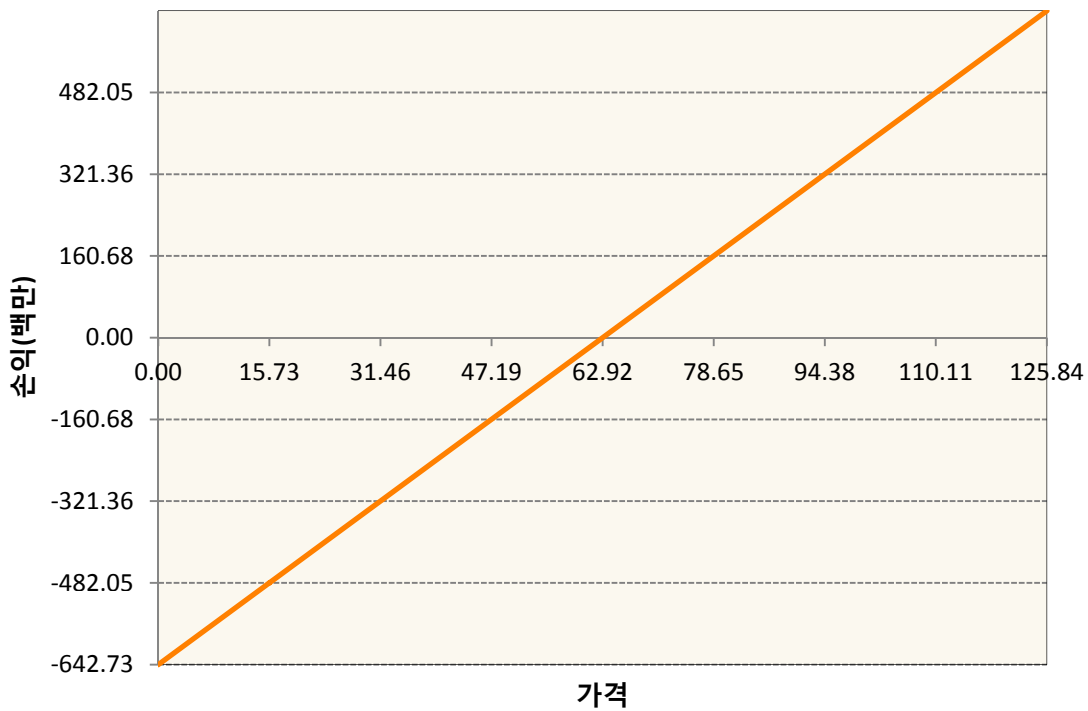
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

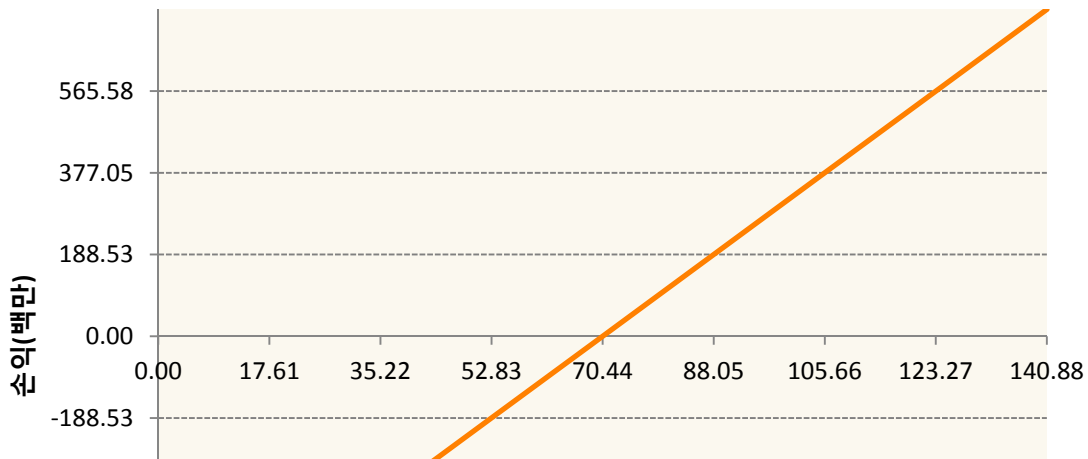
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,818	298	2,519	

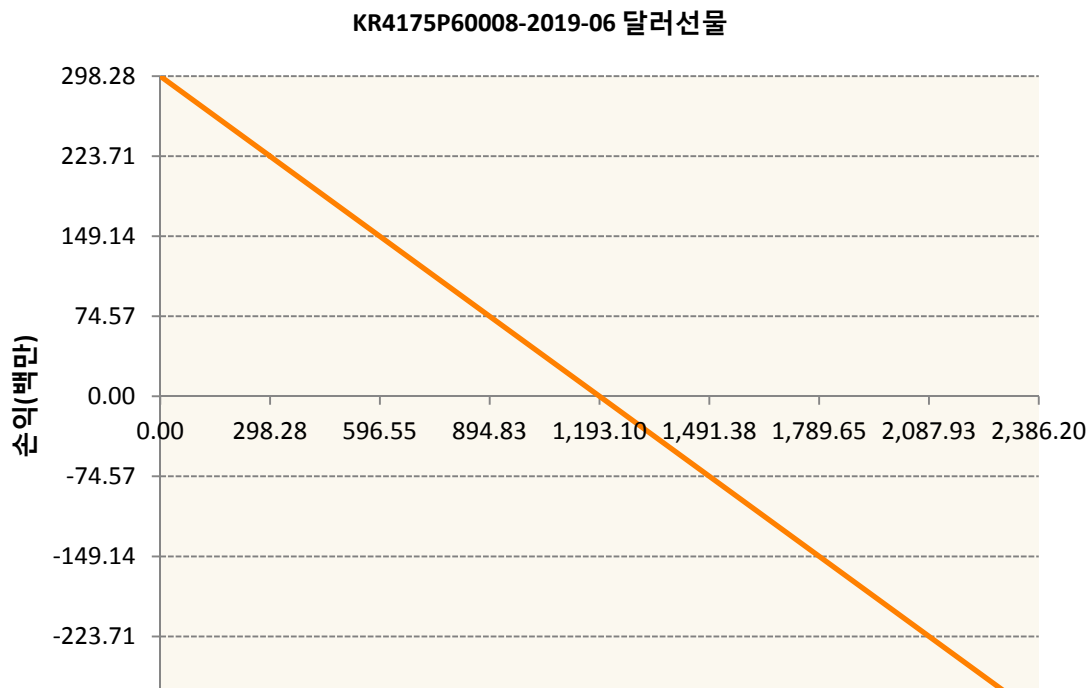
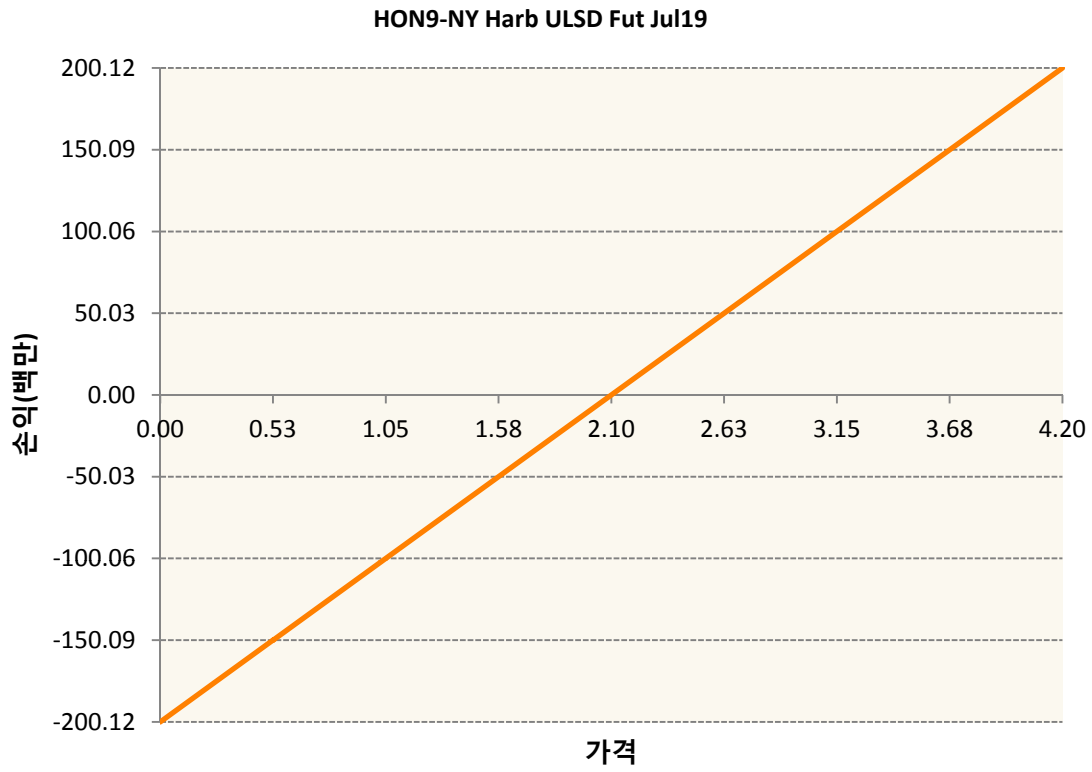
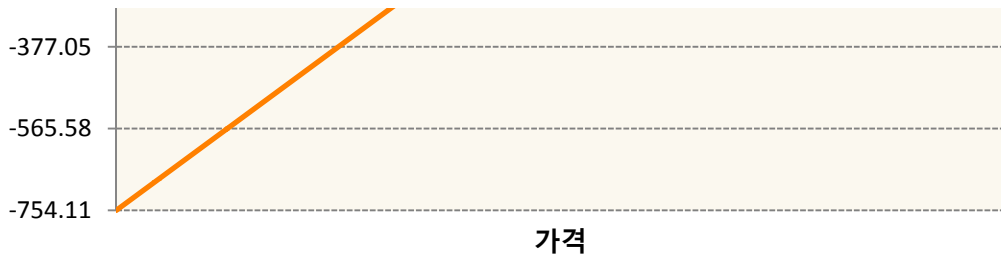
### 2. 만기시점의 손익구조

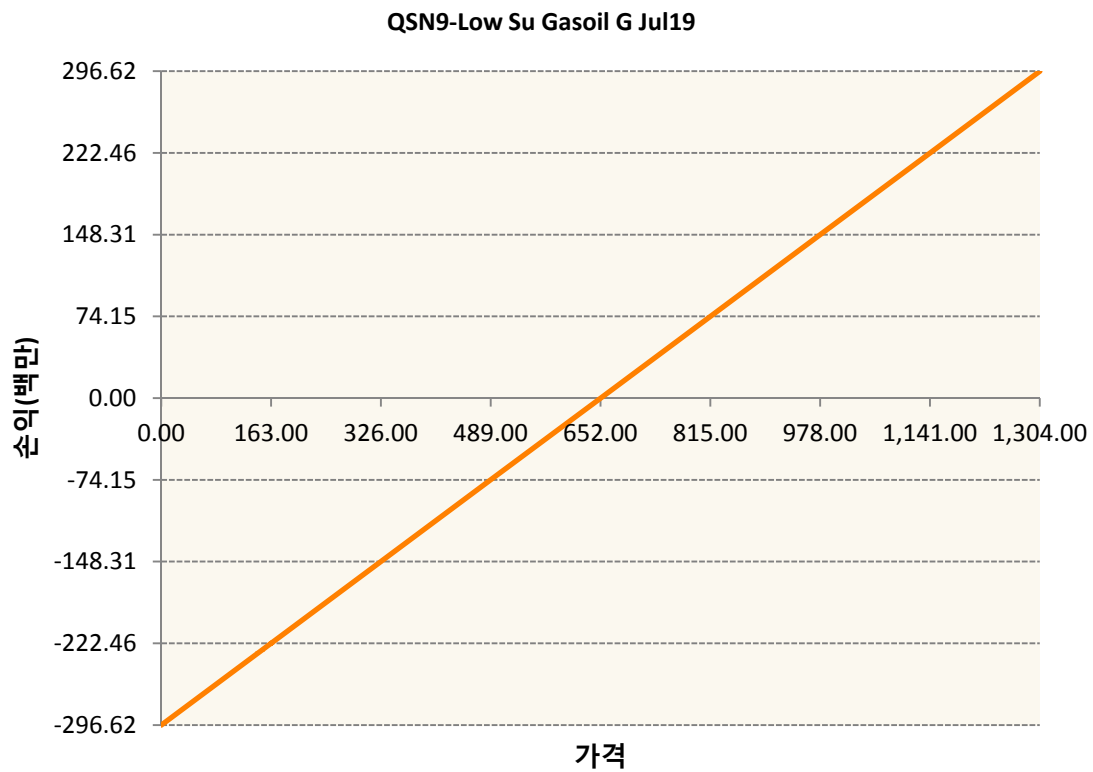
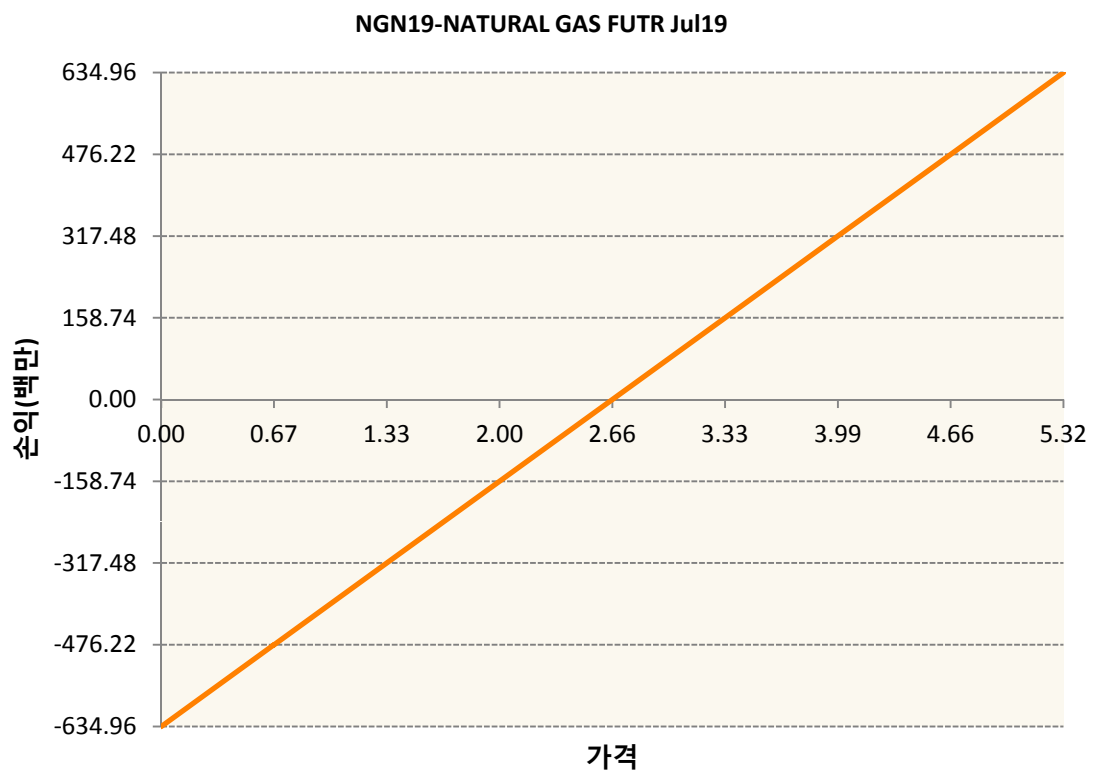
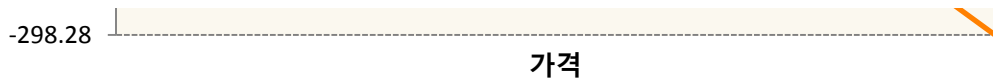
CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19



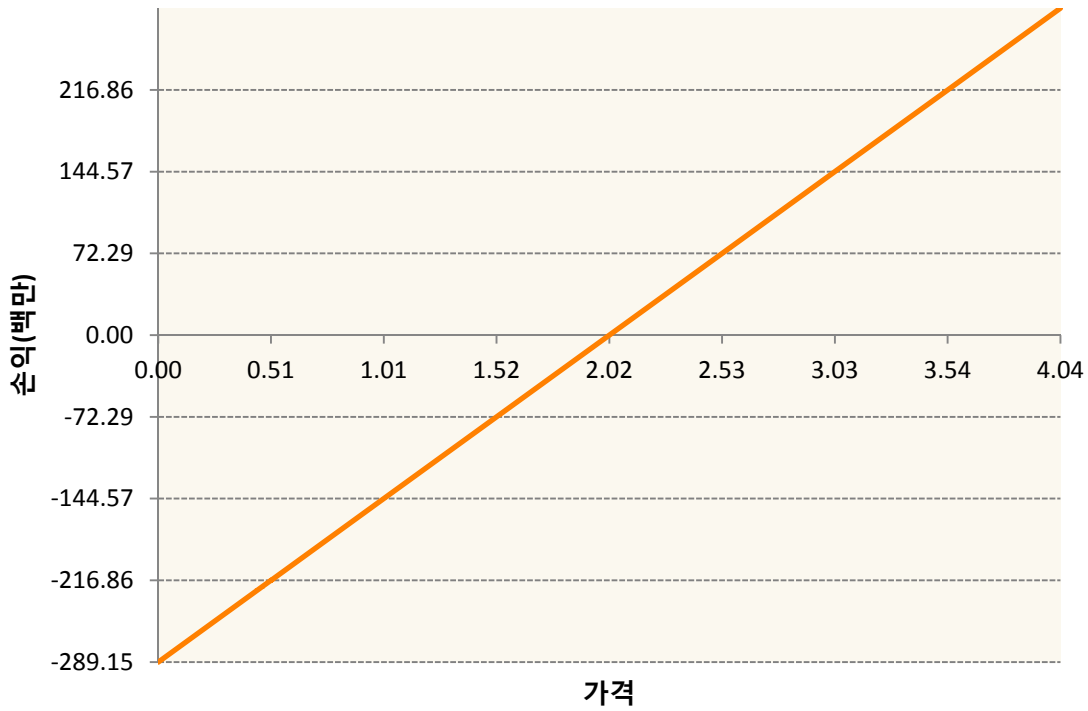
COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19







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
KR4175P600	2019-06 달러선물	24
NGN19	NATURAL GAS FUTR Jul19	51
QSN9	Low Su Gasoil G Jul19	24
XBN9	GASOLINE RBOB FUT Jul19	23

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

412

공시일	2019-05-21
기준일	2019-05-20

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

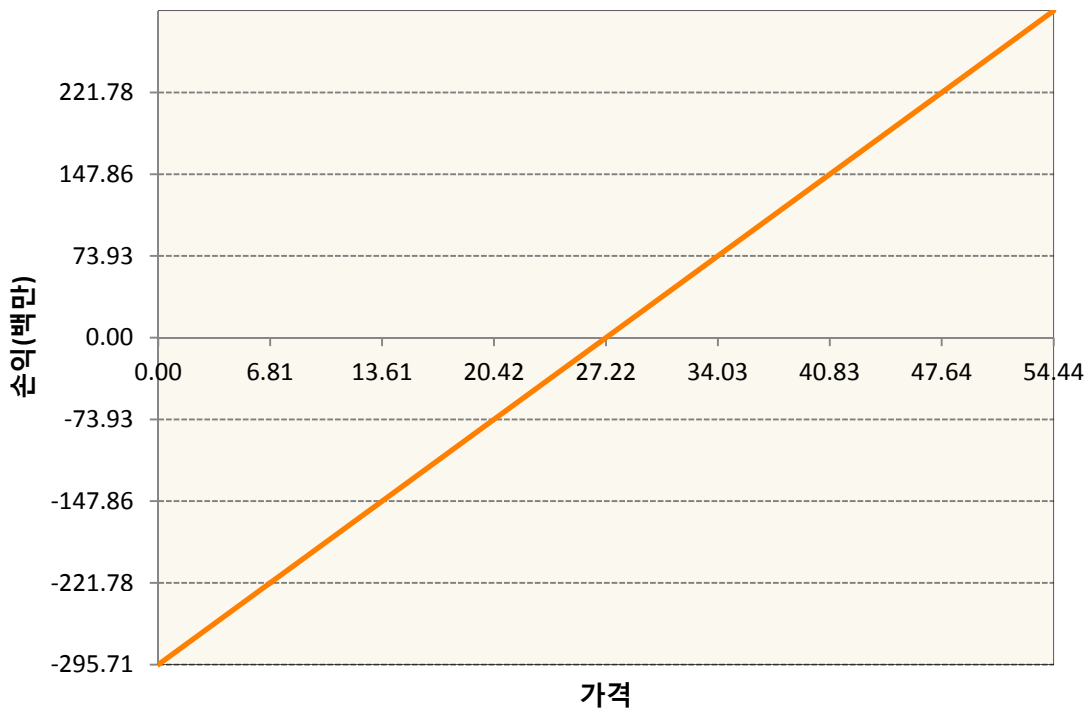
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

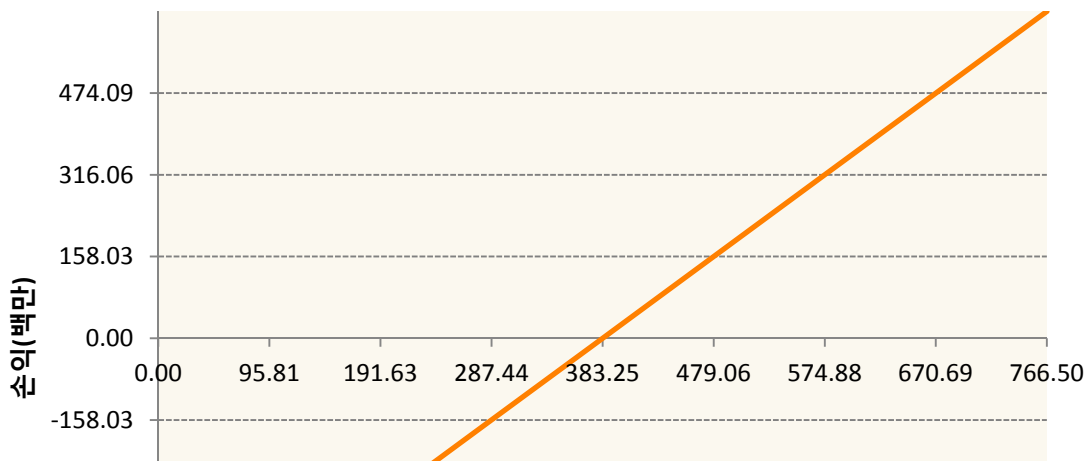
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,871	60	2,811	

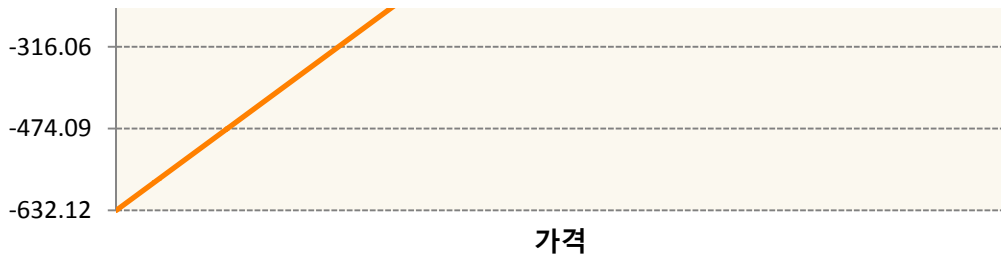
### 2. 만기시점의 손익구조

**BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19**

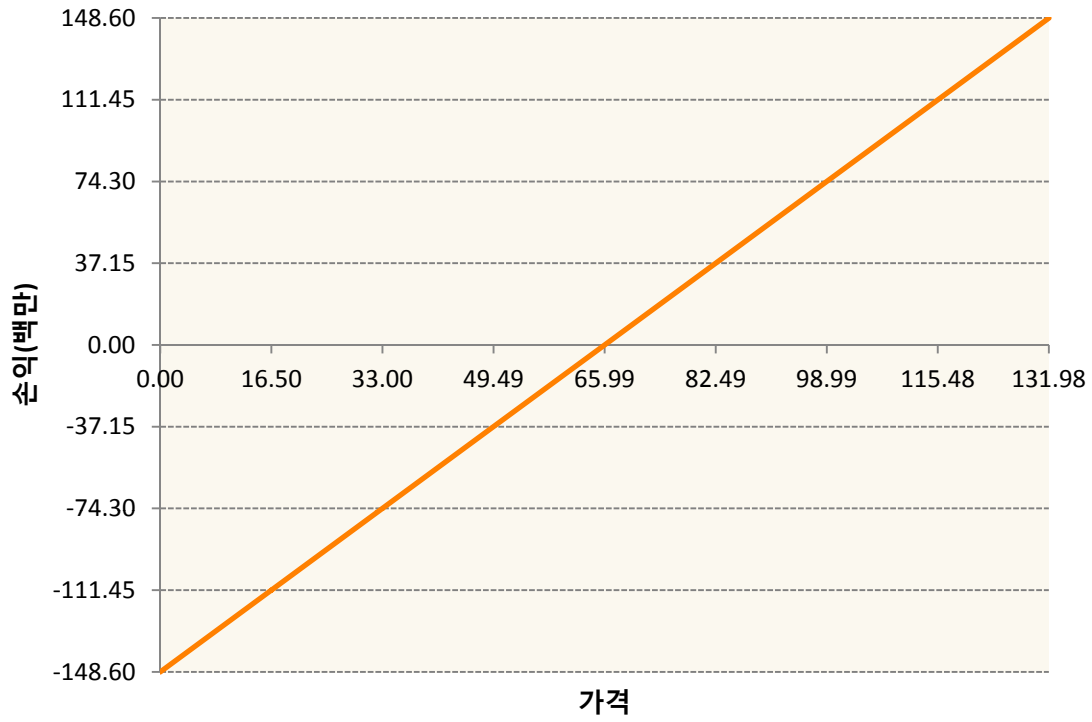


**CN9-CORN FUTURE Jul19**

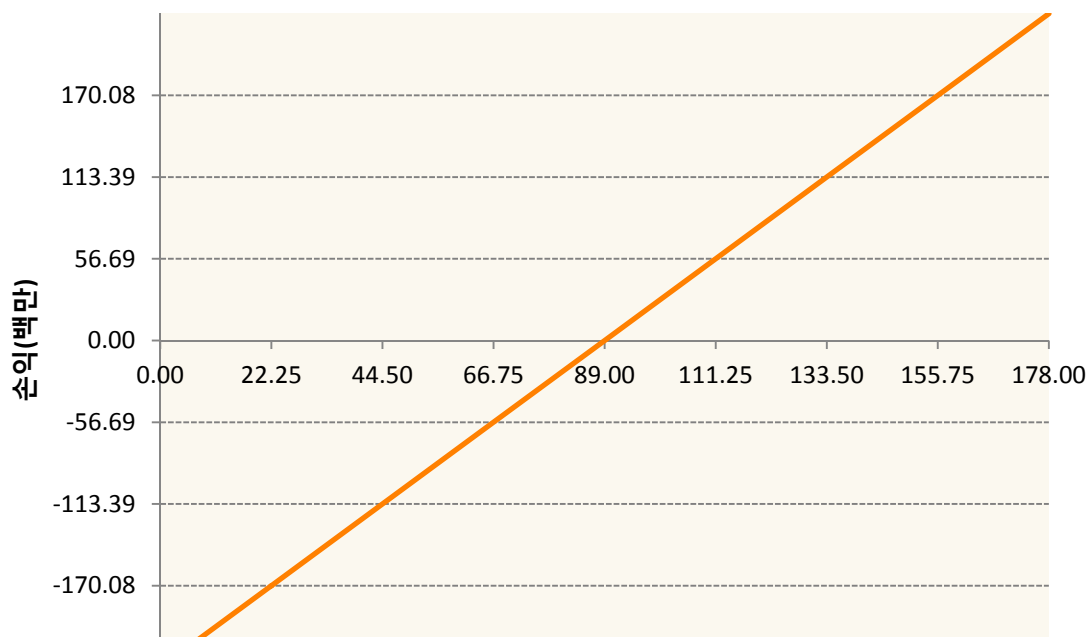


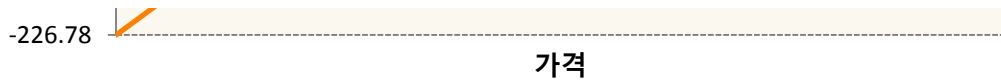


CTN9-COTTON NO.2 FUTR Jul19

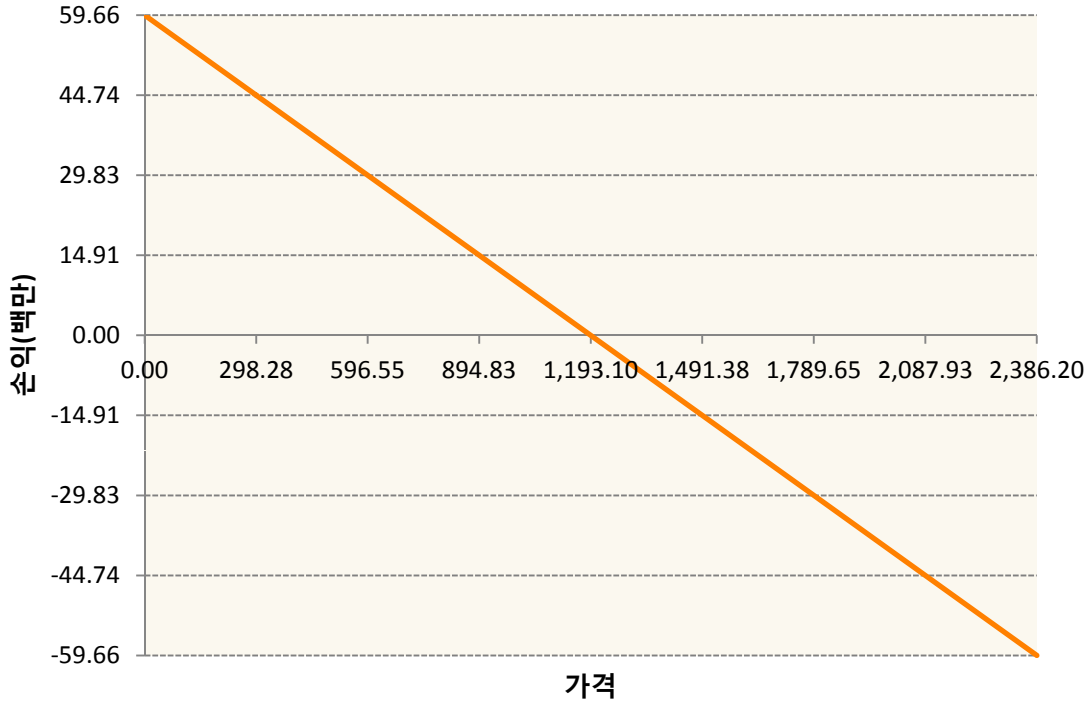


KCN9-COFFEE 'C' FUTURE Jul19

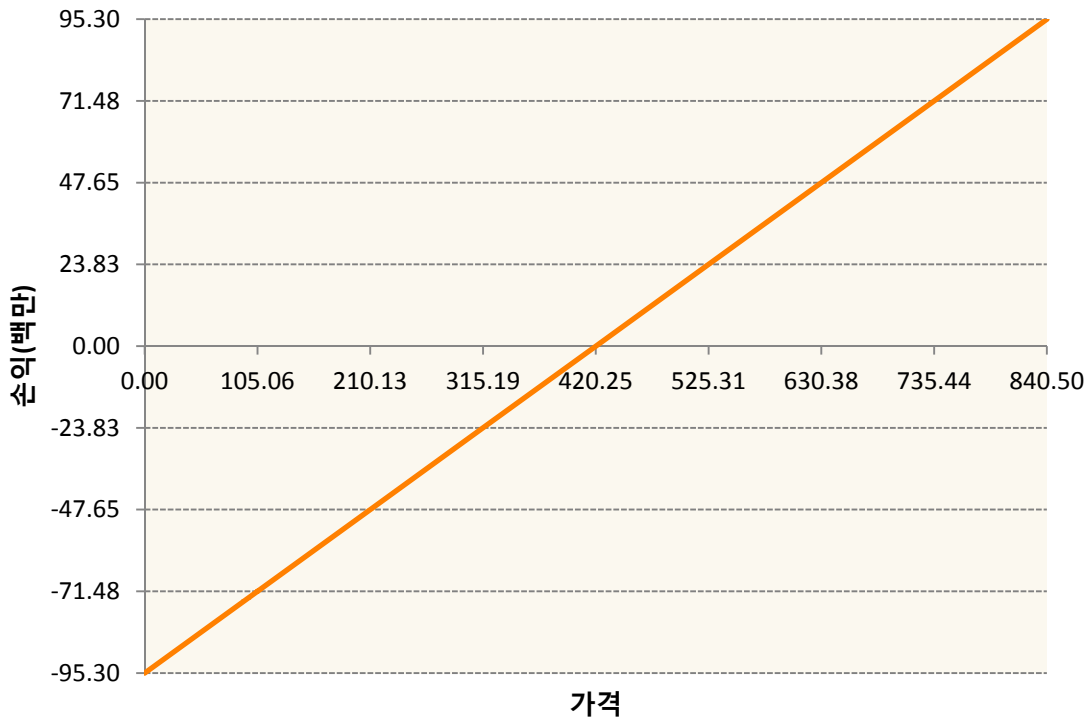




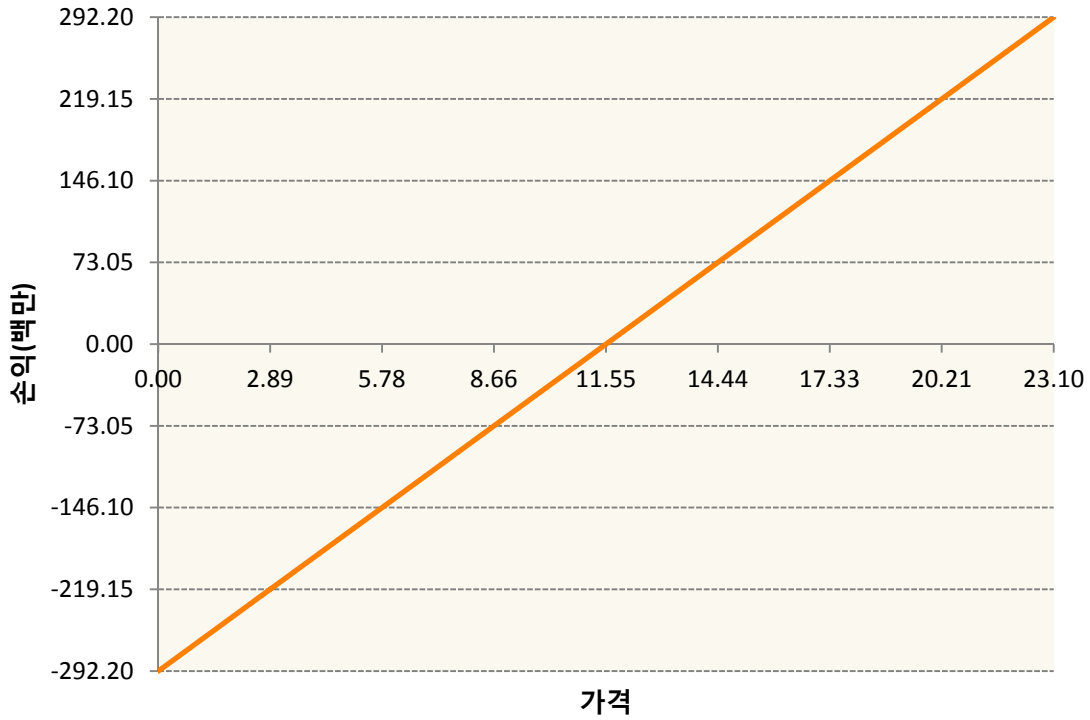
KR4175P60008-2019-06 달러선물



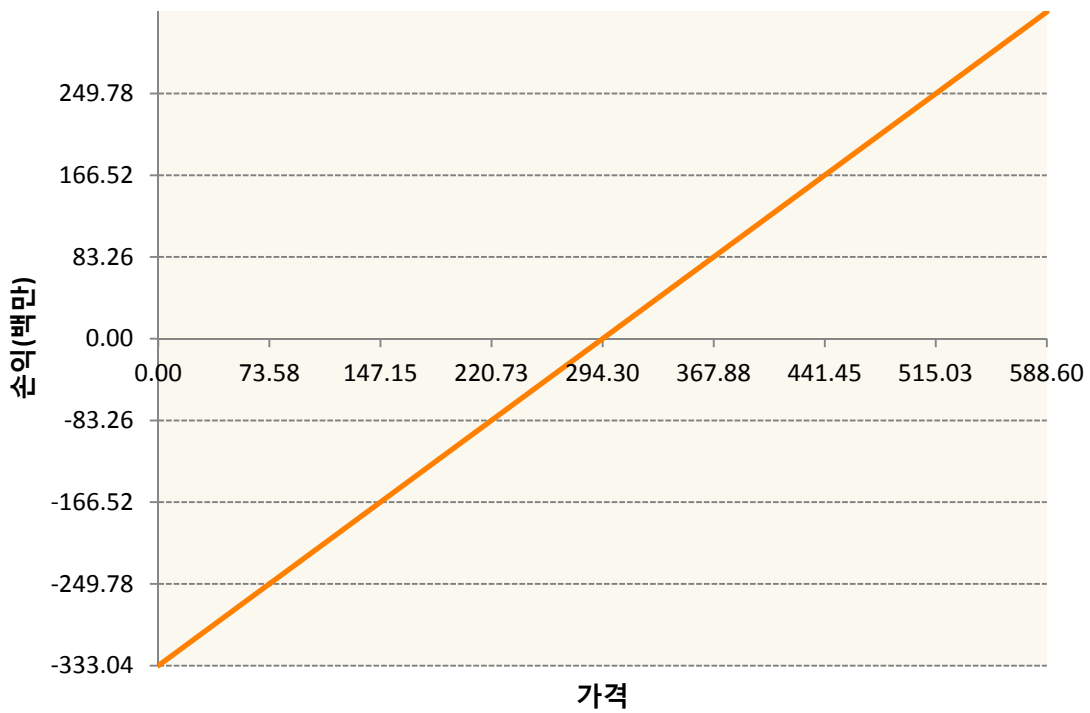
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



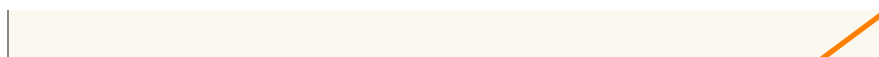
SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

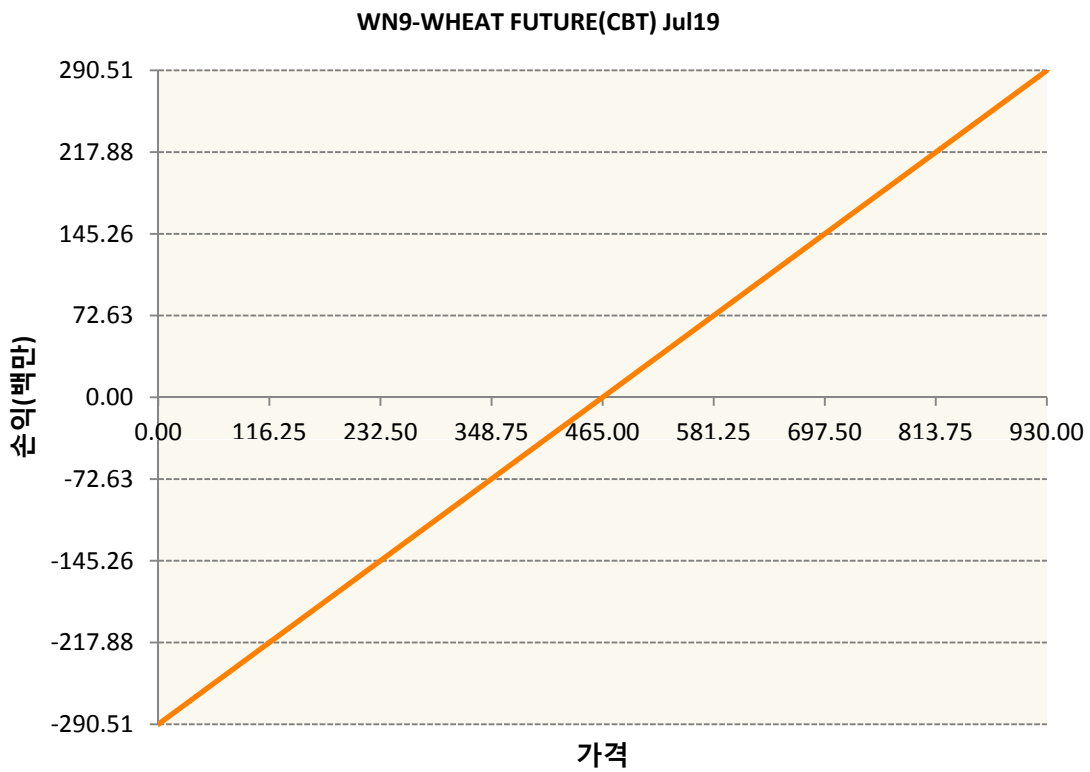
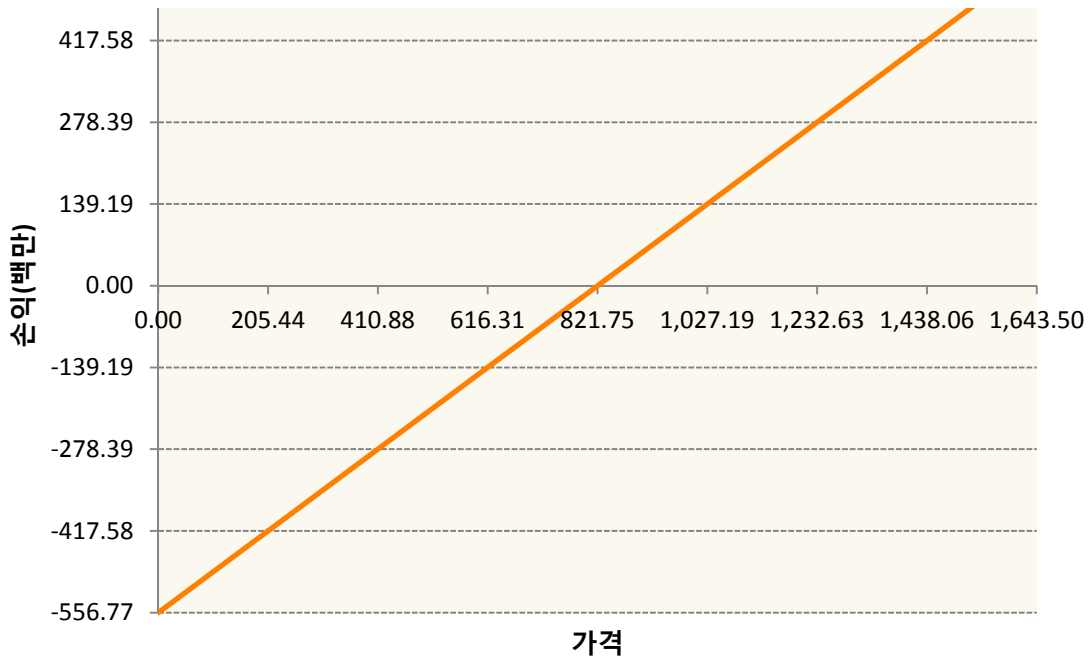


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19



SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BON9	SOYBEAN OIL FUTR Jul19	24
CN9	CORN FUTURE Jul19	51
CTN9	COTTON NO.2 FUTR Jul19	12
KCN9	COFFEE 'C' FUTURE Jul19	18
KR4175P600	2019-06 달러선물	5

KWN9	KC HRW WHEAT FUT Jul19	8
SBN9	SUGAR #11 (WORLD) Jul19	23
SMN9	SOYBEAN MEAL FUTR Jul19	27
SN9	SOYBEAN FUTURE Jul19	45
WN9	WHEAT FUTURE(CBT) Jul19	23

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

(단위:백만원)

**236**