

공시일	2019-05-22
기준일	2019-05-21

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	2019-05-22
기준일	2019-05-21

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

1,130

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

675

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-05-22
기준일	2019-05-21

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)	302
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	83
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	142

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

879

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-05-22
기준일	2019-05-21

유로인덱스모(주식-파생형)

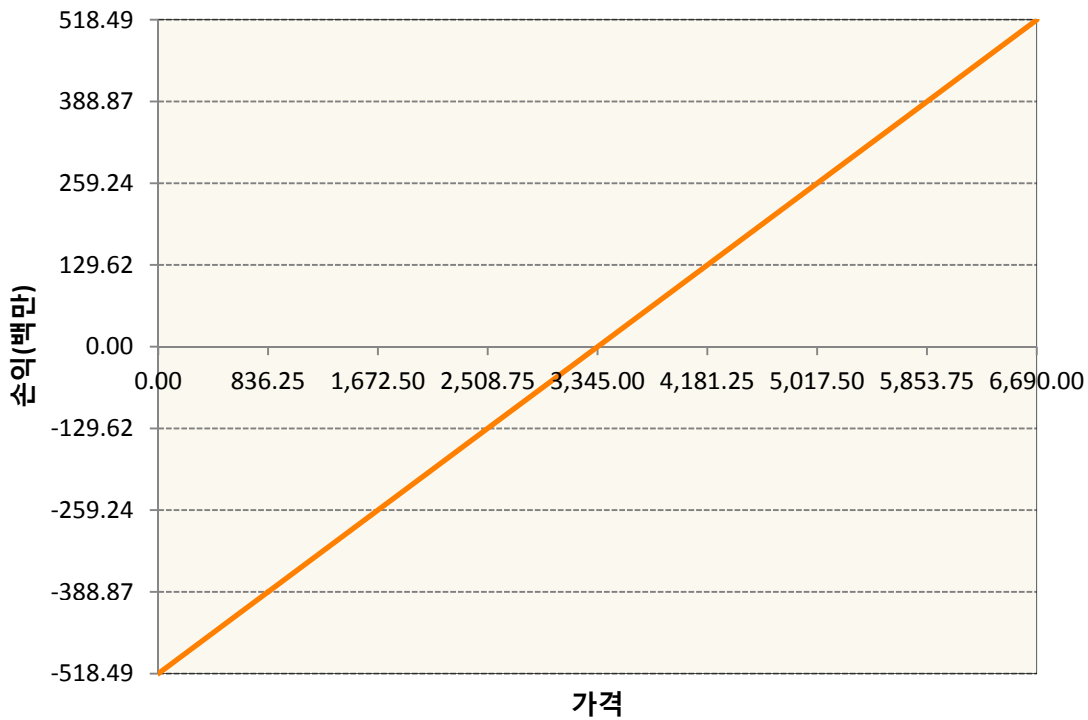
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	518	0	518	

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	2019-05-22
기준일	2019-05-21

차이나인덱스모(주식-파생형)

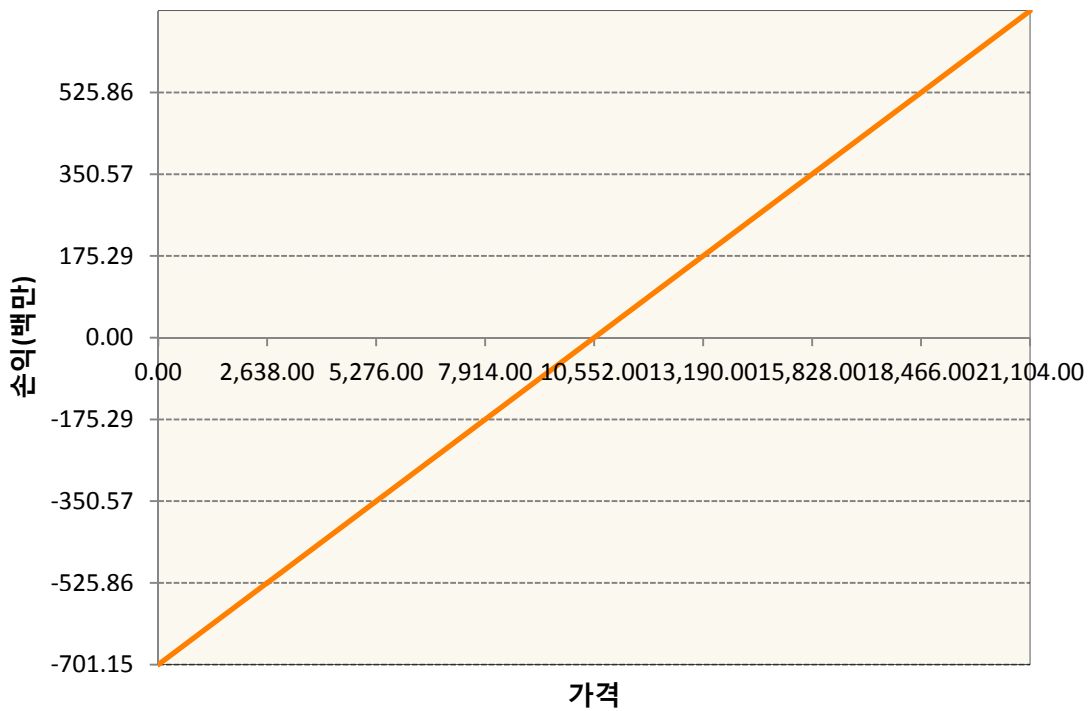
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	701	0	701	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	2019-05-22
기준일	2019-05-21

커버드콜모(주식혼합-파생형)

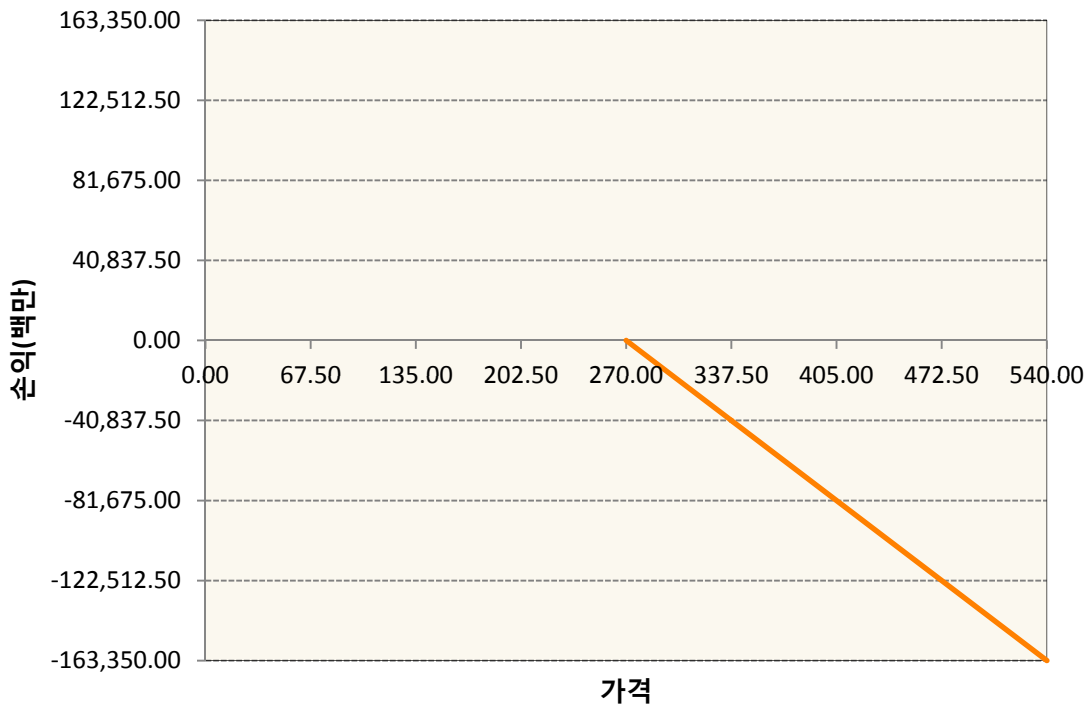
1. 계약금액

(단위:백만원)

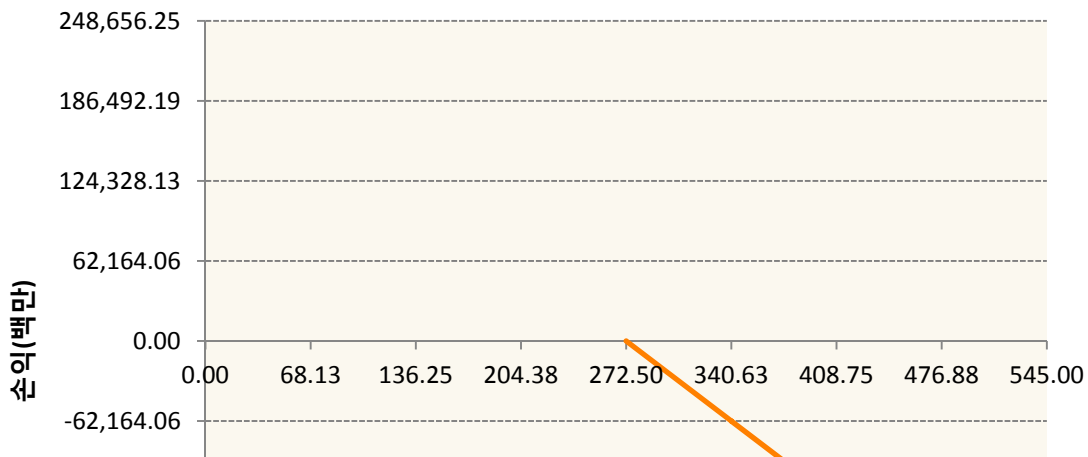
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	614,506	-614,506	장내

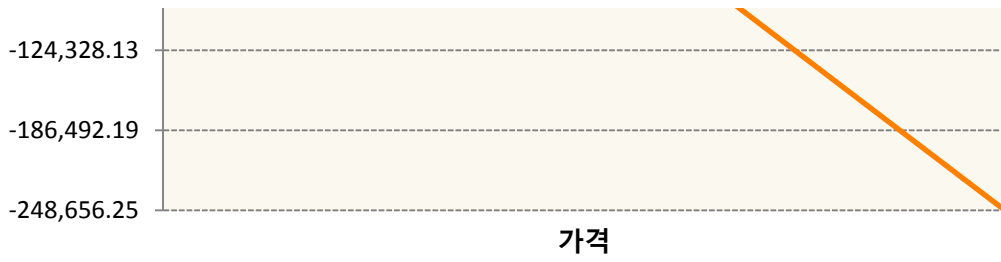
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P62701-2019-06 콜270



KR4201P62727-2019-06 콜272.5





KR4301P62709-2019-06 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P62701		2019-06 콜270					9,090
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,949	2,901	2,833	2,744	2,635	2,508	2,364
-5.33%	2,764	2,637	2,487	2,314	2,124	1,918	1,698
-2.67%	2,213	1,975	1,722	1,456	1,181	897	607
0%	988	661	332	0	-333	-667	-1,003
2.67%	-1,132	-1,470	-1,809	-2,150	-2,491	-2,833	-3,175
5.33%	-4,135	-4,402	-4,683	-4,975	-5,275	-5,582	-5,894
8.00%	-7,793	-7,959	-8,150	-8,361	-8,590	-8,834	-9,090
KR4201P62727		2019-06 콜272.5					12,831
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,646	3,595	3,519	3,415	3,282	3,123	2,937

-5.33%	3,462	3,316	3,133	2,916	2,669	2,396	2,100
-2.67%	2,862	2,559	2,225	1,867	1,488	1,093	685
0%	1,410	949	478	0	-484	-973	-1,466
2.67%	-1,298	-1,823	-2,347	-2,872	-3,396	-3,921	-4,445
5.33%	-5,378	-5,834	-6,303	-6,782	-7,269	-7,761	-8,259
8.00%	-10,583	-10,893	-11,236	-11,605	-11,997	-12,406	-12,831
KR4301P62709 2019-06 풋270							14,171
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,095	-14,097	-14,101	-14,109	-14,122	-14,143	-14,171
-5.33%	-8,797	-8,817	-8,848	-8,893	-8,951	-9,022	-9,107
-2.67%	-3,663	-3,765	-3,885	-4,021	-4,172	-4,334	-4,507
0%	708	477	240	0	-243	-489	-736
2.67%	3,460	3,213	2,963	2,711	2,458	2,203	1,946
5.33%	4,562	4,432	4,283	4,119	3,943	3,755	3,559
8.00%	4,821	4,785	4,733	4,664	4,580	4,480	4,366

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

(단위:백만원)

36,090

공시일	2019-05-22
기준일	2019-05-21

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

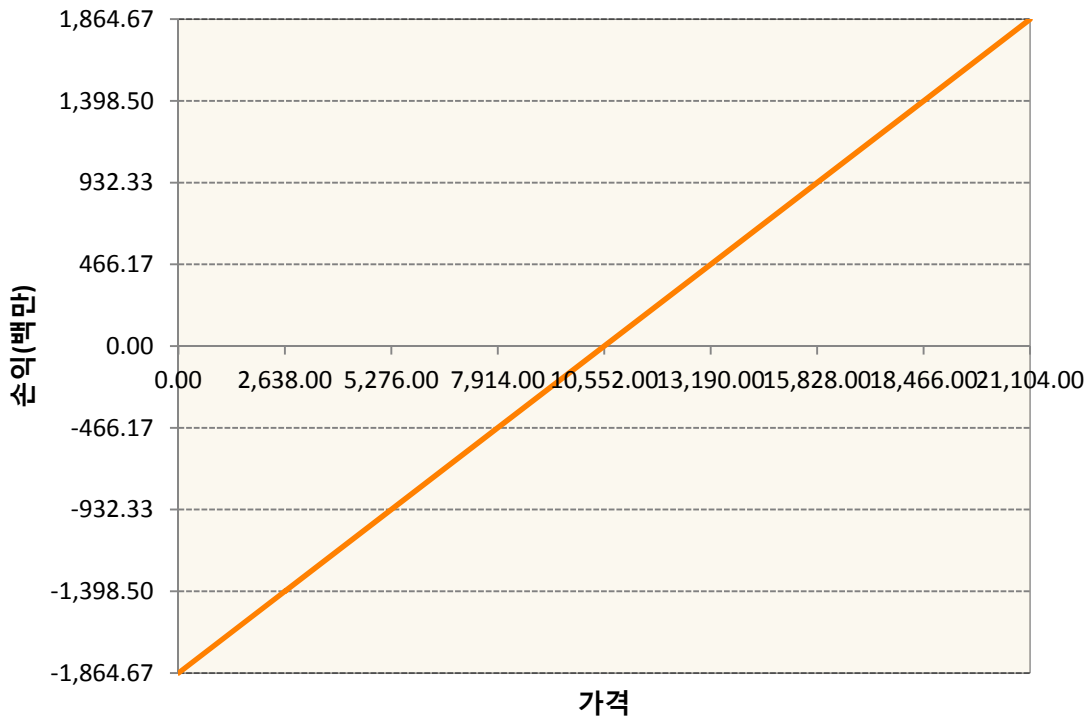
1. 계약금액

(단위:백만원)

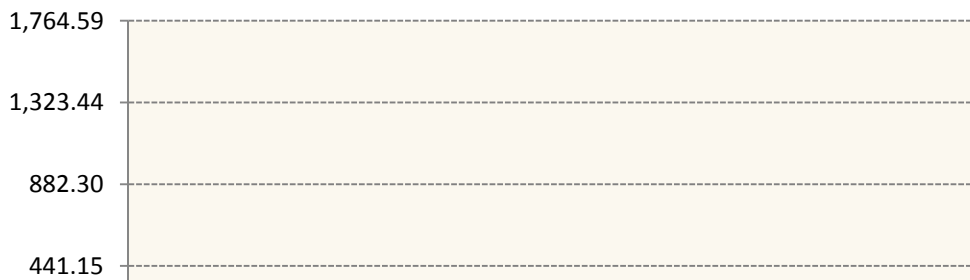
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,865	0	1,865	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,665	-5,665	장내
누계	통화	선도	0	3,195	-3,195	장외

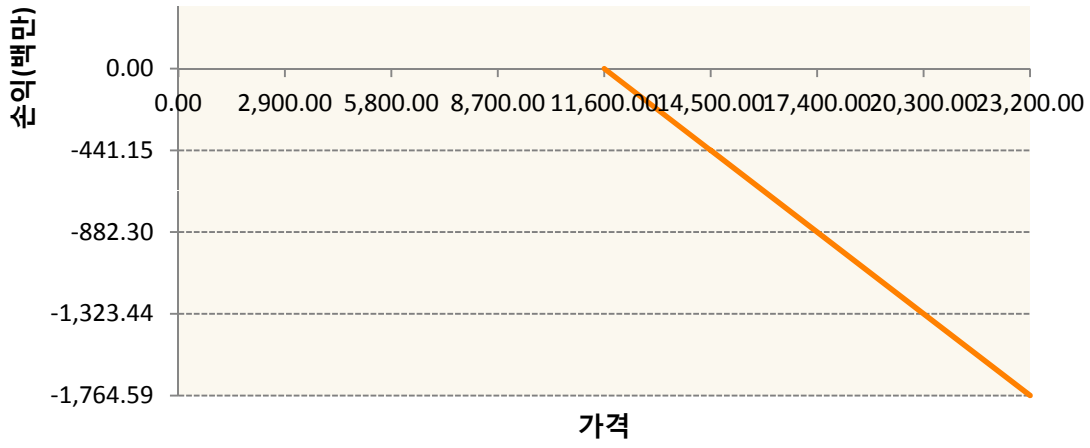
2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19

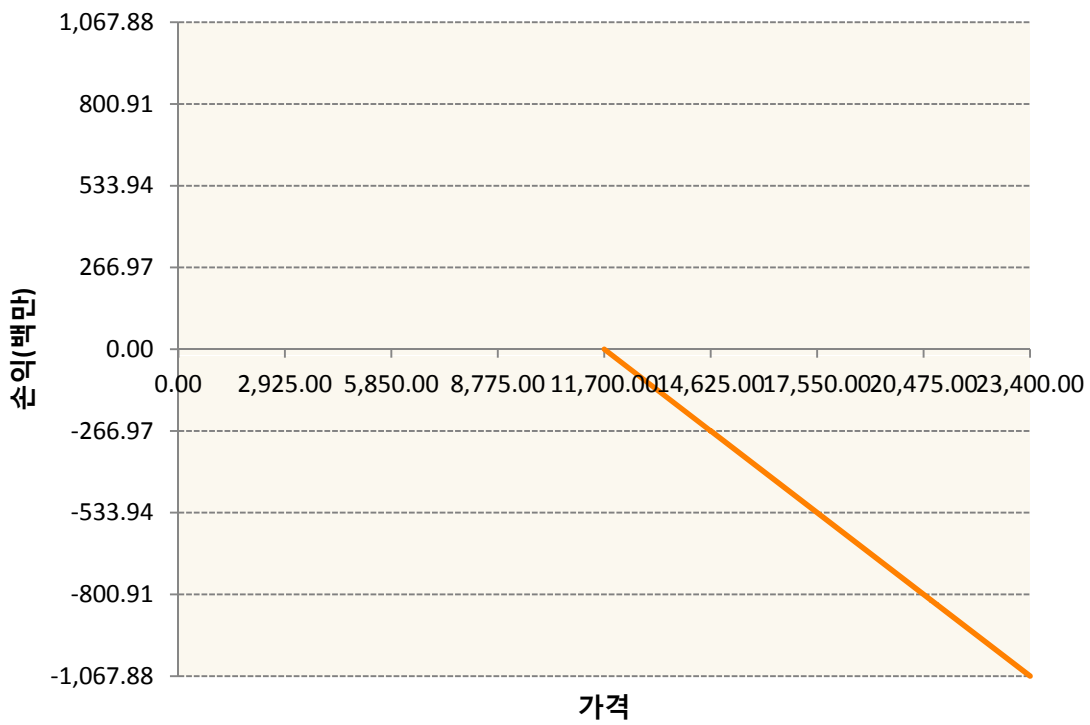


OHHIK9-C116-HSCEI

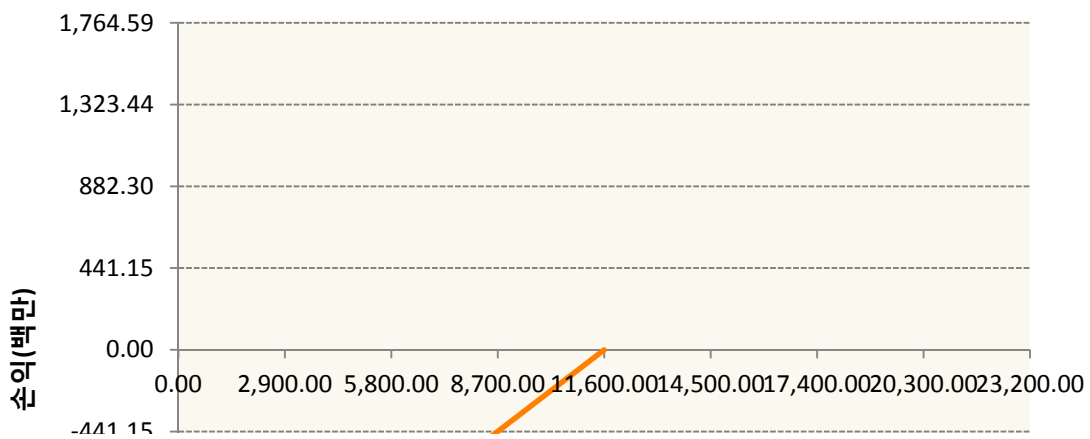


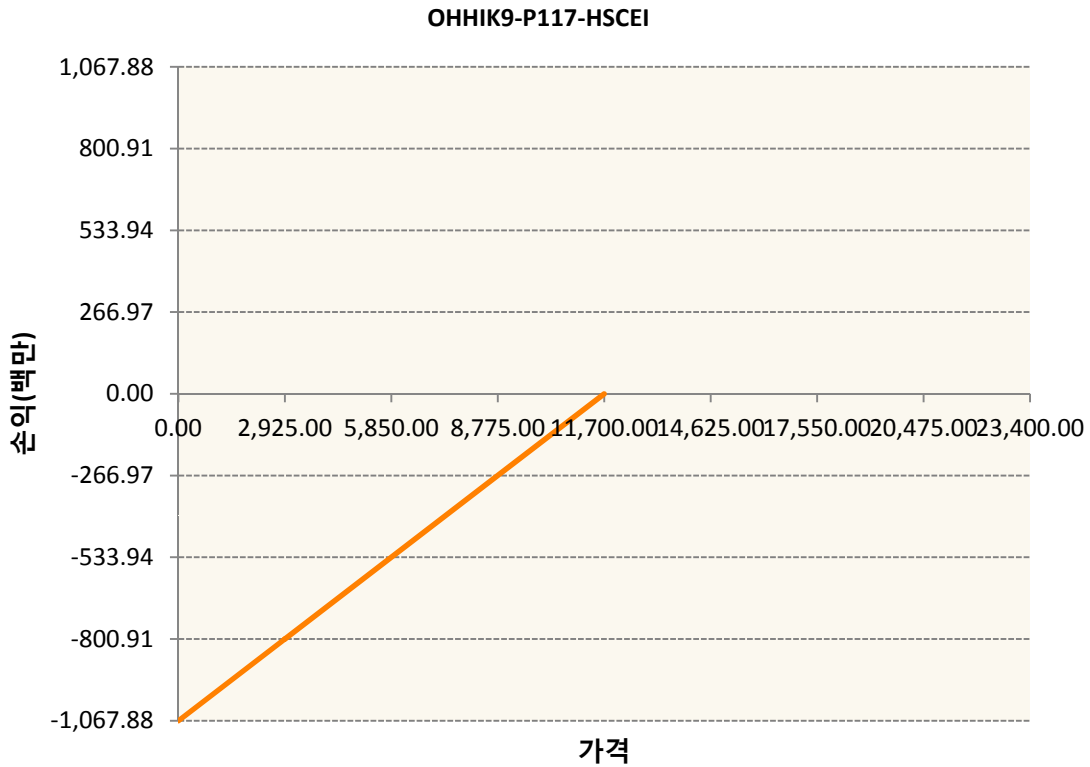


OHHIK9-C117-HSCEI



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	149
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)

704

공시일	2019-05-22
기준일	2019-05-21

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

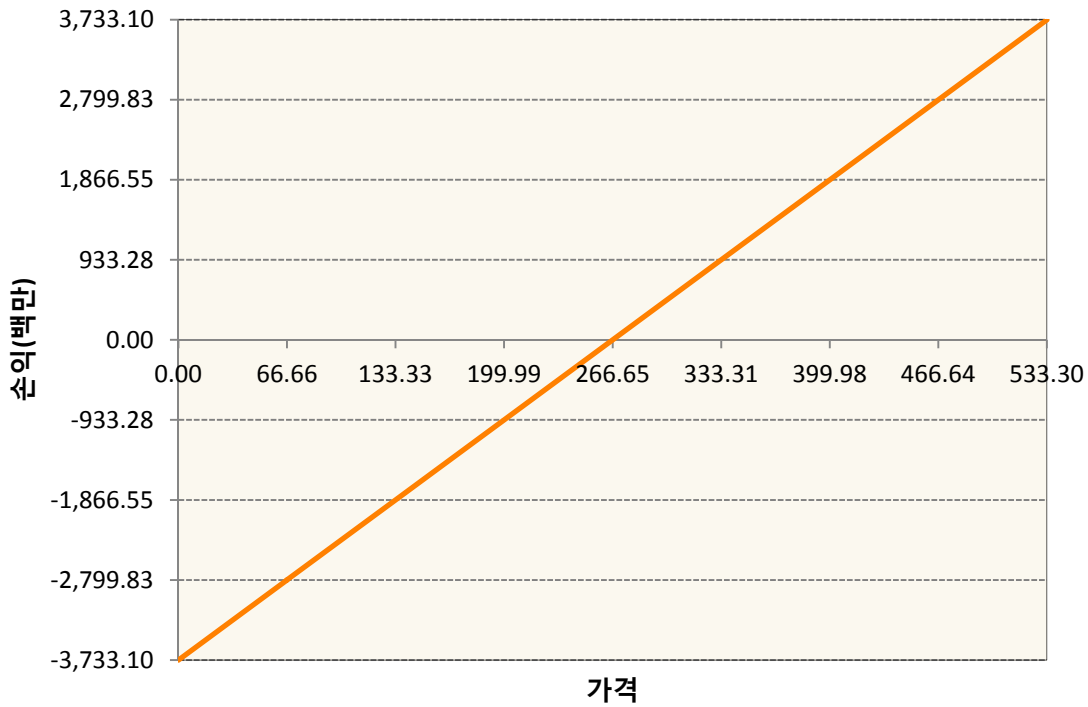
1. 계약금액

(단위:백만원)

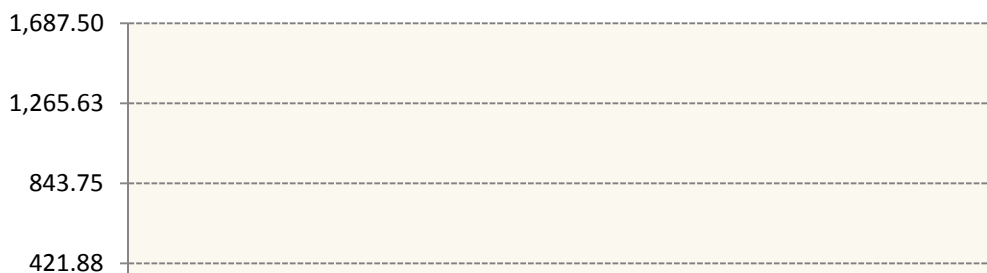
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	6,000	-6,000	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,733	0	3,733	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	21,759	-21,759	장내

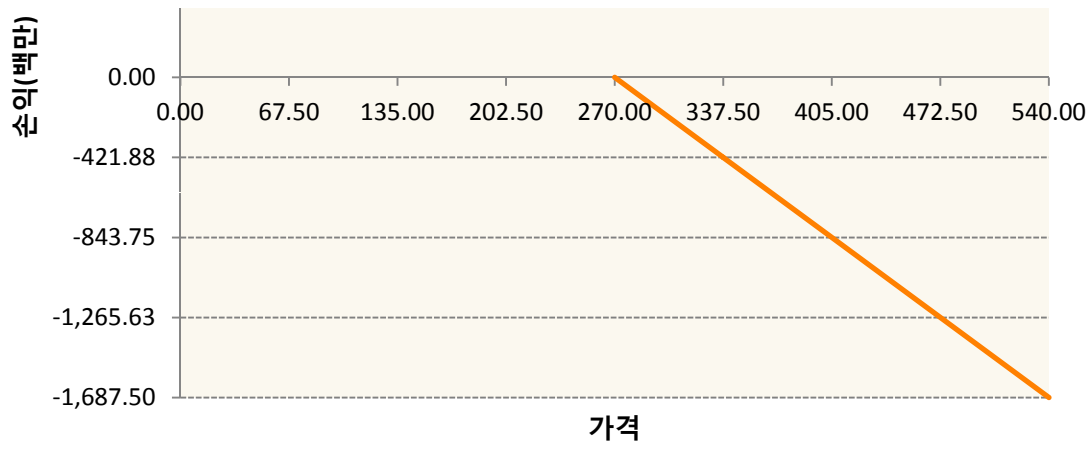
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

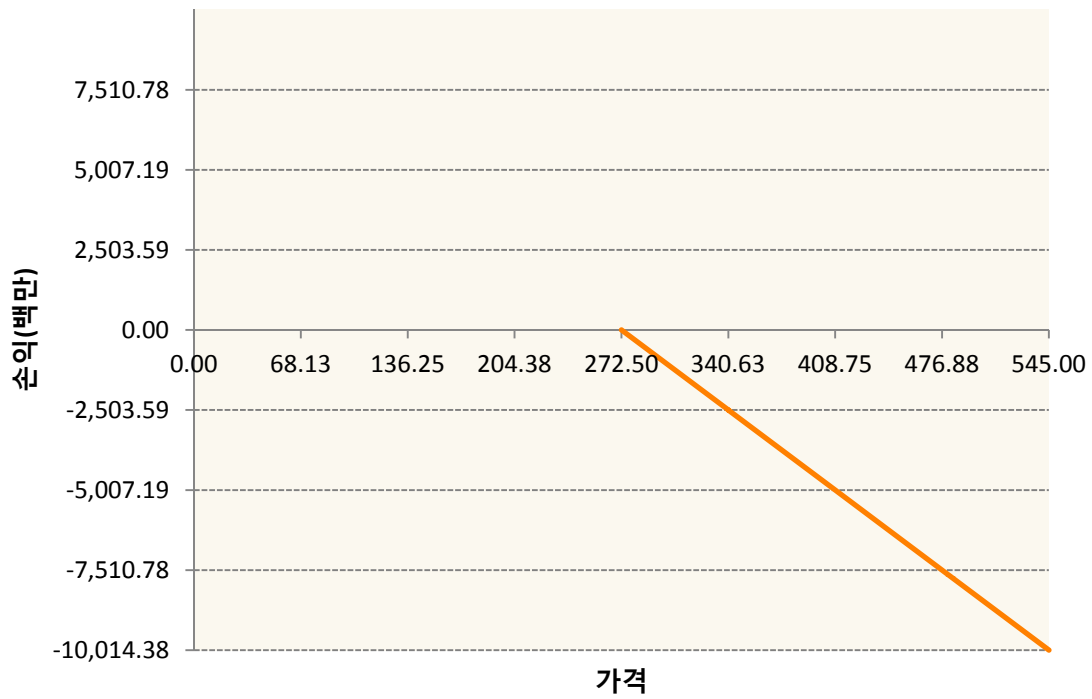


KR4201P62701-2019-06 콜270

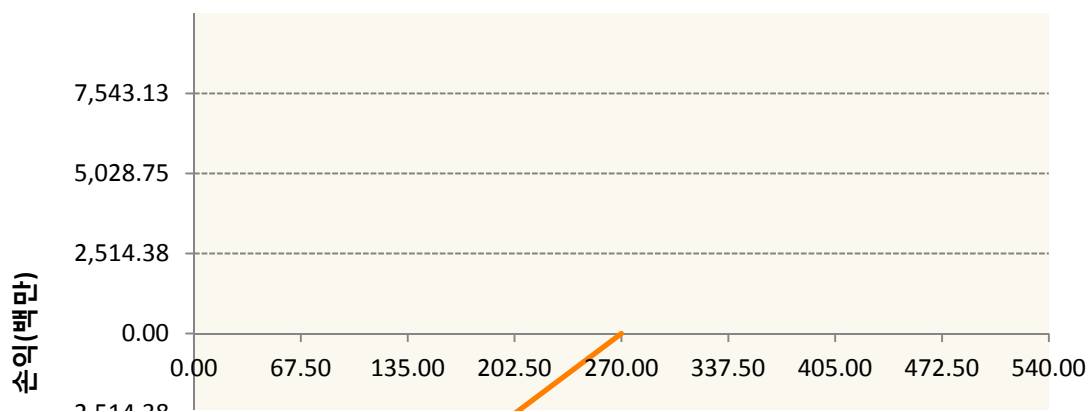


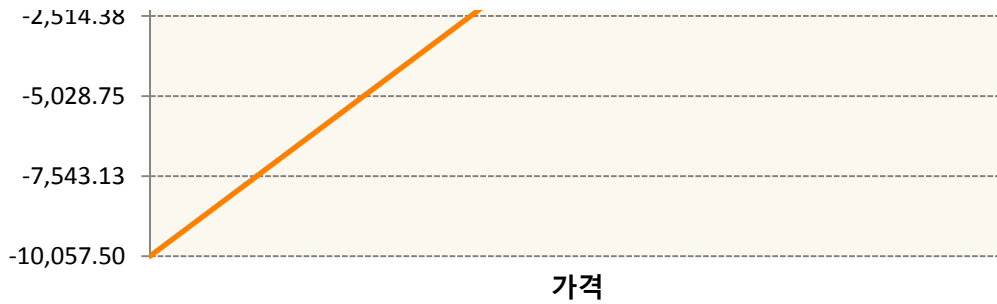


KR4201P62727-2019-06 콜272.5



KR4301P62709-2019-06 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,191
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,191	-1,191	-1,191	-1,191	-1,191	-1,191	-1,191	
-5.33%	-794	-794	-794	-794	-794	-794	-794	
-2.67%	-397	-397	-397	-397	-397	-397	-397	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	397	397	397	397	397	397	397	
5.33%	794	794	794	794	794	794	794	
8.00%	1,191	1,191	1,191	1,191	1,191	1,191	1,191	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						603
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-603	-603	-603	-603	-603	-603	-603	
-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%	603	603	603	603	603	603	603	
KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						298
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-298	-298	-298	-298	-298	-298	-298	
-5.33%	-199	-199	-199	-199	-199	-199	-199	
-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%	199	199	199	199	199	199	199	
8.00%	298	298	298	298	298	298	298	
KR4201P62701		2019-06 콜270						94
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	30	30	29	28	27	26	24
-5.33%	29	27	26	24	22	20	18
-2.67%	23	20	18	15	12	9	6
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	-12	-15	-19	-22	-26	-29	-33
5.33%	-43	-45	-48	-51	-54	-58	-61
8.00%	-81	-82	-84	-86	-89	-91	-94
KR4201P62727 2019-06 콜272.5							517
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	147	145	142	138	132	126	118
-5.33%	139	134	126	117	108	97	85
-2.67%	115	103	90	75	60	44	28
0%	57	38	19	0	-20	-39	-59
2.67%	-52	-73	-95	-116	-137	-158	-179
5.33%	-217	-235	-254	-273	-293	-313	-333
8.00%	-426	-439	-453	-467	-483	-500	-517
KR4301P62709 2019-06 풋270							704
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-700	-700	-700	-701	-701	-702	-704
-5.33%	-437	-438	-439	-442	-445	-448	-452
-2.67%	-182	-187	-193	-200	-207	-215	-224
0%	35	24	12	0	-12	-24	-37
2.67%	172	160	147	135	122	109	97
5.33%	227	220	213	205	196	187	177
8.00%	239	238	235	232	227	222	217

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

(단위:백만원)

3,393

공시일	2019-05-22
기준일	2019-05-21

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

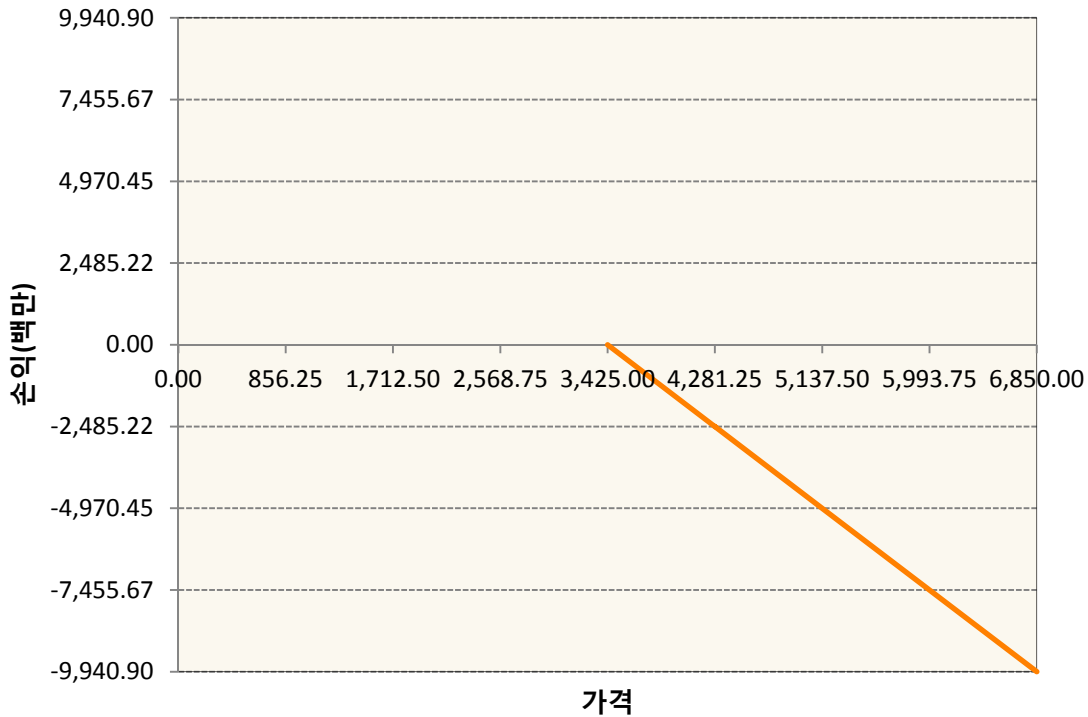
1. 계약금액

(단위:백만원)

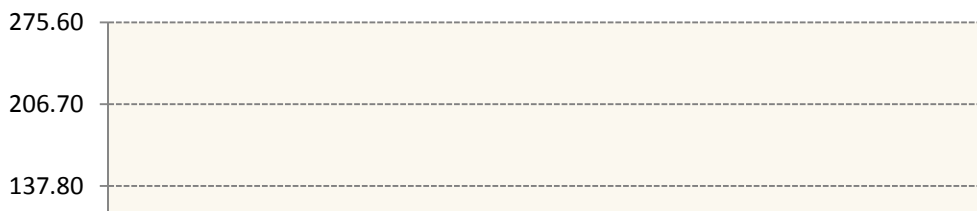
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,657	0	3,657	
누계	유가증권	스왑	56,358	0	56,358	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,433	-20,433	장내
누계	통화	선도	0	18,640	-18,640	장외

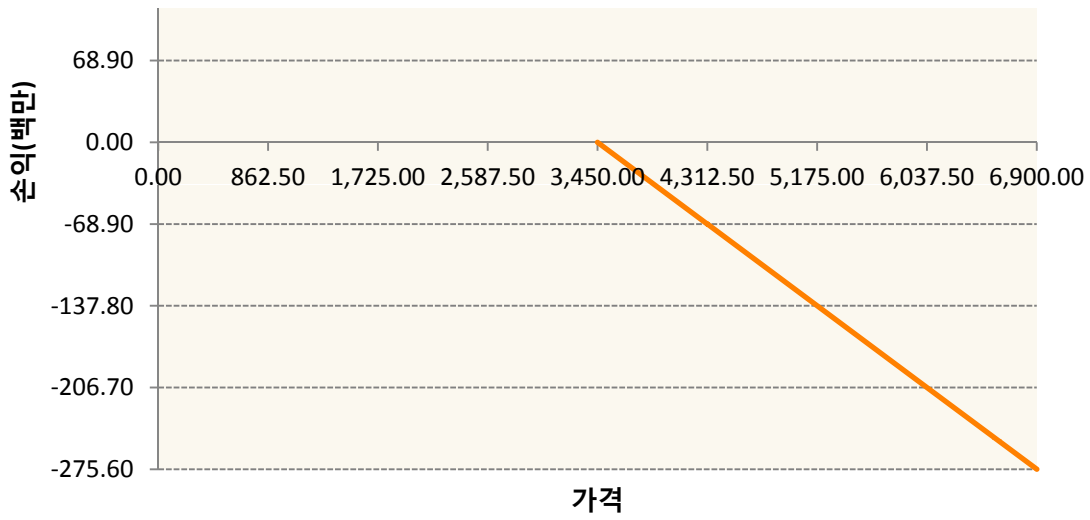
2. 만기시점의 손익구조

OESXM9-C3425-EURO STOXX 50

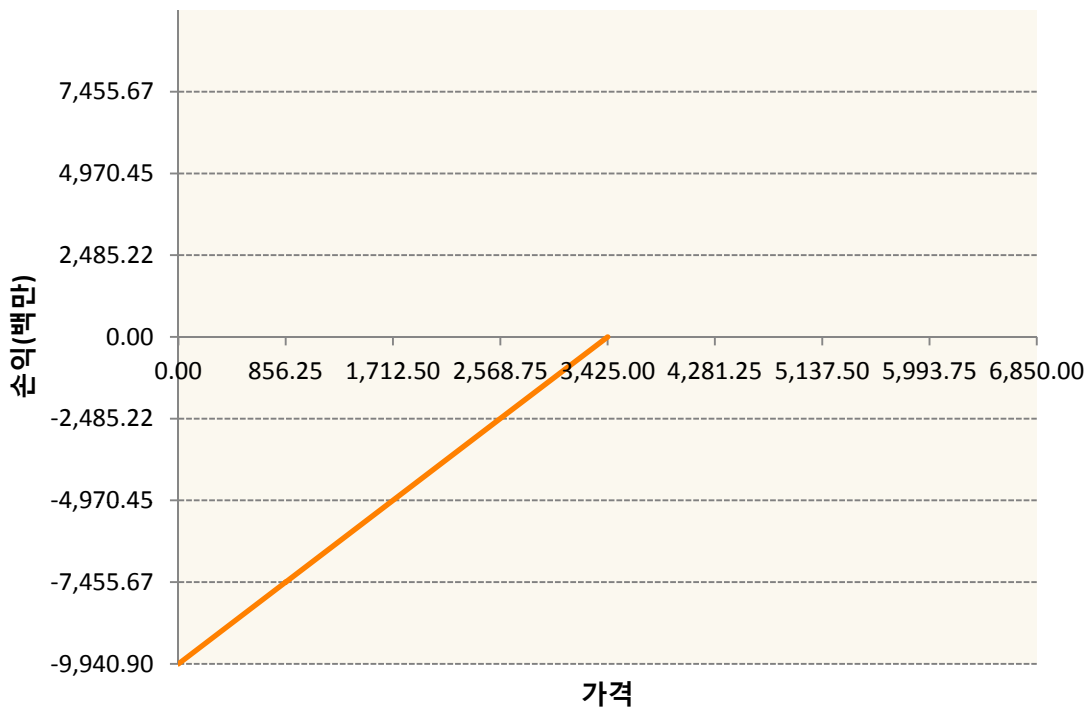


OESXM9-C3450-EURO STOXX 50

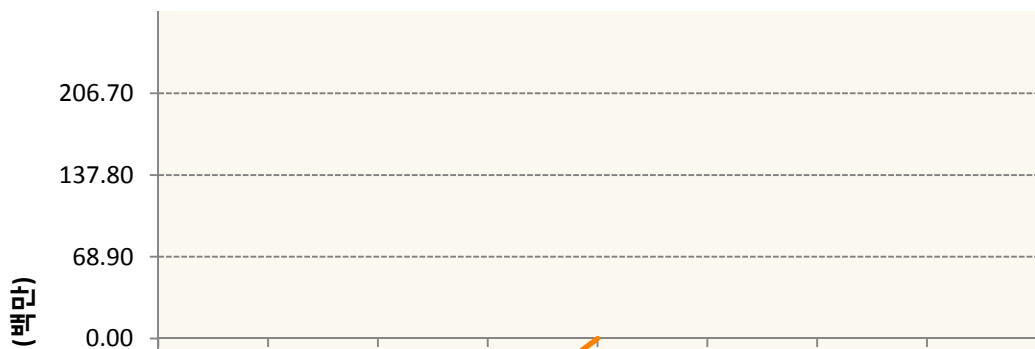


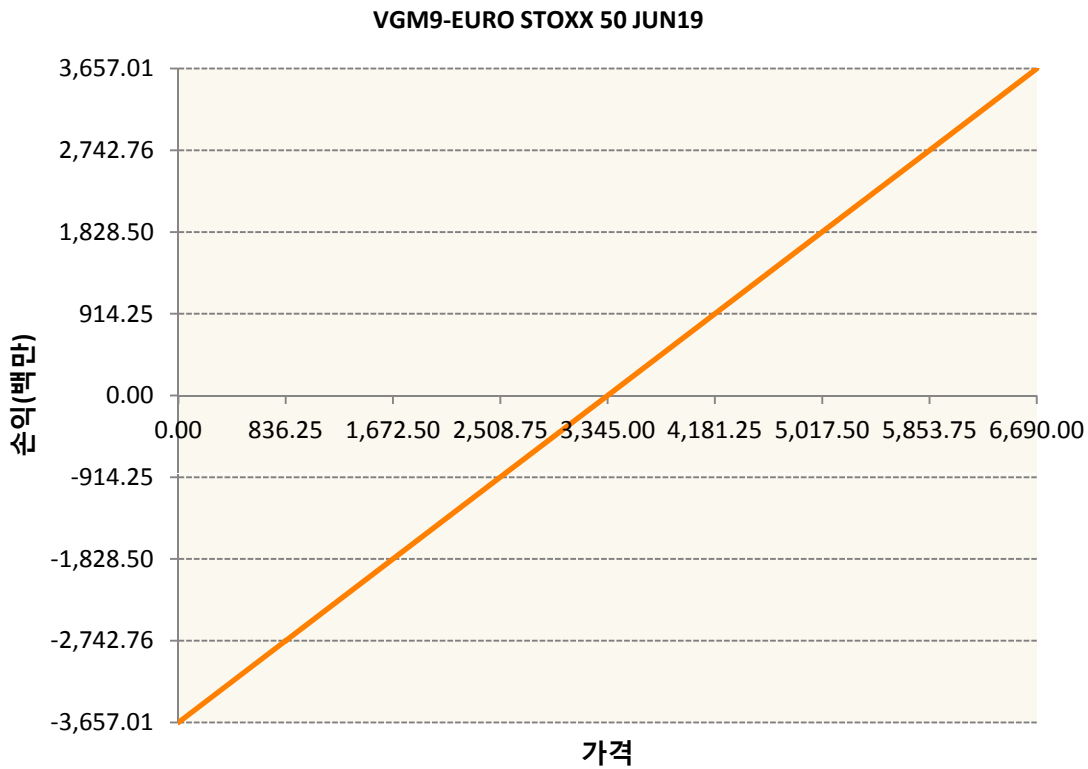
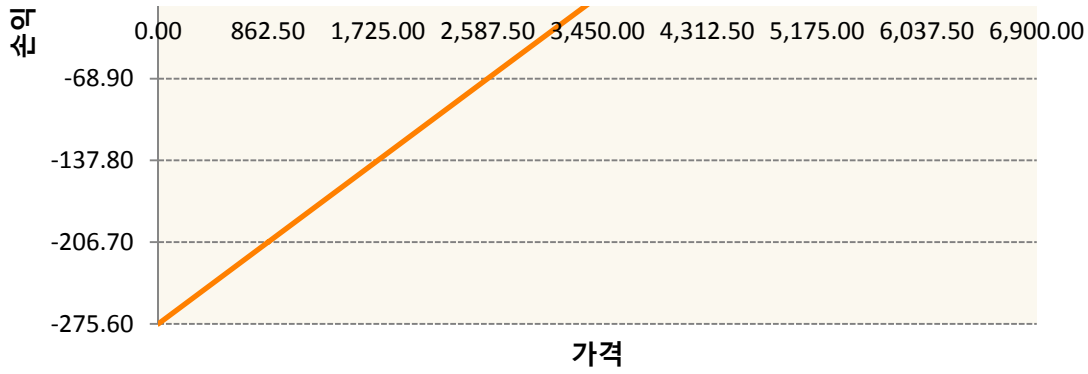


OESXM9-P3425-EURO STOXX 50



OESXM9-P3450-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	72
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	426
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	852
FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E	213
OESXM9-C3 EURO STOXX 50	795
OESXM9-C3 EURO STOXX 50	22
OESXM9-P3 EURO STOXX 50	795
OESXM9-P3 EURO STOXX 50	22
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	293

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

(단위:백만원)

2,213

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

(단위:백만원)

1,021

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

(단위:백만원)

90

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

(단위:백만원)

130

공시일	2019-05-22
기준일	2019-05-21

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

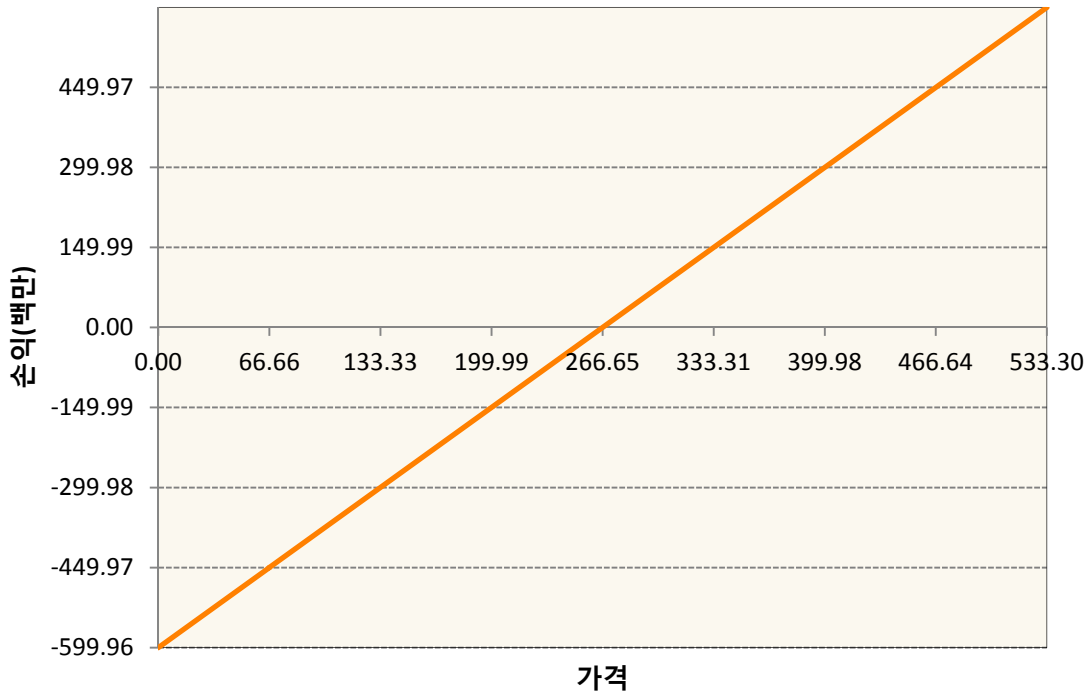
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	600	0	600	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						48
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48	
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
-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%	32	32	32	32	32	32	32	
8.00%	48	48	48	48	48	48	48	

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

(단위:백만원)

40

공시일	2019-05-22
기준일	2019-05-21

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

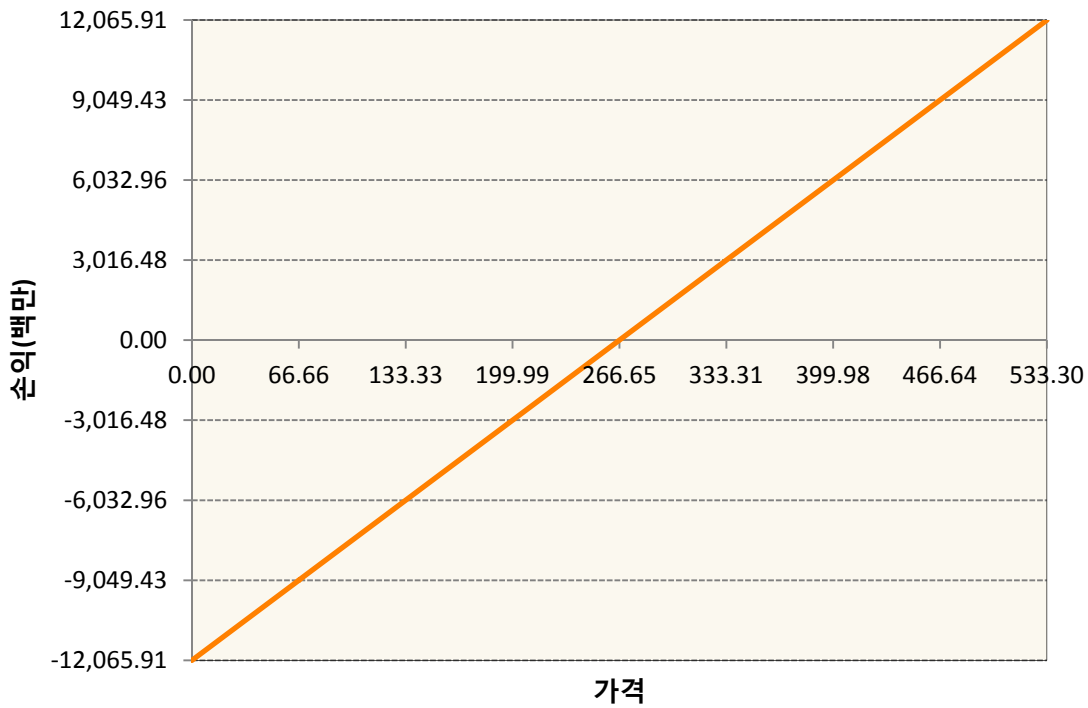
1. 계약금액

(단위:백만원)

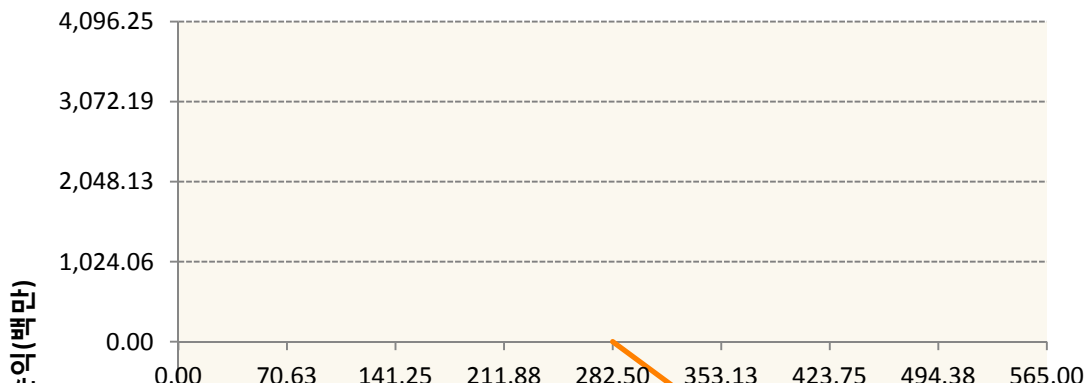
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,066	0	12,066	장내
누계	유가증권	옵션	5,081	22,906	-17,825	장내

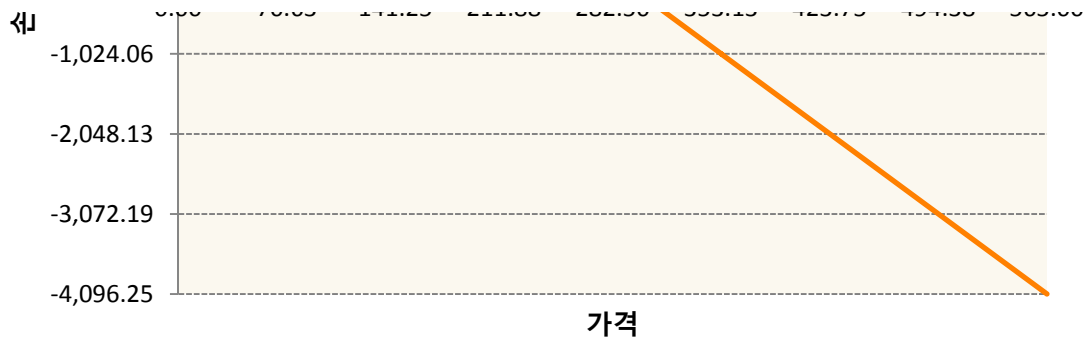
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

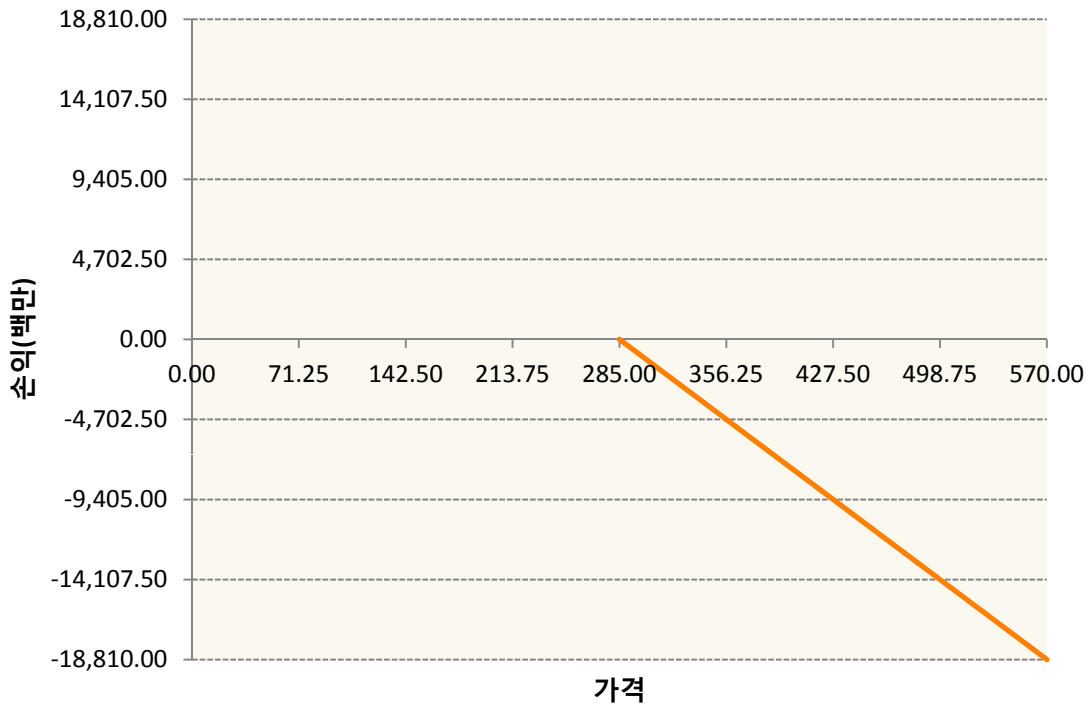


KR4201P62826-2019-06 콜282.5

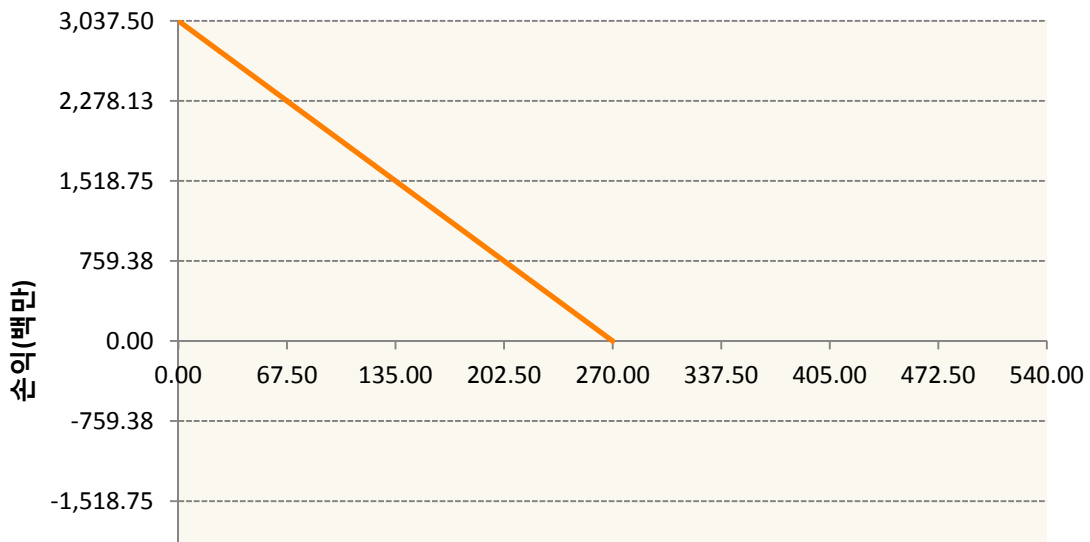


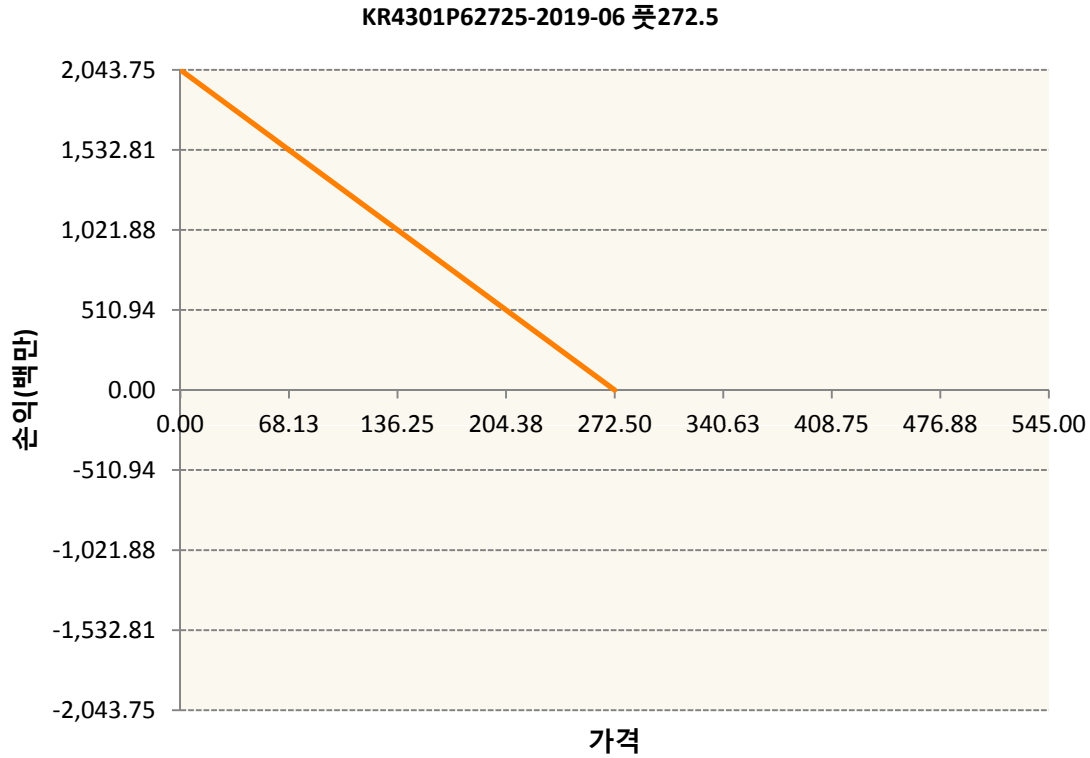
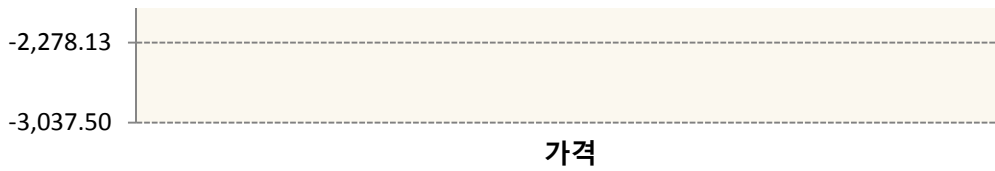


KR4201P62859-2019-06 콜285



KR4301P62709-2019-06 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						963
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-963	-963	-963	-963	-963	-963	-963	
-5.33%	-642	-642	-642	-642	-642	-642	-642	
-2.67%	-321	-321	-321	-321	-321	-321	-321	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	321	321	321	321	321	321	321	
5.33%	642	642	642	642	642	642	642	
8.00%	963	963	963	963	963	963	963	
KR4201P62826		2019-06 콜282.5						145
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	23	23	23	22	21	20	19	
-5.33%	23	22	21	20	18	16	13	
-2.67%	21	19	16	13	10	6	2	

공시일	2019-05-22
기준일	2019-05-21

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	5,552	0	5,552	
누계	유가증권	수익증권	16,363	0	16,363	

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	2019-05-22
기준일	2019-05-21

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	60,715	0	60,715	

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	2019-05-22
기준일	2019-05-21

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	11,940	0	11,940	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	250,687	0	250,687	
누계	통화	선도	0	267,456	-267,456	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		802
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		821
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		1,337

FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E	478
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E	802
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	802
FX21019K02 KRW/USD 24-06-19E	382

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

(단위:백만원)

7,209

공시일	2019-05-22
기준일	2019-05-21

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

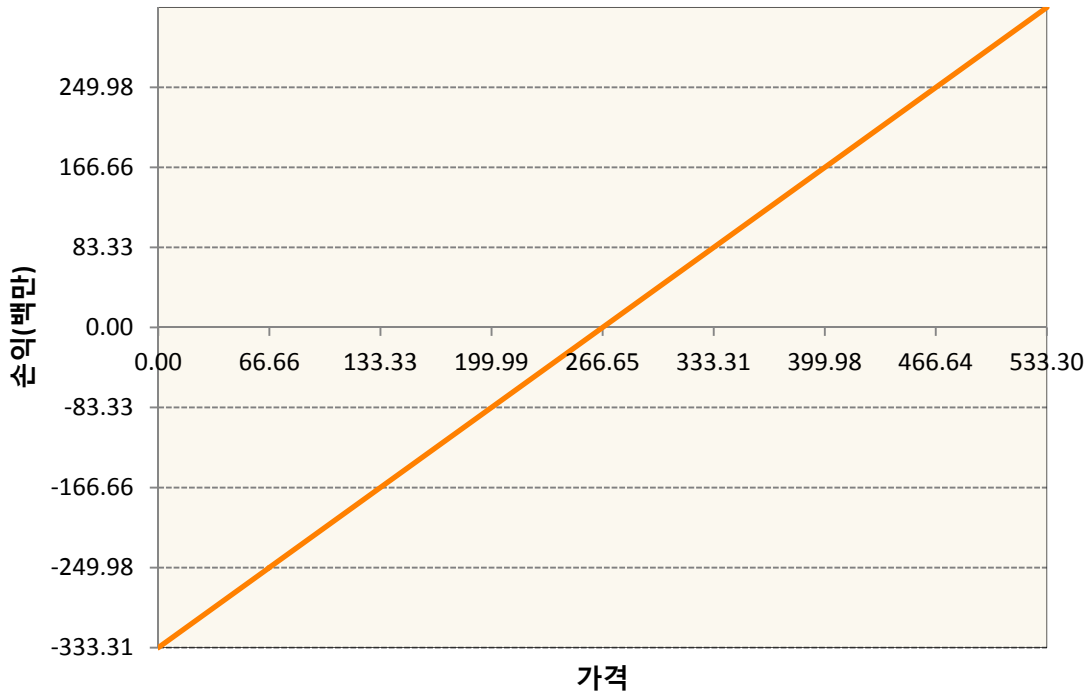
1. 계약금액

(단위:백만원)

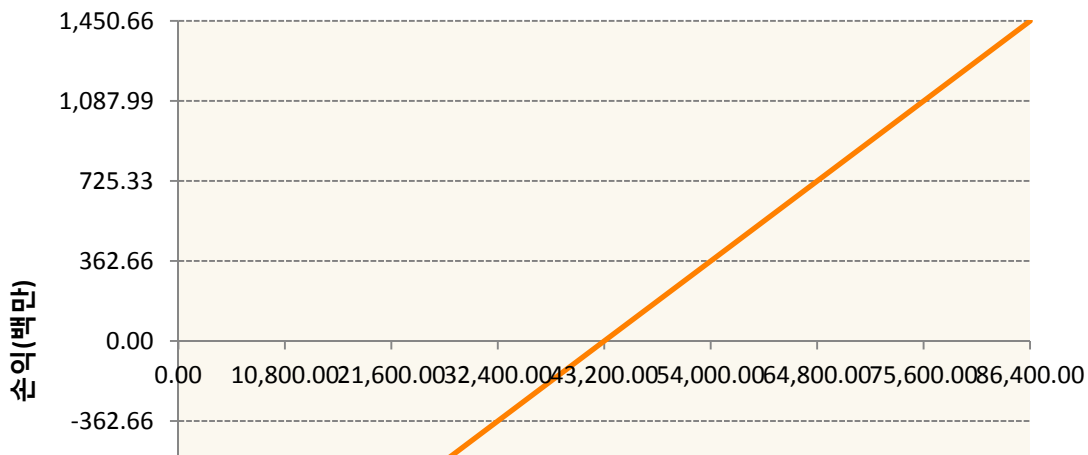
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,784	0	1,784	장내

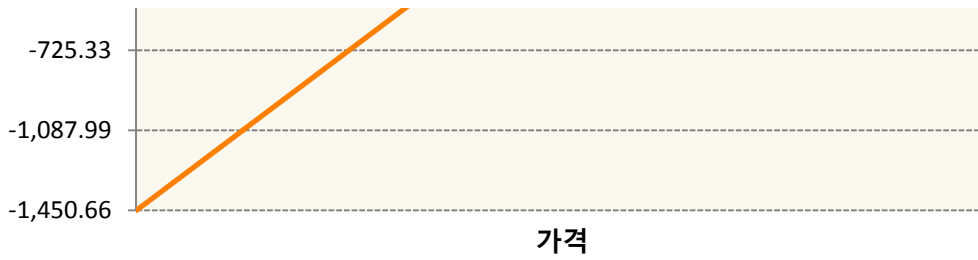
2. 만기시점의 손익구조

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						116
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116	
-5.33%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77	
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	39	39	39	39	39	39	39	
5.33%	77	77	77	77	77	77	77	
8.00%	116	116	116	116	116	116	116	

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

158

공시일	2019-05-22
기준일	2019-05-21

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

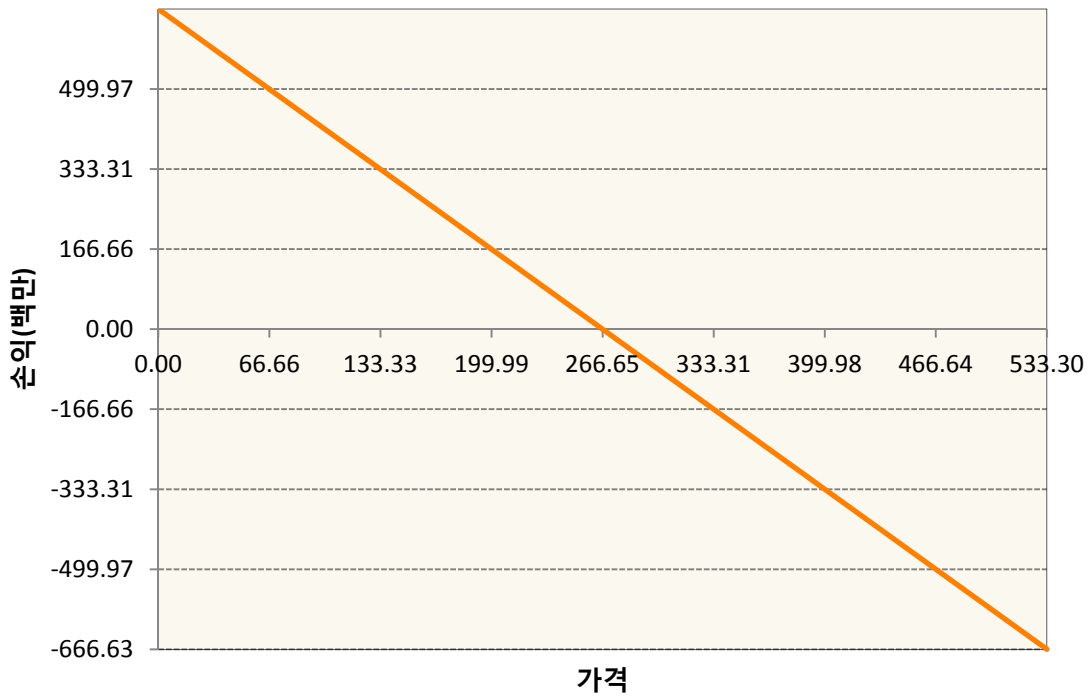
1. 계약금액

(단위:백만원)

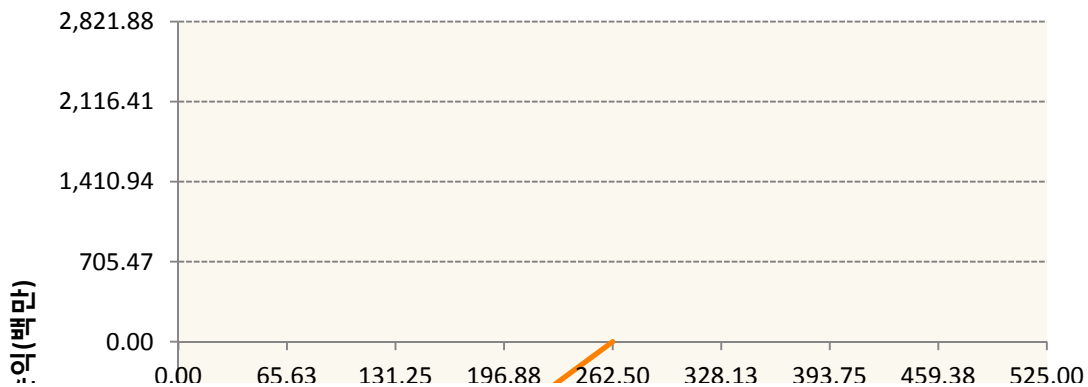
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	667	-667	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,352	-3,352	장내

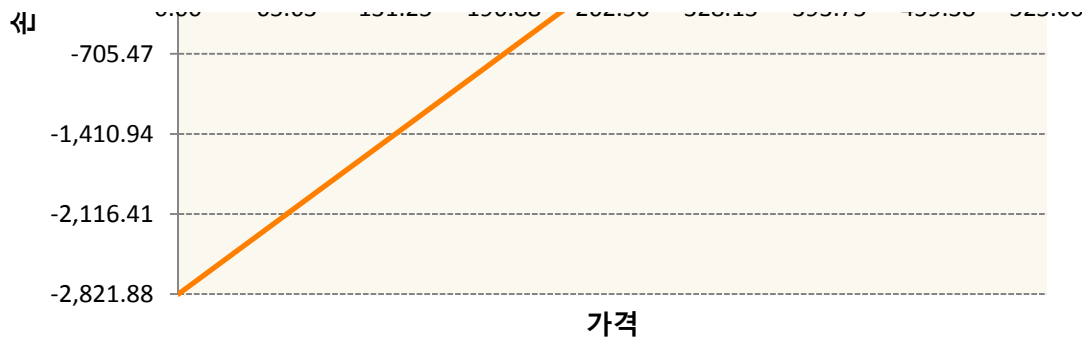
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

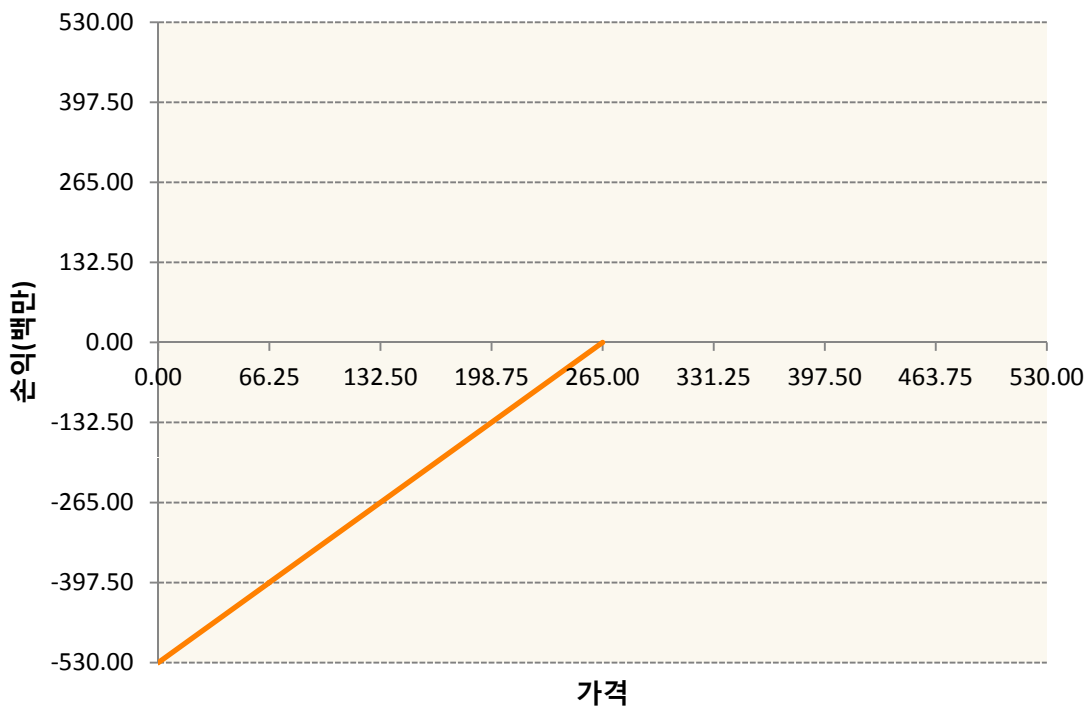


KR4301P62626-2019-06 풋262.5





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						168
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-163	-164	-164	-165	-165	-166	-168
-5.33%	-90	-91	-93	-95	-97	-99	-102
-2.67%	-28	-31	-34	-38	-41	-45	-48
0%	10	7	3	0	-3	-7	-11
2.67%	25	23	21	19	17	14	11
5.33%	28	27	27	26	25	23	22
8.00%	28	28	28	28	27	27	26
KR4301P62659 2019-06 풋265							34
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-33	-33	-33	-33	-33	-34	-34
-5.33%	-19	-19	-20	-20	-20	-21	-21
-2.67%	-7	-7	-8	-8	-9	-10	-10
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	6	6	5	5	4	4	3
5.33%	7	7	7	7	6	6	6
8.00%	7	7	7	7	7	7	7

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

(단위:백만원)

251

공시일	2019-05-22
기준일	2019-05-21

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

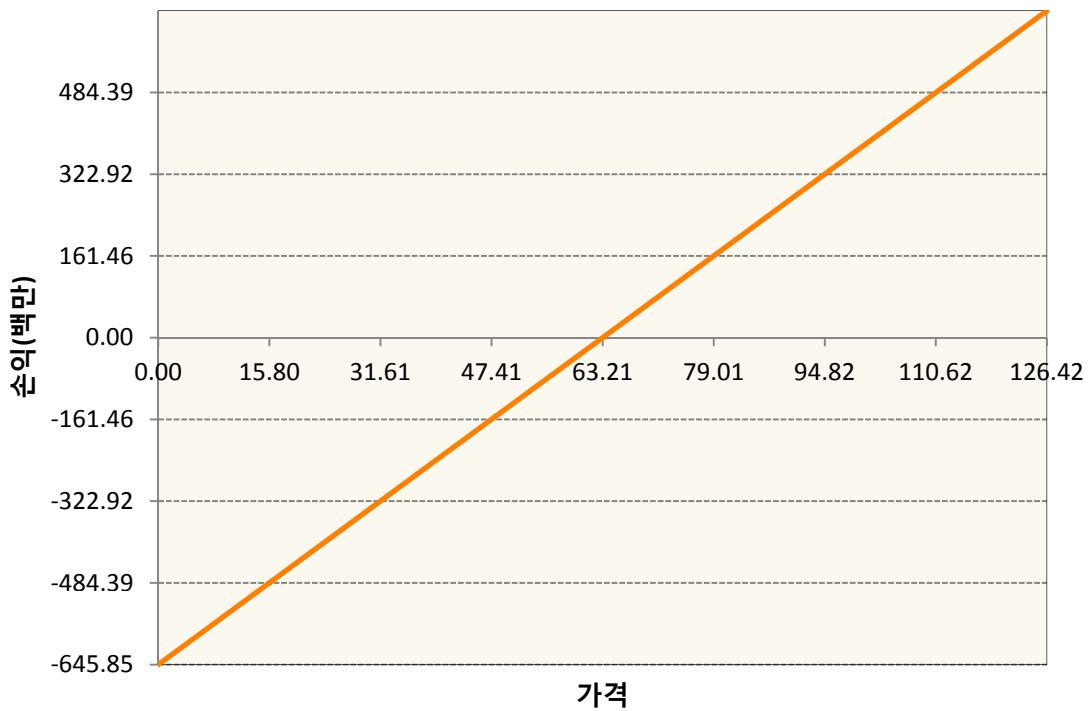
1. 계약금액

(단위:백만원)

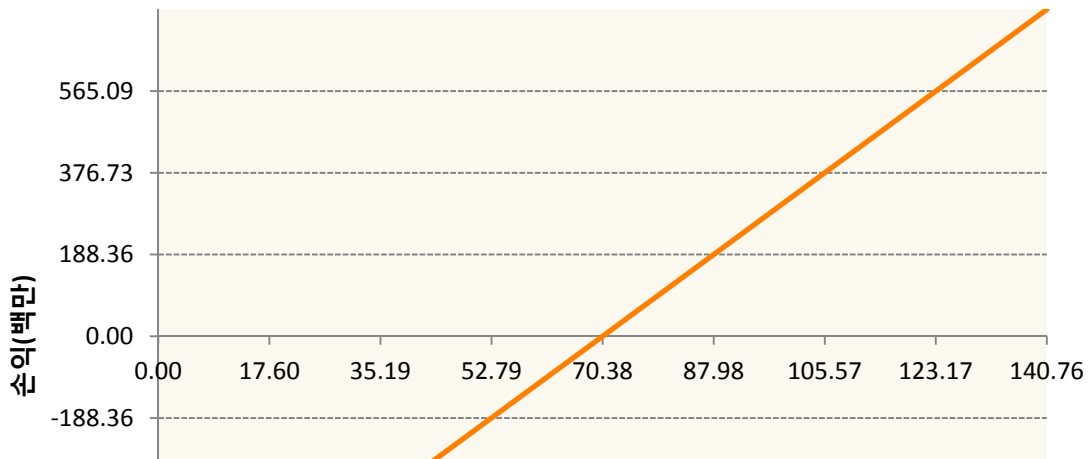
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,820	298	2,521	

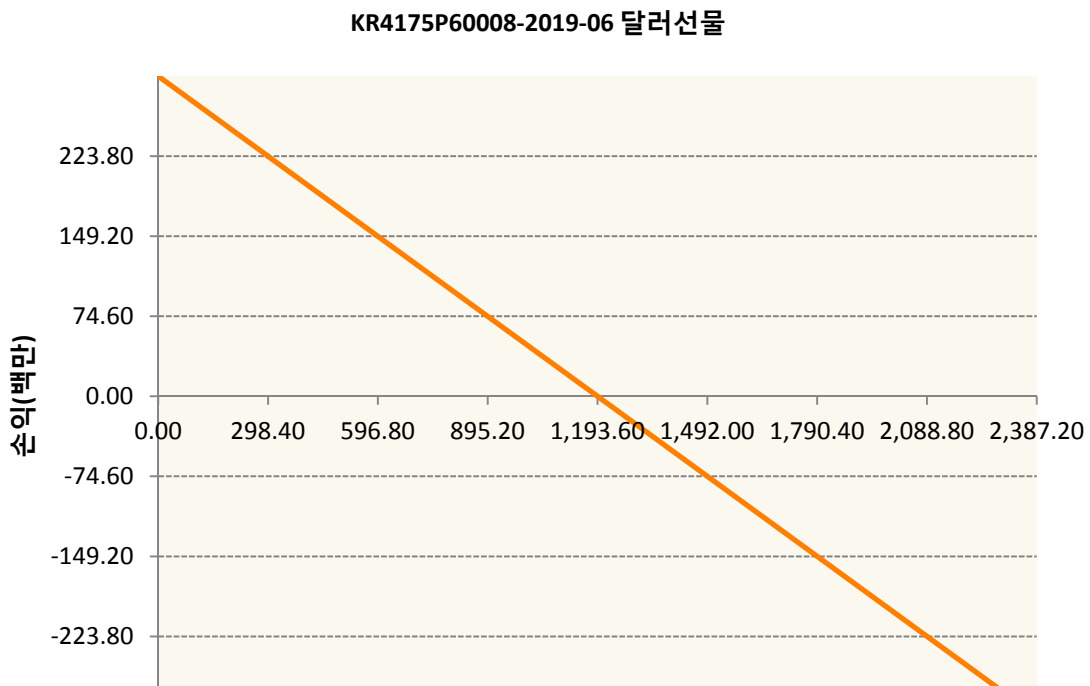
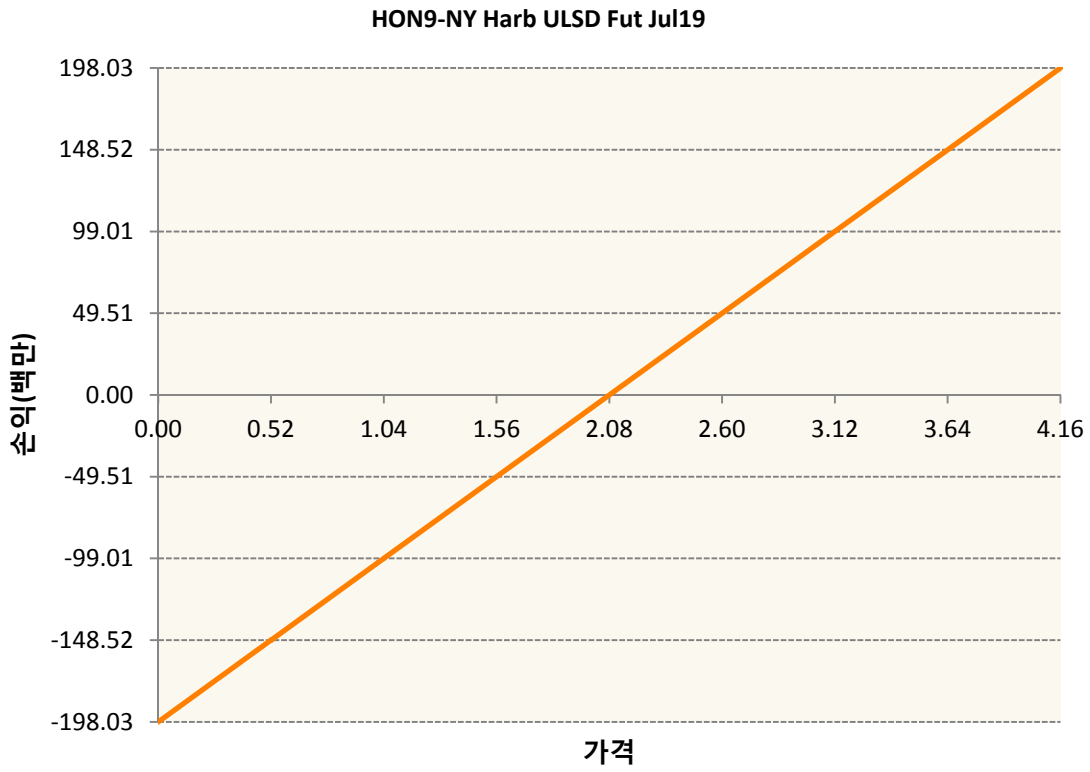
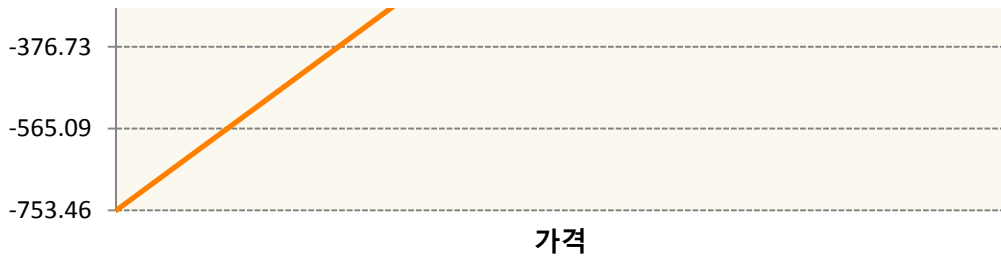
2. 만기시점의 손익구조

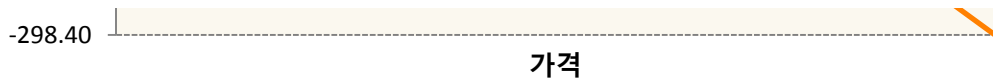
CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19



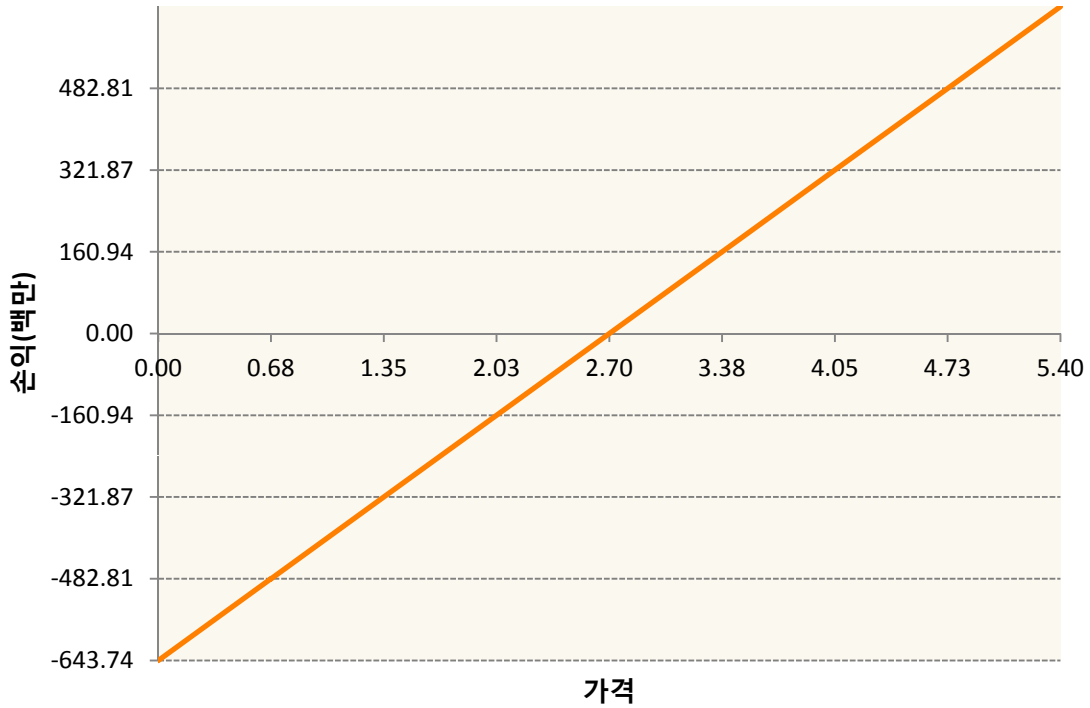
COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19



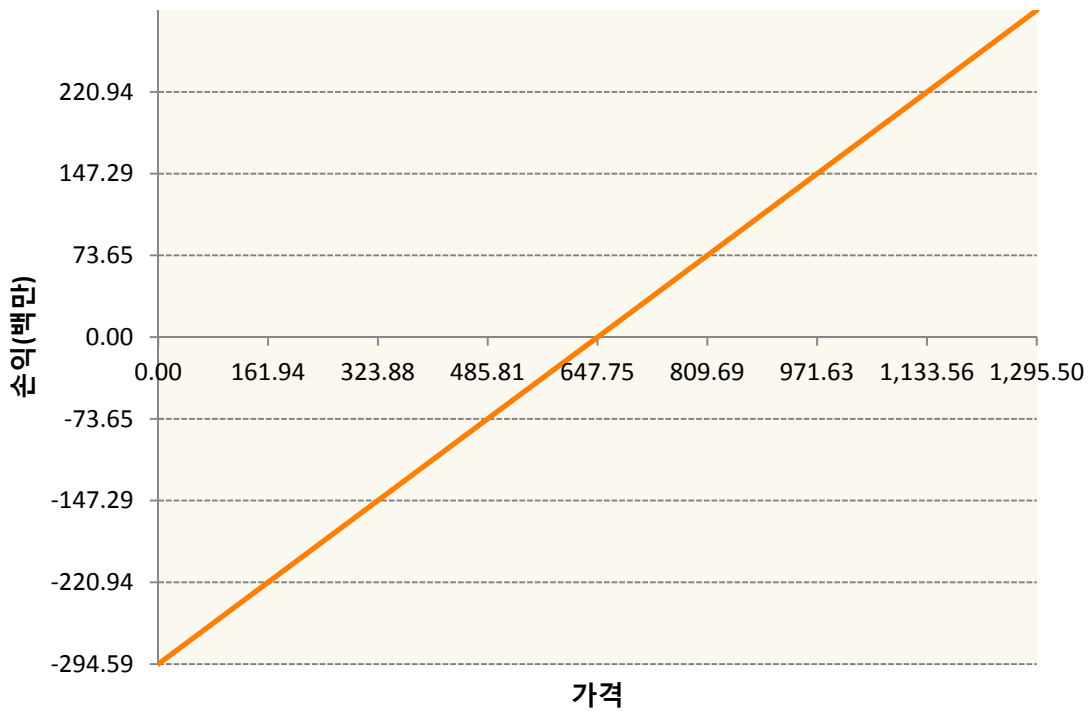




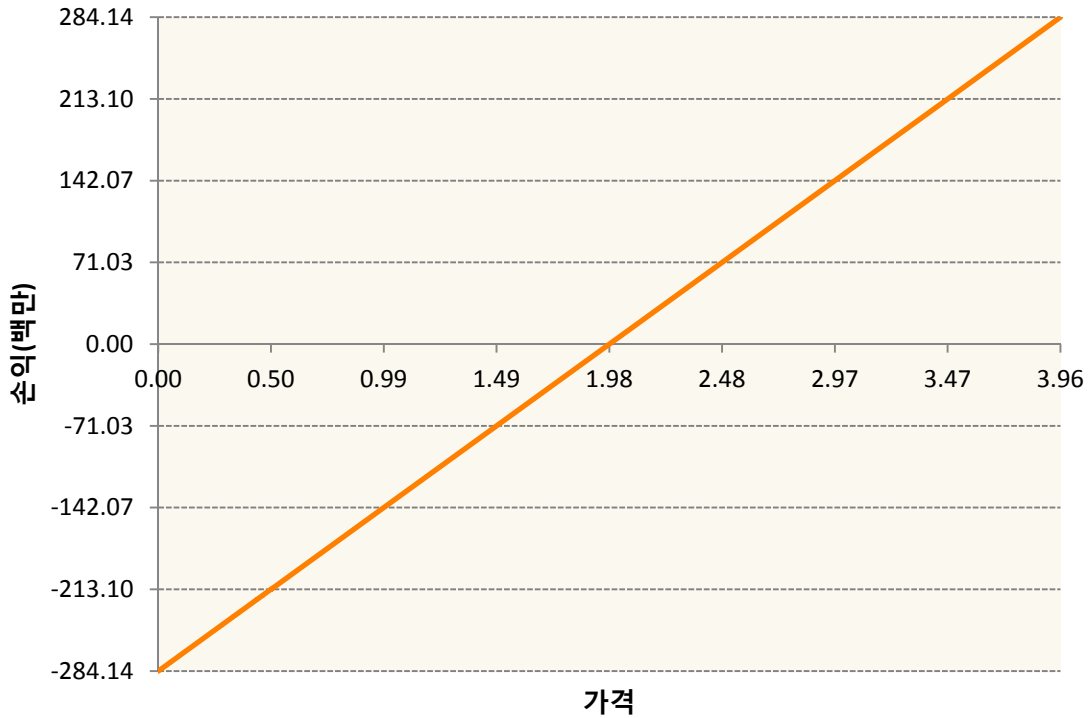
NGN19-NATURAL GAS FUTR Jul19



QSN9-Low Su Gasoil G Jul19



XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN9	WTI CRUDE FUTURE Jul19	52
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)

413

공시일	2019-05-22
기준일	2019-05-21

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

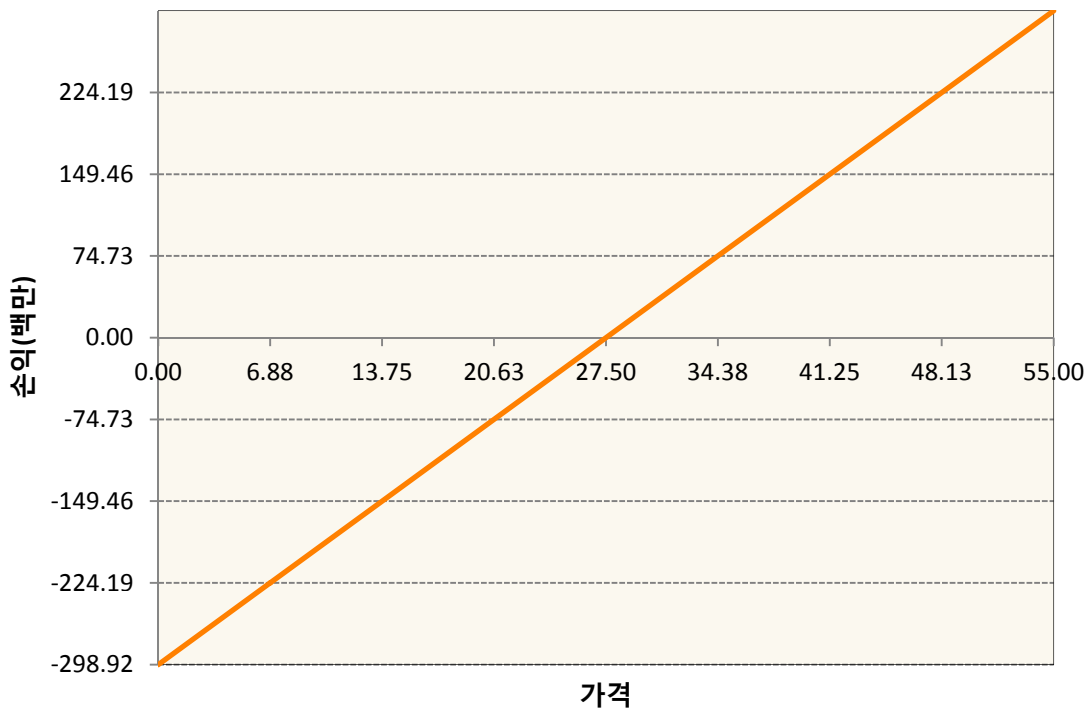
1. 계약금액

(단위:백만원)

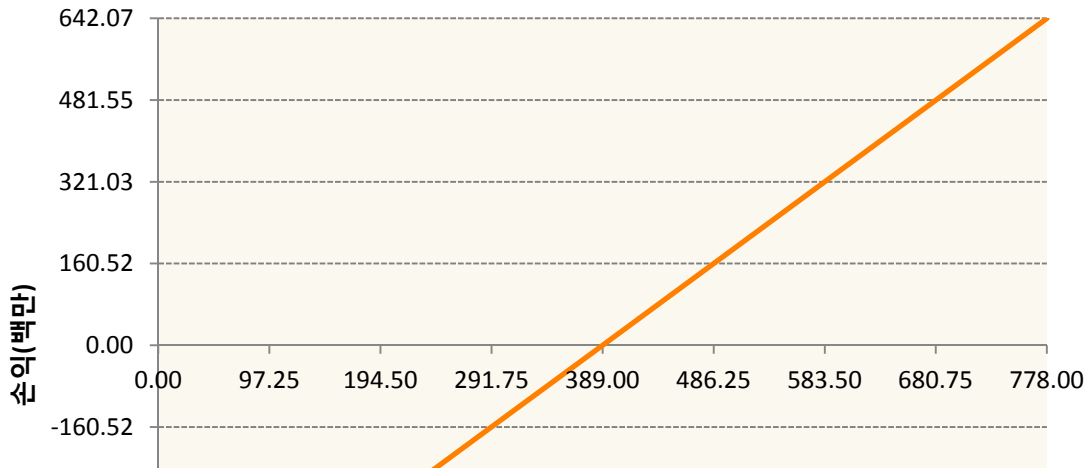
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,916	60	2,856	

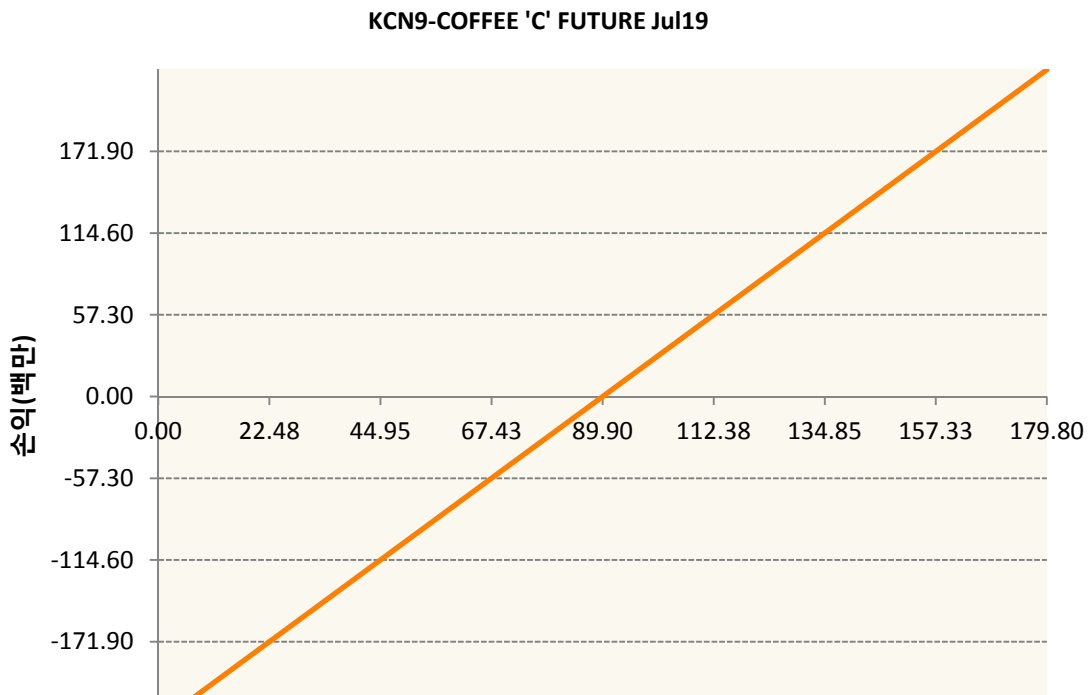
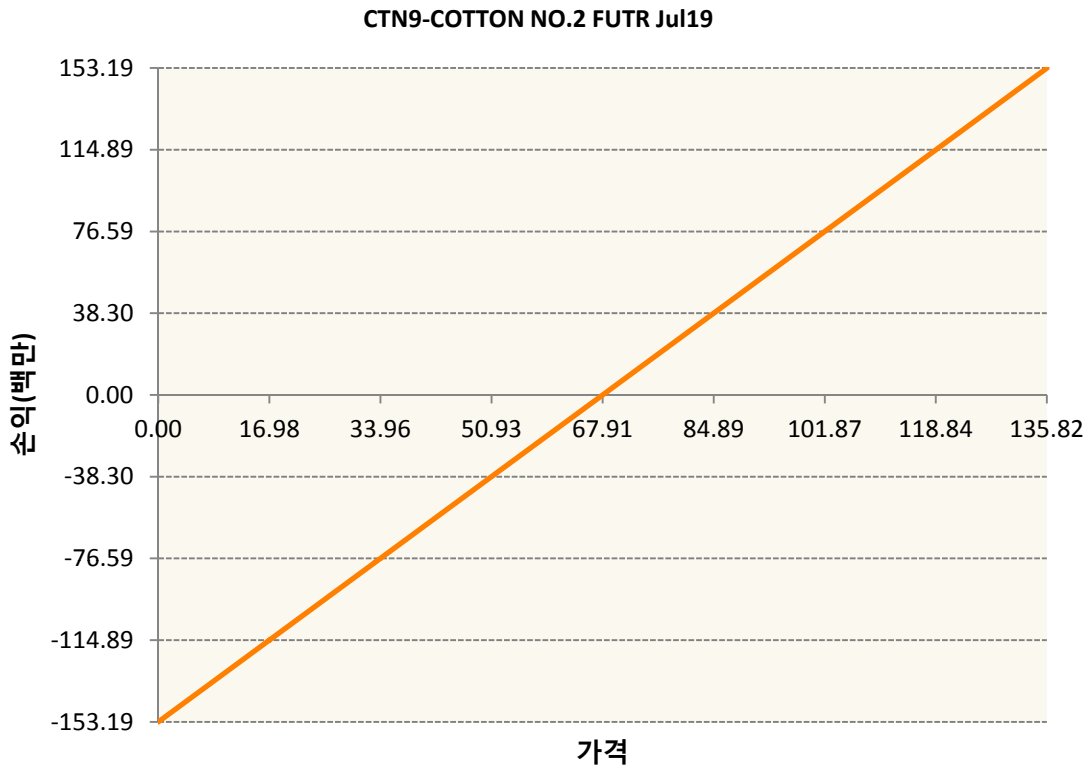
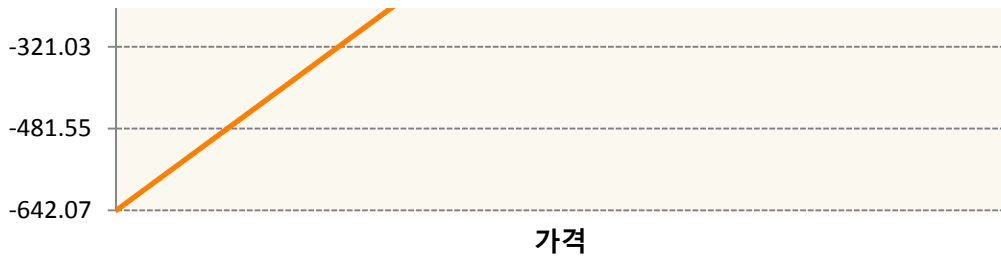
2. 만기시점의 손익구조

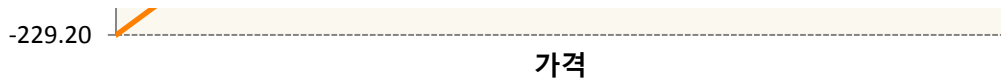
BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19



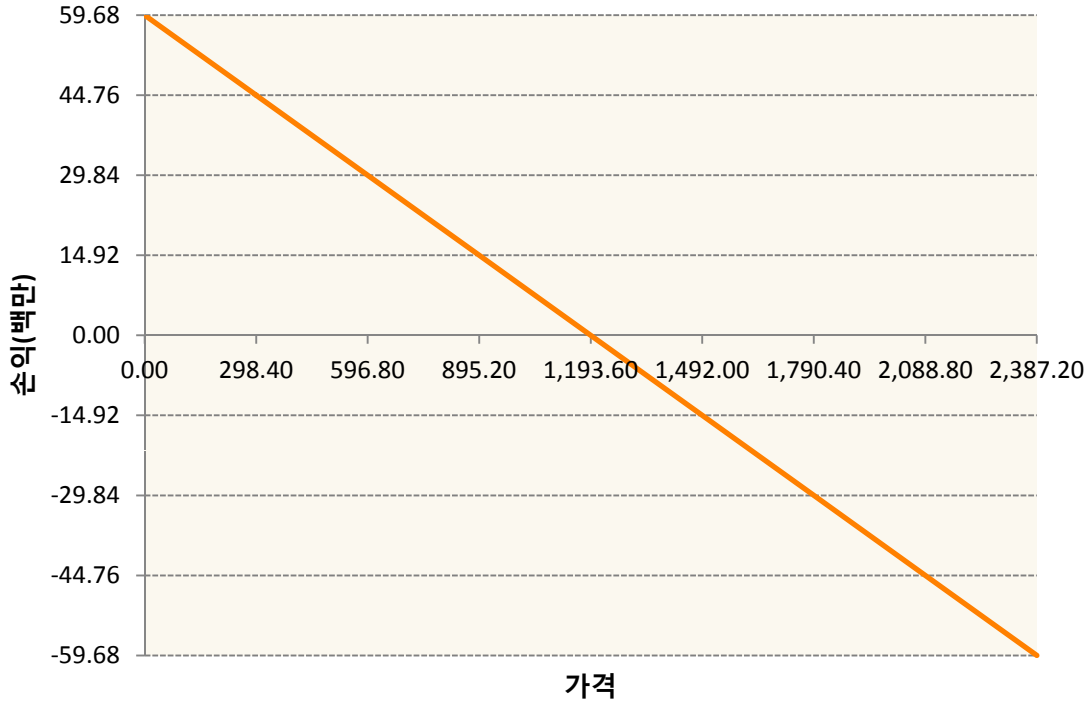
CN9-CORN FUTURE Jul19



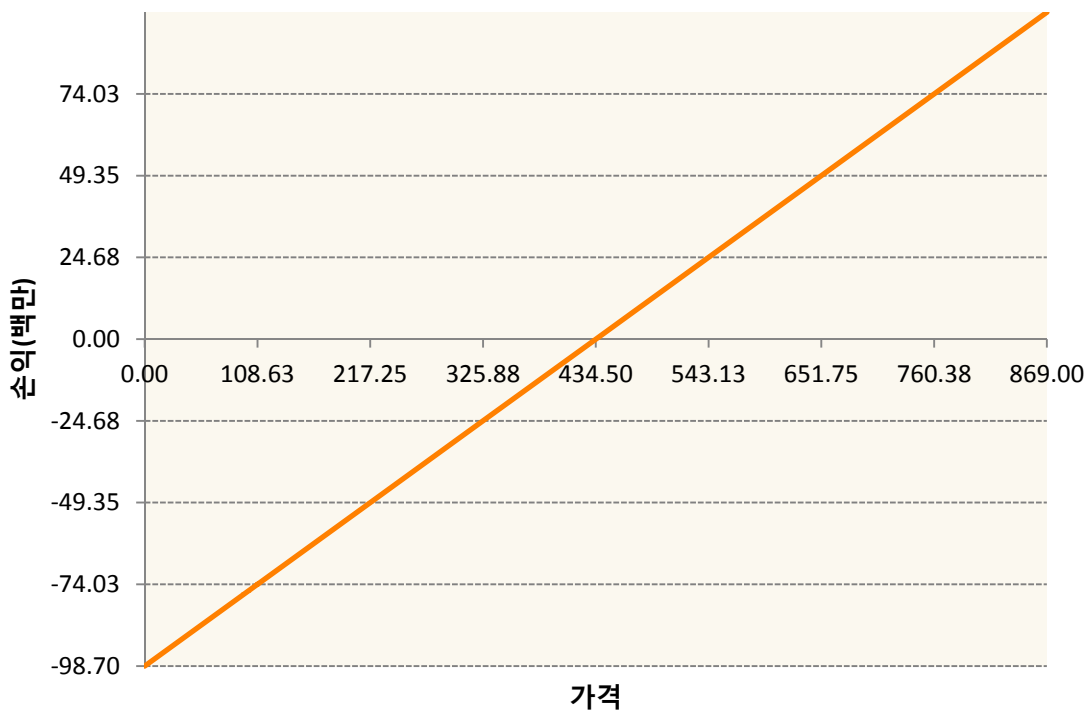




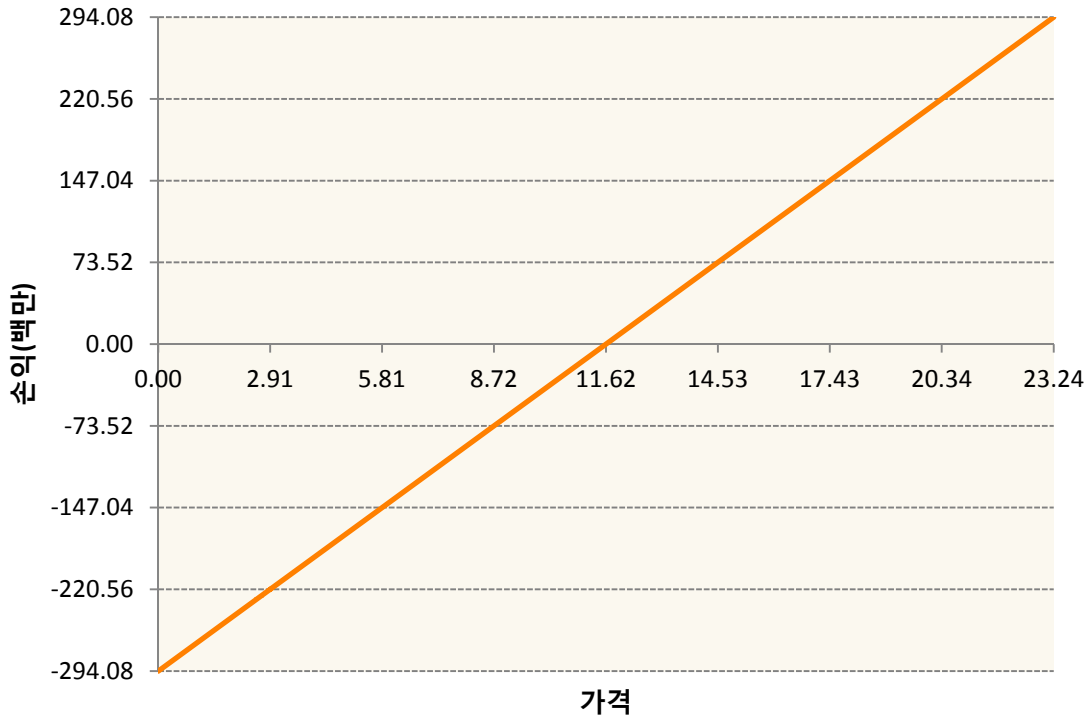
KR4175P60008-2019-06 달러선물



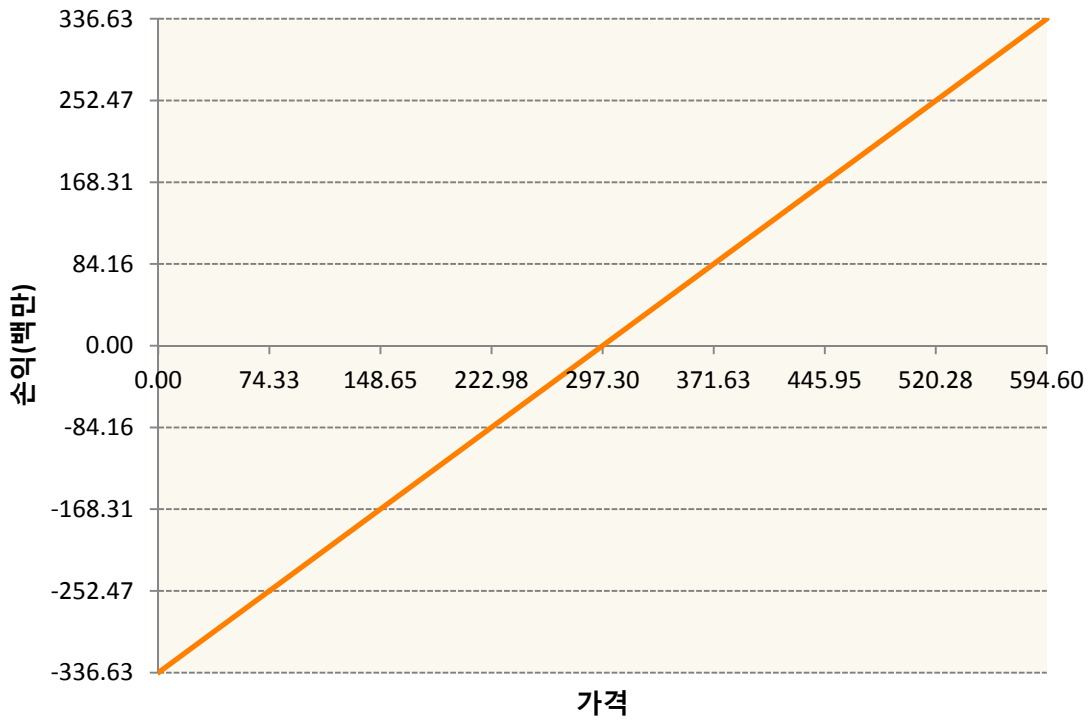
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



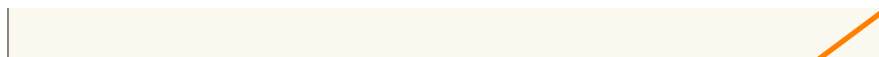
SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

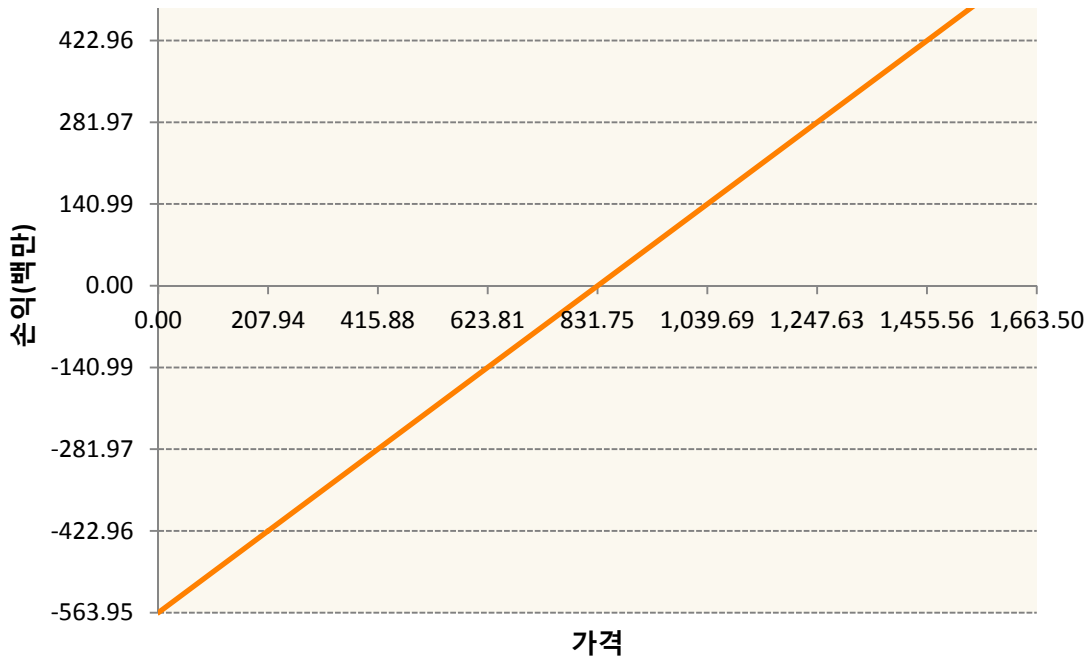


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19

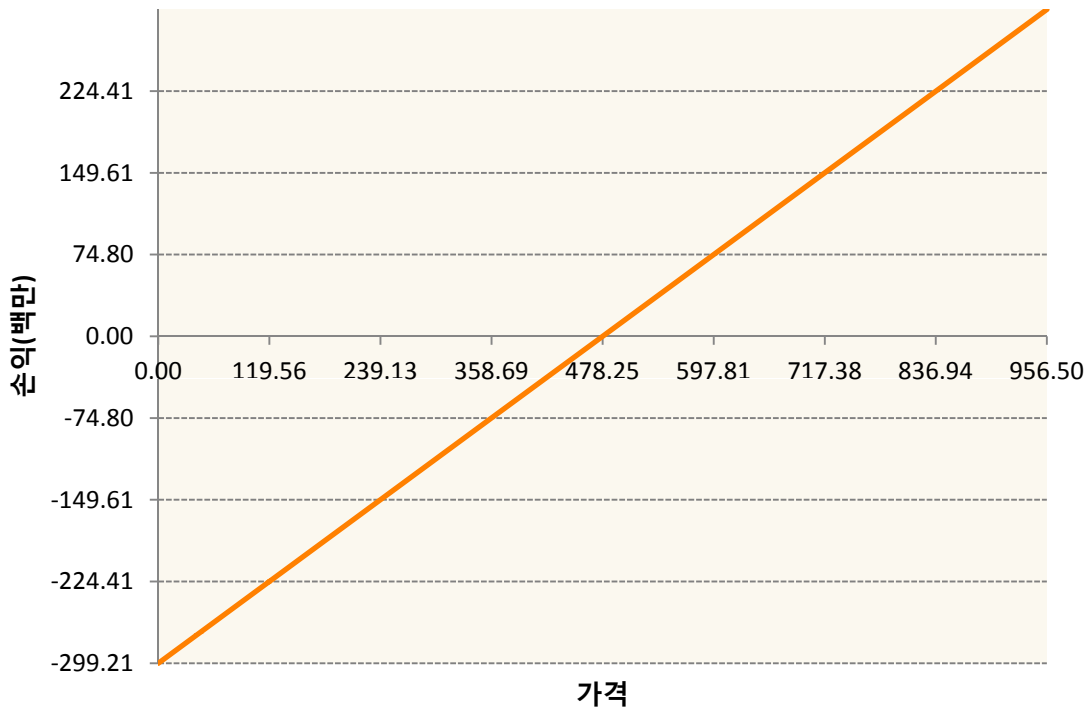


SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





WN9-WHEAT FUTURE(CBT) 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	24
SMN9	SOYBEAN MEAL FUTR Jul19	27
SN9	SOYBEAN FUTURE Jul19	45
WN9	WHEAT FUTURE(CBT) Jul19	24

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

(단위:백만원)

240