

공시일	2019-05-23
기준일	2019-05-22

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	2019-05-23
기준일	2019-05-22

SMART합성-MSCI선진국증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	14,160	0	14,160	장외
누계	지수	스왑	14,160	0	14,160	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S190522

1,133

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

677

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-05-23
기준일	2019-05-22

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)	301
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	83
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	141

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

877

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-05-23
기준일	2019-05-22

유로인덱스모(주식-파생형)

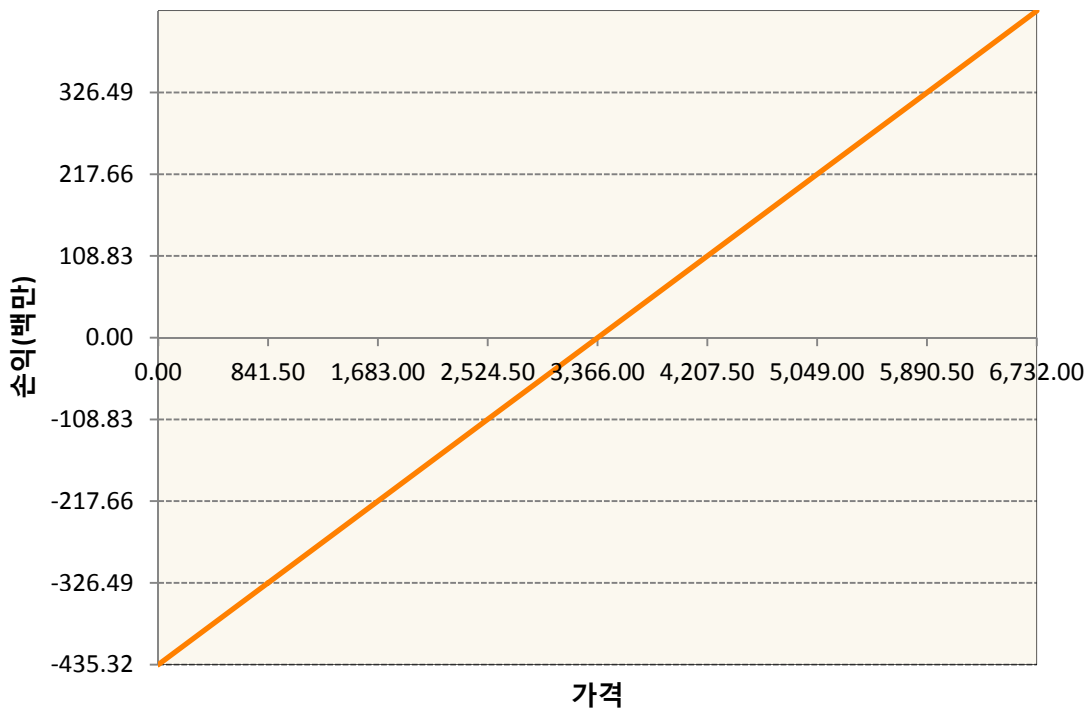
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	435	0	435	

2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	35
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

25

공시일	2019-05-23
기준일	2019-05-22

차이나인덱스모(주식-파생형)

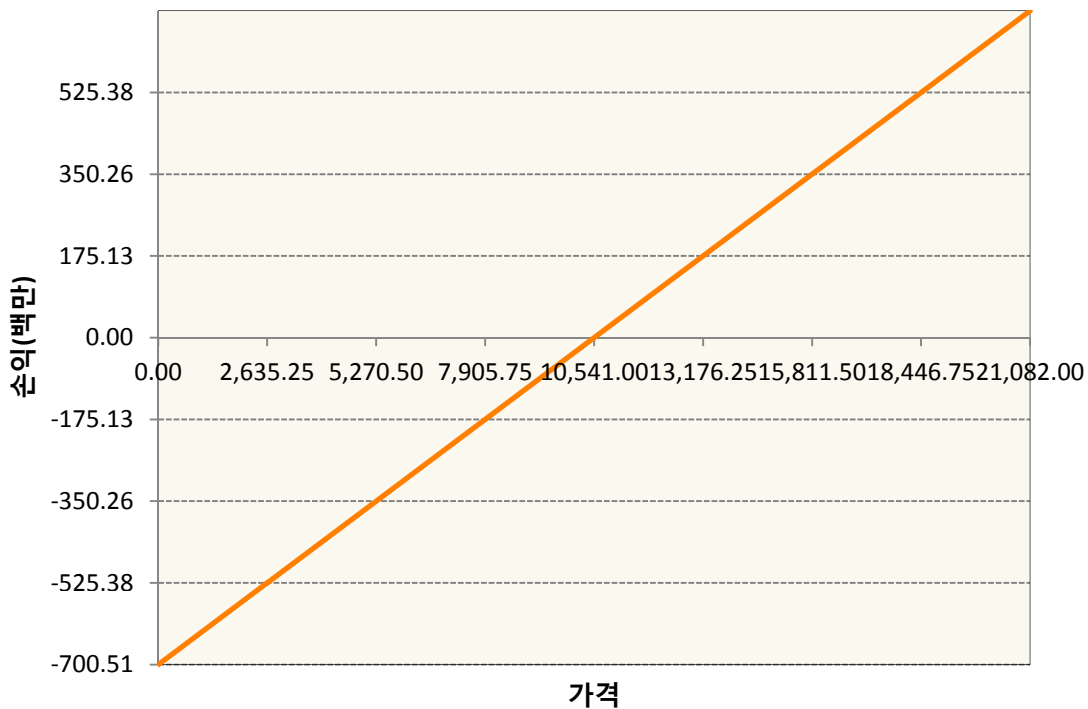
1. 계약금액

(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)

57

공시일	2019-05-23
기준일	2019-05-22

커버드콜모(주식혼합-파생형)

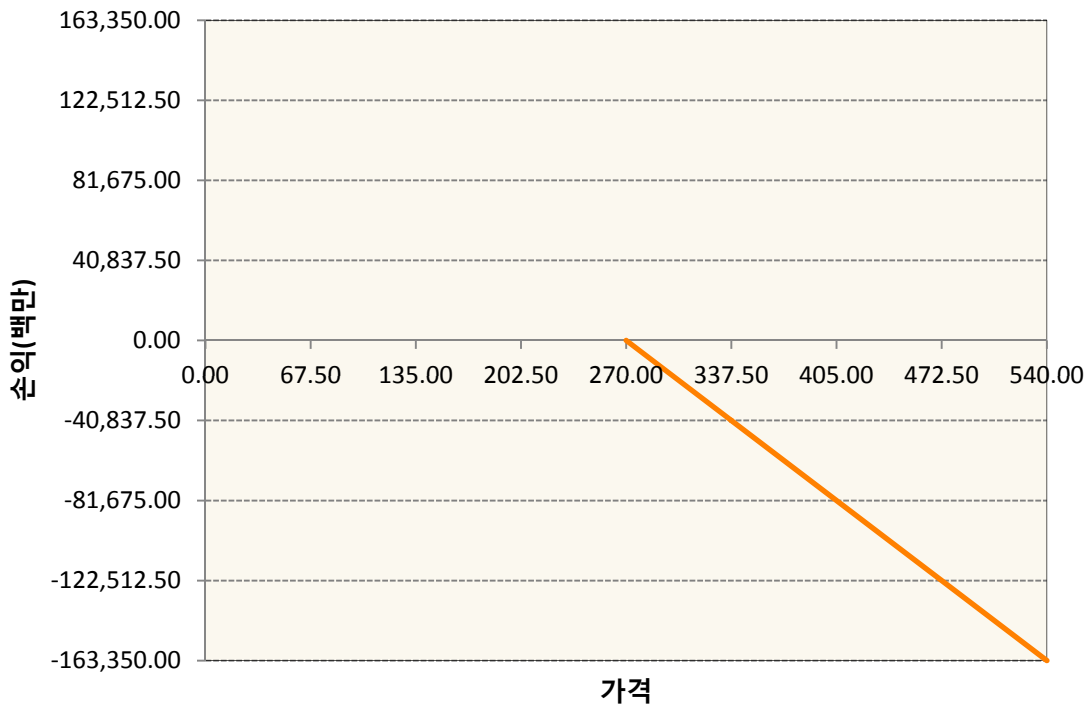
1. 계약금액

(단위:백만원)

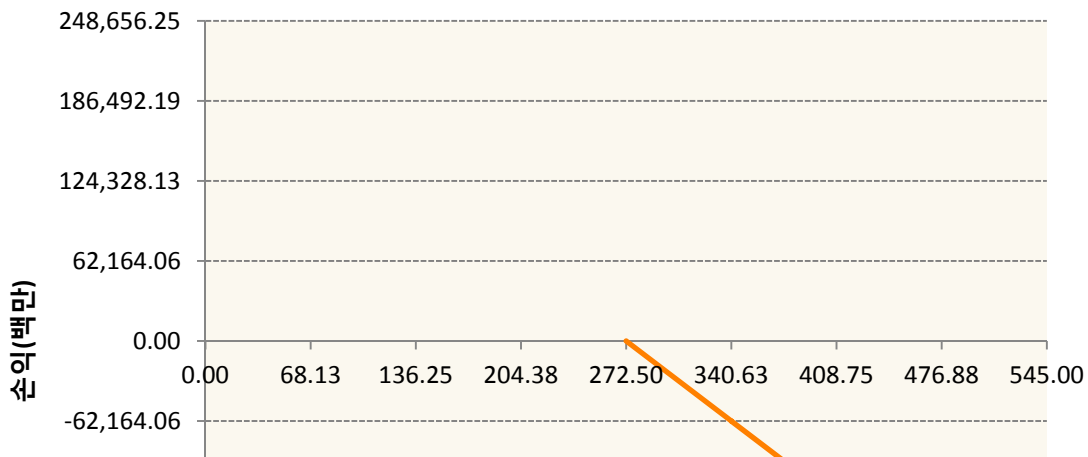
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	614,506	-614,506	장내

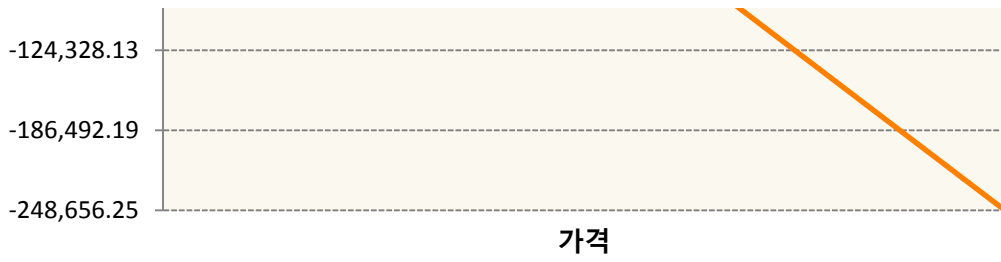
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P62701-2019-06 콜270



KR4201P62727-2019-06 콜272.5





KR4301P62709-2019-06 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P62701		2019-06 콜270					9,235
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,017	2,969	2,901	2,813	2,706	2,580	2,438
-5.33%	2,827	2,700	2,548	2,376	2,187	1,982	1,763
-2.67%	2,254	2,015	1,762	1,497	1,223	941	653
0%	980	655	328	0	-330	-660	-991
2.67%	-1,216	-1,544	-1,875	-2,207	-2,541	-2,875	-3,210
5.33%	-4,299	-4,551	-4,819	-5,098	-5,386	-5,682	-5,983
8.00%	-8,022	-8,173	-8,349	-8,546	-8,761	-8,991	-9,235
KR4201P62727		2019-06 콜272.5					13,046
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,725	3,675	3,600	3,497	3,366	3,209	3,026

-5.33%	3,538	3,391	3,207	2,991	2,746	2,474	2,180
-2.67%	2,916	2,610	2,276	1,918	1,541	1,148	742
0%	1,405	944	475	0	-480	-965	-1,453
2.67%	-1,406	-1,921	-2,436	-2,951	-3,466	-3,981	-4,496
5.33%	-5,609	-6,045	-6,495	-6,957	-7,428	-7,906	-8,389
8.00%	-10,923	-11,210	-11,530	-11,878	-12,249	-12,639	-13,046
KR4301P62709 2019-06 풋270							14,046
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-13,958	-13,960	-13,965	-13,975	-13,991	-14,014	-14,046
-5.33%	-8,653	-8,677	-8,714	-8,765	-8,829	-8,908	-9,001
-2.67%	-3,543	-3,656	-3,788	-3,935	-4,096	-4,268	-4,449
0%	733	492	248	0	-250	-501	-754
2.67%	3,349	3,106	2,859	2,609	2,357	2,103	1,847
5.33%	4,364	4,241	4,099	3,941	3,770	3,587	3,394
8.00%	4,595	4,562	4,514	4,449	4,368	4,273	4,162

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

(단위:백만원)

36,423

공시일	2019-05-23
기준일	2019-05-22

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

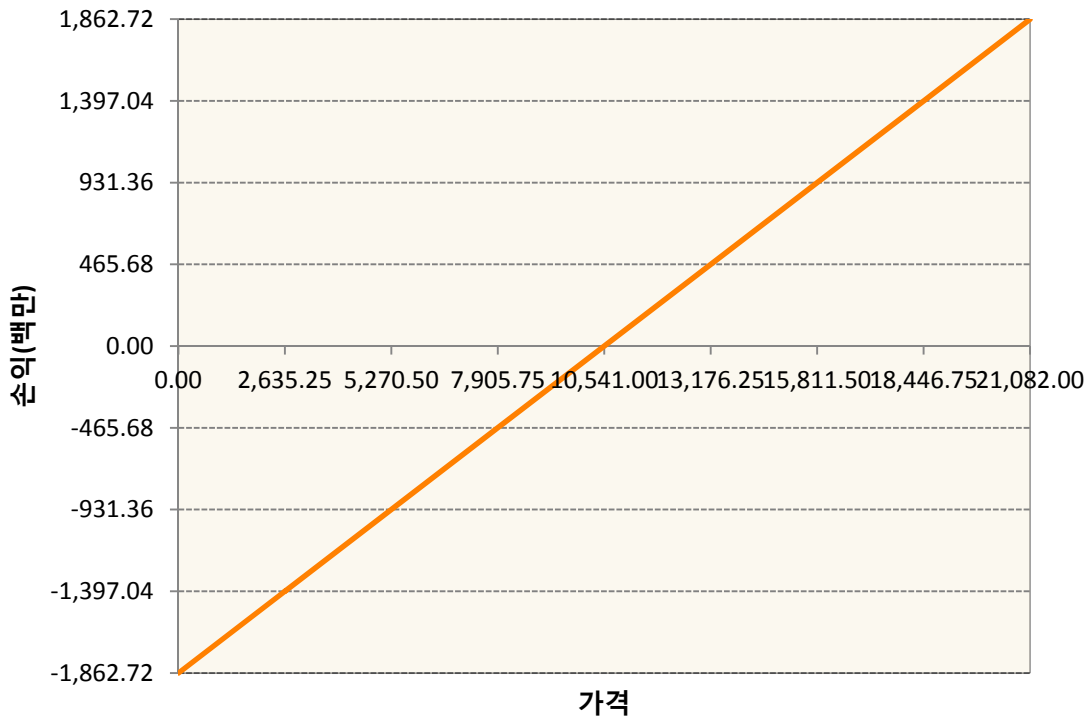
1. 계약금액

(단위:백만원)

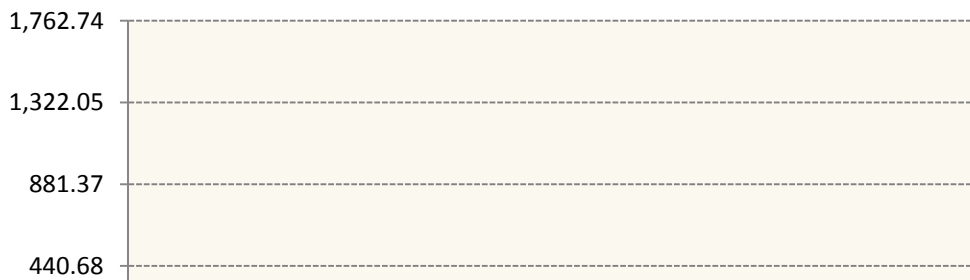
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,863	0	1,863	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,659	-5,659	장내
누계	통화	선도	0	6,382	-6,382	장외

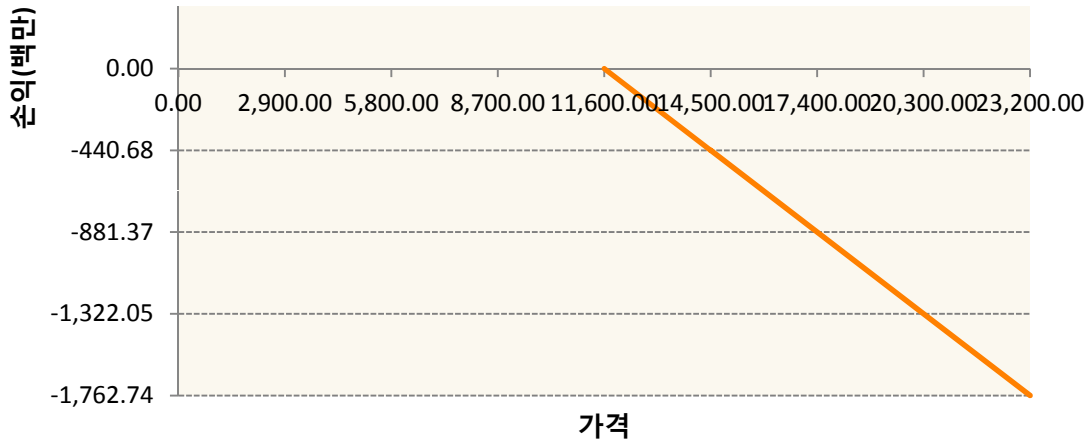
2. 만기시점의 손익구조

HCK9-HSCEI Futures May19



OHHIK9-C116-HSCEI

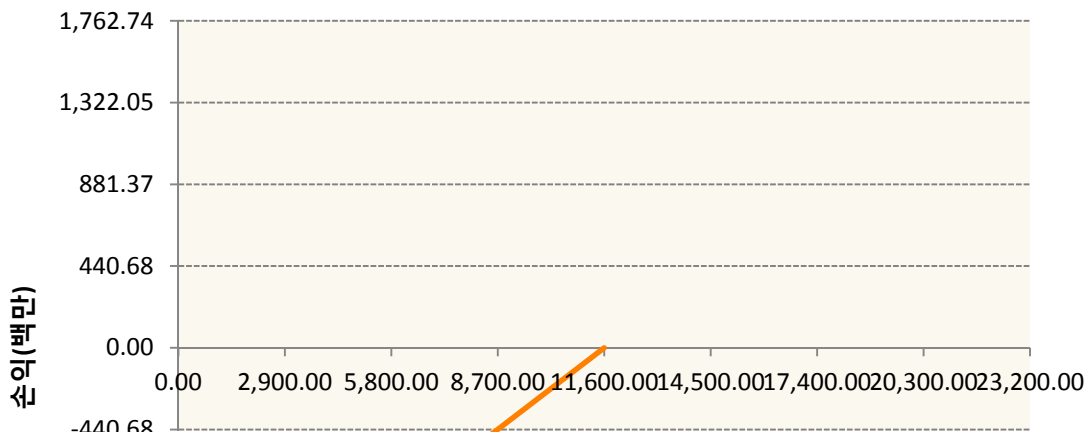


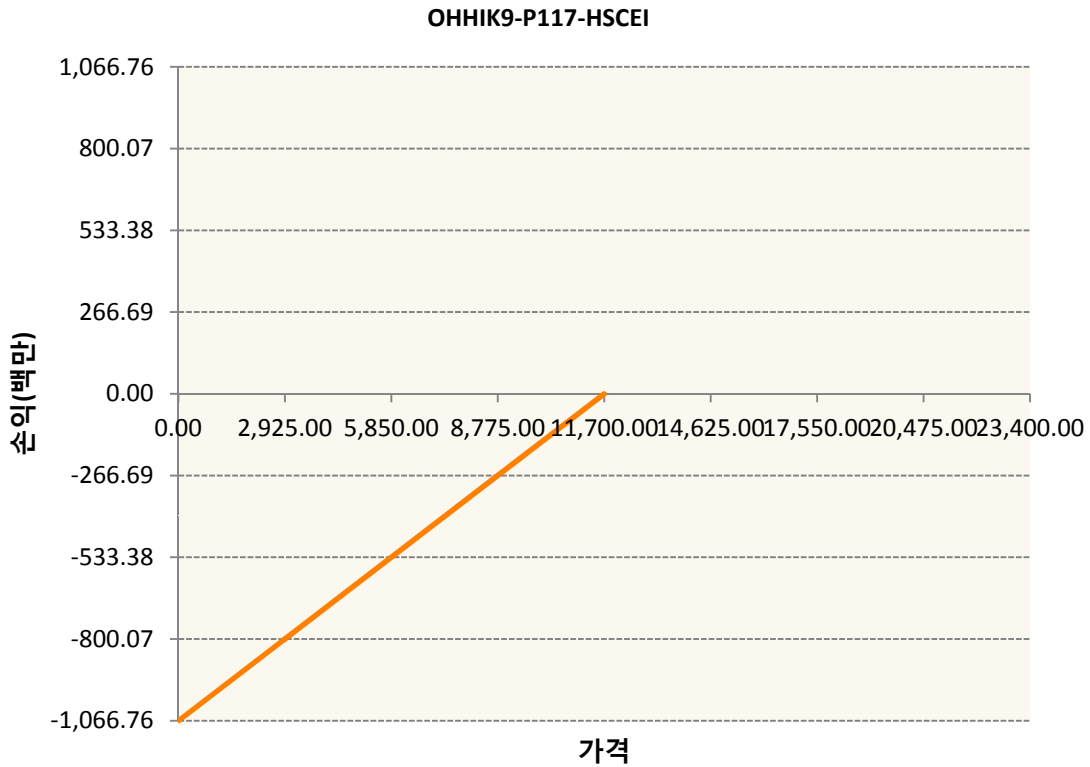


OHHIK9-C117-HSCEI



OHHIK9-P116-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	231
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	24
FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	255
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)
	787

공시일	2019-05-23
기준일	2019-05-22

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

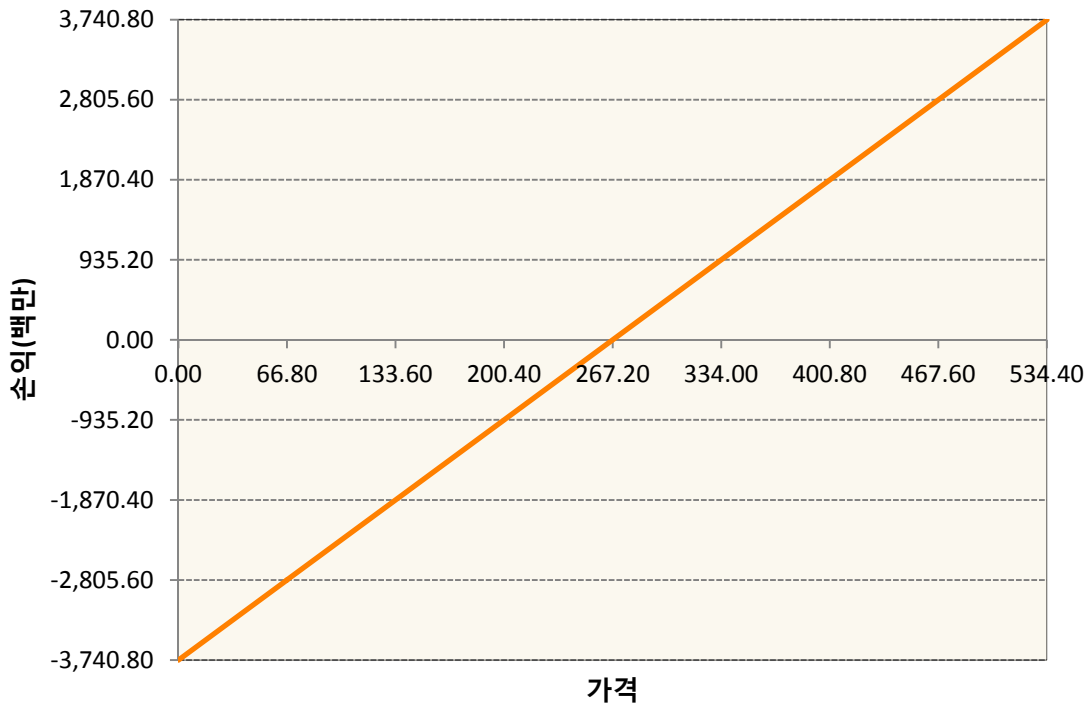
1. 계약금액

(단위:백만원)

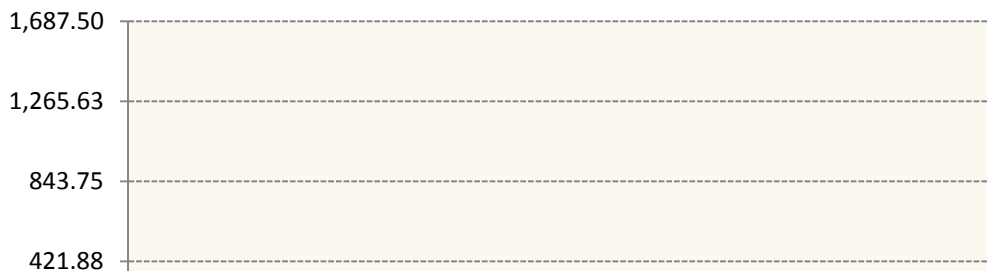
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,741	0	3,741	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	21,759	-21,759	장내

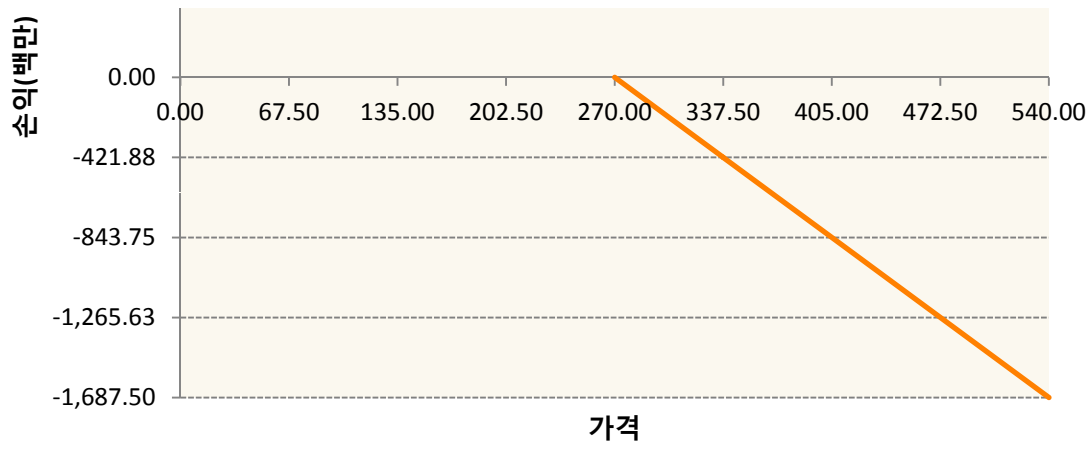
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

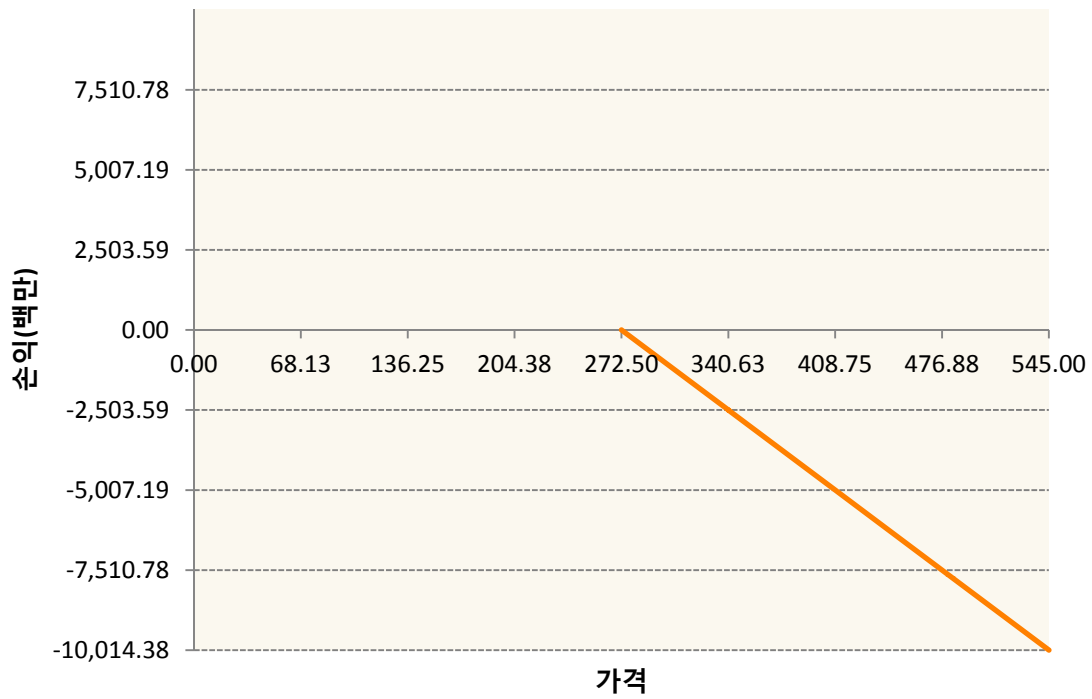


KR4201P62701-2019-06 콜270

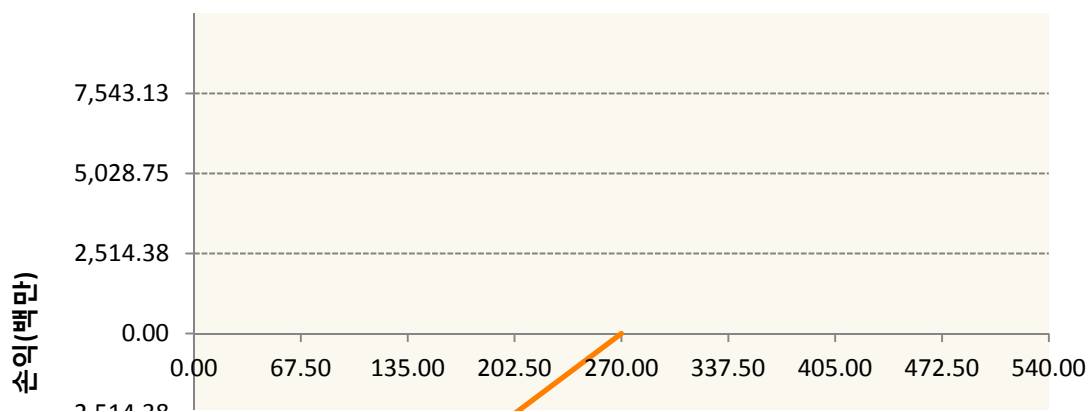


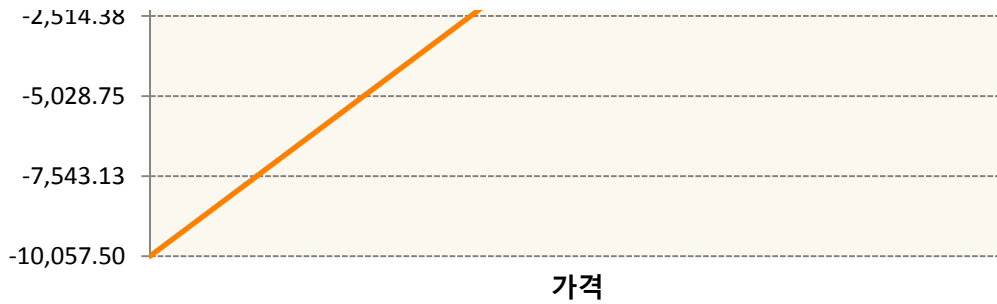


KR4201P62727-2019-06 콜272.5



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						299
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-299	-299	-299	-299	-299	-299	-299	
-5.33%	-199	-199	-199	-199	-199	-199	-199	
-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%	199	199	199	199	199	199	199	
8.00%	299	299	299	299	299	299	299	
KR4201P62701		2019-06 콜270						95
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	31	31	30	29	28	27	25
-5.33%	29	28	26	25	23	20	18
-2.67%	23	21	18	15	13	10	7
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	-13	-16	-19	-23	-26	-30	-33
5.33%	-44	-47	-50	-53	-56	-59	-62
8.00%	-83	-84	-86	-88	-91	-93	-95

KR4201P62727 2019-06 콜272.5 525

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	150	148	145	141	136	129	122
-5.33%	142	137	129	120	111	100	88
-2.67%	117	105	92	77	62	46	30
0%	57	38	19	0	-19	-39	-59
2.67%	-57	-77	-98	-119	-140	-160	-181
5.33%	-226	-243	-262	-280	-299	-318	-338
8.00%	-440	-451	-464	-478	-493	-509	-525

KR4301P62709 2019-06 풋270 698

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-693	-693	-694	-694	-695	-696	-698
-5.33%	-430	-431	-433	-435	-439	-442	-447
-2.67%	-176	-182	-188	-195	-203	-212	-221
0%	36	24	12	0	-12	-25	-37
2.67%	166	154	142	130	117	104	92
5.33%	217	211	204	196	187	178	169
8.00%	228	227	224	221	217	212	207

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

(단위:백만원)

3,399

공시일	2019-05-23
기준일	2019-05-22

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

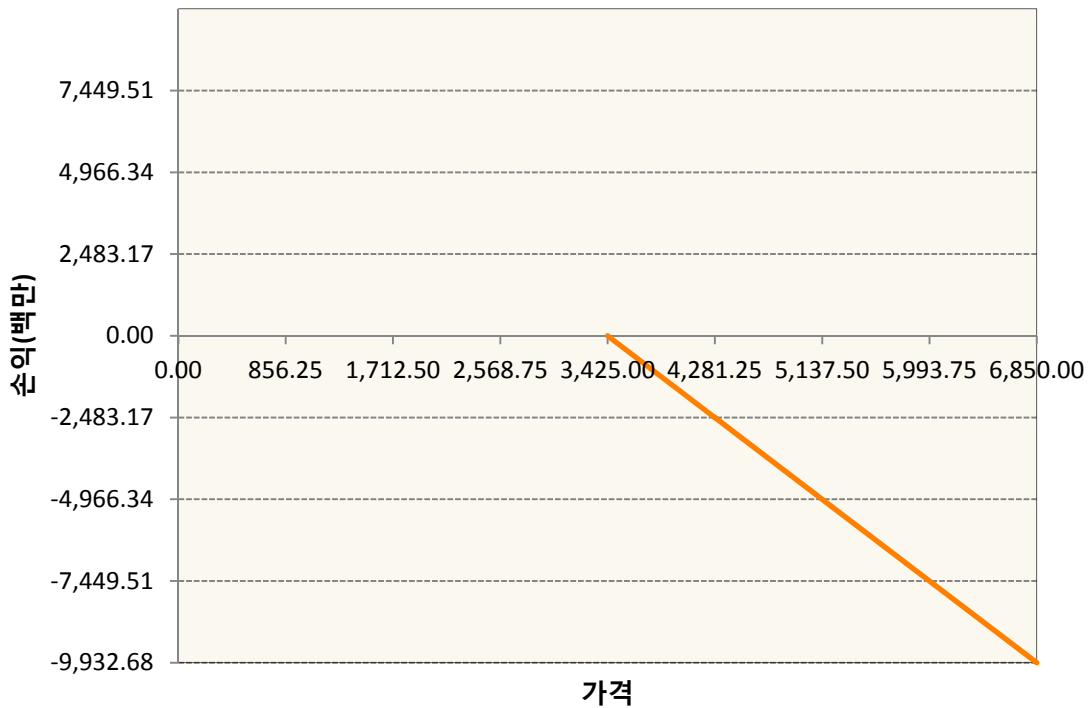
1. 계약금액

(단위:백만원)

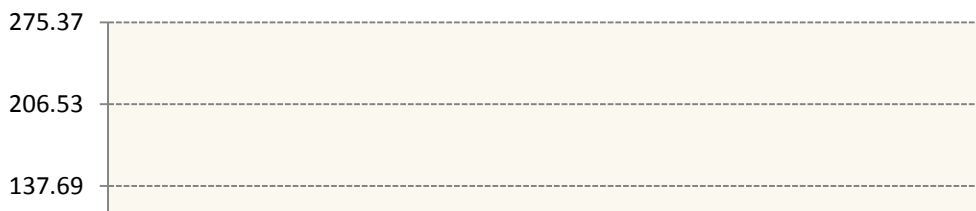
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,680	0	3,680	
누계	유가증권	스왑	56,312	0	56,312	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,416	-20,416	장내
누계	통화	선도	0	23,946	-23,946	장외

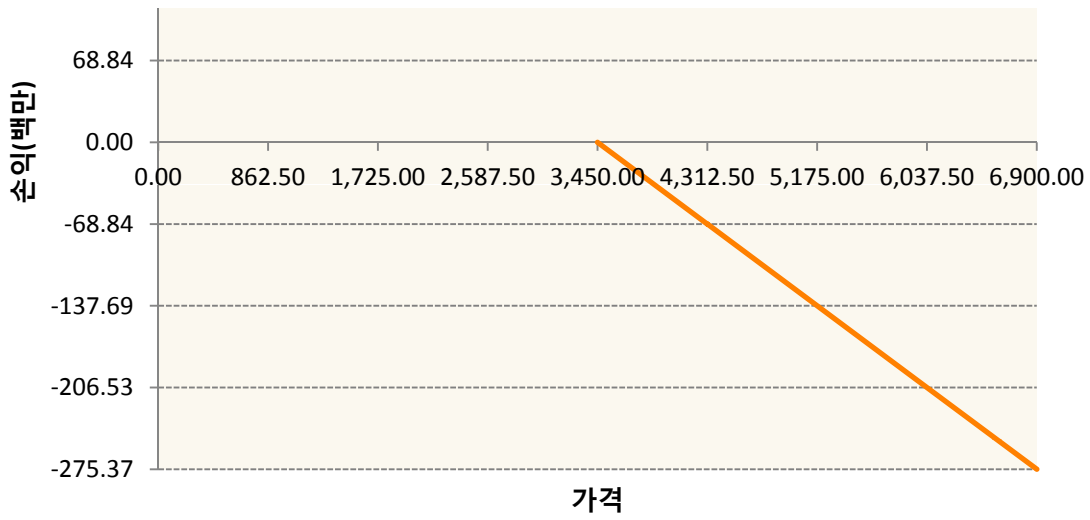
2. 만기시점의 손익구조

OESXM9-C3425-EURO STOXX 50

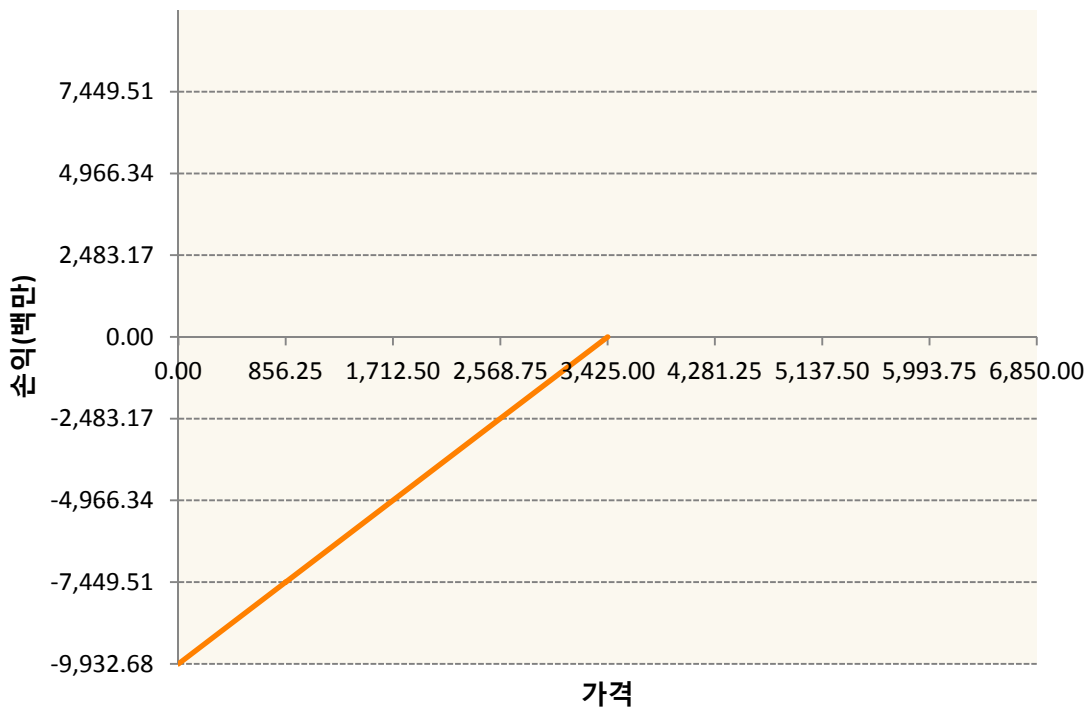


OESXM9-C3450-EURO STOXX 50

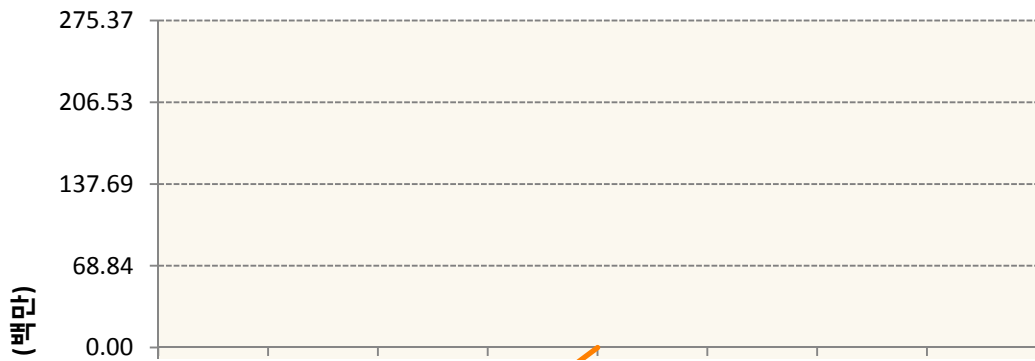


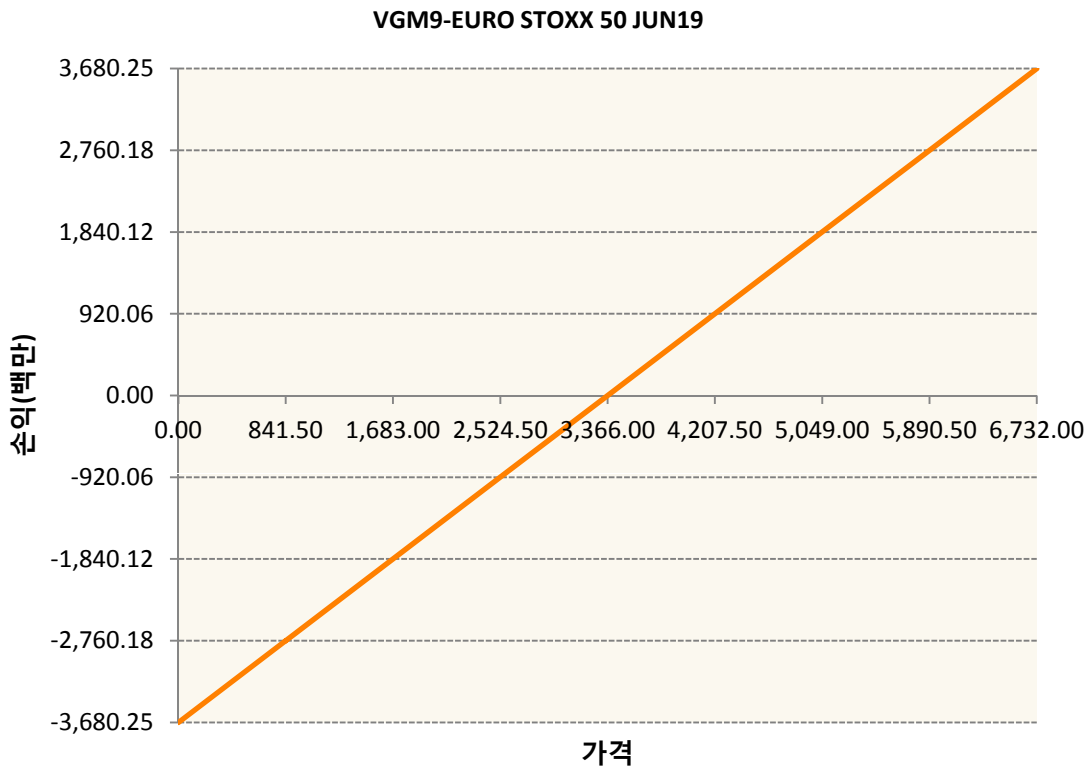
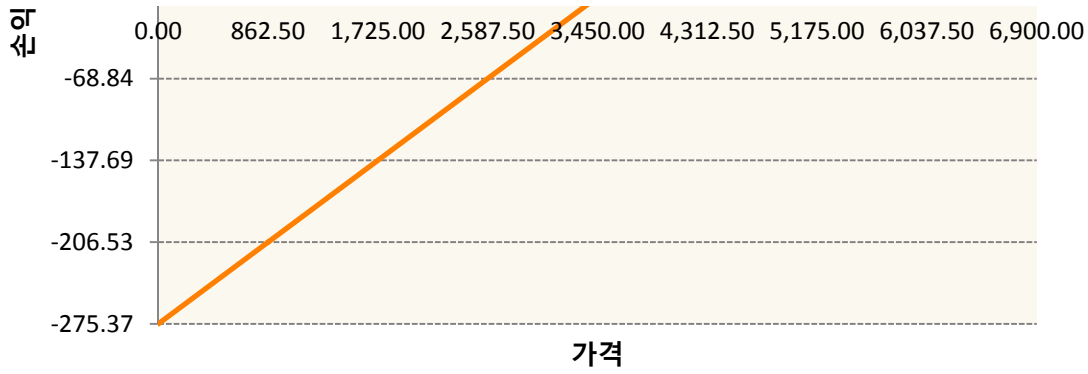


OESXM9-P3425-EURO STOXX 50



OESXM9-P3450-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	51
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	426
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	851
FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E	213
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	426
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	294

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

(단위:백만원)

2,395

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

(단위:백만원)

1,023

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

(단위:백만원)

90

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

(단위:백만원)

131

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-05-23
기준일	2019-05-22

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

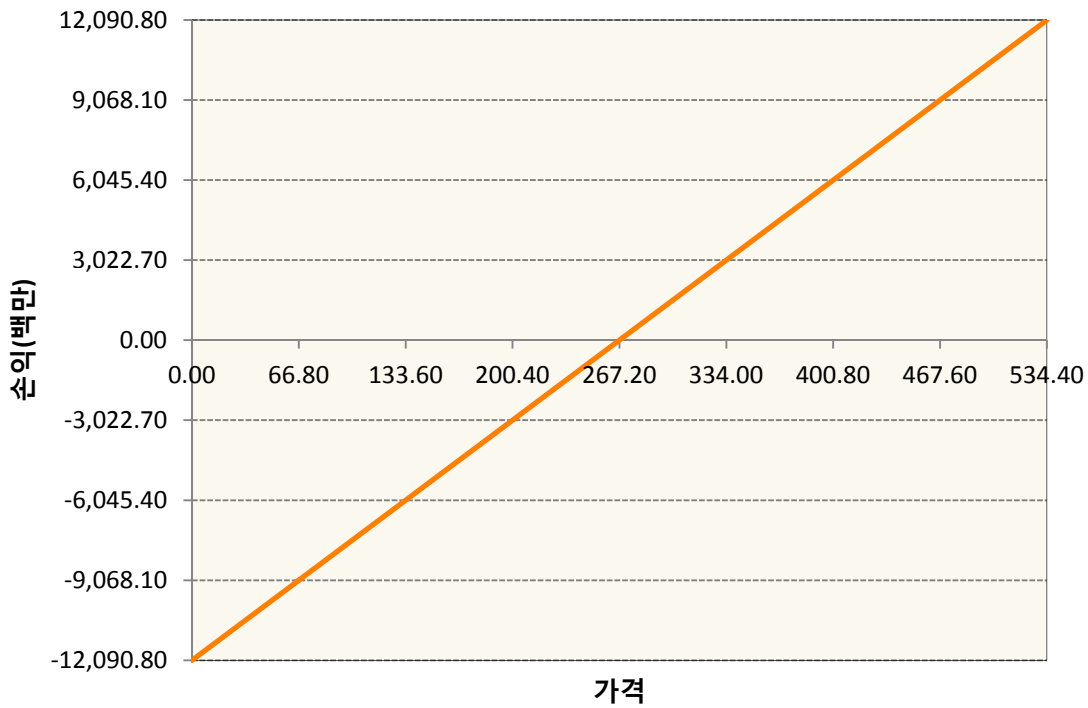
1. 계약금액

(단위:백만원)

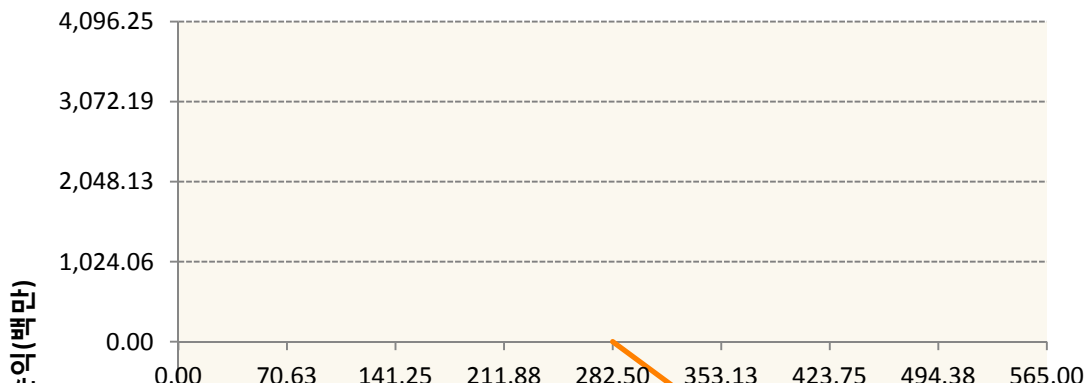
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,091	0	12,091	장내
누계	유가증권	옵션	5,081	22,906	-17,825	장내

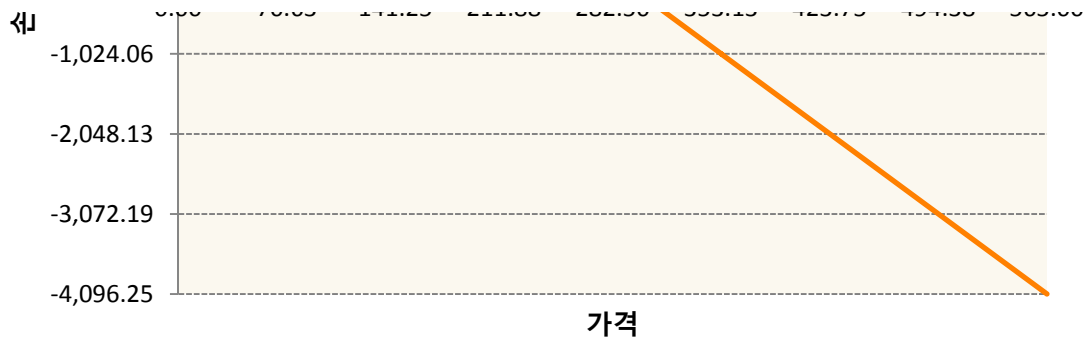
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

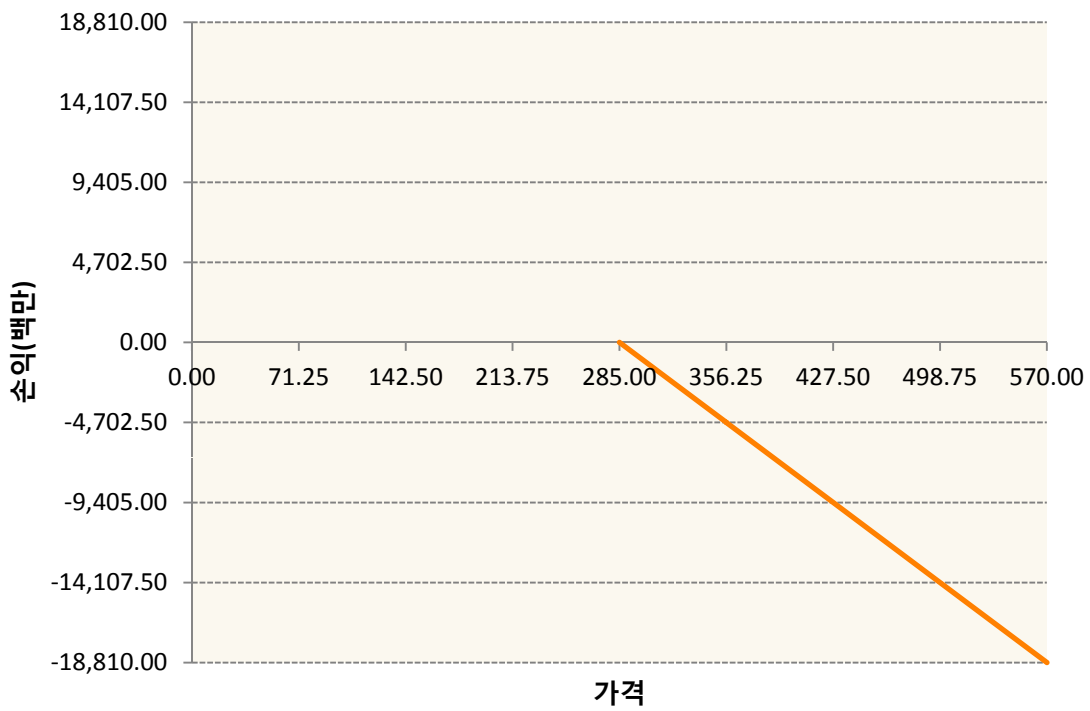


KR4201P62826-2019-06 콜282.5

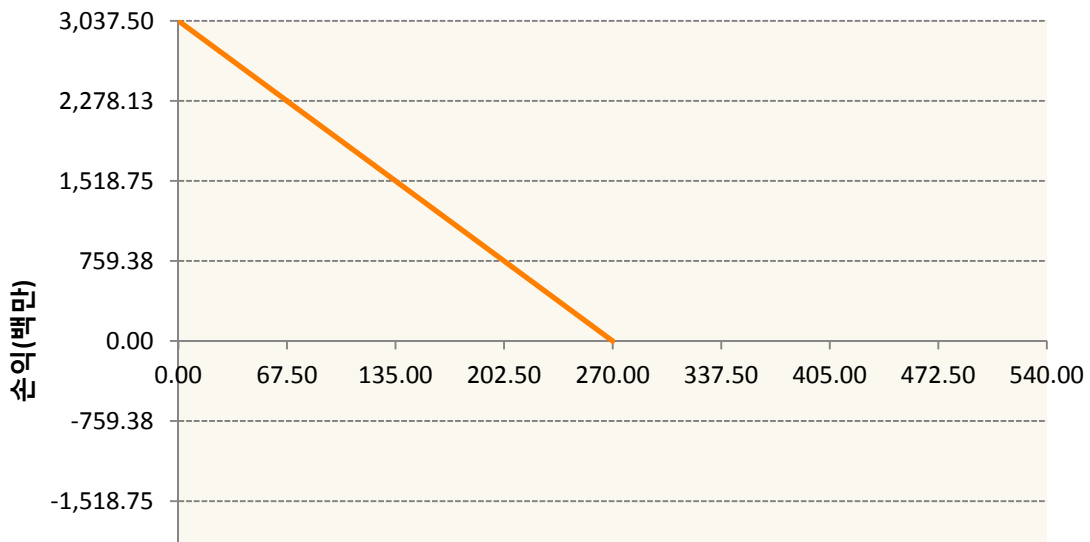


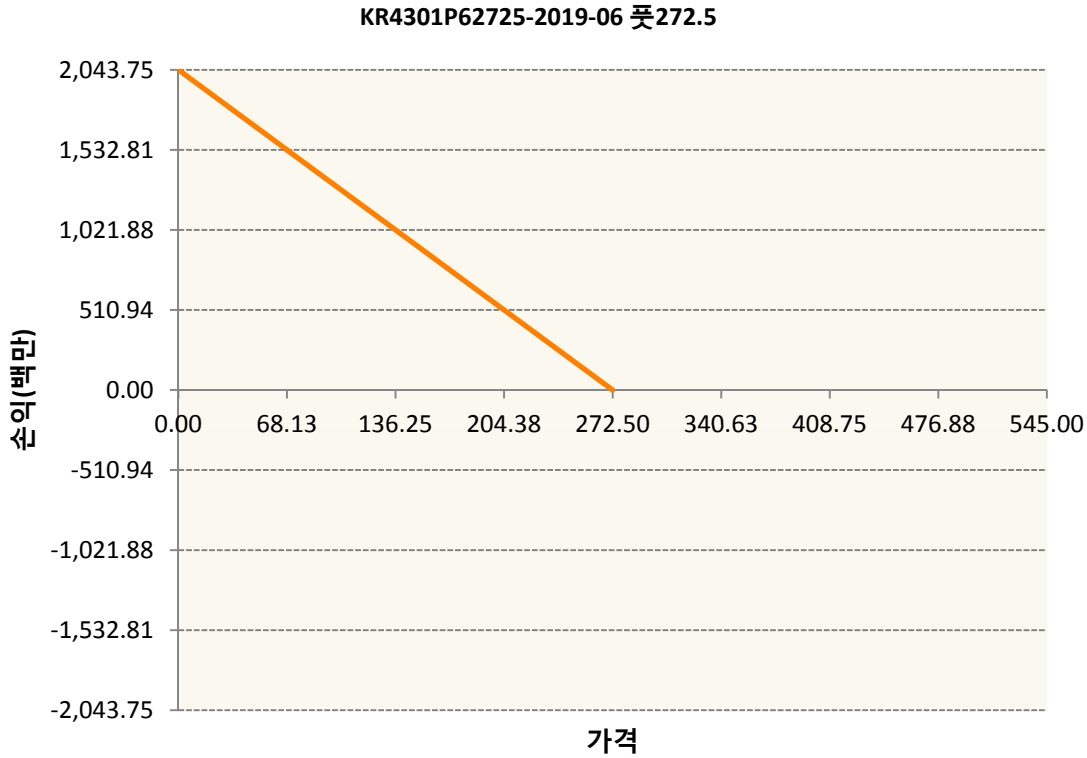
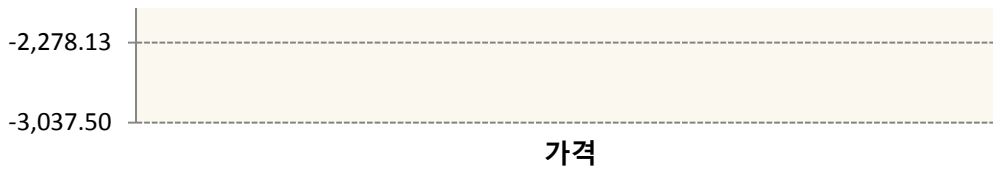


KR4201P62859-2019-06 콜285



KR4301P62709-2019-06 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						965
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-965	-965	-965	-965	-965	-965	-965	
-5.33%	-644	-644	-644	-644	-644	-644	-644	
-2.67%	-322	-322	-322	-322	-322	-322	-322	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	322	322	322	322	322	322	322	
5.33%	644	644	644	644	644	644	644	
8.00%	965	965	965	965	965	965	965	
KR4201P62826		2019-06 콜282.5						147
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	23	23	23	22	22	21	19	
-5.33%	23	22	21	20	18	16	14	
-2.67%	21	19	17	14	10	6	2	

0%	14	10	5	0	-6	-11	-17
2.67%	-4	-11	-18	-25	-33	-40	-48
5.33%	-41	-49	-57	-66	-74	-83	-91
8.00%	-98	-106	-114	-123	-131	-139	-147
KR4201P62859 2019-06 콜285							604
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	82	81	80	79	76	73	68
-5.33%	81	79	76	71	65	57	47
-2.67%	75	69	60	50	37	21	4
0%	53	38	20	0	-22	-46	-71
2.67%	-10	-37	-66	-96	-127	-159	-192
5.33%	-144	-181	-218	-255	-293	-331	-369
8.00%	-372	-411	-449	-488	-526	-565	-604
KR4301P62709 2019-06 풋270							211
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	209	209	209	210	210	210	211
-5.33%	130	130	131	131	132	134	135
-2.67%	53	55	57	59	61	64	67
0%	-11	-7	-4	0	4	8	11
2.67%	-50	-47	-43	-39	-35	-32	-28
5.33%	-65	-64	-61	-59	-57	-54	-51
8.00%	-69	-68	-68	-67	-66	-64	-62
KR4301P62725 2019-06 풋272.5							146
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	146	146	146	146	146	146	146
-5.33%	92	93	93	93	93	94	95
-2.67%	40	41	42	43	44	46	47
0%	-6	-4	-2	0	2	5	7
2.67%	-39	-36	-34	-31	-28	-26	-23
5.33%	-54	-52	-50	-48	-46	-44	-42
8.00%	-58	-58	-57	-56	-55	-54	-52

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

(단위:백만원)

1,614

공시일	2019-05-23
기준일	2019-05-22

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	16,335	0	16,335	

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	2019-05-23
기준일	2019-05-22

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	60,614	0	60,614	

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	2019-05-23
기준일	2019-05-22

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	250,259	0	250,259	
누계	통화	선도	0	288,180	-288,180	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		954
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		954
FX21019J030 KRW/USD 28-05-19E		1,011
FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E		382
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		76
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		1,004
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E		1,031
FX21019J041 KRW/USD 28-05-19E		286
FX21019J043 KRW/USD 03-06-19E		573
FX21019J044 KRW/USD 03-06-19E		477
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		286
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		477
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		668
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		668
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		830
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		821
FX21019K00 KRW/USD 18-06-19E		573
FX21019K01 KRW/USD 14-06-19E		668
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		573
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		477
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		573
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,431
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,336
FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E		477

FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E	802
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E	637
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E	477
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E	382
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E	802
FX21019K02 KRW/USD 24-06-19E	382
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E	954
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E	1,527

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

(단위:백만원)

7,716

공시일	2019-05-23
기준일	2019-05-22

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

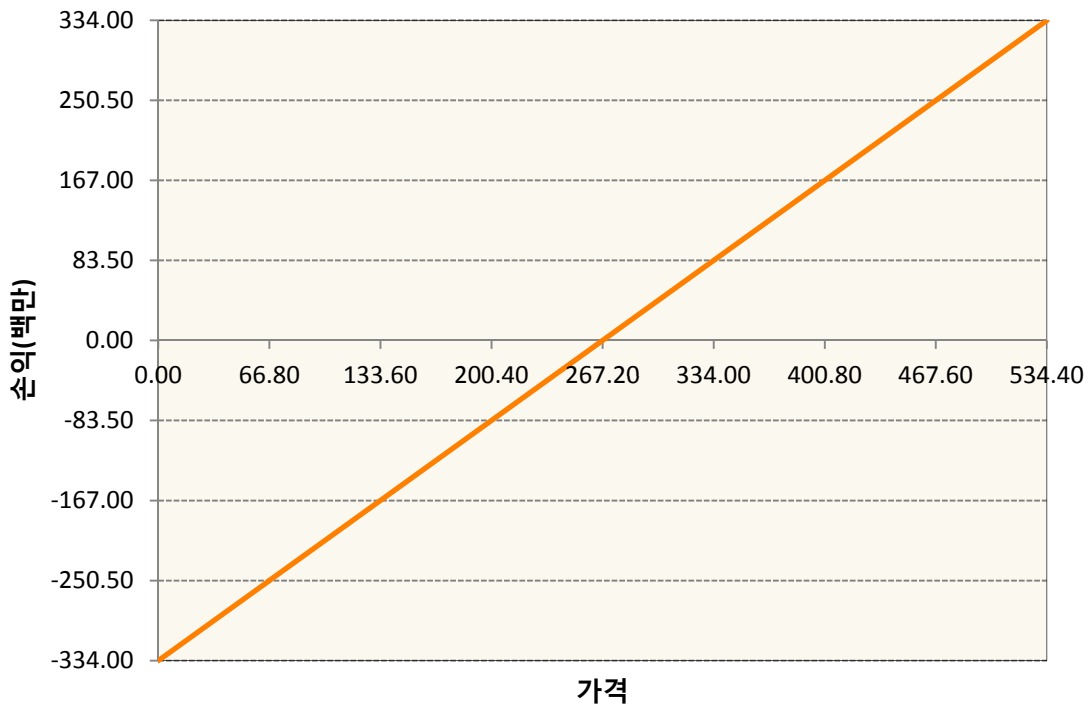
1. 계약금액

(단위:백만원)

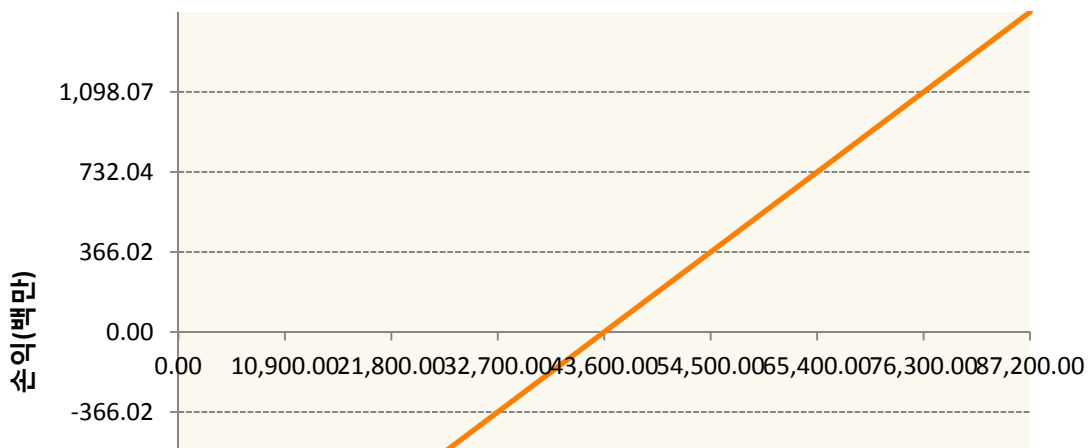
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,798	0	1,798	장내

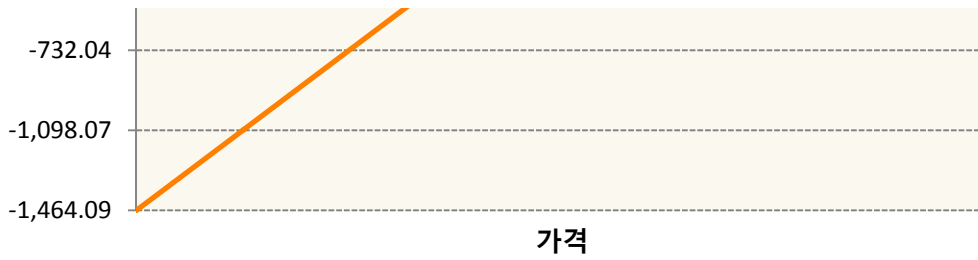
2. 만기시점의 손익구조

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						117
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117	
-5.33%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78	
-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%	78	78	78	78	78	78	78	
8.00%	117	117	117	117	117	117	117	

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

159

공시일	2019-05-23
기준일	2019-05-22

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

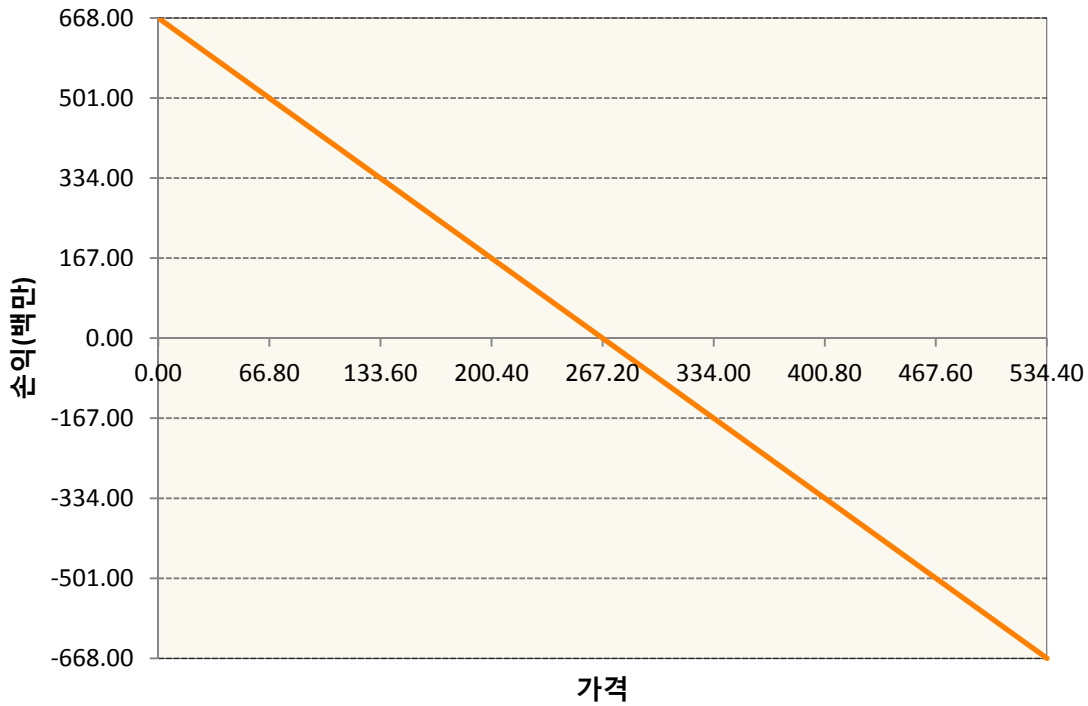
1. 계약금액

(단위:백만원)

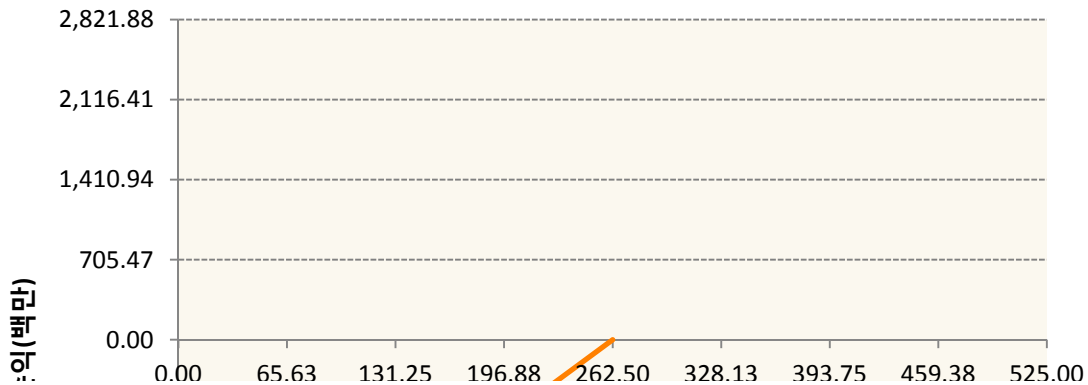
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	668	-668	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,352	-3,352	장내

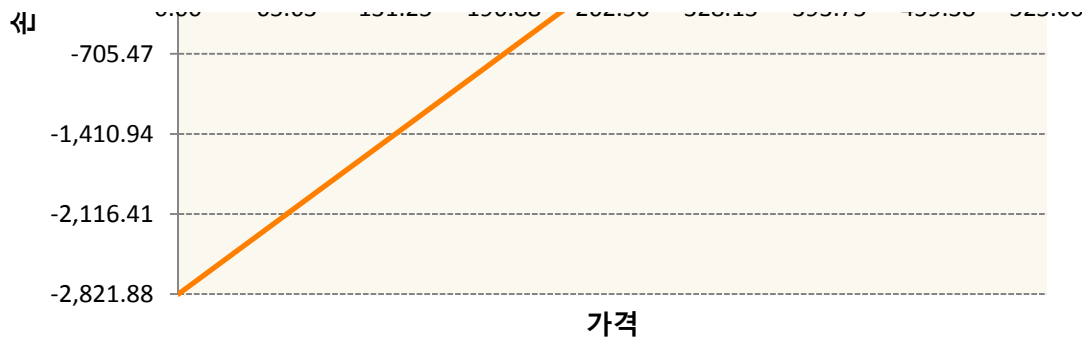
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

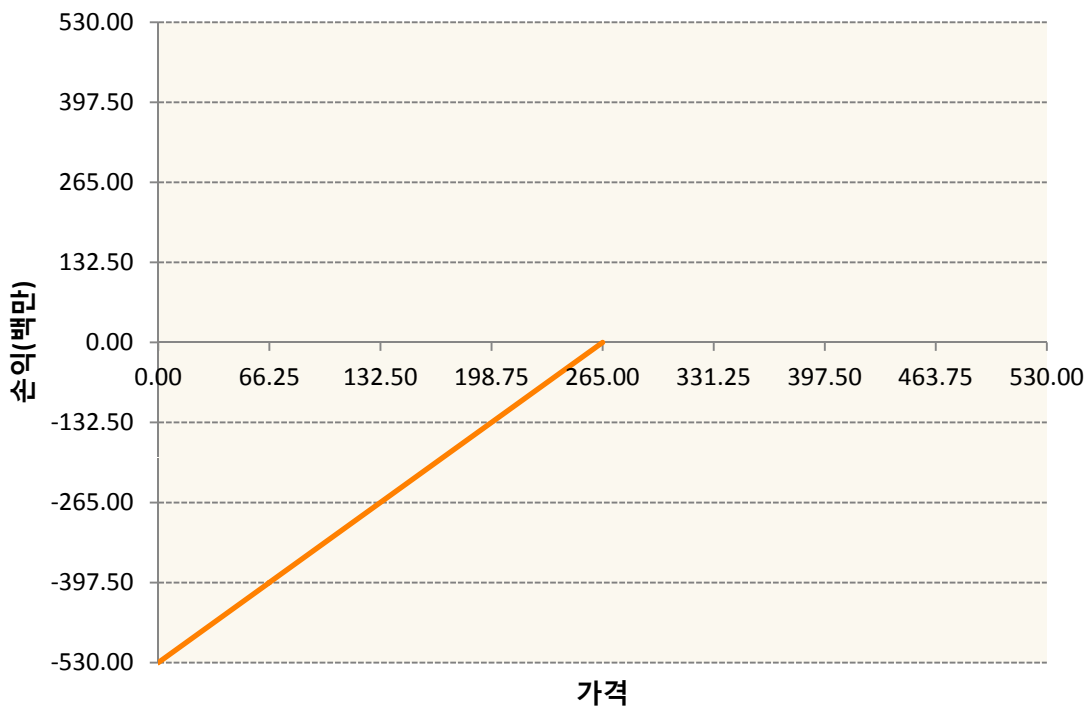


KR4301P62626-2019-06 풋262.5





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%	36	36	36	36	36	36	36	
-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%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	
8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53	
KR4301P62626		2019-06 풋262.5						165
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-160	-160	-161	-161	-162	-163	-165
-5.33%	-87	-88	-90	-92	-94	-97	-99
-2.67%	-26	-29	-33	-36	-40	-43	-47
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	23	22	20	18	16	13	11
5.33%	26	26	25	24	23	22	21
8.00%	26	26	26	26	26	25	25
KR4301P62659 2019-06 풋265							33
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-5.33%	-19	-19	-19	-19	-20	-20	-21
-2.67%	-6	-7	-7	-8	-9	-9	-10
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	6	5	5	4	4	3	3
5.33%	7	7	6	6	6	6	5
8.00%	7	7	7	7	7	7	6

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

(단위:백만원)

244

공시일	2019-05-23
기준일	2019-05-22

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

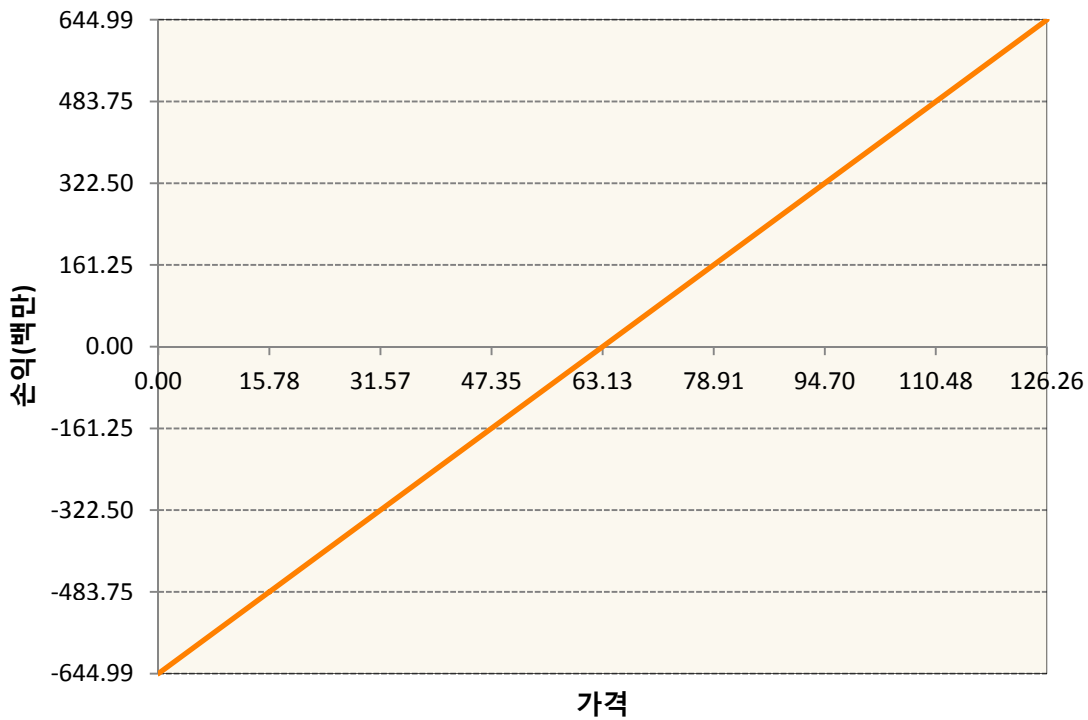
1. 계약금액

(단위:백만원)

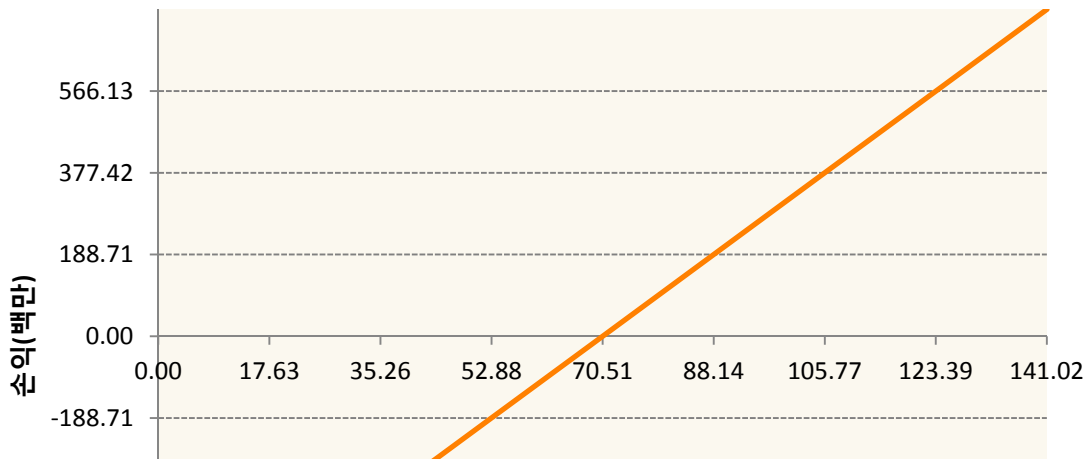
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,806	298	2,508	

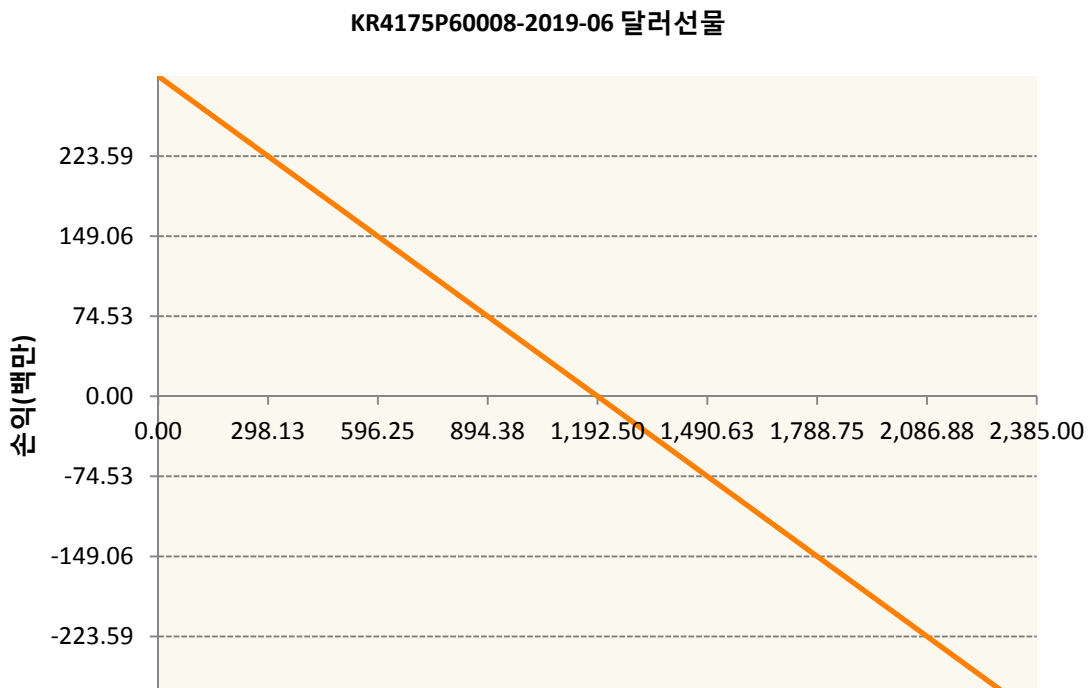
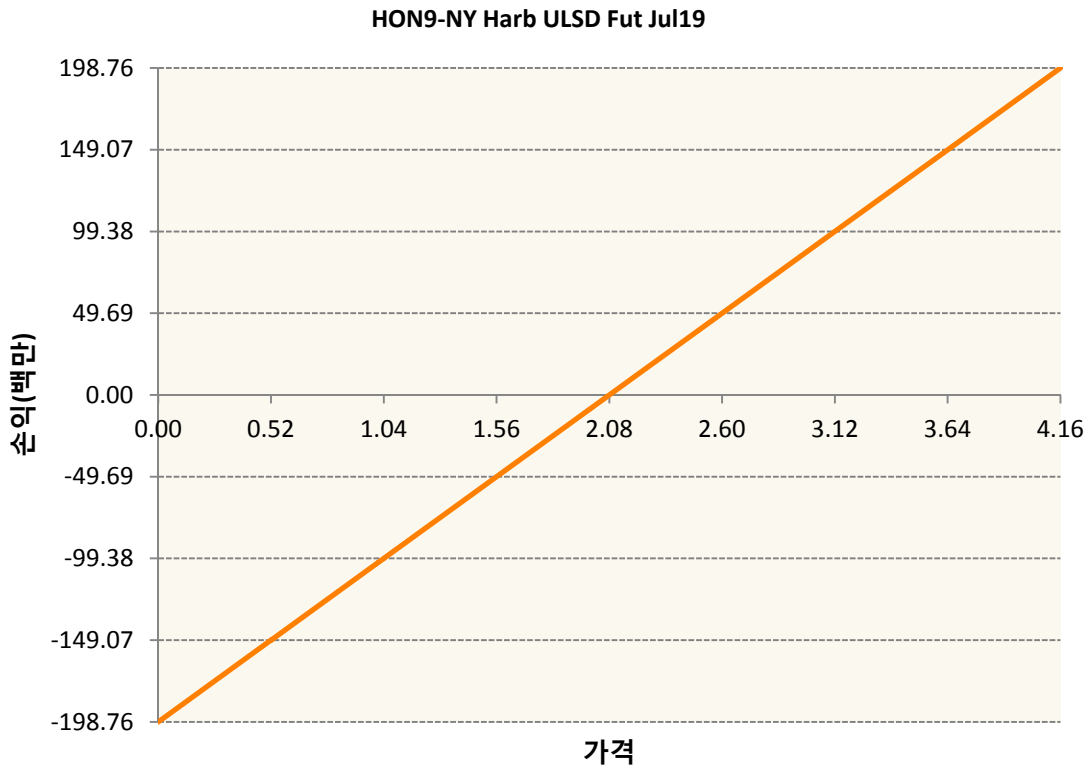
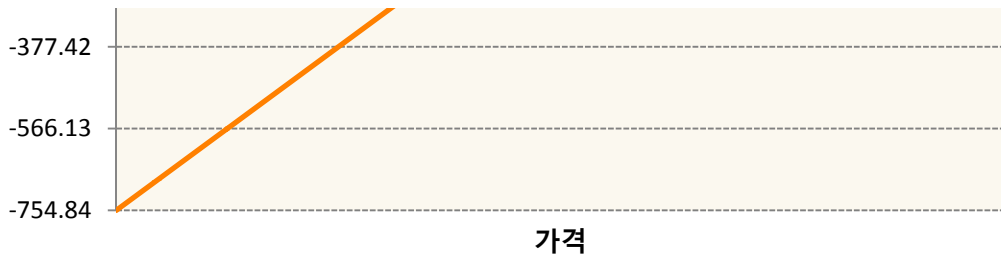
2. 만기시점의 손익구조

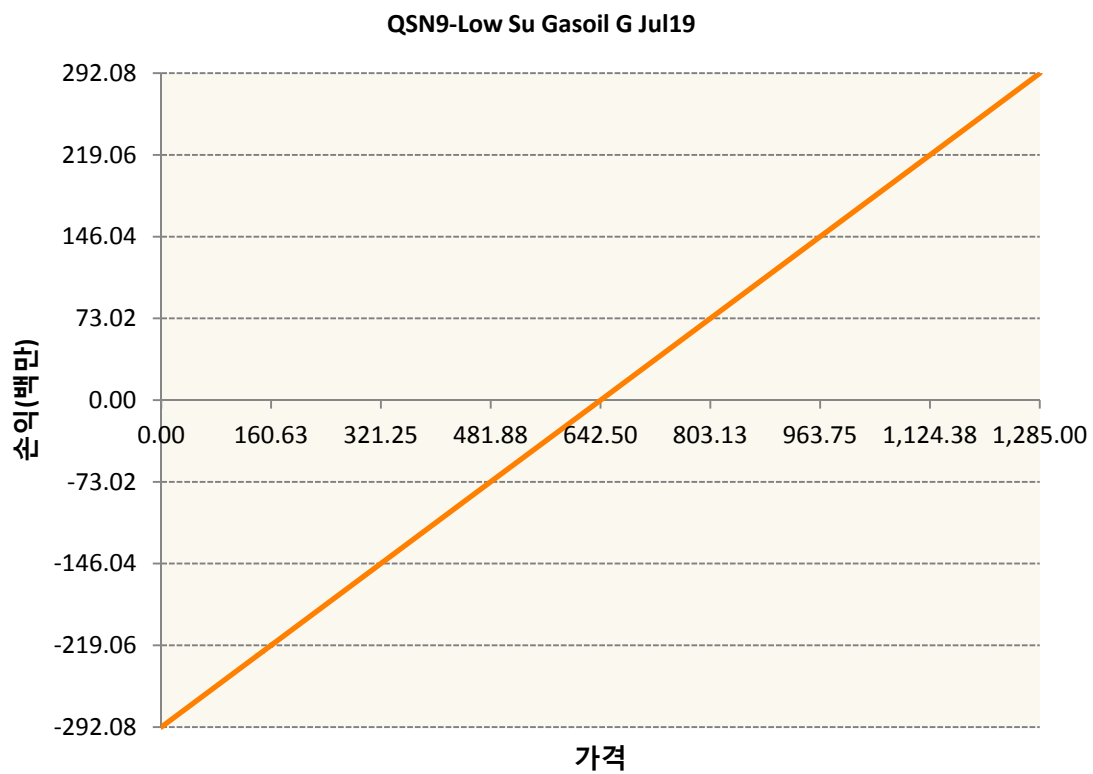
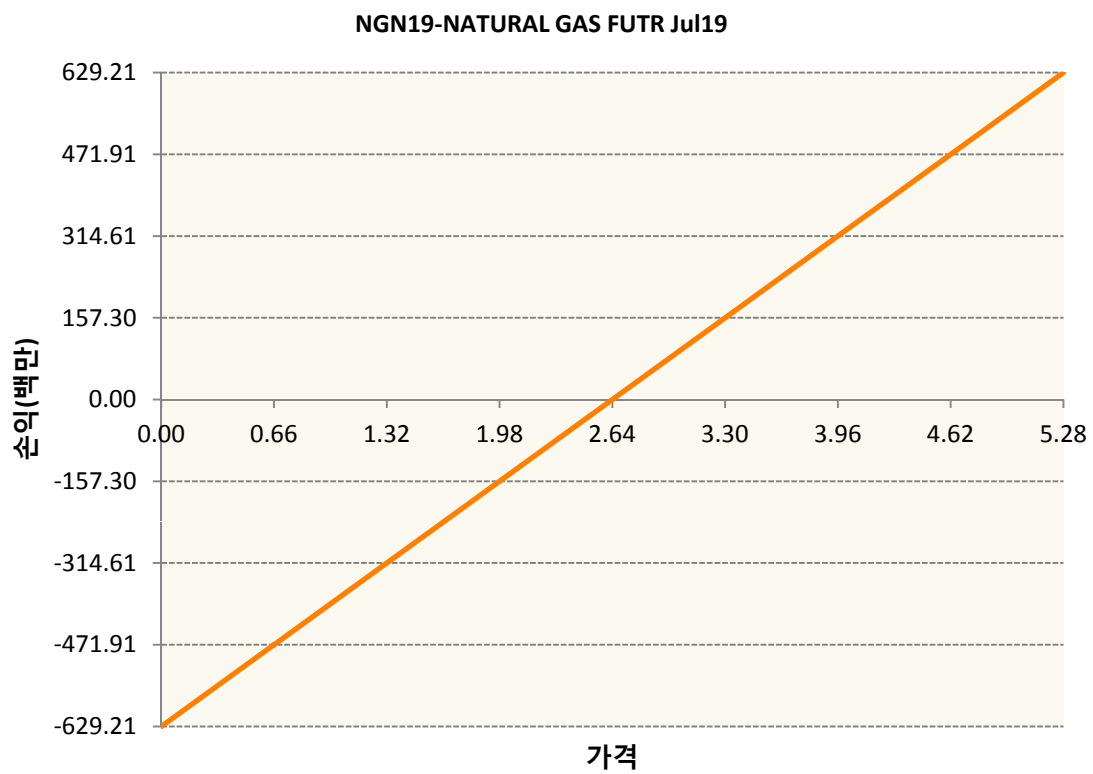
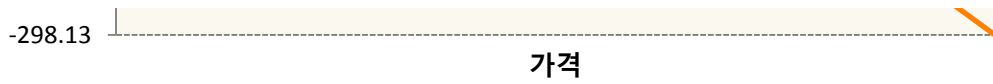
CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19



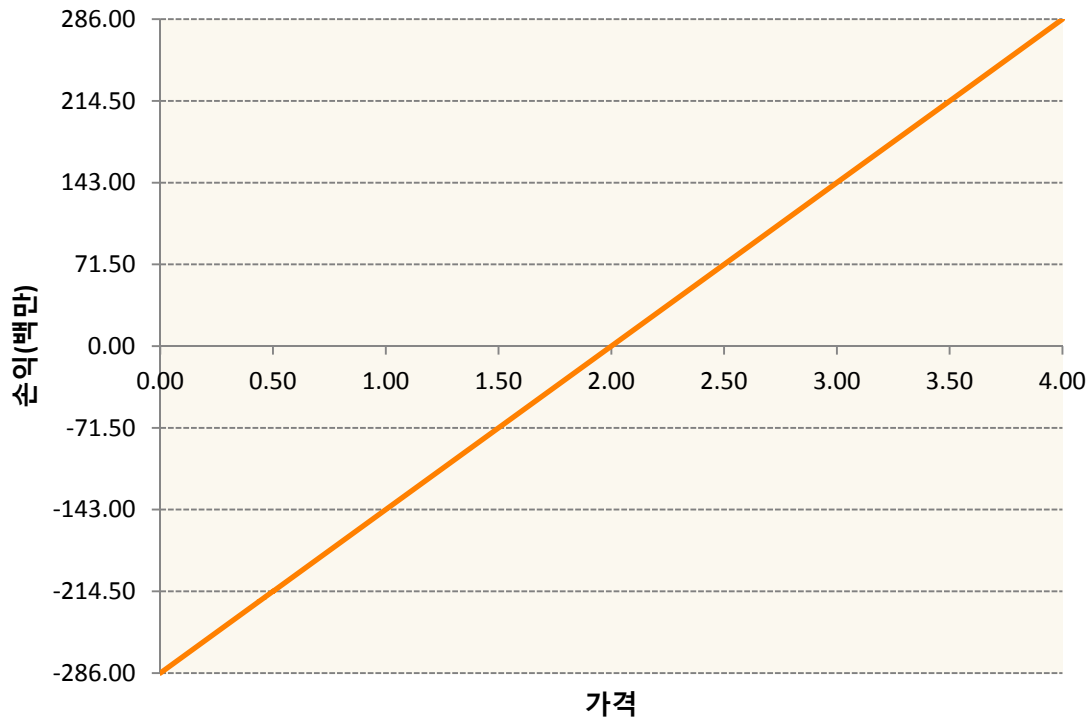
COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19







XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN9	WTI CRUDE FUTURE Jul19	52
COU9	BRENT CRUDE FUTR Sep19	60
HON9	NY Harb ULSD Fut Jul19	16
KR4175P600	2019-06 달러선물	24
NGN19	NATURAL GAS FUTR Jul19	50
QSN9	Low Su Gasoil G Jul19	23
XBN9	GASOLINE RBOB FUT Jul19	23

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

(단위:백만원)

410

공시일	2019-05-23
기준일	2019-05-22

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

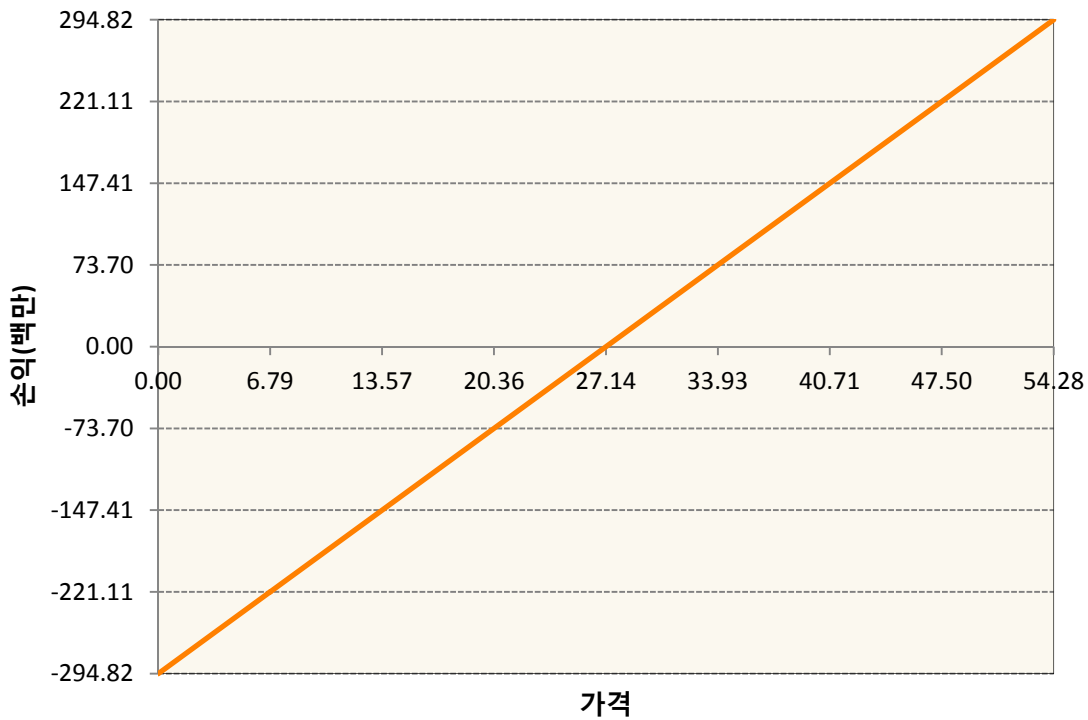
1. 계약금액

(단위:백만원)

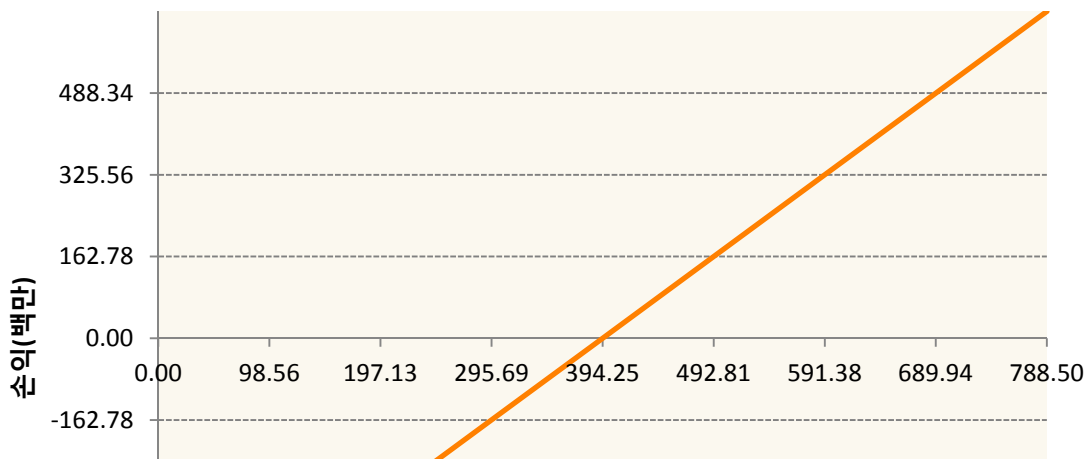
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,924	60	2,864	

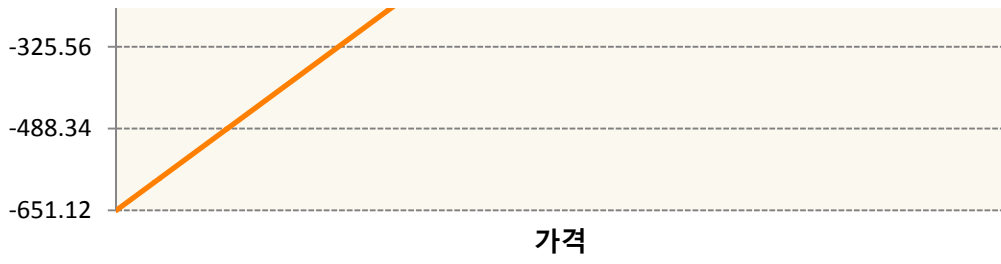
2. 만기시점의 손익구조

BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19

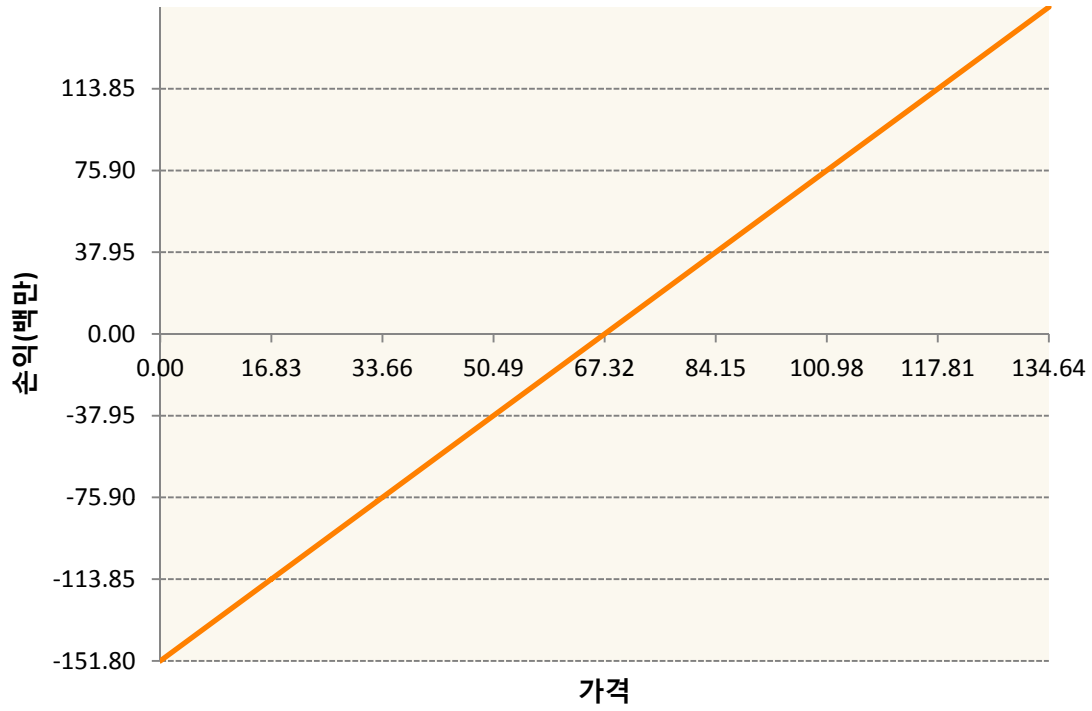


CN9-CORN FUTURE Jul19

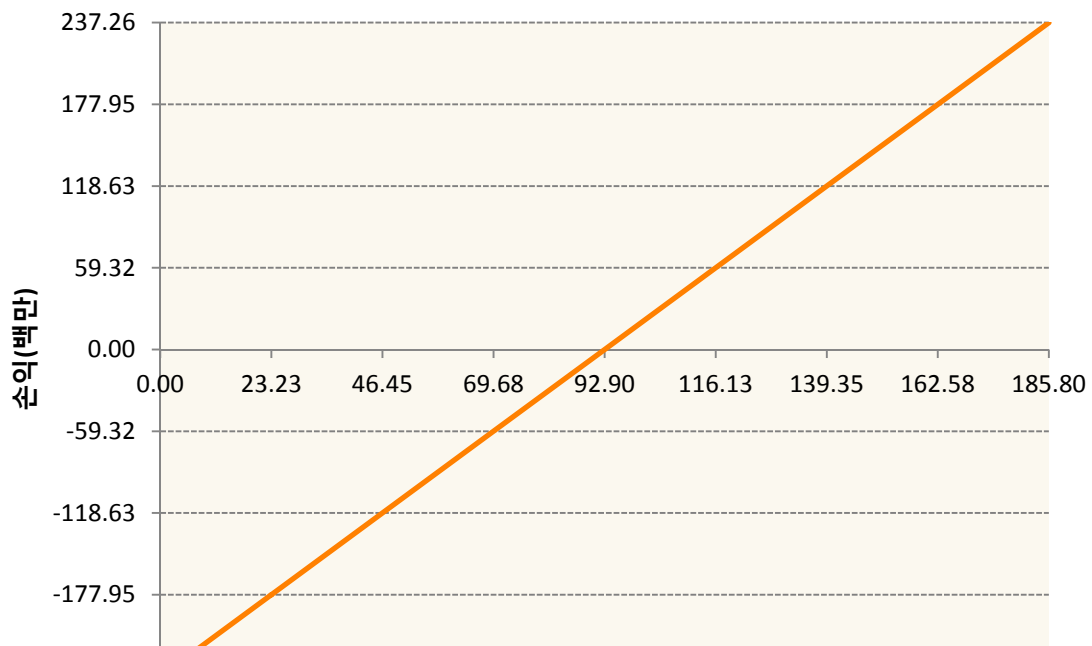


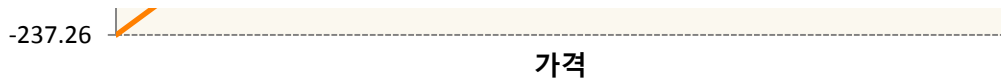


CTN9-COTTON NO.2 FUTR Jul19

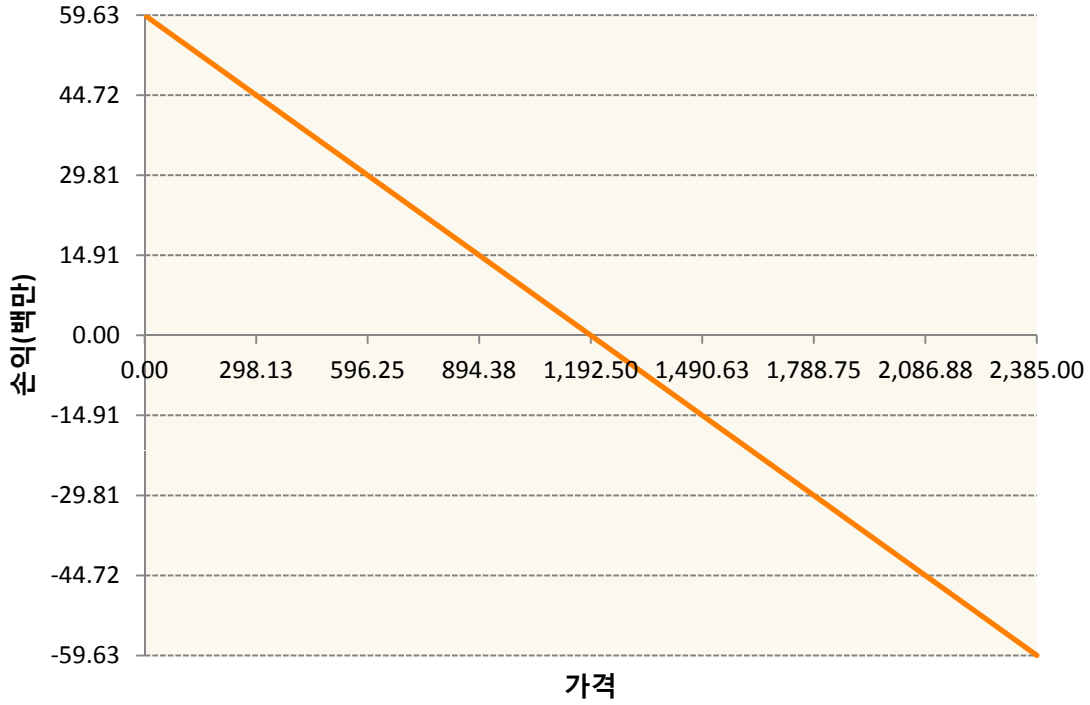


KCN9-COFFEE 'C' FUTURE Jul19

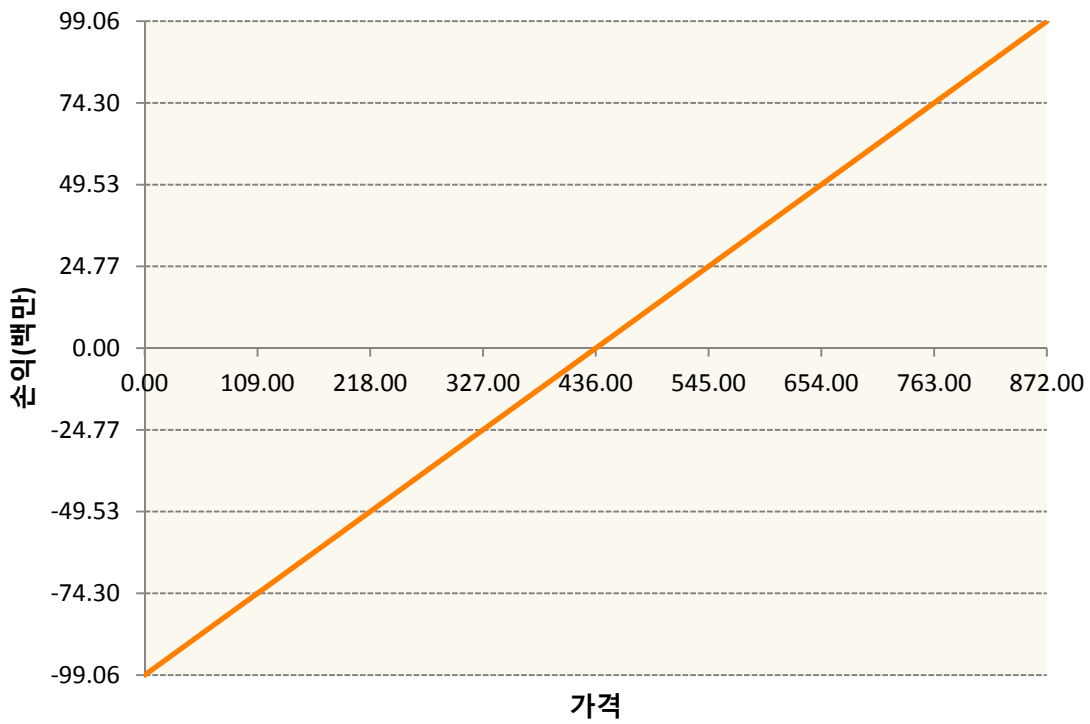




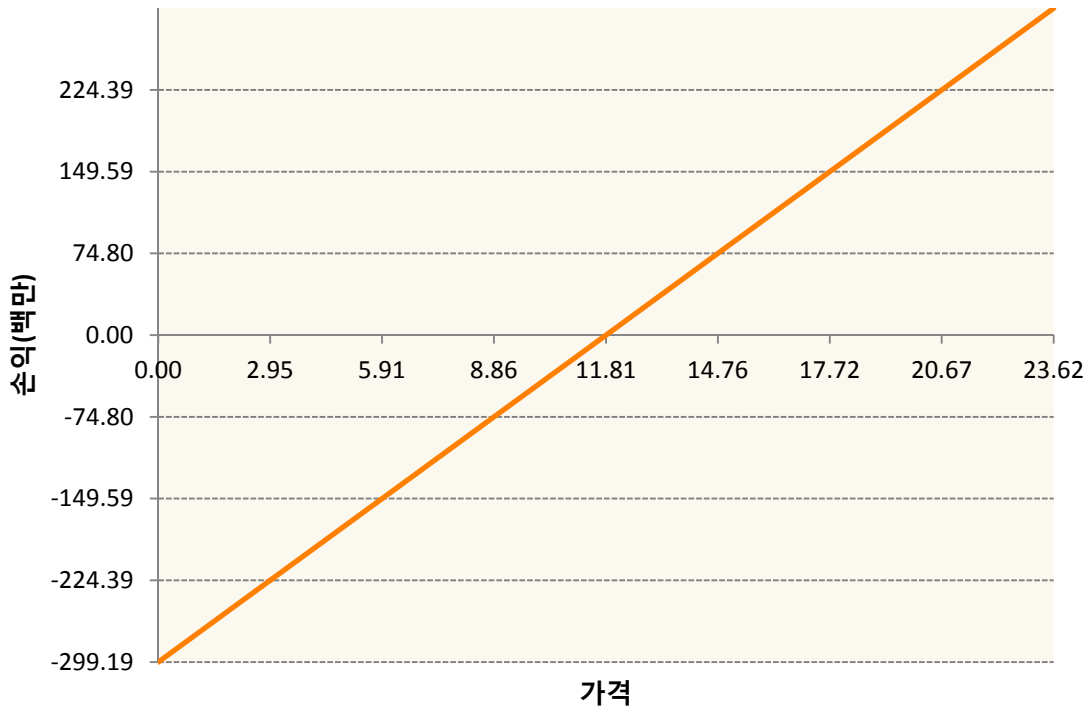
KR4175P60008-2019-06 달러선물



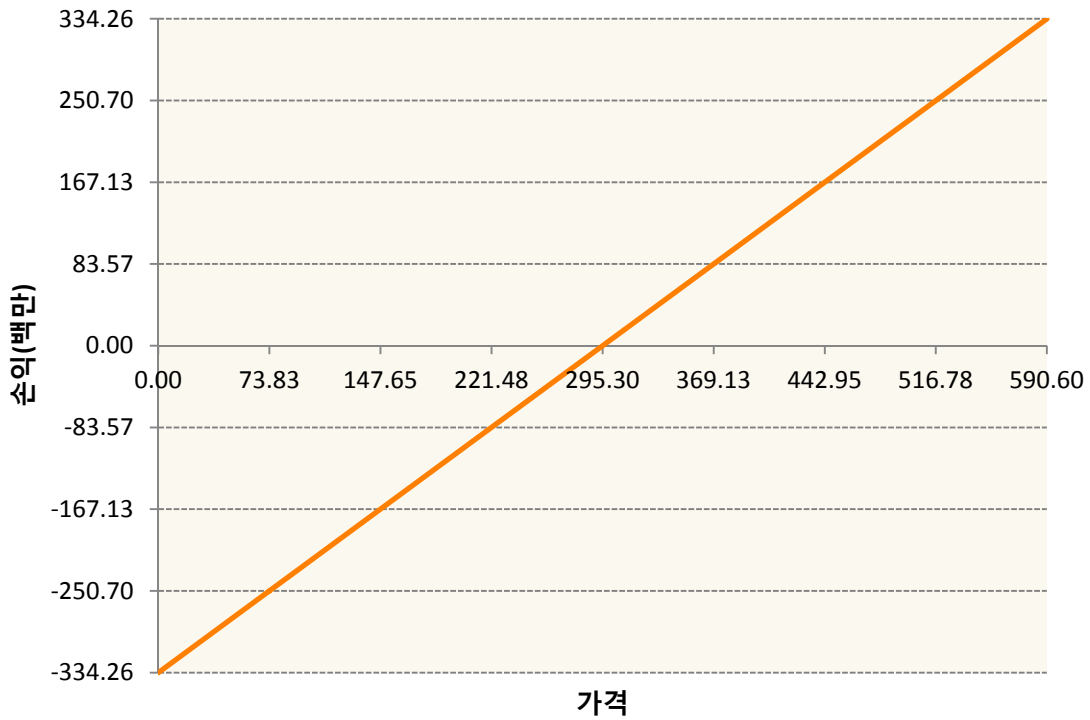
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

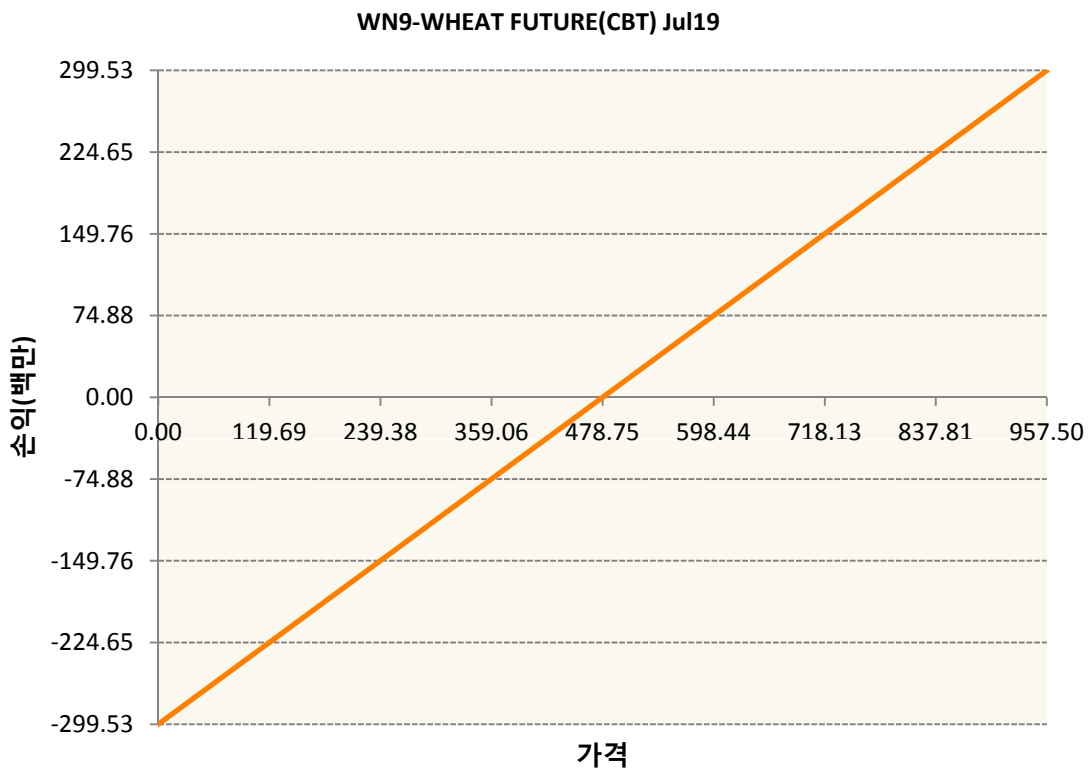
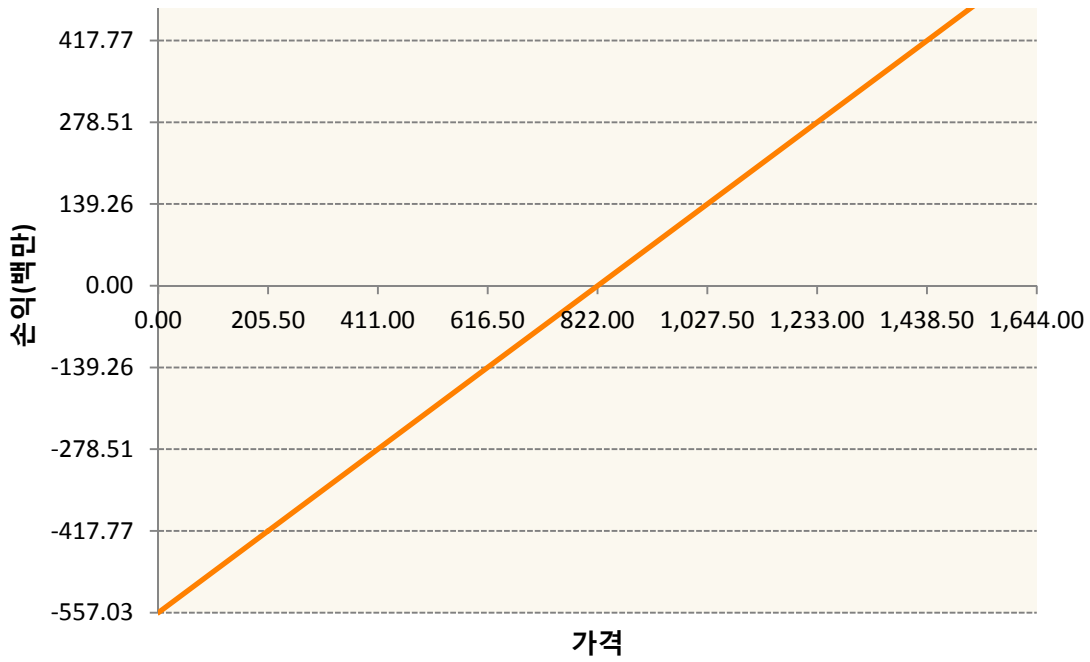


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19



SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON9	SOYBEAN OIL FUTR Jul19	24
CN9	CORN FUTURE Jul19	52
CTN9	COTTON NO.2 FUTR Jul19	12
KCN9	COFFEE 'C' FUTURE Jul19	19
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)

242