

공시일	2019-03-18
기준일	2019-03-15

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)

95

공시일	2019-03-18
기준일	2019-03-15

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

1,120

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

650

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-03-18
기준일	2019-03-15

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)	335
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	92
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	157

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

915

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-03-18
기준일	2019-03-15

유로인덱스모(주식-파생형)

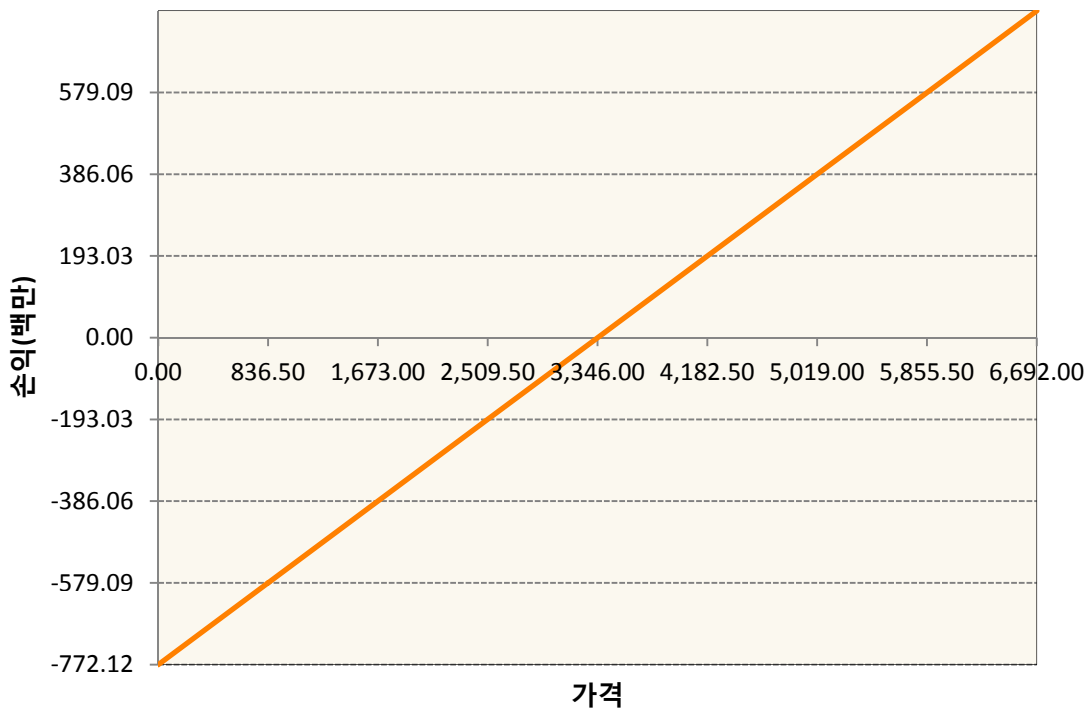
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

VGH9-EURO STOXX 50 Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH9	EURO STOXX 50 Mar19	62
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-03-18
기준일	2019-03-15

차이나인덱스모(주식-파생형)

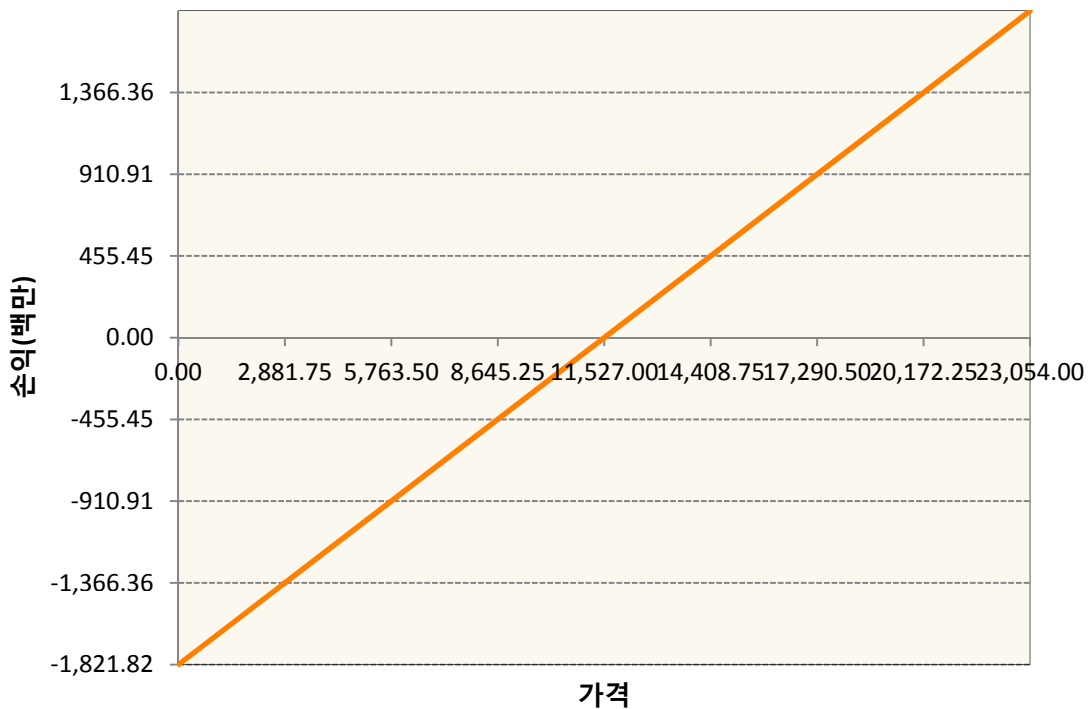
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,822	0	1,822	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCH9-HSCEI Futures Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH9	HSCEI Futures Mar19	146
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

150

공시일	2019-03-18
기준일	2019-03-15

커버드콜모(주식혼합-파생형)

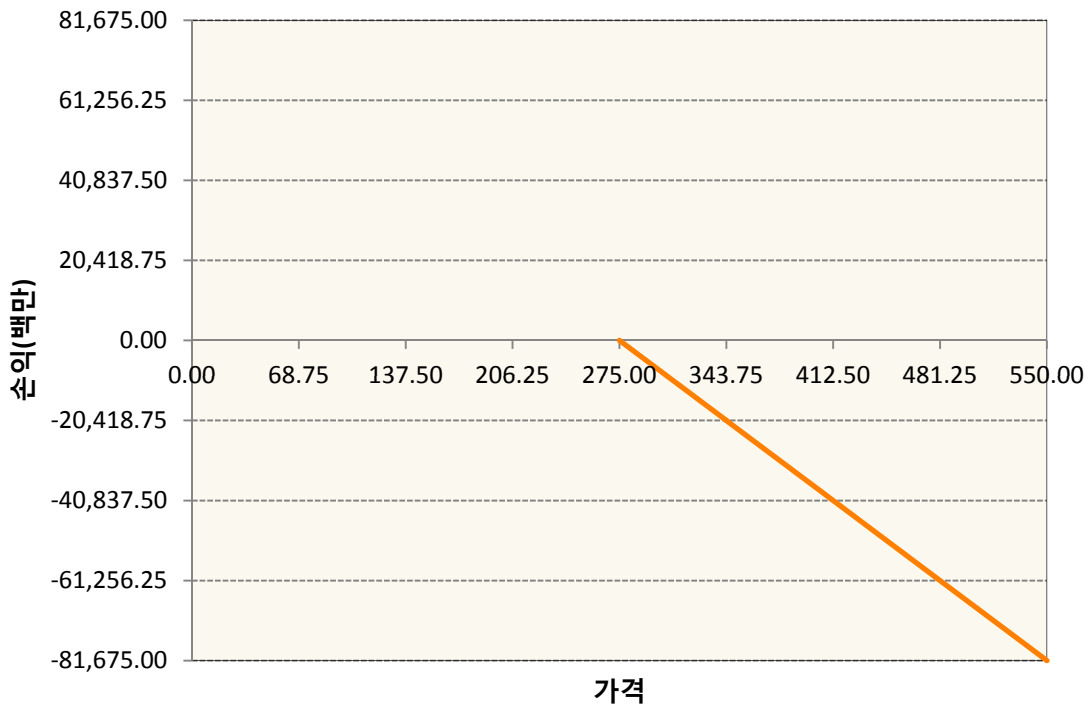
1. 계약금액

(단위:백만원)

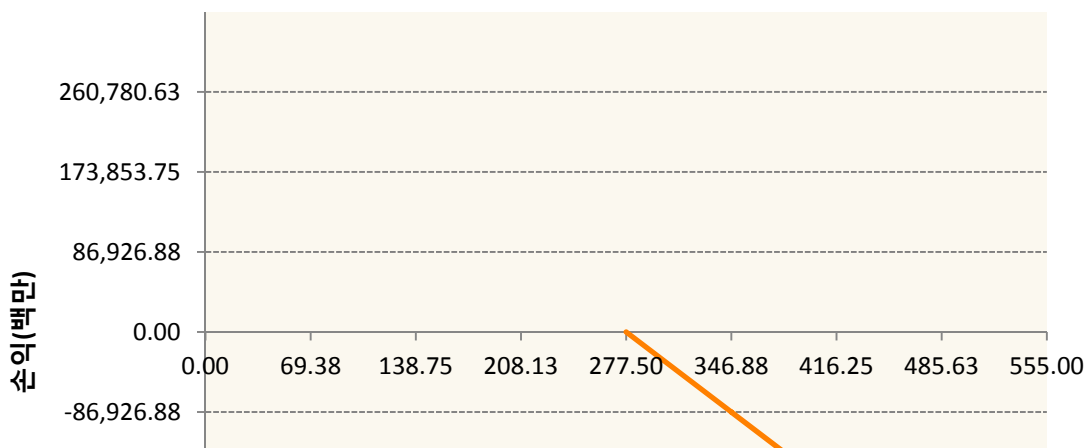
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	508,563	-508,563	장내
누계	유가증권	옵션	0	674,320	-674,320	장내

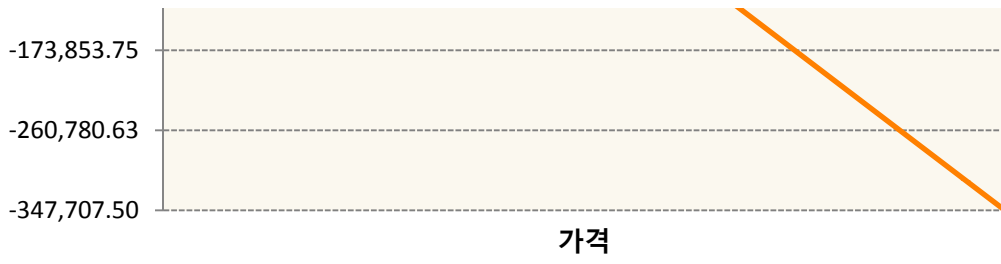
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P42752-2019-04 콜275

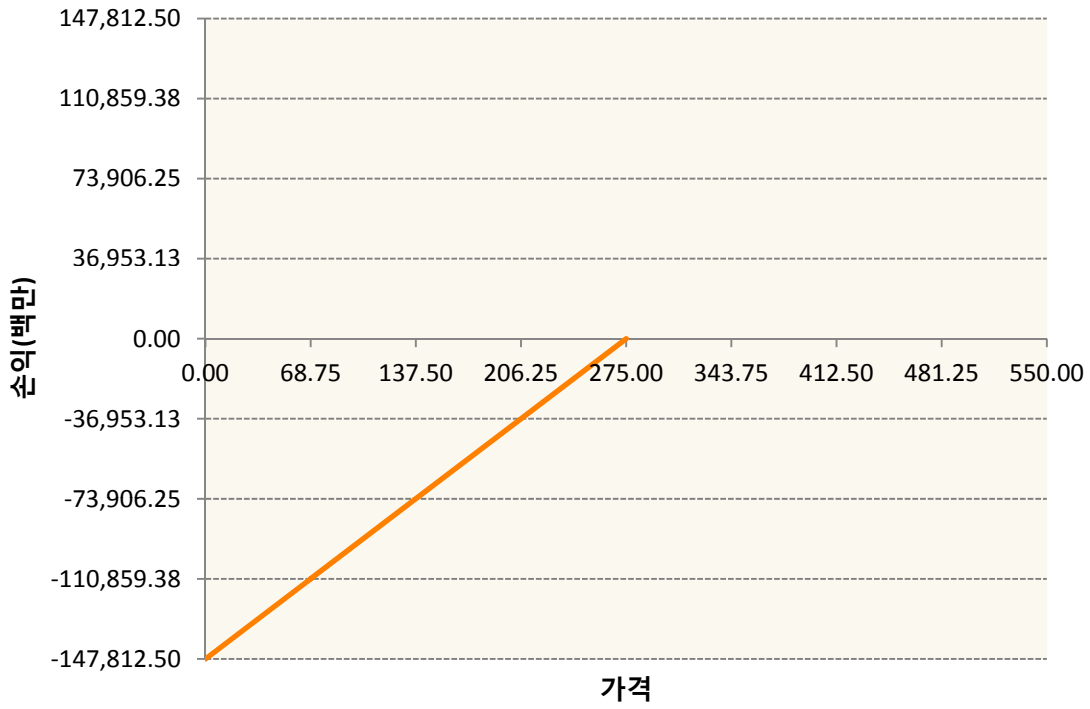


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

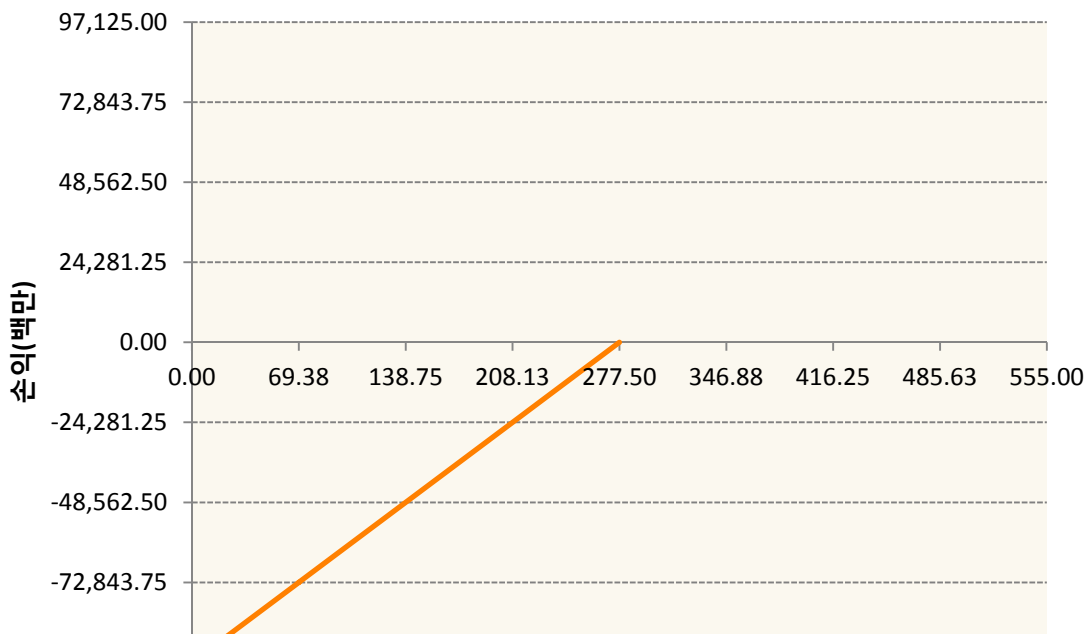




KR4301P42750-2019-04 풋275



KR4301P42776-2019-04 풋277.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P42752 2019-04 콜275							5,508
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,886	2,793	2,688	2,572	2,448	2,316	2,178
-5.33%	2,500	2,350	2,193	2,031	1,865	1,696	1,525
-2.67%	1,750	1,561	1,372	1,183	993	803	613
0%	560	375	188	0	-189	-379	-569
2.67%	-1,039	-1,184	-1,338	-1,499	-1,664	-1,834	-2,007
5.33%	-2,938	-3,032	-3,139	-3,258	-3,387	-3,524	-3,667
8.00%	-5,016	-5,065	-5,129	-5,207	-5,297	-5,397	-5,508
KR4201P42778 2019-04 콜277.5							22,373
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,711	10,390	10,012	9,584	9,115	8,610	8,073
-5.33%	9,455	8,889	8,286	7,654	6,999	6,325	5,635
-2.67%	6,840	6,073	5,299	4,518	3,733	2,944	2,153
0%	2,447	1,632	817	0	-818	-1,636	-2,454
2.67%	-3,747	-4,438	-5,153	-5,886	-6,634	-7,394	-8,162
5.33%	-11,378	-11,854	-12,383	-12,955	-13,562	-14,198	-14,859
8.00%	-19,926	-20,198	-20,533	-20,924	-21,365	-21,850	-22,373
KR4301P42750 2019-04 풋275							8,549
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,346	-8,359	-8,379	-8,408	-8,446	-8,493	-8,549
-5.33%	-4,485	-4,560	-4,648	-4,746	-4,854	-4,969	-5,091
-2.67%	-1,308	-1,476	-1,646	-1,817	-1,990	-2,163	-2,337
0%	469	317	160	0	-163	-329	-497
2.67%	1,030	970	898	813	718	613	500
5.33%	1,121	1,110	1,092	1,066	1,030	985	931
8.00%	1,129	1,128	1,125	1,120	1,111	1,097	1,078
KR4301P42776 2019-04 풋277.5							6,065
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,979	-5,983	-5,990	-6,001	-6,017	-6,038	-6,065
-5.33%	-3,416	-3,447	-3,486	-3,533	-3,587	-3,648	-3,713
-2.67%	-1,142	-1,236	-1,334	-1,435	-1,538	-1,643	-1,749
0%	343	230	115	0	-116	-232	-348
2.67%	925	866	799	725	646	561	473

5.33%	1,047	1,033	1,012	984	949	907	859
8.00%	1,060	1,058	1,055	1,048	1,038	1,023	1,004

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

(단위:백만원)

42,096

공시일	2019-03-18
기준일	2019-03-15

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

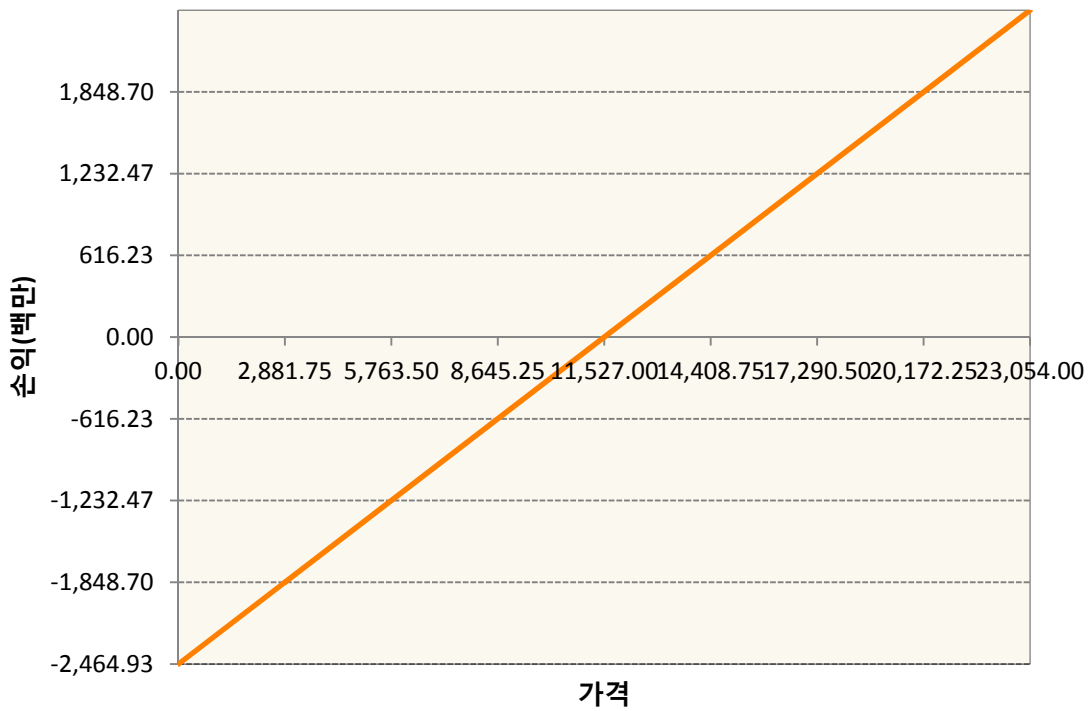
1. 계약금액

(단위:백만원)

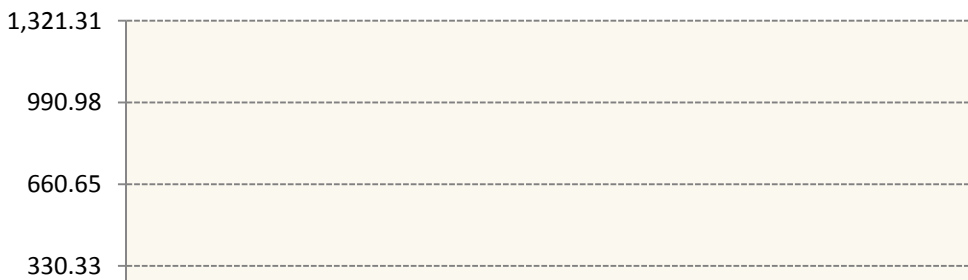
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,465	0	2,465	장내
누계	유가증권	옵션	0	6,308	-6,308	장내
누계	통화	선도	0	3,043	-3,043	장외

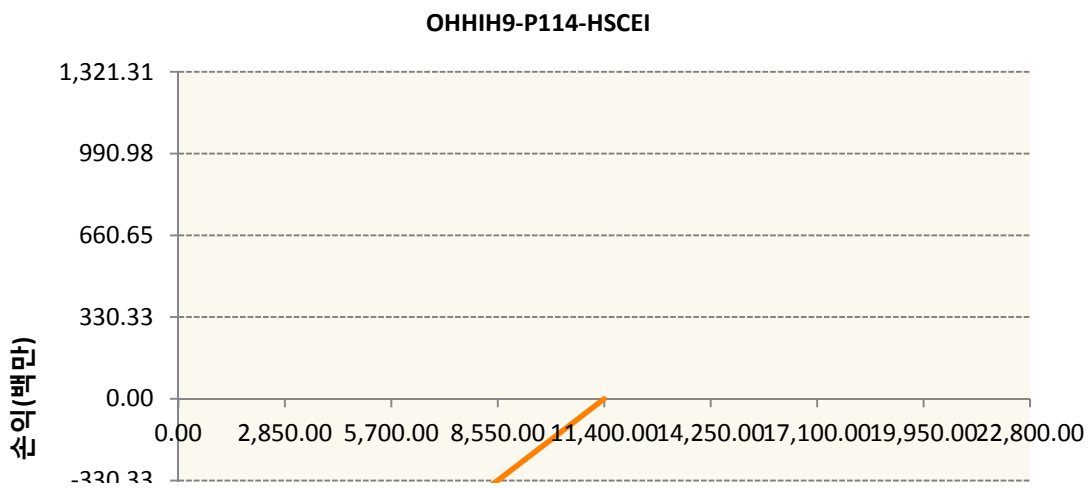
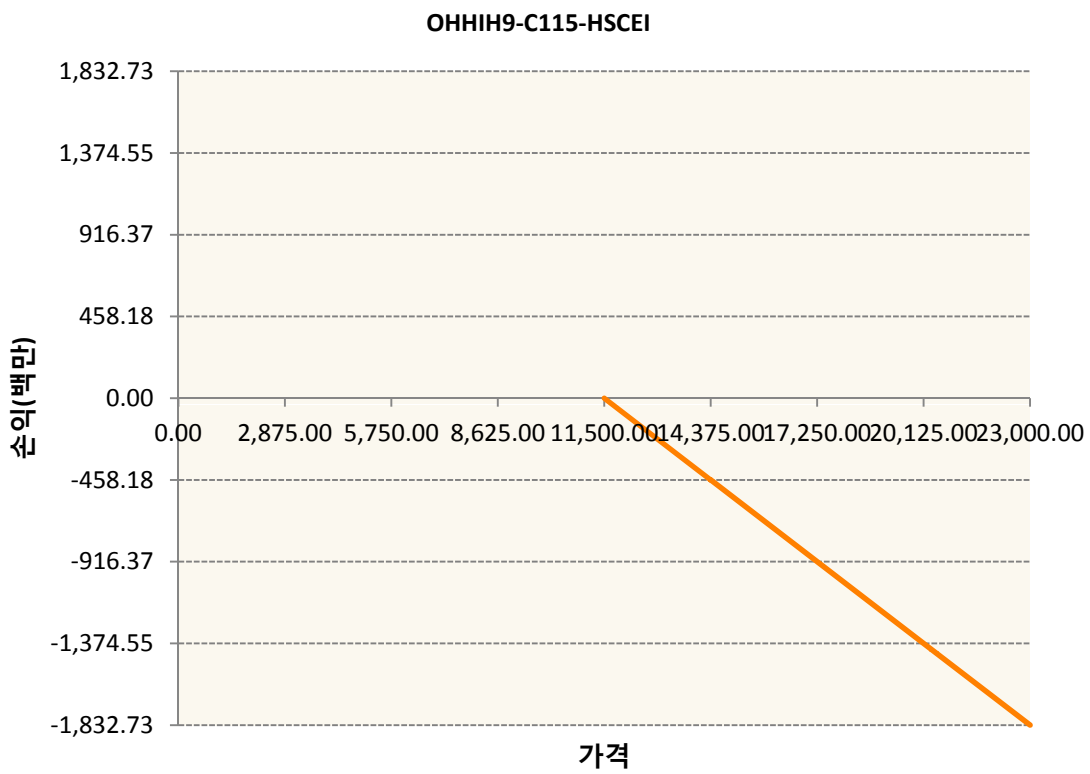
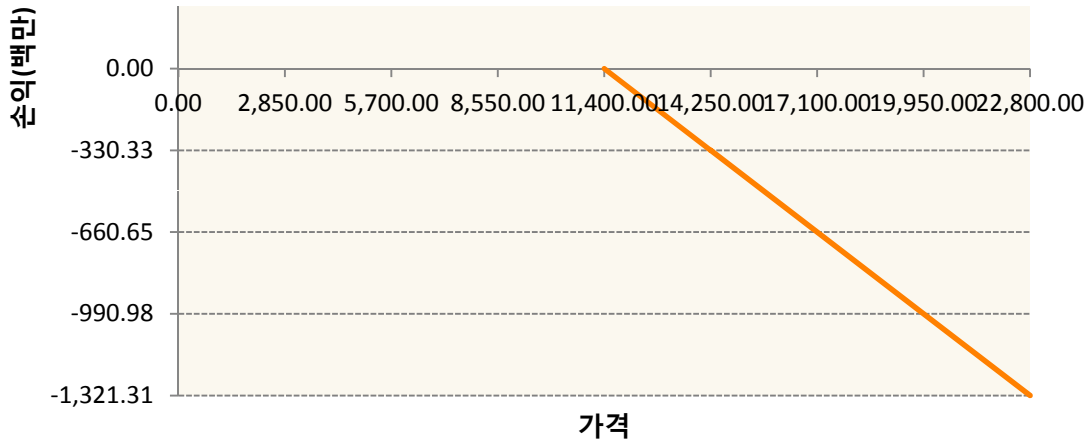
2. 만기시점의 손익구조

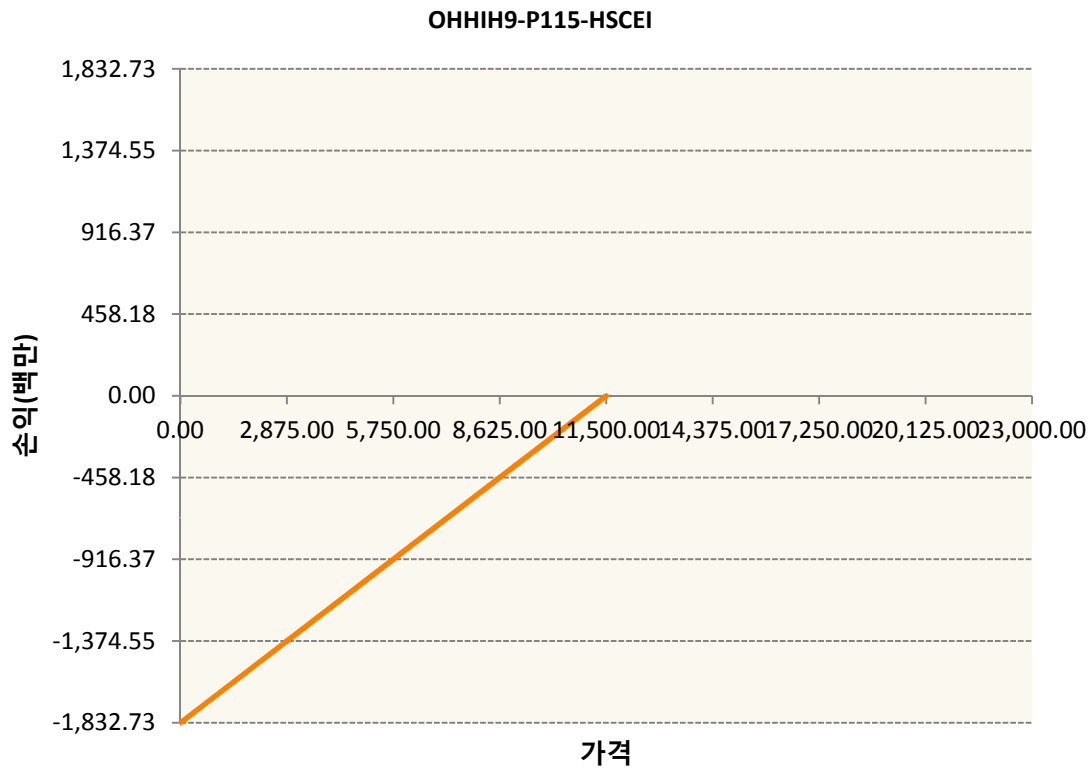
HCH9-HSCEI Futures Mar19



OHHIH9-C114-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	220
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	23
HCH9 HSCEI Futures Mar19	197
OHHIH9-C11 HSCEI	106
OHHIH9-C11 HSCEI	147
OHHIH9-P11 HSCEI	106
OHHIH9-P11 HSCEI	147

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

808

공시일	2019-03-18
기준일	2019-03-15

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

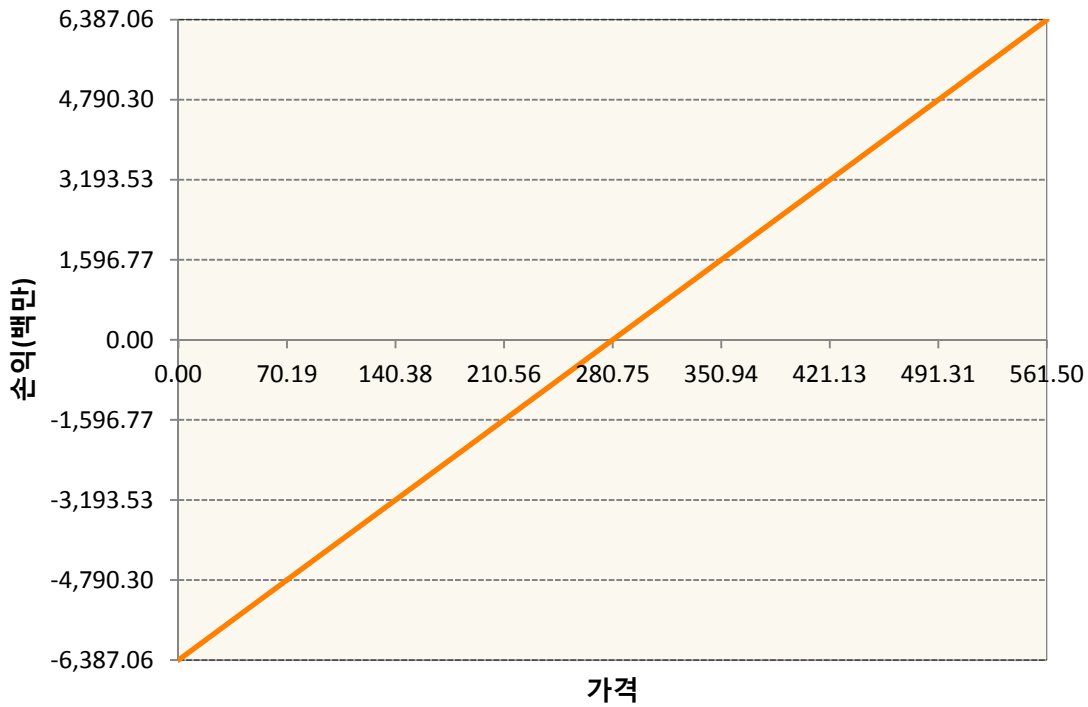
1. 계약금액

(단위:백만원)

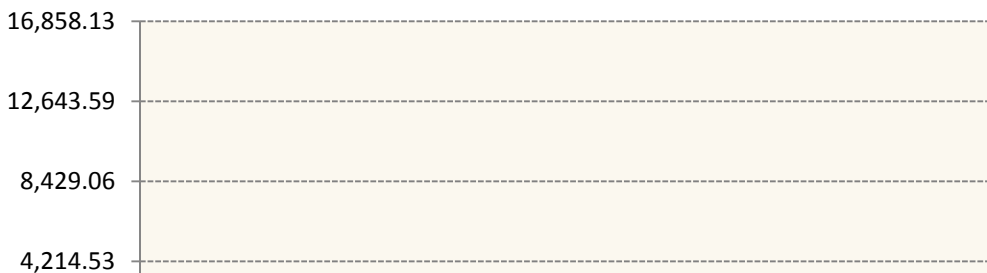
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	35,122	-35,122	장내
누계	유가증권	선물	6,387	0	6,387	장내
누계	유가증권	스왑	35,836	0	35,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,649	-34,649	장내

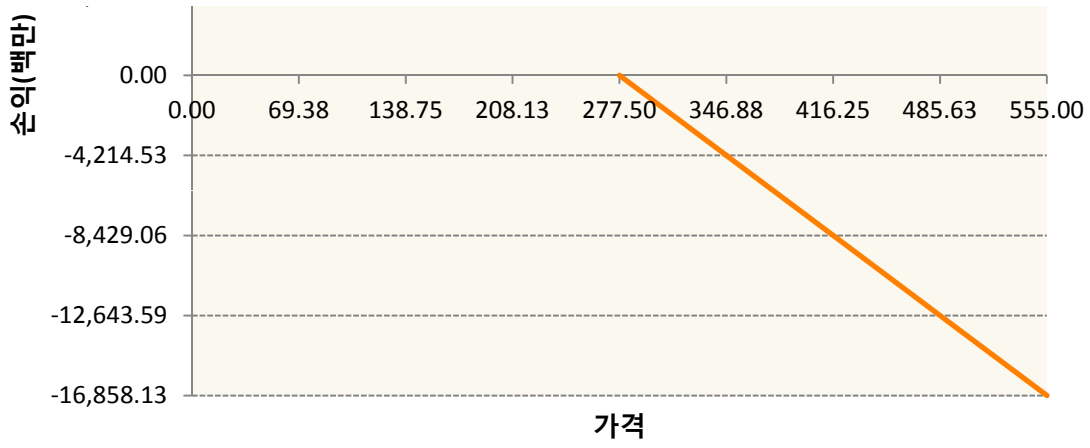
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

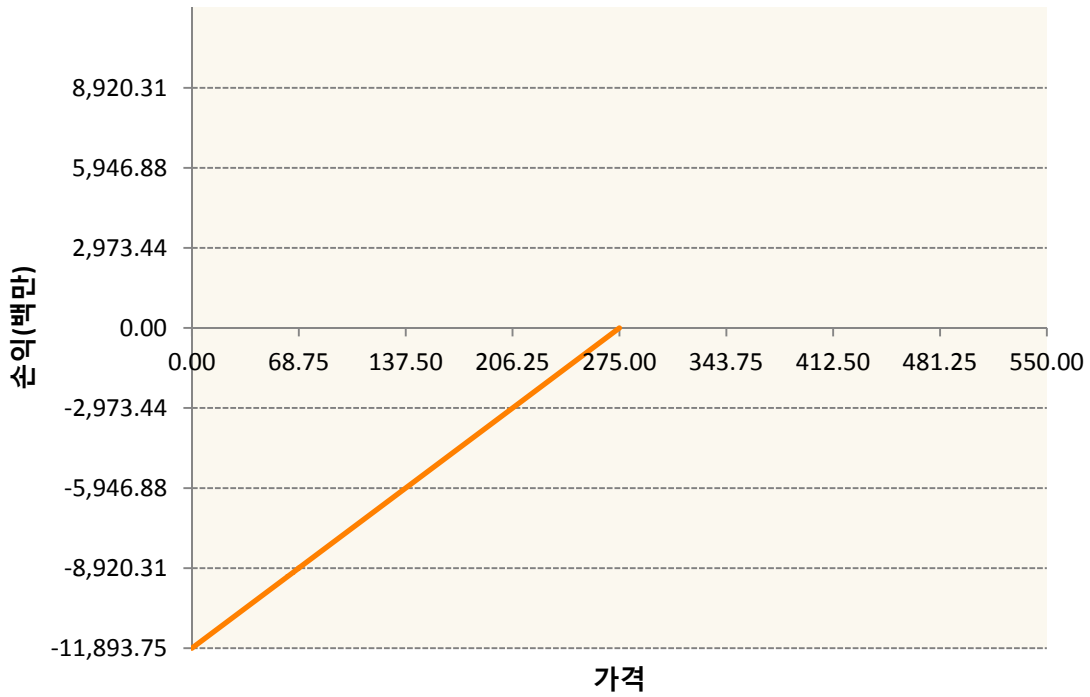


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

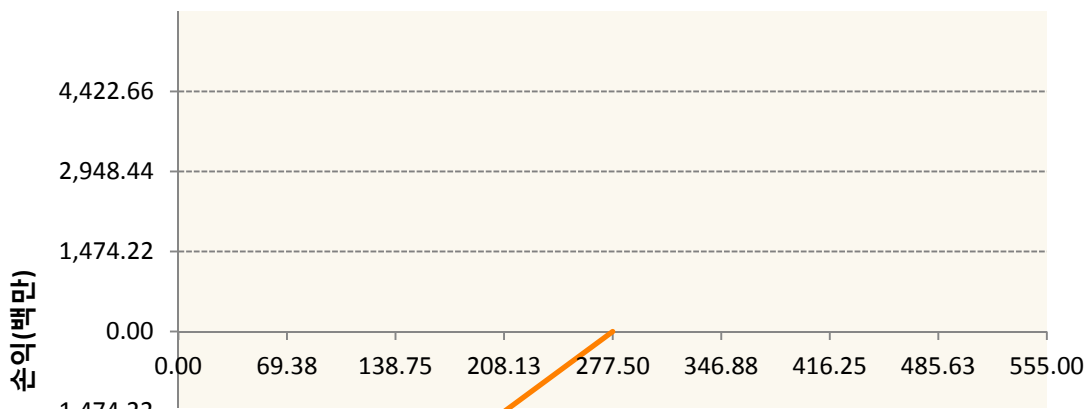


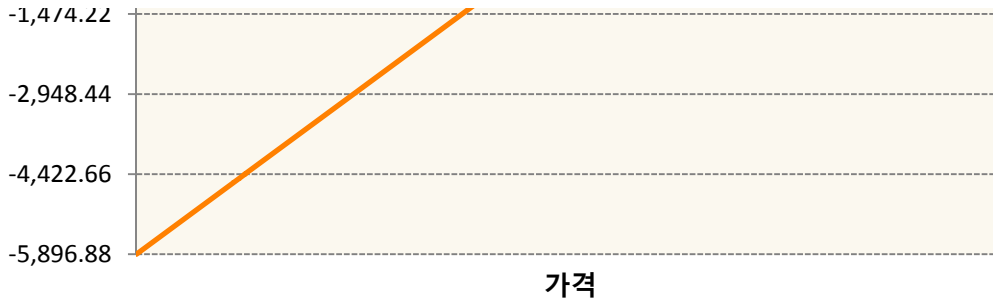


KR4301P42750-2019-04 풋275



KR4301P42776-2019-04 풋277.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,434
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,434	-2,434	-2,434	-2,434	-2,434	-2,434	-2,434	
-5.33%	-1,623	-1,623	-1,623	-1,623	-1,623	-1,623	-1,623	
-2.67%	-811	-811	-811	-811	-811	-811	-811	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	811	811	811	811	811	811	811	
5.33%	1,623	1,623	1,623	1,623	1,623	1,623	1,623	
8.00%	2,434	2,434	2,434	2,434	2,434	2,434	2,434	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						591
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-591	-591	-591	-591	-591	-591	-591	
-5.33%	-394	-394	-394	-394	-394	-394	-394	
-2.67%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	197	197	197	197	197	197	197	
5.33%	394	394	394	394	394	394	394	
8.00%	591	591	591	591	591	591	591	
KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						509
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-509	-509	-509	-509	-509	-509	-509	
-5.33%	-340	-340	-340	-340	-340	-340	-340	
-2.67%	-170	-170	-170	-170	-170	-170	-170	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	170	170	170	170	170	170	170	
5.33%	340	340	340	340	340	340	340	
8.00%	509	509	509	509	509	509	509	
KR4201P42778		2019-04 콜277.5						1,085
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	519	504	485	465	442	417	391
-5.33%	458	431	402	371	339	307	273
-2.67%	332	294	257	219	181	143	104
0%	119	79	40	0	-40	-79	-119
2.67%	-182	-215	-250	-285	-322	-358	-396
5.33%	-552	-575	-600	-628	-658	-688	-720
8.00%	-966	-979	-996	-1,014	-1,036	-1,059	-1,085
KR4301P42750 2019-04 풋275							688
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-672	-673	-674	-677	-680	-683	-688
-5.33%	-361	-367	-374	-382	-391	-400	-410
-2.67%	-105	-119	-132	-146	-160	-174	-188
0%	38	25	13	0	-13	-26	-40
2.67%	83	78	72	65	58	49	40
5.33%	90	89	88	86	83	79	75
8.00%	91	91	91	90	89	88	87
KR4301P42776 2019-04 풋277.5							368
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-363	-363	-364	-364	-365	-367	-368
-5.33%	-207	-209	-212	-215	-218	-221	-225
-2.67%	-69	-75	-81	-87	-93	-100	-106
0%	21	14	7	0	-7	-14	-21
2.67%	56	53	49	44	39	34	29
5.33%	64	63	61	60	58	55	52
8.00%	64	64	64	64	63	62	61

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

(단위:백만원)

5,583

공시일	2019-03-18
기준일	2019-03-15

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

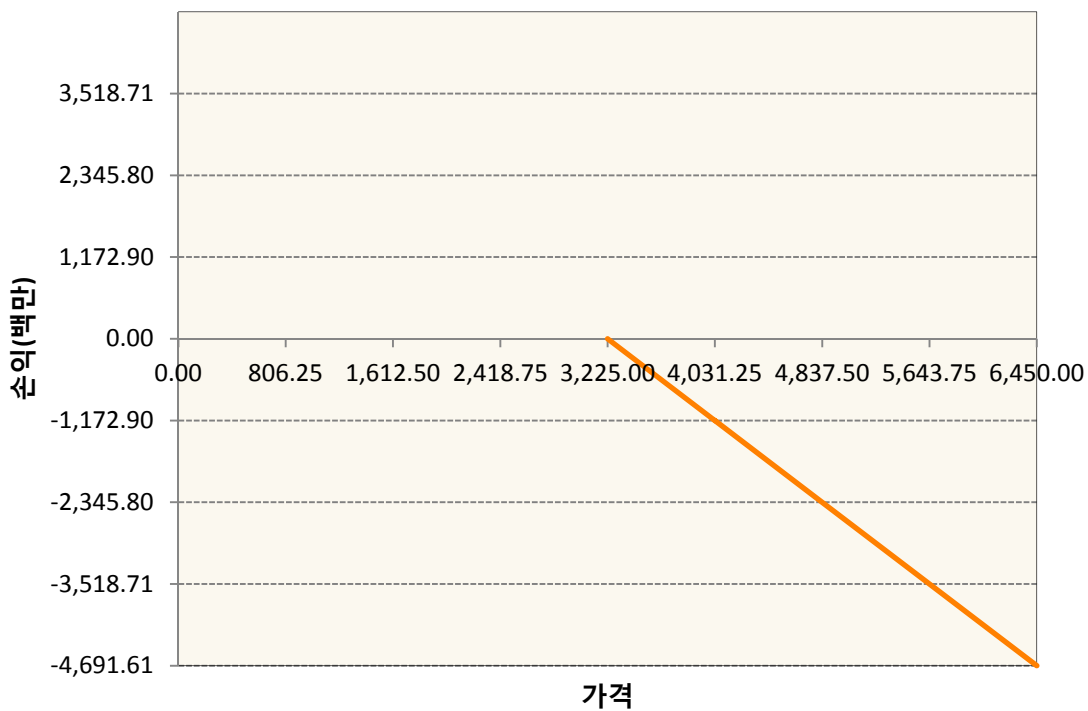
1. 계약금액

(단위:백만원)

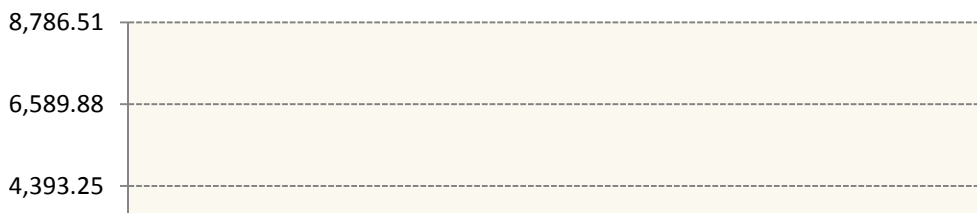
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,247	0	7,247	
누계	유가증권	스왑	60,780	0	60,780	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,956	-26,956	장내
누계	통화	선도	0	15,449	-15,449	장외

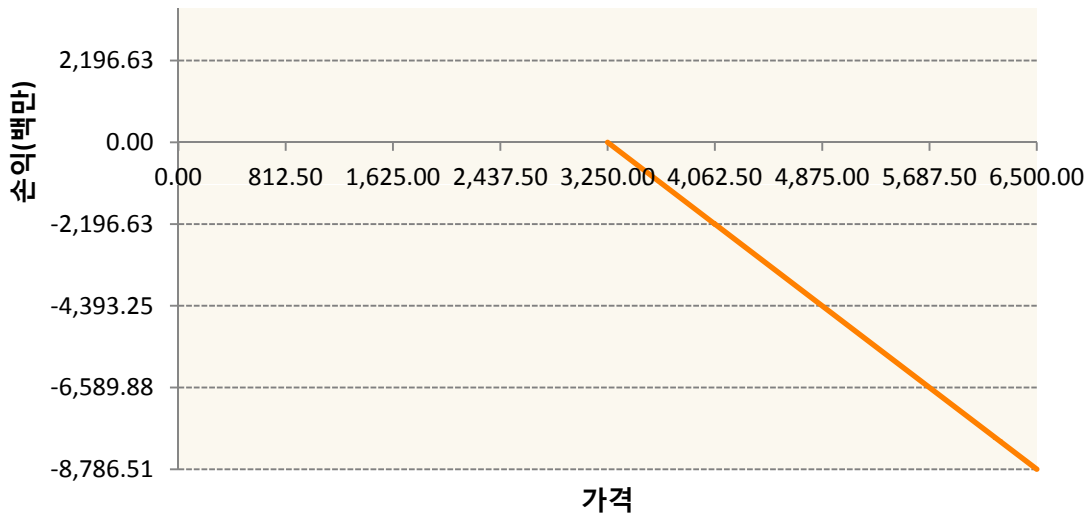
2. 만기시점의 손익구조

OESXH9-C3225-EURO STOXX 50

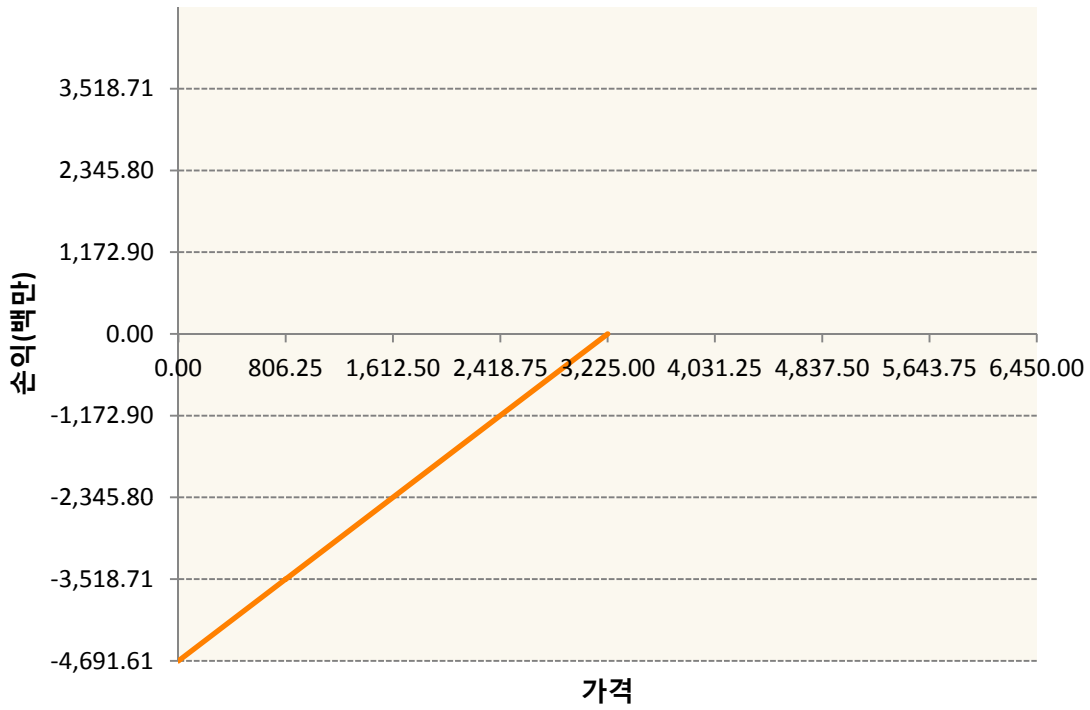


OESXH9-C3250-EURO STOXX 50

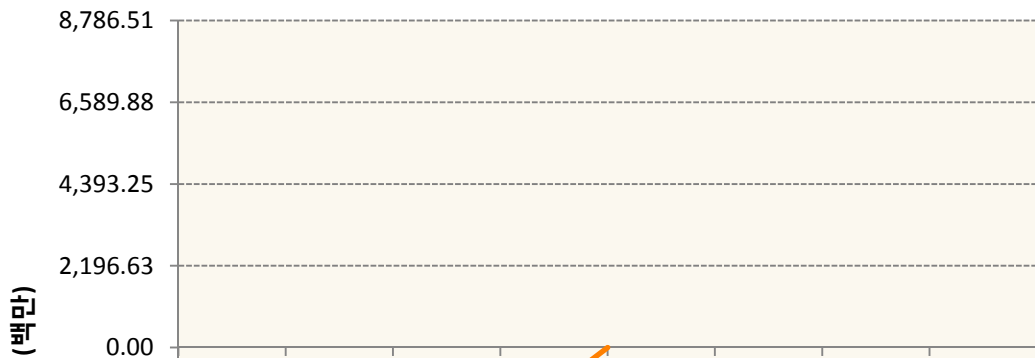


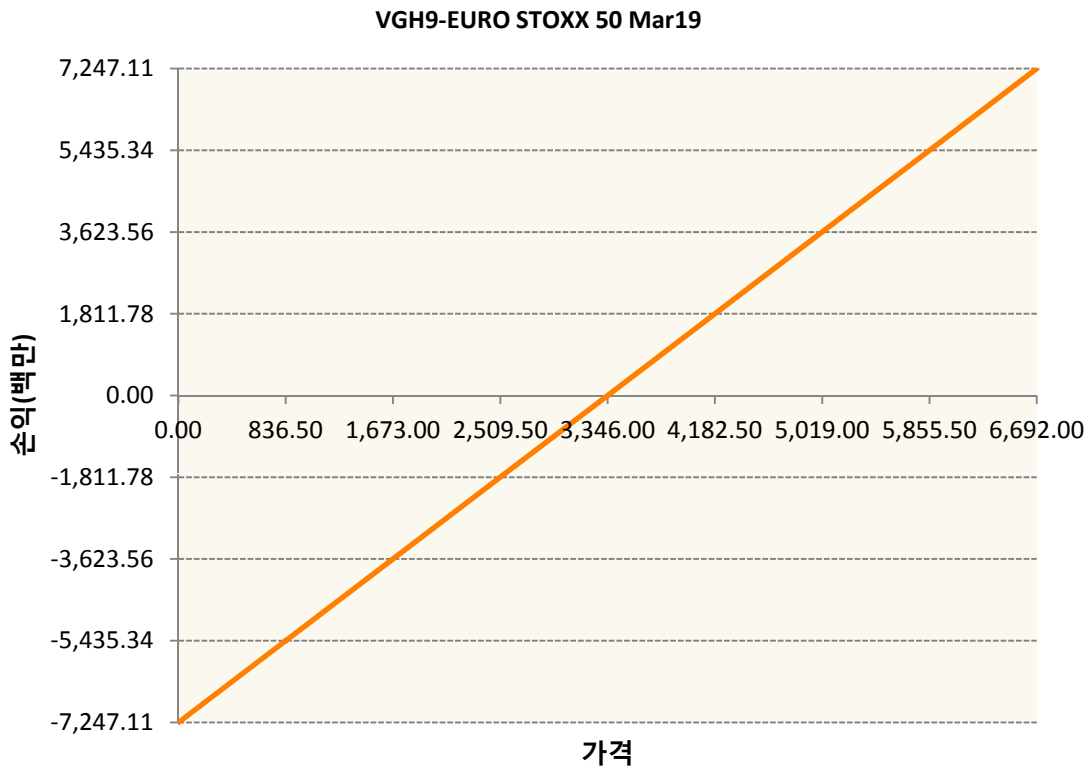
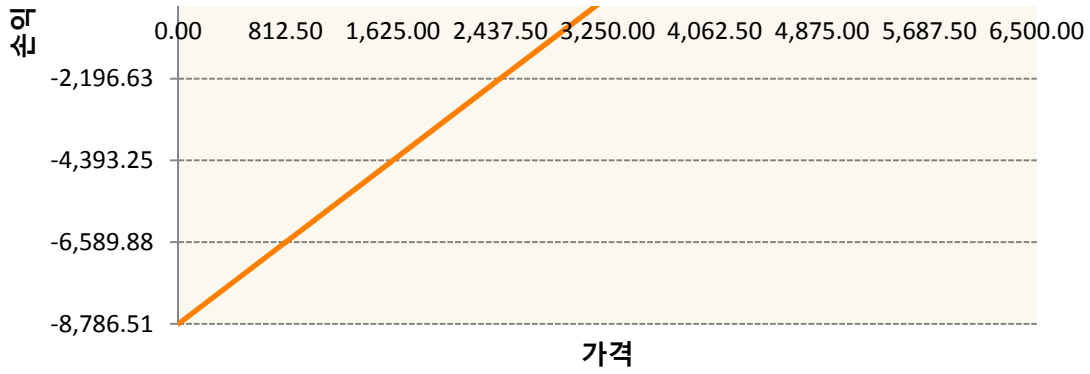


OESXH9-P3225-EURO STOXX 50



OESXH9-P3250-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	136
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E	824
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	412
OESXH9-C32 EURO STOXX 50	375
OESXH9-C32 EURO STOXX 50	703
OESXH9-P32 EURO STOXX 50	375
OESXH9-P32 EURO STOXX 50	703
VGH9 EURO STOXX 50 Mar19	580

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

(단위:백만원)

2,708

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

(단위:백만원)

1,107

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

(단위:백만원)

95

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

(단위:백만원)

137

공시일	2019-03-18
기준일	2019-03-15

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

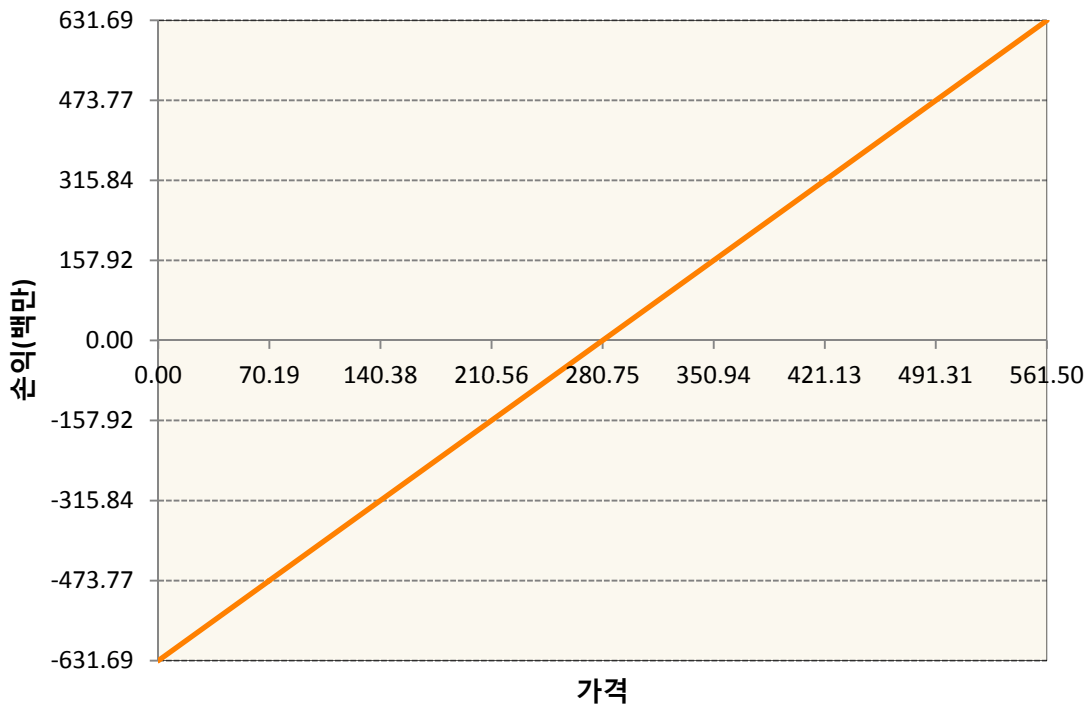
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	632	0	632	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						50
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	
-5.33%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34	
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	17	17	17	17	17	17	17	
5.33%	34	34	34	34	34	34	34	
8.00%	50	50	50	50	50	50	50	

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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-03-18
기준일	2019-03-15

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

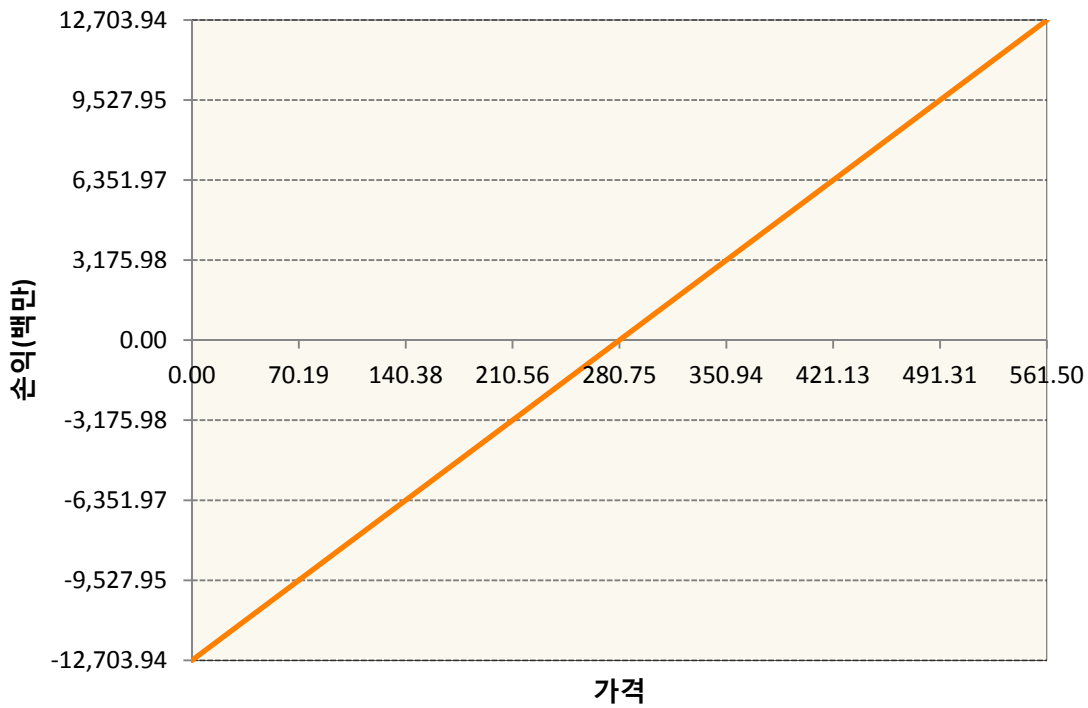
1. 계약금액

(단위:백만원)

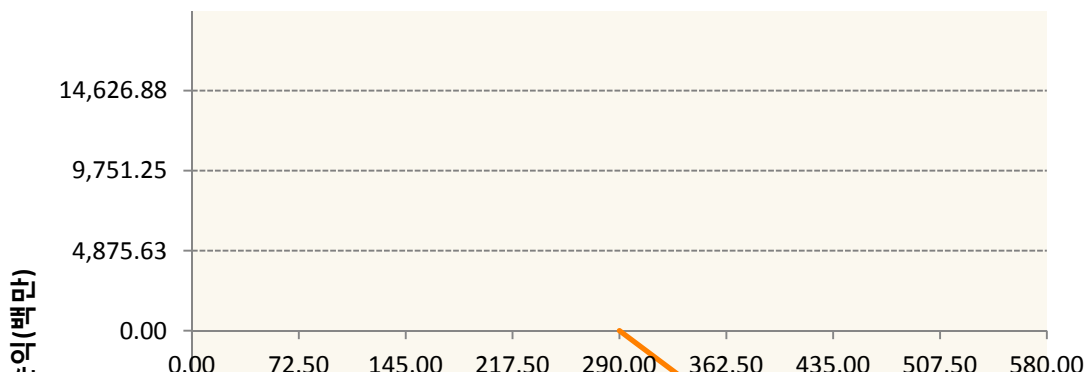
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	1,166	13,693	-12,528	장내
누계	유가증권	선물	12,704	0	12,704	장내
누계	유가증권	옵션	1,867	24,036	-22,169	장내

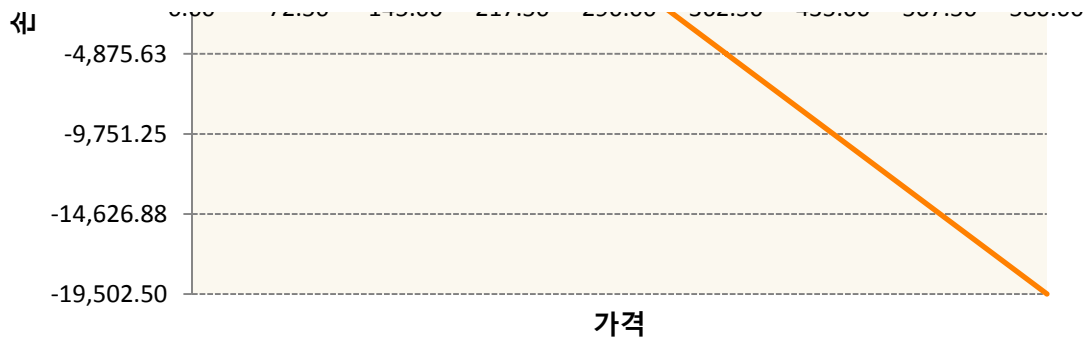
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

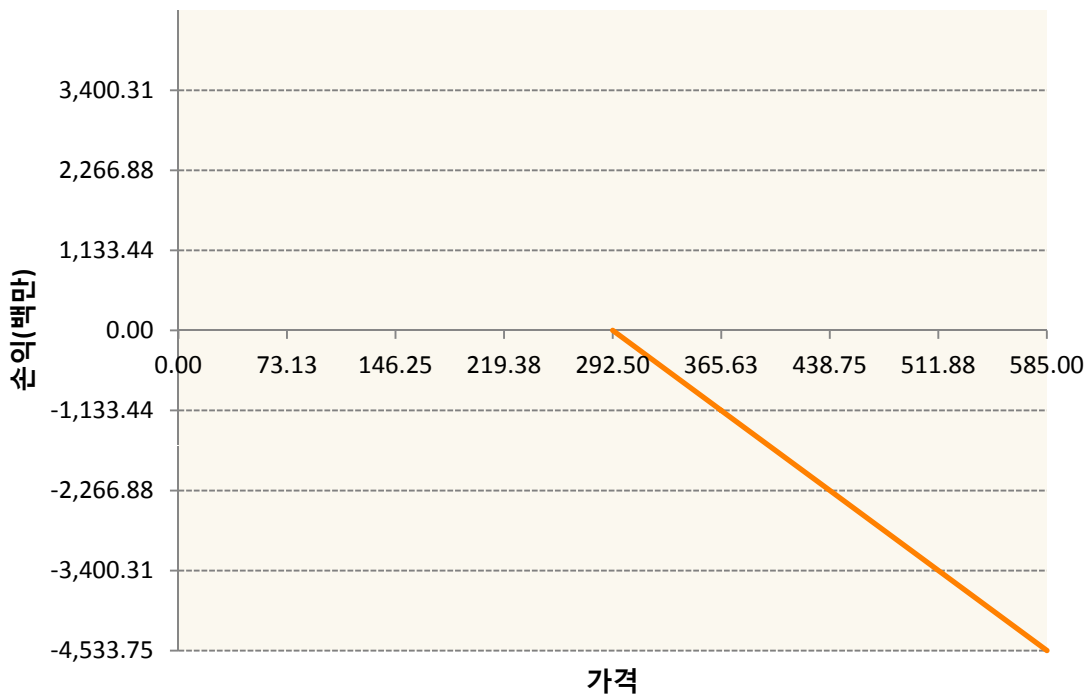


KR4201P42901-2019-04 콜290

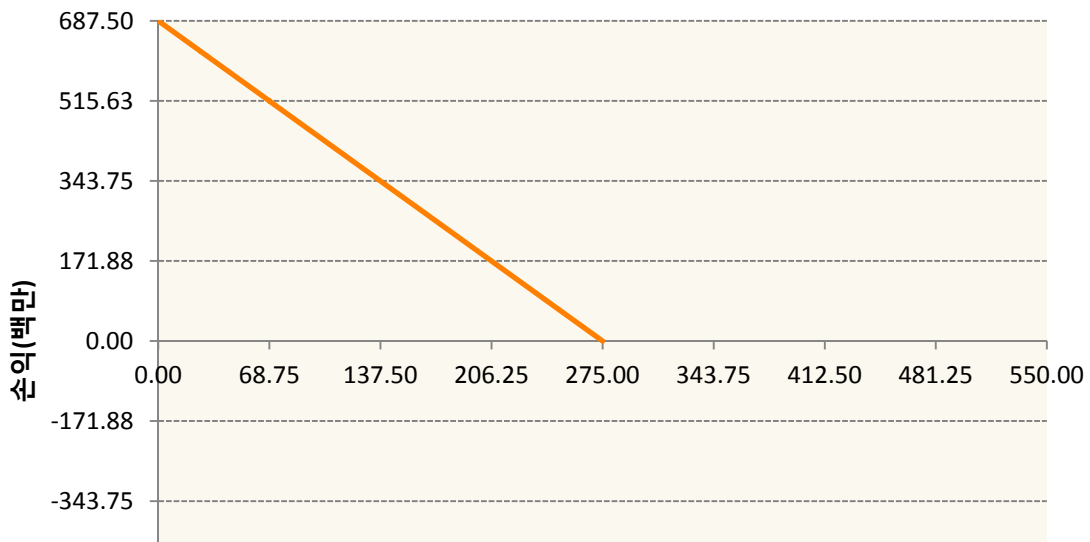


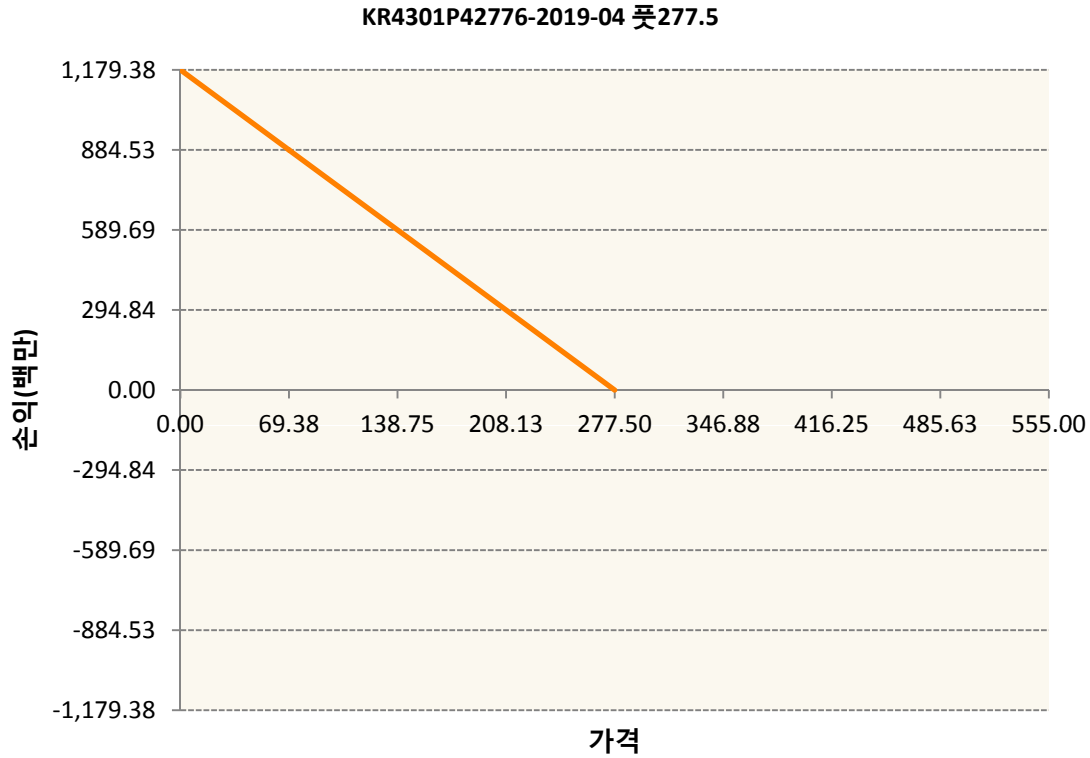
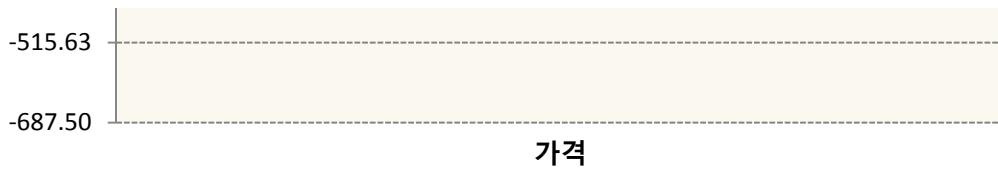


KR4201P42927-2019-04 콜292.5



KR4301P42750-2019-04 풋275





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						1,013
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,013	-1,013	-1,013	-1,013	-1,013	-1,013	-1,013	
-5.33%	-675	-675	-675	-675	-675	-675	-675	
-2.67%	-338	-338	-338	-338	-338	-338	-338	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	338	338	338	338	338	338	338	
5.33%	675	675	675	675	675	675	675	
8.00%	1,013	1,013	1,013	1,013	1,013	1,013	1,013	
KR4201P42901		2019-04 콜290						919
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	261	257	250	241	229	215	198	
-5.33%	248	236	221	203	182	159	134	
-2.67%	207	184	157	128	97	65	31	

0%	114	77	39	0	-40	-81	-122
2.67%	-59	-104	-149	-195	-240	-285	-331
5.33%	-327	-371	-416	-461	-506	-552	-597
8.00%	-683	-719	-757	-796	-836	-877	-919
KR4201P42927 2019-04 콜292.5							197
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	50	49	48	46	44	41	38
-5.33%	48	46	43	39	35	31	25
-2.67%	41	36	31	25	19	12	5
0%	24	16	8	0	-9	-18	-27
2.67%	-9	-19	-29	-40	-50	-60	-71
5.33%	-64	-74	-85	-96	-106	-117	-128
8.00%	-139	-148	-158	-168	-177	-187	-197
KR4301P42750 2019-04 풋275							40
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	39	39	39	39	39	40	40
-5.33%	21	21	22	22	23	23	24
-2.67%	6	7	8	8	9	10	11
0%	-2	-1	-1	0	1	2	2
2.67%	-5	-5	-4	-4	-3	-3	-2
5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-4
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
KR4301P42776 2019-04 풋277.5							74
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	73	73	73	73	73	73	74
-5.33%	41	42	42	43	44	44	45
-2.67%	14	15	16	17	19	20	21
0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-11	-11	-10	-9	-8	-7	-6
5.33%	-13	-13	-12	-12	-12	-11	-10
8.00%	-13	-13	-13	-13	-13	-12	-12

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

(단위:백만원)

1,862

공시일	2019-03-18
기준일	2019-03-15

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	1,908	0	1,908	

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	2019-03-18
기준일	2019-03-15

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	7,645	0	7,645	

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	2019-03-18
기준일	2019-03-15

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	682	0	682	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	45,819	0	45,819	
누계	통화	선도	0	52,526	-52,526	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019F02: KRW/USD 28-03-19E	473
FX21019F02: KRW/USD 29-03-19E	25
FX21019F02: KRW/USD 29-03-19E	73
FX21019G00 KRW/USD 29-03-19E	27
FX21019G00 KRW/USD 29-03-19E	14
FX21019G00 KRW/USD 19-03-19E	50
FX21019G00 KRW/USD 19-03-19E	27
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E	55
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E	106
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E	107
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E	44
FX21019G01 KRW/USD 21-03-19E	428
FX21019G01 KRW/USD 21-03-19E	273
FX21019G02 KRW/USD 25-03-19E	137
FX21019G02 KRW/USD 25-03-19E	482
FX21019G03 KRW/USD 28-03-19E	255
FX21019G03 KRW/USD 28-03-19E	118
FX21019G03 KRW/USD 29-03-19E	337
FX21019G04 KRW/USD 10-04-19E	73
FX21019H00 KRW/USD 08-04-19E	36
FX21019H00 KRW/USD 10-04-19E	36
FX21019H01 KRW/USD 10-04-19E	100
FX21019H01 KRW/USD 10-04-19E	91
FX21019H01 KRW/USD 10-04-19E	109
FX21019H01 KRW/USD 19-04-19E	146
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	118
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	207

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

(단위:백만원)

1,469

공시일	2019-03-18
기준일	2019-03-15

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

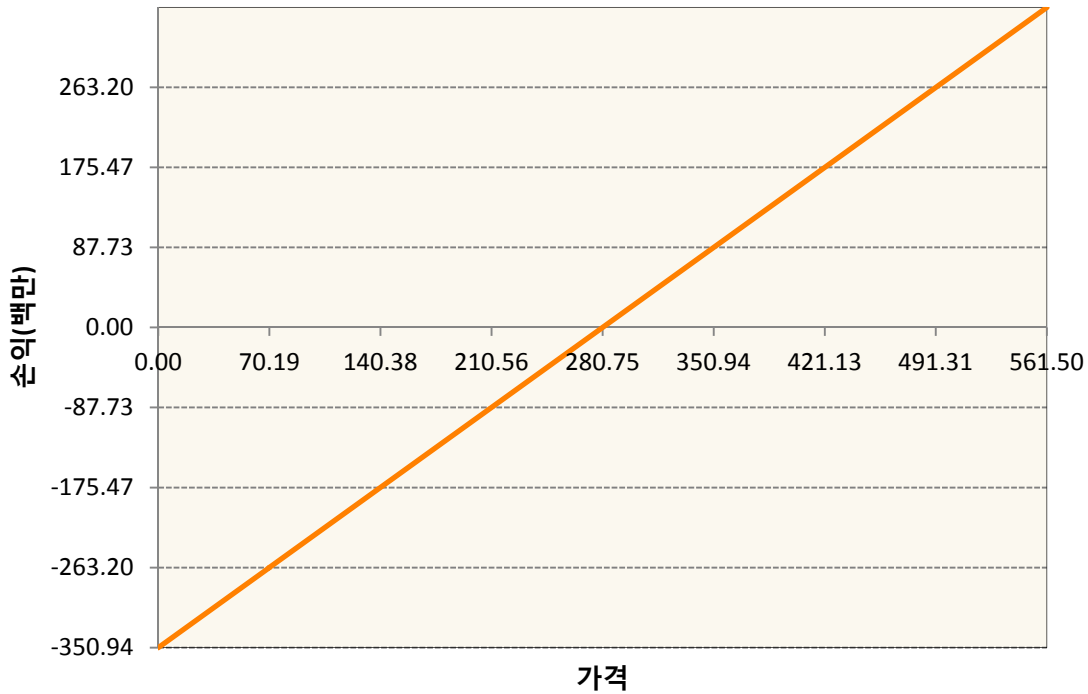
1. 계약금액

(단위:백만원)

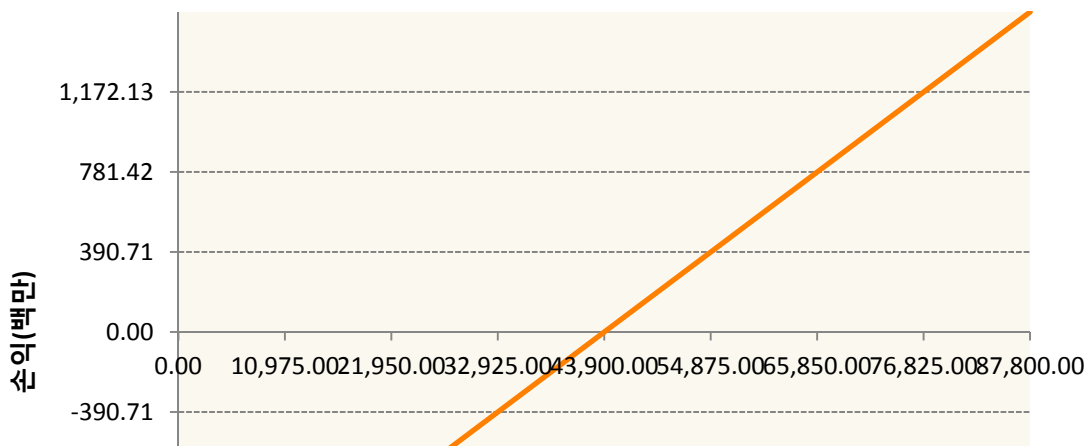
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,914	0	1,914	장내

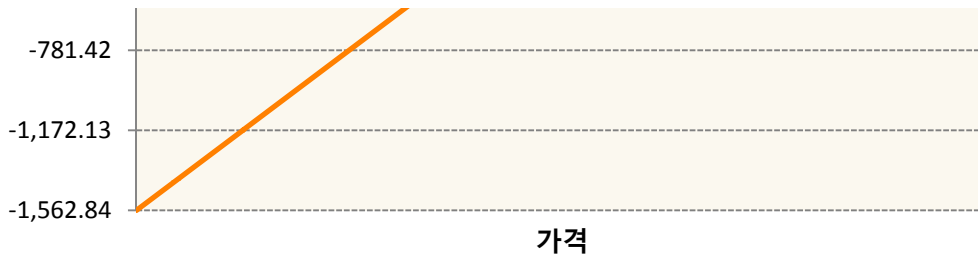
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4111P40005-2019-04 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						28
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28	
-5.33%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
-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%	19	19	19	19	19	19	19	
8.00%	28	28	28	28	28	28	28	

KR4111P40005		2019-04 삼성전자개별선물						126
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126	
-5.33%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84	
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	42	42	42	42	42	42	42	
5.33%	84	84	84	84	84	84	84	
8.00%	126	126	126	126	126	126	126	

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

169

공시일	2019-03-18
기준일	2019-03-15

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

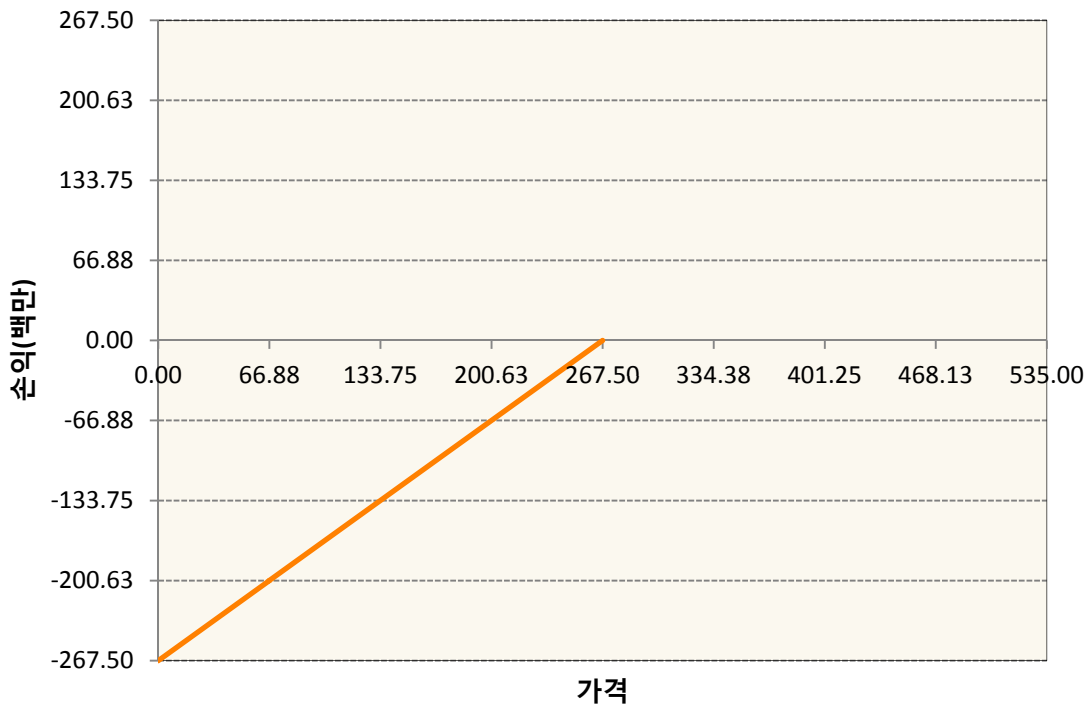
1. 계약금액

(단위:백만원)

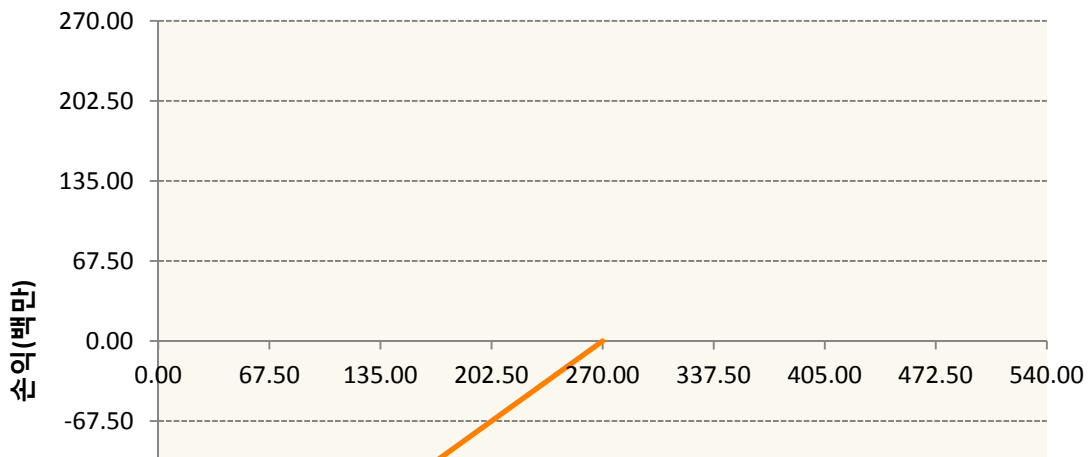
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	270	-270	장내
누계	유가증권	옵션	0	538	-538	장내

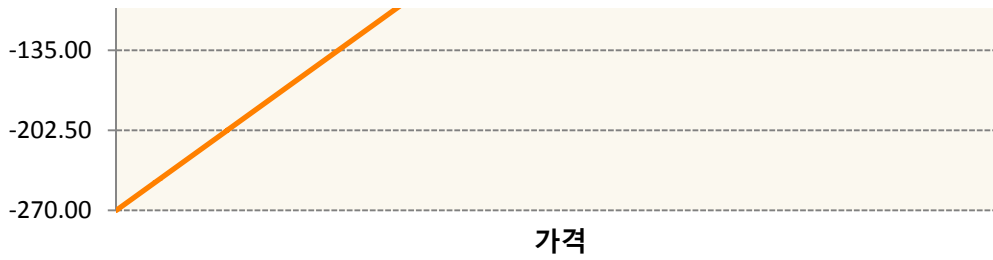
2. 만기시점의 손익구조

KR4301P42677-2019-04 풋267.5



KR4301P42701-2019-04 풋270





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301P42677 2019-04 풋267.5 11

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-11	-11
-5.33%	-4	-4	-5	-5	-5	-5	-6
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-2	-2	-2
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	1	1	0	0	0	0	0
5.33%	1	1	1	1	1	0	0
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

KR4301P42701 2019-04 풋270 13

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-13
-5.33%	-5	-6	-6	-6	-6	-7	-7
-2.67%	-1	-1	-2	-2	-2	-3	-3
0%	1	0	0	0	0	0	-1
2.67%	1	1	1	1	1	0	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

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

18

공시일	2019-03-18
기준일	2019-03-15

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

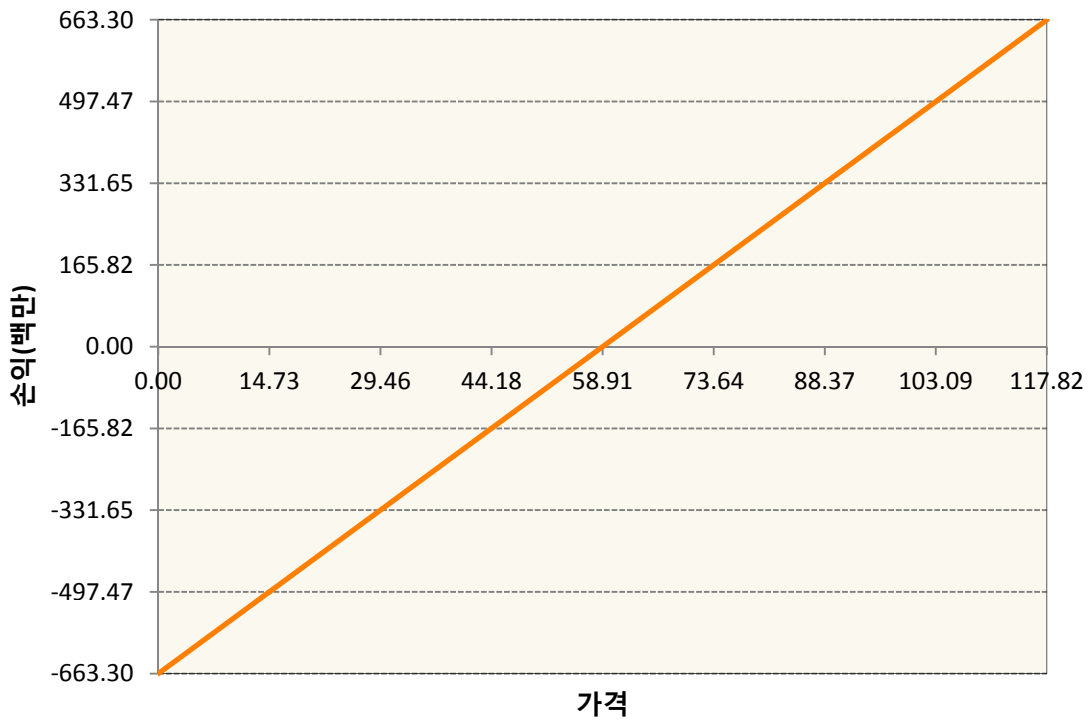
1. 계약금액

(단위:백만원)

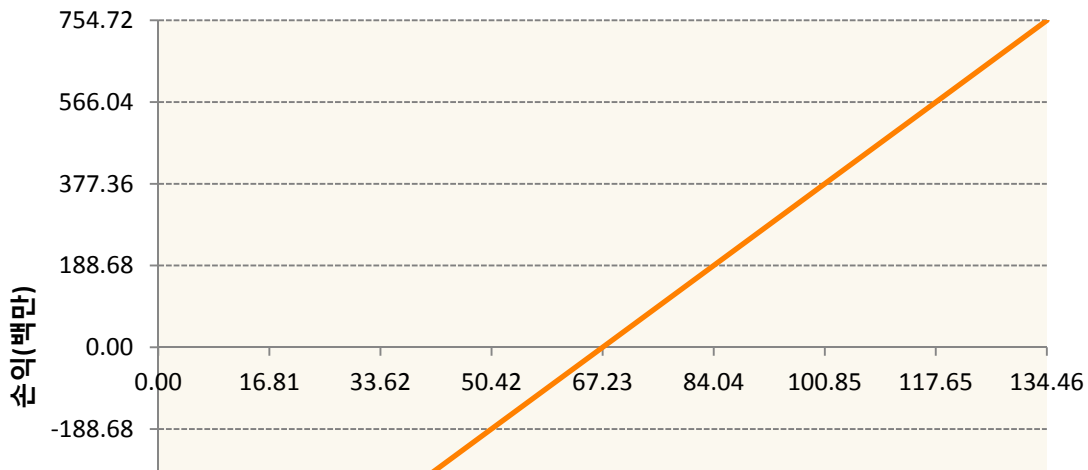
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,883	284	2,599	

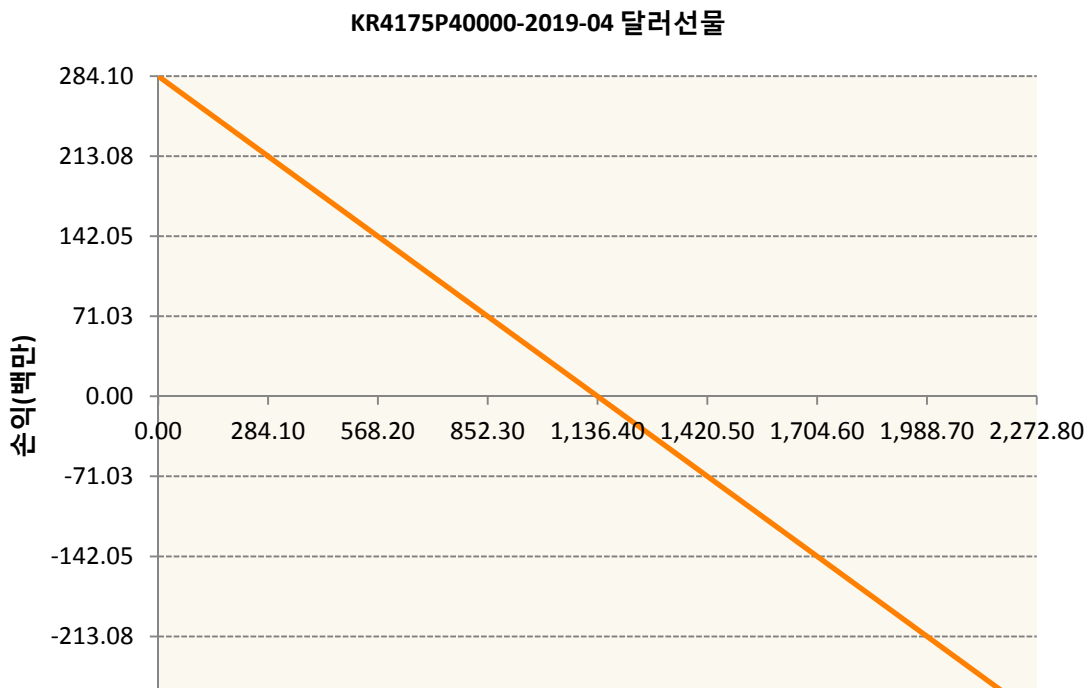
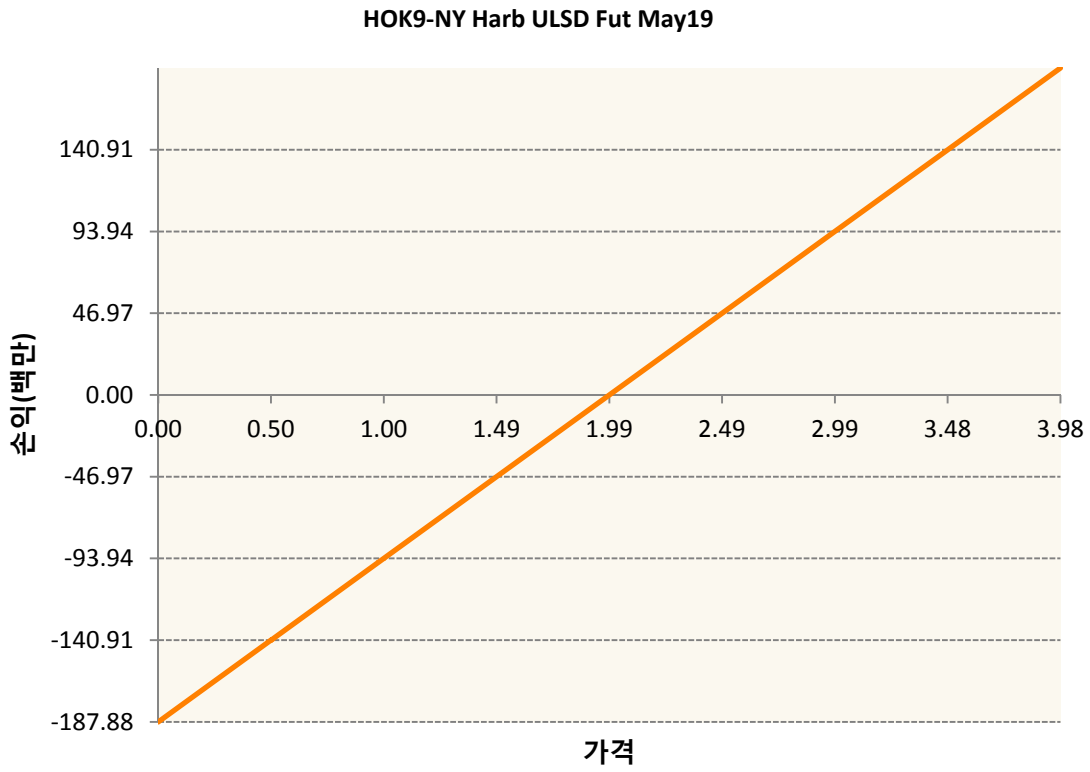
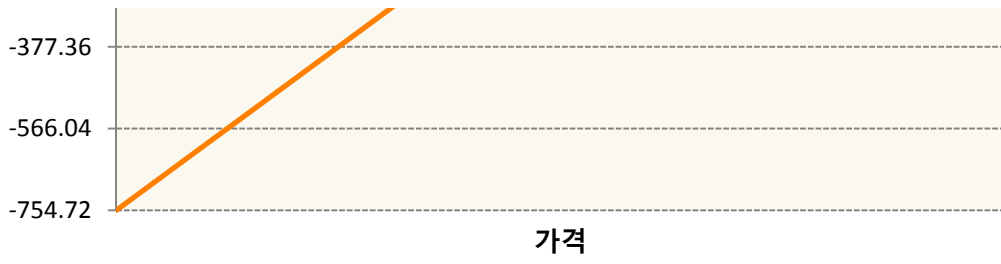
2. 만기시점의 손익구조

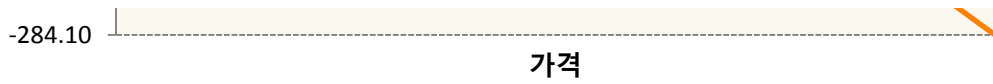
CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19



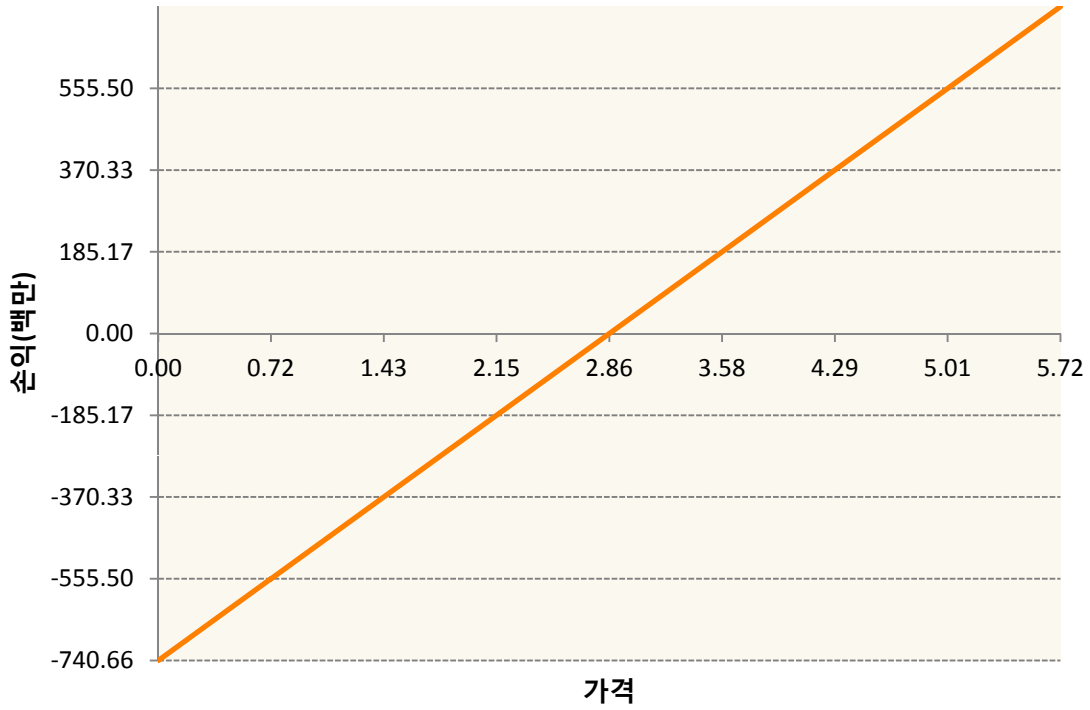
COK9-BRENT CRUDE FUTR May19



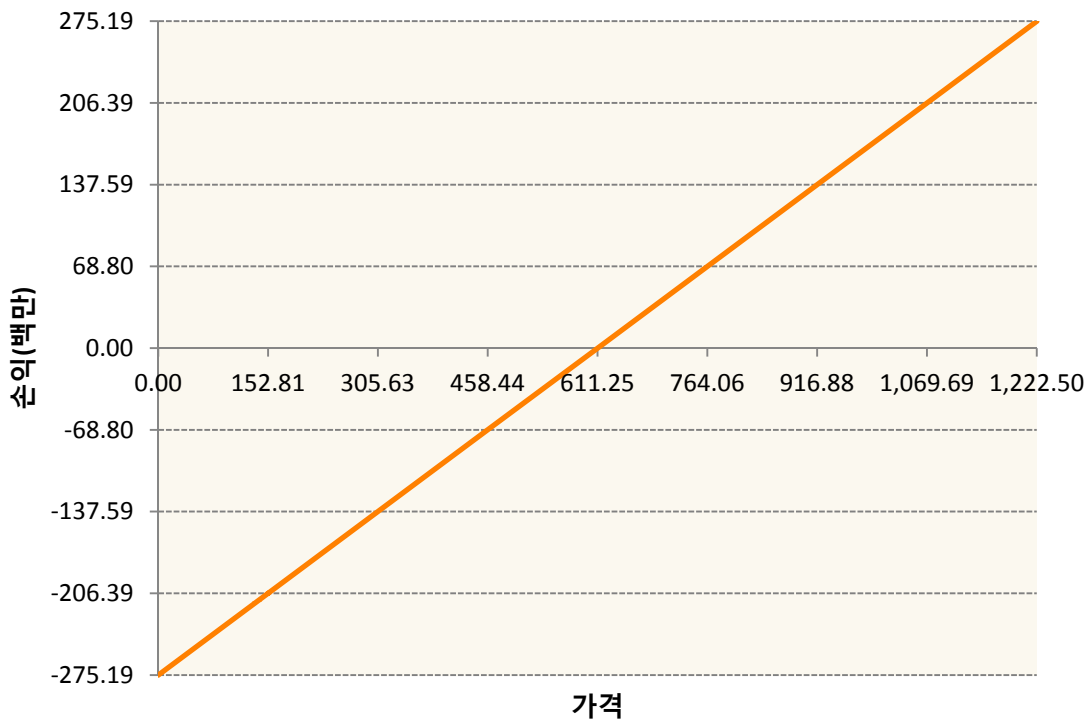




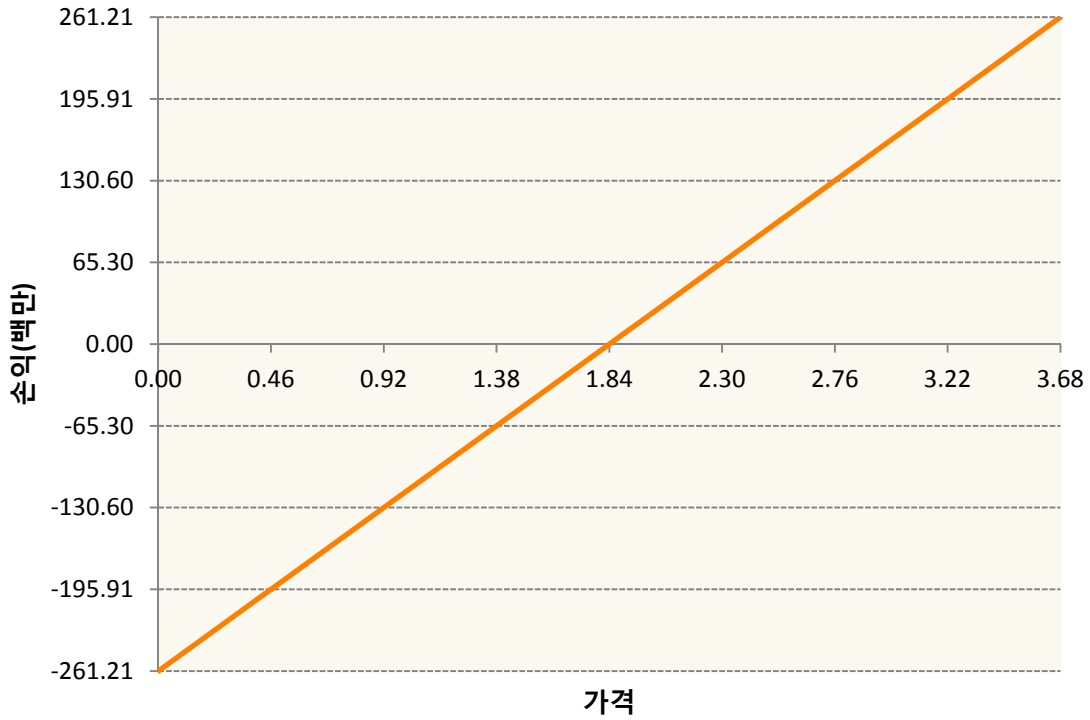
NGK19-NATURAL GAS FUTR May19



QSK9-Low Su Gasoil G May19



XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK9	WTI CRUDE FUTURE May19	53
COK9	BRENT CRUDE FUTR May19	60
HOK9	NY Harb ULSD Fut May19	15
KR4175P400	2019-04 달러선물	23
NGK19	NATURAL GAS FUTR May19	59
QSK9	Low Su Gasoil G May19	22
XBK9	GASOLINE RBOB FUT May19	21

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

(단위:백만원)

440

공시일	2019-03-18
기준일	2019-03-15

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

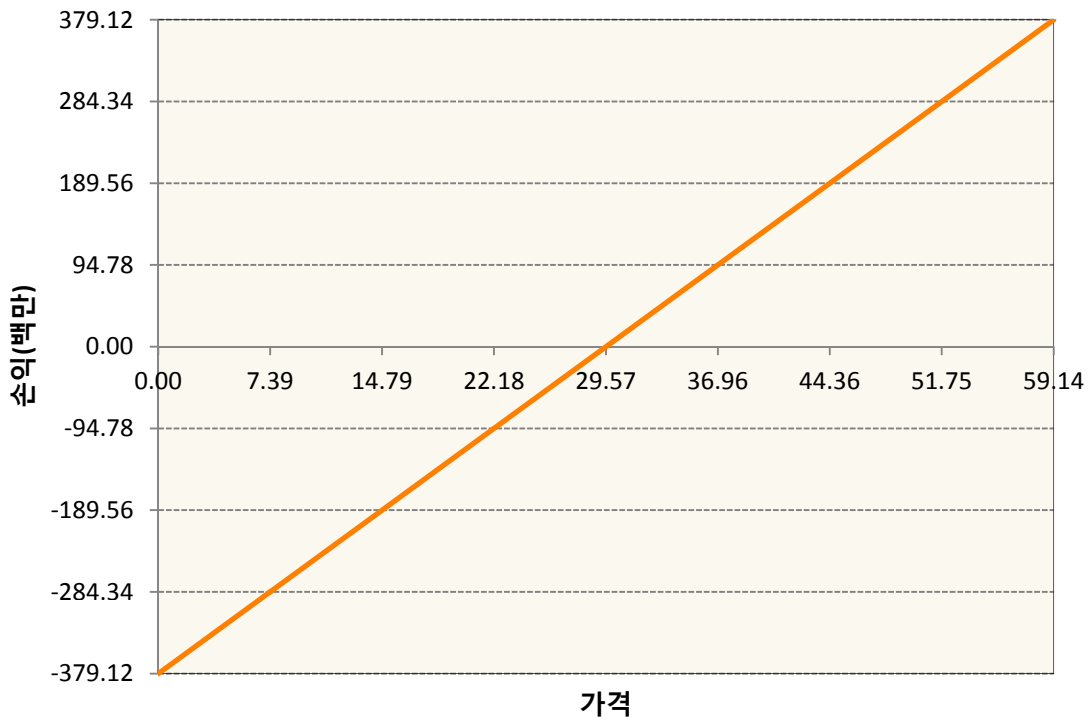
1. 계약금액

(단위:백만원)

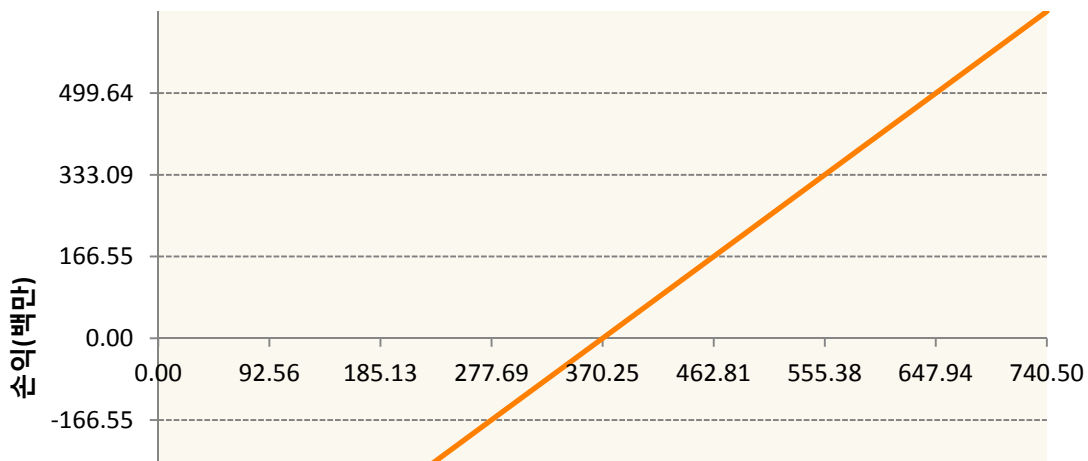
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,357	80	3,277	

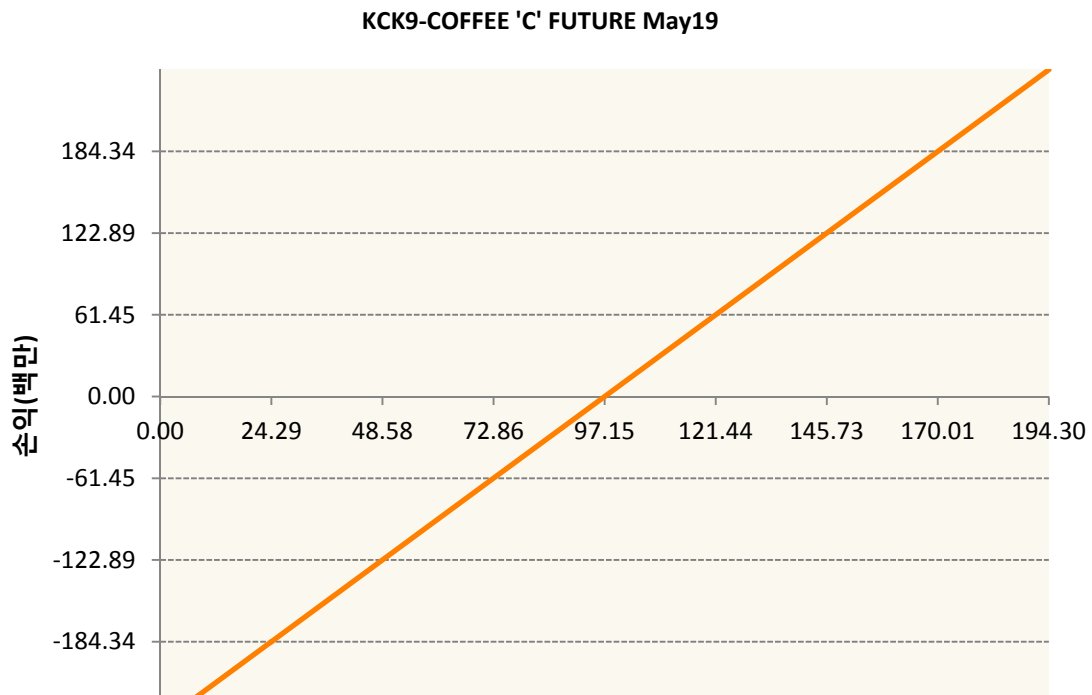
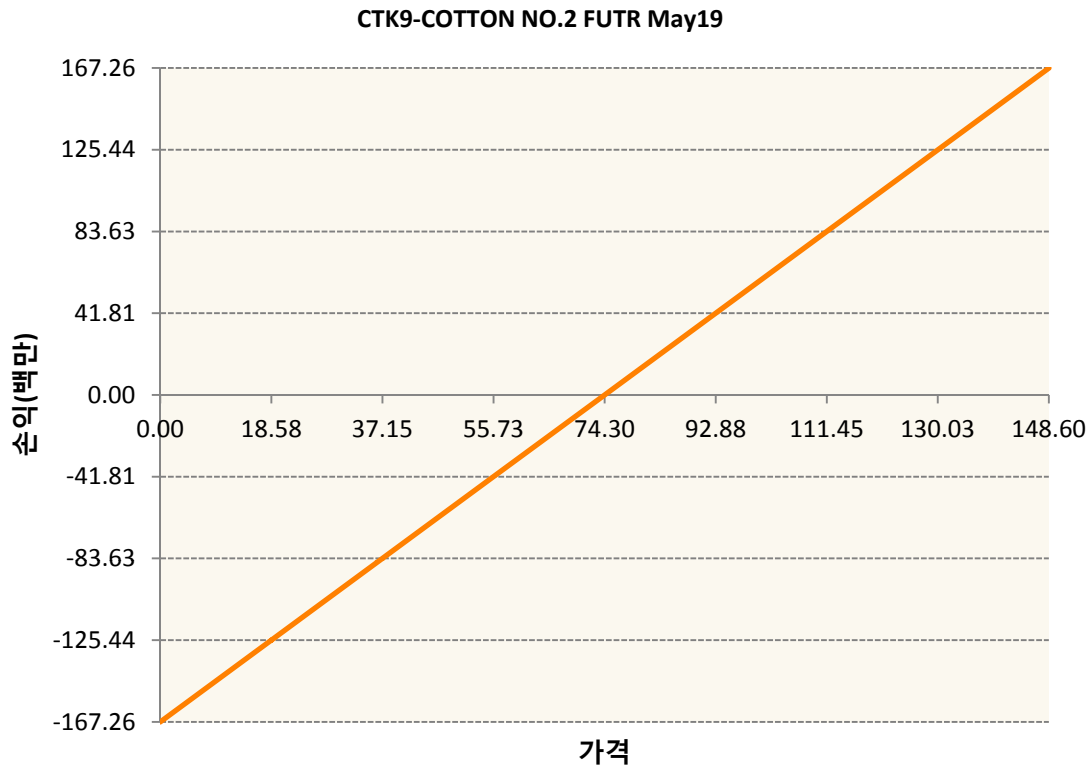
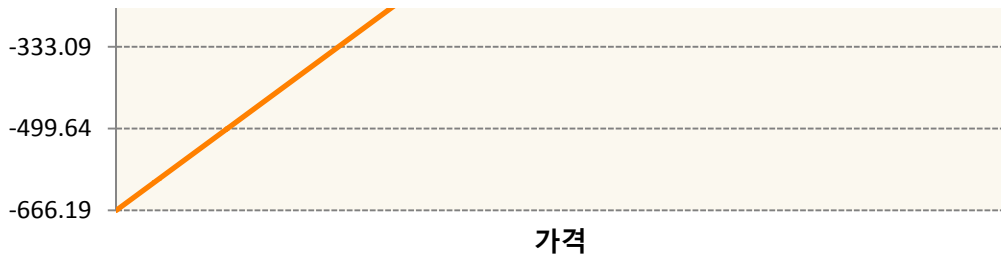
2. 만기시점의 손익구조

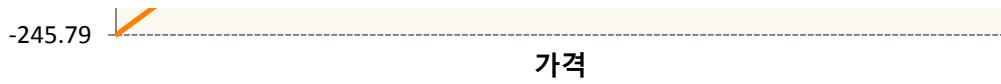
BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19



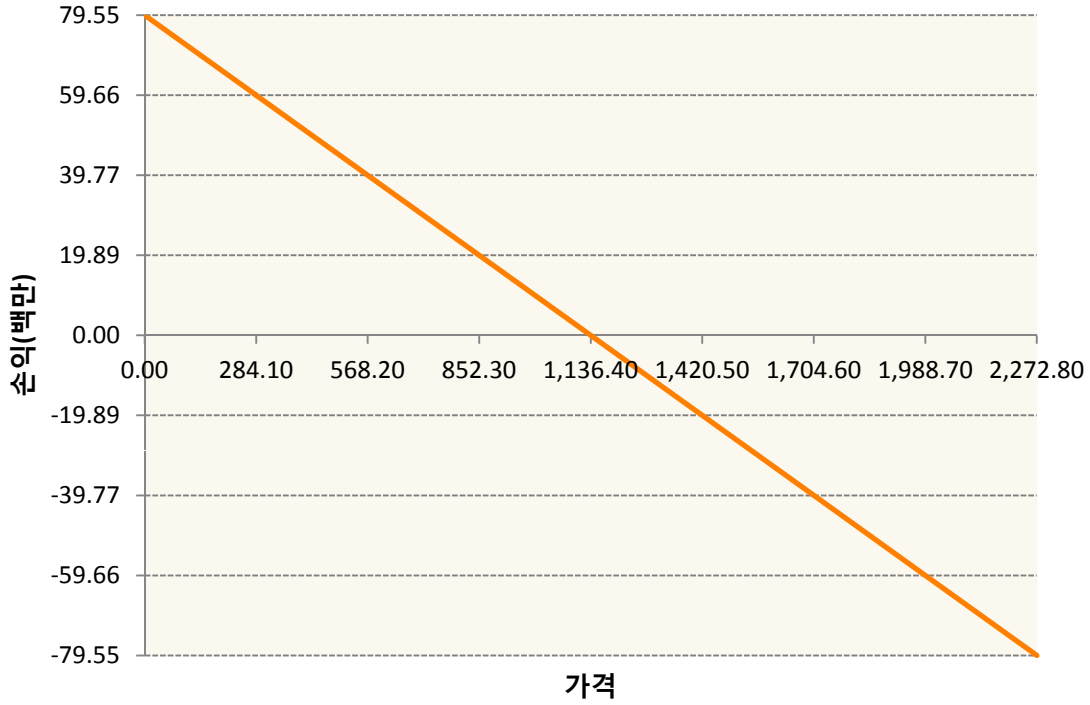
CK9-CORN FUTURE May19



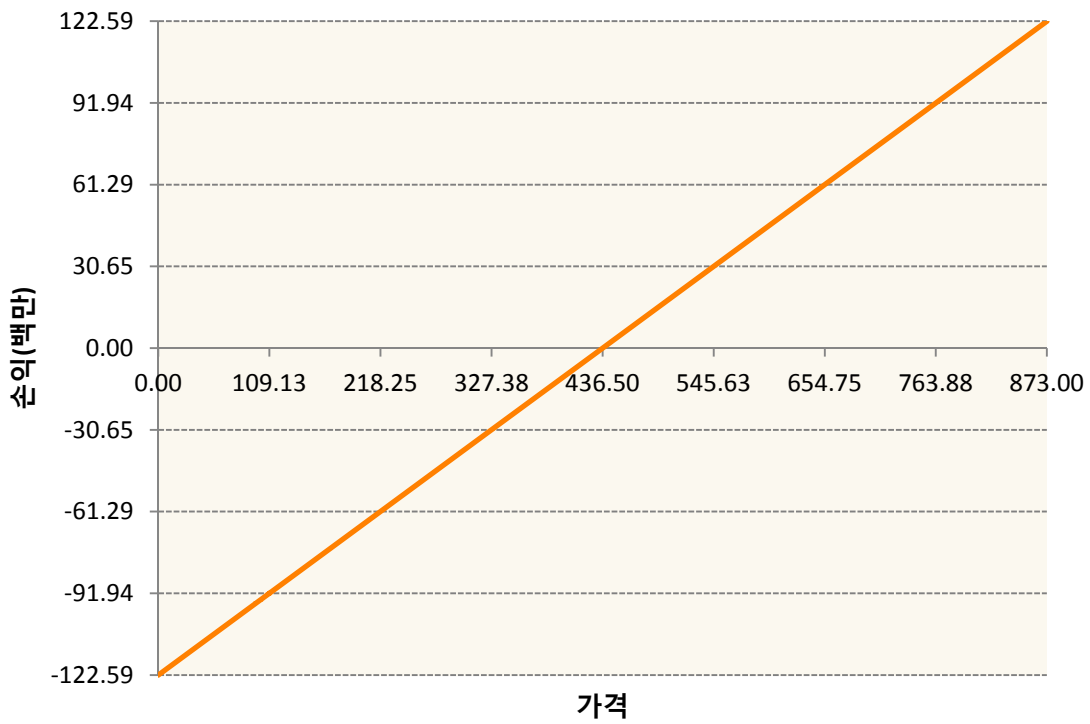




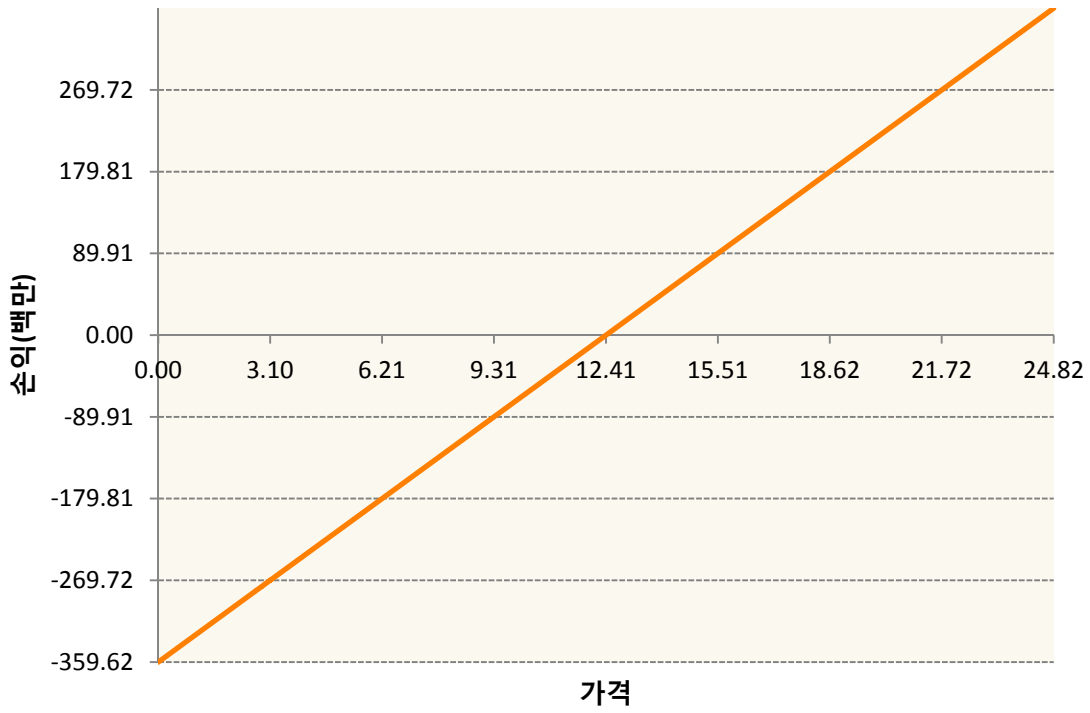
KR4175P40000-2019-04 달러선물



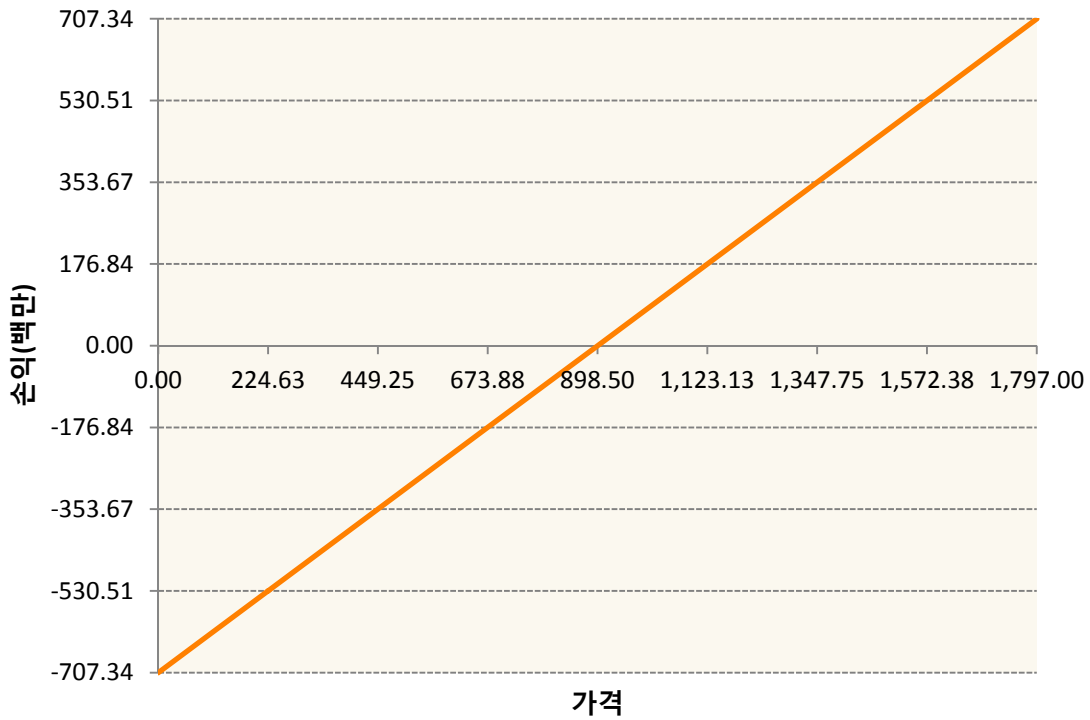
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



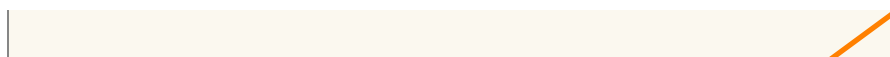
SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

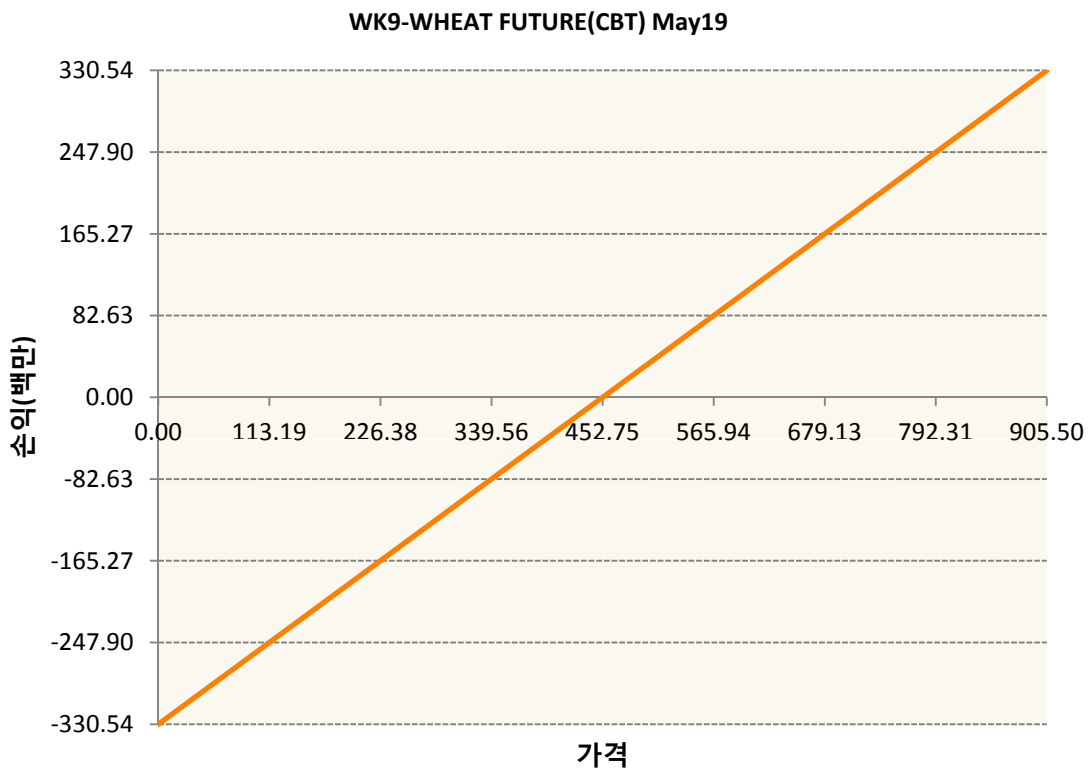
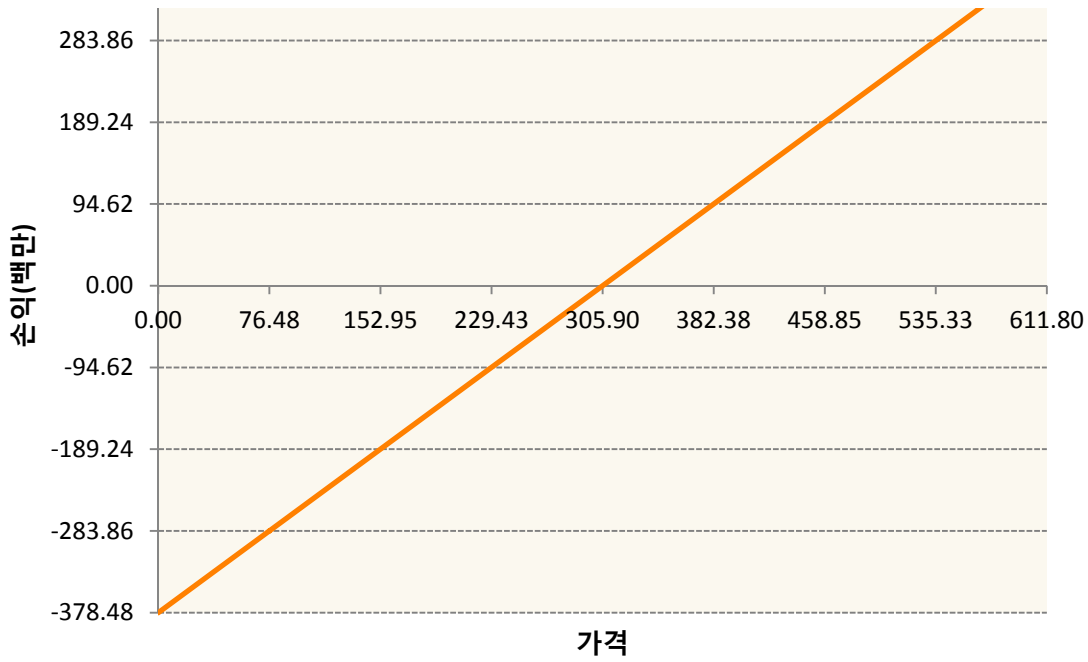


SK9-SOYBEAN FUTURE May19



SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK9	SOYBEAN OIL FUTR May19	30
CK9	CORN FUTURE May19	53
CTK9	COTTON NO.2 FUTR May19	13
KCK9	COFFEE 'C' FUTURE May19	20
KR4175P400 2019-04	달러선물	6

KWK9	KC HRW WHEAT FUT May19	10
SBK9	SUGAR #11 (WORLD) May19	29
SK9	SOYBEAN FUTURE May19	57
SMK9	SOYBEAN MEAL FUTR May19	30
WK9	WHEAT FUTURE(CBT) May19	26

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

(단위:백만원)

268