

공시일	2019-03-19
기준일	2019-03-18

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)

94

공시일	2019-03-19
기준일	2019-03-18

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

1,127

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

654

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-03-19
기준일	2019-03-18

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)	343
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	95
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	161

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

938

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-03-19
기준일	2019-03-18

유로인덱스모(주식-파생형)

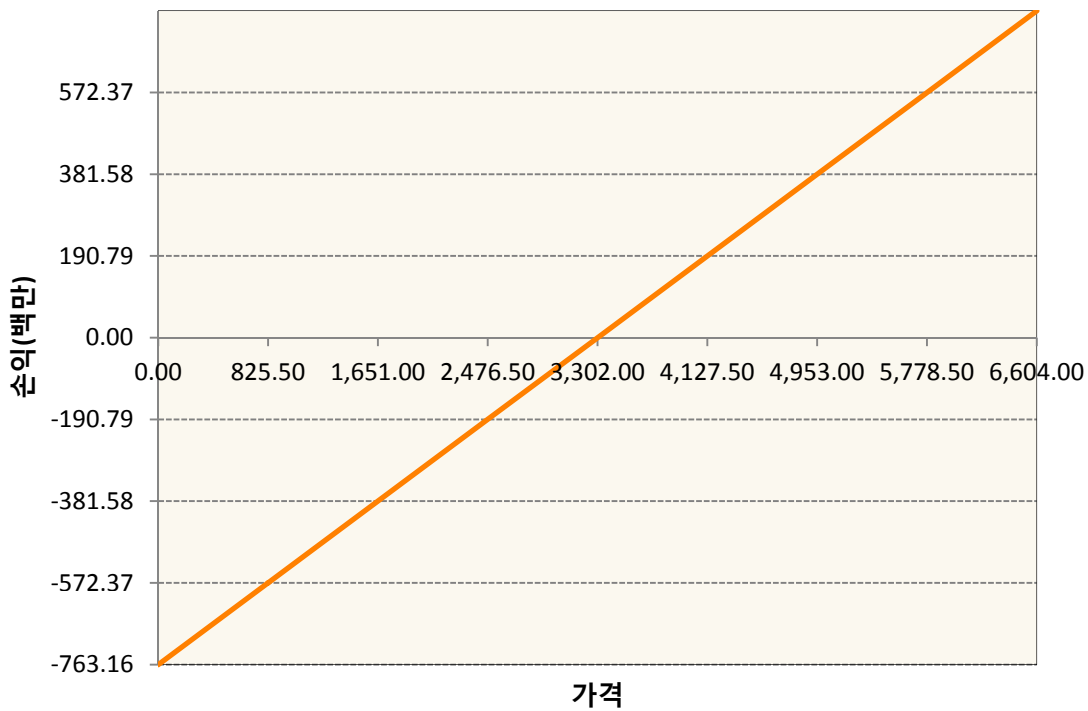
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	763	0	763	

2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	61
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-03-19
기준일	2019-03-18

차이나인덱스모(주식-파생형)

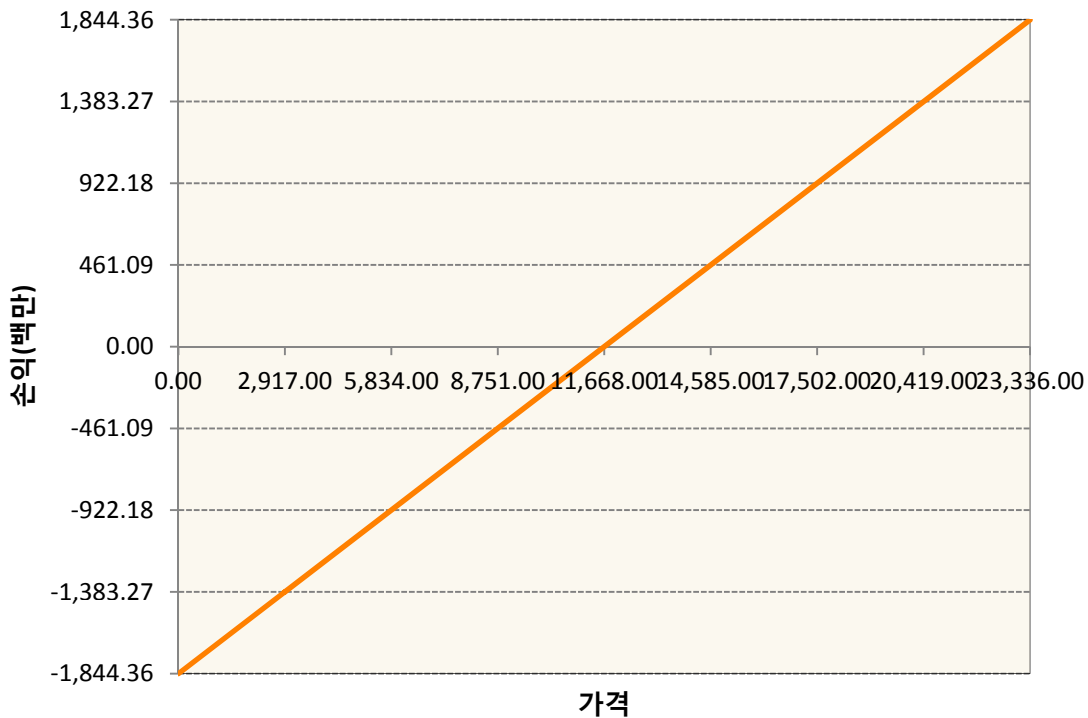
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,844	0	1,844	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCH9-HSCEI Futures Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH9	HSCEI Futures Mar19	148
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

152

공시일	2019-03-19
기준일	2019-03-18

커버드콜모(주식혼합-파생형)

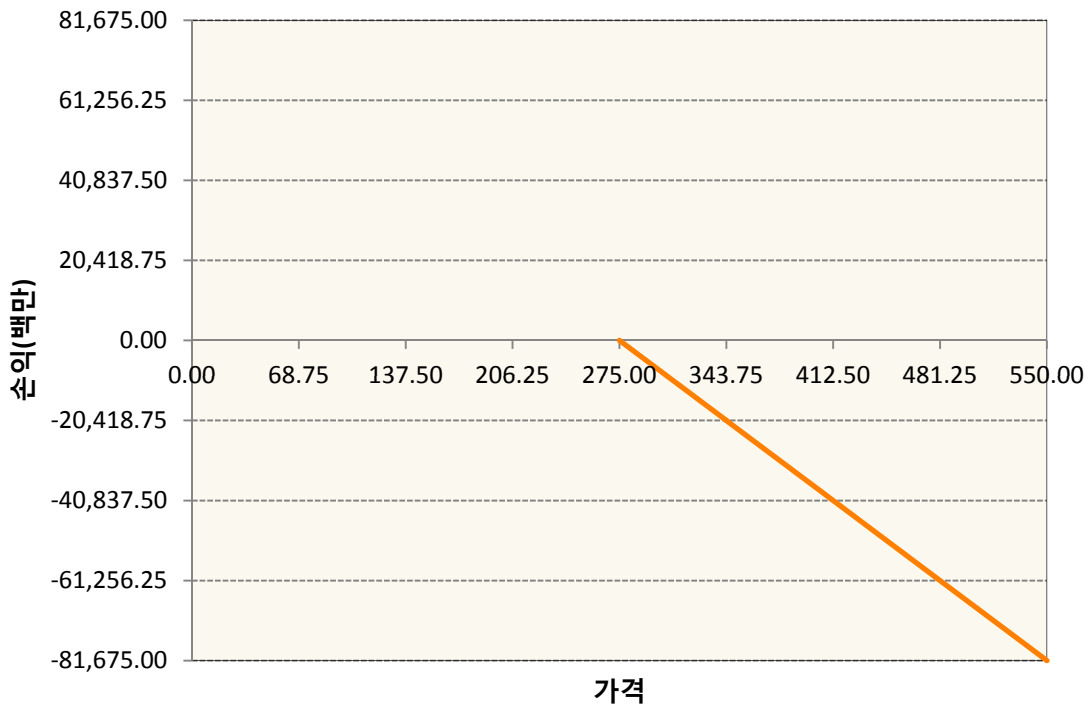
1. 계약금액

(단위:백만원)

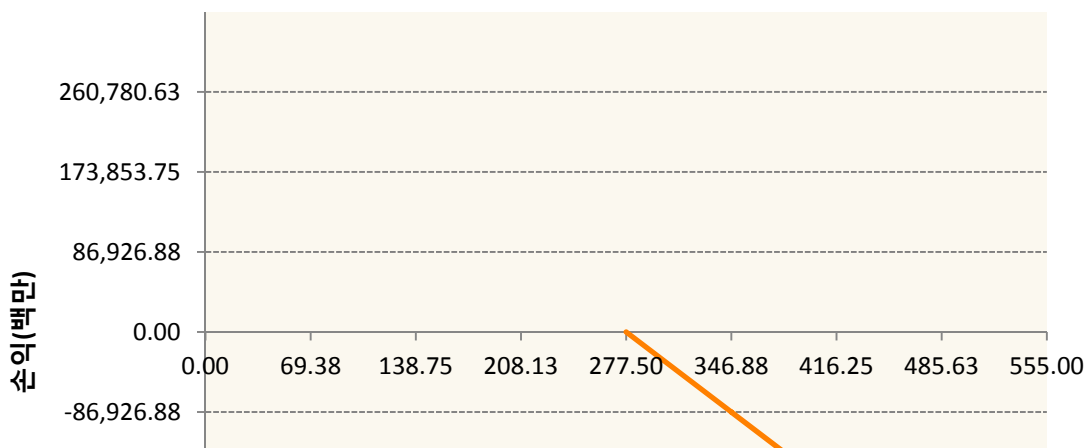
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	674,320	-674,320	장내

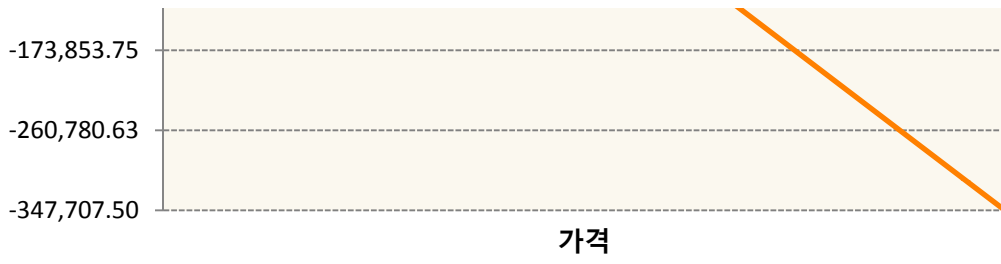
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P42752-2019-04 콜275

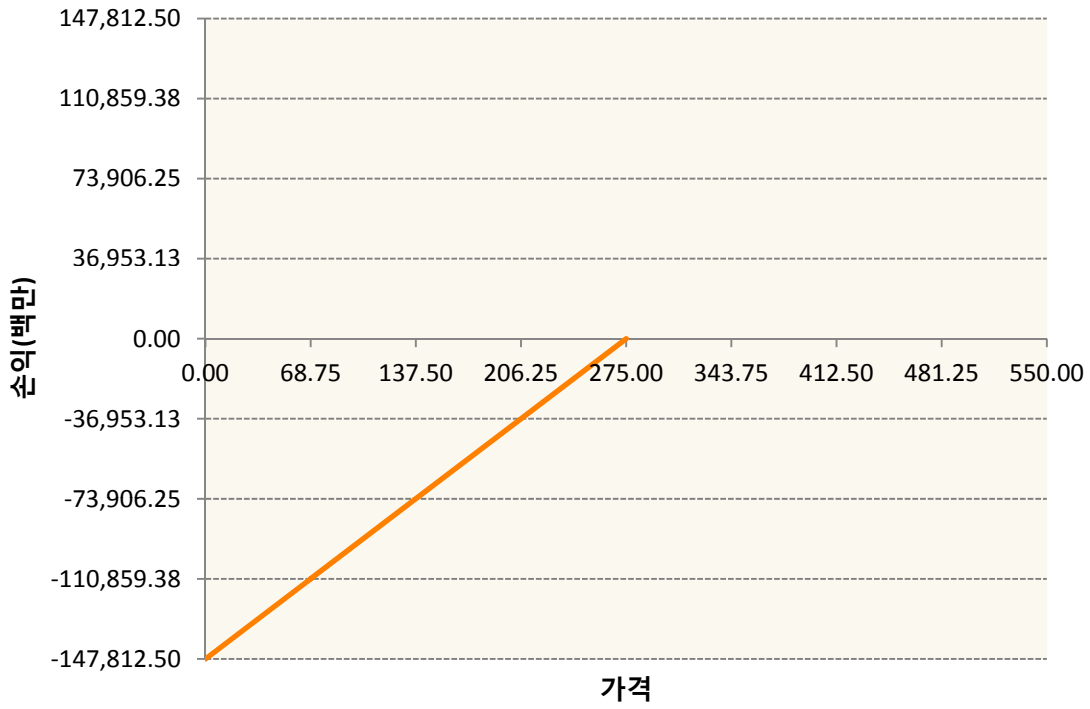


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

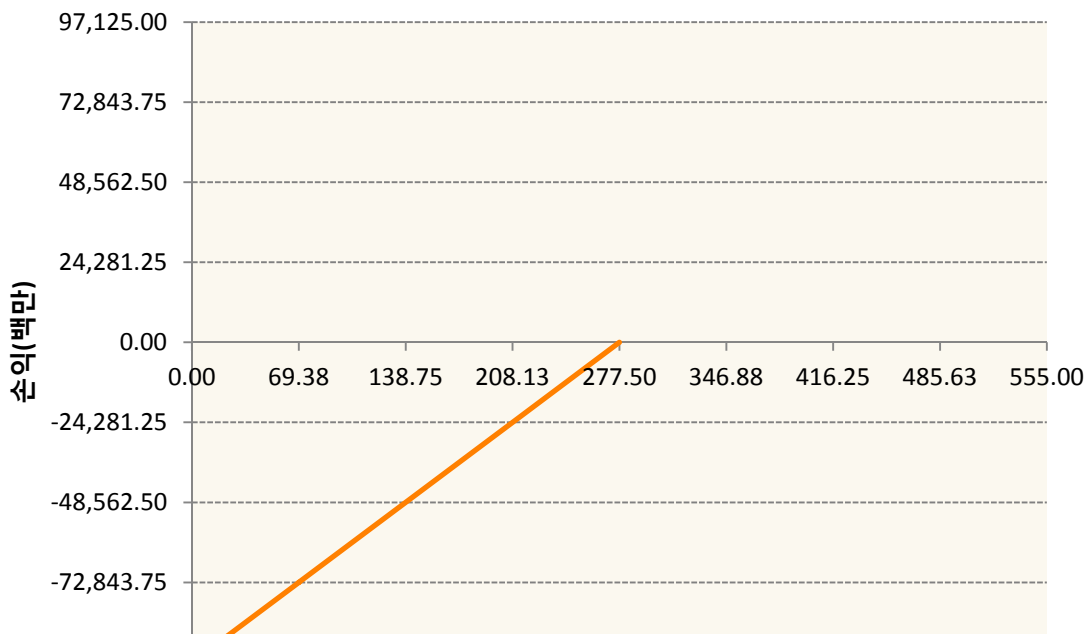




KR4301P42750-2019-04 풋275



KR4301P42776-2019-04 풋277.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P42752 2019-04 콜275							5,550
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,810	2,730	2,637	2,534	2,422	2,302	2,177
-5.33%	2,454	2,316	2,171	2,021	1,867	1,709	1,549
-2.67%	1,722	1,544	1,366	1,188	1,009	830	651
0%	525	351	176	0	-177	-355	-534
2.67%	-1,102	-1,234	-1,374	-1,521	-1,673	-1,830	-1,990
5.33%	-3,034	-3,114	-3,207	-3,311	-3,426	-3,549	-3,678
8.00%	-5,136	-5,175	-5,227	-5,291	-5,367	-5,454	-5,550
KR4201P42778 2019-04 콜277.5							22,520
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,335	10,063	9,736	9,361	8,945	8,493	8,010
-5.33%	9,203	8,690	8,139	7,560	6,956	6,333	5,694
-2.67%	6,688	5,970	5,243	4,510	3,772	3,031	2,286
0%	2,302	1,536	769	0	-770	-1,540	-2,311
2.67%	-3,987	-4,621	-5,280	-5,959	-6,653	-7,359	-8,075
5.33%	-11,756	-12,172	-12,640	-13,151	-13,698	-14,275	-14,877
8.00%	-20,423	-20,643	-20,922	-21,254	-21,635	-22,059	-22,520
KR4301P42750 2019-04 풋275							8,556
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,371	-8,382	-8,400	-8,426	-8,460	-8,504	-8,556
-5.33%	-4,498	-4,568	-4,652	-4,745	-4,848	-4,959	-5,076
-2.67%	-1,307	-1,471	-1,637	-1,804	-1,972	-2,140	-2,310
0%	451	305	155	0	-158	-318	-480
2.67%	982	928	861	783	694	596	489
5.33%	1,061	1,052	1,037	1,014	983	942	893
8.00%	1,067	1,066	1,064	1,060	1,053	1,042	1,025
KR4301P42776 2019-04 풋277.5							6,078
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,001	-6,005	-6,011	-6,021	-6,035	-6,054	-6,078
-5.33%	-3,433	-3,461	-3,498	-3,542	-3,594	-3,651	-3,713
-2.67%	-1,148	-1,240	-1,334	-1,432	-1,532	-1,634	-1,738
0%	333	223	112	0	-112	-225	-338
2.67%	894	840	777	707	632	552	467

5.33%	1,004	992	974	949	917	879	835
8.00%	1,014	1,013	1,010	1,005	996	984	967

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

(단위:백만원)

42,711

공시일	2019-03-19
기준일	2019-03-18

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

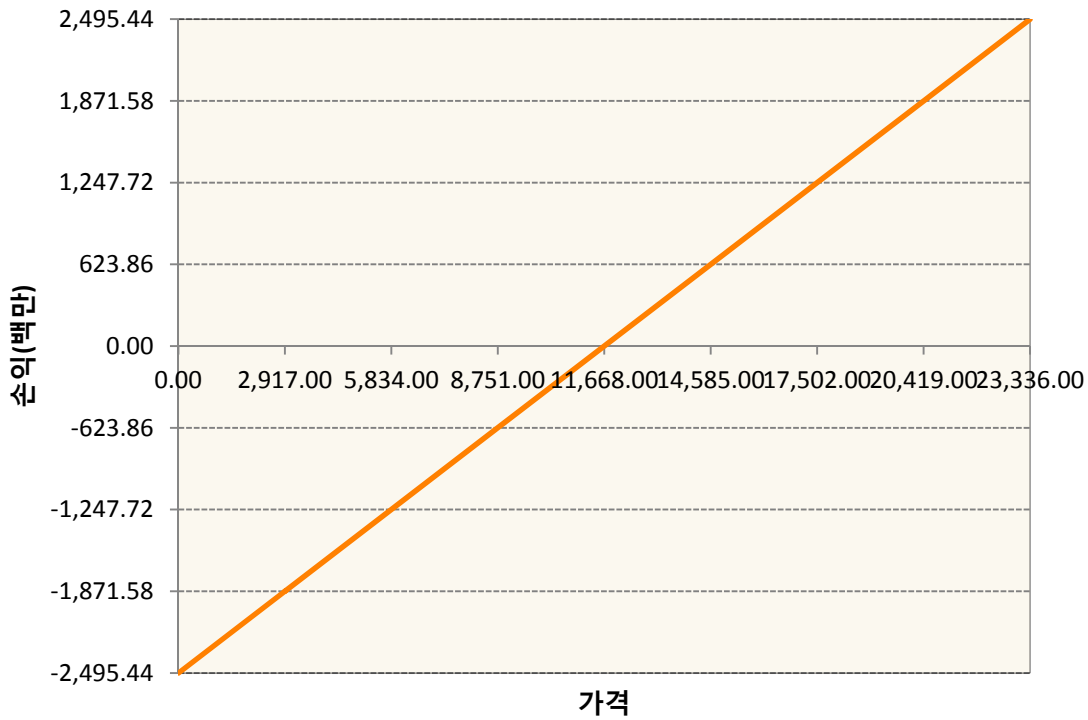
1. 계약금액

(단위:백만원)

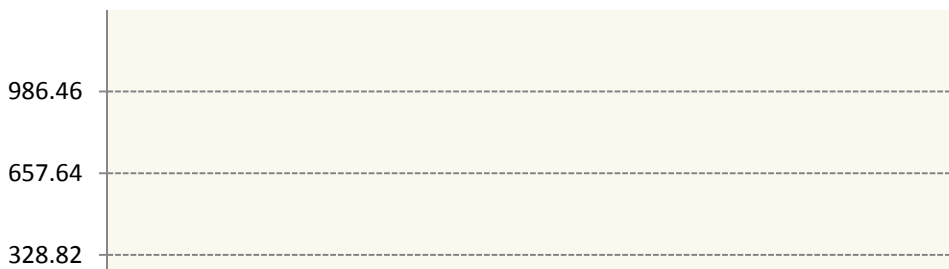
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,495	0	2,495	장내
누계	유가증권	옵션	0	6,279	-6,279	장내
누계	통화	선도	0	3,029	-3,029	장외

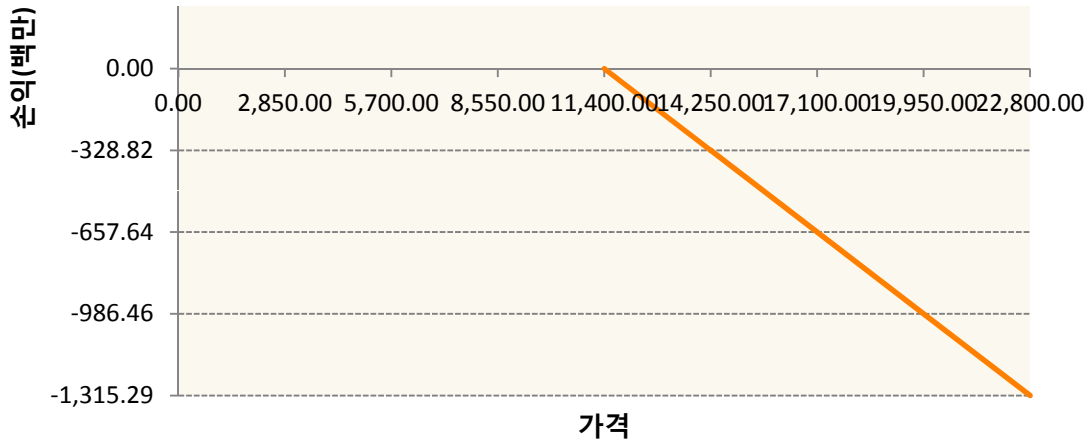
2. 만기시점의 손익구조

HCH9-HSCEI Futures Mar19

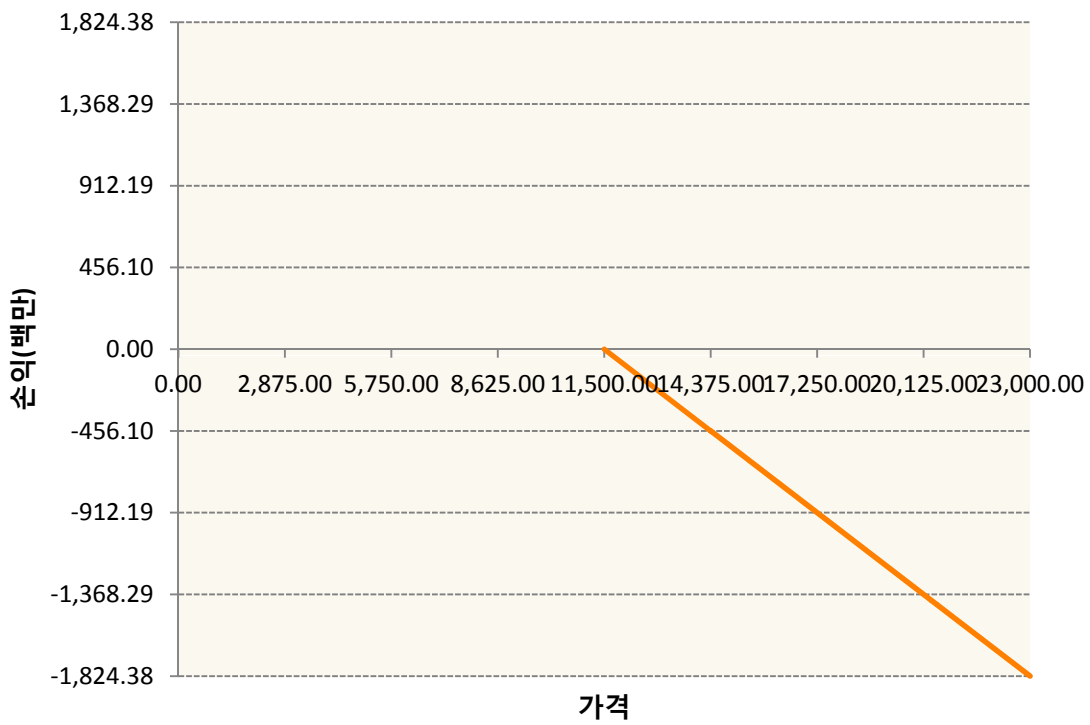


OHHIH9-C114-HSCEI

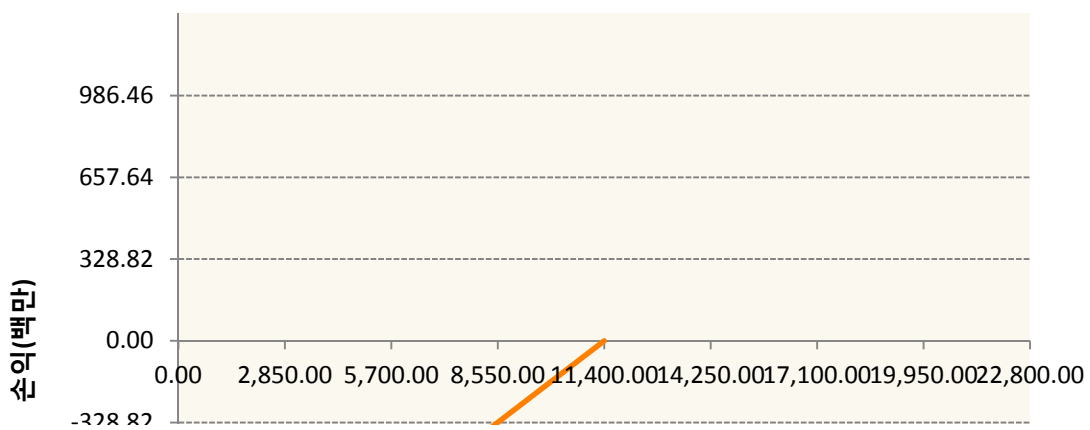


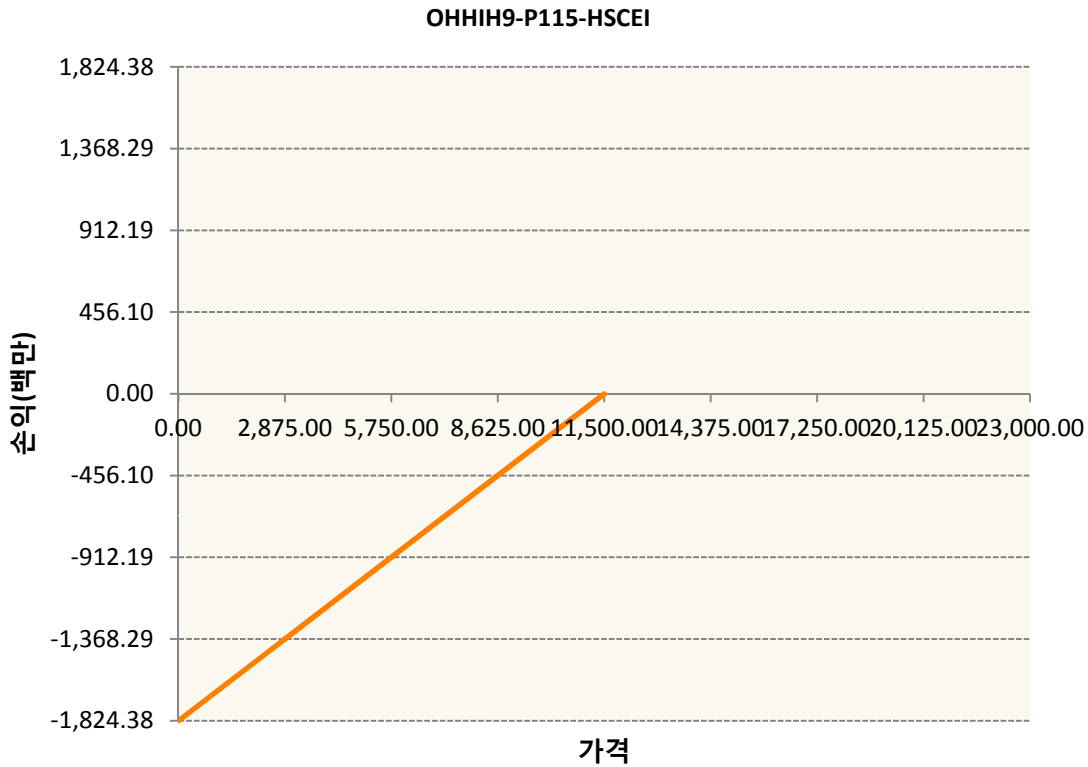


OHHIH9-C115-HSCEI



OHHIH9-P114-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	219
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	23
HCH9 HSCEI Futures Mar19	200
OHHIH9-C11 HSCEI	105
OHHIH9-C11 HSCEI	146
OHHIH9-P11 HSCEI	105
OHHIH9-P11 HSCEI	146

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	808

공시일	2019-03-19
기준일	2019-03-18

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

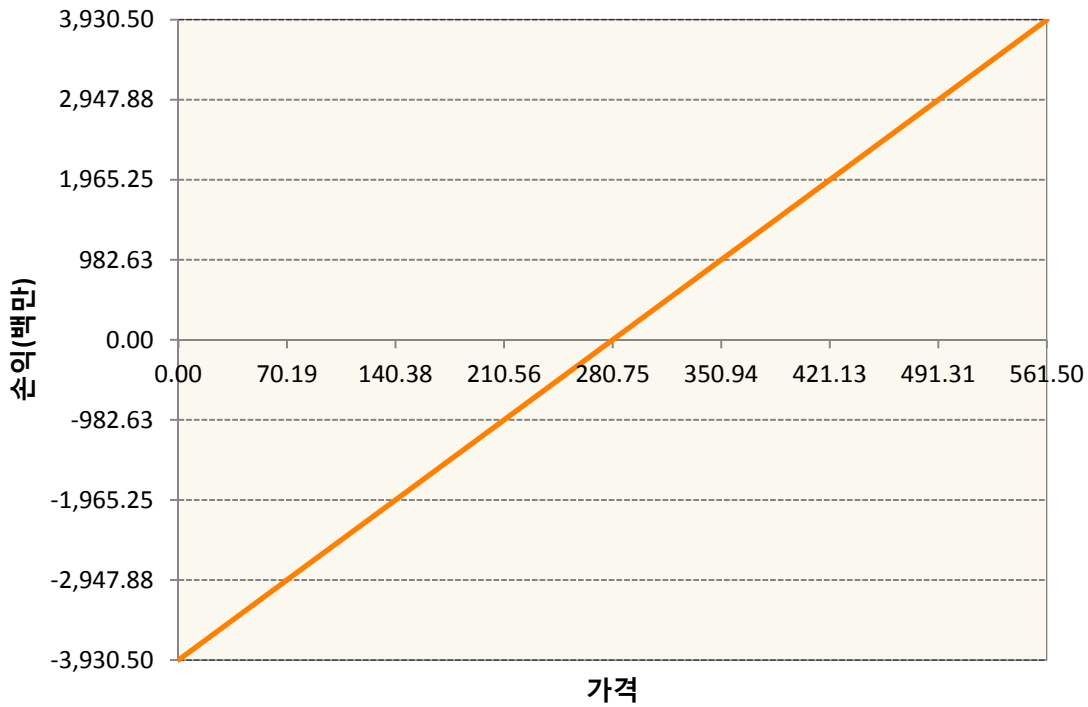
1. 계약금액

(단위:백만원)

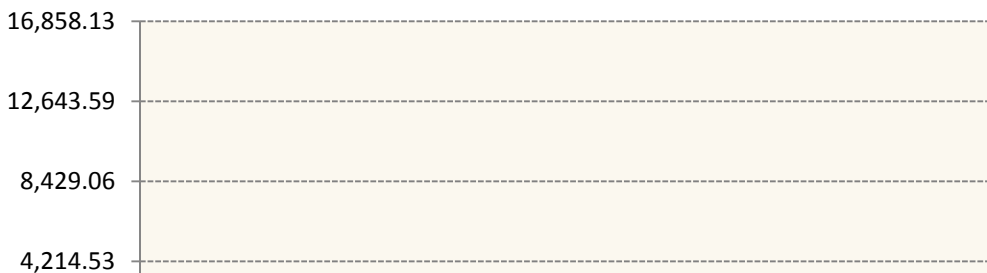
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	2,454	-2,454	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,931	0	3,931	장내
누계	유가증권	스왑	35,836	0	35,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,649	-34,649	장내

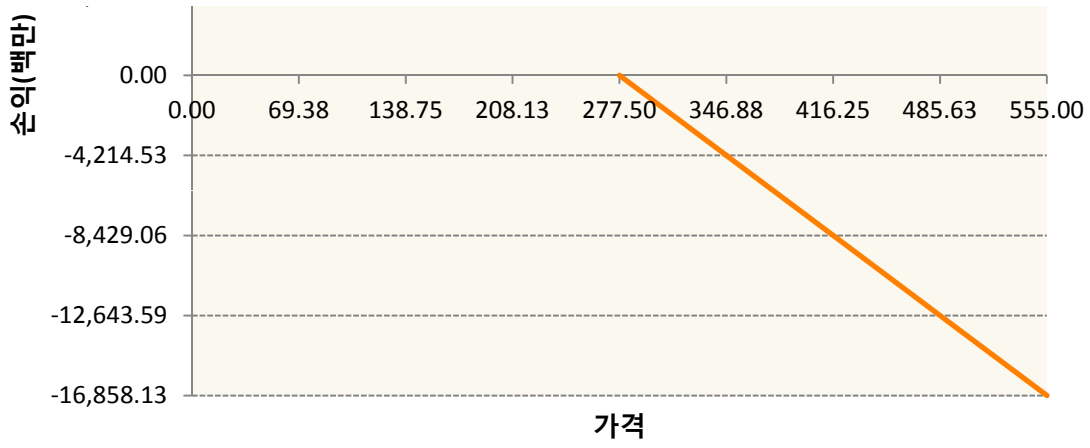
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

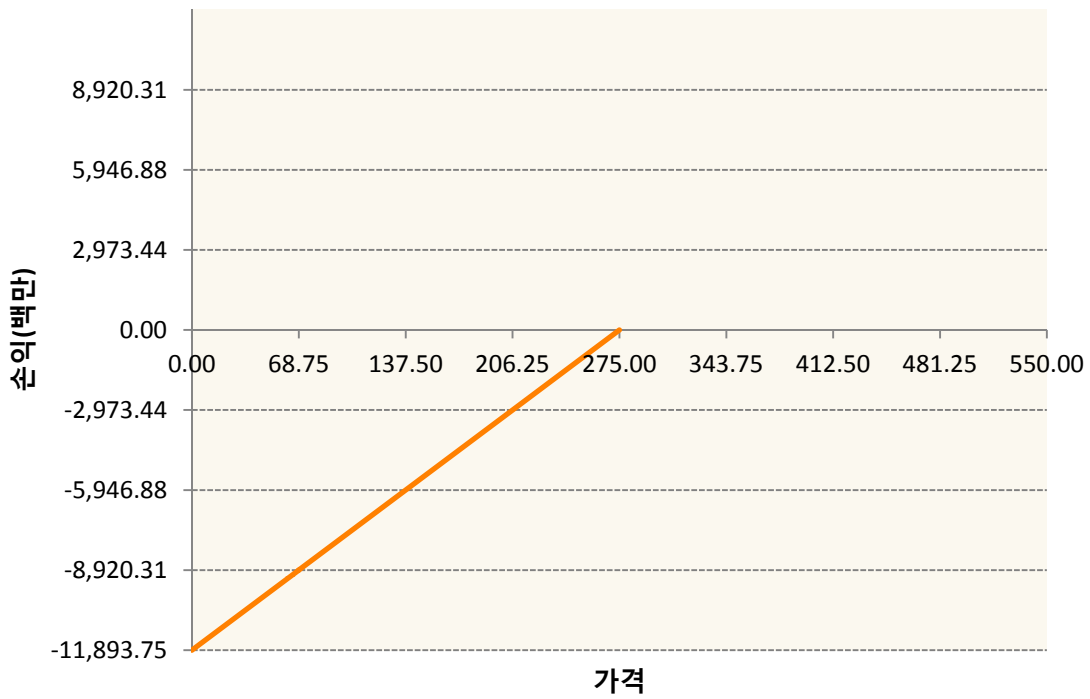


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

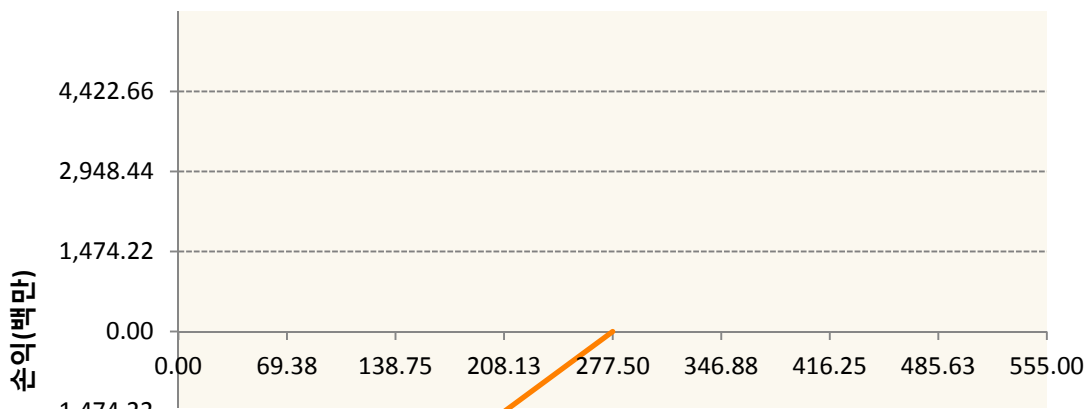


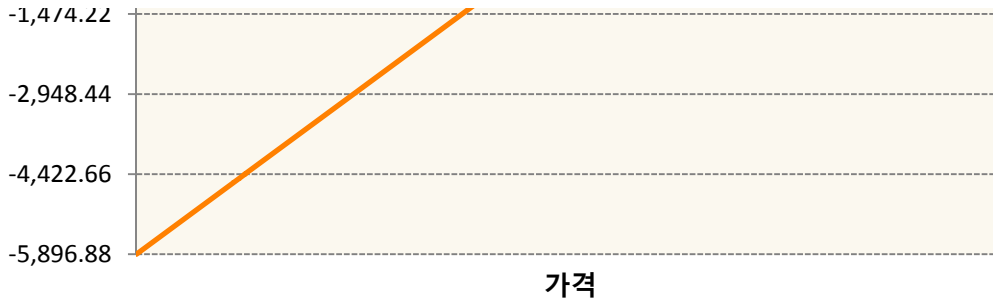


KR4301P42750-2019-04 풋275



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						314
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-314	-314	-314	-314	-314	-314	-314	
-5.33%	-209	-209	-209	-209	-209	-209	-209	
-2.67%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	105	105	105	105	105	105	105	
5.33%	209	209	209	209	209	209	209	
8.00%	314	314	314	314	314	314	314	
KR4201P42778		2019-04 콜277.5						1,092
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	501	488	472	454	434	412	388
-5.33%	446	421	395	367	337	307	276
-2.67%	324	289	254	219	183	147	111
0%	112	74	37	0	-37	-75	-112
2.67%	-193	-224	-256	-289	-323	-357	-392
5.33%	-570	-590	-613	-638	-664	-692	-721
8.00%	-990	-1,001	-1,014	-1,030	-1,049	-1,069	-1,092
KR4301P42750 2019-04 풋275							688
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-674	-674	-676	-678	-681	-684	-688
-5.33%	-362	-368	-374	-382	-390	-399	-408
-2.67%	-105	-118	-132	-145	-159	-172	-186
0%	36	25	12	0	-13	-26	-39
2.67%	79	75	69	63	56	48	39
5.33%	85	85	83	82	79	76	72
8.00%	86	86	86	85	85	84	82
KR4301P42776 2019-04 풋277.5							369
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-364	-365	-365	-366	-366	-368	-369
-5.33%	-208	-210	-212	-215	-218	-222	-225
-2.67%	-70	-75	-81	-87	-93	-99	-105
0%	20	14	7	0	-7	-14	-21
2.67%	54	51	47	43	38	33	28
5.33%	61	60	59	58	56	53	51
8.00%	62	62	61	61	60	60	59

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

(단위:백만원)

5,441

공시일	2019-03-19
기준일	2019-03-18

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

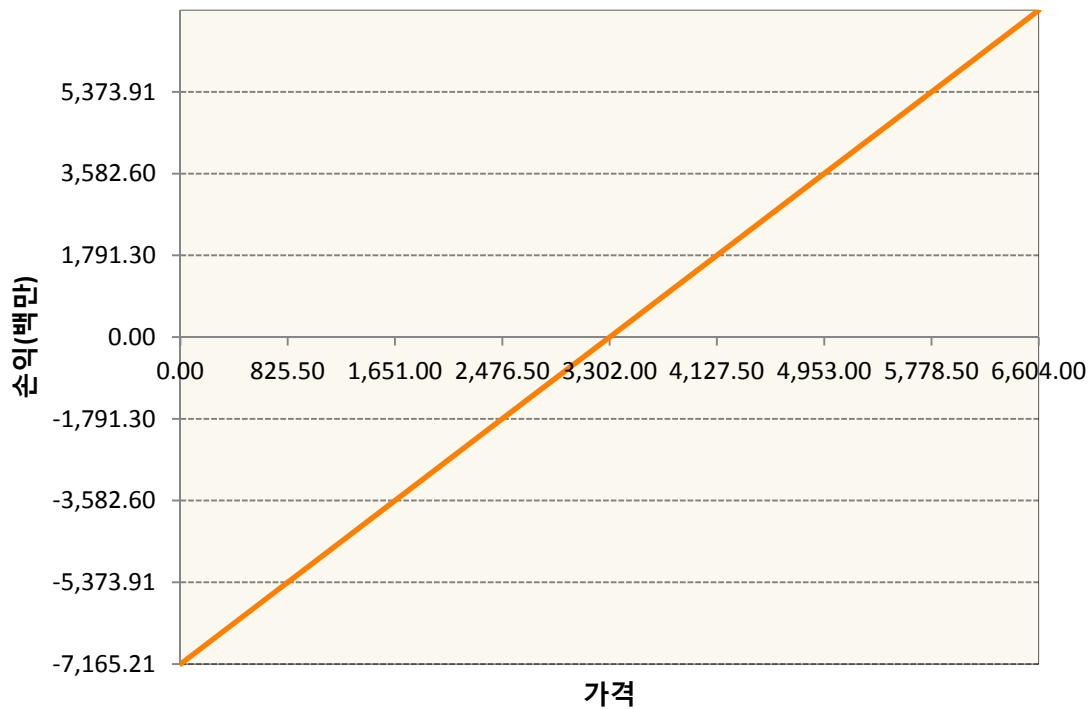
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1	0	1	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,165	0	7,165	
누계	유가증권	스왑	60,617	0	60,617	장외
누계	통화	선도	0	15,408	-15,408	장외

2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	136
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E	822
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	411
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	573

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

(단위:백만원)

1,195

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

(단위:백만원)

1,103

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

(단위:백만원)

94

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

(단위:백만원)

137

공시일	2019-03-19
기준일	2019-03-18

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

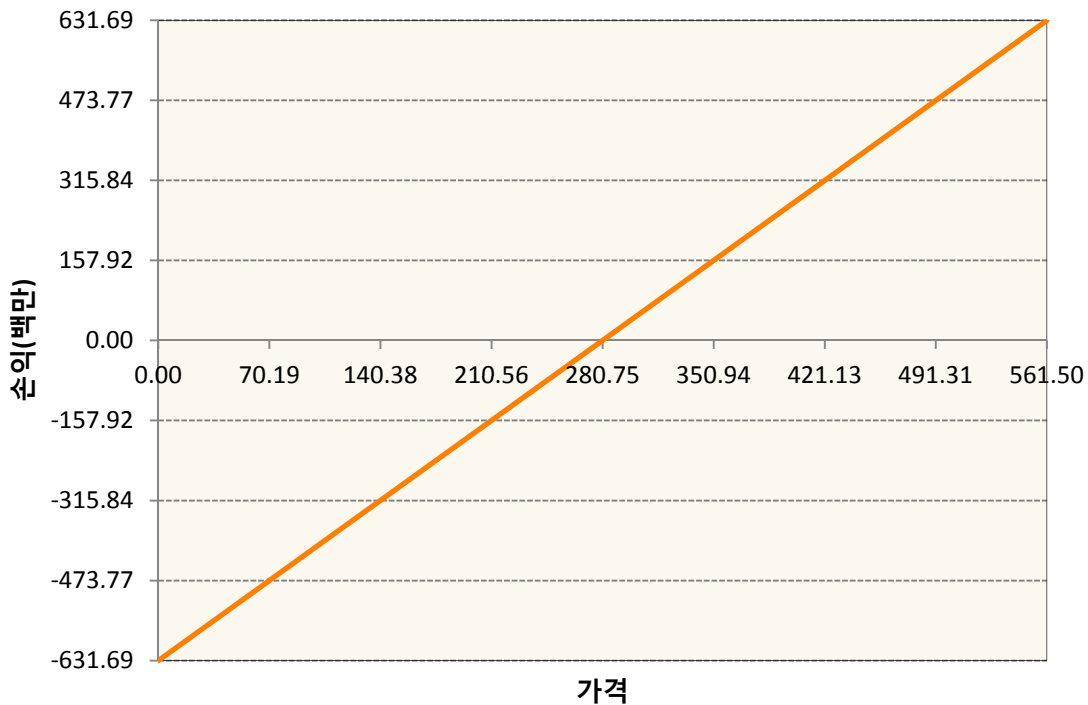
1. 계약금액

(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)

42

공시일	2019-03-19
기준일	2019-03-18

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

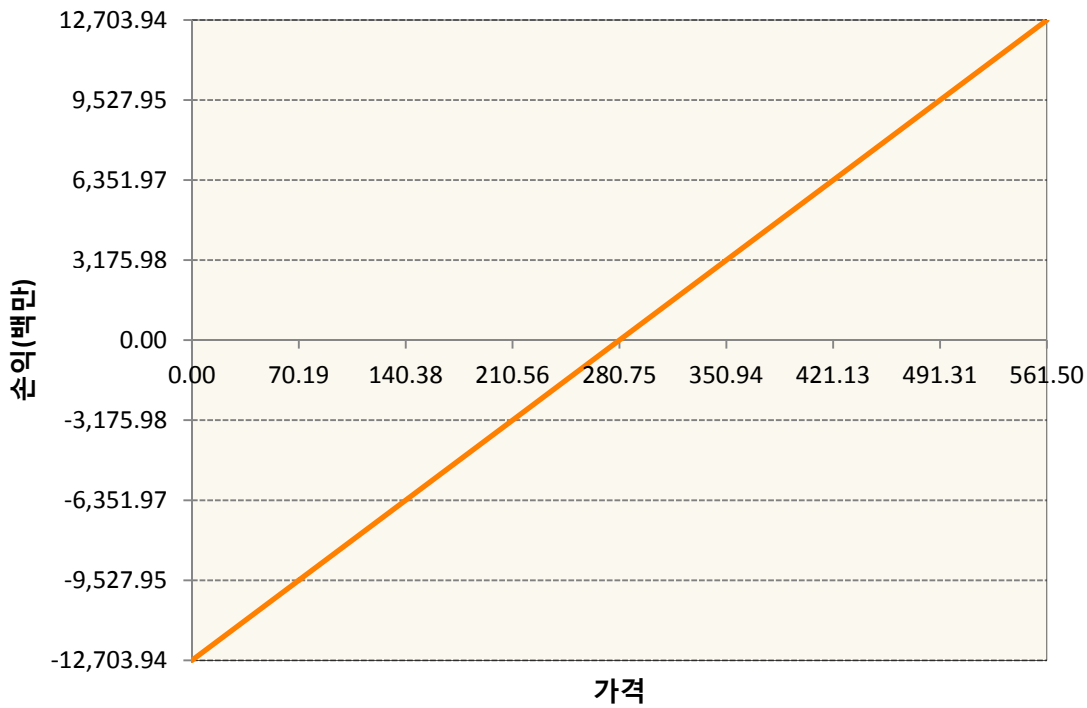
1. 계약금액

(단위:백만원)

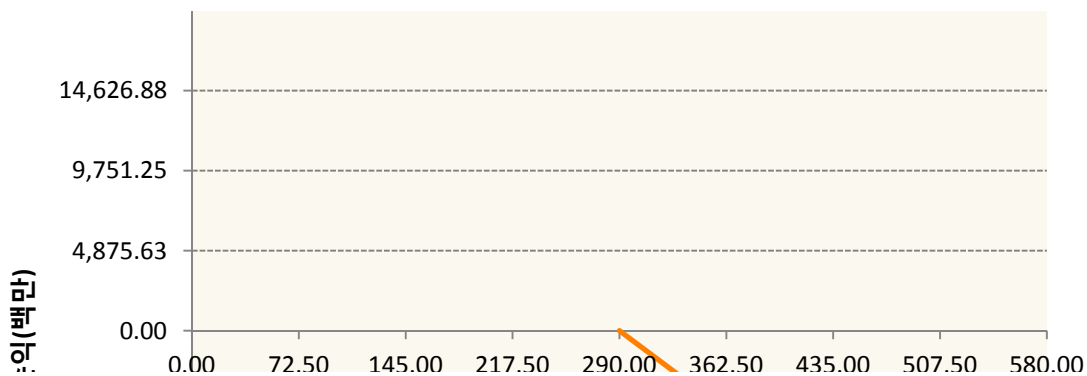
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,704	0	12,704	장내
누계	유가증권	옵션	1,867	24,036	-22,169	장내

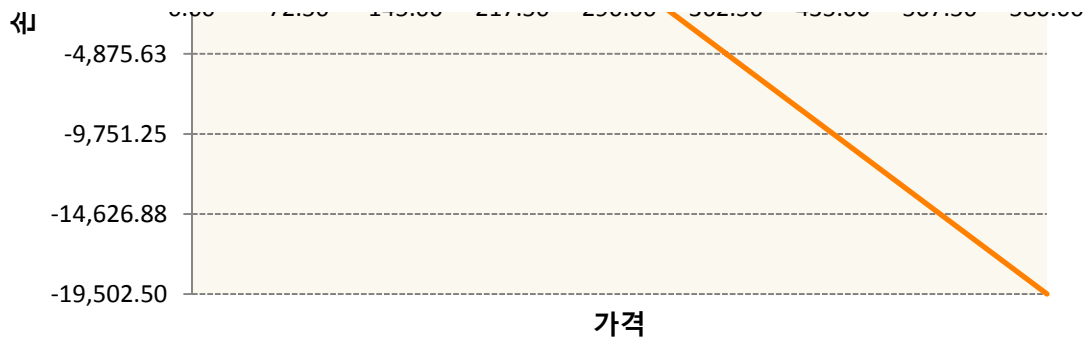
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

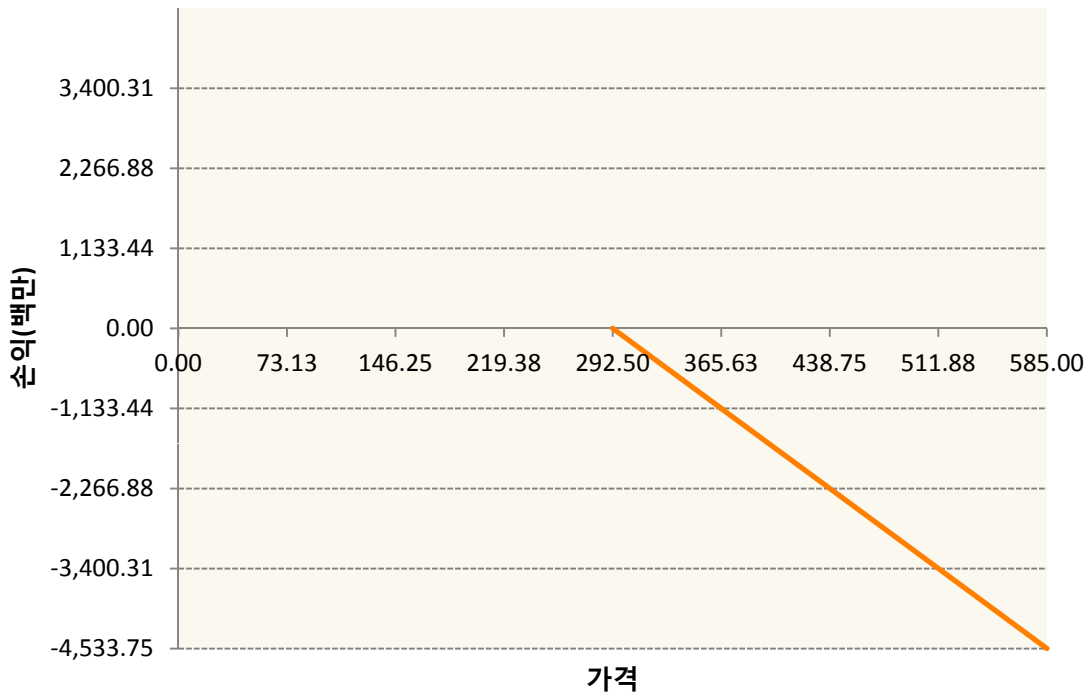


KR4201P42901-2019-04 콜290

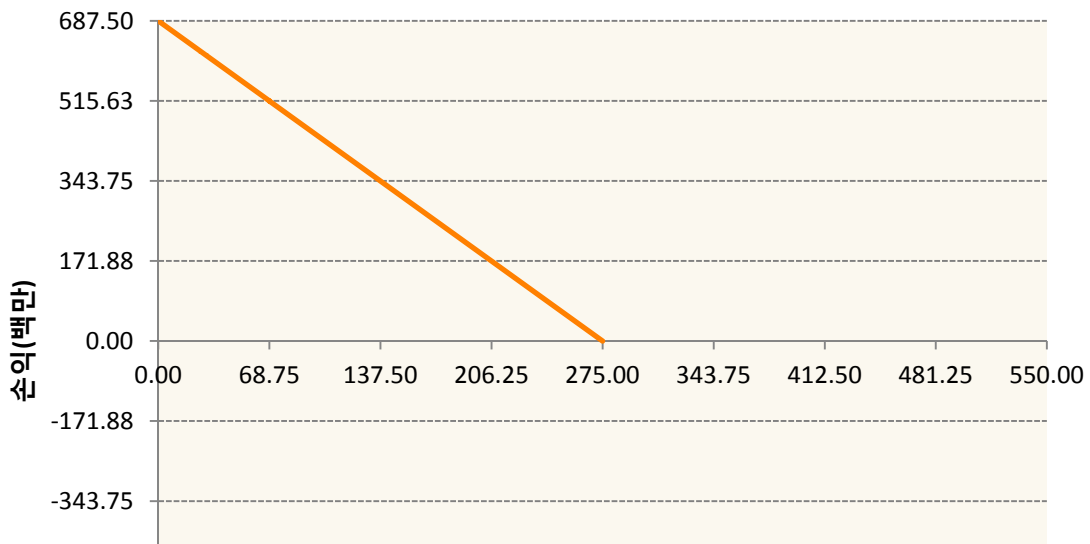


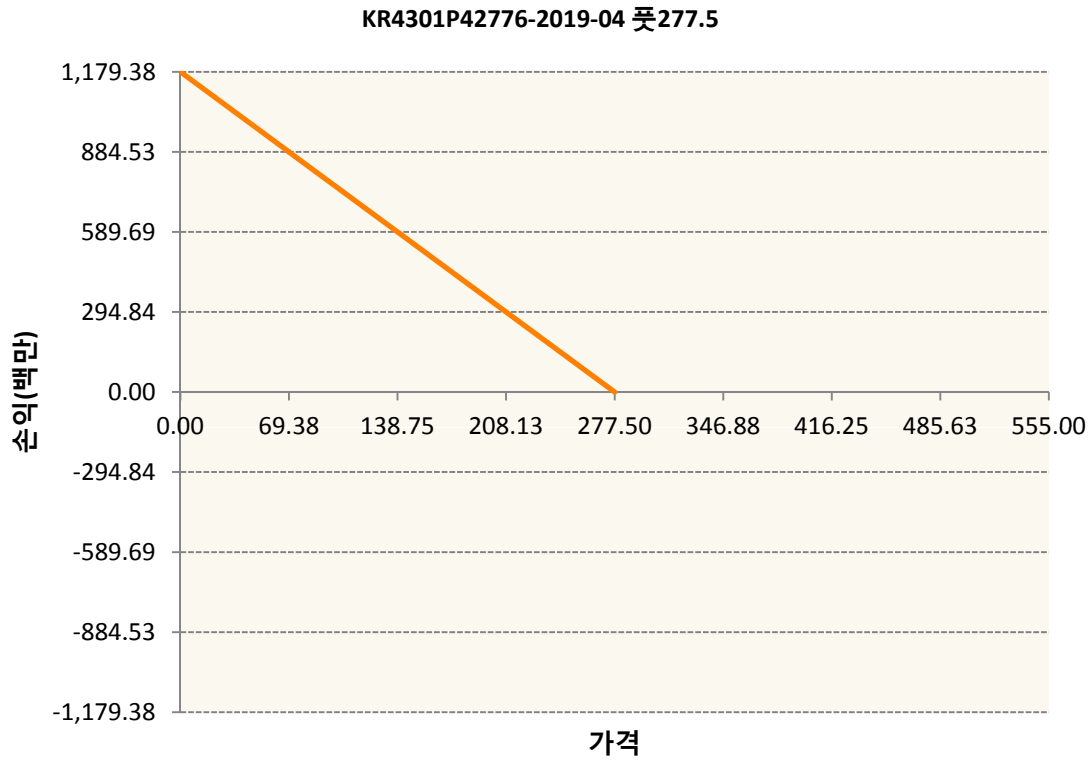
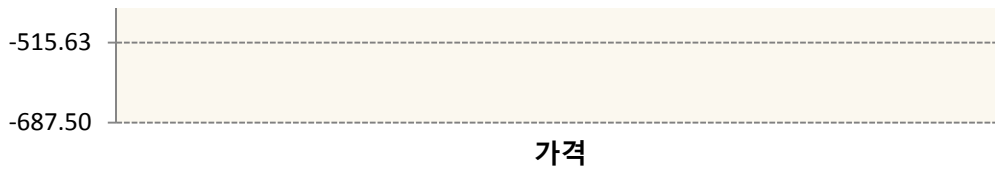


KR4201P42927-2019-04 콜292.5



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%	-676	-676	-676	-676	-676	-676	-676	
-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%	676	676	676	676	676	676	676	
8.00%	1,013	1,013	1,013	1,013	1,013	1,013	1,013	
KR4201P42901		2019-04 콜290						912
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	237	234	229	222	212	200	187	
-5.33%	227	217	205	189	172	152	129	
-2.67%	192	171	148	122	94	64	33	

0%	106	72	36	0	-37	-75	-114
2.67%	-64	-106	-149	-191	-234	-277	-320
5.33%	-333	-375	-417	-459	-501	-544	-587
8.00%	-695	-728	-763	-798	-836	-874	-912
KR4201P42927 2019-04 콜292.5							195
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	45	44	43	42	40	38	35
-5.33%	43	41	39	36	33	29	24
-2.67%	37	34	29	24	18	12	5
0%	22	15	8	0	-8	-16	-25
2.67%	-10	-19	-29	-39	-48	-58	-68
5.33%	-64	-74	-84	-94	-104	-114	-125
8.00%	-141	-149	-158	-167	-176	-186	-195
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	1	2
2.67%	-5	-4	-4	-4	-3	-3	-2
5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-4	-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	74	74
-5.33%	42	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	-10	-9	-9	-8	-7	-6
5.33%	-12	-12	-12	-12	-11	-11	-10
8.00%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12

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

(단위:백만원)

1,856

공시일	2019-03-19
기준일	2019-03-18

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	374	0	374	
누계	유가증권	수익증권	2,282	0	2,282	

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	2019-03-19
기준일	2019-03-18

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	7,649	0	7,649	

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	2019-03-19
기준일	2019-03-18

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,472	0	1,472	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	47,316	0	47,316	
누계	통화	선도	0	54,211	-54,211	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019F02: KRW/USD 28-03-19E	471
FX21019F02: KRW/USD 29-03-19E	24
FX21019F02: KRW/USD 29-03-19E	72
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	54
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E	106
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E	106
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E	43
FX21019G01 KRW/USD 21-03-19E	426
FX21019G01 KRW/USD 21-03-19E	272
FX21019G02 KRW/USD 25-03-19E	137
FX21019G02 KRW/USD 25-03-19E	480
FX21019G03 KRW/USD 28-03-19E	254
FX21019G03 KRW/USD 28-03-19E	118
FX21019G03 KRW/USD 29-03-19E	335
FX21019G04 KRW/USD 10-04-19E	72
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	145
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	118
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	206

FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E

254

FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E

154

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

(단위:백만원)

1,509

공시일	2019-03-19
기준일	2019-03-18

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

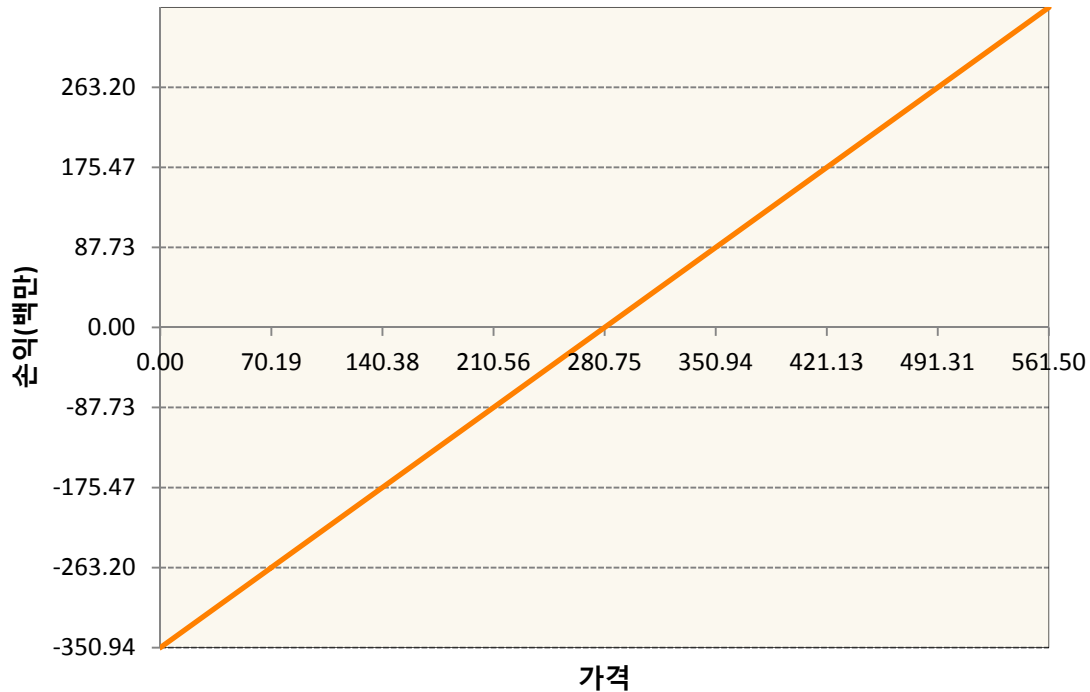
1. 계약금액

(단위:백만원)

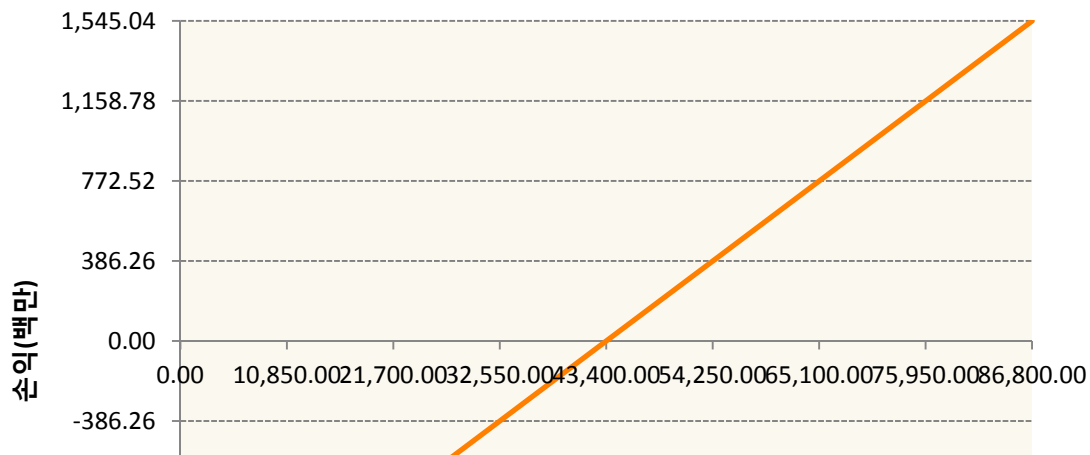
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,896	0	1,896	장내

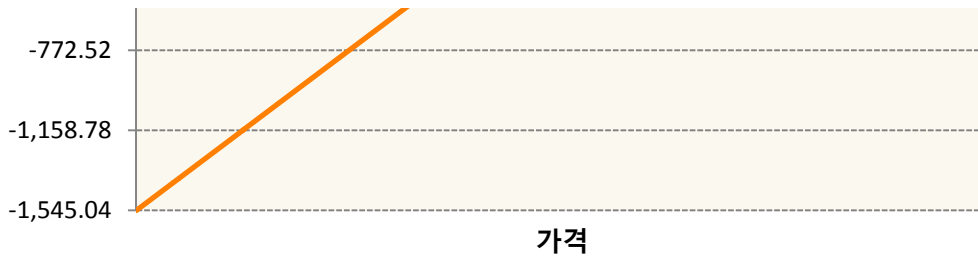
2. 만기시점의 손익구조

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						124
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124	
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83	
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	41	41	41	41	41	41	41	
5.33%	83	83	83	83	83	83	83	
8.00%	124	124	124	124	124	124	124	

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

168

공시일	2019-03-19
기준일	2019-03-18

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

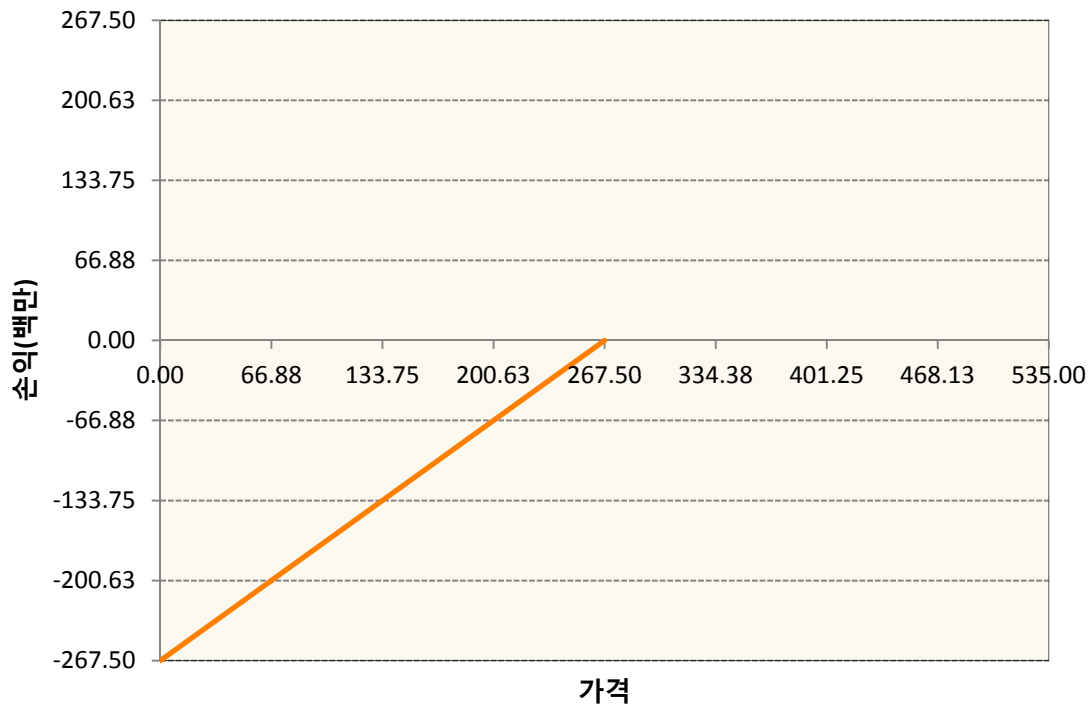
1. 계약금액

(단위:백만원)

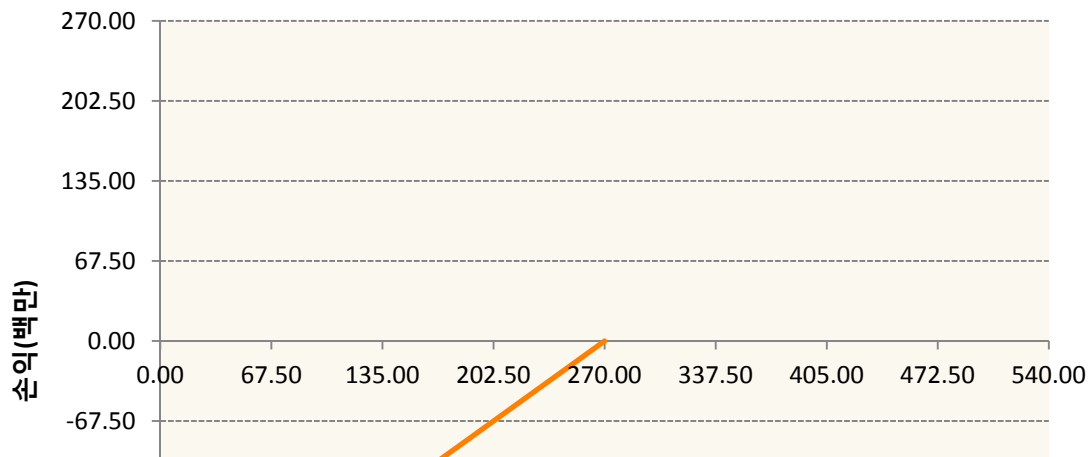
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	538	-538	장내

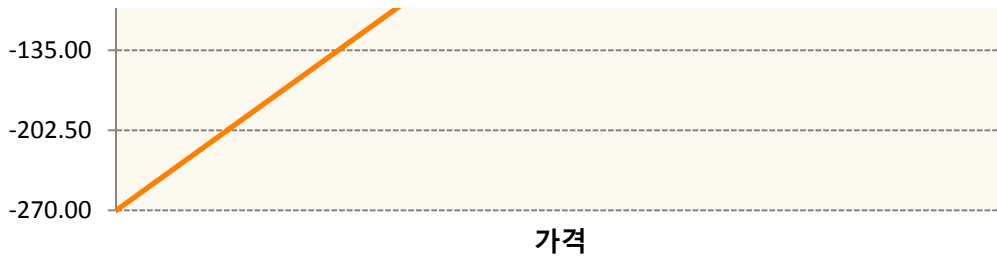
2. 만기시점의 손익구조

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	-4	-5	-5	-5	-6
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-2	-2	-2
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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)

17

공시일	2019-03-19
기준일	2019-03-18

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

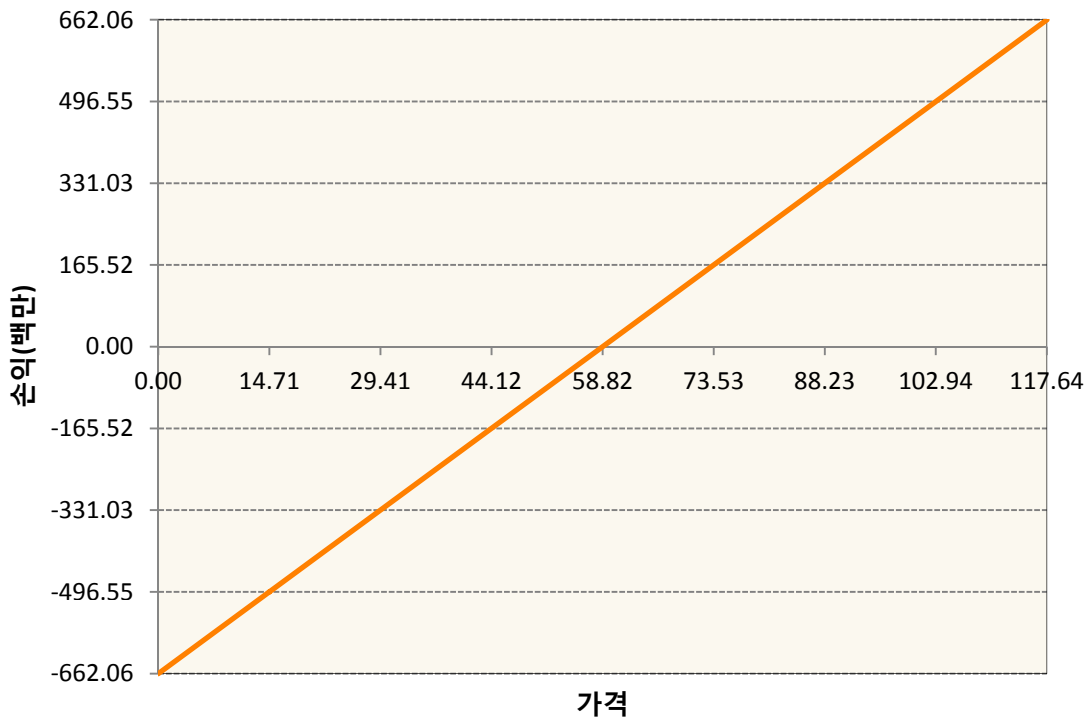
1. 계약금액

(단위:백만원)

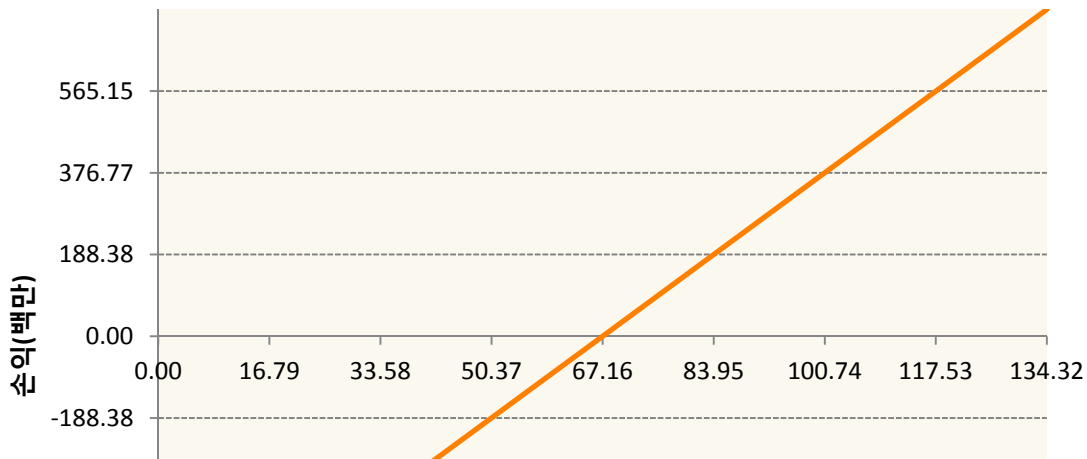
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,862	283	2,580	

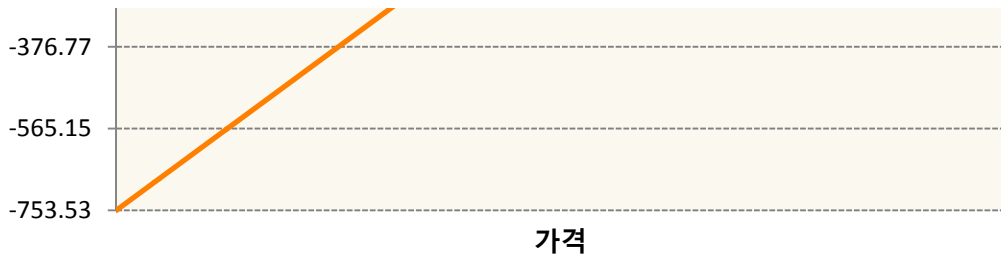
2. 만기시점의 손익구조

CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19

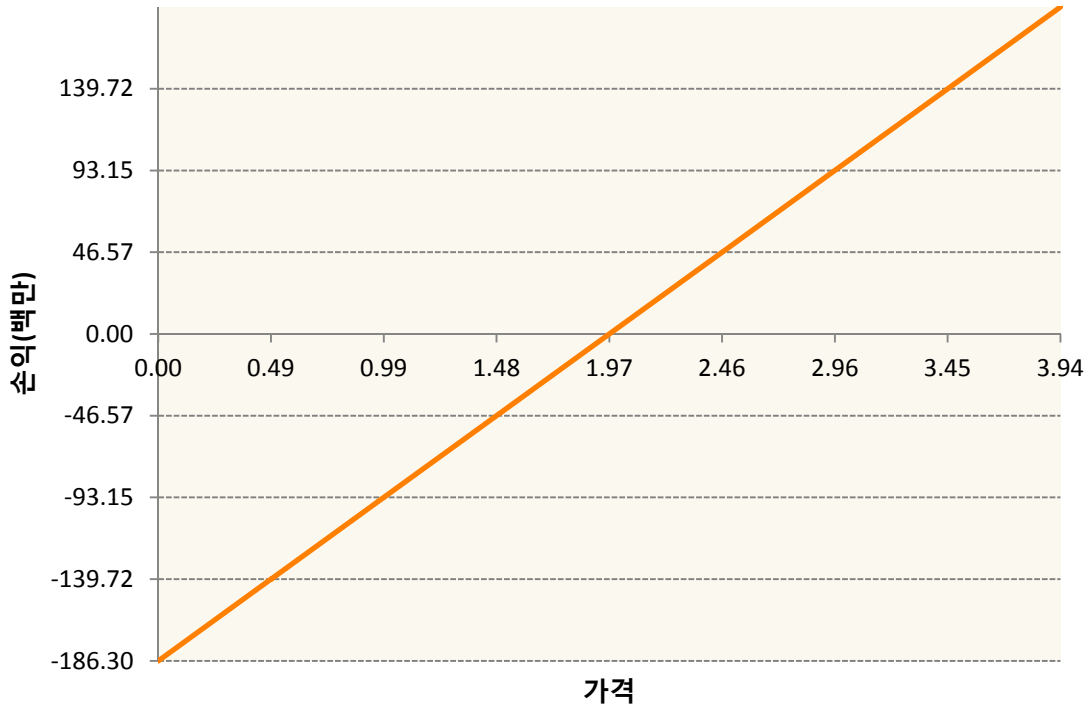


COK9-BRENT CRUDE FUTR May19

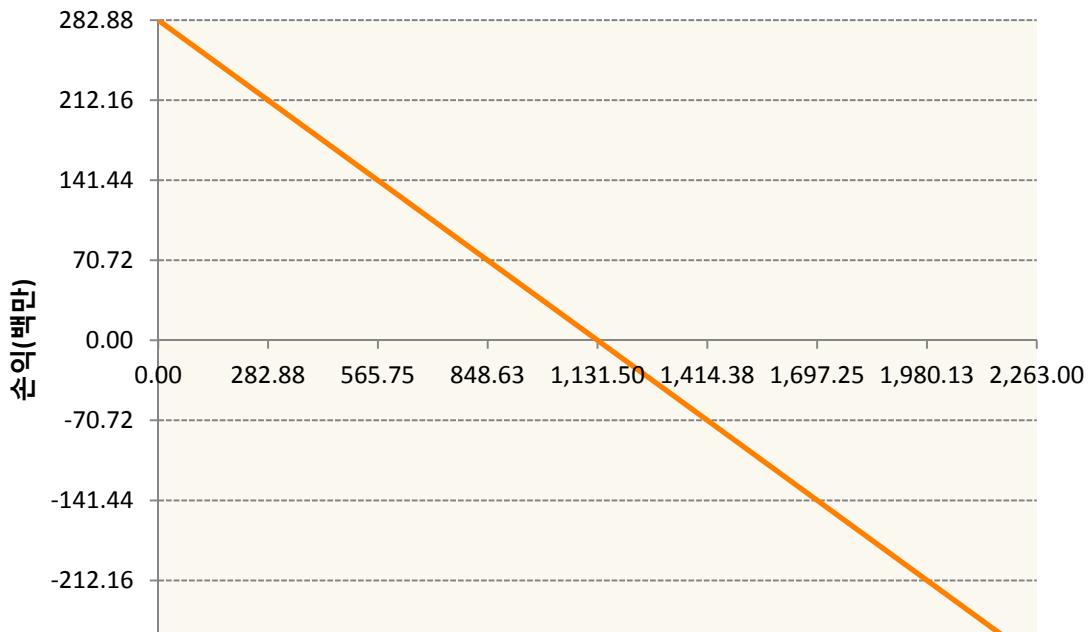


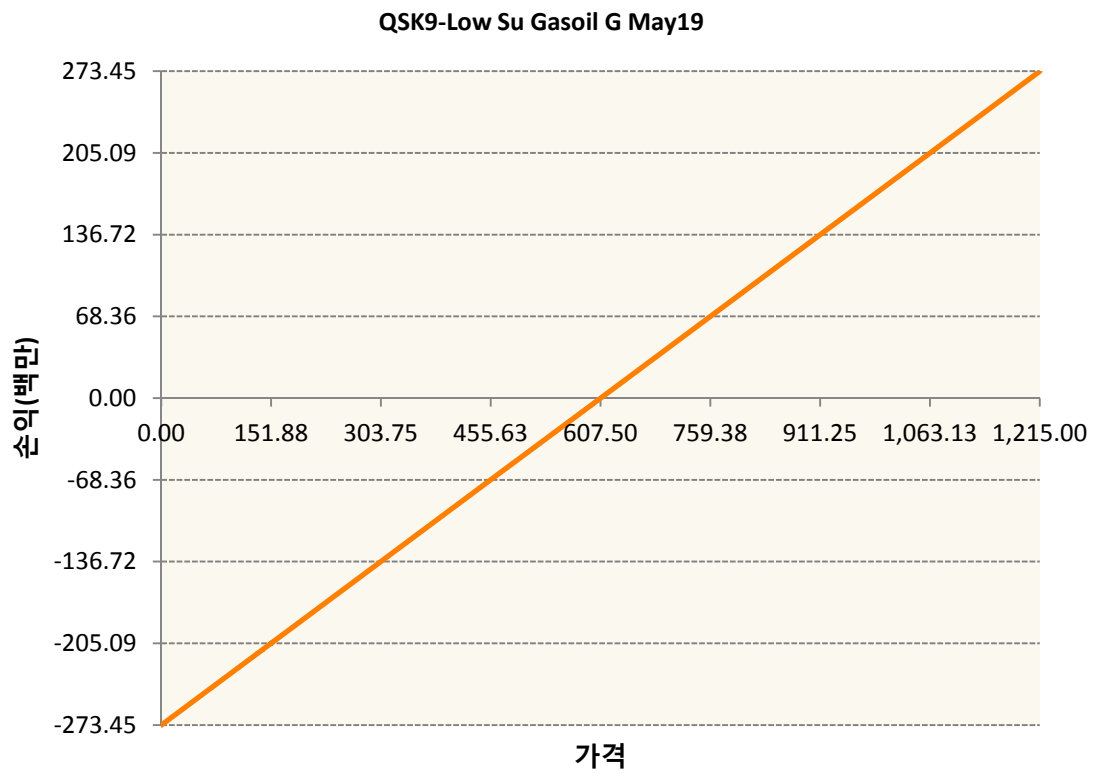
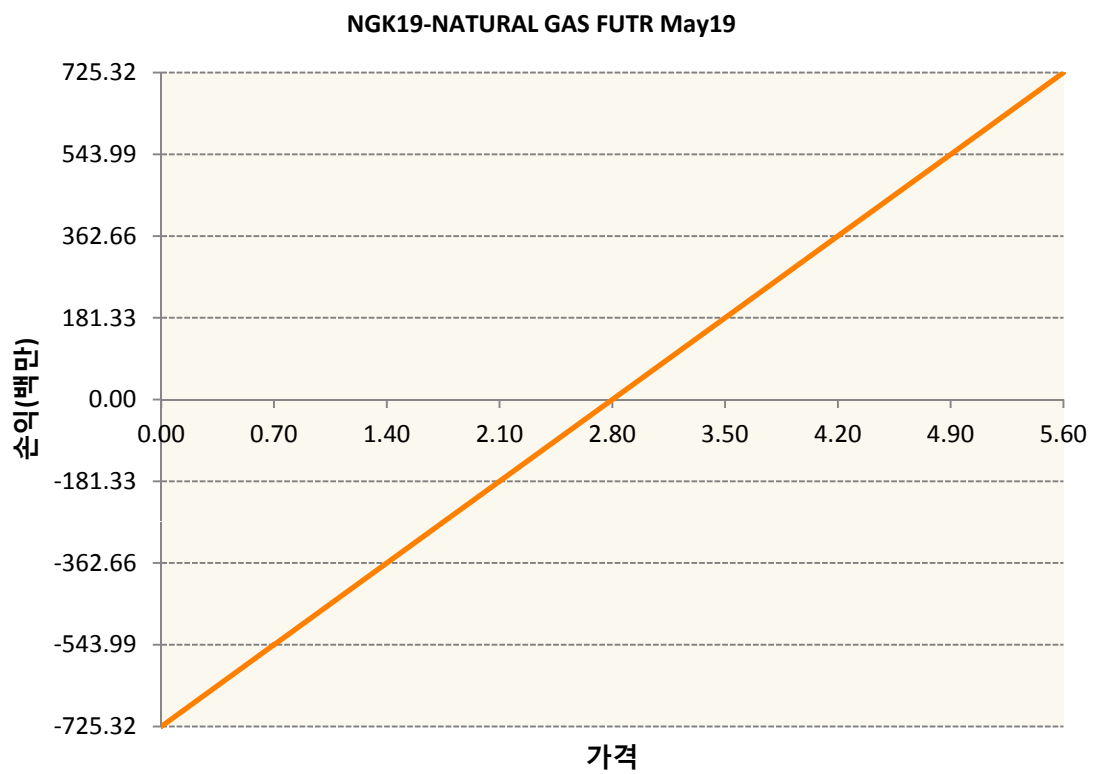
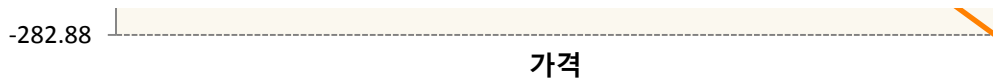


HOK9-NY Harb ULSD Fut May19

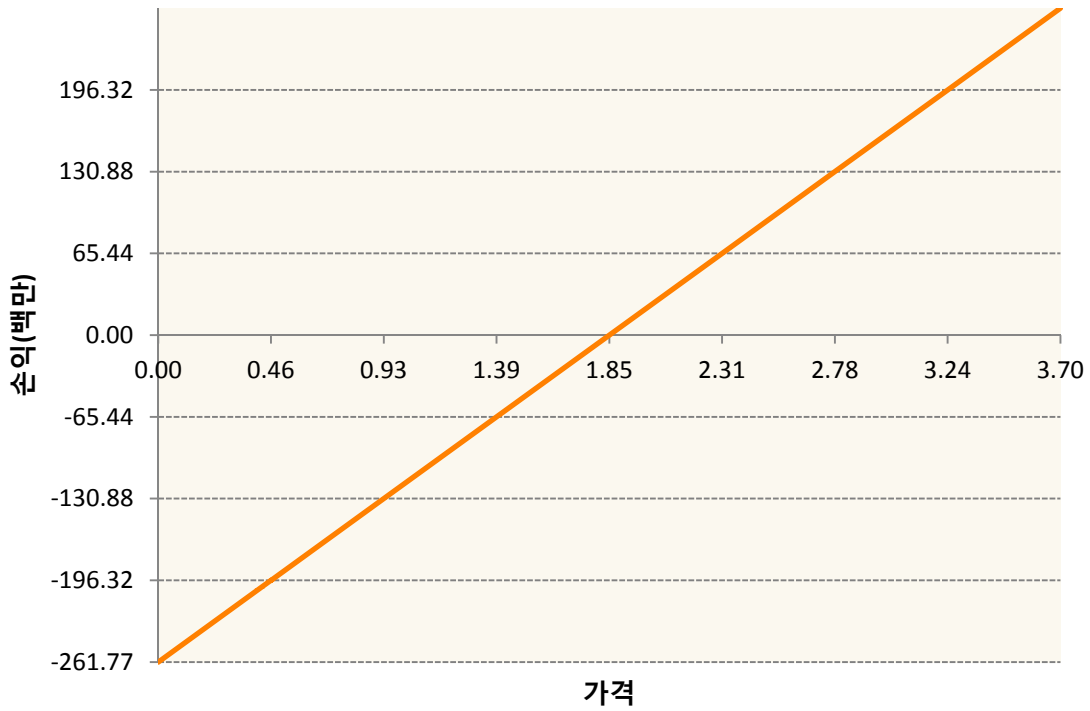


KR4175P40000-2019-04 달러선물





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	58
QSK9	Low Su Gasoil G May19	22
XBK9	GASOLINE RBOB FUT May19	21

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

(단위:백만원)

436

공시일	2019-03-19
기준일	2019-03-18

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

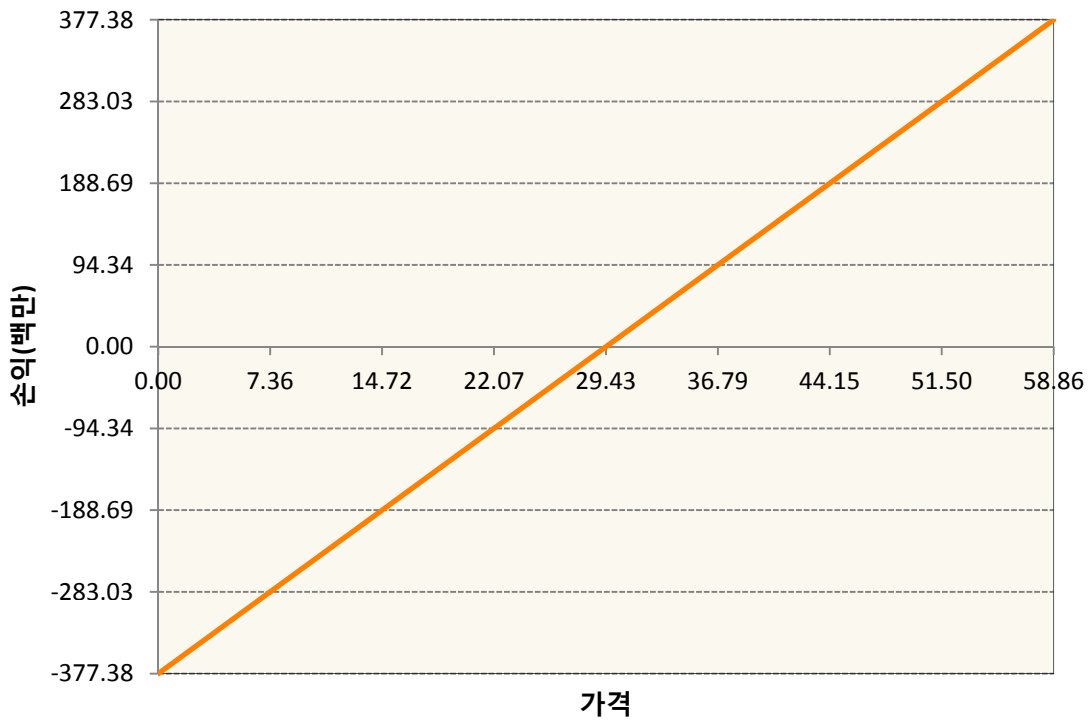
1. 계약금액

(단위:백만원)

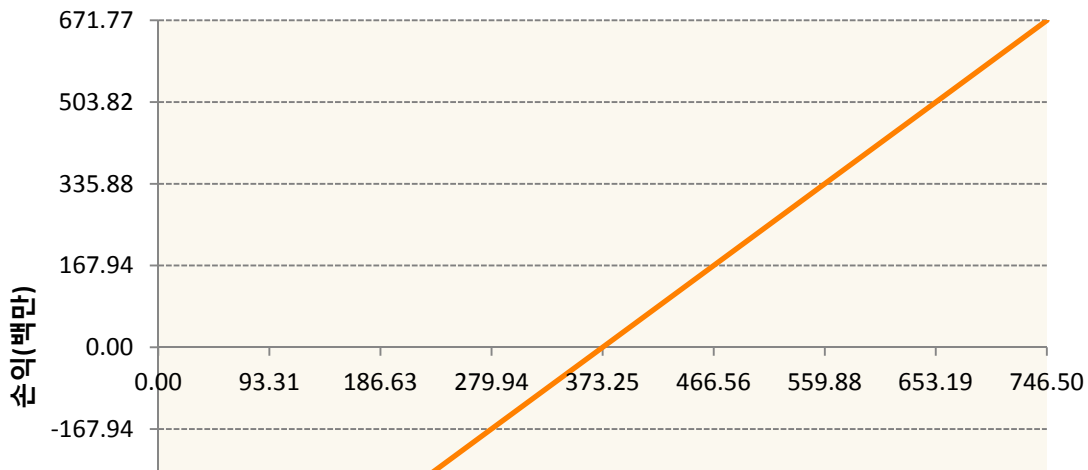
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,392	79	3,313	

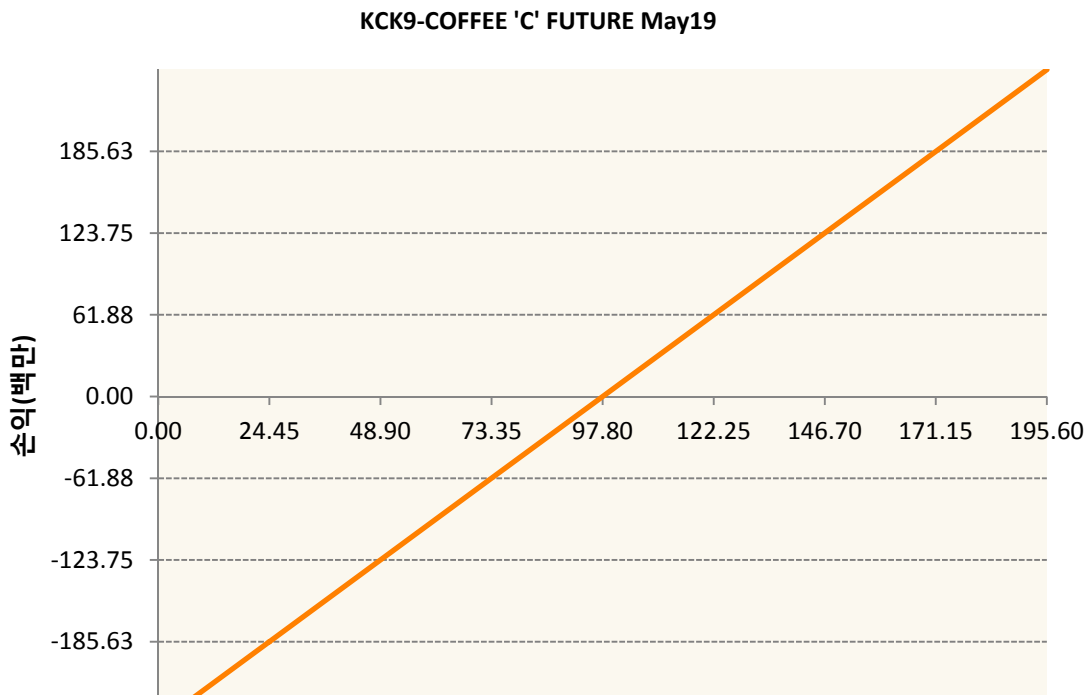
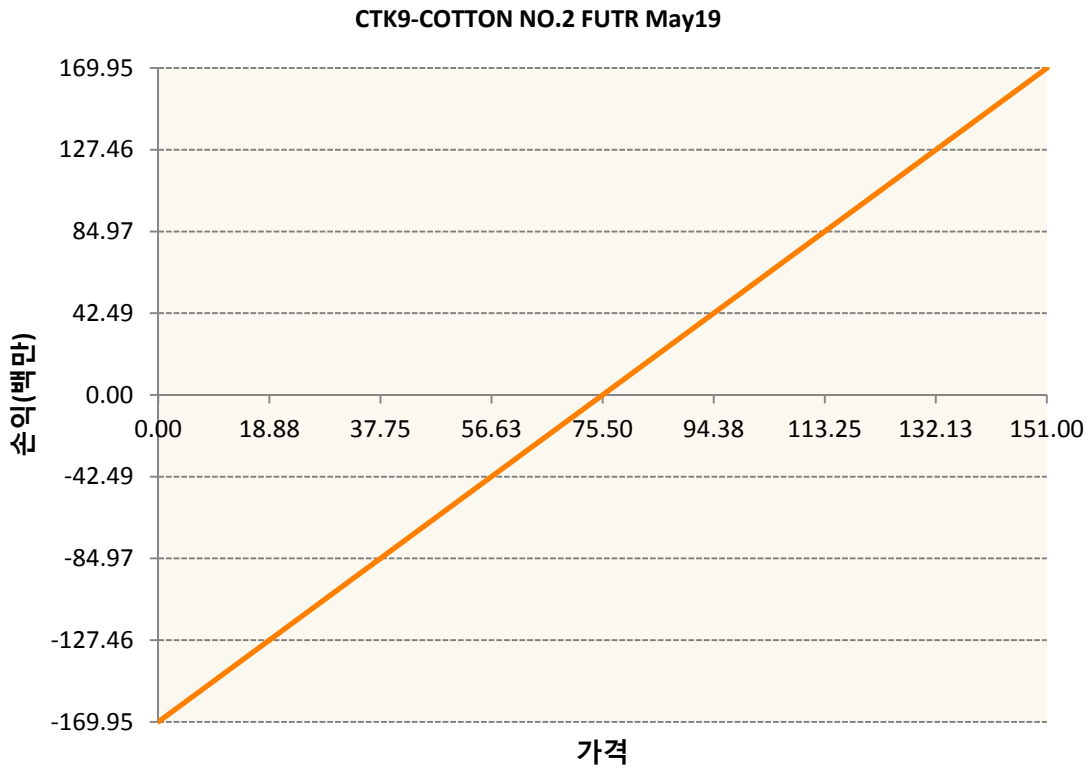
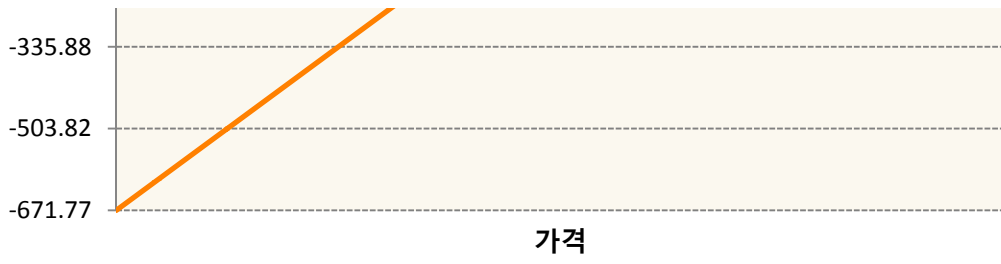
2. 만기시점의 손익구조

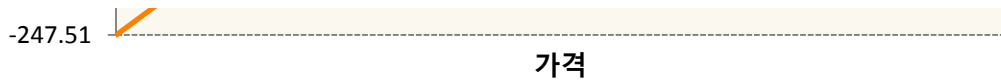
BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19



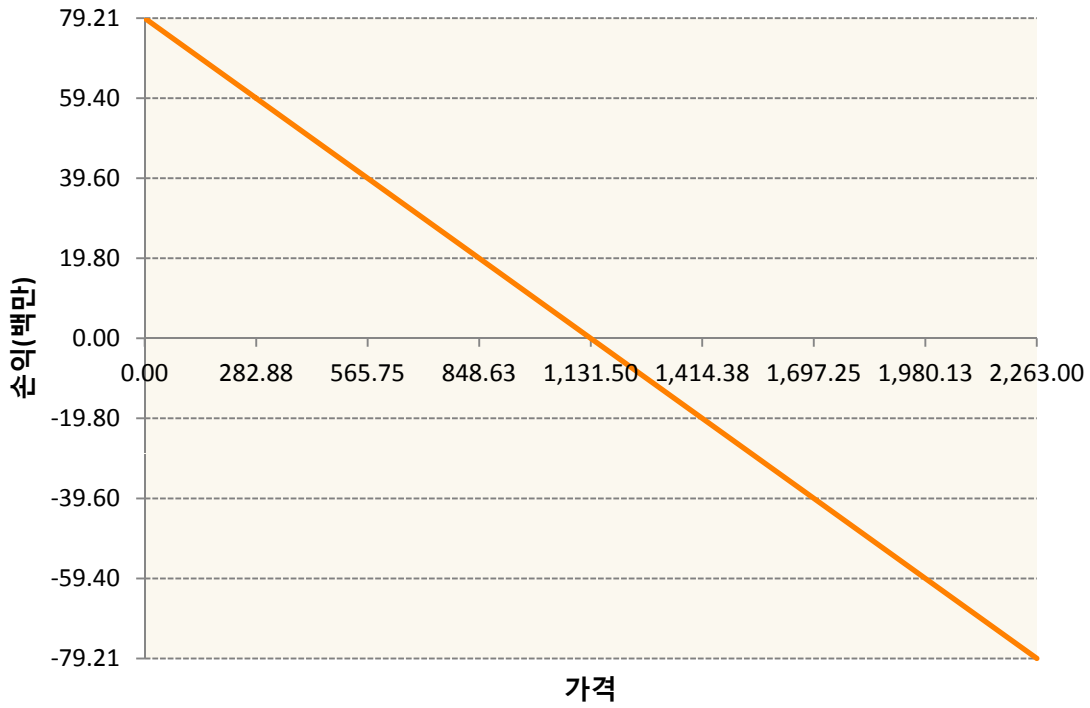
CK9-CORN FUTURE May19



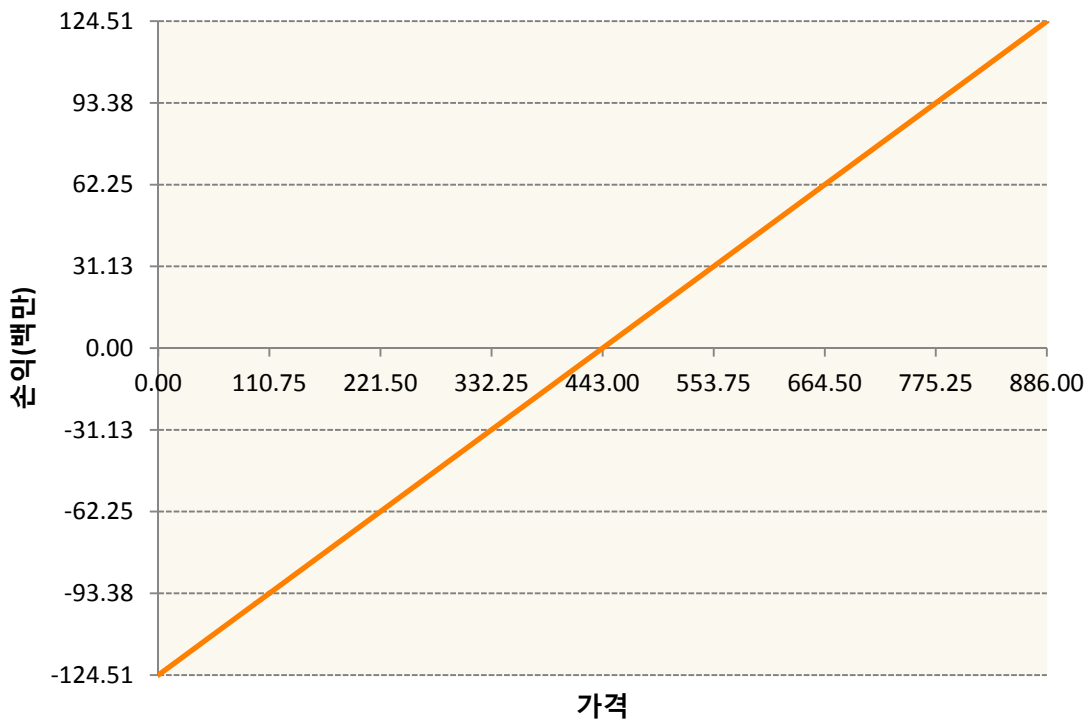




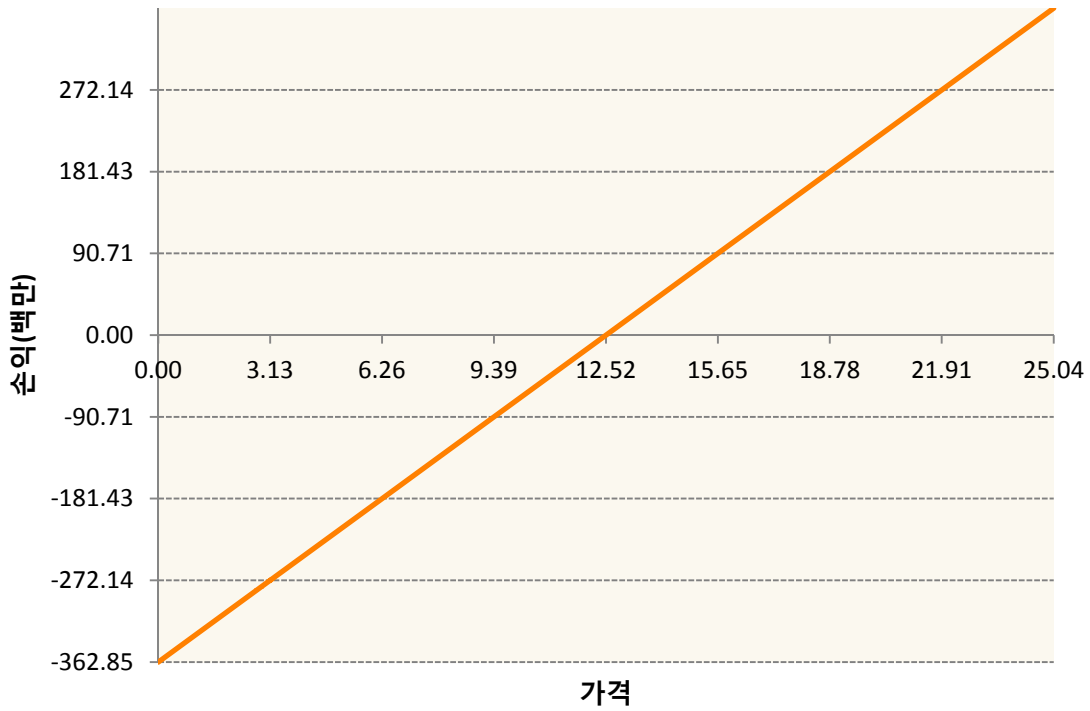
KR4175P40000-2019-04 달러선물



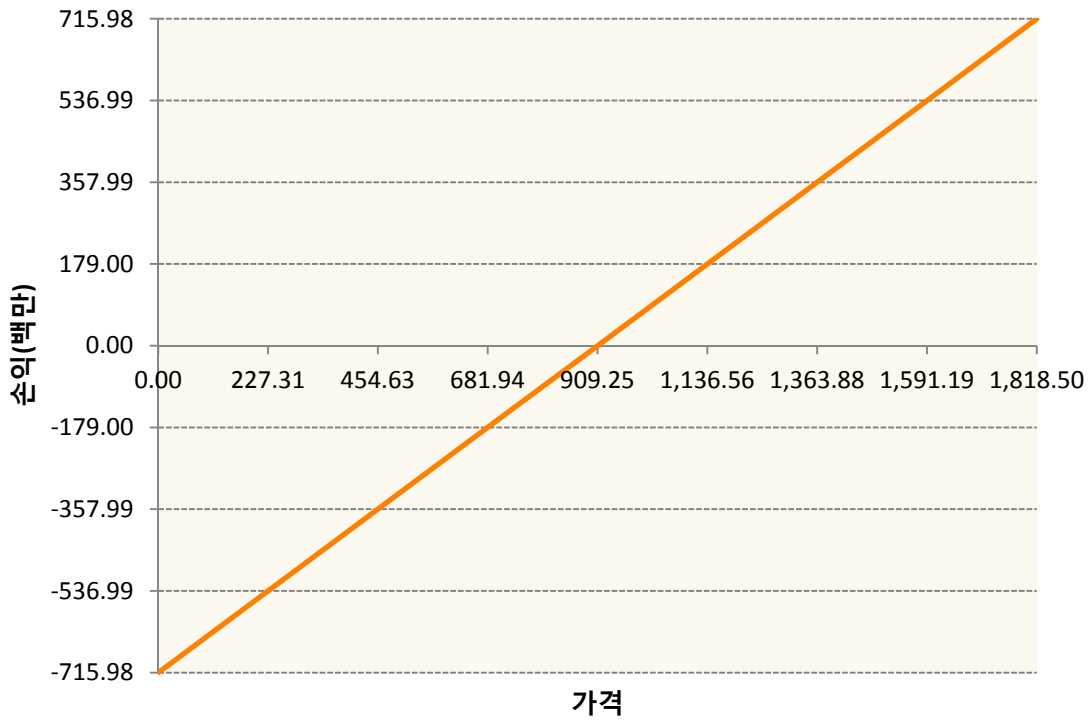
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

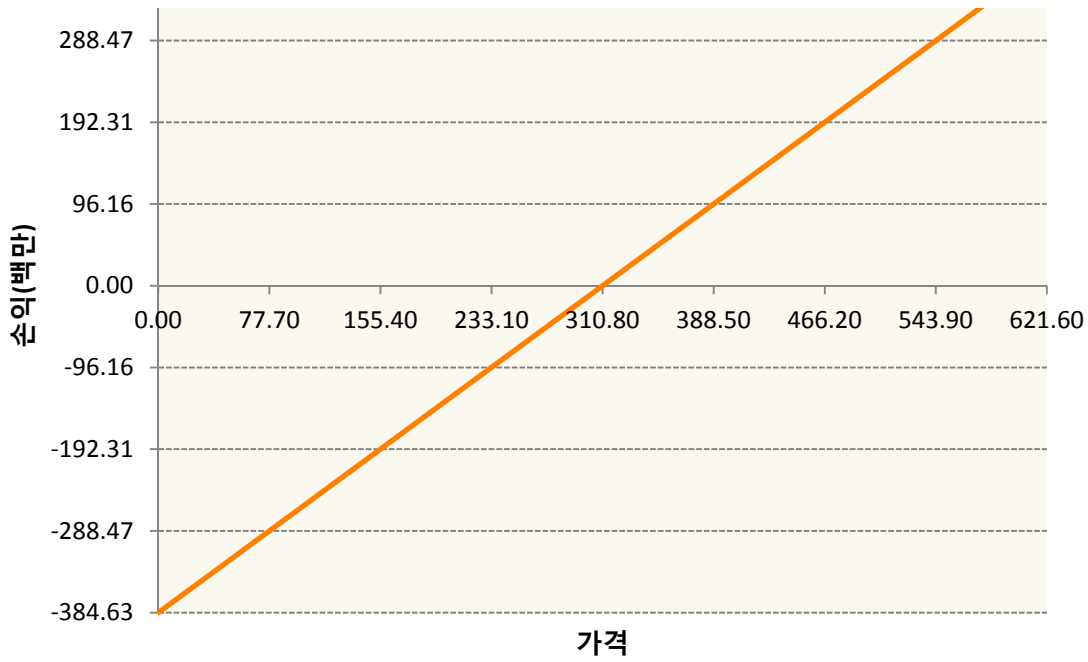


SK9-SOYBEAN FUTURE May19

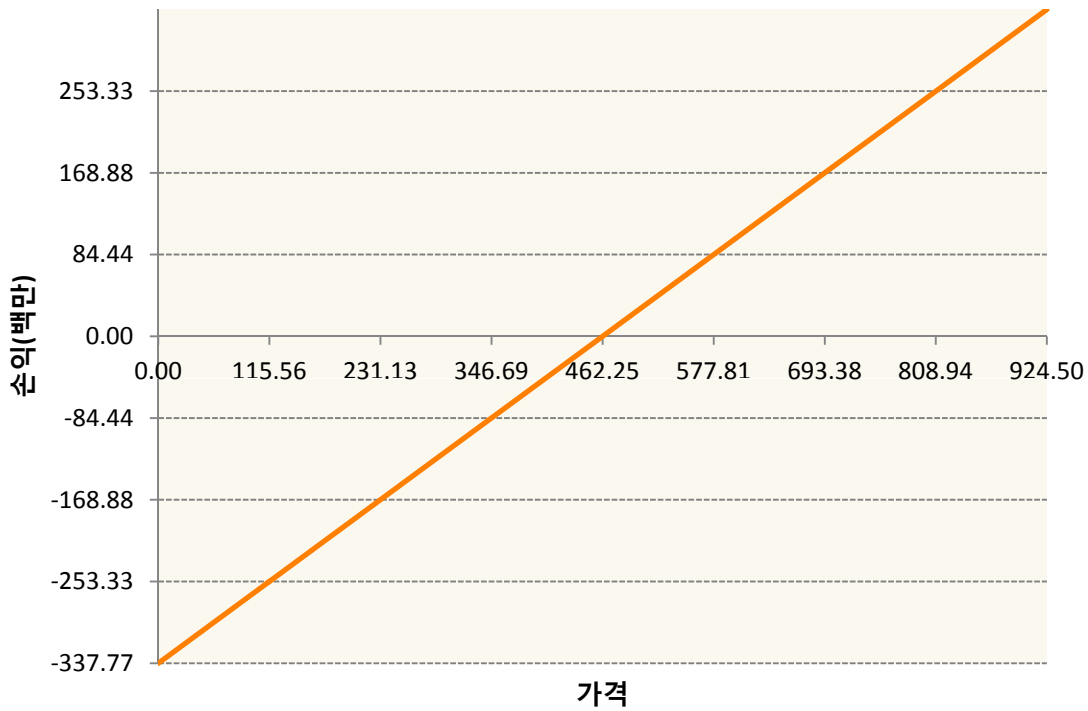


SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





WK9-WHEAT FUTURE(CBT) May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK9	SOYBEAN OIL FUTR May19	30
CK9	CORN FUTURE May19	54
CTK9	COTTON NO.2 FUTR May19	14
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	31
WK9	WHEAT FUTURE(CBT) May19	27

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

(단위:백만원)

272