

공시일	2019-03-20
기준일	2019-03-19

## 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	2019-03-20
기준일	2019-03-19

## 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

1,132

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

657

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-03-20
기준일	2019-03-19

## 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)	345
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)

<b>946</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-03-20
기준일	2019-03-19

## 유로인덱스모(주식-파생형)

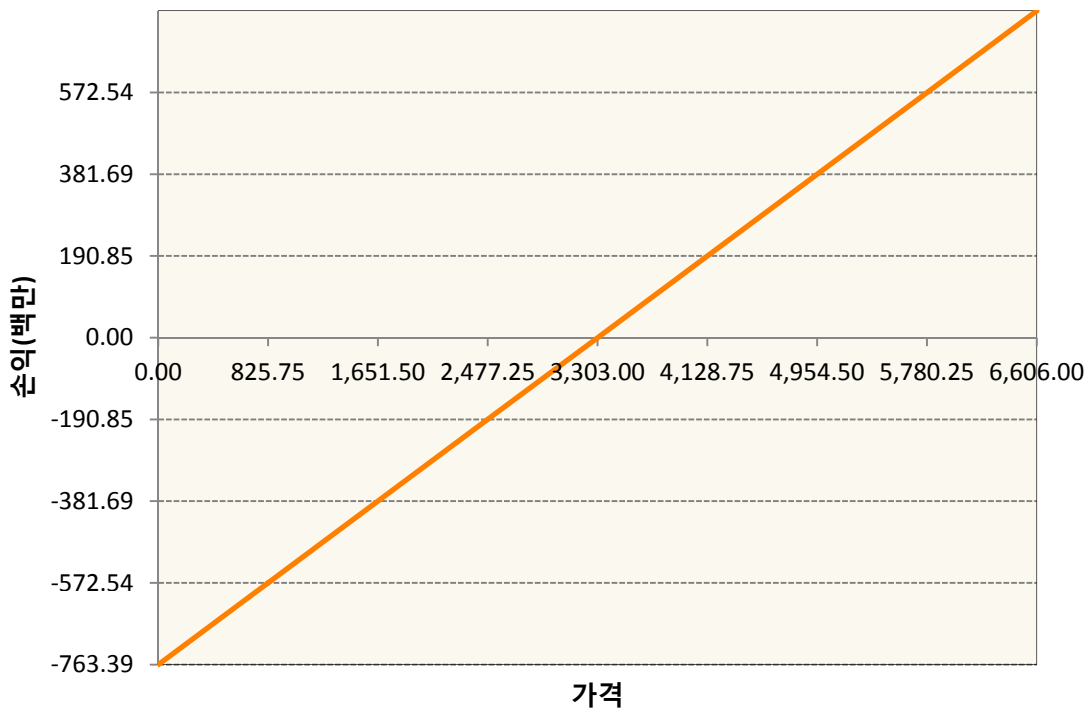
### 1. 계약금액

(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	2019-03-20
기준일	2019-03-19

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

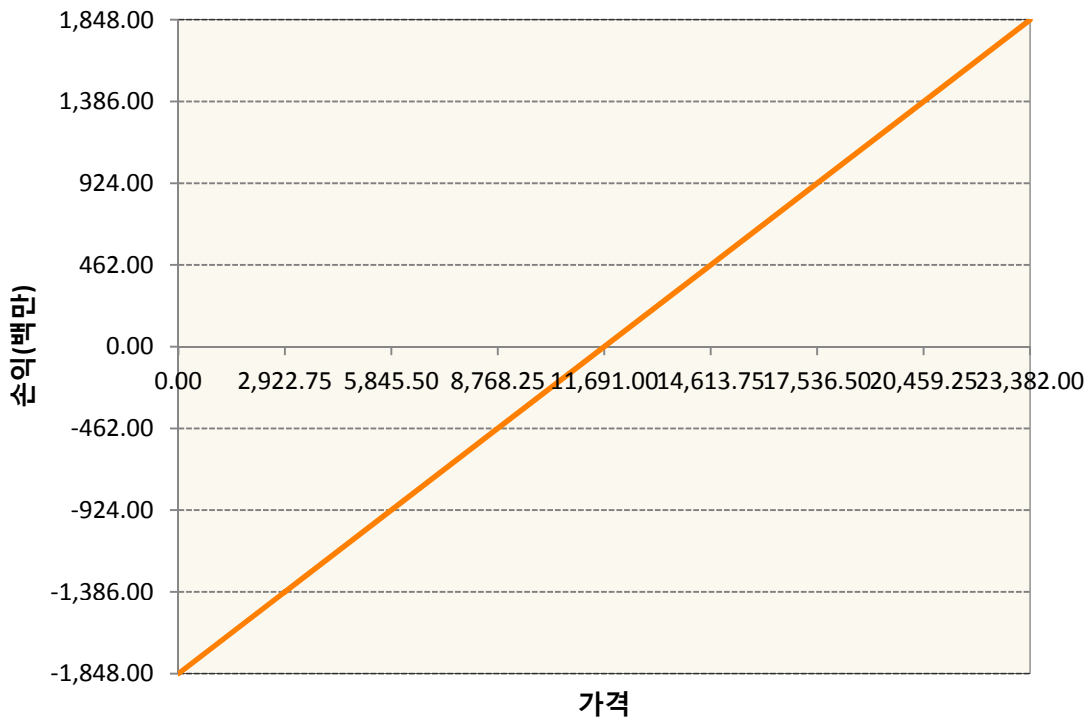
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,848	0	1,848	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	2019-03-20
기준일	2019-03-19

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

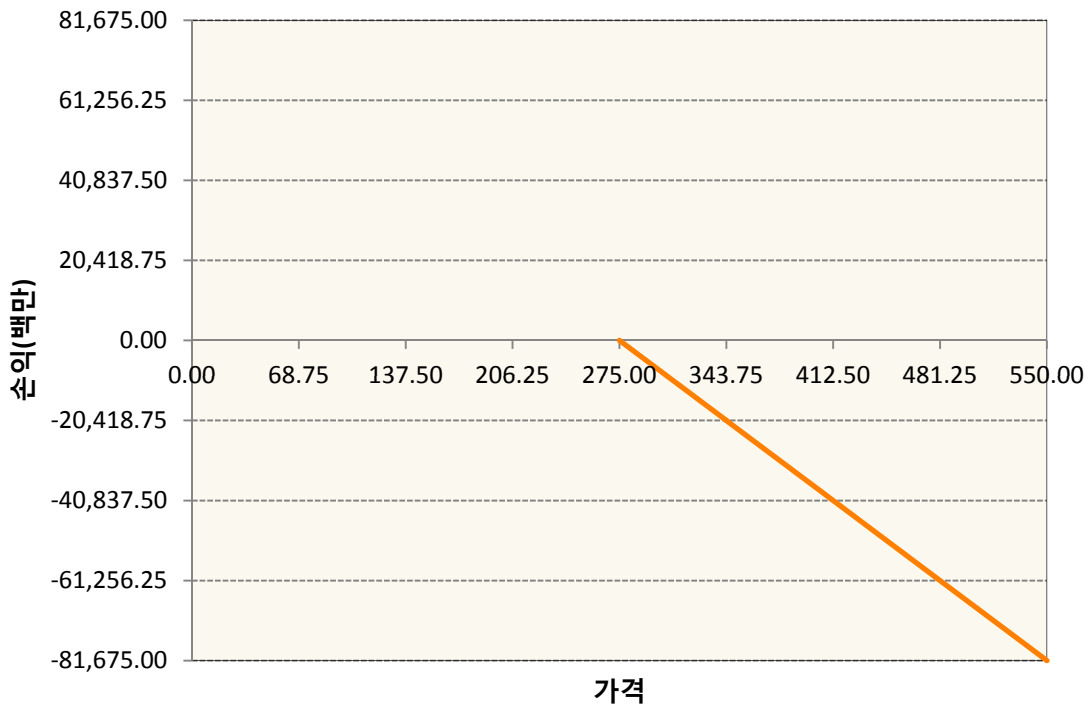
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

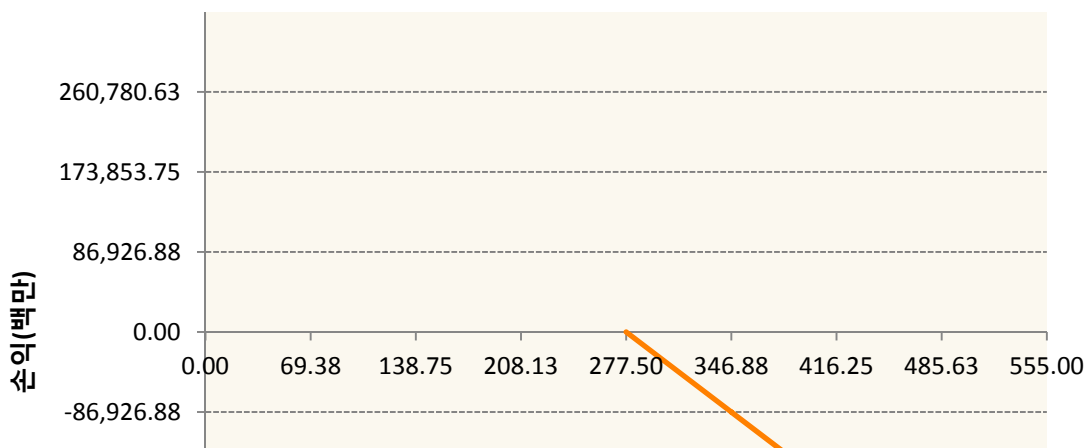
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	674,320	-674,320	장내

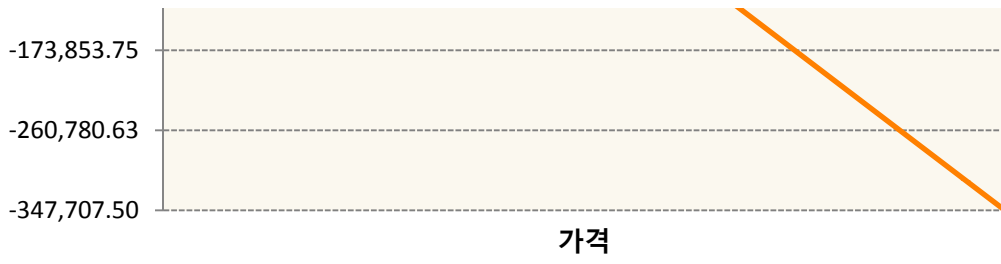
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P42752-2019-04 콜275

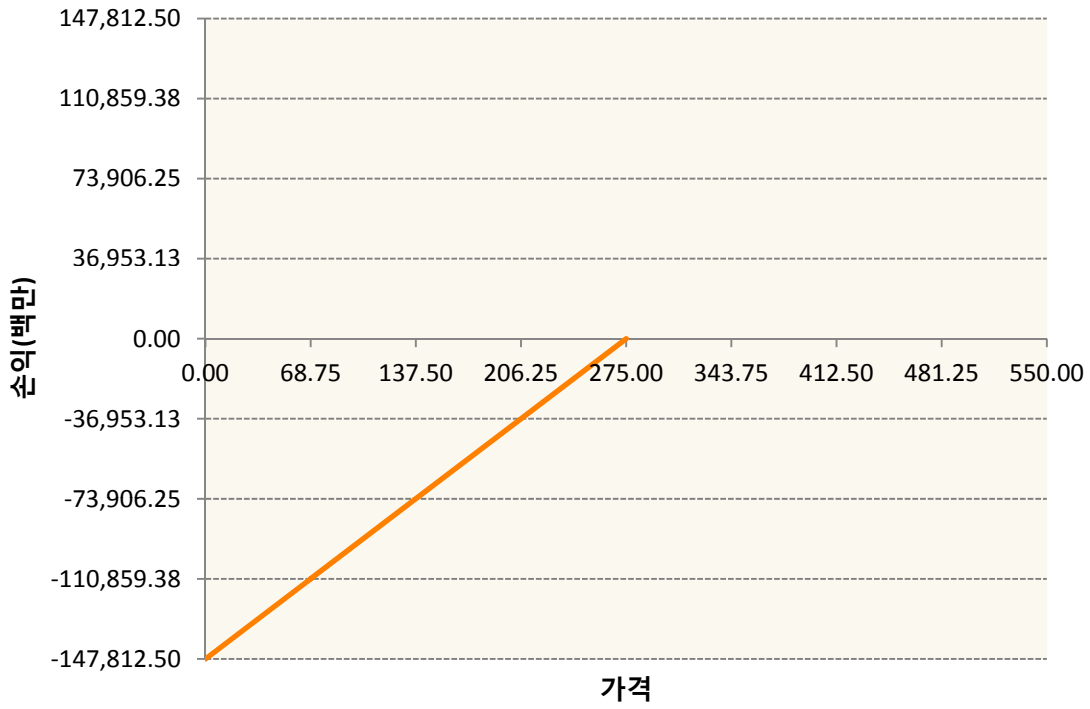


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

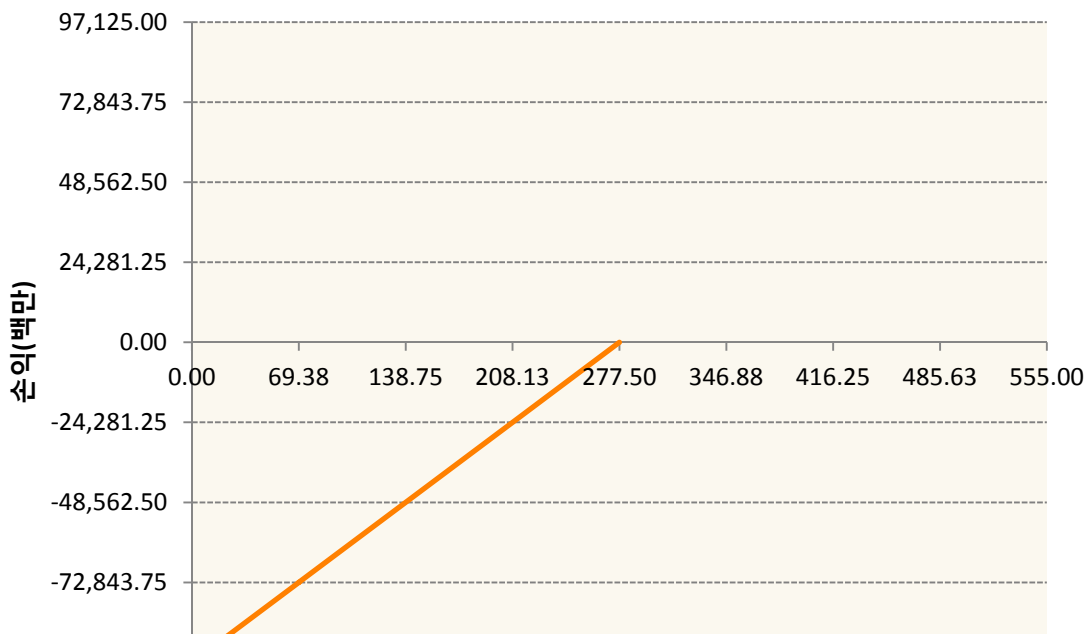




**KR4301P42750-2019-04 풋275**



**KR4301P42776-2019-04 풋277.5**



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P42752		2019-04 콜275						5,554
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,760	2,685	2,598	2,500	2,393	2,279	2,159	
-5.33%	2,421	2,288	2,148	2,003	1,854	1,702	1,547	
-2.67%	1,703	1,530	1,357	1,183	1,008	834	659	
0%	513	343	172	0	-173	-347	-522	
2.67%	-1,118	-1,245	-1,381	-1,524	-1,672	-1,824	-1,979	
5.33%	-3,057	-3,133	-3,221	-3,321	-3,431	-3,549	-3,674	
8.00%	-5,165	-5,201	-5,249	-5,309	-5,381	-5,463	-5,554	
KR4201P42778		2019-04 콜277.5						22,522
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	10,106	9,855	9,551	9,199	8,806	8,377	7,917	
-5.33%	9,039	8,551	8,024	7,467	6,886	6,285	5,667	
-2.67%	6,596	5,898	5,191	4,478	3,759	3,037	2,312	
0%	2,250	1,501	751	0	-752	-1,505	-2,258	
2.67%	-4,042	-4,659	-5,300	-5,960	-6,636	-7,324	-8,022	
5.33%	-11,840	-12,238	-12,686	-13,178	-13,705	-14,263	-14,845	
8.00%	-20,536	-20,741	-21,002	-21,316	-21,677	-22,081	-22,522	
KR4301P42750		2019-04 풋275						8,622
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-8,465	-8,473	-8,488	-8,509	-8,539	-8,576	-8,622	
-5.33%	-4,573	-4,636	-4,712	-4,797	-4,893	-4,995	-5,105	
-2.67%	-1,339	-1,496	-1,655	-1,815	-1,977	-2,139	-2,303	
0%	435	294	149	0	-152	-307	-464	
2.67%	948	899	838	765	682	590	489	
5.33%	1,019	1,011	999	979	951	916	871	
8.00%	1,023	1,022	1,021	1,018	1,012	1,003	989	
KR4301P42776		2019-04 풋277.5						6,127
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-6,064	-6,066	-6,071	-6,079	-6,091	-6,107	-6,127	
-5.33%	-3,489	-3,513	-3,546	-3,585	-3,631	-3,684	-3,741	
-2.67%	-1,179	-1,265	-1,355	-1,448	-1,543	-1,641	-1,740	
0%	323	216	108	0	-109	-218	-327	
2.67%	876	825	766	700	629	552	472	

5.33%	977	966	951	929	900	866	825
8.00%	985	984	982	978	971	960	946

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

(단위:백만원)

**43,079**

공시일	2019-03-20
기준일	2019-03-19

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

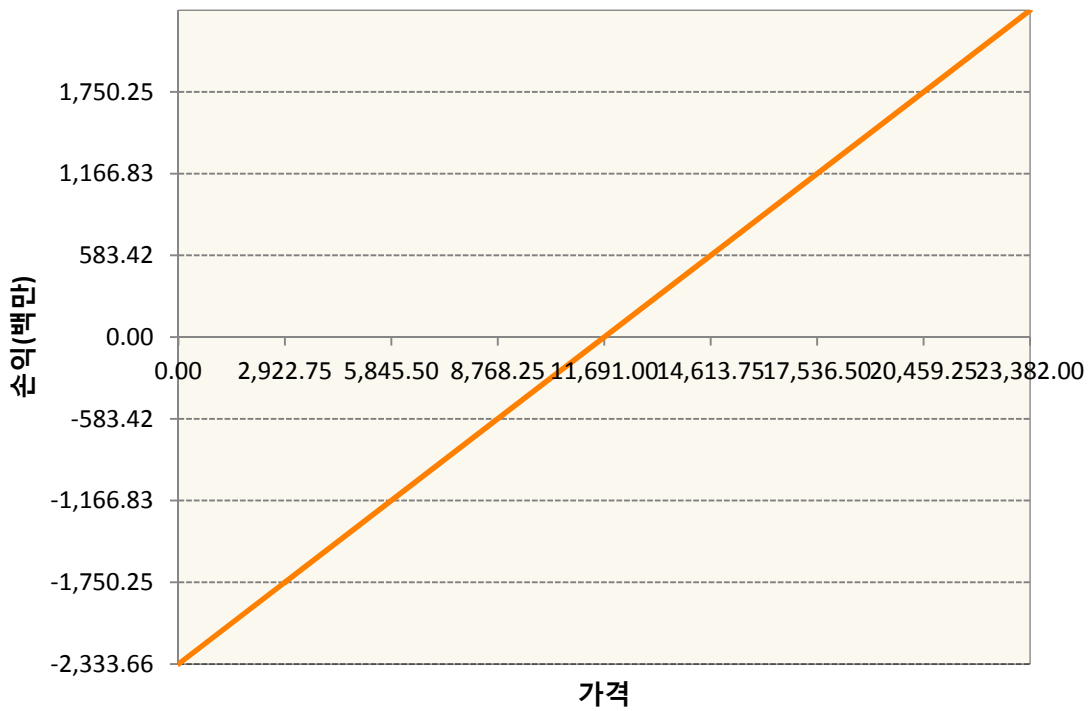
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

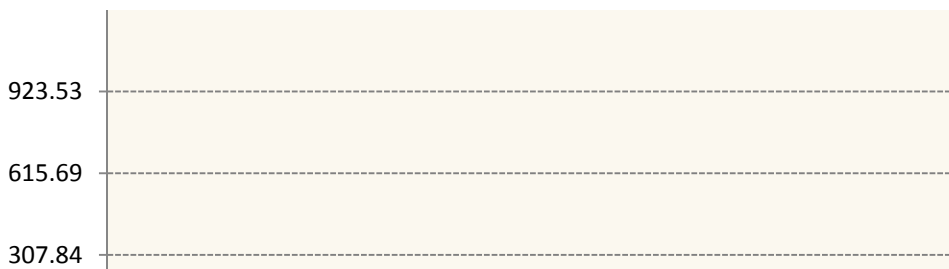
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,334	0	2,334	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,941	-5,941	장내
누계	통화	선도	0	3,024	-3,024	장외

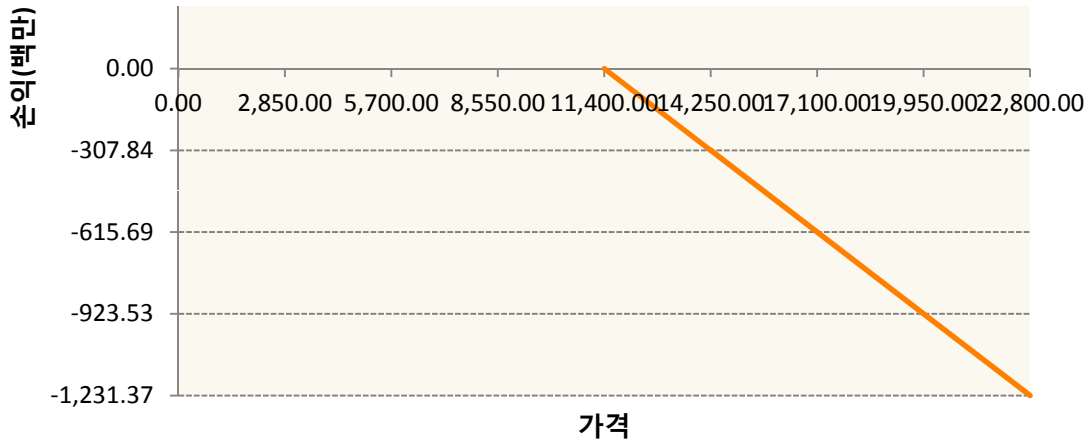
### 2. 만기시점의 손익구조

HCH9-HSCEI Futures Mar19

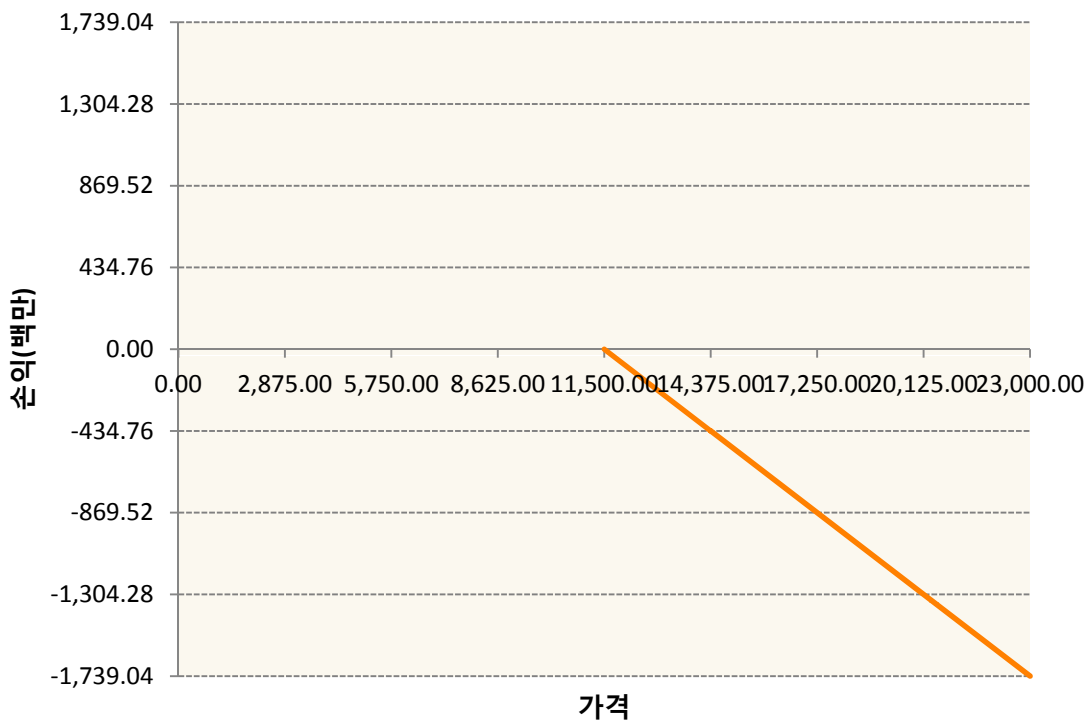


OHHIH9-C114-HSCEI

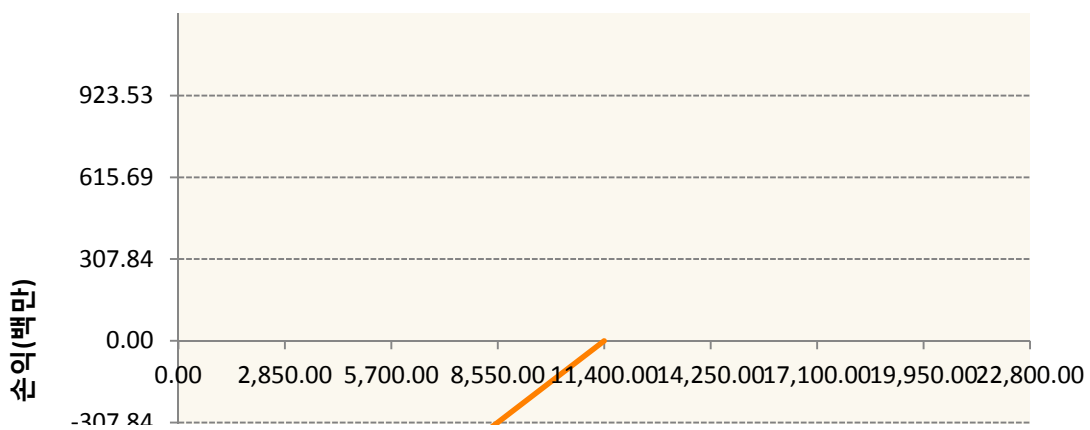


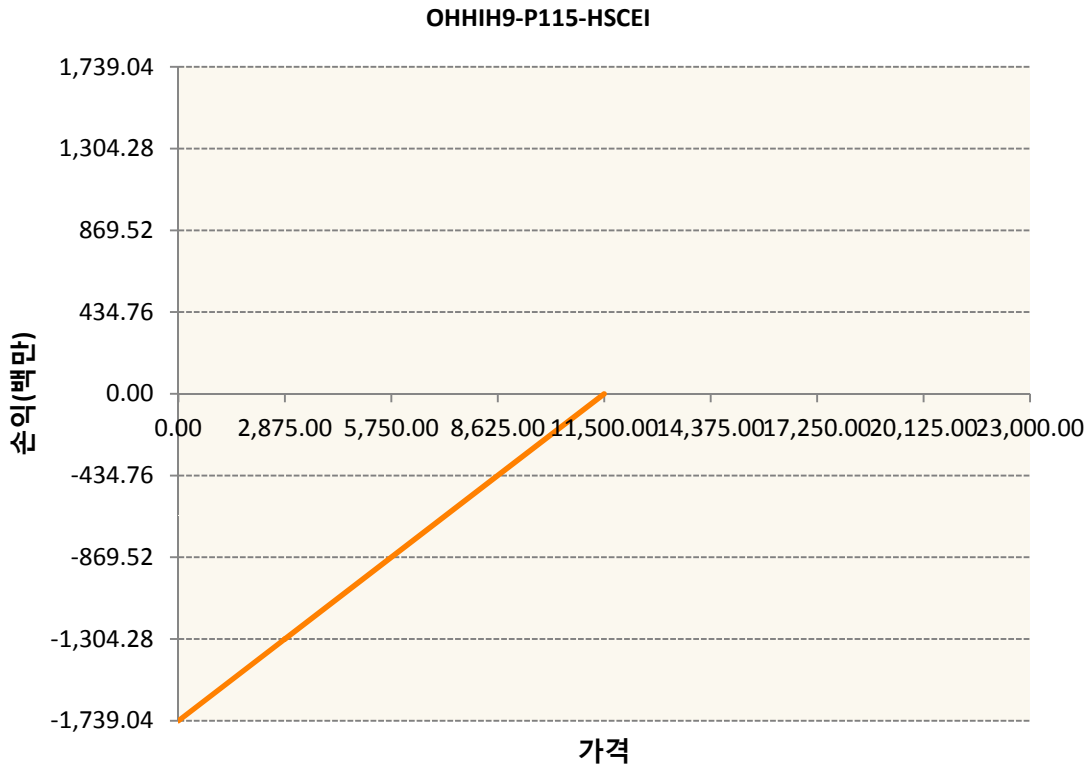


OHHIH9-C115-HSCEI



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		187
OHHIH9-C11 HSCEI		99
OHHIH9-C11 HSCEI		139
OHHIH9-P11 HSCEI		99
OHHIH9-P11 HSCEI		139

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	767

공시일	2019-03-20
기준일	2019-03-19

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

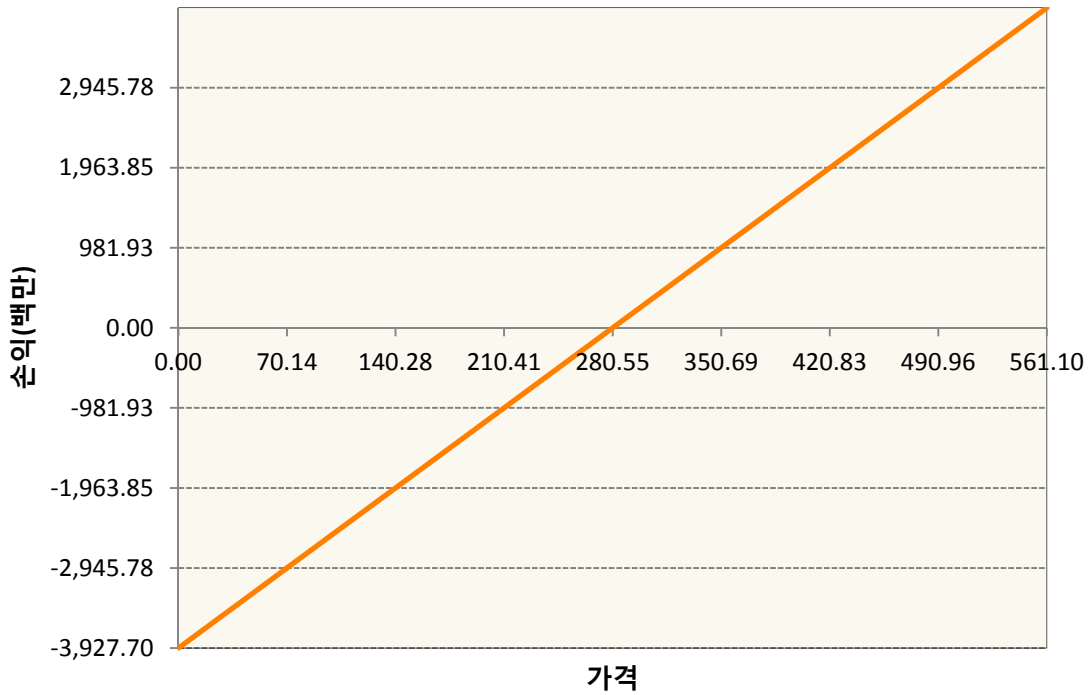
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

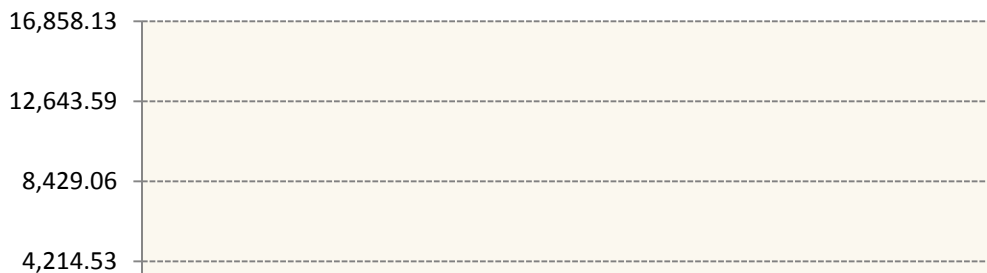
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,928	0	3,928	장내
누계	유가증권	스왑	35,836	0	35,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,649	-34,649	장내

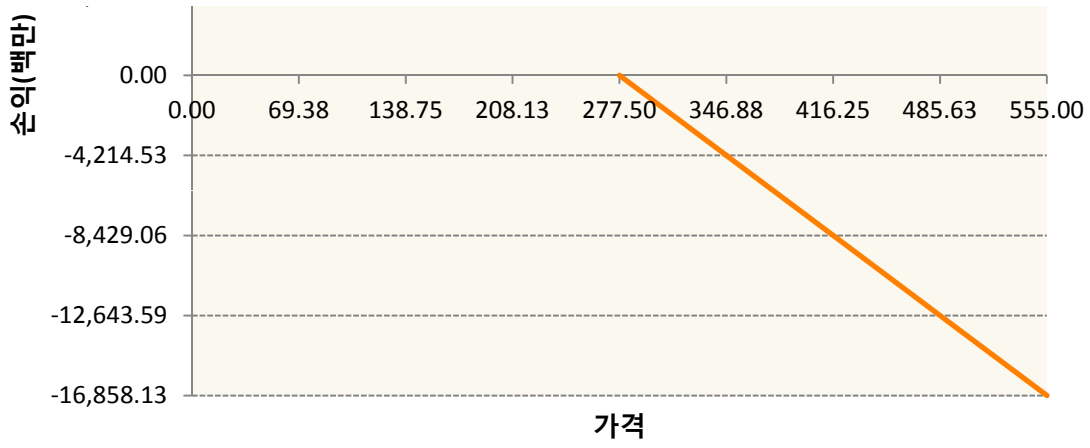
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

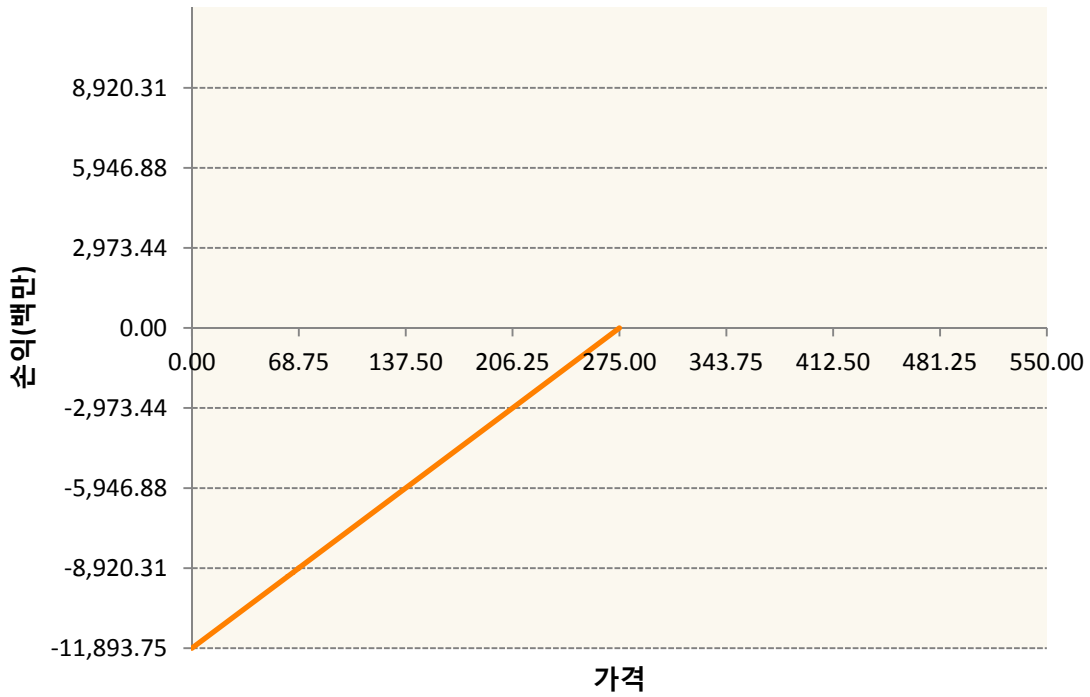


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

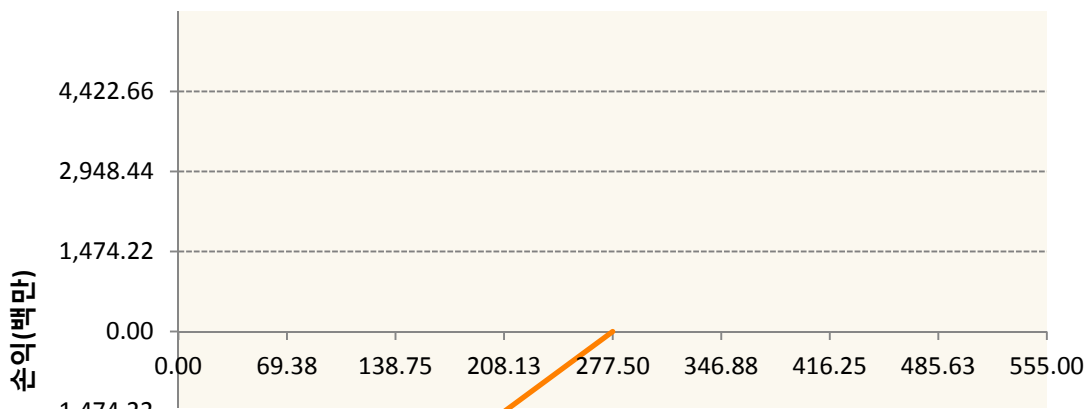


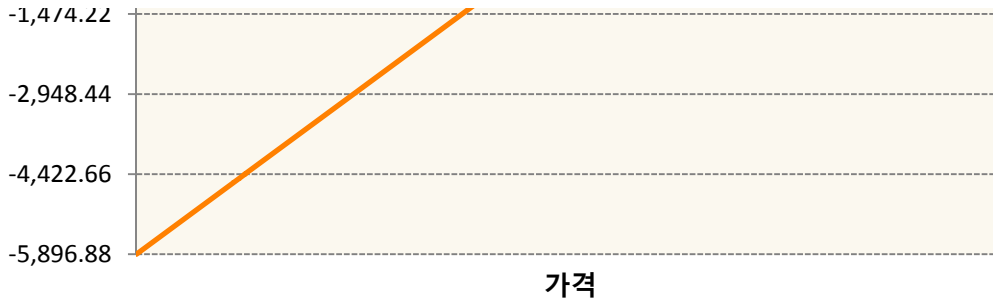


**KR4301P42750-2019-04 풋275**



**KR4301P42776-2019-04 풋277.5**





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,432
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,432	-2,432	-2,432	-2,432	-2,432	-2,432	-2,432	
-5.33%	-1,621	-1,621	-1,621	-1,621	-1,621	-1,621	-1,621	
-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%	1,621	1,621	1,621	1,621	1,621	1,621	1,621	
8.00%	2,432	2,432	2,432	2,432	2,432	2,432	2,432	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						590
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-590	-590	-590	-590	-590	-590	-590	
-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%	590	590	590	590	590	590	590	
KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						313
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313	
-5.33%	-209	-209	-209	-209	-209	-209	-209	
-2.67%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	104	104	104	104	104	104	104	
5.33%	209	209	209	209	209	209	209	
8.00%	313	313	313	313	313	313	313	
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%	490	478	463	446	427	406	384
-5.33%	438	415	389	362	334	305	275
-2.67%	320	286	252	217	182	147	112
0%	109	73	36	0	-36	-73	-109
2.67%	-196	-226	-257	-289	-322	-355	-389
5.33%	-574	-593	-615	-639	-664	-692	-720
8.00%	-996	-1,006	-1,018	-1,033	-1,051	-1,071	-1,092

KR4301P42750                      2019-04 풋275    694

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-681	-682	-683	-685	-687	-690	-694
-5.33%	-368	-373	-379	-386	-394	-402	-411
-2.67%	-108	-120	-133	-146	-159	-172	-185
0%	35	24	12	0	-12	-25	-37
2.67%	76	72	67	62	55	47	39
5.33%	82	81	80	79	77	74	70
8.00%	82	82	82	82	81	81	80

KR4301P42776                      2019-04 풋277.5    372

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-368	-368	-369	-369	-370	-371	-372
-5.33%	-212	-213	-215	-218	-220	-224	-227
-2.67%	-72	-77	-82	-88	-94	-100	-106
0%	20	13	7	0	-7	-13	-20
2.67%	53	50	47	43	38	34	29
5.33%	59	59	58	56	55	53	50
8.00%	60	60	60	59	59	58	57

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

(단위:백만원)

**5,459**

공시일	2019-03-20
기준일	2019-03-19

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

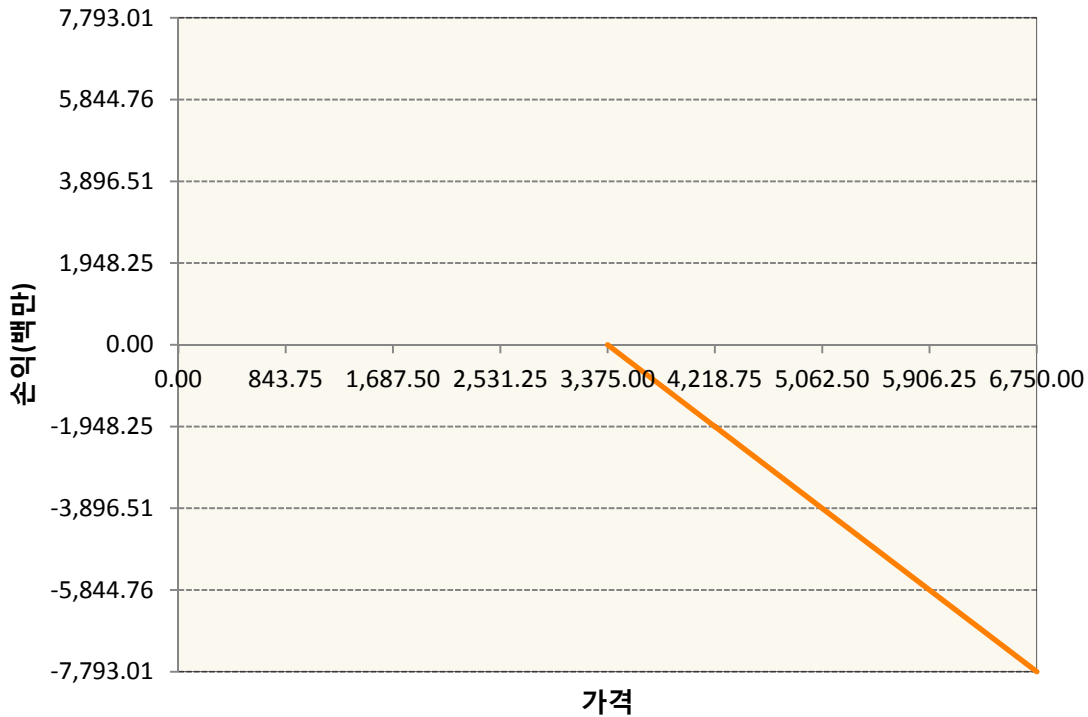
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

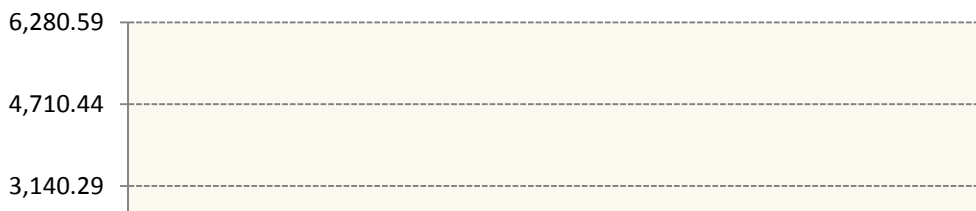
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,167	0	7,167	
누계	유가증권	스왑	60,564	0	60,564	장외
누계	유가증권	옵션	0	28,147	-28,147	장내
누계	통화	선도	0	15,394	-15,394	장외

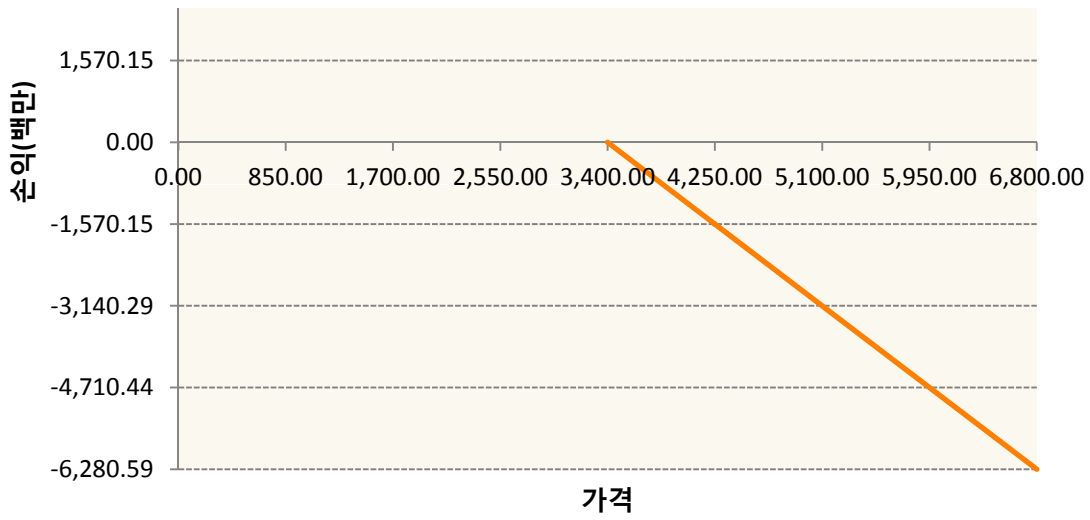
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXJ9-C3375-EURO STOXX 50**

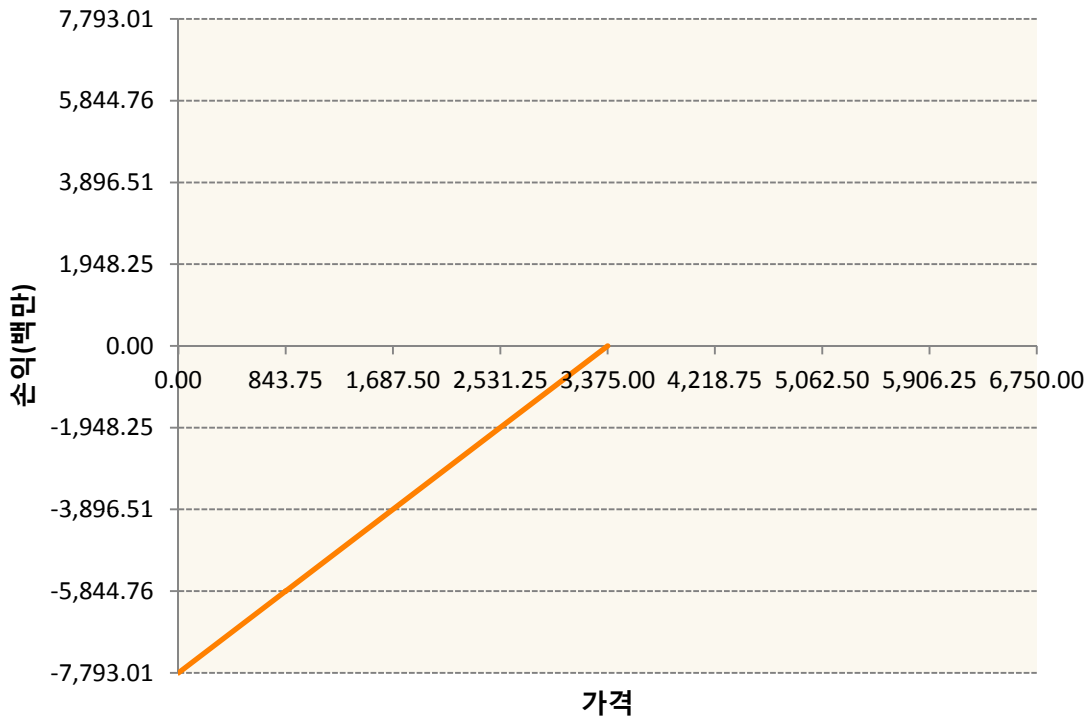


**OESXJ9-C3400-EURO STOXX 50**

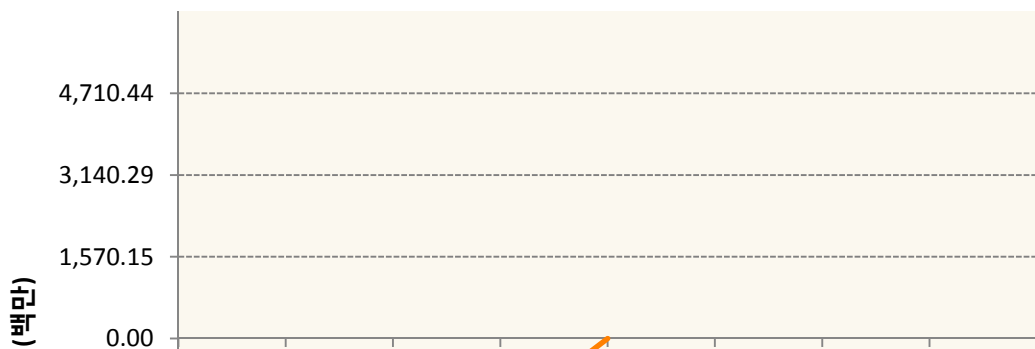


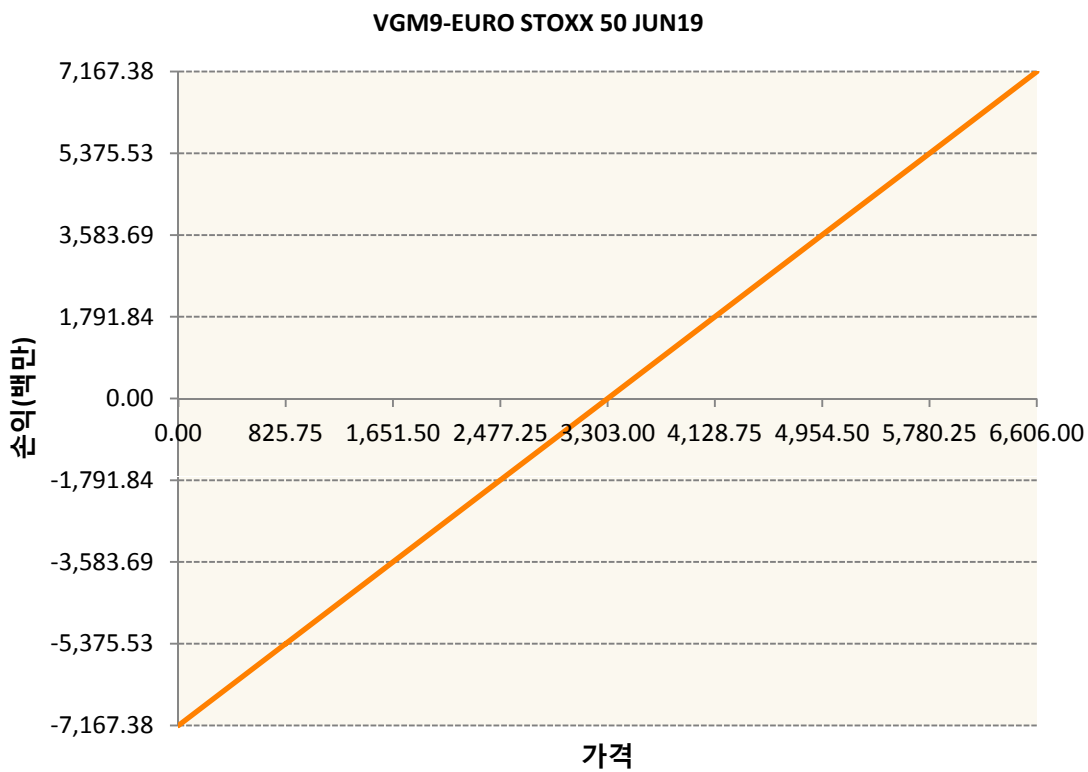
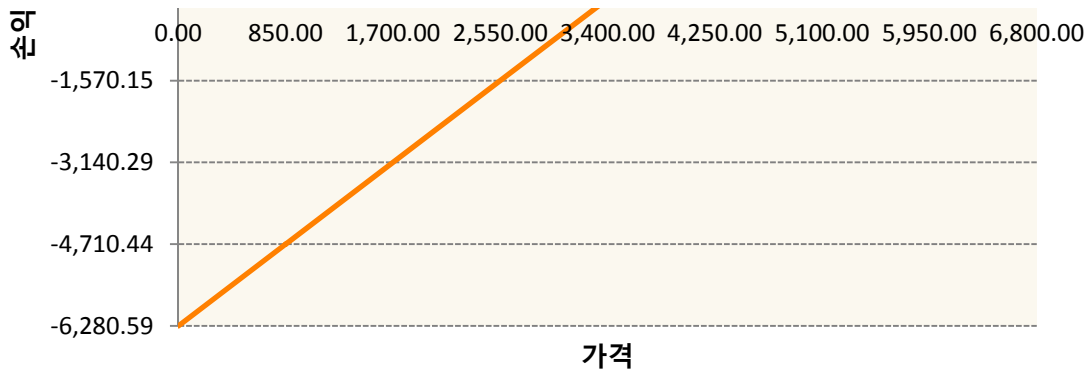


**OESXJ9-P3375-EURO STOXX 50**



**OESXJ9-P3400-EURO STOXX 50**





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	140
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E	821
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	411
OESXJ9-C33 EURO STOXX 50	623
OESXJ9-C34 EURO STOXX 50	502
OESXJ9-P33 EURO STOXX 50	623
OESXJ9-P34 EURO STOXX 50	502
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	573

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

(단위:백만원)

2,793



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

(단위:백만원)

1,100



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

(단위:백만원)

94



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

(단위:백만원)

136

공시일	2019-03-20
기준일	2019-03-19

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

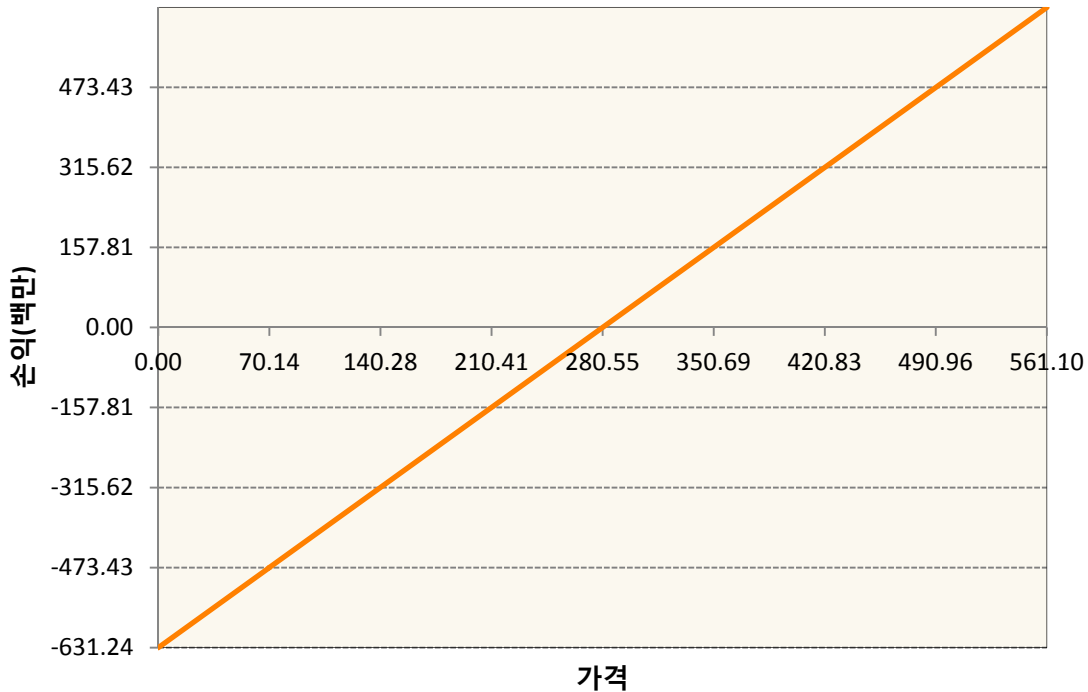
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	631	0	631	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	2019-03-20
기준일	2019-03-19

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

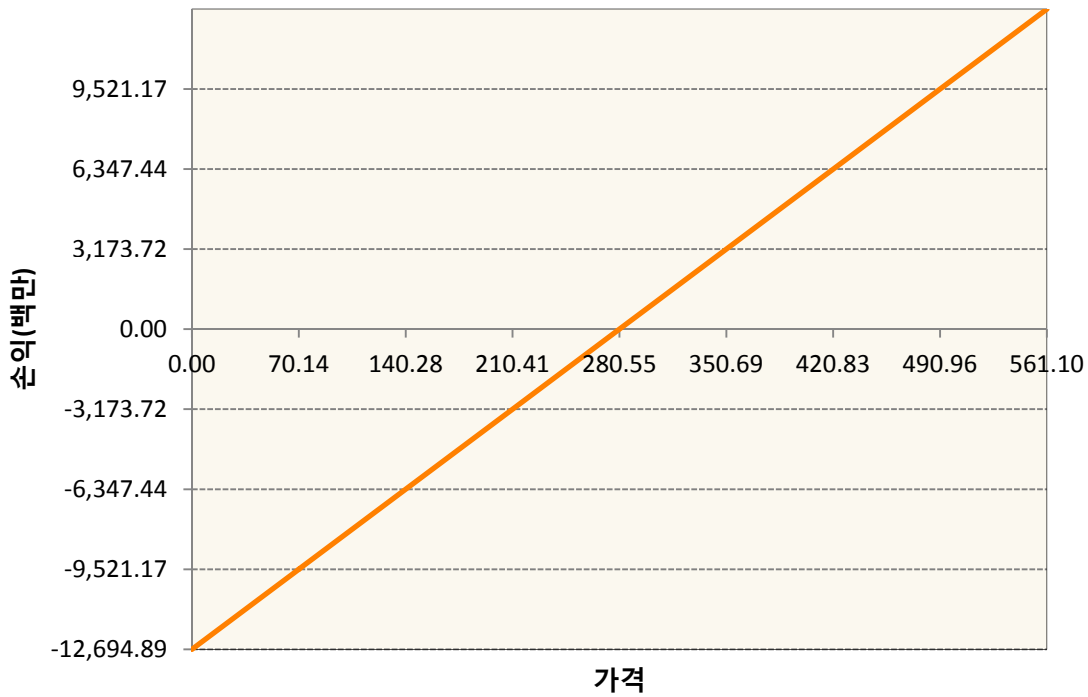
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

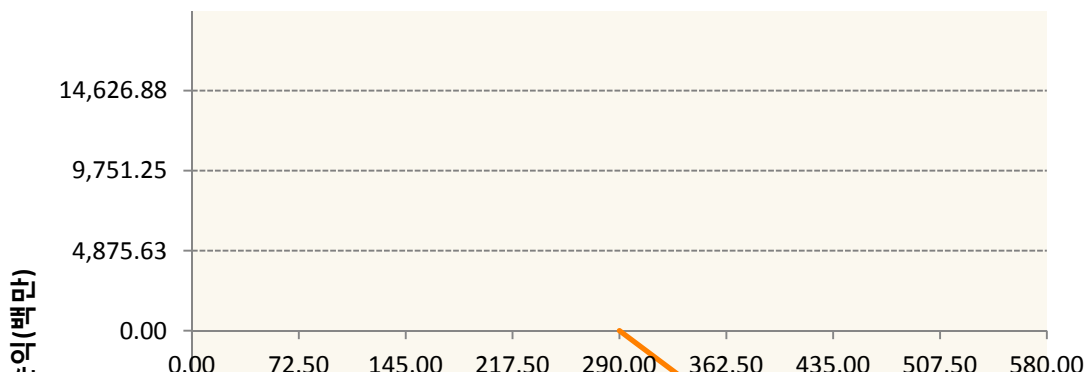
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,695	0	12,695	장내
누계	유가증권	옵션	1,867	24,036	-22,169	장내

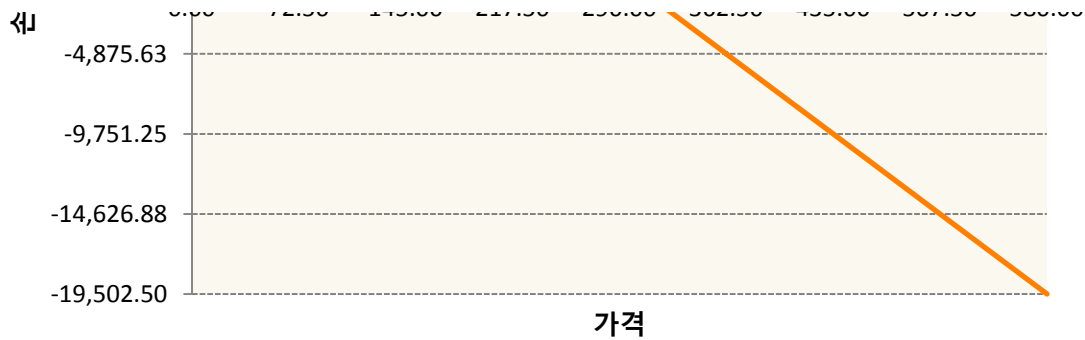
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

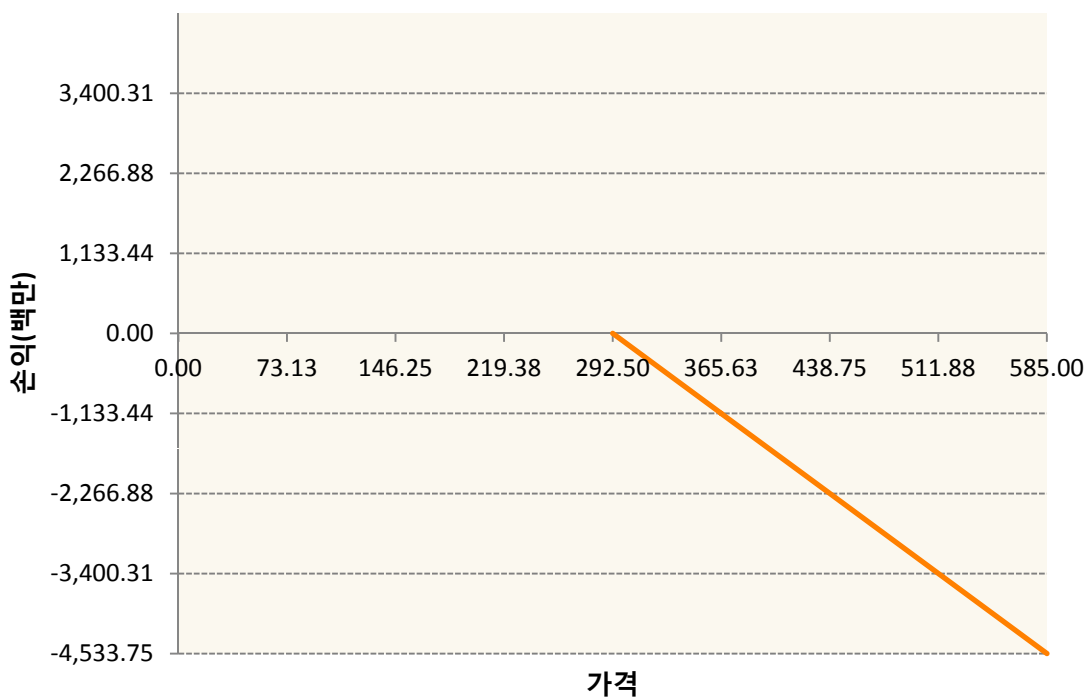


KR4201P42901-2019-04 콜290

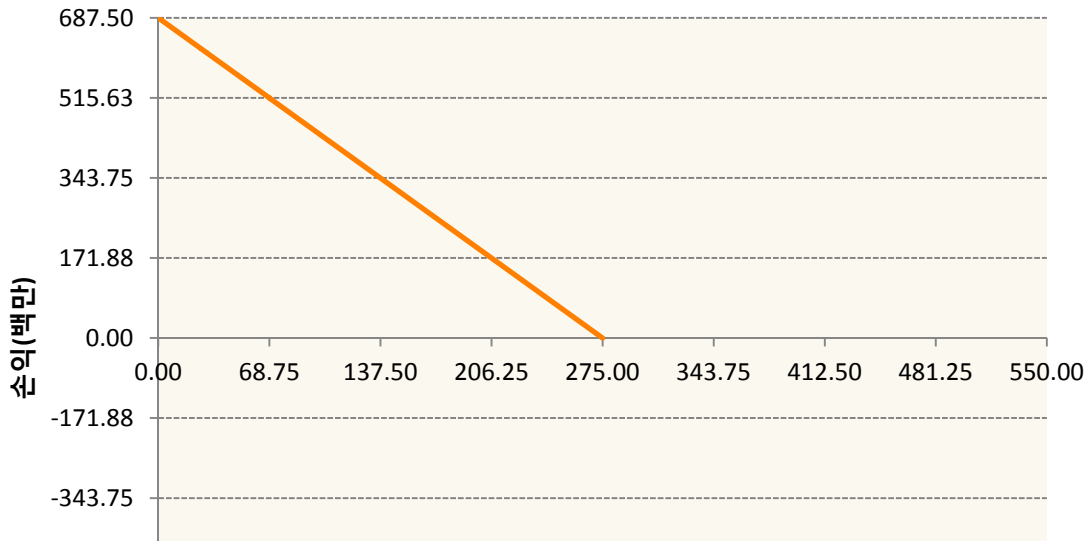


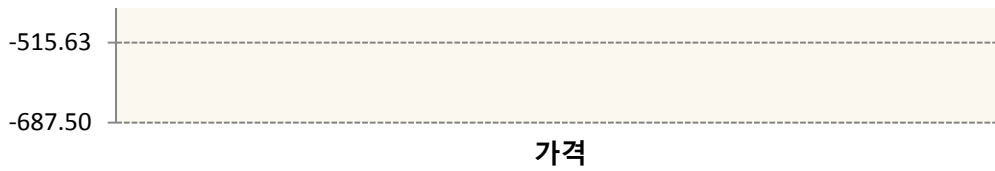


KR4201P42927-2019-04 콜292.5

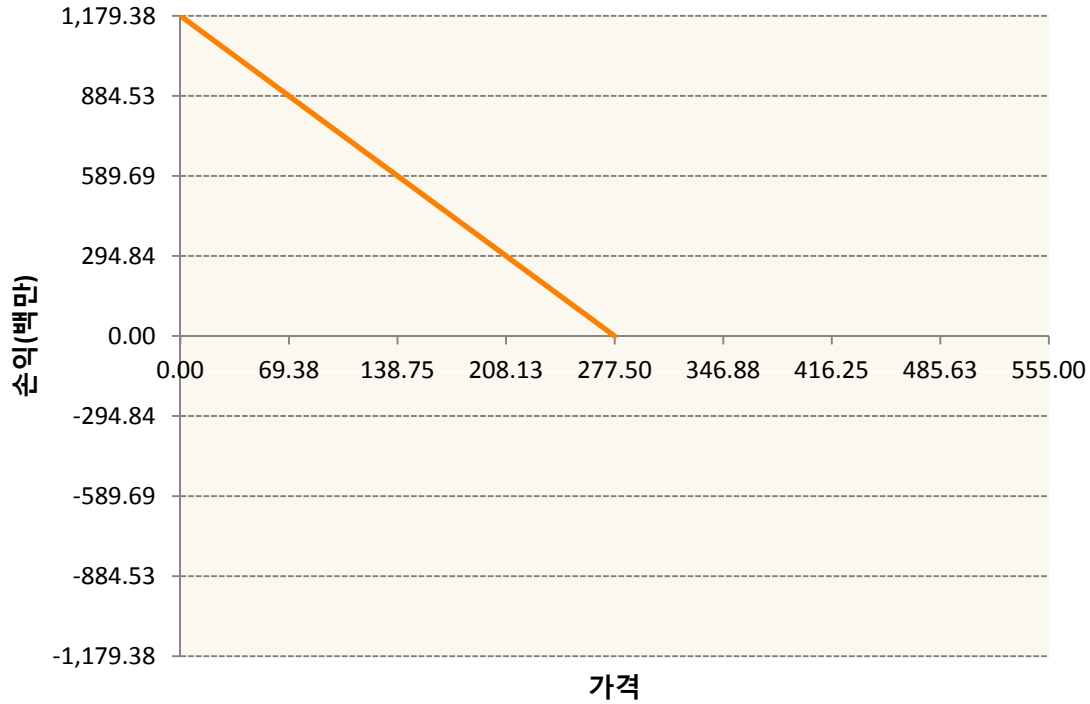


KR4301P42750-2019-04 풋275





KR4301P42776-2019-04 풋277.5



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						906
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	225	223	218	212	203	193	180	
-5.33%	216	208	196	182	166	147	126	
-2.67%	184	165	143	118	91	63	33	

0%	102	69	35	0	-36	-73	-110
2.67%	-64	-105	-147	-189	-230	-272	-314
5.33%	-332	-373	-414	-455	-496	-538	-580
8.00%	-695	-727	-760	-795	-831	-868	-906
KR4201P42927                      2019-04 콜292.5							193
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	42	42	41	40	38	36	34
-5.33%	41	39	37	35	31	28	23
-2.67%	36	32	28	23	17	11	5
0%	21	15	7	0	-8	-16	-24
2.67%	-10	-19	-29	-38	-47	-57	-66
5.33%	-64	-74	-83	-93	-103	-113	-123
8.00%	-141	-149	-157	-166	-175	-184	-193
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	40	40	40	40
-5.33%	21	22	22	22	23	23	24
-2.67%	6	7	8	8	9	10	11
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-4	-4	-4	-4	-3	-3	-2
5.33%	-5	-5	-5	-5	-4	-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%	74	74	74	74	74	74	74
-5.33%	42	43	43	44	44	45	45
-2.67%	14	15	16	18	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	-11	-11	-11	-10
8.00%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-11

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

(단위:백만원)

1,847

공시일	2019-03-20
기준일	2019-03-19

## 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	2,279	0	2,279	

### 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	2019-03-20
기준일	2019-03-19

## 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	7,639	0	7,639	

### 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	2019-03-20
기준일	2019-03-19

## 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	47,253	0	47,253	
누계	통화	선도	0	59,142	-59,142	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019F02: KRW/USD 28-03-19E		470
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
FX21019G01 KRW/USD 21-03-19E		425
FX21019G01 KRW/USD 21-03-19E		271
FX21019G02 KRW/USD 25-03-19E		137
FX21019G02 KRW/USD 25-03-19E		479
FX21019G03 KRW/USD 28-03-19E		253
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		99
FX21019H01 KRW/USD 10-04-19E		90
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		253
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E		154
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E		362
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E		425

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

(단위:백만원)

1,647

공시일	2019-03-20
기준일	2019-03-19

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

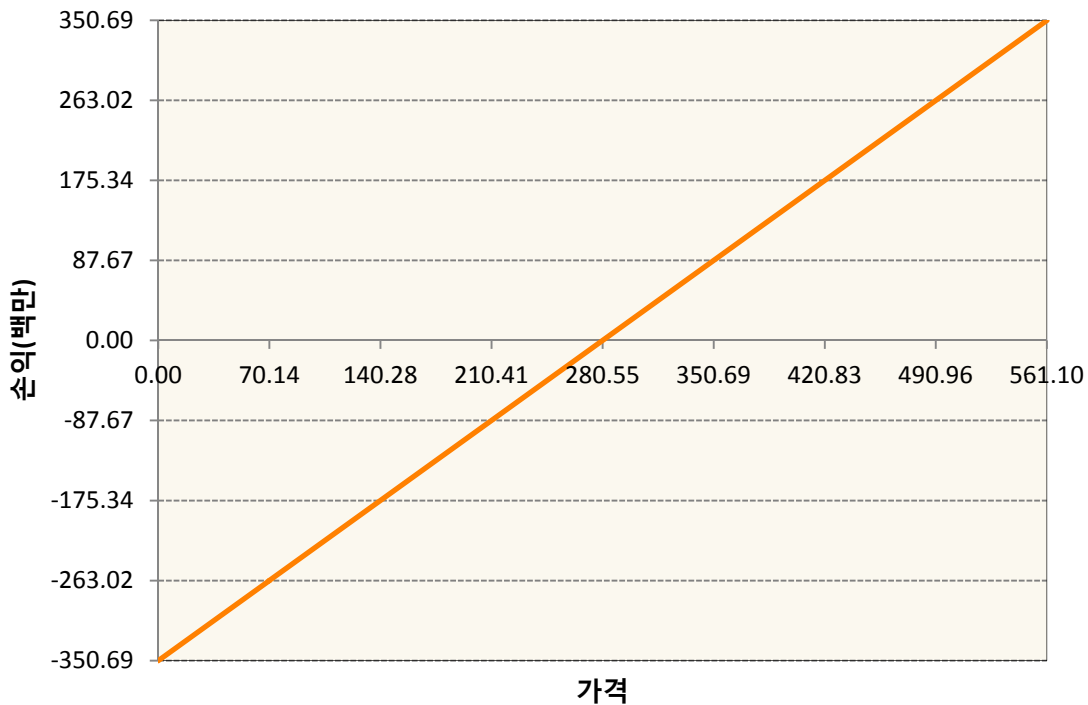
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

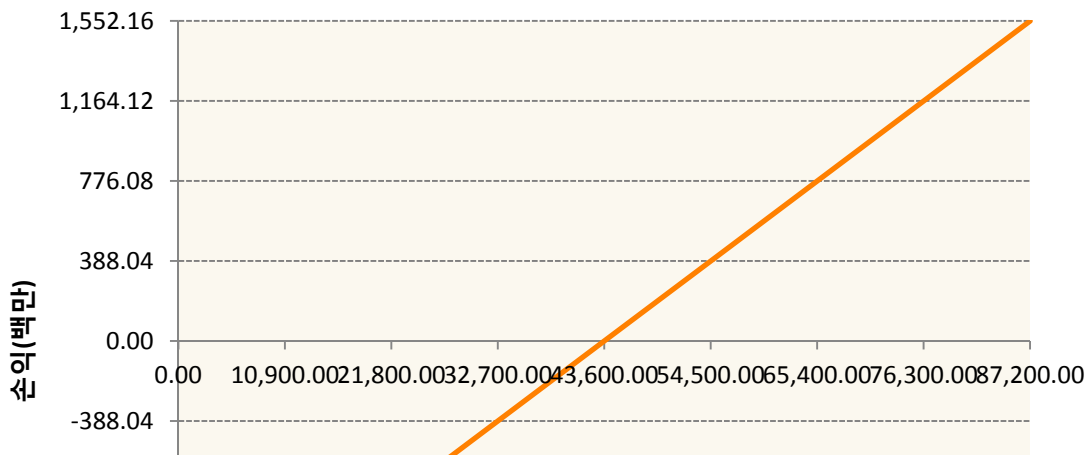
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,903	0	1,903	장내

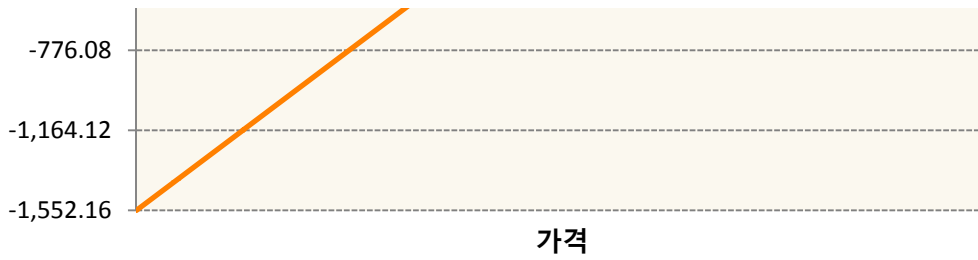
### 2. 만기시점의 손익구조

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						125
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125	
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83	
-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%	83	83	83	83	83	83	83	
8.00%	125	125	125	125	125	125	125	

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

**169**

공시일	2019-03-20
기준일	2019-03-19

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

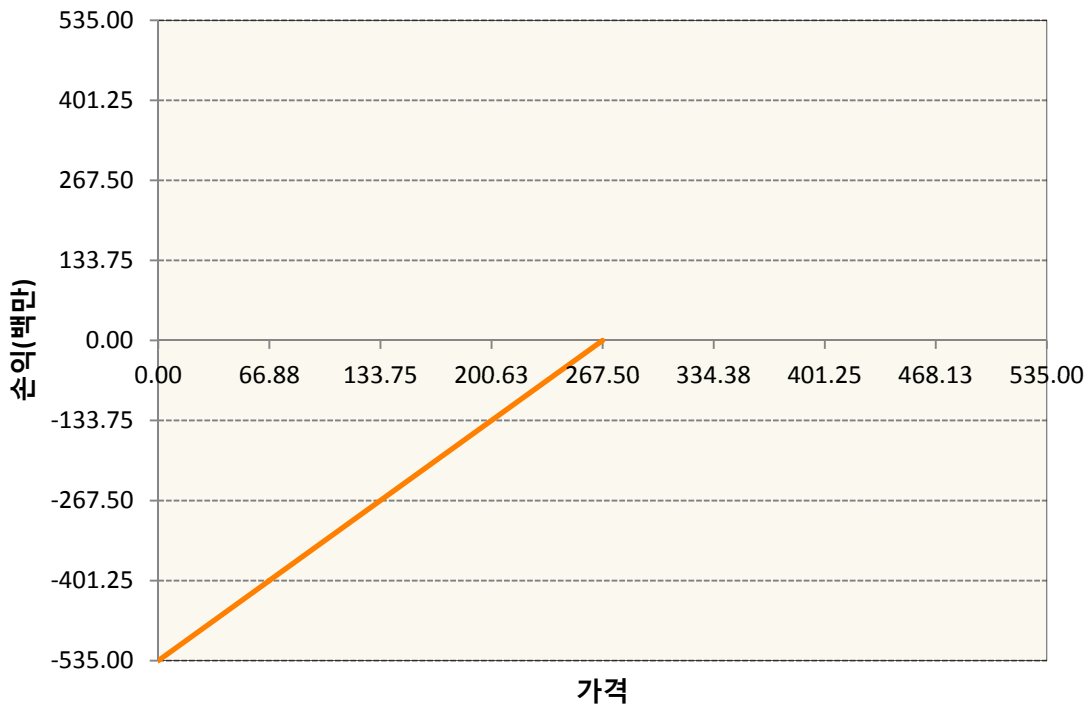
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

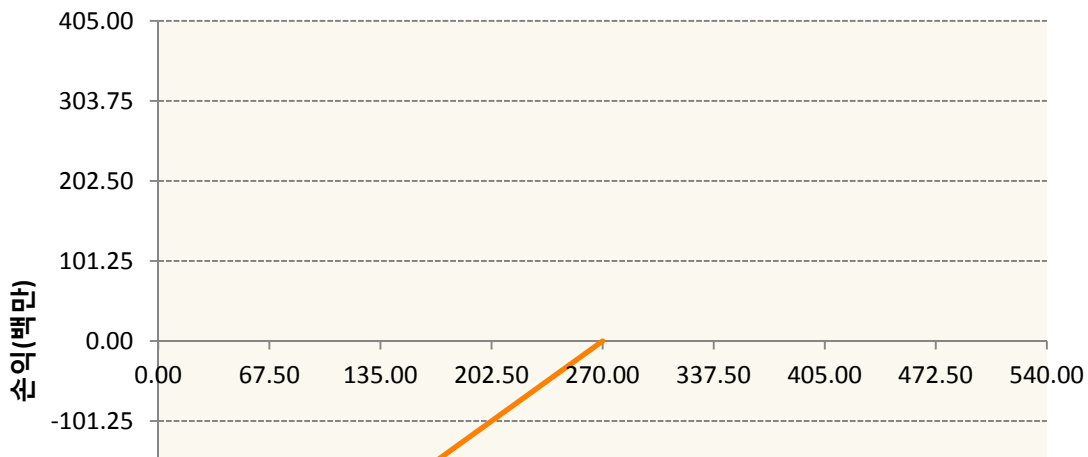
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	403	-403	장내
누계	유가증권	옵션	0	940	-940	장내

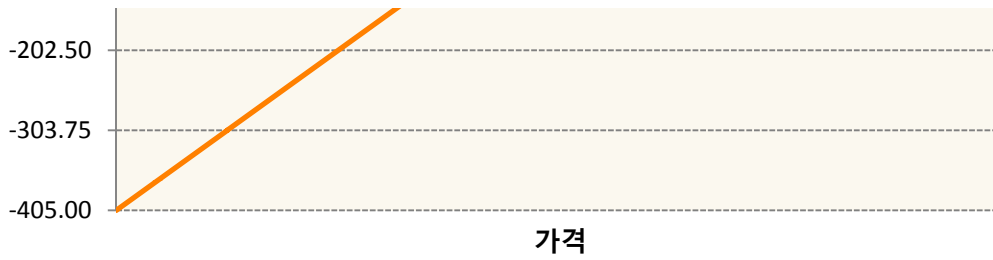
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4301P42677-2019-04 풋267.5



KR4301P42701-2019-04 풋270





**3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4301P42677      2019-04 풋267.5      22

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20	-20	-20	-21	-21	-21	-22
-5.33%	-8	-8	-9	-9	-10	-11	-11
-2.67%	-1	-2	-2	-3	-3	-4	-4
0%	1	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	1	1	1	1	1	1	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

KR4301P42701      2019-04 풋270      19

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-18	-18	-18	-18	-19	-19	-19
-5.33%	-8	-8	-9	-9	-10	-10	-10
-2.67%	-2	-2	-2	-3	-3	-4	-4
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
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)

**30**

공시일	2019-03-20
기준일	2019-03-19

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

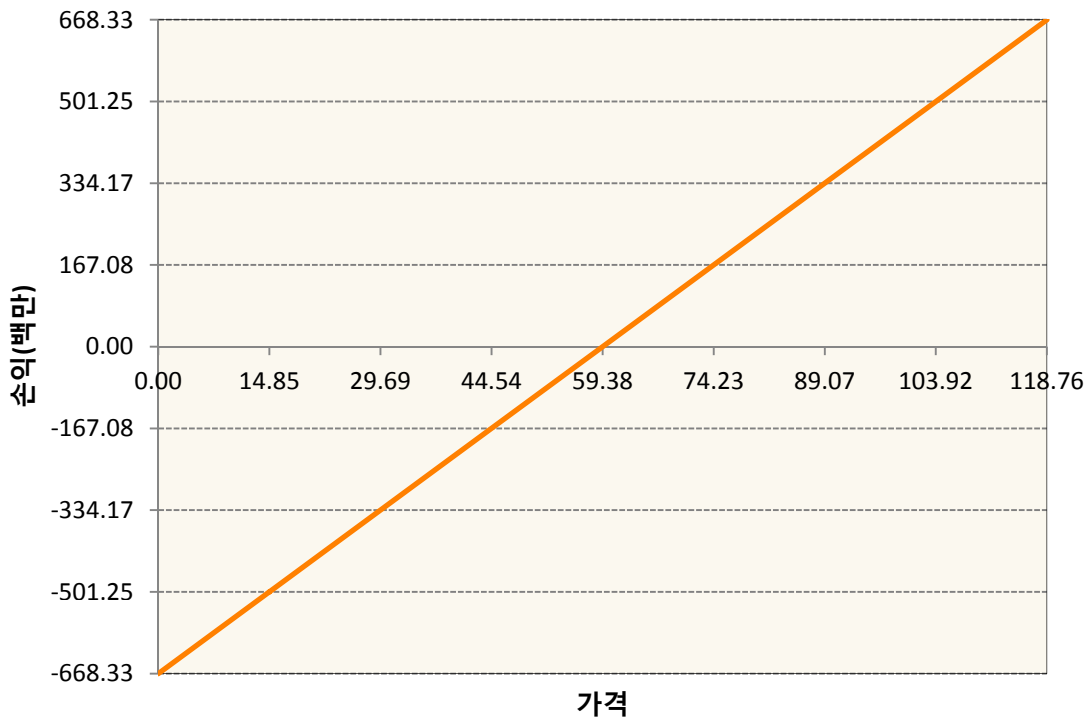
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

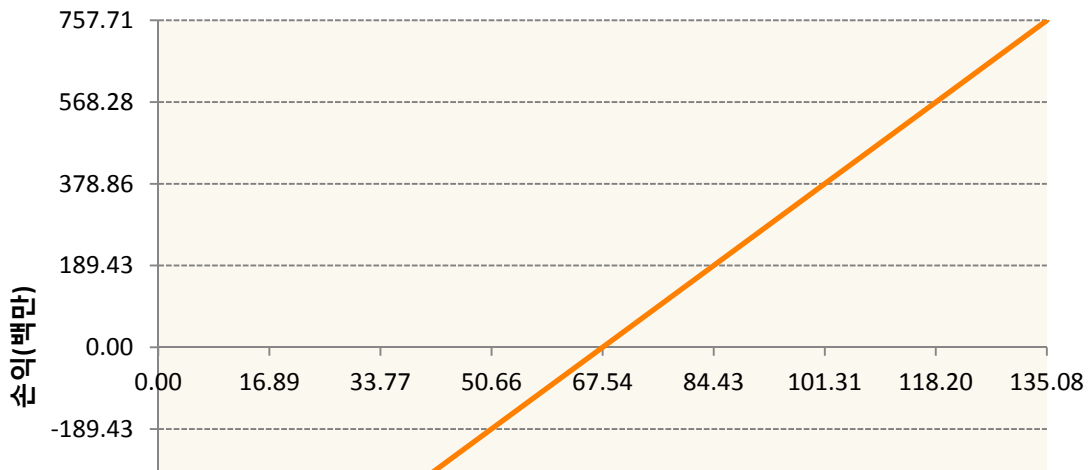
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,889	282	2,607	

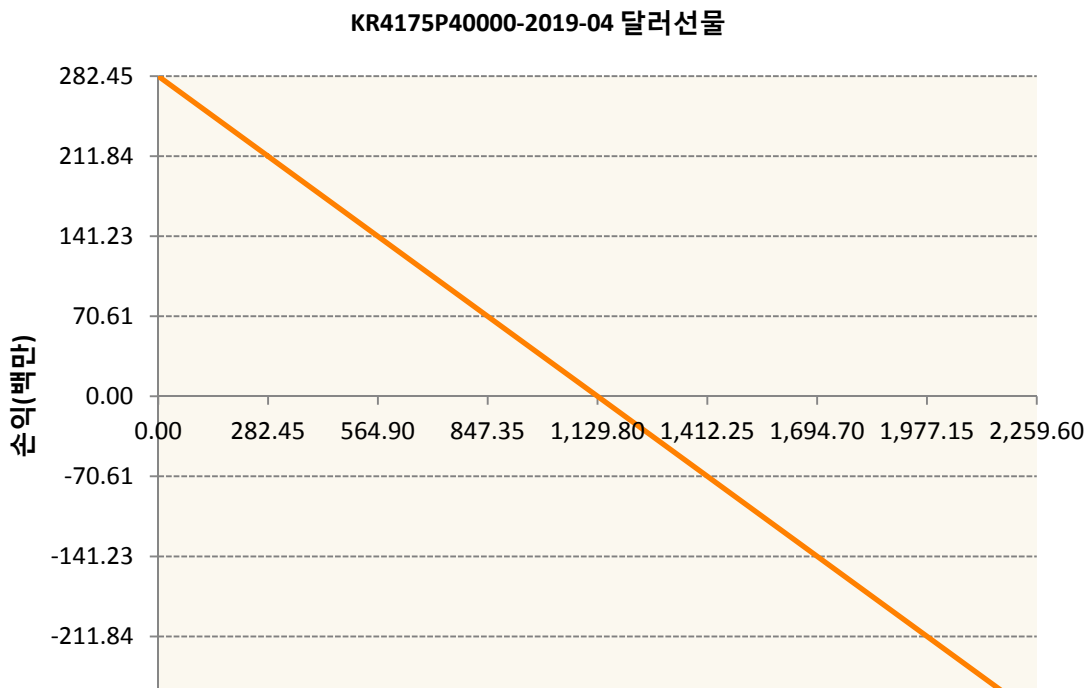
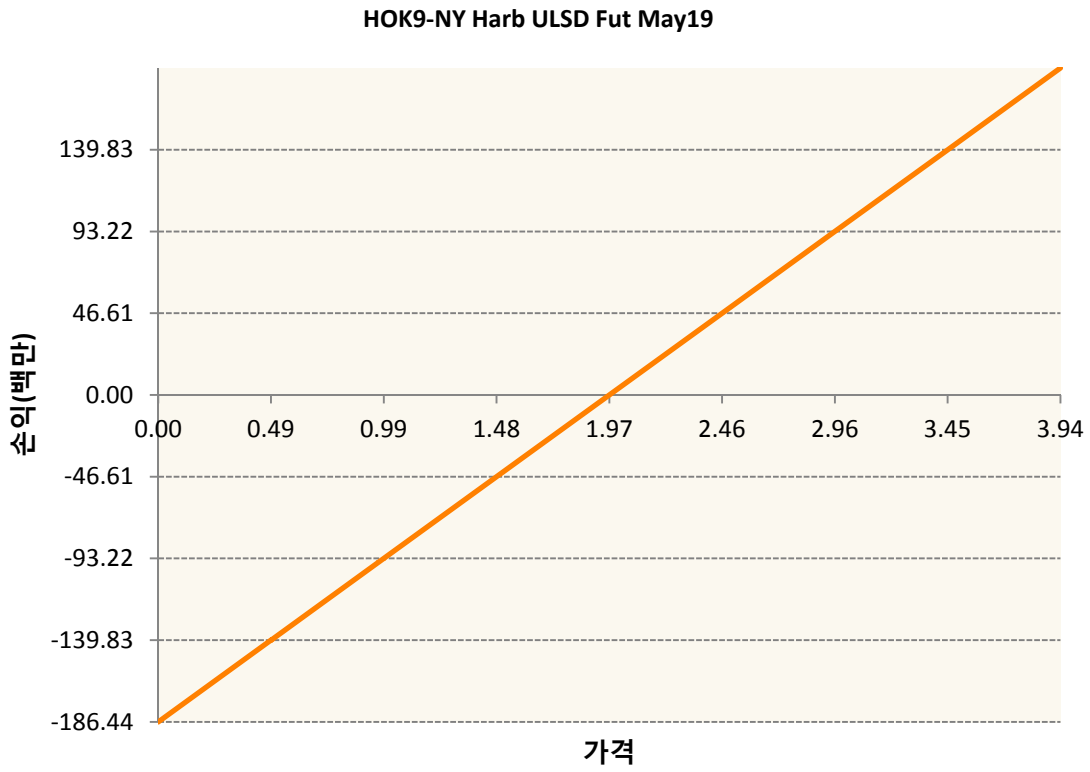
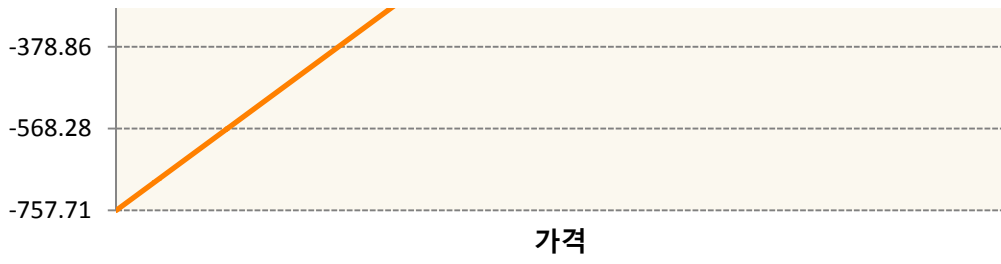
### 2. 만기시점의 손익구조

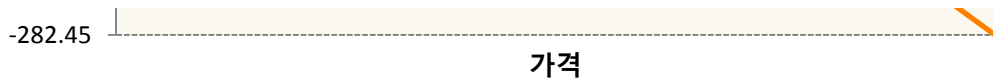
**CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19**



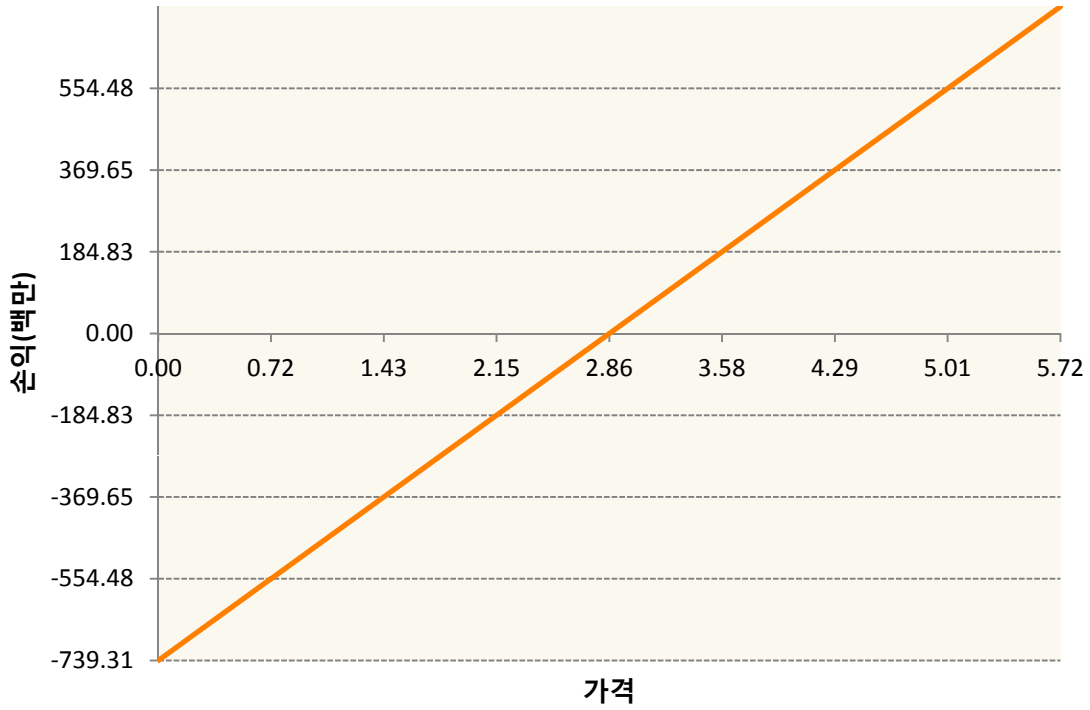
**COK9-BRENT CRUDE FUTR May19**



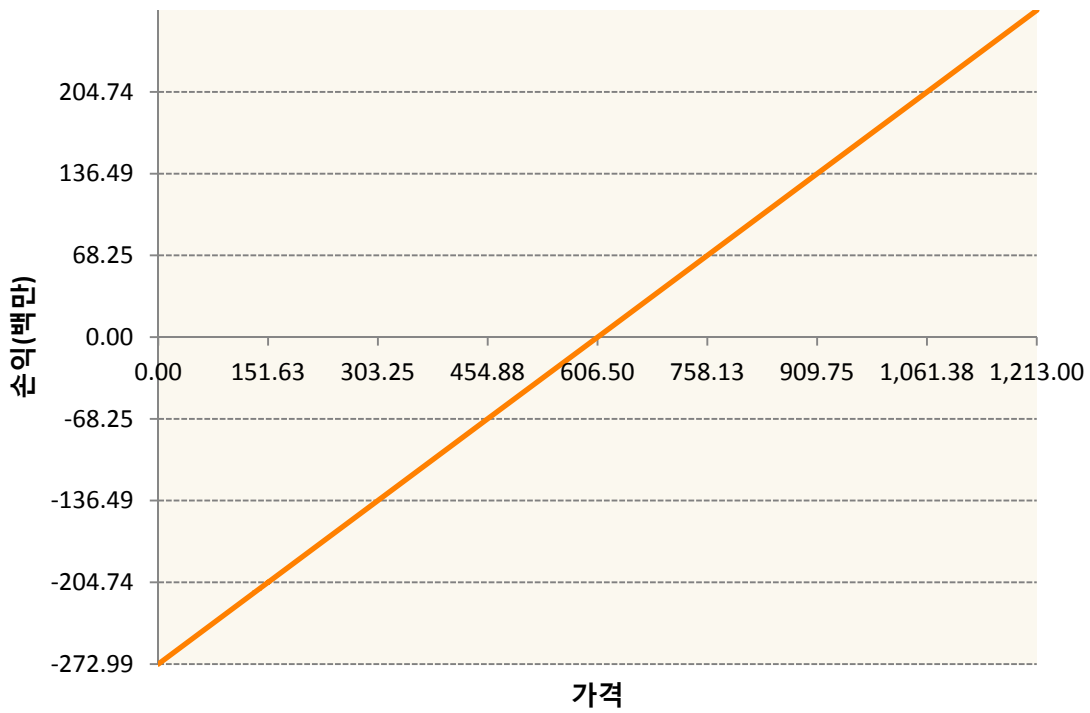




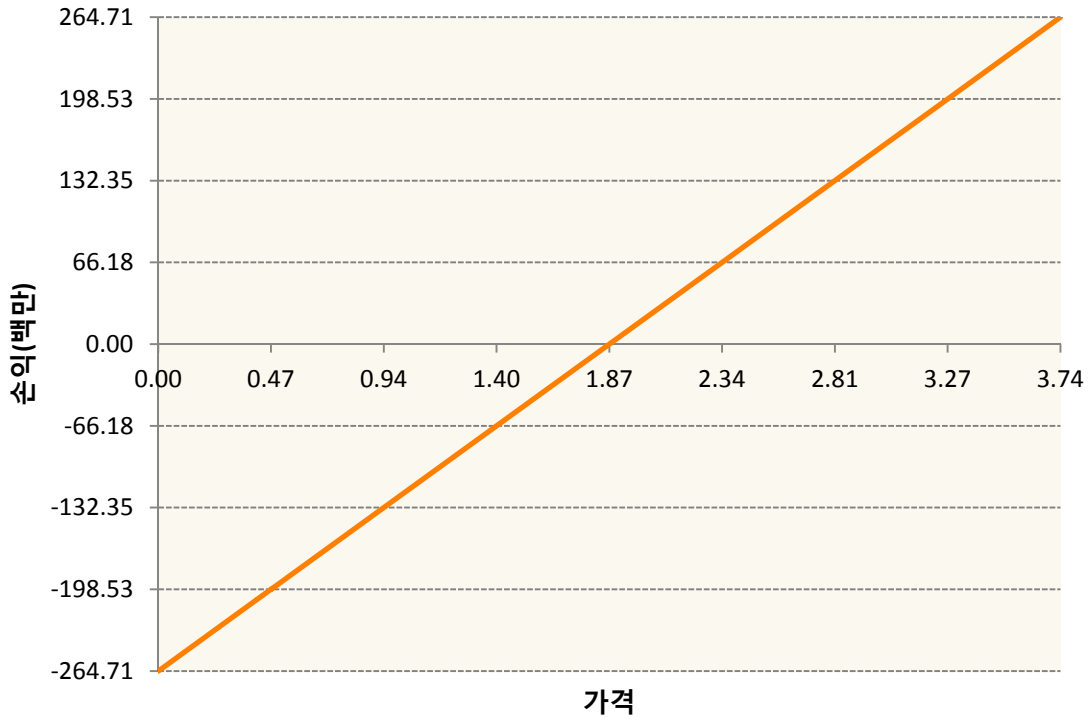
NGK19-NATURAL GAS FUTR May19



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	61
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	2019-03-20
기준일	2019-03-19

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

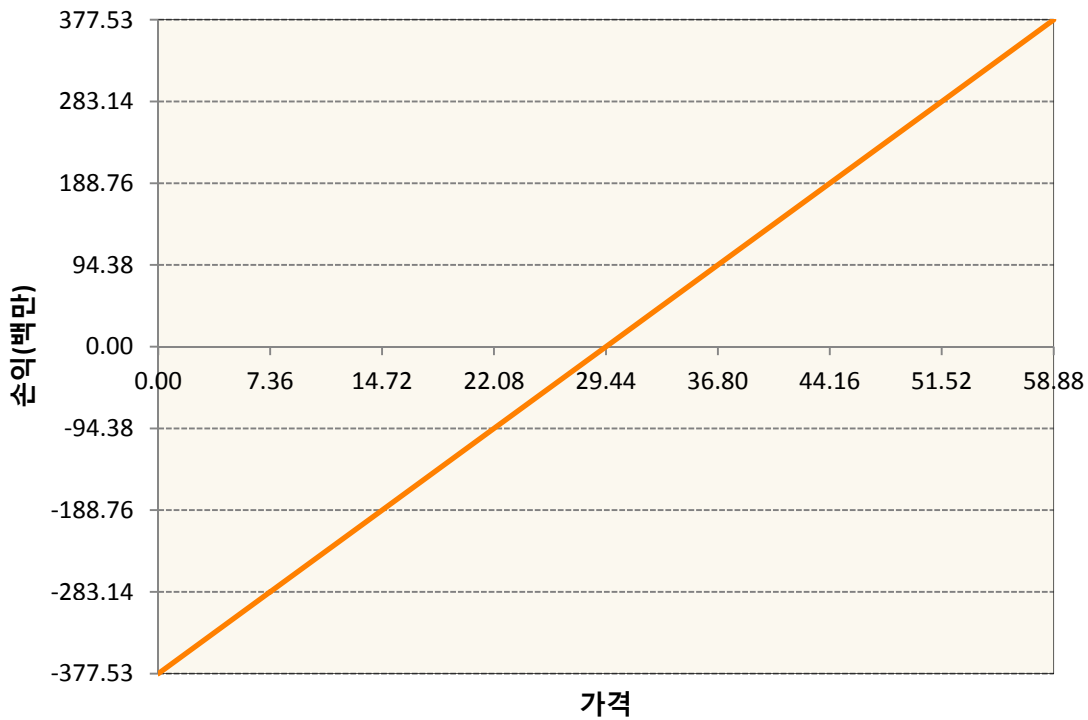
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

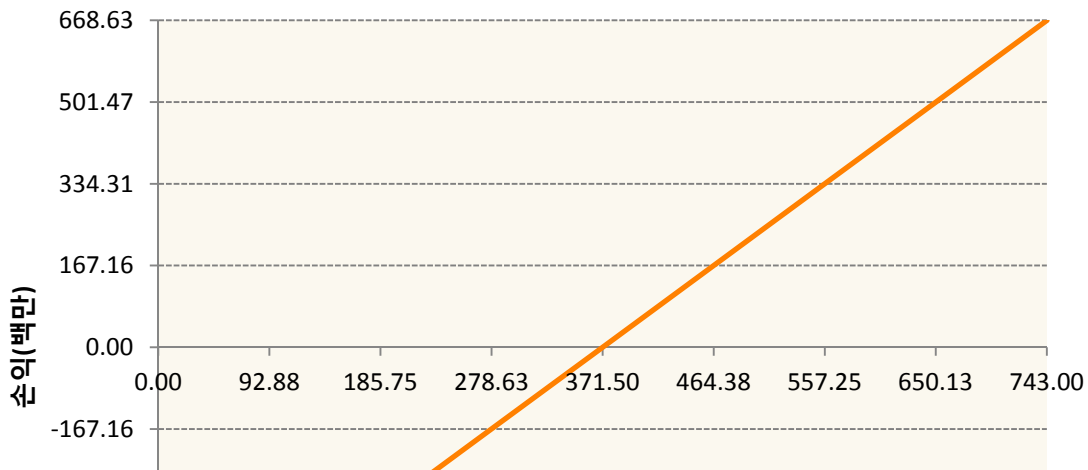
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,386	79	3,307	

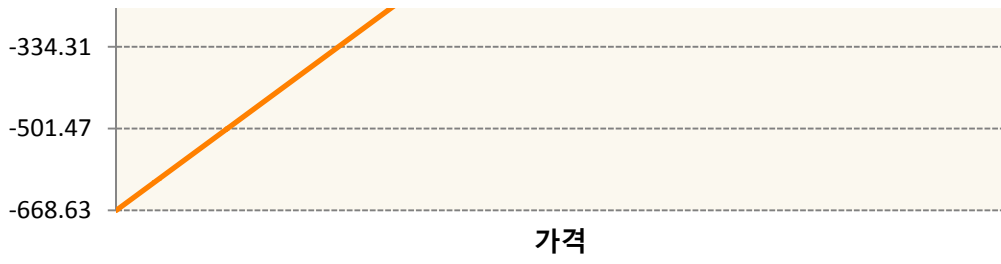
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19**

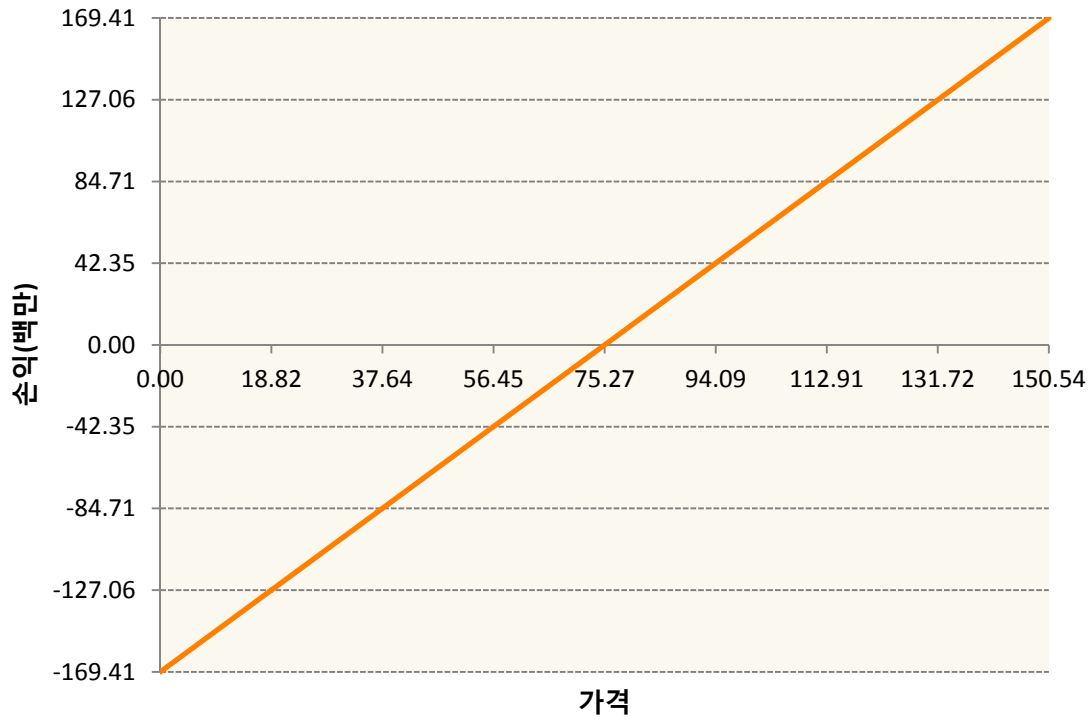


**CK9-CORN FUTURE May19**

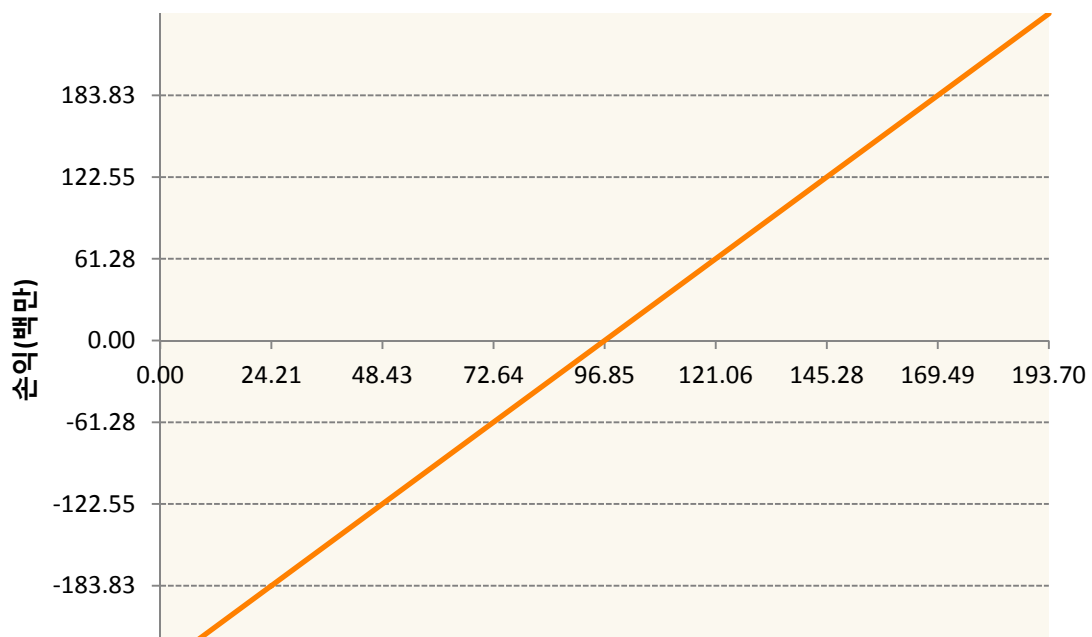


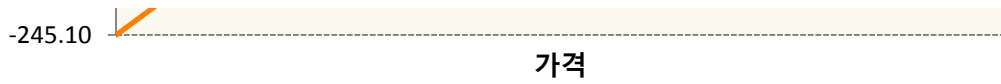


**CTK9-COTTON NO.2 FUTR May19**

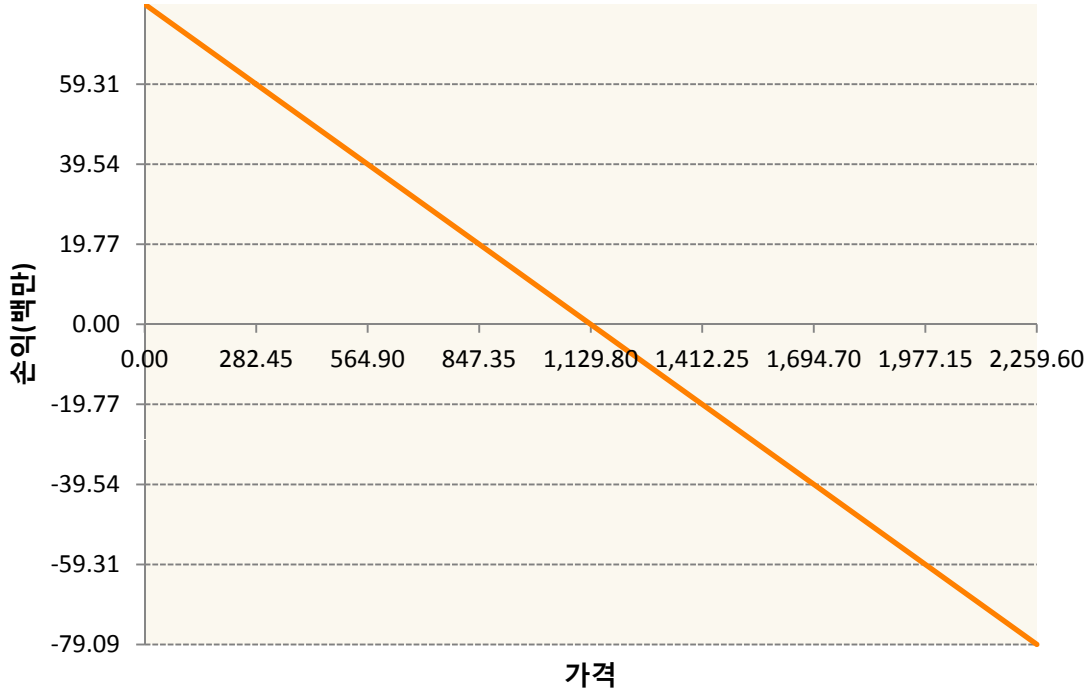


**KCK9-COFFEE 'C' FUTURE May19**

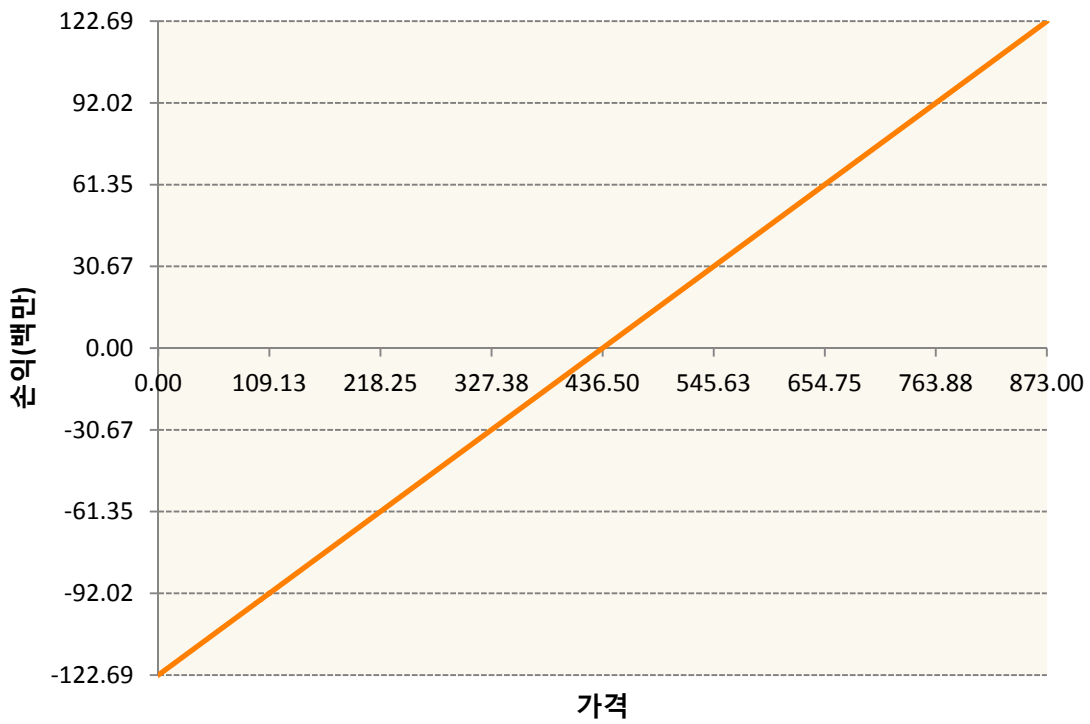




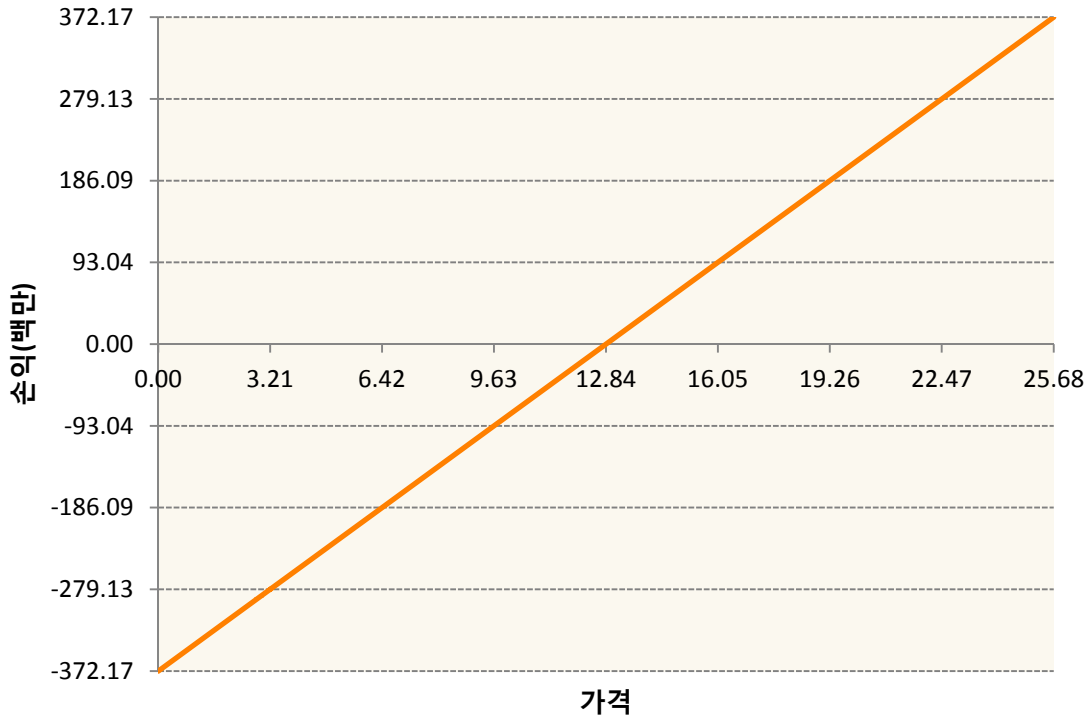
KR4175P40000-2019-04 달러선물



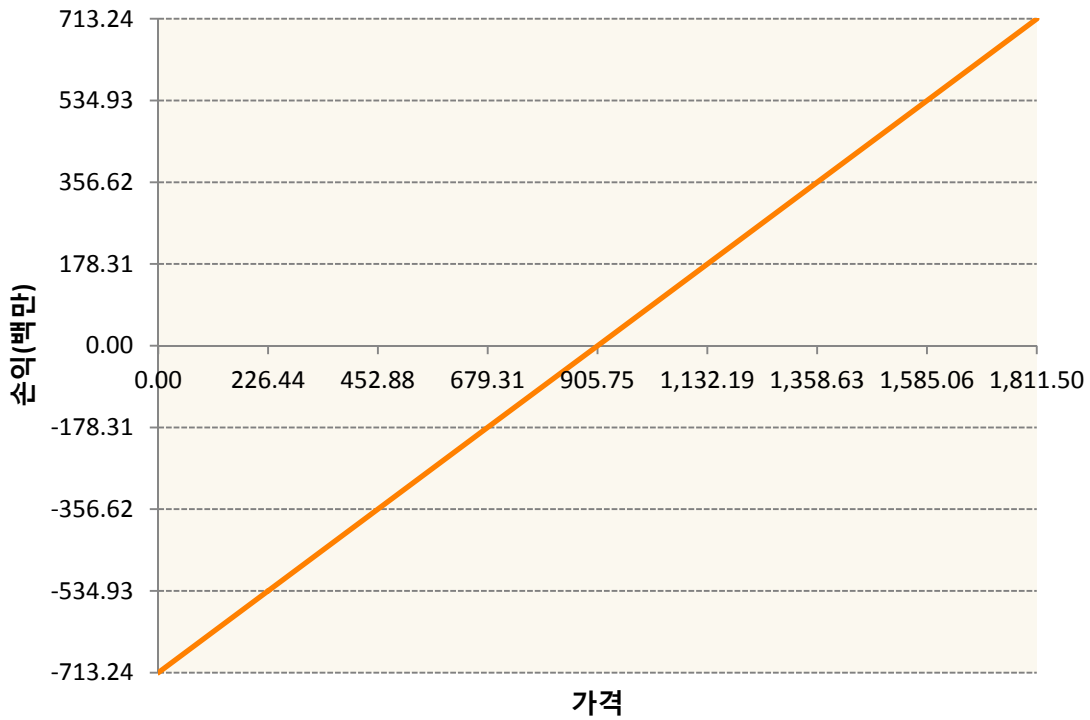
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



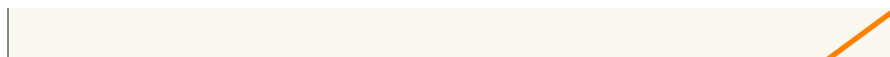
SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

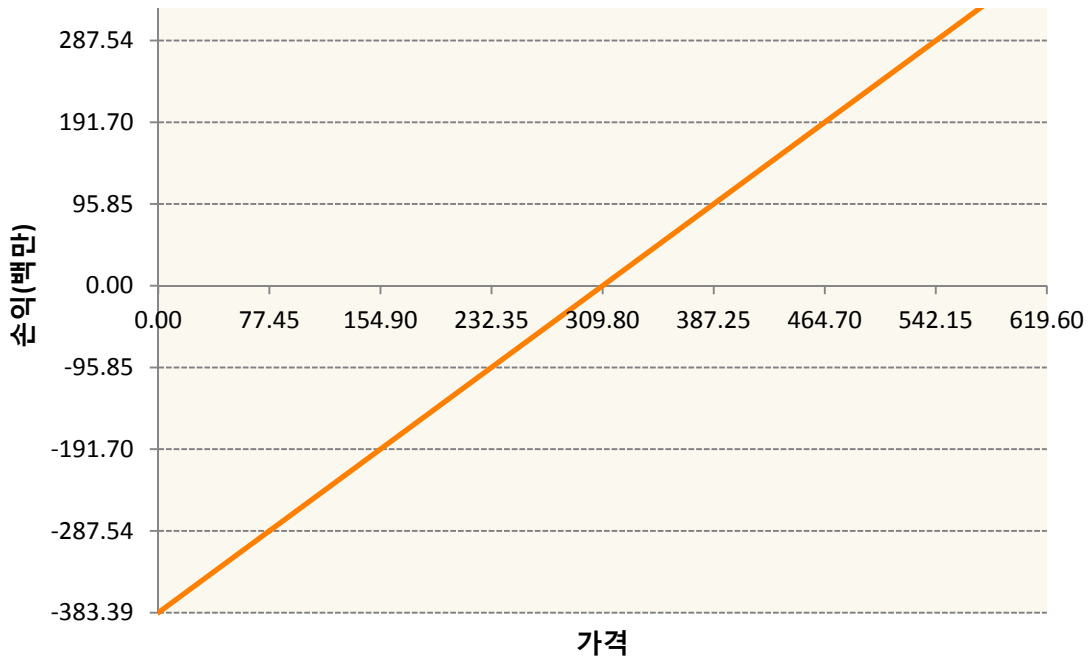


SK9-SOYBEAN FUTURE May19

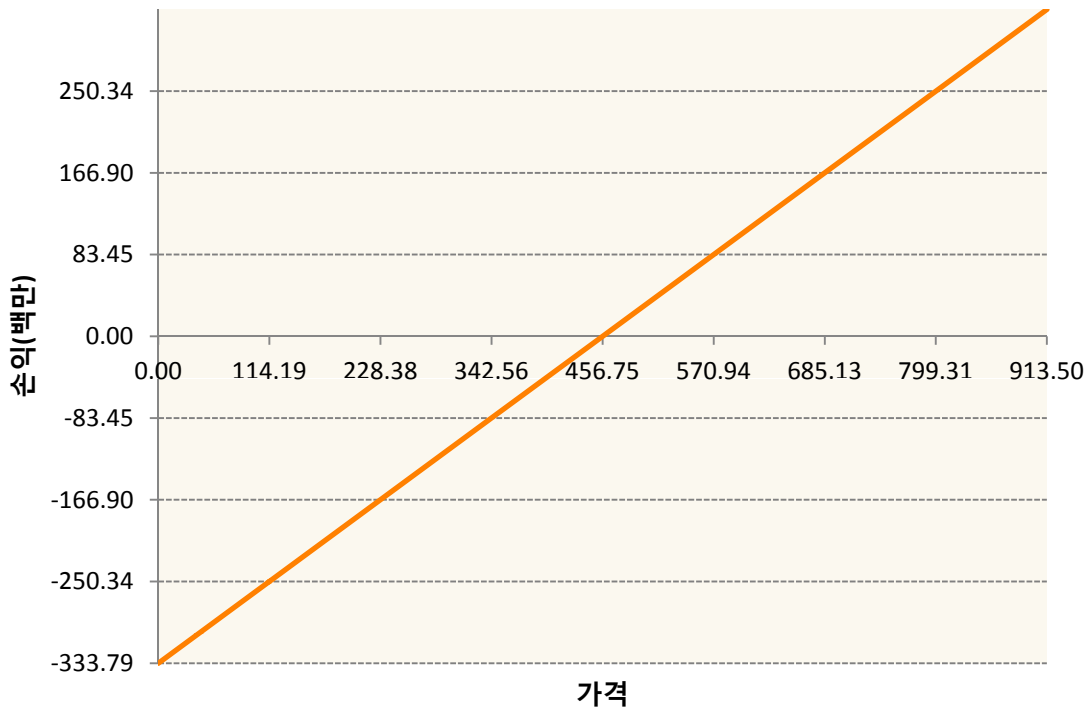


SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





WK9-WHEAT FUTURE(CBT) May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK9	SOYBEAN OIL FUTR May19	30
CK9	CORN FUTURE May19	53
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	30
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