

공시일	2019-03-21
기준일	2019-03-20

## 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	2019-03-21
기준일	2019-03-20

## 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

1,133

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

658

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-03-21
기준일	2019-03-20

## 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>945</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-03-21
기준일	2019-03-20

## 유로인덱스모(주식-파생형)

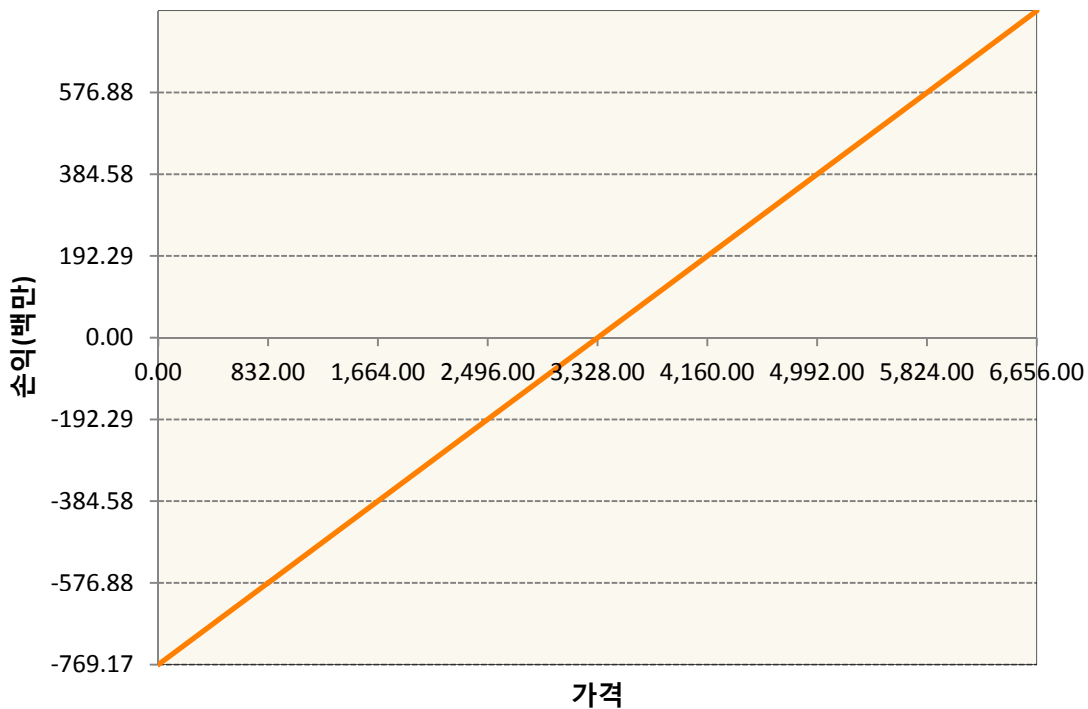
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	769	0	769	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	62
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

44
----

공시일	2019-03-21
기준일	2019-03-20

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

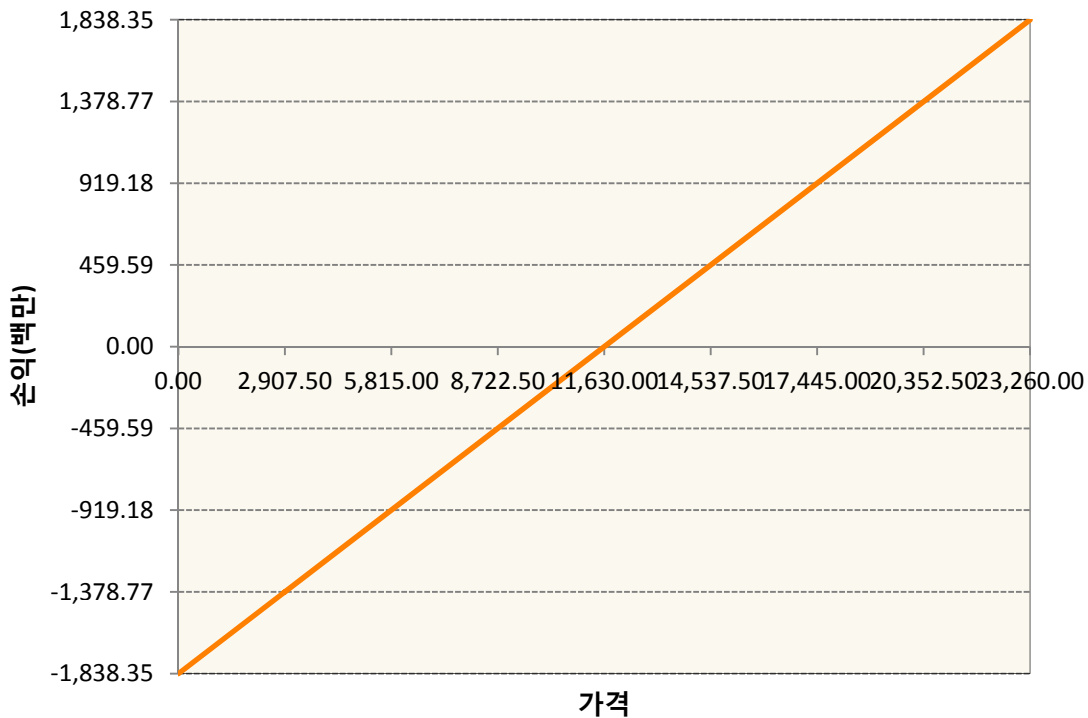
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,838	0	1,838	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCH9-HSCEI Futures Mar19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH9	HSCEI Futures Mar19	147
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

152
-----

공시일	2019-03-21
기준일	2019-03-20

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

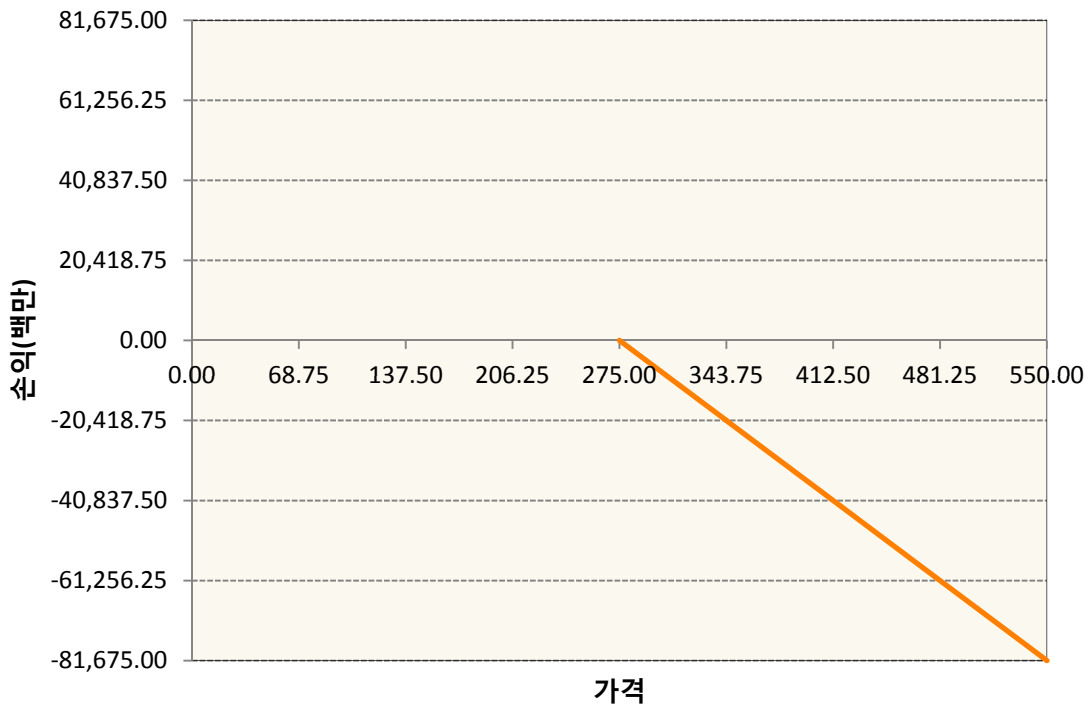
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

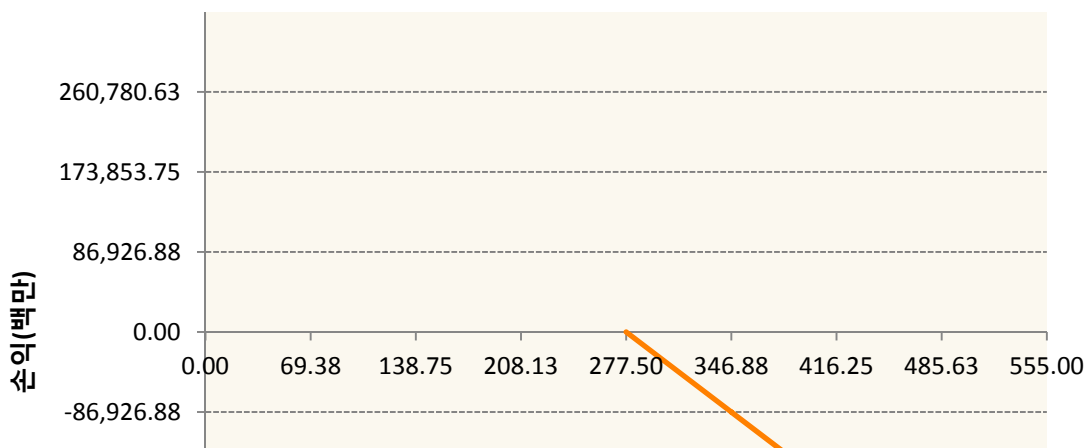
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	674,320	-674,320	장내

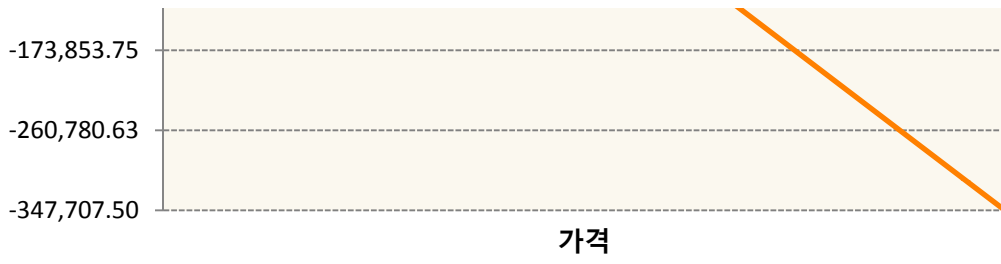
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P42752-2019-04 콜275

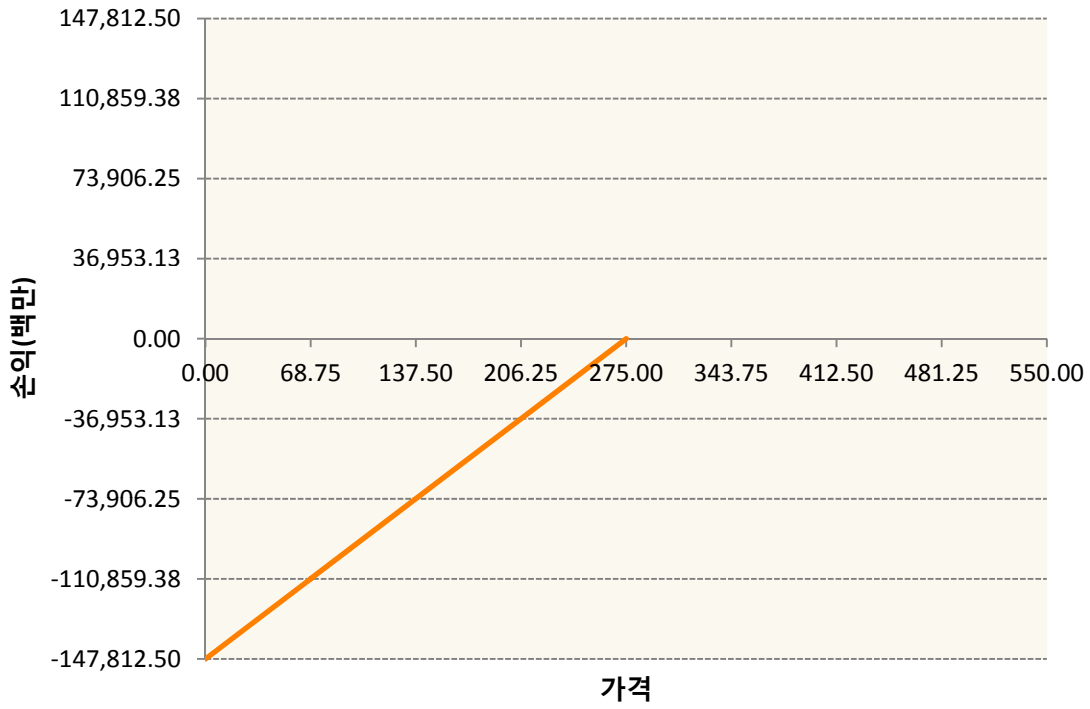


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

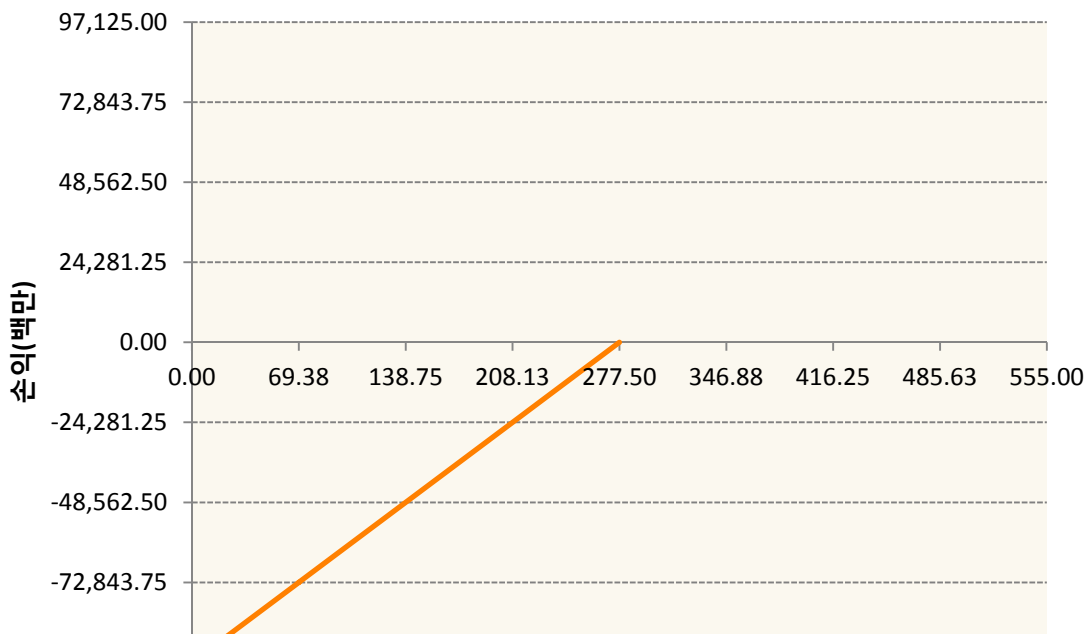




**KR4301P42750-2019-04 풋275**



**KR4301P42776-2019-04 풋277.5**



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P42752		2019-04 콜275						5,584
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,736	2,666	2,583	2,491	2,389	2,281	2,166	
-5.33%	2,408	2,280	2,145	2,005	1,861	1,714	1,564	
-2.67%	1,695	1,527	1,358	1,189	1,019	849	679	
0%	496	332	167	0	-168	-336	-506	
2.67%	-1,153	-1,273	-1,402	-1,538	-1,680	-1,826	-1,975	
5.33%	-3,110	-3,179	-3,261	-3,354	-3,457	-3,568	-3,687	
8.00%	-5,230	-5,261	-5,304	-5,358	-5,424	-5,499	-5,584	
KR4201P42778		2019-04 콜277.5						22,636
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	9,975	9,743	9,459	9,129	8,758	8,351	7,914	
-5.33%	8,956	8,489	7,984	7,449	6,890	6,310	5,714	
-2.67%	6,547	5,869	5,182	4,489	3,791	3,090	2,385	
0%	2,184	1,458	729	0	-730	-1,462	-2,193	
2.67%	-4,175	-4,763	-5,378	-6,012	-6,662	-7,325	-7,999	
5.33%	-12,054	-12,422	-12,841	-13,304	-13,802	-14,331	-14,886	
8.00%	-20,811	-20,993	-21,228	-21,515	-21,848	-22,223	-22,636	
KR4301P42750		2019-04 풋275						8,600
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-8,445	-8,454	-8,468	-8,489	-8,518	-8,555	-8,600	
-5.33%	-4,552	-4,615	-4,689	-4,775	-4,869	-4,971	-5,080	
-2.67%	-1,324	-1,480	-1,638	-1,798	-1,959	-2,120	-2,282	
0%	427	289	147	0	-150	-302	-457	
2.67%	921	875	816	746	666	576	479	
5.33%	987	980	968	950	924	890	848	
8.00%	991	990	989	986	981	972	959	
KR4301P42776		2019-04 풋277.5						6,118
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-6,056	-6,058	-6,063	-6,071	-6,082	-6,098	-6,118	
-5.33%	-3,479	-3,504	-3,536	-3,575	-3,621	-3,672	-3,729	
-2.67%	-1,171	-1,257	-1,346	-1,439	-1,534	-1,631	-1,729	
0%	319	213	107	0	-108	-215	-324	
2.67%	857	808	751	687	618	543	465	

5.33%	952	942	928	907	880	847	808
8.00%	959	959	957	953	946	937	923

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

(단위:백만원)

**43,359**

공시일	2019-03-21
기준일	2019-03-20

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

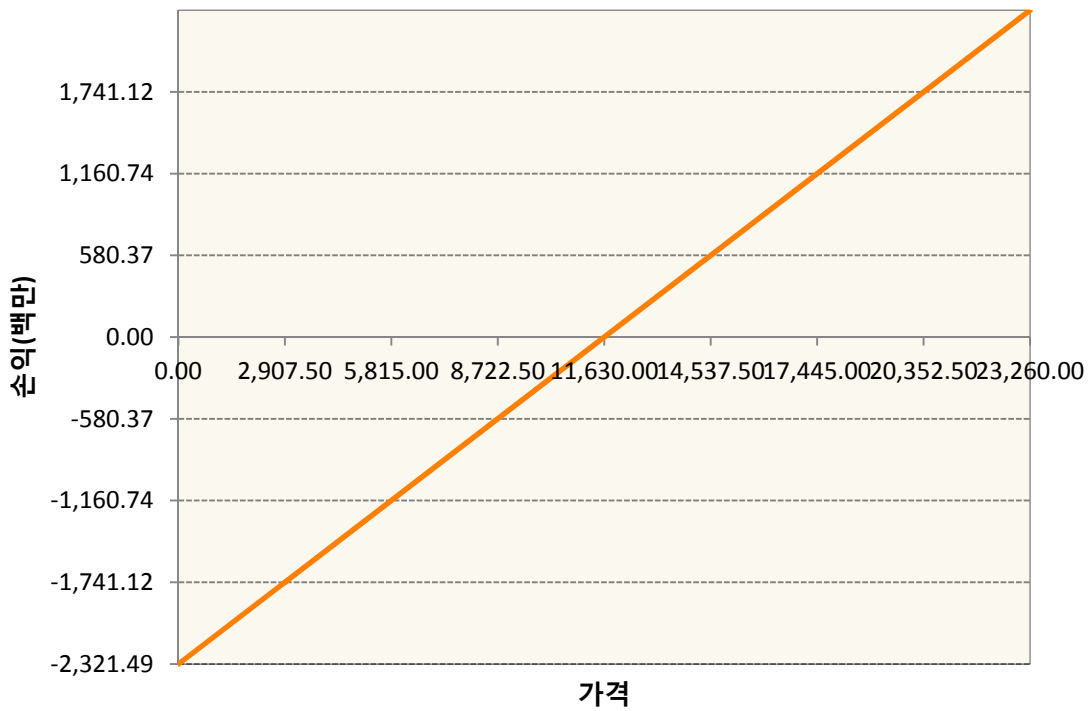
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

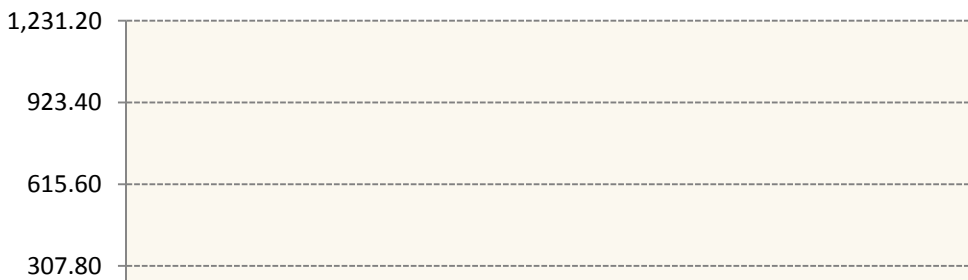
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,321	0	2,321	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,940	-5,940	장내
누계	통화	선도	0	3,024	-3,024	장외

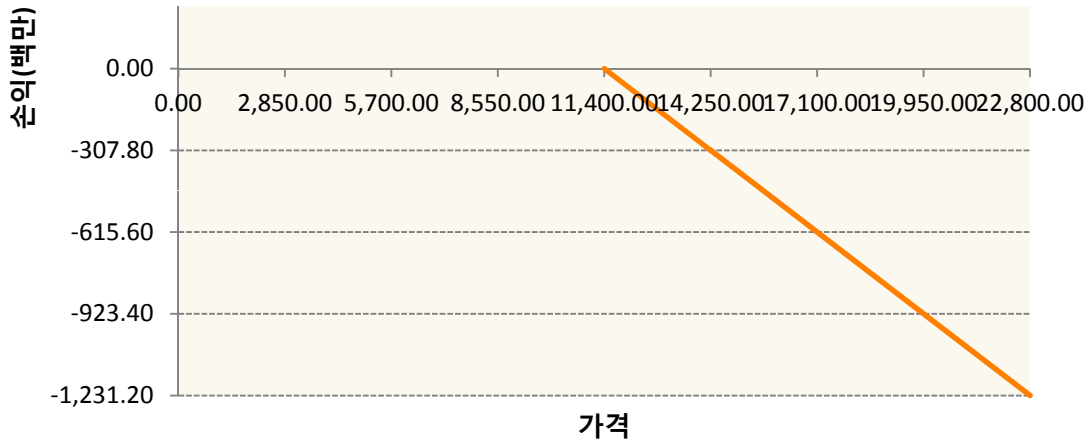
### 2. 만기시점의 손익구조

HCH9-HSCEI Futures Mar19

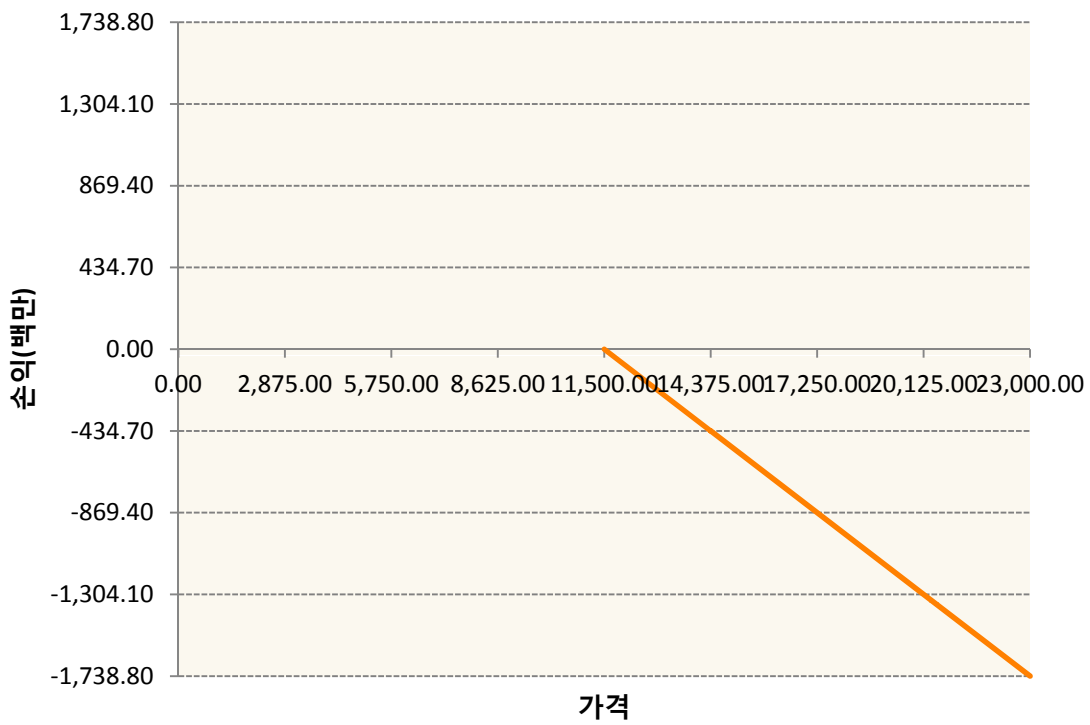


OHHIH9-C114-HSCEI

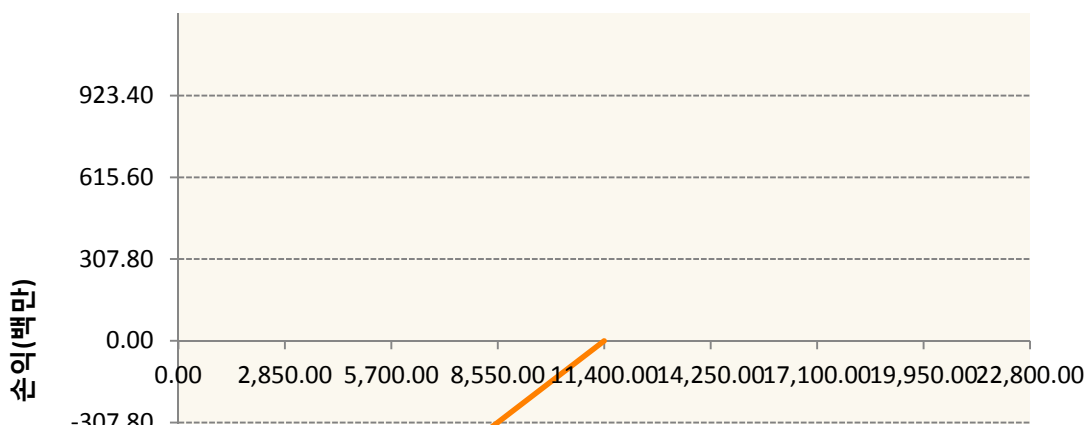


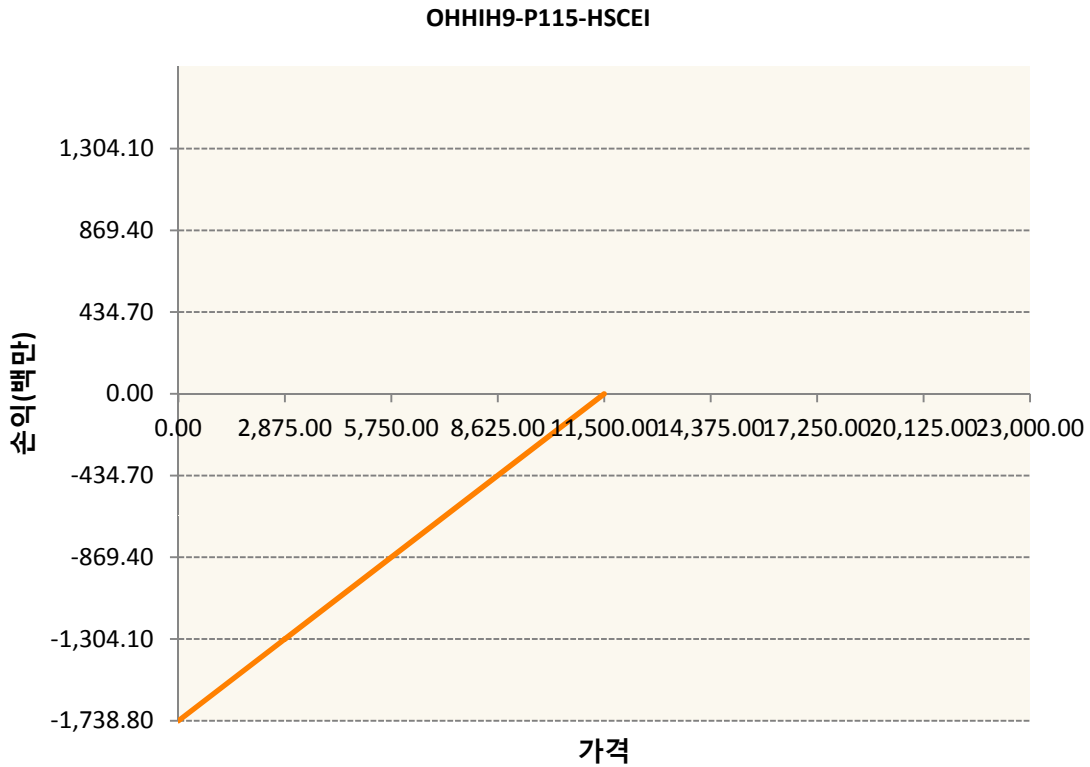


OHHIH9-C115-HSCEI



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	186
OHHIH9-C11 HSCEI	98
OHHIH9-C11 HSCEI	139
OHHIH9-P11 HSCEI	98
OHHIH9-P11 HSCEI	139

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	766

공시일	2019-03-21
기준일	2019-03-20

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

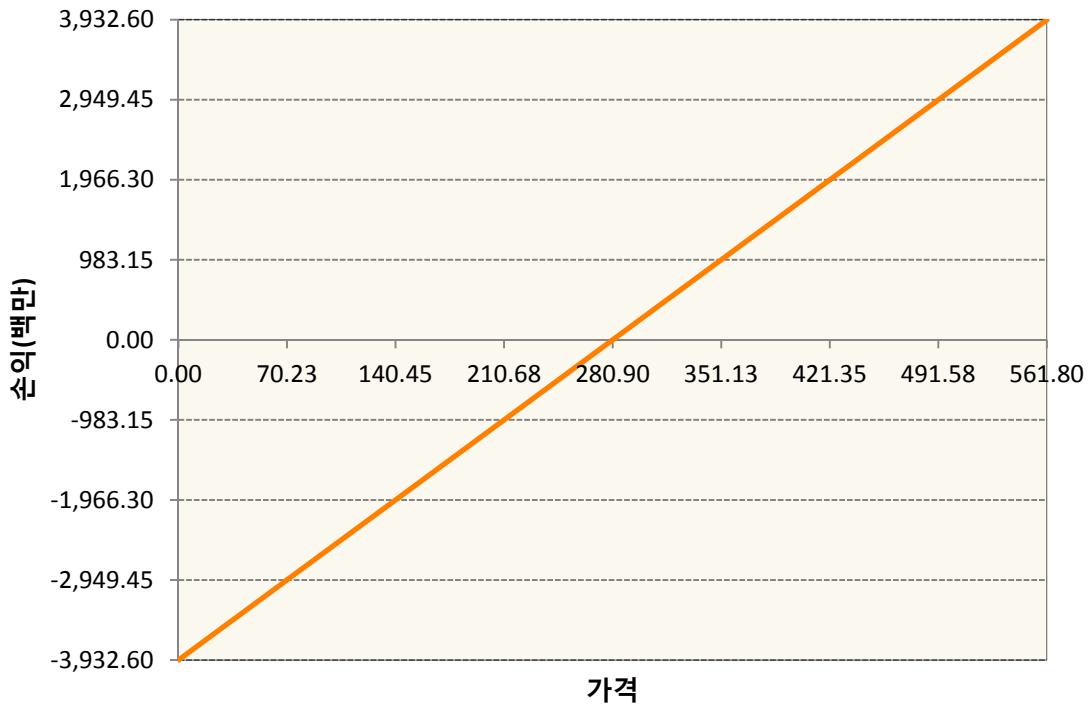
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

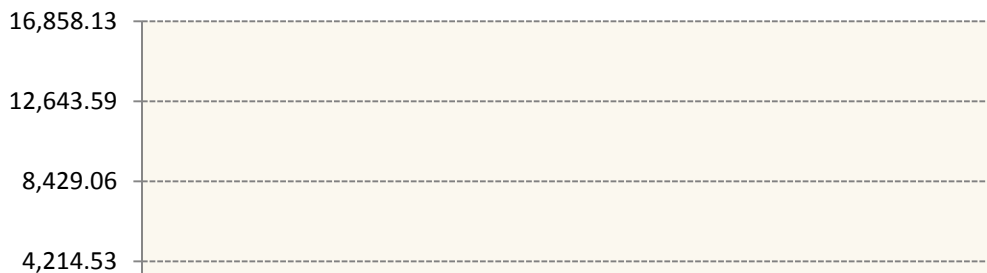
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,933	0	3,933	장내
누계	유가증권	스왑	35,836	0	35,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,649	-34,649	장내

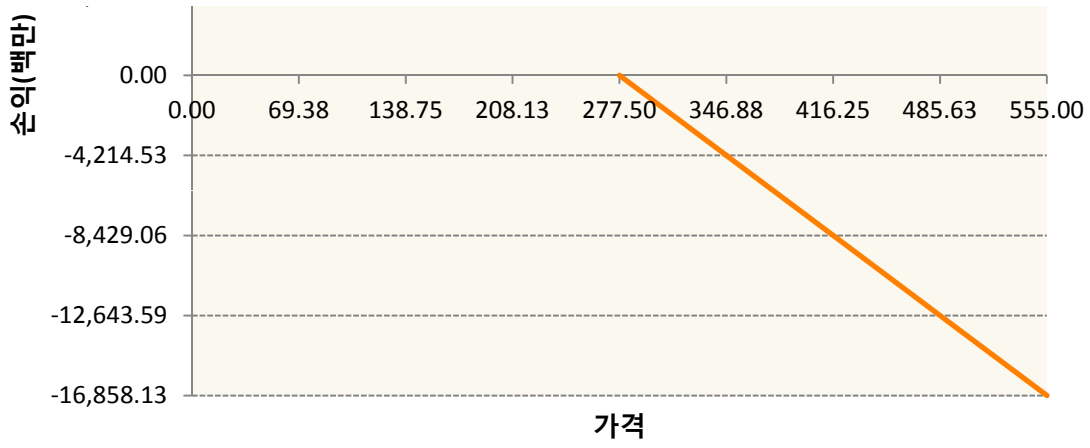
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

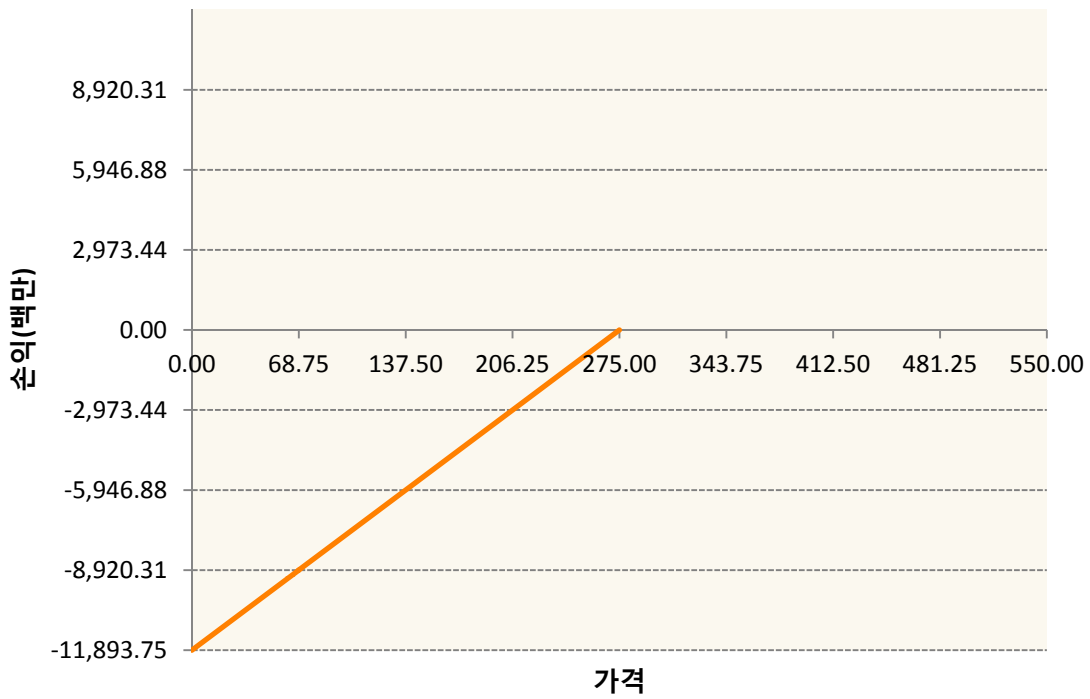


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

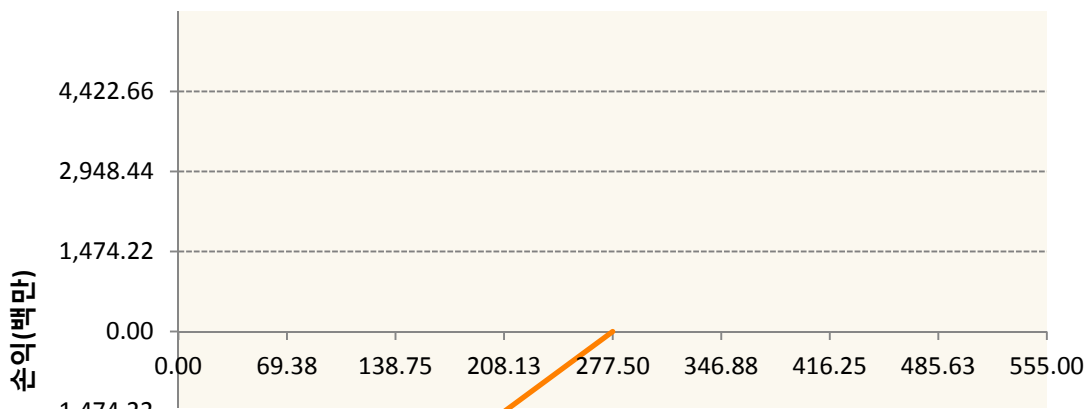


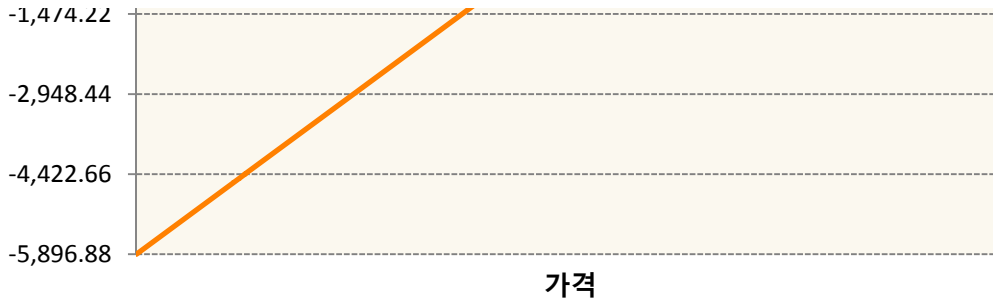


**KR4301P42750-2019-04 풋275**



**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						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						1,097
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	484	472	459	443	425	405	384
-5.33%	434	412	387	361	334	306	277
-2.67%	317	285	251	218	184	150	116
0%	106	71	35	0	-35	-71	-106
2.67%	-202	-231	-261	-291	-323	-355	-388
5.33%	-584	-602	-623	-645	-669	-695	-722
8.00%	-1,009	-1,018	-1,029	-1,043	-1,059	-1,077	-1,097
KR4301P42750                      2019-04 풋275							692
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-680	-680	-681	-683	-685	-688	-692
-5.33%	-366	-371	-377	-384	-392	-400	-409
-2.67%	-107	-119	-132	-145	-158	-171	-184
0%	34	23	12	0	-12	-24	-37
2.67%	74	70	66	60	54	46	39
5.33%	79	79	78	76	74	72	68
8.00%	80	80	80	79	79	78	77
KR4301P42776                      2019-04 풋277.5							371
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-368	-368	-368	-369	-369	-370	-371
-5.33%	-211	-213	-215	-217	-220	-223	-226
-2.67%	-71	-76	-82	-87	-93	-99	-105
0%	19	13	6	0	-7	-13	-20
2.67%	52	49	46	42	37	33	28
5.33%	58	57	56	55	53	51	49
8.00%	58	58	58	58	57	57	56

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

(단위:백만원)

**5,467**

공시일	2019-03-21
기준일	2019-03-20

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

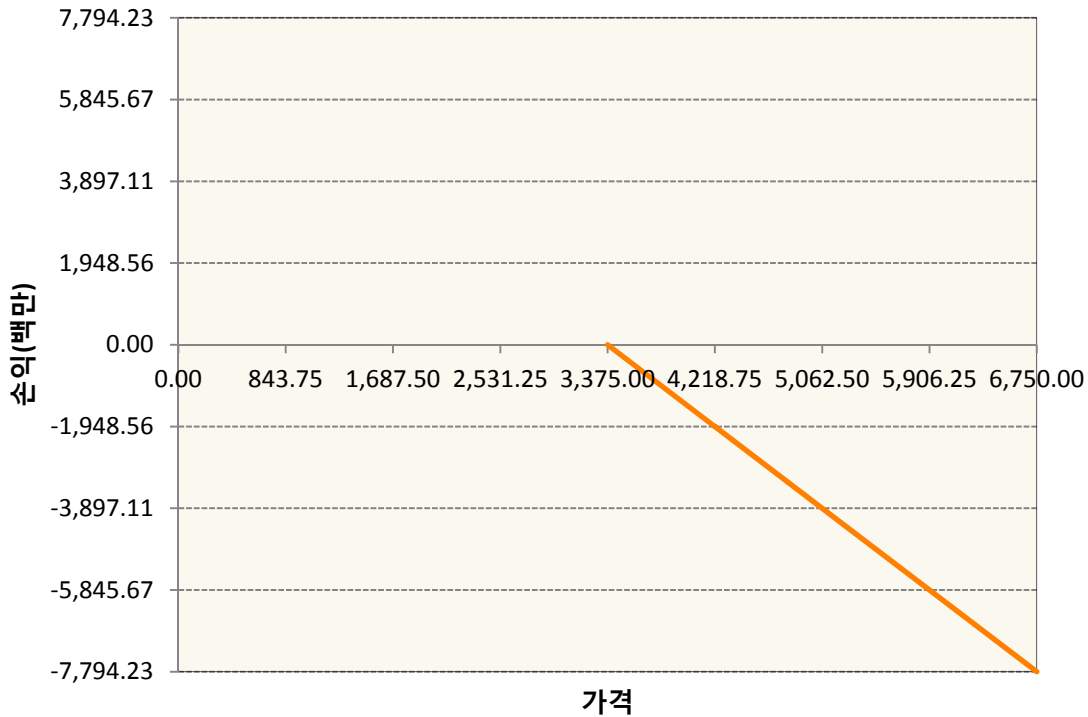
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

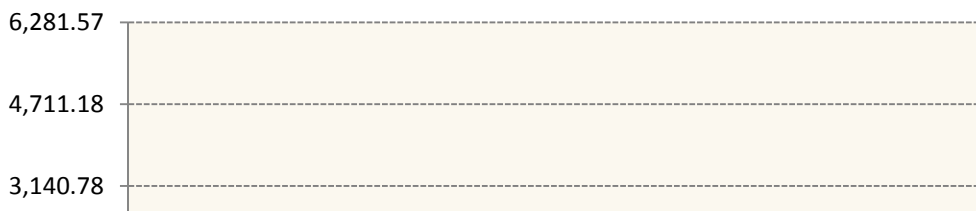
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,222	0	7,222	
누계	유가증권	스왑	60,572	0	60,572	장외
누계	유가증권	옵션	0	28,152	-28,152	장내
누계	통화	선도	0	25,660	-25,660	장외

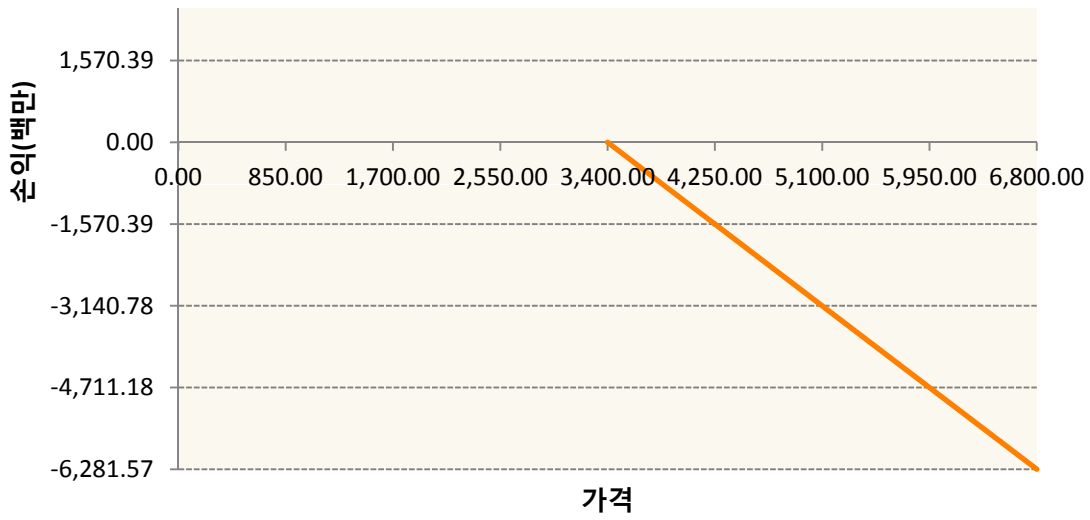
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXJ9-C3375-EURO STOXX 50**

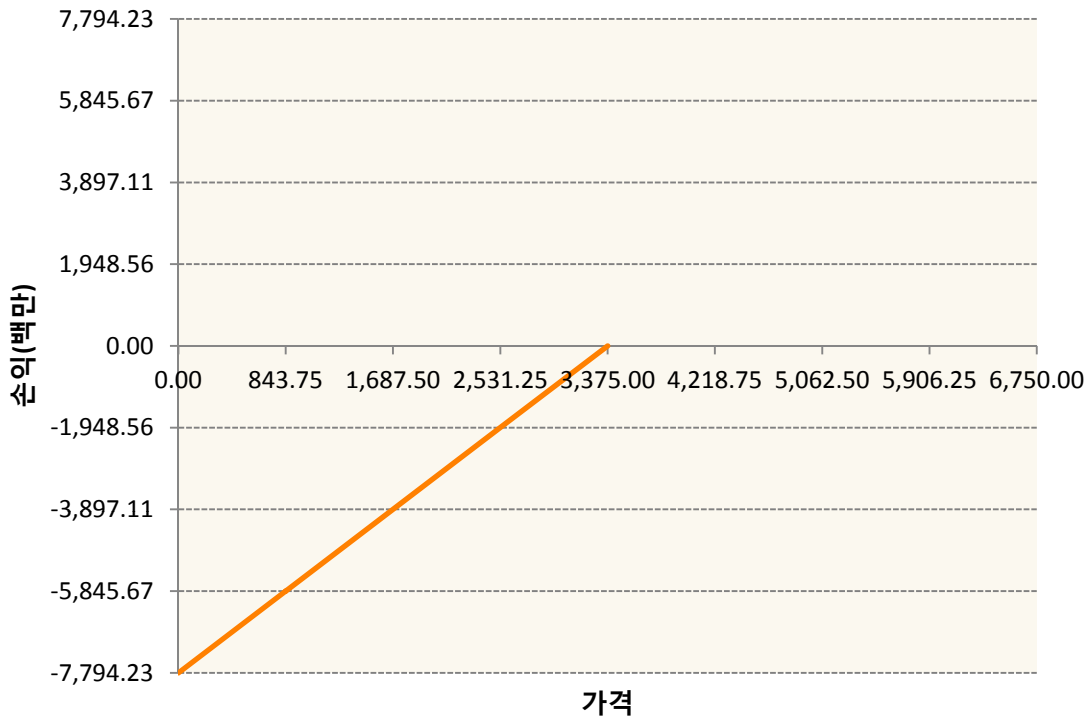


**OESXJ9-C3400-EURO STOXX 50**

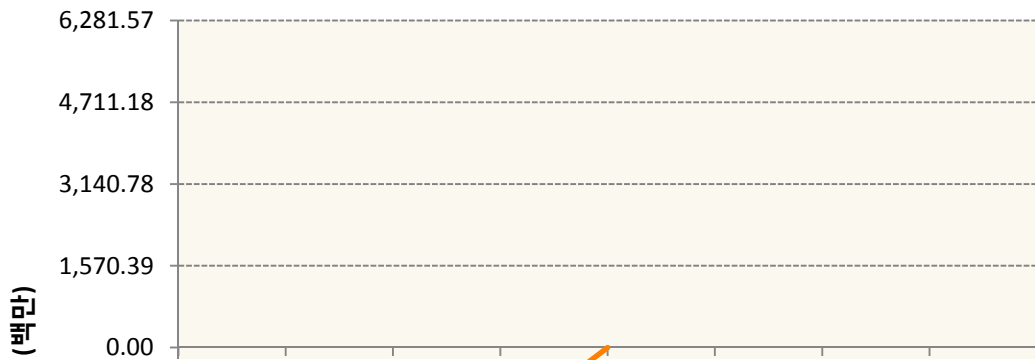


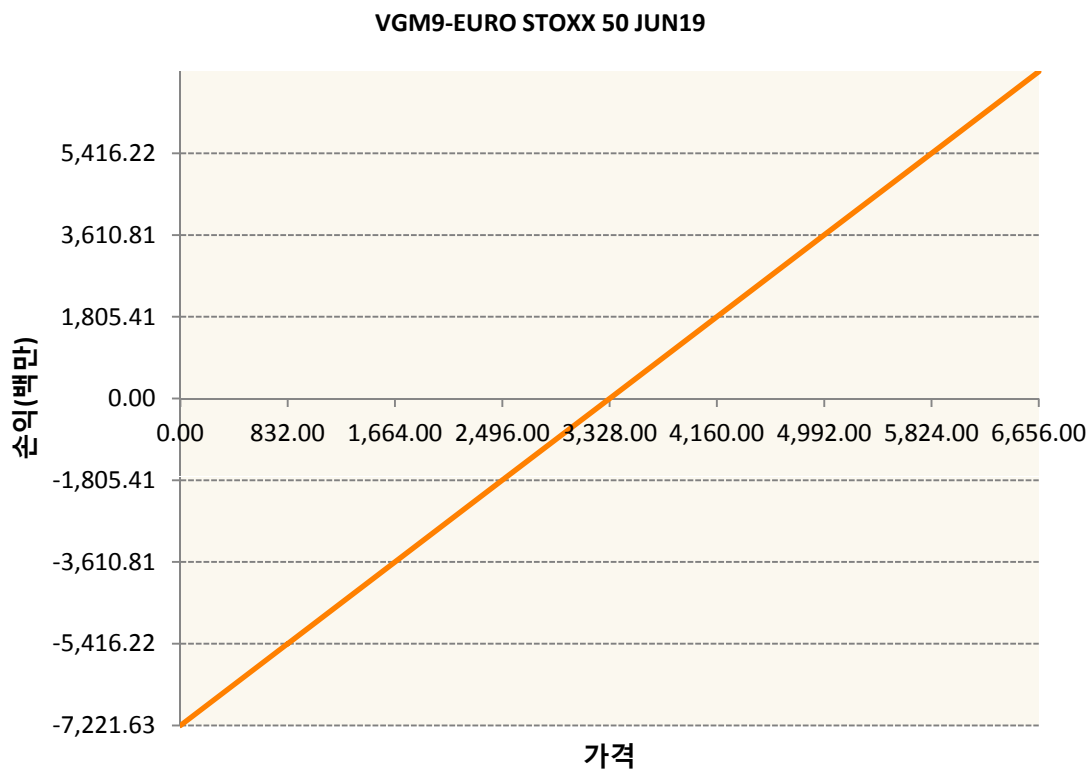
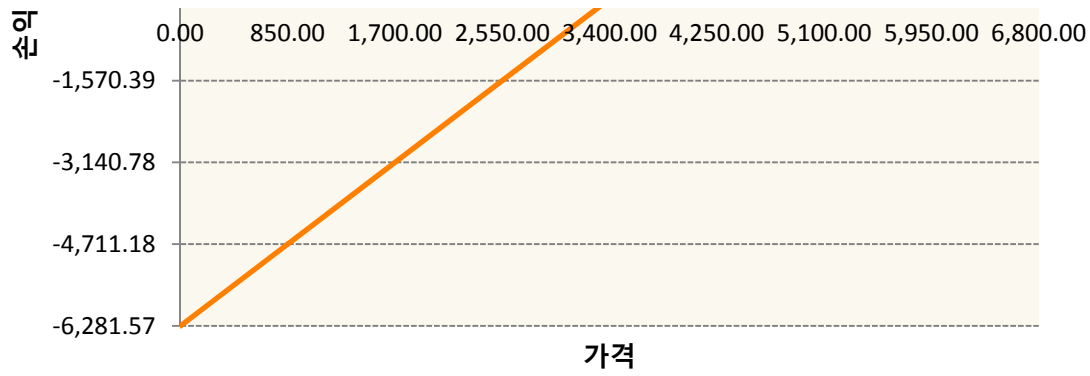


OESXJ9-P3375-EURO STOXX 50



OESXJ9-P3400-EURO STOXX 50





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	156
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E	821
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	411
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	821
OESXJ9-C33 EURO STOXX 50	624
OESXJ9-C34 EURO STOXX 50	503
OESXJ9-P33 EURO STOXX 50	624
OESXJ9-P34 EURO STOXX 50	503
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	578

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

(단위:백만원)

3,244



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

(단위:백만원)

1,098



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

(단위:백만원)

94



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

(단위:백만원)

136



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

(단위:백만원)

42

공시일	2019-03-21
기준일	2019-03-20

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

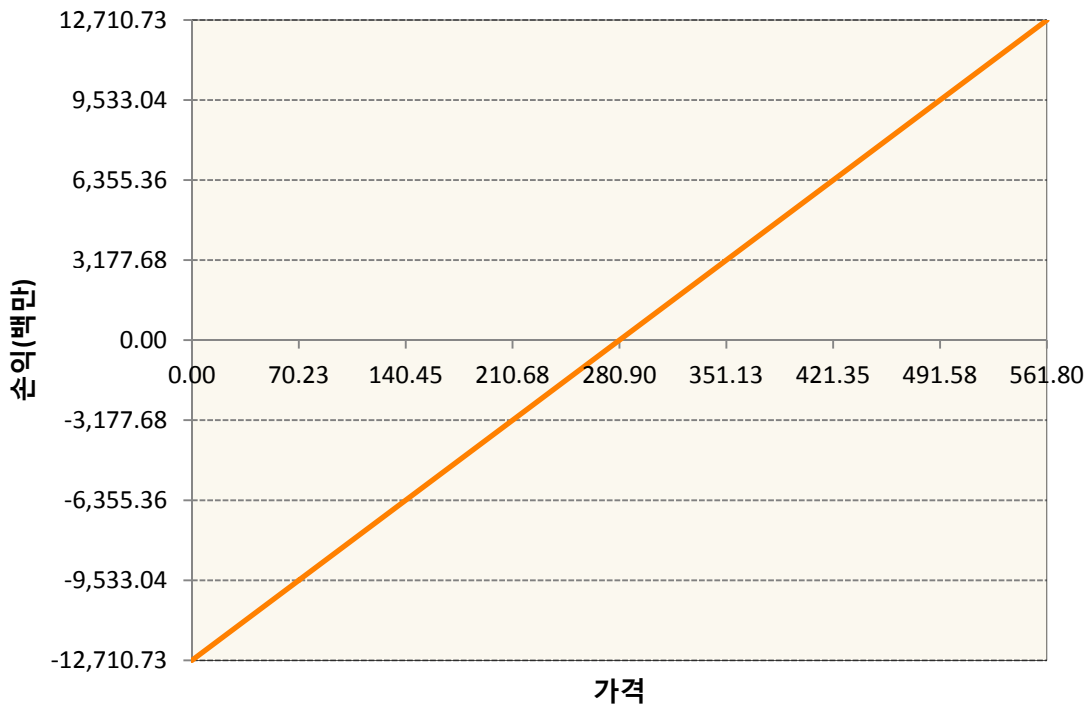
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

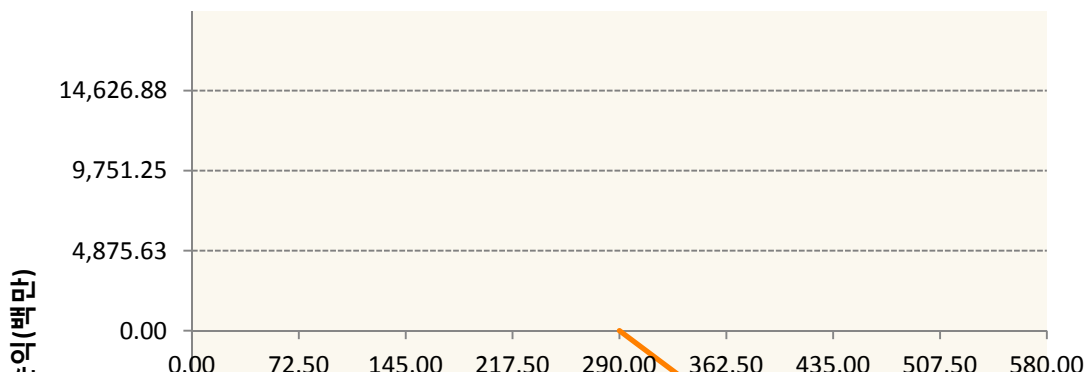
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,711	0	12,711	장내
누계	유가증권	옵션	1,867	24,036	-22,169	장내

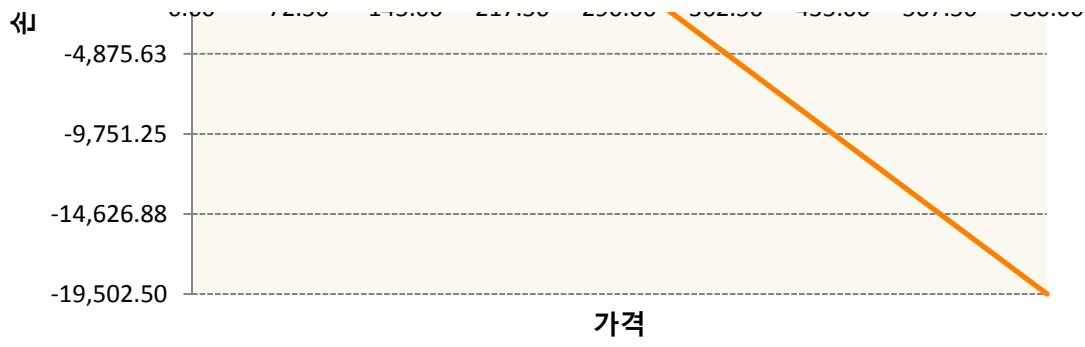
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

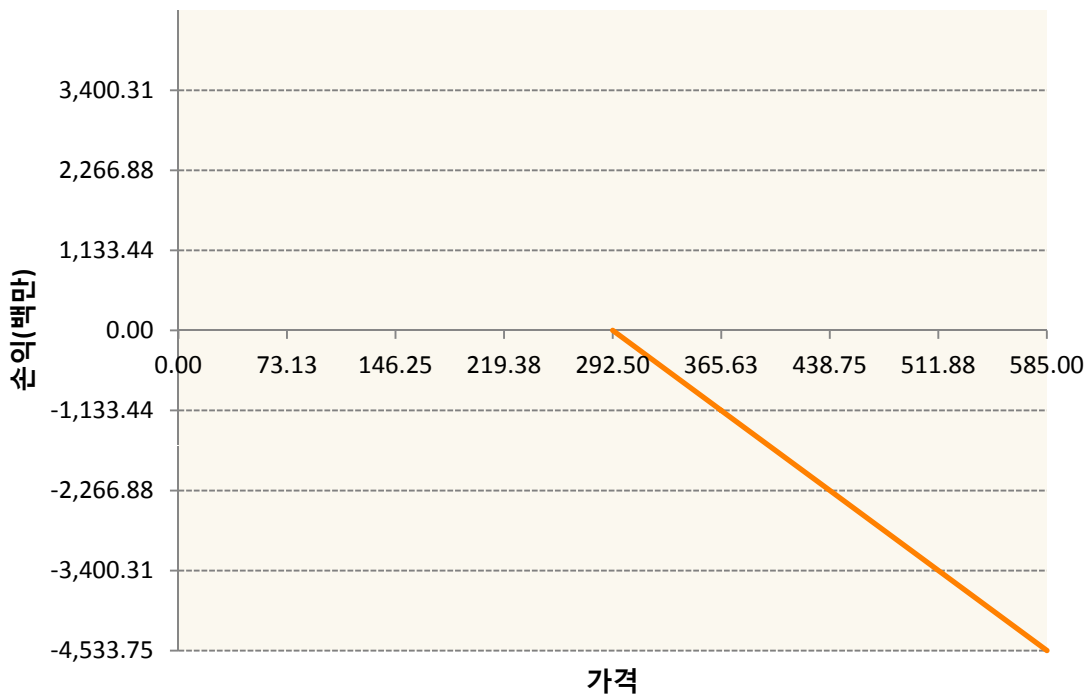


KR4201P42901-2019-04 콜290

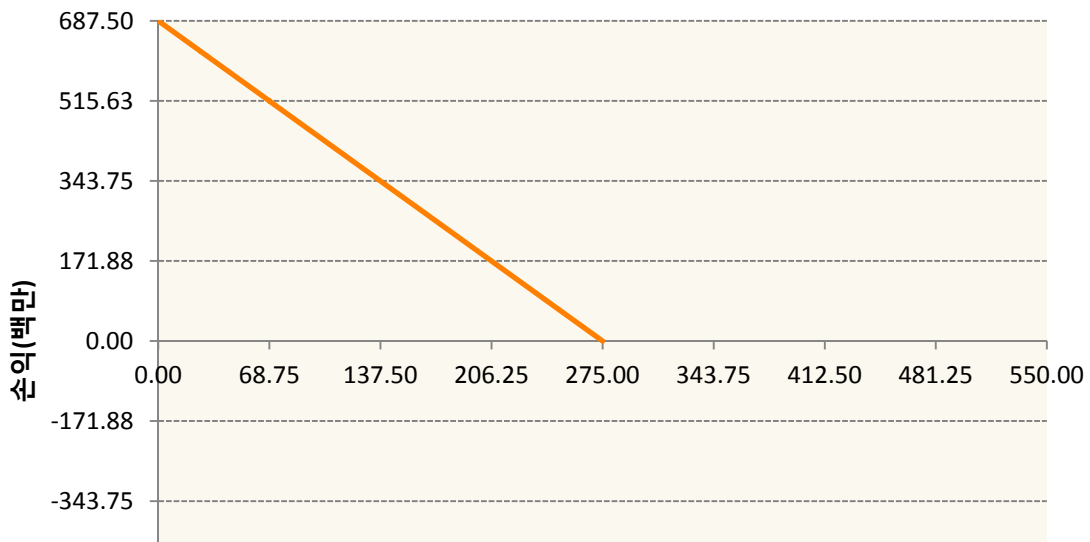


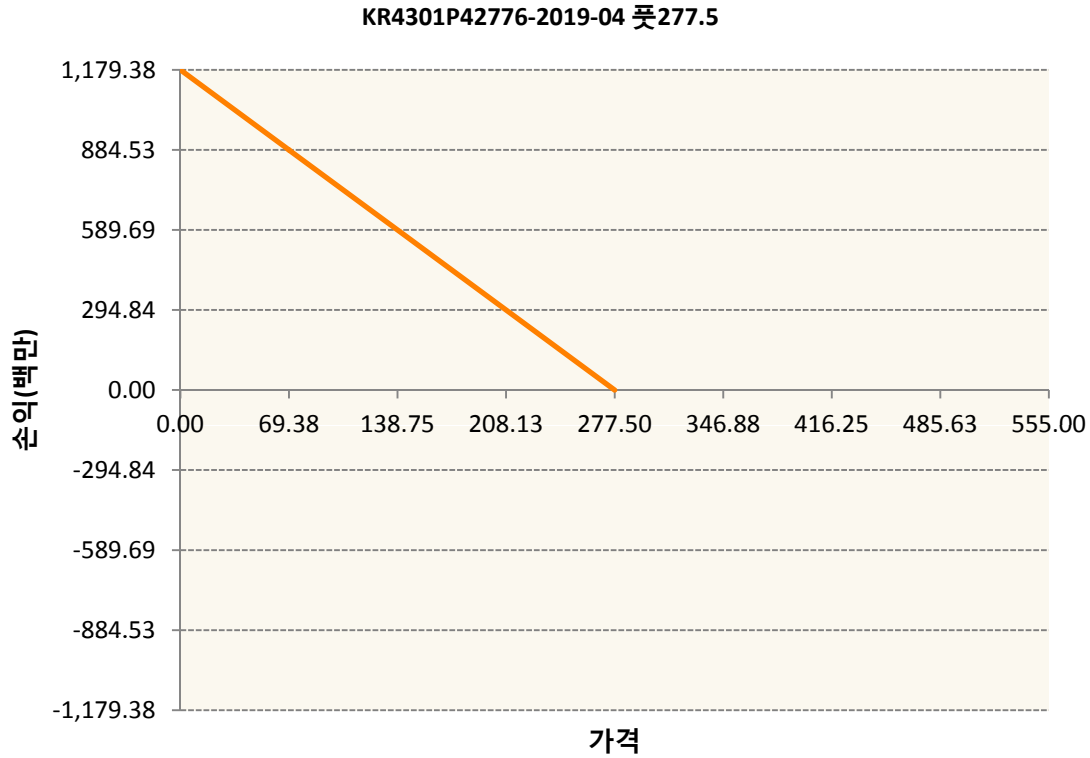
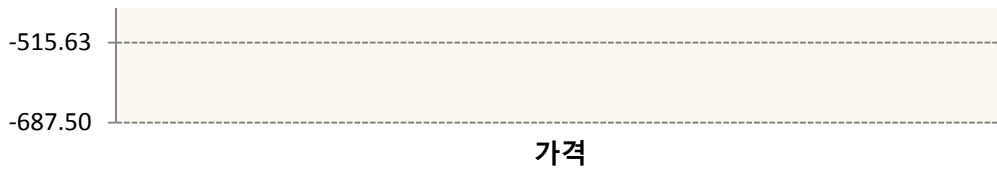


KR4201P42927-2019-04 콜292.5



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						905
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	216	214	210	204	196	187	175	
-5.33%	208	200	190	177	161	144	124	
-2.67%	178	160	139	116	90	63	35	

0%	98	67	34	0	-35	-71	-107
2.67%	-67	-107	-147	-188	-228	-269	-309
5.33%	-336	-376	-415	-455	-496	-536	-577
8.00%	-704	-734	-765	-799	-833	-869	-905
KR4201P42927                      2019-04 콜292.5							193
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	40	40	39	38	37	35	33
-5.33%	39	38	36	33	30	27	23
-2.67%	34	31	27	22	17	11	5
0%	20	14	7	0	-7	-15	-23
2.67%	-11	-19	-28	-38	-47	-56	-65
5.33%	-65	-74	-84	-93	-103	-112	-122
8.00%	-142	-150	-158	-167	-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	39	40	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%	-4	-4	-4	-3	-3	-3	-2
5.33%	-5	-5	-5	-4	-4	-4	-4
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-4
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	43	44	45	45
-2.67%	14	15	16	17	19	20	21
0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-10	-10	-9	-8	-7	-7	-6
5.33%	-12	-11	-11	-11	-11	-10	-10
8.00%	-12	-12	-12	-12	-11	-11	-11

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

(단위:백만원)

**1,847**

공시일	2019-03-21
기준일	2019-03-20

## 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	2019-03-21
기준일	2019-03-20

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	339	0	339	
누계	유가증권	수익증권	7,977	0	7,977	

### 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	2019-03-21
기준일	2019-03-20

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	904	0	904	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	48,152	0	48,152	
누계	통화	선도	0	63,653	-63,653	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
FX21019H03 KRW/USD 22-04-19E		362

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

(단위:백만원)

1,775

공시일	2019-03-21
기준일	2019-03-20

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

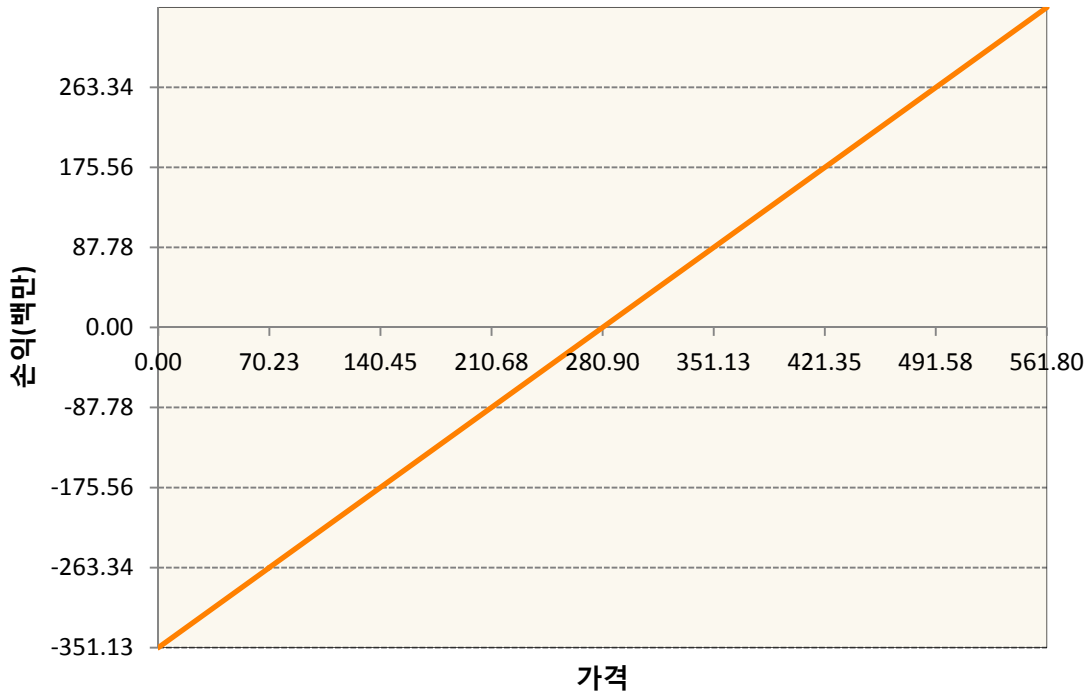
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

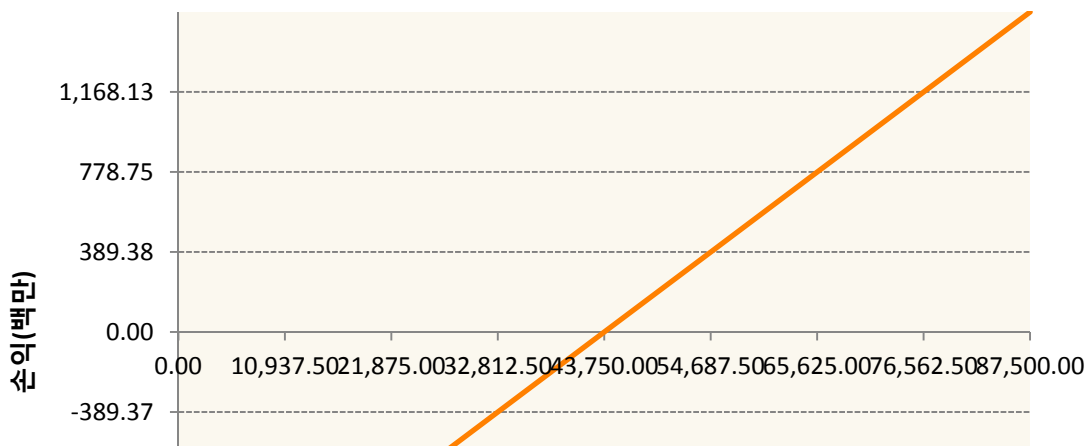
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,909	0	1,909	장내

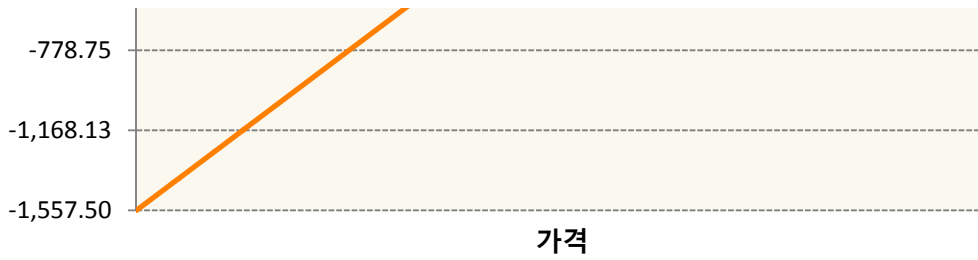
### 2. 만기시점의 손익구조

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%	-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%	125	125	125	125	125	125	125	

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

**169**

공시일	2019-03-21
기준일	2019-03-20

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

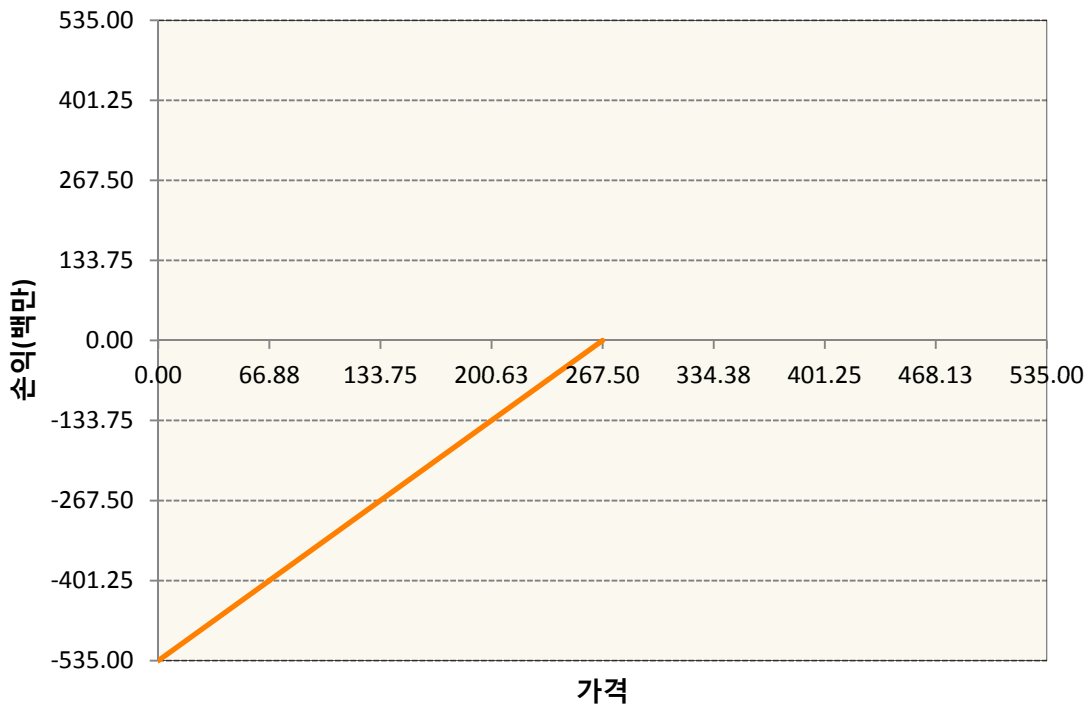
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

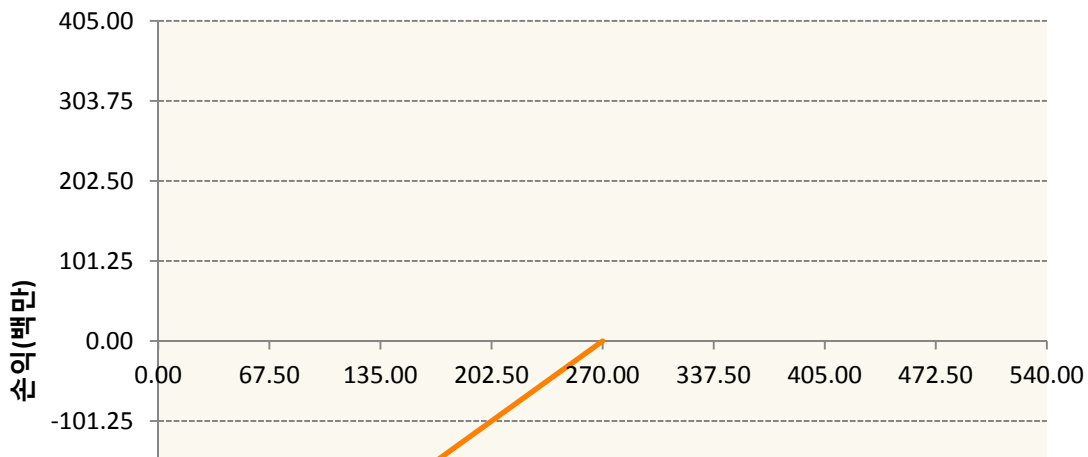
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	940	-940	장내

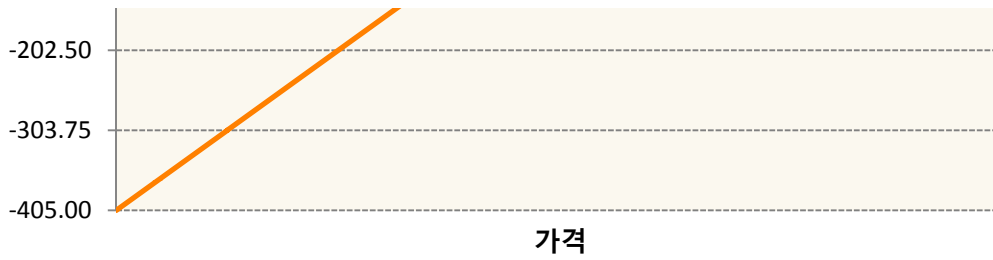
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4301P42677-2019-04 풋267.5**



**KR4301P42701-2019-04 풋270**





**3. 시나리오별 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	-20	-21	-21	-22
-5.33%	-8	-8	-9	-9	-10	-10	-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	0	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	-18	-19	-19
-5.33%	-8	-8	-9	-9	-9	-10	-10
-2.67%	-2	-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

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

29

공시일	2019-03-21
기준일	2019-03-20

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

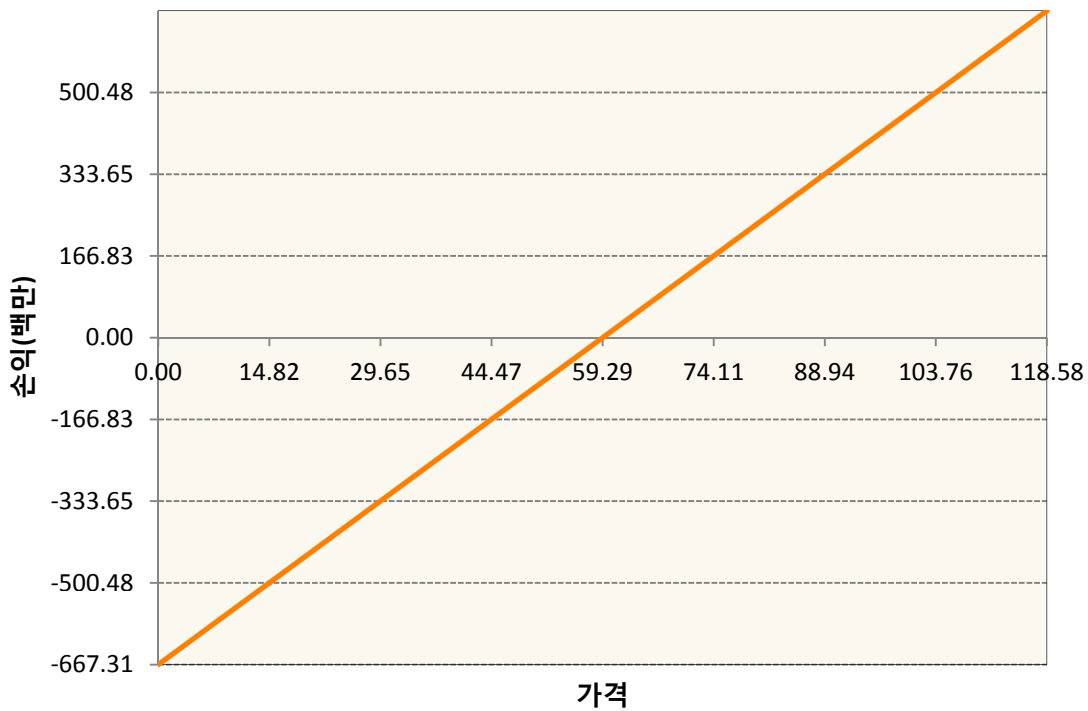
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

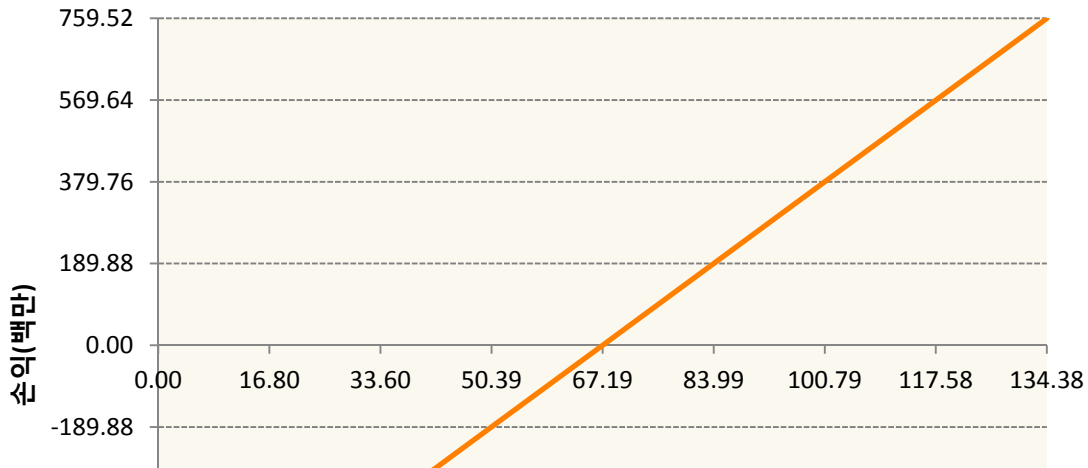
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,899	282	2,617	

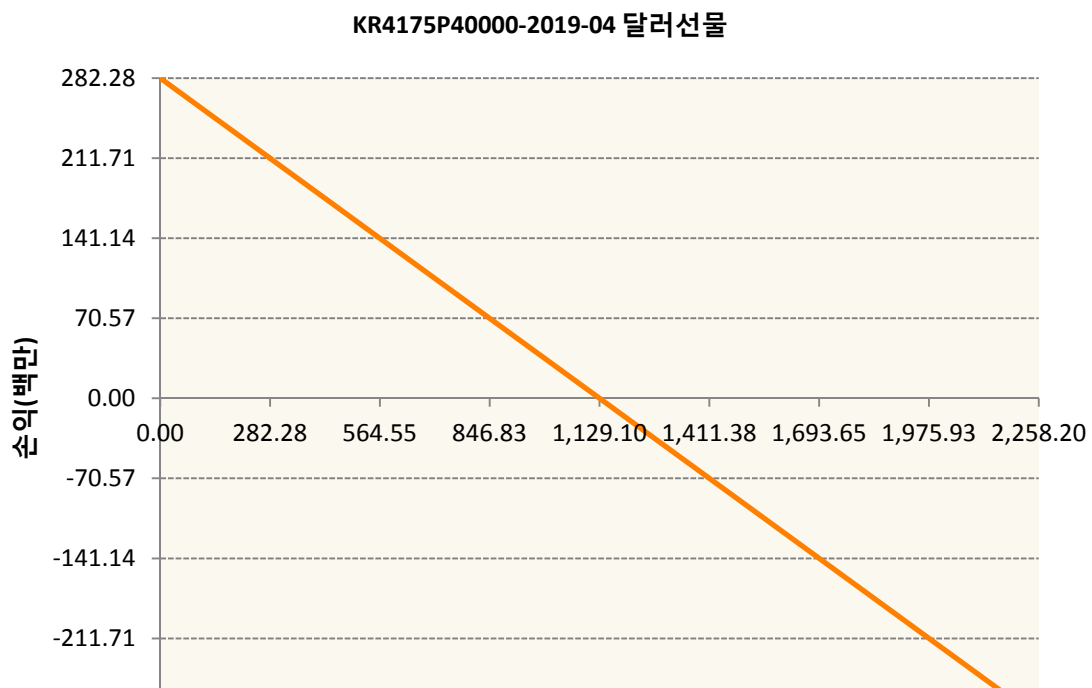
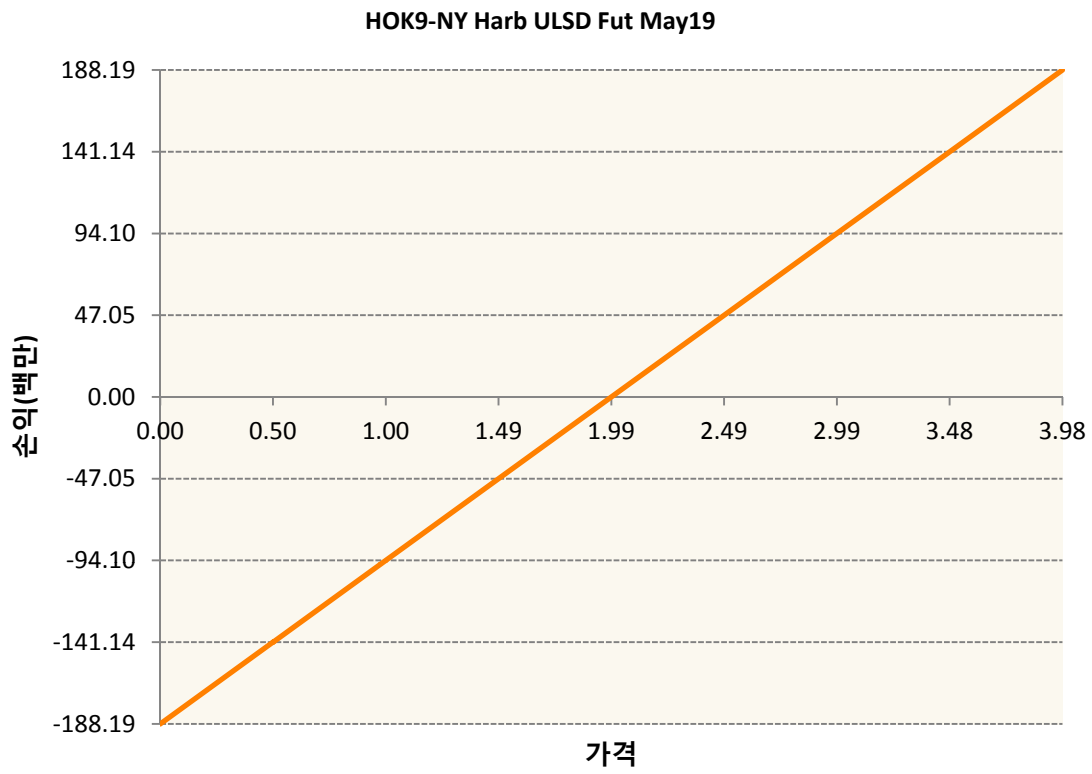
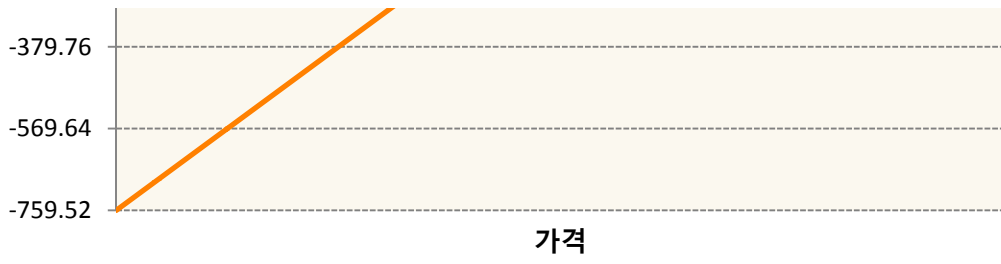
### 2. 만기시점의 손익구조

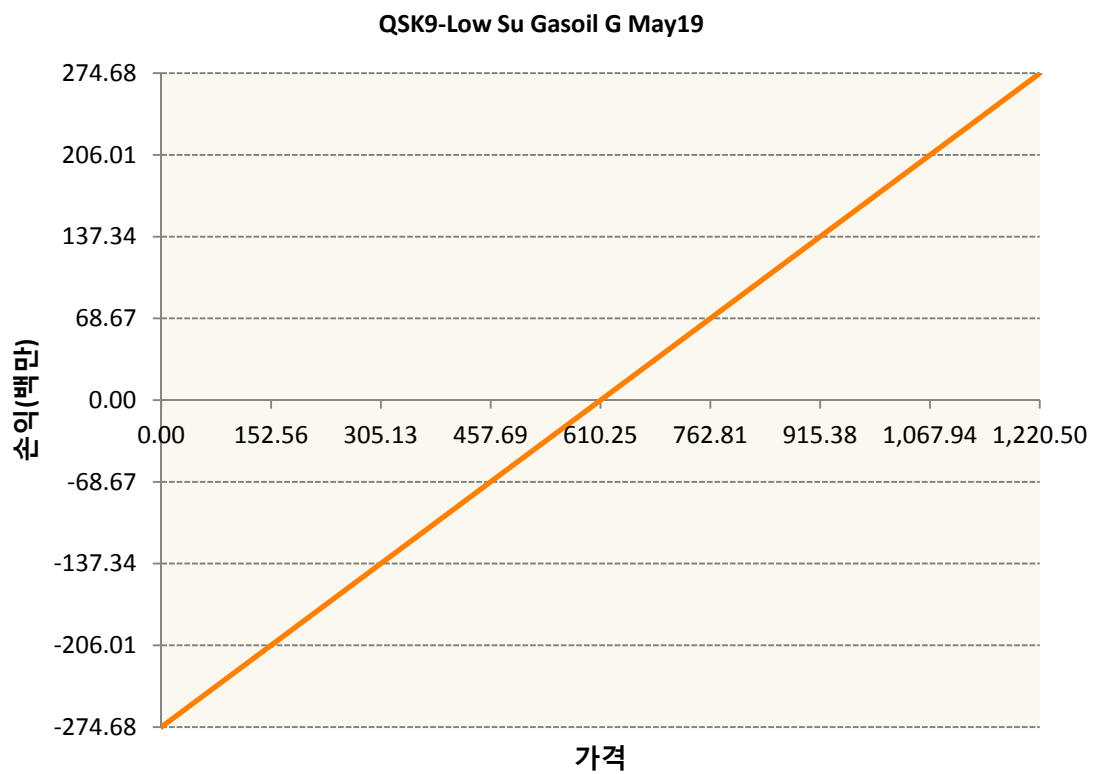
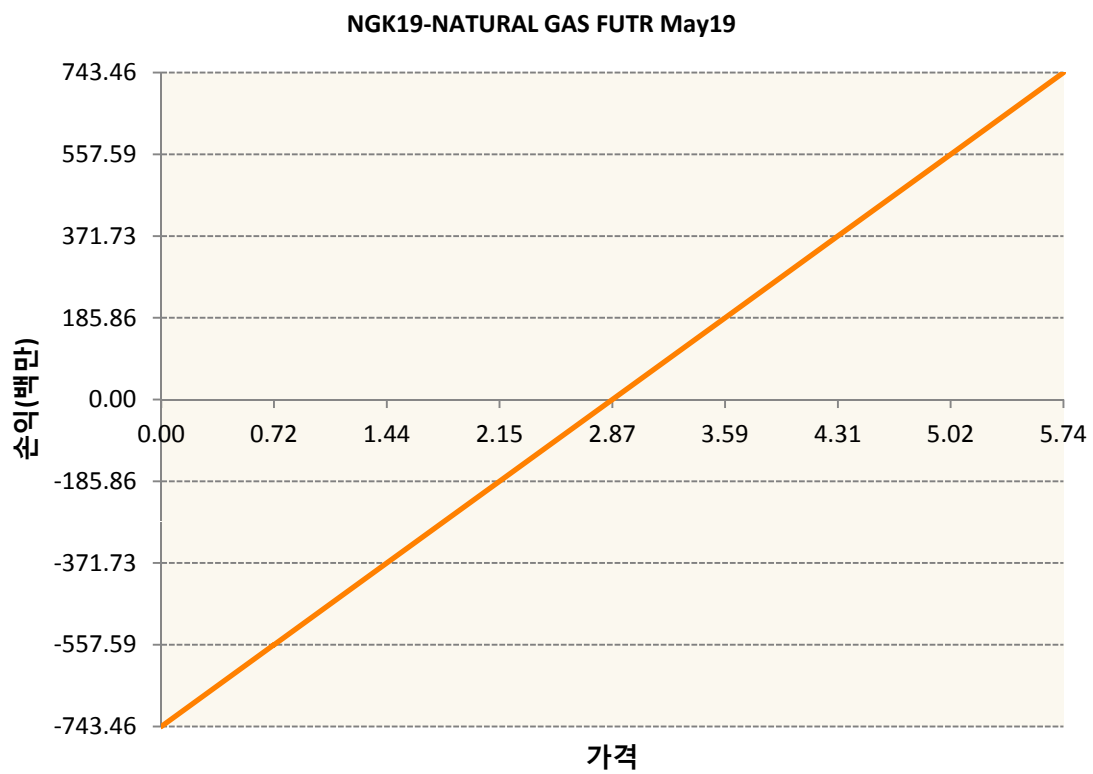
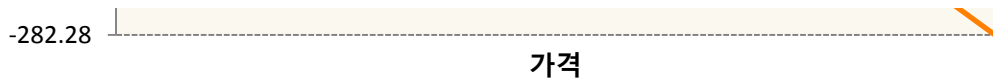
CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19



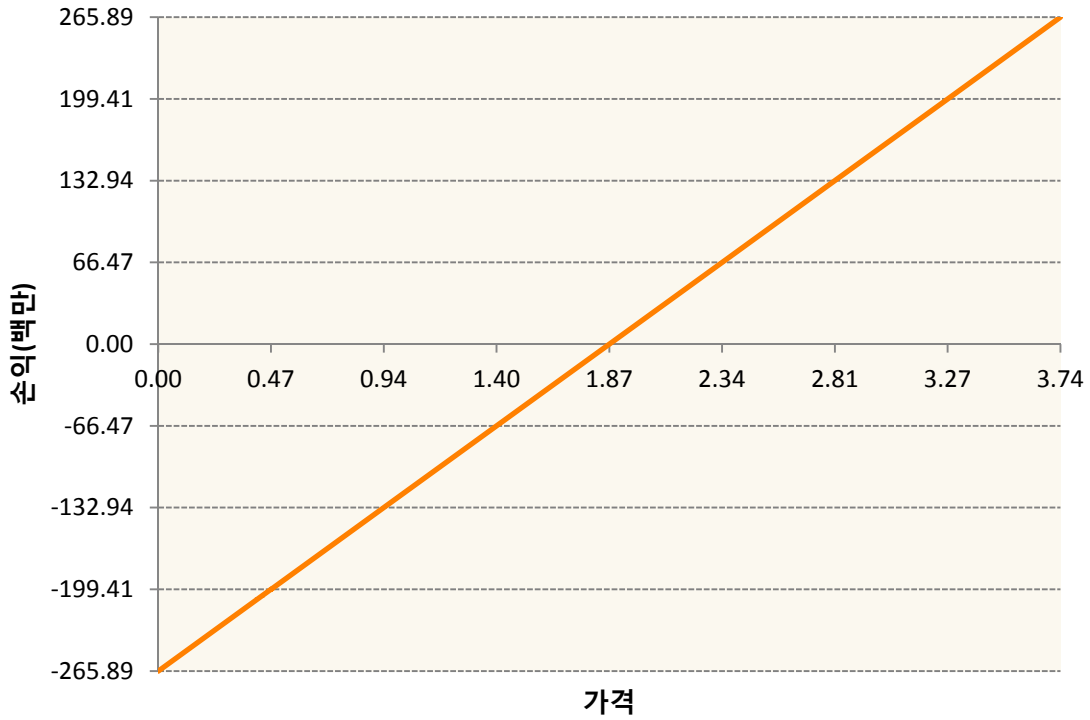
CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19







**XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19**



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

CLK9	WTI CRUDE FUTURE May19	53
CON9	BRENT CRUDE FUTR Jul19	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)

**441**

공시일	2019-03-21
기준일	2019-03-20

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

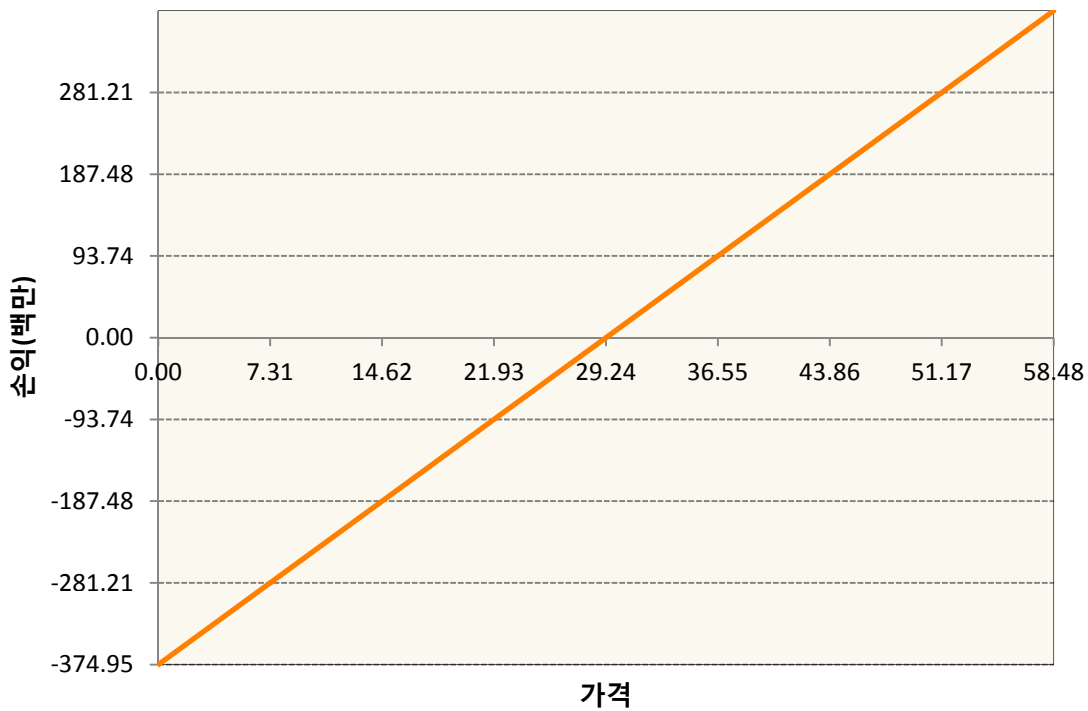
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

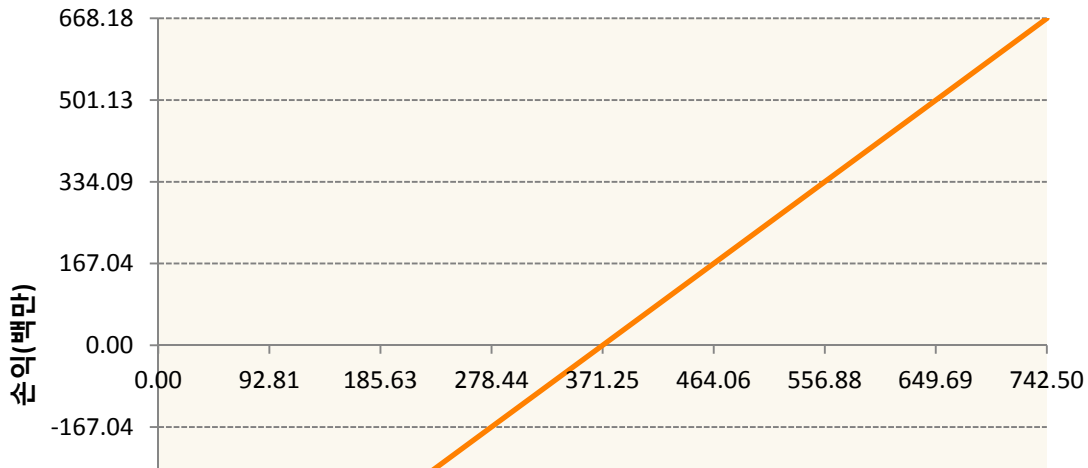
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,381	79	3,302	

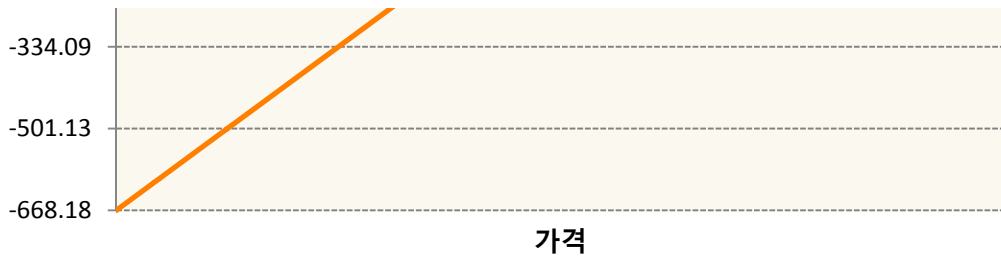
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19**

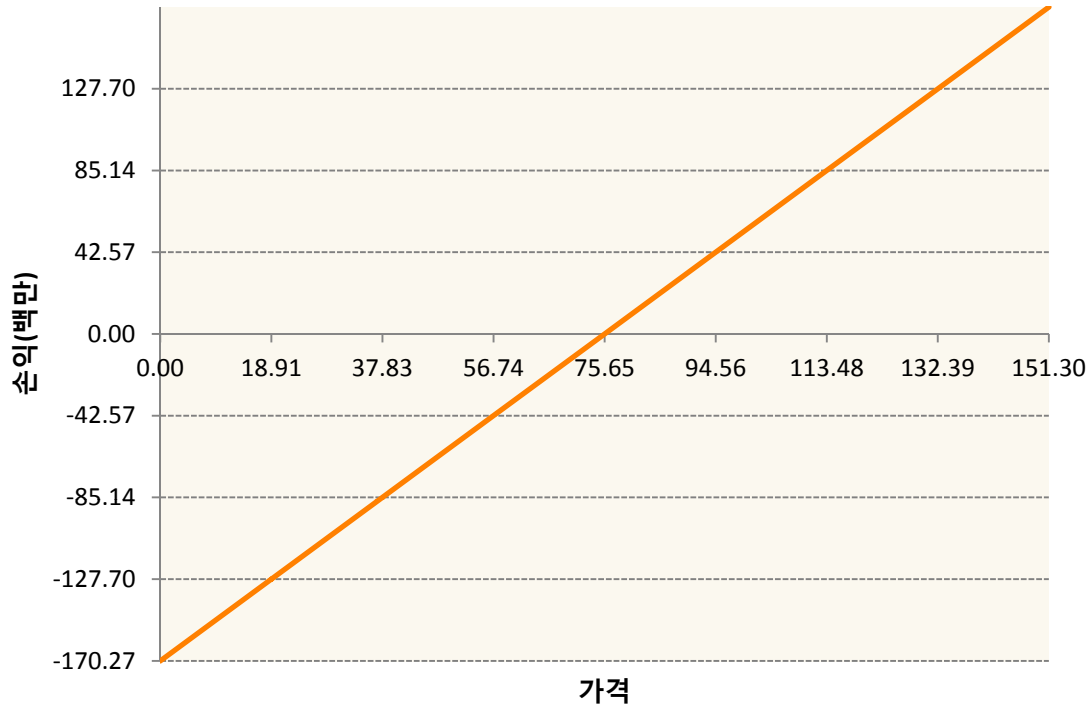


**CK9-CORN FUTURE May19**

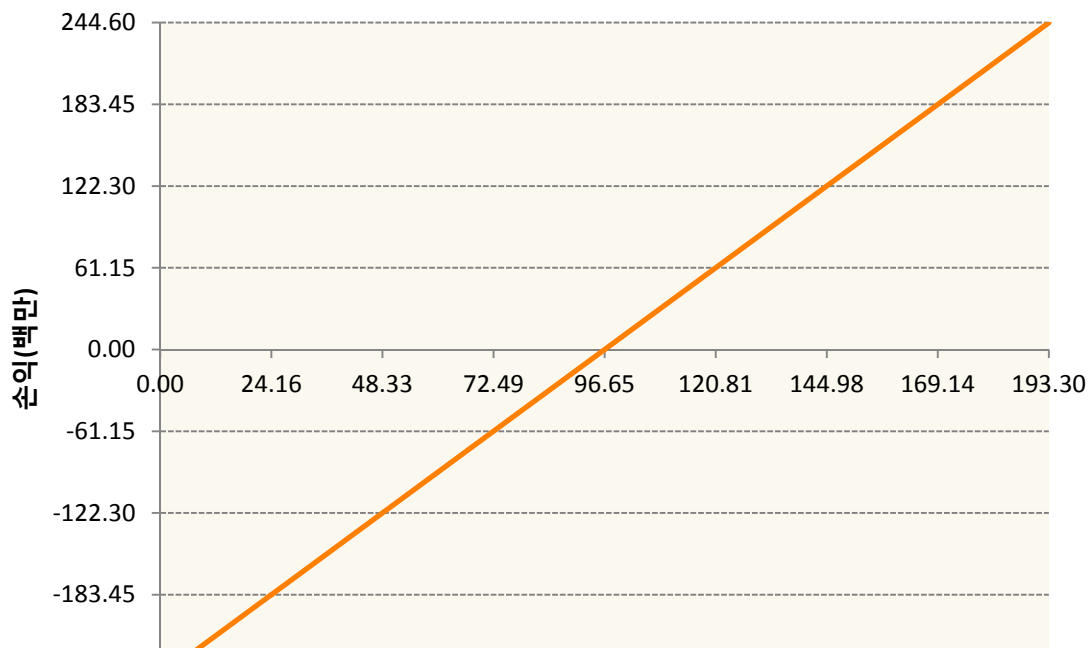


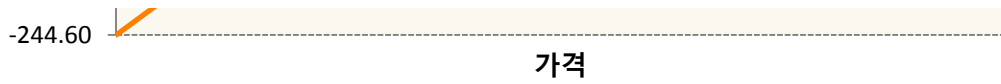


**CTK9-COTTON NO.2 FUTR May19**

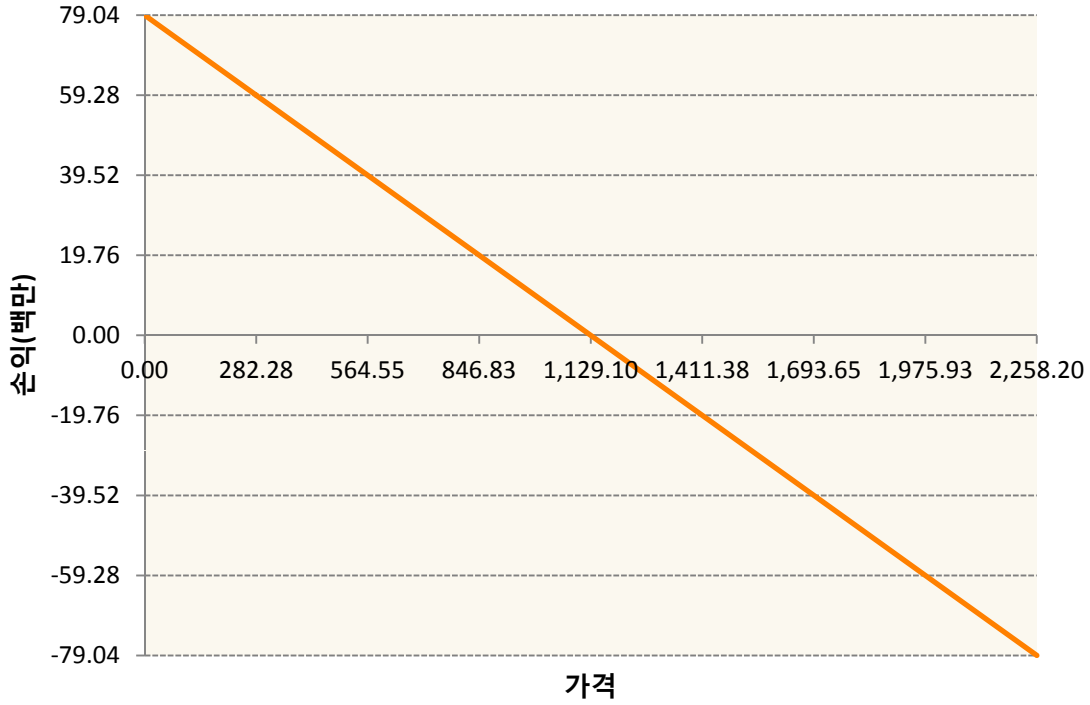


**KCK9-COFFEE 'C' FUTURE May19**

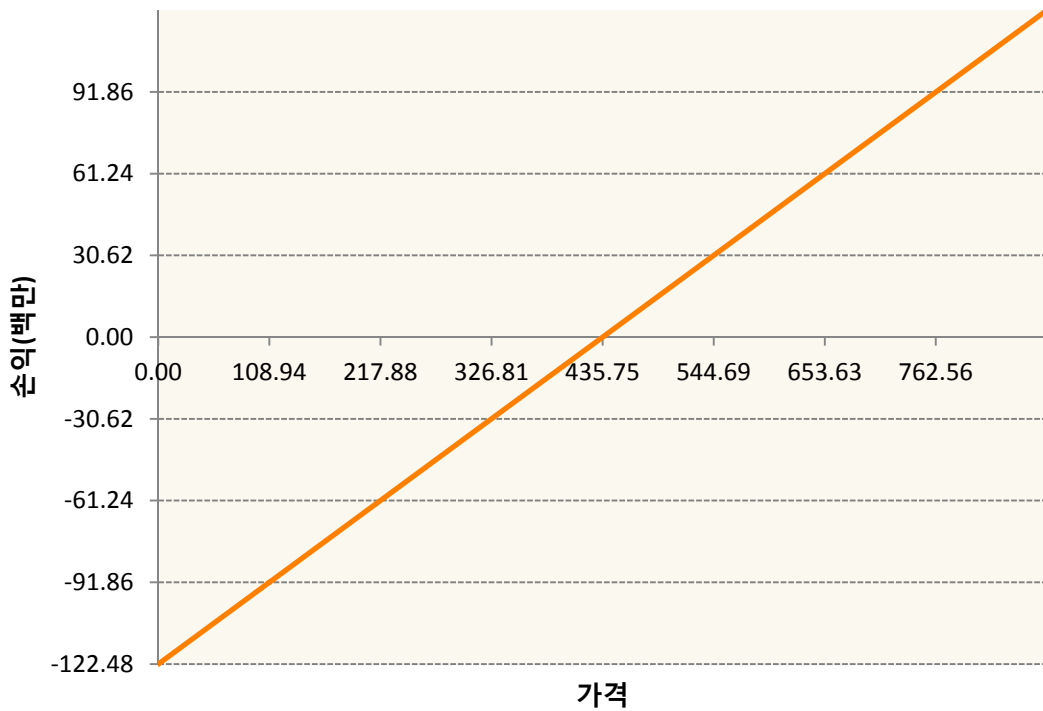




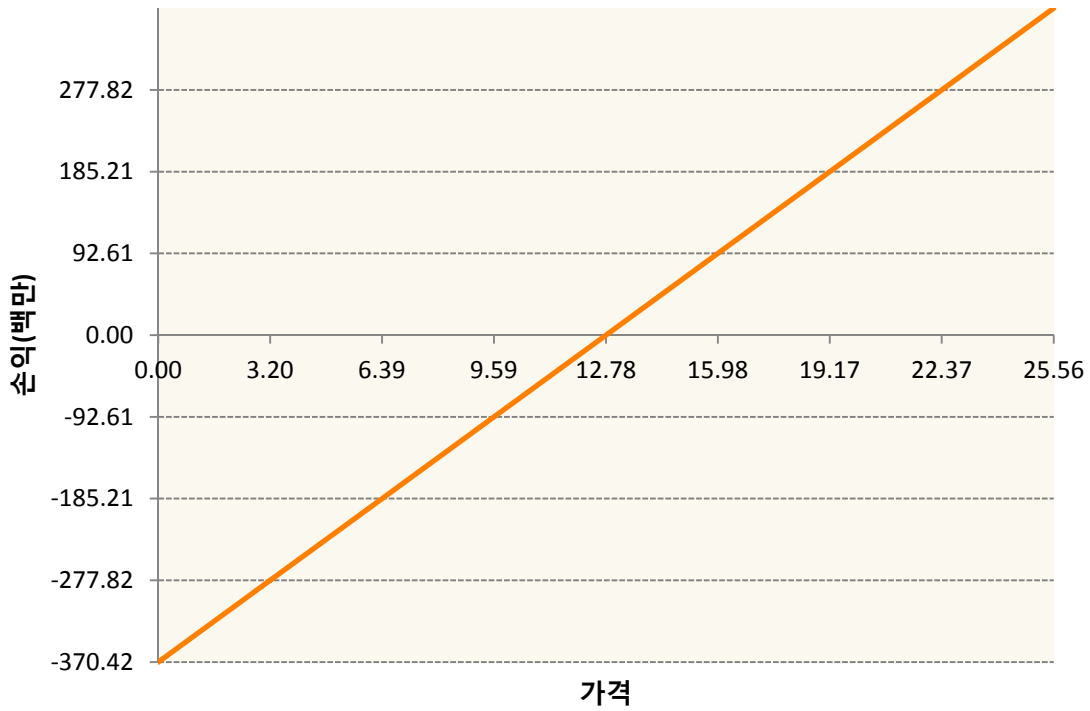
KR4175P40000-2019-04 달러선물



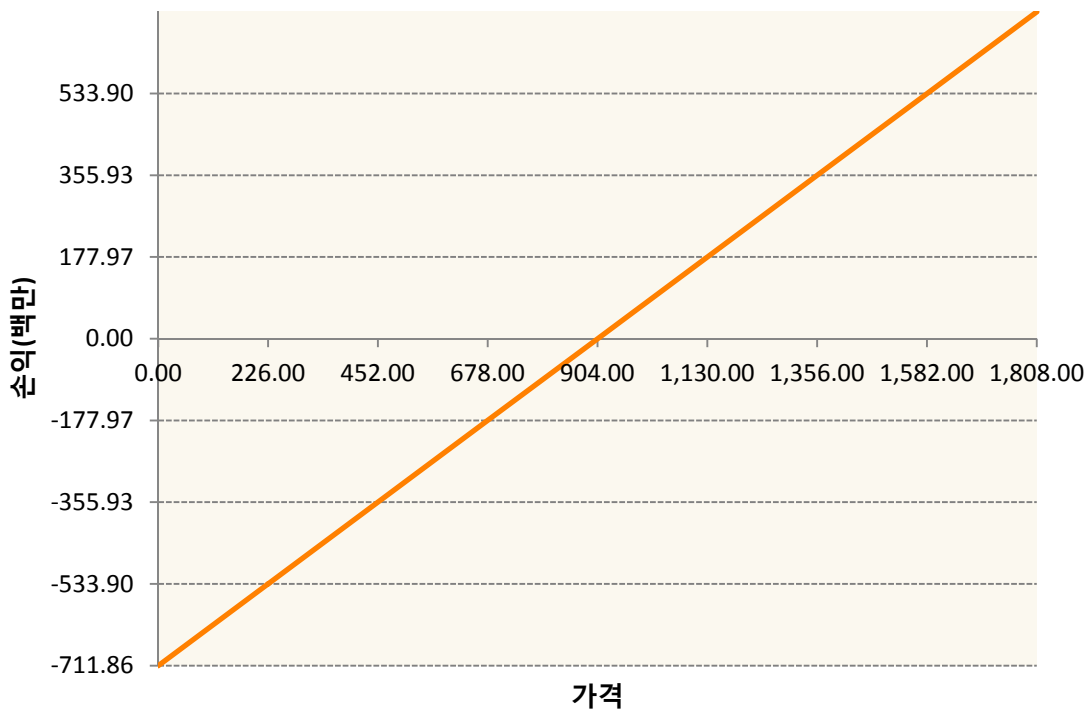
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

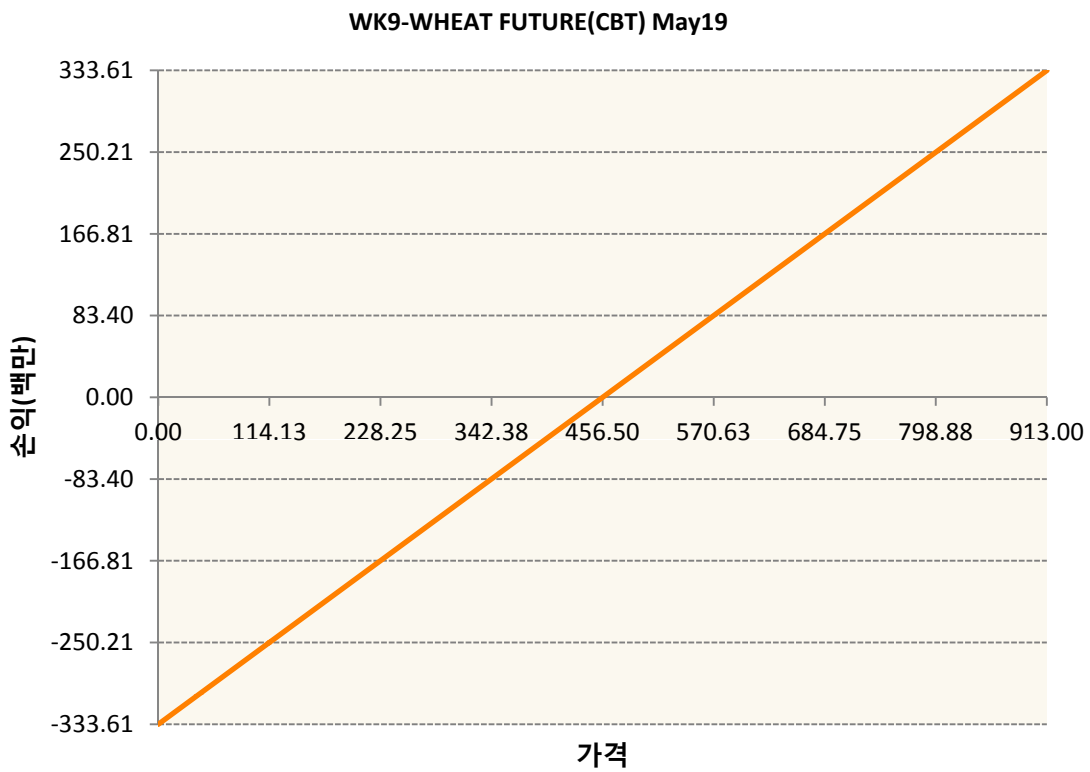
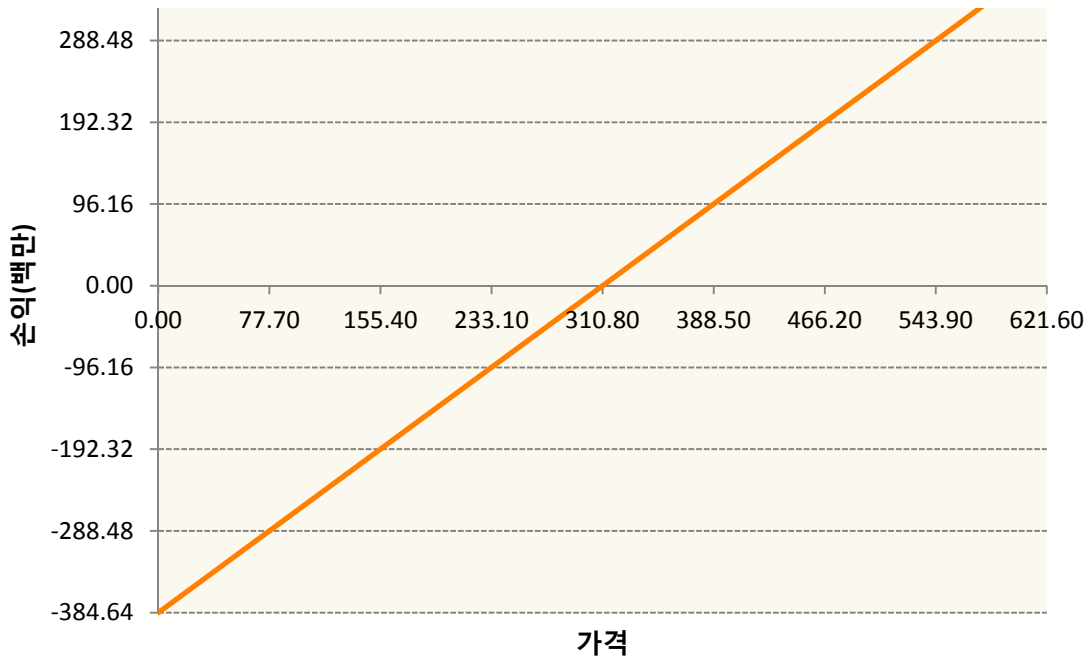


SK9-SOYBEAN FUTURE May19



SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





**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)

**271**