

공시일	2019-03-22
기준일	2019-03-21

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	2019-03-22
기준일	2019-03-21

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

1,129

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

656

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-03-22
기준일	2019-03-21

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)	349
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	96
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	163

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

957

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-03-22
기준일	2019-03-21

유로인덱스모(주식-파생형)

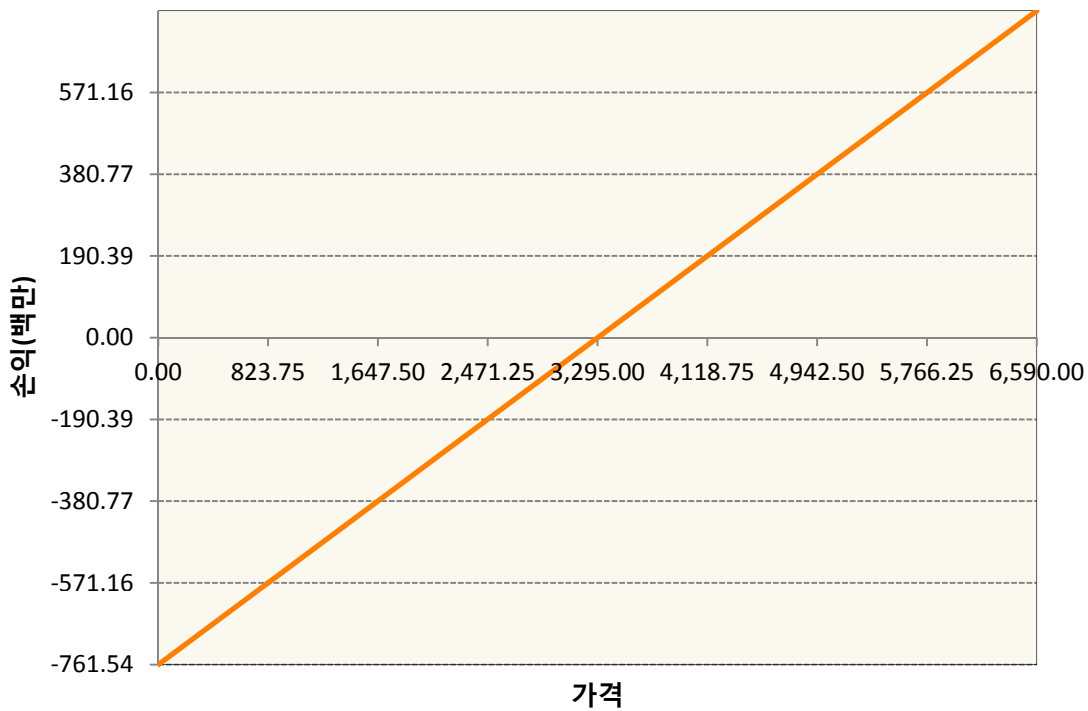
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	762	0	762	

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	2019-03-22
기준일	2019-03-21

차이나인덱스모(주식-파생형)

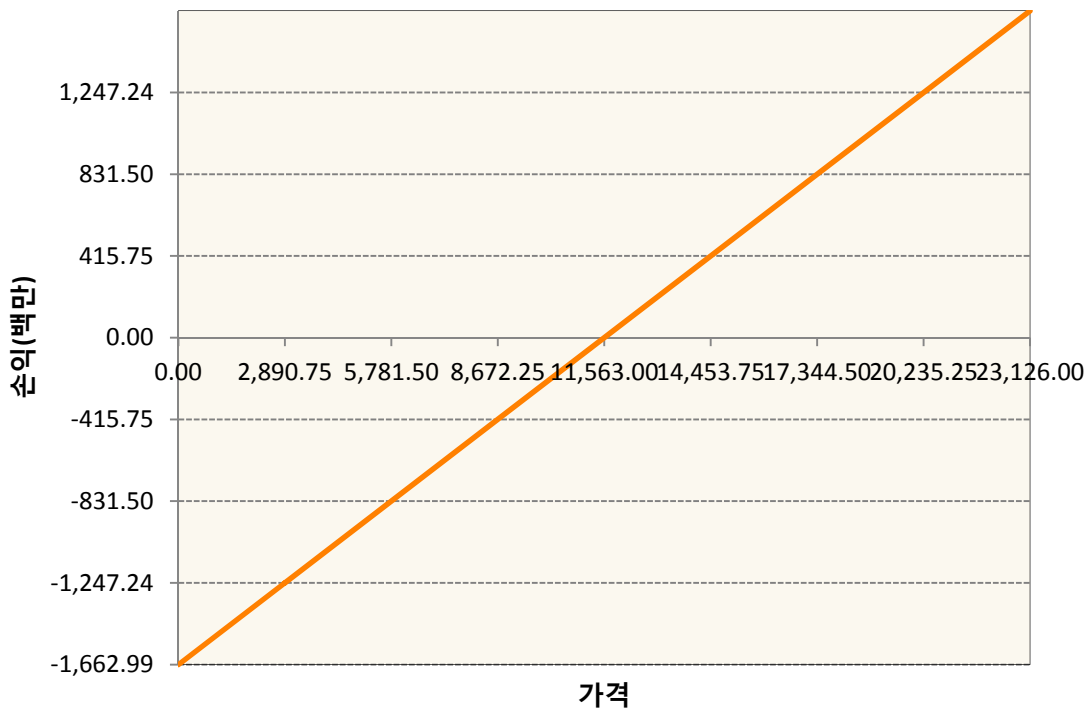
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,663	0	1,663	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCH9-HSCEI Futures Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH9	HSCEI Futures Mar19	133
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

136

공시일	2019-03-22
기준일	2019-03-21

커버드콜모(주식혼합-파생형)

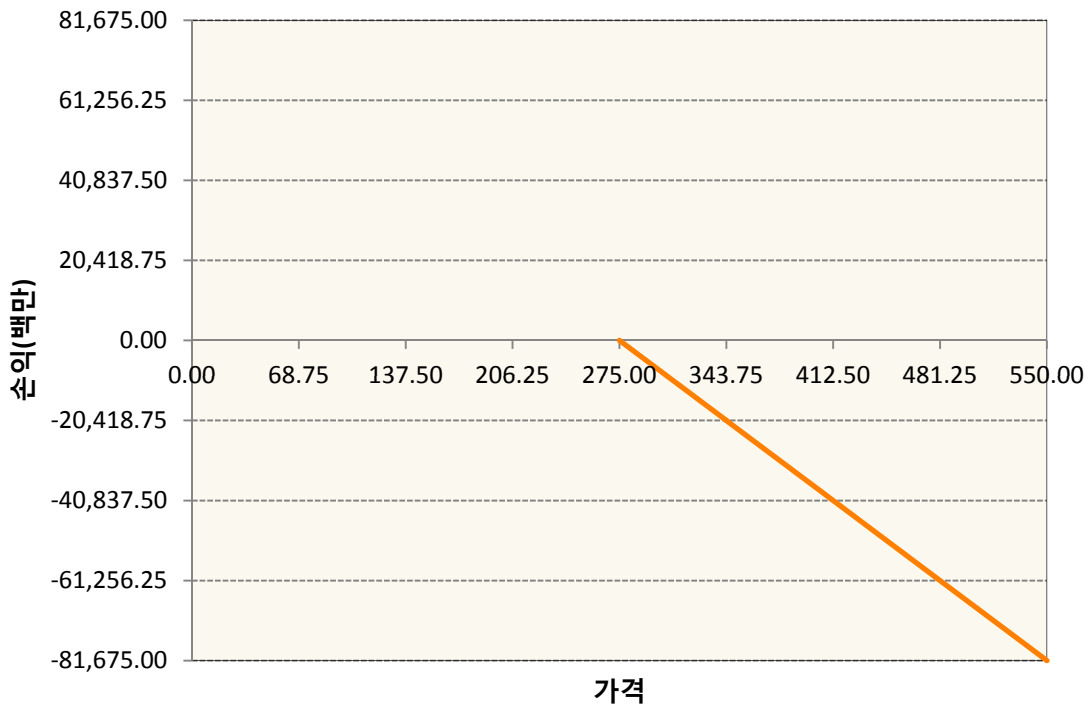
1. 계약금액

(단위:백만원)

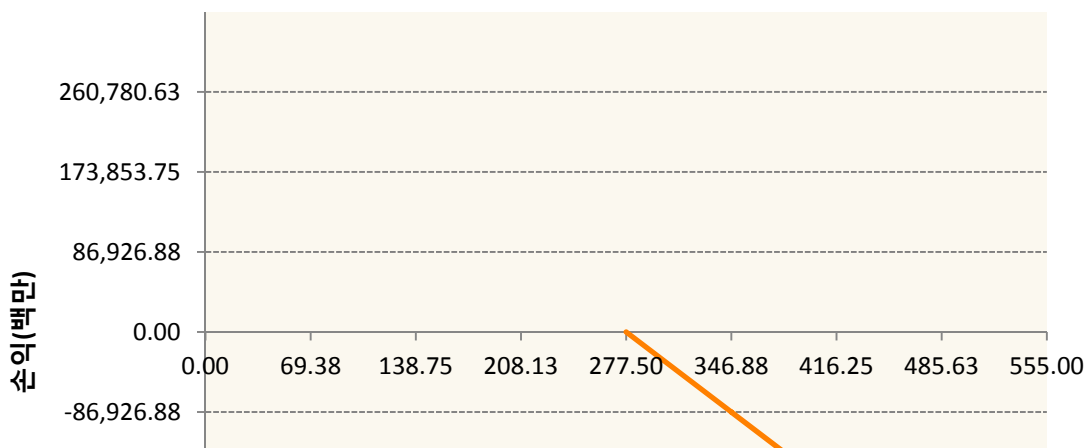
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	6,846	0	6,846	장내
누계	유가증권	옵션	0	667,445	-667,445	장내

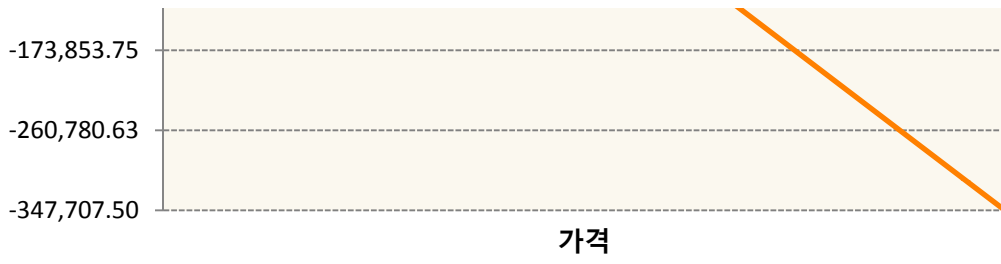
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P42752-2019-04 콜275

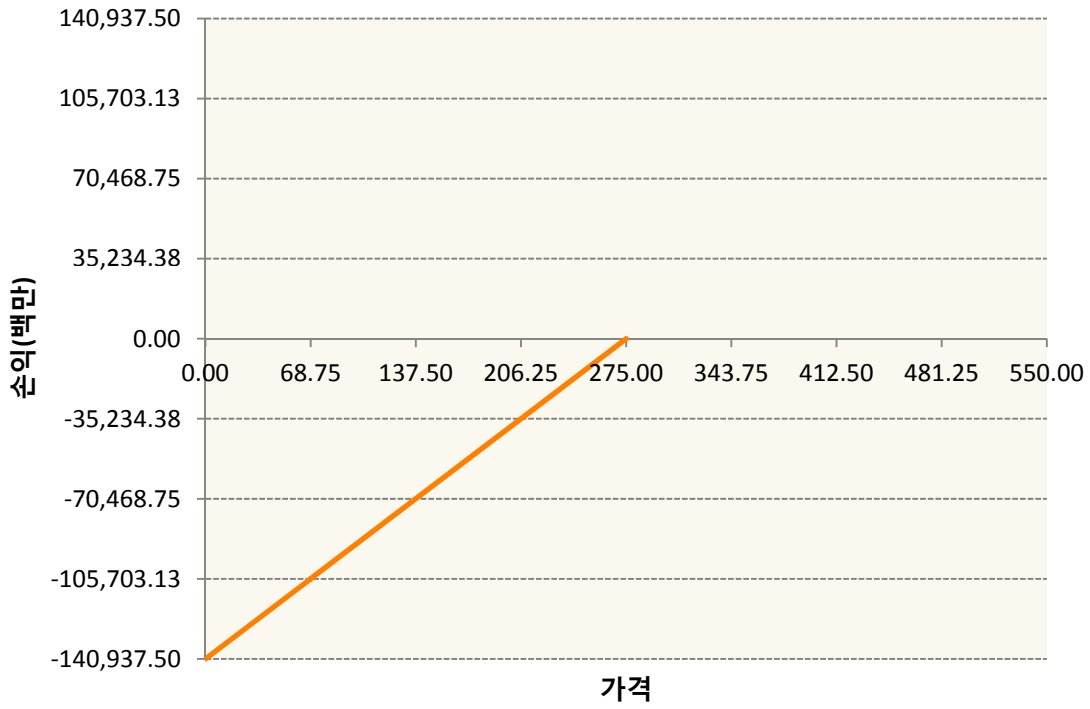


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

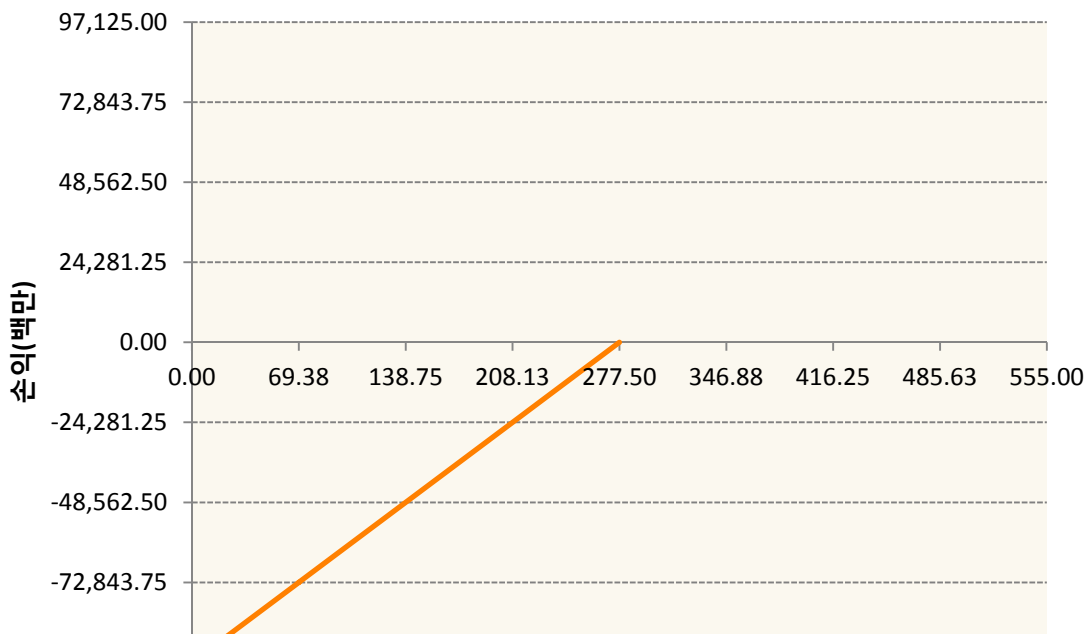




KR4301P42750-2019-04 풋275



KR4301P42776-2019-04 풋277.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P42752 2019-04 콜275							5,846
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,104	3,022	2,930	2,828	2,719	2,604	2,483
-5.33%	2,687	2,548	2,405	2,259	2,110	1,959	1,806
-2.67%	1,825	1,658	1,491	1,324	1,157	990	824
0%	450	304	153	0	-156	-313	-472
2.67%	-1,350	-1,446	-1,553	-1,668	-1,791	-1,920	-2,053
5.33%	-3,409	-3,458	-3,518	-3,591	-3,673	-3,765	-3,865
8.00%	-5,587	-5,606	-5,634	-5,673	-5,721	-5,779	-5,846
KR4201P42778 2019-04 콜277.5							23,829
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,409	11,136	10,813	10,447	10,044	9,608	9,146
-5.33%	10,096	9,579	9,032	8,463	7,876	7,275	6,661
-2.67%	7,134	6,441	5,745	5,047	4,348	3,648	2,946
0%	2,044	1,370	688	0	-692	-1,388	-2,086
2.67%	-5,010	-5,499	-6,024	-6,578	-7,156	-7,753	-8,366
5.33%	-13,395	-13,665	-13,989	-14,360	-14,772	-15,220	-15,698
8.00%	-22,455	-22,571	-22,734	-22,943	-23,198	-23,494	-23,829
KR4301P42750 2019-04 풋275							7,496
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,331	-7,341	-7,357	-7,381	-7,412	-7,450	-7,496
-5.33%	-3,646	-3,720	-3,804	-3,896	-3,995	-4,099	-4,208
-2.67%	-876	-1,023	-1,170	-1,317	-1,464	-1,610	-1,757
0%	282	196	102	0	-108	-221	-338
2.67%	492	476	451	418	377	327	269
5.33%	507	506	503	498	489	476	457
8.00%	507	507	507	507	505	503	499
KR4301P42776 2019-04 풋277.5							5,725
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,657	-5,660	-5,665	-5,674	-5,687	-5,704	-5,725
-5.33%	-3,076	-3,107	-3,146	-3,191	-3,242	-3,298	-3,359
-2.67%	-899	-992	-1,086	-1,182	-1,278	-1,375	-1,472
0%	251	171	87	0	-89	-180	-272
2.67%	536	514	484	448	405	356	303

5.33%	565	562	558	550	539	524	504
8.00%	566	566	565	565	563	560	555

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

(단위:백만원)

42,788

공시일	2019-03-22
기준일	2019-03-21

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

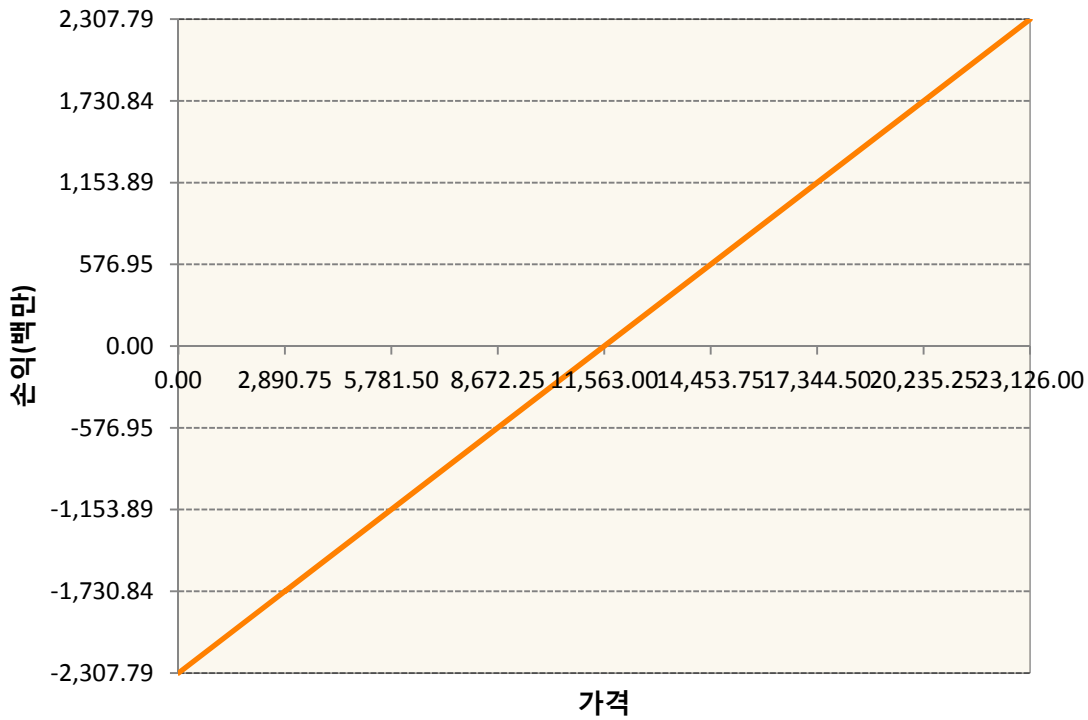
1. 계약금액

(단위:백만원)

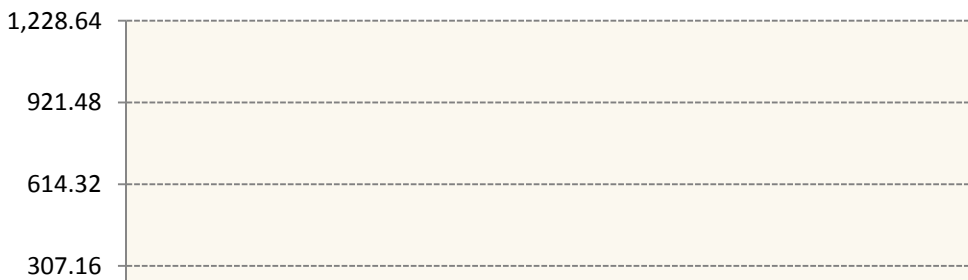
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,308	0	2,308	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,928	-5,928	장내
누계	통화	선도	0	3,018	-3,018	장외

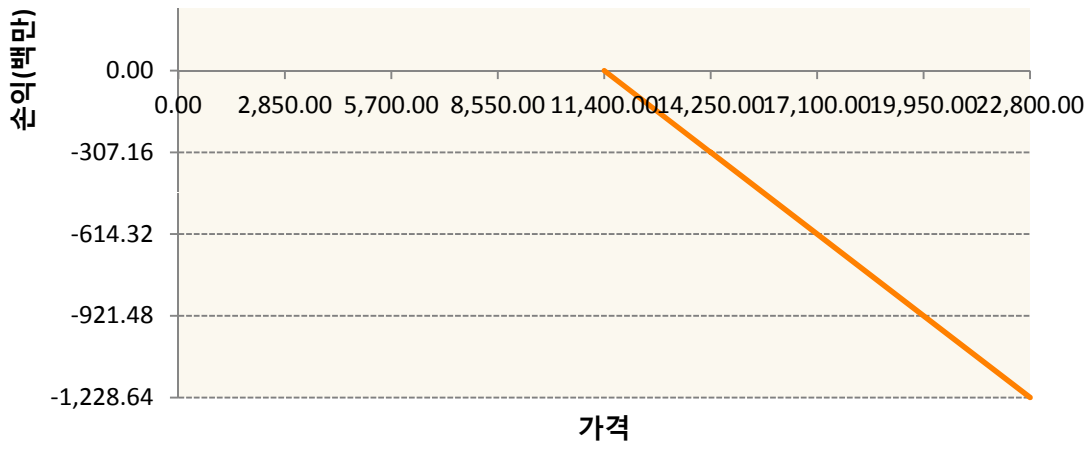
2. 만기시점의 손익구조

HCH9-HSCEI Futures Mar19

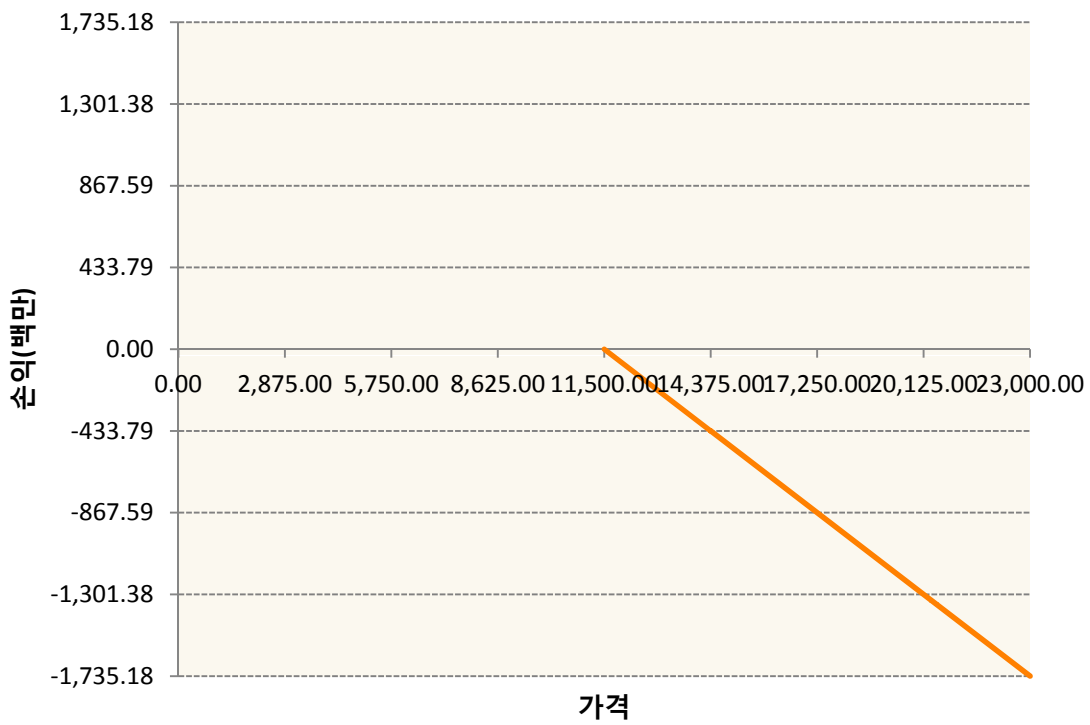


OHHIH9-C114-HSCEI

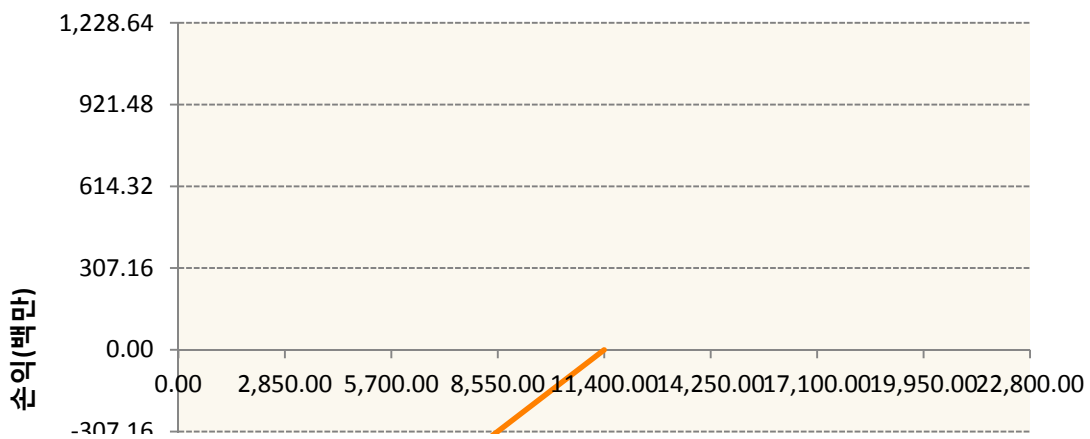


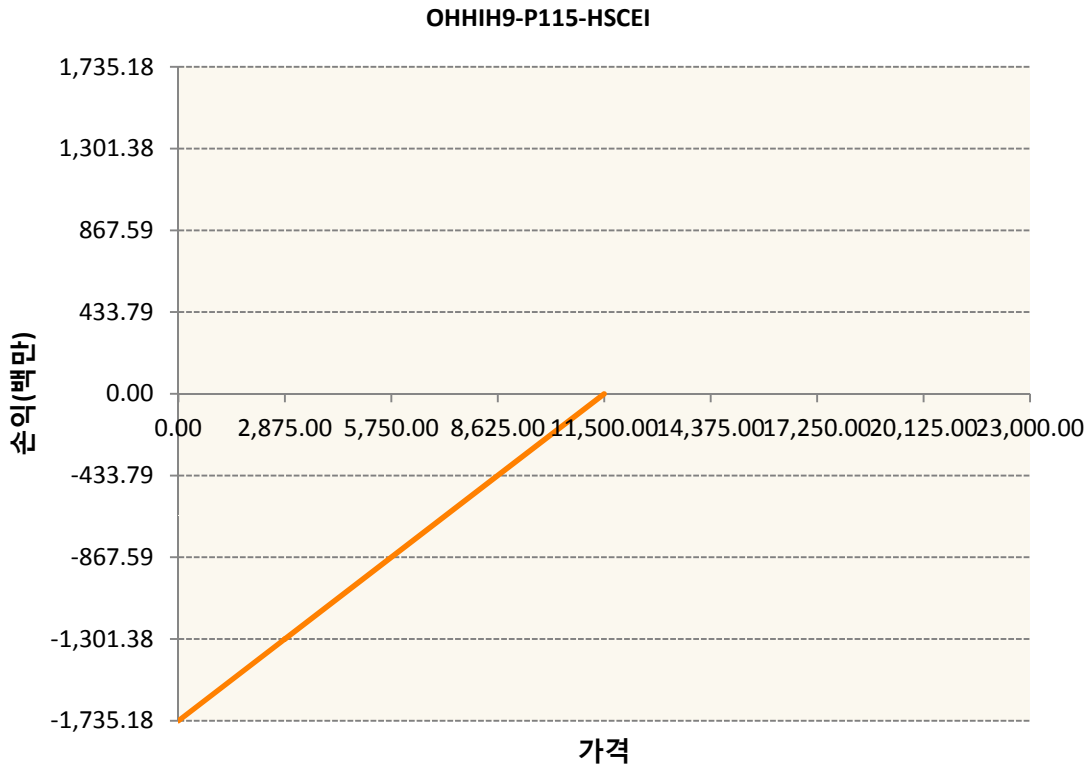


OHHIH9-C115-HSCEI



OHHIH9-P114-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	218
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	23
HCH9 HSCEI Futures Mar19	185
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)
	756

공시일	2019-03-22
기준일	2019-03-21

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

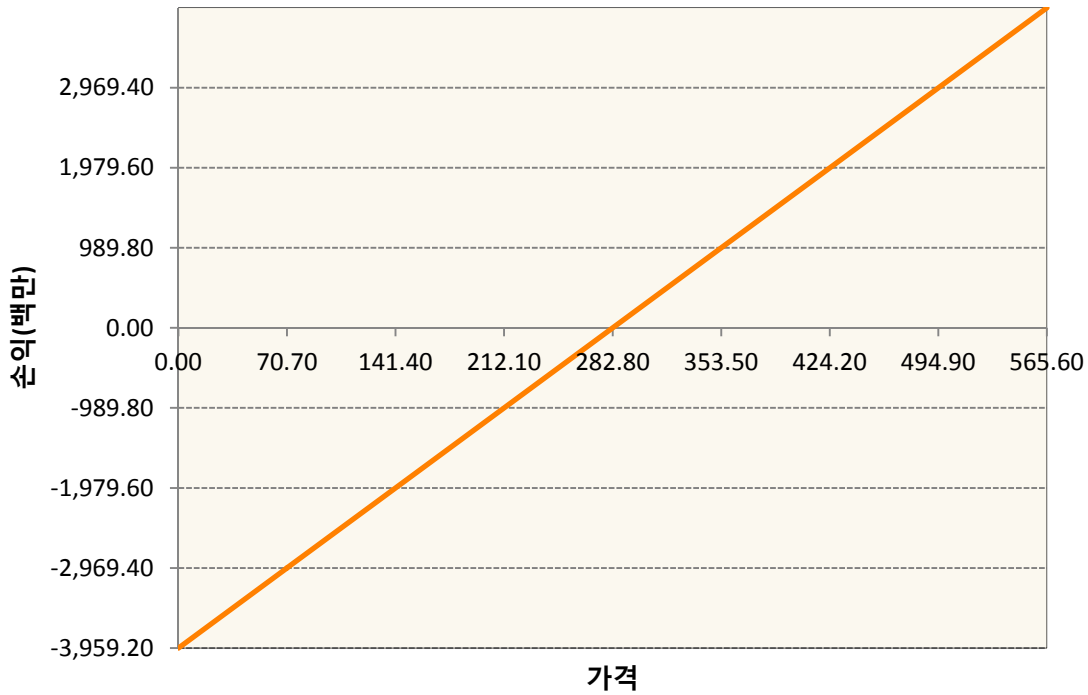
1. 계약금액

(단위:백만원)

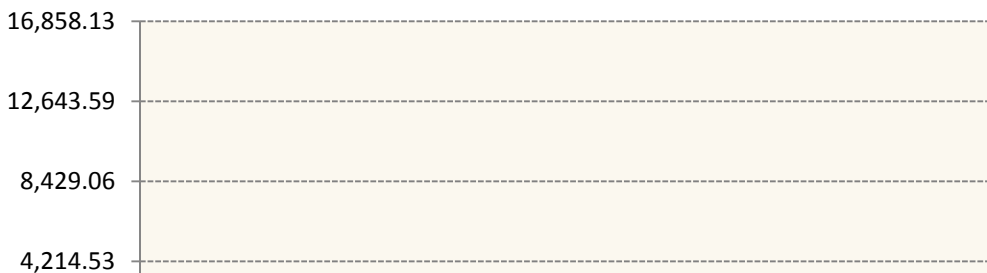
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,959	0	3,959	장내
누계	유가증권	스왑	35,836	0	35,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,649	-34,649	장내

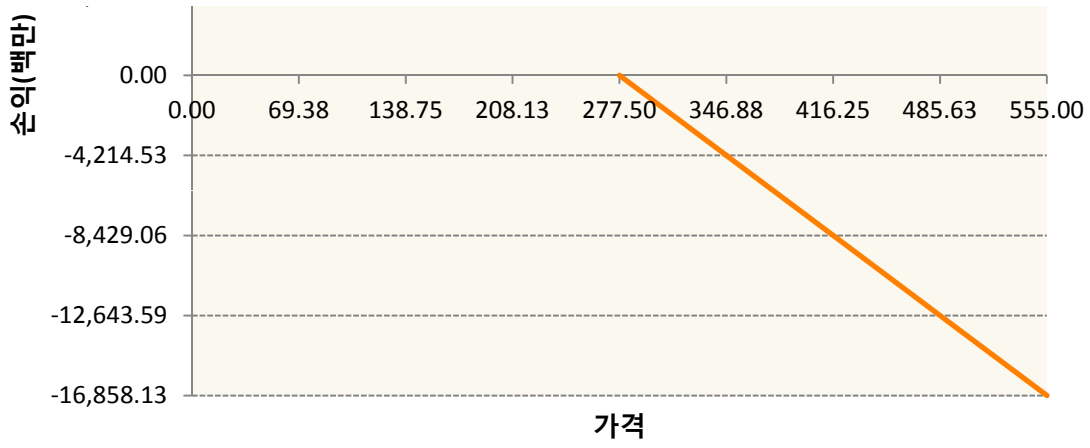
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

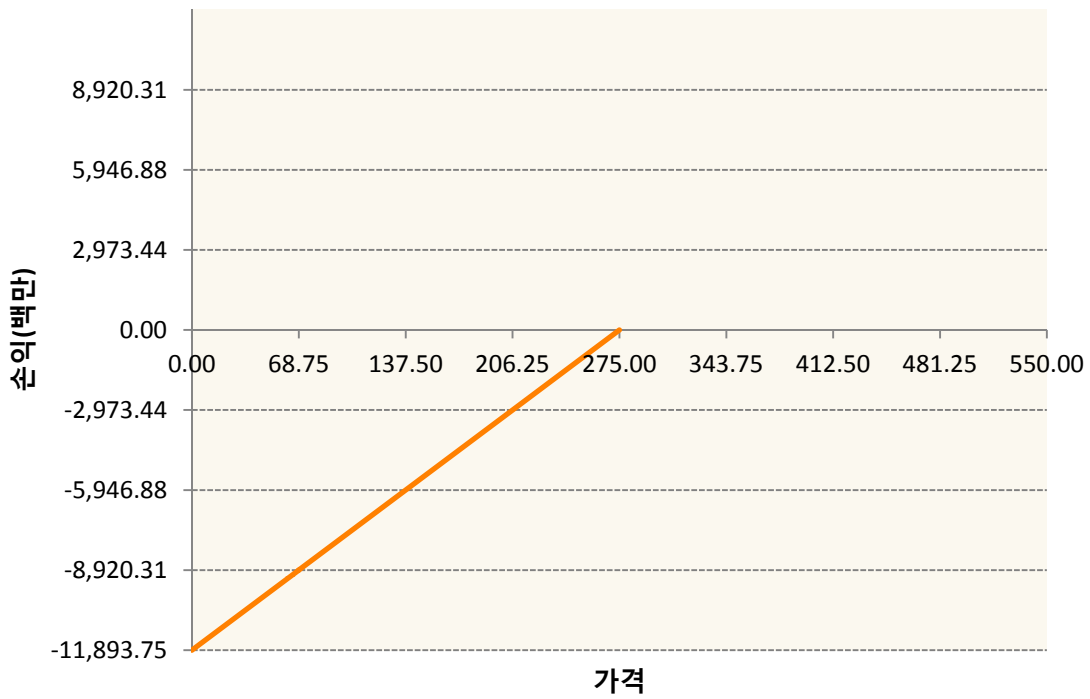


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

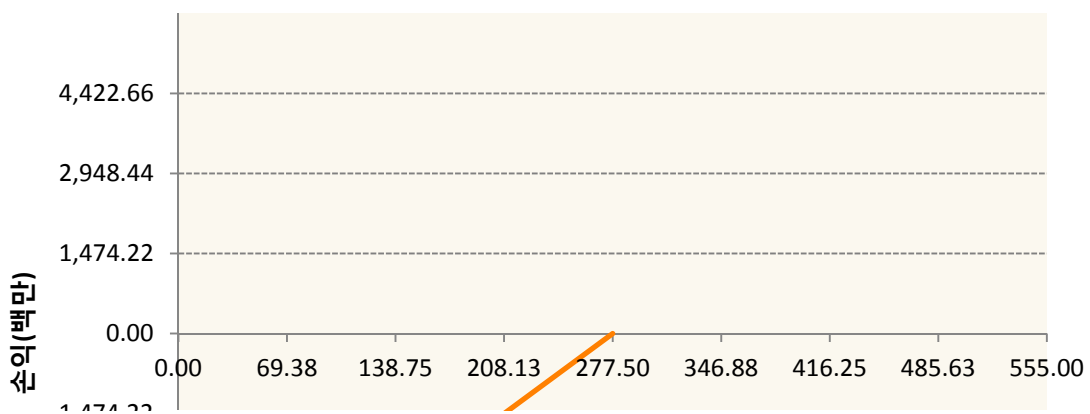


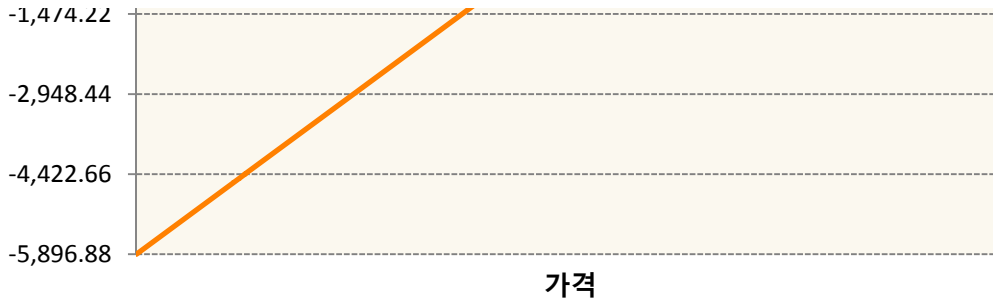


KR4301P42750-2019-04 풋275



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						316
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-316	-316	-316	-316	-316	-316	-316	
-5.33%	-211	-211	-211	-211	-211	-211	-211	
-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%	211	211	211	211	211	211	211	
8.00%	316	316	316	316	316	316	316	
KR4201P42778		2019-04 콜277.5						1,155
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	553	540	524	507	487	466	443
-5.33%	489	464	438	410	382	353	323
-2.67%	346	312	279	245	211	177	143
0%	99	66	33	0	-34	-67	-101
2.67%	-243	-267	-292	-319	-347	-376	-406
5.33%	-649	-663	-678	-696	-716	-738	-761
8.00%	-1,089	-1,094	-1,102	-1,112	-1,125	-1,139	-1,155
KR4301P42750 2019-04 풋275							633
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-619	-620	-621	-623	-625	-629	-633
-5.33%	-308	-314	-321	-329	-337	-346	-355
-2.67%	-74	-86	-99	-111	-124	-136	-148
0%	24	17	9	0	-9	-19	-29
2.67%	42	40	38	35	32	28	23
5.33%	43	43	42	42	41	40	39
8.00%	43	43	43	43	43	42	42
KR4301P42776 2019-04 풋277.5							348
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-343	-344	-344	-345	-345	-346	-348
-5.33%	-187	-189	-191	-194	-197	-200	-204
-2.67%	-55	-60	-66	-72	-78	-83	-89
0%	15	10	5	0	-5	-11	-17
2.67%	33	31	29	27	25	22	18
5.33%	34	34	34	33	33	32	31
8.00%	34	34	34	34	34	34	34

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

(단위:백만원)

5,381

공시일	2019-03-22
기준일	2019-03-21

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

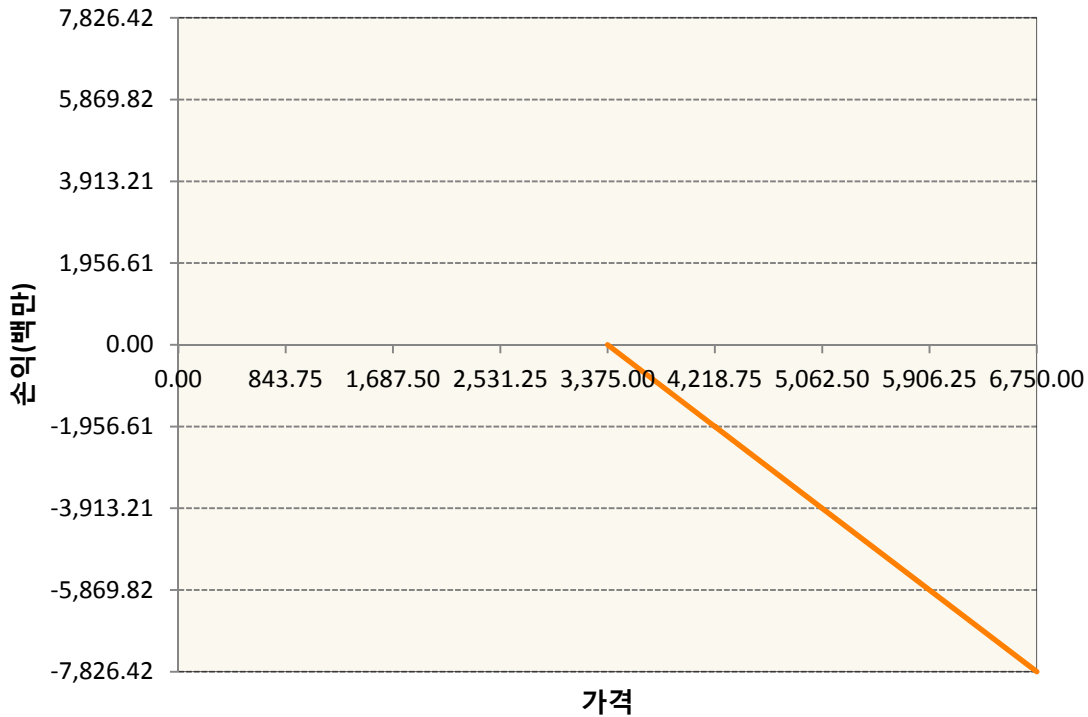
1. 계약금액

(단위:백만원)

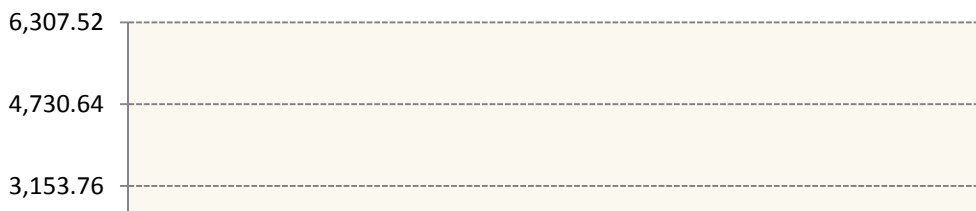
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,150	0	7,150	
누계	유가증권	스왑	60,821	0	60,821	장외
누계	유가증권	옵션	0	28,268	-28,268	장내
누계	통화	선도	0	25,766	-25,766	장외

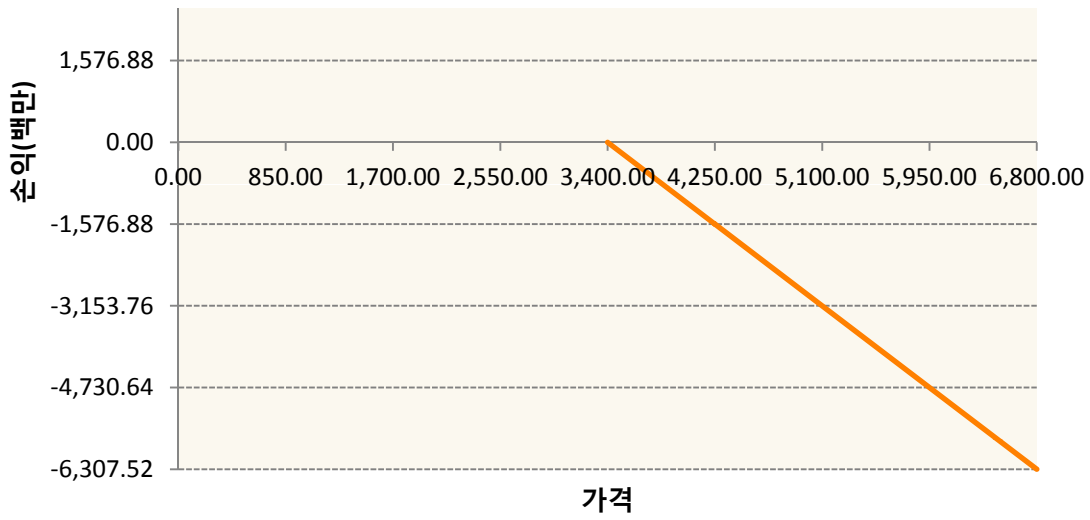
2. 만기시점의 손익구조

OESXJ9-C3375-EURO STOXX 50

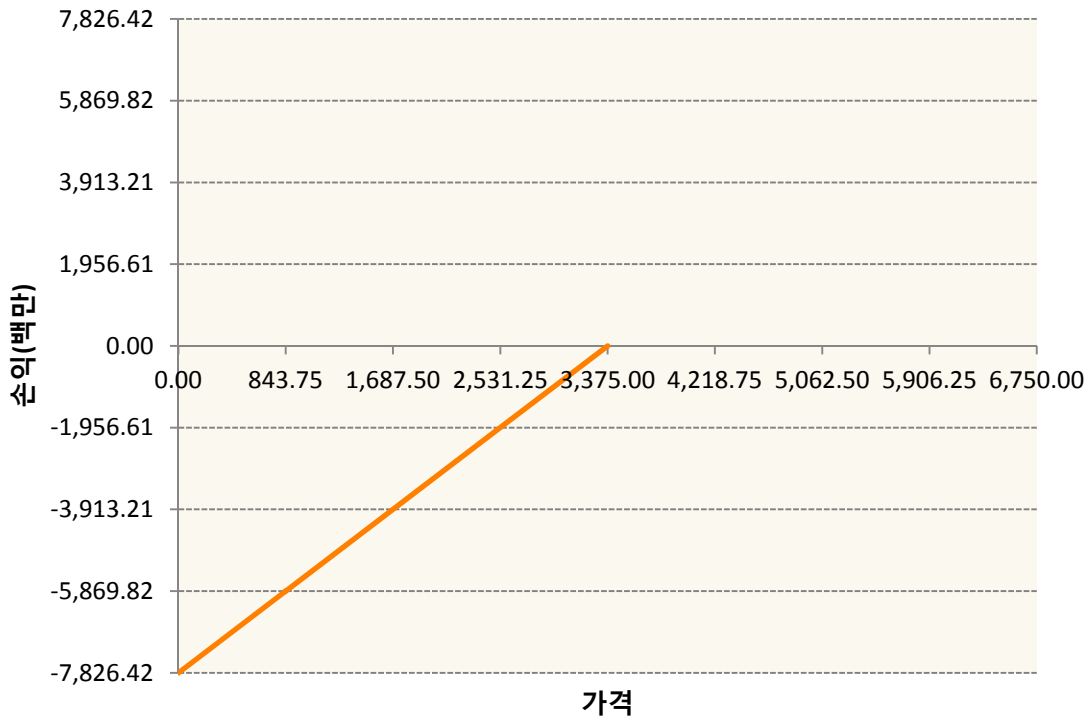


OESXJ9-C3400-EURO STOXX 50

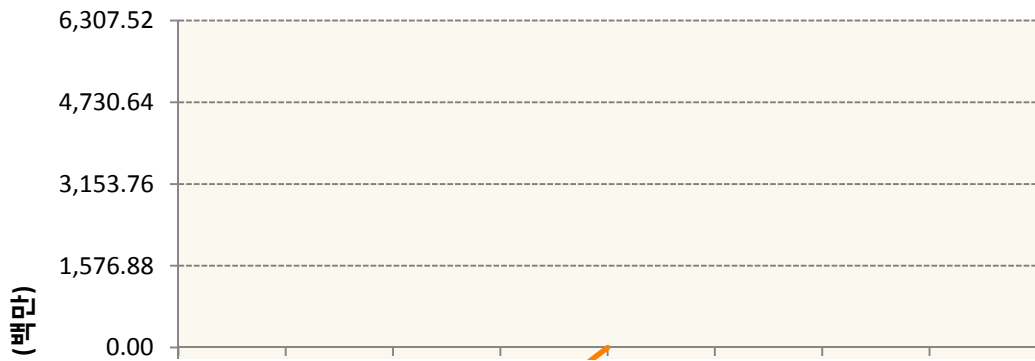


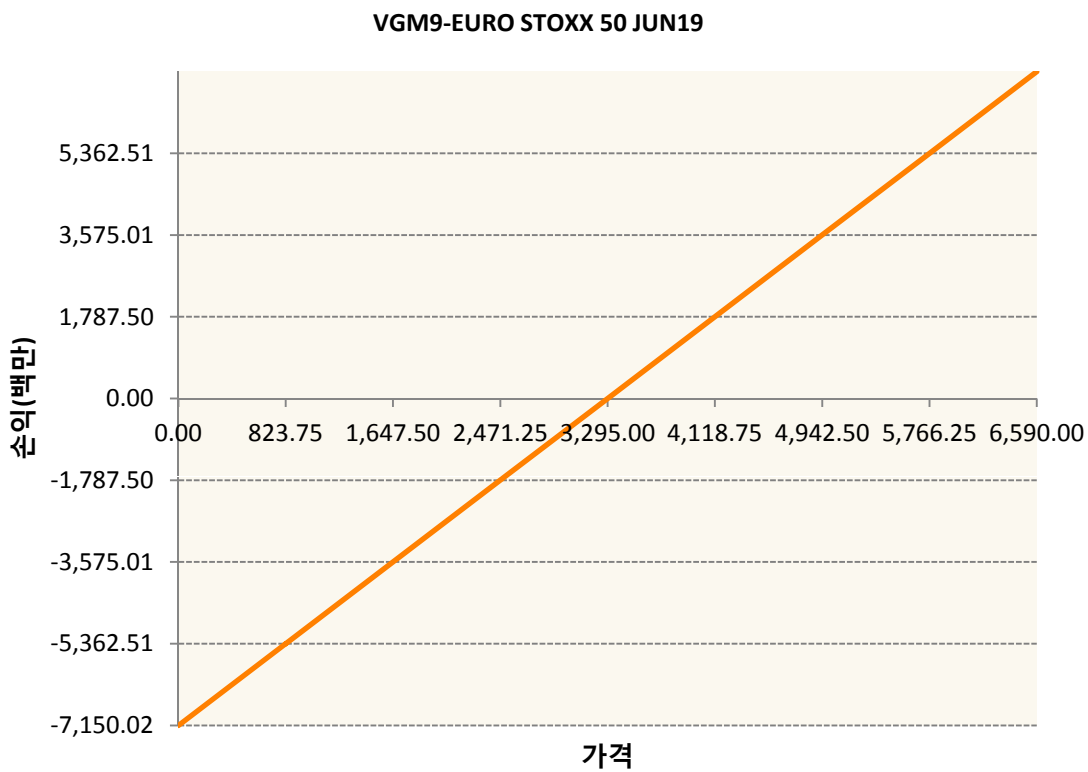
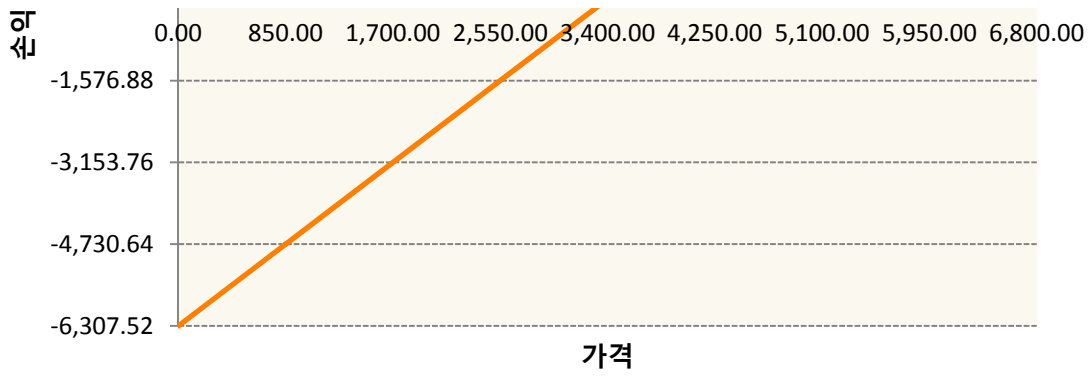


OESXJ9-P3375-EURO STOXX 50



OESXJ9-P3400-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	127
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E	825
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	412
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	825
OESXJ9-C33 EURO STOXX 50	626
OESXJ9-C34 EURO STOXX 50	505
OESXJ9-P33 EURO STOXX 50	626
OESXJ9-P34 EURO STOXX 50	505
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	572

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

(단위:백만원)

3,225

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

(단위:백만원)

1,109

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

(단위:백만원)

95

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

(단위:백만원)

137

공시일	2019-03-22
기준일	2019-03-21

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

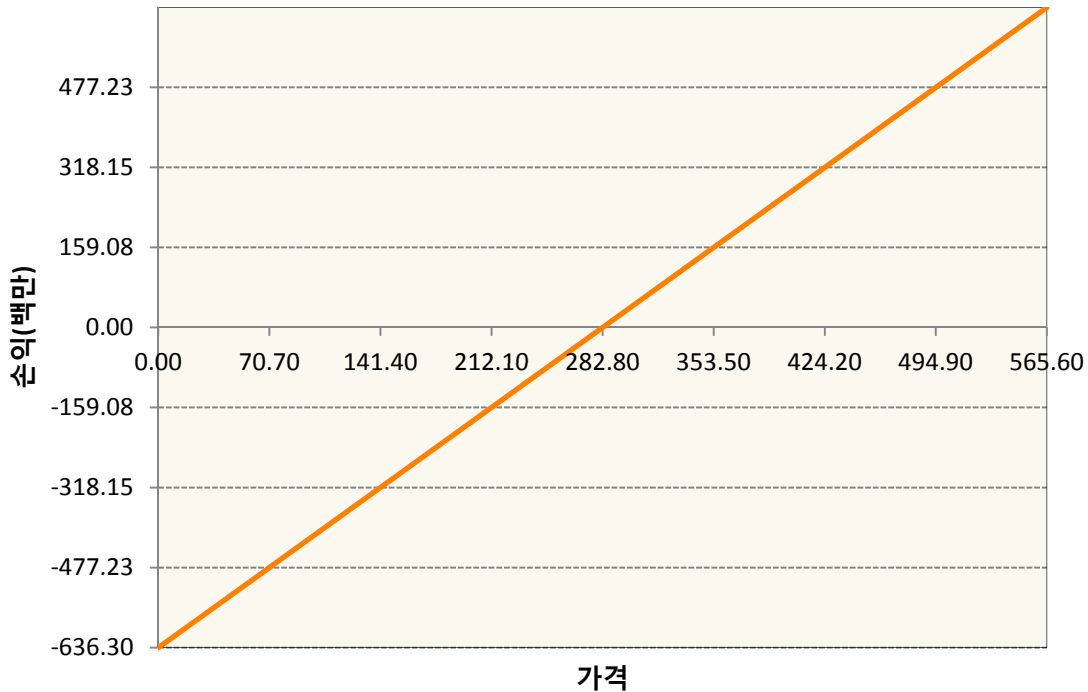
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	636	0	636	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P60004 2019-06 코스피200지수선물 51

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
-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%	51	51	51	51	51	51	51

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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-03-22
기준일	2019-03-21

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

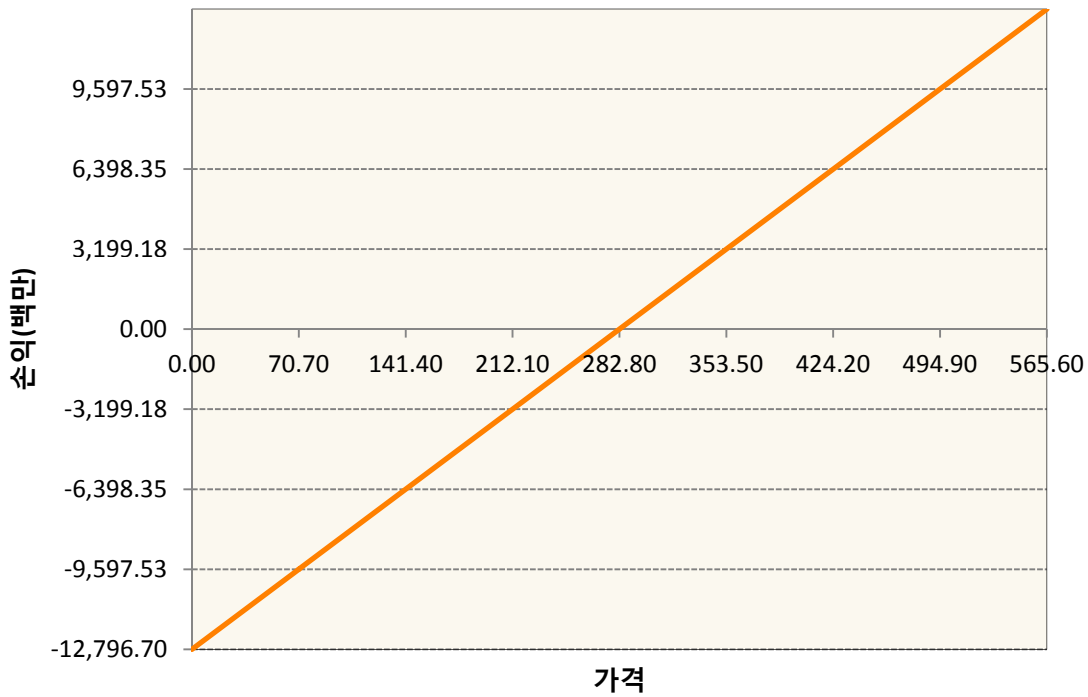
1. 계약금액

(단위:백만원)

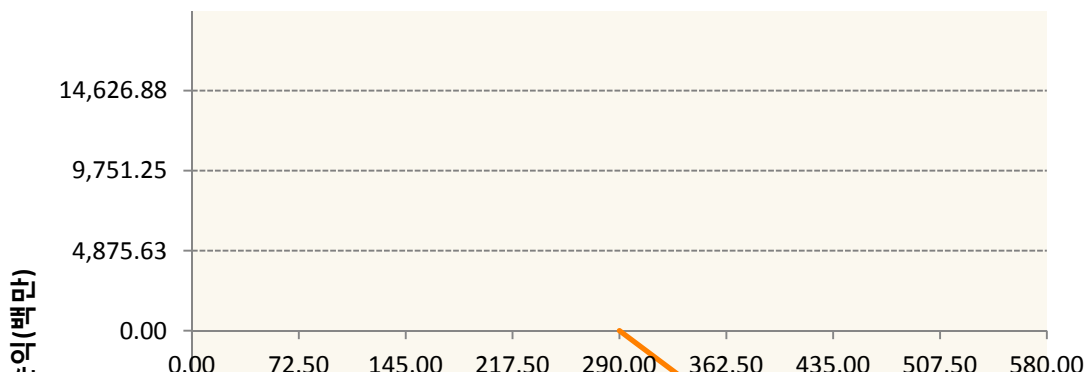
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,797	0	12,797	장내
누계	유가증권	옵션	1,867	24,036	-22,169	장내

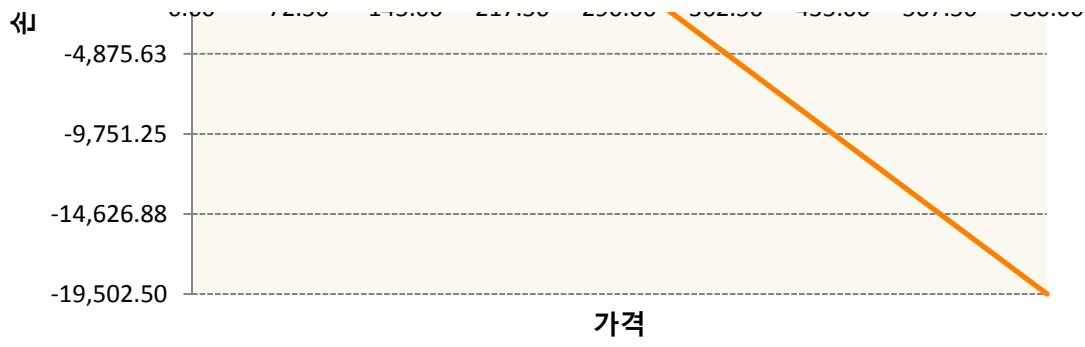
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

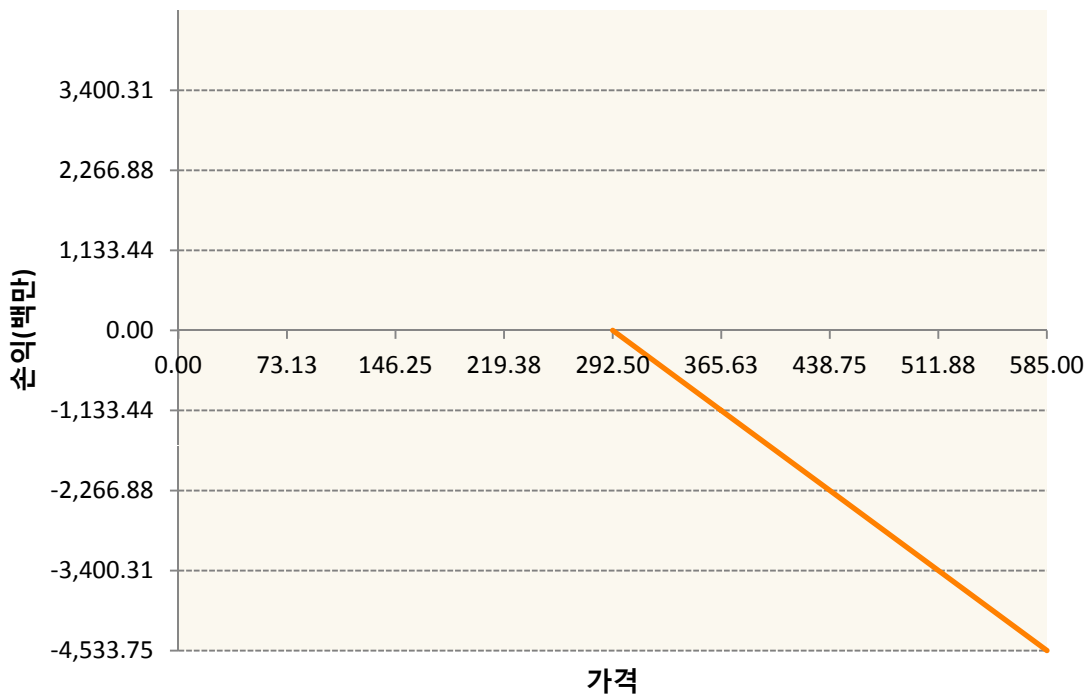


KR4201P42901-2019-04 콜290

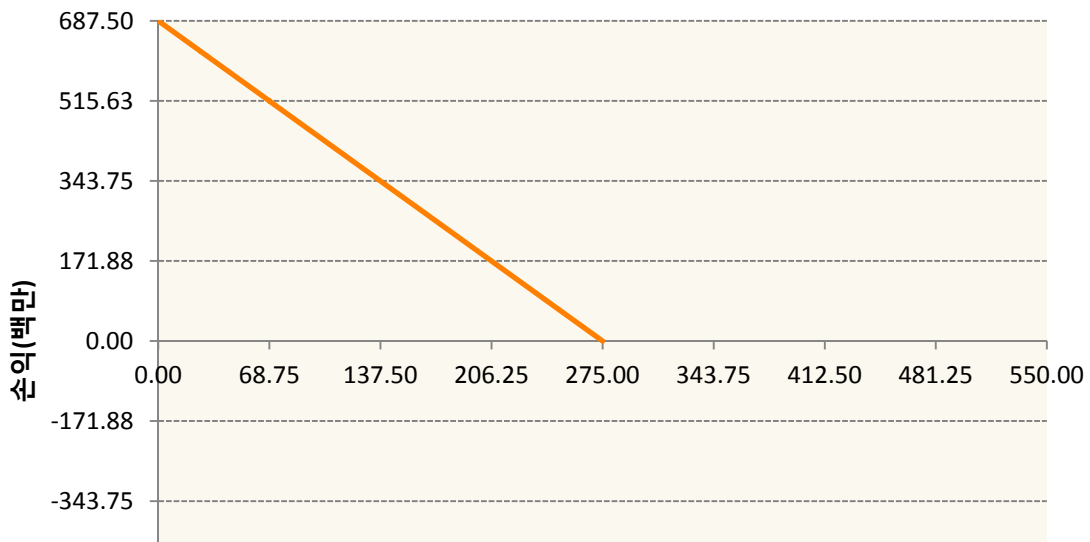


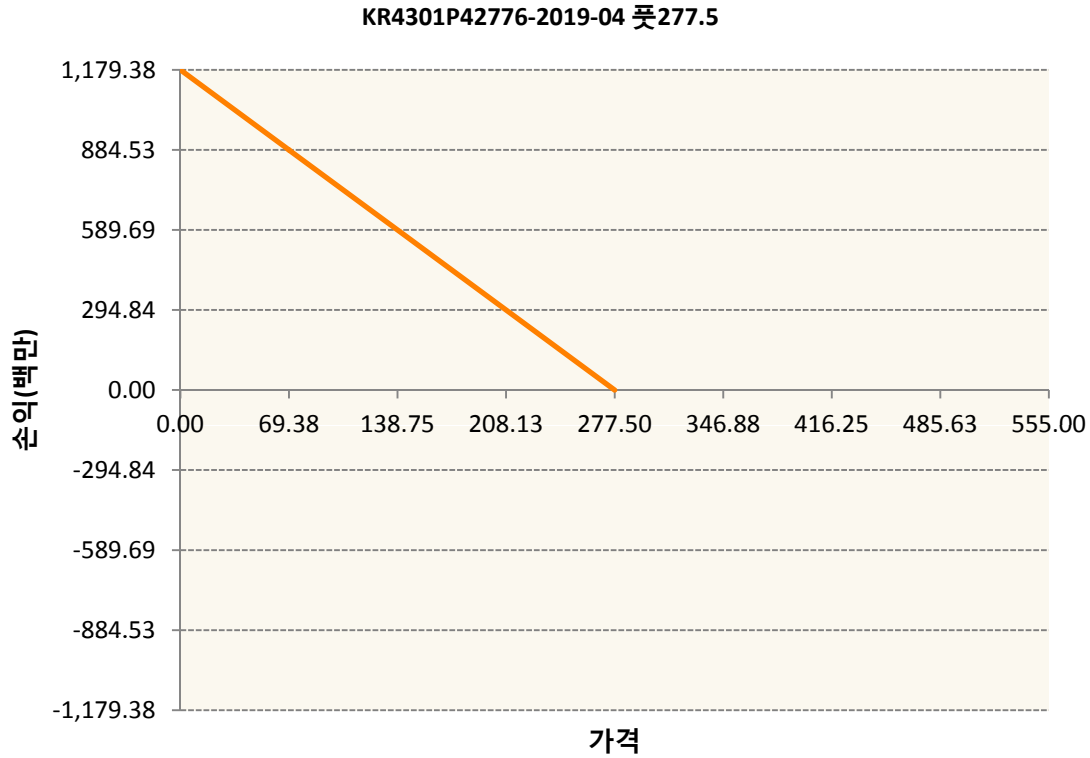
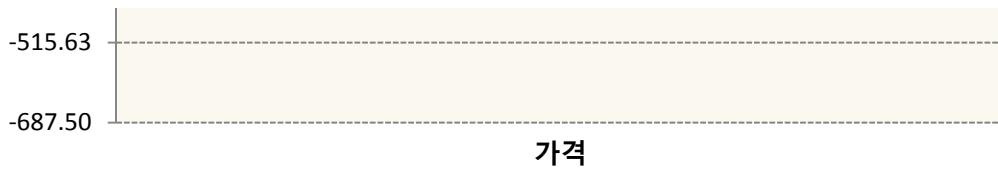


KR4201P42927-2019-04 콜292.5



KR4301P42750-2019-04 풋275





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						1,022
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,022	-1,022	-1,022	-1,022	-1,022	-1,022	-1,022	
-5.33%	-681	-681	-681	-681	-681	-681	-681	
-2.67%	-341	-341	-341	-341	-341	-341	-341	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	341	341	341	341	341	341	341	
5.33%	681	681	681	681	681	681	681	
8.00%	1,022	1,022	1,022	1,022	1,022	1,022	1,022	
KR4201P42901		2019-04 콜290						980
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	255	253	248	241	233	222	209	
-5.33%	245	235	223	208	191	172	151	
-2.67%	205	184	161	135	108	79	50	

0%	104	70	35	0	-36	-73	-109
2.67%	-95	-135	-175	-215	-255	-294	-334
5.33%	-404	-440	-476	-513	-551	-588	-626
8.00%	-807	-831	-858	-886	-916	-948	-980
KR4201P42927 2019-04 콜292.5							210
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	48	47	46	45	44	42	39
-5.33%	46	44	42	40	36	32	28
-2.67%	40	36	31	26	21	15	8
0%	22	15	8	0	-8	-16	-24
2.67%	-16	-25	-34	-43	-52	-62	-71
5.33%	-79	-88	-97	-106	-115	-124	-133
8.00%	-165	-172	-179	-186	-194	-202	-210
KR4301P42750 2019-04 풋275							37
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	36	36	36	36	36	36	37
-5.33%	18	18	19	19	19	20	21
-2.67%	4	5	6	6	7	8	9
0%	-1	-1	0	0	1	1	2
2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-1
5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
KR4301P42776 2019-04 풋277.5							70
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	69	69	69	69	69	69	70
-5.33%	37	38	38	39	39	40	41
-2.67%	11	12	13	14	16	17	18
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-7	-6	-6	-5	-5	-4	-4
5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-6	-6
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7

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

(단위:백만원)

1,965

공시일	2019-03-22
기준일	2019-03-21

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	2,278	0	2,278	

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	2019-03-22
기준일	2019-03-21

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	7,974	0	7,974	

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	2019-03-22
기준일	2019-03-21

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	48,131	0	48,131	
누계	통화	선도	0	64,516	-64,516	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019F02: KRW/USD 28-03-19E		469
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
FX21019G02 KRW/USD 25-03-19E		136
FX21019G02 KRW/USD 25-03-19E		478
FX21019G03 KRW/USD 28-03-19E		253
FX21019G03 KRW/USD 28-03-19E		117
FX21019G03 KRW/USD 29-03-19E		334
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		108
FX21019H01 KRW/USD 19-04-19E		144
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E		117
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E		206
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E		253
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E		153
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E		361
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E		424
FX21019H03 KRW/USD 22-04-19E		361
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E		361
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E		415

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

(단위:백만원)

1,793

공시일	2019-03-22
기준일	2019-03-21

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

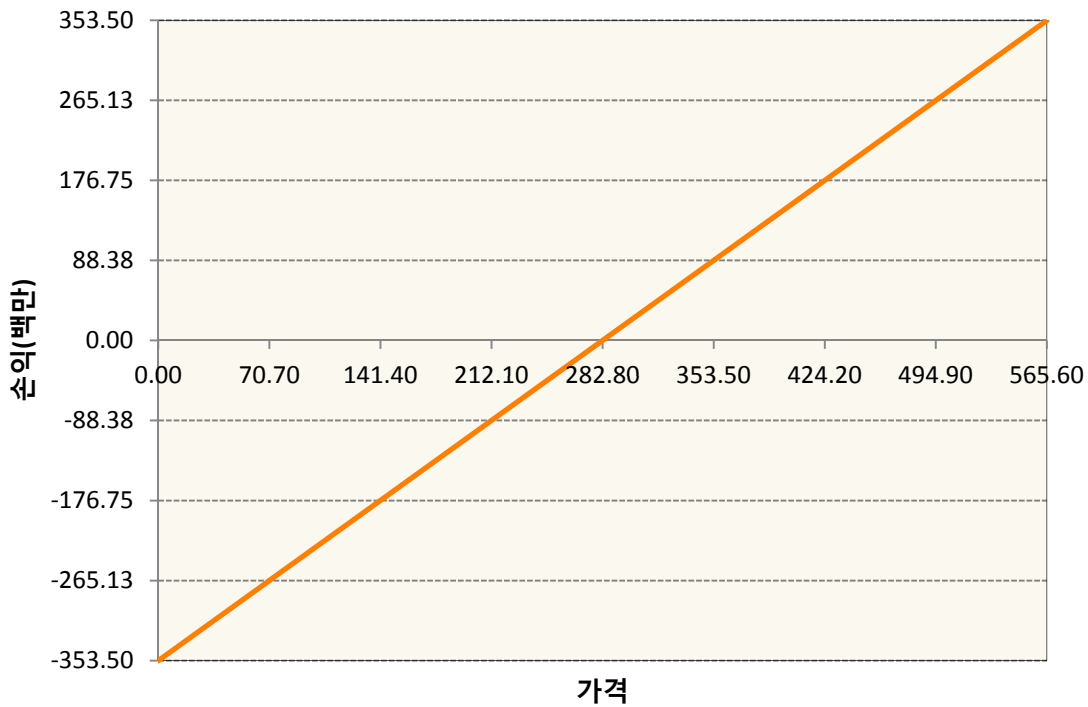
1. 계약금액

(단위:백만원)

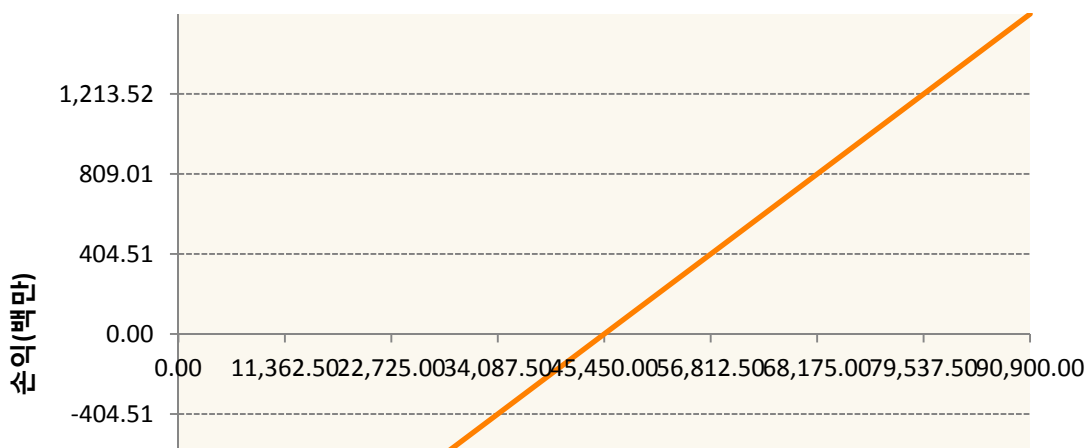
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,972	0	1,972	장내

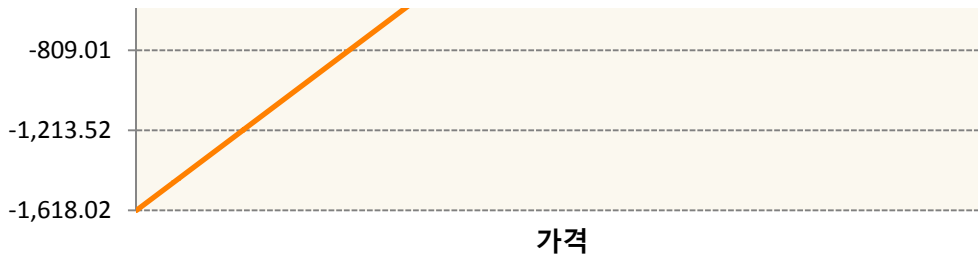
2. 만기시점의 손익구조

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						131
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131	
-5.33%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87	
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	44	44	44	44	44	44	44	
5.33%	87	87	87	87	87	87	87	
8.00%	131	131	131	131	131	131	131	

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

177

공시일	2019-03-22
기준일	2019-03-21

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

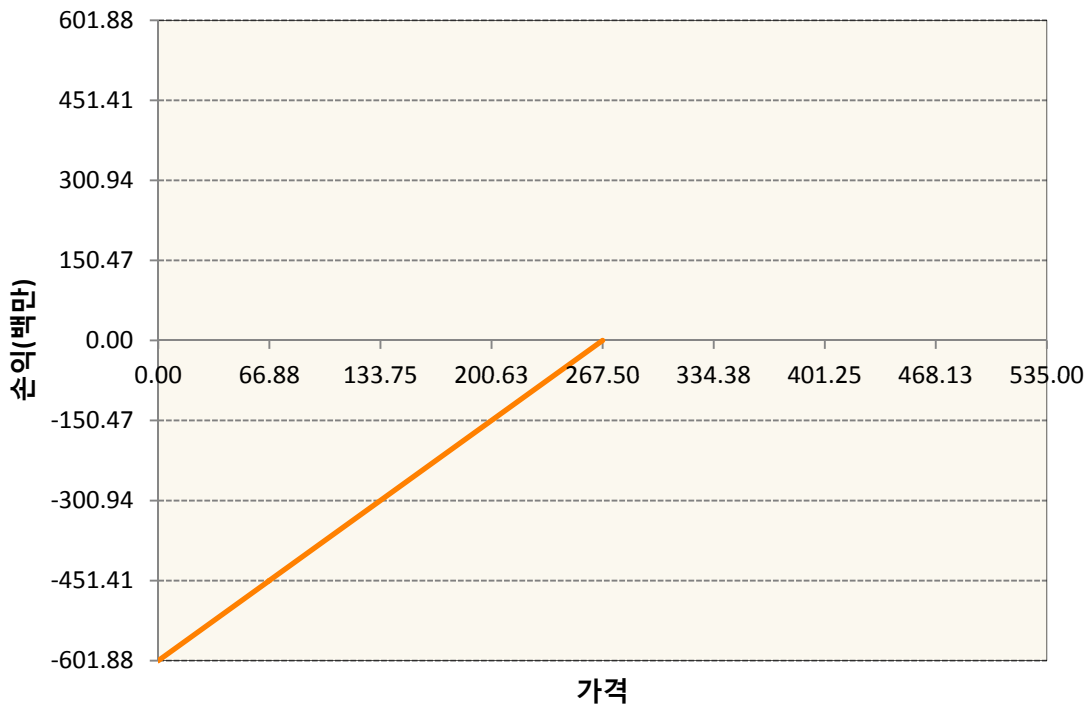
1. 계약금액

(단위:백만원)

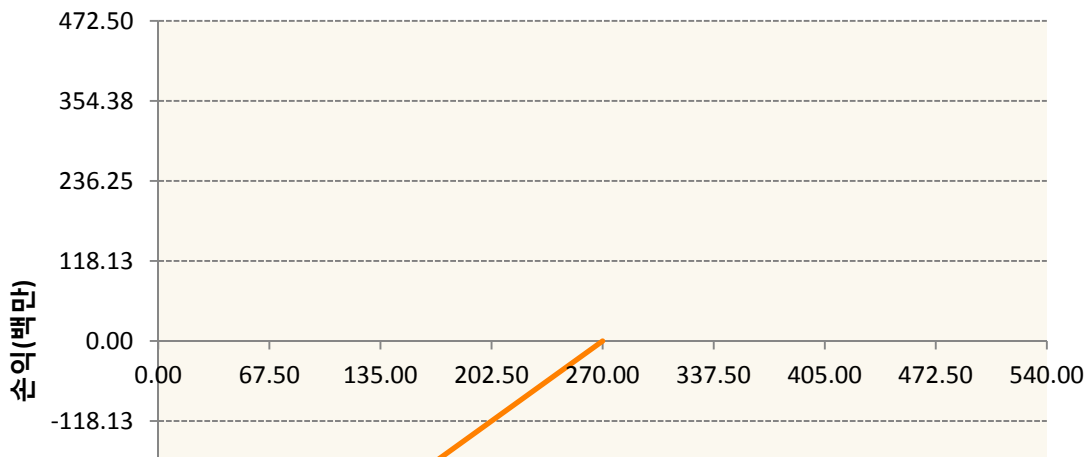
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	135	-135	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,074	-1,074	장내

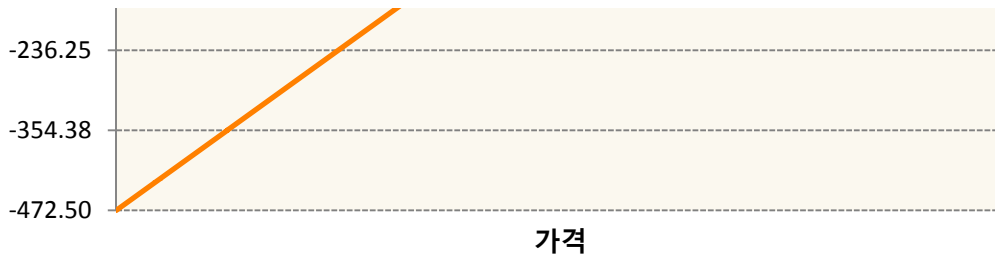
2. 만기시점의 손익구조

KR4301P42677-2019-04 풋267.5



KR4301P42701-2019-04 풋270





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301P42677 2019-04 풋267.5 20

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-18	-18	-19	-19	-19	-20	-20
-5.33%	-6	-6	-7	-7	-8	-9	-9
-2.67%	-1	-1	-1	-2	-2	-3	-3
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 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%	-7	-7	-8	-8	-9	-9	-9
-2.67%	-1	-1	-2	-2	-3	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	1	1	1	0	0	0	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	0
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

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

22

공시일	2019-03-22
기준일	2019-03-21

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

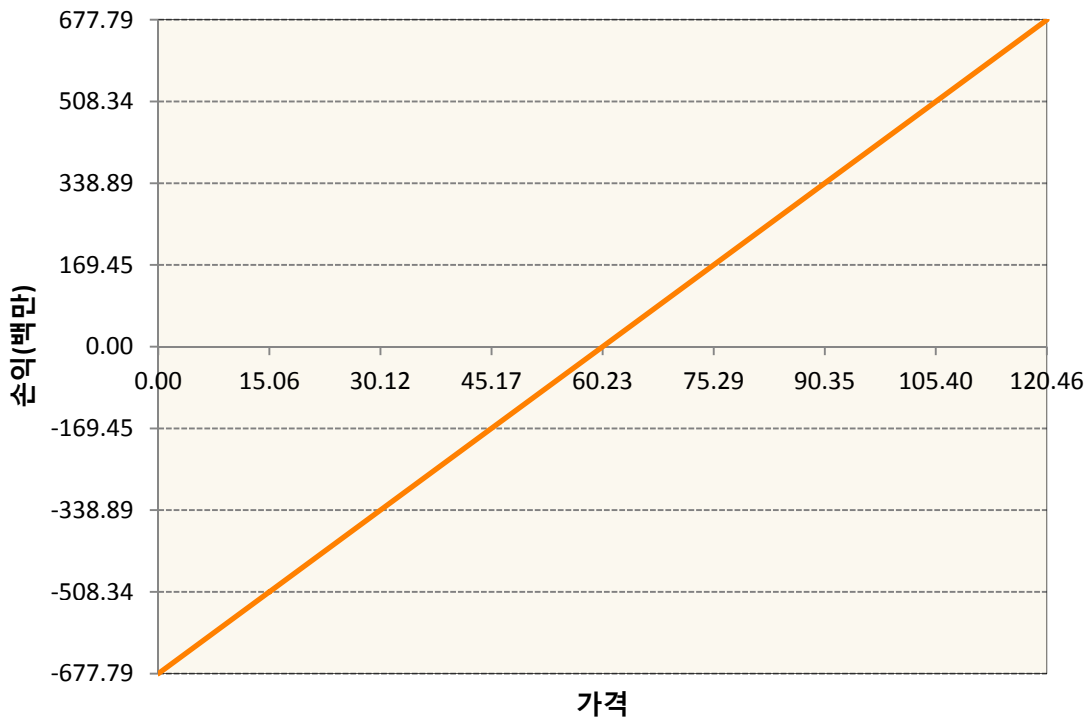
1. 계약금액

(단위:백만원)

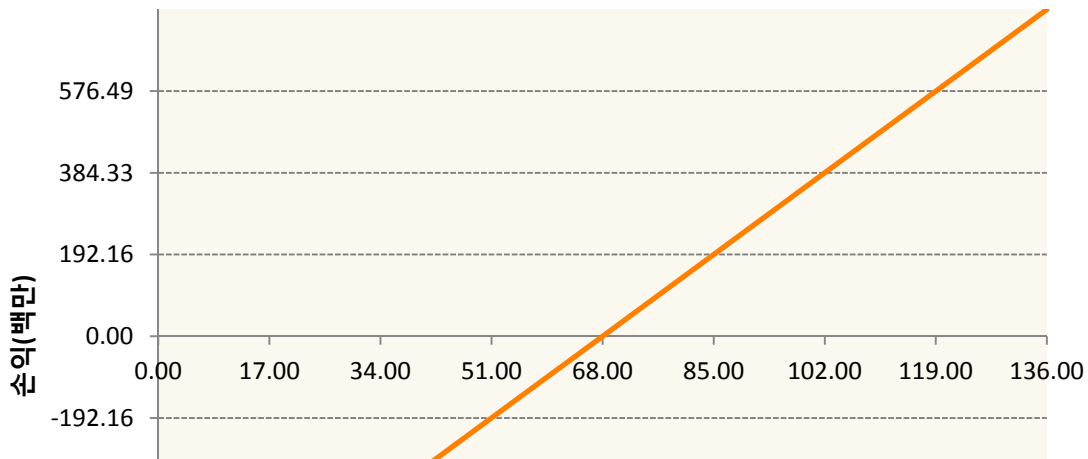
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,916	282	2,634	

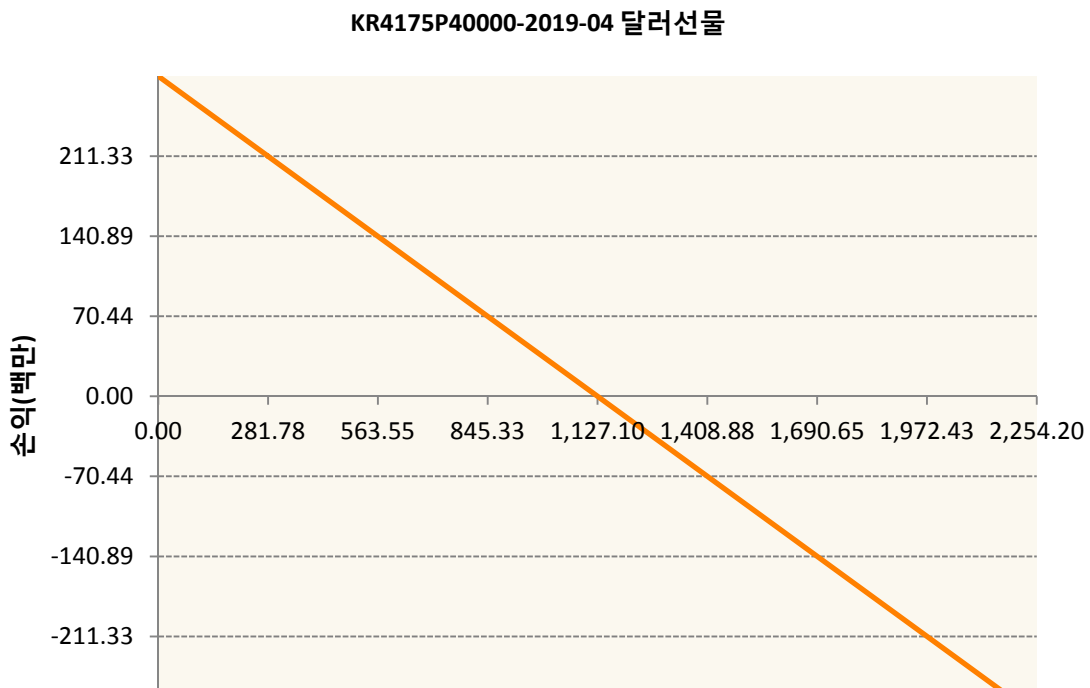
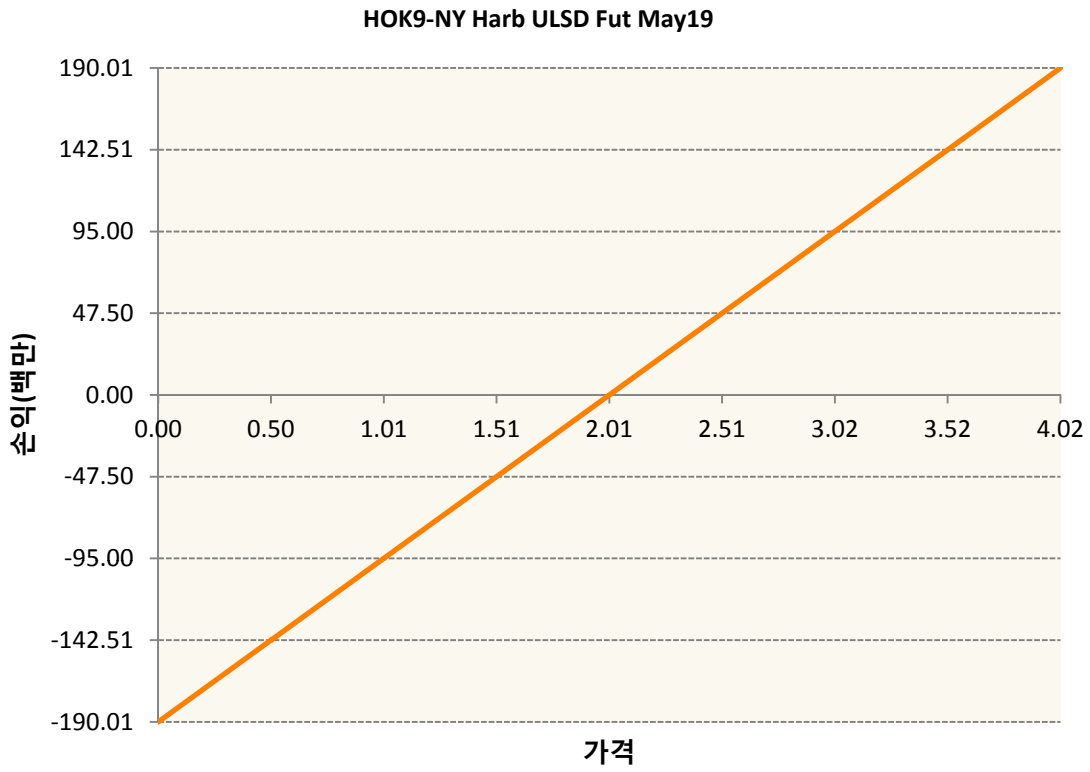
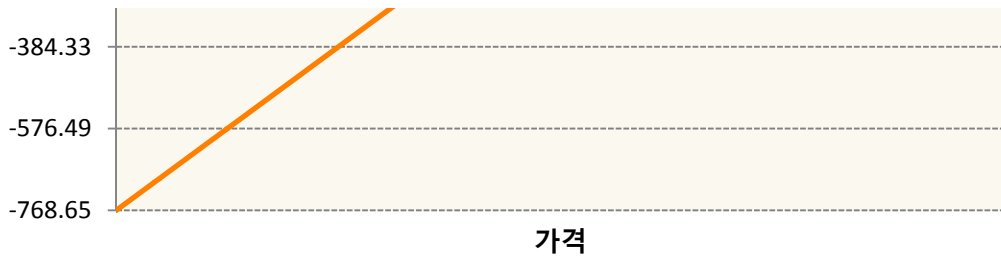
2. 만기시점의 손익구조

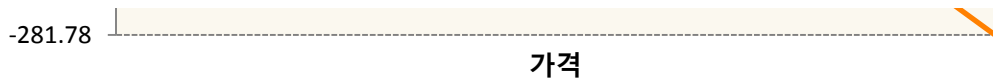
CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19



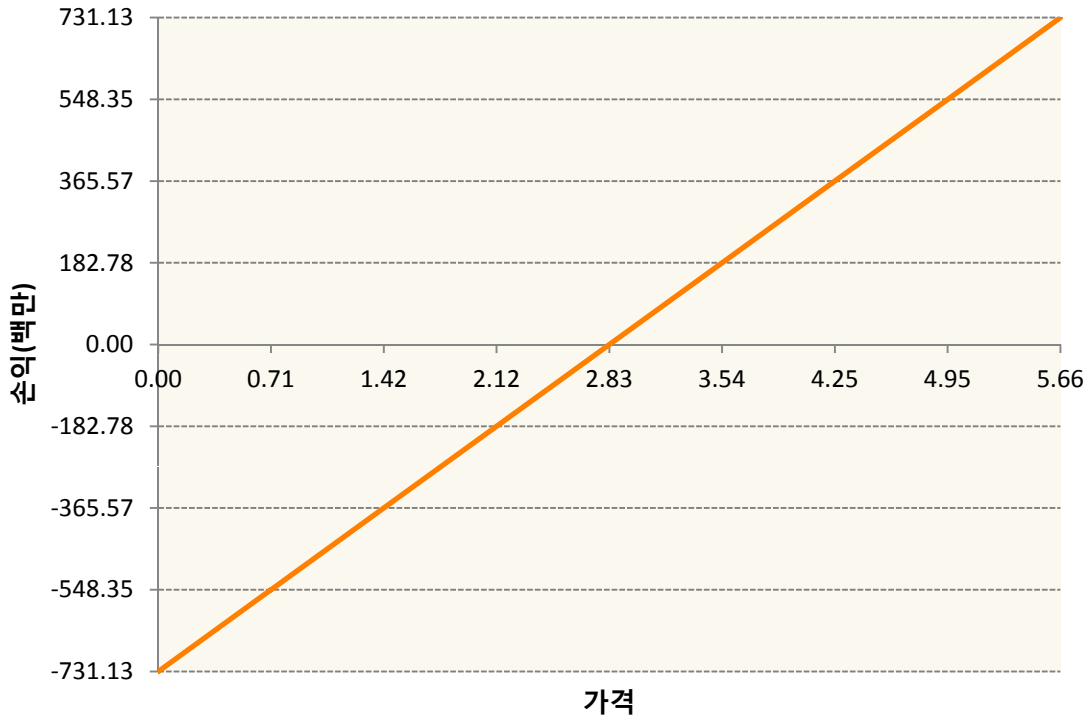
CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19



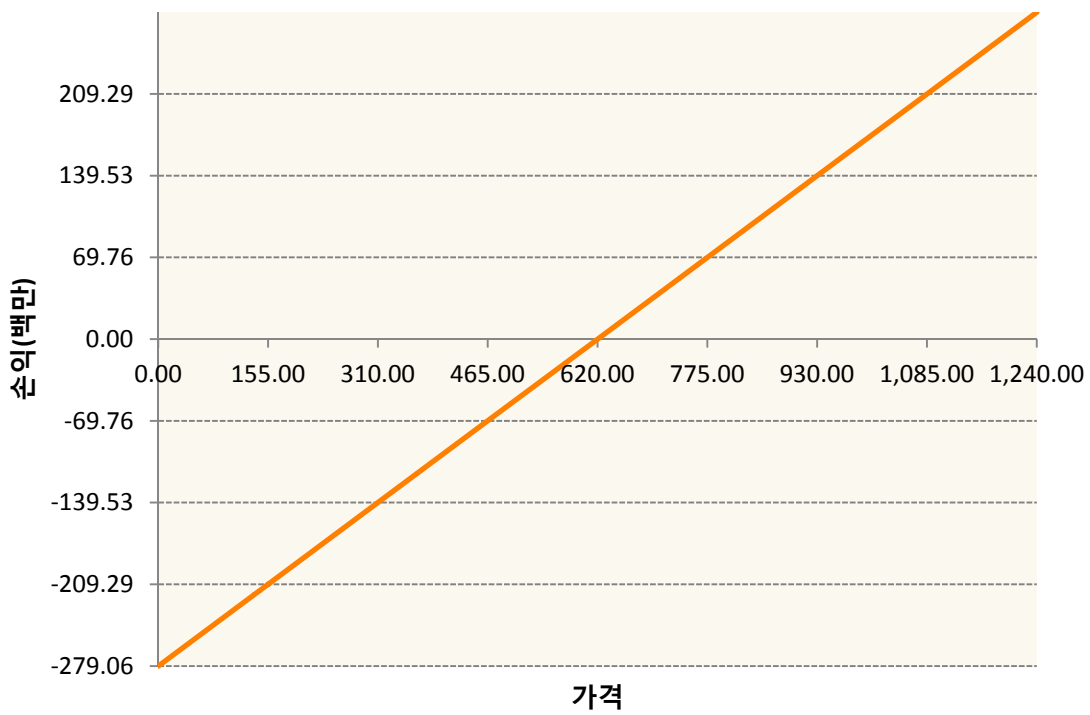




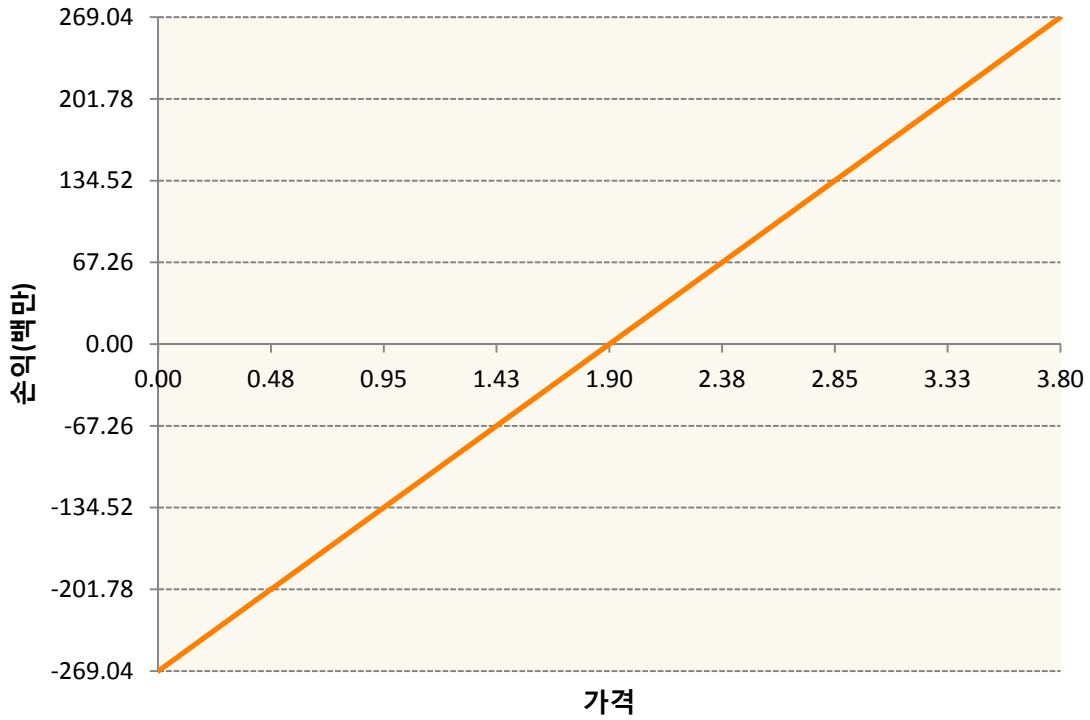
NGK19-NATURAL GAS FUTR May19



QSK9-Low Su Gasoil G May19



XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK9	WTI CRUDE FUTURE May19	54
CON9	BRENT CRUDE FUTR Jul19	61
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	22

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

(단위:백만원)

443

공시일	2019-03-22
기준일	2019-03-21

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

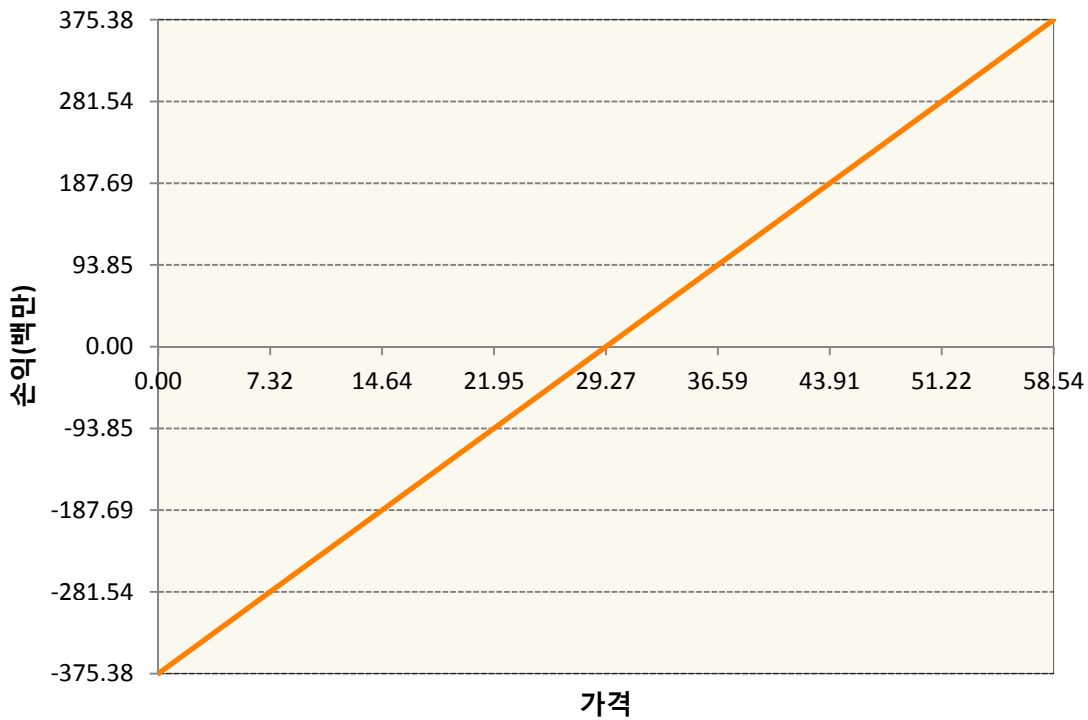
1. 계약금액

(단위:백만원)

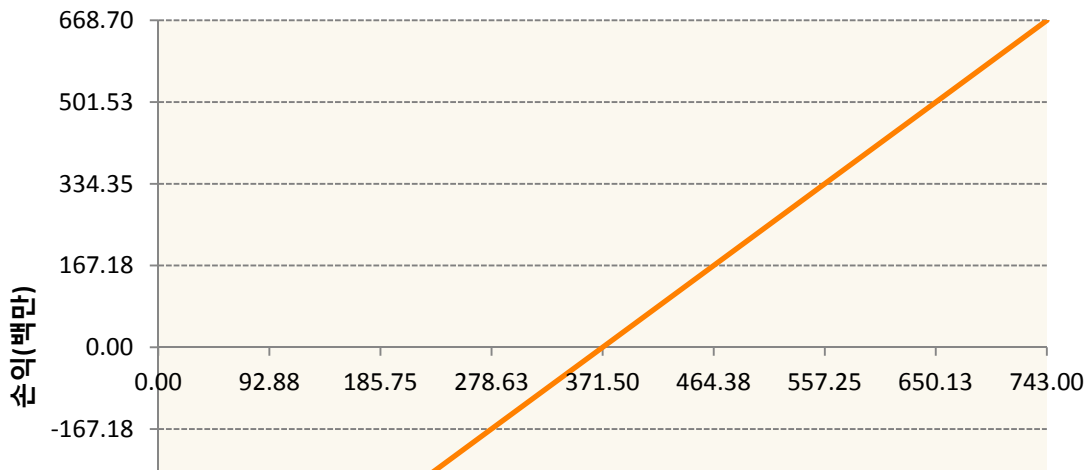
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,387	79	3,308	

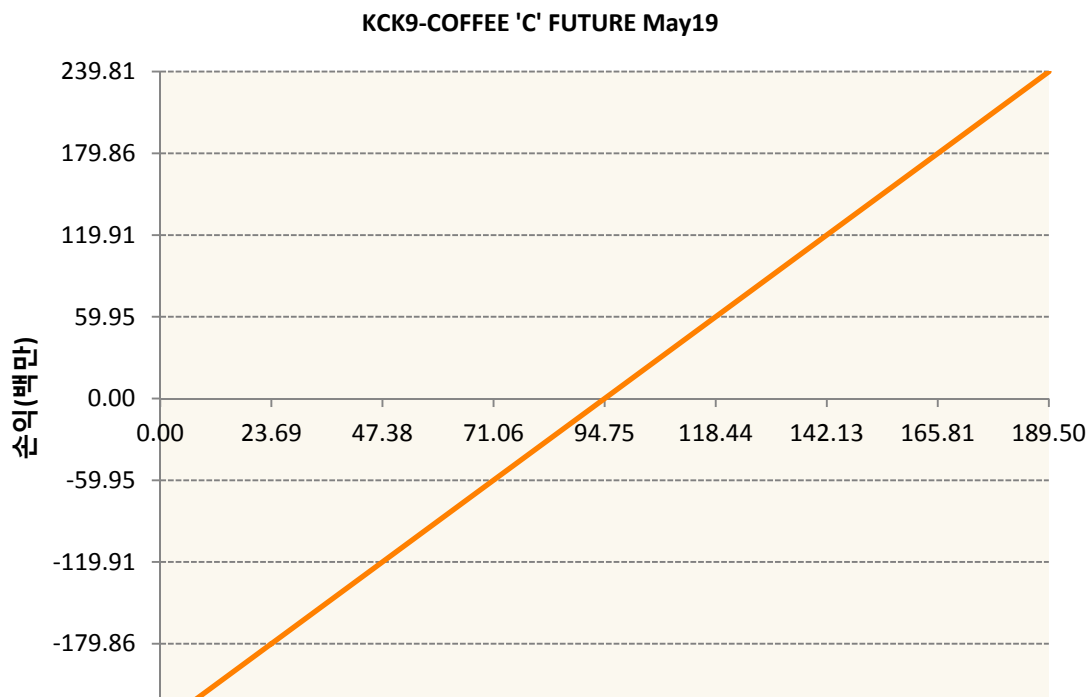
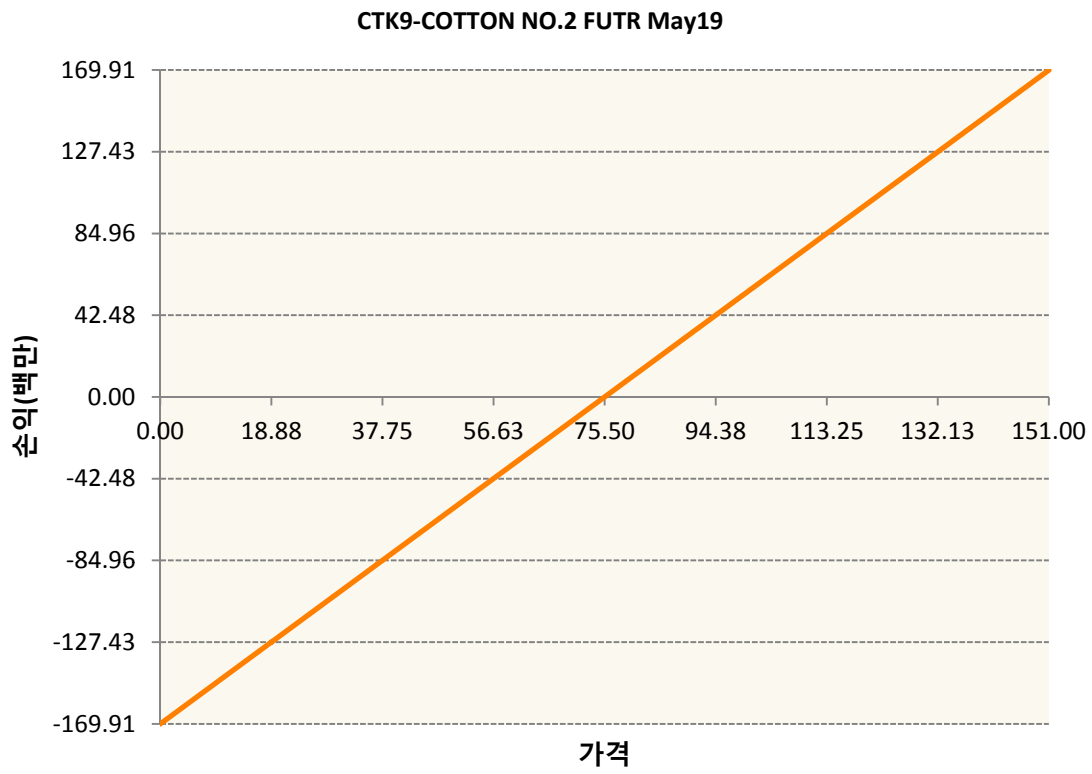
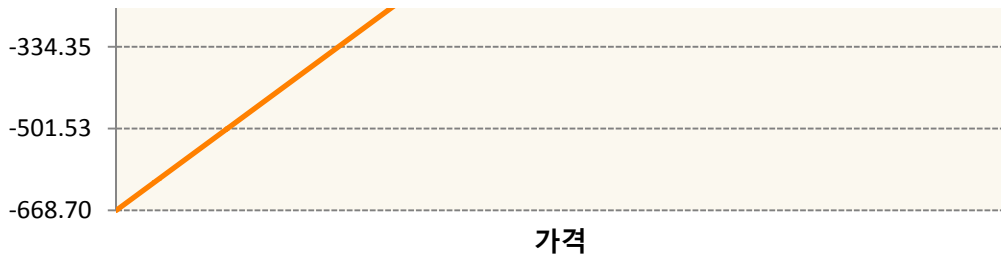
2. 만기시점의 손익구조

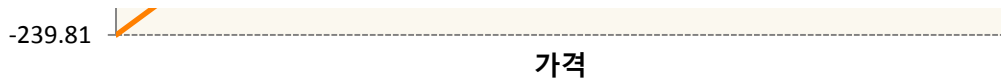
BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19



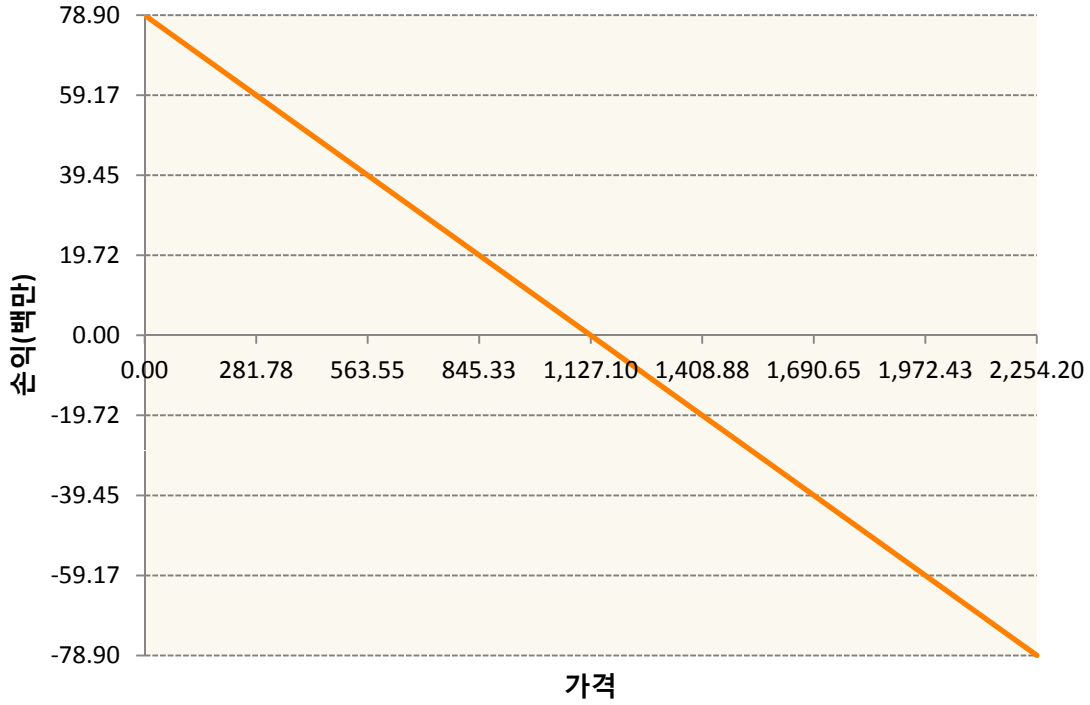
CK9-CORN FUTURE May19



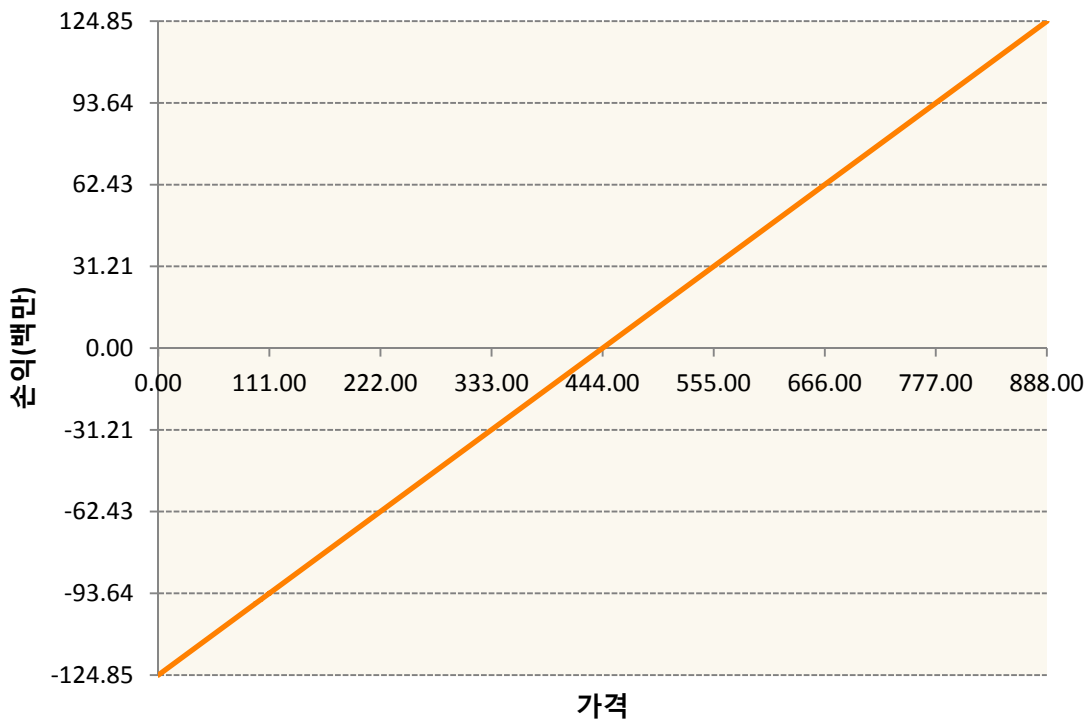




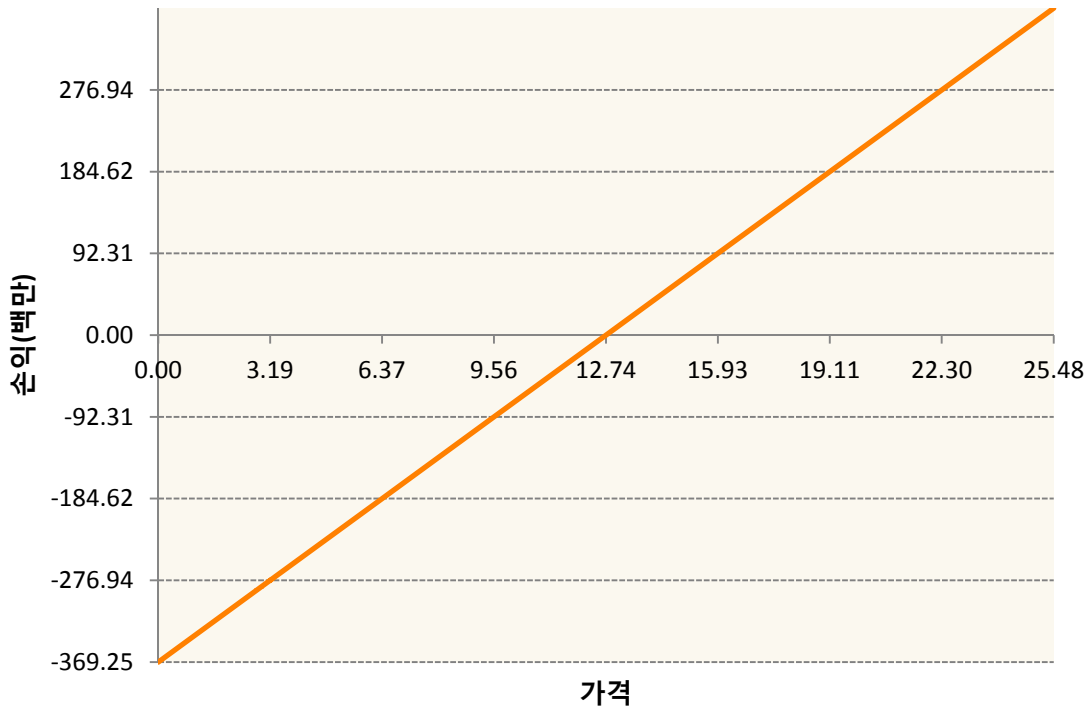
KR4175P40000-2019-04 달러선물



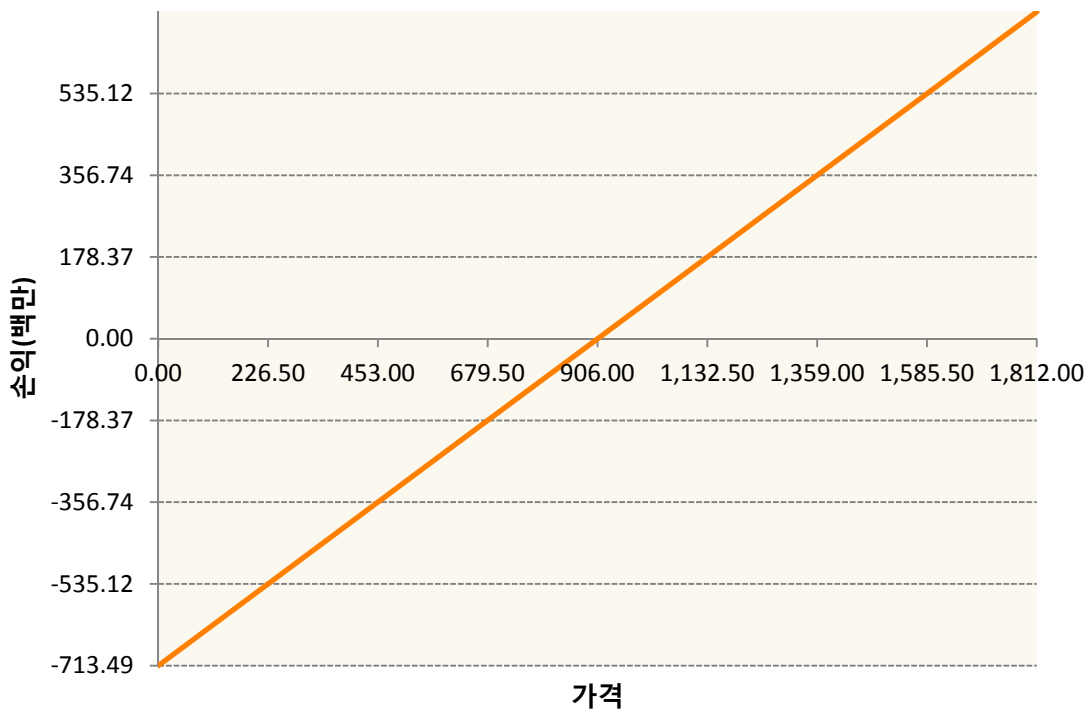
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



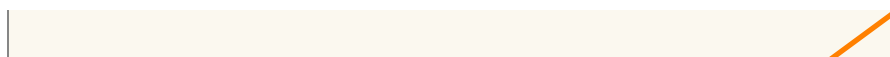
SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

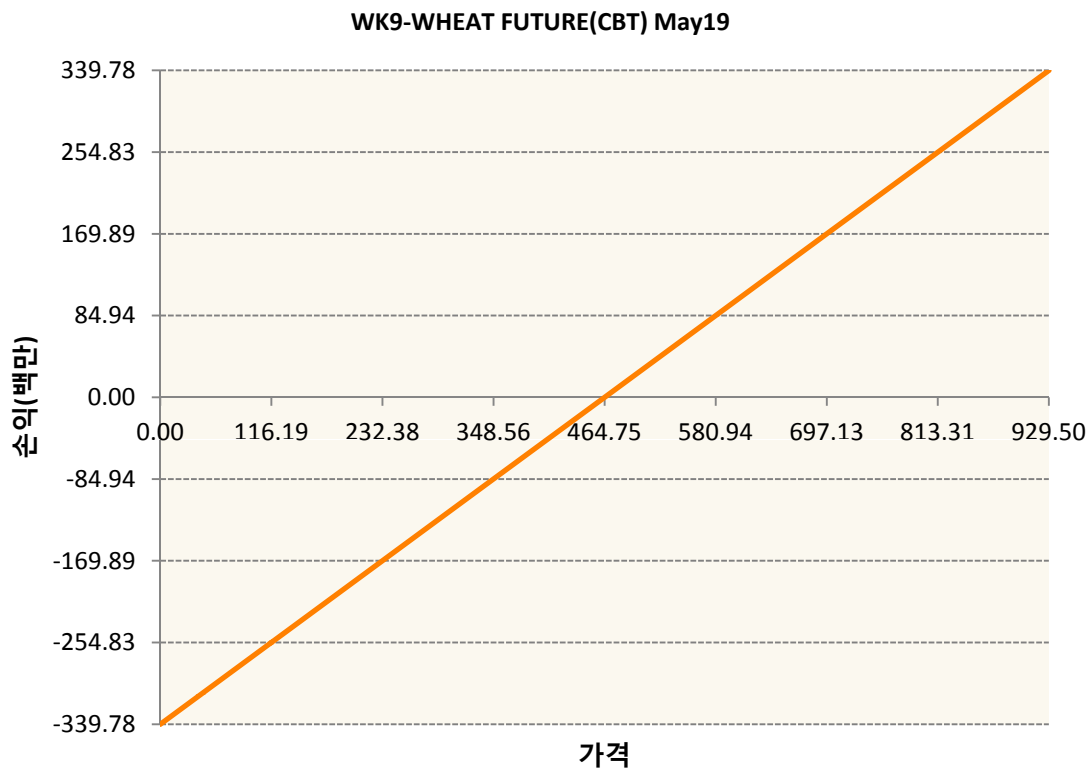
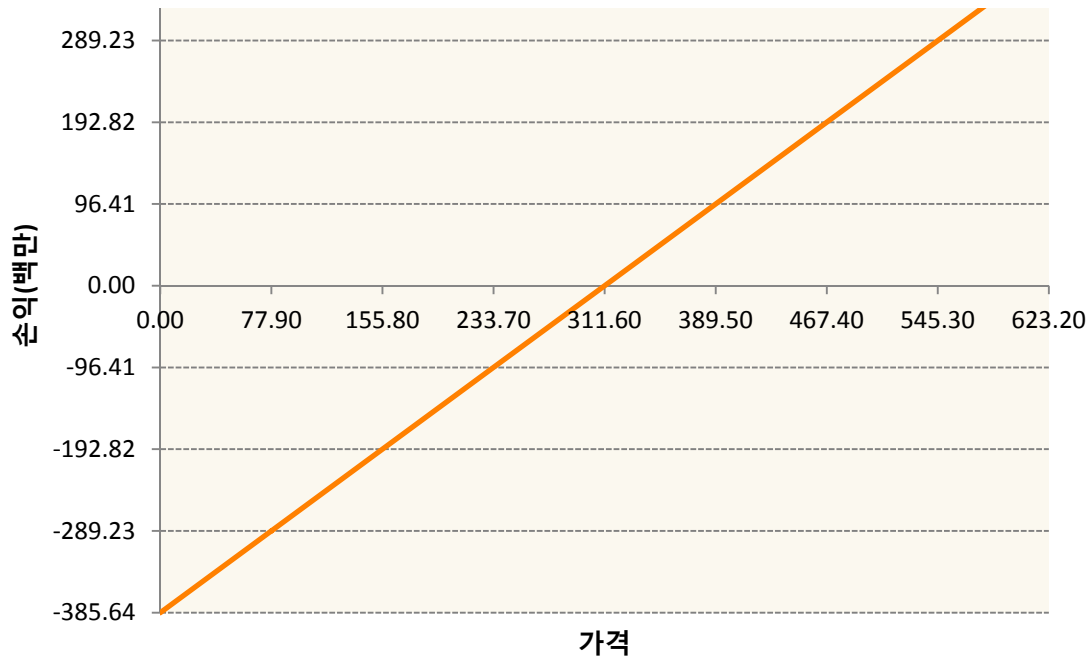


SK9-SOYBEAN FUTURE May19



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	14
KCK9	COFFEE 'C' FUTURE May19	19
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