

공시일	2019-03-25
기준일	2019-03-22

## 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	2019-03-25
기준일	2019-03-22

## 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

1,137

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

661

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-03-25
기준일	2019-03-22

## 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)	352
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	97
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	165

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

<b>967</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-03-25
기준일	2019-03-22

## 유로인덱스모(주식-파생형)

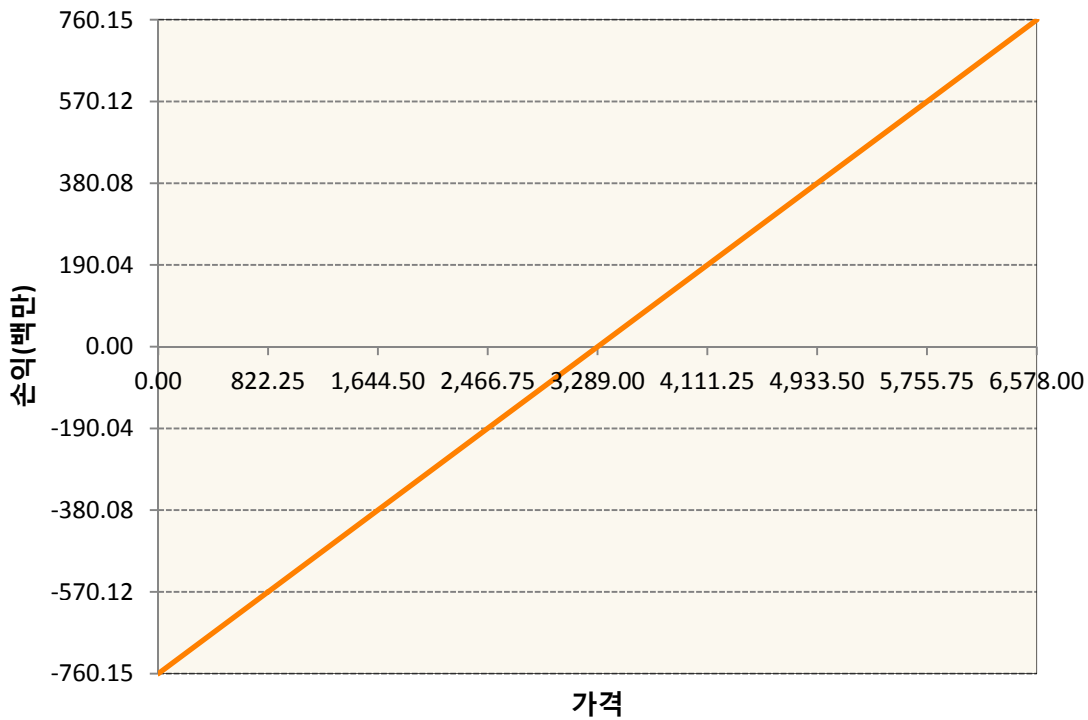
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	760	0	760	

### 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	2019-03-25
기준일	2019-03-22

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

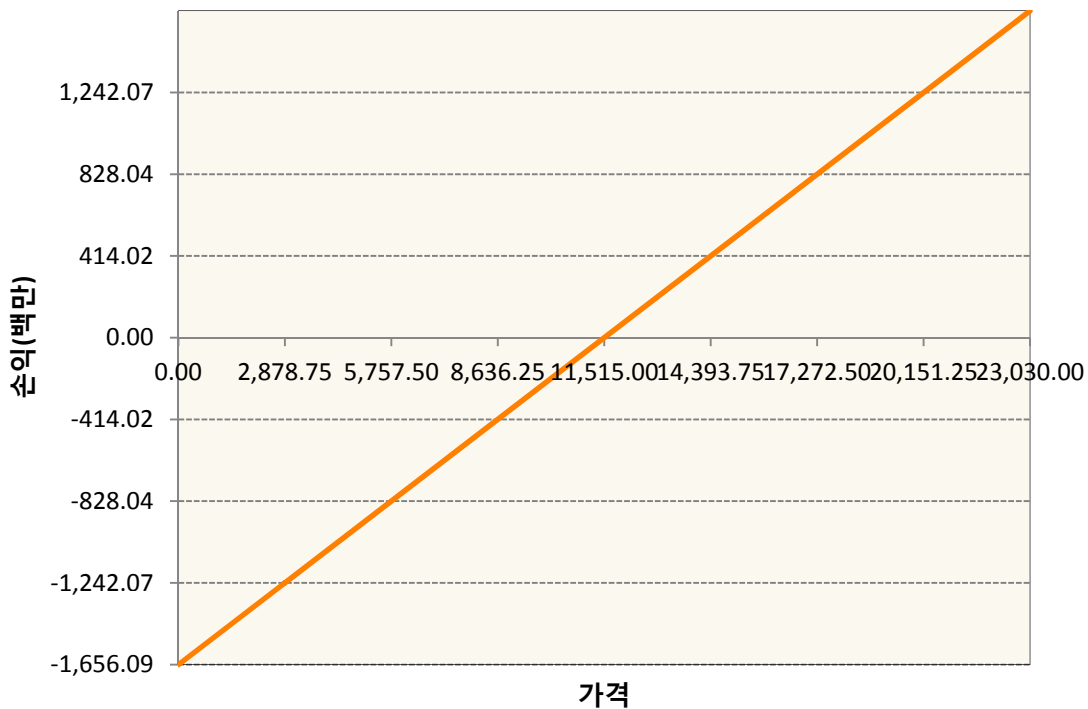
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,656	0	1,656	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCH9-HSCEI Futures Mar19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH9	HSCEI Futures Mar19	132
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

135

공시일	2019-03-25
기준일	2019-03-22

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

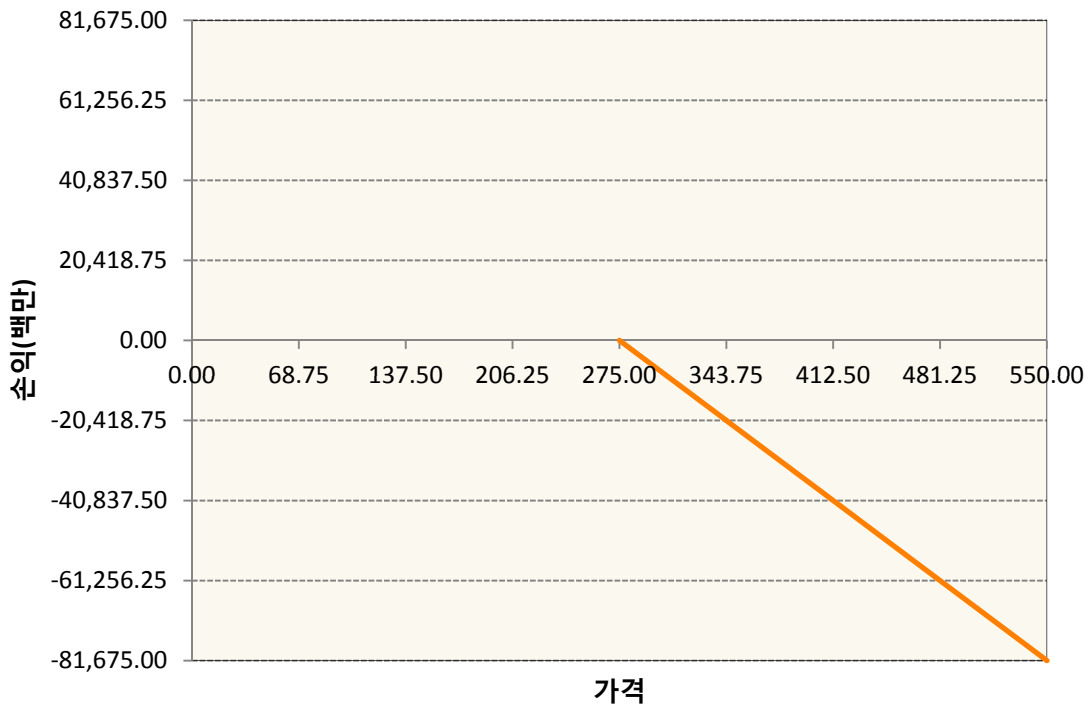
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

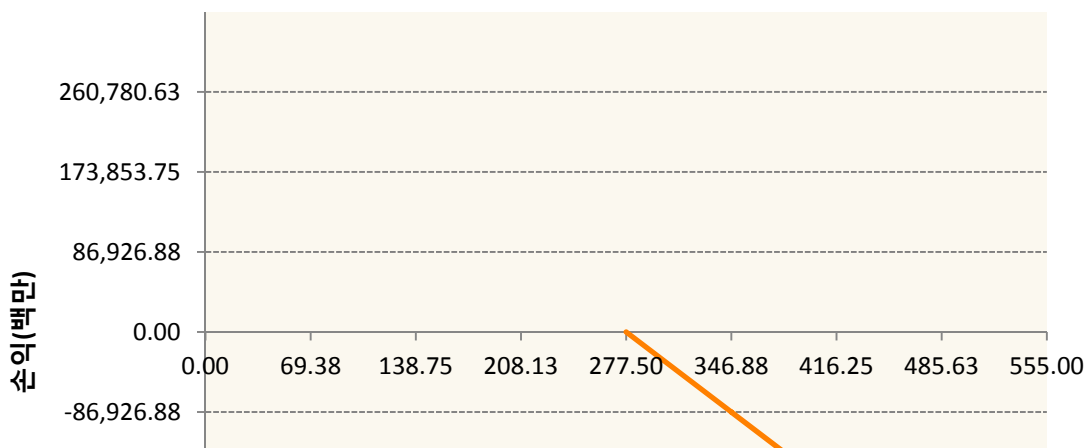
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	667,445	-667,445	장내

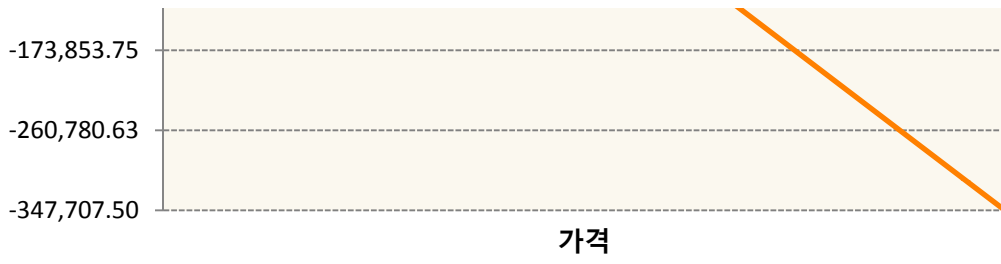
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P42752-2019-04 콜275

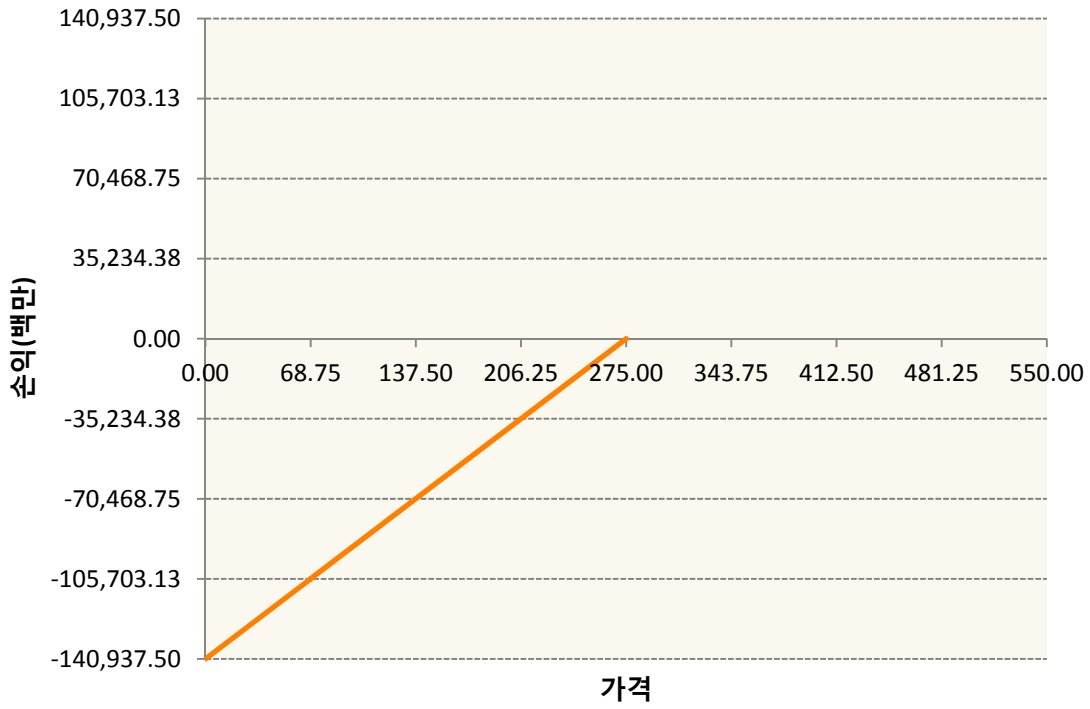


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

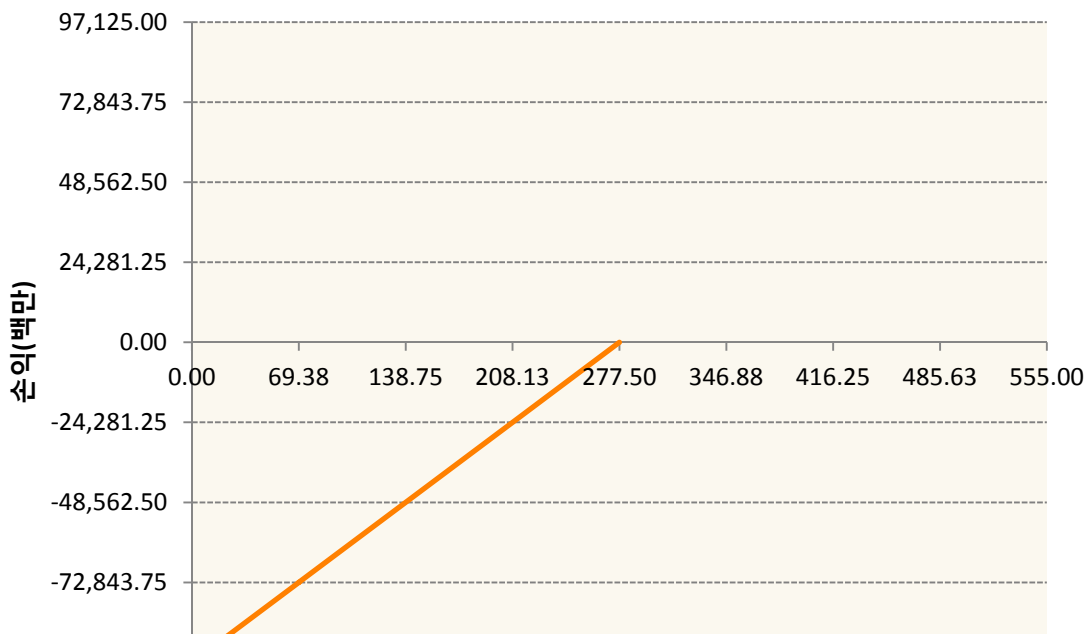




**KR4301P42750-2019-04 풋275**



**KR4301P42776-2019-04 풋277.5**



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P42752		2019-04 콜275						5,934
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,208	3,126	3,033	2,931	2,822	2,707	2,587	
-5.33%	2,767	2,628	2,485	2,340	2,192	2,042	1,891	
-2.67%	1,860	1,696	1,533	1,369	1,206	1,042	879	
0%	427	289	146	0	-149	-301	-454	
2.67%	-1,423	-1,510	-1,607	-1,713	-1,827	-1,948	-2,074	
5.33%	-3,516	-3,556	-3,609	-3,673	-3,747	-3,830	-3,922	
8.00%	-5,711	-5,726	-5,749	-5,781	-5,823	-5,874	-5,934	
KR4201P42778		2019-04 콜277.5						24,223
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	11,804	11,528	11,202	10,835	10,432	9,998	9,538	
-5.33%	10,416	9,894	9,346	8,778	8,193	7,595	6,986	
-2.67%	7,287	6,602	5,915	5,228	4,539	3,850	3,161	
0%	1,962	1,317	662	0	-668	-1,341	-2,018	
2.67%	-5,323	-5,769	-6,255	-6,772	-7,315	-7,880	-8,462	
5.33%	-13,873	-14,105	-14,391	-14,724	-15,099	-15,511	-15,954	
8.00%	-23,027	-23,120	-23,256	-23,436	-23,658	-23,922	-24,223	
KR4301P42750		2019-04 풋275						7,257
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-7,097	-7,107	-7,123	-7,146	-7,175	-7,213	-7,257	
-5.33%	-3,418	-3,494	-3,579	-3,672	-3,770	-3,873	-3,981	
-2.67%	-758	-898	-1,039	-1,179	-1,320	-1,460	-1,601	
0%	233	164	86	0	-93	-192	-296	
2.67%	378	368	352	329	299	260	215	
5.33%	386	385	384	381	376	367	355	
8.00%	386	386	386	386	385	384	382	
KR4301P42776		2019-04 풋277.5						5,593
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-5,529	-5,532	-5,537	-5,545	-5,557	-5,573	-5,593	
-5.33%	-2,944	-2,976	-3,016	-3,061	-3,112	-3,168	-3,227	
-2.67%	-813	-905	-998	-1,092	-1,186	-1,280	-1,375	
0%	220	151	77	0	-80	-163	-247	
2.67%	434	419	398	370	337	298	253	

5.33%	451	450	447	443	435	425	410
8.00%	451	451	451	451	450	448	445

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

(단위:백만원)

**42,700**

공시일	2019-03-25
기준일	2019-03-22

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

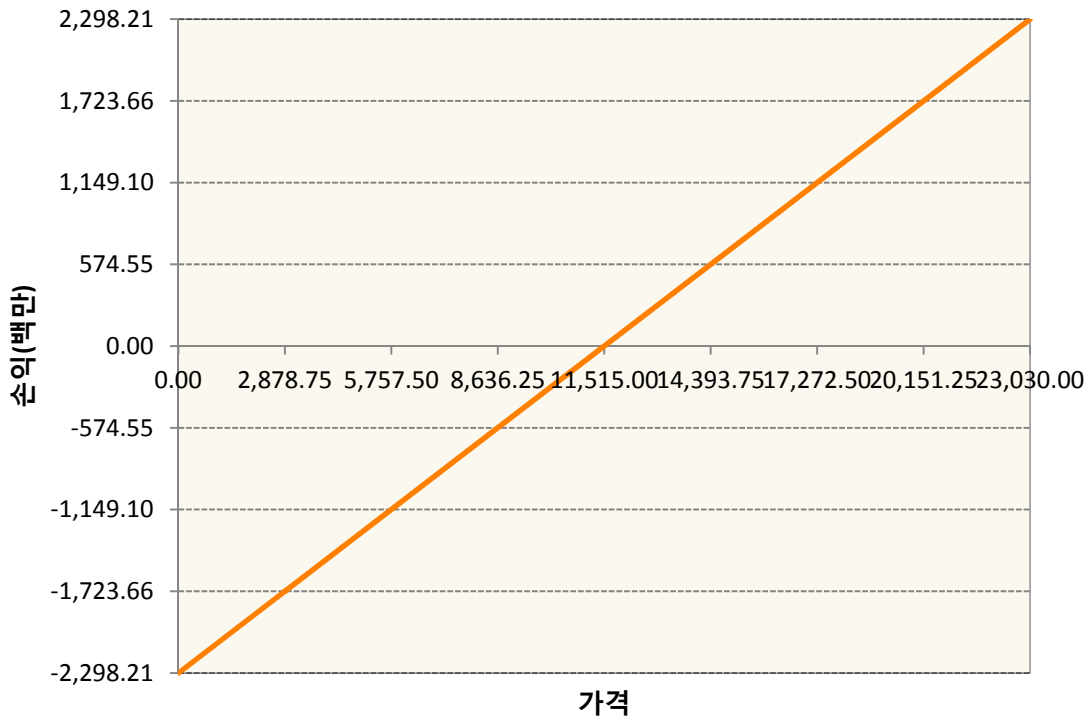
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

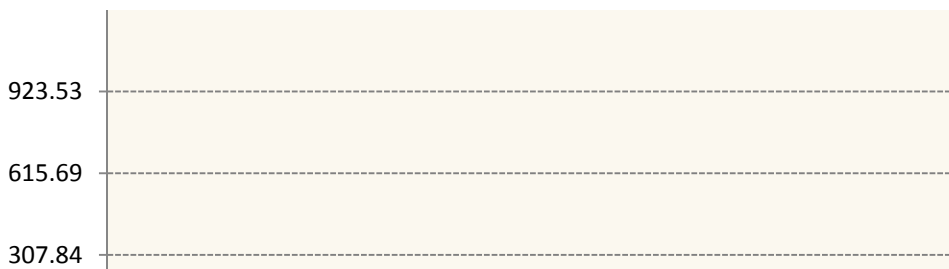
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,298	0	2,298	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,941	-5,941	장내
누계	통화	선도	0	3,025	-3,025	장외

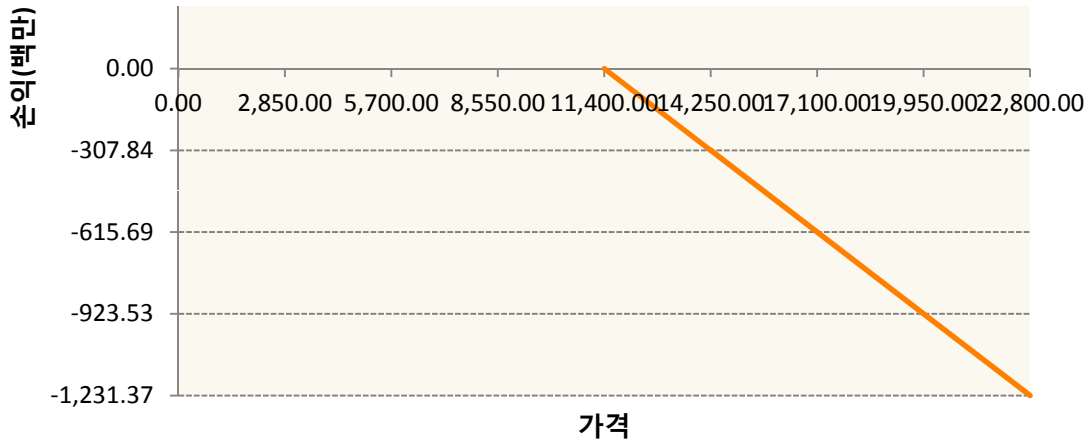
### 2. 만기시점의 손익구조

HCH9-HSCEI Futures Mar19

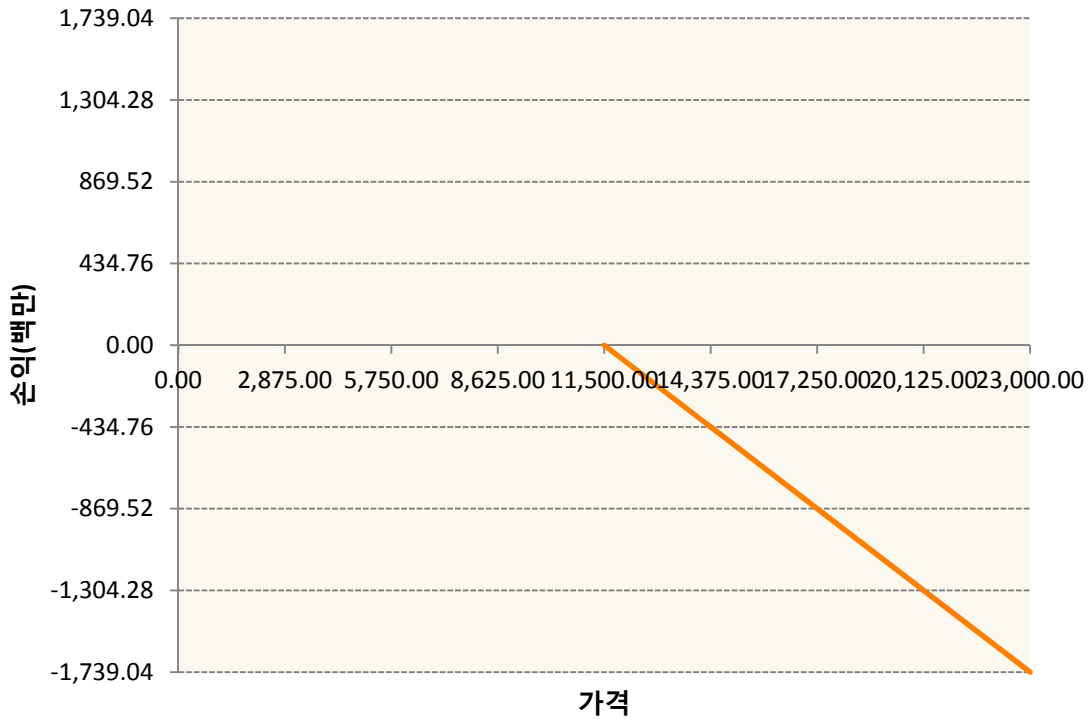


OHHIH9-C114-HSCEI

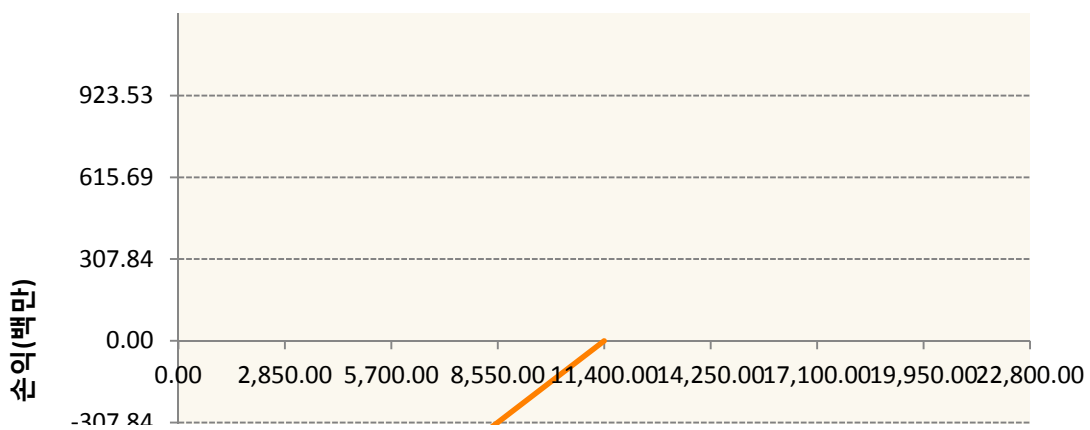


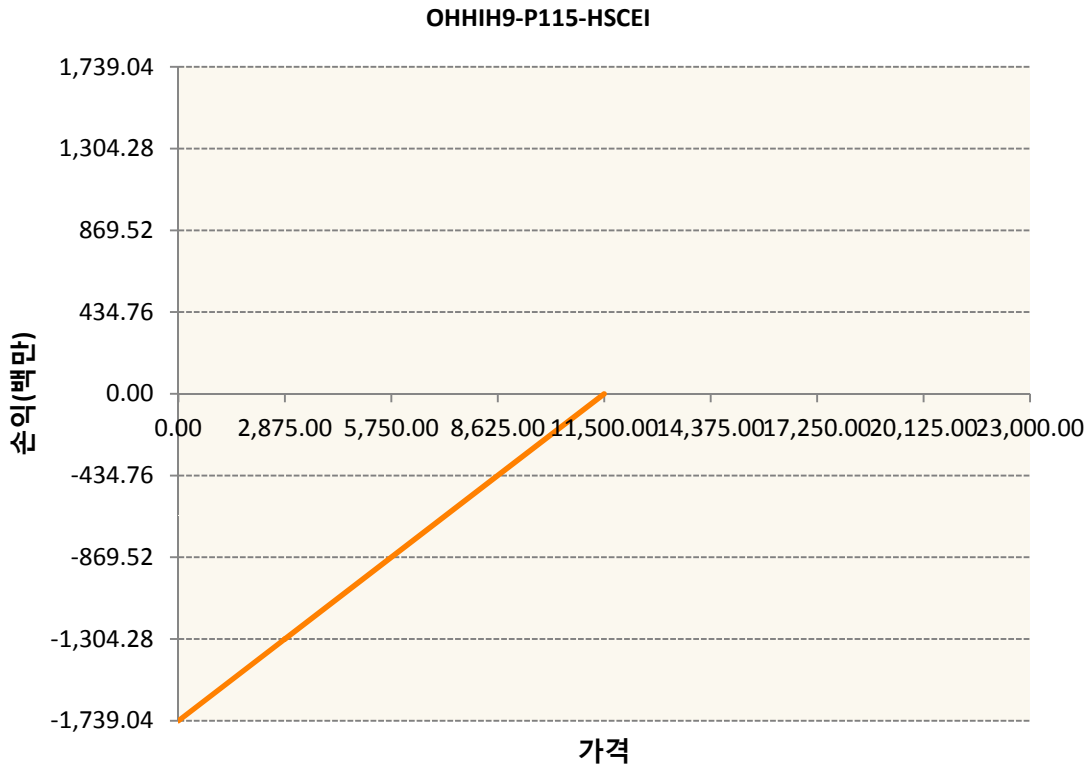


OHHIH9-C115-HSCEI



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		184
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)
		757

공시일	2019-03-25
기준일	2019-03-22

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

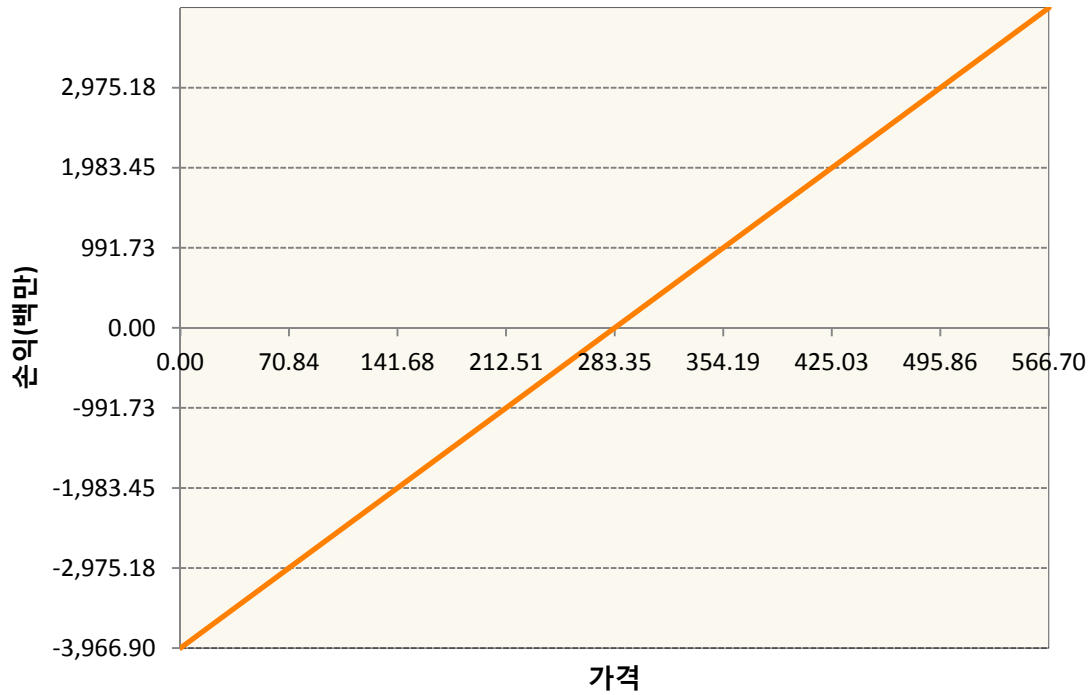
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

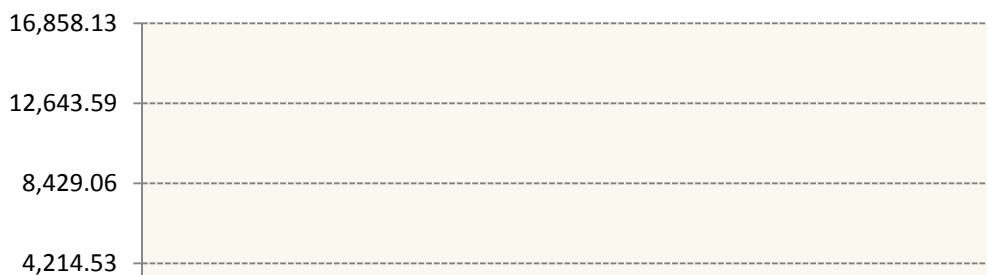
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,967	0	3,967	장내
누계	유가증권	스왑	35,836	0	35,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,649	-34,649	장내

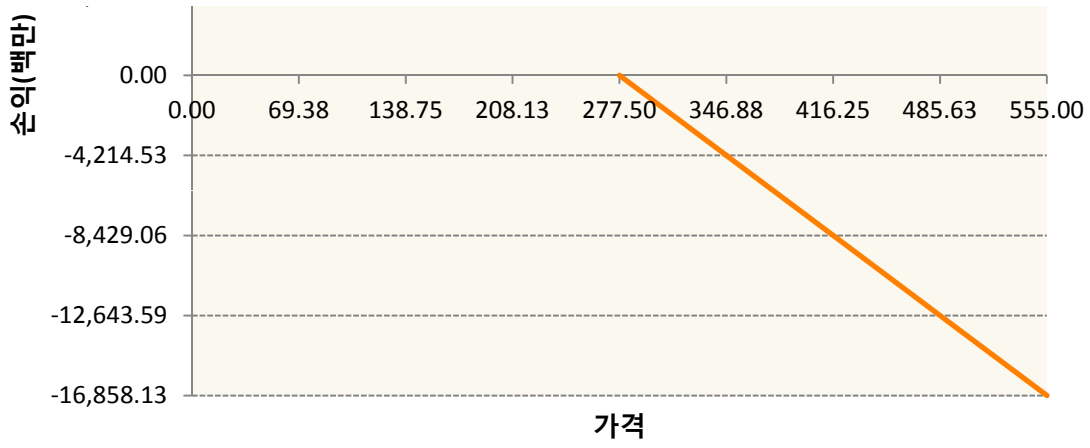
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

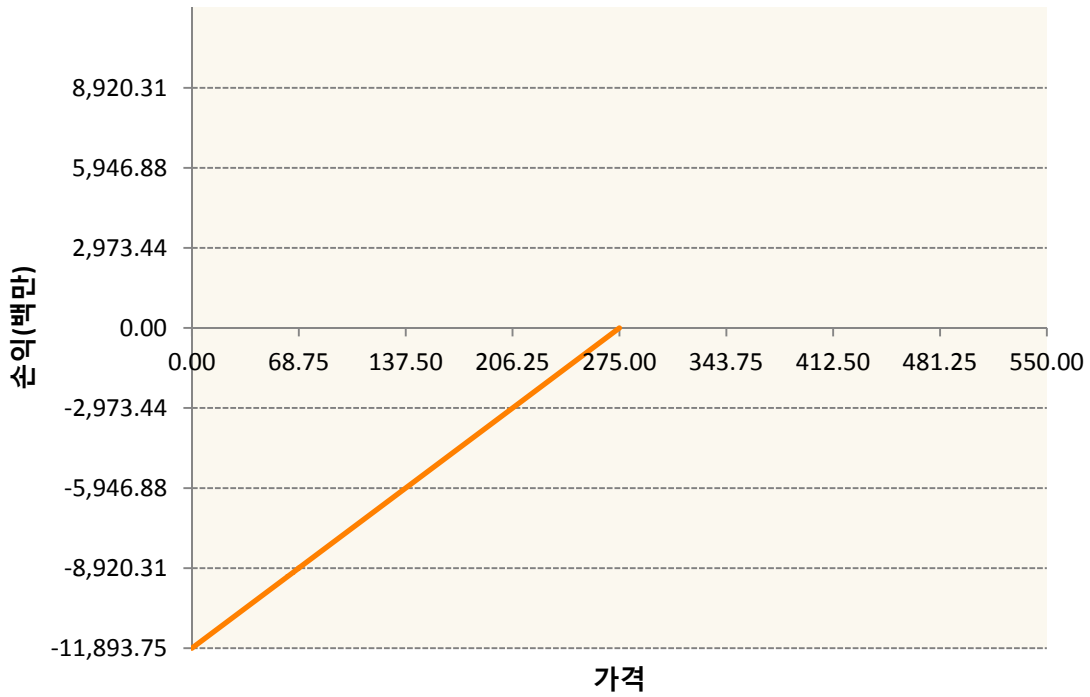


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

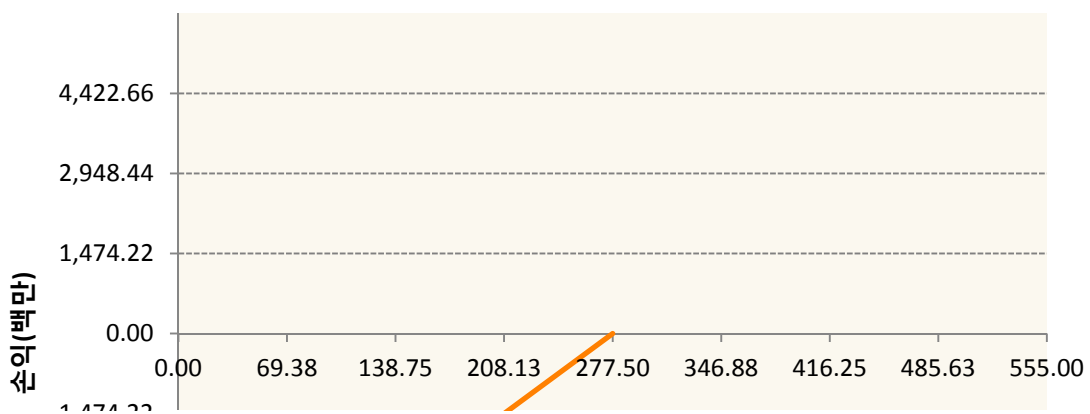




KR4301P42750-2019-04 풋275



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						317
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-317	-317	-317	-317	-317	-317	-317	
-5.33%	-211	-211	-211	-211	-211	-211	-211	
-2.67%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	106	106	106	106	106	106	106	
5.33%	211	211	211	211	211	211	211	
8.00%	317	317	317	317	317	317	317	
KR4201P42778		2019-04 콜277.5						1,174
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	572	559	543	525	506	485	462
-5.33%	505	480	453	426	397	368	339
-2.67%	353	320	287	253	220	187	153
0%	95	64	32	0	-32	-65	-98
2.67%	-258	-280	-303	-328	-355	-382	-410
5.33%	-673	-684	-698	-714	-732	-752	-774
8.00%	-1,116	-1,121	-1,128	-1,136	-1,147	-1,160	-1,174
KR4301P42750                      2019-04 풋275							612
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-599	-600	-601	-603	-606	-609	-612
-5.33%	-288	-295	-302	-310	-318	-327	-336
-2.67%	-64	-76	-88	-100	-111	-123	-135
0%	20	14	7	0	-8	-16	-25
2.67%	32	31	30	28	25	22	18
5.33%	33	33	32	32	32	31	30
8.00%	33	33	33	33	33	32	32
KR4301P42776                      2019-04 풋277.5							340
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-336	-336	-336	-337	-337	-338	-340
-5.33%	-179	-181	-183	-186	-189	-192	-196
-2.67%	-49	-55	-61	-66	-72	-78	-83
0%	13	9	5	0	-5	-10	-15
2.67%	26	25	24	22	20	18	15
5.33%	27	27	27	27	26	26	25
8.00%	27	27	27	27	27	27	27

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

(단위:백만원)

**5,349**

공시일	2019-03-25
기준일	2019-03-22

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

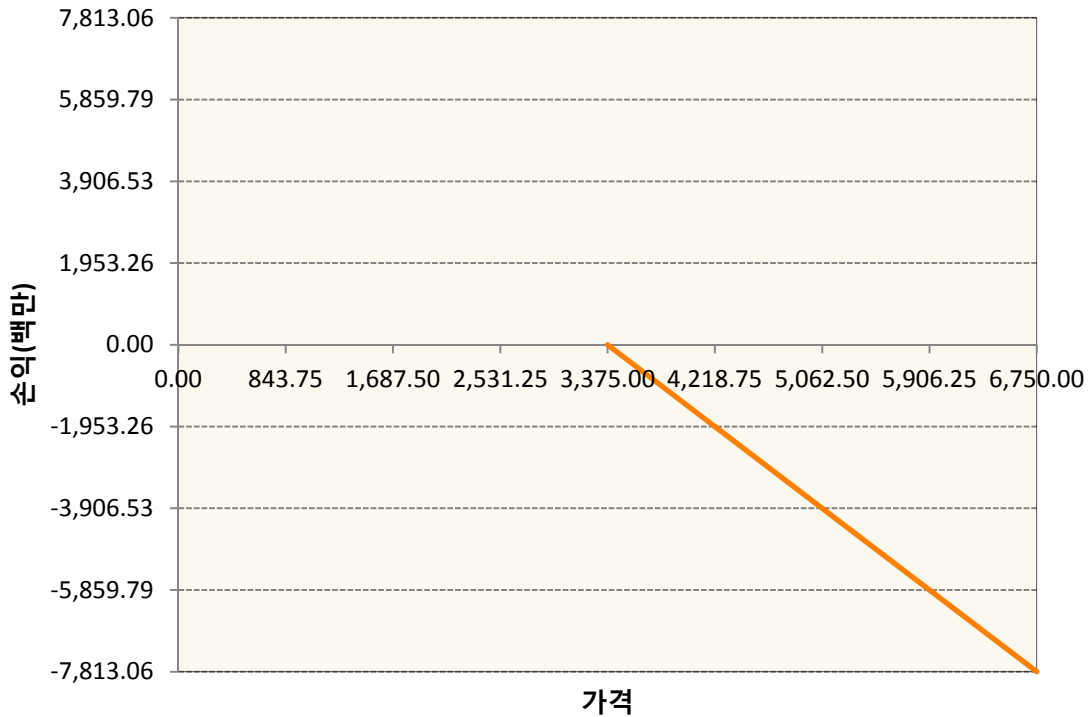
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

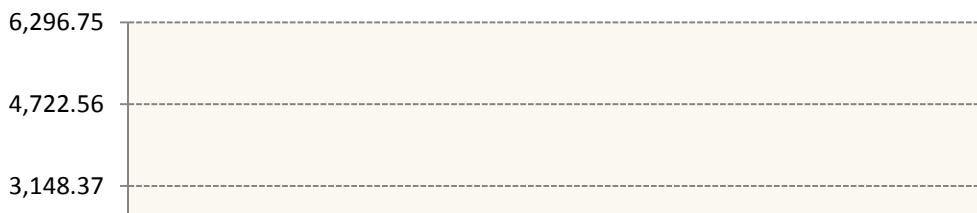
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,137	0	7,137	
누계	유가증권	스왑	60,716	0	60,716	장외
누계	유가증권	옵션	0	28,220	-28,220	장내
누계	통화	선도	0	15,433	-15,433	장외

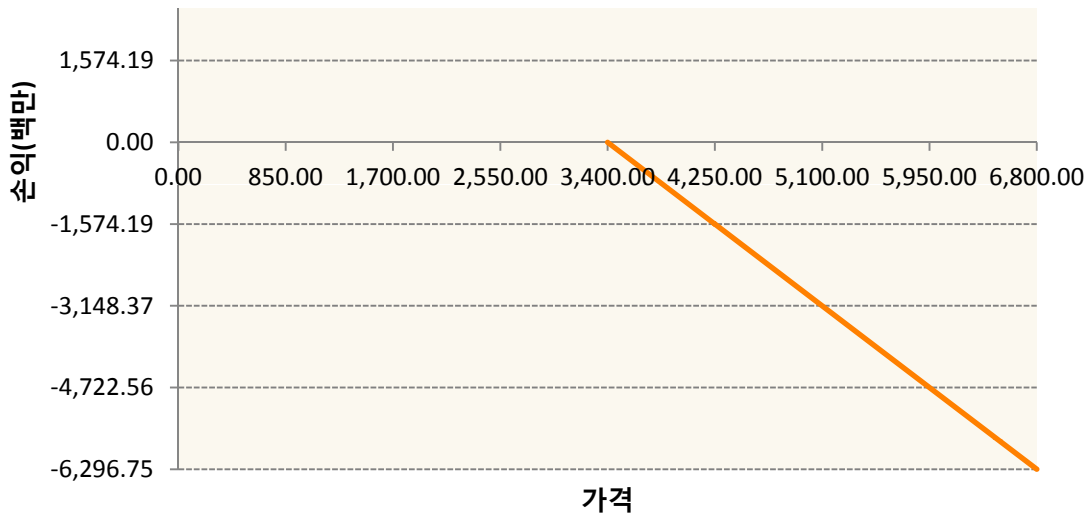
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXJ9-C3375-EURO STOXX 50**

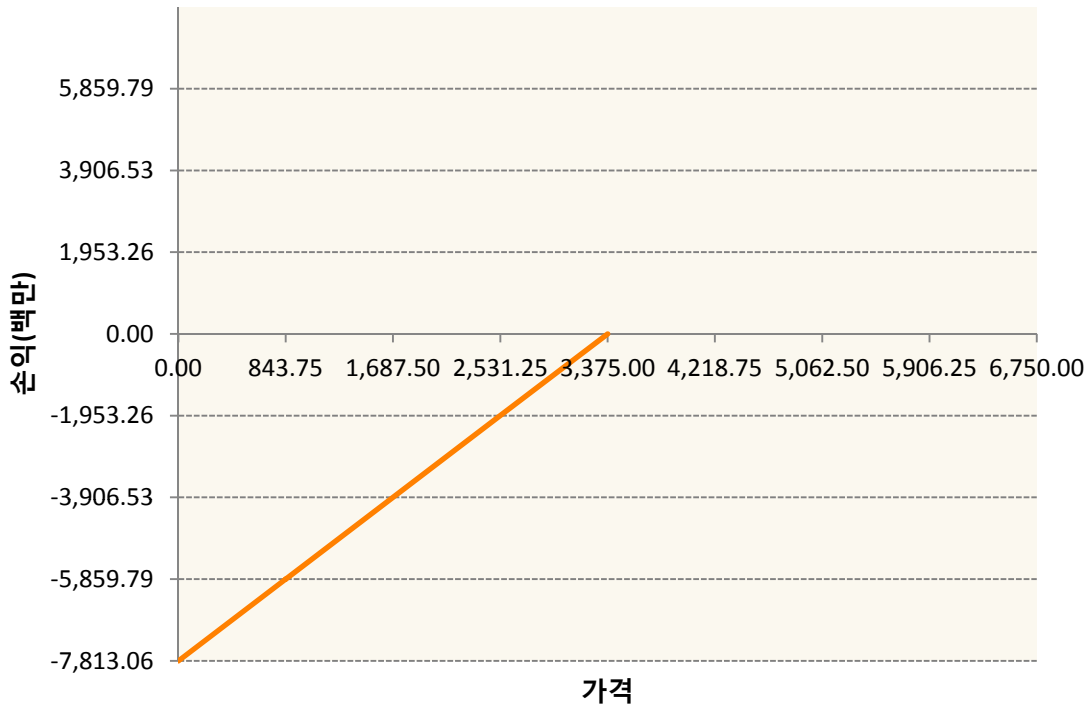


**OESXJ9-C3400-EURO STOXX 50**

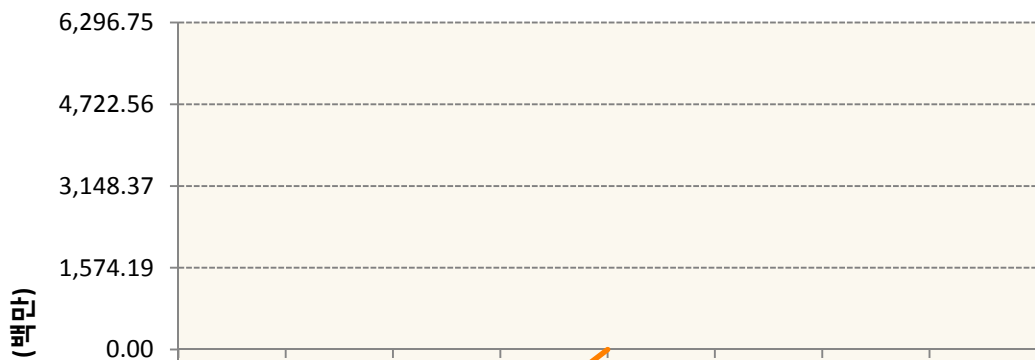


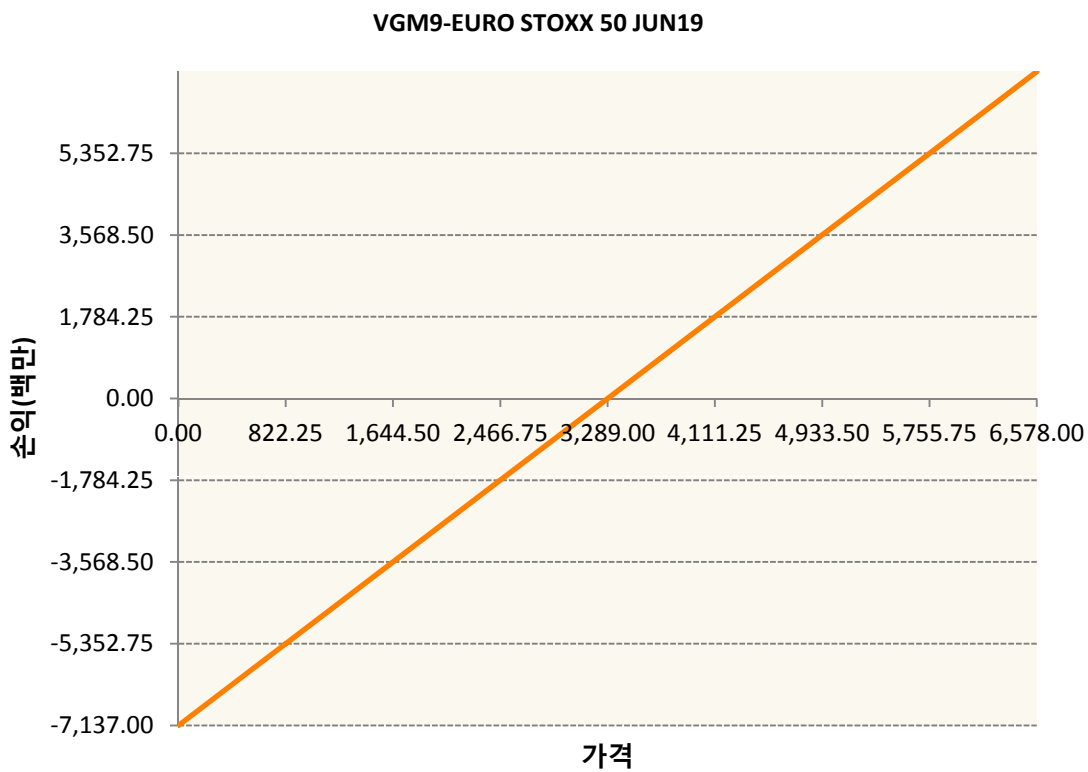
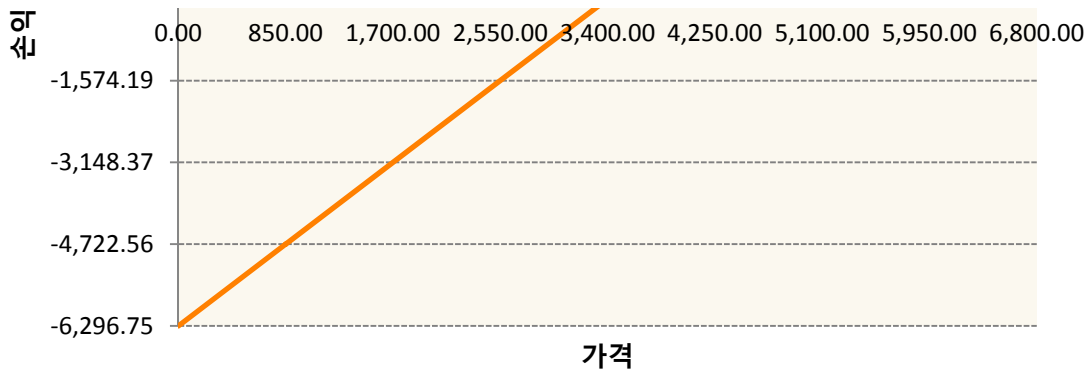


**OESXJ9-P3375-EURO STOXX 50**



**OESXJ9-P3400-EURO STOXX 50**





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		120
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E		412
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E		823
OESXJ9-C33' EURO STOXX 50		625
OESXJ9-C34' EURO STOXX 50		504
OESXJ9-P33' EURO STOXX 50		625
OESXJ9-P34' EURO STOXX 50		504
VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	571

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

(단위:백만원)

2,782



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

(단위:백만원)

1,112



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

(단위:백만원)

95



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

(단위:백만원)

138

공시일	2019-03-25
기준일	2019-03-22

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

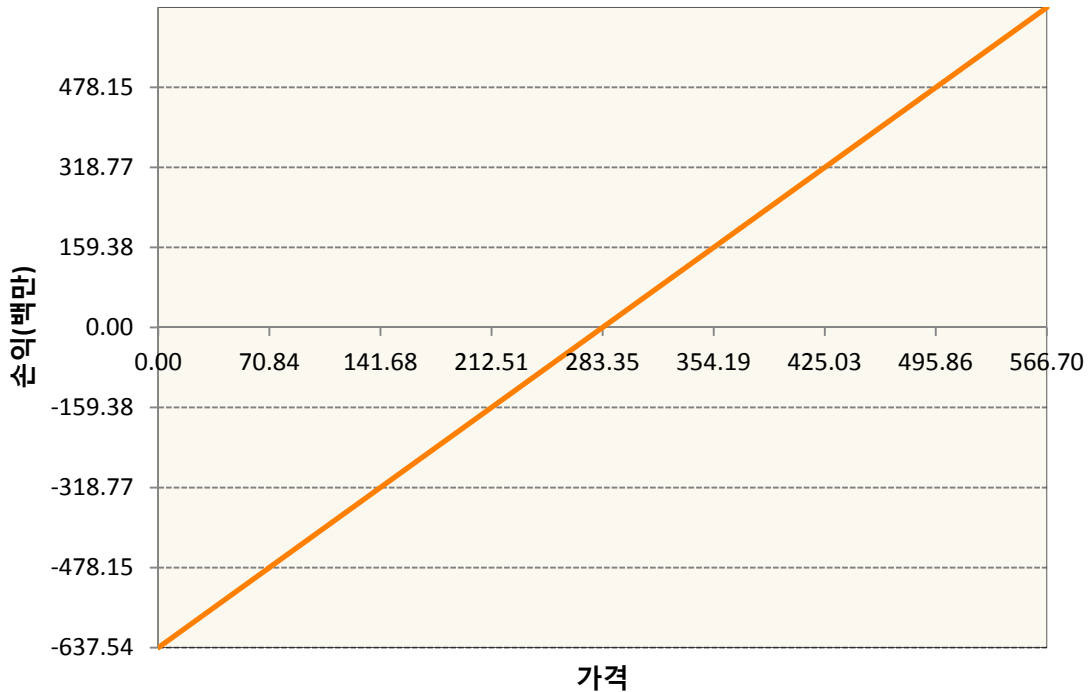
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	638	0	638	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						51
기초자산의 변동성								
가격	-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	2019-03-25
기준일	2019-03-22

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

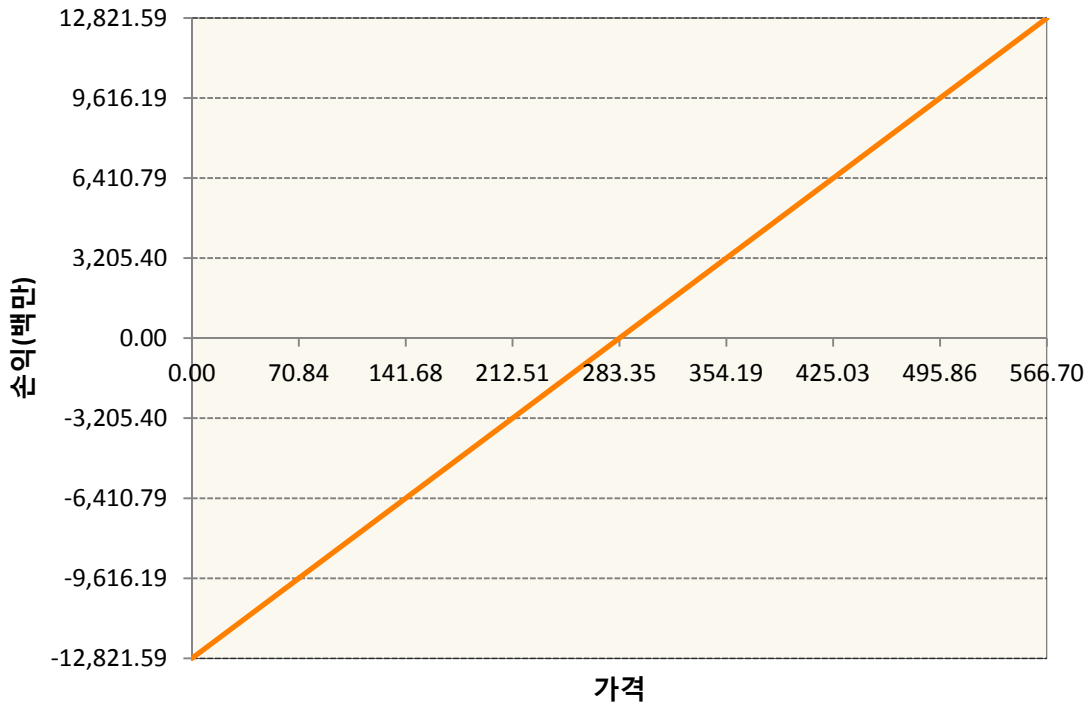
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

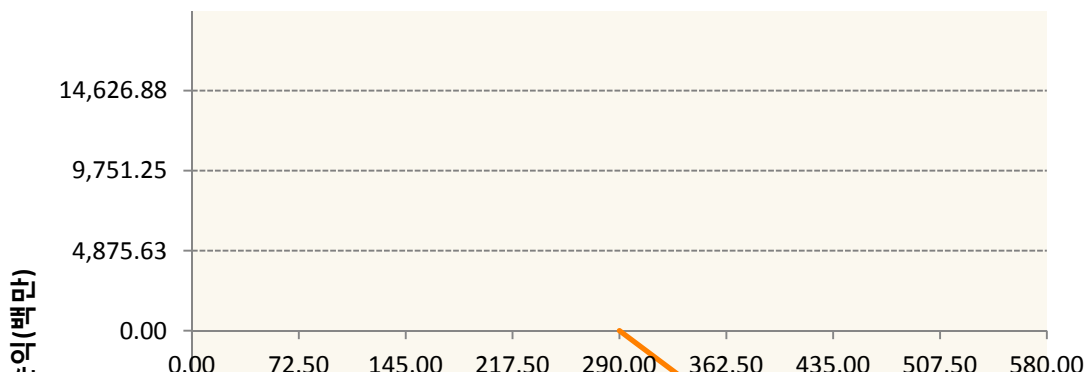
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,822	0	12,822	장내
누계	유가증권	옵션	1,867	24,036	-22,169	장내

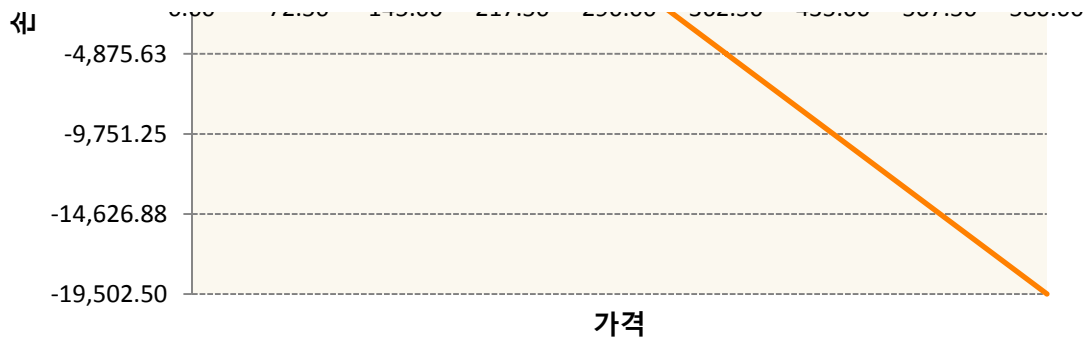
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

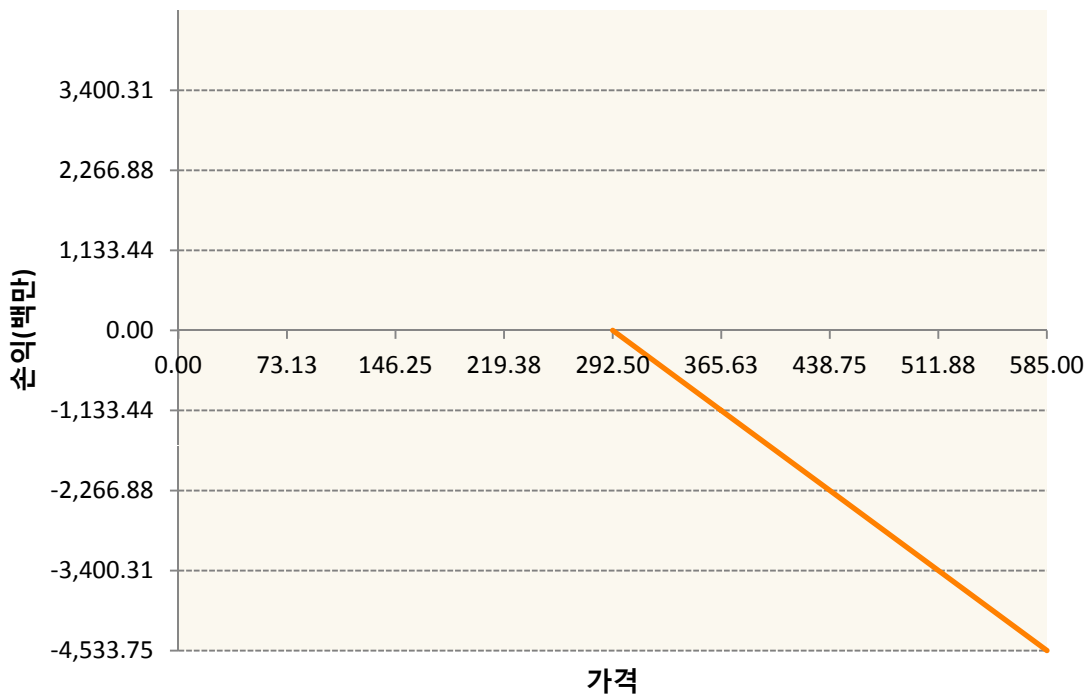


KR4201P42901-2019-04 콜290

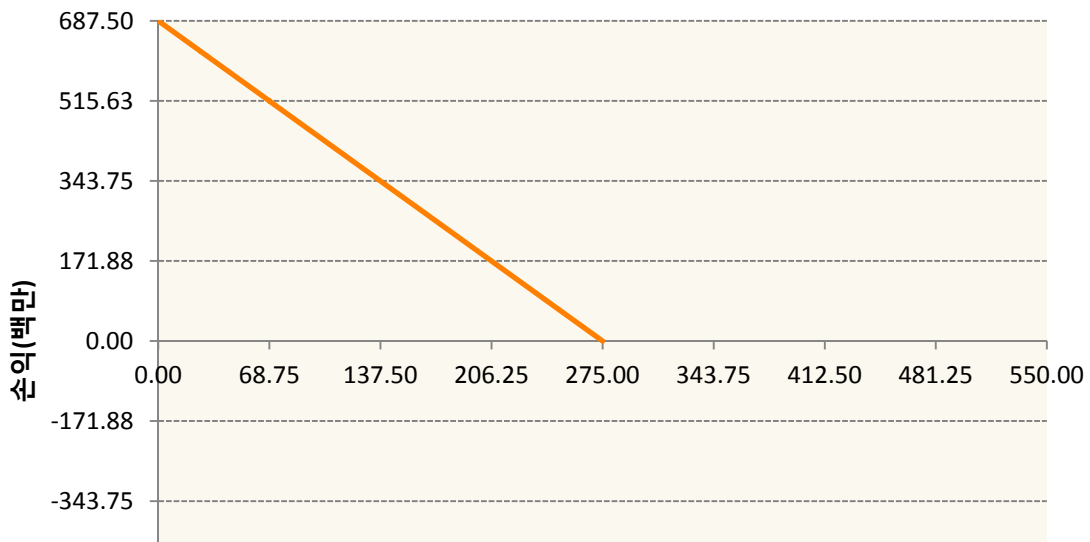


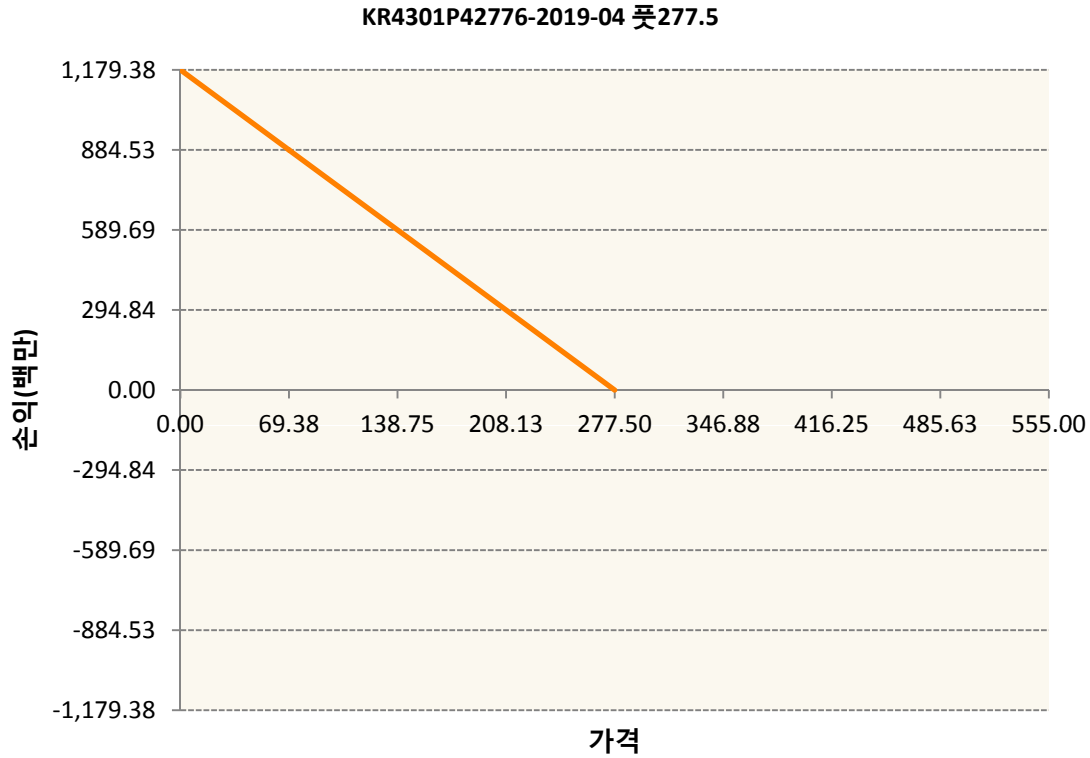
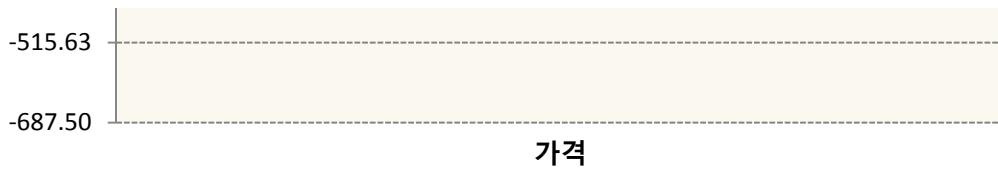


KR4201P42927-2019-04 콜292.5



KR4301P42750-2019-04 풋275





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

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						1,025
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,025	-1,025	-1,025	-1,025	-1,025	-1,025	-1,025	
-5.33%	-683	-683	-683	-683	-683	-683	-683	
-2.67%	-342	-342	-342	-342	-342	-342	-342	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	342	342	342	342	342	342	342	
5.33%	683	683	683	683	683	683	683	
8.00%	1,025	1,025	1,025	1,025	1,025	1,025	1,025	
KR4201P42901		2019-04 콜290						1,003
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	264	261	256	250	241	231	218	
-5.33%	252	243	231	216	199	180	159	
-2.67%	211	190	166	141	113	85	55	

0%	104	70	35	0	-36	-72	-108
2.67%	-106	-145	-184	-223	-262	-301	-340
5.33%	-428	-462	-496	-531	-567	-604	-641
8.00%	-842	-864	-888	-915	-943	-972	-1,003
KR4201P42927                      2019-04 콜292.5							215
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	49	49	48	47	45	43	41
-5.33%	47	46	44	41	38	34	30
-2.67%	41	37	32	27	22	16	9
0%	22	15	8	0	-8	-16	-24
2.67%	-18	-27	-36	-45	-54	-63	-72
5.33%	-84	-92	-101	-110	-118	-127	-136
8.00%	-173	-179	-186	-193	-200	-207	-215
KR4301P42750                      2019-04 풋275							35
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	35	35	35	35	35	35	35
-5.33%	17	17	17	18	18	19	19
-2.67%	4	4	5	6	6	7	8
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-2	-2	-2	-2	-1	-1	-1
5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
KR4301P42776                      2019-04 풋277.5							68
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	67	67	67	67	67	68	68
-5.33%	36	36	37	37	38	38	39
-2.67%	10	11	12	13	14	16	17
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-5	-5	-5	-4	-4	-4	-3
5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5

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

(단위:백만원)

**2,004**

공시일	2019-03-25
기준일	2019-03-22

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	283	0	283	
누계	유가증권	수익증권	2,561	0	2,561	

### 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	2019-03-25
기준일	2019-03-22

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	339	693	-354	
누계	유가증권	수익증권	7,623	0	7,623	

### 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	2019-03-25
기준일	2019-03-22

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	7,572	0	7,572	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	55,724	0	55,724	
누계	통화	선도	0	66,913	-66,913	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
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	108
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
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	362
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	416
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	181

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

(단위:백만원)

1,864

공시일	2019-03-25
기준일	2019-03-22

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

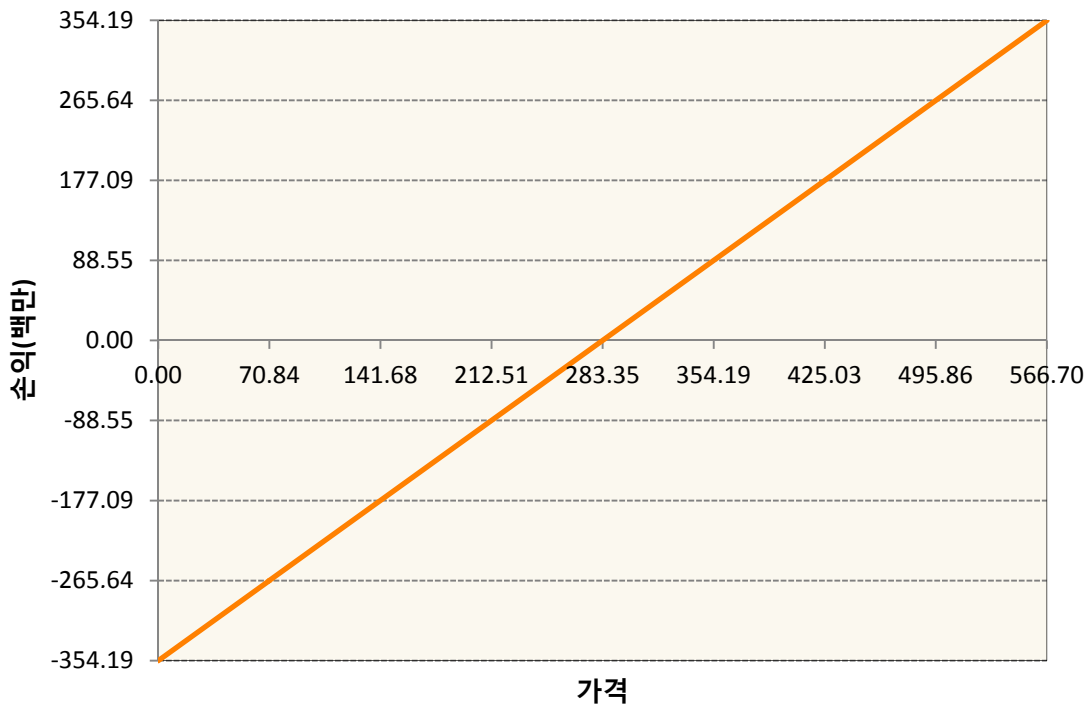
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

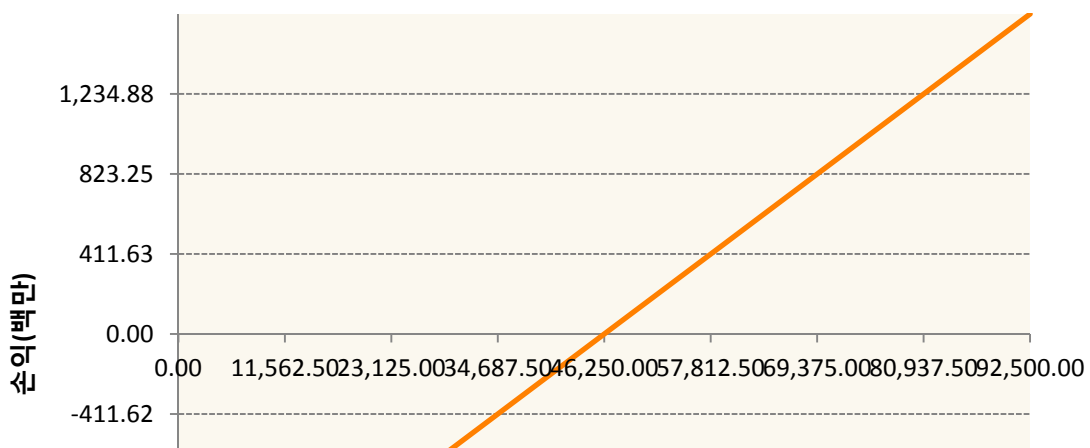
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,001	0	2,001	장내

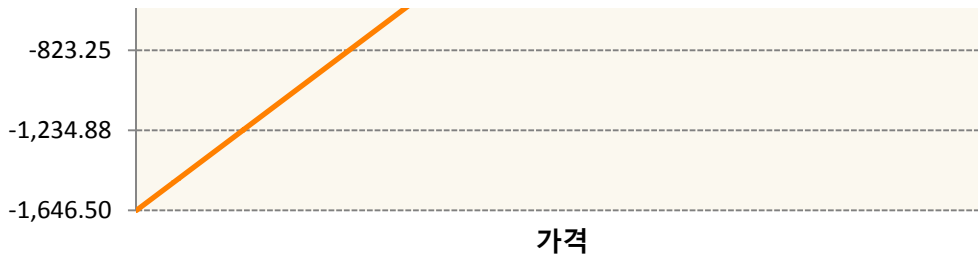
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4111P40005-2019-04 삼성전자개별선물





**3. 시나리오 별 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						133
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133	
-5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88	
-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%	88	88	88	88	88	88	88	
8.00%	133	133	133	133	133	133	133	

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

**180**

공시일	2019-03-25
기준일	2019-03-22

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

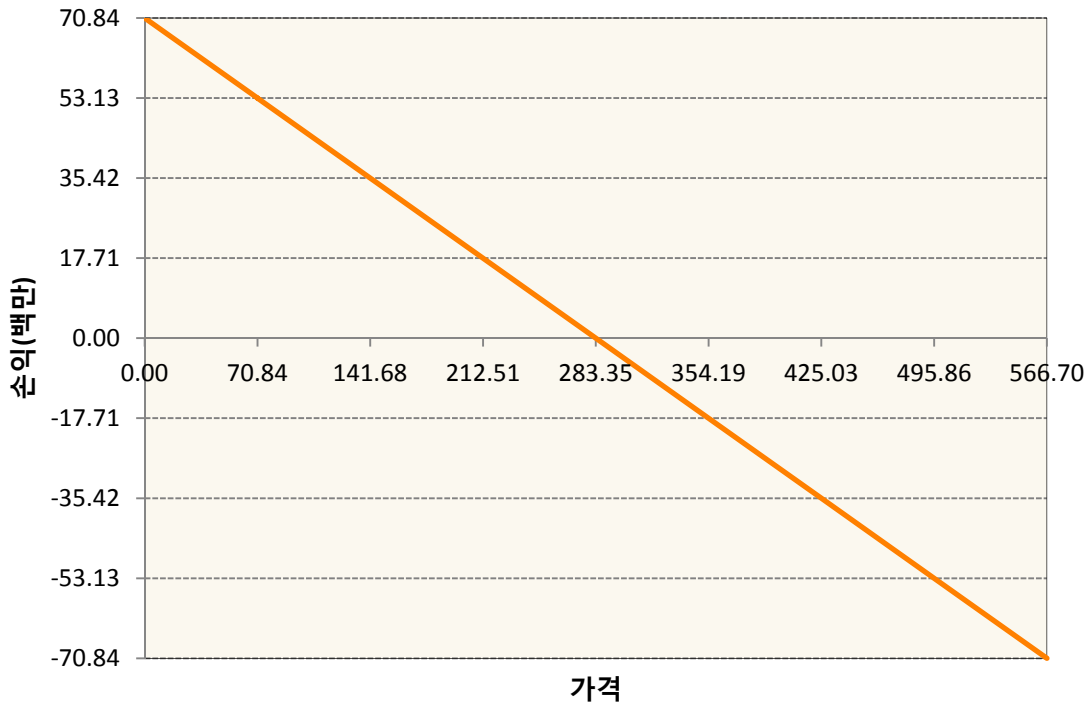
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

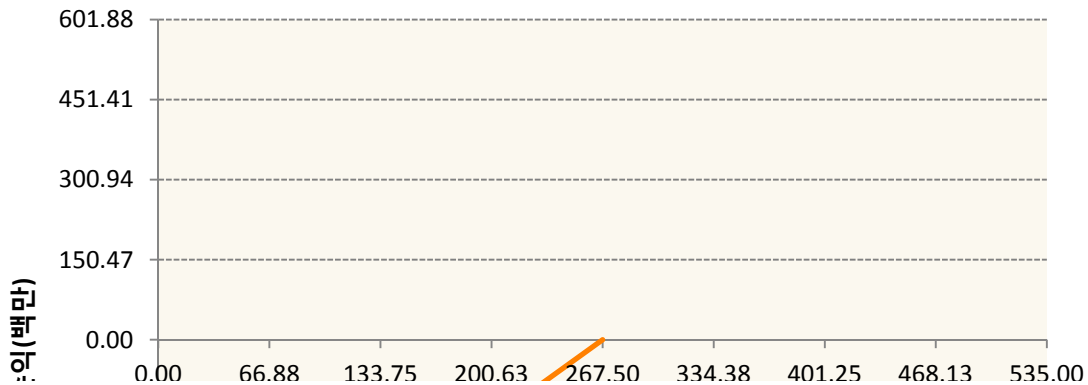
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	71	-71	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	71	-71	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,074	-1,074	장내

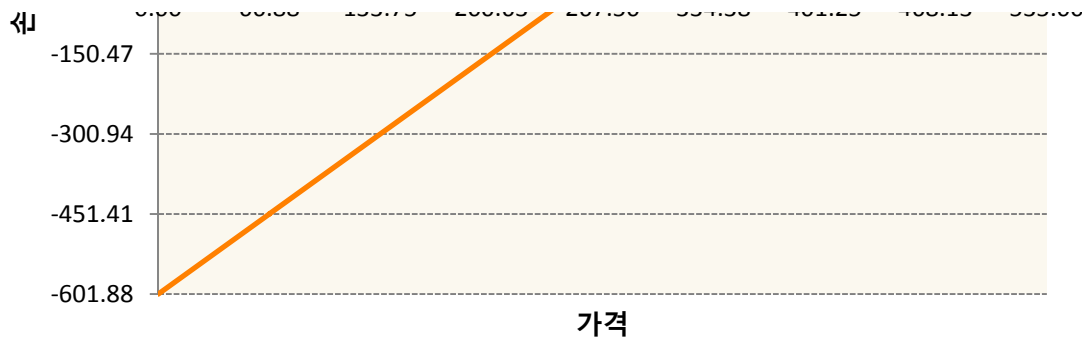
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

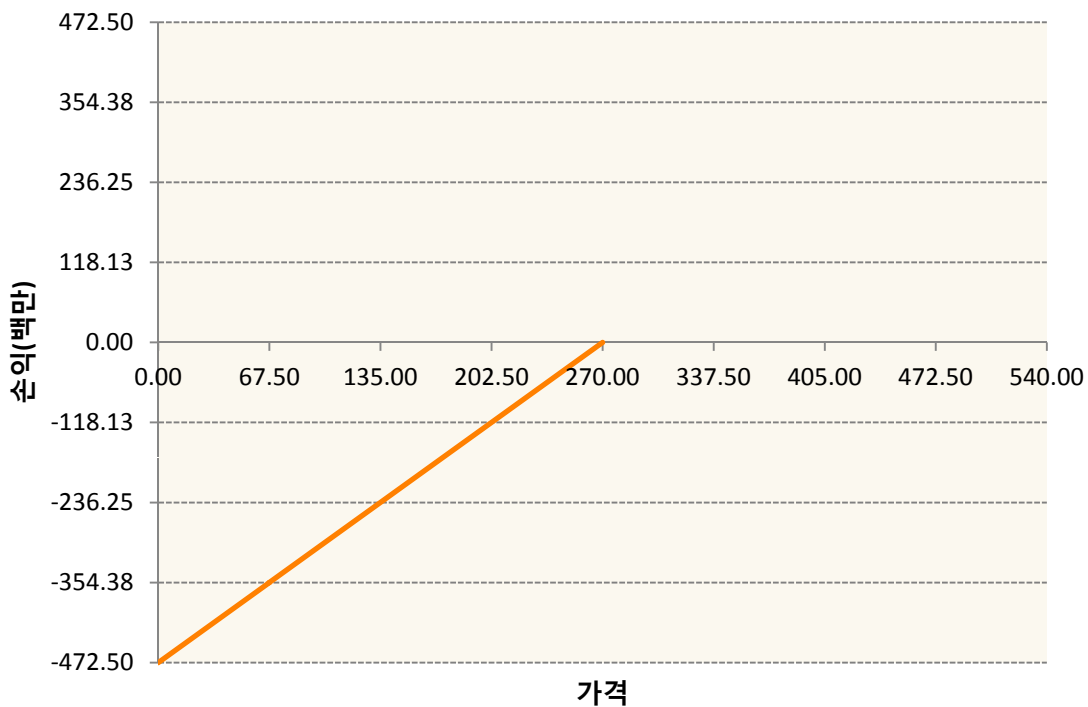


KR4301P42677-2019-04 풋267.5





KR4301P42701-2019-04 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						6
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	6	6	6	6	6	6	6	
-5.33%	4	4	4	4	4	4	4	
-2.67%	2	2	2	2	2	2	2	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2	
5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4	
8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6	
KR4301P42677		2019-04 풋267.5						19
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-17	-17	-17	-18	-18	-18	-19
-5.33%	-5	-5	-6	-7	-7	-8	-8
-2.67%	0	-1	-1	-1	-2	-2	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
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

18

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-17	-17	-17	-17	-17	-18	-18
-5.33%	-6	-6	-7	-7	-8	-8	-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

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

(단위:백만원)

23

공시일	2019-03-25
기준일	2019-03-22

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

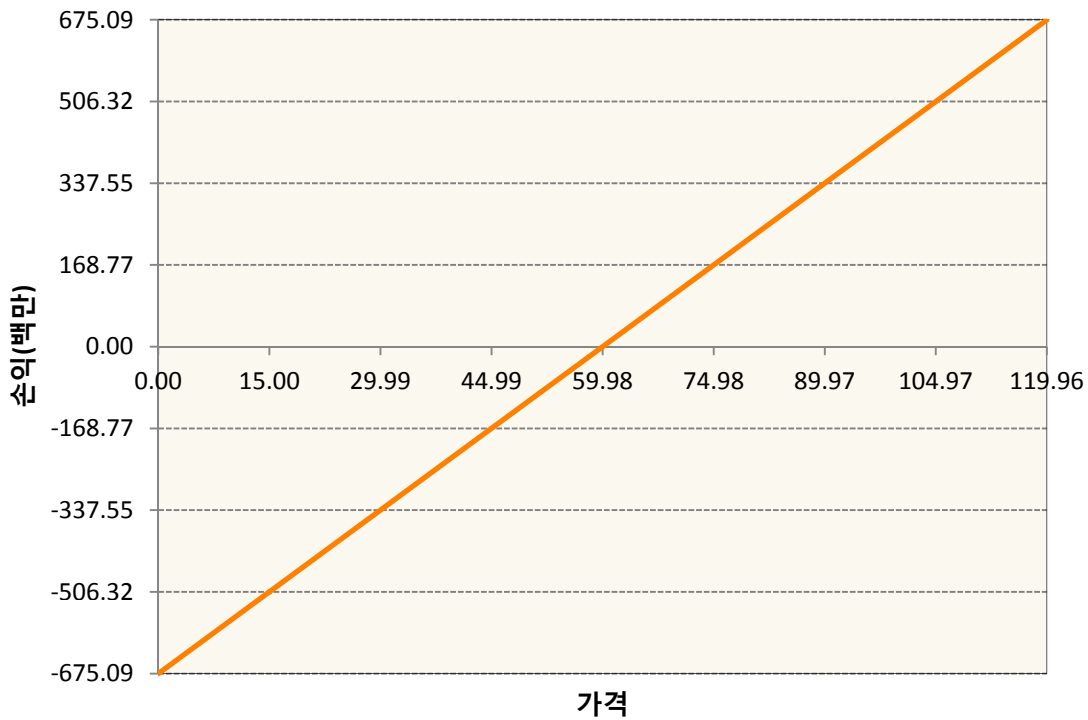
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

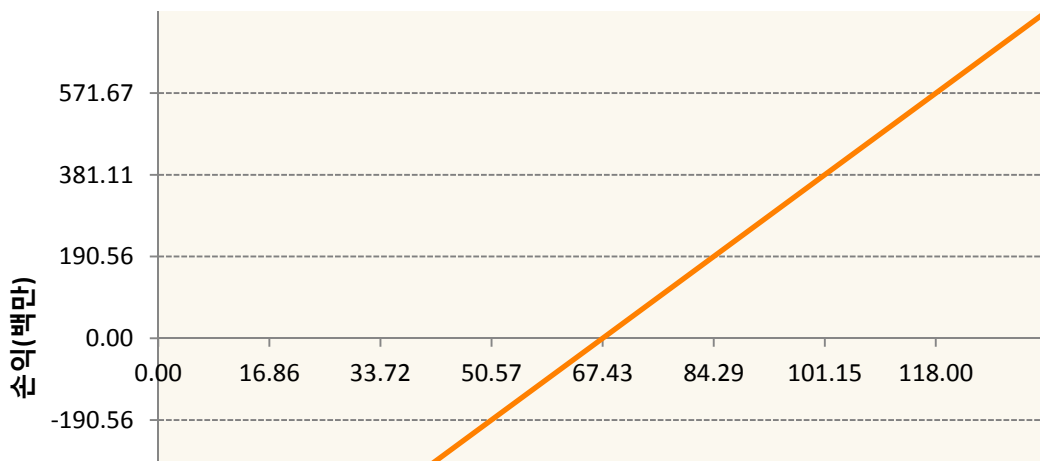
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,901	282	2,619	

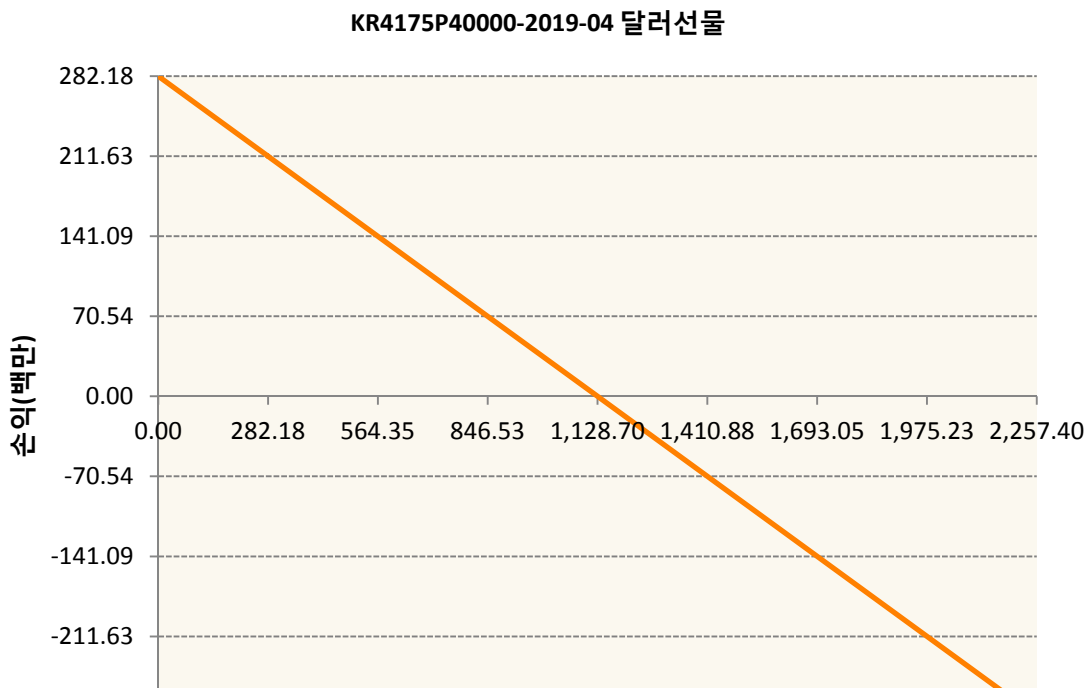
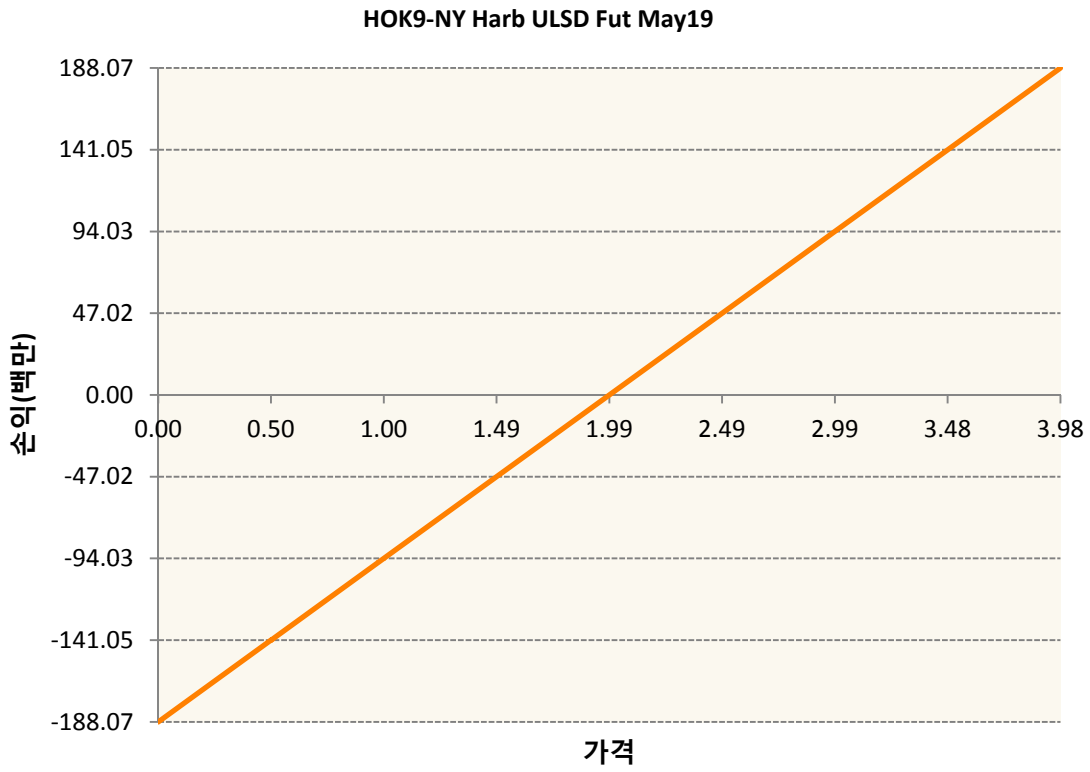
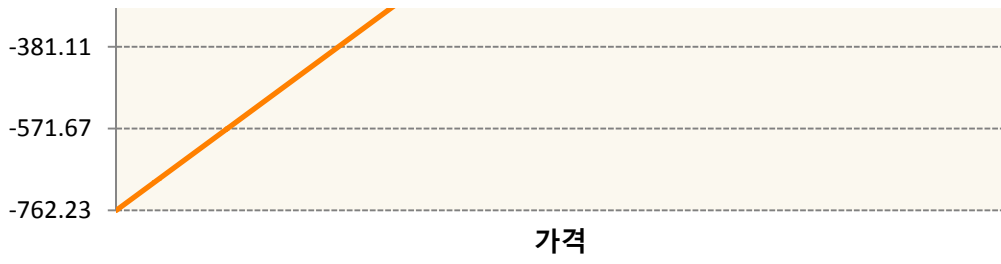
### 2. 만기시점의 손익구조

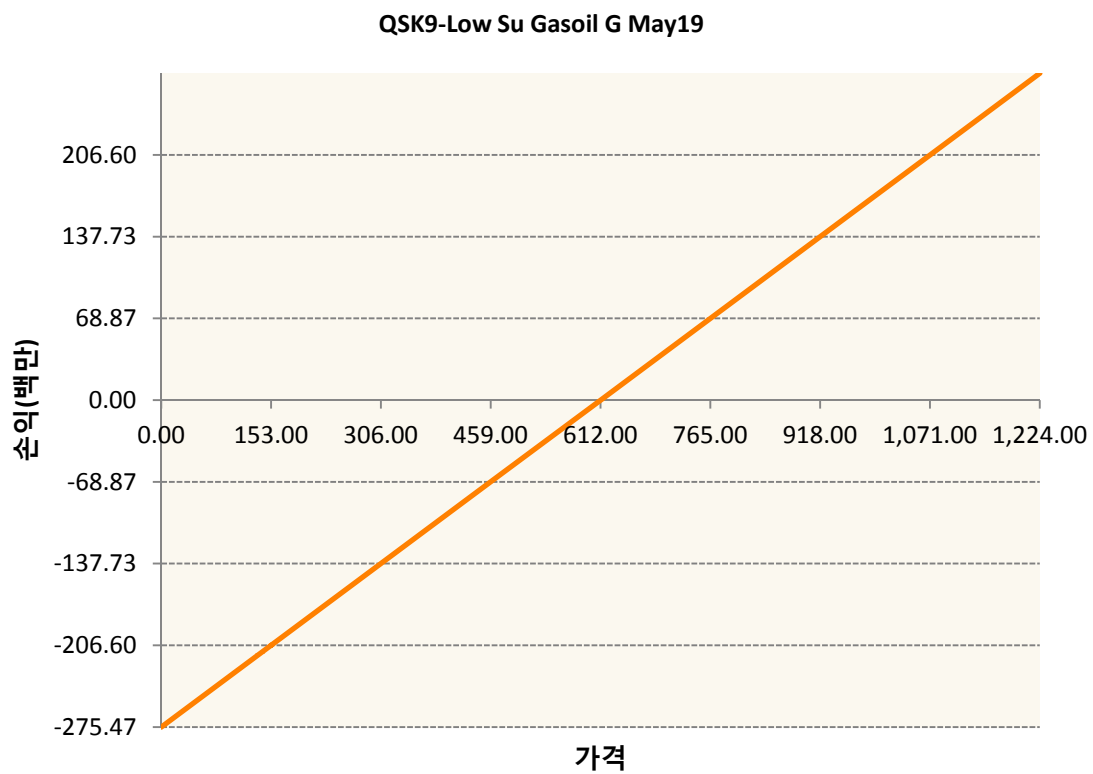
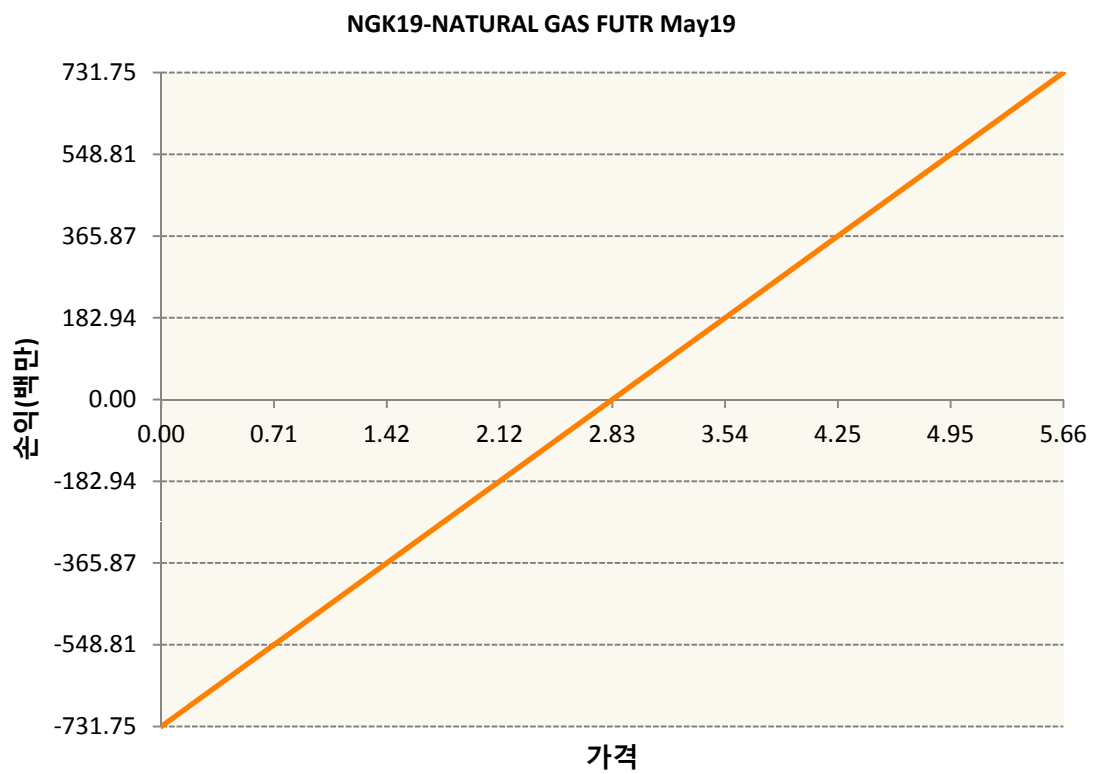
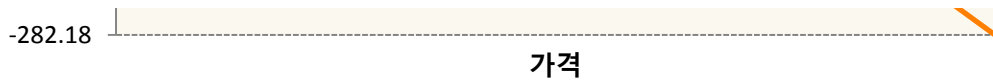
**CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19**



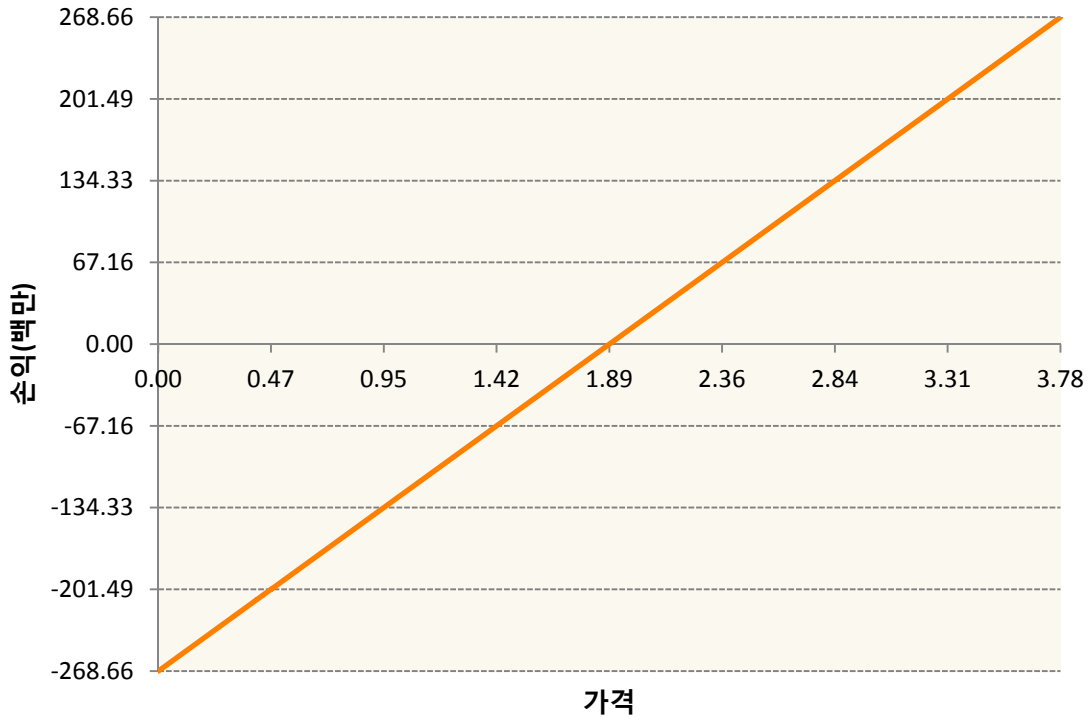
**CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19**







**XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19**



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

CLK9	WTI CRUDE FUTURE May19	54
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	2019-03-25
기준일	2019-03-22

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

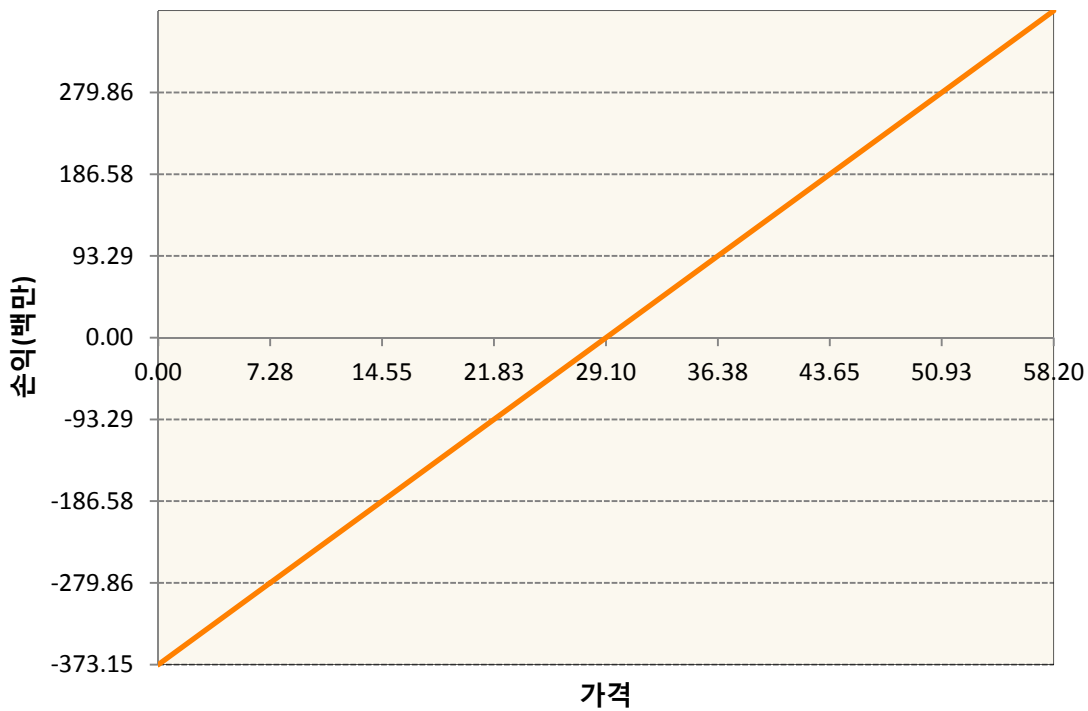
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

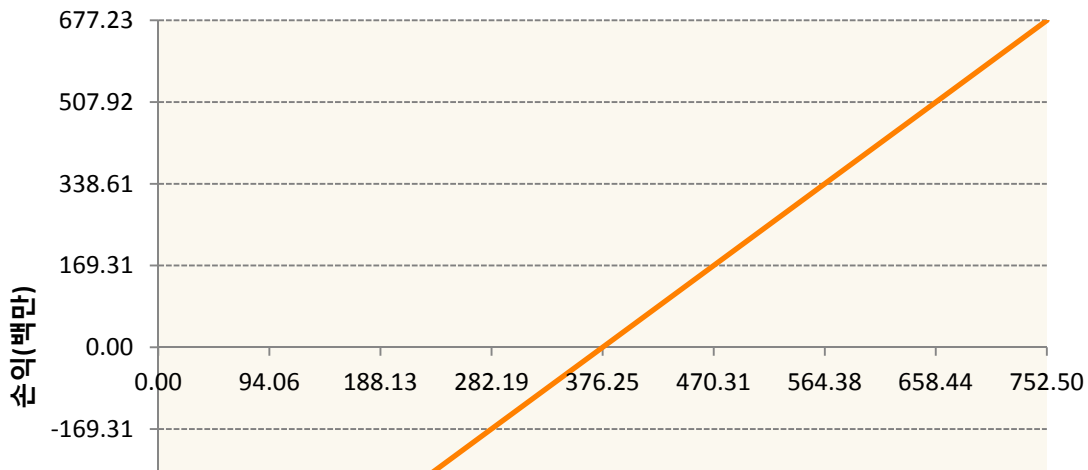
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,400	79	3,321	

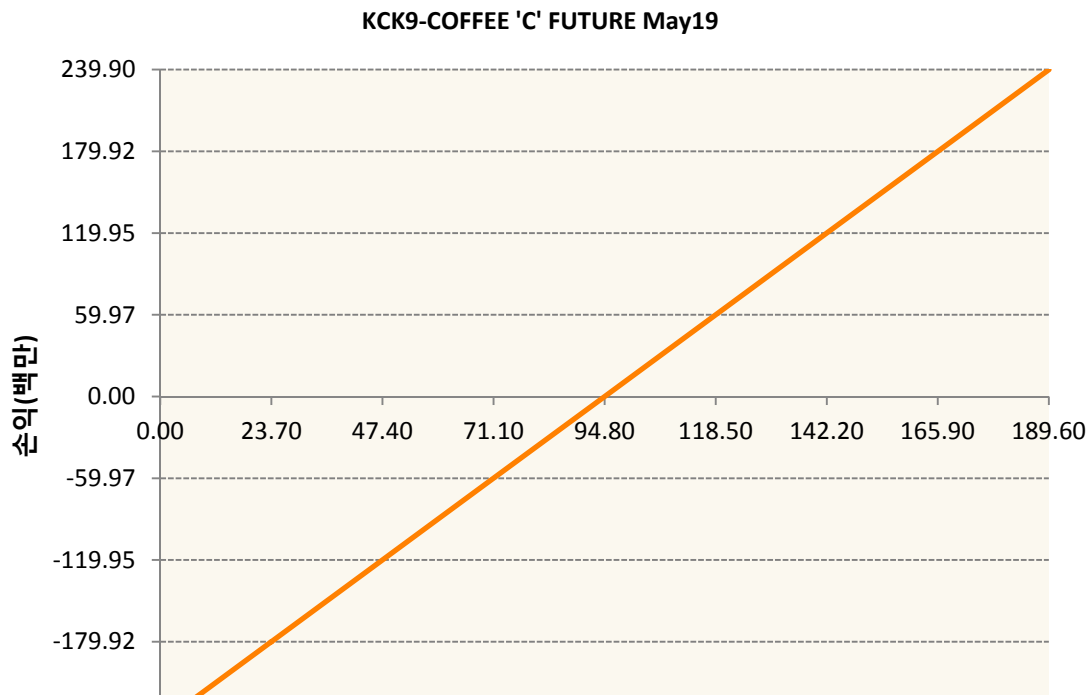
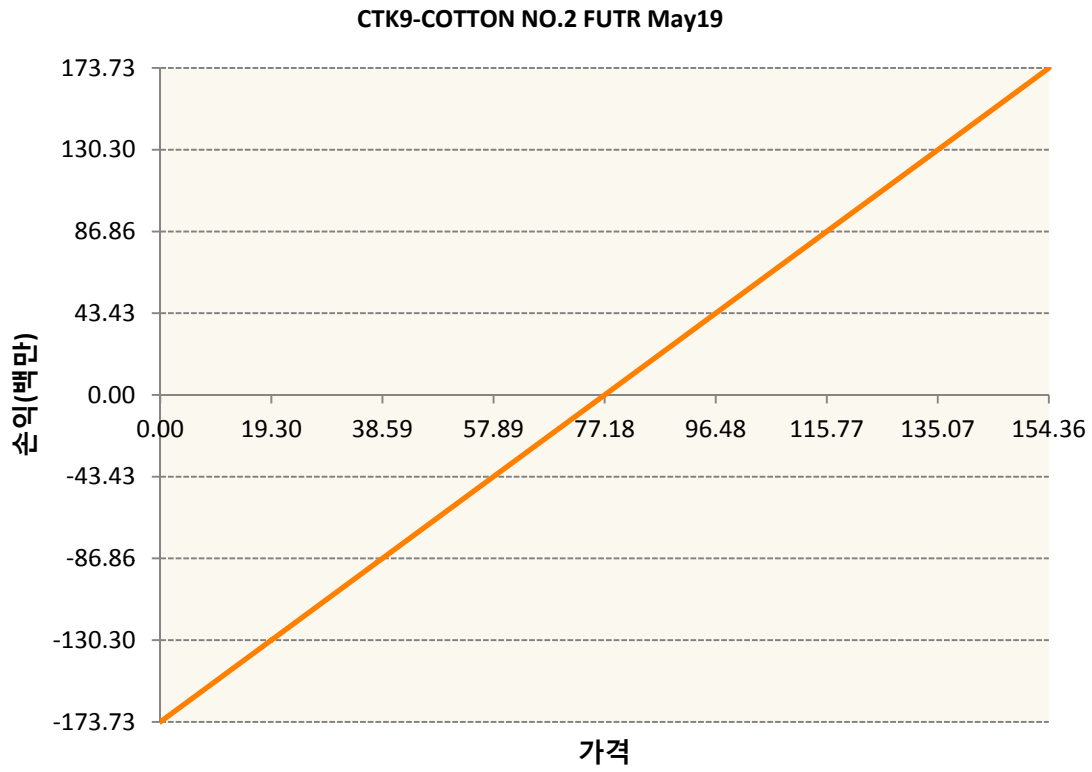
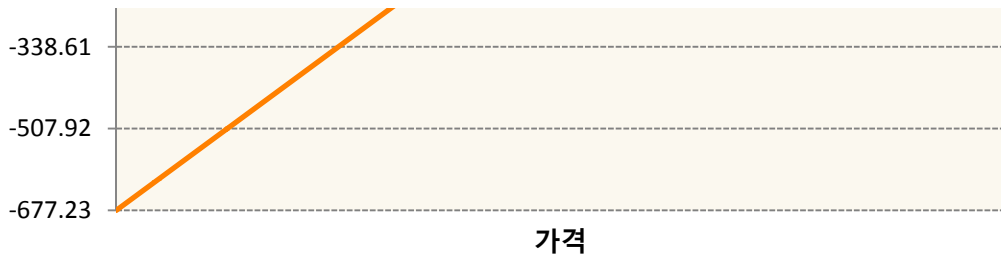
### 2. 만기시점의 손익구조

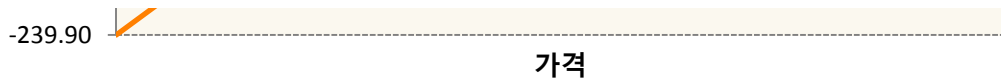
**BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19**



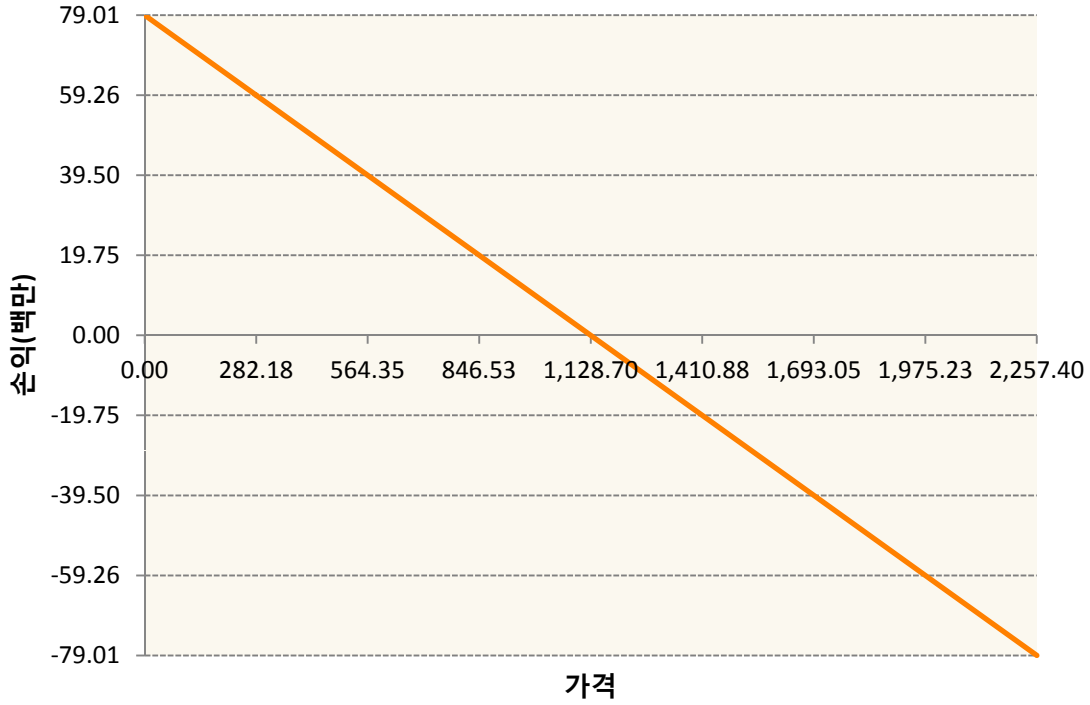
**CK9-CORN FUTURE May19**



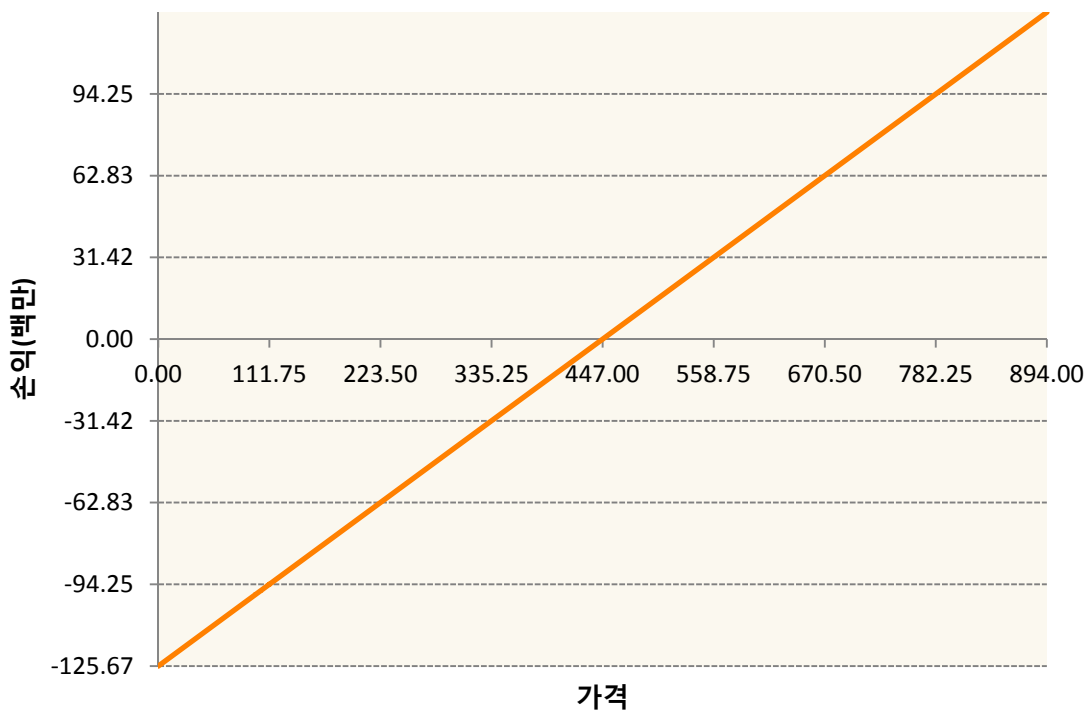




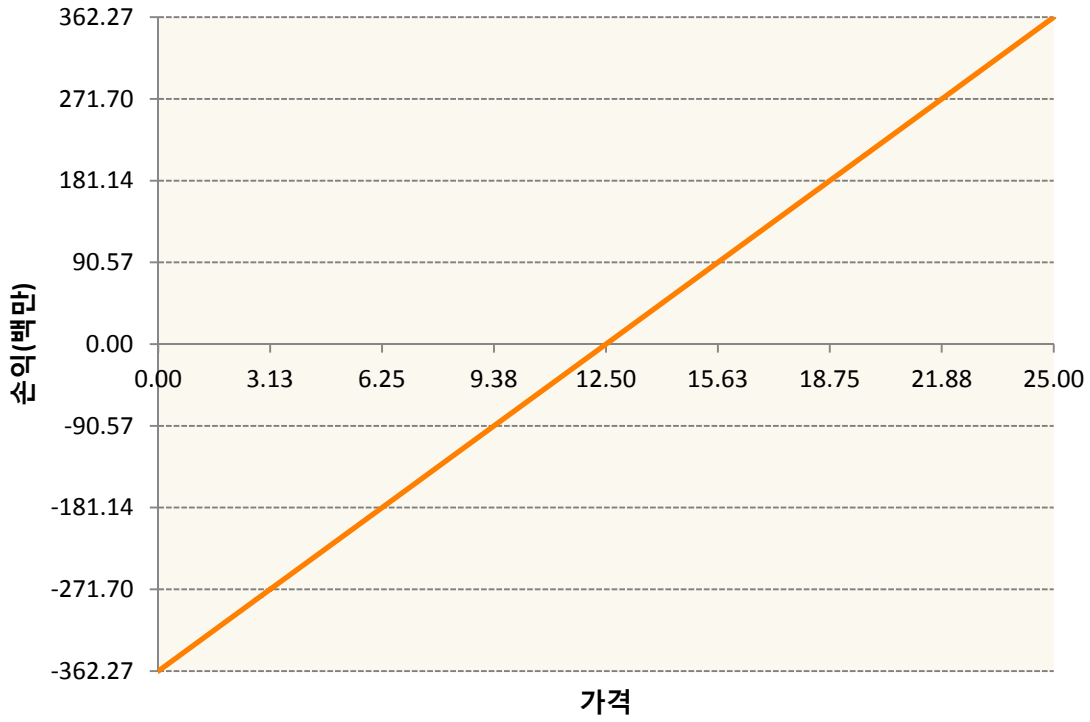
KR4175P40000-2019-04 달러선물



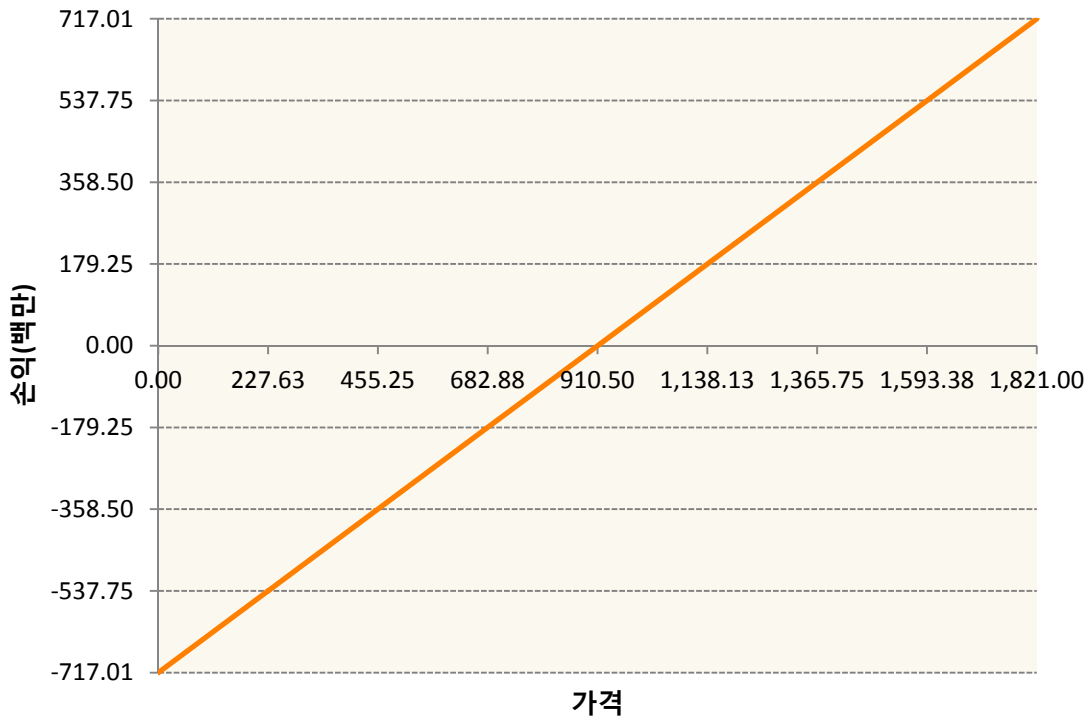
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



**SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19**

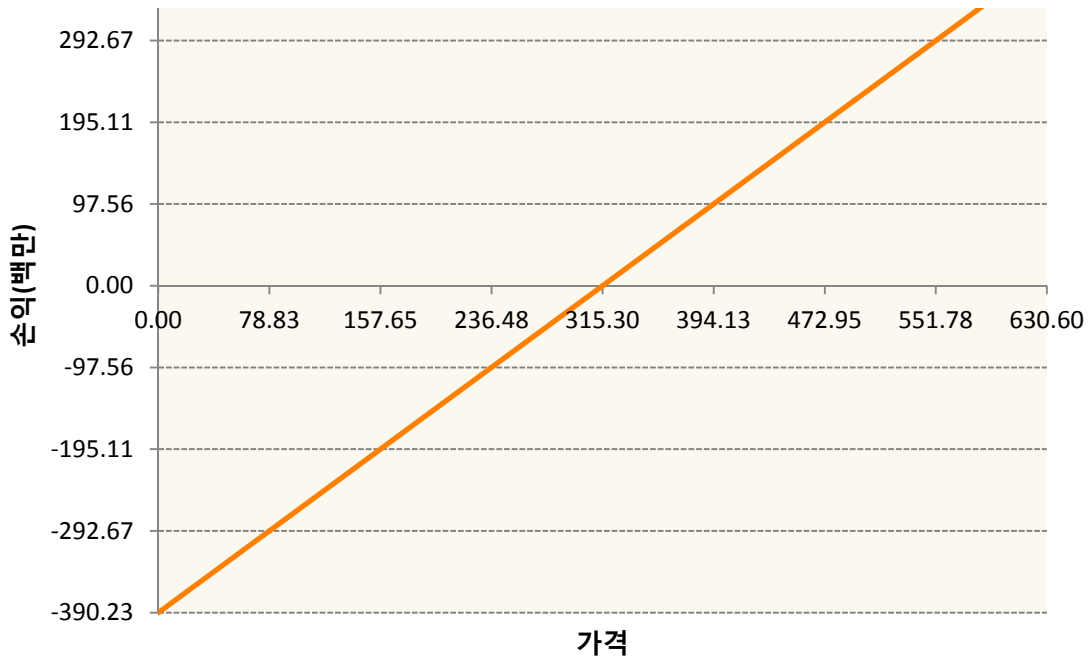


**SK9-SOYBEAN FUTURE May19**

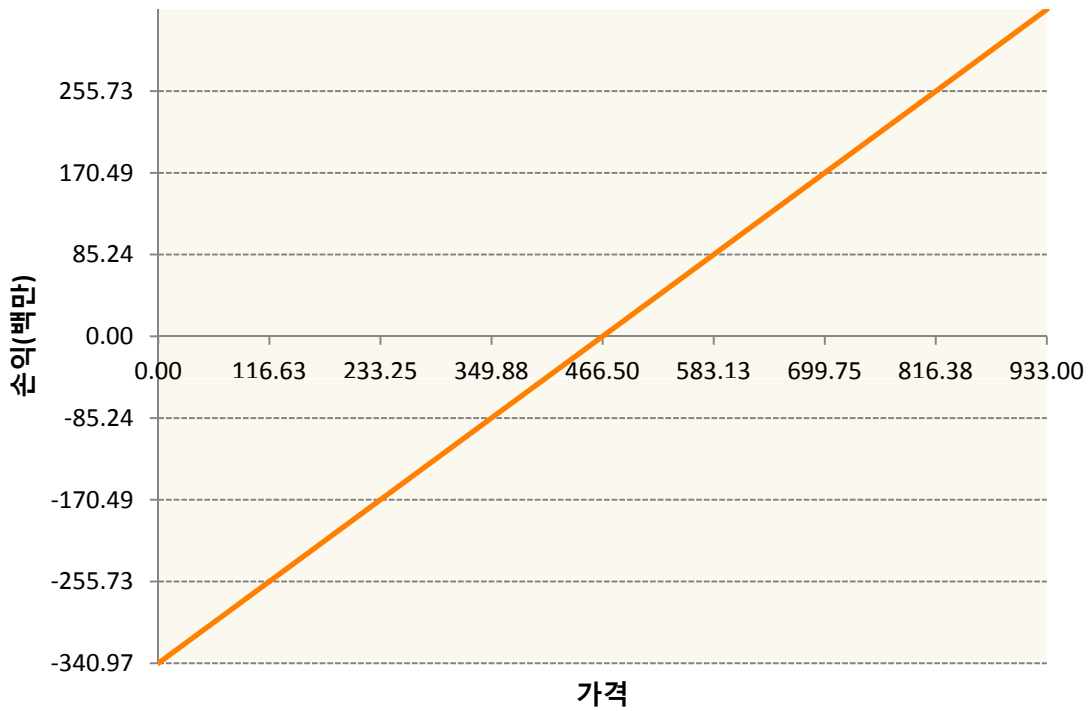


**SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19**





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	19
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