

공시일	2019-03-26
기준일	2019-03-25

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	2019-03-26
기준일	2019-03-25

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

1,120

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

655

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-03-26
기준일	2019-03-25

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)	347
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	96
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	163

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

953

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-03-26
기준일	2019-03-25

유로인덱스모(주식-파생형)

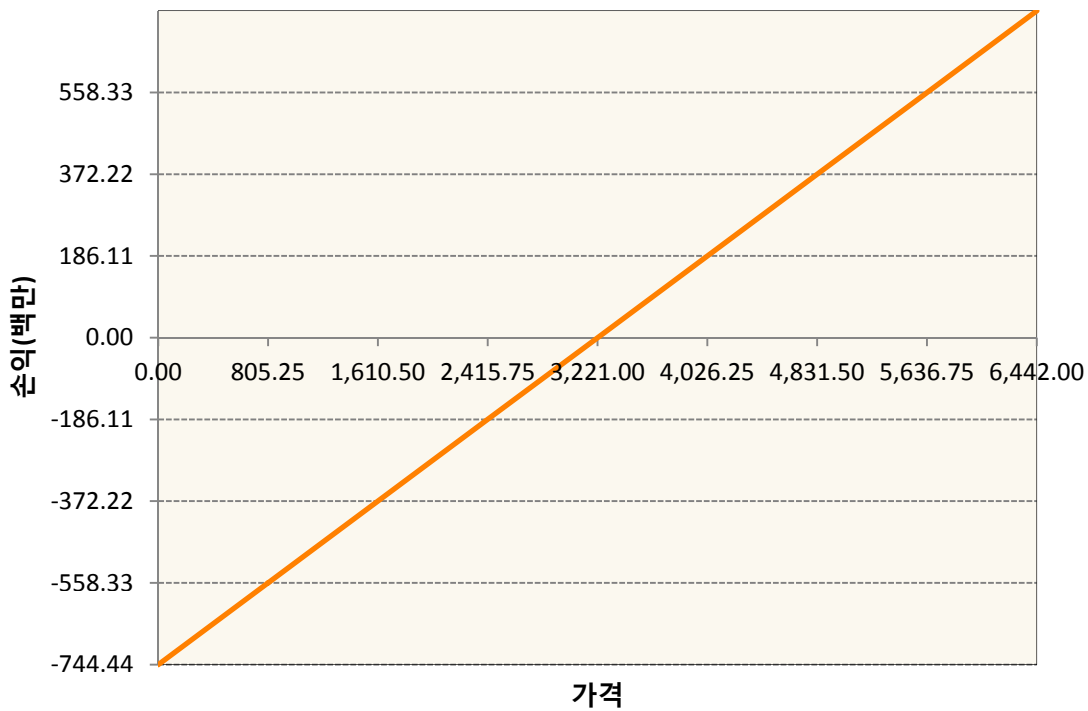
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	744	0	744	

2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	60
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-03-26
기준일	2019-03-25

차이나인덱스모(주식-파생형)

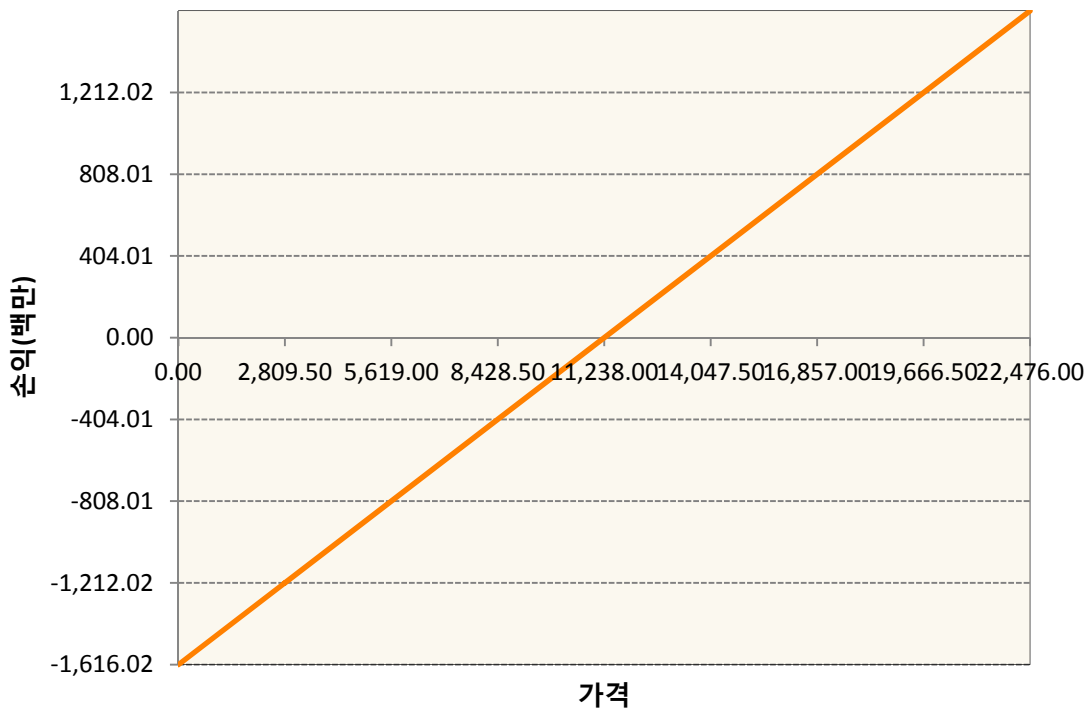
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,616	0	1,616	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCH9-HSCEI Futures Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH9	HSCEI Futures Mar19	129
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

132

공시일	2019-03-26
기준일	2019-03-25

커버드콜모(주식혼합-파생형)

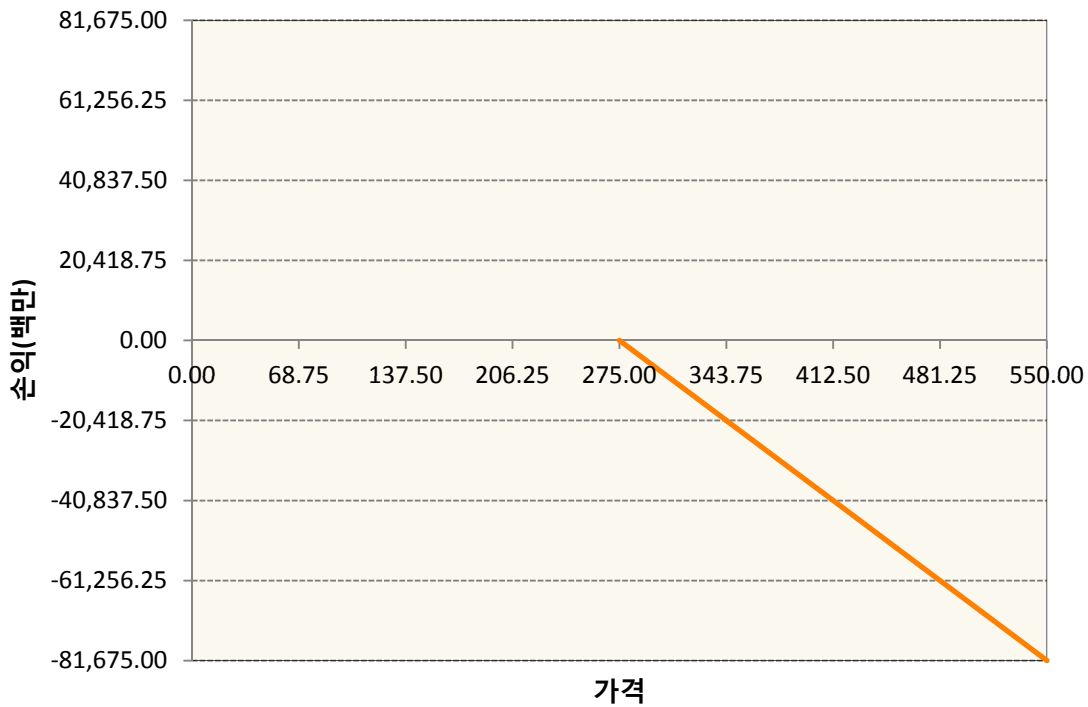
1. 계약금액

(단위:백만원)

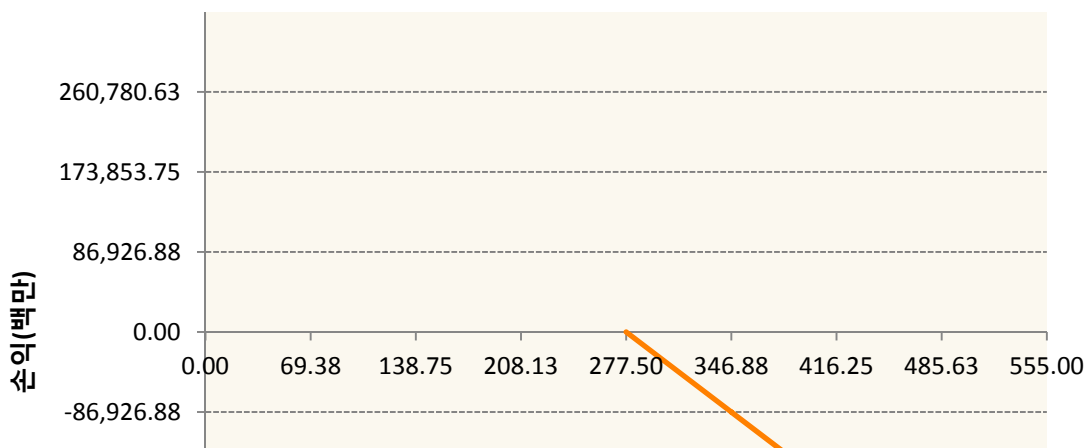
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	667,445	-667,445	장내

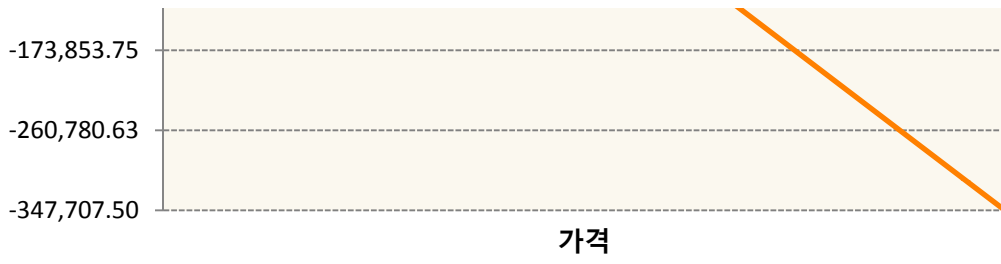
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P42752-2019-04 콜275

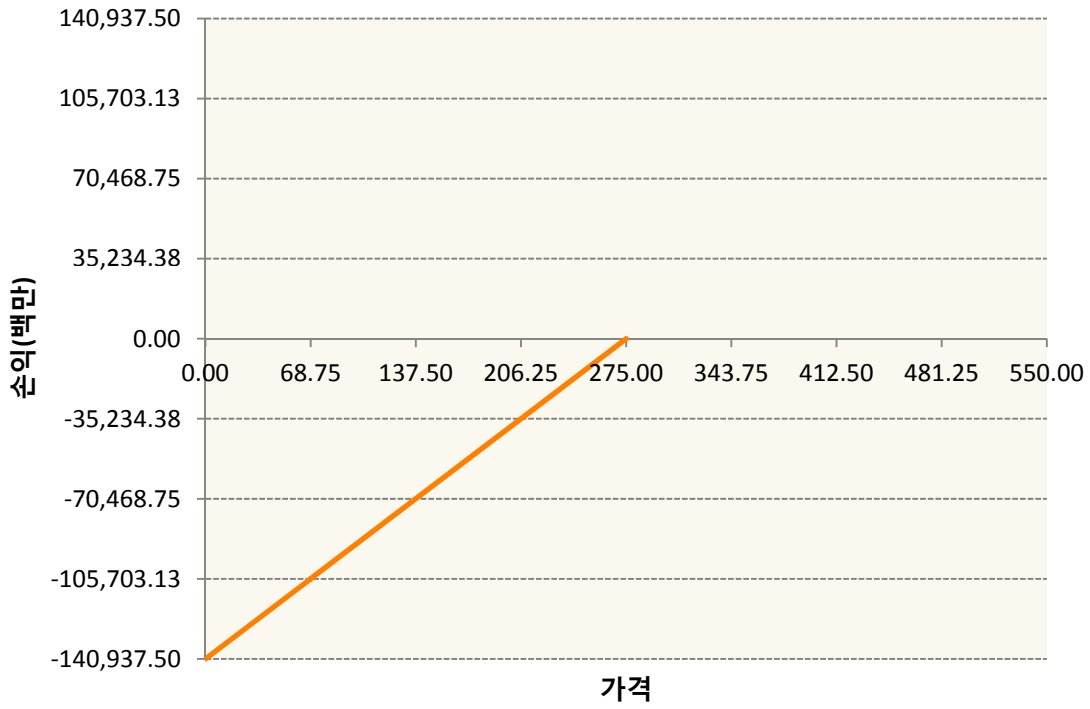


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

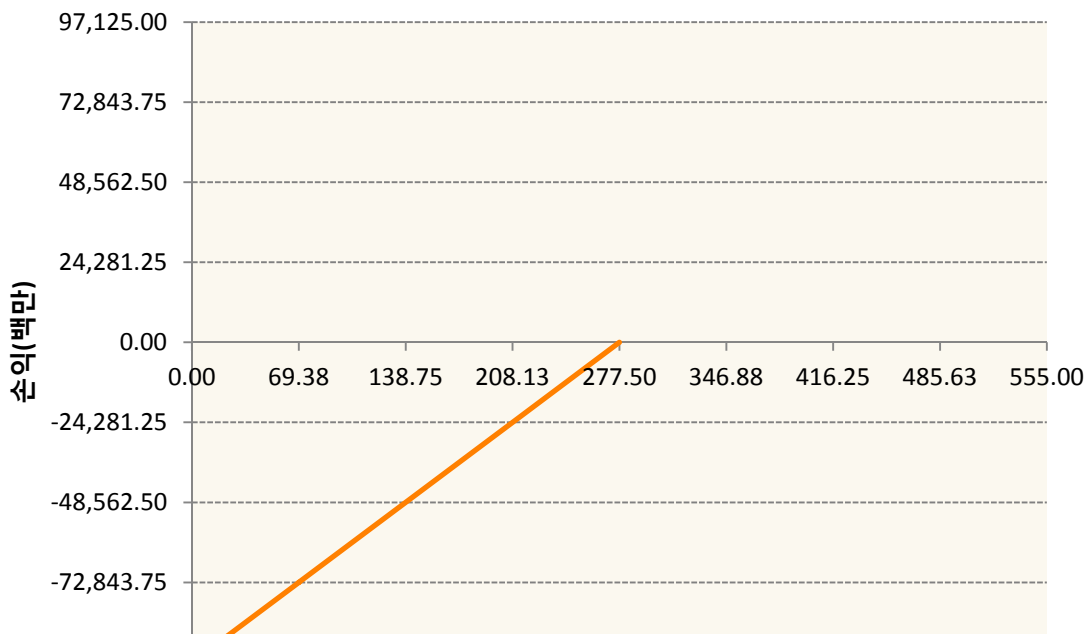




KR4301P42750-2019-04 풋275



KR4301P42776-2019-04 풋277.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P42752		2019-04 콜275						5,407
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,147	2,113	2,068	2,013	1,950	1,878	1,800	
-5.33%	1,969	1,884	1,790	1,689	1,581	1,468	1,352	
-2.67%	1,464	1,326	1,187	1,046	904	760	616	
0%	448	299	150	0	-150	-300	-451	
2.67%	-1,095	-1,208	-1,327	-1,451	-1,579	-1,711	-1,845	
5.33%	-3,014	-3,075	-3,147	-3,229	-3,319	-3,417	-3,521	
8.00%	-5,120	-5,144	-5,178	-5,222	-5,275	-5,337	-5,407	
KR4201P42778		2019-04 콜277.5						21,710
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	7,526	7,424	7,283	7,103	6,886	6,634	6,350	
-5.33%	7,029	6,743	6,414	6,048	5,651	5,226	4,780	
-2.67%	5,445	4,922	4,381	3,825	3,258	2,682	2,098	
0%	1,930	1,287	643	0	-643	-1,286	-1,930	
2.67%	-3,865	-4,414	-4,980	-5,560	-6,150	-6,749	-7,354	
5.33%	-11,501	-11,835	-12,212	-12,627	-13,072	-13,543	-14,036	
8.00%	-20,178	-20,327	-20,522	-20,762	-21,042	-21,360	-21,710	
KR4301P42750		2019-04 풋275						8,955
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-8,892	-8,894	-8,898	-8,905	-8,917	-8,933	-8,955	
-5.33%	-5,137	-5,165	-5,202	-5,248	-5,303	-5,367	-5,438	
-2.67%	-1,738	-1,852	-1,970	-2,094	-2,220	-2,350	-2,482	
0%	429	287	144	0	-145	-291	-437	
2.67%	1,146	1,088	1,019	940	852	758	657	
5.33%	1,250	1,242	1,227	1,205	1,176	1,139	1,094	
8.00%	1,256	1,256	1,254	1,251	1,246	1,237	1,223	
KR4301P42776		2019-04 풋277.5						6,572
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-6,548	-6,549	-6,550	-6,552	-6,556	-6,563	-6,572	
-5.33%	-3,969	-3,979	-3,993	-4,012	-4,037	-4,068	-4,103	
-2.67%	-1,517	-1,573	-1,635	-1,703	-1,775	-1,851	-1,929	
0%	308	206	103	0	-103	-206	-308	
2.67%	1,089	1,028	960	887	810	730	647	

5.33%	1,243	1,230	1,211	1,185	1,154	1,116	1,073
8.00%	1,256	1,255	1,253	1,248	1,240	1,229	1,214

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

(단위:백만원)

44,641

공시일	2019-03-26
기준일	2019-03-25

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

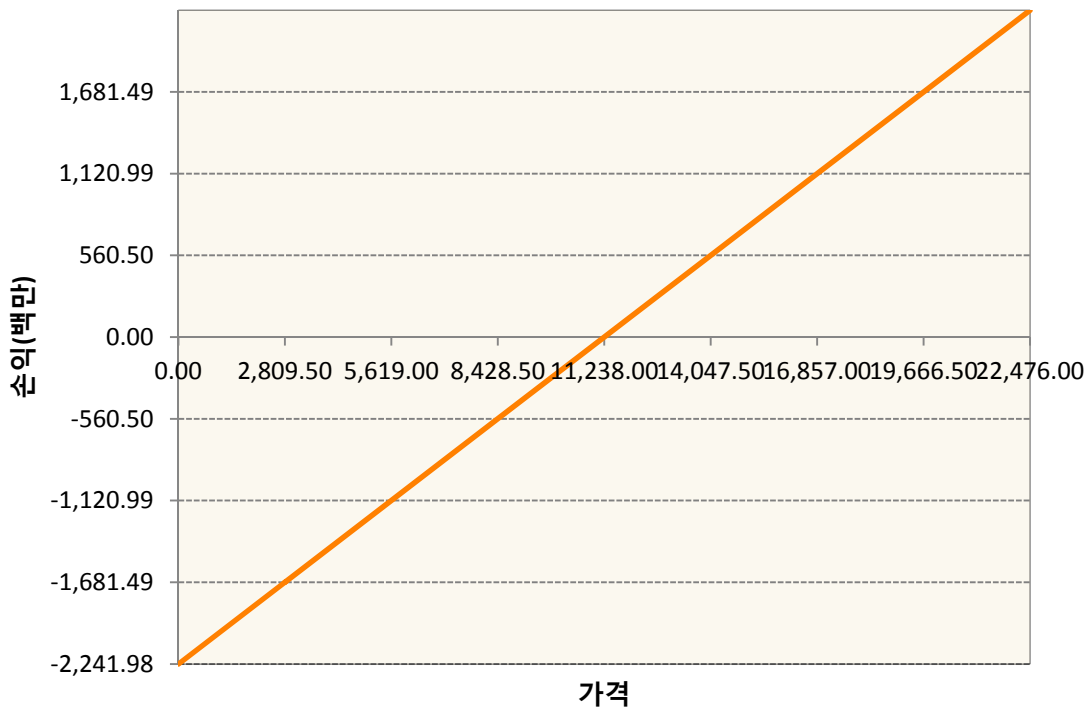
1. 계약금액

(단위:백만원)

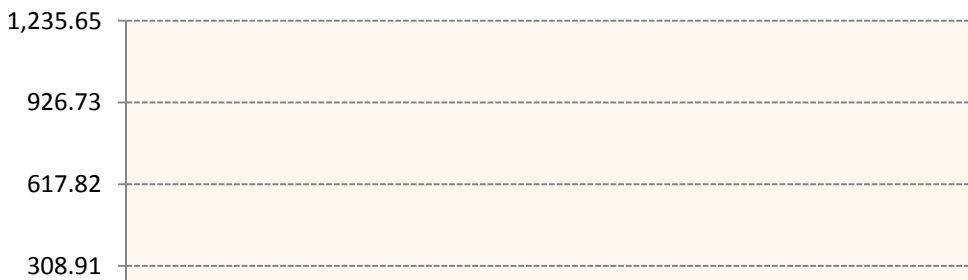
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,242	0	2,242	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,961	-5,961	장내
누계	통화	선도	0	3,035	-3,035	장외

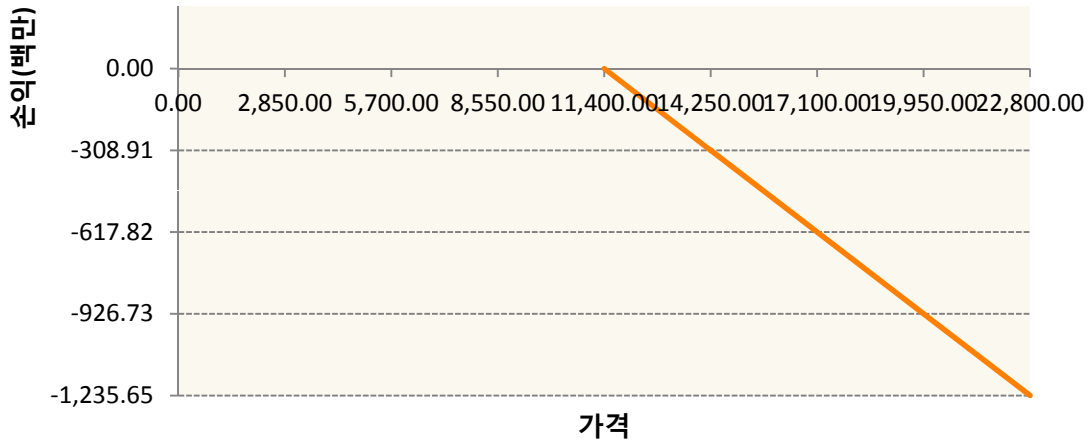
2. 만기시점의 손익구조

HCH9-HSCEI Futures Mar19

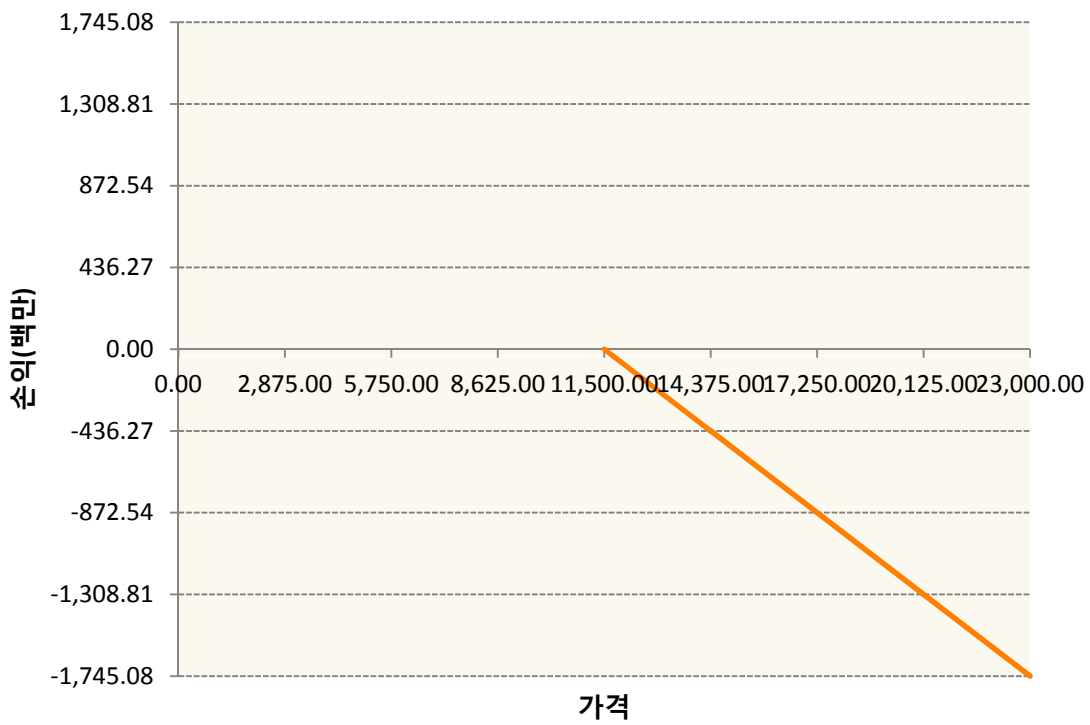


OHHIH9-C114-HSCEI

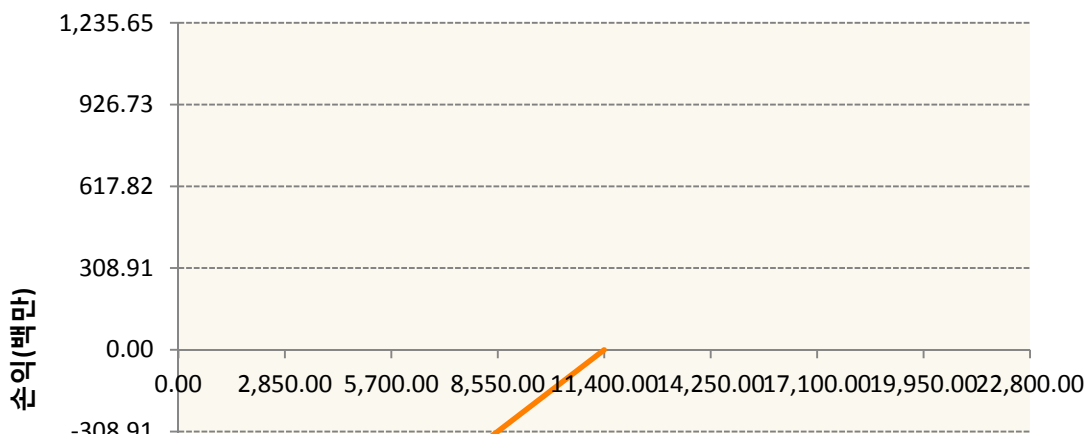


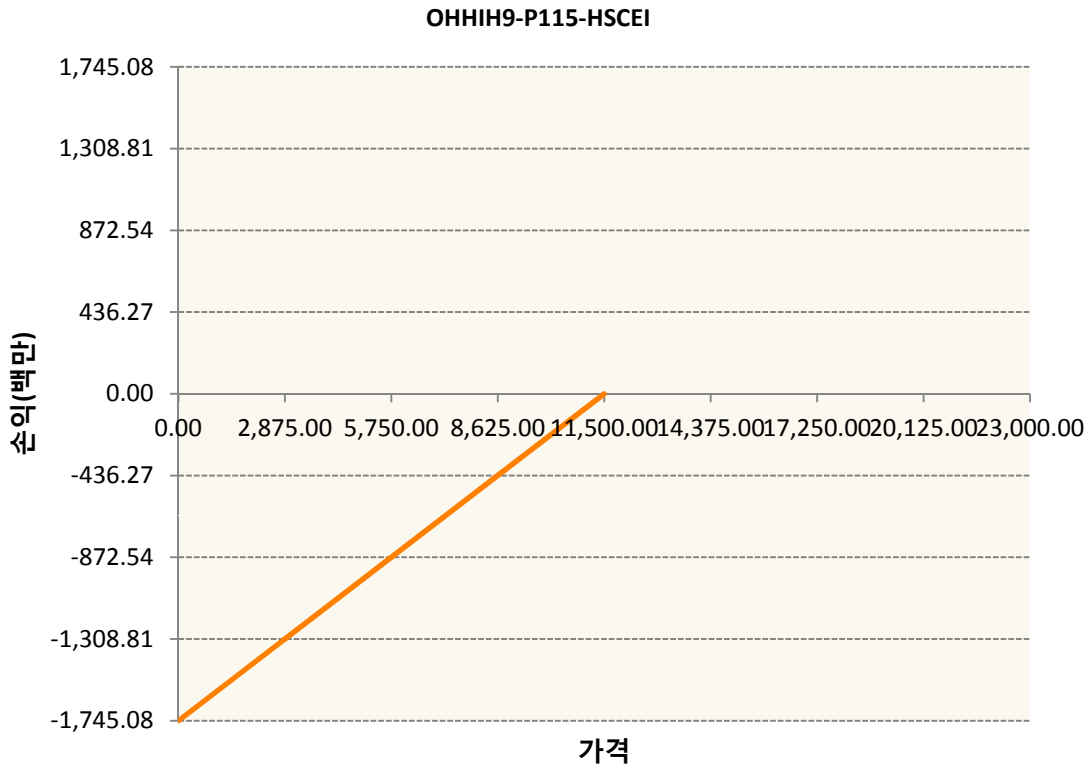


OHHIH9-C115-HSCEI



OHHIH9-P114-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	220
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	23
HCH9 HSCEI Futures Mar19	179
OHHIH9-C11 HSCEI	99
OHHIH9-C11 HSCEI	140
OHHIH9-P11 HSCEI	99
OHHIH9-P11 HSCEI	140

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	754

공시일	2019-03-26
기준일	2019-03-25

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

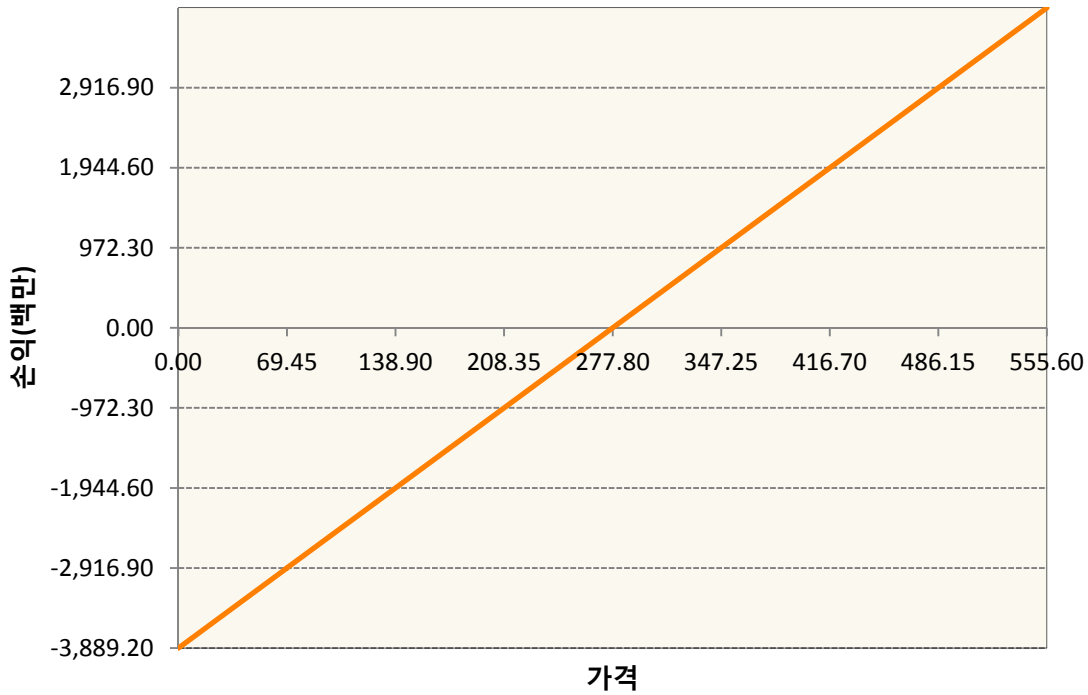
1. 계약금액

(단위:백만원)

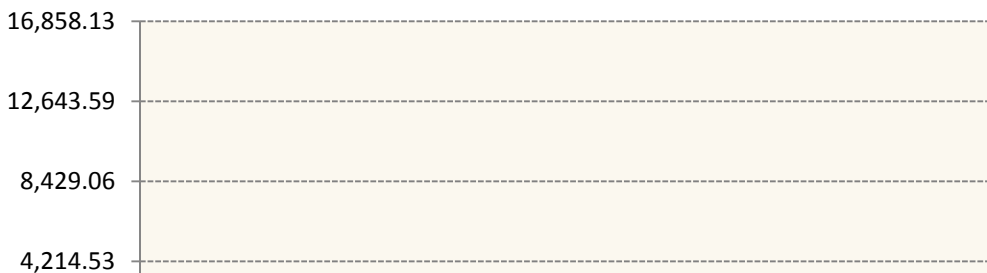
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,889	0	3,889	장내
누계	유가증권	스왑	35,836	0	35,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,649	-34,649	장내

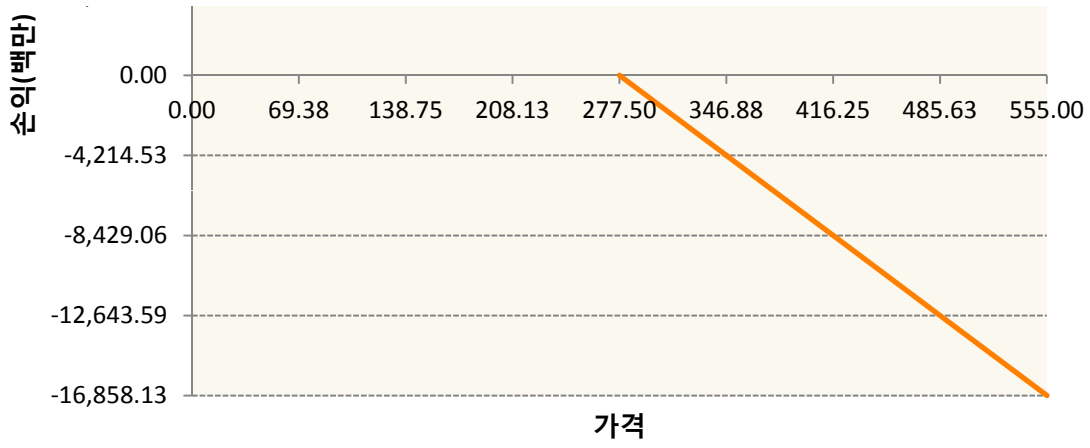
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

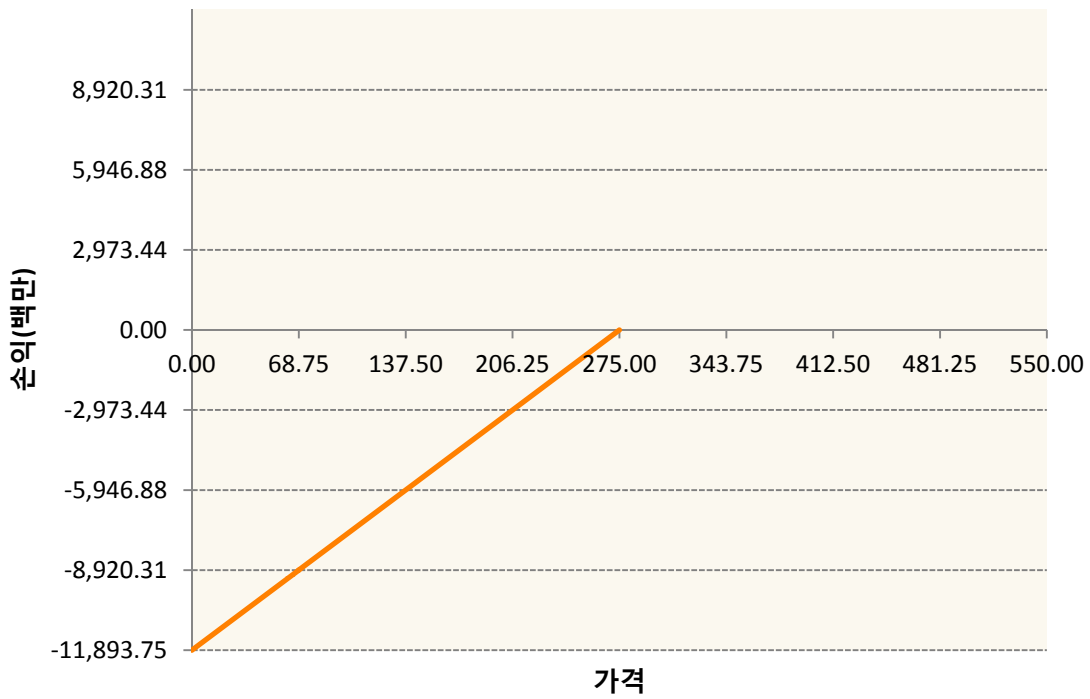


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

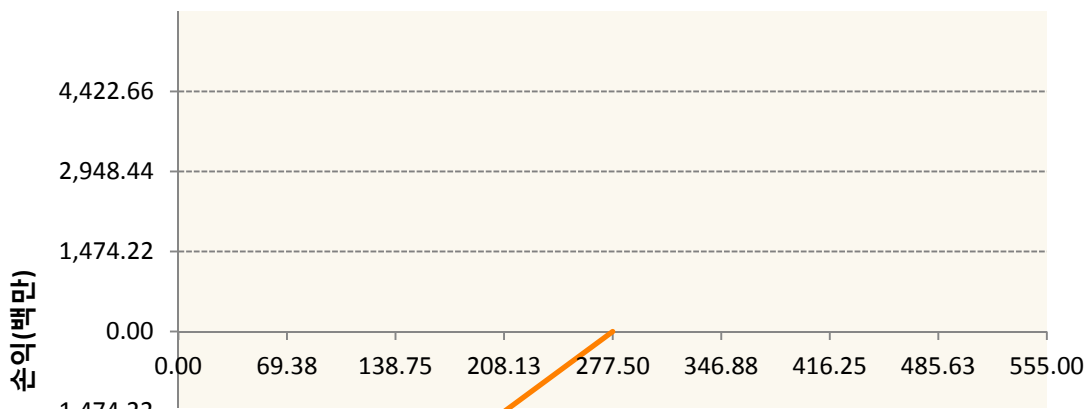


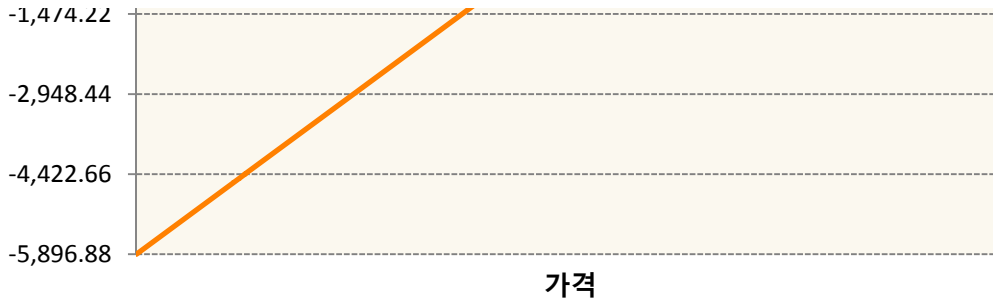


KR4301P42750-2019-04 풋275



KR4301P42776-2019-04 풋277.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,438
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,438	-2,438	-2,438	-2,438	-2,438	-2,438	-2,438	
-5.33%	-1,626	-1,626	-1,626	-1,626	-1,626	-1,626	-1,626	
-2.67%	-813	-813	-813	-813	-813	-813	-813	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	813	813	813	813	813	813	813	
5.33%	1,626	1,626	1,626	1,626	1,626	1,626	1,626	
8.00%	2,438	2,438	2,438	2,438	2,438	2,438	2,438	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						592
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-592	-592	-592	-592	-592	-592	-592	
-5.33%	-395	-395	-395	-395	-395	-395	-395	
-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%	395	395	395	395	395	395	395	
8.00%	592	592	592	592	592	592	592	
KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						311
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-311	-311	-311	-311	-311	-311	-311	
-5.33%	-207	-207	-207	-207	-207	-207	-207	
-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%	207	207	207	207	207	207	207	
8.00%	311	311	311	311	311	311	311	
KR4201P42778		2019-04 콜277.5						1,053
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	365	360	353	344	334	322	308
-5.33%	341	327	311	293	274	253	232
-2.67%	264	239	212	185	158	130	102
0%	94	62	31	0	-31	-62	-94
2.67%	-187	-214	-241	-270	-298	-327	-357
5.33%	-558	-574	-592	-612	-634	-657	-681
8.00%	-978	-986	-995	-1,007	-1,020	-1,036	-1,053
KR4301P42750 2019-04 풋275							756
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-750	-751	-751	-752	-752	-754	-756
-5.33%	-434	-436	-439	-443	-448	-453	-459
-2.67%	-147	-156	-166	-177	-187	-198	-209
0%	36	24	12	0	-12	-25	-37
2.67%	97	92	86	79	72	64	55
5.33%	106	105	104	102	99	96	92
8.00%	106	106	106	106	105	104	103
KR4301P42776 2019-04 풋277.5							399
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-398	-398	-398	-398	-398	-398	-399
-5.33%	-241	-242	-242	-244	-245	-247	-249
-2.67%	-92	-96	-99	-103	-108	-112	-117
0%	19	12	6	0	-6	-12	-19
2.67%	66	62	58	54	49	44	39
5.33%	75	75	74	72	70	68	65
8.00%	76	76	76	76	75	75	74

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

(단위:백만원)

5,629

공시일	2019-03-26
기준일	2019-03-25

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

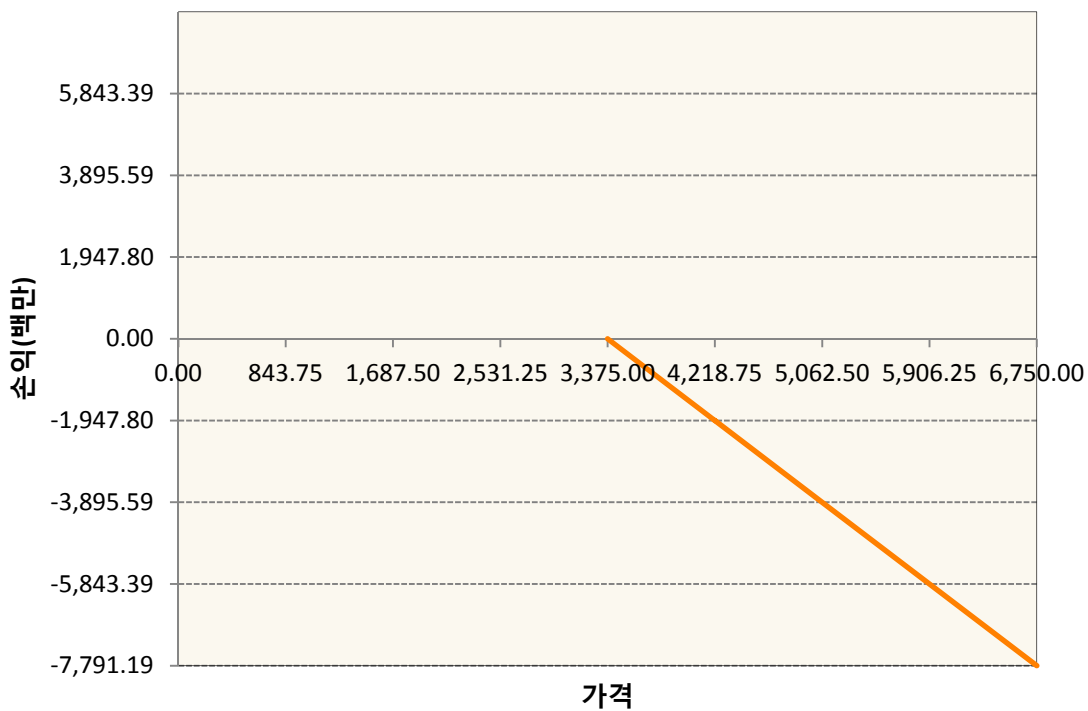
1. 계약금액

(단위:백만원)

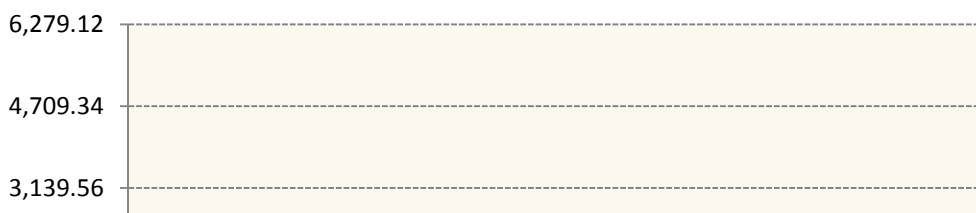
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,989	0	6,989	
누계	유가증권	스왑	60,548	0	60,548	장외
누계	유가증권	옵션	0	28,141	-28,141	장내
누계	통화	선도	0	15,390	-15,390	장외

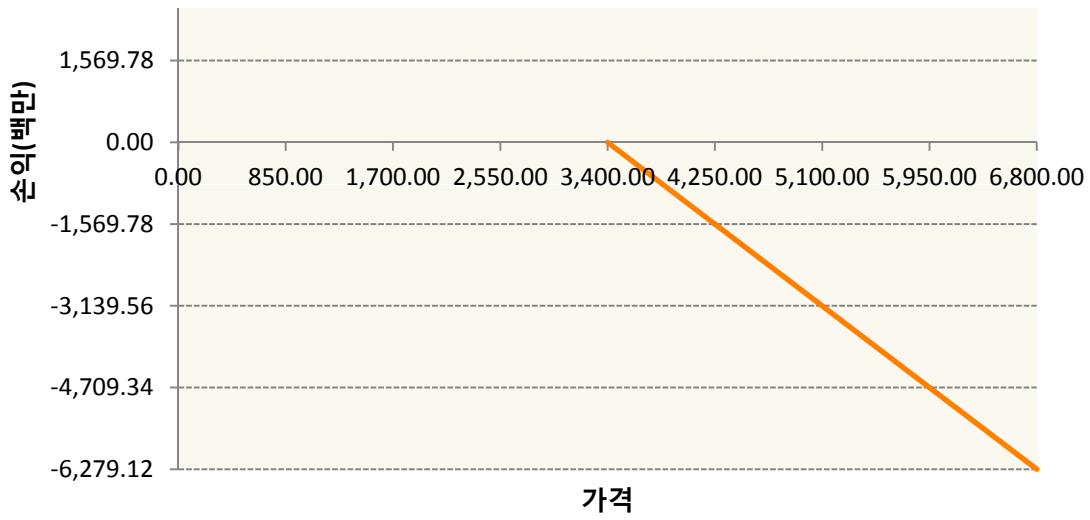
2. 만기시점의 손익구조

OESXJ9-C3375-EURO STOXX 50

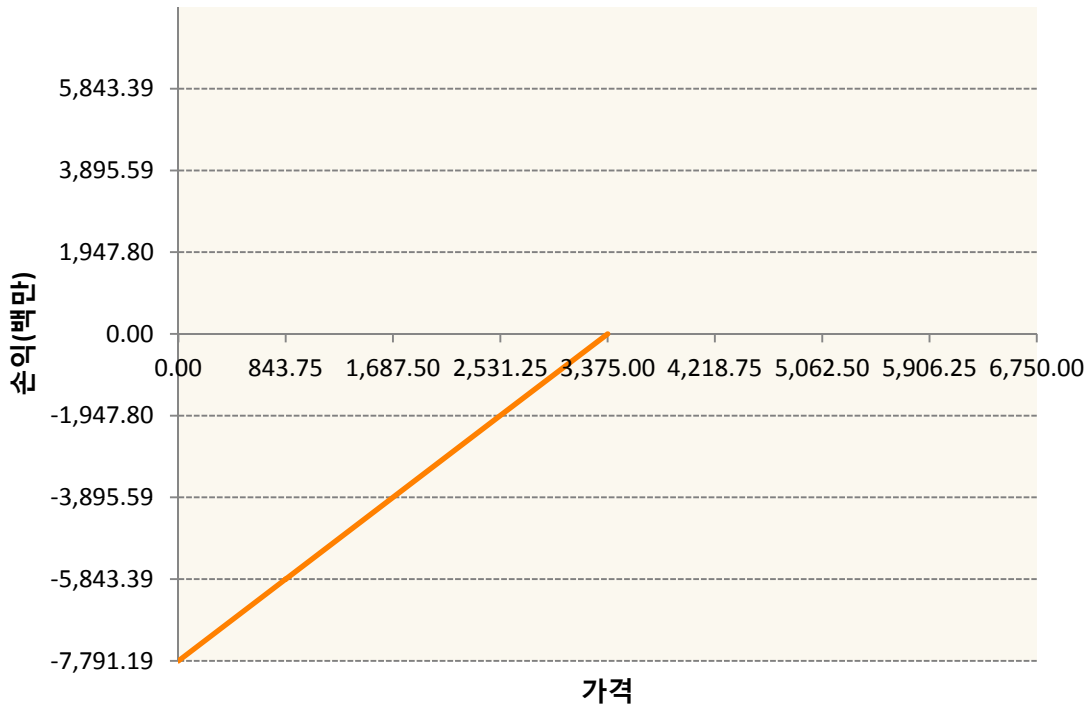


OESXJ9-C3400-EURO STOXX 50

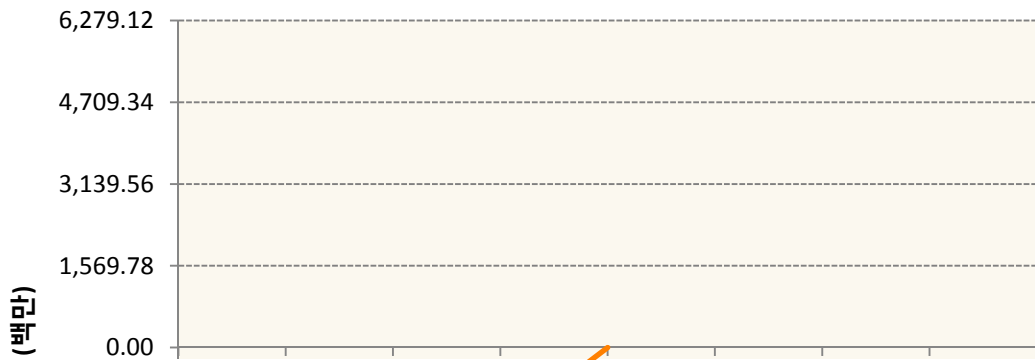


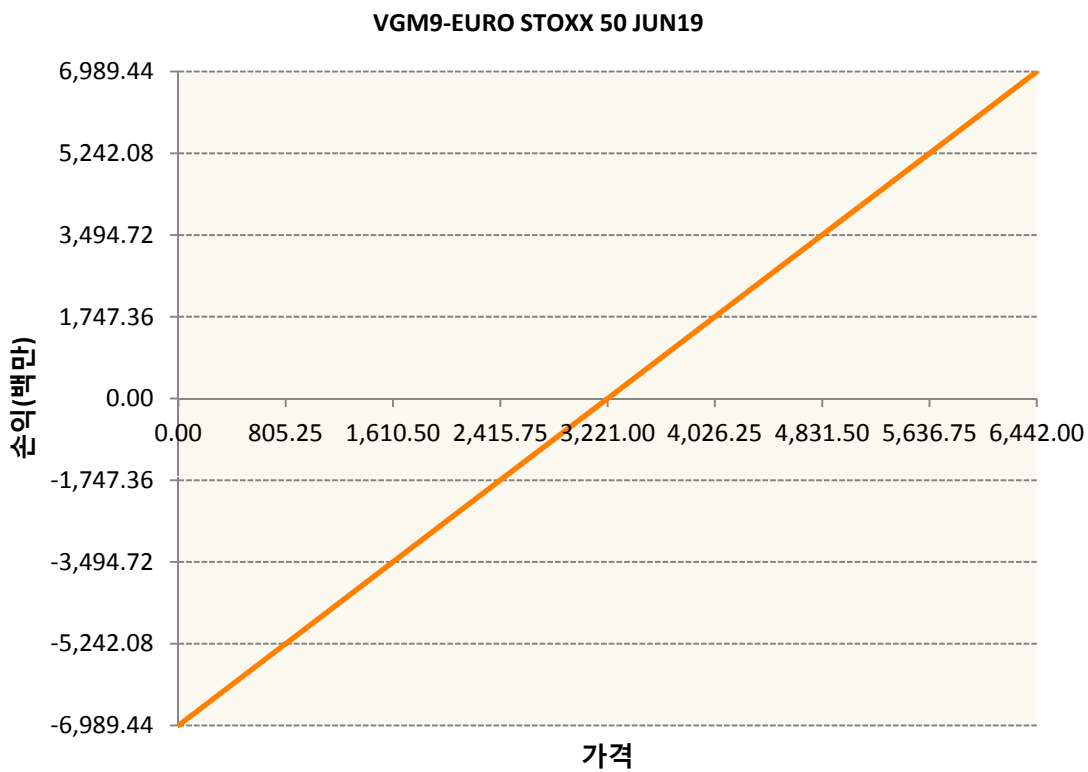
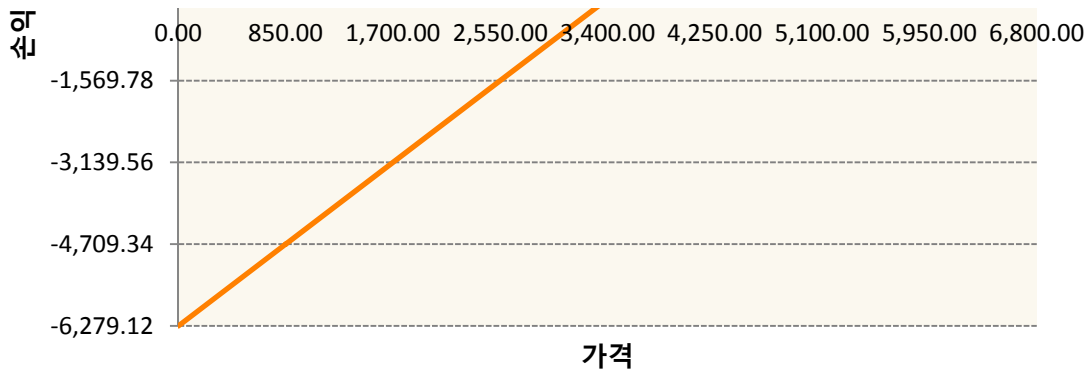


OESXJ9-P3375-EURO STOXX 50



OESXJ9-P3400-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		55
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E		410
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E		821
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		559

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

(단위:백만원)

2,712

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

(단위:백만원)

1,099

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	2019-03-26
기준일	2019-03-25

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

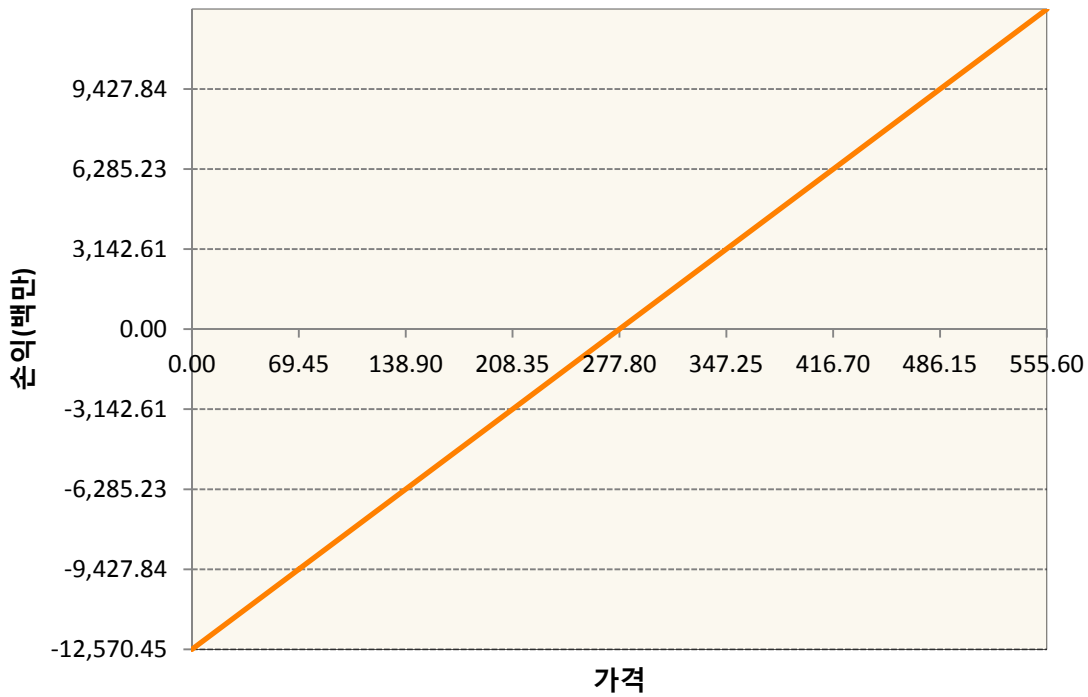
1. 계약금액

(단위:백만원)

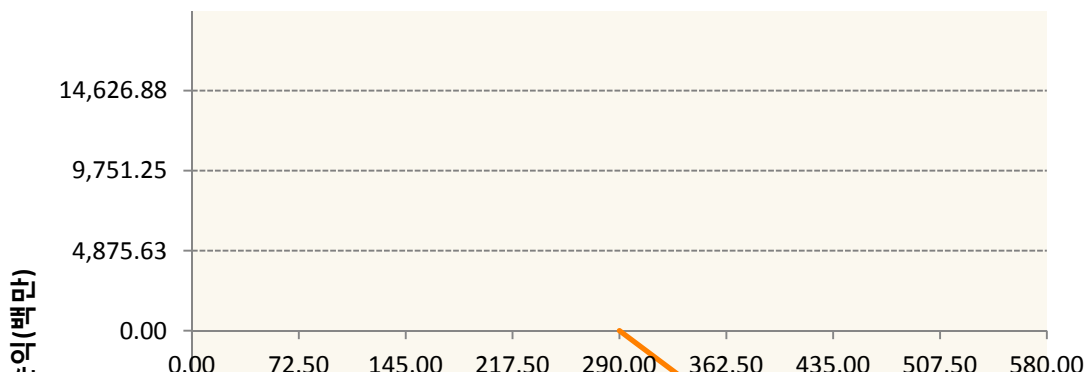
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,570	0	12,570	장내
누계	유가증권	옵션	1,867	24,036	-22,169	장내

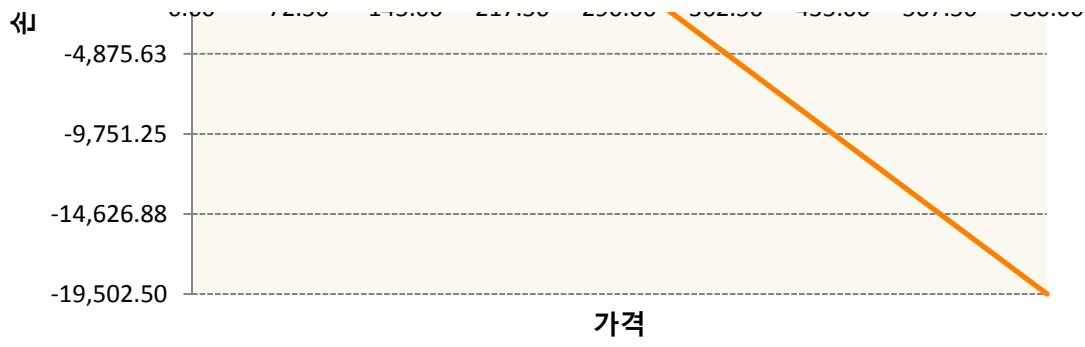
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

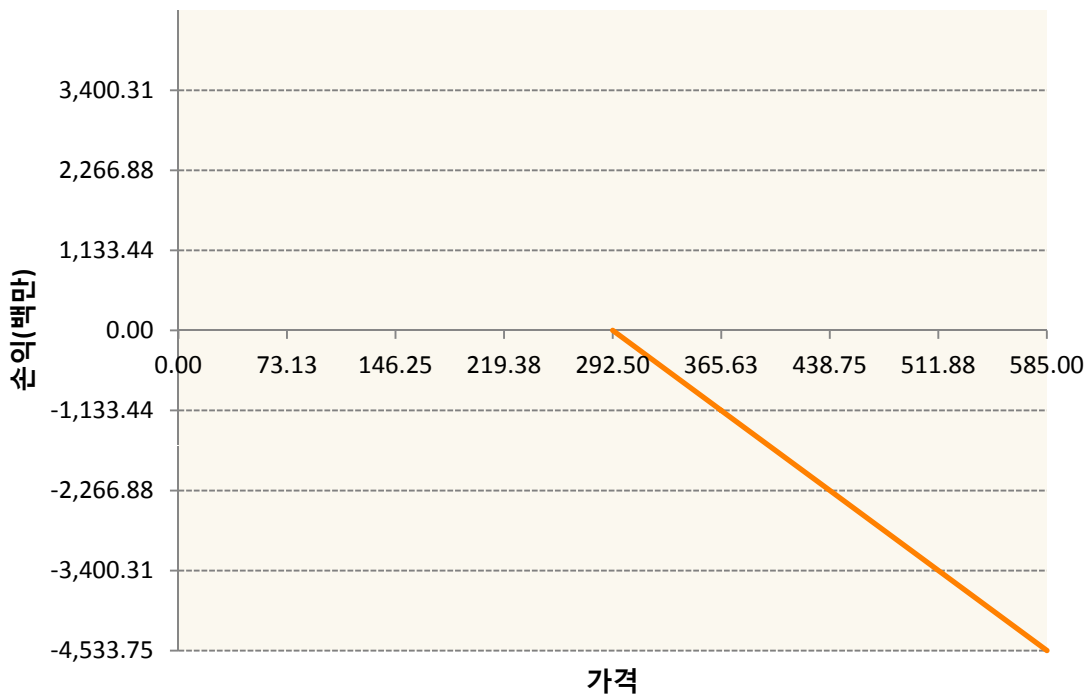


KR4201P42901-2019-04 콜290

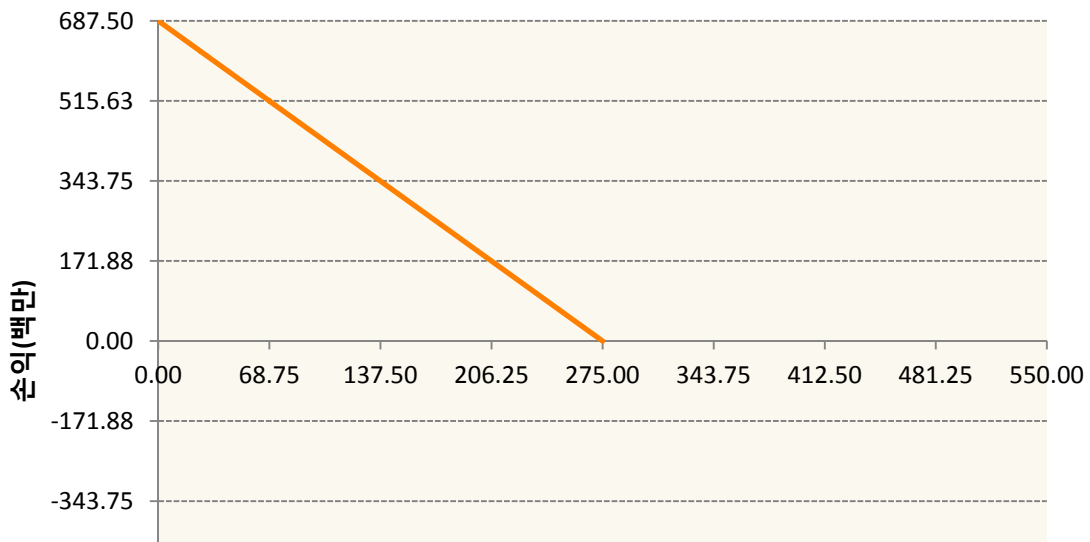


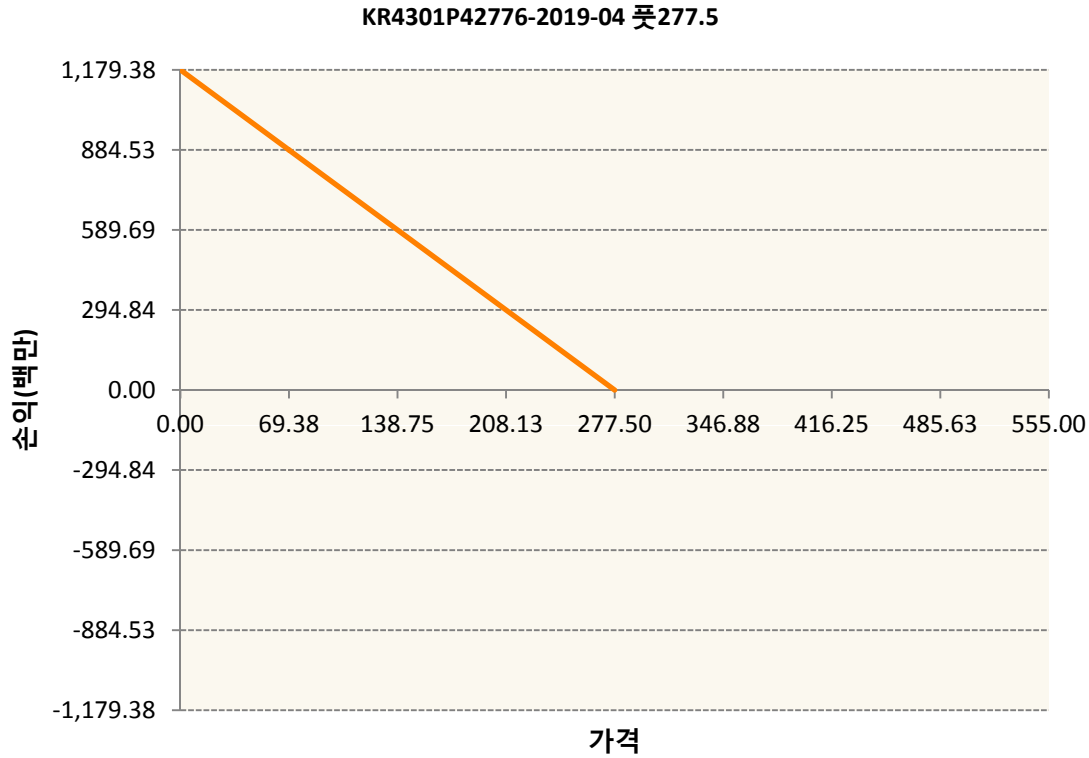
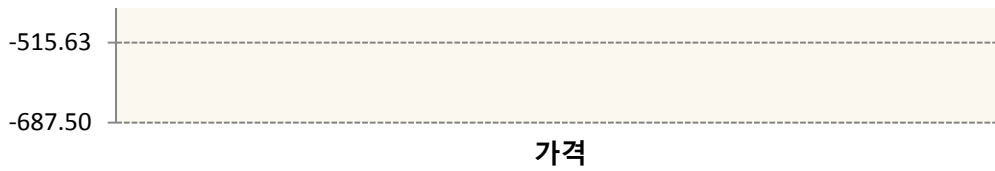


KR4201P42927-2019-04 콜292.5



KR4301P42750-2019-04 풋275





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						1,004
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,004	-1,004	-1,004	-1,004	-1,004	-1,004	-1,004	-1,004
-5.33%	-670	-670	-670	-670	-670	-670	-670	-670
-2.67%	-335	-335	-335	-335	-335	-335	-335	-335
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	335	335	335	335	335	335	335	335
5.33%	670	670	670	670	670	670	670	670
8.00%	1,004	1,004	1,004	1,004	1,004	1,004	1,004	1,004
KR4201P42901		2019-04 콜290						802
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	128	127	126	124	121	117	111	111
-5.33%	126	123	119	112	105	95	83	83
-2.67%	114	105	93	79	62	44	24	24

0%	69	48	25	0	-26	-54	-82
2.67%	-48	-81	-115	-148	-182	-217	-251
5.33%	-276	-312	-348	-384	-419	-455	-491
8.00%	-618	-646	-676	-706	-738	-770	-802
KR4201P42927 2019-04 콜292.5							167
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	22	22	22	22	21	21	20
-5.33%	22	22	21	20	19	17	15
-2.67%	20	19	17	14	11	8	4
0%	13	9	5	0	-5	-11	-17
2.67%	-7	-14	-21	-28	-36	-43	-51
5.33%	-51	-59	-67	-76	-84	-92	-101
8.00%	-121	-128	-136	-143	-151	-159	-167
KR4301P42750 2019-04 풋275							44
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	43	43	43	43	43	44	44
-5.33%	25	25	25	26	26	26	27
-2.67%	8	9	10	10	11	11	12
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-6	-5	-5	-5	-4	-4	-3
5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-5
8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
KR4301P42776 2019-04 풋277.5							80
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	80	80	80	80	80	80	80
-5.33%	48	48	48	49	49	49	50
-2.67%	18	19	20	21	22	22	23
0%	-4	-2	-1	0	1	2	4
2.67%	-13	-12	-12	-11	-10	-9	-8
5.33%	-15	-15	-15	-14	-14	-14	-13
8.00%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15

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

(단위:백만원)

1,706

공시일	2019-03-26
기준일	2019-03-25

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	2,575	0	2,575	

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	2019-03-26
기준일	2019-03-25

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	7,665	0	7,665	

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	2019-03-26
기준일	2019-03-25

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,042	0	2,042	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	58,073	0	58,073	
누계	통화	선도	0	59,432	-59,432	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019F02: KRW/USD 28-03-19E	472
FX21019F02: KRW/USD 29-03-19E	24
FX21019F02: KRW/USD 29-03-19E	73
FX21019G00 KRW/USD 29-03-19E	27
FX21019G00 KRW/USD 29-03-19E	14
FX21019G03 KRW/USD 28-03-19E	254
FX21019G03 KRW/USD 28-03-19E	118
FX21019G03 KRW/USD 29-03-19E	336
FX21019G04 KRW/USD 10-04-19E	73
FX21019H00 KRW/USD 08-04-19E	36
FX21019H00 KRW/USD 10-04-19E	36
FX21019H01 KRW/USD 10-04-19E	100
FX21019H01 KRW/USD 10-04-19E	91
FX21019H01 KRW/USD 10-04-19E	109
FX21019H01 KRW/USD 19-04-19E	145
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	118
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	207
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	254
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E	154
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E	363
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E	426
FX21019H03 KRW/USD 22-04-19E	363
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	363
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	417
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	181

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

(단위:백만원)

1,658

공시일	2019-03-26
기준일	2019-03-25

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

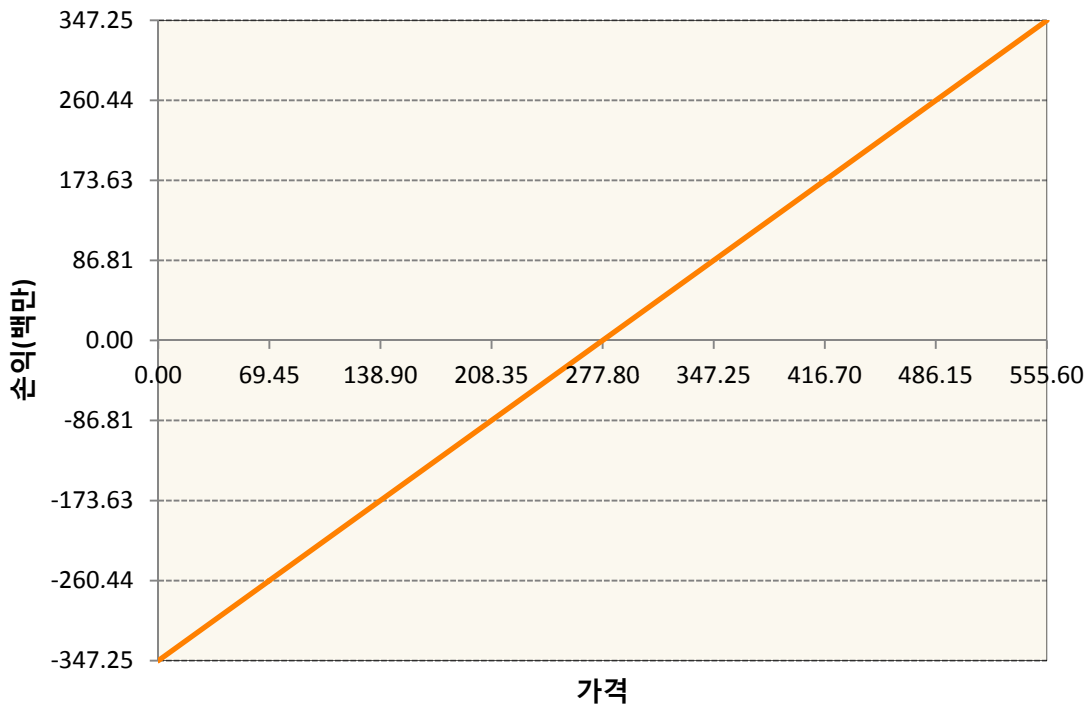
1. 계약금액

(단위:백만원)

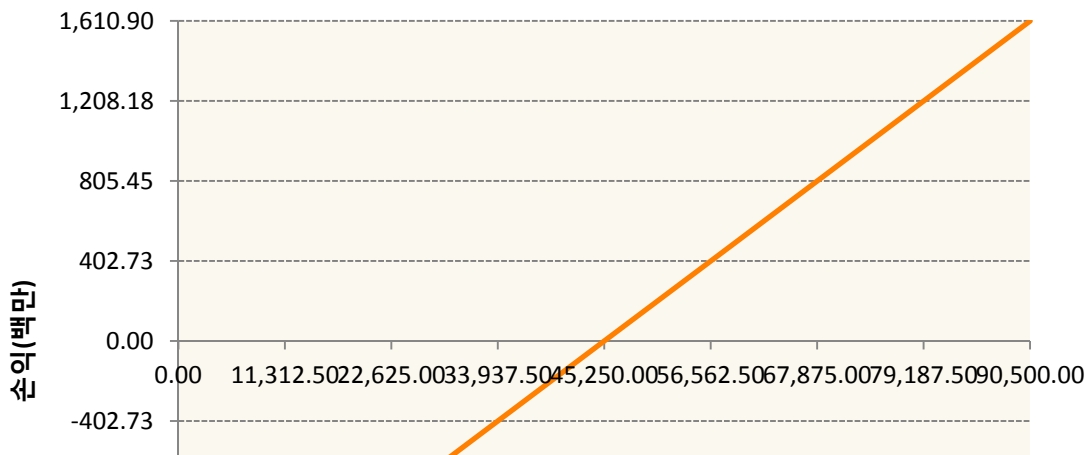
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,958	0	1,958	장내

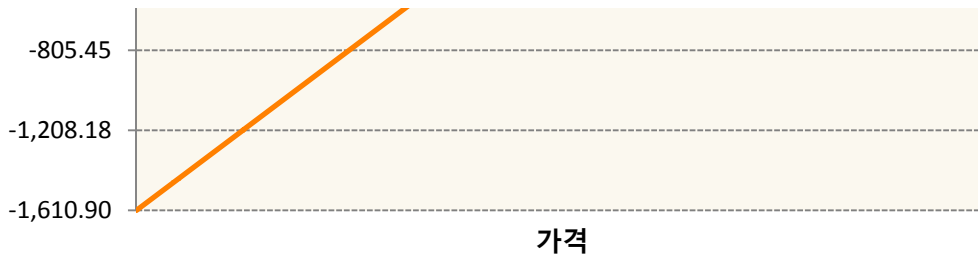
2. 만기시점의 손익구조

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%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
-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%	18	18	18	18	18	18	18	
8.00%	28	28	28	28	28	28	28	
KR4111P40005		2019-04 삼성전자개별선물						130
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130	
-5.33%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86	
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	43	43	43	43	43	43	43	
5.33%	86	86	86	86	86	86	86	
8.00%	130	130	130	130	130	130	130	

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

176

공시일	2019-03-26
기준일	2019-03-25

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

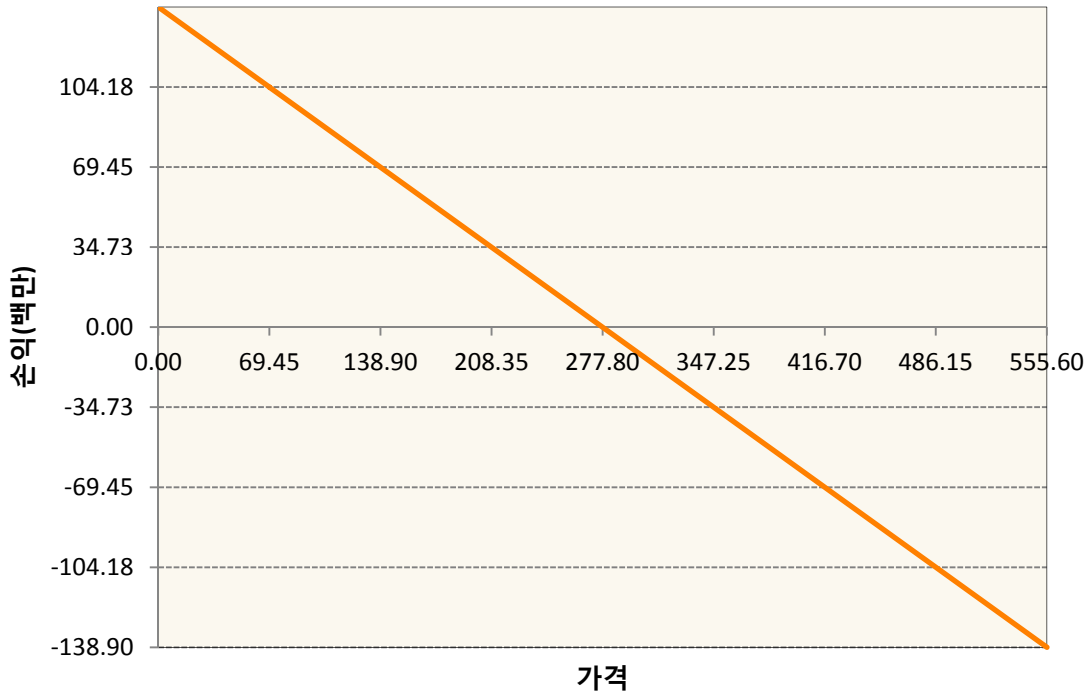
1. 계약금액

(단위:백만원)

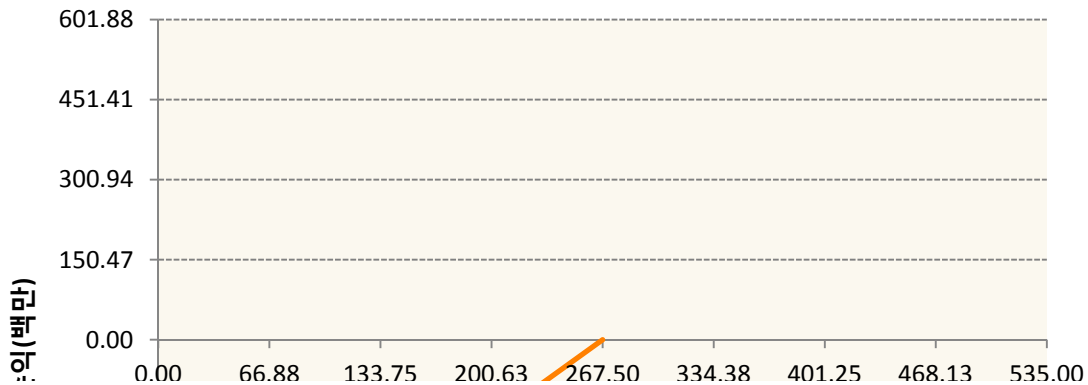
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	70	-70	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	139	-139	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,074	-1,074	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

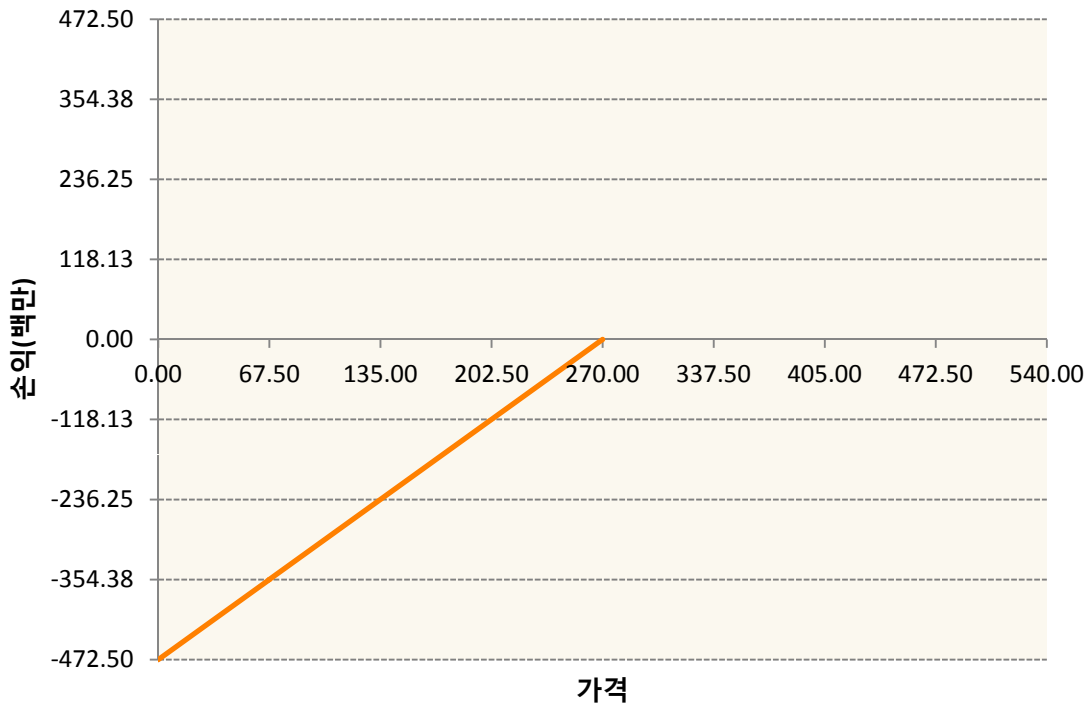


KR4301P42677-2019-04 풋267.5





KR4301P42701-2019-04 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						11
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	11	11	11	11	11	11	11	
-5.33%	7	7	7	7	7	7	7	
-2.67%	4	4	4	4	4	4	4	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4	
5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7	
8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11	
KR4301P42677		2019-04 풋267.5						28
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-27	-27	-27	-27	-27	-28	-28
-5.33%	-12	-12	-13	-13	-14	-14	-15
-2.67%	-2	-3	-3	-4	-5	-5	-6
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

KR4301P42701

2019-04 풋270

25

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-24	-24	-24	-24	-25	-25	-25
-5.33%	-12	-12	-13	-13	-13	-14	-14
-2.67%	-3	-3	-4	-4	-5	-5	-6
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	2	2	2	1	1	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

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

(단위:백만원)

52

공시일	2019-03-26
기준일	2019-03-25

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

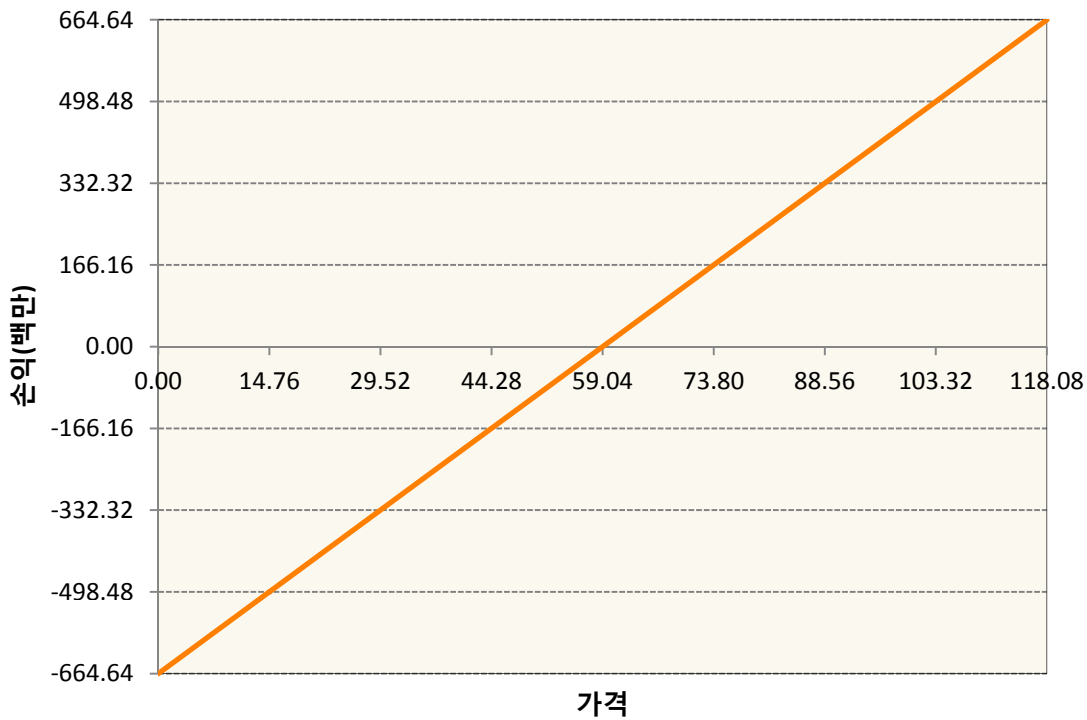
1. 계약금액

(단위:백만원)

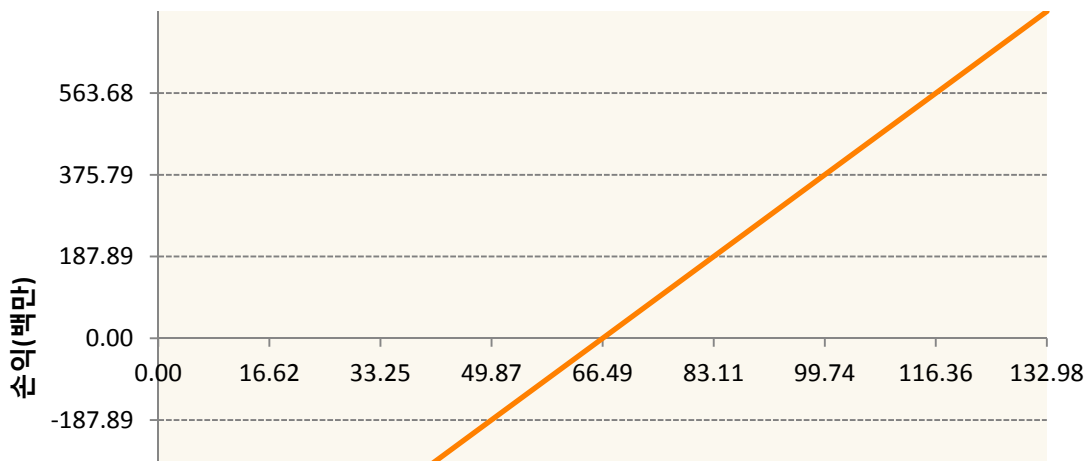
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,856	283	2,573	

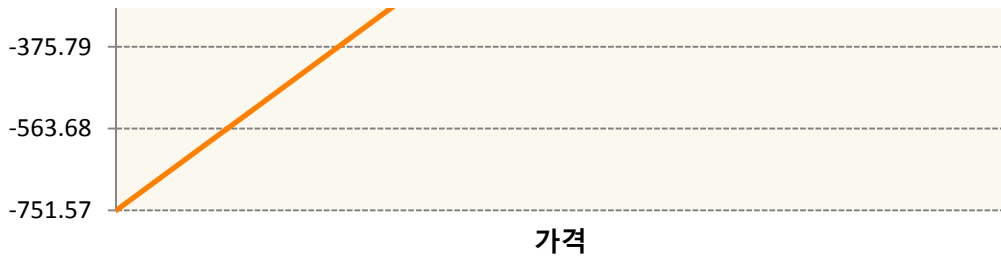
2. 만기시점의 손익구조

CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19

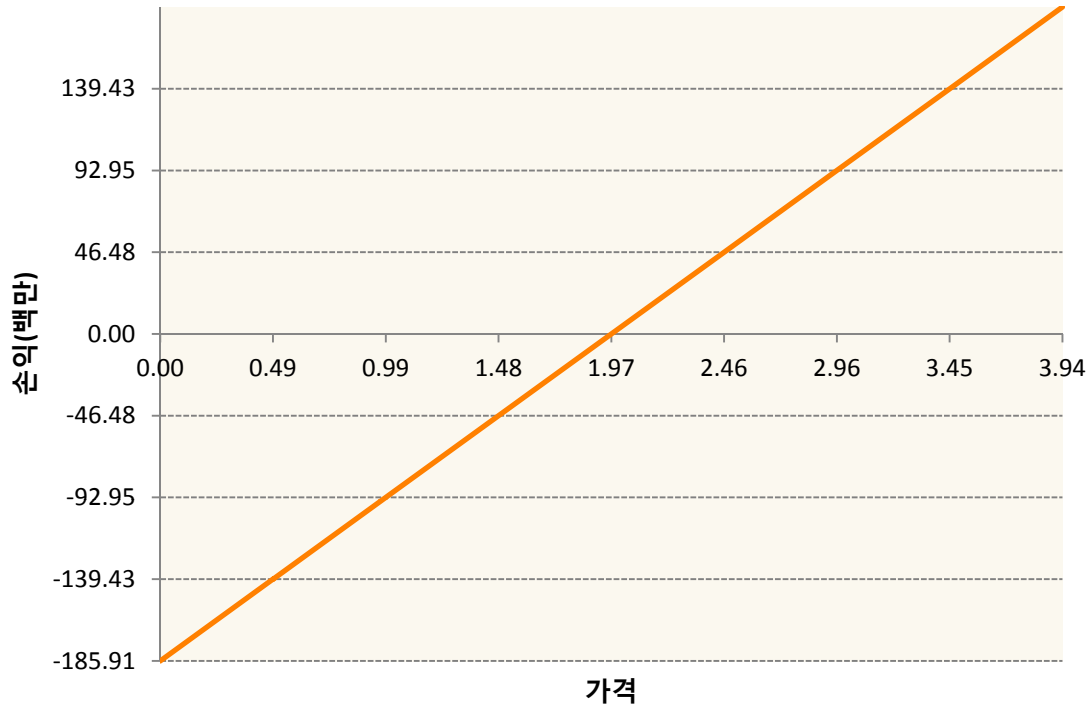


CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19

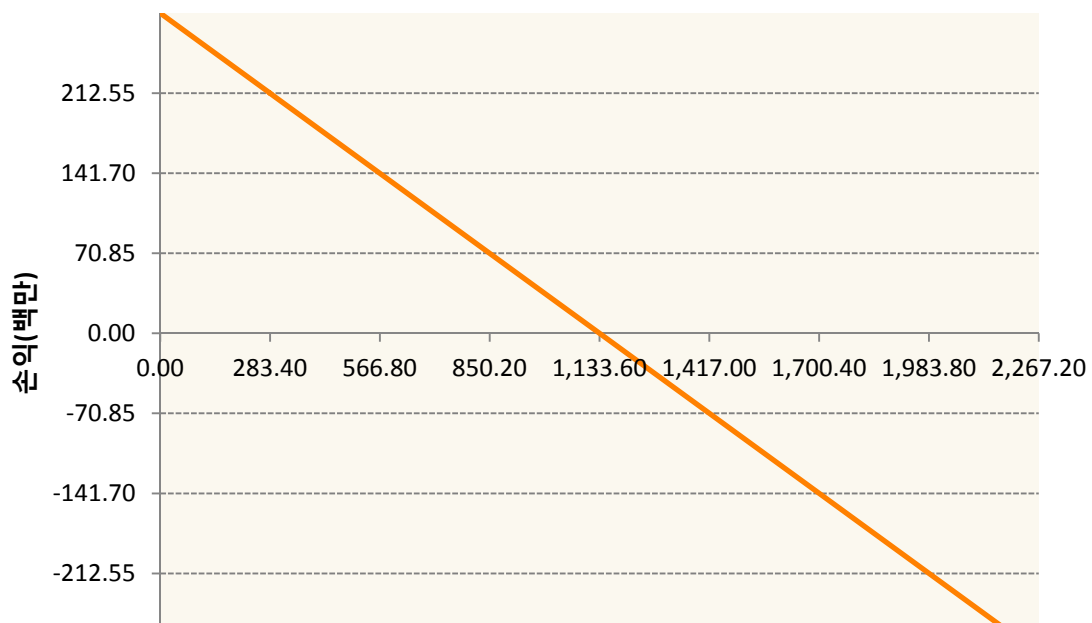


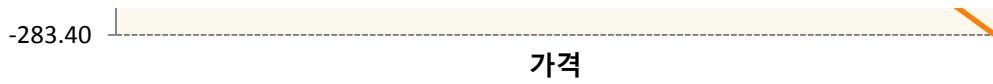


HOK9-NY Harb ULSD Fut May19

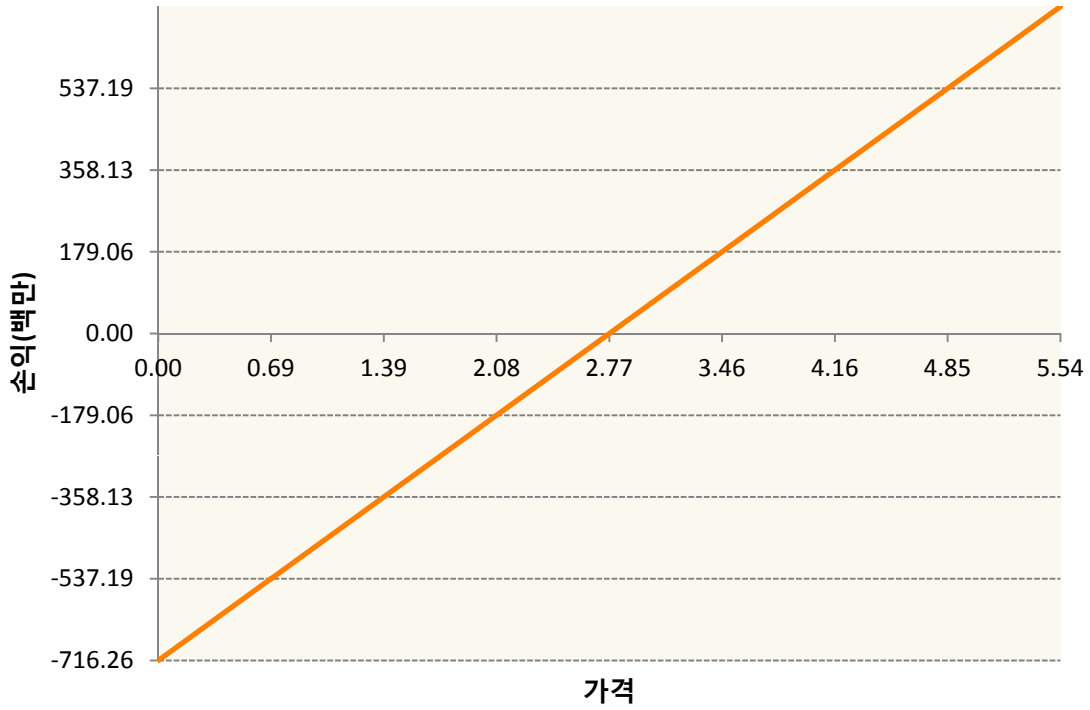


KR4175P40000-2019-04 달러선물

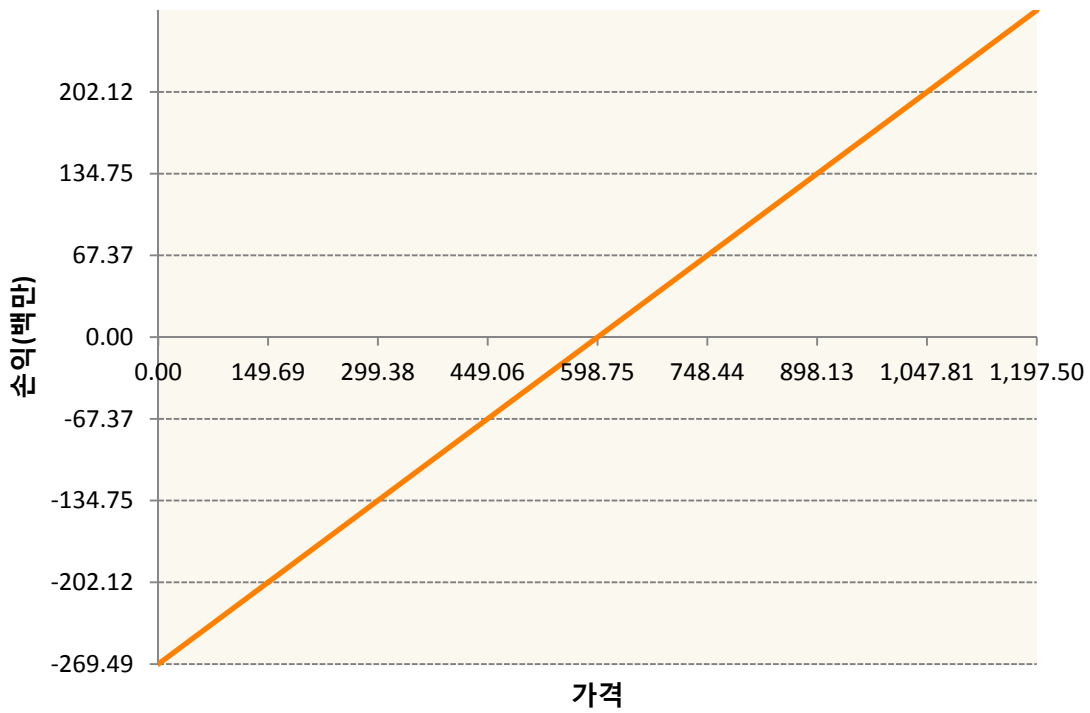




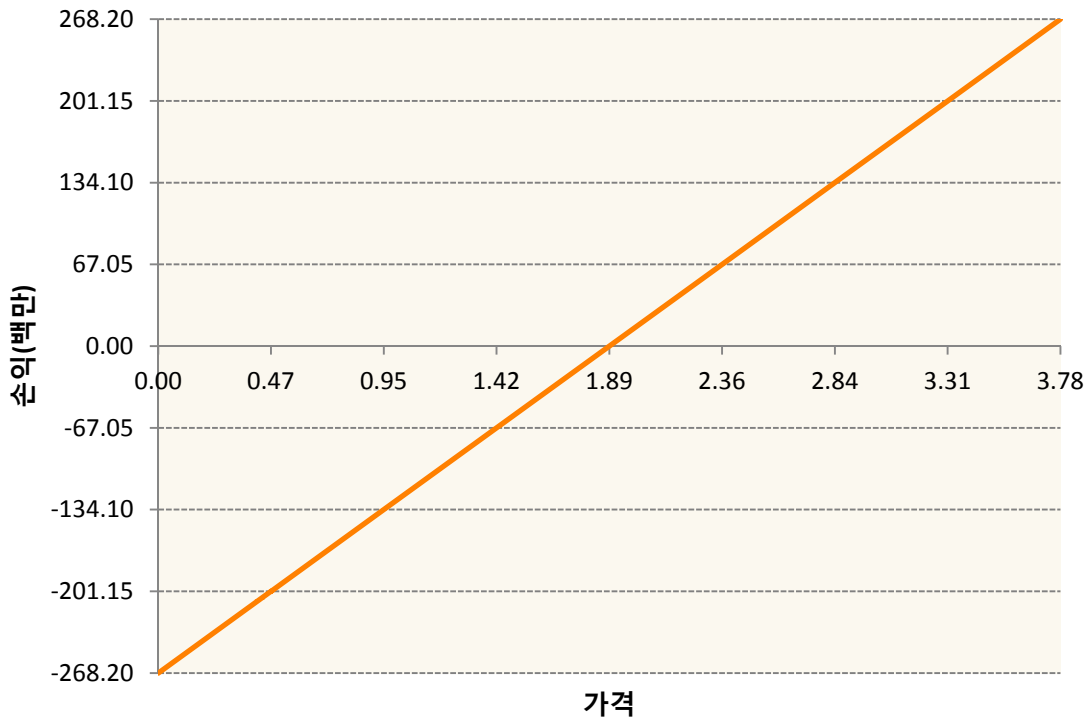
NGK19-NATURAL GAS FUTR May19



QSK9-Low Su Gasoil G May19



XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK9	WTI CRUDE FUTURE May19	53
CON9	BRENT CRUDE FUTR Jul19	60
HOK9	NY Harb ULSD Fut May19	15
KR4175P400	2019-04 달러선물	23
NGK19	NATURAL GAS FUTR May19	57
QSK9	Low Su Gasoil G May19	22
XBK9	GASOLINE RBOB FUT May19	21

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

(단위:백만원)

434

공시일	2019-03-26
기준일	2019-03-25

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

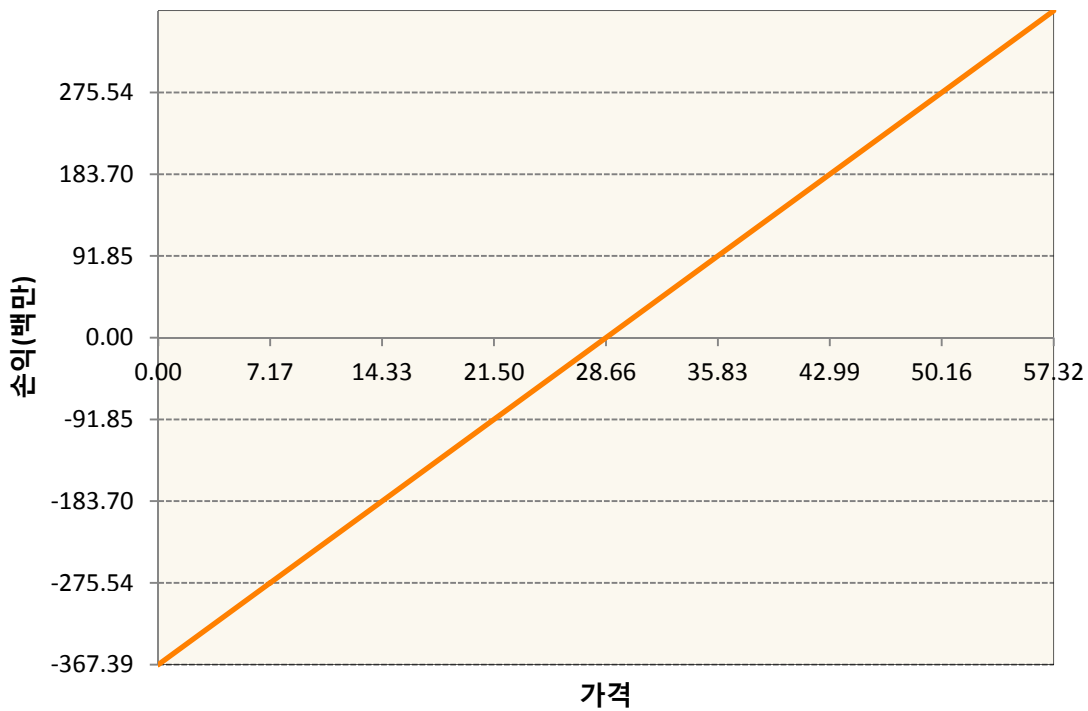
1. 계약금액

(단위:백만원)

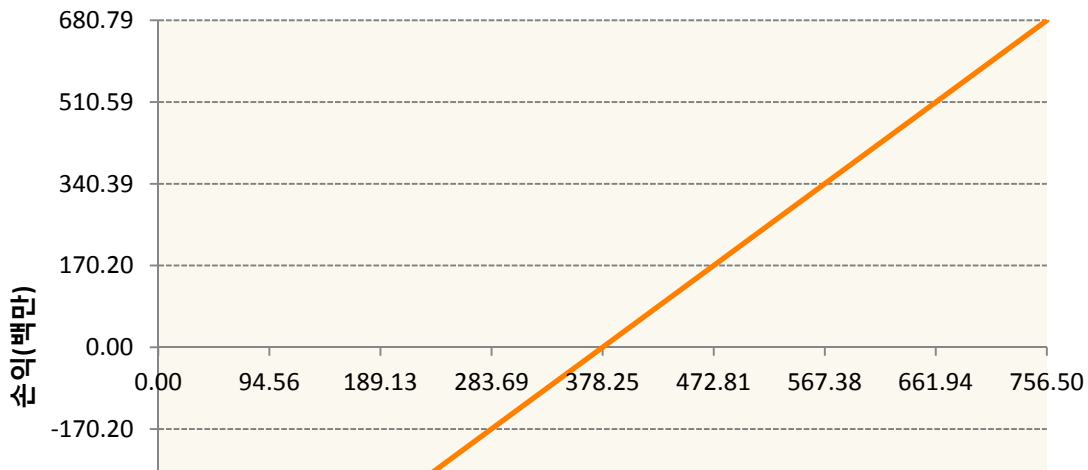
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,389	79	3,310	

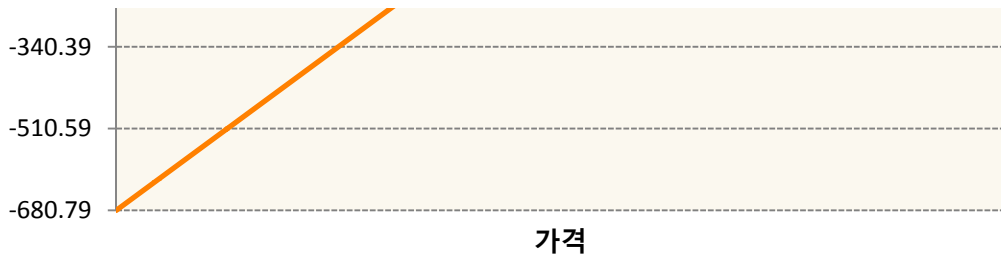
2. 만기시점의 손익구조

BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19

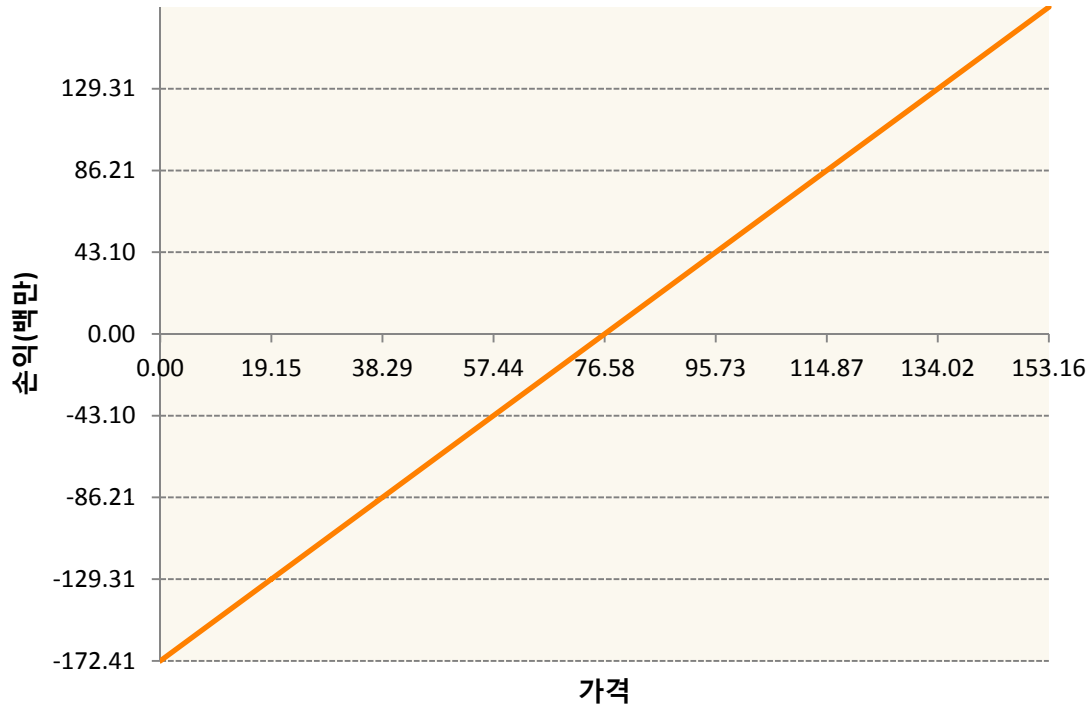


CK9-CORN FUTURE May19

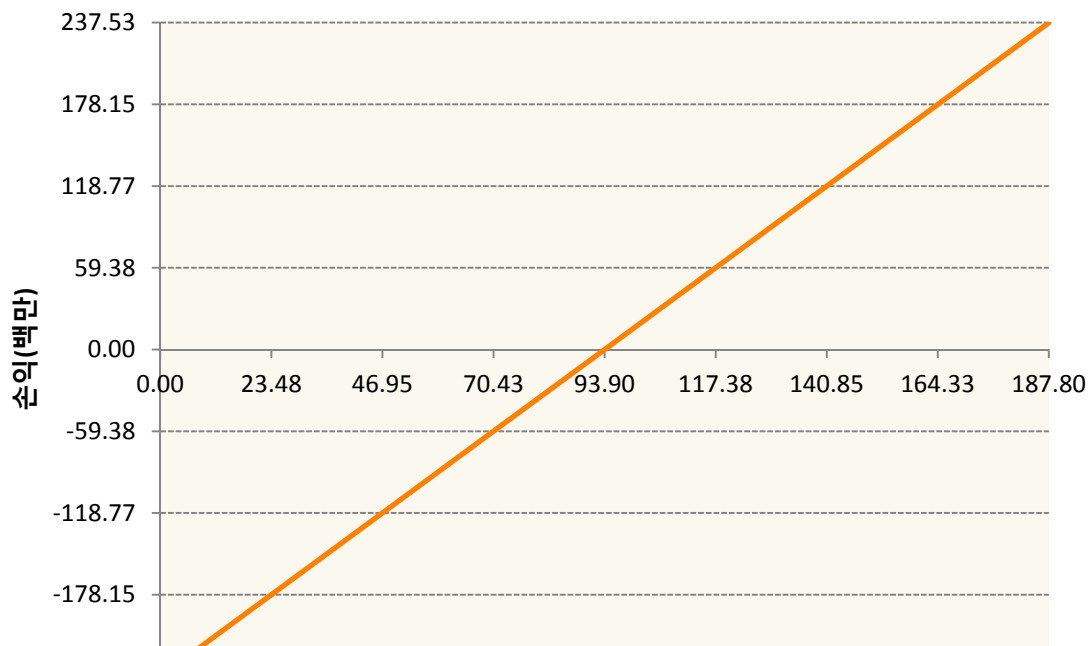


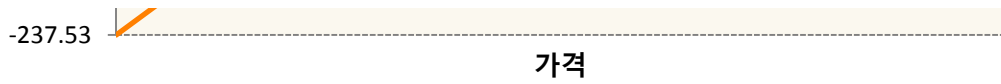


CTK9-COTTON NO.2 FUTR May19

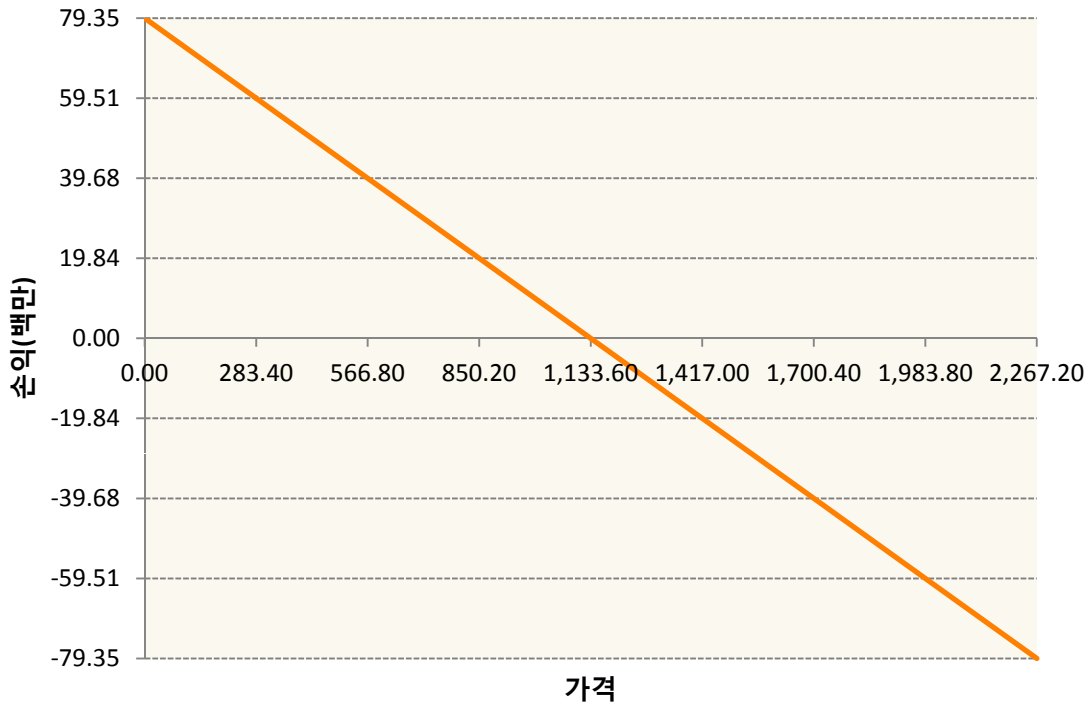


KCK9-COFFEE 'C' FUTURE May19

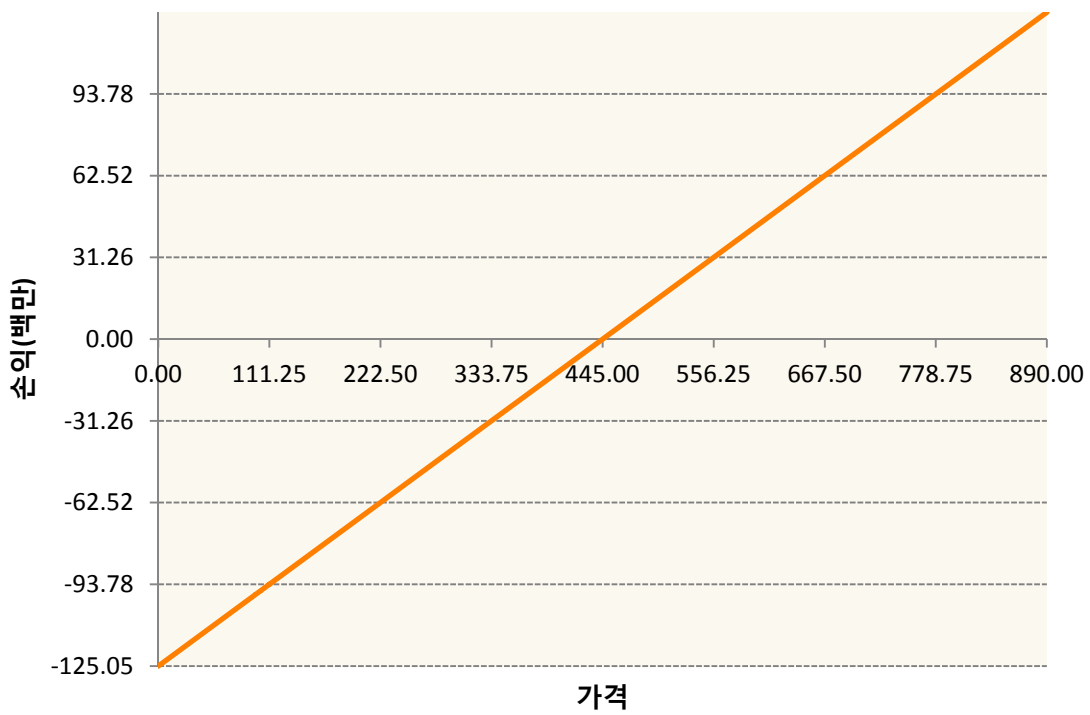




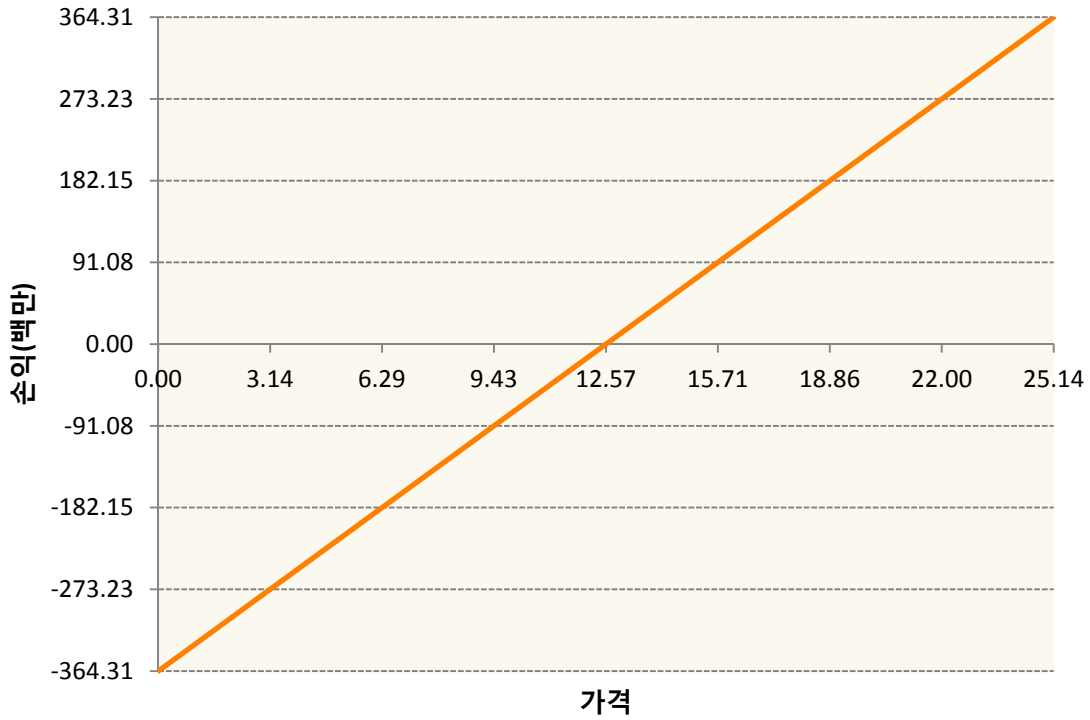
KR4175P40000-2019-04 달러선물



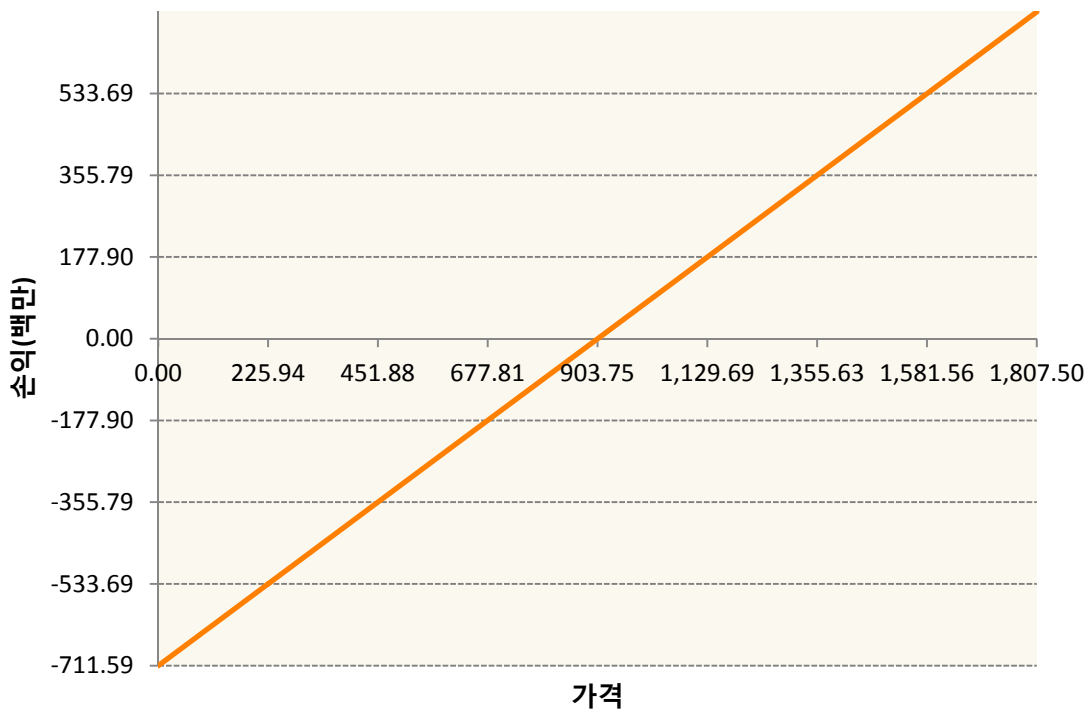
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

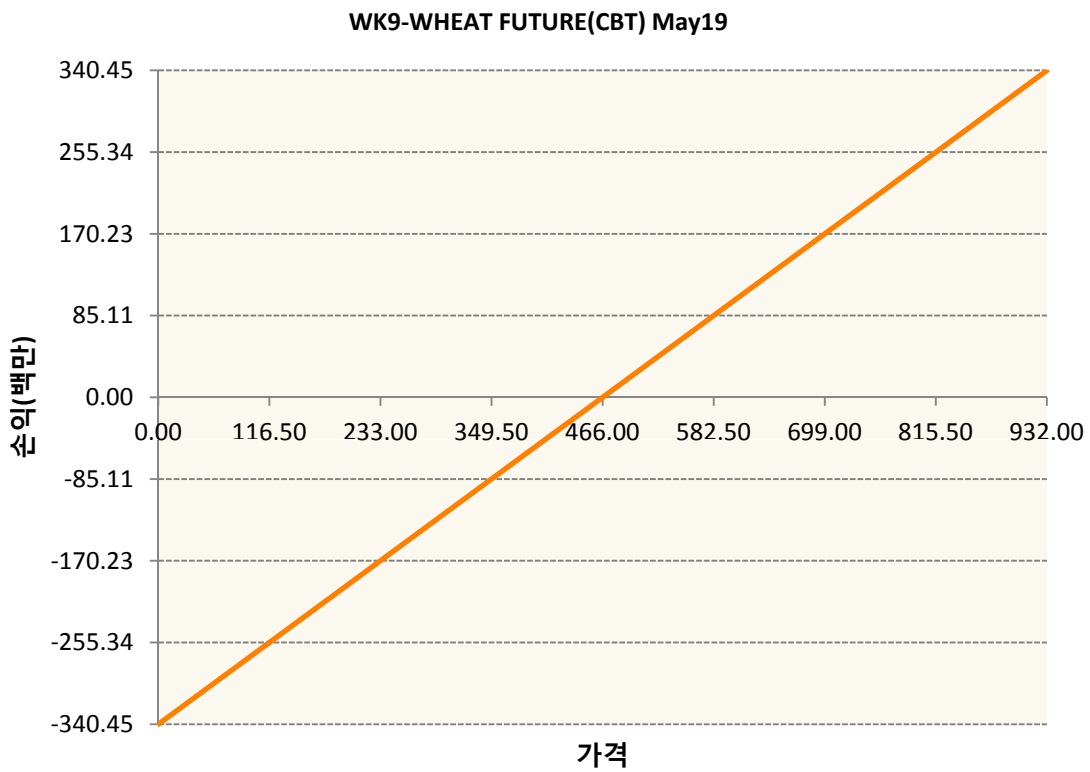
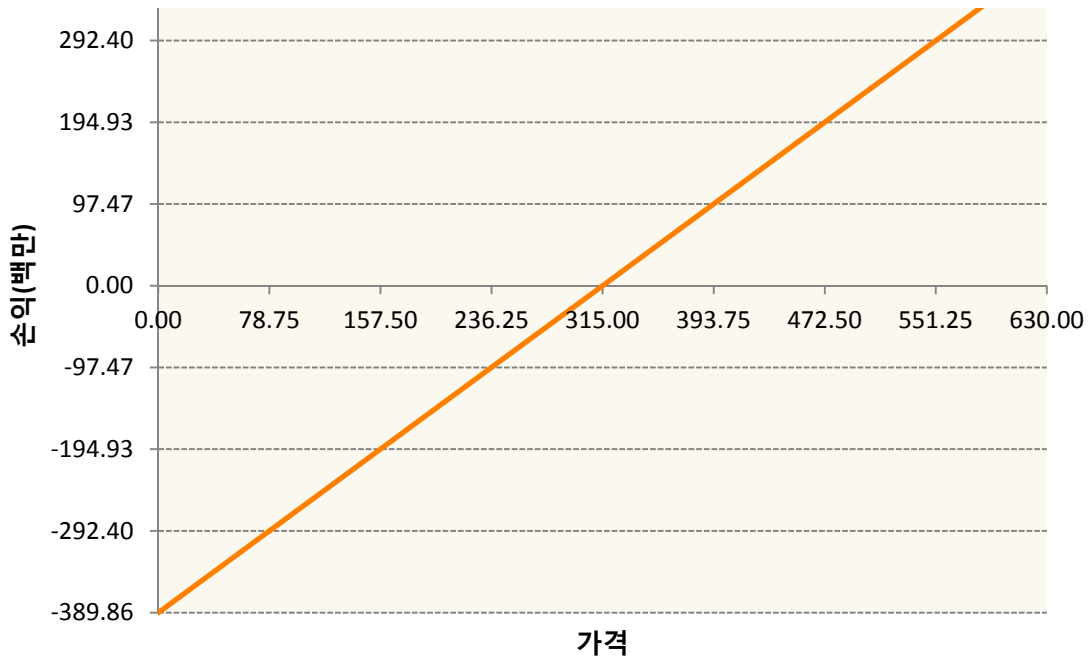


SK9-SOYBEAN FUTURE May19



SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOK9	SOYBEAN OIL FUTR May19	29
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