

공시일	2019-03-28
기준일	2019-03-27

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	2019-03-28
기준일	2019-03-27

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

1,124

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

659

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-03-28
기준일	2019-03-27

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)	340
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	94
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	159

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

939

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-03-28
기준일	2019-03-27

유로인덱스모(주식-파생형)

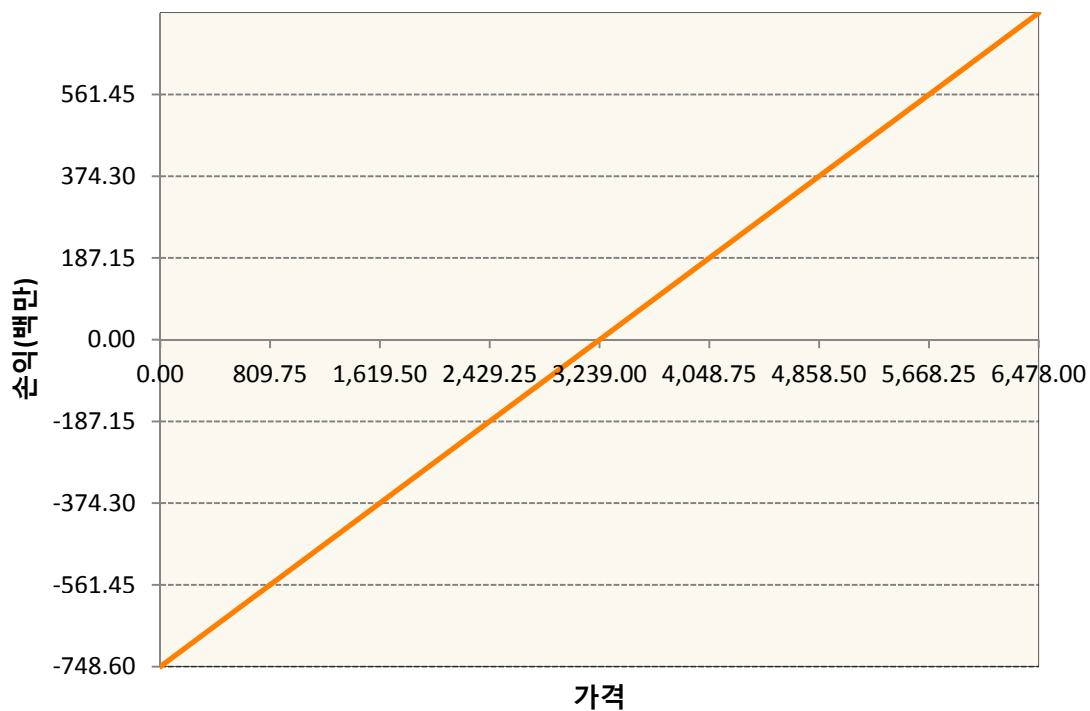
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	749	0	749	

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	2019-03-28
기준일	2019-03-27

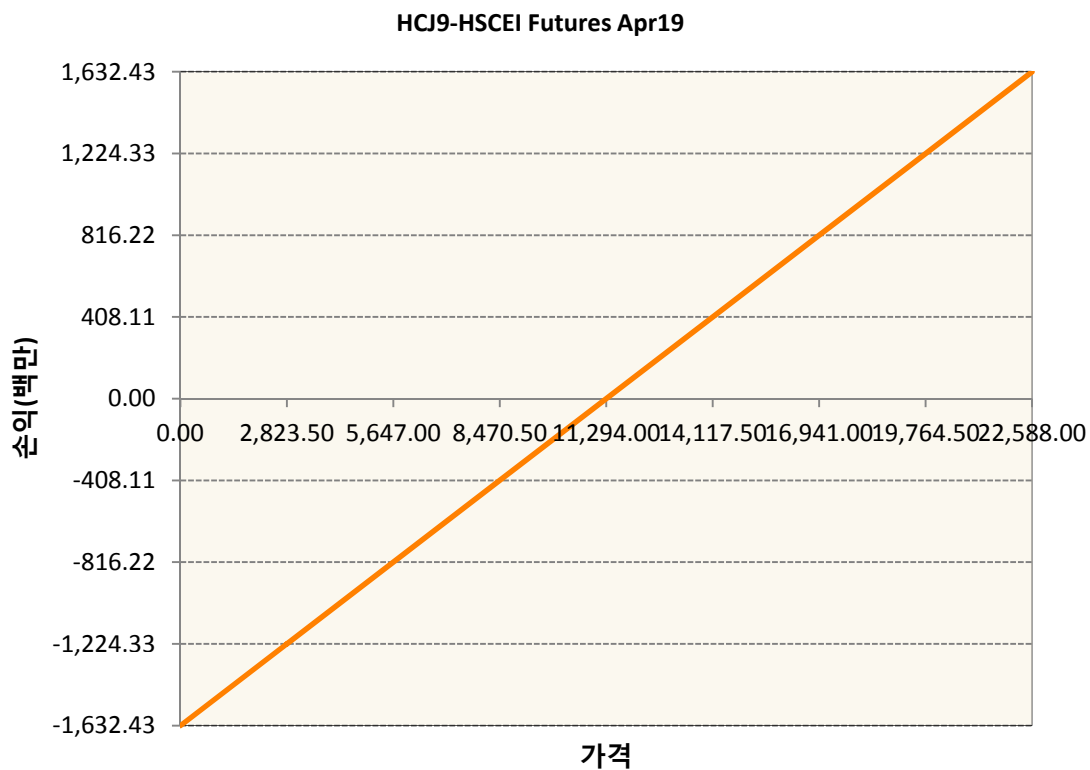
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,632	0	1,632	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI9	HSCEI Futures Apr19	131
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

134

공시일	2019-03-28
기준일	2019-03-27

커버드콜모(주식혼합-파생형)

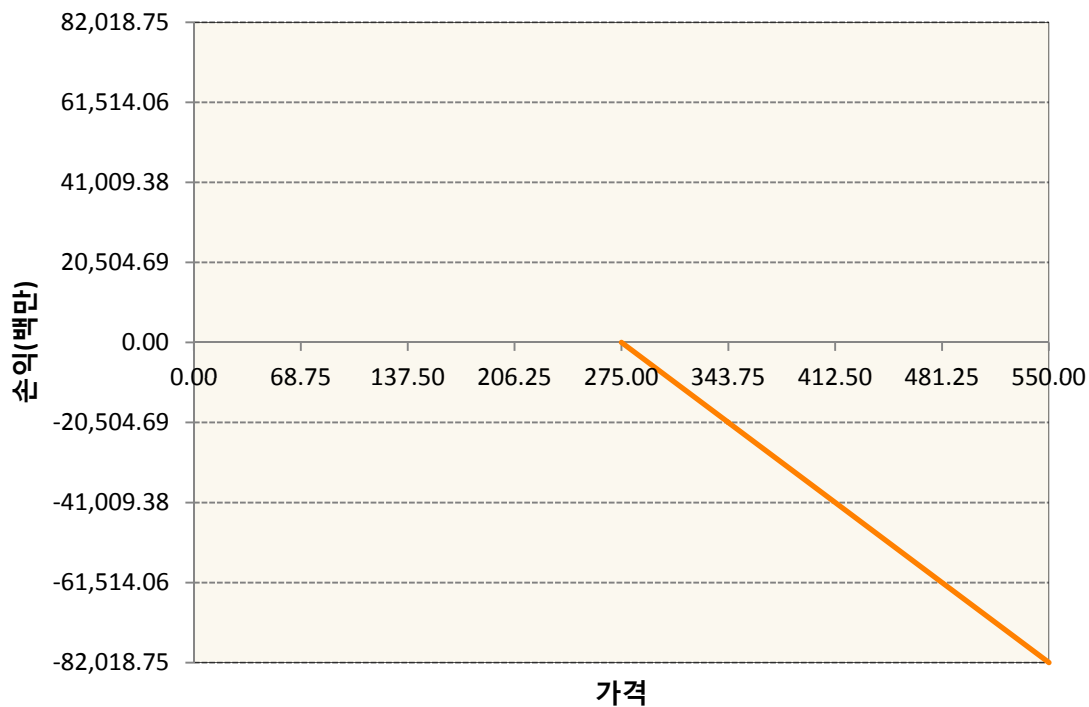
1. 계약금액

(단위:백만원)

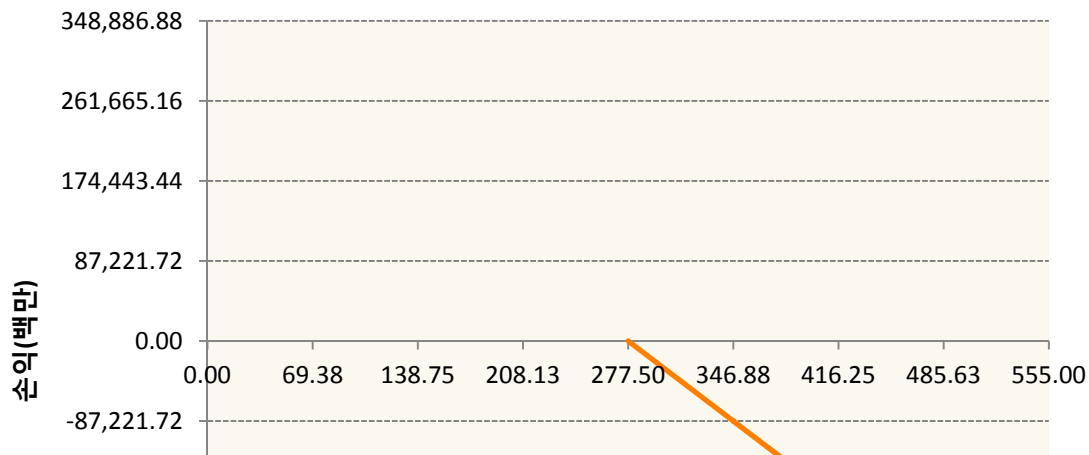
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	668,968	-668,968	장내

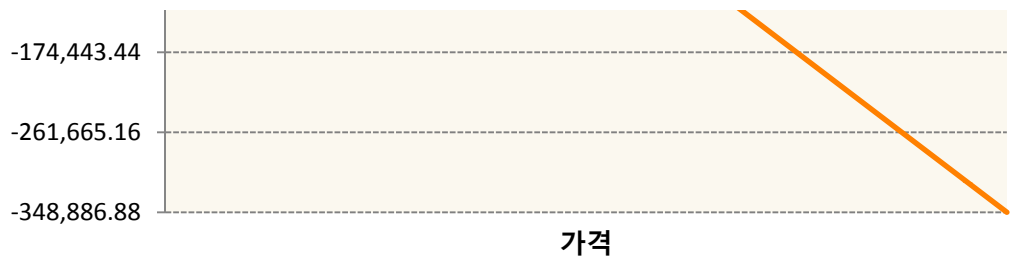
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P42752-2019-04 콜275

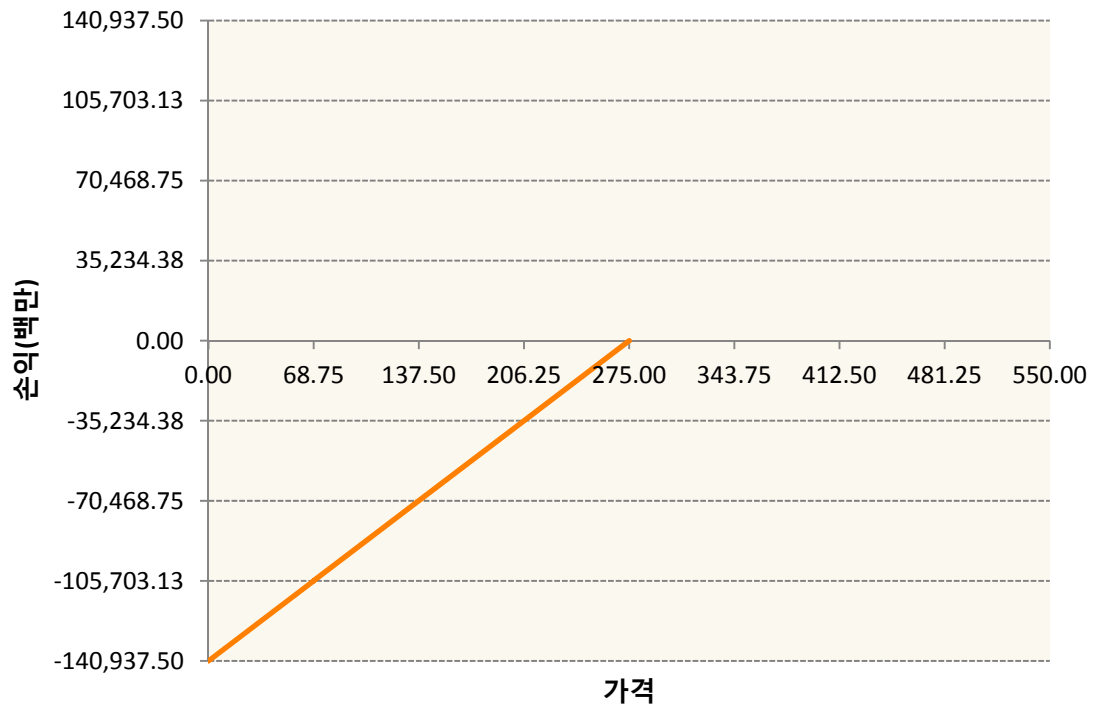


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

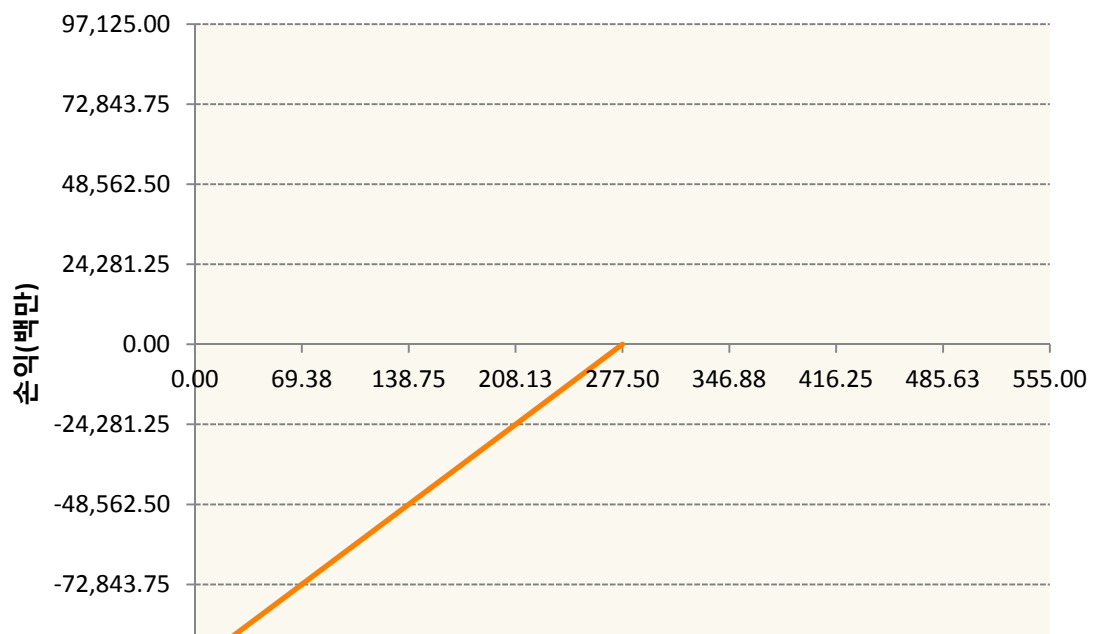




KR4301P42750-2019-04 풋275



KR4301P42776-2019-04 풋277.5



-97,125.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P42752			2019-04 콜275				5,457
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,033	2,007	1,972	1,928	1,875	1,815	1,747
-5.33%	1,887	1,814	1,731	1,641	1,545	1,444	1,338
-2.67%	1,421	1,294	1,165	1,034	901	767	632
0%	422	282	141	0	-141	-283	-425
2.67%	-1,140	-1,242	-1,352	-1,466	-1,585	-1,707	-1,832
5.33%	-3,090	-3,141	-3,203	-3,275	-3,355	-3,442	-3,536
8.00%	-5,220	-5,238	-5,265	-5,300	-5,344	-5,397	-5,457
KR4201P42778			2019-04 콜277.5				21,845
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,013	6,940	6,835	6,694	6,520	6,312	6,075
-5.33%	6,624	6,388	6,108	5,792	5,444	5,069	4,670
-2.67%	5,212	4,738	4,243	3,732	3,210	2,677	2,136
0%	1,816	1,211	605	0	-605	-1,211	-1,816
2.67%	-4,006	-4,516	-5,042	-5,582	-6,133	-6,692	-7,259
5.33%	-11,763	-12,055	-12,389	-12,760	-13,161	-13,588	-14,037
8.00%	-20,553	-20,670	-20,829	-21,028	-21,266	-21,540	-21,845
KR4301P42750			2019-04 풋275				9,069
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,025	-9,026	-9,028	-9,033	-9,041	-9,053	-9,069
-5.33%	-5,261	-5,282	-5,311	-5,349	-5,395	-5,448	-5,509
-2.67%	-1,809	-1,911	-2,020	-2,133	-2,250	-2,370	-2,493
0%	408	273	137	0	-138	-276	-415
2.67%	1,109	1,057	995	923	843	757	664
5.33%	1,197	1,191	1,180	1,162	1,138	1,107	1,069
8.00%	1,201	1,201	1,200	1,198	1,194	1,188	1,178
KR4301P42776			2019-04 풋277.5				6,651
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,635	-6,635	-6,636	-6,637	-6,640	-6,644	-6,651
-5.33%	-4,054	-4,061	-4,071	-4,086	-4,106	-4,130	-4,160
-2.67%	-1,577	-1,625	-1,680	-1,741	-1,805	-1,874	-1,946
0%	293	195	98	0	-98	-195	-293
2.67%	1,074	1,017	955	887	815	740	662

5.33%	1,213	1,203	1,187	1,166	1,138	1,106	1,068
8.00%	1,223	1,222	1,221	1,217	1,212	1,203	1,191

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

45,665

공시일	2019-03-28
기준일	2019-03-27

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

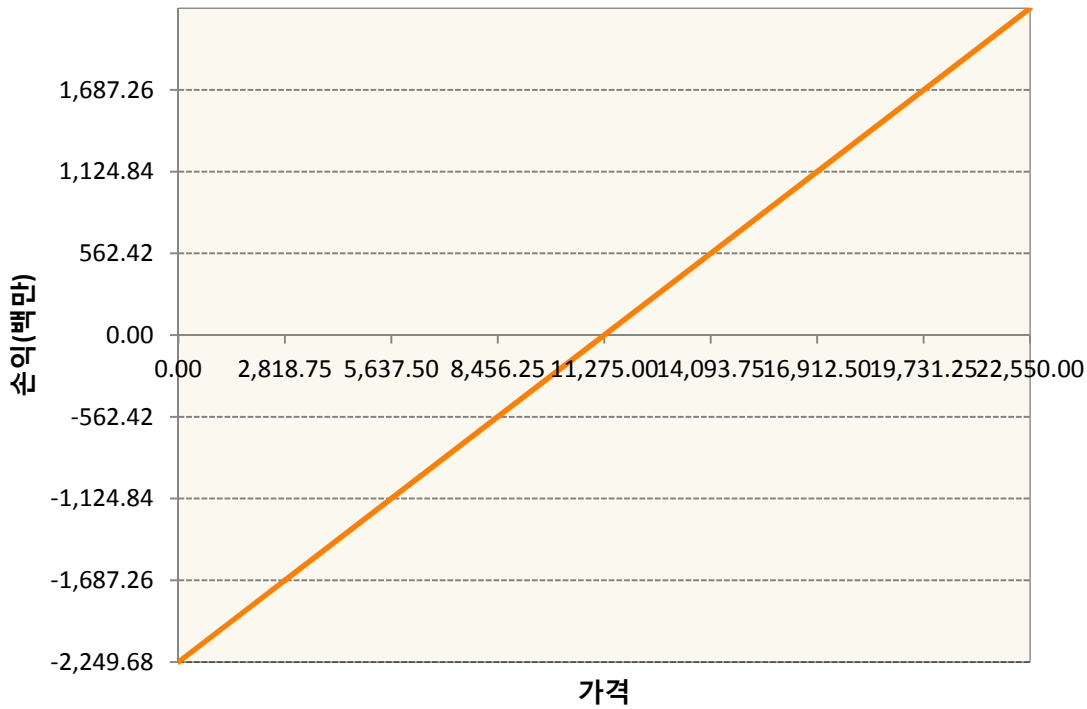
1. 계약금액

(단위:백만원)

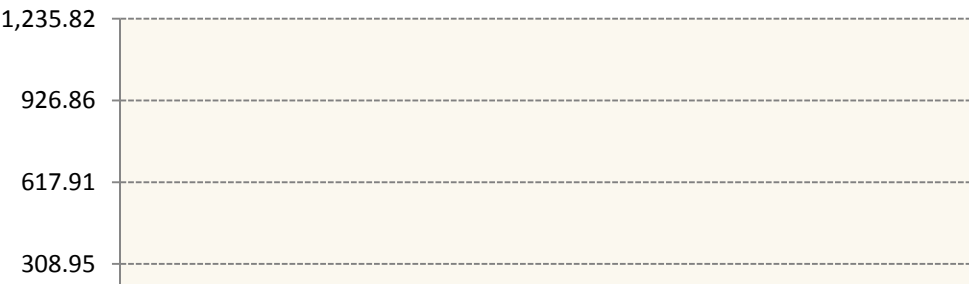
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,250	0	2,250	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,962	-5,962	장내
누계	통화	선도	0	3,035	-3,035	장외

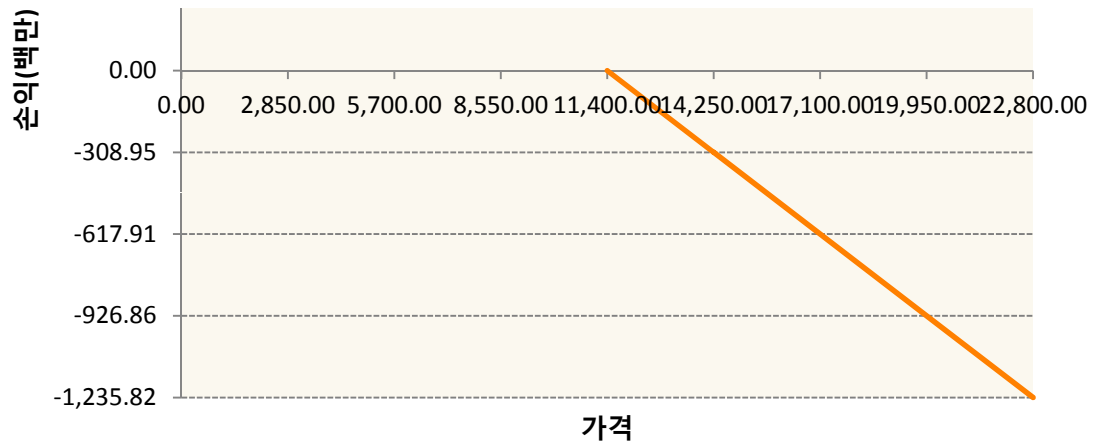
2. 만기시점의 손익구조

HCH9-HSCEI Futures Mar19

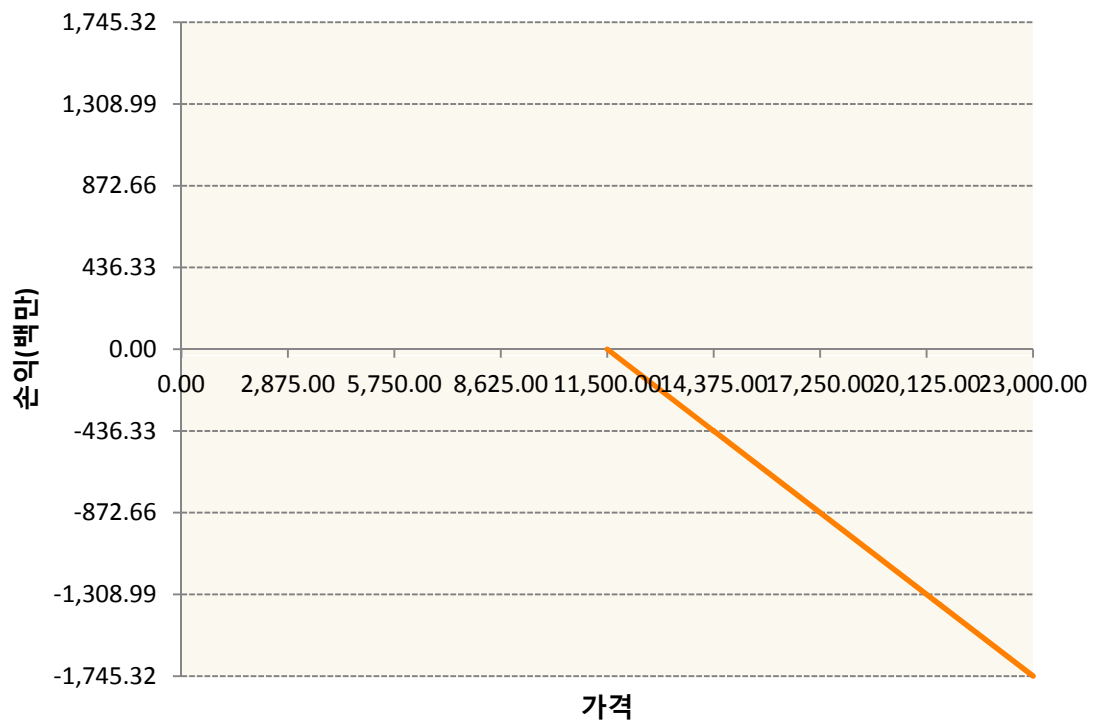


OHHIH9-C114-HSCEI

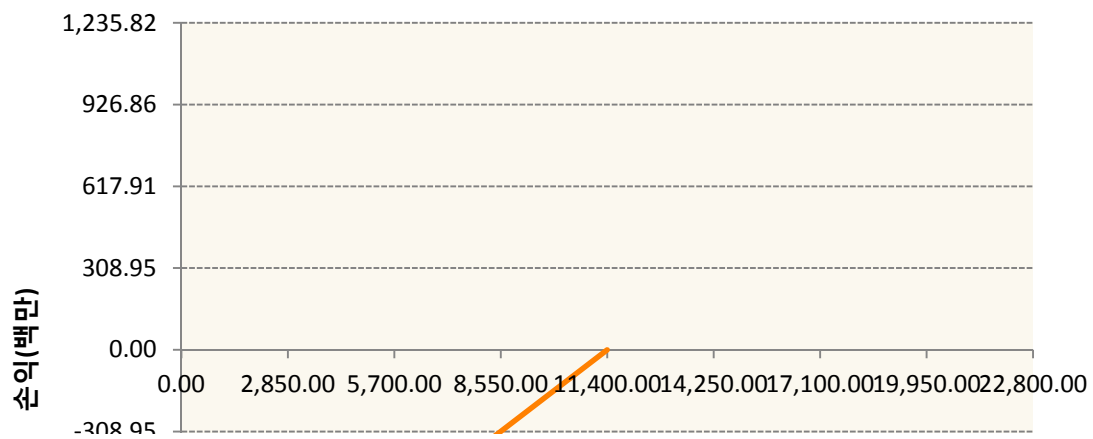


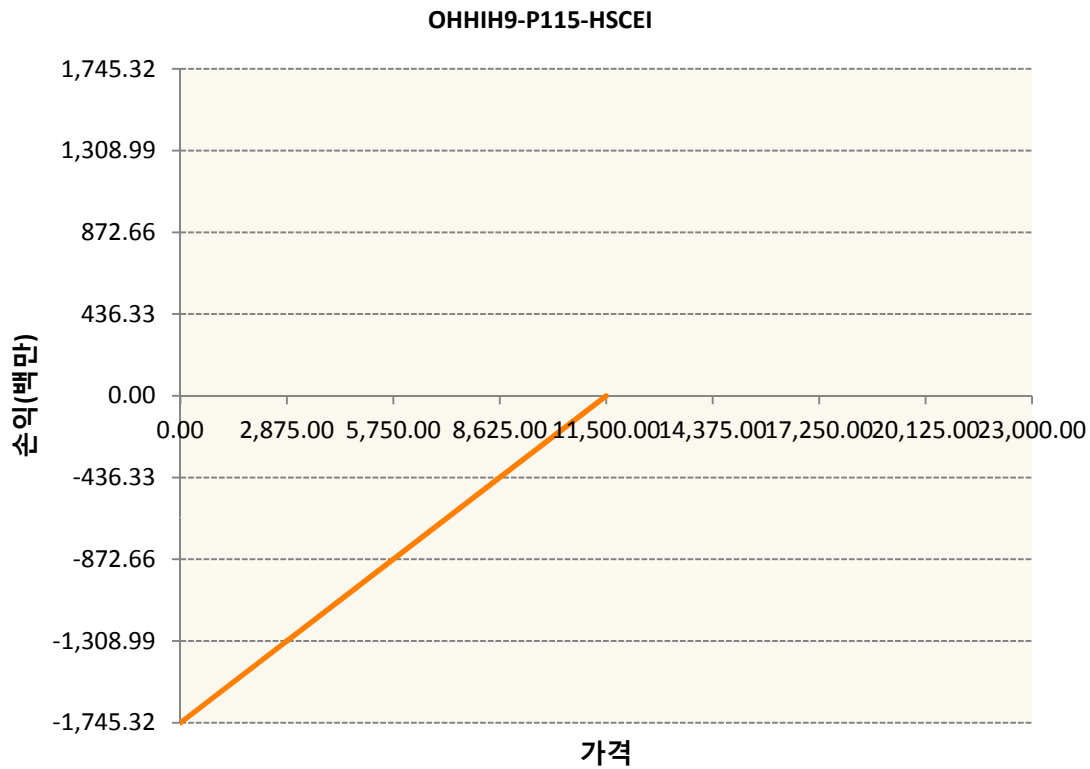


OHHIH9-C115-HSCEI



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		180
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)
	758

공시일	2019-03-28
기준일	2019-03-27

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

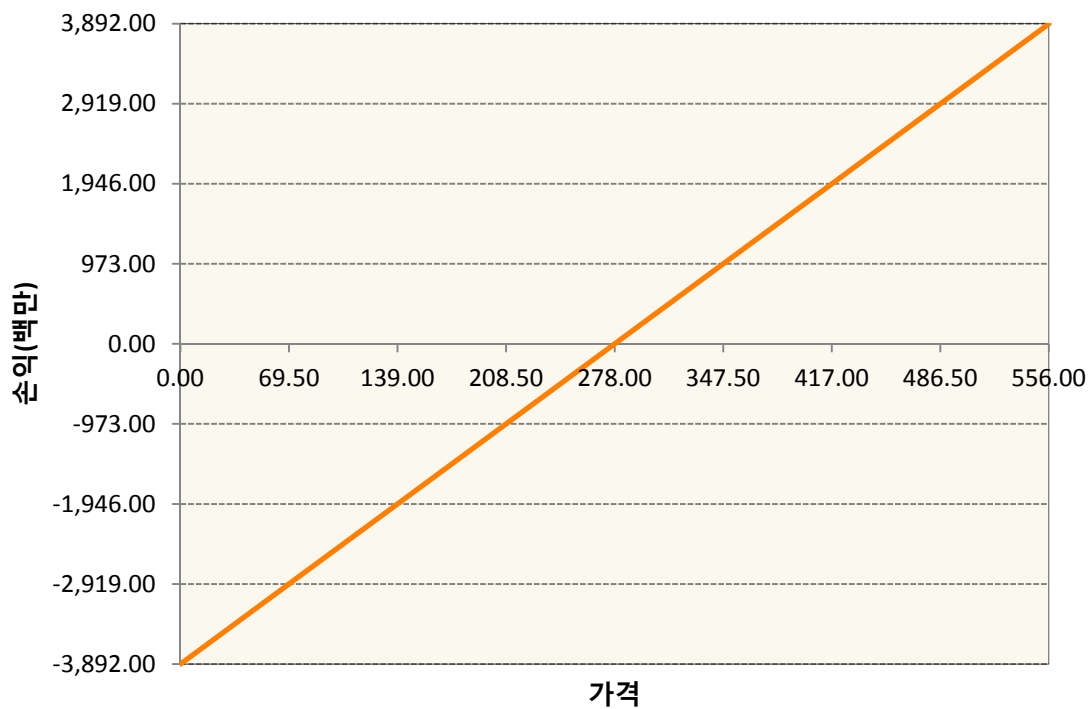
1. 계약금액

(단위:백만원)

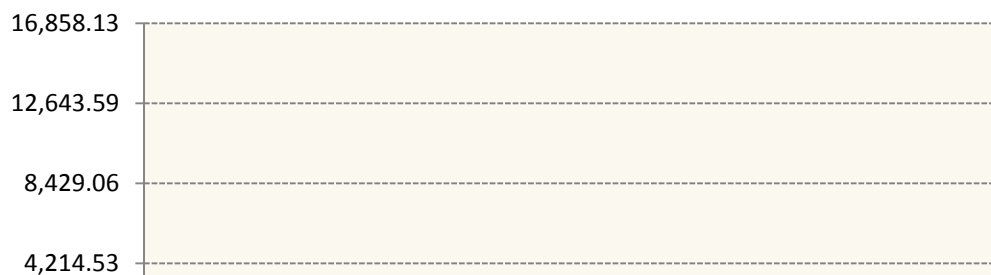
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,892	0	3,892	장내
누계	유가증권	스왑	35,836	0	35,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,649	-34,649	장내

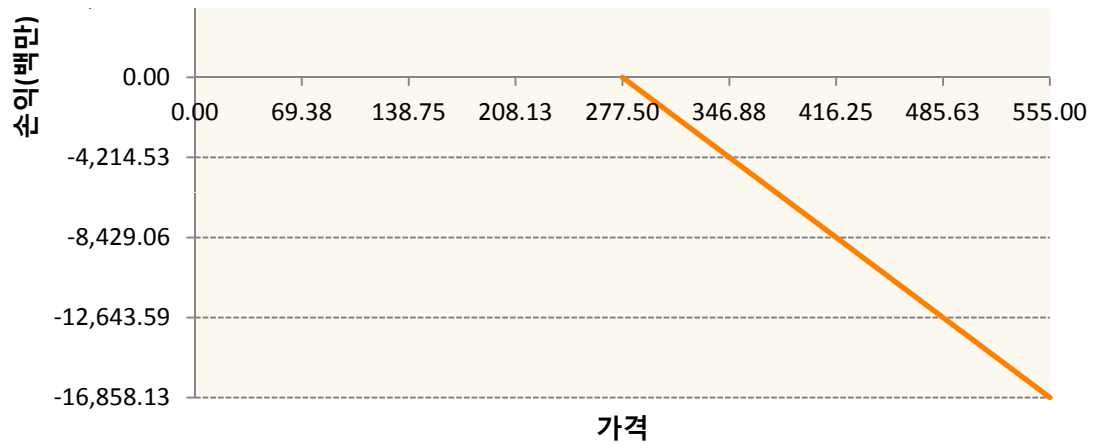
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

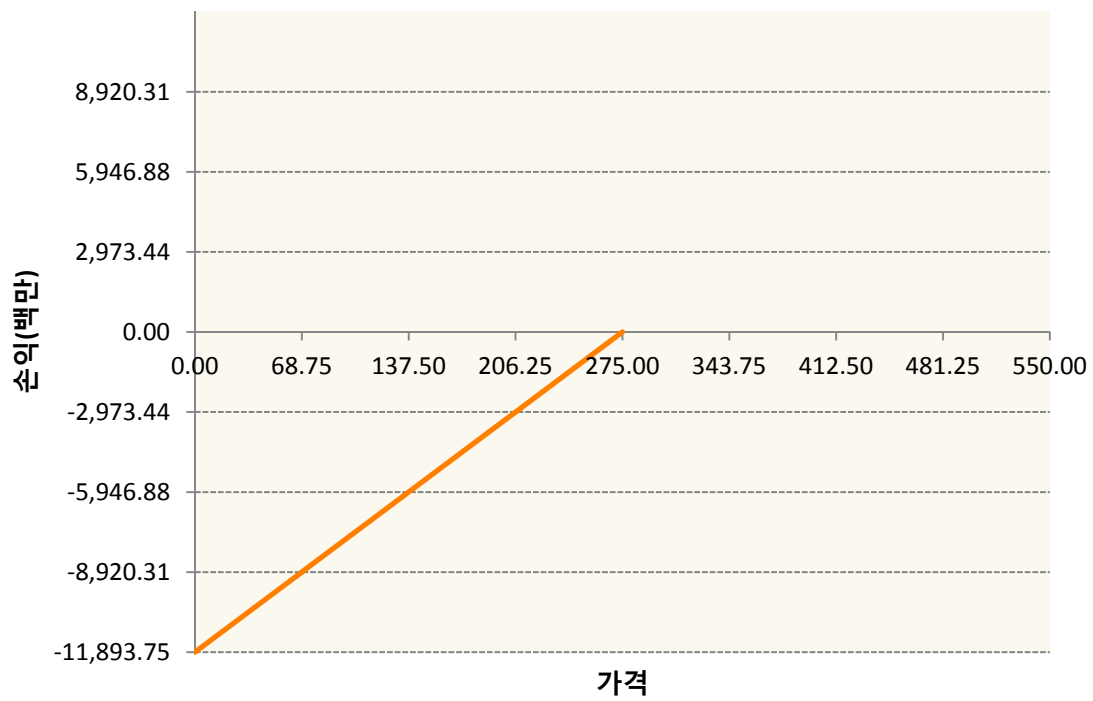


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

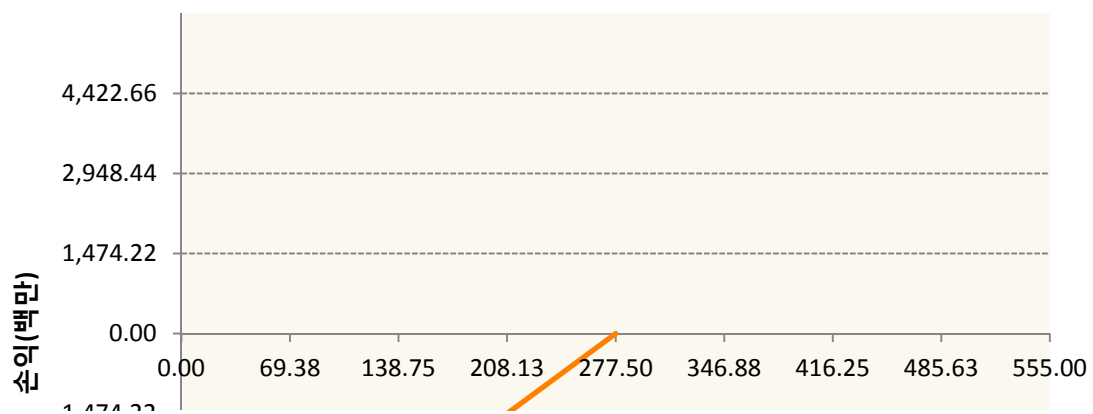




KR4301P42750-2019-04 풋275



KR4301P42776-2019-04 풋277.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14					2,439
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,439	-2,439	-2,439	-2,439	-2,439	-2,439	-2,439
-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%	2,439	2,439	2,439	2,439	2,439	2,439	2,439
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					1,056
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	339	335	330	323	315	305	294
-5.33%	320	309	295	280	263	245	226
-2.67%	252	229	205	180	155	129	103
0%	88	59	29	0	-29	-59	-88
2.67%	-194	-218	-244	-270	-296	-323	-351
5.33%	-568	-582	-599	-617	-636	-657	-678
8.00%	-993	-999	-1,006	-1,016	-1,028	-1,041	-1,056
KR4301P42750 2019-04 풋275							765
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-762	-762	-762	-762	-763	-764	-765
-5.33%	-444	-446	-448	-451	-455	-460	-465
-2.67%	-153	-161	-170	-180	-190	-200	-210
0%	34	23	12	0	-12	-23	-35
2.67%	94	89	84	78	71	64	56
5.33%	101	100	100	98	96	93	90
8.00%	101	101	101	101	101	100	99
KR4301P42776 2019-04 풋277.5							404
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-403	-403	-403	-403	-403	-403	-404
-5.33%	-246	-247	-247	-248	-249	-251	-253
-2.67%	-96	-99	-102	-106	-110	-114	-118
0%	18	12	6	0	-6	-12	-18
2.67%	65	62	58	54	49	45	40
5.33%	74	73	72	71	69	67	65
8.00%	74	74	74	74	74	73	72

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

(단위:백만원)

5,682

공시일	2019-03-28
기준일	2019-03-27

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

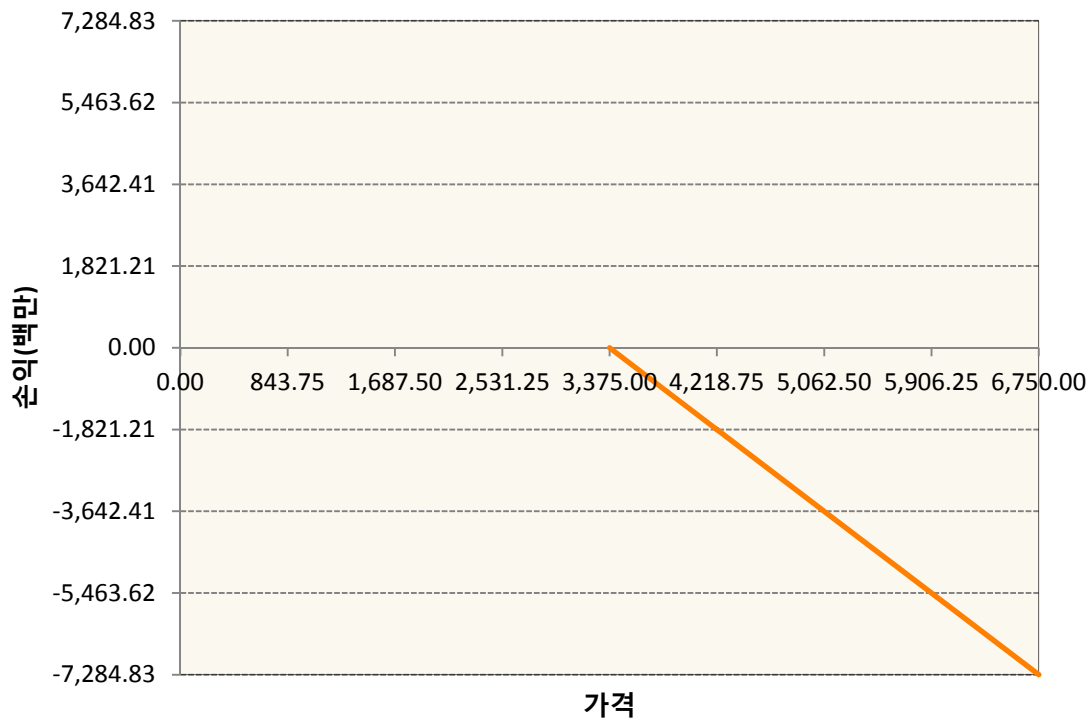
1. 계약금액

(단위:백만원)

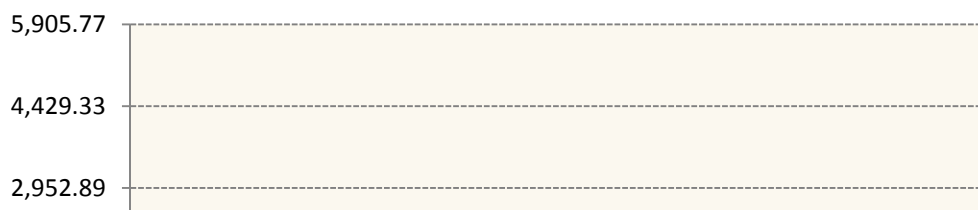
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,239	0	6,239	
누계	유가증권	스왑	60,296	0	60,296	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,381	-26,381	장내
누계	통화	선도	0	15,326	-15,326	장외

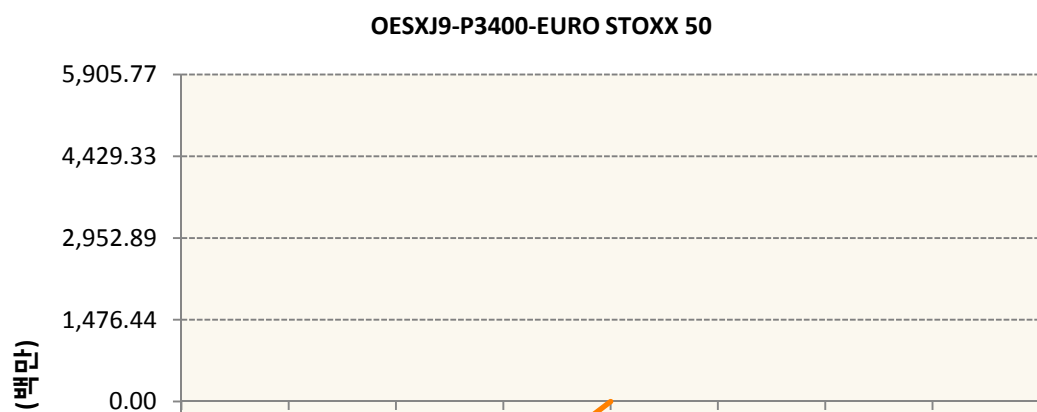
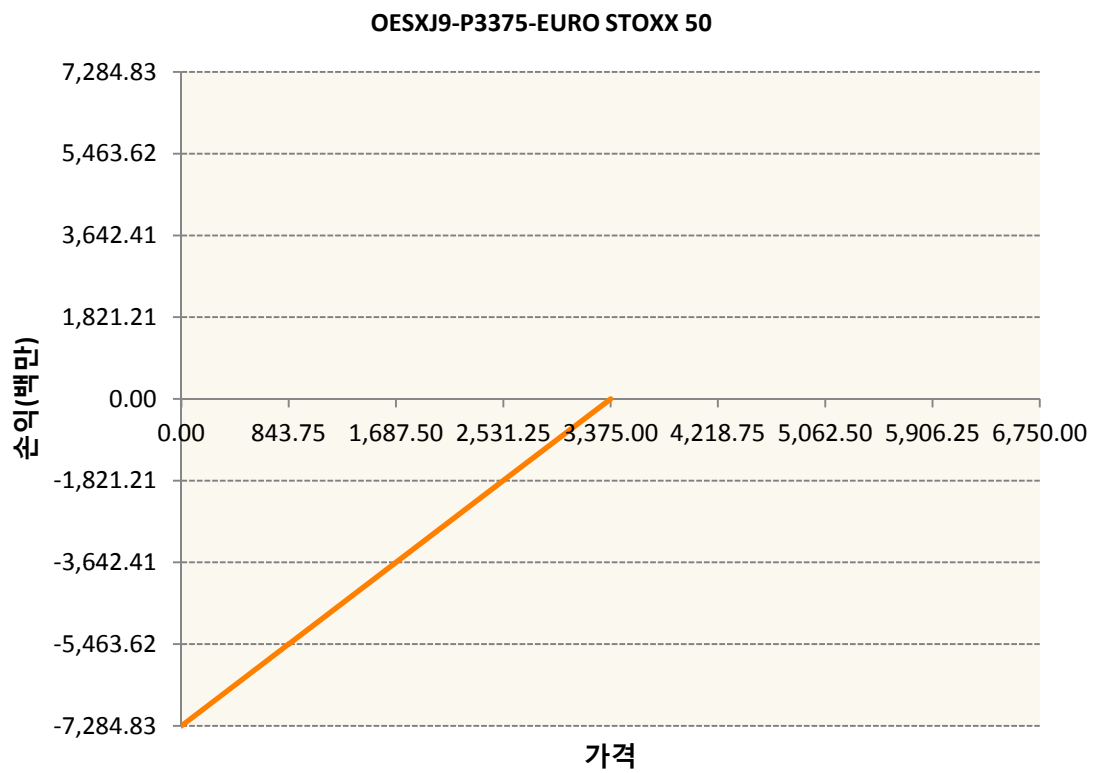
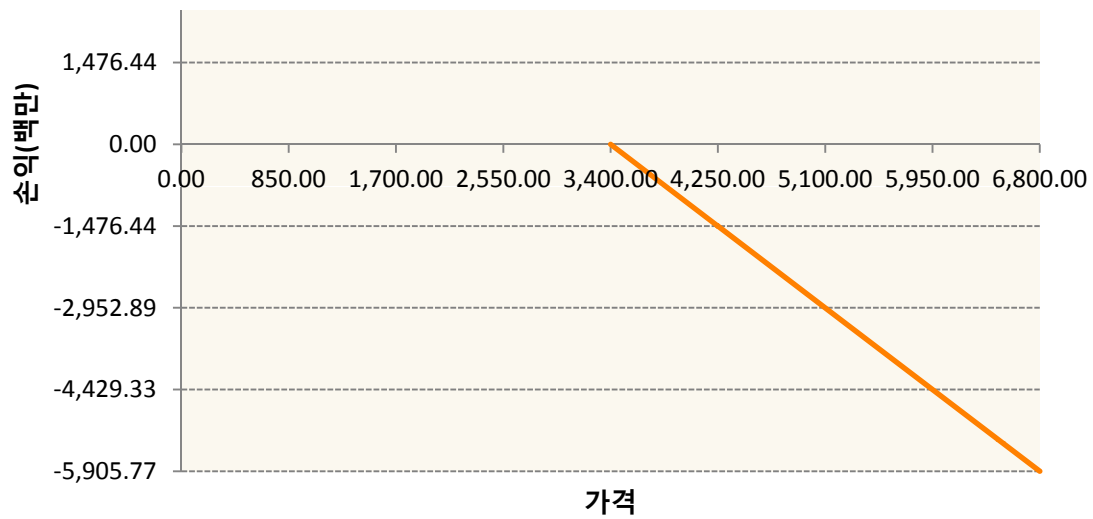
2. 만기시점의 손익구조

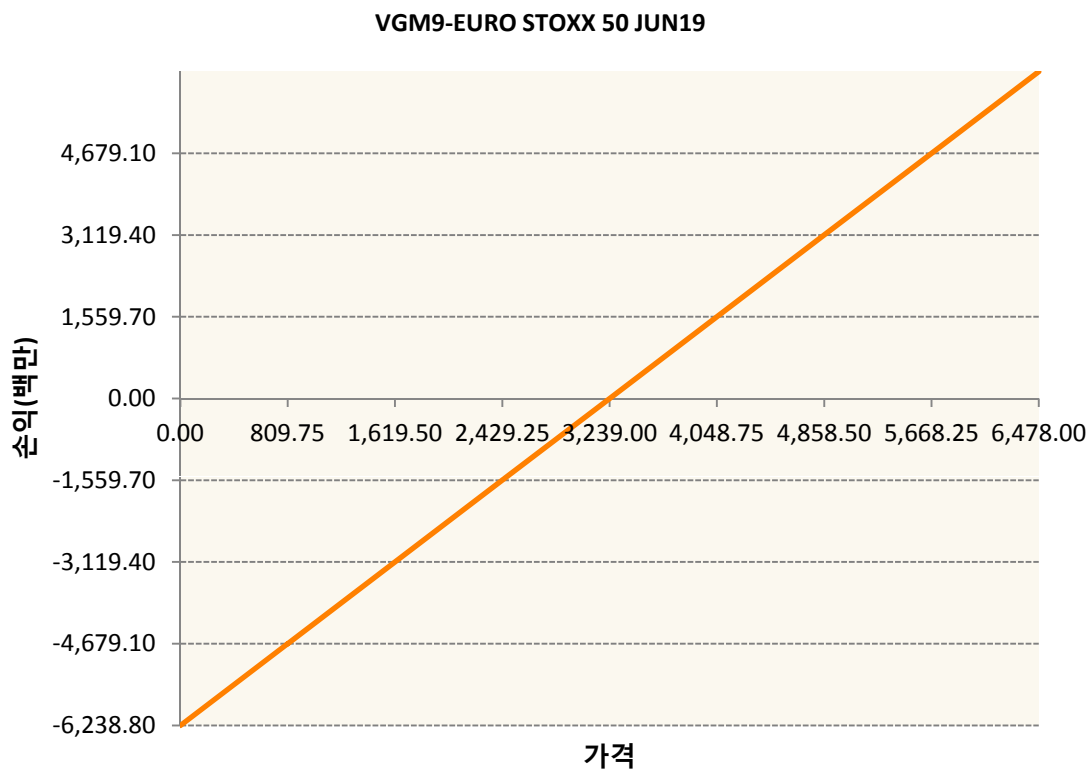
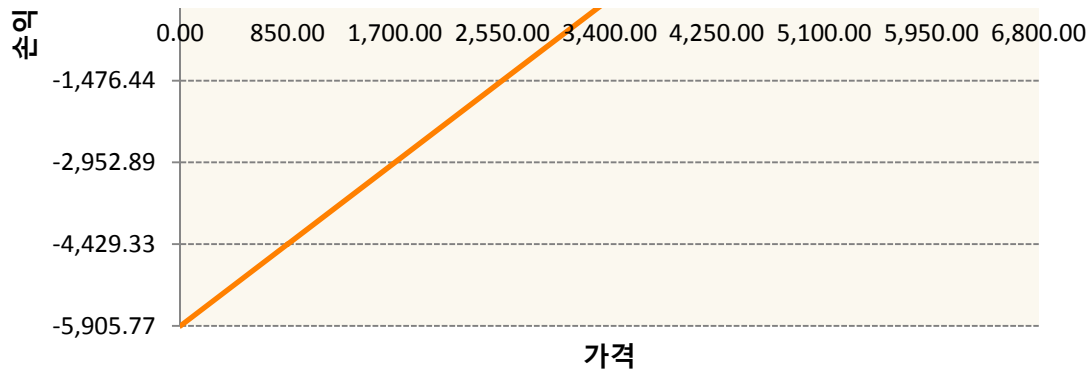
OESXJ9-C3375-EURO STOXX 50



OESXJ9-C3400-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY		77
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E		409
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E		817
OESXJ9-C33` EURO STOXX 50		583
OESXJ9-C34` EURO STOXX 50		472
OESXJ9-P33` EURO STOXX 50		583
OESXJ9-P34` EURO STOXX 50		472
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19		499

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

(단위:백만원)

2,585

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

(단위:백만원)

1,097

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

(단위:백만원)

94

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

(단위:백만원)

136

공시일	2019-03-28
기준일	2019-03-27

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

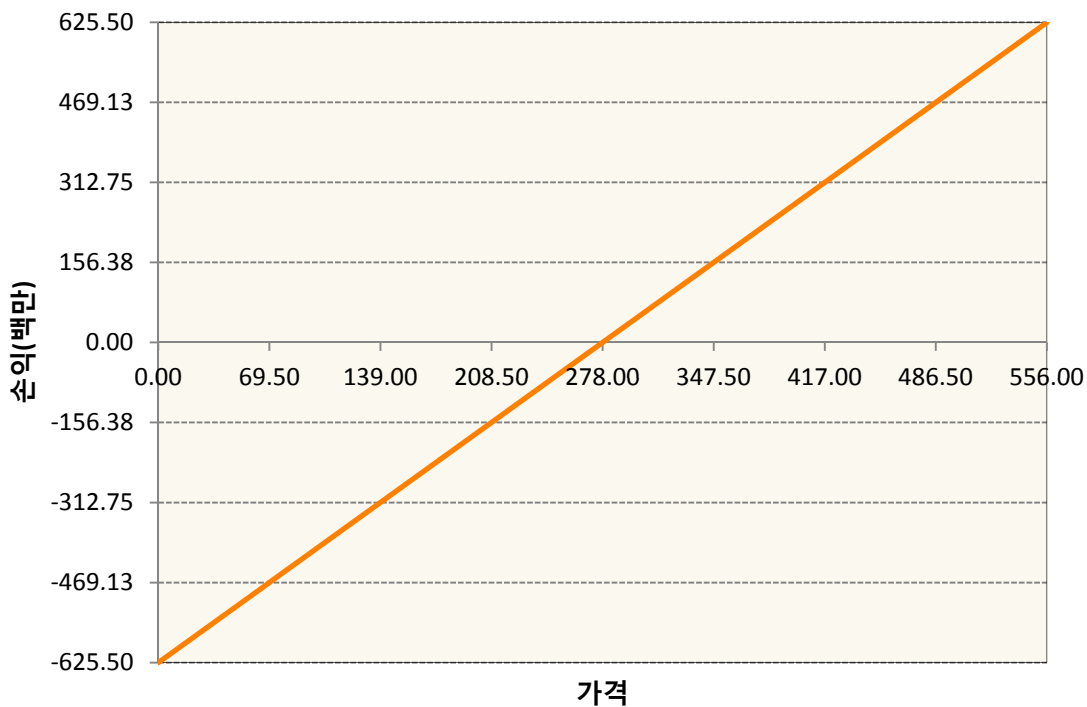
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	626	0	626	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P60004				2019-06 코스피200지수선물				50
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
-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%	33	33	33	33	33	33	33	
8.00%	50	50	50	50	50	50	50	

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

(단위:백만원)

42

공시일	2019-03-28
기준일	2019-03-27

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

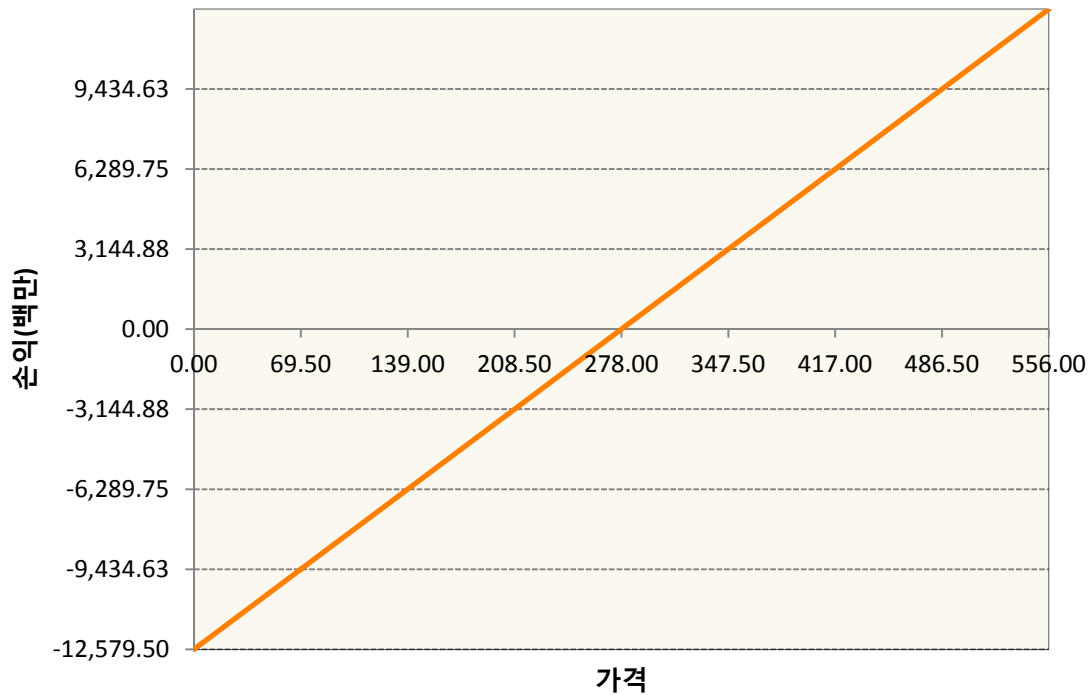
1. 계약금액

(단위:백만원)

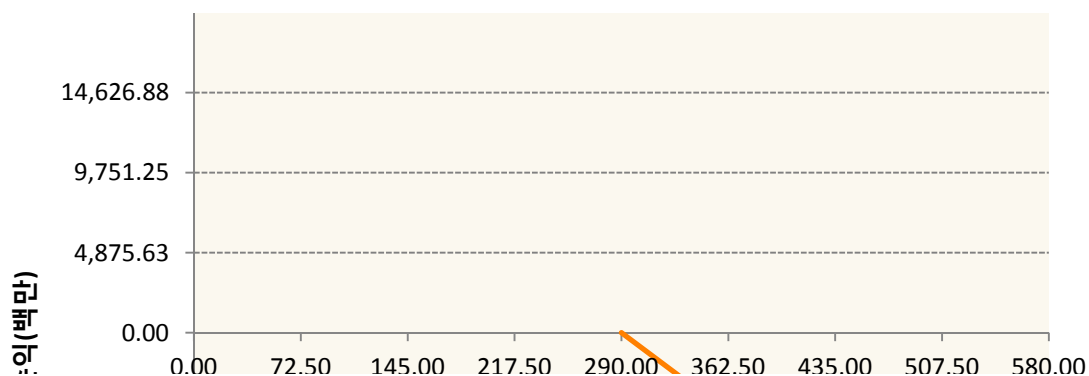
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,580	0	12,580	장내
누계	유가증권	옵션	1,867	24,036	-22,169	장내

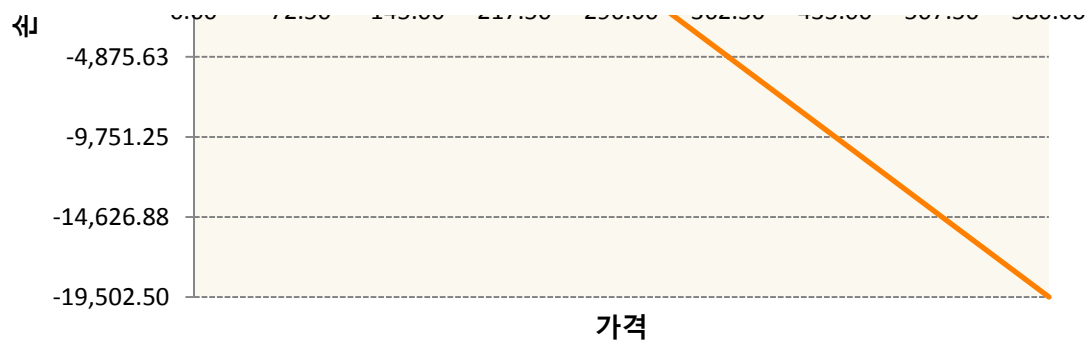
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

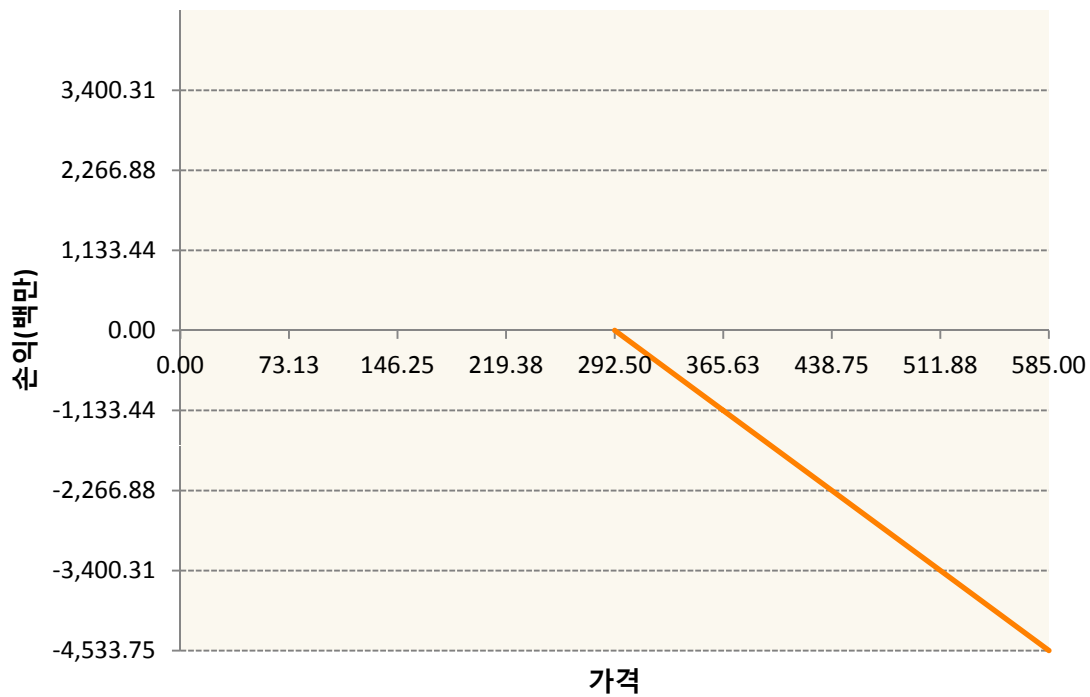


KR4201P42901-2019-04 콜290

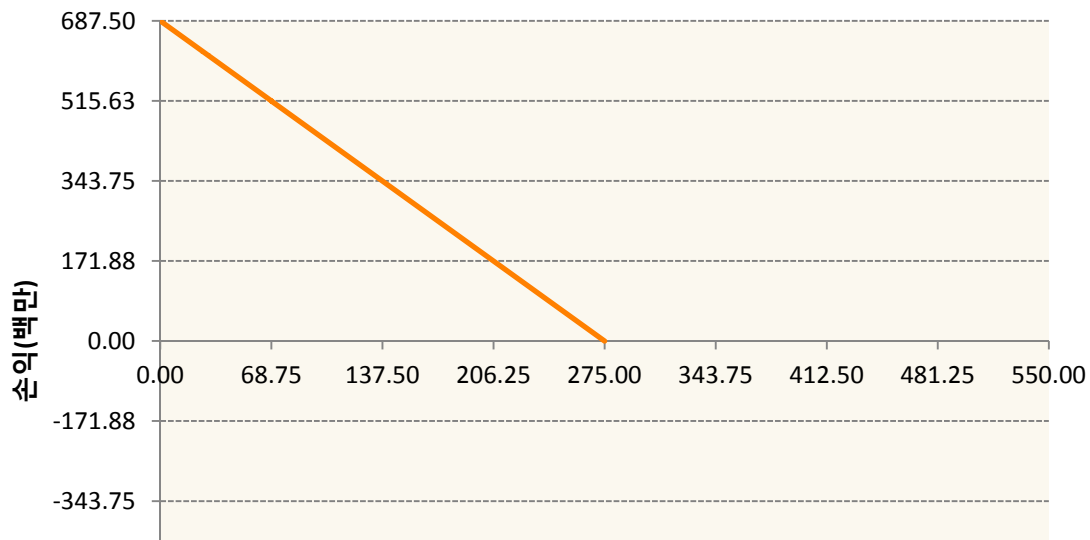


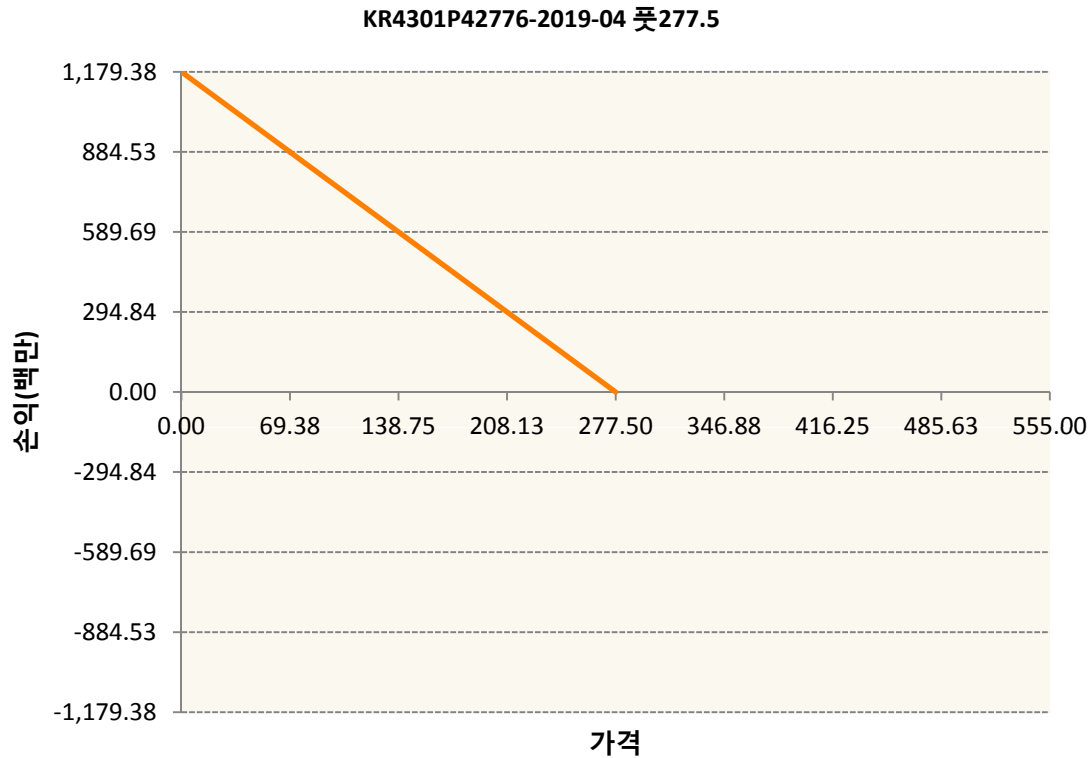
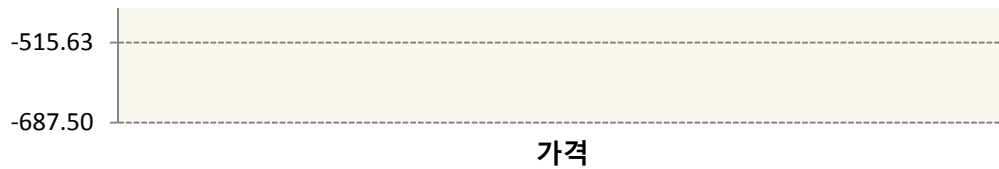


KR4201P42927-2019-04 콜 292.5



KR4301P42750-2019-04 풋 275





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
-5.33%	-669	-669	-669	-669	-669	-669	-669
-2.67%	-335	-335	-335	-335	-335	-335	-335
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	335	335	335	335	335	335	335
5.33%	669	669	669	669	669	669	669
8.00%	1,004	1,004	1,004	1,004	1,004	1,004	1,004
KR4201P42901			2019-04 콜290				785
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	107	107	106	105	103	100	96
-5.33%	106	104	101	97	91	83	74
-2.67%	98	90	81	69	56	40	23

0%	61	42	22	0	-23	-48	-74
2.67%	-48	-78	-109	-140	-172	-203	-236
5.33%	-270	-304	-338	-371	-405	-439	-473
8.00%	-615	-641	-668	-696	-725	-754	-785
KR4201P42927 2019-04 콜292.5							162
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	18	18	18	18	18	17	16
-5.33%	18	18	17	17	16	14	13
-2.67%	17	16	14	12	10	7	3
0%	11	8	4	0	-5	-10	-15
2.67%	-7	-13	-20	-26	-33	-40	-47
5.33%	-49	-57	-64	-72	-80	-88	-96
8.00%	-119	-126	-133	-140	-147	-155	-162
KR4301P42750 2019-04 풋275							44
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	44	44	44	44	44	44	44
-5.33%	26	26	26	26	26	27	27
-2.67%	9	9	10	10	11	12	12
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-5	-5	-5	-5	-4	-4	-3
5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-5	-5
8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
KR4301P42776 2019-04 풋277.5							81
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	81	81	81	81	81	81	81
-5.33%	49	49	49	50	50	50	51
-2.67%	19	20	20	21	22	23	24
0%	-4	-2	-1	0	1	2	4
2.67%	-13	-12	-12	-11	-10	-9	-8
5.33%	-15	-15	-14	-14	-14	-13	-13
8.00%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-14

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

(단위:백만원)

1,676

공시일	2019-03-28
기준일	2019-03-27

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	2,565	0	2,565	

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	2019-03-28
기준일	2019-03-27

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	7,862	0	7,862	

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	2019-03-28
기준일	2019-03-27

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	60,110	0	60,110	
누계	통화	선도	0	79,097	-79,097	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		25
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		427
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		182
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E		454
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E		526

FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E

319

FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E

272

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

(단위:백만원)

2,211

공시일	2019-03-28
기준일	2019-03-27

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

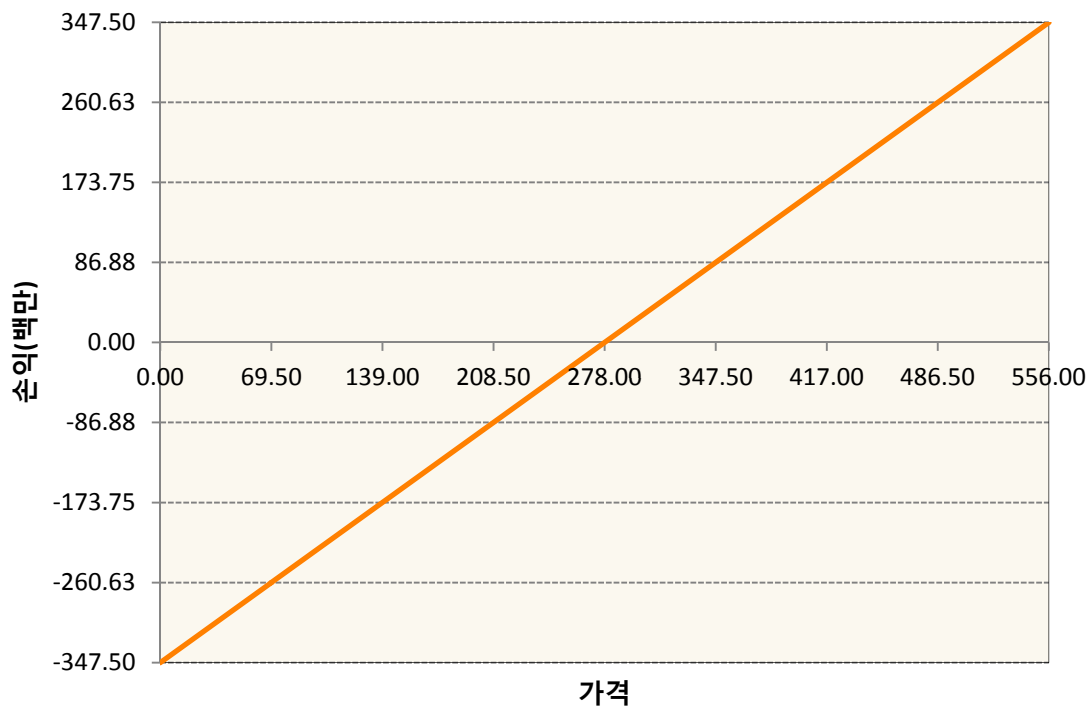
1. 계약금액

(단위:백만원)

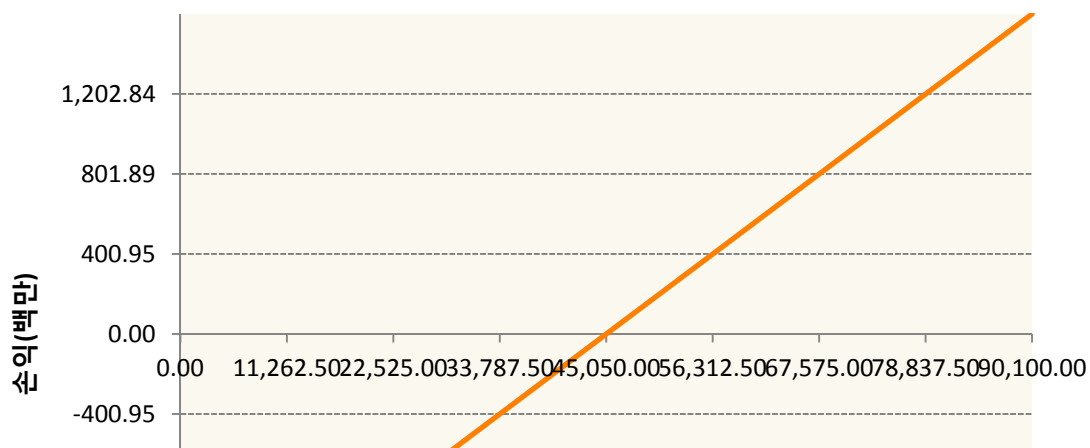
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,951	0	1,951	장내

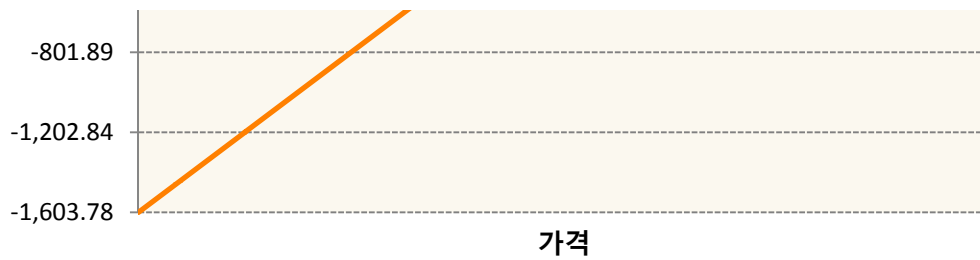
2. 만기시점의 손익구조

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					129
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-129	-129	-129	-129	-129	-129	-129
-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%	129	129	129	129	129	129	129

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

177

공시일	2019-03-28
기준일	2019-03-27

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

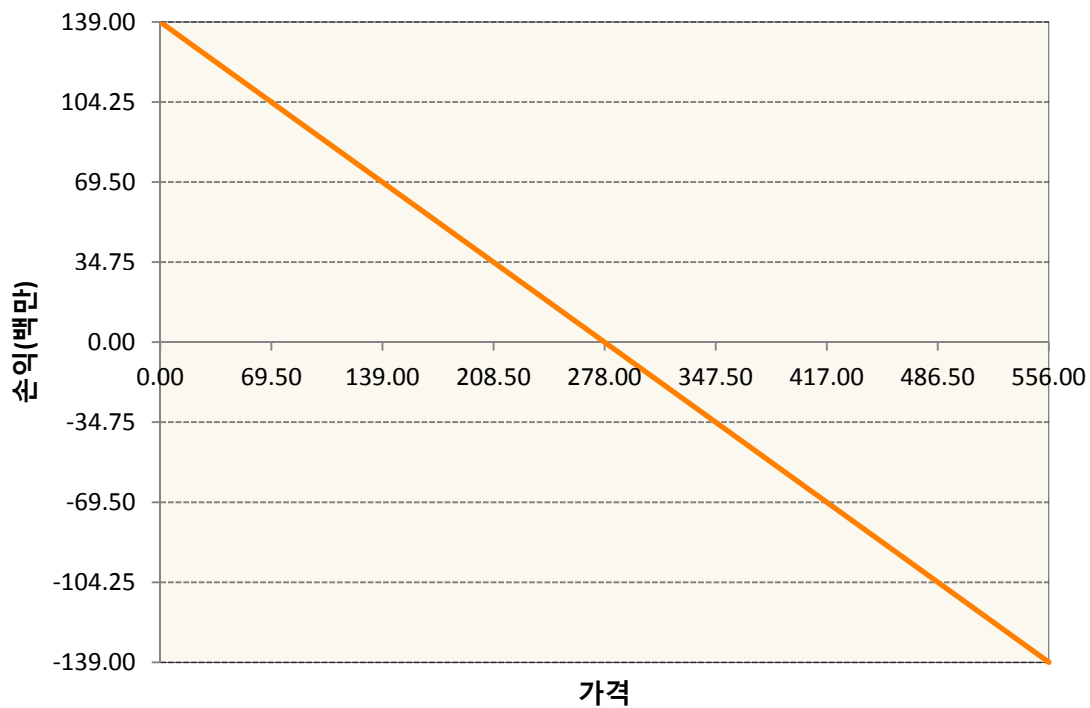
1. 계약금액

(단위:백만원)

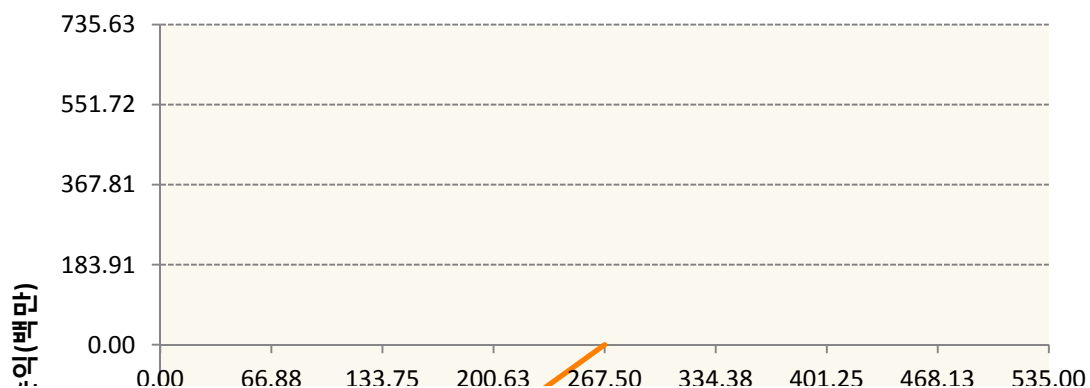
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	134	-134	장내
누계	유가증권	선물	0	139	-139	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,208	-1,208	장내

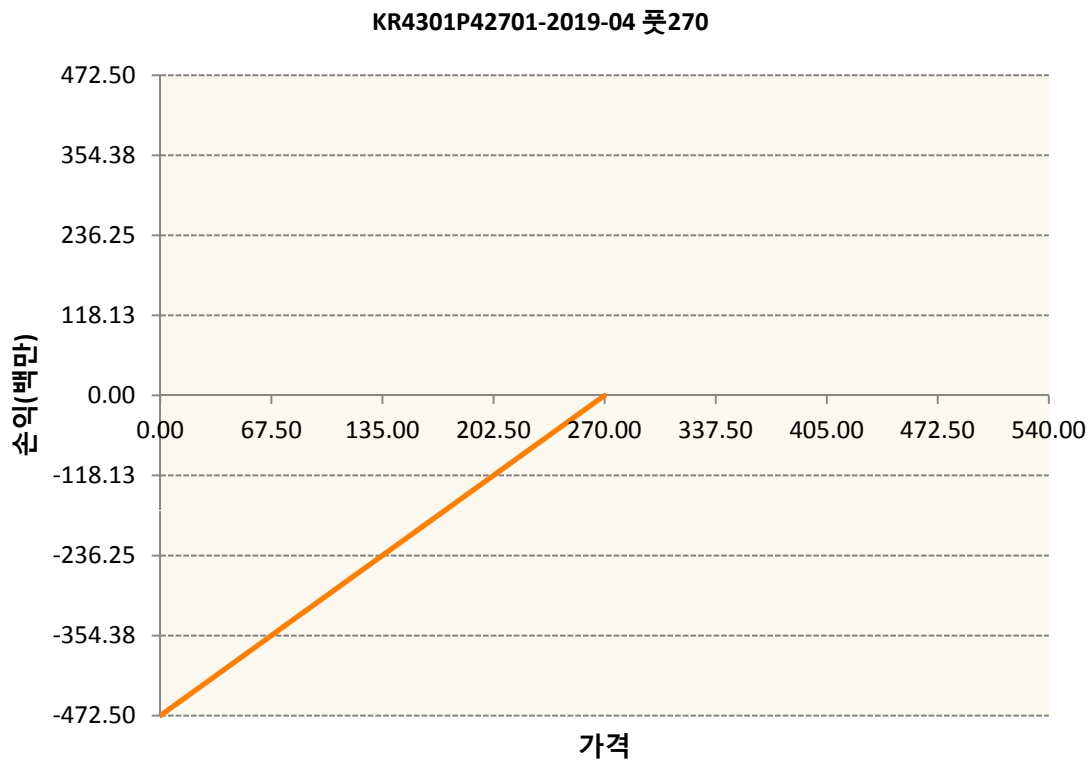
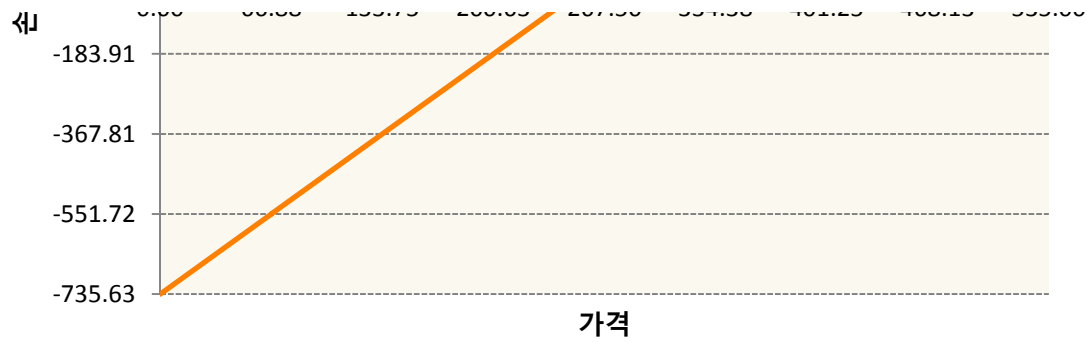
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4301P42677-2019-04 풋267.5





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		34
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-33	-33	-33	-33	-34	-34	-34
-5.33%	-14	-15	-16	-16	-17	-17	-18
-2.67%	-3	-3	-4	-5	-5	-6	-7
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%	-25	-25	-25	-25	-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%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	2	2	2	2	1	1	1
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

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

(단위:백만원)

57

공시일	2019-03-28
기준일	2019-03-27

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

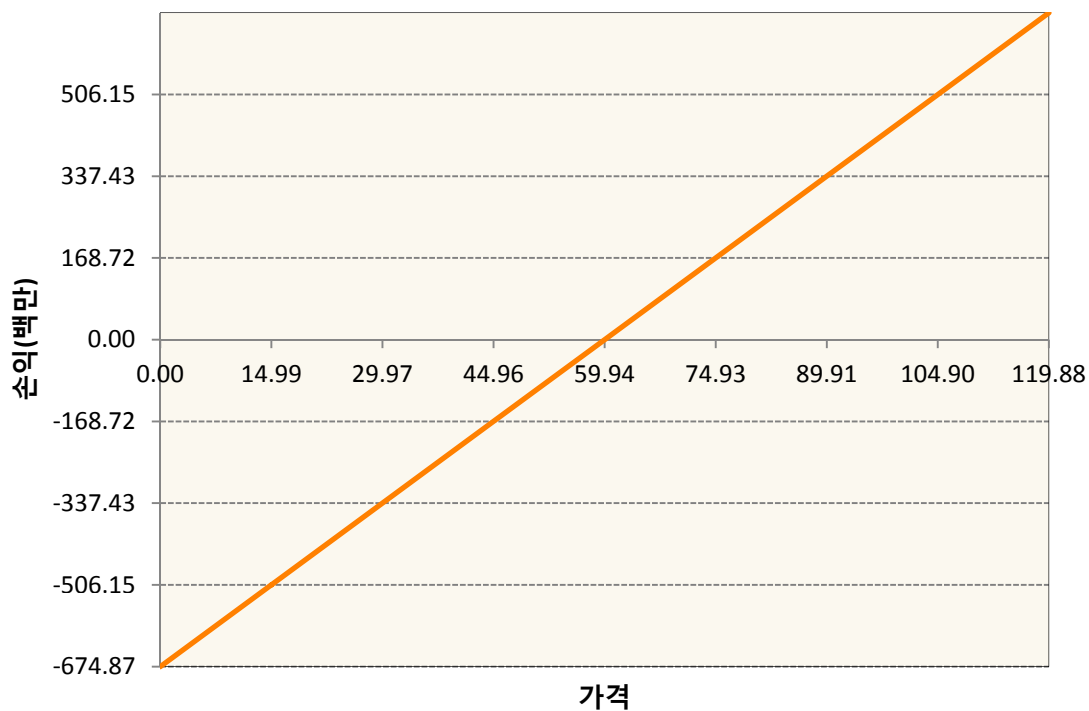
1. 계약금액

(단위:백만원)

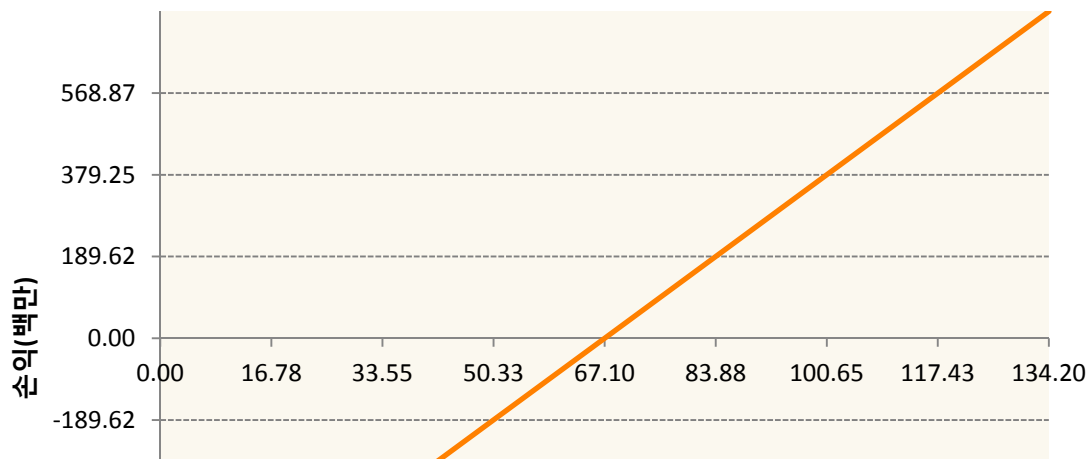
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,879	283	2,595	

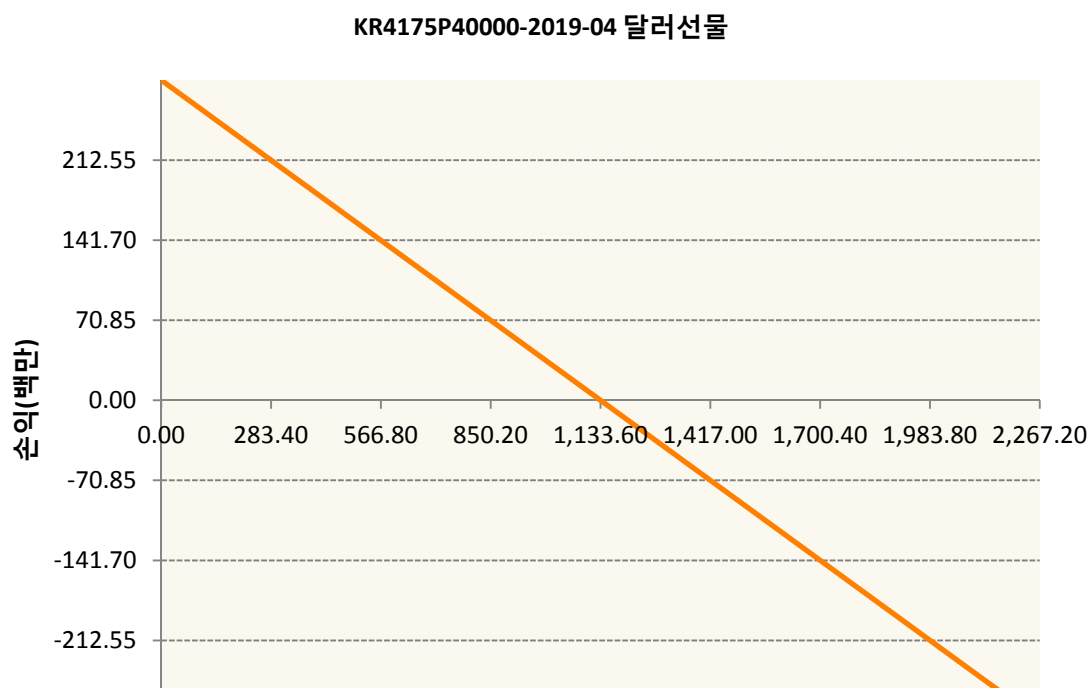
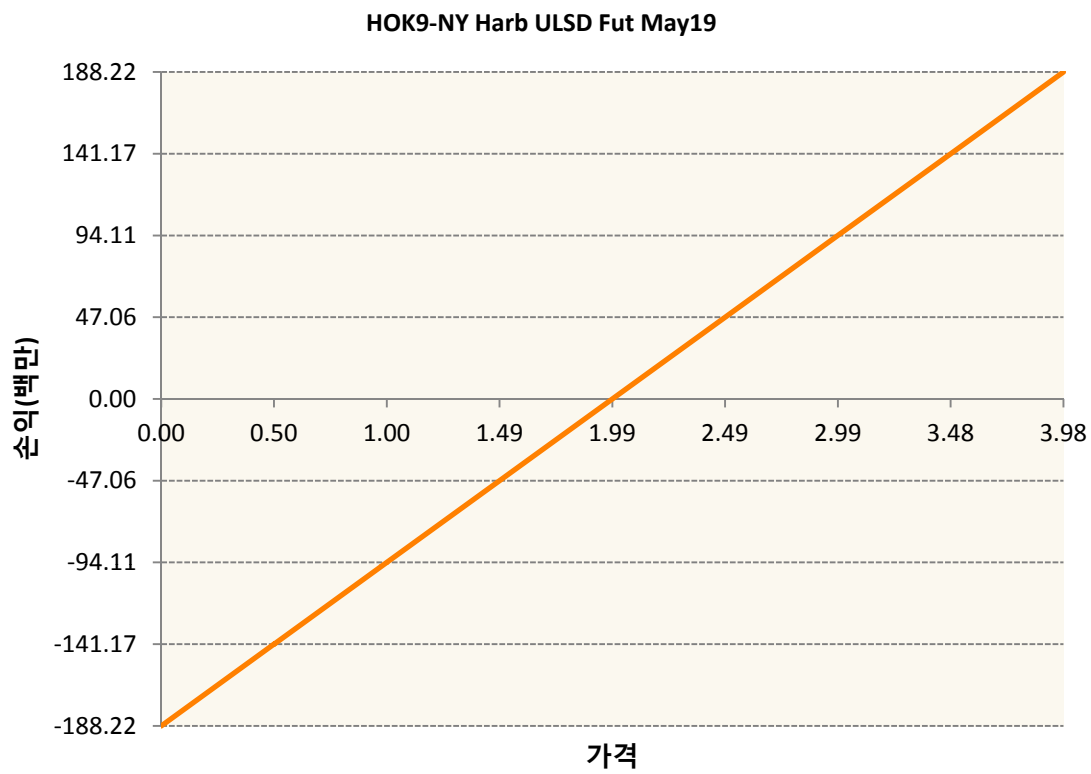
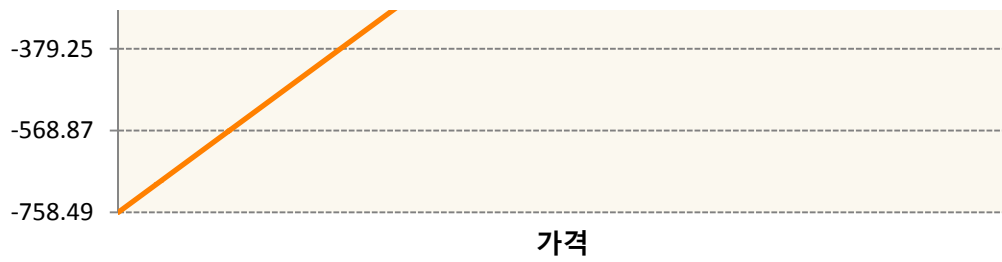
2. 만기시점의 손익구조

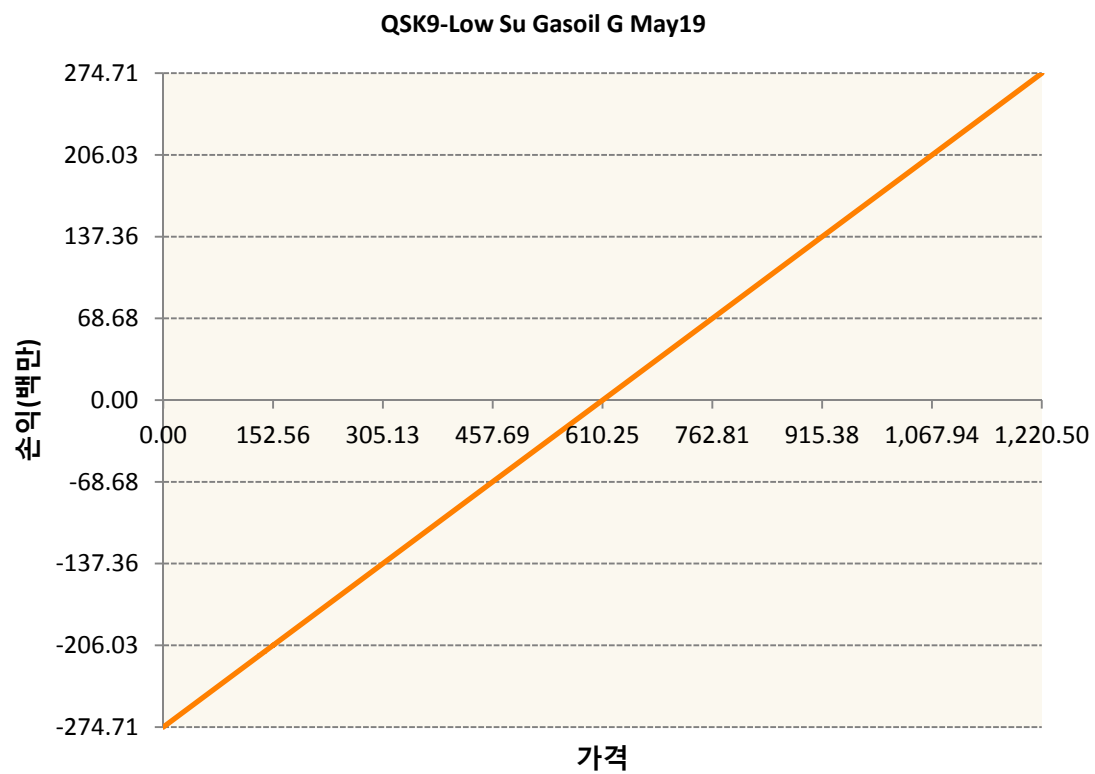
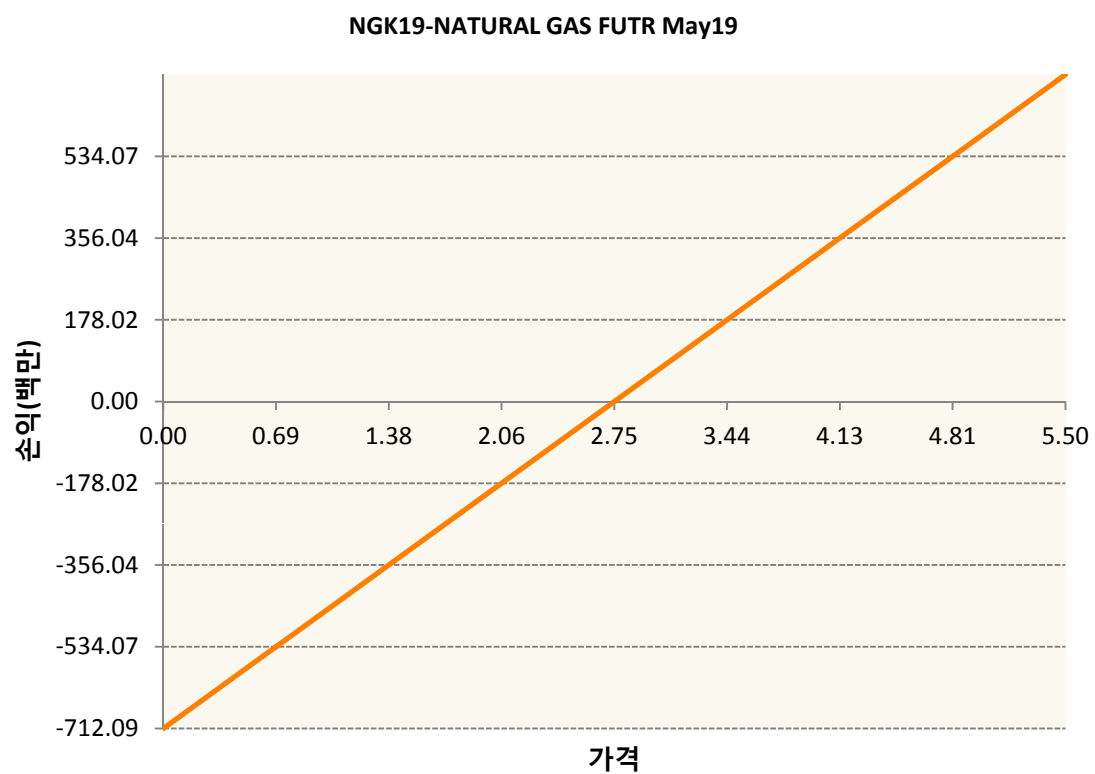
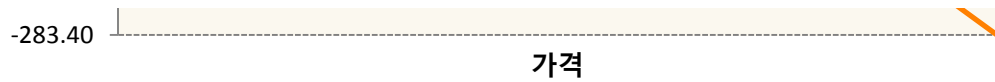
CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19

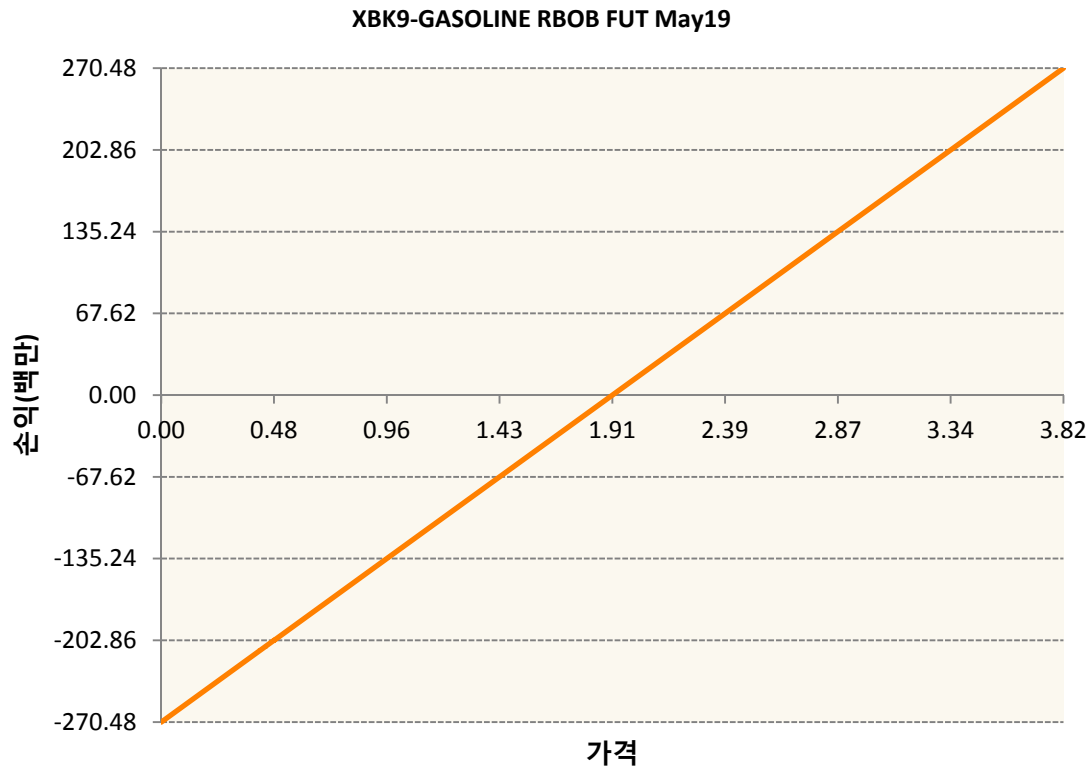


CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19









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	57
QSK9	Low Su Gasoil G May19	22
XBK9	GASOLINE RBOB FUT May19	22

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

(단위:백만원)

436

공시일	2019-03-28
기준일	2019-03-27

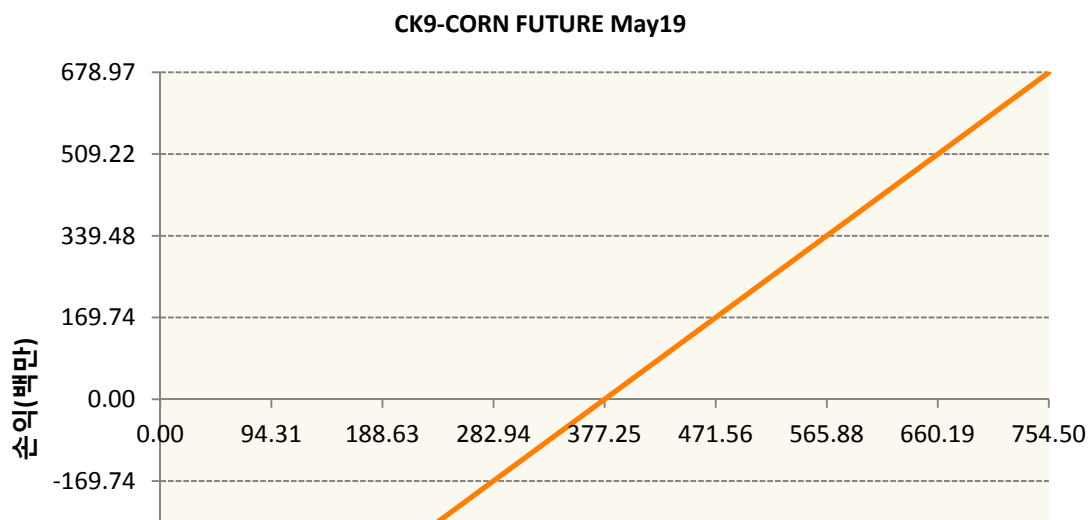
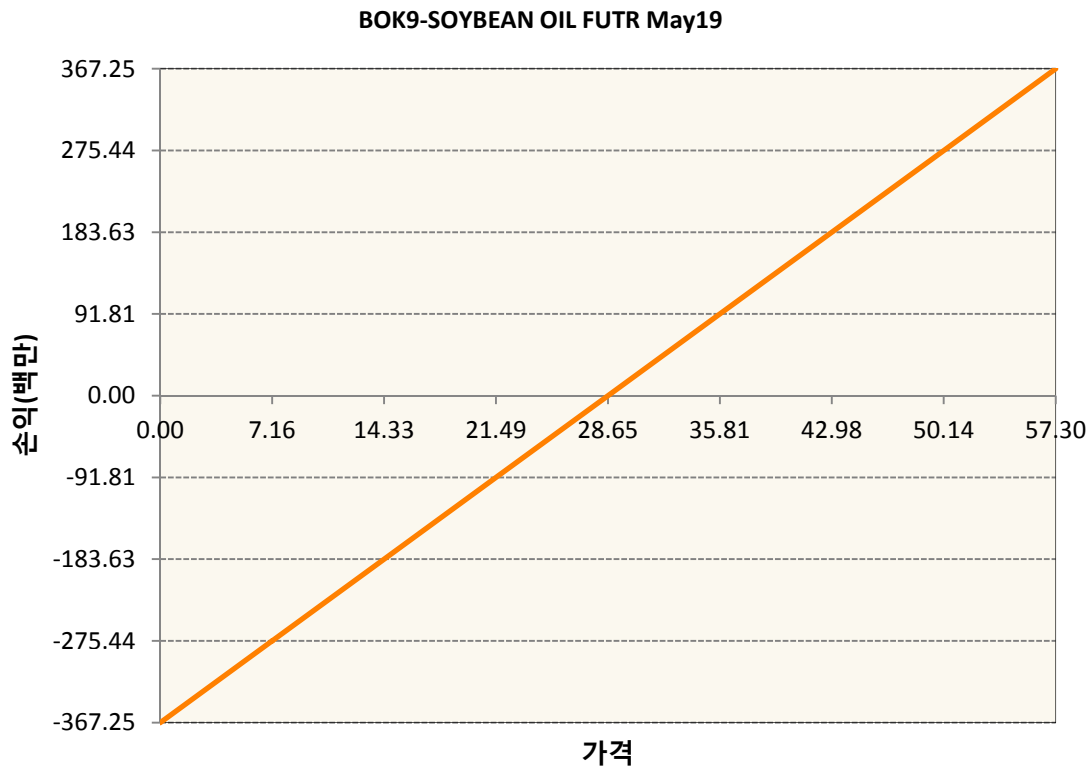
애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

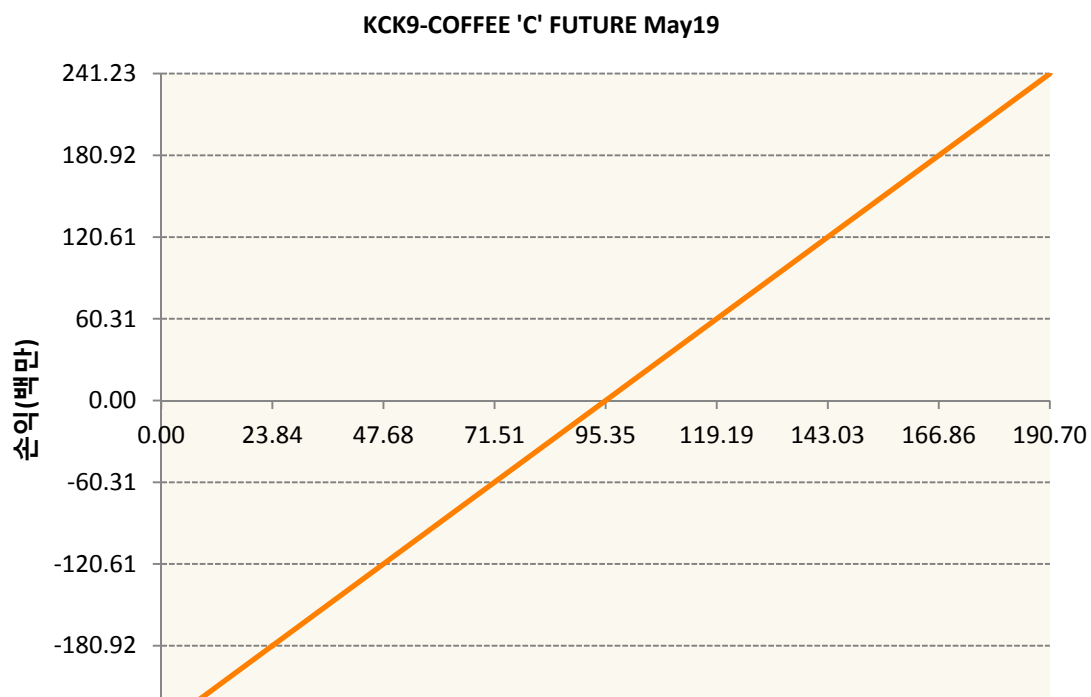
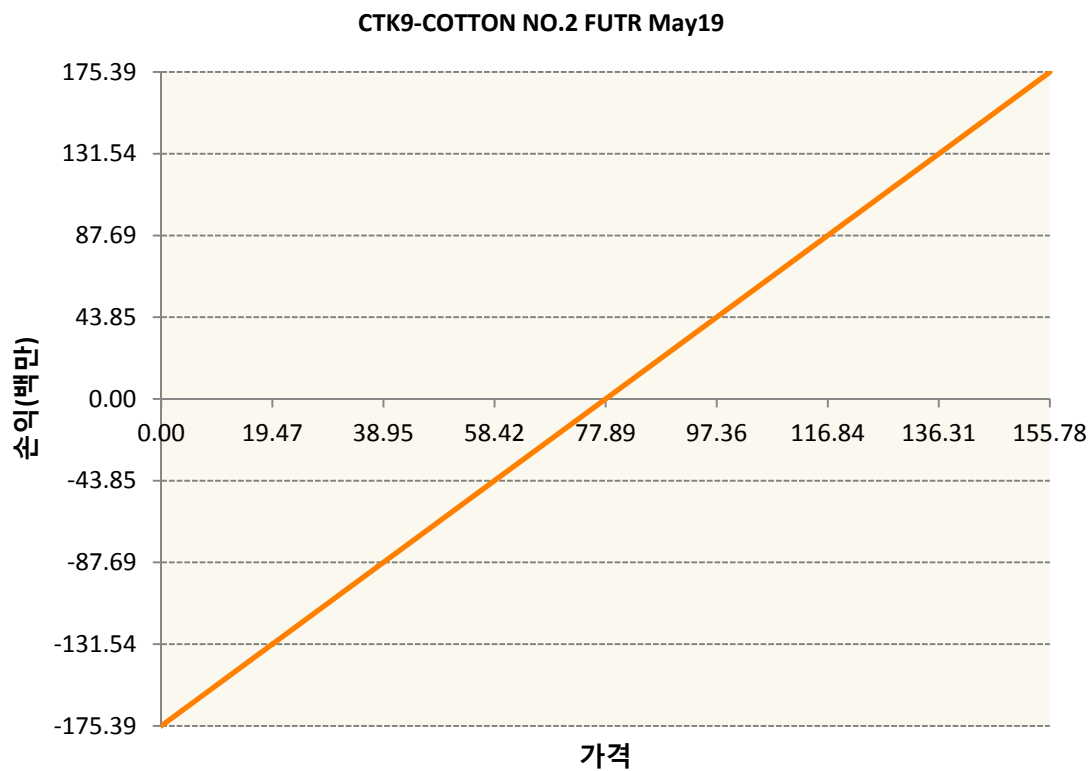
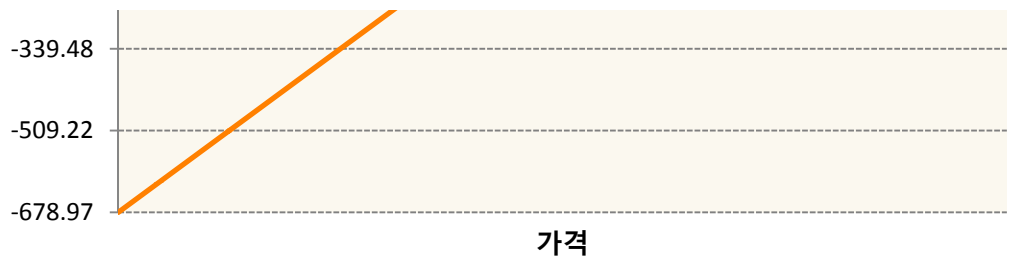
1. 계약금액

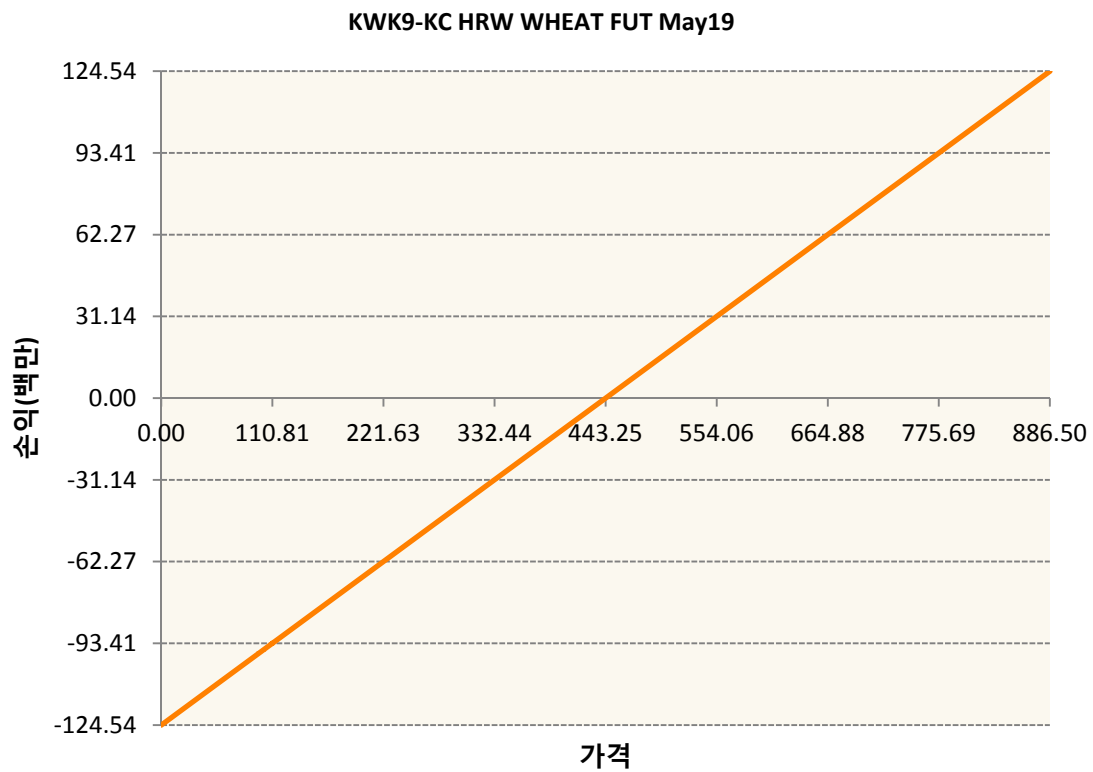
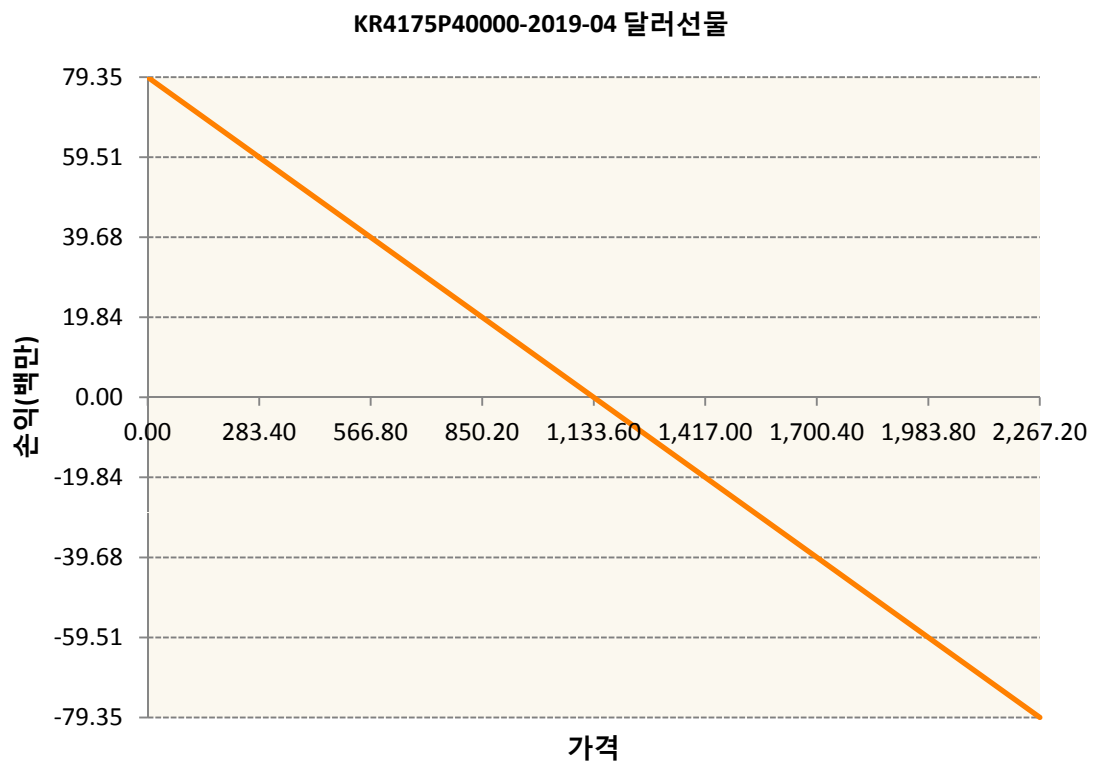
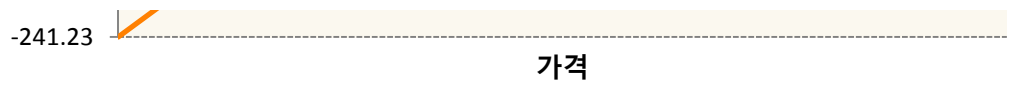
(단위:백만원)

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	

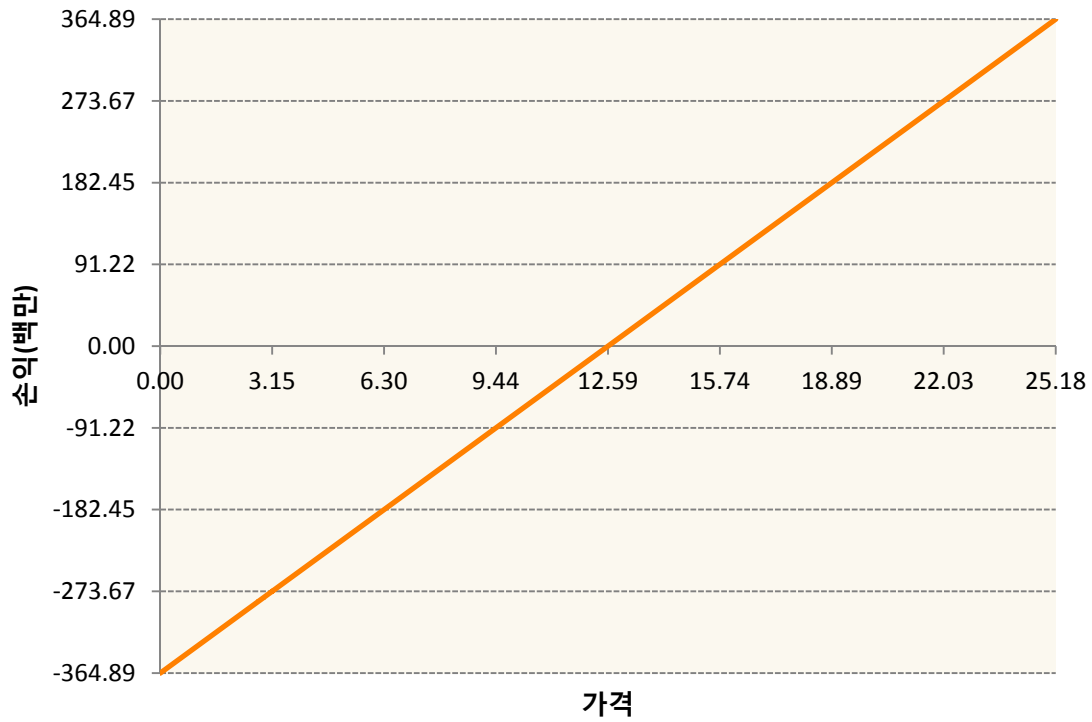
2. 만기시점의 손익구조



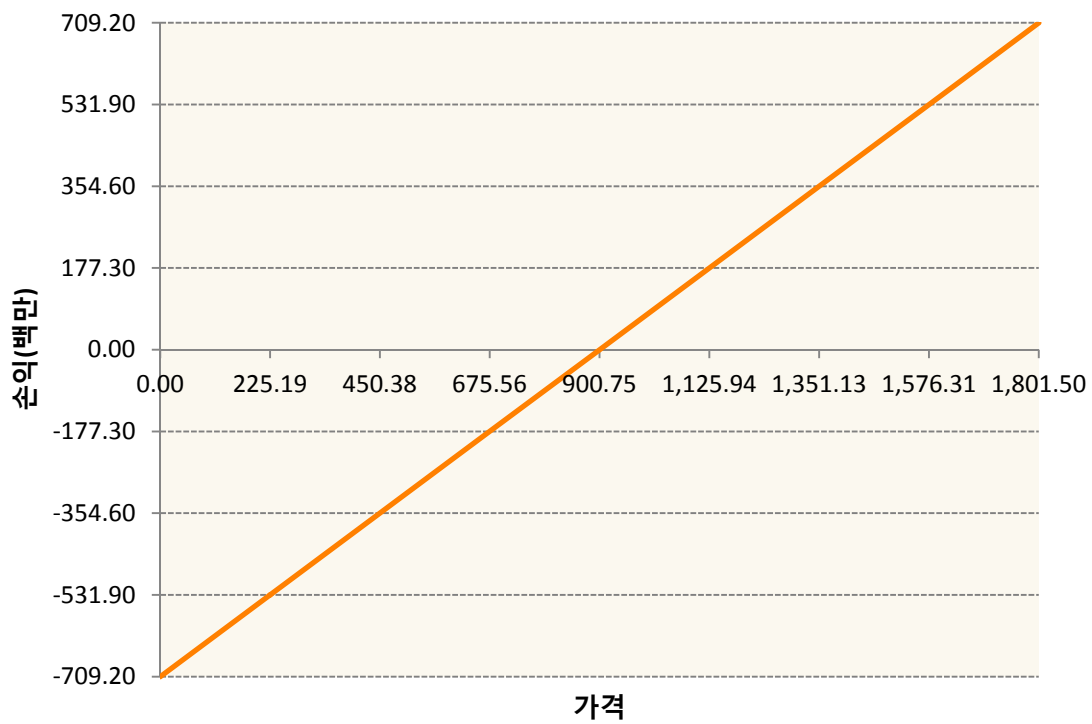




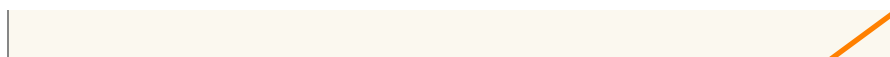
SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

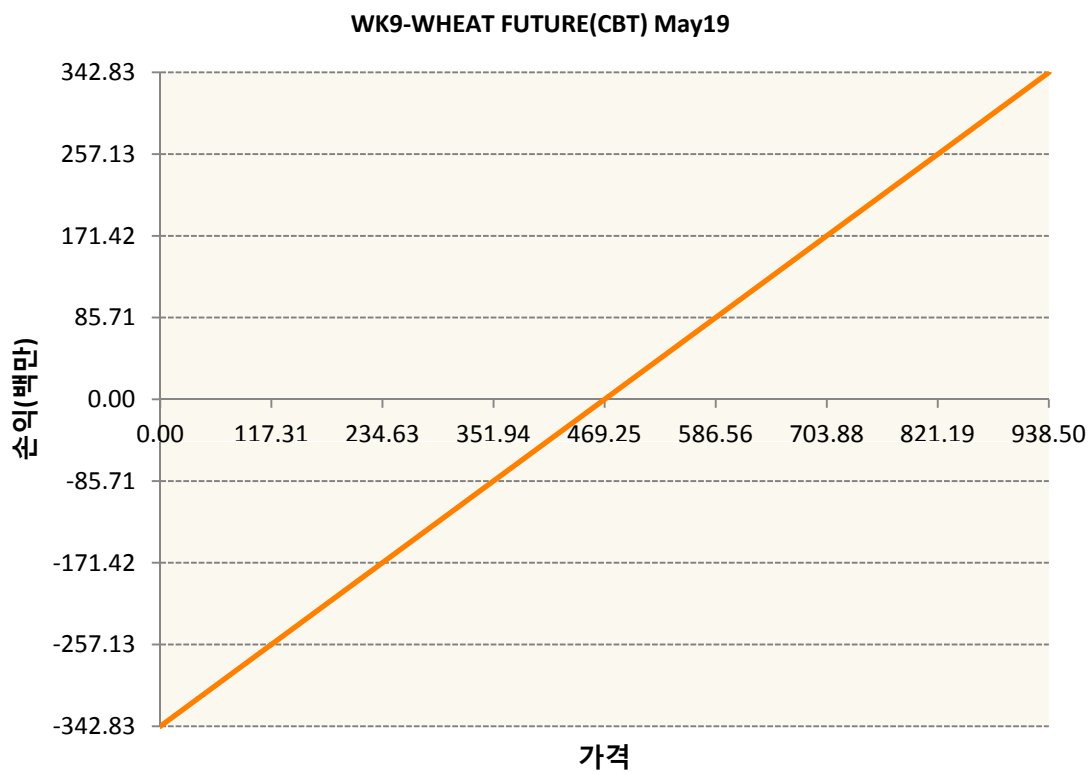
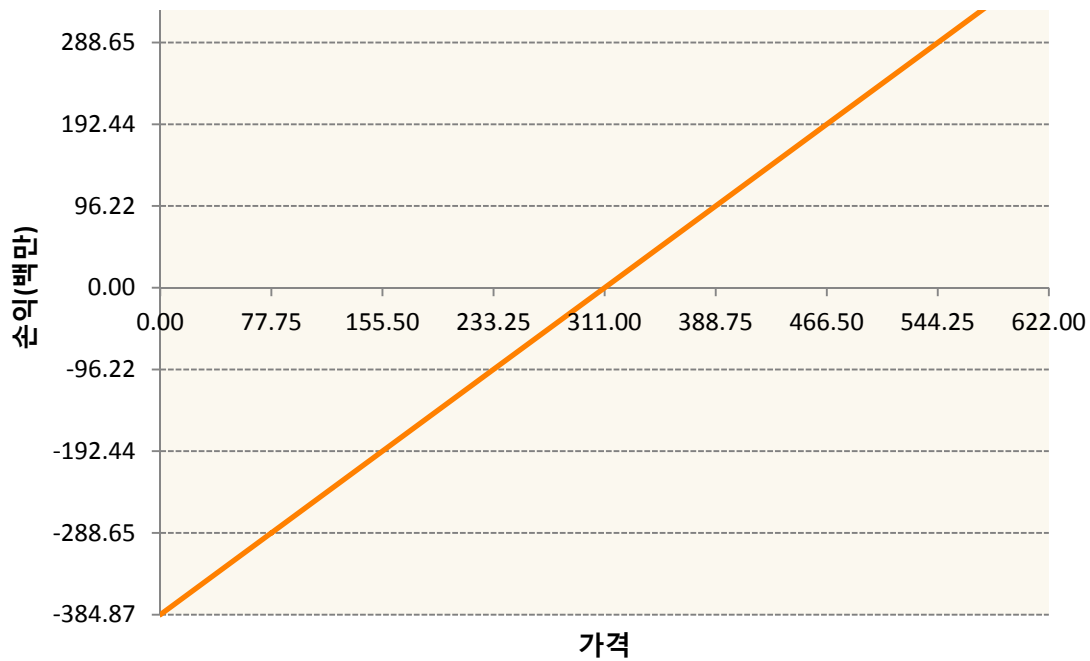


SK9-SOYBEAN FUTURE May19



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