

공시일	2019-03-29
기준일	2019-03-28

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)

93

공시일	2019-03-29
기준일	2019-03-28

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)

657

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-03-29
기준일	2019-03-28

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)	335
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	92
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	157

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

925

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-03-29
기준일	2019-03-28

유로인덱스모(주식-파생형)

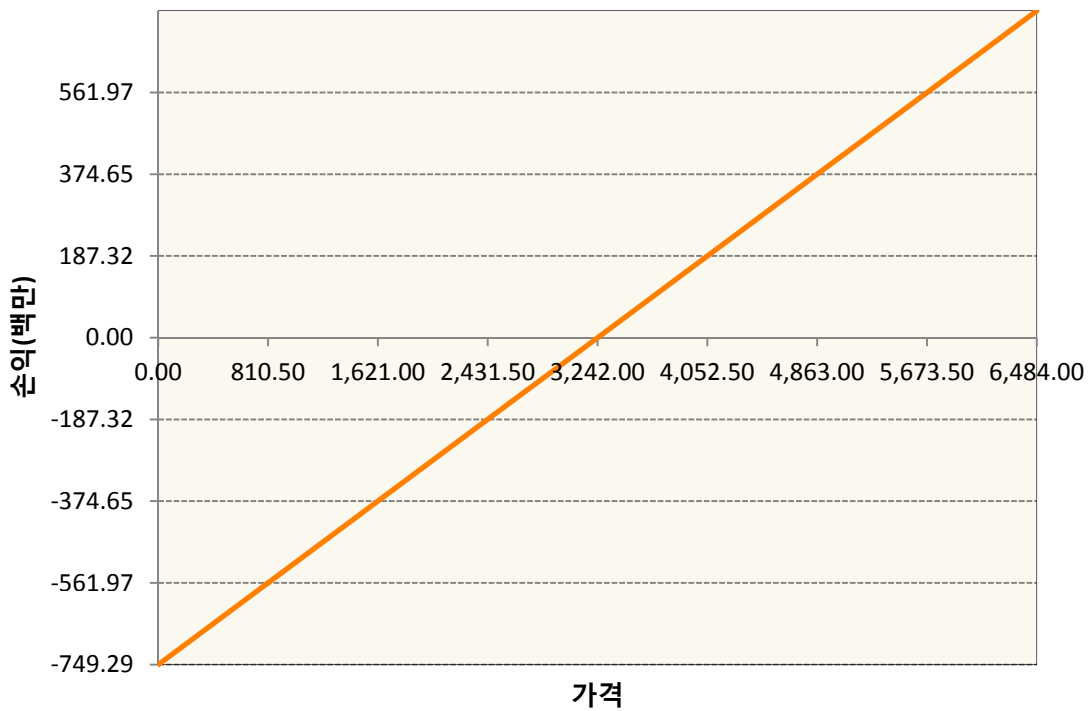
1. 계약금액

(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	2019-03-29
기준일	2019-03-28

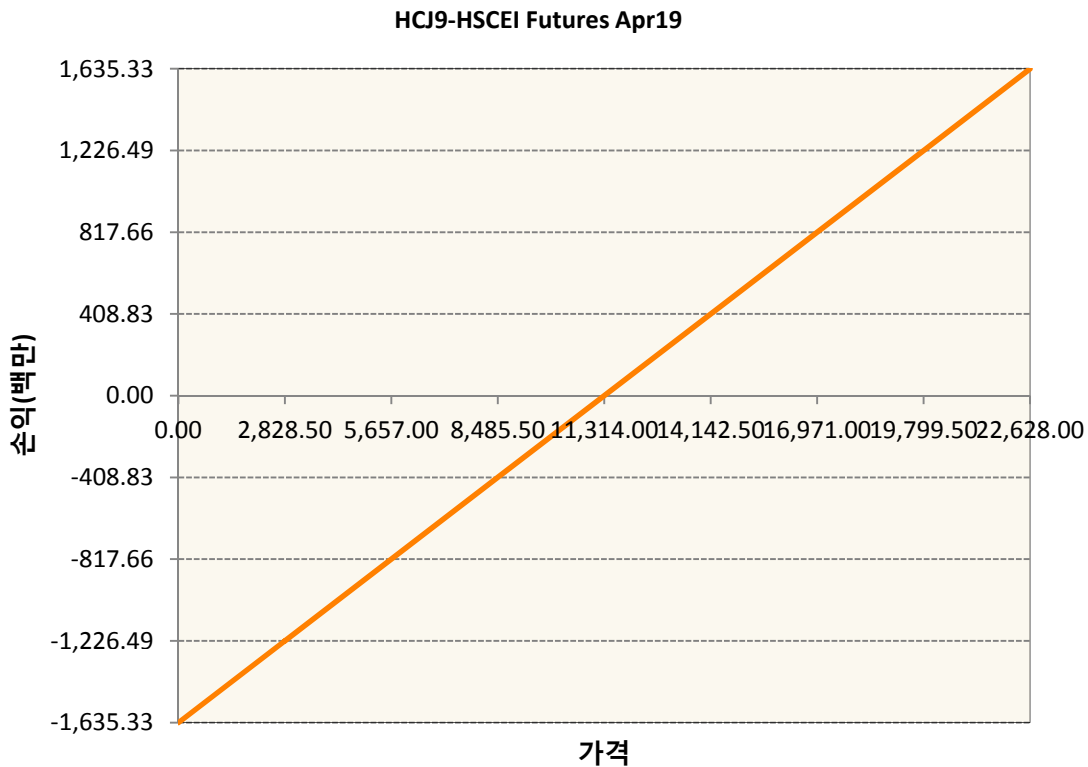
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,635	0	1,635	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ9	HSCEI Futures Apr19	131
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

134

공시일	2019-03-29
기준일	2019-03-28

커버드콜모(주식혼합-파생형)

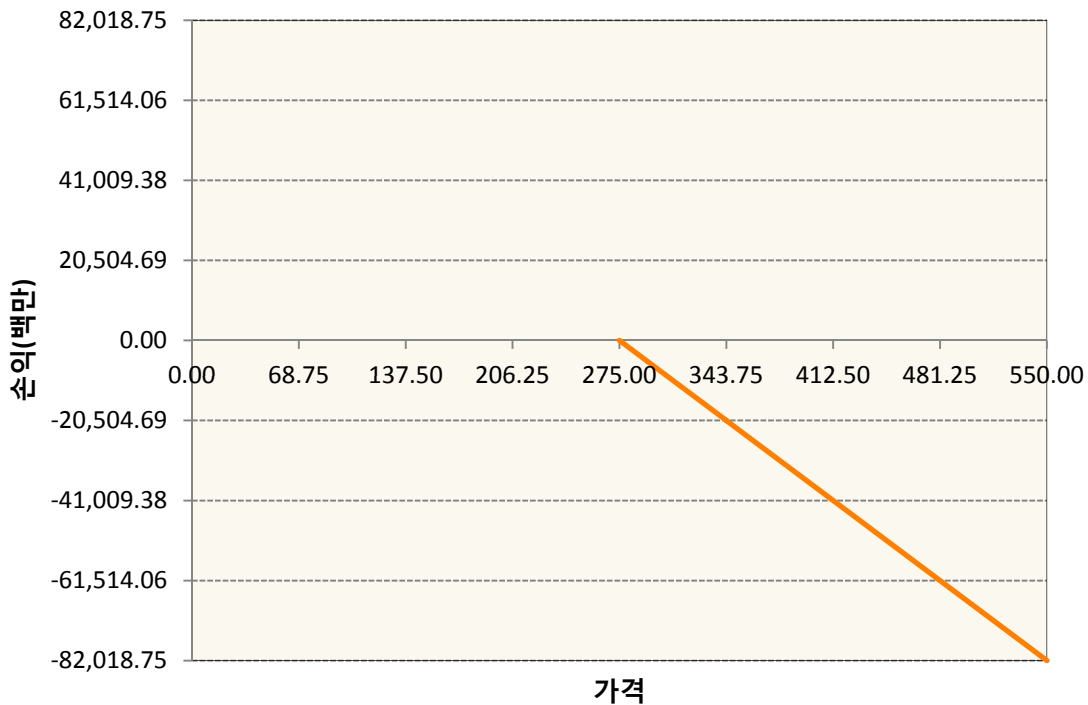
1. 계약금액

(단위:백만원)

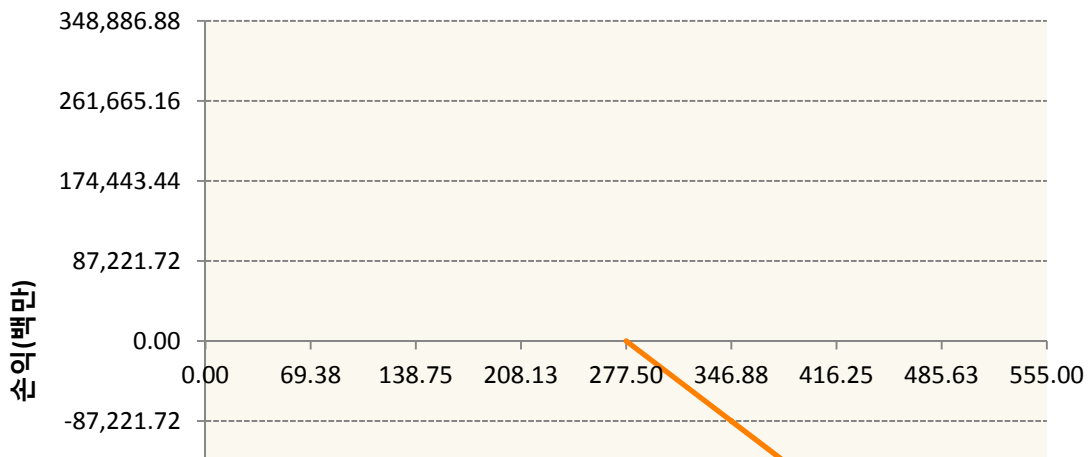
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	668,968	-668,968	장내

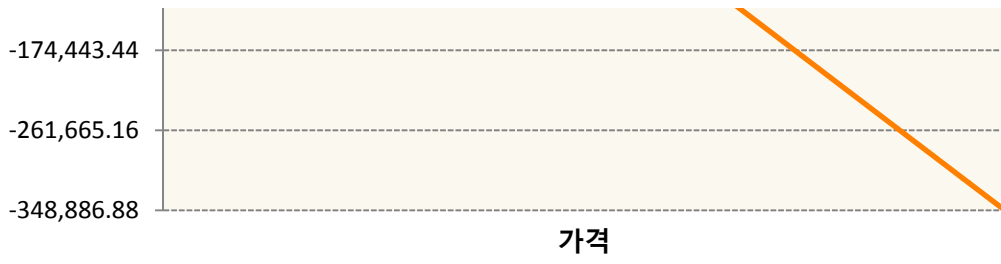
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P42752-2019-04 콜275

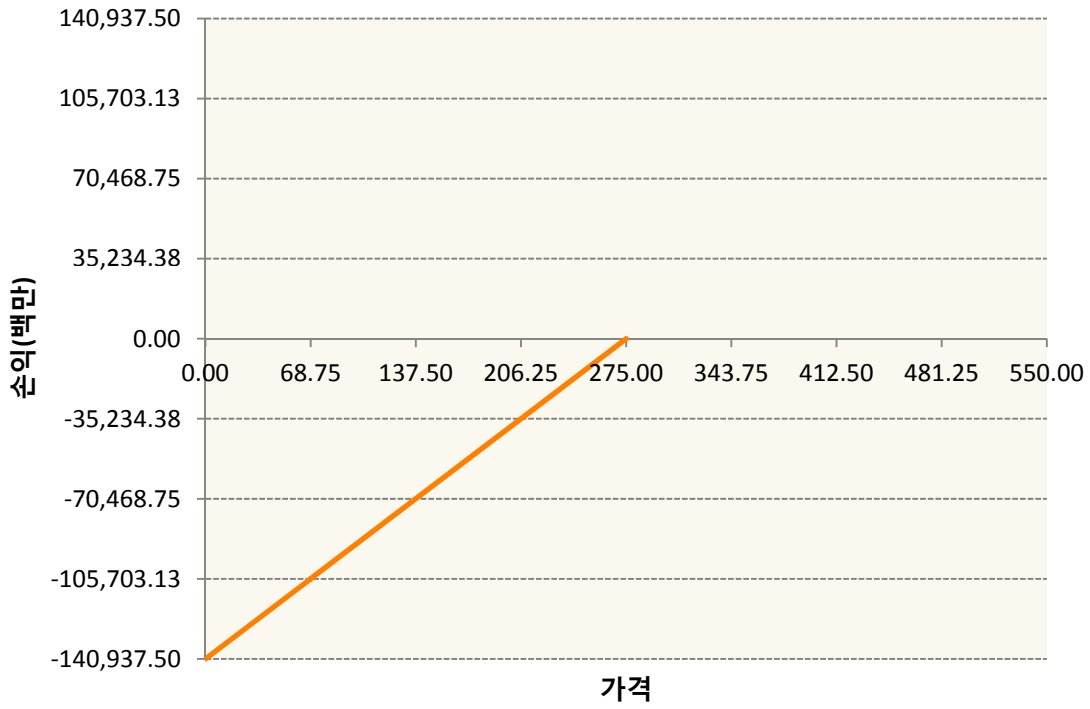


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

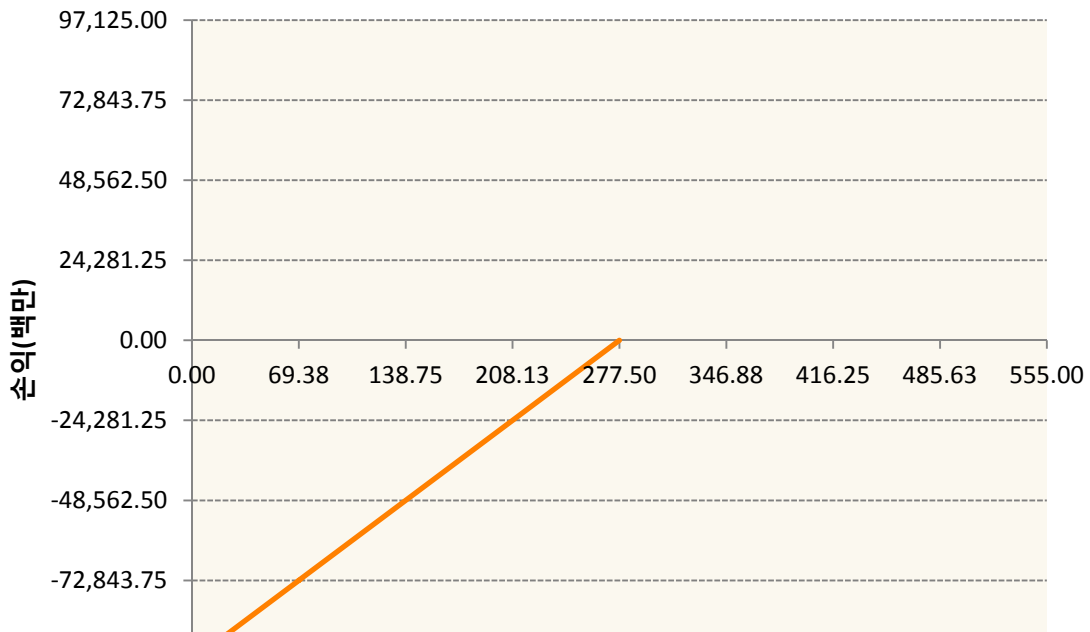




KR4301P42750-2019-04 풋275



KR4301P42776-2019-04 풋277.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P42752		2019-04 콜275						5,214
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,599	1,586	1,566	1,539	1,505	1,464	1,415	
-5.33%	1,522	1,473	1,415	1,349	1,275	1,195	1,109	
-2.67%	1,207	1,103	994	882	766	649	530	
0%	402	268	134	0	-134	-268	-402	
2.67%	-1,006	-1,114	-1,226	-1,343	-1,462	-1,583	-1,706	
5.33%	-2,875	-2,932	-2,998	-3,073	-3,155	-3,244	-3,338	
8.00%	-4,970	-4,990	-5,018	-5,055	-5,100	-5,153	-5,214	
KR4201P42778		2019-04 콜277.5						20,658
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5,342	5,309	5,254	5,174	5,067	4,931	4,768	
-5.33%	5,154	5,009	4,825	4,604	4,349	4,065	3,754	
-2.67%	4,264	3,899	3,504	3,086	2,648	2,195	1,729	
0%	1,666	1,113	558	0	-559	-1,120	-1,681	
2.67%	-3,415	-3,937	-4,468	-5,006	-5,549	-6,097	-6,649	
5.33%	-10,729	-11,046	-11,400	-11,785	-12,196	-12,627	-13,076	
8.00%	-19,319	-19,448	-19,618	-19,827	-20,072	-20,350	-20,658	
KR4301P42750		2019-04 풋275						9,611
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-9,589	-9,589	-9,590	-9,592	-9,596	-9,602	-9,611	
-5.33%	-5,840	-5,849	-5,865	-5,886	-5,915	-5,951	-5,994	
-2.67%	-2,249	-2,321	-2,402	-2,490	-2,584	-2,684	-2,788	
0%	419	279	140	0	-140	-279	-419	
2.67%	1,486	1,410	1,326	1,233	1,134	1,030	922	
5.33%	1,663	1,650	1,630	1,603	1,567	1,524	1,474	
8.00%	1,674	1,673	1,671	1,667	1,660	1,650	1,635	
KR4301P42776		2019-04 풋277.5						6,936
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-6,928	-6,929	-6,929	-6,929	-6,930	-6,932	-6,936	
-5.33%	-4,365	-4,367	-4,372	-4,380	-4,391	-4,406	-4,426	
-2.67%	-1,847	-1,876	-1,913	-1,955	-2,004	-2,057	-2,114	
0%	271	181	91	0	-92	-184	-277	
2.67%	1,362	1,287	1,210	1,129	1,046	961	874	

5.33%	1,614	1,595	1,570	1,538	1,500	1,457	1,409
8.00%	1,637	1,635	1,632	1,626	1,617	1,604	1,587

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

(단위:백만원)

45,585

공시일	2019-03-29
기준일	2019-03-28

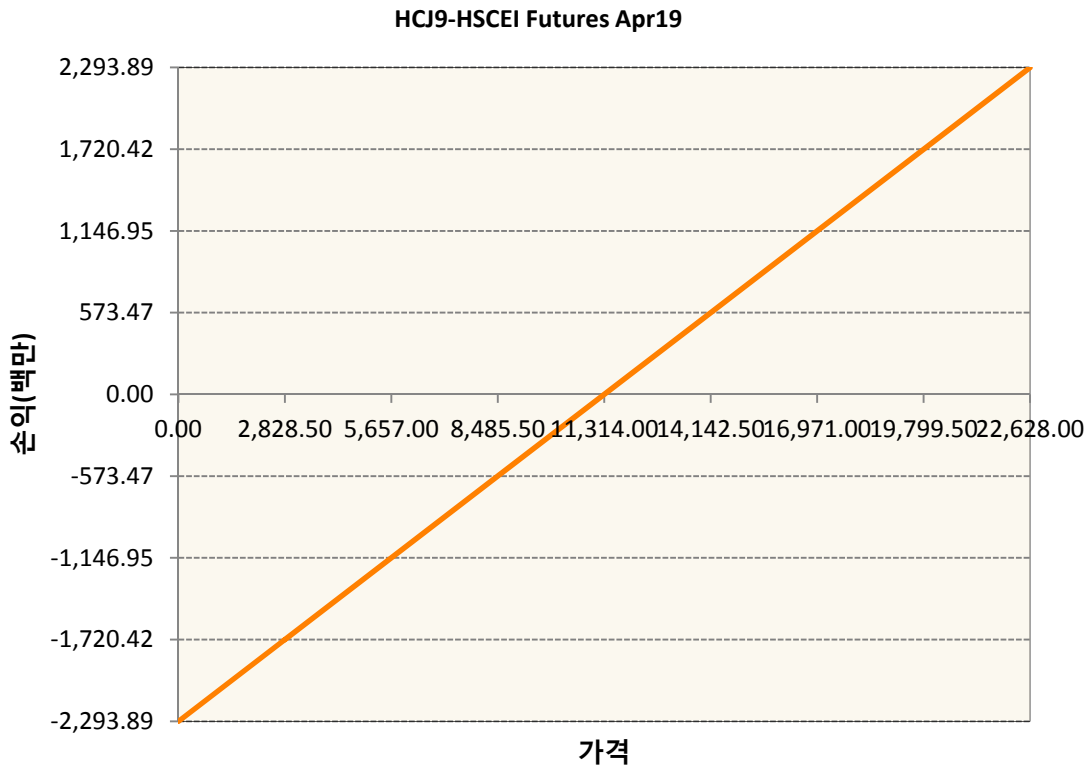
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,294	0	2,294	장내
누계	통화	선도	0	3,041	-3,041	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	220
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	23
HCI9 HSCEI Futures Apr19	184

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

(단위:백만원)

273

공시일	2019-03-29
기준일	2019-03-28

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

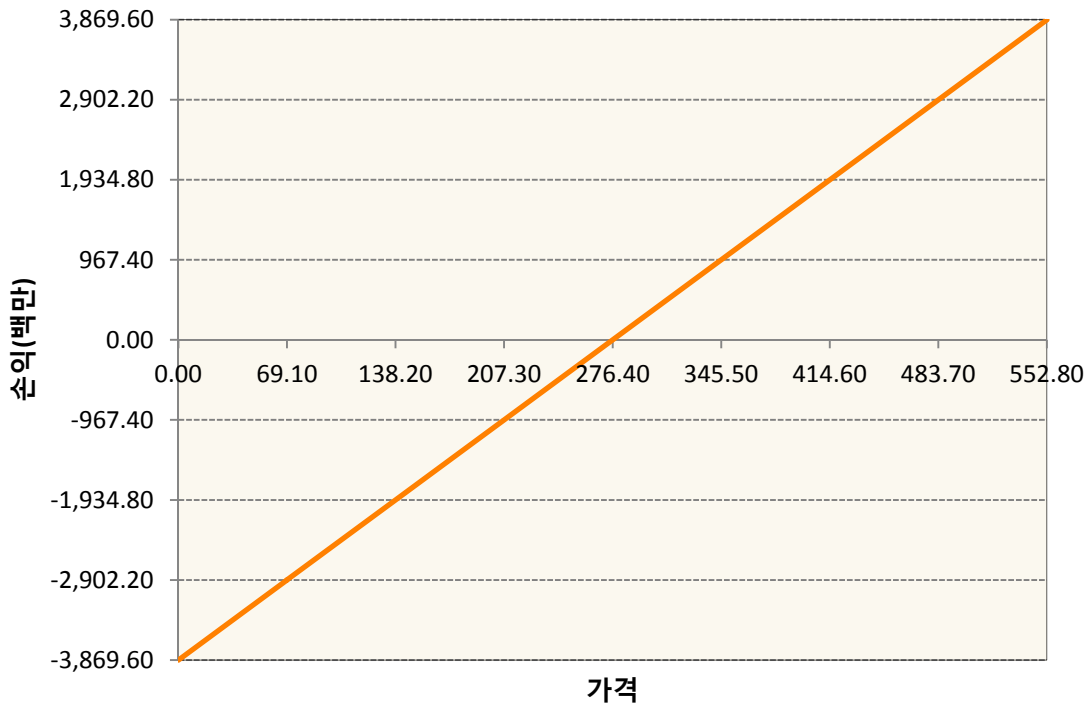
1. 계약금액

(단위:백만원)

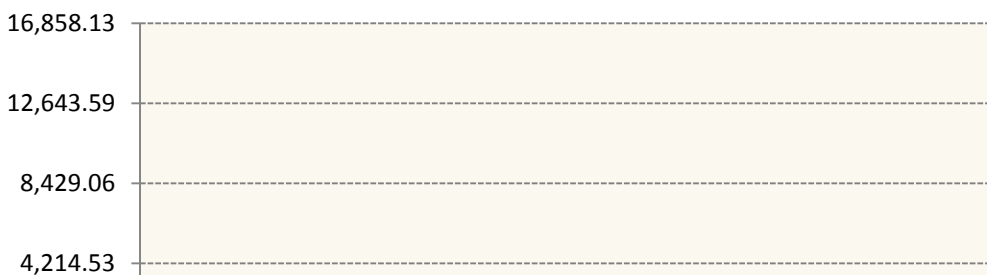
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,870	0	3,870	장내
누계	유가증권	스왑	35,836	0	35,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,649	-34,649	장내

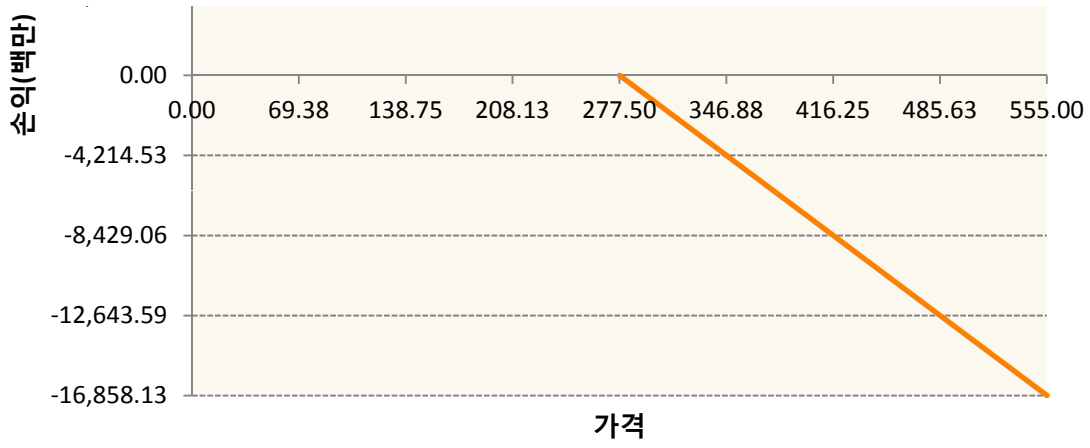
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

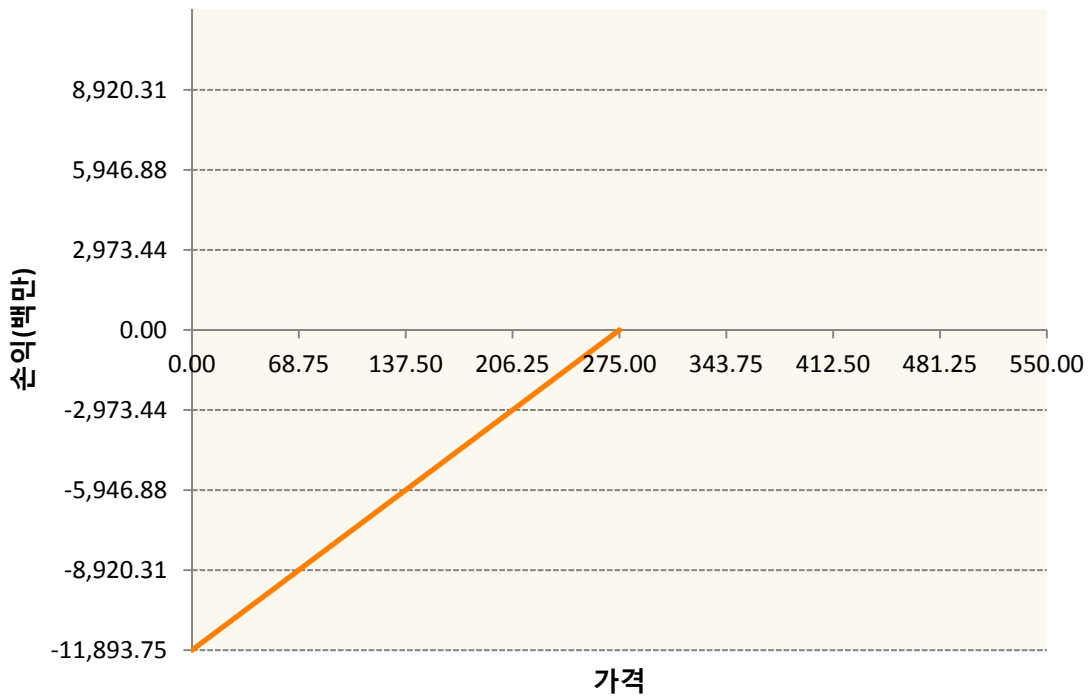


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

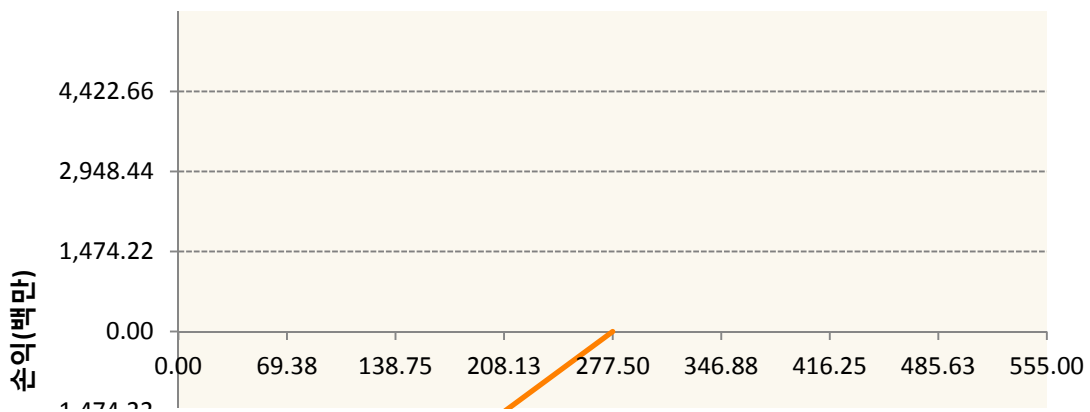




KR4301P42750-2019-04 풋275



KR4301P42776-2019-04 풋277.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,443
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,443	-2,443	-2,443	-2,443	-2,443	-2,443	-2,443	
-5.33%	-1,629	-1,629	-1,629	-1,629	-1,629	-1,629	-1,629	
-2.67%	-814	-814	-814	-814	-814	-814	-814	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	814	814	814	814	814	814	814	
5.33%	1,629	1,629	1,629	1,629	1,629	1,629	1,629	
8.00%	2,443	2,443	2,443	2,443	2,443	2,443	2,443	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						593
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-593	-593	-593	-593	-593	-593	-593	
-5.33%	-395	-395	-395	-395	-395	-395	-395	
-2.67%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	198	198	198	198	198	198	198	
5.33%	395	395	395	395	395	395	395	
8.00%	593	593	593	593	593	593	593	
KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						308
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-308	-308	-308	-308	-308	-308	-308	
-5.33%	-205	-205	-205	-205	-205	-205	-205	
-2.67%	-103	-103	-103	-103	-103	-103	-103	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	103	103	103	103	103	103	103	
5.33%	205	205	205	205	205	205	205	
8.00%	308	308	308	308	308	308	308	
KR4201P42778		2019-04 콜277.5						998
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	258	257	254	250	245	238	230
-5.33%	249	242	233	222	210	196	181
-2.67%	206	188	169	149	128	106	84
0%	81	54	27	0	-27	-54	-81
2.67%	-165	-190	-216	-242	-268	-295	-321
5.33%	-518	-534	-551	-569	-589	-610	-632
8.00%	-933	-940	-948	-958	-970	-983	-998
KR4301P42750 2019-04 풋275							811
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-809	-809	-809	-809	-810	-810	-811
-5.33%	-493	-494	-495	-497	-499	-502	-506
-2.67%	-190	-196	-203	-210	-218	-226	-235
0%	35	24	12	0	-12	-24	-35
2.67%	125	119	112	104	96	87	78
5.33%	140	139	138	135	132	129	124
8.00%	141	141	141	141	140	139	138
KR4301P42776 2019-04 풋277.5							421
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-421	-421	-421	-421	-421	-421	-421
-5.33%	-265	-265	-265	-266	-267	-268	-269
-2.67%	-112	-114	-116	-119	-122	-125	-128
0%	16	11	6	0	-6	-11	-17
2.67%	83	78	73	69	63	58	53
5.33%	98	97	95	93	91	88	86
8.00%	99	99	99	99	98	97	96

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

(단위:백만원)

5,744

공시일	2019-03-29
기준일	2019-03-28

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

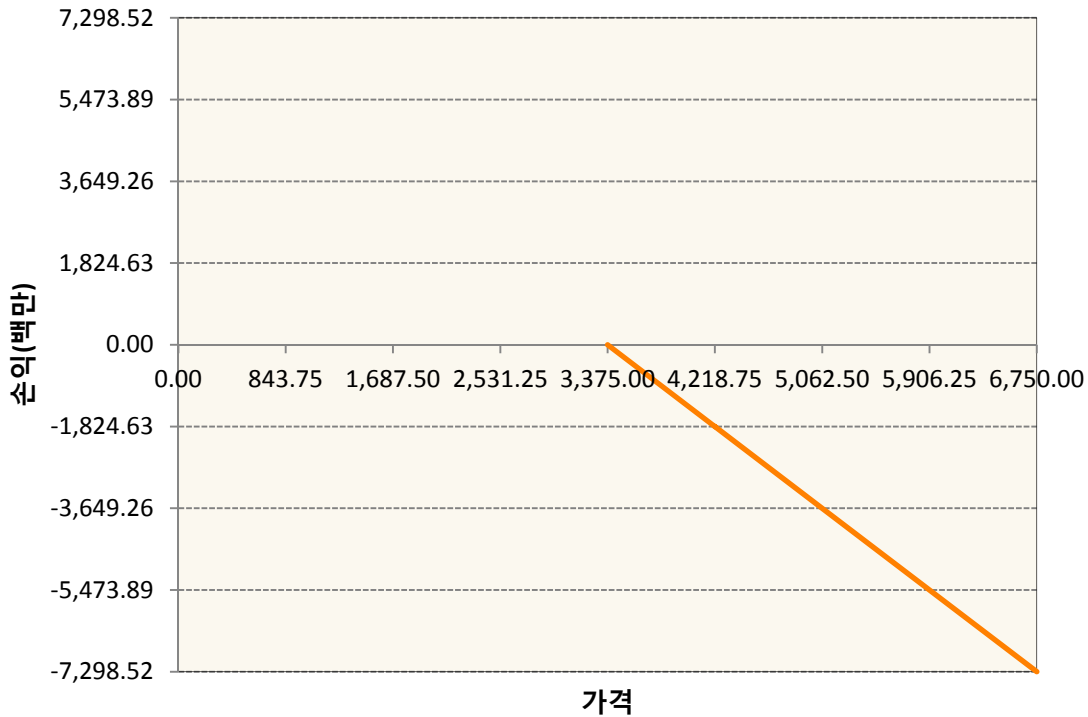
1. 계약금액

(단위:백만원)

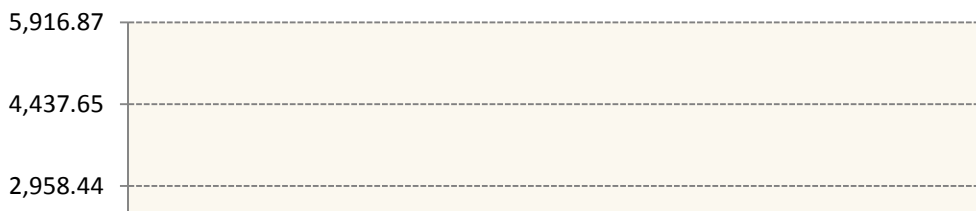
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,245	0	6,245	
누계	유가증권	스왑	60,413	0	60,413	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,431	-26,431	장내
누계	통화	선도	0	15,356	-15,356	장외

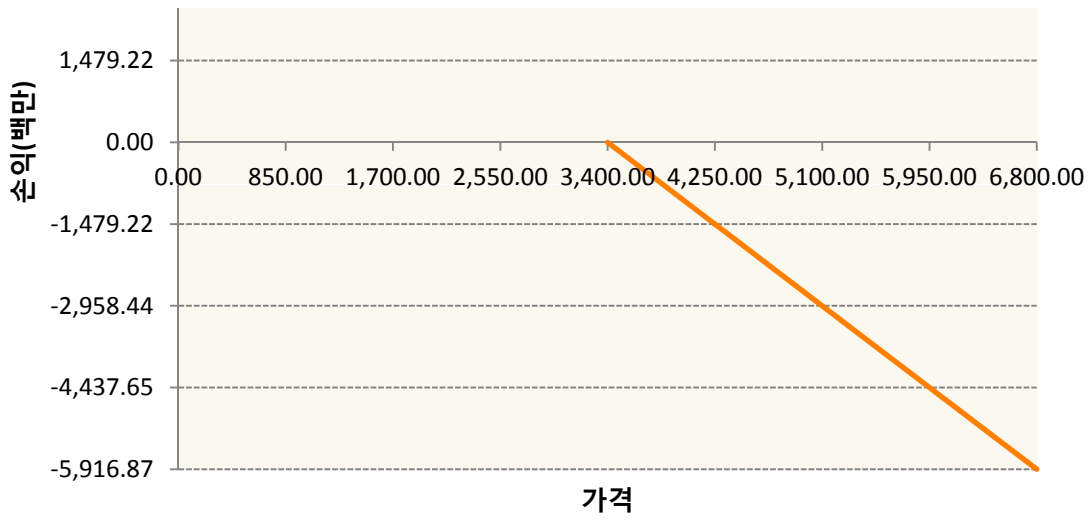
2. 만기시점의 손익구조

OESXJ9-C3375-EURO STOXX 50

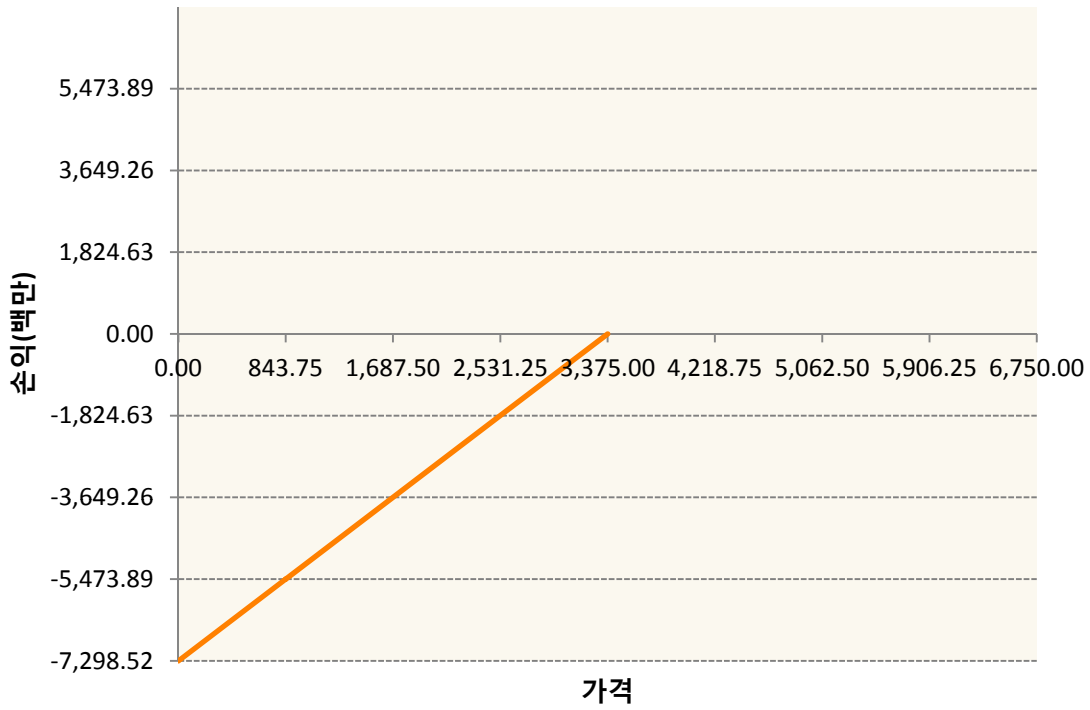


OESXJ9-C3400-EURO STOXX 50

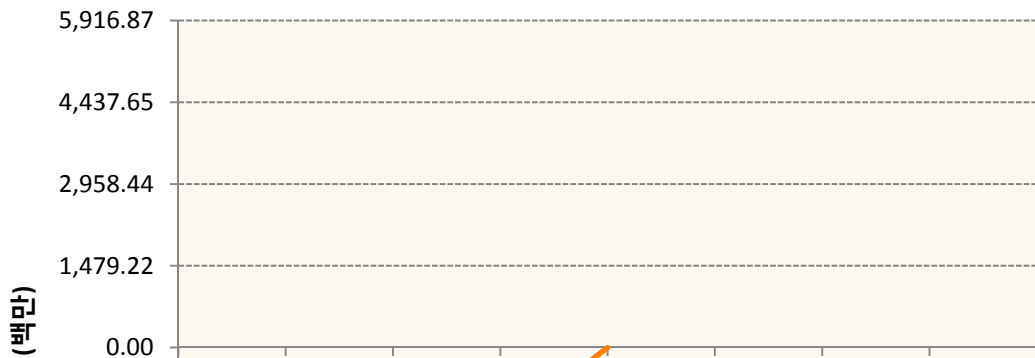


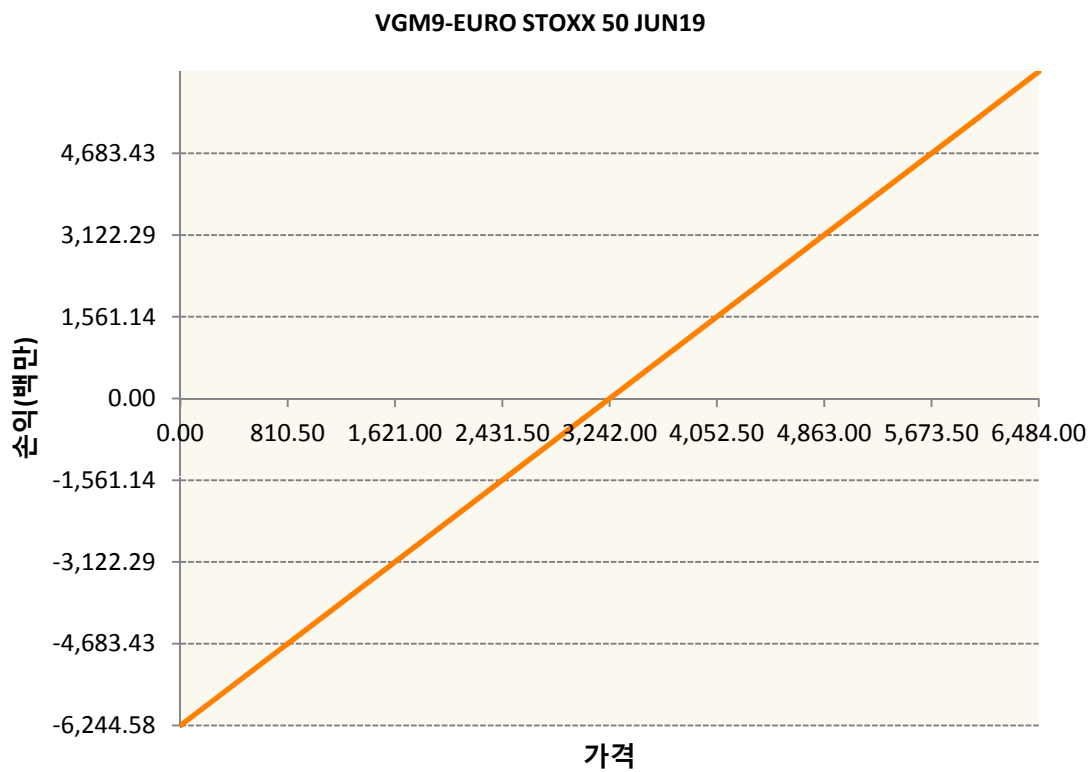
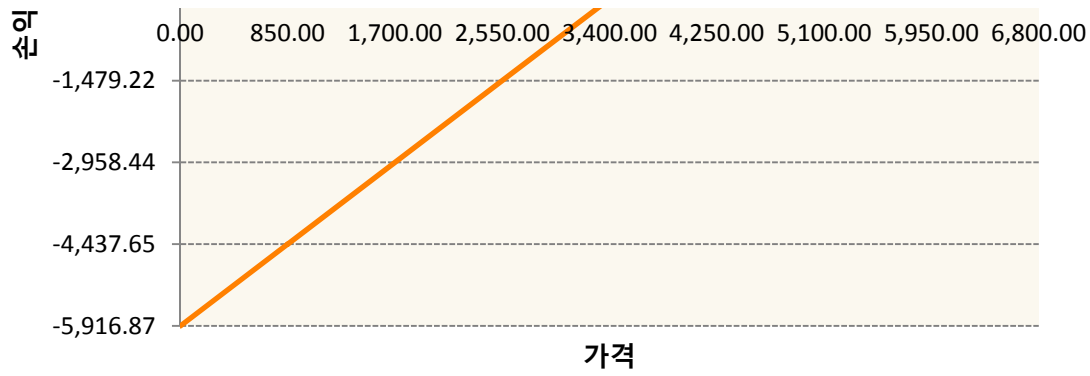


OESXJ9-P3375-EURO STOXX 50



OESXJ9-P3400-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	81
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	409
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	819
OESXJ9-C33' EURO STOXX 50	584
OESXJ9-C34' EURO STOXX 50	473
OESXJ9-P33' EURO STOXX 50	584
OESXJ9-P34' EURO STOXX 50	473
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	500

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

(단위:백만원)

2,592

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

(단위:백만원)

1,089

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

(단위:백만원)

93

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

(단위:백만원)

135

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

(단위:백만원)

42

공시일	2019-03-29
기준일	2019-03-28

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

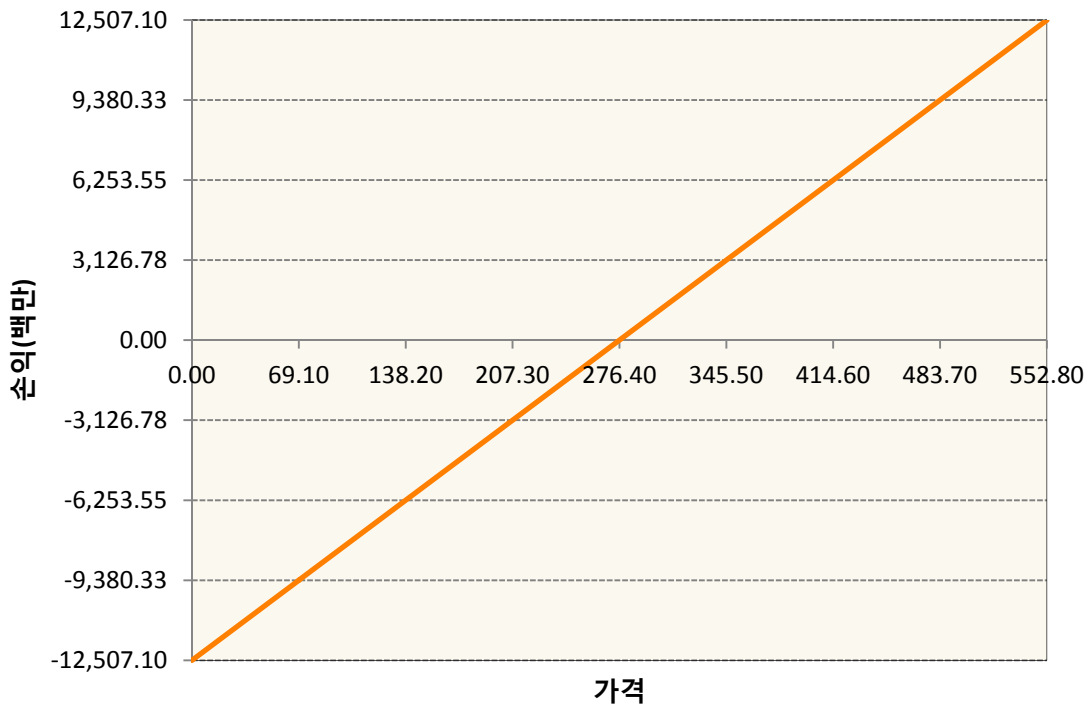
1. 계약금액

(단위:백만원)

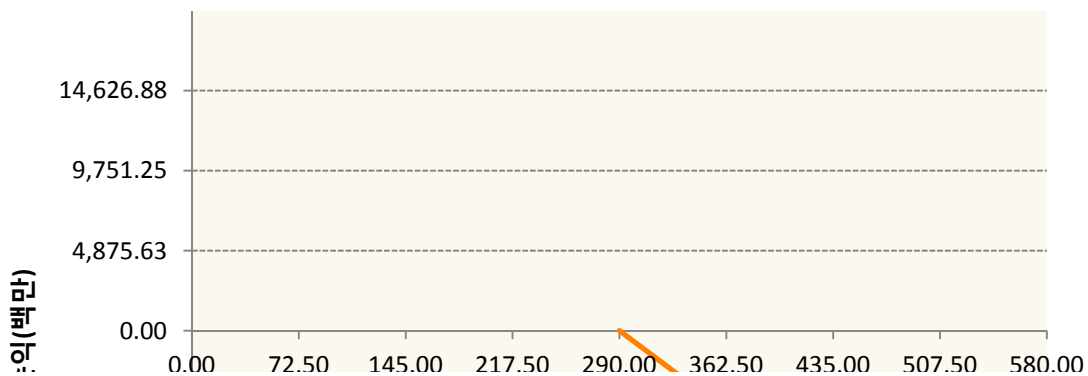
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,507	0	12,507	장내
누계	유가증권	옵션	1,867	24,036	-22,169	장내

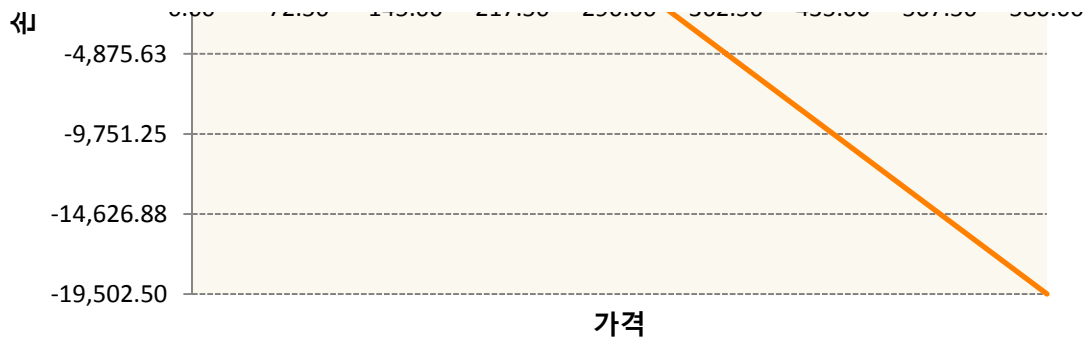
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

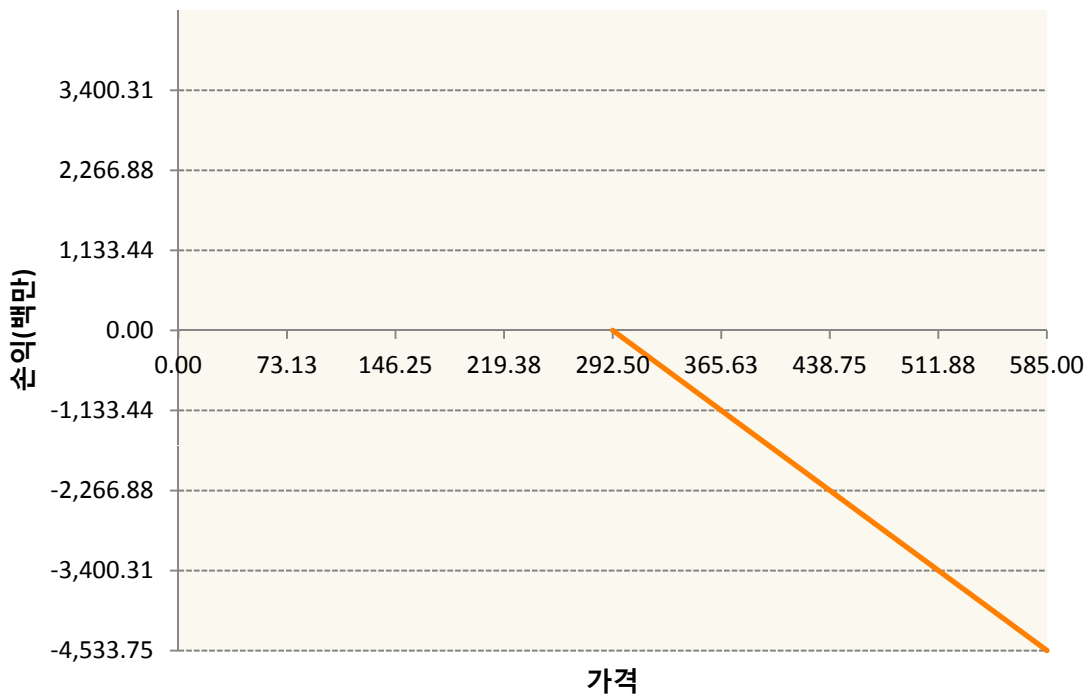


KR4201P42901-2019-04 콜290

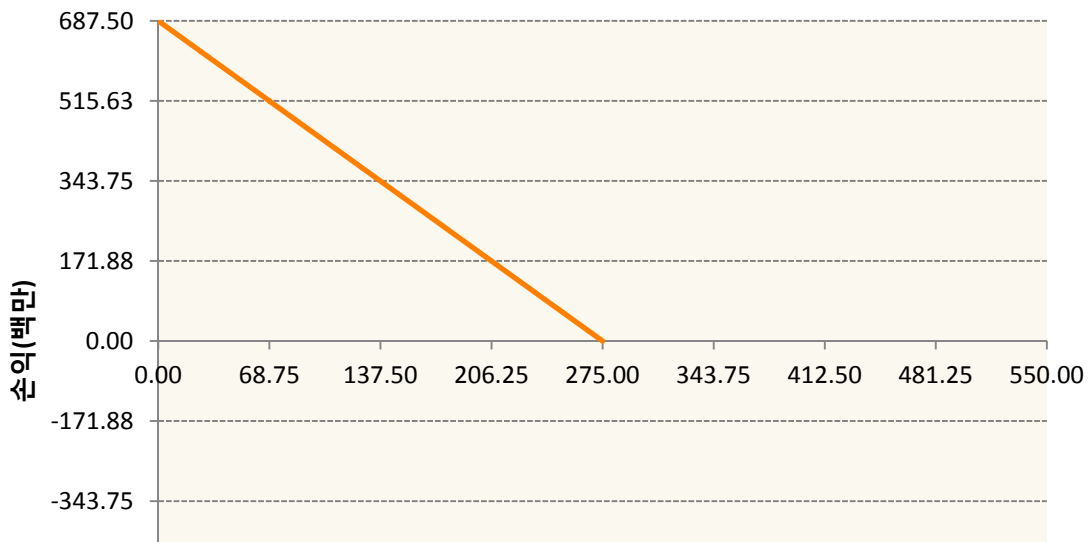


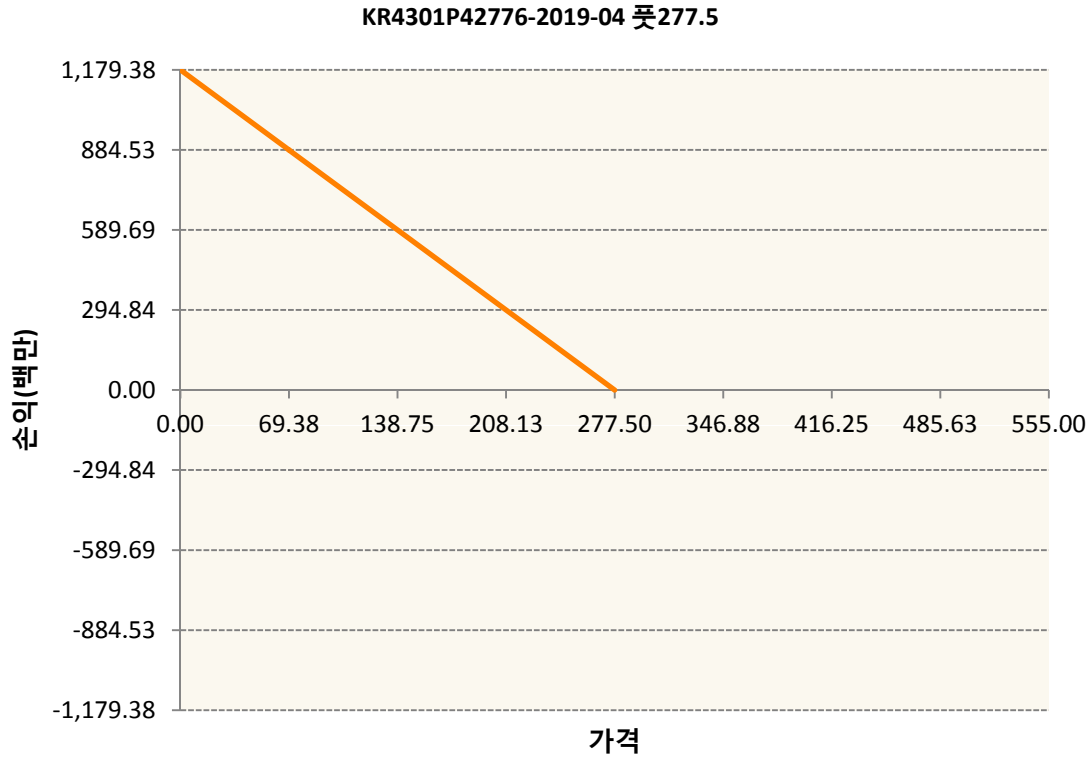
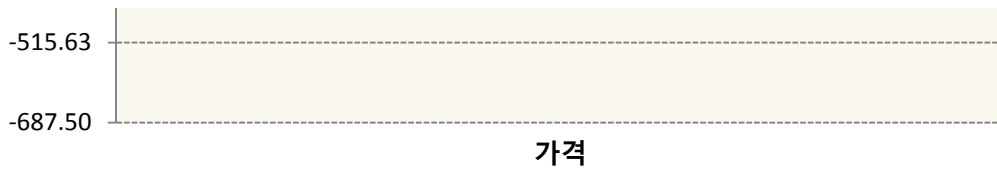


KR4201P42927-2019-04 콜292.5



KR4301P42750-2019-04 풋275





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						996
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-996	-996	-996	-996	-996	-996	-996	
-5.33%	-664	-664	-664	-664	-664	-664	-664	
-2.67%	-332	-332	-332	-332	-332	-332	-332	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	332	332	332	332	332	332	332	
5.33%	664	664	664	664	664	664	664	
8.00%	996	996	996	996	996	996	996	
KR4201P42901		2019-04 콜290						689
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	67	67	67	66	65	64	62	
-5.33%	67	66	65	62	59	55	49	
-2.67%	63	60	54	47	38	27	15	

0%	43	31	16	0	-18	-38	-59
2.67%	-30	-55	-81	-108	-135	-163	-192
5.33%	-209	-241	-273	-305	-337	-369	-400
8.00%	-518	-545	-572	-601	-630	-659	-689
KR4201P42927 2019-04 콜292.5							140
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11	11	11	11	11	10	10
-5.33%	11	11	11	10	10	9	8
-2.67%	10	10	9	8	6	4	2
0%	8	6	3	0	-3	-7	-12
2.67%	-4	-9	-14	-19	-25	-31	-37
5.33%	-36	-43	-50	-58	-65	-72	-79
8.00%	-97	-104	-111	-118	-125	-132	-140
KR4301P42750 2019-04 풋275							47
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	47	47	47	47	47	47	47
-5.33%	28	29	29	29	29	29	29
-2.67%	11	11	12	12	13	13	14
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-7	-7	-6	-6	-6	-5	-4
5.33%	-8	-8	-8	-8	-8	-7	-7
8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
KR4301P42776 2019-04 풋277.5							84
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	84	84	84	84	84	84	84
-5.33%	53	53	53	53	53	54	54
-2.67%	22	23	23	24	24	25	26
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-17	-16	-15	-14	-13	-12	-11
5.33%	-20	-19	-19	-19	-18	-18	-17
8.00%	-20	-20	-20	-20	-20	-19	-19

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

(단위:백만원)

1,532

공시일	2019-03-29
기준일	2019-03-28

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	2,570	0	2,570	

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	2019-03-29
기준일	2019-03-28

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,865	0	3,865	
누계	유가증권	수익증권	11,745	0	11,745	

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	2019-03-29
기준일	2019-03-28

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,705	0	1,705	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	61,923	0	61,923	
누계	통화	선도	0	69,254	-69,254	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
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 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	146
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	118
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	207
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	255
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E	155
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E	364
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E	427
FX21019H03 KRW/USD 22-04-19E	364
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	364
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	418
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	182
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	455
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	527
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	320
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	273
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E	45

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

(단위:백만원)

1,937

공시일	2019-03-29
기준일	2019-03-28

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

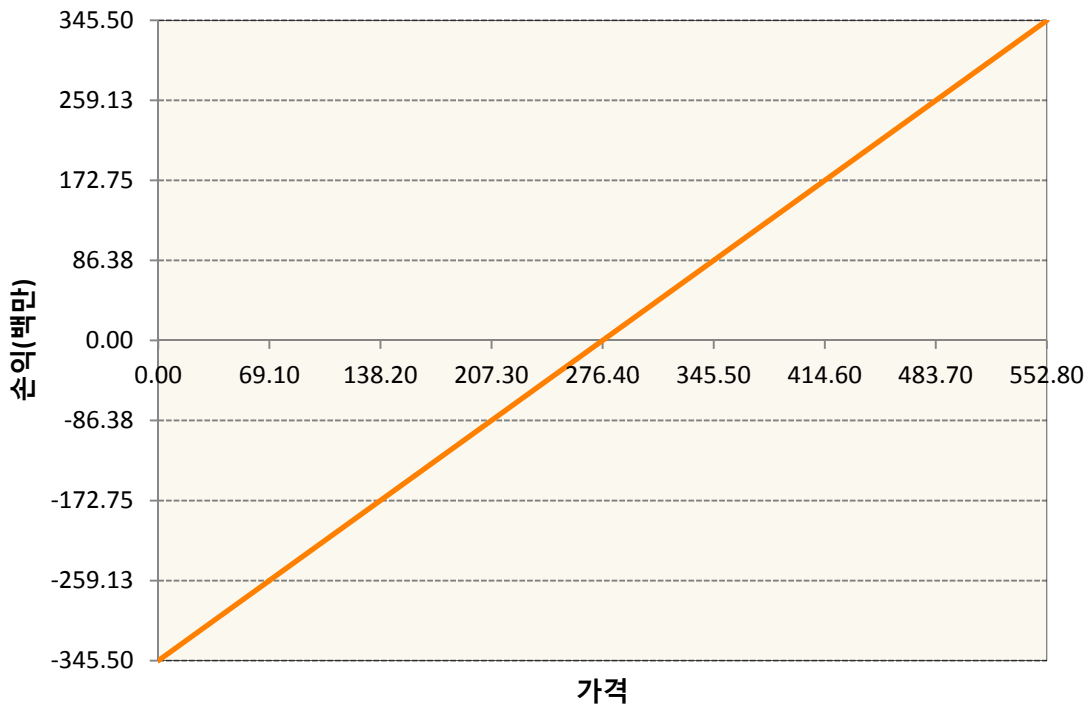
1. 계약금액

(단위:백만원)

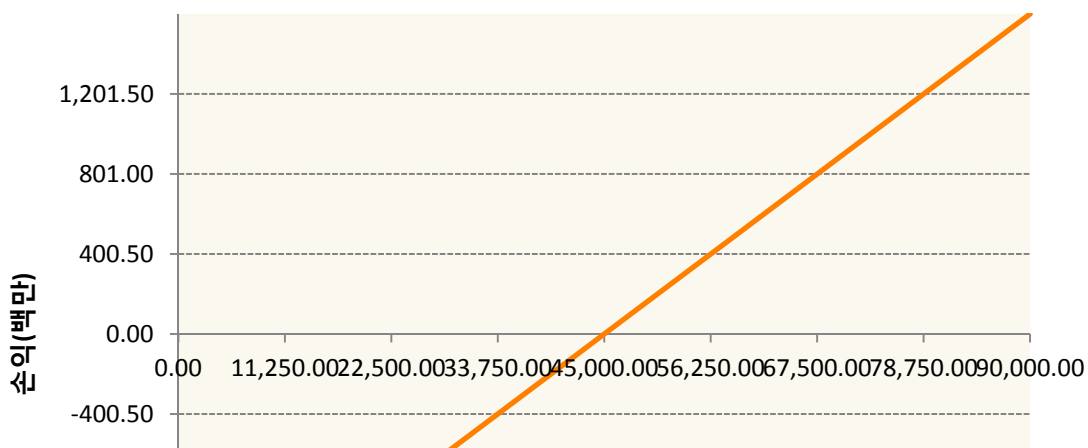
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,948	0	1,948	장내

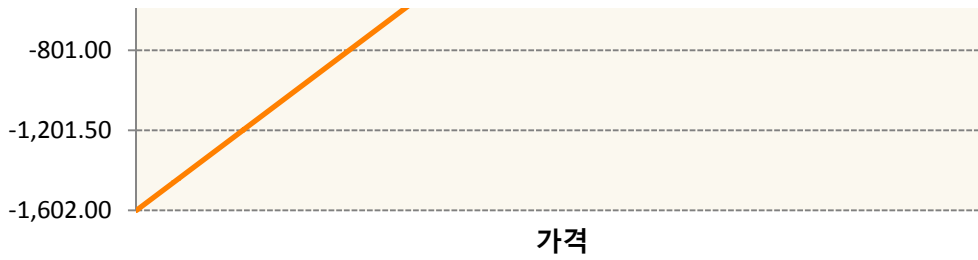
2. 만기시점의 손익구조

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						128
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128	
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85	
-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%	85	85	85	85	85	85	85	
8.00%	128	128	128	128	128	128	128	

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

175

공시일	2019-03-29
기준일	2019-03-28

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

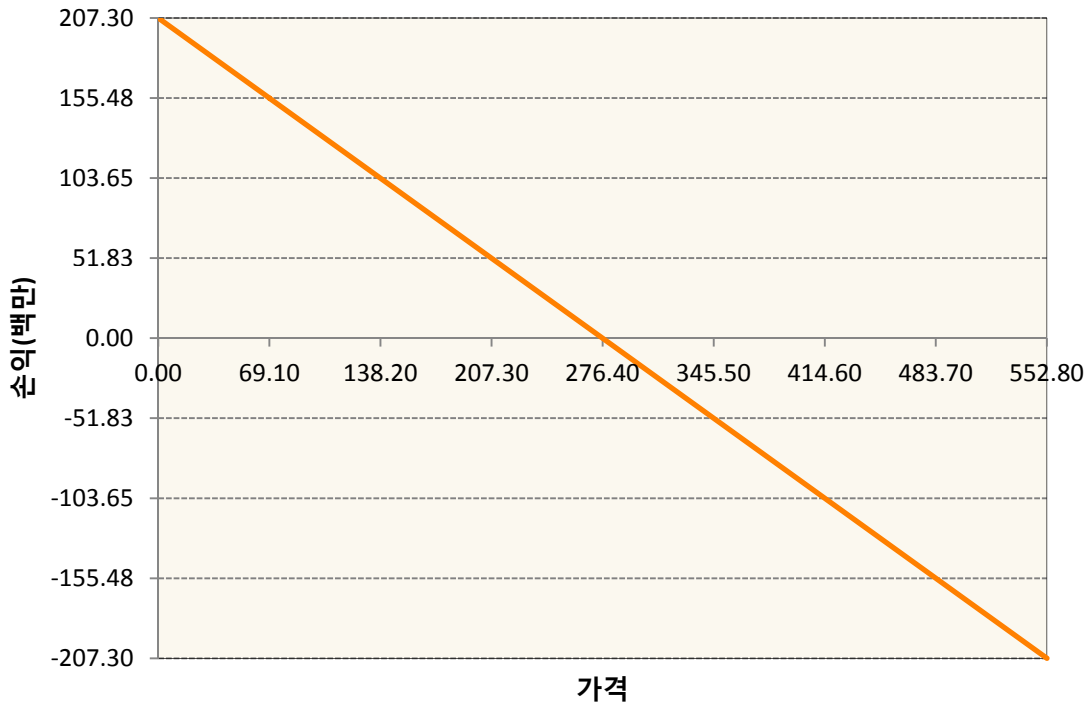
1. 계약금액

(단위:백만원)

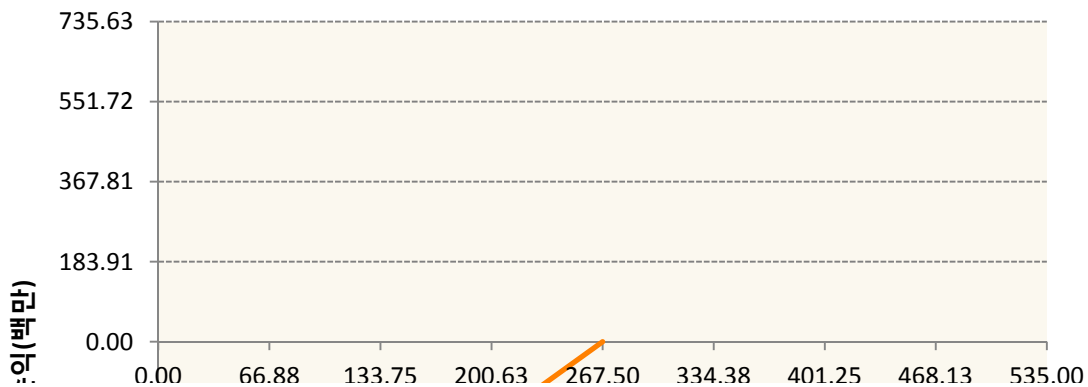
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	69	-69	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	207	-207	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,208	-1,208	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

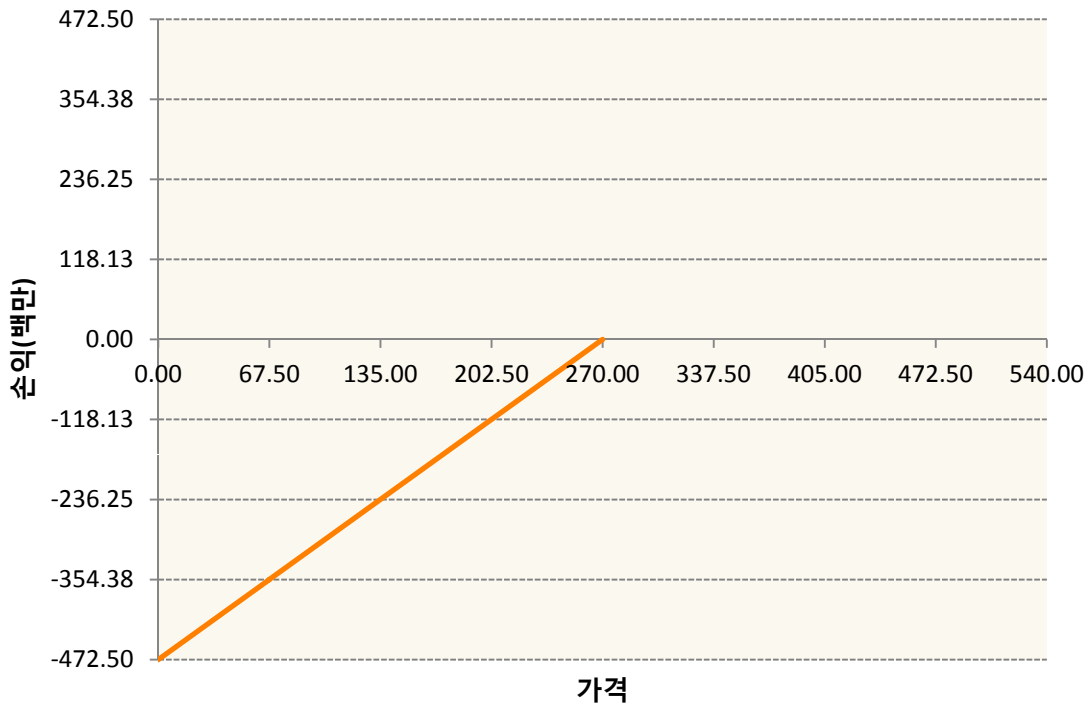


KR4301P42677-2019-04 풋267.5





KR4301P42701-2019-04 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						17
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	17	17	17	17	17	17	17	
-5.33%	11	11	11	11	11	11	11	
-2.67%	6	6	6	6	6	6	6	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6	
5.33%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11	
8.00%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
KR4301P42677		2019-04 풋267.5						38
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
-5.33%	-18	-19	-19	-20	-20	-21	-21
-2.67%	-4	-5	-6	-6	-7	-8	-9
0%	1	1	0	0	0	-1	-2
2.67%	2	2	2	2	2	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

KR4301P42701

2019-04 풋270

28

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-27	-27	-27	-27	-28	-28	-28
-5.33%	-15	-15	-15	-15	-16	-16	-16
-2.67%	-4	-5	-5	-6	-6	-6	-7
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
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

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

(단위:백만원)

75

공시일	2019-03-29
기준일	2019-03-28

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

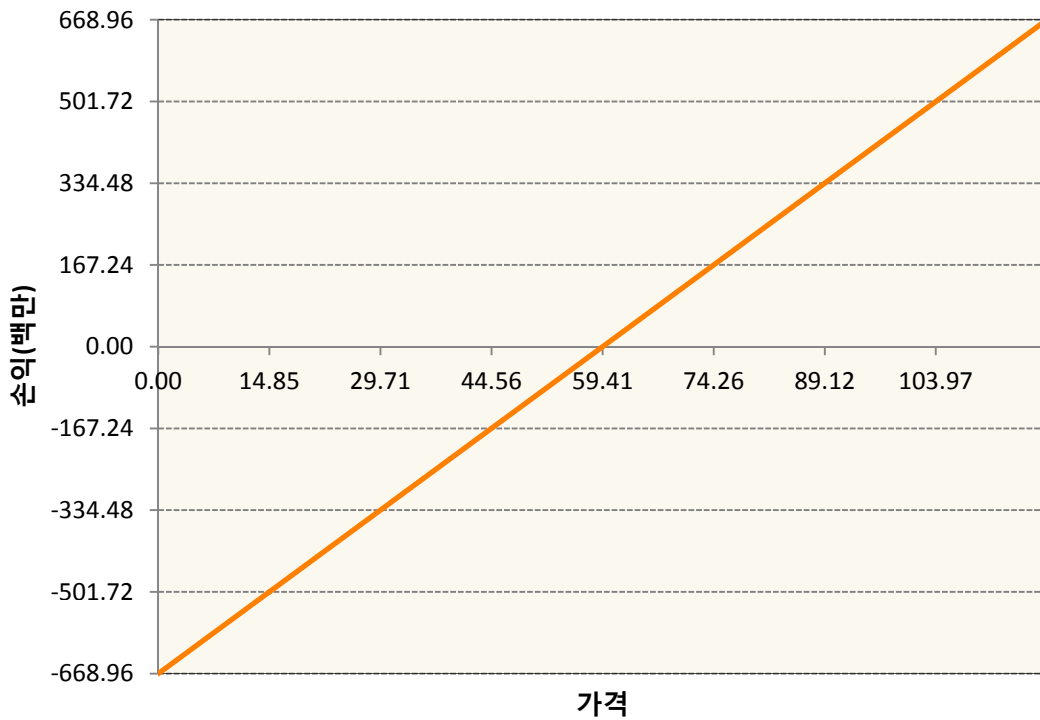
1. 계약금액

(단위:백만원)

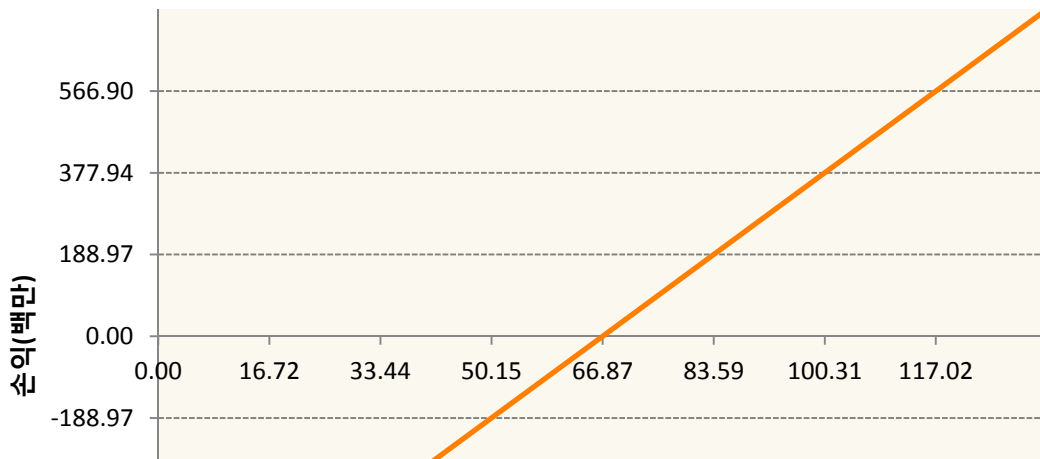
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,856	284	2,572	

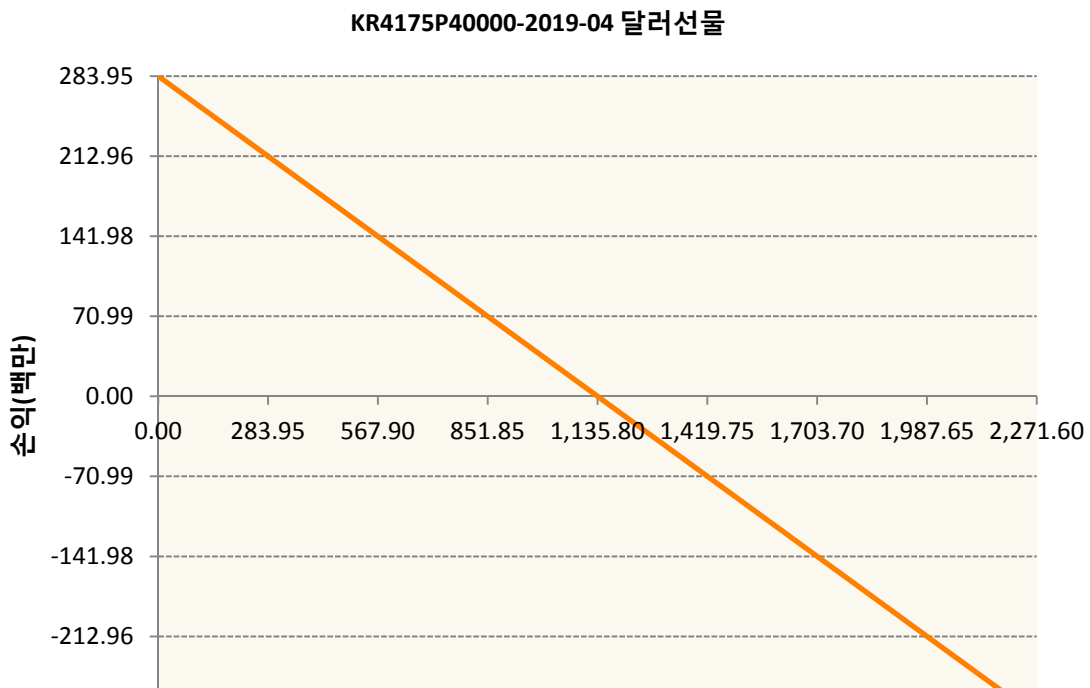
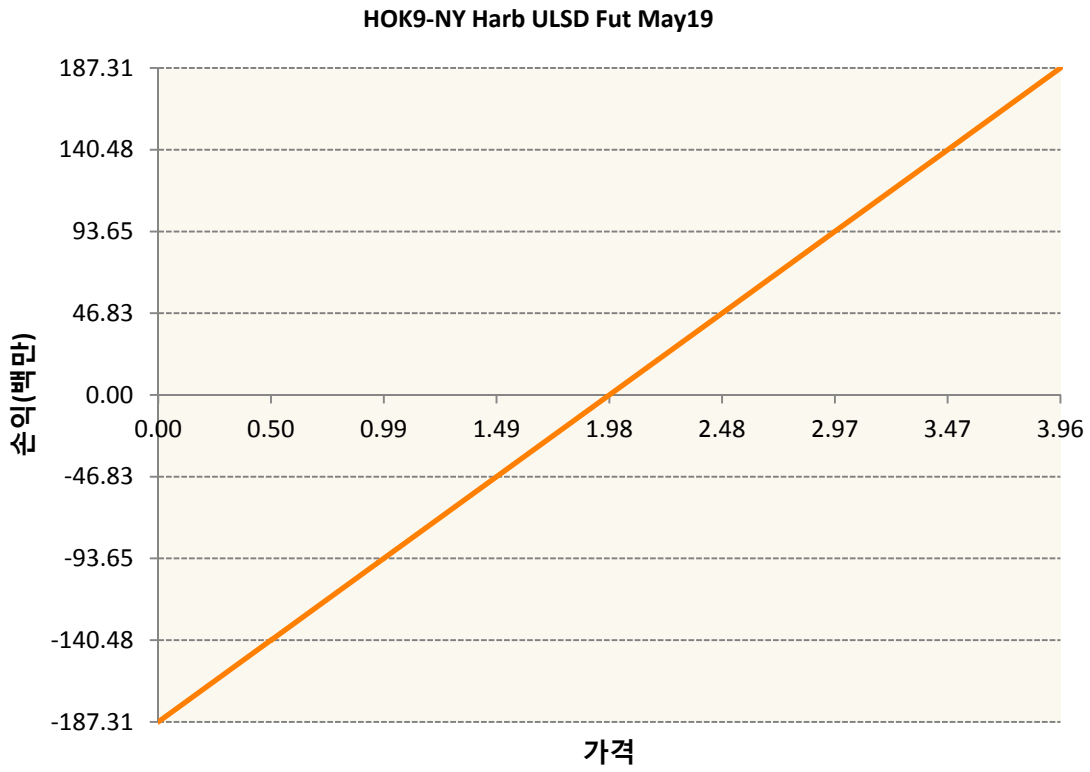
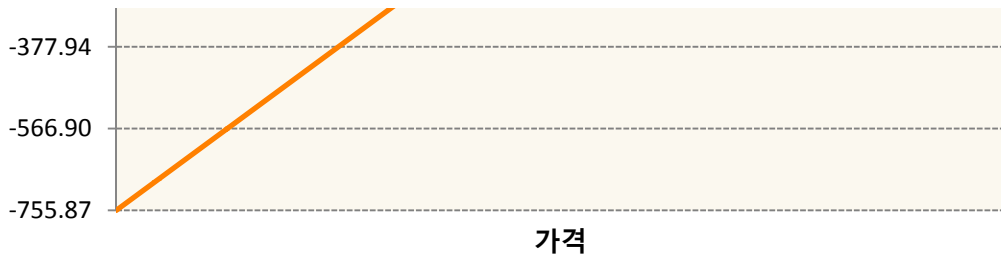
2. 만기시점의 손익구조

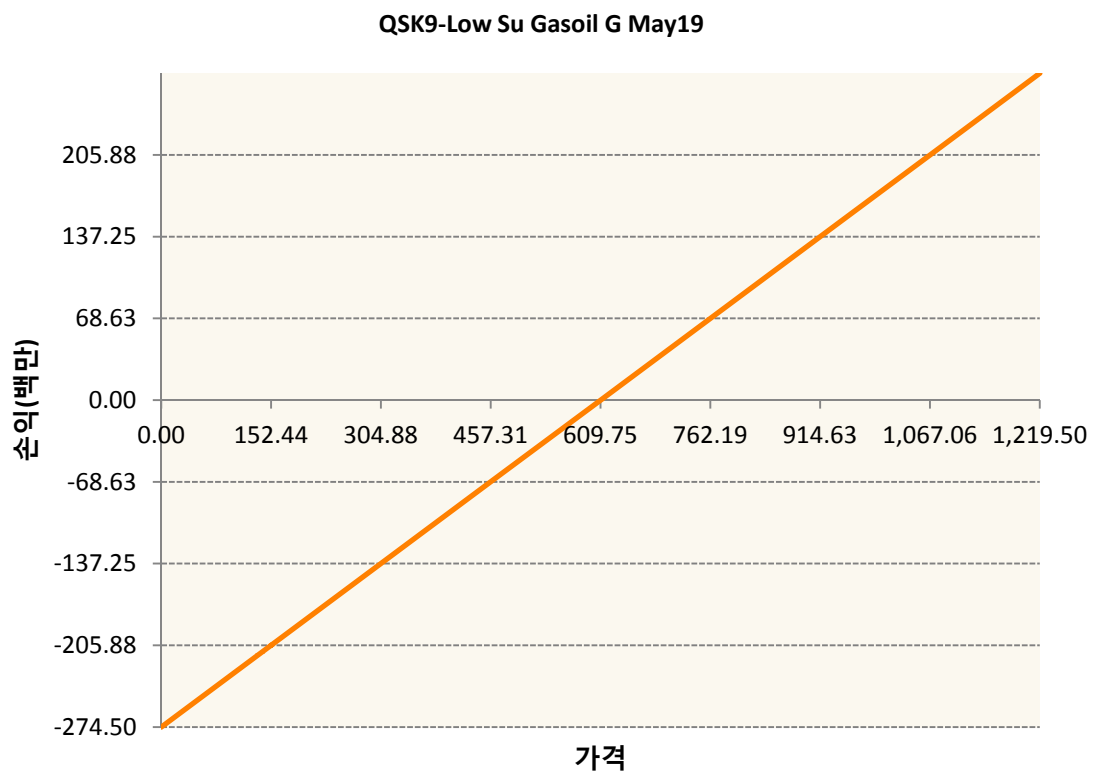
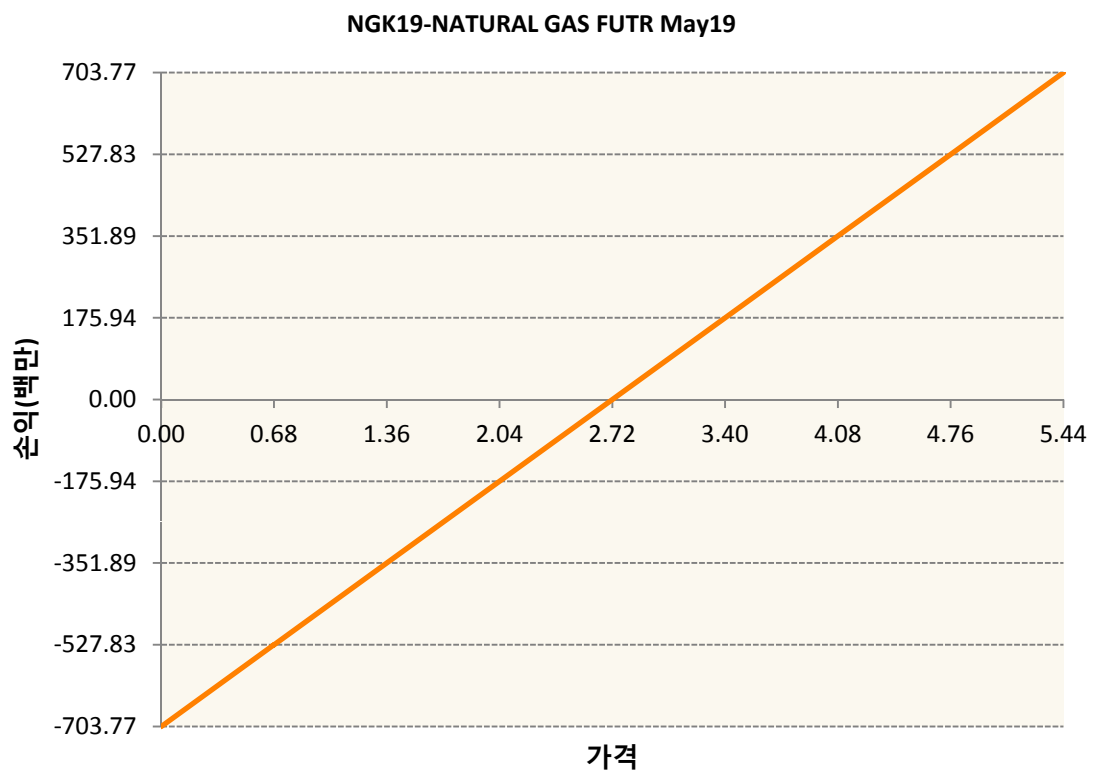
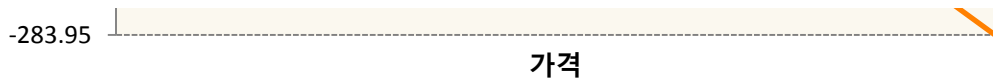
CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19



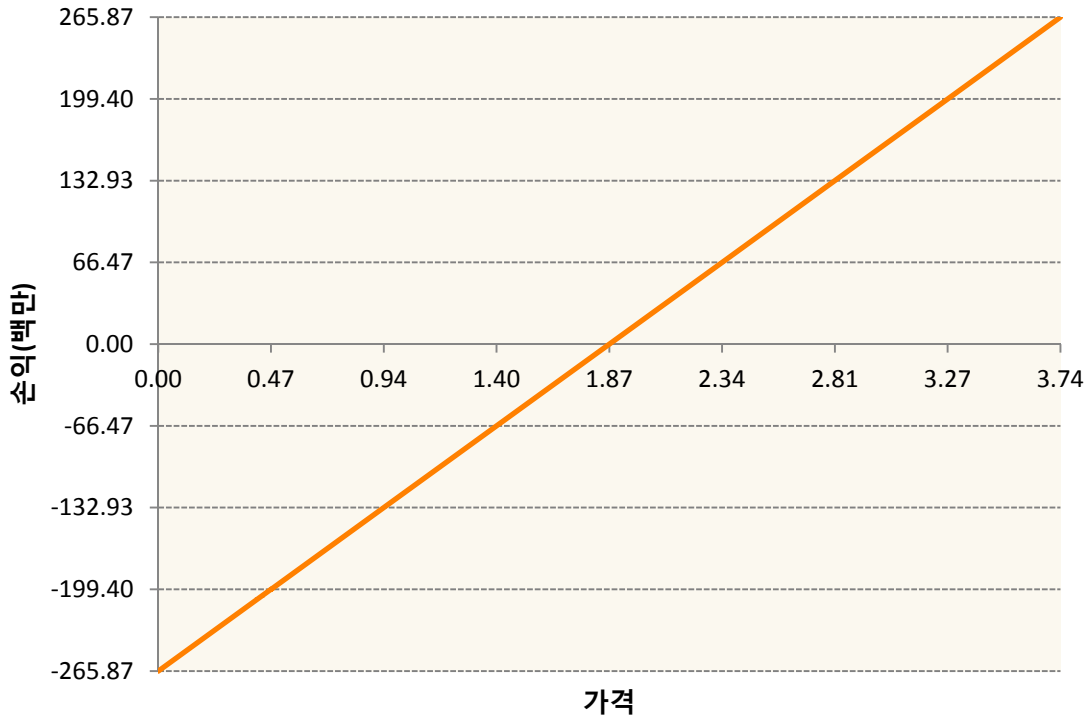
CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19







XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK9	WTI CRUDE FUTURE May19	54
CON9	BRENT CRUDE FUTR Jul19	60
HOK9	NY Harb ULSD Fut May19	15
KR4175P400	2019-04 달러선물	23
NGK19	NATURAL GAS FUTR May19	56
QSK9	Low Su Gasoil G May19	22
XBK9	GASOLINE RBOB FUT May19	21

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

(단위:백만원)

432

공시일	2019-03-29
기준일	2019-03-28

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

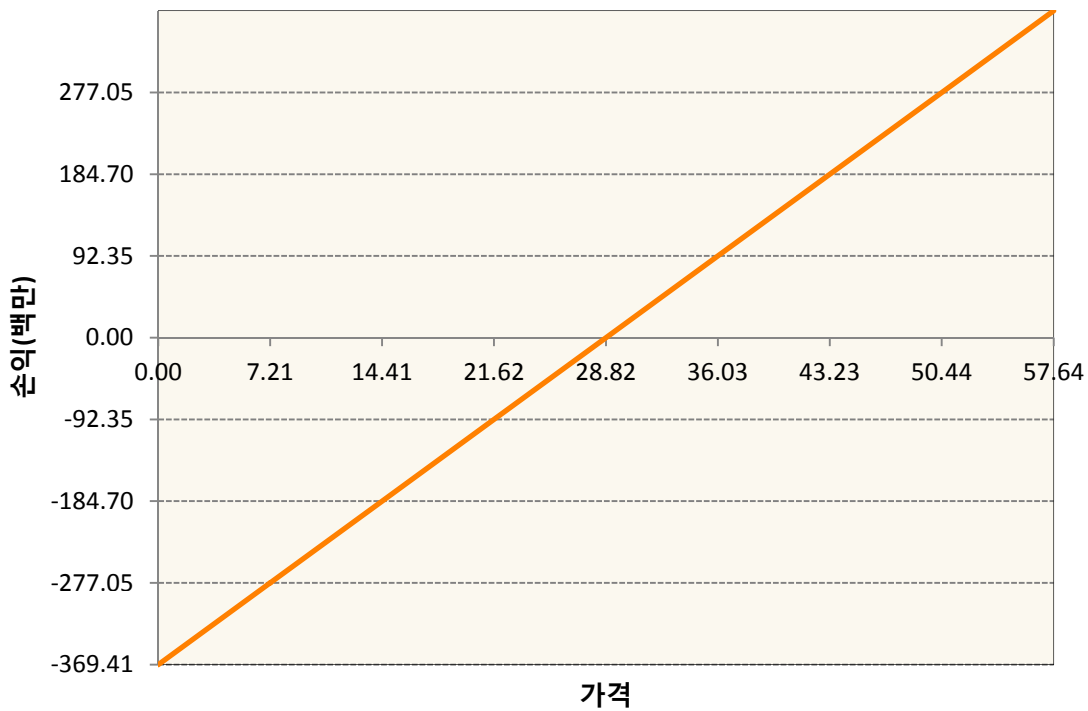
1. 계약금액

(단위:백만원)

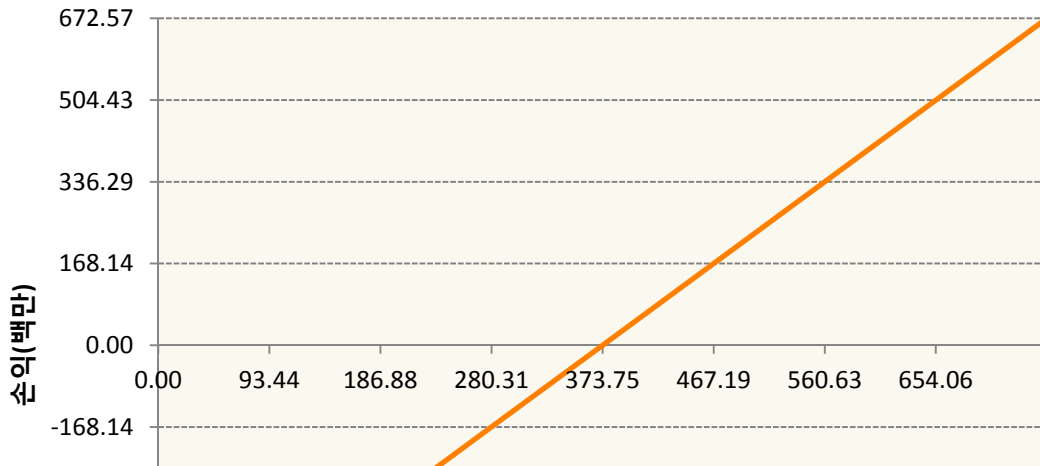
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,360	80	3,281	

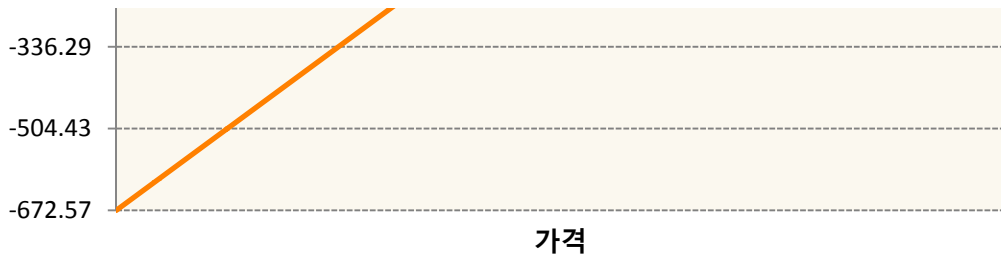
2. 만기시점의 손익구조

BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19

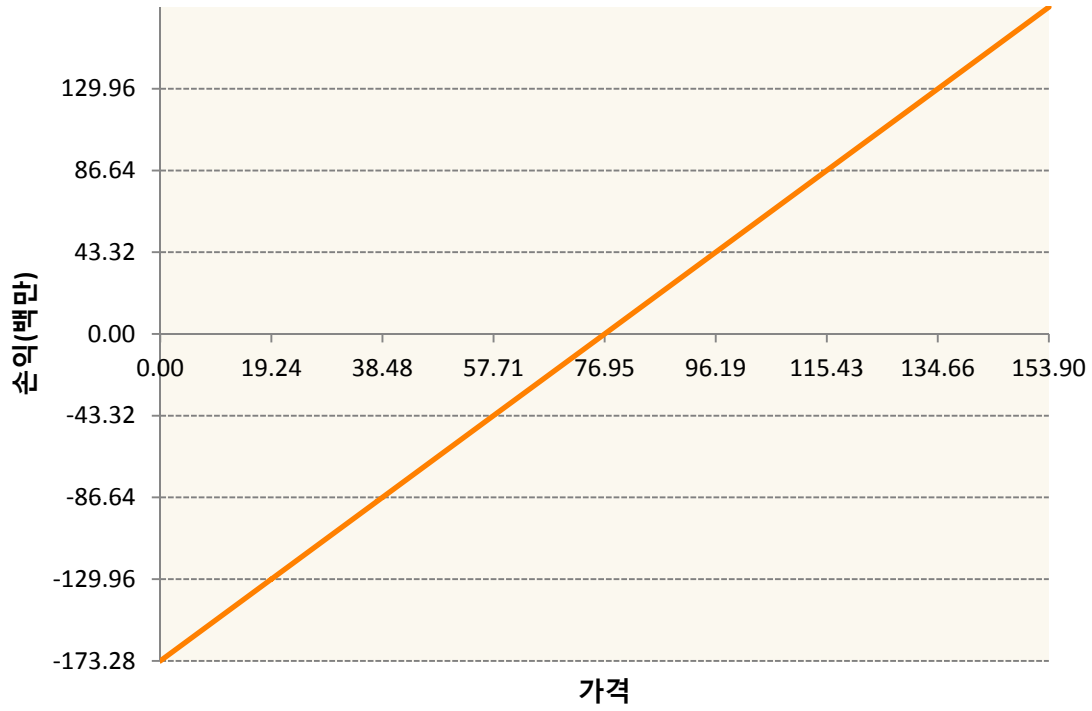


CK9-CORN FUTURE May19

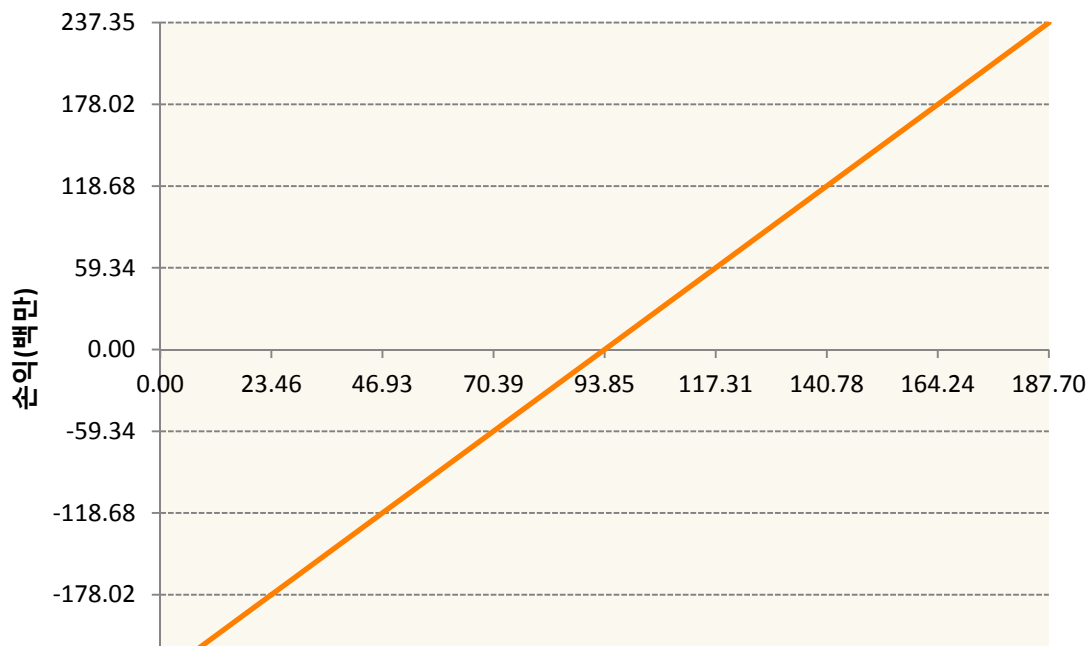


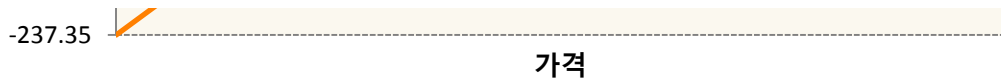


CTK9-COTTON NO.2 FUTR May19

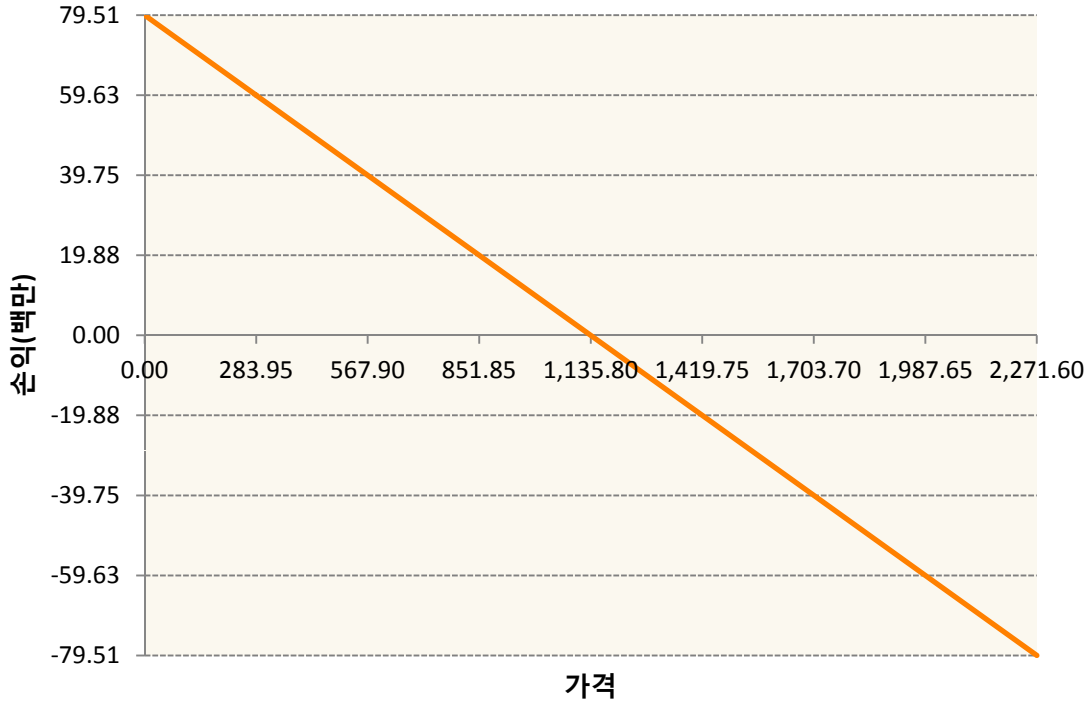


KCK9-COFFEE 'C' FUTURE May19

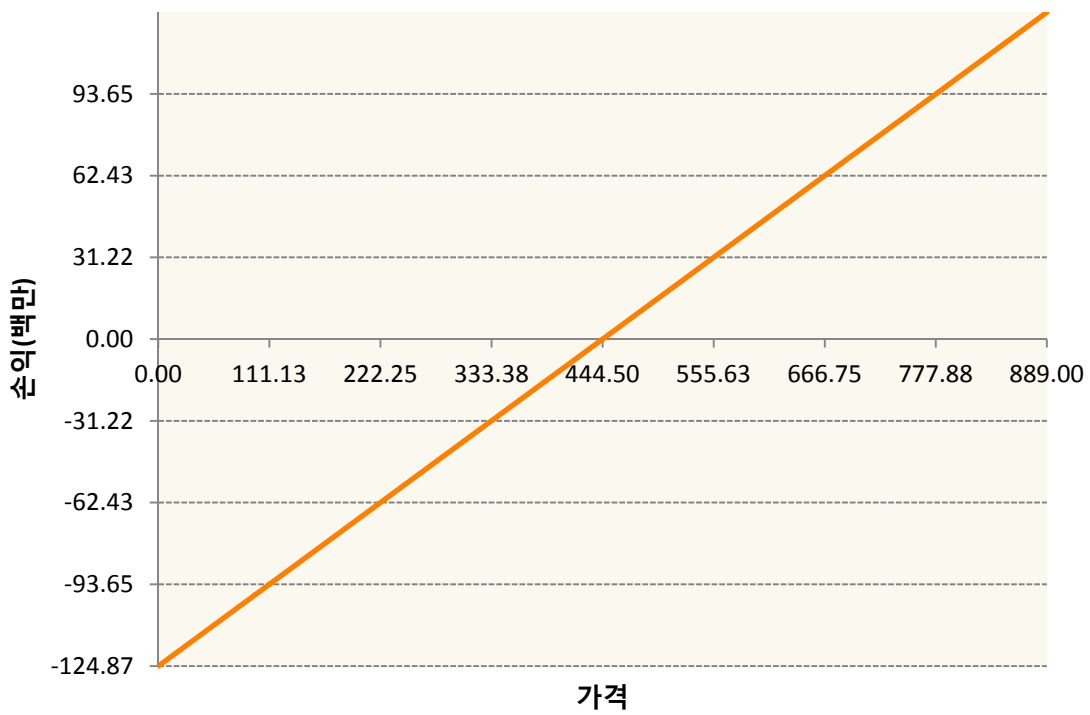




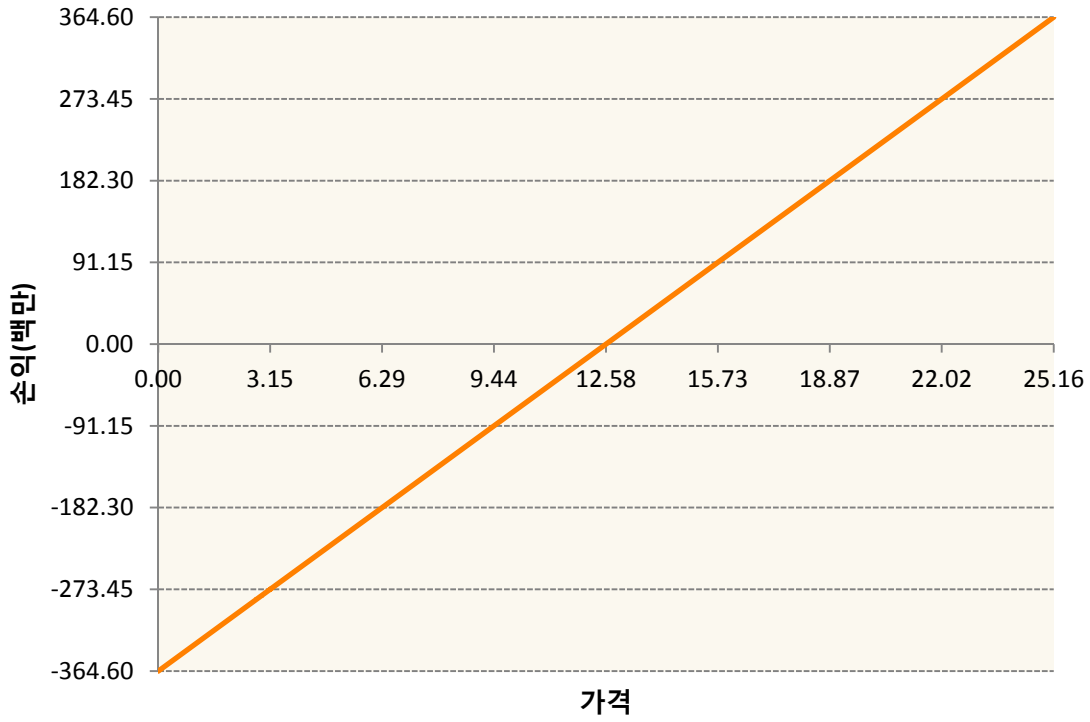
KR4175P40000-2019-04 달러선물



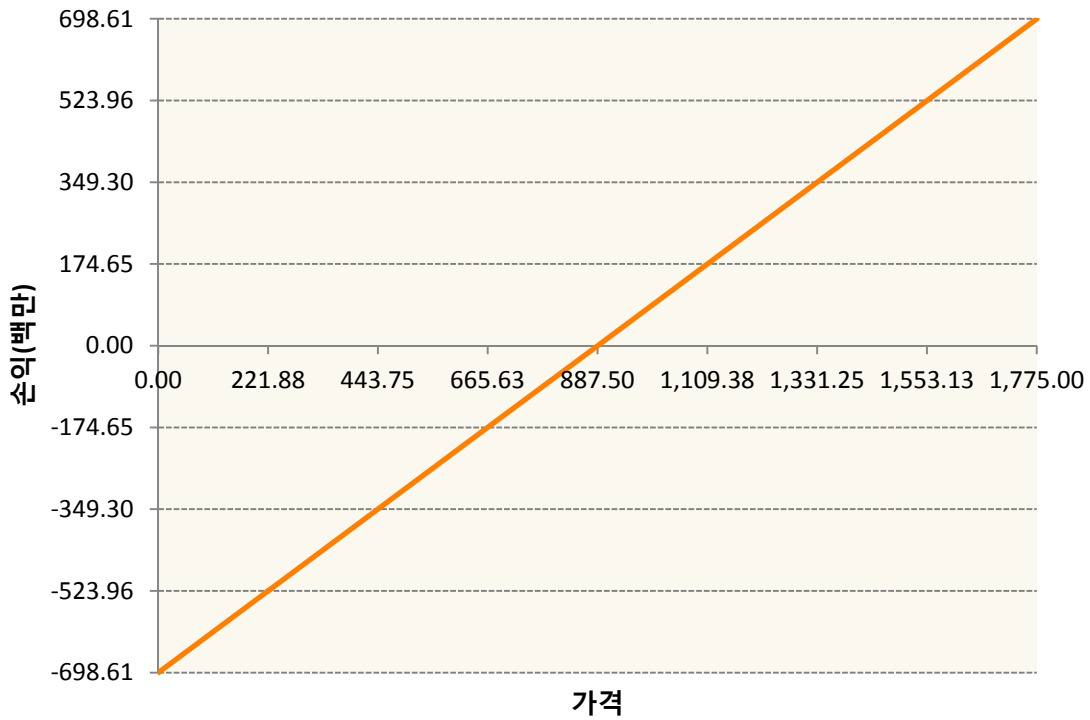
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

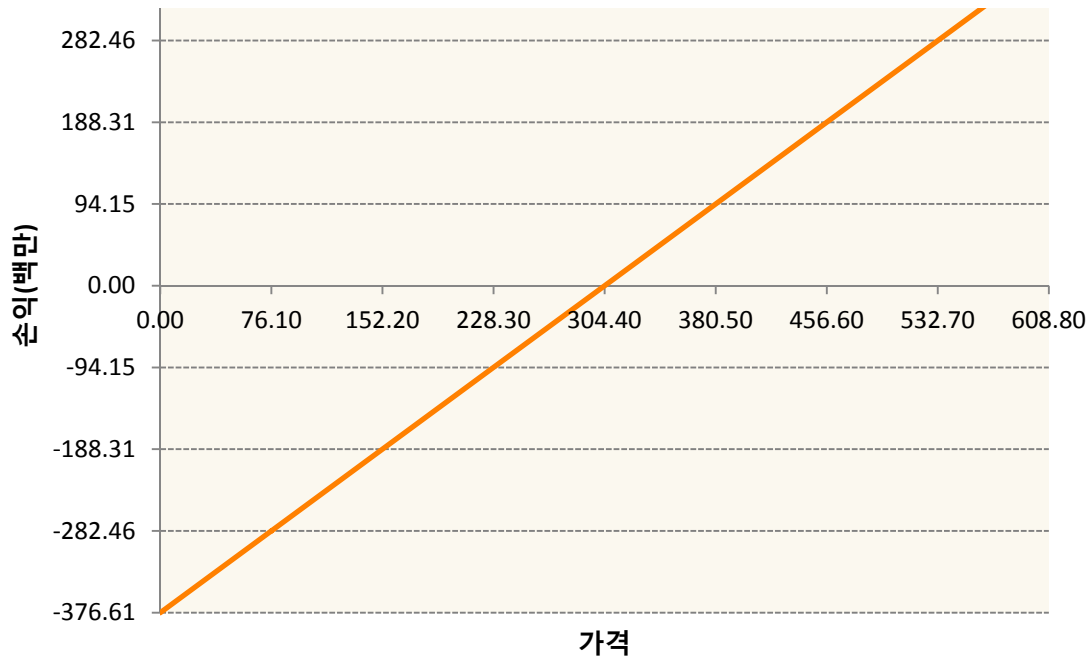


SK9-SOYBEAN FUTURE May19

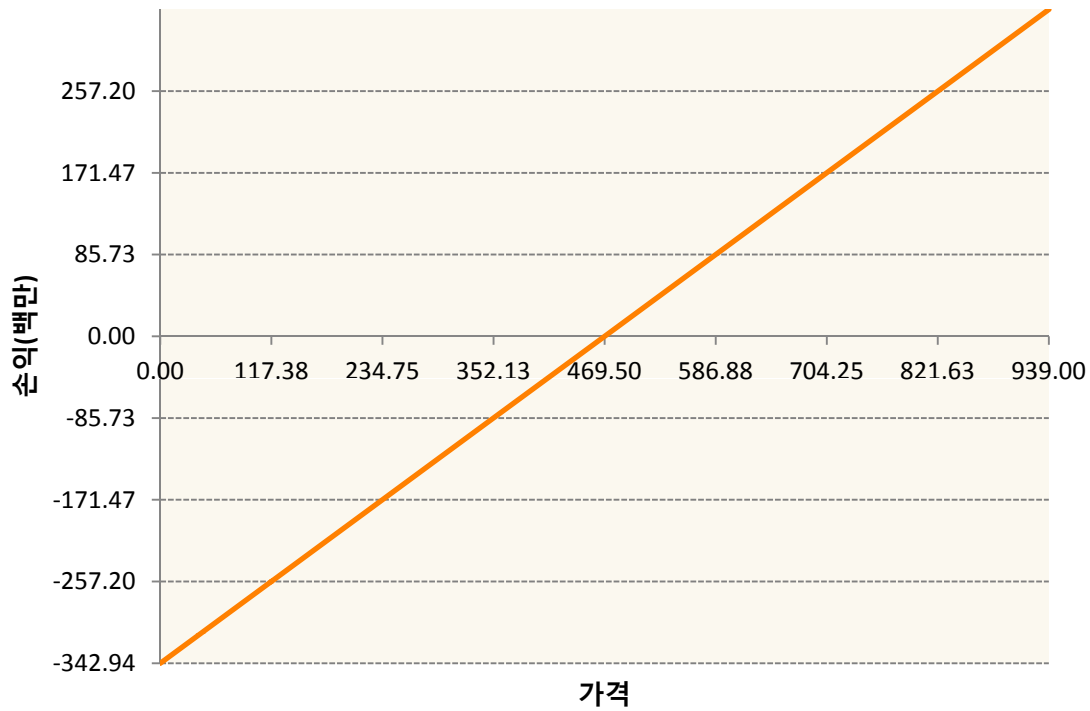


SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





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	56
SMK9	SOYBEAN MEAL FUTR May19	30
WK9	WHEAT FUTURE(CBT) May19	27

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

(단위:백만원)

270