

공시일	2019-04-01
기준일	2019-03-29

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	2019-04-01
기준일	2019-03-29

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

1,121

* 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	2019-04-01
기준일	2019-03-29

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)	162

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

959

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-04-01
기준일	2019-03-29

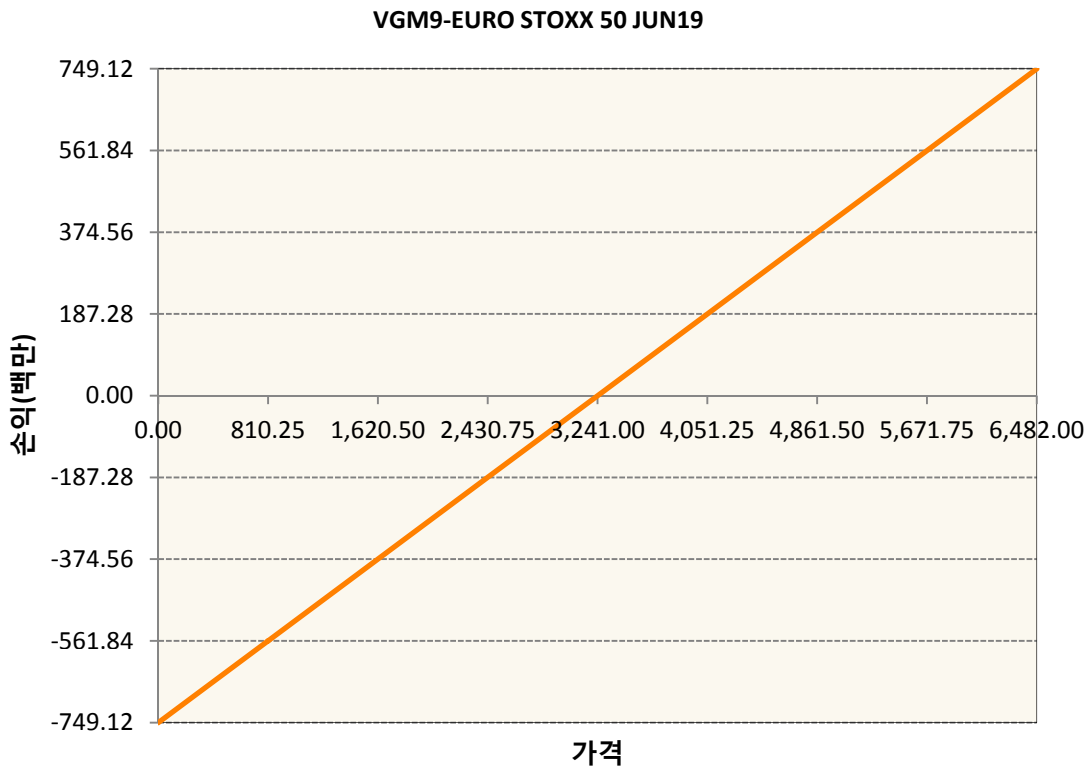
유로인덱스모(주식-파생형)

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



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-04-01
기준일	2019-03-29

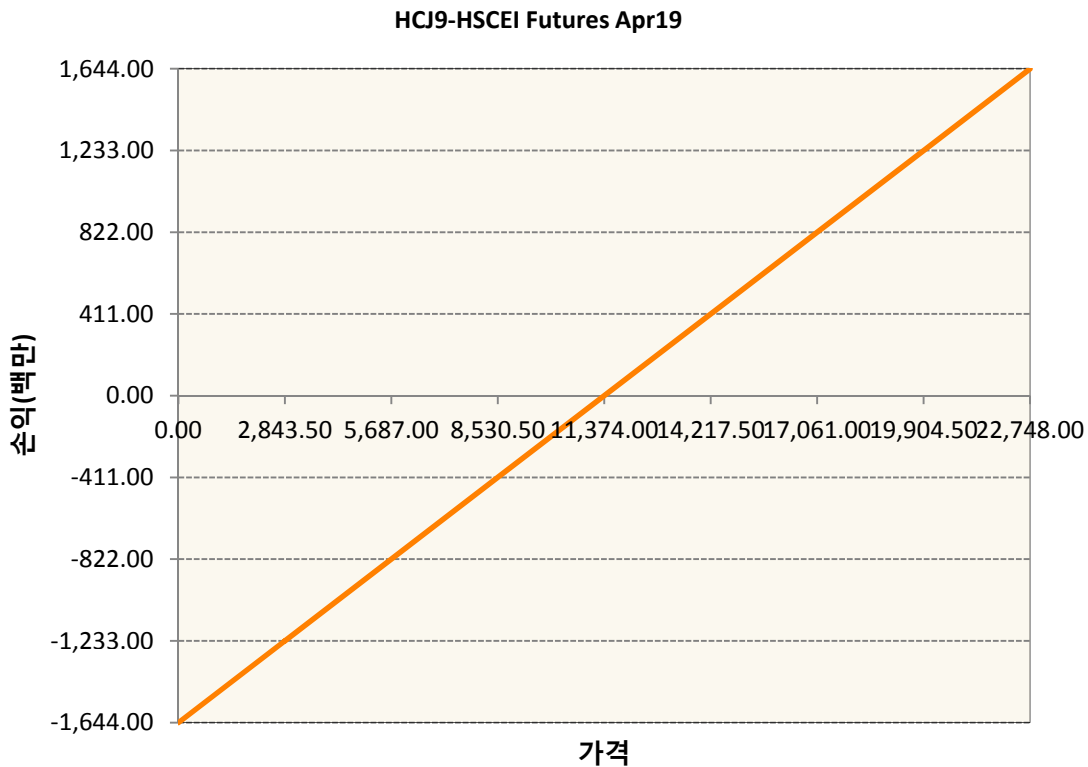
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,644	0	1,644	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ9	HSCEI Futures Apr19	132
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

135

공시일	2019-04-01
기준일	2019-03-29

커버드콜모(주식혼합-파생형)

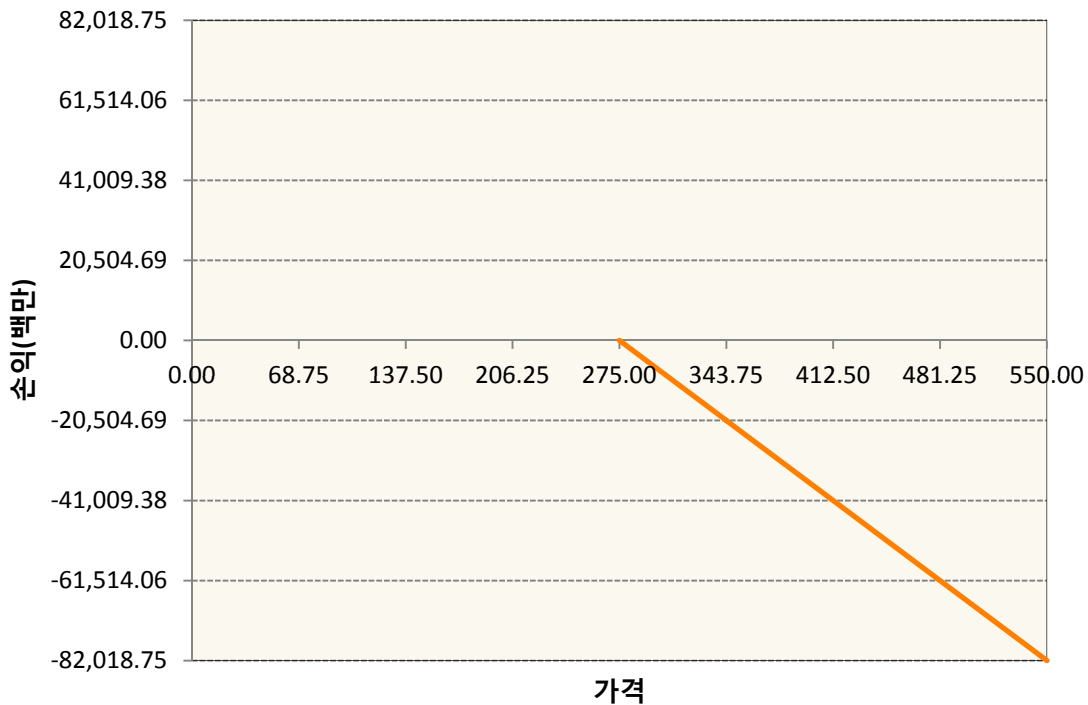
1. 계약금액

(단위:백만원)

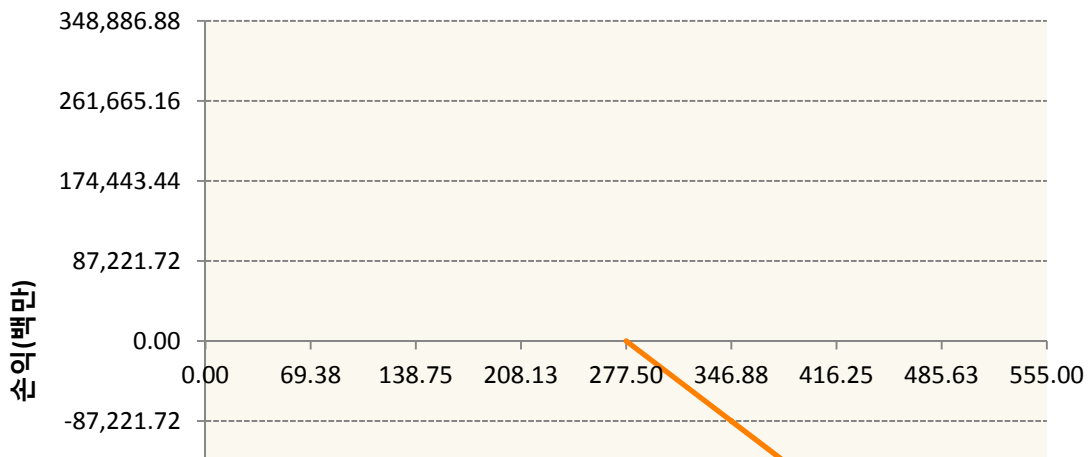
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	668,968	-668,968	장내

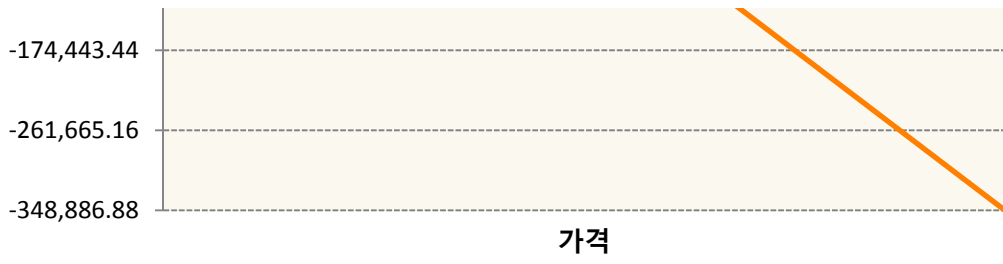
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P42752-2019-04 콜275

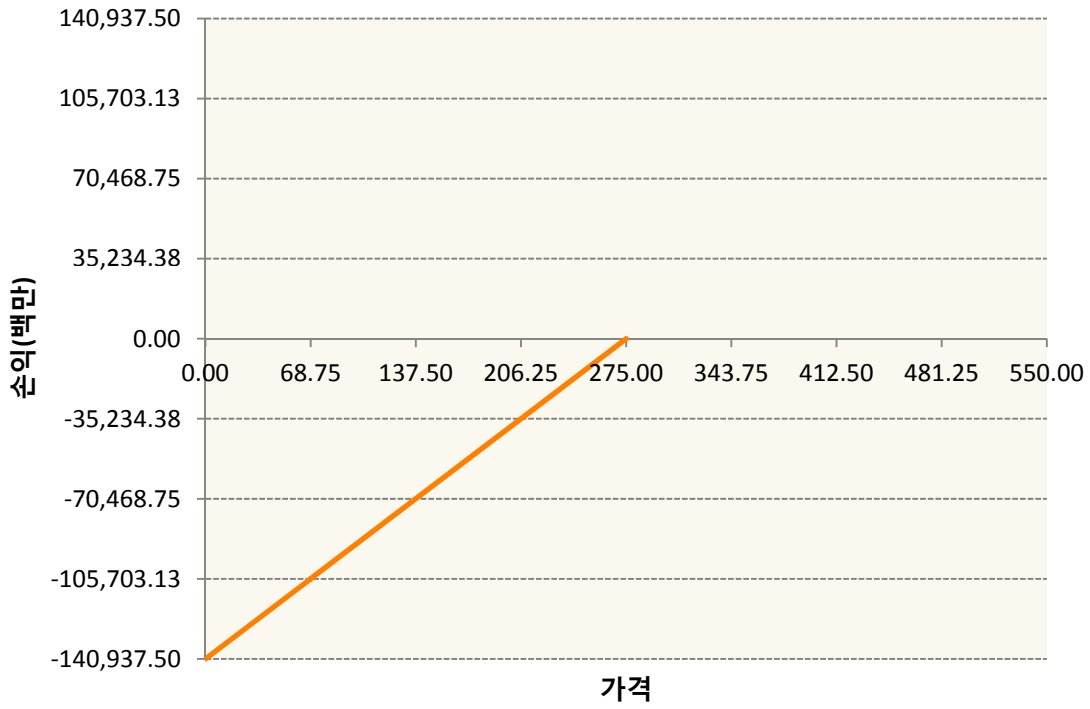


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

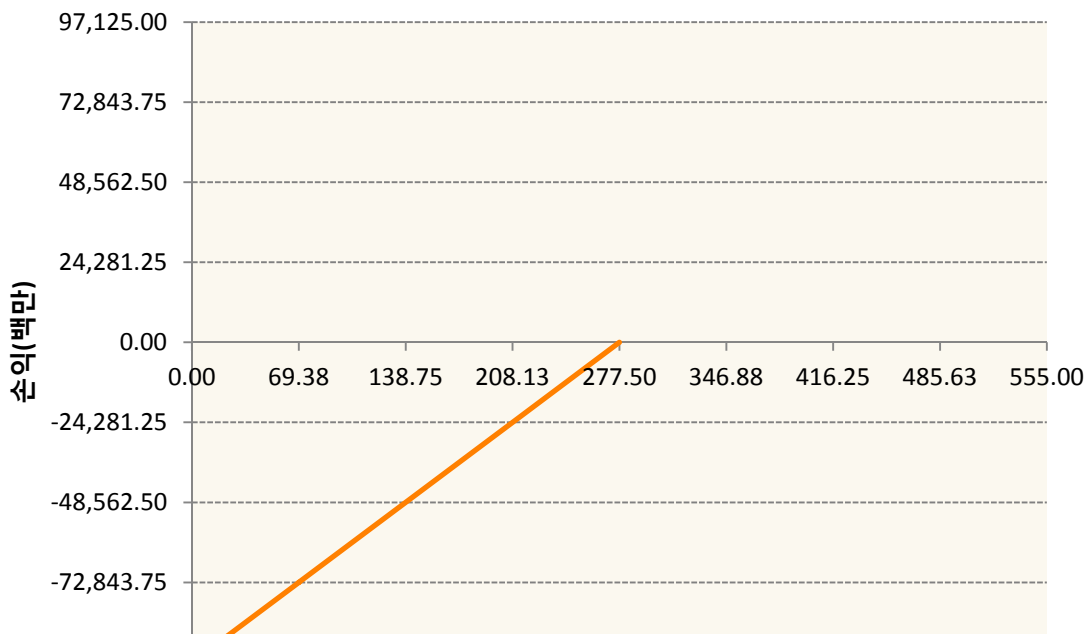




KR4301P42750-2019-04 풋275



KR4301P42776-2019-04 풋277.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P42752							2019-04 콜275		5,437
기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	1,757	1,743	1,723	1,695	1,660	1,618	1,570		
-5.33%	1,667	1,615	1,554	1,486	1,410	1,329	1,244		
-2.67%	1,299	1,192	1,082	969	853	737	618		
0%	383	256	128	0	-128	-256	-385		
2.67%	-1,156	-1,248	-1,345	-1,447	-1,554	-1,663	-1,775		
5.33%	-3,120	-3,161	-3,211	-3,271	-3,338	-3,412	-3,492		
8.00%	-5,260	-5,272	-5,291	-5,317	-5,350	-5,390	-5,437		
KR4201P42778							2019-04 콜277.5		21,651
기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	5,878	5,843	5,787	5,705	5,597	5,461	5,299		
-5.33%	5,661	5,506	5,313	5,084	4,824	4,536	4,223		
-2.67%	4,621	4,238	3,831	3,405	2,963	2,509	2,044		
0%	1,630	1,087	544	0	-544	-1,088	-1,633		
2.67%	-4,010	-4,471	-4,948	-5,436	-5,934	-6,440	-6,951		
5.33%	-11,793	-12,036	-12,320	-12,638	-12,984	-13,355	-13,747		
8.00%	-20,640	-20,724	-20,842	-20,995	-21,182	-21,402	-21,651		
KR4301P42750							2019-04 풋275		9,407
기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-9,390	-9,390	-9,391	-9,392	-9,395	-9,400	-9,407		
-5.33%	-5,621	-5,631	-5,645	-5,666	-5,693	-5,728	-5,768		
-2.67%	-2,049	-2,125	-2,209	-2,299	-2,393	-2,492	-2,593		
0%	376	251	126	0	-126	-253	-380		
2.67%	1,121	1,076	1,022	959	888	811	729		
5.33%	1,198	1,194	1,186	1,174	1,156	1,133	1,104		
8.00%	1,200	1,200	1,200	1,199	1,197	1,193	1,187		
KR4301P42776							2019-04 풋277.5		6,859
기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-6,854	-6,854	-6,854	-6,854	-6,855	-6,857	-6,859		
-5.33%	-4,276	-4,279	-4,283	-4,290	-4,300	-4,314	-4,332		
-2.67%	-1,754	-1,785	-1,823	-1,866	-1,915	-1,967	-2,023		
0%	261	174	87	0	-87	-175	-262		
2.67%	1,114	1,062	1,004	943	877	809	738		

5.33%	1,247	1,239	1,227	1,210	1,188	1,162	1,131
8.00%	1,253	1,253	1,252	1,250	1,246	1,241	1,233

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

(단위:백만원)

47,252

공시일	2019-04-01
기준일	2019-03-29

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

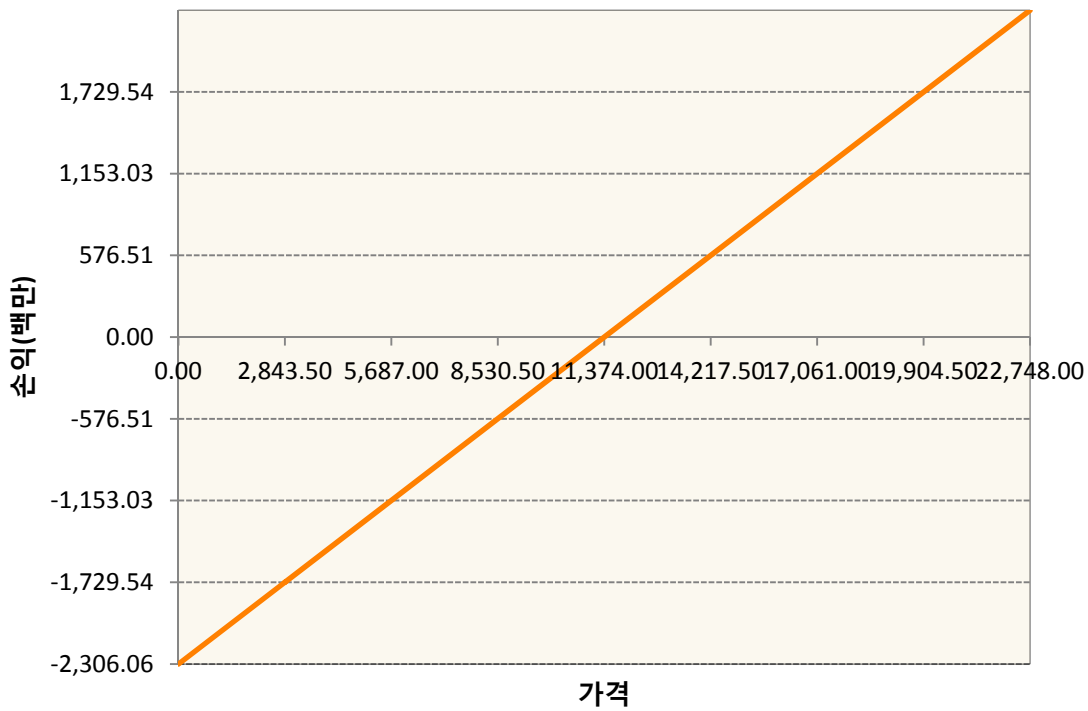
1. 계약금액

(단위:백만원)

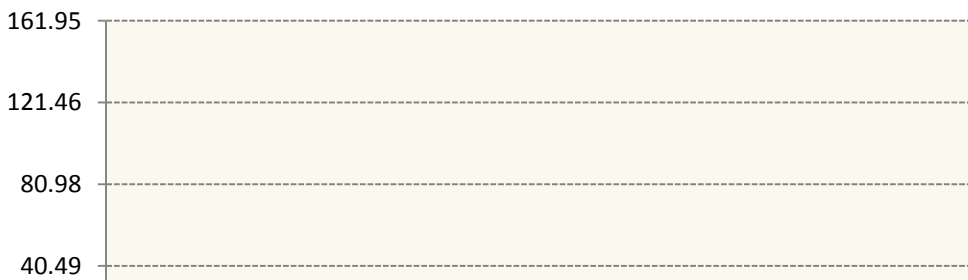
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,306	0	2,306	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,879	-5,879	장내
누계	통화	선도	0	3,037	-3,037	장외

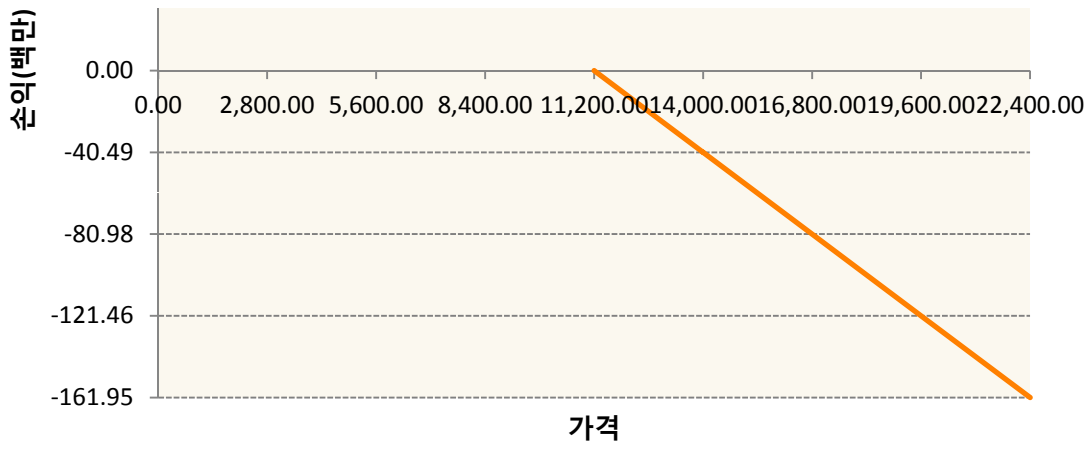
2. 만기시점의 손익구조

HCJ9-HSCEI Futures Apr19

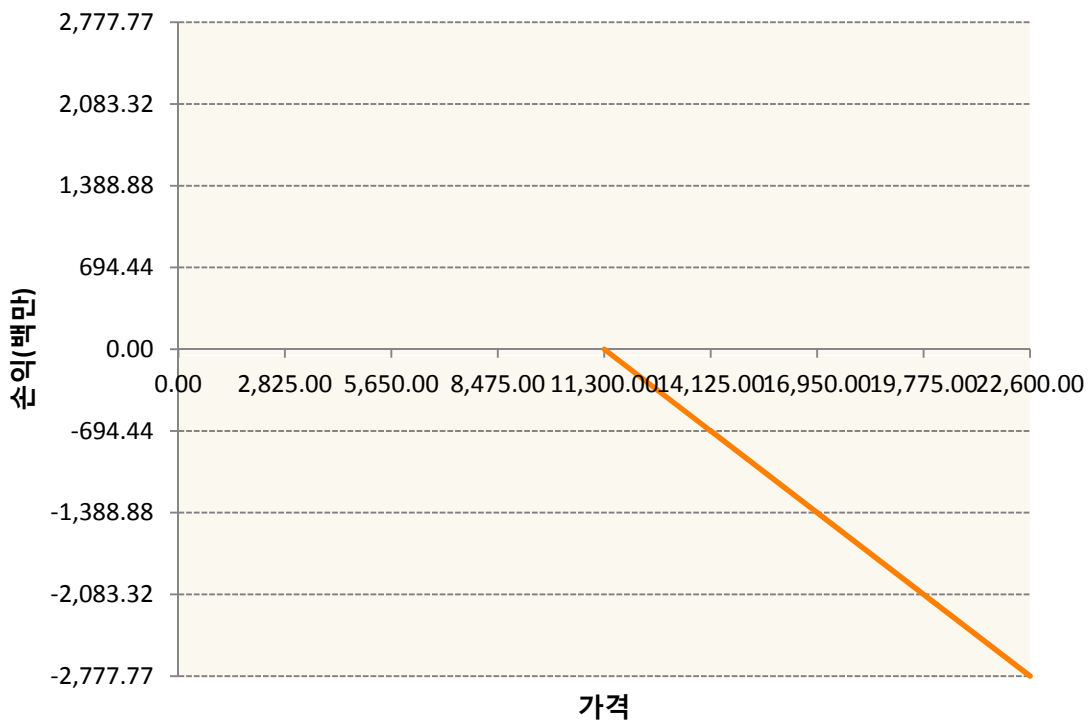


OHHIJ9-C112-HSCEI

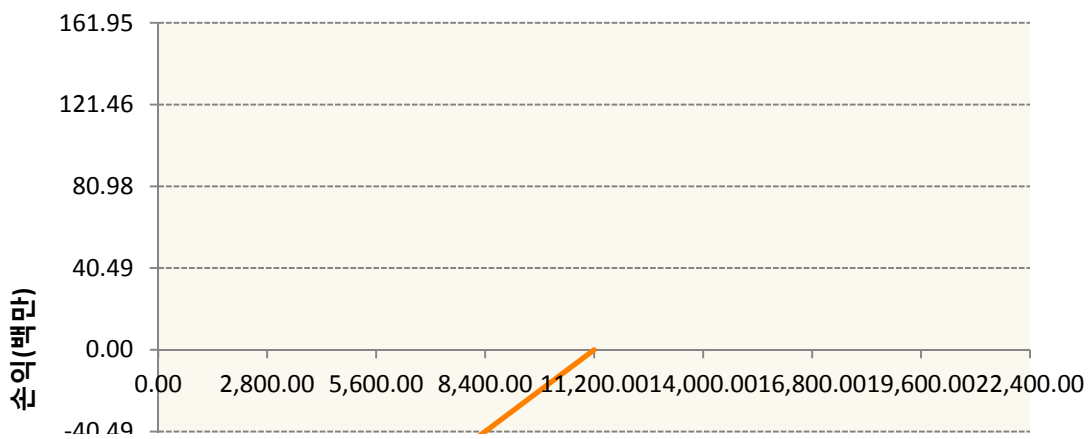


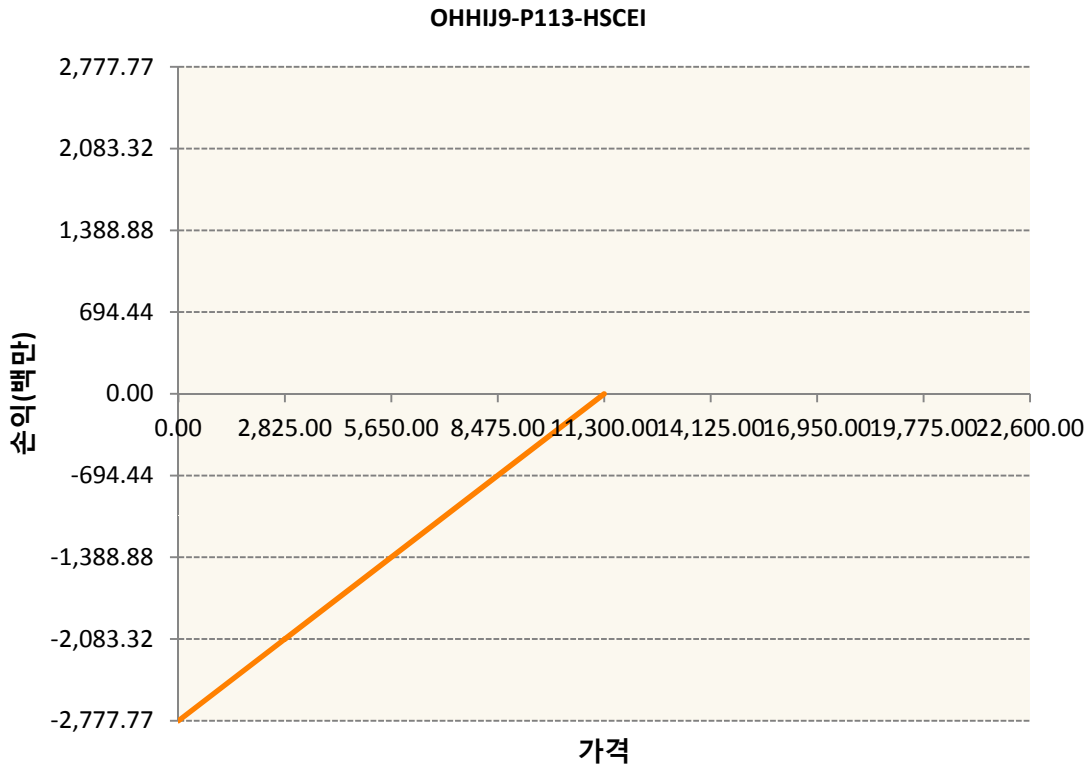


OHHIJ9-C113-HSCEI



OHHIJ9-P112-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	220
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	23
HCJ9 HSCEI Futures Apr19	184
OHHIJ9-C11 HSCEI	13
OHHIJ9-C11 HSCEI	222
OHHIJ9-P11: HSCEI	13
OHHIJ9-P11: HSCEI	222

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

756

공시일	2019-04-01
기준일	2019-03-29

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

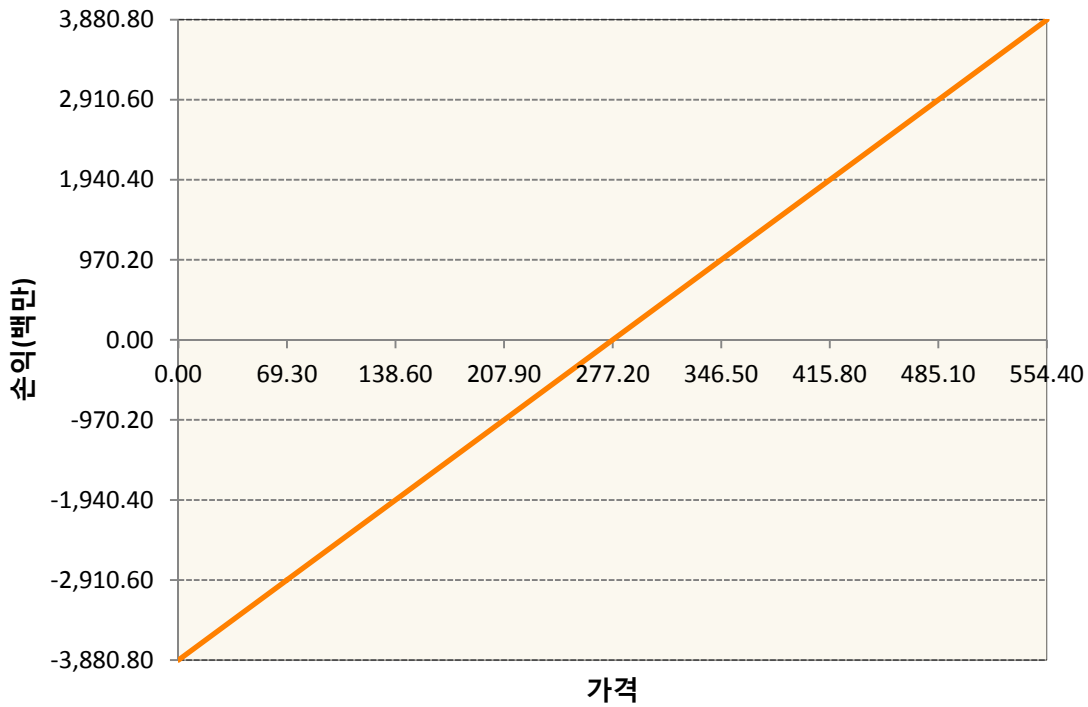
1. 계약금액

(단위:백만원)

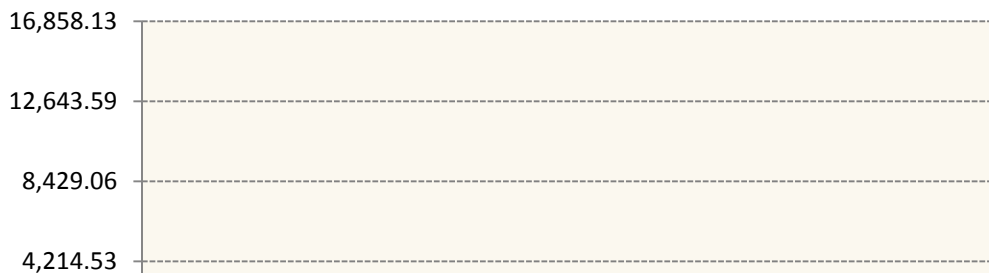
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,881	0	3,881	장내
누계	유가증권	스왑	35,836	0	35,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,649	-34,649	장내

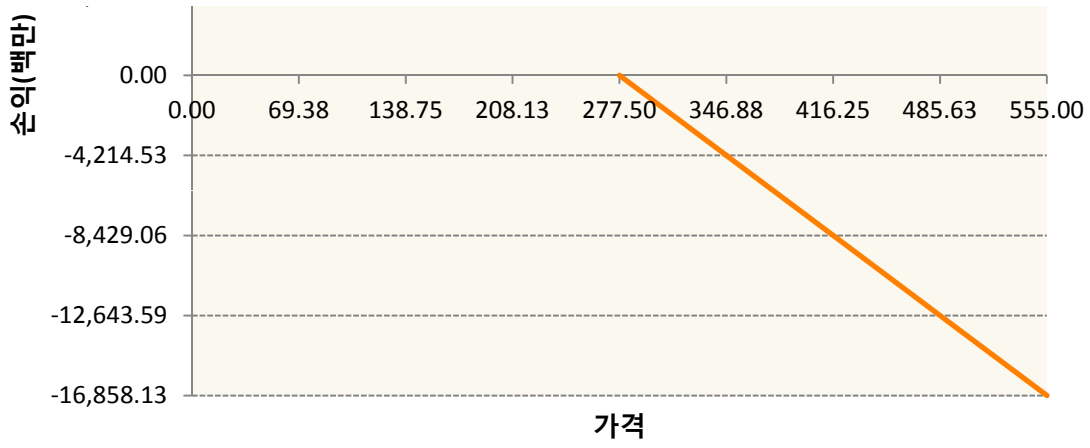
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

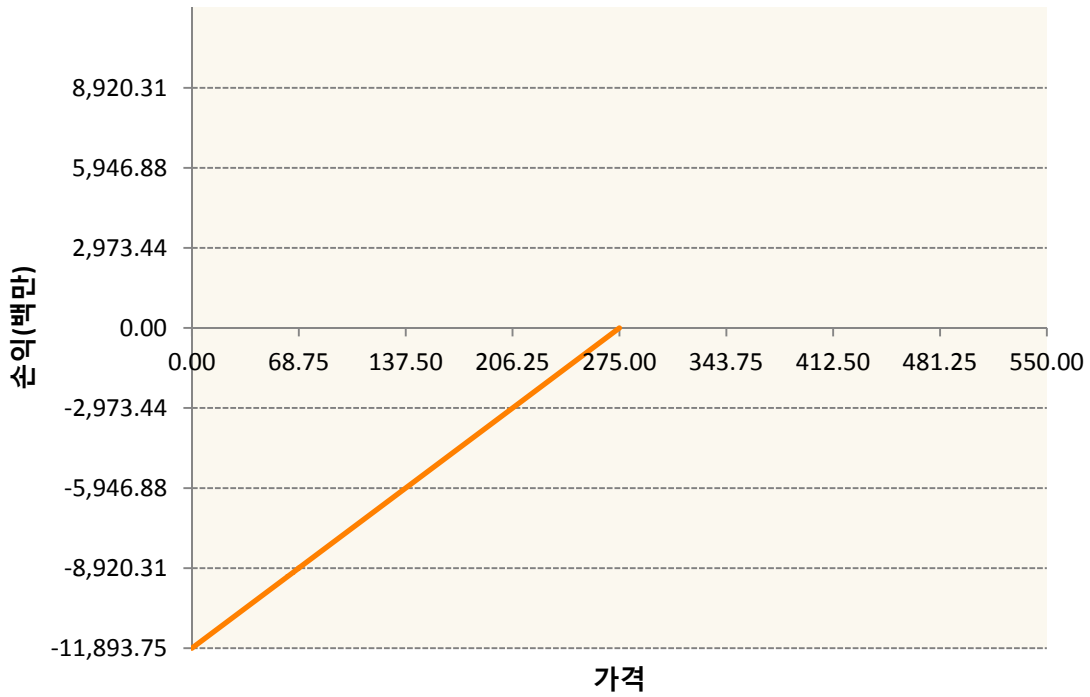


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

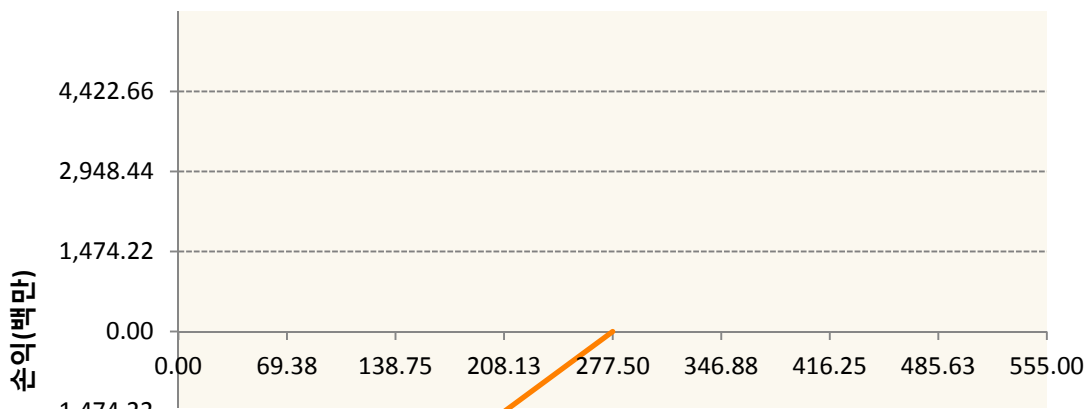


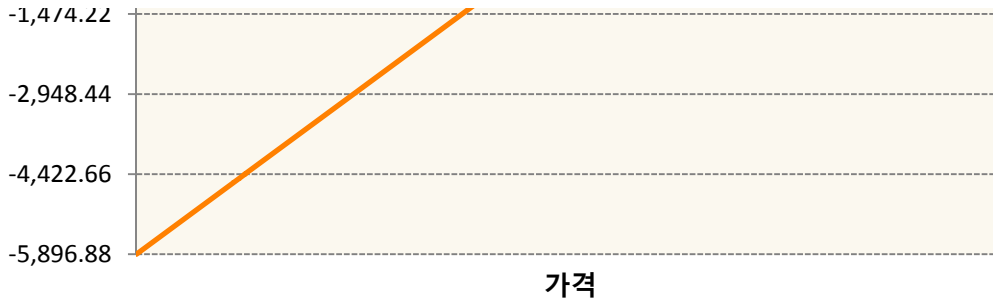


KR4301P42750-2019-04 풋275



KR4301P42776-2019-04 풋277.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,442
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,442	-2,442	-2,442	-2,442	-2,442	-2,442	-2,442	
-5.33%	-1,628	-1,628	-1,628	-1,628	-1,628	-1,628	-1,628	
-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%	1,628	1,628	1,628	1,628	1,628	1,628	1,628	
8.00%	2,442	2,442	2,442	2,442	2,442	2,442	2,442	
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						310
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-310	-310	-310	-310	-310	-310	-310	
-5.33%	-206	-206	-206	-206	-206	-206	-206	
-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%	206	206	206	206	206	206	206	
8.00%	310	310	310	310	310	310	310	
KR4201P42778		2019-04 콜277.5						1,046
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	284	282	280	276	270	264	256
-5.33%	274	266	257	246	233	219	204
-2.67%	223	205	185	165	143	121	99
0%	79	53	26	0	-26	-53	-79
2.67%	-194	-216	-239	-263	-287	-311	-336
5.33%	-570	-582	-595	-611	-627	-645	-664
8.00%	-997	-1,001	-1,007	-1,014	-1,024	-1,034	-1,046
KR4301P42750 2019-04 풋275							794
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-792	-792	-792	-793	-793	-793	-794
-5.33%	-474	-475	-476	-478	-480	-483	-487
-2.67%	-173	-179	-186	-194	-202	-210	-219
0%	32	21	11	0	-11	-21	-32
2.67%	95	91	86	81	75	68	62
5.33%	101	101	100	99	98	96	93
8.00%	101	101	101	101	101	101	100
KR4301P42776 2019-04 풋277.5							416
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-416	-416	-416	-416	-416	-416	-416
-5.33%	-260	-260	-260	-260	-261	-262	-263
-2.67%	-106	-108	-111	-113	-116	-119	-123
0%	16	11	5	0	-5	-11	-16
2.67%	68	64	61	57	53	49	45
5.33%	76	75	74	73	72	71	69
8.00%	76	76	76	76	76	75	75

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

(단위:백만원)

5,795

공시일	2019-04-01
기준일	2019-03-29

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

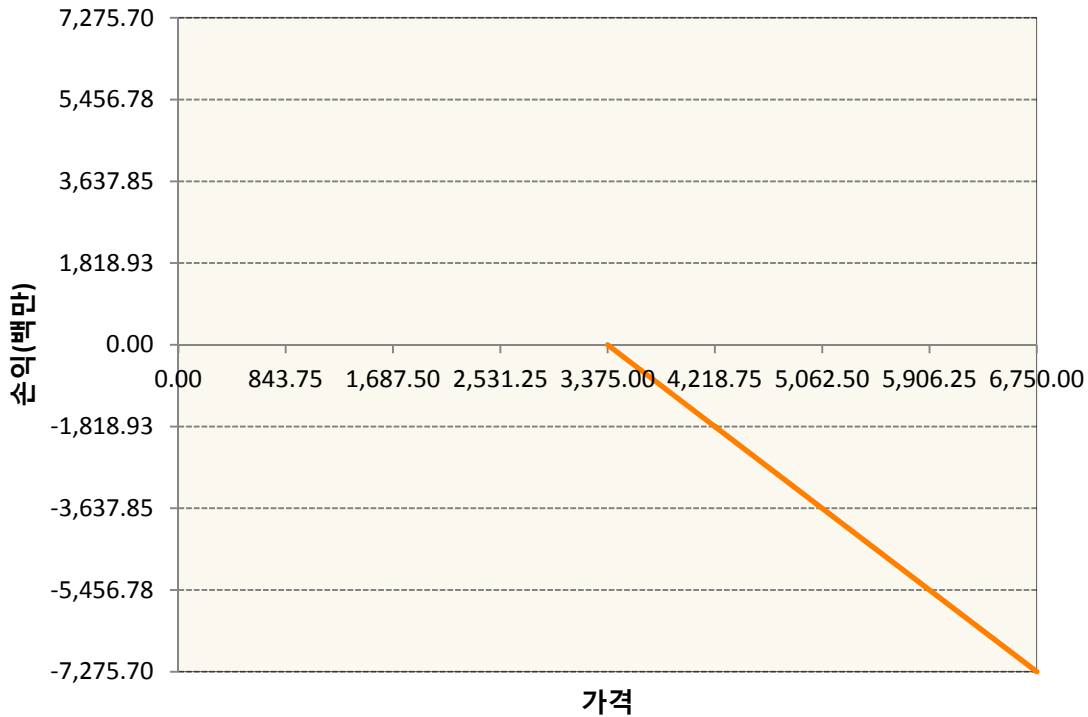
1. 계약금액

(단위:백만원)

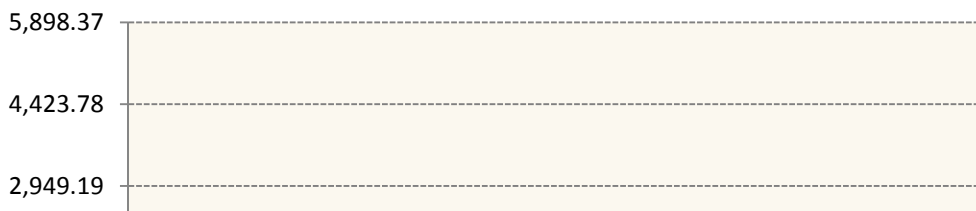
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,243	0	6,243	
누계	유가증권	스왑	60,221	0	60,221	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,348	-26,348	장내
누계	통화	선도	0	15,307	-15,307	장외

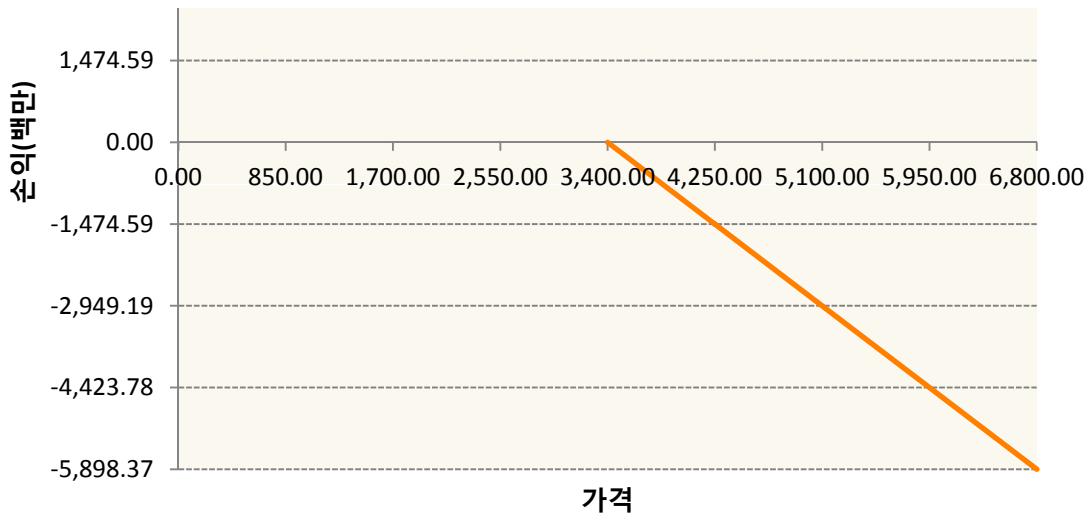
2. 만기시점의 손익구조

OESXJ9-C3375-EURO STOXX 50

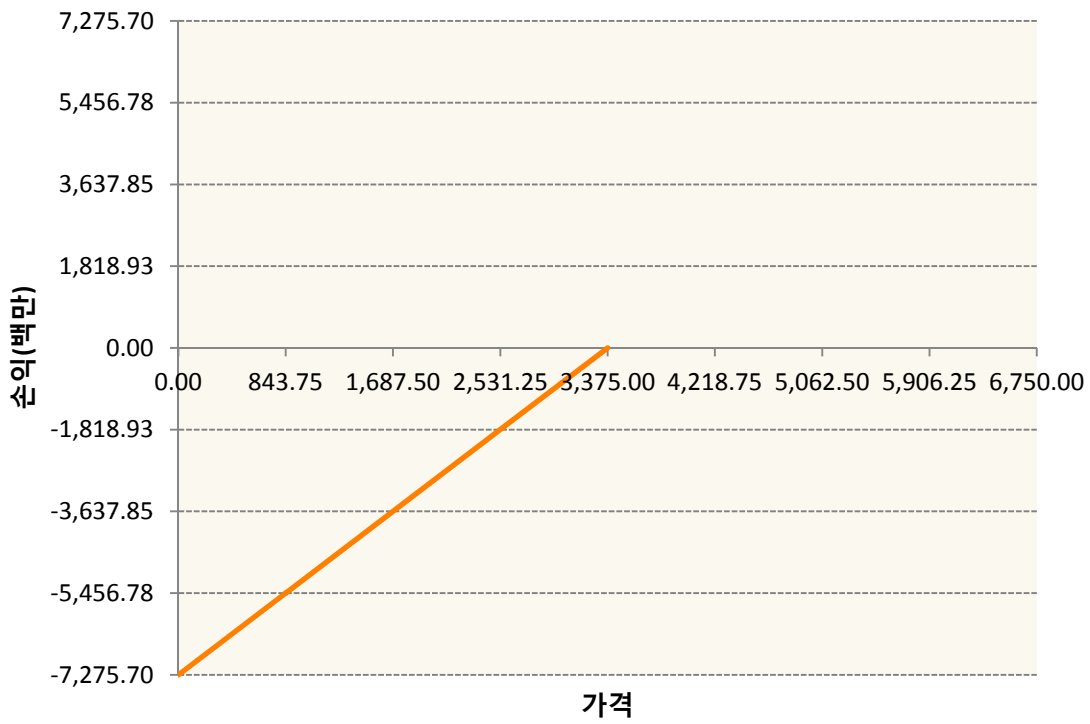


OESXJ9-C3400-EURO STOXX 50

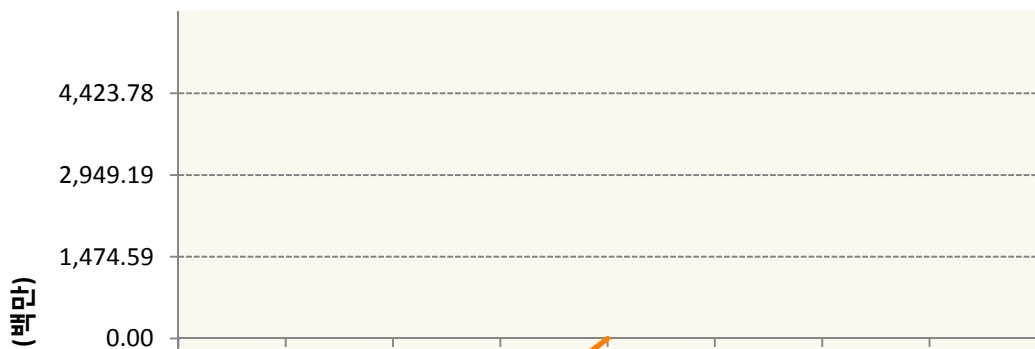


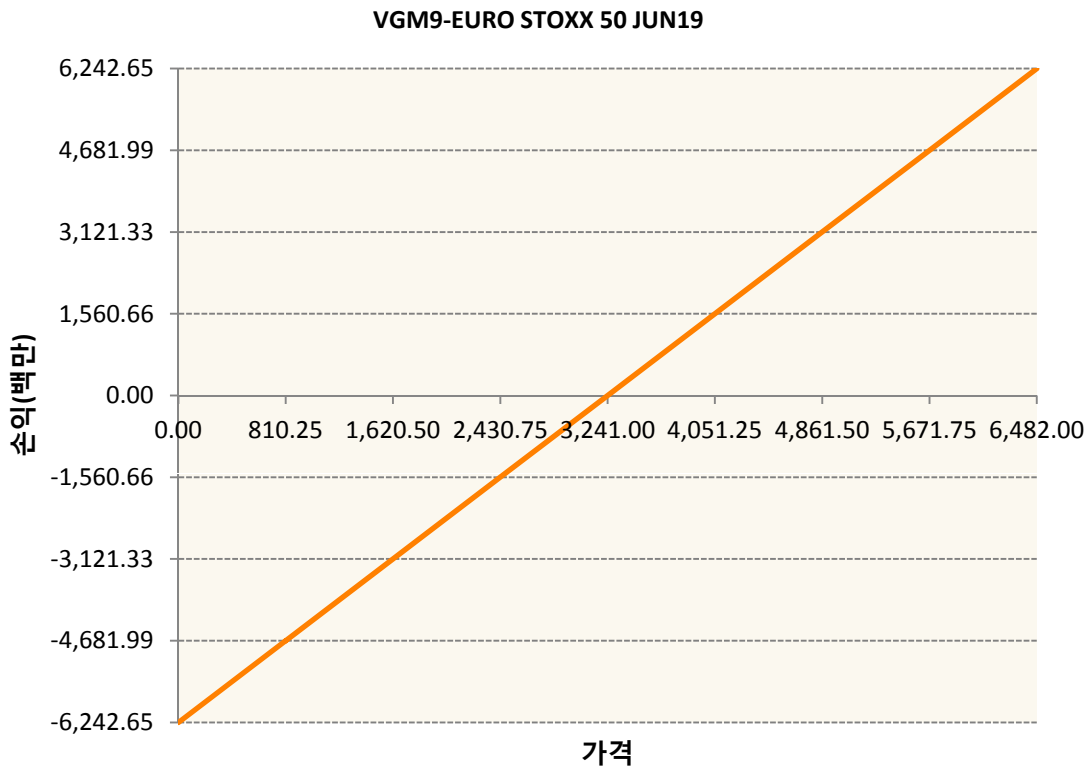
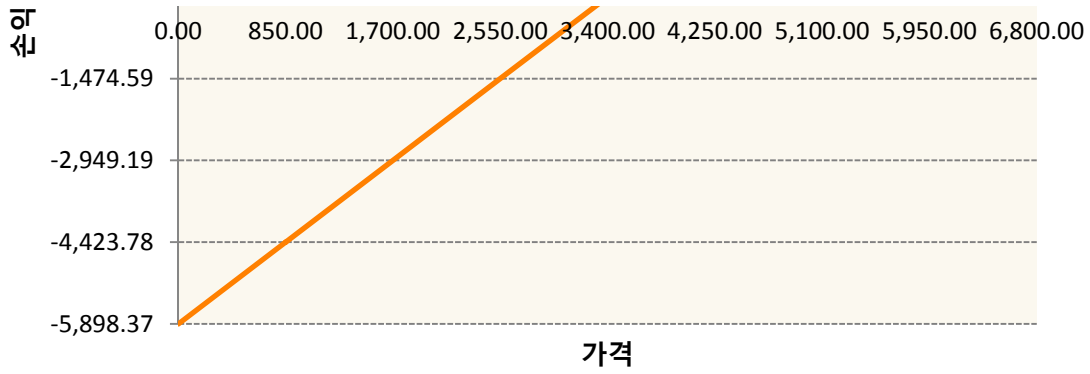


OESXJ9-P3375-EURO STOXX 50



OESXJ9-P3400-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	82
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	408
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	816
OESXJ9-C33` EURO STOXX 50	582
OESXJ9-C34` EURO STOXX 50	472
OESXJ9-P33` EURO STOXX 50	582
OESXJ9-P34` EURO STOXX 50	472
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	499

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

(단위:백만원)

2,583

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

(단위:백만원)

1,096

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	2019-04-01
기준일	2019-03-29

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

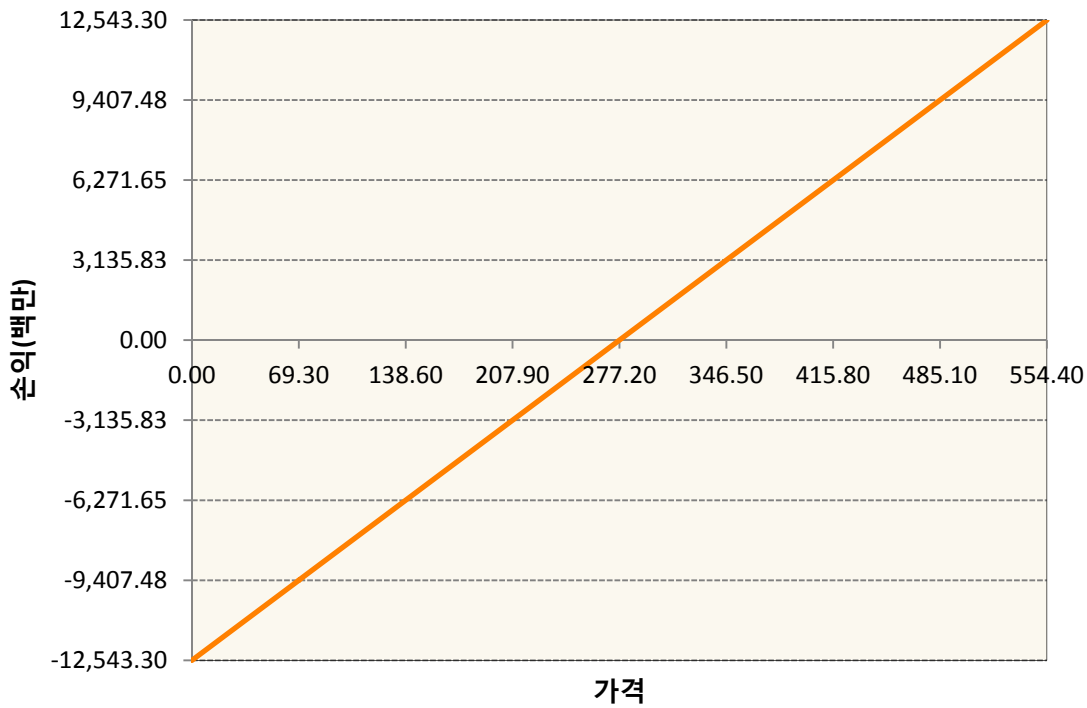
1. 계약금액

(단위:백만원)

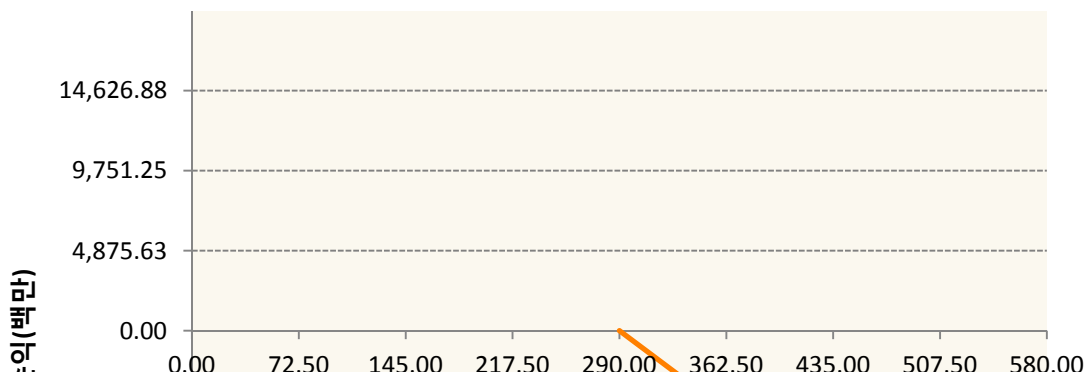
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,543	0	12,543	장내
누계	유가증권	옵션	1,867	24,036	-22,169	장내

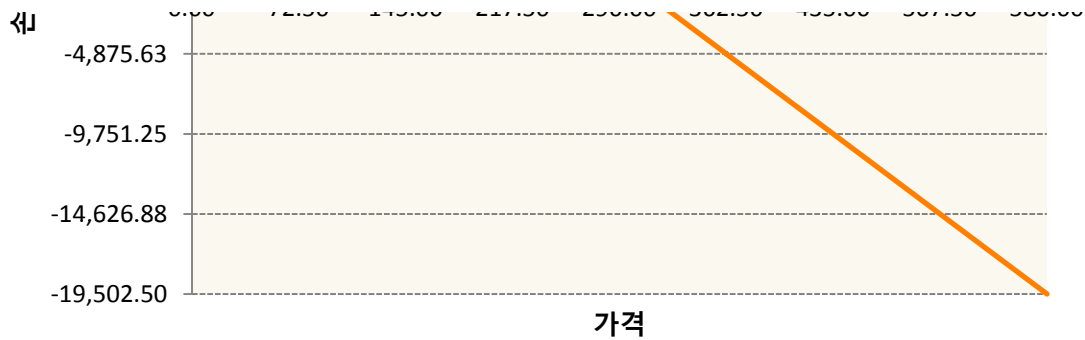
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

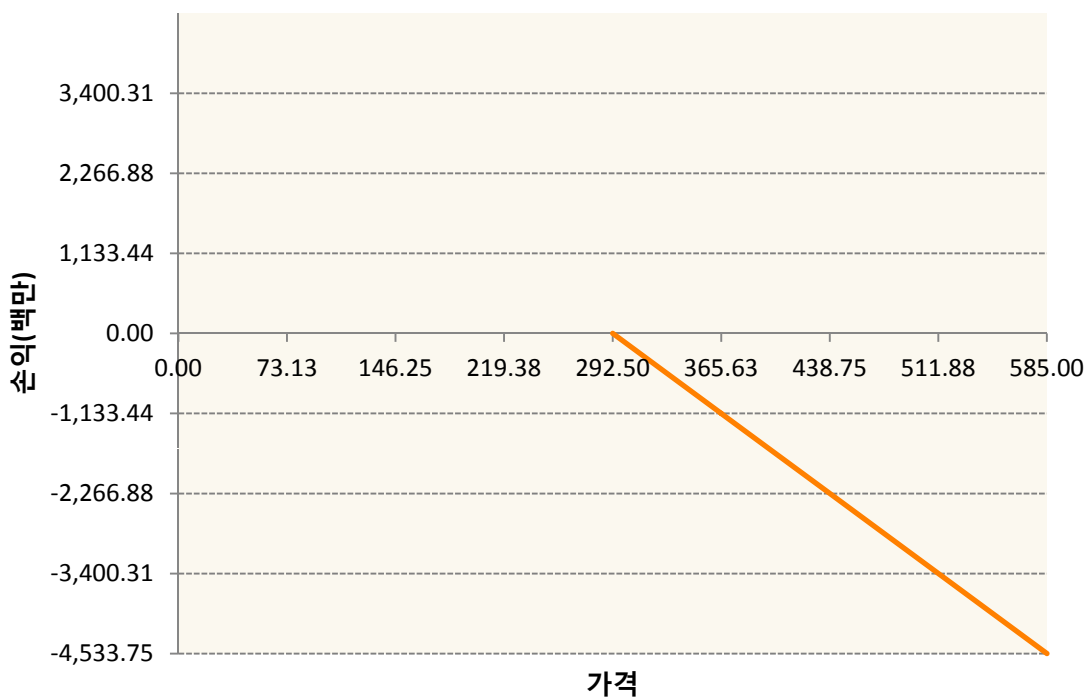


KR4201P42901-2019-04 콜290

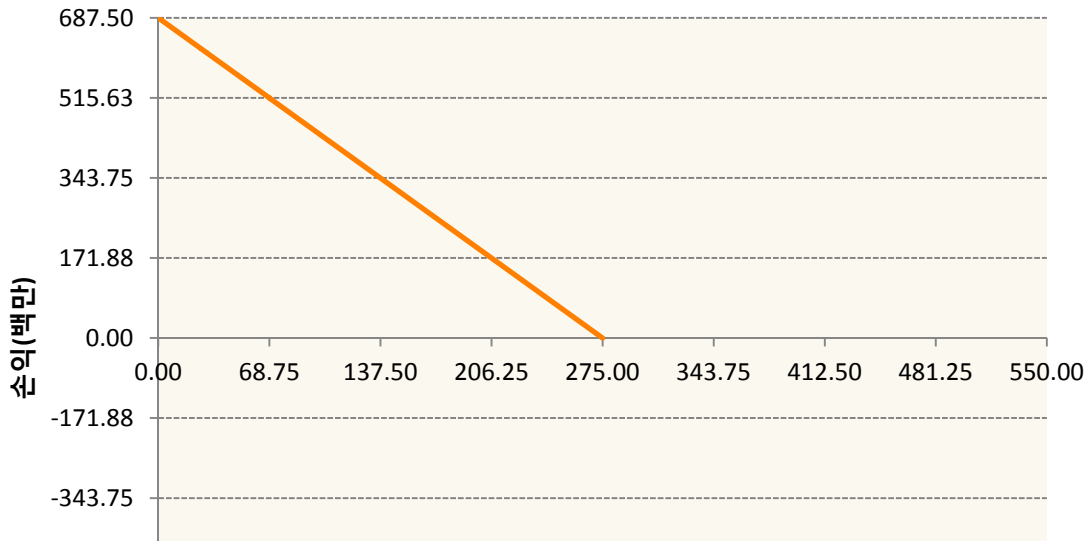


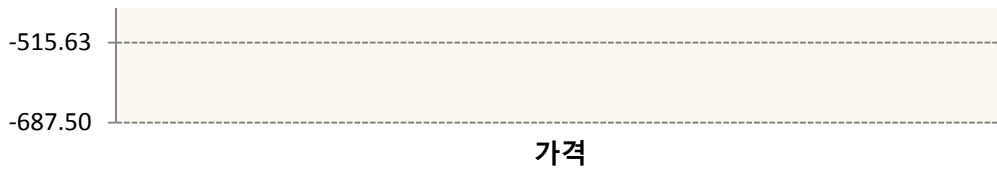


KR4201P42927-2019-04 콜292.5

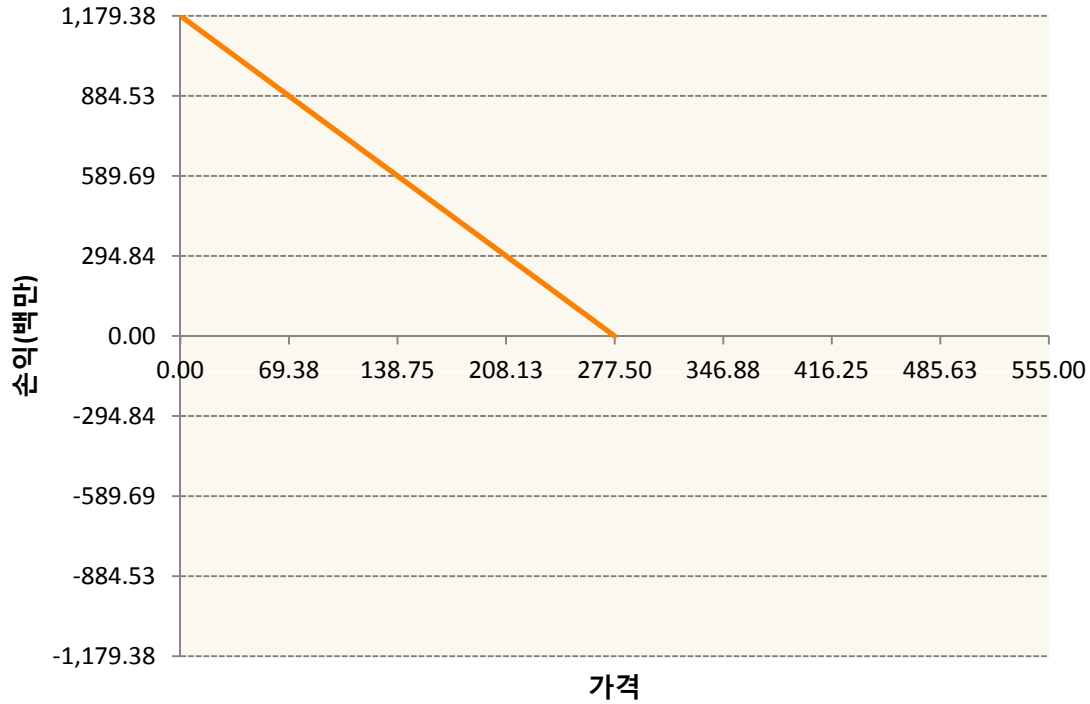


KR4301P42750-2019-04 풋275





KR4301P42776-2019-04 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						1,001
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,001	-1,001	-1,001	-1,001	-1,001	-1,001	-1,001	
-5.33%	-667	-667	-667	-667	-667	-667	-667	
-2.67%	-334	-334	-334	-334	-334	-334	-334	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	334	334	334	334	334	334	334	
5.33%	667	667	667	667	667	667	667	
8.00%	1,001	1,001	1,001	1,001	1,001	1,001	1,001	
KR4201P42901		2019-04 콜290						735
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	73	73	72	72	71	70	68	
-5.33%	72	72	70	68	65	60	55	
-2.67%	69	65	59	51	42	31	19	

0%	45	32	17	0	-19	-38	-59
2.67%	-41	-66	-93	-120	-147	-175	-203
5.33%	-245	-275	-305	-336	-366	-397	-428
8.00%	-583	-606	-630	-655	-681	-708	-735
KR4201P42927 2019-04 콜292.5							149
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12	12	12	12	12	11	11
-5.33%	12	12	11	11	11	10	9
-2.67%	11	11	10	9	7	5	3
0%	8	6	3	0	-4	-7	-12
2.67%	-6	-11	-16	-22	-27	-33	-39
5.33%	-42	-49	-56	-64	-71	-78	-85
8.00%	-110	-116	-123	-129	-136	-143	-149
KR4301P42750 2019-04 풋275							46
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	46	46	46	46	46	46	46
-5.33%	27	27	28	28	28	28	28
-2.67%	10	10	11	11	12	12	13
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-5	-5	-5	-5	-4	-4	-4
5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-5
8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
KR4301P42776 2019-04 풋277.5							83
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	83	83	83	83	83	83	83
-5.33%	52	52	52	52	52	52	53
-2.67%	21	22	22	23	23	24	25
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-14	-13	-12	-11	-11	-10	-9
5.33%	-15	-15	-15	-15	-14	-14	-14
8.00%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15

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

(단위:백만원)

1,595

공시일	2019-04-01
기준일	2019-03-29

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	2,566	0	2,566	

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	2019-04-01
기준일	2019-03-29

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	11,727	0	11,727	

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	2019-04-01
기준일	2019-03-29

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	61,831	0	61,831	
누계	통화	선도	0	65,495	-65,495	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
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		418
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E		182
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E		454
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E		527
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E		320
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E		272
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E		45
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E		91
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E		91

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

(단위:백만원)

1,833

공시일	2019-04-01
기준일	2019-03-29

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

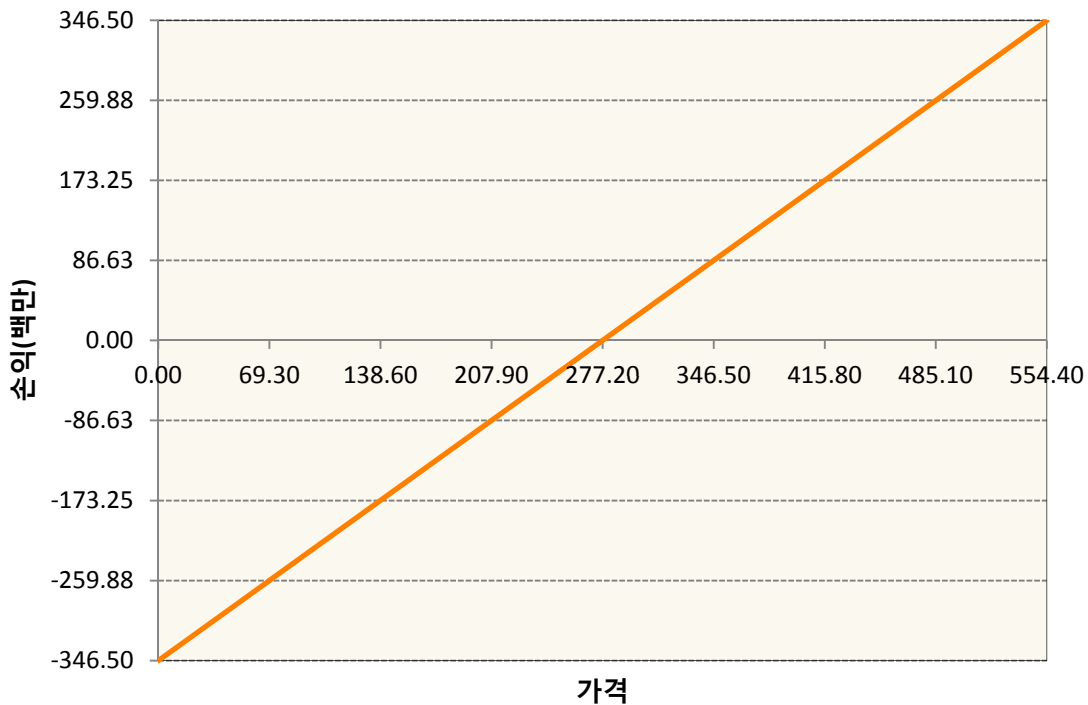
1. 계약금액

(단위:백만원)

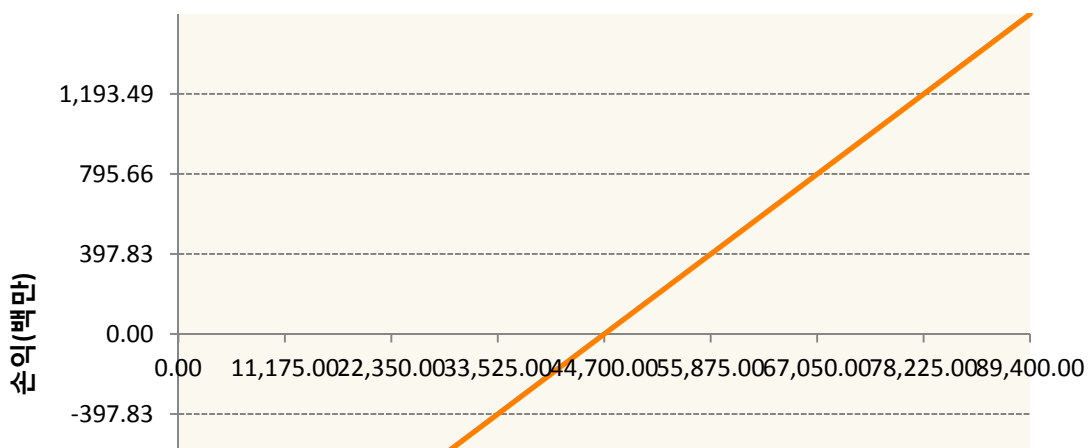
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,938	0	1,938	장내

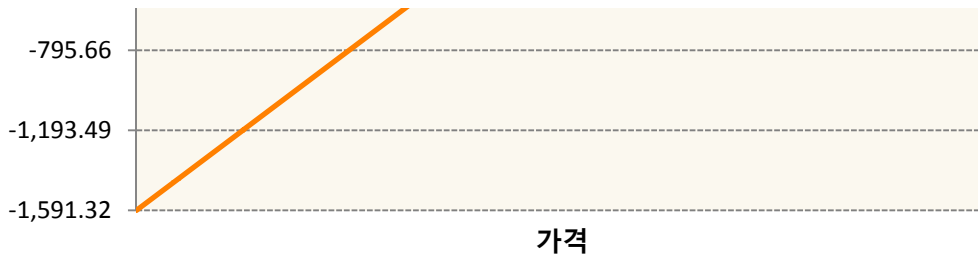
2. 만기시점의 손익구조

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						127
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127	
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85	
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	42	42	42	42	42	42	42	
5.33%	85	85	85	85	85	85	85	
8.00%	127	127	127	127	127	127	127	

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

174

공시일	2019-04-01
기준일	2019-03-29

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

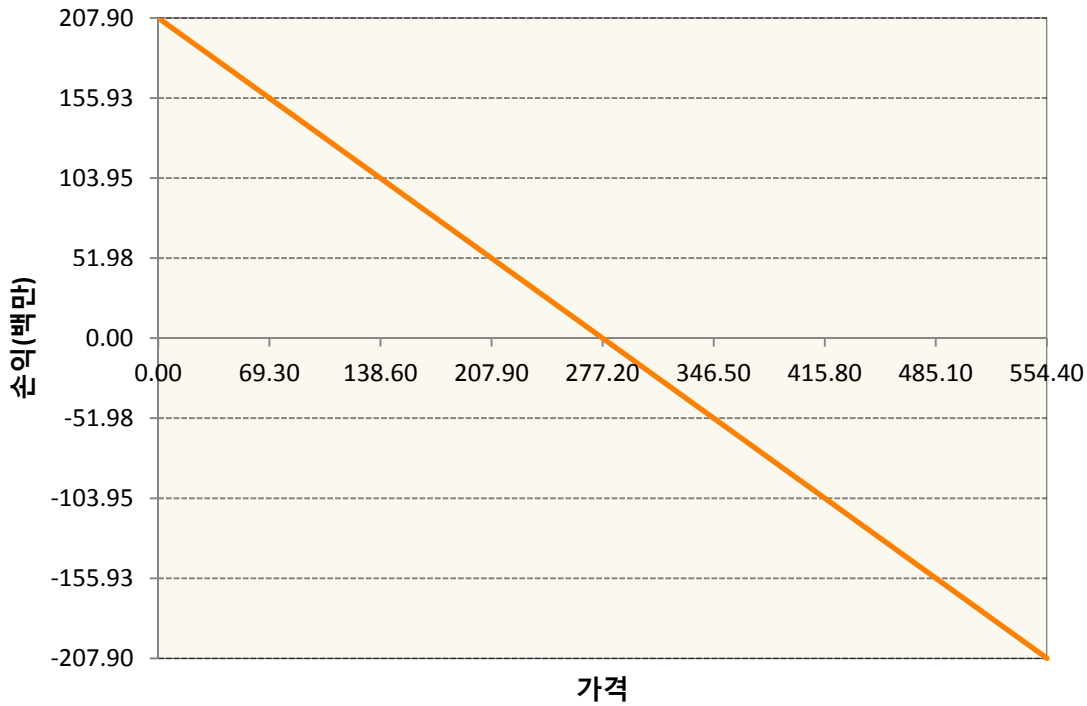
1. 계약금액

(단위:백만원)

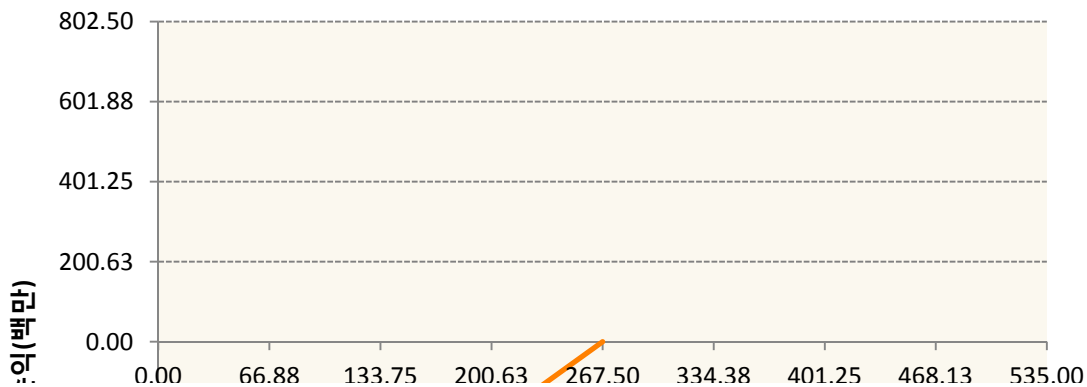
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	67	-67	장내
누계	유가증권	선물	0	208	-208	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,275	-1,275	장내

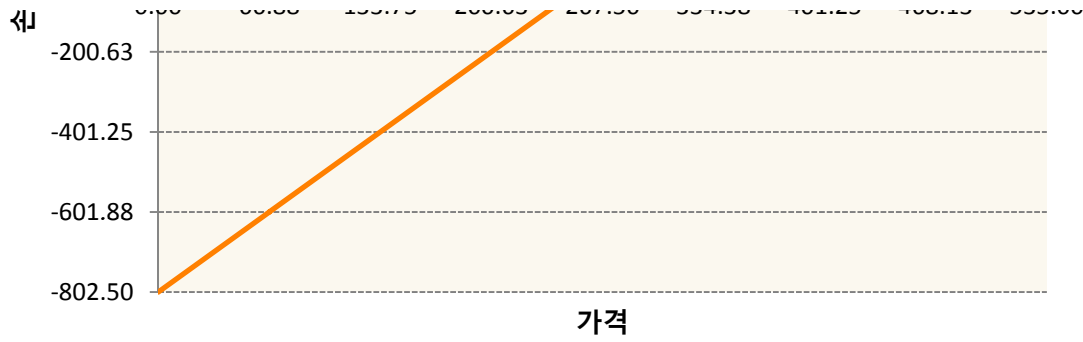
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

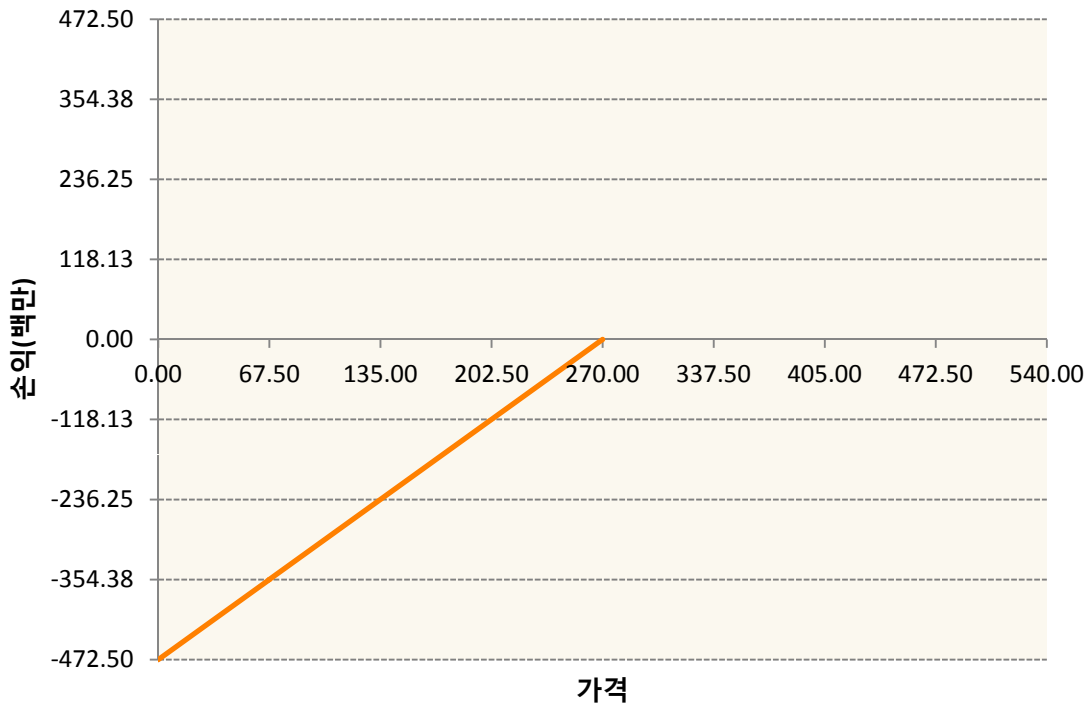


KR4301P42677-2019-04 풋267.5





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						39
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-38	-38	-38	-39	-39	-39	-39
-5.33%	-17	-18	-18	-19	-19	-20	-20
-2.67%	-3	-4	-5	-5	-6	-7	-8
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

26

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
-5.33%	-13	-14	-14	-14	-14	-14	-15
-2.67%	-3	-4	-4	-5	-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

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

(단위:백만원)

68

공시일	2019-04-01
기준일	2019-03-29

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

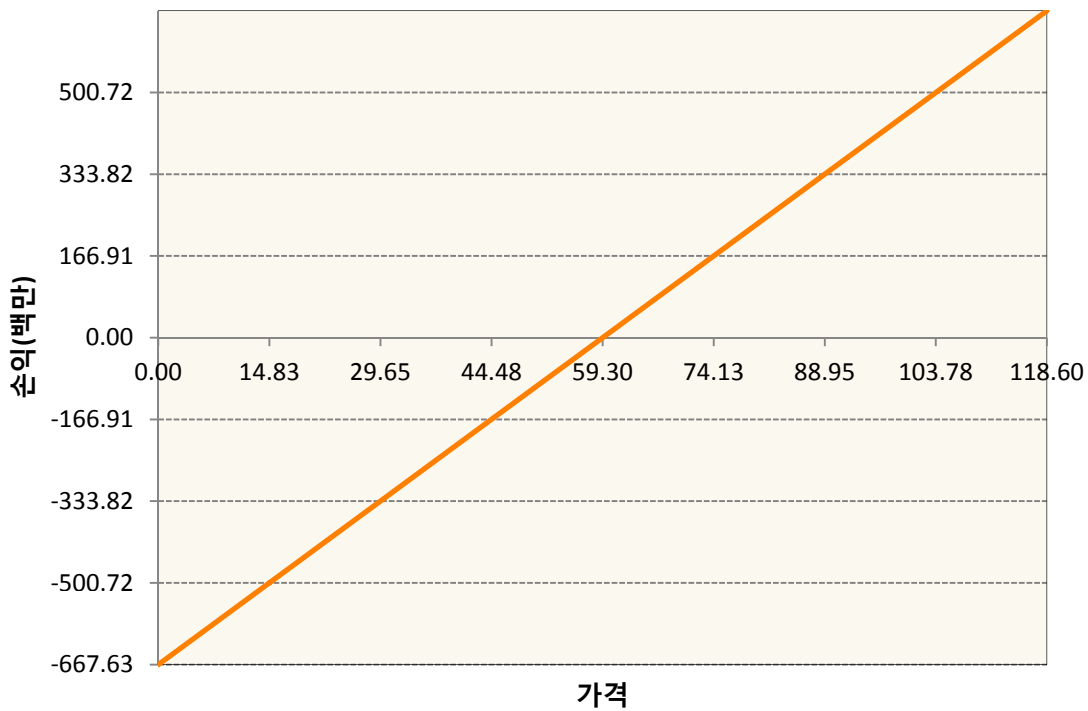
1. 계약금액

(단위:백만원)

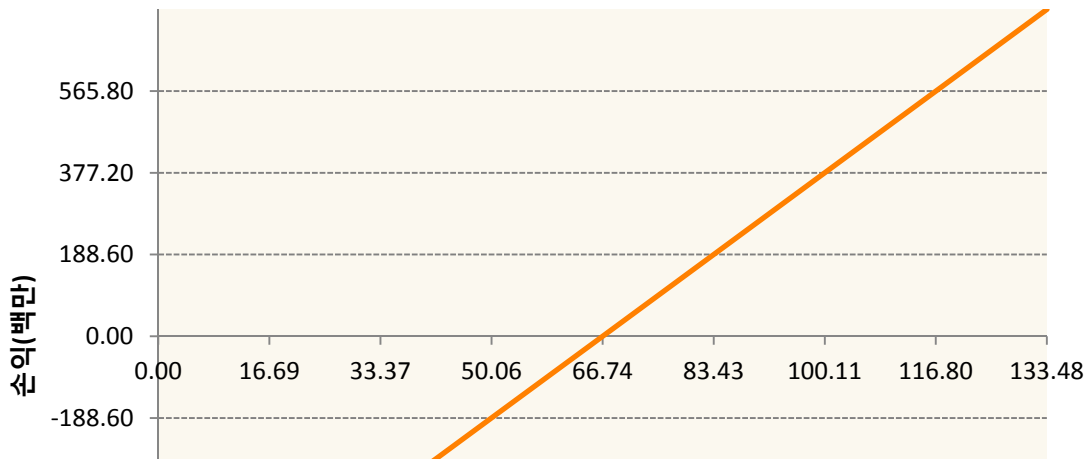
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,845	284	2,562	

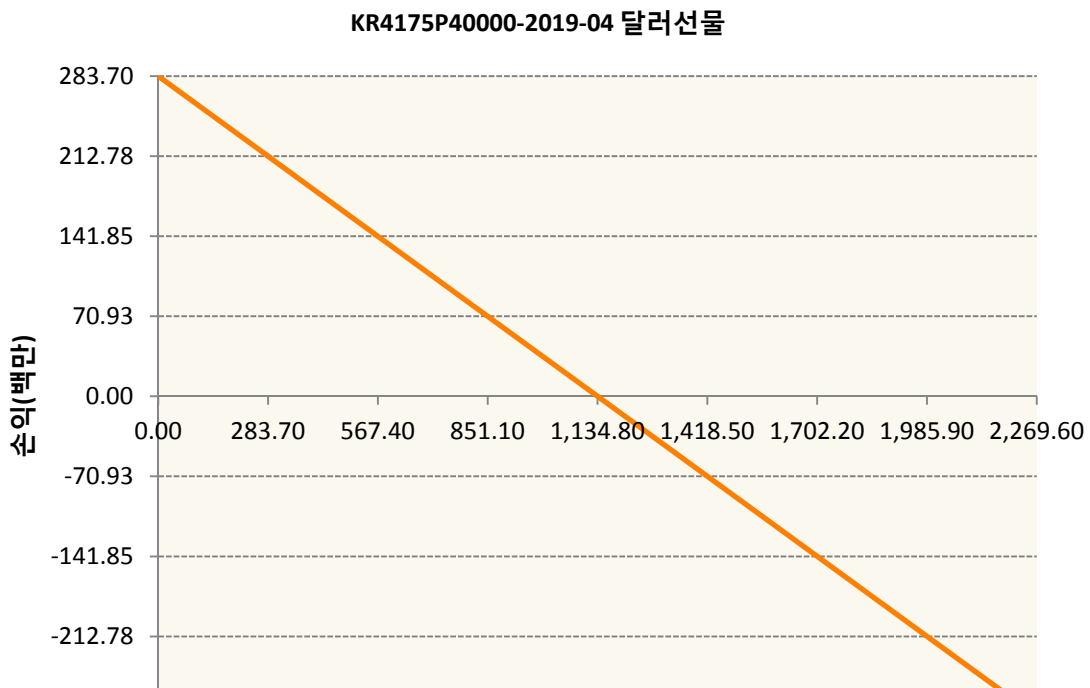
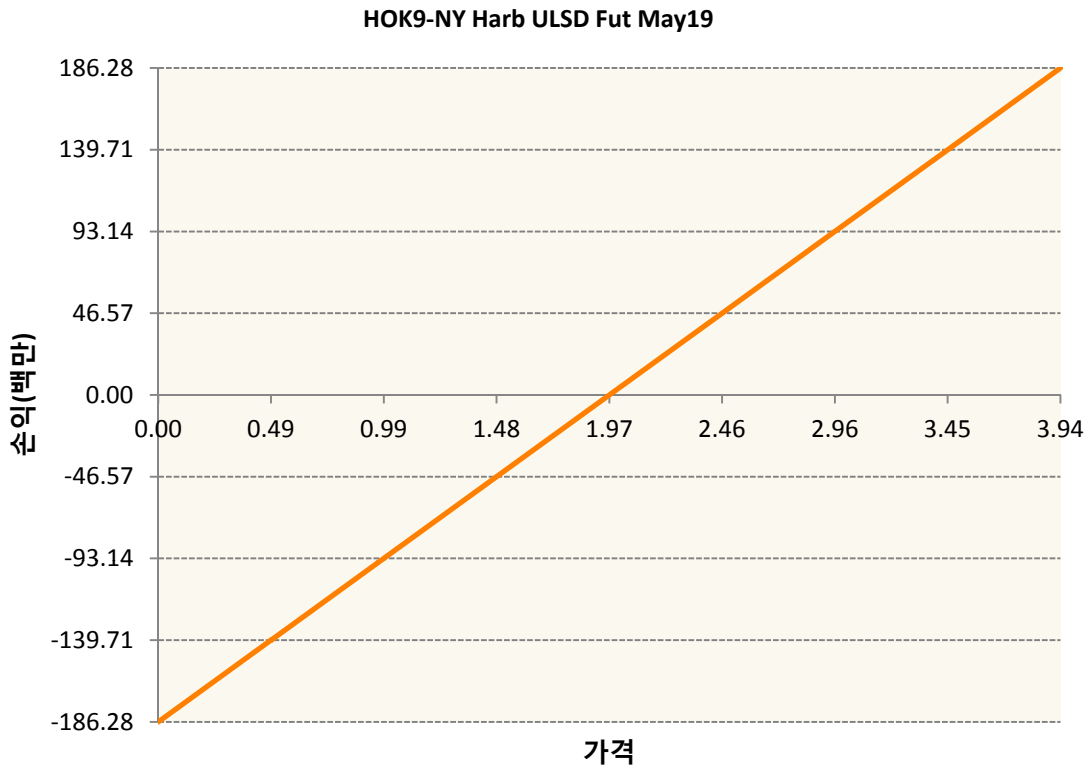
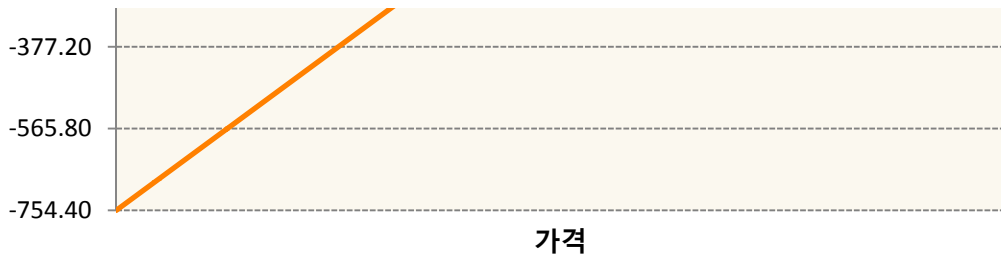
2. 만기시점의 손익구조

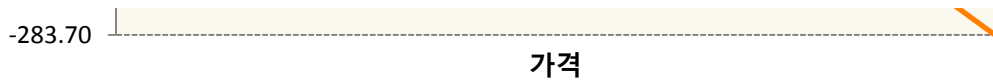
CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19



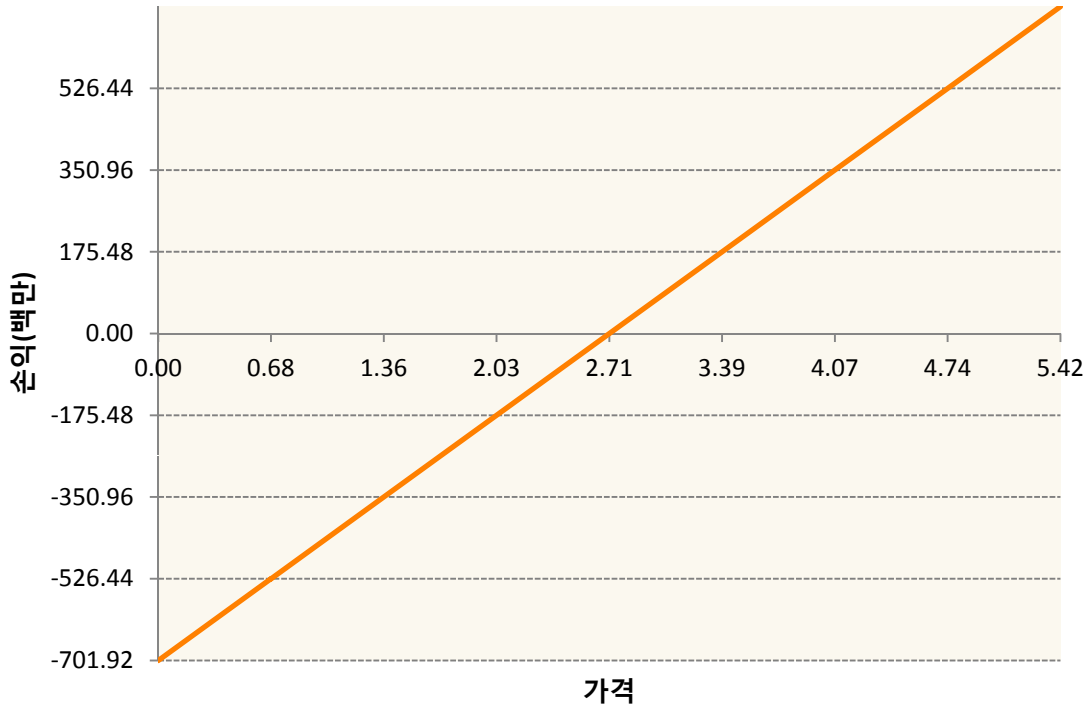
CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19



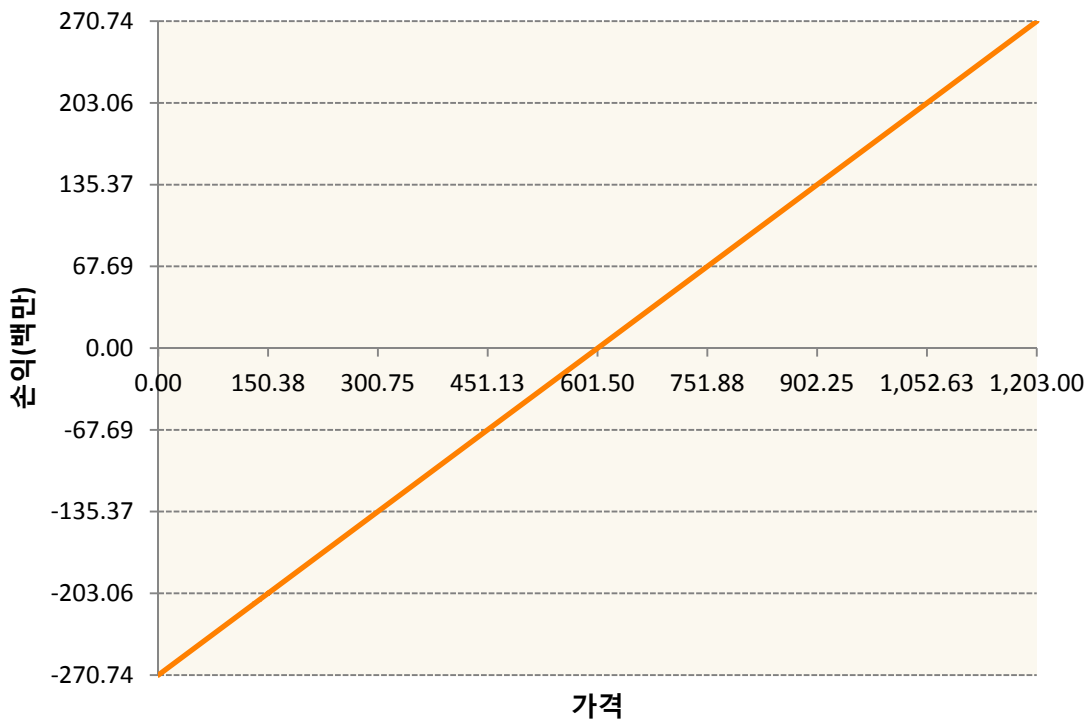




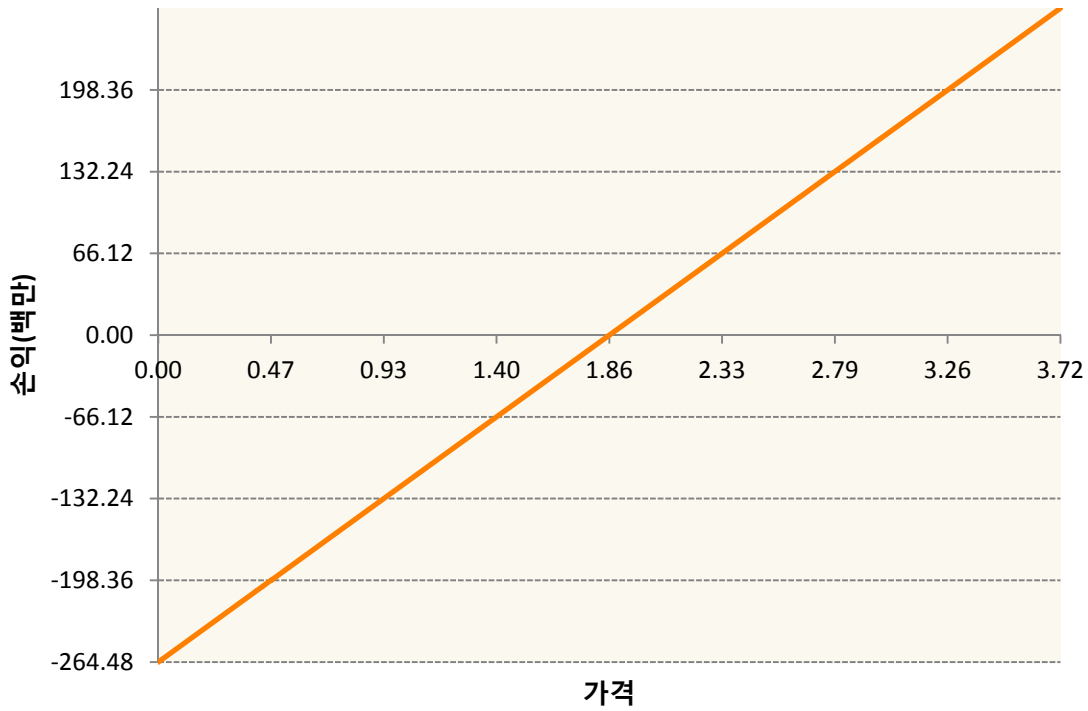
NGK19-NATURAL GAS FUTR May19



QSK9-Low Su Gasoil G May19



XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK9	WTI CRUDE FUTURE May19	53
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)

430

공시일	2019-04-01
기준일	2019-03-29

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

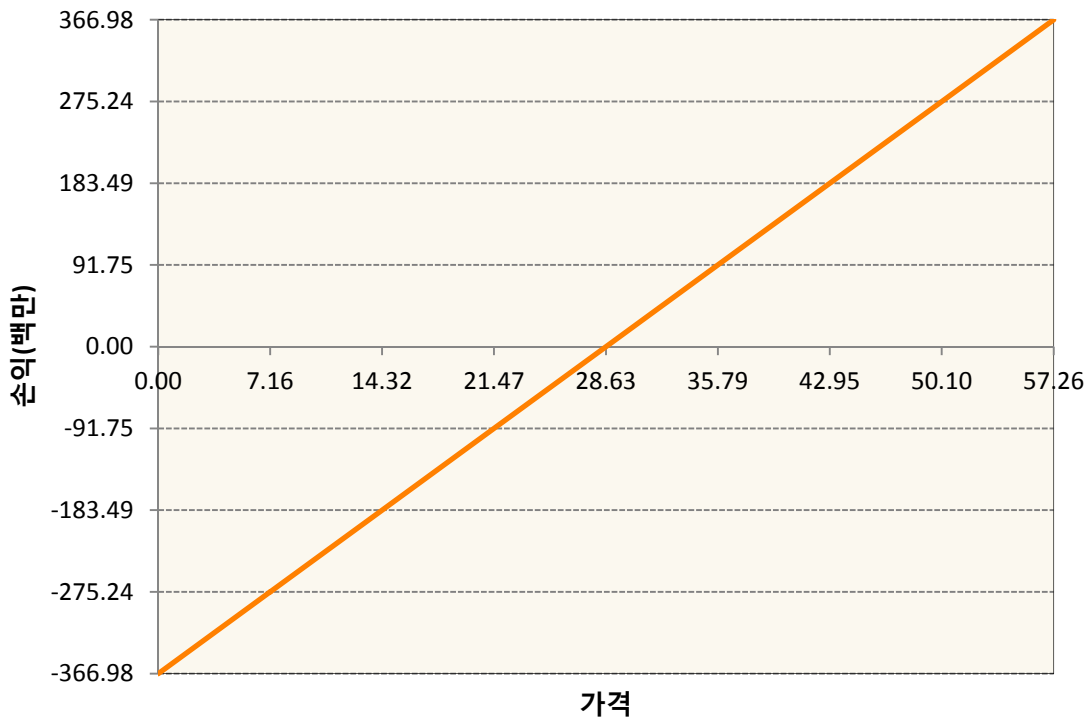
1. 계약금액

(단위:백만원)

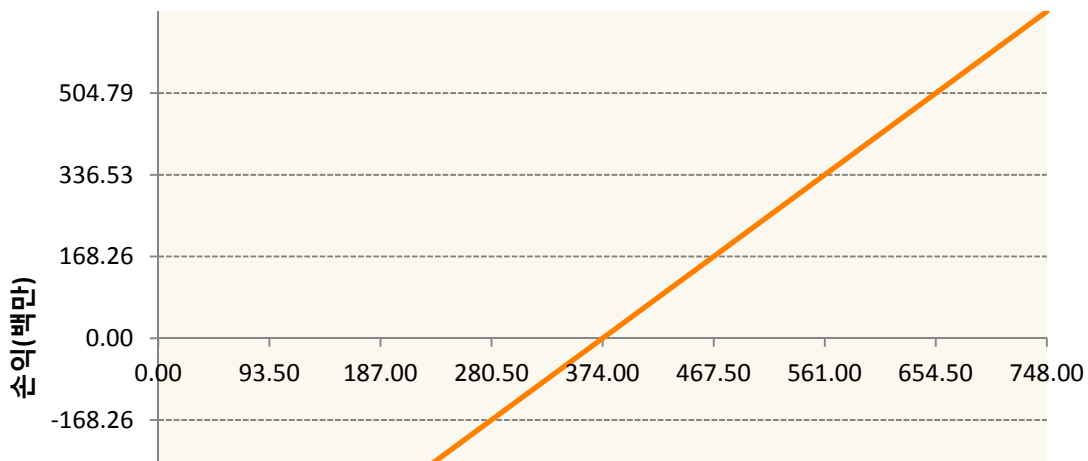
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,354	79	3,274	

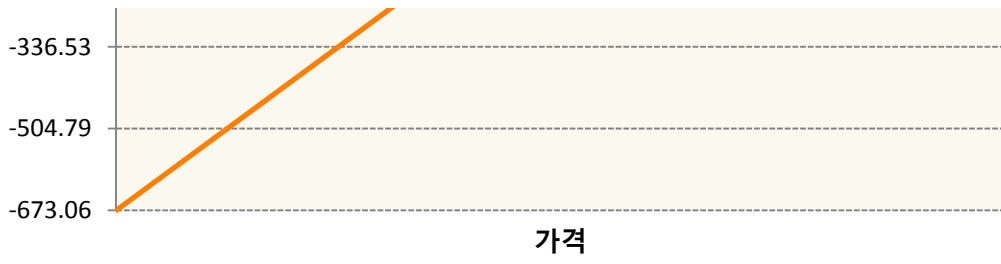
2. 만기시점의 손익구조

BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19

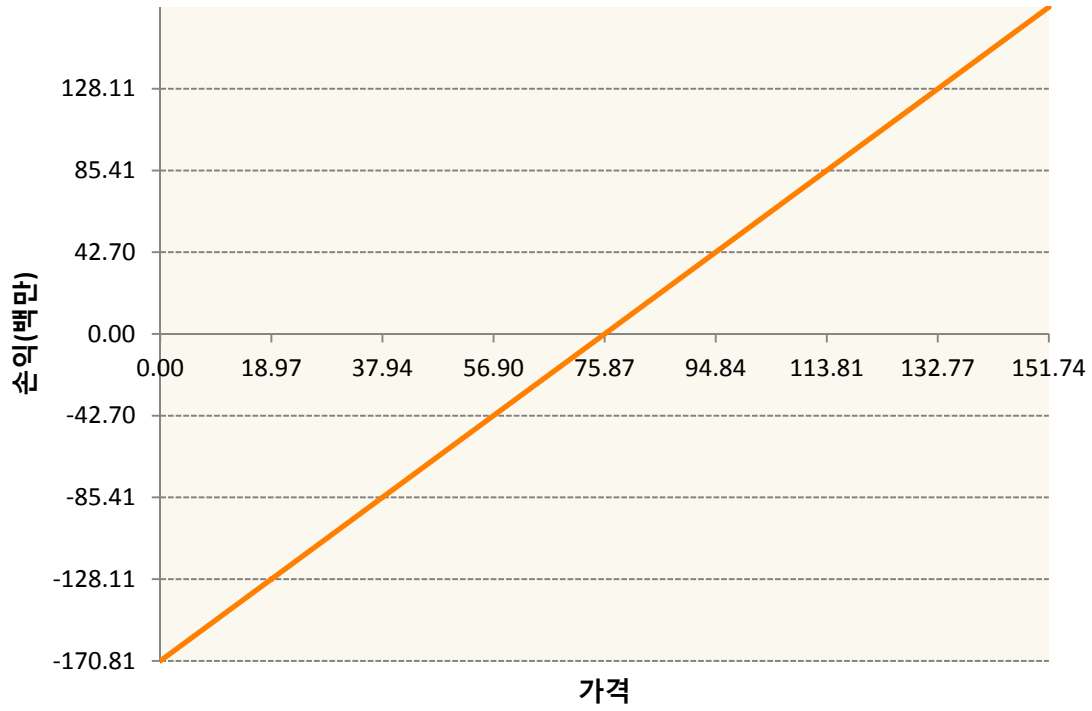


CK9-CORN FUTURE May19

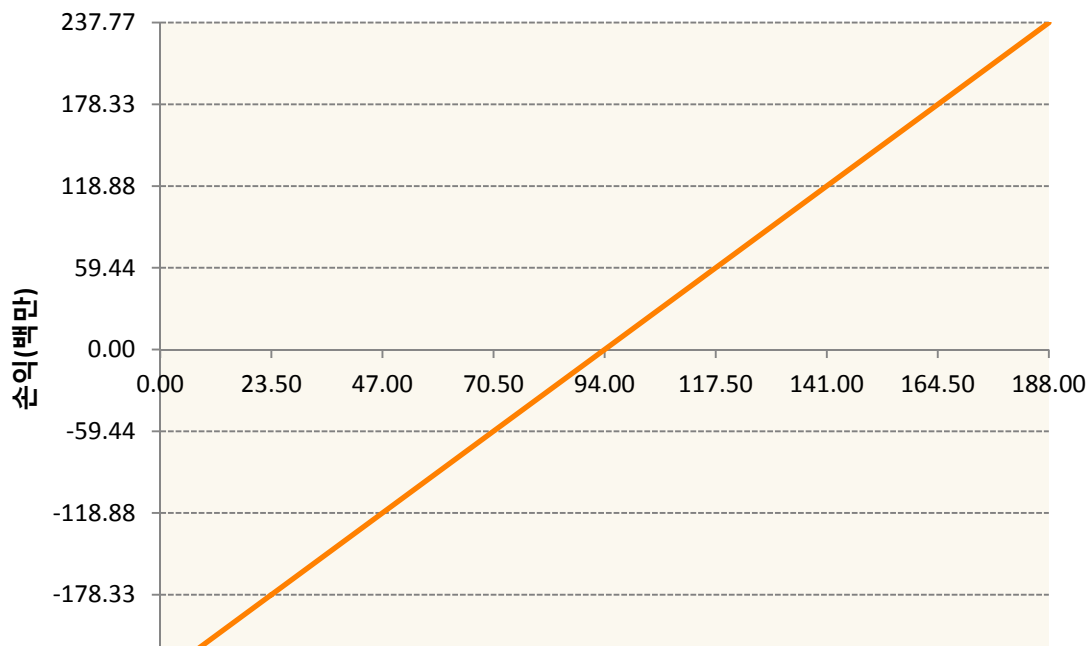


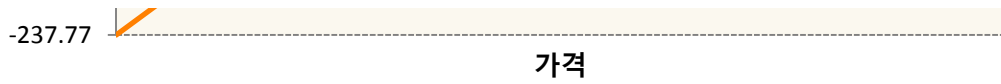


CTK9-COTTON NO.2 FUTR May19

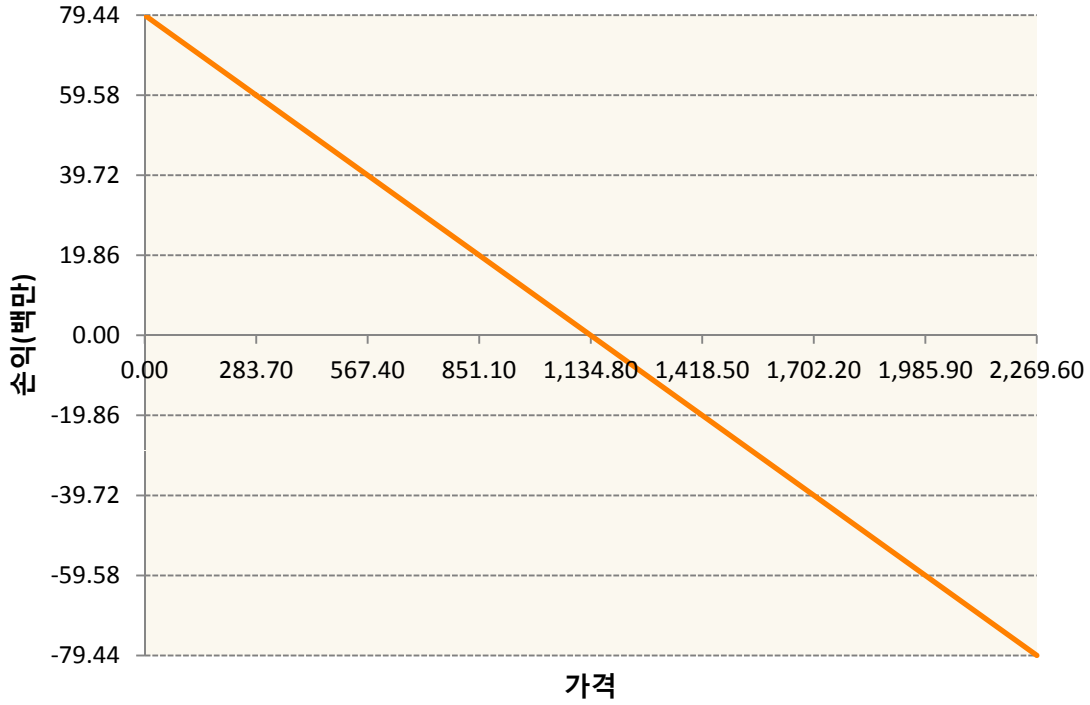


KCK9-COFFEE 'C' FUTURE May19

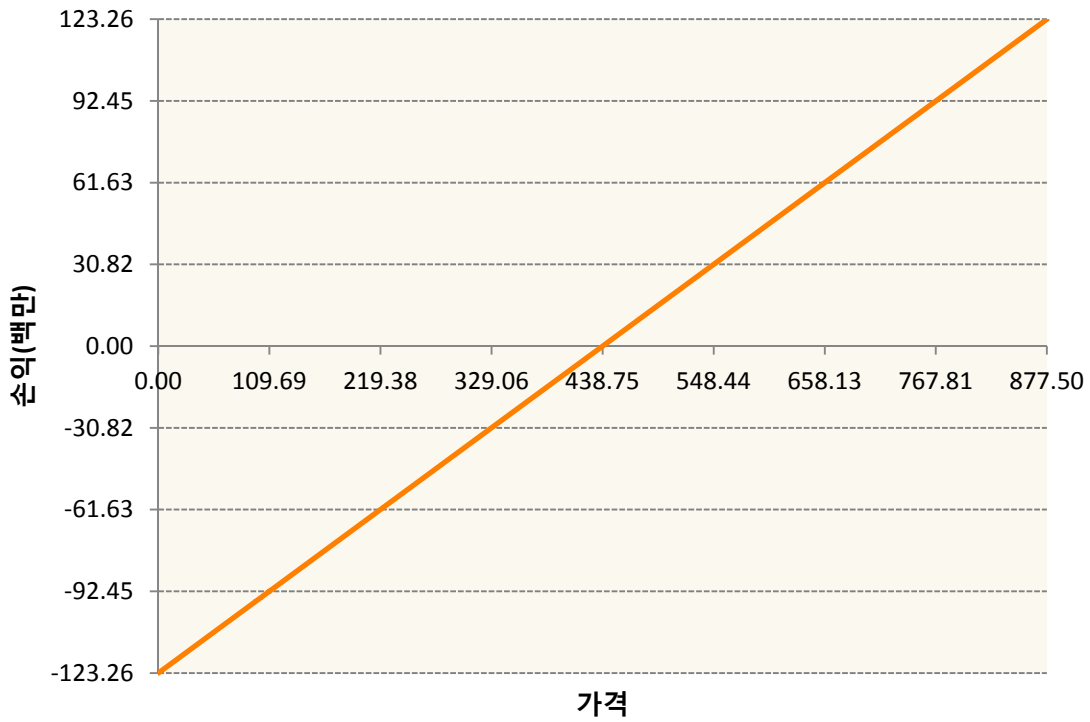




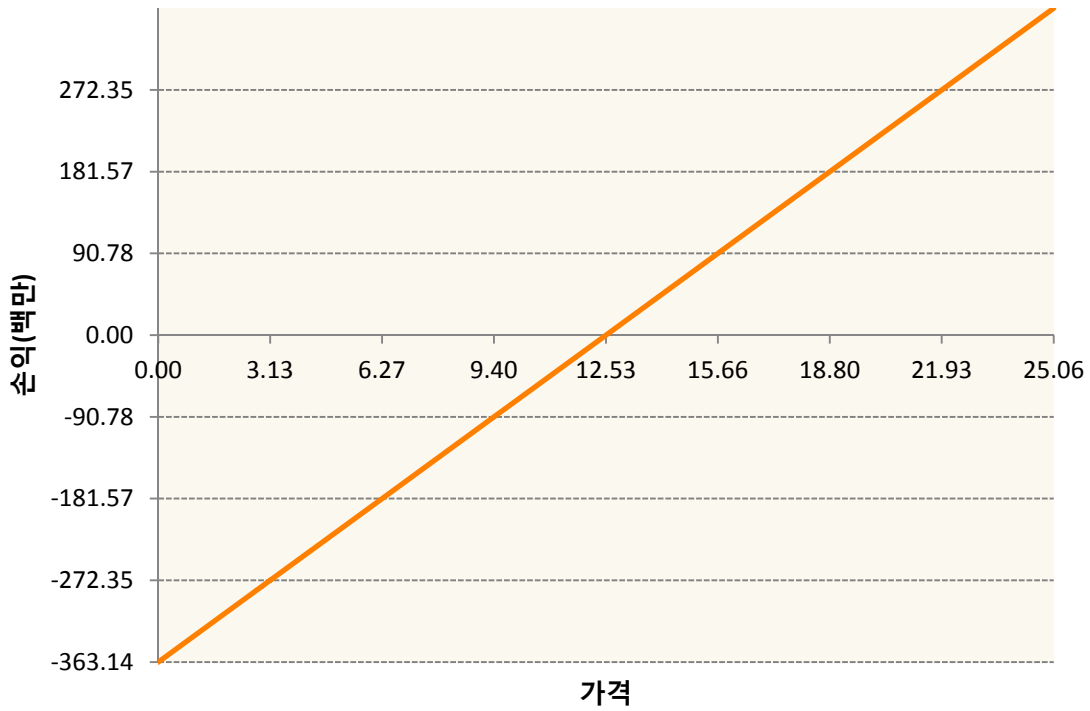
KR4175P40000-2019-04 달러선물



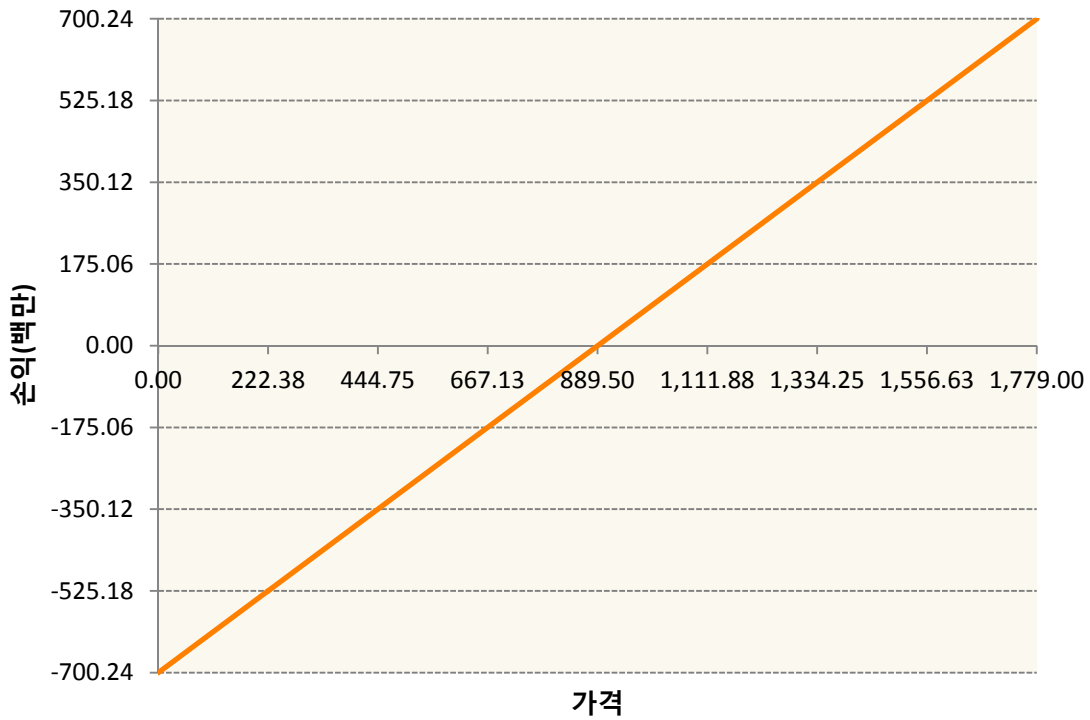
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

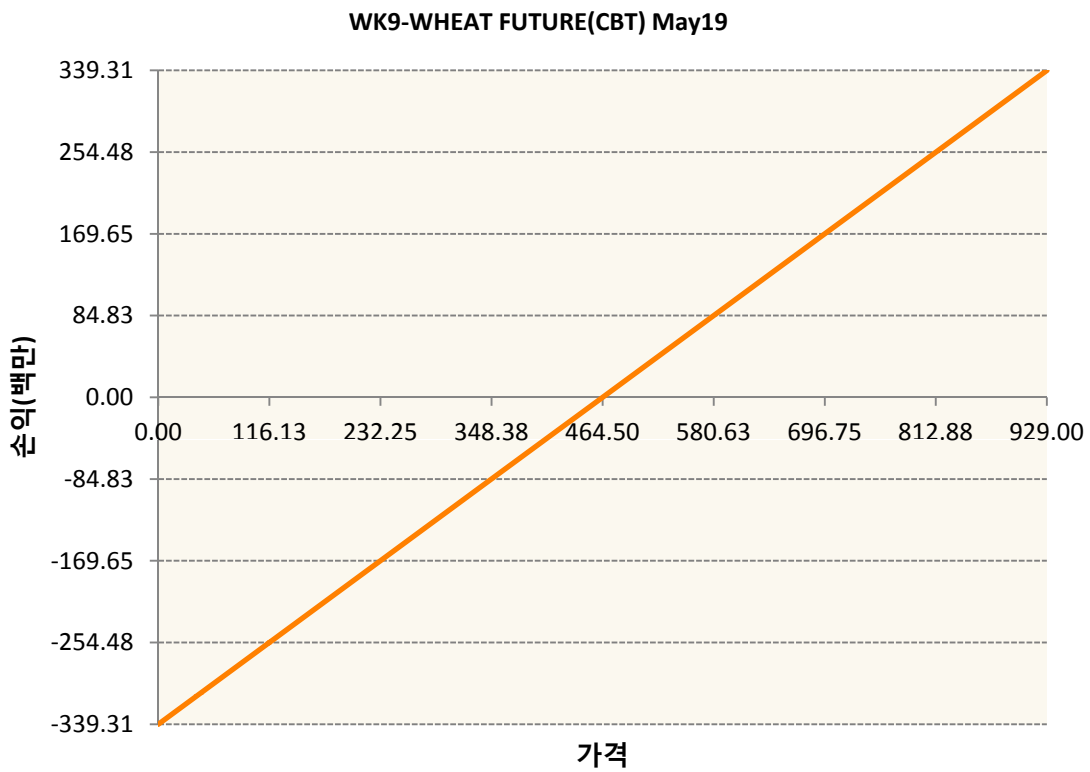
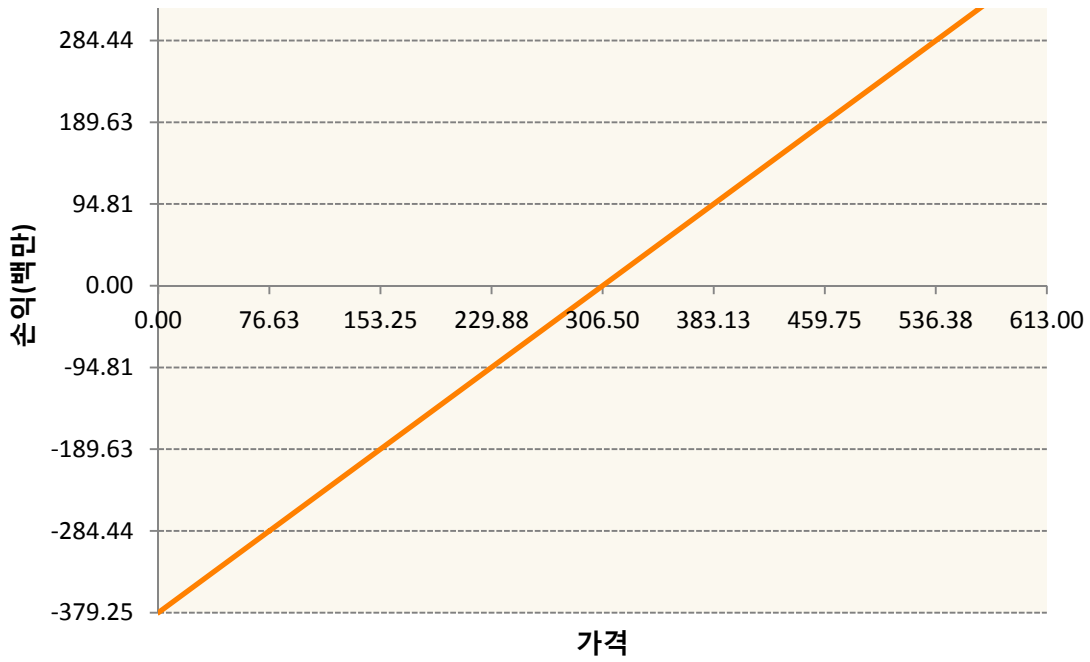


SK9-SOYBEAN FUTURE May19



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

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

(단위:백만원)

269