

공시일	2019-04-02
기준일	2019-04-01

포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6	0	6	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

95

공시일	2019-04-02
기준일	2019-04-01

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

1,128

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

661

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-04-02
기준일	2019-04-01

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)	359
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	99
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	168

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,001

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-04-02
기준일	2019-04-01

유로인덱스모(주식-파생형)

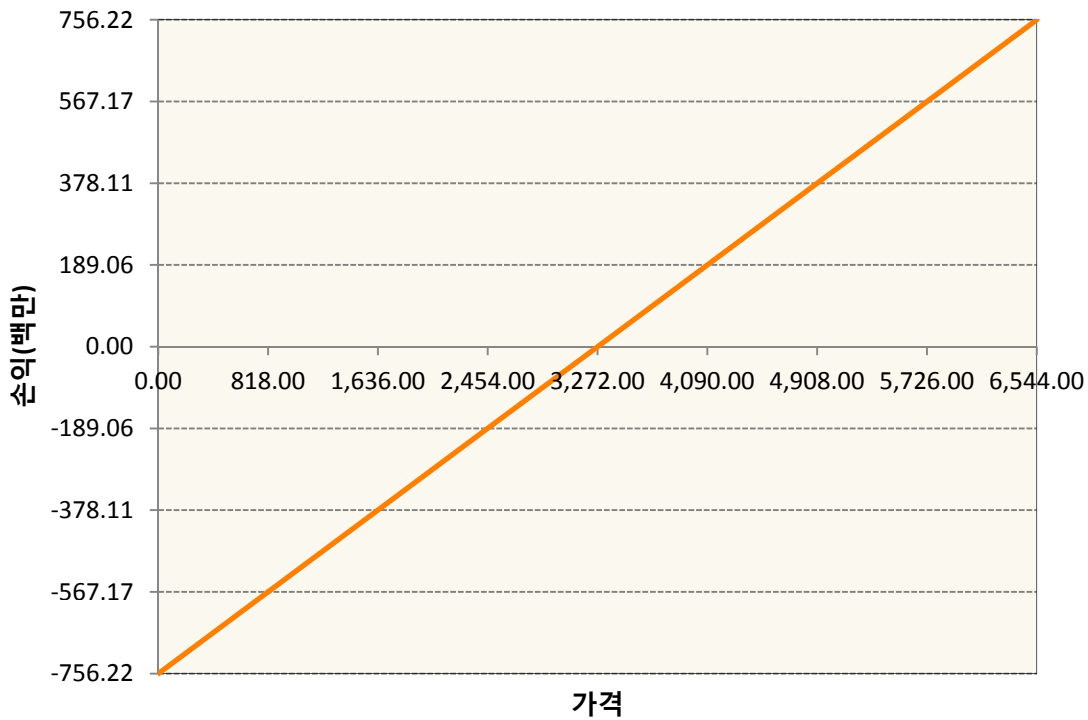
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	756	0	756	

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	2019-04-02
기준일	2019-04-01

차이나인덱스모(주식-파생형)

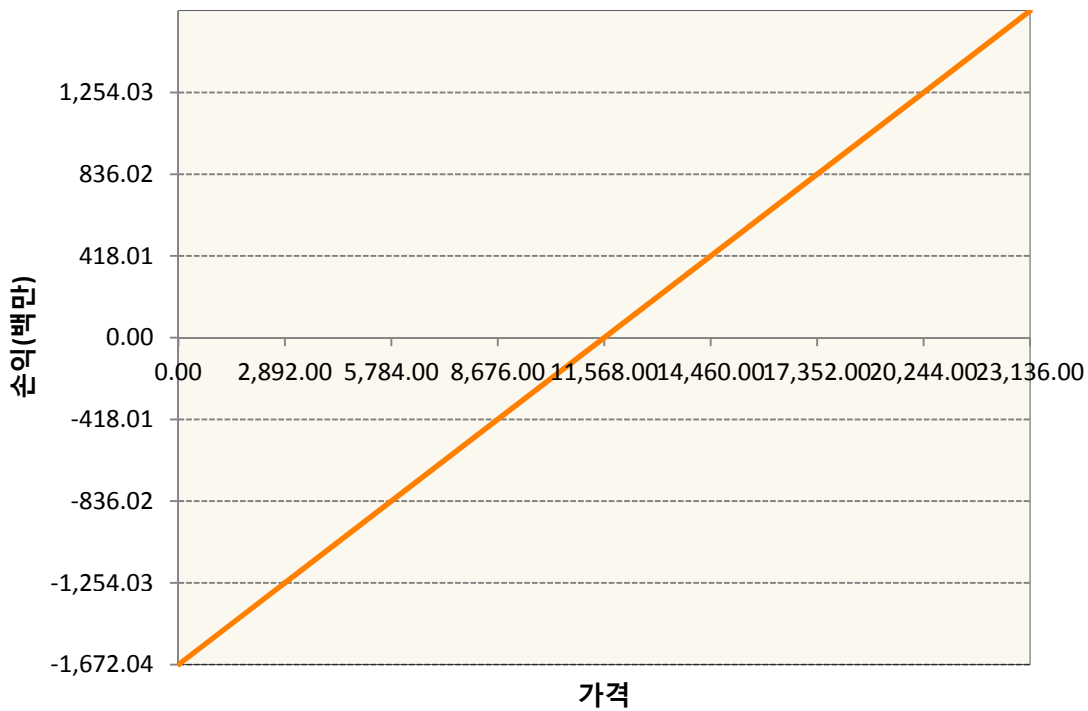
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,672	0	1,672	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCJ9-HSCEI Futures Apr19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ9	HSCEI Futures Apr19	134
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

137

공시일	2019-04-02
기준일	2019-04-01

커버드콜모(주식혼합-파생형)

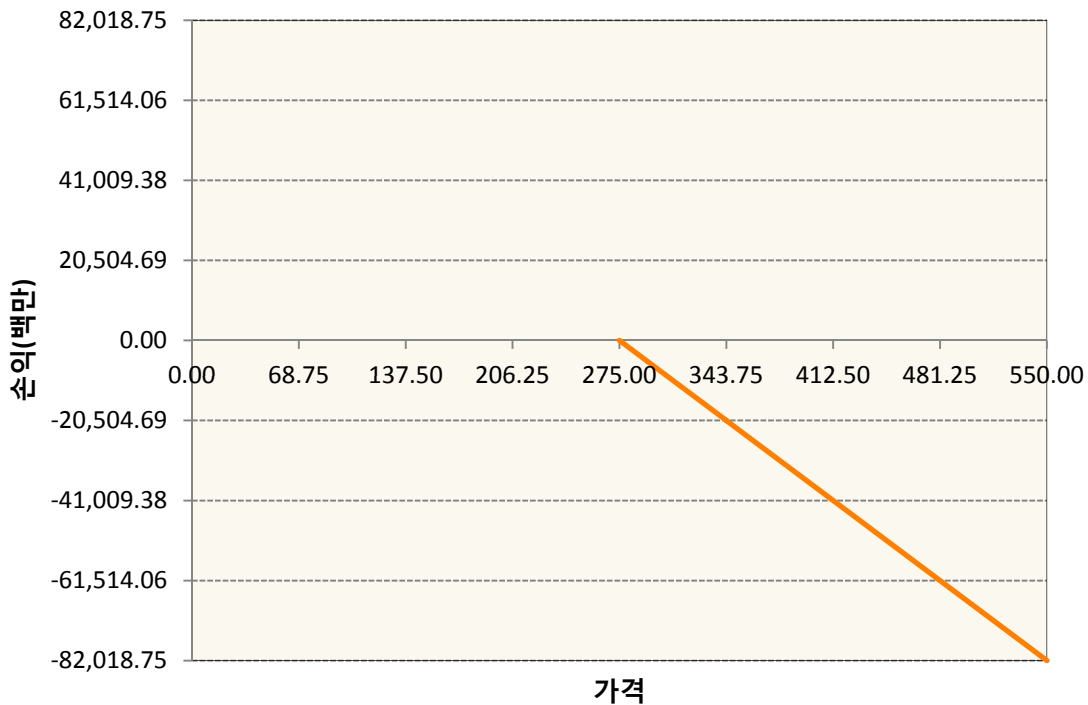
1. 계약금액

(단위:백만원)

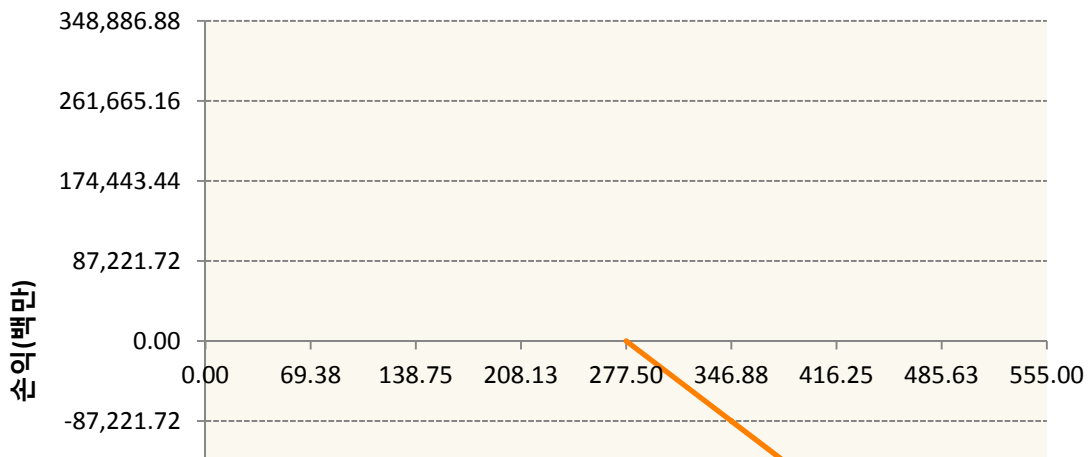
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	668,968	-668,968	장내

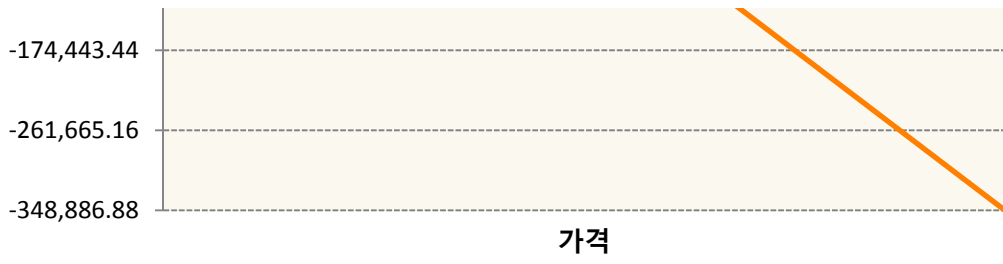
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P42752-2019-04 콜275

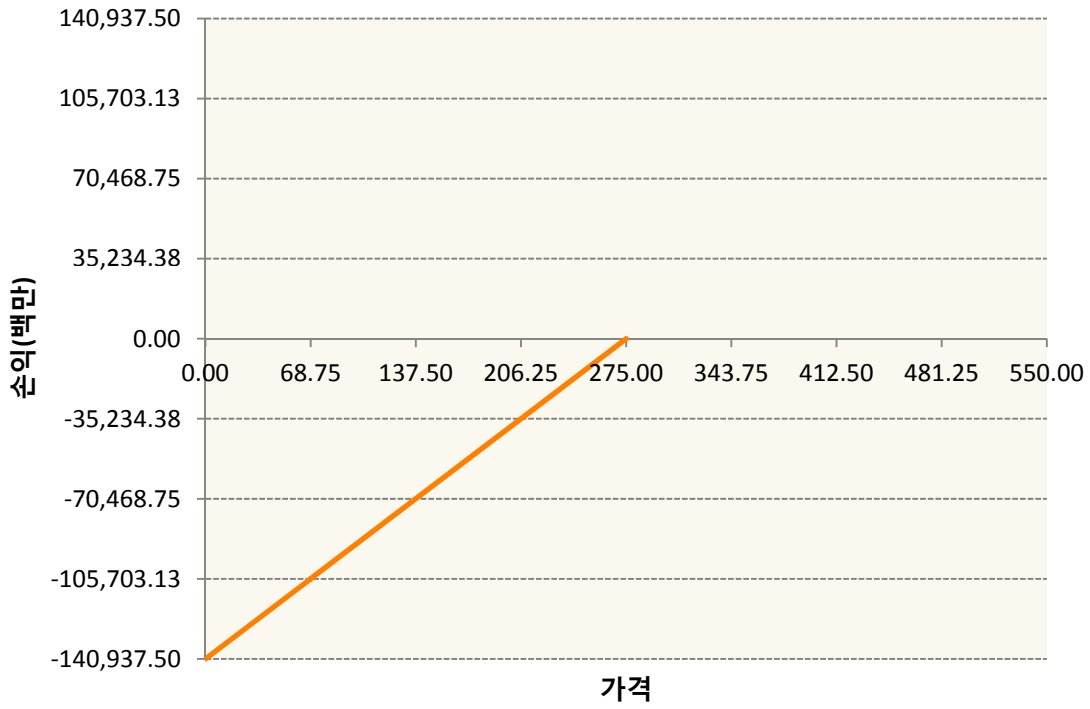


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

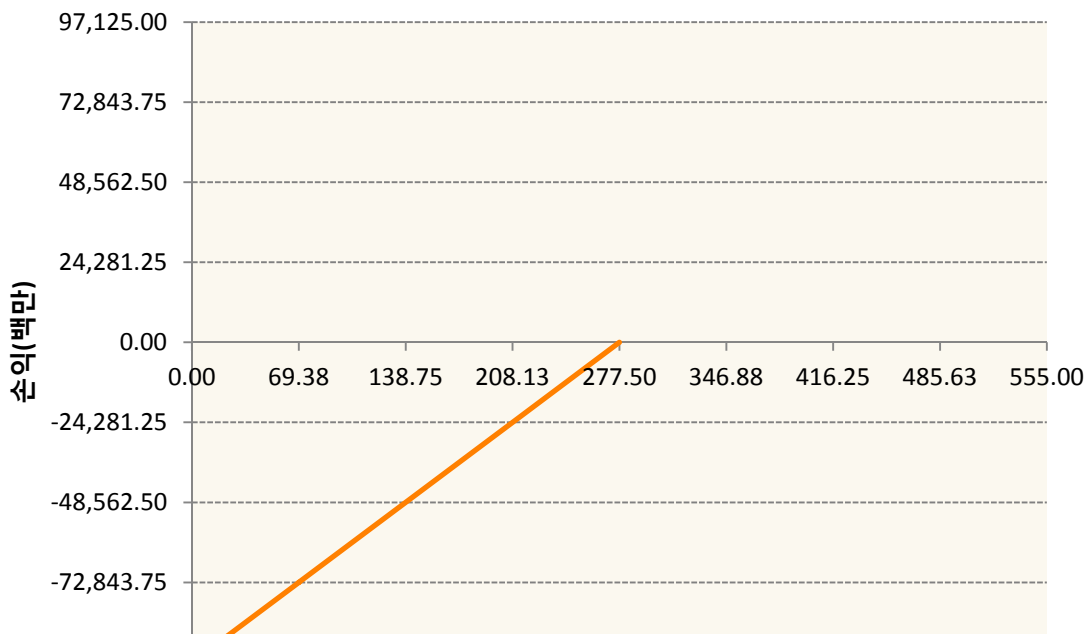




KR4301P42750-2019-04 풋275



KR4301P42776-2019-04 풋277.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P42752		2019-04 콜275						6,030
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,268	2,252	2,231	2,203	2,168	2,128	2,081	
-5.33%	2,135	2,075	2,009	1,936	1,859	1,778	1,694	
-2.67%	1,576	1,468	1,360	1,251	1,142	1,032	923	
0%	292	198	100	0	-102	-205	-310	
2.67%	-1,601	-1,644	-1,695	-1,753	-1,818	-1,888	-1,963	
5.33%	-3,759	-3,770	-3,786	-3,808	-3,837	-3,872	-3,913	
8.00%	-5,979	-5,980	-5,984	-5,989	-5,999	-6,012	-6,030	
KR4201P42778		2019-04 콜277.5						24,381
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	7,615	7,580	7,524	7,445	7,341	7,212	7,060	
-5.33%	7,308	7,130	6,919	6,677	6,410	6,122	5,814	
-2.67%	5,719	5,310	4,890	4,462	4,028	3,588	3,145	
0%	1,374	920	461	0	-464	-929	-1,396	
2.67%	-5,887	-6,145	-6,433	-6,747	-7,083	-7,437	-7,805	
5.33%	-14,737	-14,815	-14,925	-15,065	-15,235	-15,433	-15,656	
8.00%	-24,048	-24,062	-24,088	-24,130	-24,192	-24,275	-24,381	
KR4301P42750		2019-04 풋275						8,436
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-8,422	-8,422	-8,422	-8,423	-8,426	-8,430	-8,436	
-5.33%	-4,607	-4,621	-4,641	-4,667	-4,700	-4,738	-4,782	
-2.67%	-1,254	-1,349	-1,445	-1,544	-1,643	-1,743	-1,843	
0%	199	139	72	0	-77	-157	-240	
2.67%	352	348	340	328	312	290	263	
5.33%	355	355	355	354	353	351	347	
8.00%	355	355	355	355	355	355	355	
KR4301P42776		2019-04 풋277.5						6,398
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-6,394	-6,394	-6,395	-6,395	-6,395	-6,396	-6,398	
-5.33%	-3,782	-3,785	-3,790	-3,798	-3,810	-3,825	-3,843	
-2.67%	-1,298	-1,344	-1,394	-1,446	-1,502	-1,559	-1,619	
0%	192	130	66	0	-67	-134	-203	
2.67%	464	455	442	424	401	375	344	

5.33%	474	474	473	472	470	466	460
8.00%	474	474	474	474	474	474	473

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

(단위:백만원)

49,429

공시일	2019-04-02
기준일	2019-04-01

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

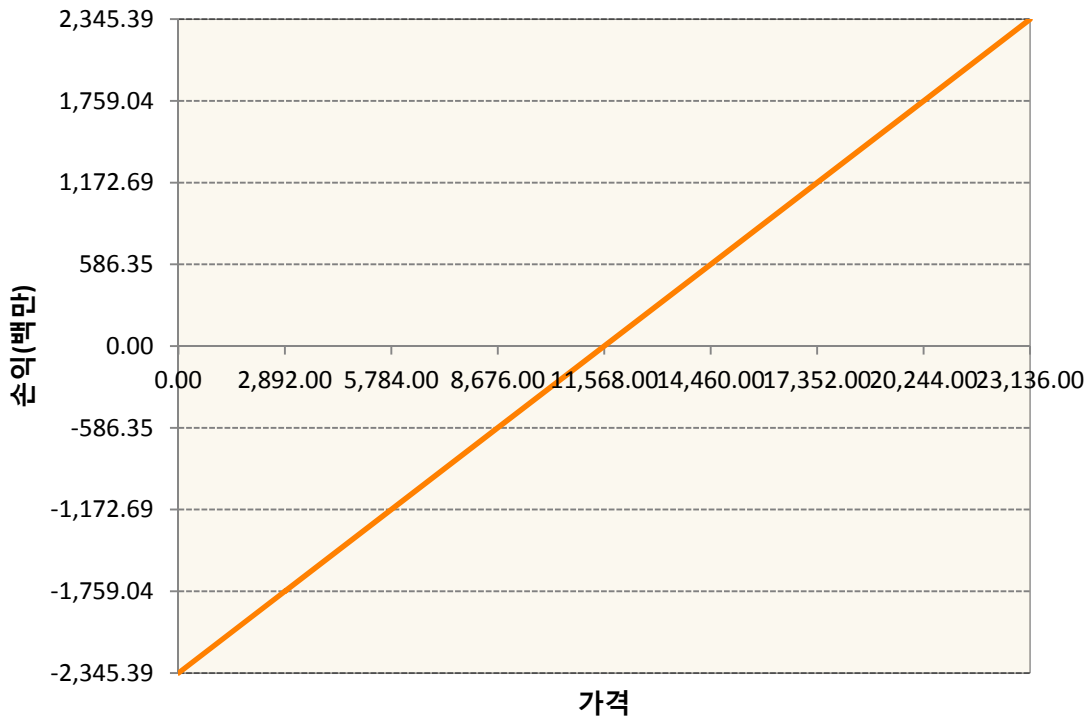
1. 계약금액

(단위:백만원)

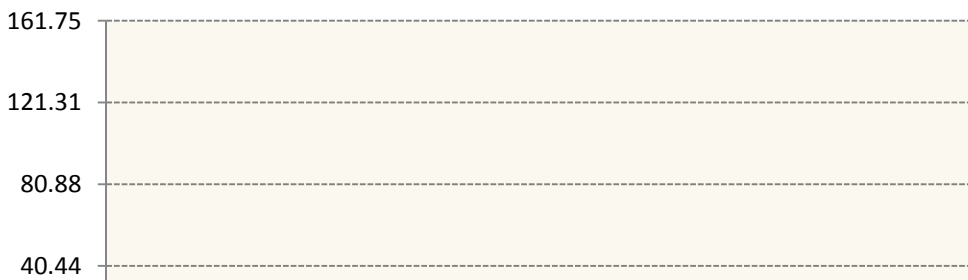
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,345	0	2,345	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,872	-5,872	장내
누계	통화	선도	0	3,033	-3,033	장외

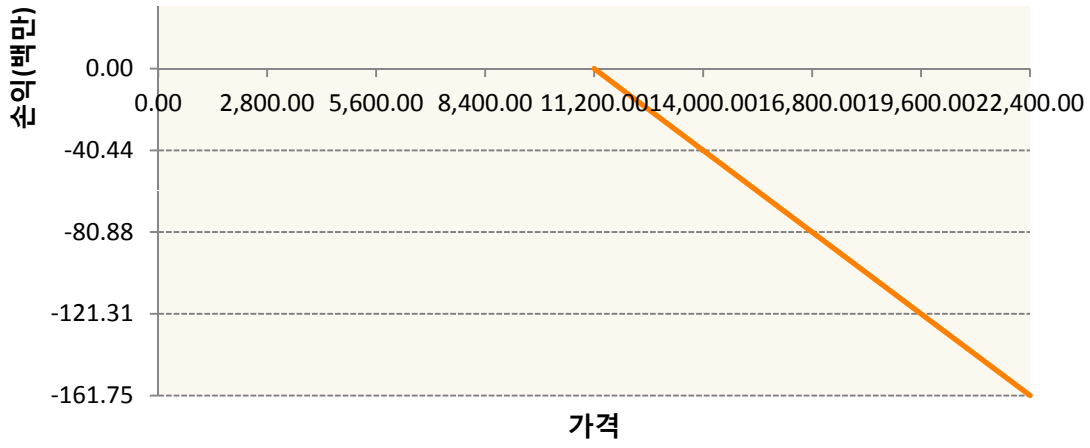
2. 만기시점의 손익구조

HCJ9-HSCEI Futures Apr19

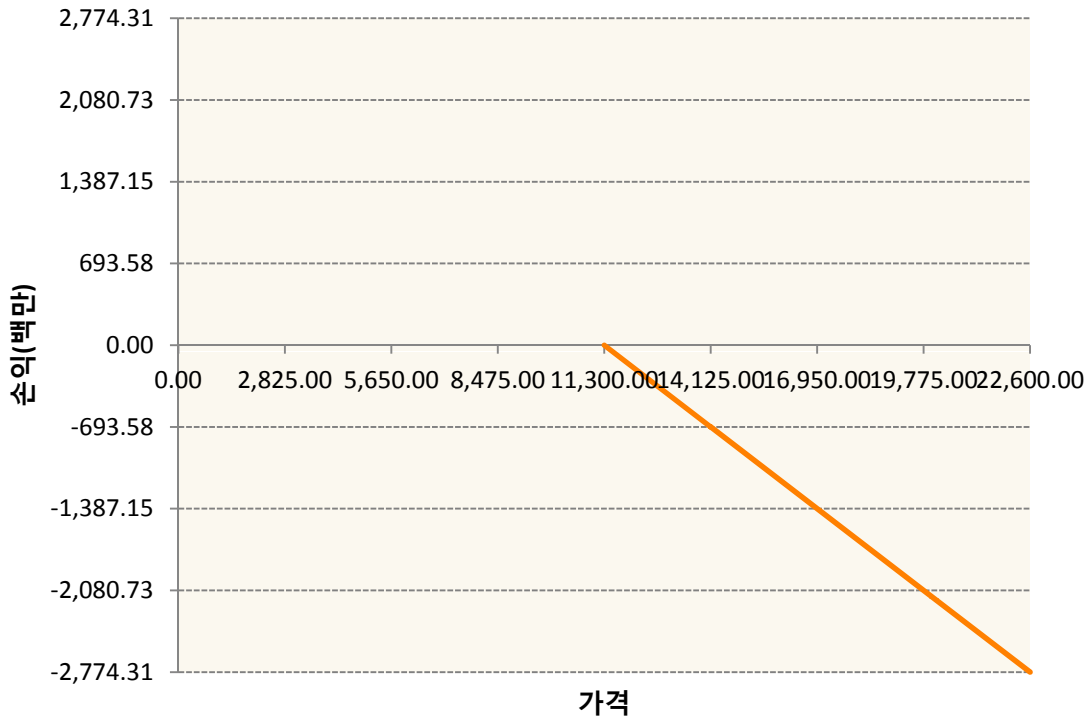


OHHIJ9-C112-HSCEI

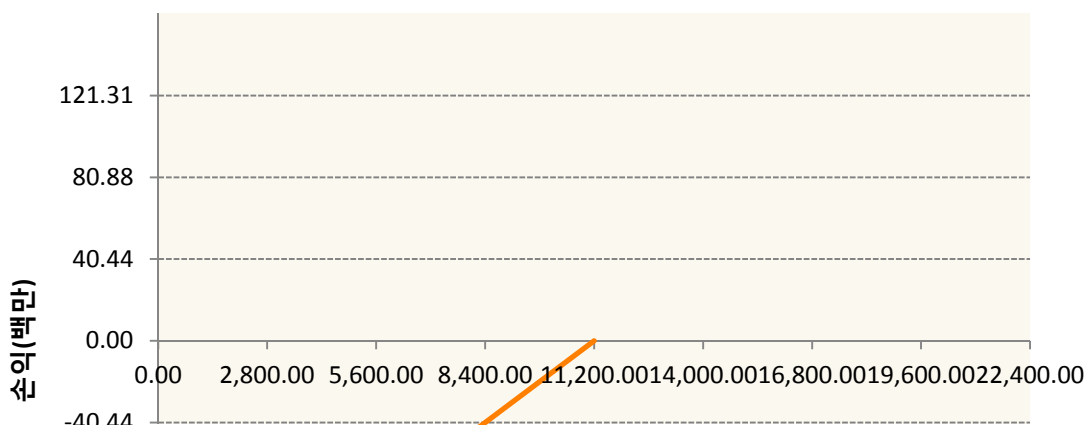


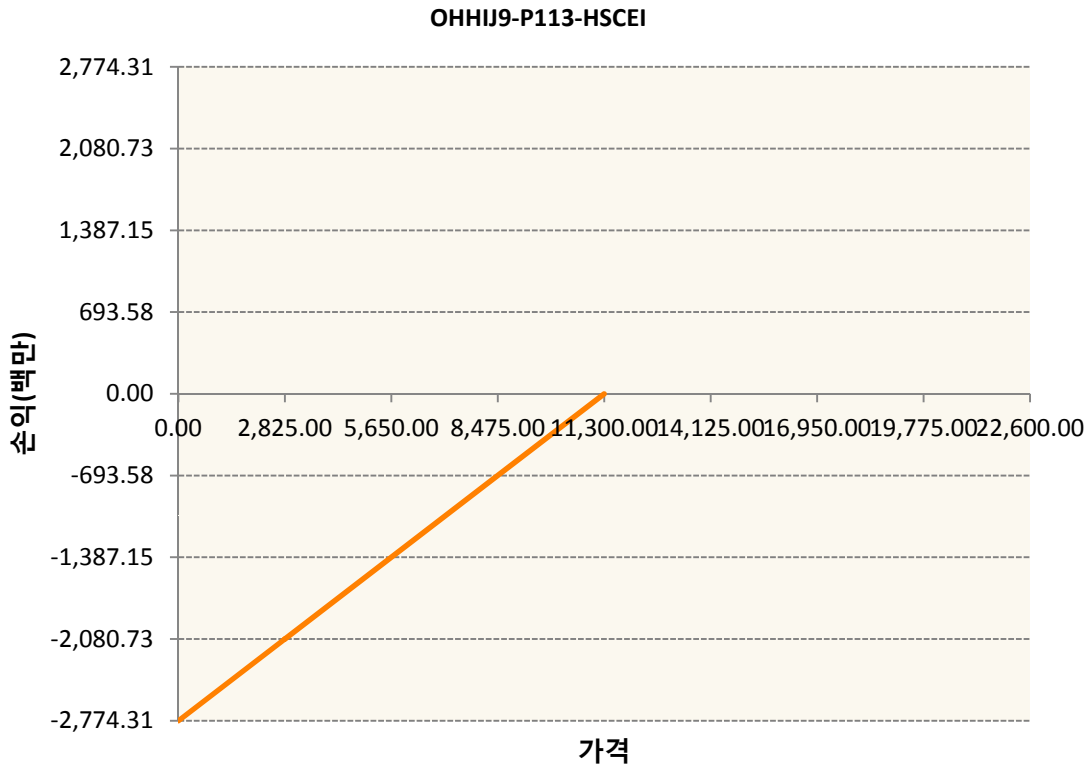


OHHIJ9-C113-HSCEI



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	188
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)

759

공시일	2019-04-02
기준일	2019-04-01

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

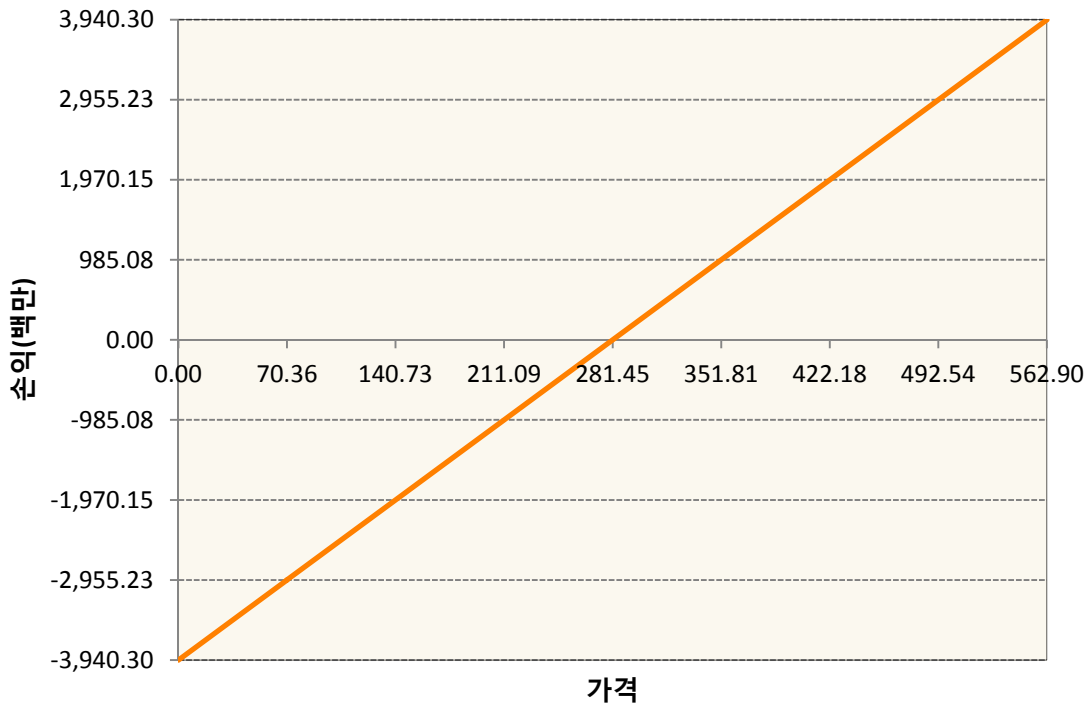
1. 계약금액

(단위:백만원)

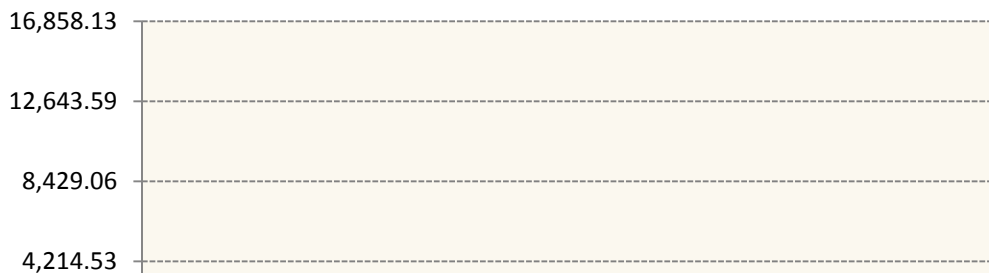
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,940	0	3,940	장내
누계	유가증권	스왑	35,836	0	35,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,649	-34,649	장내

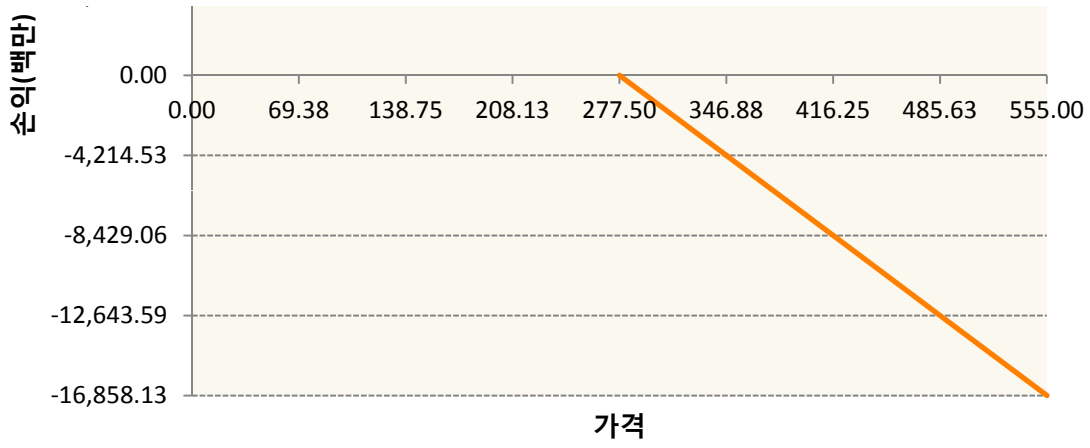
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

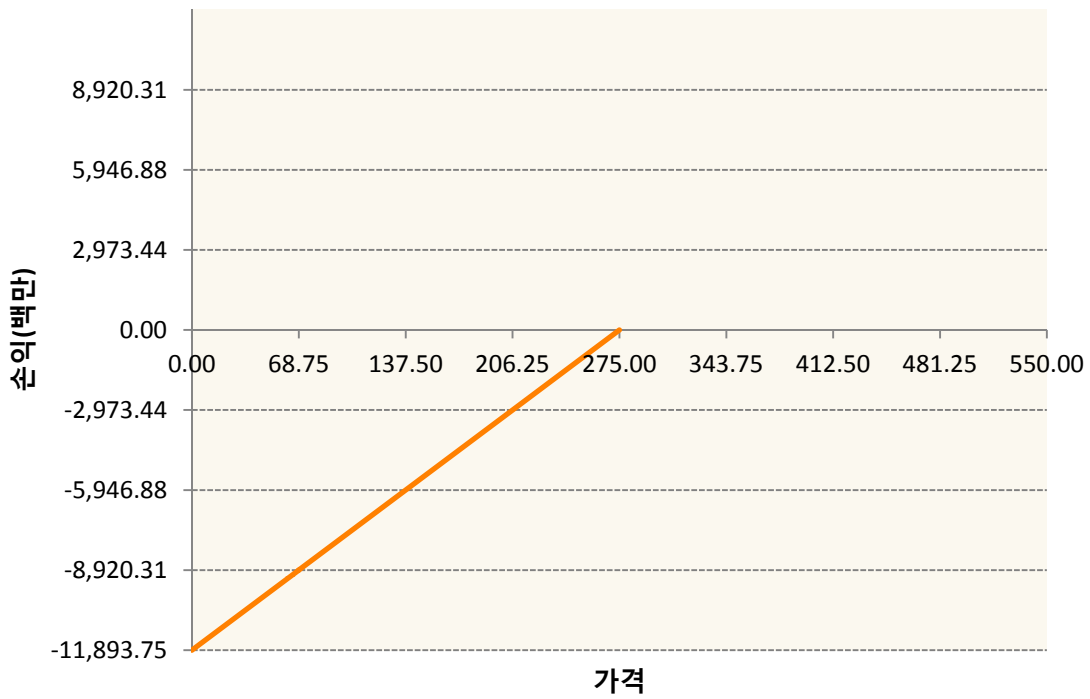


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

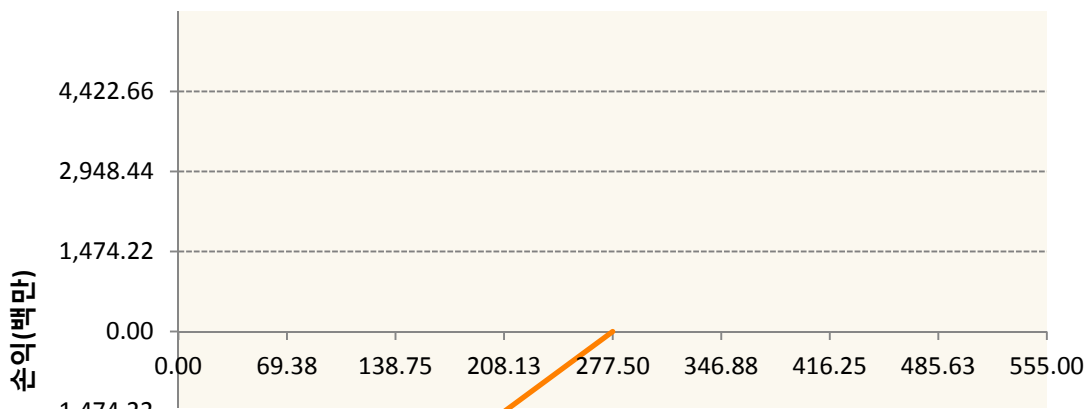


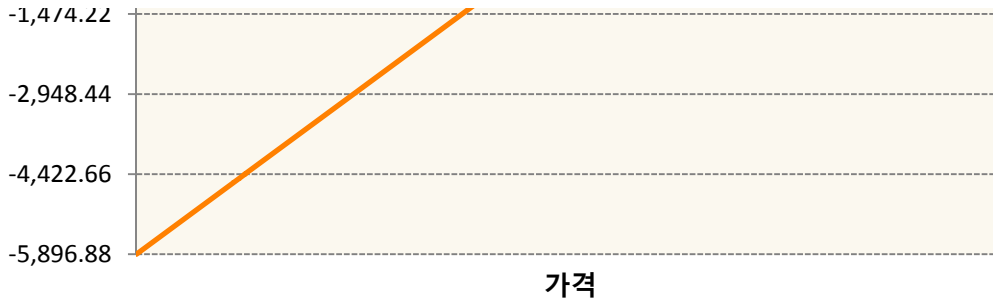


KR4301P42750-2019-04 풋275



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						314
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-314	-314	-314	-314	-314	-314	-314	
-5.33%	-209	-209	-209	-209	-209	-209	-209	
-2.67%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	105	105	105	105	105	105	105	
5.33%	209	209	209	209	209	209	209	
8.00%	314	314	314	314	314	314	314	
KR4201P42778		2019-04 콜277.5						1,178
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	368	366	364	360	355	348	341
-5.33%	353	345	334	323	310	296	281
-2.67%	276	257	236	216	195	173	152
0%	66	44	22	0	-22	-45	-67
2.67%	-284	-297	-311	-326	-342	-359	-377
5.33%	-712	-716	-721	-728	-736	-746	-756
8.00%	-1,162	-1,163	-1,164	-1,166	-1,169	-1,173	-1,178
KR4301P42750 2019-04 풋275							712
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-711	-711	-711	-711	-711	-711	-712
-5.33%	-389	-390	-392	-394	-397	-400	-404
-2.67%	-106	-114	-122	-130	-139	-147	-156
0%	17	12	6	0	-6	-13	-20
2.67%	30	29	29	28	26	24	22
5.33%	30	30	30	30	30	30	29
8.00%	30	30	30	30	30	30	30
KR4301P42776 2019-04 풋277.5							388
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-388	-388	-388	-388	-388	-388	-388
-5.33%	-230	-230	-230	-231	-231	-232	-233
-2.67%	-79	-82	-85	-88	-91	-95	-98
0%	12	8	4	0	-4	-8	-12
2.67%	28	28	27	26	24	23	21
5.33%	29	29	29	29	29	28	28
8.00%	29	29	29	29	29	29	29

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

(단위:백만원)

5,753

공시일	2019-04-02
기준일	2019-04-01

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

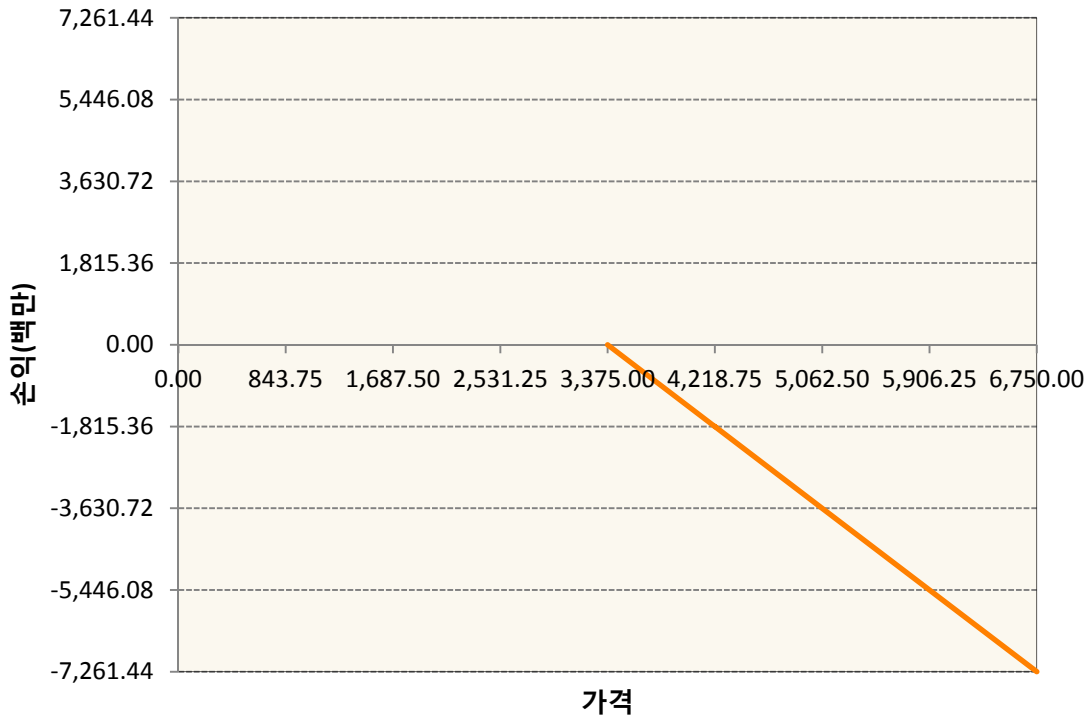
1. 계약금액

(단위:백만원)

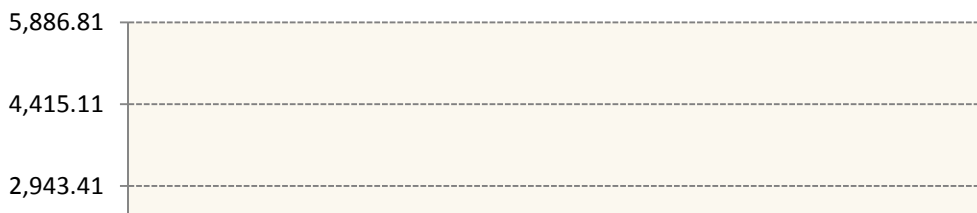
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,302	0	6,302	
누계	유가증권	스왑	60,106	0	60,106	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,297	-26,297	장내
누계	통화	선도	0	15,278	-15,278	장외

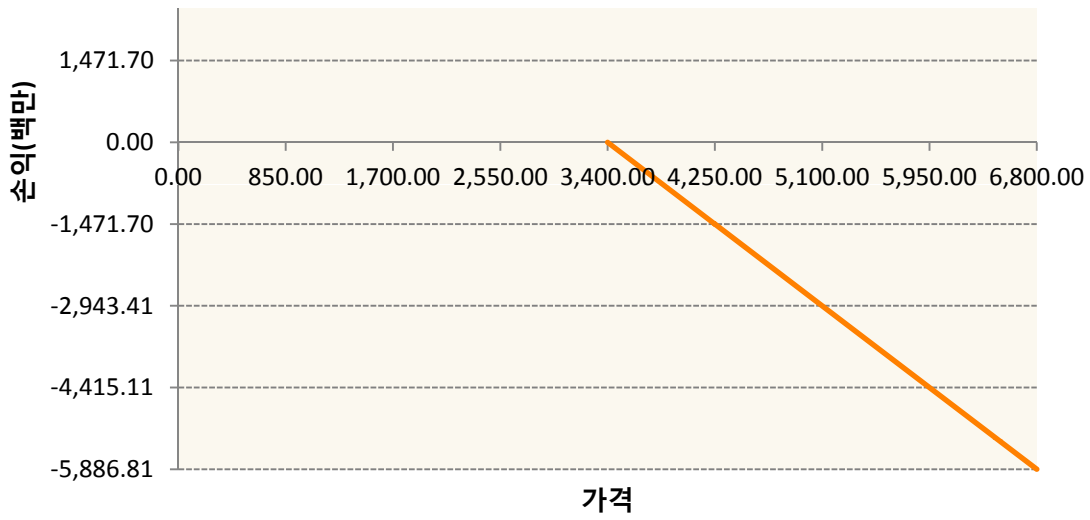
2. 만기시점의 손익구조

OESXJ9-C3375-EURO STOXX 50

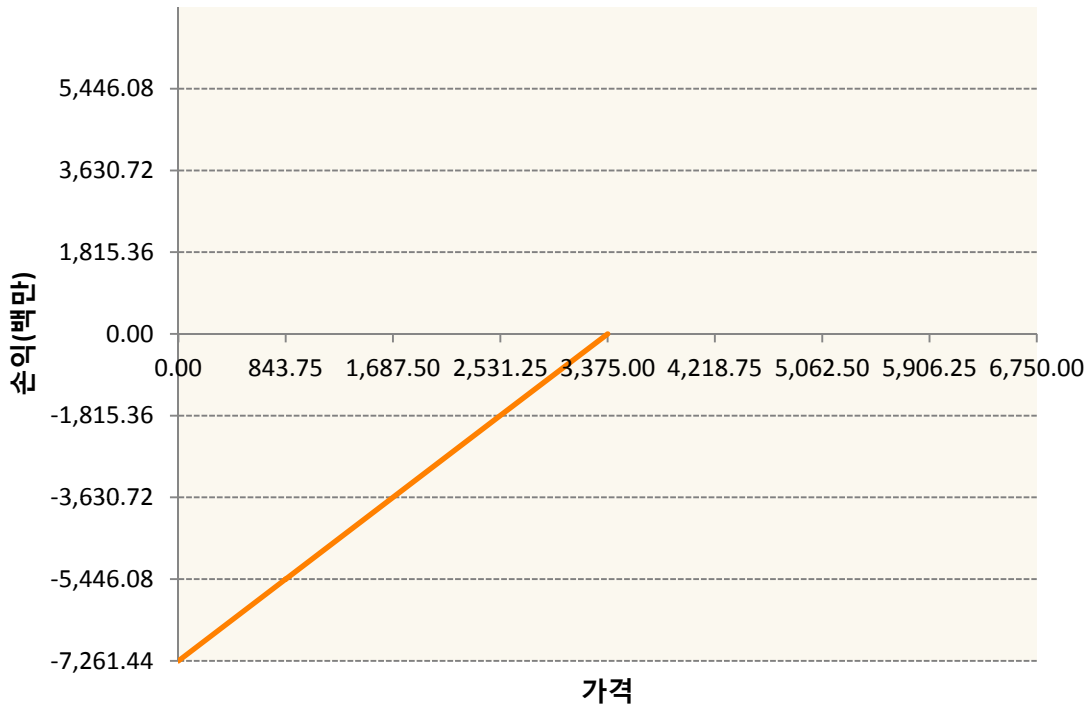


OESXJ9-C3400-EURO STOXX 50

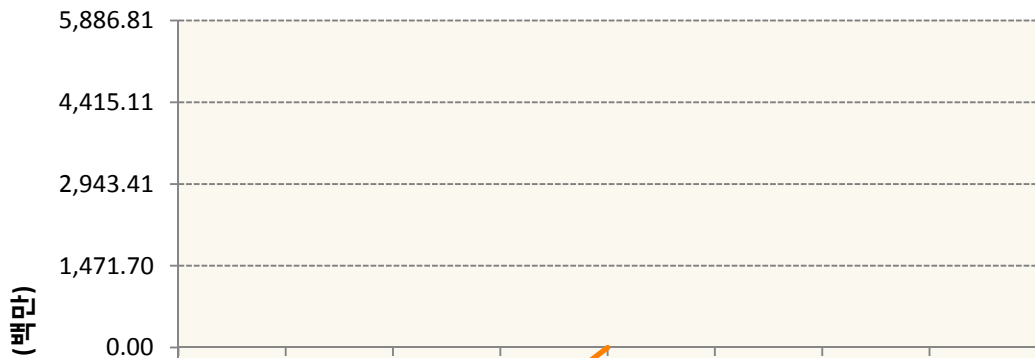


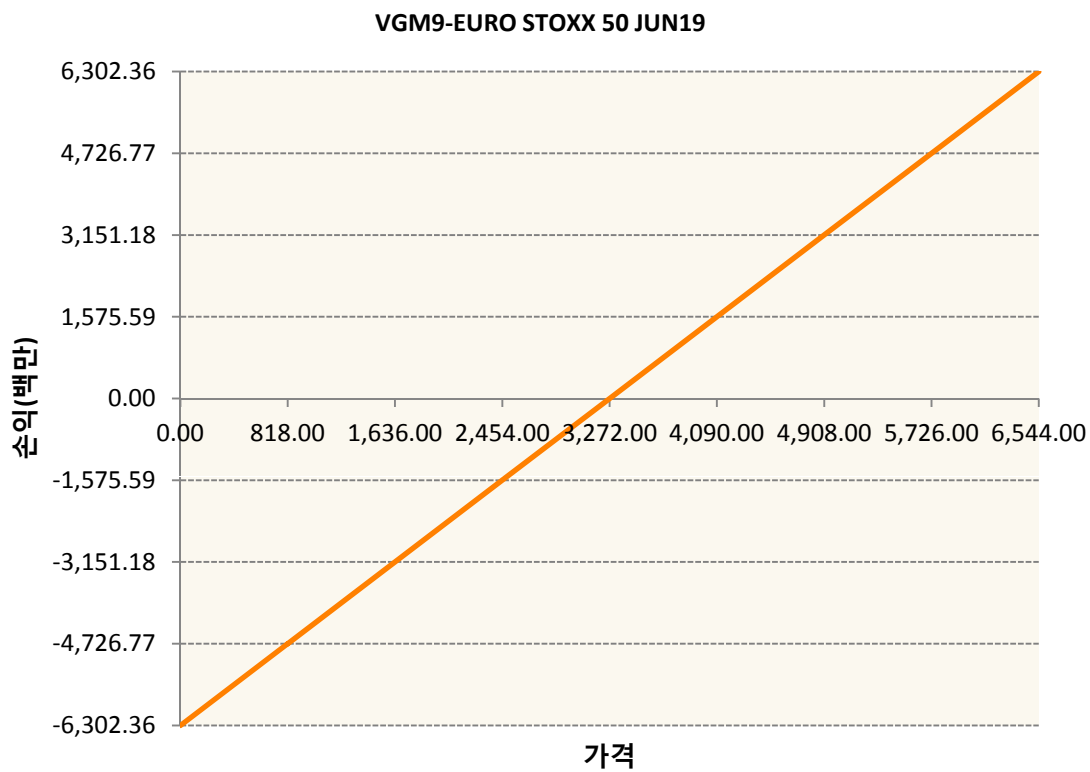
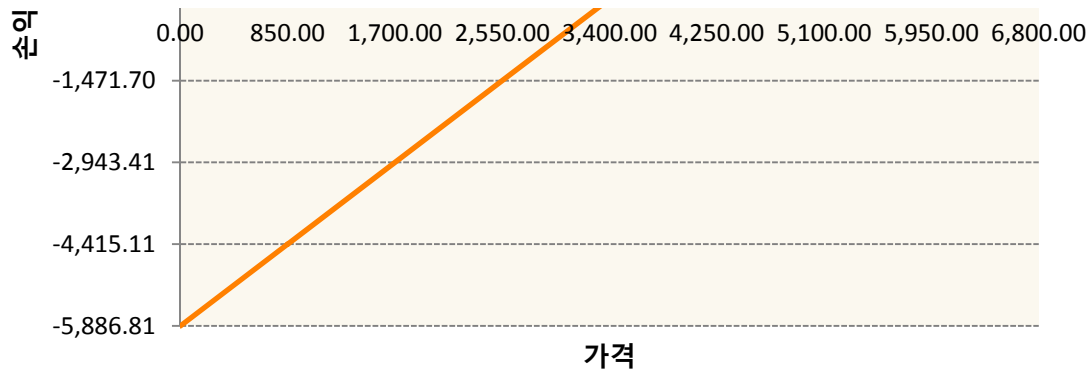


OESXJ9-P3375-EURO STOXX 50



OESXJ9-P3400-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		122
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E		407
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E		815
OESXJ9-C33' EURO STOXX 50		581
OESXJ9-C34' EURO STOXX 50		471
OESXJ9-P33' EURO STOXX 50		581
OESXJ9-P34' EURO STOXX 50		471
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19		504

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

(단위:백만원)

2,625

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

(단위:백만원)

1,115

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

(단위:백만원)

95

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

(단위:백만원)

138

공시일	2019-04-02
기준일	2019-04-01

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

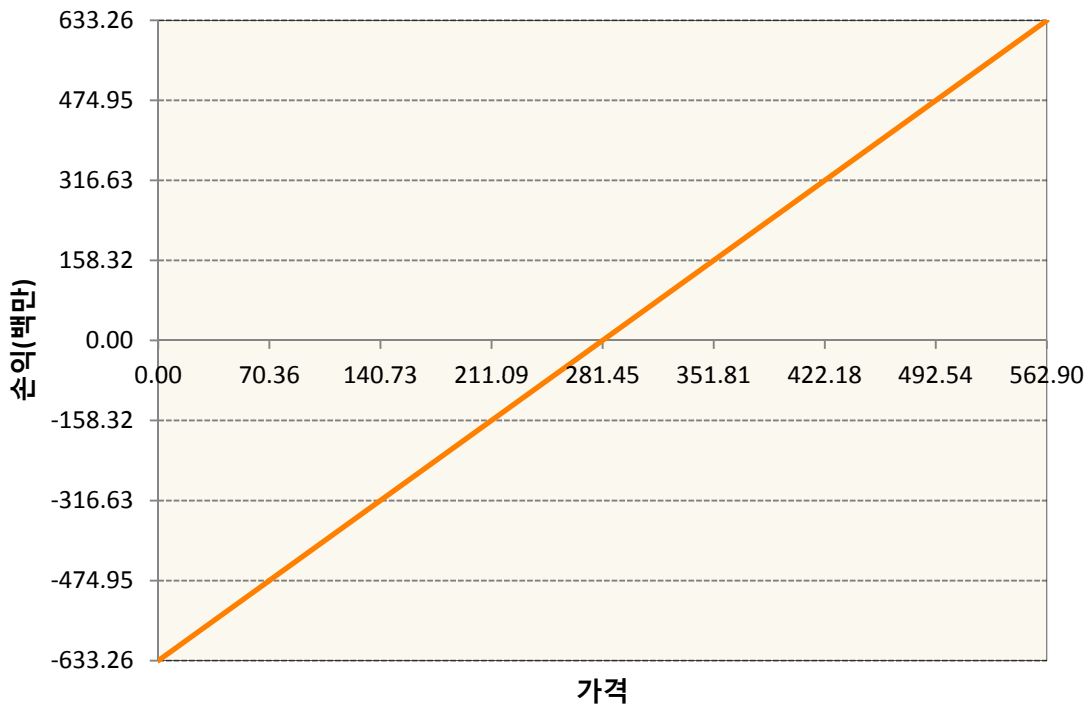
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	633	0	633	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%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34	
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	17	17	17	17	17	17	17	
5.33%	34	34	34	34	34	34	34	
8.00%	50	50	50	50	50	50	50	

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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-04-02
기준일	2019-04-01

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

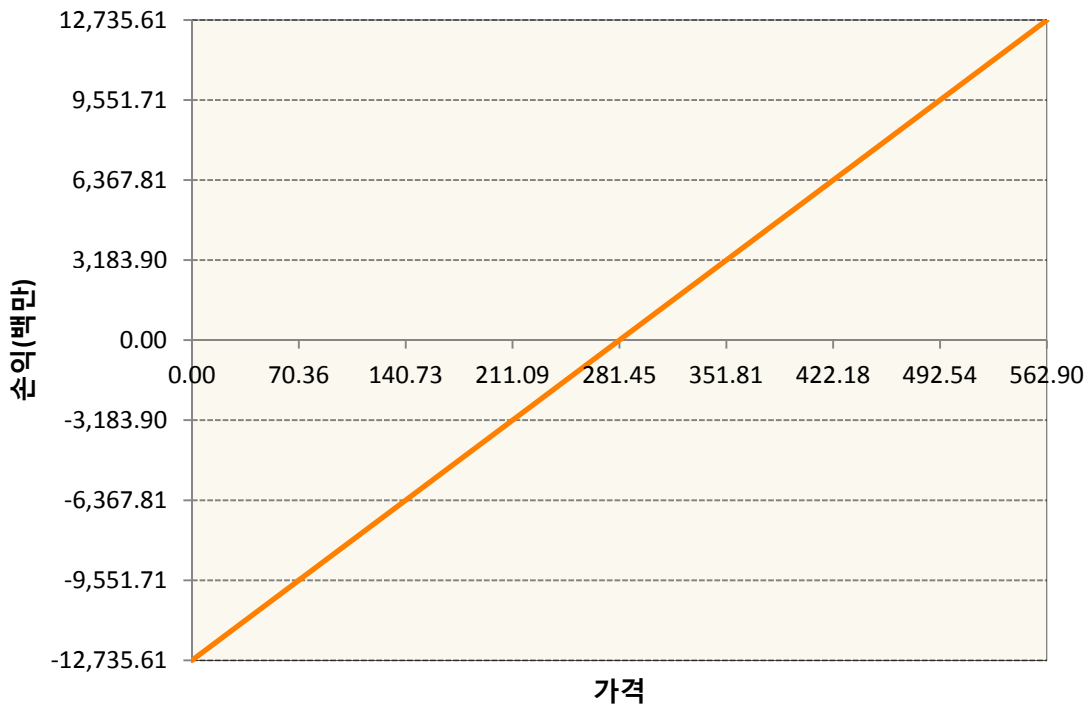
1. 계약금액

(단위:백만원)

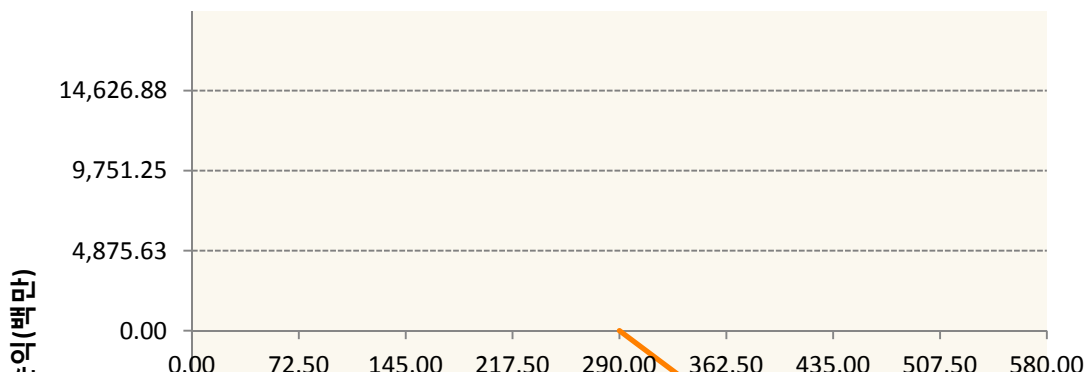
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,736	0	12,736	장내
누계	유가증권	옵션	1,867	24,036	-22,169	장내

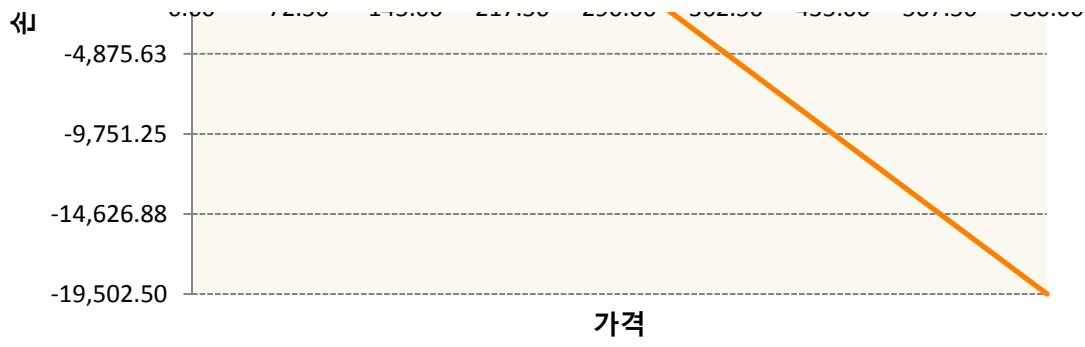
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

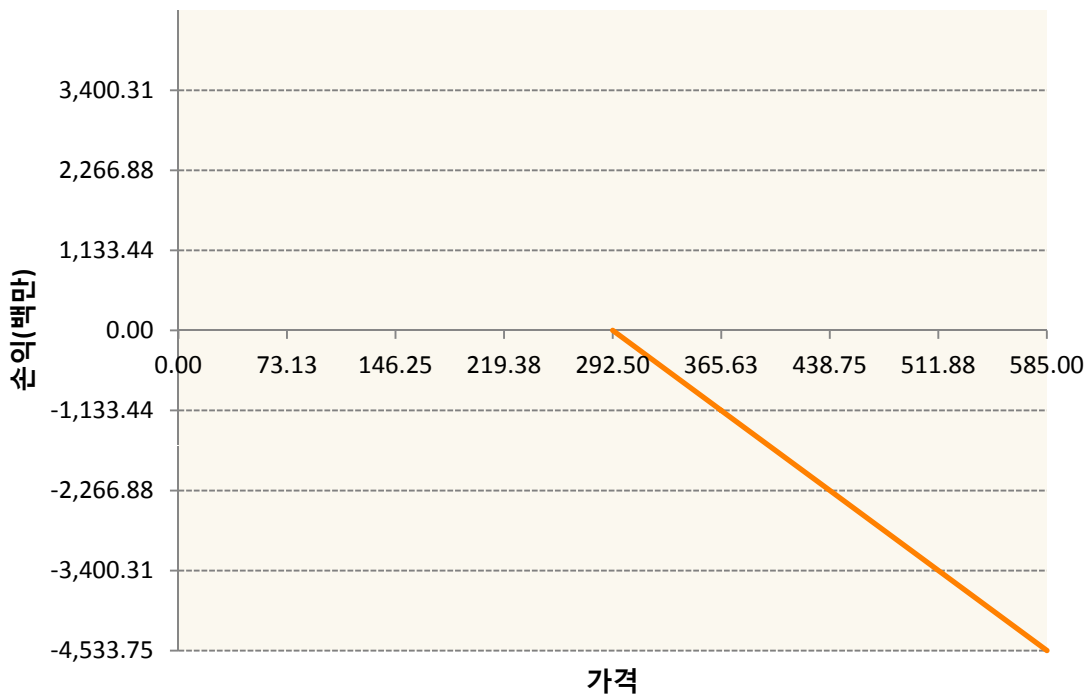


KR4201P42901-2019-04 콜290

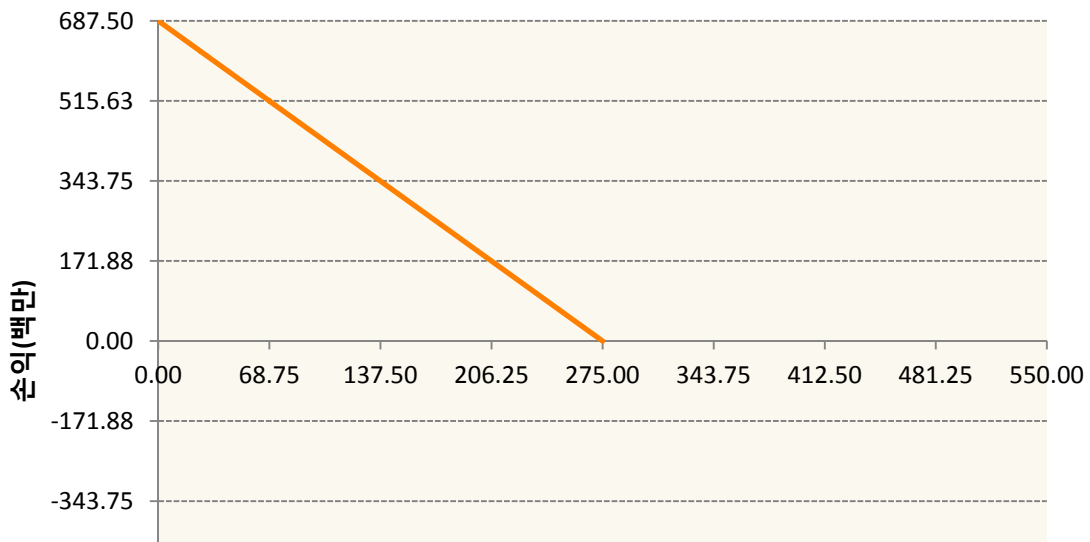


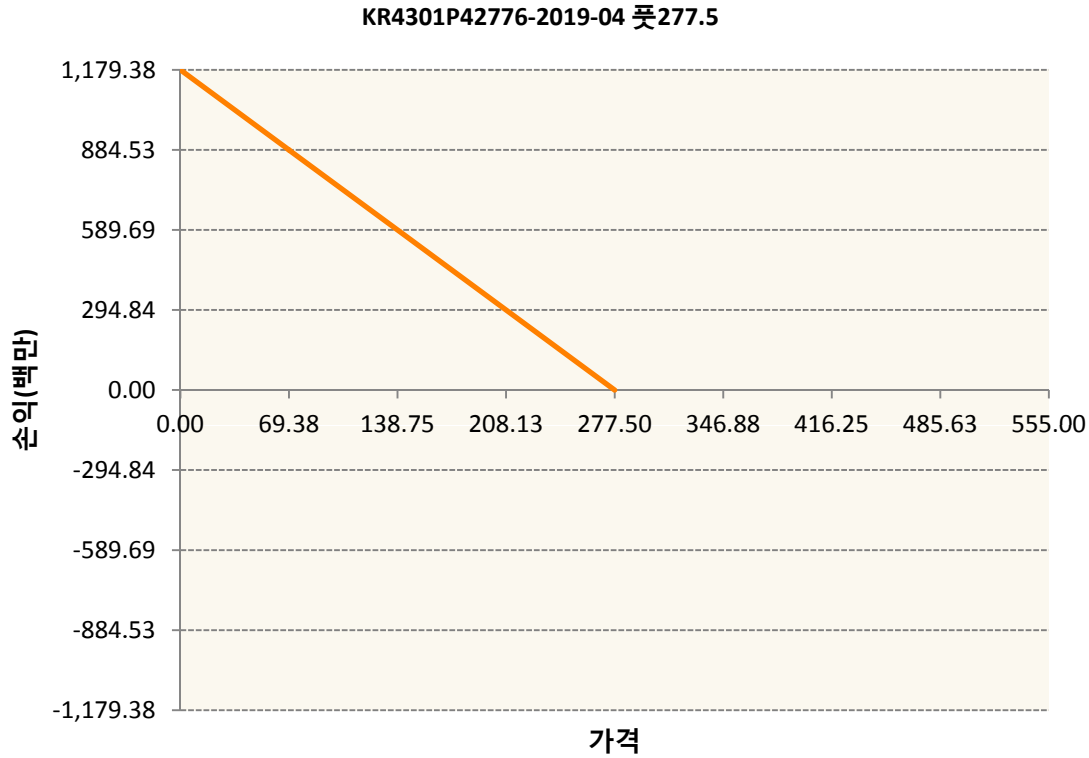
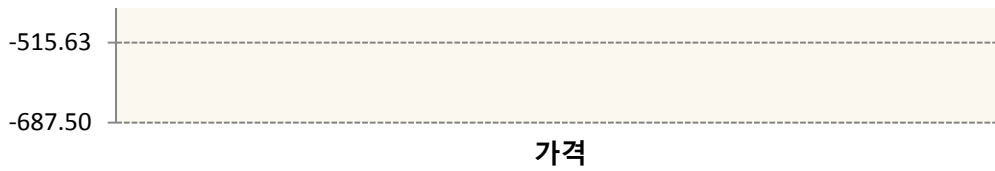


KR4201P42927-2019-04 콜292.5



KR4301P42750-2019-04 풋275





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						1,015
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,015	-1,015	-1,015	-1,015	-1,015	-1,015	-1,015	
-5.33%	-677	-677	-677	-677	-677	-677	-677	
-2.67%	-338	-338	-338	-338	-338	-338	-338	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	338	338	338	338	338	338	338	
5.33%	677	677	677	677	677	677	677	
8.00%	1,015	1,015	1,015	1,015	1,015	1,015	1,015	
KR4201P42901		2019-04 콜290						880
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	89	89	89	89	88	87	86	
-5.33%	89	88	87	85	82	78	73	
-2.67%	84	80	74	66	57	46	34	

0%	49	34	18	0	-19	-39	-59
2.67%	-81	-107	-133	-158	-184	-210	-237
5.33%	-368	-391	-414	-438	-463	-488	-513
8.00%	-788	-799	-813	-827	-844	-861	-880
KR4201P42927 2019-04 콜292.5							180
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	14	14	14	14	14	14	13
-5.33%	14	14	14	13	13	12	12
-2.67%	13	13	12	11	9	7	5
0%	9	6	3	0	-4	-8	-12
2.67%	-12	-17	-23	-29	-34	-40	-46
5.33%	-66	-71	-77	-84	-90	-96	-102
8.00%	-154	-157	-161	-165	-170	-175	-180
KR4301P42750 2019-04 풋275							41
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	41	41	41	41	41	41	41
-5.33%	22	23	23	23	23	23	23
-2.67%	6	7	7	8	8	9	9
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
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
KR4301P42776 2019-04 풋277.5							78
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	78	78	78	78	78	78	78
-5.33%	46	46	46	46	46	46	47
-2.67%	16	16	17	18	18	19	20
0%	-2	-2	-1	0	1	2	2
2.67%	-6	-6	-5	-5	-5	-5	-4
5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6

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

(단위:백만원)

1,810

공시일	2019-04-02
기준일	2019-04-01

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	998	0	998	
누계	유가증권	수익증권	3,560	0	3,560	

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	2019-04-02
기준일	2019-04-01

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,474	0	1,474	
누계	유가증권	수익증권	13,187	0	13,187	

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	2019-04-02
기준일	2019-04-01

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,041	0	2,041	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	63,795	0	63,795	
누계	통화	선도	0	65,970	-65,970	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	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
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	453
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	526
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	319
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
FX21019J001 KRW/USD 10-05-19E	44

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

(단위:백만원)

1,847

공시일	2019-04-02
기준일	2019-04-01

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

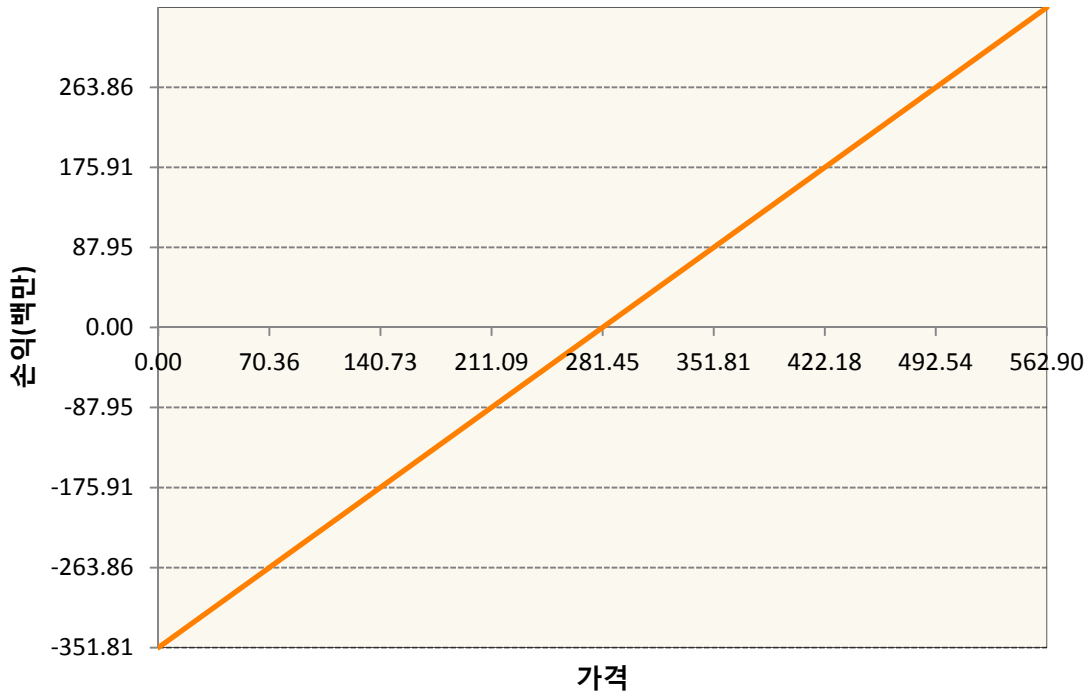
1. 계약금액

(단위:백만원)

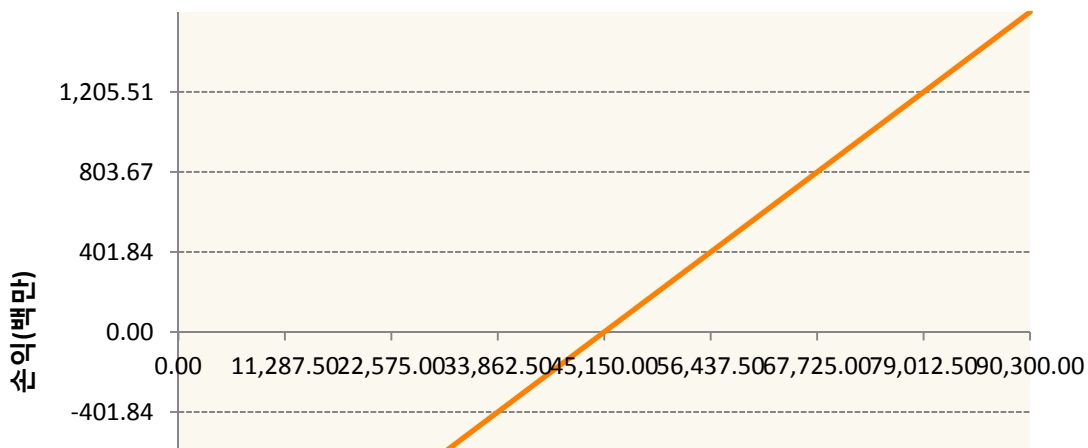
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,959	0	1,959	장내

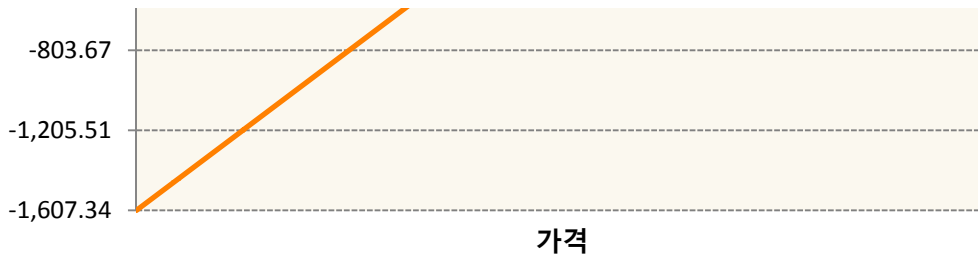
2. 만기시점의 손익구조

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%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
-2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	9	9	9	9	9	9	9	
5.33%	19	19	19	19	19	19	19	
8.00%	28	28	28	28	28	28	28	
KR4111P40005		2019-04 삼성전자개별선물						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%	-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%	128	128	128	128	128	128	128	

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

176

공시일	2019-04-02
기준일	2019-04-01

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

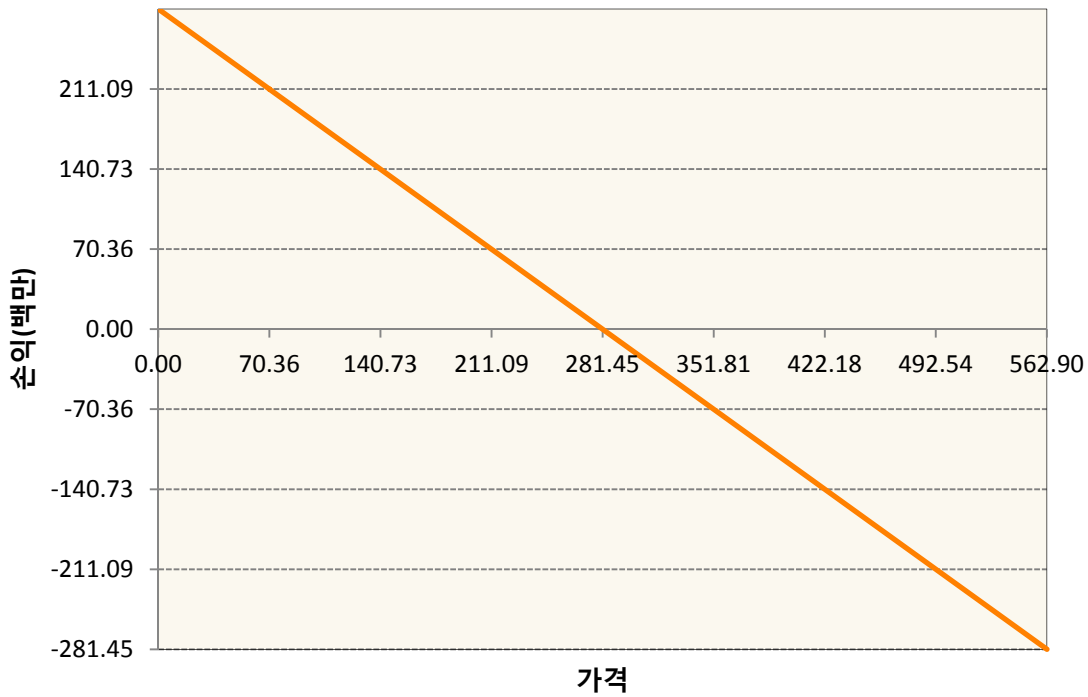
1. 계약금액

(단위:백만원)

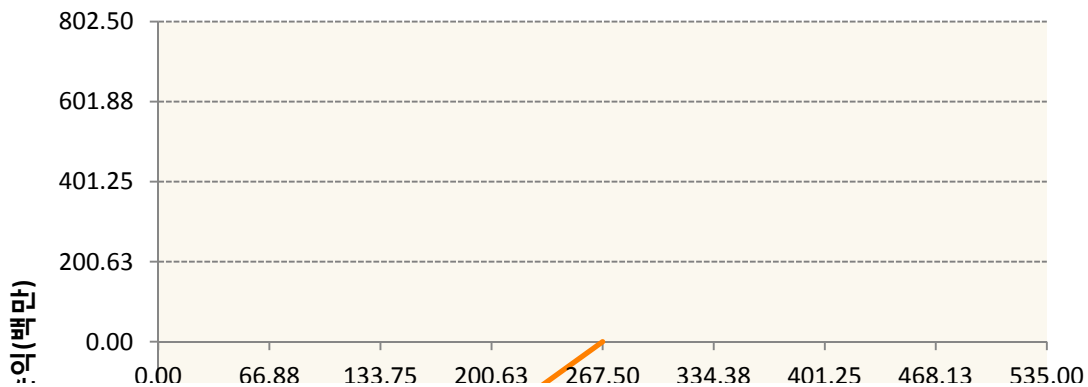
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	70	-70	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	281	-281	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,275	-1,275	장내

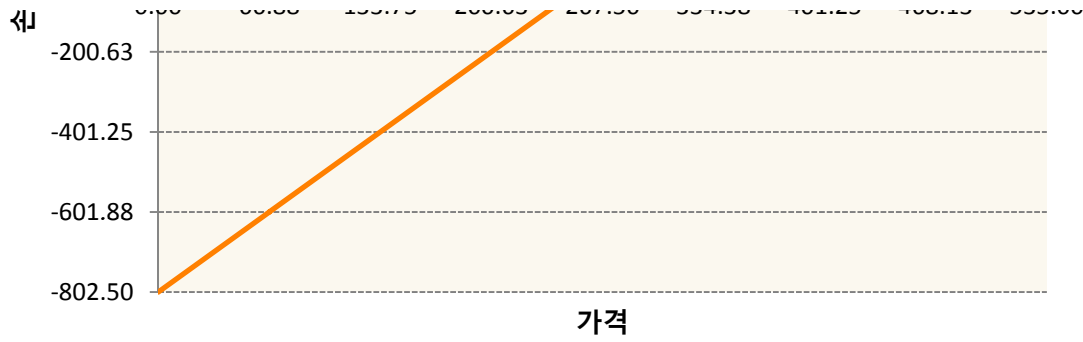
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

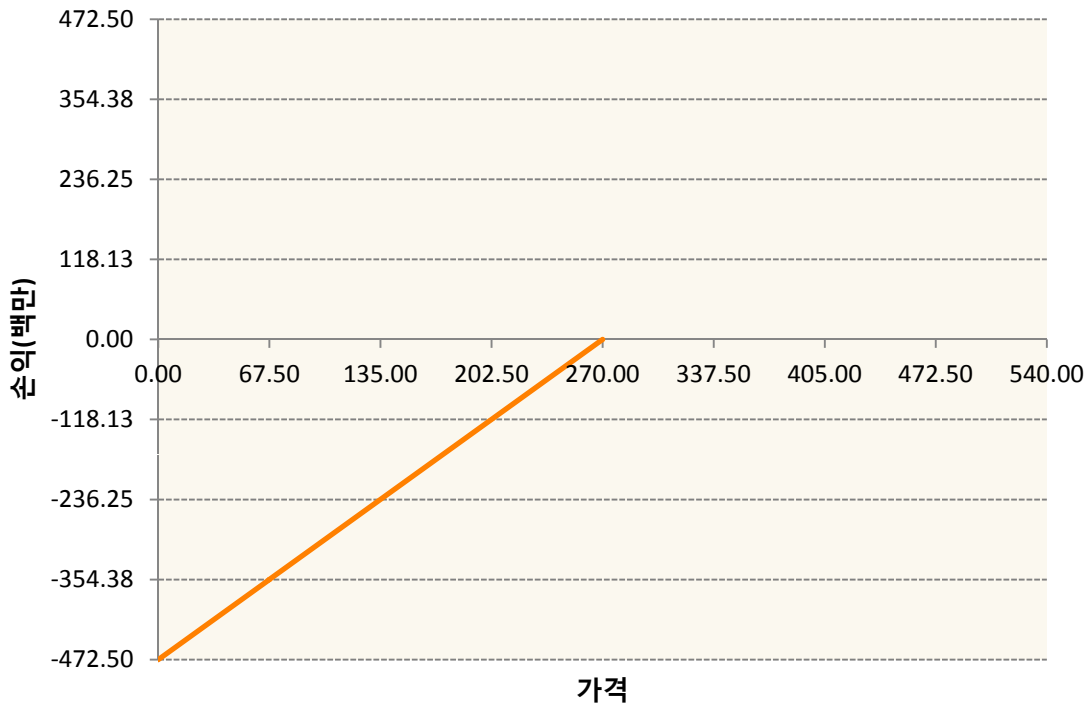


KR4301P42677-2019-04 풋267.5





KR4301P42701-2019-04 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						22
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	22	22	22	22	22	22	22	
-5.33%	15	15	15	15	15	15	15	
-2.67%	7	7	7	7	7	7	7	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7	
5.33%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	
8.00%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22	
KR4301P42677		2019-04 풋267.5						30
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-29	-29	-29	-29	-29	-30	-30
-5.33%	-9	-10	-10	-11	-11	-12	-12
-2.67%	-1	-1	-1	-2	-2	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

KR4301P42701

2019-04 풋270

21

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-5.33%	-9	-9	-9	-9	-10	-10	-10
-2.67%	-1	-1	-2	-2	-2	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-04-02
기준일	2019-04-01

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

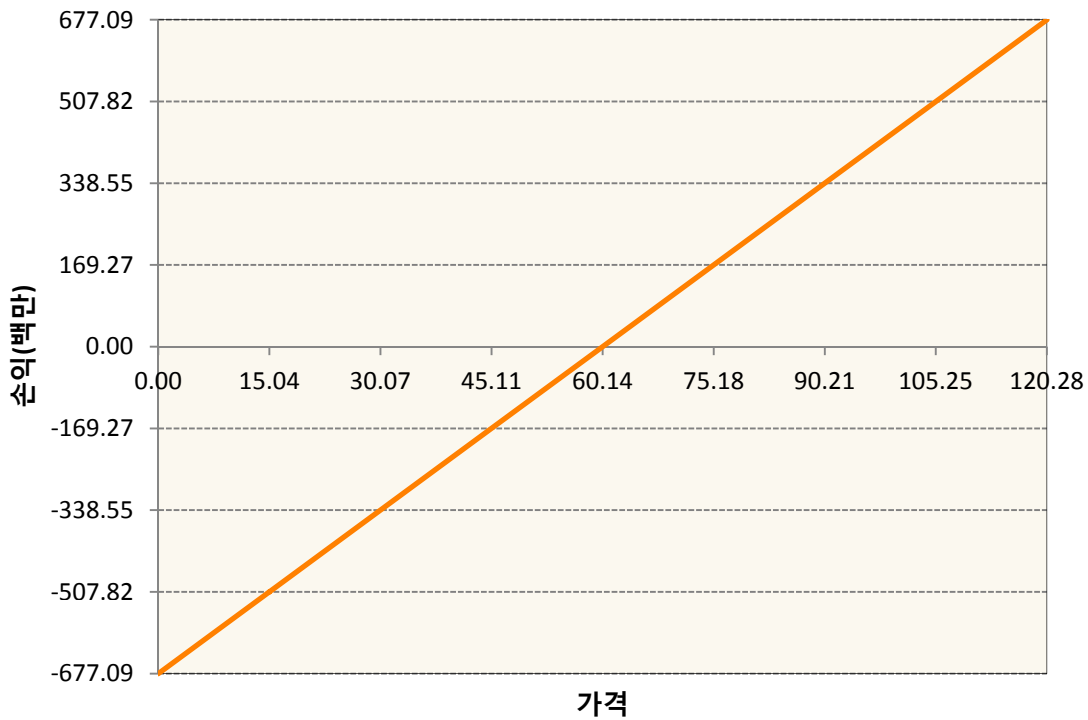
1. 계약금액

(단위:백만원)

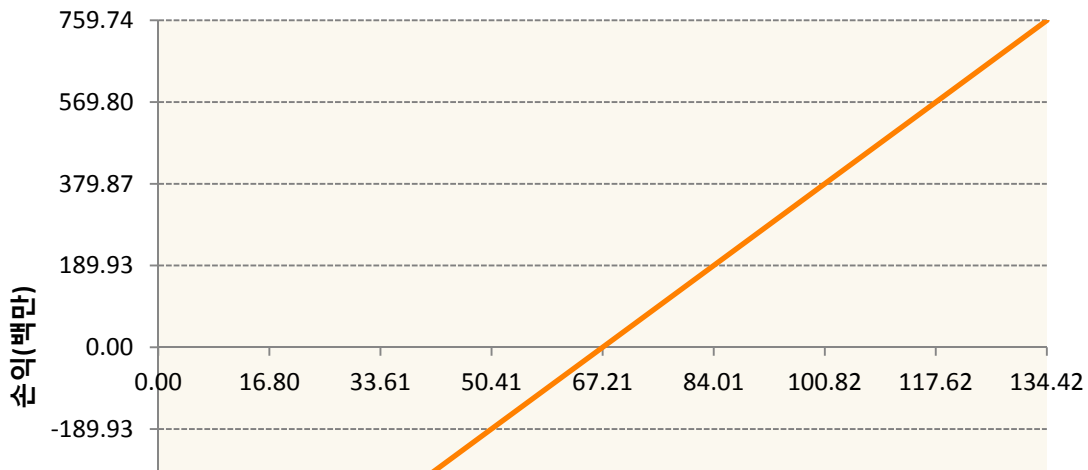
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,852	283	2,569	

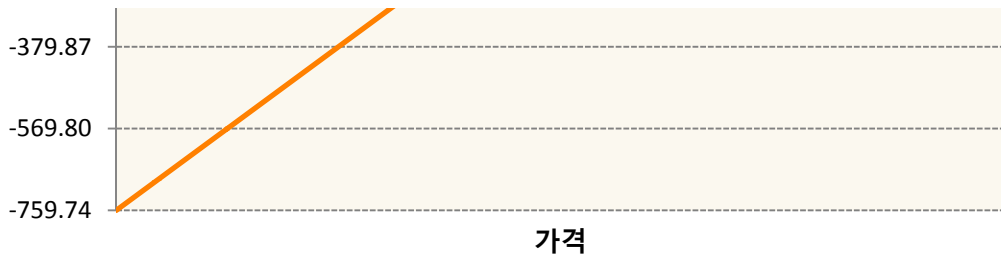
2. 만기시점의 손익구조

CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19

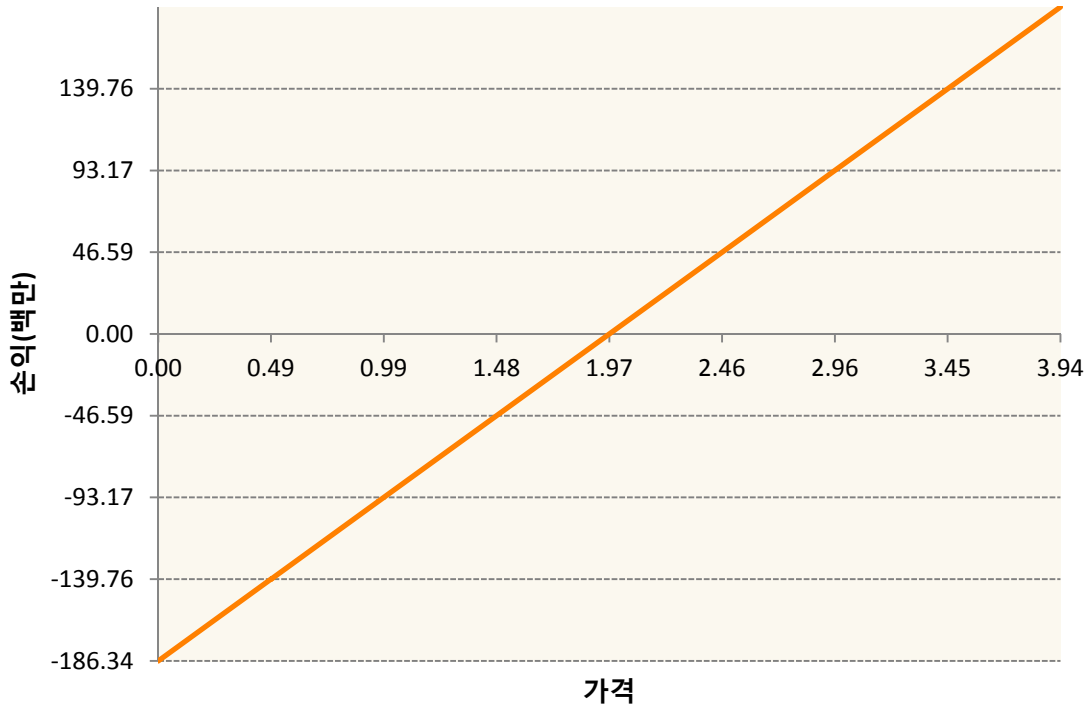


CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19

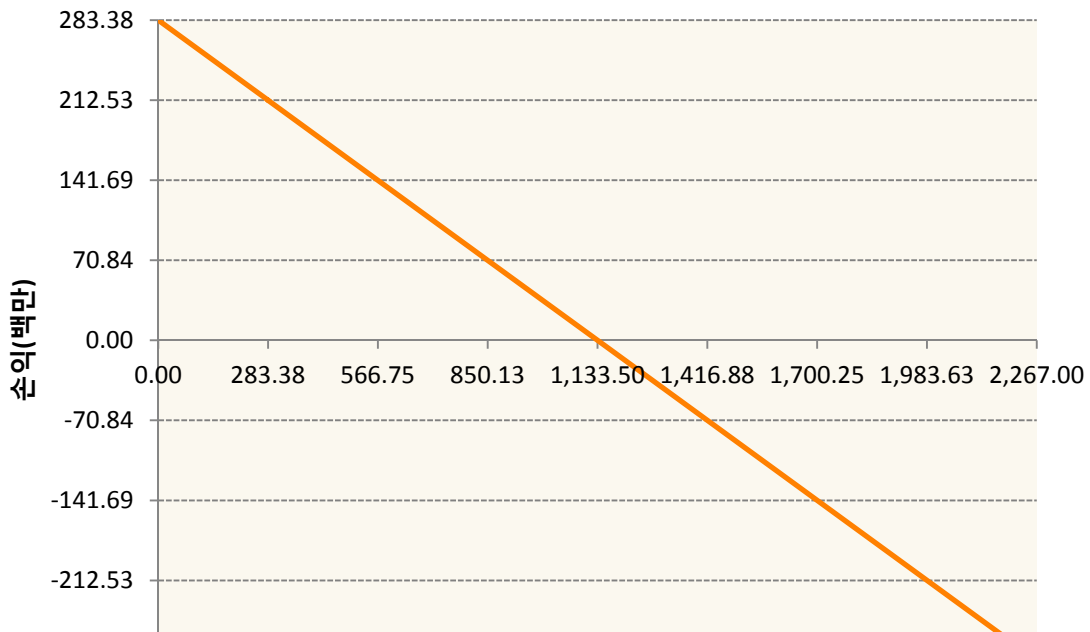


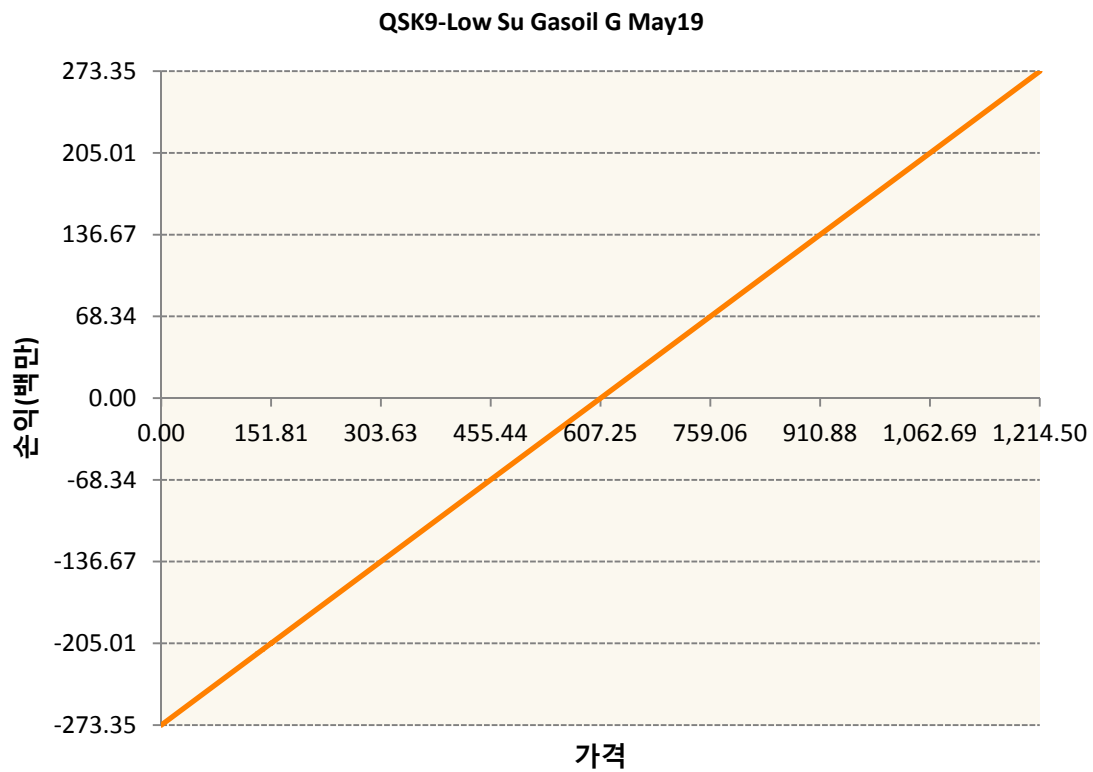
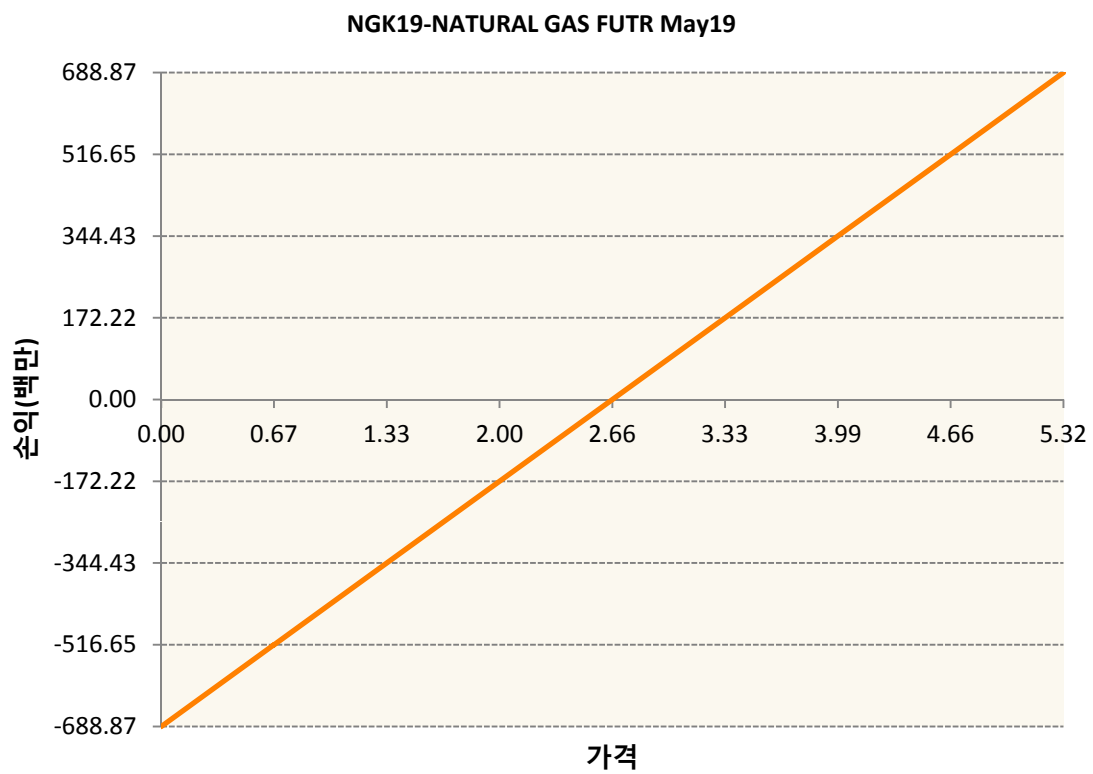
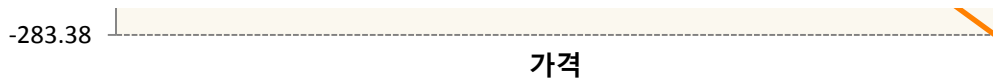


HOK9-NY Harb ULSD Fut May19

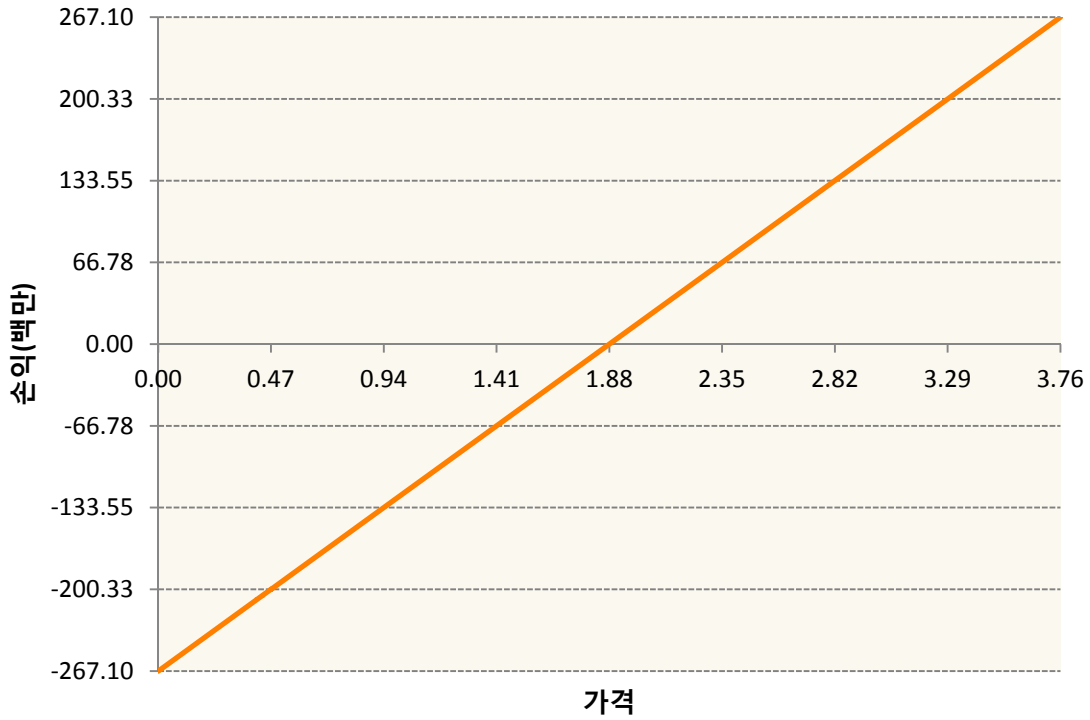


KR4175P40000-2019-04 달러선물





XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK9	WTI CRUDE FUTURE May19	54
CON9	BRENT CRUDE FUTR Jul19	61
HOK9	NY Harb ULSD Fut May19	15
KR4175P400	2019-04 달러선물	23
NGK19	NATURAL GAS FUTR May19	55
QSK9	Low Su Gasoil G May19	22
XBK9	GASOLINE RBOB FUT May19	21

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

(단위:백만원)

430

공시일	2019-04-02
기준일	2019-04-01

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

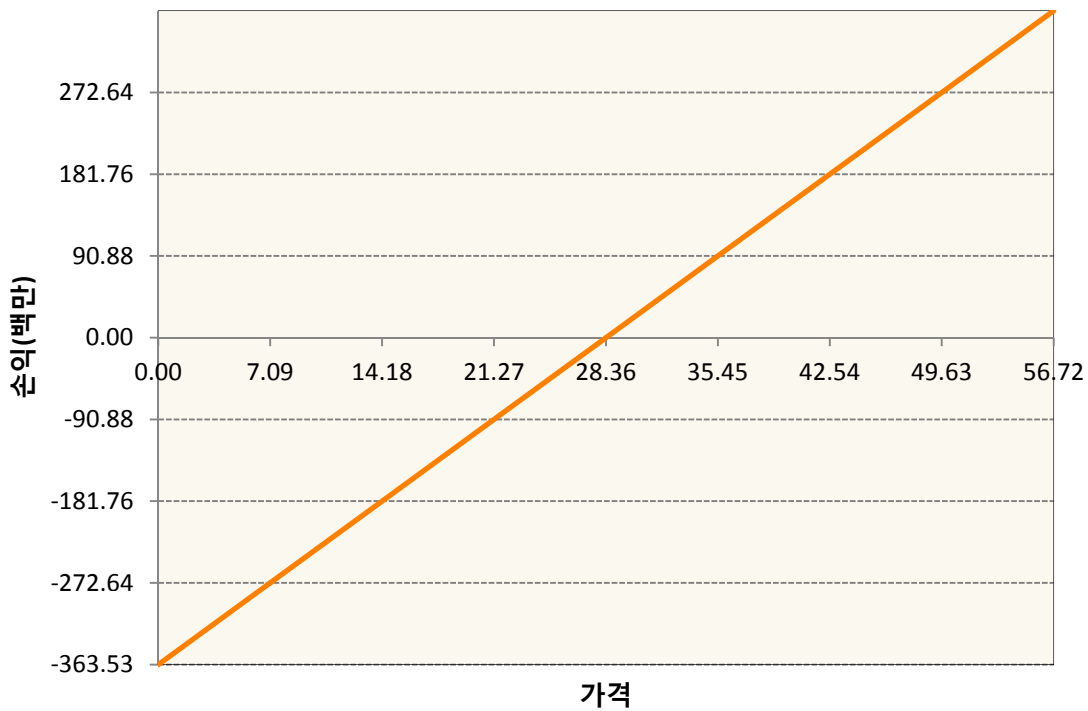
1. 계약금액

(단위:백만원)

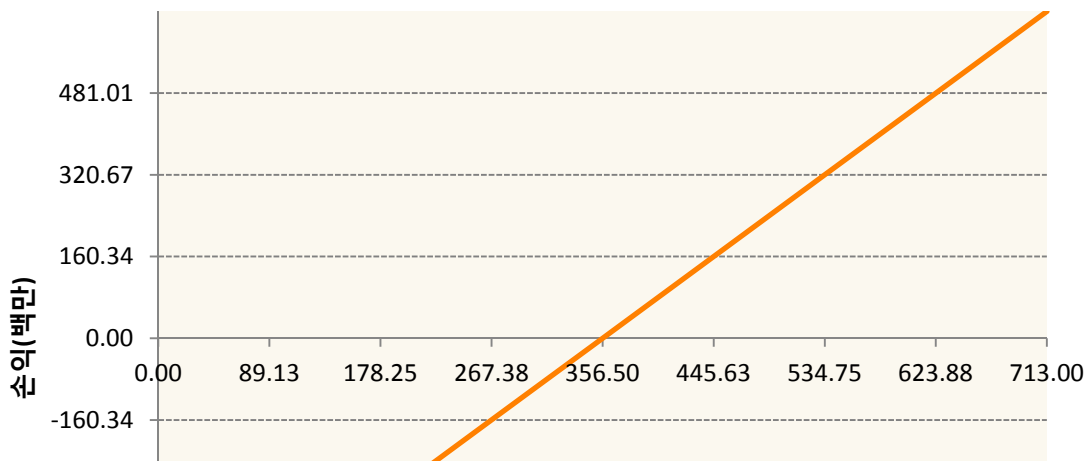
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,312	79	3,233	

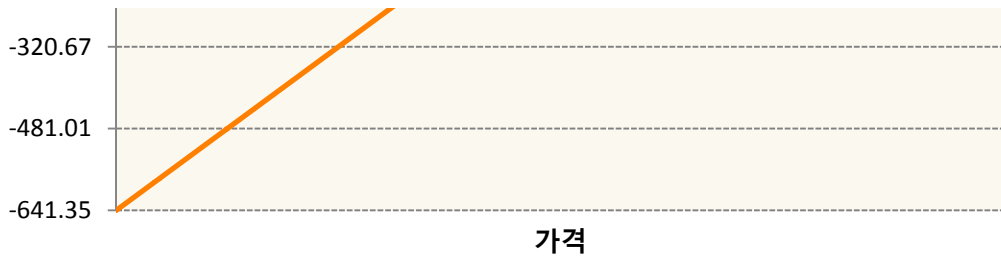
2. 만기시점의 손익구조

BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19

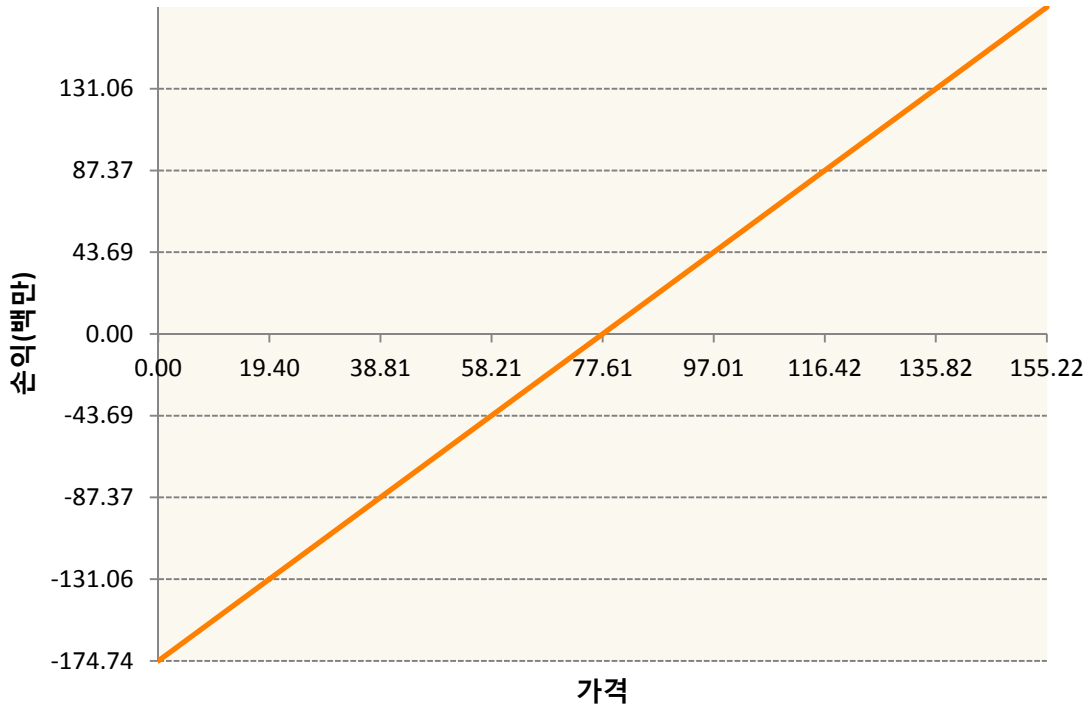


CK9-CORN FUTURE May19

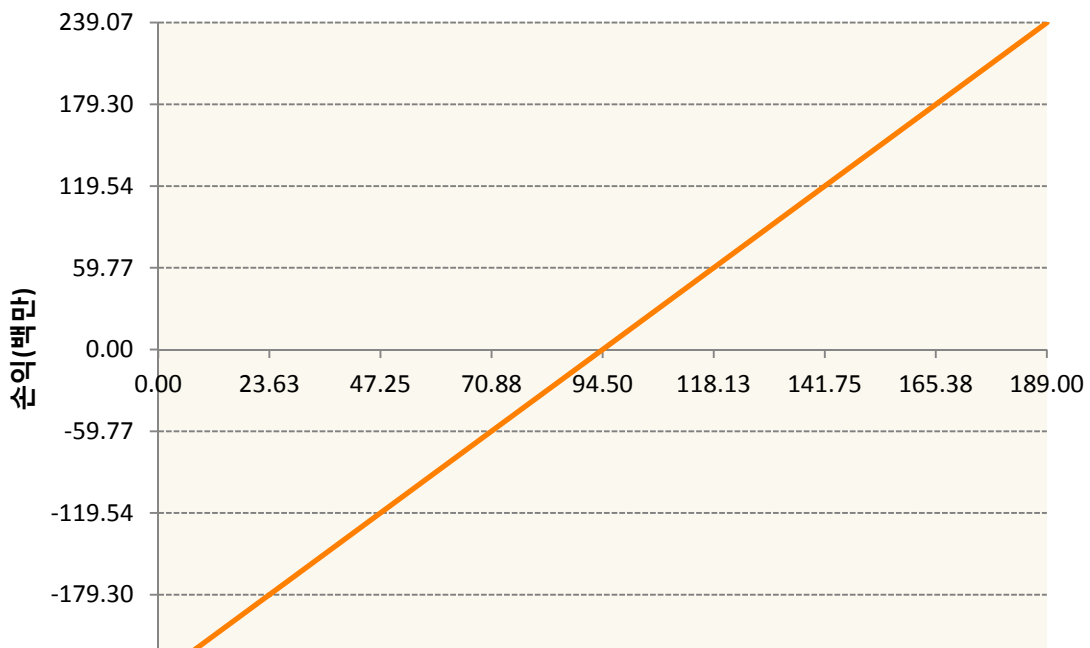


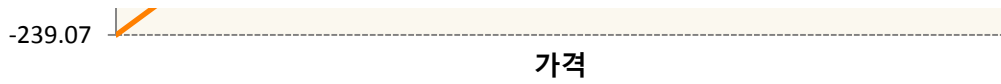


CTK9-COTTON NO.2 FUTR May19

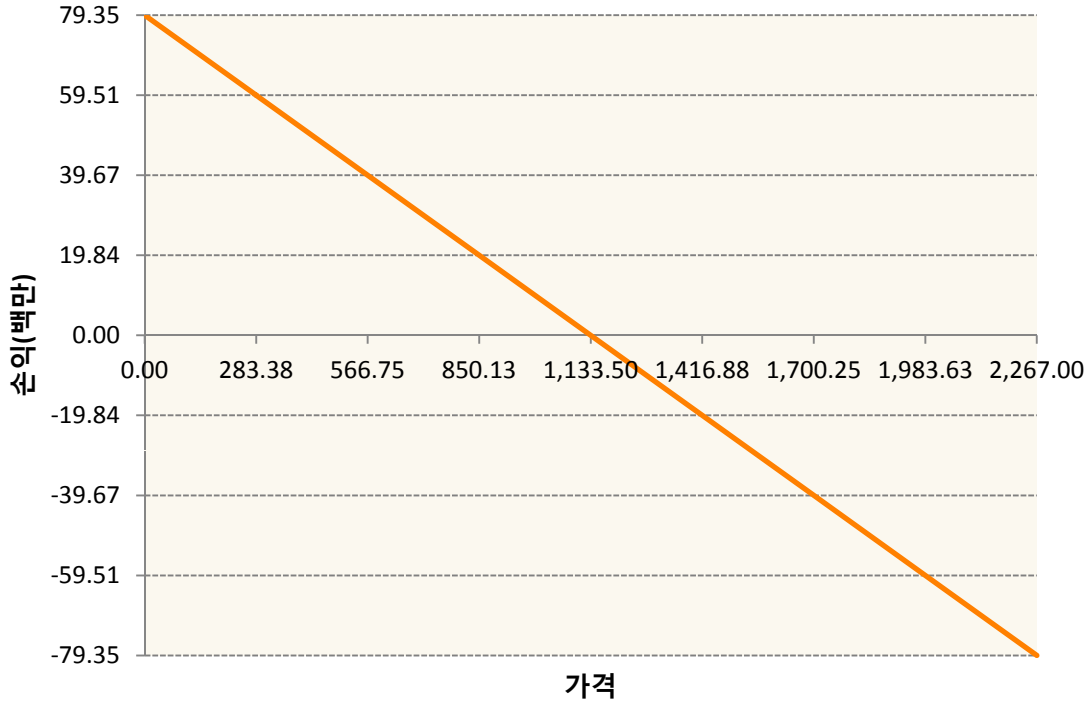


KCK9-COFFEE 'C' FUTURE May19

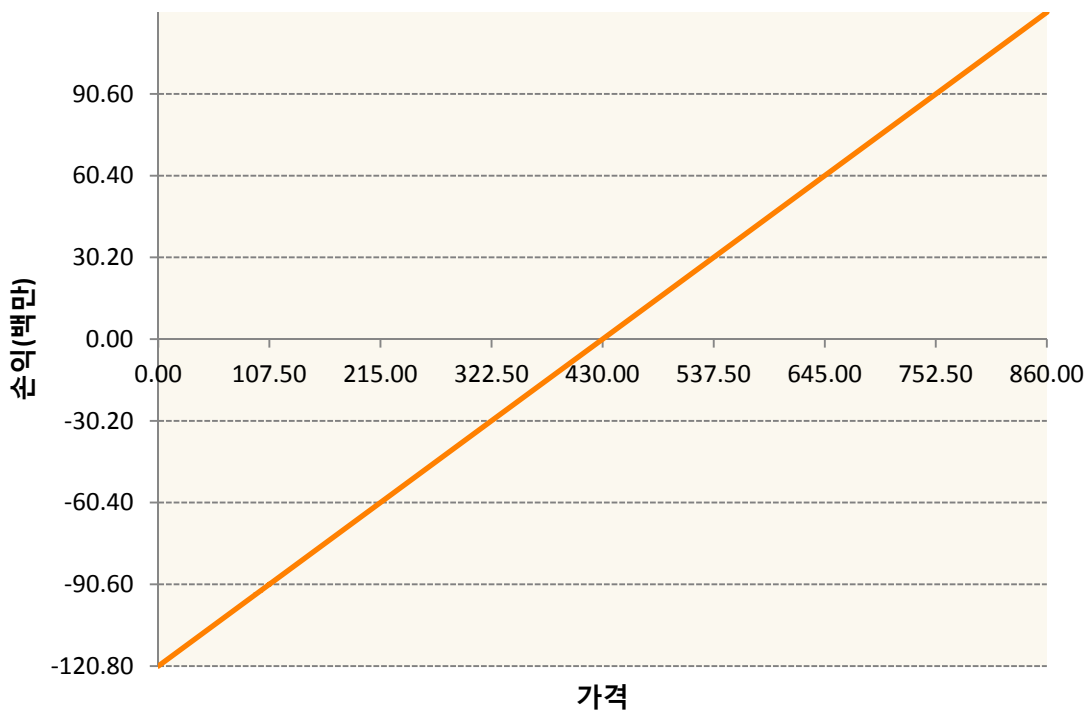




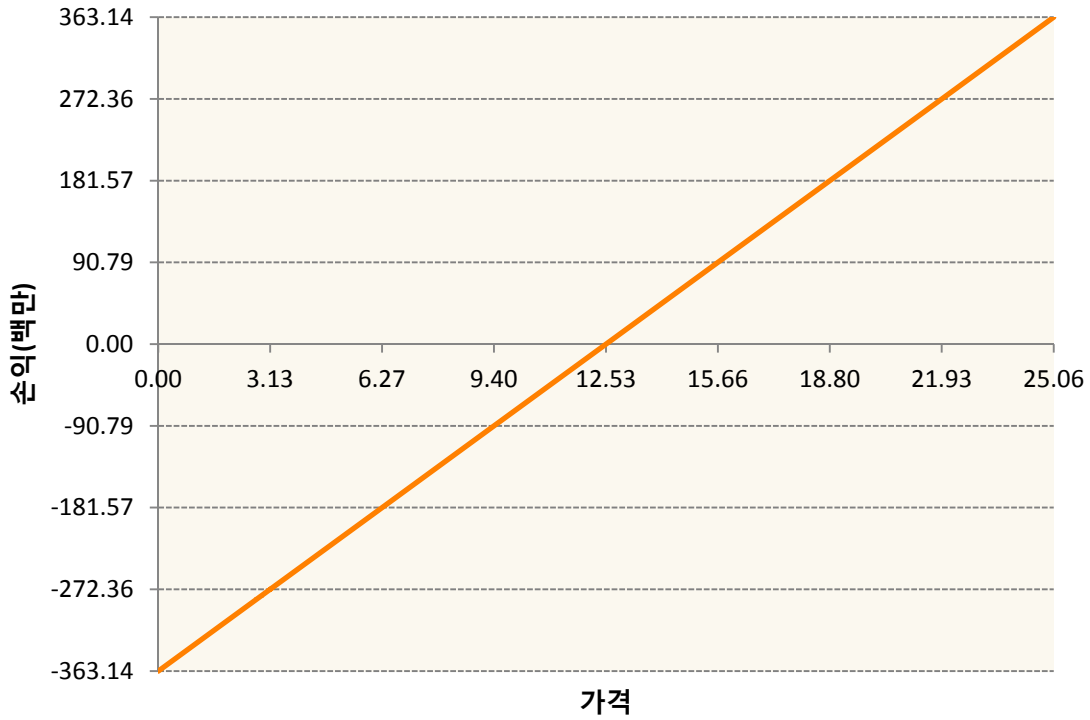
KR4175P40000-2019-04 달러선물



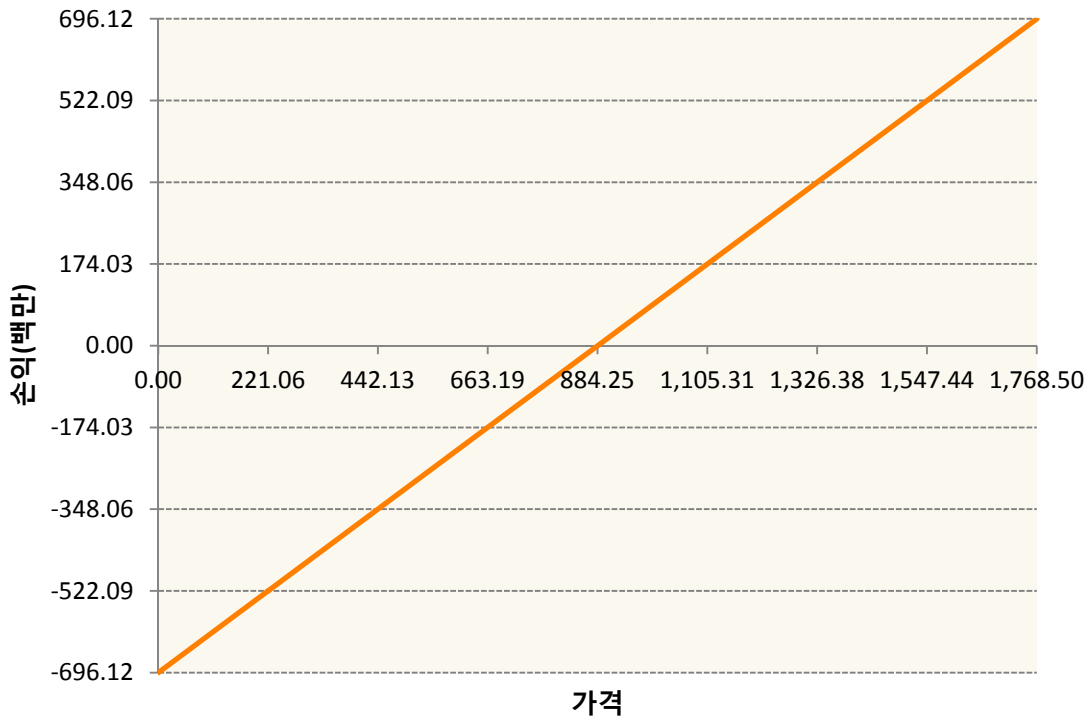
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

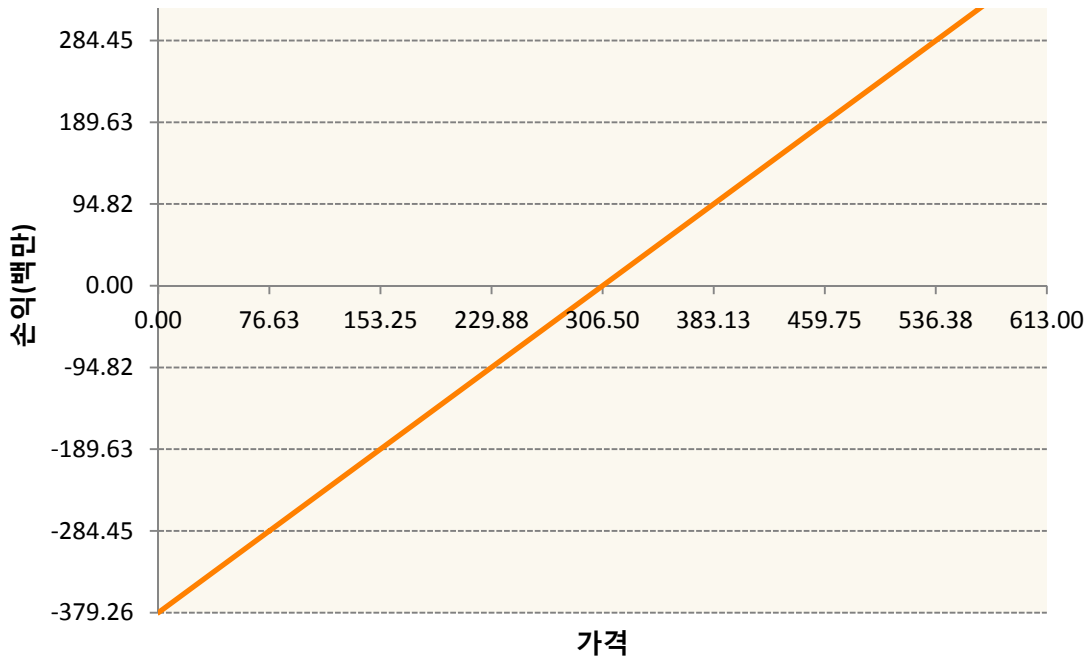


SK9-SOYBEAN FUTURE May19

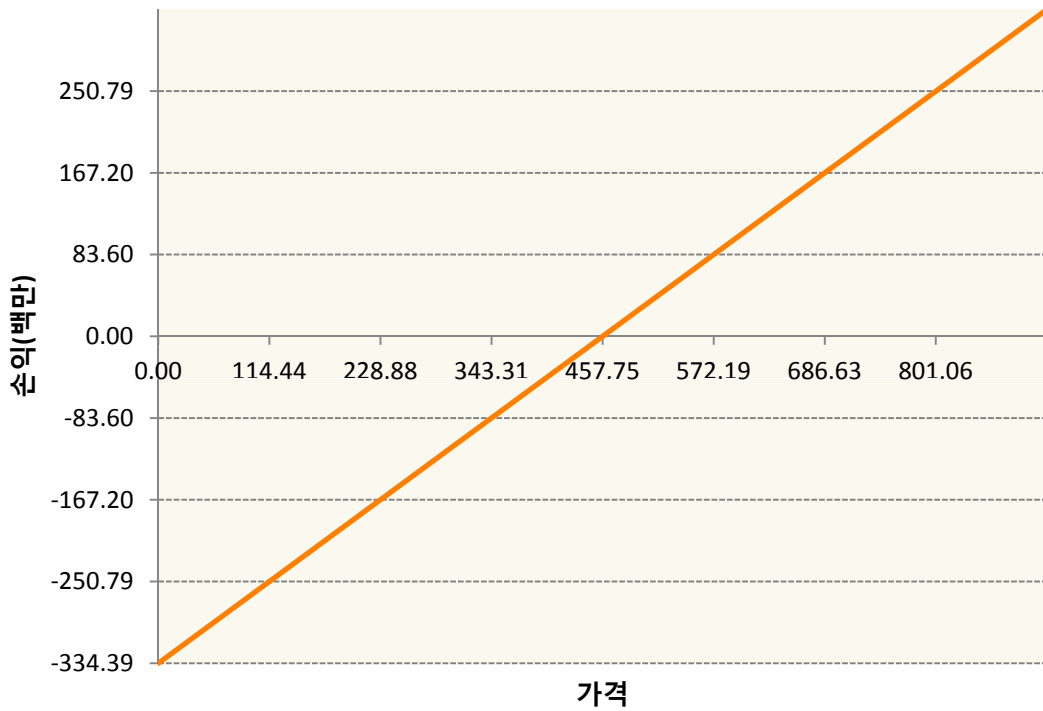


SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





WK9-WHEAT FUTURE(CBT) May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK9	SOYBEAN OIL FUTR May19	29
CK9	CORN FUTURE May19	51
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)

267