

공시일	2019-04-03
기준일	2019-04-02

## 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	2019-04-03
기준일	2019-04-02

## 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

1,141

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

671

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-04-03
기준일	2019-04-02

## 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)	361
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	99
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	169

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

<b>997</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-04-03
기준일	2019-04-02

## 유로인덱스모(주식-파생형)

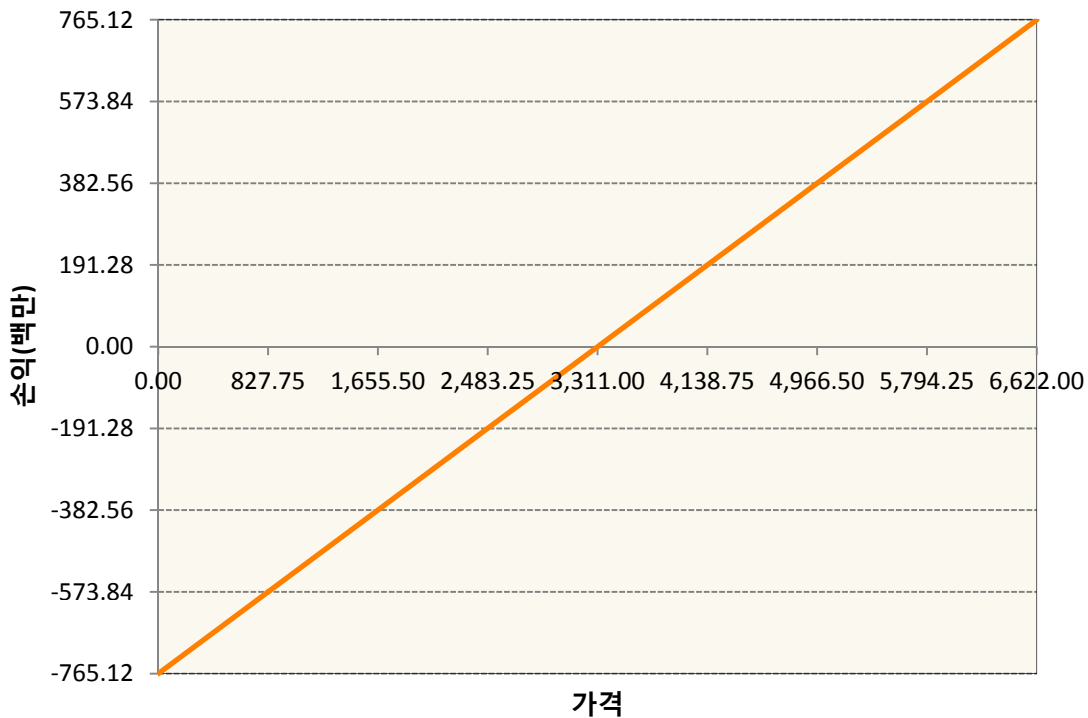
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	765	0	765	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	61
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

44
----

공시일	2019-04-03
기준일	2019-04-02

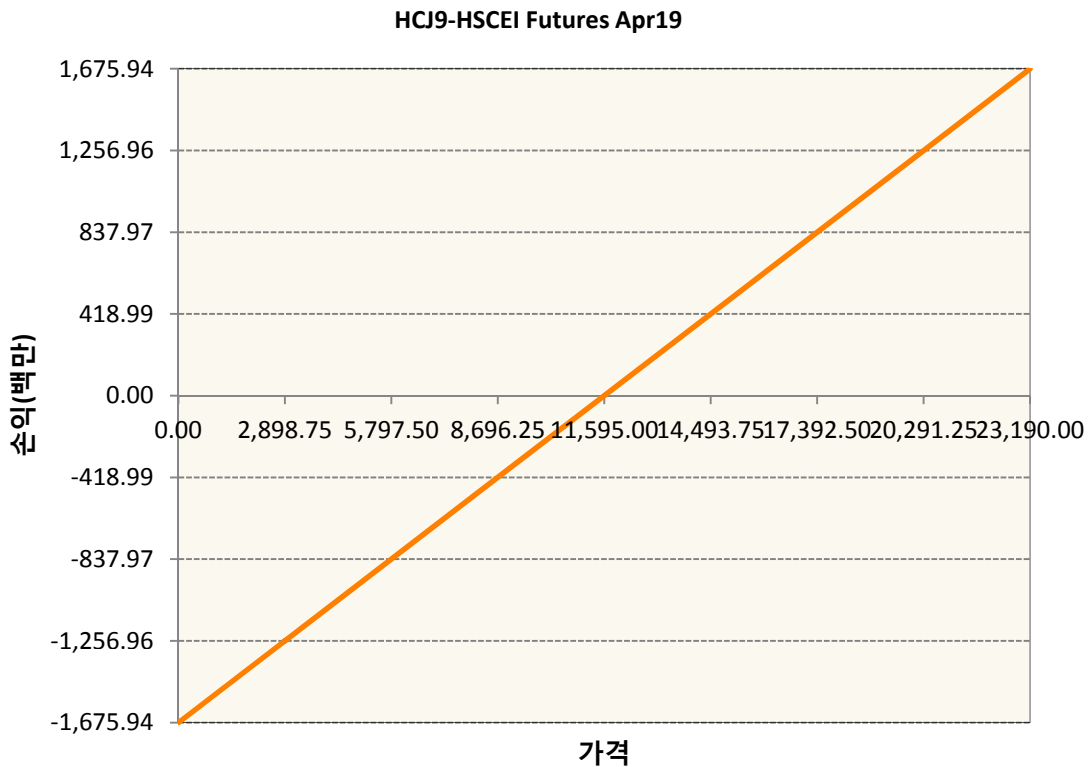
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,676	0	1,676	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

<b>138</b>
------------

공시일	2019-04-03
기준일	2019-04-02

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

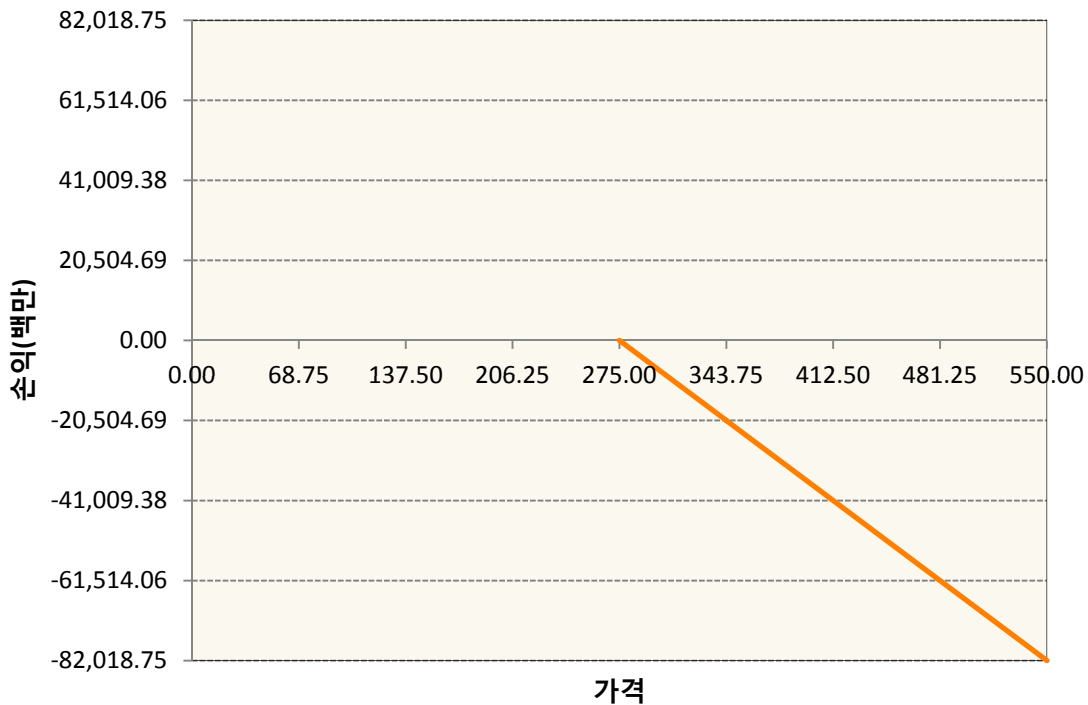
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

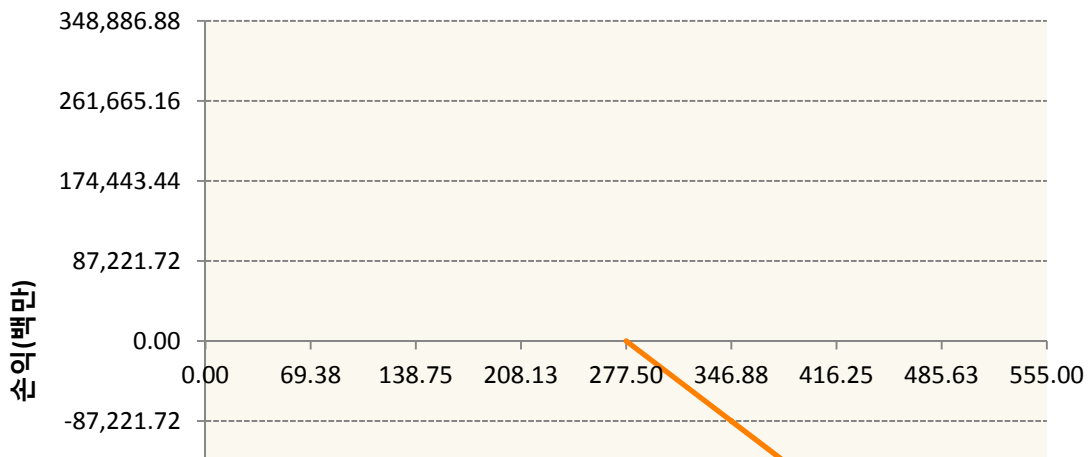
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	668,968	-668,968	장내

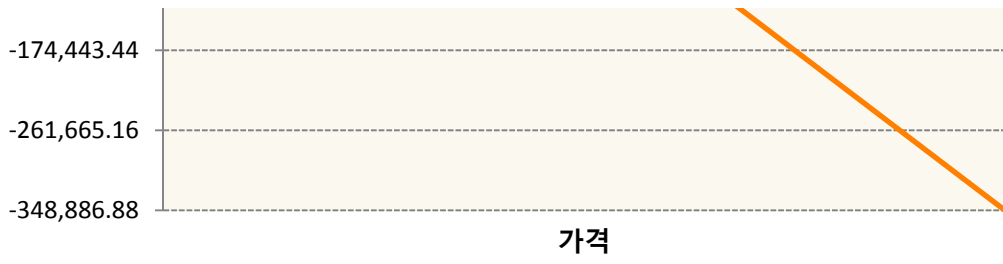
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P42752-2019-04 콜275

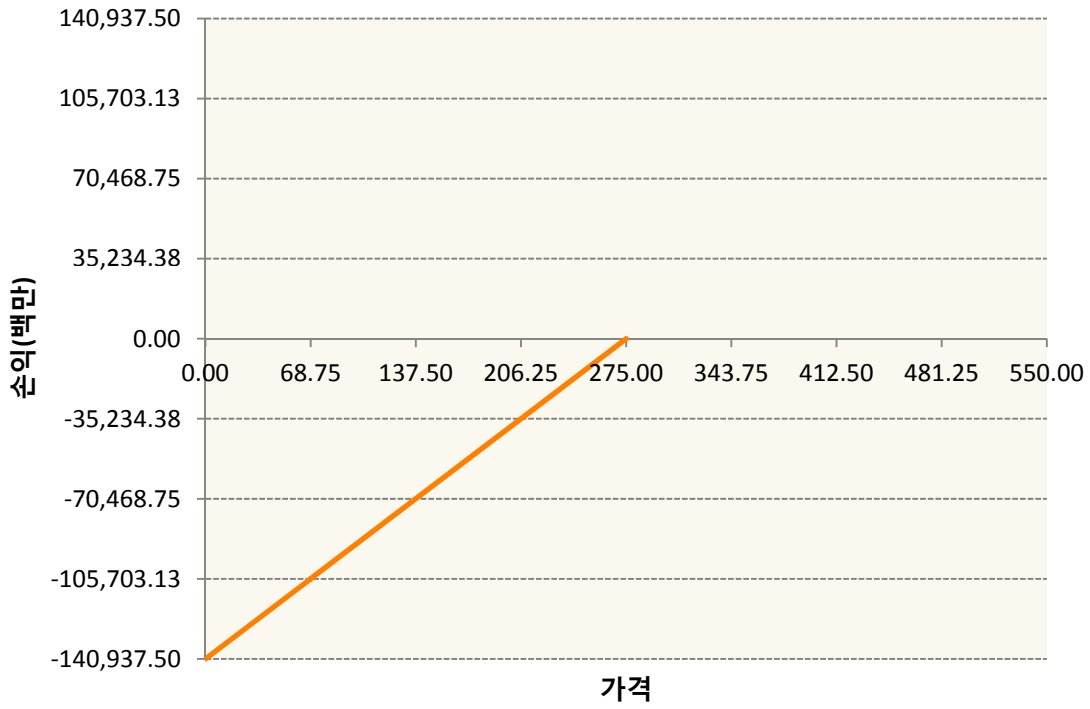


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

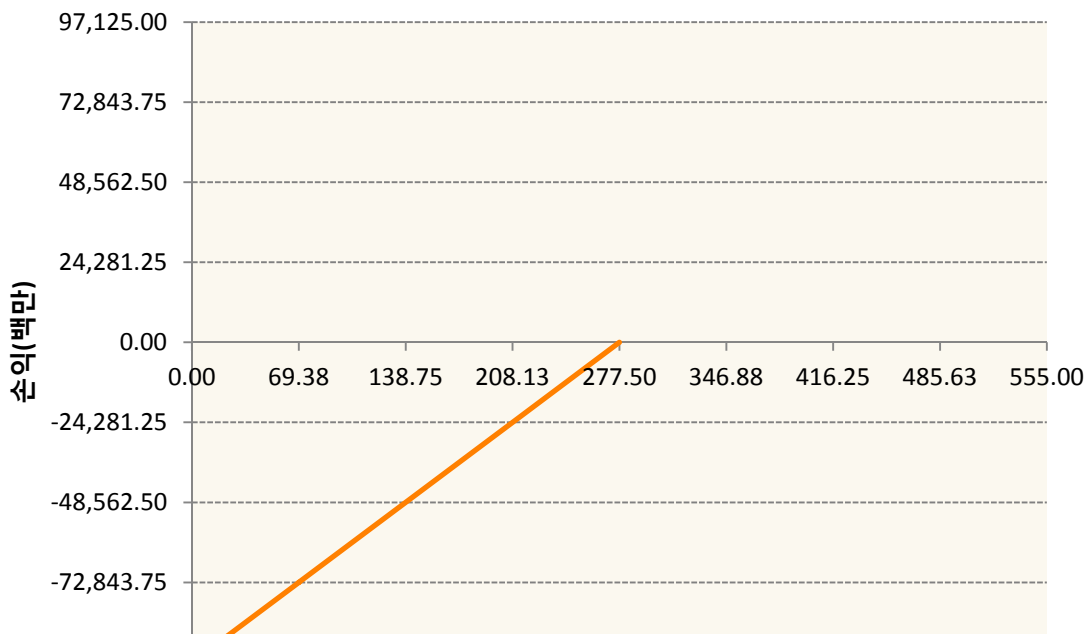




**KR4301P42750-2019-04 풋275**



**KR4301P42776-2019-04 풋277.5**



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P42752		2019-04 콜275						6,225
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,499	2,483	2,461	2,433	2,399	2,359	2,313	
-5.33%	2,343	2,281	2,212	2,139	2,062	1,981	1,898	
-2.67%	1,687	1,583	1,478	1,373	1,269	1,164	1,059	
0%	247	169	86	0	-89	-180	-274	
2.67%	-1,759	-1,787	-1,823	-1,865	-1,915	-1,970	-2,030	
5.33%	-3,962	-3,967	-3,976	-3,989	-4,007	-4,031	-4,060	
8.00%	-6,198	-6,199	-6,200	-6,203	-6,207	-6,215	-6,225	
KR4201P42778		2019-04 콜277.5						25,333
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	8,420	8,384	8,328	8,250	8,148	8,023	7,875	
-5.33%	8,066	7,878	7,659	7,414	7,145	6,857	6,552	
-2.67%	6,190	5,778	5,361	4,939	4,514	4,086	3,655	
0%	1,223	824	415	0	-421	-845	-1,273	
2.67%	-6,617	-6,800	-7,016	-7,260	-7,530	-7,820	-8,129	
5.33%	-15,737	-15,780	-15,845	-15,935	-16,050	-16,191	-16,356	
8.00%	-25,143	-25,148	-25,160	-25,181	-25,216	-25,266	-25,333	
KR4301P42750		2019-04 풋275						7,945
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-7,931	-7,931	-7,932	-7,933	-7,935	-7,939	-7,945	
-5.33%	-4,103	-4,120	-4,144	-4,173	-4,209	-4,250	-4,296	
-2.67%	-920	-1,016	-1,113	-1,210	-1,306	-1,403	-1,500	
0%	124	90	48	0	-54	-112	-175	
2.67%	184	183	181	177	170	160	146	
5.33%	185	185	185	185	184	184	183	
8.00%	185	185	185	185	185	185	185	
KR4301P42776		2019-04 풋277.5						6,137
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-6,134	-6,134	-6,134	-6,134	-6,134	-6,135	-6,137	
-5.33%	-3,508	-3,512	-3,518	-3,527	-3,540	-3,555	-3,575	
-2.67%	-1,070	-1,121	-1,175	-1,231	-1,289	-1,348	-1,408	
0%	145	100	51	0	-54	-109	-166	
2.67%	281	278	273	265	253	239	221	

5.33%	283	283	283	283	282	281	279
8.00%	283	283	283	283	283	283	283

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

(단위:백만원)

**49,127**

공시일	2019-04-03
기준일	2019-04-02

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

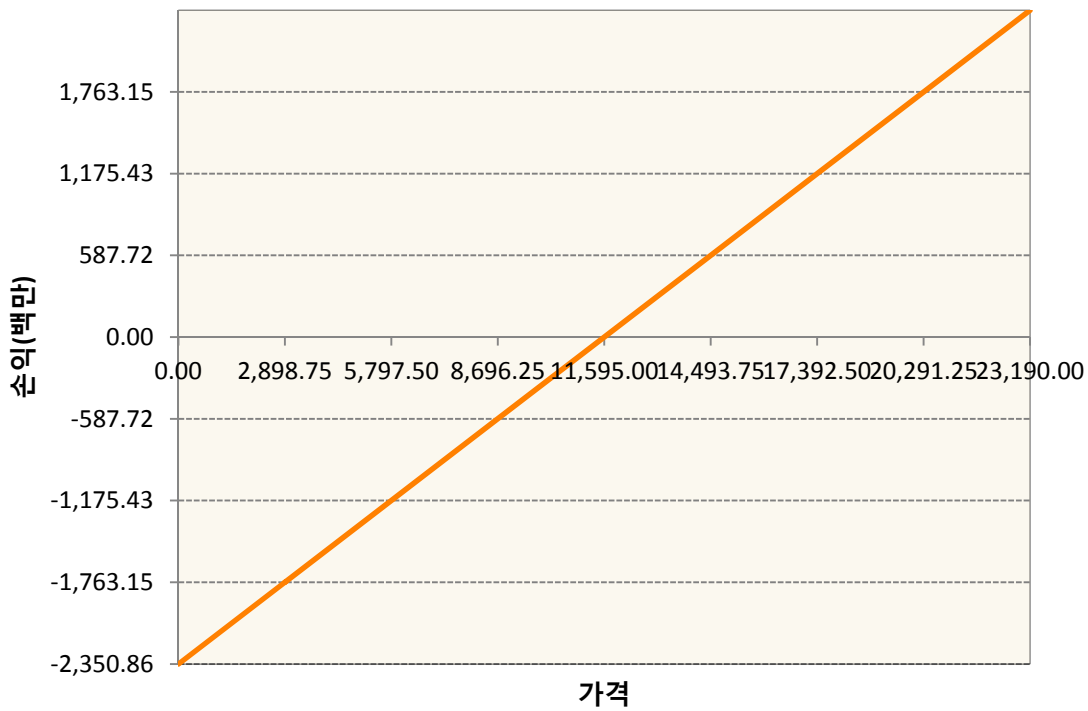
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

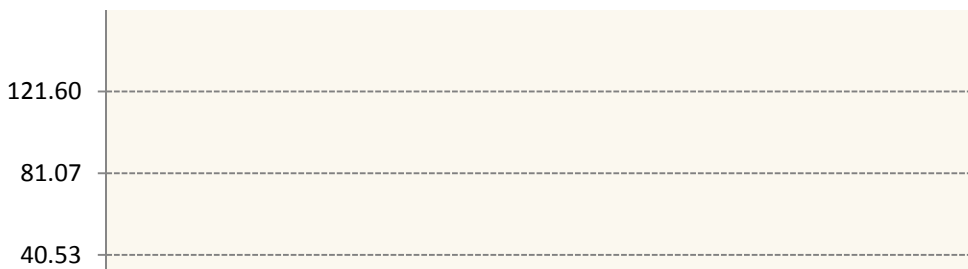
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,351	0	2,351	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,886	-5,886	장내
누계	통화	선도	0	3,040	-3,040	장외

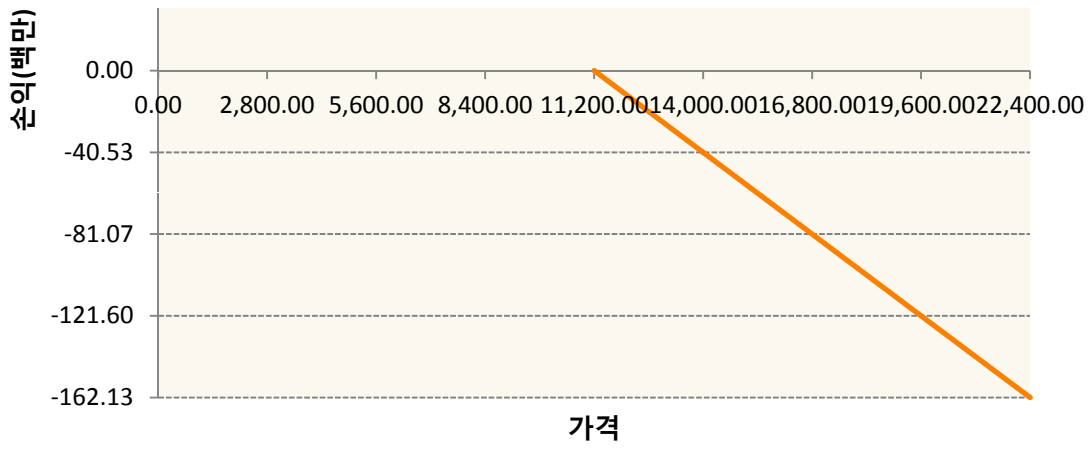
### 2. 만기시점의 손익구조

HCJ9-HSCEI Futures Apr19

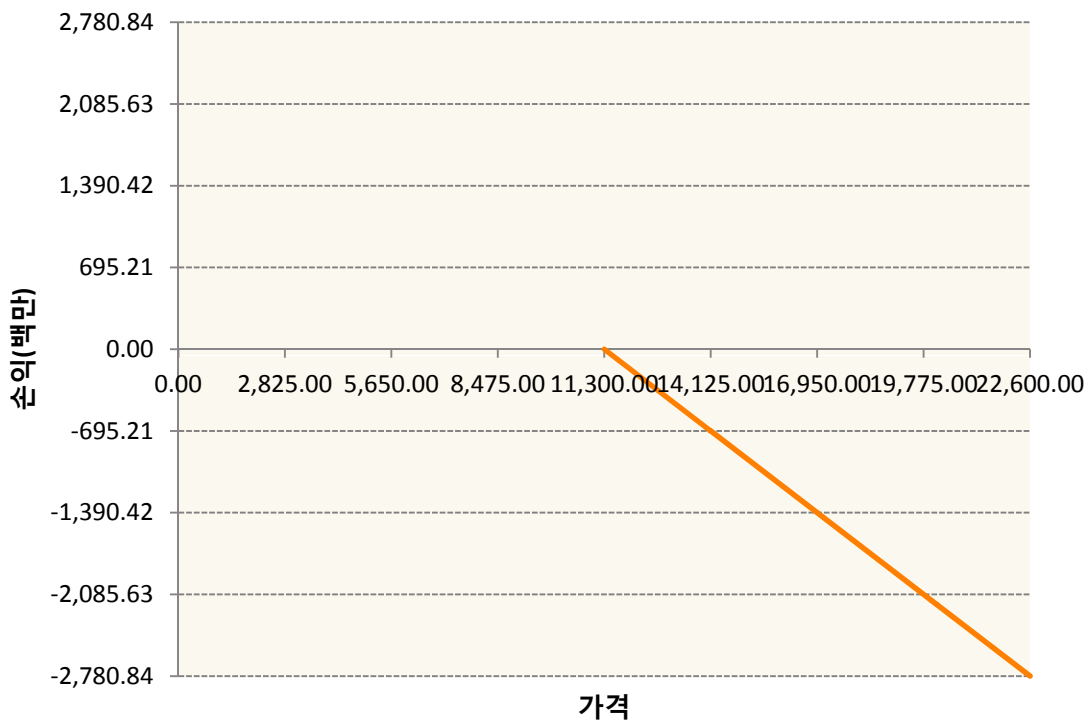


OHHIJ9-C112-HSCEI

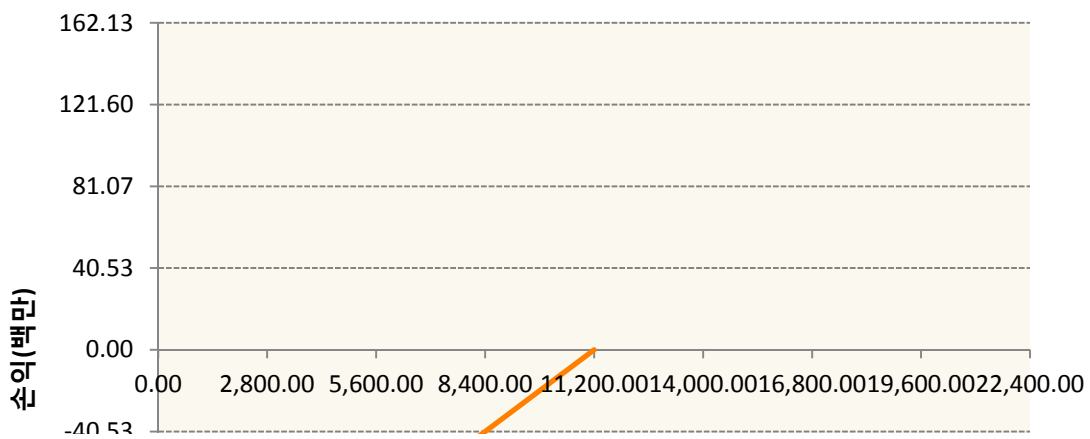


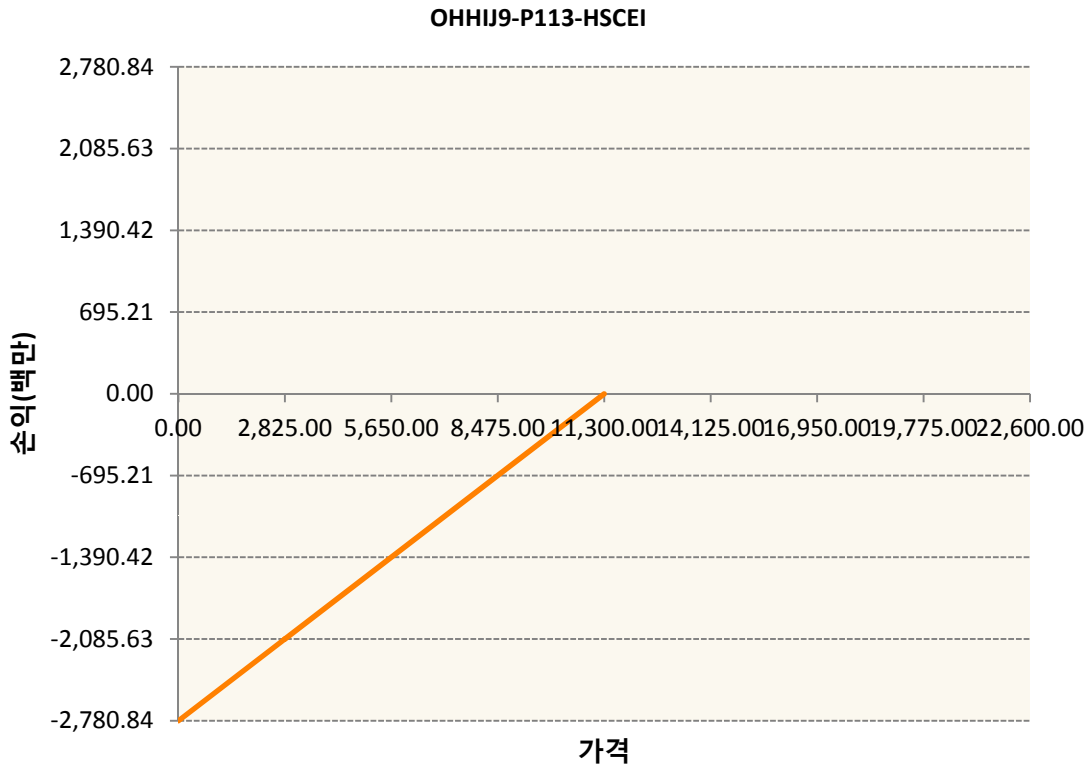


**OHHIJ9-C113-HSCEI**



**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)
	762

공시일	2019-04-03
기준일	2019-04-02

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

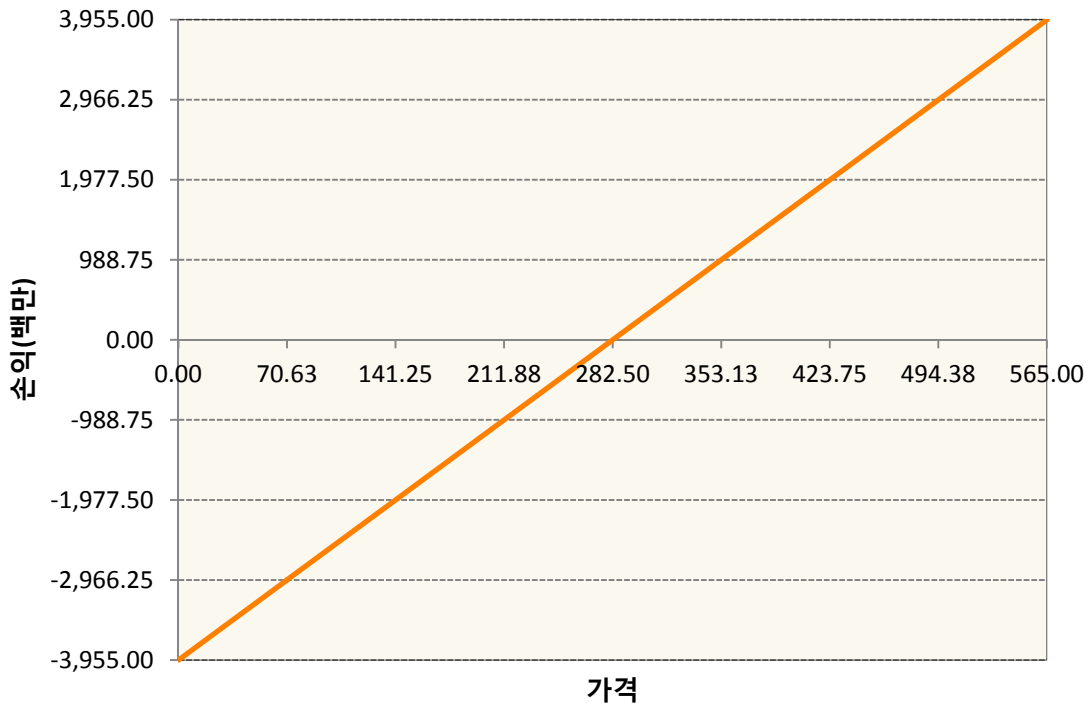
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

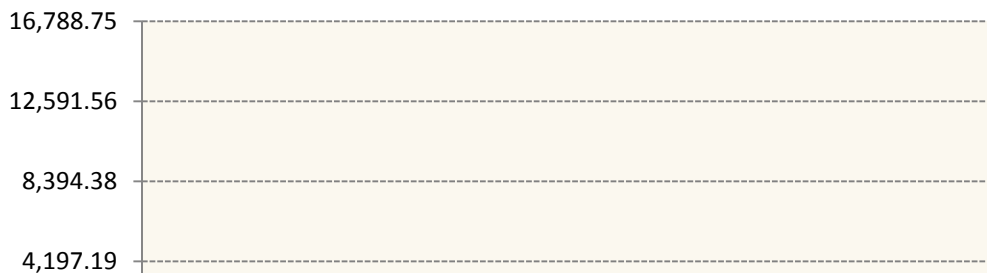
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	68	0	68	장내
누계	유가증권	선물	3,955	0	3,955	장내
누계	유가증권	스왑	35,836	0	35,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,579	-34,579	장내

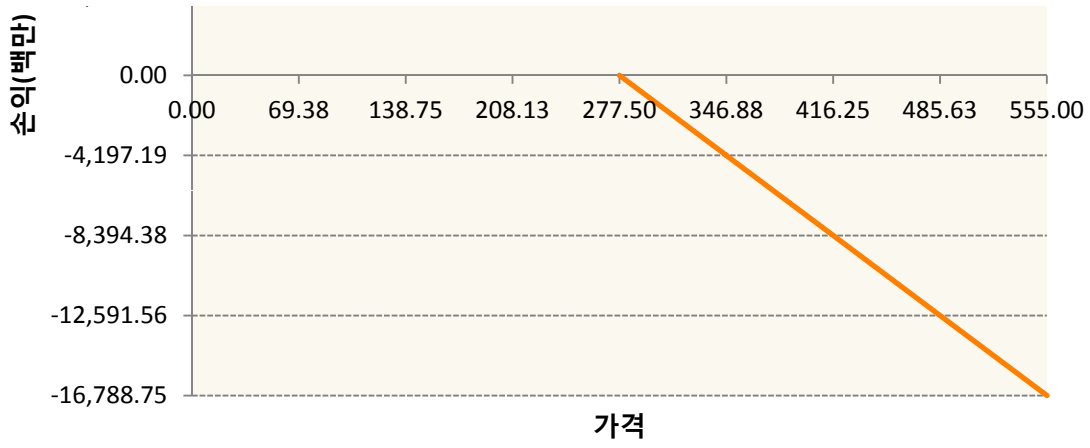
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

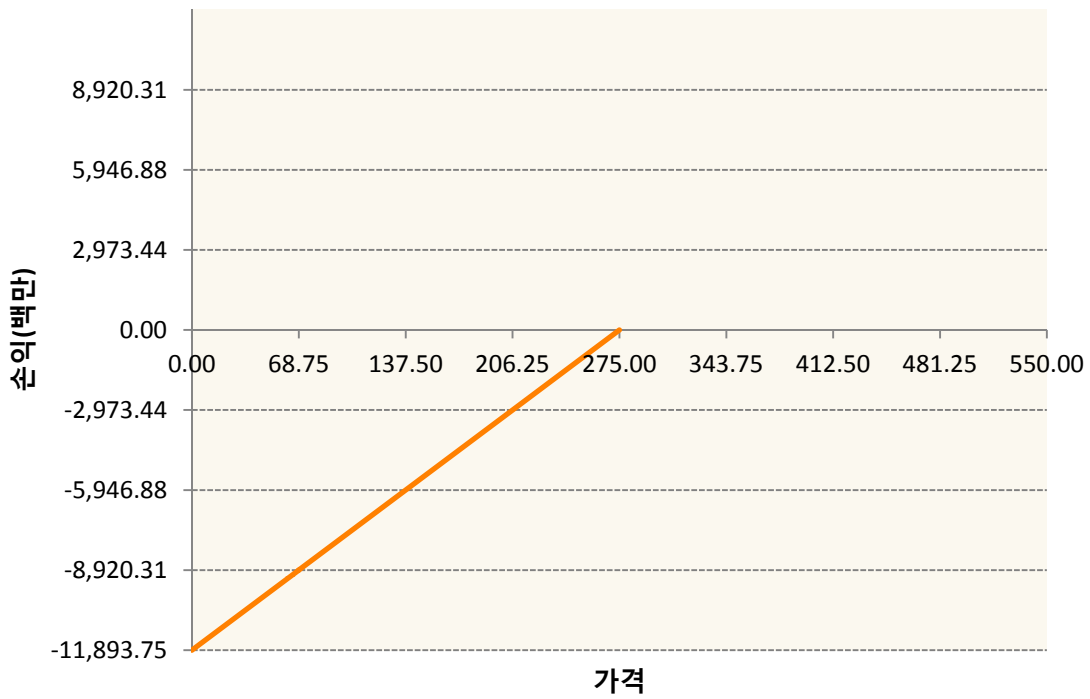


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

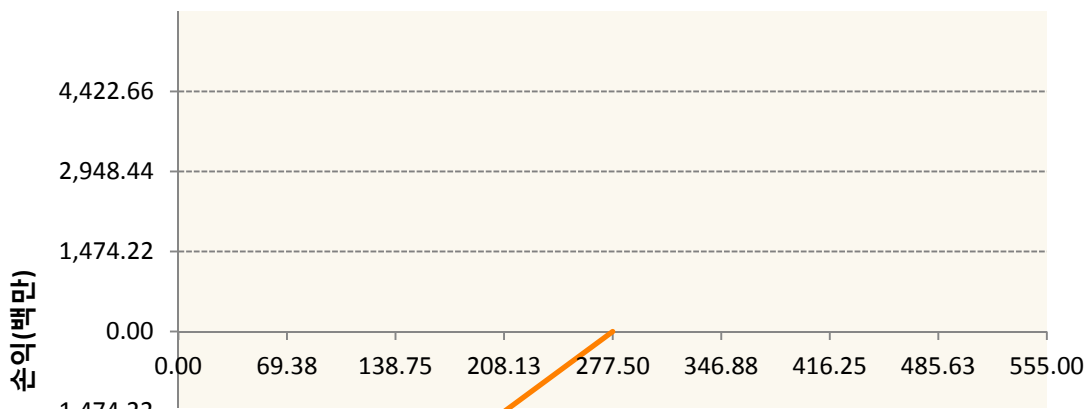


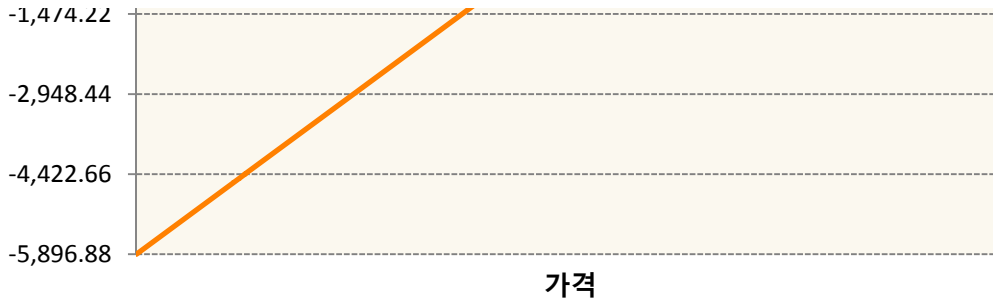


KR4301P42750-2019-04 풋275



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						316
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-316	-316	-316	-316	-316	-316	-316	
-5.33%	-210	-210	-210	-210	-210	-210	-210	
-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%	210	210	210	210	210	210	210	
8.00%	316	316	316	316	316	316	316	
KR4201P42778		2019-04 콜277.5						1,219
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	405	403	401	397	392	386	379
-5.33%	388	379	369	357	344	330	315
-2.67%	298	278	258	238	217	197	176
0%	59	40	20	0	-20	-41	-61
2.67%	-318	-327	-338	-349	-362	-376	-391
5.33%	-757	-759	-762	-767	-772	-779	-787
8.00%	-1,210	-1,210	-1,211	-1,212	-1,213	-1,216	-1,219
KR4301P42750                      2019-04 풋275							670
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-669	-669	-669	-669	-670	-670	-670
-5.33%	-346	-348	-350	-352	-355	-359	-363
-2.67%	-78	-86	-94	-102	-110	-118	-127
0%	10	8	4	0	-5	-9	-15
2.67%	16	15	15	15	14	13	12
5.33%	16	16	16	16	16	16	15
8.00%	16	16	16	16	16	16	16
KR4301P42776                      2019-04 풋277.5							373
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-372	-372	-372	-372	-372	-373	-373
-5.33%	-213	-213	-214	-214	-215	-216	-217
-2.67%	-65	-68	-71	-75	-78	-82	-85
0%	9	6	3	0	-3	-7	-10
2.67%	17	17	17	16	15	14	13
5.33%	17	17	17	17	17	17	17
8.00%	17	17	17	17	17	17	17

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

(단위:백만원)

**5,656**

공시일	2019-04-03
기준일	2019-04-02

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

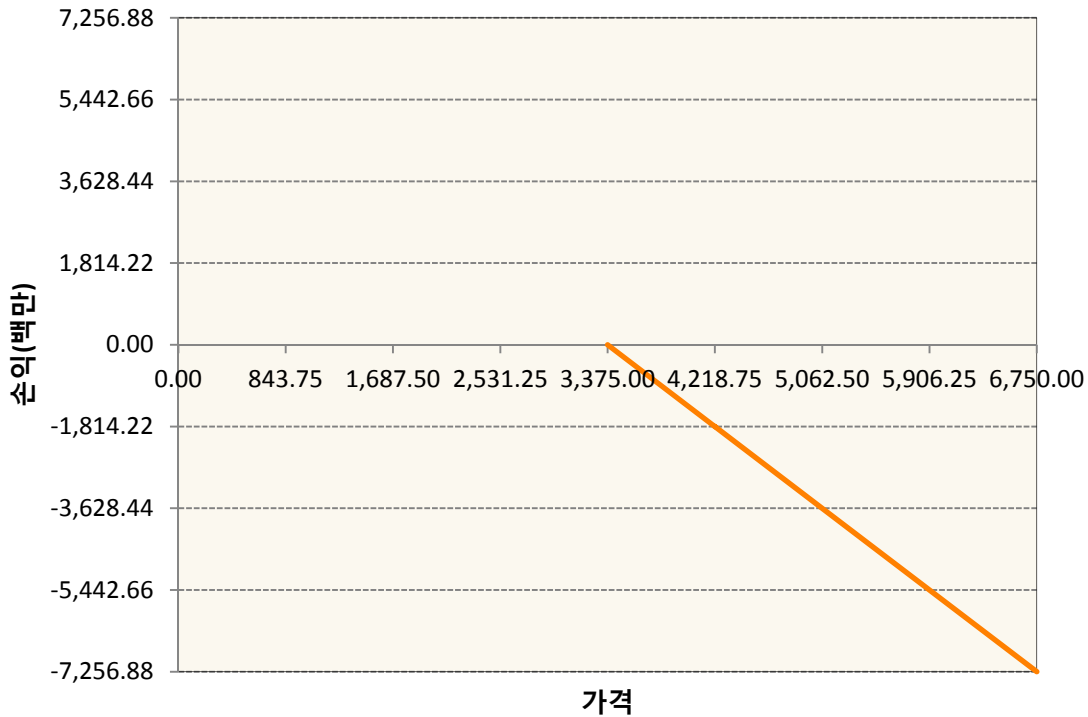
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

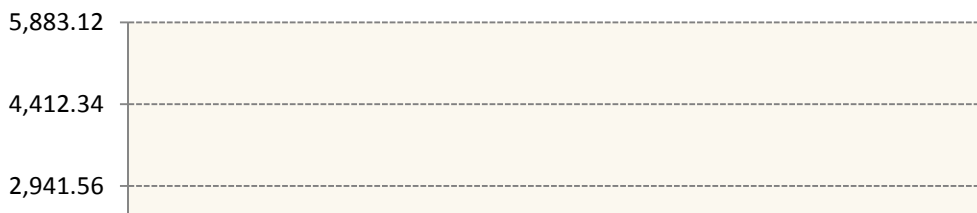
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,376	0	6,376	
누계	유가증권	스왑	60,067	0	60,067	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,280	-26,280	장내
누계	통화	선도	0	15,268	-15,268	장외

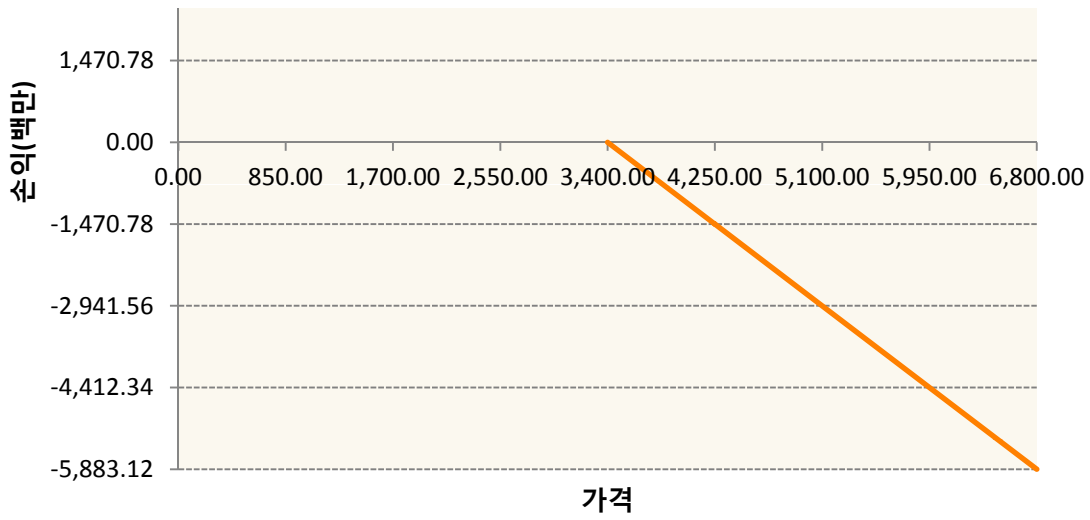
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXJ9-C3375-EURO STOXX 50**

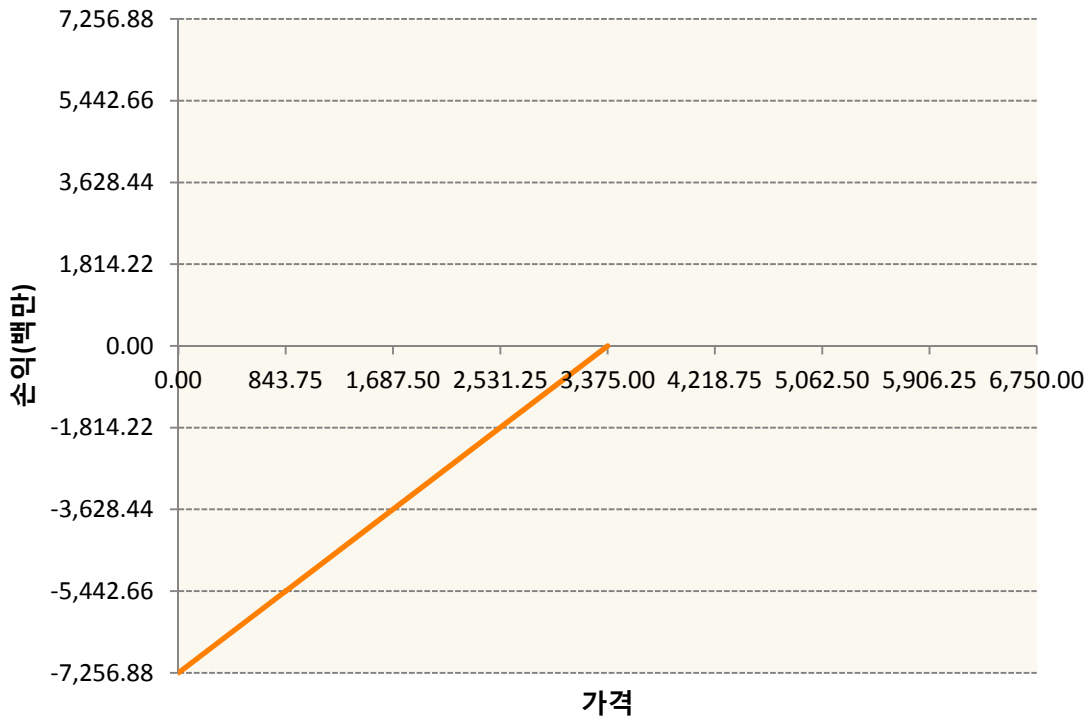


**OESXJ9-C3400-EURO STOXX 50**

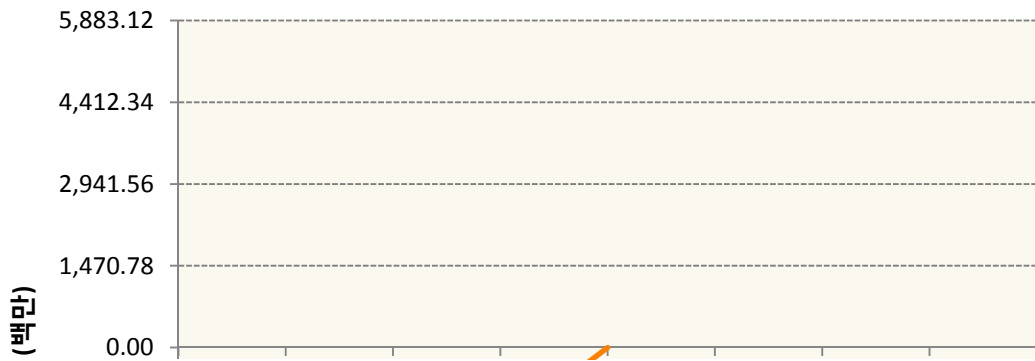


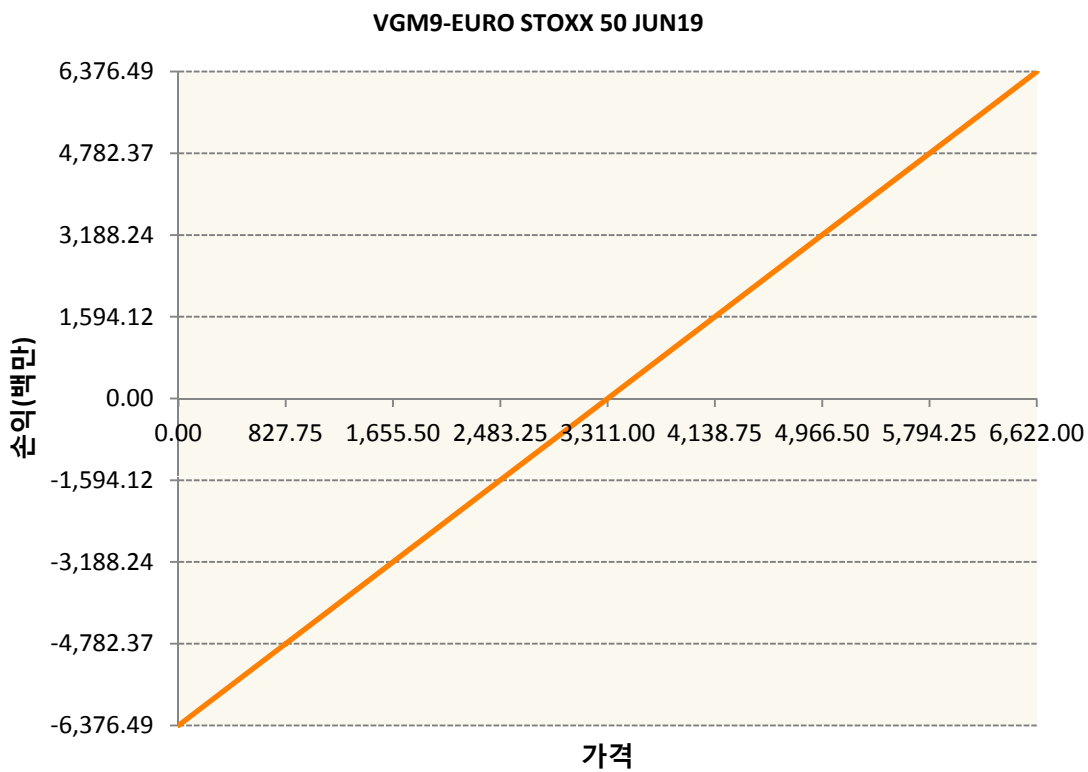
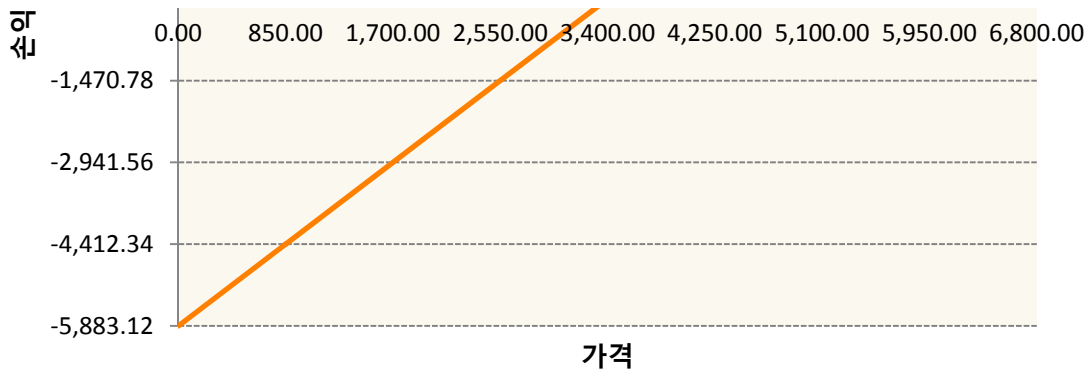


OESXJ9-P3375-EURO STOXX 50



OESXJ9-P3400-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		153
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E		407
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E		814
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		510

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

(단위:백만원)

2,660



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

(단위:백만원)

1,091



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

(단위:백만원)

93



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

(단위:백만원)

135

공시일	2019-04-03
기준일	2019-04-02

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

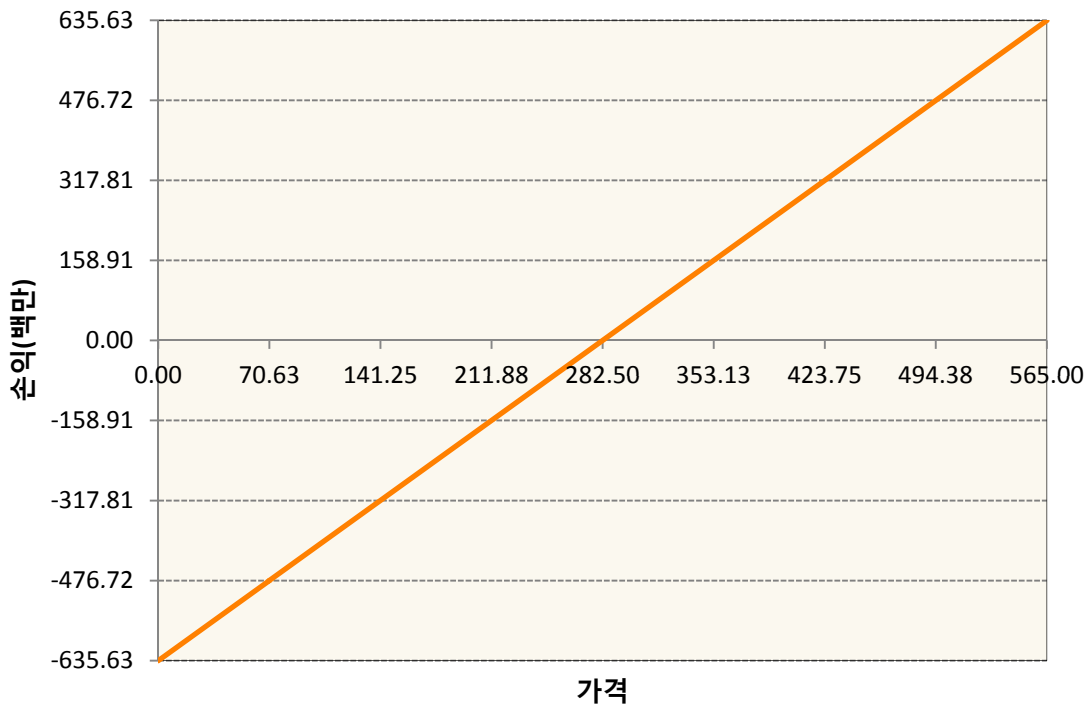
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	636	0	636	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						51
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51	
-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%	51	51	51	51	51	51	51	

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

(단위:백만원)

42

공시일	2019-04-03
기준일	2019-04-02

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

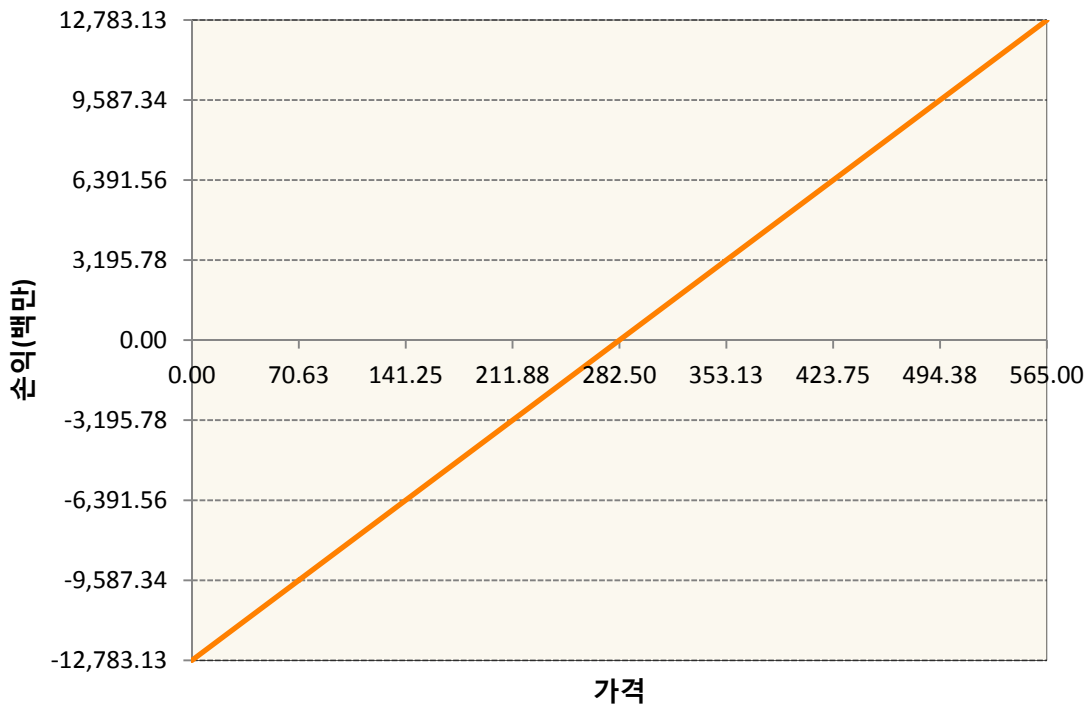
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

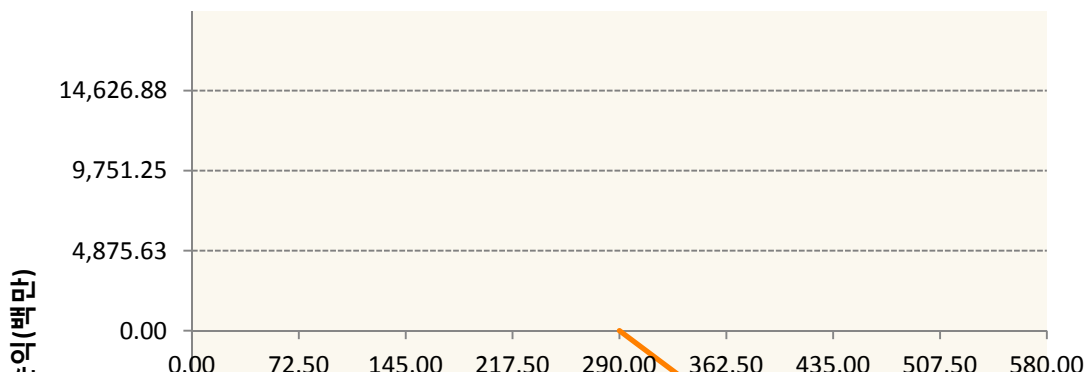
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,783	0	12,783	장내
누계	유가증권	옵션	1,867	24,036	-22,169	장내

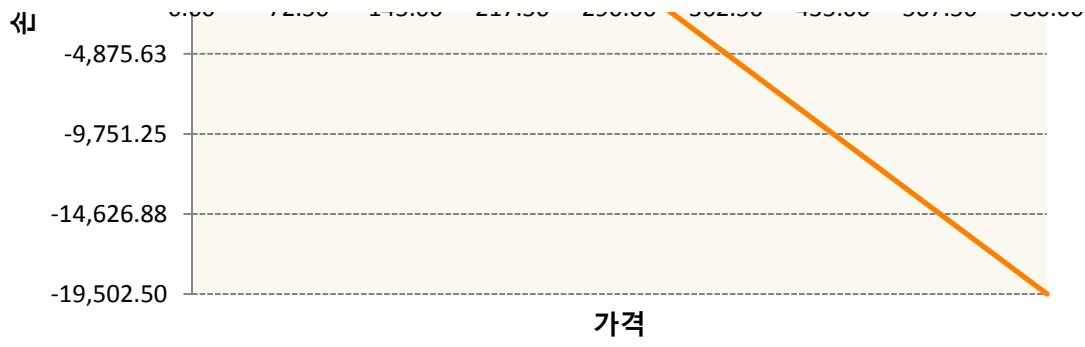
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

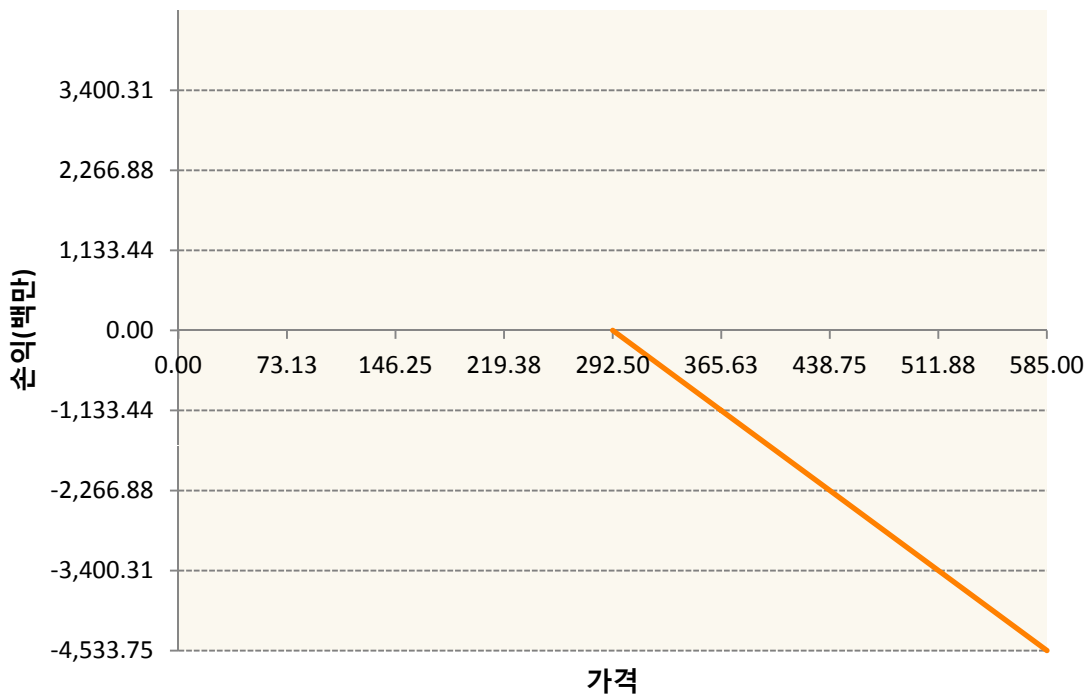


KR4201P42901-2019-04 콜290

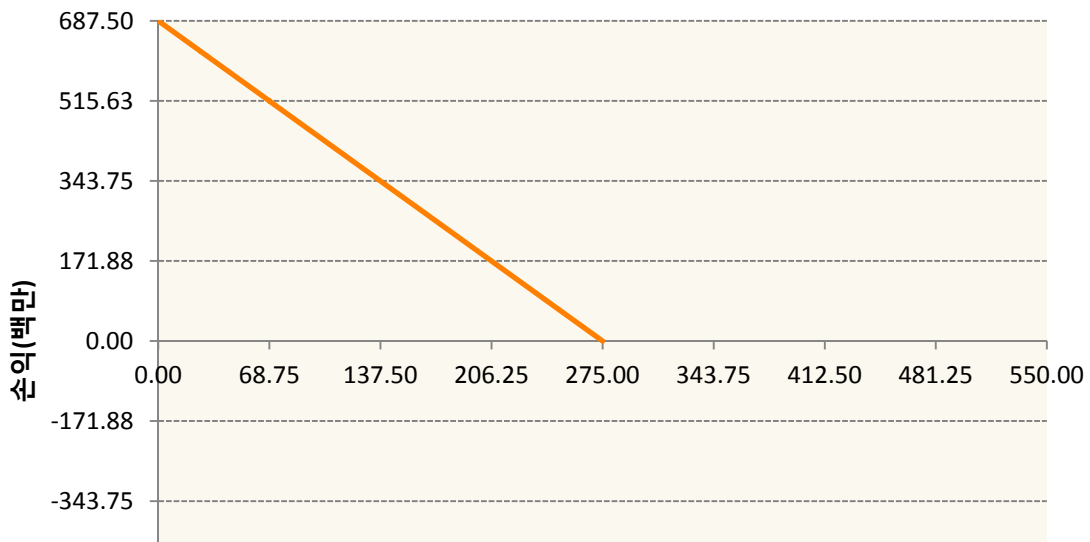


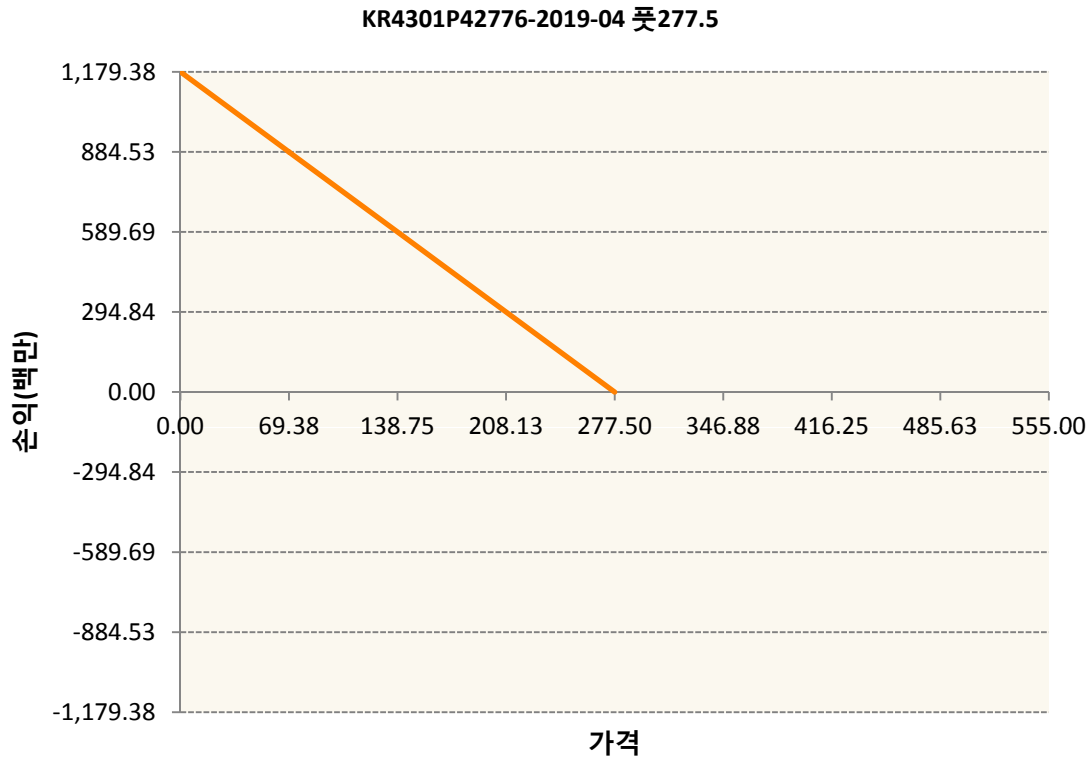
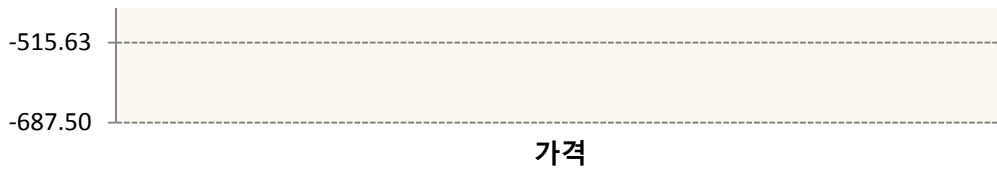


KR4201P42927-2019-04 콜292.5



KR4301P42750-2019-04 풋275





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						1,020
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	
-5.33%	-680	-680	-680	-680	-680	-680	-680	
-2.67%	-340	-340	-340	-340	-340	-340	-340	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	340	340	340	340	340	340	340	
5.33%	680	680	680	680	680	680	680	
8.00%	1,020	1,020	1,020	1,020	1,020	1,020	1,020	
KR4201P42901		2019-04 콜290						941
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	97	97	97	96	96	95	94	
-5.33%	97	96	95	93	90	87	82	
-2.67%	91	87	81	73	64	53	41	

0%	51	35	18	0	-19	-39	-59
2.67%	-102	-127	-152	-177	-202	-227	-252
5.33%	-424	-444	-464	-485	-506	-528	-550
8.00%	-871	-879	-888	-899	-912	-926	-941
KR4201P42927                      2019-04 콜292.5							193
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15	15	15	15	15	15	15
-5.33%	15	15	15	15	14	14	13
-2.67%	14	14	13	12	10	8	6
0%	9	6	3	0	-4	-8	-12
2.67%	-15	-21	-26	-32	-37	-43	-49
5.33%	-77	-82	-87	-93	-98	-104	-109
8.00%	-172	-175	-178	-181	-185	-189	-193
KR4301P42750                      2019-04 풋275							39
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	39	39	39	39	39	39	39
-5.33%	20	20	20	20	21	21	21
-2.67%	4	5	5	6	6	7	7
0%	-1	0	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
KR4301P42776                      2019-04 풋277.5							75
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	74	74	74	74	74	75	75
-5.33%	43	43	43	43	43	43	43
-2.67%	13	14	14	15	16	16	17
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3

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

(단위:백만원)

**1,888**

공시일	2019-04-03
기준일	2019-04-02

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	51	-51	
누계	유가증권	수익증권	3,513	0	3,513	

### 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	2019-04-03
기준일	2019-04-02

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	909	0	909	
누계	유가증권	수익증권	14,112	0	14,112	

### 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	2019-04-03
기준일	2019-04-02

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,273	0	2,273	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	66,148	0	66,148	
누계	통화	선도	0	66,127	-66,127	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	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
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E	91
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E	91
FX21019J001 KRW/USD 10-05-19E	45

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

(단위:백만원)

1,853

공시일	2019-04-03
기준일	2019-04-02

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

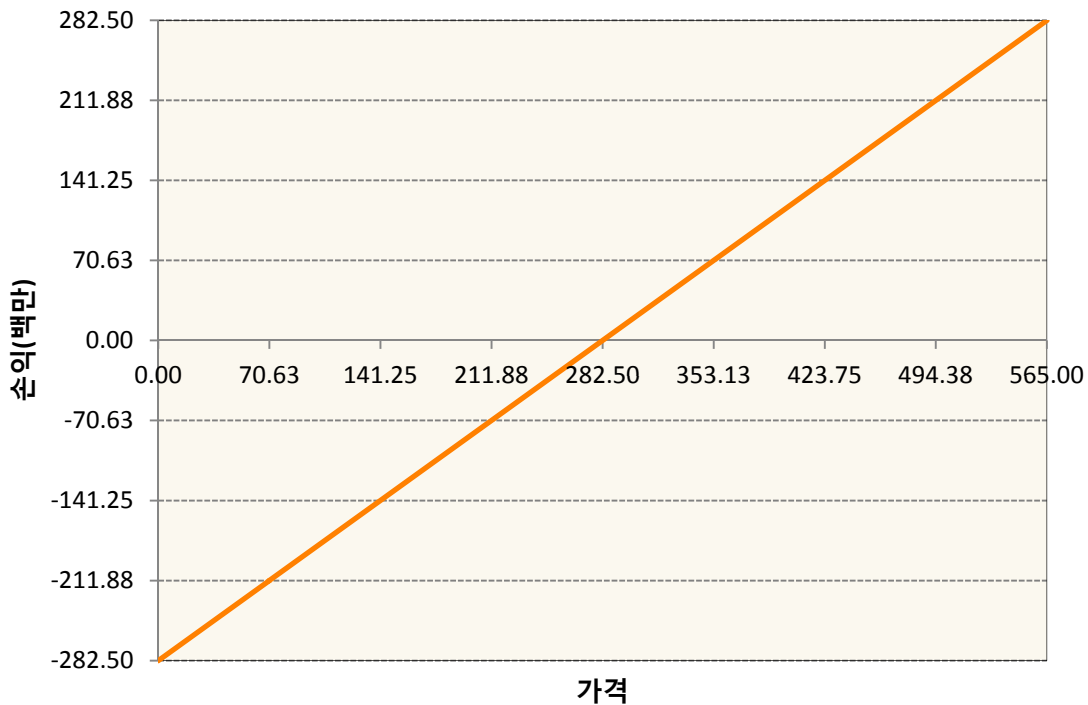
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

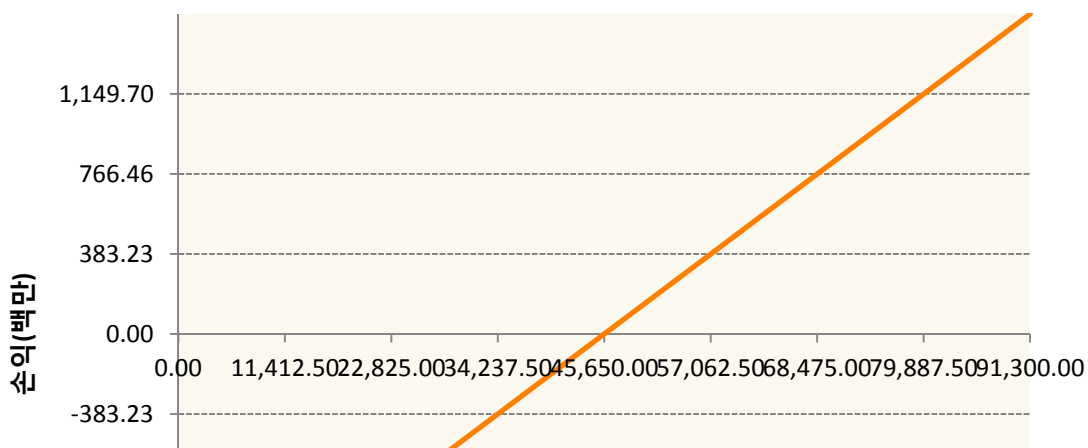
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	163	-163	장내
누계	유가증권	선물	1,815	0	1,815	장내

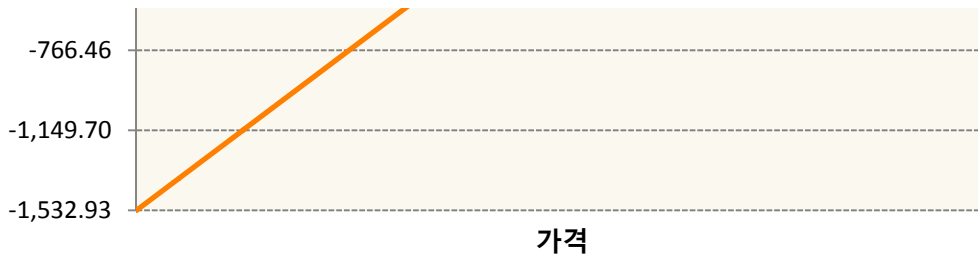
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4111P40005-2019-04 삼성전자개별선물





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						23
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23	
-5.33%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	
-2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	8	8	8	8	8	8	8	
5.33%	15	15	15	15	15	15	15	
8.00%	23	23	23	23	23	23	23	
KR4111P40005		2019-04 삼성전자개별선물						123
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123	
-5.33%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82	
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	41	41	41	41	41	41	41	
5.33%	82	82	82	82	82	82	82	
8.00%	123	123	123	123	123	123	123	

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

**162**

공시일	2019-04-03
기준일	2019-04-02

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

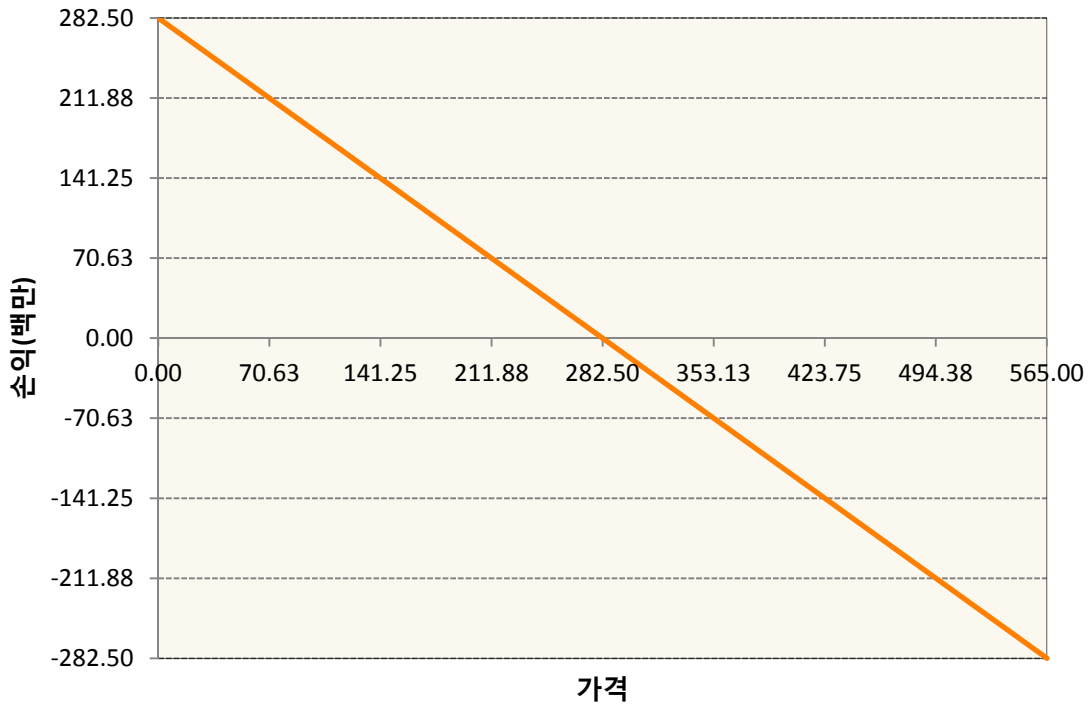
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

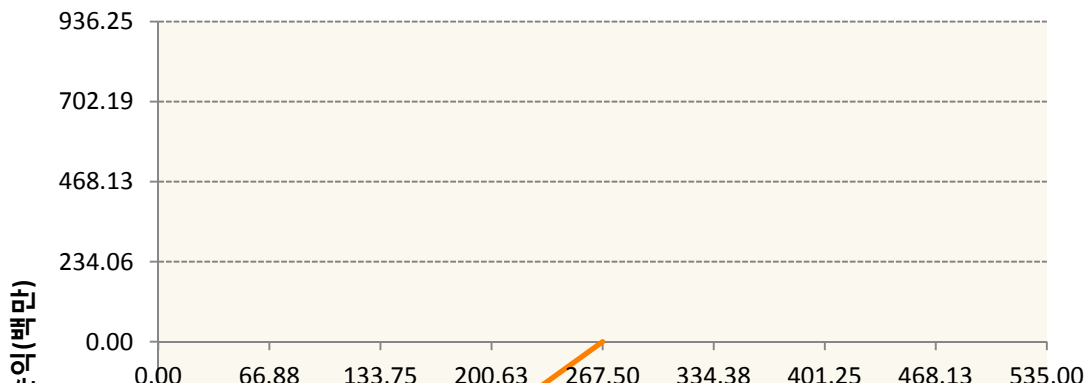
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	201	-201	장내
누계	유가증권	선물	0	283	-283	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,476	-1,476	장내

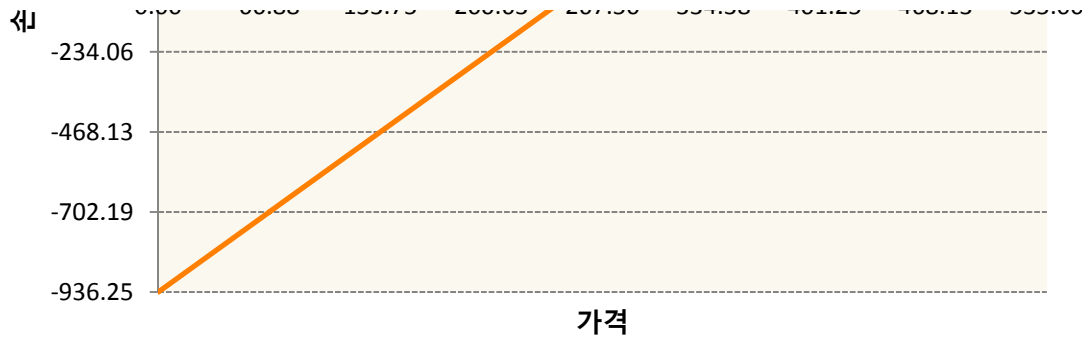
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

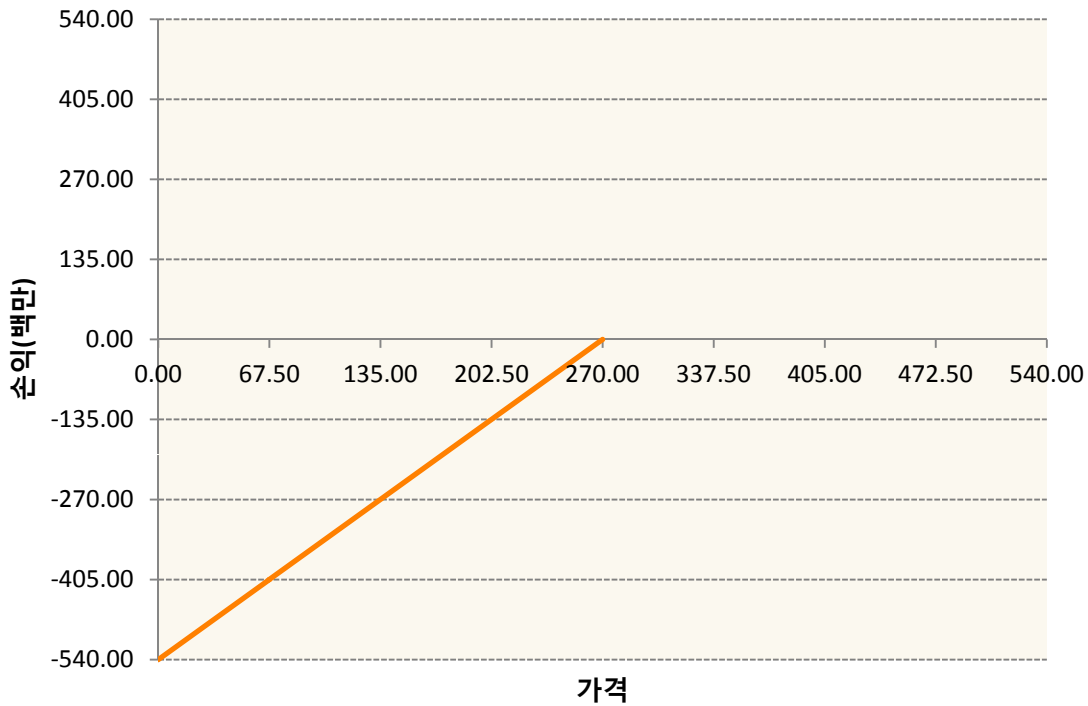


KR4301P42677-2019-04 풋267.5





KR4301P42701-2019-04 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						23
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	23	23	23	23	23	23	23	
-5.33%	15	15	15	15	15	15	15	
-2.67%	8	8	8	8	8	8	8	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8	
5.33%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	
8.00%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23	
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	-30	-30	-30	-30	-30
-5.33%	-7	-8	-9	-9	-10	-11	-11
-2.67%	0	-1	-1	-1	-1	-2	-2
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

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%	-8	-8	-8	-8	-9	-9	-9
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-2	-2	-2
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)

35

공시일	2019-04-03
기준일	2019-04-02

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

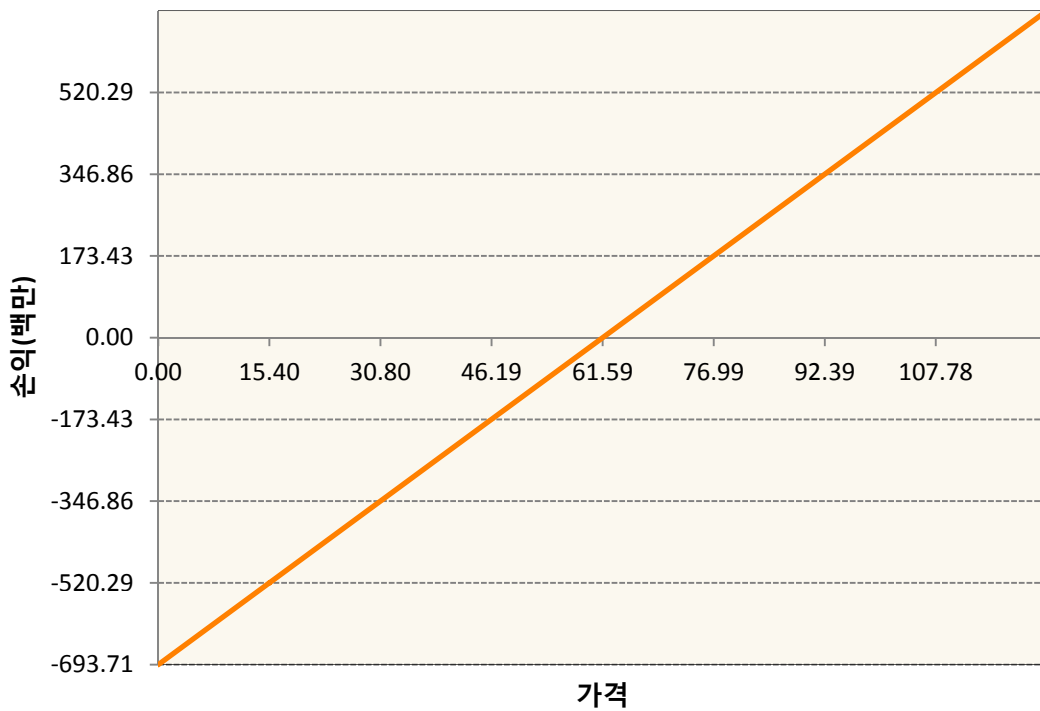
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

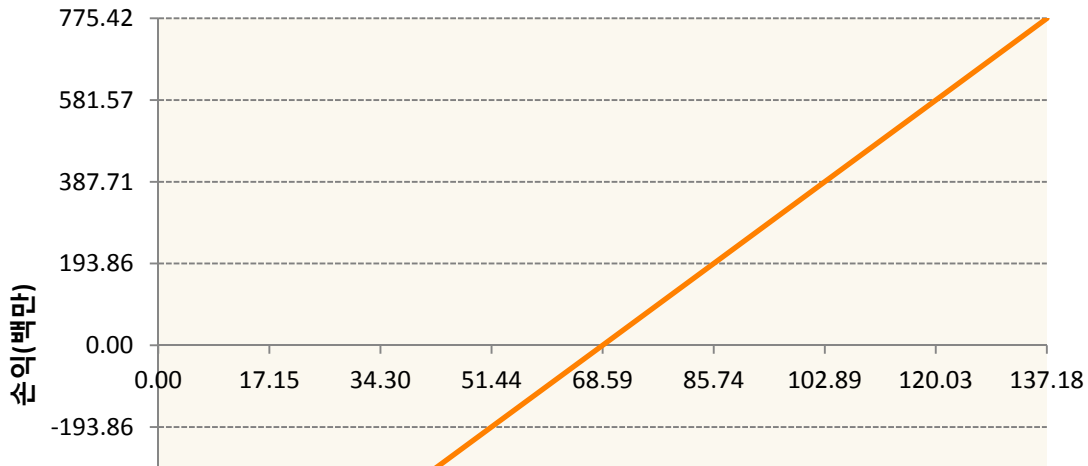
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,902	284	2,618	

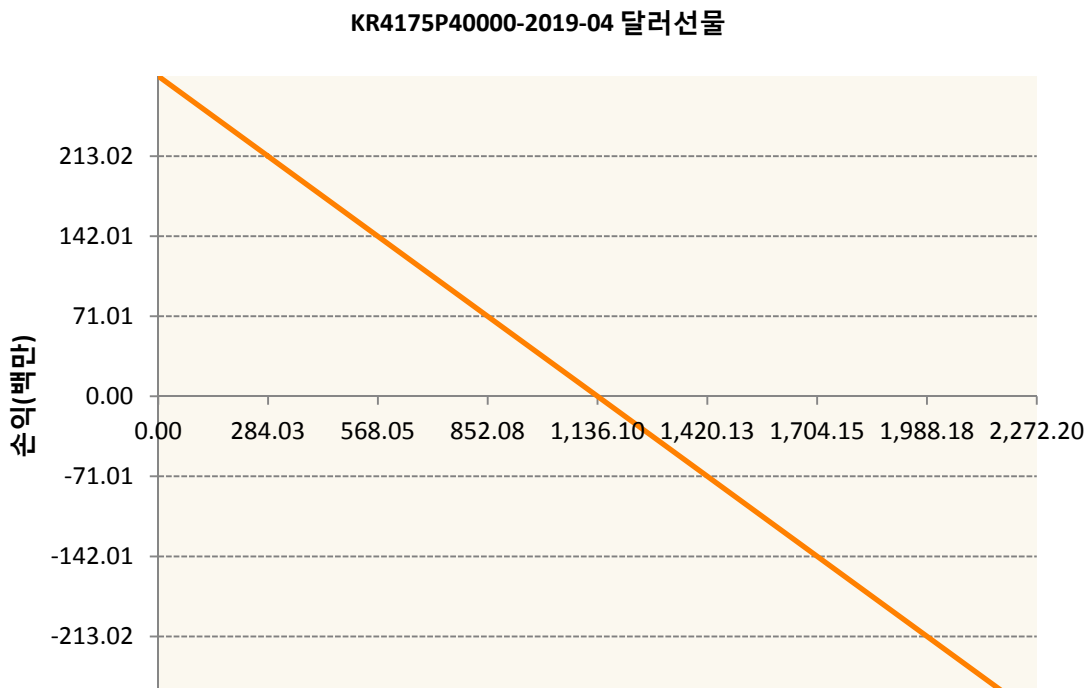
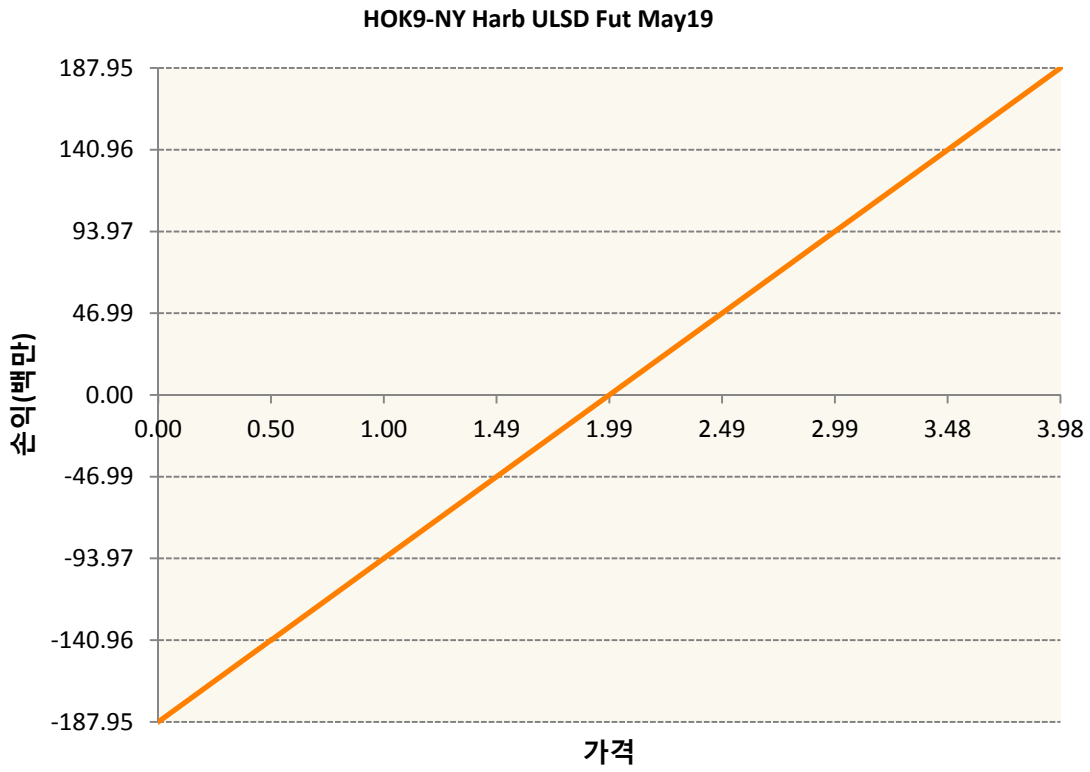
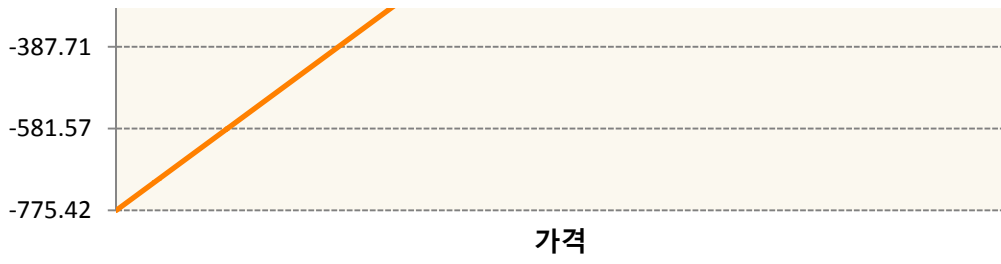
### 2. 만기시점의 손익구조

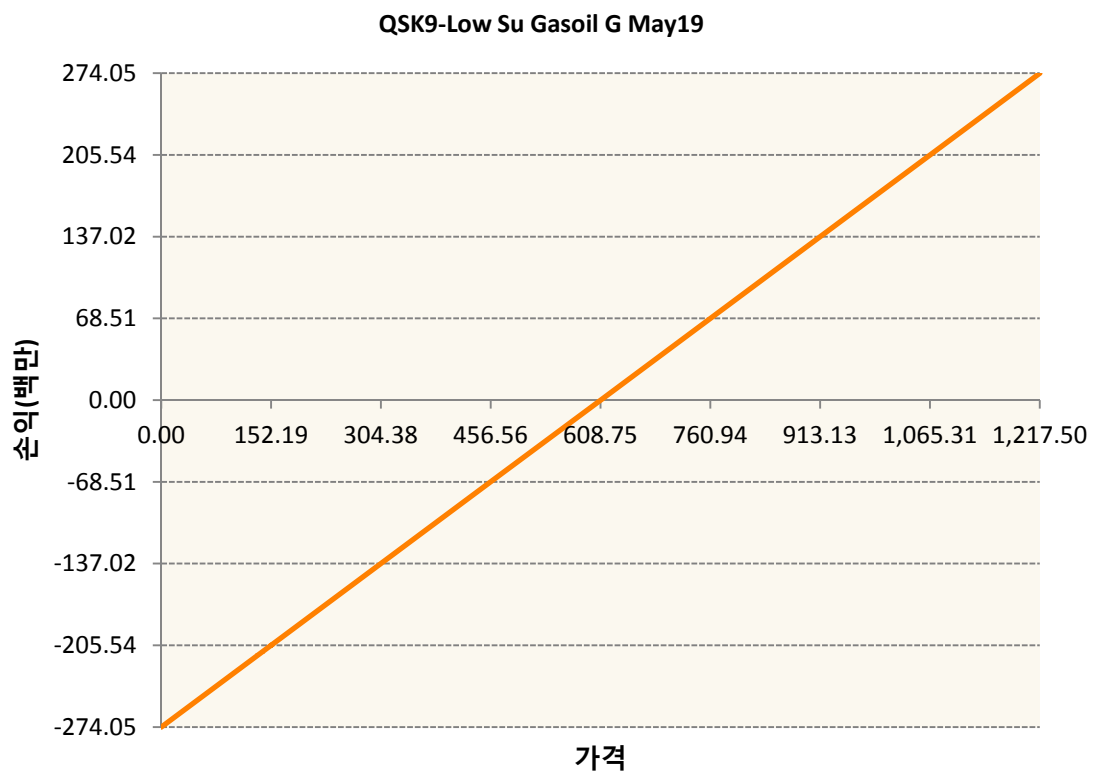
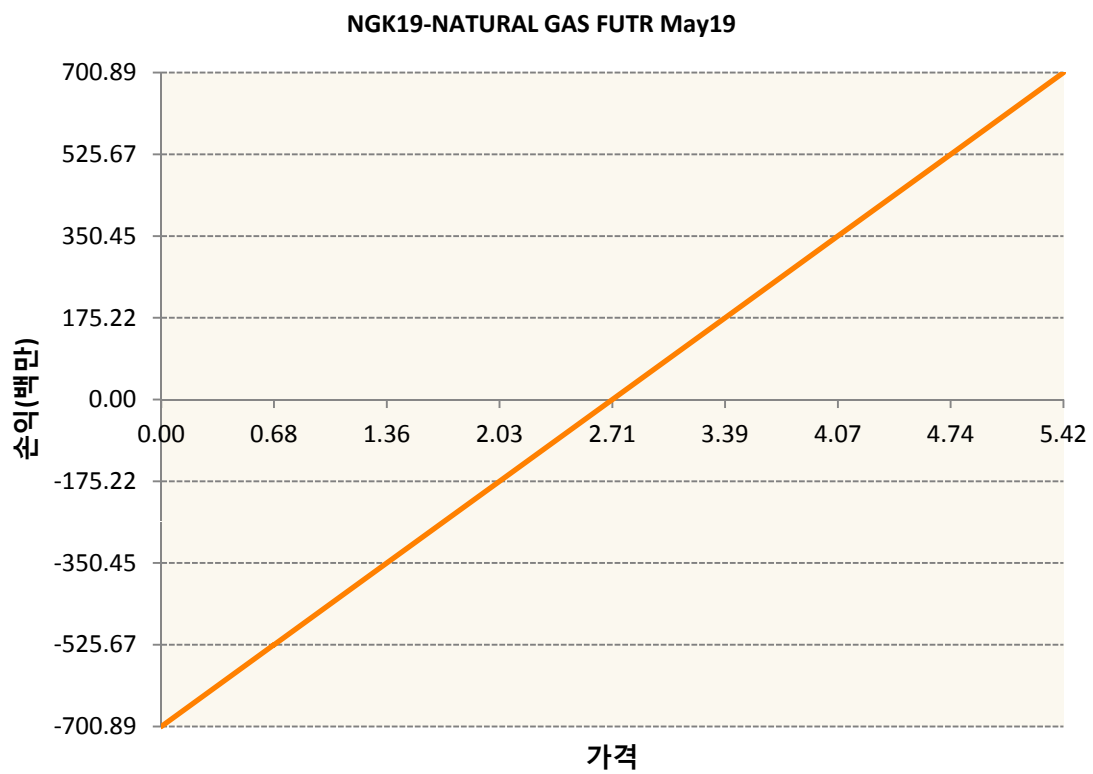
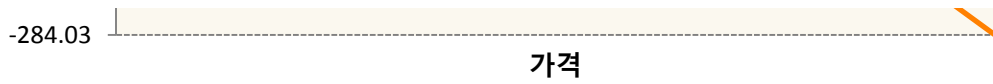
CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19



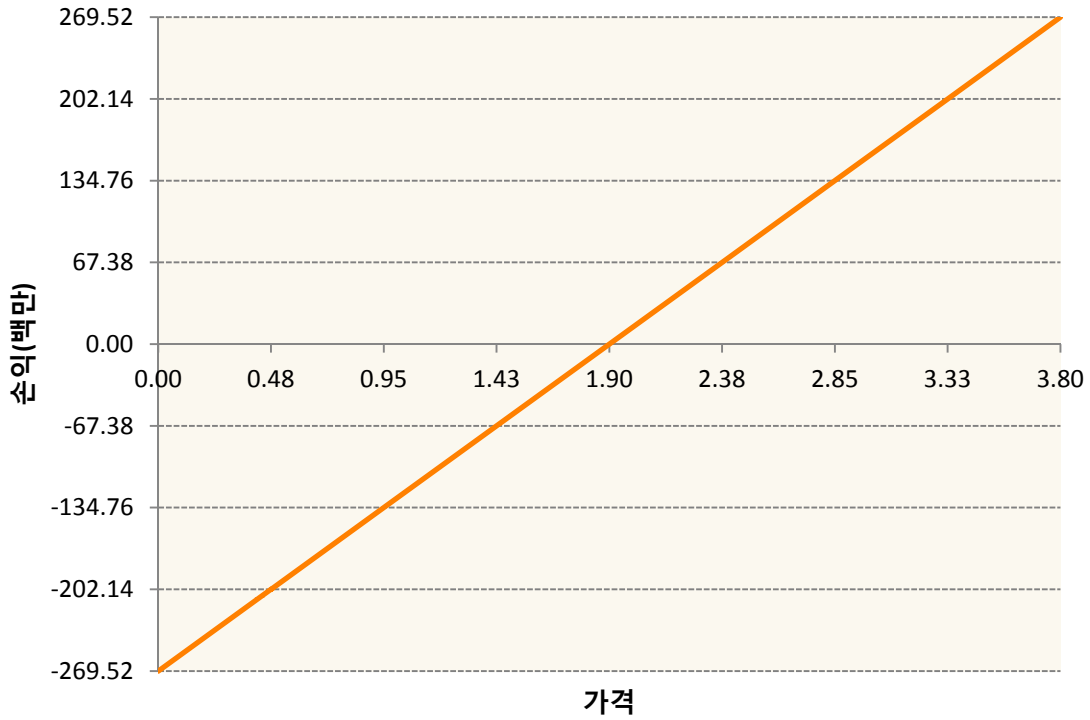
CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19







**XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19**



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

CLK9	WTI CRUDE FUTURE May19	55
CON9	BRENT CRUDE FUTR Jul19	62
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	22

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

(단위:백만원)

**437**

공시일	2019-04-03
기준일	2019-04-02

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

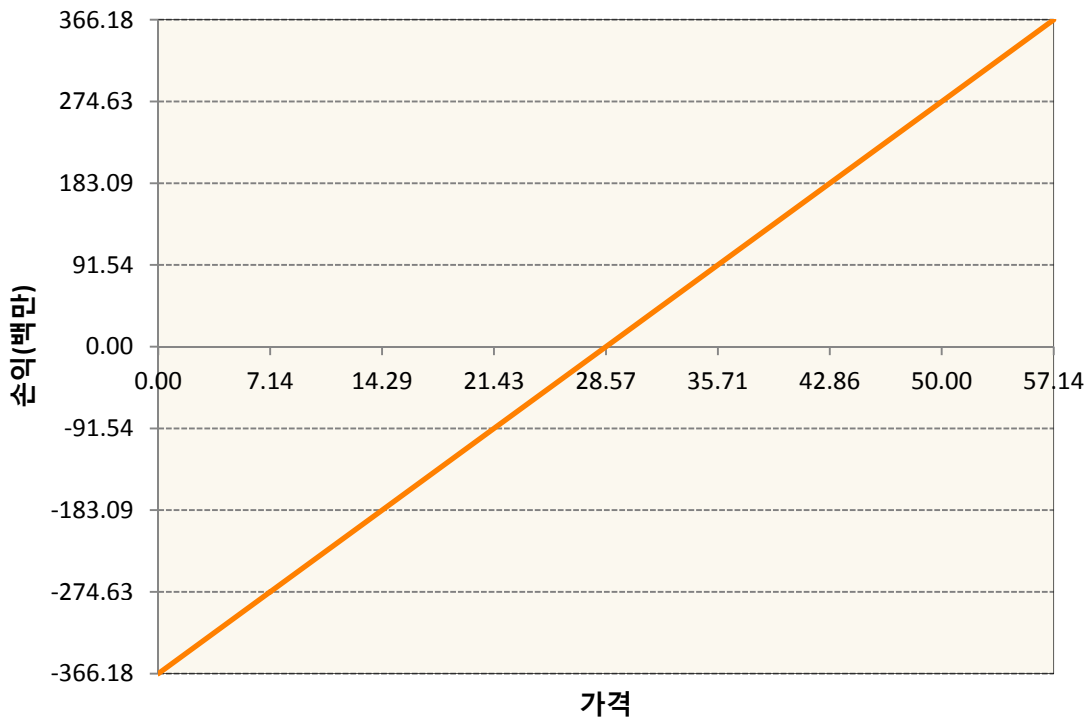
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

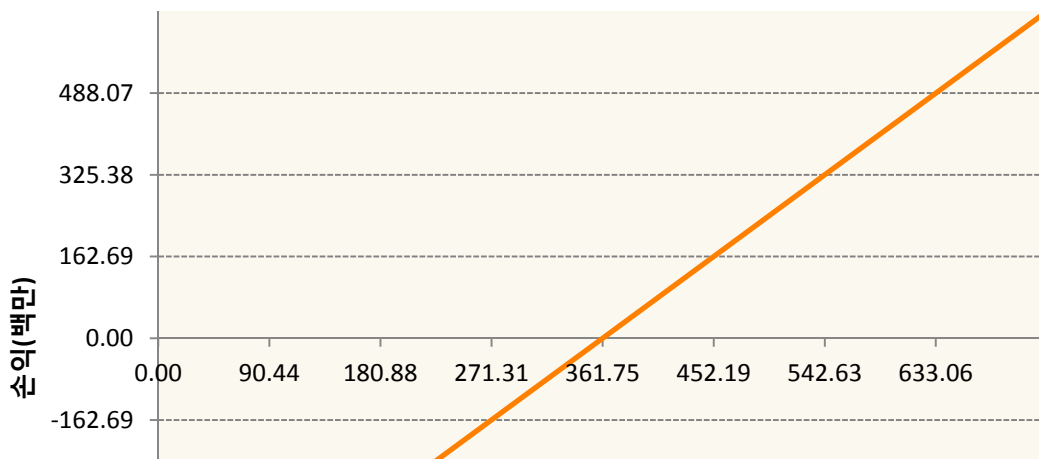
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,339	80	3,260	

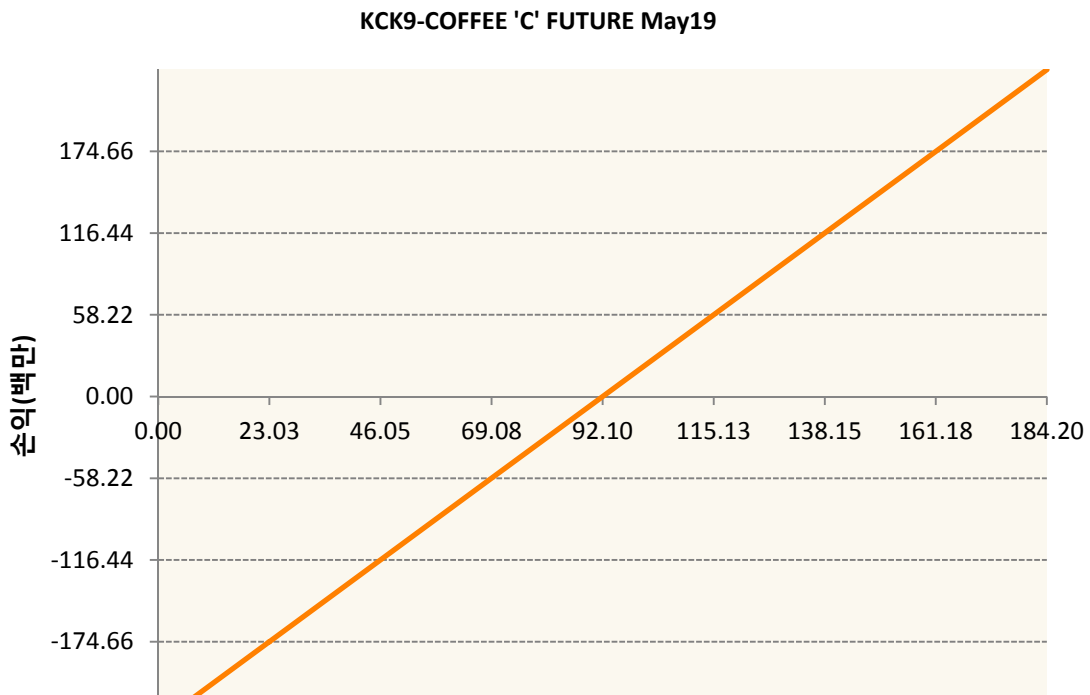
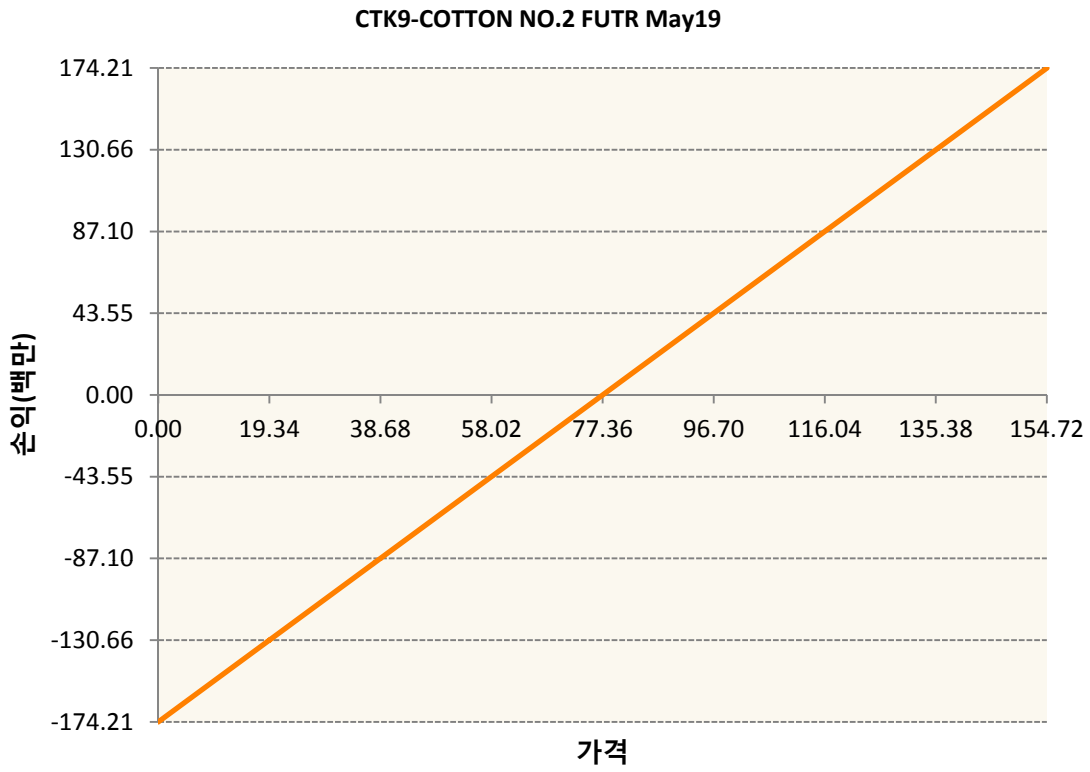
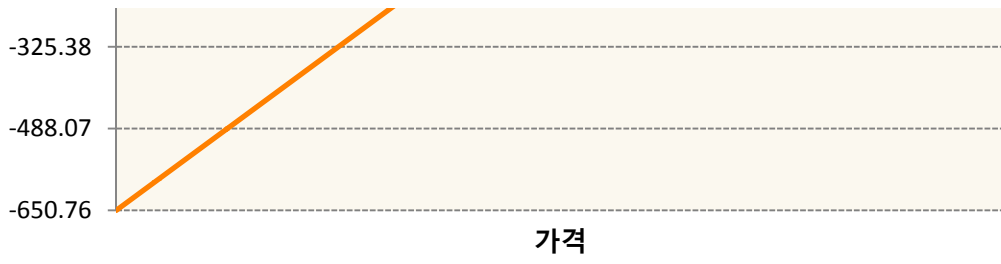
### 2. 만기시점의 손익구조

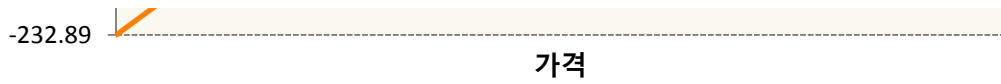
**BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19**



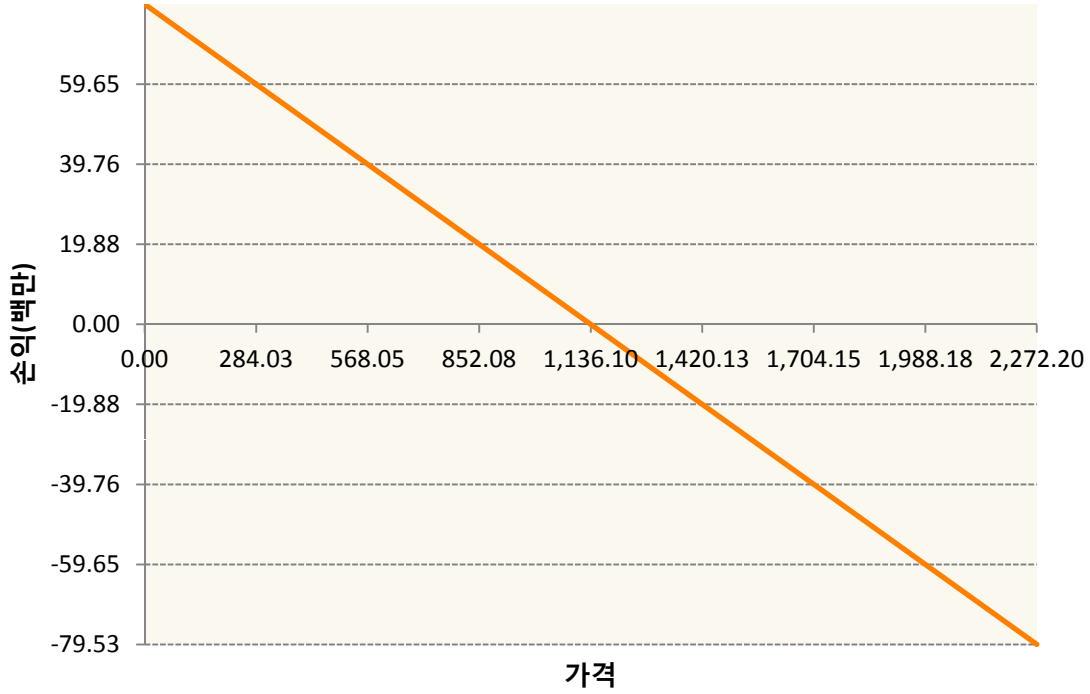
**CK9-CORN FUTURE May19**



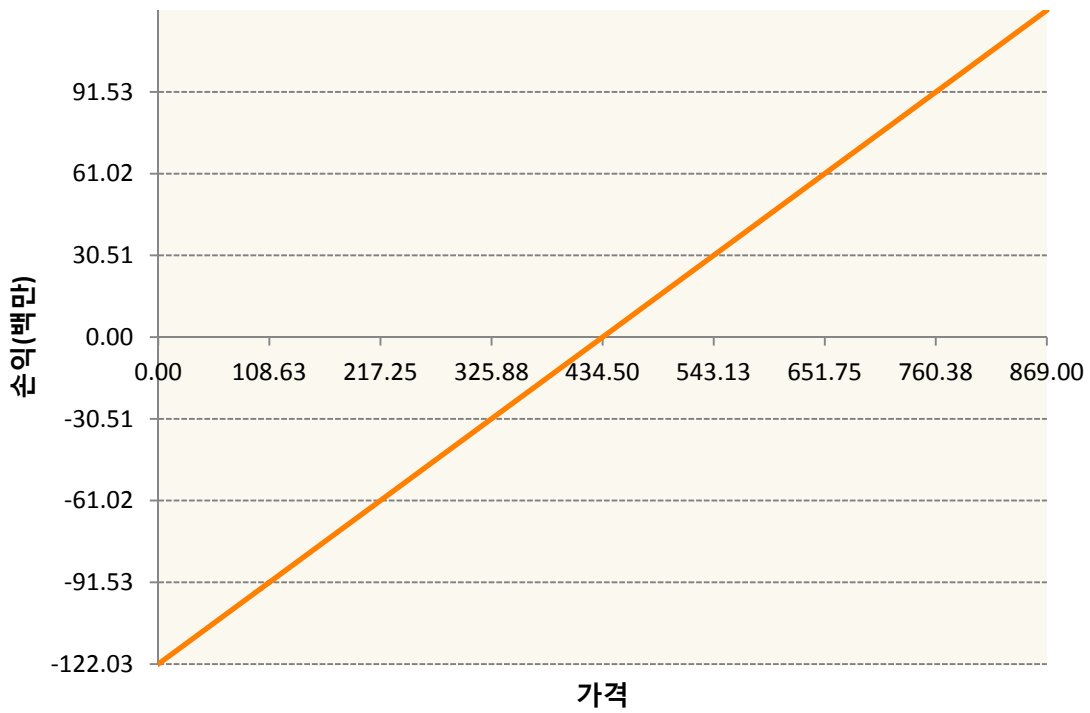




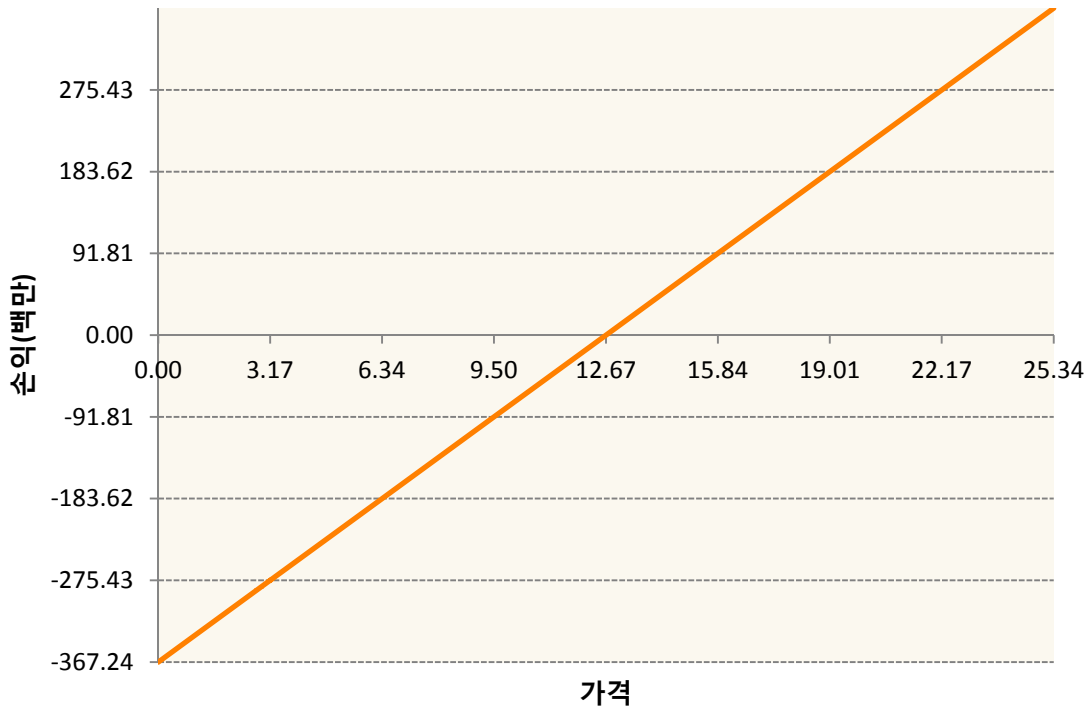
KR4175P40000-2019-04 달러선물



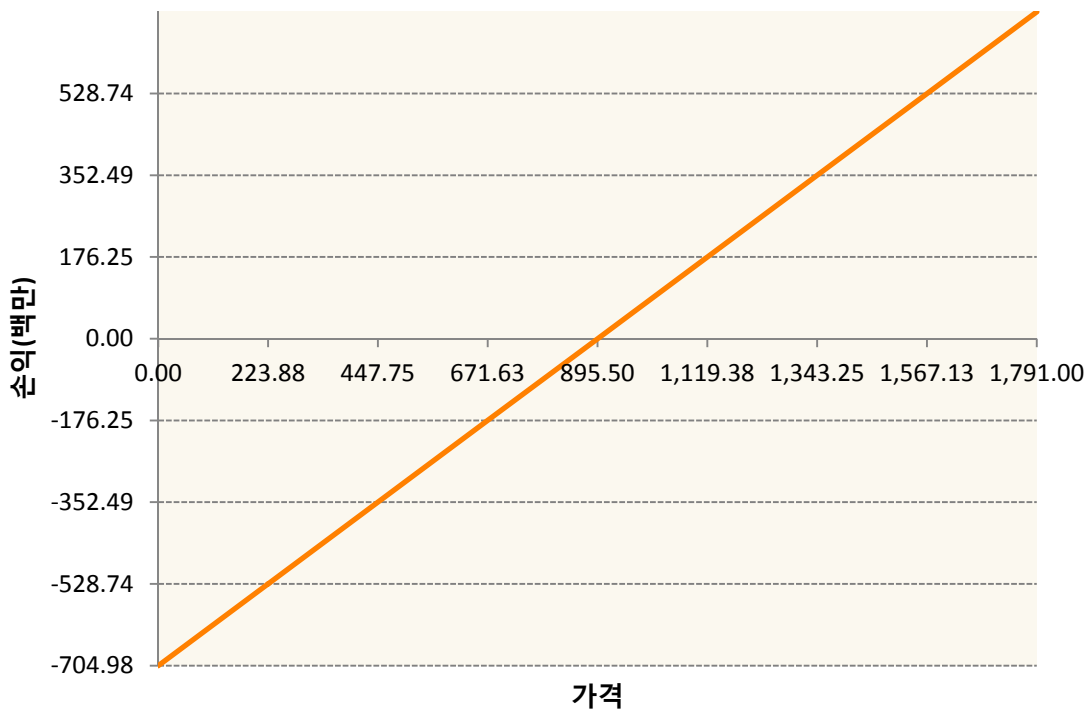
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

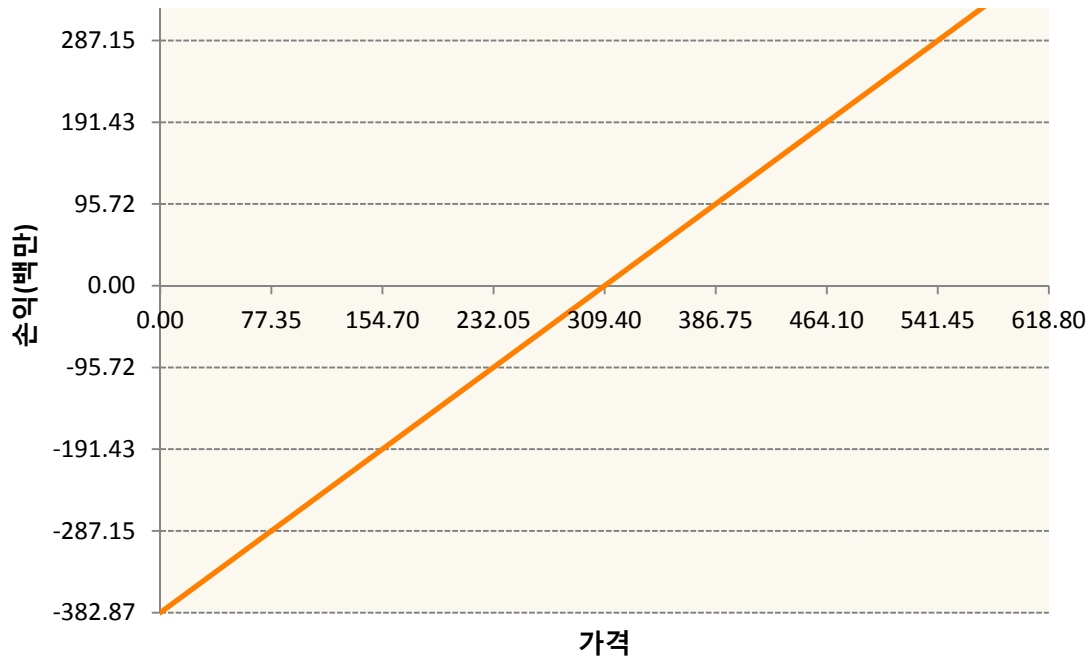


SK9-SOYBEAN FUTURE May19

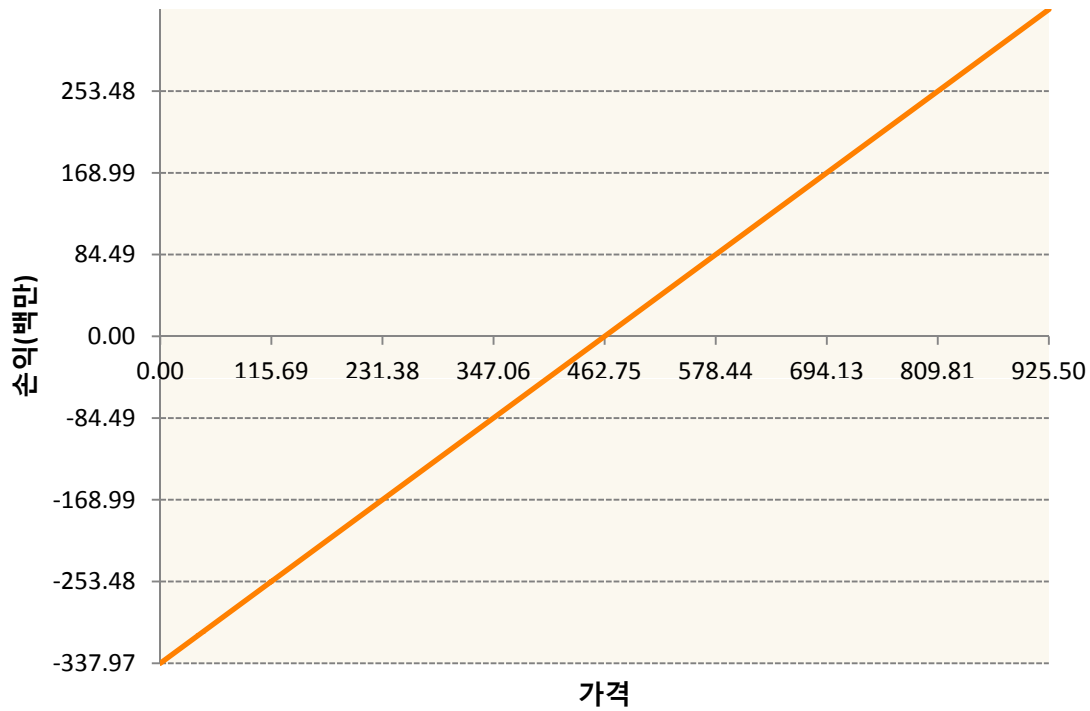


SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





WK9-WHEAT FUTURE(CBT) May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK9	SOYBEAN OIL FUTR May19	29
CK9	CORN FUTURE May19	52
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	31
WK9	WHEAT FUTURE(CBT) May19	27

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

(단위:백만원)

**269**