

공시일	2019-04-04
기준일	2019-04-03

## 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	2019-04-04
기준일	2019-04-03

## 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	2019-04-04
기준일	2019-04-03

## 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)	365
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	101
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	171

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

<b>1,005</b>
--------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-04-04
기준일	2019-04-03

## 유로인덱스모(주식-파생형)

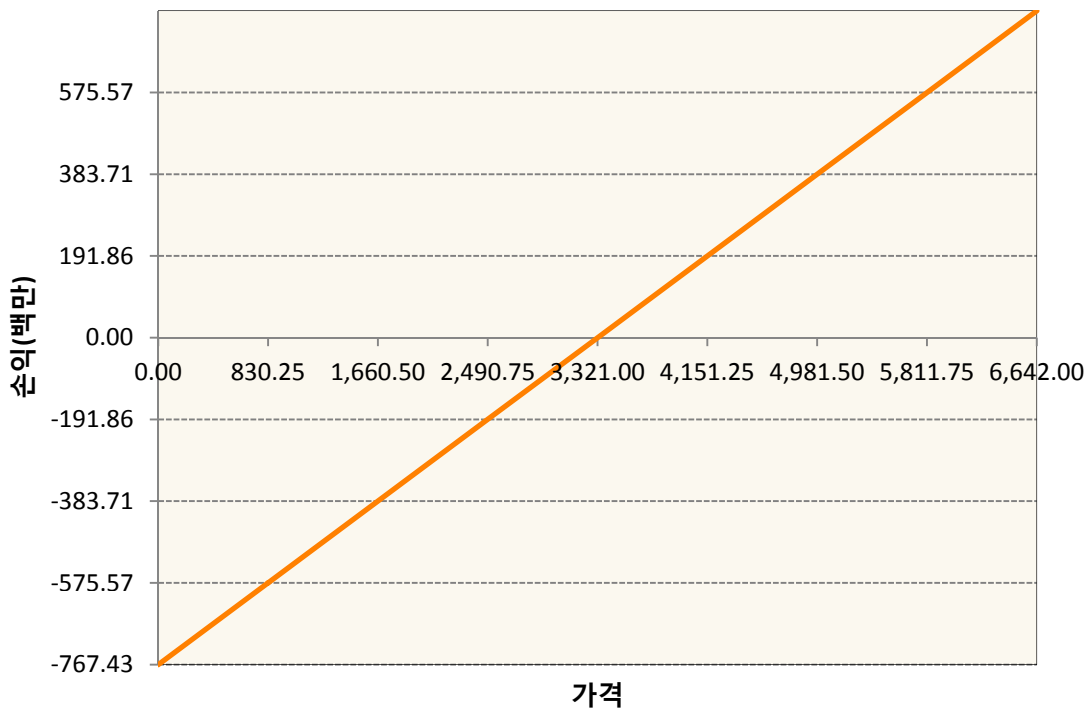
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	767	0	767	

### 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	2019-04-04
기준일	2019-04-03

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

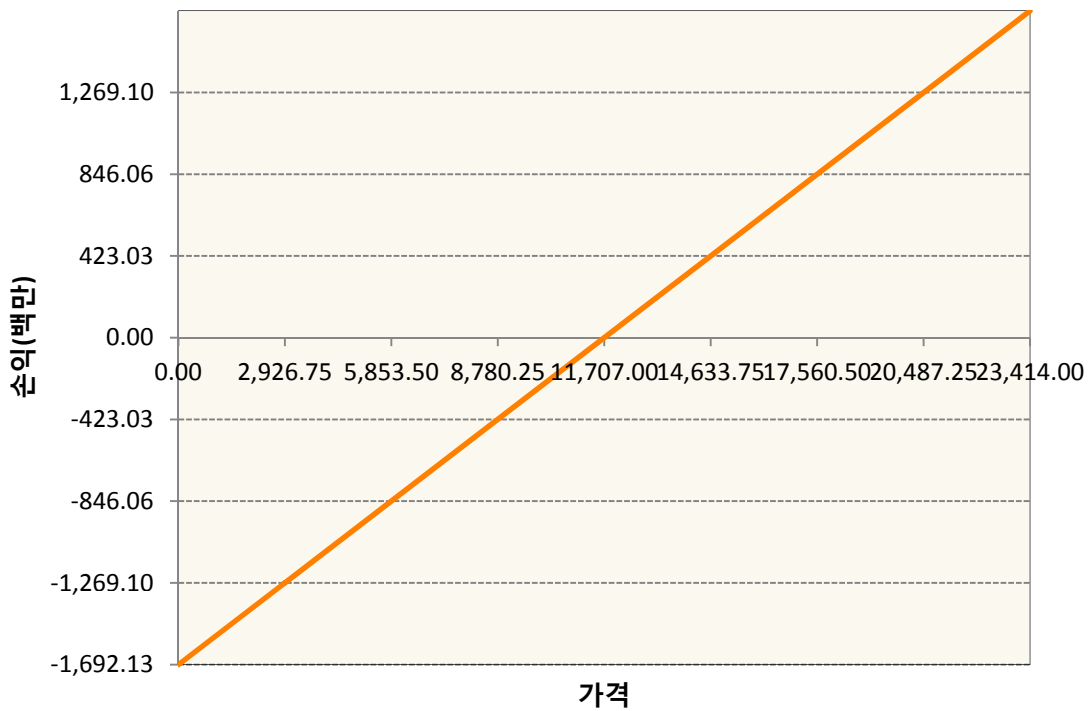
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,692	0	1,692	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCJ9-HSCEI Futures Apr19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ9	HSCEI Futures Apr19	135
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

139
-----

공시일	2019-04-04
기준일	2019-04-03

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

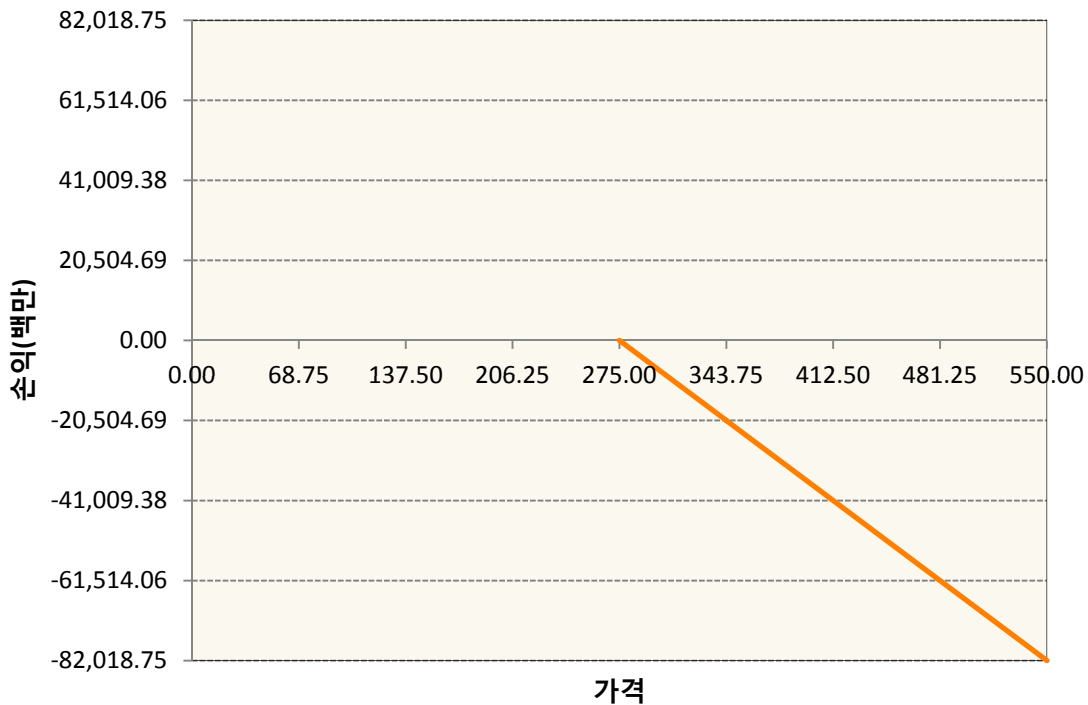
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

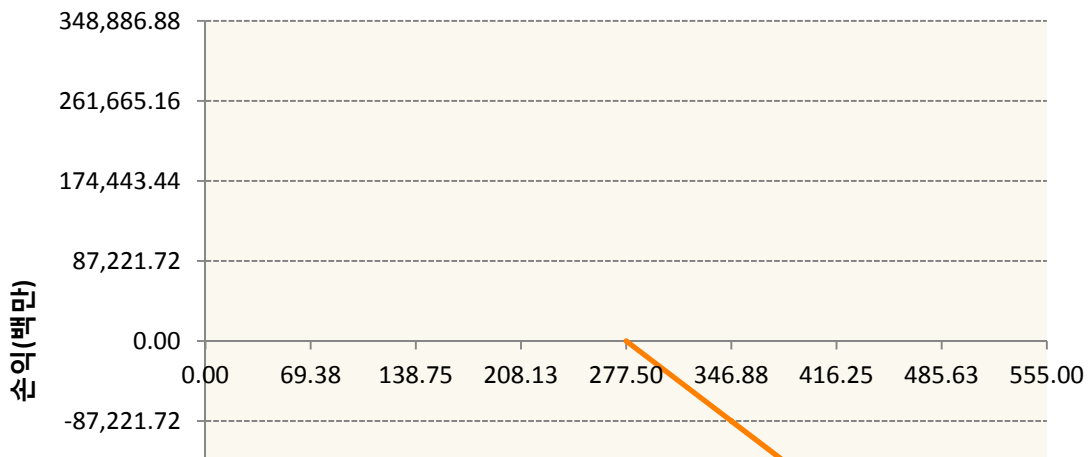
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	668,968	-668,968	장내

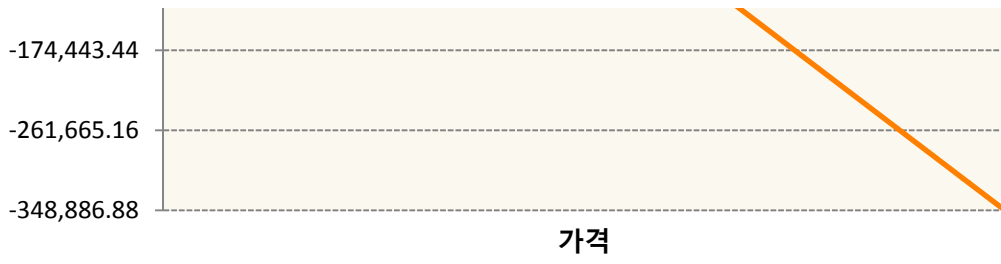
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P42752-2019-04 콜275

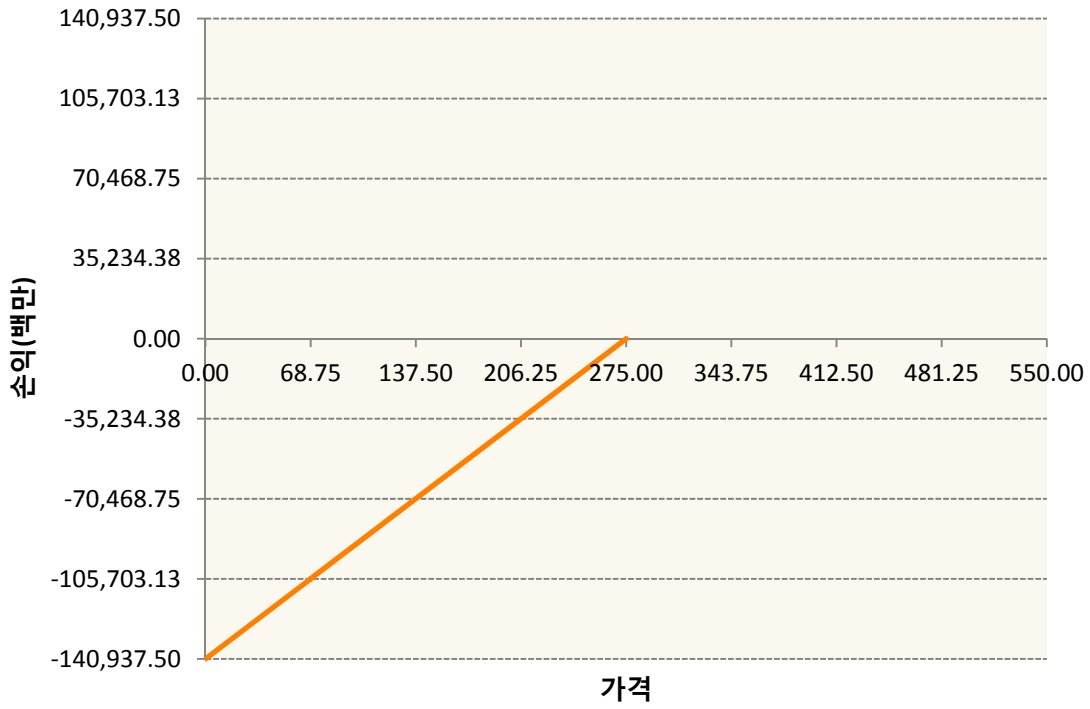


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

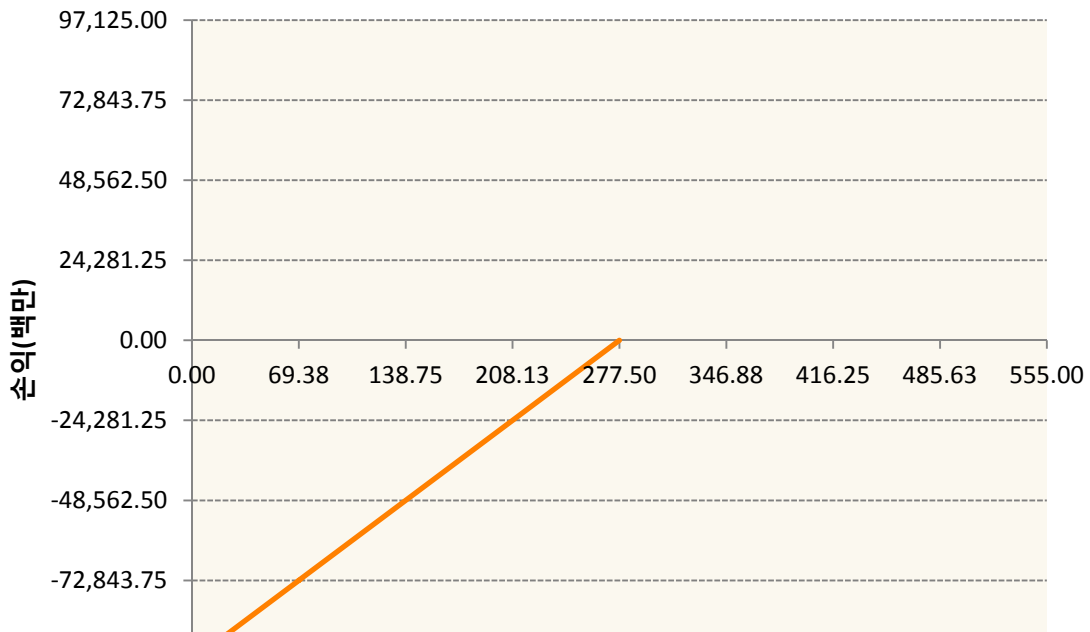




**KR4301P42750-2019-04 풋275**



**KR4301P42776-2019-04 풋277.5**



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P42752		2019-04 콜275						6,588
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,358	3,330	3,295	3,254	3,207	3,155	3,099	
-5.33%	3,039	2,957	2,872	2,785	2,696	2,606	2,515	
-2.67%	1,986	1,893	1,799	1,705	1,609	1,513	1,417	
0%	147	105	56	0	-61	-126	-196	
2.67%	-2,046	-2,054	-2,068	-2,086	-2,110	-2,140	-2,175	
5.33%	-4,310	-4,311	-4,313	-4,316	-4,323	-4,332	-4,344	
8.00%	-6,580	-6,580	-6,581	-6,581	-6,582	-6,584	-6,588	
KR4201P42778		2019-04 콜277.5						27,216
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	11,694	11,626	11,532	11,412	11,267	11,099	10,910	
-5.33%	10,918	10,642	10,344	10,030	9,701	9,362	9,013	
-2.67%	7,650	7,230	6,809	6,389	5,968	5,547	5,126	
0%	842	585	302	0	-319	-651	-995	
2.67%	-8,092	-8,161	-8,257	-8,380	-8,529	-8,702	-8,898	
5.33%	-17,592	-17,601	-17,618	-17,648	-17,692	-17,754	-17,834	
8.00%	-27,160	-27,161	-27,163	-27,167	-27,176	-27,192	-27,216	
KR4301P42750		2019-04 풋275						6,273
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-6,238	-6,239	-6,241	-6,245	-6,252	-6,261	-6,273	
-5.33%	-2,452	-2,499	-2,552	-2,610	-2,672	-2,737	-2,805	
-2.67%	-237	-306	-378	-454	-531	-610	-690	
0%	21	18	11	0	-15	-34	-57	
2.67%	24	24	24	24	23	22	20	
5.33%	24	24	24	24	24	24	24	
8.00%	24	24	24	24	24	24	24	
KR4301P42776		2019-04 풋277.5						5,106
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-5,098	-5,098	-5,098	-5,099	-5,100	-5,102	-5,106	
-5.33%	-2,452	-2,466	-2,484	-2,506	-2,532	-2,561	-2,593	
-2.67%	-416	-477	-539	-600	-661	-723	-784	
0%	42	32	18	0	-22	-47	-75	
2.67%	53	53	53	52	51	49	45	

5.33%	53	53	53	53	53	53	53
8.00%	53	53	53	53	53	53	53

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

(단위:백만원)

**44,845**

공시일	2019-04-04
기준일	2019-04-03

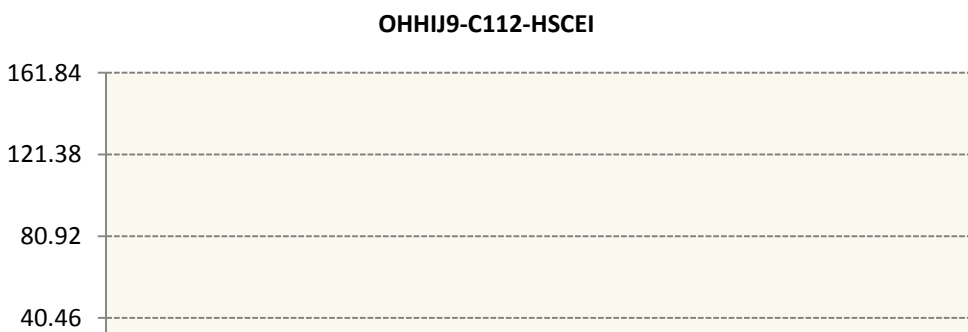
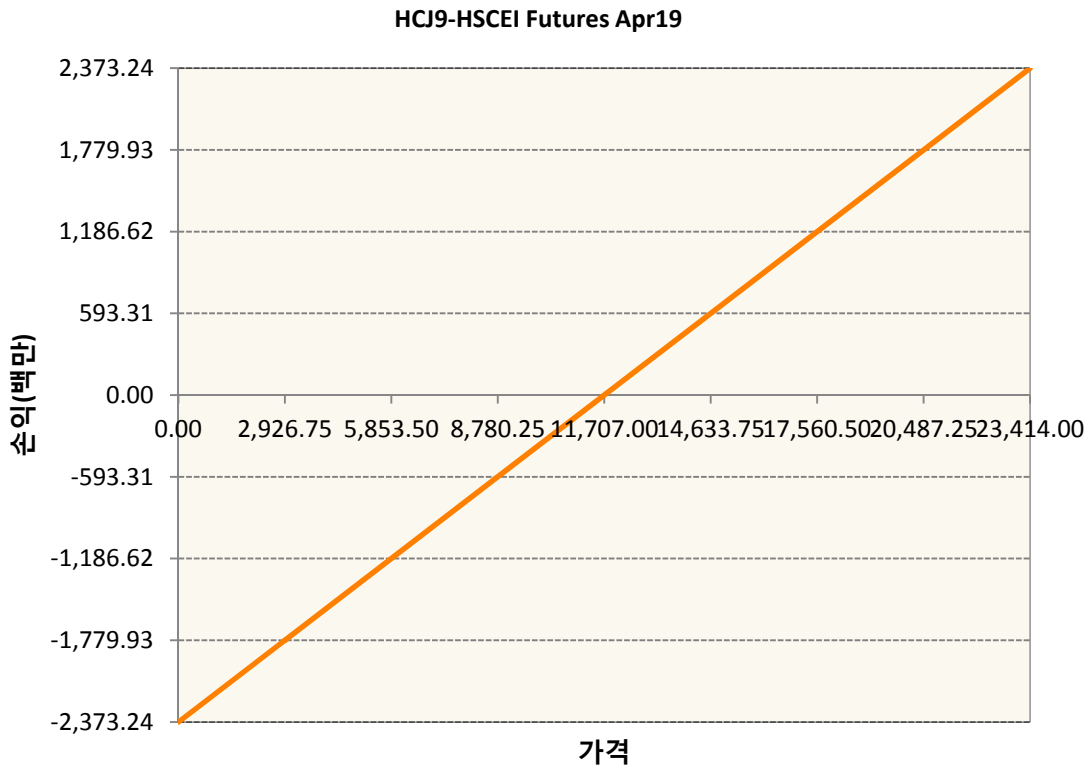
## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

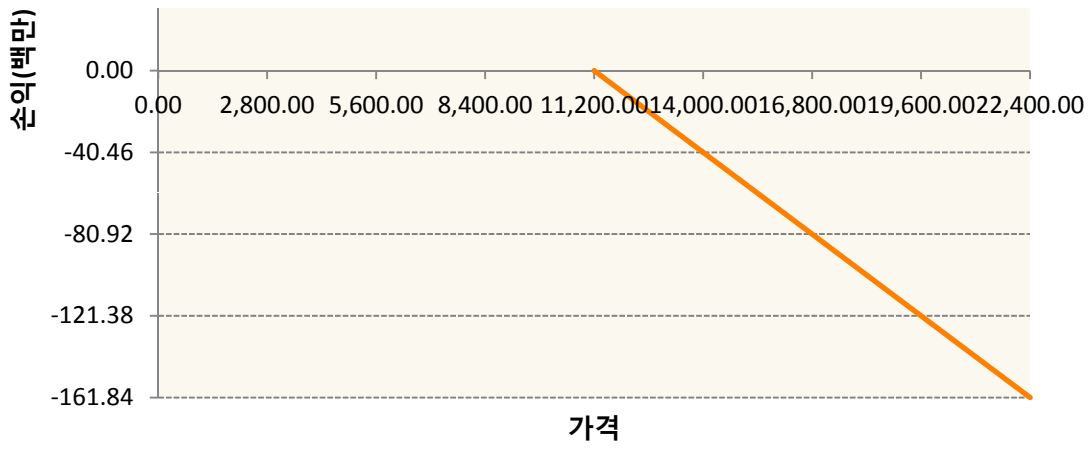
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

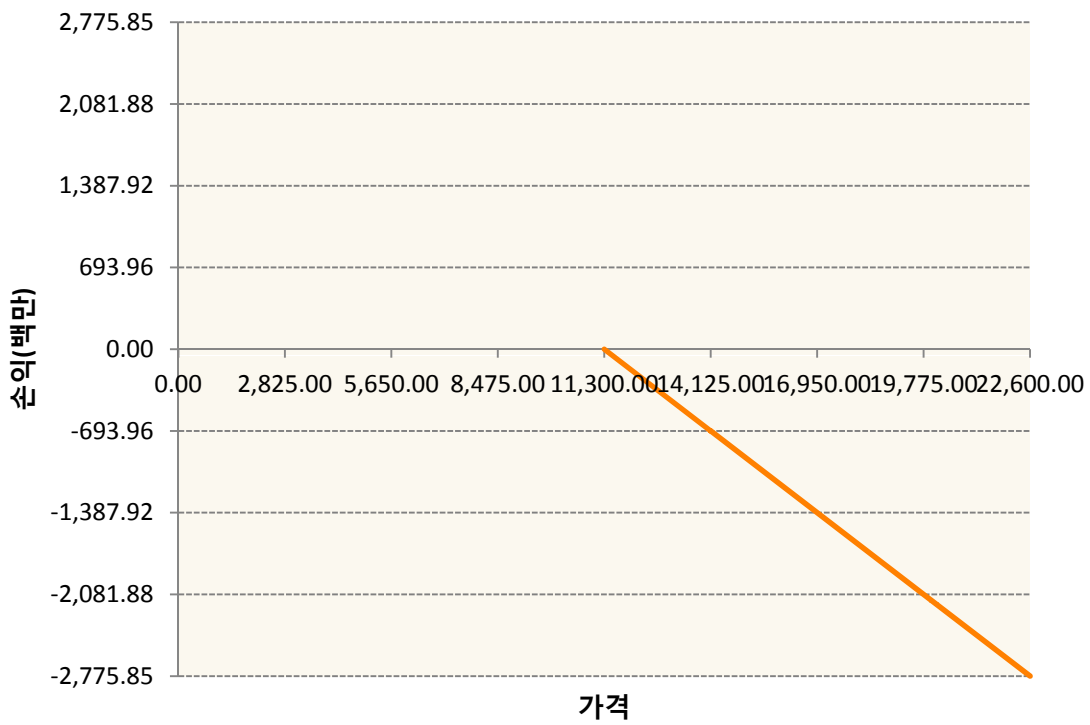
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,373	0	2,373	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,875	-5,875	장내
누계	통화	선도	0	3,035	-3,035	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

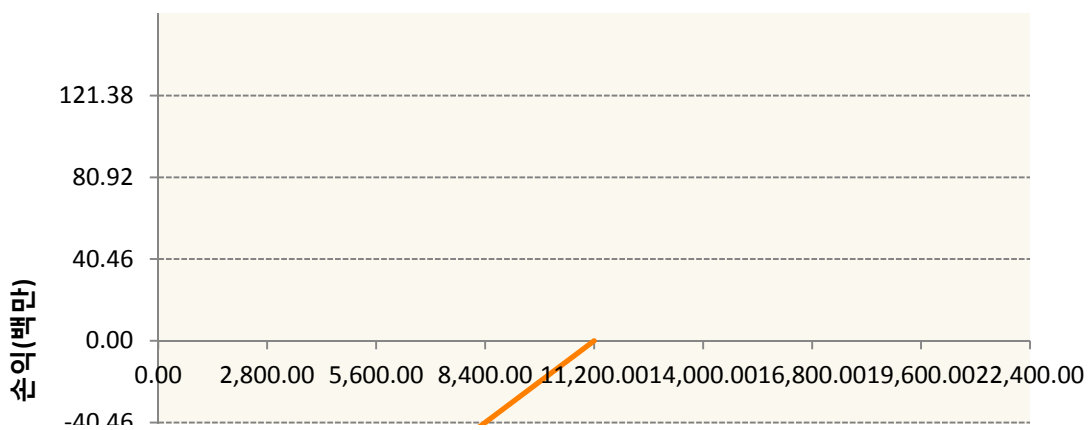


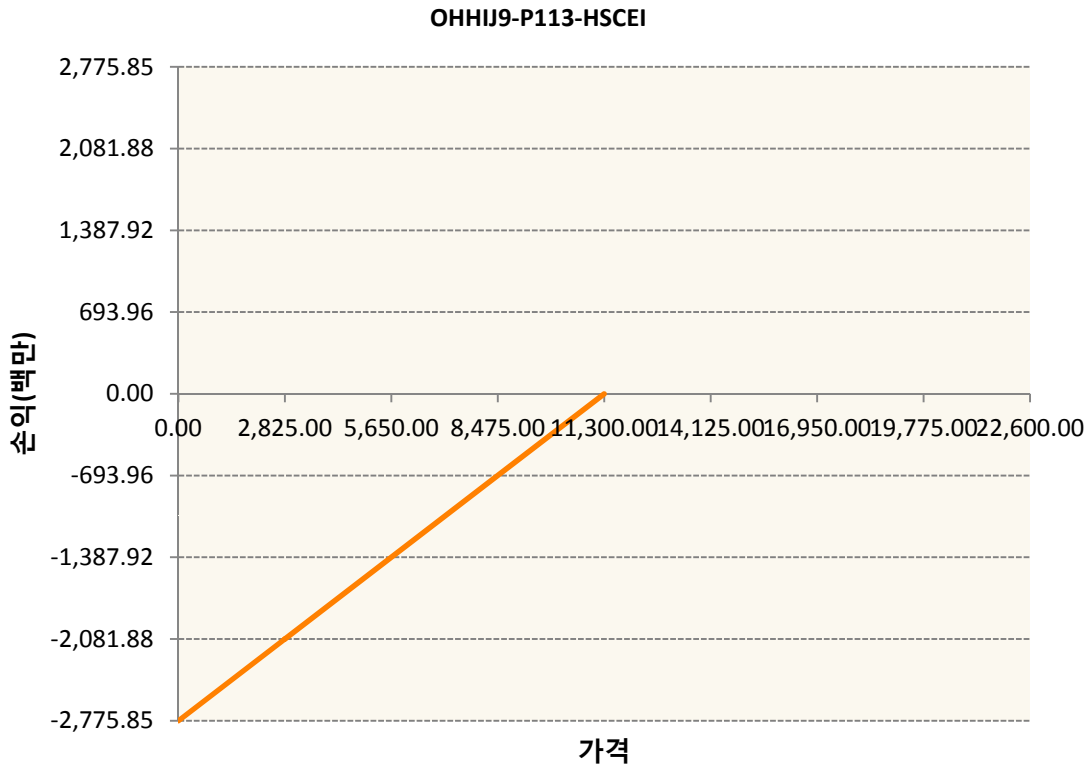


**OHHIJ9-C113-HSCEI**



**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	190
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)
	761

공시일	2019-04-04
기준일	2019-04-03

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

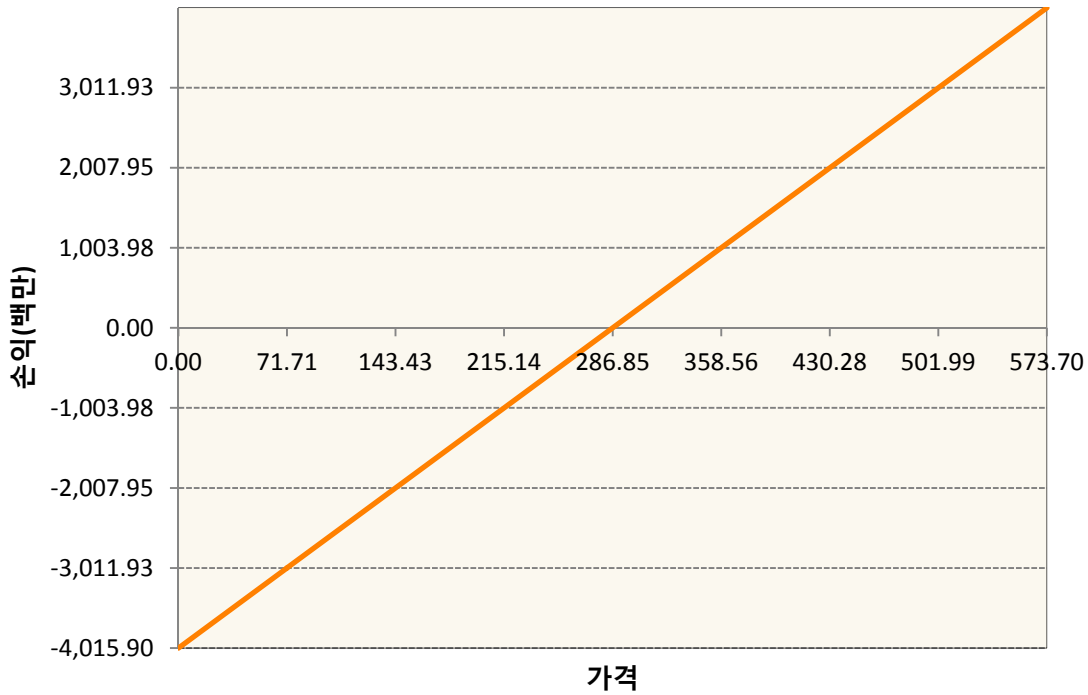
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

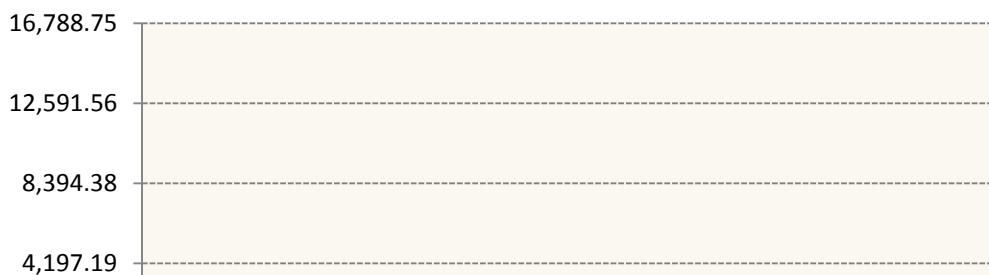
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,016	0	4,016	장내
누계	유가증권	스왑	35,836	0	35,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,579	-34,579	장내

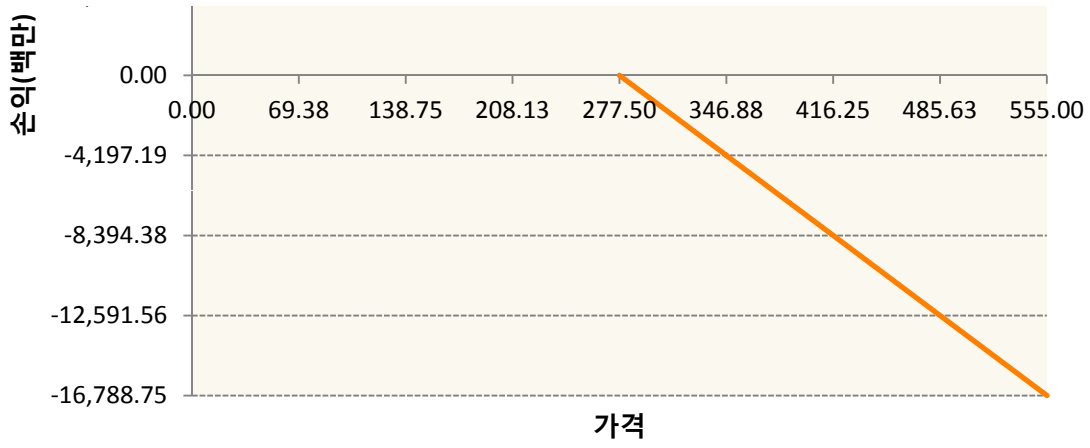
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

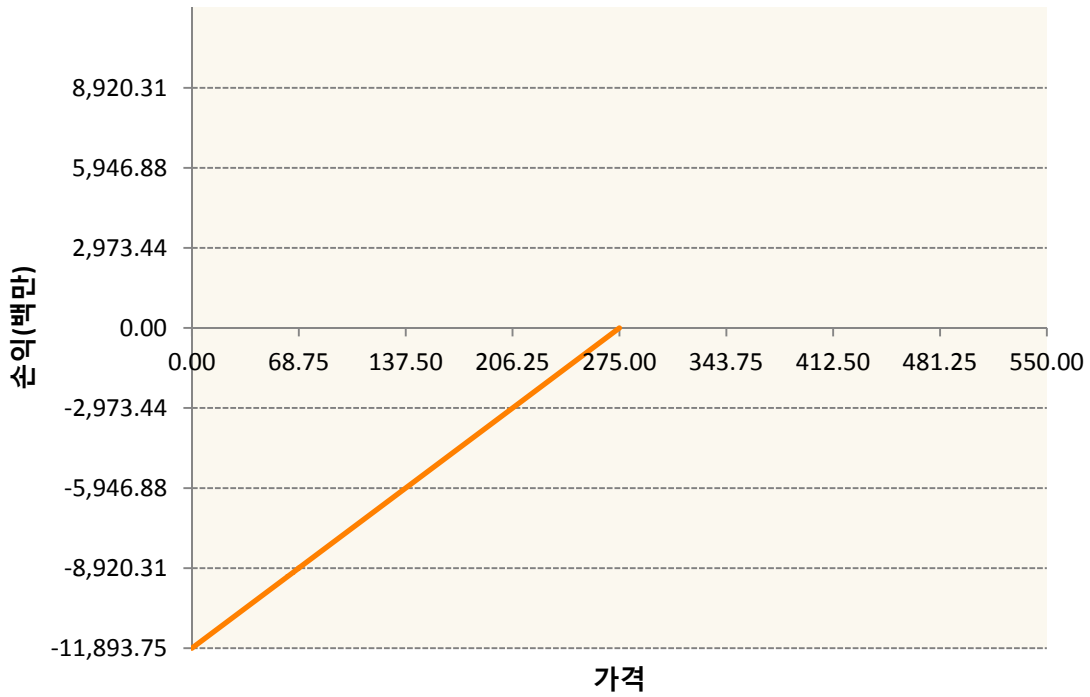


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

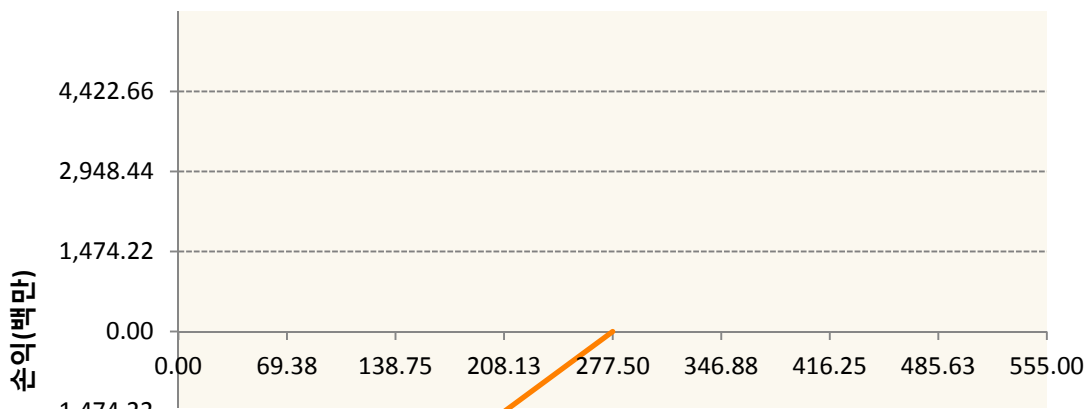


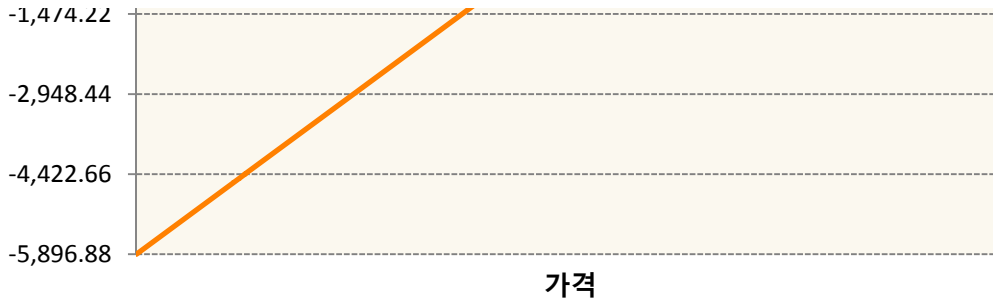


**KR4301P42750-2019-04 풋275**



**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						320
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-320	-320	-320	-320	-320	-320	-320	
-5.33%	-213	-213	-213	-213	-213	-213	-213	
-2.67%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	107	107	107	107	107	107	107	
5.33%	213	213	213	213	213	213	213	
8.00%	320	320	320	320	320	320	320	
KR4201P42778		2019-04 콜277.5						1,310
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	563	559	555	549	542	534	525
-5.33%	525	512	498	483	467	451	434
-2.67%	368	348	328	307	287	267	247
0%	41	28	15	0	-15	-31	-48
2.67%	-389	-393	-397	-403	-410	-419	-428
5.33%	-847	-847	-848	-849	-851	-854	-858
8.00%	-1,307	-1,307	-1,307	-1,307	-1,308	-1,308	-1,310
KR4301P42750                      2019-04 풋275							529
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-526	-527	-527	-527	-528	-528	-529
-5.33%	-207	-211	-215	-220	-225	-231	-237
-2.67%	-20	-26	-32	-38	-45	-51	-58
0%	2	1	1	0	-1	-3	-5
2.67%	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2
KR4301P42776                      2019-04 풋277.5							310
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-309	-310	-310	-310	-310	-310	-310
-5.33%	-149	-150	-151	-152	-154	-155	-157
-2.67%	-25	-29	-33	-36	-40	-44	-48
0%	3	2	1	0	-1	-3	-5
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)

**5,256**

공시일	2019-04-04
기준일	2019-04-03

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

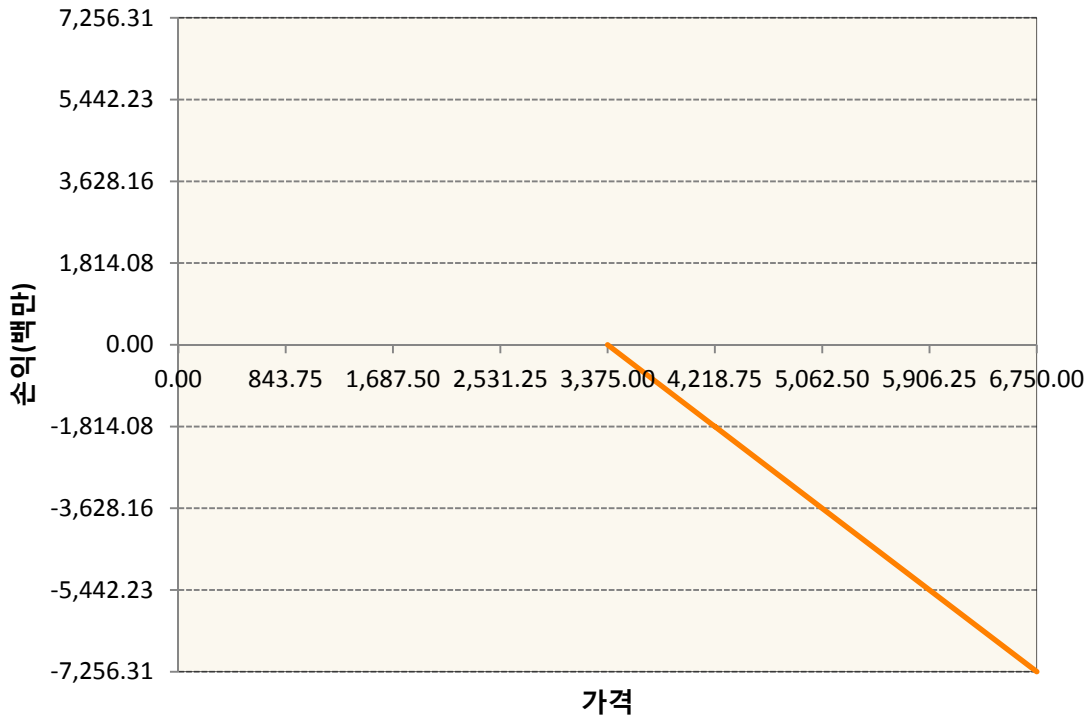
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

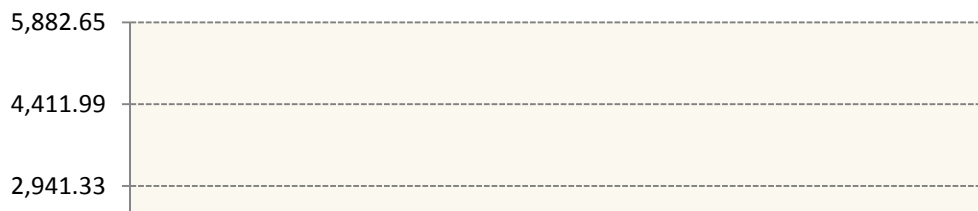
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,396	0	6,396	
누계	유가증권	스왑	60,063	0	60,063	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,278	-26,278	장내
누계	통화	선도	0	15,267	-15,267	장외

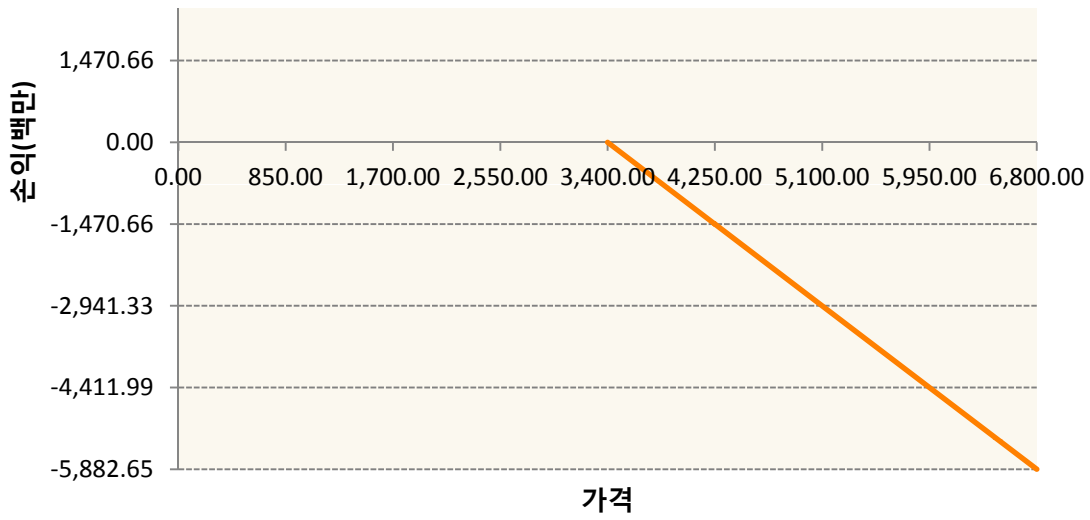
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXJ9-C3375-EURO STOXX 50**

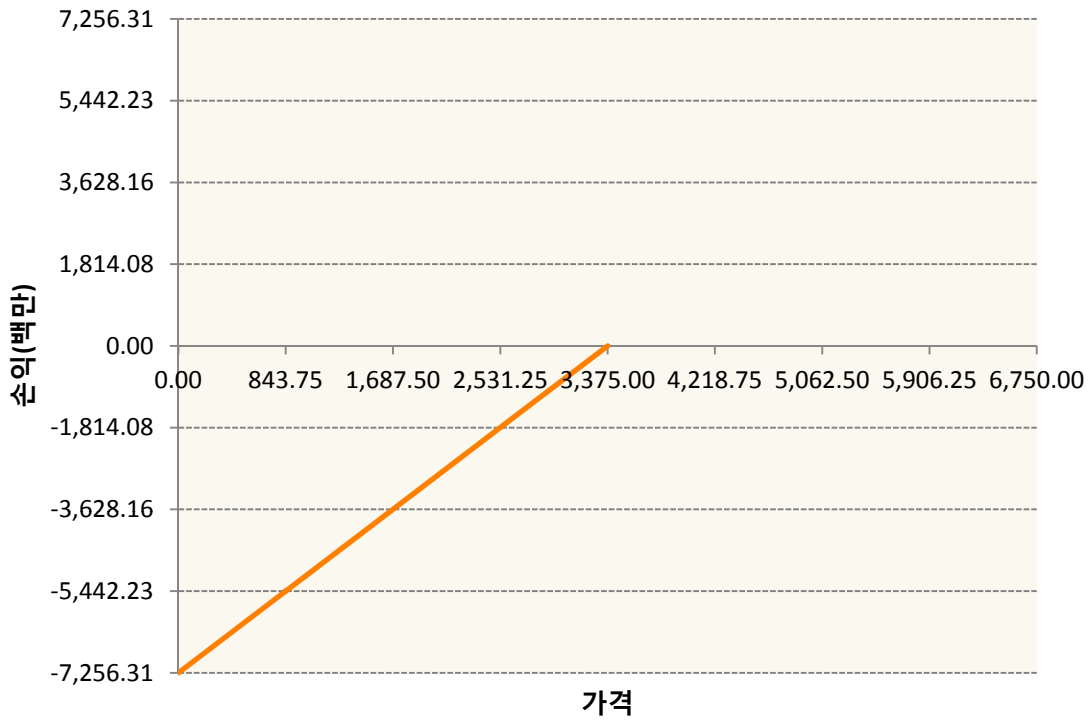


**OESXJ9-C3400-EURO STOXX 50**

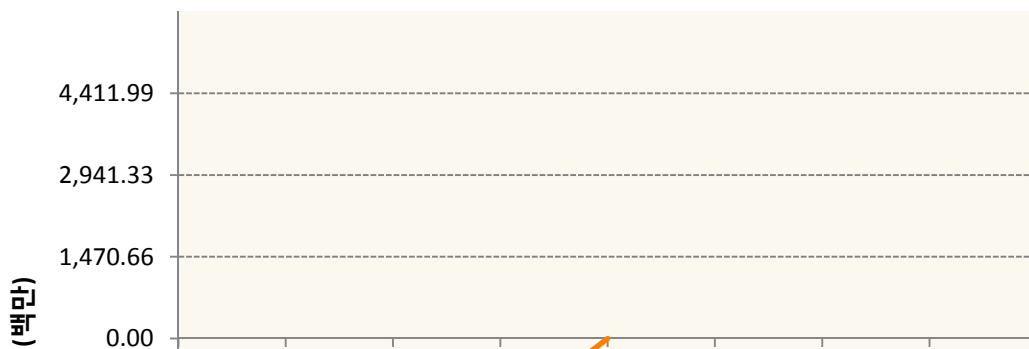


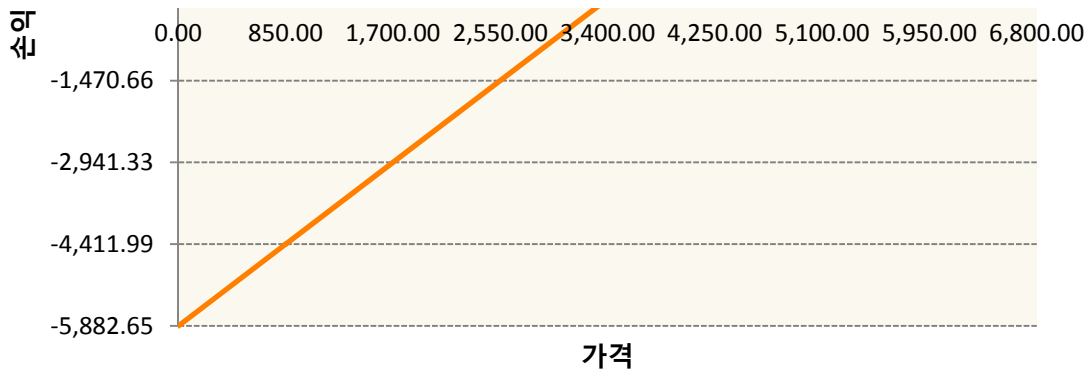


OESXJ9-P3375-EURO STOXX 50

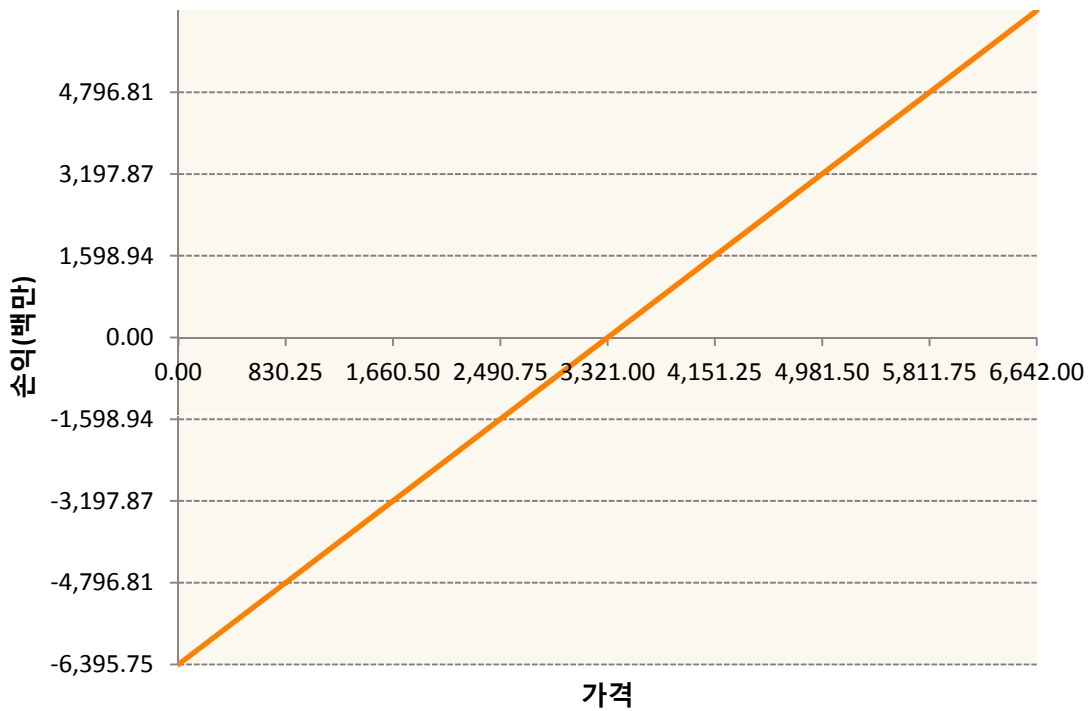


OESXJ9-P3400-EURO STOXX 50





VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	162
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	512

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

(단위:백만원)

2,662



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

(단위:백만원)

1,110



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

(단위:백만원)

95



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

(단위:백만원)

138



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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-04-04
기준일	2019-04-03

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

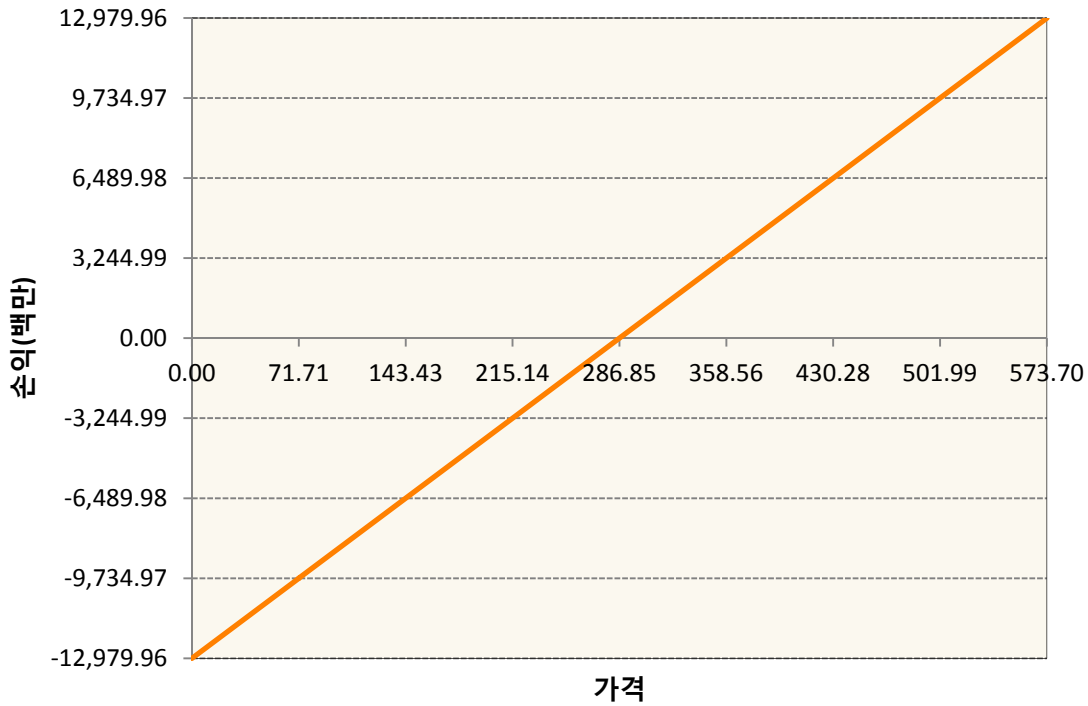
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

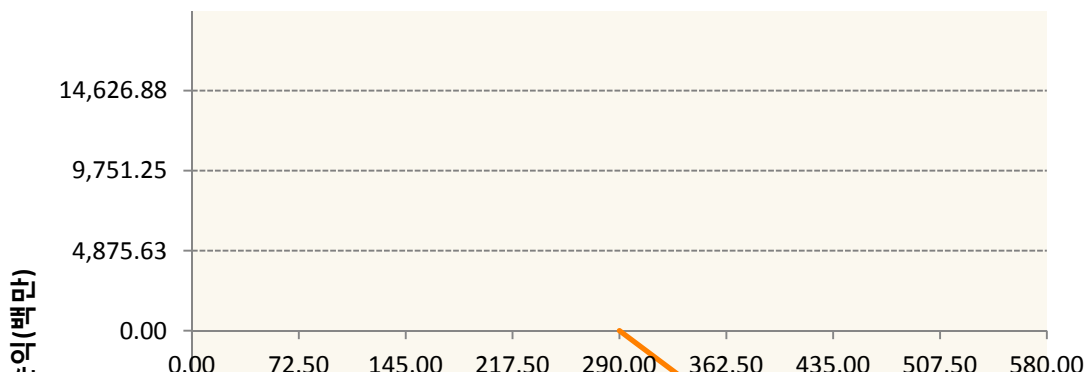
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,980	0	12,980	장내
누계	유가증권	옵션	1,867	24,036	-22,169	장내

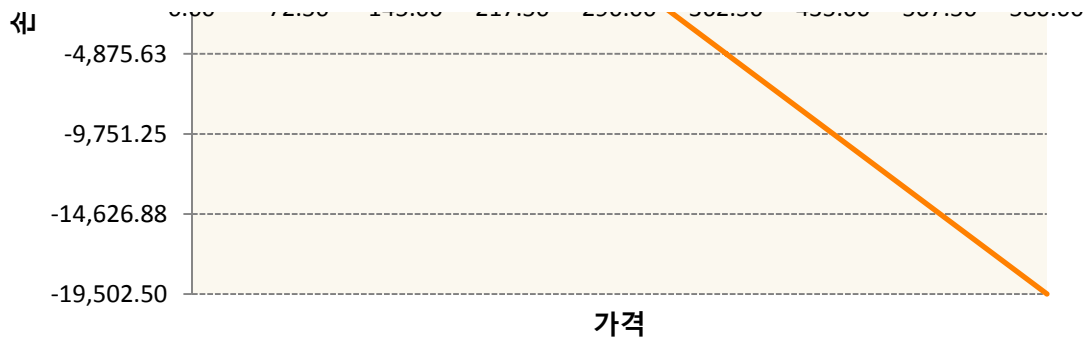
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

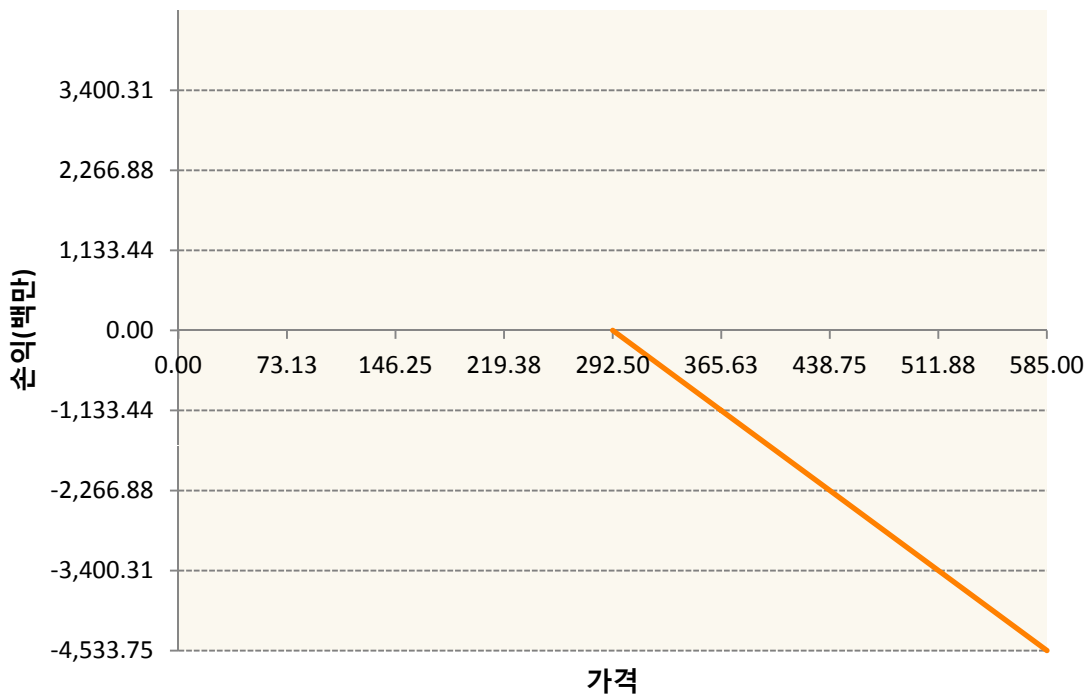


KR4201P42901-2019-04 콜290

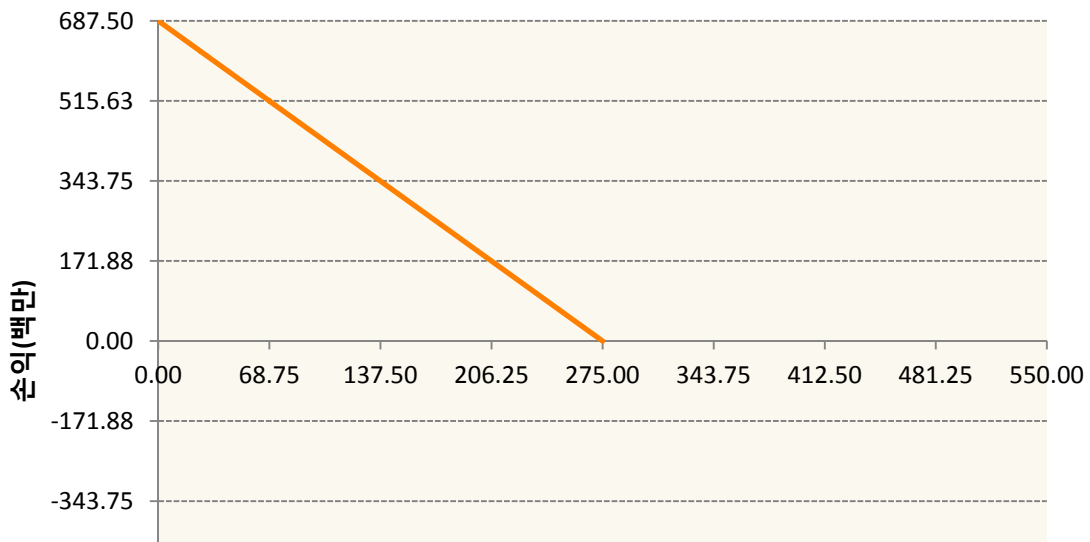


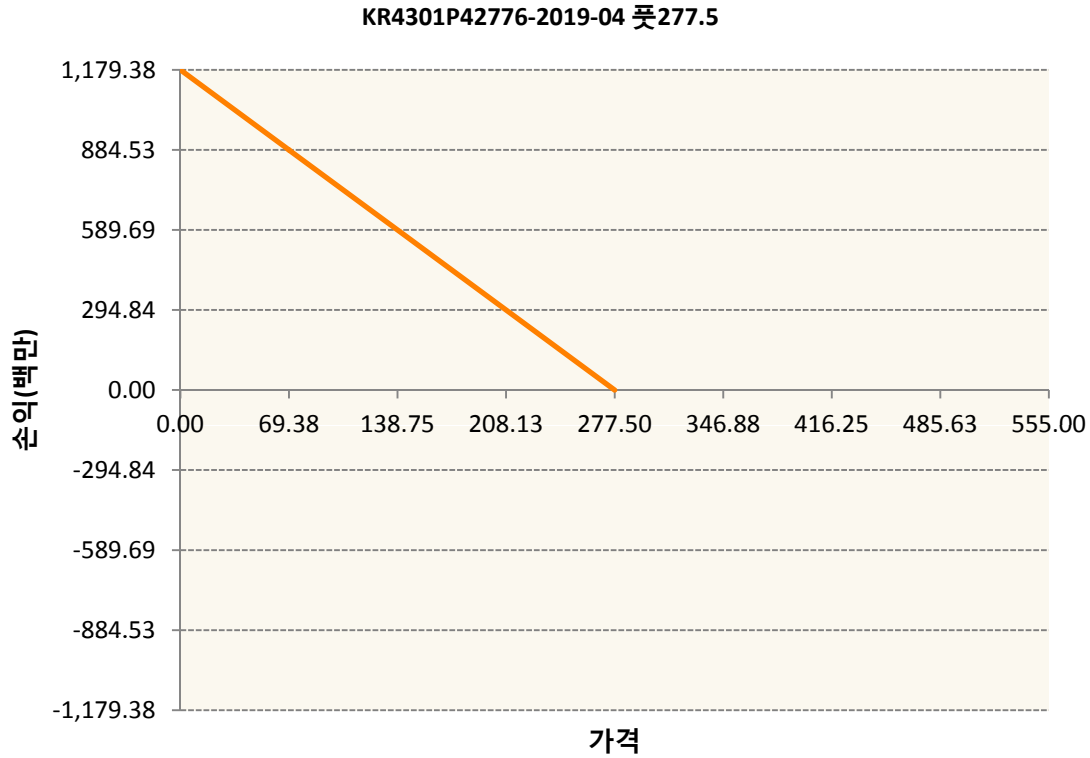
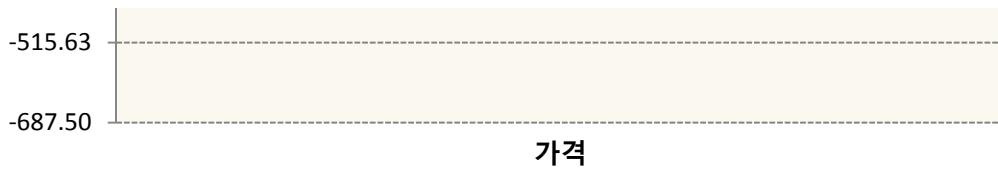


**KR4201P42927-2019-04 콜292.5**



**KR4301P42750-2019-04 풋275**





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						1,034
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,034	-1,034	-1,034	-1,034	-1,034	-1,034	-1,034	
-5.33%	-689	-689	-689	-689	-689	-689	-689	
-2.67%	-345	-345	-345	-345	-345	-345	-345	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	345	345	345	345	345	345	345	
5.33%	689	689	689	689	689	689	689	
8.00%	1,034	1,034	1,034	1,034	1,034	1,034	1,034	
KR4201P42901		2019-04 콜290						1,121
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	157	157	157	157	156	155	153	
-5.33%	157	155	153	150	146	141	135	
-2.67%	144	136	127	116	103	90	75	

0%	62	42	21	0	-22	-43	-65
2.67%	-182	-204	-226	-249	-271	-294	-317
5.33%	-595	-605	-618	-631	-646	-662	-679
8.00%	-1,087	-1,089	-1,093	-1,098	-1,104	-1,112	-1,121
KR4201P42927                      2019-04 콜292.5							235
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	25	25	25	25	25	25	24
-5.33%	25	25	25	24	24	23	22
-2.67%	24	22	21	19	17	15	12
0%	12	8	4	0	-4	-9	-14
2.67%	-30	-36	-41	-47	-52	-58	-63
5.33%	-114	-118	-121	-125	-130	-134	-138
8.00%	-224	-225	-226	-228	-230	-232	-235
KR4301P42750                      2019-04 풋275							31
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	30	30	30	30	30	31	31
-5.33%	12	12	12	13	13	13	14
-2.67%	1	1	2	2	3	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
KR4301P42776                      2019-04 풋277.5							62
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	62	62	62	62	62	62	62
-5.33%	30	30	30	30	31	31	31
-2.67%	5	6	7	7	8	9	10
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

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

(단위:백만원)

**2,244**

공시일	2019-04-04
기준일	2019-04-03

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	15	-15	
누계	유가증권	수익증권	3,504	0	3,504	

### 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	2019-04-04
기준일	2019-04-03

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,134	0	1,134	
누계	유가증권	수익증권	15,268	0	15,268	

### 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	2019-04-04
기준일	2019-04-03

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	567	0	567	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	66,816	0	66,816	
누계	통화	선도	0	67,253	-67,253	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	454
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
FX21019J002 KRW/USD 10-06-19E	100

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

(단위:백만원)

1,857

공시일	2019-04-04
기준일	2019-04-03

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

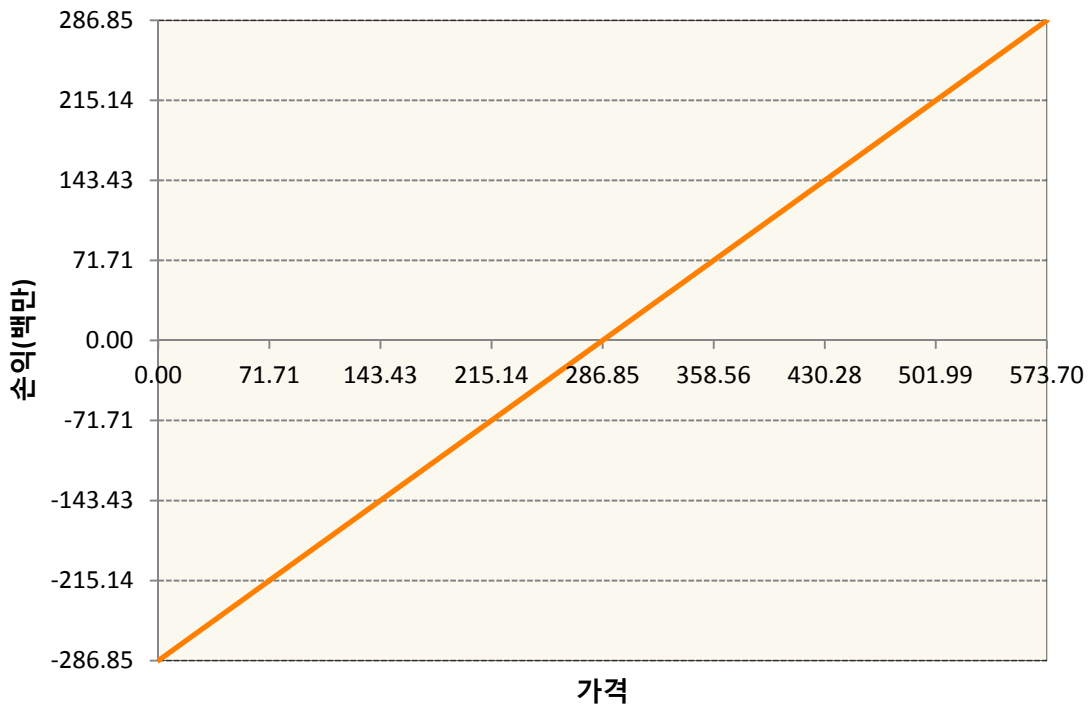
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

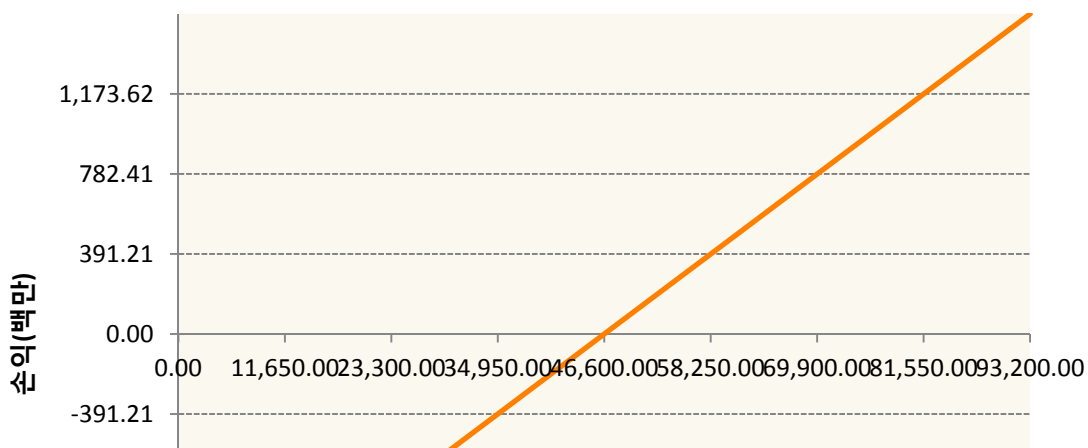
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,852	0	1,852	장내

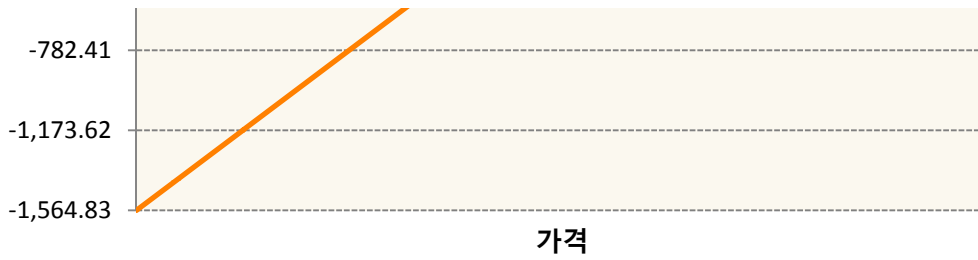
### 2. 만기시점의 손익구조

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						125
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125	
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83	
-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%	83	83	83	83	83	83	83	
8.00%	125	125	125	125	125	125	125	

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

**165**

공시일	2019-04-04
기준일	2019-04-03

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

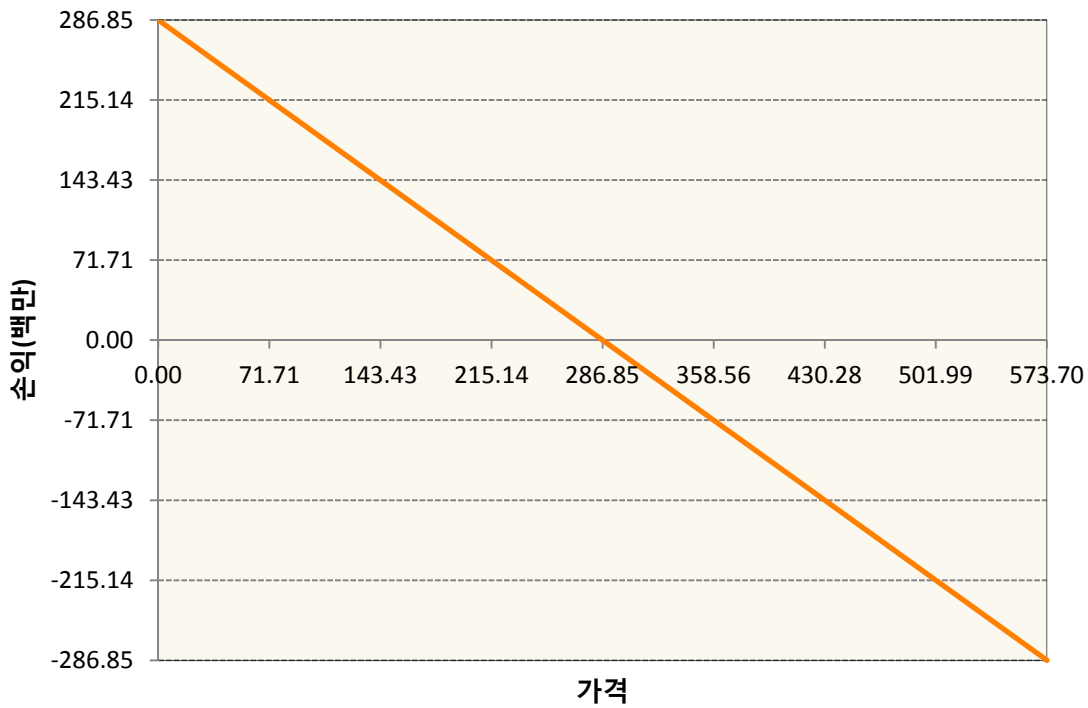
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

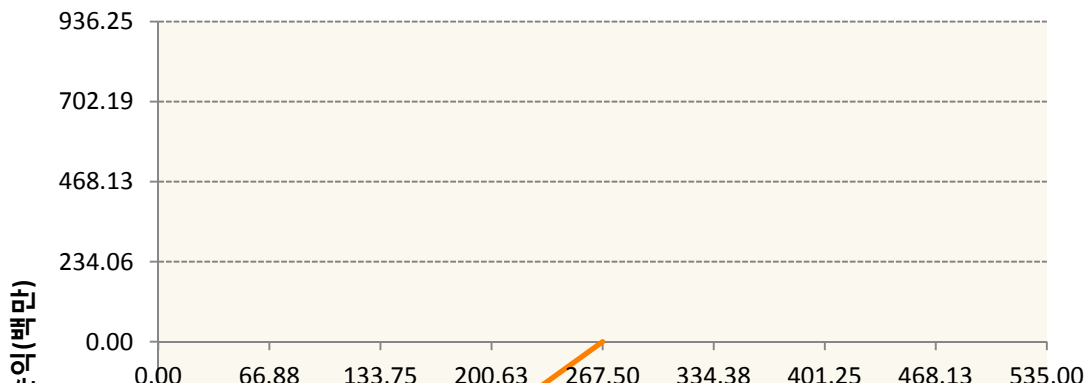
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	287	-287	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,476	-1,476	장내

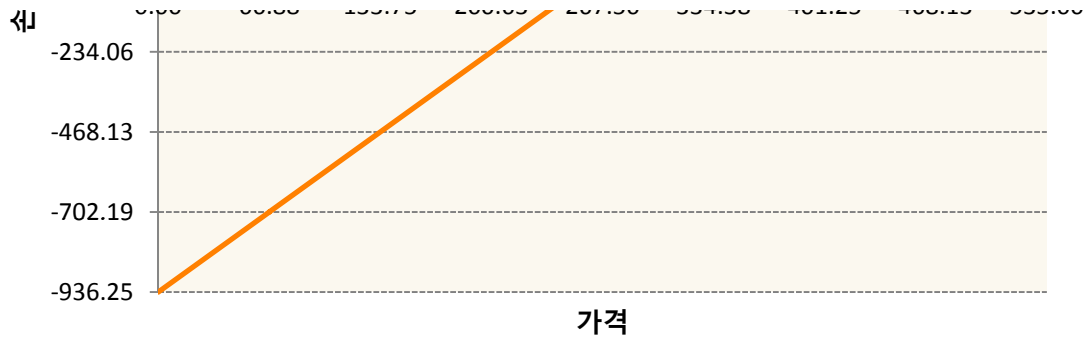
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

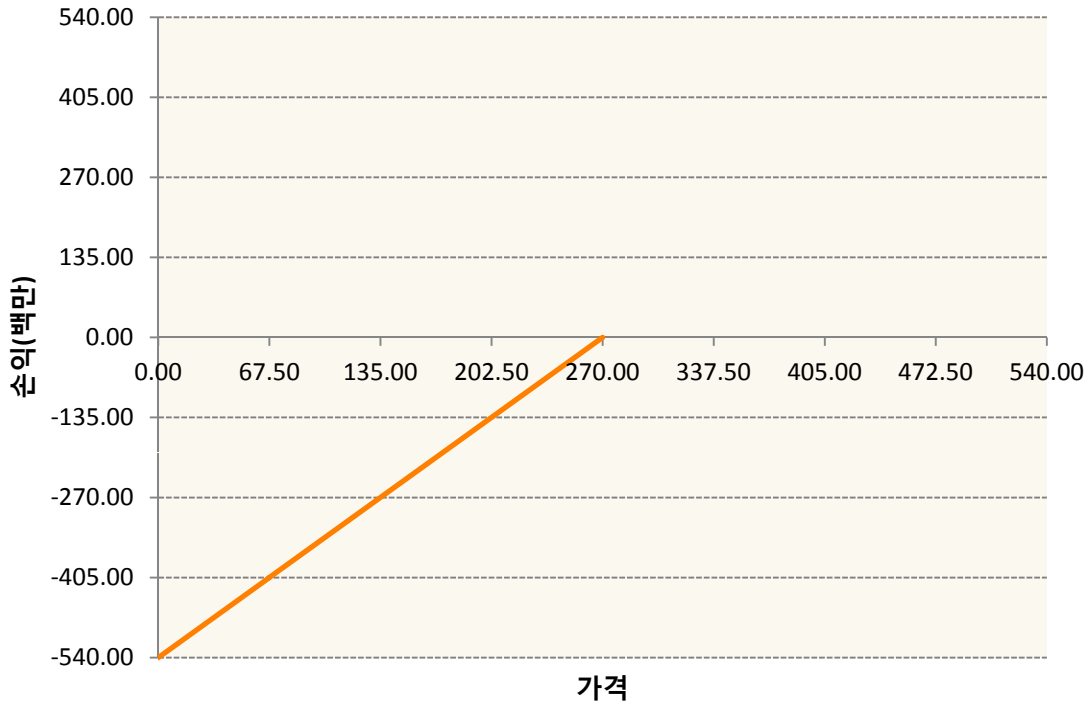


KR4301P42677-2019-04 풋267.5





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						19
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-17	-17	-18	-18	-19	-19	-19
-5.33%	-2	-2	-3	-3	-4	-4	-5
-2.67%	0	0	0	0	0	0	-1
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

15

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%	-3	-3	-3	-4	-4	-4	-5
-2.67%	0	0	0	0	0	-1	-1
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)

22

공시일	2019-04-04
기준일	2019-04-03

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

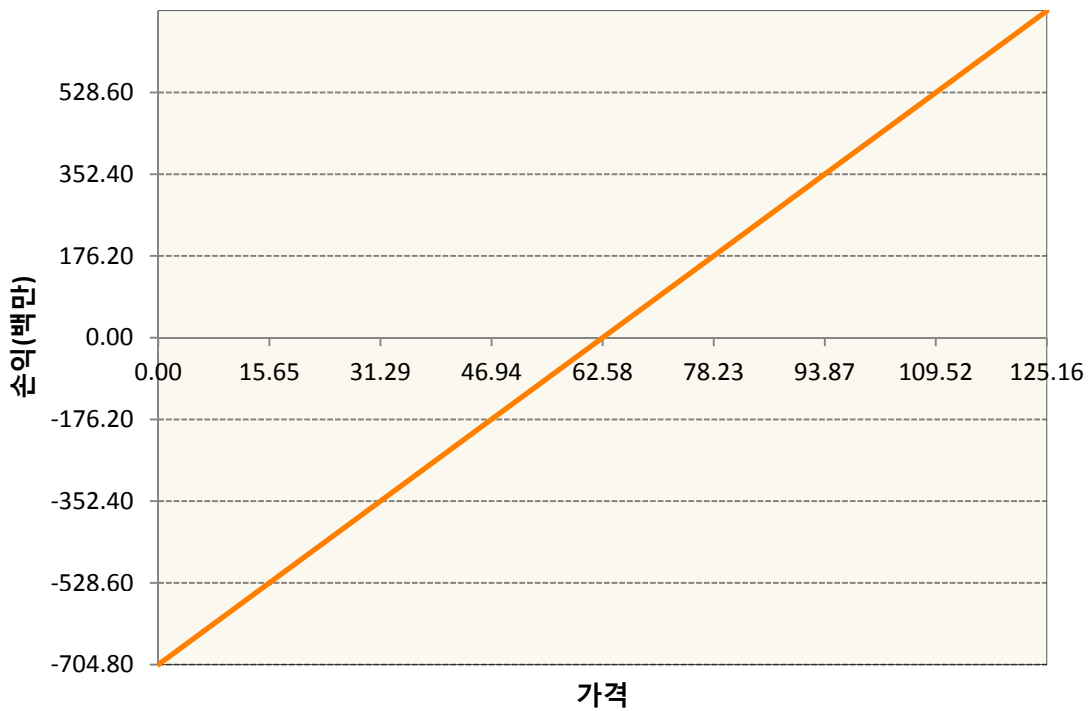
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

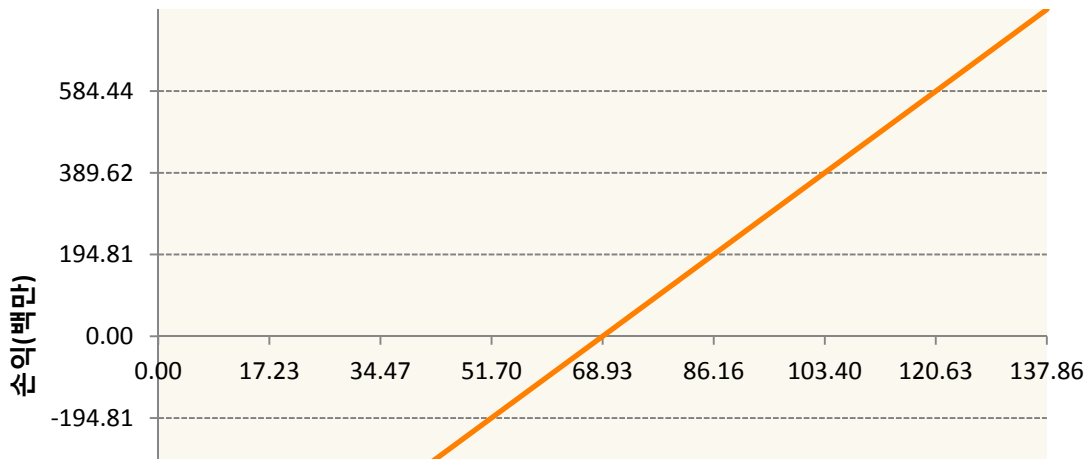
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,919	284	2,636	

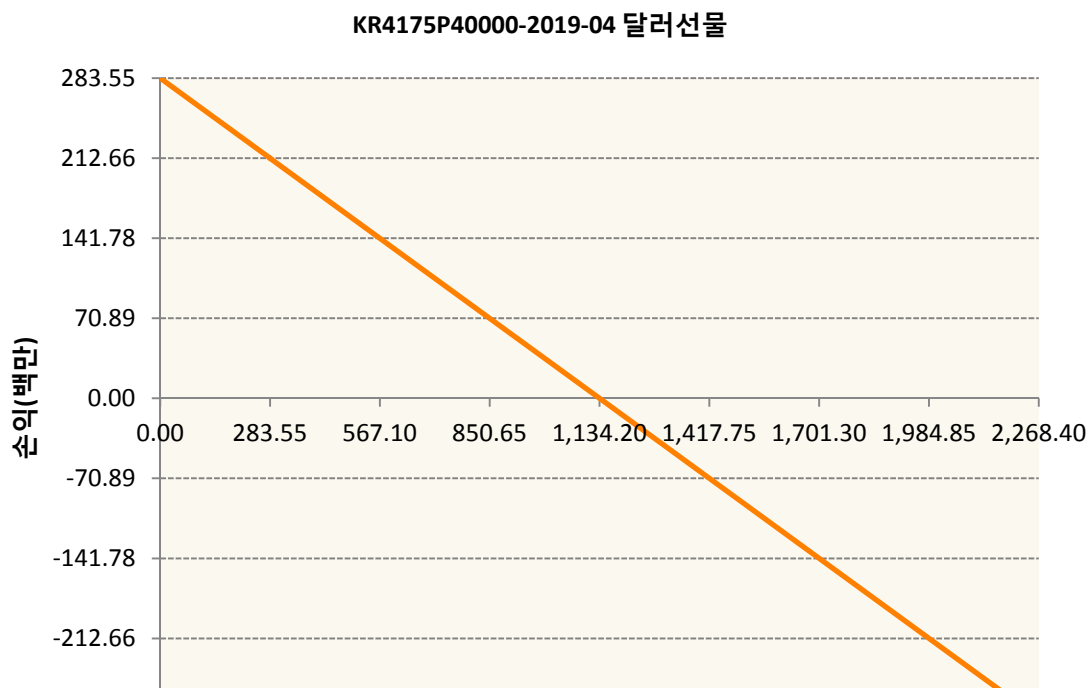
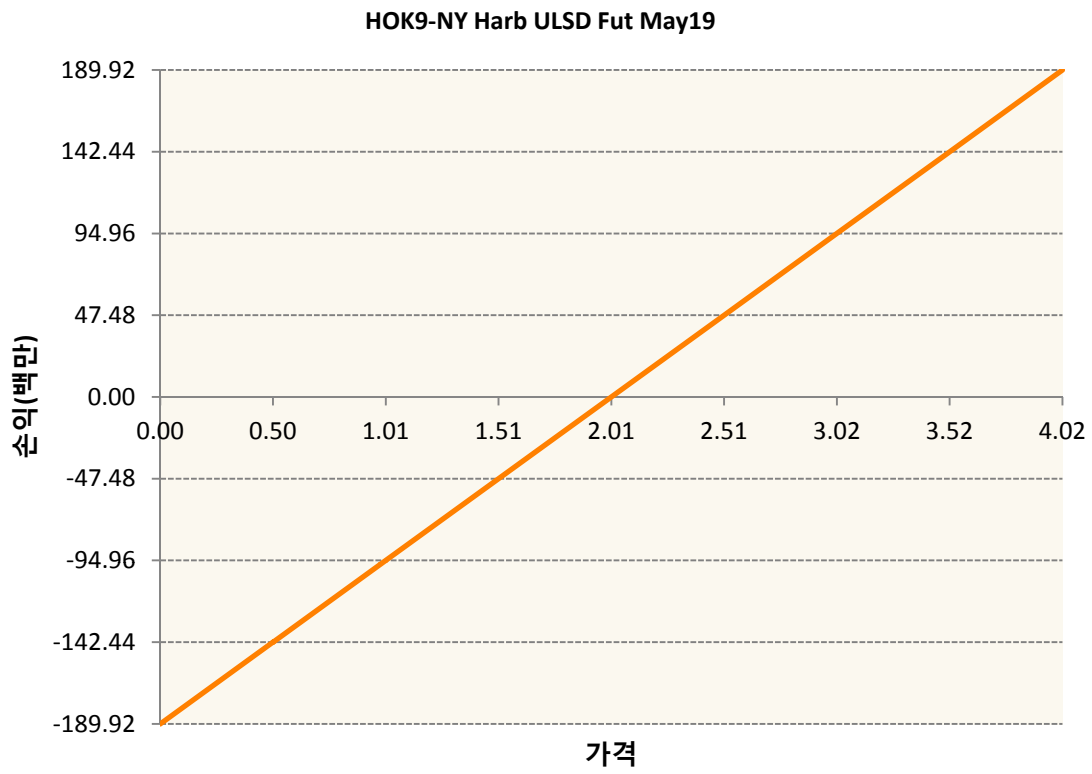
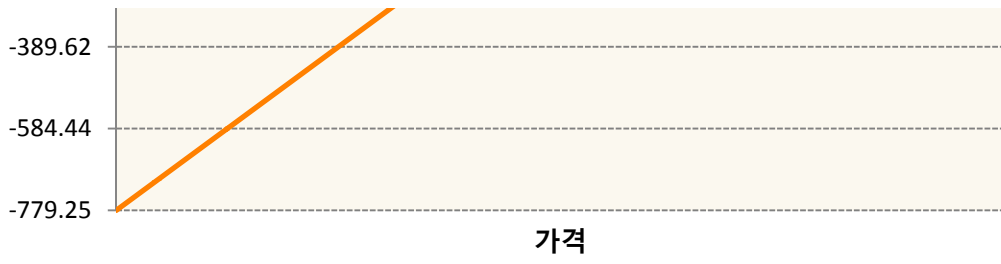
### 2. 만기시점의 손익구조

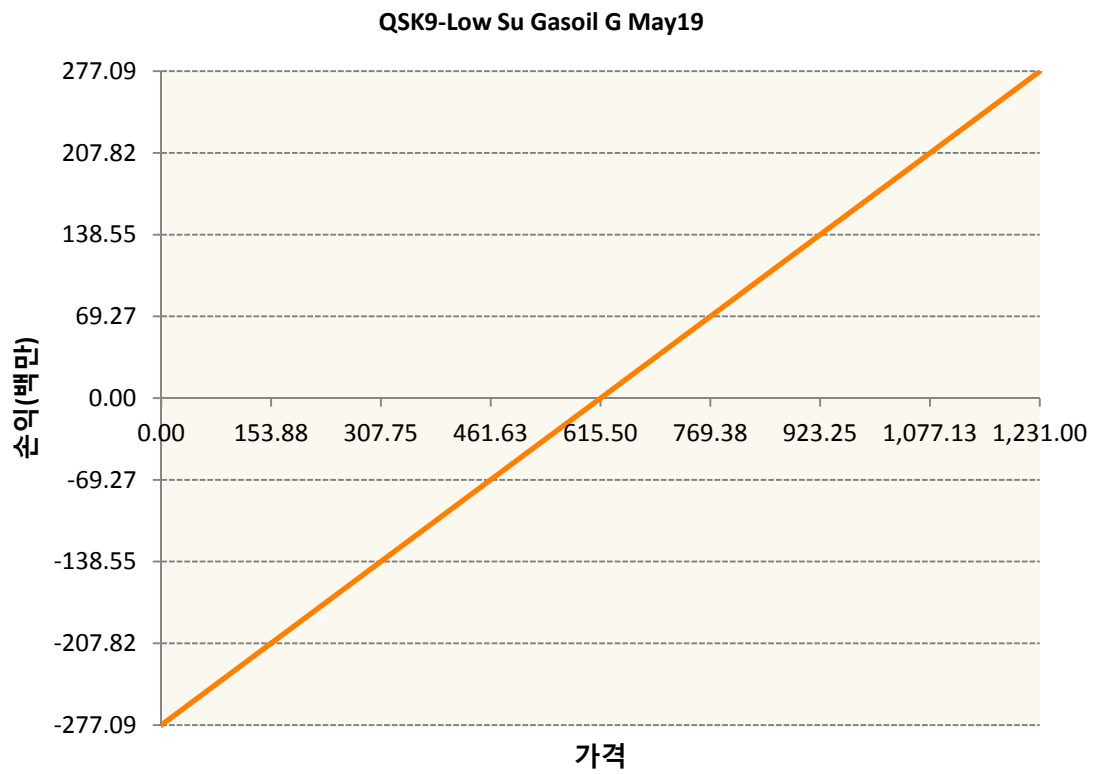
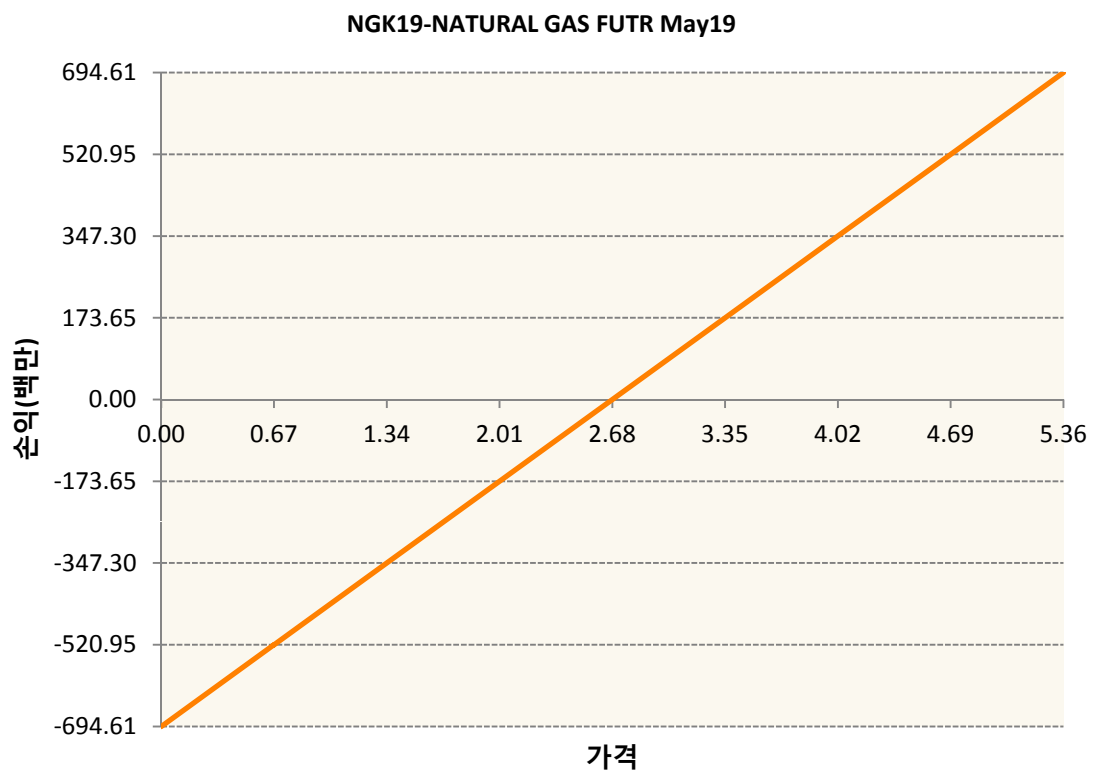
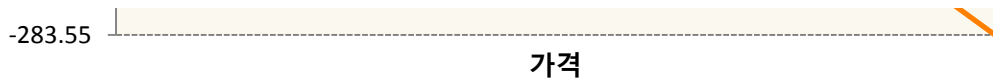
CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19



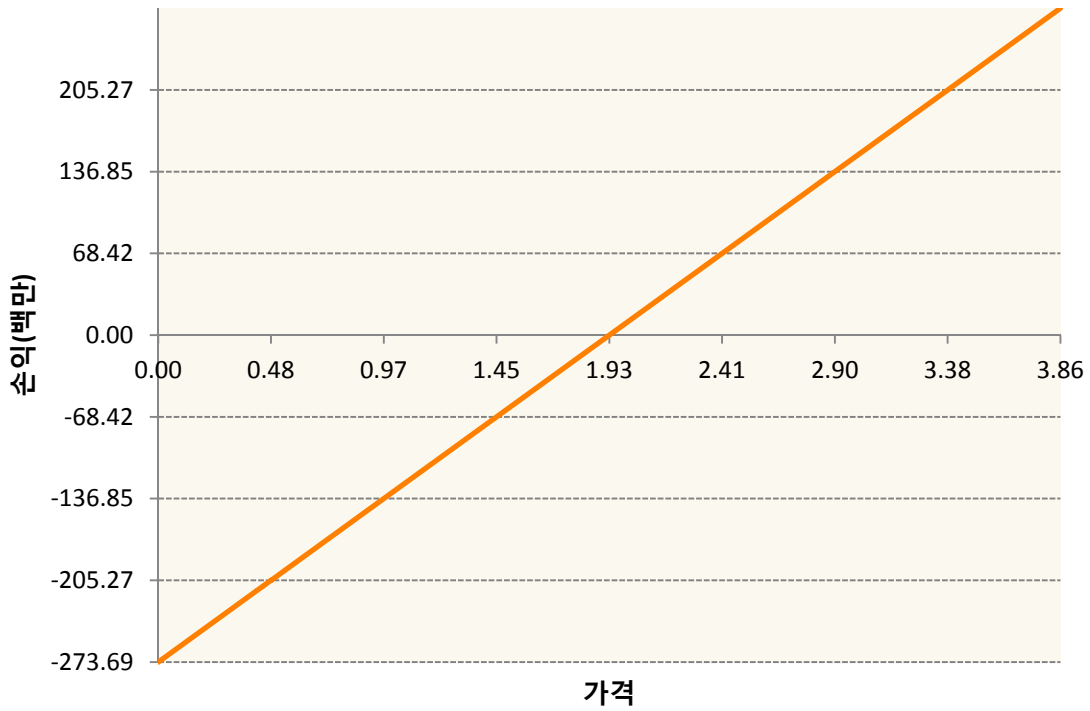
CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19







**XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19**



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

CLK9	WTI CRUDE FUTURE May19	56
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)

**439**

공시일	2019-04-04
기준일	2019-04-03

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

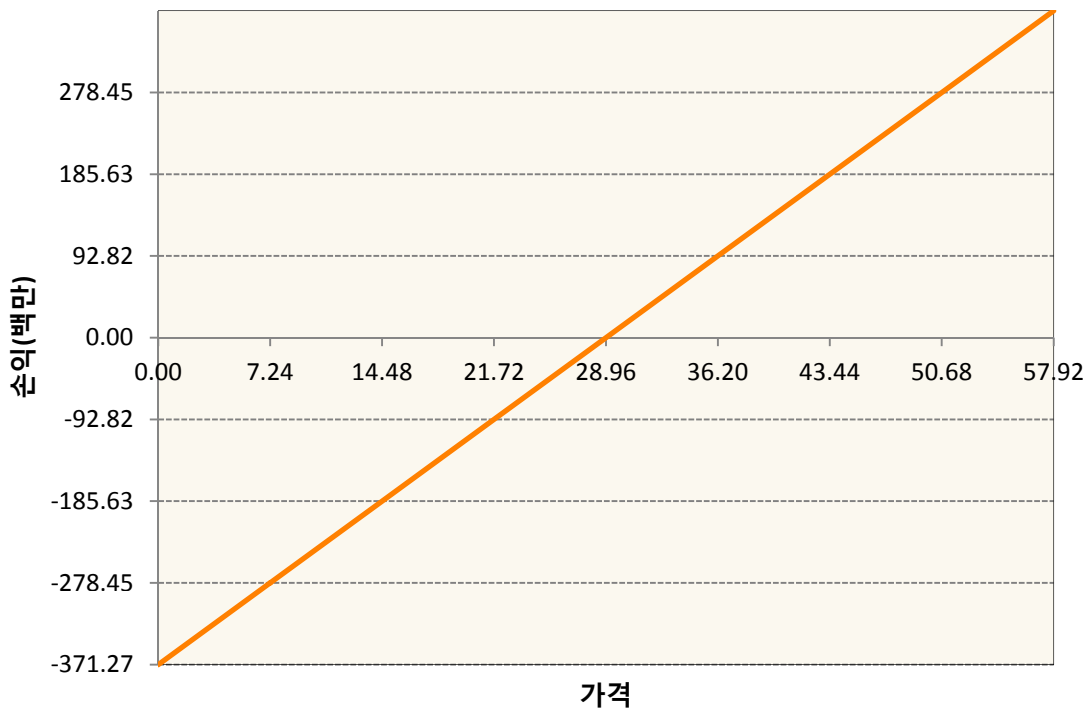
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

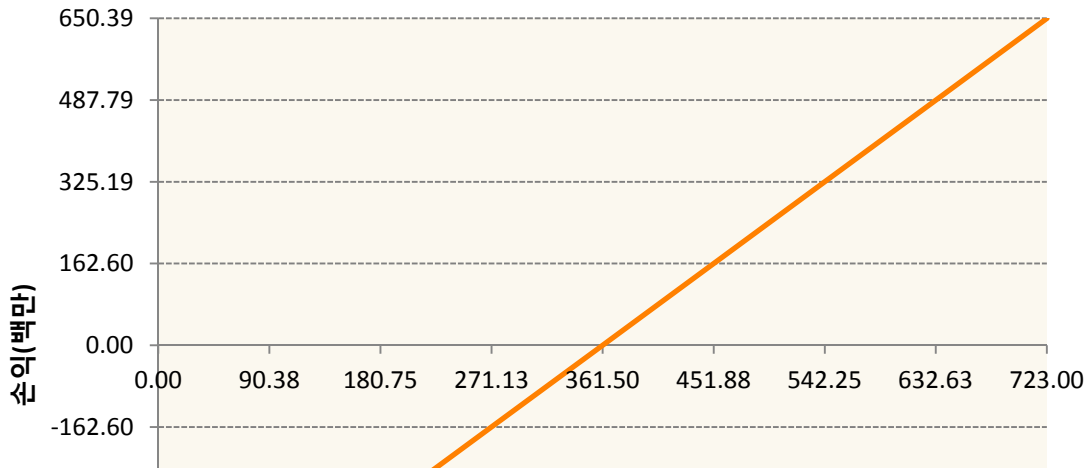
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,348	79	3,269	

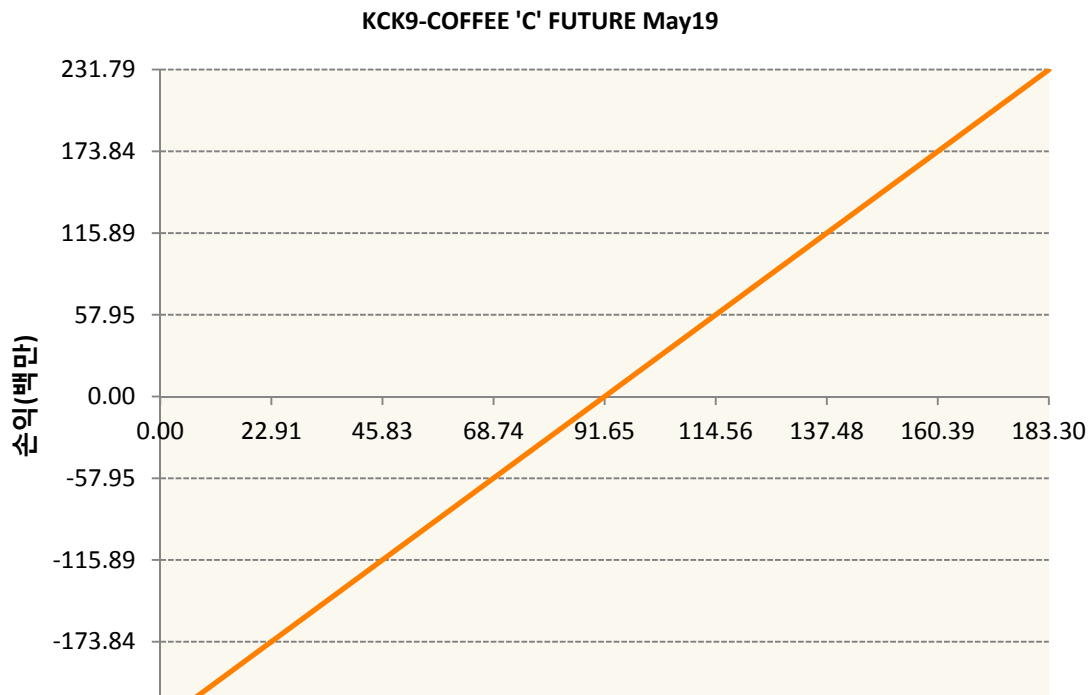
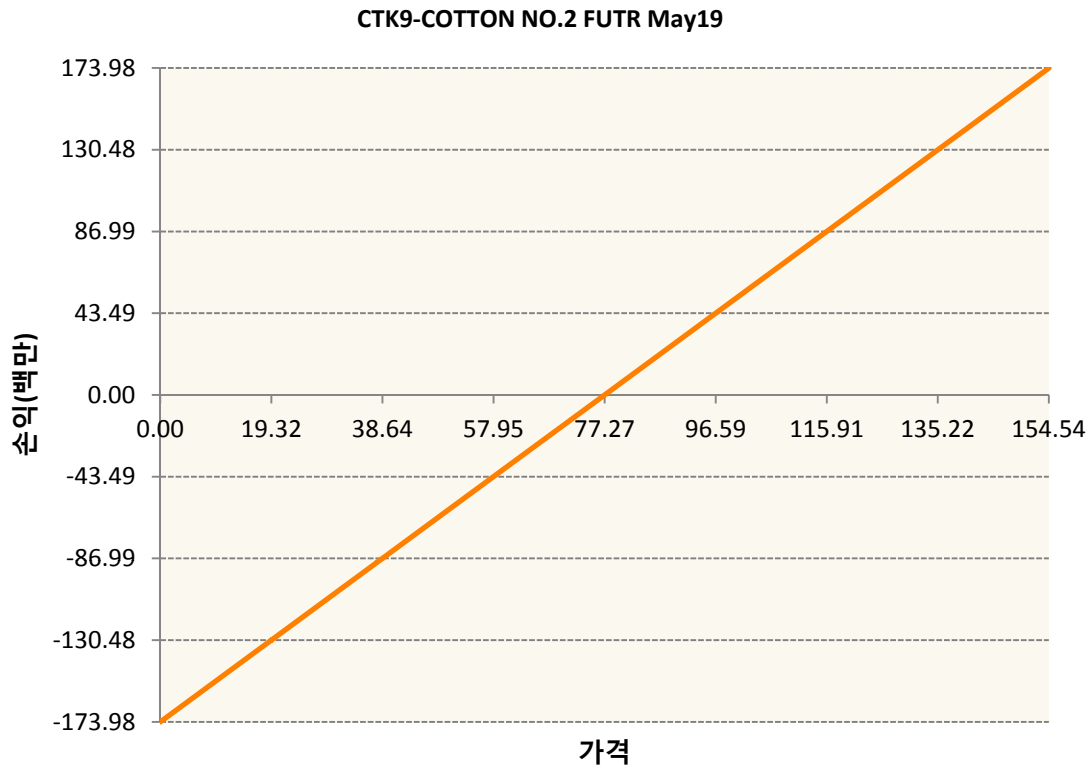
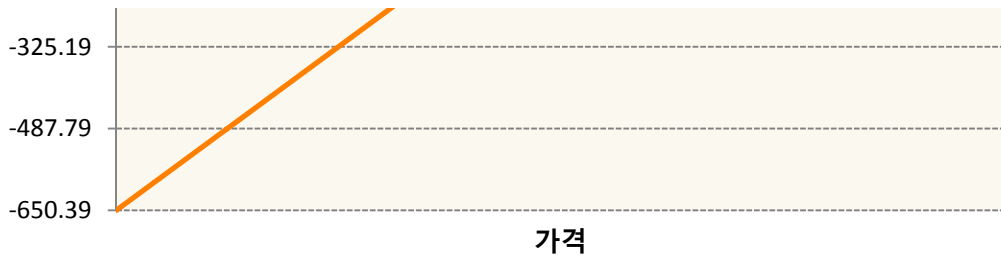
### 2. 만기시점의 손익구조

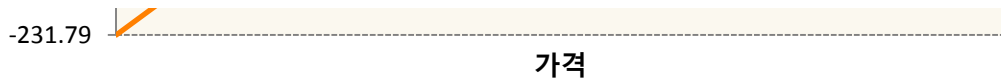
**BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19**



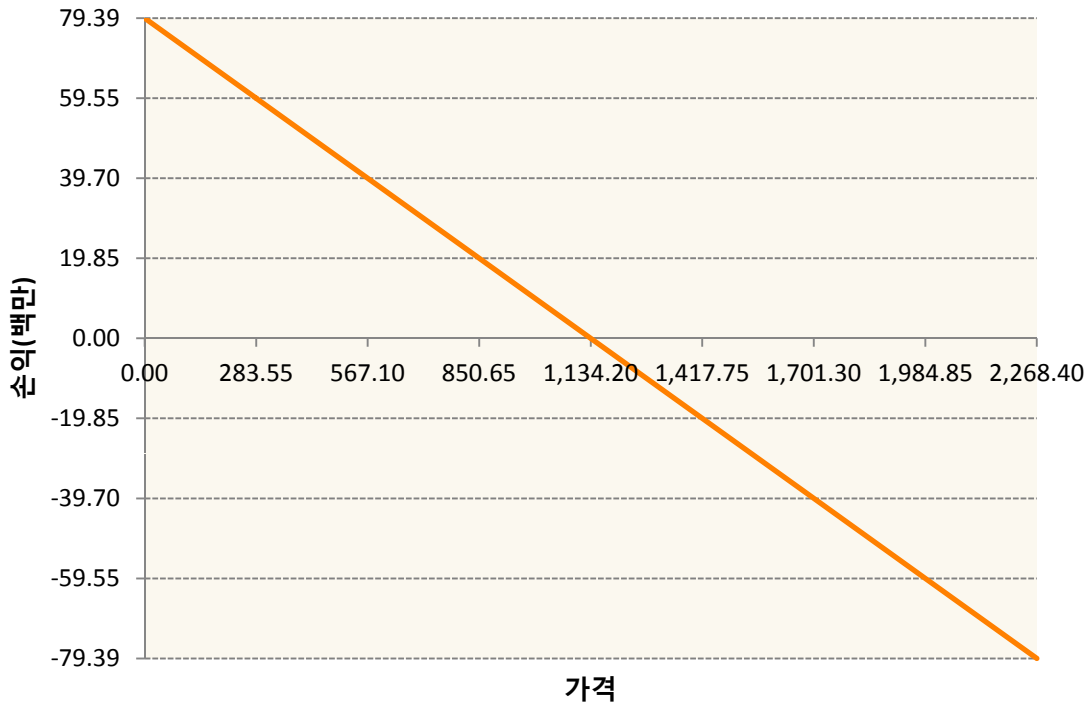
**CK9-CORN FUTURE May19**



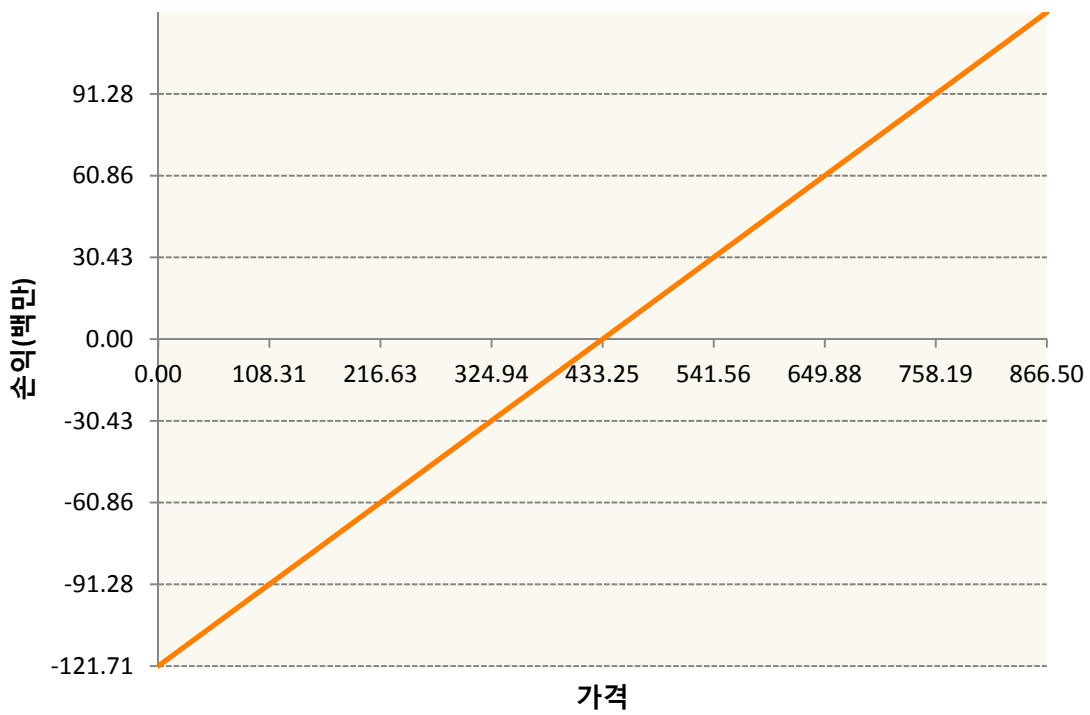




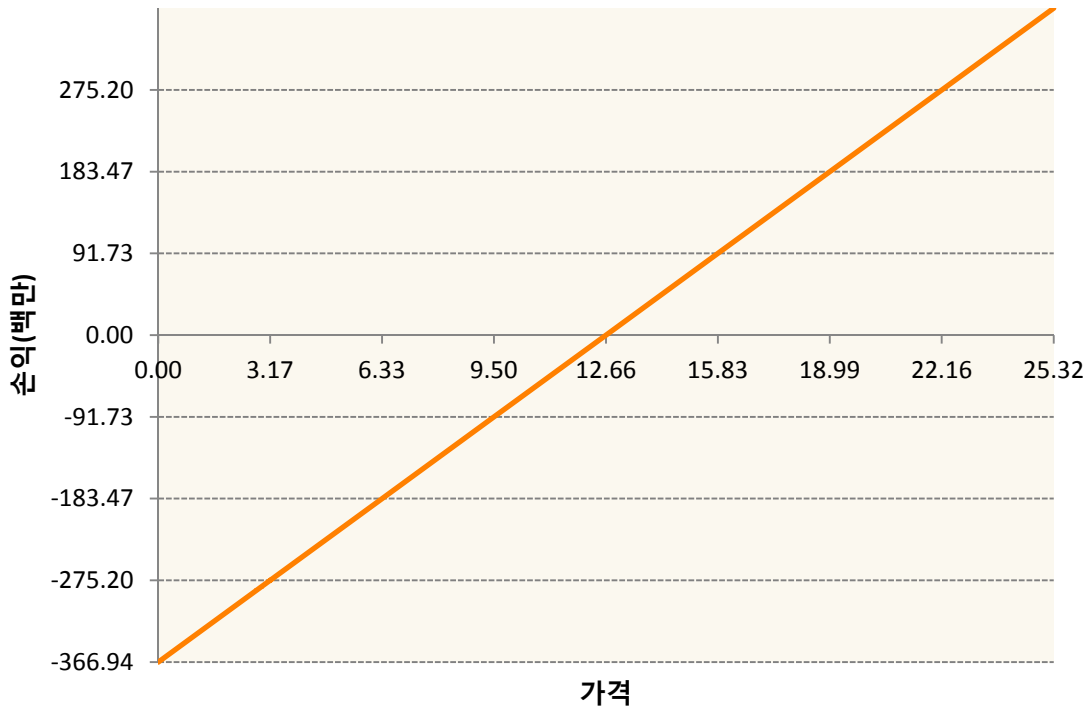
KR4175P40000-2019-04 달러선물



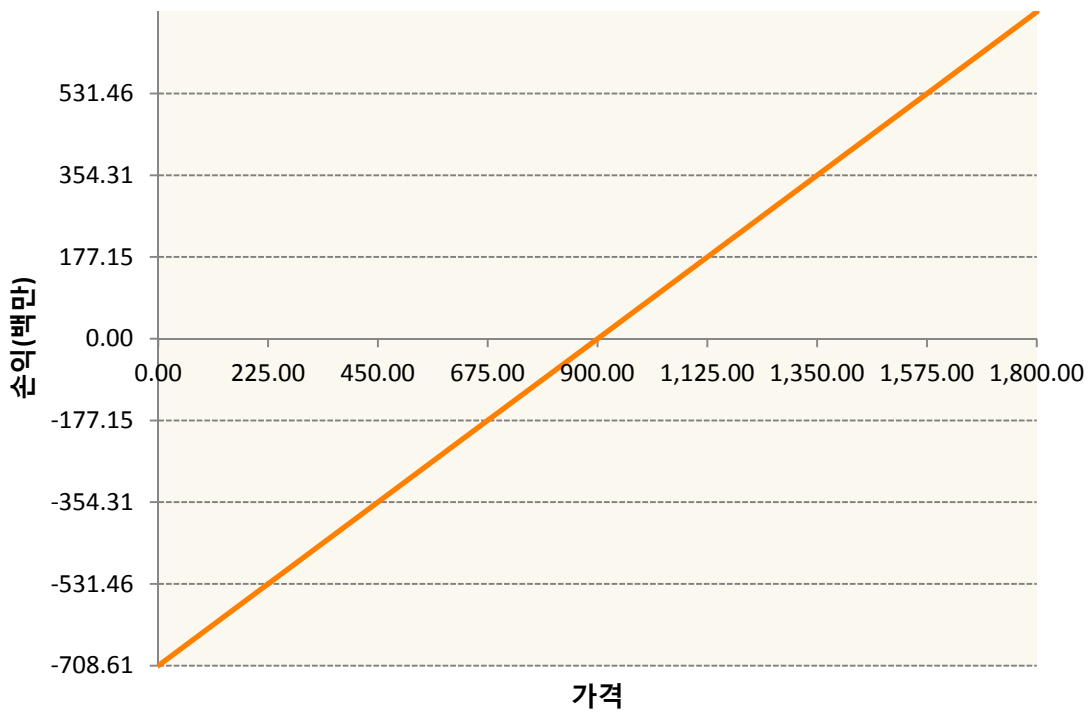
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

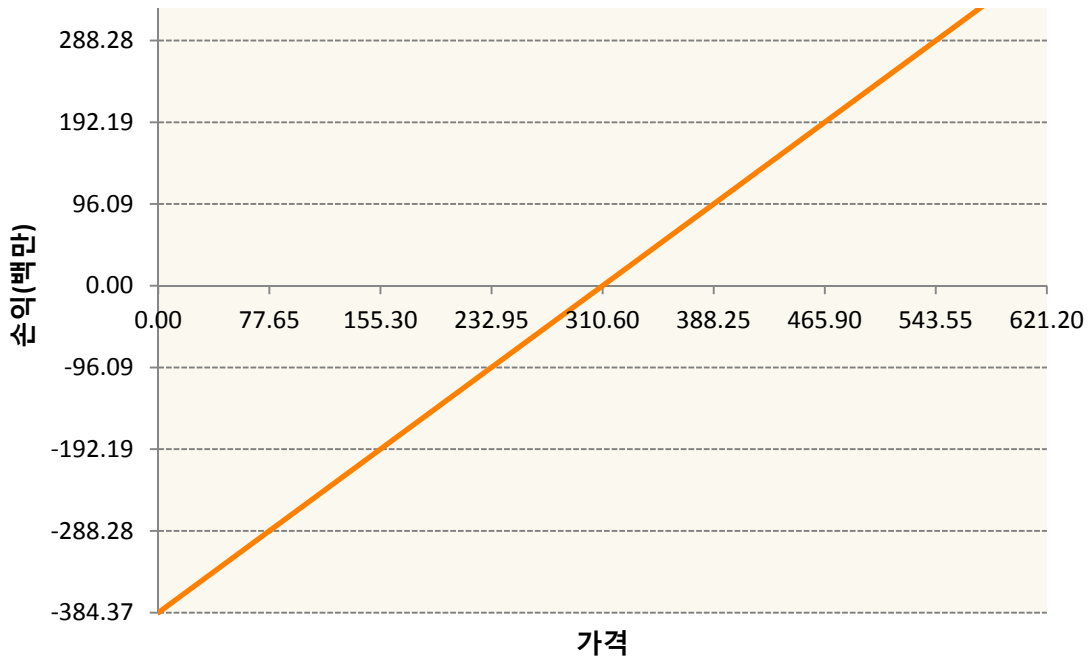


SK9-SOYBEAN FUTURE May19

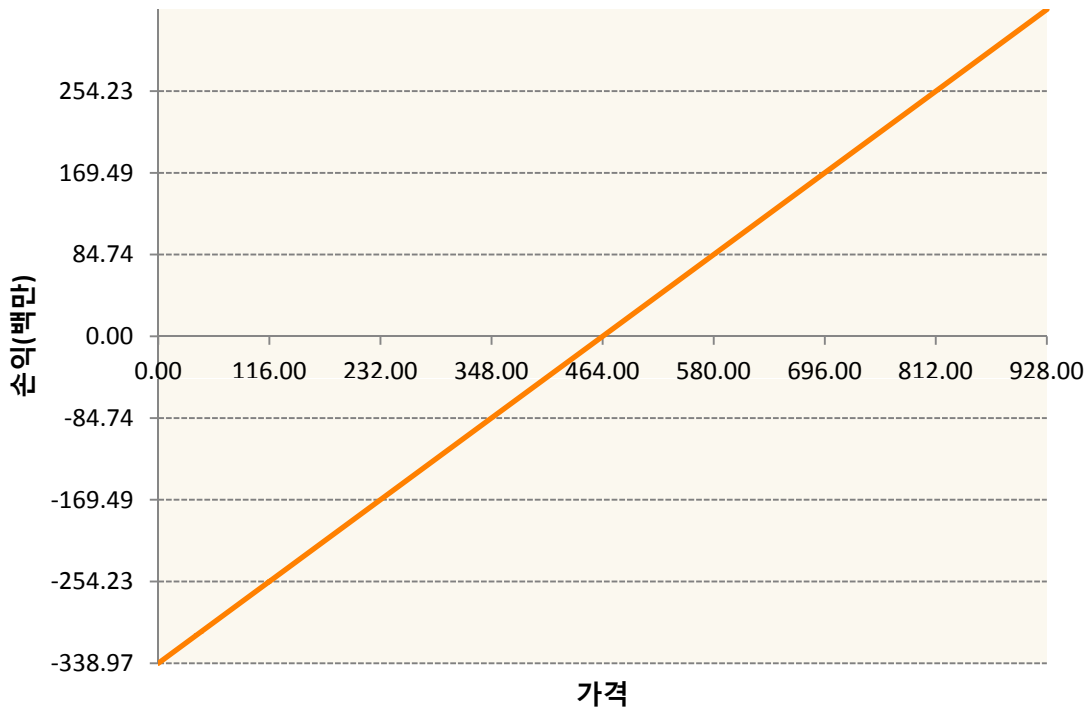


SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





WK9-WHEAT FUTURE(CBT) May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK9	SOYBEAN OIL FUTR May19	30
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	57
SMK9	SOYBEAN MEAL FUTR May19	31
WK9	WHEAT FUTURE(CBT) May19	27

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

(단위:백만원)

**269**