

공시일	2019-04-08
기준일	2019-04-05

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	2019-04-08
기준일	2019-04-05

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

1,147

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

674

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-04-08
기준일	2019-04-05

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)	367
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	101
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	172

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,003

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-04-08
기준일	2019-04-05

유로인덱스모(주식-파생형)

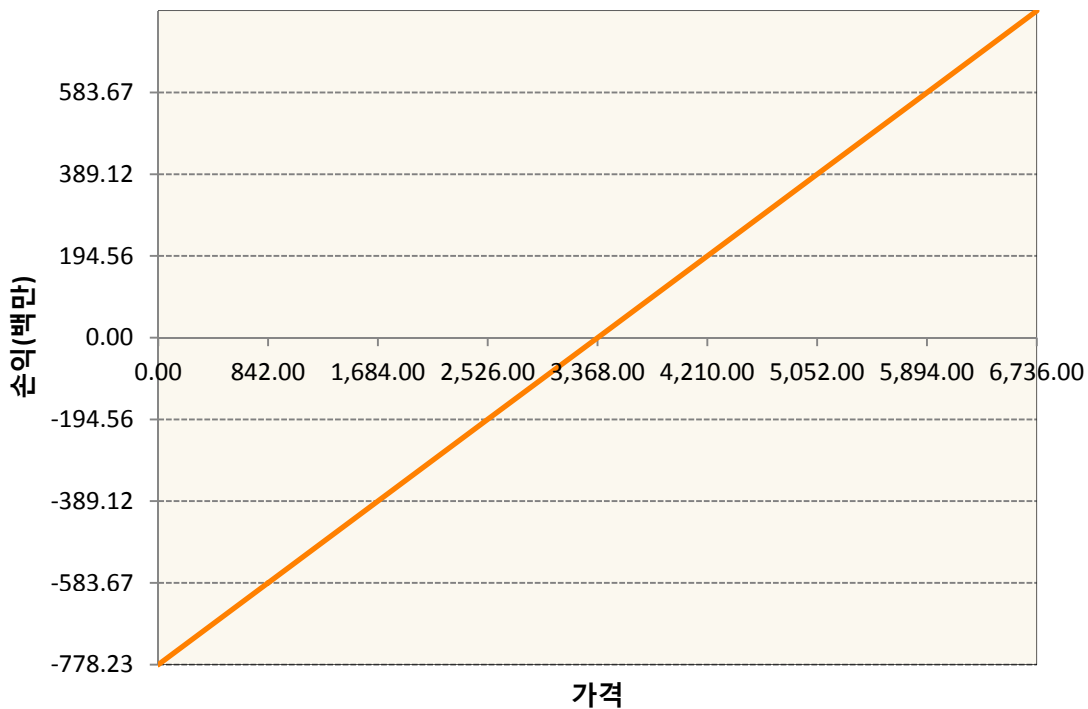
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	778	0	778	

2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	62
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

44

공시일	2019-04-08
기준일	2019-04-05

차이나인덱스모(주식-파생형)

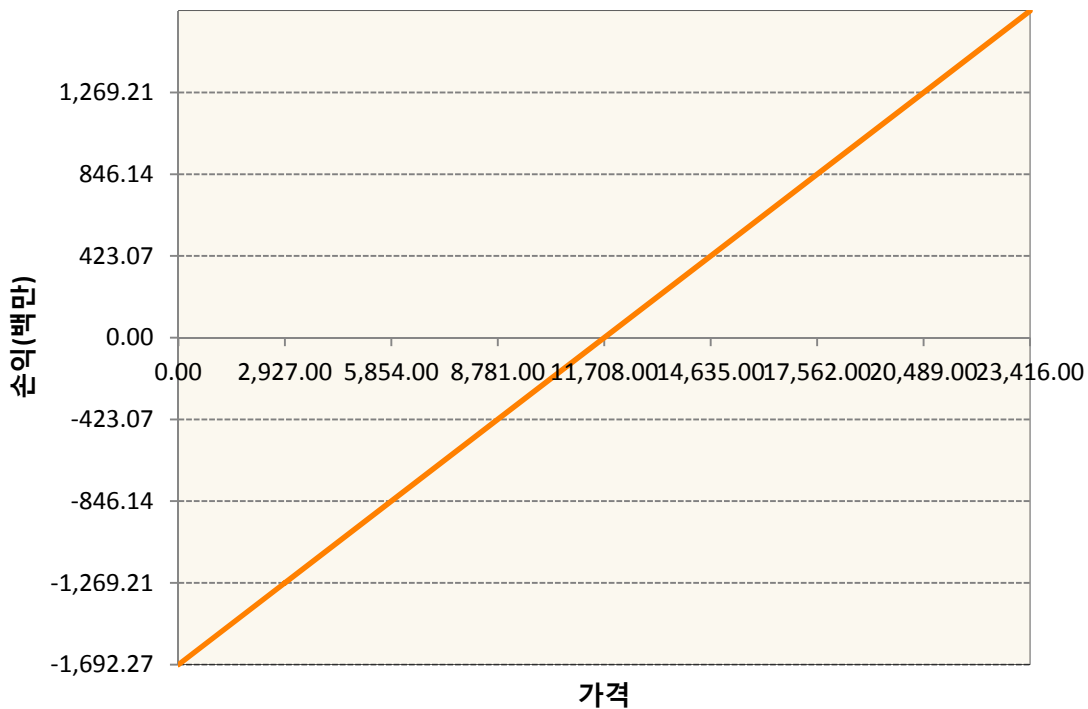
1. 계약금액

(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	2019-04-08
기준일	2019-04-05

커버드콜모(주식혼합-파생형)

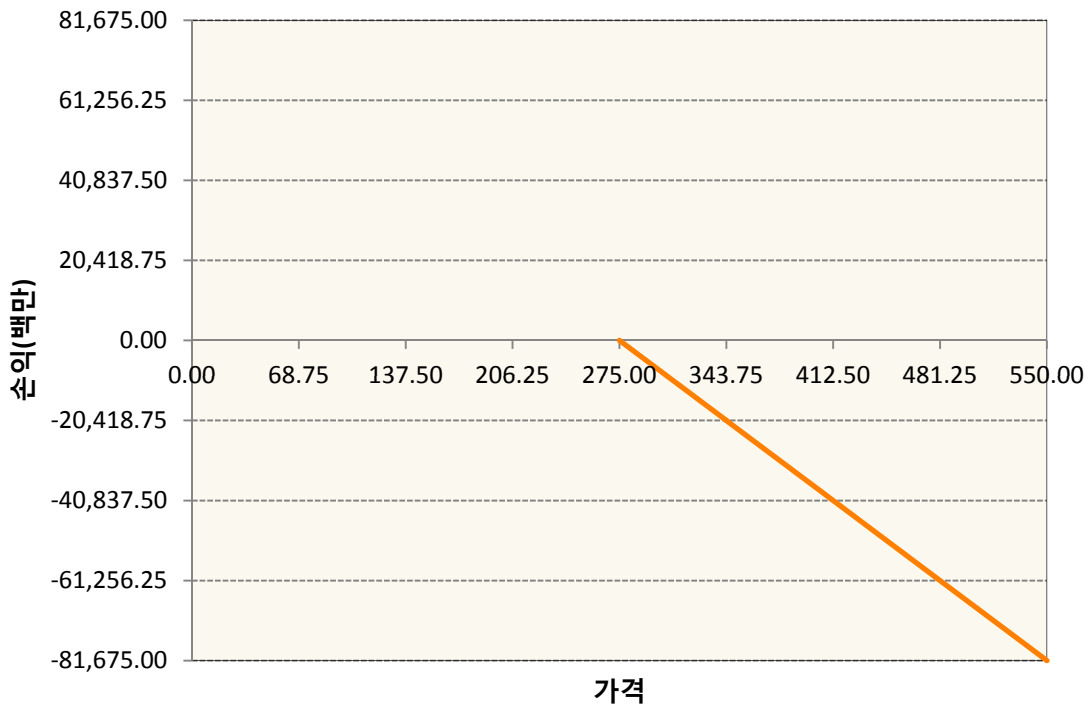
1. 계약금액

(단위:백만원)

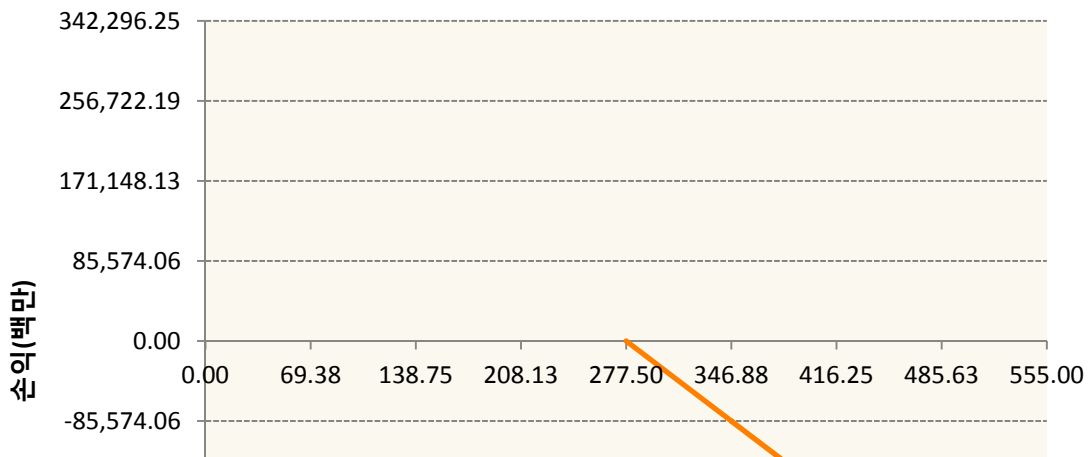
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	662,034	-662,034	장내

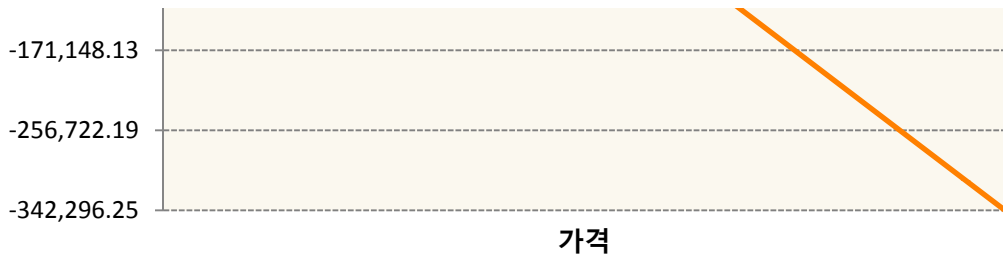
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P42752-2019-04 콜275

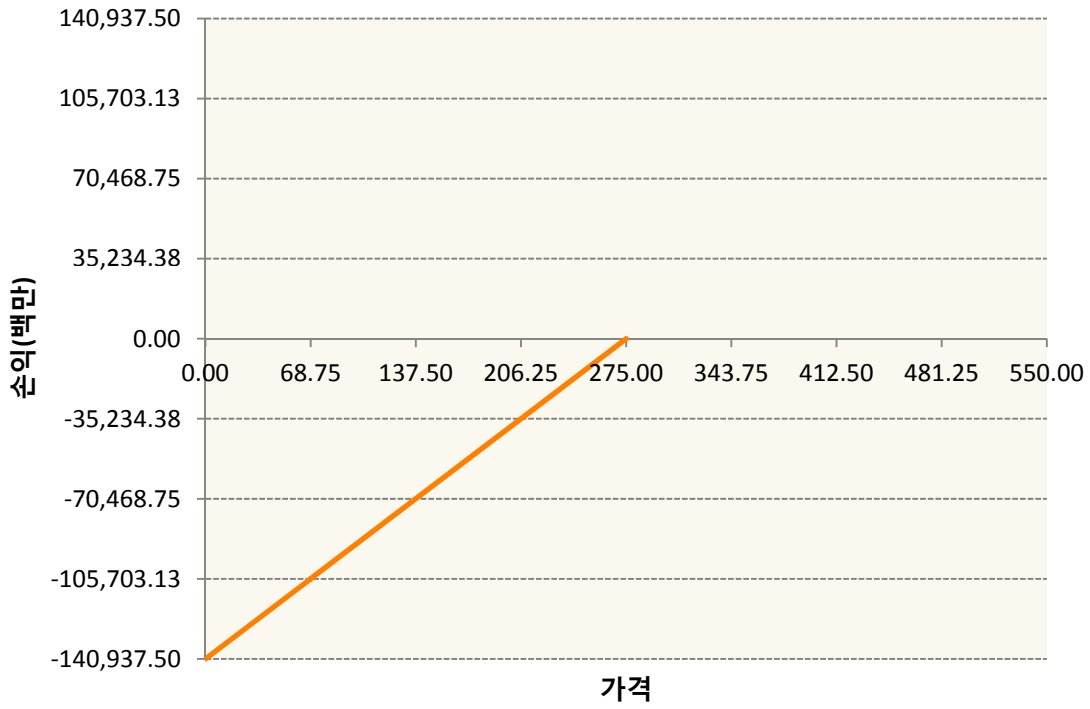


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

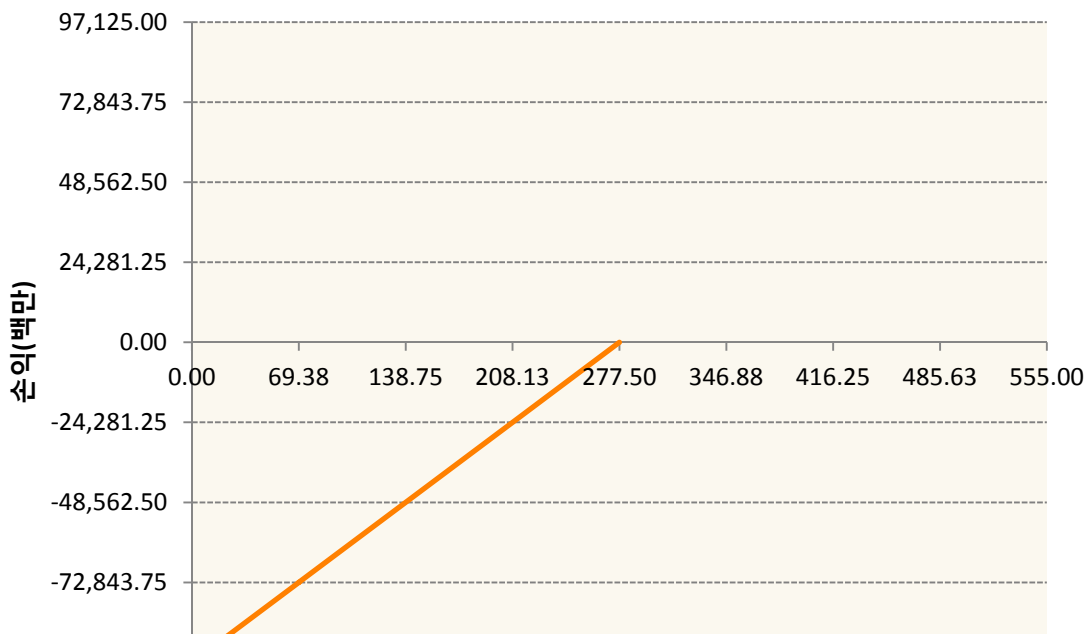




KR4301P42750-2019-04 풋275



KR4301P42776-2019-04 풋277.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P42752		2019-04 콜275						6,709
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,540	3,522	3,498	3,469	3,435	3,397	3,355	
-5.33%	3,242	3,171	3,099	3,025	2,949	2,873	2,796	
-2.67%	2,071	2,002	1,930	1,857	1,782	1,706	1,629	
0%	75	56	31	0	-36	-76	-121	
2.67%	-2,170	-2,172	-2,175	-2,181	-2,189	-2,201	-2,217	
5.33%	-4,439	-4,439	-4,439	-4,440	-4,441	-4,443	-4,446	
8.00%	-6,709	-6,709	-6,709	-6,709	-6,709	-6,709	-6,709	
KR4201P42778		2019-04 콜277.5						27,513
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	12,041	12,004	11,950	11,876	11,783	11,671	11,542	
-5.33%	11,403	11,181	10,940	10,684	10,417	10,140	9,855	
-2.67%	7,924	7,585	7,245	6,904	6,562	6,219	5,876	
0%	498	356	189	0	-208	-432	-671	
2.67%	-8,664	-8,683	-8,714	-8,761	-8,825	-8,906	-9,006	
5.33%	-18,079	-18,079	-18,082	-18,087	-18,098	-18,115	-18,141	
8.00%	-27,505	-27,505	-27,505	-27,505	-27,506	-27,509	-27,513	
KR4301P42750		2019-04 풋275						5,795
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-5,768	-5,769	-5,771	-5,773	-5,778	-5,785	-5,795	
-5.33%	-1,988	-2,036	-2,089	-2,145	-2,205	-2,267	-2,331	
-2.67%	-108	-153	-202	-256	-313	-373	-435	
0%	5	5	3	0	-5	-13	-23	
2.67%	6	6	6	6	6	5	5	
5.33%	6	6	6	6	6	6	6	
8.00%	6	6	6	6	6	6	6	
KR4301P42776		2019-04 풋277.5						4,806
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-4,800	-4,800	-4,800	-4,801	-4,802	-4,803	-4,806	
-5.33%	-2,145	-2,158	-2,176	-2,197	-2,221	-2,248	-2,278	
-2.67%	-255	-306	-357	-409	-461	-514	-567	
0%	16	13	8	0	-10	-23	-39	
2.67%	18	18	18	18	17	17	16	

5.33%	18	18	18	18	18	18	18
8.00%	18	18	18	18	18	18	18

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

(단위:백만원)

43,558

공시일	2019-04-08
기준일	2019-04-05

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

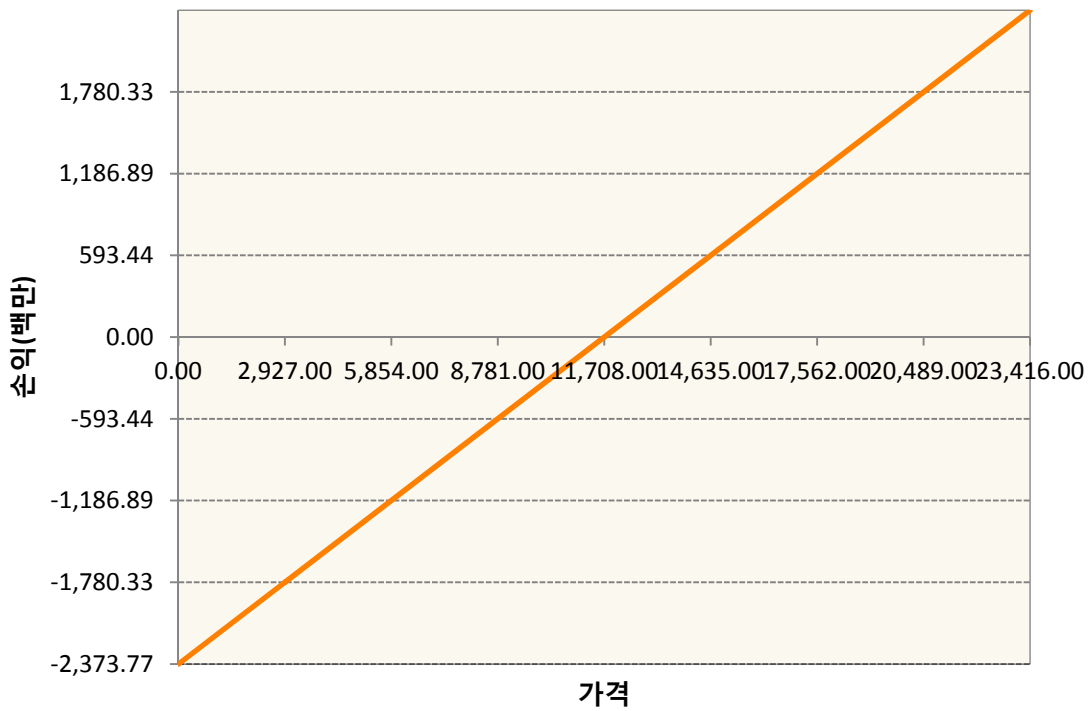
1. 계약금액

(단위:백만원)

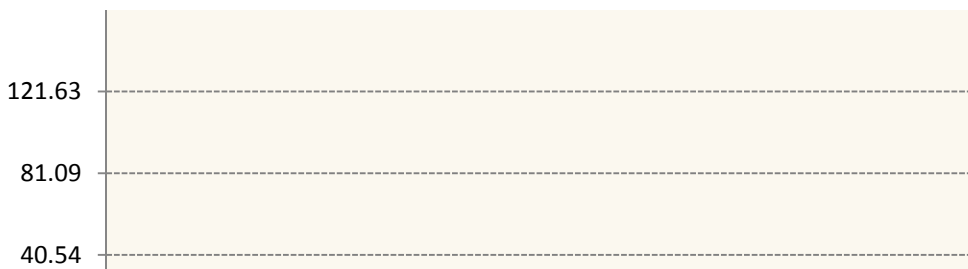
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,374	0	2,374	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,888	-5,888	장내
누계	통화	선도	0	3,041	-3,041	장외

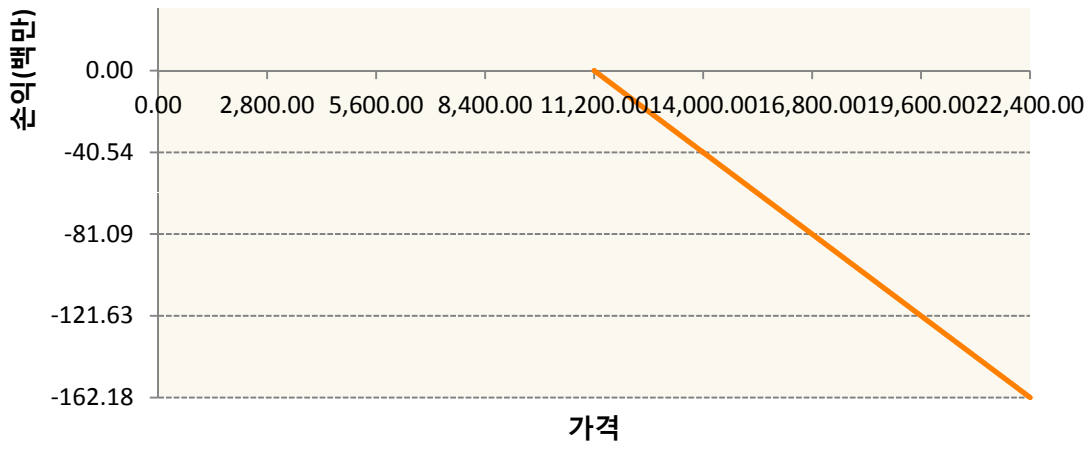
2. 만기시점의 손익구조

HCJ9-HSCEI Futures Apr19

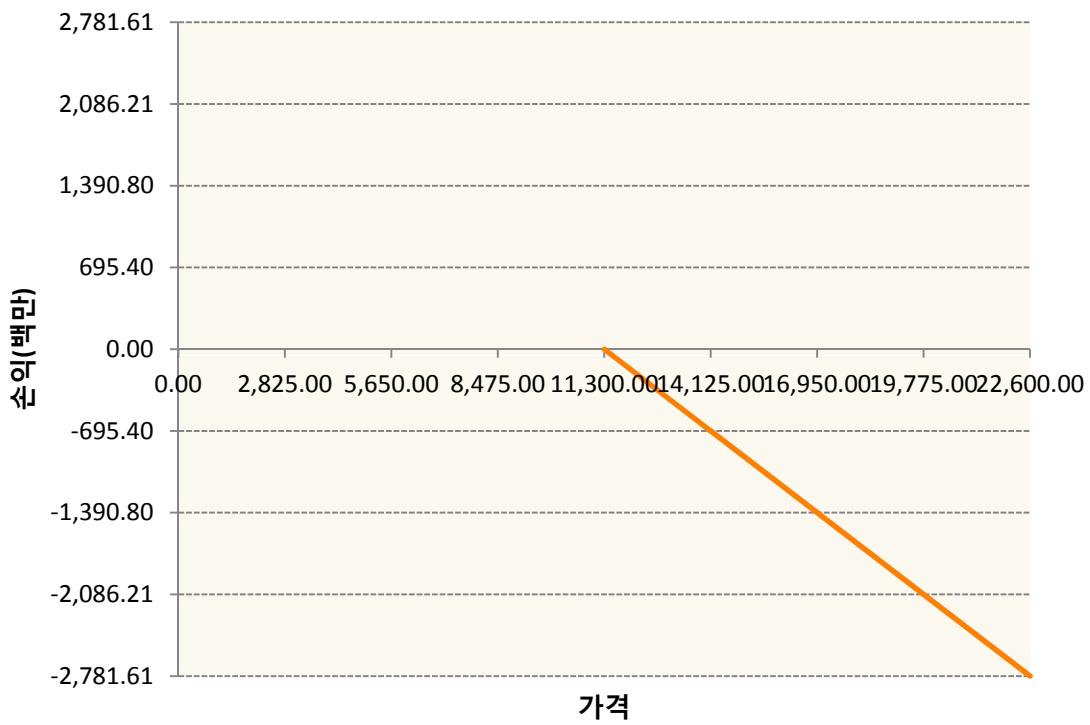


OHHIJ9-C112-HSCEI

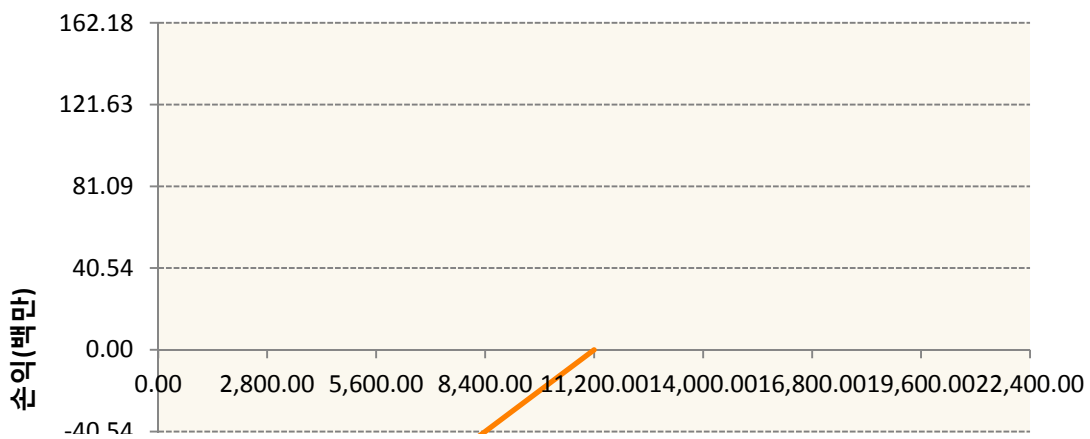


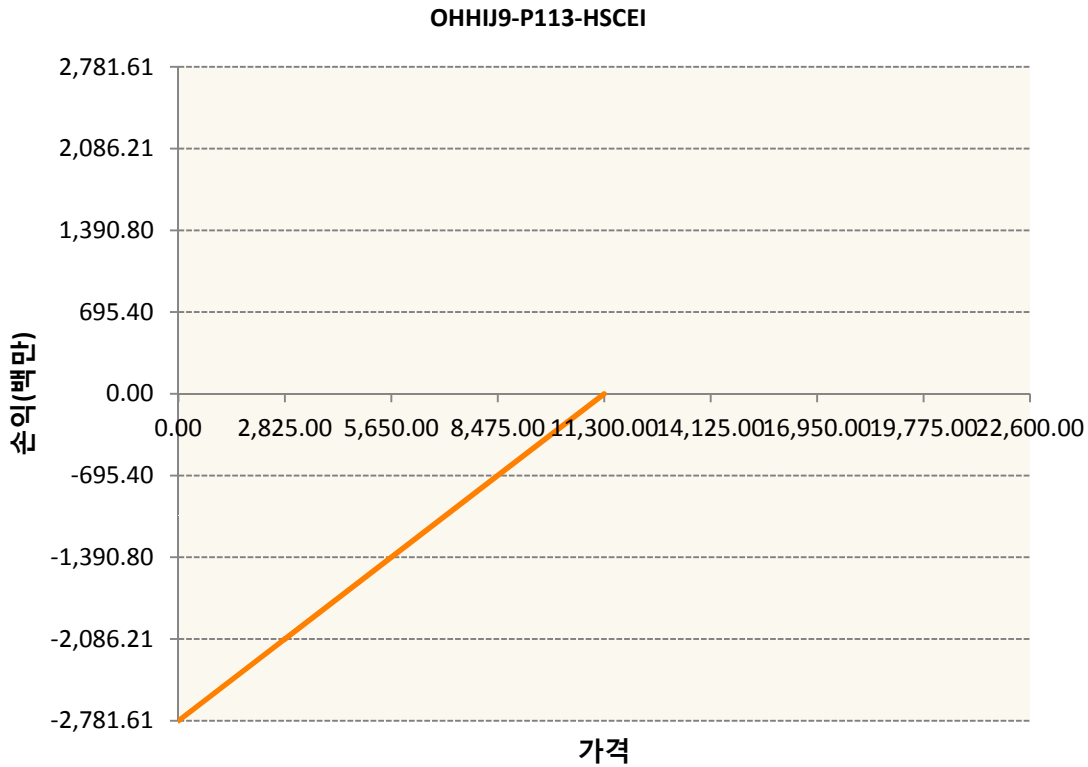


OHHIJ9-C113-HSCEI



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	190
OHHIJ9-C11 HSCEI	13
OHHIJ9-C11 HSCEI	223
OHHIJ9-P11: HSCEI	13
OHHIJ9-P11: HSCEI	223

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	760

공시일	2019-04-08
기준일	2019-04-05

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

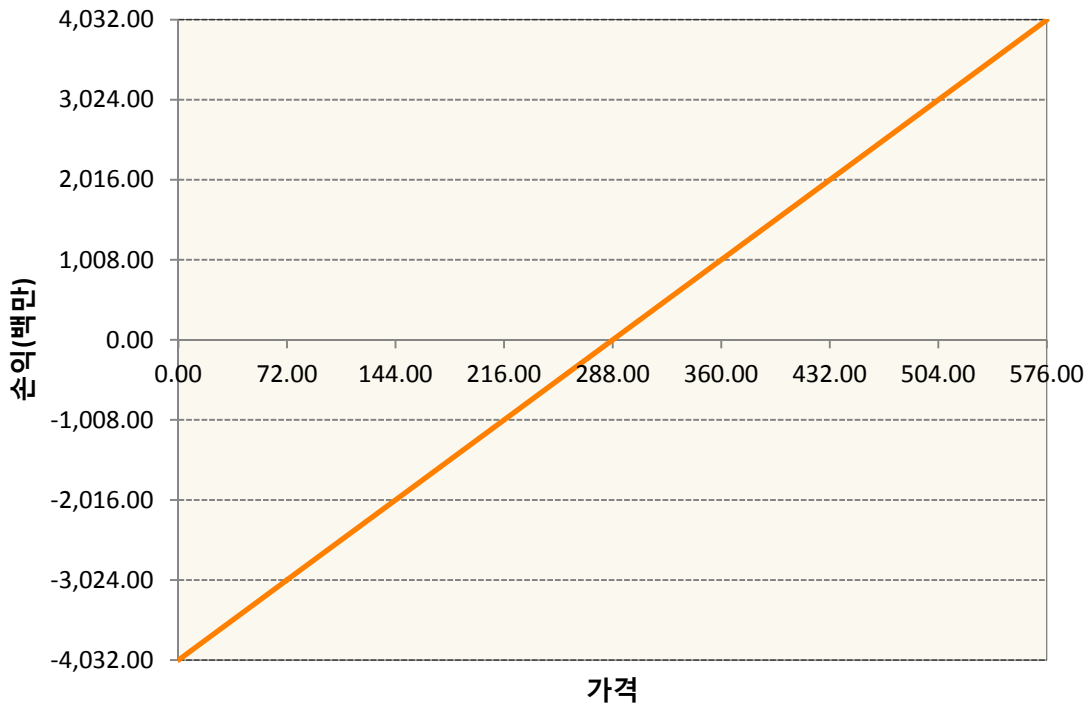
1. 계약금액

(단위:백만원)

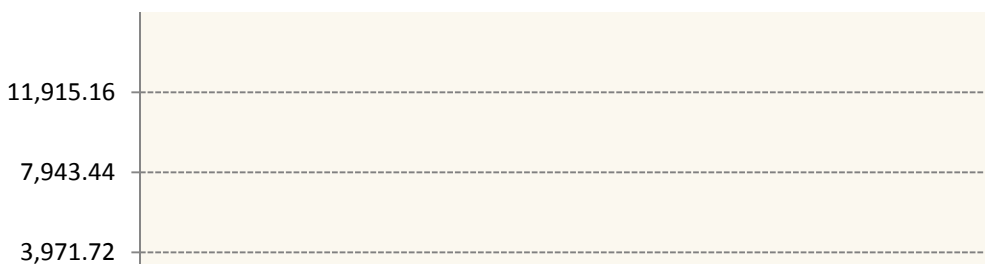
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,032	0	4,032	장내
누계	유가증권	스왑	35,836	0	35,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	33,678	-33,678	장내

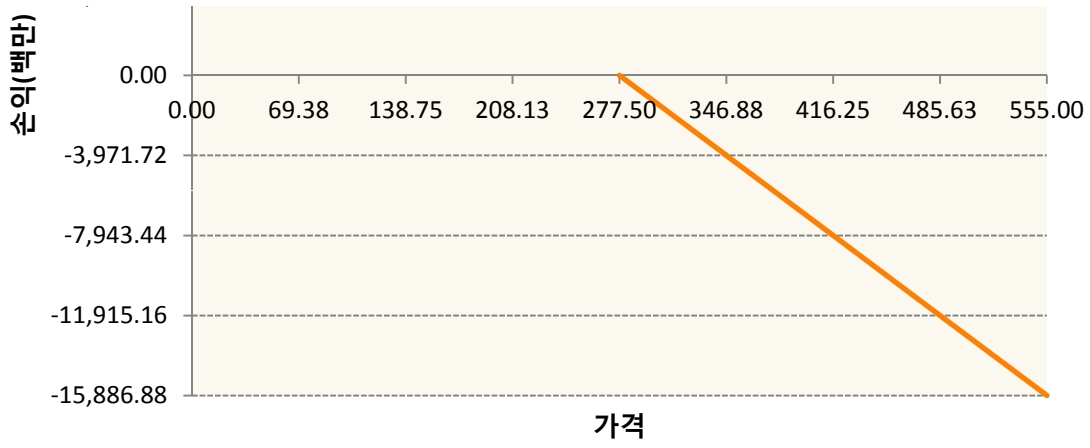
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

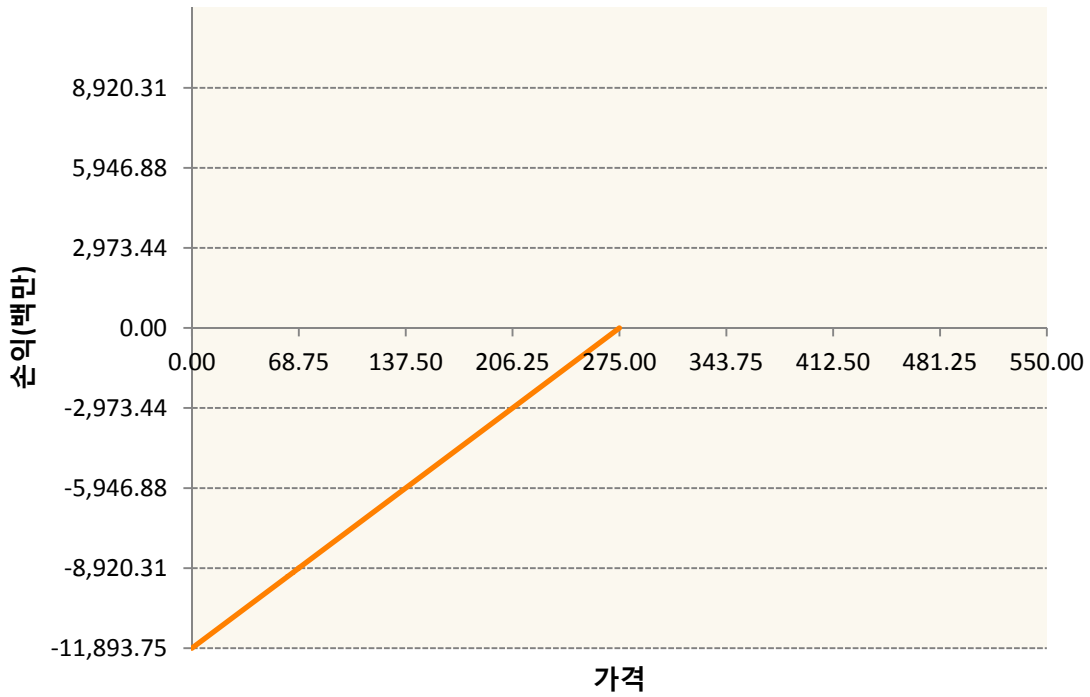


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

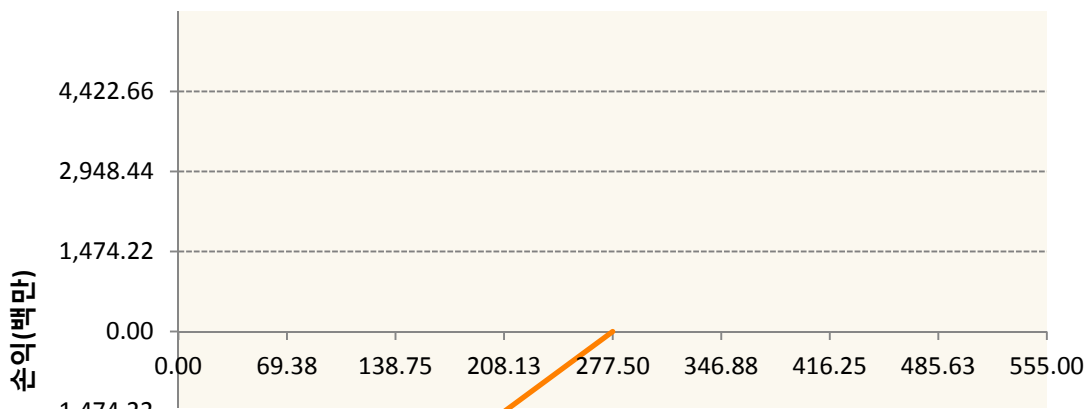


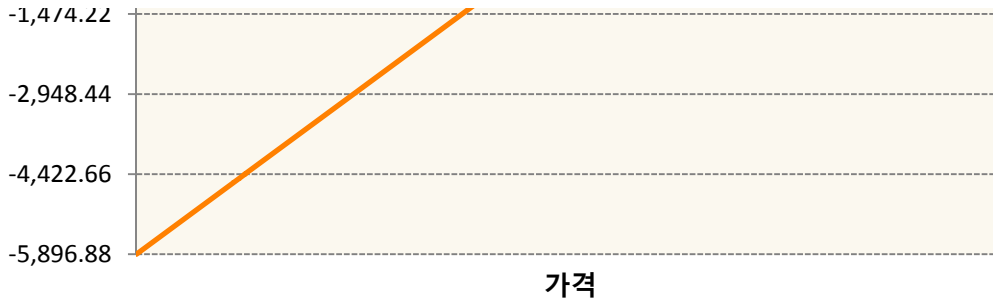


KR4301P42750-2019-04 풋275



KR4301P42776-2019-04 풋277.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,446
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,446	-2,446	-2,446	-2,446	-2,446	-2,446	-2,446	
-5.33%	-1,631	-1,631	-1,631	-1,631	-1,631	-1,631	-1,631	
-2.67%	-815	-815	-815	-815	-815	-815	-815	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	815	815	815	815	815	815	815	
5.33%	1,631	1,631	1,631	1,631	1,631	1,631	1,631	
8.00%	2,446	2,446	2,446	2,446	2,446	2,446	2,446	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						594
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-594	-594	-594	-594	-594	-594	-594	
-5.33%	-396	-396	-396	-396	-396	-396	-396	
-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%	396	396	396	396	396	396	396	
8.00%	594	594	594	594	594	594	594	
KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						321
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-321	-321	-321	-321	-321	-321	-321	
-5.33%	-214	-214	-214	-214	-214	-214	-214	
-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%	214	214	214	214	214	214	214	
8.00%	321	321	321	321	321	321	321	
KR4201P42778		2019-04 콜277.5						1,277
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	559	557	555	551	547	542	536
-5.33%	529	519	508	496	483	471	457
-2.67%	368	352	336	320	305	289	273
0%	23	17	9	0	-10	-20	-31
2.67%	-402	-403	-404	-407	-410	-413	-418
5.33%	-839	-839	-839	-839	-840	-841	-842
8.00%	-1,277	-1,277	-1,277	-1,277	-1,277	-1,277	-1,277
KR4301P42750 2019-04 풋275							489
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-487	-487	-487	-487	-488	-488	-489
-5.33%	-168	-172	-176	-181	-186	-191	-197
-2.67%	-9	-13	-17	-22	-26	-31	-37
0%	0	0	0	0	0	-1	-2
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							292
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-291	-291	-291	-291	-292	-292	-292
-5.33%	-130	-131	-132	-133	-135	-137	-138
-2.67%	-15	-19	-22	-25	-28	-31	-34
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
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)

5,084

공시일	2019-04-08
기준일	2019-04-05

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

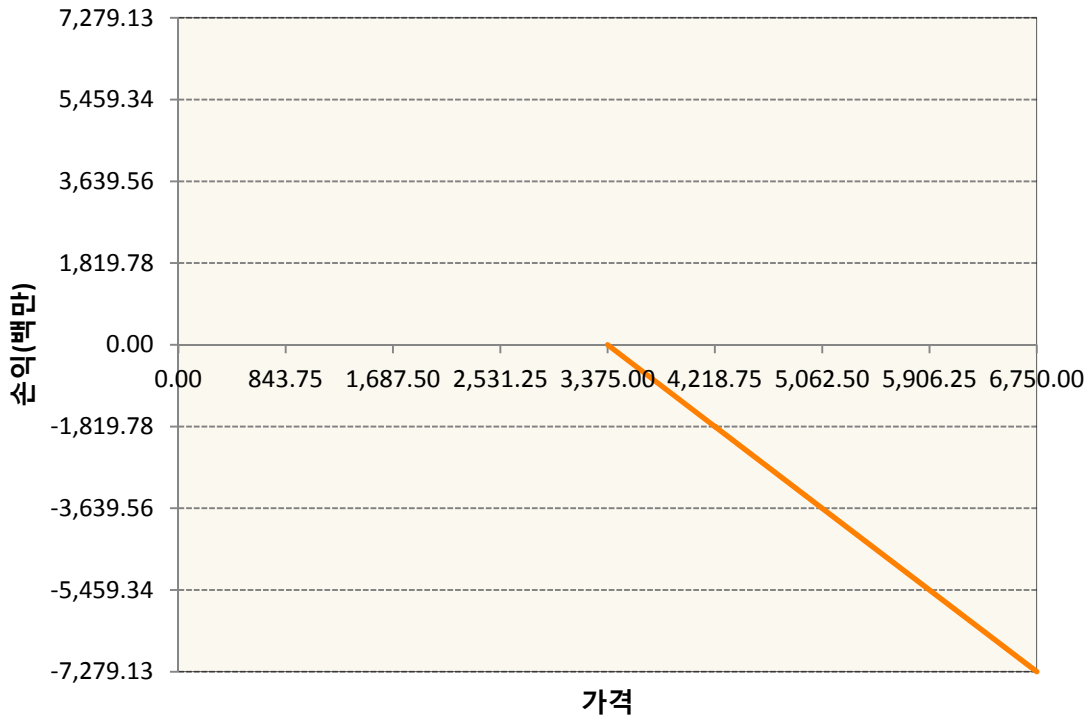
1. 계약금액

(단위:백만원)

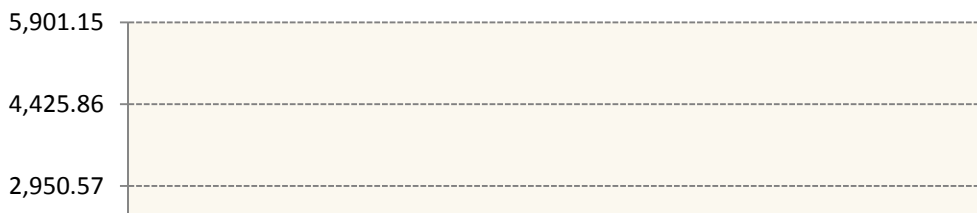
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,486	0	6,486	
누계	유가증권	스왑	60,252	0	60,252	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,361	-26,361	장내
누계	통화	선도	0	15,315	-15,315	장외

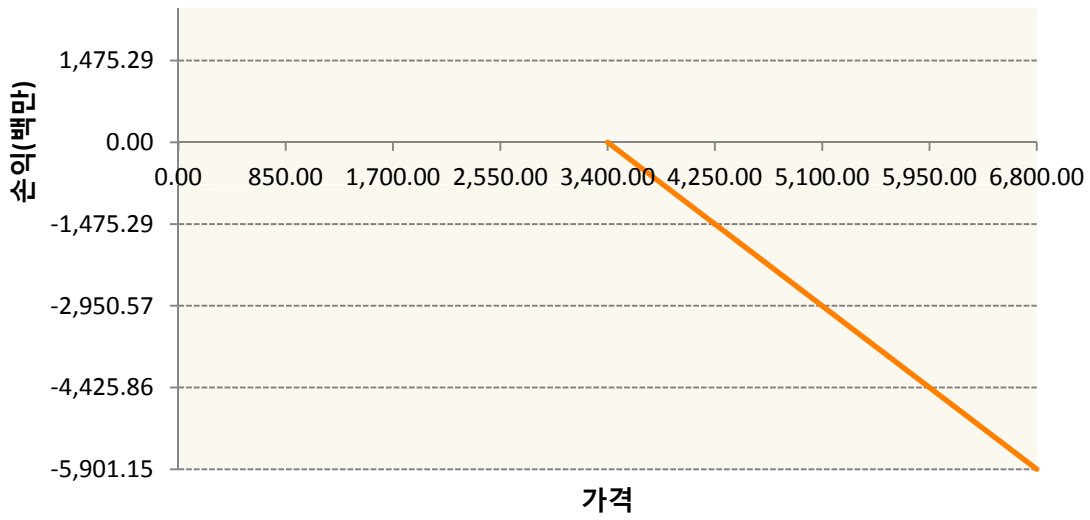
2. 만기시점의 손익구조

OESXJ9-C3375-EURO STOXX 50

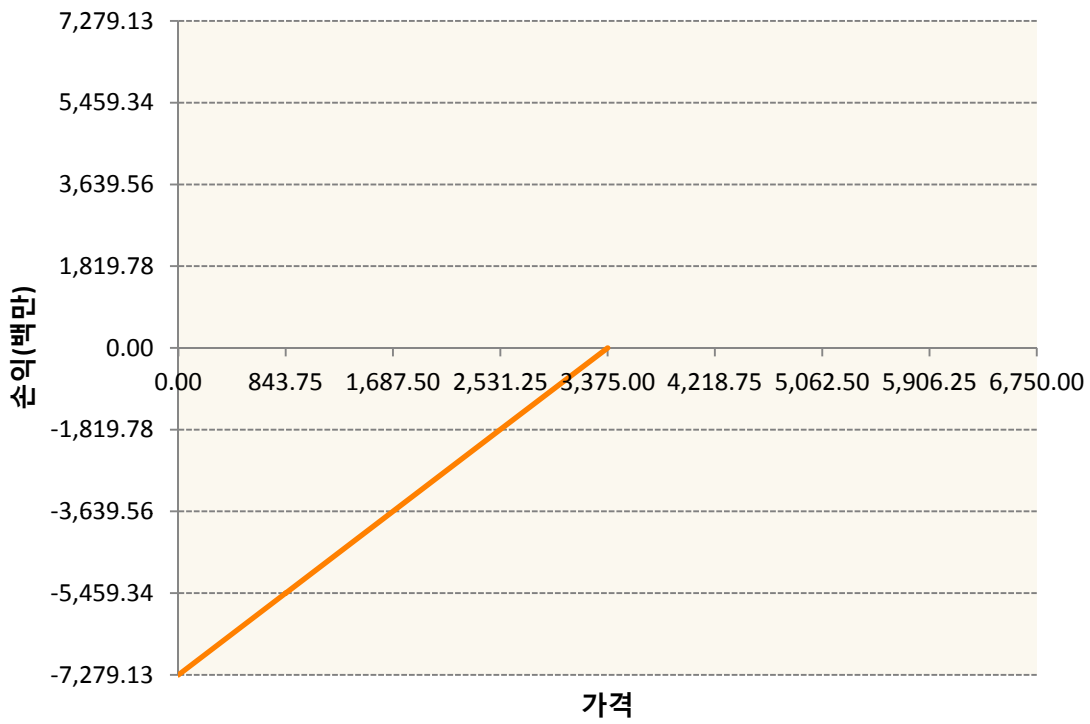


OESXJ9-C3400-EURO STOXX 50

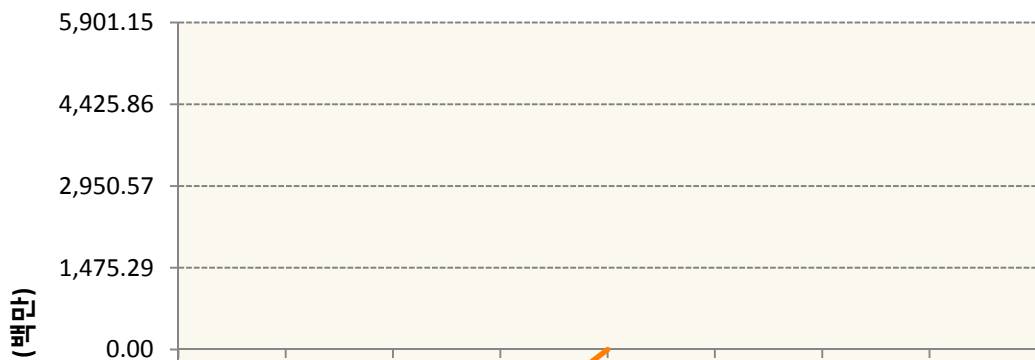


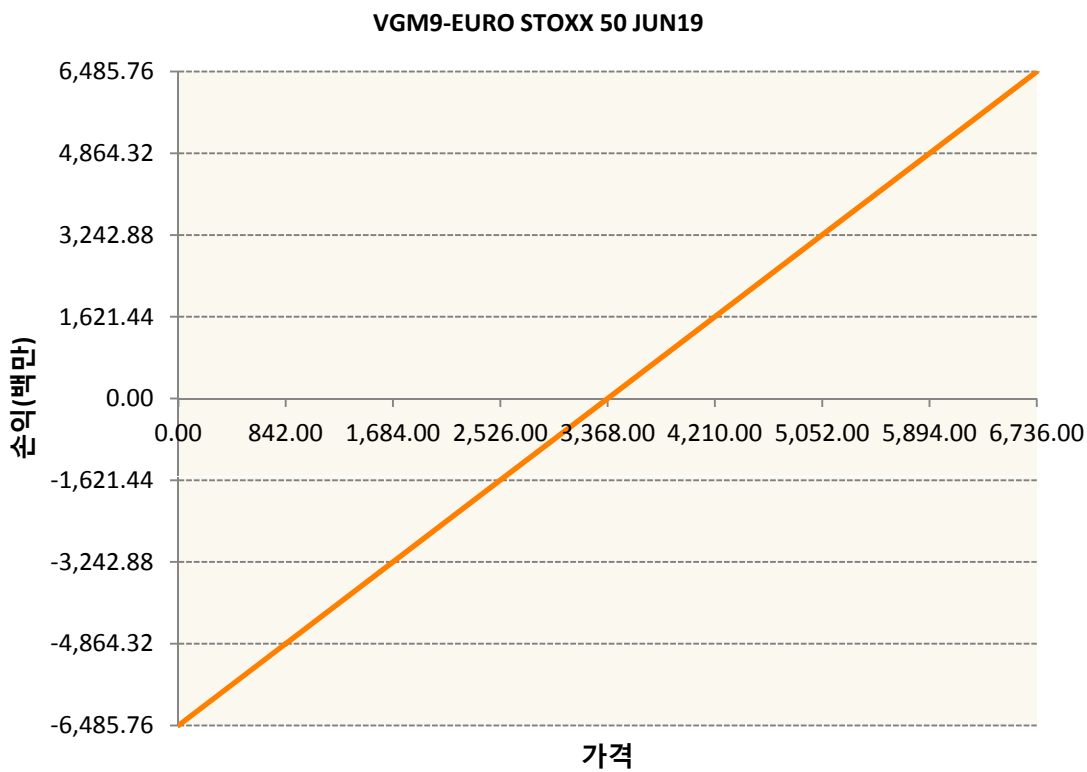
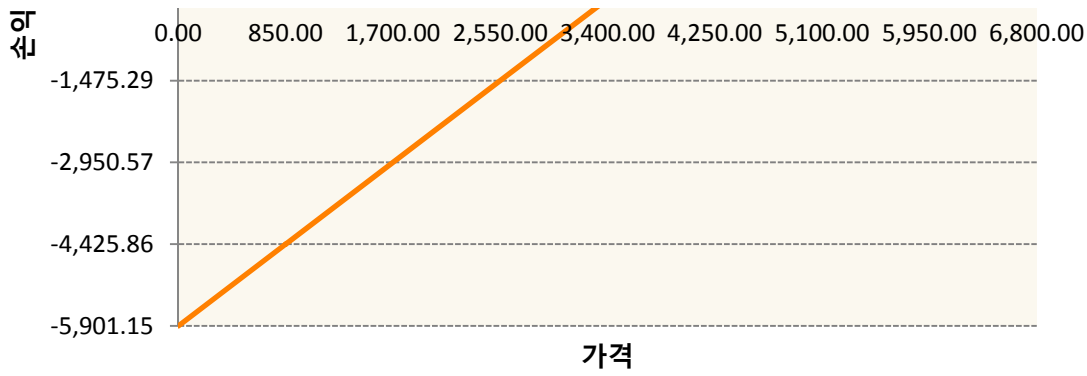


OESXJ9-P3375-EURO STOXX 50



OESXJ9-P3400-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	189
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	408
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	817
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	519

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

(단위:백만원)

2,699

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

(단위:백만원)

1,108

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

(단위:백만원)

95

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

(단위:백만원)

137

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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-04-08
기준일	2019-04-05

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

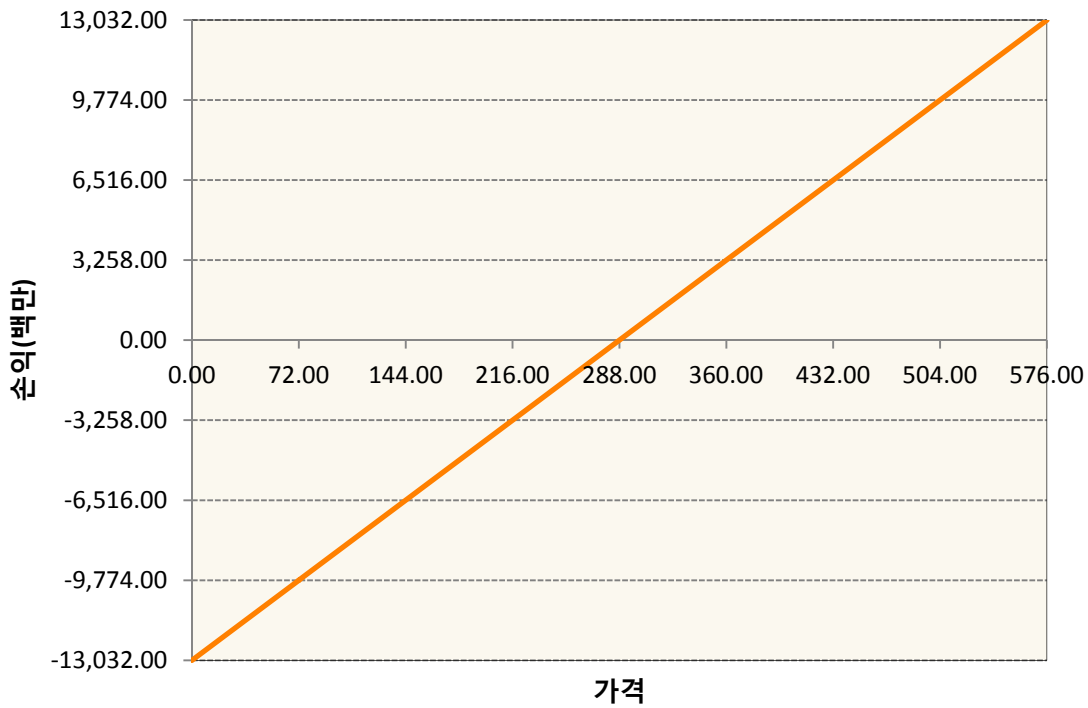
1. 계약금액

(단위:백만원)

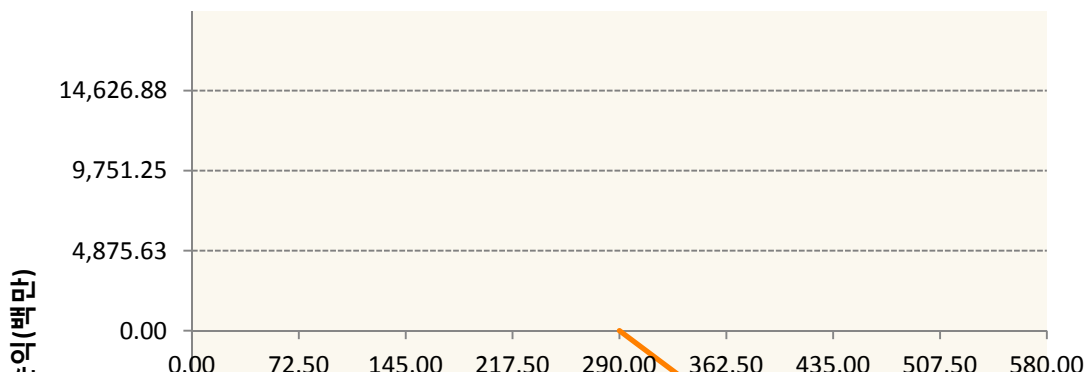
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,032	0	13,032	장내
누계	유가증권	옵션	1,867	24,036	-22,169	장내

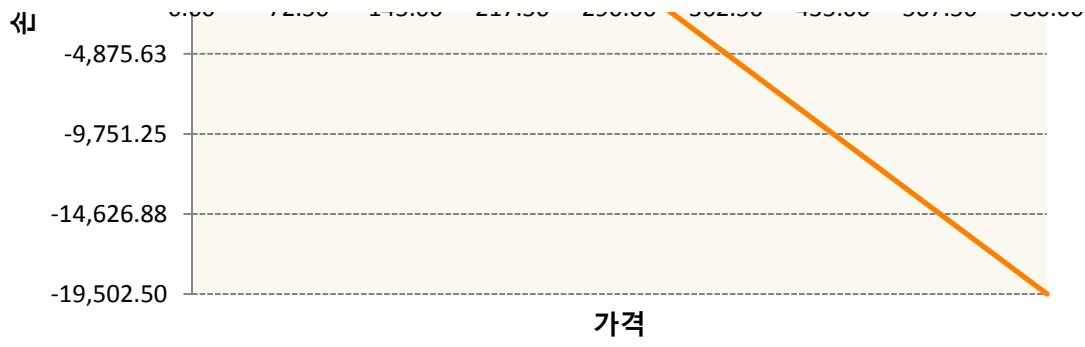
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

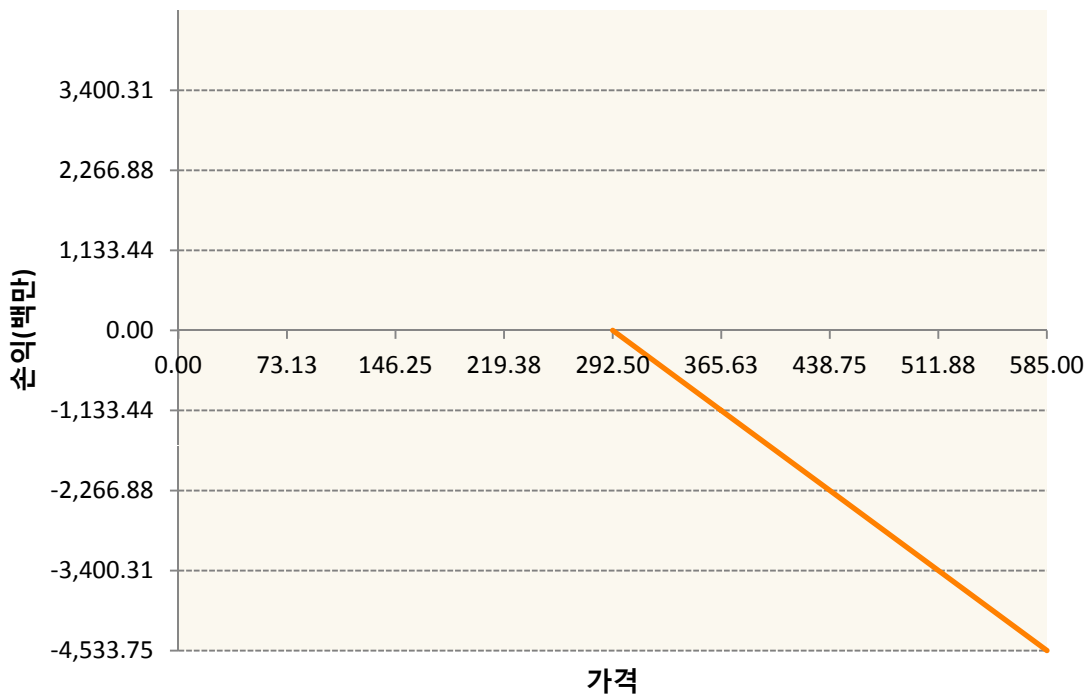


KR4201P42901-2019-04 콜290

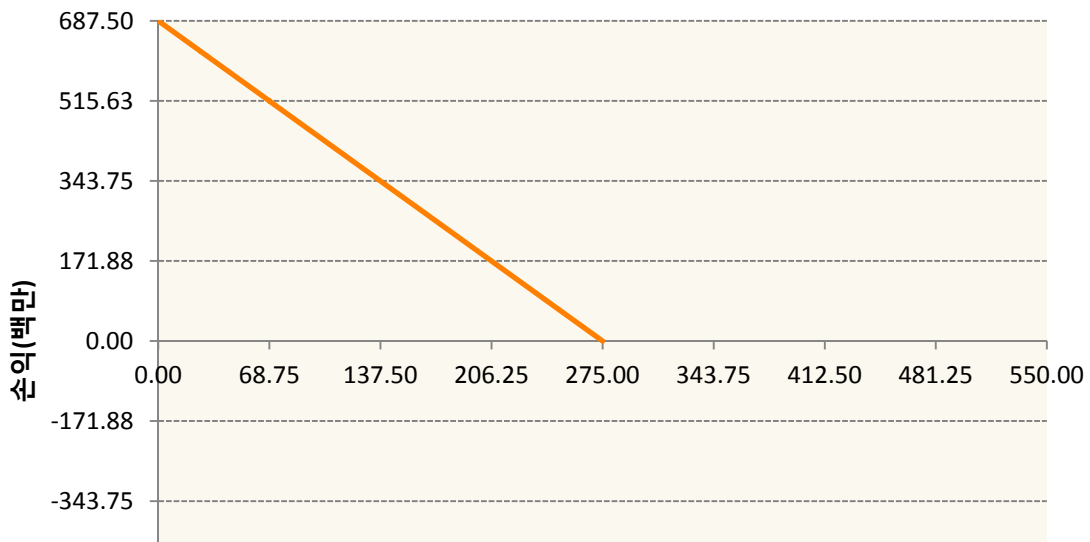


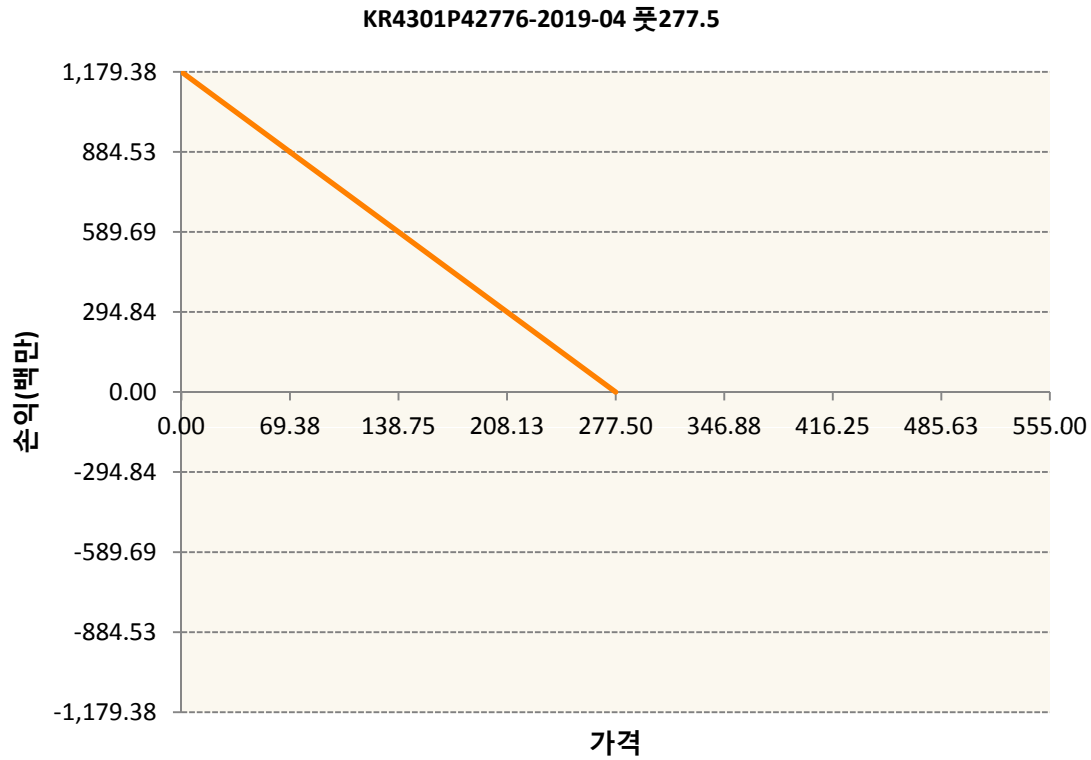
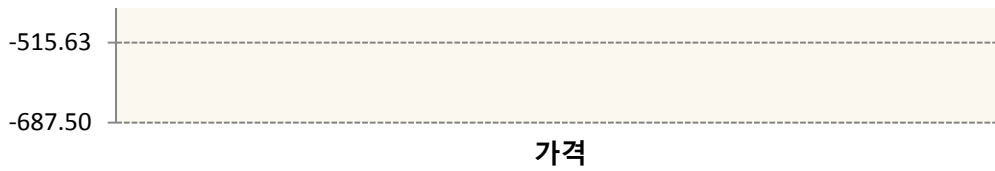


KR4201P42927-2019-04 콜292.5



KR4301P42750-2019-04 풋275





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						1,038
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,038	-1,038	-1,038	-1,038	-1,038	-1,038	-1,038	
-5.33%	-692	-692	-692	-692	-692	-692	-692	
-2.67%	-346	-346	-346	-346	-346	-346	-346	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	346	346	346	346	346	346	346	
5.33%	692	692	692	692	692	692	692	
8.00%	1,038	1,038	1,038	1,038	1,038	1,038	1,038	
KR4201P42901		2019-04 콜290						1,191
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	140	140	140	140	140	139	139	
-5.33%	140	139	139	137	135	132	128	
-2.67%	132	127	120	112	102	92	81	

0%	53	36	18	0	-18	-37	-56
2.67%	-220	-236	-253	-271	-289	-307	-325
5.33%	-671	-675	-682	-690	-698	-709	-720
8.00%	-1,178	-1,178	-1,179	-1,181	-1,183	-1,187	-1,191
KR4201P42927 2019-04 콜292.5							249
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%	21	21	21	21	20	20	19
-2.67%	20	19	18	17	16	14	12
0%	10	7	4	0	-4	-8	-11
2.67%	-36	-41	-45	-50	-54	-59	-63
5.33%	-130	-132	-134	-136	-139	-142	-145
8.00%	-244	-245	-245	-246	-247	-248	-249
KR4301P42750 2019-04 풋275							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%	10	10	10	10	11	11	11
-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
KR4301P42776 2019-04 풋277.5							58
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	58	58	58	58	58	58	58
-5.33%	26	26	26	27	27	27	28
-2.67%	3	4	4	5	6	6	7
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)

2,400

공시일	2019-04-08
기준일	2019-04-05

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	3,510	0	3,510	

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	2019-04-08
기준일	2019-04-05

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	511	0	511	
누계	유가증권	수익증권	16,717	0	16,717	

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	2019-04-08
기준일	2019-04-05

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,250	0	1,250	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	68,192	0	68,192	
누계	통화	선도	0	70,231	-70,231	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
FX21019J002 KRW/USD 10-06-19E	100
FX21019J003 KRW/USD 10-05-19E	155

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

(단위:백만원)

1,919

공시일	2019-04-08
기준일	2019-04-05

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

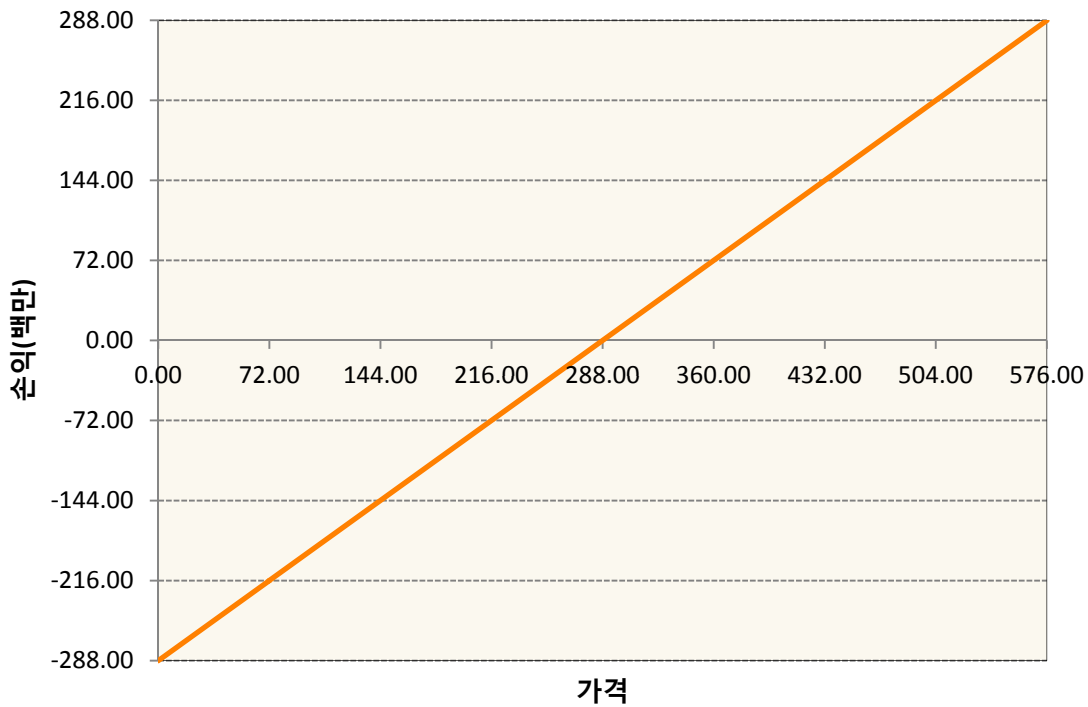
1. 계약금액

(단위:백만원)

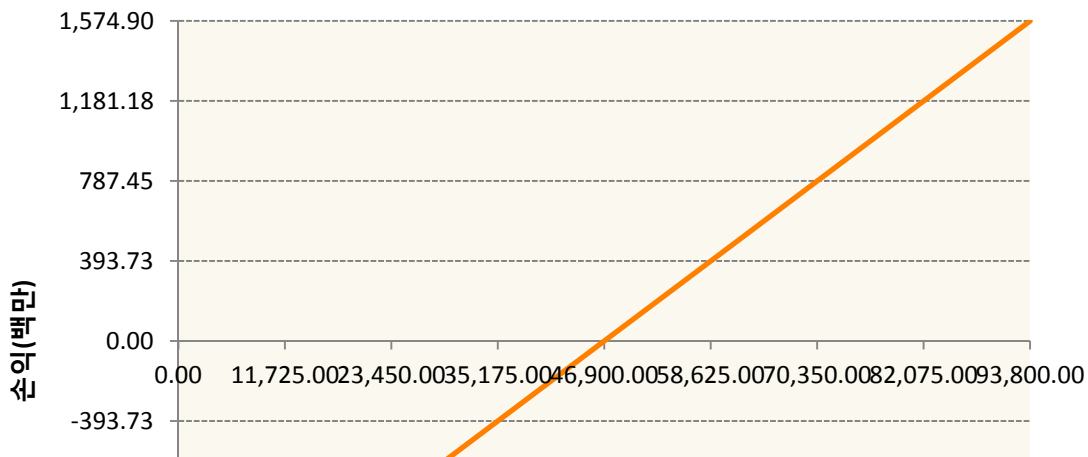
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,863	0	1,863	장내

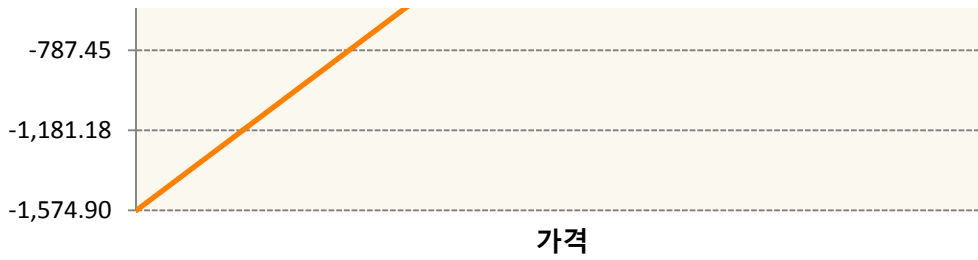
2. 만기시점의 손익구조

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						126
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126	
-5.33%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84	
-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%	84	84	84	84	84	84	84	
8.00%	126	126	126	126	126	126	126	

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

164

공시일	2019-04-08
기준일	2019-04-05

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

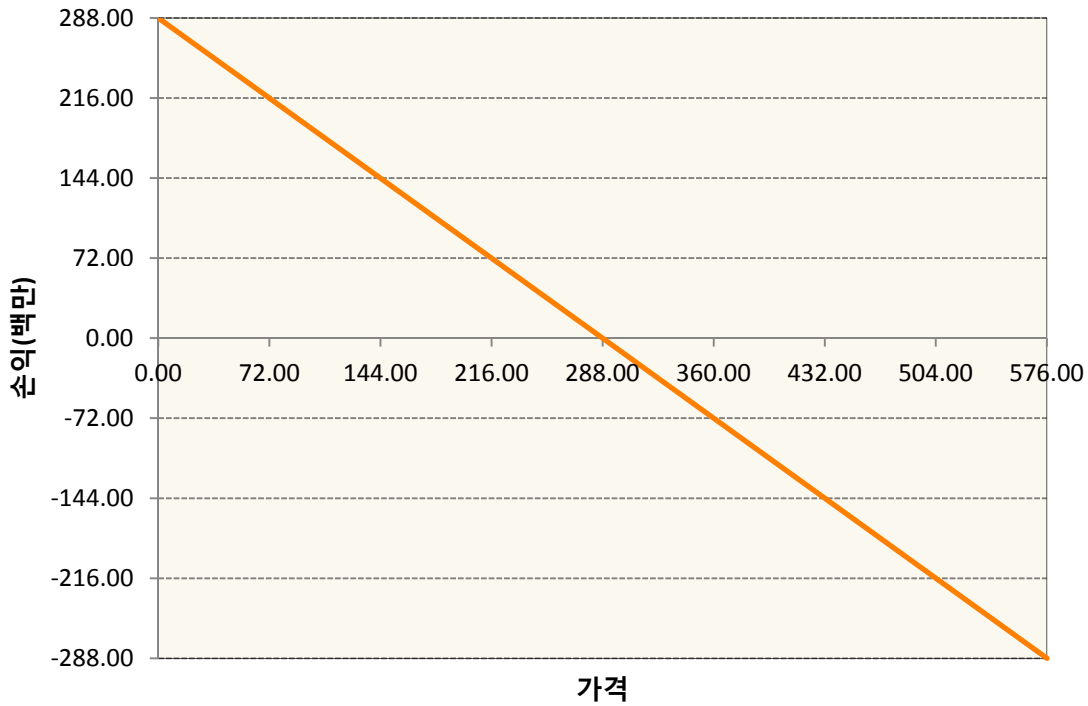
1. 계약금액

(단위:백만원)

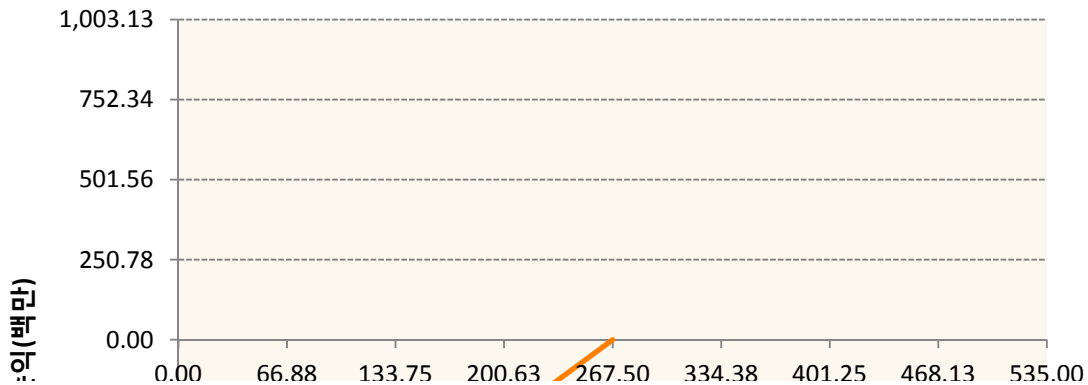
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	288	-288	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,543	-1,543	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

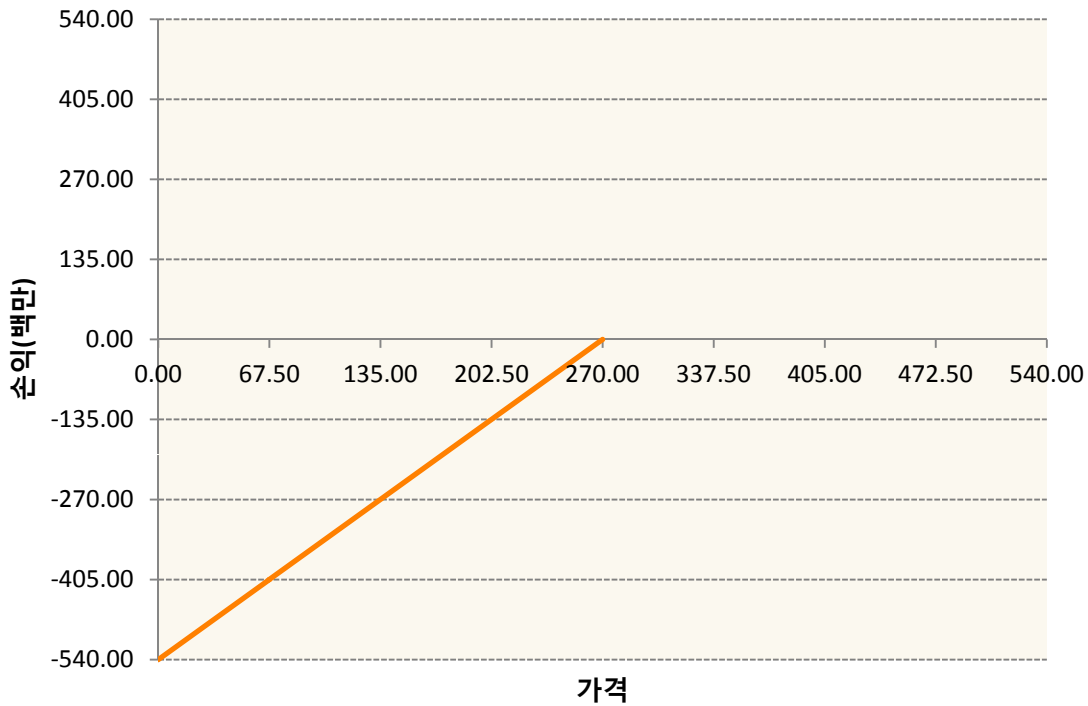


KR4301P42677-2019-04 풋267.5





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						17
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-15	-15	-16	-16	-16	-17	-17
-5.33%	-1	-1	-2	-2	-2	-3	-3
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
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

13

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
-5.33%	-2	-2	-2	-2	-3	-3	-3
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
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)

20

공시일	2019-04-08
기준일	2019-04-05

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

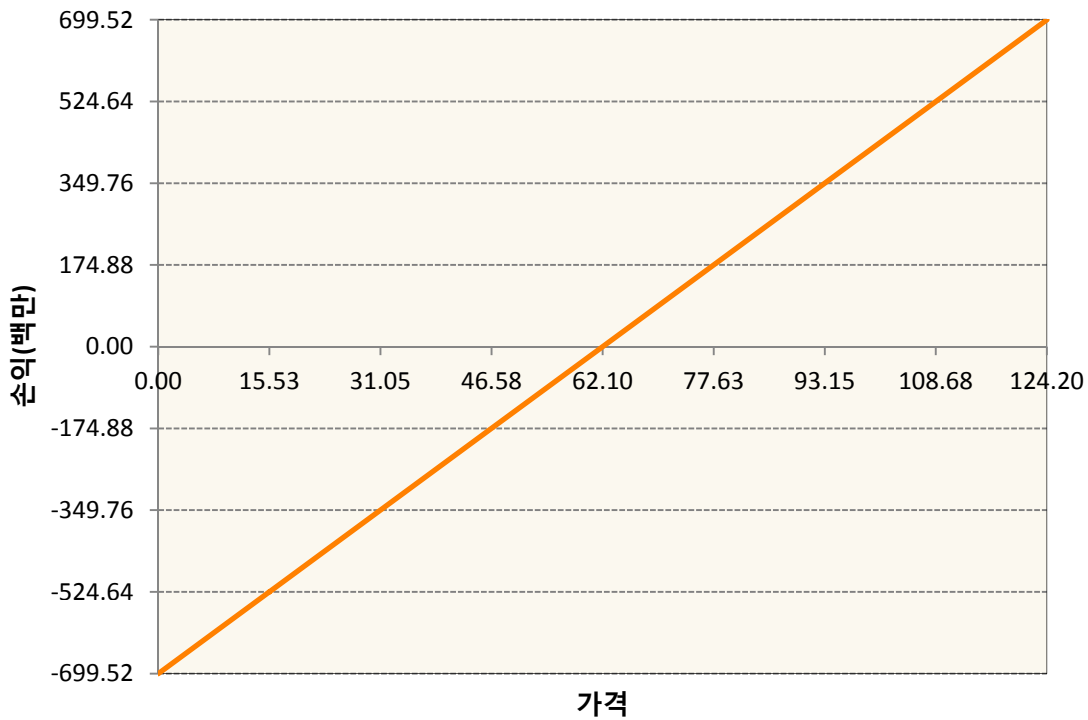
1. 계약금액

(단위:백만원)

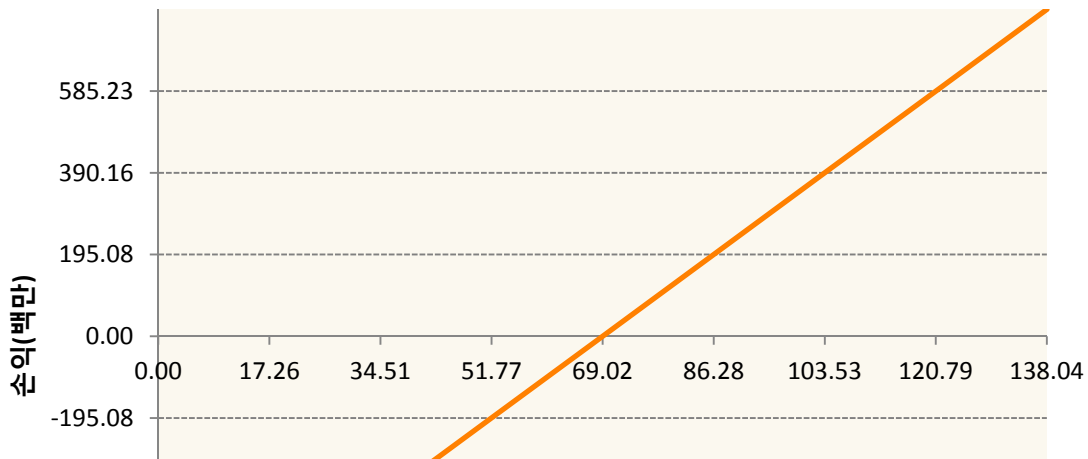
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,908	284	2,623	

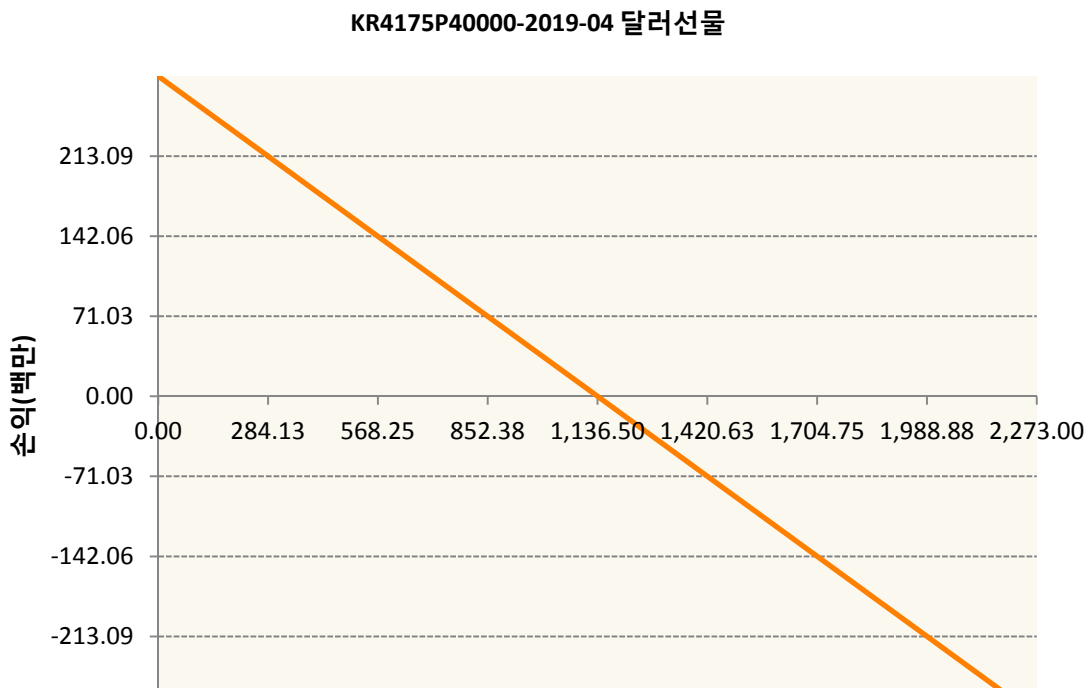
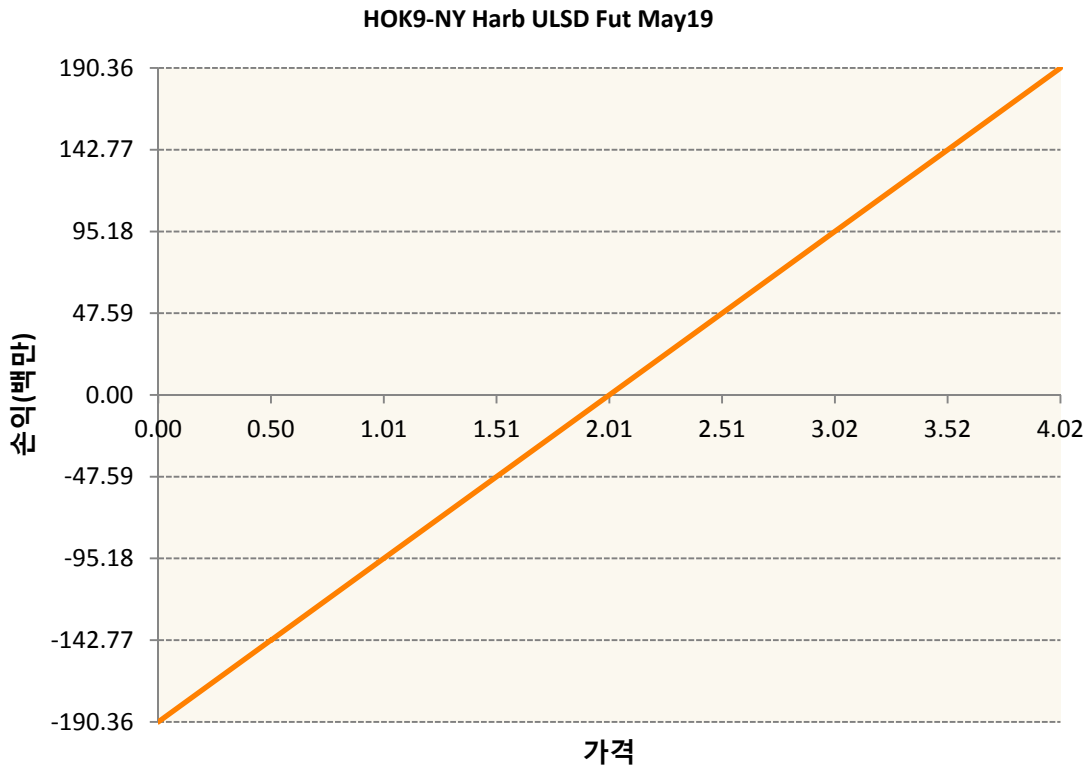
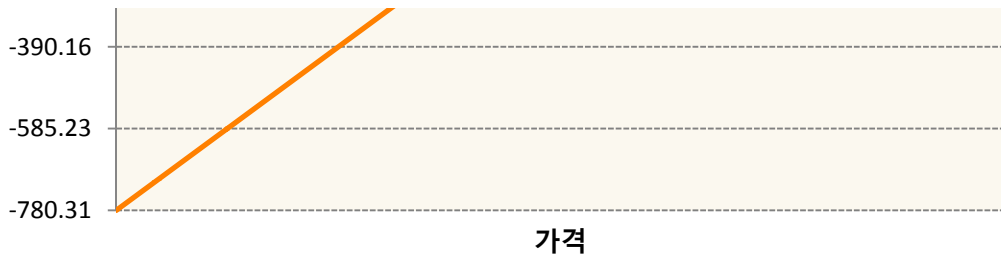
2. 만기시점의 손익구조

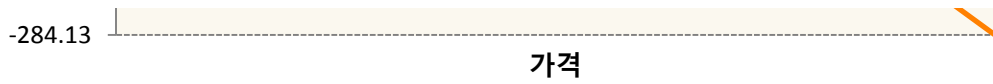
CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19



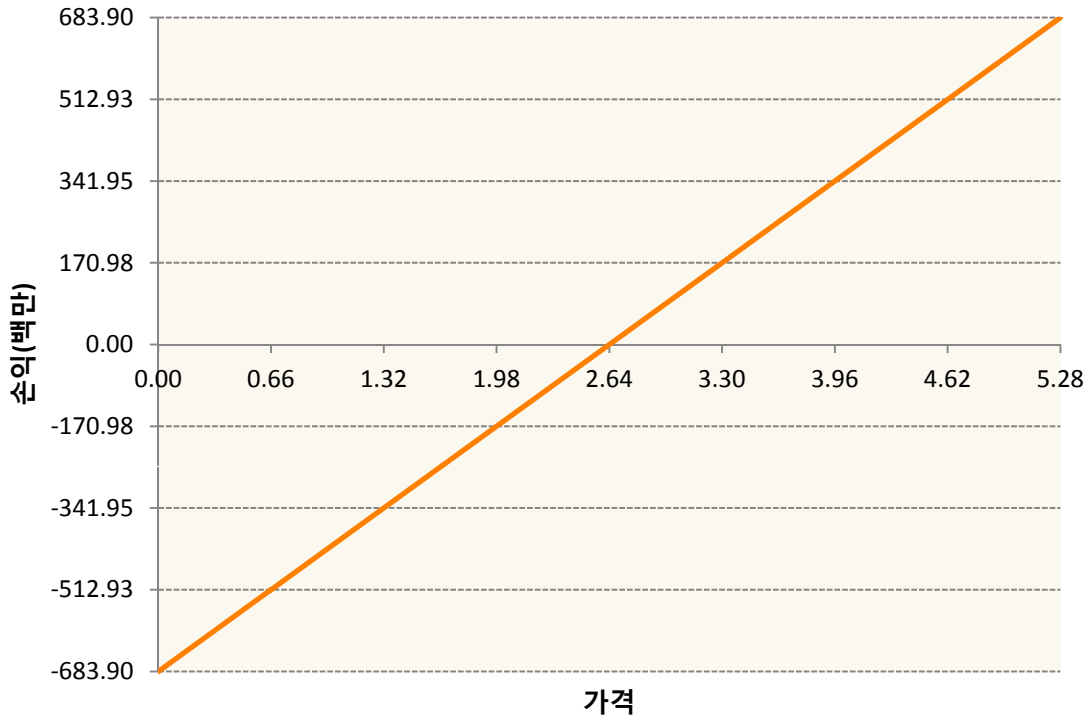
CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19



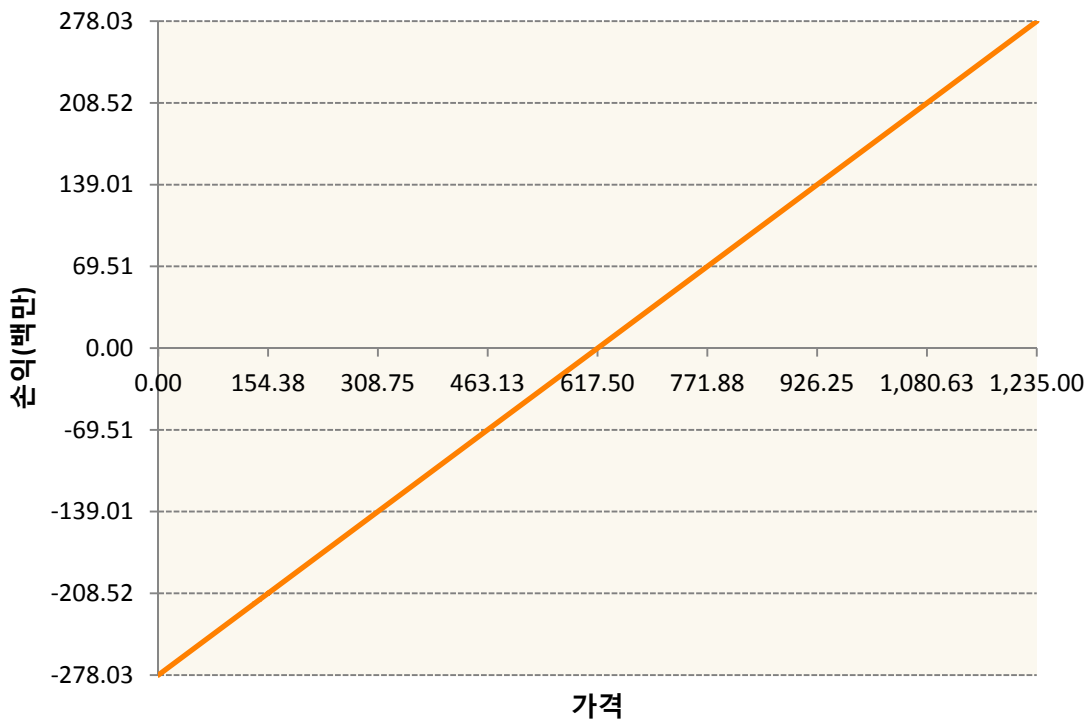




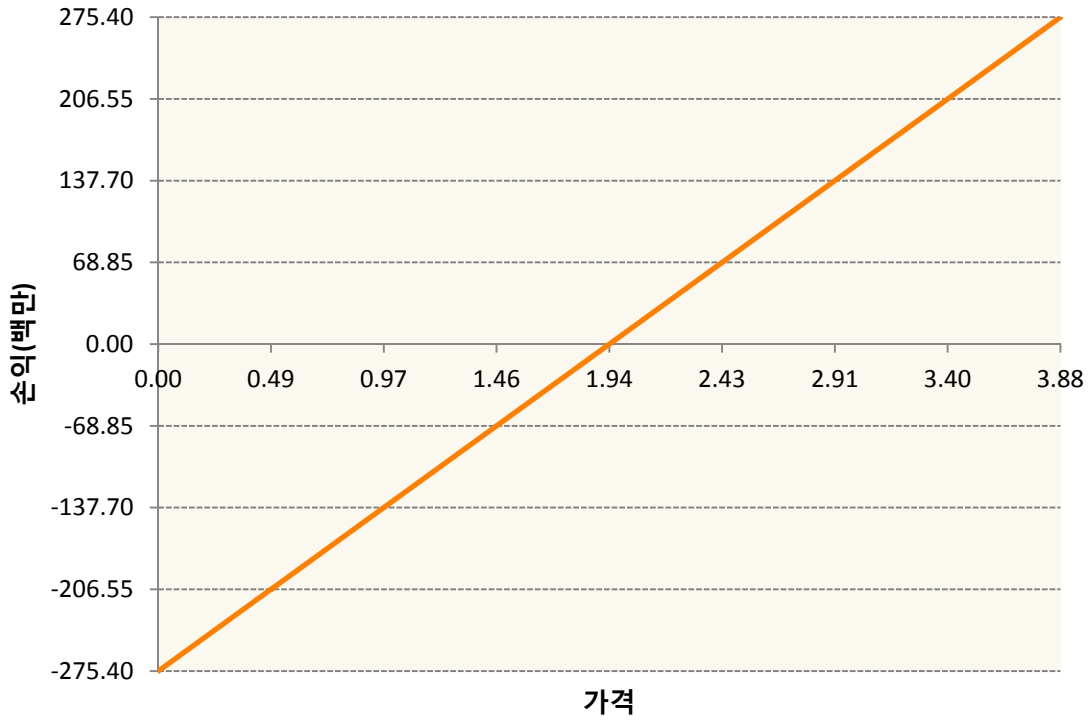
NGK19-NATURAL GAS FUTR May19



QSK9-Low Su Gasoil G May19



XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK9	WTI CRUDE FUTURE May19	56
CON9	BRENT CRUDE FUTR Jul19	62
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	22

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

(단위:백만원)

435

공시일	2019-04-08
기준일	2019-04-05

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

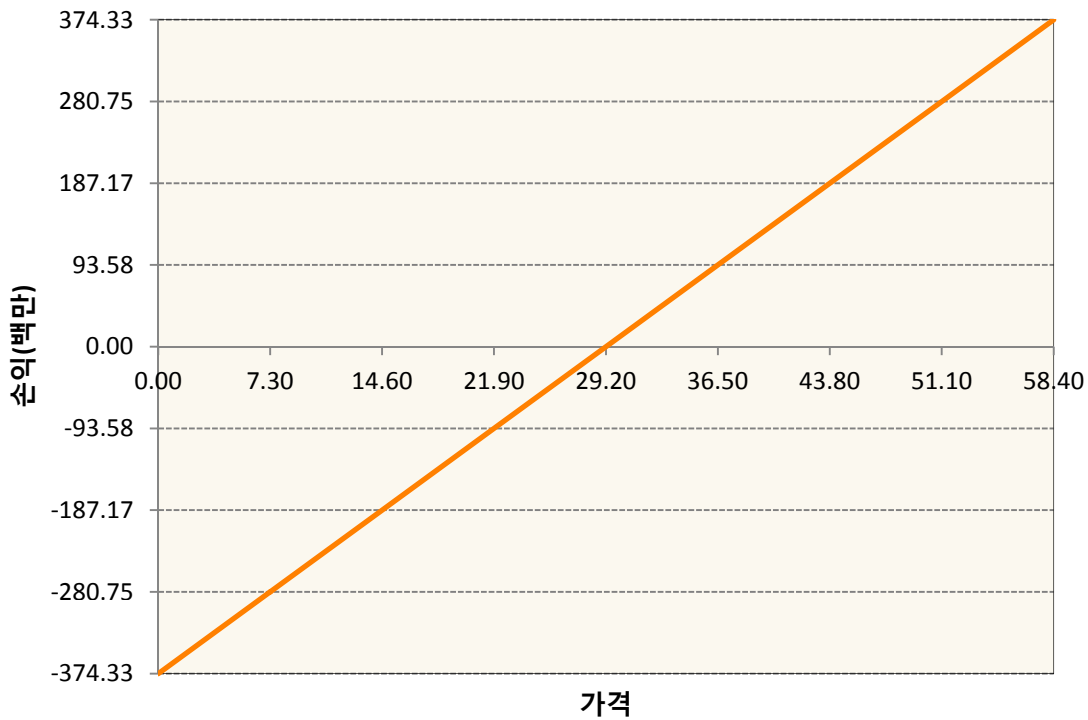
1. 계약금액

(단위:백만원)

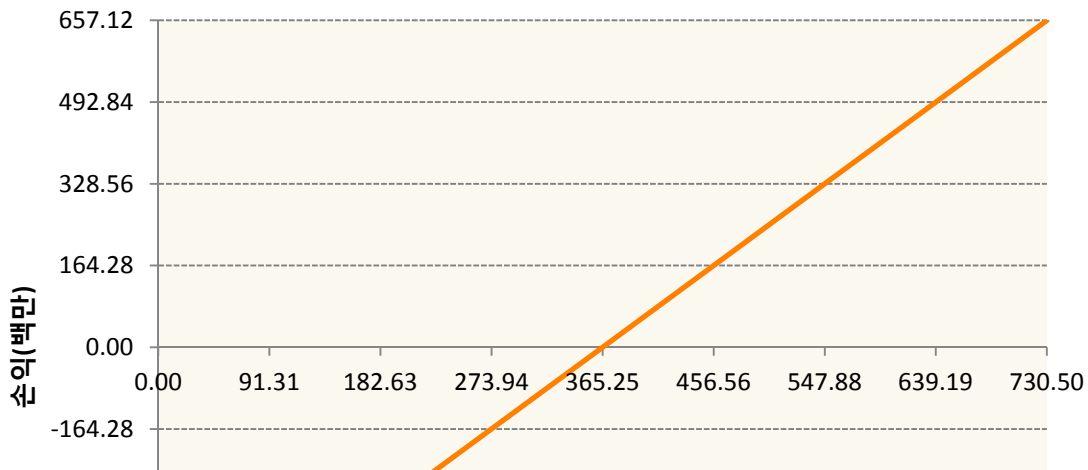
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,382	80	3,303	

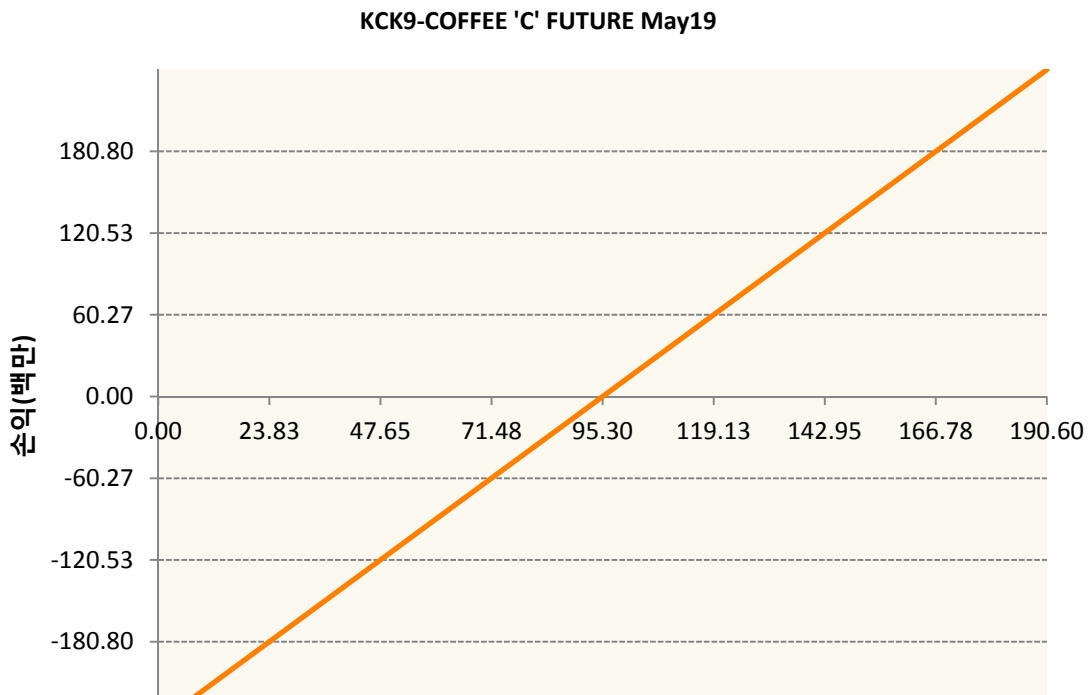
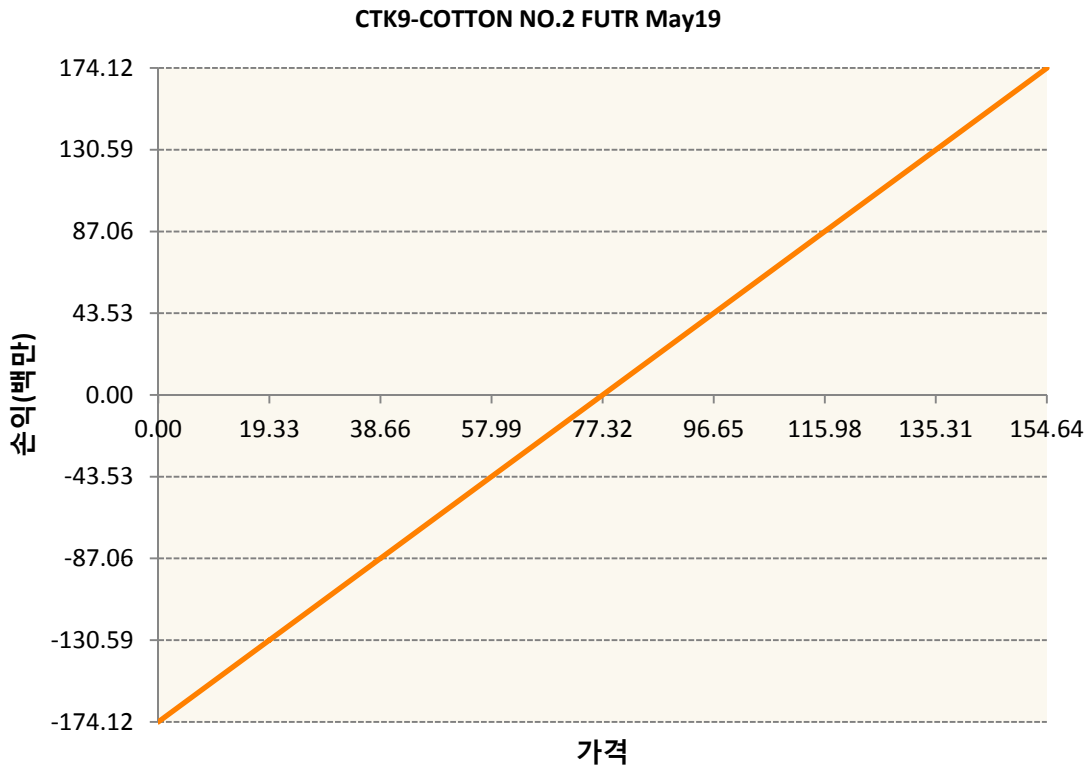
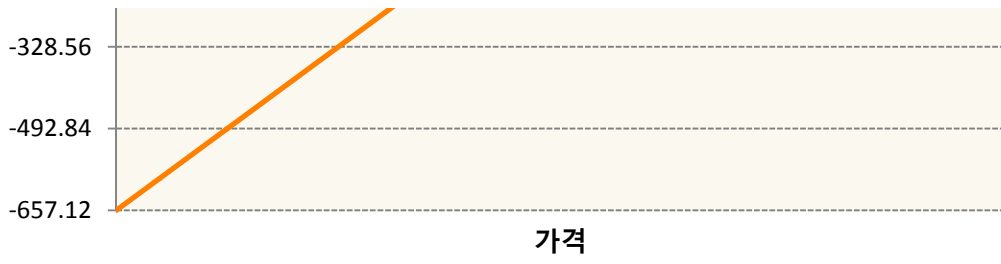
2. 만기시점의 손익구조

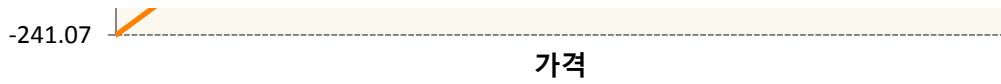
BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19



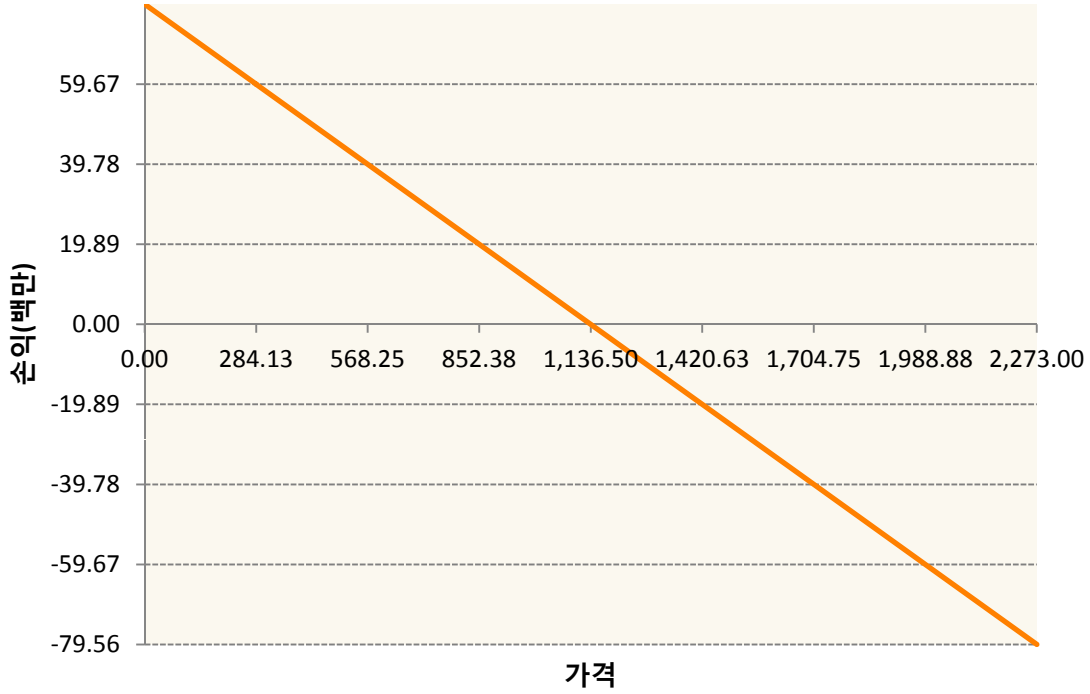
CK9-CORN FUTURE May19



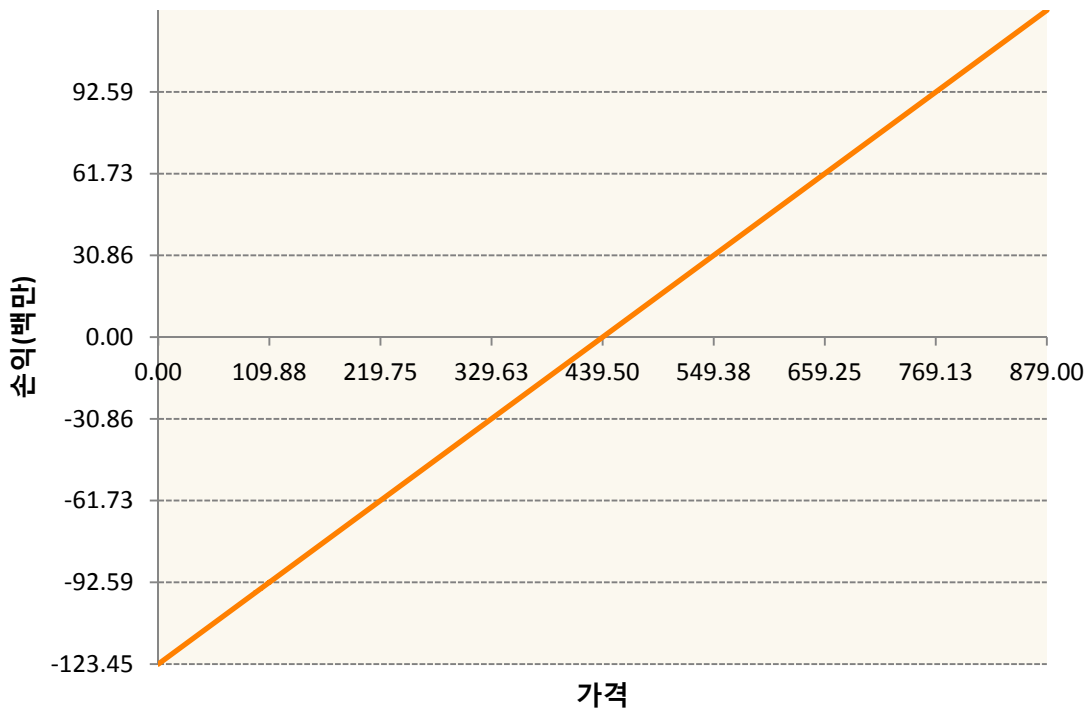




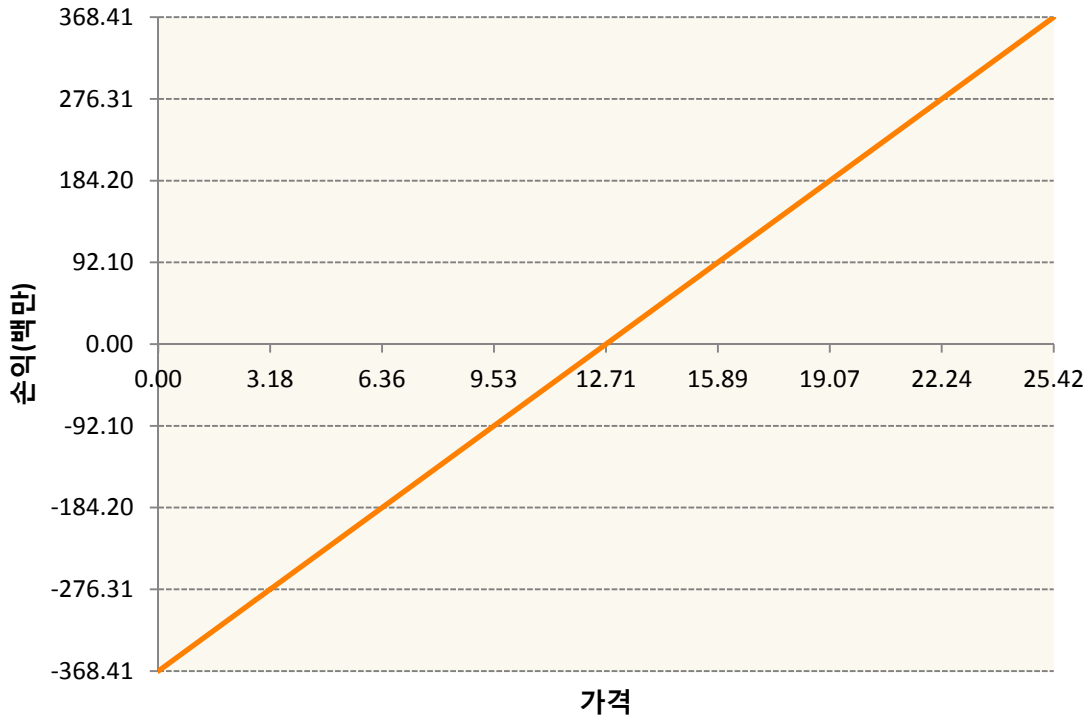
KR4175P40000-2019-04 달러선물



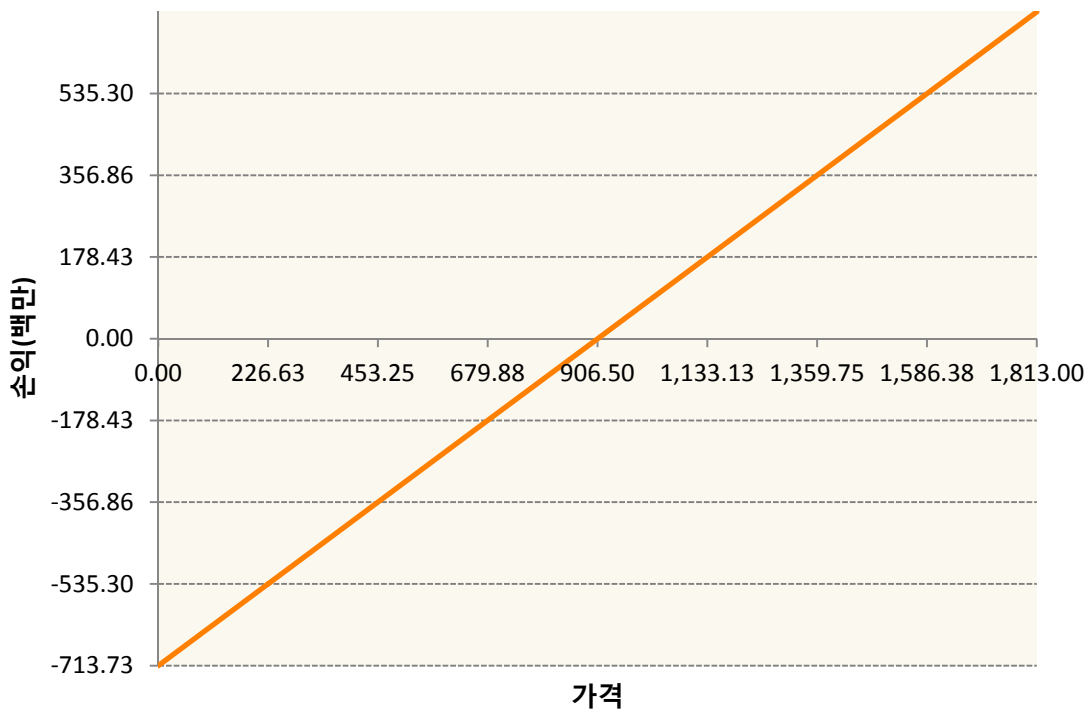
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

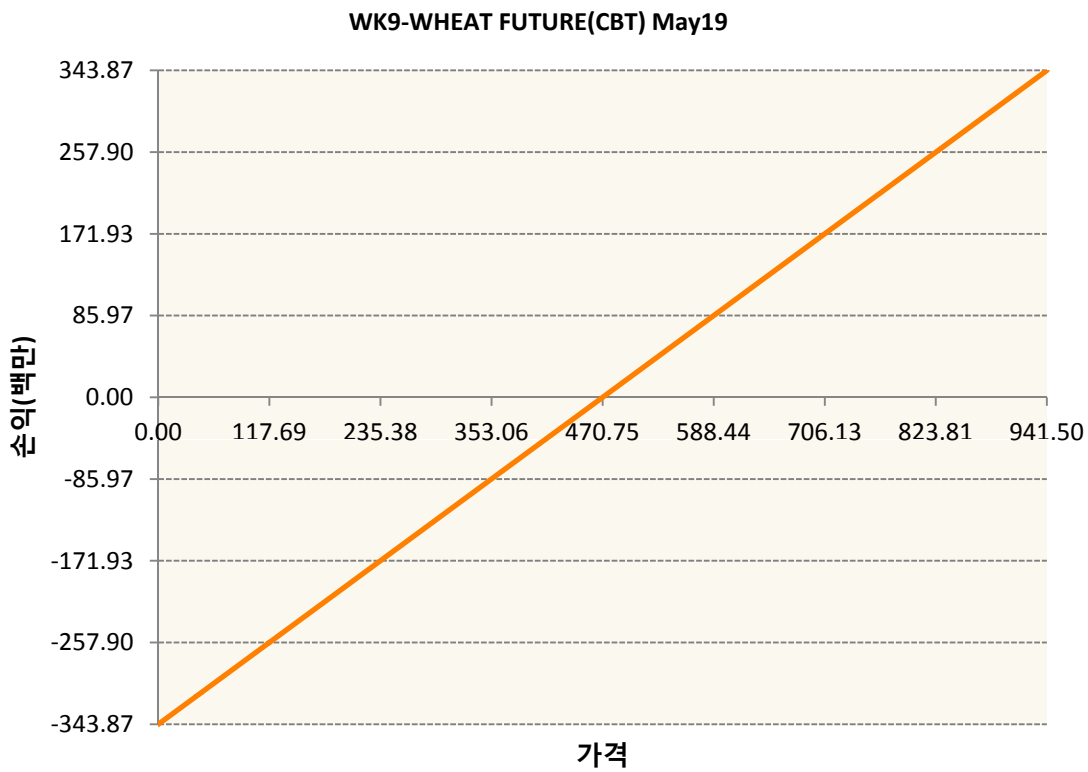
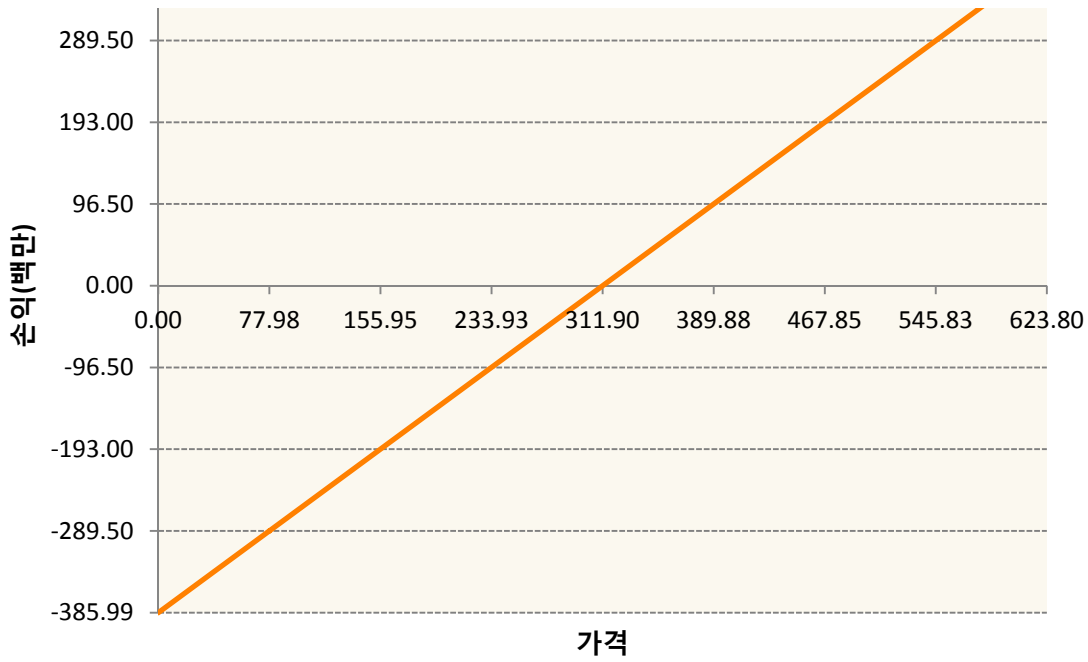


SK9-SOYBEAN FUTURE May19



SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOK9	SOYBEAN OIL FUTR May19	30
CK9	CORN FUTURE May19	53
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	28

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

(단위:백만원)

273