

공시일	2019-04-09
기준일	2019-04-08

## 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	2019-04-09
기준일	2019-04-08

## 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

1,151

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

677

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-04-09
기준일	2019-04-08

## 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 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

<b>998</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-04-09
기준일	2019-04-08

## 유로인덱스모(주식-파생형)

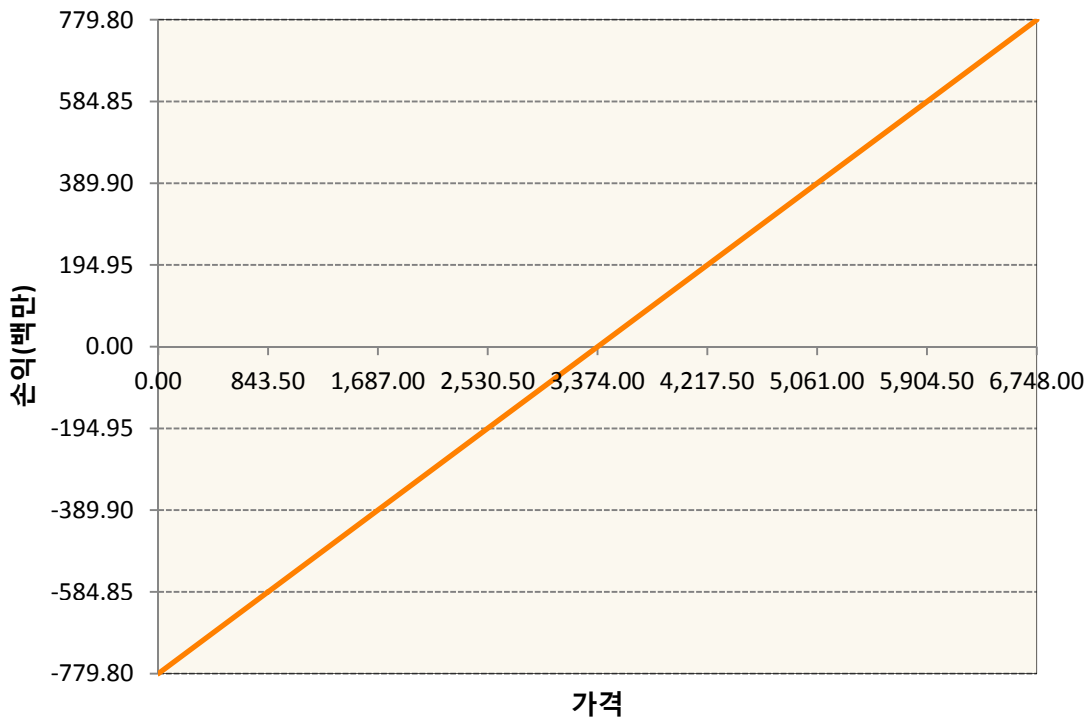
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	780	0	780	

### 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)

45
----

공시일	2019-04-09
기준일	2019-04-08

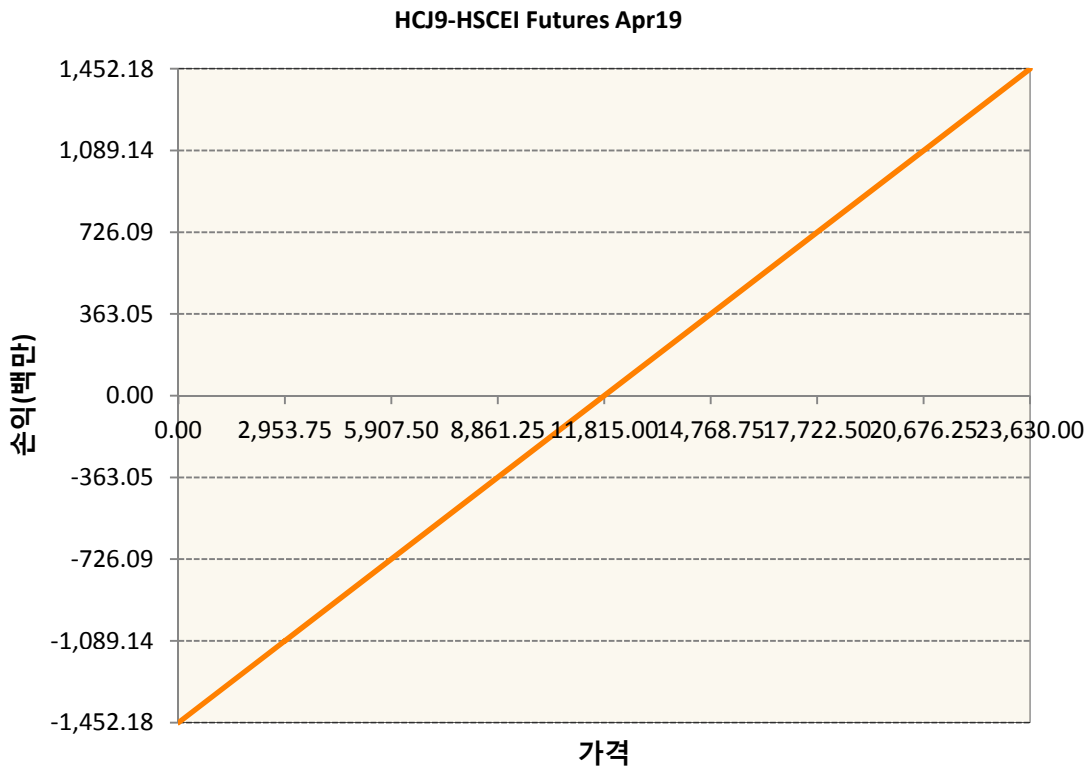
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,452	0	1,452	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ9	HSCEI Futures Apr19	116
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

<b>119</b>
------------

공시일	2019-04-09
기준일	2019-04-08

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

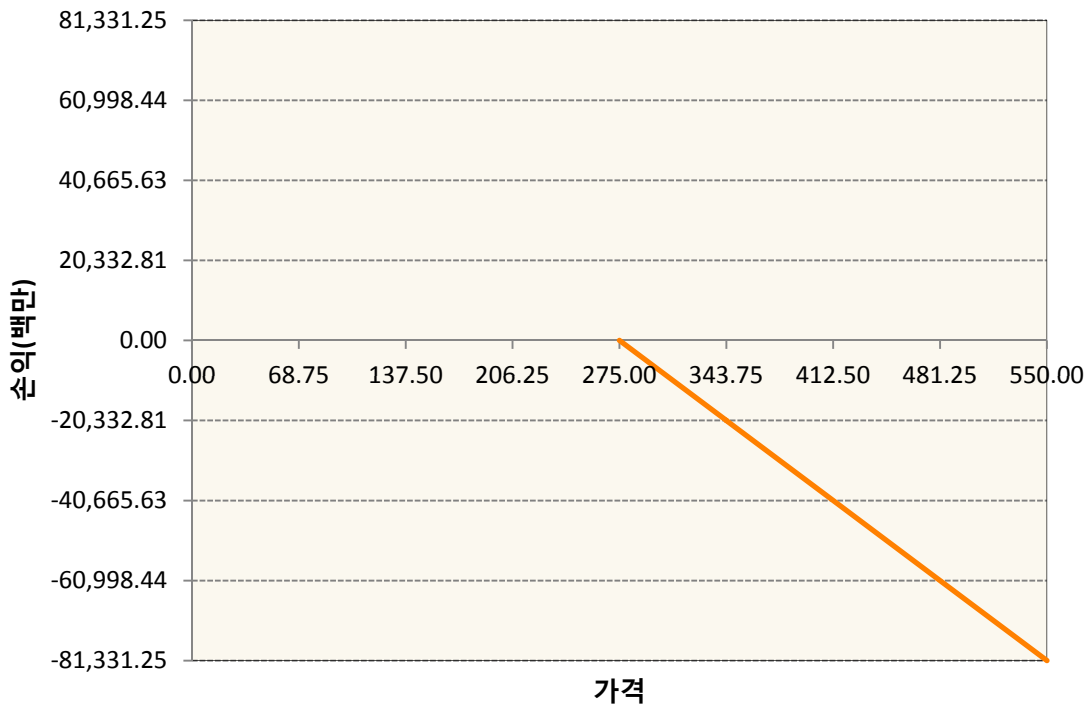
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

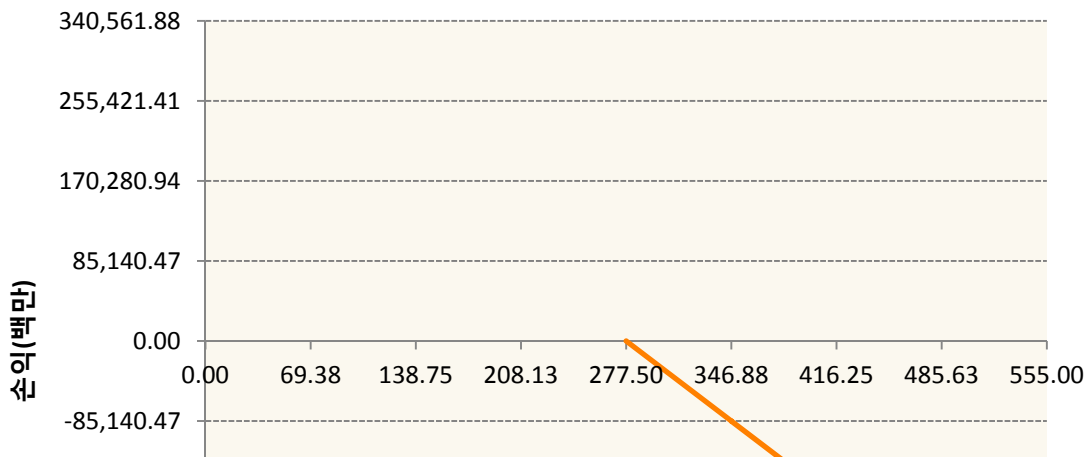
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	8,906	0	8,906	장내
누계	유가증권	옵션	0	653,056	-653,056	장내

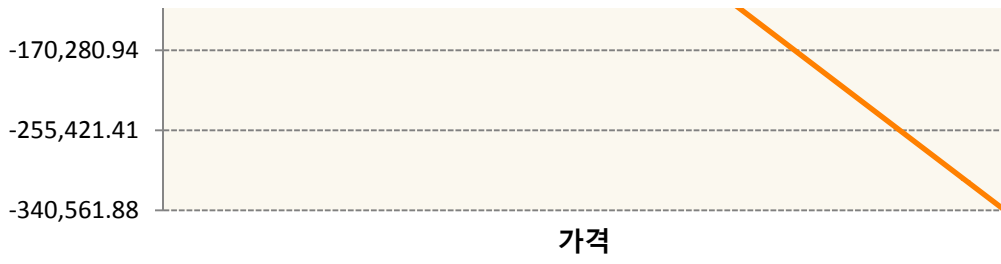
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P42752-2019-04 콜275

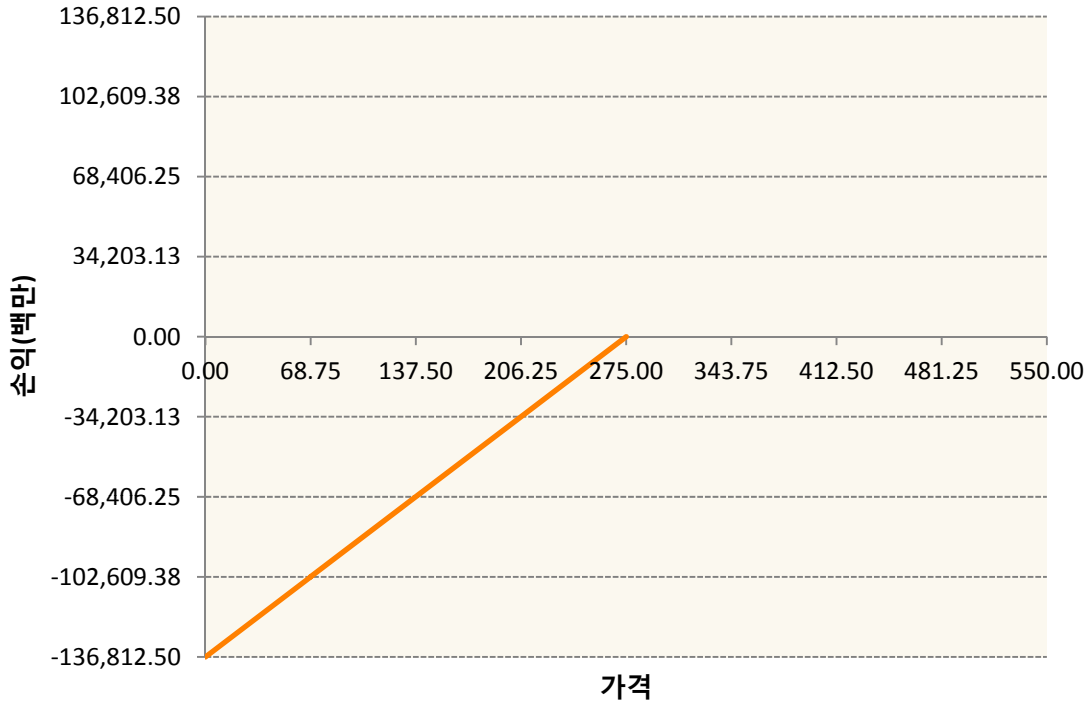


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

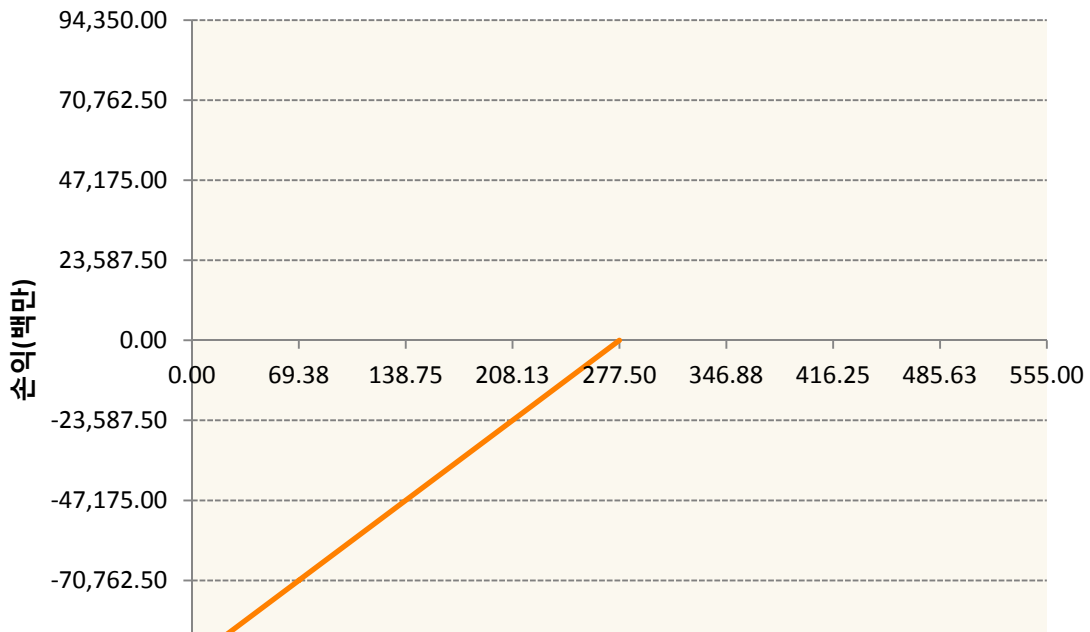




**KR4301P42750-2019-04 풋275**



**KR4301P42776-2019-04 풋277.5**



-94,350.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P42752		2019-04 콜275						6,755
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,381	3,379	3,375	3,368	3,359	3,348	3,333	
-5.33%	3,250	3,210	3,167	3,122	3,075	3,027	2,977	
-2.67%	2,131	2,088	2,044	1,997	1,948	1,898	1,847	
0%	18	14	8	0	-11	-26	-43	
2.67%	-2,238	-2,238	-2,238	-2,239	-2,239	-2,241	-2,243	
5.33%	-4,496	-4,496	-4,496	-4,496	-4,496	-4,496	-4,496	
8.00%	-6,755	-6,755	-6,755	-6,755	-6,755	-6,755	-6,755	
KR4201P42778		2019-04 콜277.5						27,879
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	11,119	11,116	11,111	11,101	11,086	11,062	11,031	
-5.33%	10,943	10,850	10,740	10,614	10,476	10,326	10,166	
-2.67%	8,091	7,856	7,620	7,383	7,144	6,905	6,666	
0%	180	136	76	0	-91	-196	-314	
2.67%	-9,138	-9,139	-9,141	-9,146	-9,155	-9,169	-9,189	
5.33%	-18,508	-18,508	-18,508	-18,509	-18,509	-18,509	-18,511	
8.00%	-27,879	-27,879	-27,879	-27,879	-27,879	-27,879	-27,879	
KR4301P42750		2019-04 풋275						5,740
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-5,739	-5,739	-5,739	-5,739	-5,739	-5,740	-5,740	
-5.33%	-1,965	-1,980	-1,999	-2,022	-2,047	-2,076	-2,106	
-2.67%	-30	-48	-70	-95	-123	-153	-186	
0%	0	0	0	0	0	-1	-1	
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						4,771
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-4,771	-4,771	-4,771	-4,771	-4,771	-4,771	-4,771	
-5.33%	-2,176	-2,177	-2,180	-2,184	-2,189	-2,196	-2,205	
-2.67%	-157	-189	-222	-256	-290	-324	-358	
0%	1	1	1	0	-1	-3	-6	
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)

42,723

공시일	2019-04-09
기준일	2019-04-08

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

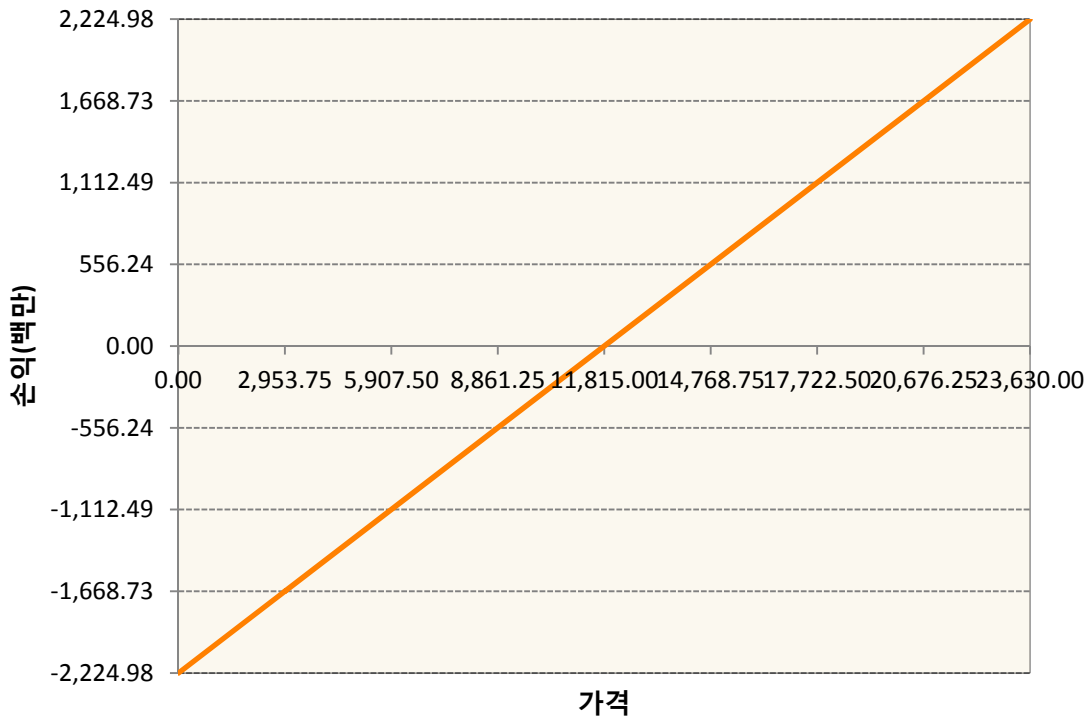
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

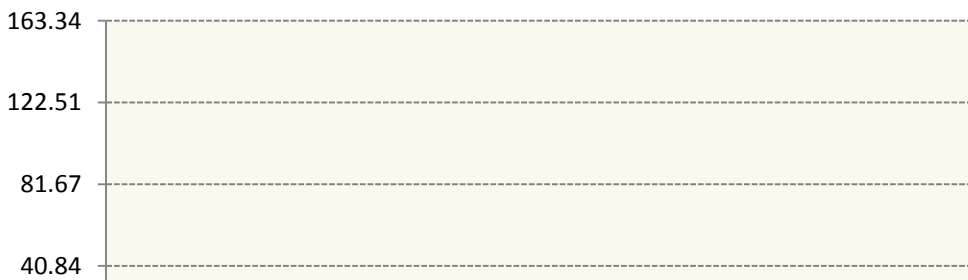
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,225	0	2,225	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,600	-5,600	장내
누계	통화	선도	0	3,062	-3,062	장외

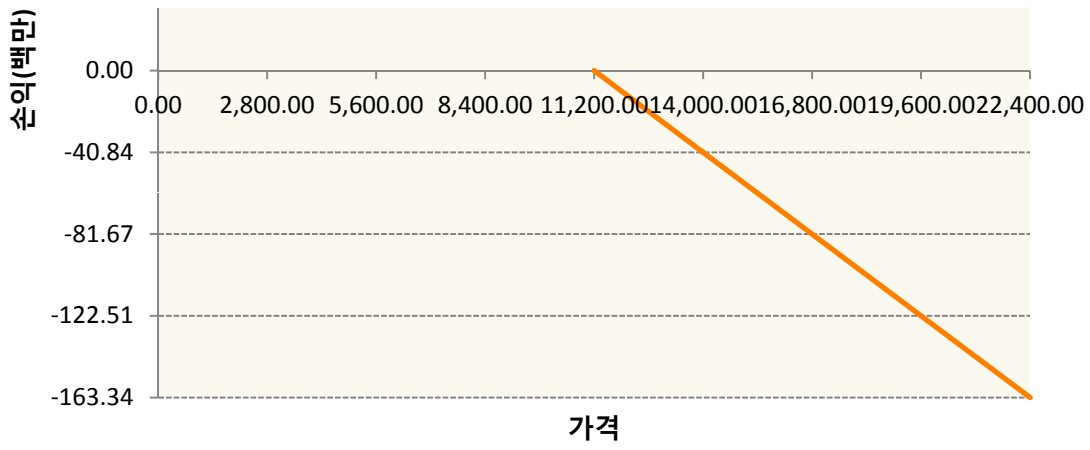
### 2. 만기시점의 손익구조

HCJ9-HSCEI Futures Apr19

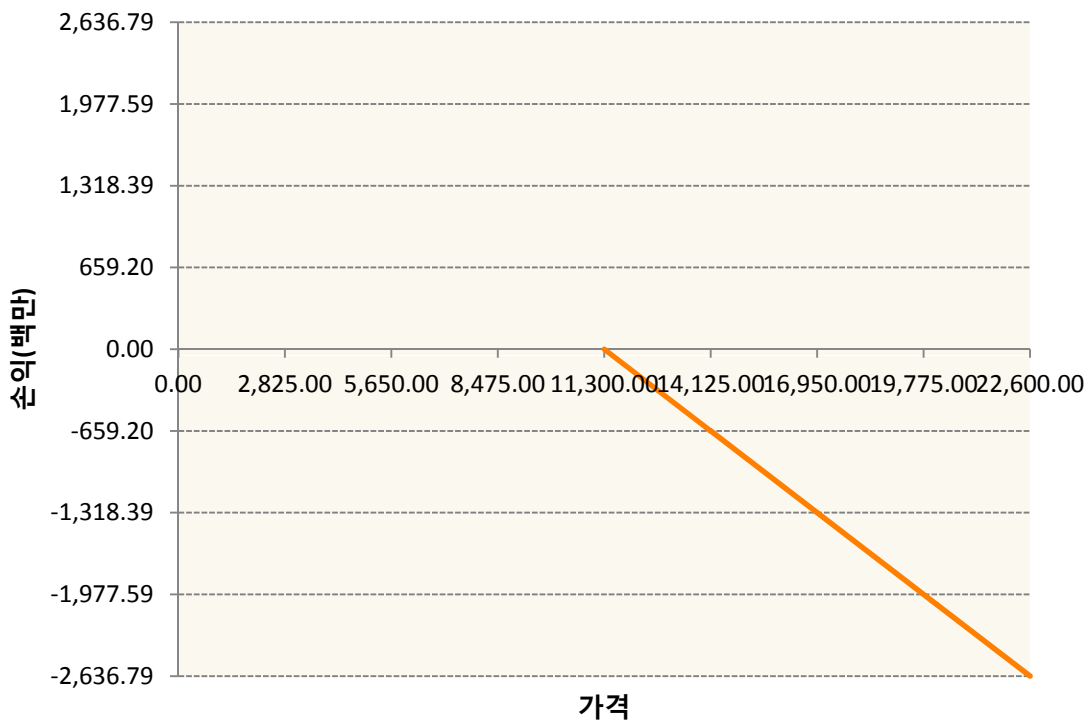


OHHIJ9-C112-HSCEI

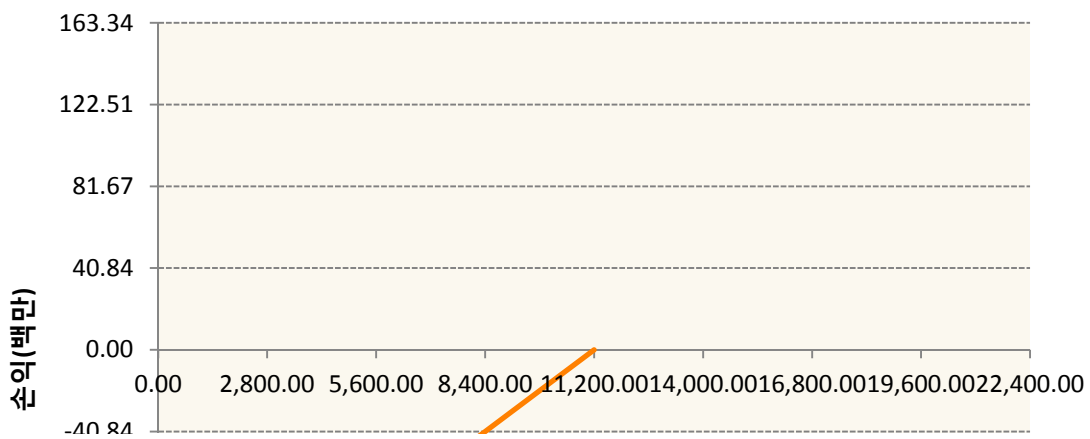


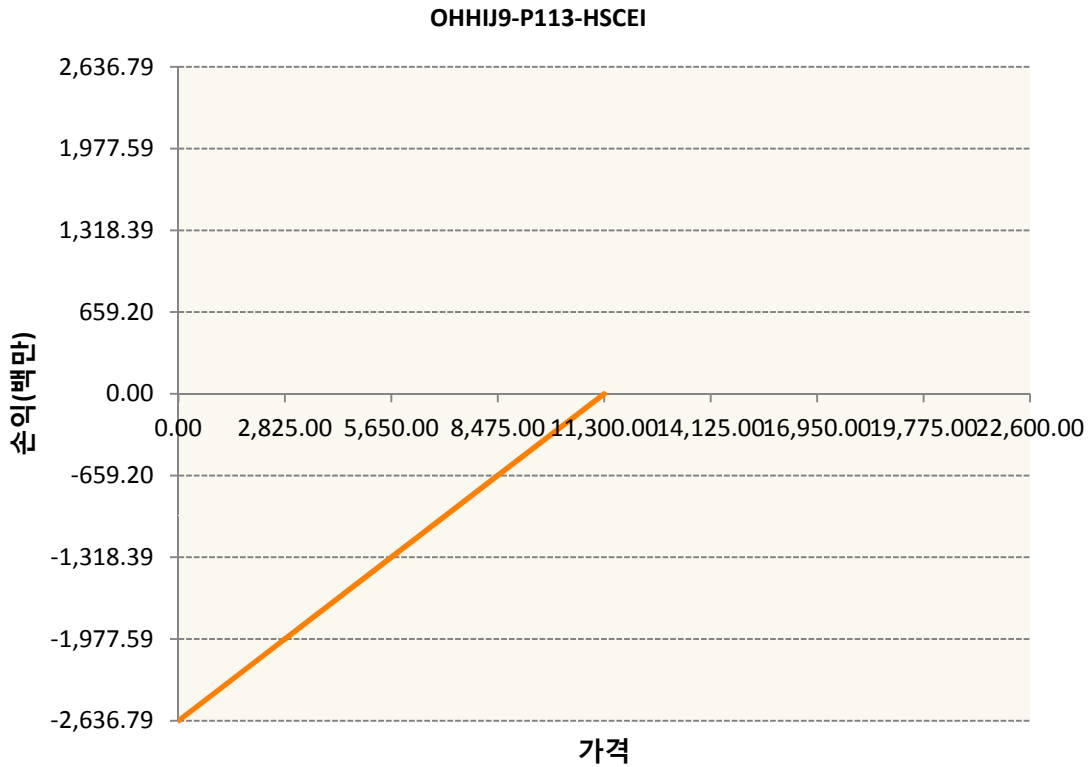


**OHHIJ9-C113-HSCEI**



**OHHIJ9-P112-HSCEI**





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	222
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	23
HCJ9 HSCEI Futures Apr19	178
OHHIJ9-C11 HSCEI	13
OHHIJ9-C11 HSCEI	211
OHHIJ9-P11: HSCEI	13
OHHIJ9-P11: HSCEI	211

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	725

공시일	2019-04-09
기준일	2019-04-08

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

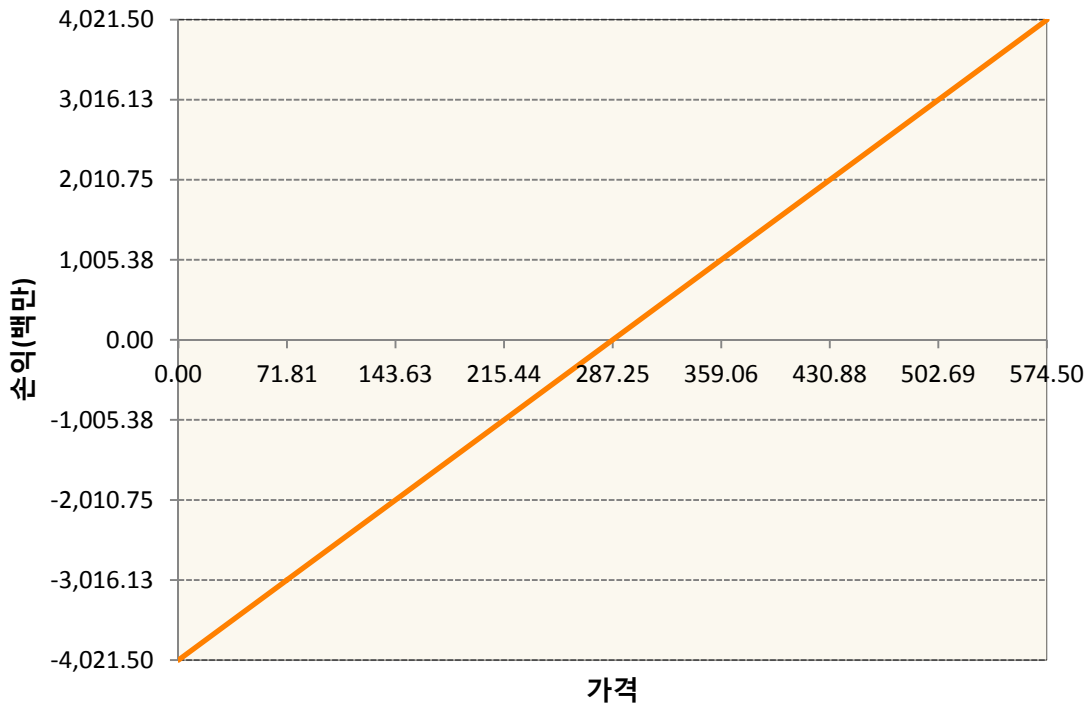
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

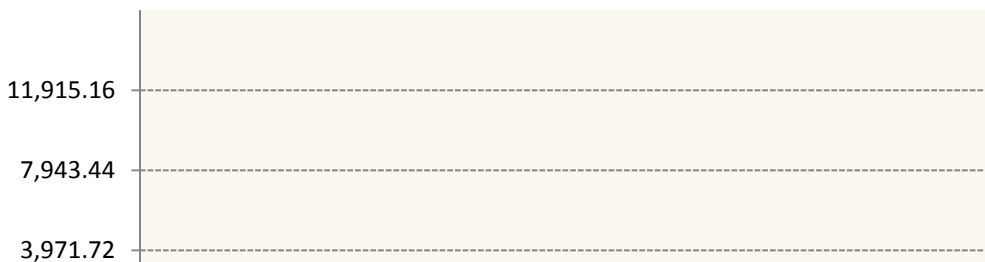
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,022	0	4,022	장내
누계	유가증권	스왑	35,836	0	35,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	33,678	-33,678	장내

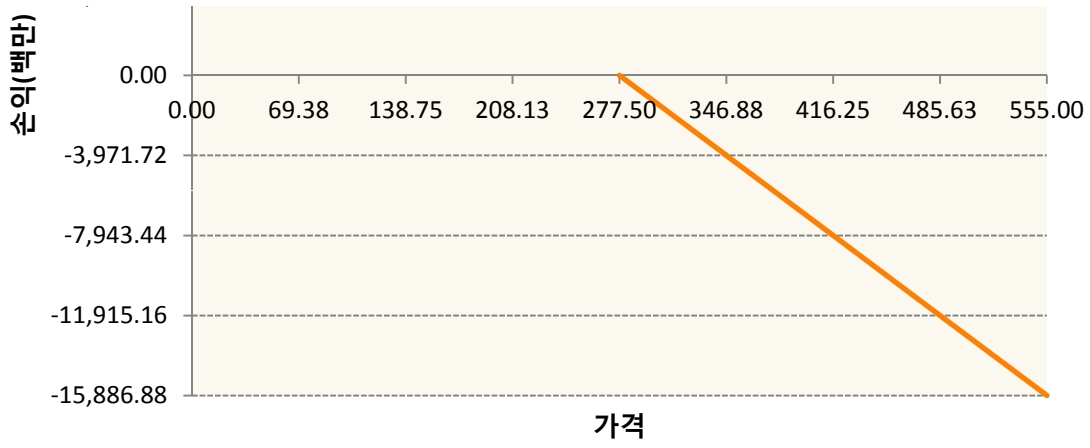
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

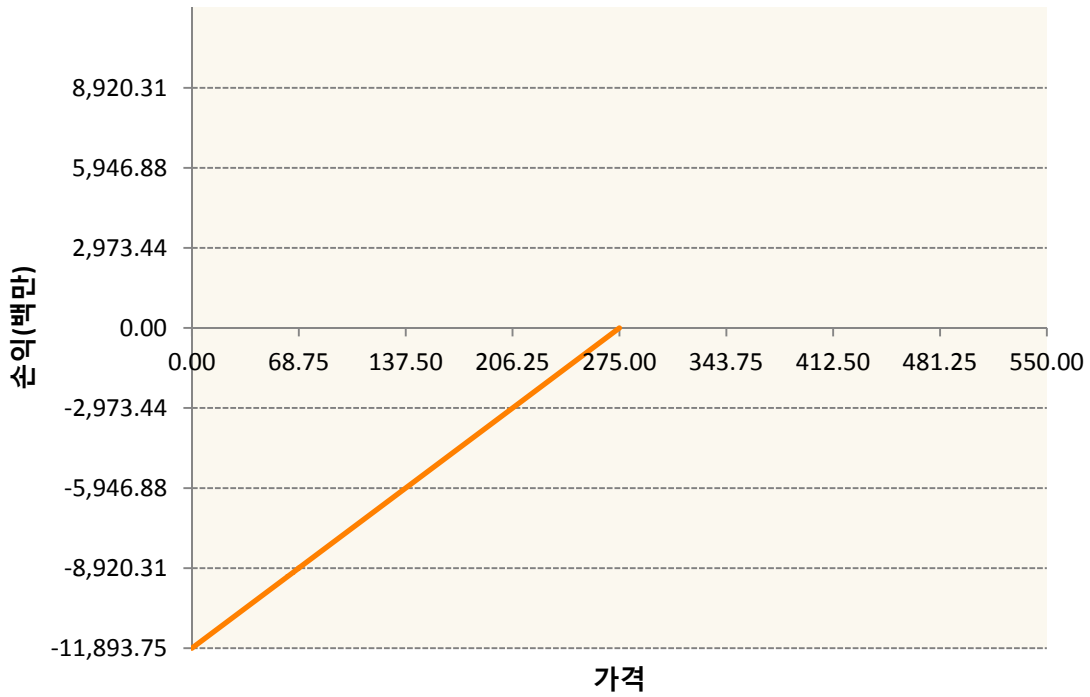


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

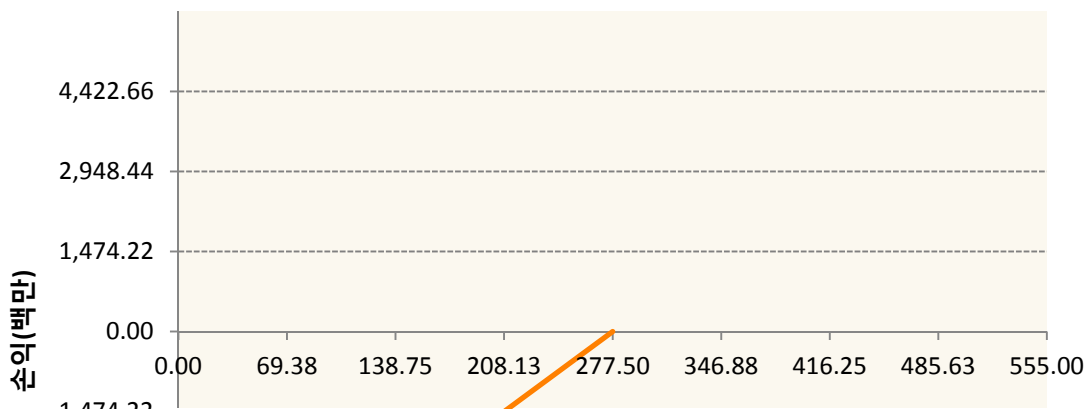


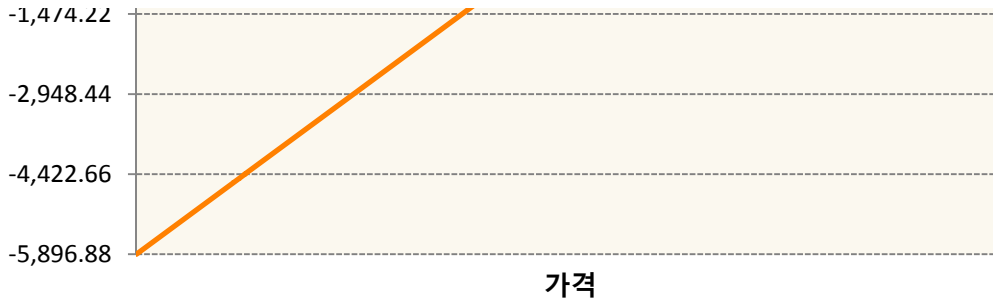


KR4301P42750-2019-04 풋275



KR4301P42776-2019-04 풋277.5





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,448
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,448	-2,448	-2,448	-2,448	-2,448	-2,448	-2,448	
-5.33%	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632	
-2.67%	-816	-816	-816	-816	-816	-816	-816	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	816	816	816	816	816	816	816	
5.33%	1,632	1,632	1,632	1,632	1,632	1,632	1,632	
8.00%	2,448	2,448	2,448	2,448	2,448	2,448	2,448	
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						1,301
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	519	519	518	518	517	516	515
-5.33%	510	506	501	495	489	482	474
-2.67%	377	366	355	344	333	322	311
0%	8	6	4	0	-4	-9	-15
2.67%	-426	-426	-426	-427	-427	-428	-429
5.33%	-863	-863	-863	-863	-863	-863	-864
8.00%	-1,301	-1,301	-1,301	-1,301	-1,301	-1,301	-1,301
KR4301P42750                      2019-04 풋275							499
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-499	-499	-499	-499	-499	-499	-499
-5.33%	-171	-172	-174	-176	-178	-180	-183
-2.67%	-3	-4	-6	-8	-11	-13	-16
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							298
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-298	-298	-298	-298	-298	-298	-298
-5.33%	-136	-136	-136	-136	-137	-137	-138
-2.67%	-10	-12	-14	-16	-18	-20	-22
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)

**5,016**

공시일	2019-04-09
기준일	2019-04-08

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

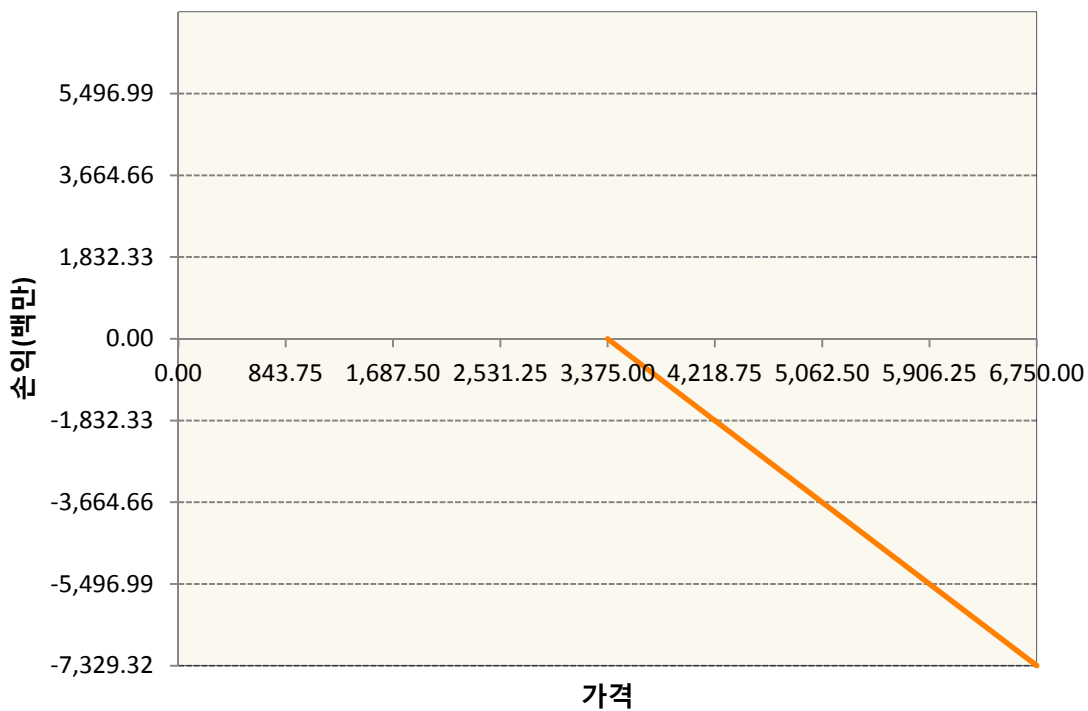
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

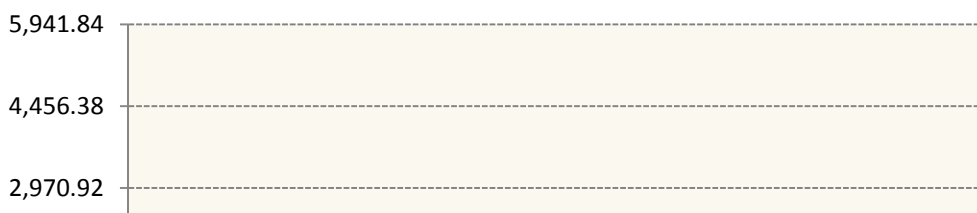
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,498	0	6,498	
누계	유가증권	스왑	60,668	0	60,668	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,542	-26,542	장내
누계	통화	선도	0	15,420	-15,420	장외

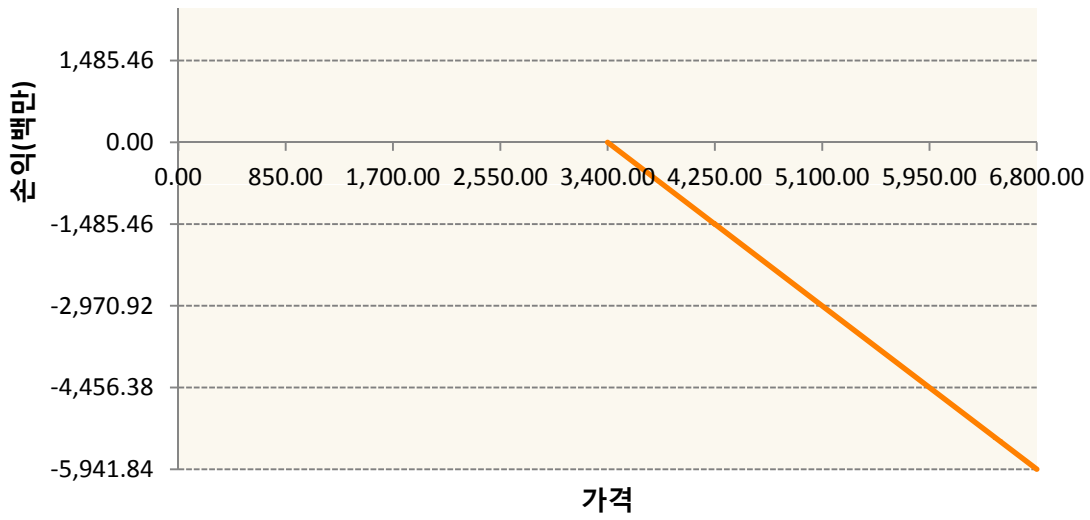
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXJ9-C3375-EURO STOXX 50**

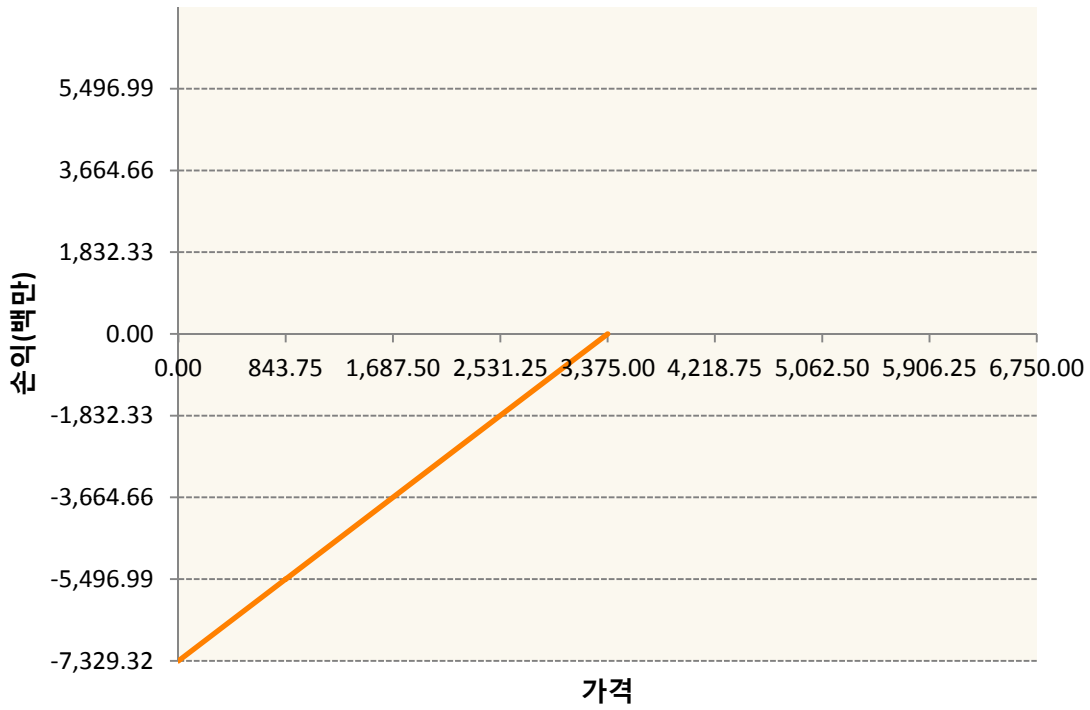


**OESXJ9-C3400-EURO STOXX 50**

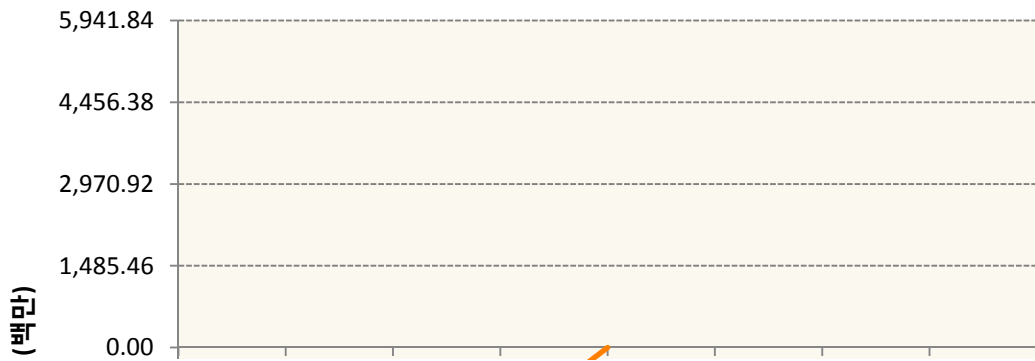


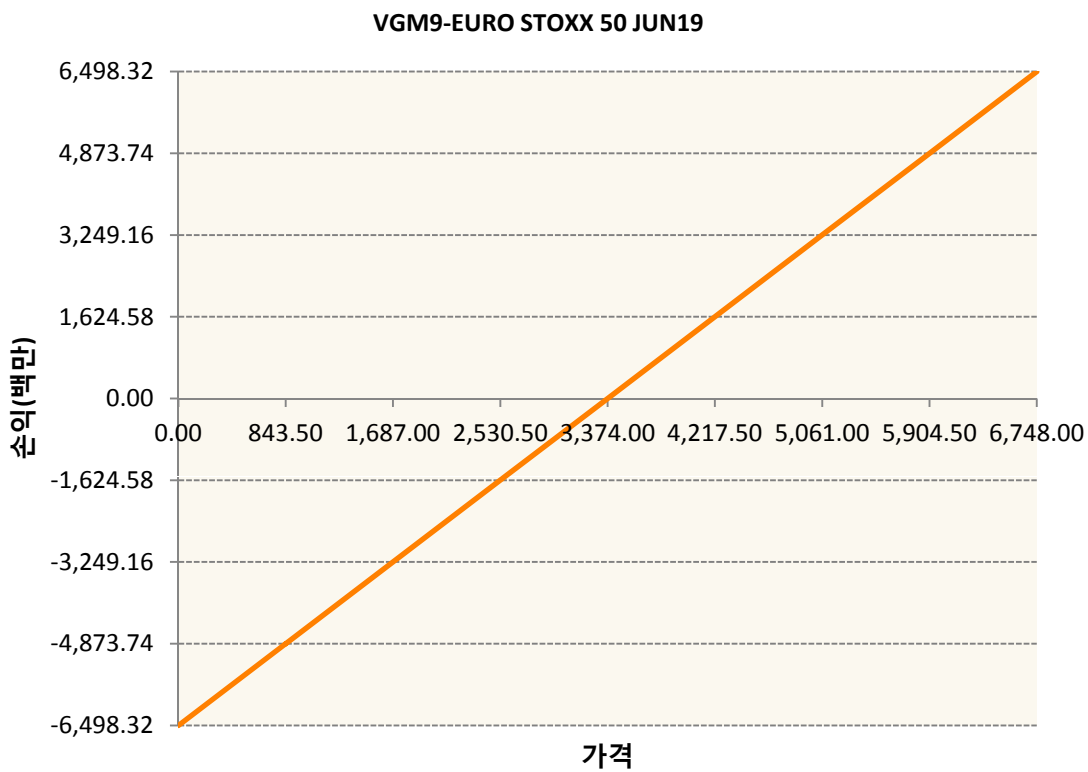
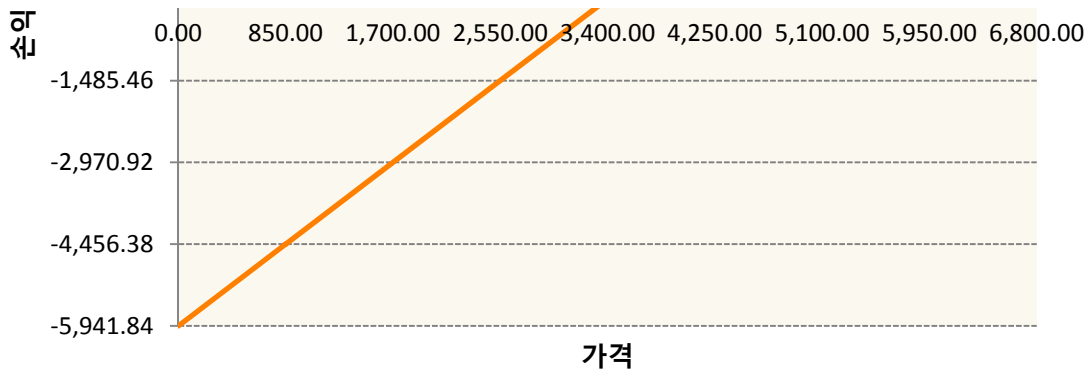


OESXJ9-P3375-EURO STOXX 50



OESXJ9-P3400-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		197
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E		411
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E		822
OESXJ9-C33' EURO STOXX 50		586
OESXJ9-C34' EURO STOXX 50		475
OESXJ9-P33' EURO STOXX 50		586
OESXJ9-P34' EURO STOXX 50		475
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19		520

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

(단위:백만원)

2,717



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

(단위:백만원)

1,106



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	2019-04-09
기준일	2019-04-08

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

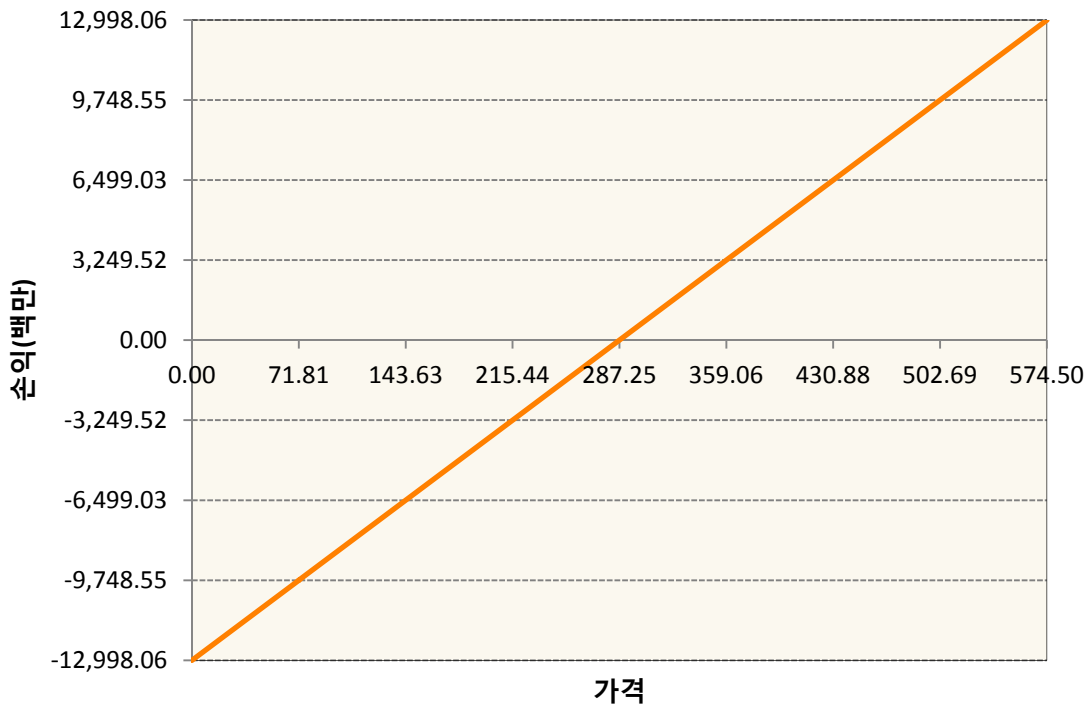
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

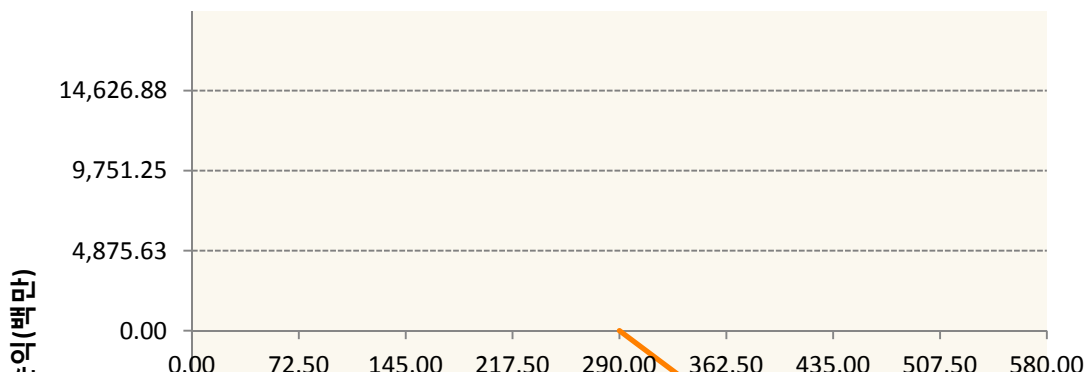
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,998	0	12,998	장내
누계	유가증권	옵션	1,867	24,036	-22,169	장내

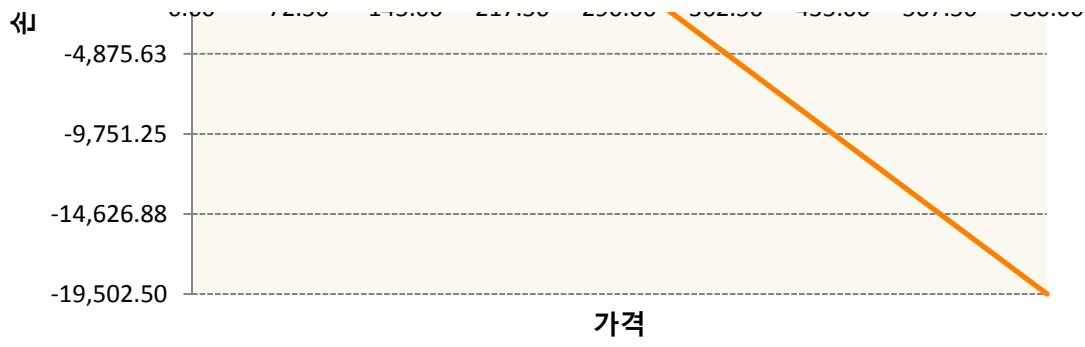
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

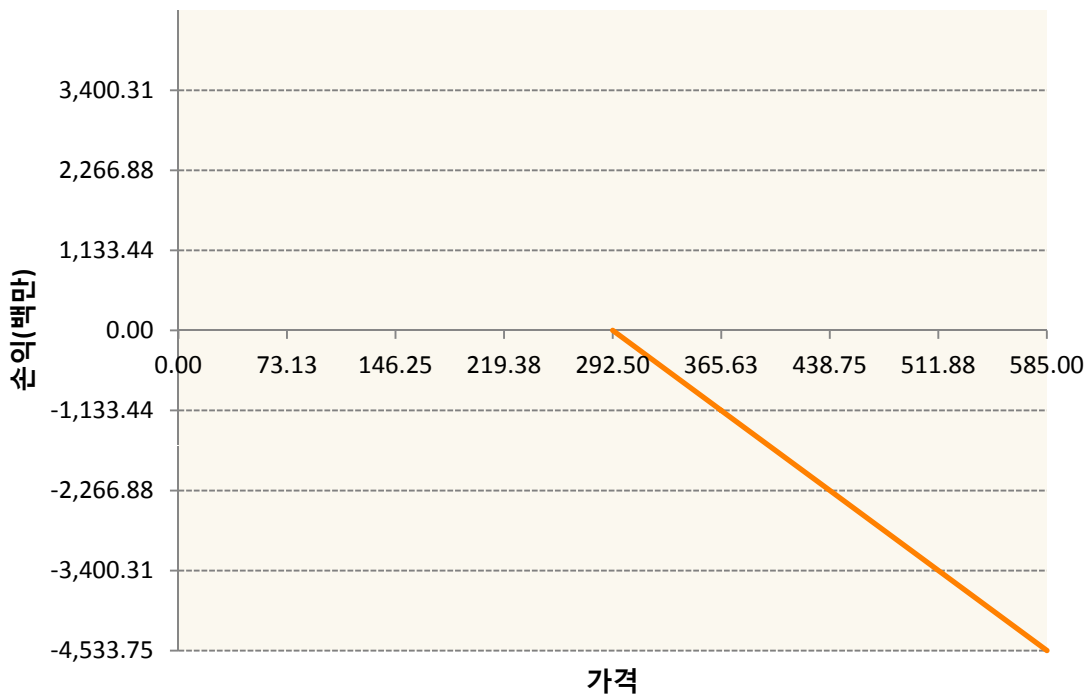


KR4201P42901-2019-04 콜290

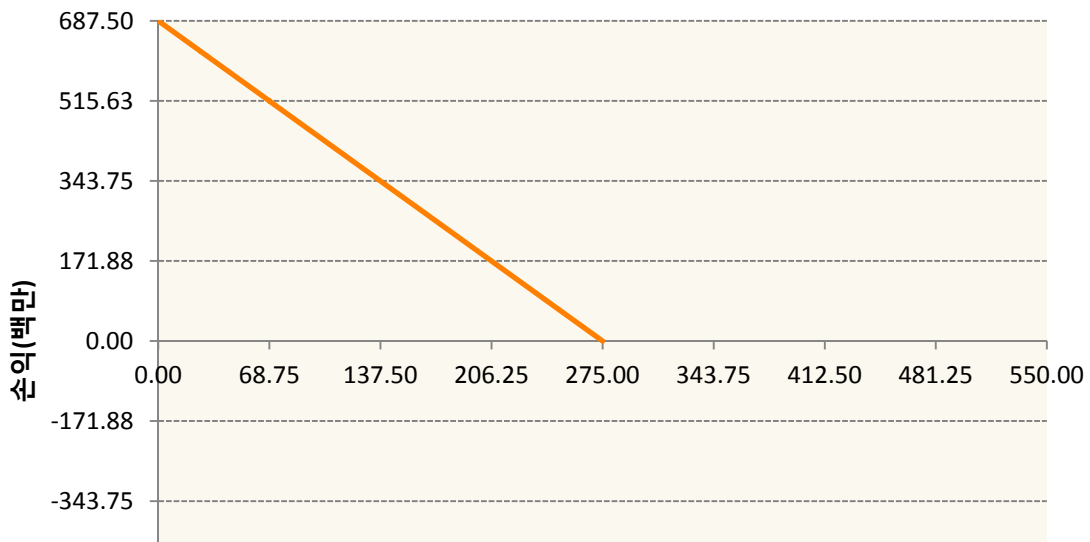


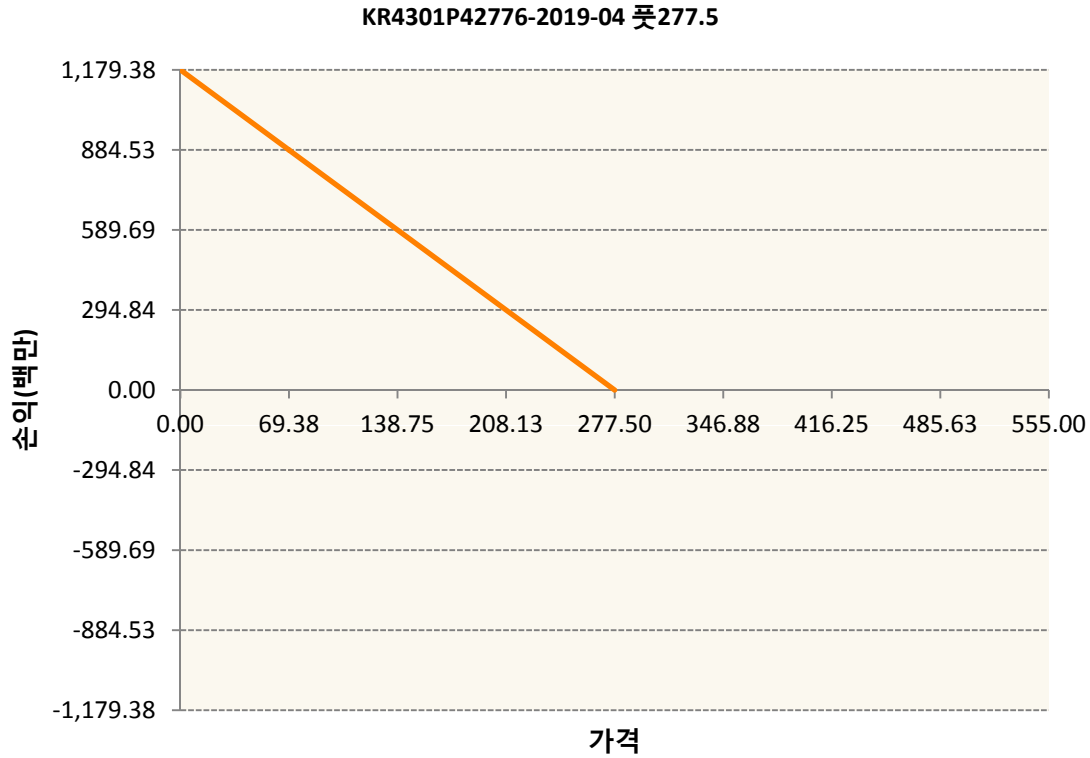
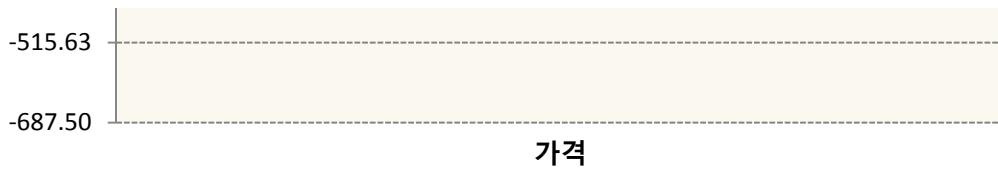


KR4201P42927-2019-04 콜292.5



KR4301P42750-2019-04 풋275





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

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						1,037
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,037	-1,037	-1,037	-1,037	-1,037	-1,037	-1,037	
-5.33%	-691	-691	-691	-691	-691	-691	-691	
-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%	691	691	691	691	691	691	691	
8.00%	1,037	1,037	1,037	1,037	1,037	1,037	1,037	
KR4201P42901		2019-04 콜290						1,227
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	71	71	71	71	71	71	71	
-5.33%	71	71	71	71	71	71	70	
-2.67%	71	70	68	66	63	60	56	

0%	33	22	11	0	-12	-24	-36
2.67%	-233	-243	-253	-264	-276	-288	-300
5.33%	-712	-713	-715	-717	-720	-724	-728
8.00%	-1,225	-1,225	-1,225	-1,225	-1,225	-1,226	-1,227
KR4201P42927                      2019-04 콜292.5							253
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8	8	8	8	8	8	8
-5.33%	8	8	8	8	8	8	8
-2.67%	8	8	8	8	7	7	6
0%	5	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	-34	-37	-40	-43	-47	-50	-53
5.33%	-134	-135	-136	-137	-138	-140	-141
8.00%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-253
KR4301P42750                      2019-04 풋275							29
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	29	29	29	29	29	29	29
-5.33%	10	10	10	10	10	10	11
-2.67%	0	0	0	0	1	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
KR4301P42776                      2019-04 풋277.5							60
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	60	60	60	60	60	60	60
-5.33%	27	27	27	27	27	27	28
-2.67%	2	2	3	3	4	4	4
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)

**2,486**

공시일	2019-04-09
기준일	2019-04-08

## 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	3,546	0	3,546	

### 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	2019-04-09
기준일	2019-04-08

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,289	0	2,289	
누계	유가증권	수익증권	19,179	0	19,179	

### 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	2019-04-09
기준일	2019-04-08

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,488	0	1,488	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	70,382	0	70,382	
누계	통화	선도	0	76,569	-76,569	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 10-04-19E	37
FX21019H01 KRW/USD 10-04-19E	101
FX21019H01 KRW/USD 10-04-19E	92
FX21019H01 KRW/USD 10-04-19E	110
FX21019H01 KRW/USD 19-04-19E	147
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	119
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	209
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	256
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E	156
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E	366
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E	430
FX21019H03 KRW/USD 22-04-19E	366
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	366
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	421
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	183
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	458
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	531
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	322
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	275
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E	46
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E	92
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E	92
FX21019J001 KRW/USD 10-05-19E	45
FX21019J004 KRW/USD 10-06-19E	101
FX21019J006 KRW/USD 10-05-19E	156
FX21019J007 KRW/USD 10-05-19E	73

FX21019J00₩ KRW/USD 10-05-19E

275

FX21019J00₩ KRW/USD 10-05-19E

229

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

(단위:백만원)

**2,090**

공시일	2019-04-09
기준일	2019-04-08

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

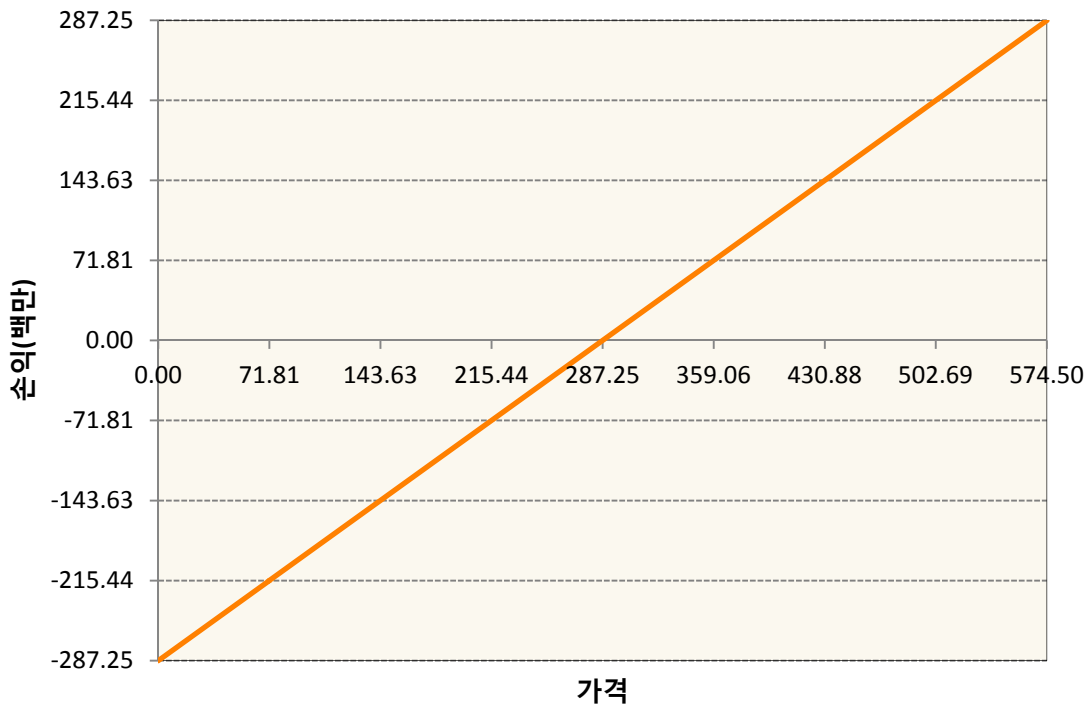
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

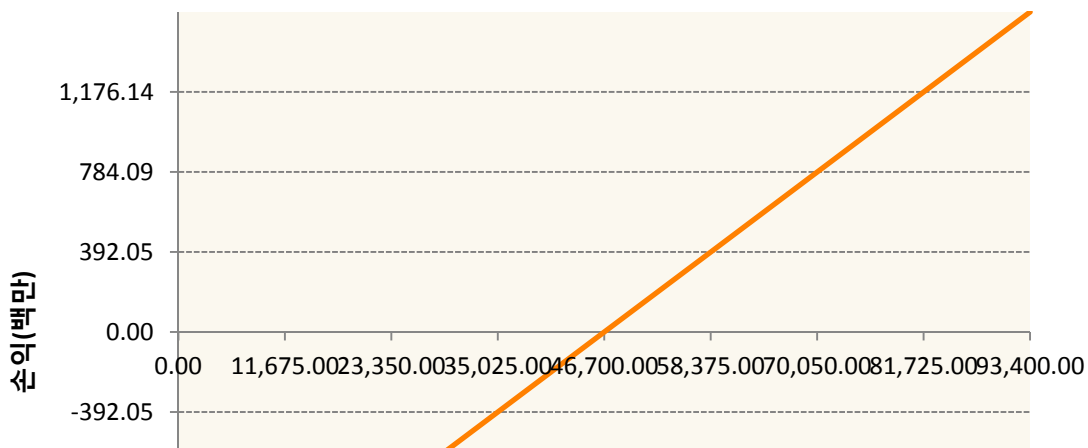
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,855	0	1,855	장내

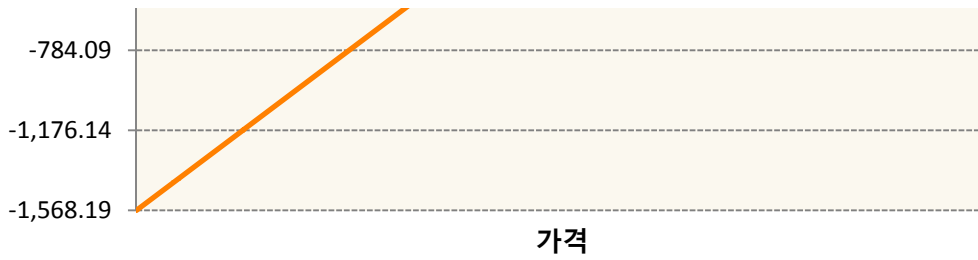
### 2. 만기시점의 손익구조

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%	-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%	125	125	125	125	125	125	125	

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

164

공시일	2019-04-09
기준일	2019-04-08

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

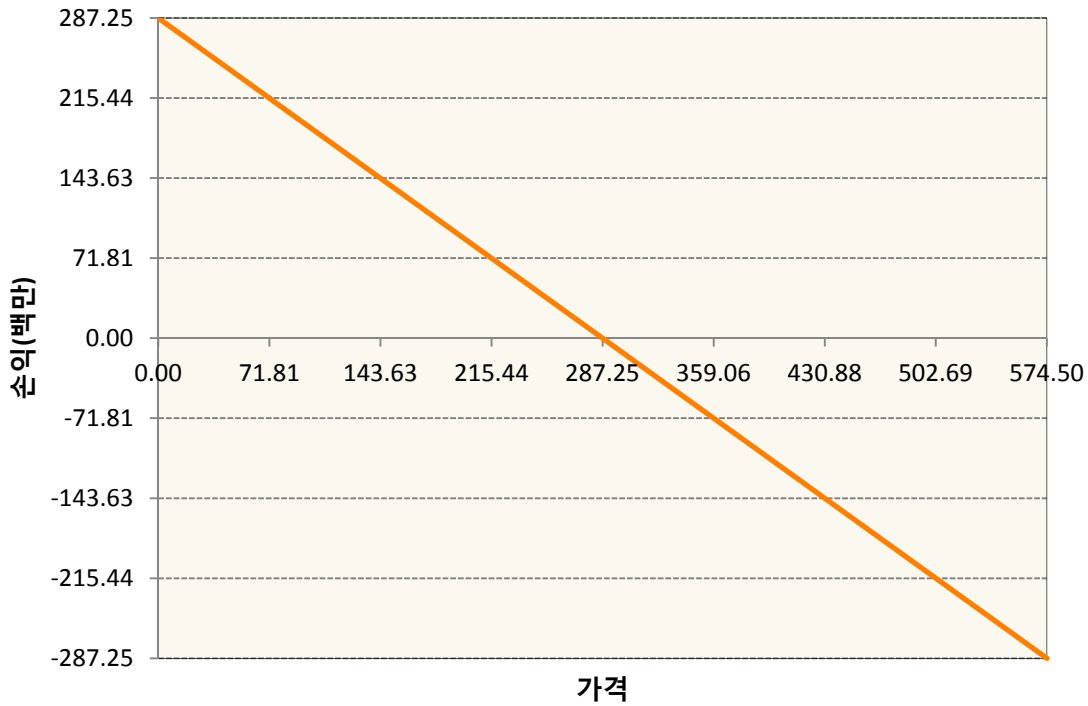
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

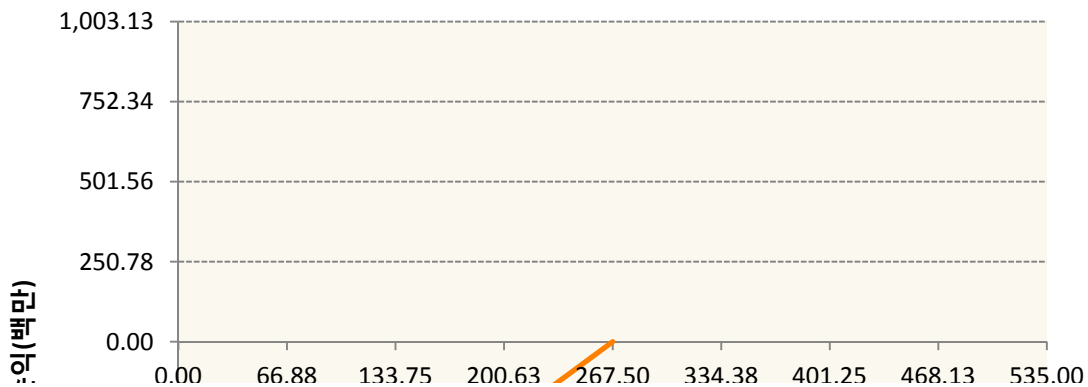
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	287	-287	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,543	-1,543	장내

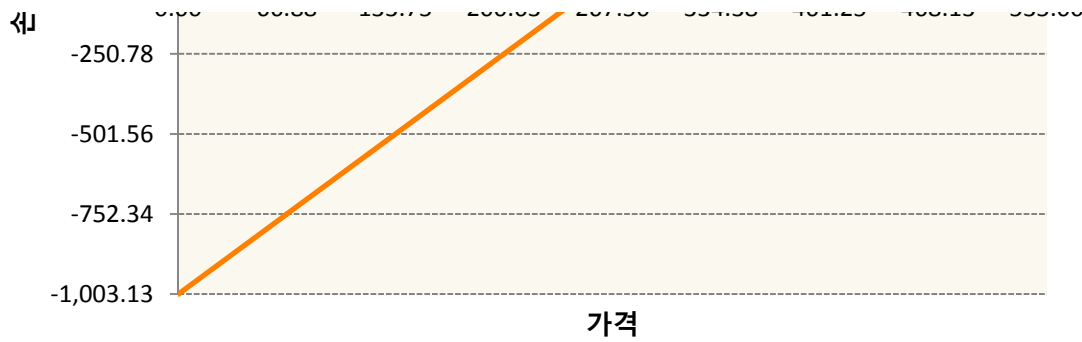
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

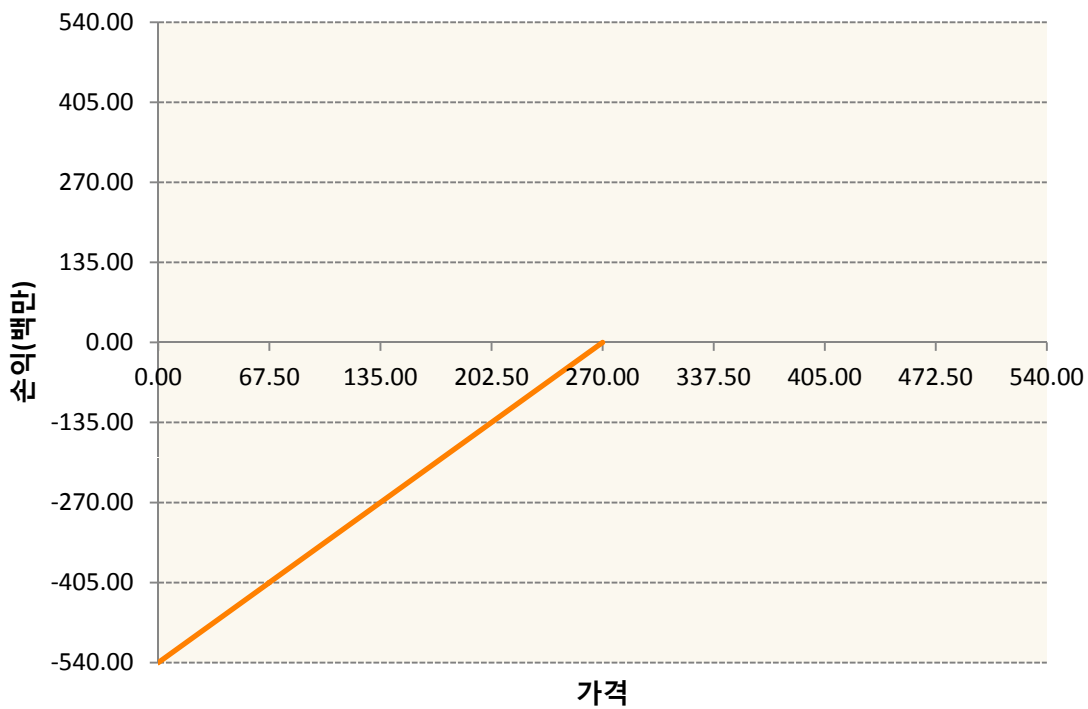


KR4301P42677-2019-04 풋267.5





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						16
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-15	-15	-15	-16	-16	-16	-16
-5.33%	0	0	-1	-1	-1	-1	-1
-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%	-1	-1	-1	-2	-2	-2	-2
-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)

19

공시일	2019-04-09
기준일	2019-04-08

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

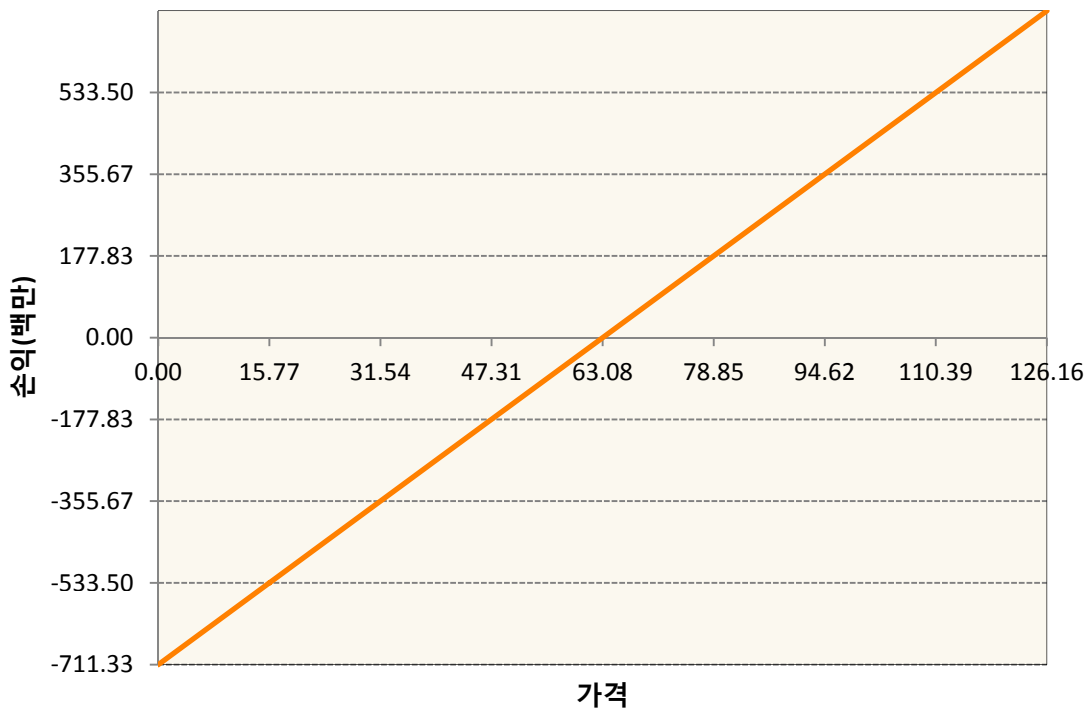
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

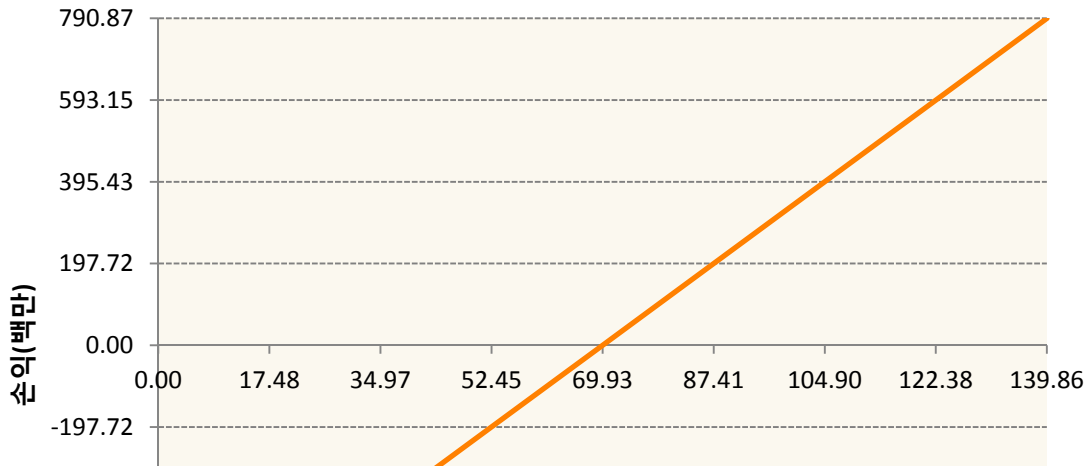
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,944	286	2,658	

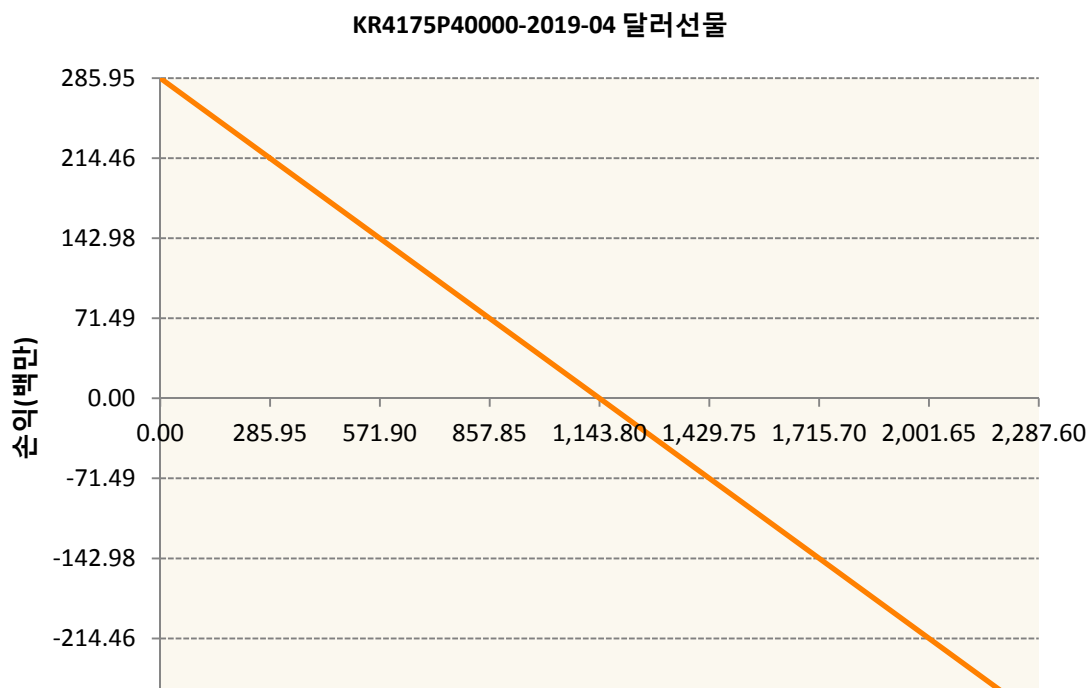
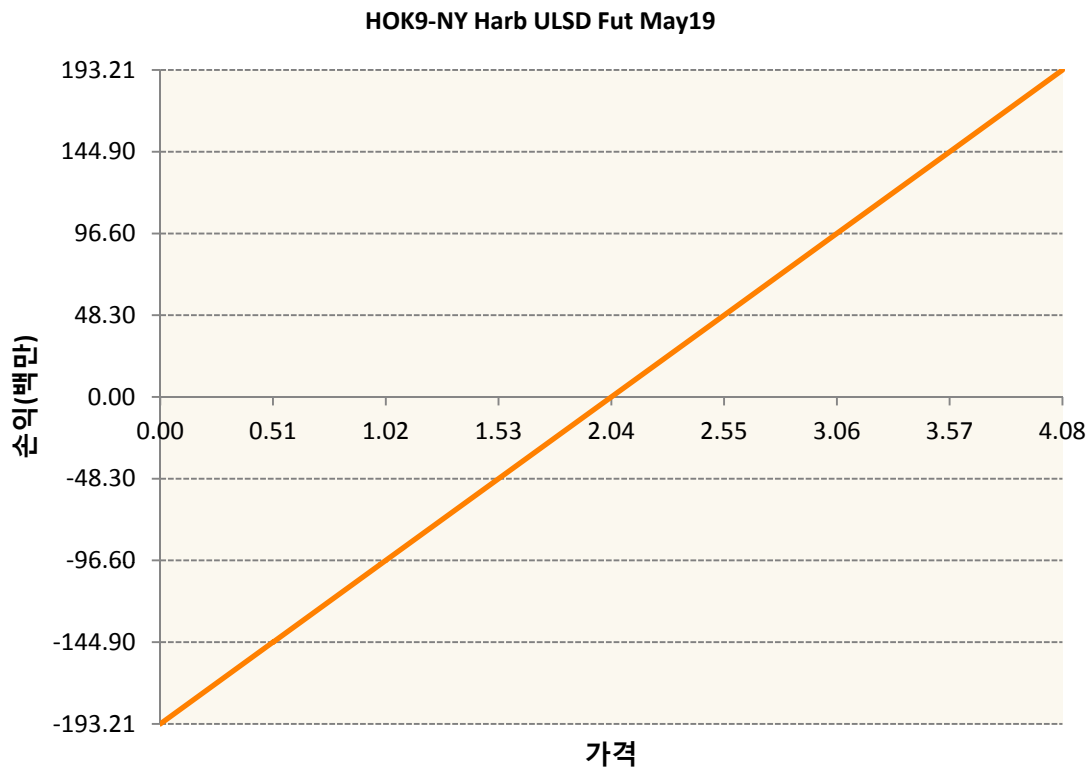
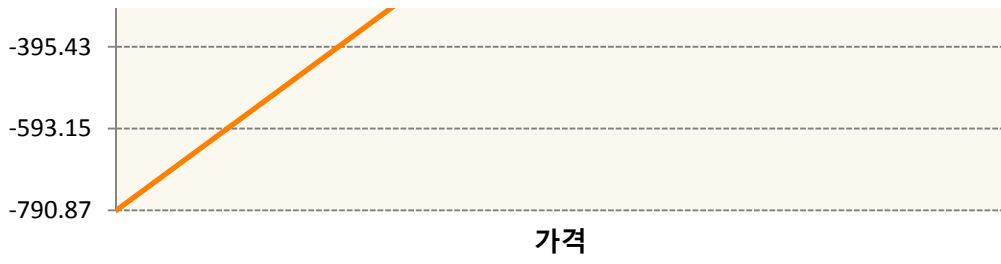
### 2. 만기시점의 손익구조

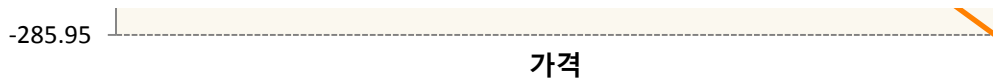
CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19



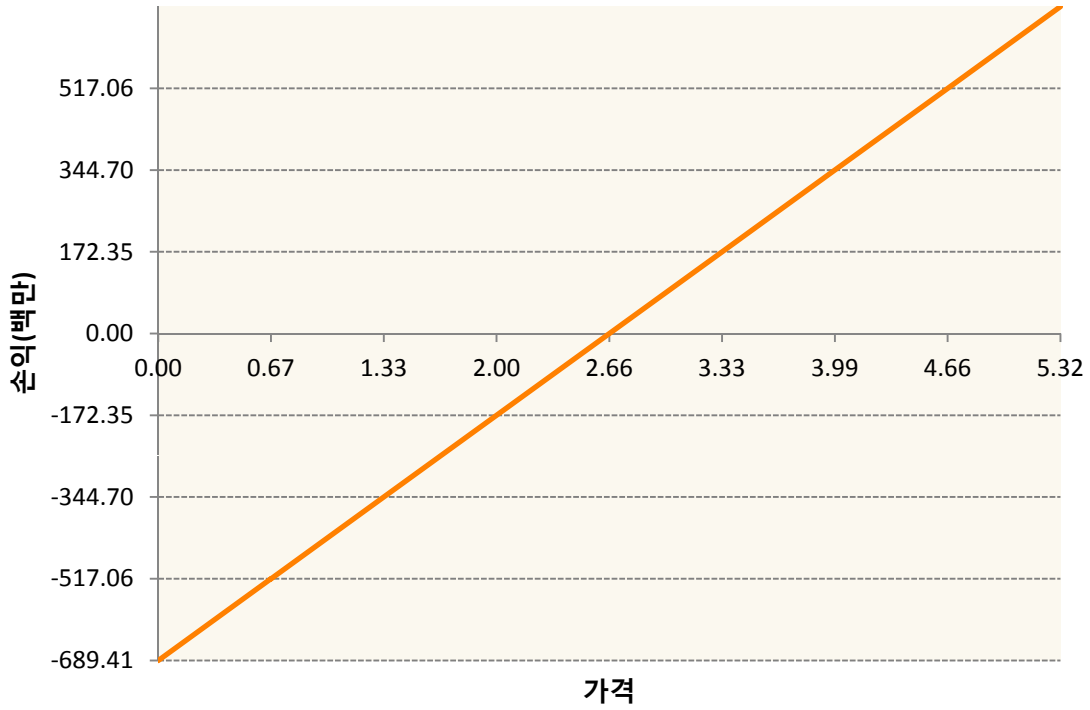
CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19



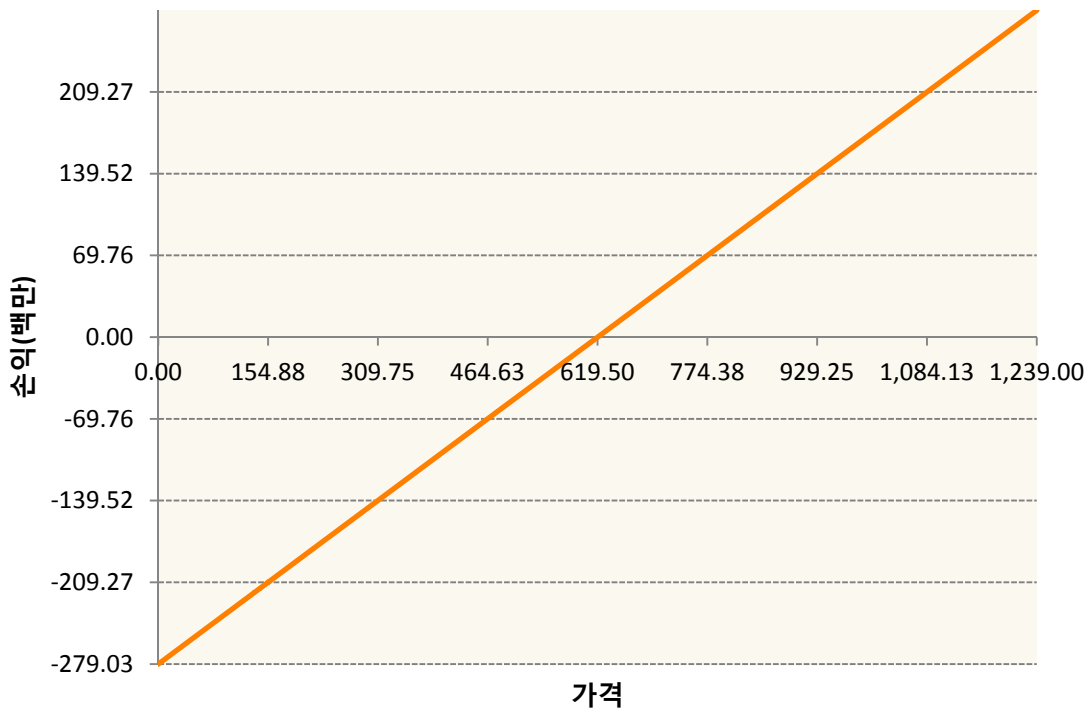




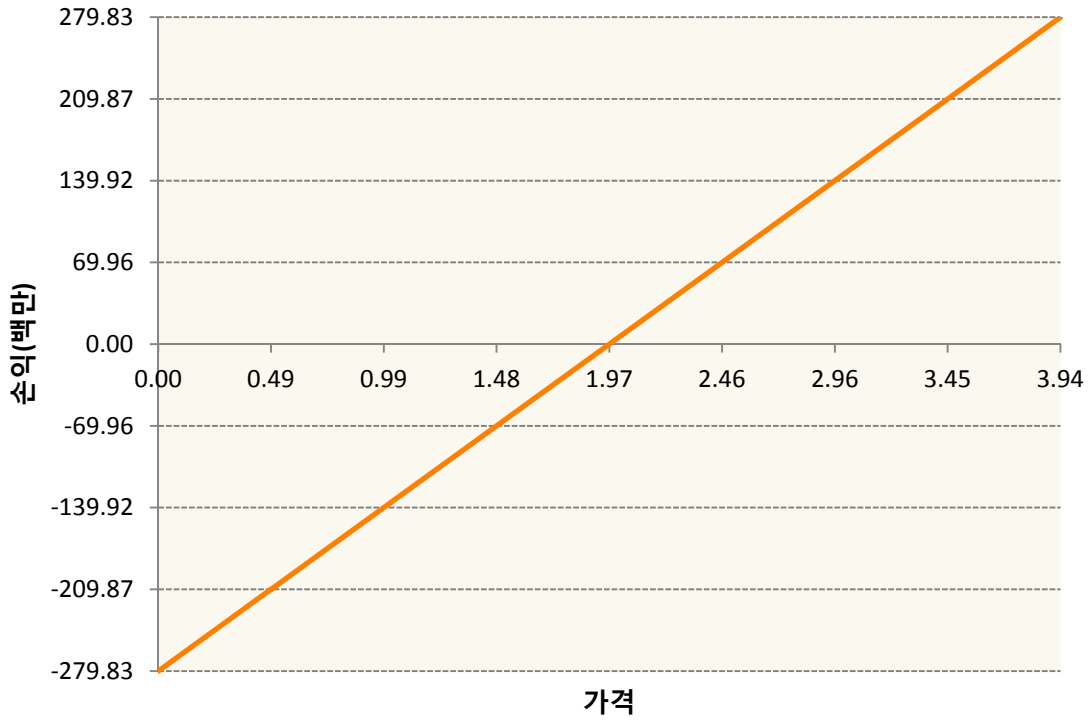
NGK19-NATURAL GAS FUTR May19



QSK9-Low Su Gasoil G May19



**XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19**



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

CLK9	WTI CRUDE FUTURE May19	57
CON9	BRENT CRUDE FUTR Jul19	63
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)

<b>441</b>
------------

공시일	2019-04-09
기준일	2019-04-08

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

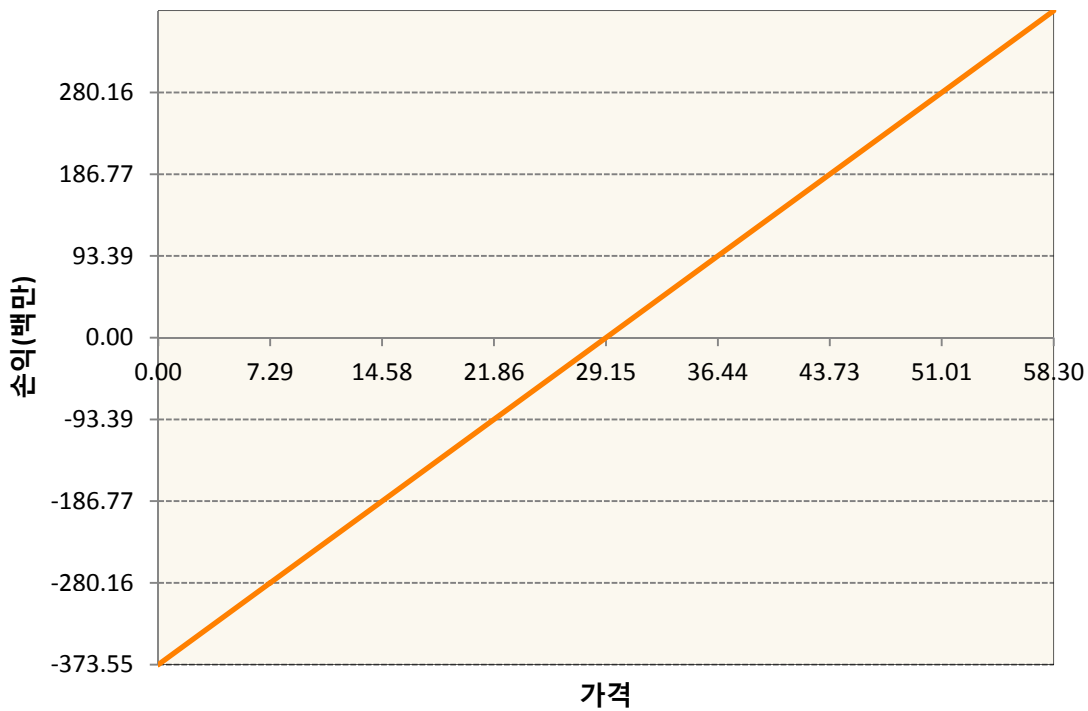
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

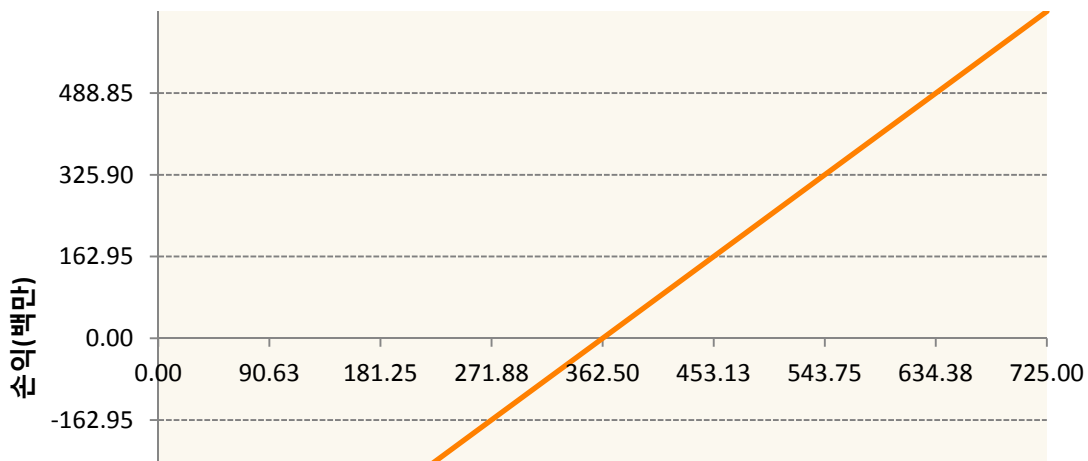
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,358	80	3,278	

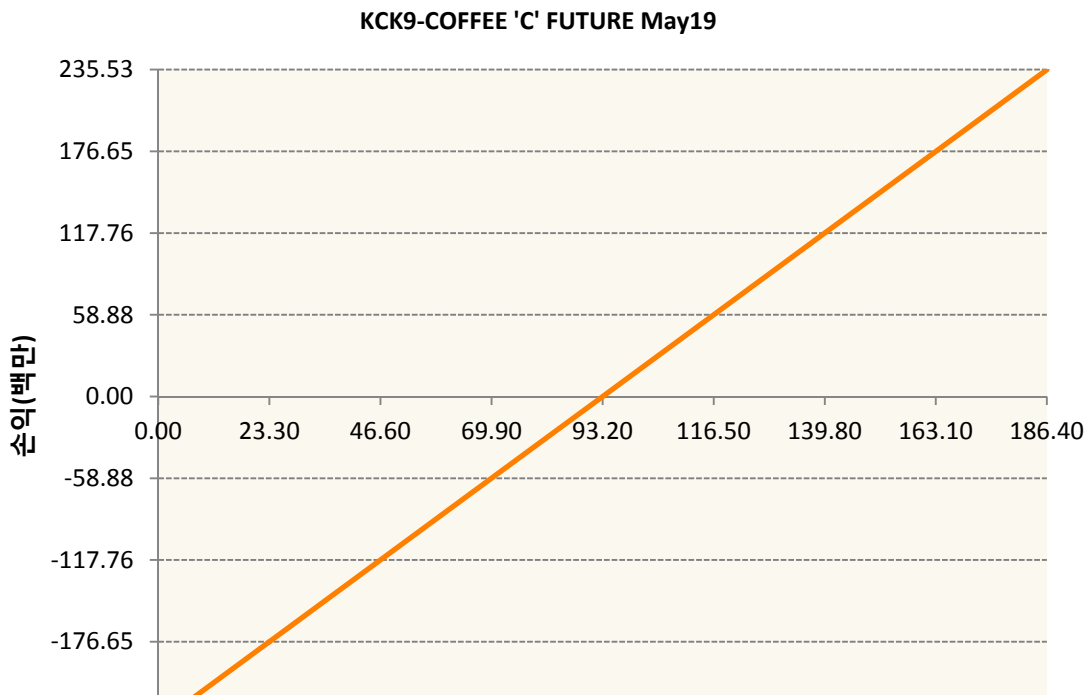
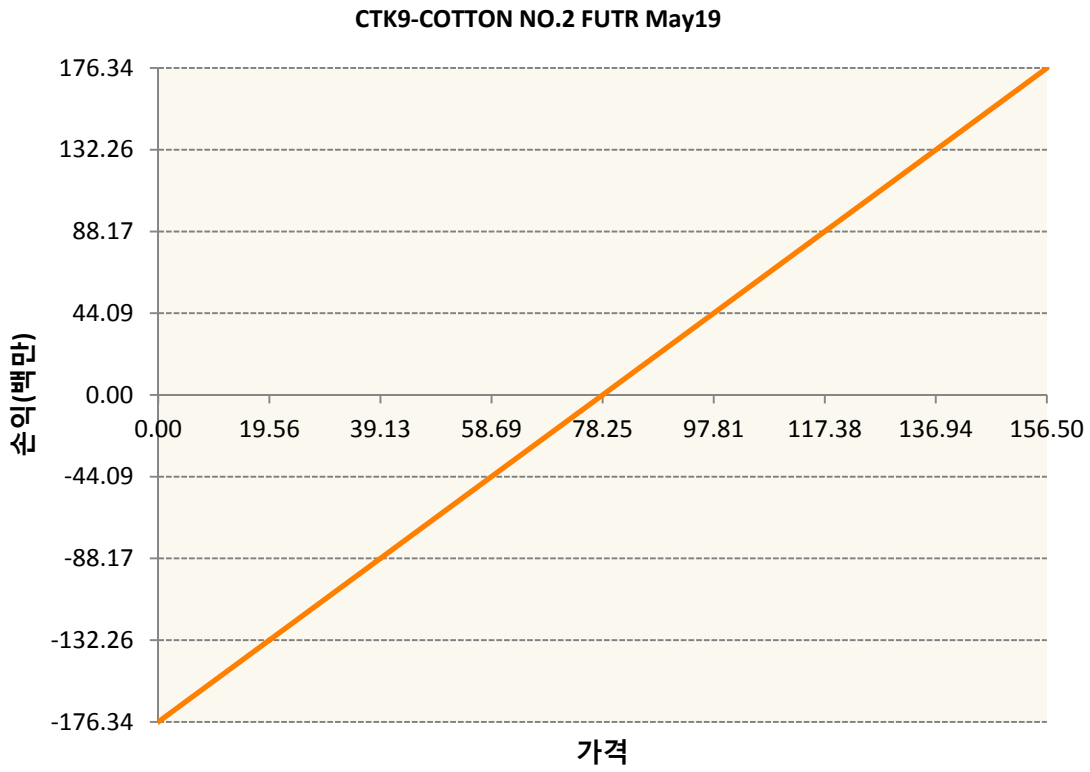
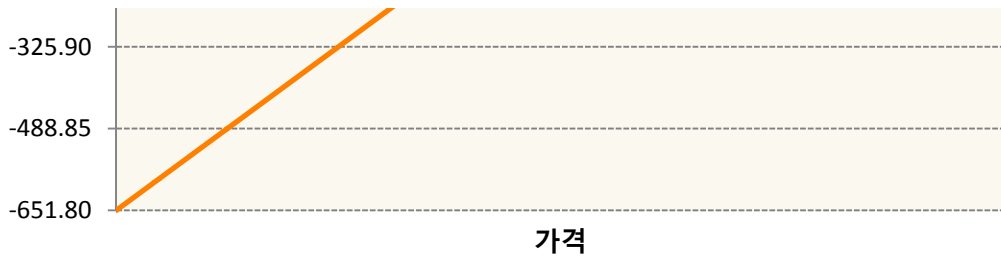
### 2. 만기시점의 손익구조

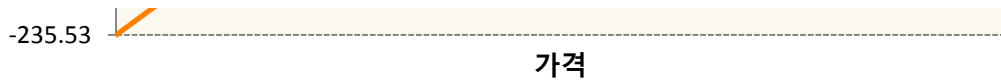
**BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19**



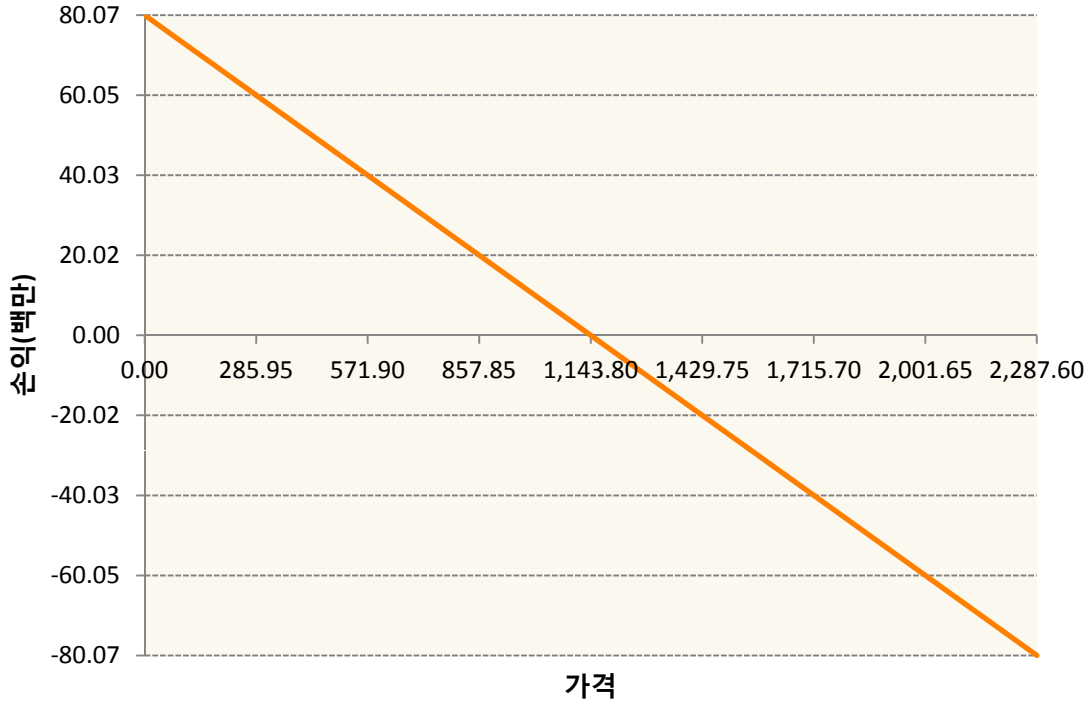
**CK9-CORN FUTURE May19**



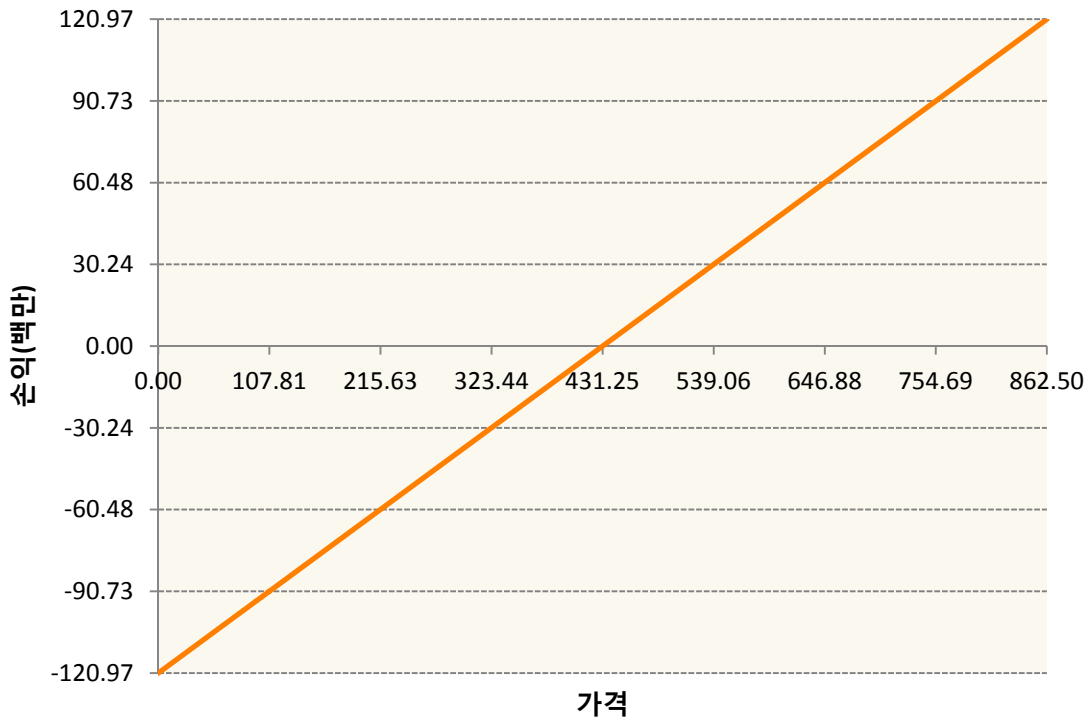




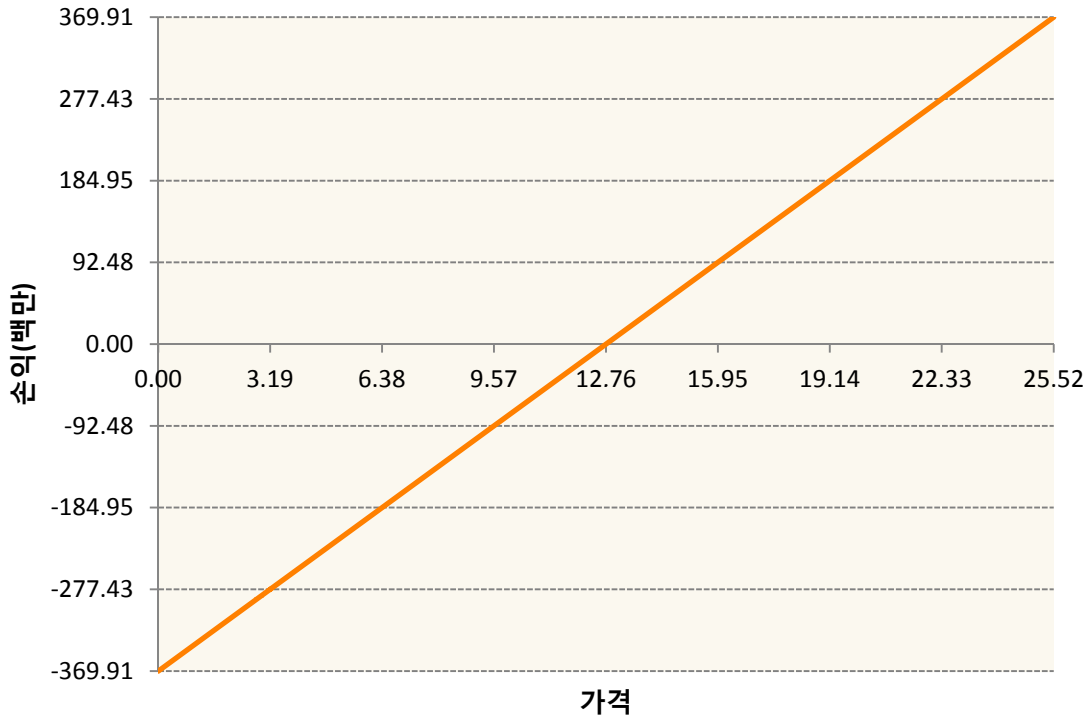
KR4175P40000-2019-04 달러선물



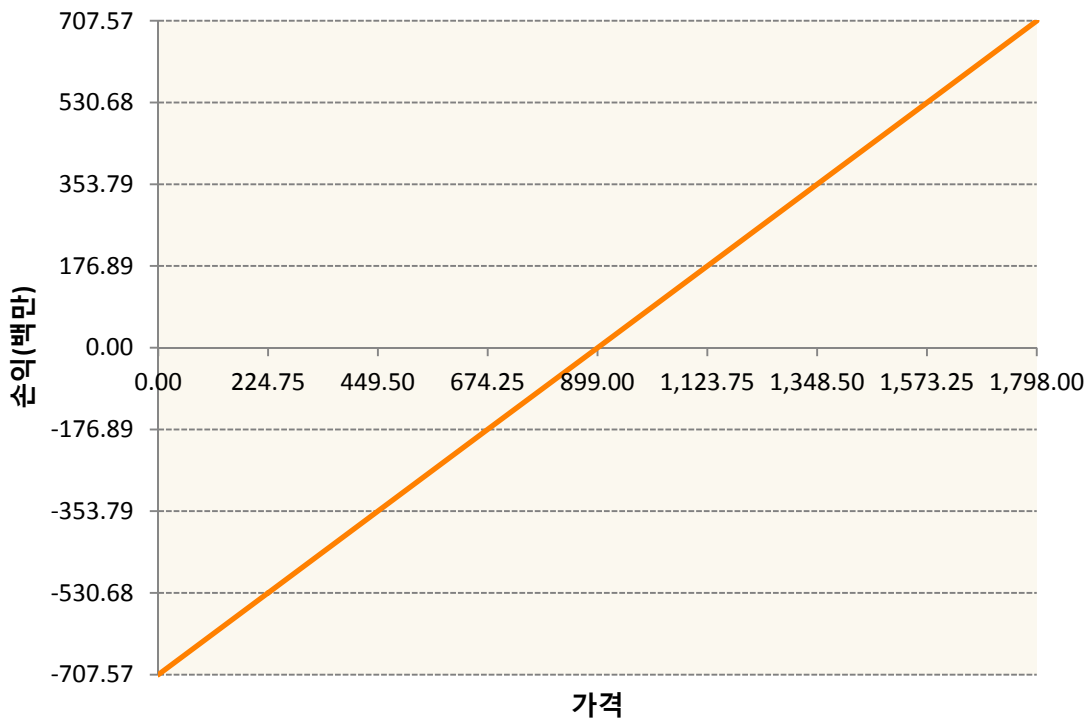
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



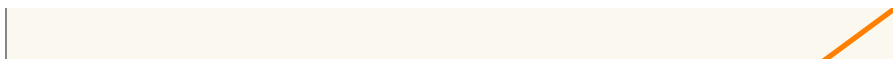
SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

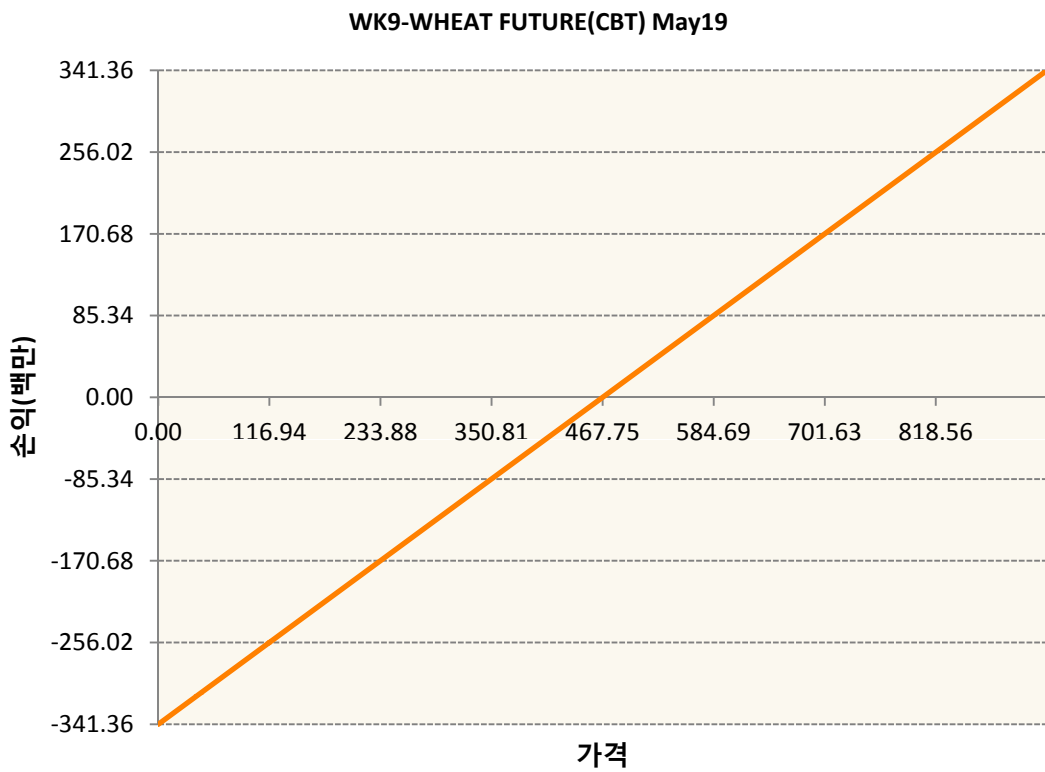
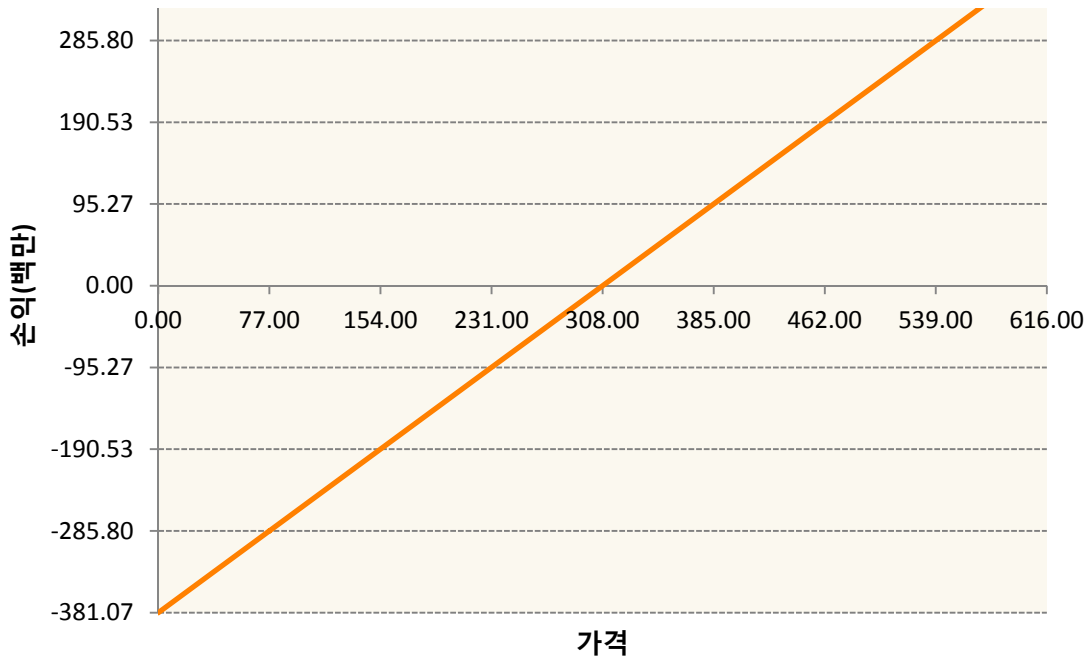


SK9-SOYBEAN FUTURE May19



SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BOK9	SOYBEAN OIL FUTR May19	30
CK9	CORN FUTURE May19	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	30
SK9	SOYBEAN FUTURE May19	57
SMK9	SOYBEAN MEAL FUTR May19	30
WK9	WHEAT FUTURE(CBT) May19	27

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

(단위:백만원)

**271**