

공시일	2019-04-10
기준일	2019-04-09

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	2019-04-10
기준일	2019-04-09

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

1,153

* 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	2019-04-10
기준일	2019-04-09

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)	366
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)

999

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-04-10
기준일	2019-04-09

유로인덱스모(주식-파생형)

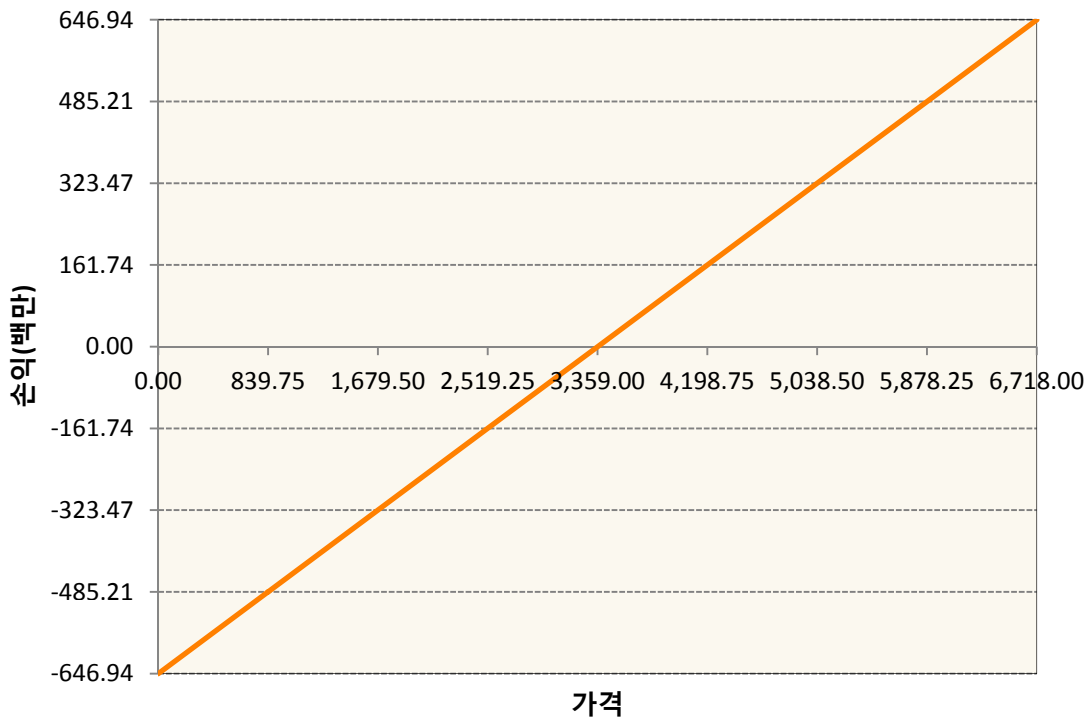
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	647	0	647	

2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	52
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

37

공시일	2019-04-10
기준일	2019-04-09

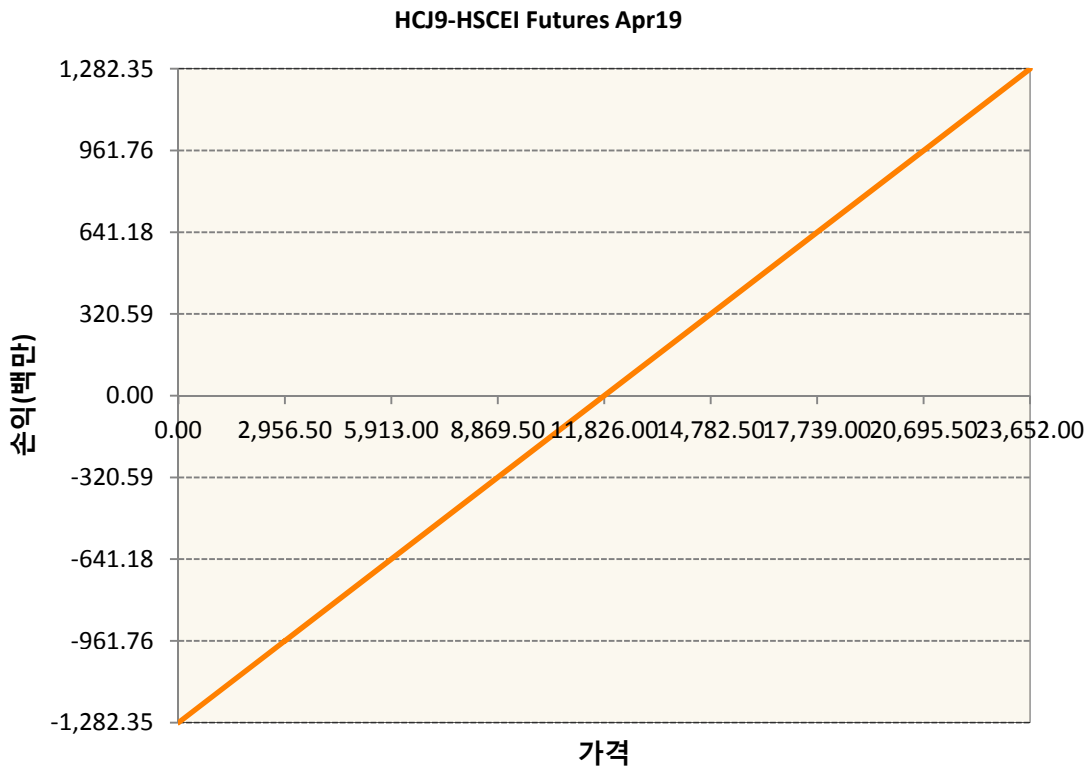
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,282	0	1,282	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ9	HSCEI Futures Apr19	103
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

105

공시일	2019-04-10
기준일	2019-04-09

커버드콜모(주식혼합-파생형)

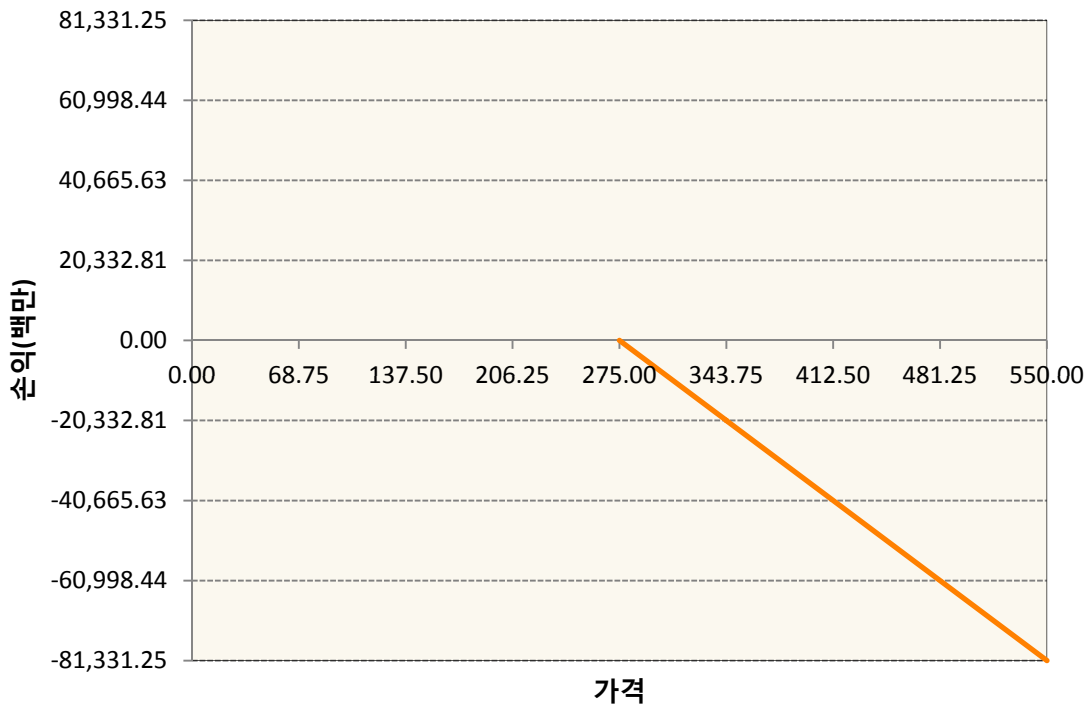
1. 계약금액

(단위:백만원)

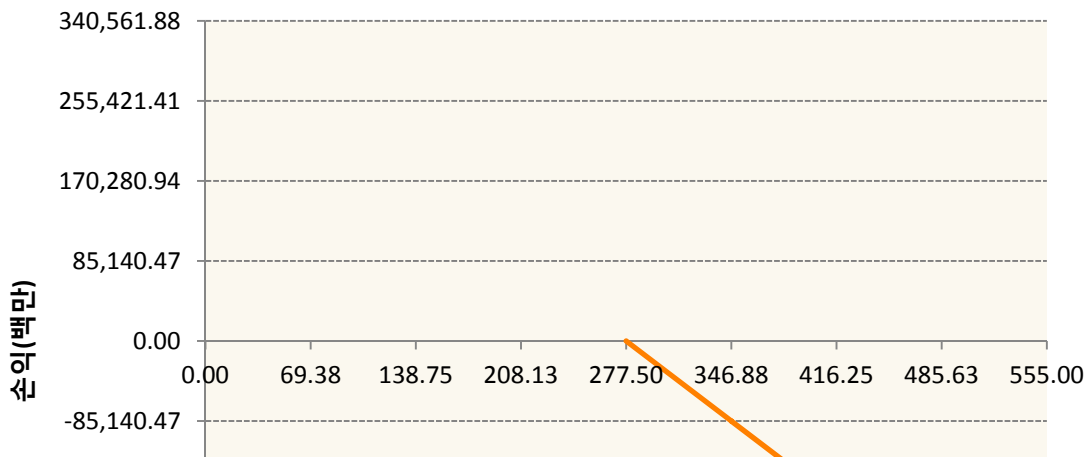
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	653,056	-653,056	장내

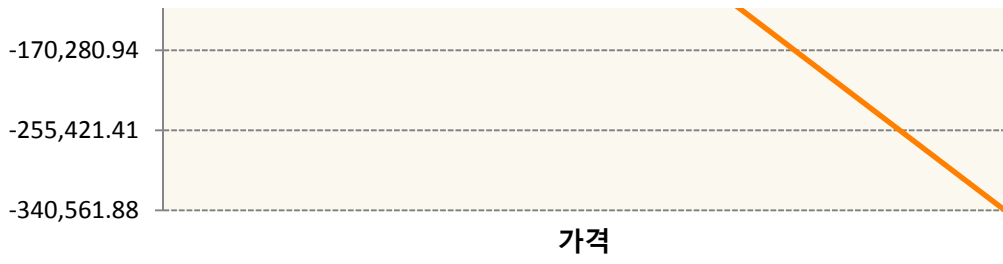
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P42752-2019-04 콜275

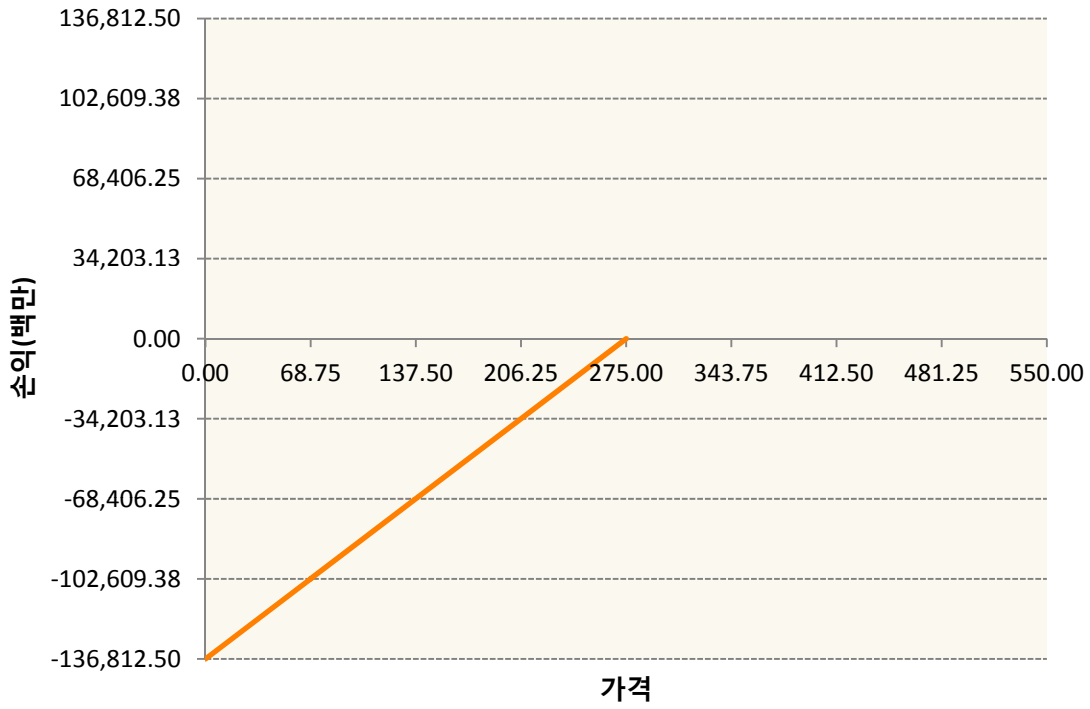


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

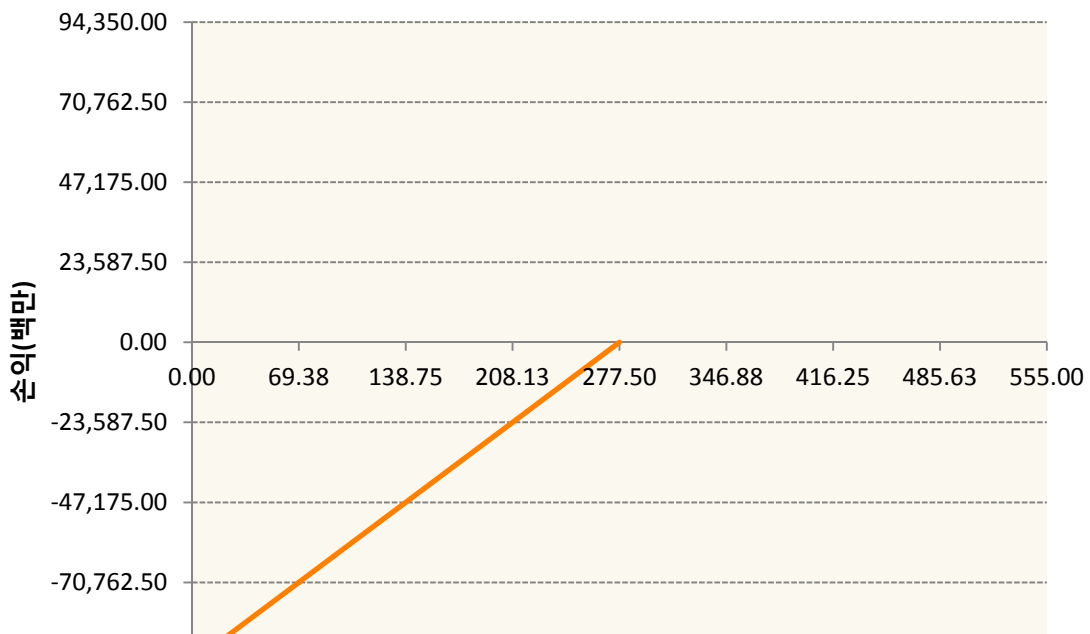




KR4301P42750-2019-04 풋275



KR4301P42776-2019-04 풋277.5



-94,350.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P42752		2019-04 콜275						6,779
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,465	3,465	3,464	3,461	3,458	3,453	3,447	
-5.33%	3,377	3,347	3,315	3,280	3,244	3,206	3,168	
-2.67%	2,194	2,166	2,136	2,104	2,069	2,033	1,996	
0%	4	3	2	0	-4	-9	-16	
2.67%	-2,257	-2,257	-2,257	-2,257	-2,257	-2,257	-2,257	
5.33%	-4,518	-4,518	-4,518	-4,518	-4,518	-4,518	-4,518	
8.00%	-6,779	-6,779	-6,779	-6,779	-6,779	-6,779	-6,779	
KR4201P42778		2019-04 콜277.5						28,073
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	11,369	11,368	11,367	11,365	11,361	11,354	11,344	
-5.33%	11,286	11,231	11,163	11,081	10,988	10,884	10,771	
-2.67%	8,464	8,281	8,095	7,907	7,718	7,527	7,335	
0%	64	51	30	0	-41	-92	-153	
2.67%	-9,309	-9,309	-9,309	-9,309	-9,310	-9,313	-9,317	
5.33%	-18,691	-18,691	-18,691	-18,691	-18,691	-18,691	-18,691	
8.00%	-28,073	-28,073	-28,073	-28,073	-28,073	-28,073	-28,073	
KR4301P42750		2019-04 풋275						5,587
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-5,587	-5,587	-5,587	-5,587	-5,587	-5,587	-5,587	
-5.33%	-1,796	-1,804	-1,816	-1,831	-1,848	-1,868	-1,889	
-2.67%	-7	-13	-21	-33	-47	-63	-82	
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						4,668
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-4,668	-4,668	-4,668	-4,668	-4,668	-4,668	-4,668	
-5.33%	-2,069	-2,070	-2,070	-2,072	-2,074	-2,077	-2,081	
-2.67%	-80	-103	-126	-150	-175	-201	-227	
0%	0	0	0	0	0	0	-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

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

(단위:백만원)

41,016

공시일	2019-04-10
기준일	2019-04-09

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

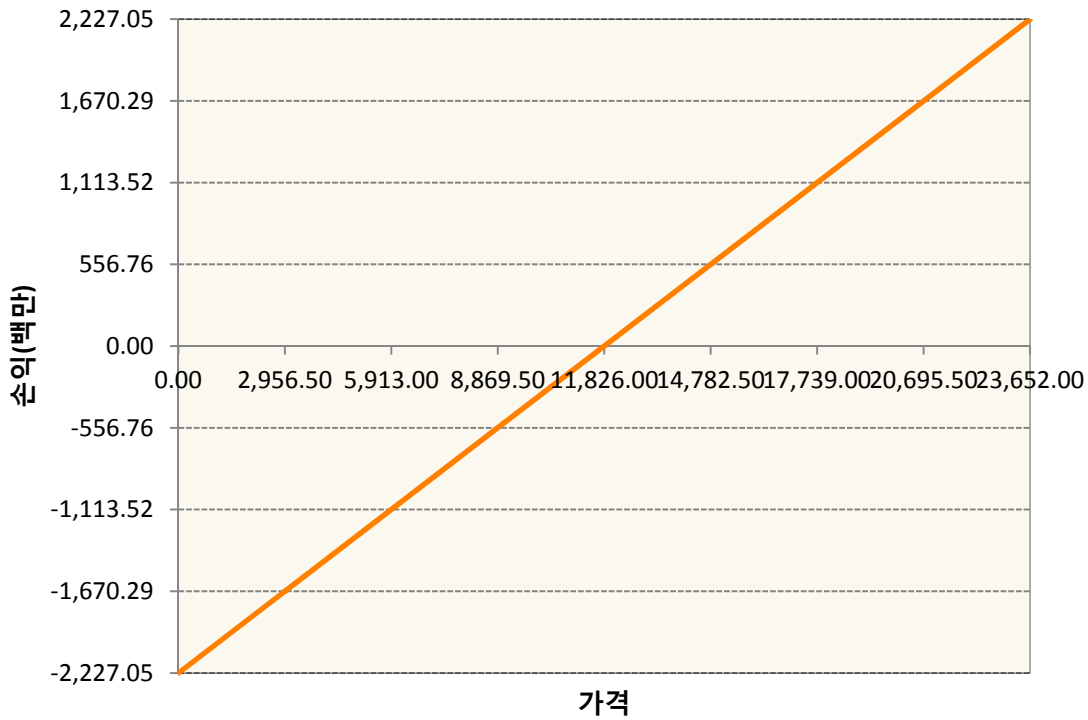
1. 계약금액

(단위:백만원)

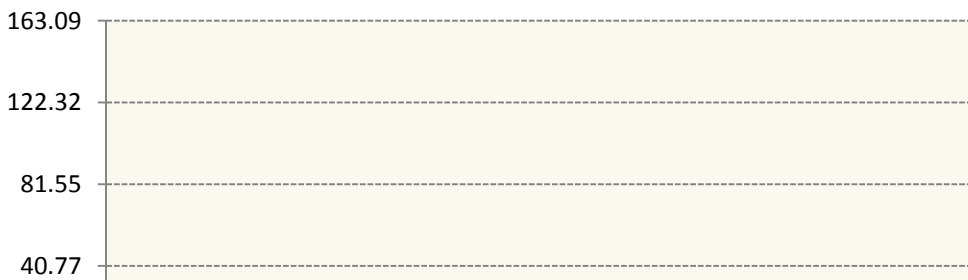
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,227	0	2,227	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,592	-5,592	장내
누계	통화	선도	0	3,058	-3,058	장외

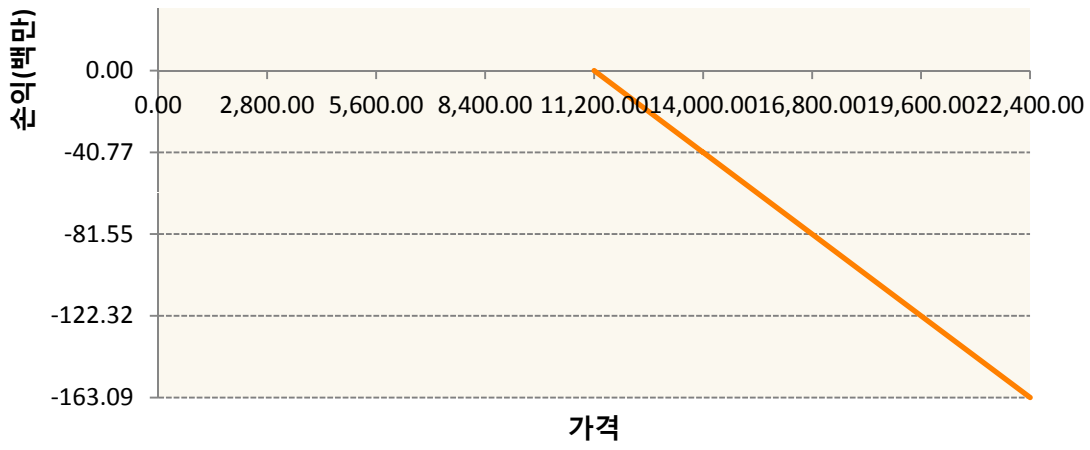
2. 만기시점의 손익구조

HCJ9-HSCEI Futures Apr19

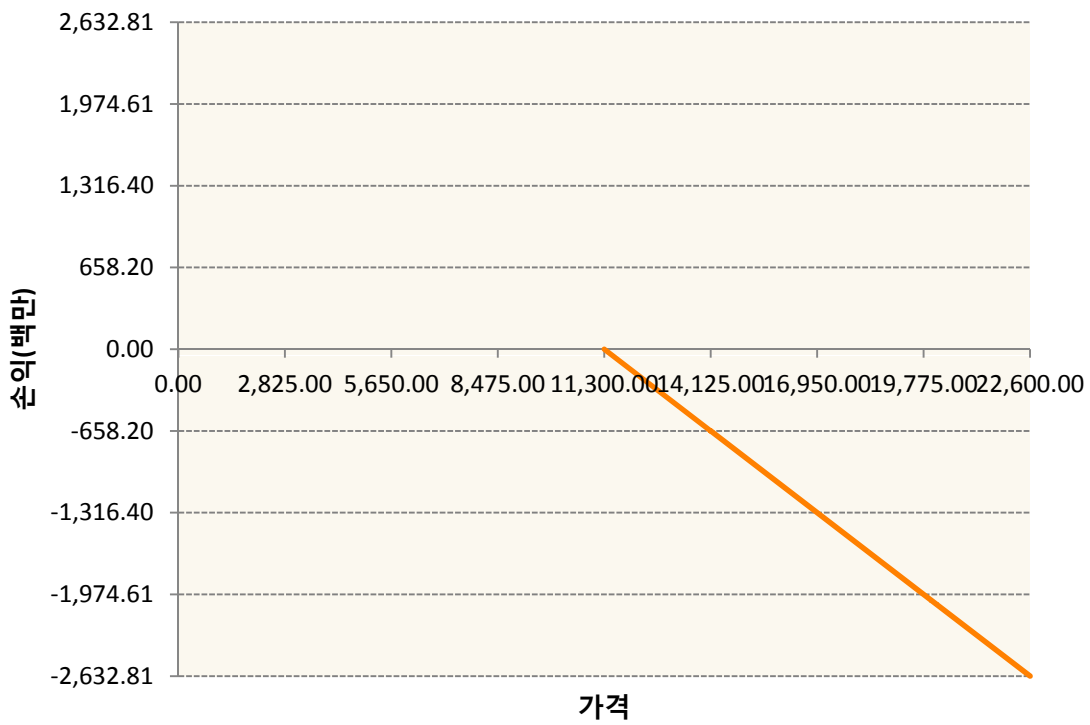


OHHIJ9-C112-HSCEI

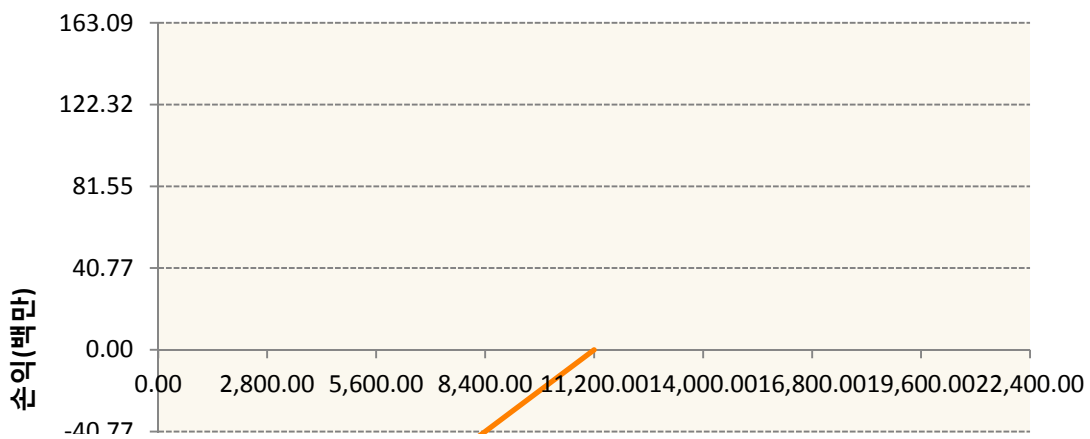


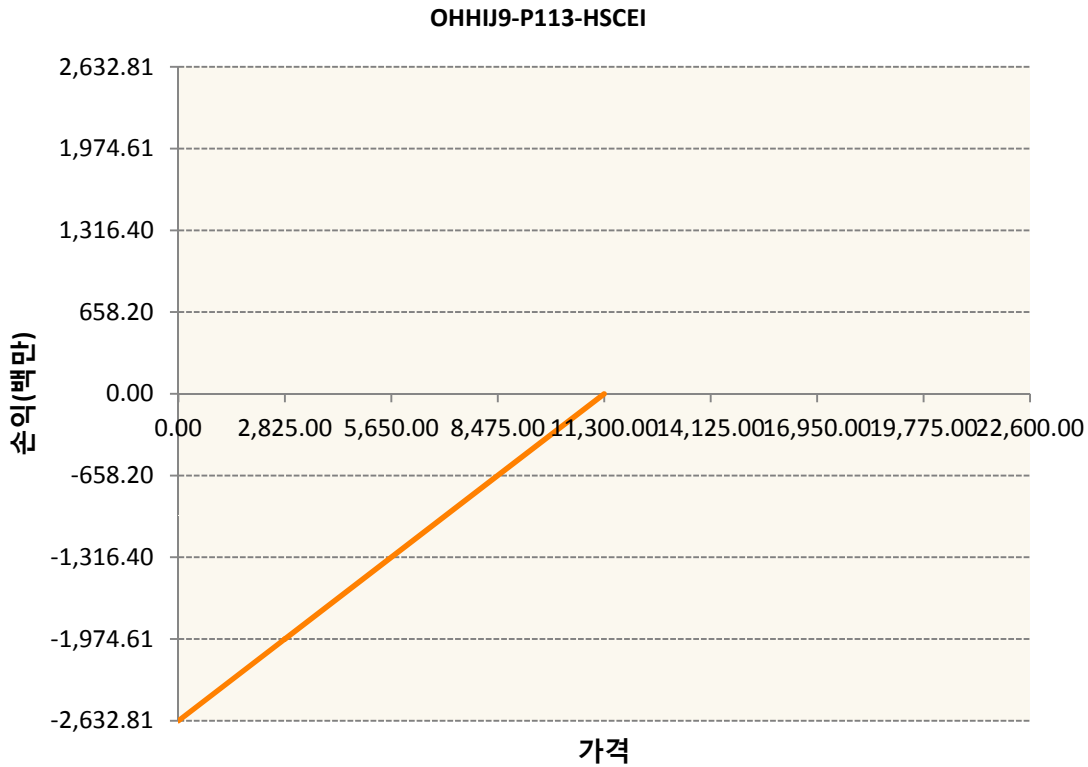
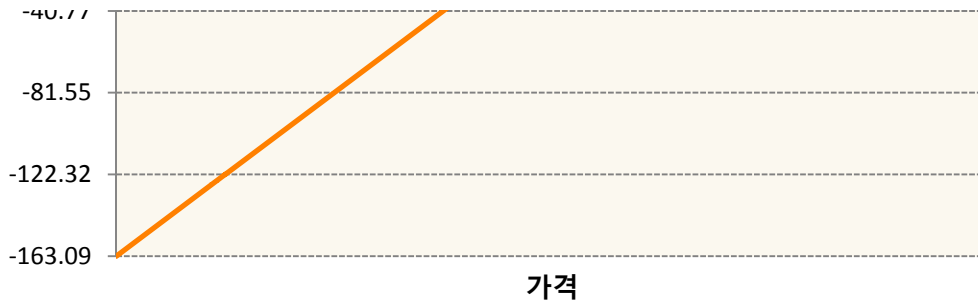


OHHIJ9-C113-HSCEI



OHHIJ9-P112-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	221
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)
	724

공시일	2019-04-10
기준일	2019-04-09

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

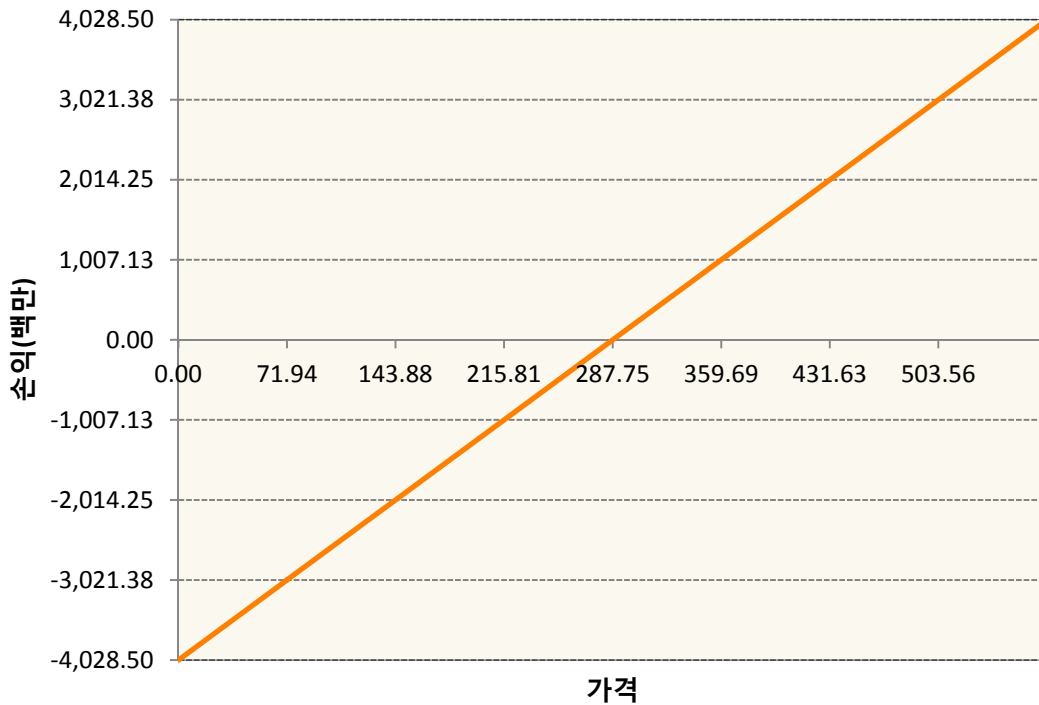
1. 계약금액

(단위:백만원)

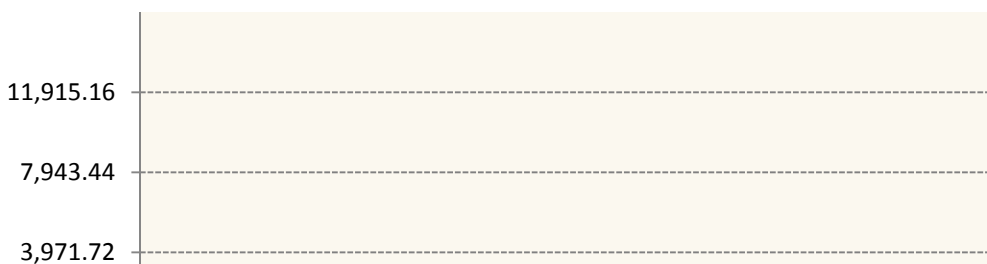
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,029	0	4,029	장내
누계	유가증권	스왑	35,836	0	35,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	33,678	-33,678	장내

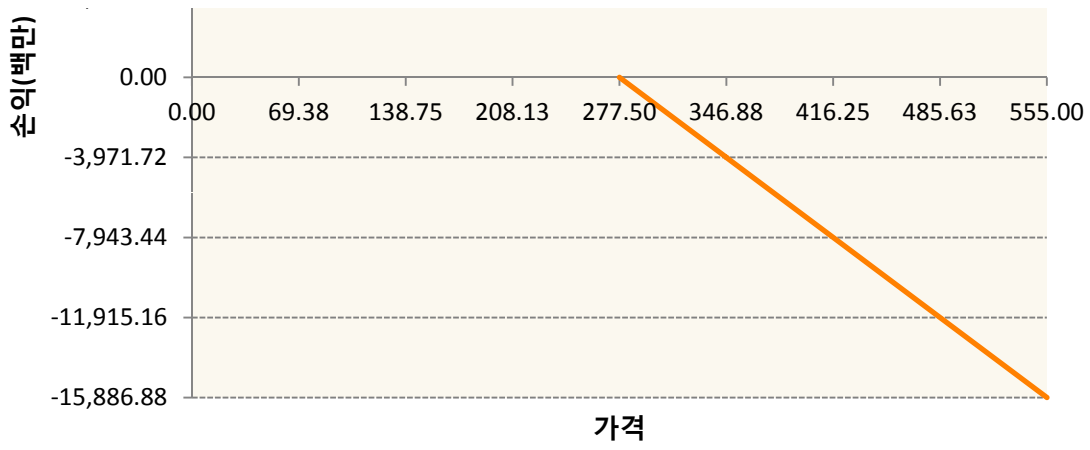
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

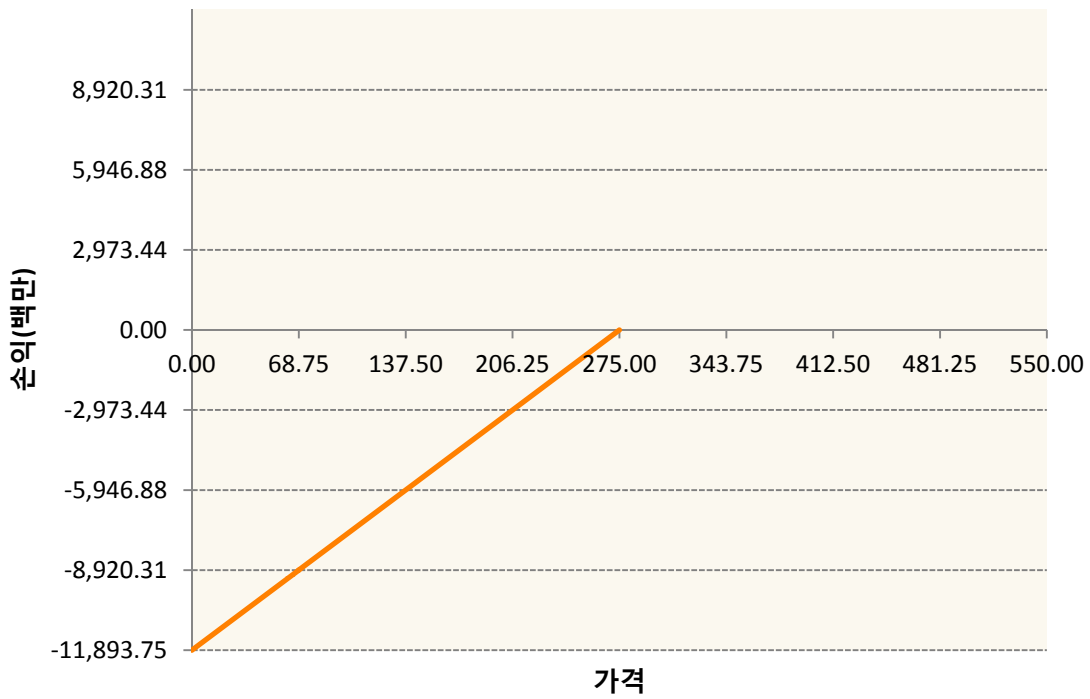


KR4201P42778-2019-04 콜277.5

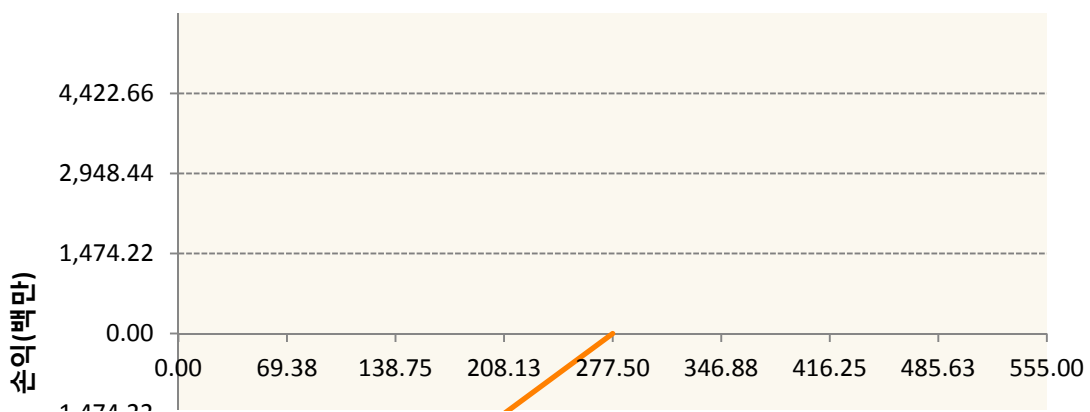


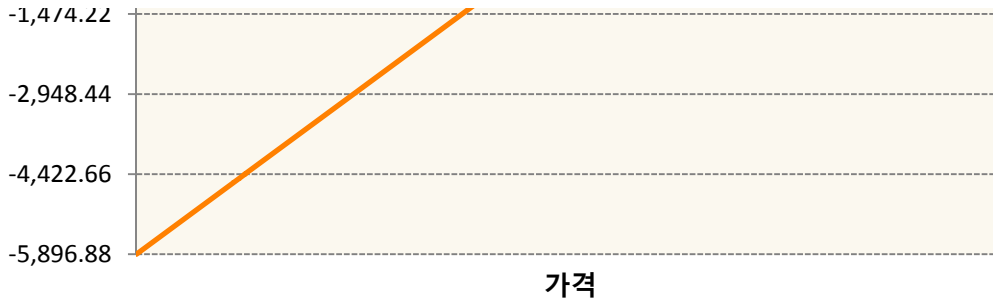


KR4301P42750-2019-04 풋275



KR4301P42776-2019-04 풋277.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,449
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,449	-2,449	-2,449	-2,449	-2,449	-2,449	-2,449	
-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%	2,449	2,449	2,449	2,449	2,449	2,449	2,449	
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						1,310
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	530	530	530	530	530	530	529
-5.33%	526	524	521	517	513	508	502
-2.67%	395	386	378	369	360	351	342
0%	3	2	1	0	-2	-4	-7
2.67%	-434	-434	-434	-434	-434	-434	-435
5.33%	-872	-872	-872	-872	-872	-872	-872
8.00%	-1,310	-1,310	-1,310	-1,310	-1,310	-1,310	-1,310
KR4301P42750 2019-04 풋275							486
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-486	-486	-486	-486	-486	-486	-486
-5.33%	-156	-157	-158	-159	-161	-162	-164
-2.67%	-1	-1	-2	-3	-4	-5	-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
KR4301P42776 2019-04 풋277.5							292
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-292	-292	-292	-292	-292	-292	-292
-5.33%	-129	-129	-129	-129	-130	-130	-130
-2.67%	-5	-6	-8	-9	-11	-13	-14
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)

4,917

공시일	2019-04-10
기준일	2019-04-09

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

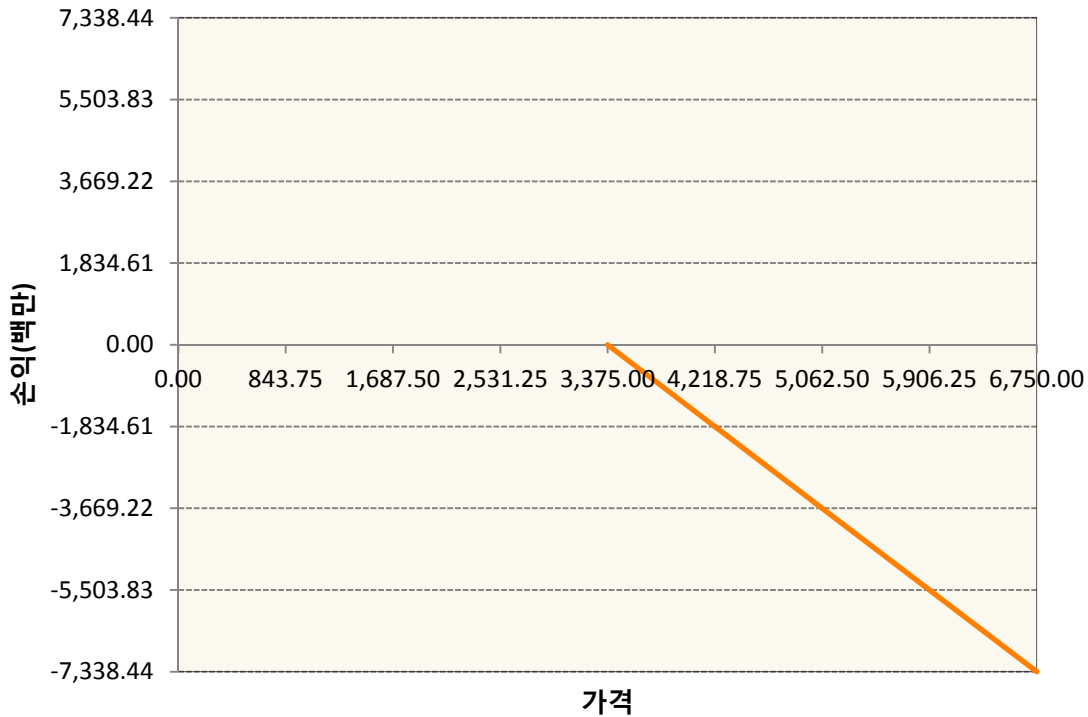
1. 계약금액

(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	6,469	0	6,469	
누계	유가증권	스왑	60,740	0	60,740	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,575	-26,575	장내
누계	통화	선도	0	15,439	-15,439	장외

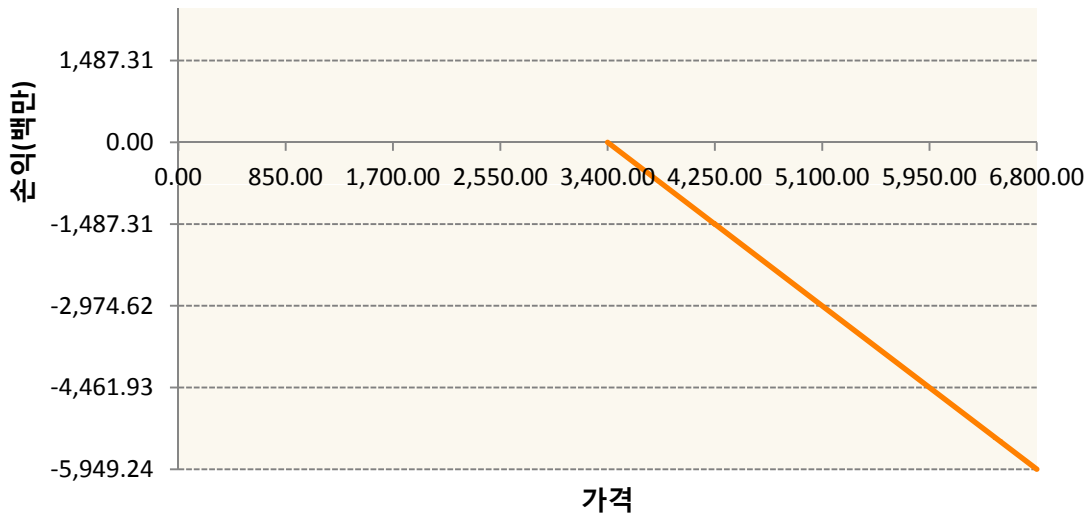
2. 만기시점의 손익구조

OESXJ9-C3375-EURO STOXX 50

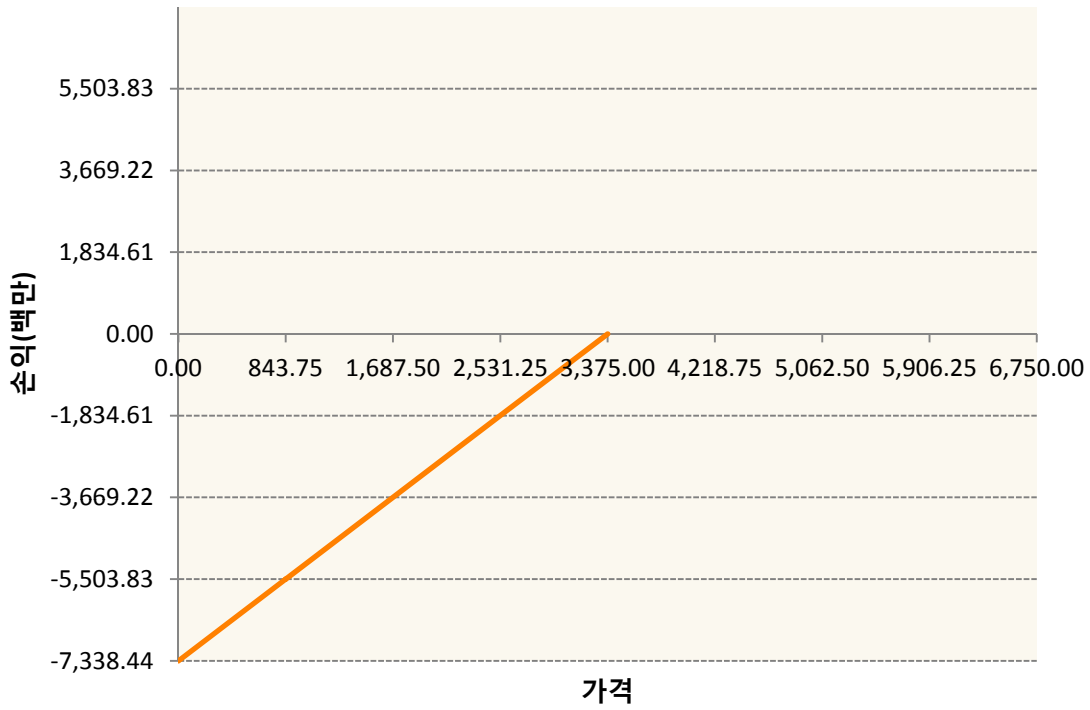


OESXJ9-C3400-EURO STOXX 50

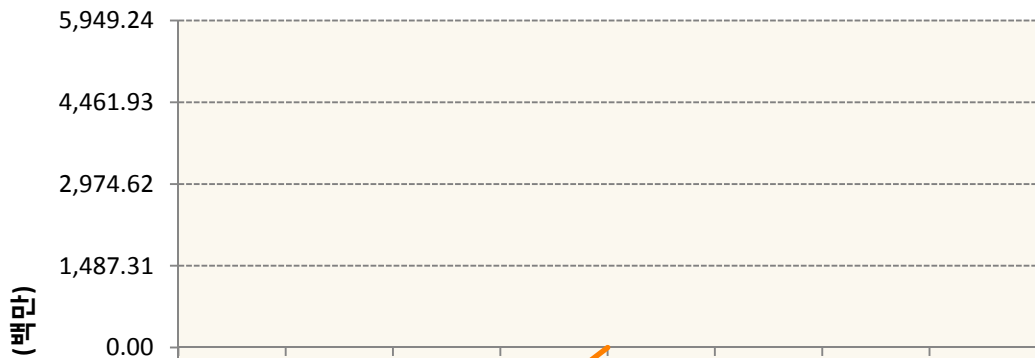


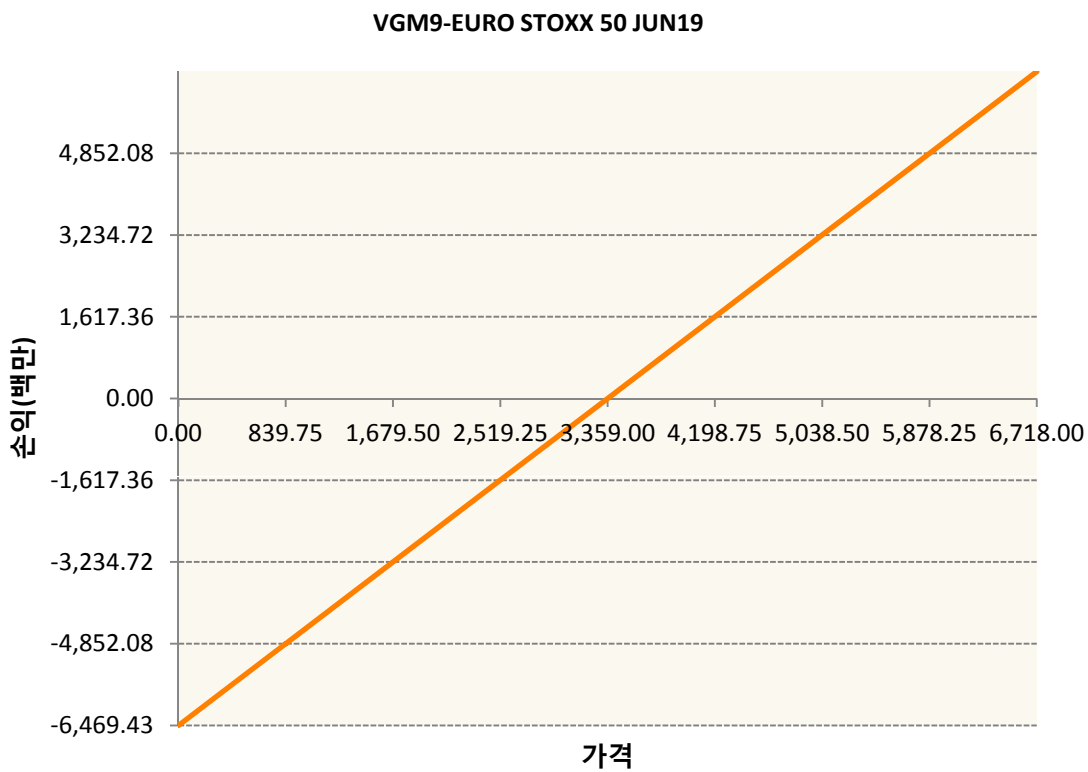
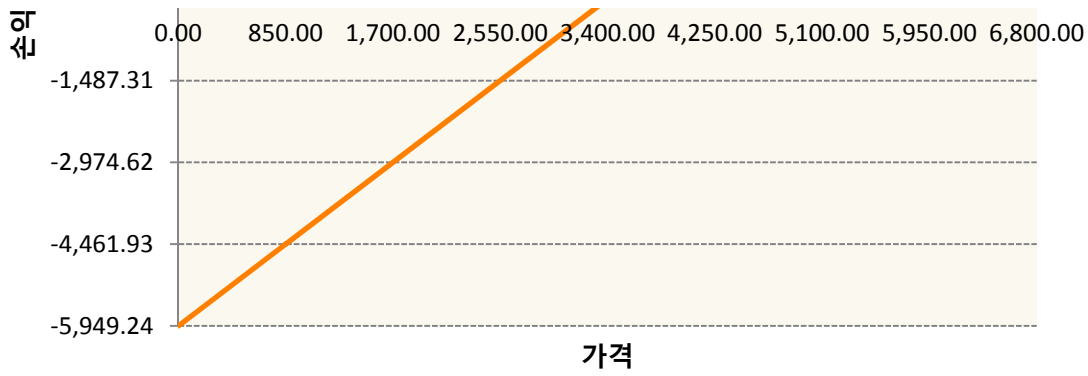


OESXJ9-P3375-EURO STOXX 50



OESXJ9-P3400-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	195
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	412
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	823
OESXJ9-C33' EURO STOXX 50	587
OESXJ9-C34' EURO STOXX 50	476
OESXJ9-P33' EURO STOXX 50	587
OESXJ9-P34' EURO STOXX 50	476
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	518

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

(단위:백만원)

2,719

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

(단위:백만원)

1,107

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

(단위:백만원)

95

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

(단위:백만원)

137

공시일	2019-04-10
기준일	2019-04-09

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

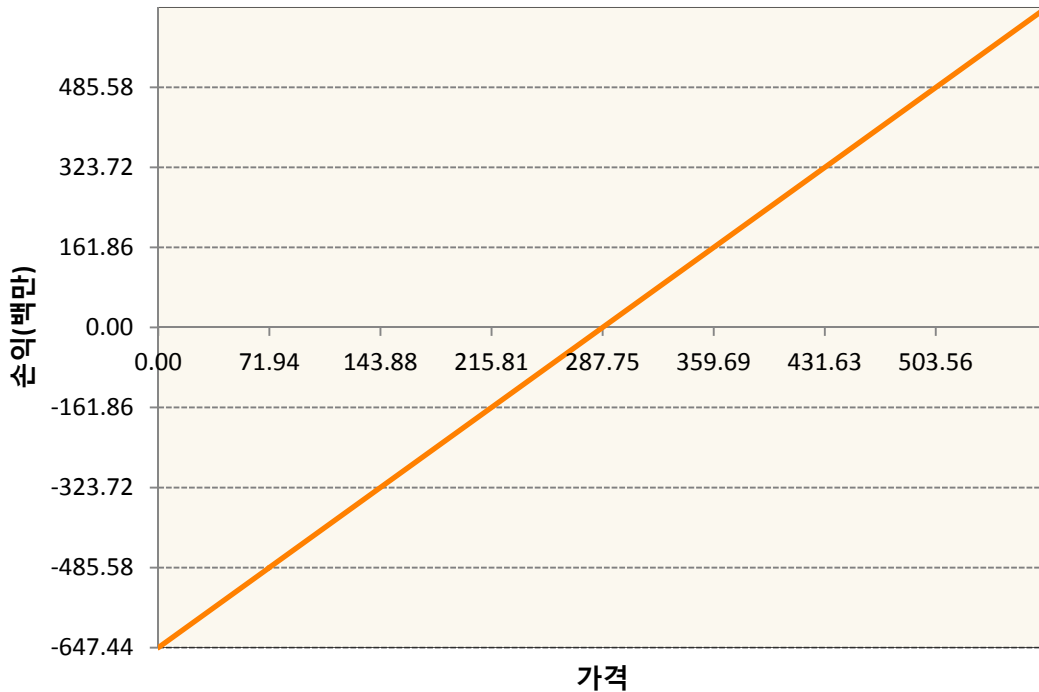
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	647	0	647	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						52
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52	
-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%	52	52	52	52	52	52	52	

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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-04-10
기준일	2019-04-09

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

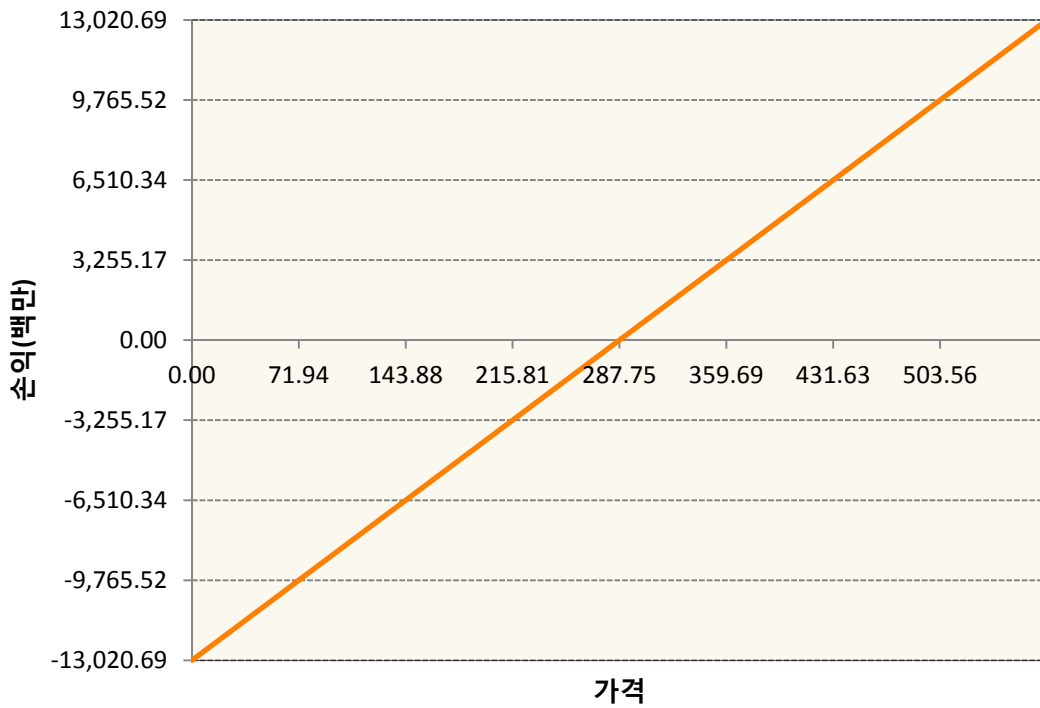
1. 계약금액

(단위:백만원)

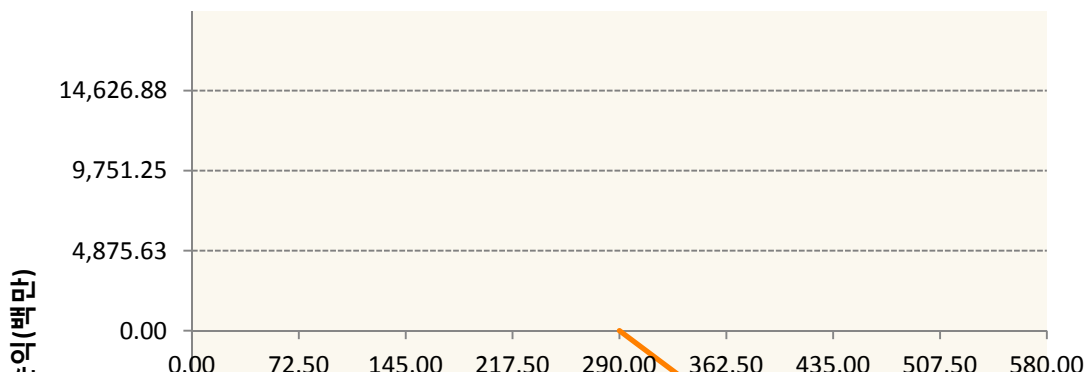
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,021	0	13,021	장내
누계	유가증권	옵션	1,867	24,036	-22,169	장내

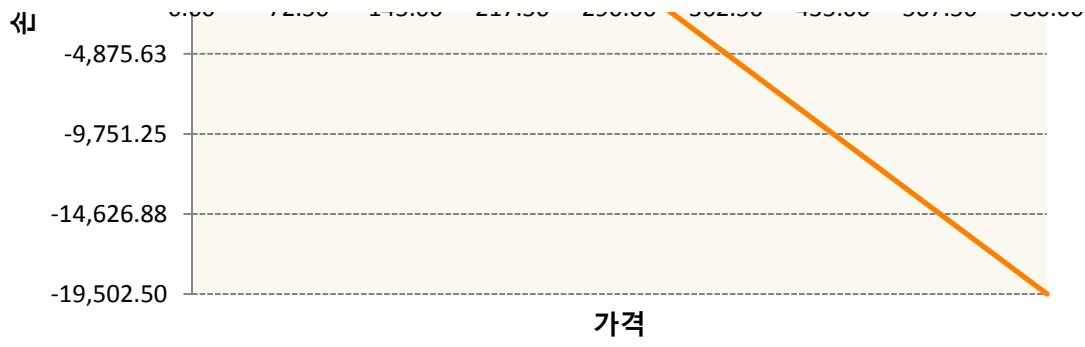
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

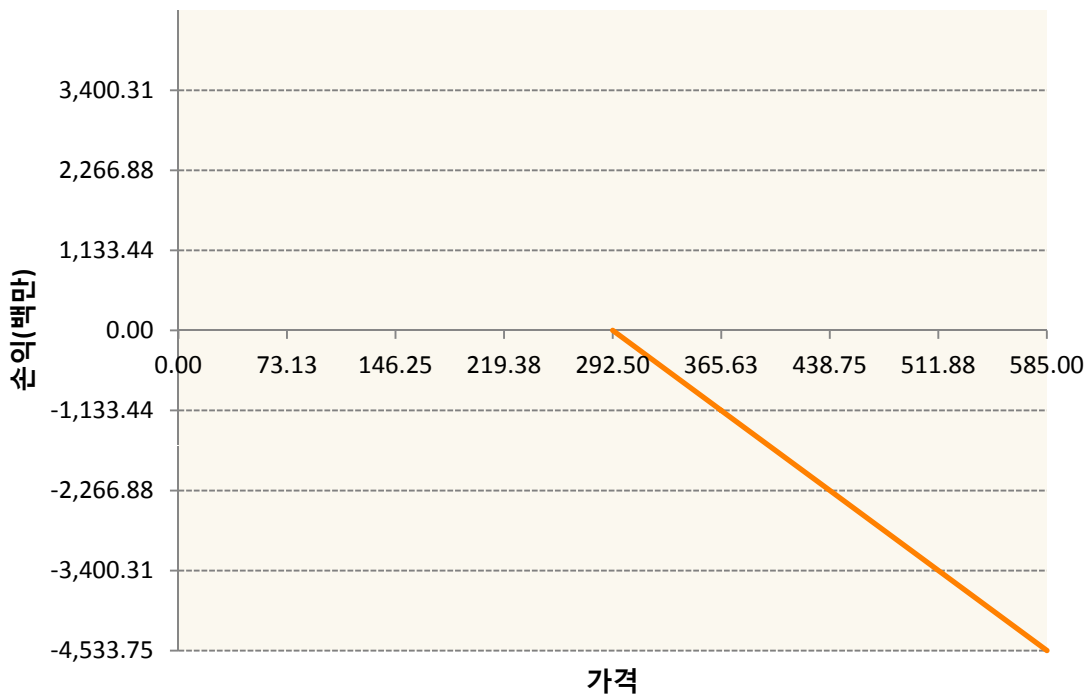


KR4201P42901-2019-04 콜290

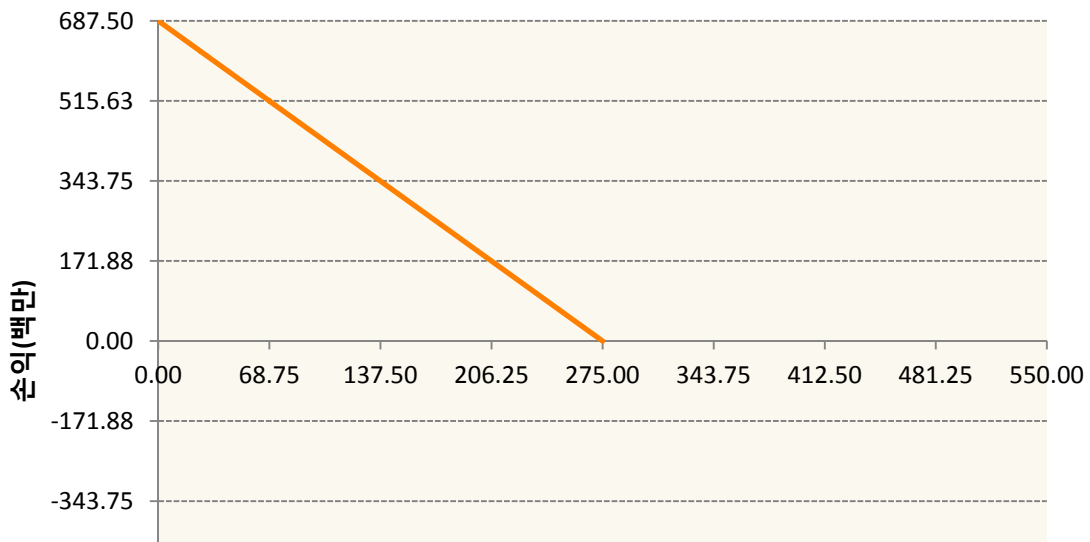


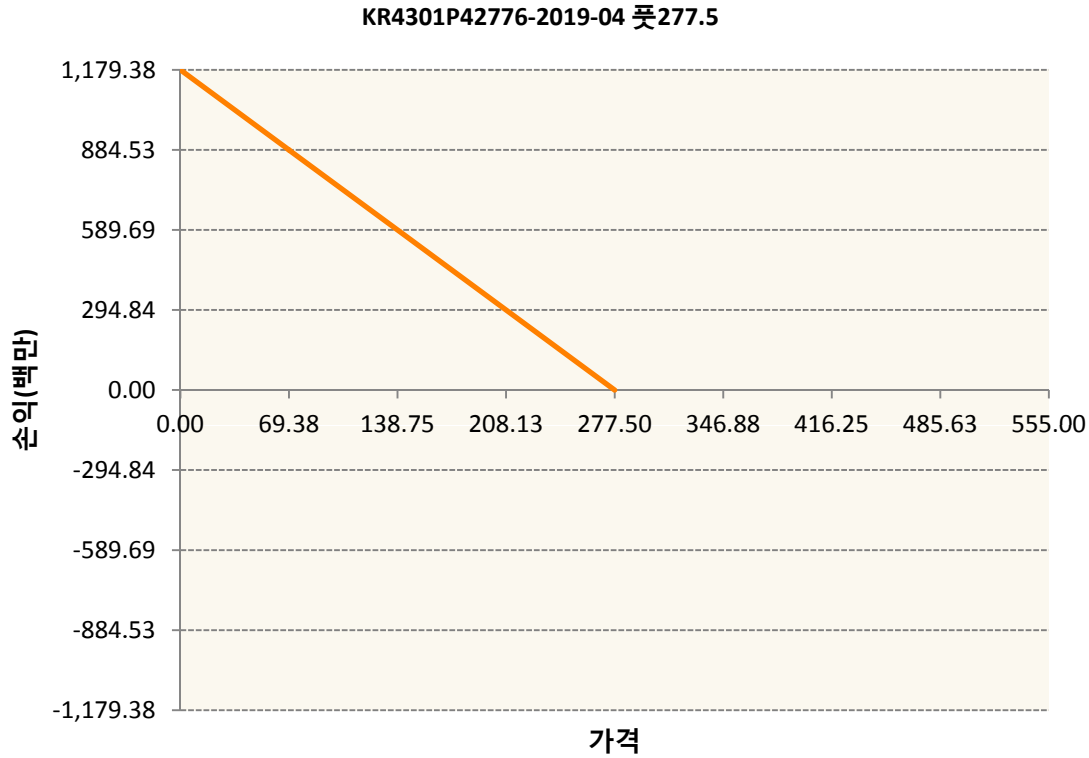
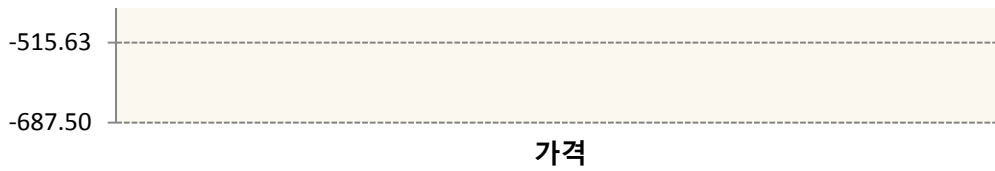


KR4201P42927-2019-04 콜292.5



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						1,268
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	52	52	52	52	52	52	52	
-5.33%	52	52	52	52	52	52	52	
-2.67%	52	52	52	51	50	48	46	

0%	25	17	9	0	-9	-19	-29
2.67%	-257	-263	-270	-278	-286	-295	-304
5.33%	-754	-754	-755	-755	-756	-758	-760
8.00%	-1,268	-1,268	-1,268	-1,268	-1,268	-1,268	-1,268
KR4201P42927 2019-04 콜292.5							261
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	5	5	5	5	5	5
-5.33%	5	5	5	5	5	5	5
-2.67%	5	5	5	5	5	5	4
0%	3	2	1	0	-1	-3	-5
2.67%	-36	-38	-41	-43	-46	-48	-51
5.33%	-142	-143	-143	-143	-144	-145	-145
8.00%	-261	-261	-261	-261	-261	-261	-261
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%	9	9	9	9	9	9	9
-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
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	26	26	26	26
-2.67%	1	1	2	2	2	3	3
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

2,615

공시일	2019-04-10
기준일	2019-04-09

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	2019-04-10
기준일	2019-04-09

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	571	0	571	
누계	유가증권	수익증권	19,749	0	19,749	

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	2019-04-10
기준일	2019-04-09

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	914	0	914	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	71,294	0	71,294	
누계	통화	선도	0	77,309	-77,309	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	91
FX21019H01 KRW/USD 10-04-19E	110
FX21019H01 KRW/USD 19-04-19E	146
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	119
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	208
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	256
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E	155
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E	365
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E	429
FX21019H03 KRW/USD 22-04-19E	365
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	365
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	420
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	183
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	457
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	530
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	322
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	274
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E	46
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E	91
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E	91
FX21019J001 KRW/USD 10-05-19E	45
FX21019J004 KRW/USD 10-06-19E	101
FX21019J006 KRW/USD 10-05-19E	155
FX21019J007 KRW/USD 10-05-19E	73

FX21019J008 KRW/USD 10-05-19E
FX21019J009 KRW/USD 10-05-19E
FX21019J009 KRW/USD 10-05-19E

274
228
73

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

(단위:백만원)

2,112

공시일	2019-04-10
기준일	2019-04-09

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

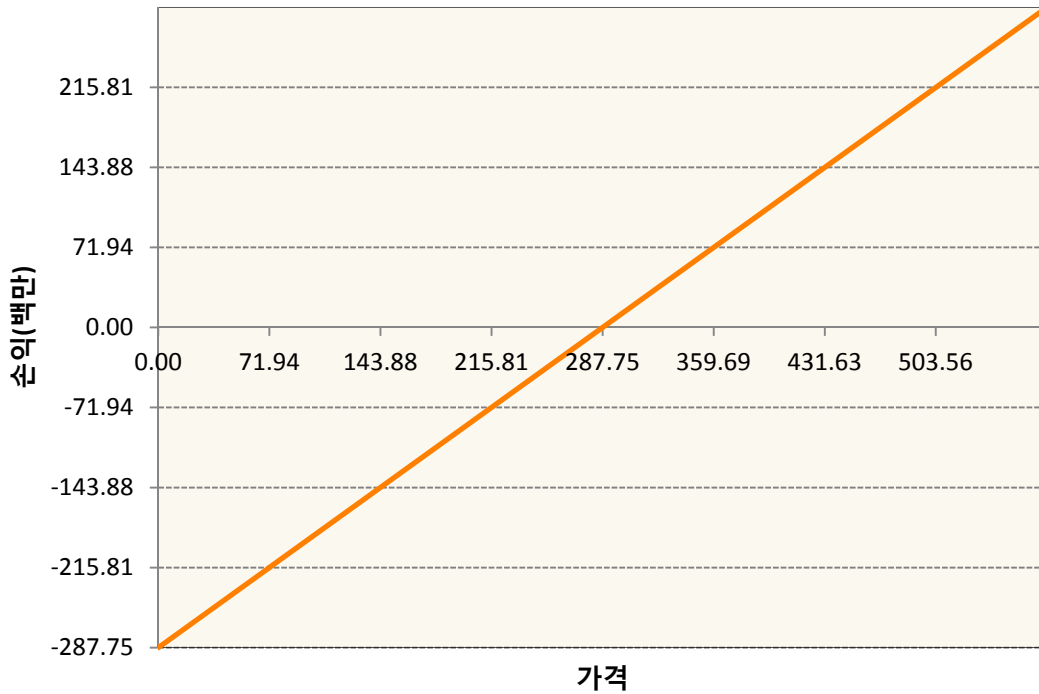
1. 계약금액

(단위:백만원)

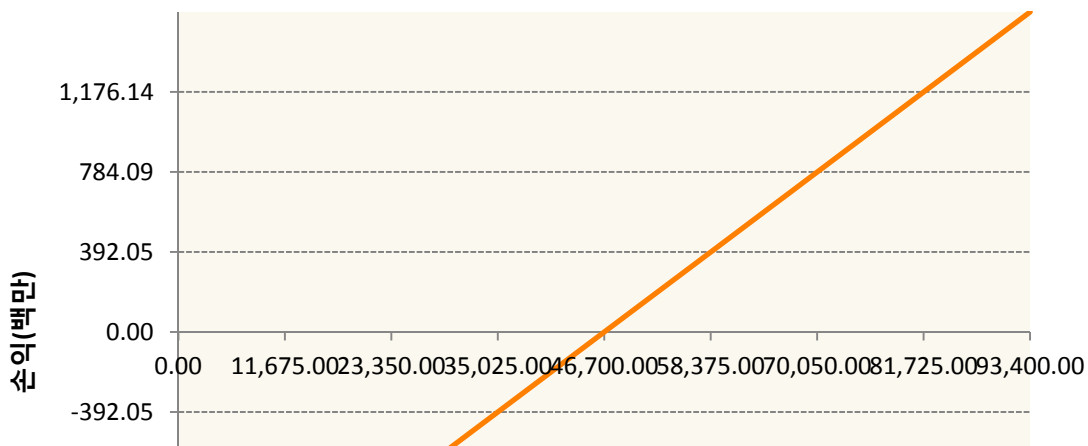
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,856	0	1,856	장내

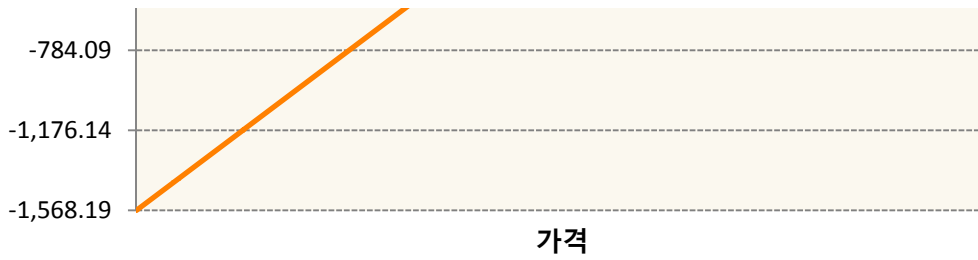
2. 만기시점의 손익구조

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)

163

공시일	2019-04-10
기준일	2019-04-09

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

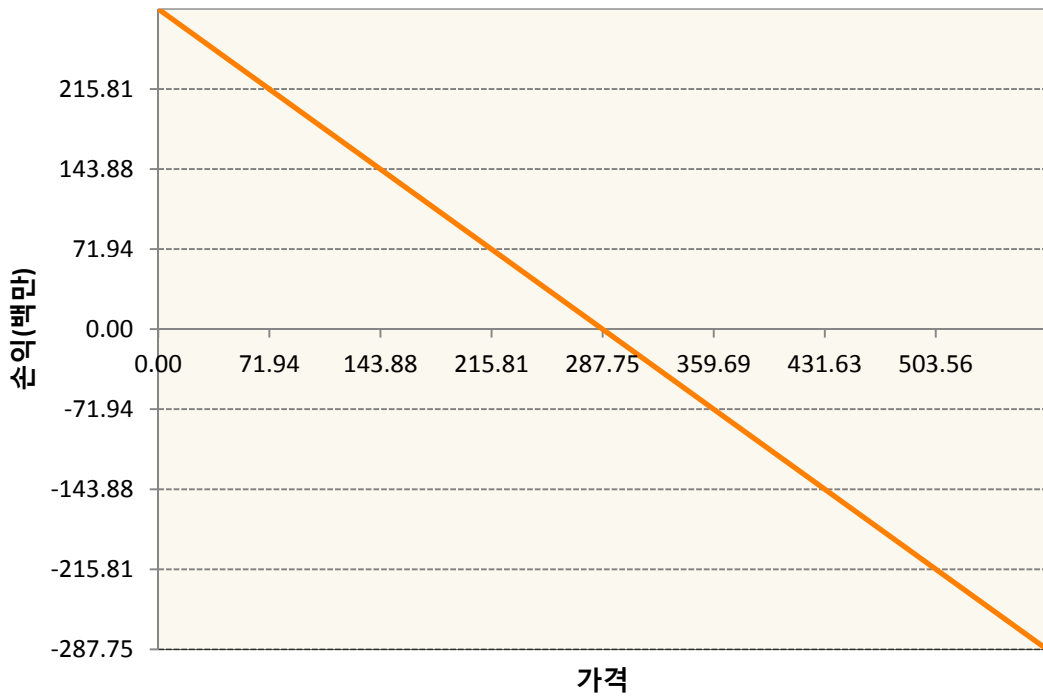
1. 계약금액

(단위:백만원)

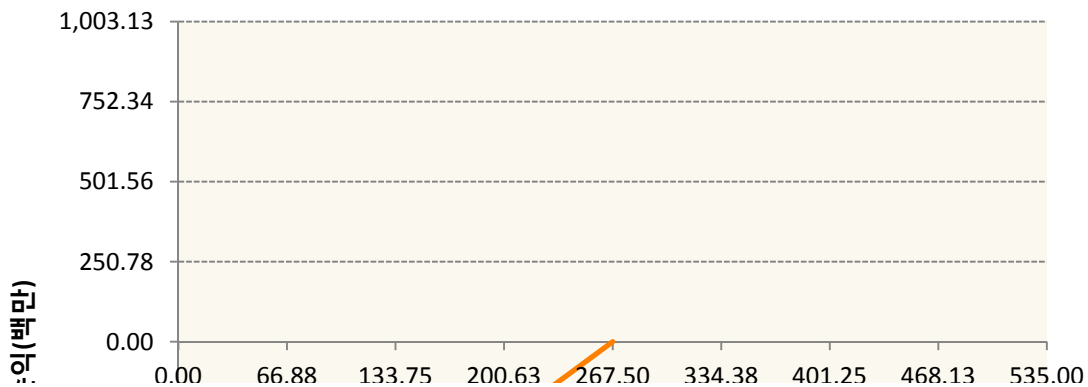
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	288	-288	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,543	-1,543	장내

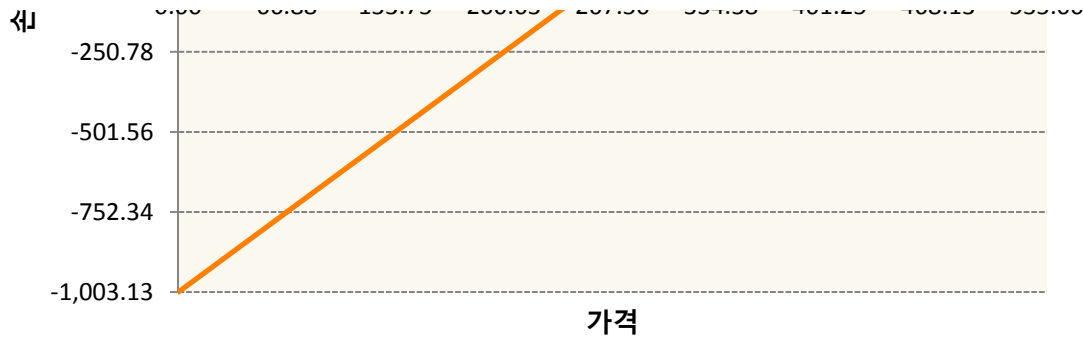
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

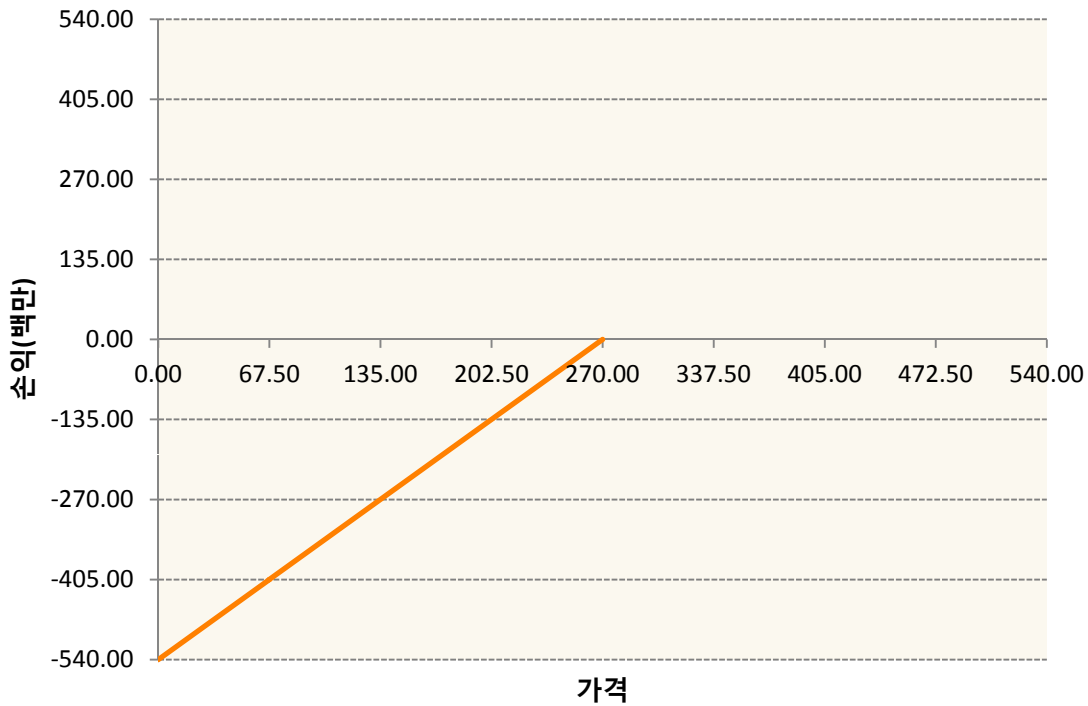


KR4301P42677-2019-04 풋267.5





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						15
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14	-14	-14	-14	-14	-15	-15
-5.33%	0	0	0	0	0	0	-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%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-13
-5.33%	-1	-1	-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

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

(단위:백만원)

19

공시일	2019-04-10
기준일	2019-04-09

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

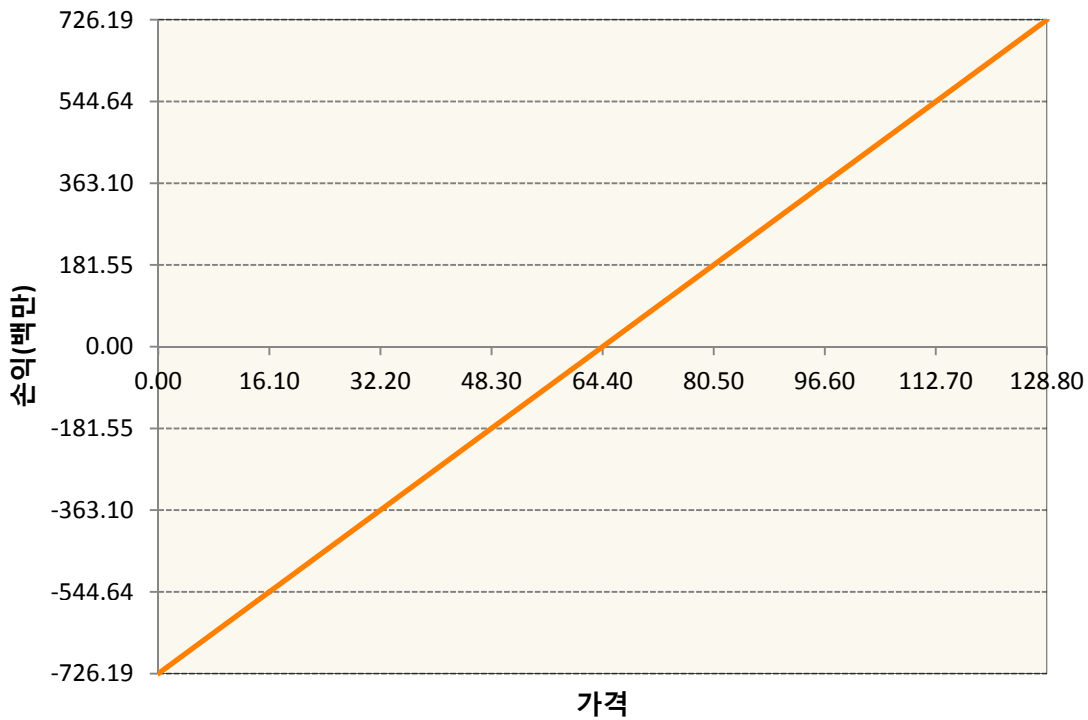
1. 계약금액

(단위:백만원)

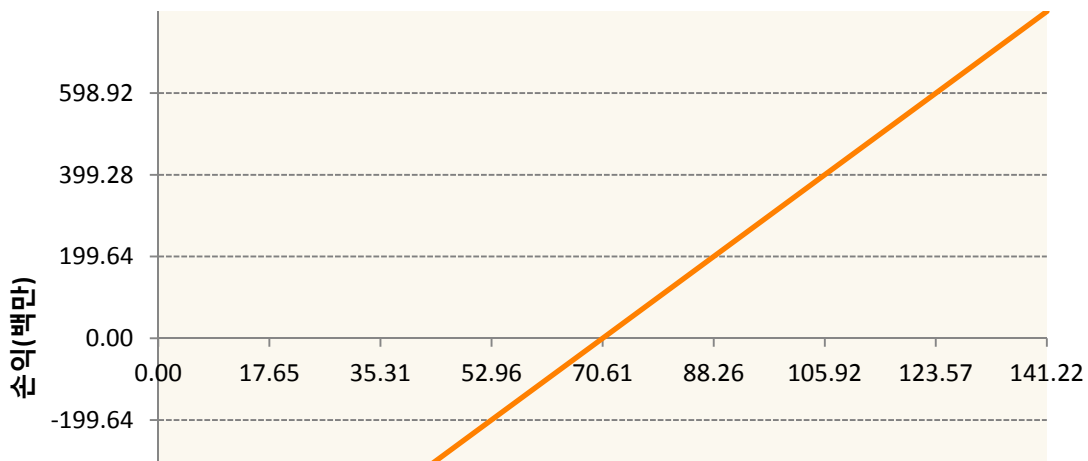
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,985	285	2,700	

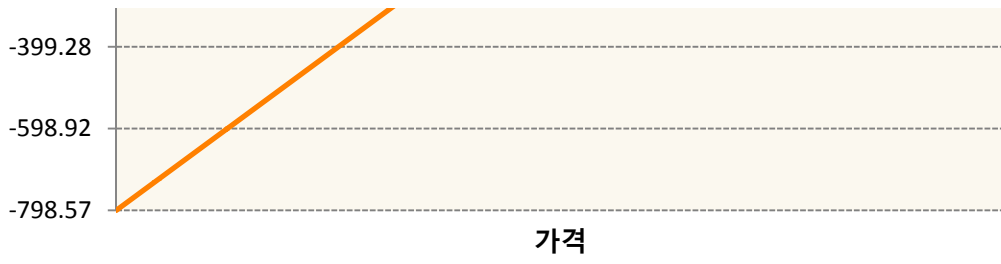
2. 만기시점의 손익구조

CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19

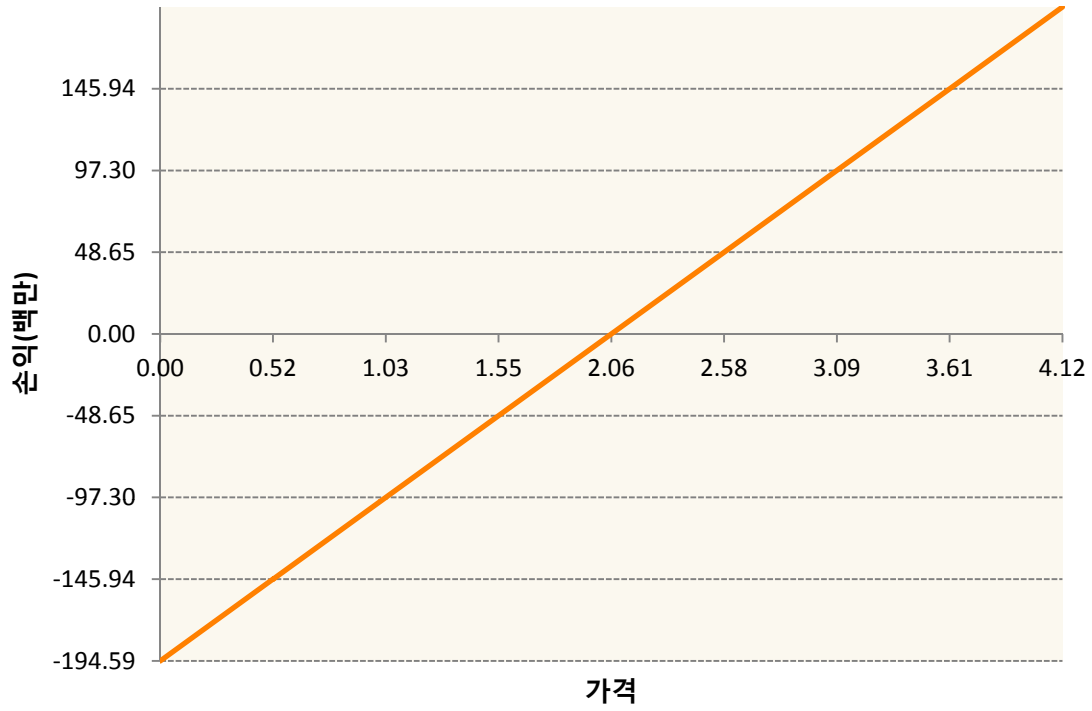


CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19

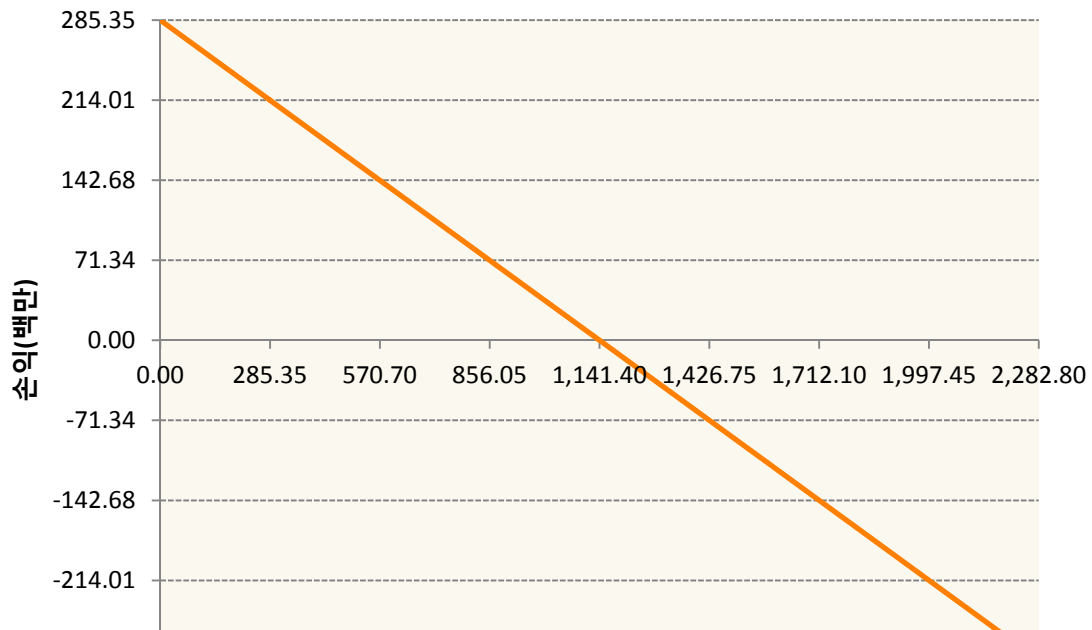


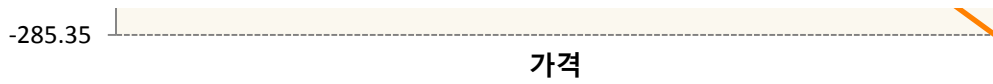


HOK9-NY Harb ULSD Fut May19

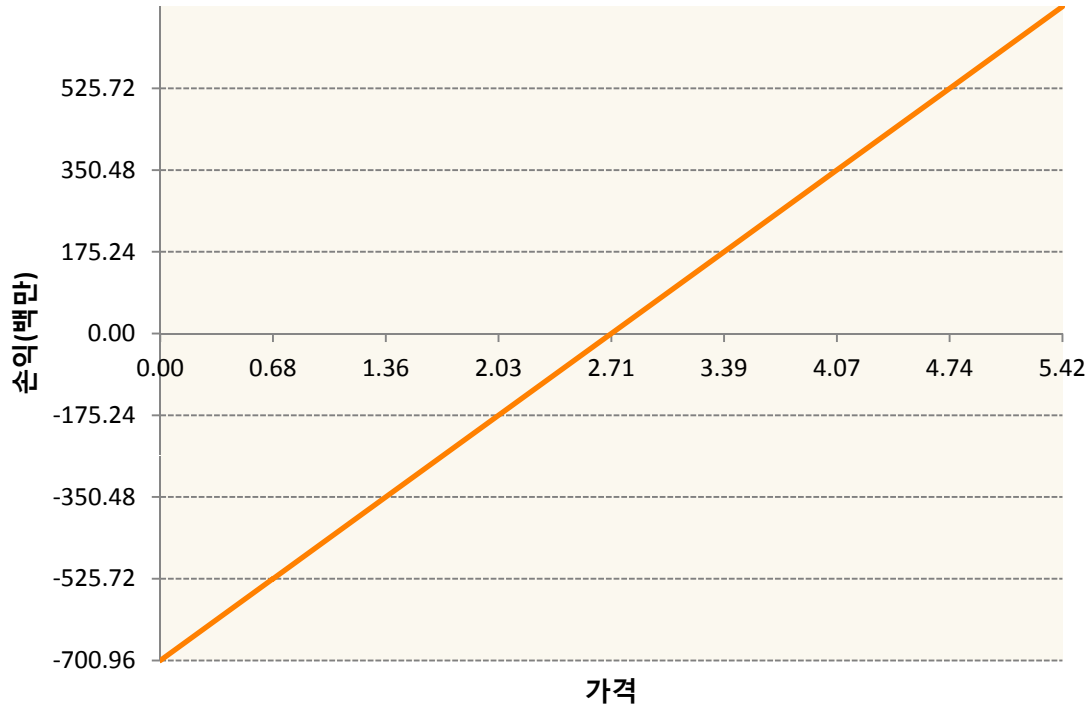


KR4175P40000-2019-04 달러선물

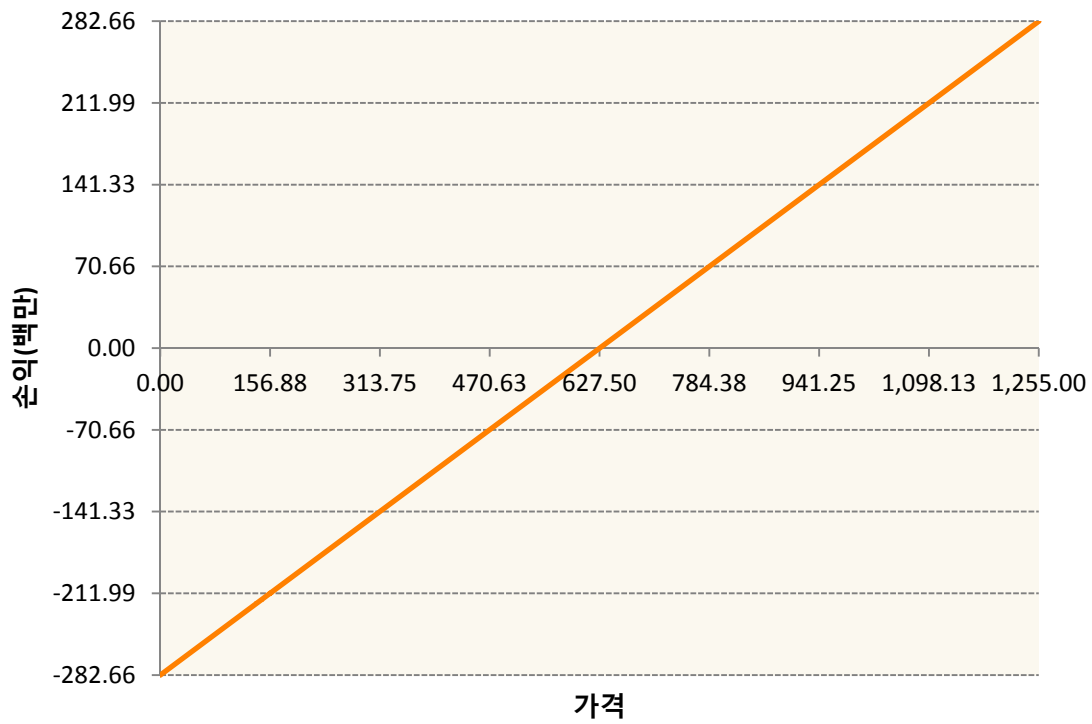




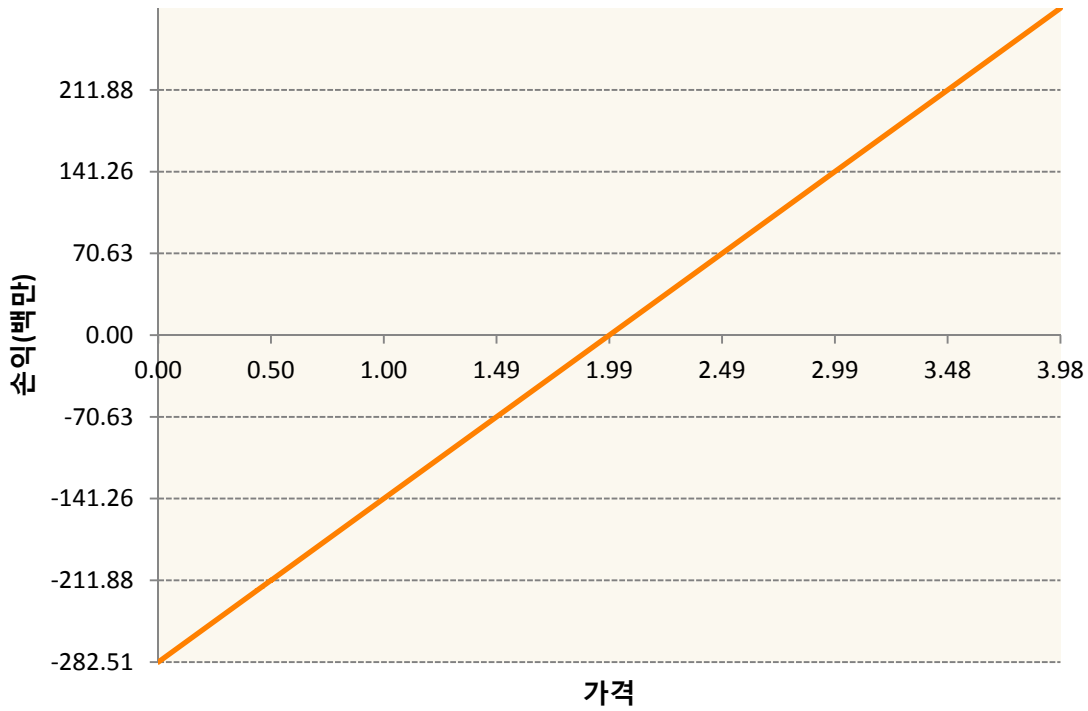
NGK19-NATURAL GAS FUTR May19



QSK9-Low Su Gasoil G May19



XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK9	WTI CRUDE FUTURE May19	58
CON9	BRENT CRUDE FUTR Jul19	64
HOK9	NY Harb ULSD Fut May19	16
KR4175P400	2019-04 달러선물	23
NGK19	NATURAL GAS FUTR May19	56
QSK9	Low Su Gasoil G May19	23
XBK9	GASOLINE RBOB FUT May19	23

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

(단위:백만원)

447

공시일	2019-04-10
기준일	2019-04-09

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

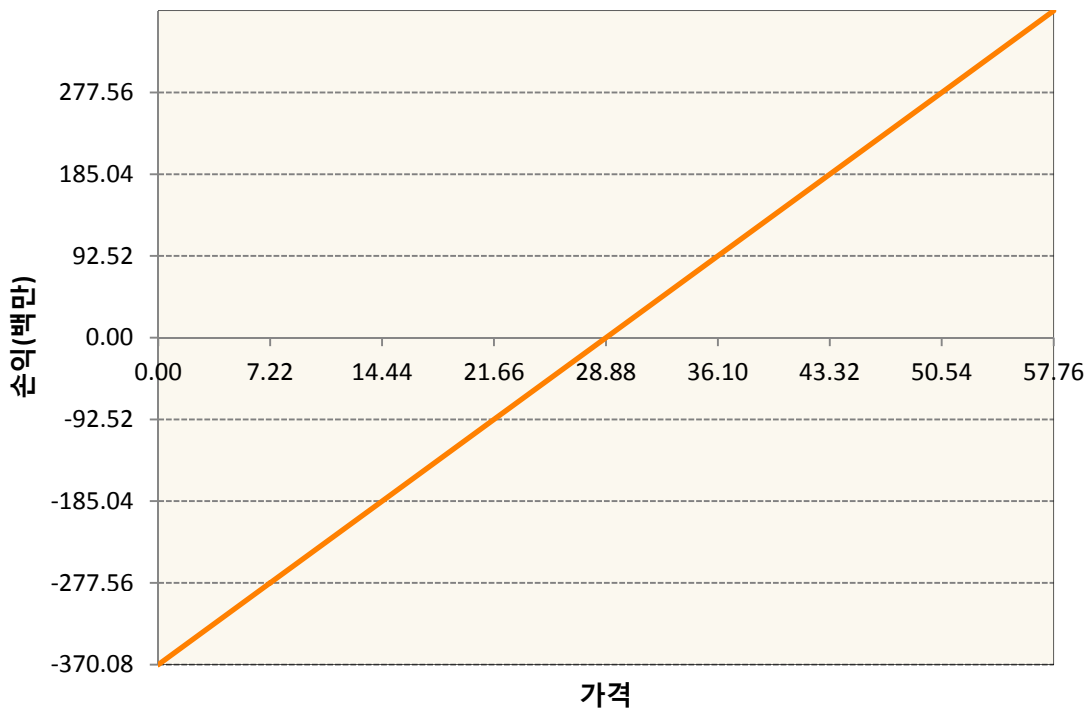
1. 계약금액

(단위:백만원)

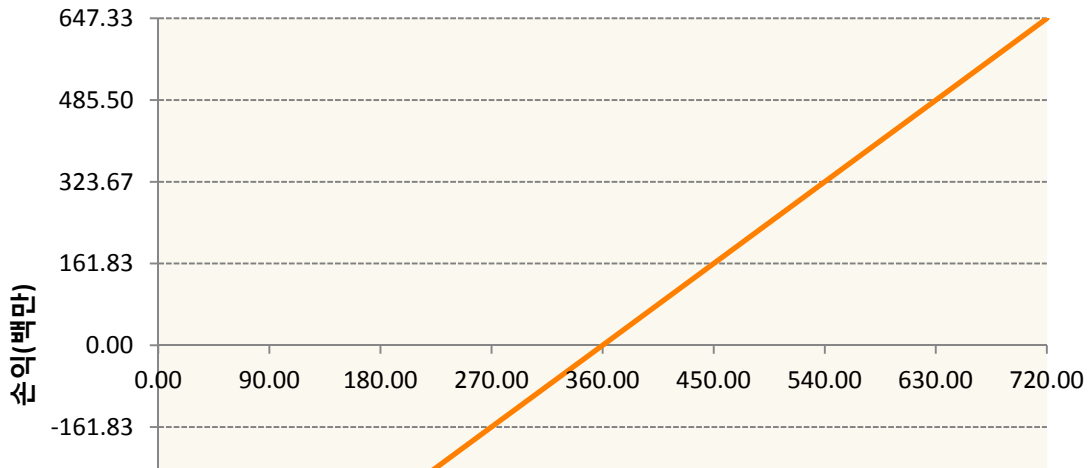
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,345	80	3,265	

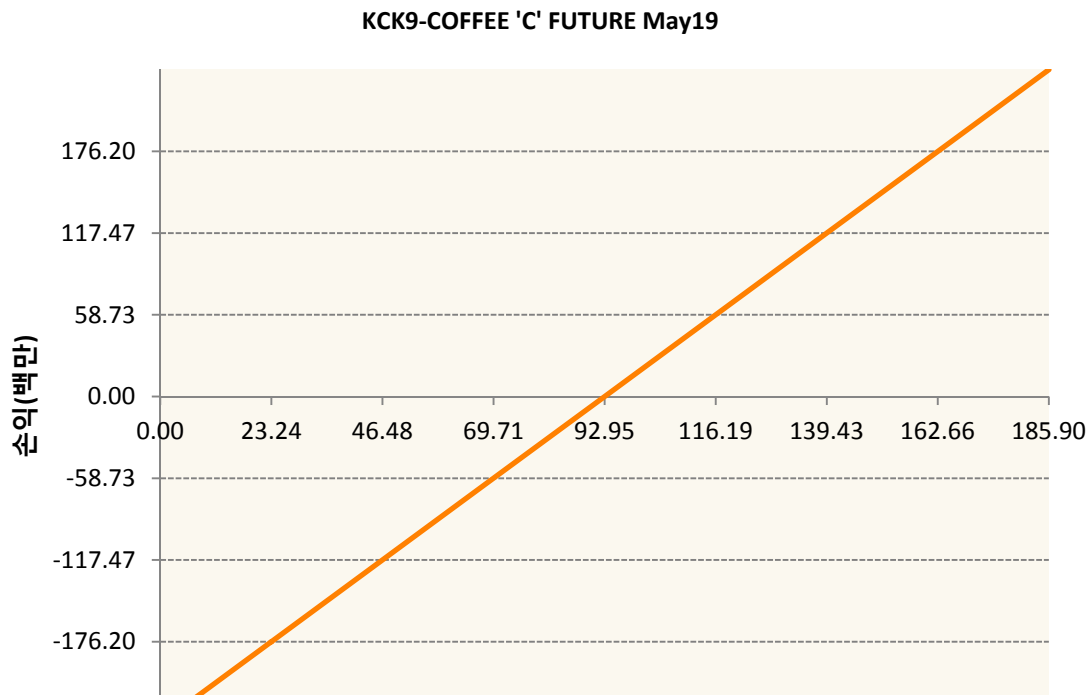
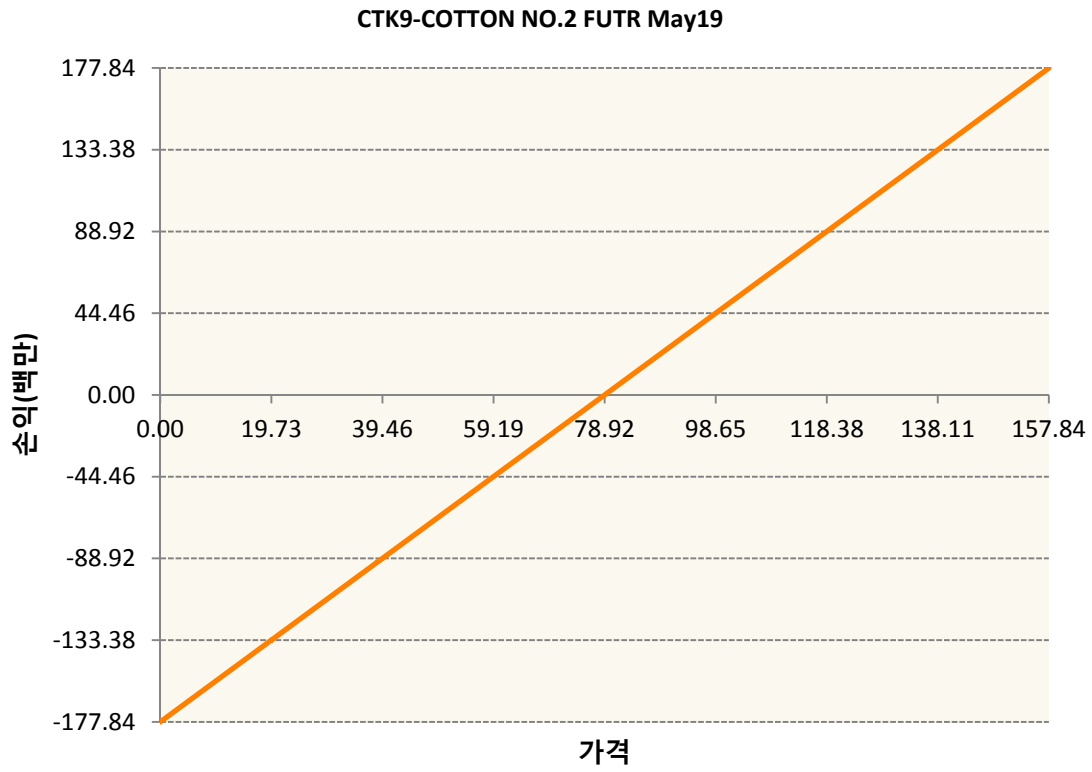
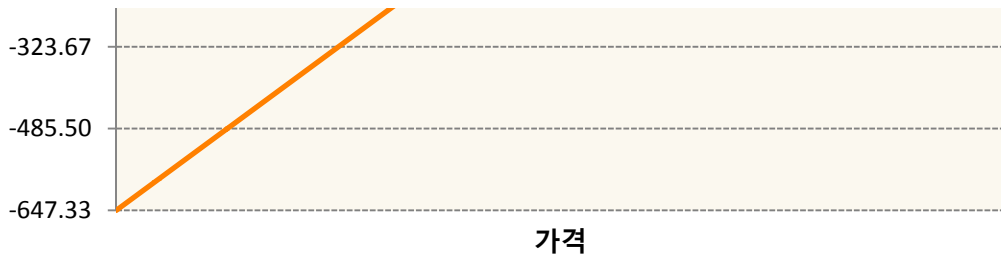
2. 만기시점의 손익구조

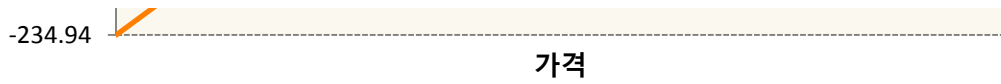
BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19



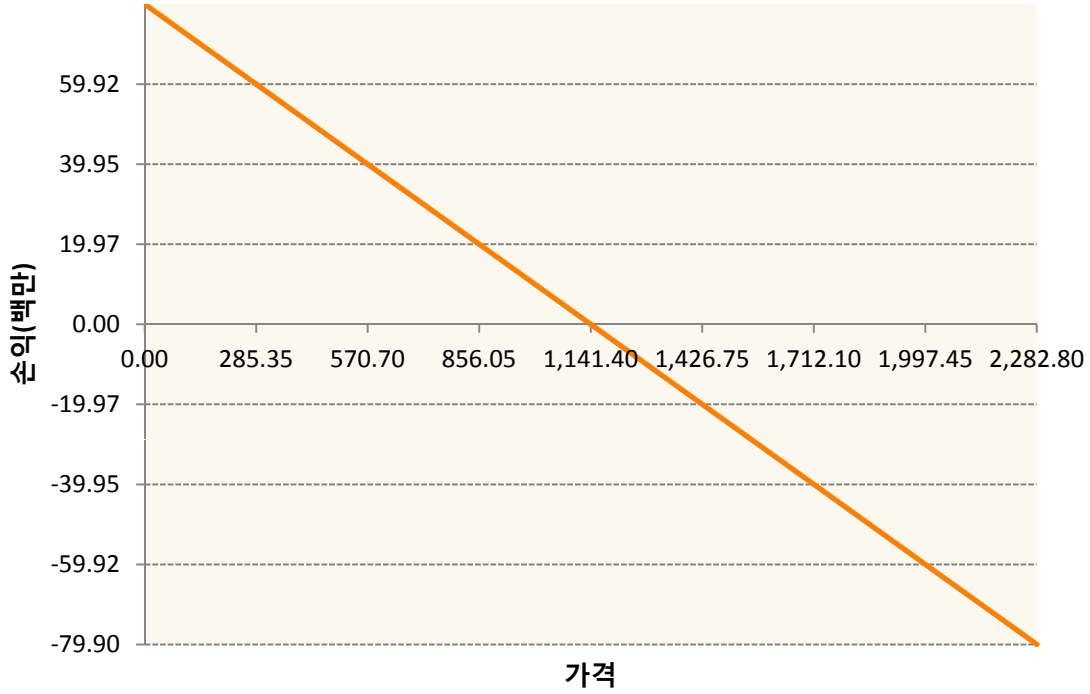
CK9-CORN FUTURE May19



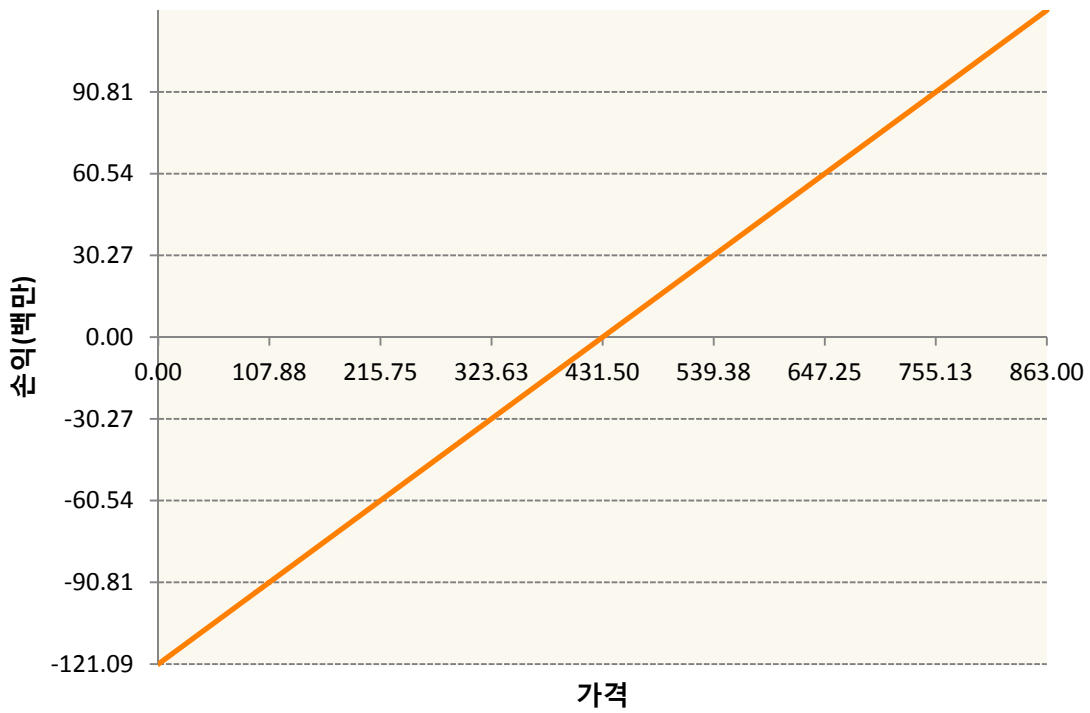




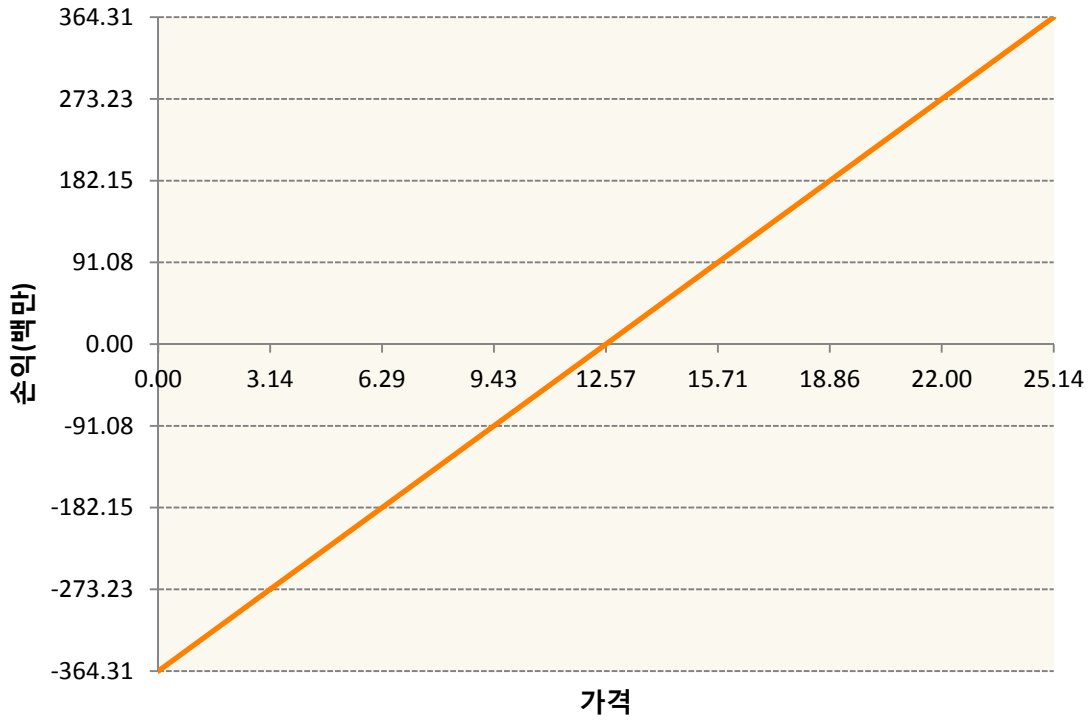
KR4175P40000-2019-04 달러선물



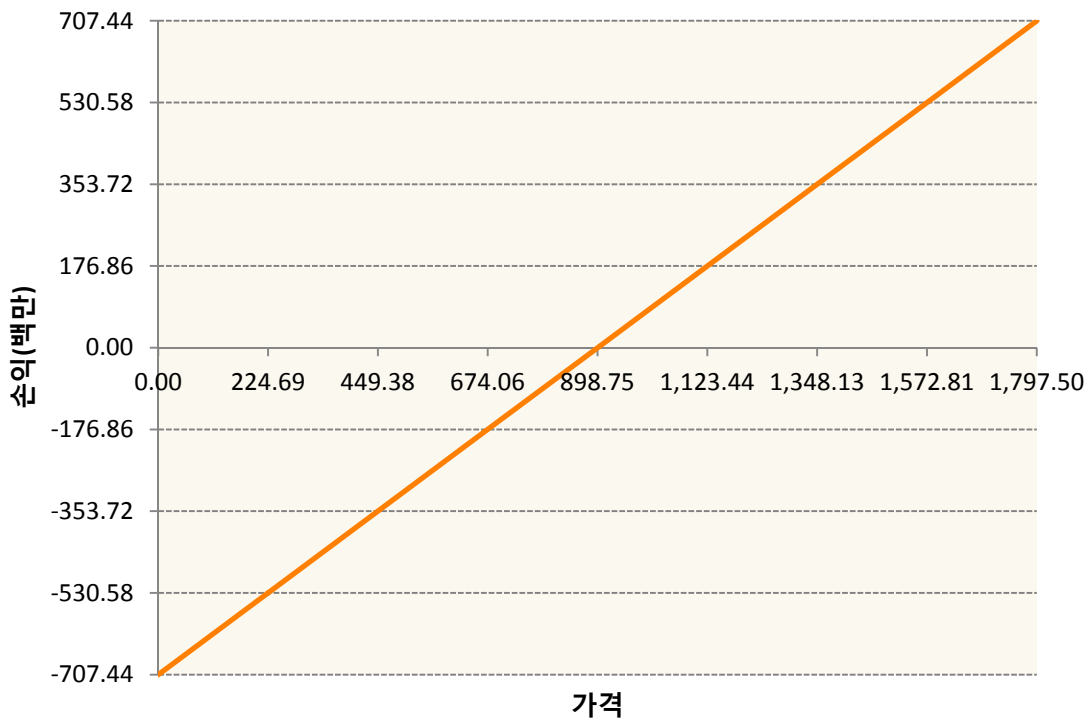
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



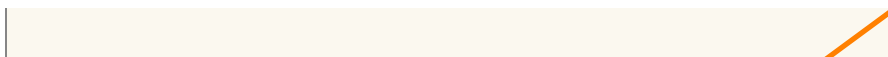
SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

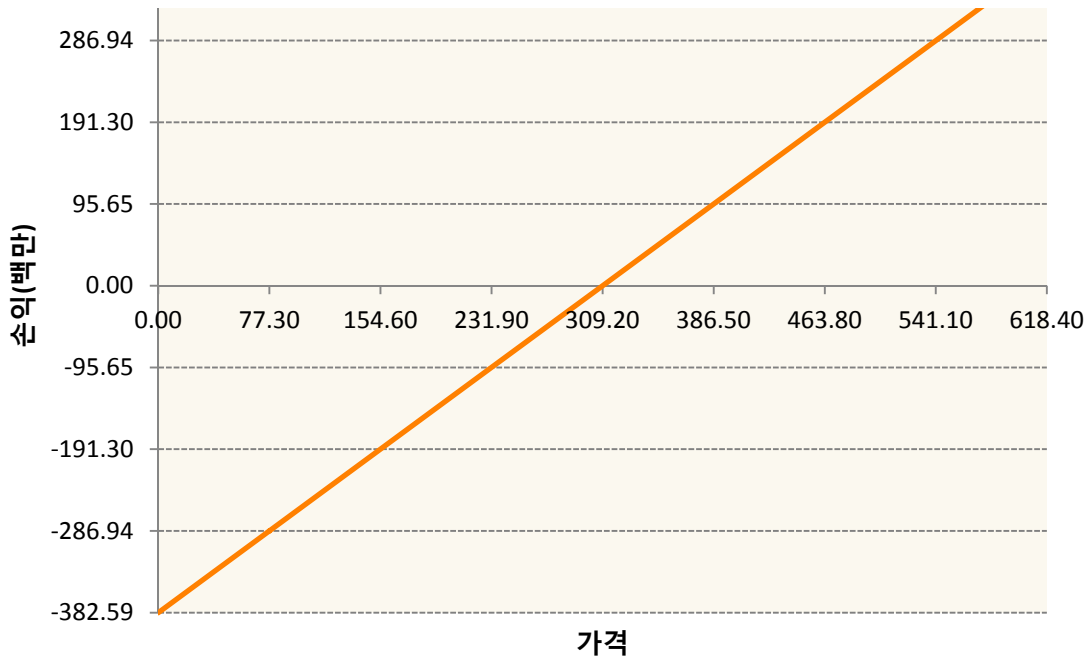


SK9-SOYBEAN FUTURE May19

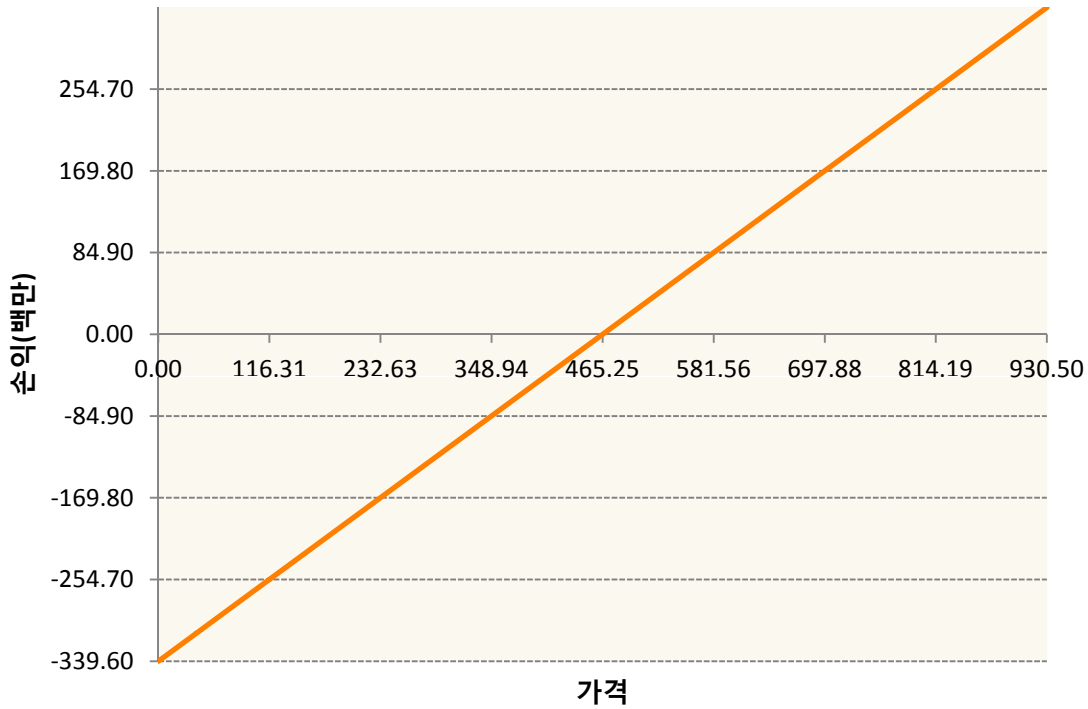


SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





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)

270