

공시일	2019-04-15
기준일	2019-04-12

## 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	2019-04-15
기준일	2019-04-12

## 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

1,150

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

675

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-04-15
기준일	2019-04-12

## 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)	357
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	98
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	167

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

<b>977</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-04-15
기준일	2019-04-12

## 유로인덱스모(주식-파생형)

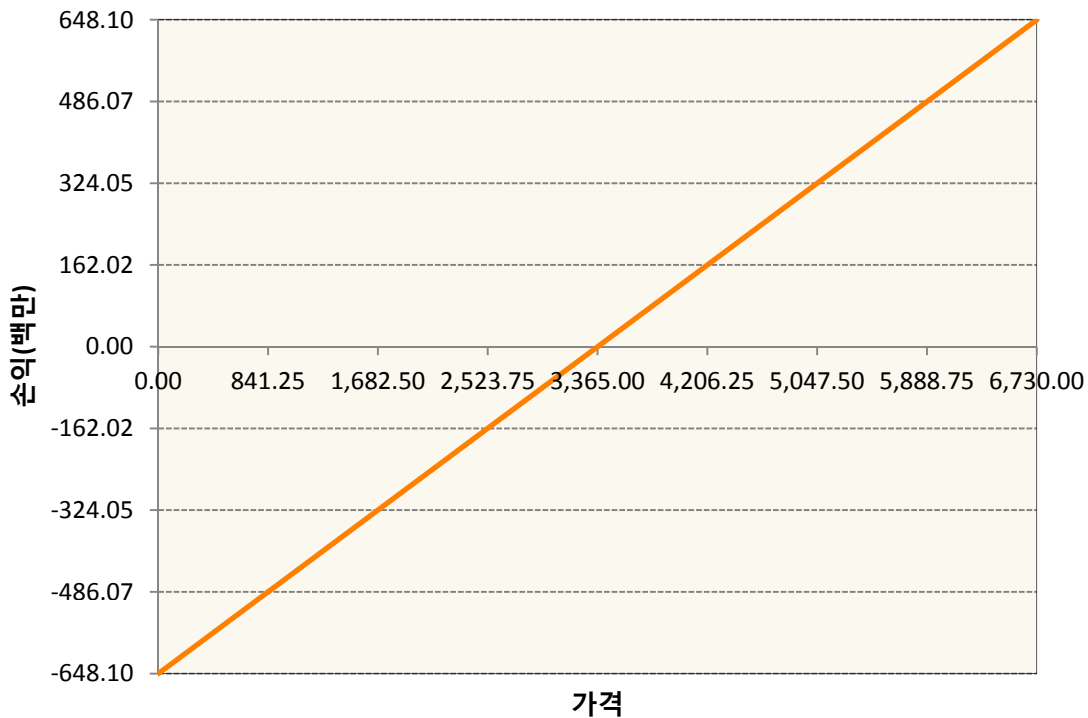
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	648	0	648	

### 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	2019-04-15
기준일	2019-04-12

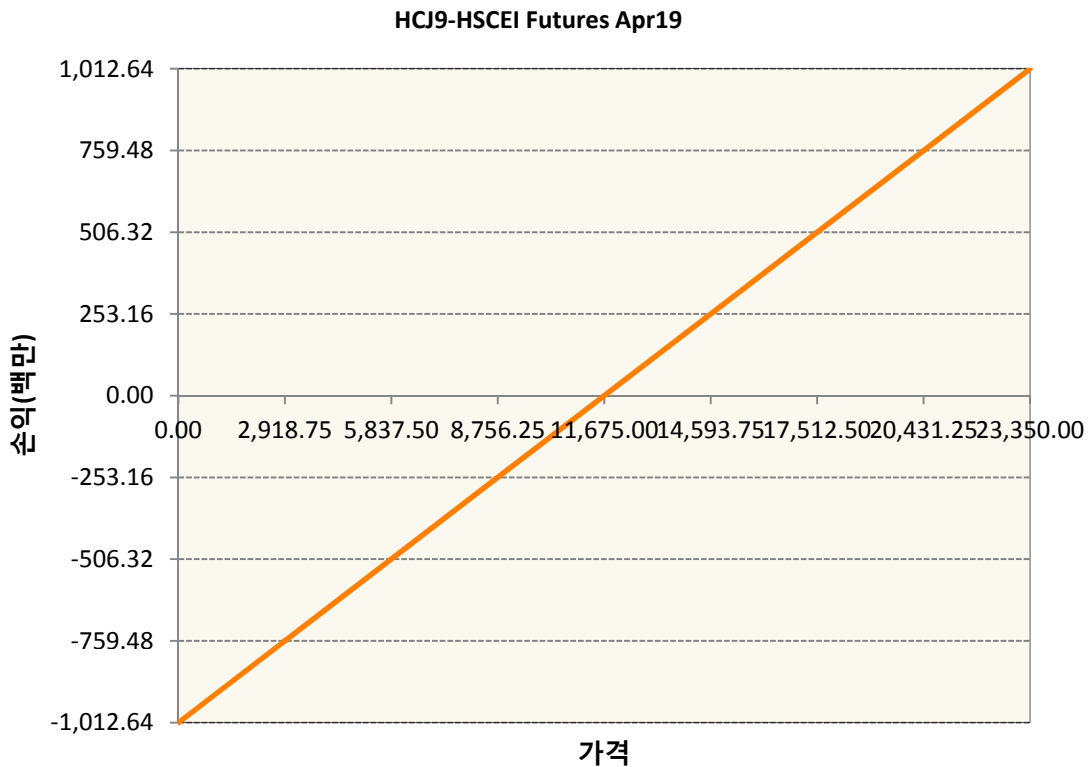
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,013	0	1,013	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ9	HSCEI Futures Apr19	81
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

83
----

공시일	2019-04-15
기준일	2019-04-12

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

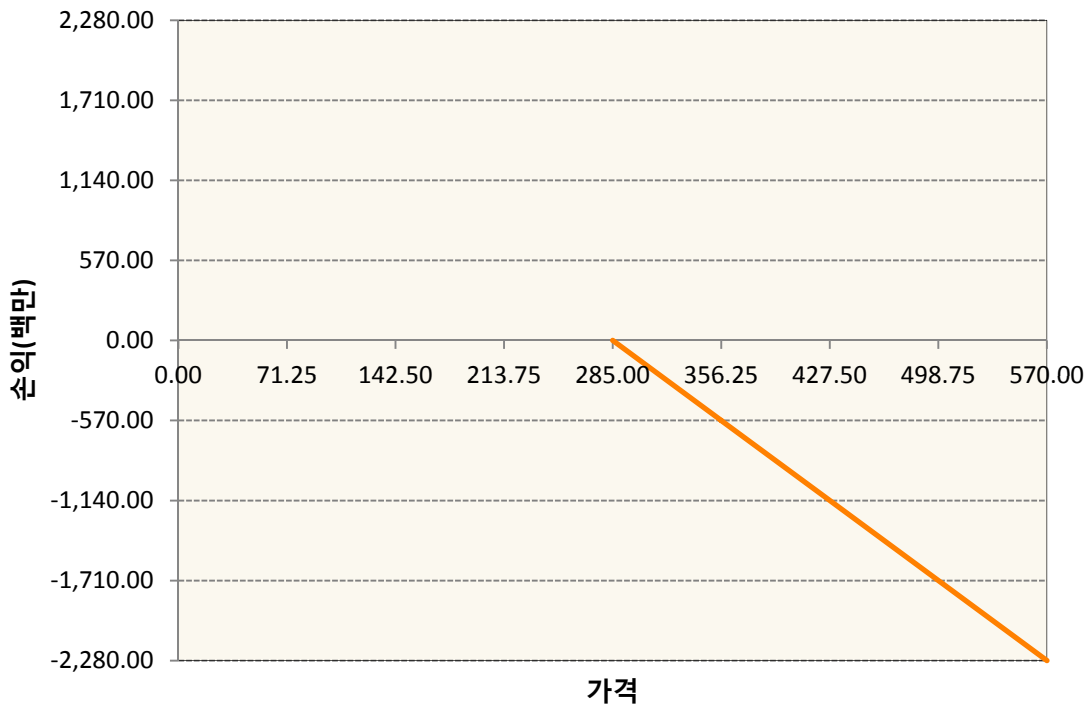
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

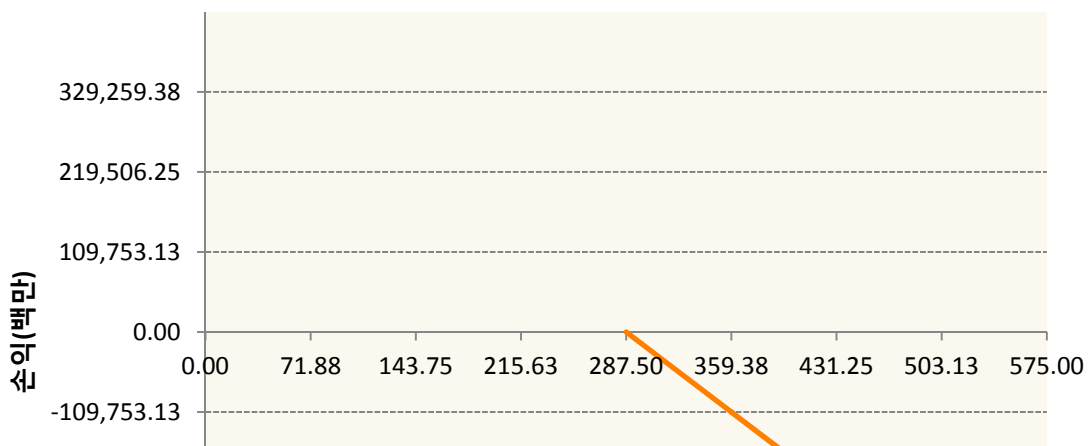
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	529,121	-529,121	장내
누계	유가증권	옵션	0	674,730	-674,730	장내

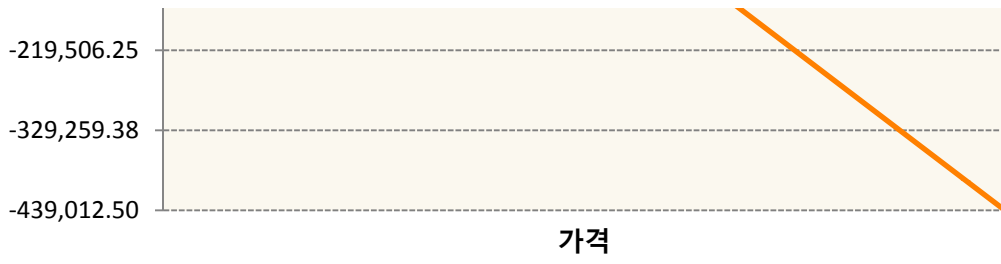
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P52850-2019-05 콜285

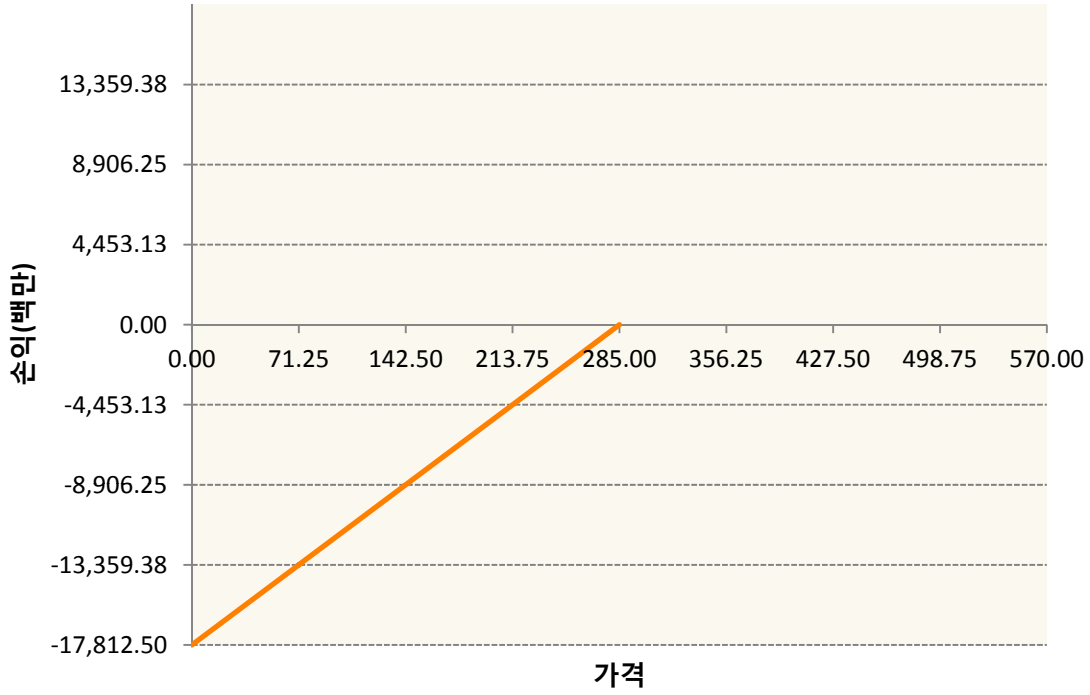


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

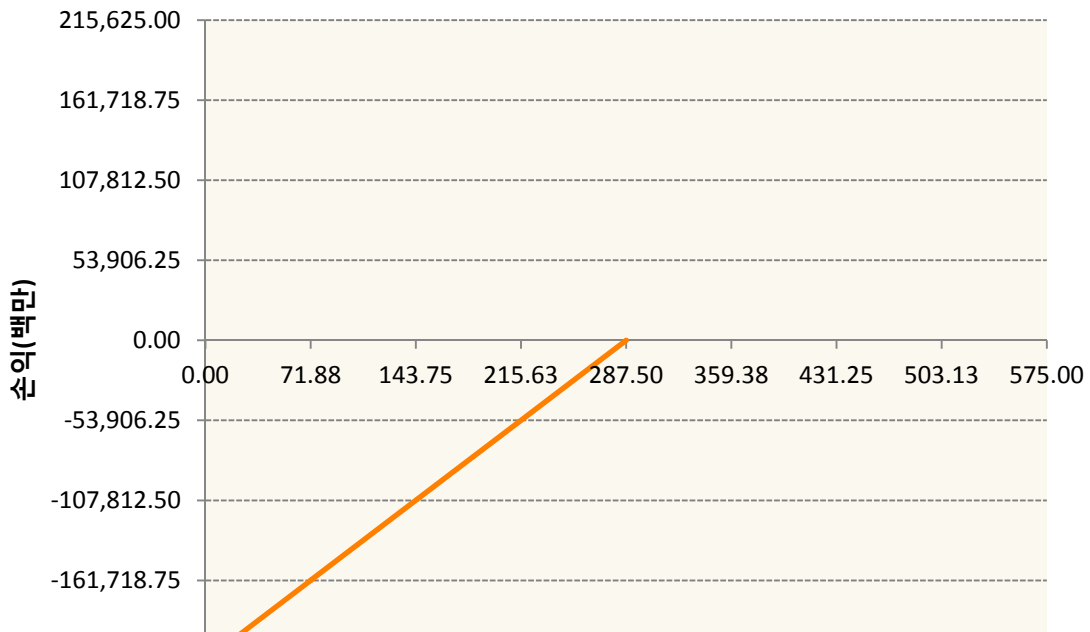




**KR4301P52858-2019-05 풋285**



**KR4301P52874-2019-05 풋287.5**



-215,625.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P52850 2019-05 콜285							151
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	69	68	66	63	61	58	55
-5.33%	62	59	55	51	48	44	40
-2.67%	45	40	35	31	26	21	17
0%	14	10	5	0	-5	-10	-14
2.67%	-29	-33	-37	-41	-45	-49	-53
5.33%	-82	-84	-86	-89	-93	-96	-99
8.00%	-140	-141	-142	-144	-146	-148	-151
KR4201P52876 2019-05 콜287.5							27,624
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,439	11,187	10,869	10,492	10,061	9,583	9,063
-5.33%	10,376	9,840	9,251	8,617	7,948	7,249	6,525
-2.67%	7,750	6,928	6,090	5,238	4,376	3,506	2,630
0%	2,798	1,865	933	0	-933	-1,865	-2,798
2.67%	-4,682	-5,484	-6,310	-7,155	-8,015	-8,886	-9,767
5.33%	-14,210	-14,744	-15,338	-15,981	-16,665	-17,382	-18,127
8.00%	-25,006	-25,287	-25,639	-26,055	-26,529	-27,054	-27,624
KR4301P52858 2019-05 풋285							1,093
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,079	-1,080	-1,081	-1,083	-1,085	-1,089	-1,093
-5.33%	-608	-613	-620	-628	-638	-648	-660
-2.67%	-195	-212	-229	-247	-266	-284	-303
0%	57	38	19	0	-19	-39	-58
2.67%	140	133	123	113	101	88	75
5.33%	154	152	150	147	143	137	131
8.00%	155	154	154	154	153	151	149
KR4301P52874 2019-05 풋287.5							14,128
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,028	-14,031	-14,037	-14,048	-14,066	-14,093	-14,128
-5.33%	-8,310	-8,348	-8,400	-8,468	-8,549	-8,645	-8,752
-2.67%	-3,012	-3,174	-3,348	-3,531	-3,723	-3,921	-4,124
0%	732	488	244	0	-244	-489	-733
2.67%	2,292	2,153	1,998	1,831	1,653	1,467	1,273

5.33%	2,617	2,584	2,537	2,475	2,398	2,307	2,202
8.00%	2,648	2,645	2,638	2,624	2,604	2,574	2,535

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

(단위:백만원)

**44,122**

공시일	2019-04-15
기준일	2019-04-12

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

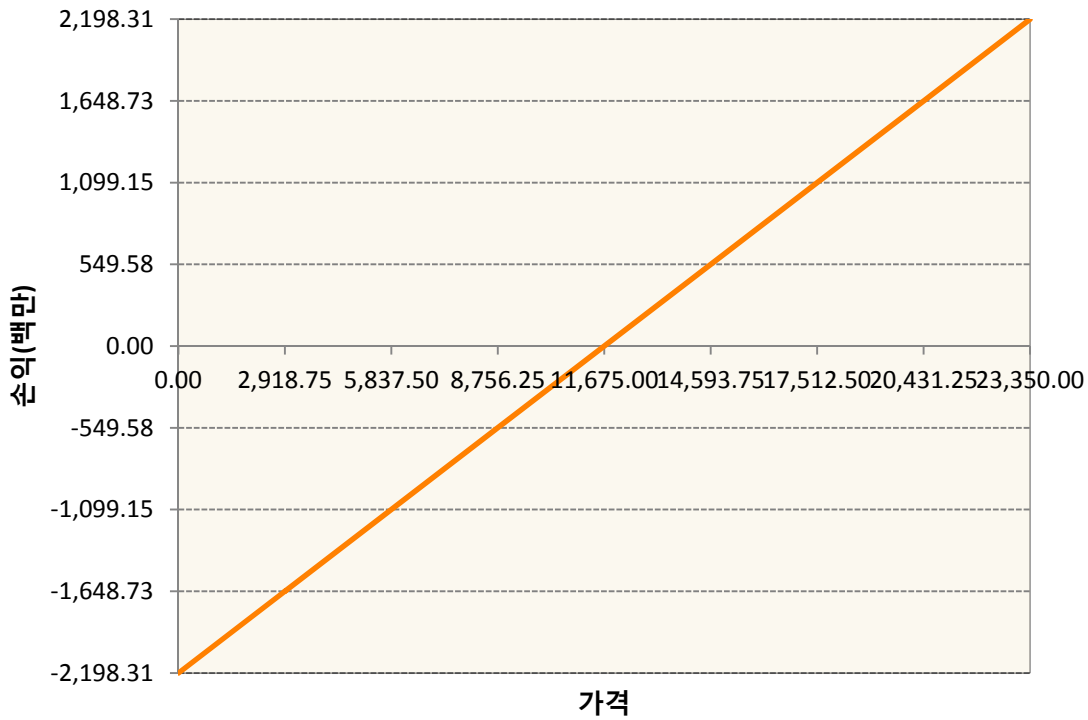
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

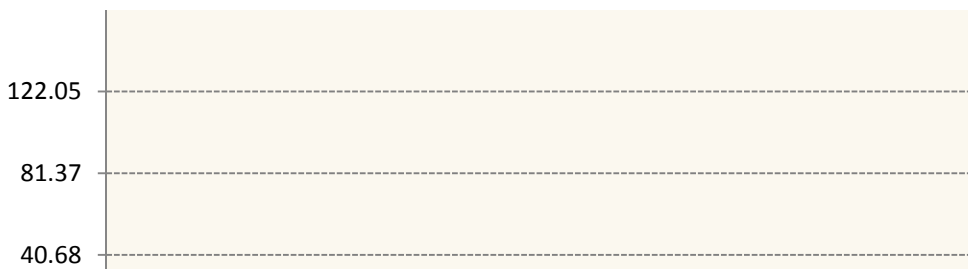
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,198	0	2,198	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,580	-5,580	장내
누계	통화	선도	0	3,051	-3,051	장외

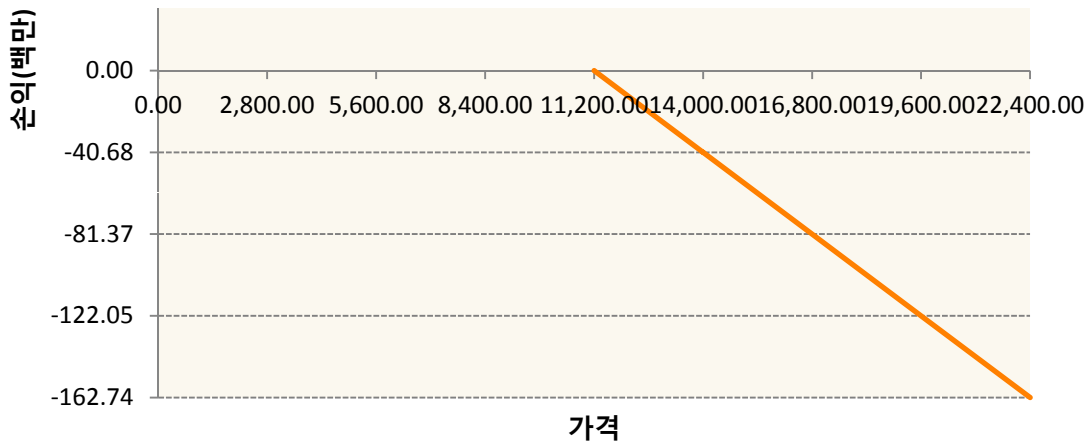
### 2. 만기시점의 손익구조

HCJ9-HSCEI Futures Apr19

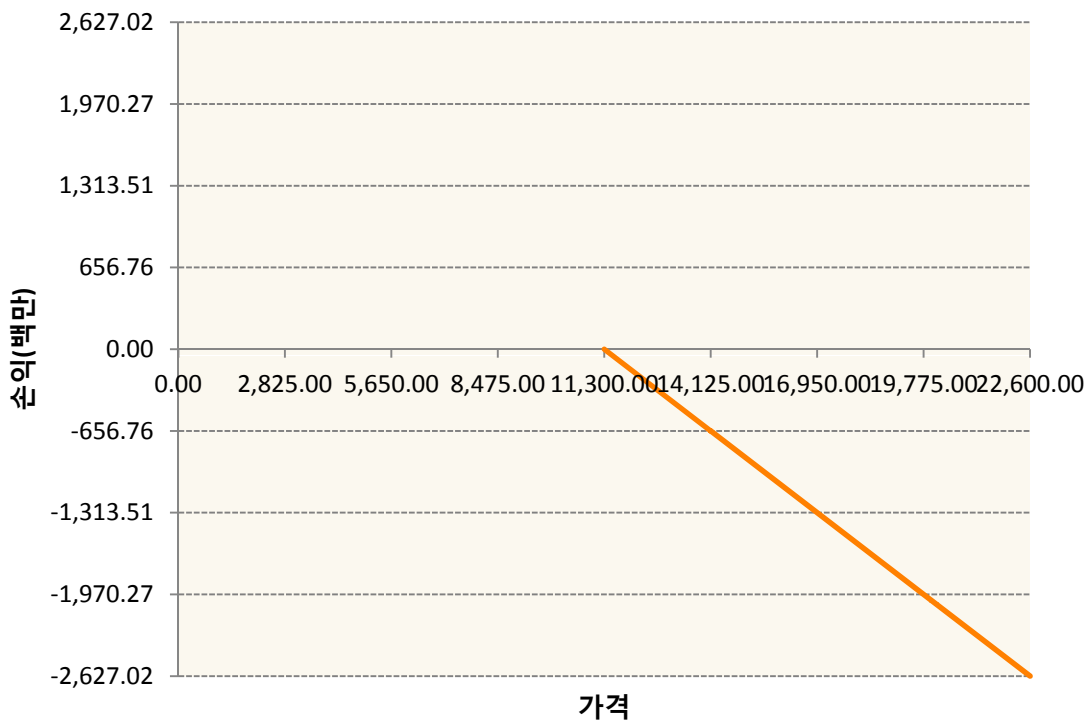


OHHIJ9-C112-HSCEI

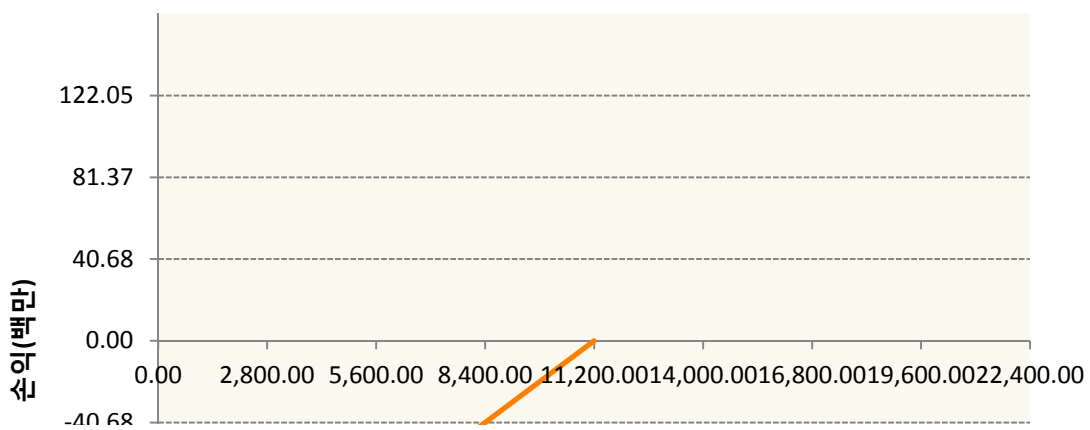


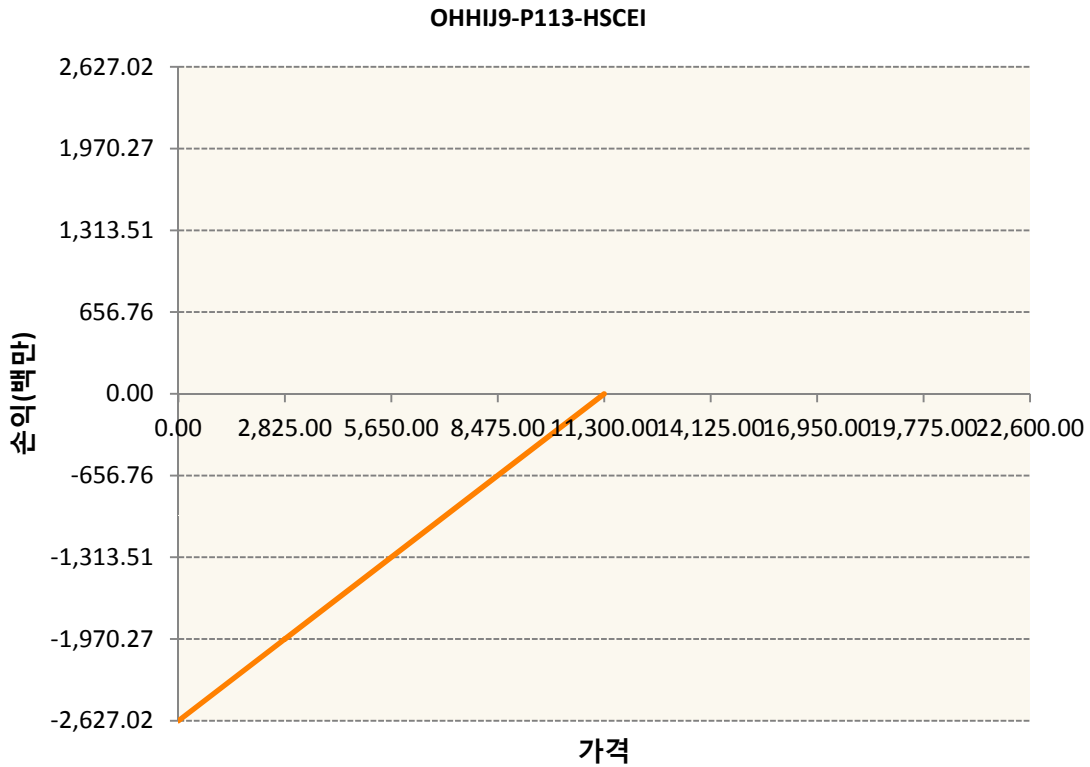
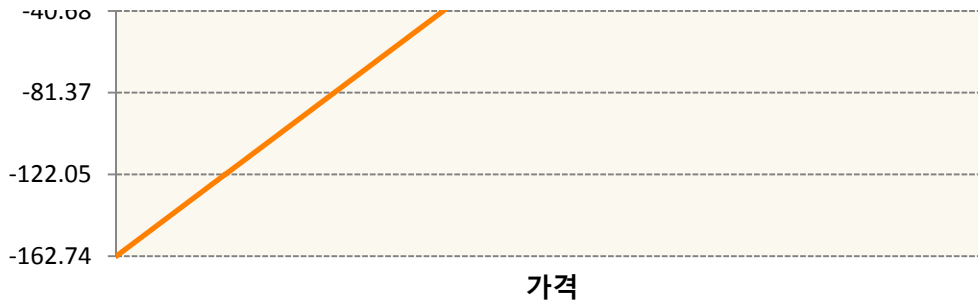


**OHHIJ9-C113-HSCEI**



**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	176
OHHIJ9-C11 HSCEI	13
OHHIJ9-C11 HSCEI	210
OHHIJ9-P11: HSCEI	13
OHHIJ9-P11: HSCEI	210

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	721

공시일	2019-04-15
기준일	2019-04-12

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

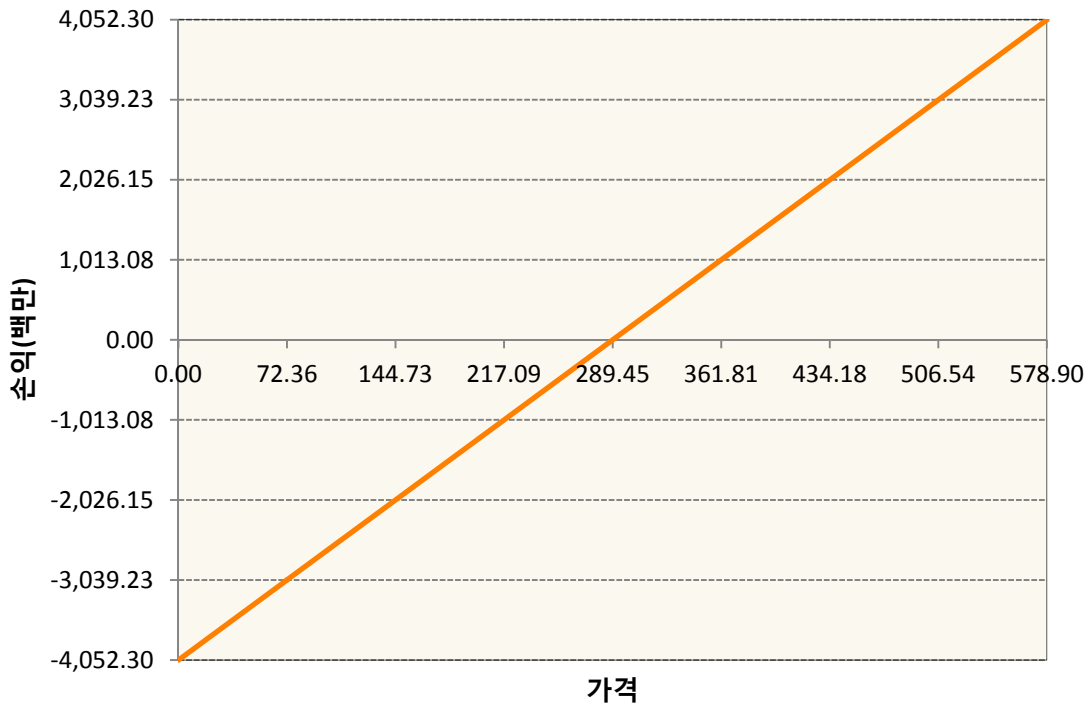
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

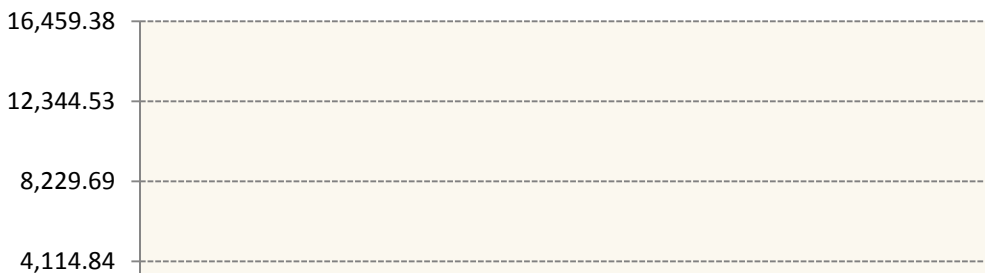
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	34,489	-34,489	장내
누계	유가증권	선물	4,052	0	4,052	장내
누계	유가증권	스왑	35,836	0	35,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,059	-34,059	장내

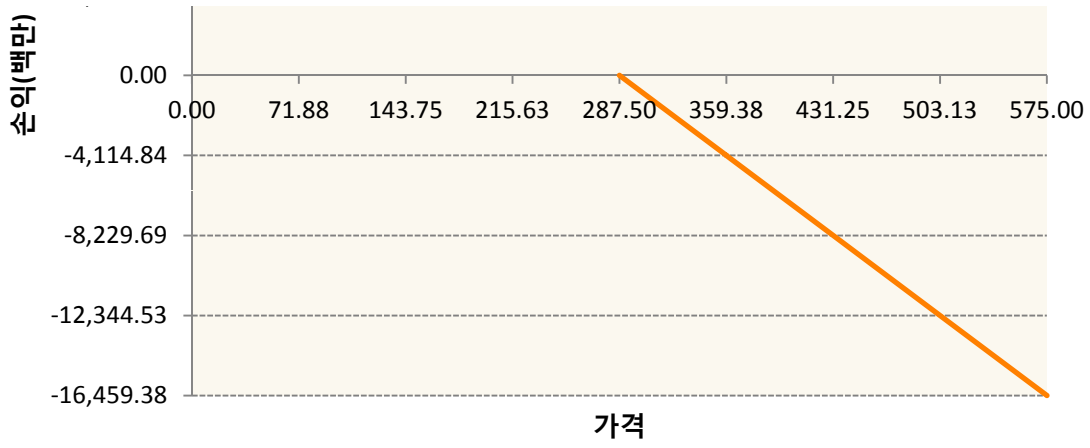
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

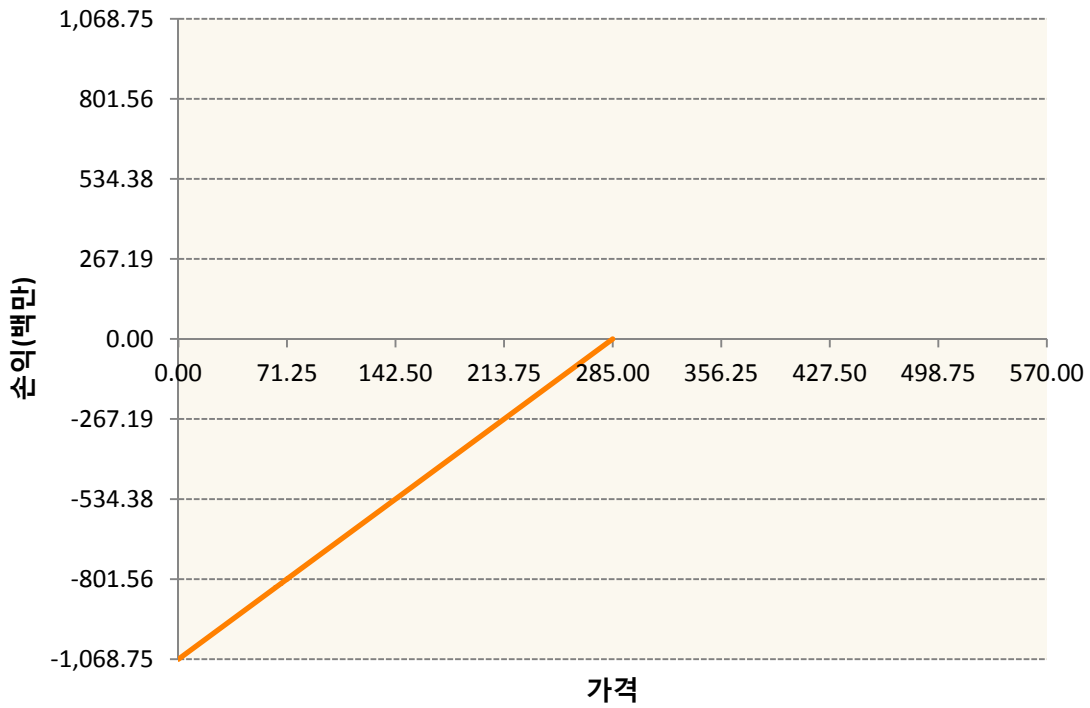


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

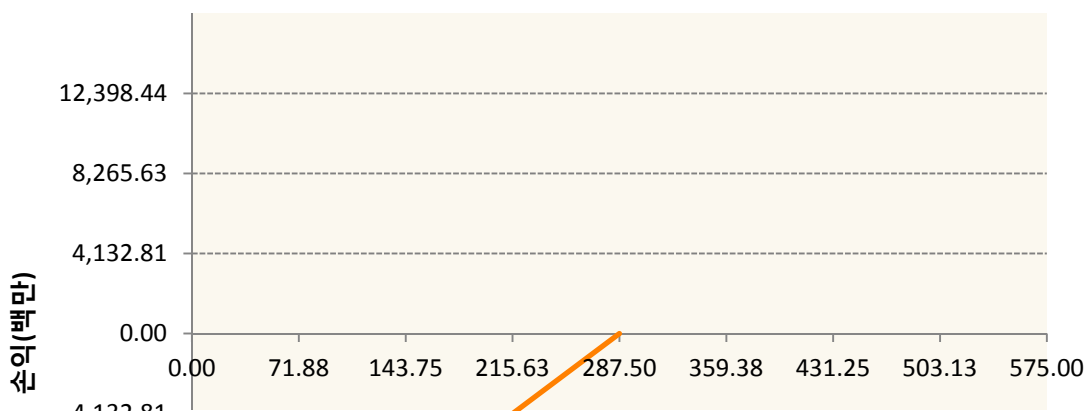


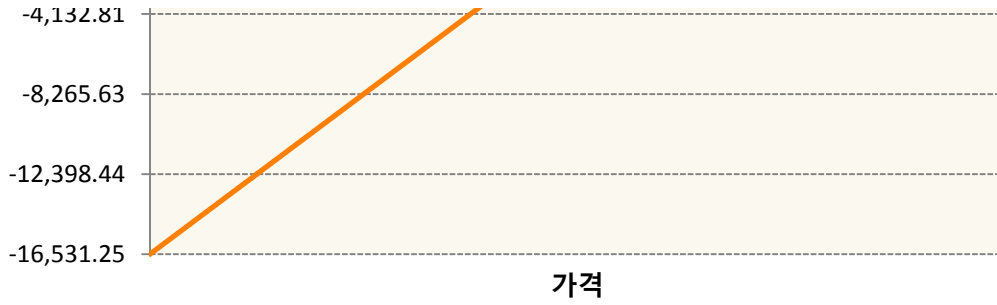


KR4301P52858-2019-05 풋285



KR4301P52874-2019-05 풋287.5





**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%	-1,633	-1,633	-1,633	-1,633	-1,633	-1,633	-1,633	
-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%	1,633	1,633	1,633	1,633	1,633	1,633	1,633	
8.00%	2,449	2,449	2,449	2,449	2,449	2,449	2,449	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						595
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-595	-595	-595	-595	-595	-595	-595	
-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%	595	595	595	595	595	595	595	
KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						323
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-323	-323	-323	-323	-323	-323	-323	
-5.33%	-215	-215	-215	-215	-215	-215	-215	
-2.67%	-108	-108	-108	-108	-108	-108	-108	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	108	108	108	108	108	108	108	
5.33%	215	215	215	215	215	215	215	
8.00%	323	323	323	323	323	323	323	
KR4201P52876		2019-05 콜287.5						1,036
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	429	419	407	393	377	359	340
-5.33%	389	369	347	323	298	272	245
-2.67%	291	260	228	196	164	131	99
0%	105	70	35	0	-35	-70	-105
2.67%	-176	-206	-237	-268	-300	-333	-366
5.33%	-533	-553	-575	-599	-625	-652	-680
8.00%	-938	-948	-961	-977	-995	-1,014	-1,036
KR4301P52858                      2019-05 풋285							66
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-66
-5.33%	-36	-37	-37	-38	-38	-39	-40
-2.67%	-12	-13	-14	-15	-16	-17	-18
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	8	8	7	7	6	5	4
5.33%	9	9	9	9	9	8	8
8.00%	9	9	9	9	9	9	9
KR4301P52874                      2019-05 풋287.5							1,083
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,075	-1,076	-1,076	-1,077	-1,078	-1,080	-1,083
-5.33%	-637	-640	-644	-649	-655	-663	-671
-2.67%	-231	-243	-257	-271	-285	-301	-316
0%	56	37	19	0	-19	-37	-56
2.67%	176	165	153	140	127	112	98
5.33%	201	198	195	190	184	177	169
8.00%	203	203	202	201	200	197	194

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

(단위:백만원)

**5,596**

공시일	2019-04-15
기준일	2019-04-12

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

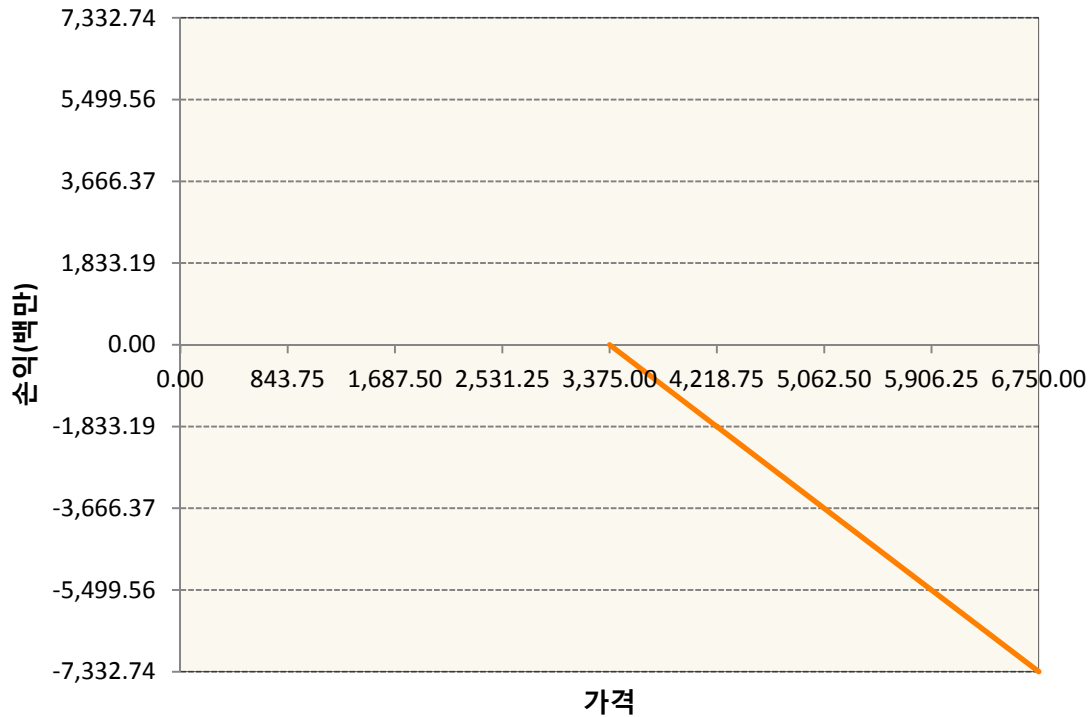
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

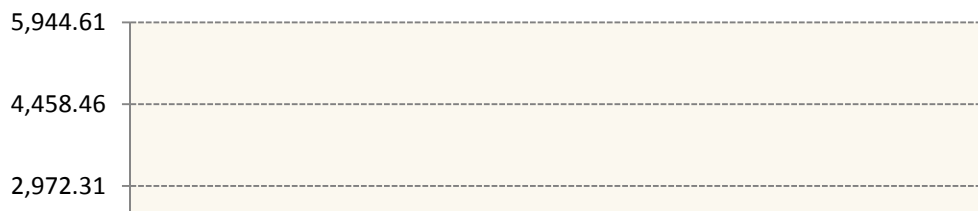
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,481	0	6,481	
누계	유가증권	스왑	60,694	0	60,694	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,555	-26,555	장내
누계	통화	선도	0	17,998	-17,998	장외

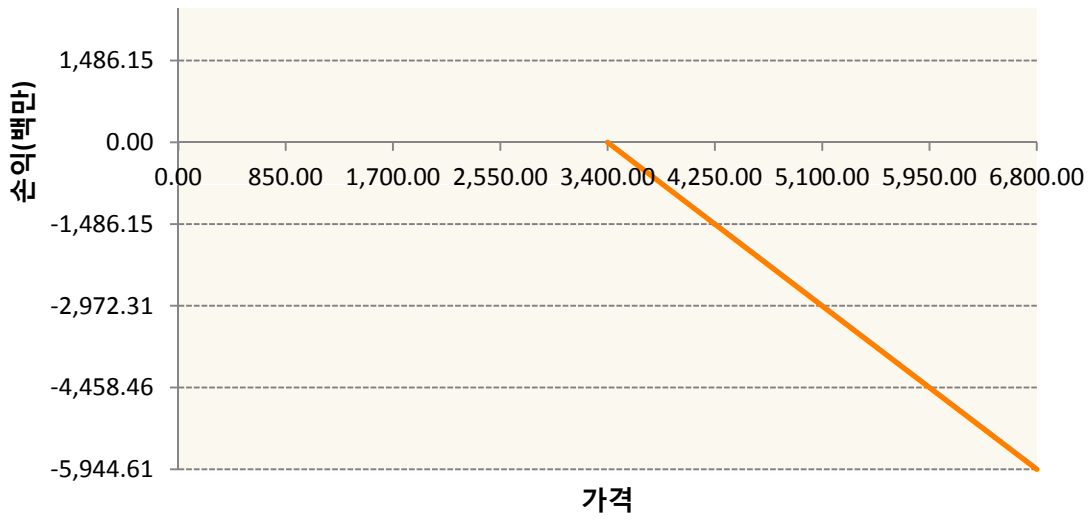
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXJ9-C3375-EURO STOXX 50**

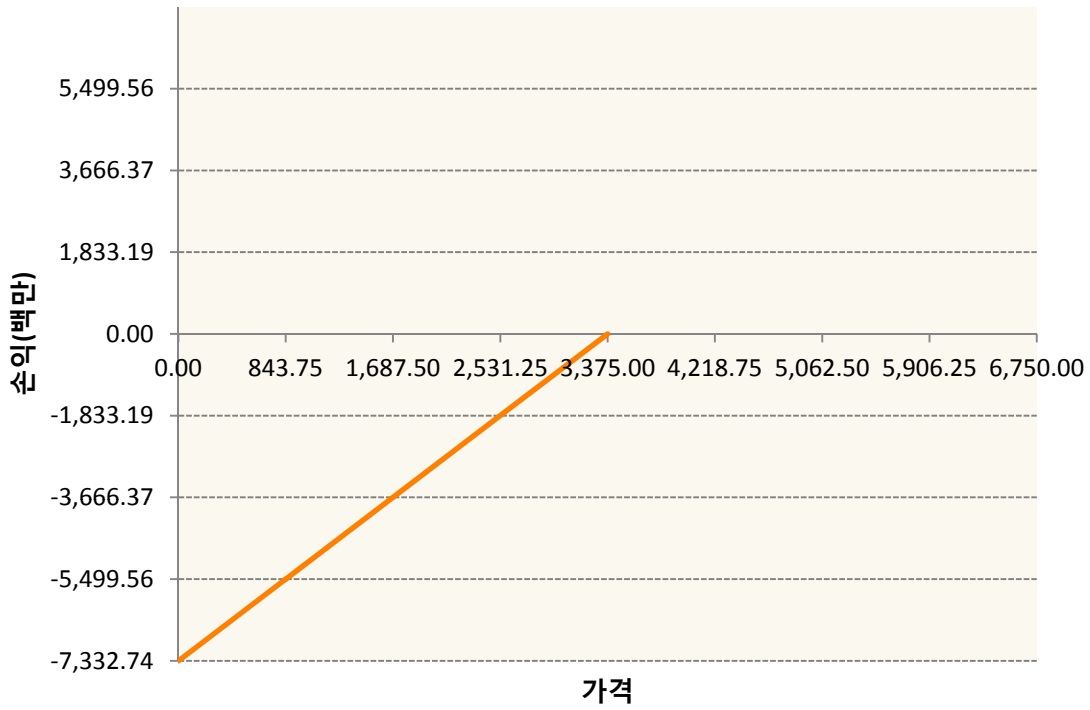


**OESXJ9-C3400-EURO STOXX 50**

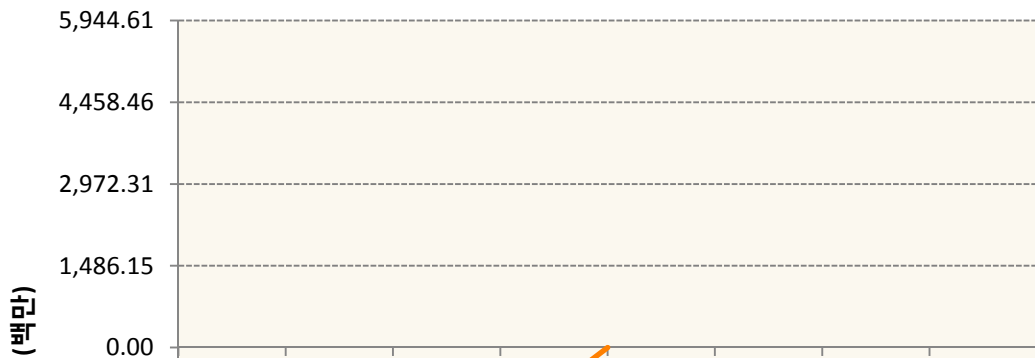


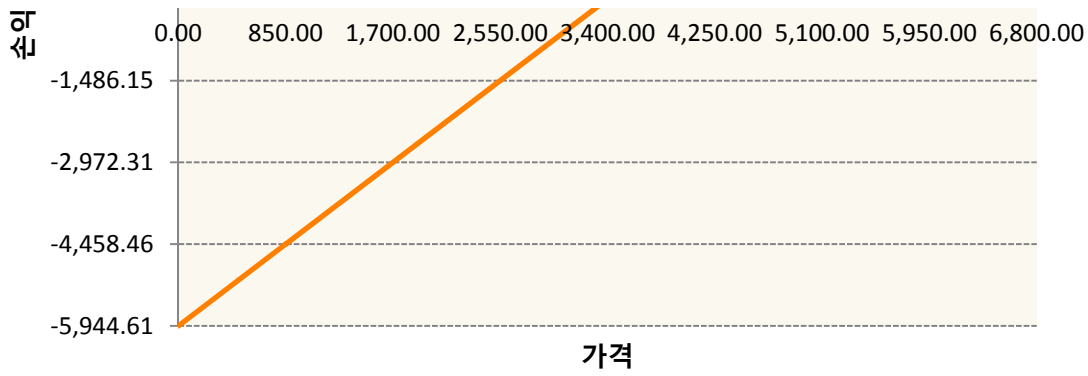


OESXJ9-P3375-EURO STOXX 50

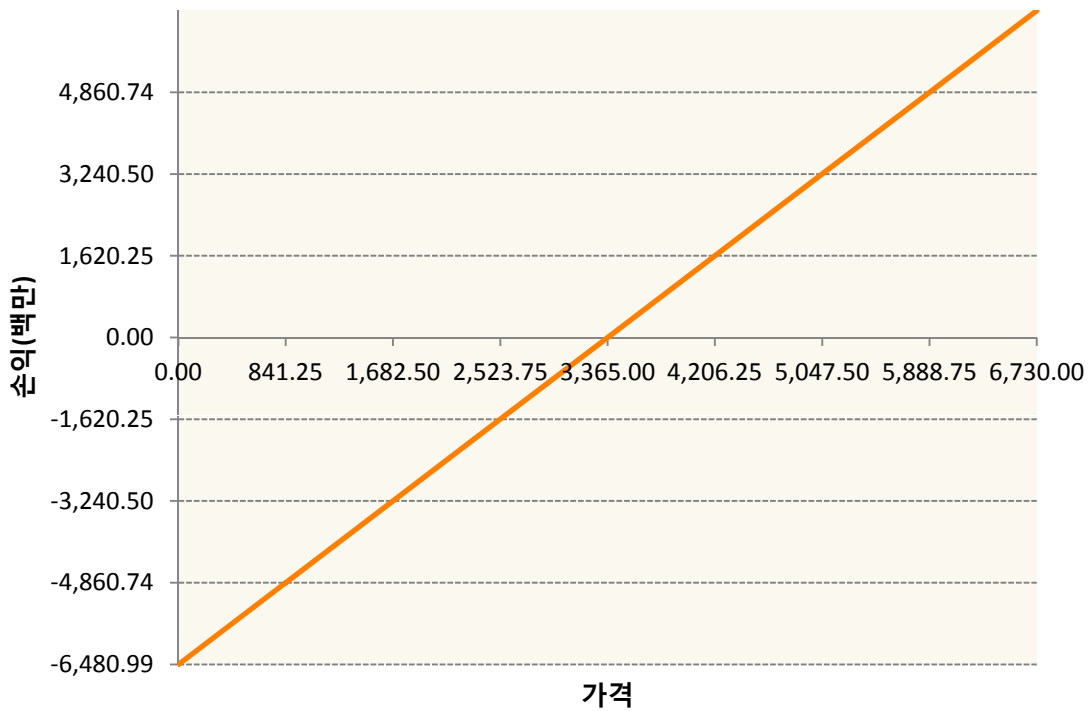


OESXJ9-P3400-EURO STOXX 50





VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	204
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	411
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	823
FX21019J01E KRW/EUR 28-06-19E	206
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)

2,821



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	2019-04-15
기준일	2019-04-12

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

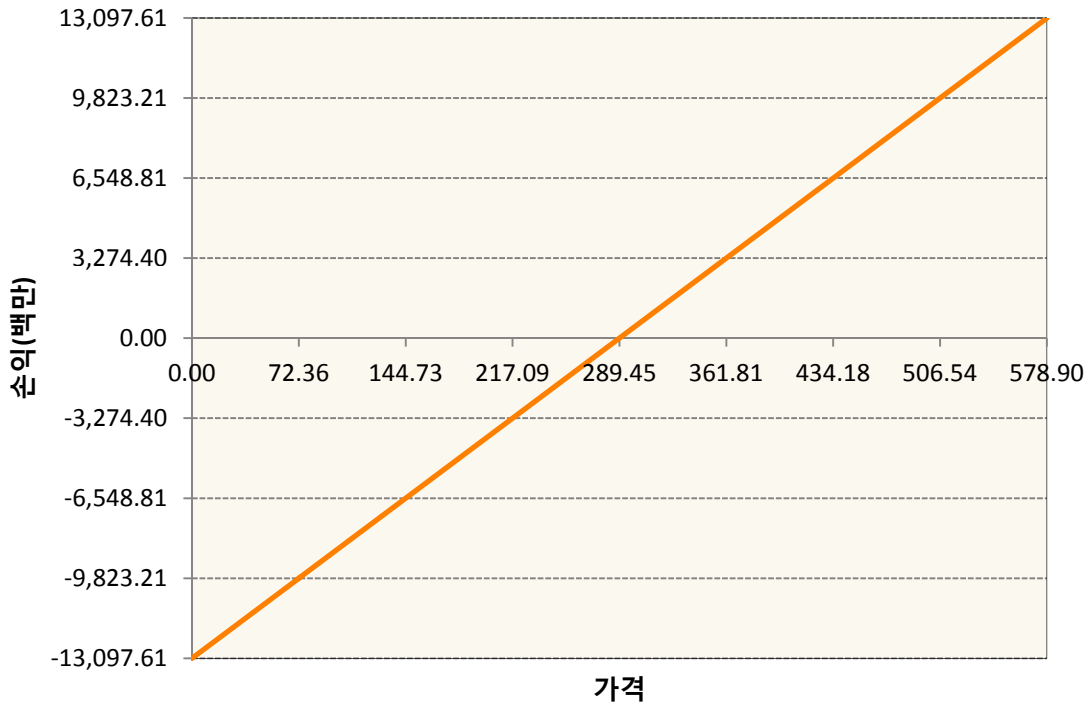
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

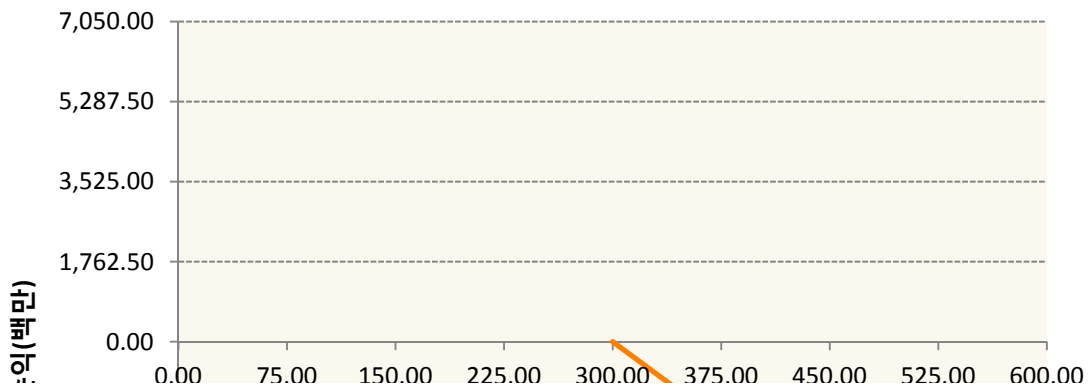
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	4,270	4,598	-329	장내
누계	유가증권	선물	13,098	0	13,098	장내
누계	유가증권	옵션	1,437	24,822	-23,385	장내

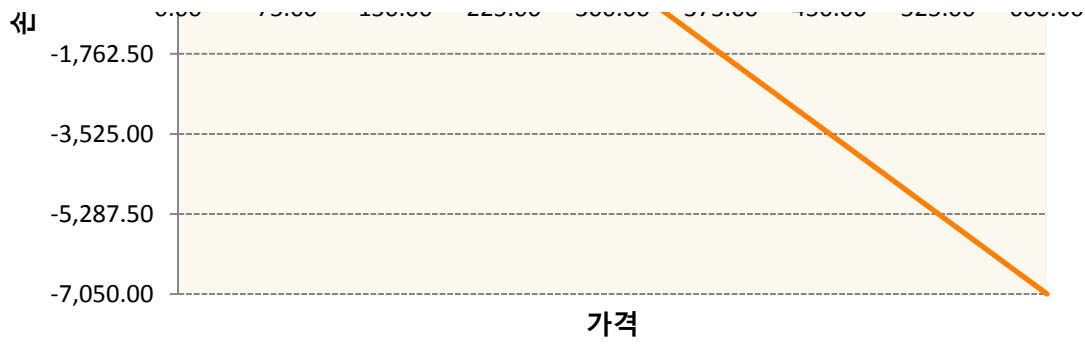
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

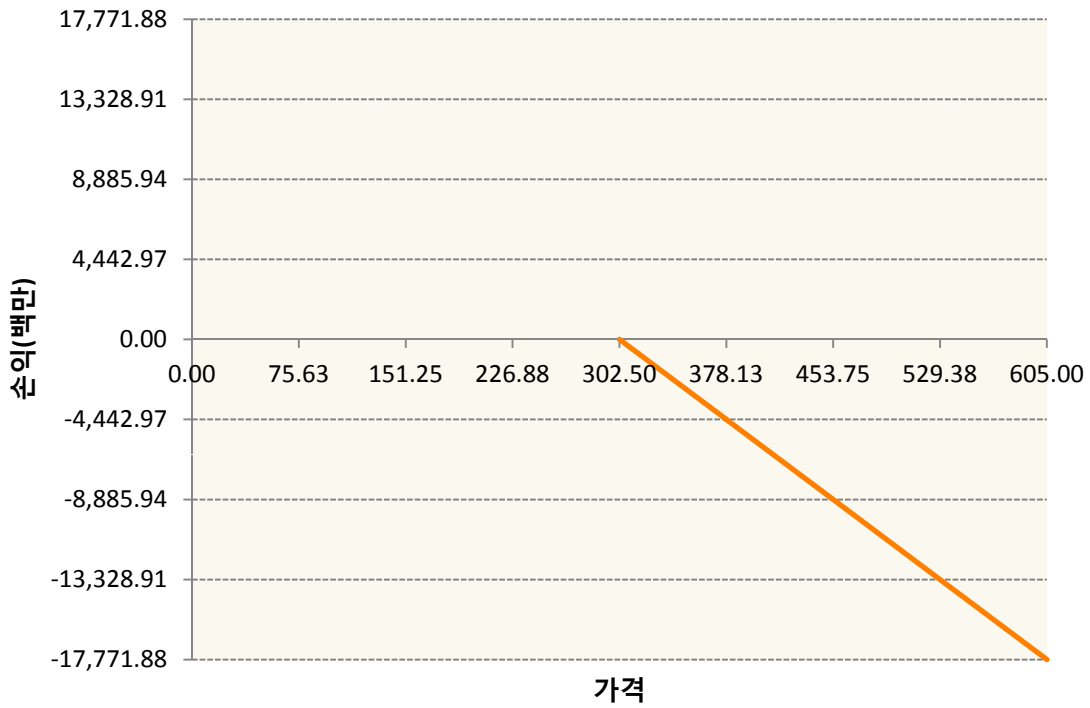


KR4201P53007-2019-05 콜300

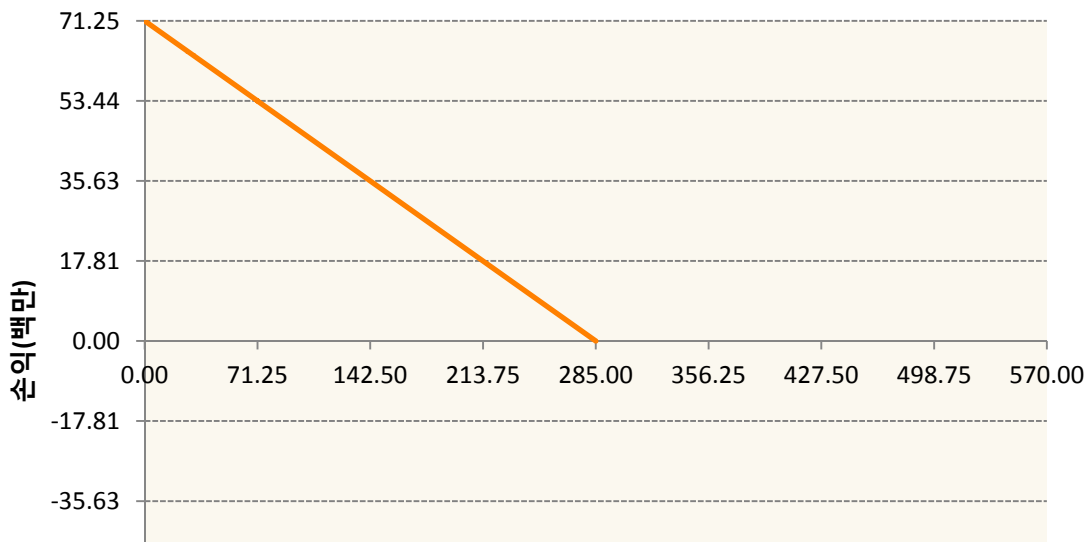


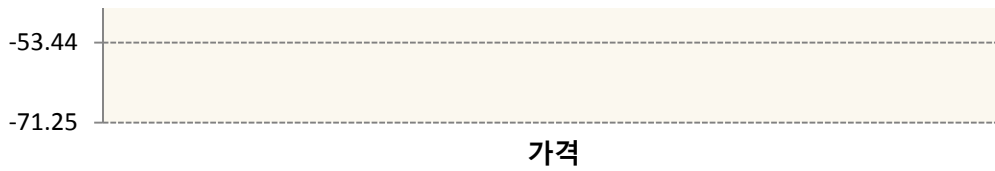


KR4201P53023-2019-05 콜302.5

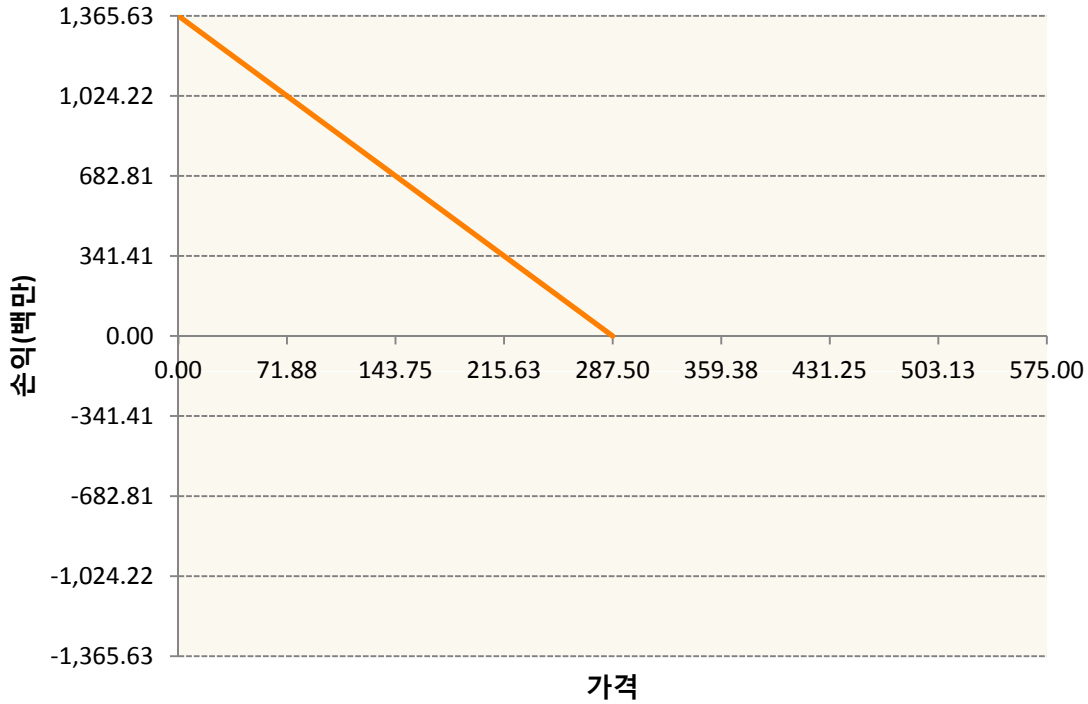


KR4301P52858-2019-05 풋285





KR4301P52874-2019-05 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						1,044
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,044	-1,044	-1,044	-1,044	-1,044	-1,044	-1,044	
-5.33%	-696	-696	-696	-696	-696	-696	-696	
-2.67%	-348	-348	-348	-348	-348	-348	-348	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	348	348	348	348	348	348	348	
5.33%	696	696	696	696	696	696	696	
8.00%	1,044	1,044	1,044	1,044	1,044	1,044	1,044	
KR4201P53007		2019-05 콜300						315
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	71	71	69	68	65	62	58	
-5.33%	69	66	63	59	53	47	41	
-2.67%	60	54	47	39	30	20	10	

0%	34	23	12	0	-12	-25	-38
2.67%	-20	-35	-49	-63	-78	-93	-107
5.33%	-111	-126	-141	-155	-170	-185	-200
8.00%	-238	-250	-262	-275	-288	-301	-315
KR4201P53023                      2019-05 콜302.5							727
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	144	143	141	137	132	126	117
-5.33%	140	136	129	120	110	97	82
-2.67%	124	112	97	80	61	40	17
0%	76	53	27	0	-28	-58	-88
2.67%	-34	-68	-103	-138	-173	-209	-245
5.33%	-231	-269	-306	-344	-382	-420	-457
8.00%	-520	-553	-586	-621	-656	-691	-727
KR4301P52858                      2019-05 풋285							4
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4	4	4	4	4	4	4
-5.33%	2	2	2	3	3	3	3
-2.67%	1	1	1	1	1	1	1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-1	-1	0	0	0	0	0
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
KR4301P52874                      2019-05 풋287.5							89
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	89	89	89	89	89	89	89
-5.33%	53	53	53	54	54	55	55
-2.67%	19	20	21	22	24	25	26
0%	-5	-3	-2	0	2	3	5
2.67%	-15	-14	-13	-12	-10	-9	-8
5.33%	-17	-16	-16	-16	-15	-15	-14
8.00%	-17	-17	-17	-17	-16	-16	-16

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

(단위:백만원)

**1,764**

공시일	2019-04-15
기준일	2019-04-12

## 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	3,617	0	3,617	

### 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	2019-04-15
기준일	2019-04-12

## H2O글로벌본드(UH)(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	21,244	0	21,244	

### 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	2019-04-15
기준일	2019-04-12

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	73,383	0	73,383	
누계	통화	선도	0	77,240	-77,240	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019H01 KRW/USD 19-04-19E	146
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	118
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	208
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	255
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E	155
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E	365
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E	428
FX21019H03 KRW/USD 22-04-19E	365
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	365
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	419
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	182
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	456
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	529
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	321
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	273
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
FX21019J002 KRW/USD 10-06-19E	100
FX21019J003 KRW/USD 10-05-19E	155
FX21019J004 KRW/USD 10-05-19E	73
FX21019J005 KRW/USD 10-05-19E	273
FX21019J006 KRW/USD 10-05-19E	228
FX21019J007 KRW/USD 10-05-19E	73
FX21019J011 KRW/USD 20-05-19E	128
FX21019J012 KRW/USD 20-05-19E	18

FX21019J01E KRW/USD 20-05-19E

137

FX21019J01F KRW/USD 20-05-19E

137

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

(단위:백만원)

**2,099**

공시일	2019-04-15
기준일	2019-04-12

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

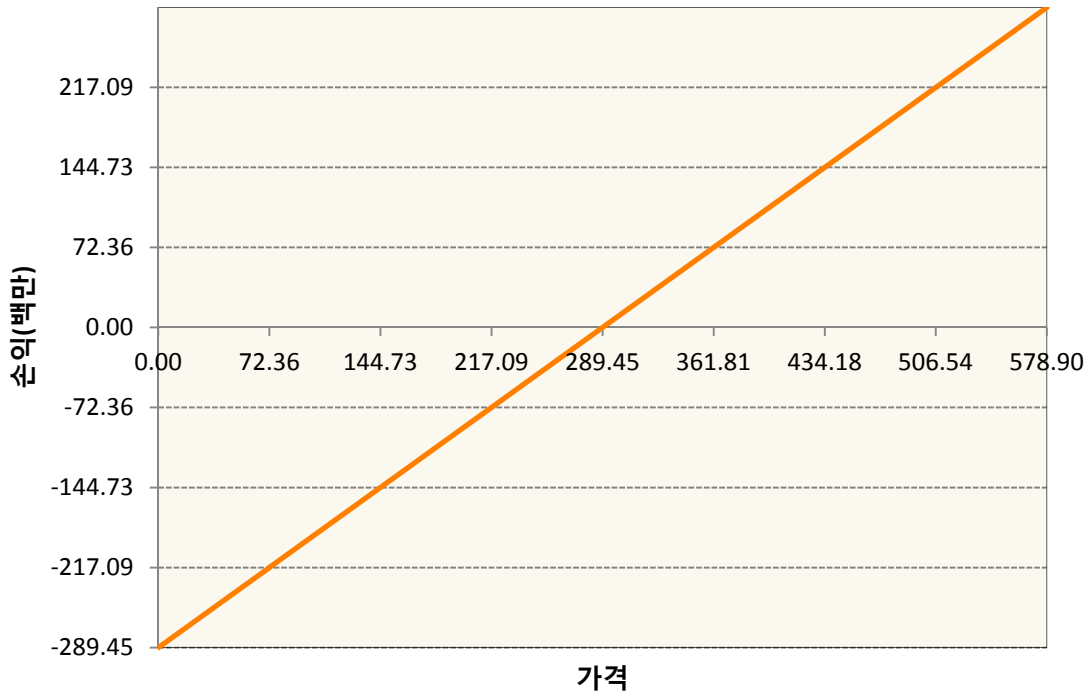
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

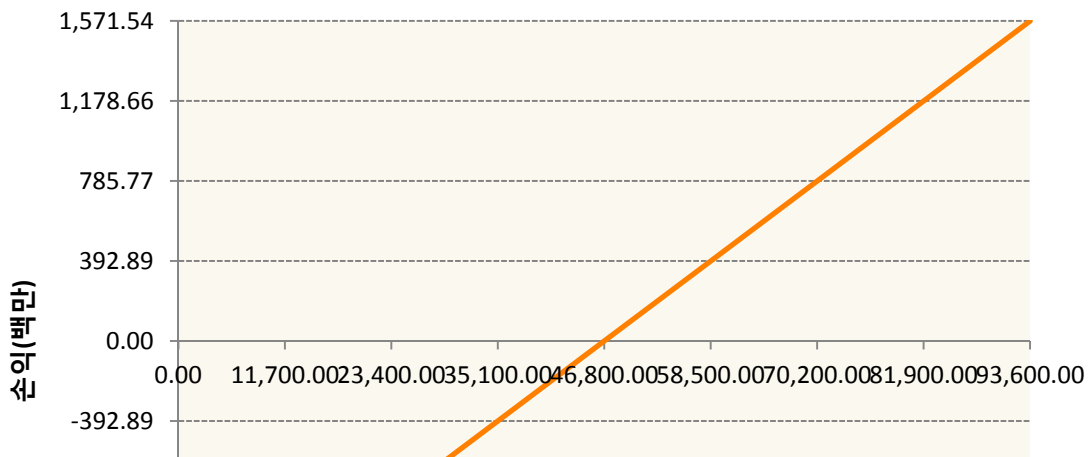
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,861	0	1,861	장내

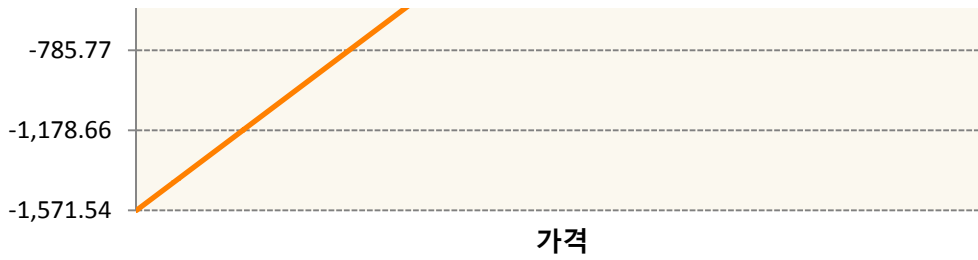
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4111P50004-2019-05 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	
KR4111P50004		2019-05 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)

**163**

공시일	2019-04-15
기준일	2019-04-12

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

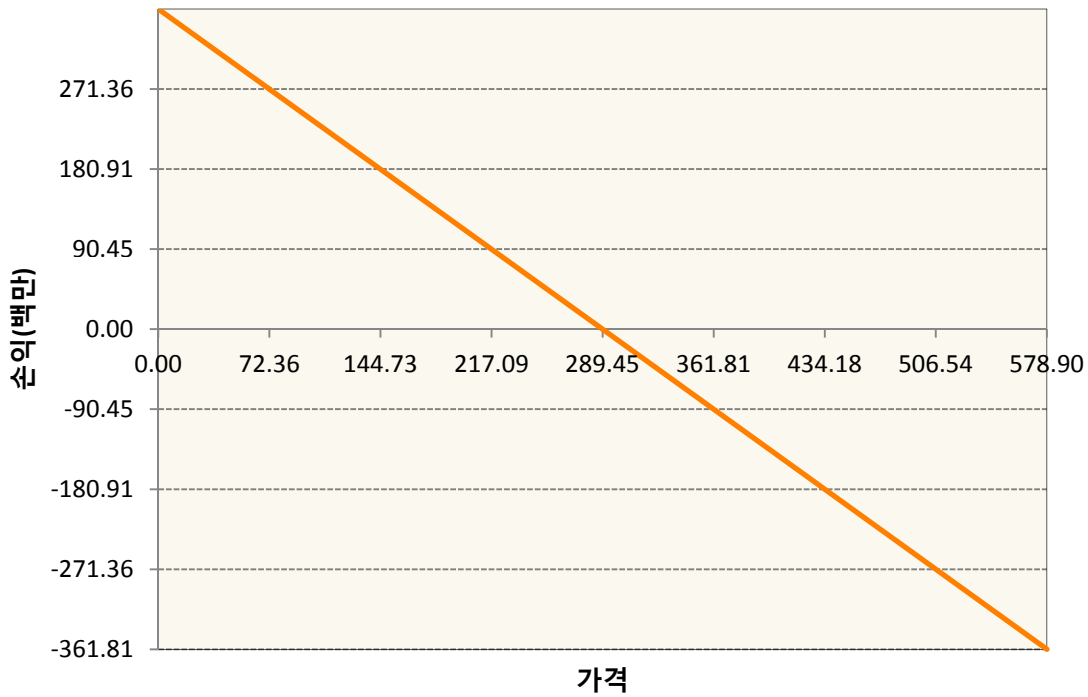
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

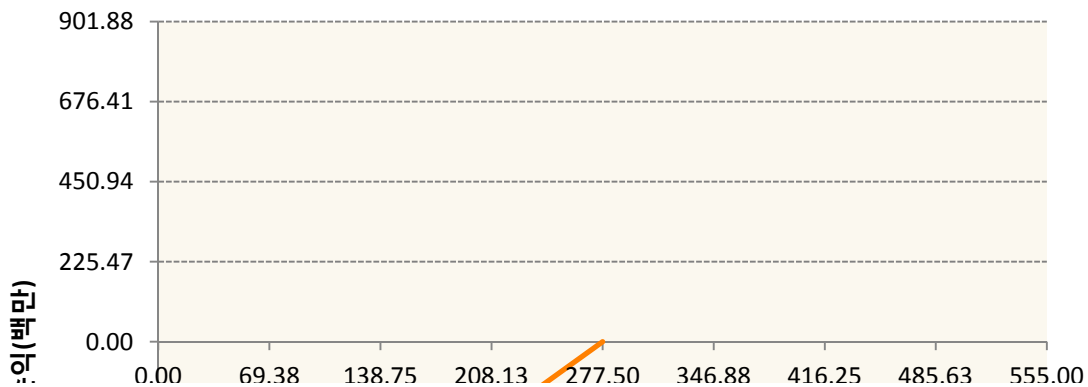
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	72	-72	장내
신규	유가증권	옵션	138	141	-2	장내
누계	유가증권	선물	0	362	-362	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,882	-1,882	장내

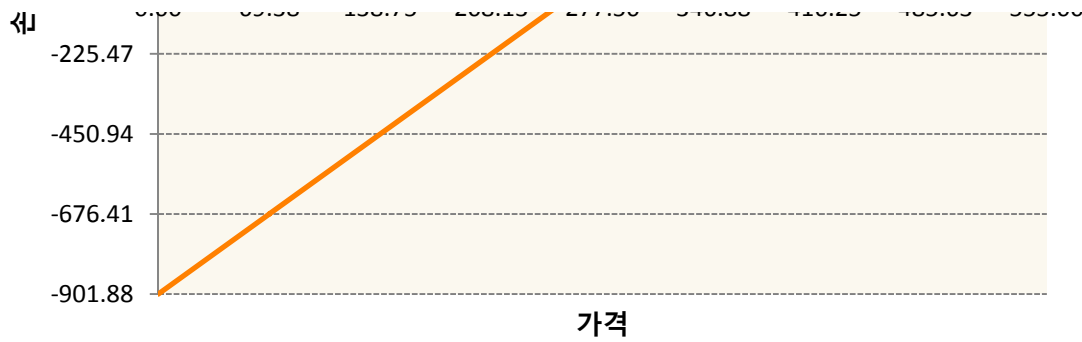
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

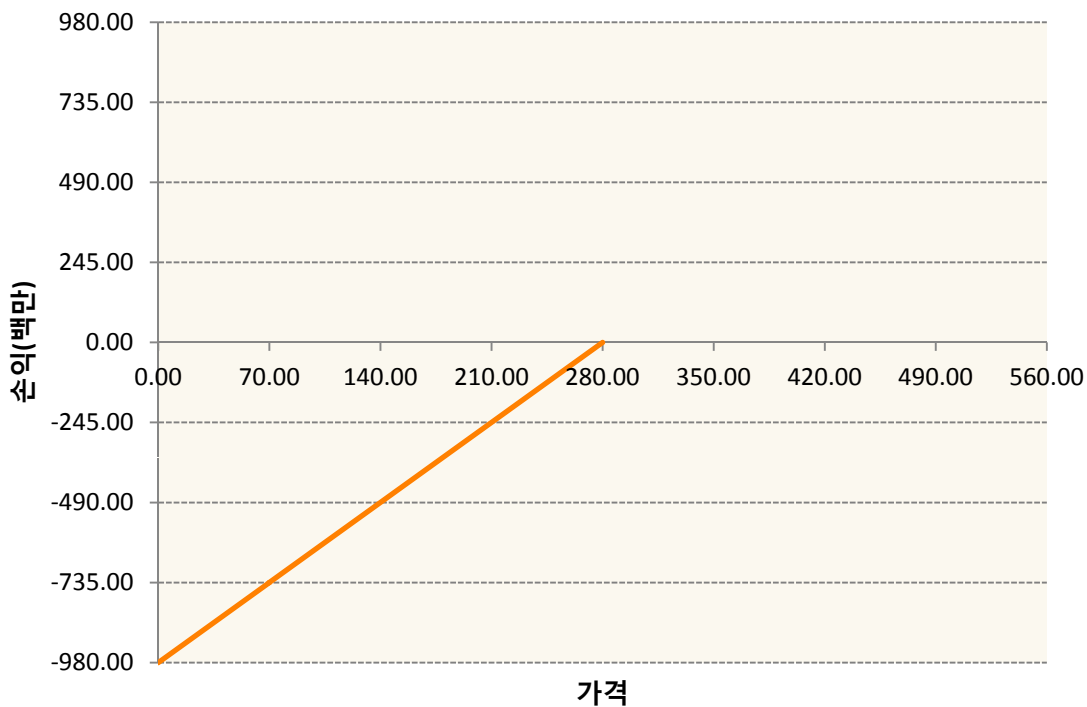


KR4301P52775-2019-05 풋277.5





KR4301P52809-2019-05 풋280



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						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%	19	19	19	19	19	19	19	
-2.67%	10	10	10	10	10	10	10	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10	
5.33%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
8.00%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29	
KR4301P52775		2019-05 풋277.5						41
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-38	-38	-39	-39	-39	-40	-41
-5.33%	-16	-17	-18	-19	-20	-21	-22
-2.67%	-3	-4	-5	-6	-7	-8	-9
0%	1	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	2	2	2	2	2	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

KR4301P52809

2019-05 풋280

50

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-48	-48	-48	-49	-49	-49	-50
-5.33%	-23	-24	-25	-25	-26	-27	-28
-2.67%	-5	-6	-8	-9	-10	-11	-12
0%	2	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	4	3	3	3	3	2	2
5.33%	4	4	4	4	4	3	3
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

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

(단위:백만원)

98

공시일	2019-04-15
기준일	2019-04-12

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

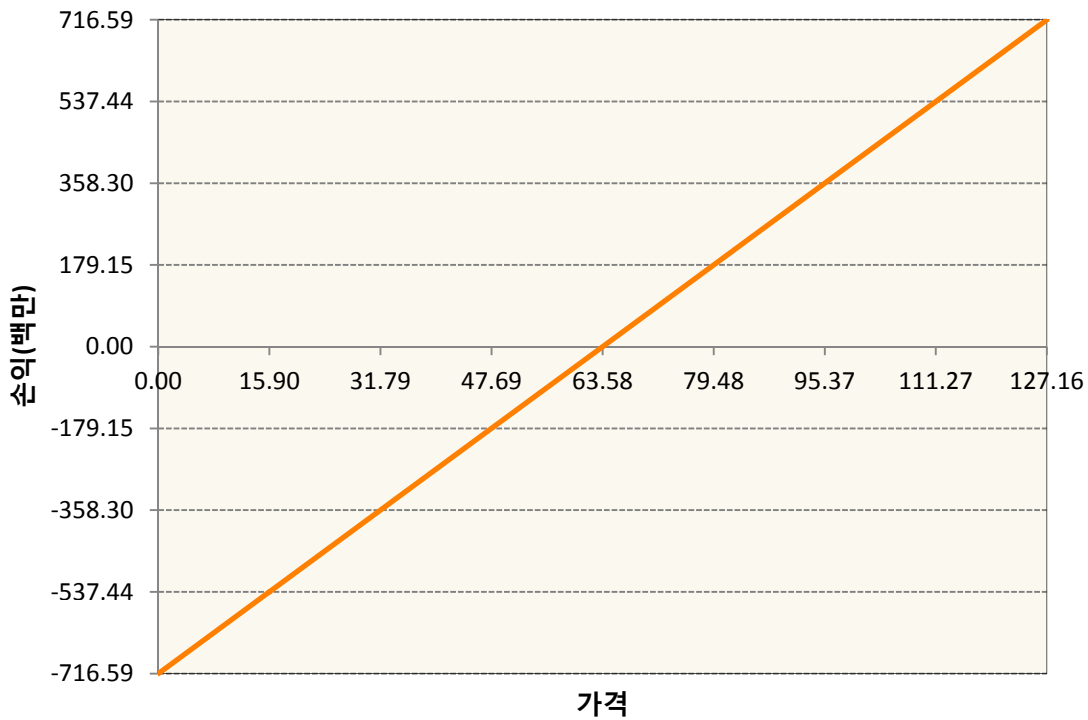
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

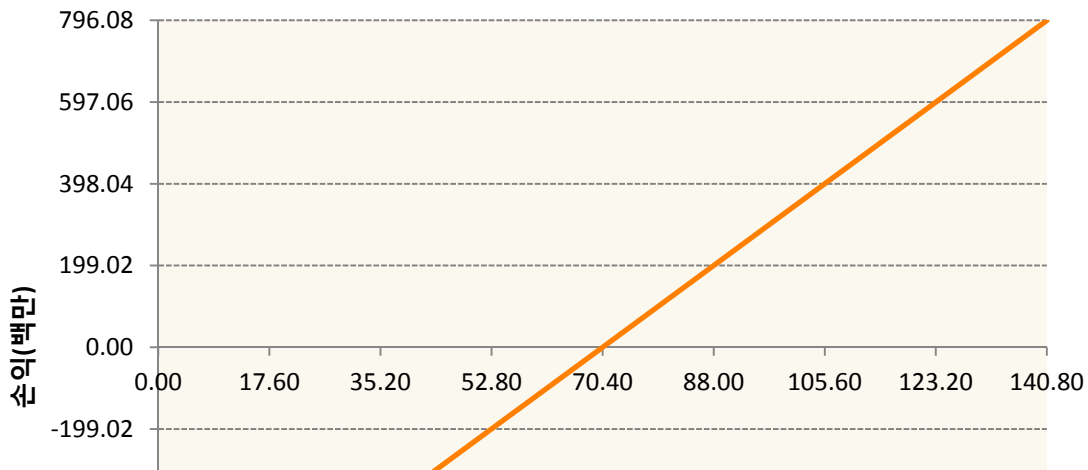
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,971	285	2,686	

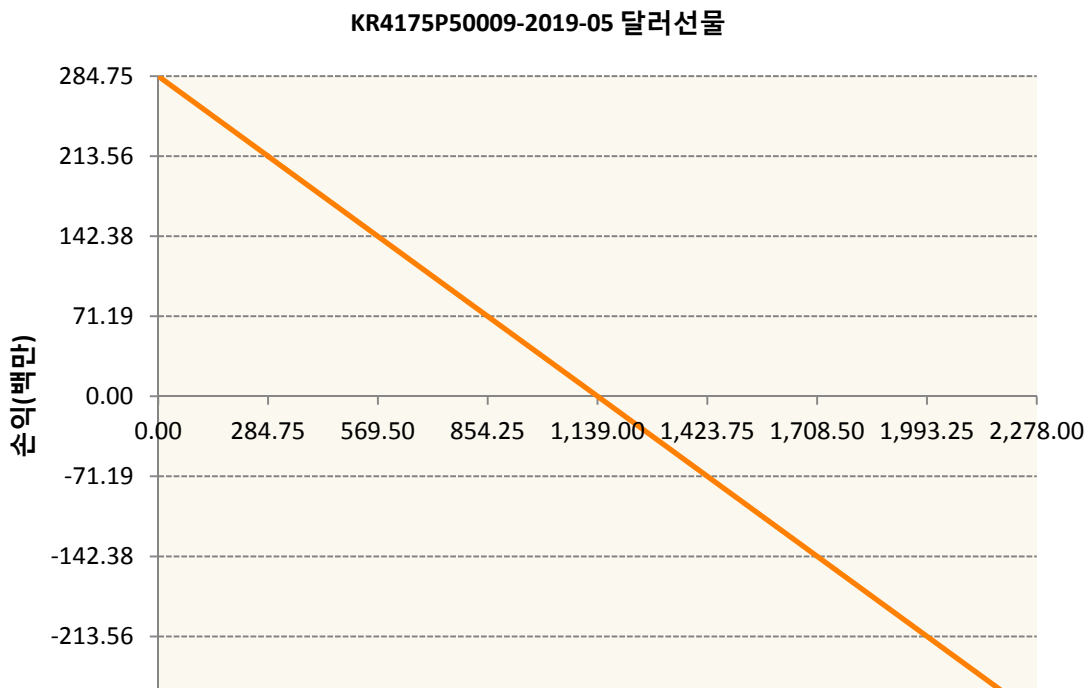
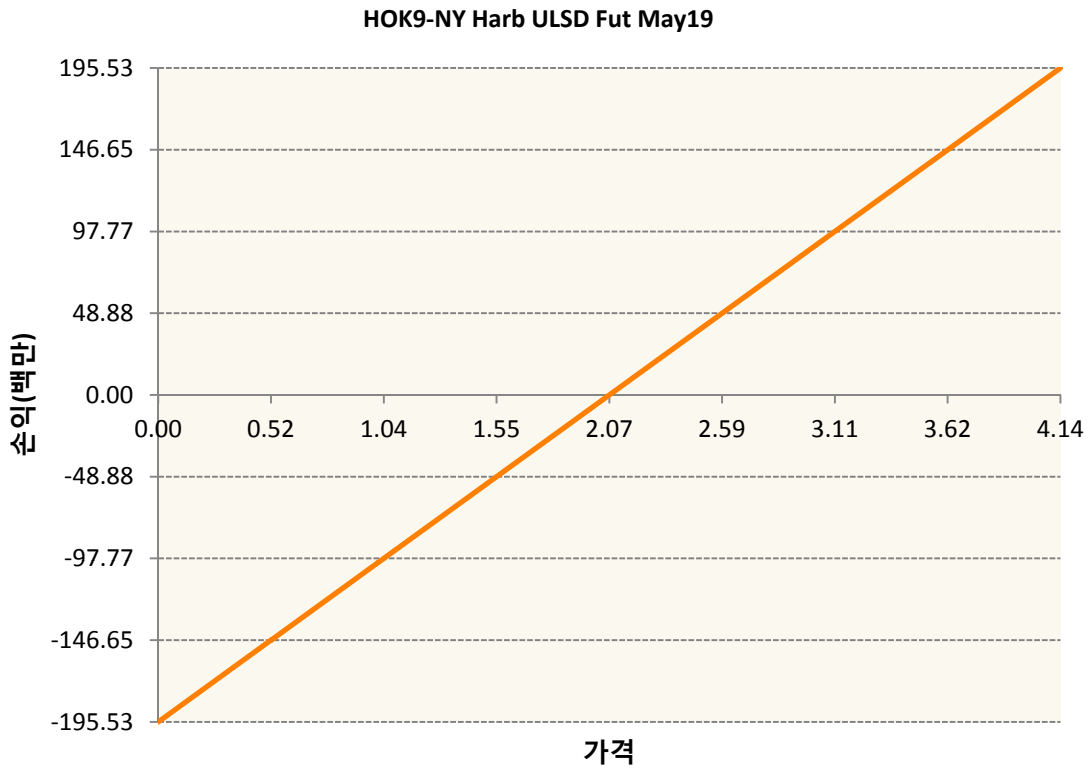
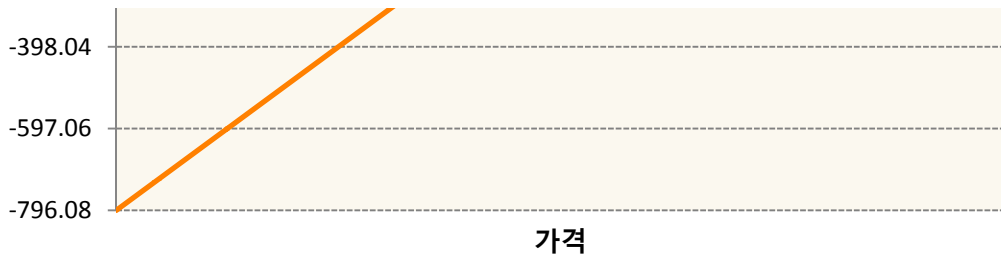
### 2. 만기시점의 손익구조

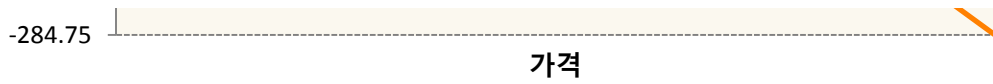
**CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19**



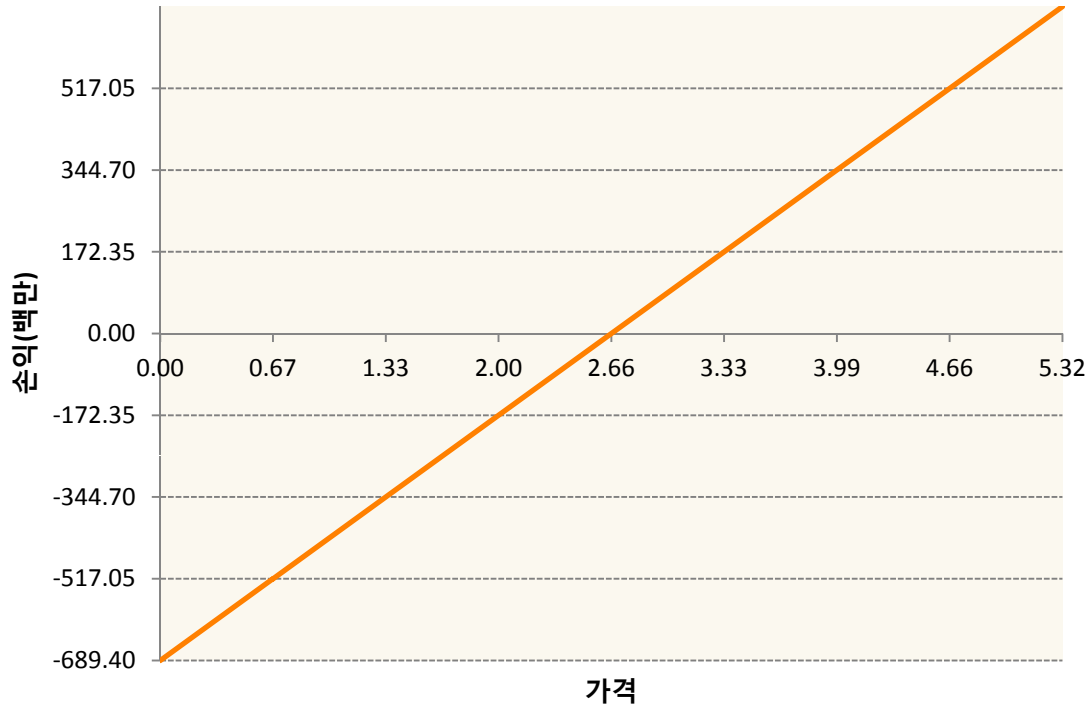
**CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19**



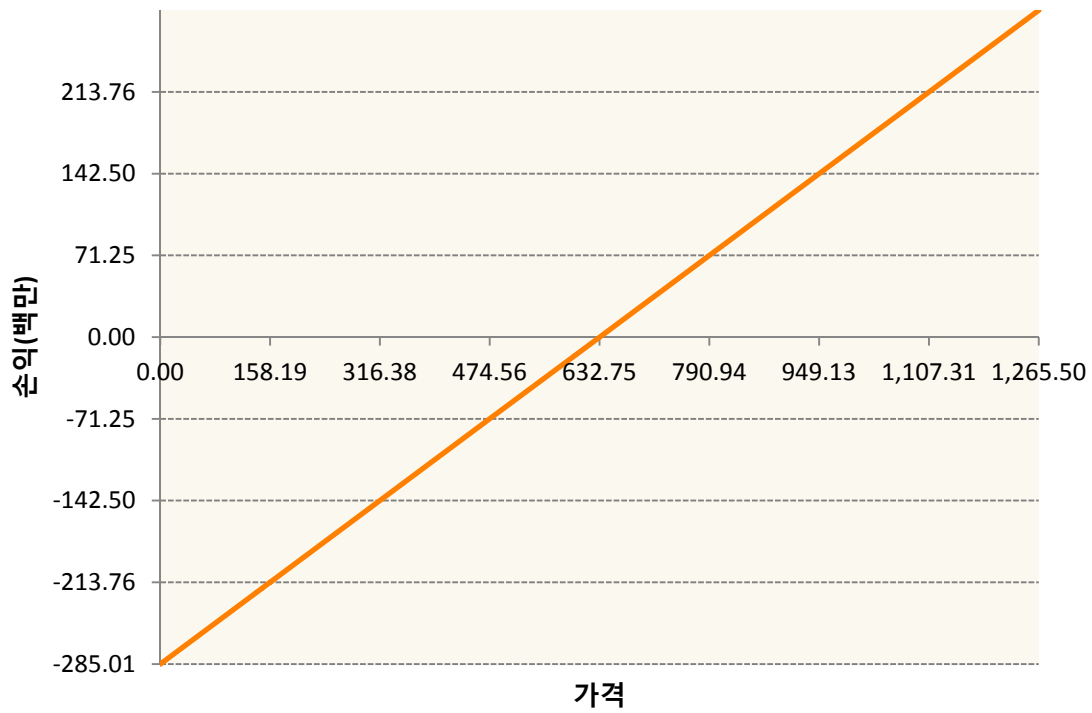




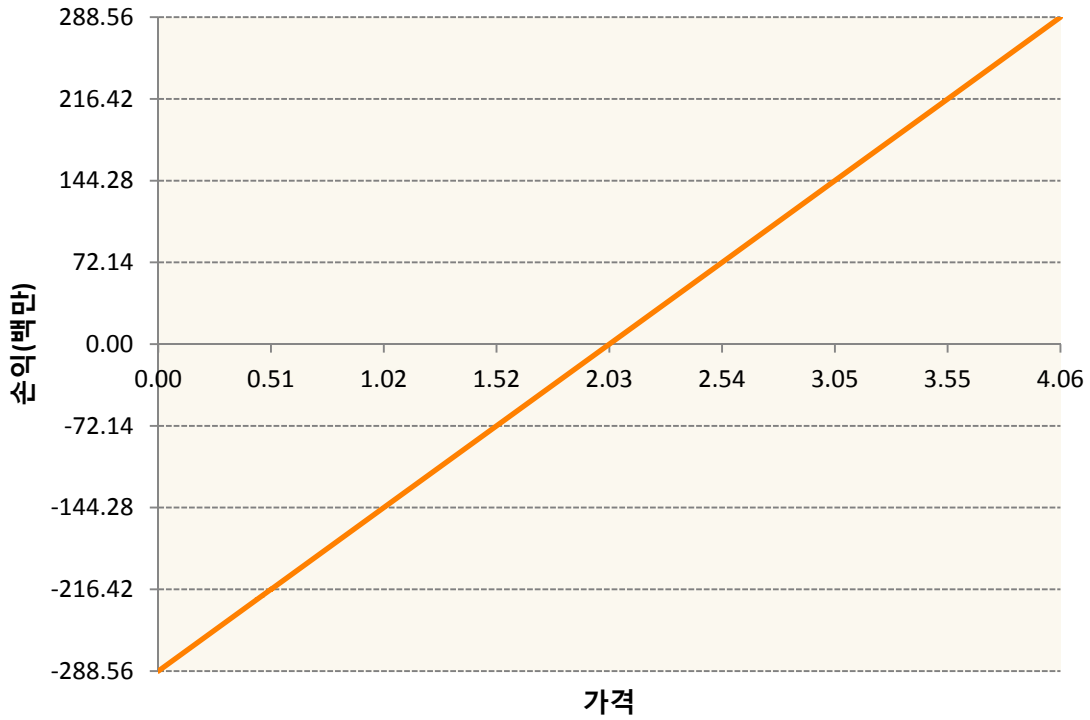
NGK19-NATURAL GAS FUTR May19



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	64
HOK9	NY Harb ULSD Fut May19	16
KR4175P500	2019-05 달러선물	23
NGK19	NATURAL GAS FUTR May19	55
QSK9	Low Su Gasoil G May19	23
XBK9	GASOLINE RBOB FUT May19	23

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

(단위:백만원)

**443**

공시일	2019-04-15
기준일	2019-04-12

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

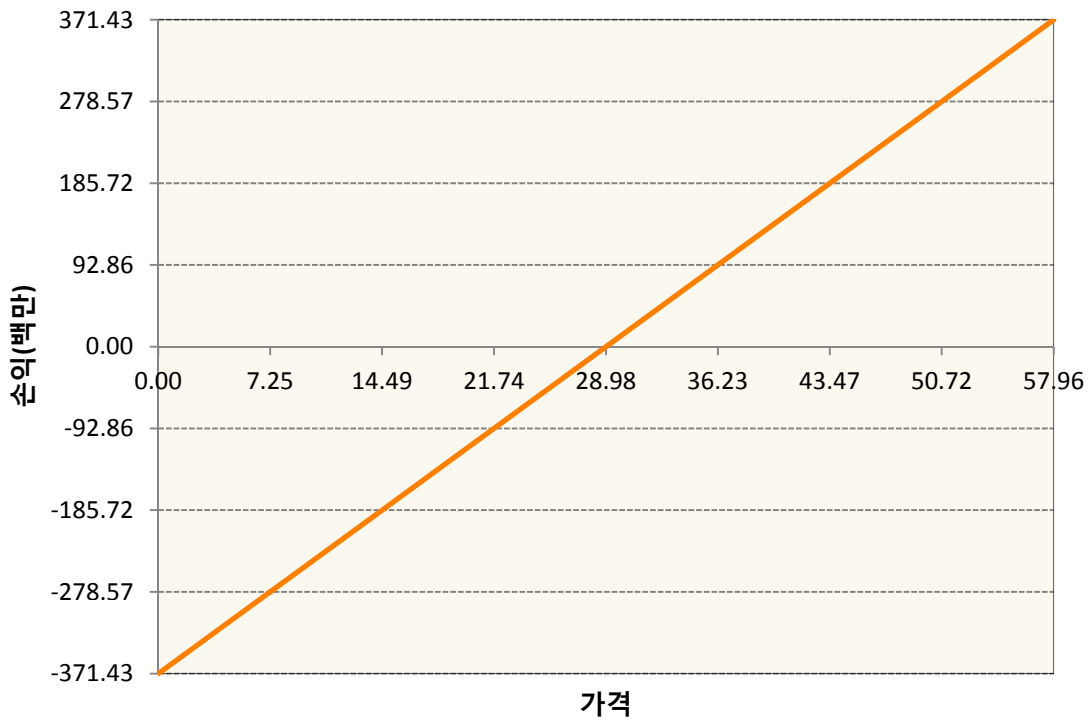
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

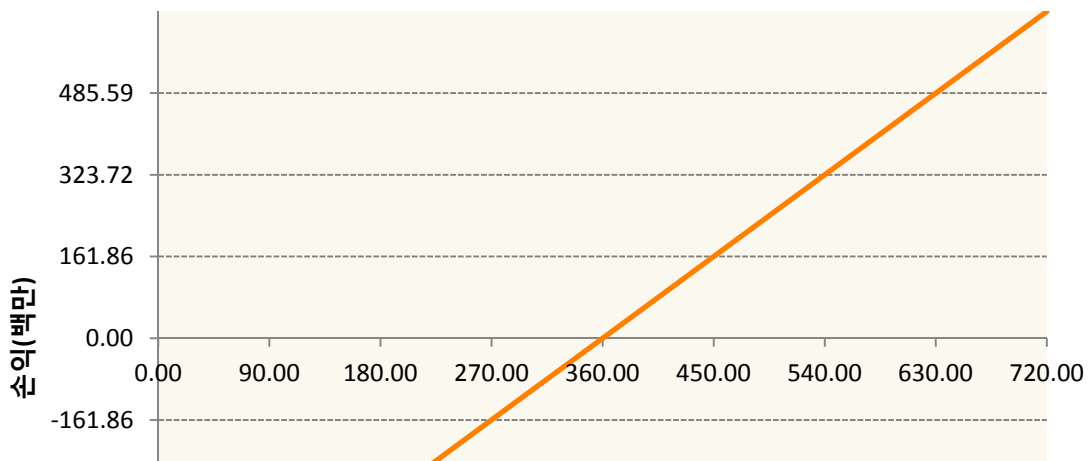
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,329	80	3,249	

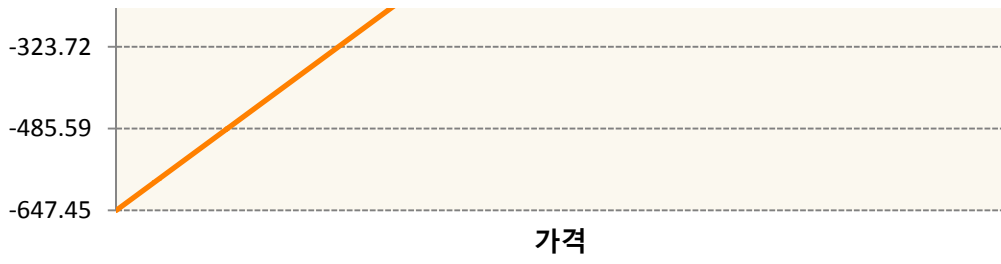
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19**

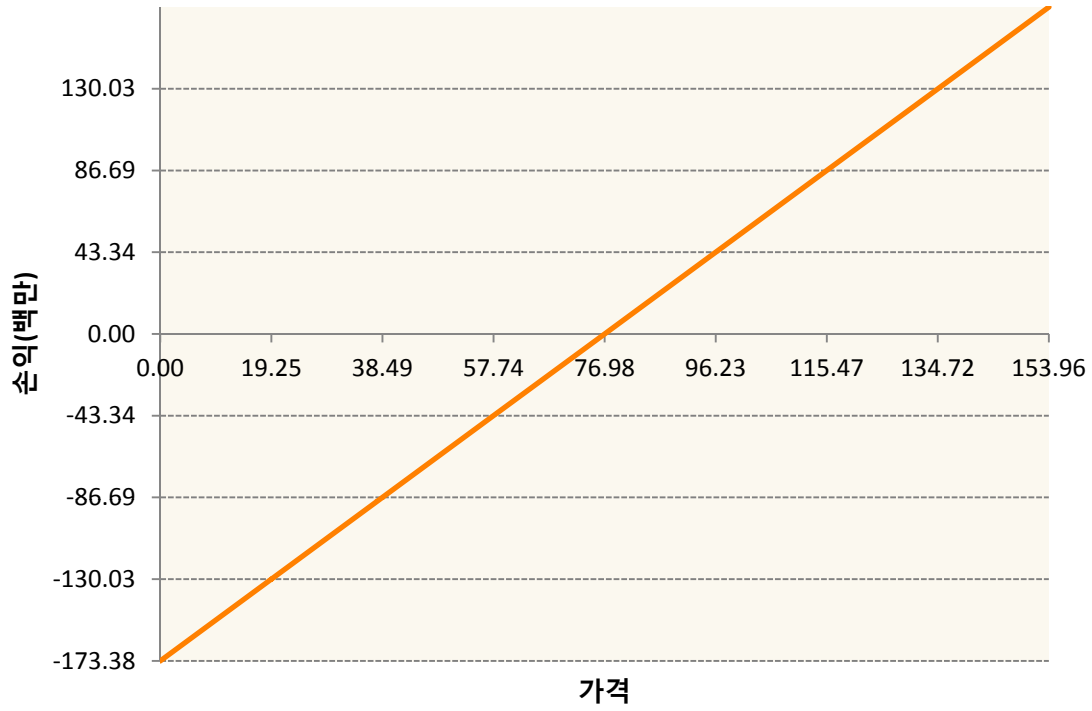


**CK9-CORN FUTURE May19**

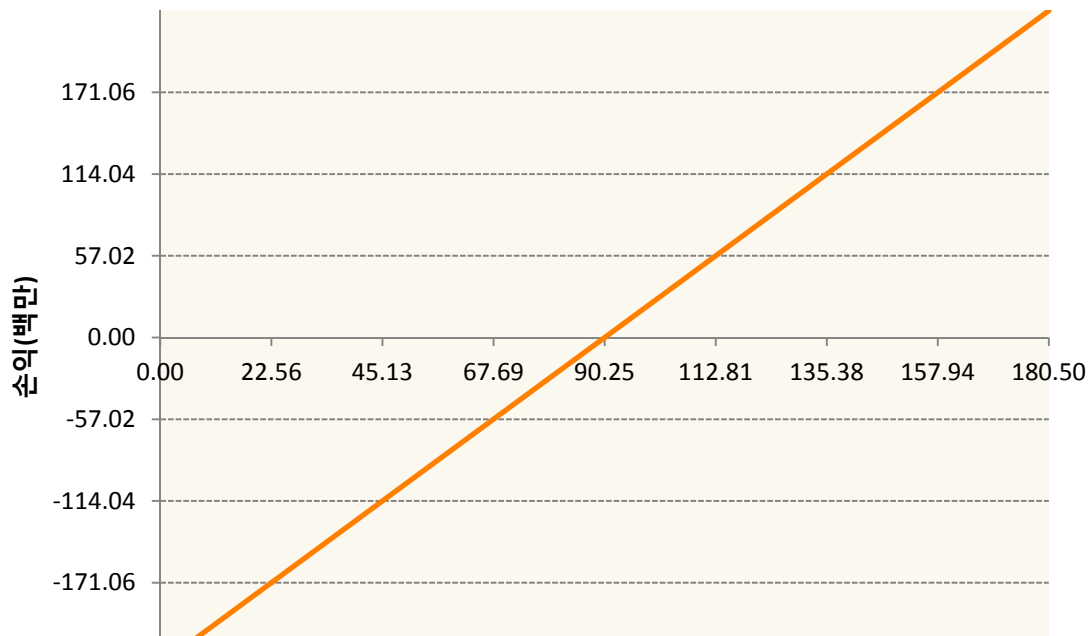


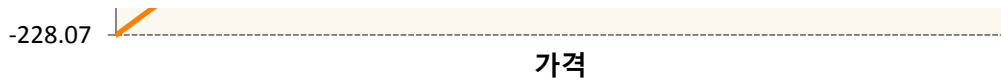


**CTK9-COTTON NO.2 FUTR May19**

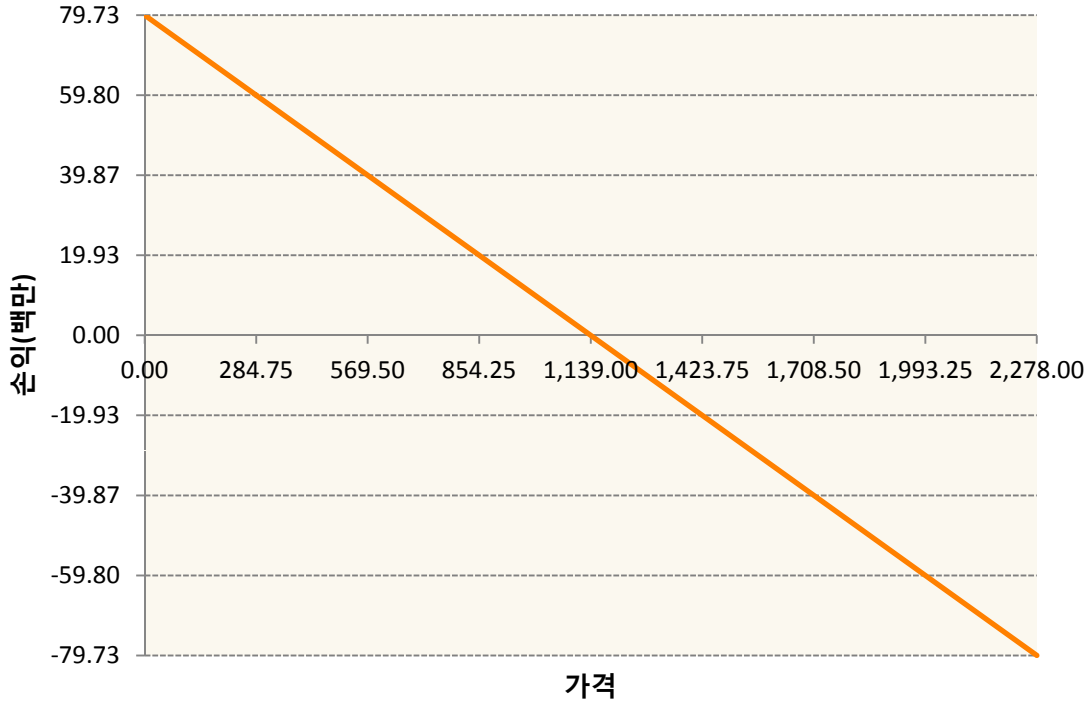


**KCK9-COFFEE 'C' FUTURE May19**

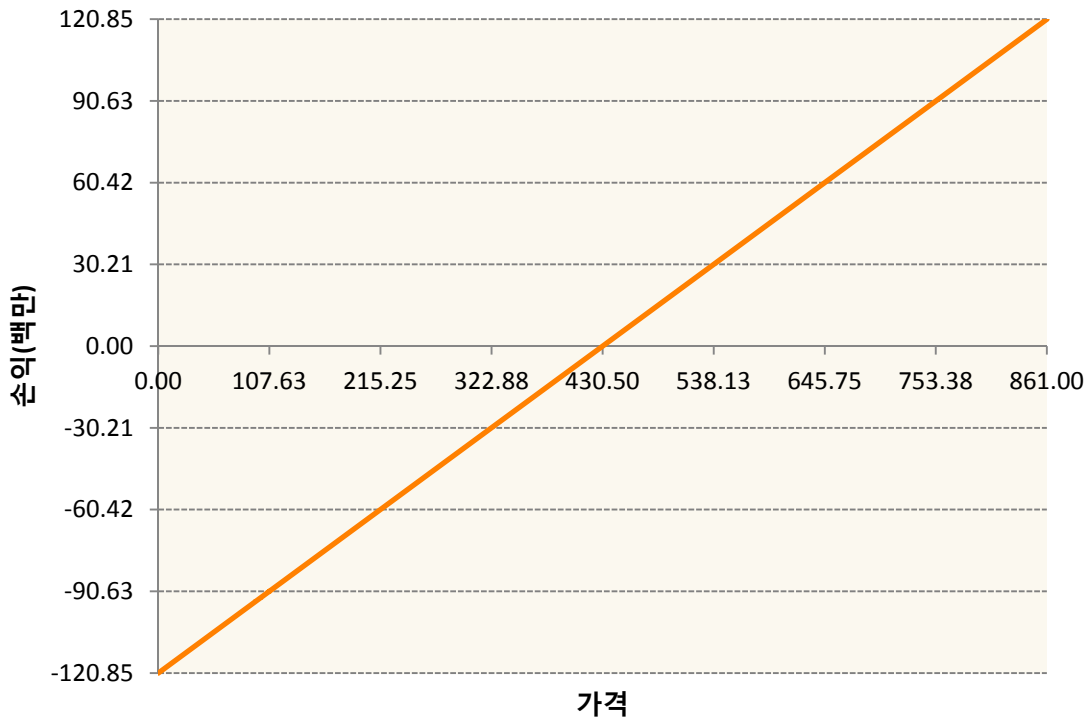




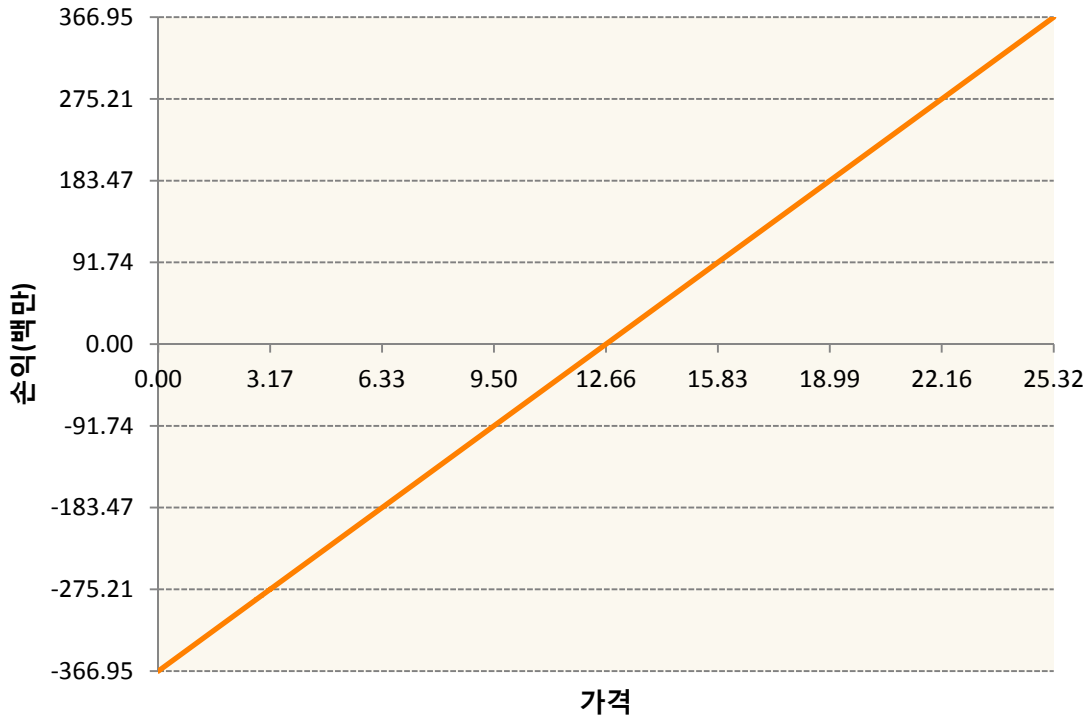
KR4175P50009-2019-05 달러선물



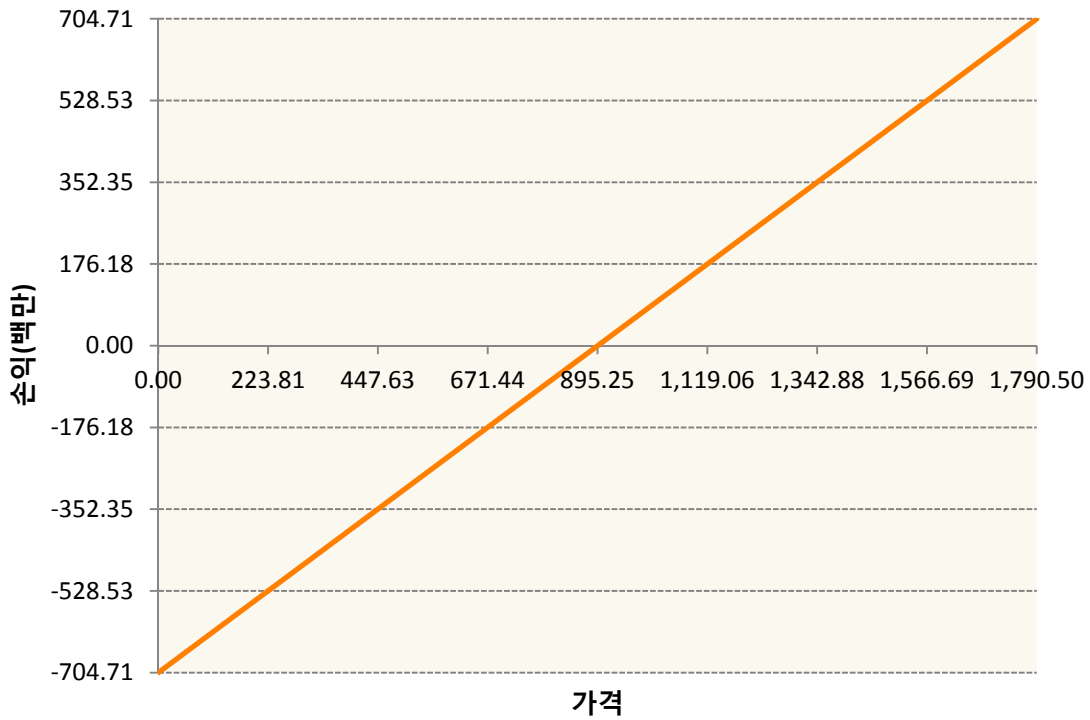
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



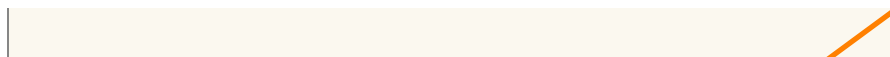
**SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19**

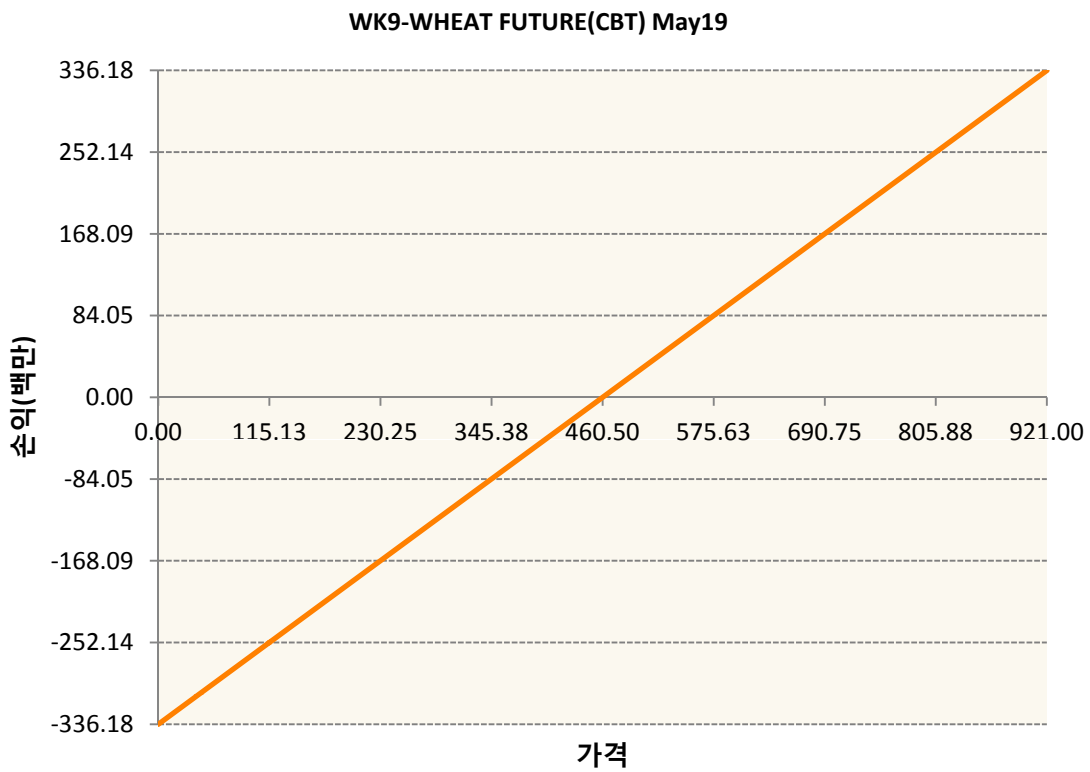
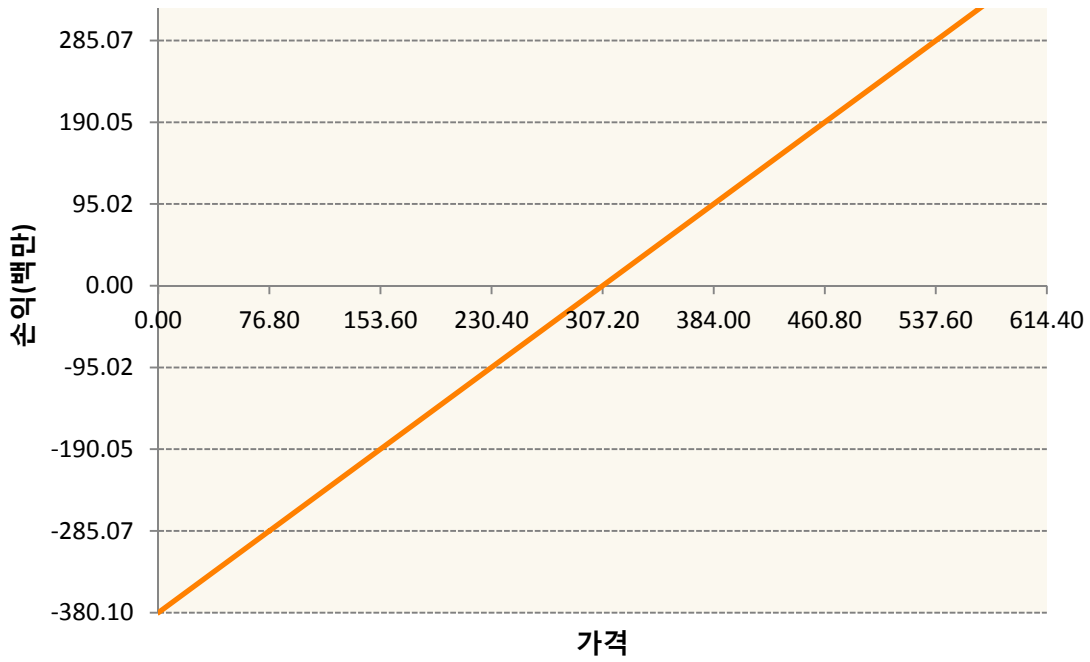


**SK9-SOYBEAN FUTURE May19**



**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	18
KR4175P500	2019-05 달러선물	6

KWK9	KC HRW WHEAT FUT May19	10
SBK9	SUGAR #11 (WORLD) May19	29
SK9	SOYBEAN FUTURE May19	56
SMK9	SOYBEAN MEAL FUTR May19	30
WK9	WHEAT FUTURE(CBT) May19	27

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

(단위:백만원)

**268**