

공시일	2019-04-16
기준일	2019-04-15

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	2019-04-16
기준일	2019-04-15

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

1,156

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

680

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-04-16
기준일	2019-04-15

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)	353
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	97
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	165

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

964

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-04-16
기준일	2019-04-15

유로인덱스모(주식-파생형)

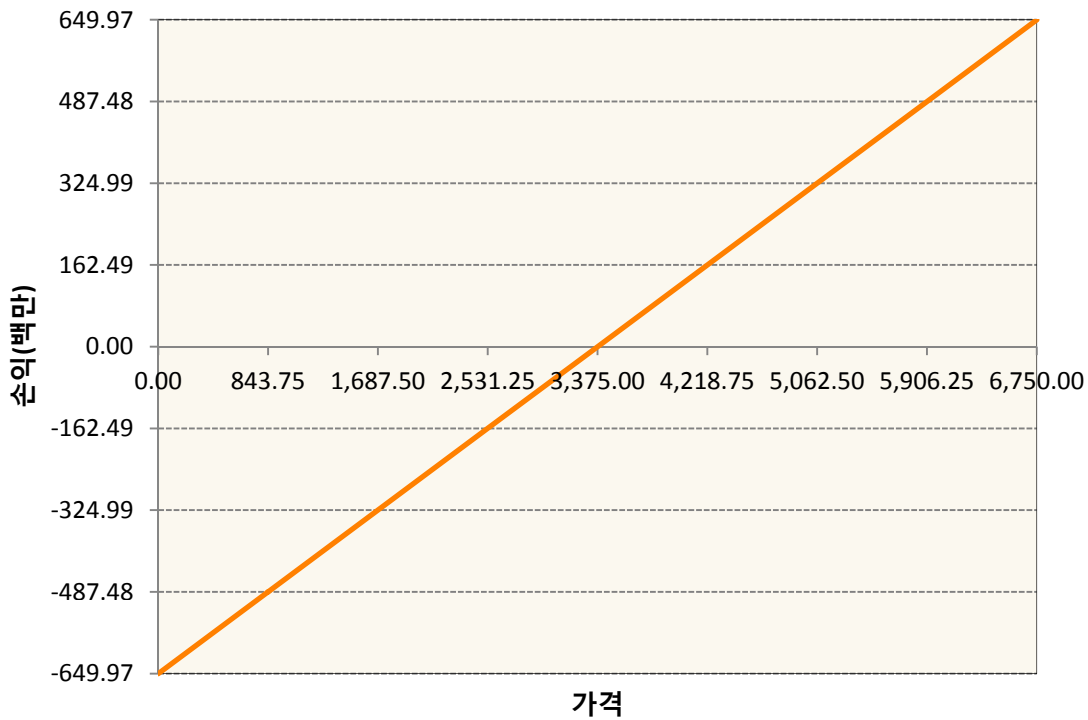
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	650	0	650	

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	2019-04-16
기준일	2019-04-15

차이나인덱스모(주식-파생형)

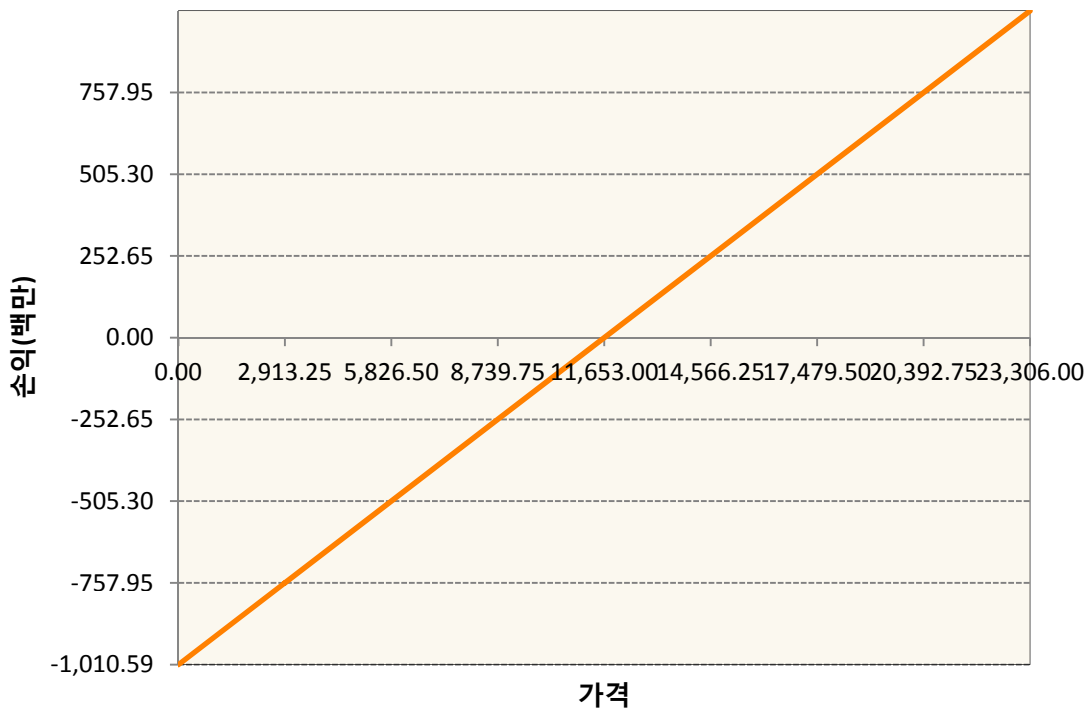
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,011	0	1,011	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCJ9-HSCEI Futures Apr19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

83

공시일	2019-04-16
기준일	2019-04-15

커버드콜모(주식혼합-파생형)

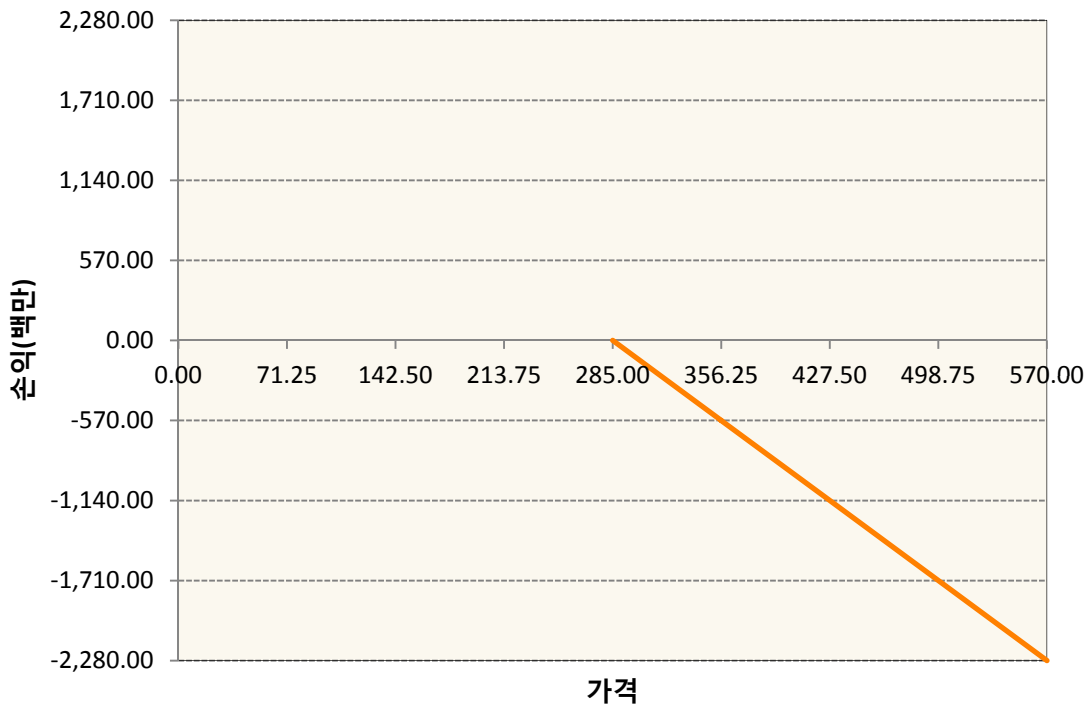
1. 계약금액

(단위:백만원)

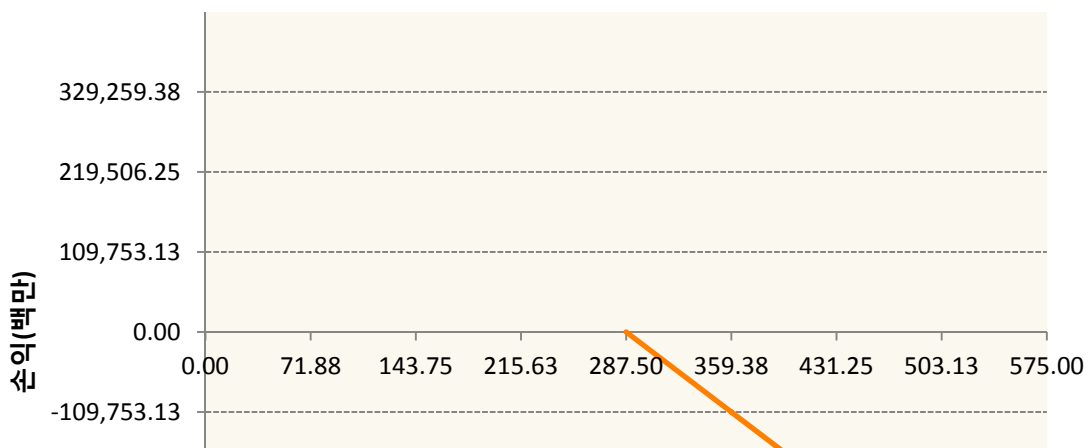
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	674,730	-674,730	장내

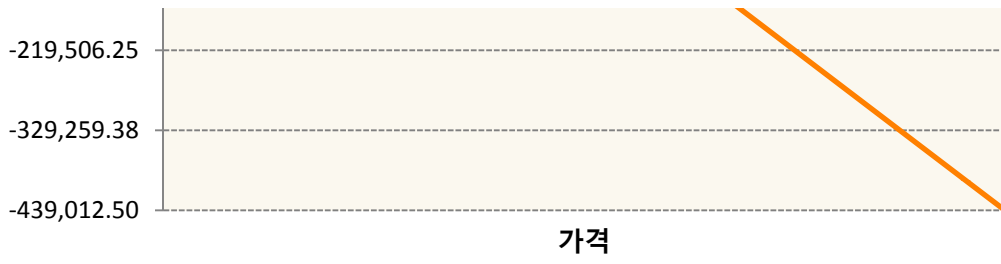
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P52850-2019-05 콜285

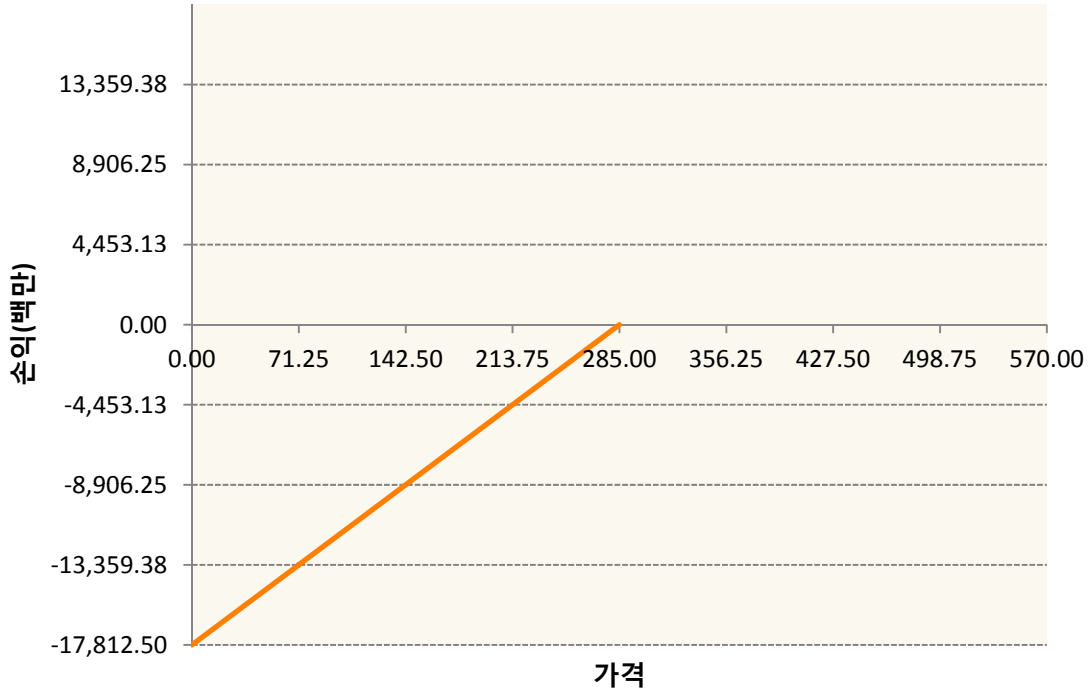


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

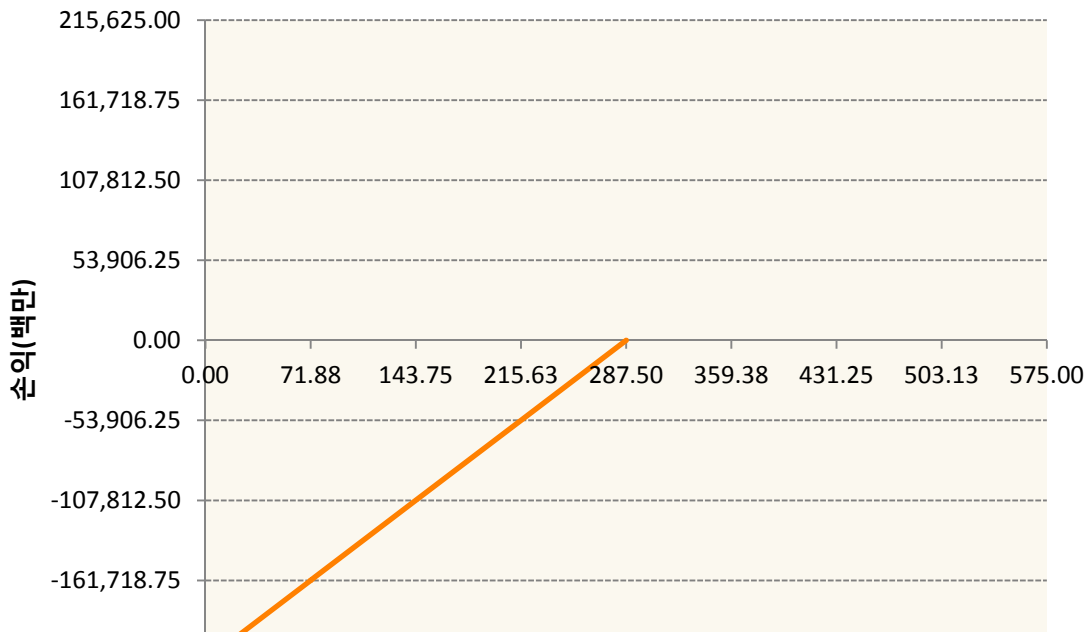




KR4301P52858-2019-05 풋285



KR4301P52874-2019-05 풋287.5



-215,625.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P52850		2019-05 콜285						155
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	71	70	68	66	63	61	58	
-5.33%	64	60	57	54	50	46	42	
-2.67%	45	41	37	32	28	23	19	
0%	13	9	4	0	-4	-9	-13	
2.67%	-32	-36	-39	-43	-46	-50	-54	
5.33%	-87	-89	-91	-93	-96	-99	-102	
8.00%	-146	-147	-148	-149	-151	-153	-155	
KR4201P52876		2019-05 콜287.5						28,396
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	11,677	11,448	11,158	10,811	10,413	9,971	9,488	
-5.33%	10,621	10,110	9,549	8,947	8,311	7,648	6,961	
-2.67%	7,883	7,093	6,288	5,473	4,650	3,821	2,986	
0%	2,624	1,750	876	0	-876	-1,754	-2,631	
2.67%	-5,296	-6,002	-6,739	-7,500	-8,280	-9,075	-9,882	
5.33%	-15,241	-15,670	-16,161	-16,704	-17,291	-17,916	-18,572	
8.00%	-26,324	-26,523	-26,786	-27,110	-27,489	-27,920	-28,396	
KR4301P52858		2019-05 풋285						1,065
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,051	-1,052	-1,053	-1,055	-1,057	-1,061	-1,065	
-5.33%	-579	-585	-592	-601	-610	-621	-633	
-2.67%	-176	-193	-211	-229	-247	-265	-284	
0%	51	35	17	0	-18	-36	-54	
2.67%	116	110	103	95	85	75	63	
5.33%	124	123	122	120	117	113	108	
8.00%	124	124	124	124	123	122	121	
KR4301P52874		2019-05 풋287.5						13,874
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-13,775	-13,778	-13,784	-13,796	-13,814	-13,839	-13,874	
-5.33%	-8,042	-8,082	-8,138	-8,208	-8,292	-8,389	-8,497	
-2.67%	-2,801	-2,971	-3,150	-3,338	-3,531	-3,730	-3,933	
0%	691	461	231	0	-232	-464	-697	
2.67%	1,968	1,860	1,734	1,595	1,443	1,281	1,111	

5.33%	2,185	2,165	2,134	2,090	2,034	1,964	1,881
8.00%	2,201	2,199	2,195	2,188	2,175	2,156	2,129

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

(단위:백만원)

44,984

공시일	2019-04-16
기준일	2019-04-15

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

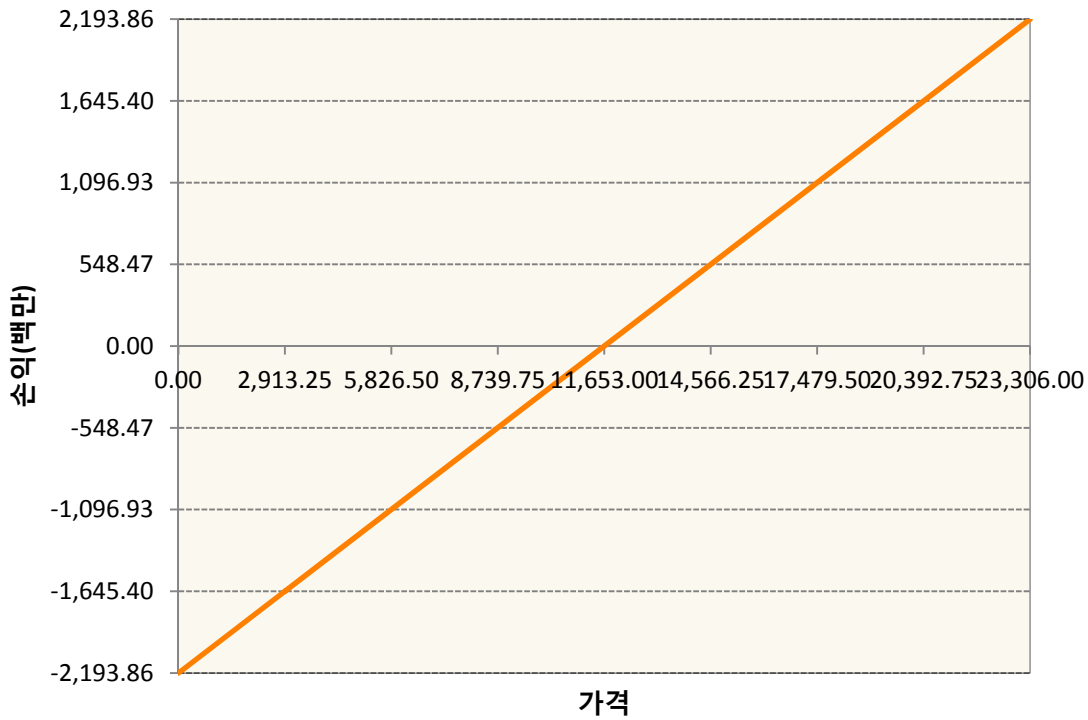
1. 계약금액

(단위:백만원)

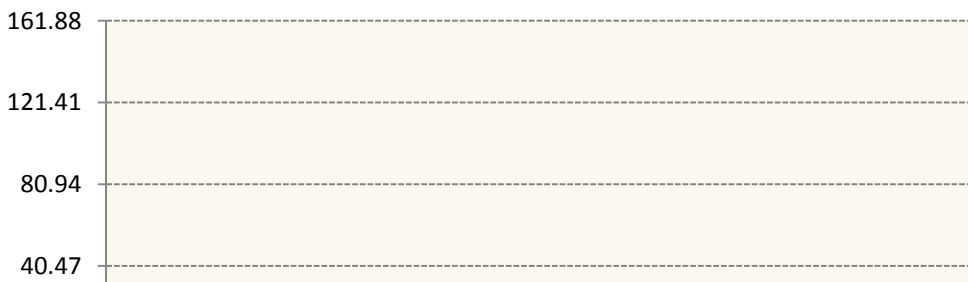
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,194	0	2,194	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,550	-5,550	장내
누계	통화	선도	0	3,035	-3,035	장외

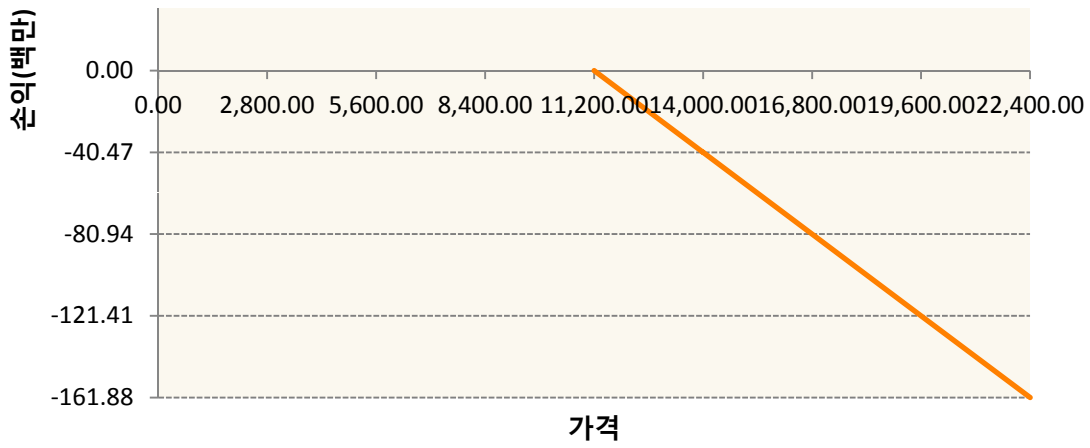
2. 만기시점의 손익구조

HCJ9-HSCEI Futures Apr19

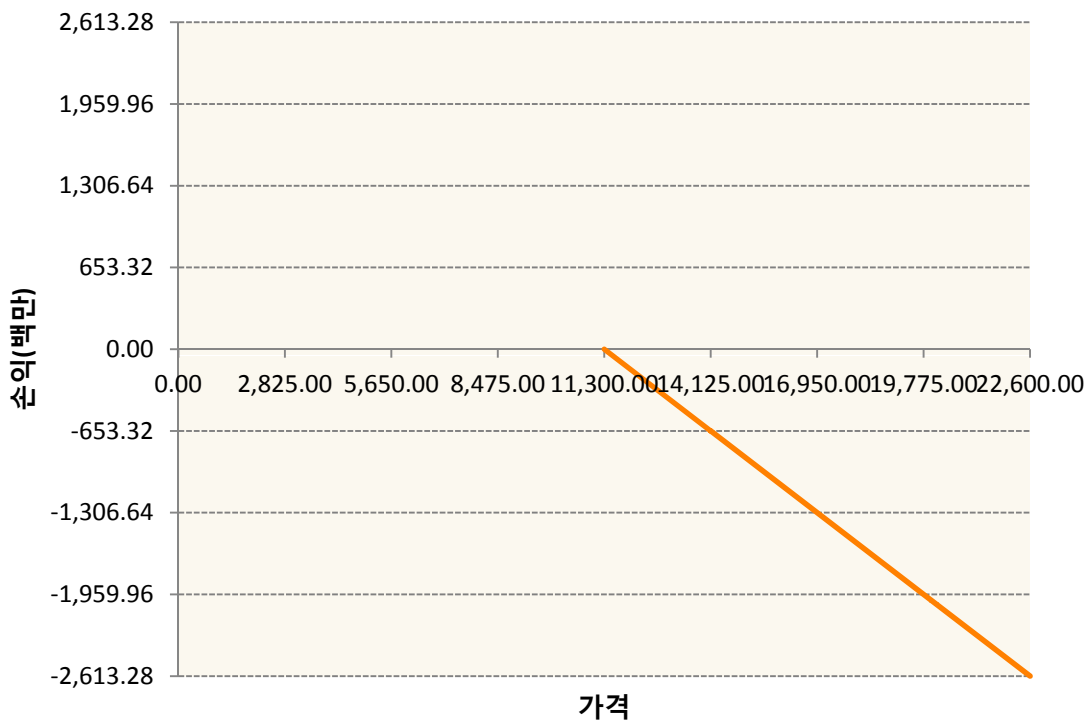


OHHIJ9-C112-HSCEI

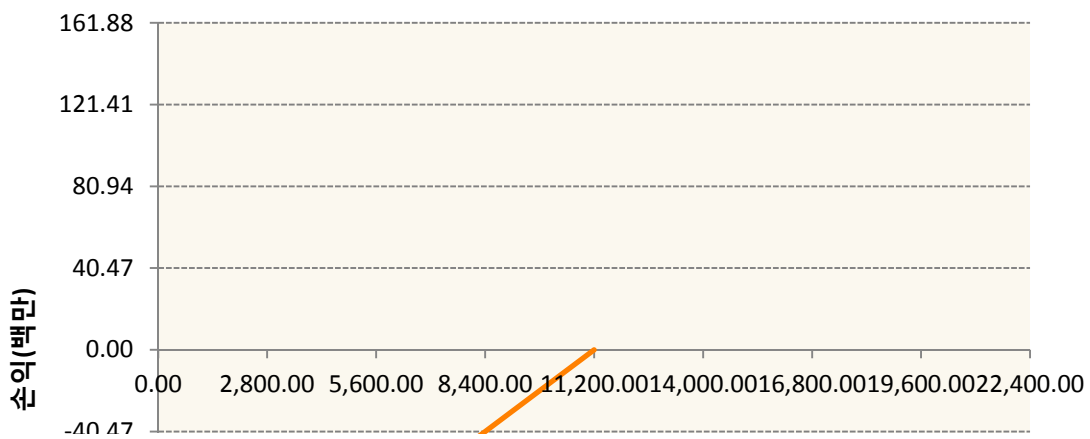


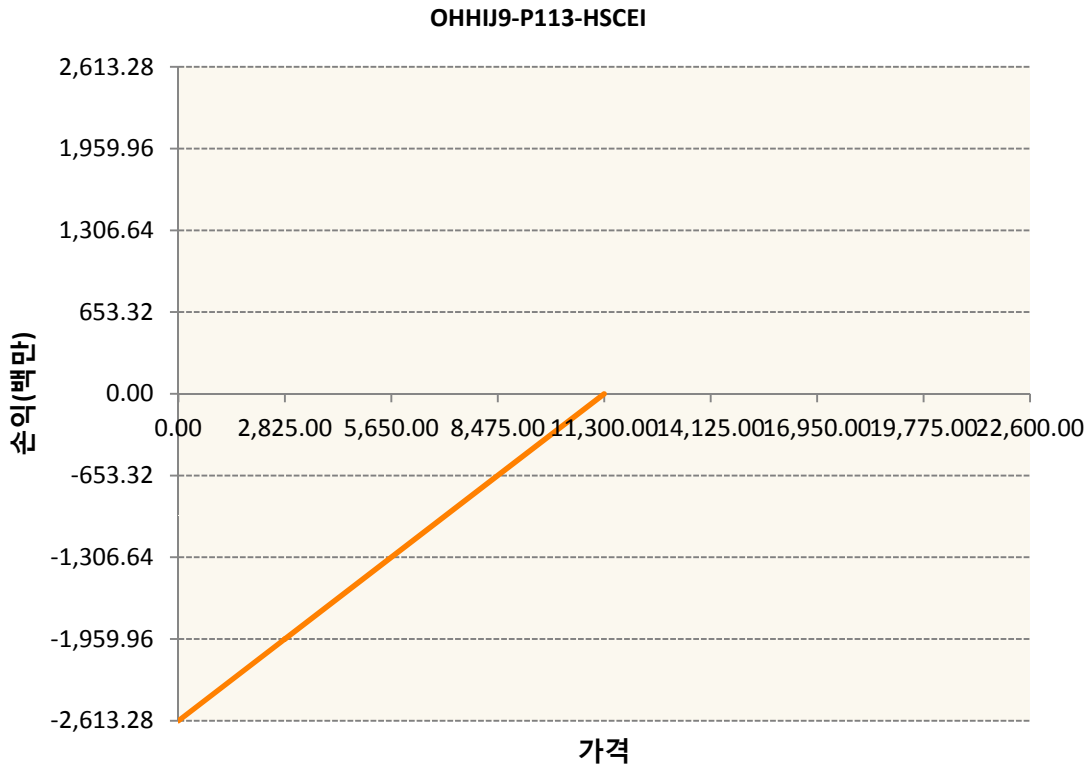


OHHIJ9-C113-HSCEI



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	175
OHHIJ9-C11 HSCEI	13
OHHIJ9-C11 HSCEI	209
OHHIJ9-P11: HSCEI	13
OHHIJ9-P11: HSCEI	209

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	718

공시일	2019-04-16
기준일	2019-04-15

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

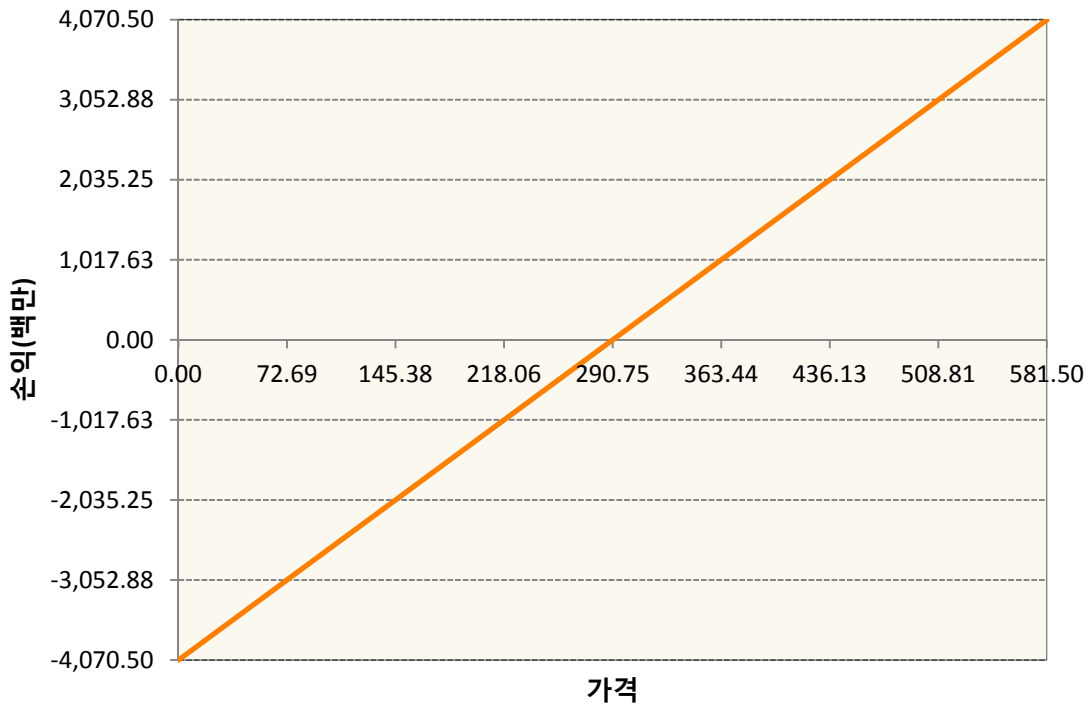
1. 계약금액

(단위:백만원)

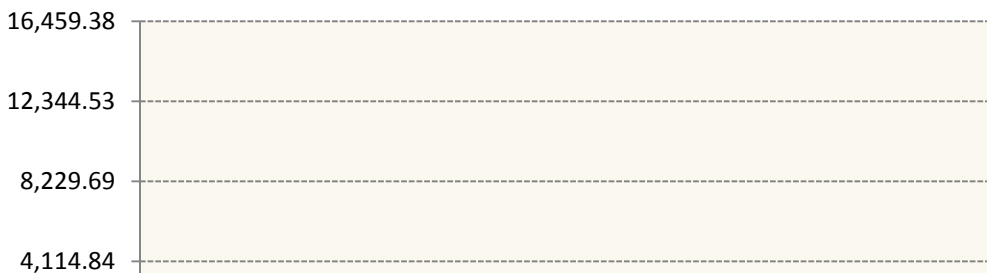
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	356	0	356	장내
누계	유가증권	선물	4,071	0	4,071	장내
누계	유가증권	스왑	35,836	0	35,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	33,700	-33,700	장내

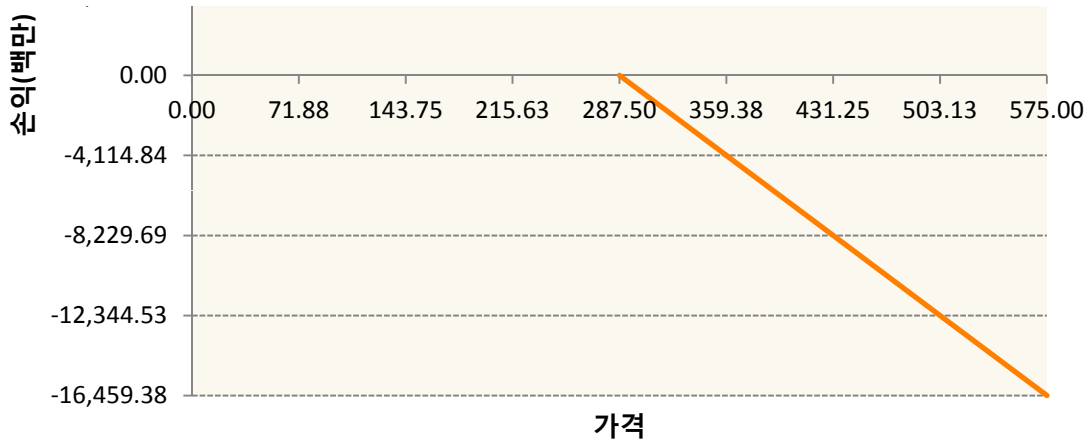
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

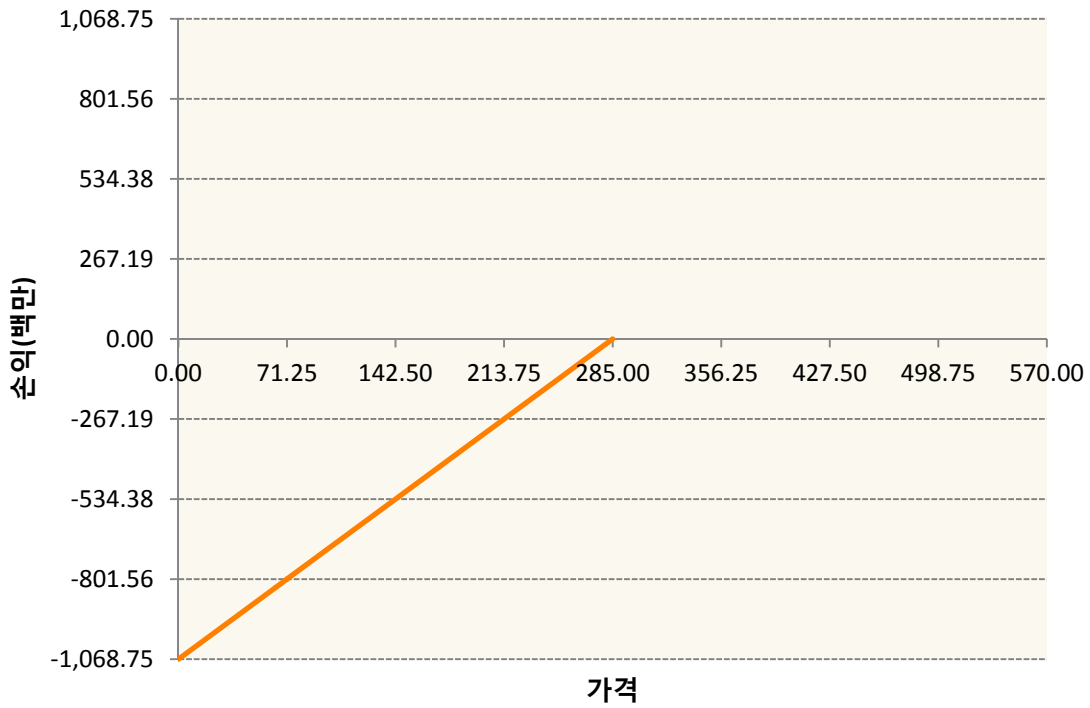


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

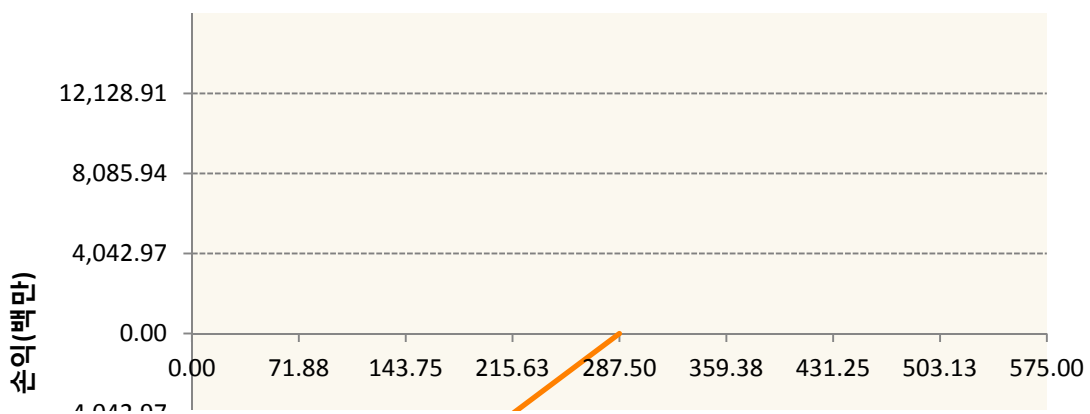




KR4301P52858-2019-05 풋285



KR4301P52874-2019-05 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,444
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,444	-2,444	-2,444	-2,444	-2,444	-2,444	-2,444	
-5.33%	-1,630	-1,630	-1,630	-1,630	-1,630	-1,630	-1,630	
-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%	1,630	1,630	1,630	1,630	1,630	1,630	1,630	
8.00%	2,444	2,444	2,444	2,444	2,444	2,444	2,444	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						593
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-593	-593	-593	-593	-593	-593	-593	
-5.33%	-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%	593	593	593	593	593	593	593	
KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						324
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-324	-324	-324	-324	-324	-324	-324	
-5.33%	-216	-216	-216	-216	-216	-216	-216	
-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%	216	216	216	216	216	216	216	
8.00%	324	324	324	324	324	324	324	
KR4201P52876		2019-05 콜287.5						1,065
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	438	429	418	405	390	374	356
-5.33%	398	379	358	335	312	287	261
-2.67%	296	266	236	205	174	143	112
0%	98	66	33	0	-33	-66	-99
2.67%	-199	-225	-253	-281	-310	-340	-370
5.33%	-571	-587	-606	-626	-648	-672	-696
8.00%	-987	-994	-1,004	-1,016	-1,031	-1,047	-1,065
KR4301P52858 2019-05 풋285							64
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-63	-63	-63	-63	-63	-64	-64
-5.33%	-35	-35	-36	-36	-37	-37	-38
-2.67%	-11	-12	-13	-14	-15	-16	-17
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	7	7	6	6	5	4	4
5.33%	7	7	7	7	7	7	6
8.00%	7	7	7	7	7	7	7
KR4301P52874 2019-05 풋287.5							1,041
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,033	-1,033	-1,034	-1,035	-1,036	-1,038	-1,041
-5.33%	-603	-606	-610	-616	-622	-629	-637
-2.67%	-210	-223	-236	-250	-265	-280	-295
0%	52	35	17	0	-17	-35	-52
2.67%	148	139	130	120	108	96	83
5.33%	164	162	160	157	153	147	141
8.00%	165	165	165	164	163	162	160

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

(단위:백만원)

5,577

공시일	2019-04-16
기준일	2019-04-15

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

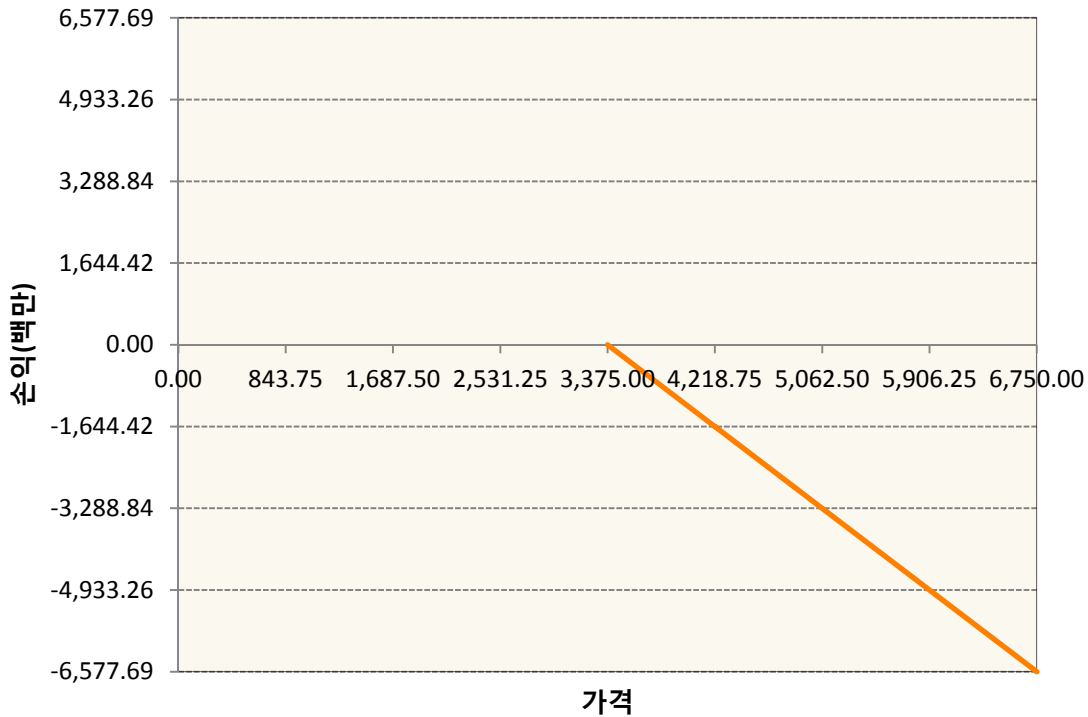
1. 계약금액

(단위:백만원)

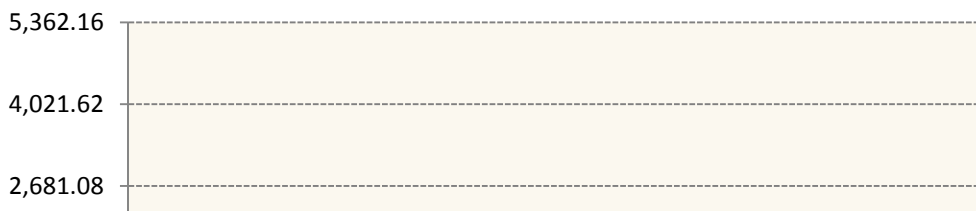
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,200	0	5,200	
누계	유가증권	스왑	60,535	0	60,535	장외
누계	유가증권	옵션	0	23,880	-23,880	장내
누계	통화	선도	0	17,951	-17,951	장외

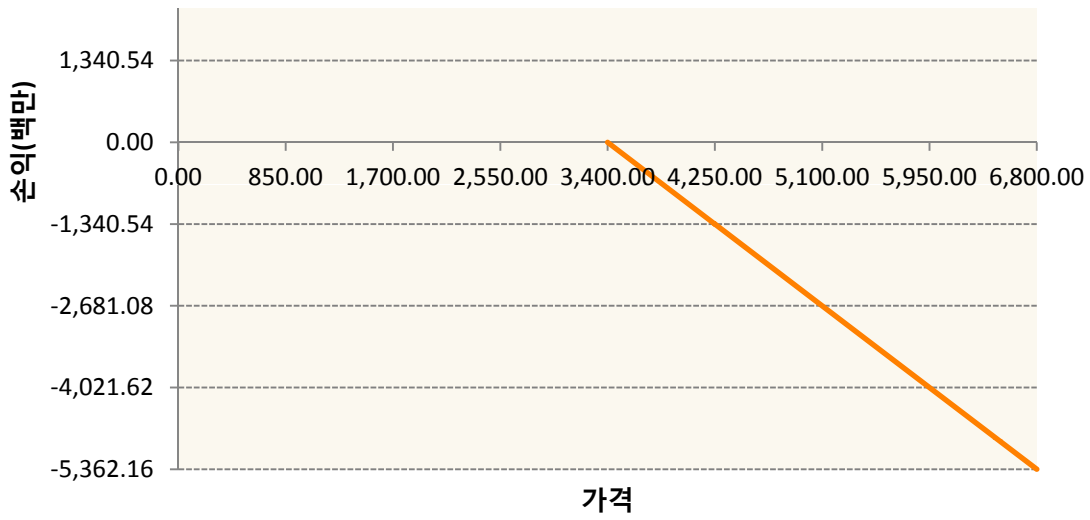
2. 만기시점의 손익구조

OESXJ9-C3375-EURO STOXX 50

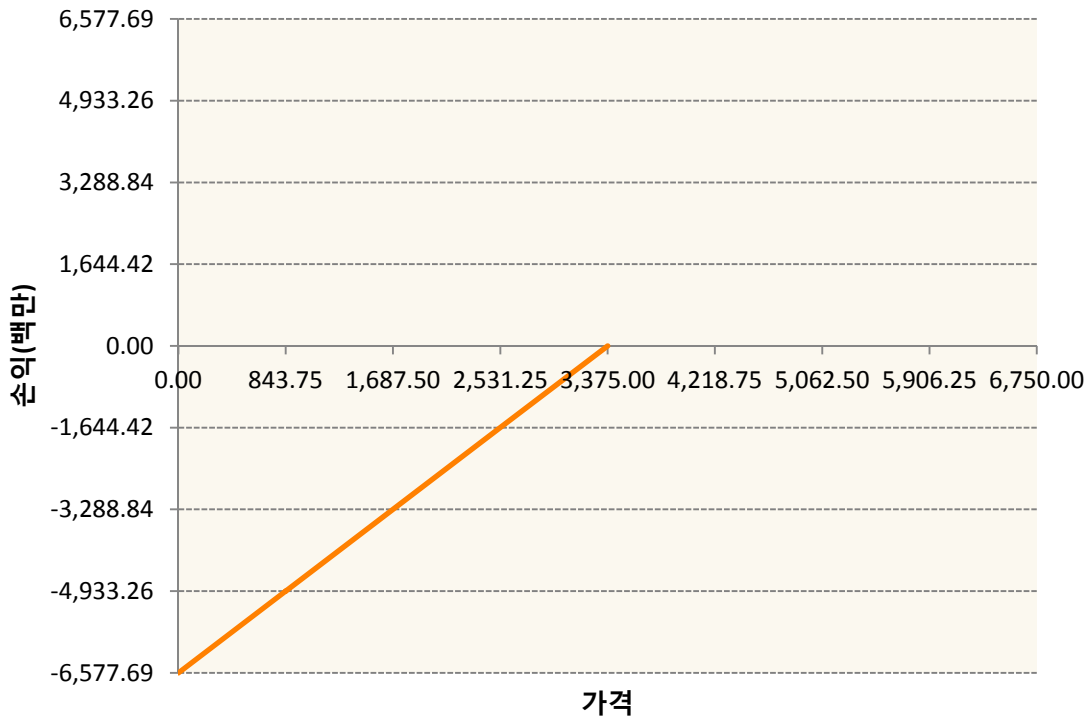


OESXJ9-C3400-EURO STOXX 50

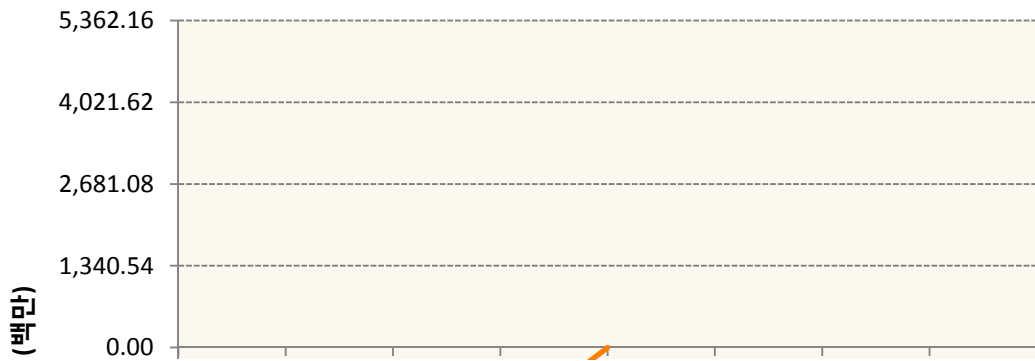


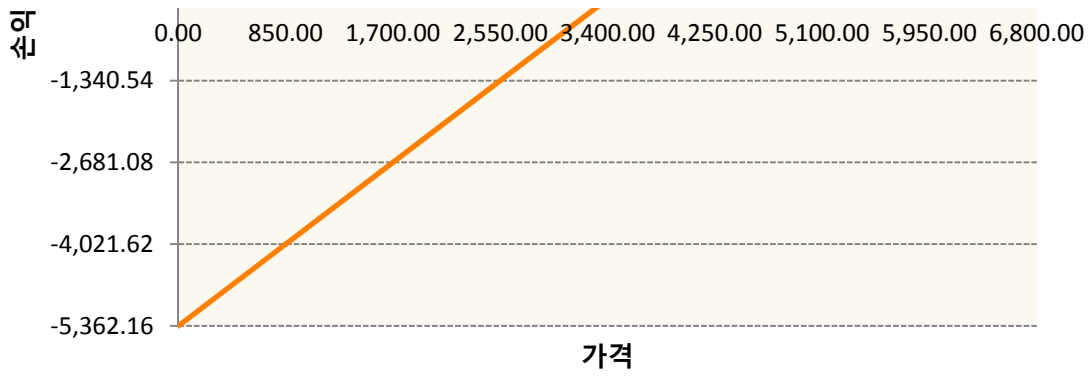


OESXJ9-P3375-EURO STOXX 50

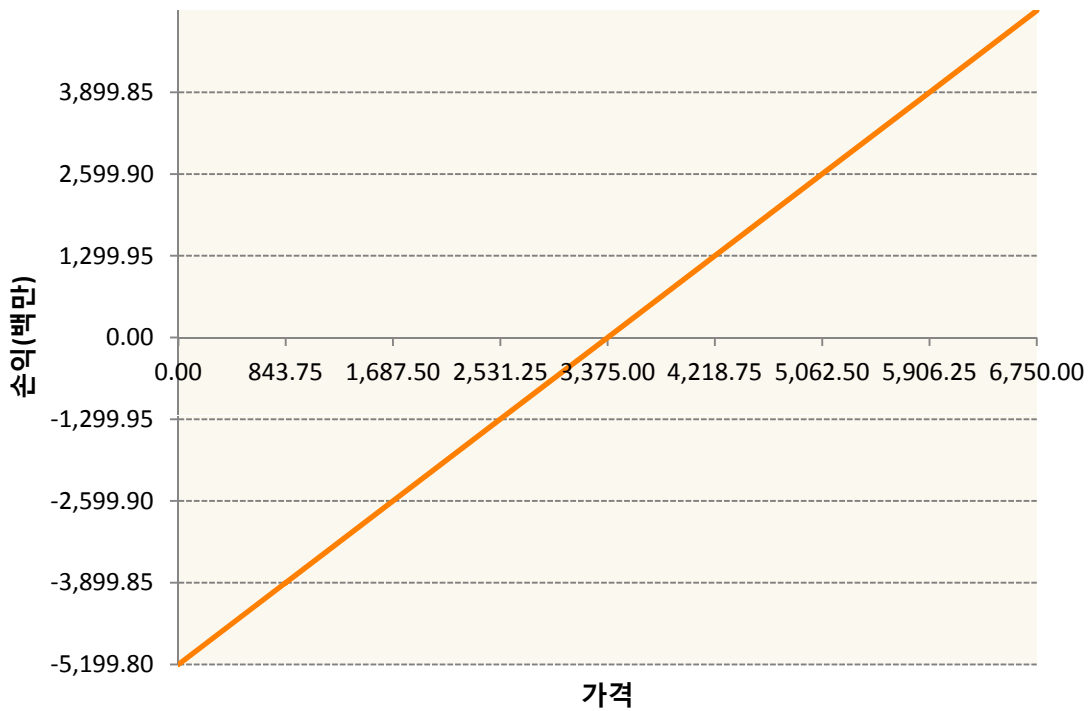


OESXJ9-P3400-EURO STOXX 50





VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	208
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	410
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	821
FX21019J01E KRW/EUR 28-06-19E	205
OESXJ9-C33 EURO STOXX 50	526
OESXJ9-C34 EURO STOXX 50	429
OESXJ9-P33 EURO STOXX 50	526
OESXJ9-P34 EURO STOXX 50	429
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	416

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

(단위:백만원)

2,597

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

공시일	2019-04-16
기준일	2019-04-15

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

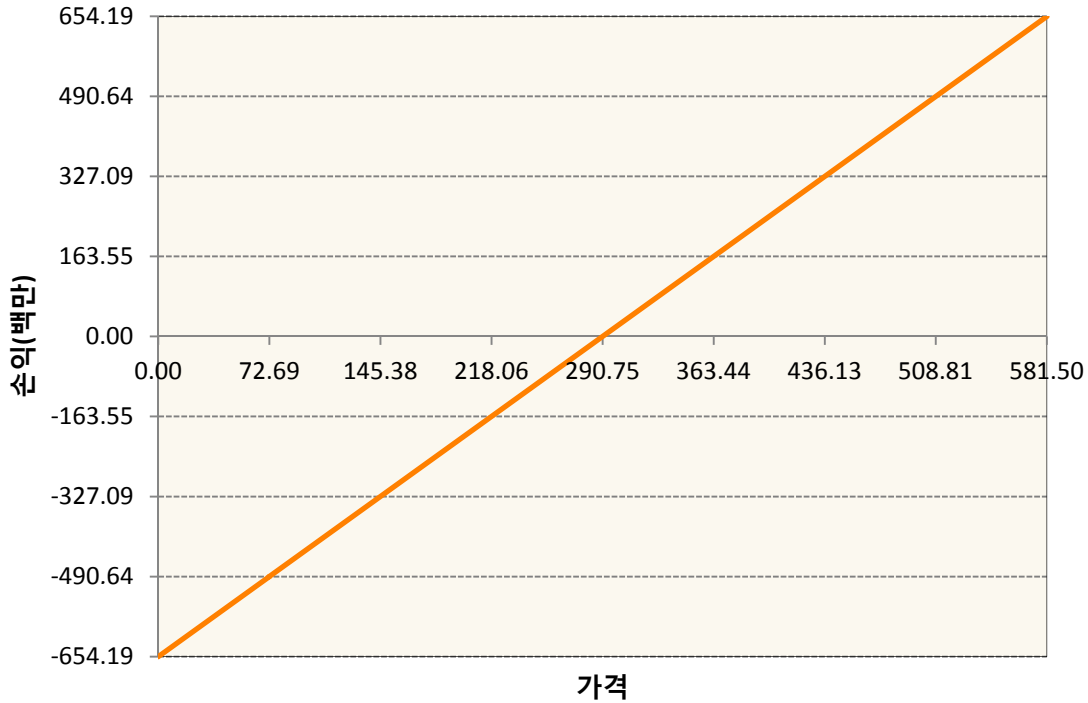
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	654	0	654	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%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	
-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%	35	35	35	35	35	35	35	
8.00%	52	52	52	52	52	52	52	

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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-04-16
기준일	2019-04-15

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

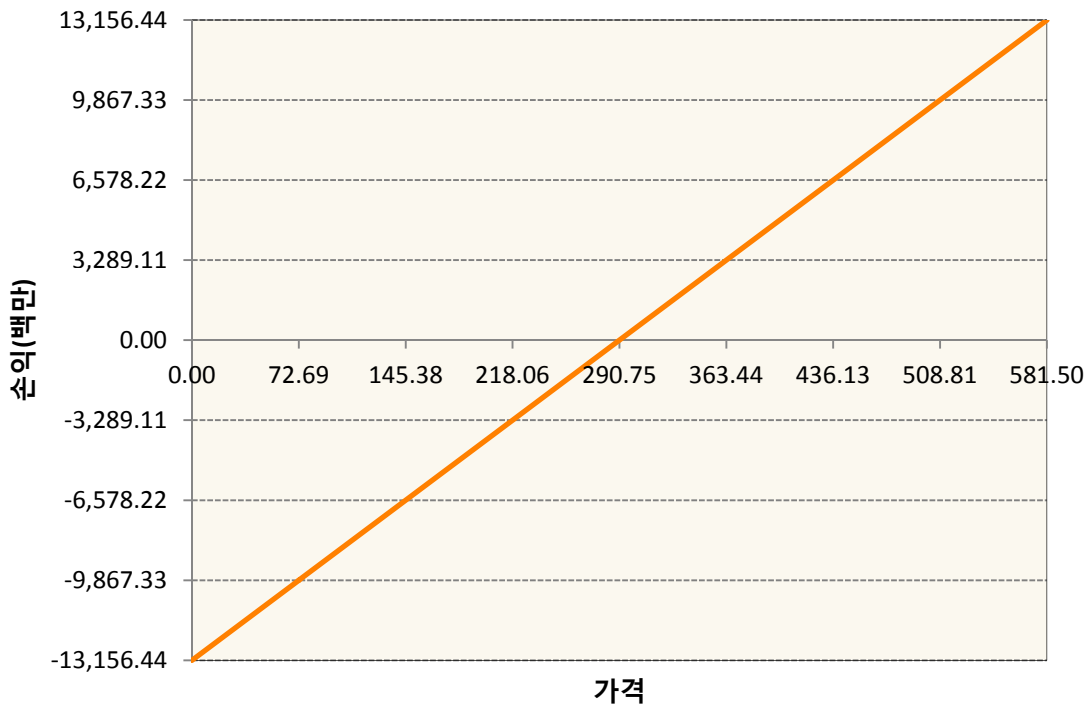
1. 계약금액

(단위:백만원)

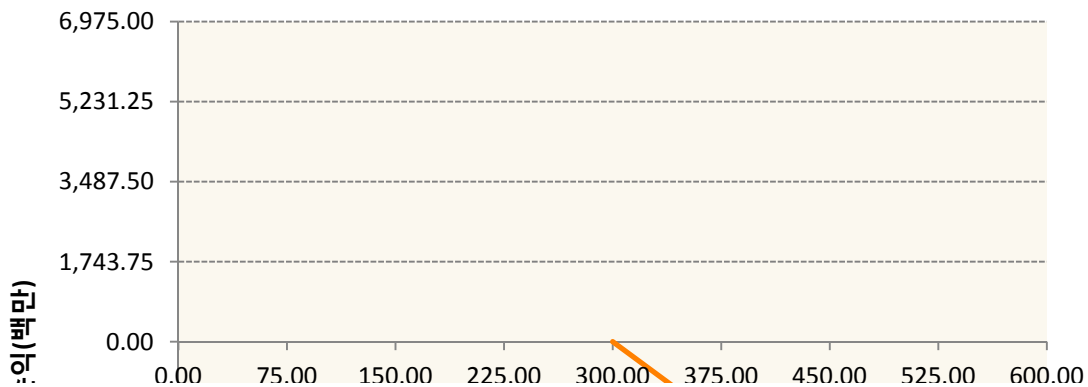
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	150	0	150	장내
누계	유가증권	선물	13,156	0	13,156	장내
누계	유가증권	옵션	1,437	24,671	-23,234	장내

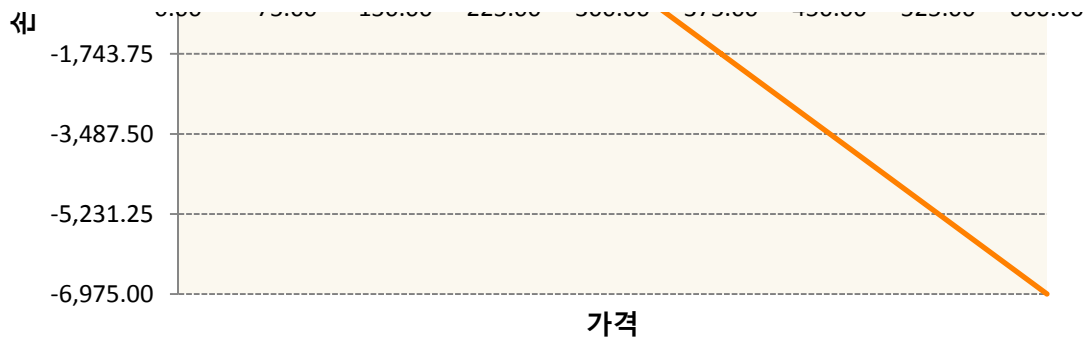
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

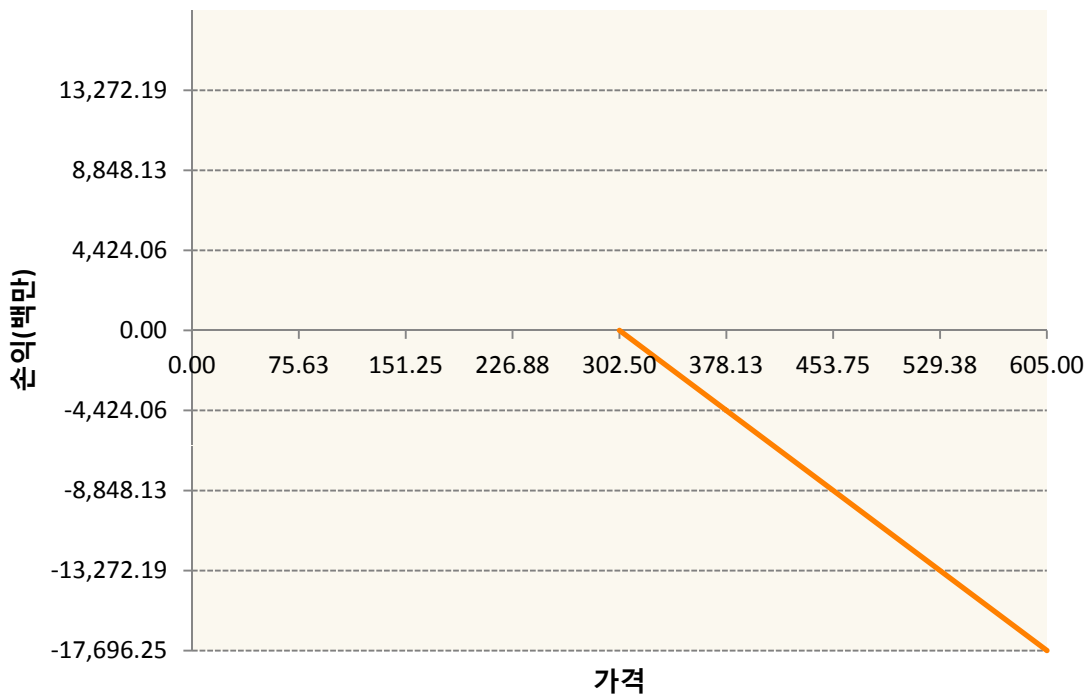


KR4201P53007-2019-05 콜300

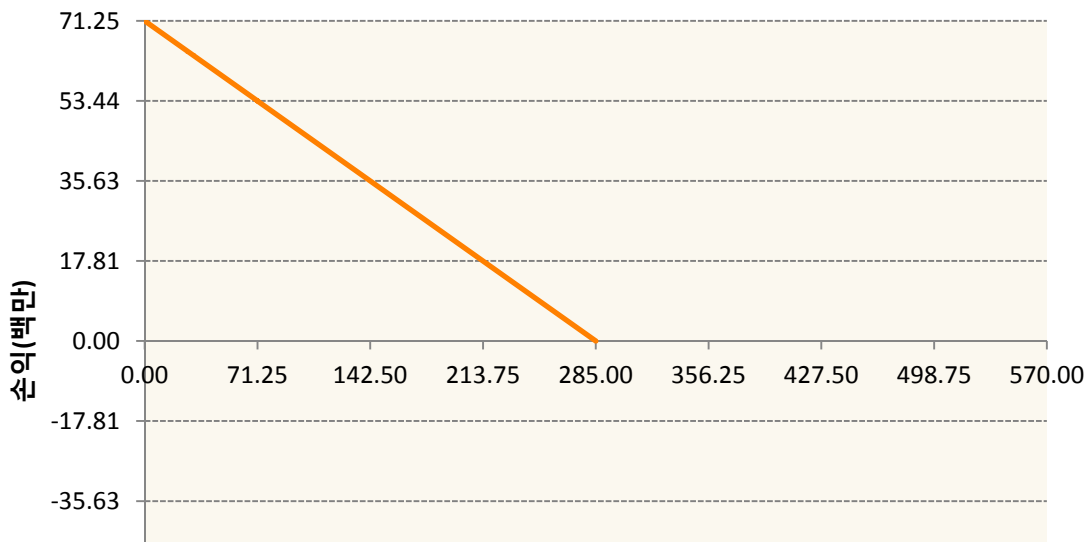


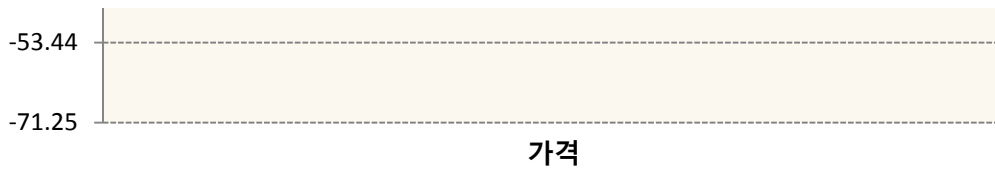


KR4201P53023-2019-05 콜302.5

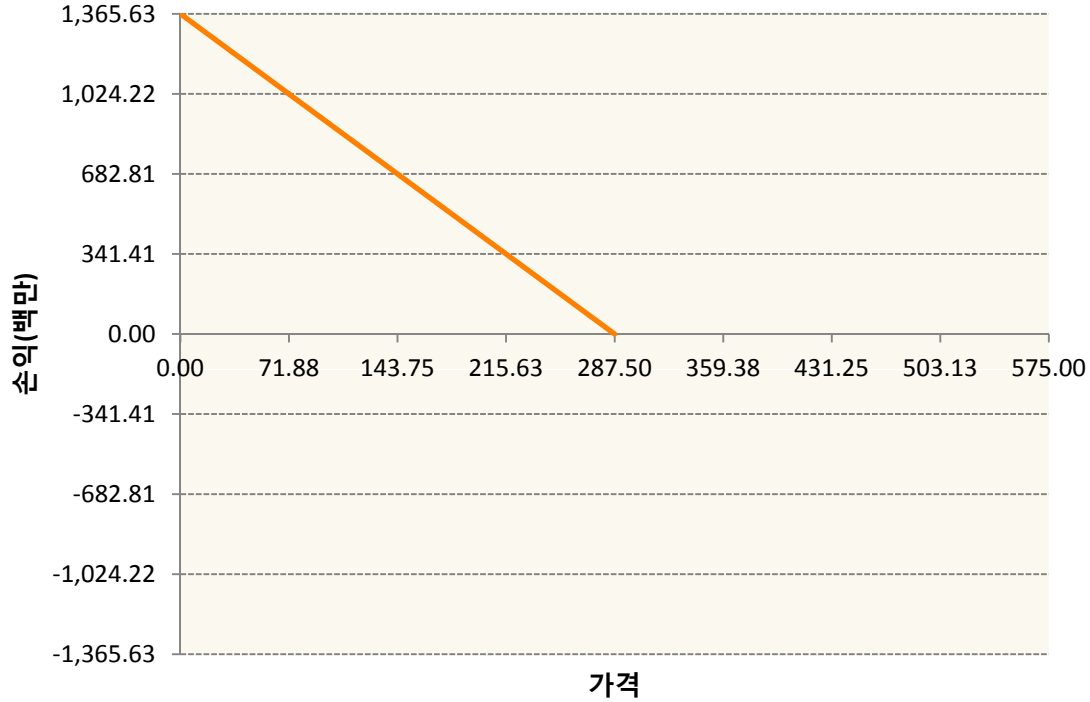


KR4301P52858-2019-05 풋285





KR4301P52874-2019-05 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						1,048
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,048	-1,048	-1,048	-1,048	-1,048	-1,048	-1,048	
-5.33%	-698	-698	-698	-698	-698	-698	-698	
-2.67%	-349	-349	-349	-349	-349	-349	-349	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	349	349	349	349	349	349	349	
5.33%	698	698	698	698	698	698	698	
8.00%	1,048	1,048	1,048	1,048	1,048	1,048	1,048	
KR4201P53007		2019-05 콜300						320
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	69	68	67	66	64	61	58	
-5.33%	67	65	62	58	53	48	42	
-2.67%	58	53	46	39	30	22	12	

0%	32	22	11	0	-12	-23	-36
2.67%	-24	-38	-51	-65	-79	-93	-106
5.33%	-120	-133	-147	-160	-174	-188	-201
8.00%	-252	-262	-273	-284	-295	-307	-320
KR4201P53023 2019-05 콜302.5							741
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	139	138	136	133	129	123	116
-5.33%	135	132	126	118	109	97	84
-2.67%	121	109	96	80	62	43	22
0%	72	50	26	0	-27	-55	-83
2.67%	-42	-75	-108	-141	-175	-209	-243
5.33%	-251	-286	-321	-356	-392	-427	-462
8.00%	-556	-584	-614	-645	-676	-708	-741
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	2	2	2	3
-2.67%	1	1	1	1	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
KR4301P52874 2019-05 풋287.5							88
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	87	87	87	87	87	88	88
-5.33%	51	51	52	52	53	53	54
-2.67%	18	19	20	21	22	24	25
0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-12	-12	-11	-10	-9	-8	-7
5.33%	-14	-14	-14	-13	-13	-12	-12
8.00%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-13

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

(단위:백만원)

1,790

공시일	2019-04-16
기준일	2019-04-15

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	3,610	0	3,610	

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	2019-04-16
기준일	2019-04-15

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,739	0	3,739	
누계	유가증권	수익증권	24,950	0	24,950	

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	2019-04-16
기준일	2019-04-15

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,286	0	3,286	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	76,535	0	76,535	
누계	통화	선도	0	109,673	-109,673	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019H01 KRW/USD 19-04-19E	145
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	118
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	207
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	254
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E	154
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E	363
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E	426
FX21019H03 KRW/USD 22-04-19E	363
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	363
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	417
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	181
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	453
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	526
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	319
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	272
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E	45
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E	91
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E	91
FX21019J001 KRW/USD 10-05-19E	44
FX21019J002 KRW/USD 10-06-19E	100
FX21019J003 KRW/USD 10-05-19E	154
FX21019J004 KRW/USD 10-05-19E	73
FX21019J005 KRW/USD 10-05-19E	272
FX21019J006 KRW/USD 10-05-19E	227
FX21019J007 KRW/USD 10-05-19E	73
FX21019J011 KRW/USD 20-05-19E	127
FX21019J012 KRW/USD 20-05-19E	18

FX21019J01E KRW/USD 20-05-19E	136
FX21019J01F KRW/USD 20-05-19E	136
FX21019J01G KRW/USD 17-05-19E	1,269
FX21019J01H KRW/USD 17-05-19E	1,360

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

2,981

공시일	2019-04-16
기준일	2019-04-15

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

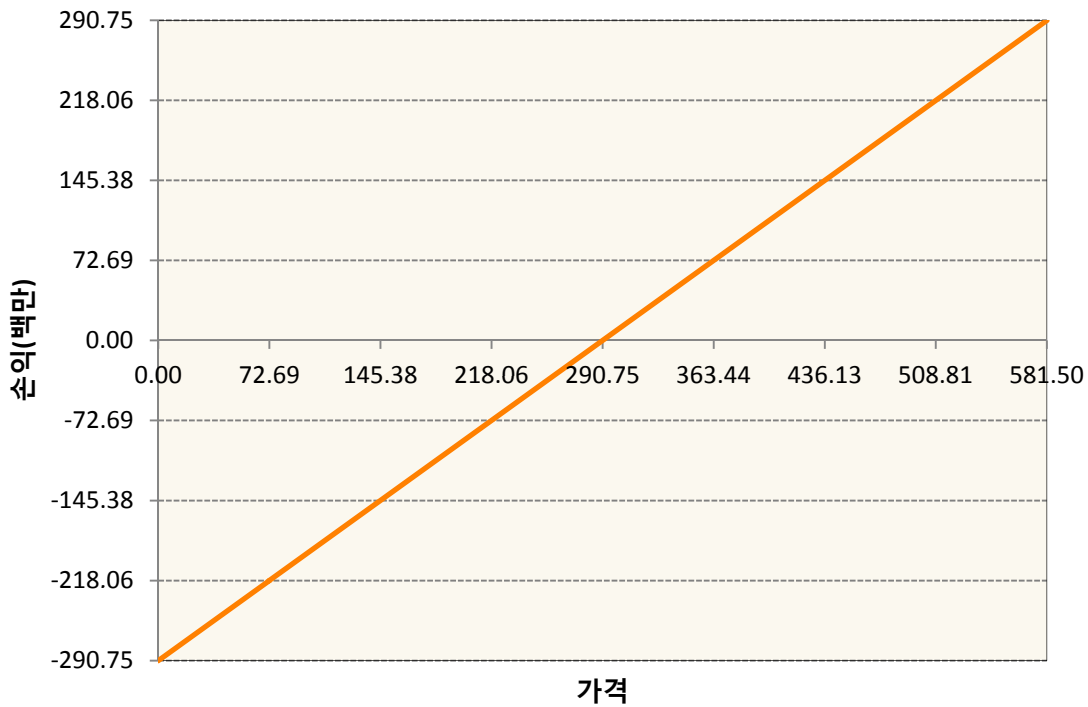
1. 계약금액

(단위:백만원)

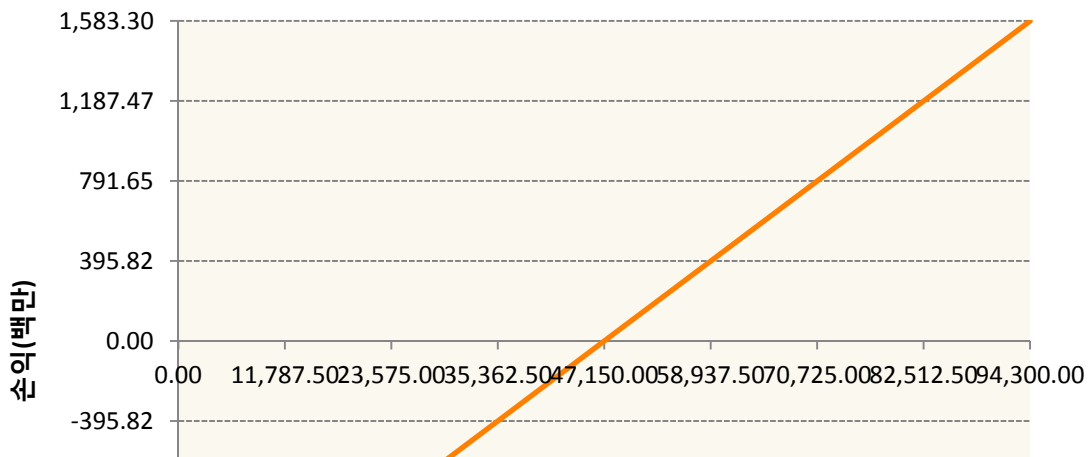
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,874	0	1,874	장내

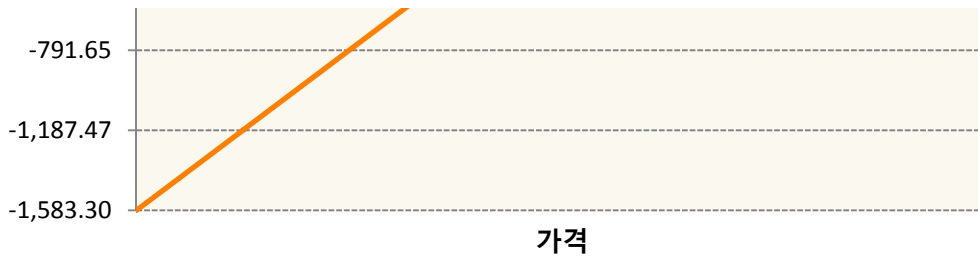
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4111P50004-2019-05 삼성전자개별선물





3. 시나리오 별 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	2019-04-16
기준일	2019-04-15

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

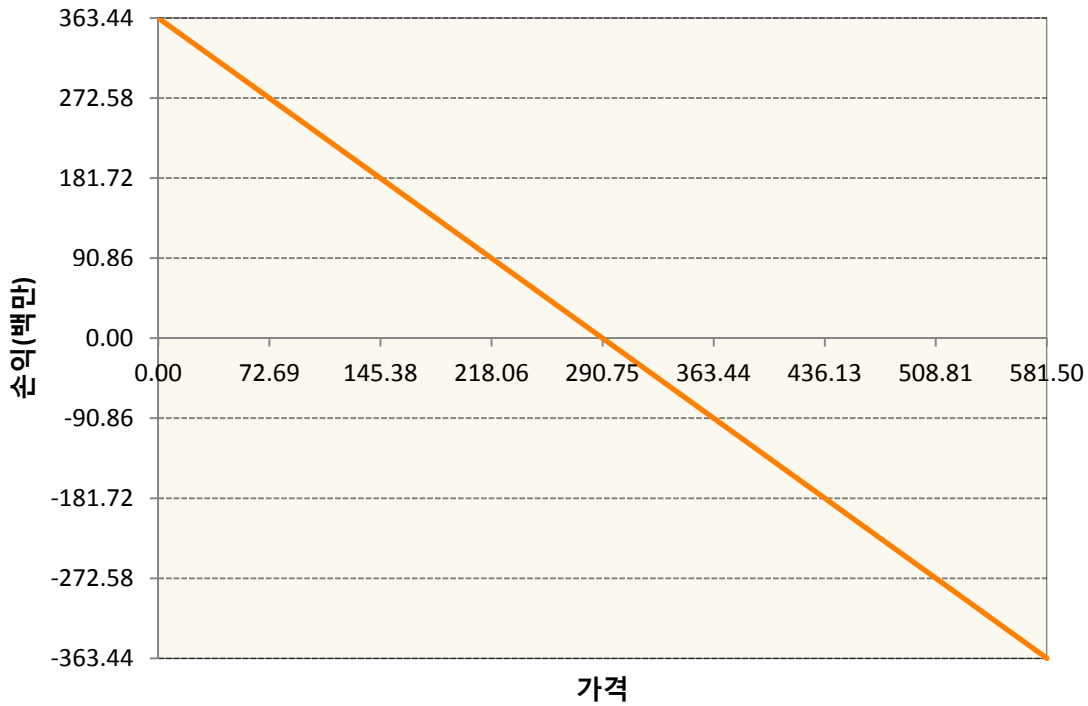
1. 계약금액

(단위:백만원)

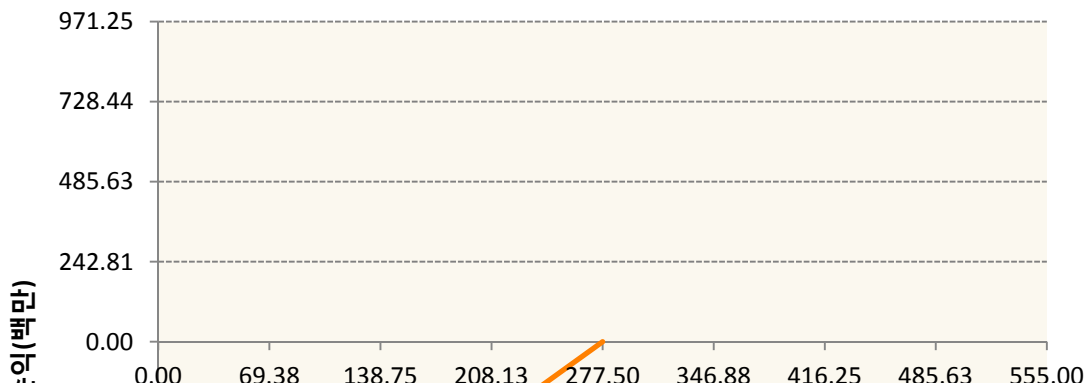
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	140	-140	장내
누계	유가증권	선물	0	363	-363	장내
누계	유가증권	옵션	0	2,021	-2,021	장내

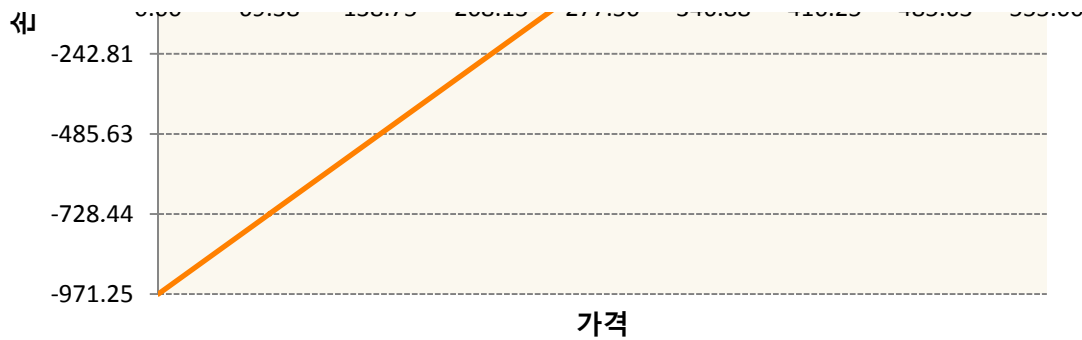
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

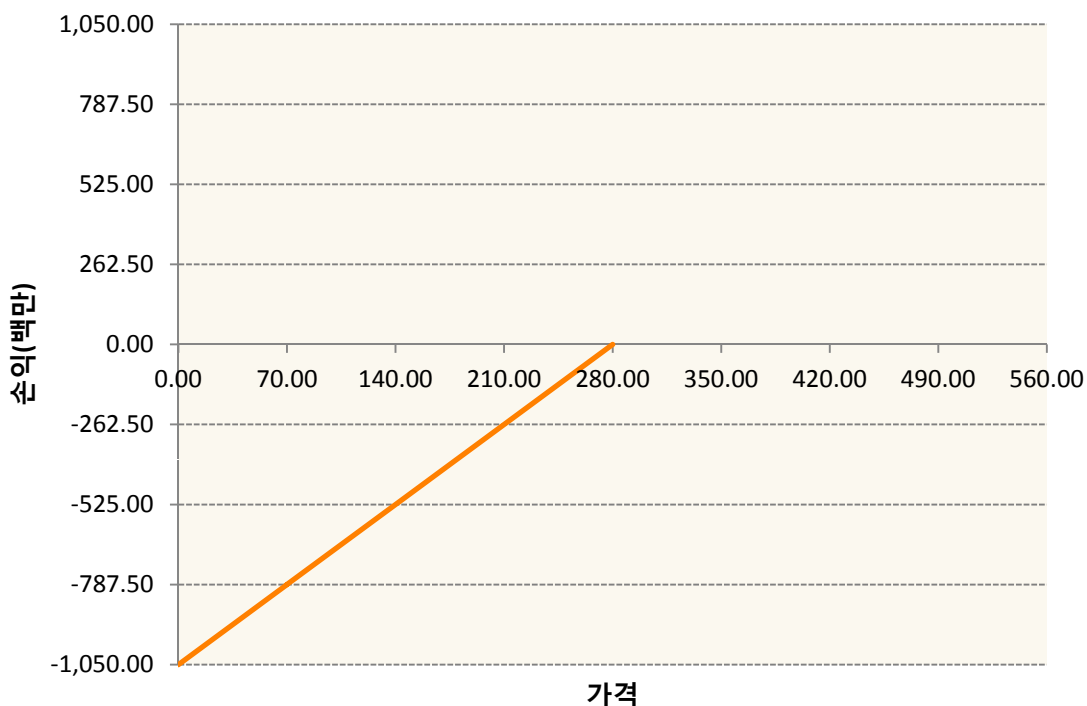


KR4301P52775-2019-05 풋277.5





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	-39	-39	-40	-40	-41	-41
-5.33%	-16	-16	-17	-18	-19	-20	-21
-2.67%	-3	-3	-4	-5	-6	-7	-8
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	2	2	1	1	1	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	1	1
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

KR4301P52809

2019-05 풋280

51

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-49	-49	-49	-50	-50	-51	-51
-5.33%	-23	-23	-24	-25	-26	-27	-28
-2.67%	-5	-6	-7	-8	-9	-10	-11
0%	2	1	1	0	-1	-2	-2
2.67%	3	3	3	2	2	2	1
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

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

(단위:백만원)

94

공시일	2019-04-16
기준일	2019-04-15

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

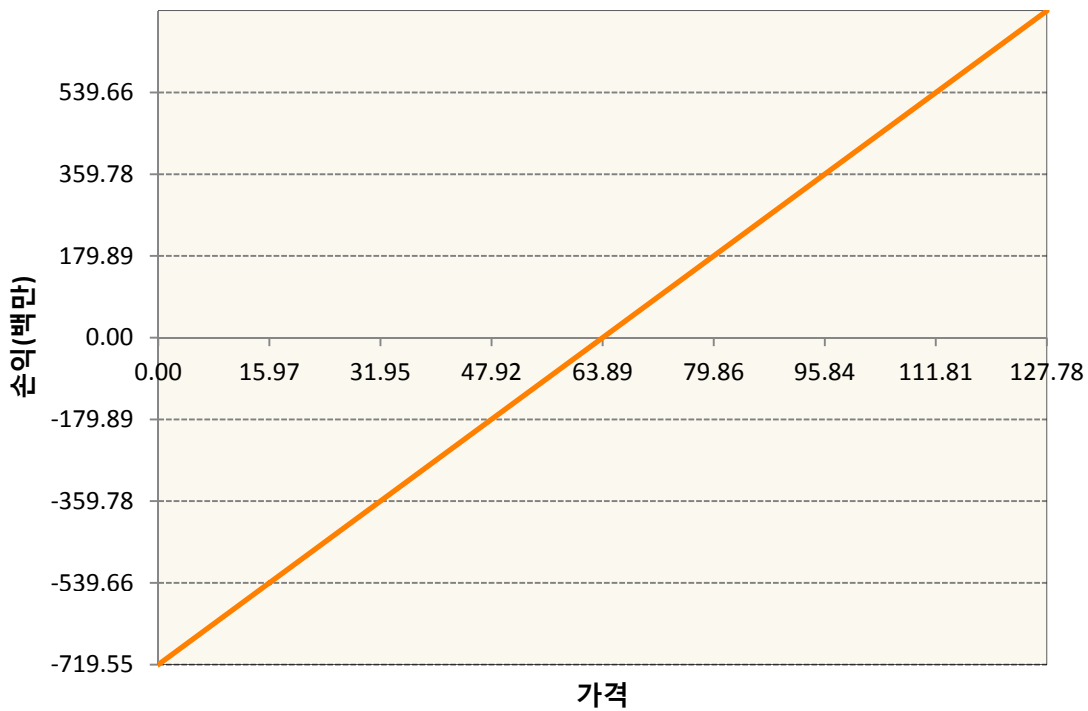
1. 계약금액

(단위:백만원)

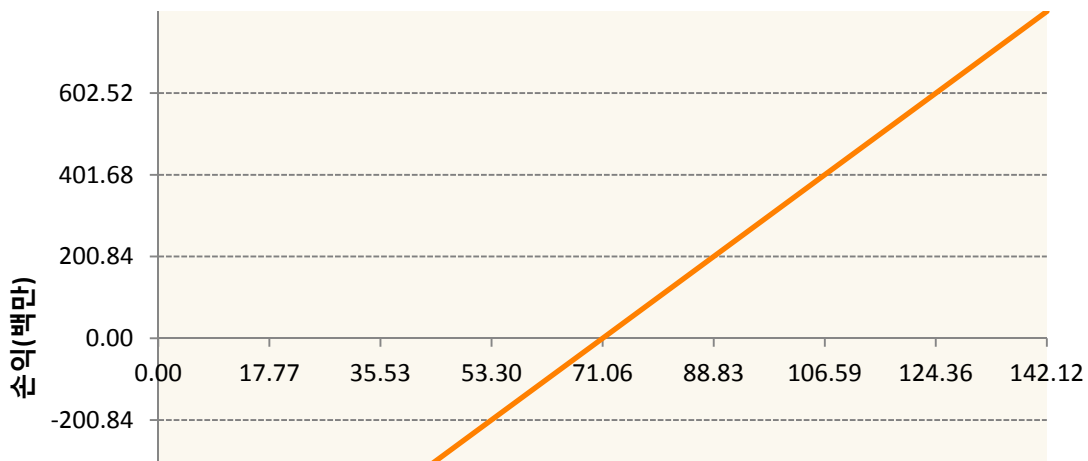
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,981	283	2,698	

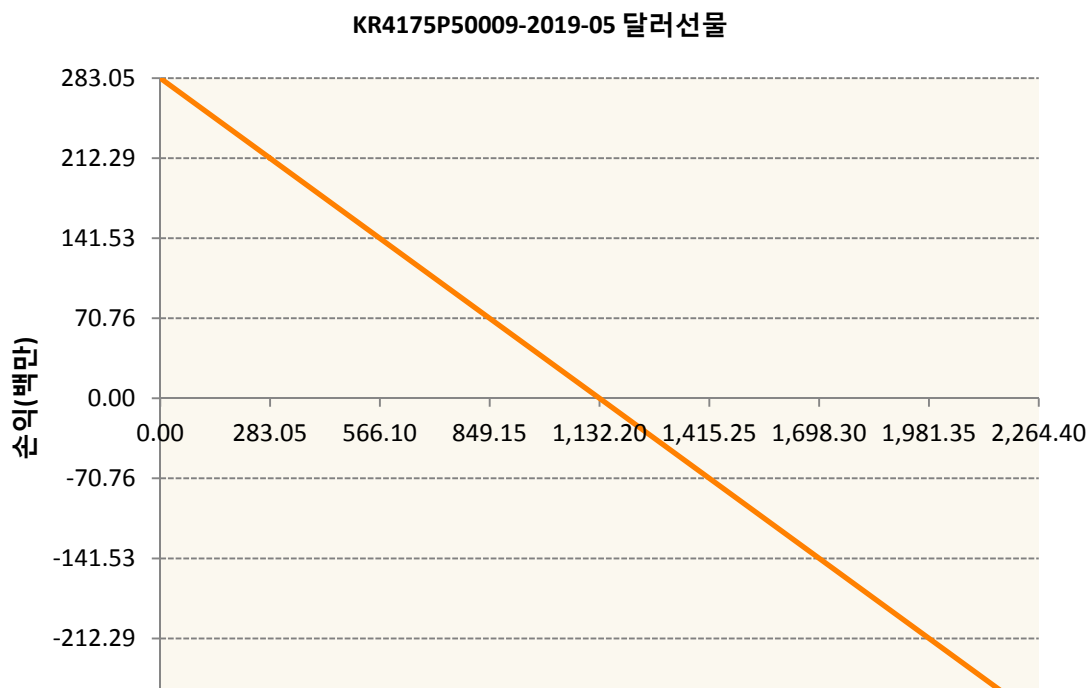
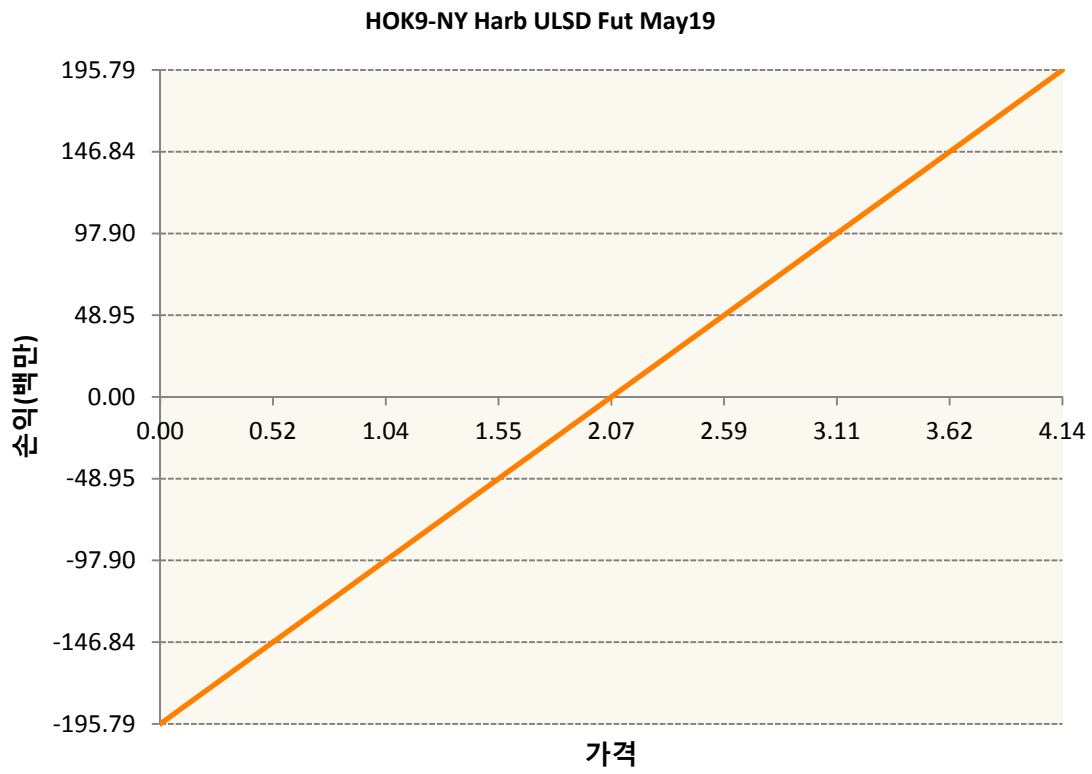
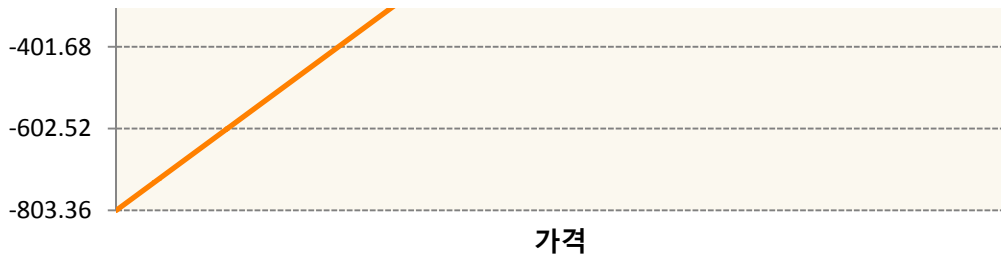
2. 만기시점의 손익구조

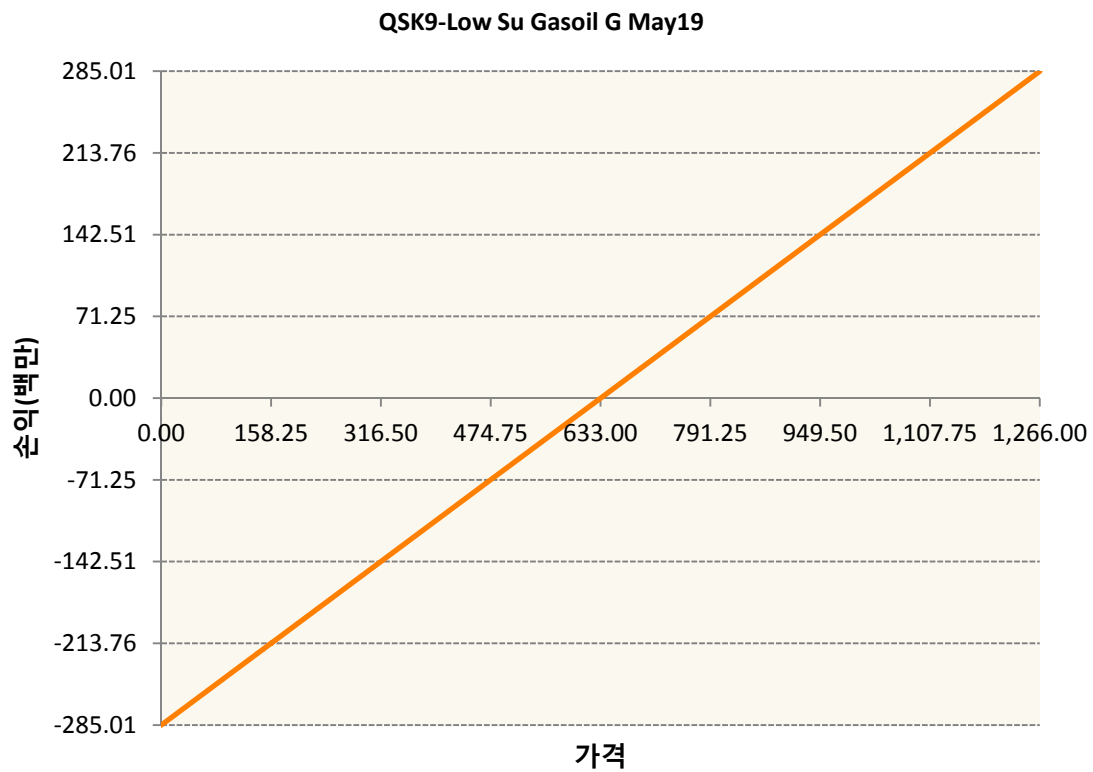
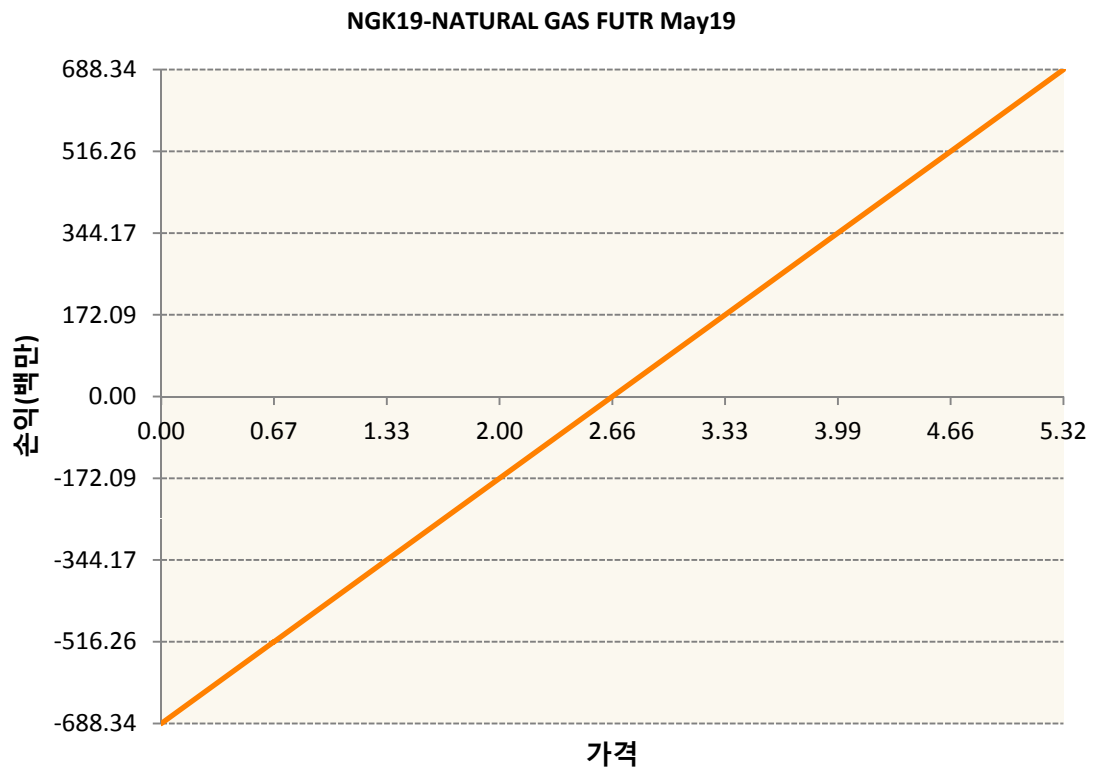
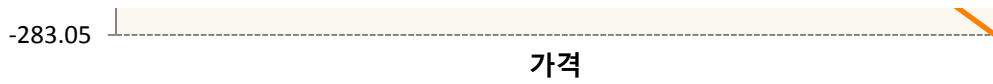
CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19



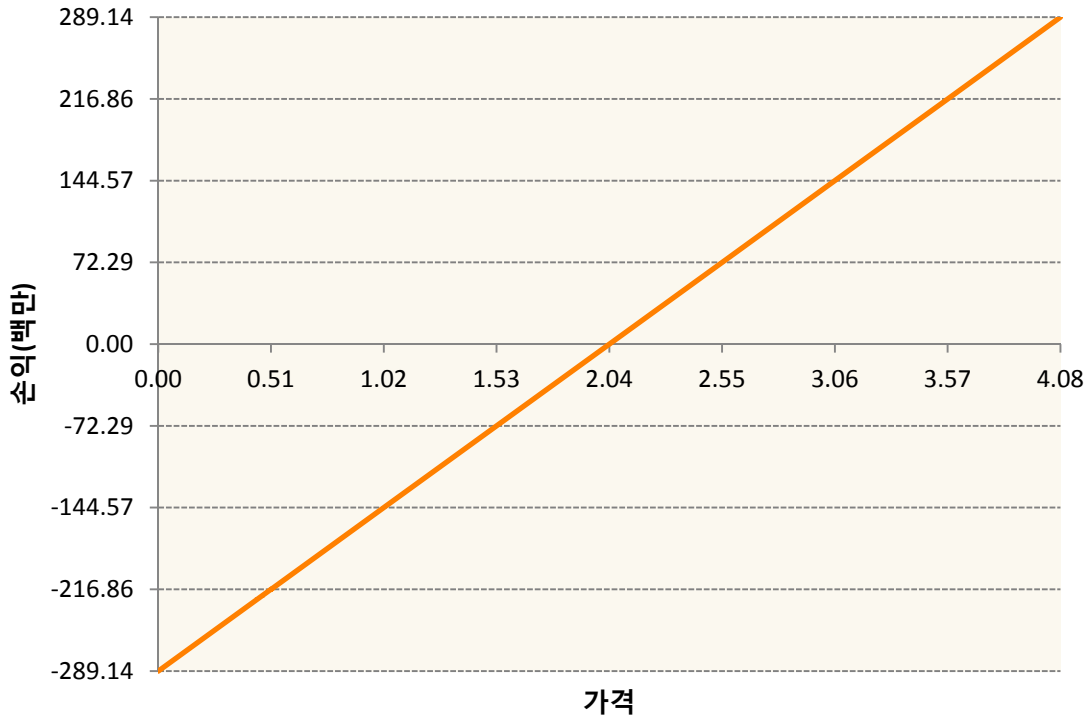
CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19







XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK9	WTI CRUDE FUTURE May19	58
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)

444

공시일	2019-04-16
기준일	2019-04-15

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

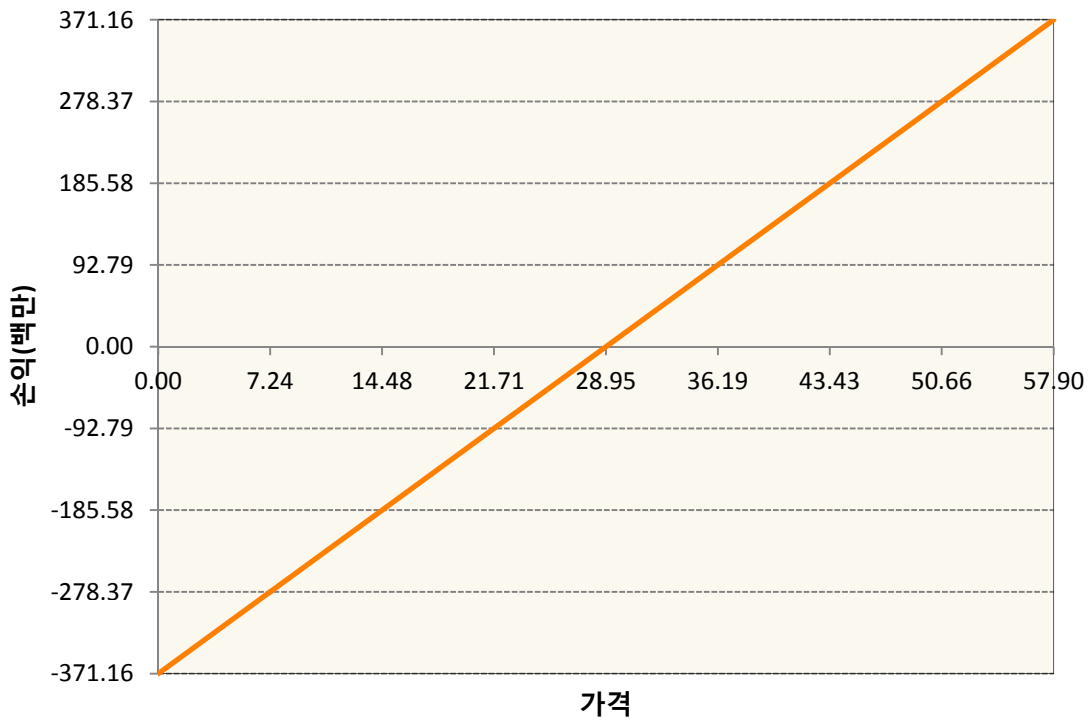
1. 계약금액

(단위:백만원)

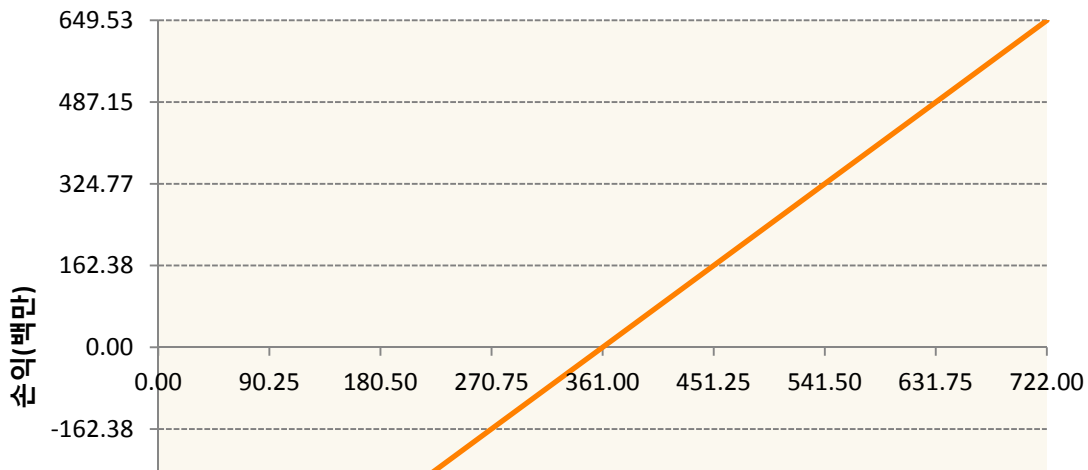
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,343	79	3,263	

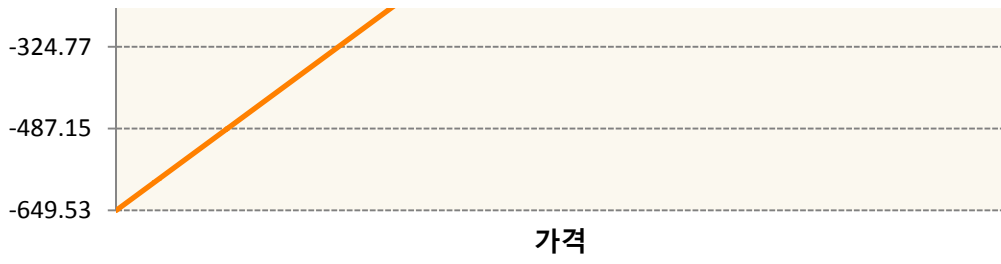
2. 만기시점의 손익구조

BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19

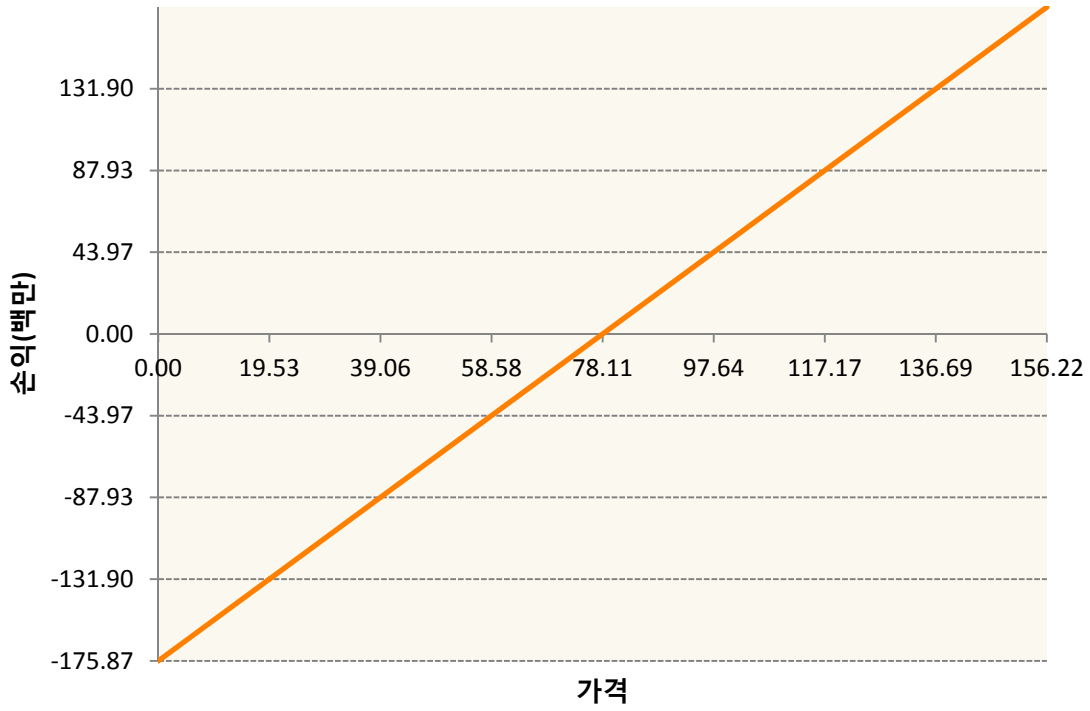


CK9-CORN FUTURE May19

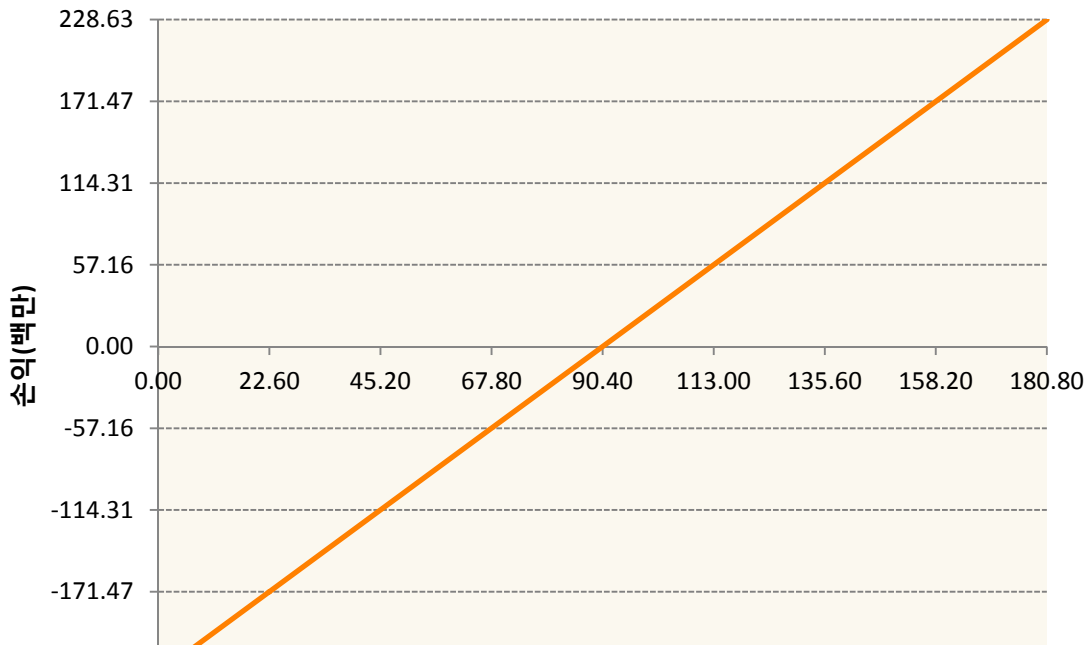


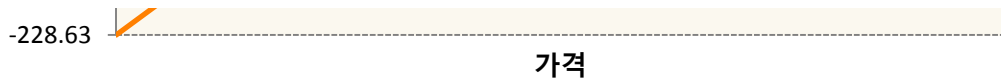


CTK9-COTTON NO.2 FUTR May19

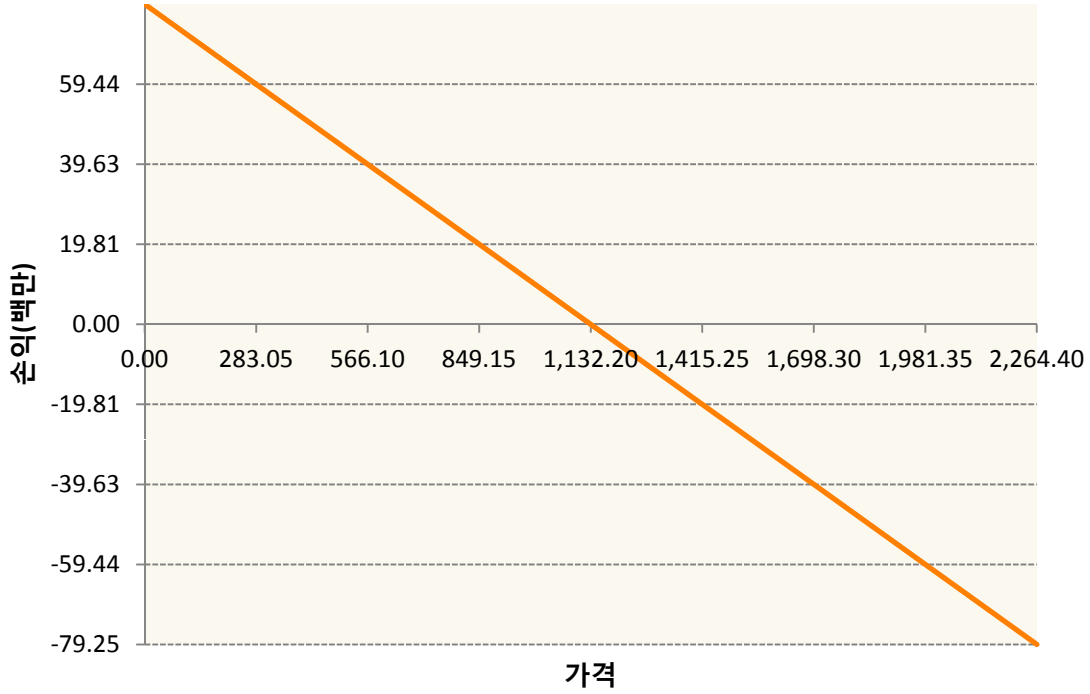


KCK9-COFFEE 'C' FUTURE May19

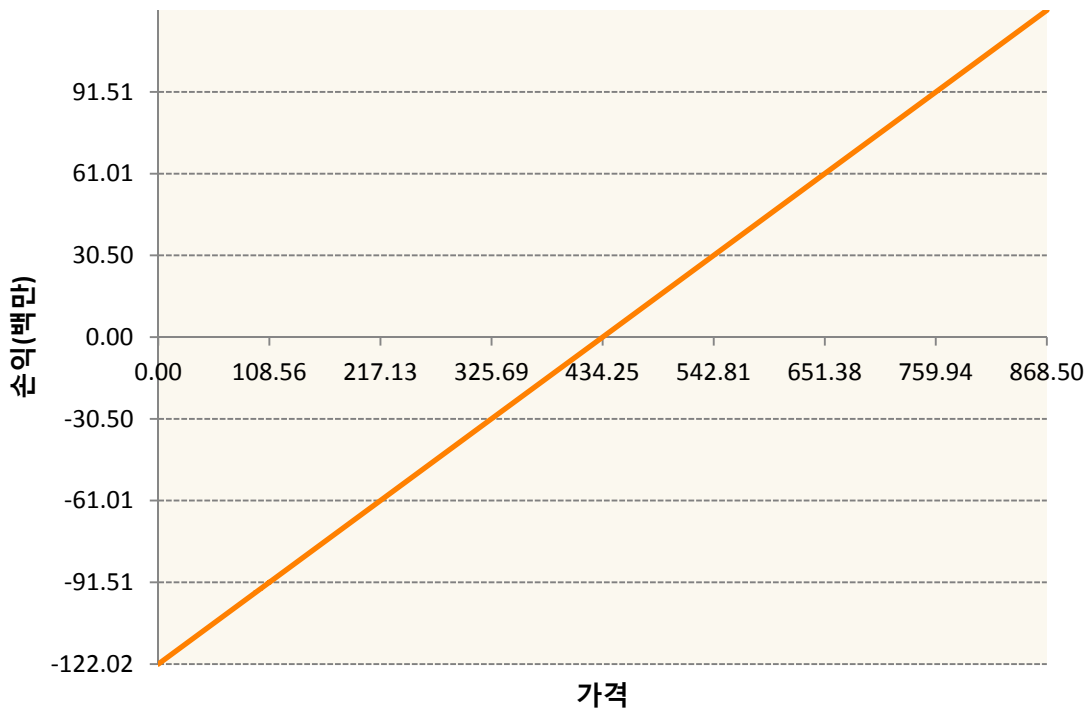




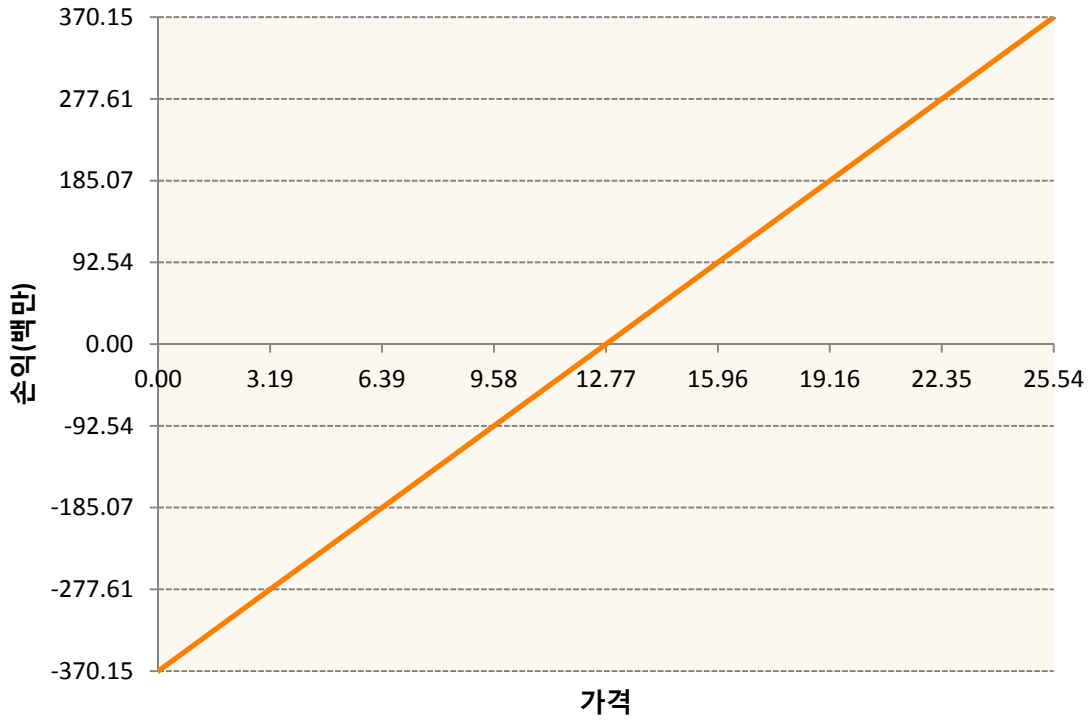
KR4175P50009-2019-05 달러선물



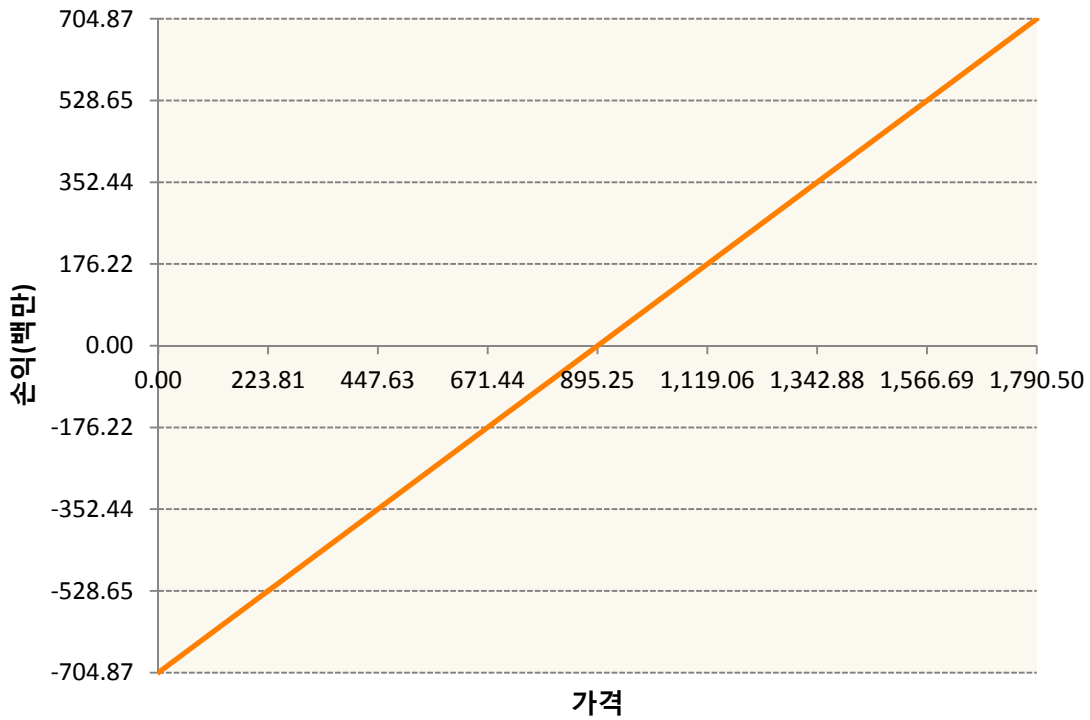
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

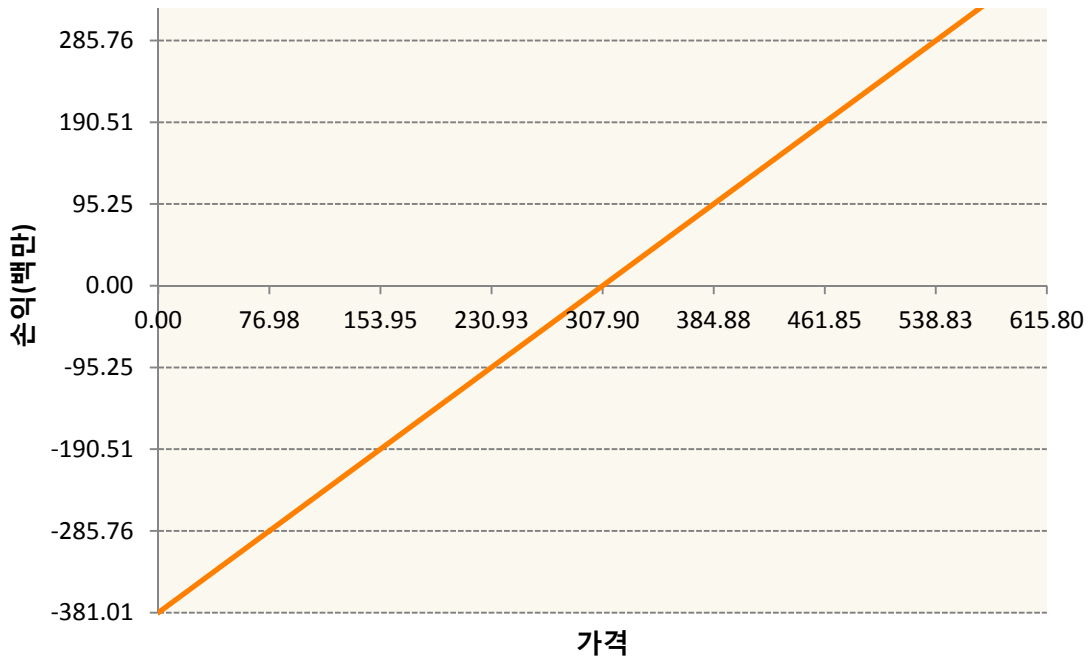


SK9-SOYBEAN FUTURE May19

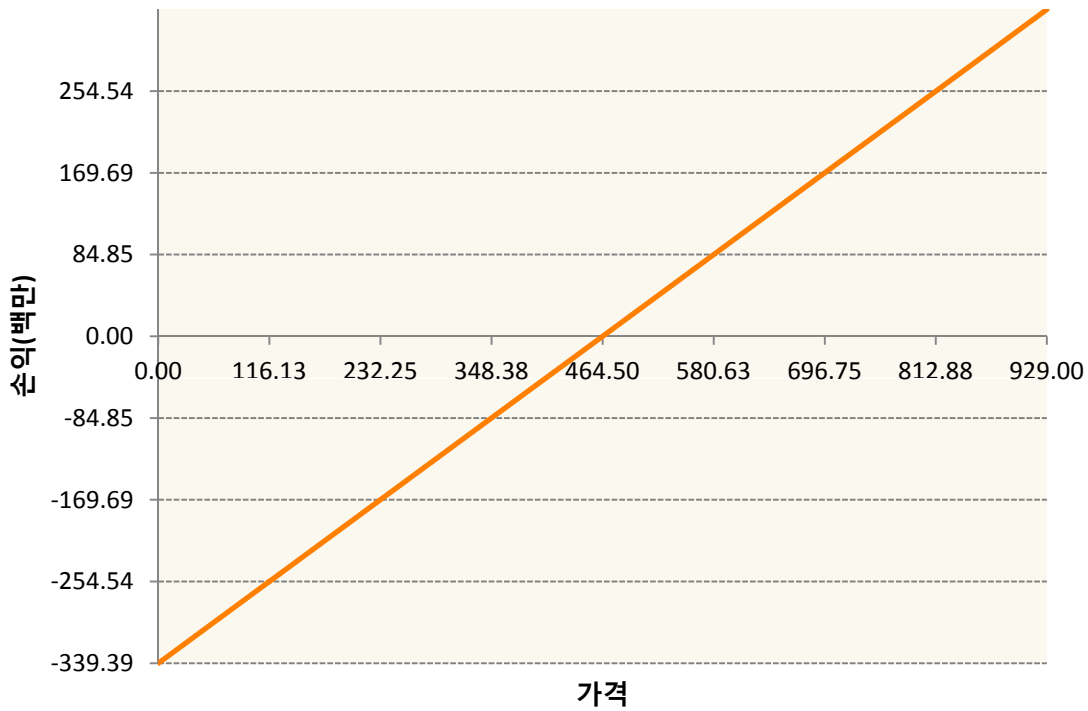


SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





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	18
KR4175P500	2019-05 달러선물	6

KWK9	KC HRW WHEAT FUT May19	10
SBK9	SUGAR #11 (WORLD) May19	30
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)

269