

공시일	2019-04-18
기준일	2019-04-17

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	2019-04-18
기준일	2019-04-17

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

1,158

* 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	2019-04-18
기준일	2019-04-17

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)	364
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	100
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	171

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,000

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-04-18
기준일	2019-04-17

유로인덱스모(주식-파생형)

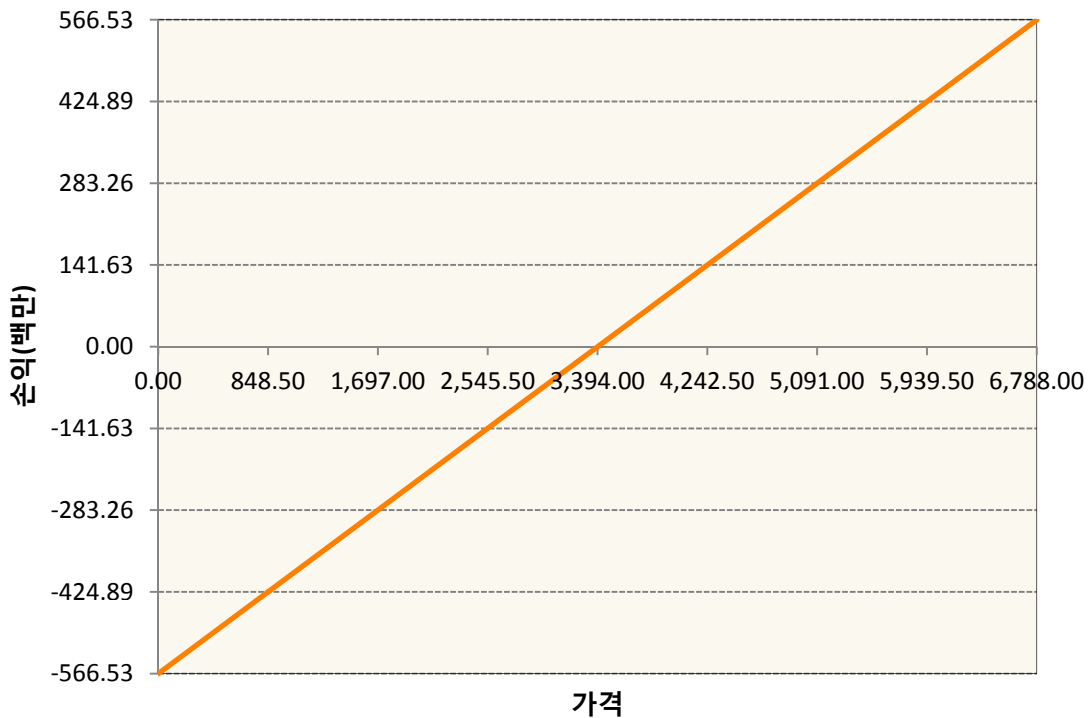
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	567	0	567	

2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	45
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

32

공시일	2019-04-18
기준일	2019-04-17

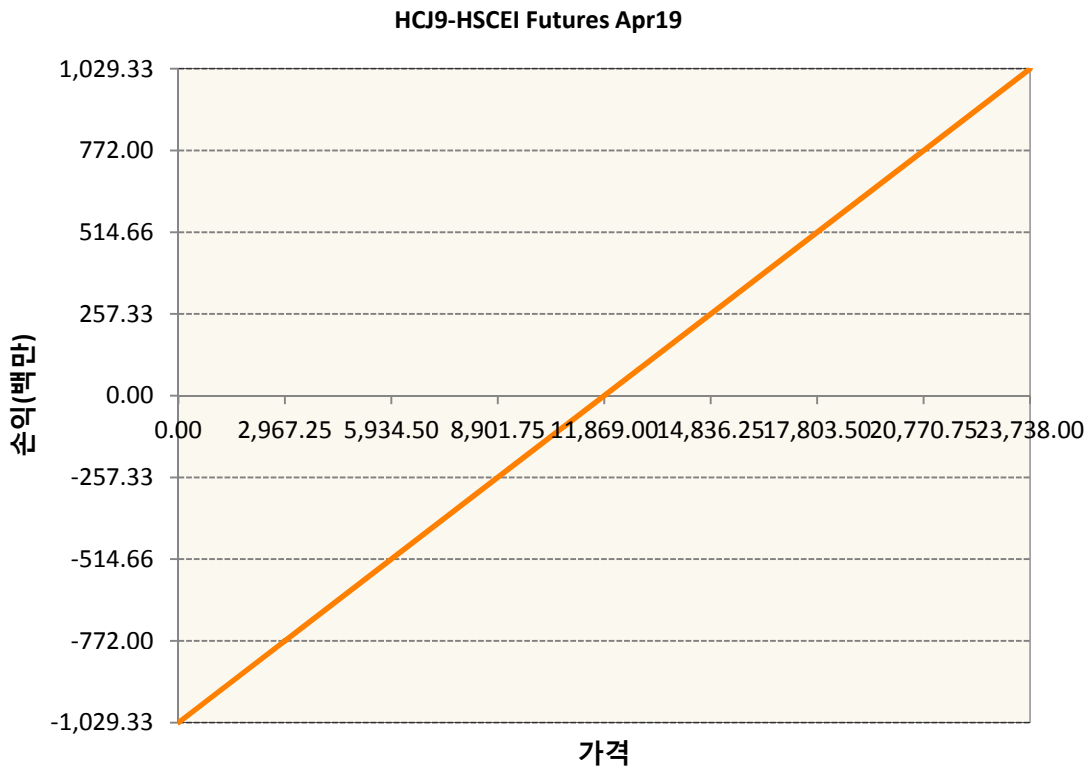
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,029	0	1,029	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ9	HSCEI Futures Apr19	82
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

84

공시일	2019-04-18
기준일	2019-04-17

커버드콜모(주식혼합-파생형)

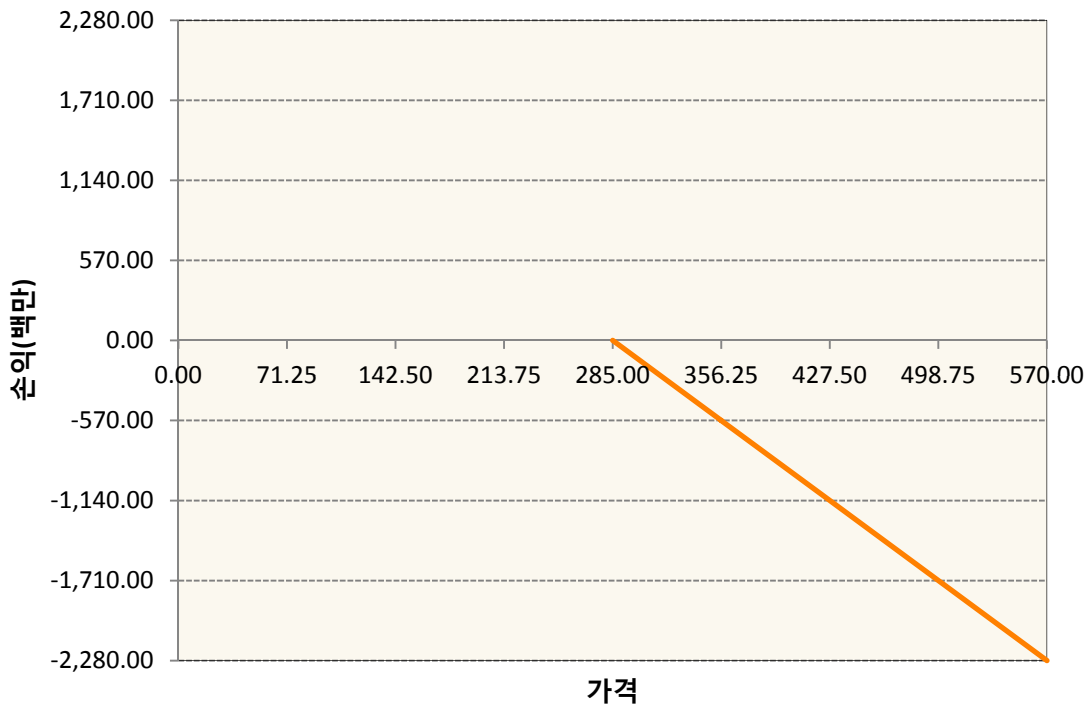
1. 계약금액

(단위:백만원)

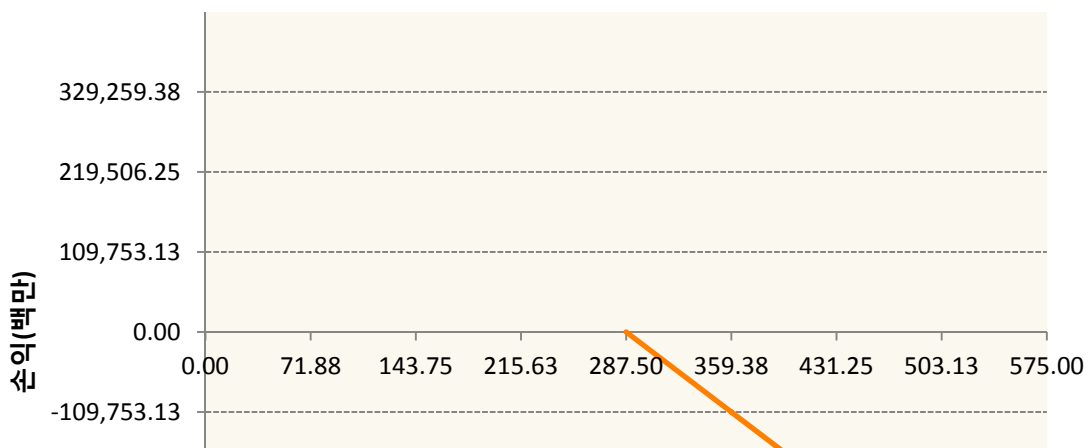
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	674,730	-674,730	장내

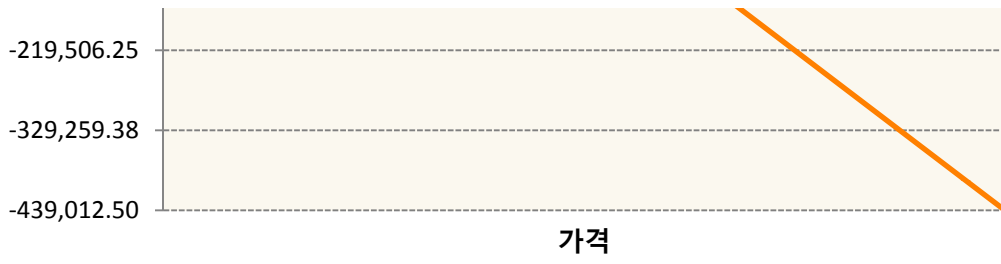
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P52850-2019-05 콜285

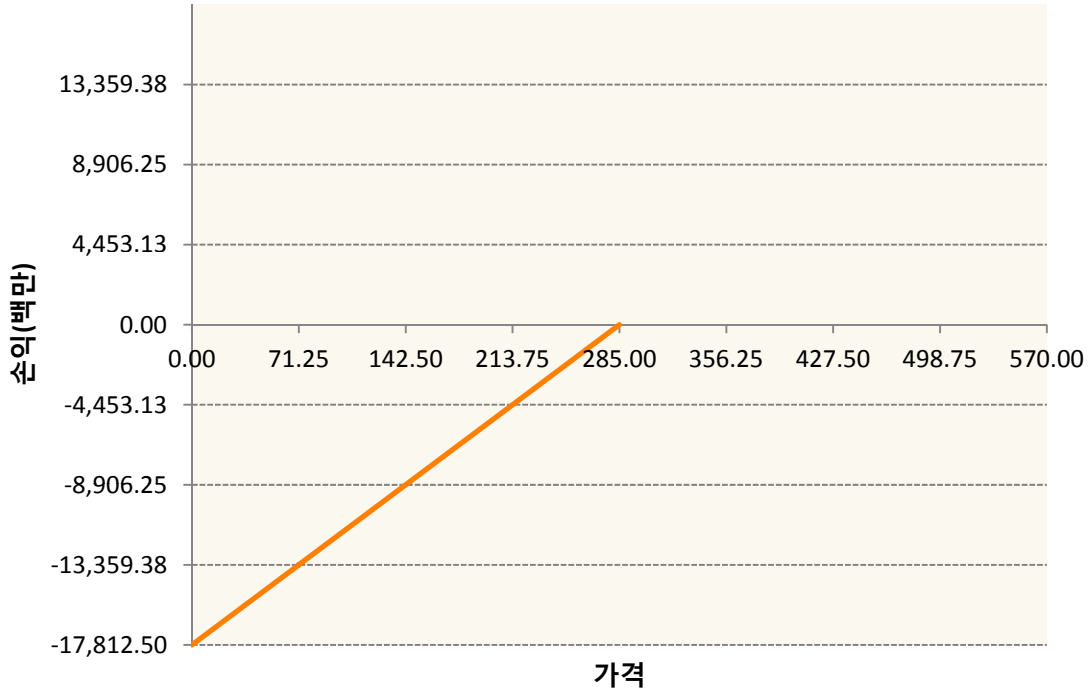


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

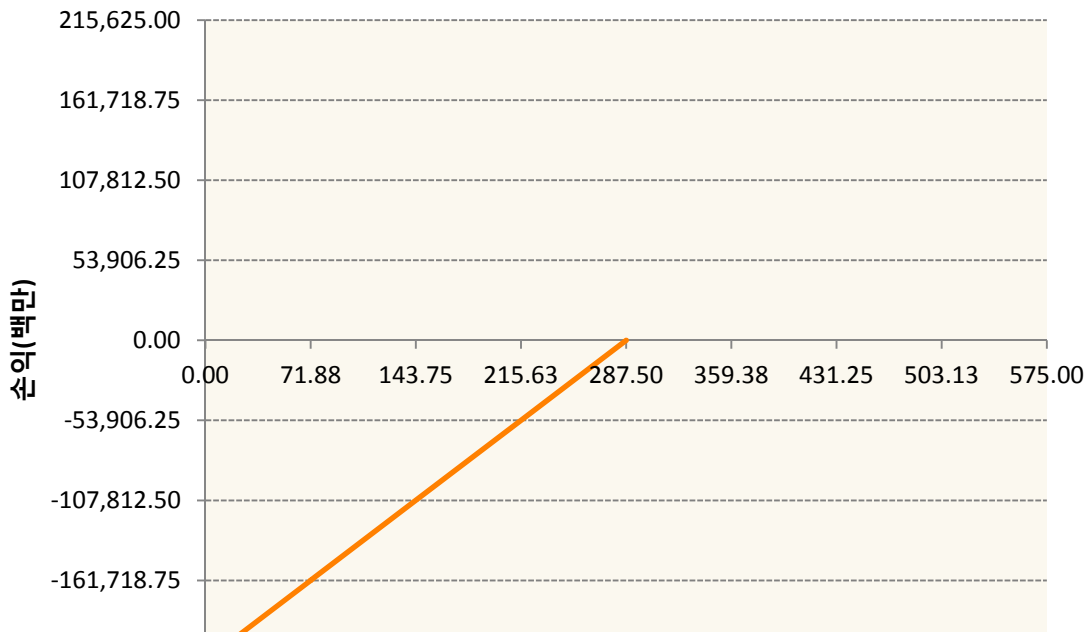




KR4301P52858-2019-05 풋285



KR4301P52874-2019-05 풋287.5



-215,625.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P52850		2019-05 콜285						159
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	74	72	71	68	66	63	61	
-5.33%	66	63	59	56	52	49	45	
-2.67%	47	42	38	34	29	25	21	
0%	12	8	4	0	-4	-8	-13	
2.67%	-35	-38	-41	-44	-48	-51	-55	
5.33%	-91	-93	-95	-97	-99	-101	-104	
8.00%	-152	-152	-153	-154	-155	-157	-159	
KR4201P52876		2019-05 콜287.5						29,106
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	12,077	11,856	11,577	11,244	10,861	10,436	9,972	
-5.33%	10,986	10,482	9,930	9,341	8,721	8,075	7,409	
-2.67%	8,084	7,308	6,522	5,728	4,928	4,123	3,315	
0%	2,491	1,664	833	0	-835	-1,671	-2,509	
2.67%	-5,840	-6,469	-7,134	-7,828	-8,545	-9,280	-10,030	
5.33%	-16,127	-16,477	-16,890	-17,357	-17,871	-18,424	-19,012	
8.00%	-27,419	-27,565	-27,768	-28,026	-28,338	-28,699	-29,106	
KR4301P52858		2019-05 풋285						1,040
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,028	-1,028	-1,029	-1,031	-1,033	-1,036	-1,040	
-5.33%	-554	-560	-567	-575	-584	-594	-605	
-2.67%	-158	-175	-192	-209	-226	-244	-261	
0%	43	29	15	0	-15	-31	-47	
2.67%	89	85	81	75	68	60	51	
5.33%	93	92	92	91	89	87	84	
8.00%	93	93	93	93	92	92	91	
KR4301P52874		2019-05 풋287.5						13,669
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-13,589	-13,591	-13,596	-13,605	-13,619	-13,640	-13,669	
-5.33%	-7,833	-7,870	-7,922	-7,987	-8,065	-8,156	-8,257	
-2.67%	-2,621	-2,789	-2,964	-3,146	-3,333	-3,524	-3,718	
0%	618	415	209	0	-210	-422	-635	
2.67%	1,603	1,529	1,439	1,334	1,216	1,087	948	

5.33%	1,724	1,715	1,699	1,674	1,639	1,594	1,537
8.00%	1,730	1,729	1,728	1,725	1,719	1,710	1,695

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

(단위:백만원)

45,771

공시일	2019-04-18
기준일	2019-04-17

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

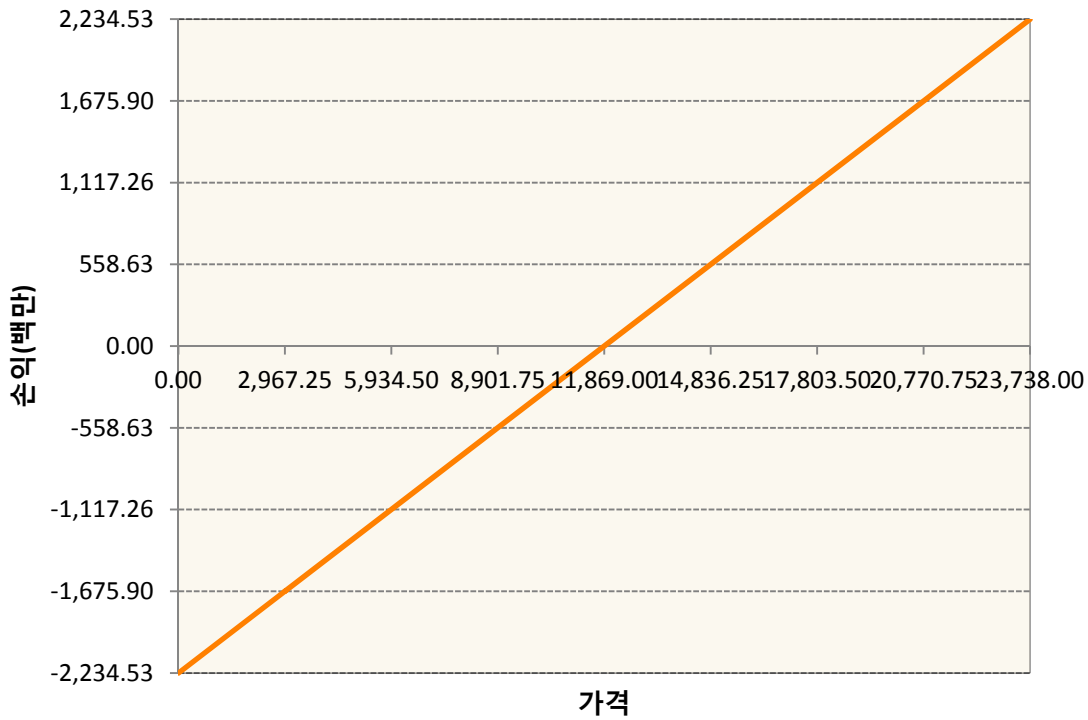
1. 계약금액

(단위:백만원)

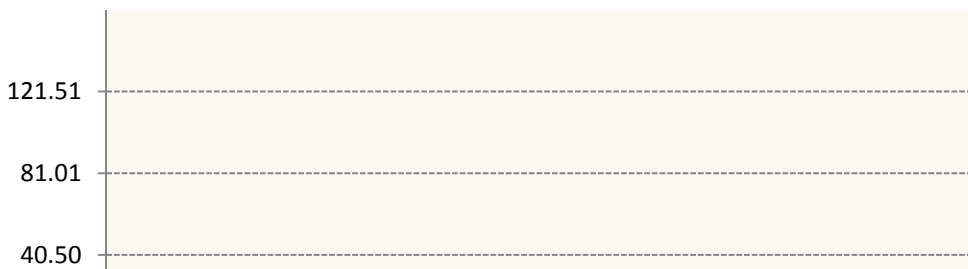
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,235	0	2,235	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,555	-5,555	장내
누계	통화	선도	0	3,038	-3,038	장외

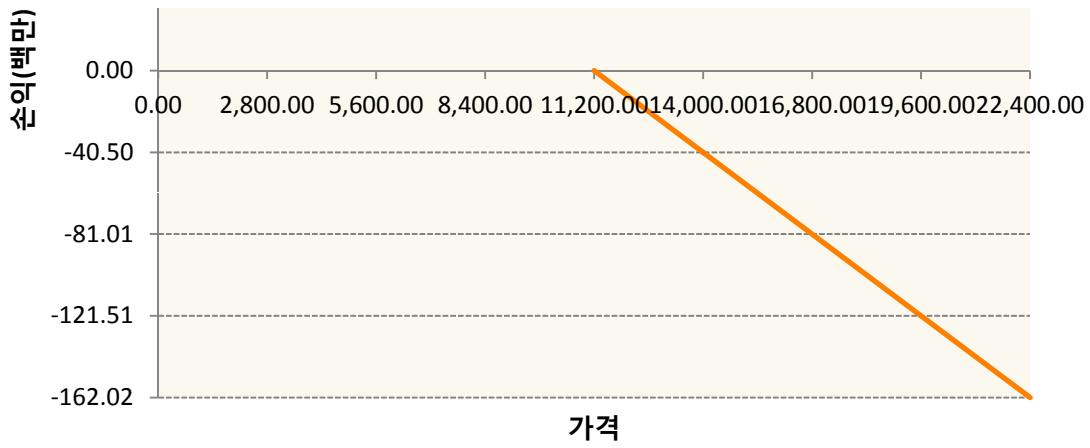
2. 만기시점의 손익구조

HCJ9-HSCEI Futures Apr19

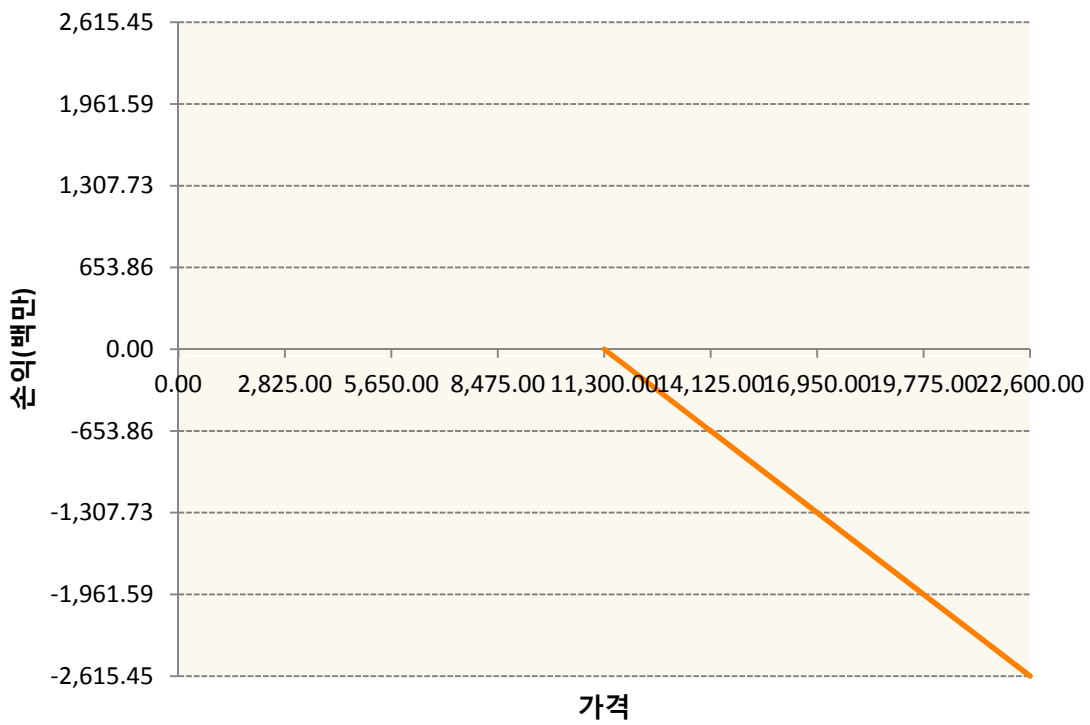


OHHIJ9-C112-HSCEI

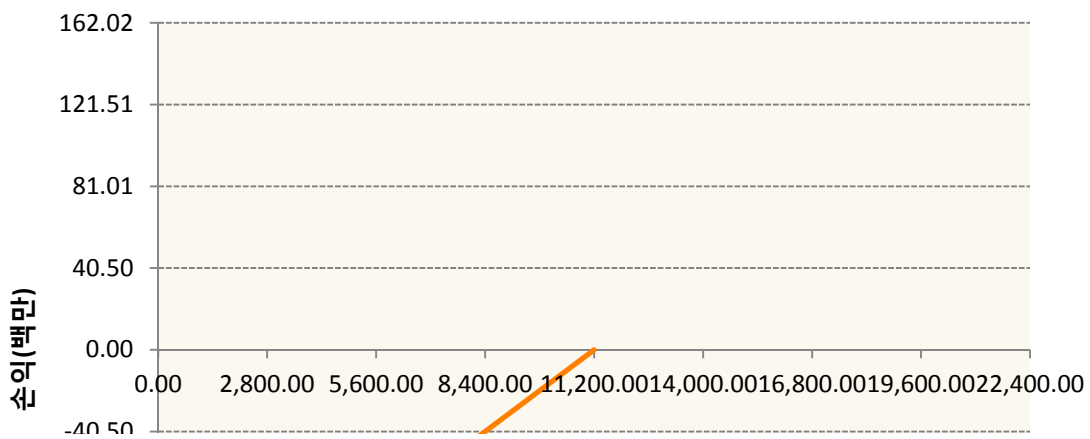


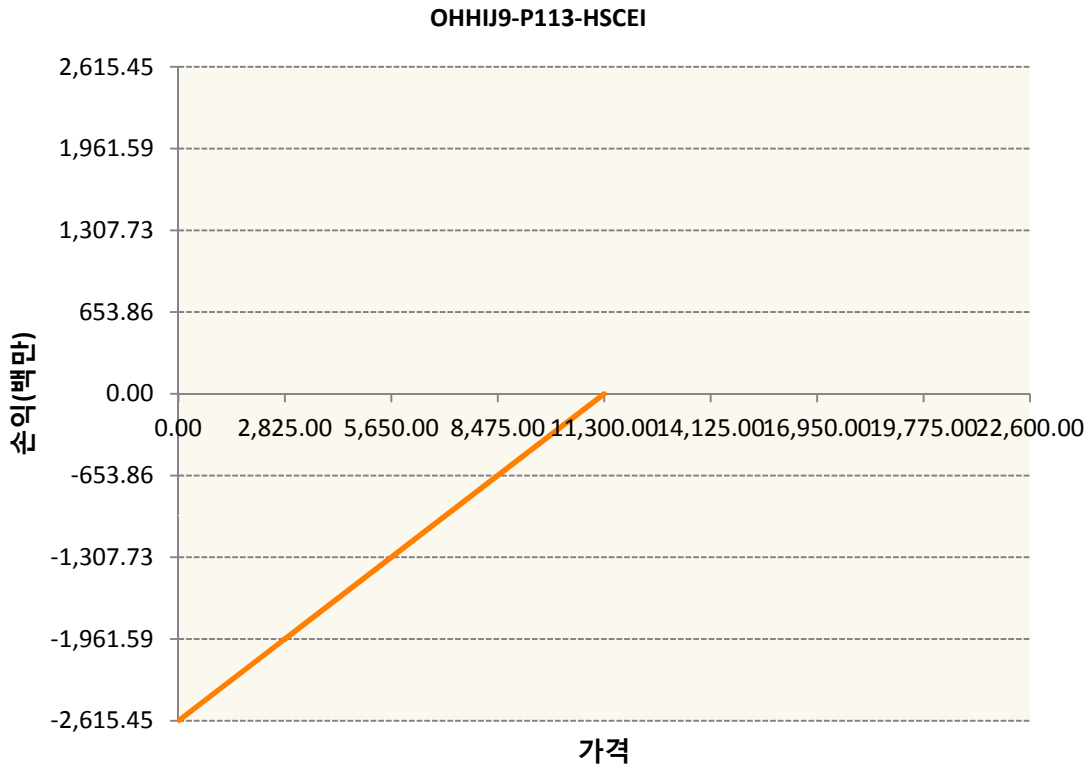
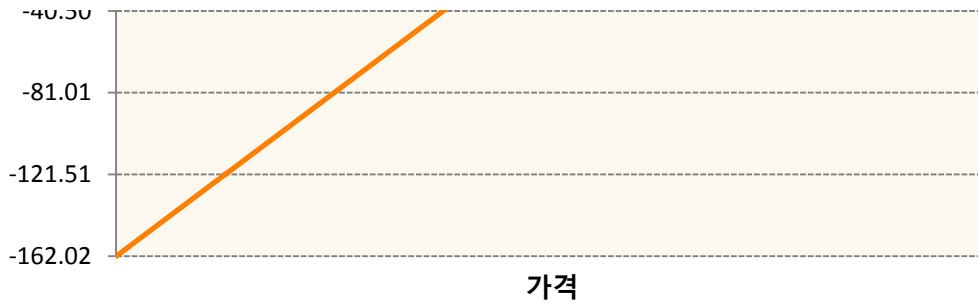


OHHIJ9-C113-HSCEI



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	179
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)

721

공시일	2019-04-18
기준일	2019-04-17

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

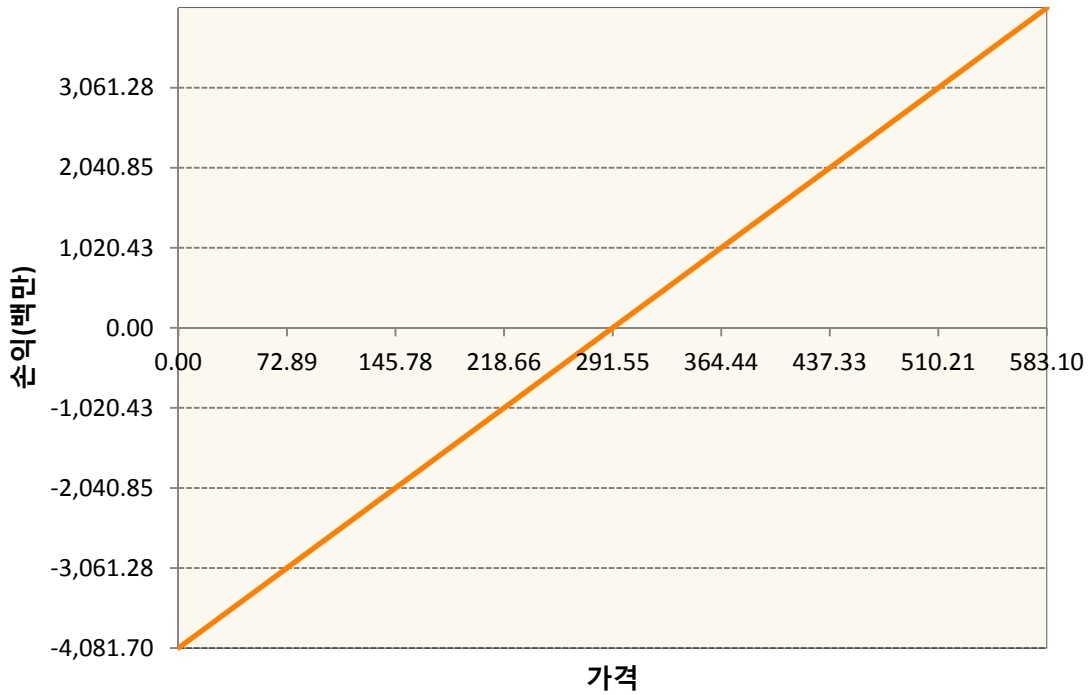
1. 계약금액

(단위:백만원)

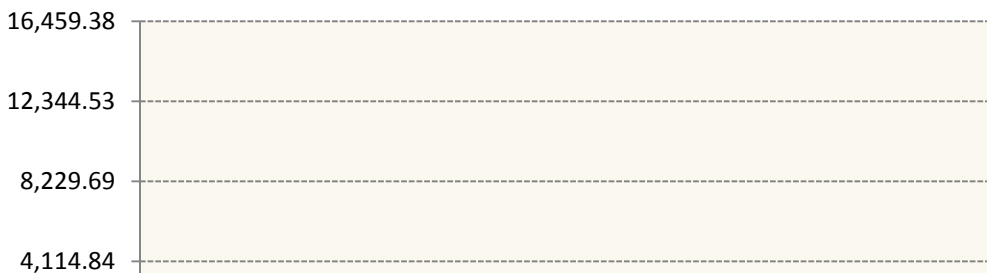
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	571	0	571	장내
누계	유가증권	선물	4,082	0	4,082	장내
누계	유가증권	스왑	35,836	0	35,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	33,126	-33,126	장내

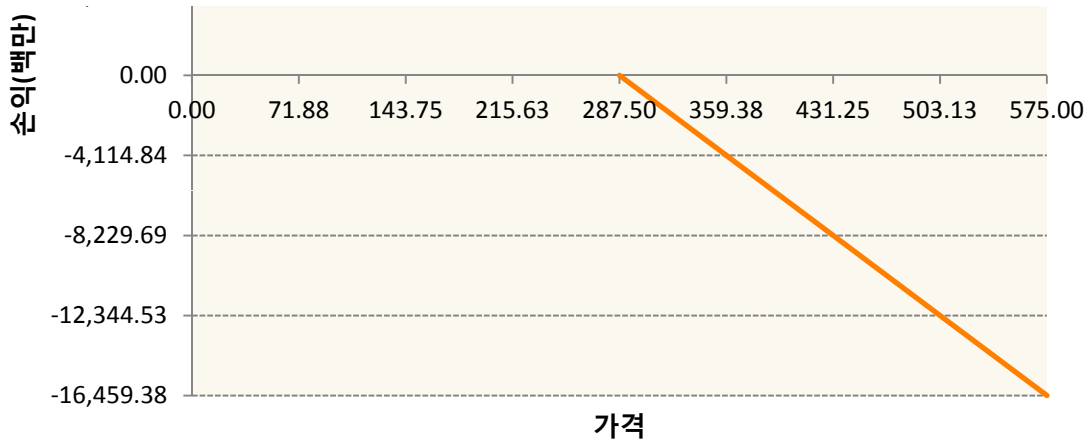
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

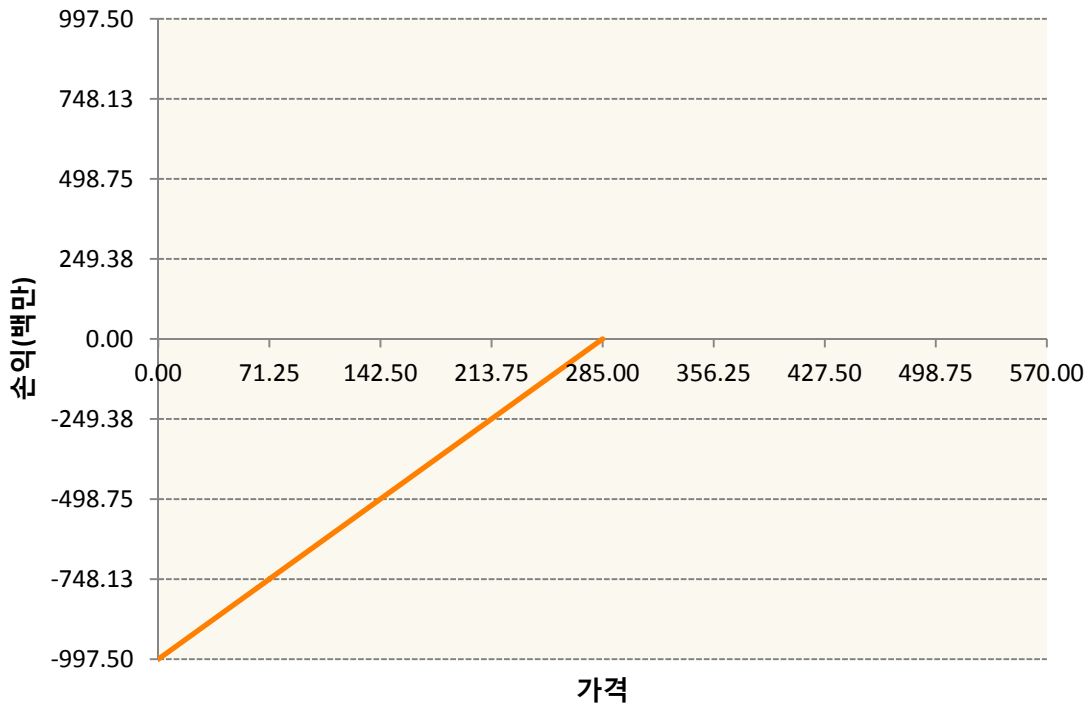


KR4201P52876-2019-05 콜287.5

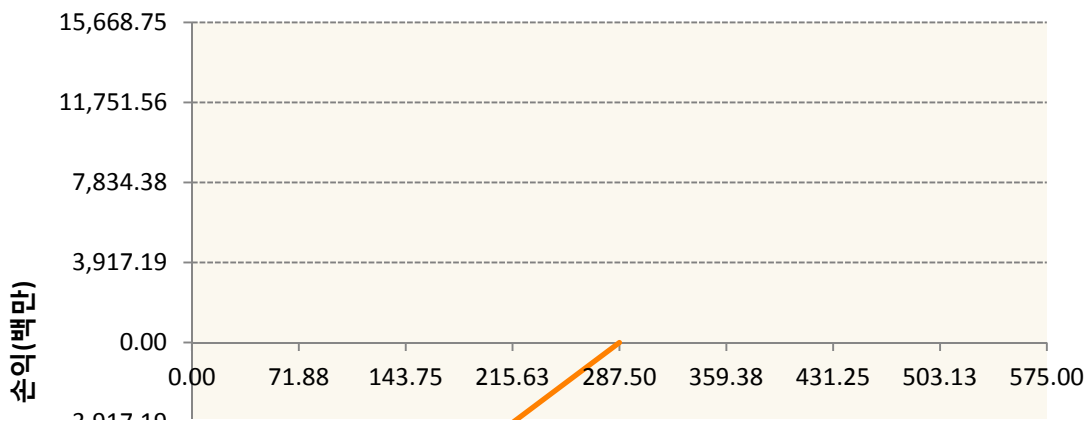




KR4301P52858-2019-05 풋285



KR4301P52874-2019-05 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,447
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,447	-2,447	-2,447	-2,447	-2,447	-2,447	-2,447	
-5.33%	-1,631	-1,631	-1,631	-1,631	-1,631	-1,631	-1,631	
-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%	1,631	1,631	1,631	1,631	1,631	1,631	1,631	
8.00%	2,447	2,447	2,447	2,447	2,447	2,447	2,447	
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						325
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-325	-325	-325	-325	-325	-325	-325	
-5.33%	-217	-217	-217	-217	-217	-217	-217	
-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%	217	217	217	217	217	217	217	
8.00%	325	325	325	325	325	325	325	
KR4201P52876		2019-05 콜287.5						1,091
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

공시일	2019-04-18
기준일	2019-04-17

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

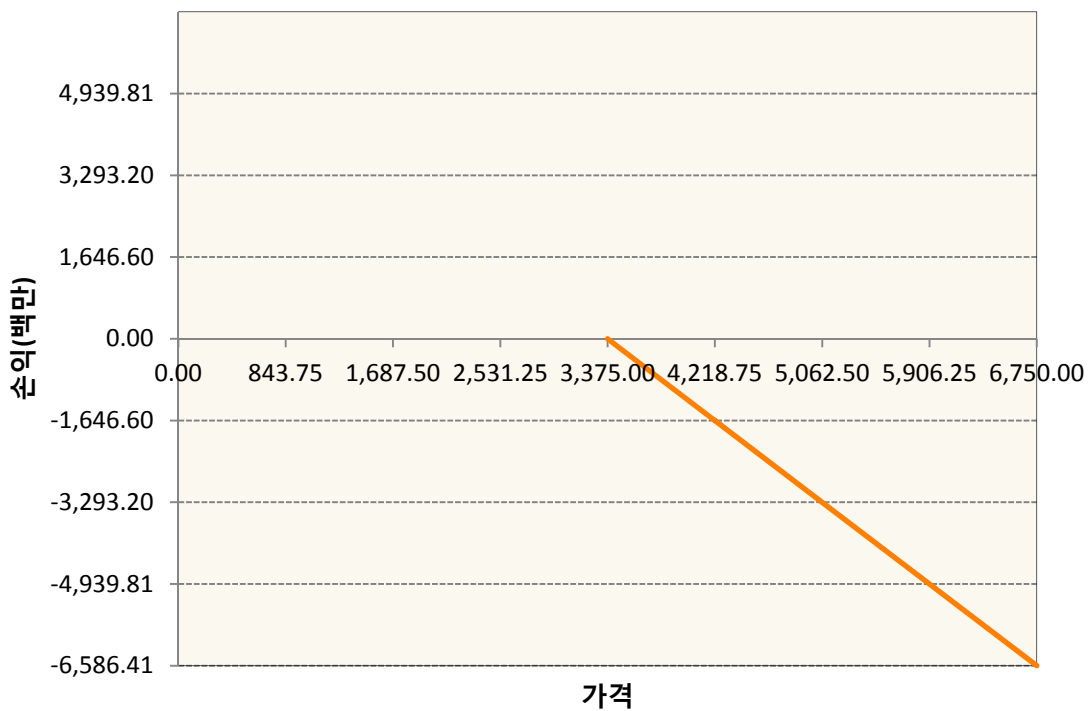
1. 계약금액

(단위:백만원)

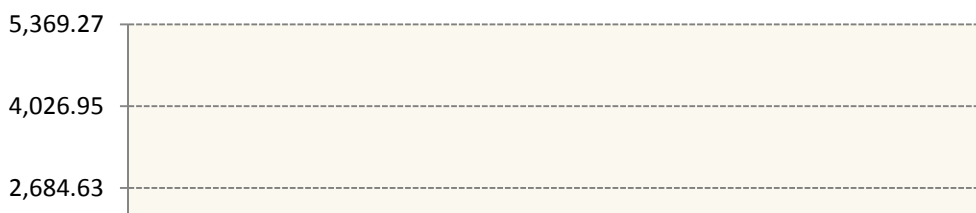
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,229	0	5,229	
누계	유가증권	스왑	60,612	0	60,612	장외
누계	유가증권	옵션	0	23,911	-23,911	장내
누계	통화	선도	0	17,974	-17,974	장외

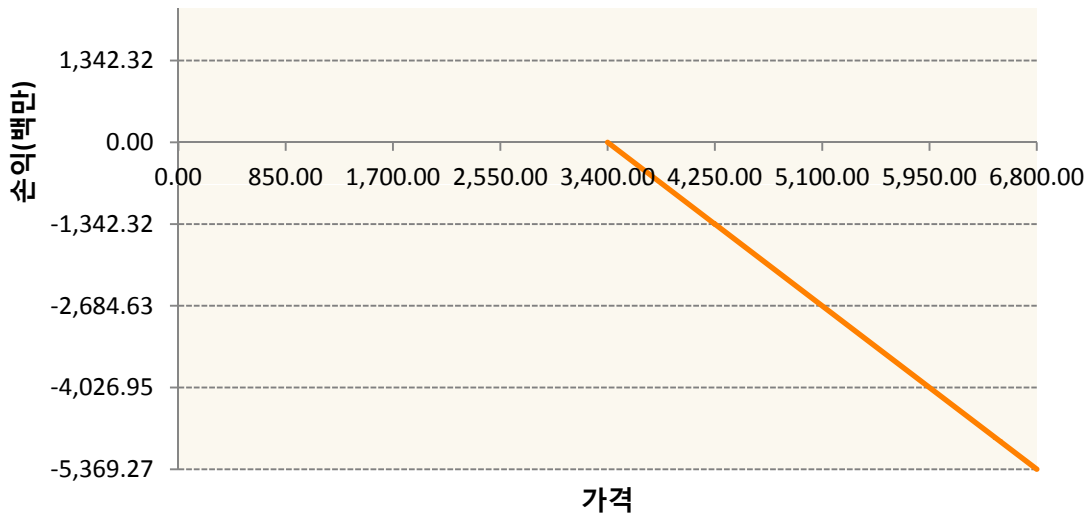
2. 만기시점의 손익구조

OESXJ9-C3375-EURO STOXX 50

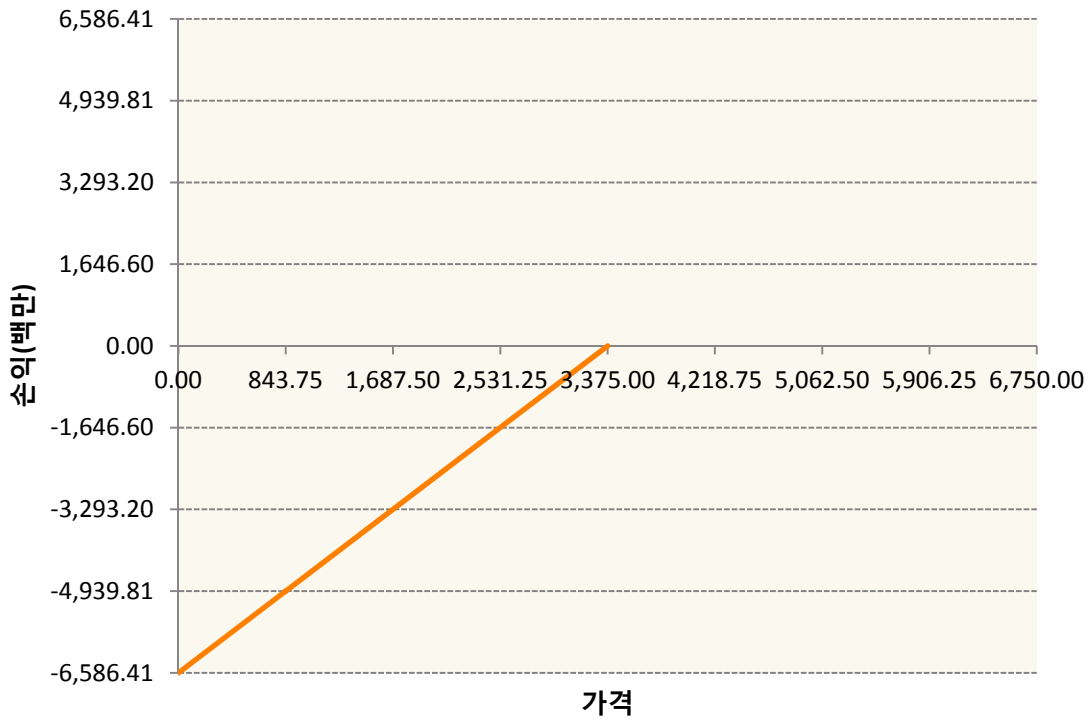


OESXJ9-C3400-EURO STOXX 50

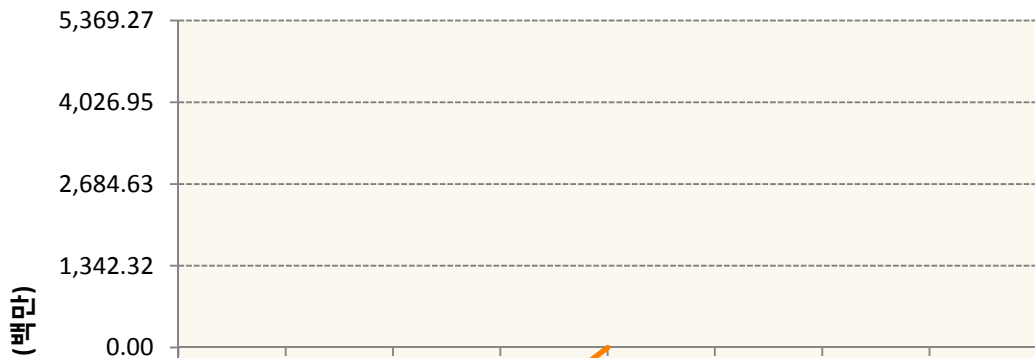


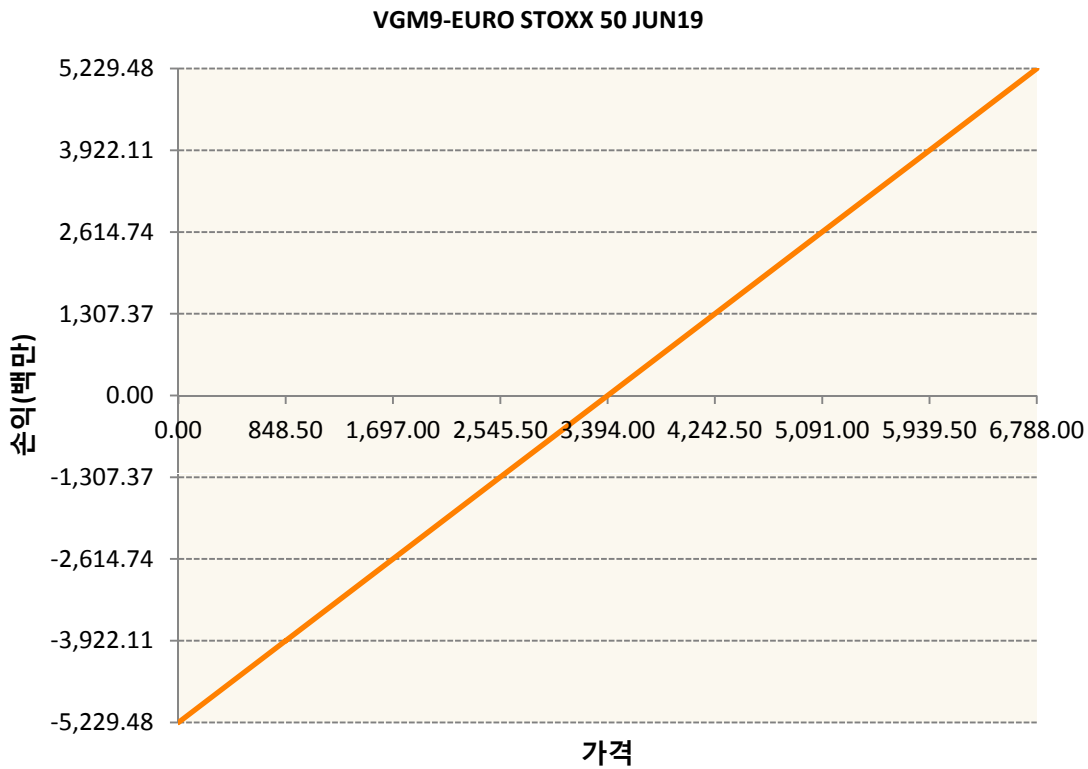
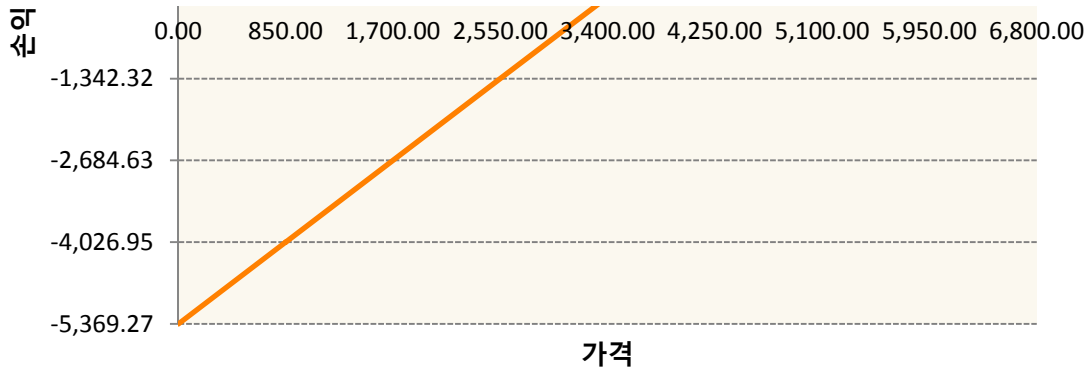


OESXJ9-P3375-EURO STOXX 50



OESXJ9-P3400-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	210
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	411
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	822
FX21019J01E KRW/EUR 28-06-19E	205
OESXJ9-C33 EURO STOXX 50	527
OESXJ9-C34 EURO STOXX 50	430
OESXJ9-P33 EURO STOXX 50	527
OESXJ9-P34 EURO STOXX 50	430
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	418

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

(단위:백만원)

2,598

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

(단위:백만원)

1,109

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

(단위:백만원)

95

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

(단위:백만원)

137

공시일	2019-04-18
기준일	2019-04-17

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

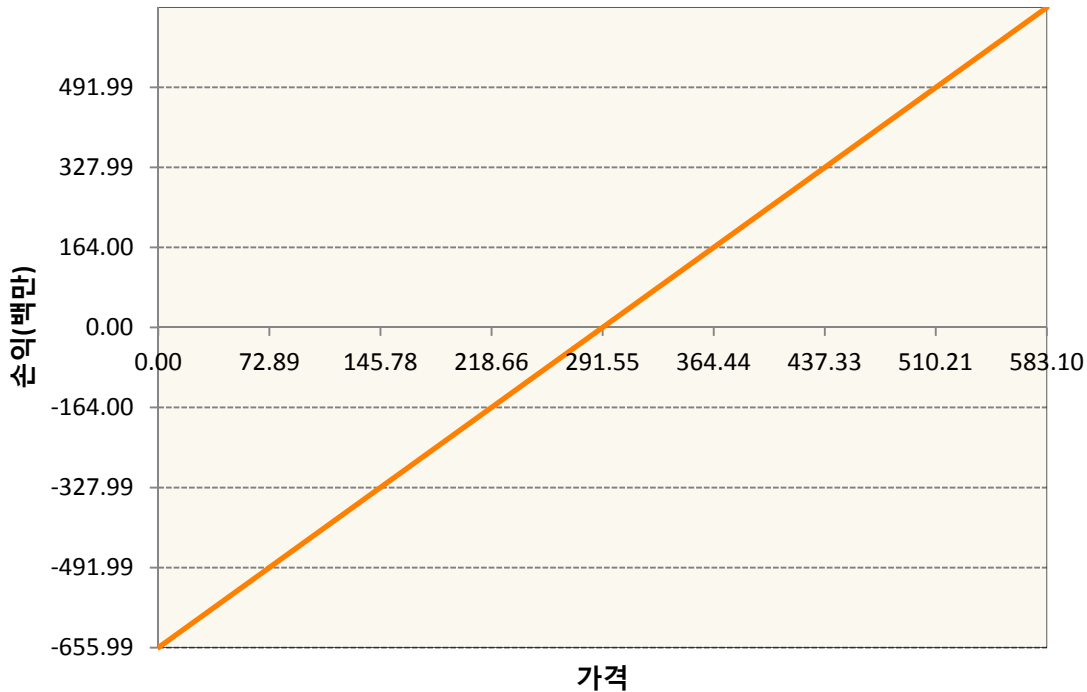
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	656	0	656	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	2019-04-18
기준일	2019-04-17

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

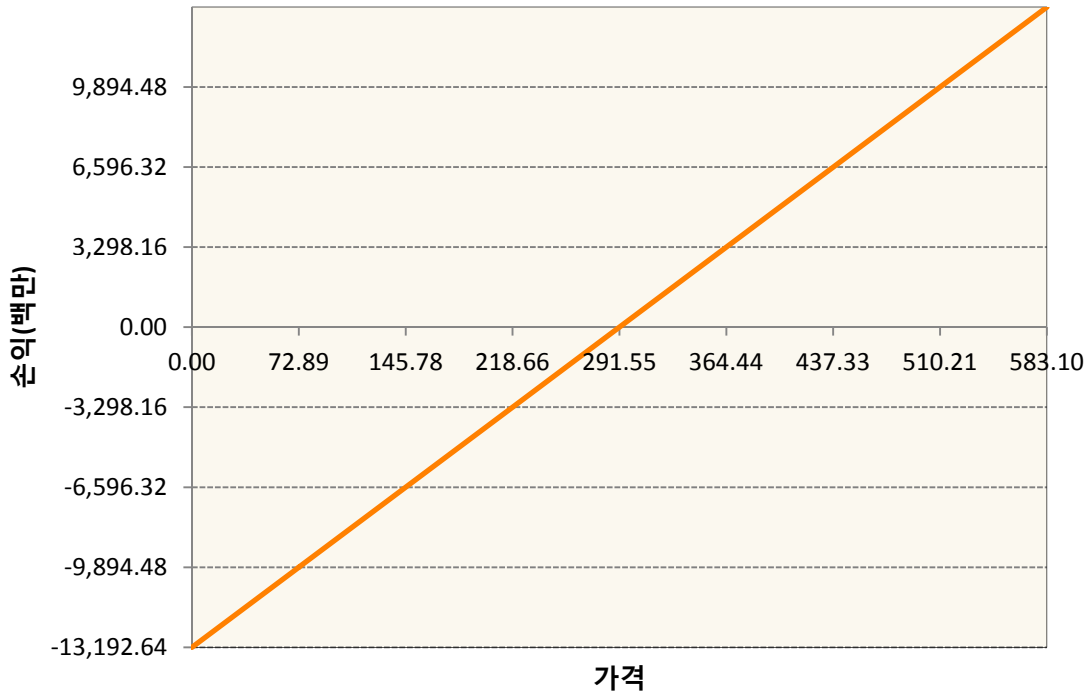
1. 계약금액

(단위:백만원)

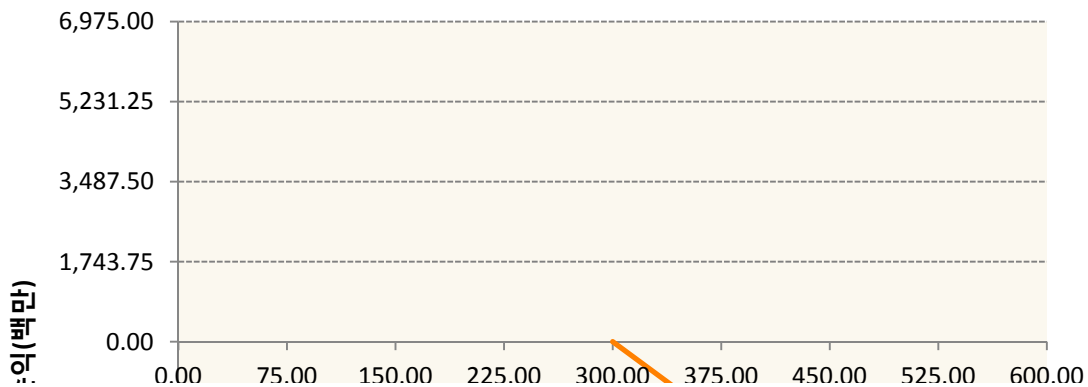
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,193	0	13,193	장내
누계	유가증권	옵션	1,437	24,671	-23,234	장내

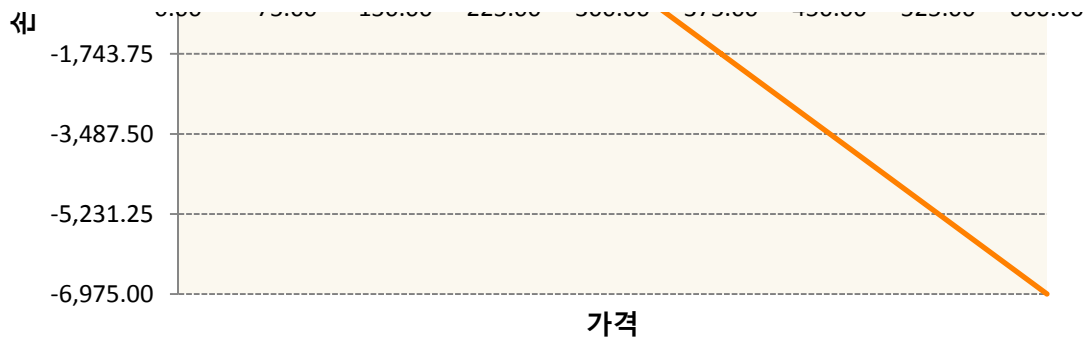
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

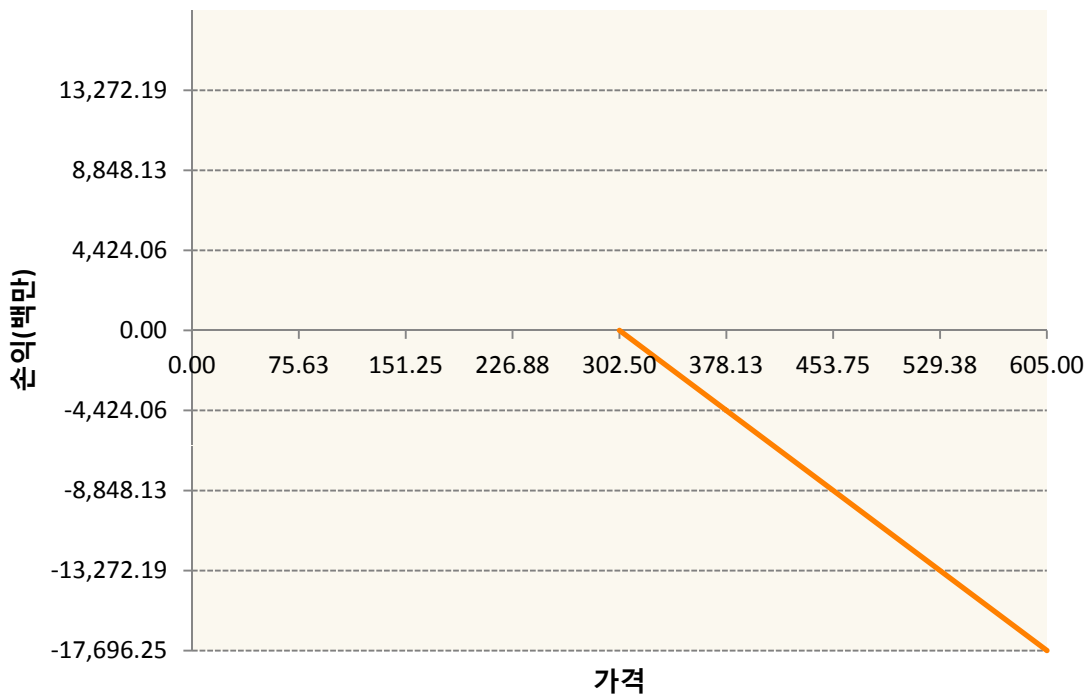


KR4201P53007-2019-05 콜300

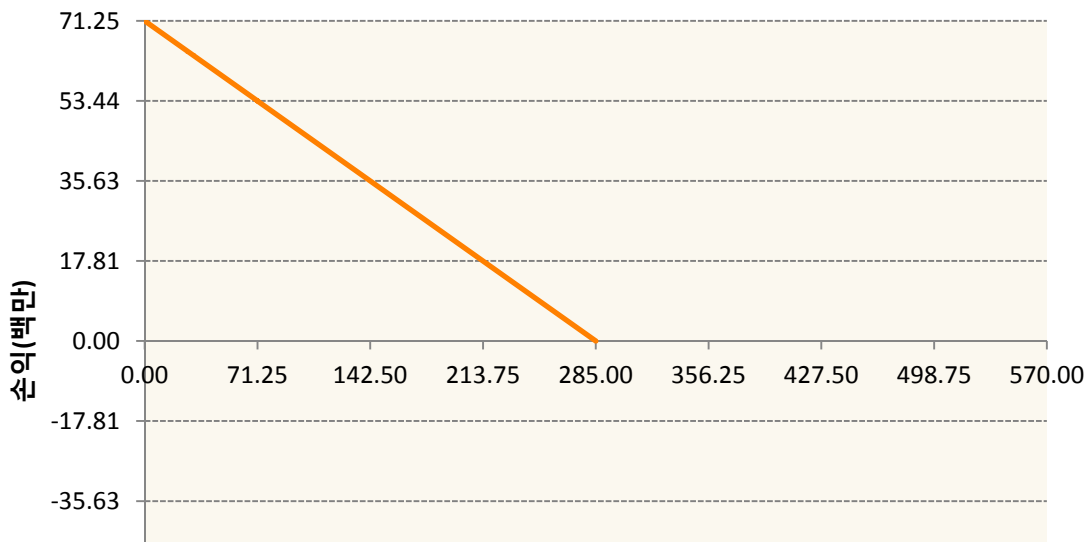


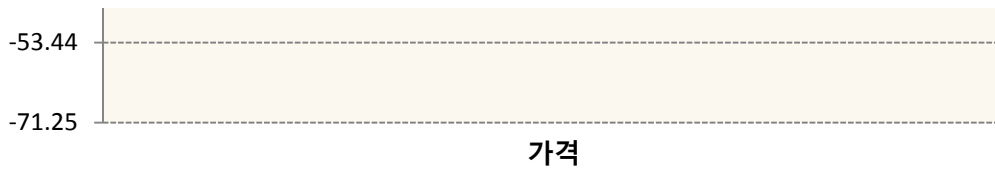


KR4201P53023-2019-05 콜302.5

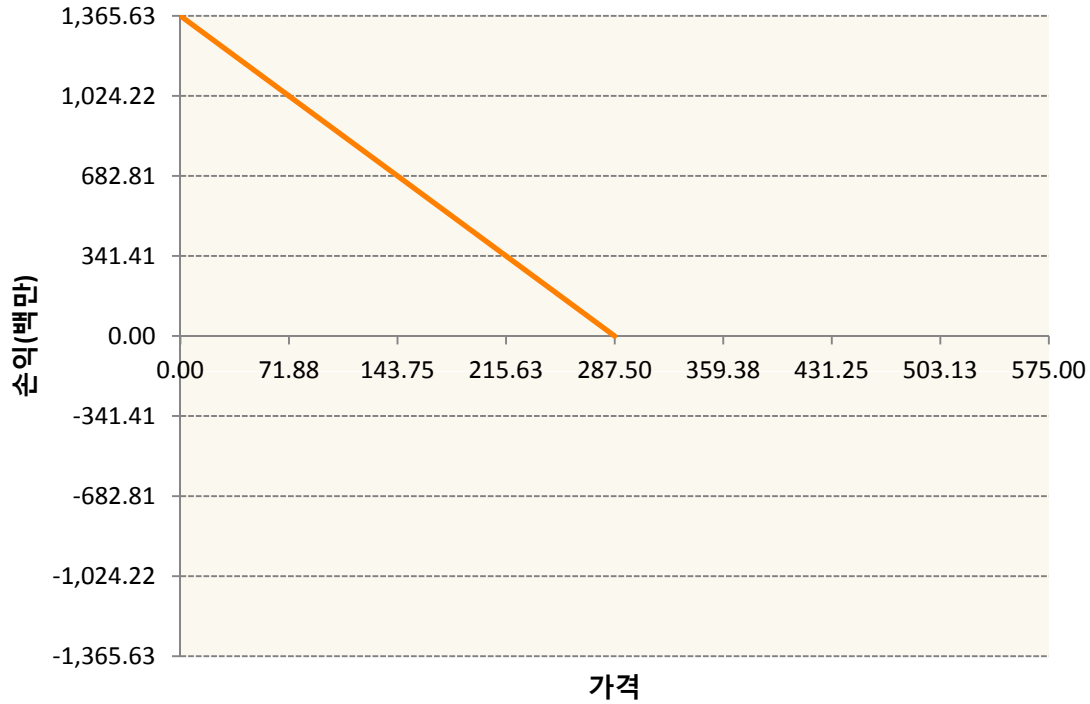


KR4301P52858-2019-05 풋285





KR4301P52874-2019-05 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						1,051
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,051	-1,051	-1,051	-1,051	-1,051	-1,051	-1,051	
-5.33%	-701	-701	-701	-701	-701	-701	-701	
-2.67%	-350	-350	-350	-350	-350	-350	-350	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	350	350	350	350	350	350	350	
5.33%	701	701	701	701	701	701	701	
8.00%	1,051	1,051	1,051	1,051	1,051	1,051	1,051	
KR4201P53007		2019-05 콜300						329
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	70	69	68	67	65	62	59	
-5.33%	68	66	63	59	55	50	44	
-2.67%	59	53	47	40	32	23	14	

0%	32	22	11	0	-11	-23	-35
2.67%	-28	-42	-55	-68	-81	-95	-108
5.33%	-130	-142	-155	-168	-180	-193	-206
8.00%	-268	-277	-286	-296	-307	-318	-329
KR4201P53023 2019-05 콜302.5							762
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	139	138	137	134	130	125	119
-5.33%	136	132	127	120	111	100	88
-2.67%	121	111	97	82	65	46	26
0%	71	49	25	0	-26	-53	-81
2.67%	-51	-83	-115	-147	-180	-213	-246
5.33%	-272	-305	-339	-372	-406	-439	-473
8.00%	-593	-618	-645	-673	-702	-732	-762
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	2
-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							87
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	86	86	86	86	86	86	87
-5.33%	50	50	50	51	51	52	52
-2.67%	17	18	19	20	21	22	24
0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-10	-10	-9	-8	-8	-7	-6
5.33%	-11	-11	-11	-11	-10	-10	-10
8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11

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

(단위:백만원)

1,831

공시일	2019-04-18
기준일	2019-04-17

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	3,614	0	3,614	

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	2019-04-18
기준일	2019-04-17

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	28,370	0	28,370	
누계	유가증권	수익증권	53,324	0	53,324	

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	2019-04-18
기준일	2019-04-17

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,702	0	1,702	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	78,333	0	78,333	
누계	통화	선도	0	126,269	-126,269	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	427
FX21019H03 KRW/USD 22-04-19E	363
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	363
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	418
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	182
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	454
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	527
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	320
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	1,271
FX21019J01H KRW/USD 17-05-19E	1,362
FX21019J01I KRW/USD 18-06-19E	363
FX21019J02C KRW/USD 20-05-19E	490
FX21019J02D KRW/USD 20-05-19E	461

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

(단위:백만원)

3,433

공시일	2019-04-18
기준일	2019-04-17

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

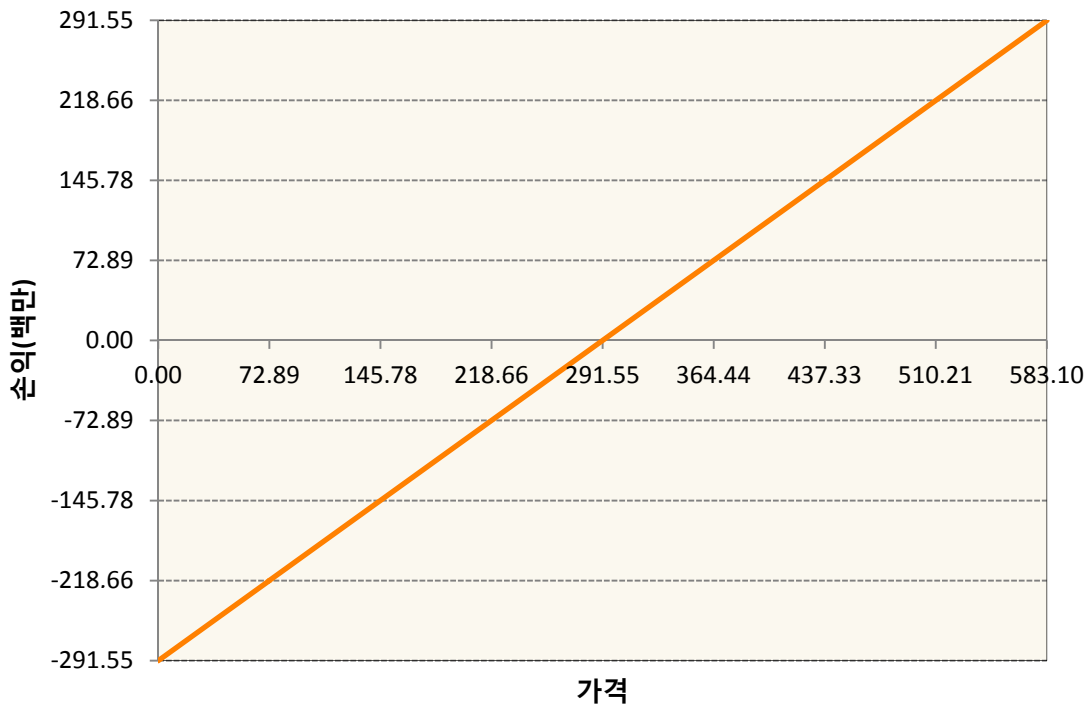
1. 계약금액

(단위:백만원)

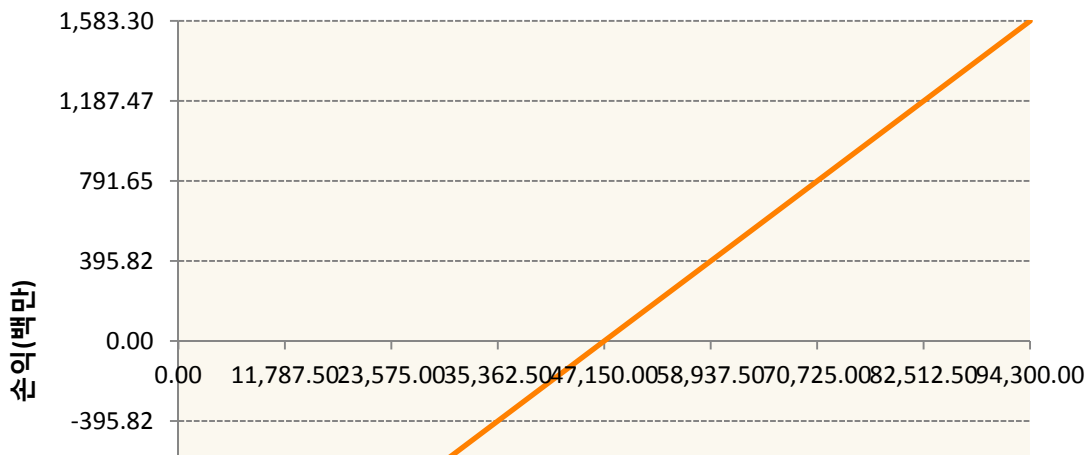
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,875	0	1,875	장내

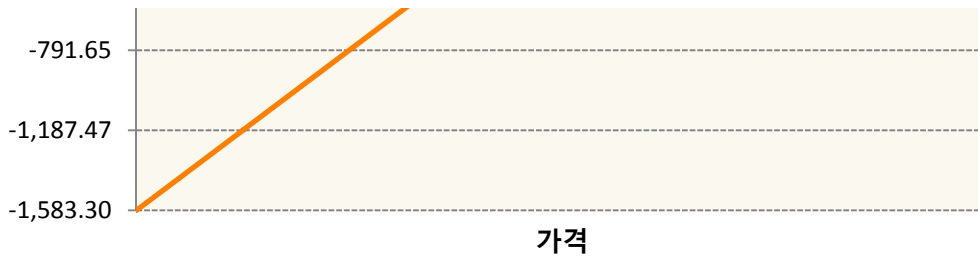
2. 만기시점의 손익구조

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	2019-04-18
기준일	2019-04-17

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

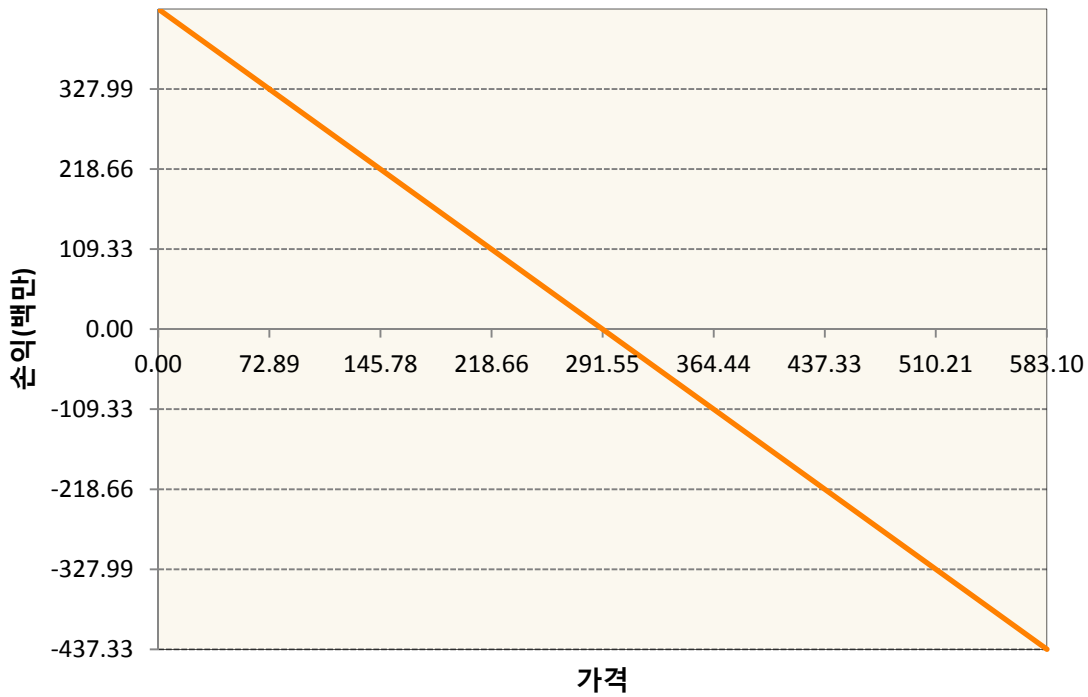
1. 계약금액

(단위:백만원)

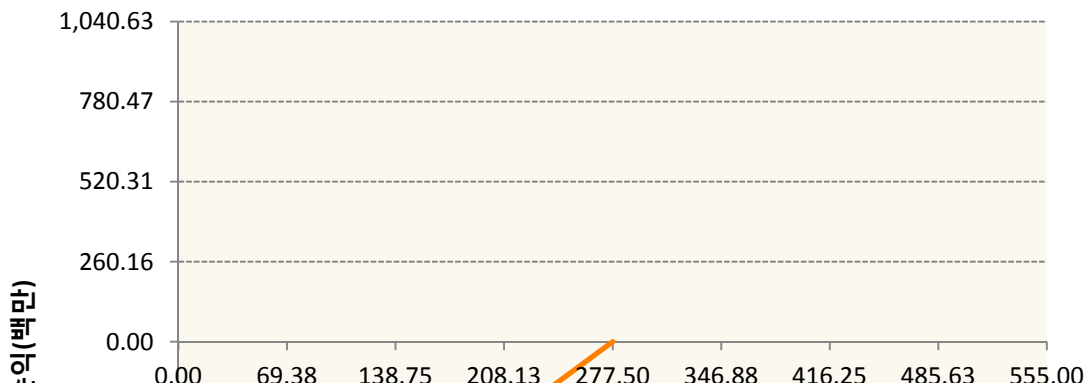
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	73	-73	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	437	-437	장내
누계	유가증권	옵션	0	2,231	-2,231	장내

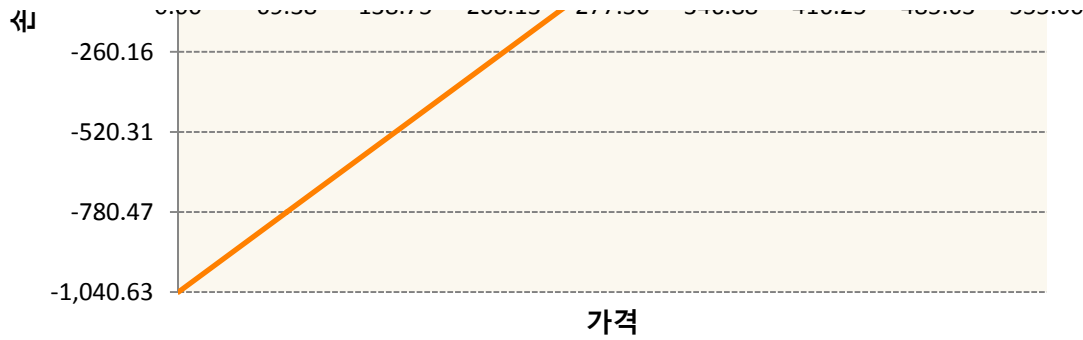
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

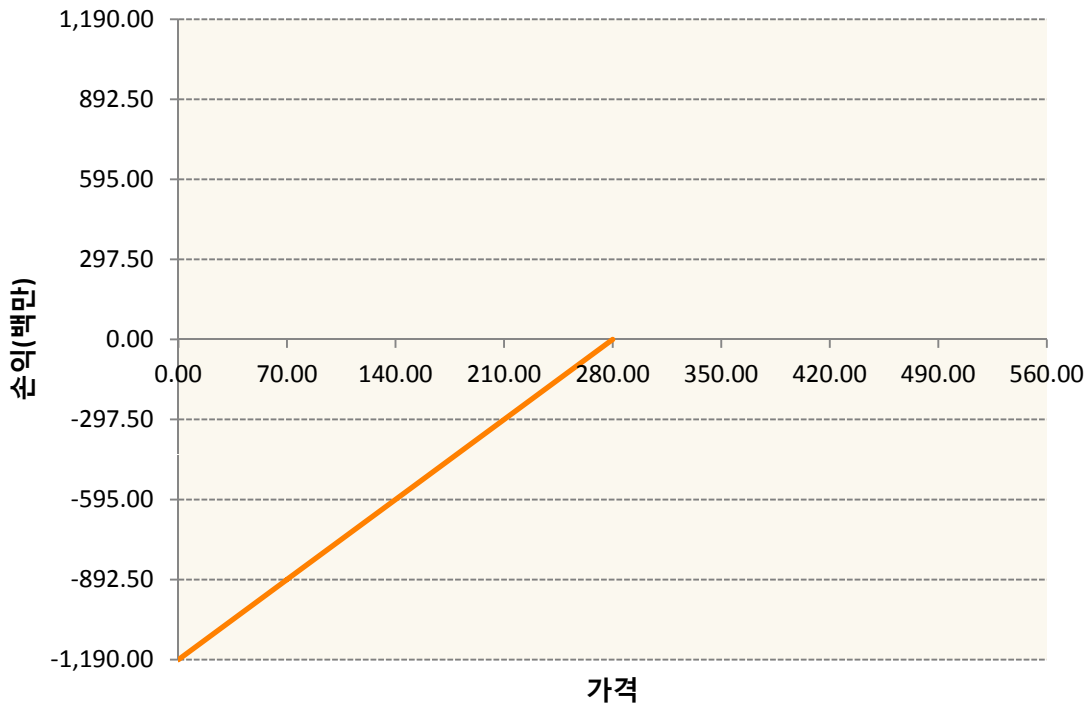


KR4301P52775-2019-05 풋277.5





KR4301P52809-2019-05 풋280



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						35
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	35	35	35	35	35	35	35	
-5.33%	23	23	23	23	23	23	23	
-2.67%	12	12	12	12	12	12	12	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12	
5.33%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23	
8.00%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	
KR4301P52775		2019-05 풋277.5						41
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-39	-39	-39	-40	-40	-41	-41
-5.33%	-14	-15	-16	-17	-18	-19	-20
-2.67%	-2	-3	-4	-5	-5	-6	-7
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
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

KR4301P52809

2019-05 풋280

55

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-53	-53	-53	-54	-54	-55	-55
-5.33%	-23	-24	-25	-26	-27	-28	-29
-2.67%	-4	-5	-6	-8	-9	-10	-11
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

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

(단위:백만원)

95

공시일	2019-04-18
기준일	2019-04-17

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

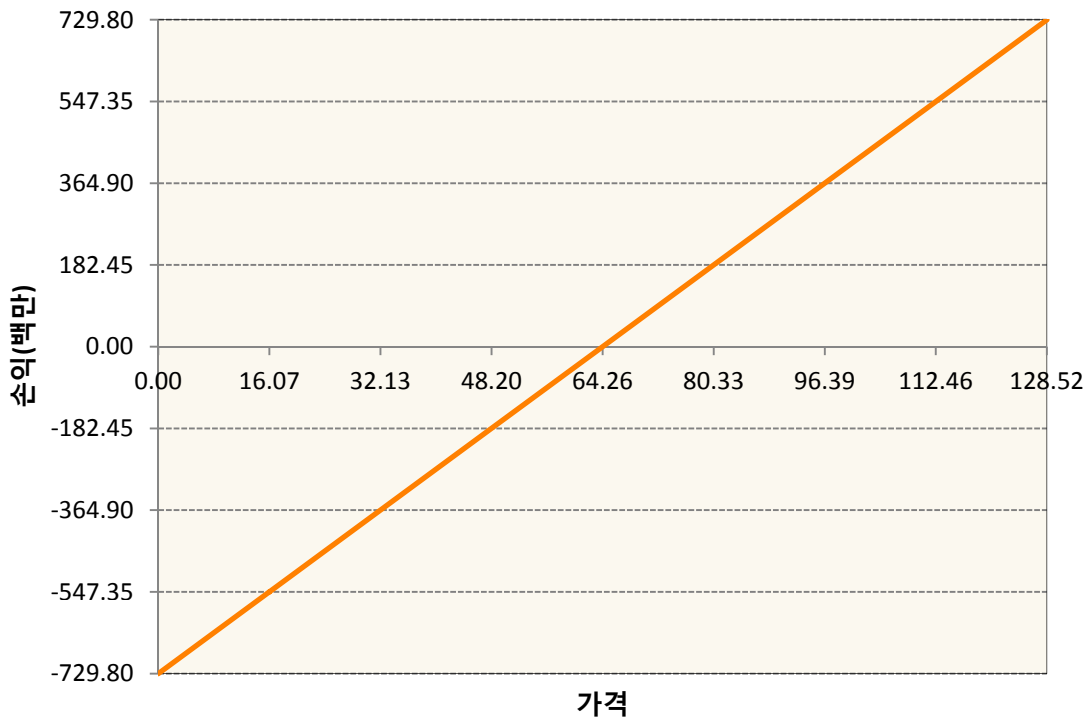
1. 계약금액

(단위:백만원)

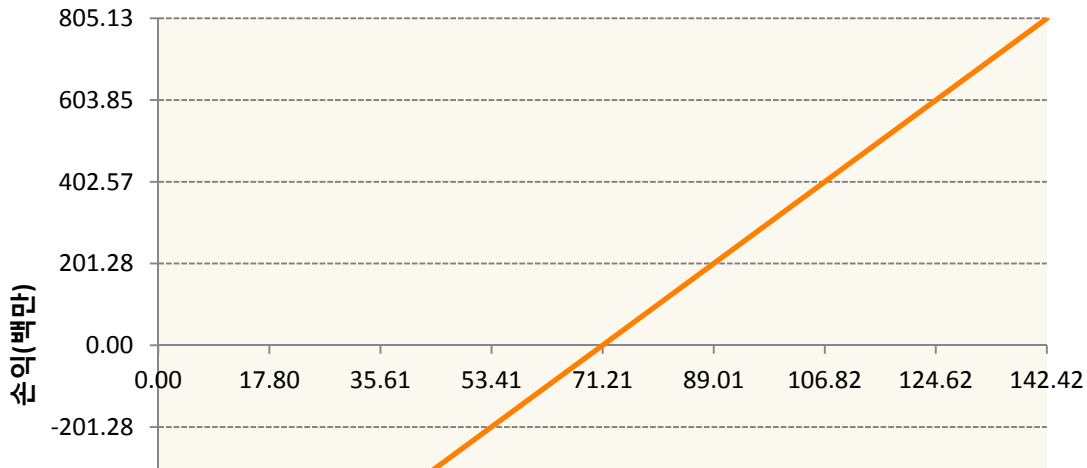
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,977	283	2,694	

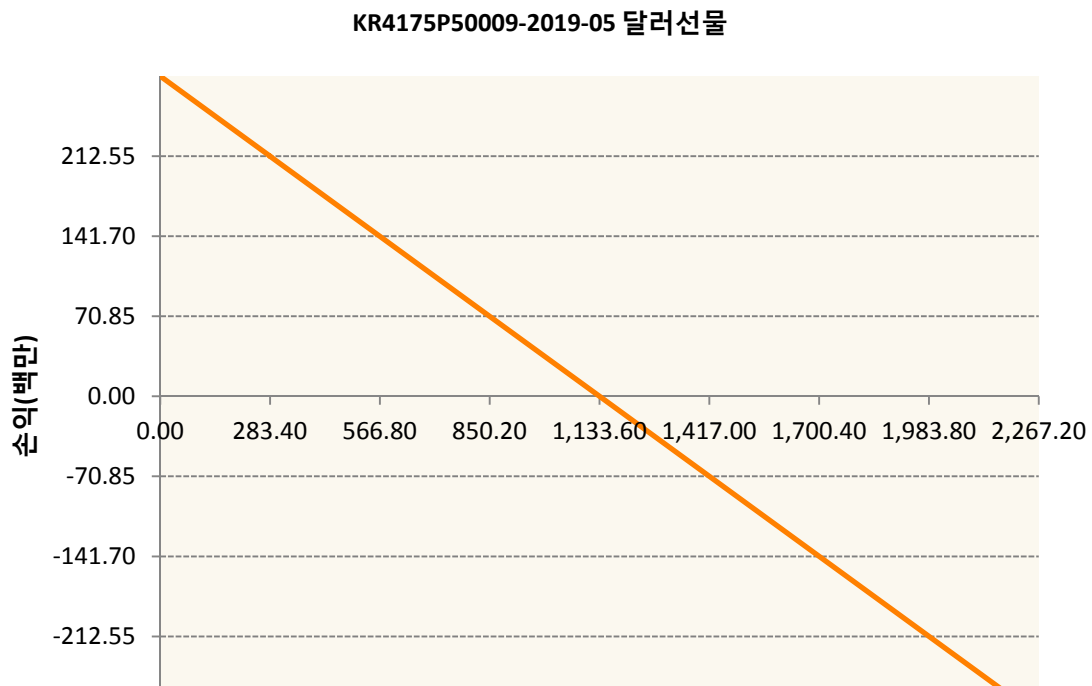
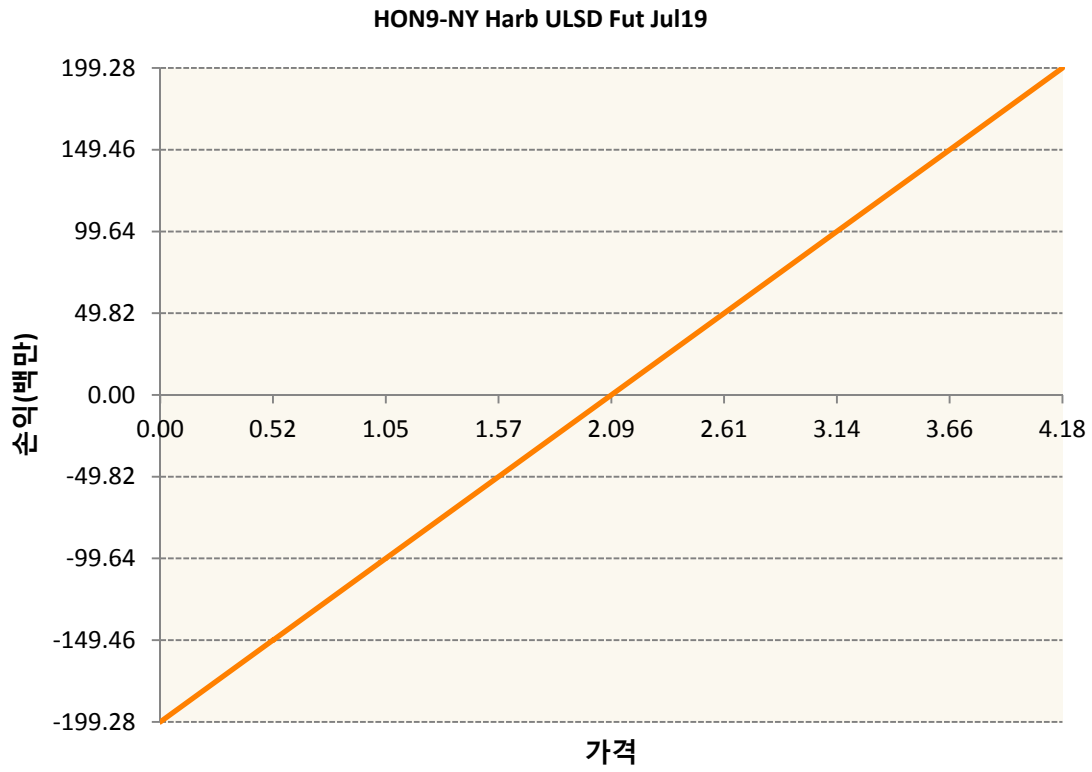
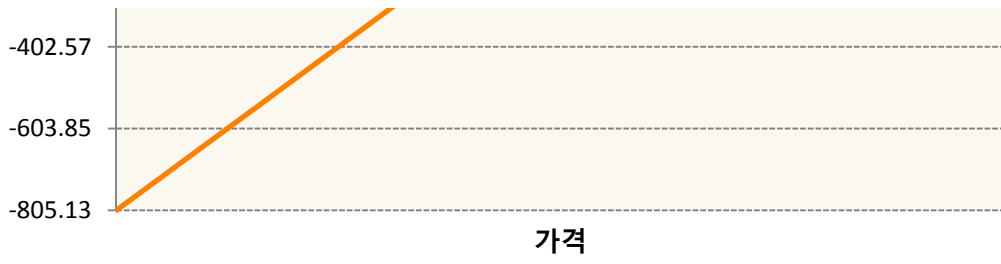
2. 만기시점의 손익구조

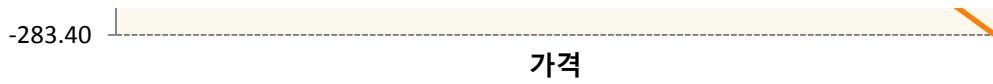
CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19



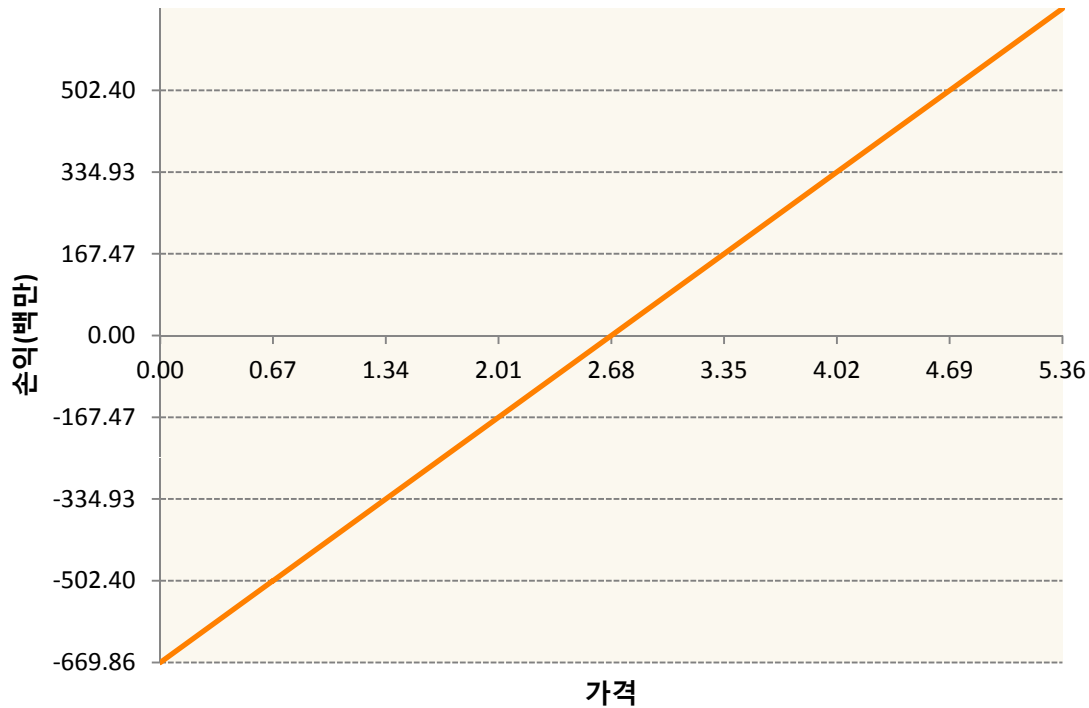
CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19



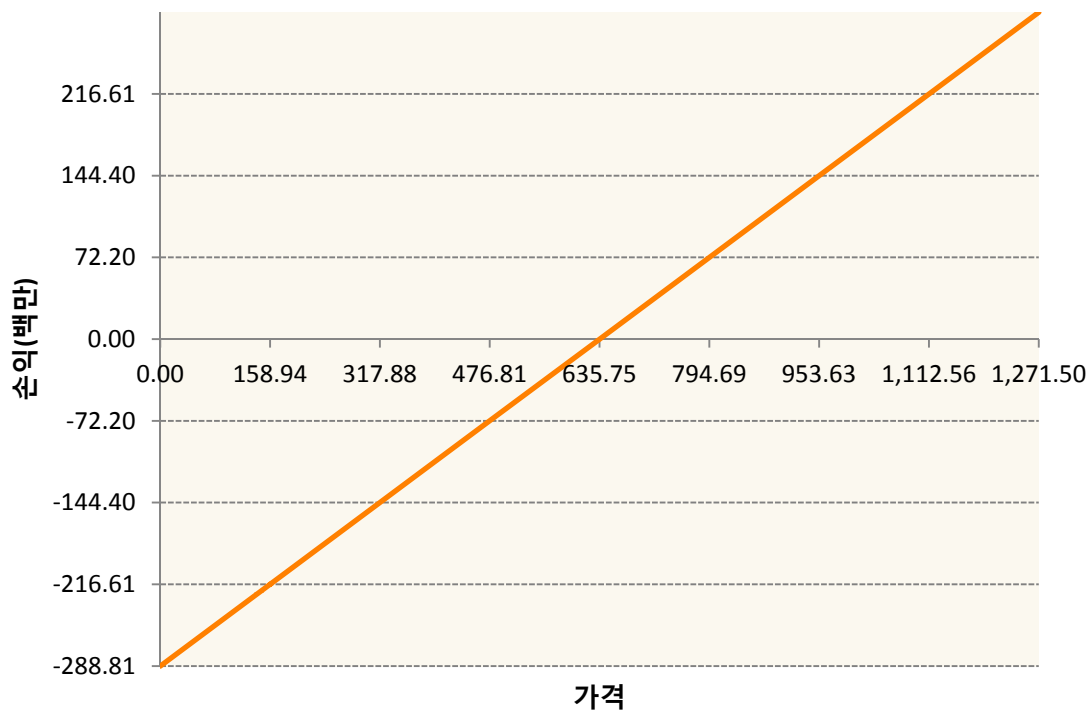




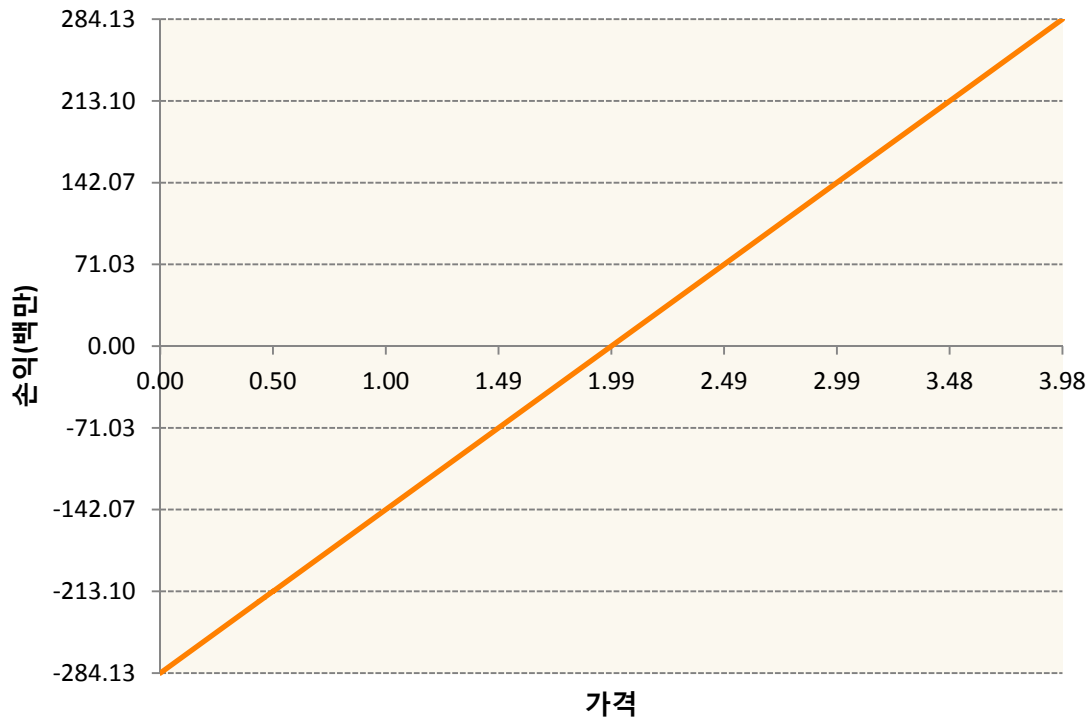
NGN19-NATURAL GAS FUTR Jul19



QSN9-Low Su Gasoil G Jul19



XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN9	WTI CRUDE FUTURE Jul19	58
CON9	BRENT CRUDE FUTR Jul19	64
HON9	NY Harb ULSD Fut Jul19	16
KR4175P500	2019-05 달러선물	23
NGN19	NATURAL GAS FUTR Jul19	54
QSN9	Low Su Gasoil G Jul19	23
XBN9	GASOLINE RBOB FUT Jul19	23

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

441

공시일	2019-04-18
기준일	2019-04-17

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

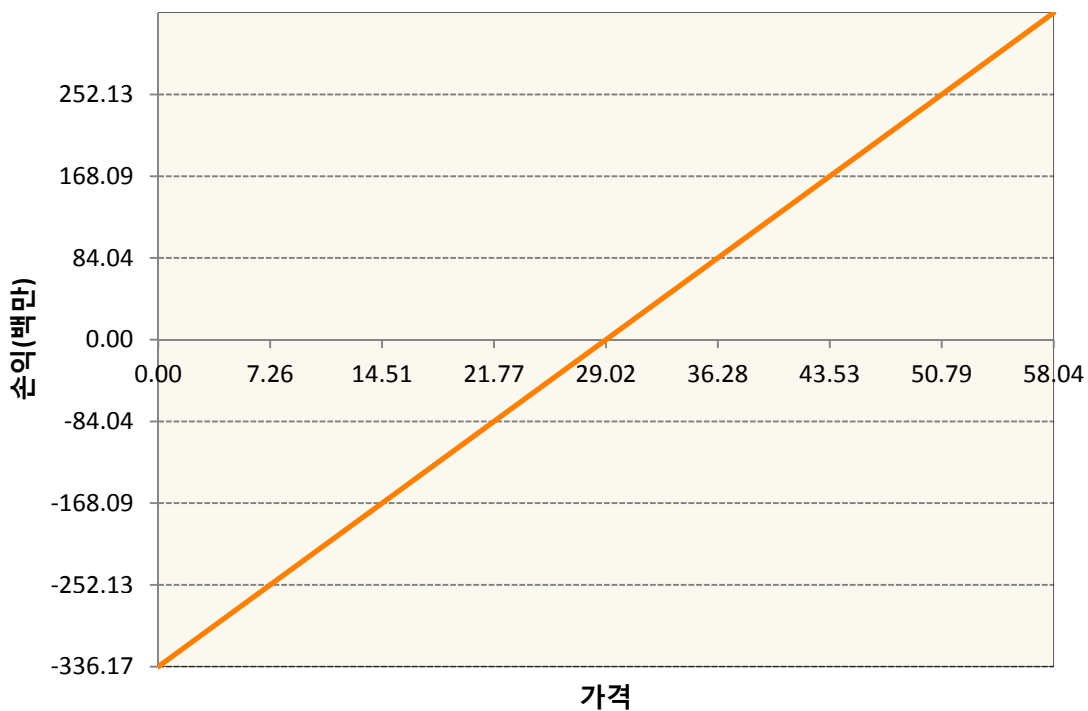
1. 계약금액

(단위:백만원)

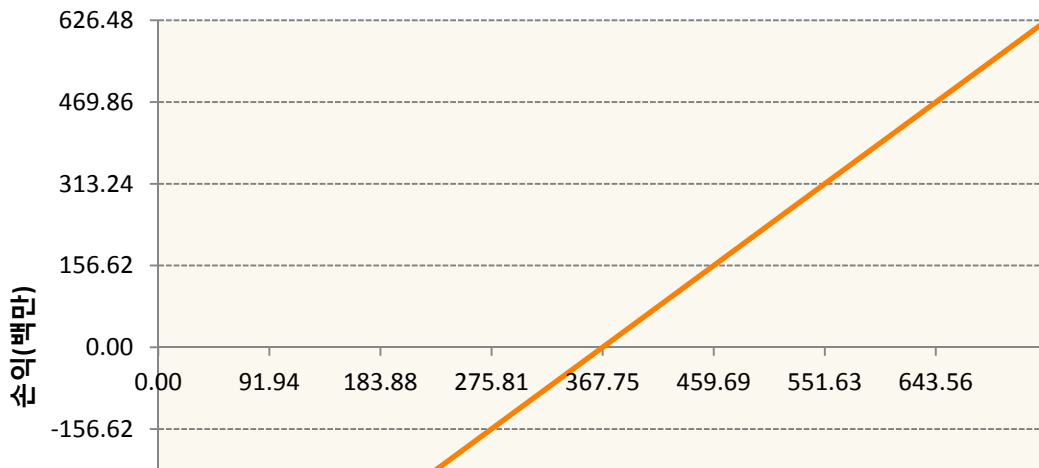
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,212	57	3,155	

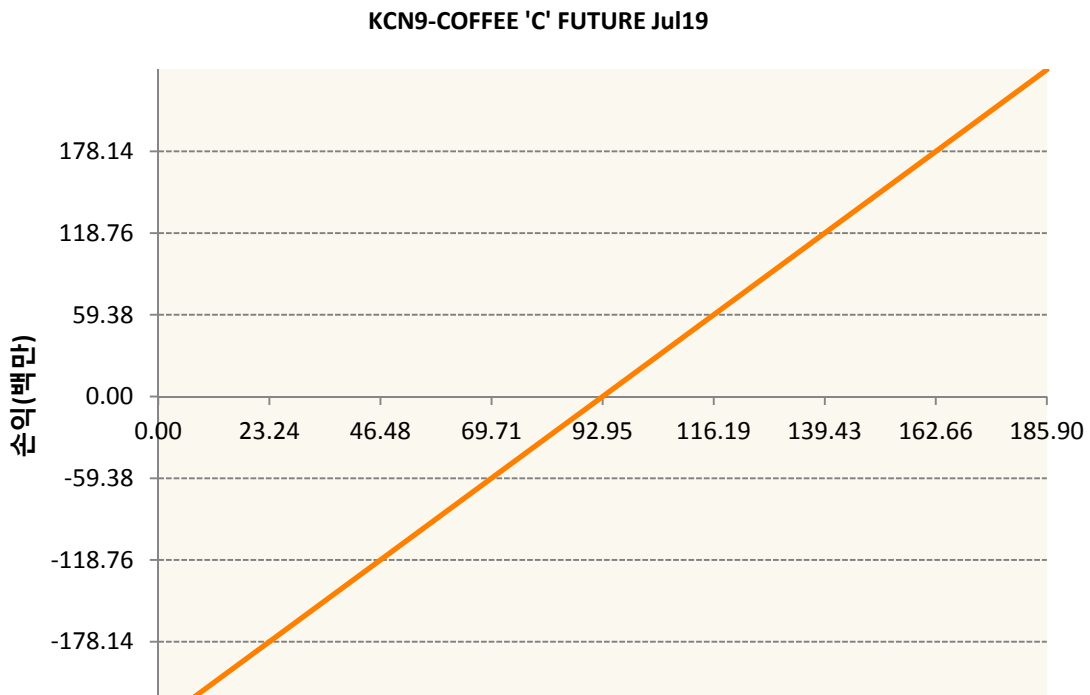
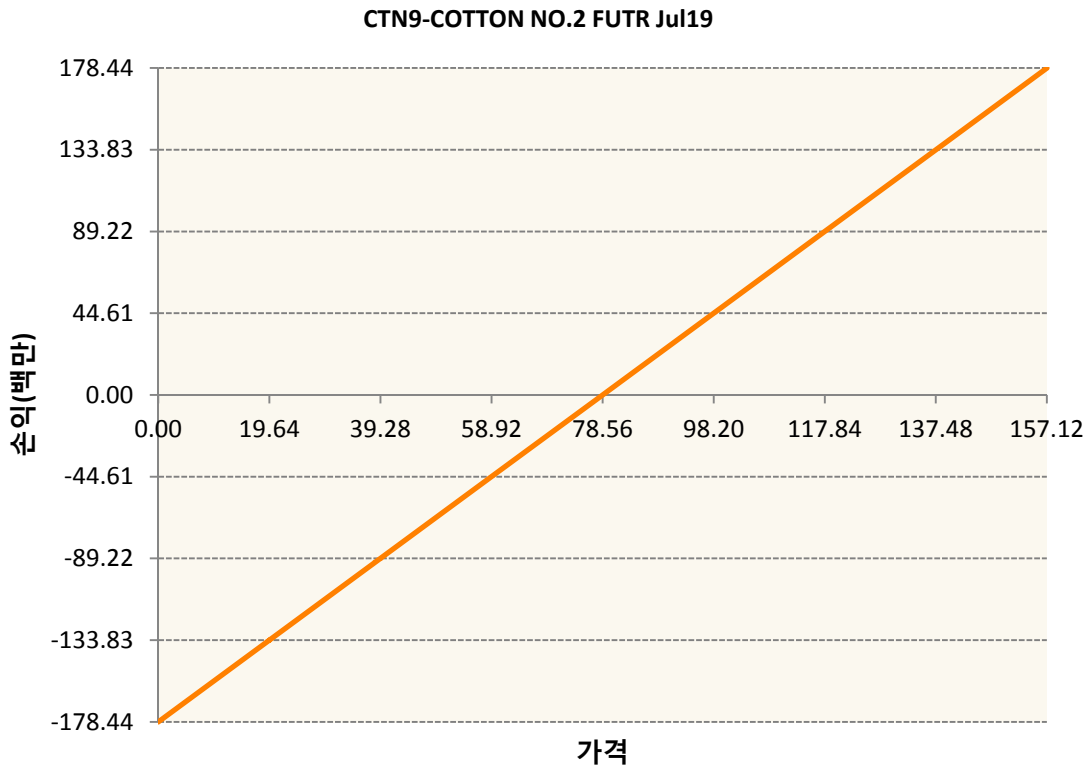
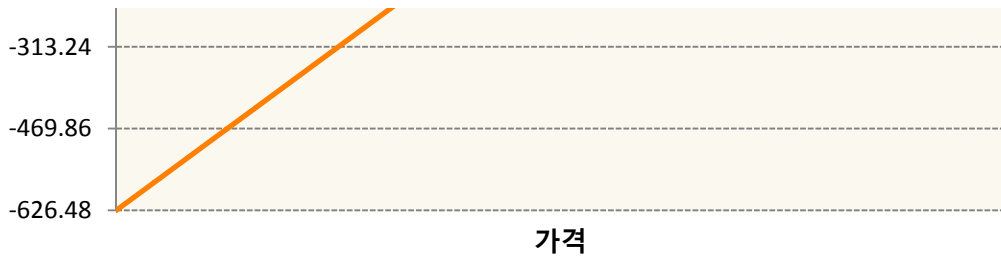
2. 만기시점의 손익구조

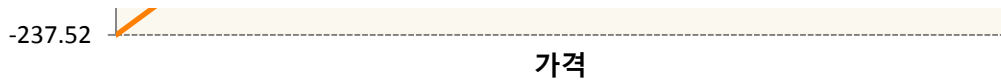
BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19



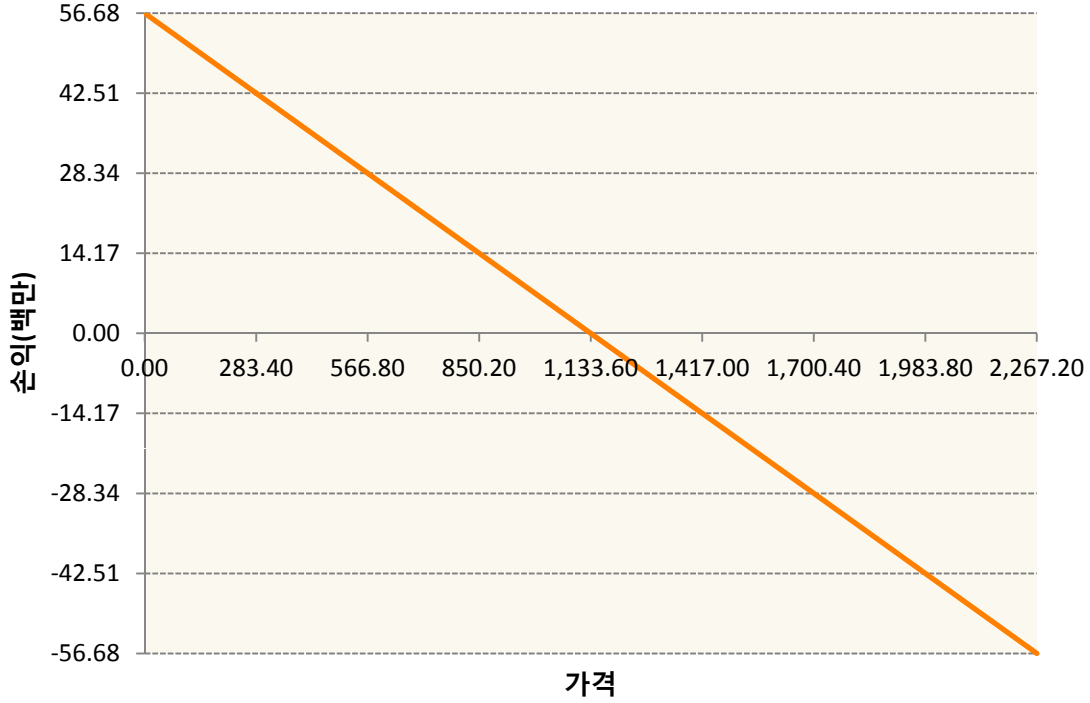
CN9-CORN FUTURE Jul19



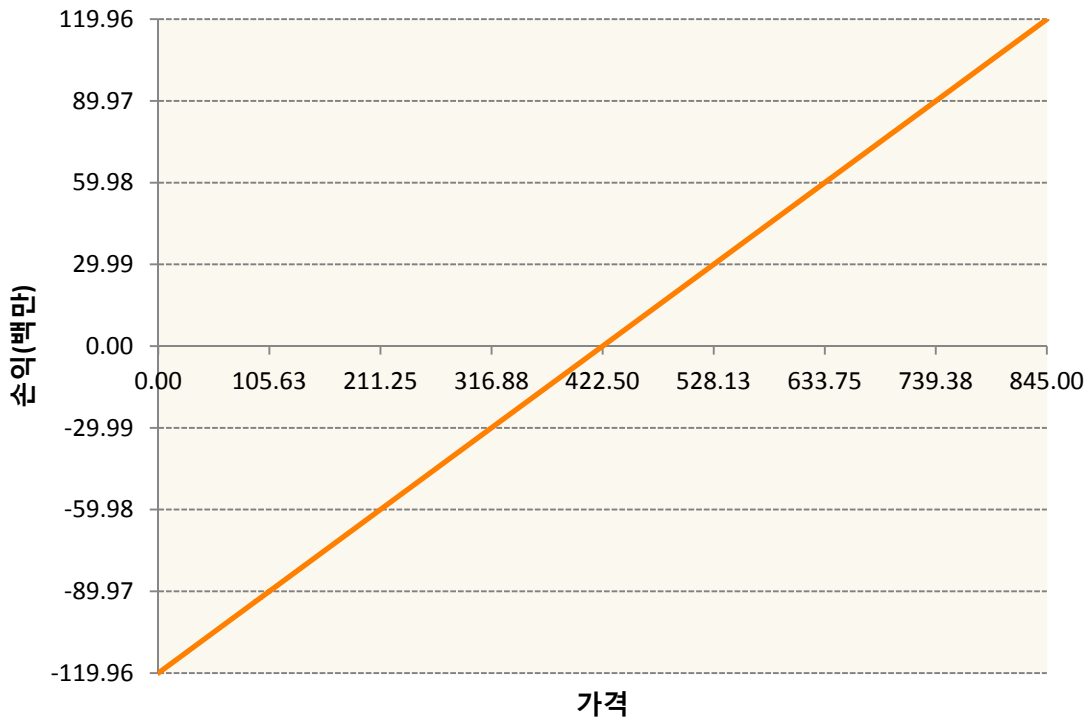




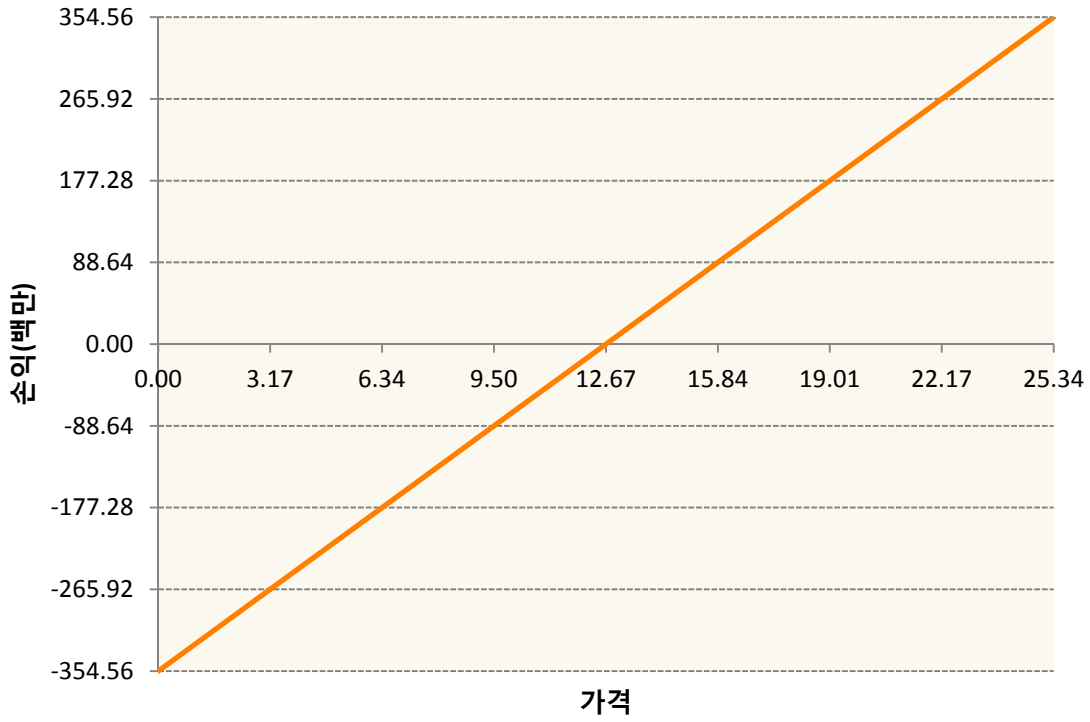
KR4175P50009-2019-05 달러선물



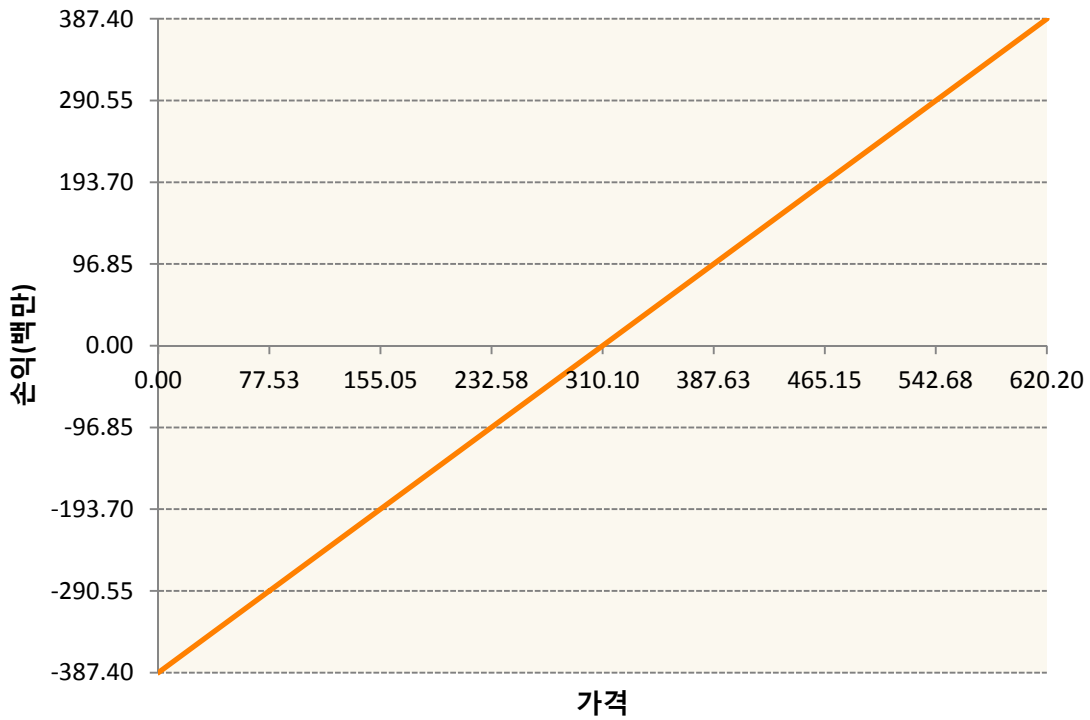
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



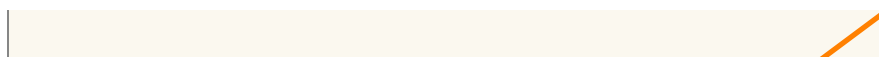
SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

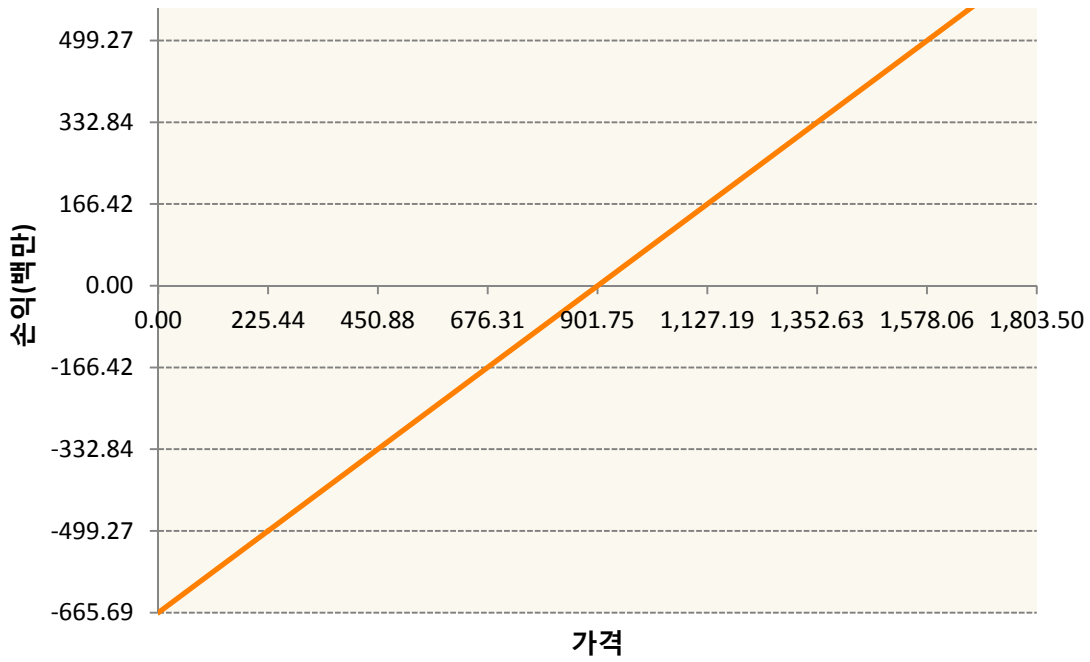


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19

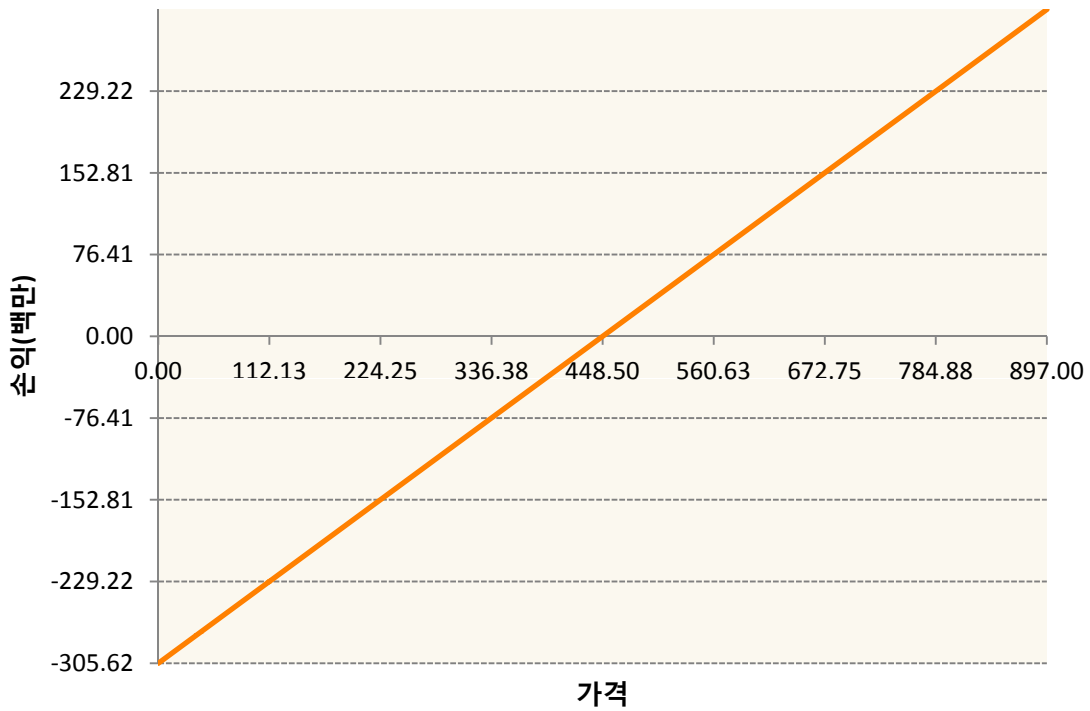


SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





WN9-WHEAT FUTURE(CBT) Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON9	SOYBEAN OIL FUTR Jul19	27
CN9	CORN FUTURE Jul19	50
CTN9	COTTON NO.2 FUTR Jul19	14
KCN9	COFFEE 'C' FUTURE Jul19	19
KR4175P500	2019-05 달러선물	5

KWN9	KC HRW WHEAT FUT Jul19	10
SBN9	SUGAR #11 (WORLD) Jul19	28
SMN9	SOYBEAN MEAL FUTR Jul19	31
SN9	SOYBEAN FUTURE Jul19	53
WN9	WHEAT FUTURE(CBT) Jul19	24

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

(단위:백만원)

258