

공시일	2019-06-04
기준일	2019-06-03

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)

91

공시일	2019-06-04
기준일	2019-06-03

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	14,160	0	14,160	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S190522

1,095

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

658

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-04
기준일	2019-06-03

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)	294
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	81
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	138

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

861

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-04
기준일	2019-06-03

유로인덱스모(주식-파생형)

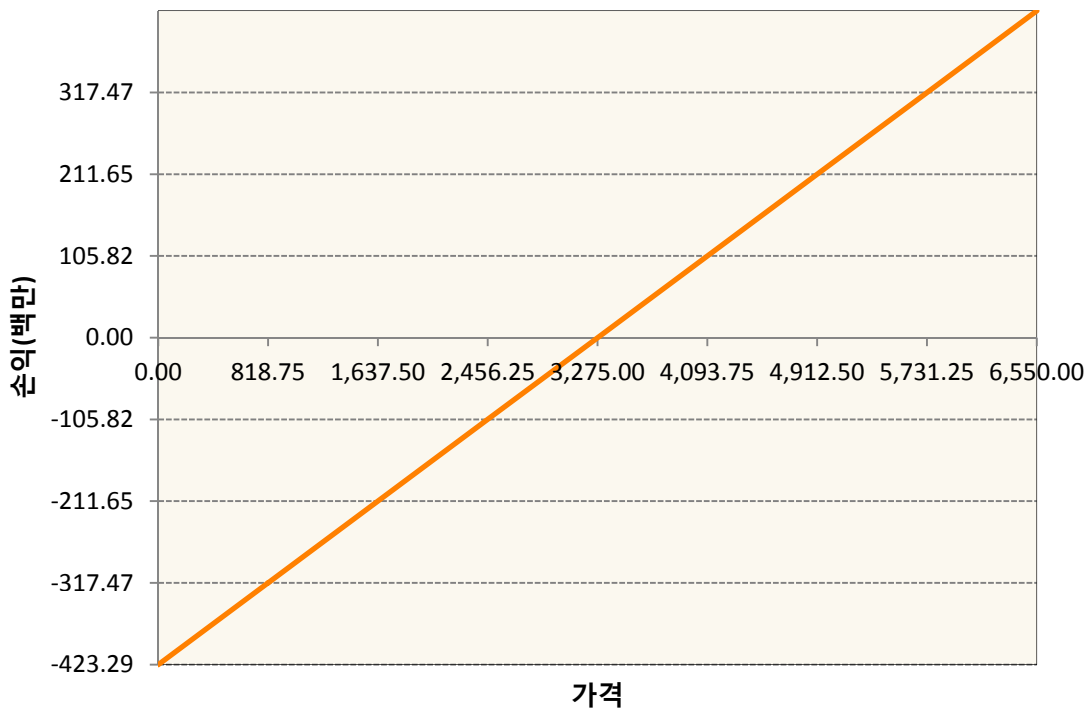
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	423	0	423	

2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	34
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

25

공시일	2019-06-04
기준일	2019-06-03

차이나인덱스모(주식-파생형)

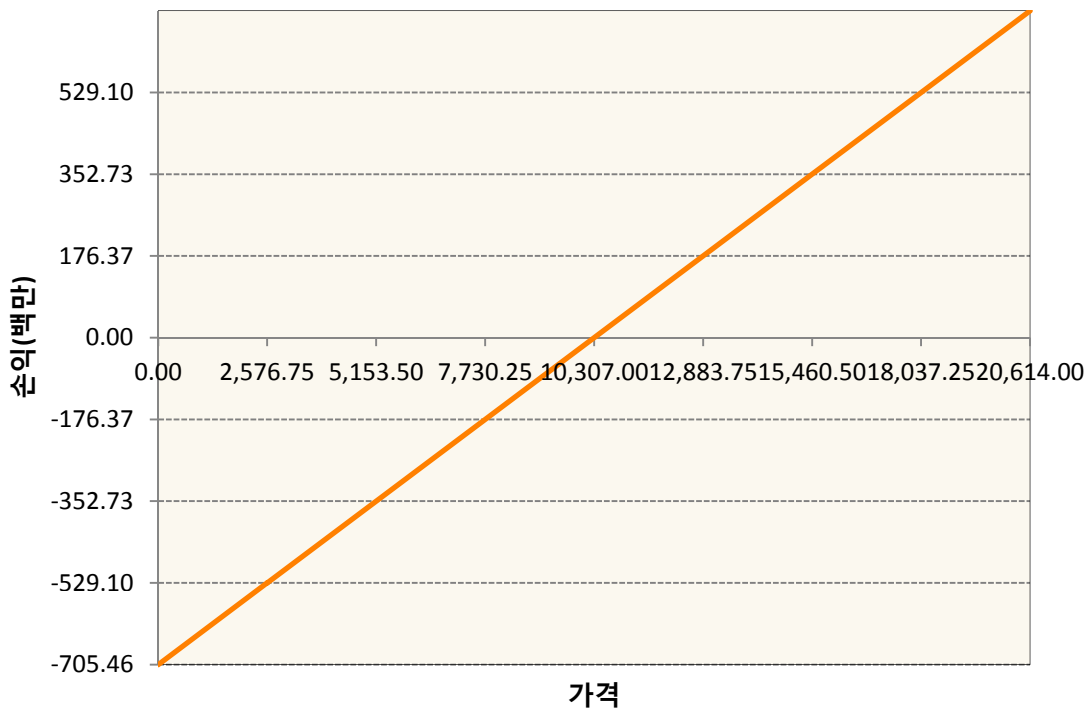
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	705	0	705	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM9	HSCEI Futures Jun19	56
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

58

공시일	2019-06-04
기준일	2019-06-03

커버드콜모(주식혼합-파생형)

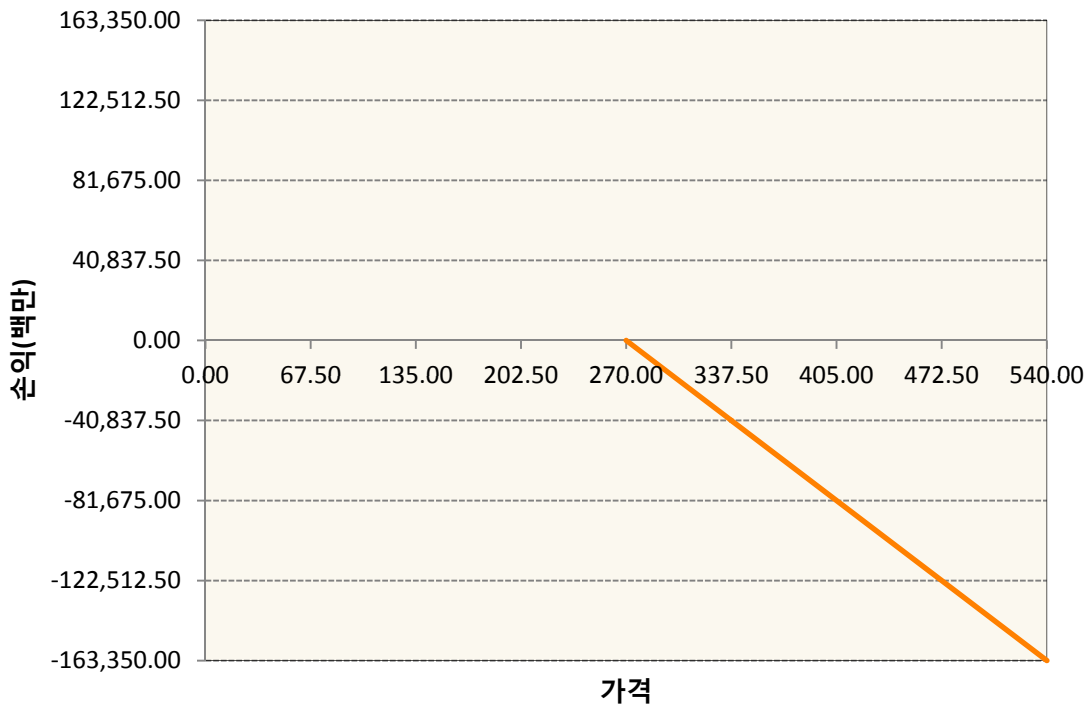
1. 계약금액

(단위:백만원)

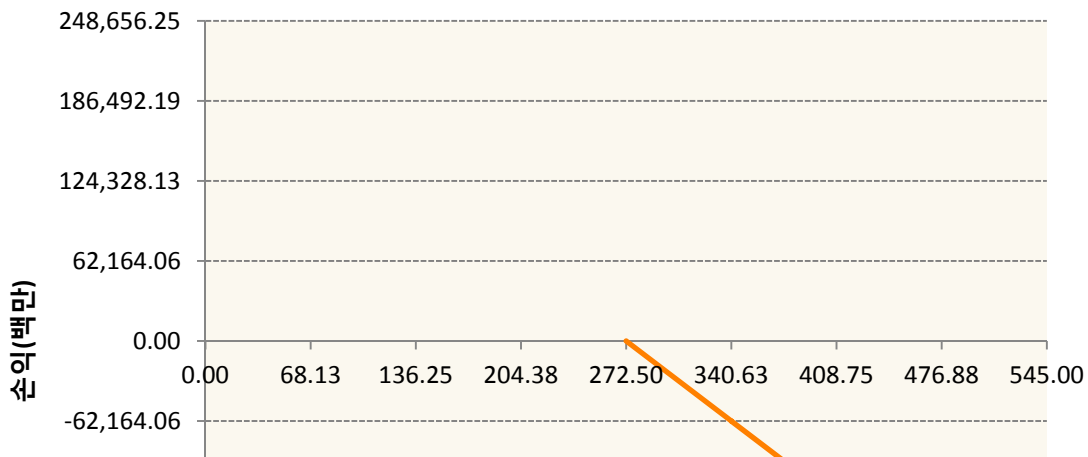
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	614,506	-614,506	장내

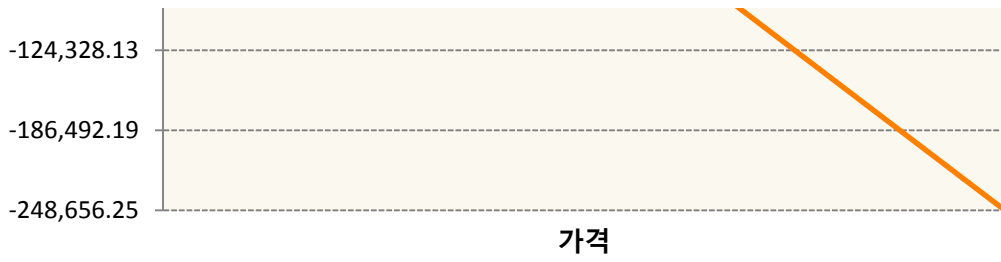
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P62701-2019-06 콜270



KR4201P62727-2019-06 콜272.5





KR4301P62709-2019-06 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201P62701		2019-06 콜270					9,991
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,222	2,216	2,204	2,185	2,158	2,121	2,073
-5.33%	2,175	2,133	2,077	2,006	1,921	1,824	1,716
-2.67%	1,851	1,715	1,566	1,406	1,237	1,060	878
0%	678	453	227	0	-227	-455	-683
2.67%	-1,830	-2,028	-2,232	-2,441	-2,653	-2,869	-3,086
5.33%	-5,462	-5,559	-5,674	-5,803	-5,944	-6,096	-6,258
8.00%	-9,619	-9,647	-9,688	-9,744	-9,813	-9,895	-9,991
KR4201P62727		2019-06 콜272.5					13,927
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,480	2,475	2,466	2,449	2,422	2,383	2,332

-5.33%	2,447	2,410	2,355	2,281	2,187	2,074	1,943
-2.67%	2,168	2,018	1,843	1,647	1,434	1,205	964
0%	949	639	322	0	-326	-655	-987
2.67%	-2,107	-2,445	-2,786	-3,129	-3,474	-3,820	-4,167
5.33%	-7,078	-7,282	-7,509	-7,753	-8,012	-8,283	-8,565
8.00%	-13,153	-13,224	-13,321	-13,441	-13,583	-13,746	-13,927
KR4301P62709 2019-06 풋270							14,431
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,418	-14,418	-14,418	-14,419	-14,421	-14,424	-14,431
-5.33%	-9,061	-9,065	-9,074	-9,089	-9,111	-9,140	-9,178
-2.67%	-3,801	-3,862	-3,937	-4,025	-4,123	-4,231	-4,348
0%	553	370	186	0	-187	-374	-562
2.67%	2,645	2,509	2,364	2,212	2,054	1,891	1,724
5.33%	3,060	3,032	2,993	2,941	2,877	2,802	2,717
8.00%	3,089	3,088	3,083	3,076	3,063	3,044	3,017

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

(단위:백만원)

41,583

공시일	2019-06-04
기준일	2019-06-03

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

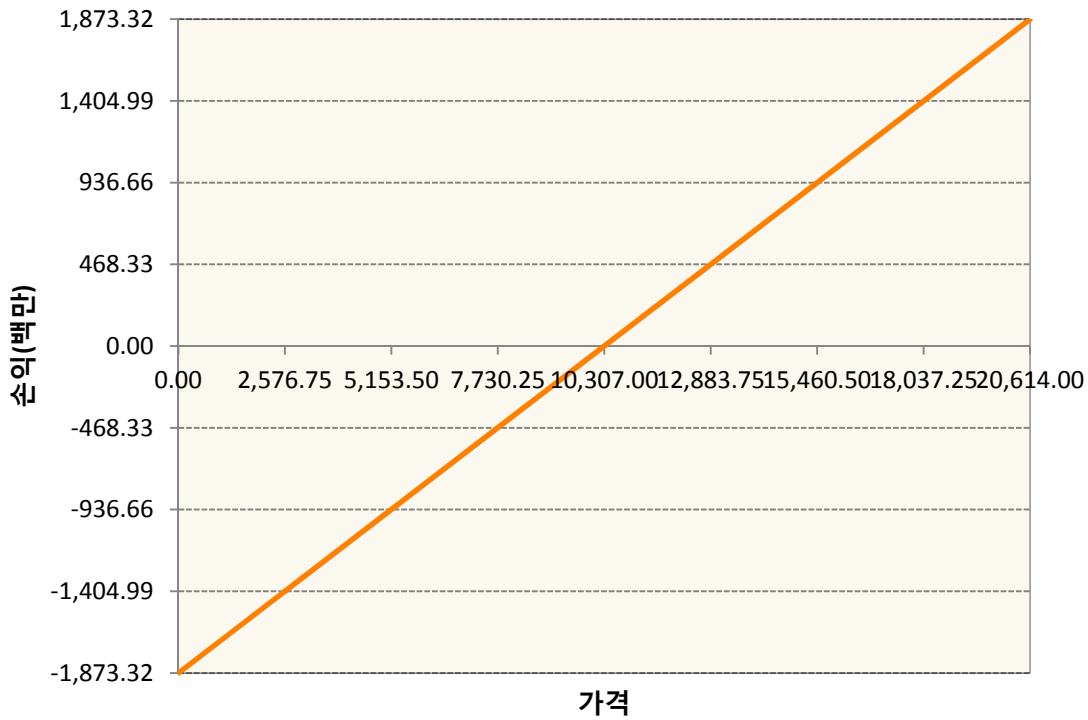
1. 계약금액

(단위:백만원)

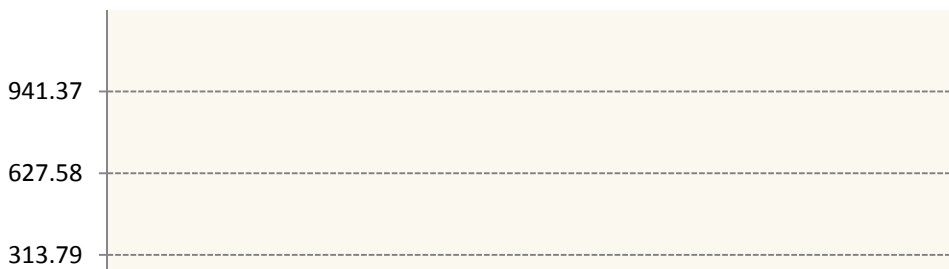
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,873	0	1,873	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,045	-5,045	장내
누계	통화	선도	151	3,168	-3,017	장외

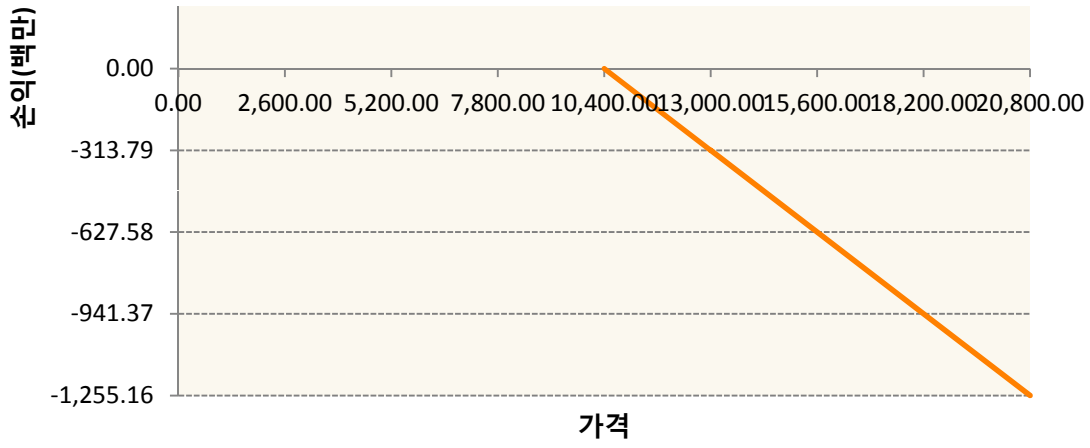
2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19

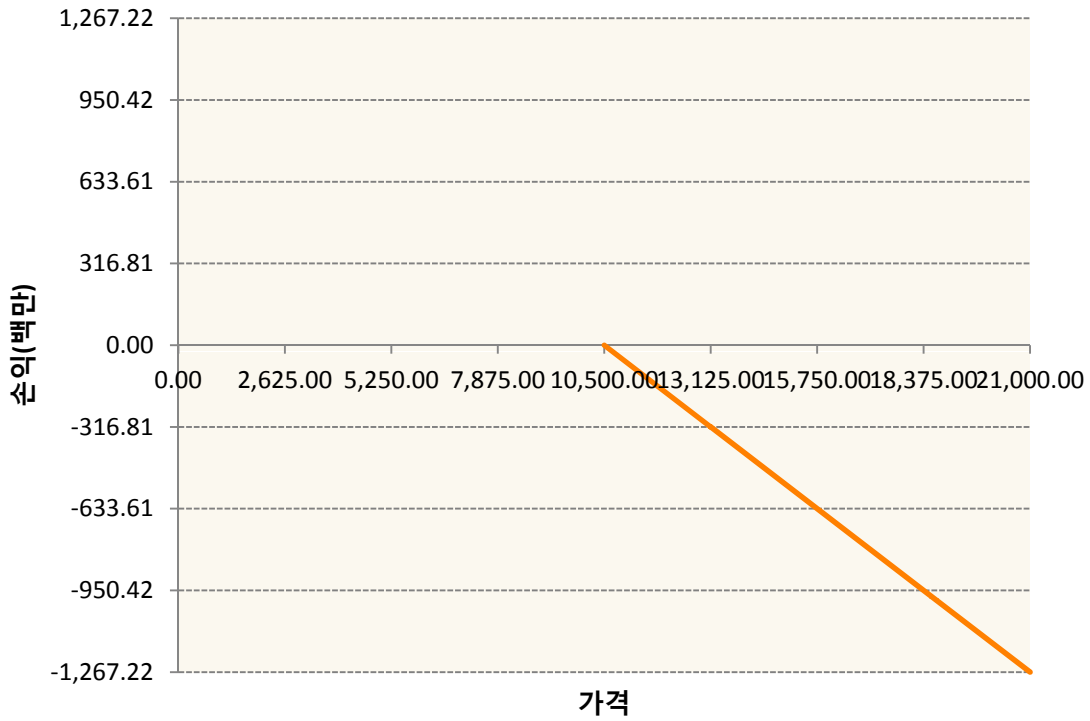


OHHIM9-C104-HSCEI

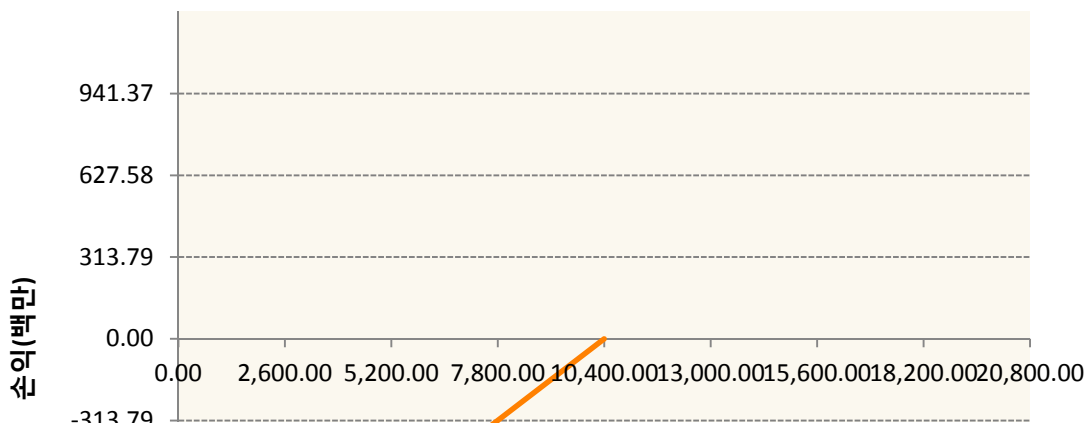


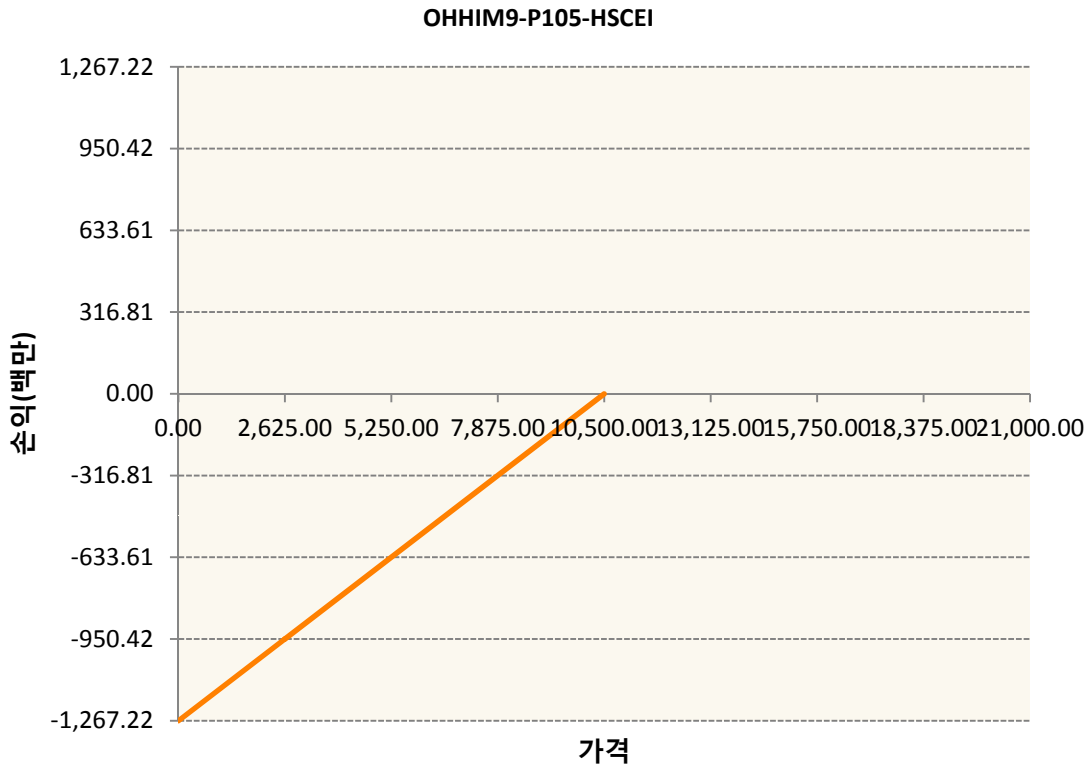


OHHIM9-C105-HSCEI



OHHIM9-P104-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	253
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E	12
HCM9 HSCEI Futures Jun19	150
OHHIM9-C1 HSCEI	100
OHHIM9-C1 HSCEI	101
OHHIM9-P1 HSCEI	100
OHHIM9-P1 HSCEI	101

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	652

공시일	2019-06-04
기준일	2019-06-03

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

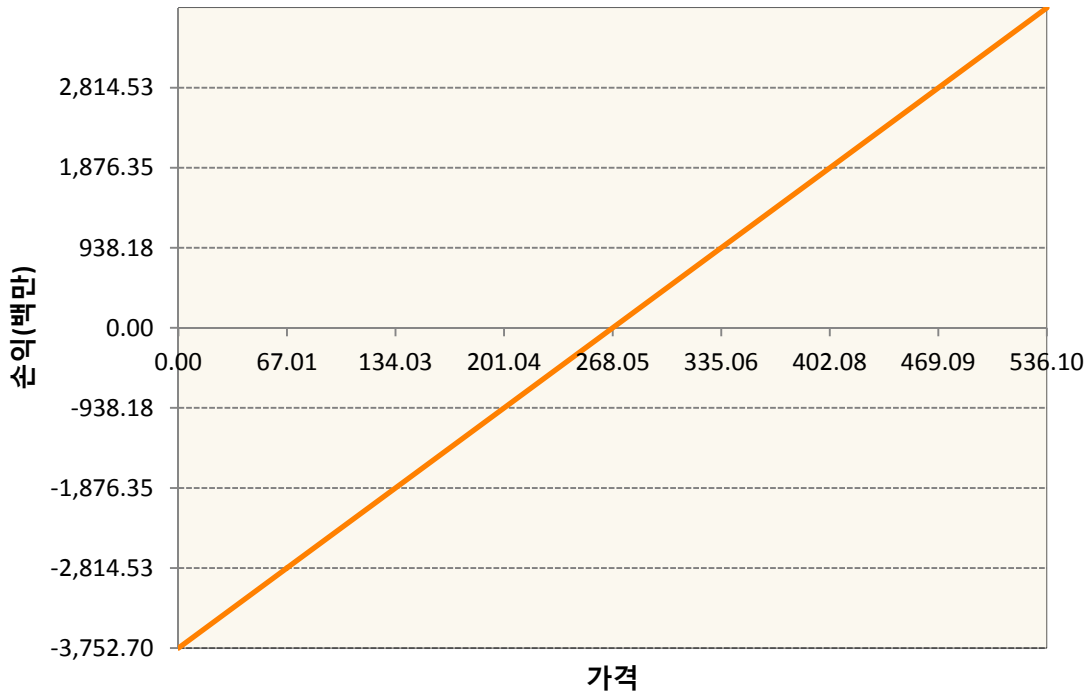
1. 계약금액

(단위:백만원)

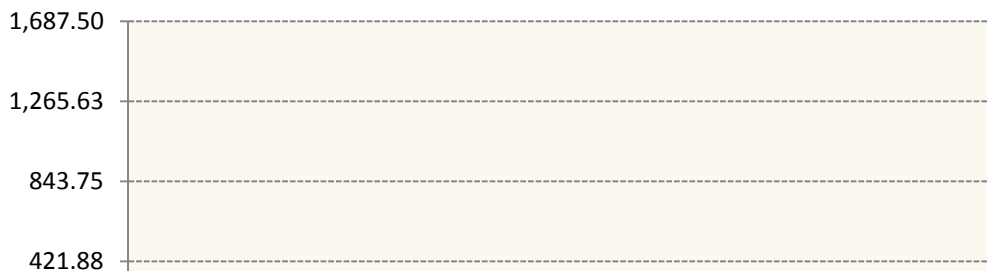
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,753	0	3,753	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	21,759	-21,759	장내

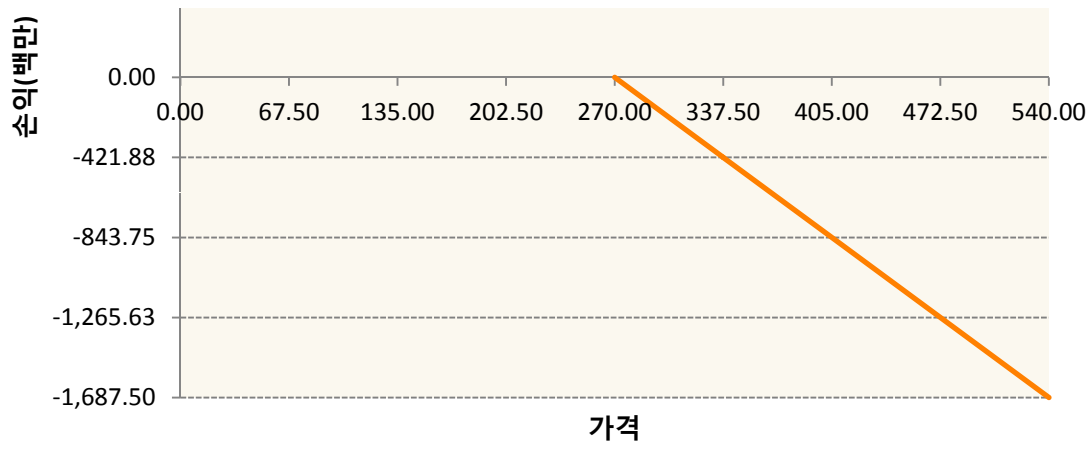
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

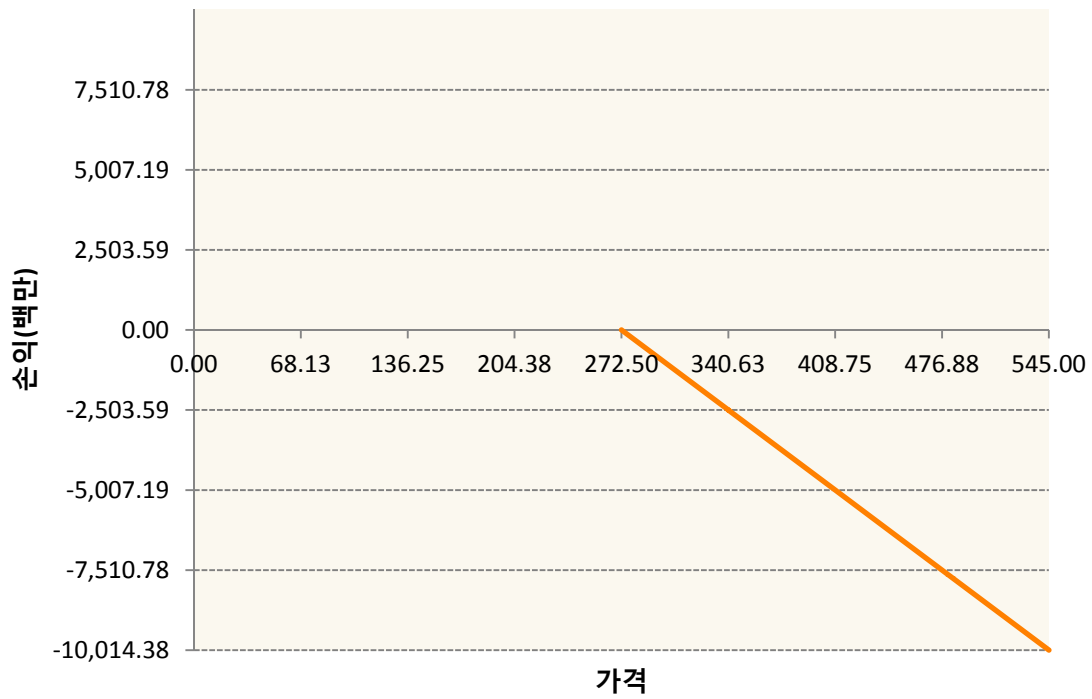


KR4201P62701-2019-06 콜270

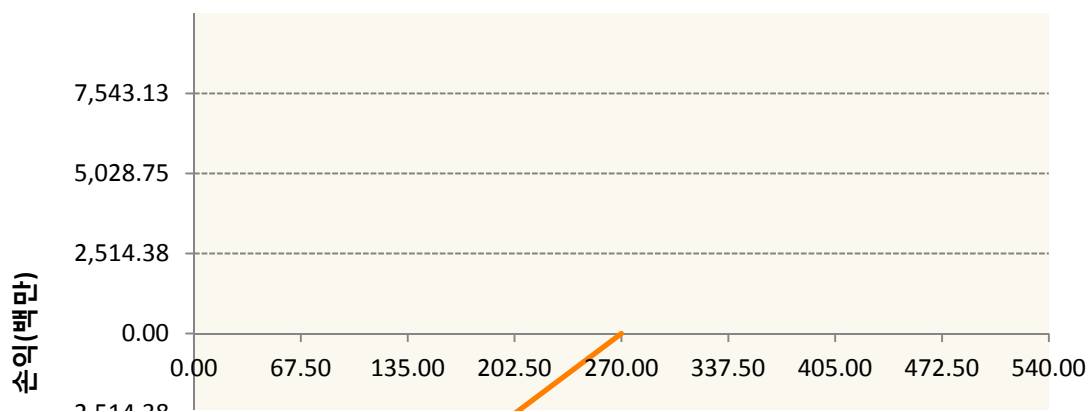


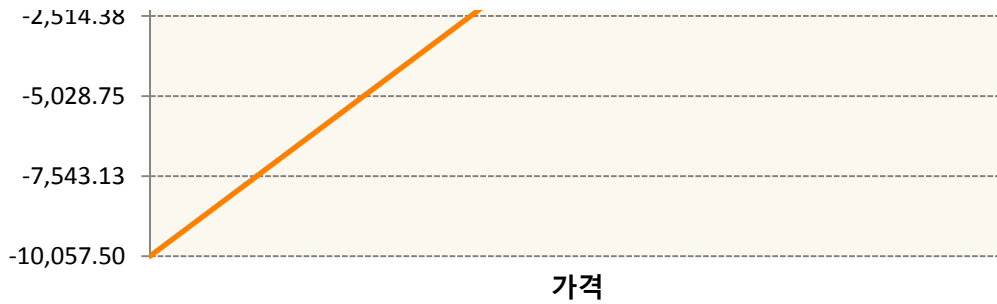


KR4201P62727-2019-06 콜272.5



KR4301P62709-2019-06 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,191
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,191	-1,191	-1,191	-1,191	-1,191	-1,191	-1,191	
-5.33%	-794	-794	-794	-794	-794	-794	-794	
-2.67%	-397	-397	-397	-397	-397	-397	-397	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	397	397	397	397	397	397	397	
5.33%	794	794	794	794	794	794	794	
8.00%	1,191	1,191	1,191	1,191	1,191	1,191	1,191	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						603
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-603	-603	-603	-603	-603	-603	-603	
-5.33%	-402	-402	-402	-402	-402	-402	-402	
-2.67%	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-201	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	201	201	201	201	201	201	201	
5.33%	402	402	402	402	402	402	402	
8.00%	603	603	603	603	603	603	603	
KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						300
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-300	-300	-300	-300	-300	-300	-300	
-5.33%	-200	-200	-200	-200	-200	-200	-200	
-2.67%	-100	-100	-100	-100	-100	-100	-100	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	100	100	100	100	100	100	100	
5.33%	200	200	200	200	200	200	200	
8.00%	300	300	300	300	300	300	300	
KR4201P62701		2019-06 콜270						103
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	23	23	23	23	22	22	21
-5.33%	22	22	21	21	20	19	18
-2.67%	19	18	16	15	13	11	9
0%	7	5	2	0	-2	-5	-7
2.67%	-19	-21	-23	-25	-27	-30	-32
5.33%	-56	-57	-59	-60	-61	-63	-65
8.00%	-99	-100	-100	-101	-101	-102	-103

KR4201P62727 2019-06 콜272.5 561

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	100	100	99	99	98	96	94
-5.33%	99	97	95	92	88	84	78
-2.67%	87	81	74	66	58	49	39
0%	38	26	13	0	-13	-26	-40
2.67%	-85	-98	-112	-126	-140	-154	-168
5.33%	-285	-293	-302	-312	-323	-334	-345
8.00%	-530	-533	-536	-541	-547	-554	-561

KR4301P62709 2019-06 풋270 717

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-716	-716	-716	-716	-716	-716	-717
-5.33%	-450	-450	-451	-451	-452	-454	-456
-2.67%	-189	-192	-196	-200	-205	-210	-216
0%	27	18	9	0	-9	-19	-28
2.67%	131	125	117	110	102	94	86
5.33%	152	151	149	146	143	139	135
8.00%	153	153	153	153	152	151	150

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

(단위:백만원)

3,576

공시일	2019-06-04
기준일	2019-06-03

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

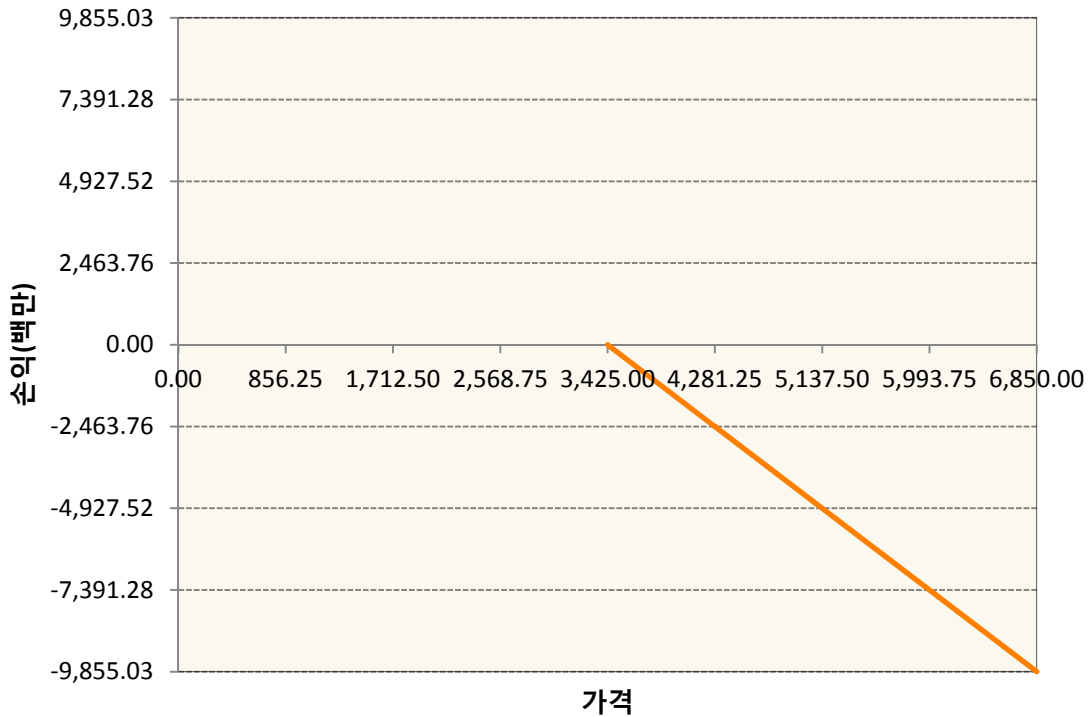
1. 계약금액

(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	3,580	0	3,580	
누계	유가증권	스왑	55,869	0	55,869	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,257	-20,257	장내
누계	통화	선도	0	18,478	-18,478	장외

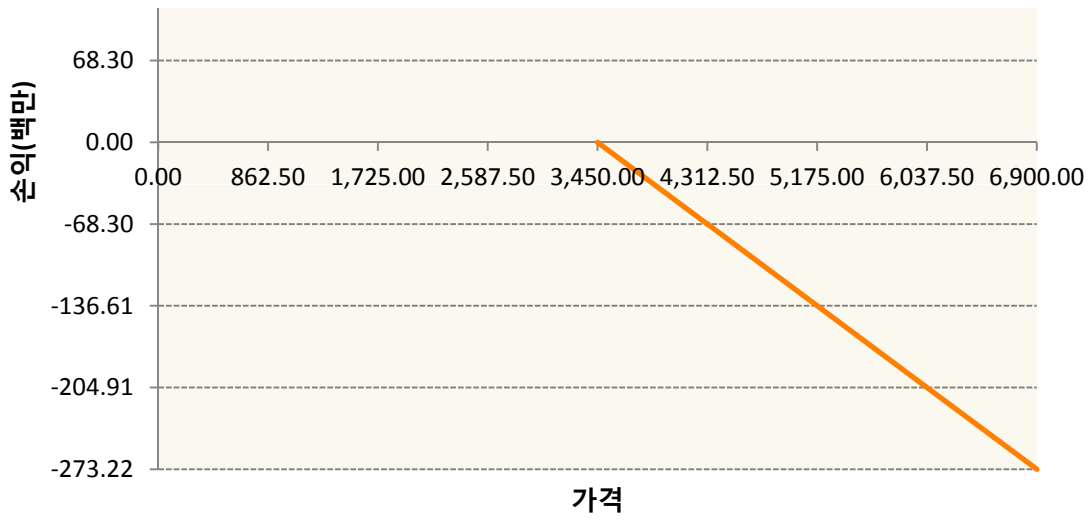
2. 만기시점의 손익구조

OESXM9-C3425-EURO STOXX 50

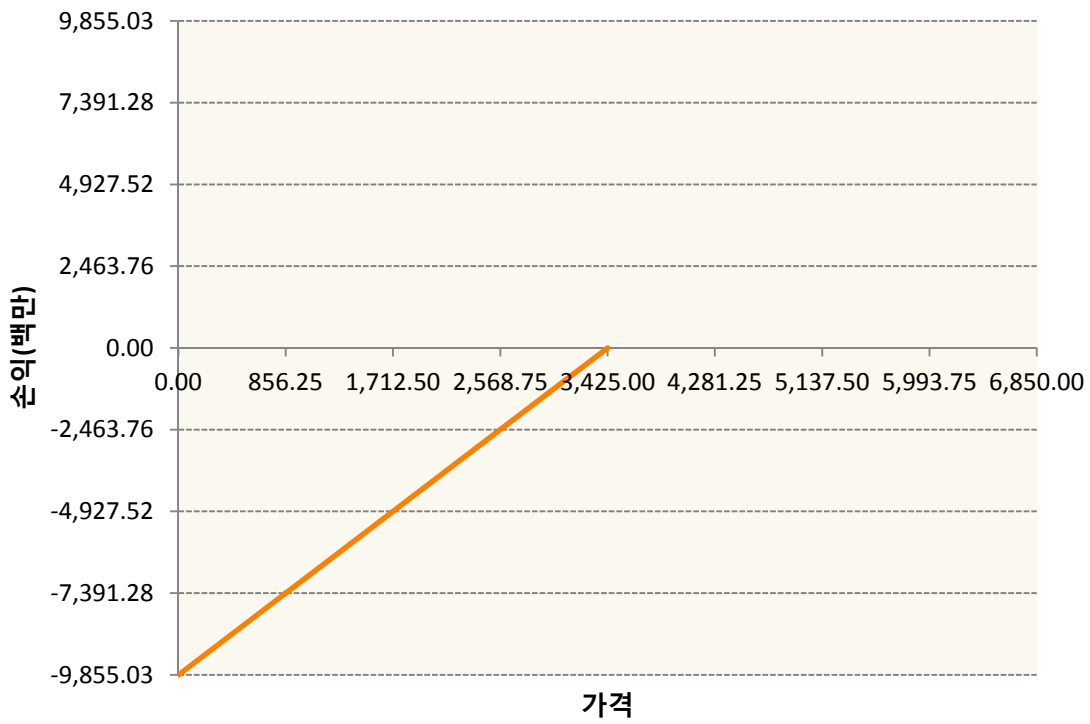


OESXM9-C3450-EURO STOXX 50

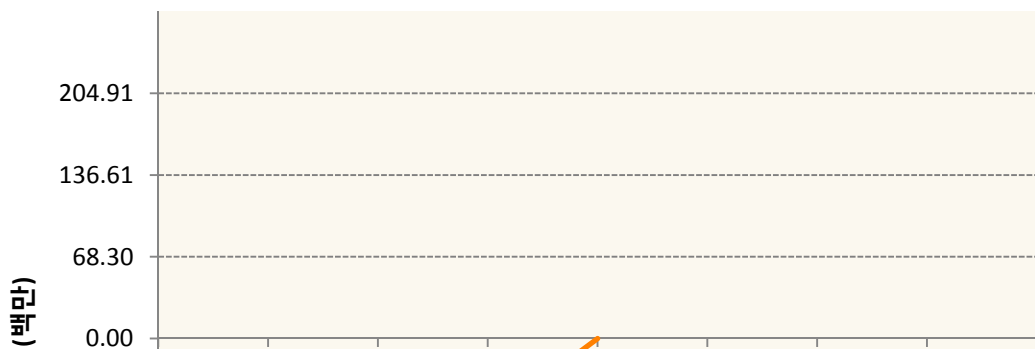


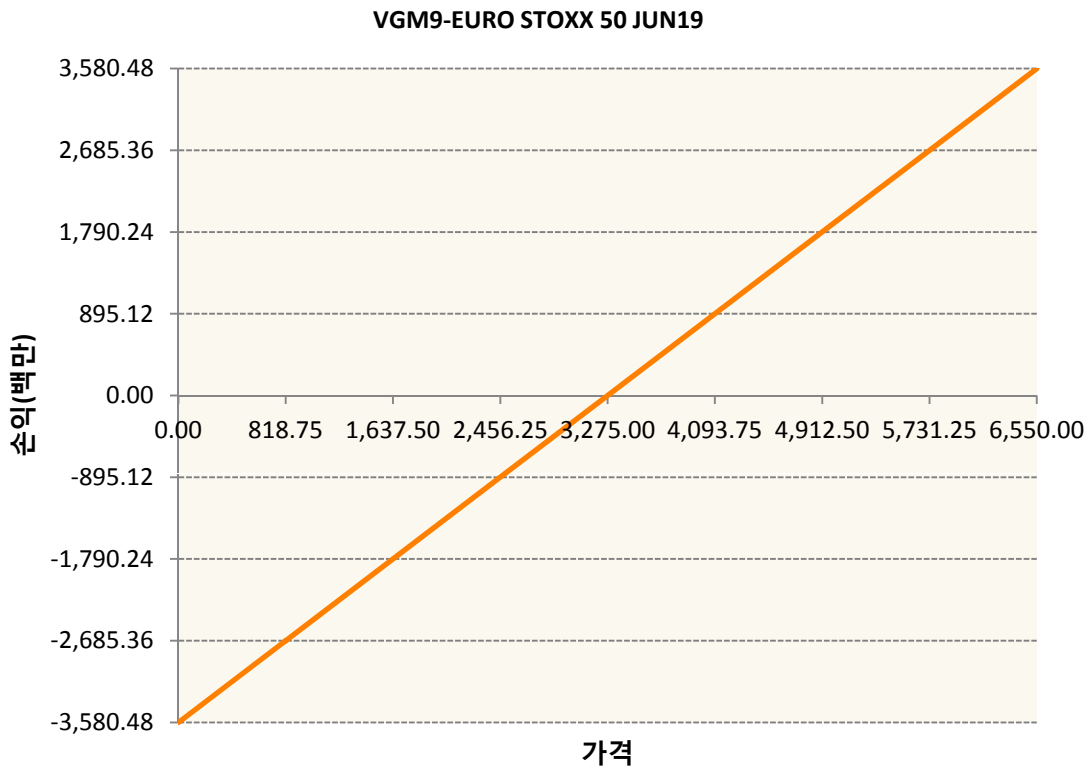
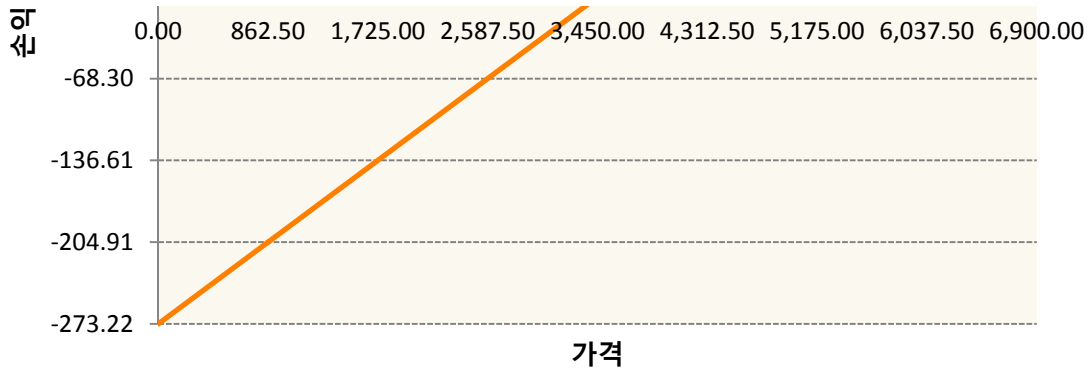


OESXM9-P3425-EURO STOXX 50



OESXM9-P3450-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	147
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	845
FX21019J01: KRW/EUR 28-06-19E	211
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	422
OESXM9-C3·EURO STOXX 50	788
OESXM9-C3·EURO STOXX 50	22
OESXM9-P3·EURO STOXX 50	788
OESXM9-P3·EURO STOXX 50	22
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	286

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

(단위:백만원)

2,278

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

(단위:백만원)

1,034

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

(단위:백만원)

91

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

(단위:백만원)

133

공시일	2019-06-04
기준일	2019-06-03

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

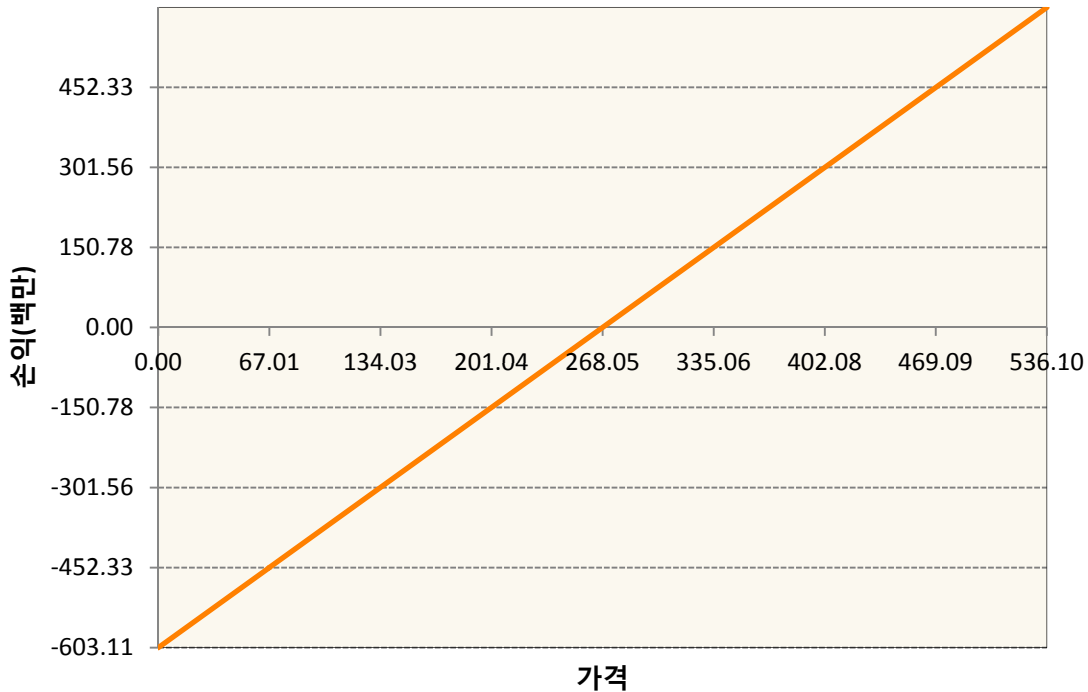
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	603	0	603	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						48
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48	
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	16	16	16	16	16	16	16	
5.33%	32	32	32	32	32	32	32	
8.00%	48	48	48	48	48	48	48	

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-06-04
기준일	2019-06-03

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

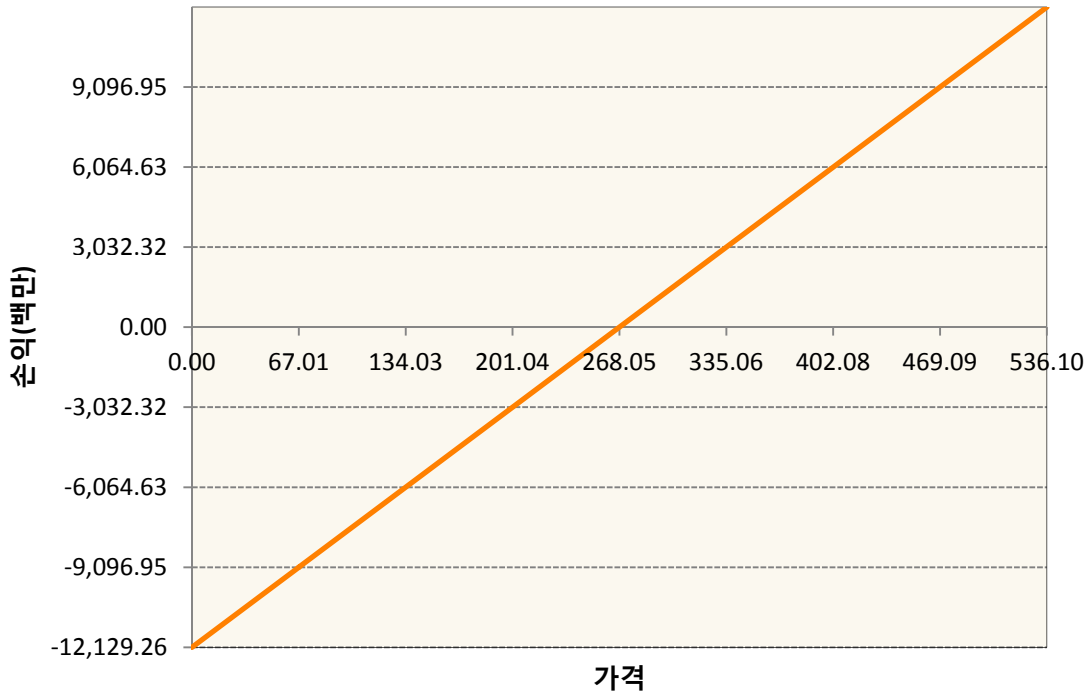
1. 계약금액

(단위:백만원)

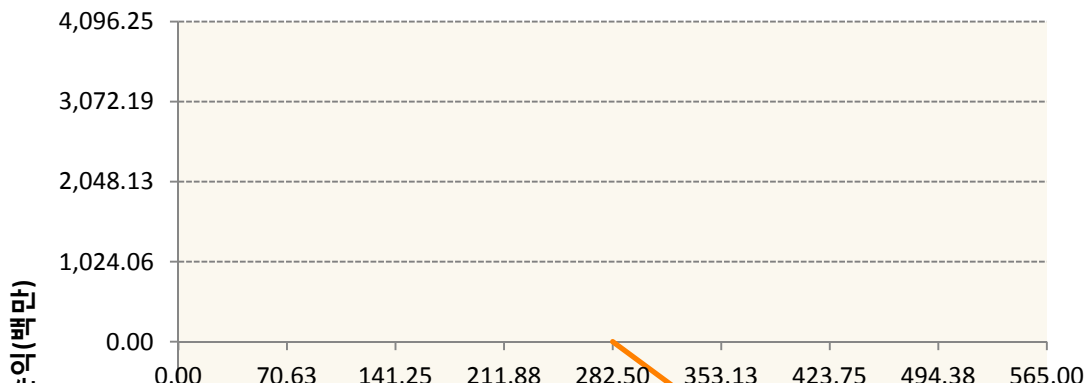
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,129	0	12,129	장내
누계	유가증권	옵션	5,081	22,906	-17,825	장내

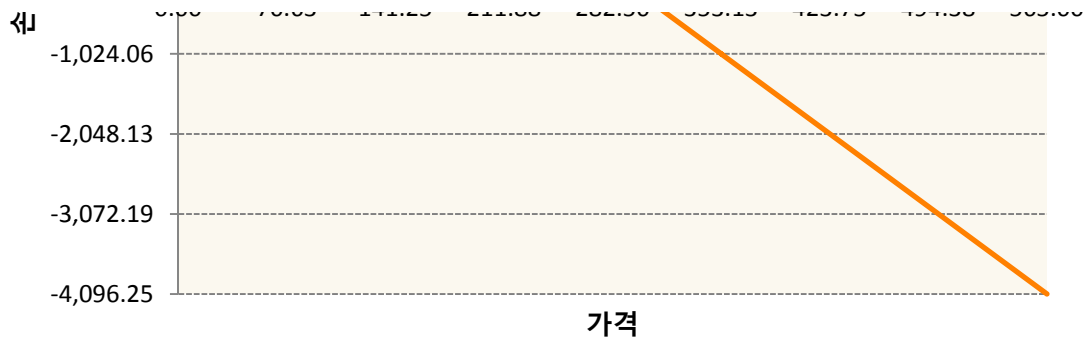
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

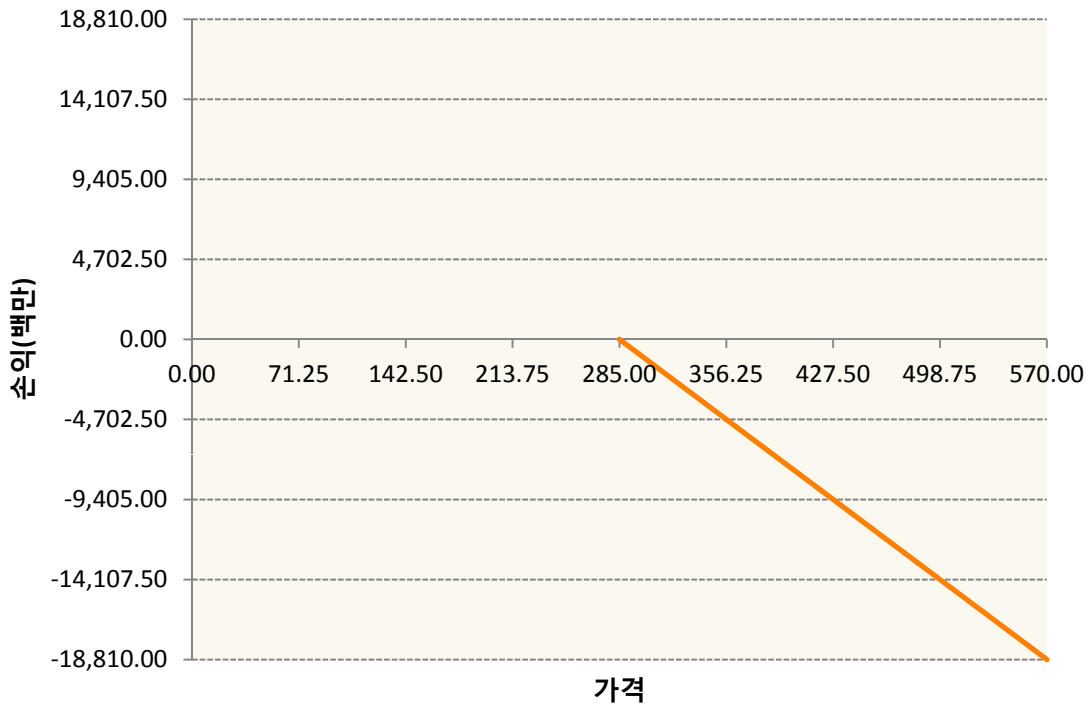


KR4201P62826-2019-06 콜282.5

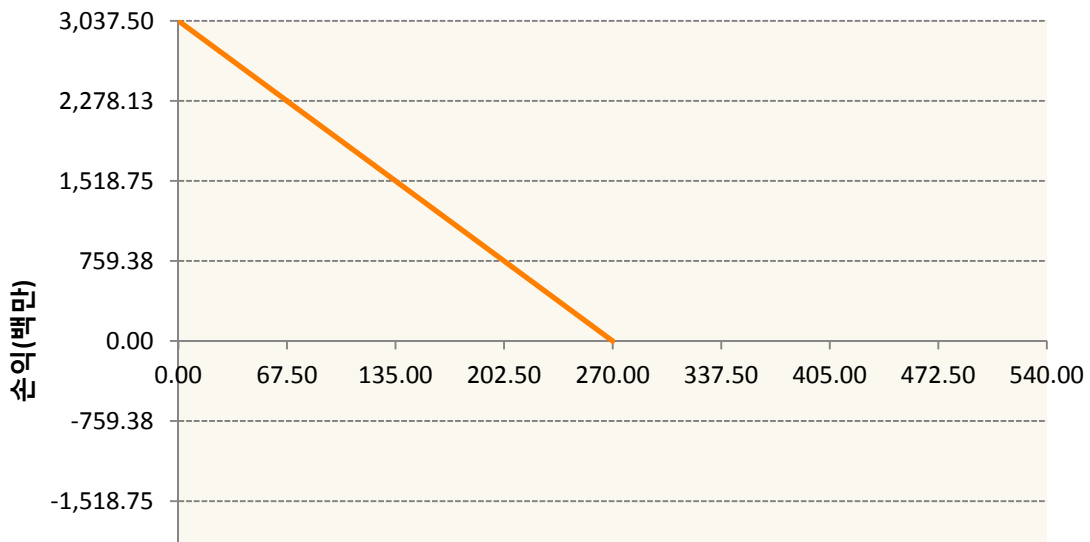


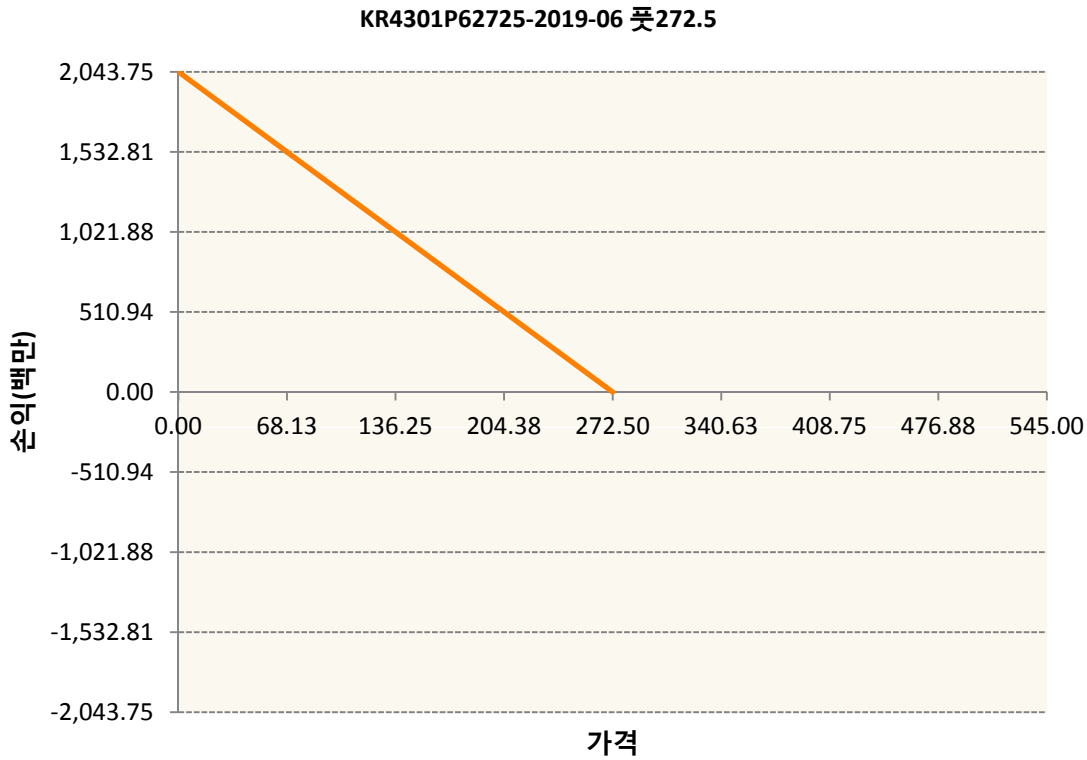
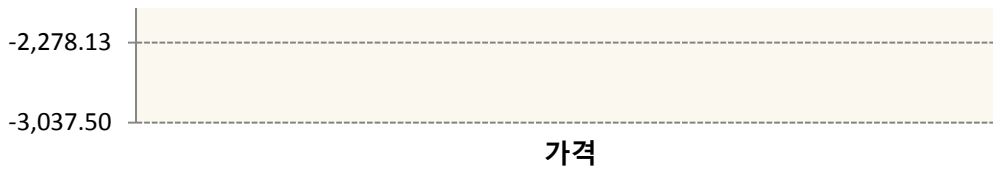


KR4201P62859-2019-06 콜285



KR4301P62709-2019-06 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						971
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-971	-971	-971	-971	-971	-971	-971	
-5.33%	-647	-647	-647	-647	-647	-647	-647	
-2.67%	-324	-324	-324	-324	-324	-324	-324	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	324	324	324	324	324	324	324	
5.33%	647	647	647	647	647	647	647	
8.00%	971	971	971	971	971	971	971	
KR4201P62826		2019-06 콜282.5						139
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	9	9	9	9	9	9	9	
-5.33%	9	9	9	9	8	8	7	
-2.67%	9	8	8	7	6	4	3	

0%	6	5	2	0	-3	-6	-9
2.67%	-6	-10	-15	-20	-24	-29	-34
5.33%	-42	-48	-54	-60	-66	-71	-77
8.00%	-110	-114	-119	-124	-129	-134	-139
KR4201P62859 2019-06 콜285							544
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	26	26	26	26	26	26	25
-5.33%	26	26	26	26	25	23	21
-2.67%	26	25	23	21	17	13	7
0%	20	15	8	0	-10	-21	-34
2.67%	-15	-30	-47	-65	-85	-105	-125
5.33%	-136	-161	-187	-213	-239	-265	-291
8.00%	-394	-418	-442	-467	-493	-518	-544
KR4301P62709 2019-06 풋270							216
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	216	216	216	216	216	216	216
-5.33%	136	136	136	136	137	137	138
-2.67%	57	58	59	60	62	63	65
0%	-8	-6	-3	0	3	6	8
2.67%	-40	-38	-35	-33	-31	-28	-26
5.33%	-46	-45	-45	-44	-43	-42	-41
8.00%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-45
KR4301P62725 2019-06 풋272.5							151
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	150	150	150	150	151	151	151
-5.33%	97	97	97	97	97	97	98
-2.67%	44	44	44	45	46	46	47
0%	-5	-3	-2	0	2	3	5
2.67%	-34	-32	-31	-29	-27	-25	-23
5.33%	-42	-42	-41	-40	-39	-38	-37
8.00%	-43	-43	-43	-43	-43	-42	-42

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

(단위:백만원)

1,510

공시일	2019-06-04
기준일	2019-06-03

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	17,794	0	17,794	

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	2019-06-04
기준일	2019-06-03

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	56,667	0	56,667	

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	2019-06-04
기준일	2019-06-03

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	5,911	0	5,911	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	317,856	0	317,856	
누계	통화	선도	0	319,876	-319,876	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019J004 KRW/USD 10-06-19E		104
FX21019J019 KRW/USD 18-06-19E		378
FX21019J024 KRW/USD 24-06-19E		946
FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E		378
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		76
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		995
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E		1,021
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		284
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		473
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		662
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		662
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		823
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		813
FX21019K00 KRW/USD 18-06-19E		567
FX21019K01 KRW/USD 14-06-19E		662
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		567
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		473
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		567
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,419
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,324
FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E		473
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E		794
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E		632
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		473
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		378
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		794

FX21019K02 KRW/USD 24-06-19E	378
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E	946
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E	1,513
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E	284
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E	1,229
FX21019K04 KRW/USD 28-06-19E	1,286
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	662
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	567
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	757
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	757
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	473

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

(단위:백만원)

8,536

공시일	2019-06-04
기준일	2019-06-03

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

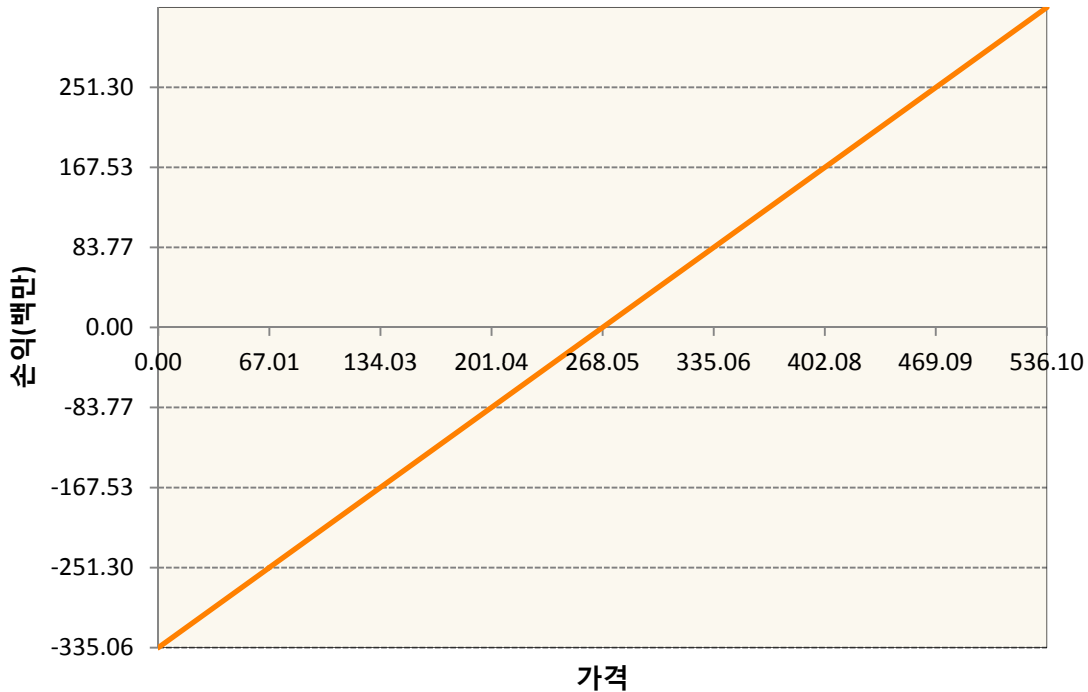
1. 계약금액

(단위:백만원)

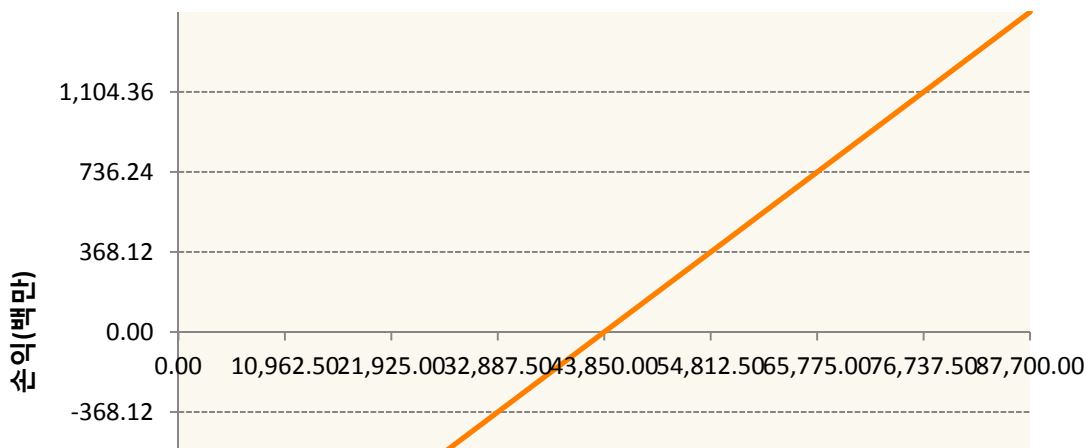
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,808	0	1,808	장내

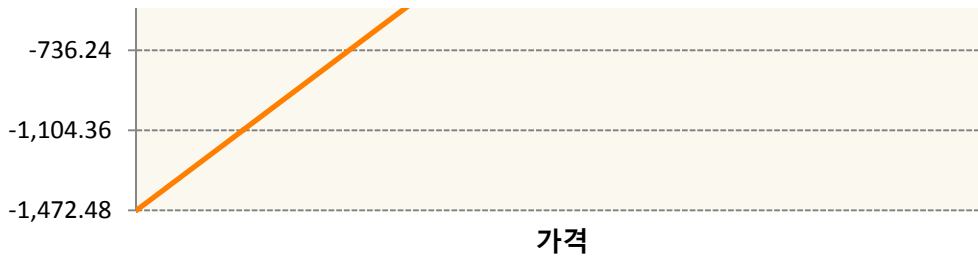
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4111P60003-2019-06 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						27
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27	
-5.33%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
-2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	9	9	9	9	9	9	9	
5.33%	18	18	18	18	18	18	18	
8.00%	27	27	27	27	27	27	27	
KR4111P60003		2019-06 삼성전자개별선물						118
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118	
-5.33%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78	
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	39	39	39	39	39	39	39	
5.33%	78	78	78	78	78	78	78	
8.00%	118	118	118	118	118	118	118	

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

162

공시일	2019-06-04
기준일	2019-06-03

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

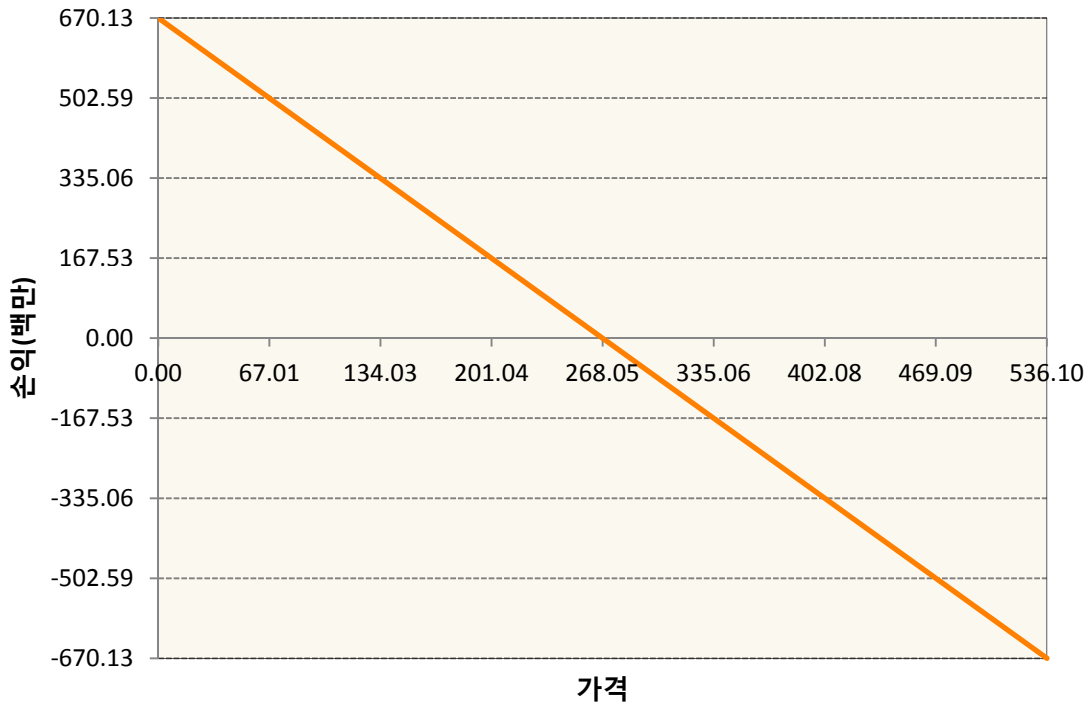
1. 계약금액

(단위:백만원)

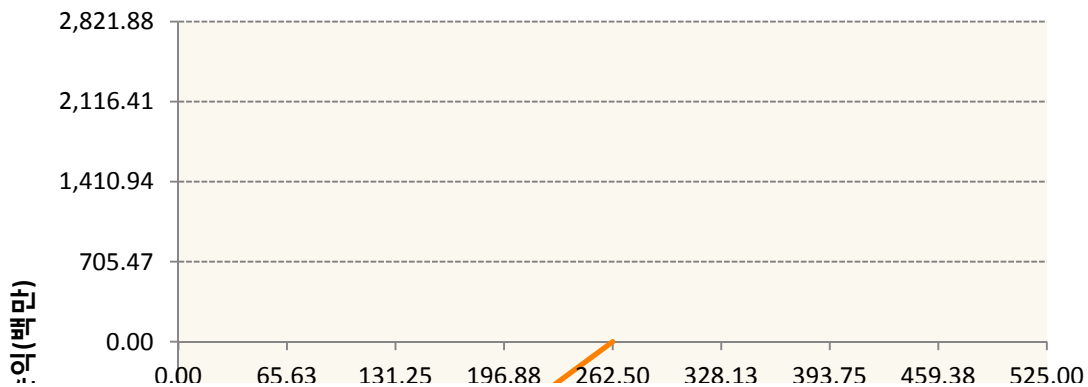
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	670	-670	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,286	-3,286	장내

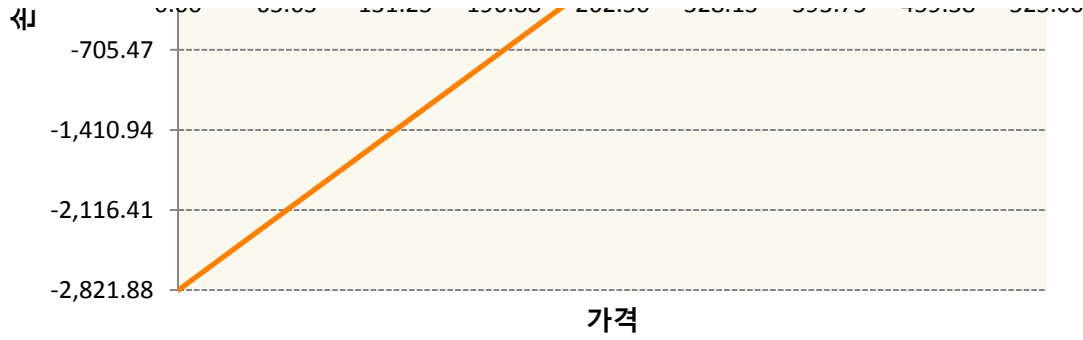
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

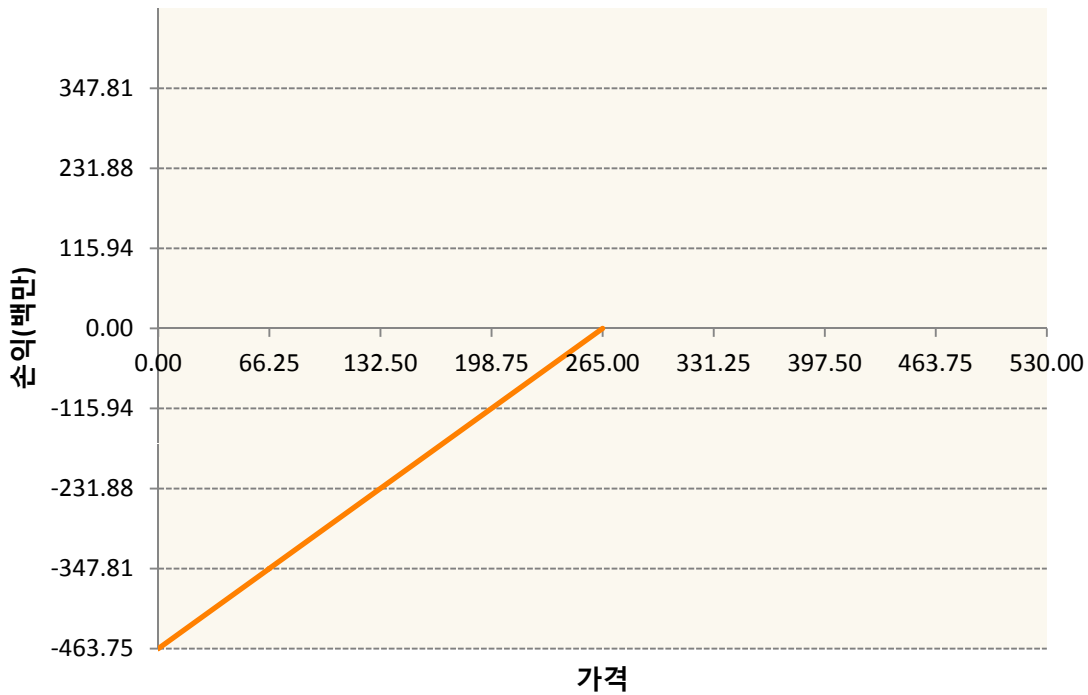


KR4301P62626-2019-06 풋262.5





KR4301P62659-2019-06 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						54
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	54	54	54	54	54	54	54	
-5.33%	36	36	36	36	36	36	36	
-2.67%	18	18	18	18	18	18	18	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	
8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54	
KR4301P62626		2019-06 풋262.5						161
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-159	-159	-160	-160	-160	-160	-161
-5.33%	-84	-85	-86	-87	-89	-90	-92
-2.67%	-22	-25	-28	-30	-33	-35	-38
0%	6	4	2	0	-2	-4	-7
2.67%	11	10	10	9	9	8	6
5.33%	11	11	11	11	11	10	10
8.00%	11	11	11	11	11	11	11
KR4301P62659 2019-06 풋265							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%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
-2.67%	-5	-6	-6	-6	-7	-7	-8
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	3	3	3	2	2	2	2
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)

232

공시일	2019-06-04
기준일	2019-06-03

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

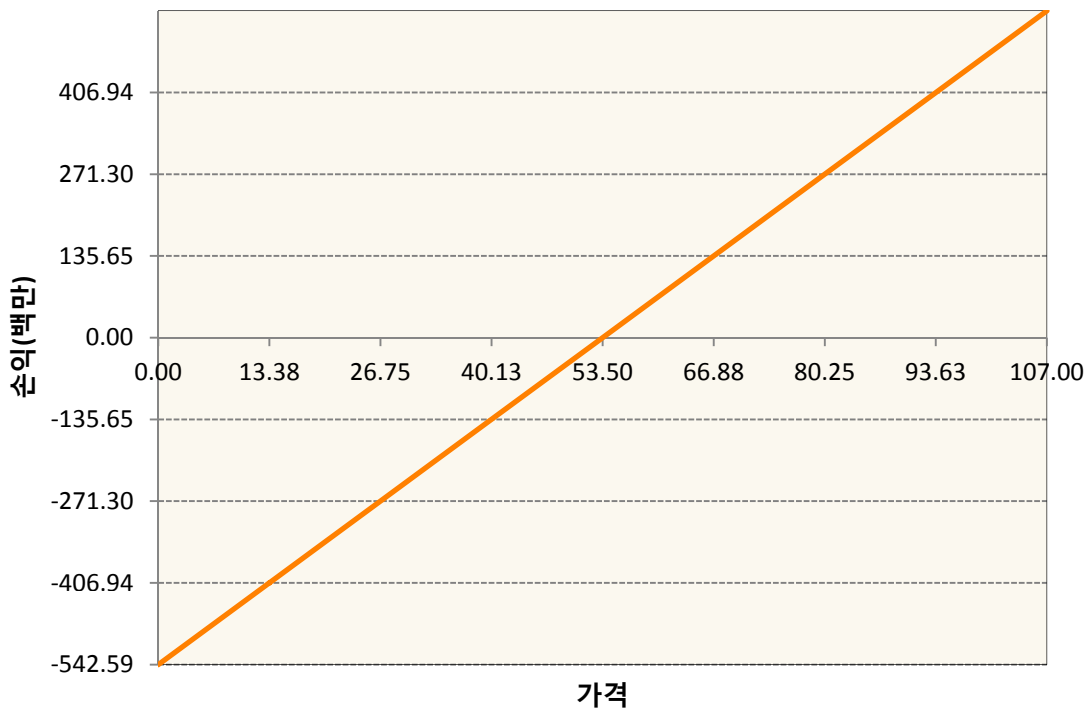
1. 계약금액

(단위:백만원)

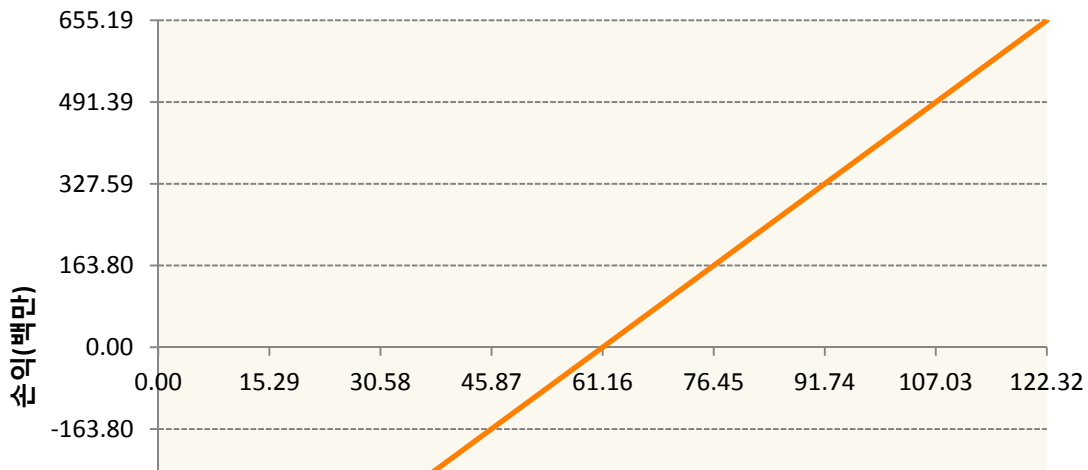
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,469	118	2,351	

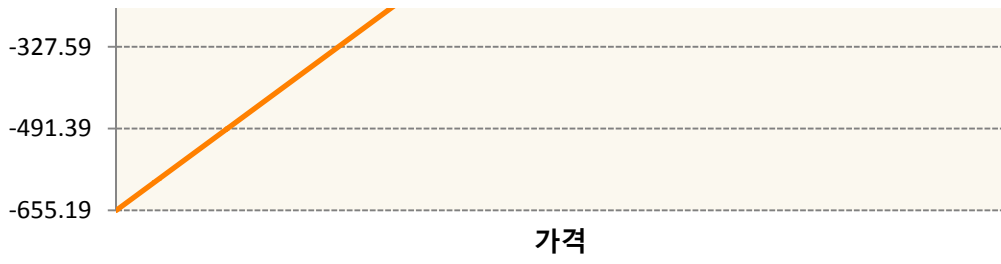
2. 만기시점의 손익구조

CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19

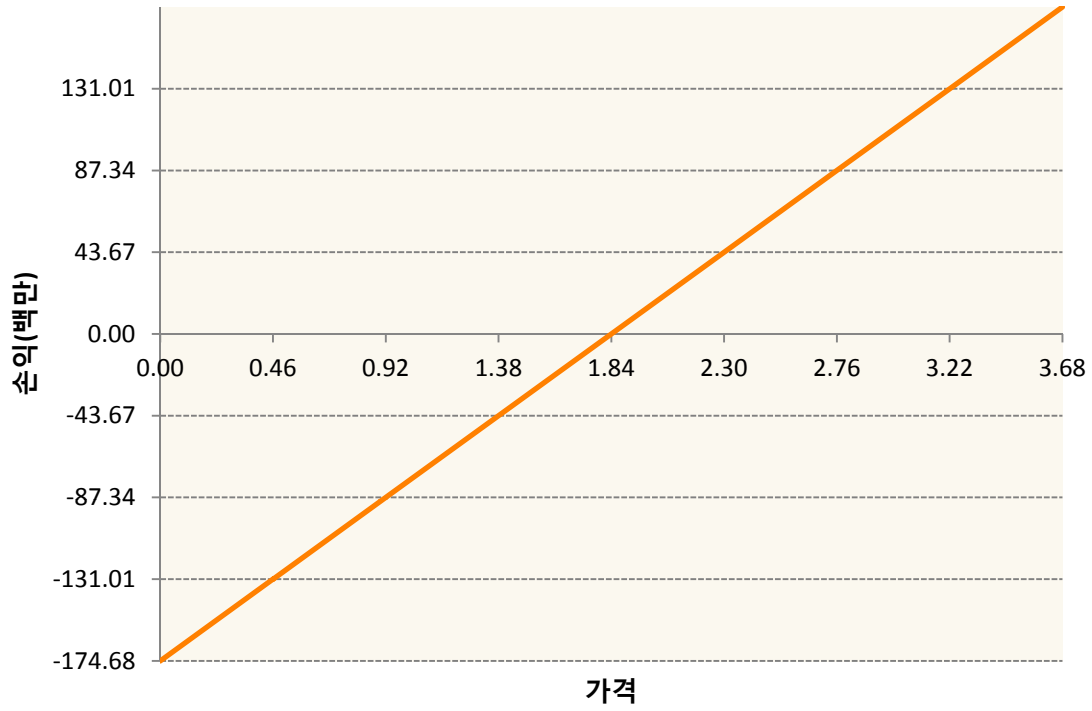


COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19

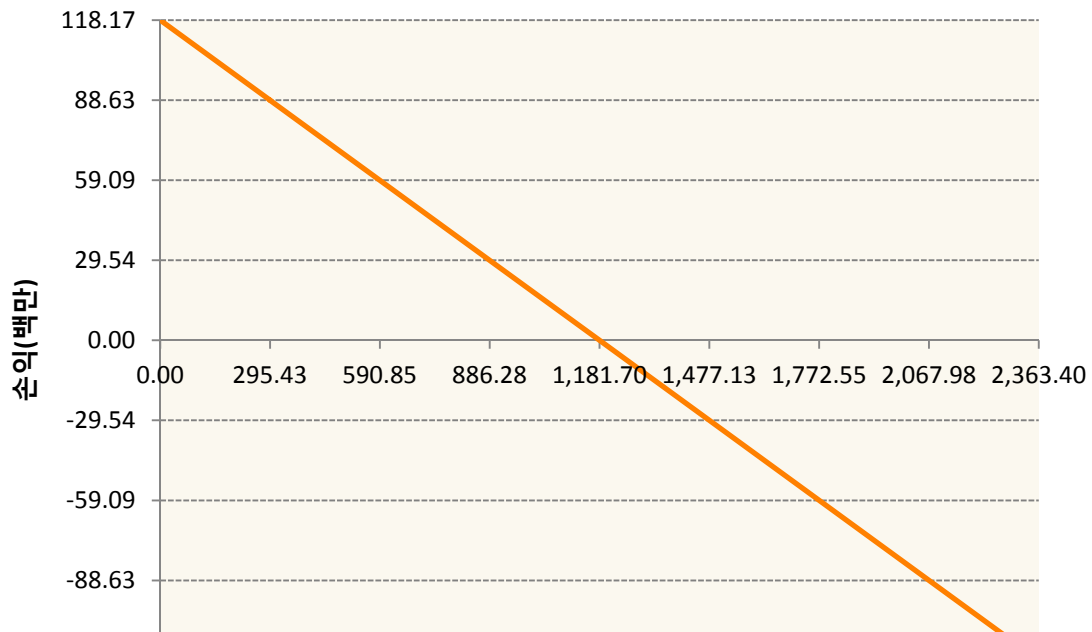


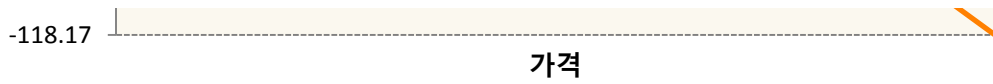


HON9-NY Harb ULSD Fut Jul19

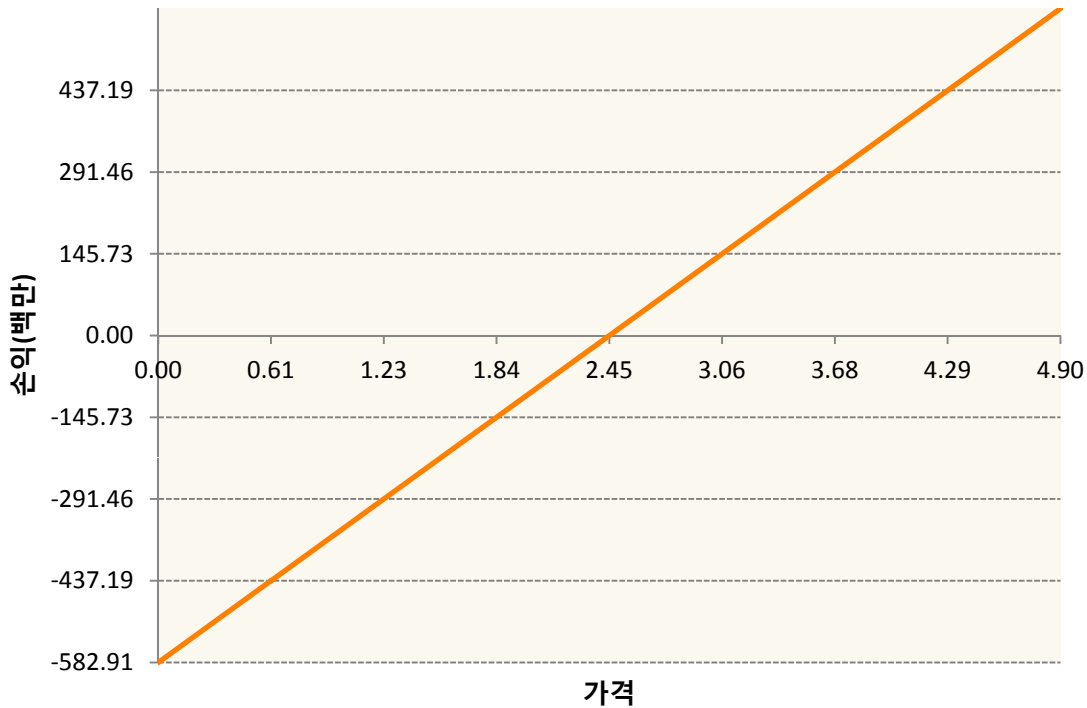


KR4175P60008-2019-06 달러선물

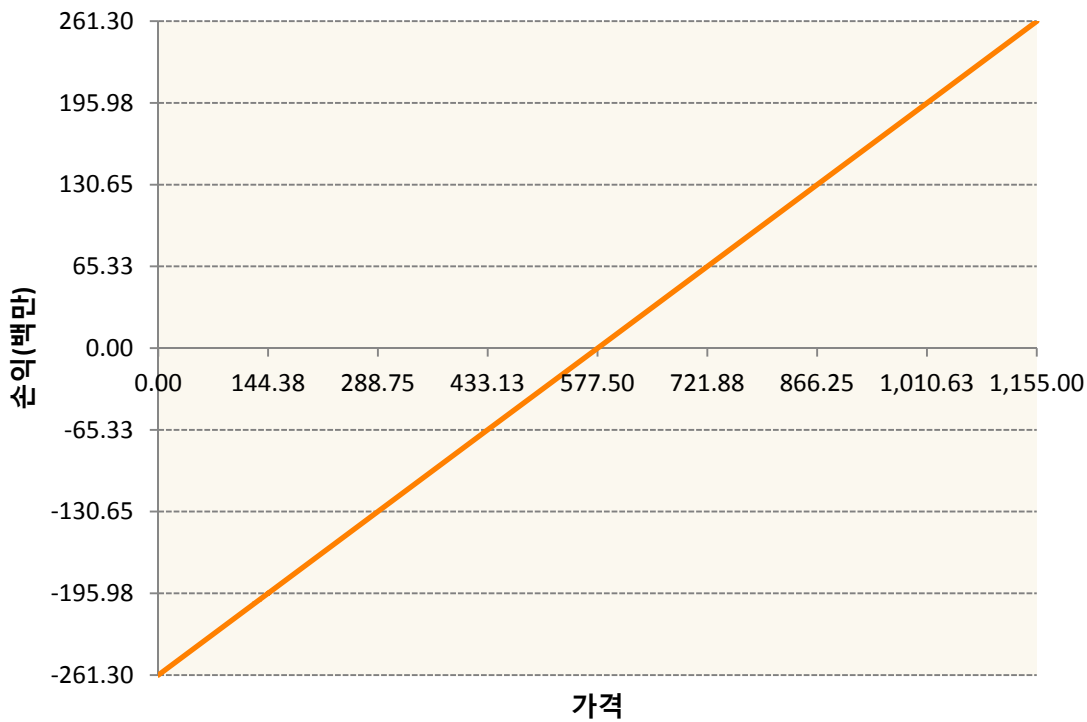




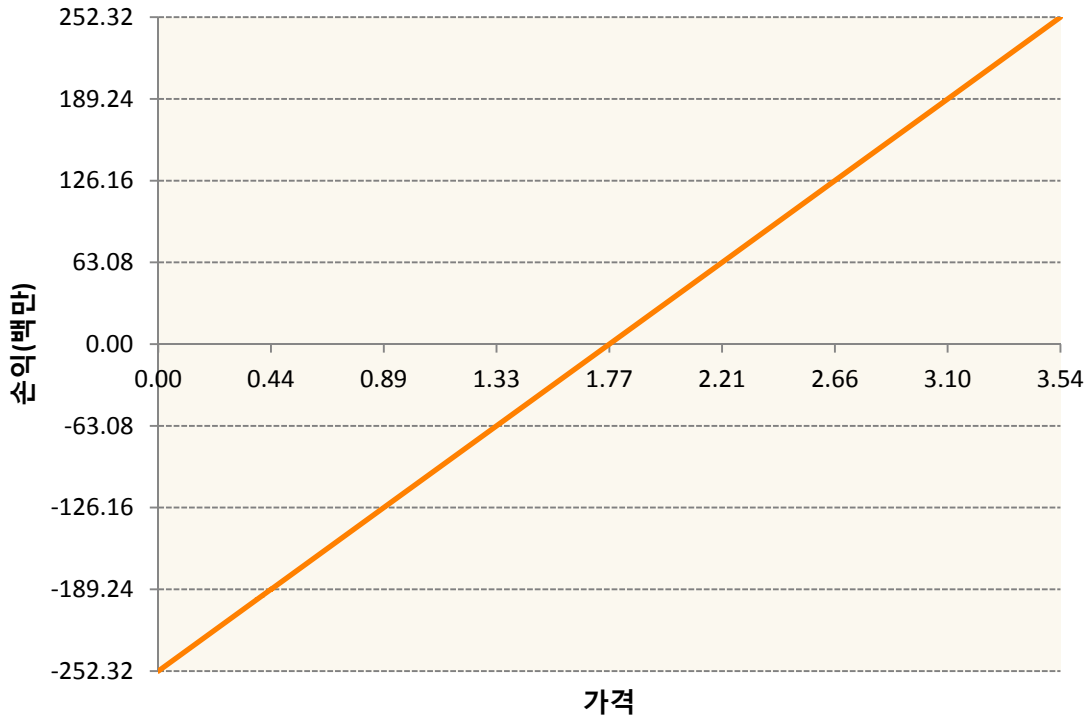
NGN19-NATURAL GAS FUTR Jul19



QSN9-Low Su Gasoil G Jul19



XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN9	WTI CRUDE FUTURE Jul19	43
COU9	BRENT CRUDE FUTR Sep19	52
HON9	NY Harb ULSD Fut Jul19	14
KR4175P600	2019-06 달러선물	9
NGN19	NATURAL GAS FUTR Jul19	47
QSN9	Low Su Gasoil G Jul19	21
XBN9	GASOLINE RBOB FUT Jul19	20

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

(단위:백만원)

364

공시일	2019-06-04
기준일	2019-06-03

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

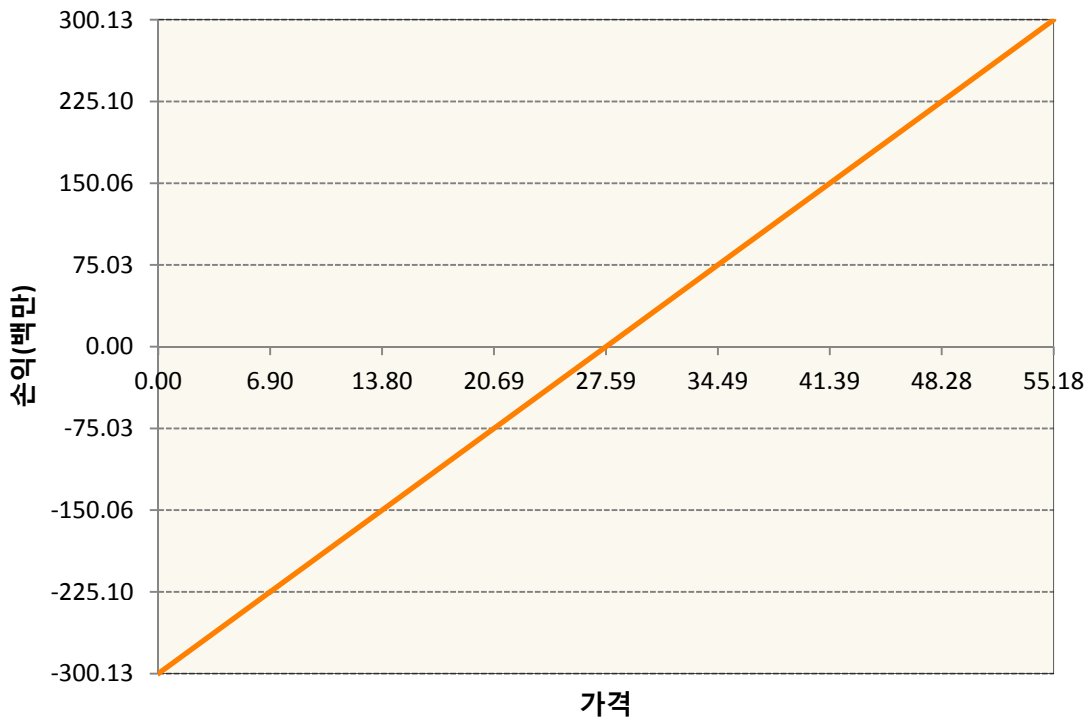
1. 계약금액

(단위:백만원)

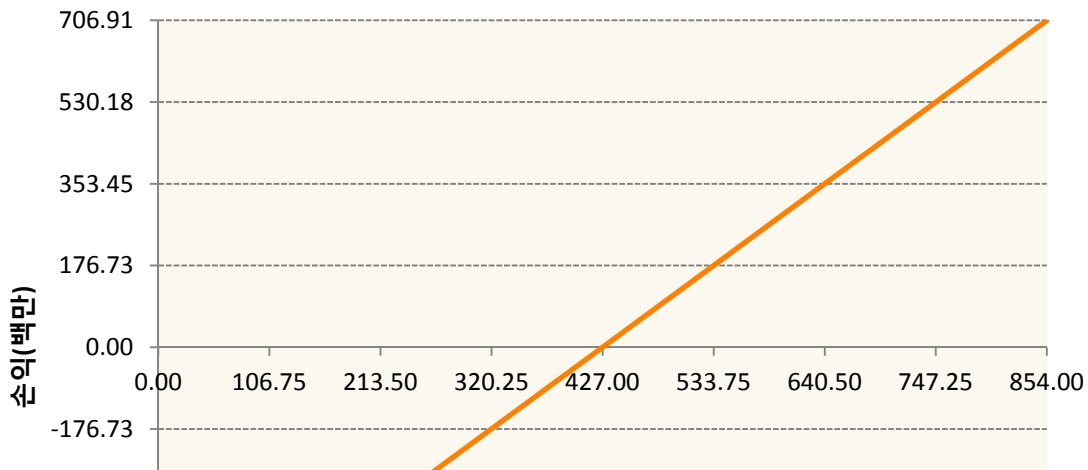
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,122	201	2,921	

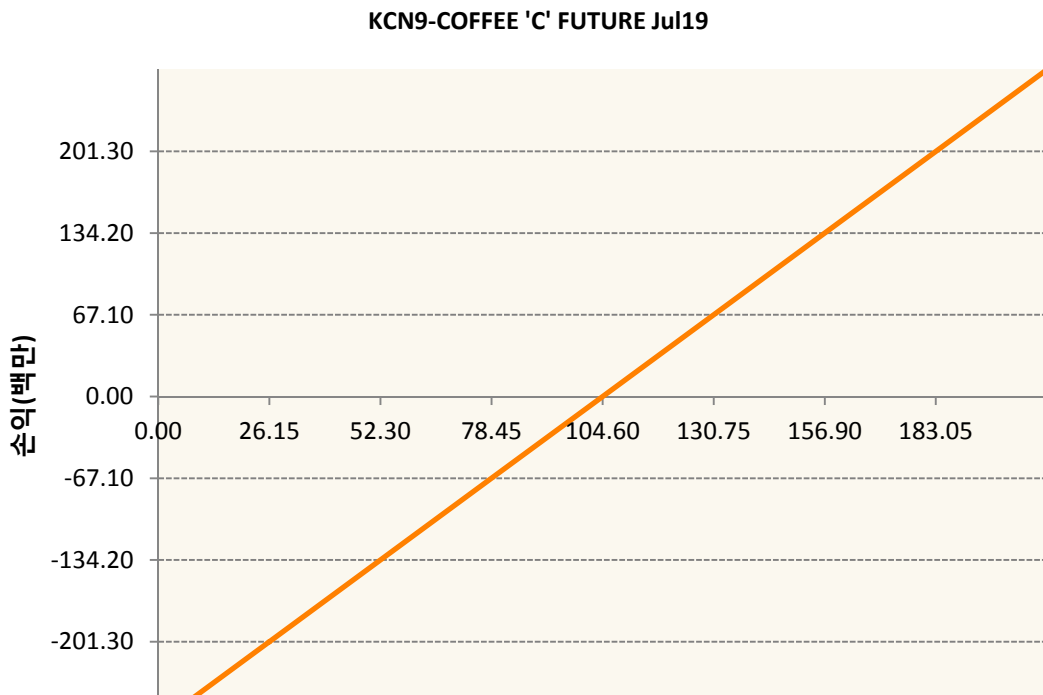
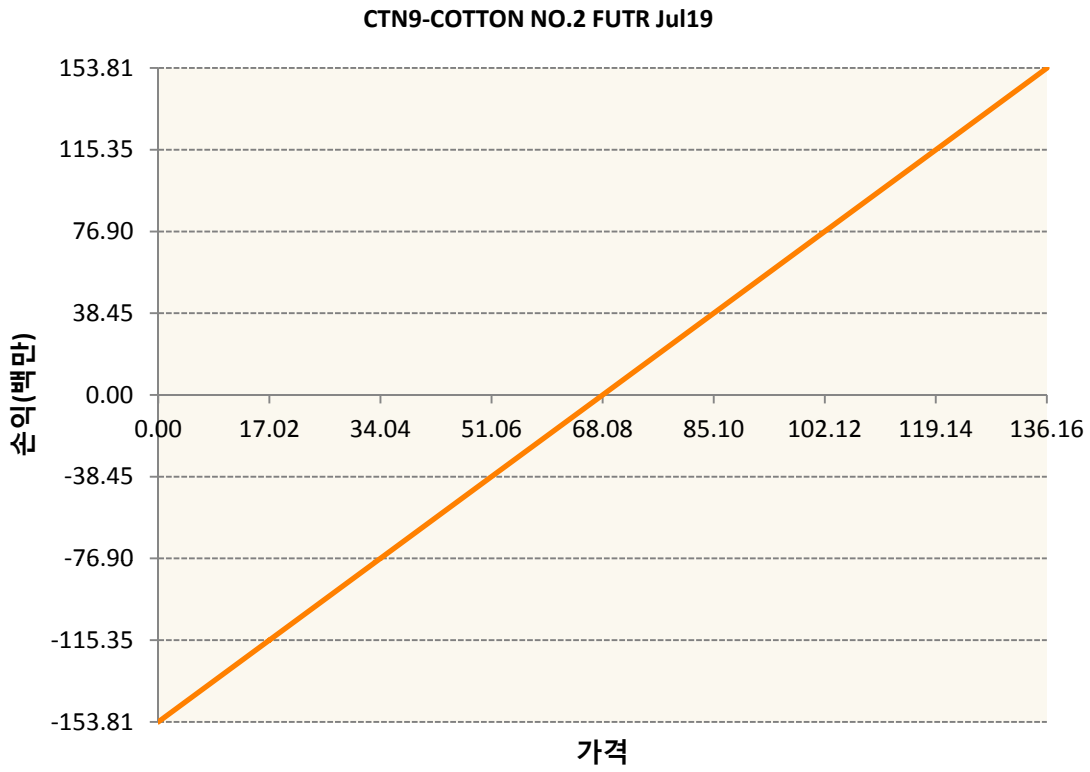
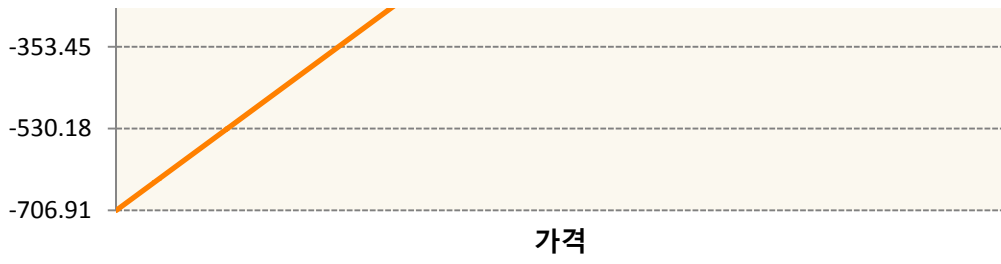
2. 만기시점의 손익구조

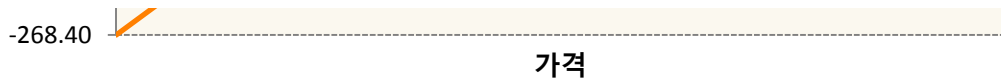
BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19



CN9-CORN FUTURE Jul19

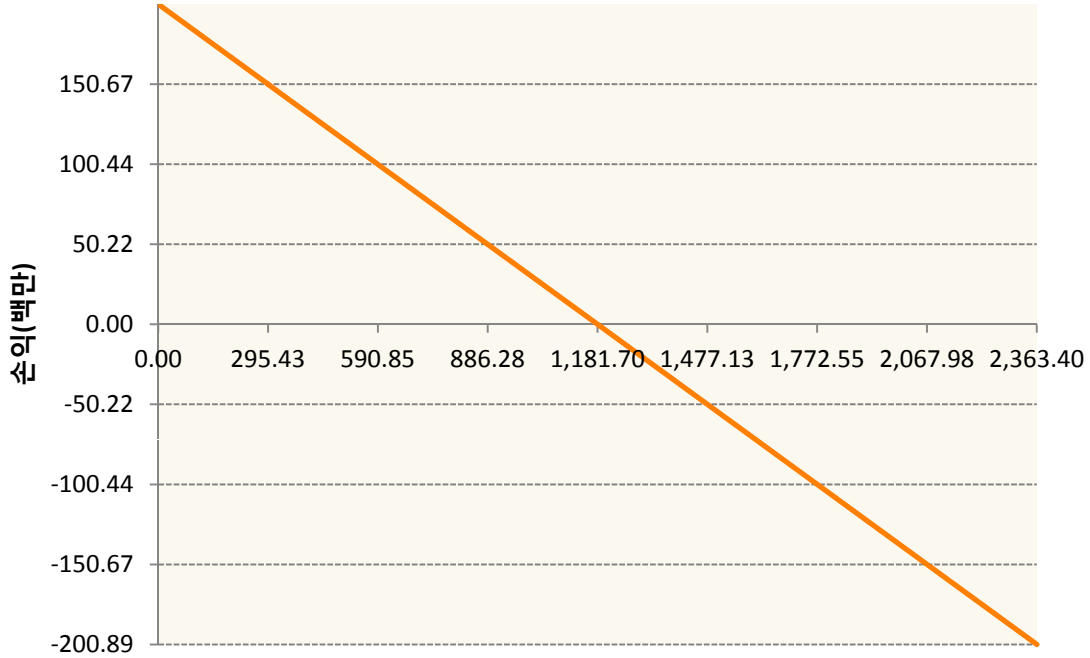






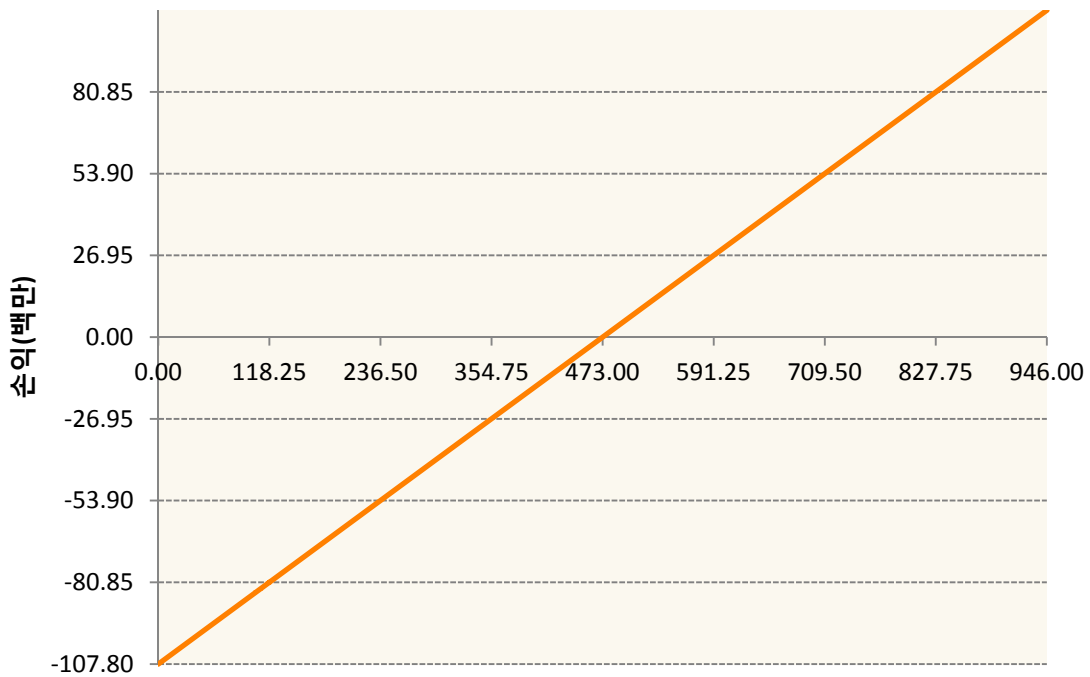
가격

KR4175P60008-2019-06 달러선물



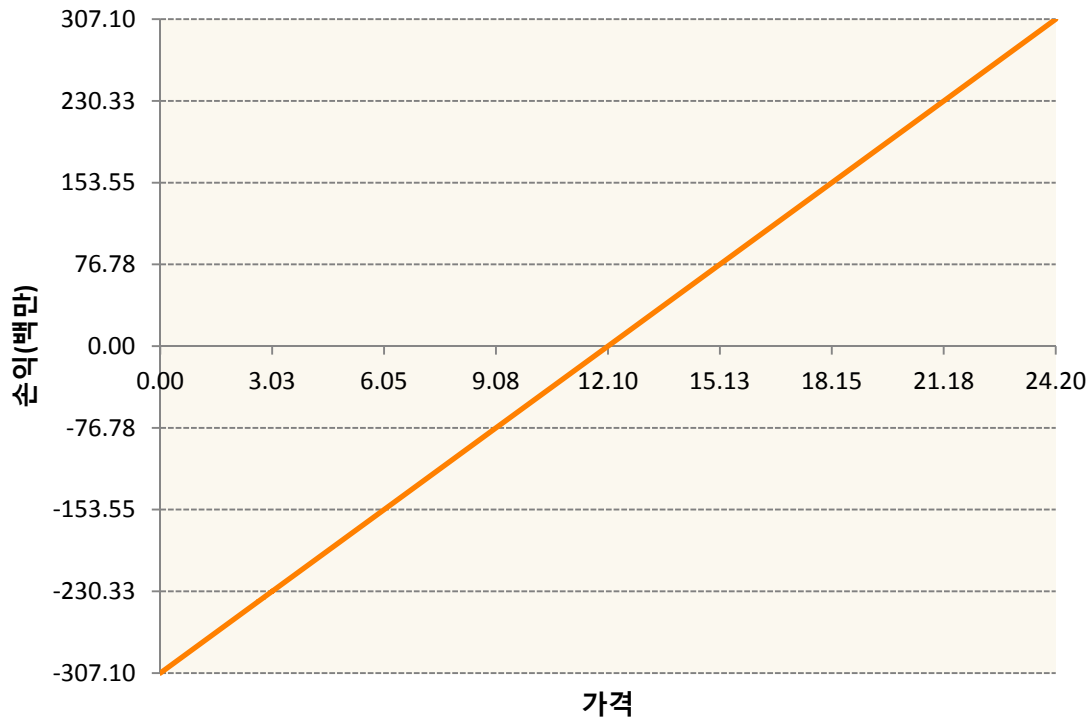
가격

KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19

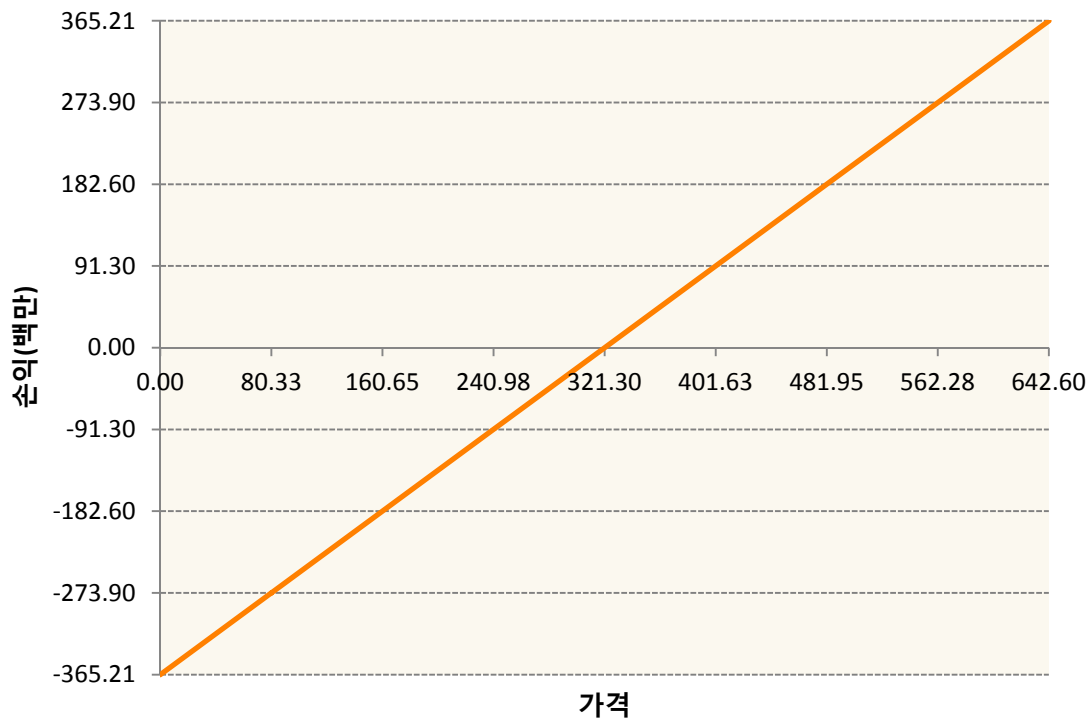


가격

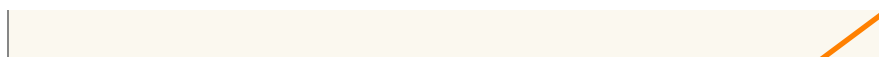
SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

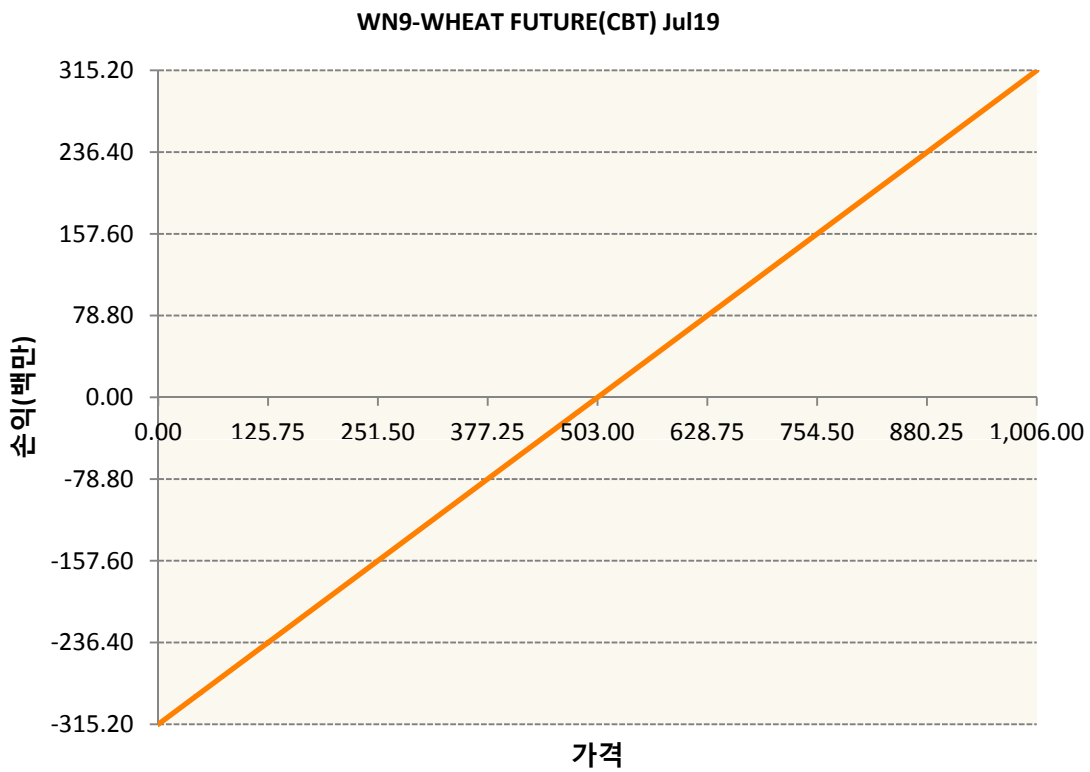
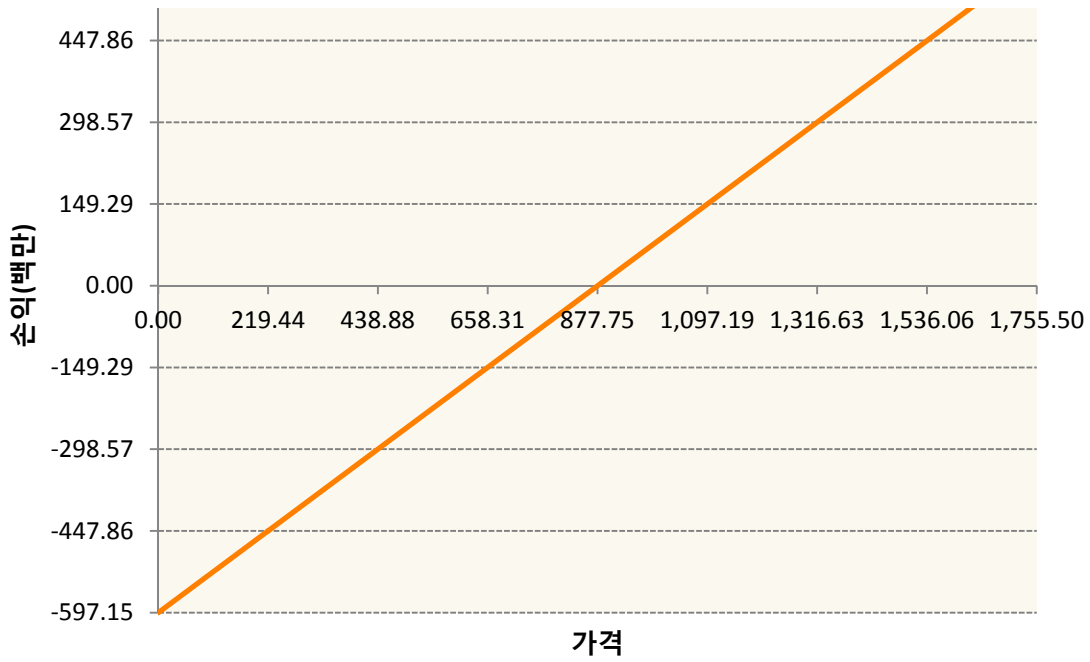


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19



SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON9	SOYBEAN OIL FUTR Jul19	24
CN9	CORN FUTURE Jul19	57
CTN9	COTTON NO.2 FUTR Jul19	12
KCN9	COFFEE 'C' FUTURE Jul19	21
KR4175P600	2019-06 달러선물	16

KWN9	KC HRW WHEAT FUT Jul19	9
SBN9	SUGAR #11 (WORLD) Jul19	25
SMN9	SOYBEAN MEAL FUTR Jul19	29
SN9	SOYBEAN FUTURE Jul19	48
WN9	WHEAT FUTURE(CBT) Jul19	25

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

(단위:백만원)

266