

공시일	2019-06-07
기준일	2019-06-05

## 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	2019-06-07
기준일	2019-06-05

## 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

1,112

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

671

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-07
기준일	2019-06-05

## 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)	290
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	80
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	136

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

<b>849</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-06-07
기준일	2019-06-05

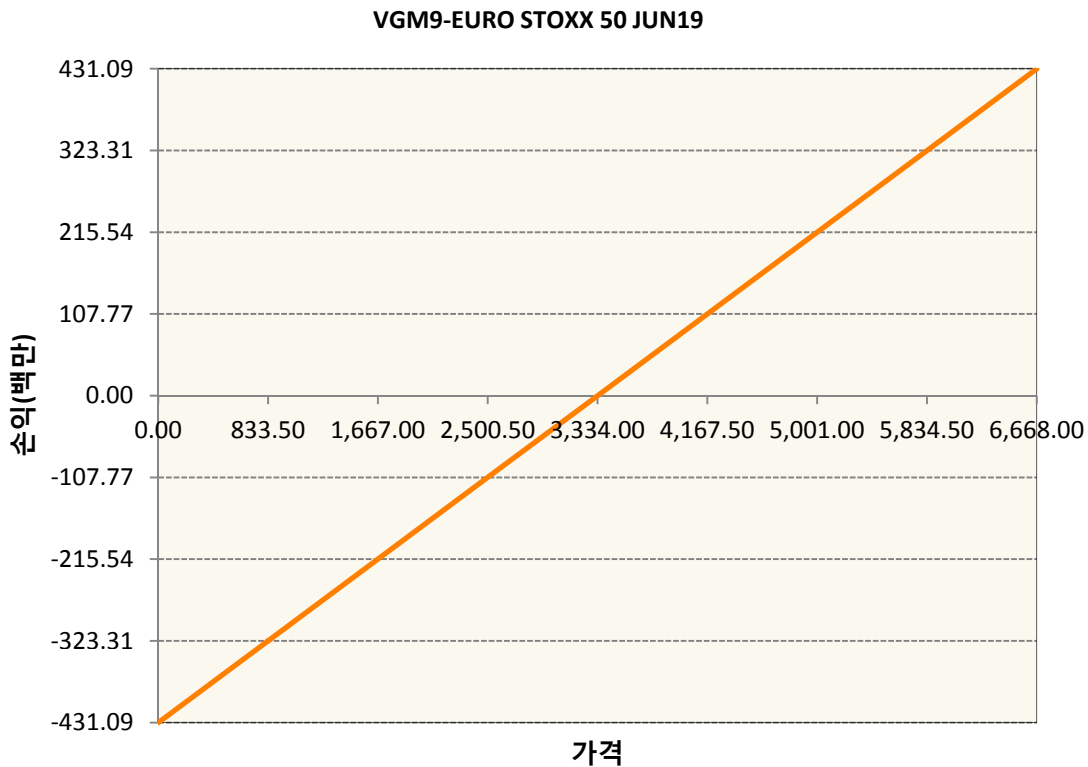
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	431	0	431	

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

25
----

공시일	2019-06-07
기준일	2019-06-05

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

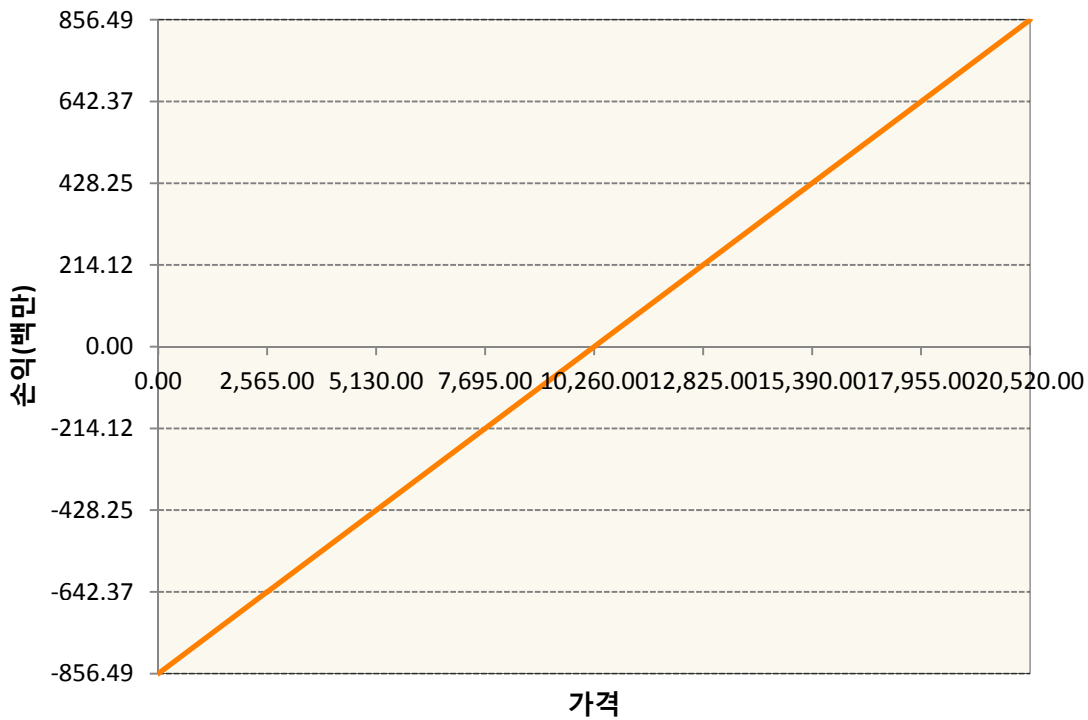
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

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

### 2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM9	HSCEI Futures Jun19	69
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

70
----

공시일	2019-06-07
기준일	2019-06-05

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

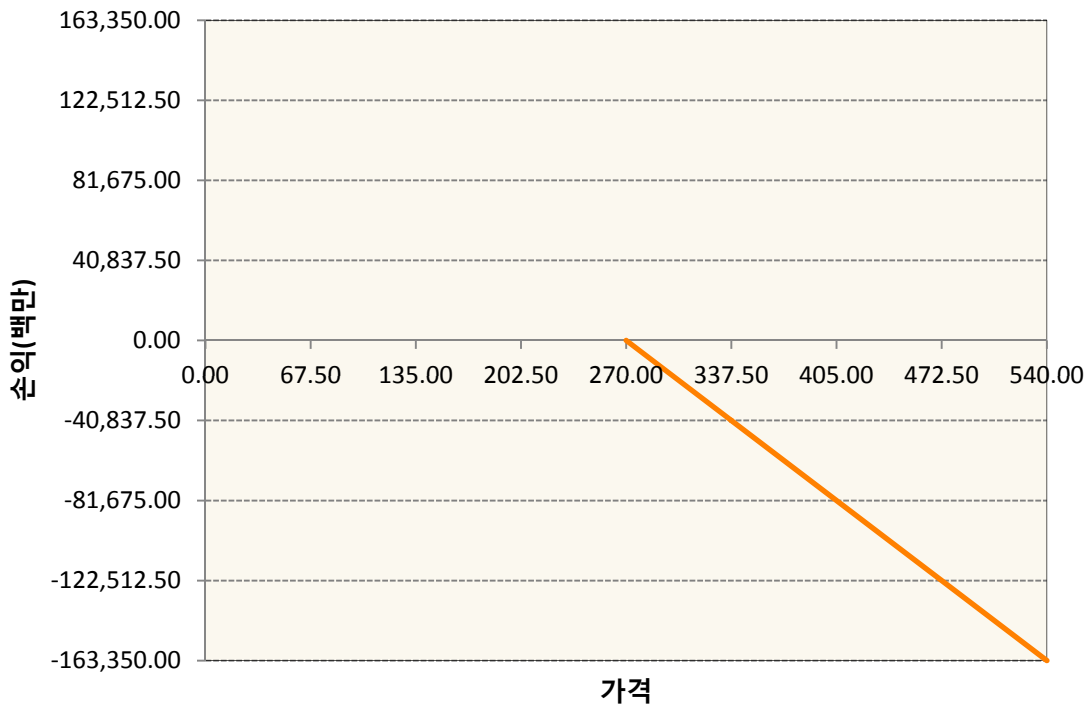
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

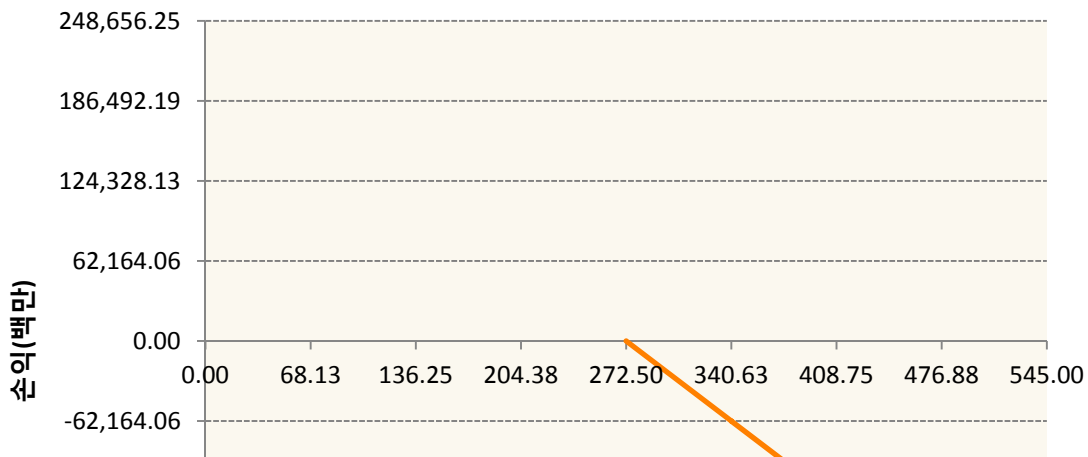
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	614,506	-614,506	장내

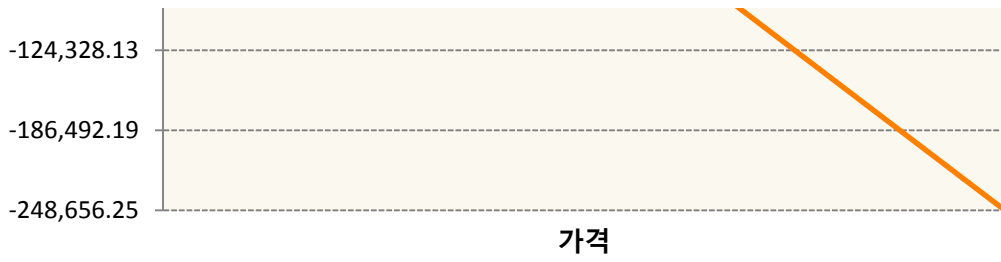
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P62701-2019-06 콜270



KR4201P62727-2019-06 콜272.5





KR4301P62709-2019-06 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P62701		2019-06 콜270					10,085
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,885	1,883	1,878	1,870	1,856	1,836	1,809
-5.33%	1,864	1,841	1,807	1,762	1,705	1,636	1,558
-2.67%	1,641	1,537	1,420	1,292	1,155	1,010	858
0%	598	400	200	0	-201	-403	-605
2.67%	-1,908	-2,079	-2,256	-2,438	-2,624	-2,813	-3,004
5.33%	-5,629	-5,700	-5,786	-5,886	-5,999	-6,121	-6,253
8.00%	-9,840	-9,855	-9,879	-9,914	-9,960	-10,017	-10,085
KR4201P62727		2019-06 콜272.5					13,970
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,009	2,008	2,005	1,998	1,986	1,968	1,940

-5.33%	1,997	1,979	1,950	1,907	1,849	1,775	1,686
-2.67%	1,827	1,722	1,595	1,447	1,282	1,102	908
0%	816	551	279	0	-283	-571	-861
2.67%	-2,154	-2,453	-2,756	-3,060	-3,366	-3,673	-3,981
5.33%	-7,238	-7,399	-7,581	-7,781	-7,996	-8,223	-8,461
8.00%	-13,424	-13,468	-13,530	-13,613	-13,714	-13,834	-13,970
KR4301P62709                      2019-06 풋270							14,791
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,789	-14,789	-14,789	-14,789	-14,789	-14,790	-14,791
-5.33%	-9,432	-9,433	-9,435	-9,440	-9,447	-9,459	-9,476
-2.67%	-4,115	-4,147	-4,190	-4,243	-4,306	-4,379	-4,459
0%	458	308	155	0	-156	-313	-471
2.67%	2,531	2,428	2,315	2,195	2,068	1,937	1,802
5.33%	2,821	2,809	2,789	2,762	2,725	2,680	2,626
8.00%	2,830	2,830	2,829	2,827	2,823	2,816	2,805

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

(단위:백만원)

**43,360**

공시일	2019-06-07
기준일	2019-06-05

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

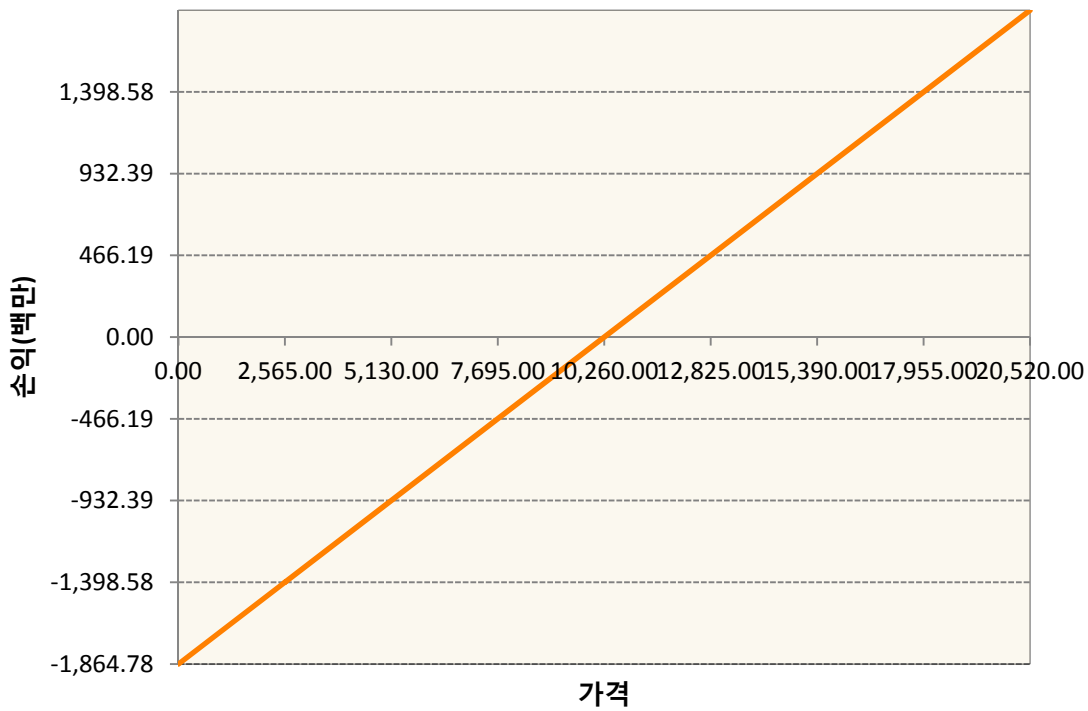
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

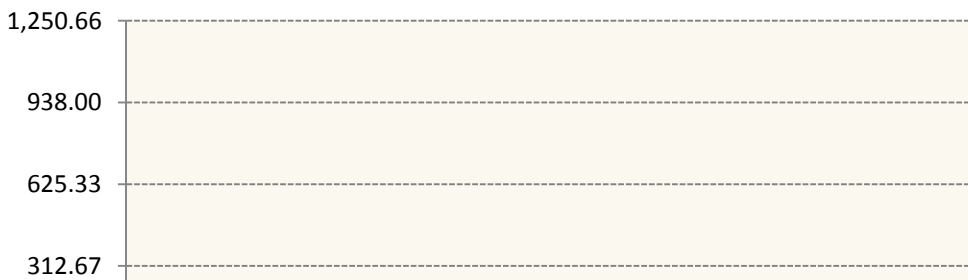
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,865	0	1,865	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,027	-5,027	장내
누계	통화	선도	150	3,157	-3,006	장외

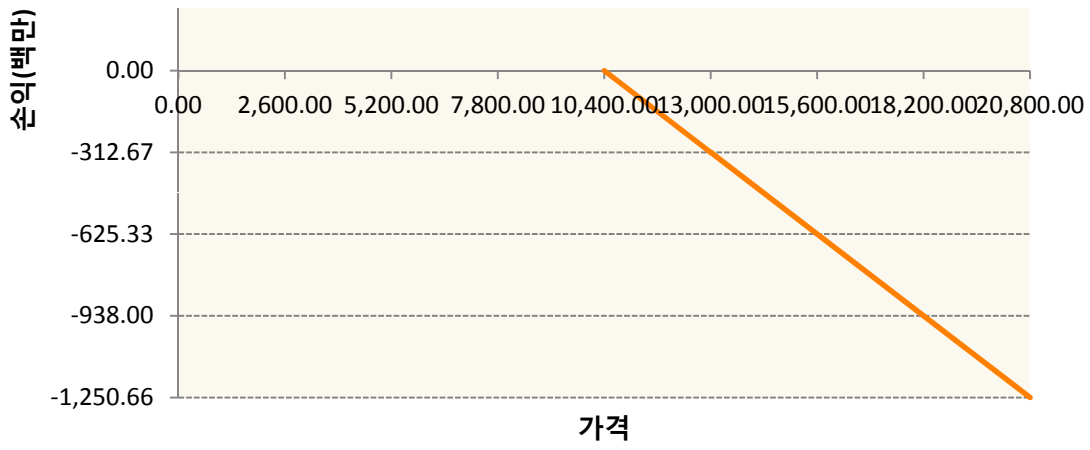
### 2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19

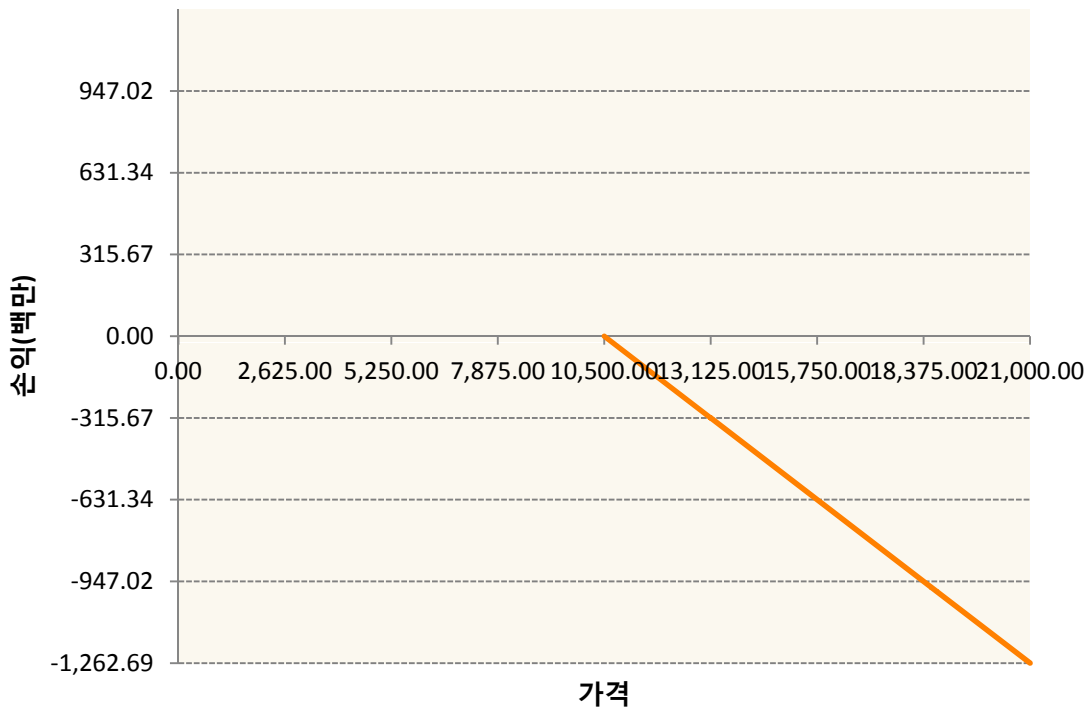


OHHIM9-C104-HSCEI

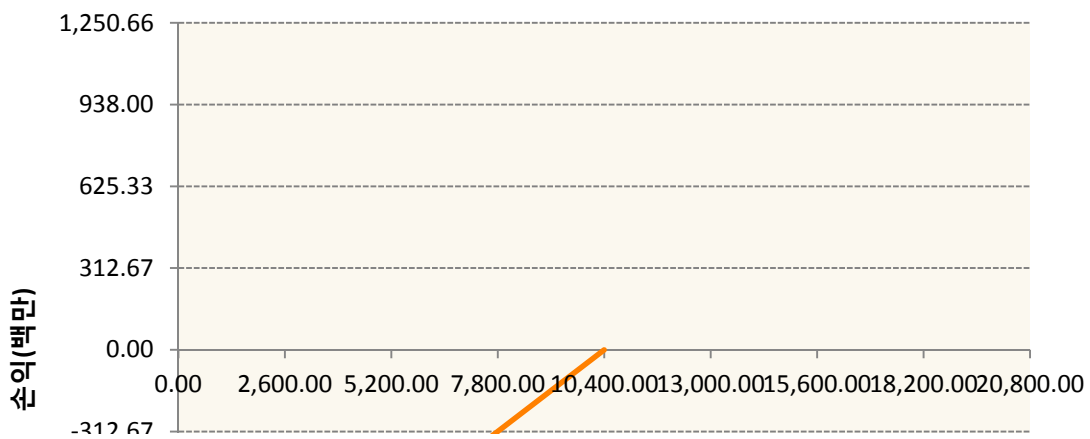


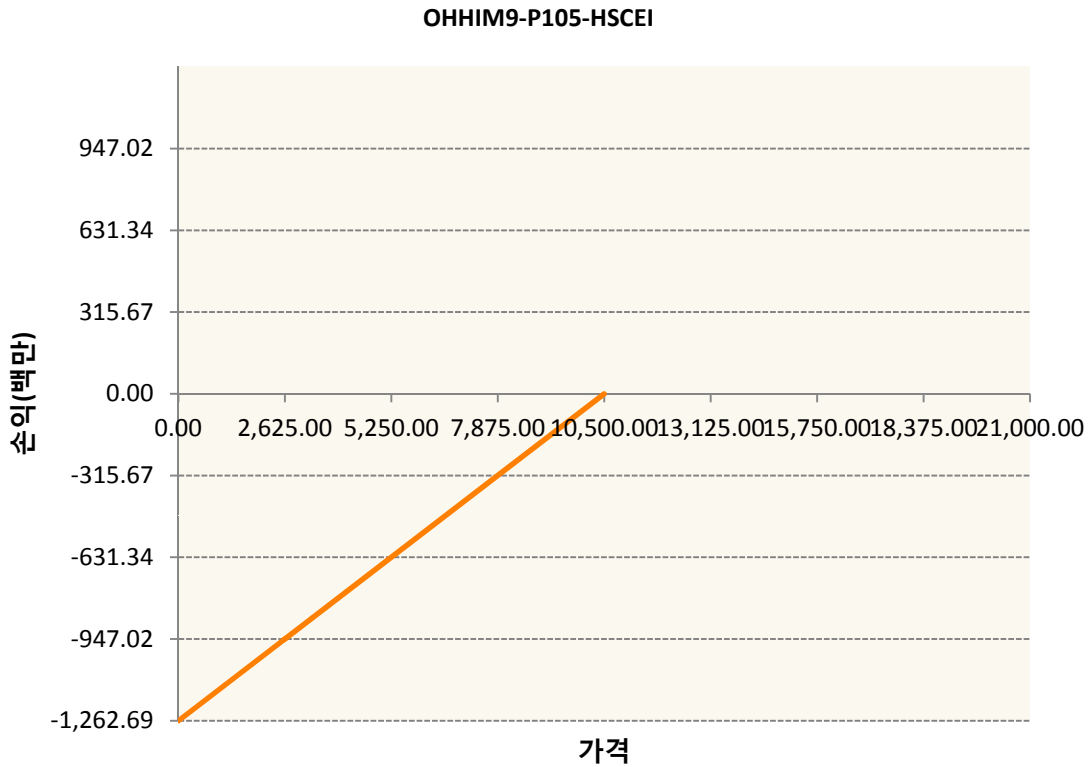


**OHHIM9-C105-HSCEI**



**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	149
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)
	649

공시일	2019-06-07
기준일	2019-06-05

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

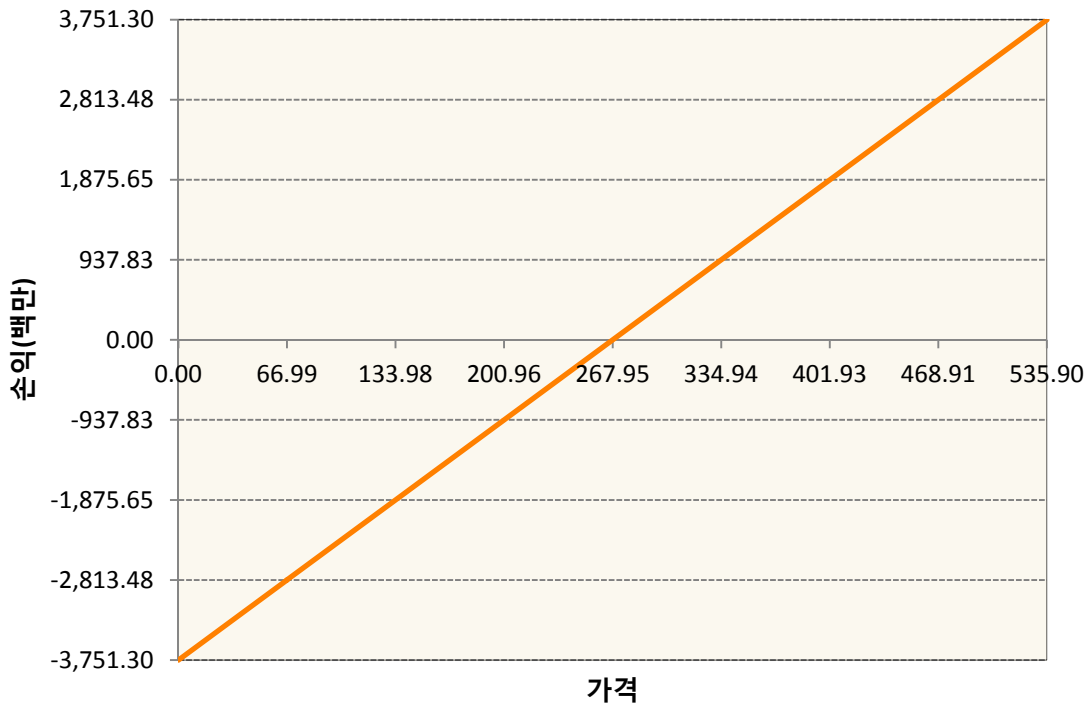
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

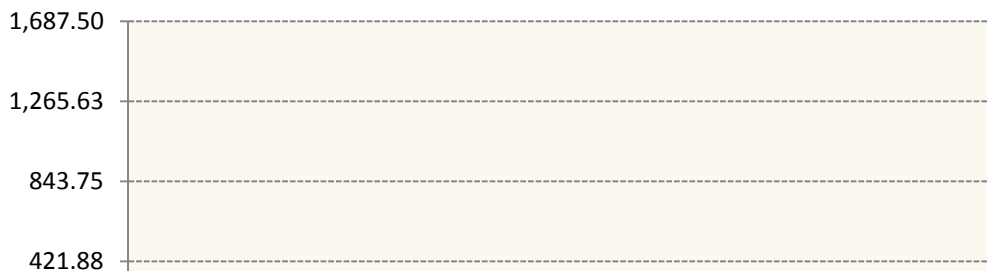
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,751	0	3,751	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	21,759	-21,759	장내

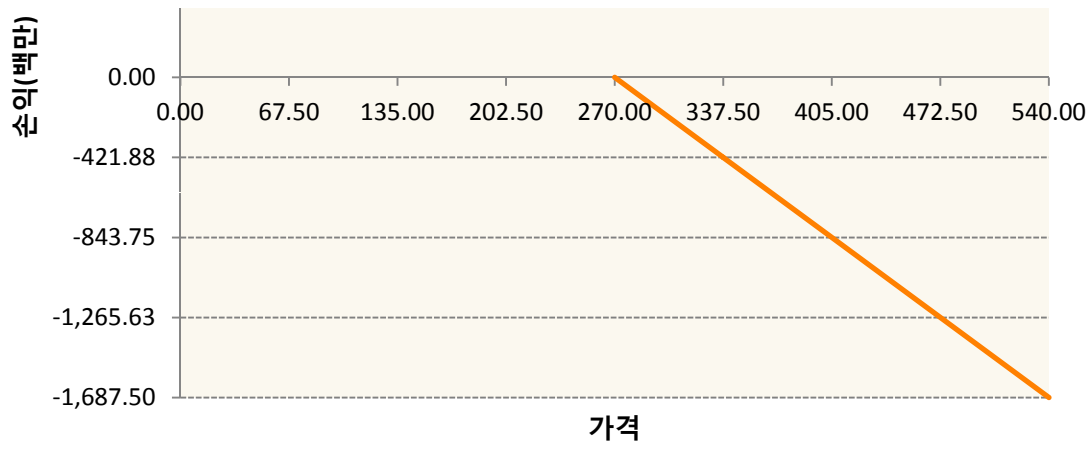
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

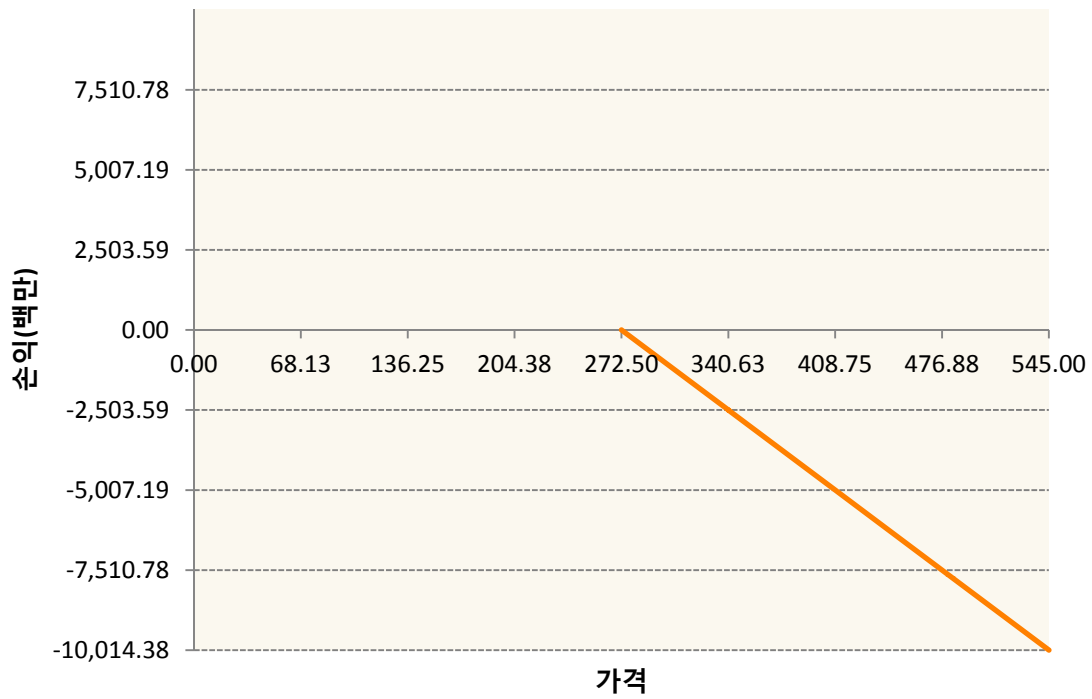


KR4201P62701-2019-06 콜270

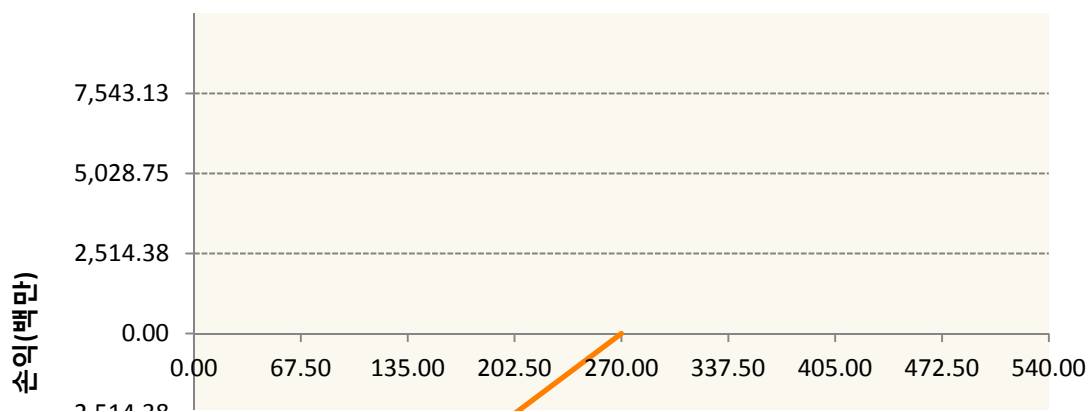


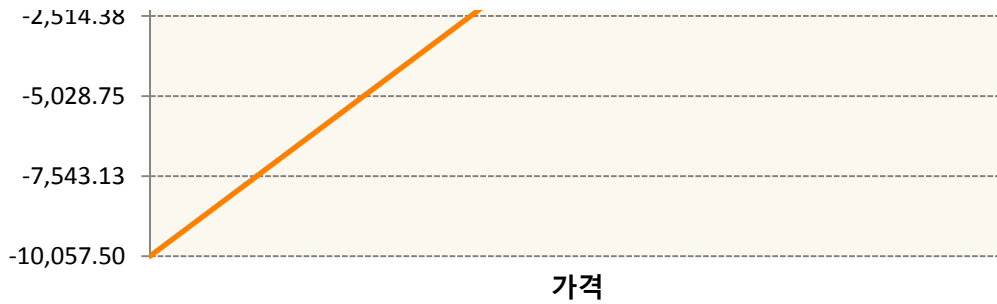


**KR4201P62727-2019-06 콜272.5**



**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						602
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-602	-602	-602	-602	-602	-602	-602	
-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%	602	602	602	602	602	602	602	
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						104
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	19	19	19	19	19	19	19
-5.33%	19	19	19	18	18	17	16
-2.67%	17	16	15	13	12	10	9
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	-20	-21	-23	-25	-27	-29	-31
5.33%	-58	-59	-60	-61	-62	-63	-65
8.00%	-102	-102	-102	-102	-103	-103	-104
KR4201P62727                      2019-06 콜272.5							563
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	81	81	81	80	80	79	78
-5.33%	80	80	79	77	74	71	68
-2.67%	74	69	64	58	52	44	37
0%	33	22	11	0	-11	-23	-35
2.67%	-87	-99	-111	-123	-136	-148	-160
5.33%	-291	-298	-305	-313	-322	-331	-341
8.00%	-541	-542	-545	-548	-552	-557	-563
KR4301P62709                      2019-06 풋270							735
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-735	-735	-735	-735	-735	-735	-735
-5.33%	-468	-469	-469	-469	-469	-470	-471
-2.67%	-204	-206	-208	-211	-214	-217	-221
0%	23	15	8	0	-8	-16	-23
2.67%	126	121	115	109	103	96	89
5.33%	140	140	139	137	135	133	130
8.00%	141	141	141	140	140	140	139

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

(단위:백만원)

**3,649**

공시일	2019-06-07
기준일	2019-06-05

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

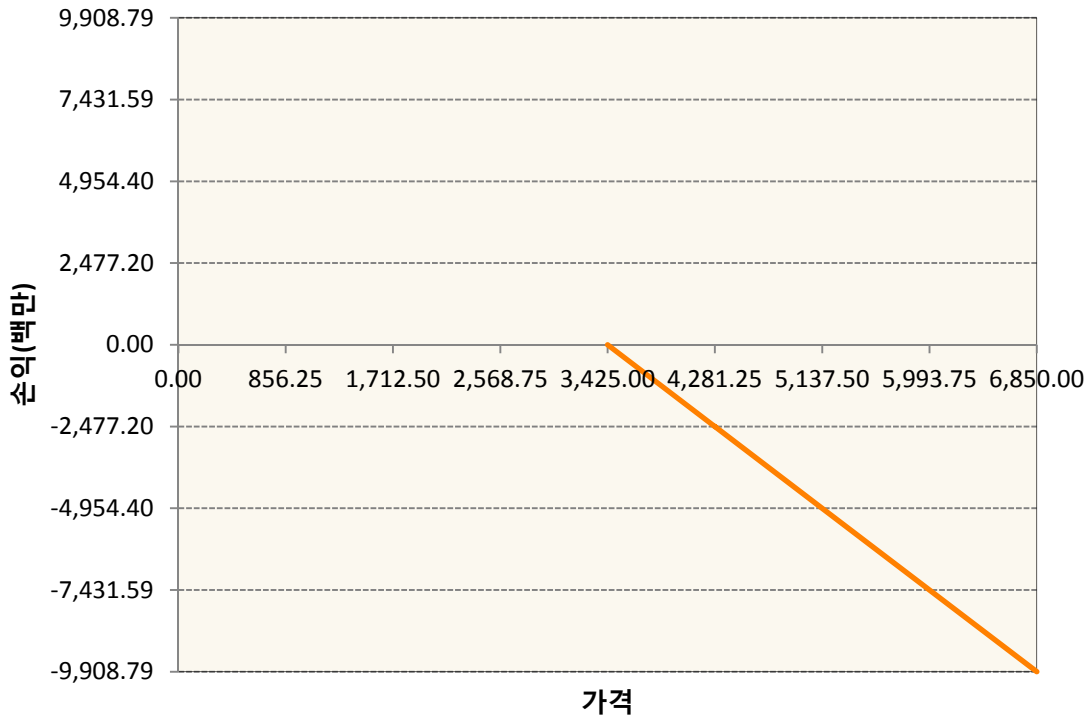
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

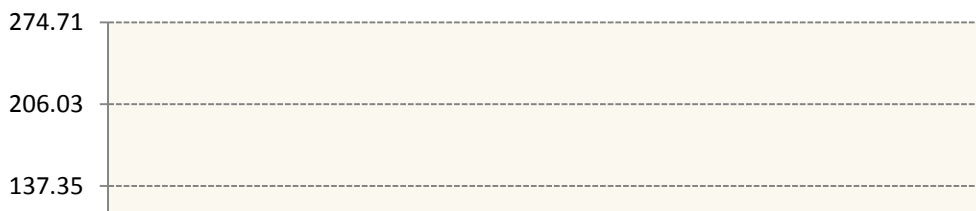
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,645	0	3,645	
누계	유가증권	스왑	56,175	0	56,175	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,367	-20,367	장내
누계	통화	선도	0	18,579	-18,579	장외

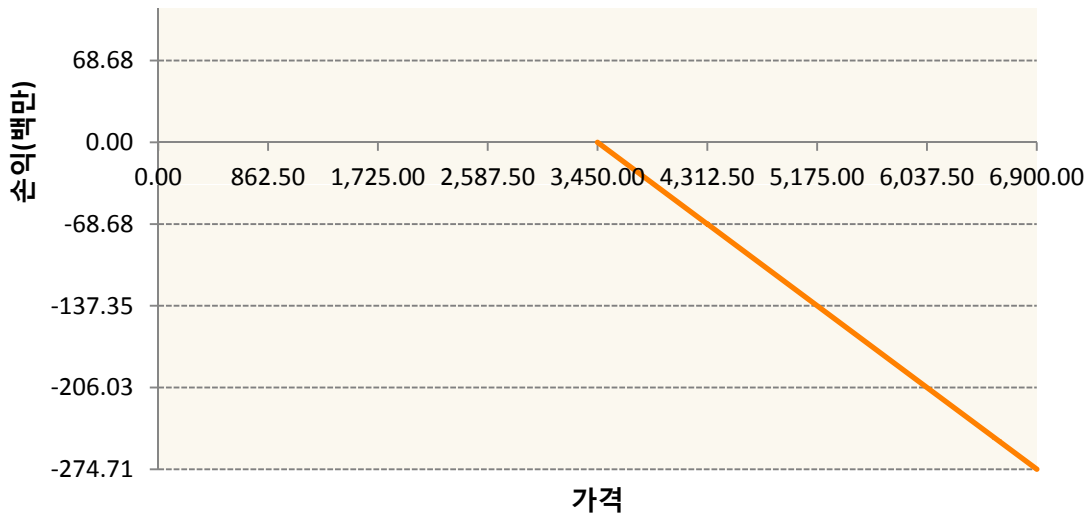
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXM9-C3425-EURO STOXX 50**

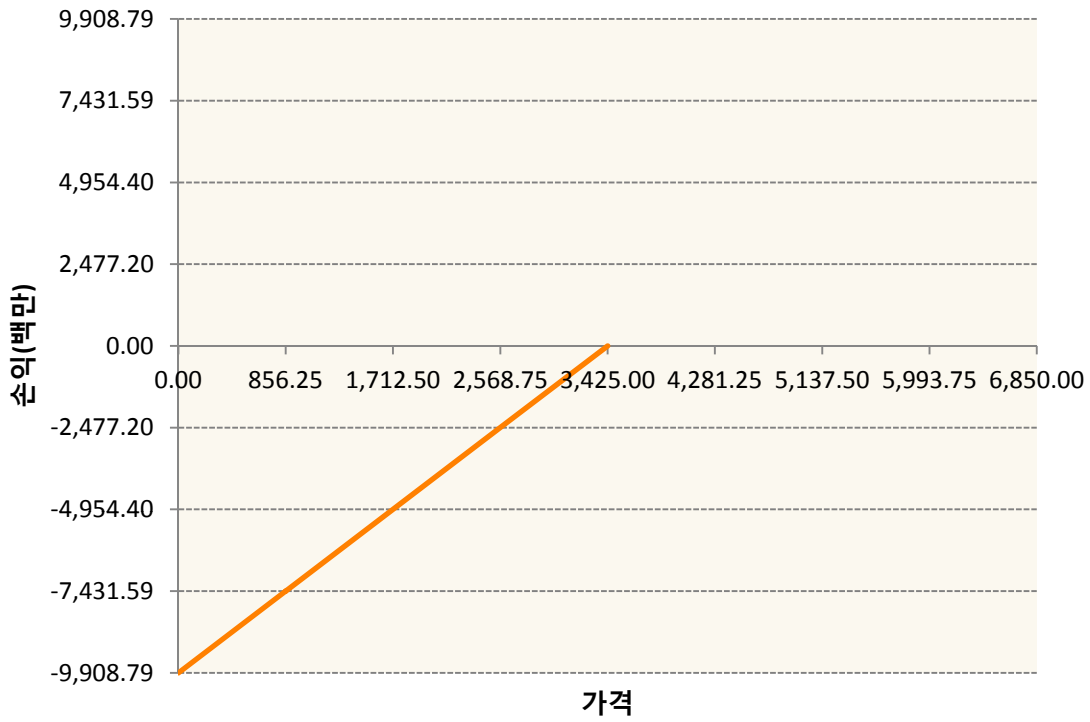


**OESXM9-C3450-EURO STOXX 50**

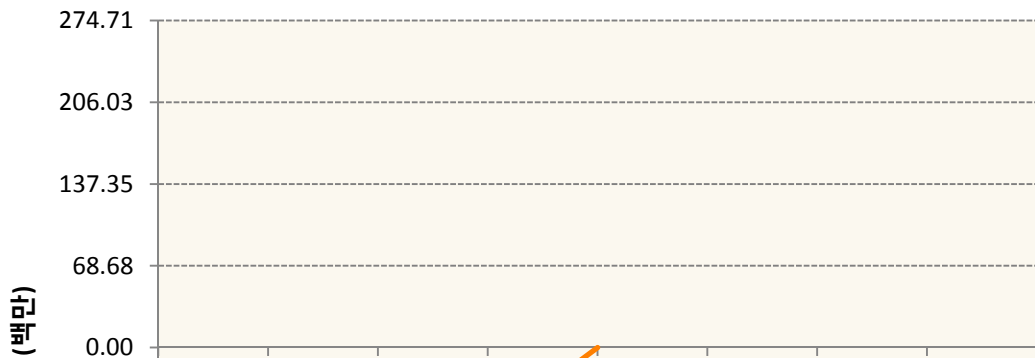


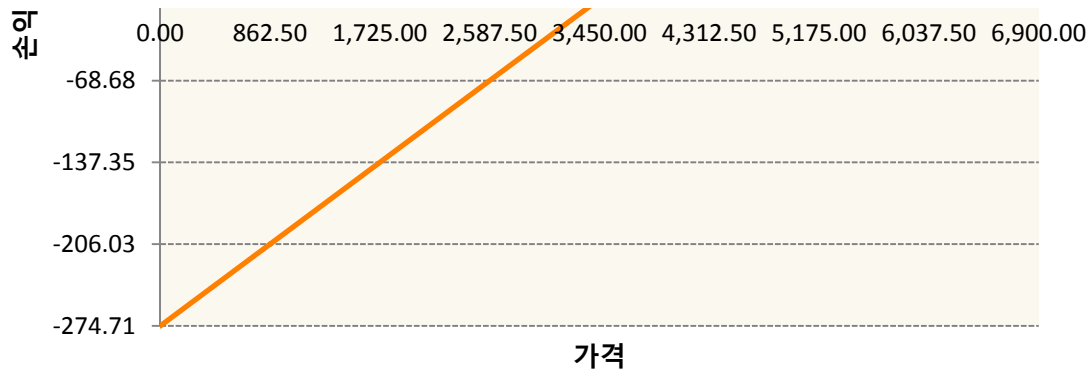


OESXM9-P3425-EURO STOXX 50

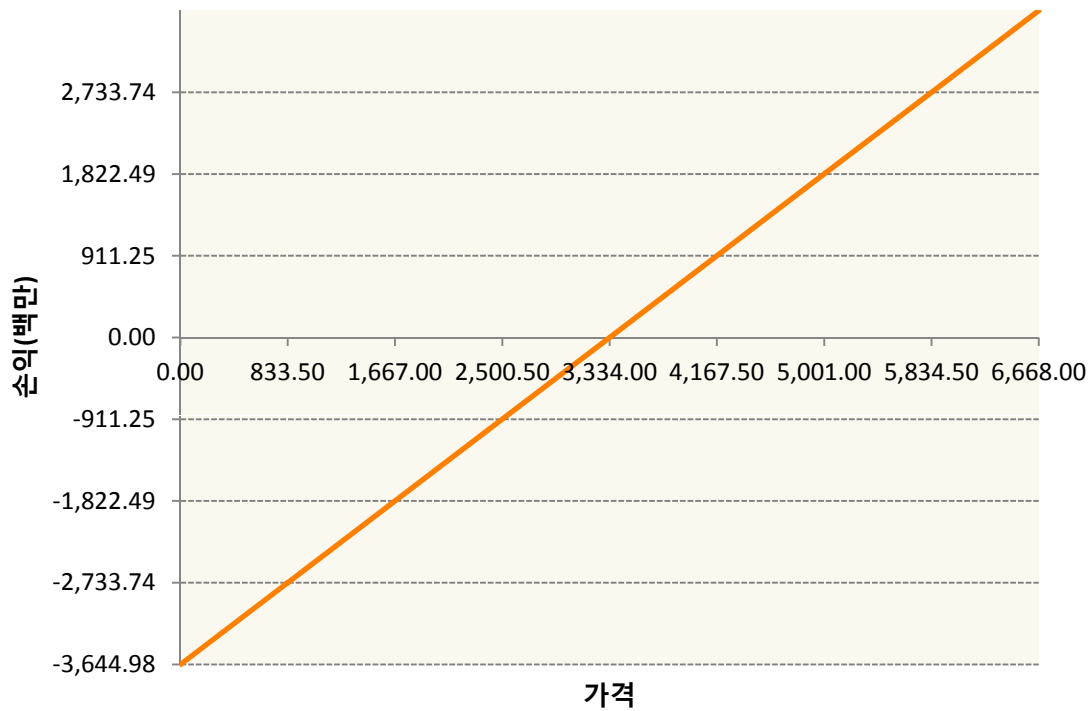


OESXM9-P3450-EURO STOXX 50





VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	83
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	849
FX21019J01: KRW/EUR 28-06-19E	212
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	425
OESXM9-C3·EURO STOXX 50	793
OESXM9-C3·EURO STOXX 50	22
OESXM9-P3·EURO STOXX 50	793
OESXM9-P3·EURO STOXX 50	22
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	292

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

(단위:백만원)

2,211



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

(단위:백만원)

1,031



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

(단위:백만원)

91



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

(단위:백만원)

132

공시일	2019-06-07
기준일	2019-06-05

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

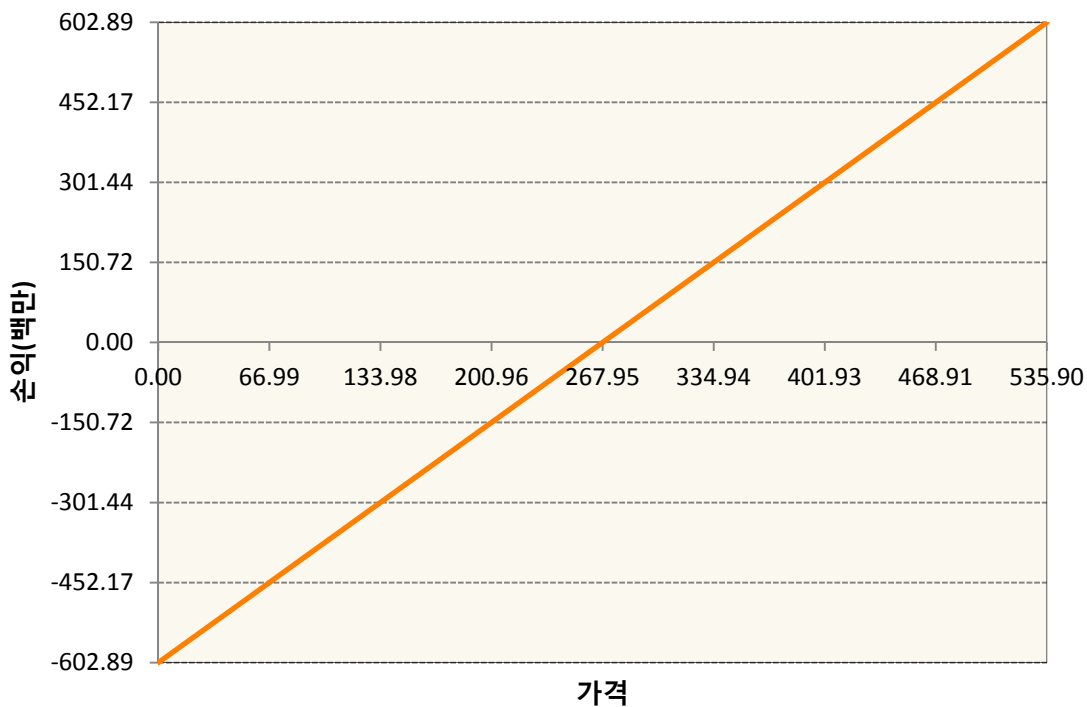
### 1. 계약금액

(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	2019-06-07
기준일	2019-06-05

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

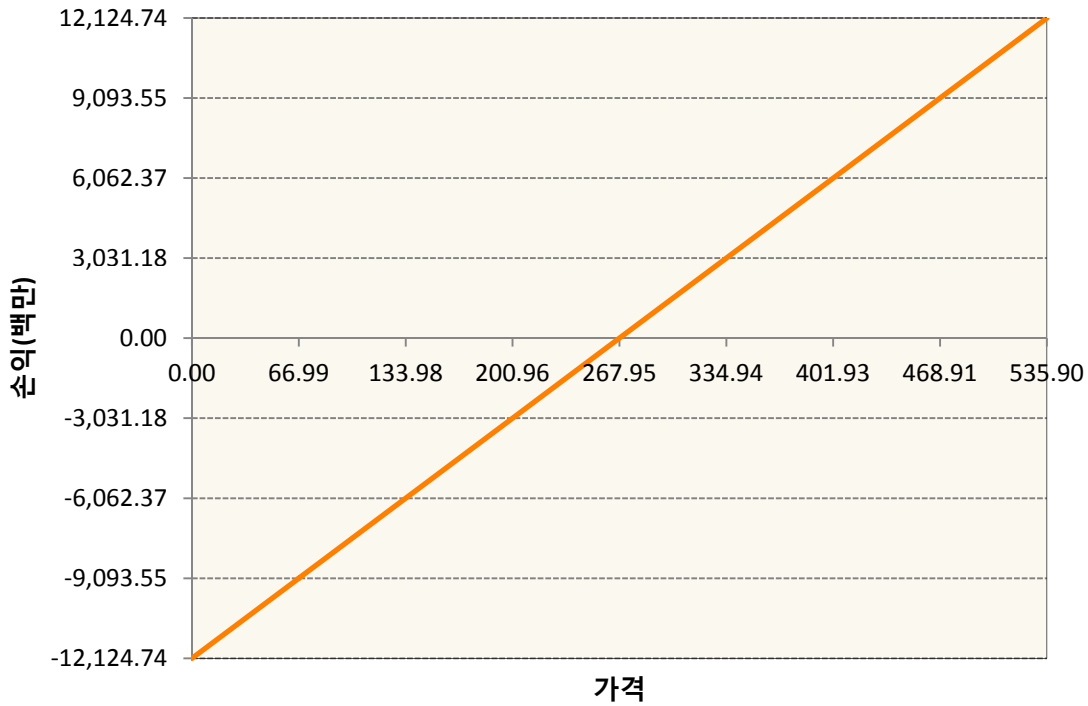
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

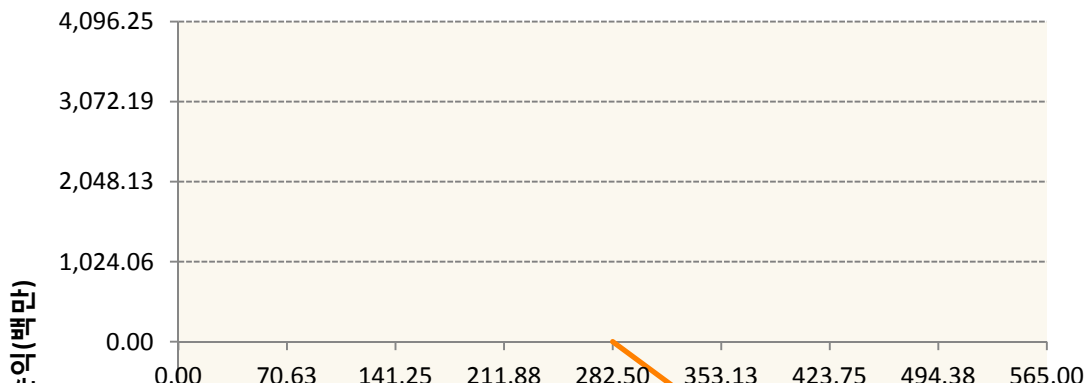
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,125	0	12,125	장내
누계	유가증권	옵션	5,081	22,906	-17,825	장내

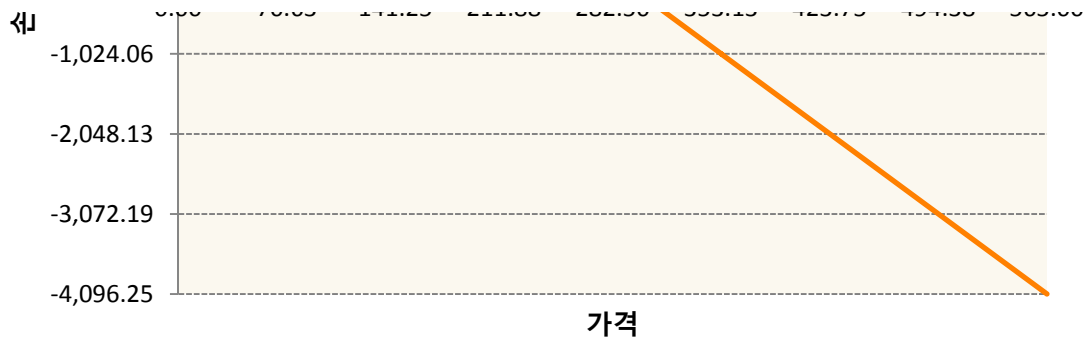
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

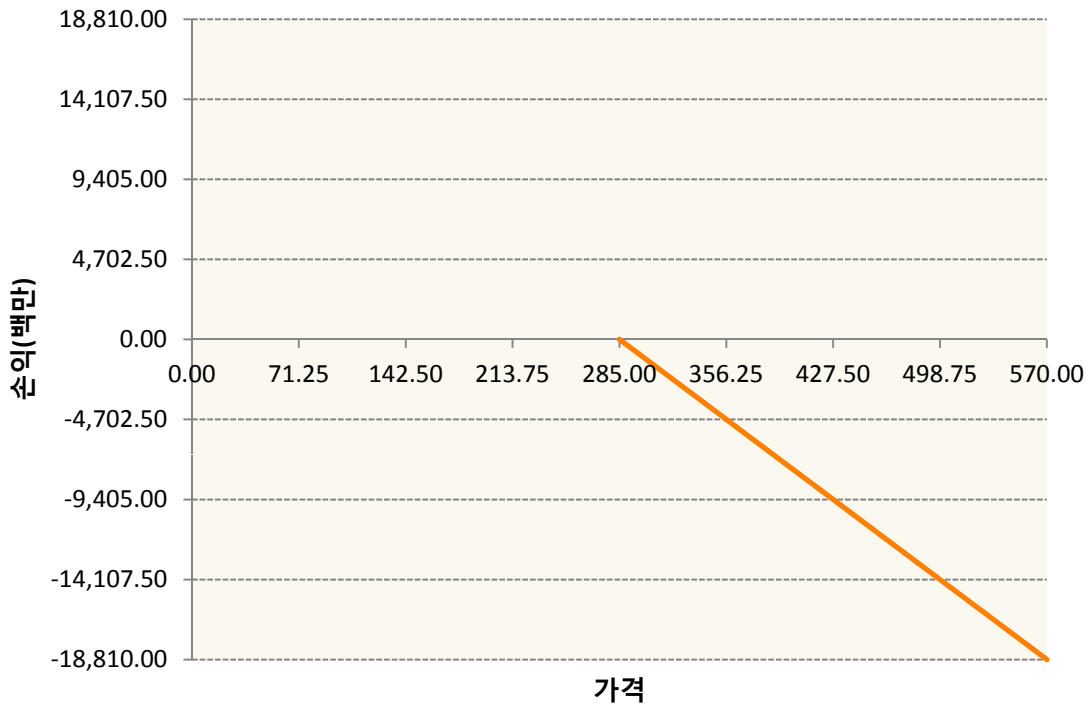


KR4201P62826-2019-06 콜282.5

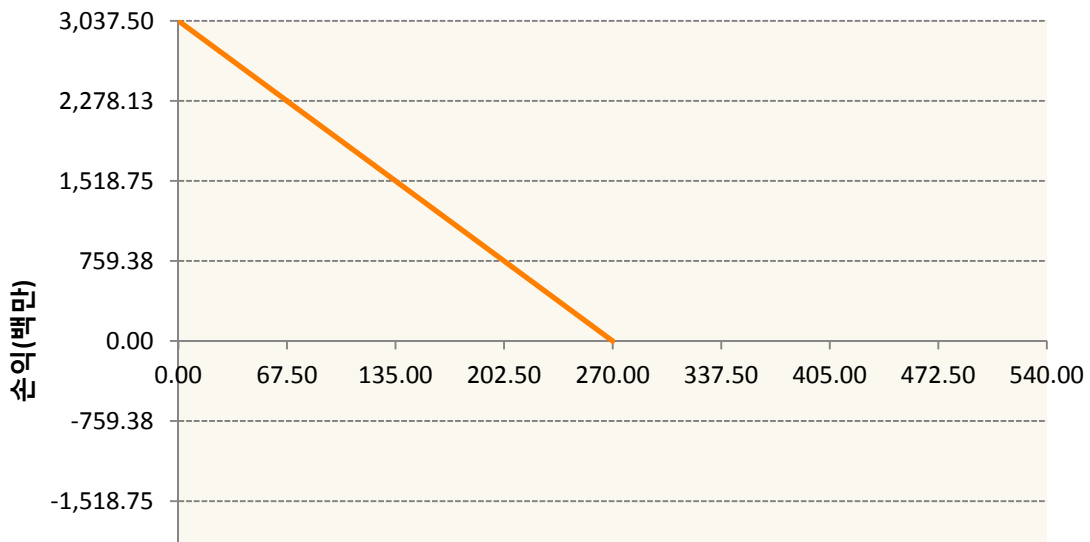


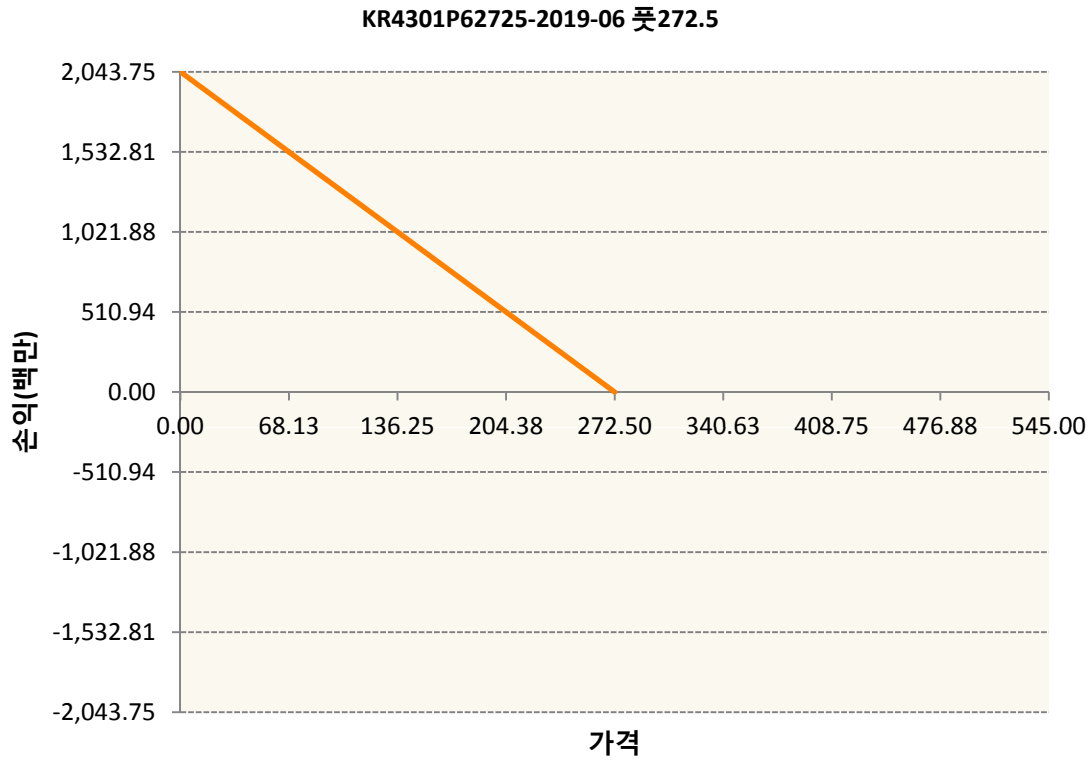
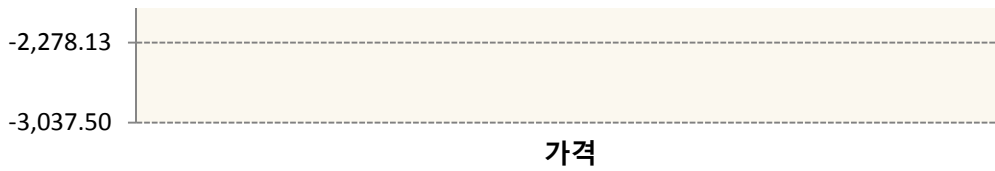


KR4201P62859-2019-06 콜285



KR4301P62709-2019-06 풋270





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						970
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-970	-970	-970	-970	-970	-970	-970	
-5.33%	-647	-647	-647	-647	-647	-647	-647	
-2.67%	-323	-323	-323	-323	-323	-323	-323	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	323	323	323	323	323	323	323	
5.33%	647	647	647	647	647	647	647	
8.00%	970	970	970	970	970	970	970	
KR4201P62826		2019-06 콜282.5						132
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	6	6	6	6	6	6	5	
-5.33%	6	6	6	5	5	5	5	
-2.67%	6	5	5	5	4	3	2	

0%	4	3	2	0	-2	-4	-7
2.67%	-5	-9	-12	-16	-20	-24	-29
5.33%	-39	-44	-49	-54	-59	-65	-70
8.00%	-107	-111	-115	-119	-123	-128	-132
KR4201P62859                      2019-06 콜285							506
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15	15	15	15	15	15	15
-5.33%	15	15	15	15	15	14	13
-2.67%	15	15	14	13	11	8	5
0%	12	9	5	0	-7	-15	-24
2.67%	-12	-23	-37	-51	-67	-83	-100
5.33%	-118	-140	-163	-186	-209	-232	-255
8.00%	-374	-395	-417	-438	-461	-483	-506
KR4301P62709                      2019-06 풋270							222
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	222	222	222	222	222	222	222
-5.33%	141	141	142	142	142	142	142
-2.67%	62	62	63	64	65	66	67
0%	-7	-5	-2	0	2	5	7
2.67%	-38	-36	-35	-33	-31	-29	-27
5.33%	-42	-42	-42	-41	-41	-40	-39
8.00%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
KR4301P62725                      2019-06 풋272.5							154
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	154	154	154	154	154	154	154
-5.33%	100	100	100	100	100	100	100
-2.67%	47	47	47	47	47	48	48
0%	-4	-2	-1	0	1	3	4
2.67%	-34	-33	-31	-30	-28	-26	-25
5.33%	-41	-41	-40	-40	-39	-38	-37
8.00%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41

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

(단위:백만원)

**1,444**

공시일	2019-06-07
기준일	2019-06-05

## 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	17,571	0	17,571	

### 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	2019-06-07
기준일	2019-06-05

## 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	55,955	0	55,955	

### 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	2019-06-07
기준일	2019-06-05

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	5,893	0	5,893	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	319,758	0	319,758	
누계	통화	선도	0	384,224	-384,224	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		377
FX21019J024 KRW/USD 24-06-19E		943
FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E		377
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		75
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		992
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E		1,018
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		283
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		471
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		660
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		660
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		820
FX21019K00 KRW/USD 10-06-19E		811
FX21019K00 KRW/USD 18-06-19E		566
FX21019K01 KRW/USD 14-06-19E		660
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		566
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		471
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		566
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,414
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,320
FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E		471
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E		792
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E		630
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		471
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		377
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		792

FX21019K02 KRW/USD 24-06-19E	377
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E	943
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E	1,509
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E	283
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E	1,226
FX21019K04 KRW/USD 28-06-19E	1,282
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	660
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	566
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	754
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	754
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	471
FX21019M0( KRW/USD 10-07-19E	283
FX21019M0( KRW/USD 10-07-19E	943
FX21019M0( KRW/USD 10-07-19E	189
FX21019M0( KRW/USD 10-07-19E	877
FX21019M0( KRW/USD 10-07-19E	1,047
FX21019M0( KRW/USD 10-07-19E	1,886

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

(단위:백만원)

**10,291**

공시일	2019-06-07
기준일	2019-06-05

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

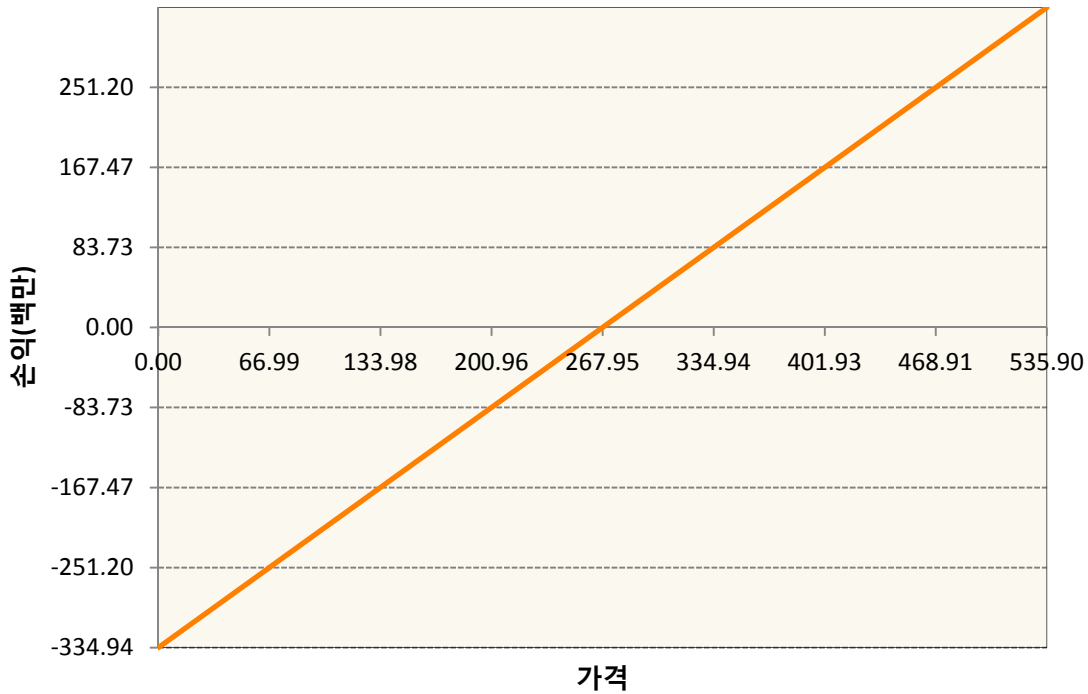
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

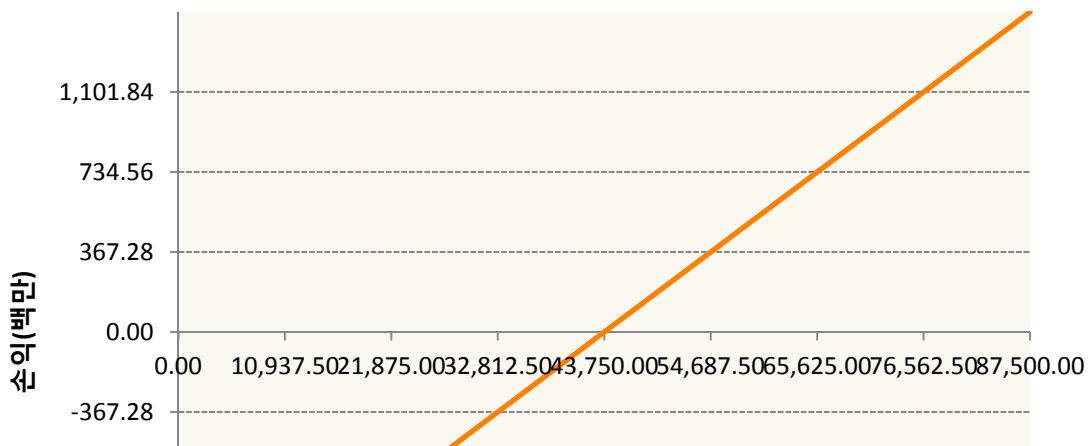
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,804	0	1,804	장내

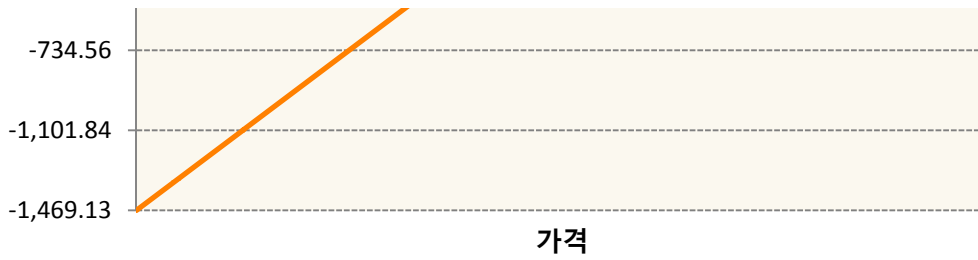
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4111P60003-2019-06 삼성전자개별선물





**3. 시나리오 별 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%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79	
-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%	79	79	79	79	79	79	79	
8.00%	118	118	118	118	118	118	118	

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

**162**

공시일	2019-06-07
기준일	2019-06-05

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

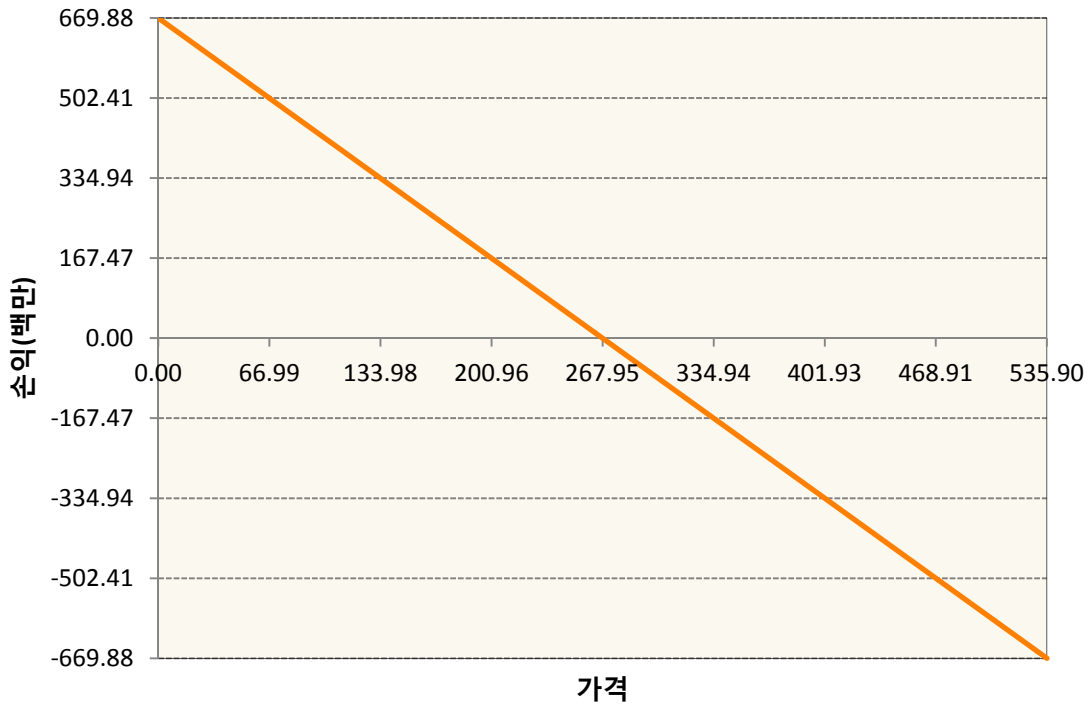
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

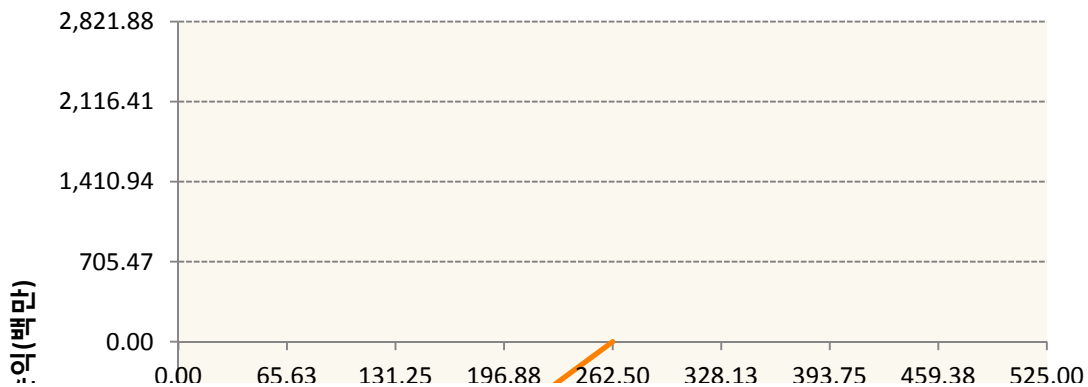
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	670	-670	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,286	-3,286	장내

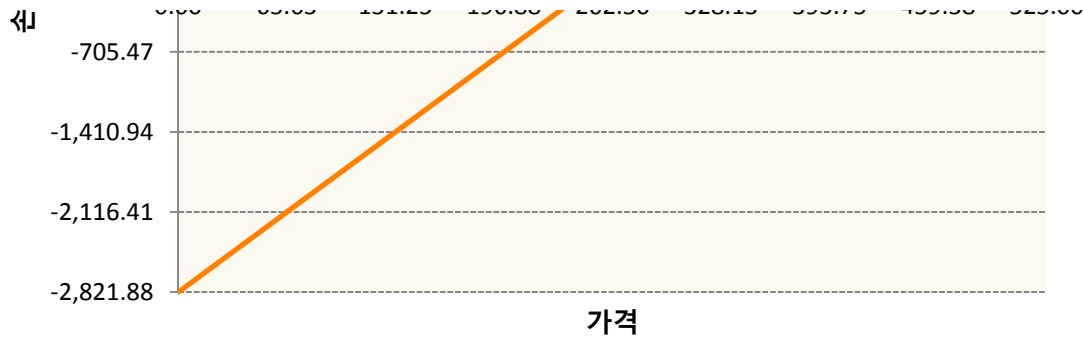
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

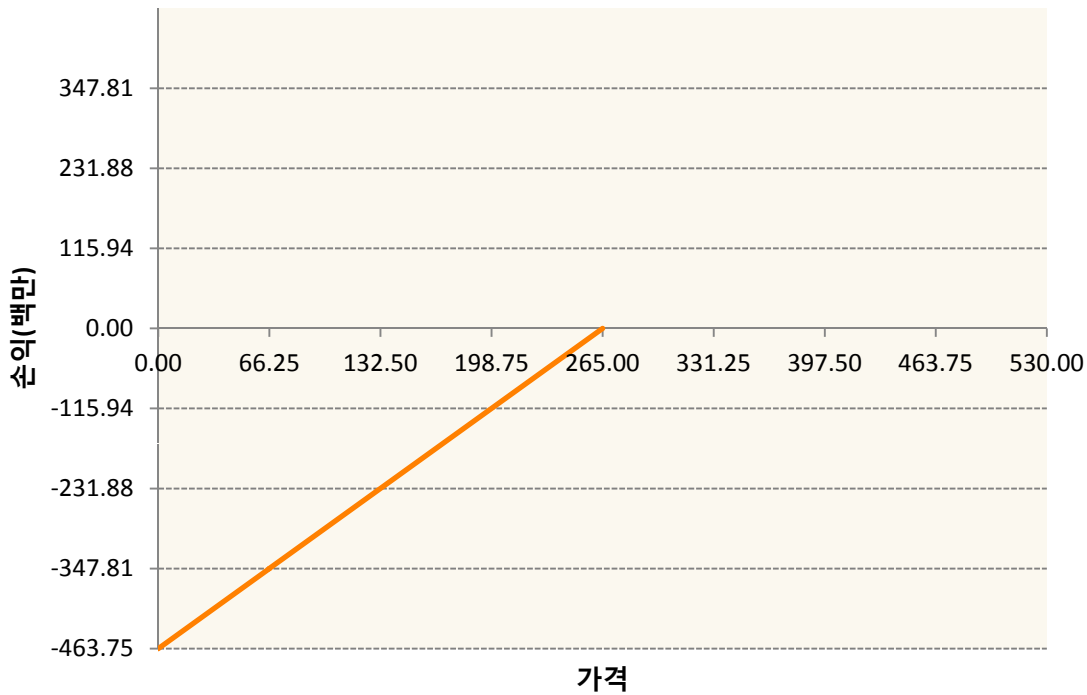


KR4301P62626-2019-06 풋262.5





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						165
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-164	-164	-164	-164	-164	-165	-165
-5.33%	-88	-88	-89	-90	-91	-92	-93
-2.67%	-23	-25	-28	-30	-32	-34	-36
0%	4	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	8	8	7	7	7	6	5
5.33%	8	8	8	8	8	8	7
8.00%	8	8	8	8	8	8	8

KR4301P62659

2019-06 풋265

30

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
-5.33%	-17	-17	-18	-18	-18	-18	-18
-2.67%	-6	-6	-6	-7	-7	-7	-8
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	2	2	2	2	2	2	2
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)

238

공시일	2019-06-07
기준일	2019-06-05

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

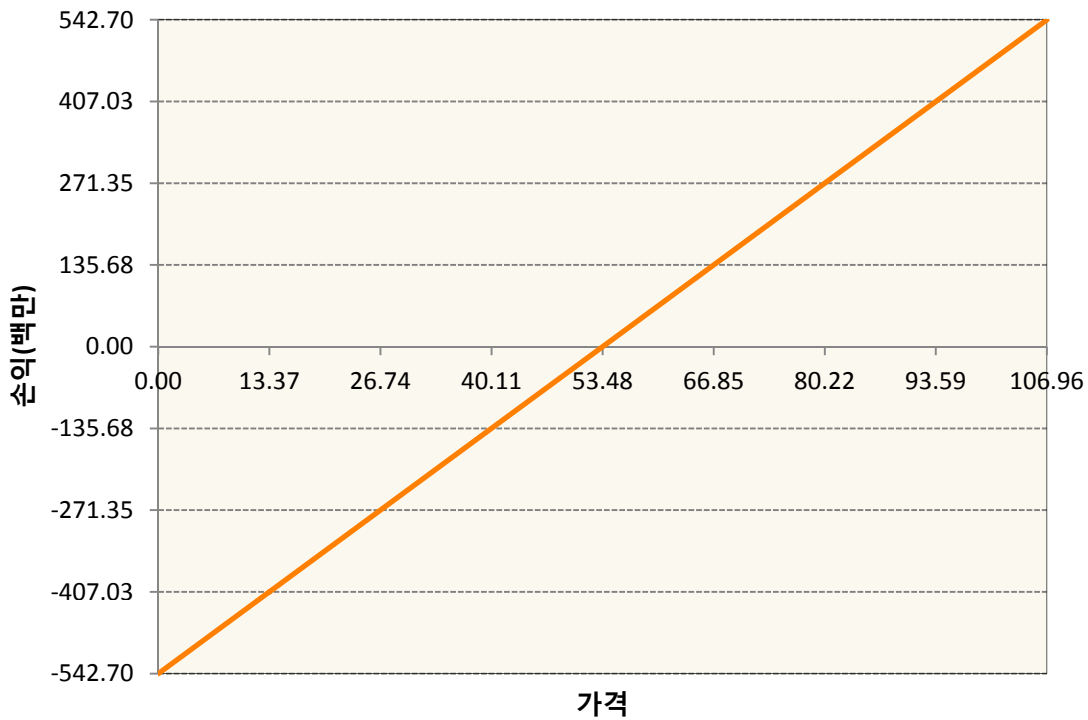
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

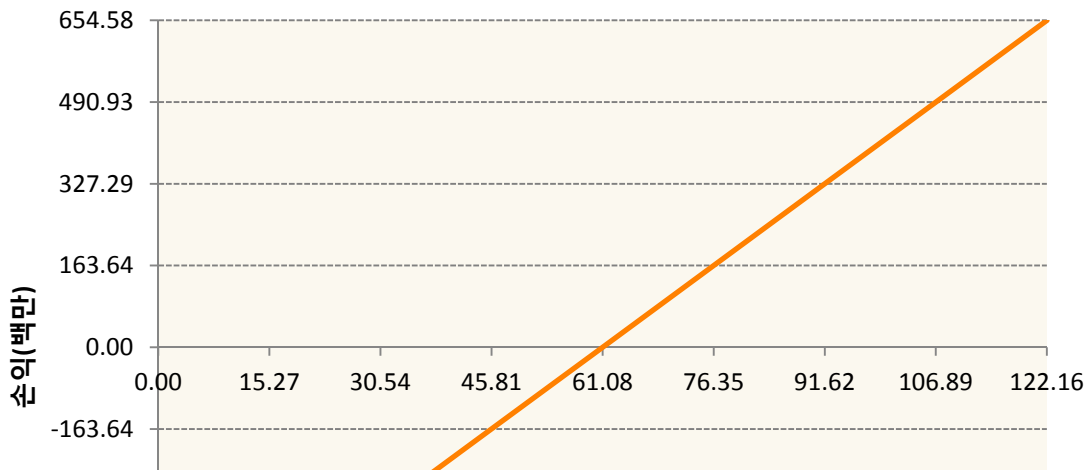
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,443	118	2,325	

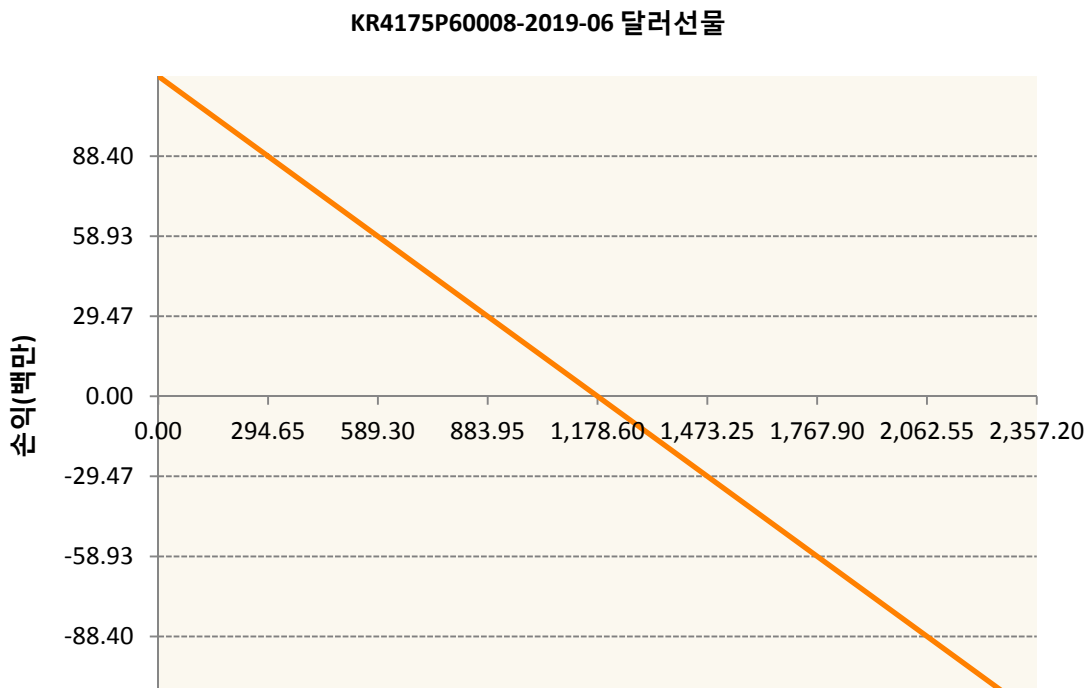
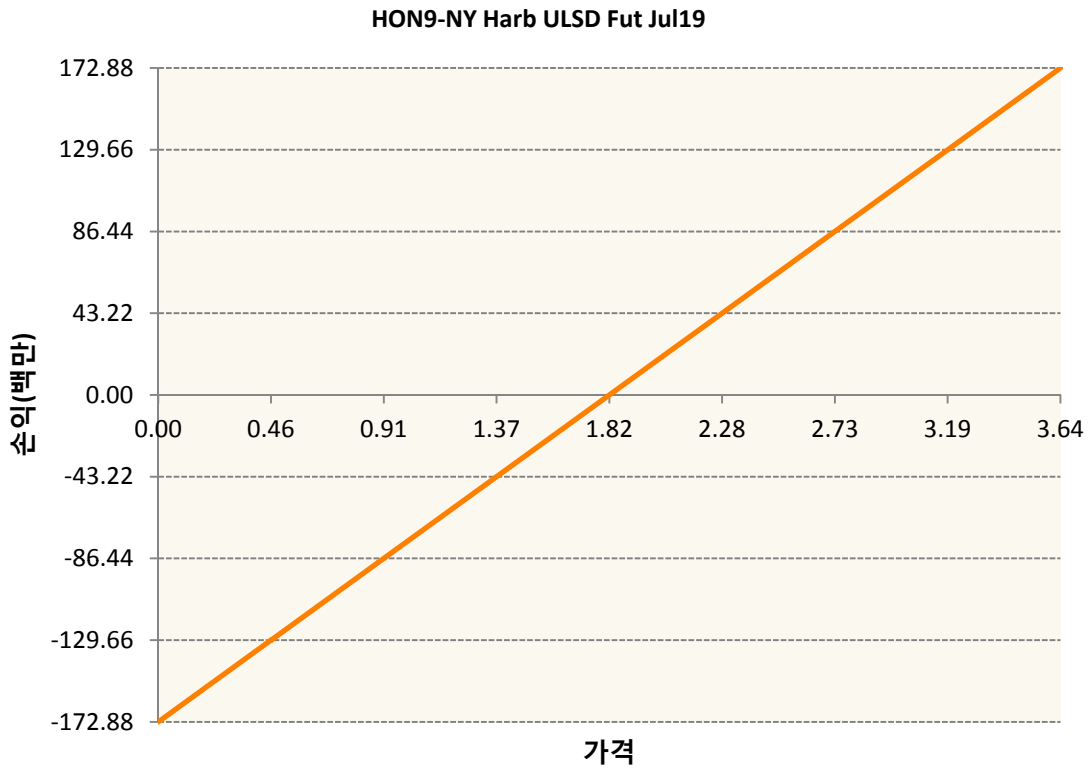
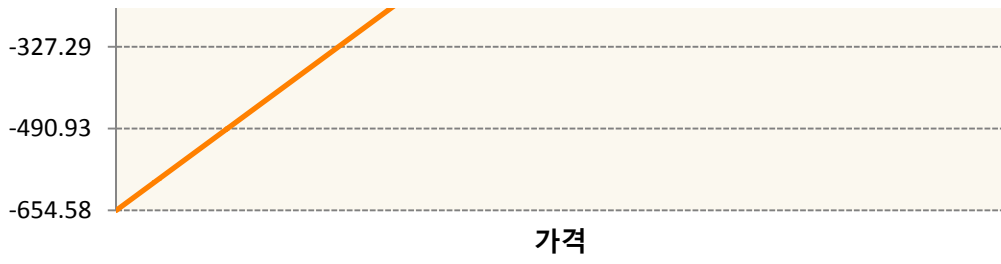
### 2. 만기시점의 손익구조

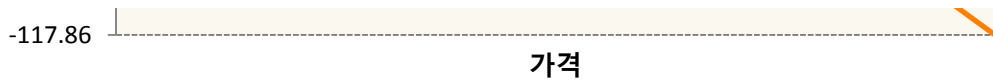
**CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19**



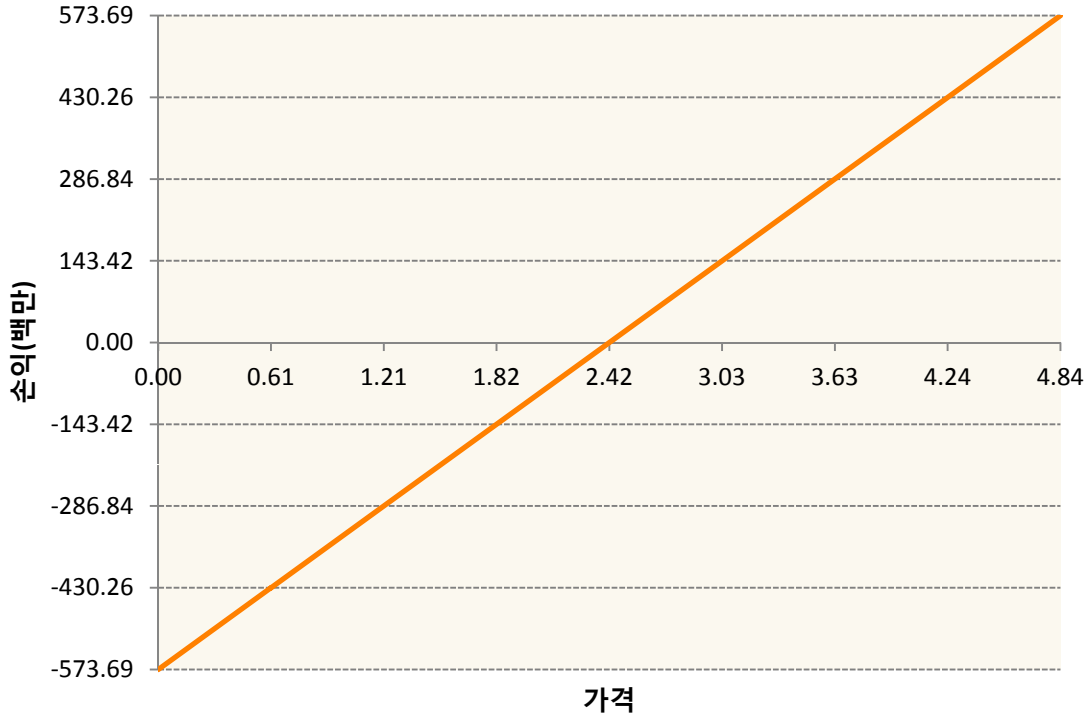
**COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19**



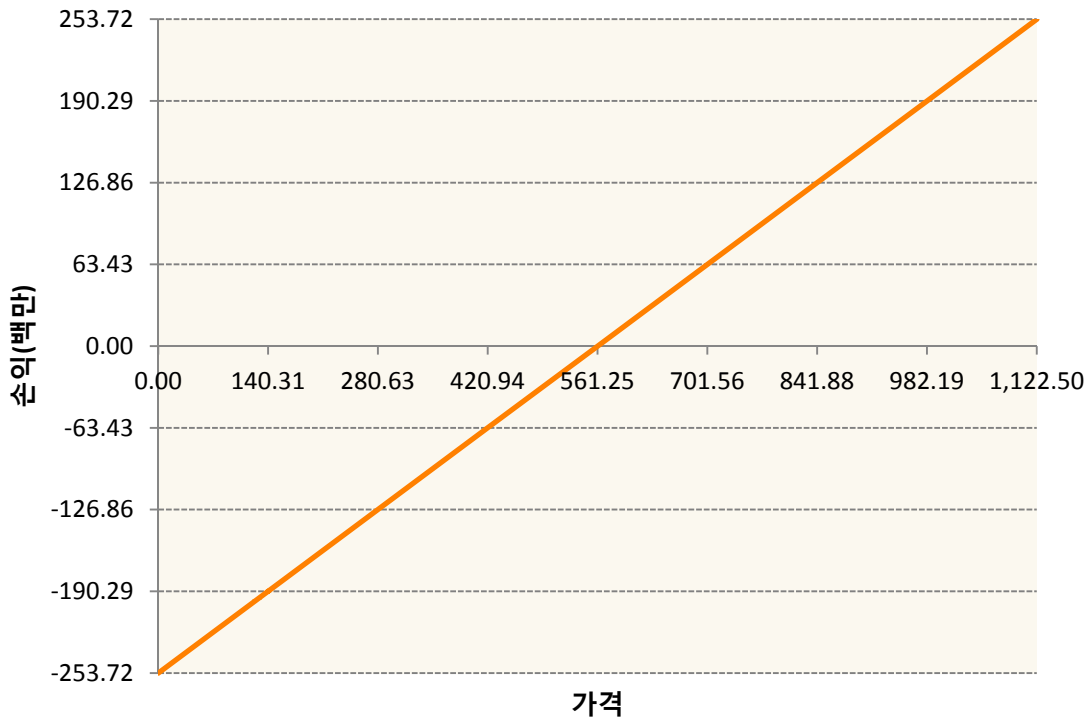




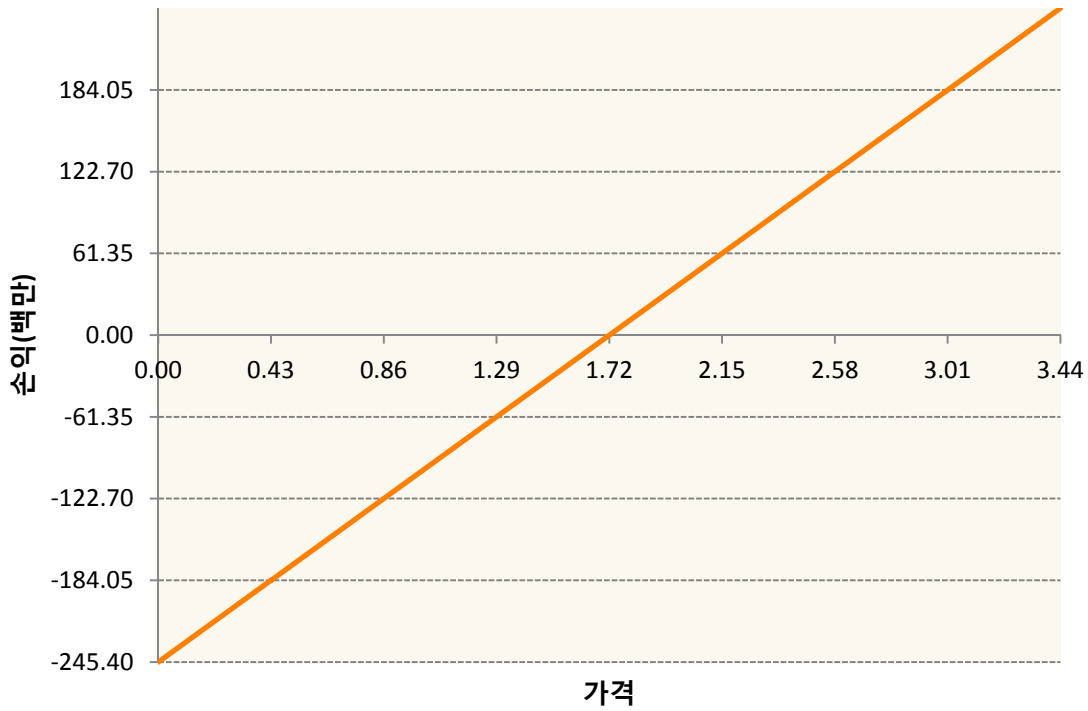
NGN19-NATURAL GAS FUTR Jul19



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	46
QSN9	Low Su Gasoil G Jul19	20
XBN9	GASOLINE RBOB FUT Jul19	20

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

(단위:백만원)

361

공시일	2019-06-07
기준일	2019-06-05

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

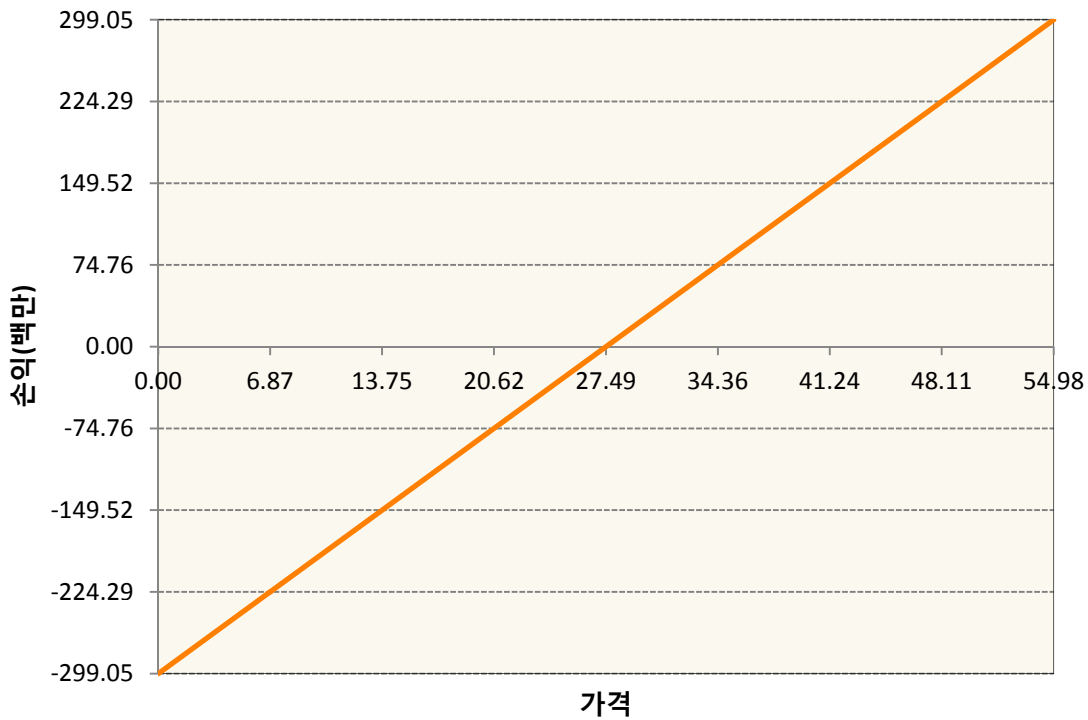
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

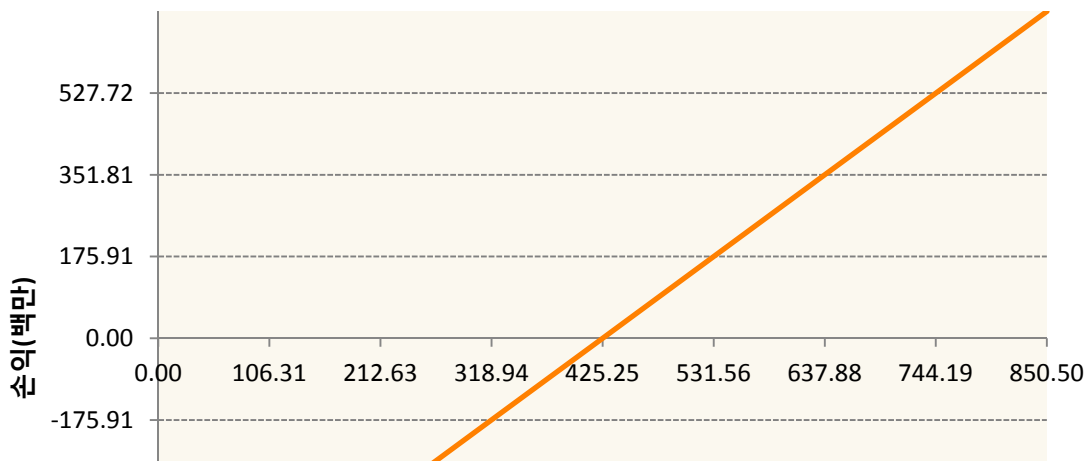
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,135	200	2,934	

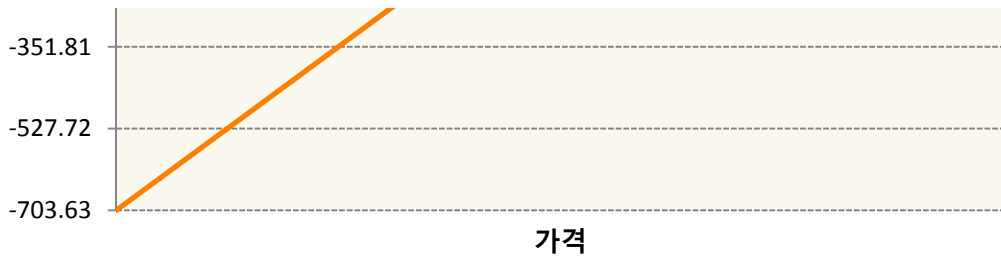
### 2. 만기시점의 손익구조

**BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19**

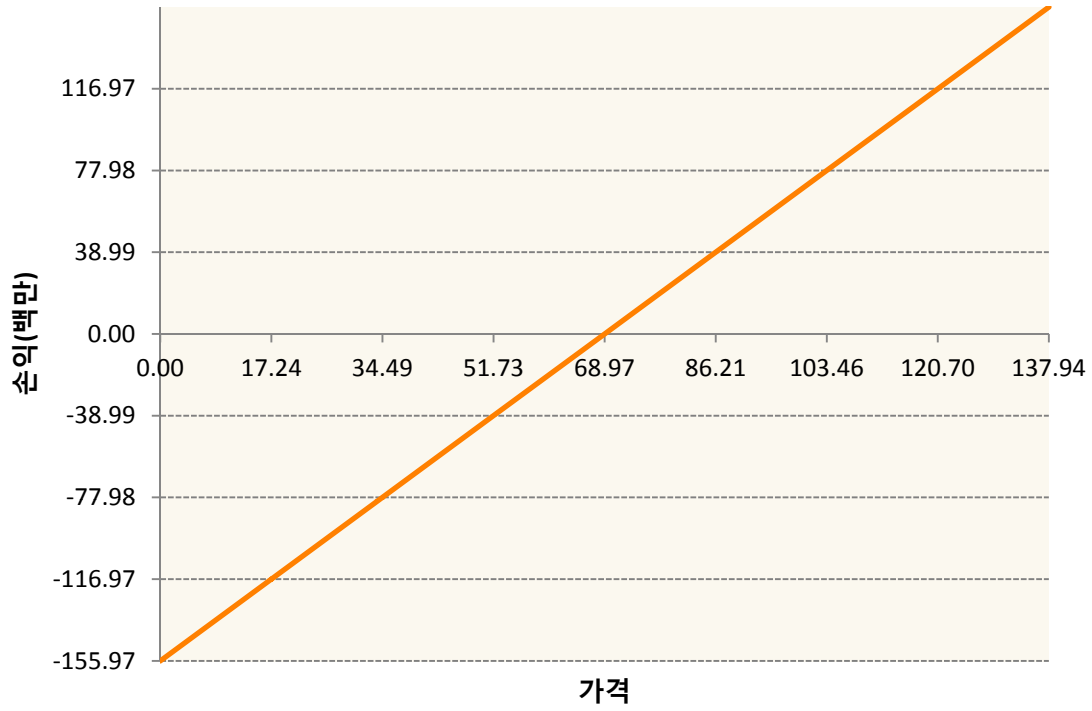


**CN9-CORN FUTURE Jul19**

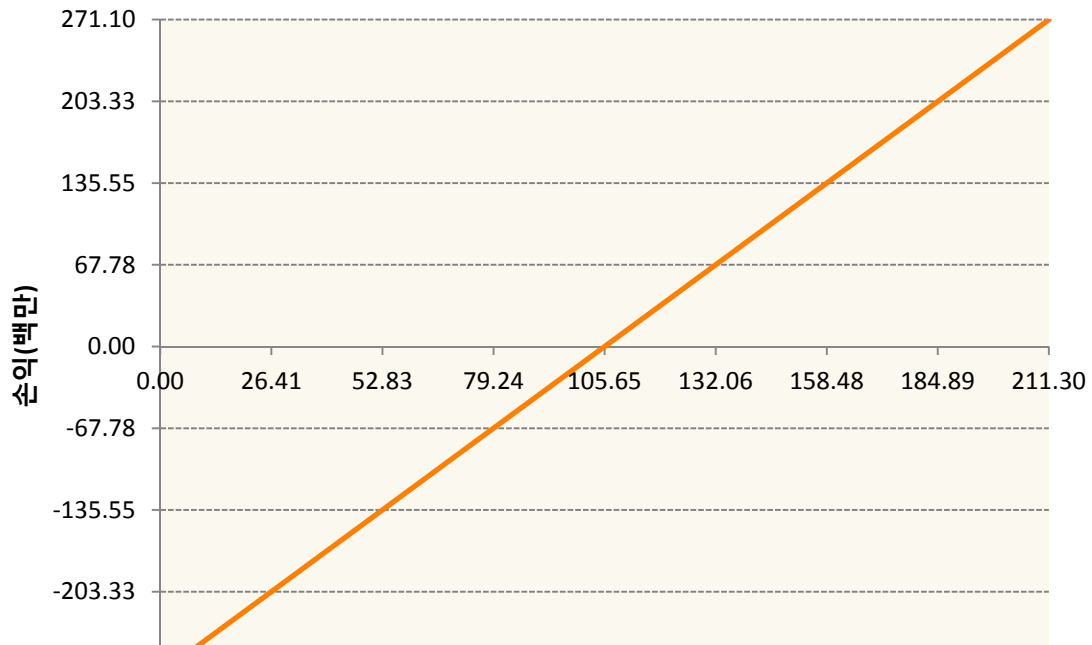


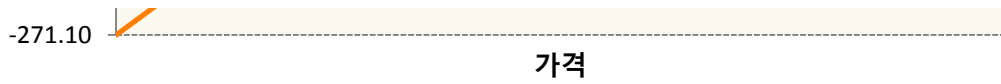


CTN9-COTTON NO.2 FUTR Jul19

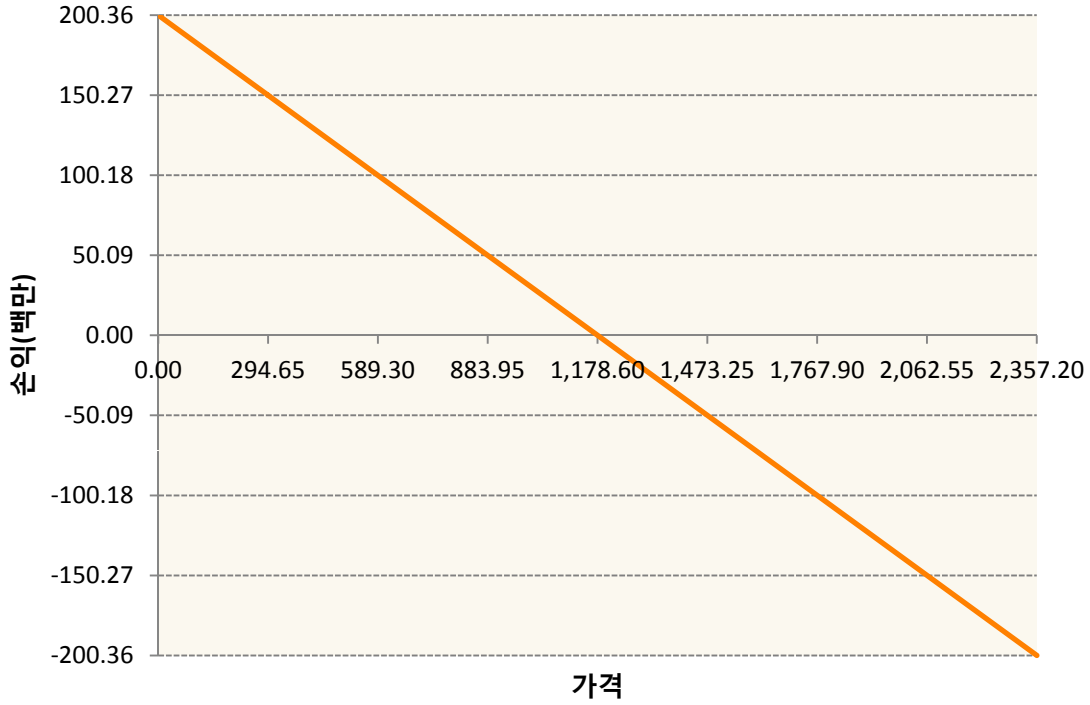


KCN9-COFFEE 'C' FUTURE Jul19

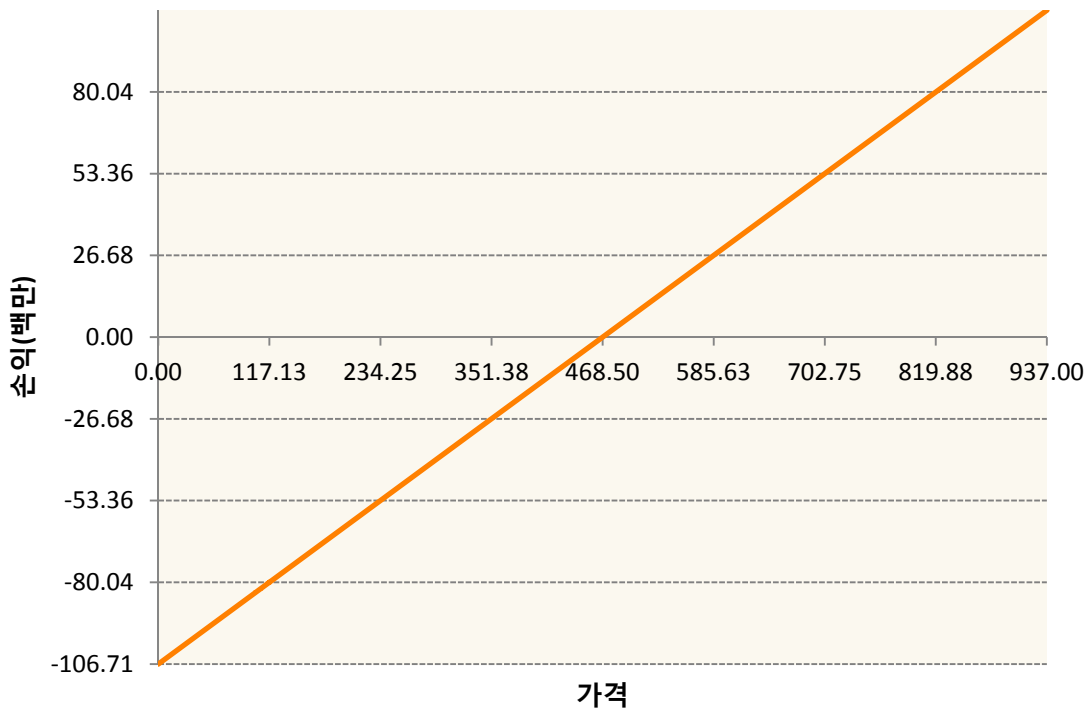




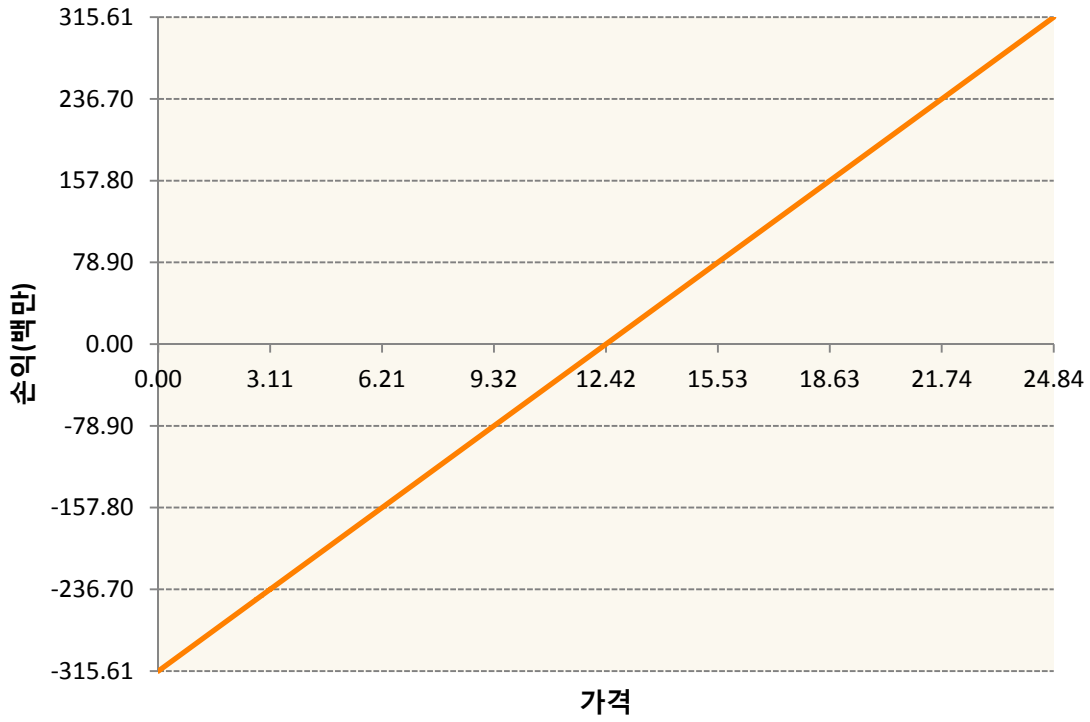
KR4175P60008-2019-06 달러선물



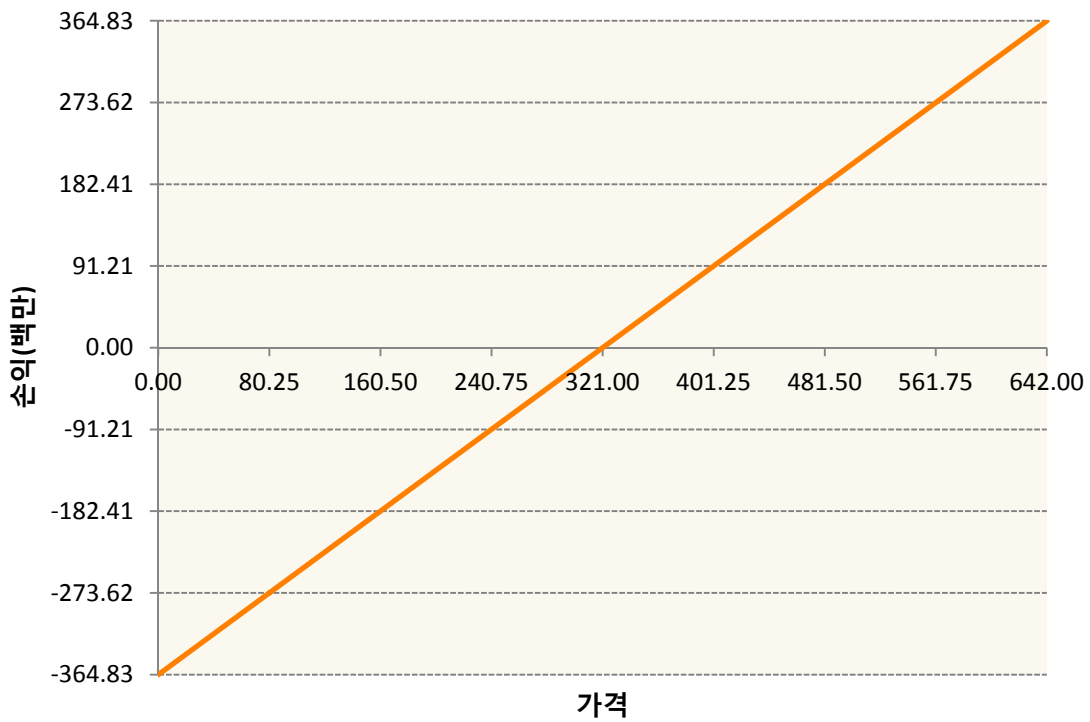
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



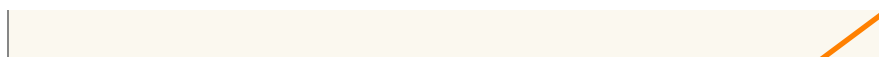
SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

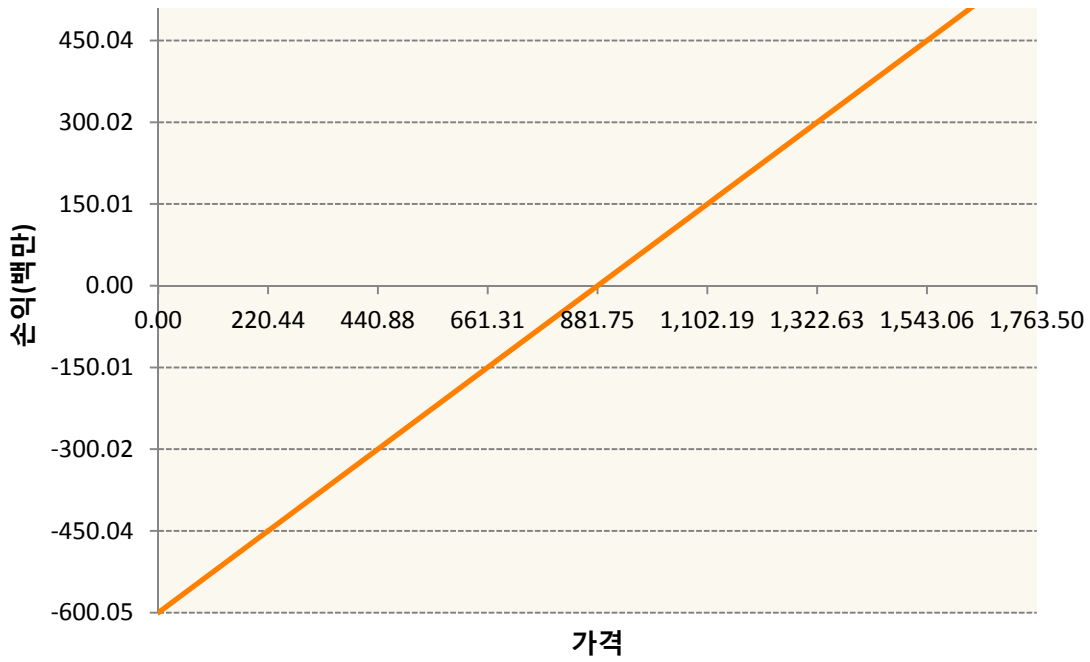


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19

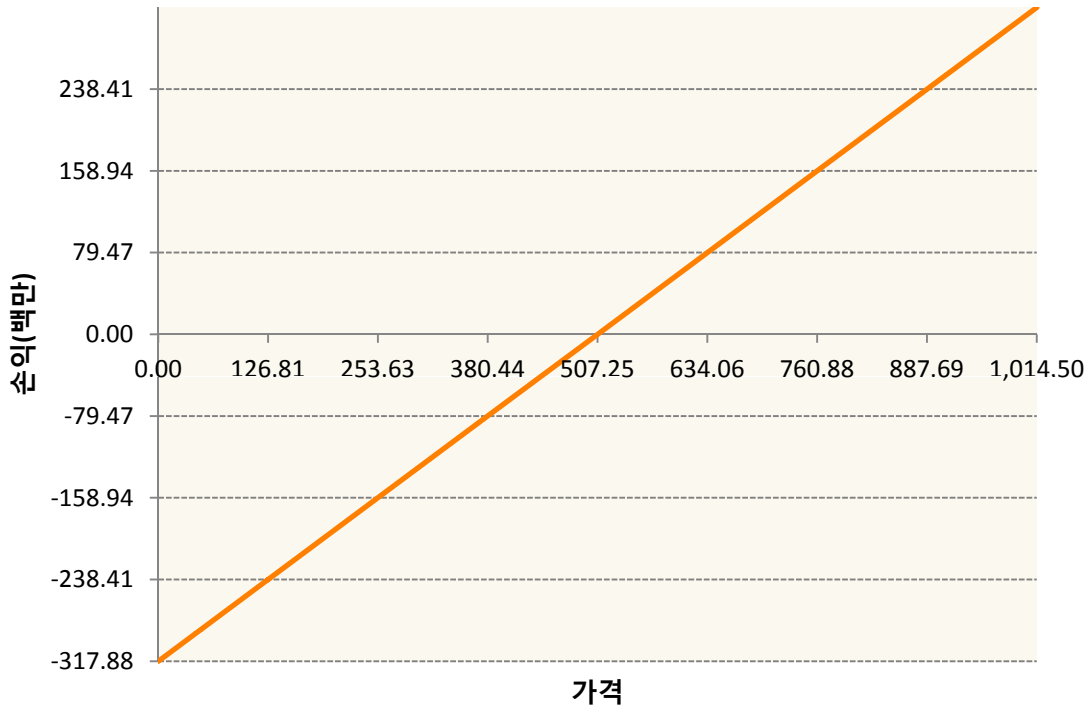


SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





WN9-WHEAT FUTURE(CBT) Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON9	SOYBEAN OIL FUTR Jul19	24
CN9	CORN FUTURE Jul19	56
CTN9	COTTON NO.2 FUTR Jul19	12
KCN9	COFFEE 'C' FUTURE Jul19	22
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)

**267**