

공시일	2019-06-10
기준일	2019-06-07

## 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)

90

공시일	2019-06-10
기준일	2019-06-07

## 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

1,126

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

681

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-10
기준일	2019-06-07

## 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)	283
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	78
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	133

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

<b>826</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-10
기준일	2019-06-07

## 유로인덱스모(주식-파생형)

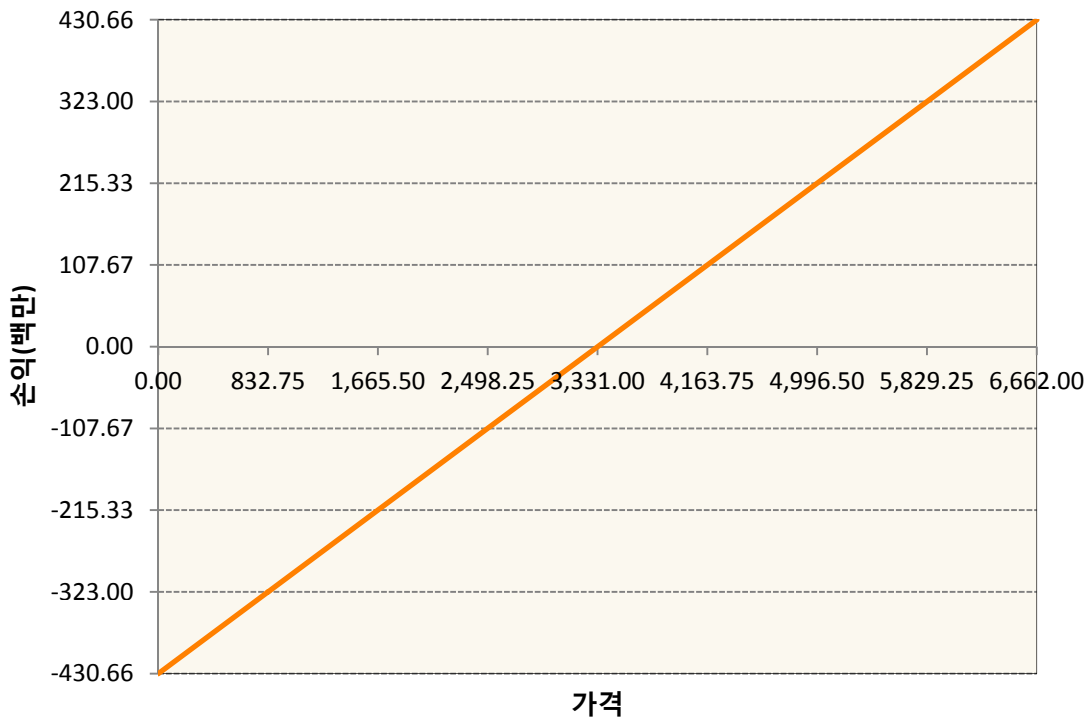
### 1. 계약금액

(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

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	2019-06-10
기준일	2019-06-07

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

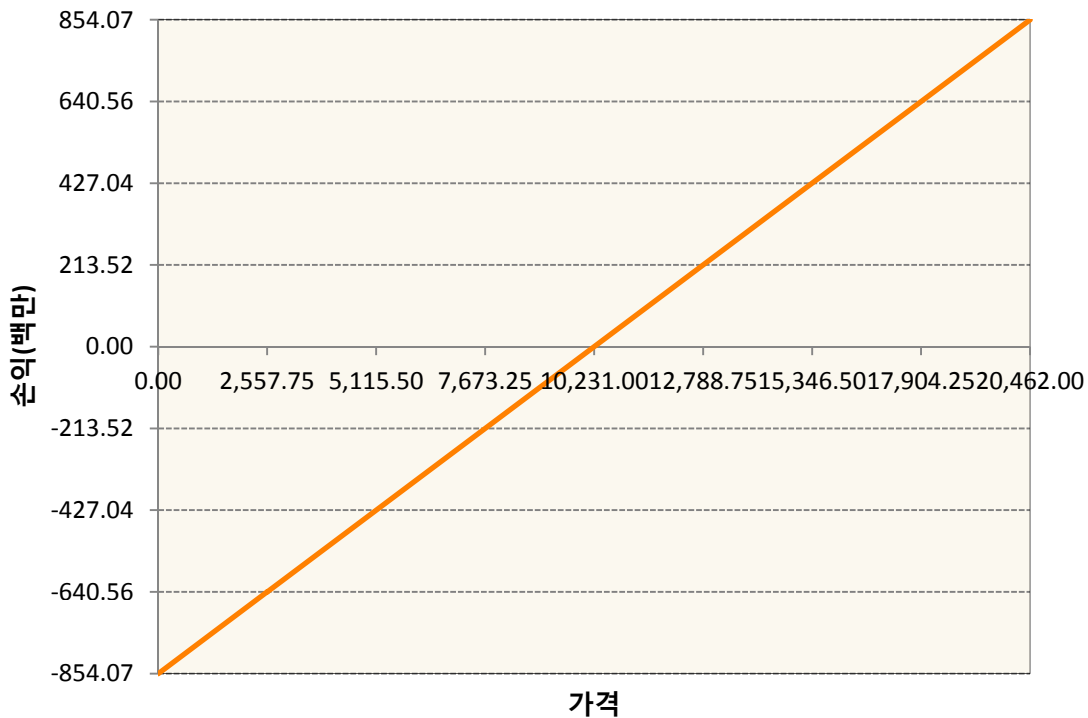
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	854	0	854	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM9	HSCEI Futures Jun19	68
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

69
----

공시일	2019-06-10
기준일	2019-06-07

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

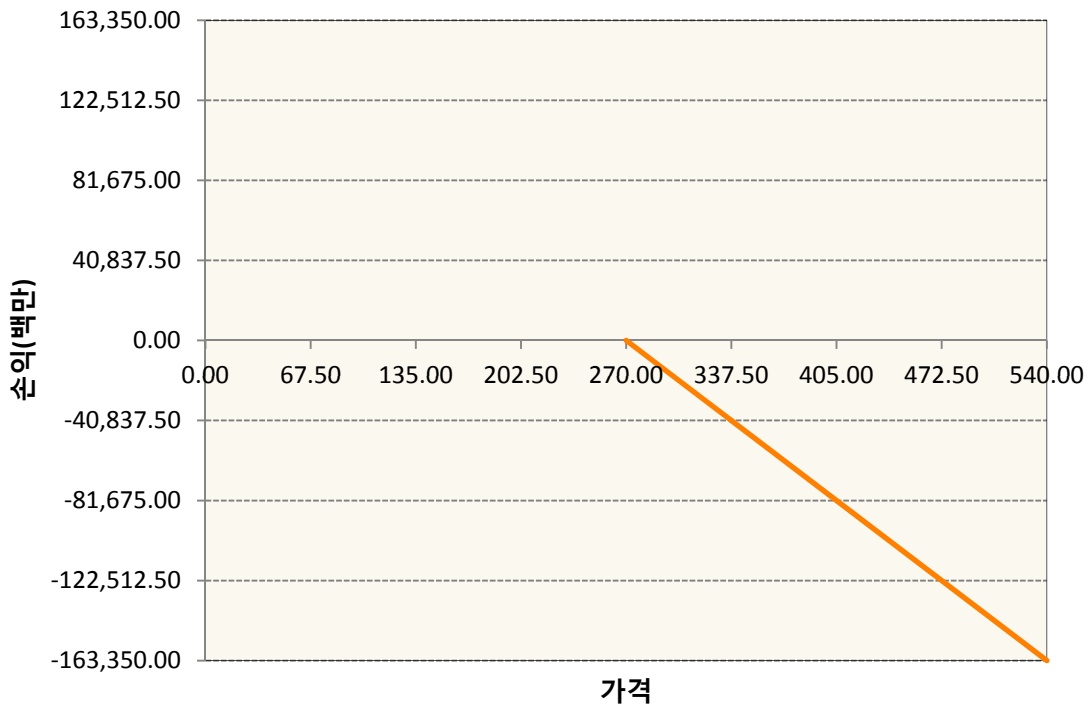
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

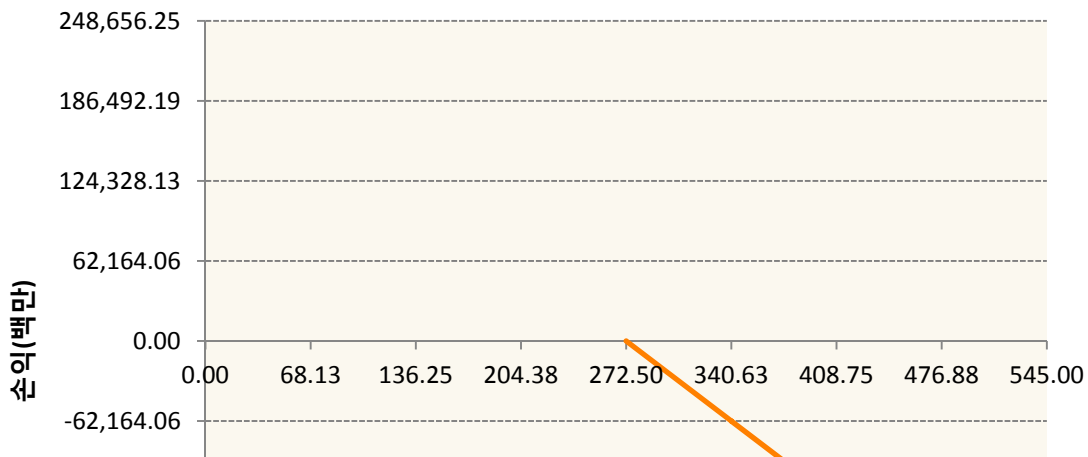
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	614,506	-614,506	장내

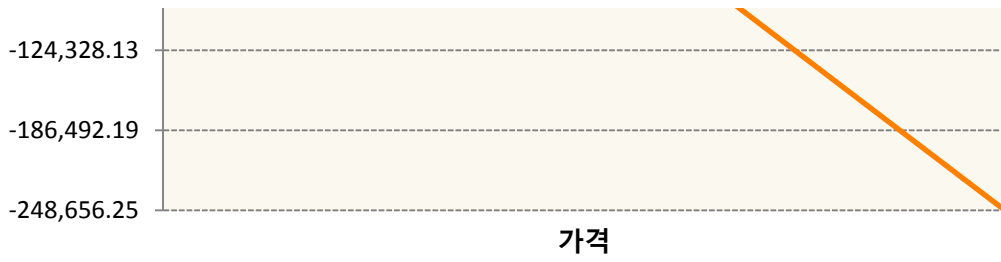
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P62701-2019-06 콜270



KR4201P62727-2019-06 콜272.5





KR4301P62709-2019-06 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P62701		2019-06 콜270					10,367
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,674	1,673	1,672	1,668	1,662	1,652	1,638
-5.33%	1,665	1,653	1,633	1,605	1,568	1,522	1,467
-2.67%	1,507	1,427	1,336	1,233	1,121	1,002	876
0%	528	353	177	0	-177	-355	-533
2.67%	-2,088	-2,226	-2,372	-2,523	-2,679	-2,838	-3,000
5.33%	-5,965	-6,007	-6,063	-6,131	-6,210	-6,299	-6,397
8.00%	-10,237	-10,242	-10,252	-10,269	-10,293	-10,326	-10,367
KR4201P62727		2019-06 콜272.5					14,320
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,697	1,697	1,696	1,694	1,689	1,681	1,668

-5.33%	1,693	1,685	1,671	1,647	1,614	1,568	1,511
-2.67%	1,589	1,516	1,424	1,314	1,187	1,047	893
0%	707	479	242	0	-247	-497	-751
2.67%	-2,330	-2,586	-2,846	-3,109	-3,374	-3,640	-3,908
5.33%	-7,667	-7,777	-7,907	-8,055	-8,219	-8,396	-8,583
8.00%	-13,997	-14,016	-14,048	-14,094	-14,155	-14,230	-14,320
KR4301P62709                      2019-06 풋270							14,964
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,963	-14,963	-14,963	-14,963	-14,963	-14,964	-14,964
-5.33%	-9,600	-9,600	-9,601	-9,602	-9,605	-9,611	-9,619
-2.67%	-4,257	-4,276	-4,303	-4,339	-4,383	-4,436	-4,495
0%	401	269	135	0	-136	-273	-411
2.67%	2,287	2,214	2,132	2,042	1,945	1,843	1,735
5.33%	2,453	2,449	2,442	2,429	2,412	2,387	2,357
8.00%	2,455	2,455	2,455	2,454	2,454	2,452	2,448

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

(단위:백만원)

**45,652**

공시일	2019-06-10
기준일	2019-06-07

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

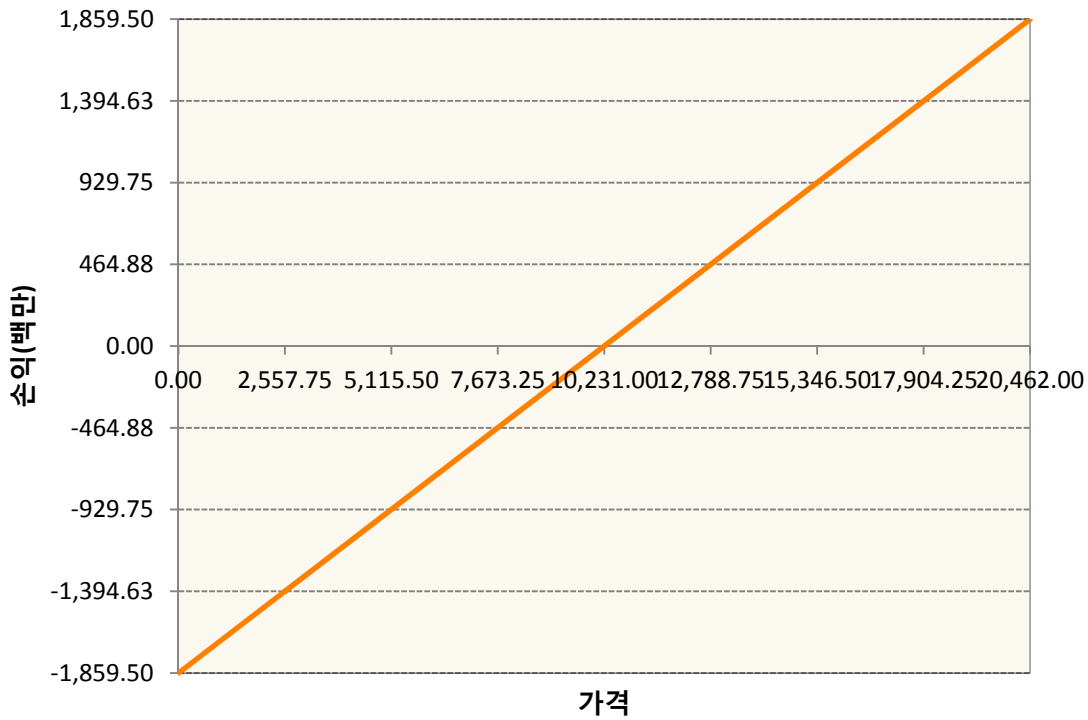
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

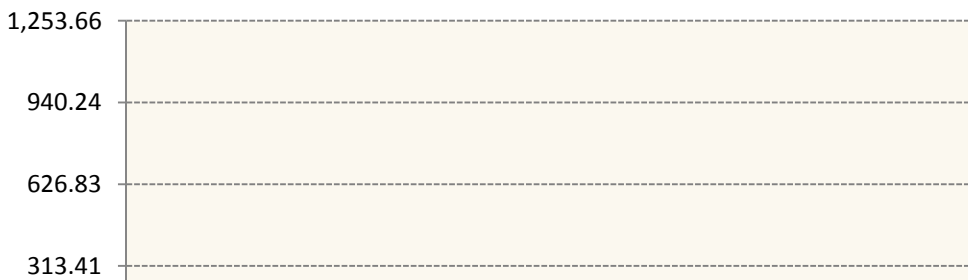
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,860	0	1,860	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,039	-5,039	장내
누계	통화	선도	151	3,164	-3,014	장외

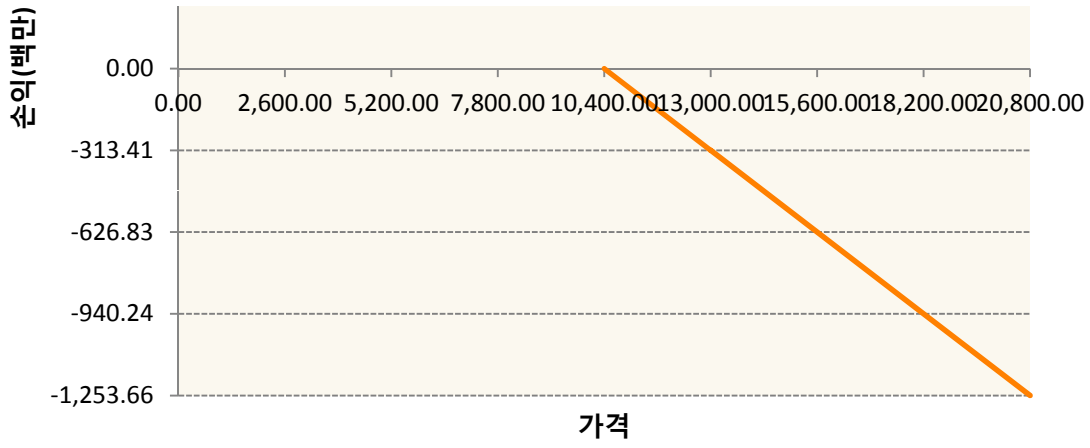
### 2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19

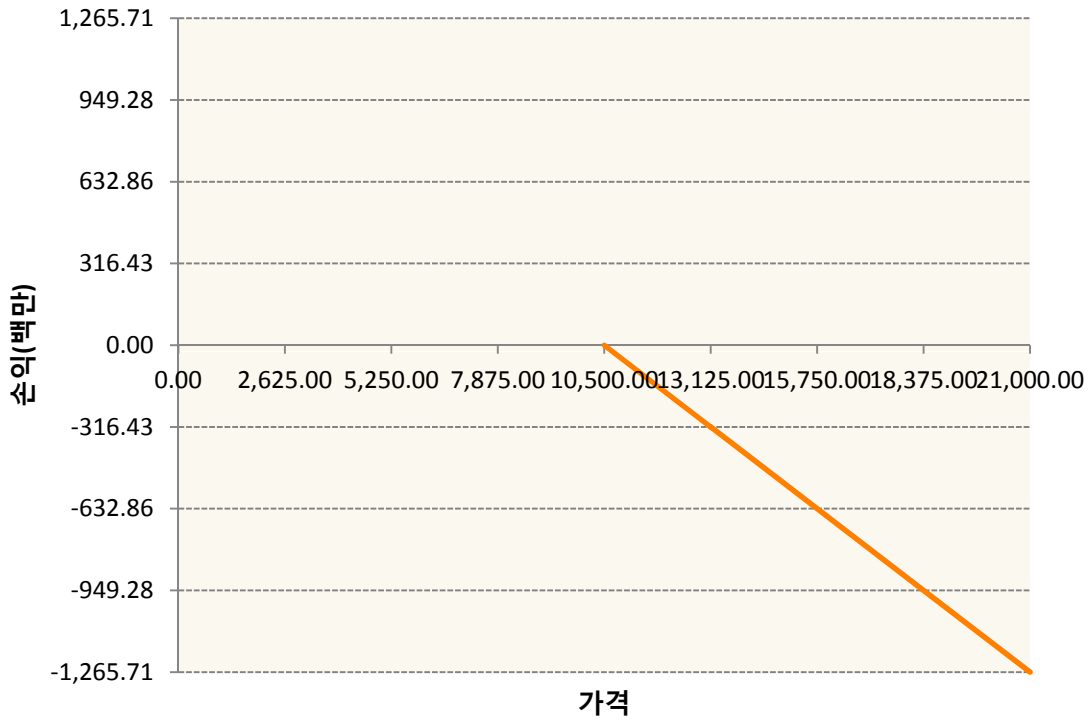


OHHIM9-C104-HSCEI

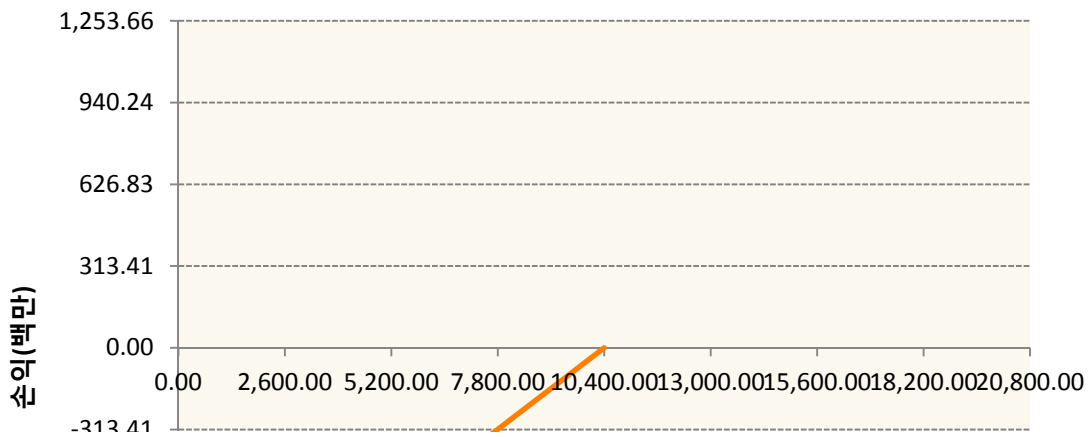


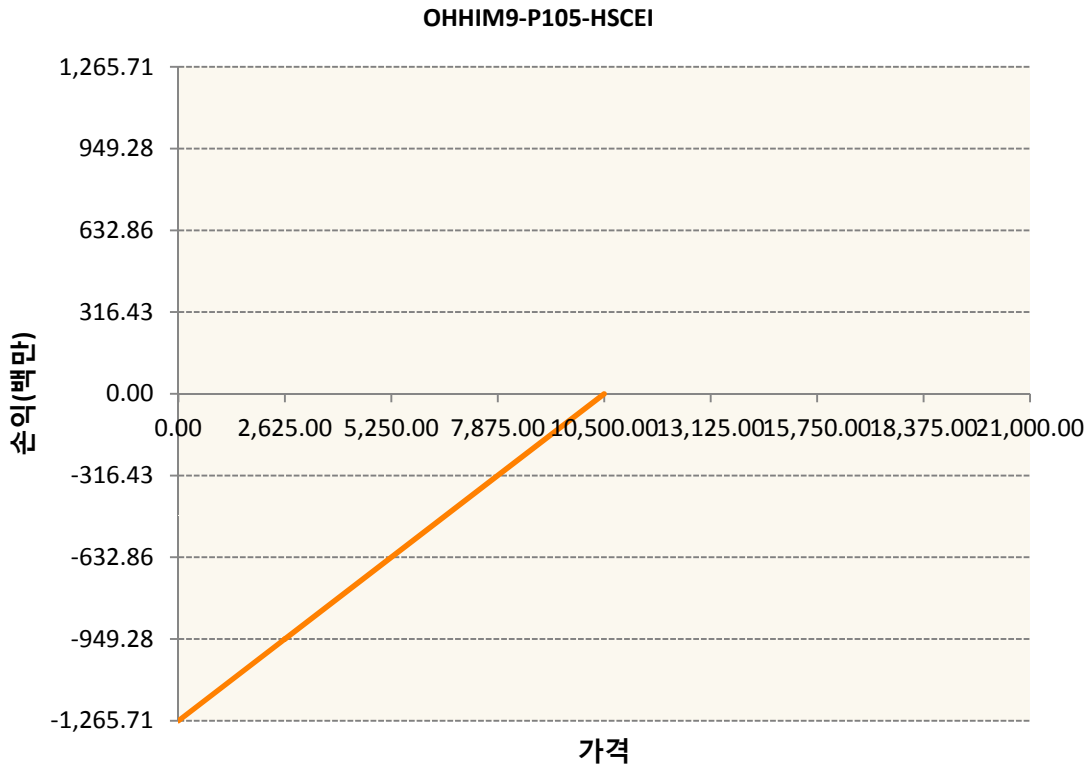


OHHIM9-C105-HSCEI



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)
	648

공시일	2019-06-10
기준일	2019-06-07

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

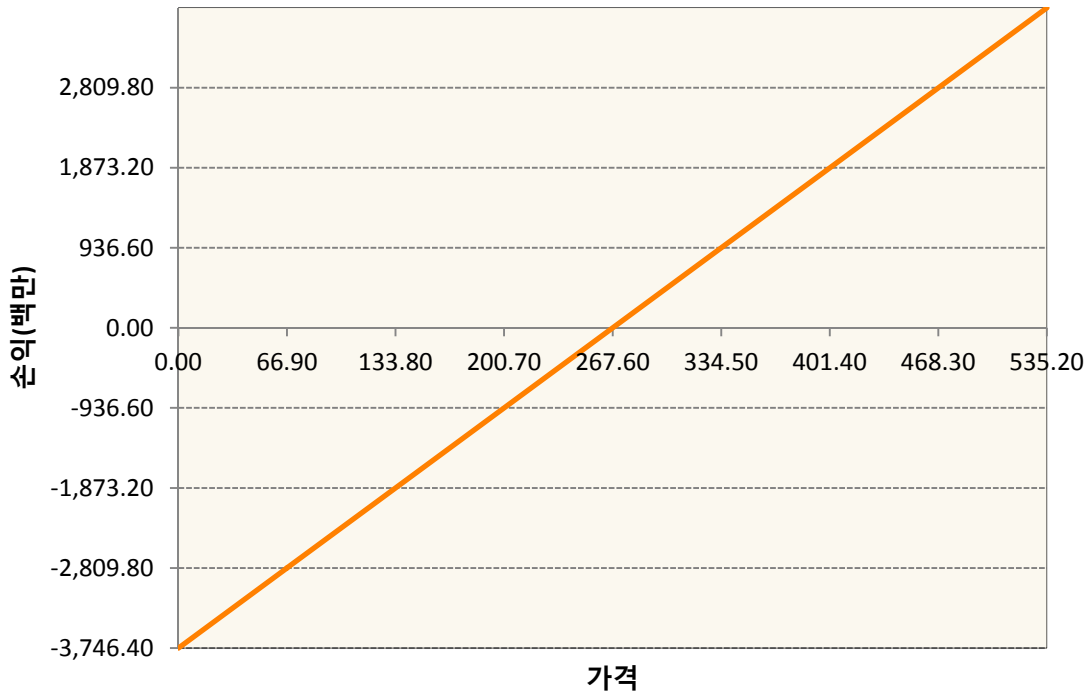
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

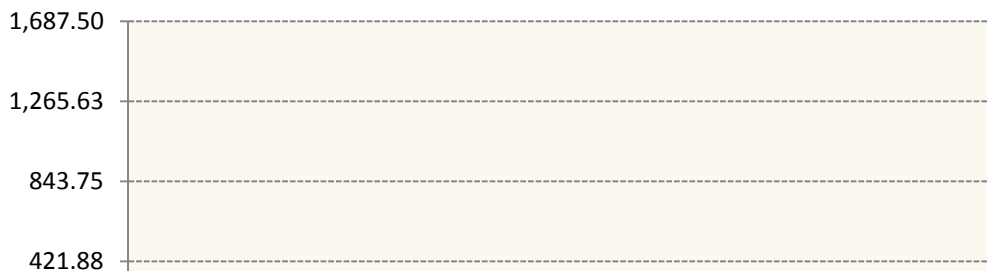
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,746	0	3,746	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	21,759	-21,759	장내

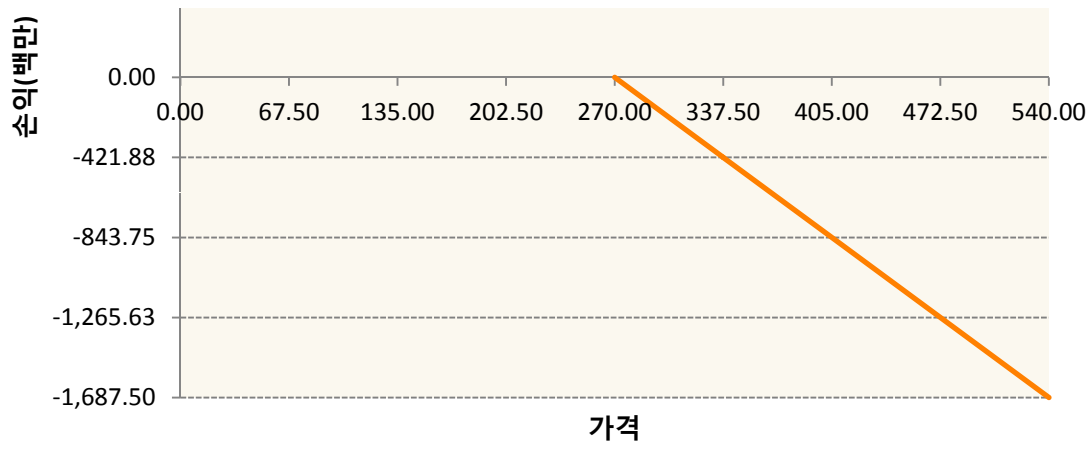
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

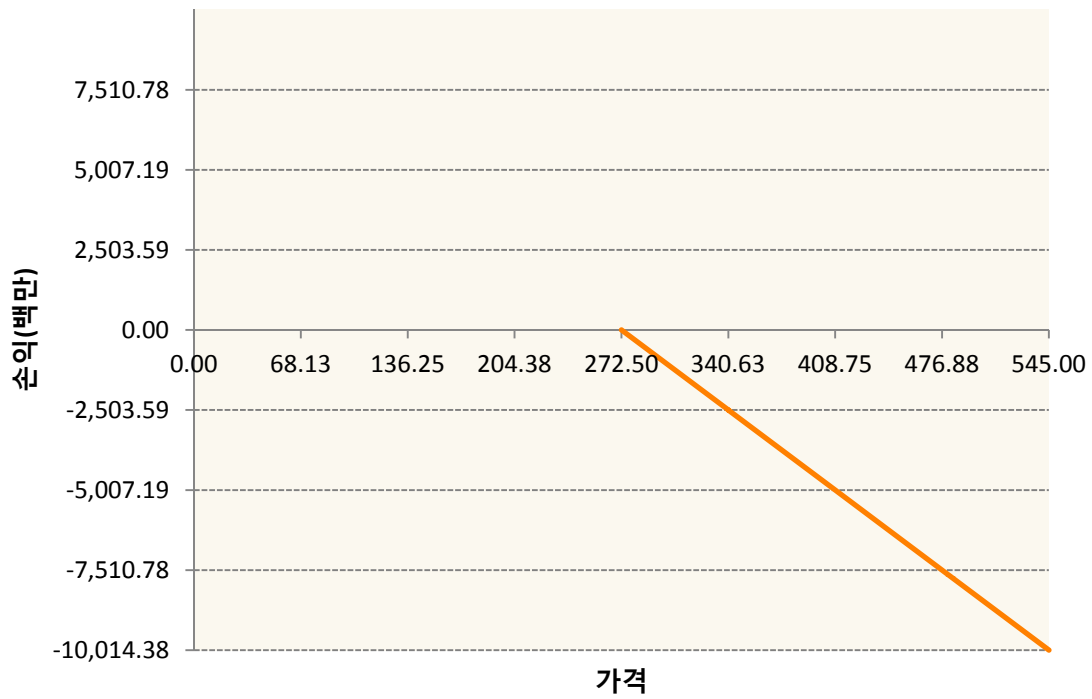


KR4201P62701-2019-06 콜270

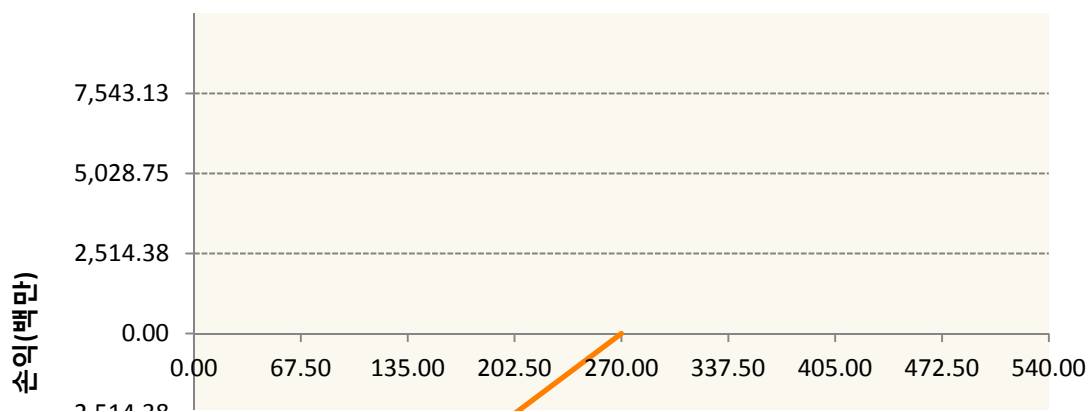


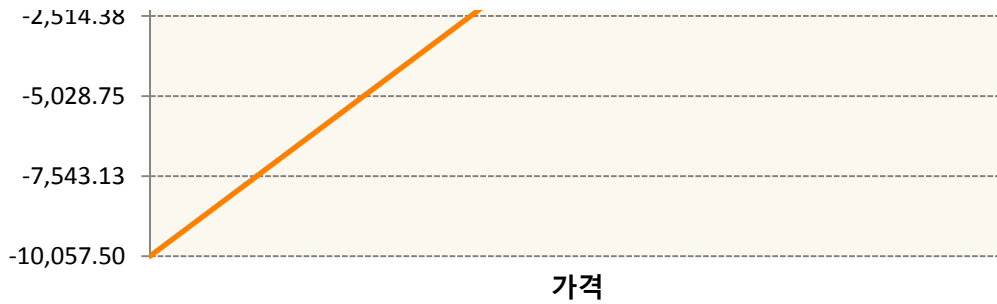


**KR4201P62727-2019-06 콜272.5**



**KR4301P62709-2019-06 풋270**





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,190
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	
-5.33%	-793	-793	-793	-793	-793	-793	-793	
-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%	793	793	793	793	793	793	793	
8.00%	1,190	1,190	1,190	1,190	1,190	1,190	1,190	
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%	-401	-401	-401	-401	-401	-401	-401	
-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%	401	401	401	401	401	401	401	
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						107
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	17	17	17	17	17	17	17
-5.33%	17	17	17	17	16	16	15
-2.67%	16	15	14	13	12	10	9
0%	5	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	-22	-23	-24	-26	-28	-29	-31
5.33%	-62	-62	-63	-63	-64	-65	-66
8.00%	-106	-106	-106	-106	-106	-107	-107
KR4201P62727                      2019-06 콜272.5							577
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	68	68	68	68	68	68	67
-5.33%	68	68	67	66	65	63	61
-2.67%	64	61	57	53	48	42	36
0%	28	19	10	0	-10	-20	-30
2.67%	-94	-104	-115	-125	-136	-147	-157
5.33%	-309	-313	-318	-324	-331	-338	-346
8.00%	-564	-564	-566	-568	-570	-573	-577
KR4301P62709                      2019-06 풋270							743
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-743	-743	-743	-743	-743	-743	-743
-5.33%	-477	-477	-477	-477	-477	-477	-478
-2.67%	-211	-212	-214	-216	-218	-220	-223
0%	20	13	7	0	-7	-14	-20
2.67%	114	110	106	101	97	92	86
5.33%	122	122	121	121	120	119	117
8.00%	122	122	122	122	122	122	122

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

(단위:백만원)

**3,726**

공시일	2019-06-10
기준일	2019-06-07

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

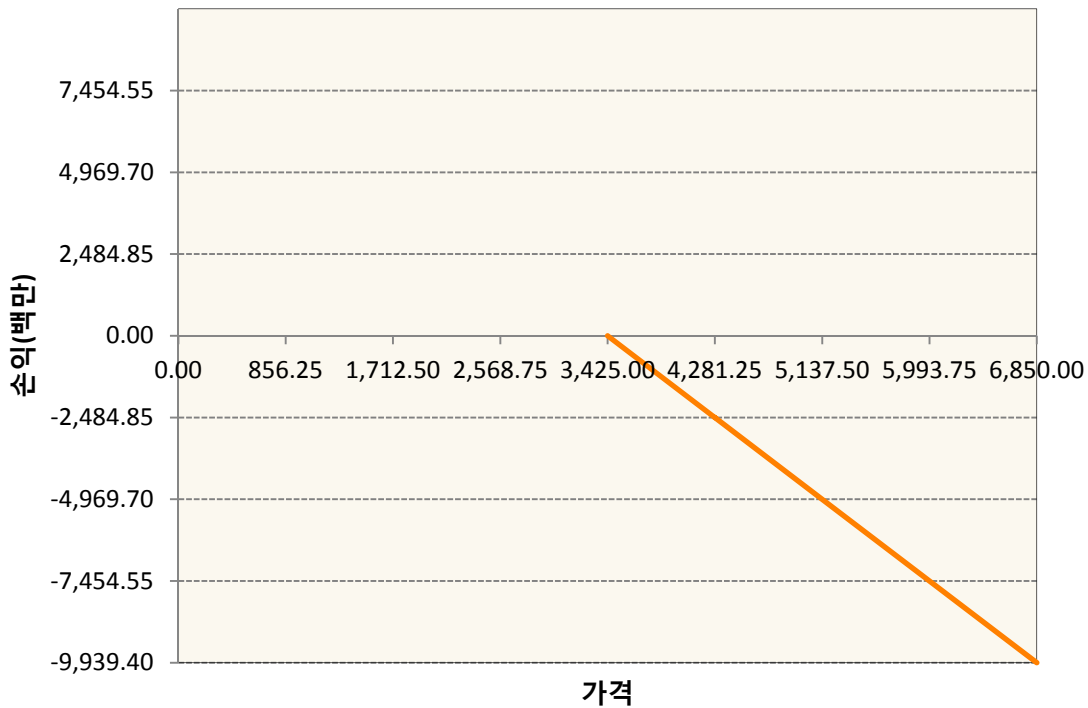
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

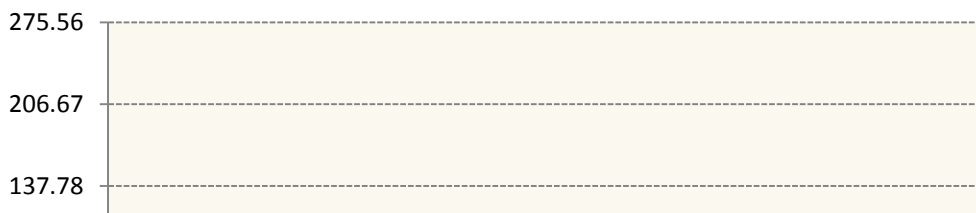
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,641	0	3,641	
누계	유가증권	스왑	56,349	0	56,349	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,430	-20,430	장내
누계	통화	선도	0	18,637	-18,637	장외

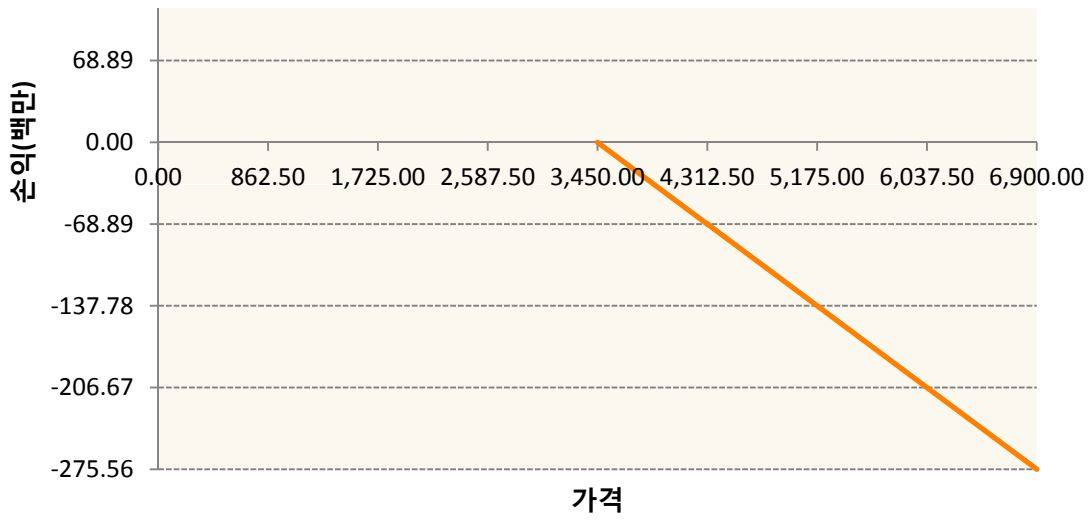
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXM9-C3425-EURO STOXX 50**

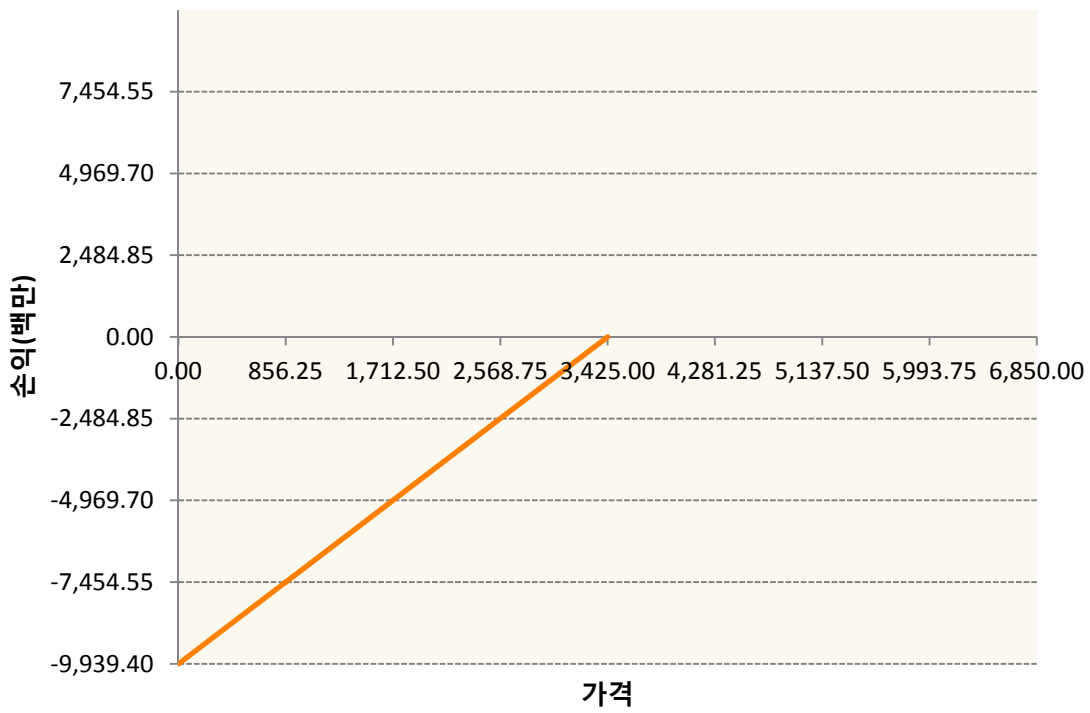


**OESXM9-C3450-EURO STOXX 50**

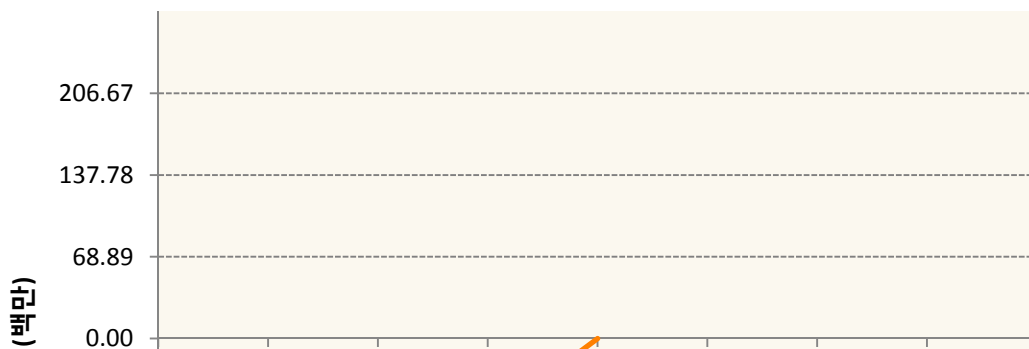


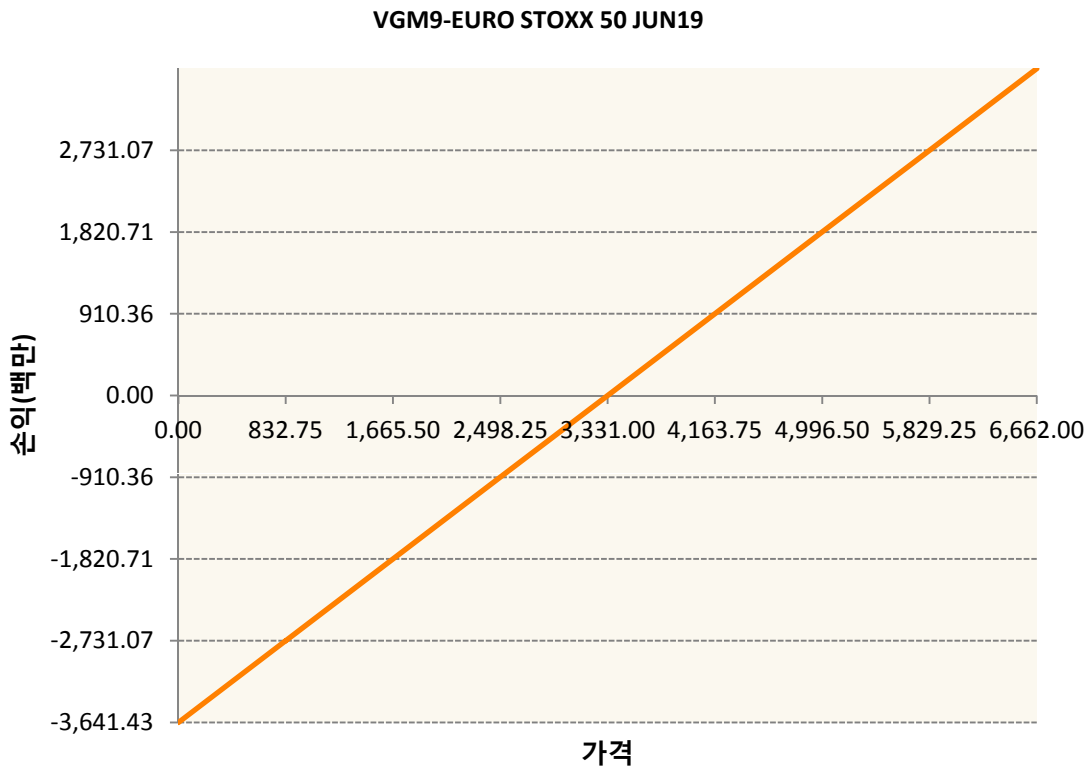
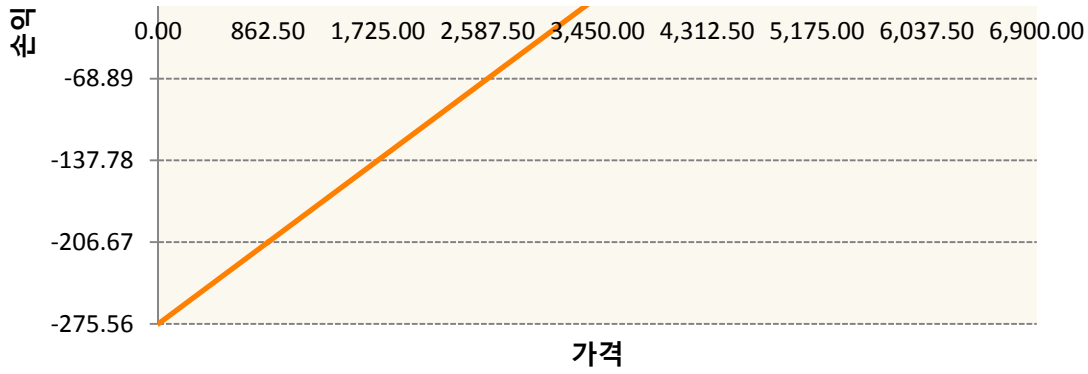


OESXM9-P3425-EURO STOXX 50



OESXM9-P3450-EURO STOXX 50





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	74
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	852
FX21019J01: KRW/EUR 28-06-19E	213
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	426
OESXM9-C3·EURO STOXX 50	795
OESXM9-C3·EURO STOXX 50	22
OESXM9-P3·EURO STOXX 50	795
OESXM9-P3·EURO STOXX 50	22
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	291

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

(단위:백만원)

2,201



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

(단위:백만원)

1,021



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

(단위:백만원)

90



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

(단위:백만원)

131

공시일	2019-06-10
기준일	2019-06-07

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

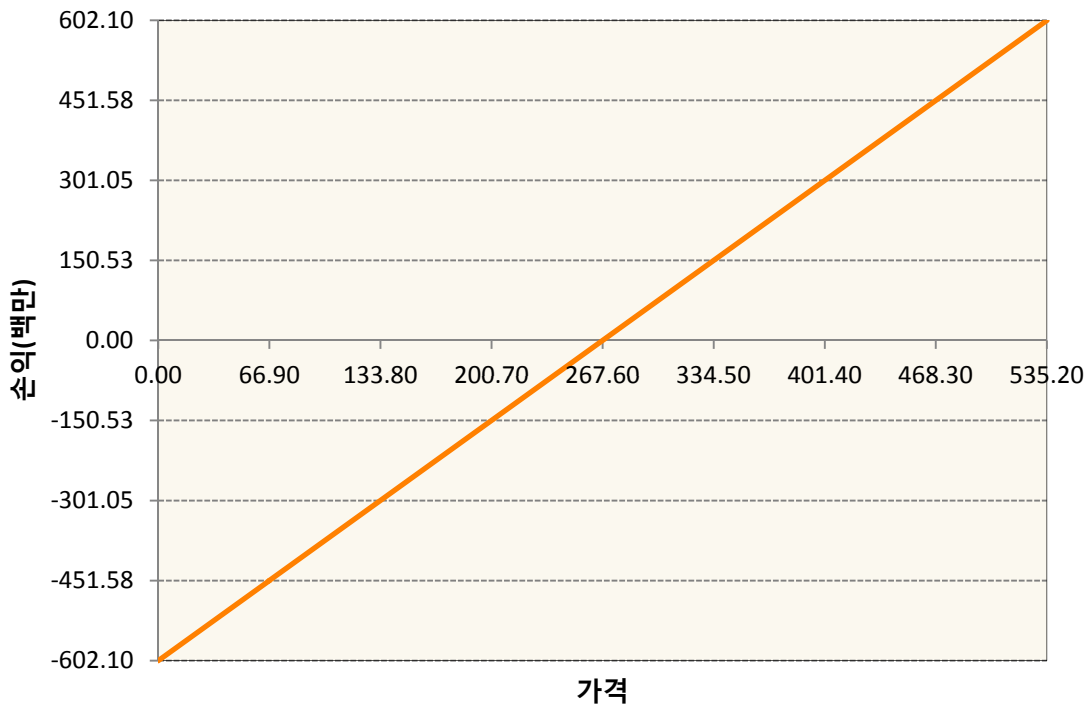
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	602	0	602	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	2019-06-10
기준일	2019-06-07

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

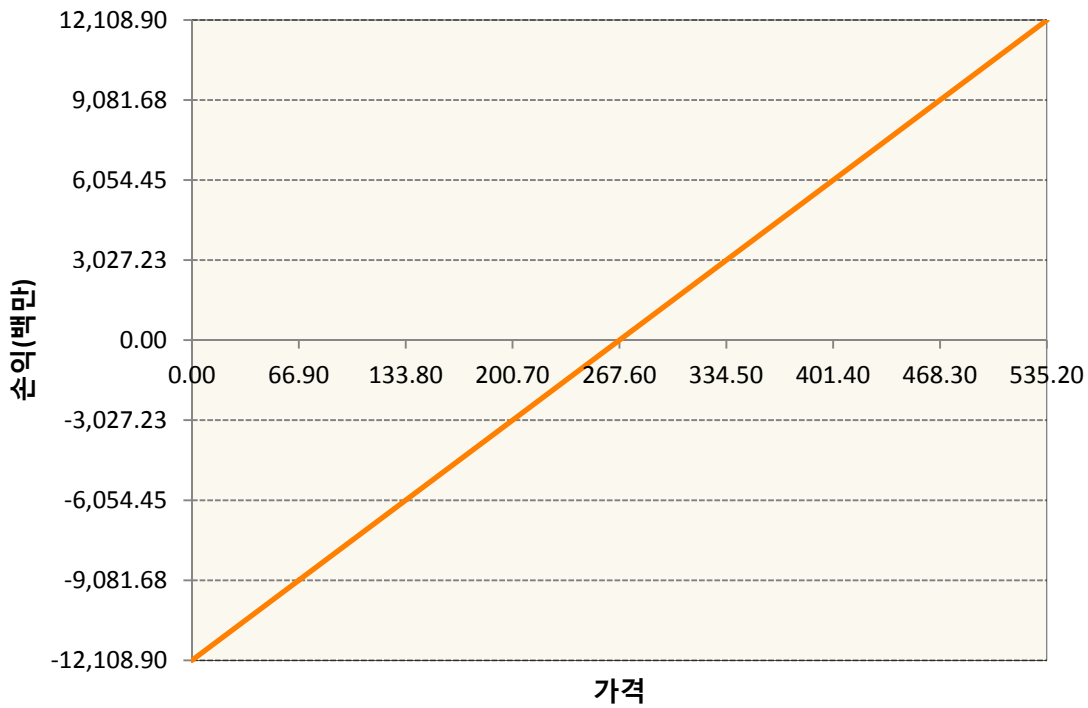
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

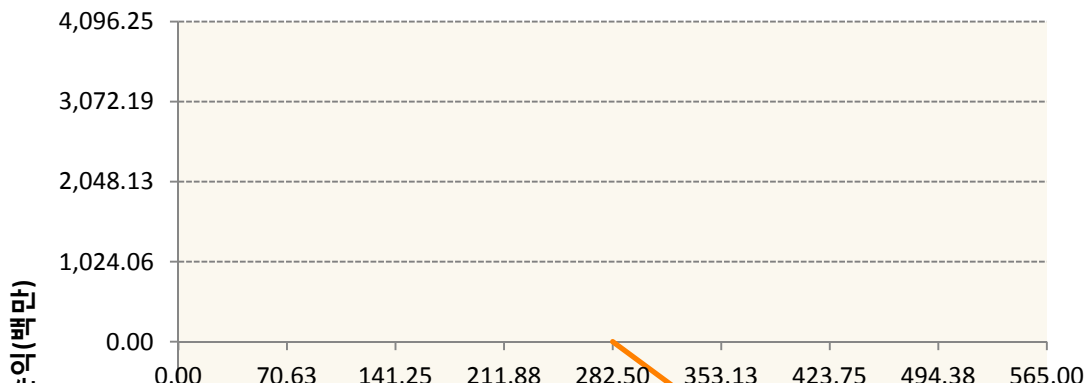
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,109	0	12,109	장내
누계	유가증권	옵션	5,081	22,906	-17,825	장내

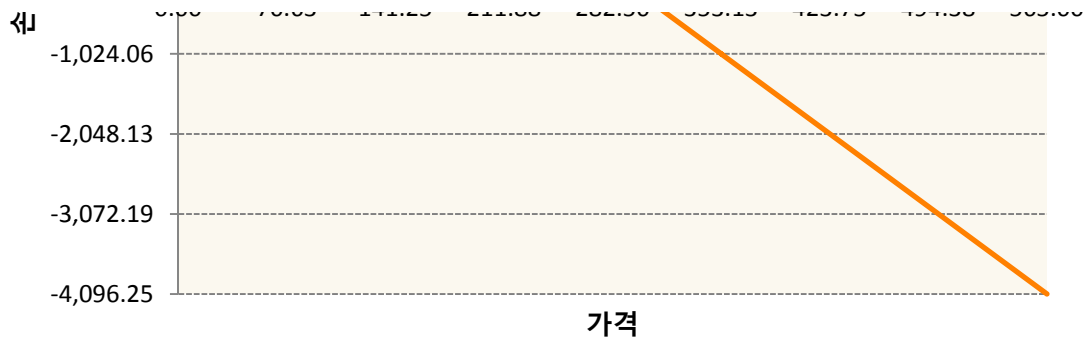
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

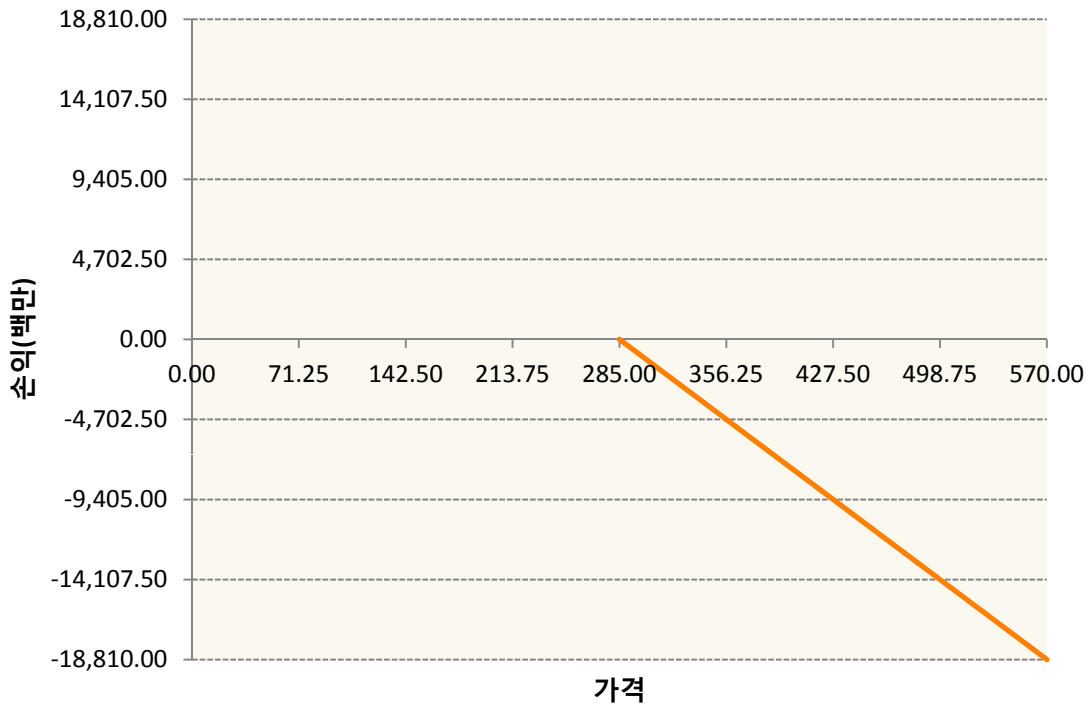


KR4201P62826-2019-06 콜282.5

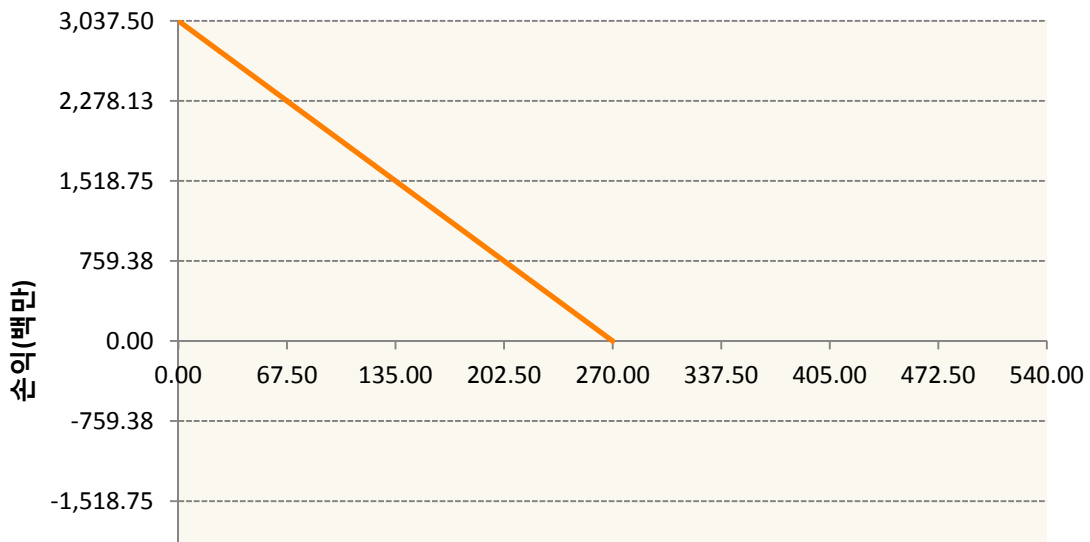


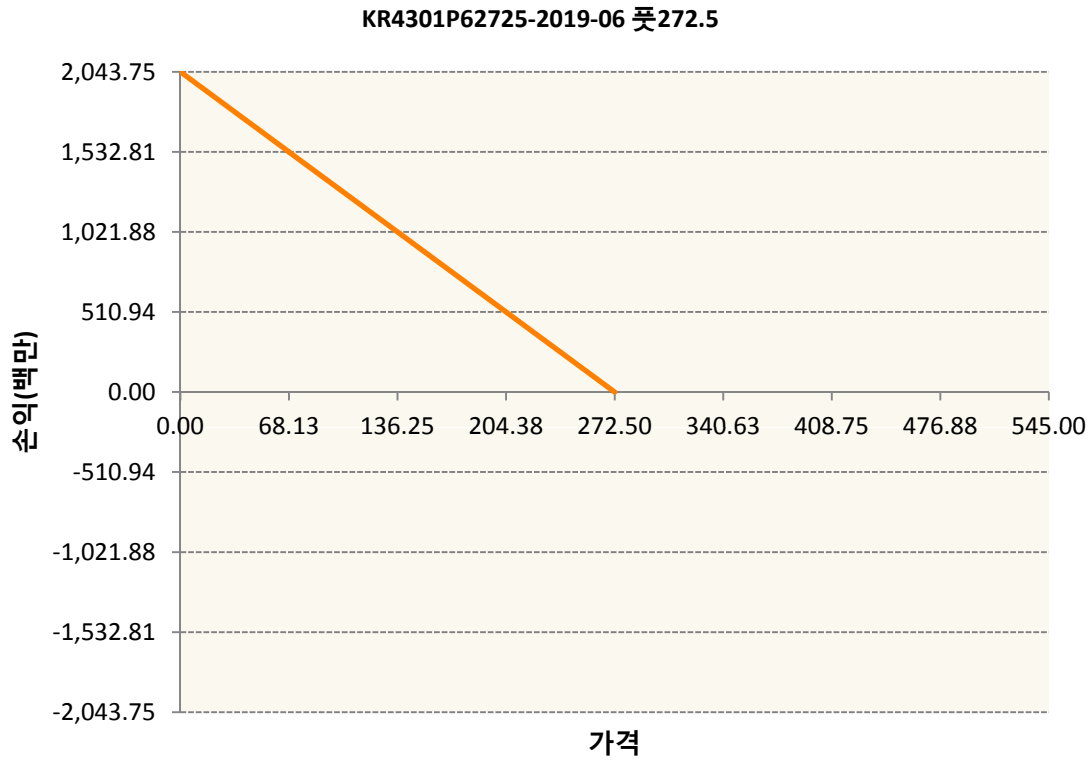
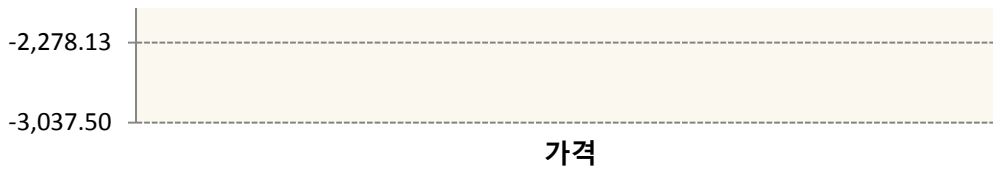


**KR4201P62859-2019-06 콜285**



**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						130
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3	3	3	3	3	3	3	
-5.33%	3	3	3	3	3	3	3	
-2.67%	3	3	3	3	3	2	2	

0%	3	2	1	0	-1	-3	-5
2.67%	-5	-7	-11	-14	-17	-21	-24
5.33%	-38	-42	-47	-51	-56	-60	-65
8.00%	-109	-112	-115	-119	-122	-126	-130
KR4201P62859                      2019-06 콜285							486
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8	8	8	8	8	8	8
-5.33%	8	8	8	8	8	8	8
-2.67%	8	8	8	8	7	5	3
0%	7	6	3	0	-4	-10	-16
2.67%	-10	-19	-29	-40	-53	-66	-81
5.33%	-108	-128	-148	-168	-188	-208	-229
8.00%	-374	-392	-410	-428	-447	-466	-486
KR4301P62709                      2019-06 풋270							224
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	224	224	224	224	224	224	224
-5.33%	144	144	144	144	144	144	144
-2.67%	64	64	65	65	66	67	67
0%	-6	-4	-2	0	2	4	6
2.67%	-34	-33	-32	-31	-29	-28	-26
5.33%	-37	-37	-37	-36	-36	-36	-35
8.00%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
KR4301P62725                      2019-06 풋272.5							155
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	155	155	155	155	155	155	155
-5.33%	102	102	102	102	102	102	102
-2.67%	48	48	48	48	48	49	49
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-33	-32	-30	-29	-28	-26	-25
5.33%	-38	-37	-37	-37	-37	-36	-36
8.00%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38

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

(단위:백만원)

**1,379**

공시일	2019-06-10
기준일	2019-06-07

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	591	0	591	
누계	유가증권	수익증권	18,253	0	18,253	

### 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	2019-06-10
기준일	2019-06-07

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	945	0	945	
누계	유가증권	수익증권	57,188	0	57,188	

### 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	2019-06-10
기준일	2019-06-07

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	18,902	0	18,902	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	340,317	0	340,317	
누계	통화	선도	0	391,043	-391,043	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		945
FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E		378
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		76
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		994
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		822
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		1,418
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,323
FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E		473
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E		794
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E		631
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	945
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E	1,512
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E	284
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E	1,229
FX21019K04 KRW/USD 28-06-19E	1,285
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	662
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	567
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	756
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	756
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	473
FX21019M0( KRW/USD 10-07-19E	284
FX21019M0( KRW/USD 10-07-19E	945
FX21019M0( KRW/USD 10-07-19E	189
FX21019M0( KRW/USD 10-07-19E	879
FX21019M0( KRW/USD 10-07-19E	1,049
FX21019M0( KRW/USD 10-07-19E	1,890
FX21019M0( KRW/USD 15-07-19E	473

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

(단위:백만원)

**10,470**

공시일	2019-06-10
기준일	2019-06-07

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

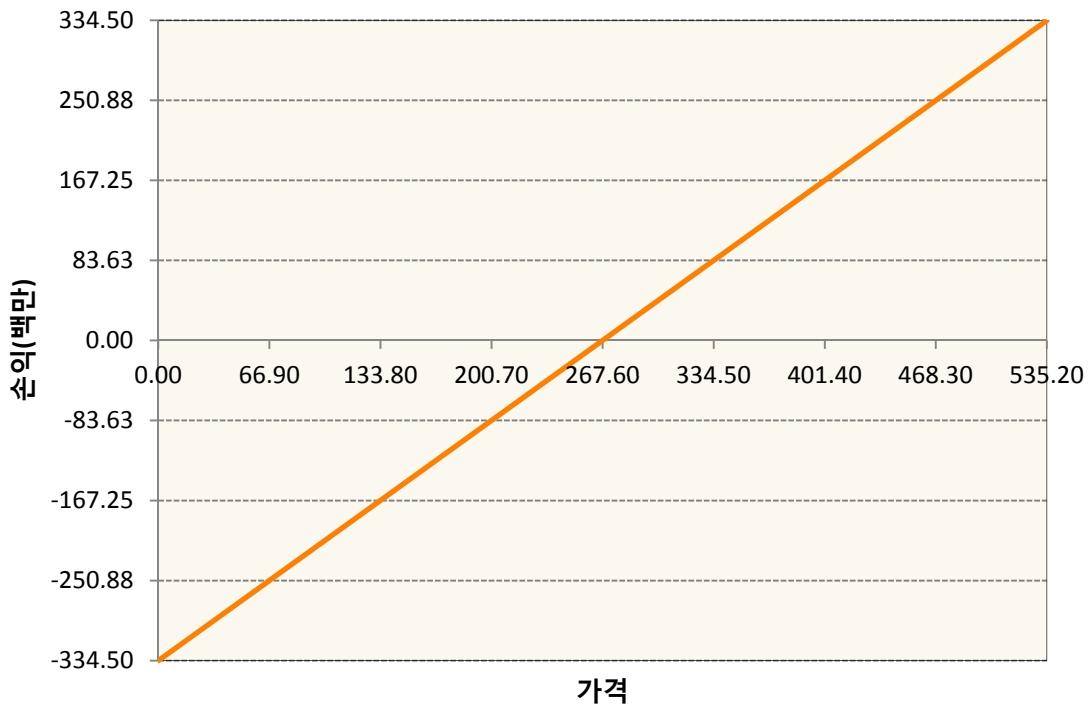
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

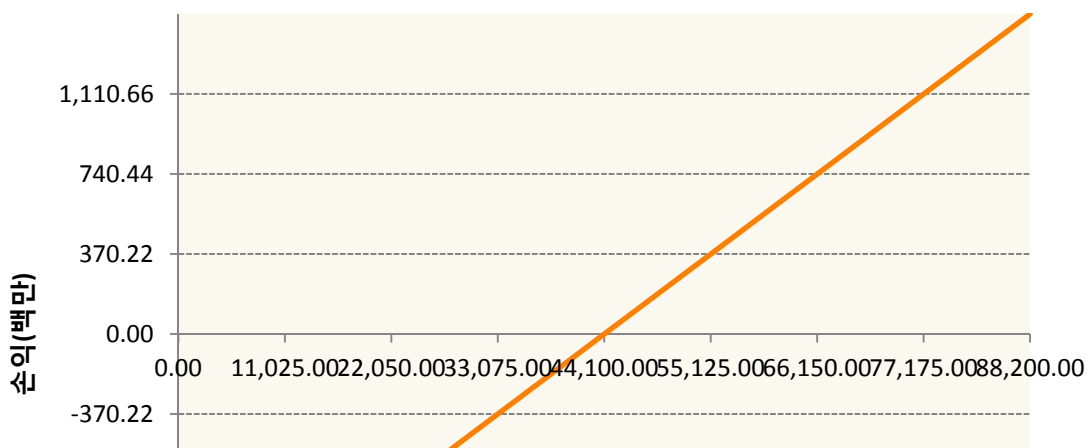
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,815	0	1,815	장내

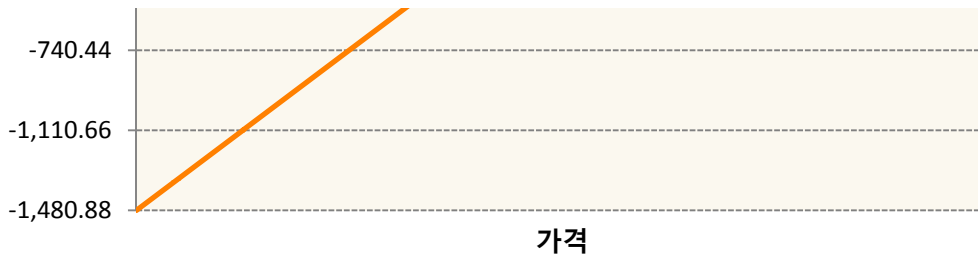
### 2. 만기시점의 손익구조

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						119
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119	
-5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79	
-2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	40	40	40	40	40	40	40	
5.33%	79	79	79	79	79	79	79	
8.00%	119	119	119	119	119	119	119	

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

**161**

공시일	2019-06-10
기준일	2019-06-07

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

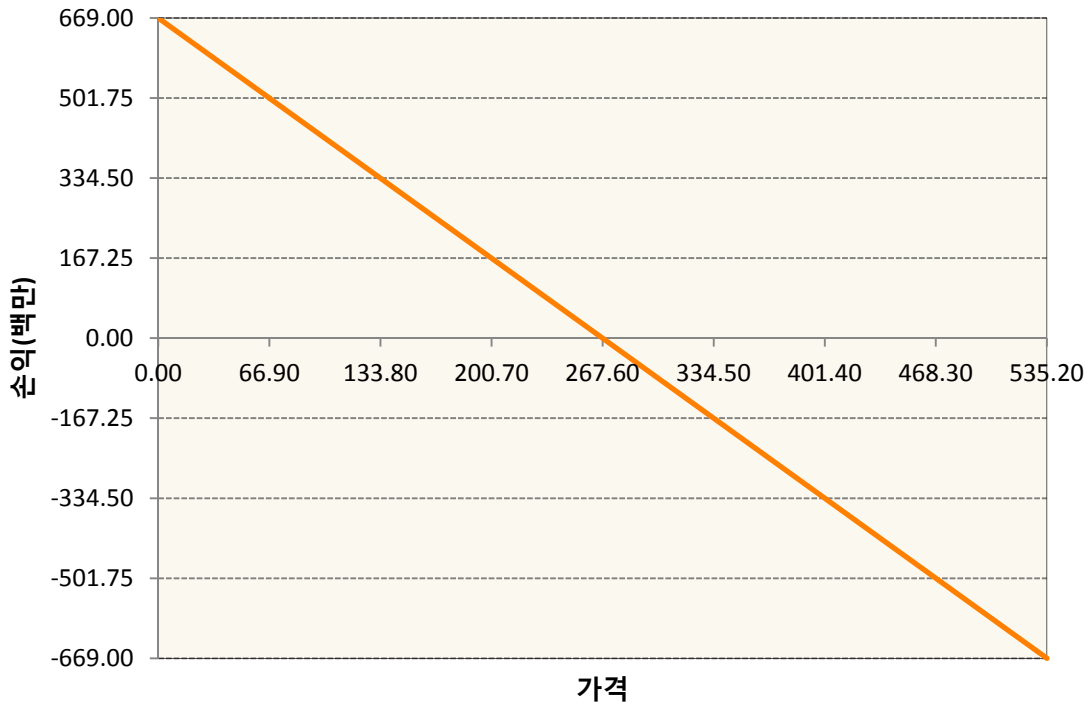
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

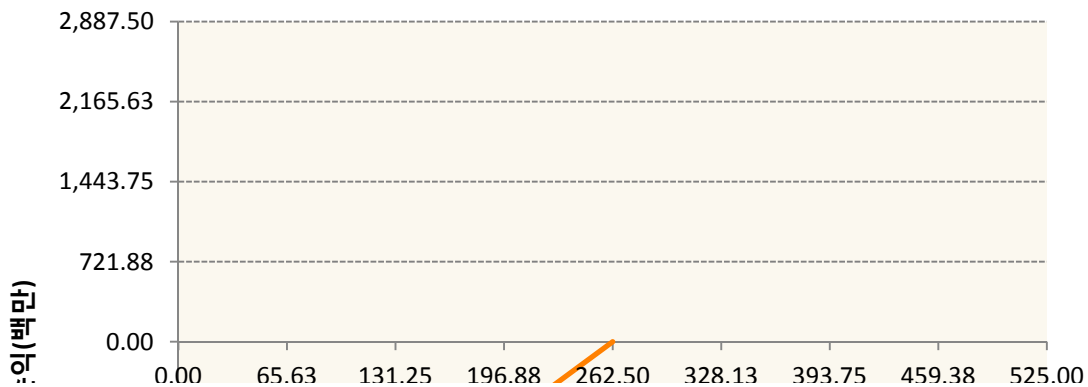
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	132	-132	장내
누계	유가증권	선물	0	669	-669	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,418	-3,418	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

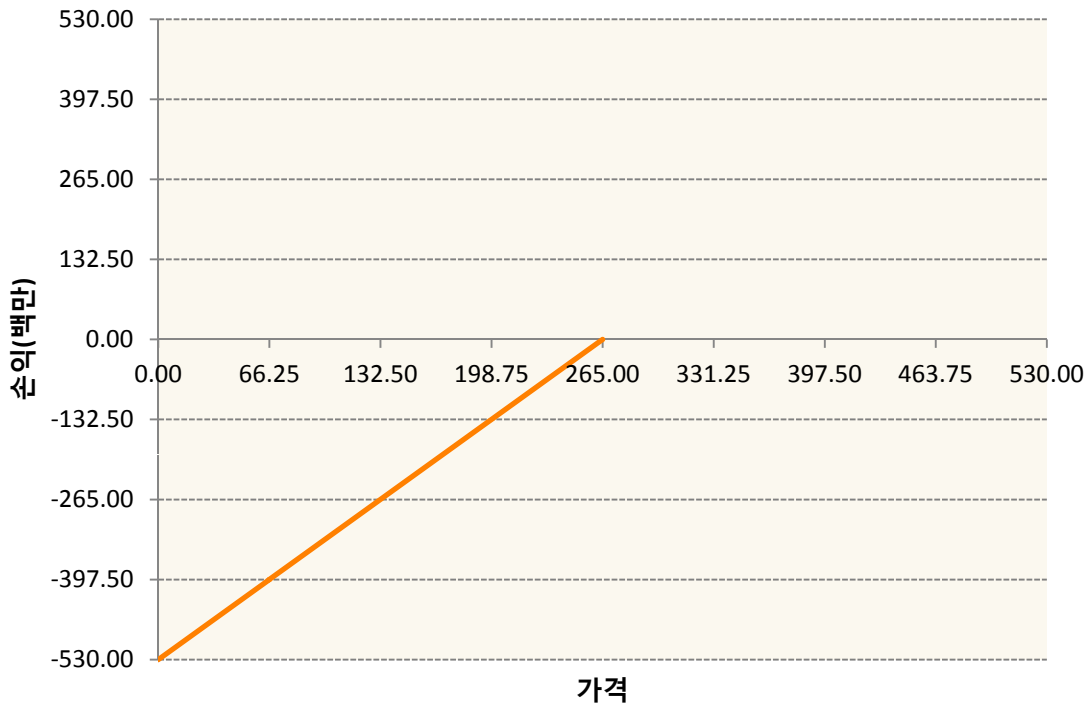


KR4301P62626-2019-06 풋262.5





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						168
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168
-5.33%	-90	-90	-90	-91	-92	-92	-93
-2.67%	-22	-24	-26	-28	-30	-32	-34
0%	3	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	5	5	5	5	5	4	4
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	5	5	5	5	5	5	5
KR4301P62659                      2019-06 풋265							34
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
-5.33%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
-2.67%	-7	-7	-7	-7	-8	-8	-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)

**241**

공시일	2019-06-10
기준일	2019-06-07

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

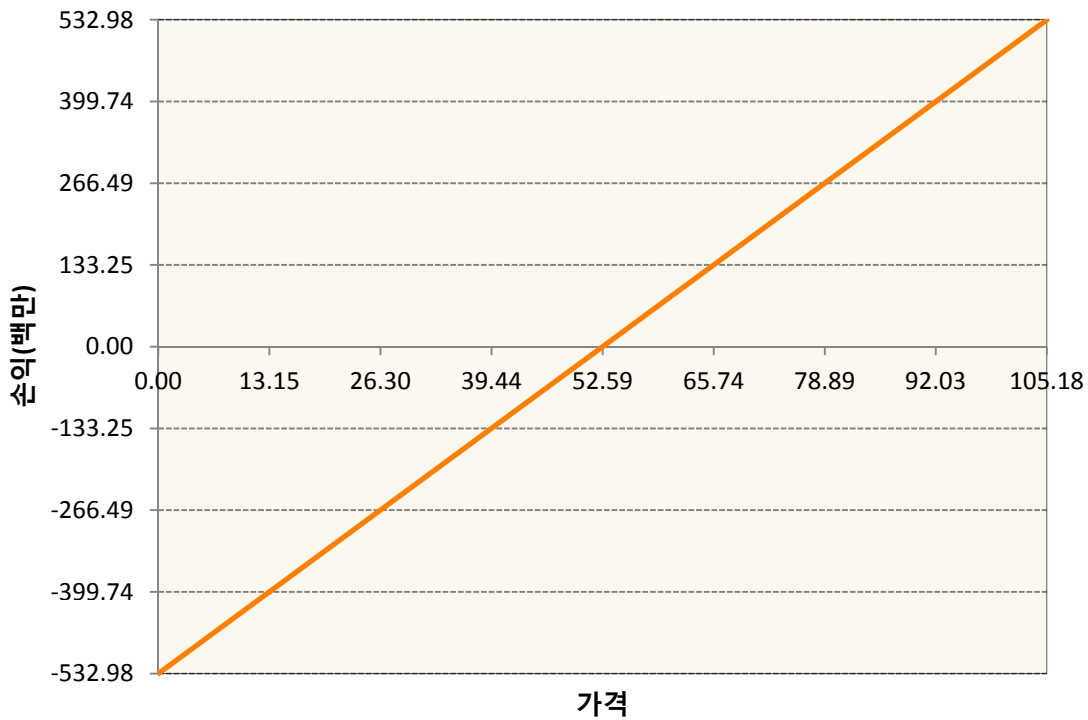
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

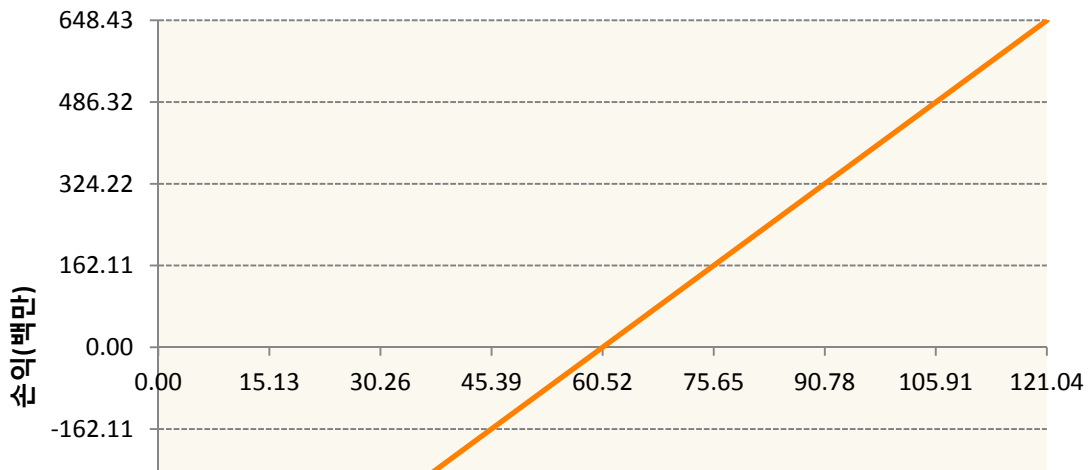
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,390	118	2,272	

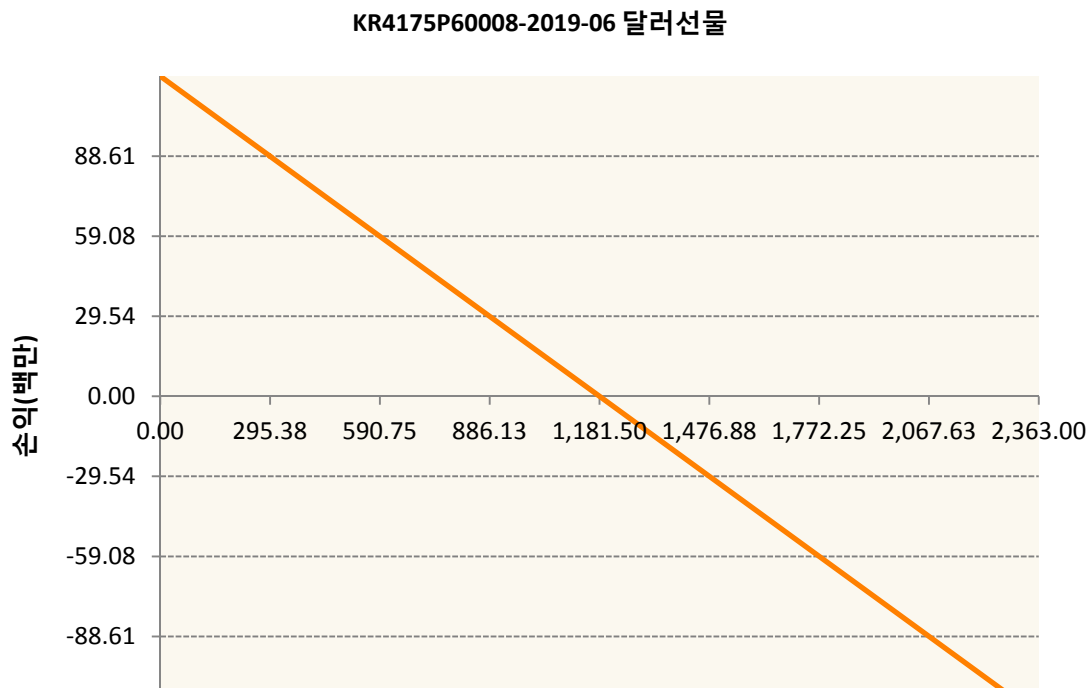
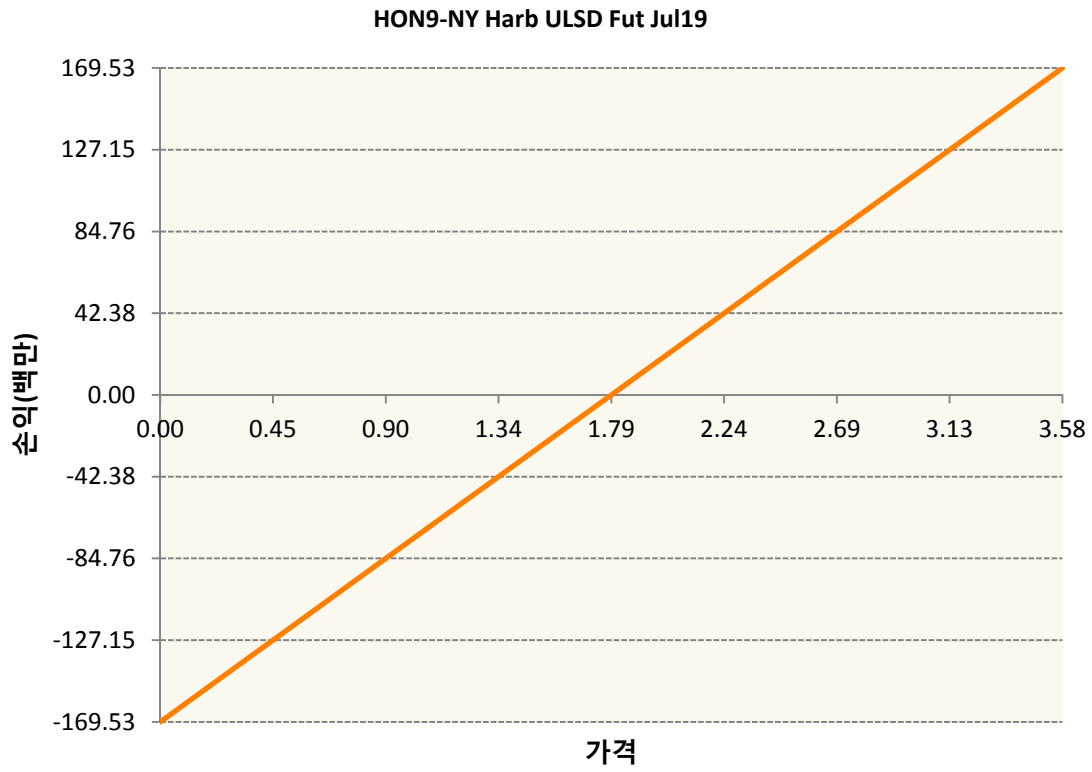
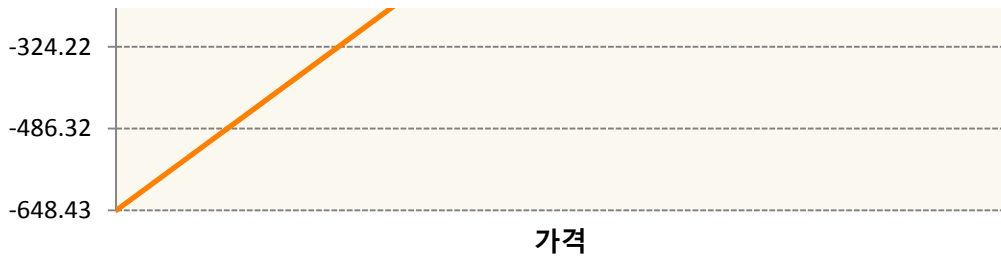
### 2. 만기시점의 손익구조

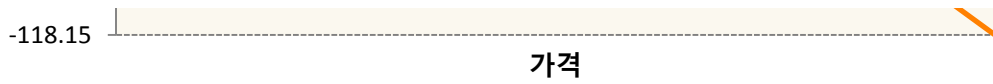
CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19



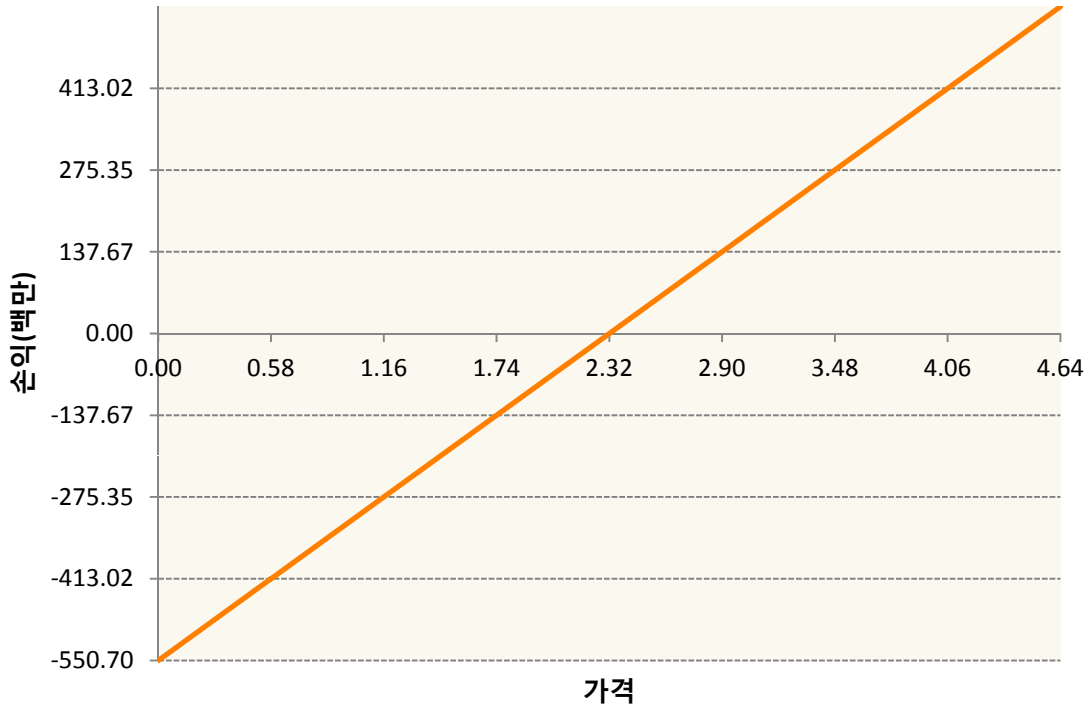
COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19



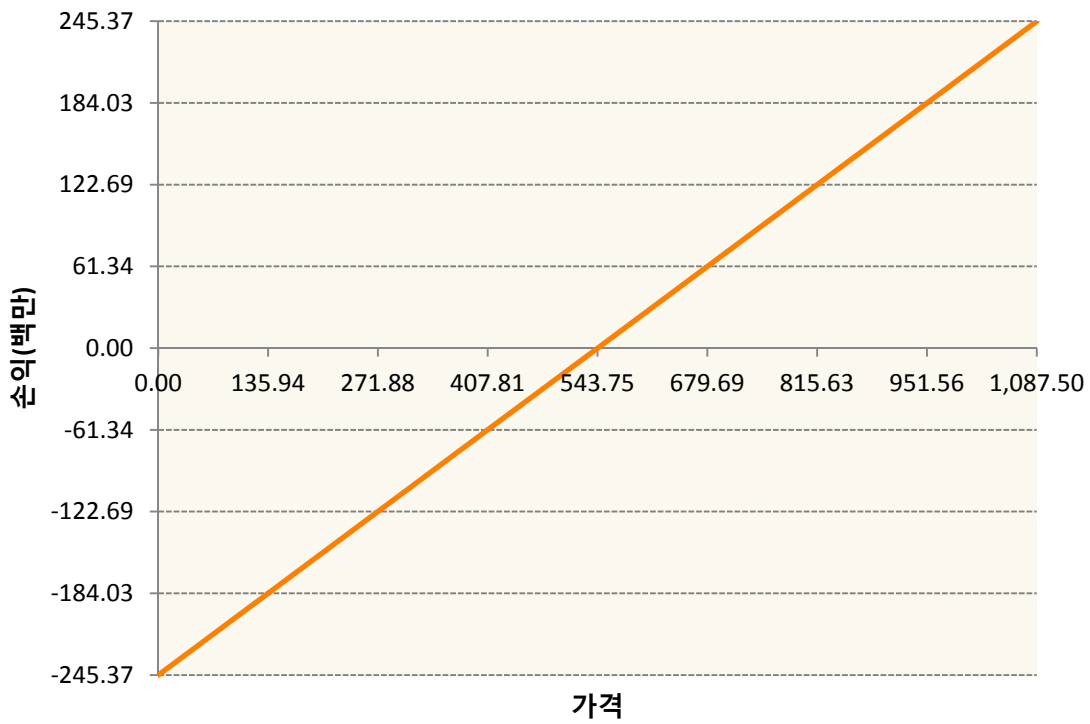




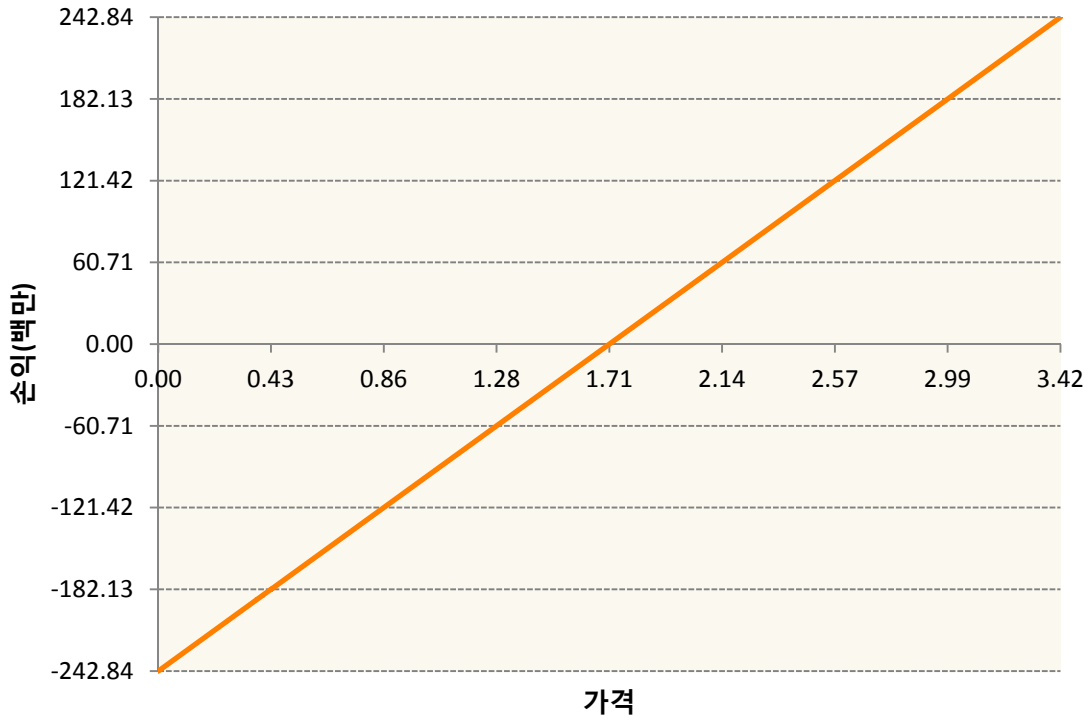
NGN19-NATURAL GAS FUTR Jul19



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	44
QSN9	Low Su Gasoil G Jul19	20
XBN9	GASOLINE RBOB FUT Jul19	19

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

(단위:백만원)

353

공시일	2019-06-10
기준일	2019-06-07

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

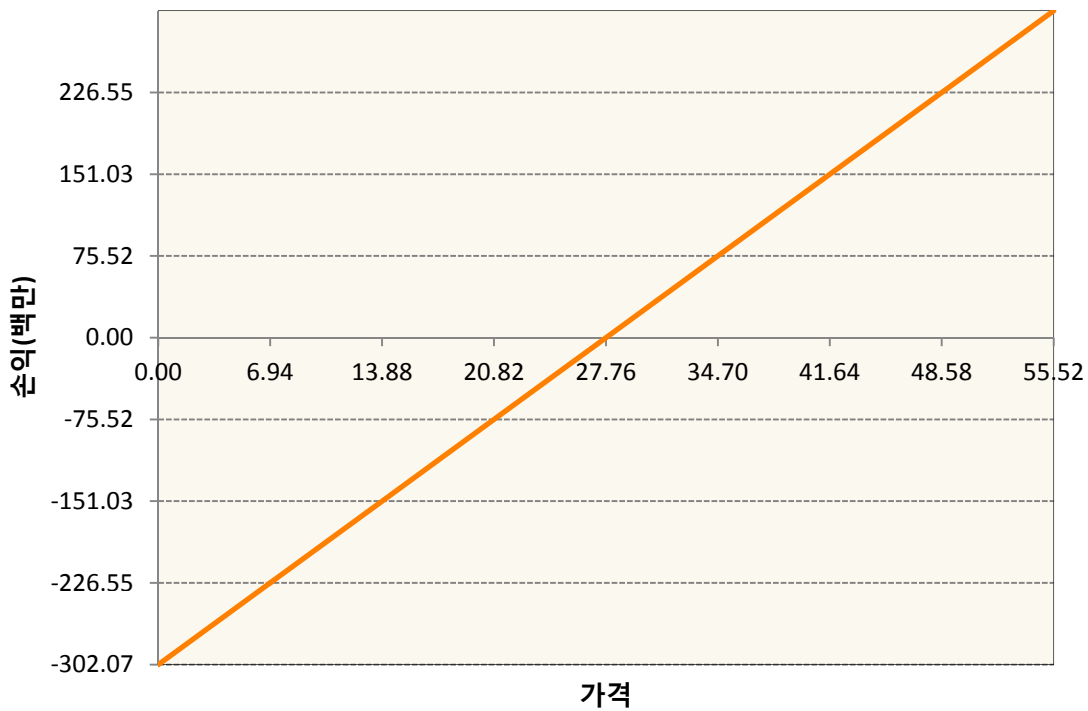
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

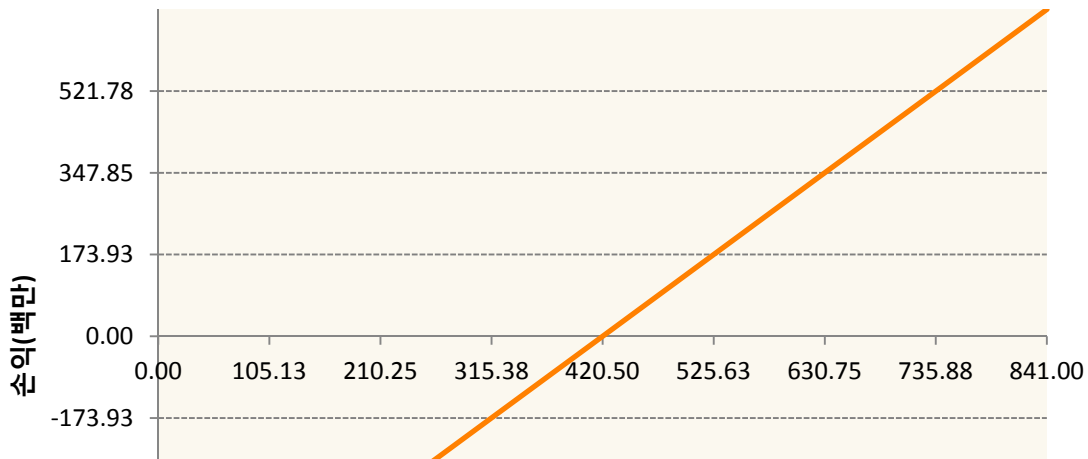
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,105	201	2,904	

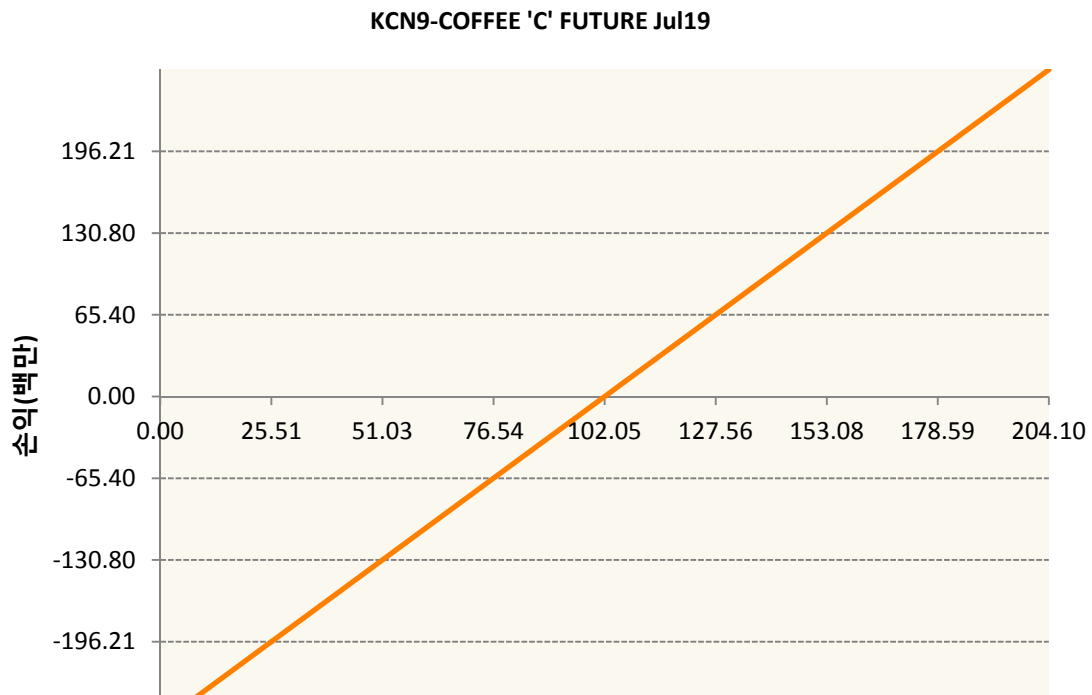
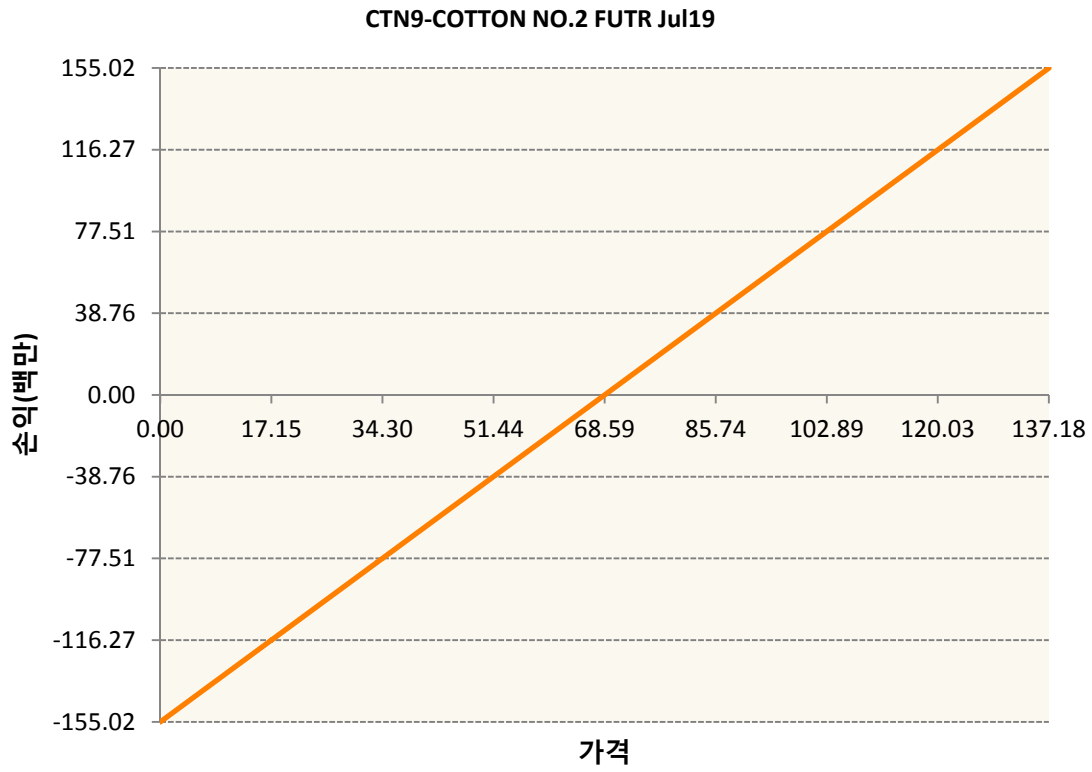
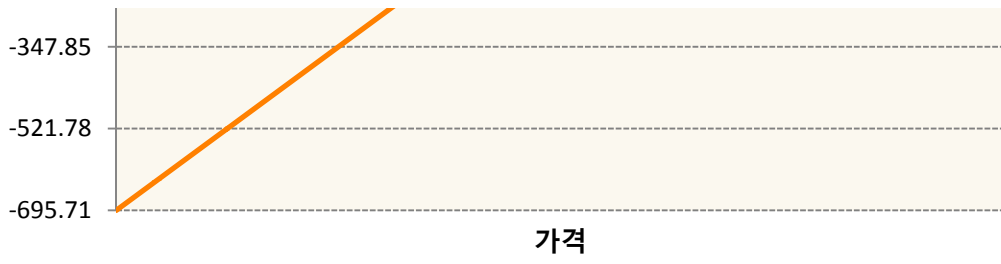
### 2. 만기시점의 손익구조

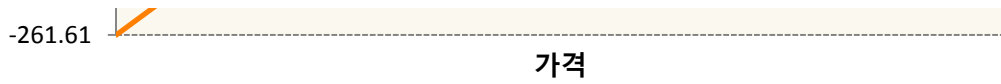
**BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19**



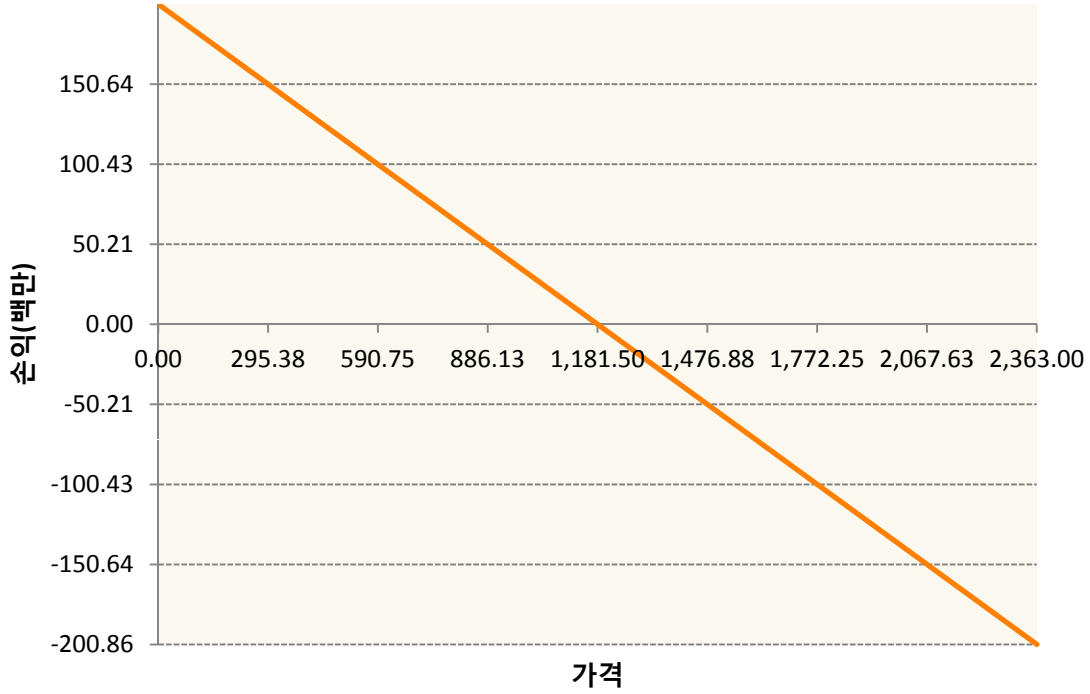
**CN9-CORN FUTURE Jul19**



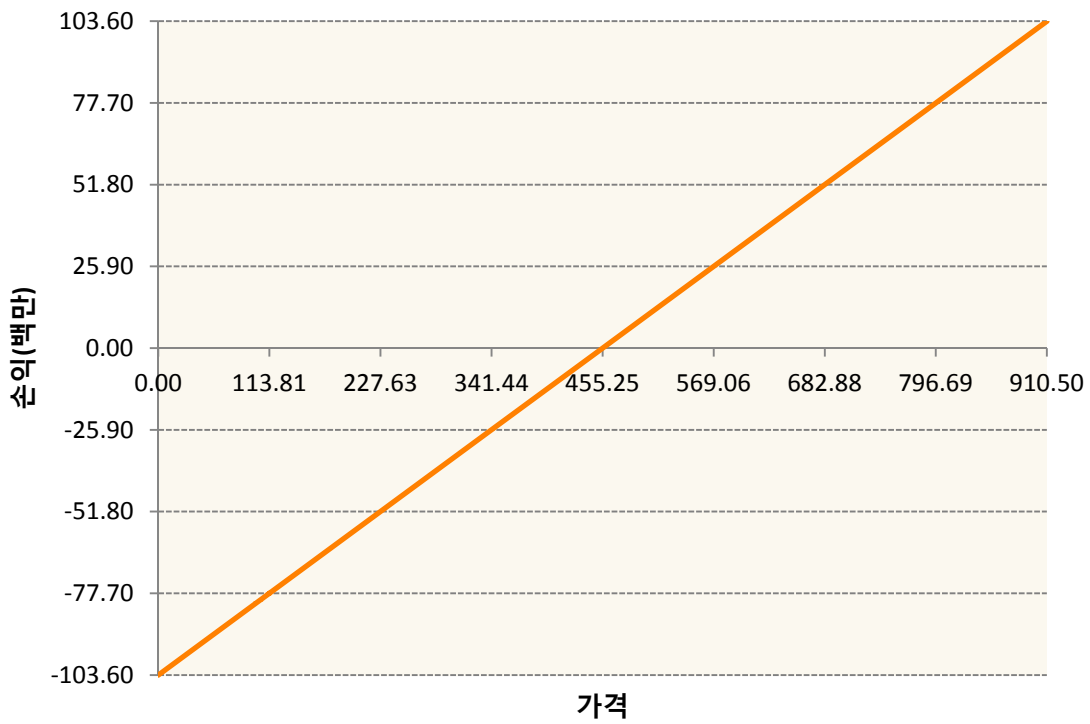




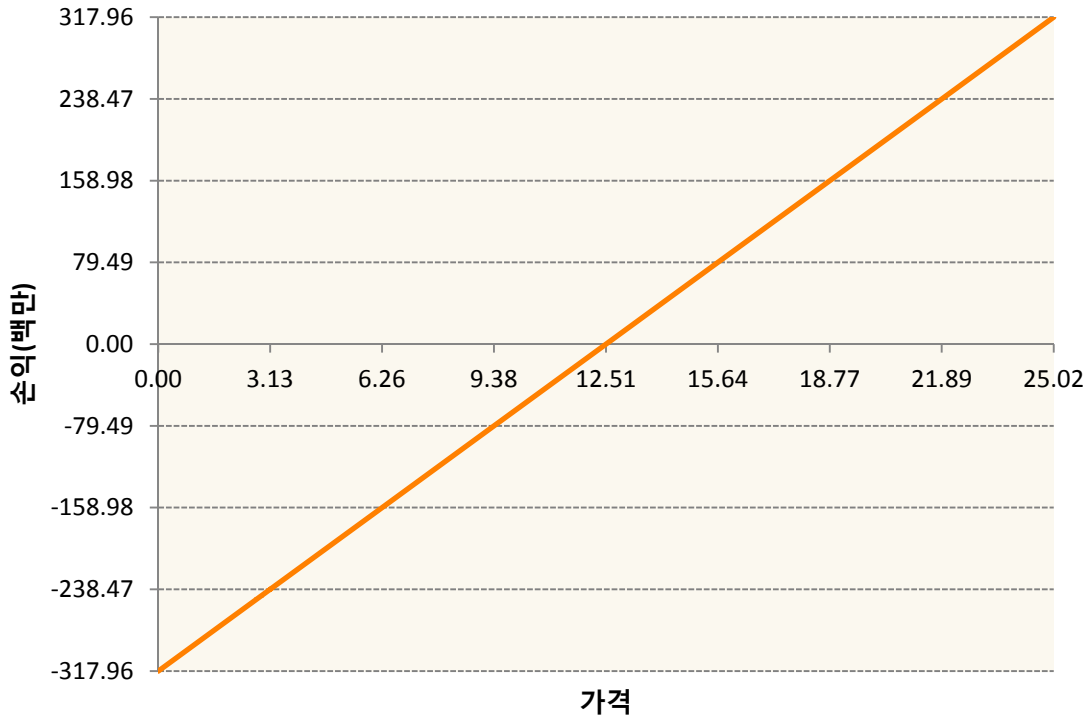
KR4175P60008-2019-06 달러선물



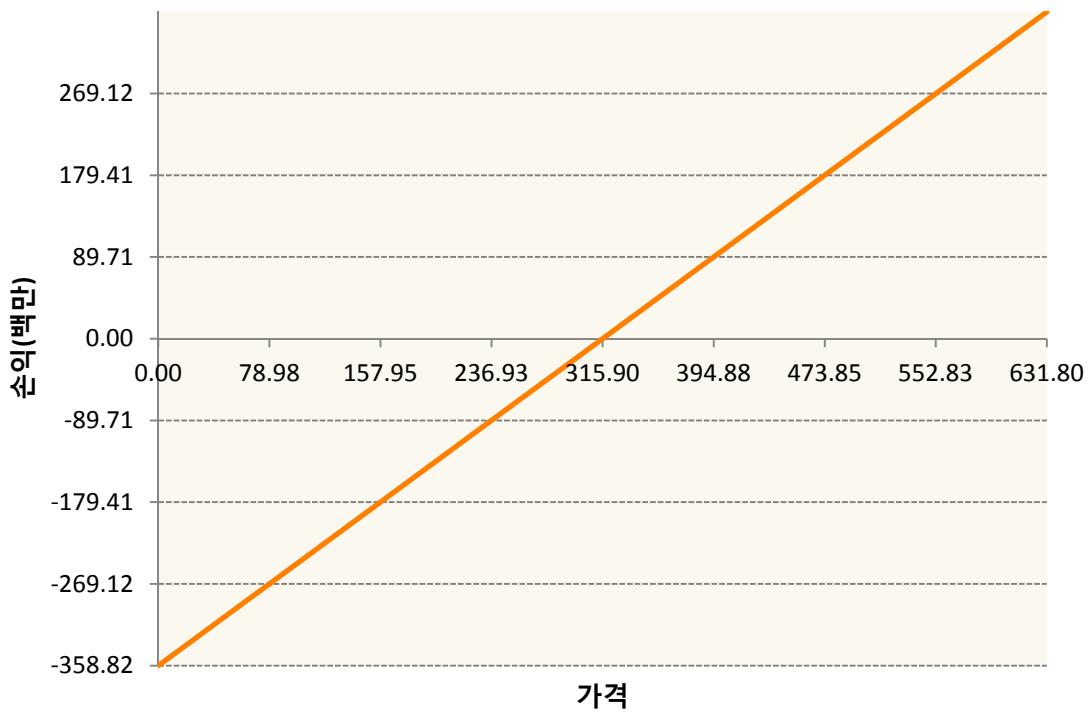
KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19



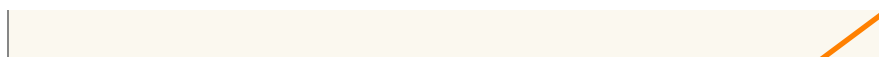
SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

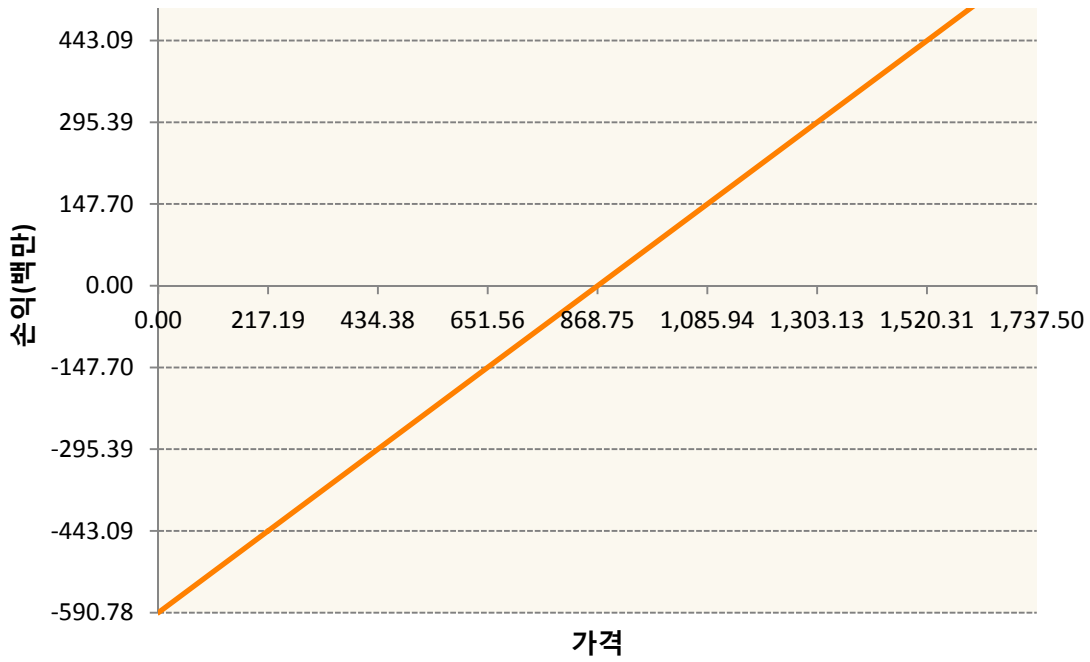


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19

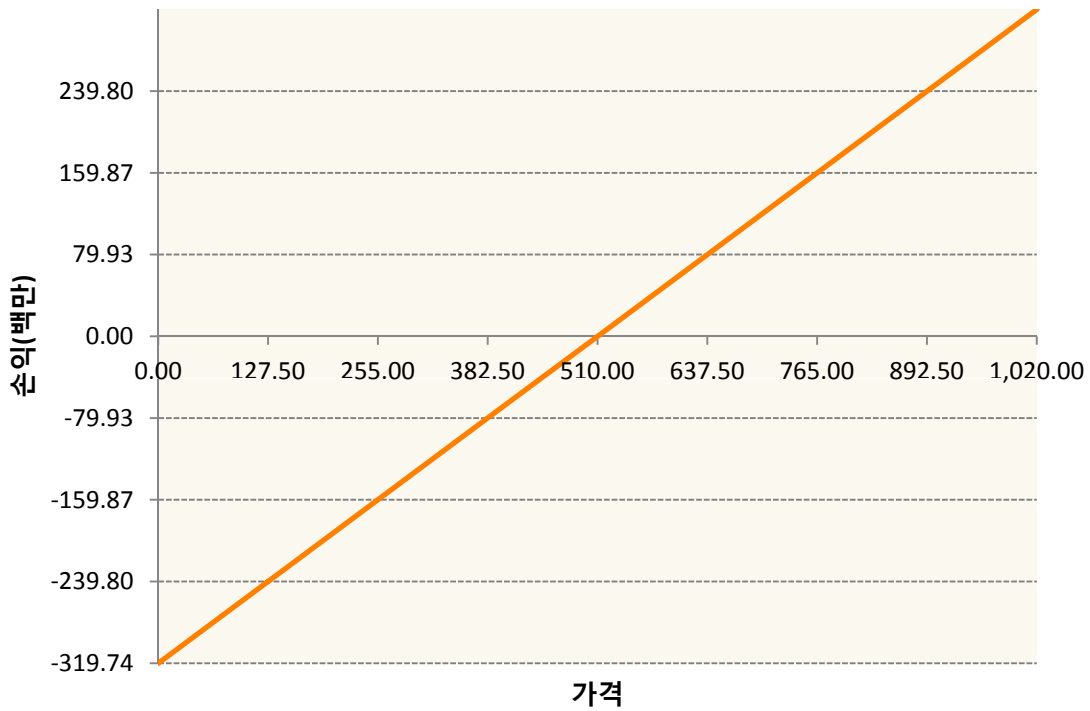


SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





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	21
KR4175P600	2019-06 달러선물	16

KWN9	KC HRW WHEAT FUT Jul19	8
SBN9	SUGAR #11 (WORLD) Jul19	25
SMN9	SOYBEAN MEAL FUTR Jul19	29
SN9	SOYBEAN FUTURE Jul19	47
WN9	WHEAT FUTURE(CBT) Jul19	26

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

(단위:백만원)

**267**