

공시일	2019-06-11
기준일	2019-06-10

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)

92

공시일	2019-06-11
기준일	2019-06-10

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

1,138

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

689

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-11
기준일	2019-06-10

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)	285
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	78
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	134

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

647

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-06-11
기준일	2019-06-10

유로인덱스모(주식-파생형)

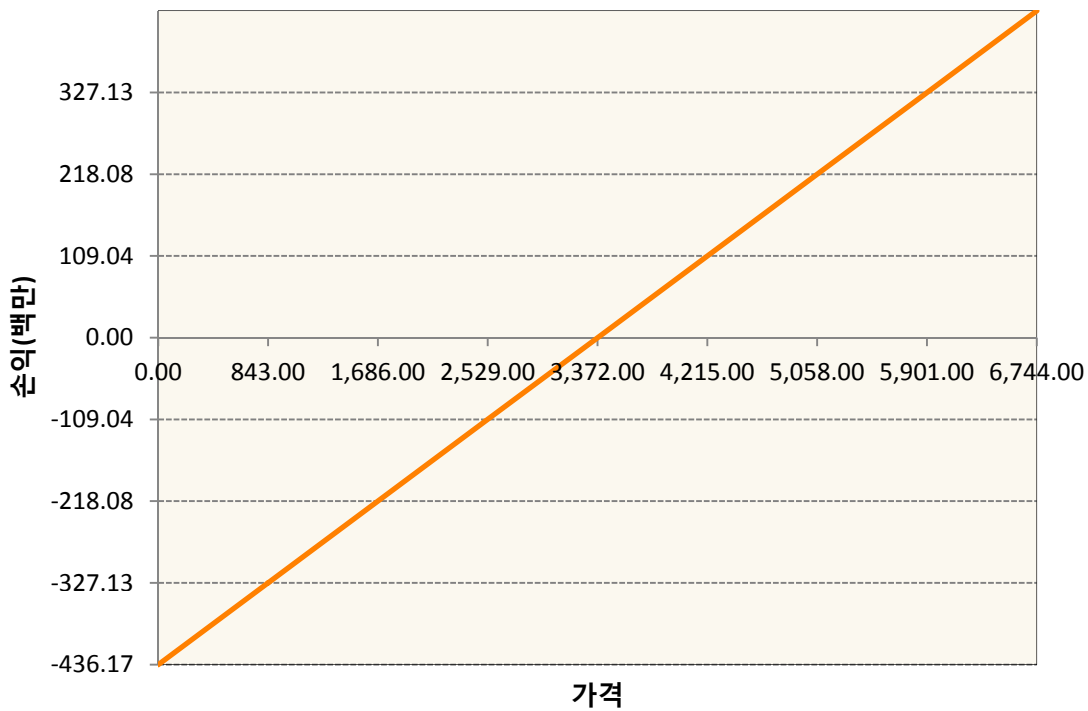
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	436	0	436	

2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	35
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

25

공시일	2019-06-11
기준일	2019-06-10

차이나인덱스모(주식-파생형)

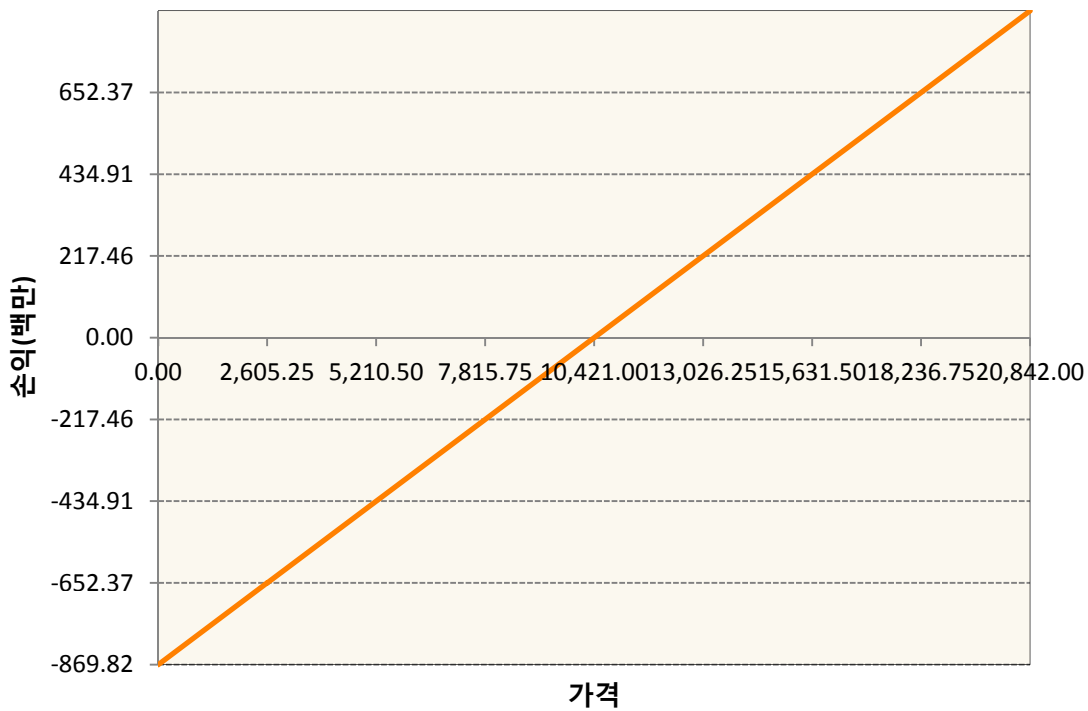
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	870	0	870	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM9	HSCEI Futures Jun19	70
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

61

공시일	2019-06-11
기준일	2019-06-10

커버드콜모(주식혼합-파생형)

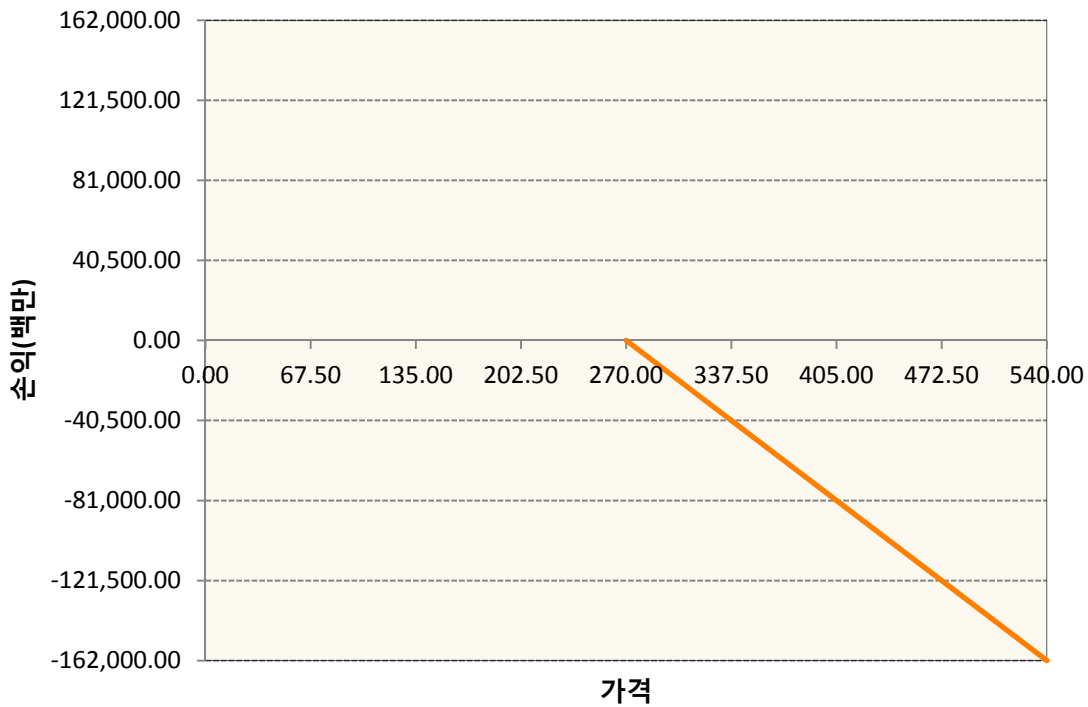
1. 계약금액

(단위:백만원)

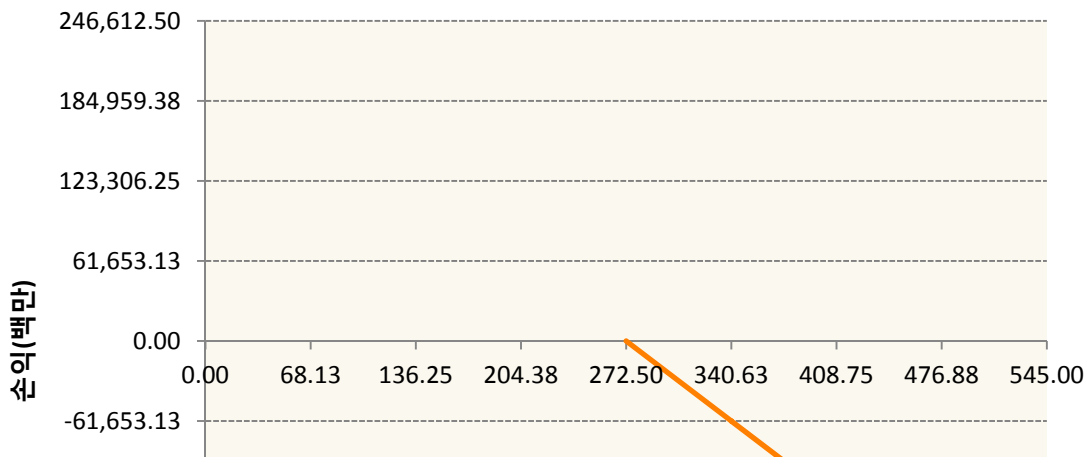
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	3,370	0	3,370	장내
누계	유가증권	옵션	0	611,113	-611,113	장내

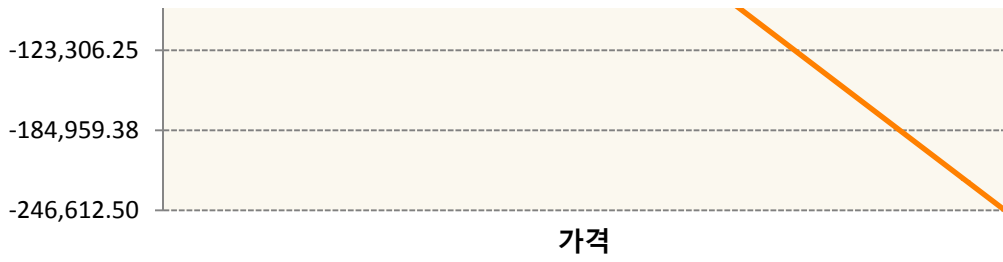
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P62701-2019-06 콜270



KR4201P62727-2019-06 콜272.5





KR4301P62709-2019-06 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P62701		2019-06 콜270					12,098
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,210	2,210	2,210	2,209	2,209	2,207	2,204
-5.33%	2,207	2,203	2,194	2,181	2,163	2,139	2,110
-2.67%	2,023	1,952	1,874	1,789	1,699	1,606	1,508
0%	350	235	118	0	-119	-239	-360
2.67%	-3,418	-3,440	-3,472	-3,511	-3,558	-3,613	-3,674
5.33%	-7,743	-7,744	-7,745	-7,749	-7,755	-7,765	-7,778
8.00%	-12,095	-12,095	-12,095	-12,096	-12,096	-12,097	-12,098
KR4201P62727		2019-06 콜272.5					17,231
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,095	2,095	2,095	2,095	2,094	2,093	2,092

-5.33%	2,094	2,093	2,089	2,081	2,069	2,051	2,026	
-2.67%	2,006	1,950	1,881	1,799	1,705	1,603	1,491	
0%	568	379	190	0	-190	-379	-569	
2.67%	-4,241	-4,318	-4,409	-4,513	-4,627	-4,749	-4,880	
5.33%	-10,657	-10,662	-10,671	-10,686	-10,708	-10,738	-10,777	
8.00%	-17,220	-17,220	-17,220	-17,221	-17,223	-17,226	-17,231	
KR4301P62709 2019-06 풋270							14,285	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-14,285	-14,285	-14,285	-14,285	-14,285	-14,285	-14,285	
-5.33%	-8,844	-8,844	-8,844	-8,844	-8,845	-8,845	-8,847	
-2.67%	-3,424	-3,441	-3,463	-3,492	-3,526	-3,565	-3,608	
0%	218	148	76	0	-78	-157	-238	
2.67%	478	478	476	474	469	462	452	
5.33%	479	479	479	479	479	479	478	
8.00%	479	479	479	479	479	479	479	

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

(단위:백만원)

56,013

공시일	2019-06-11
기준일	2019-06-10

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

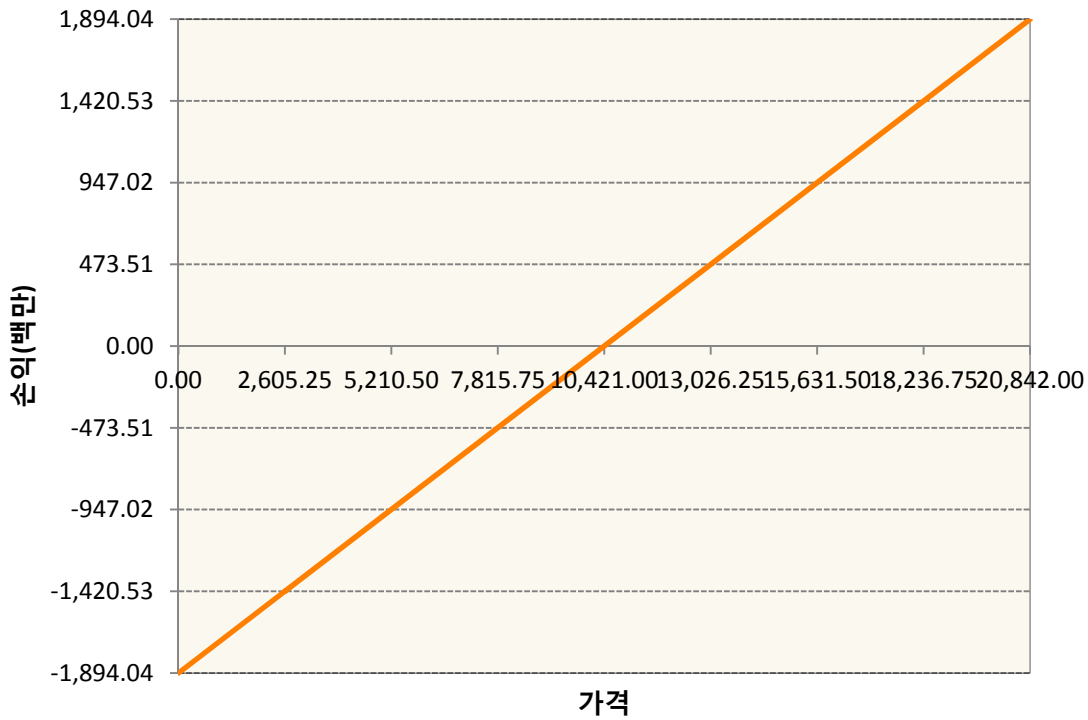
1. 계약금액

(단위:백만원)

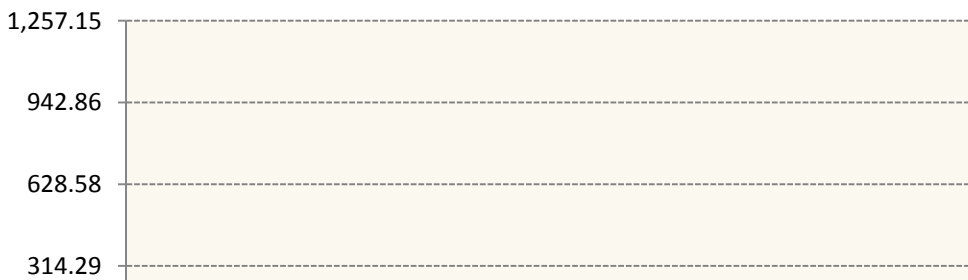
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,894	0	1,894	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,053	-5,053	장내
누계	통화	선도	151	3,173	-3,022	장외

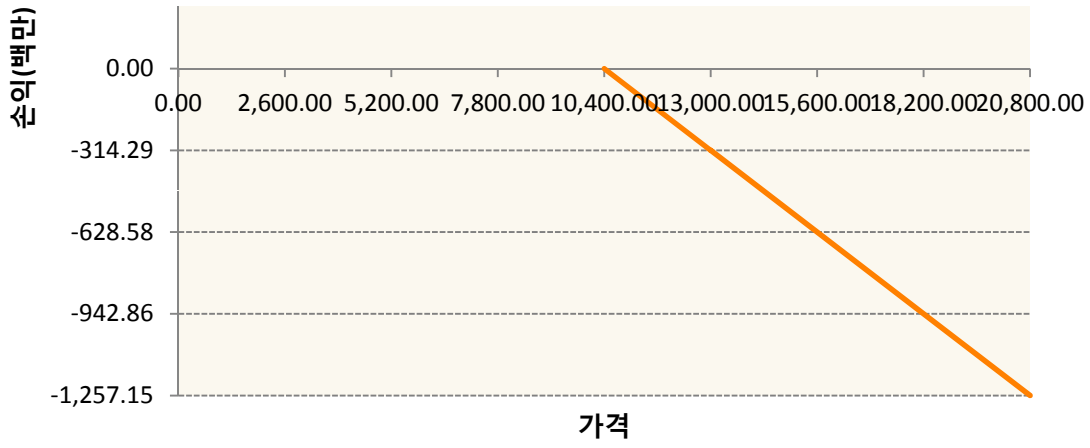
2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19

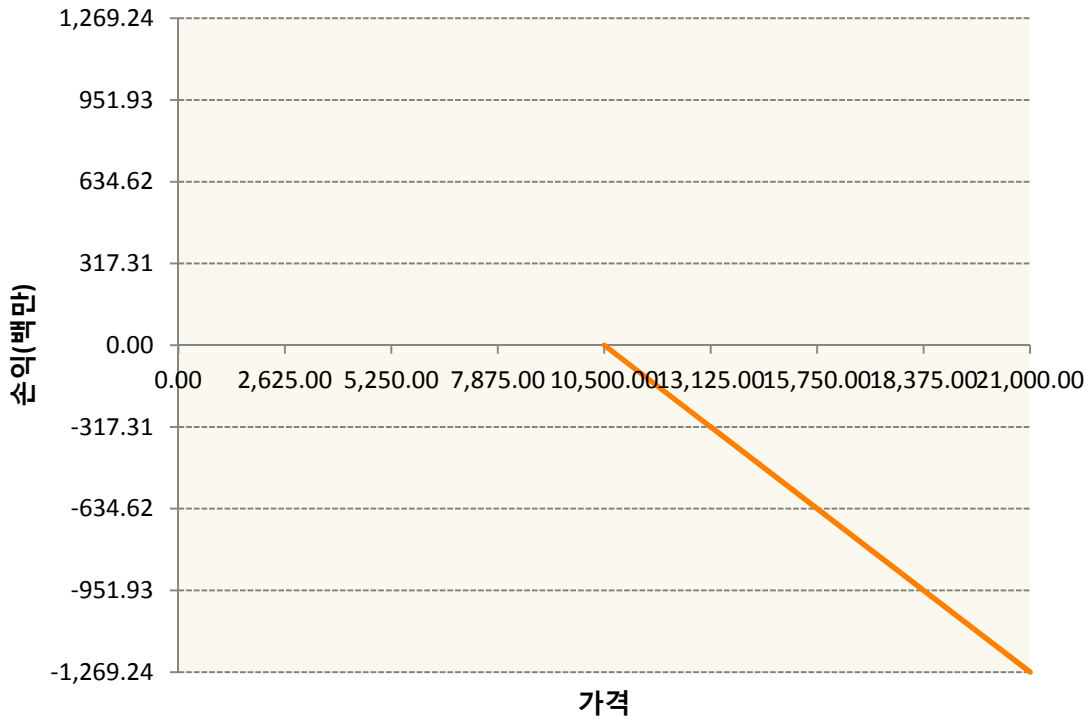


OHHIM9-C104-HSCEI

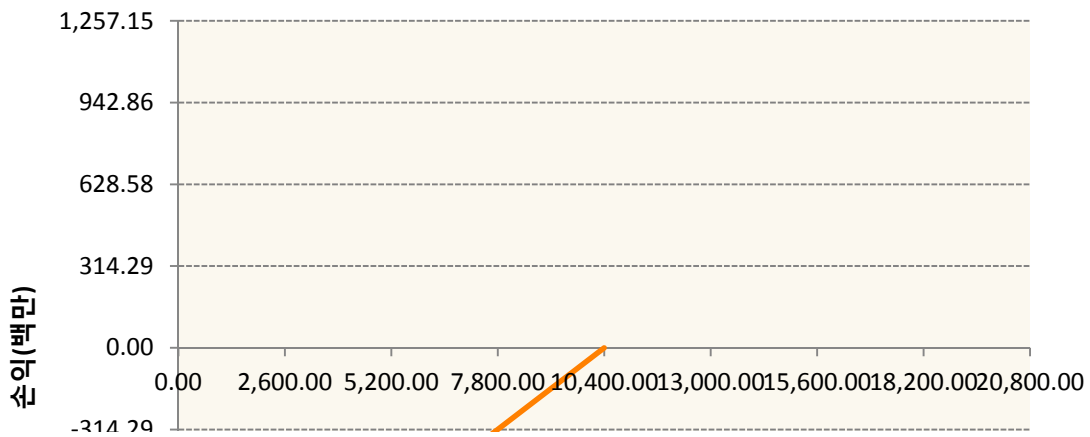


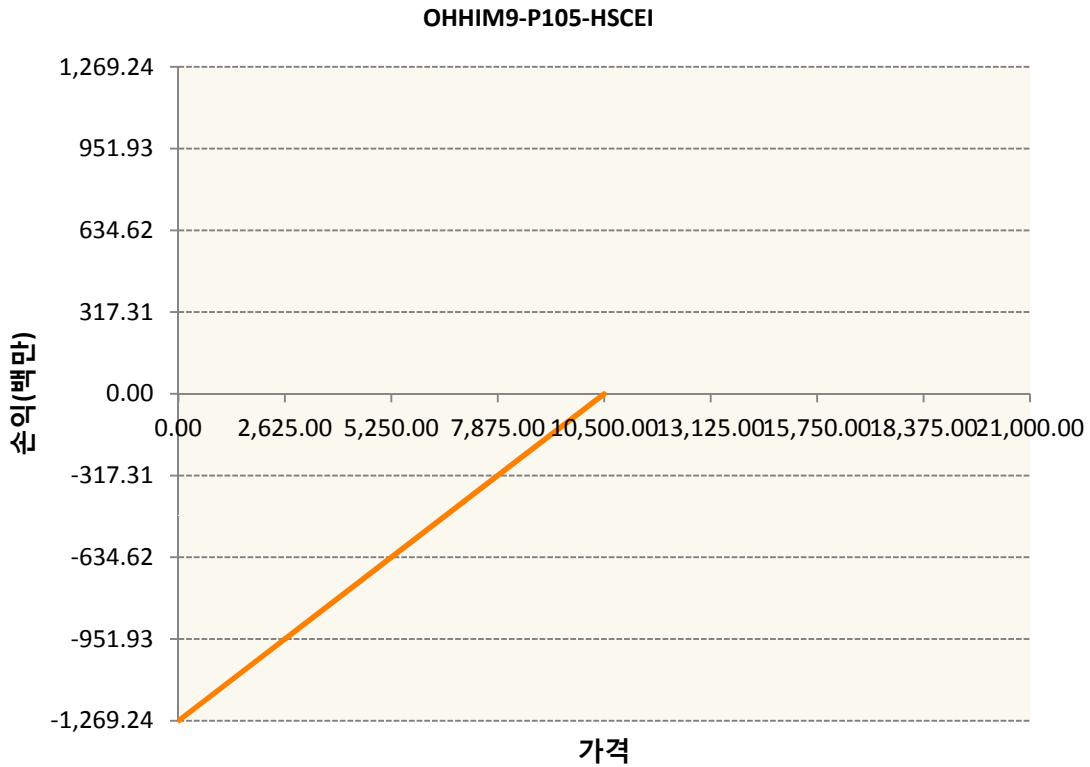


OHHIM9-C105-HSCEI



OHHIM9-P104-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	254
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E	12
HCM9 HSCEI Futures Jun19	152
OHHIM9-C1 HSCEI	101
OHHIM9-C1 HSCEI	102
OHHIM9-P1 HSCEI	101
OHHIM9-P1 HSCEI	102

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	578

공시일	2019-06-11
기준일	2019-06-10

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

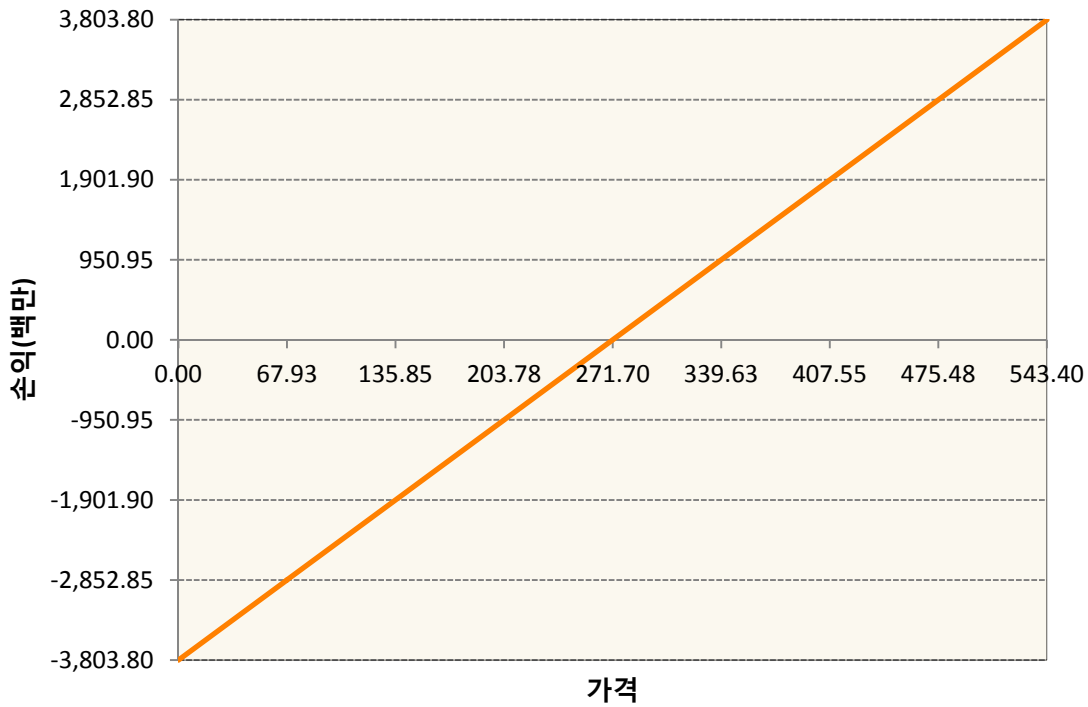
1. 계약금액

(단위:백만원)

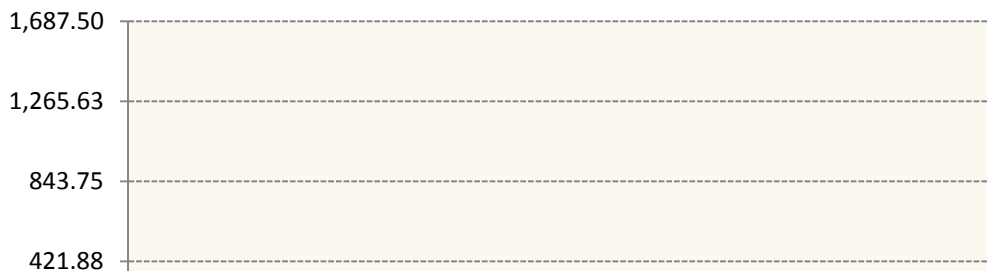
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	135	0	135	장내
누계	유가증권	선물	3,804	0	3,804	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	21,624	-21,624	장내

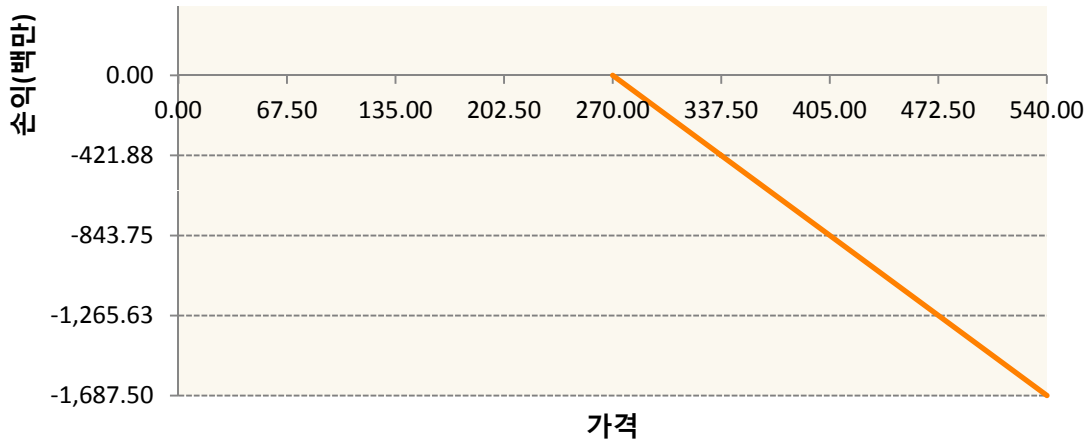
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

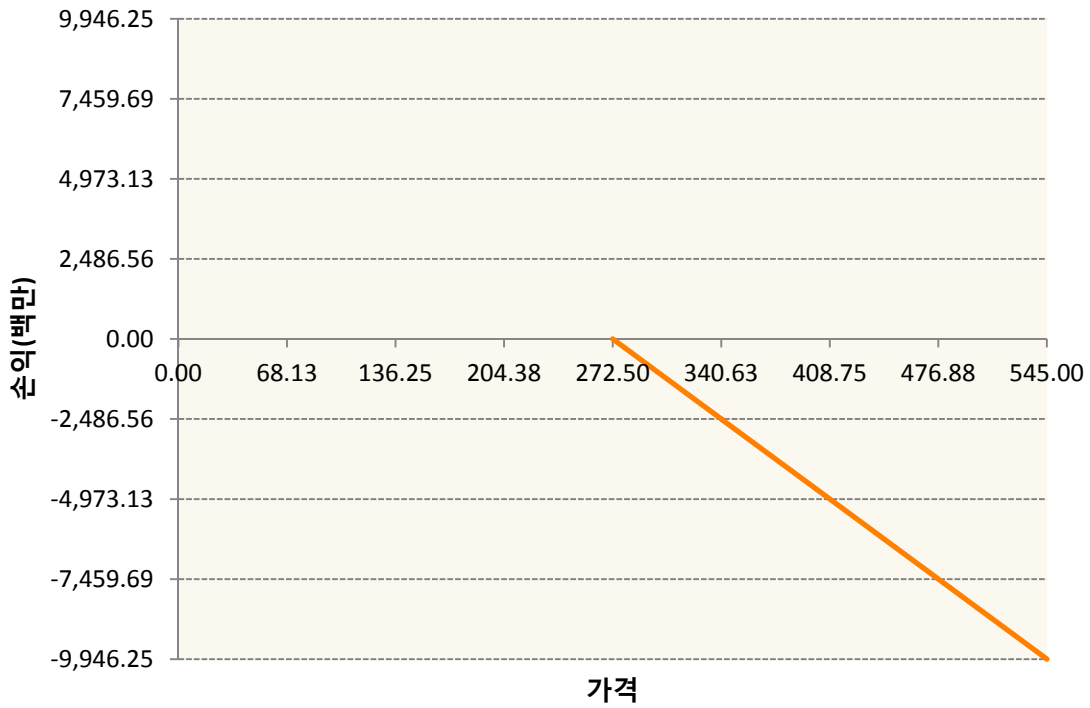


KR4201P62701-2019-06 콜270

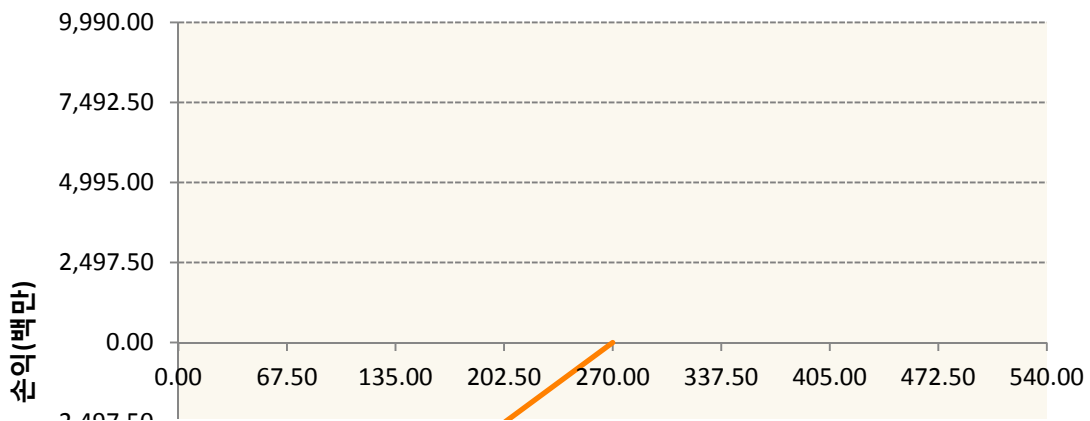




KR4201P62727-2019-06 콜272.5



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						305
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-305	-305	-305	-305	-305	-305	-305	
-5.33%	-203	-203	-203	-203	-203	-203	-203	
-2.67%	-102	-102	-102	-102	-102	-102	-102	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	102	102	102	102	102	102	102	
5.33%	203	203	203	203	203	203	203	
8.00%	305	305	305	305	305	305	305	
KR4201P62701		2019-06 콜270						126
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%	23	23	23	23	23	22	22
-2.67%	21	20	20	19	18	17	16
0%	4	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	-36	-36	-36	-37	-37	-38	-38
5.33%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
8.00%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126

KR4201P62727 2019-06 콜272.5 695

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	84	84	84	84	84	84	84
-5.33%	84	84	84	84	83	83	82
-2.67%	81	79	76	73	69	65	60
0%	23	15	8	0	-8	-15	-23
2.67%	-171	-174	-178	-182	-187	-192	-197
5.33%	-430	-430	-430	-431	-432	-433	-435
8.00%	-695	-695	-695	-695	-695	-695	-695

KR4301P62709 2019-06 풋270 705

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-705	-705	-705	-705	-705	-705	-705
-5.33%	-436	-436	-436	-436	-436	-436	-436
-2.67%	-169	-170	-171	-172	-174	-176	-178
0%	11	7	4	0	-4	-8	-12
2.67%	24	24	24	23	23	23	22
5.33%	24	24	24	24	24	24	24
8.00%	24	24	24	24	24	24	24

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

(단위:백만원)

4,018

공시일	2019-06-11
기준일	2019-06-10

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

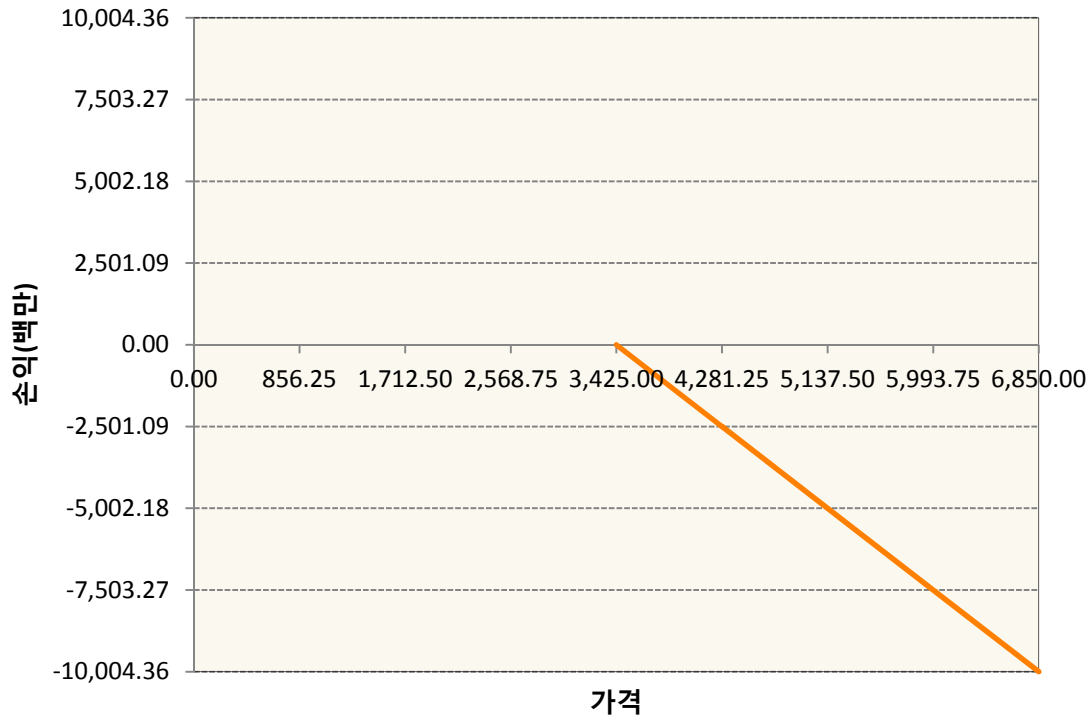
1. 계약금액

(단위:백만원)

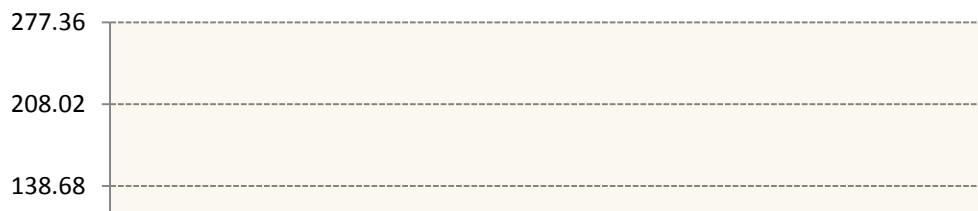
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,687	0	3,687	
누계	유가증권	스왑	56,715	0	56,715	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,563	-20,563	장내
누계	통화	선도	0	18,758	-18,758	장외

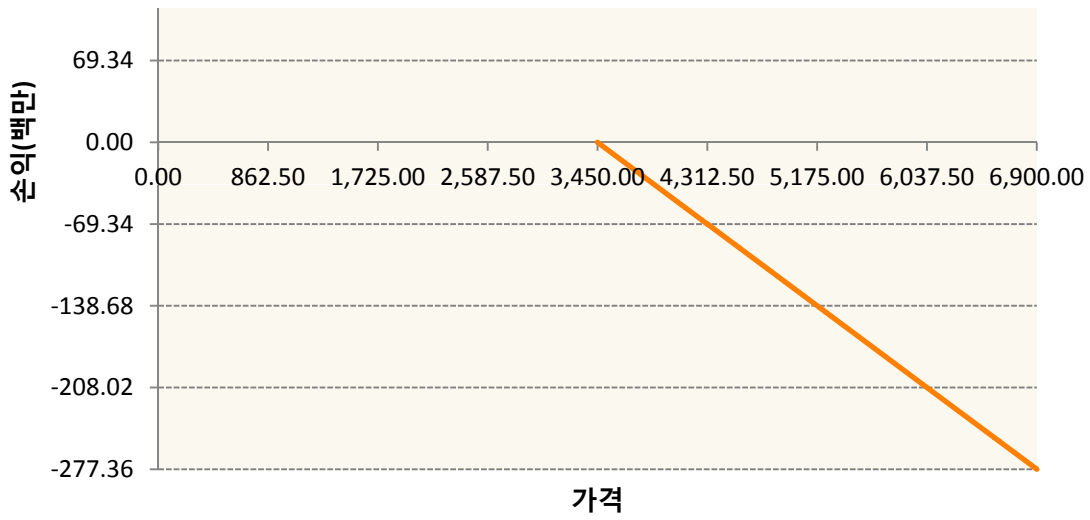
2. 만기시점의 손익구조

OESXM9-C3425-EURO STOXX 50

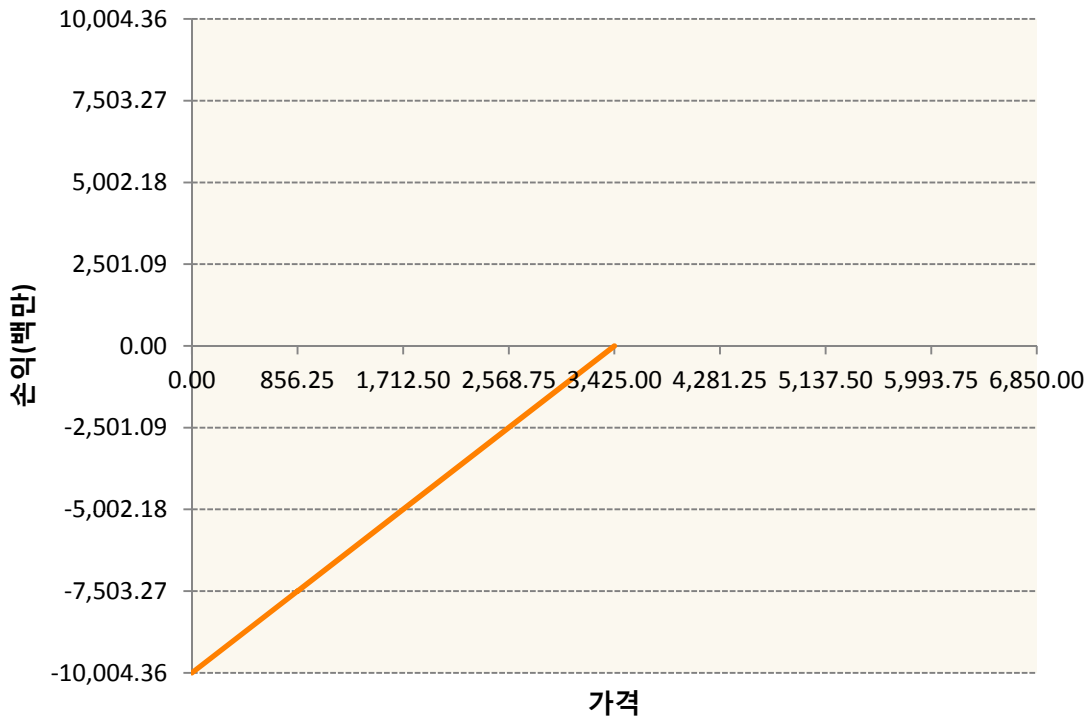


OESXM9-C3450-EURO STOXX 50

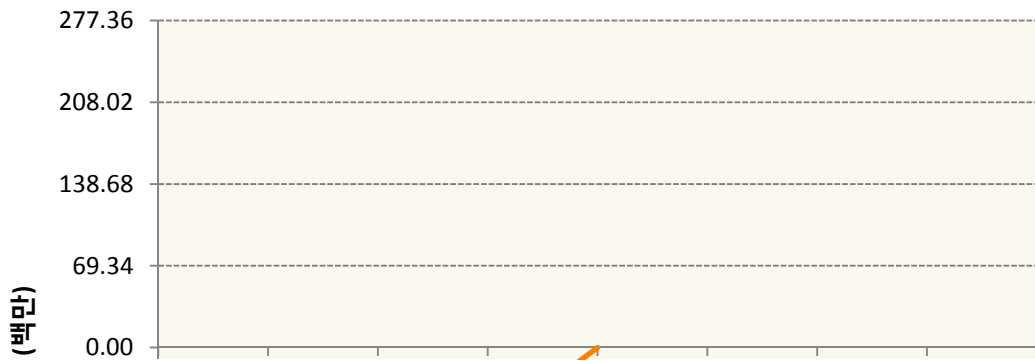


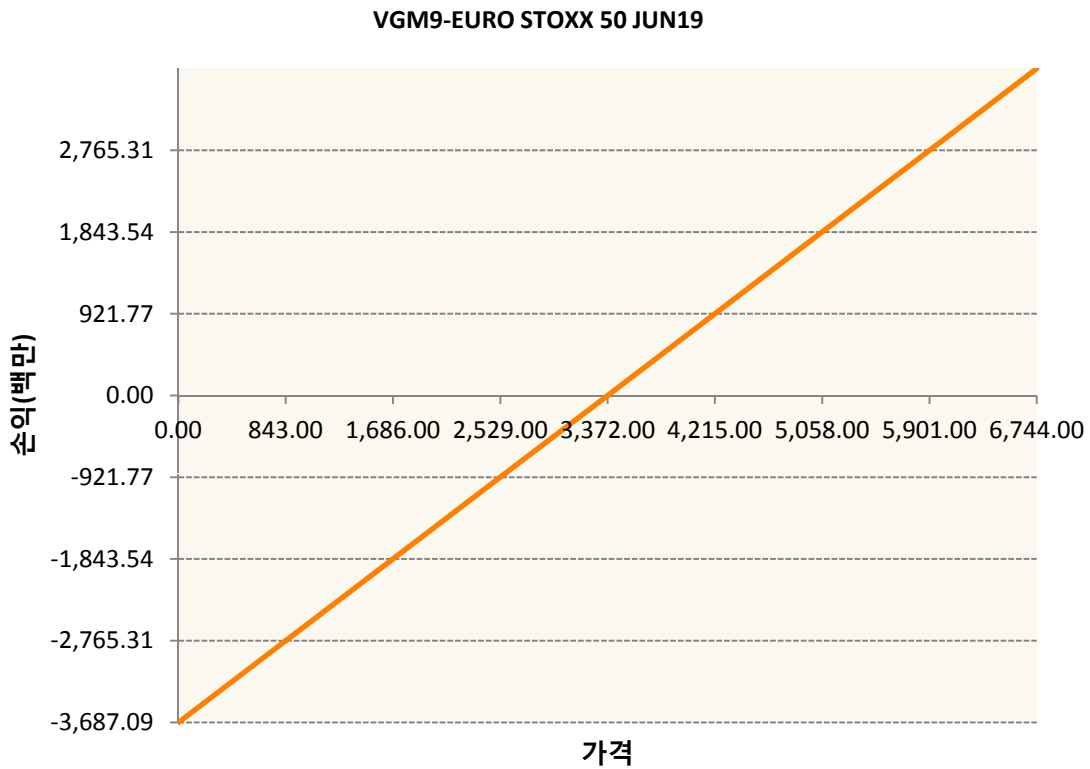
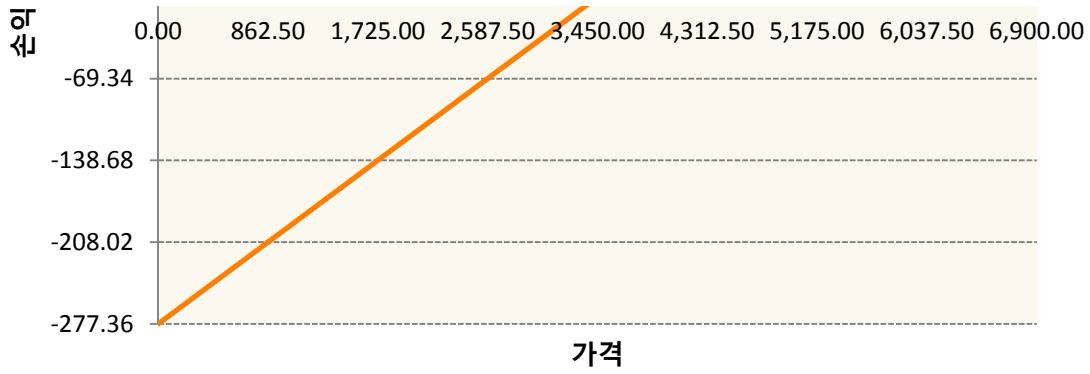


OESXM9-P3425-EURO STOXX 50



OESXM9-P3450-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	29
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	858
FX21019J01: KRW/EUR 28-06-19E	214
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	429
OESXM9-C3·EURO STOXX 50	800
OESXM9-C3·EURO STOXX 50	22
OESXM9-P3·EURO STOXX 50	800
OESXM9-P3·EURO STOXX 50	22
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	295

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

(단위:백만원)

2,154

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

(단위:백만원)

1,040

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

(단위:백만원)

92

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

(단위:백만원)

133

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-06-11
기준일	2019-06-10

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

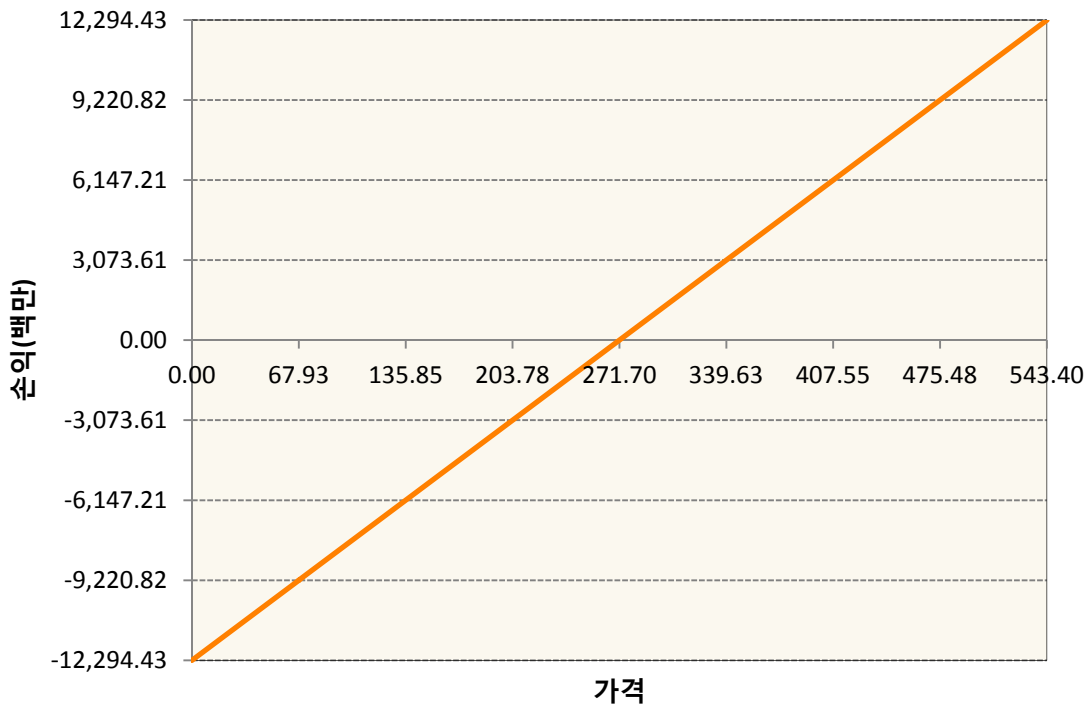
1. 계약금액

(단위:백만원)

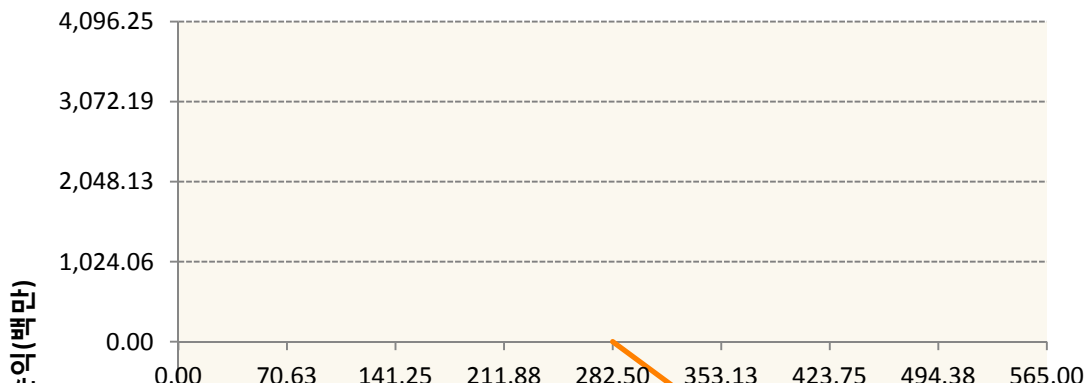
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	136	-136	장내
누계	유가증권	선물	12,294	0	12,294	장내
누계	유가증권	옵션	4,946	22,906	-17,961	장내

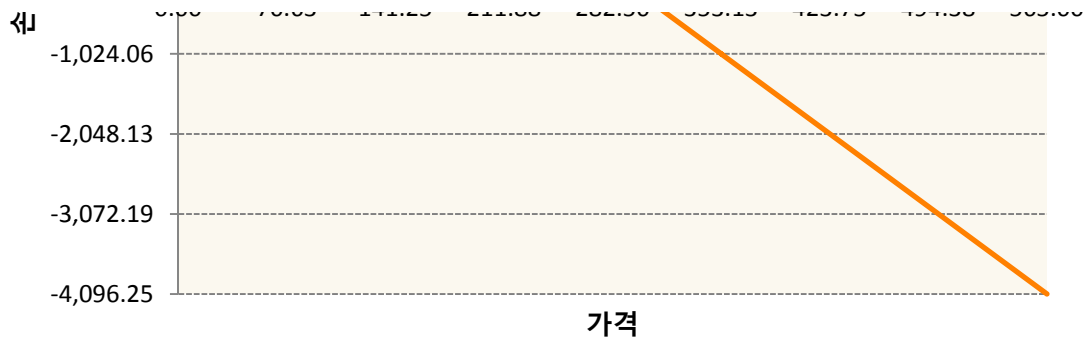
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

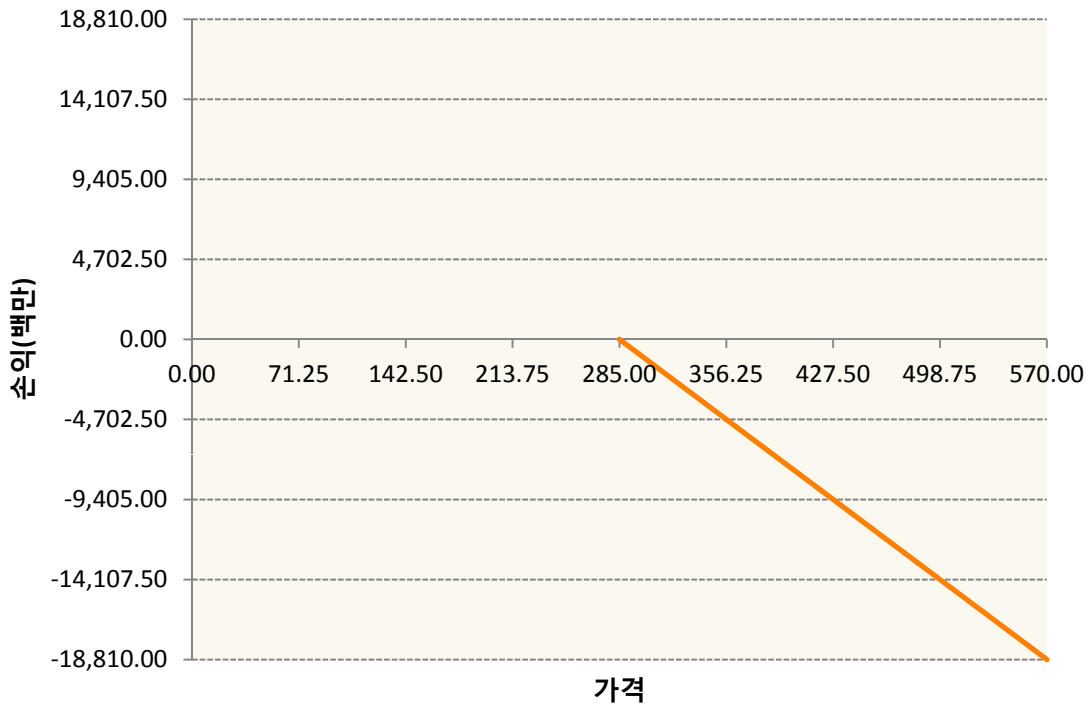


KR4201P62826-2019-06 콜282.5

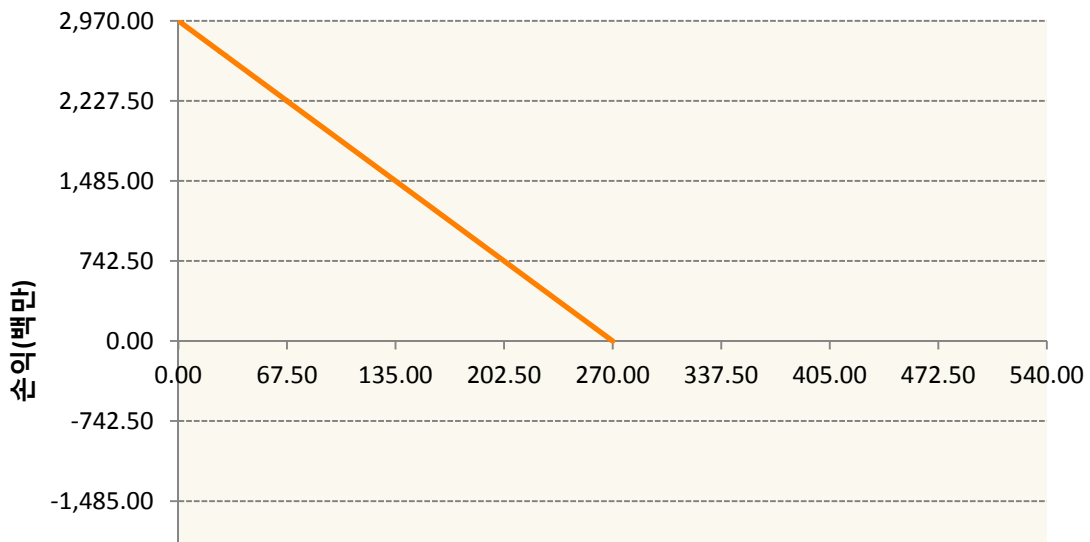


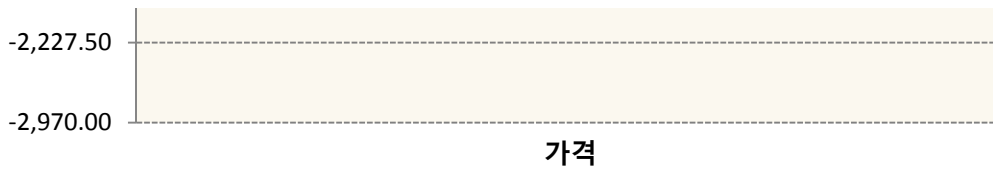


KR4201P62859-2019-06 콜285

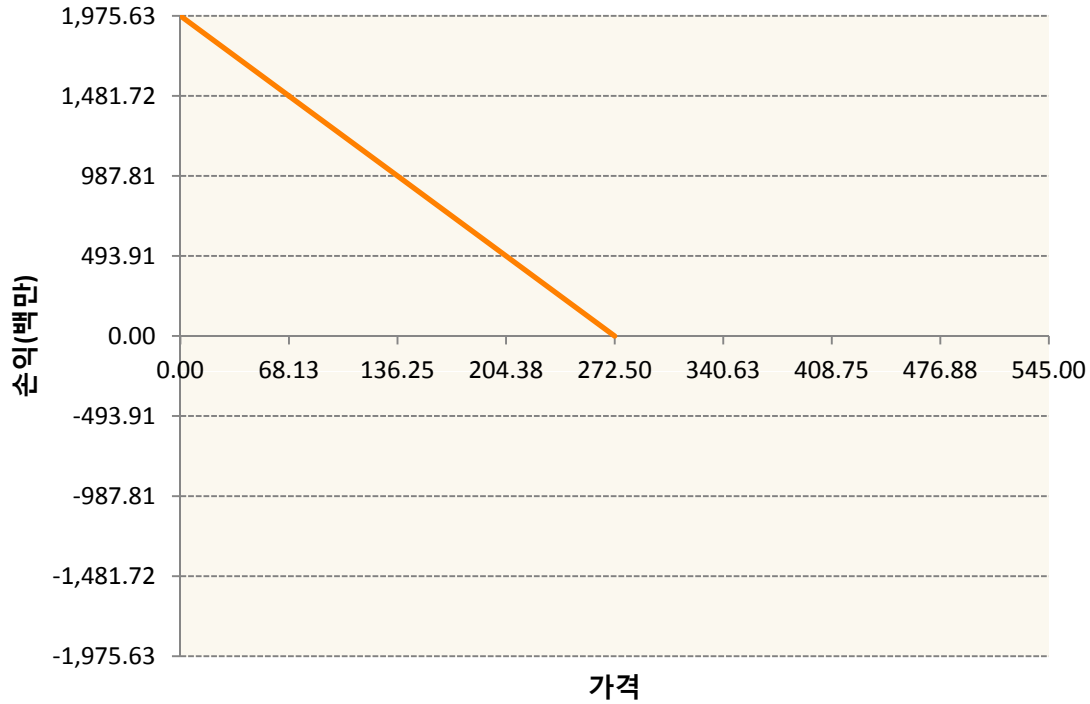


KR4301P62709-2019-06 풋270





KR4301P62725-2019-06 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						985
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-985	-985	-985	-985	-985	-985	-985	
-5.33%	-657	-657	-657	-657	-657	-657	-657	
-2.67%	-328	-328	-328	-328	-328	-328	-328	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	328	328	328	328	328	328	328	
5.33%	657	657	657	657	657	657	657	
8.00%	985	985	985	985	985	985	985	
KR4201P62826		2019-06 콜282.5						167
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2	2	2	2	2	2	2	
-5.33%	2	2	2	2	2	2	2	
-2.67%	2	2	2	2	2	2	2	

0%	2	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-9	-12	-14	-17	-20	-23	-26
5.33%	-65	-68	-70	-73	-76	-78	-81
8.00%	-163	-163	-164	-164	-165	-166	-167
KR4201P62859 2019-06 콜285							622
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%	4	4	4	4	4	4	4
-2.67%	4	4	4	4	3	3	3
0%	3	3	2	0	-2	-5	-9
2.67%	-16	-24	-33	-43	-53	-63	-75
5.33%	-186	-200	-214	-228	-243	-257	-271
8.00%	-585	-589	-594	-600	-606	-614	-622
KR4301P62709 2019-06 풋270							210
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	210	210	210	210	210	210	210
-5.33%	130	130	130	130	130	130	130
-2.67%	50	50	51	51	52	52	53
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
KR4301P62725 2019-06 풋272.5							149
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	149	149	149	149	149	149	149
-5.33%	96	96	96	96	96	96	96
-2.67%	44	44	44	44	44	44	44
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-12	-12	-12	-12	-12	-11	-11
5.33%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
8.00%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12

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

(단위:백만원)

1,371

공시일	2019-06-11
기준일	2019-06-10

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	18,308	0	18,308	

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	2019-06-11
기준일	2019-06-10

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	57,363	0	57,363	

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	2019-06-11
기준일	2019-06-10

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	341,352	0	341,352	
누계	통화	선도	0	349,160	-349,160	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019J019 KRW/USD 18-06-19E		379
FX21019J024 KRW/USD 24-06-19E		948
FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E		379
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		76
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		997
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E		1,024
FX21019K00 KRW/USD 18-06-19E		569
FX21019K01 KRW/USD 14-06-19E		664
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		569
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		474
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		569
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,422
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,327
FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E		474
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E		796
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E		633
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		474
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		379
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		796
FX21019K02 KRW/USD 24-06-19E		379
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E		948
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E		1,517
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E		284
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E		1,233
FX21019K04 KRW/USD 28-06-19E		1,289
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		664

FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	569
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	759
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	759
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	474
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	284
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	948
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	190
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	882
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	1,052
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	1,896
FX21019M00 KRW/USD 15-07-19E	474
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	379

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

(단위:백만원)

9,321

공시일	2019-06-11
기준일	2019-06-10

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

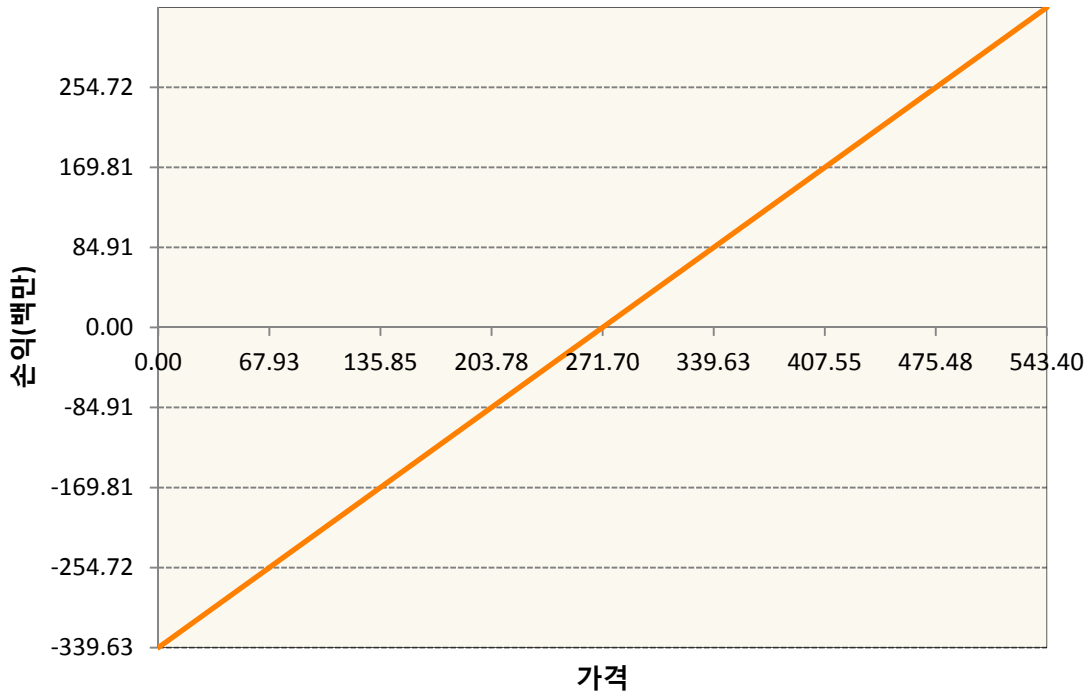
1. 계약금액

(단위:백만원)

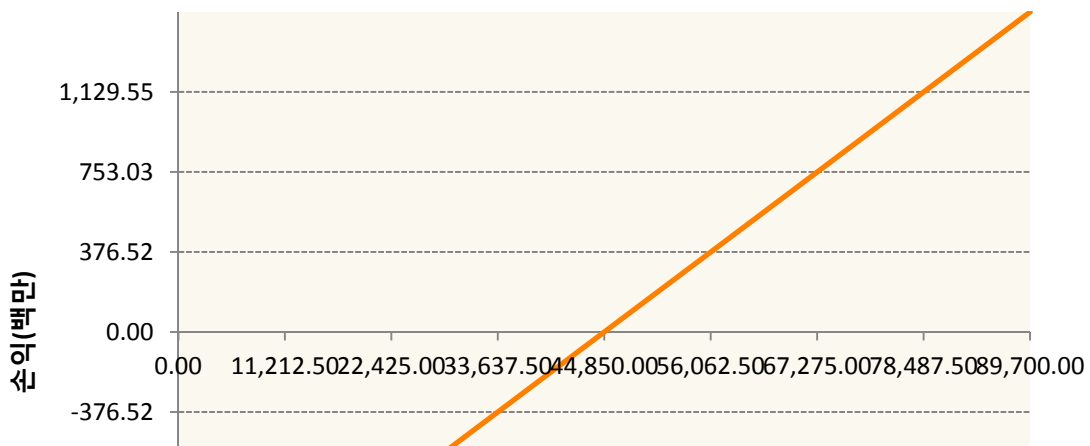
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,846	0	1,846	장내

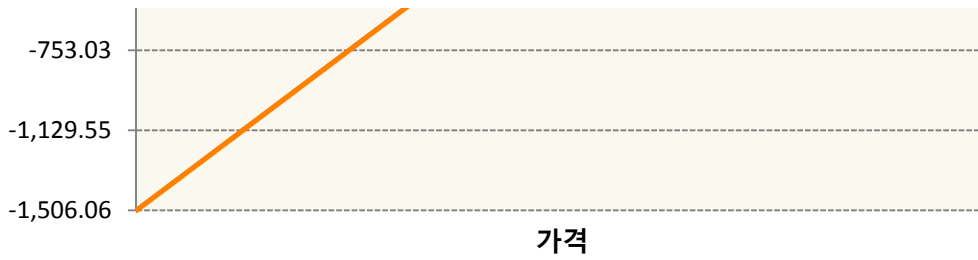
2. 만기시점의 손익구조

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						120
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120	
-5.33%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80	
-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%	80	80	80	80	80	80	80	
8.00%	120	120	120	120	120	120	120	

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

163

공시일	2019-06-11
기준일	2019-06-10

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

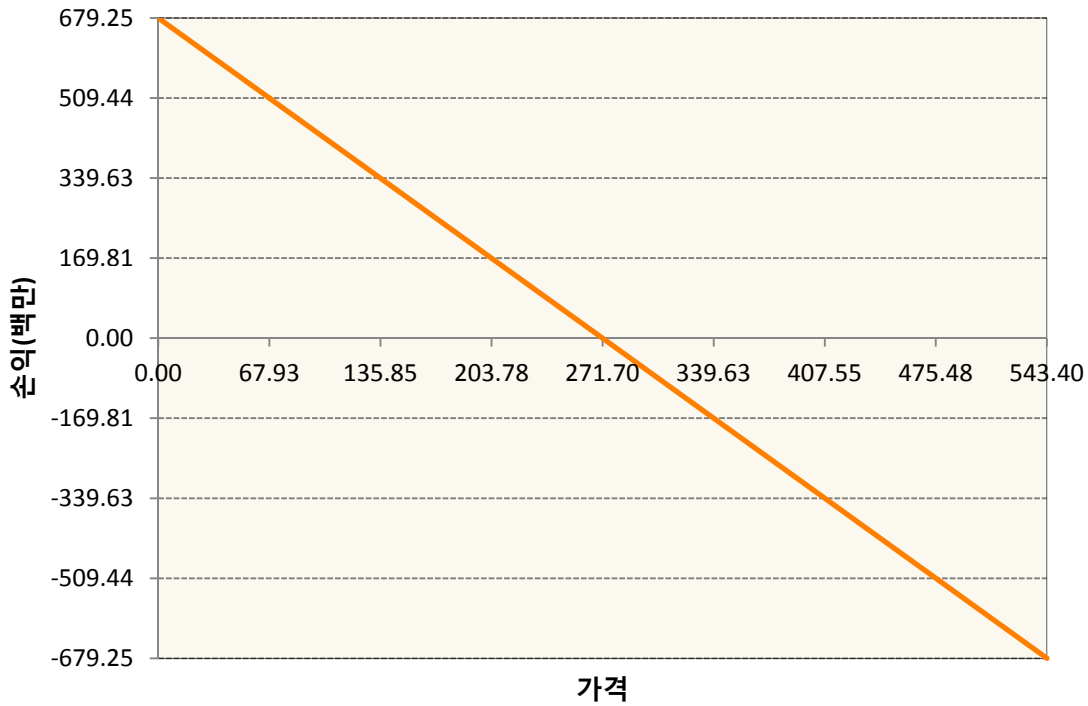
1. 계약금액

(단위:백만원)

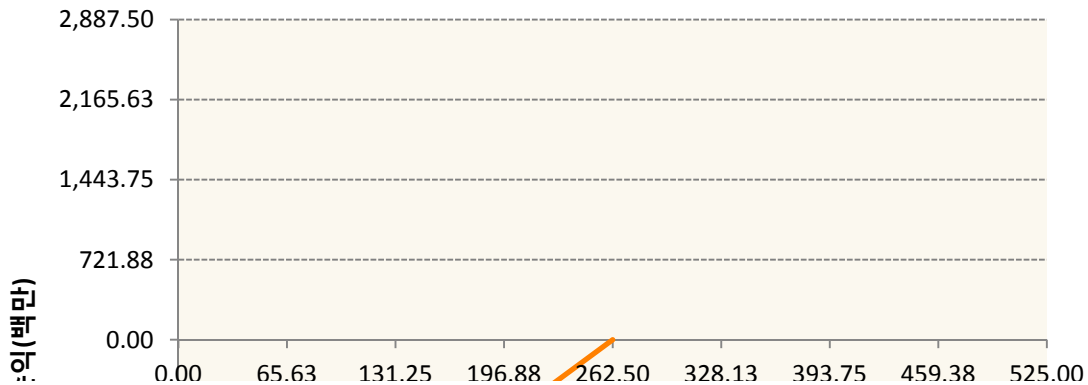
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	66	0	66	장내
누계	유가증권	선물	0	679	-679	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,351	-3,351	장내

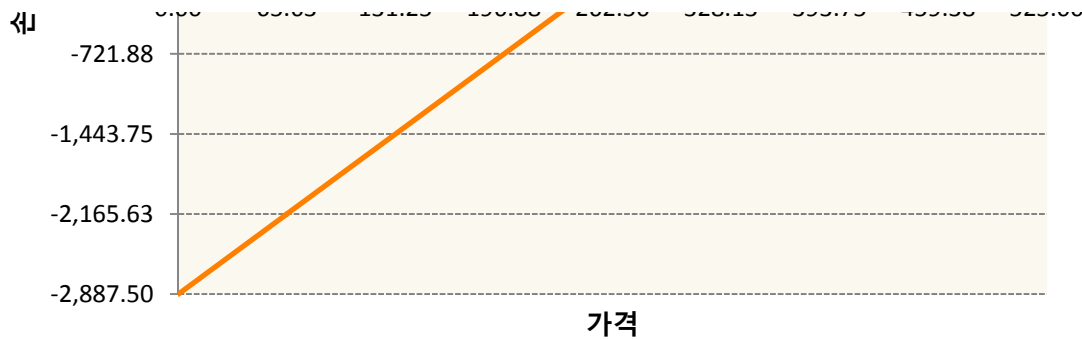
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

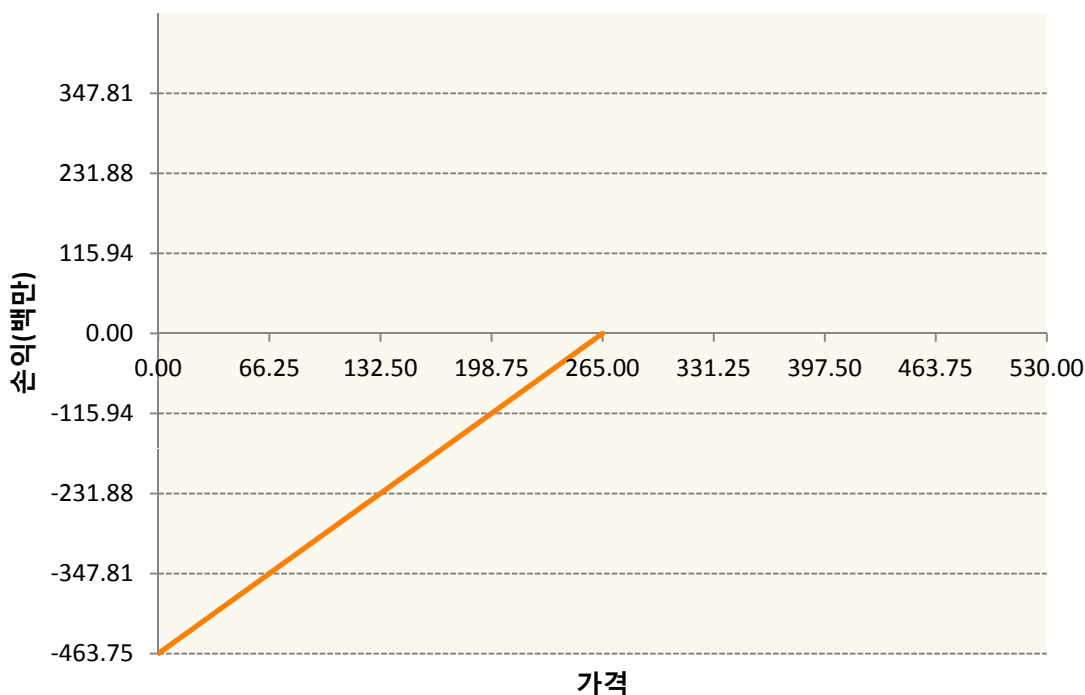


KR4301P62626-2019-06 풋262.5





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						134
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-134	-134	-134	-134	-134	-134	-134
-5.33%	-55	-55	-55	-56	-56	-57	-57
-2.67%	-3	-4	-5	-6	-7	-8	-9
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

KR4301P62659

2019-06 풋265

26

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
-5.33%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
-2.67%	-2	-2	-2	-3	-3	-3	-3
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

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

(단위:백만원)

106

공시일	2019-06-11
기준일	2019-06-10

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

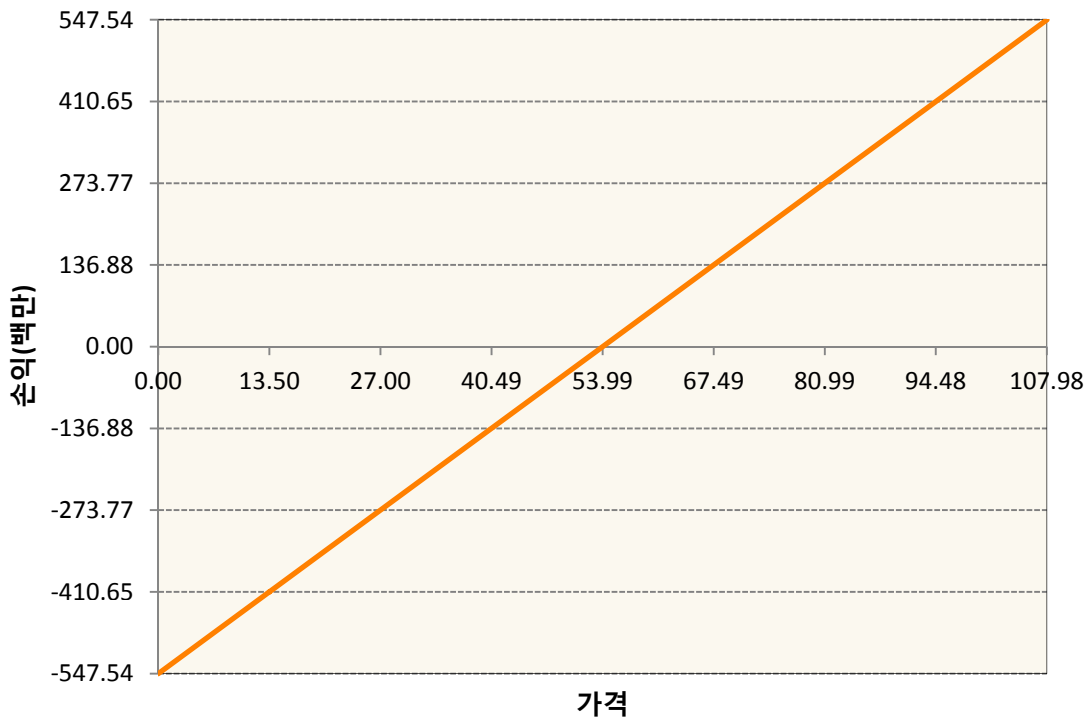
1. 계약금액

(단위:백만원)

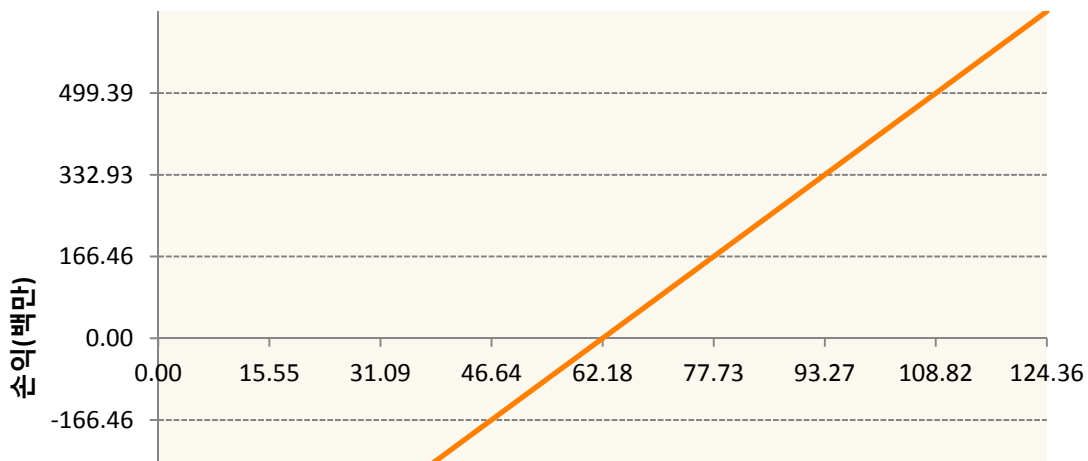
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,440	119	2,322	

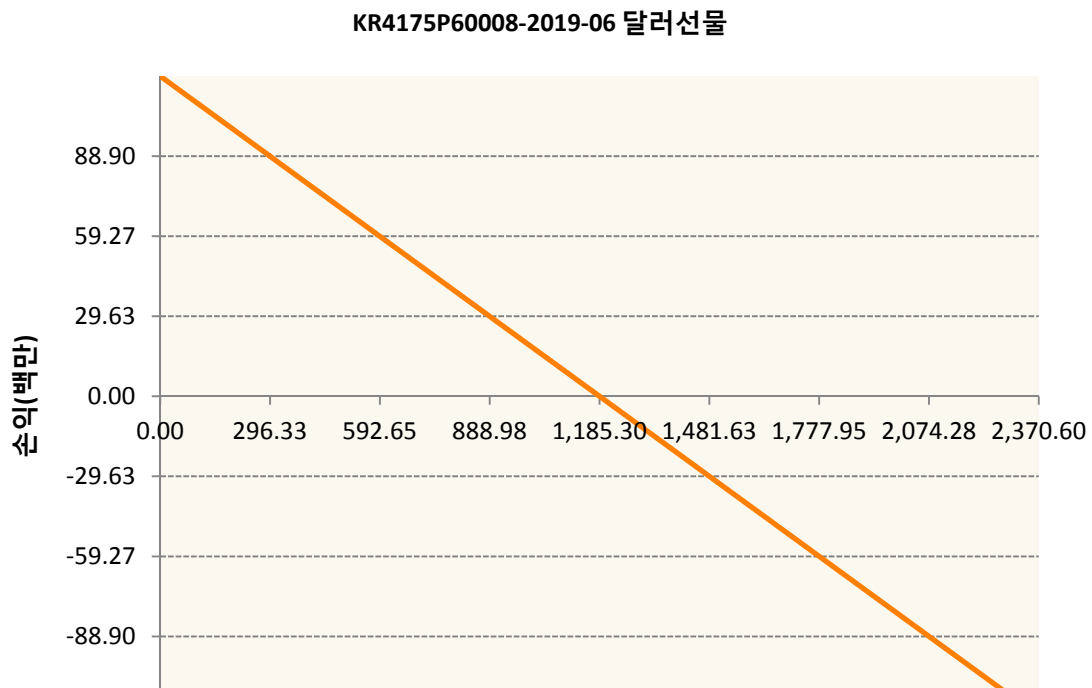
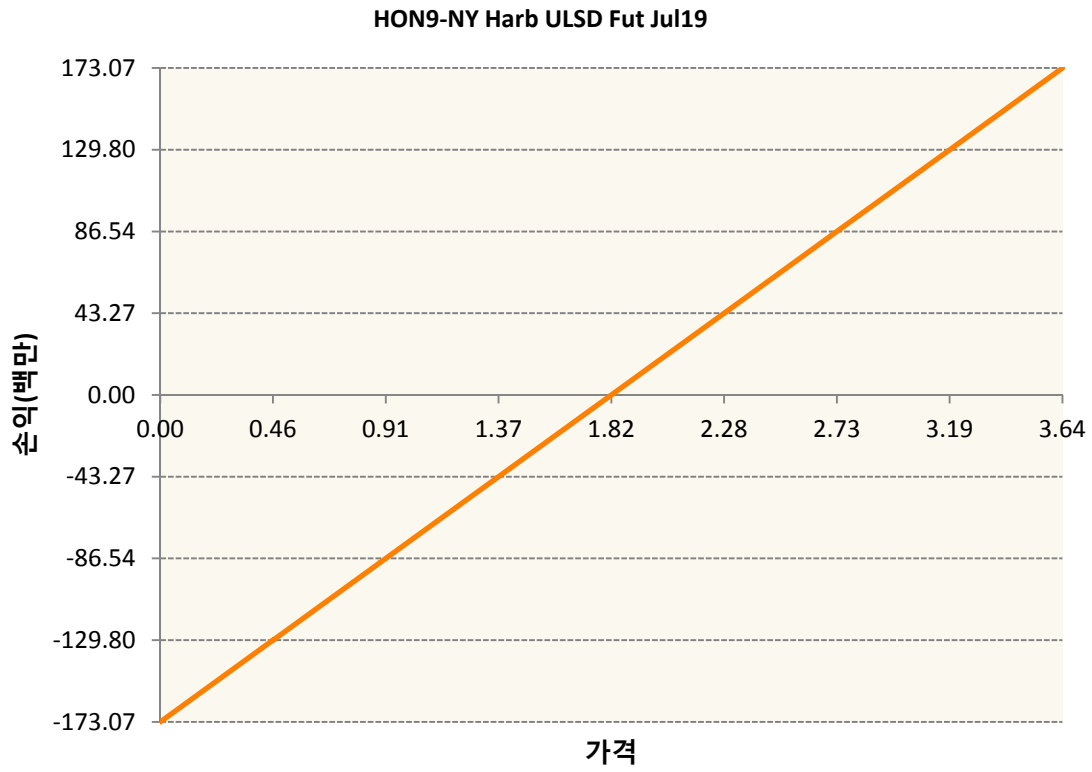
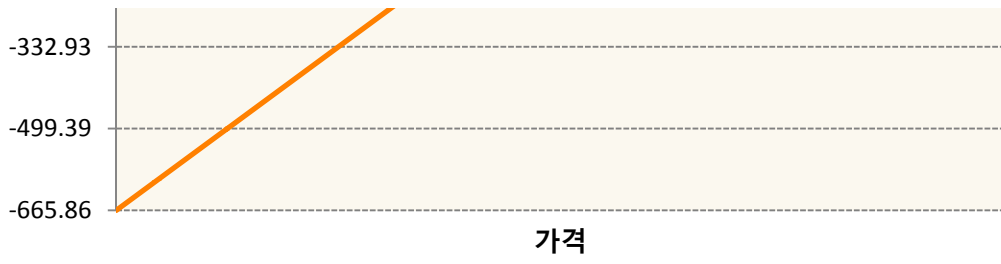
2. 만기시점의 손익구조

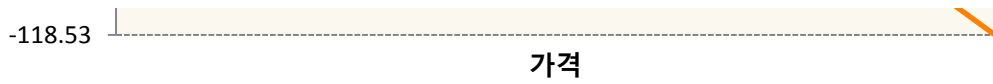
CLN9-WTI CRUDE FUTURE Jul19



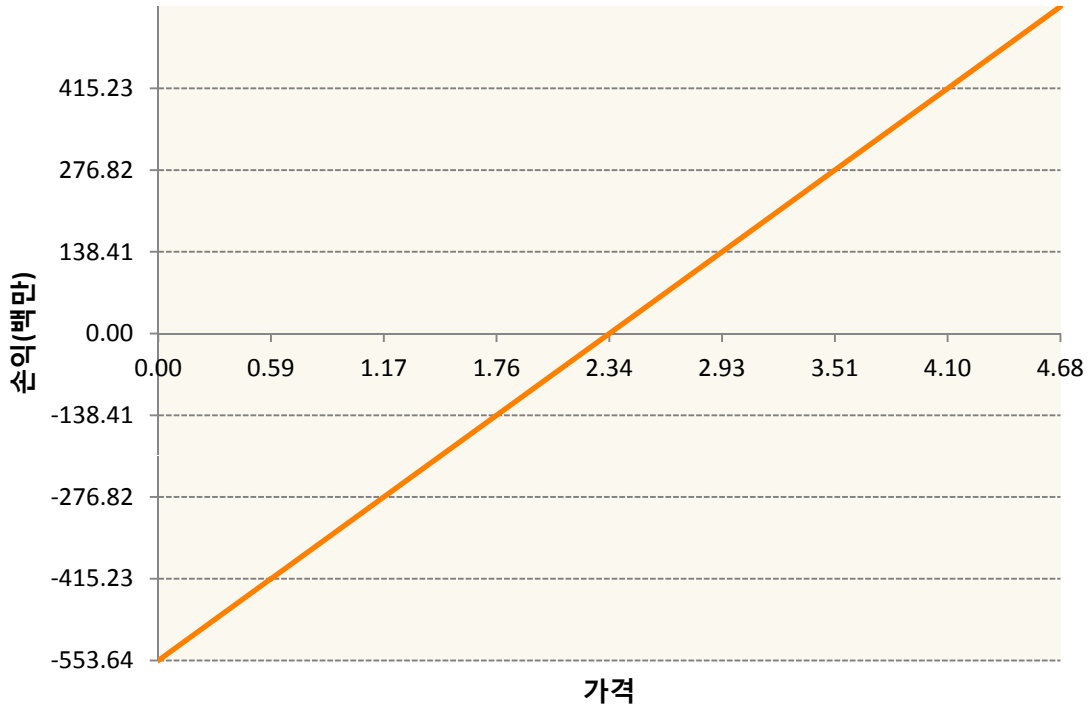
COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19



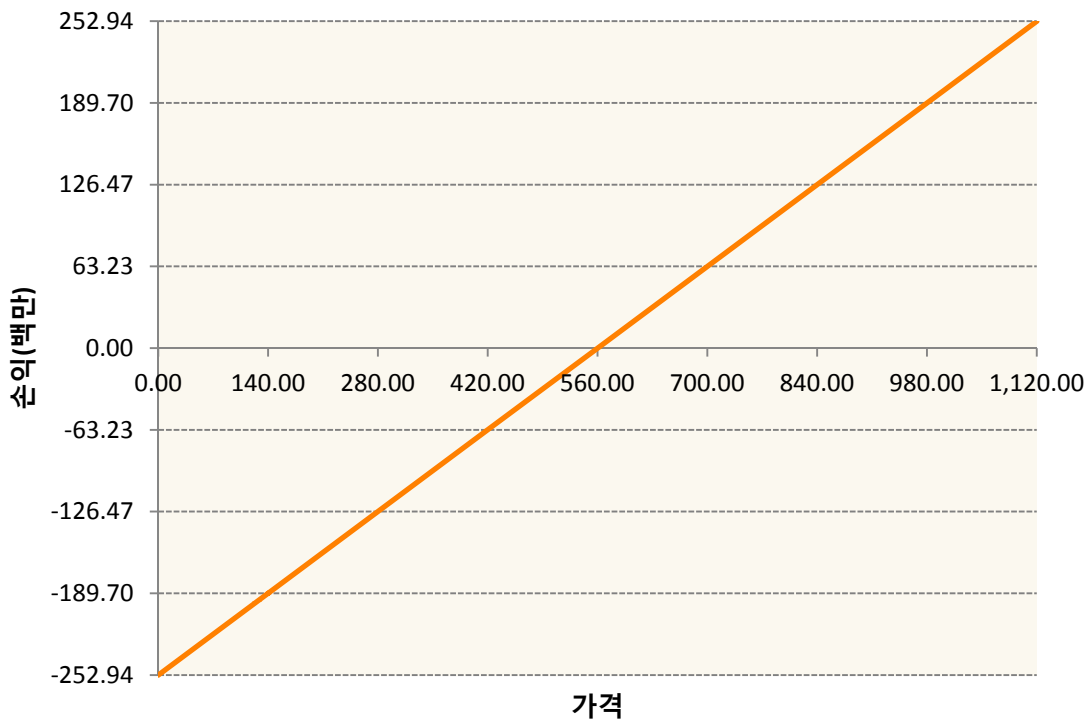




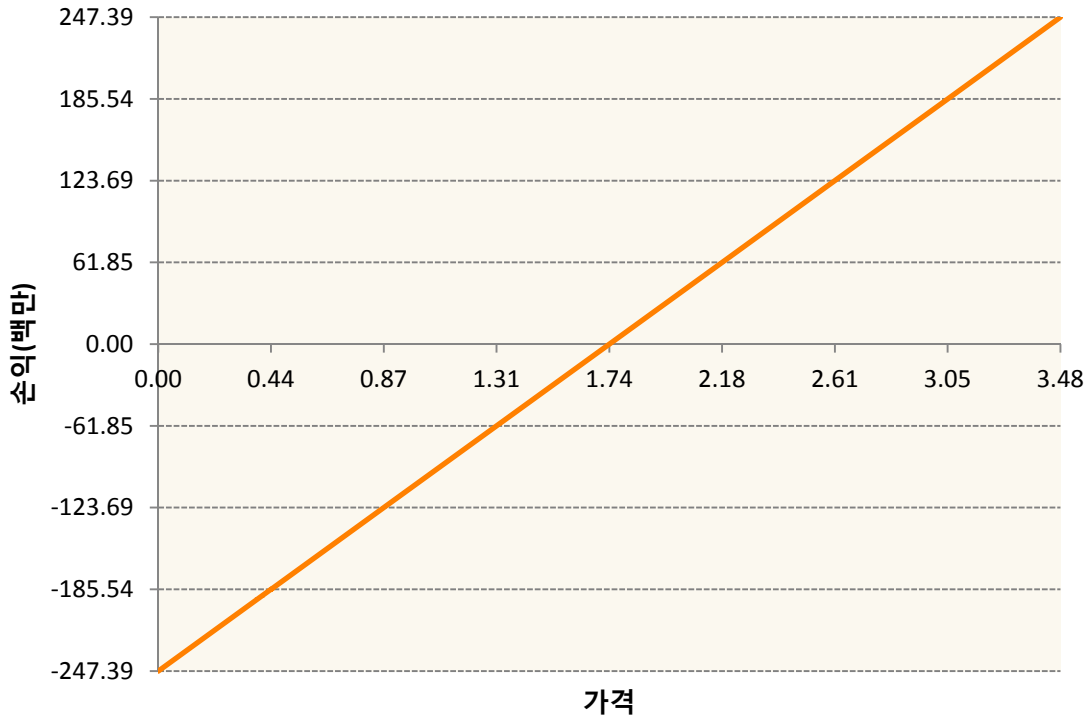
NGN19-NATURAL GAS FUTR Jul19



QSN9-Low Su Gasoil G Jul19



XBN9-GASOLINE RBOB FUT Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN9	WTI CRUDE FUTURE Jul19	44
COU9	BRENT CRUDE FUTR Sep19	53
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	20

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

322

공시일	2019-06-11
기준일	2019-06-10

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

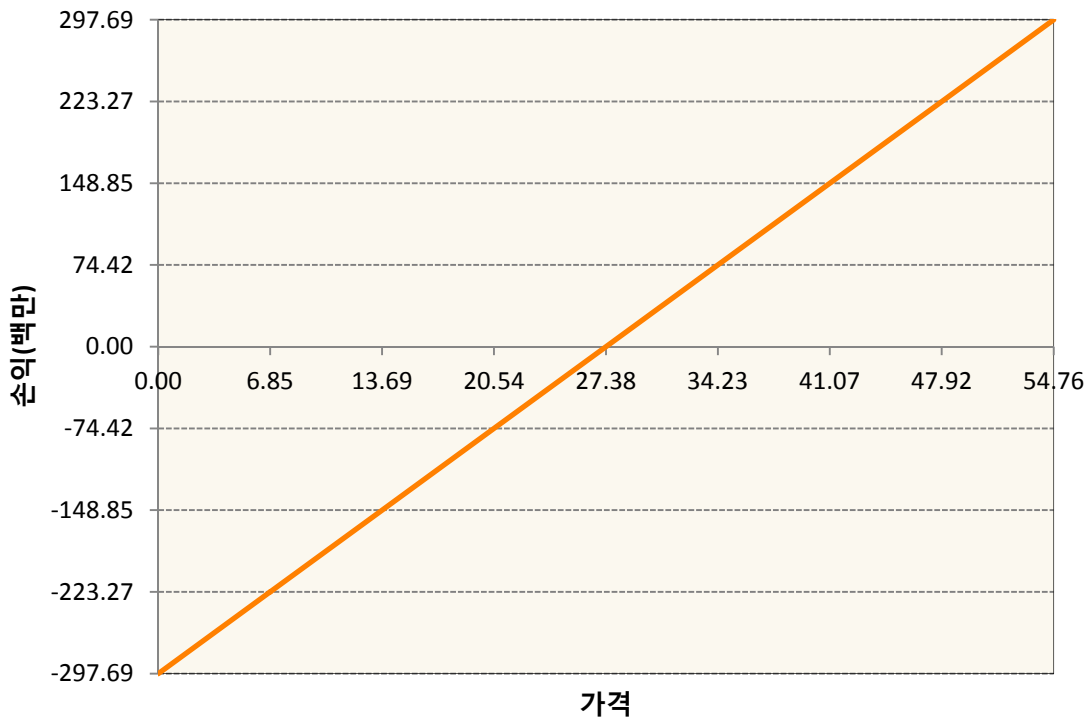
1. 계약금액

(단위:백만원)

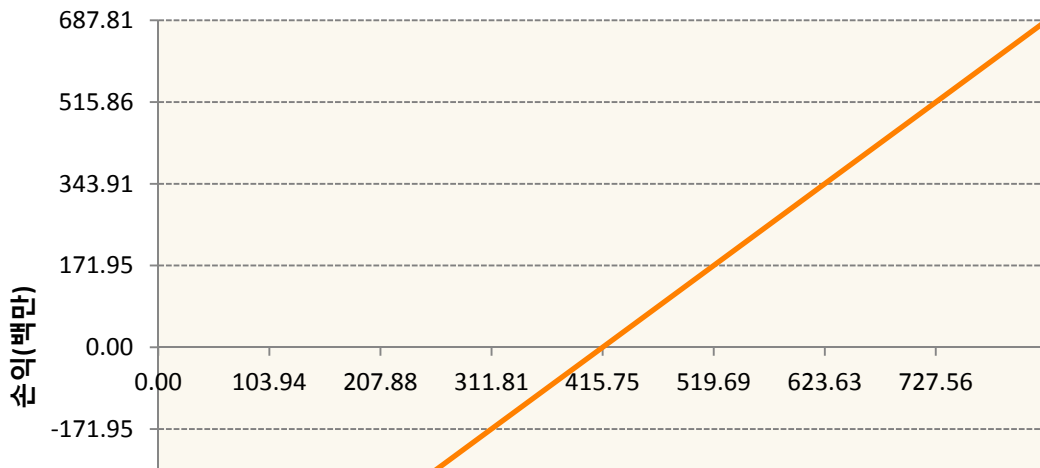
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,065	202	2,863	

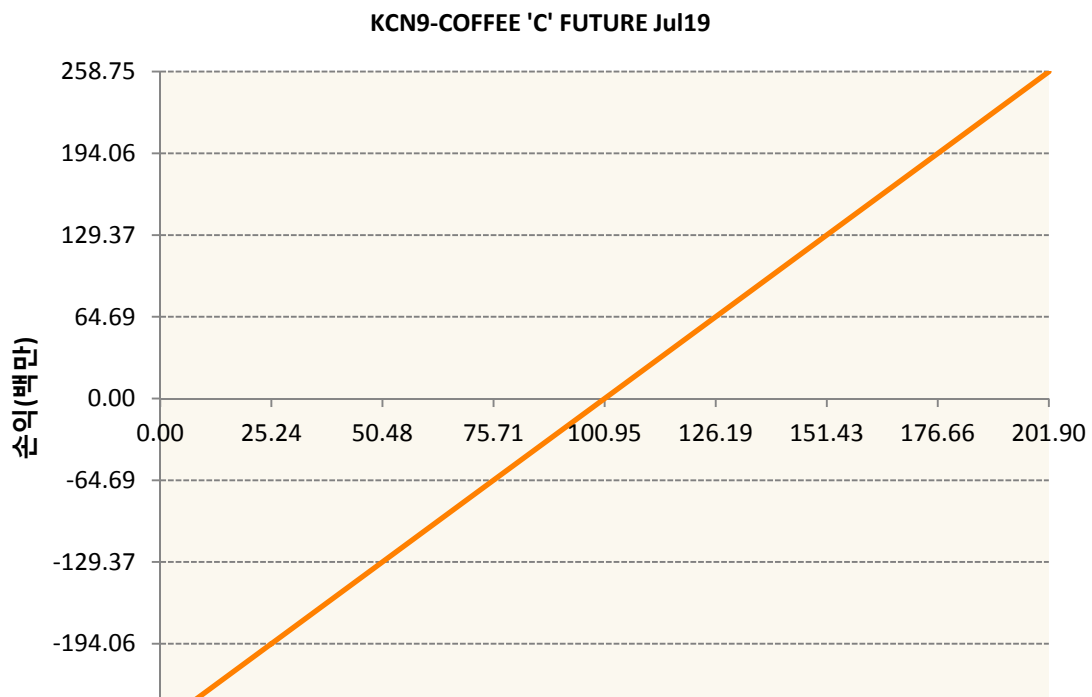
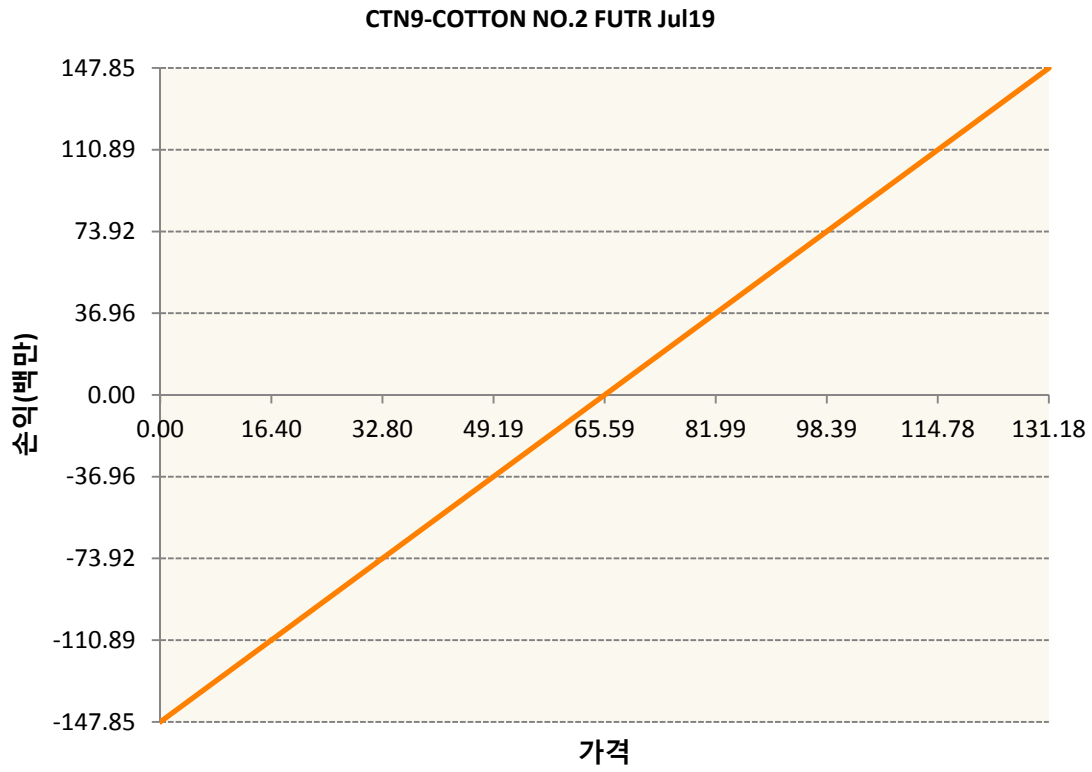
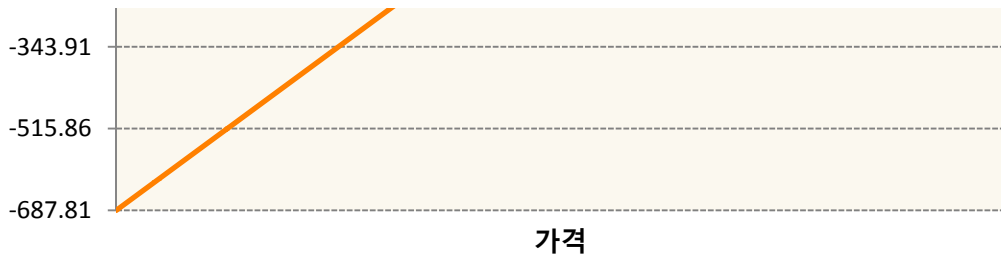
2. 만기시점의 손익구조

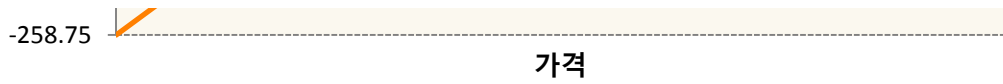
BON9-SOYBEAN OIL FUTR Jul19



CN9-CORN FUTURE Jul19

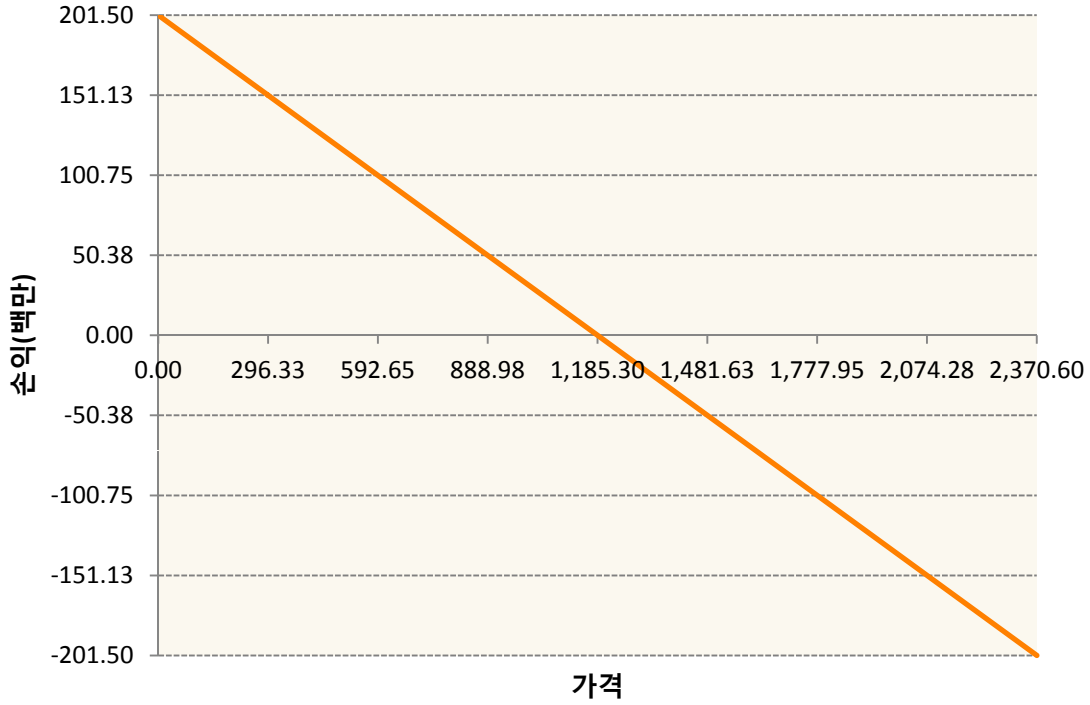






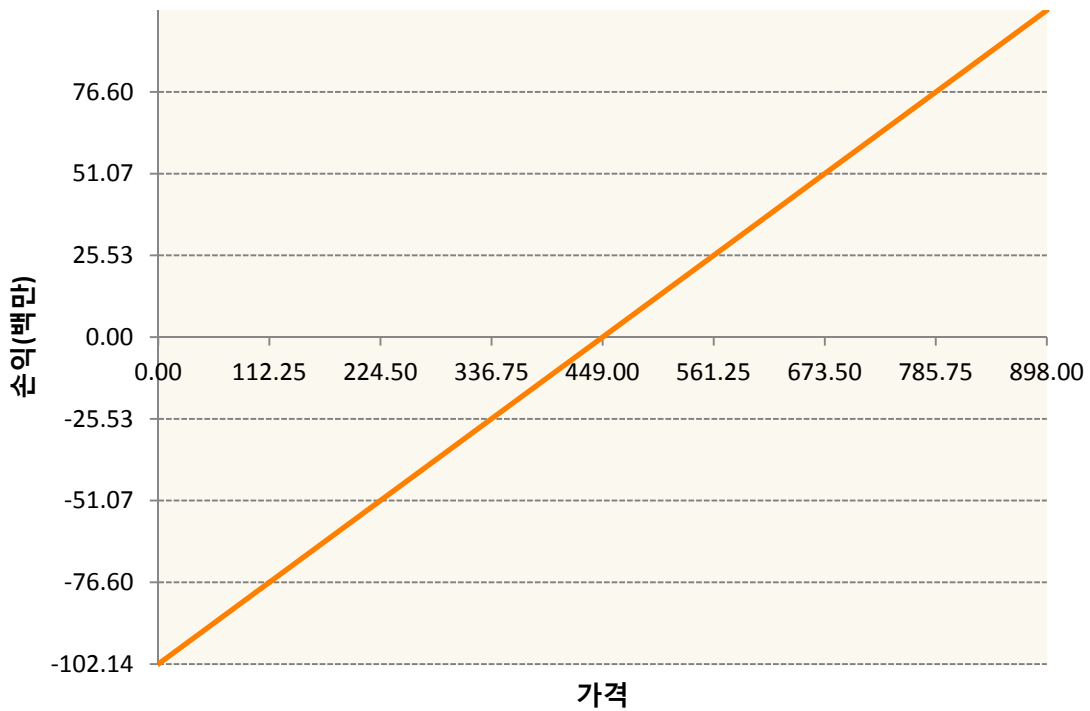
가격

KR4175P60008-2019-06 달러선물



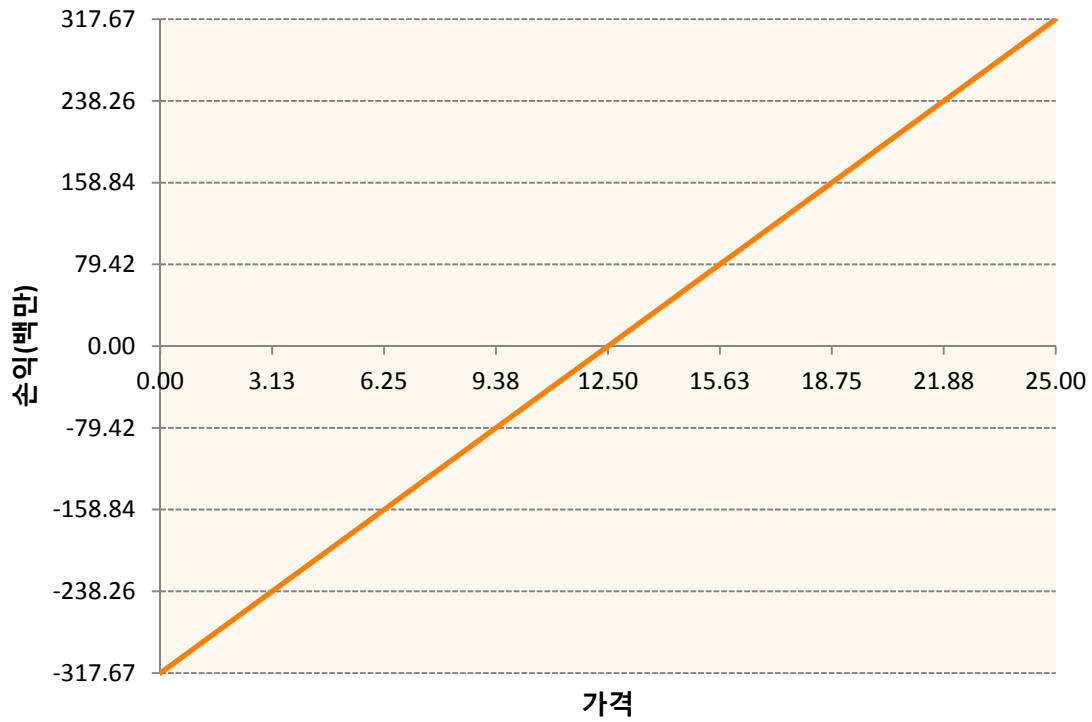
가격

KWN9-KC HRW WHEAT FUT Jul19

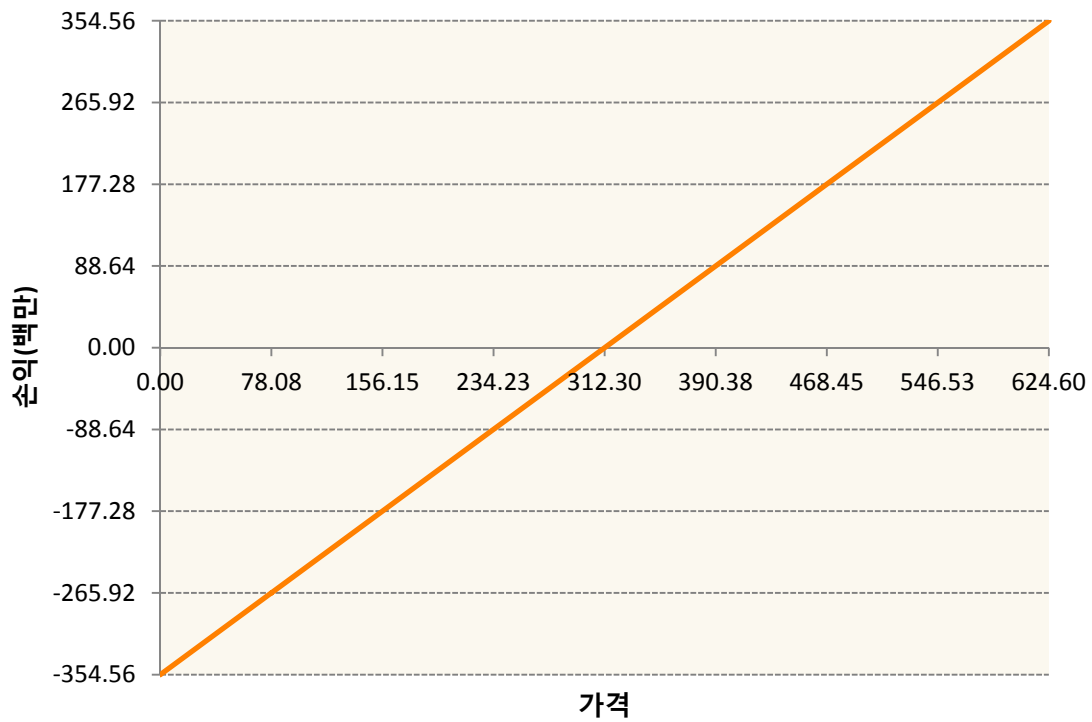


가격

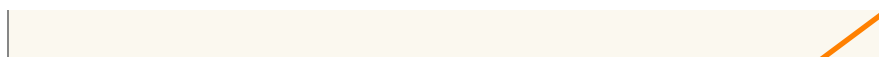
SBN9-SUGAR #11 (WORLD) Jul19

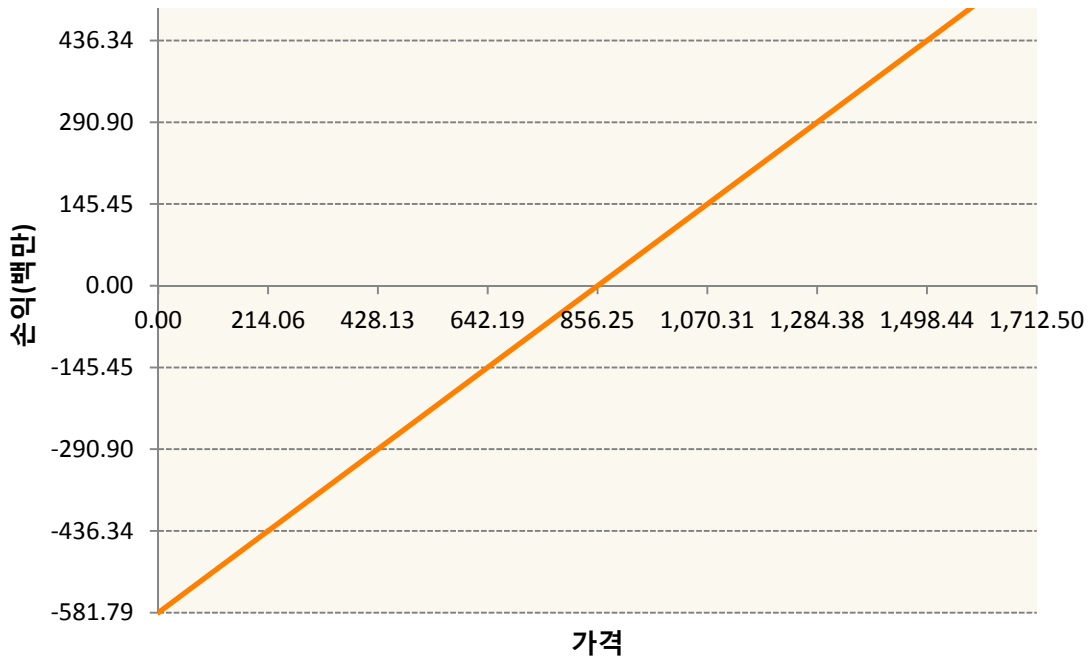


SMN9-SOYBEAN MEAL FUTR Jul19

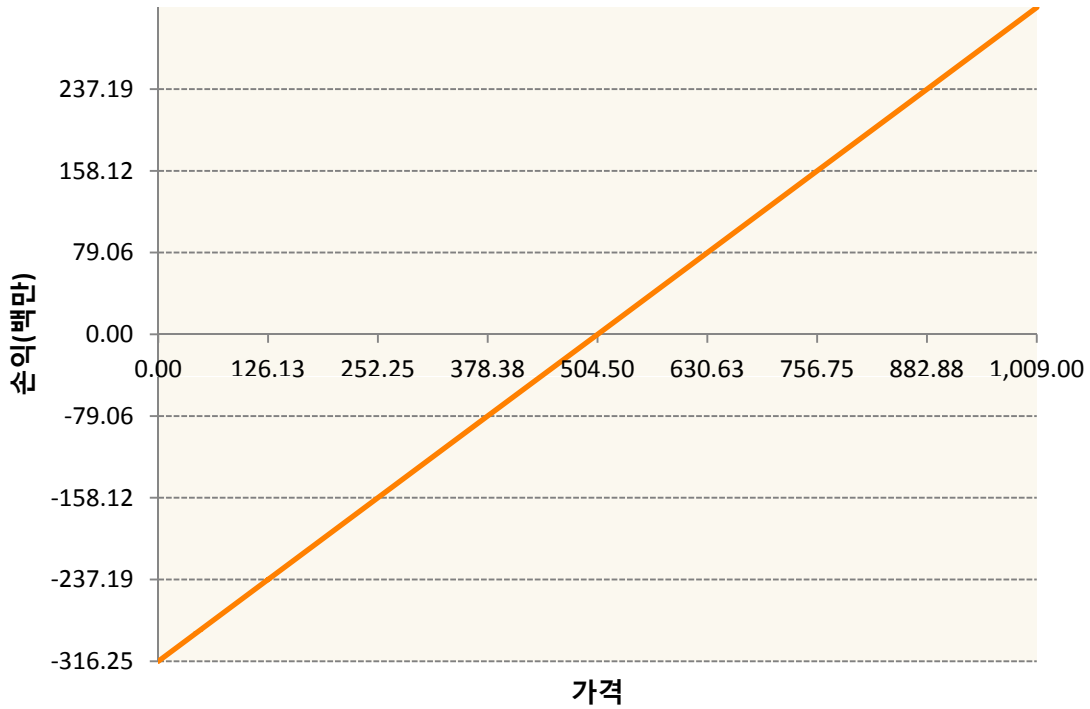


SN9-SOYBEAN FUTURE Jul19





WN9-WHEAT FUTURE(CBT) Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON9	SOYBEAN OIL FUTR Jul19	24
CN9	CORN FUTURE Jul19	55
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	28
SN9	SOYBEAN FUTURE Jul19	47
WN9	WHEAT FUTURE(CBT) Jul19	25

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

(단위:백만원)

264