

공시일	2019-06-12
기준일	2019-06-11

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	2019-06-12
기준일	2019-06-11

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

1,143

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

691

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-12
기준일	2019-06-11

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	6,210	0	6,210	장외
누계	지수	스왑	6,210	0	6,210	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(1)	378
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	139

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

865

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-12
기준일	2019-06-11

유로인덱스모(주식-파생형)

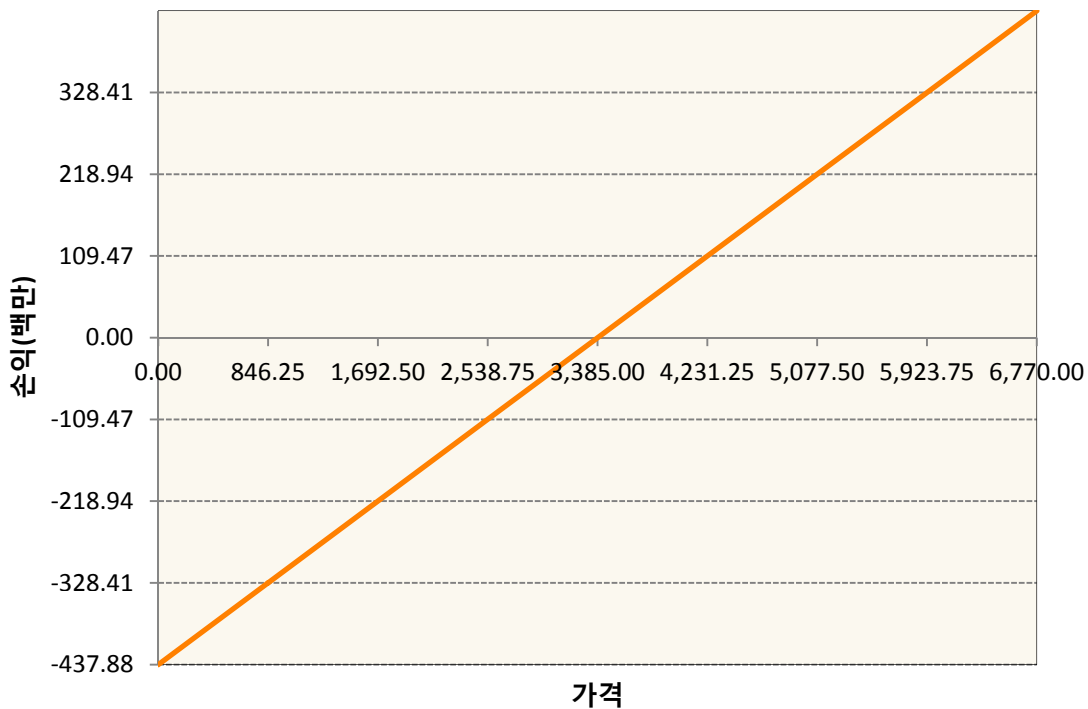
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	438	0	438	

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	2019-06-12
기준일	2019-06-11

차이나인덱스모(주식-파생형)

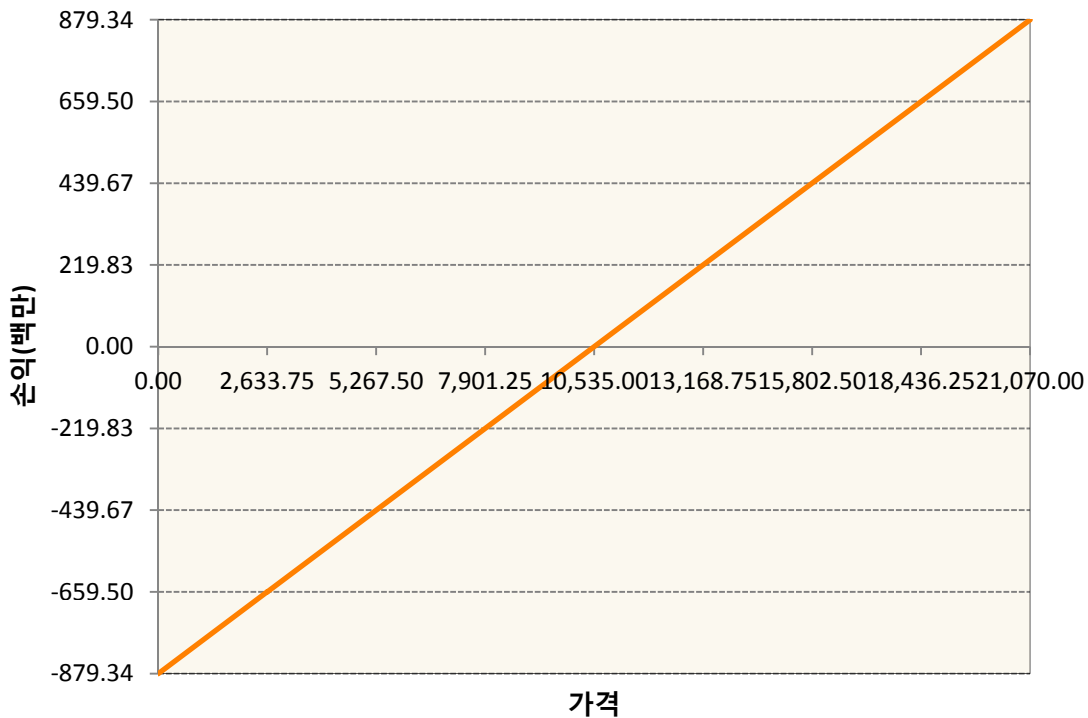
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	879	0	879	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)

71

공시일	2019-06-12
기준일	2019-06-11

커버드콜모(주식혼합-파생형)

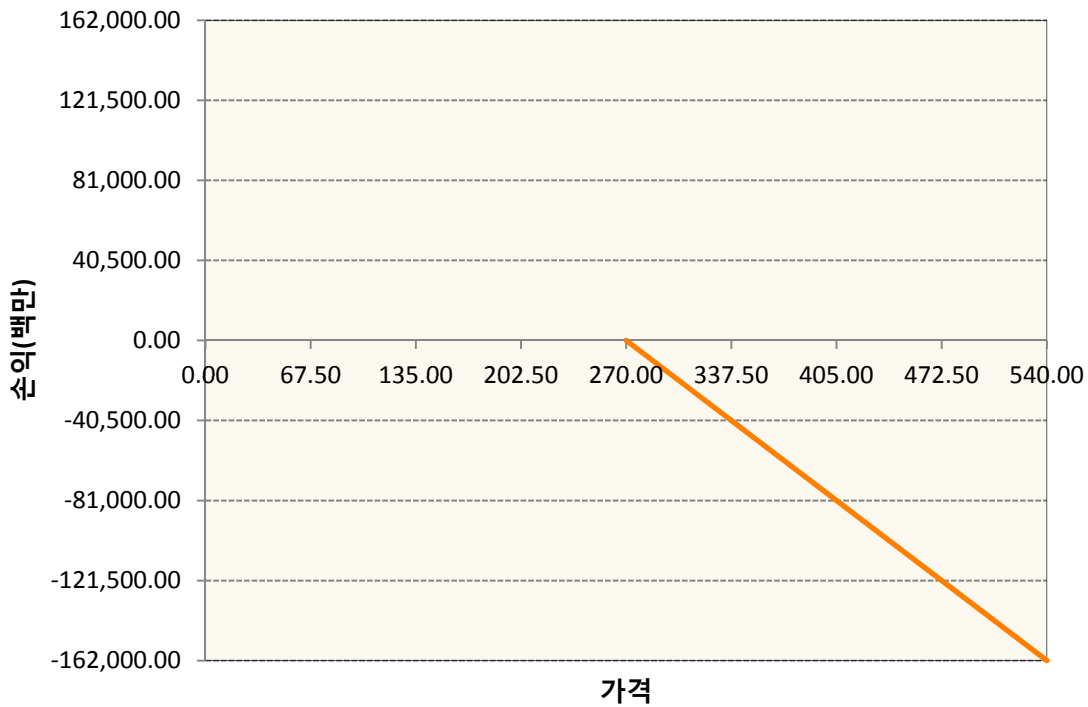
1. 계약금액

(단위:백만원)

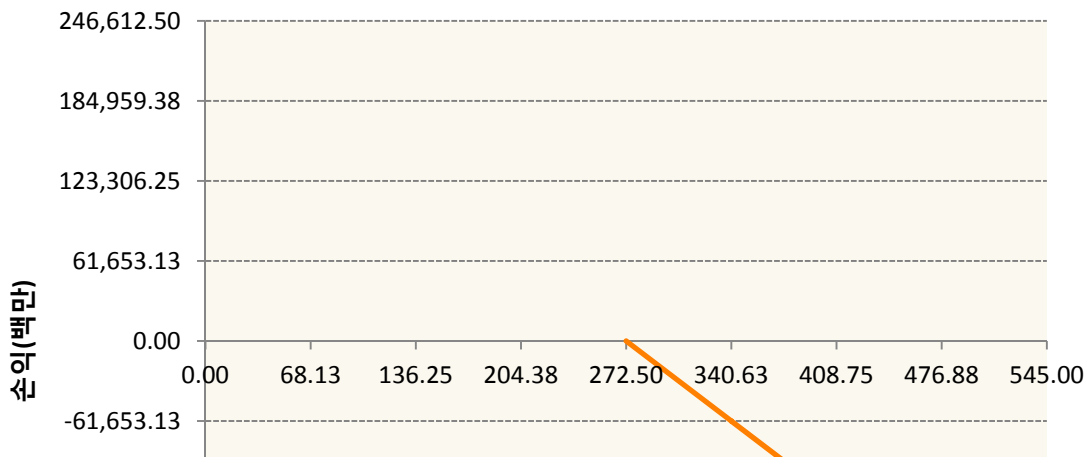
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	611,113	-611,113	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201P62701-2019-06 콜270



KR4201P62727-2019-06 콜272.5



-5.33%	2,197	2,197	2,196	2,193	2,189	2,181	2,170
-2.67%	2,137	2,097	2,045	1,984	1,913	1,834	1,747
0%	461	308	154	0	-154	-308	-463
2.67%	-5,053	-5,078	-5,112	-5,157	-5,210	-5,273	-5,344
5.33%	-11,618	-11,618	-11,619	-11,621	-11,624	-11,630	-11,640
8.00%	-18,210	-18,210	-18,210	-18,210	-18,210	-18,211	-18,211
KR4301P62709 2019-06 풋270							13,835
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-13,835	-13,835	-13,835	-13,835	-13,835	-13,835	-13,835
-5.33%	-8,371	-8,371	-8,371	-8,371	-8,371	-8,372	-8,372
-2.67%	-2,928	-2,943	-2,963	-2,988	-3,018	-3,051	-3,089
0%	103	74	39	0	-43	-90	-139
2.67%	159	159	159	159	158	158	157
5.33%	159	159	159	159	159	159	159
8.00%	159	159	159	159	159	159	159

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

(단위:백만원)

58,721

공시일	2019-06-12
기준일	2019-06-11

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

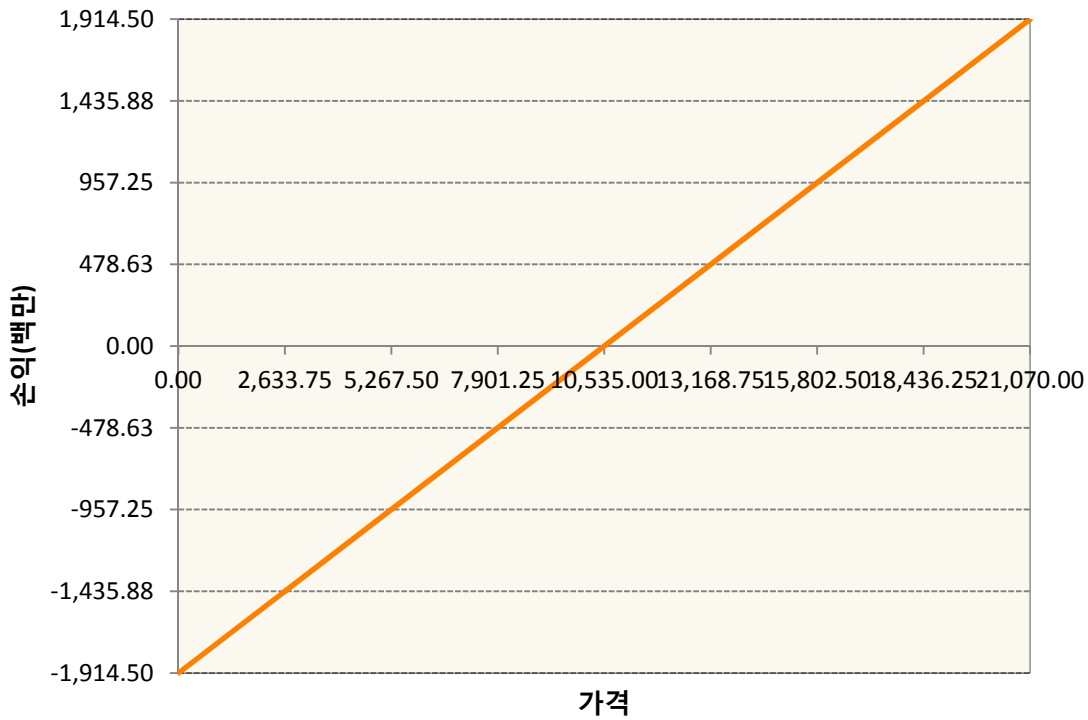
1. 계약금액

(단위:백만원)

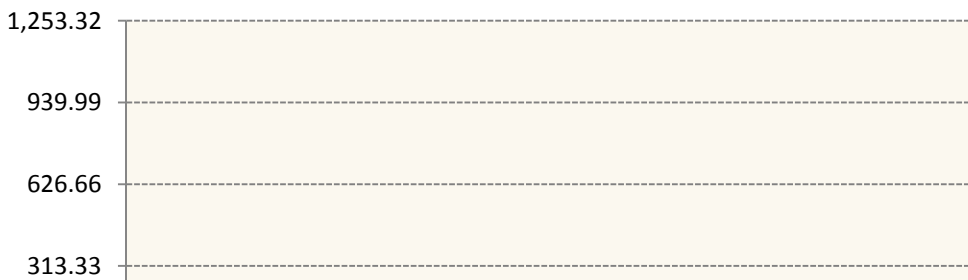
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,915	0	1,915	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,037	-5,037	장내
누계	통화	선도	151	3,163	-3,013	장외

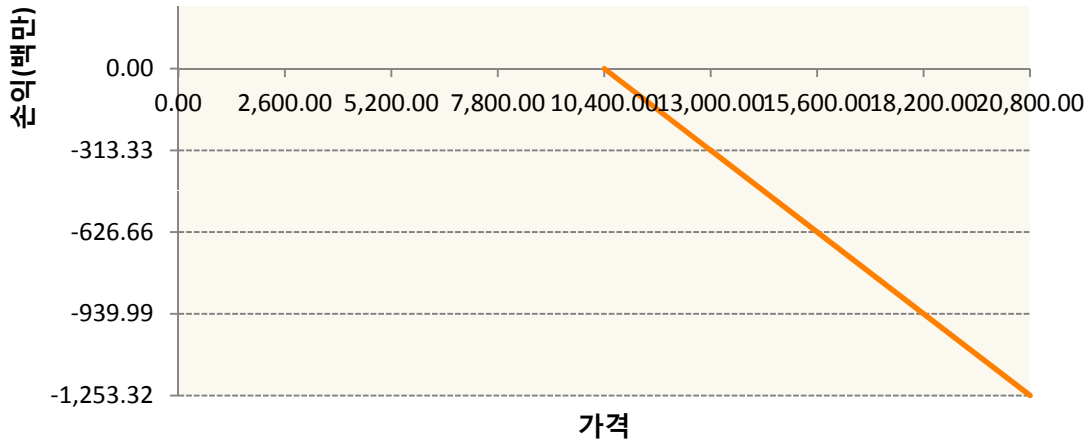
2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19

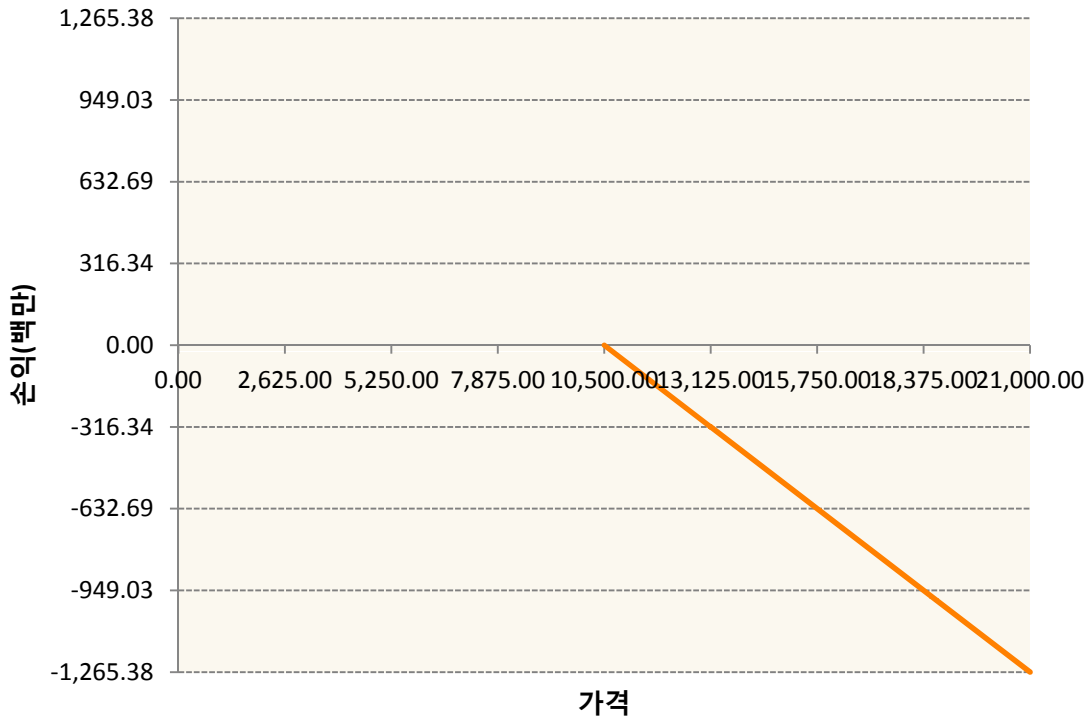


OHHIM9-C104-HSCEI

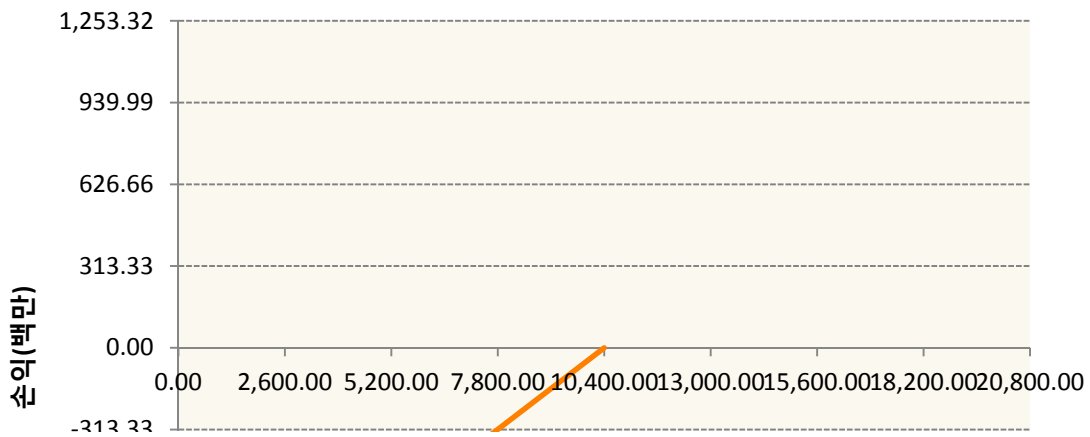


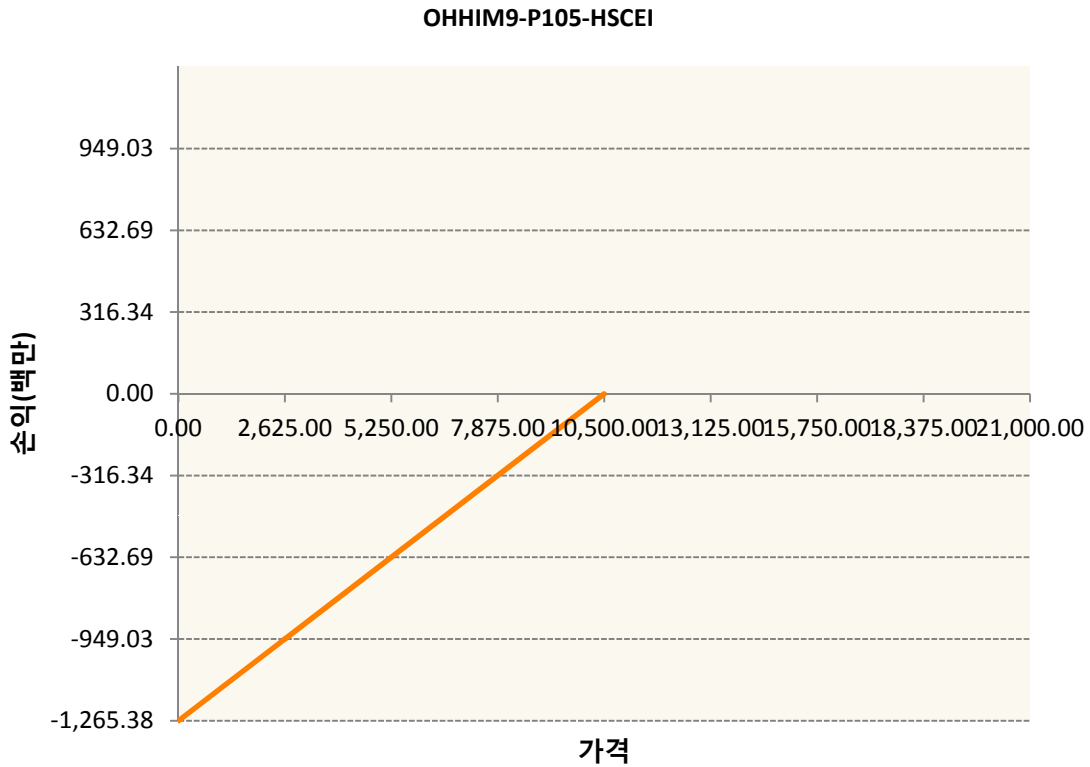


OHHIM9-C105-HSCEI



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	153
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	2019-06-12
기준일	2019-06-11

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

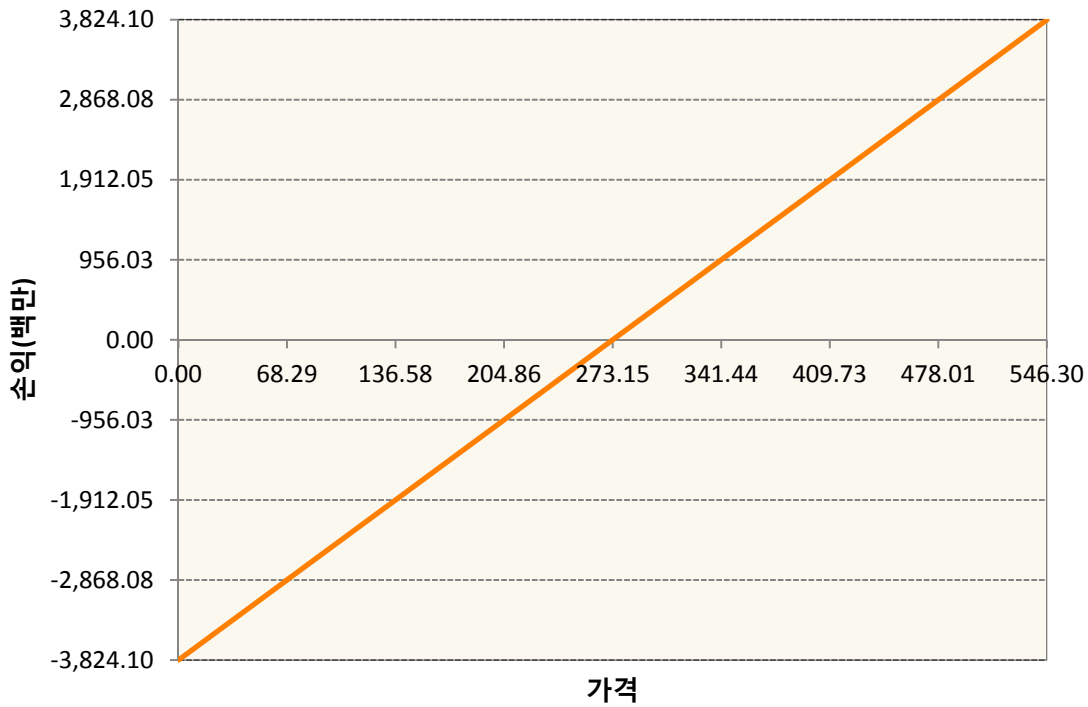
1. 계약금액

(단위:백만원)

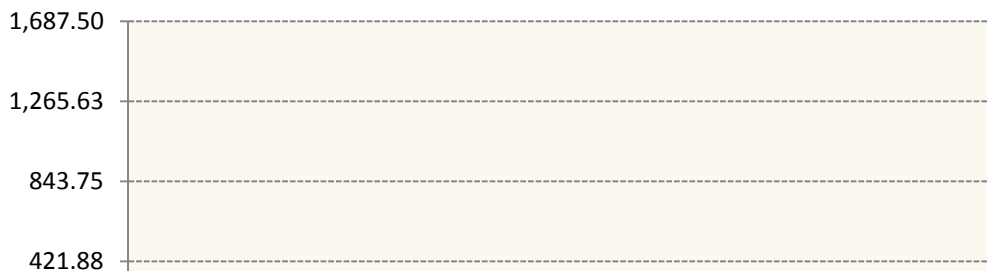
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,824	0	3,824	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	21,624	-21,624	장내

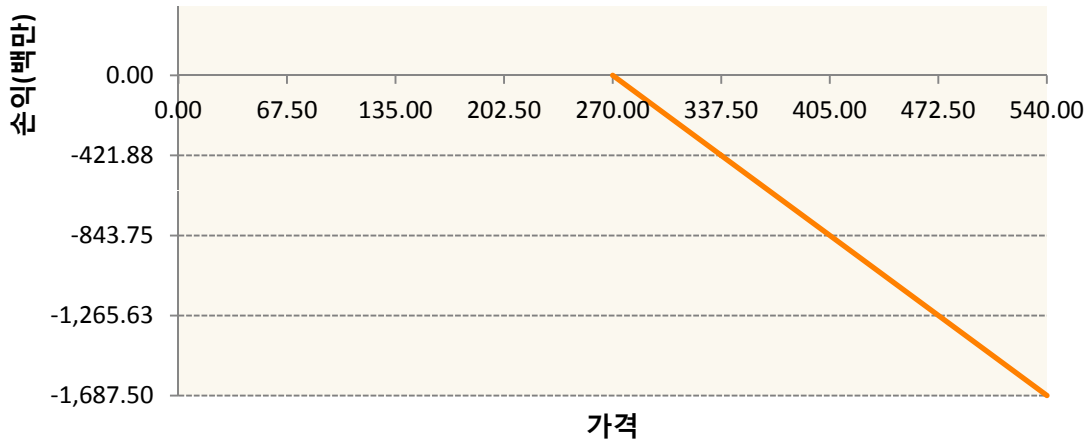
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

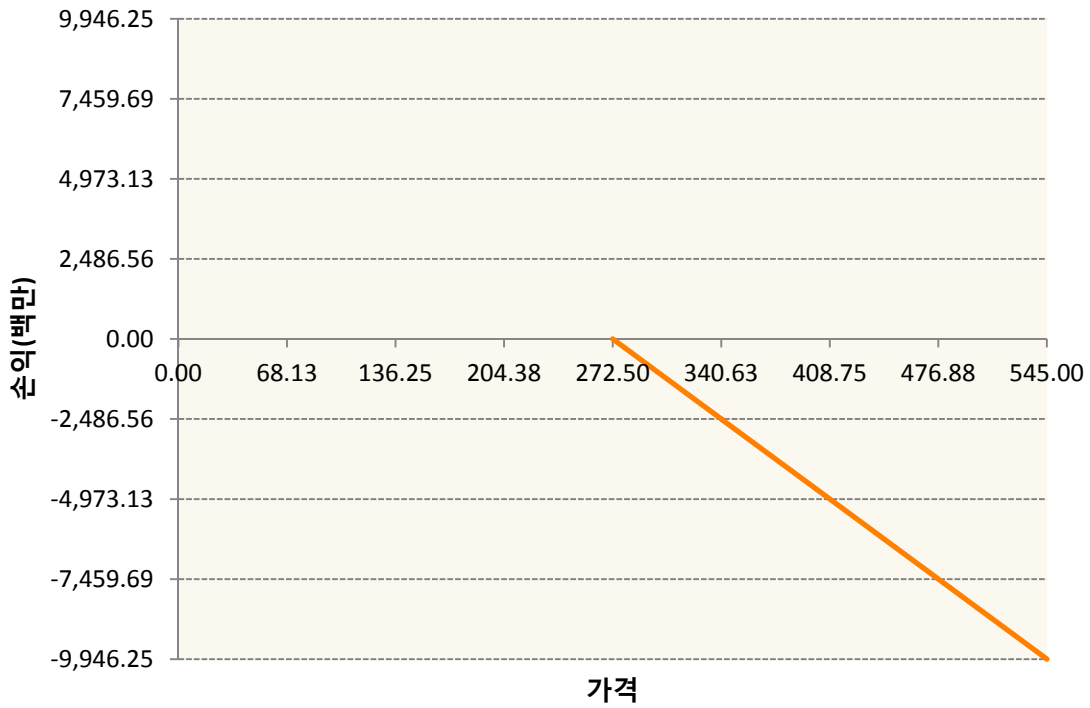


KR4201P62701-2019-06 콜270

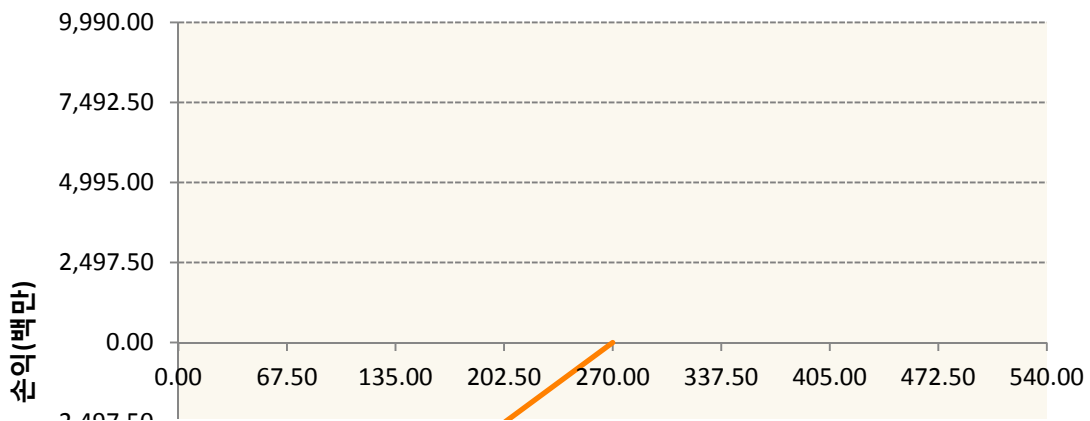




KR4201P62727-2019-06 콜272.5



KR4301P62709-2019-06 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,189
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,189	-1,189	-1,189	-1,189	-1,189	-1,189	-1,189	
-5.33%	-793	-793	-793	-793	-793	-793	-793	
-2.67%	-396	-396	-396	-396	-396	-396	-396	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	396	396	396	396	396	396	396	
5.33%	793	793	793	793	793	793	793	
8.00%	1,189	1,189	1,189	1,189	1,189	1,189	1,189	
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						306
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-306	-306	-306	-306	-306	-306	-306	
-5.33%	-204	-204	-204	-204	-204	-204	-204	
-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%	204	204	204	204	204	204	204	
8.00%	306	306	306	306	306	306	306	
KR4201P62701		2019-06 콜270						131
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	25	25	25	25	25	25	25
-5.33%	25	25	25	25	25	25	25
-2.67%	23	23	22	21	21	20	19
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-40	-40	-40	-41	-41	-41	-41
5.33%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
8.00%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131

KR4201P62727 2019-06 콜272.5 734

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	89	89	89	89	89	89	89
-5.33%	89	89	89	88	88	88	88
-2.67%	86	85	82	80	77	74	70
0%	19	12	6	0	-6	-12	-19
2.67%	-204	-205	-206	-208	-210	-213	-216
5.33%	-469	-469	-469	-469	-469	-469	-469
8.00%	-734	-734	-734	-734	-734	-734	-734

KR4301P62709 2019-06 풋270 683

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-683	-683	-683	-683	-683	-683	-683
-5.33%	-413	-413	-413	-413	-413	-413	-413
-2.67%	-144	-145	-146	-147	-149	-151	-152
0%	5	4	2	0	-2	-4	-7
2.67%	8	8	8	8	8	8	8
5.33%	8	8	8	8	8	8	8
8.00%	8	8	8	8	8	8	8

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

(단위:백만원)

4,070

공시일	2019-06-12
기준일	2019-06-11

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

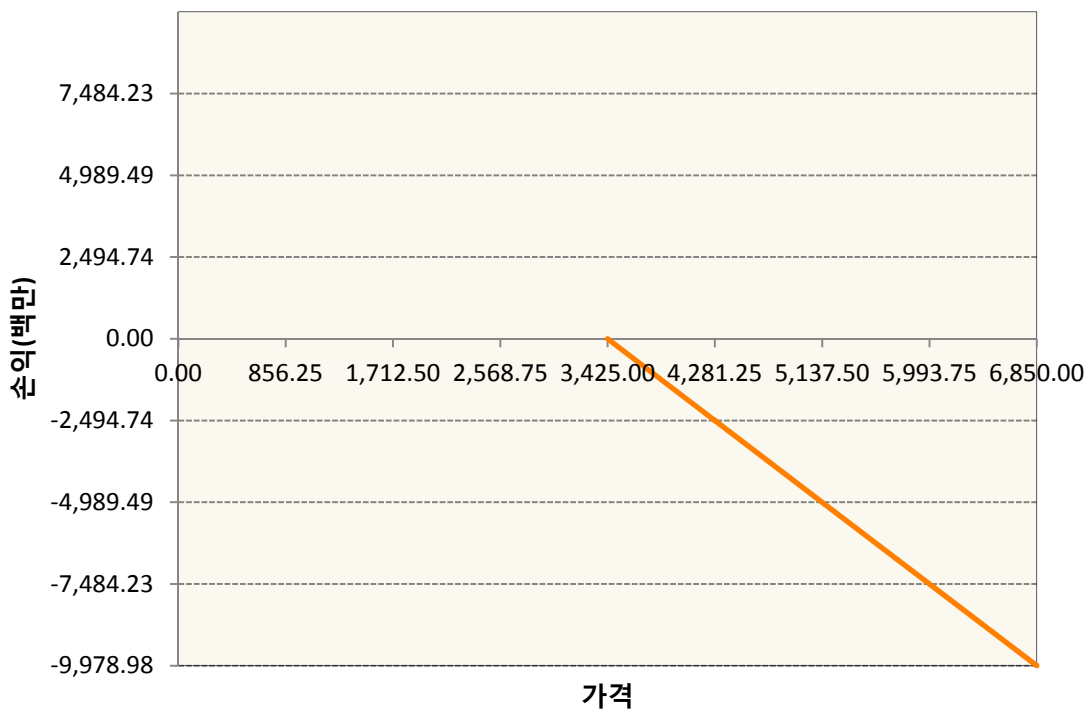
1. 계약금액

(단위:백만원)

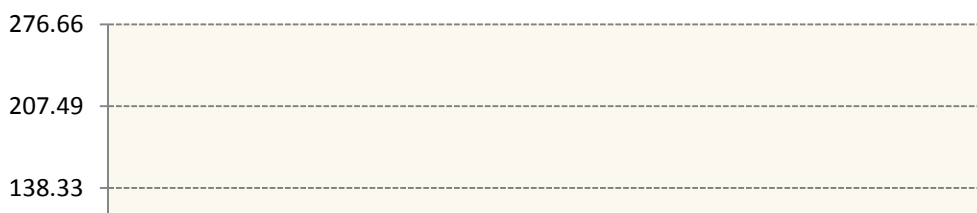
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,701	0	3,701	
누계	유가증권	스왑	56,573	0	56,573	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,511	-20,511	장내
누계	통화	선도	0	18,711	-18,711	장외

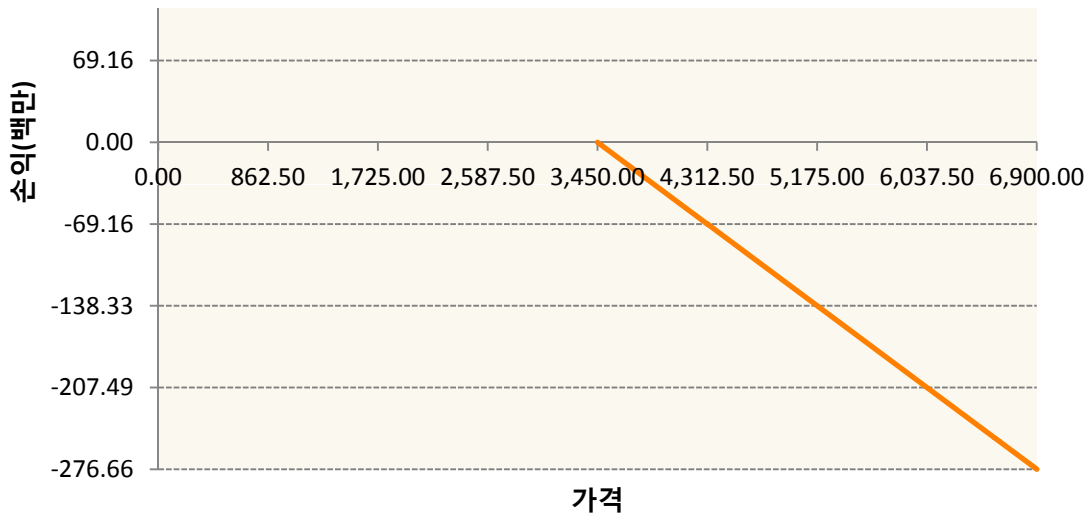
2. 만기시점의 손익구조

OESXM9-C3425-EURO STOXX 50

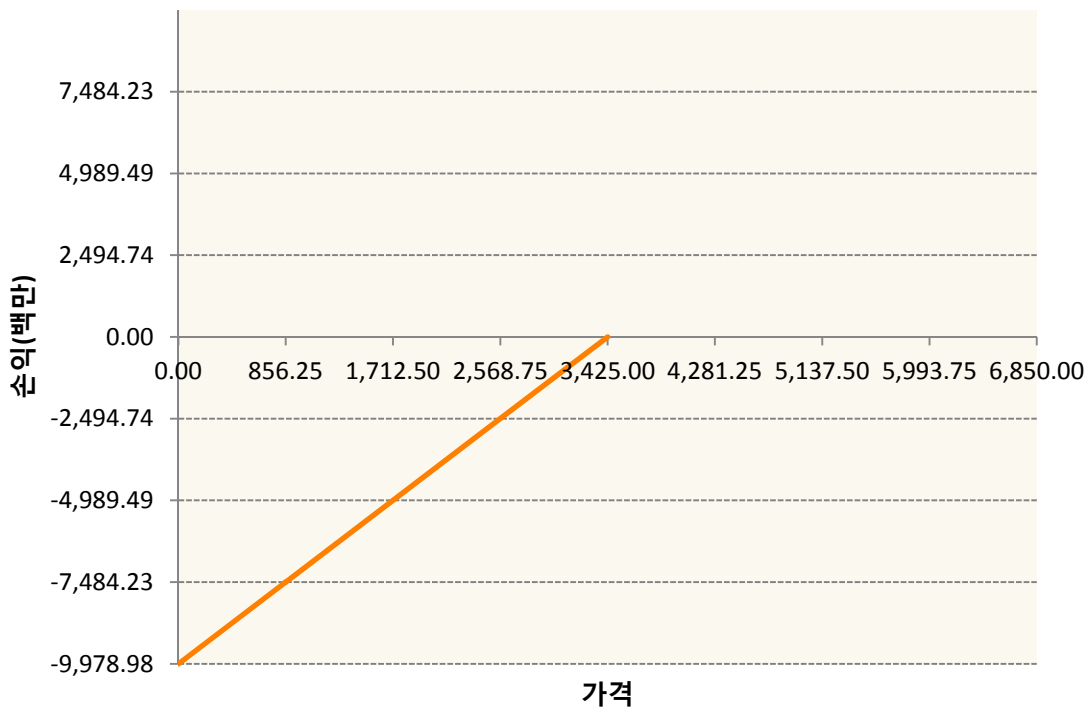


OESXM9-C3450-EURO STOXX 50

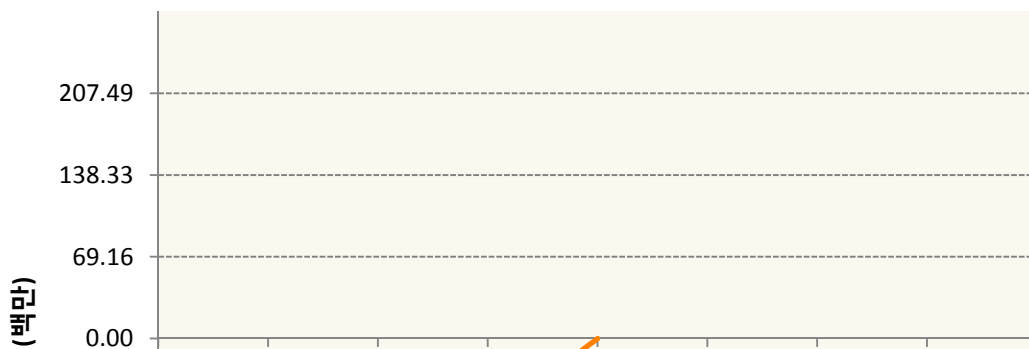


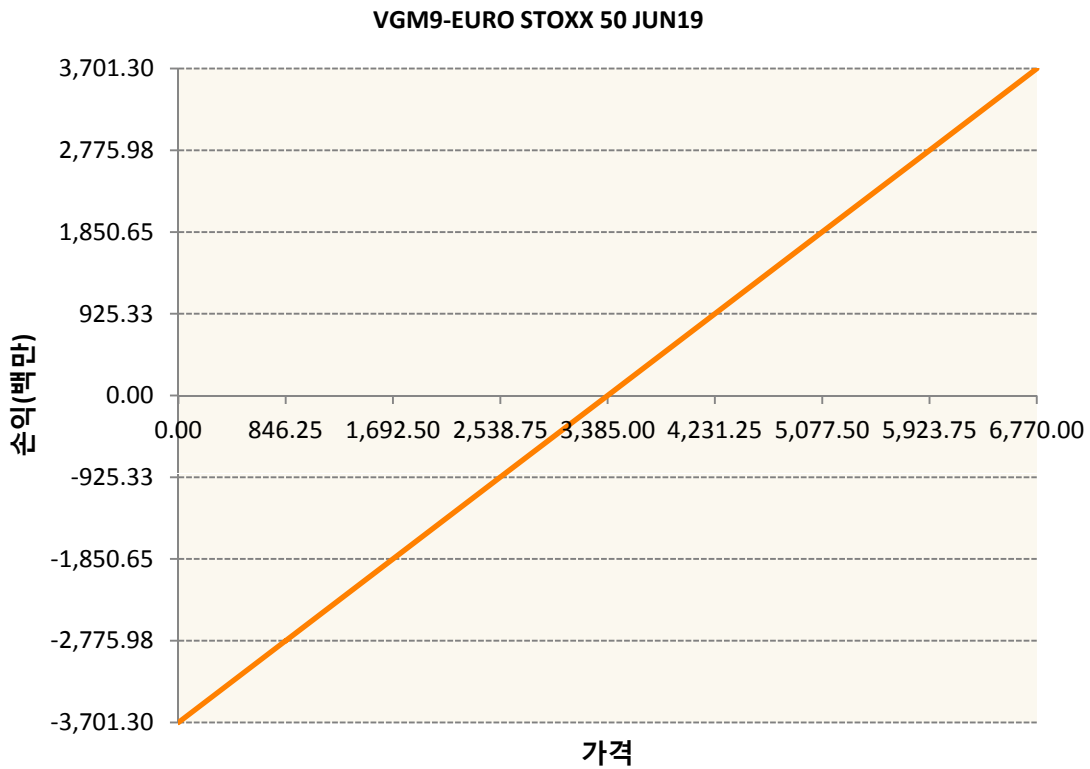
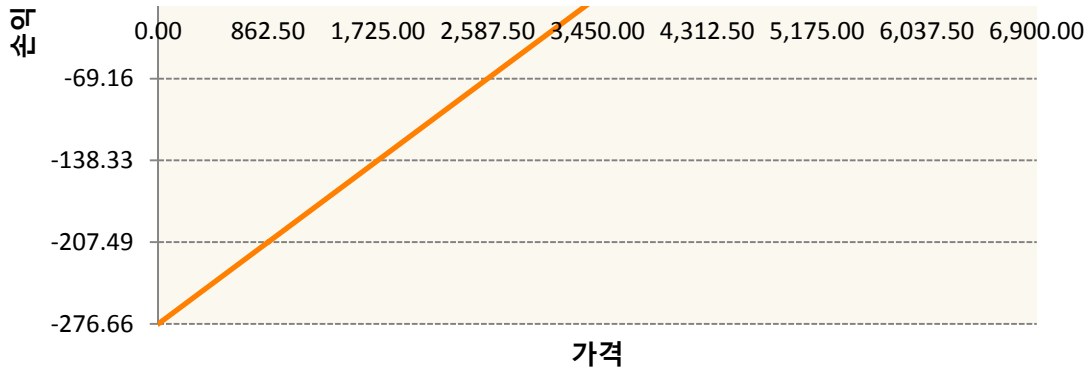


OESXM9-P3425-EURO STOXX 50



OESXM9-P3450-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	18
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	855
FX21019J01: KRW/EUR 28-06-19E	214
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	428
OESXM9-C3·EURO STOXX 50	798
OESXM9-C3·EURO STOXX 50	22
OESXM9-P3·EURO STOXX 50	798
OESXM9-P3·EURO STOXX 50	22
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	296

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

(단위:백만원)

2,138

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

(단위:백만원)

1,043

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

(단위:백만원)

92

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

(단위:백만원)

134

공시일	2019-06-12
기준일	2019-06-11

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

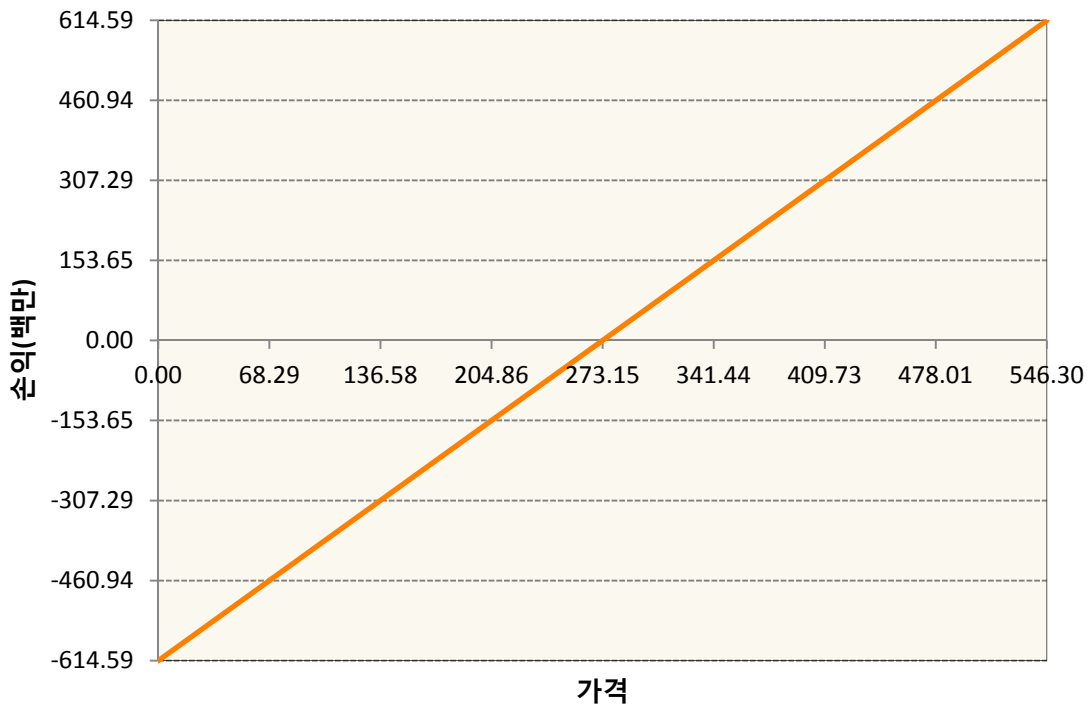
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	615	0	615	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P60004 2019-06 코스피200지수선물 49

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-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%	33	33	33	33	33	33	33
8.00%	49	49	49	49	49	49	49

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

(단위:백만원)

42

공시일	2019-06-12
기준일	2019-06-11

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

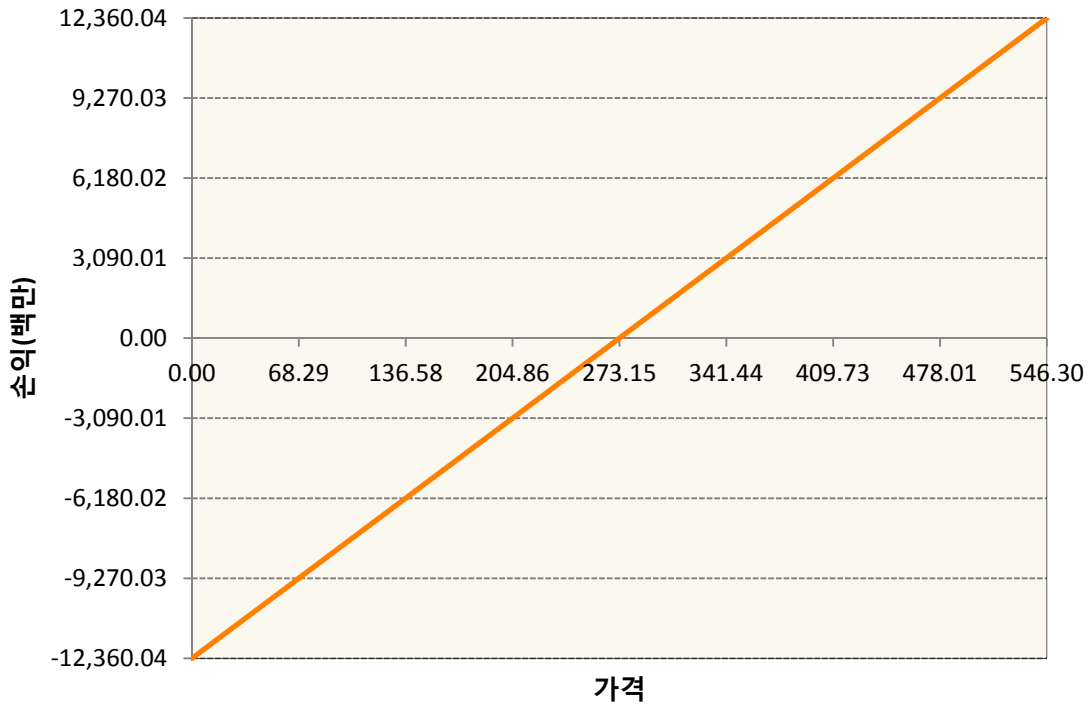
1. 계약금액

(단위:백만원)

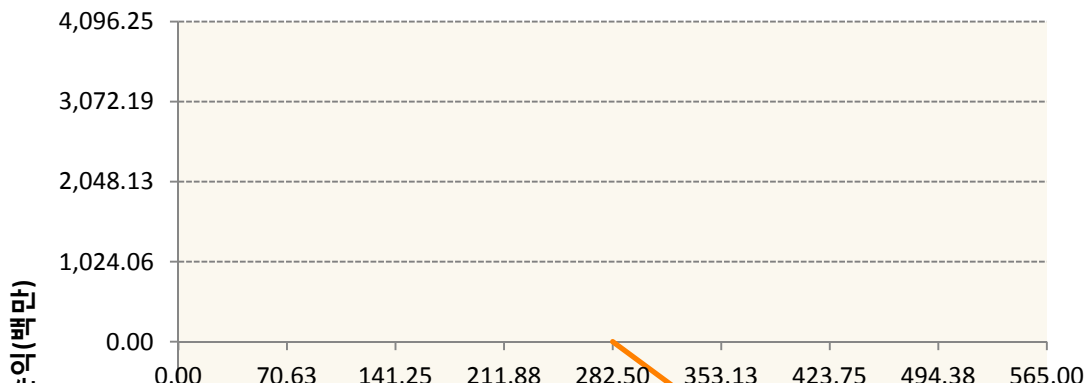
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,360	0	12,360	장내
누계	유가증권	옵션	4,946	22,906	-17,961	장내

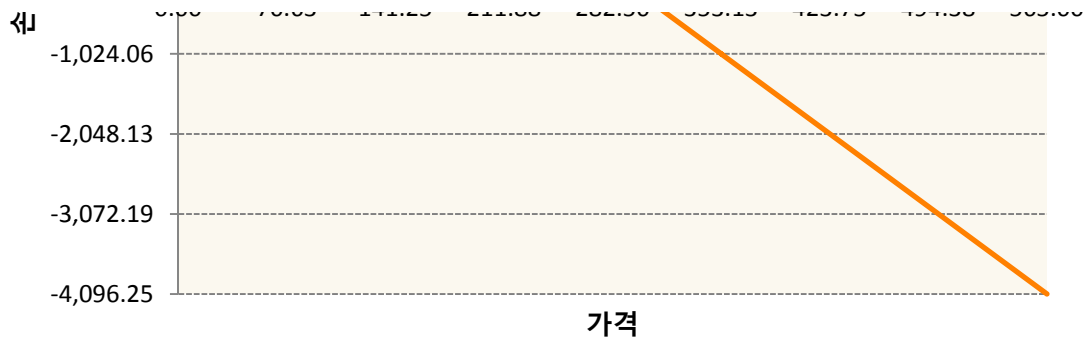
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

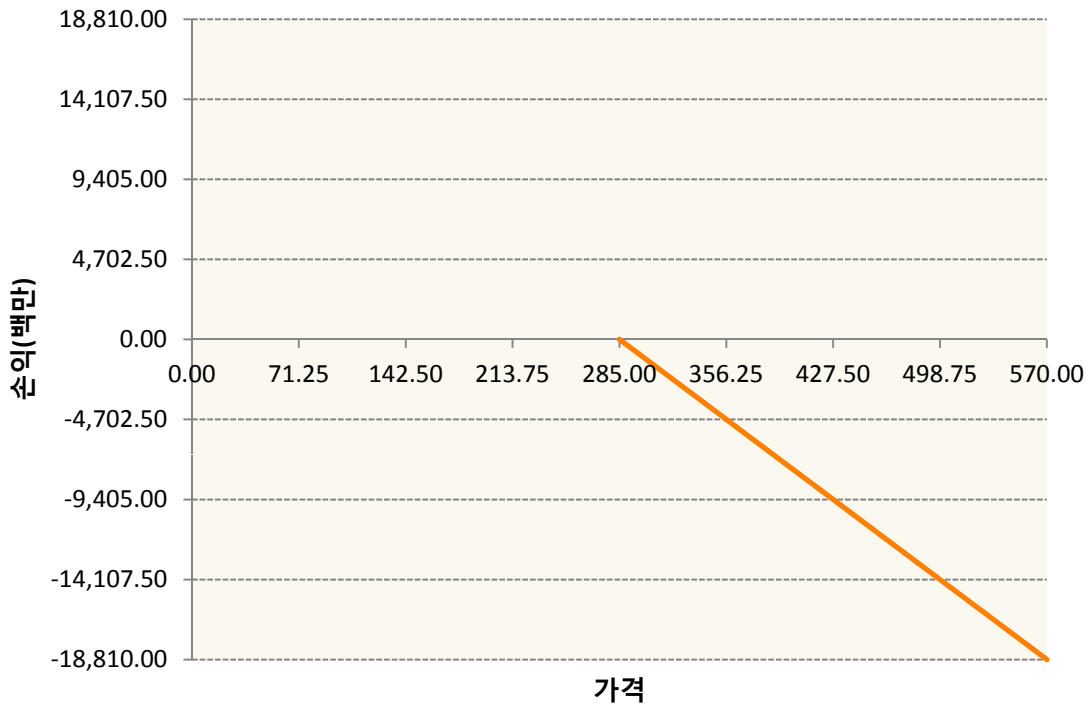


KR4201P62826-2019-06 콜282.5

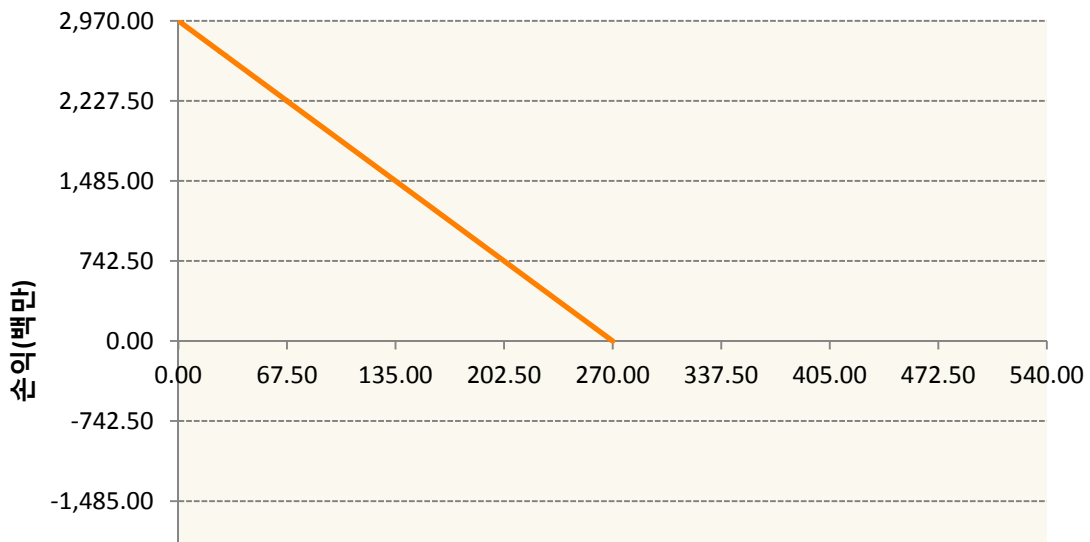


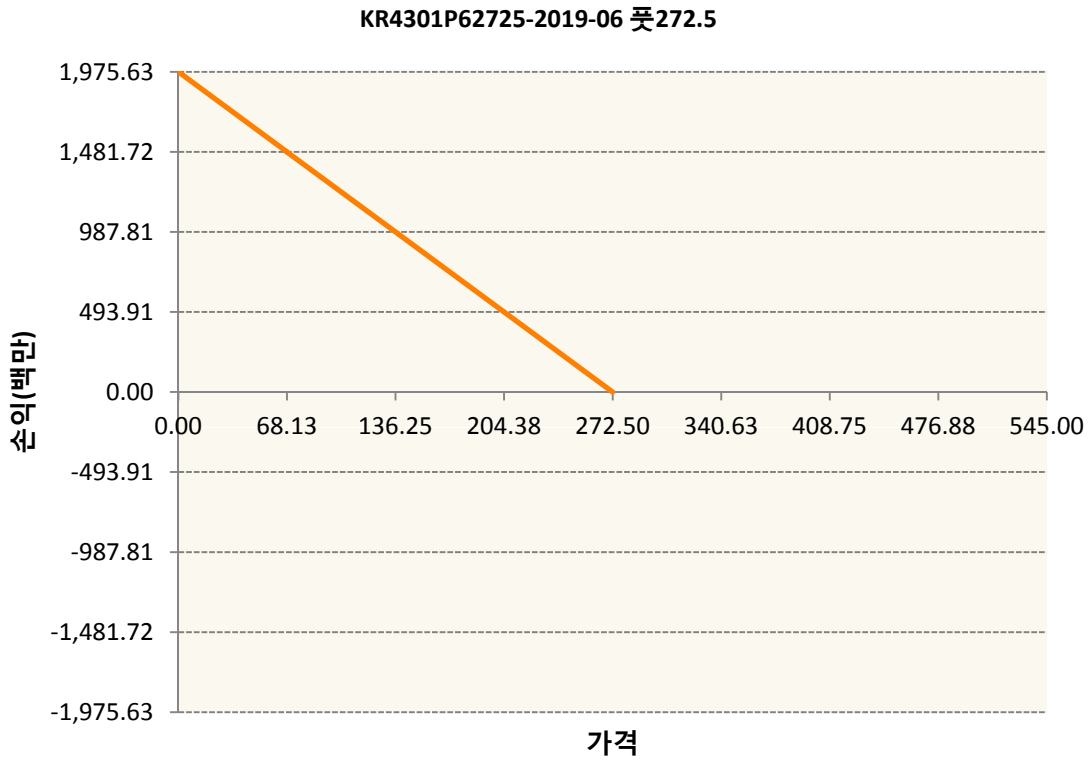
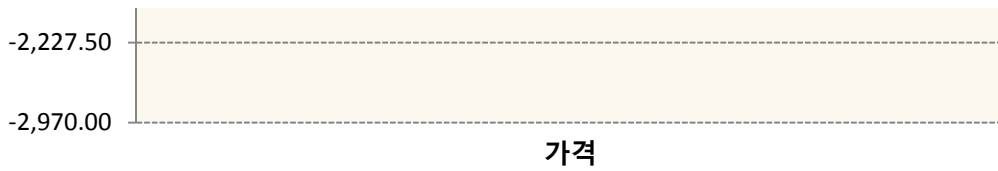


KR4201P62859-2019-06 콜285



KR4301P62709-2019-06 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						989
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-989	-989	-989	-989	-989	-989	-989	
-5.33%	-659	-659	-659	-659	-659	-659	-659	
-2.67%	-330	-330	-330	-330	-330	-330	-330	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	330	330	330	330	330	330	330	
5.33%	659	659	659	659	659	659	659	
8.00%	989	989	989	989	989	989	989	
KR4201P62826		2019-06 콜282.5						182
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1	
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1	
-2.67%	1	1	1	1	1	1	1	

0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	-10	-12	-15	-17	-20	-22	-24
5.33%	-78	-79	-80	-82	-84	-85	-87
8.00%	-181	-181	-181	-181	-181	-182	-182
KR4201P62859 2019-06 콜285							676
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	1	1
0%	1	1	1	0	-1	-3	-5
2.67%	-16	-22	-30	-38	-46	-55	-64
5.33%	-221	-230	-240	-251	-261	-272	-283
8.00%	-662	-663	-665	-667	-669	-672	-676
KR4301P62709 2019-06 풋270							203
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	203	203	203	203	203	203	203
-5.33%	123	123	123	123	123	123	123
-2.67%	43	43	43	44	44	45	45
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
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
KR4301P62725 2019-06 풋272.5							147
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	147	147	147	147	147	147	147
-5.33%	94	94	94	94	94	94	94
-2.67%	41	41	41	42	42	42	42
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6

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

(단위:백만원)

1,337

공시일	2019-06-12
기준일	2019-06-11

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	18,309	0	18,309	

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	2019-06-12
기준일	2019-06-11

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	57,367	0	57,367	

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	2019-06-12
기준일	2019-06-11

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	5,902	0	5,902	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	347,282	0	347,282	
누계	통화	선도	0	367,813	-367,813	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		378
FX21019J024 KRW/USD 24-06-19E		944
FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E		378
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		76
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		993
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E		1,020
FX21019K00 KRW/USD 18-06-19E		567
FX21019K01 KRW/USD 14-06-19E		661
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		567
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		472
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		567
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,416
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,322
FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E		472
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E		793
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E		631
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		472
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		378
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		793
FX21019K02 KRW/USD 24-06-19E		378
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E		944
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E		1,511
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E		283
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E		1,228
FX21019K04 KRW/USD 28-06-19E		1,284
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		661

FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	567
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	755
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	755
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	472
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	283
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	944
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	189
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	878
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	1,048
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	1,889
FX21019M00 KRW/USD 15-07-19E	472
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	378
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	661
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	944

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

(단위:백만원)

9,801

공시일	2019-06-12
기준일	2019-06-11

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

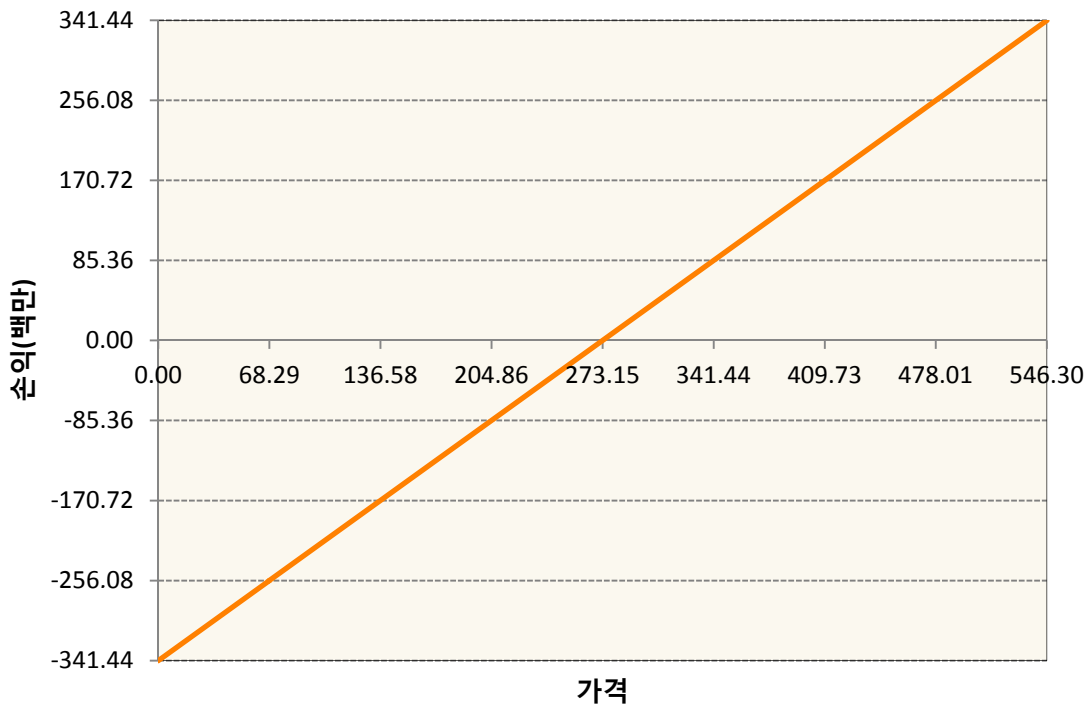
1. 계약금액

(단위:백만원)

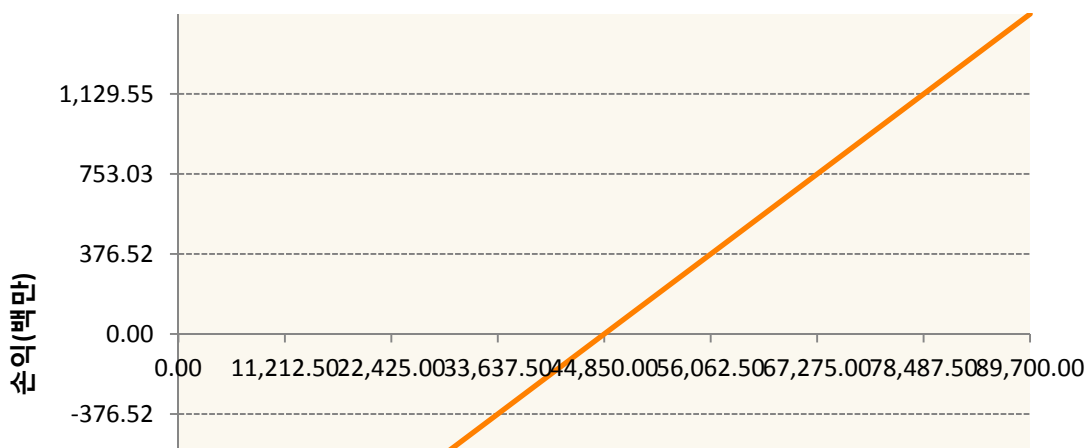
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,848	0	1,848	장내

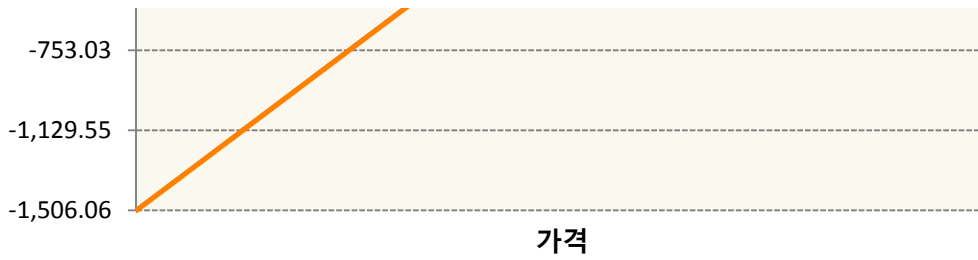
2. 만기시점의 손익구조

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	2019-06-12
기준일	2019-06-11

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

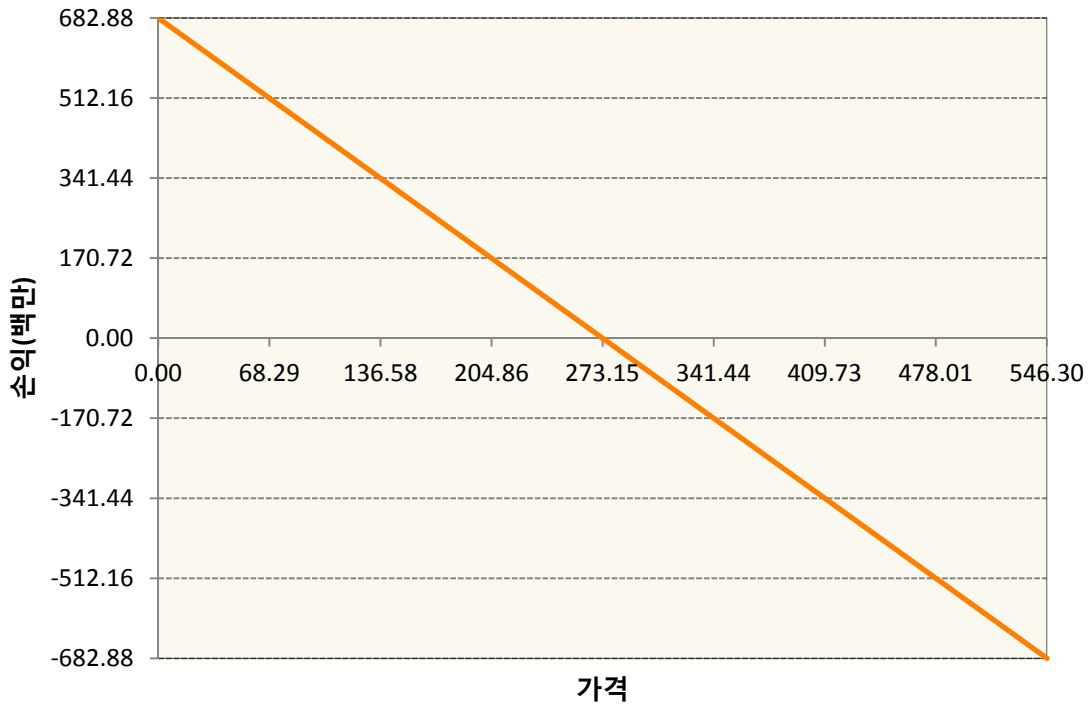
1. 계약금액

(단위:백만원)

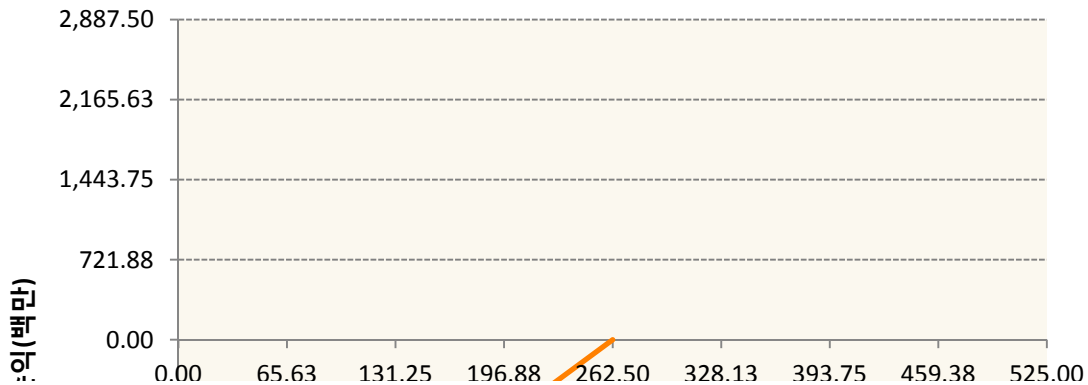
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	683	-683	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,351	-3,351	장내

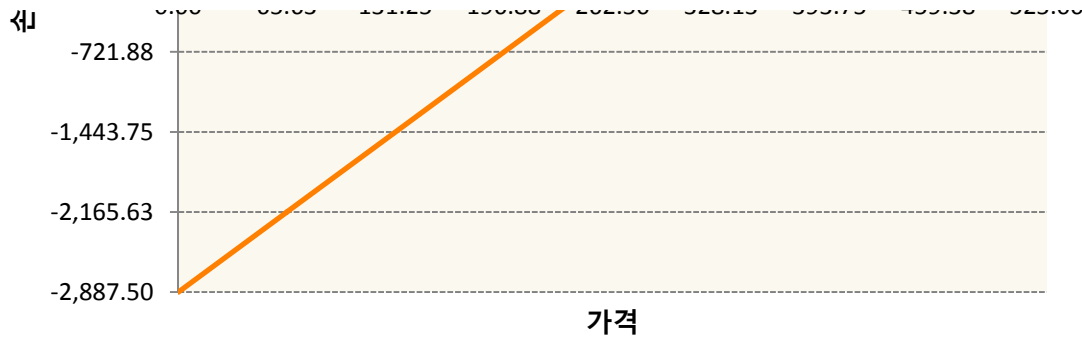
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

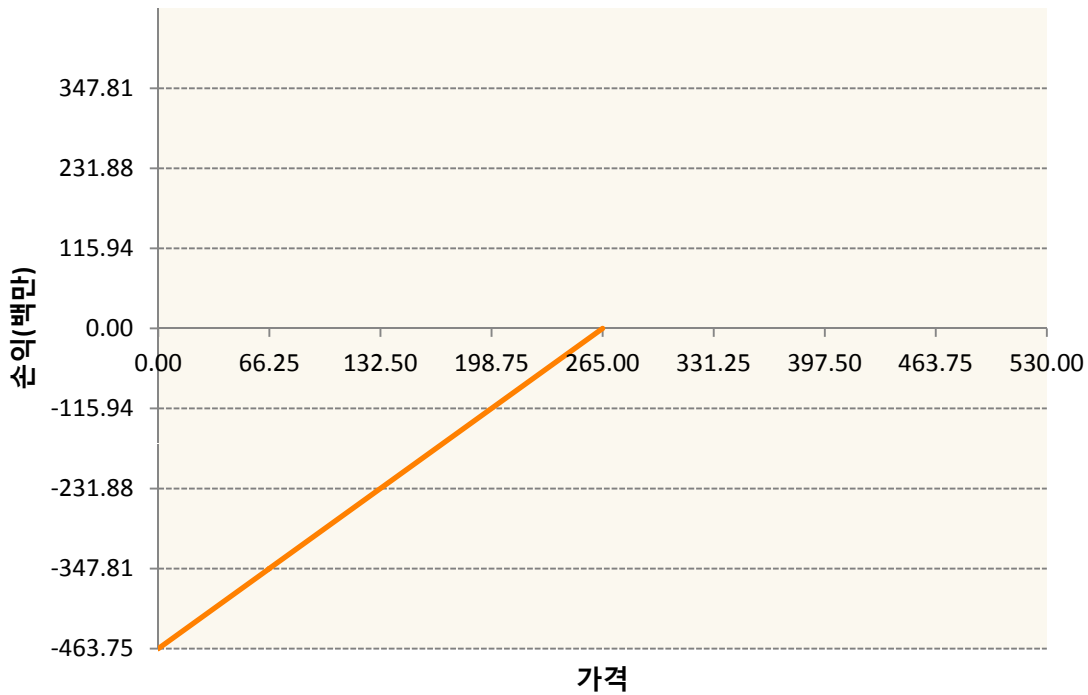


KR4301P62626-2019-06 풋262.5





KR4301P62659-2019-06 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						55
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	55	55	55	55	55	55	55	
-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%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55	
KR4301P62626		2019-06 풋262.5						123
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123
-5.33%	-43	-43	-43	-44	-44	-45	-45
-2.67%	-1	-1	-1	-2	-2	-3	-4
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

24

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
-5.33%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-2	-2
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)

72

공시일	2019-06-12
기준일	2019-06-11

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

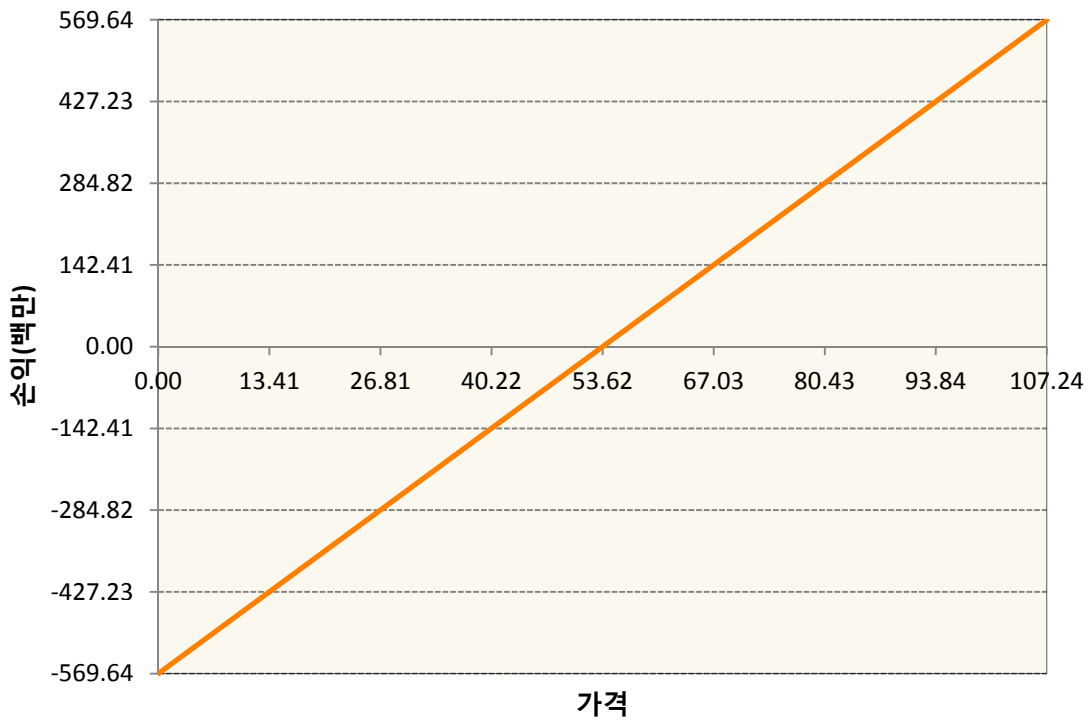
1. 계약금액

(단위:백만원)

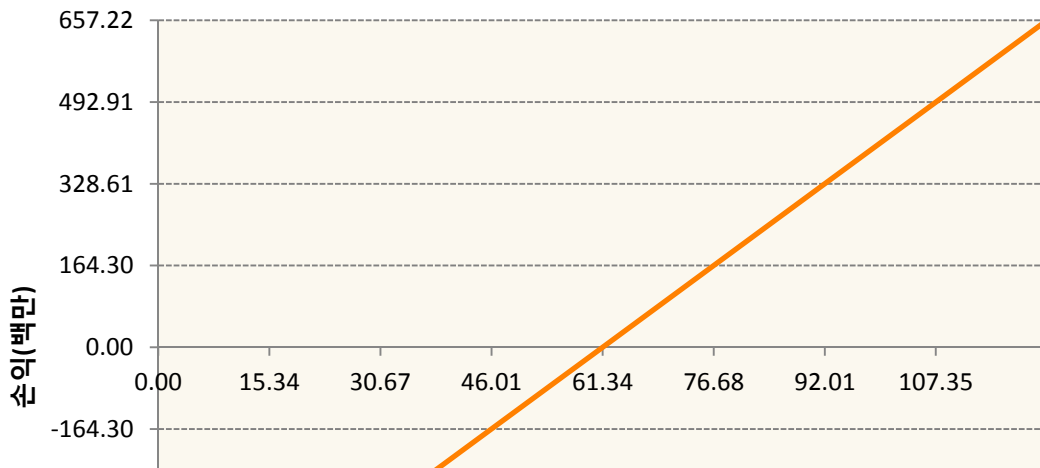
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,503	118	2,385	

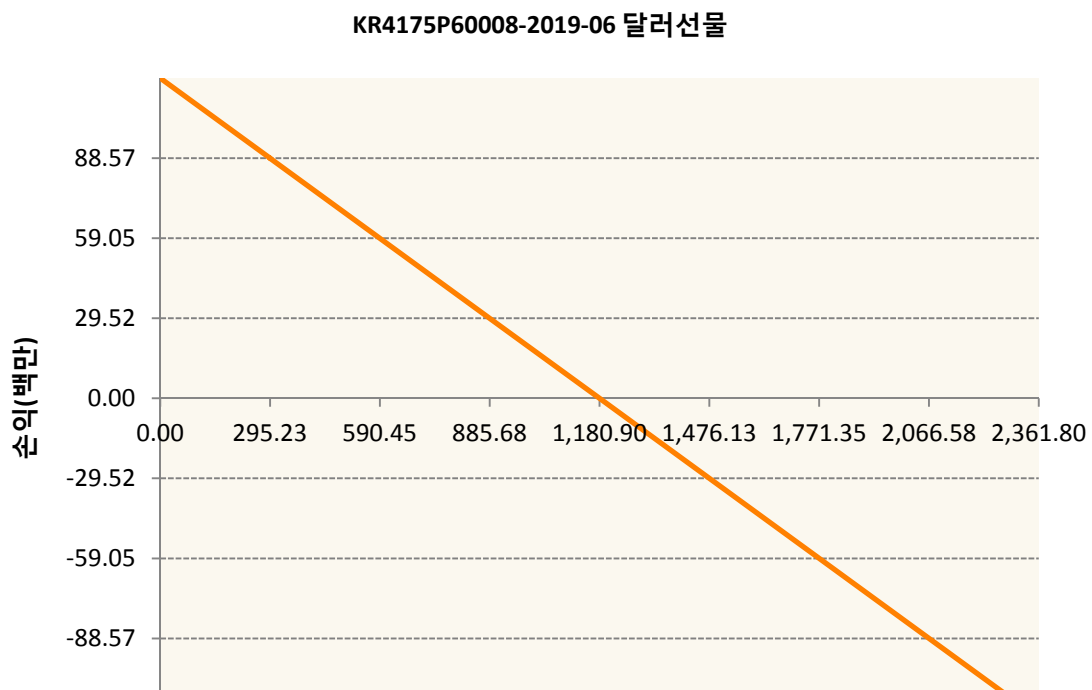
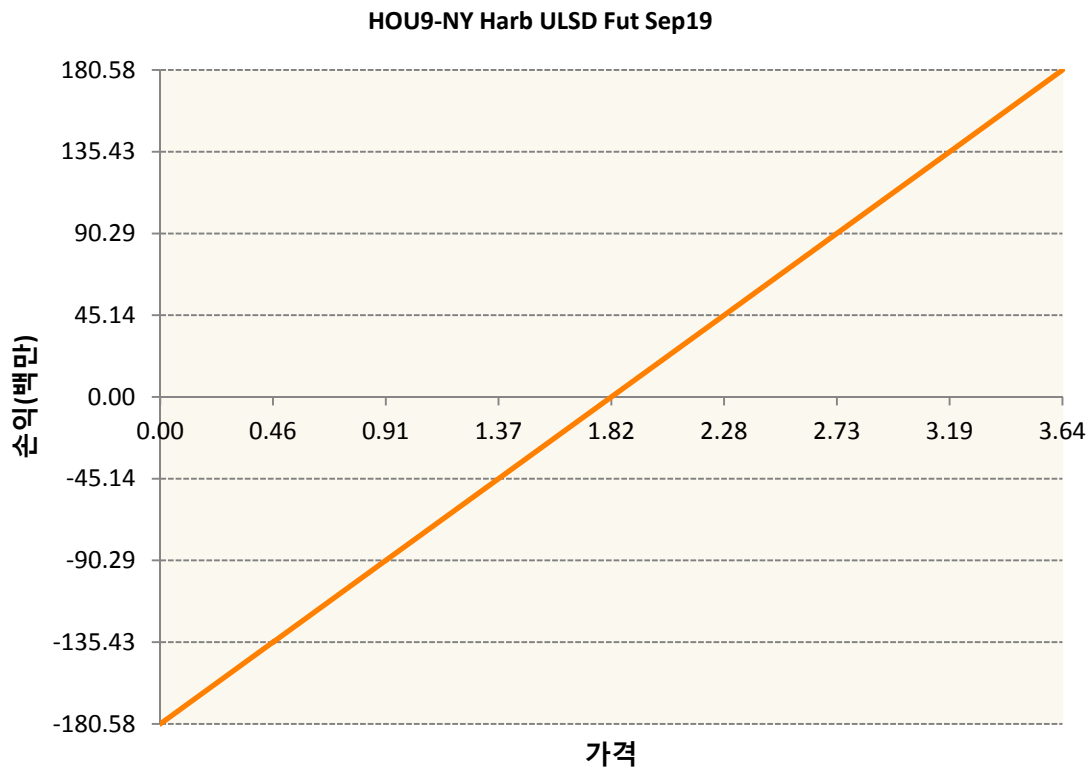
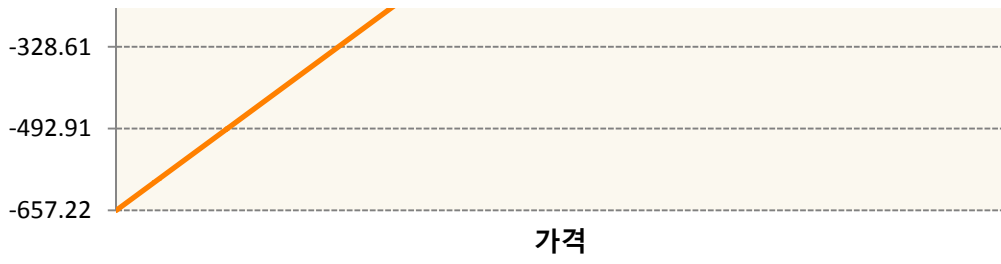
2. 만기시점의 손익구조

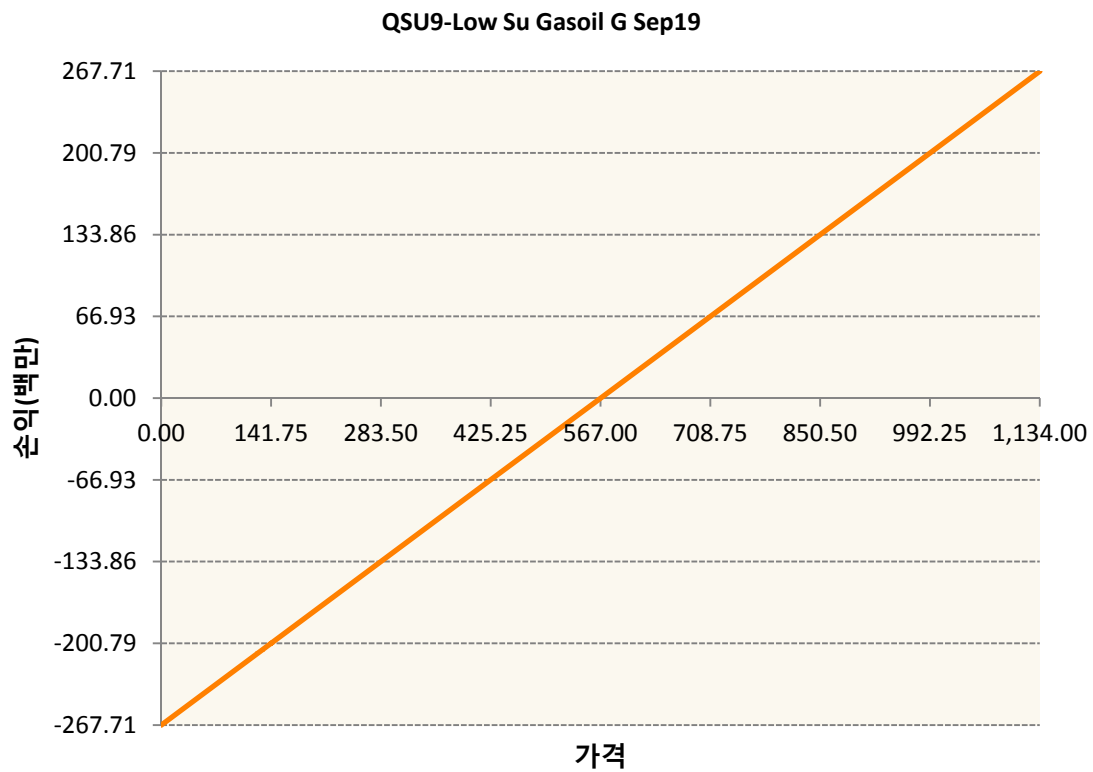
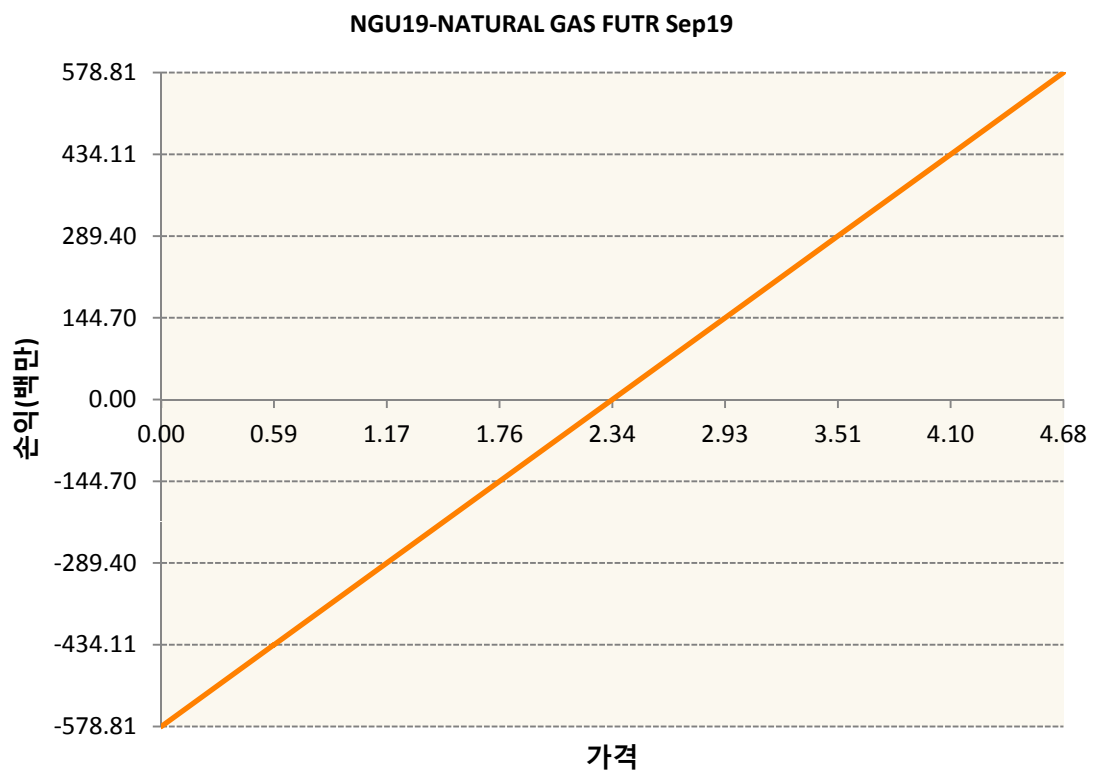
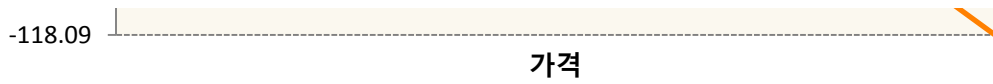
CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19



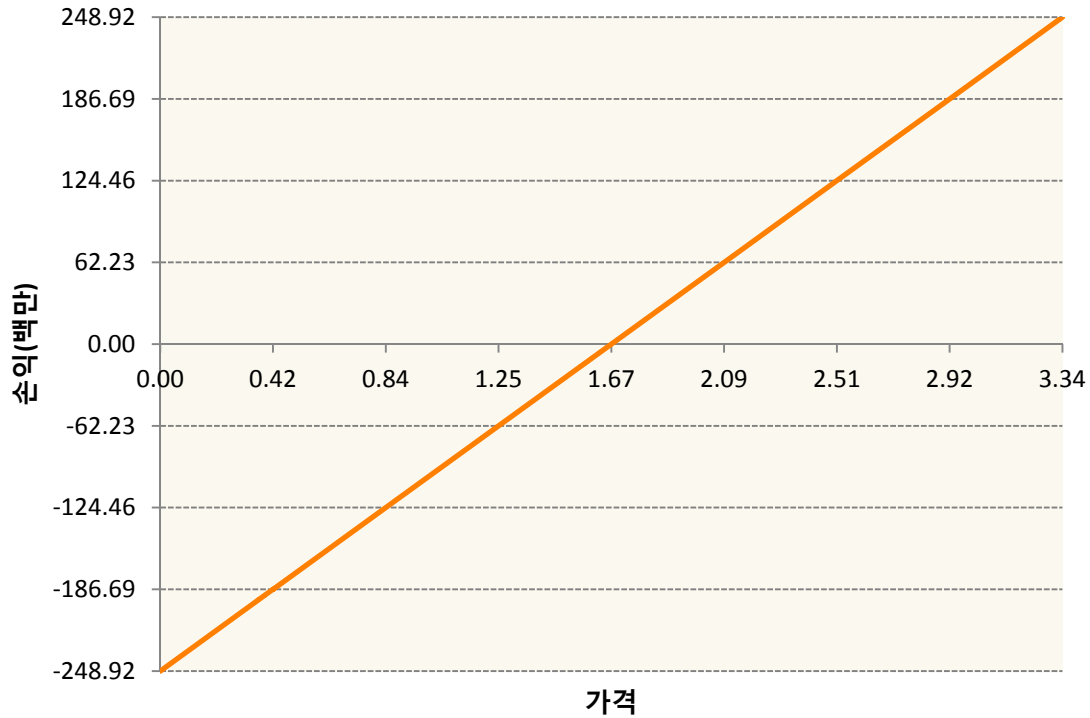
COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19







XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	46
COU9	BRENT CRUDE FUTR Sep19	53
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	14
KR4175P600	2019-06 달러선물	9
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	46
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	21
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	20

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

(단위:백만원)

371

공시일	2019-06-12
기준일	2019-06-11

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

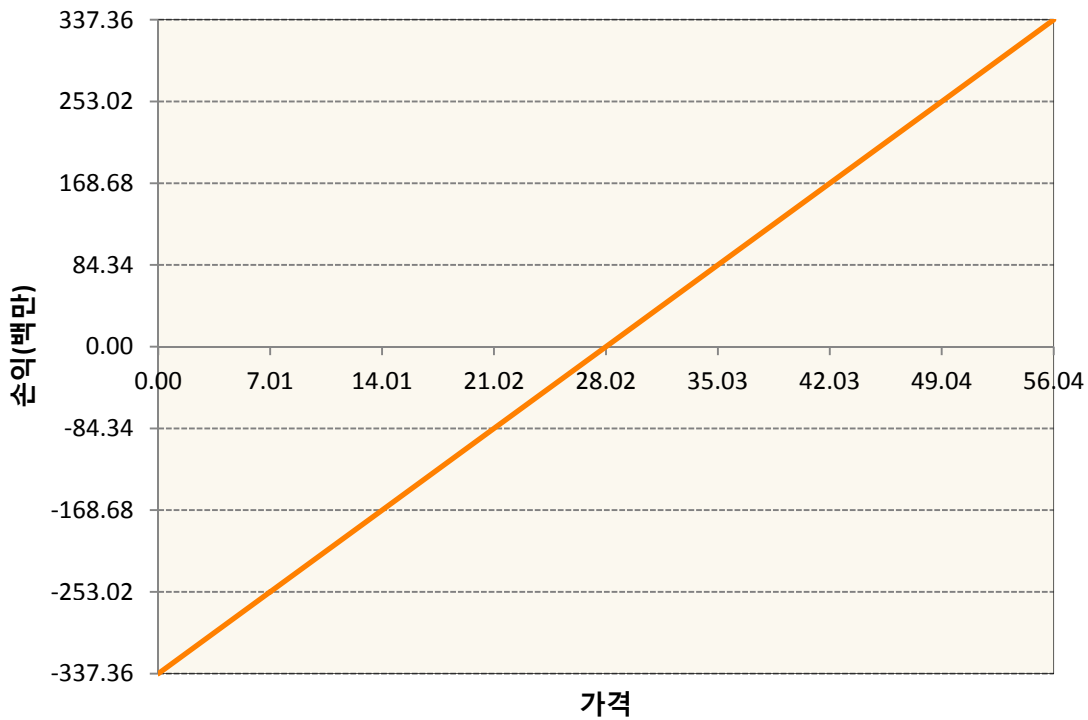
1. 계약금액

(단위:백만원)

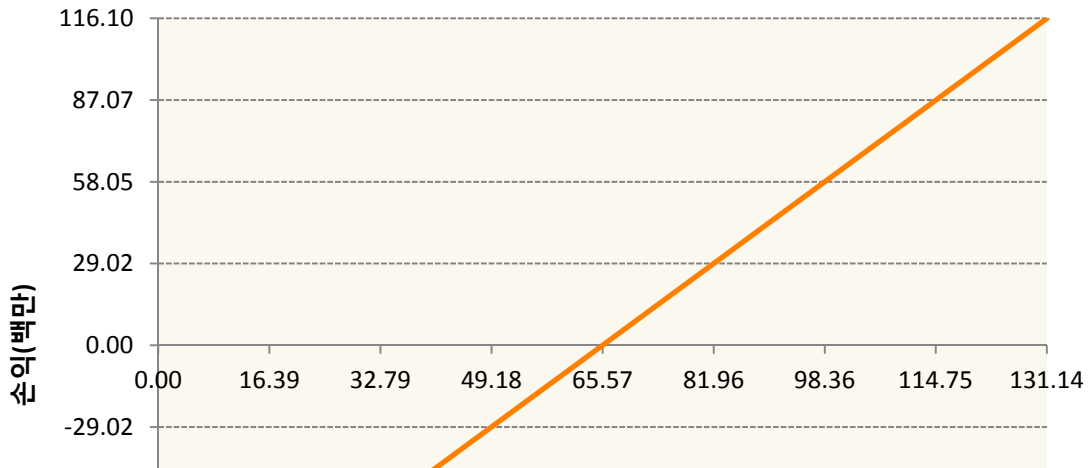
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,208	201	3,007	

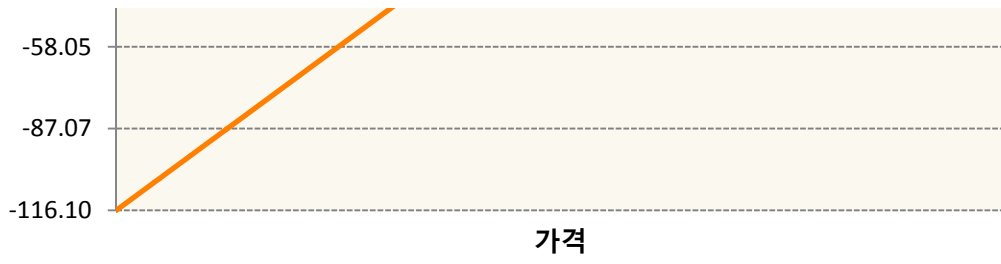
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

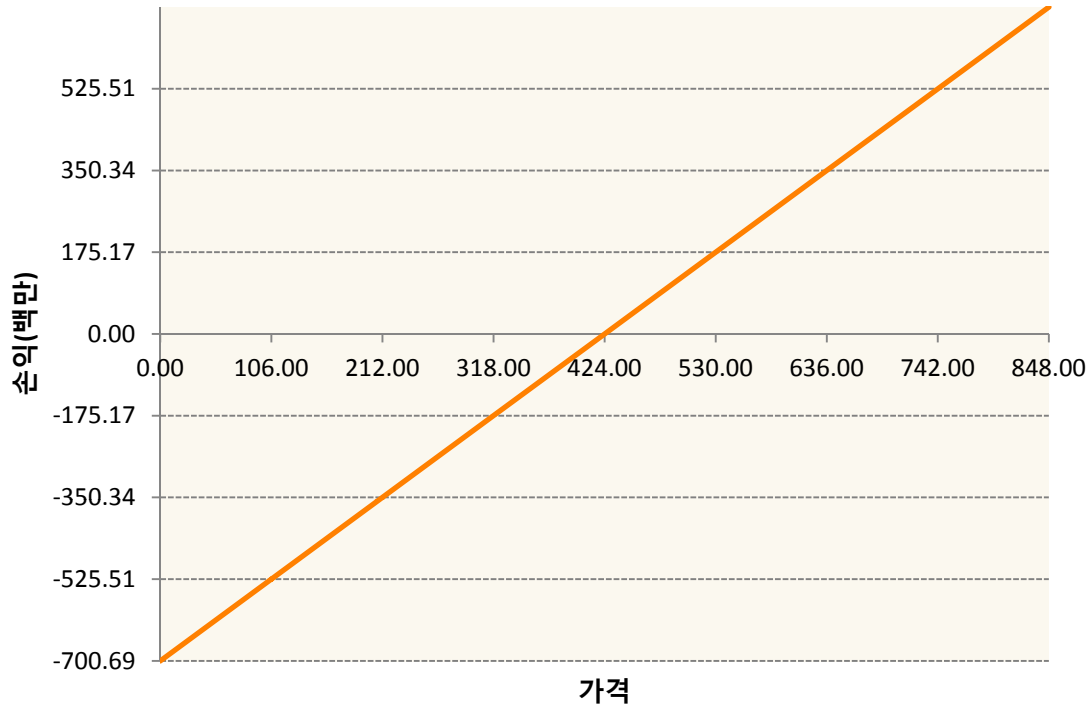


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

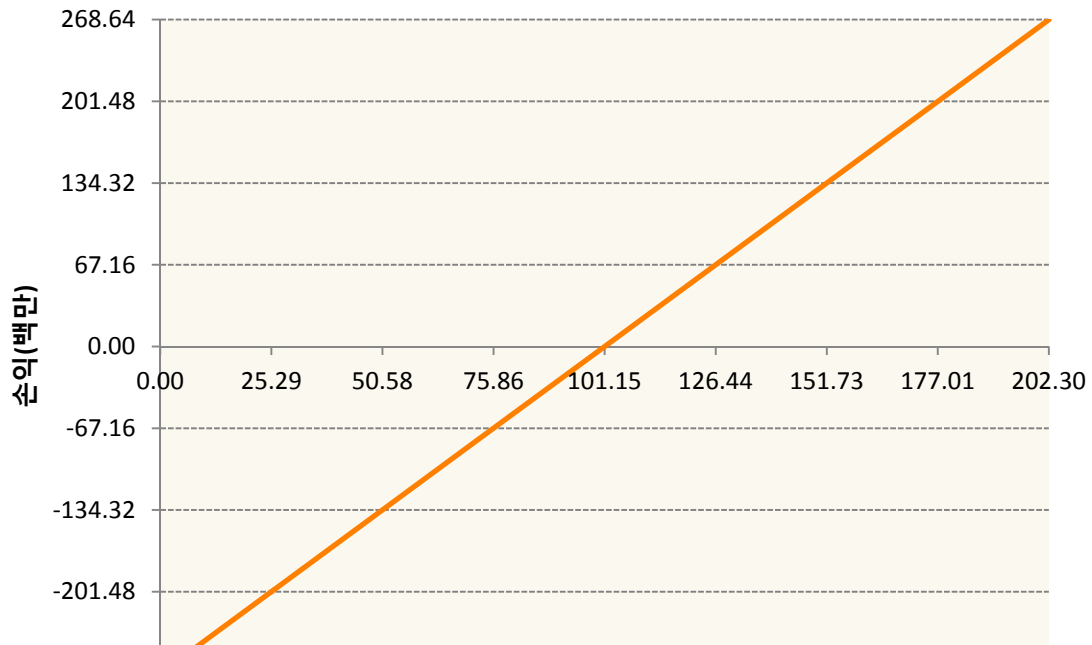


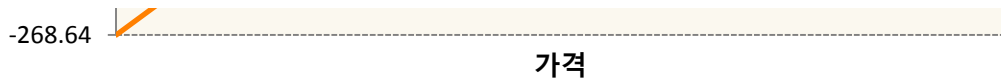


CU9-CORN FUTURE Sep19

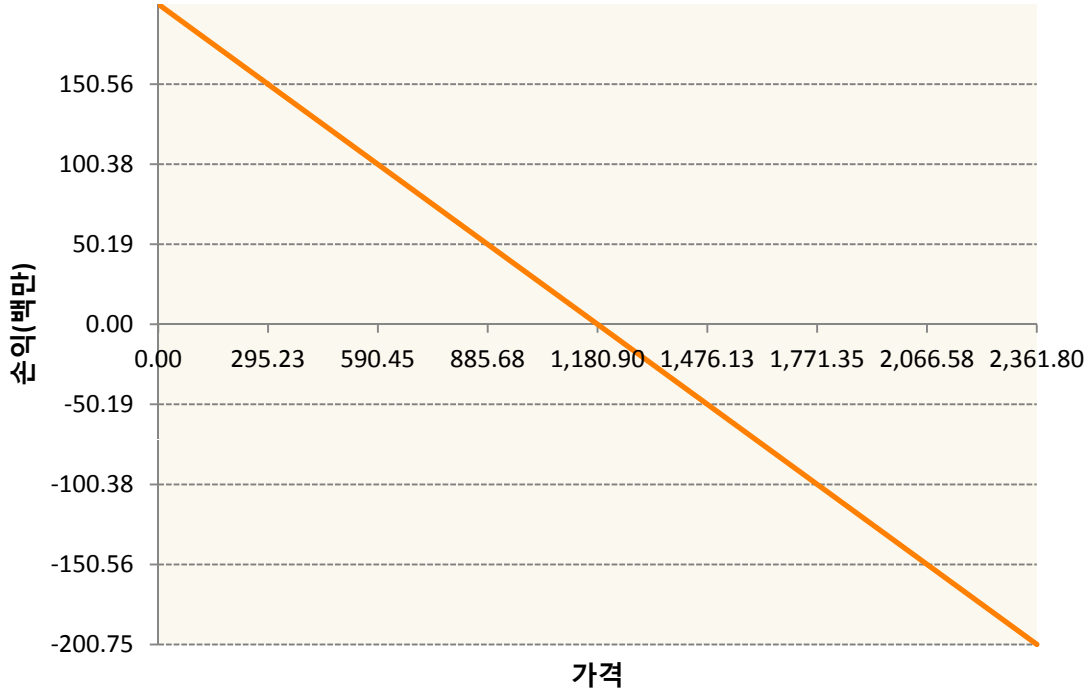


KCU9-COFFEE 'C' FUTURE Sep19

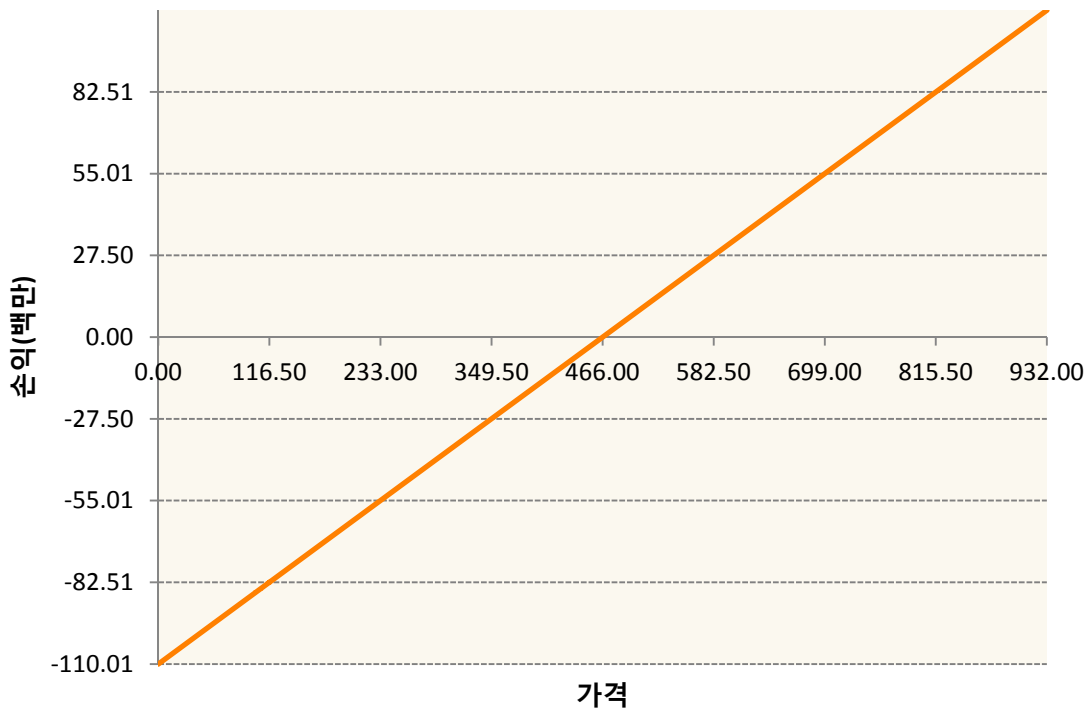




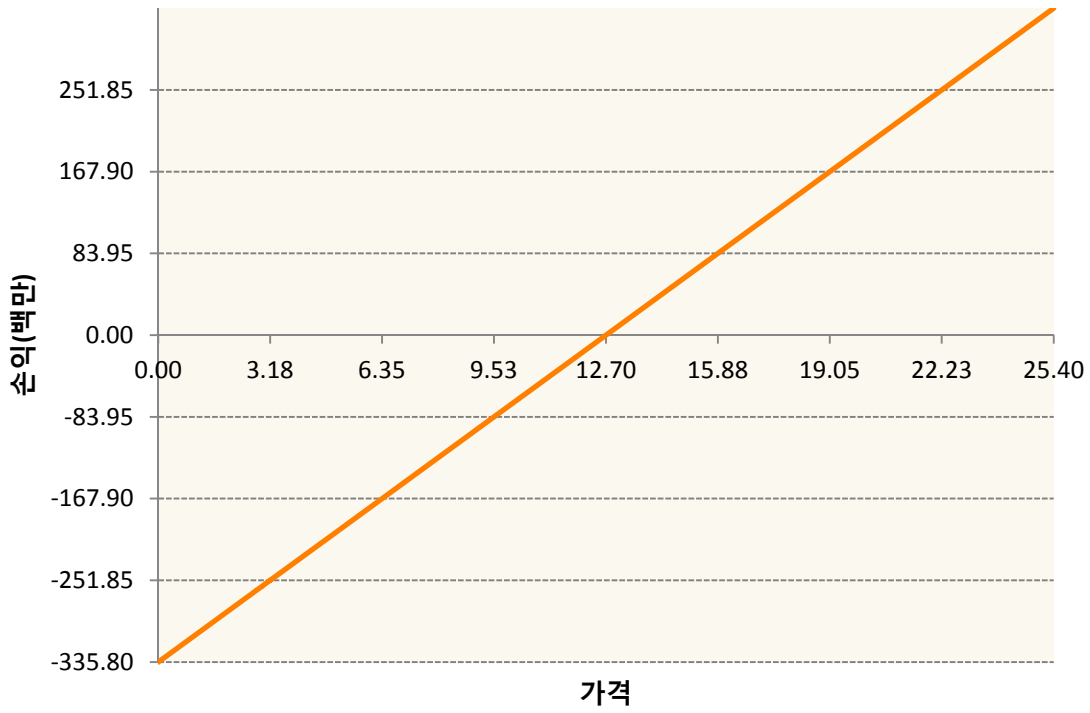
KR4175P60008-2019-06 달러선물



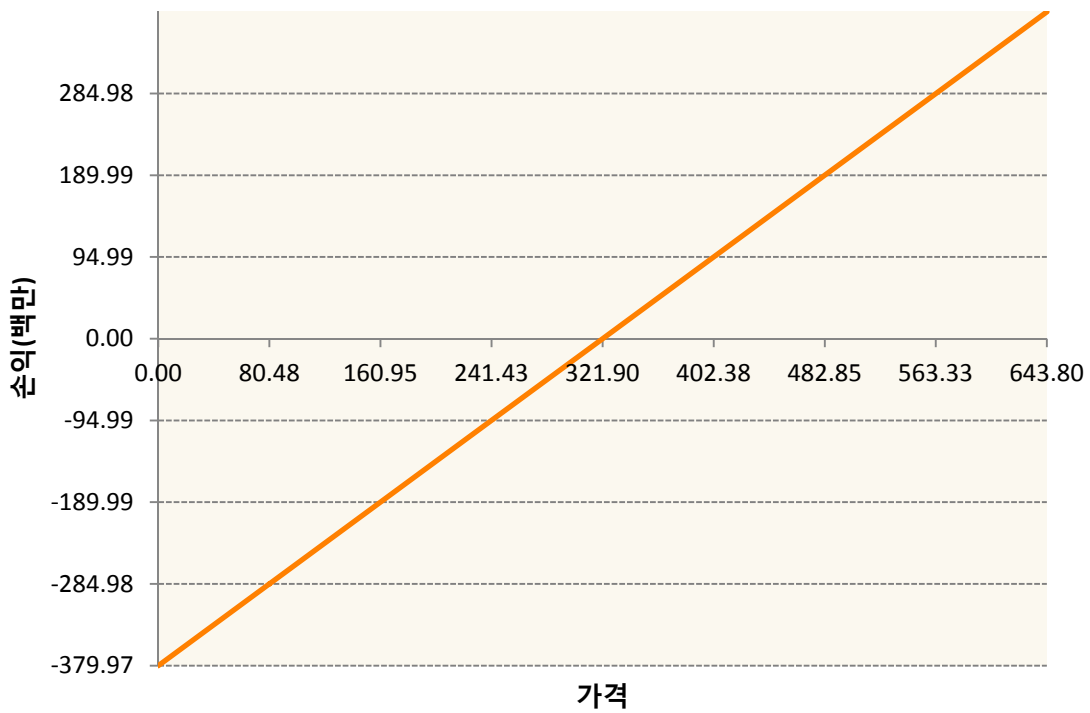
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

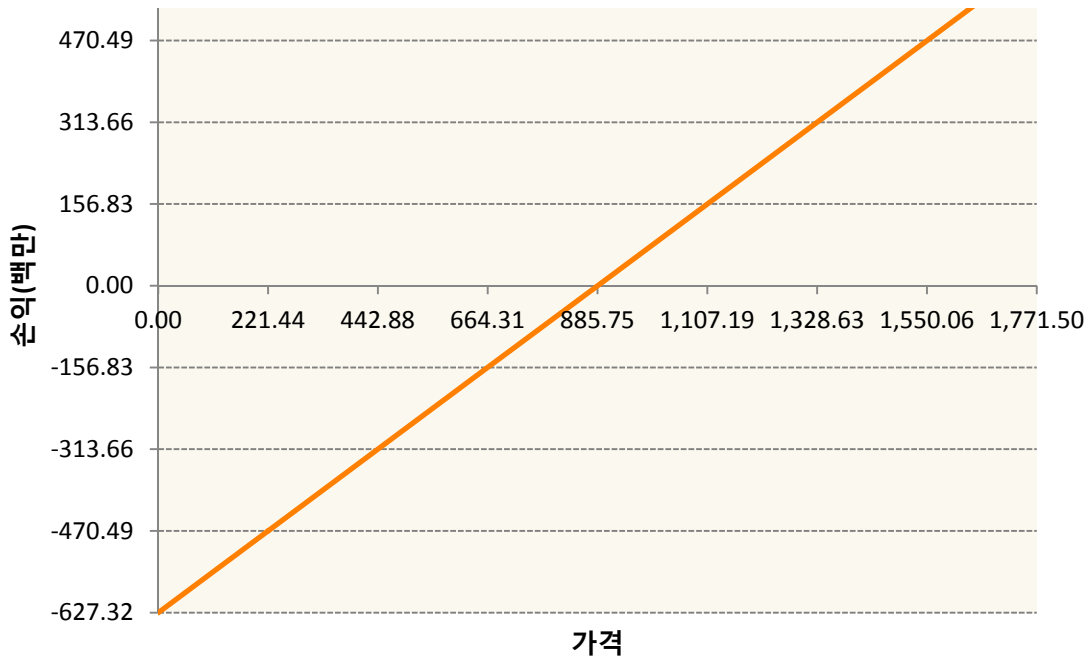


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

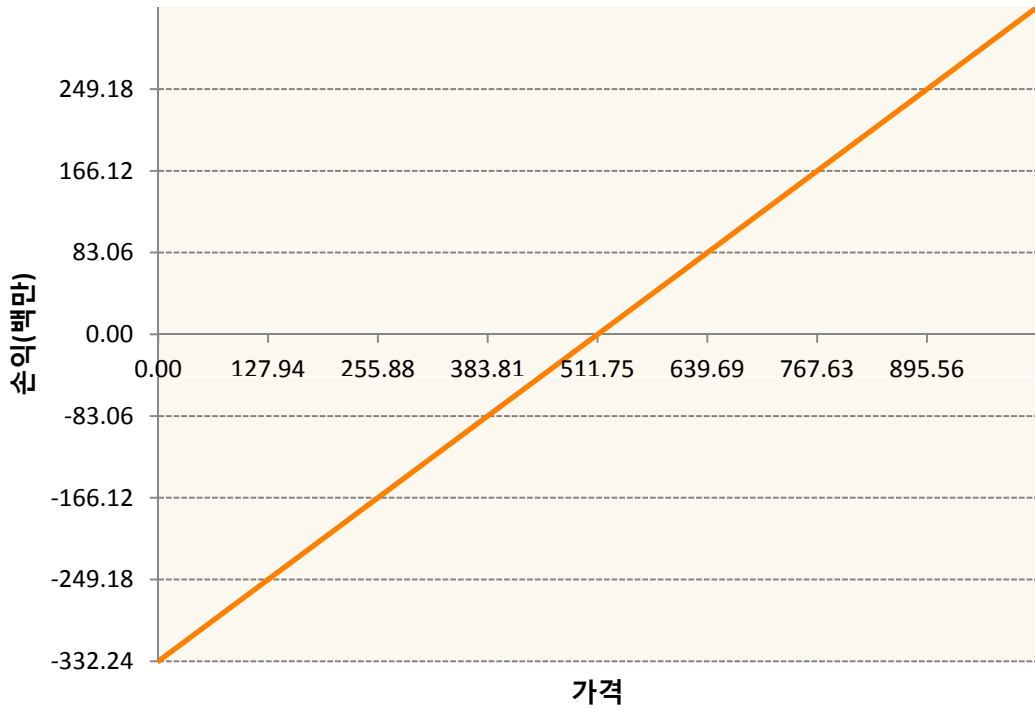


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





WU9-WHEAT FUTURE(CBT) Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	27
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	9
CU9	CORN FUTURE Sep19	56
KCU9	COFFEE 'C' FUTURE Sep19	21
KR4175P600	2019-06 달러선물	16

KWU9	KC HRW WHEAT FUT Sep19	9
SBV9	SUGAR #11 (WORLD) Oct19	27
SMZ9	SOYBEAN MEAL FUTR Dec19	30
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	50
WU9	WHEAT FUTURE(CBT) Sep19	27

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

(단위:백만원)

275