

공시일	2019-06-13
기준일	2019-06-12

## 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

공시일	2019-06-13
기준일	2019-06-12

## 스마트인덱스모

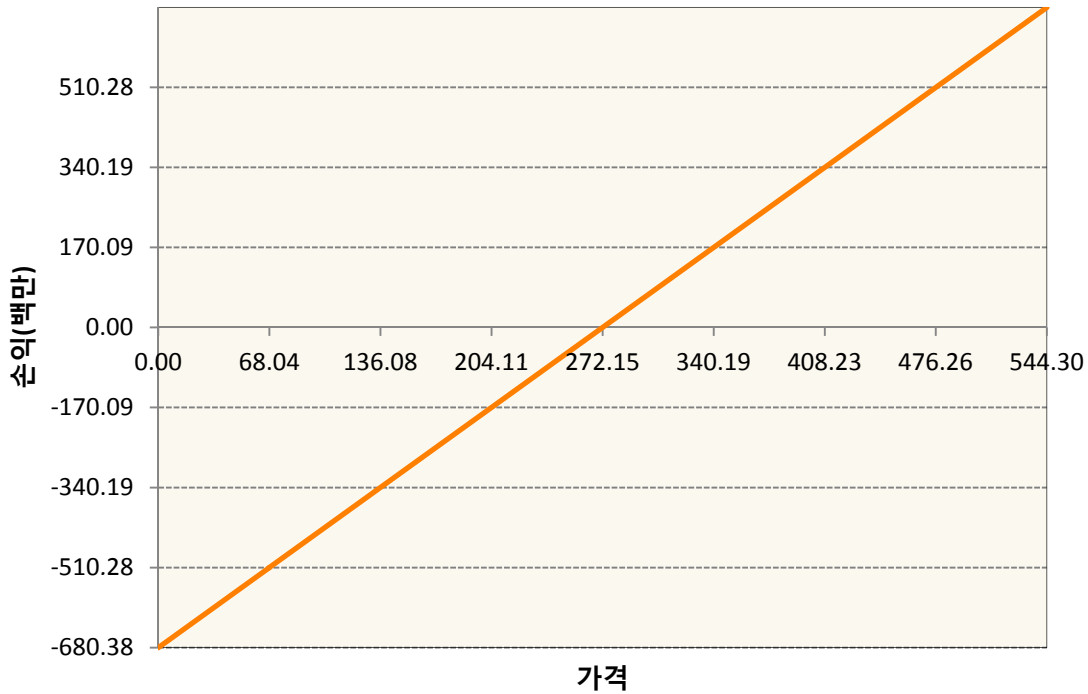
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

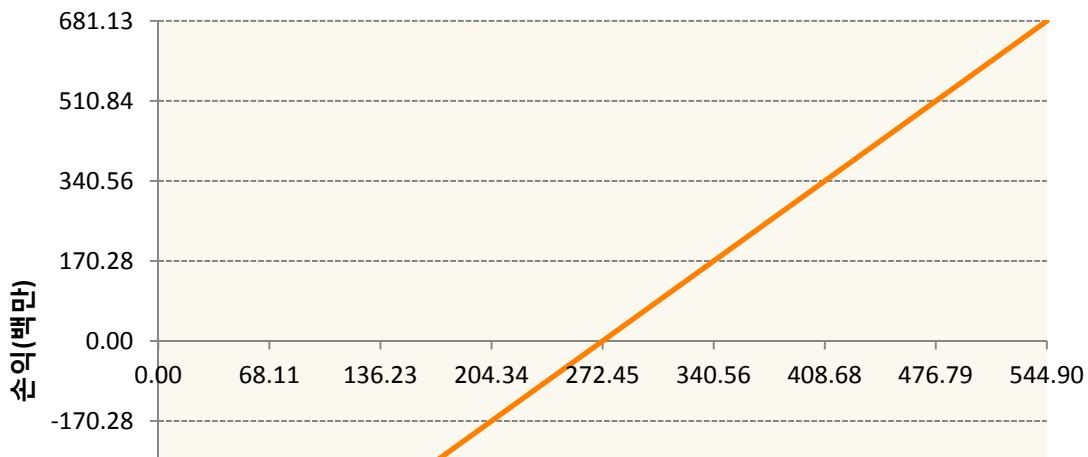
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	683	682	1	장내
누계	유가증권	선물	1,362	0	1,362	장내

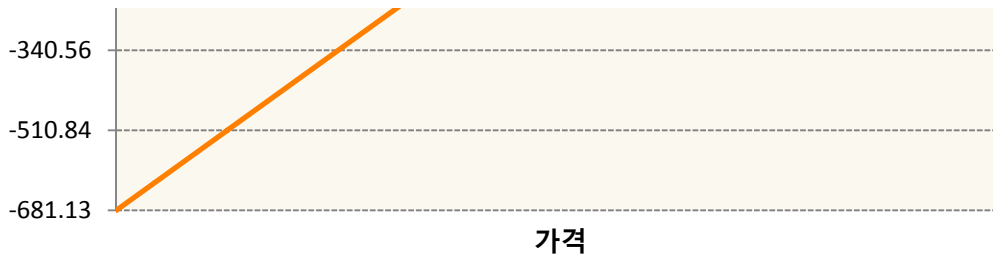
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물





**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	
KR4101P90001		2019-09 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	

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

92

공시일	2019-06-13
기준일	2019-06-12

## 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

1,145

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

694

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-13
기준일	2019-06-12

## 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	6,210	0	6,210	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(1)	375
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	137

\* 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	2019-06-13
기준일	2019-06-12

## 유로인덱스모(주식-파생형)

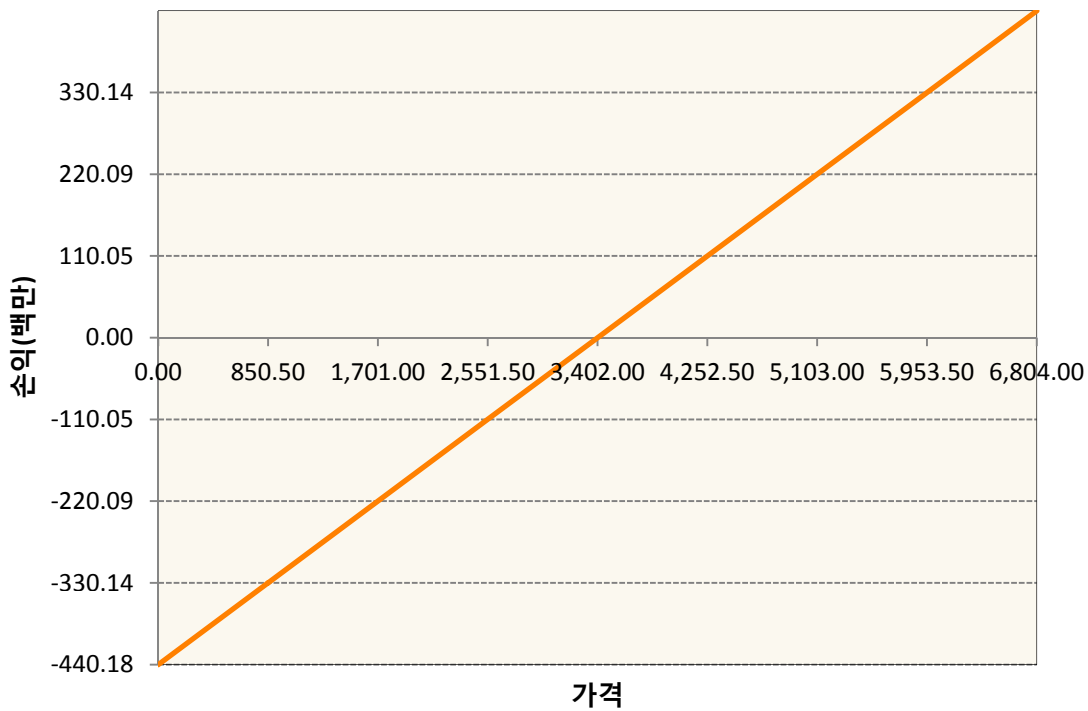
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

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

### 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)

26
----

공시일	2019-06-13
기준일	2019-06-12

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

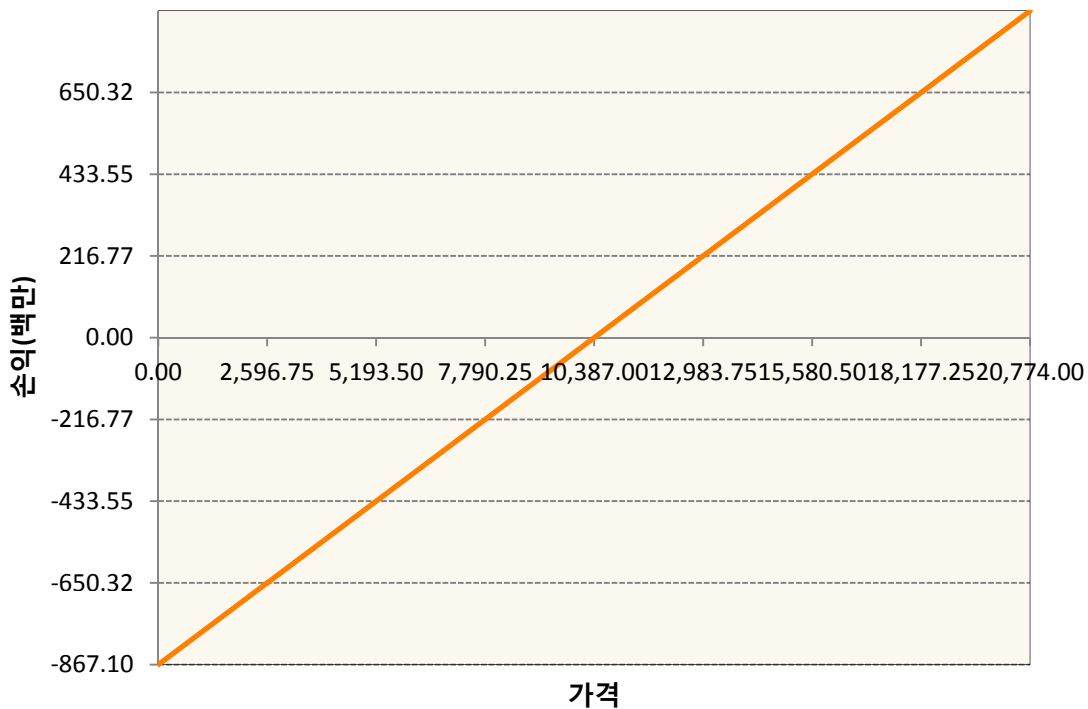
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	867	0	867	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	2019-06-13
기준일	2019-06-12

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

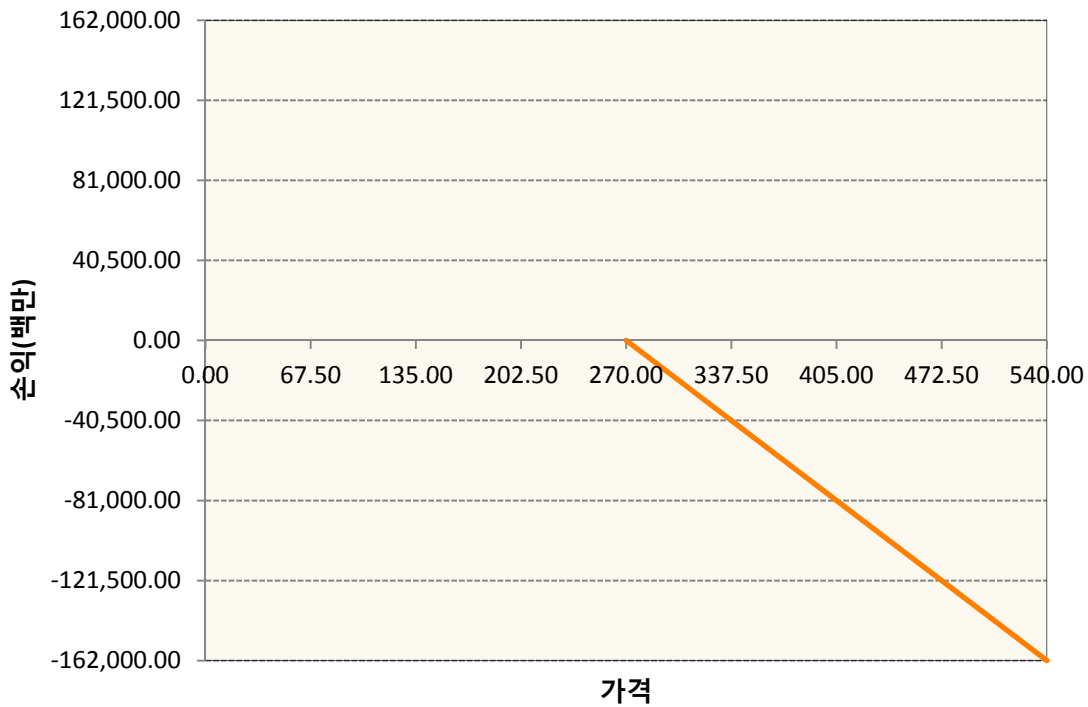
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

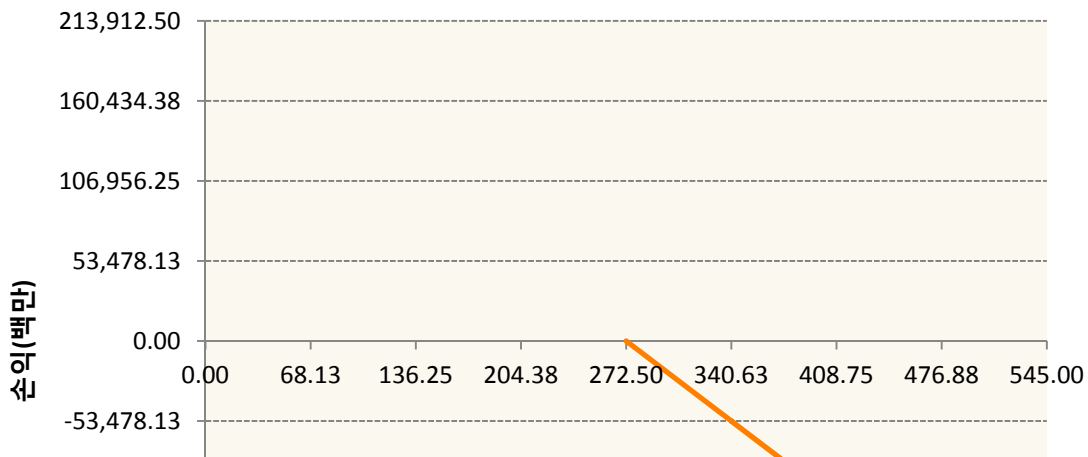
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	32,567	33,171	-604	장내
누계	유가증권	옵션	0	611,113	-611,113	장내

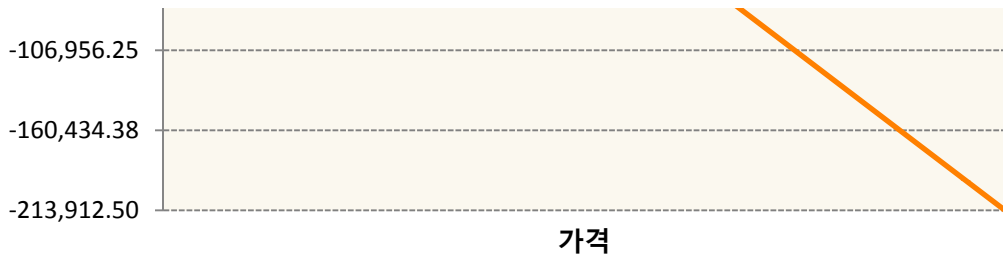
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P62701-2019-06 콜270

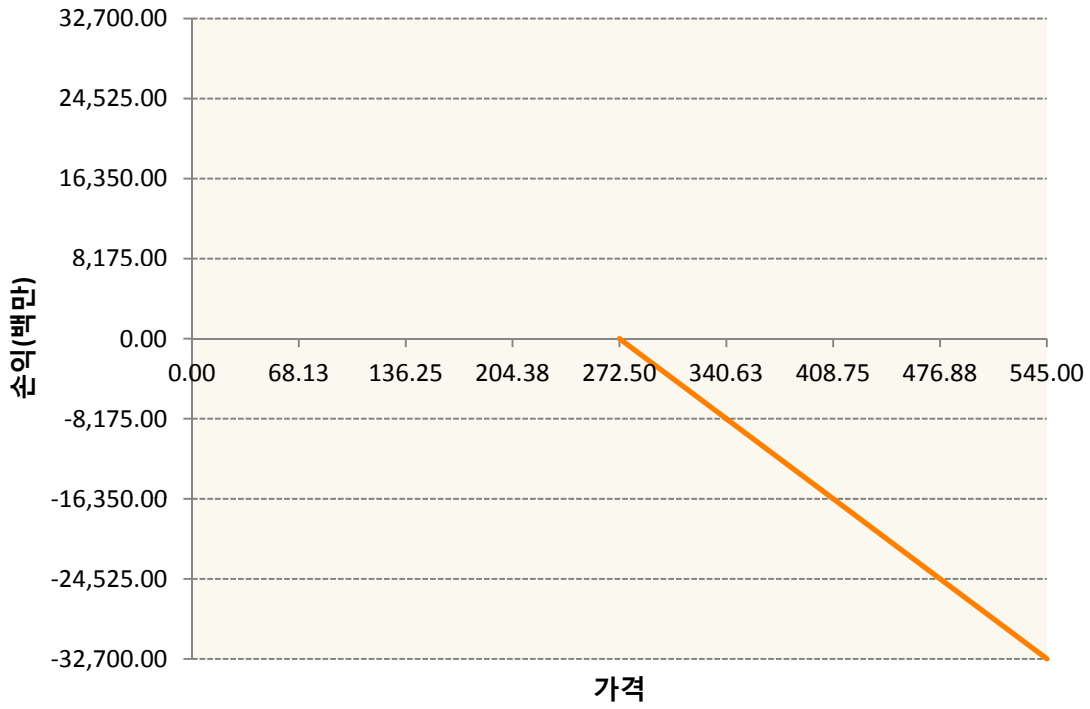


KR4201P62727-2019-06 콜272.5

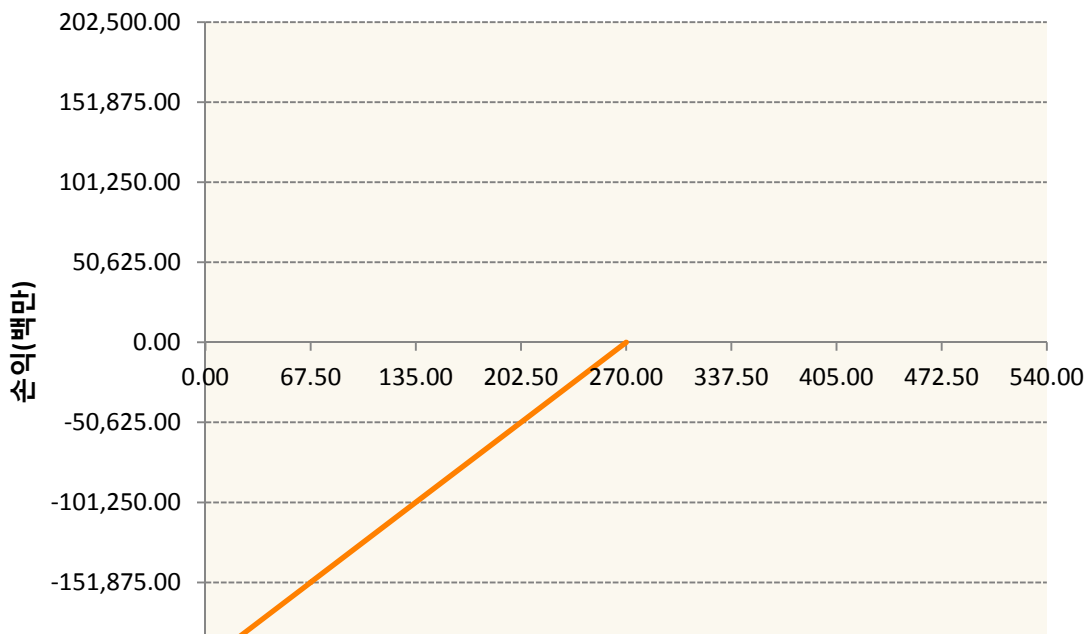




**KR4201P72726-2019-07 콜272.5**



**KR4301P62709-2019-06 풋270**



-202,500.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P62701 2019-06 콜270							12,811
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,919	1,919	1,919	1,919	1,919	1,919	1,919
-5.33%	1,919	1,919	1,919	1,919	1,918	1,918	1,916
-2.67%	1,890	1,871	1,846	1,817	1,784	1,747	1,706
0%	147	102	53	0	-55	-112	-171
2.67%	-4,084	-4,084	-4,085	-4,086	-4,088	-4,092	-4,098
5.33%	-8,448	-8,448	-8,448	-8,448	-8,448	-8,448	-8,448
8.00%	-12,811	-12,811	-12,811	-12,811	-12,811	-12,811	-12,811
KR4201P62727 2019-06 콜272.5							16,082
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,227	1,227	1,227	1,227	1,227	1,227	1,227
-5.33%	1,227	1,227	1,227	1,227	1,227	1,227	1,227
-2.67%	1,224	1,220	1,213	1,202	1,186	1,166	1,141
0%	283	188	94	0	-94	-189	-283
2.67%	-4,666	-4,670	-4,676	-4,686	-4,700	-4,718	-4,741
5.33%	-10,373	-10,373	-10,373	-10,373	-10,373	-10,374	-10,374
8.00%	-16,082	-16,082	-16,082	-16,082	-16,082	-16,082	-16,082
KR4201P72726 2019-07 콜272.5							2,010
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	890	865	834	798	759	715	668
-5.33%	797	749	698	643	585	526	464
-2.67%	593	524	455	384	312	240	167
0%	233	155	78	0	-78	-155	-233
2.67%	-296	-367	-439	-512	-586	-660	-735
5.33%	-971	-1,023	-1,079	-1,139	-1,201	-1,266	-1,332
8.00%	-1,745	-1,777	-1,815	-1,857	-1,905	-1,956	-2,010
KR4301P62709 2019-06 풋270							14,243
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,243	-14,243	-14,243	-14,243	-14,243	-14,243	-14,243
-5.33%	-8,789	-8,789	-8,789	-8,789	-8,789	-8,789	-8,789
-2.67%	-3,335	-3,336	-3,338	-3,342	-3,347	-3,355	-3,365
0%	51	38	21	0	-24	-50	-79
2.67%	71	71	71	71	71	71	71

5.33%	71	71	71	71	71	71	71
8.00%	71	71	71	71	71	71	71

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

(단위:백만원)

**63,559**

공시일	2019-06-13
기준일	2019-06-12

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

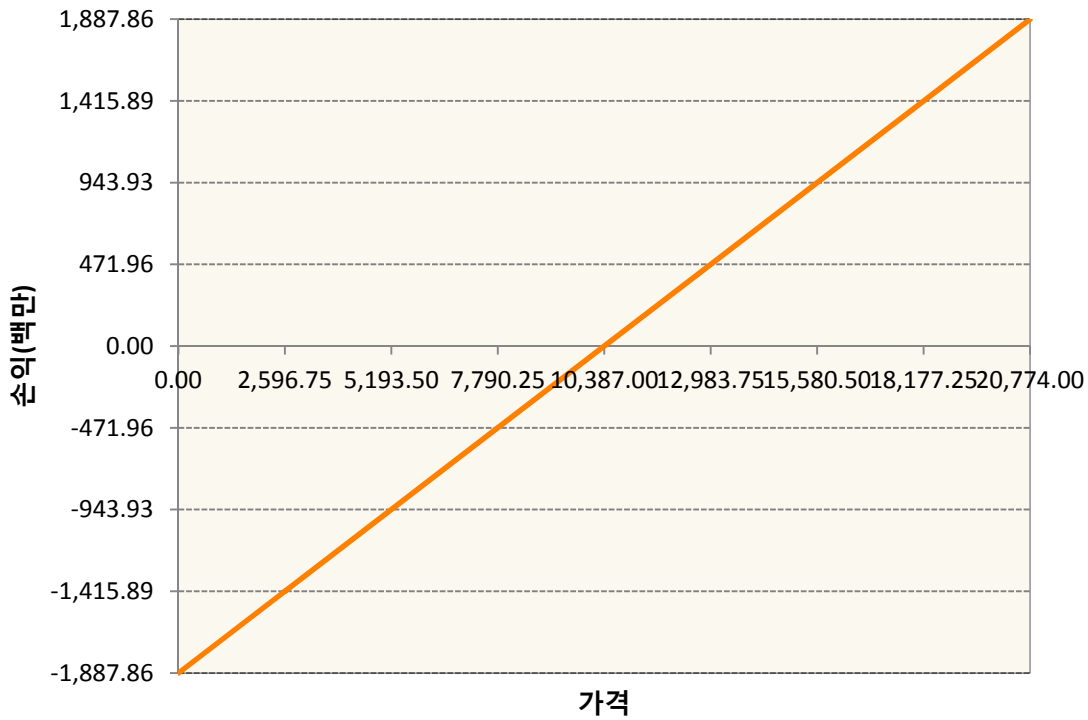
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

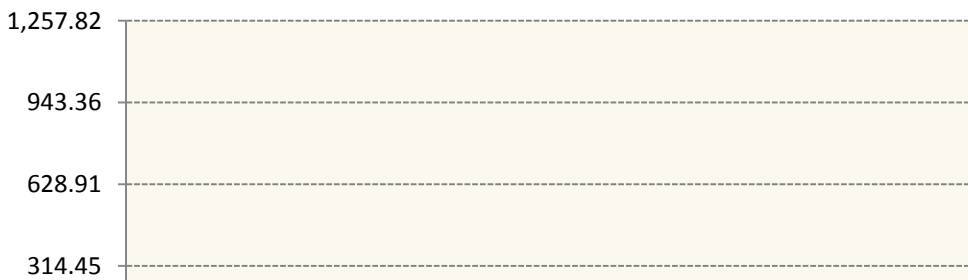
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,888	0	1,888	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,055	-5,055	장내
누계	통화	선도	151	3,175	-3,023	장외

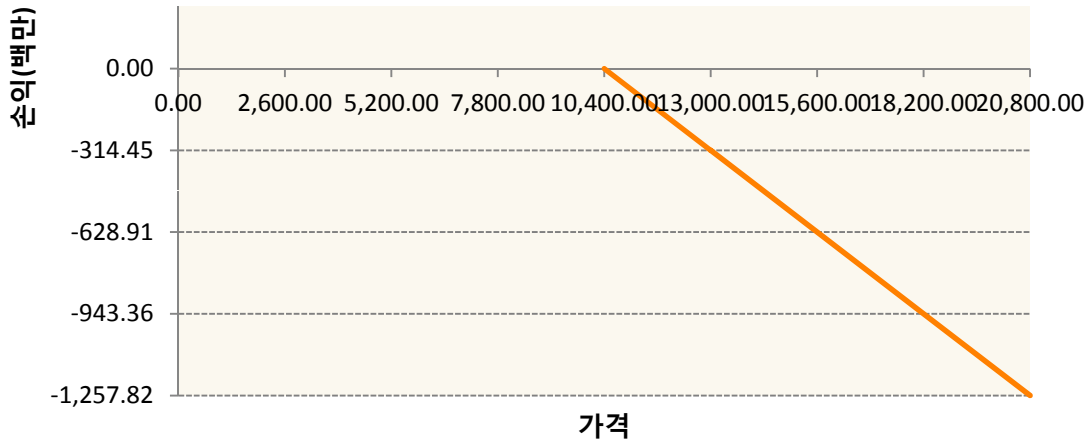
### 2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19

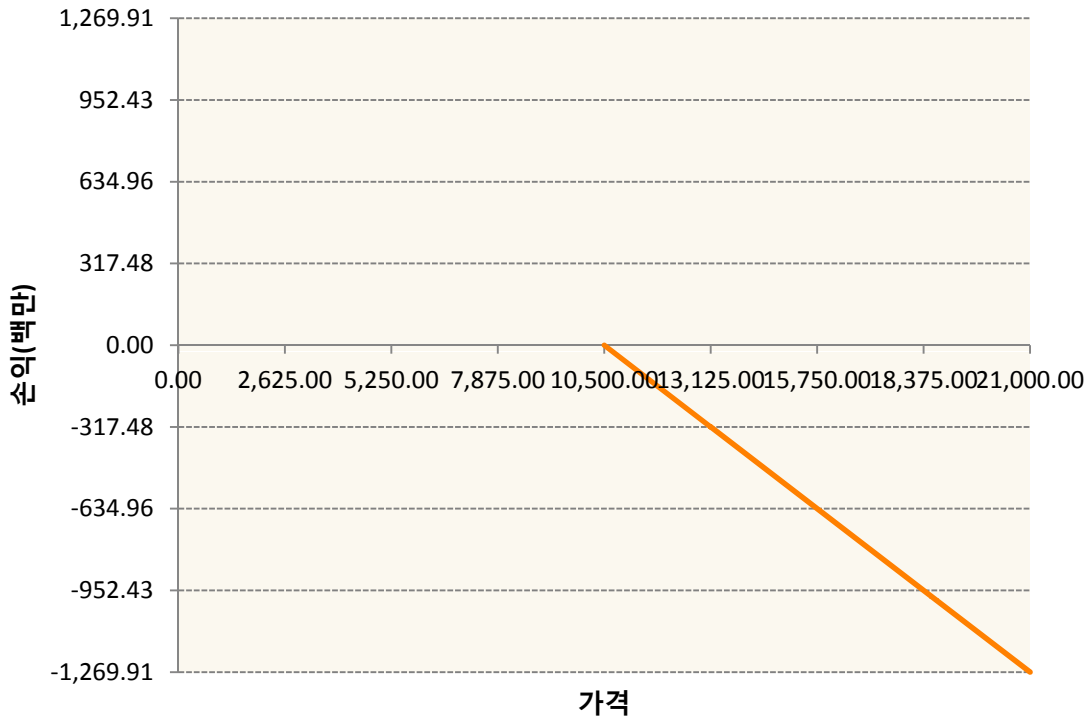


OHHIM9-C104-HSCEI

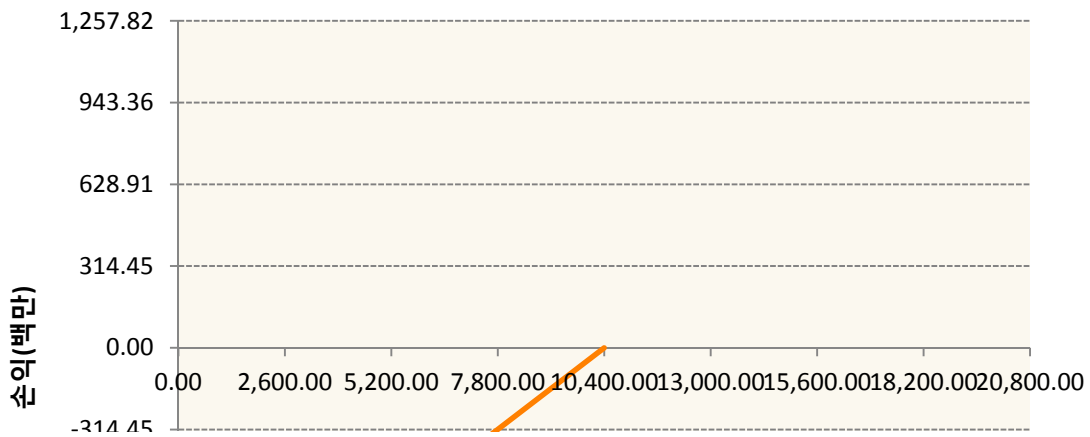


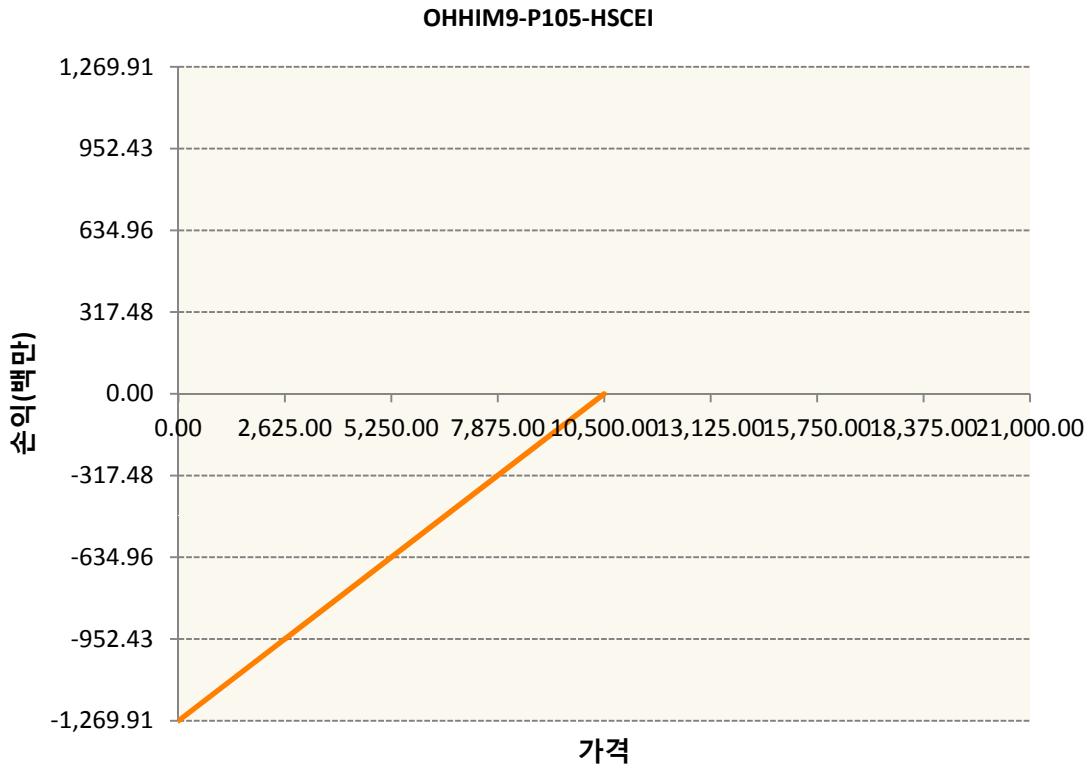


**OHHIM9-C105-HSCEI**



**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	151
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)
	652

공시일	2019-06-13
기준일	2019-06-12

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

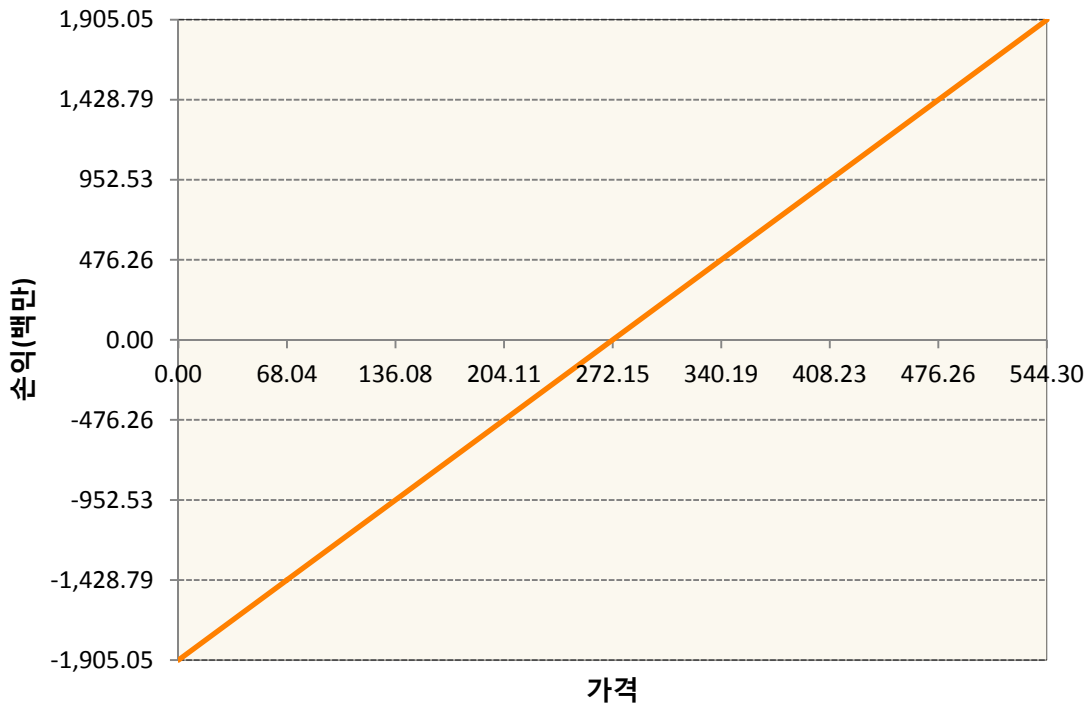
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

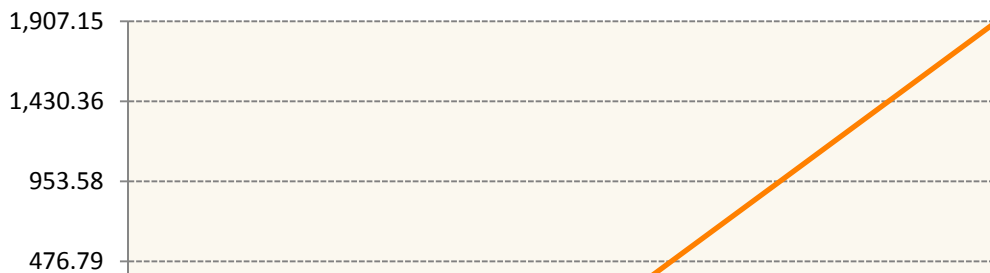
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,912	1,910	2	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,812	0	3,812	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	21,624	-21,624	장내

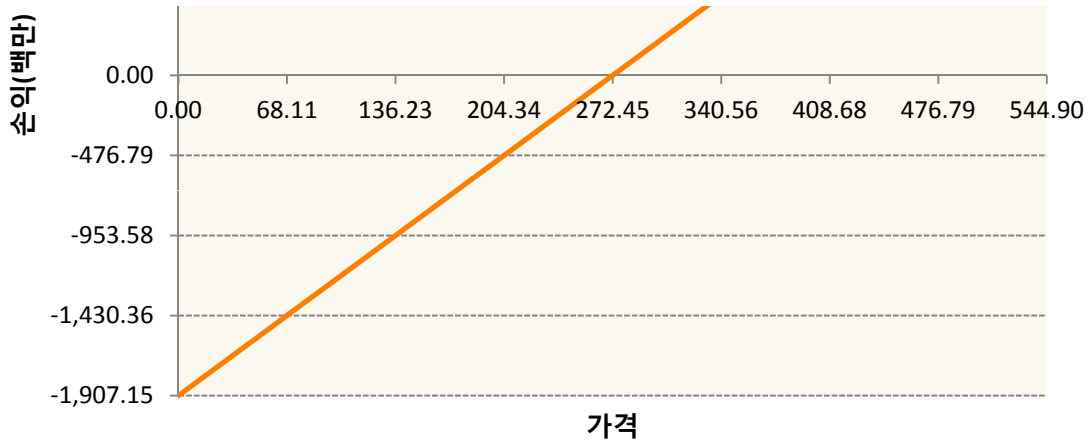
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

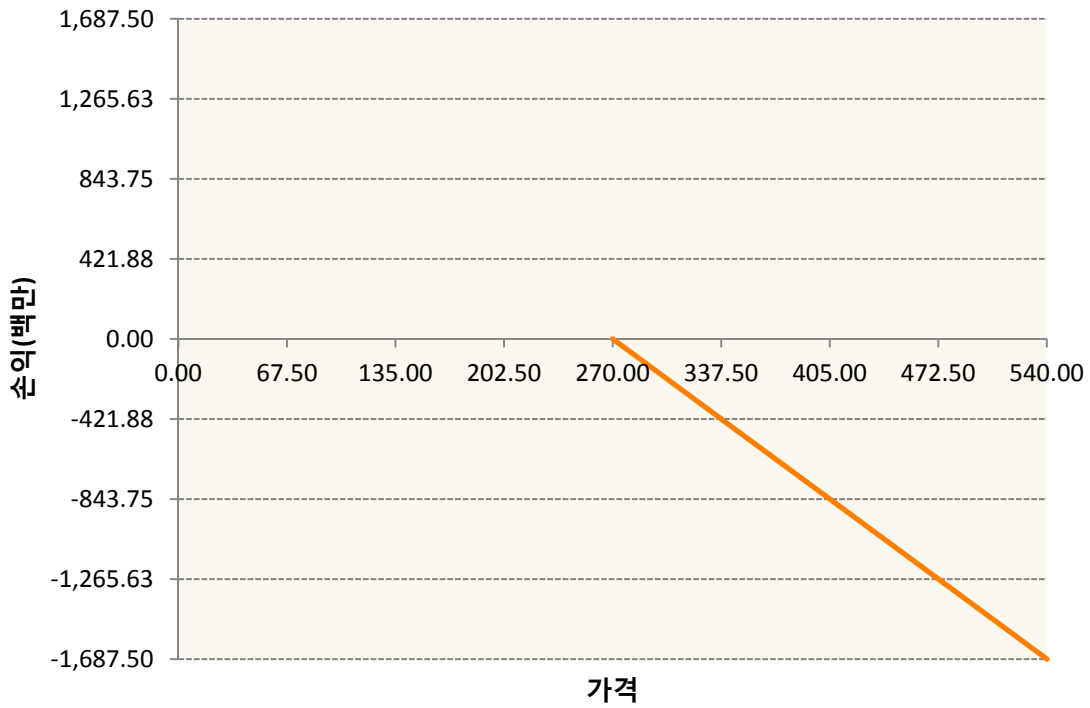


KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

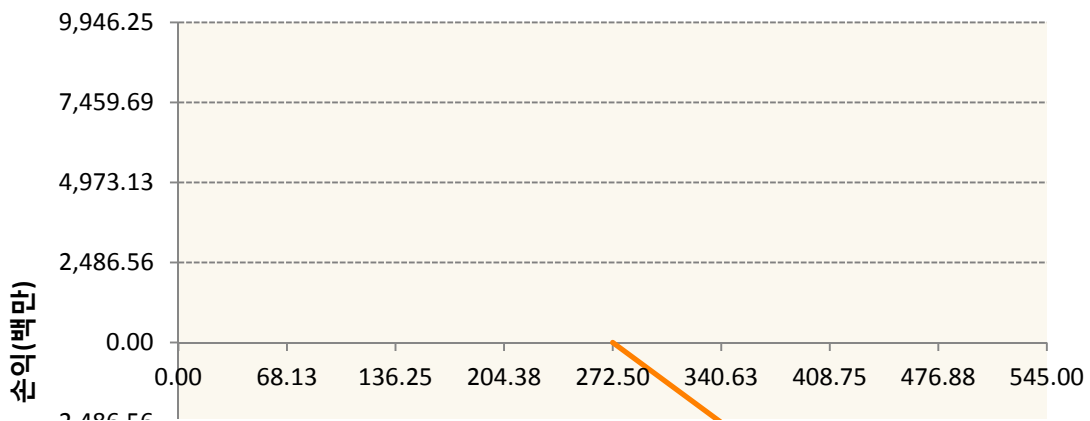


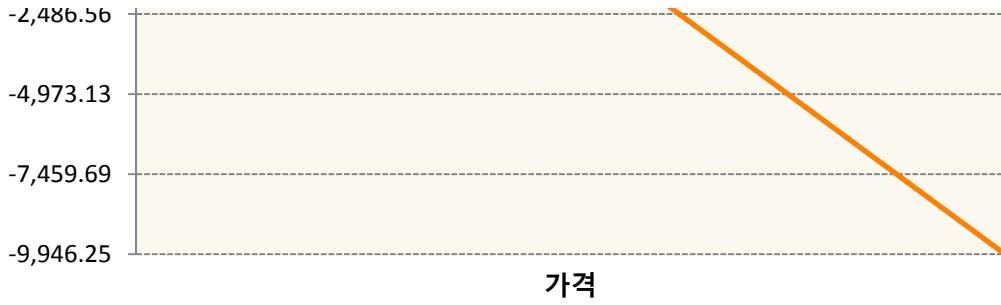


**KR4201P62701-2019-06 콜270**

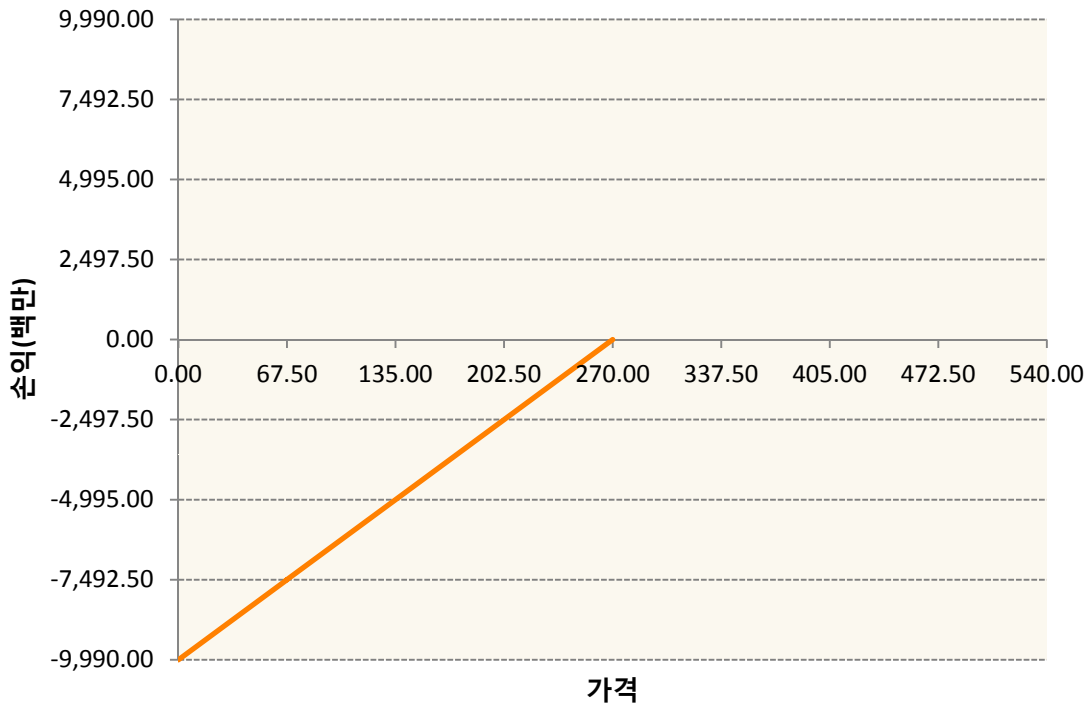


**KR4201P62727-2019-06 콜272.5**





KR4301P62709-2019-06 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14						1,192
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,192	-1,192	-1,192	-1,192	-1,192	-1,192	-1,192
-5.33%	-795	-795	-795	-795	-795	-795	-795
-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%	795	795	795	795	795	795	795
8.00%	1,192	1,192	1,192	1,192	1,192	1,192	1,192
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_15						603
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-603	-603	-603	-603	-603	-603	-603
-5.33%	-402	-402	-402	-402	-402	-402	-402
-2.67%	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-201
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	201	201	201	201	201	201	201
5.33%	402	402	402	402	402	402	402
8.00%	603	603	603	603	603	603	603

KR4101P60004 2019-06 코스피200지수선물 153

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-153	-153	-153	-153	-153	-153	-153
-5.33%	-102	-102	-102	-102	-102	-102	-102
-2.67%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	51	51	51	51	51	51	51
5.33%	102	102	102	102	102	102	102
8.00%	153	153	153	153	153	153	153

KR4101P90001 2019-09 코스피200지수선물 153

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-153	-153	-153	-153	-153	-153	-153
-5.33%	-102	-102	-102	-102	-102	-102	-102
-2.67%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	51	51	51	51	51	51	51
5.33%	102	102	102	102	102	102	102
8.00%	153	153	153	153	153	153	153

KR4201P62701 2019-06 콜270 133

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	20	20	20	20	20	20	20
-5.33%	20	20	20	20	20	20	20
-2.67%	20	19	19	19	19	18	18
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
8.00%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133

KR4201P62727 2019-06 콜272.5 748

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	57	57	57	57	57	57	57
-5.33%	57	57	57	57	57	57	57
-2.67%	57	57	56	56	55	54	53
0%	13	9	4	0	-4	-9	-13

2.67%	-217	-217	-217	-218	-219	-219	-220
5.33%	-482	-482	-482	-482	-482	-482	-482
8.00%	-748	-748	-748	-748	-748	-748	-748
KR4301P62709                      2019-06 풋270							703
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-703	-703	-703	-703	-703	-703	-703
-5.33%	-434	-434	-434	-434	-434	-434	-434
-2.67%	-165	-165	-165	-165	-165	-166	-166
0%	3	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	3	3	3	3	3	3	3
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

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

(단위:백만원)

**4,307**

공시일	2019-06-13
기준일	2019-06-12

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

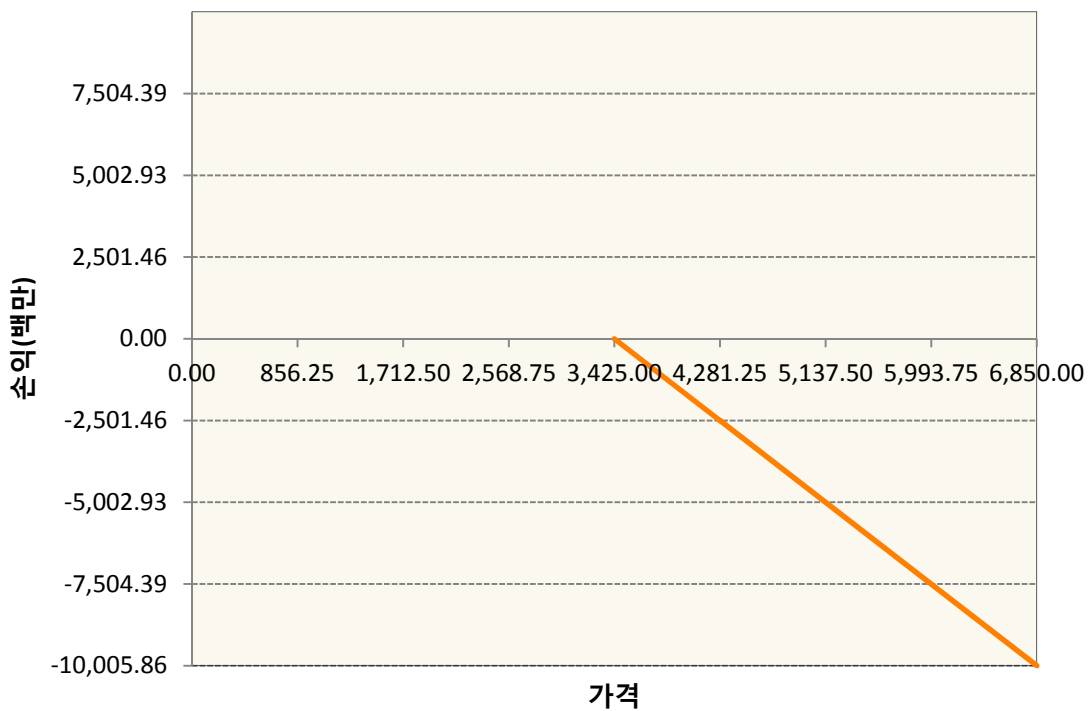
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

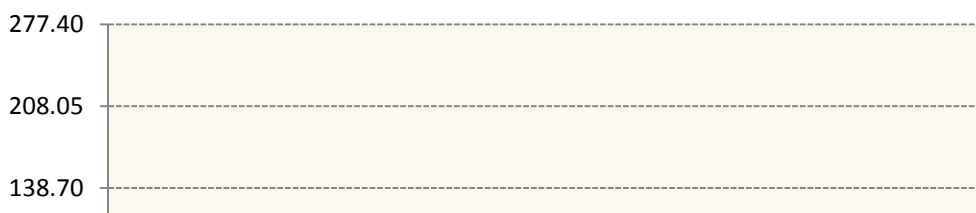
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,720	0	3,720	
누계	유가증권	스왑	56,726	0	56,726	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,567	-20,567	장내
누계	통화	선도	0	18,762	-18,762	장외

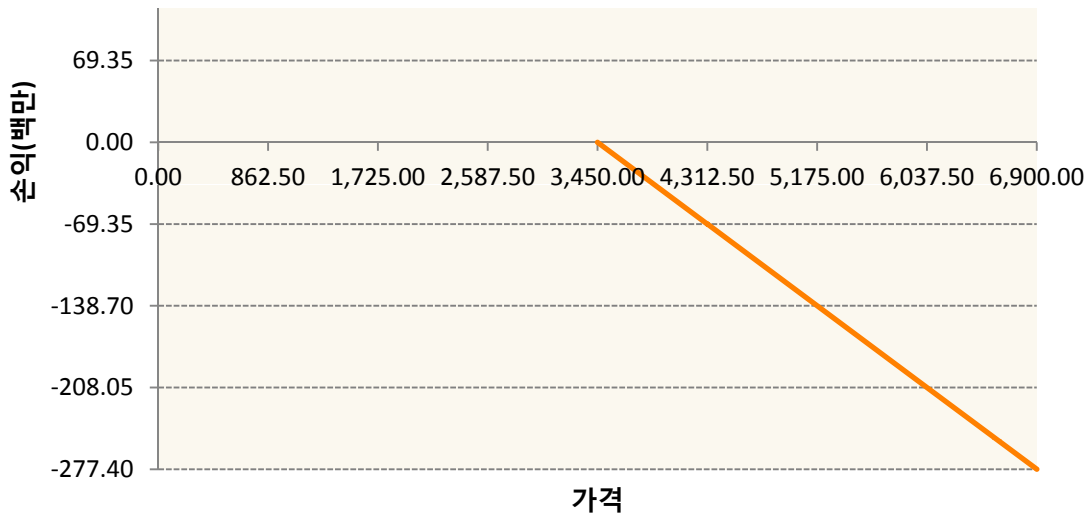
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXM9-C3425-EURO STOXX 50

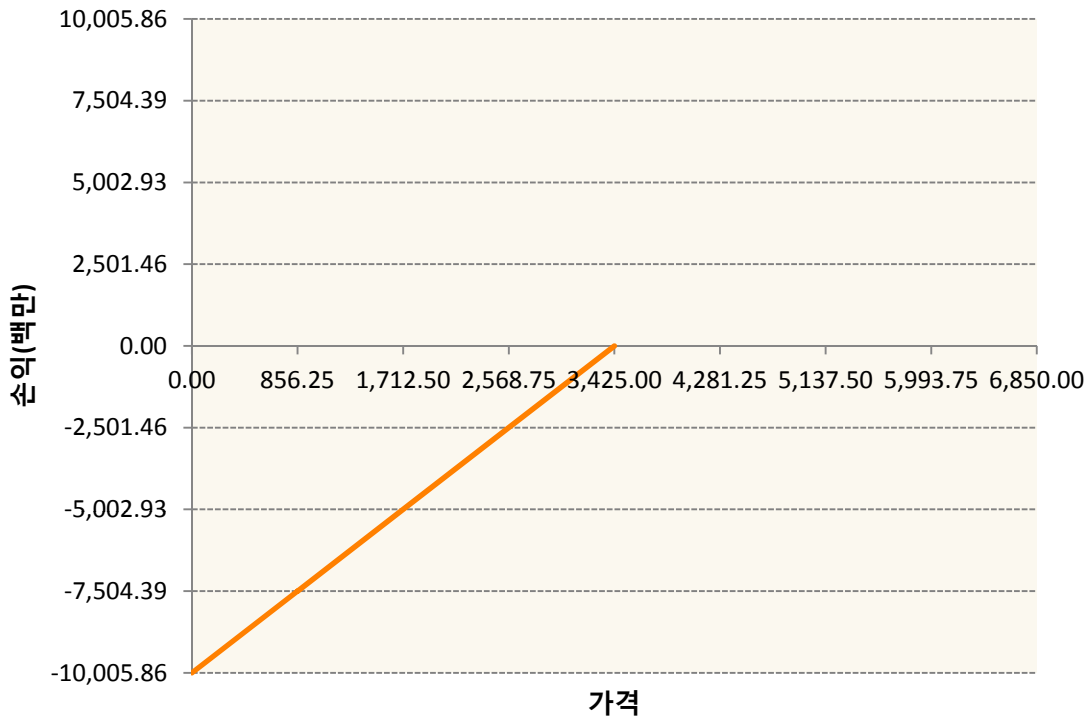


OESXM9-C3450-EURO STOXX 50

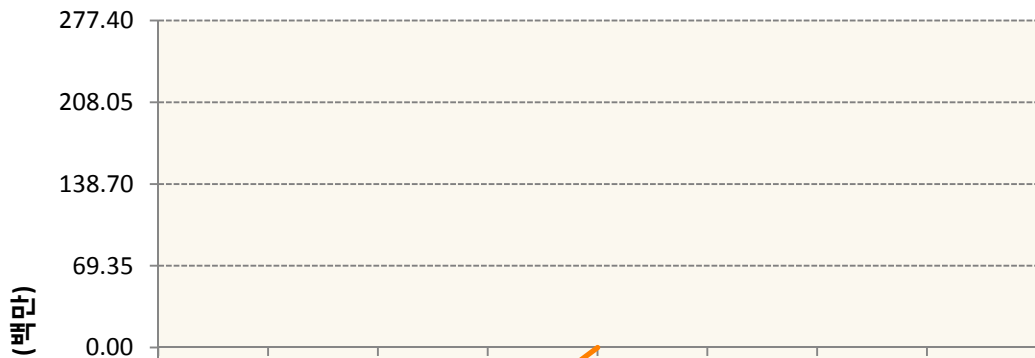


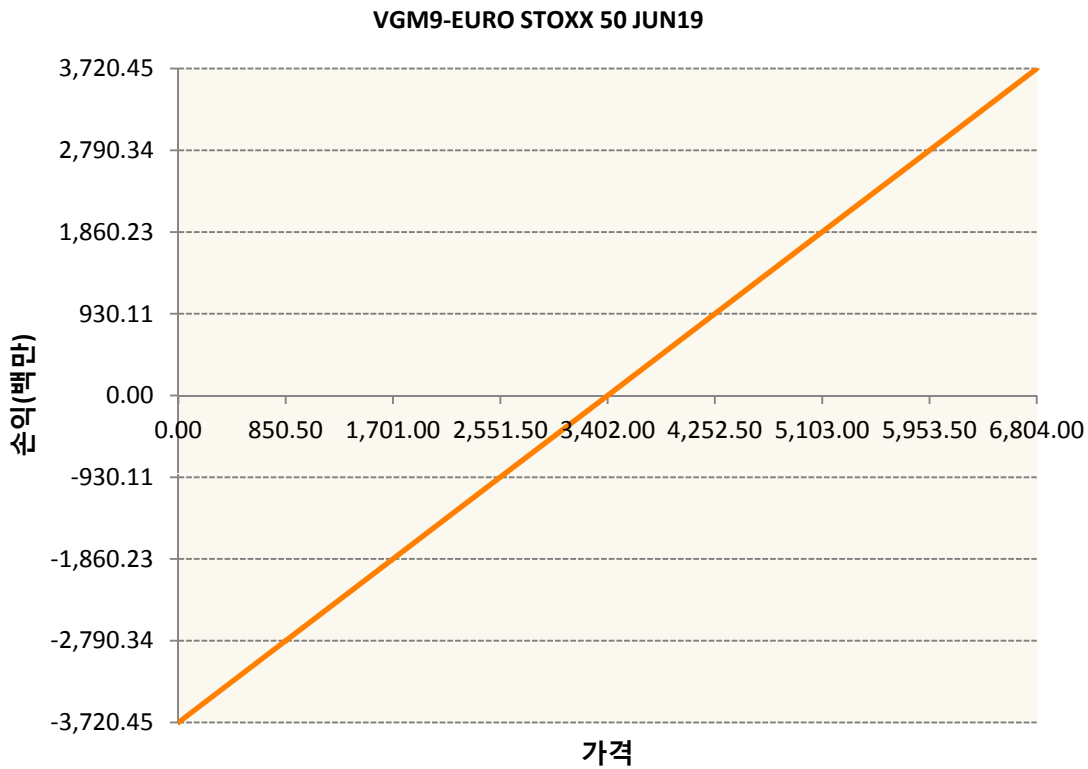
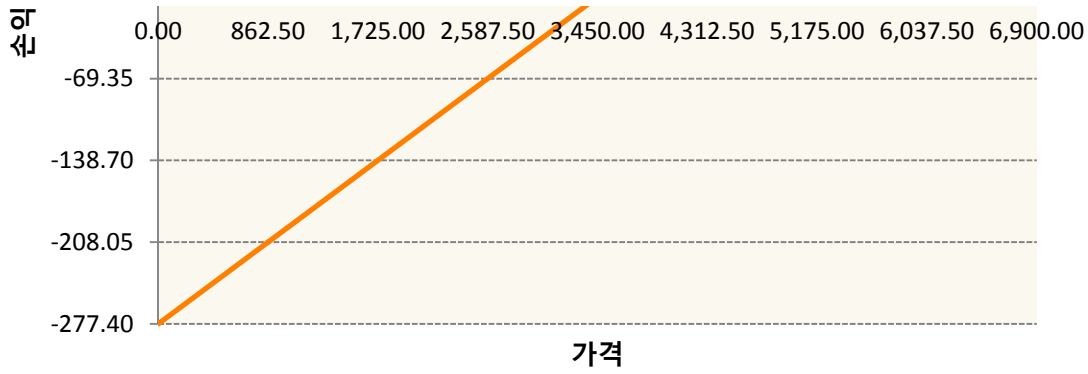


OESXM9-P3425-EURO STOXX 50



OESXM9-P3450-EURO STOXX 50





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	3
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	298

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

(단위:백만원)

2,131

공시일	2019-06-13
기준일	2019-06-12

## ETF스마트레버리지목표전환형8호

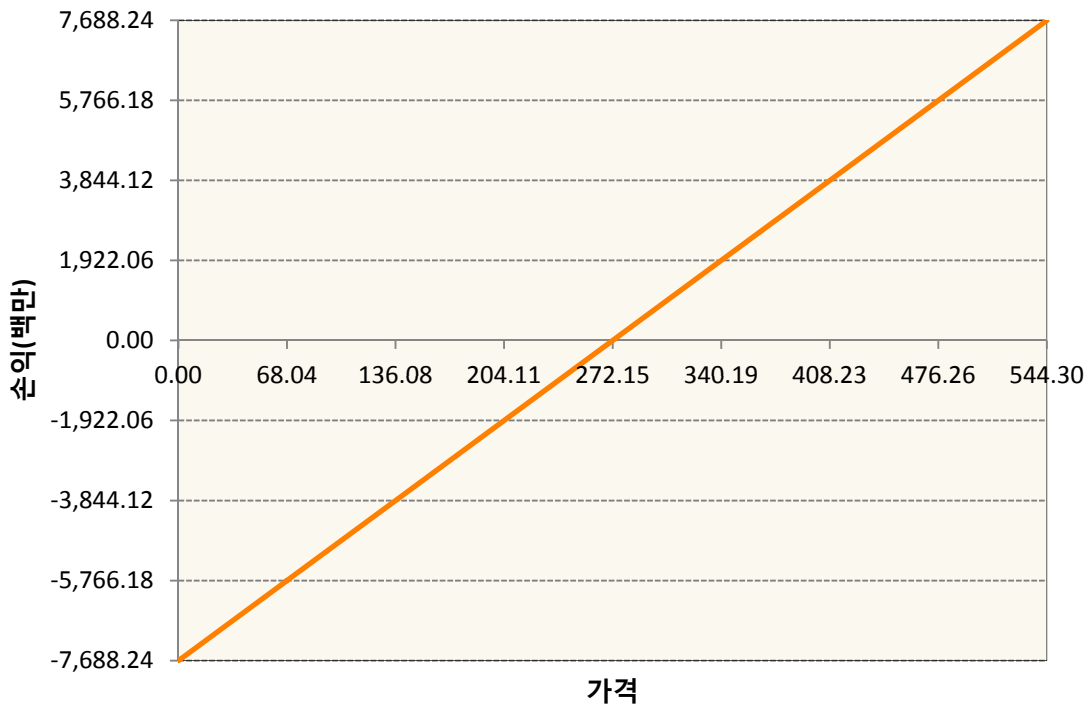
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

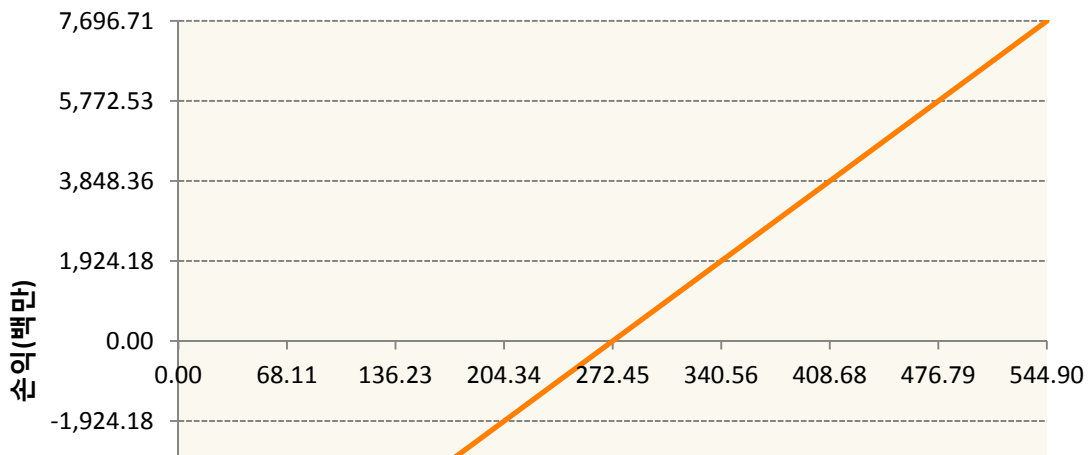
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	7,715	7,707	7	장내
누계	유가증권	선물	15,385	0	15,385	장내

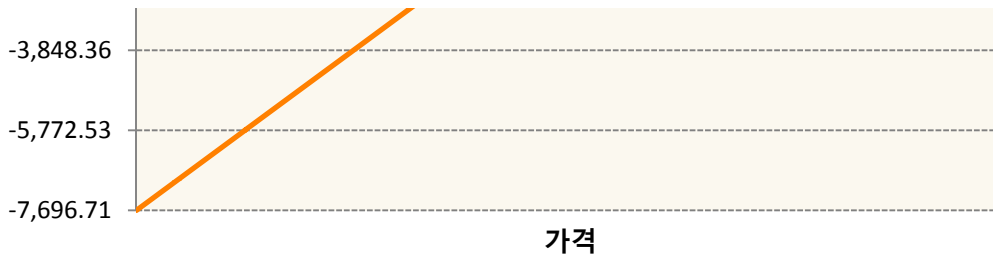
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물





**3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						616
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-616	-616	-616	-616	-616	-616	-616	
-5.33%	-411	-411	-411	-411	-411	-411	-411	
-2.67%	-205	-205	-205	-205	-205	-205	-205	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	205	205	205	205	205	205	205	
5.33%	411	411	411	411	411	411	411	
8.00%	616	616	616	616	616	616	616	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						616
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-616	-616	-616	-616	-616	-616	-616	
-5.33%	-411	-411	-411	-411	-411	-411	-411	
-2.67%	-205	-205	-205	-205	-205	-205	-205	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	205	205	205	205	205	205	205	
5.33%	411	411	411	411	411	411	411	
8.00%	616	616	616	616	616	616	616	

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

**1,041**

공시일	2019-06-13
기준일	2019-06-12

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

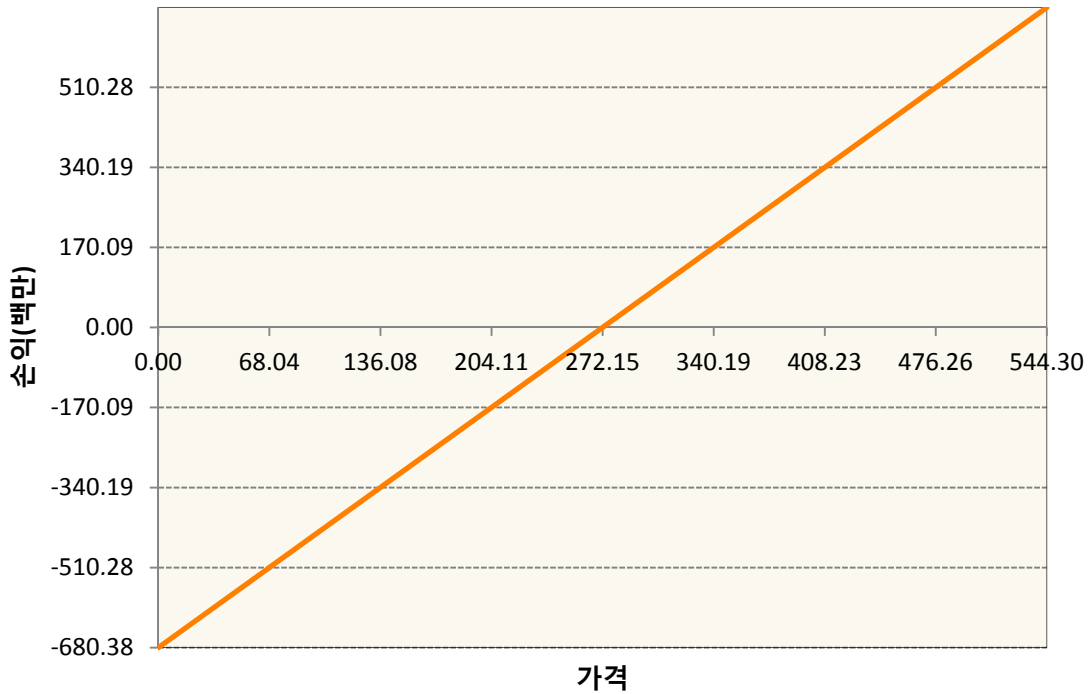
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

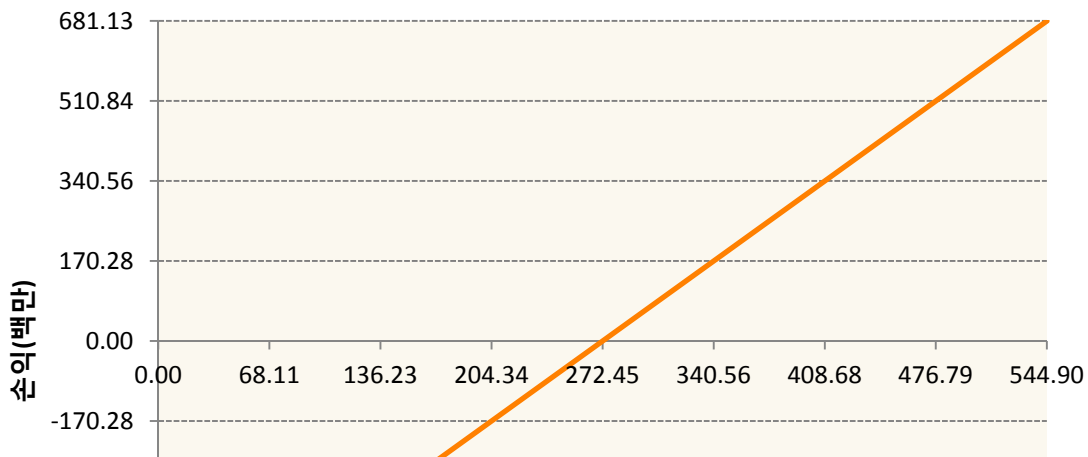
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	683	682	1	장내
누계	유가증권	선물	1,362	0	1,362	장내

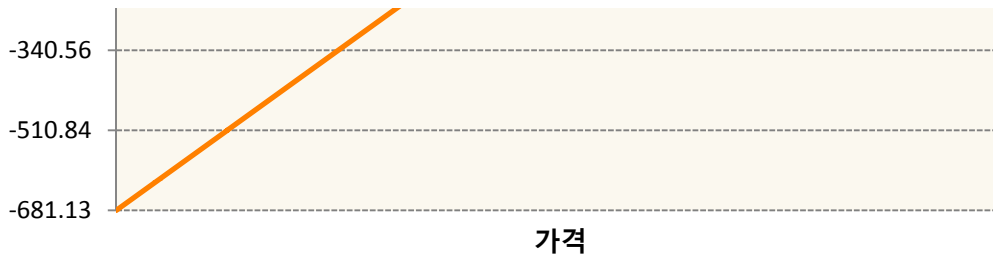
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물





**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	
KR4101P90001		2019-09 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	

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

92

공시일	2019-06-13
기준일	2019-06-12

## ETF스마트레버리지목표전환형10호

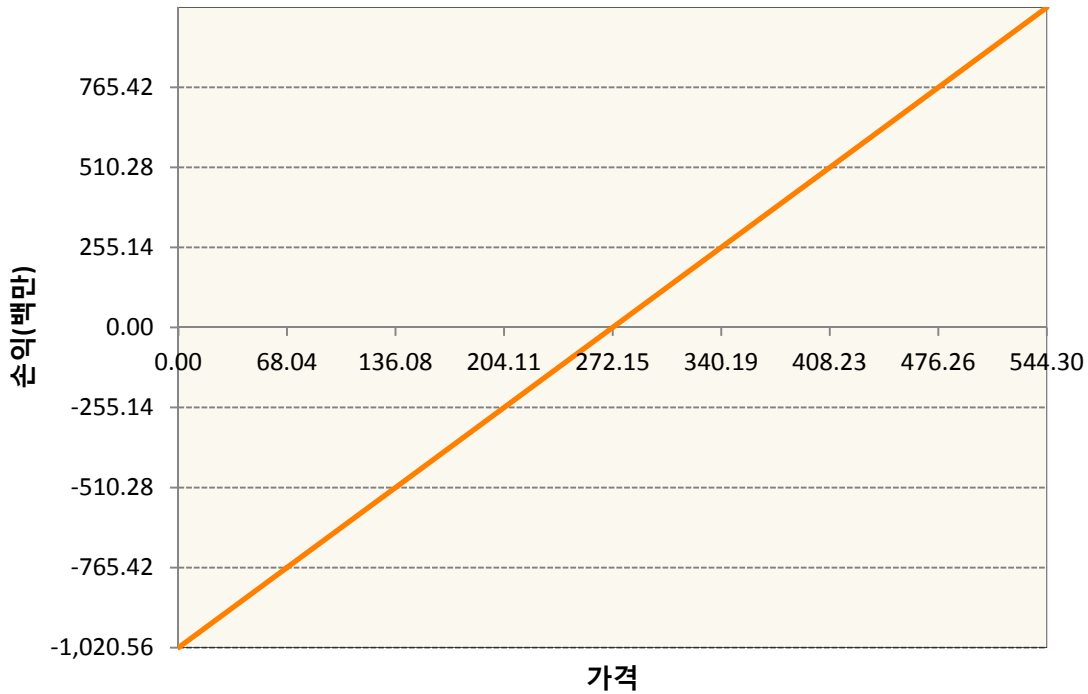
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

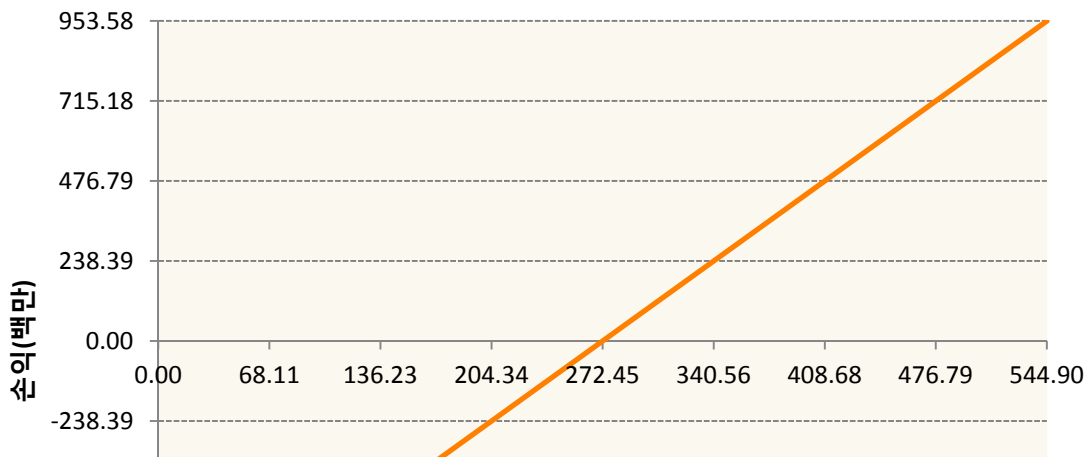
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	956	955	1	장내
누계	유가증권	선물	1,974	0	1,974	장내

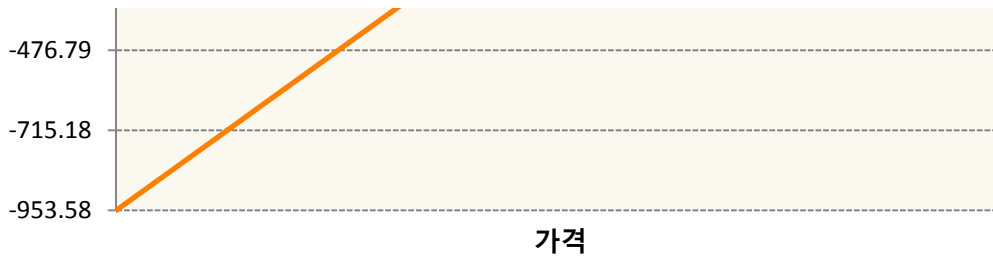
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물





**3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						82
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82	
-5.33%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55	
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	27	27	27	27	27	27	27	
5.33%	55	55	55	55	55	55	55	
8.00%	82	82	82	82	82	82	82	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						76
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76	
-5.33%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51	
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	25	25	25	25	25	25	25	
5.33%	51	51	51	51	51	51	51	
8.00%	76	76	76	76	76	76	76	

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

134

공시일	2019-06-13
기준일	2019-06-12

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

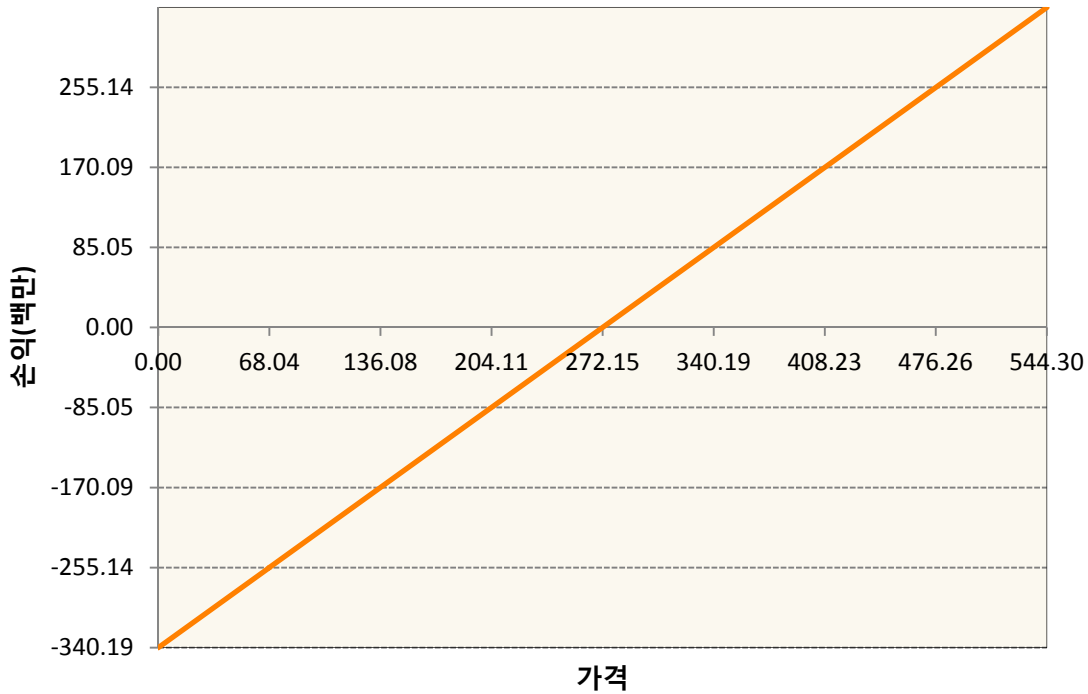
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

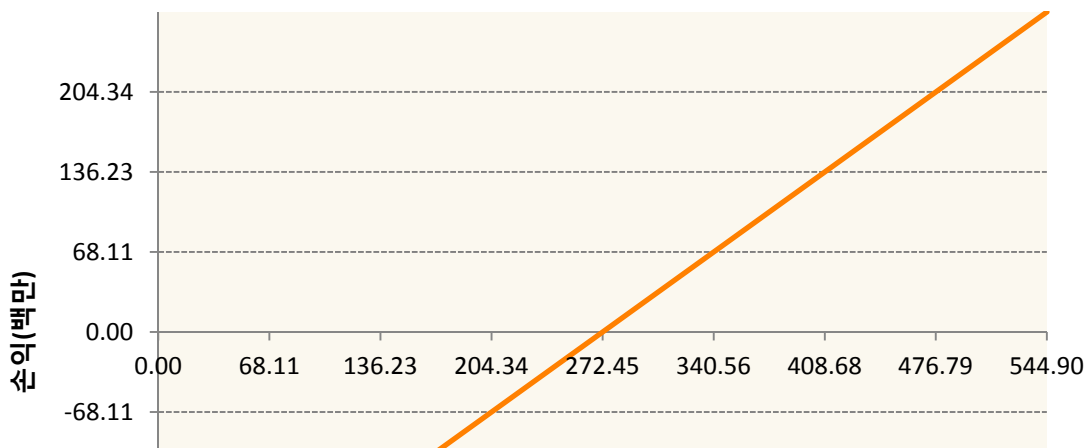
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	273	272	0	장내
누계	유가증권	선물	613	0	613	장내

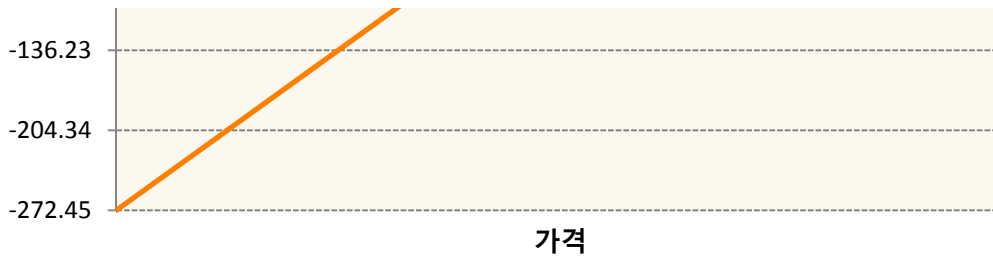
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물





**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	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						22
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22	
-5.33%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	
-2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	7	7	7	7	7	7	7	
5.33%	15	15	15	15	15	15	15	
8.00%	22	22	22	22	22	22	22	

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

41

공시일	2019-06-13
기준일	2019-06-12

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

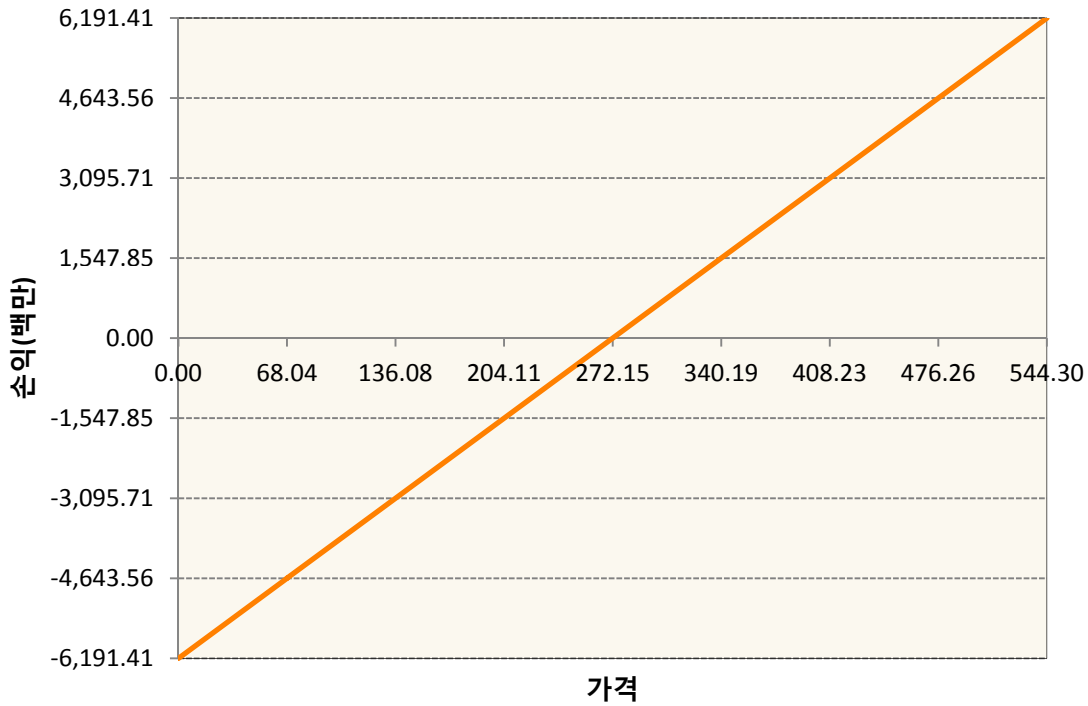
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

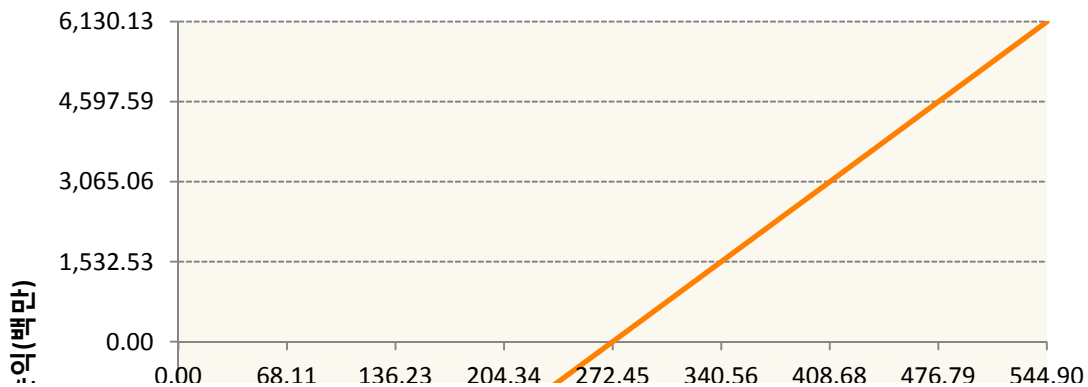
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	6,145	6,139	6	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,322	0	12,322	장내
누계	유가증권	옵션	4,946	22,906	-17,961	장내

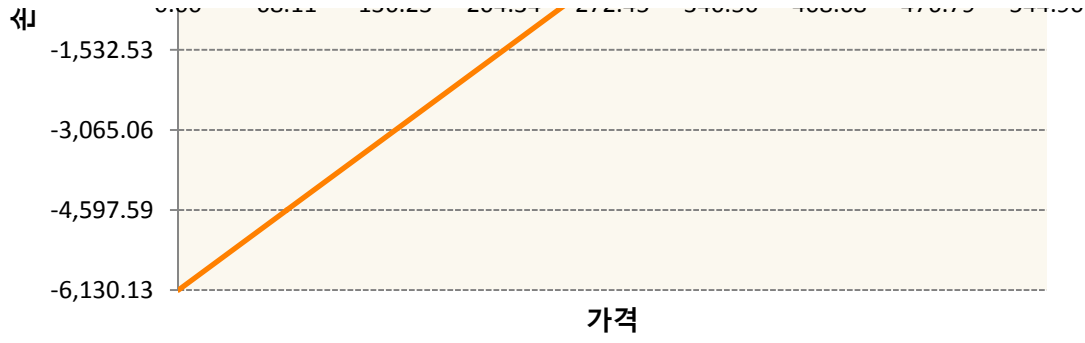
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

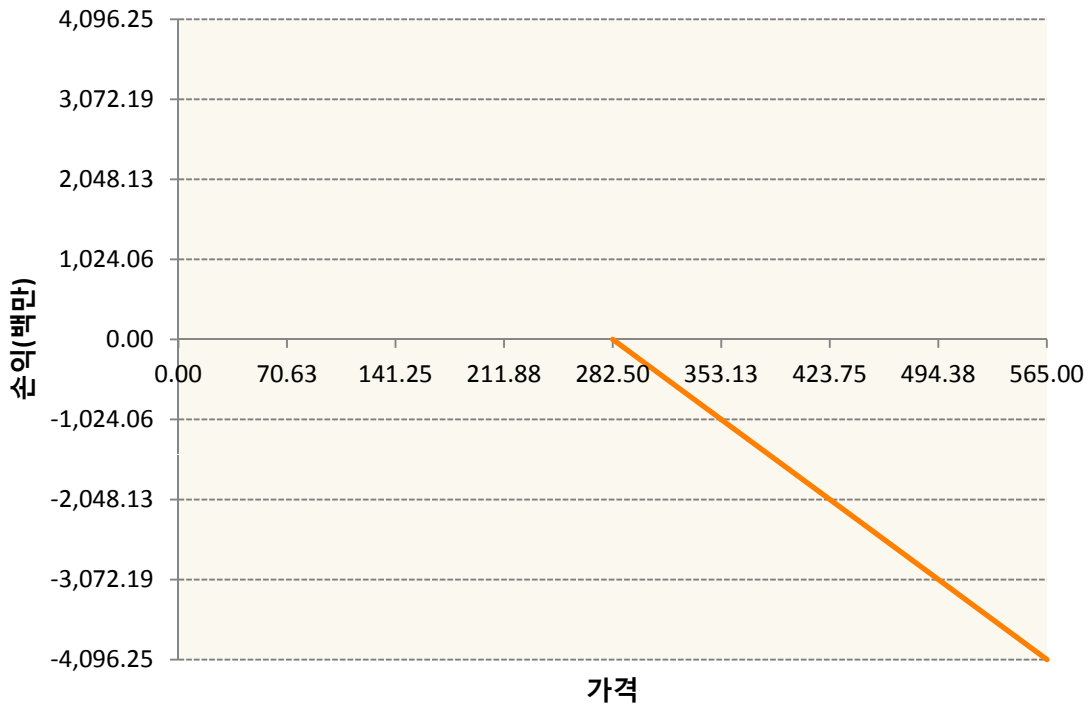


KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

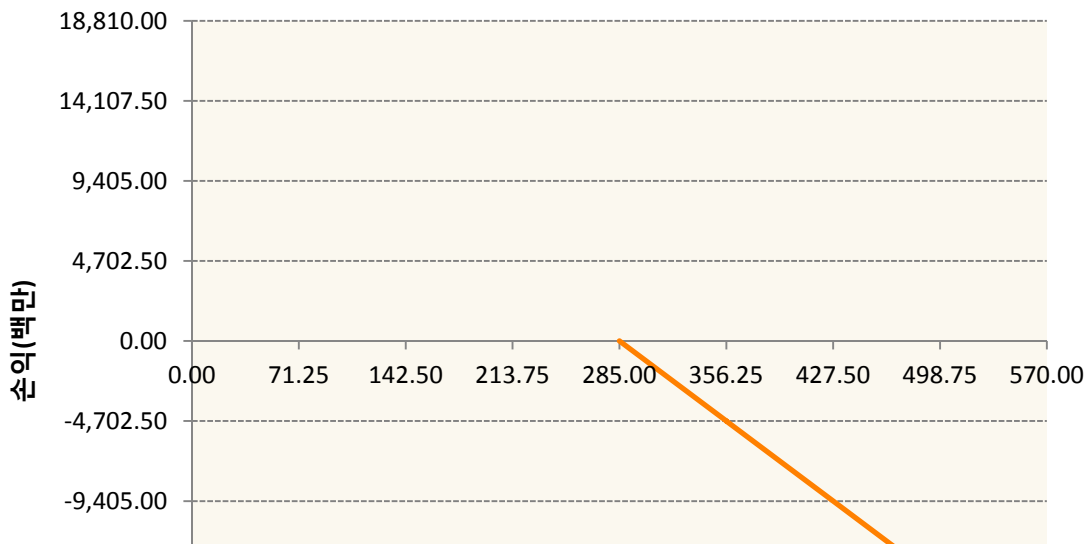


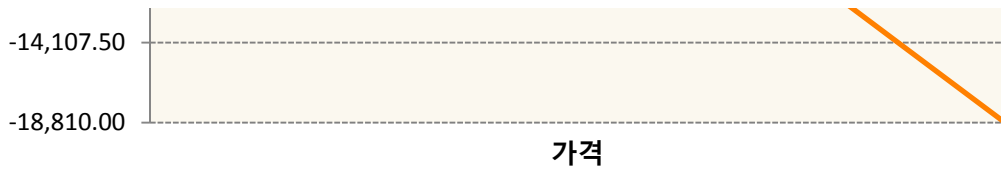


KR4201P62826-2019-06 콜282.5



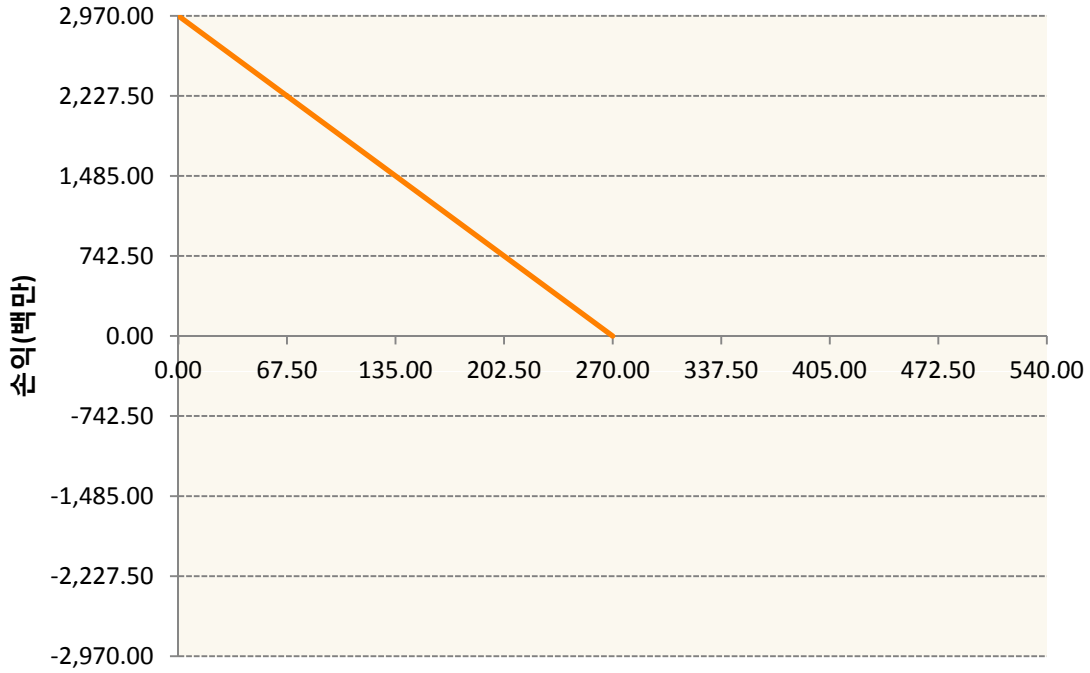
KR4201P62859-2019-06 콜285





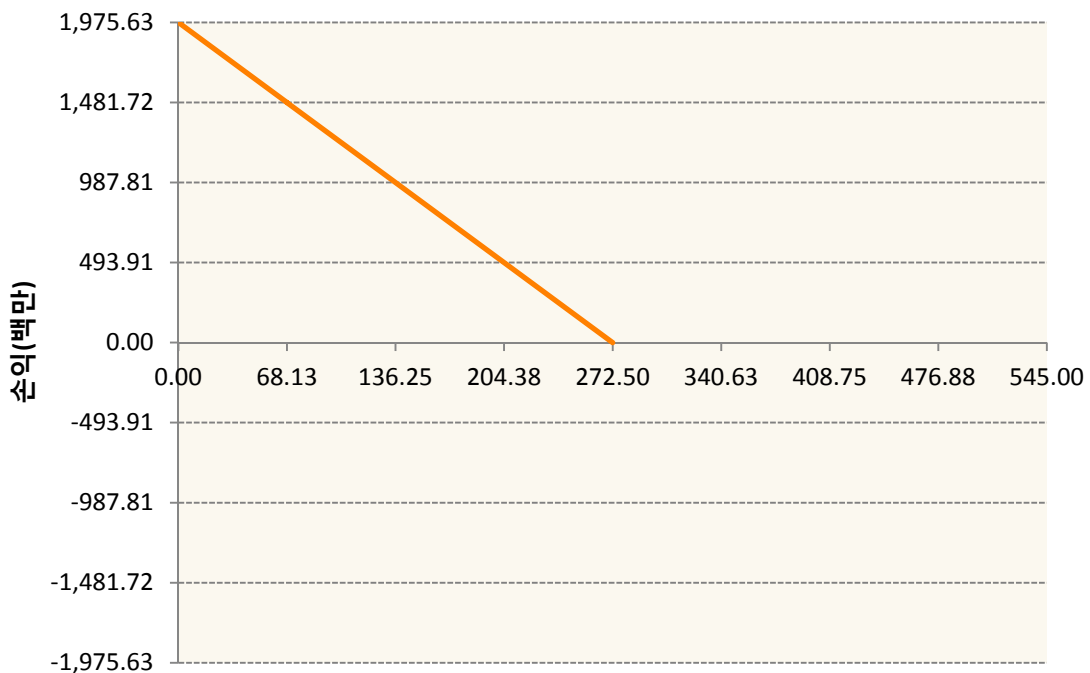
가격

KR4301P62709-2019-06 풋270



가격

KR4301P62725-2019-06 풋272.5



가격

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

KR4101P60004 2019-06 코스피200지수선물							496
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-496	-496	-496	-496	-496	-496	-496
-5.33%	-331	-331	-331	-331	-331	-331	-331
-2.67%	-165	-165	-165	-165	-165	-165	-165
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	165	165	165	165	165	165	165
5.33%	331	331	331	331	331	331	331
8.00%	496	496	496	496	496	496	496
KR4101P90001 2019-09 코스피200지수선물							491
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-491	-491	-491	-491	-491	-491	-491
-5.33%	-327	-327	-327	-327	-327	-327	-327
-2.67%	-164	-164	-164	-164	-164	-164	-164
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	164	164	164	164	164	164	164
5.33%	327	327	327	327	327	327	327
8.00%	491	491	491	491	491	491	491
KR4201P62826 2019-06 콜282.5							175
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-4	-5	-7	-8	-10	-11	-13
5.33%	-70	-71	-71	-72	-73	-74	-75
8.00%	-175	-175	-175	-175	-175	-175	-175
KR4201P62859 2019-06 콜285							633
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-3	-5	-7	-11	-14	-18	-23
5.33%	-173	-179	-186	-193	-200	-207	-214
8.00%	-630	-630	-631	-631	-631	-632	-633

KR4301P62709		2019-06 풋270						209
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	209	209	209	209	209	209	209	
-5.33%	129	129	129	129	129	129	129	
-2.67%	49	49	49	49	49	49	49	
0%	-1	-1	0	0	0	1	1	
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	
KR4301P62725		2019-06 풋272.5						151
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	151	151	151	151	151	151	151	
-5.33%	98	98	98	98	98	98	98	
-2.67%	46	46	46	46	46	46	46	
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2	
2.67%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5	
5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5	
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5	

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

(단위:백만원)

1,134

공시일	2019-06-13
기준일	2019-06-12

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	237	0	237	
누계	유가증권	수익증권	18,748	0	18,748	

### 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	2019-06-13
기준일	2019-06-12

## H2O글로벌본드(UH)(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	58,591	0	58,591	

### 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	2019-06-13
기준일	2019-06-12

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	4,730	0	4,730	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	355,843	0	355,843	
누계	통화	선도	0	385,055	-385,055	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		946
FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E		378
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		76
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		995
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E		1,022
FX21019K00 KRW/USD 18-06-19E		568
FX21019K01 KRW/USD 14-06-19E		662
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		568
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		473
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		568
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,419
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,325
FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E		473
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E		795
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E		632
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		473
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		378
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		795
FX21019K02 KRW/USD 24-06-19E		378
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E		946
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E		1,514
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E		284
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E		1,230
FX21019K04 KRW/USD 28-06-19E		1,287
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		662

FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	568
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	757
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	757
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	473
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	284
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	946
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	189
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	880
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	1,050
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	1,892
FX21019M00 KRW/USD 15-07-19E	473
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	378
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	662
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	946
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	662
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	662

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

(단위:백만원)

**10,268**

공시일	2019-06-13
기준일	2019-06-12

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

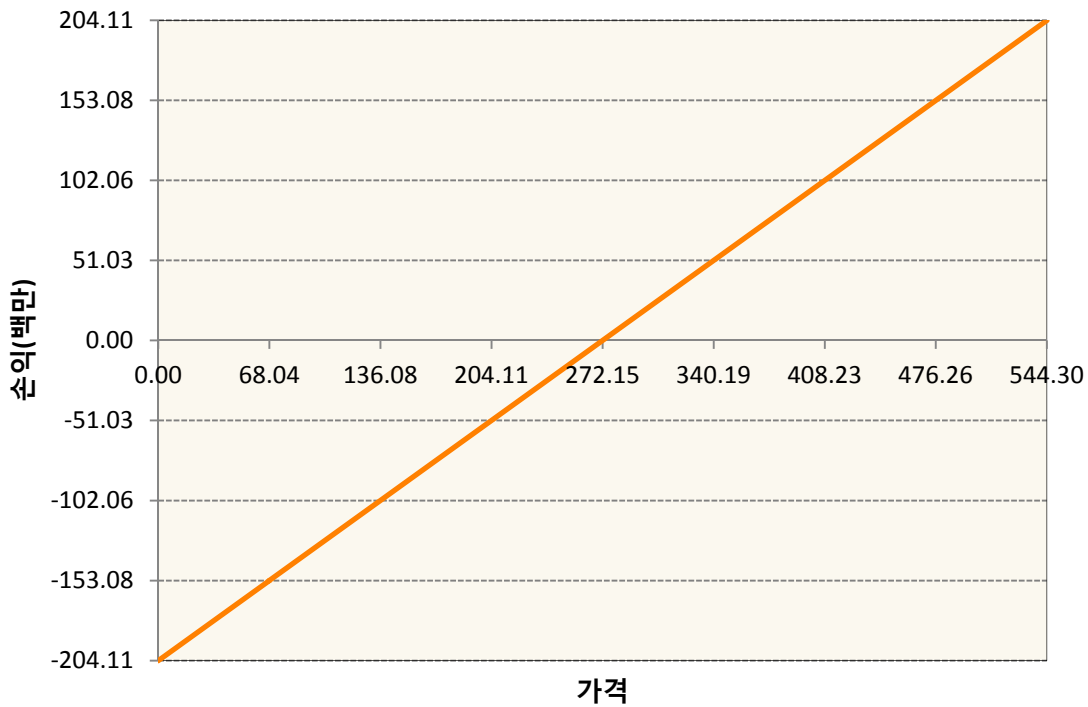
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

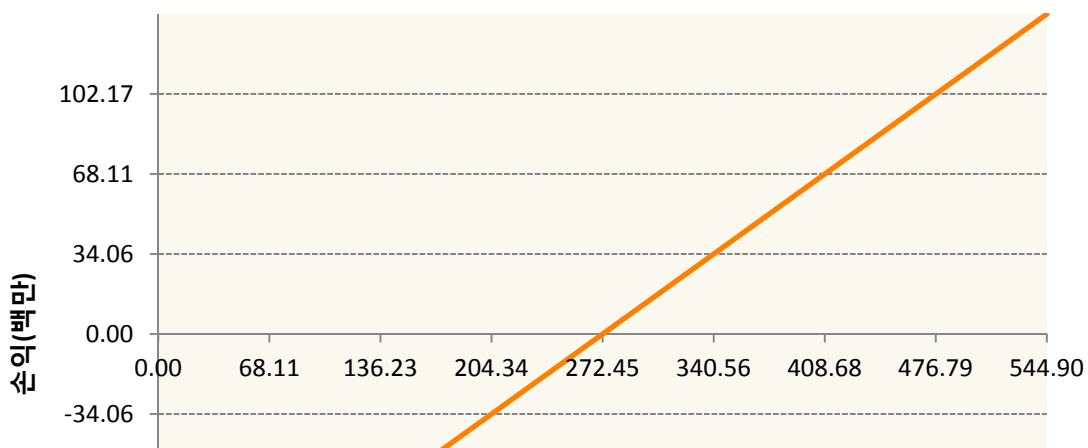
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,626	136	1,490	장내
누계	유가증권	선물	1,825	0	1,825	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물





-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	11	11	11	11	11	11	11
KR4111P70002                      2019-07 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)

**162**

공시일	2019-06-13
기준일	2019-06-12

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

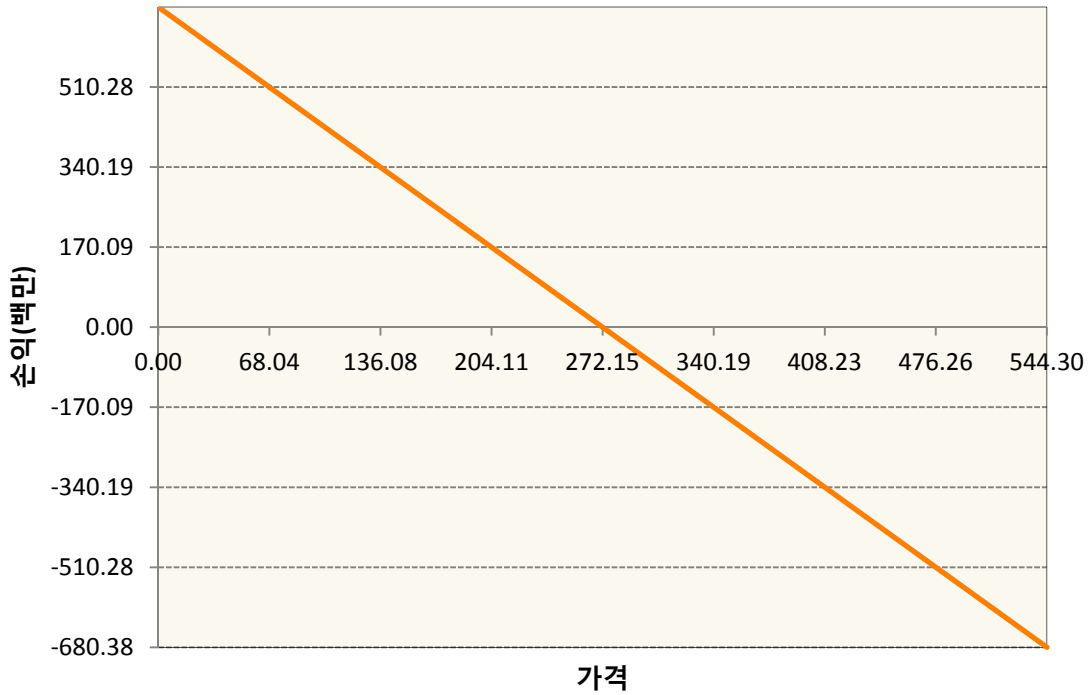
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

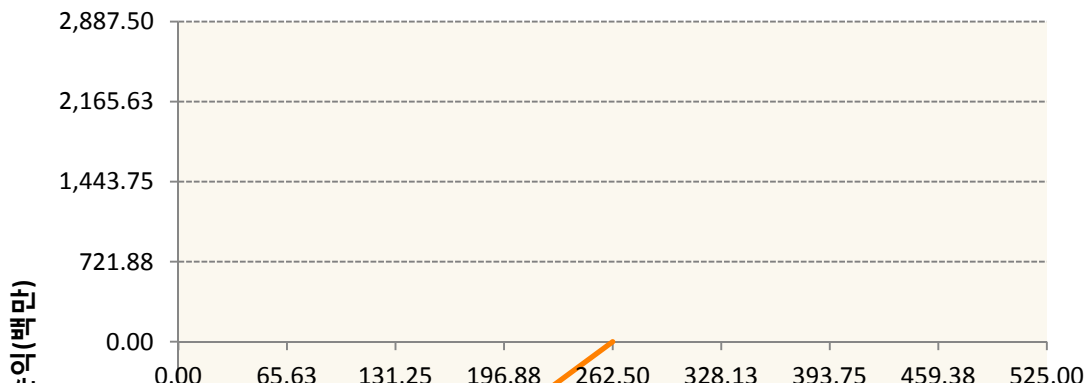
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	680	-680	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,351	-3,351	장내

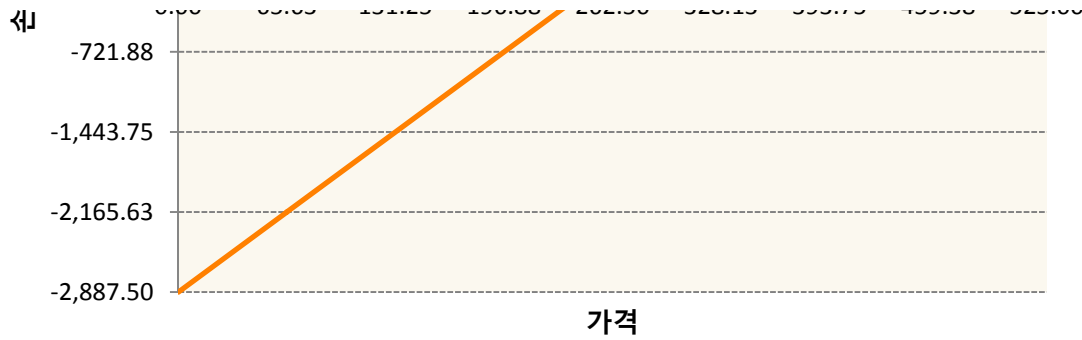
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

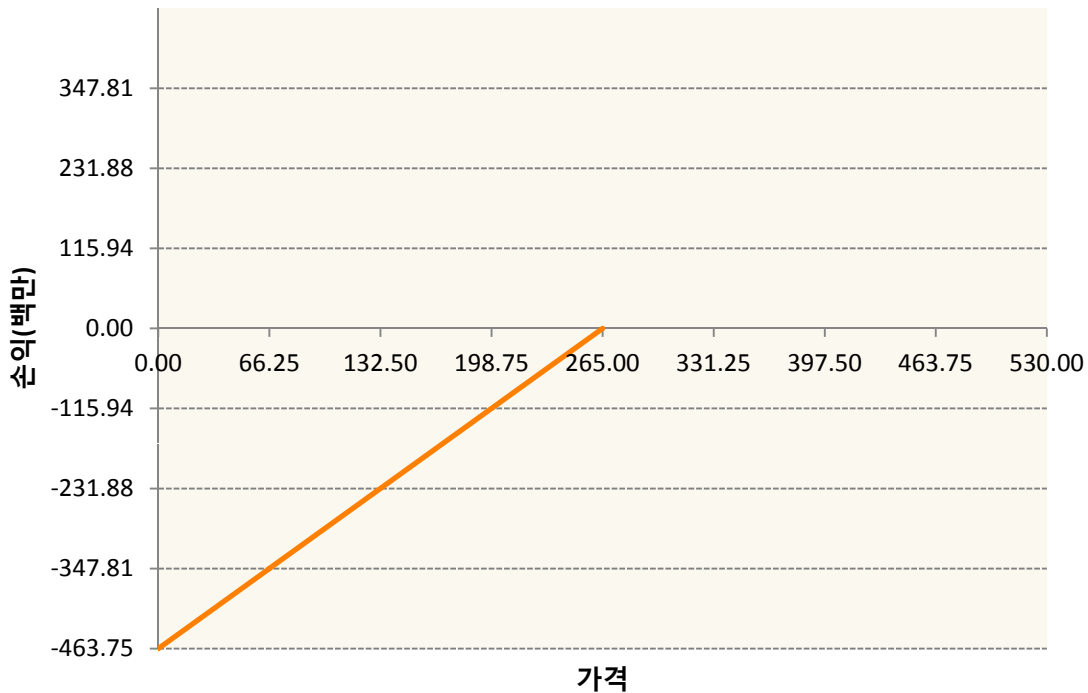


KR4301P62626-2019-06 풋262.5





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						127
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127
-5.33%	-47	-47	-48	-48	-48	-48	-48
-2.67%	0	0	0	-1	-1	-1	-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

KR4301P62659

2019-06 풋265

25

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%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
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)

64

공시일	2019-06-13
기준일	2019-06-12

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

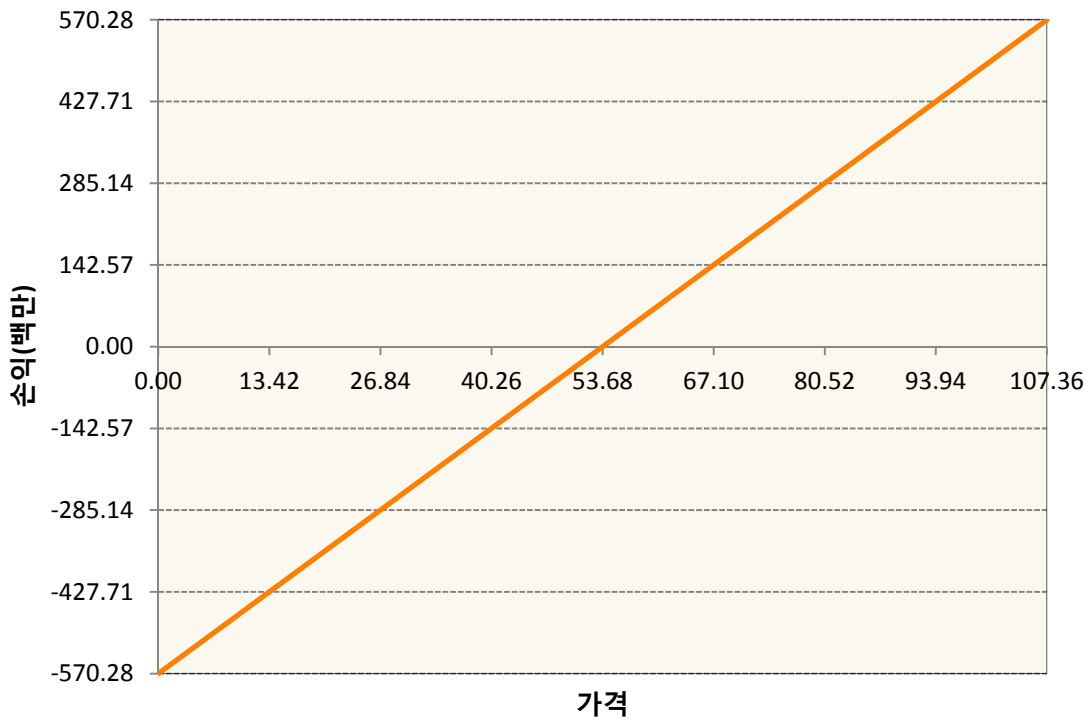
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

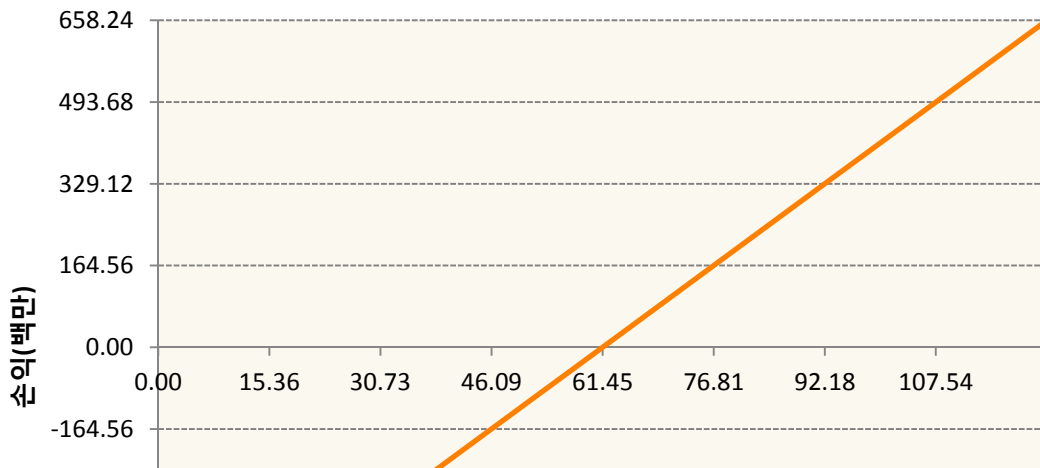
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,519	118	2,400	

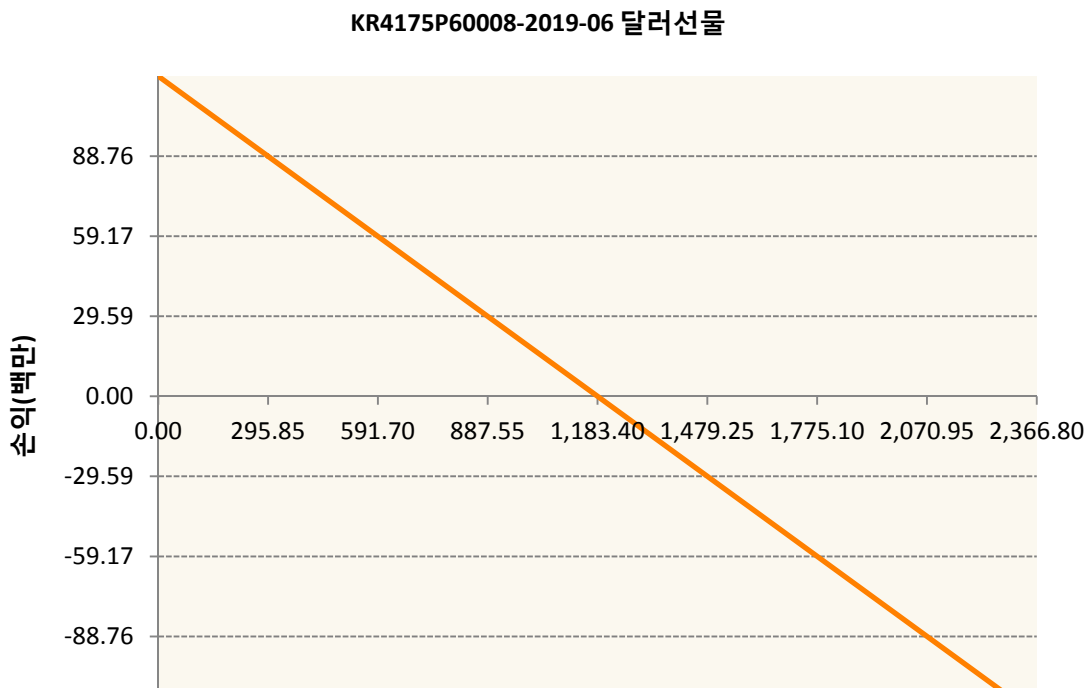
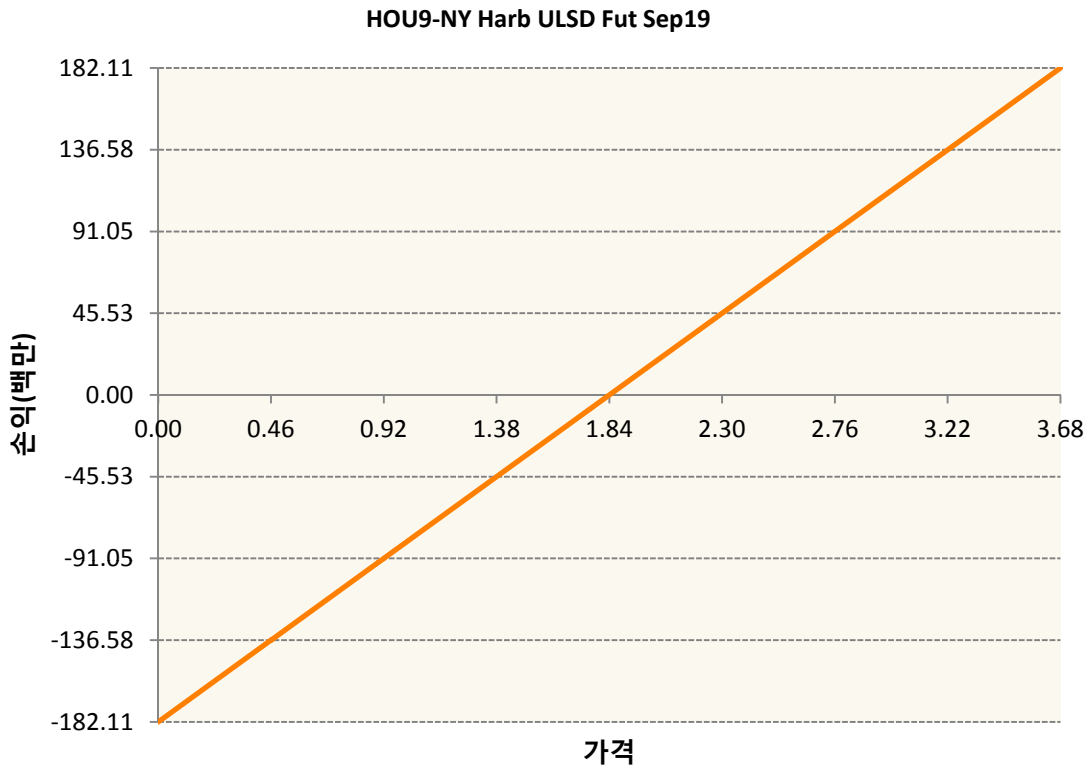
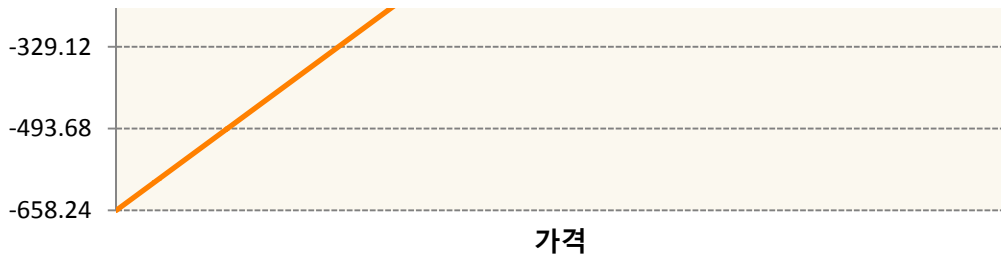
### 2. 만기시점의 손익구조

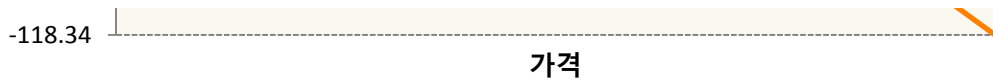
CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19



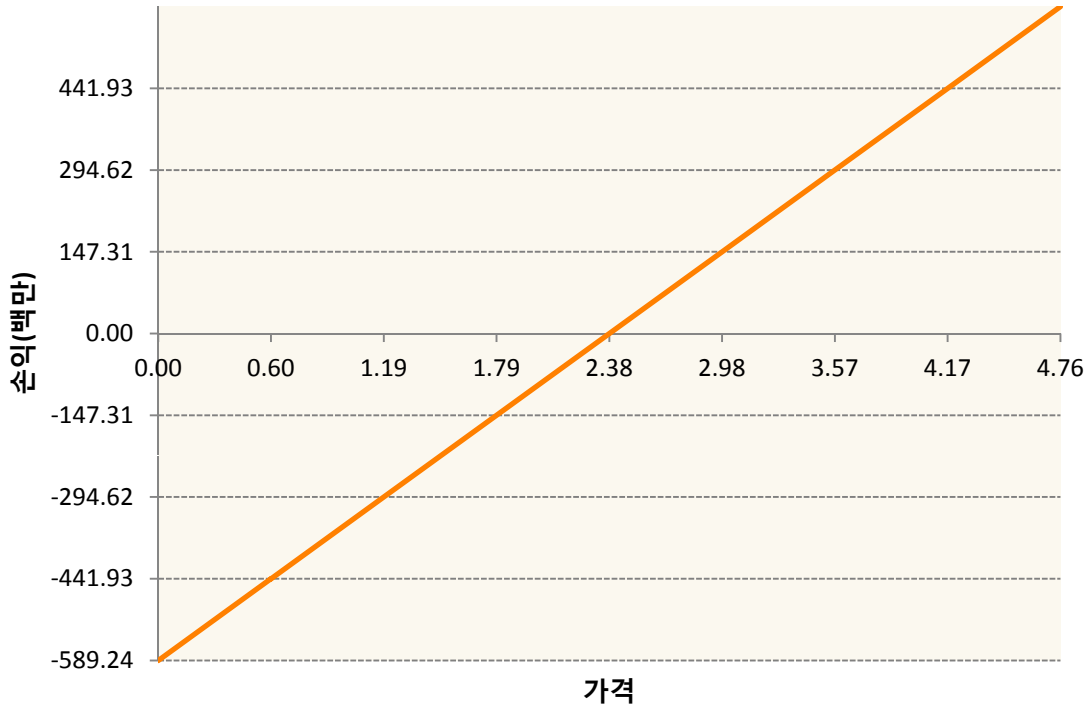
COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19



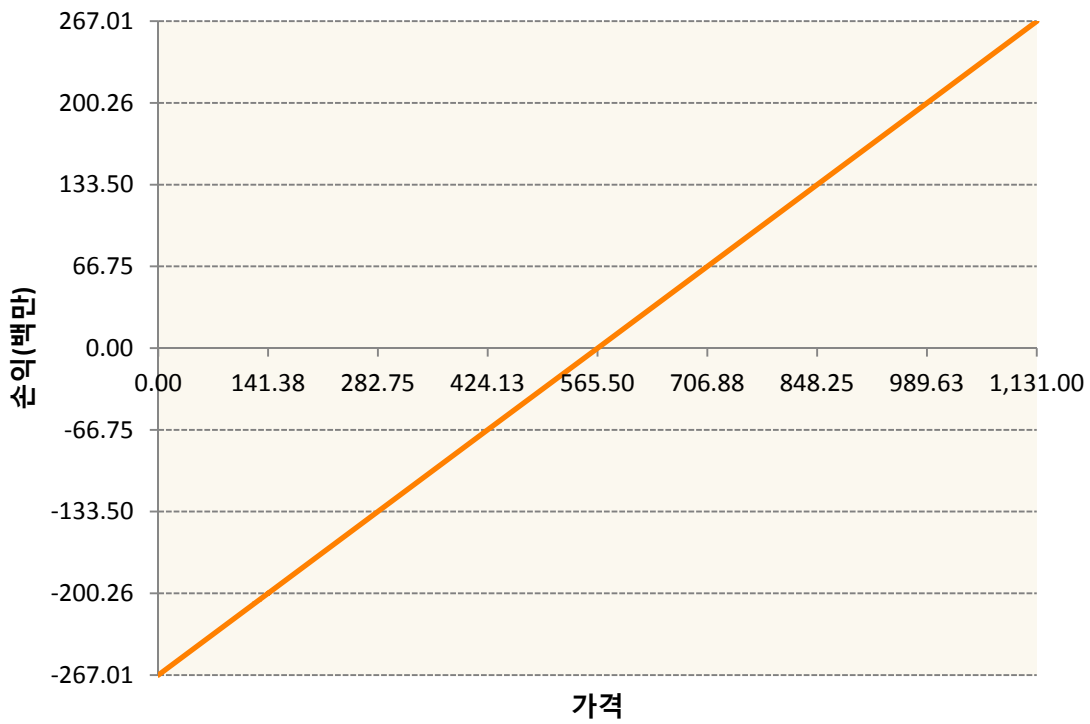




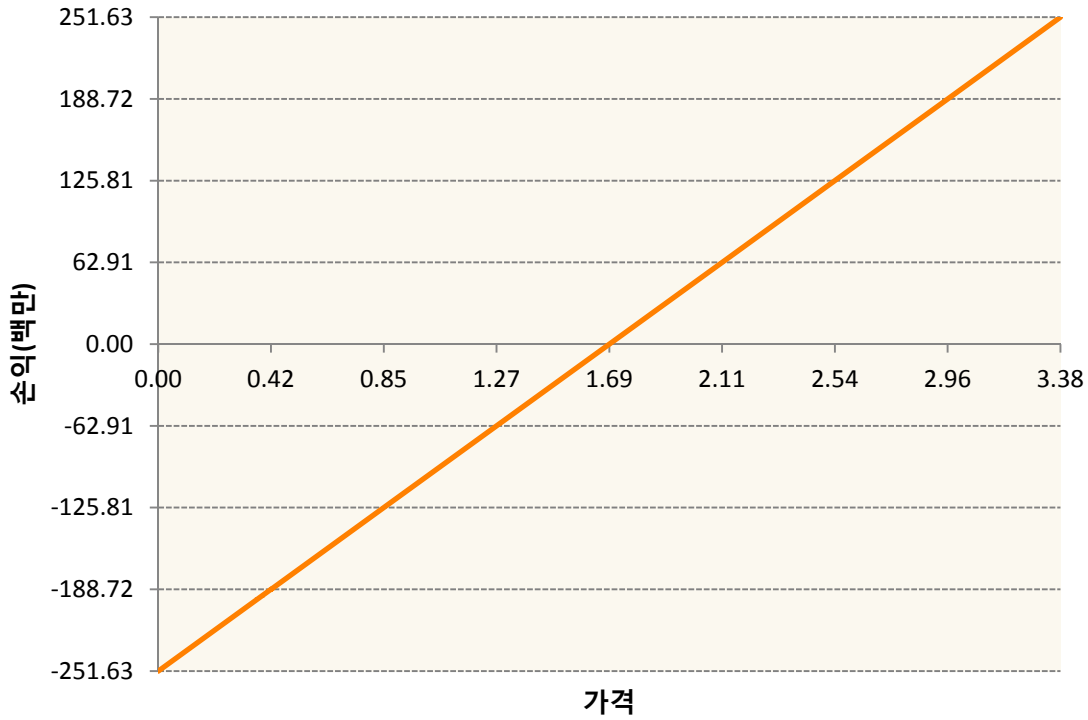
NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



QSU9-Low Su Gasoil G 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	15
KR4175P600	2019-06 달러선물	9
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	47
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	21
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	20

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

(단위:백만원)

373

공시일	2019-06-13
기준일	2019-06-12

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

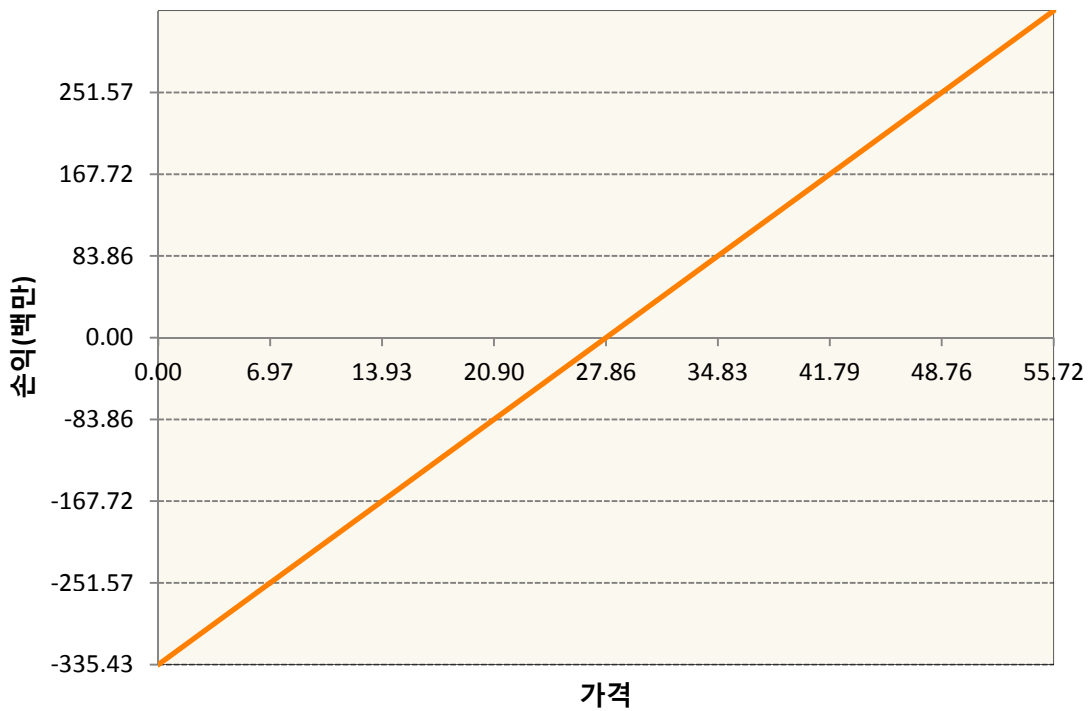
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

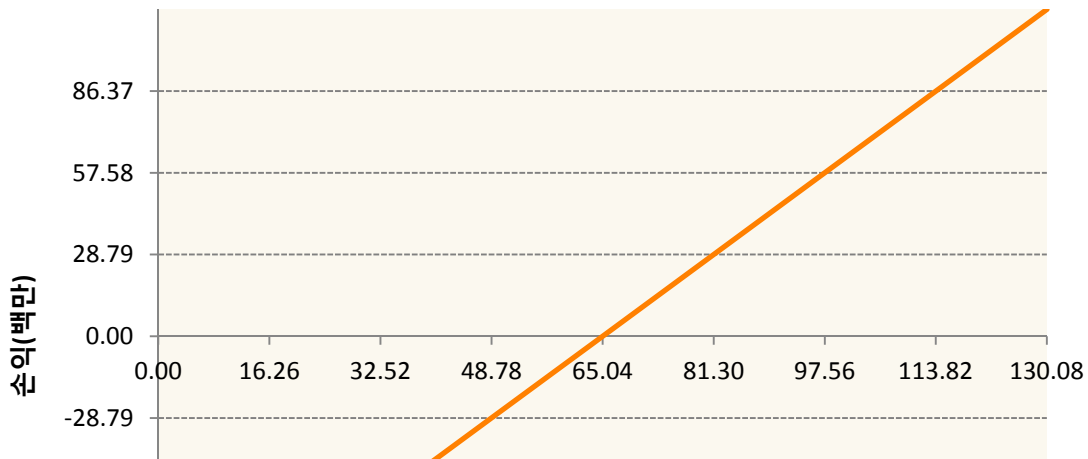
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,234	201	3,032	

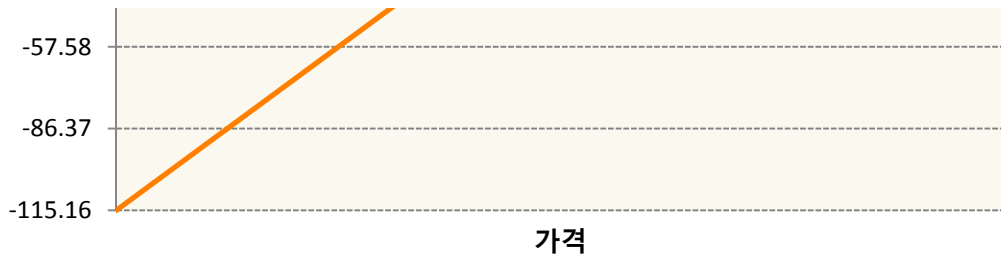
### 2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

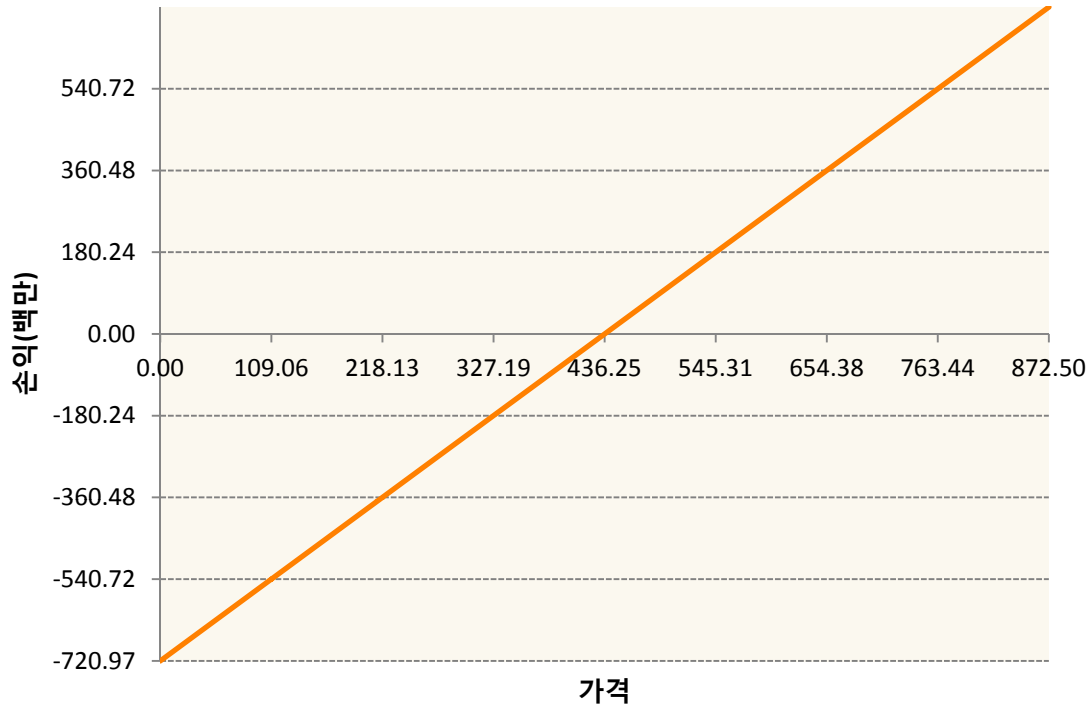


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

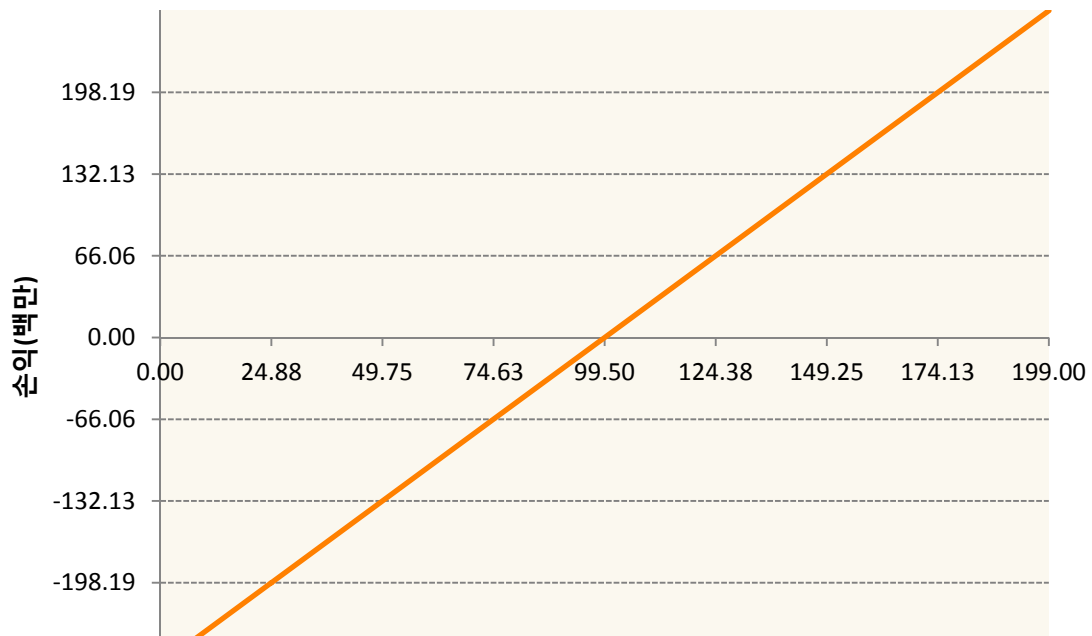


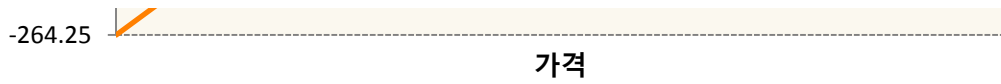


CU9-CORN FUTURE Sep19



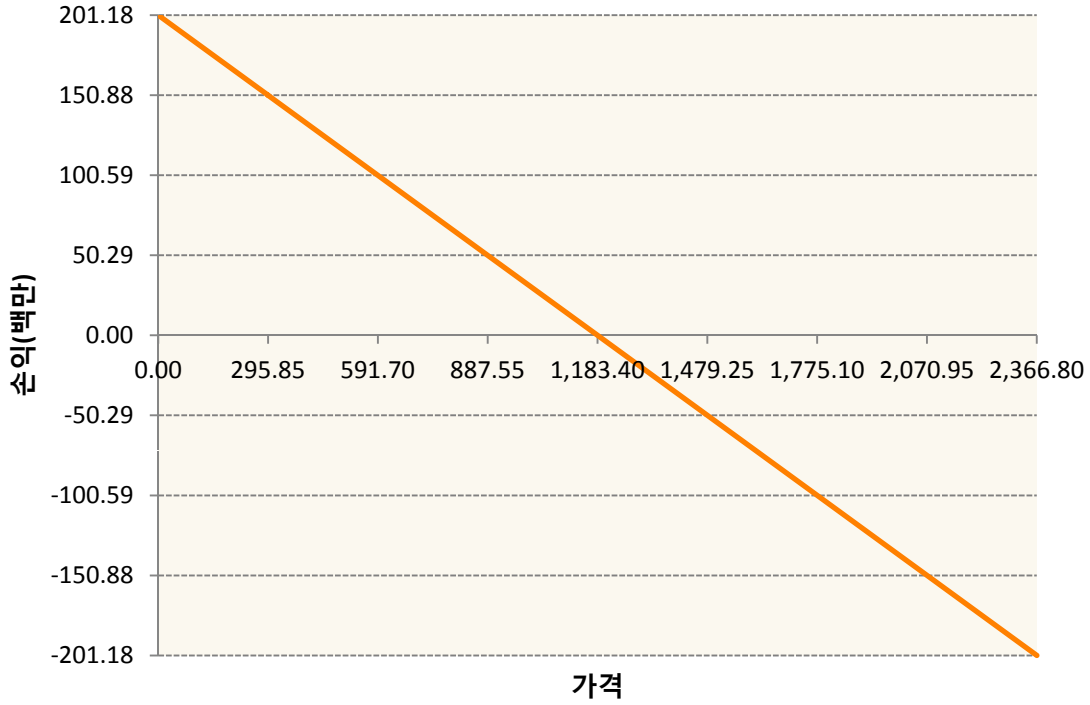
KCU9-COFFEE 'C' FUTURE Sep19





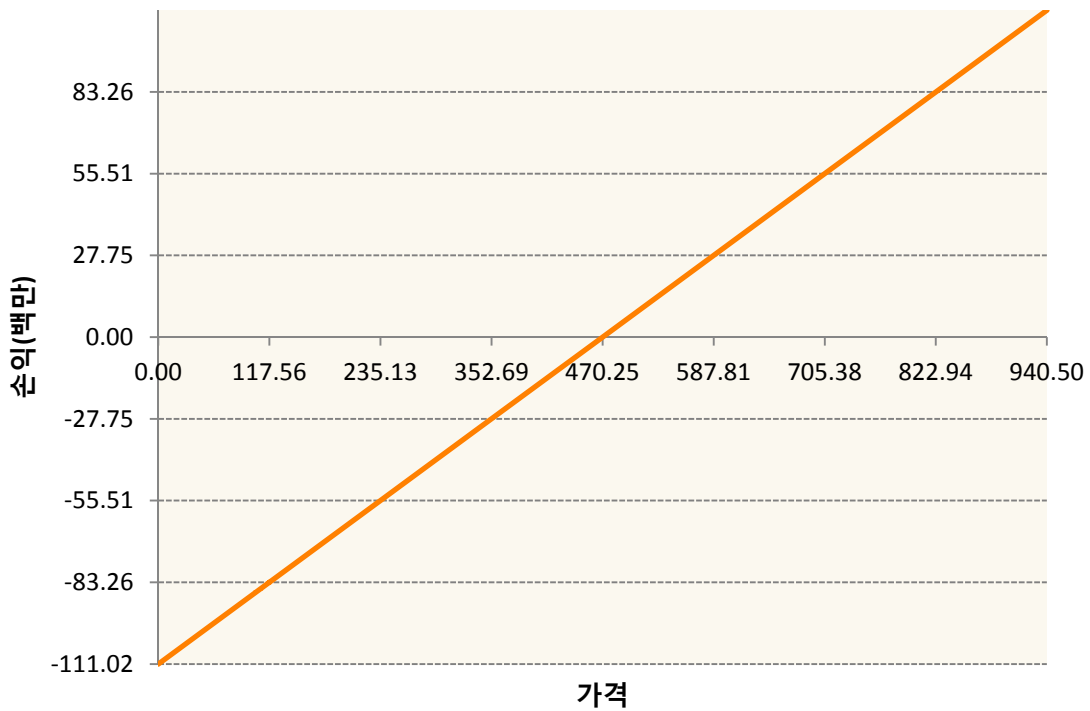
가격

KR4175P60008-2019-06 달러선물



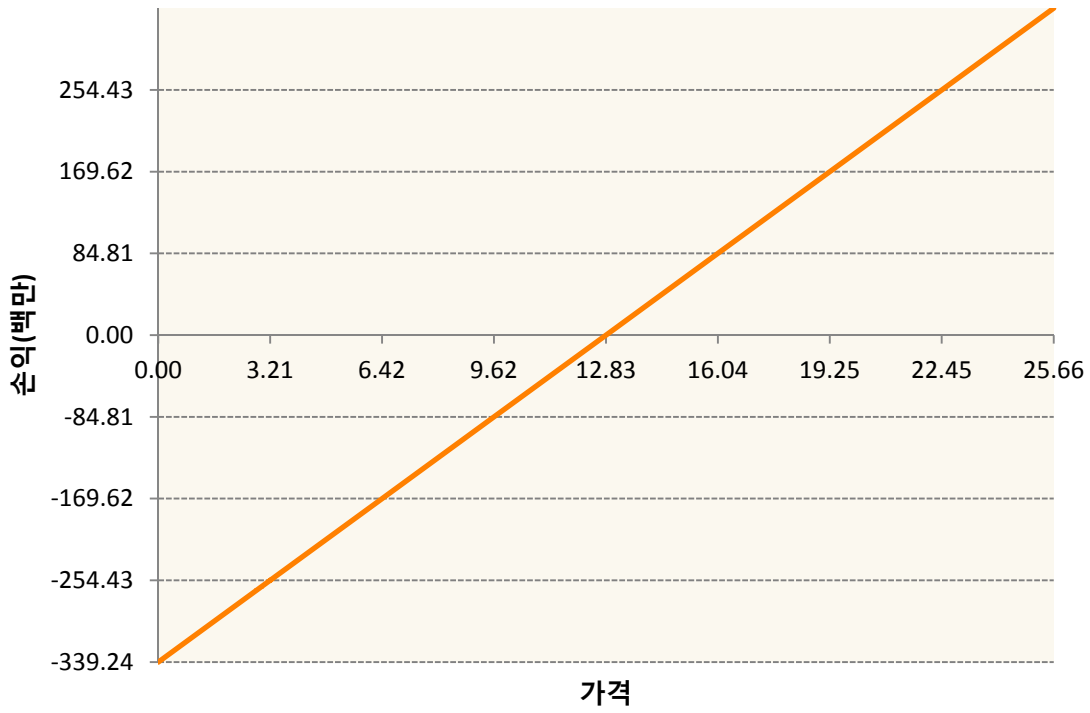
가격

KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19

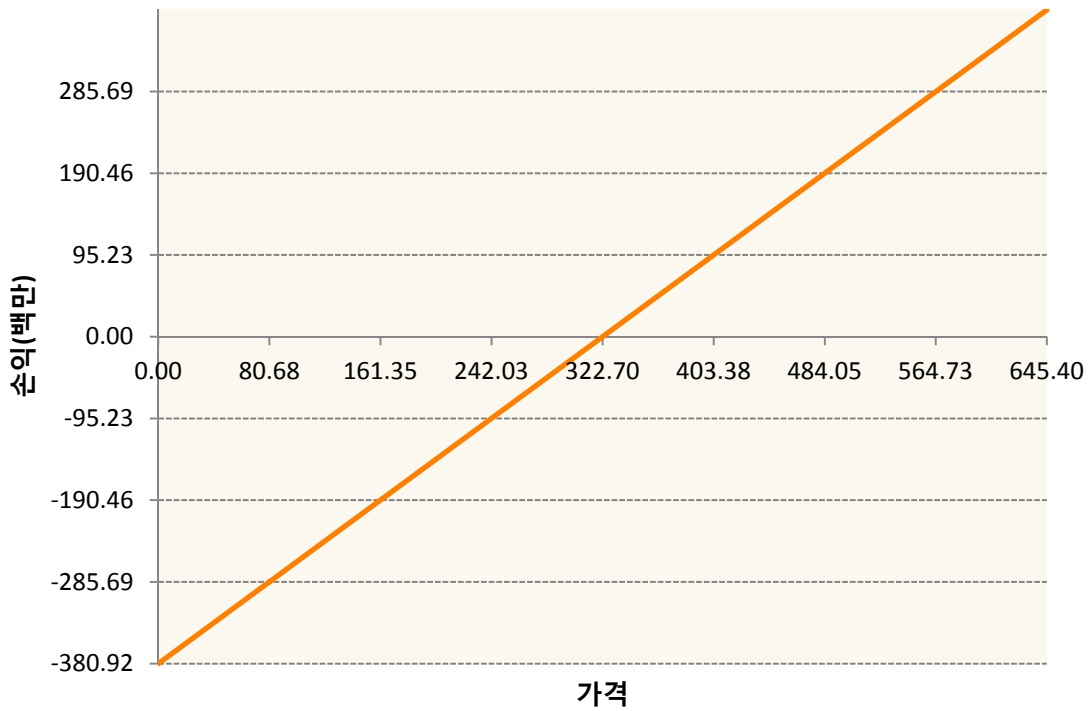


가격

SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

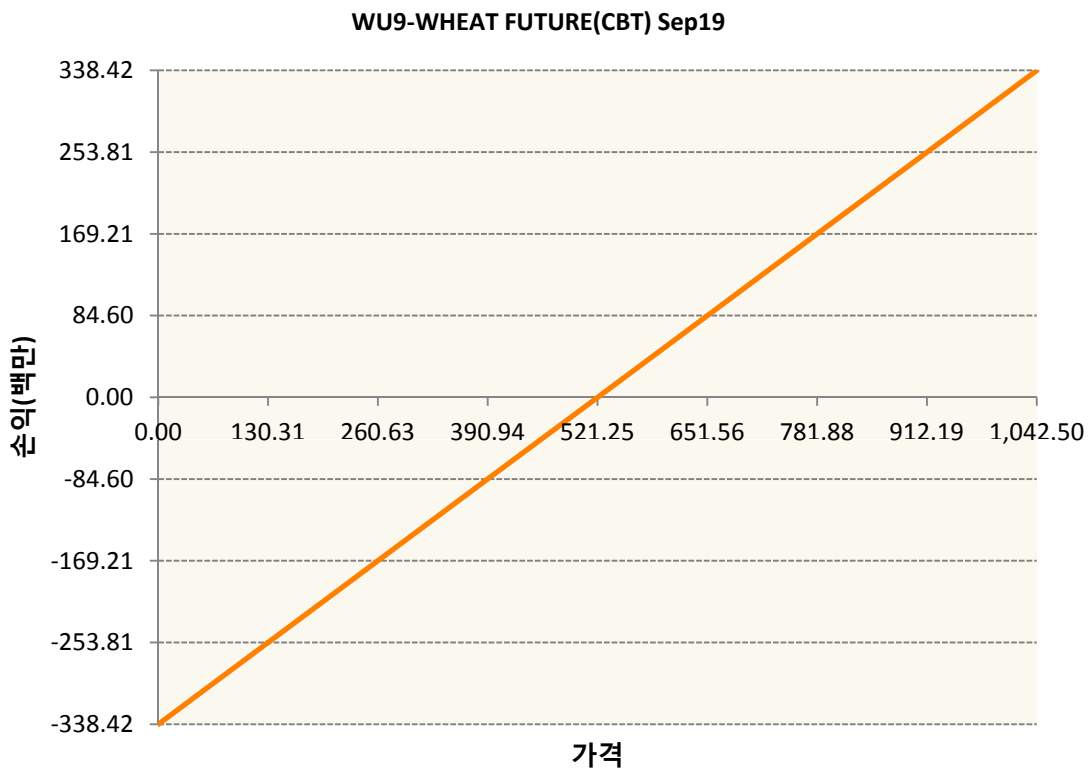
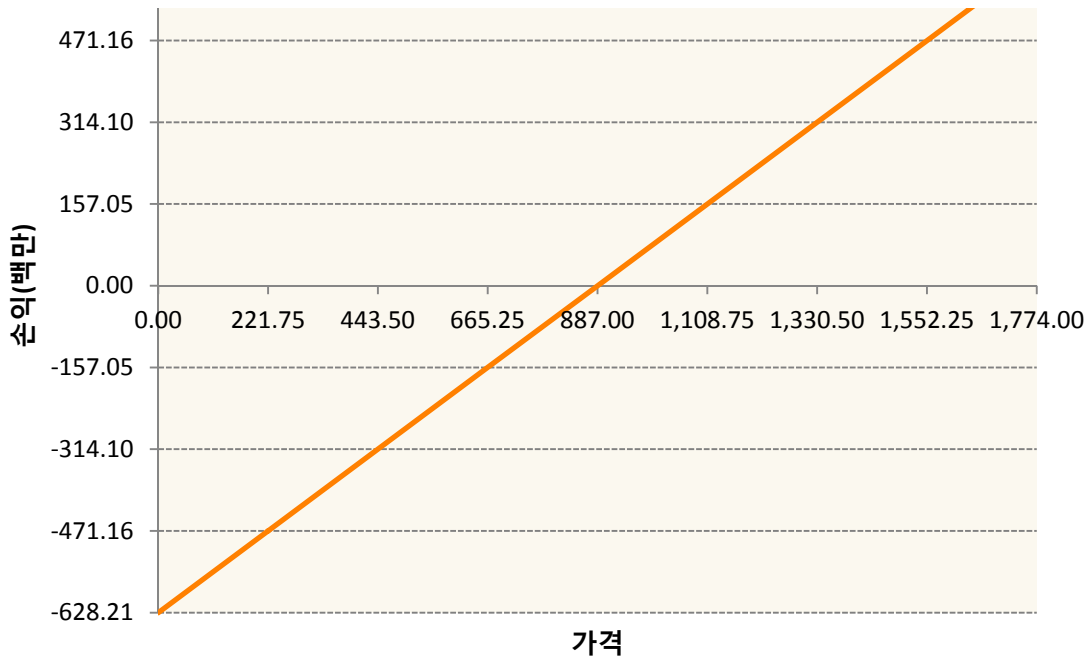


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	27
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	9
CU9	CORN FUTURE Sep19	58
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)

277