

공시일	2019-06-17
기준일	2019-06-14

포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

91

공시일	2019-06-17
기준일	2019-06-14

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

1,144

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

692

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-17
기준일	2019-06-14

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)	370
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	136

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

853

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-17
기준일	2019-06-14

유로인덱스모(주식-파생형)

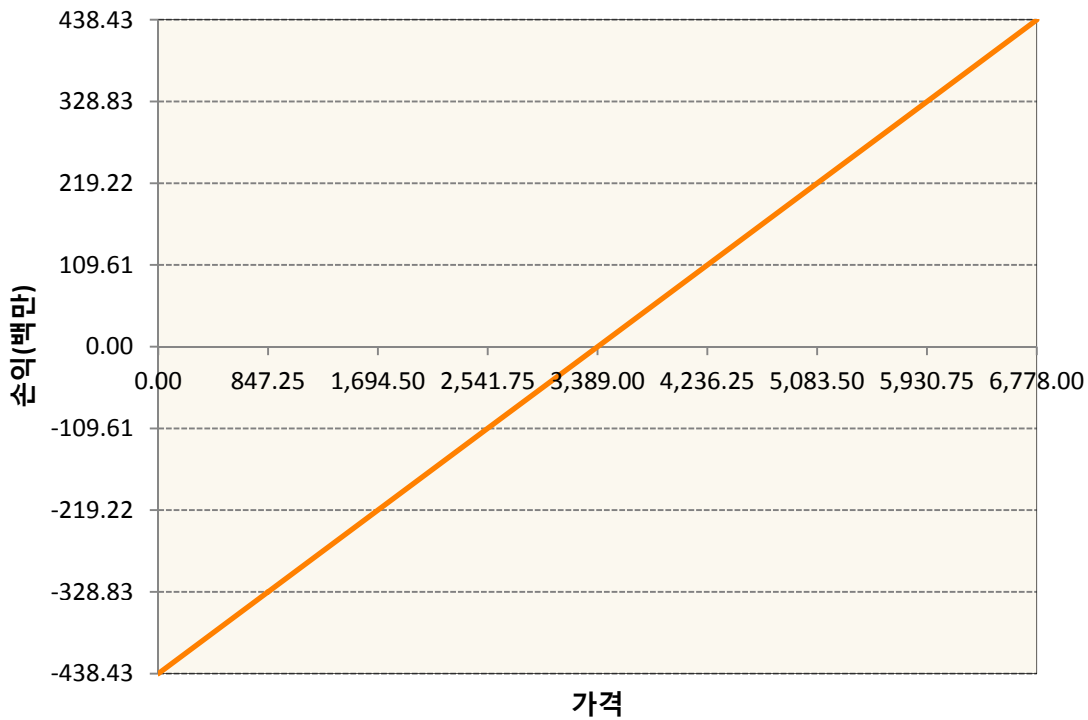
1. 계약금액

(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)

26

공시일	2019-06-17
기준일	2019-06-14

차이나인덱스모(주식-파생형)

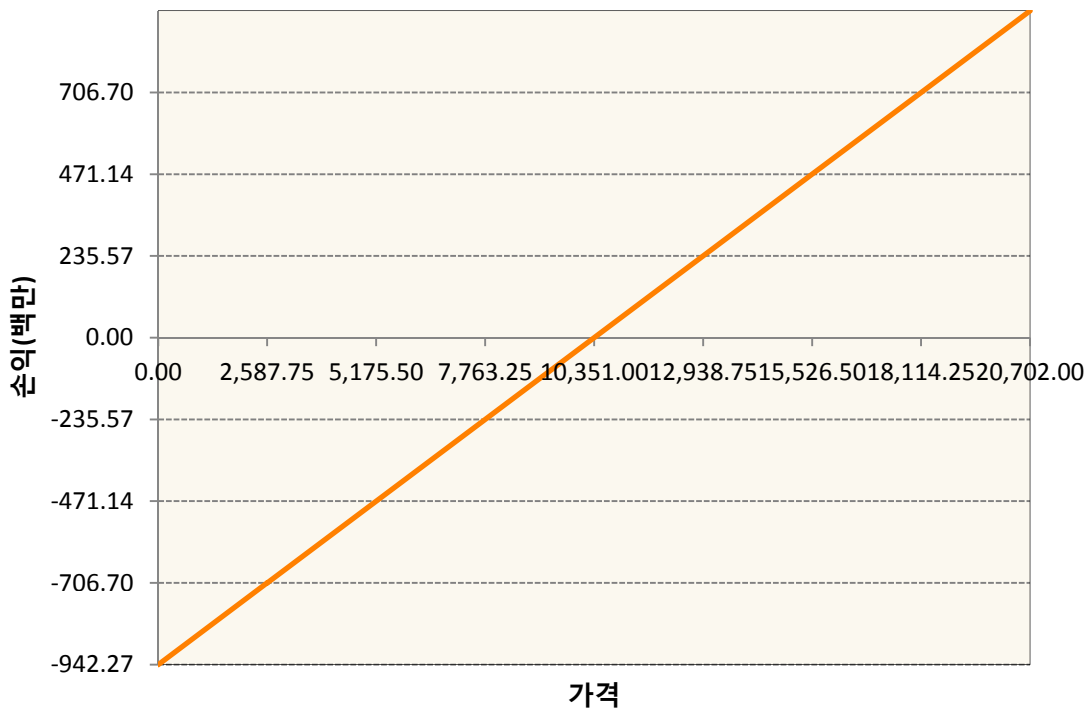
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	942	0	942	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM9	HSCEI Futures Jun19	75
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

77

공시일	2019-06-17
기준일	2019-06-14

커버드콜모(주식혼합-파생형)

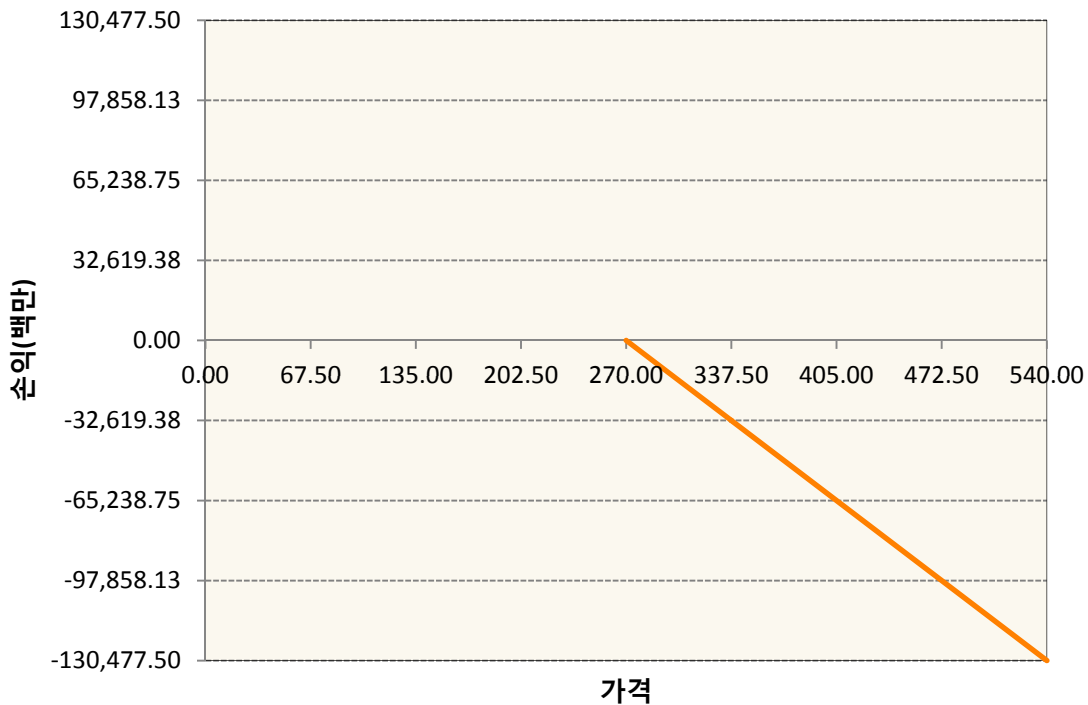
1. 계약금액

(단위:백만원)

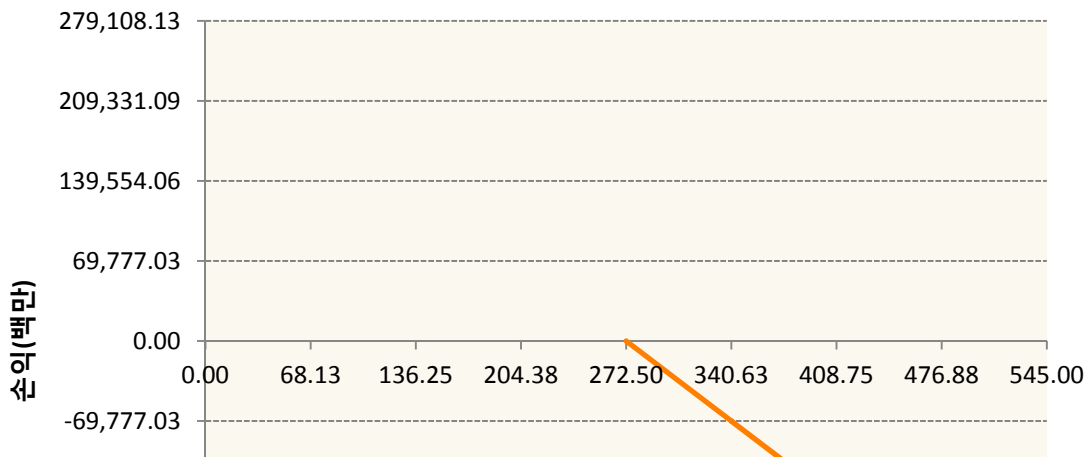
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	415,200	-415,200	장내
누계	유가증권	옵션	0	612,086	-612,086	장내

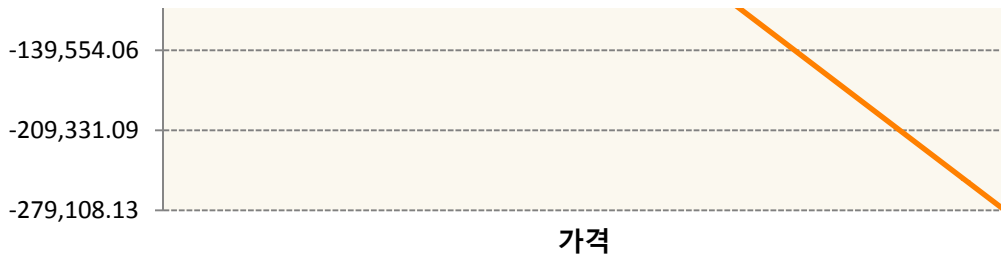
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P72700-2019-07 콜270

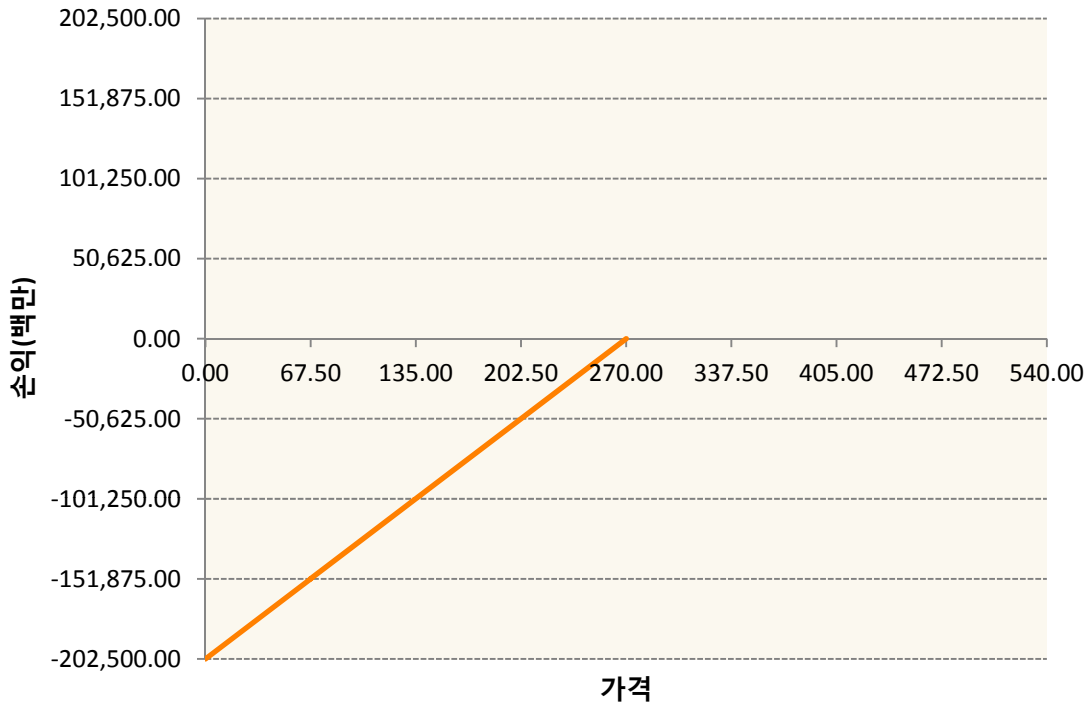


KR4201P72726-2019-07 콜272.5





KR4301P72708-2019-07 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P72700		2019-07 콜270					8,080	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,506	3,414	3,301	3,169	3,020	2,856	2,680	
-5.33%	3,152	2,972	2,776	2,567	2,347	2,118	1,882	
-2.67%	2,346	2,083	1,813	1,540	1,264	985	703	
0%	898	598	299	0	-299	-598	-897	
2.67%	-1,250	-1,517	-1,791	-2,069	-2,351	-2,636	-2,923	
5.33%	-3,987	-4,178	-4,387	-4,610	-4,844	-5,087	-5,338	
8.00%	-7,117	-7,229	-7,364	-7,519	-7,692	-7,879	-8,080	
KR4201P72726		2019-07 콜272.5					16,296	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	6,354	6,204	6,010	5,775	5,504	5,199	4,864	

-5.33%	5,808	5,489	5,129	4,735	4,313	3,867	3,401
-2.67%	4,470	3,959	3,429	2,883	2,326	1,758	1,184
0%	1,894	1,264	632	0	-633	-1,266	-1,900
2.67%	-2,151	-2,762	-3,380	-4,001	-4,627	-5,255	-5,885
5.33%	-7,549	-8,023	-8,526	-9,051	-9,594	-10,152	-10,721
8.00%	-13,927	-14,227	-14,573	-14,959	-15,378	-15,825	-16,296
KR4301P72708 2019-07 풋270							13,060
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,861	-12,871	-12,887	-12,913	-12,950	-12,999	-13,060
-5.33%	-7,543	-7,606	-7,687	-7,785	-7,900	-8,029	-8,170
-2.67%	-2,700	-2,890	-3,092	-3,304	-3,523	-3,748	-3,978
0%	809	539	270	0	-270	-539	-809
2.67%	2,524	2,336	2,134	1,922	1,702	1,475	1,242
5.33%	3,034	2,965	2,877	2,770	2,647	2,508	2,356
8.00%	3,122	3,108	3,085	3,049	3,000	2,937	2,861

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

(단위:백만원)

37,170

공시일	2019-06-17
기준일	2019-06-14

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

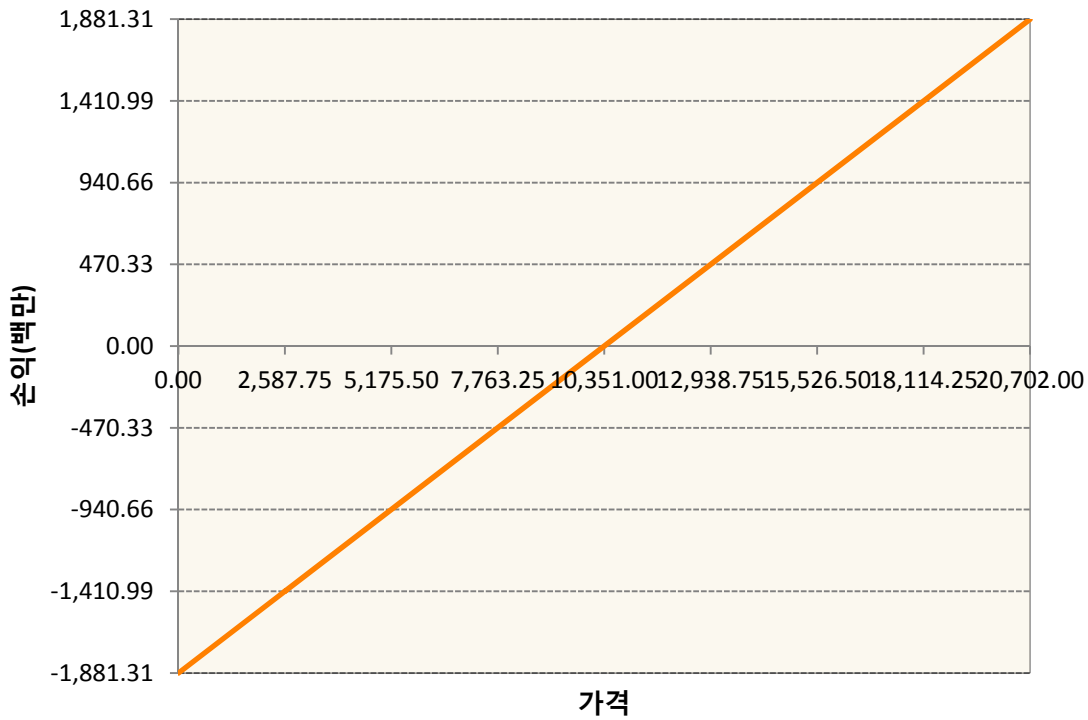
1. 계약금액

(단위:백만원)

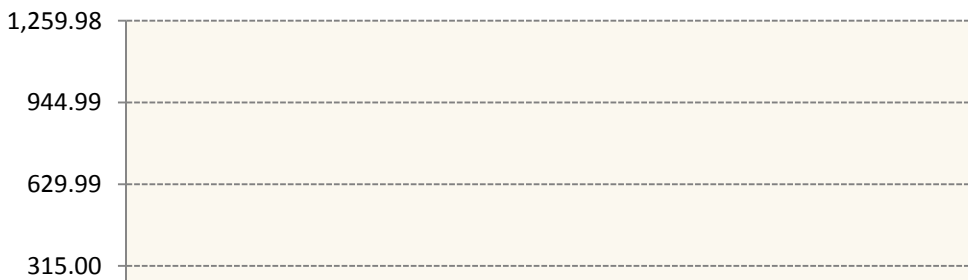
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,881	0	1,881	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,064	-5,064	장내
누계	통화	선도	151	3,180	-3,029	장외

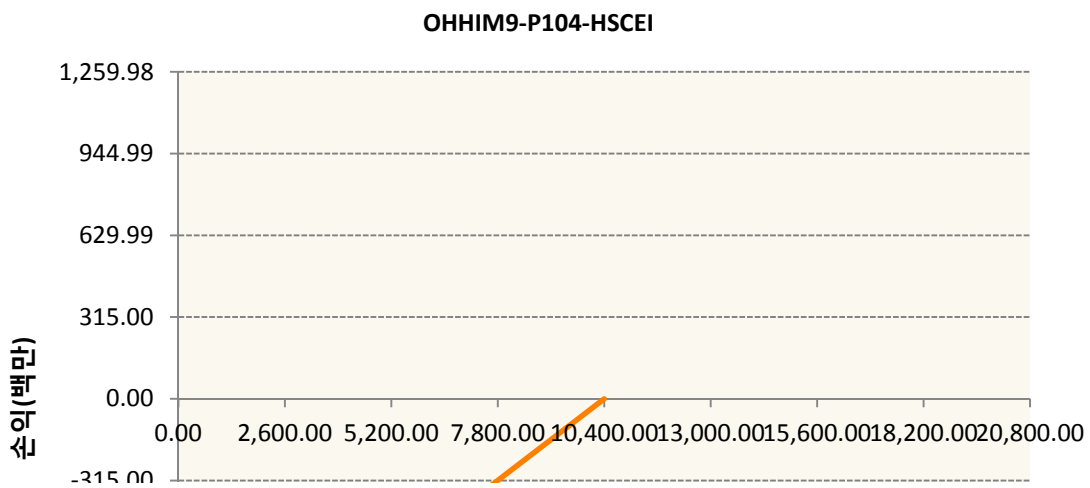
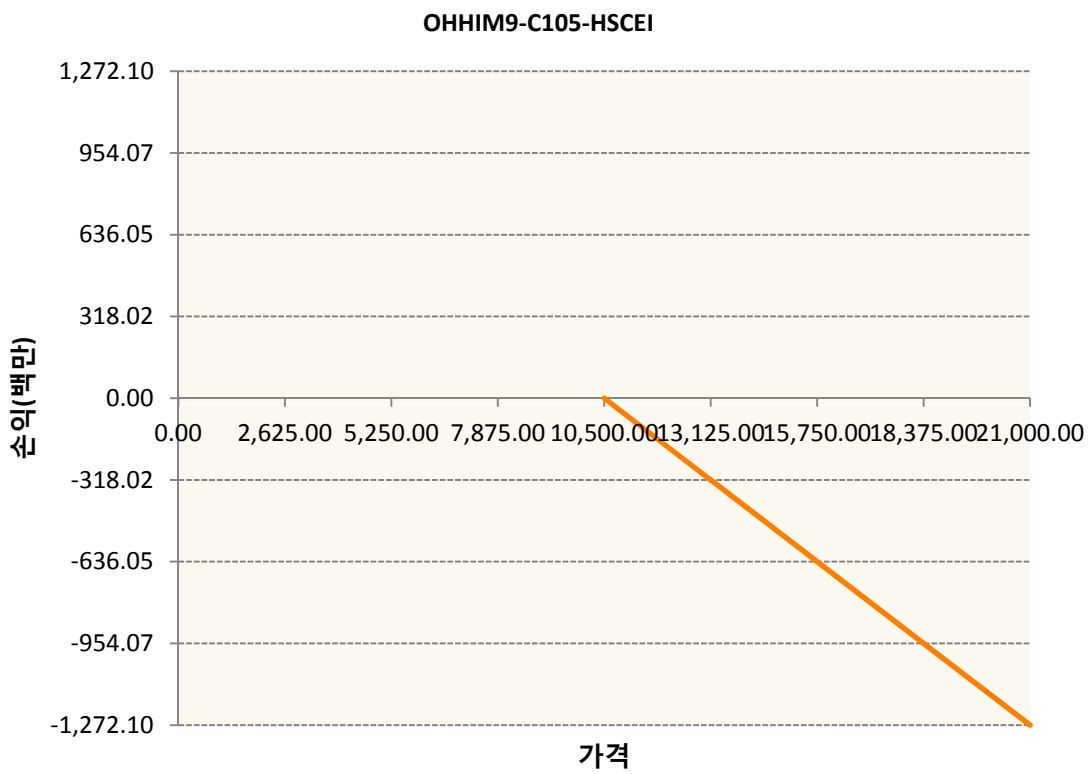
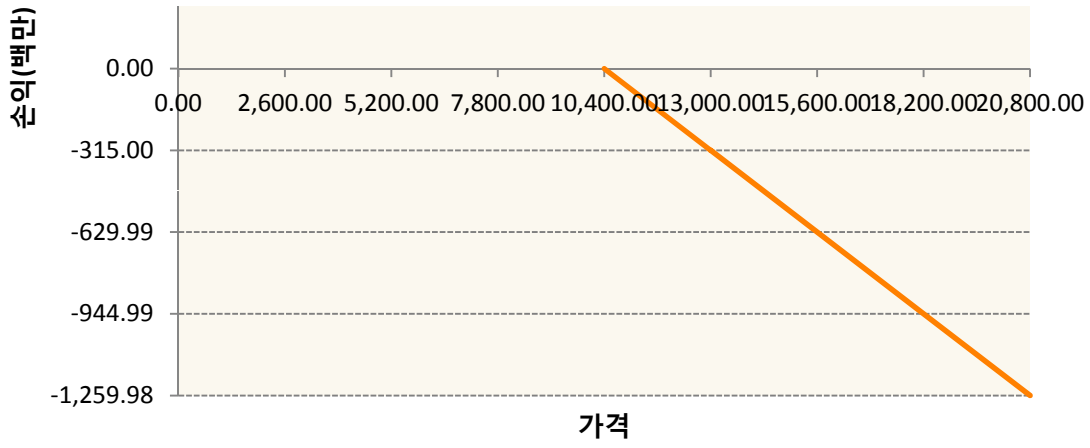
2. 만기시점의 손익구조

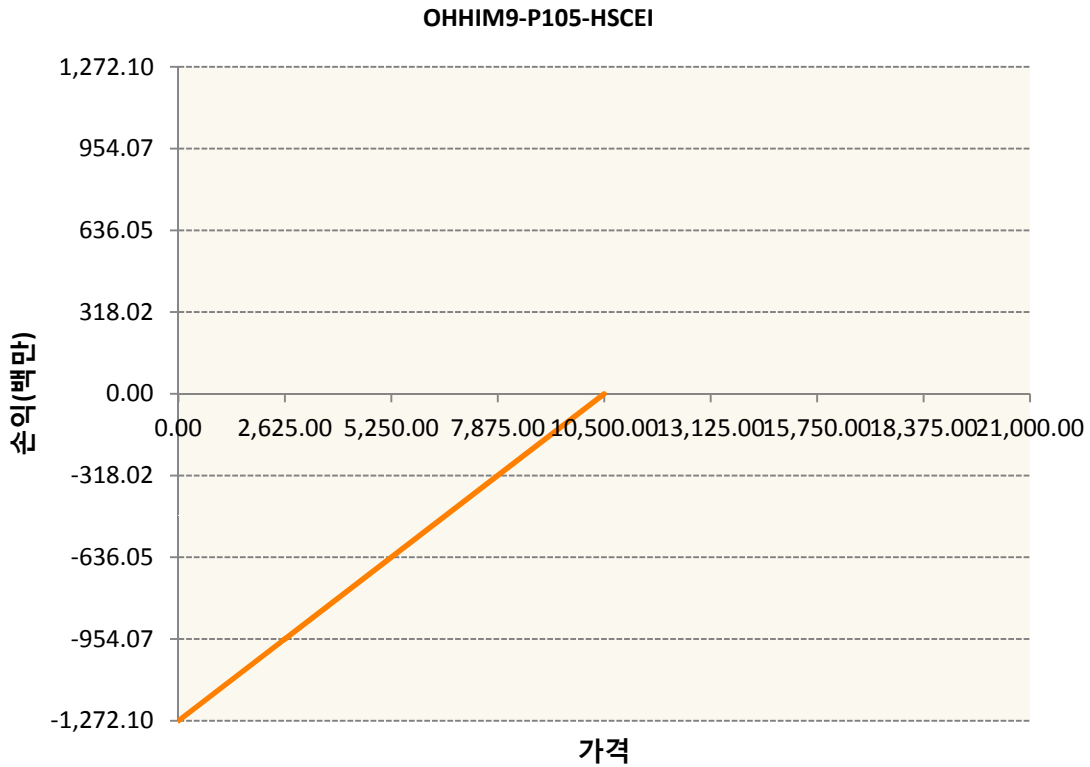
HCM9-HSCEI Futures Jun19



OHHIM9-C104-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	2019-06-17
기준일	2019-06-14

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

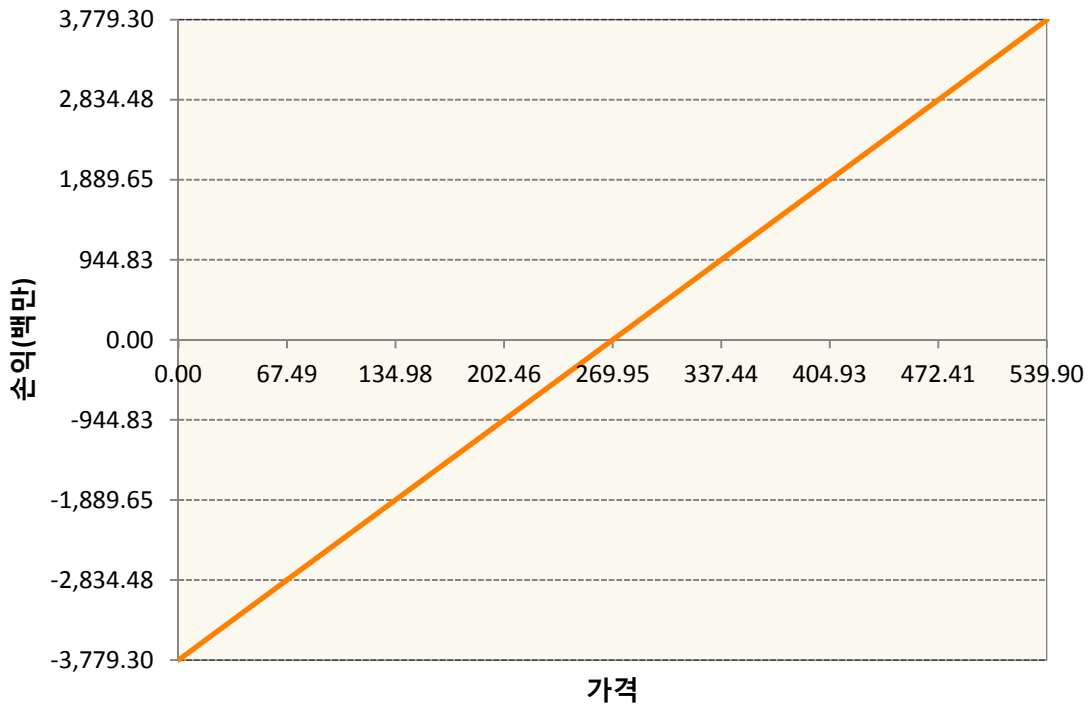
1. 계약금액

(단위:백만원)

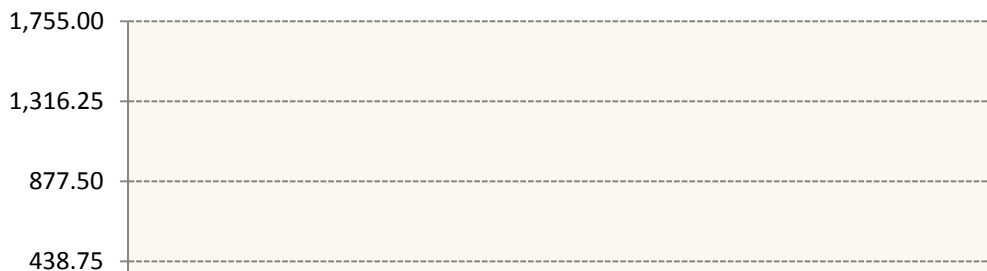
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	21,833	-21,833	장내
누계	유가증권	선물	3,779	0	3,779	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	21,555	-21,555	장내

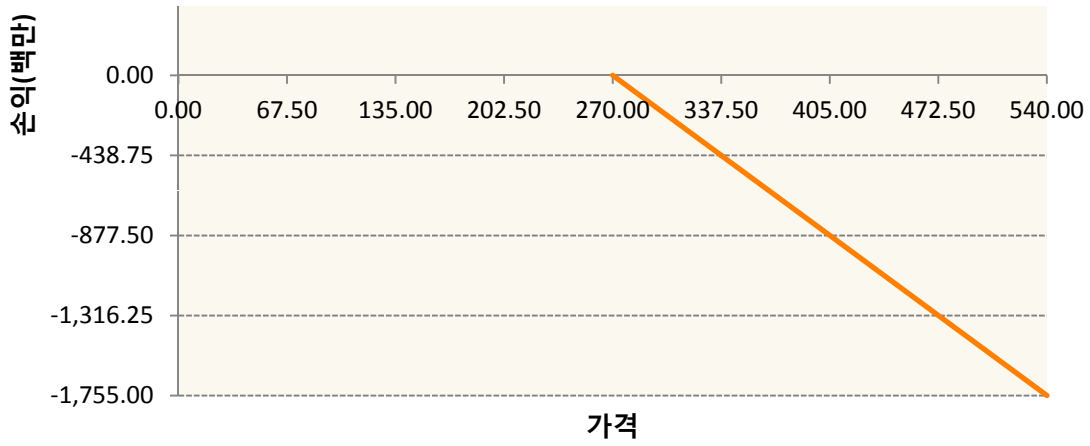
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

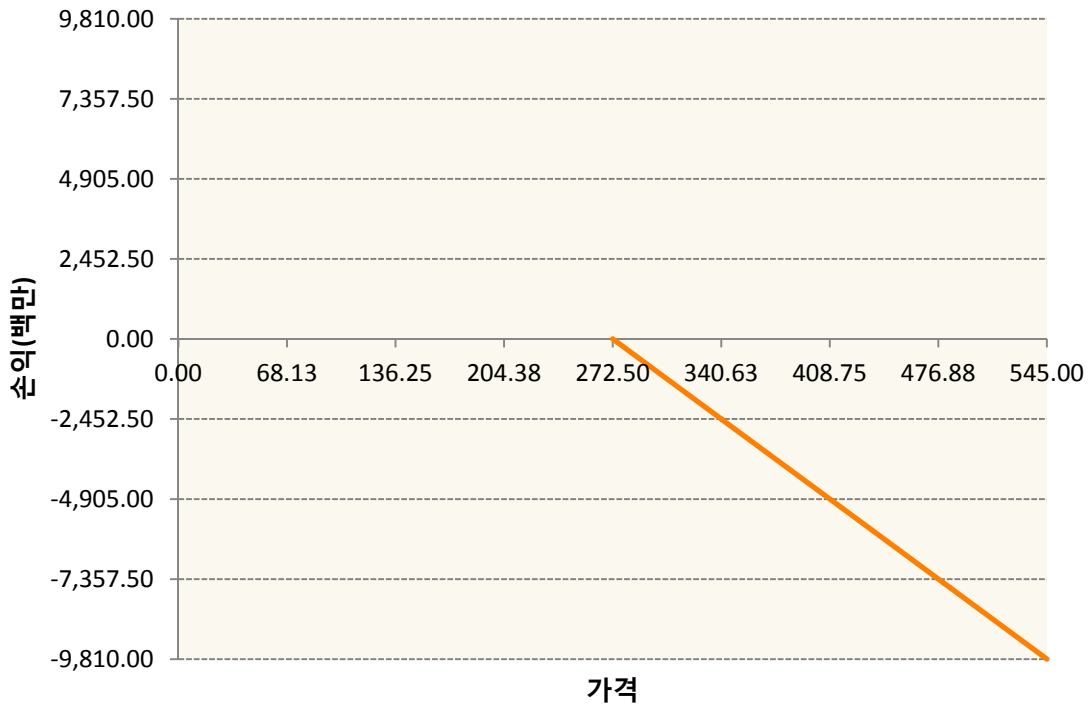


KR4201P72700-2019-07 콜270

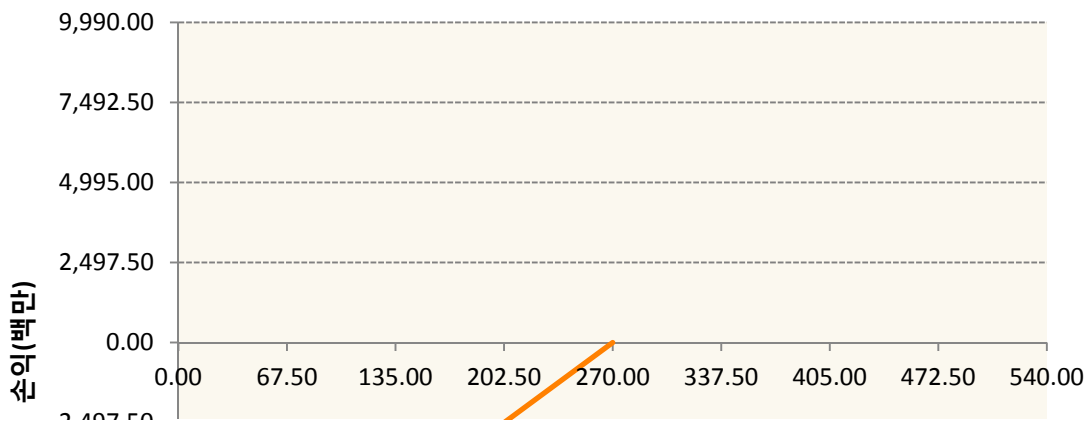




KR4201P72726-2019-07 콜272.5



KR4301P72708-2019-07 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,193
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	
-5.33%	-795	-795	-795	-795	-795	-795	-795	
-2.67%	-398	-398	-398	-398	-398	-398	-398	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	398	398	398	398	398	398	398	
5.33%	795	795	795	795	795	795	795	
8.00%	1,193	1,193	1,193	1,193	1,193	1,193	1,193	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						604
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-604	-604	-604	-604	-604	-604	-604	
-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%	604	604	604	604	604	604	604	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						303
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-303	-303	-303	-303	-303	-303	-303	
-5.33%	-202	-202	-202	-202	-202	-202	-202	
-2.67%	-101	-101	-101	-101	-101	-101	-101	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	101	101	101	101	101	101	101	
5.33%	202	202	202	202	202	202	202	
8.00%	303	303	303	303	303	303	303	
KR4201P72700		2019-07 콜270						109
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	47	46	44	43	41	38	36
-5.33%	42	40	37	35	32	28	25
-2.67%	32	28	24	21	17	13	9
0%	12	8	4	0	-4	-8	-12
2.67%	-17	-20	-24	-28	-32	-35	-39
5.33%	-54	-56	-59	-62	-65	-68	-72
8.00%	-96	-97	-99	-101	-103	-106	-109

KR4201P72726 2019-07 콜272.5 573

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	223	218	211	203	193	183	171
-5.33%	204	193	180	166	152	136	120
-2.67%	157	139	121	101	82	62	42
0%	67	44	22	0	-22	-45	-67
2.67%	-76	-97	-119	-141	-163	-185	-207
5.33%	-265	-282	-300	-318	-337	-357	-377
8.00%	-490	-500	-512	-526	-540	-556	-573

KR4301P72708 2019-07 풋270 644

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-634	-635	-636	-637	-639	-641	-644
-5.33%	-372	-375	-379	-384	-390	-396	-403
-2.67%	-133	-143	-153	-163	-174	-185	-196
0%	40	27	13	0	-13	-27	-40
2.67%	125	115	105	95	84	73	61
5.33%	150	146	142	137	131	124	116
8.00%	154	153	152	150	148	145	141

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

(단위:백만원)

3,388

공시일	2019-06-17
기준일	2019-06-14

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

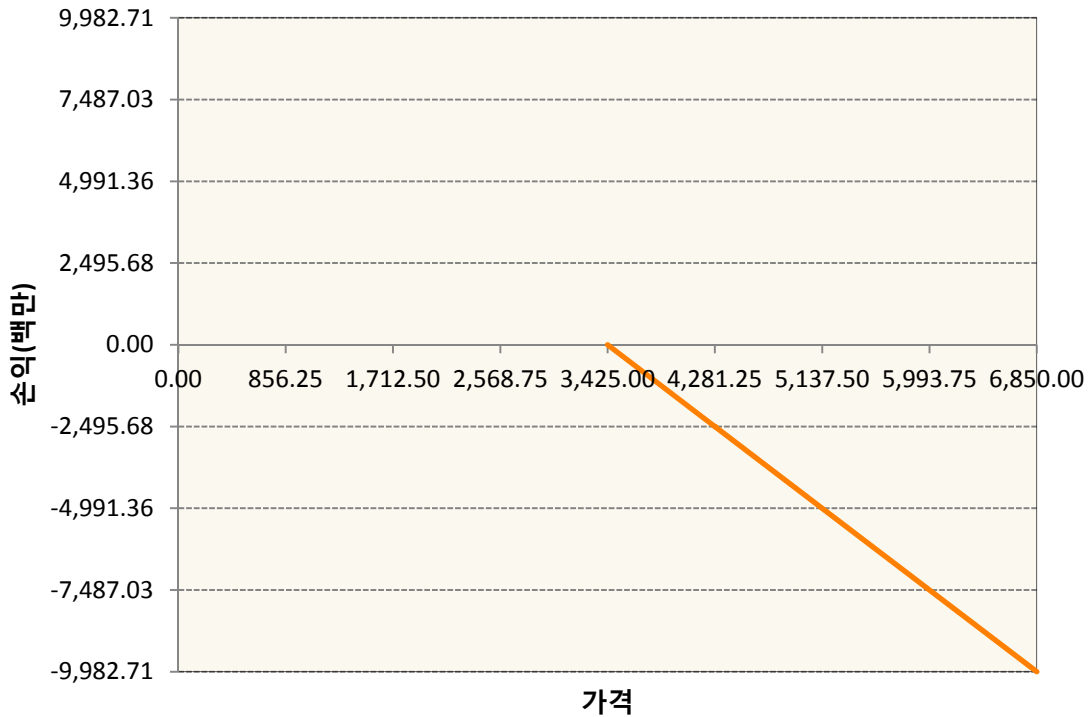
1. 계약금액

(단위:백만원)

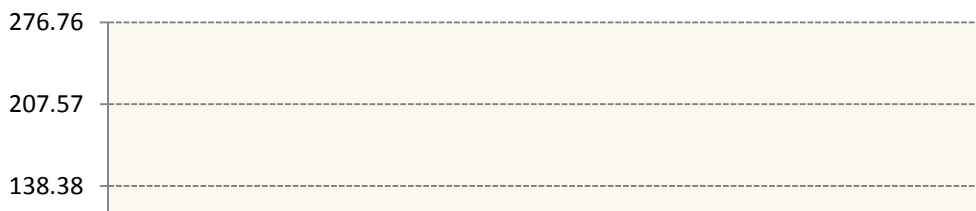
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,706	0	3,706	
누계	유가증권	스왑	56,592	0	56,592	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,519	-20,519	장내
누계	통화	선도	0	18,717	-18,717	장외

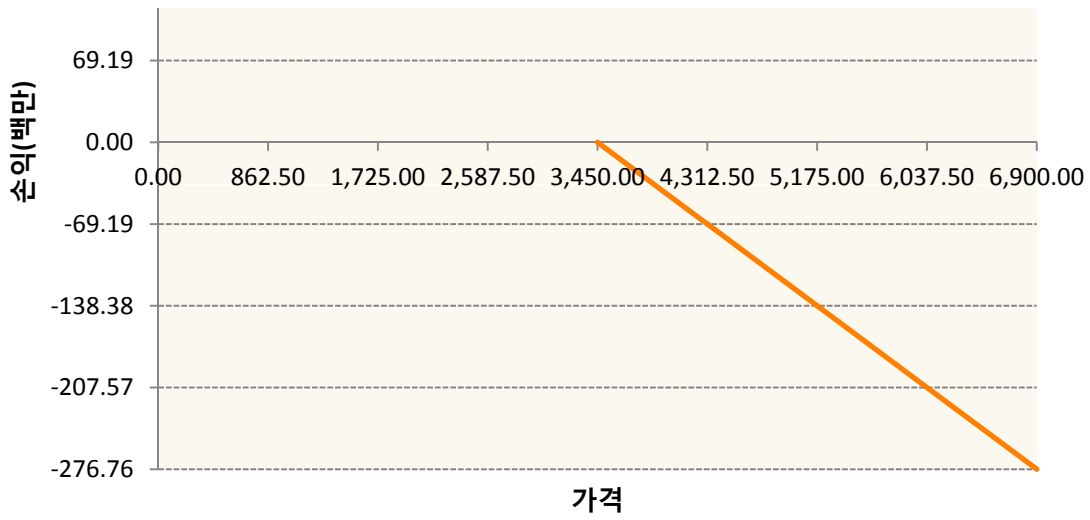
2. 만기시점의 손익구조

OESXM9-C3425-EURO STOXX 50

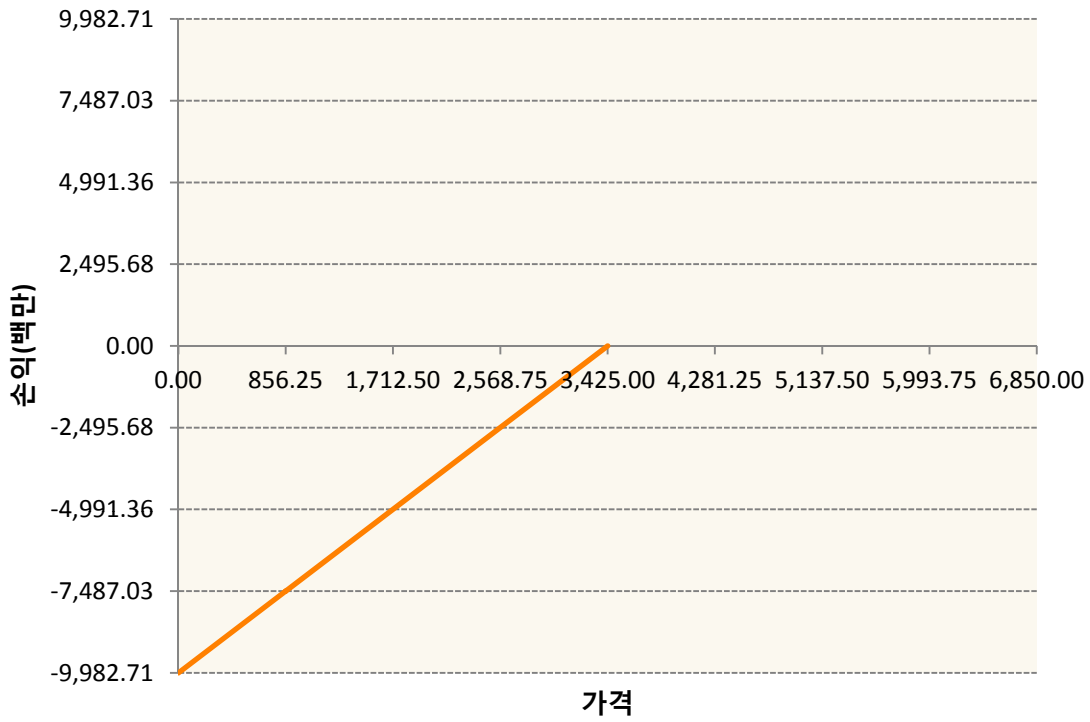


OESXM9-C3450-EURO STOXX 50

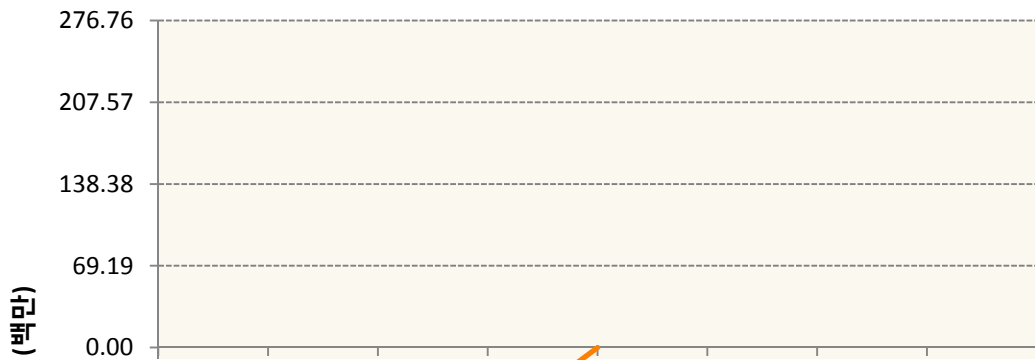


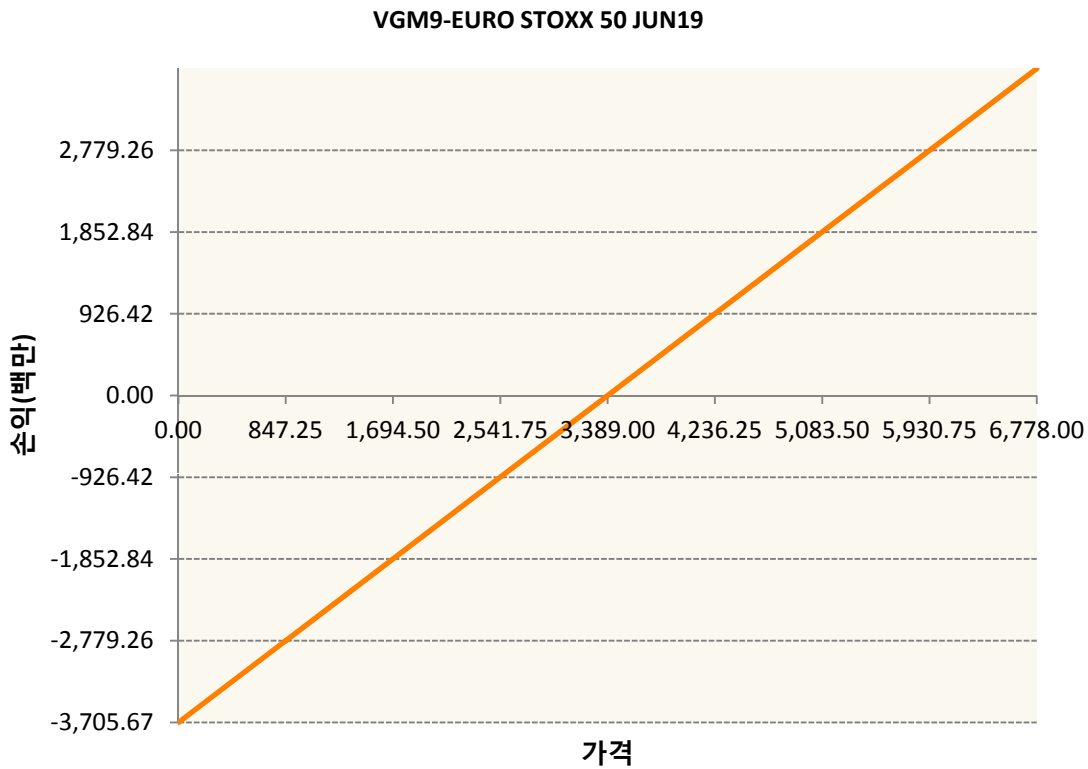
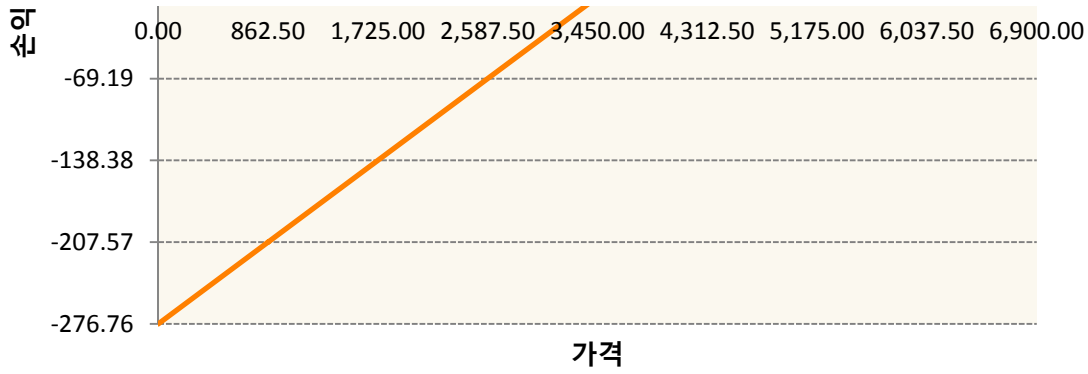


OESXM9-P3425-EURO STOXX 50



OESXM9-P3450-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	6
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	856
FX21019J01: KRW/EUR 28-06-19E	214
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	428
OESXM9-C3·EURO STOXX 50	799
OESXM9-C3·EURO STOXX 50	22
OESXM9-P3·EURO STOXX 50	799
OESXM9-P3·EURO STOXX 50	22
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	296

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

(단위:백만원)

2,127

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

(단위:백만원)

1,032

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

(단위:백만원)

91

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

(단위:백만원)

132

공시일	2019-06-17
기준일	2019-06-14

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

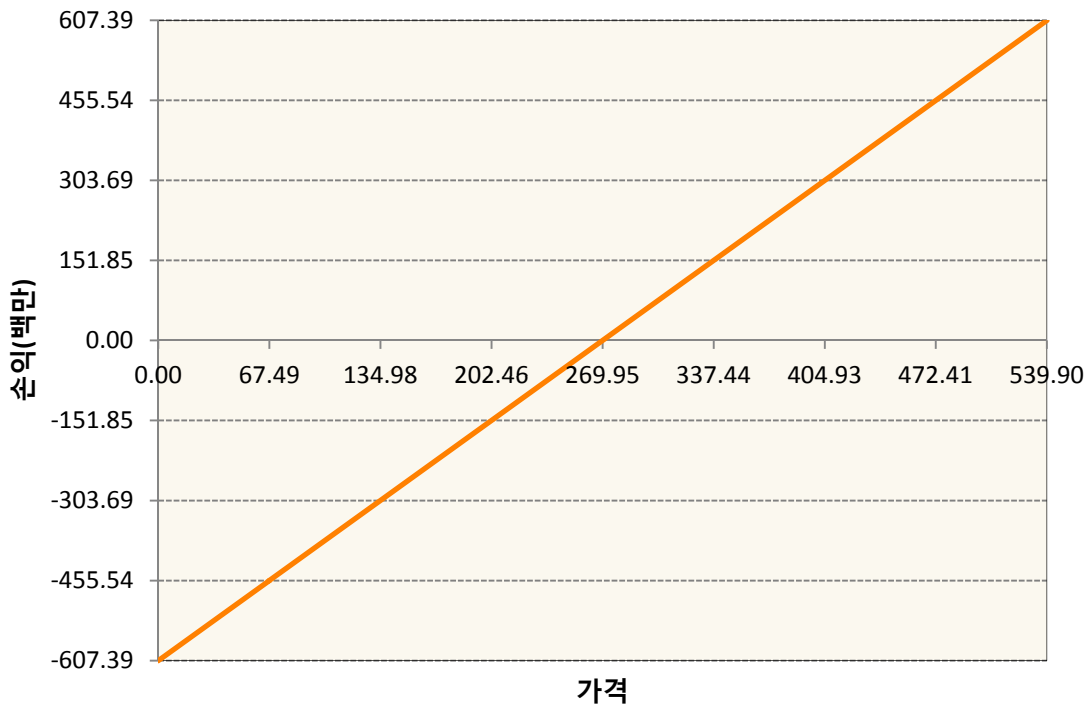
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	607	0	607	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						49
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
-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%	49	49	49	49	49	49	49	

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-06-17
기준일	2019-06-14

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

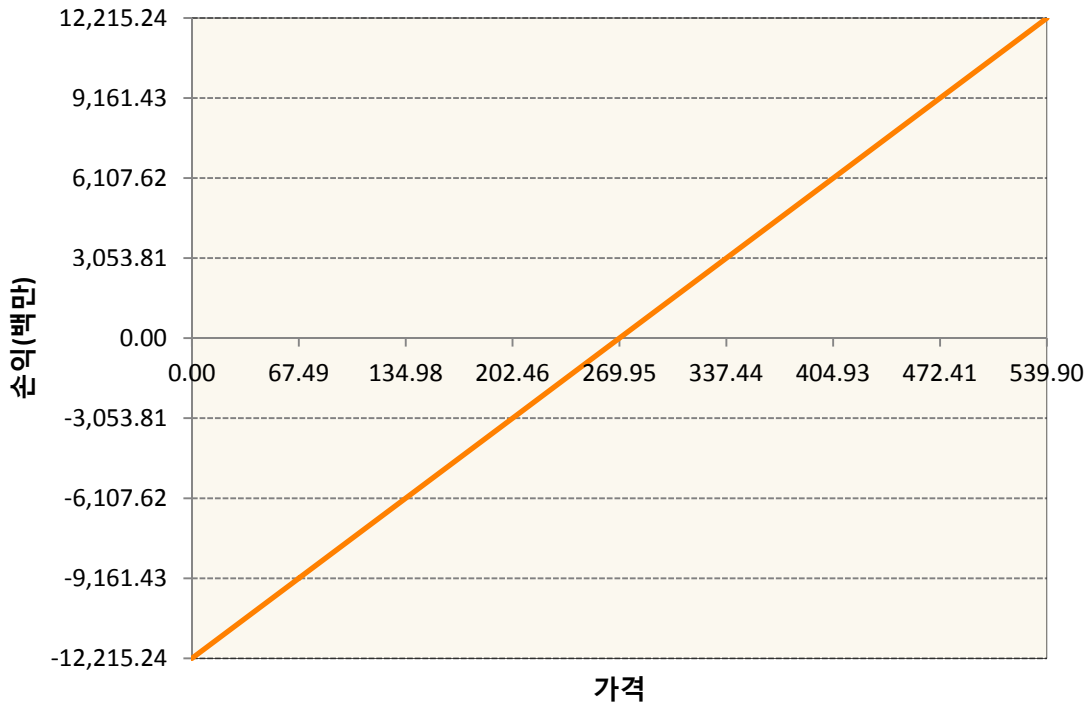
1. 계약금액

(단위:백만원)

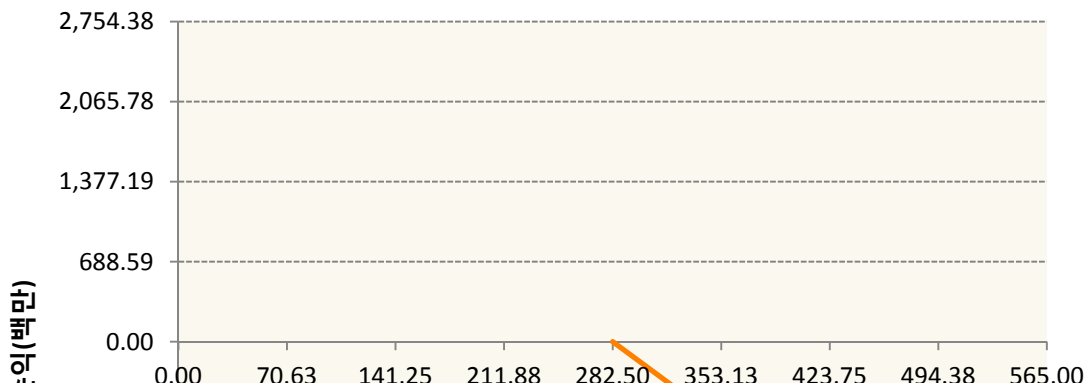
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	8,089	8,460	-371	장내
누계	유가증권	선물	12,215	0	12,215	장내
누계	유가증권	옵션	1,084	22,206	-21,121	장내

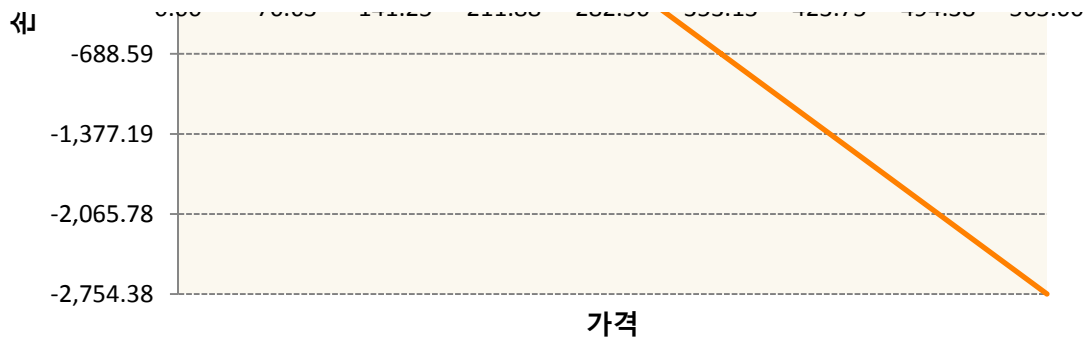
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

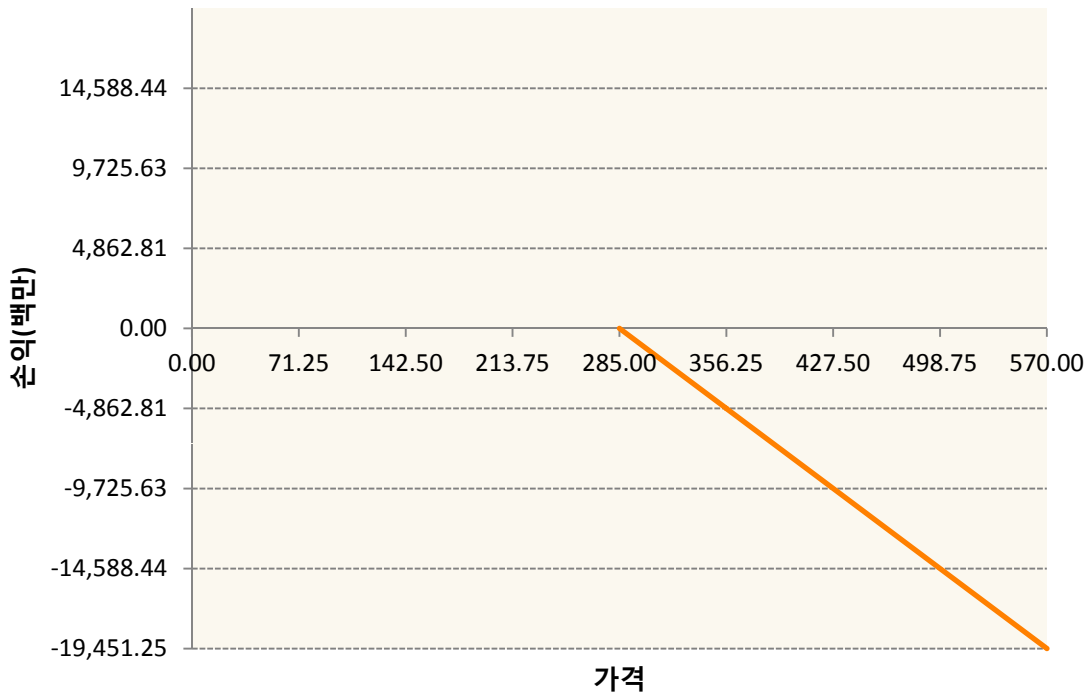


KR4201P72825-2019-07 콜282.5

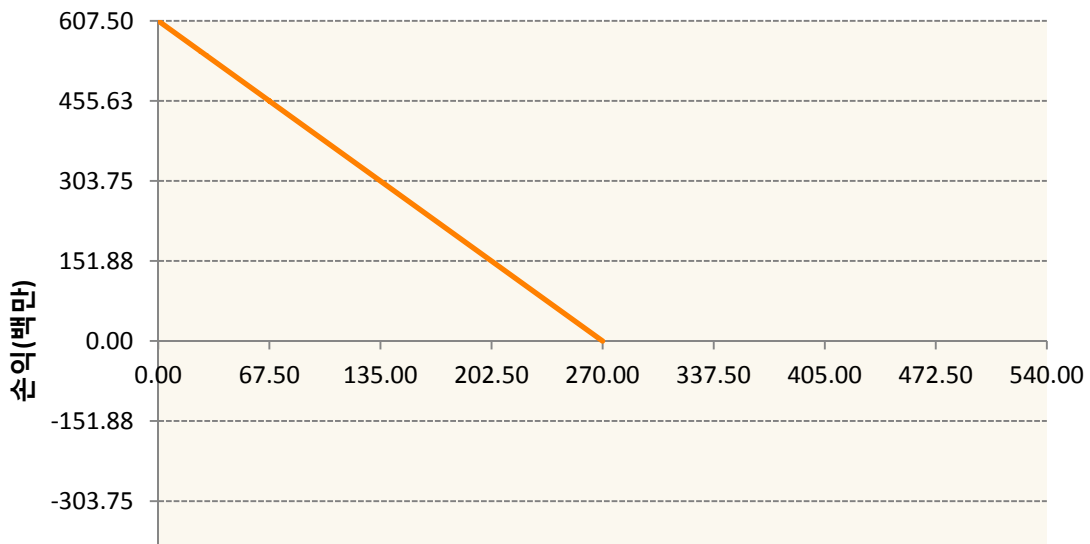


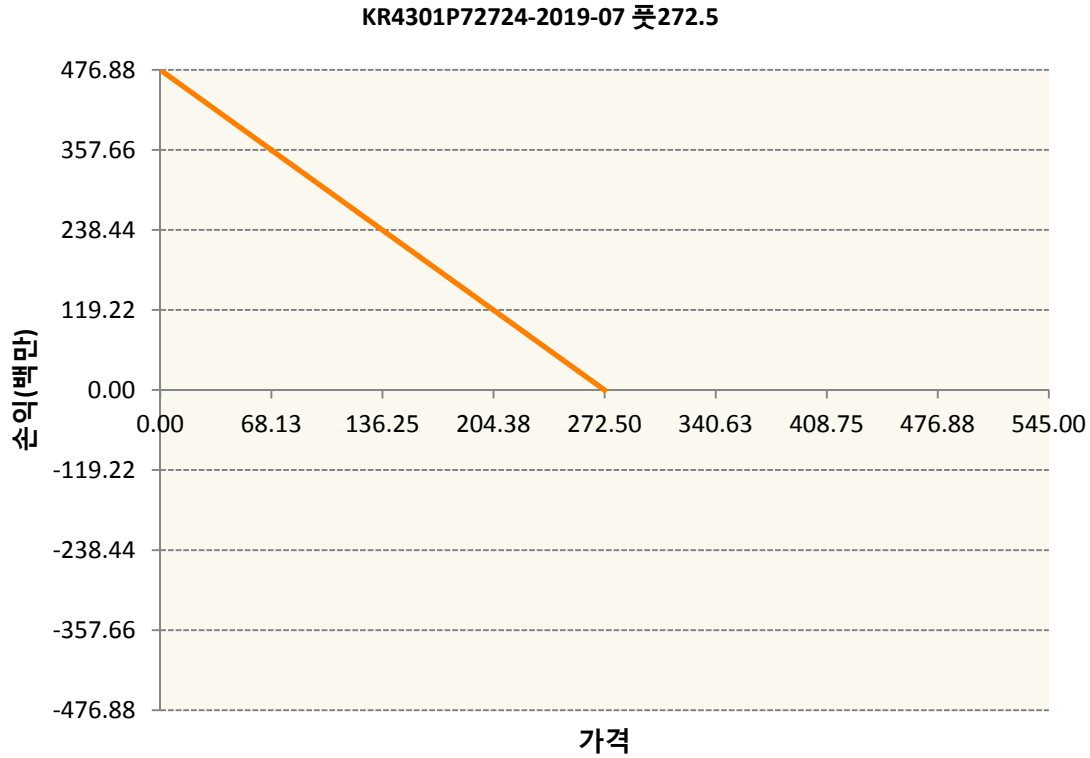
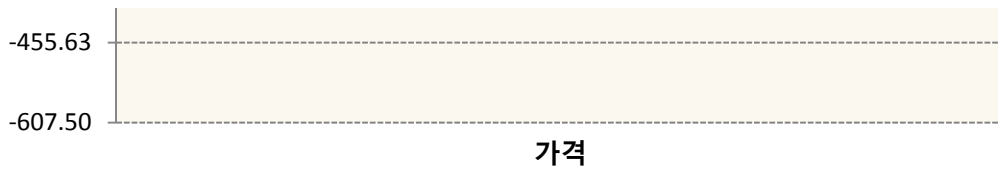


KR4201P72858-2019-07 콜285



KR4301P72708-2019-07 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						979
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-979	-979	-979	-979	-979	-979	-979	
-5.33%	-653	-653	-653	-653	-653	-653	-653	
-2.67%	-326	-326	-326	-326	-326	-326	-326	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	326	326	326	326	326	326	326	
5.33%	653	653	653	653	653	653	653	
8.00%	979	979	979	979	979	979	979	
KR4201P72825		2019-07 콜282.5						120
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	29	29	28	27	26	24	22	
-5.33%	28	27	25	23	21	18	15	
-2.67%	24	21	18	15	11	7	3	

0%	14	10	5	0	-5	-10	-16
2.67%	-6	-12	-18	-24	-30	-36	-42
5.33%	-39	-45	-52	-58	-64	-71	-77
8.00%	-85	-91	-96	-102	-108	-114	-120
KR4201P72858 2019-07 콜285							772
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	165	163	160	155	148	139	128
-5.33%	160	154	145	134	120	104	86
-2.67%	141	126	108	88	65	39	12
0%	88	61	31	0	-33	-67	-103
2.67%	-26	-65	-104	-145	-186	-228	-269
5.33%	-225	-269	-314	-359	-403	-448	-492
8.00%	-518	-559	-601	-643	-686	-729	-772
KR4301P72708 2019-07 풋270							39
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	39	39	39	39	39	39	39
-5.33%	23	23	23	23	24	24	25
-2.67%	8	9	9	10	11	11	12
0%	-2	-2	-1	0	1	2	2
2.67%	-8	-7	-6	-6	-5	-4	-4
5.33%	-9	-9	-9	-8	-8	-8	-7
8.00%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
KR4301P72724 2019-07 풋272.5							32
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	32	32	32	32	32	32	32
-5.33%	19	20	20	20	20	20	21
-2.67%	8	8	8	9	9	10	10
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-7	-7	-6	-6	-5	-4	-4
5.33%	-9	-9	-9	-8	-8	-8	-7
8.00%	-10	-10	-9	-9	-9	-9	-9

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

(단위:백만원)

1,579

공시일	2019-06-17
기준일	2019-06-14

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	119	0	119	
누계	유가증권	수익증권	18,884	0	18,884	

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	2019-06-17
기준일	2019-06-14

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	356	0	356	
누계	유가증권	수익증권	58,999	0	58,999	

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	2019-06-17
기준일	2019-06-14

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	8,297	0	8,297	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	384,565	0	384,565	
누계	통화	선도	0	451,125	-451,125	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		998
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E		1,024
FX21019K00 KRW/USD 18-06-19E		569
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		1,328
FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E		474
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E		797
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		797
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		1,290
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	1,053
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	1,896
FX21019M00 KRW/USD 15-07-19E	474
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	379
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	664
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	948
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	664
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	664
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E	569
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E	3,034
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E	2,276

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

(단위:백만원)

11,985

공시일	2019-06-17
기준일	2019-06-14

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

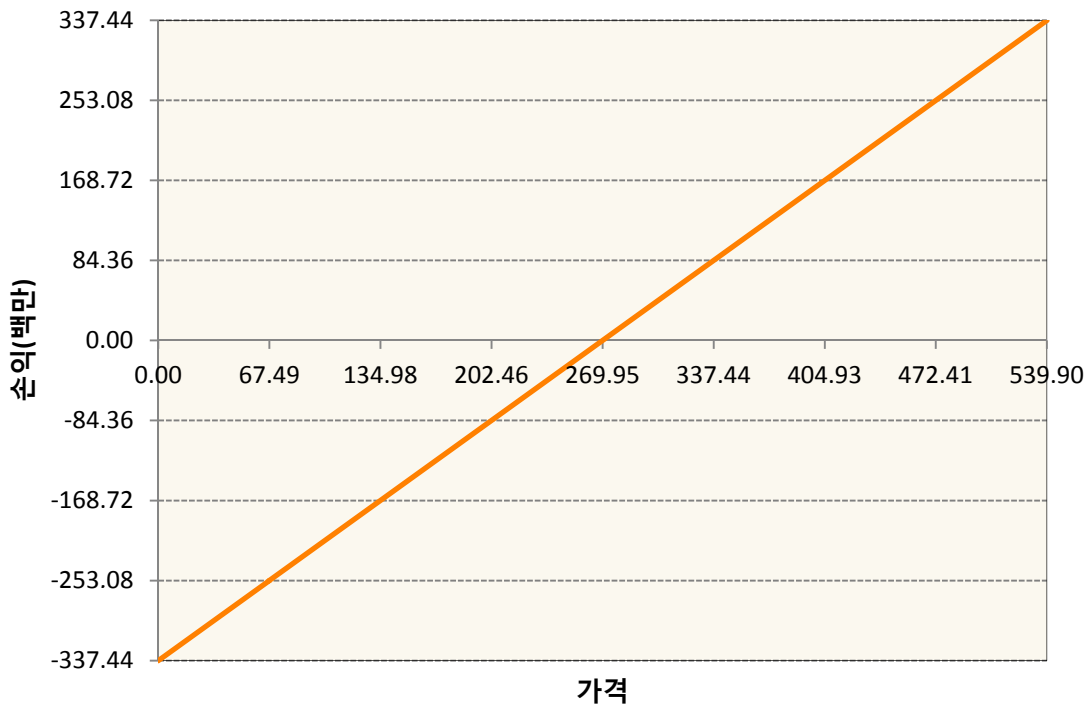
1. 계약금액

(단위:백만원)

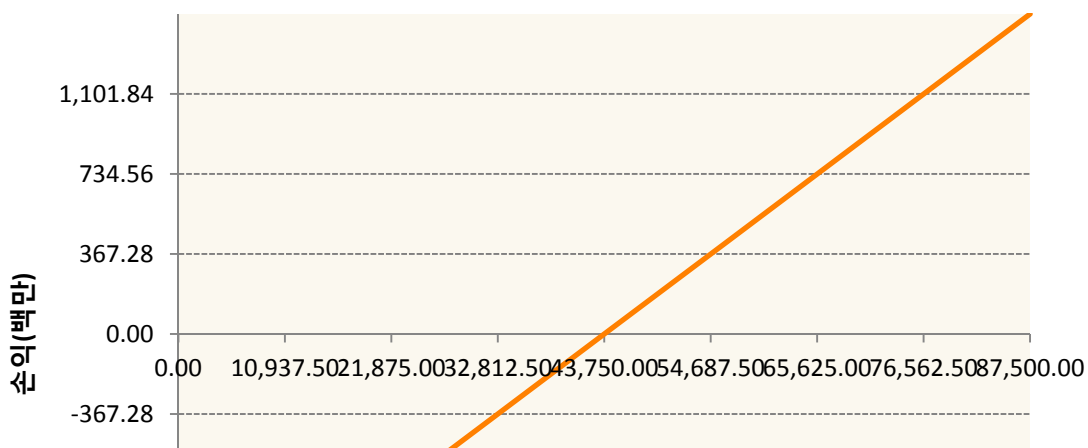
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,807	0	1,807	장내

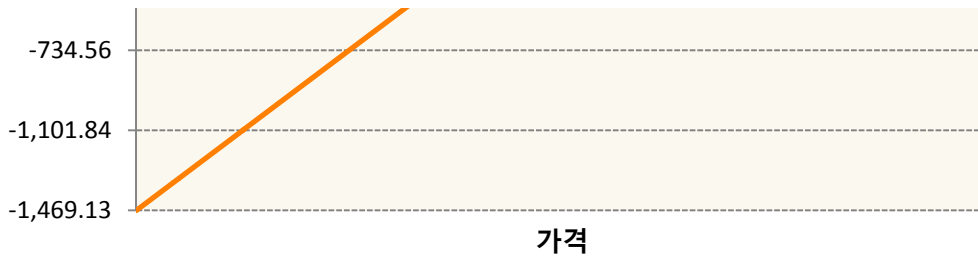
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P70002-2019-07 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 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	
KR4111P70002		2019-07 삼성전자개별선물						118
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118	
-5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79	
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	39	39	39	39	39	39	39	
5.33%	79	79	79	79	79	79	79	
8.00%	118	118	118	118	118	118	118	

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

158

공시일	2019-06-17
기준일	2019-06-14

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

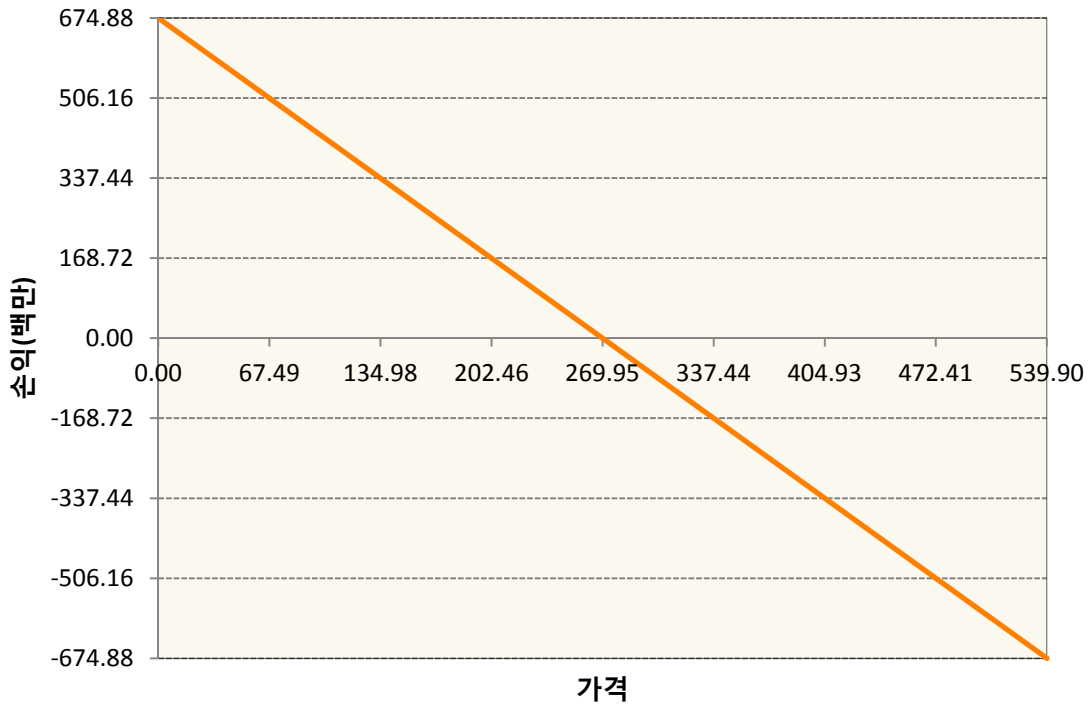
1. 계약금액

(단위:백만원)

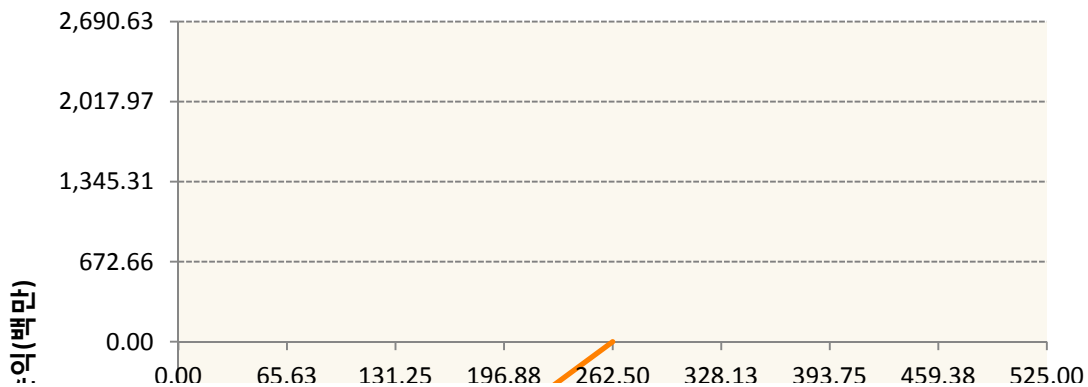
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	933	-933	장내
누계	유가증권	선물	0	675	-675	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,353	-3,353	장내

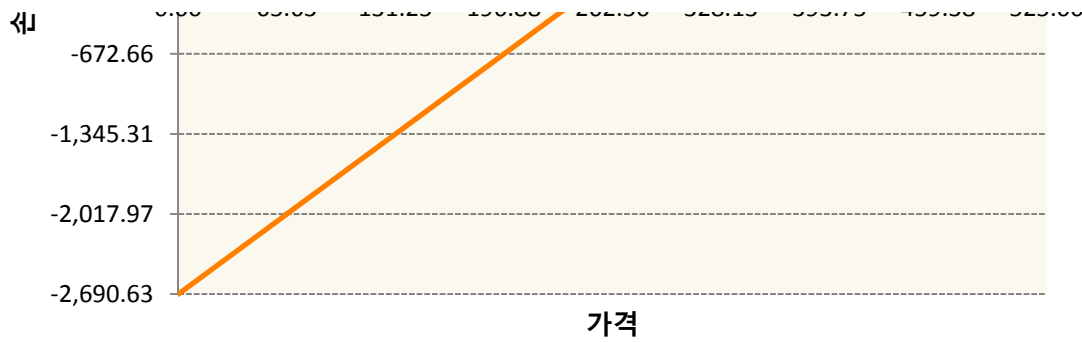
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

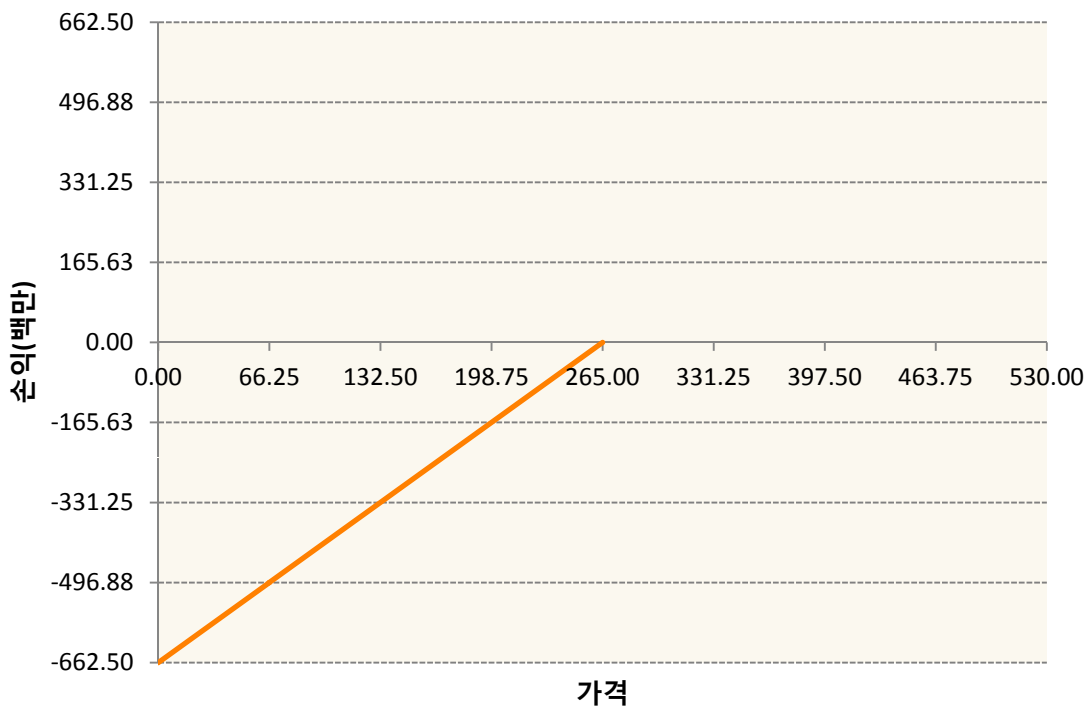


KR4301P72625-2019-07 풋262.5





KR4301P72658-2019-07 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 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	
KR4301P72625		2019-07 풋262.5						136
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-128	-129	-130	-131	-133	-134	-136
-5.33%	-62	-64	-67	-70	-73	-76	-79
-2.67%	-15	-18	-22	-25	-29	-32	-36
0%	8	5	3	0	-3	-6	-9
2.67%	14	13	12	11	9	7	6
5.33%	15	15	14	14	13	13	12
8.00%	15	15	15	15	15	14	14

KR4301P72658

2019-07 풋265

37

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-36	-36	-36	-36	-36	-37	-37
-5.33%	-19	-19	-20	-20	-21	-21	-22
-2.67%	-5	-6	-7	-8	-9	-9	-10
0%	2	2	1	0	-1	-2	-2
2.67%	5	4	4	4	3	3	2
5.33%	5	5	5	5	5	4	4
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

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

(단위:백만원)

202

공시일	2019-06-17
기준일	2019-06-14

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

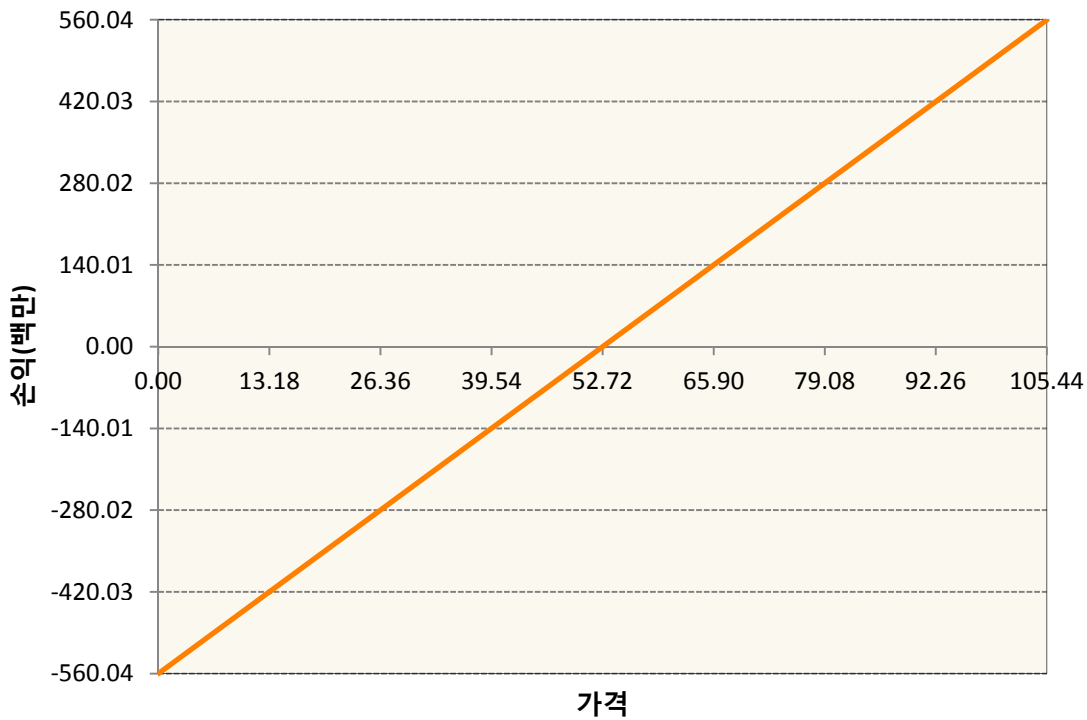
1. 계약금액

(단위:백만원)

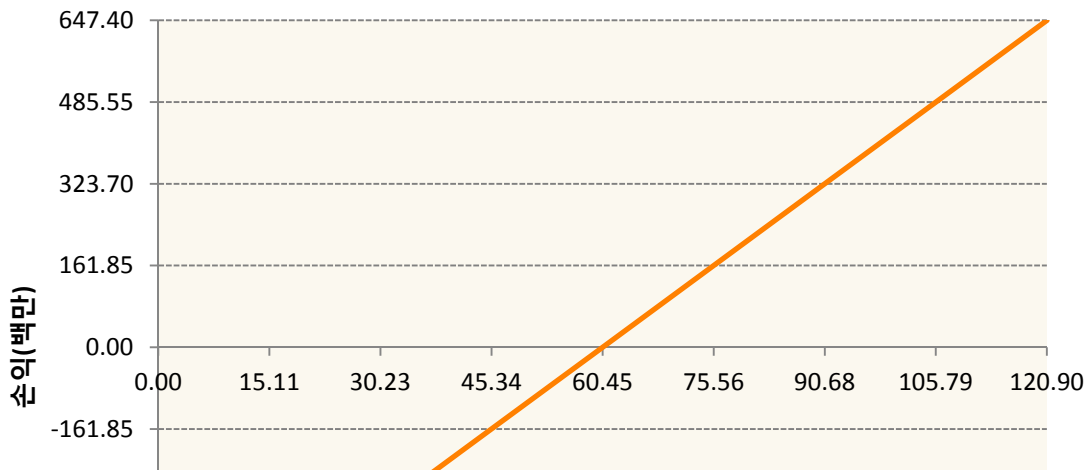
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,474	118	2,356	

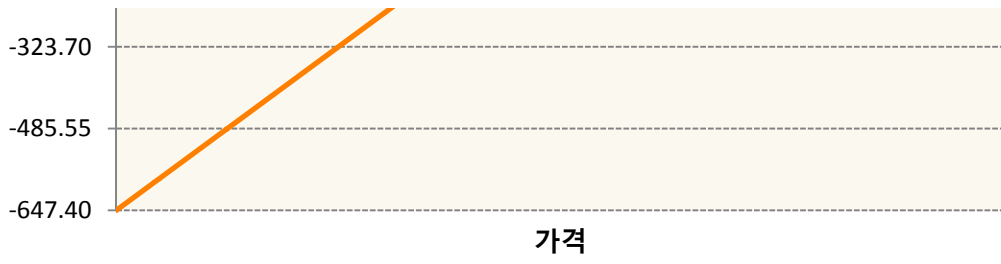
2. 만기시점의 손익구조

CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19

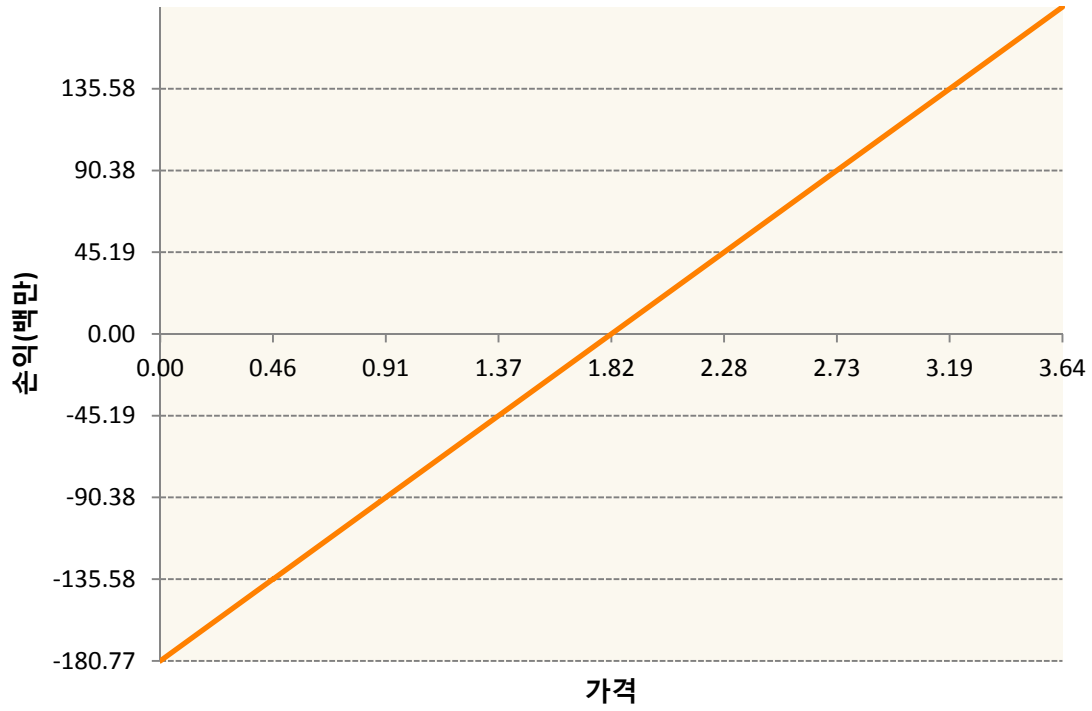


COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19

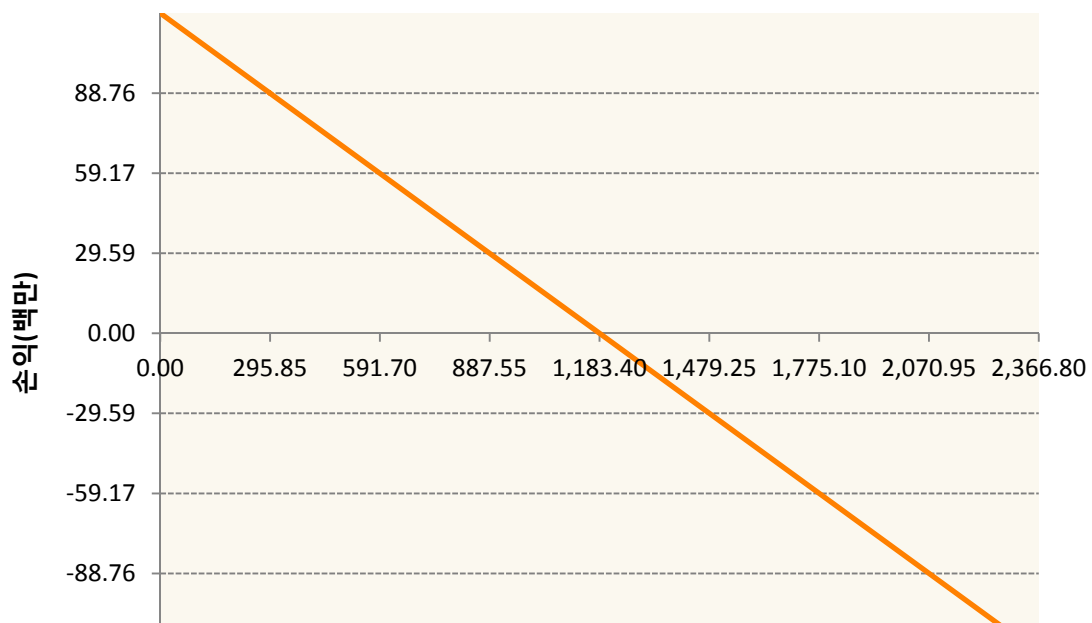


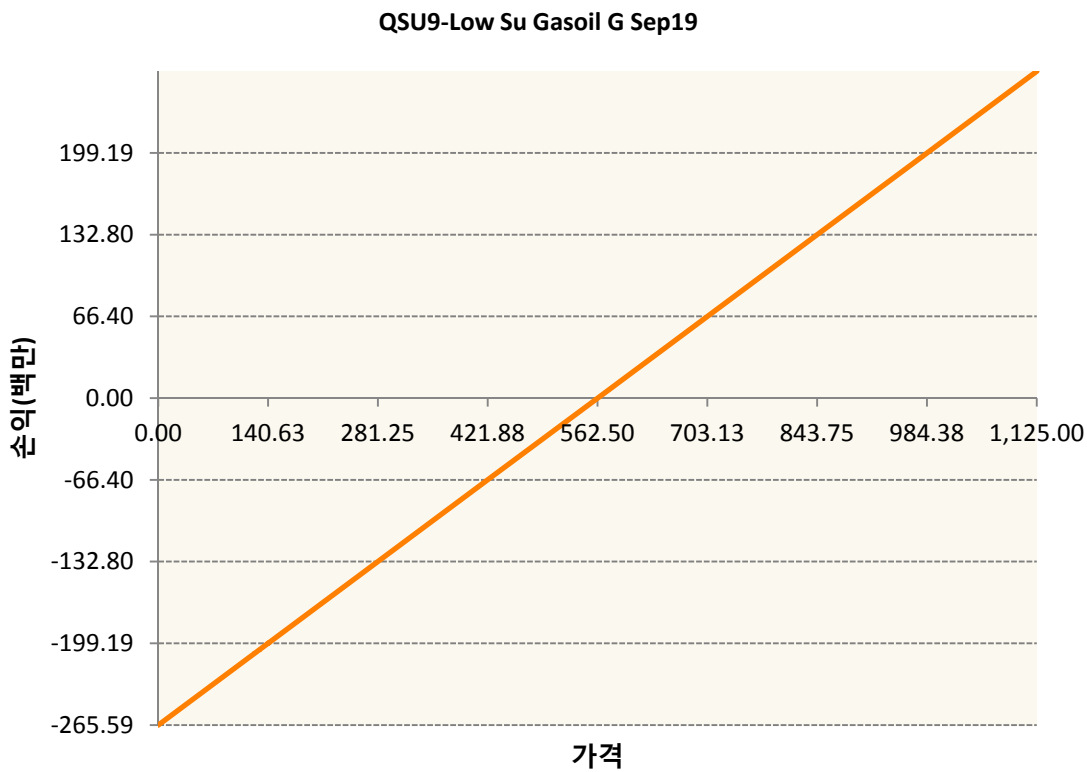
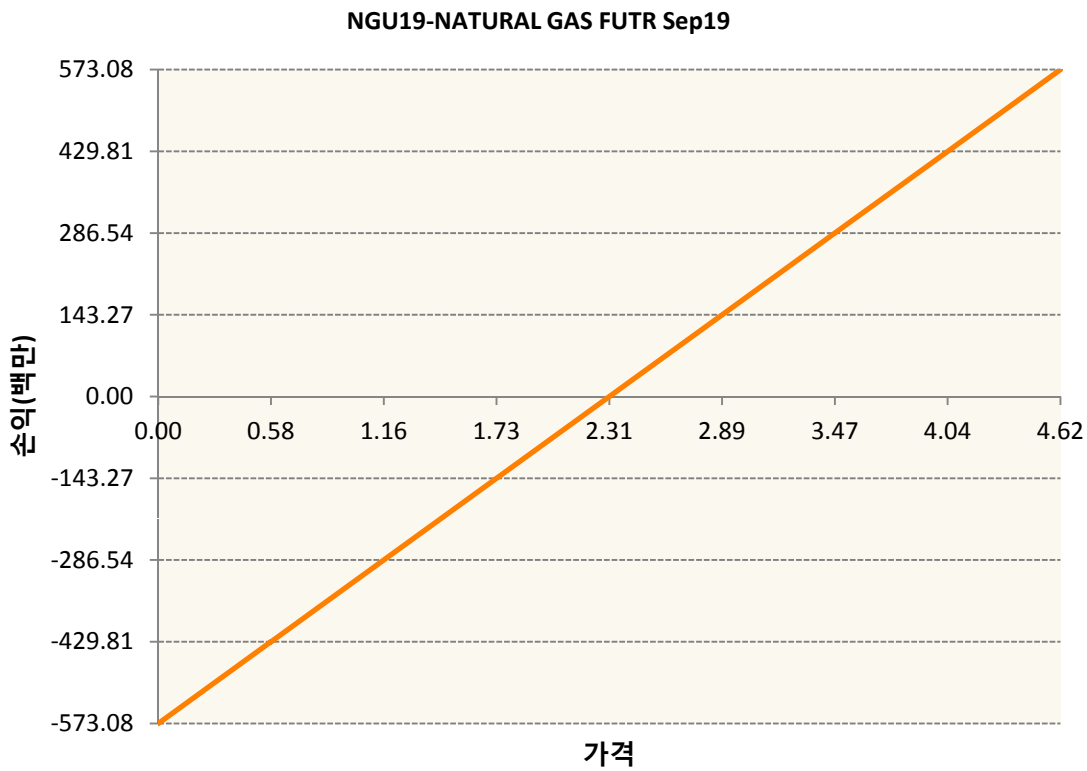
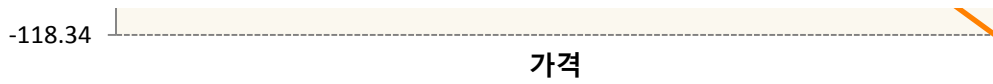


HOU9-NY Harb ULSD Fut Sep19

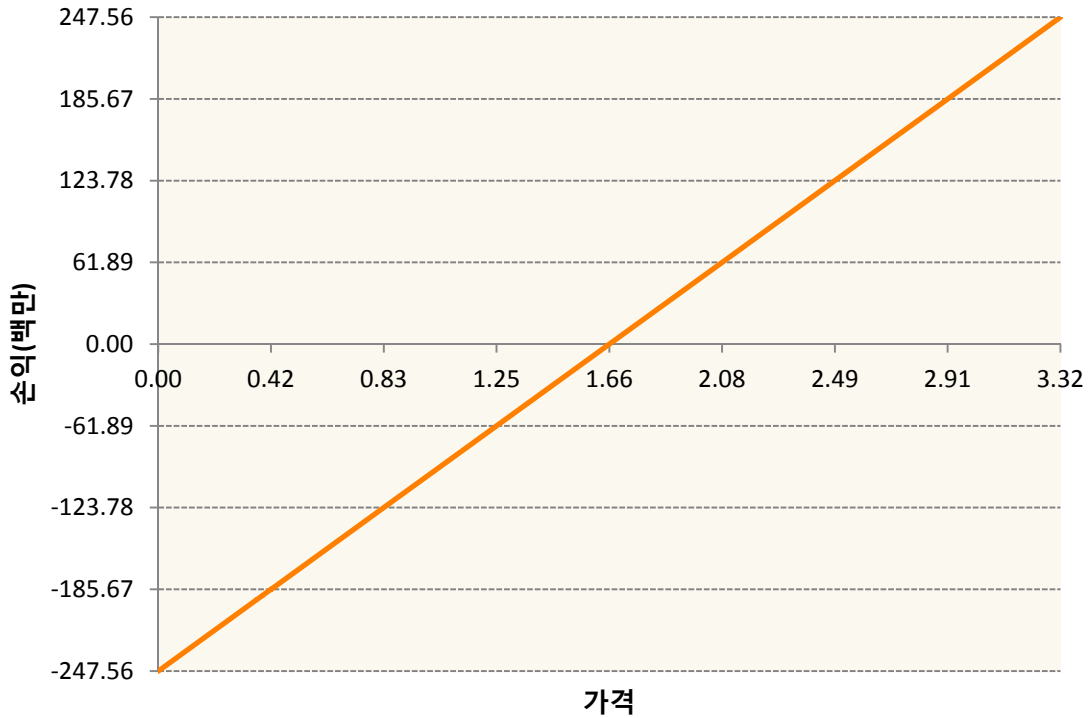


KR4175P70007-2019-07 달러선물





XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	45
COU9	BRENT CRUDE FUTR Sep19	52
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	14
KR4175P700	2019-07 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)

368

공시일	2019-06-17
기준일	2019-06-14

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

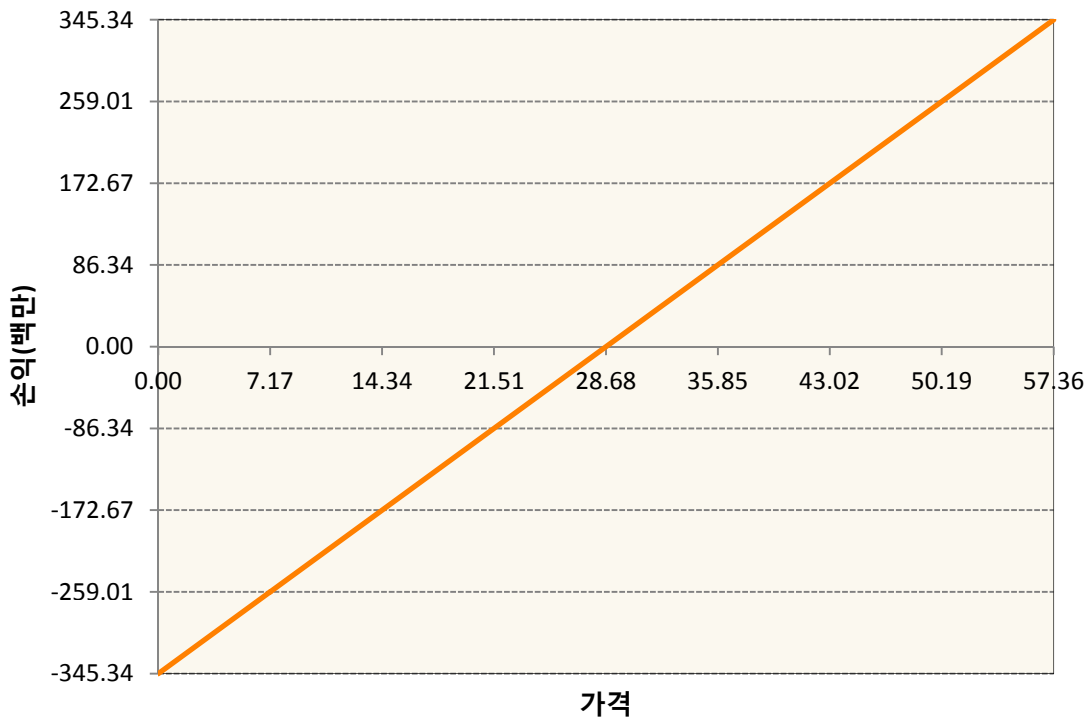
1. 계약금액

(단위:백만원)

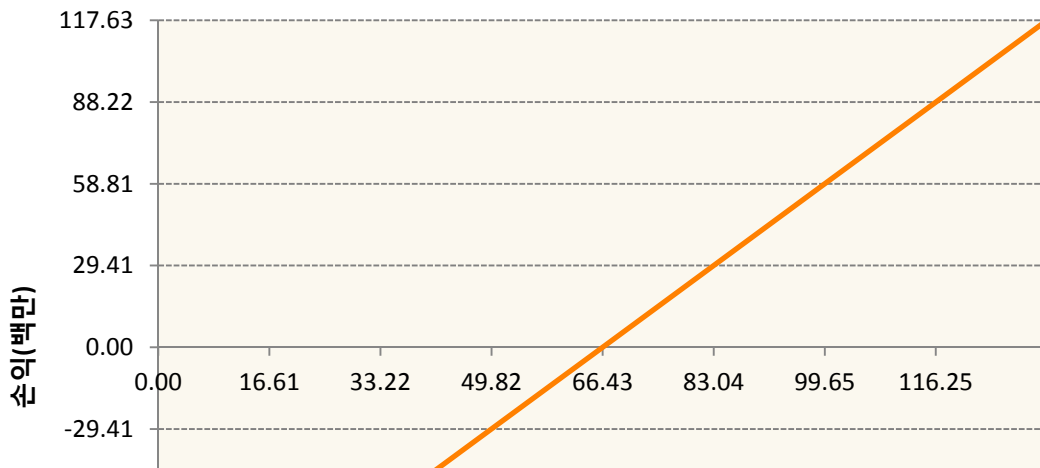
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,311	201	3,110	

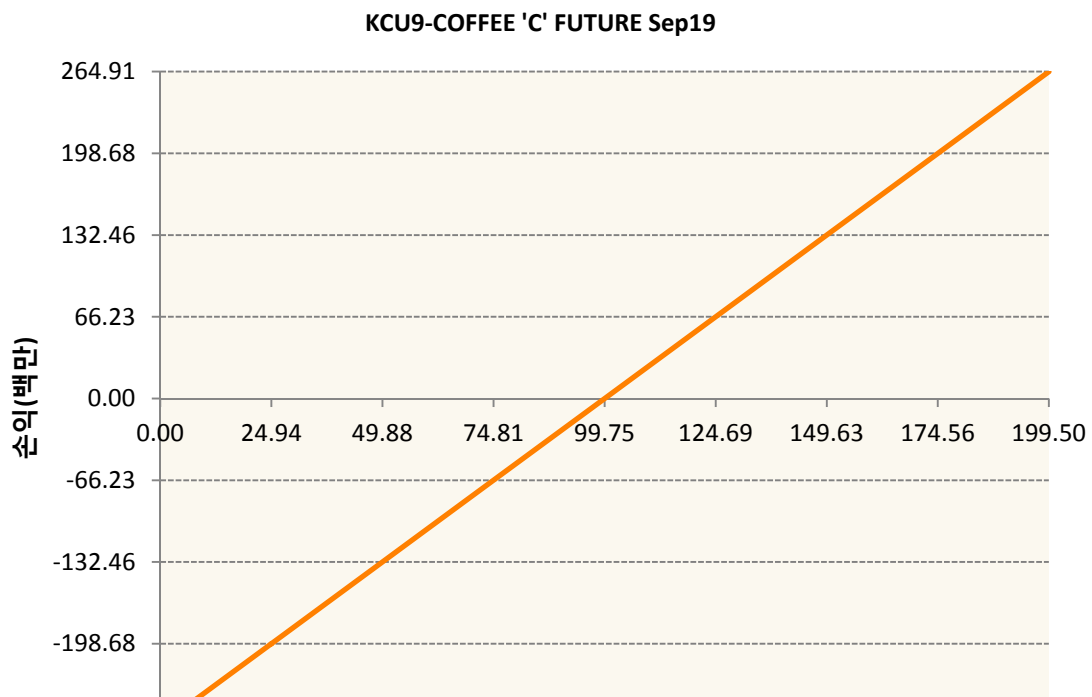
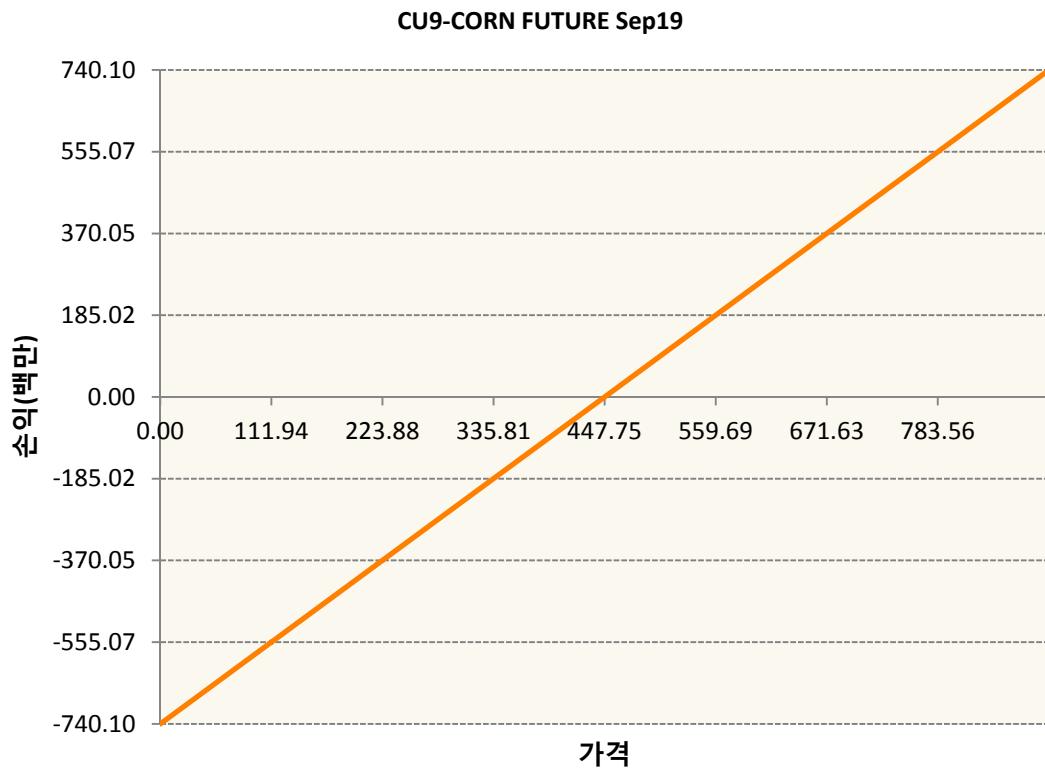
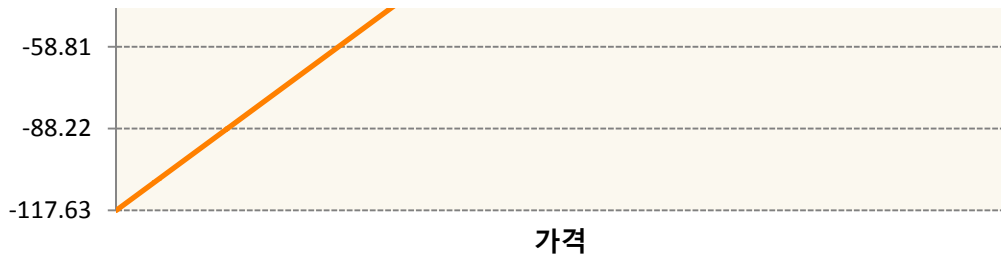
2. 만기시점의 손익구조

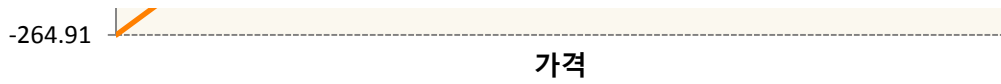
BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19



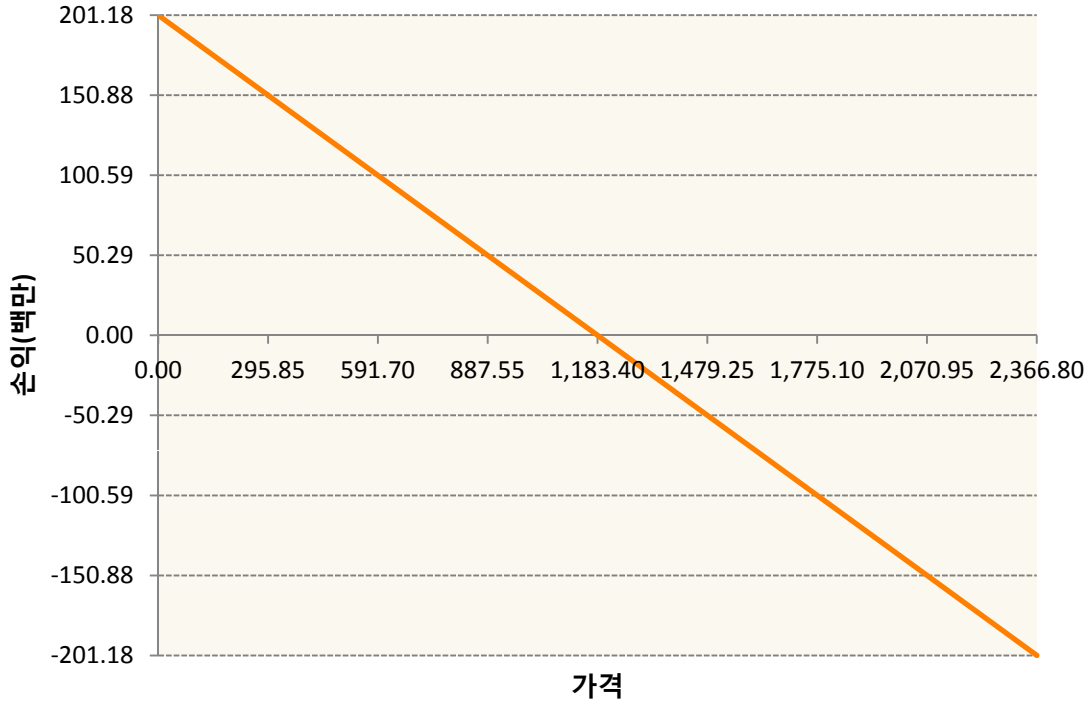
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



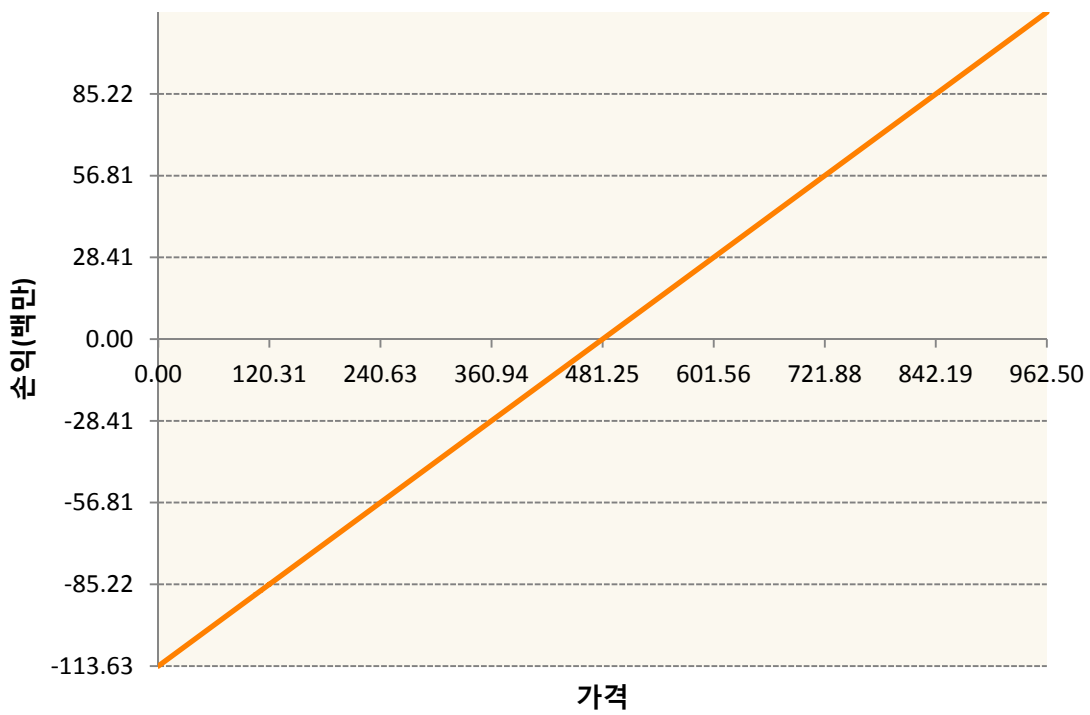




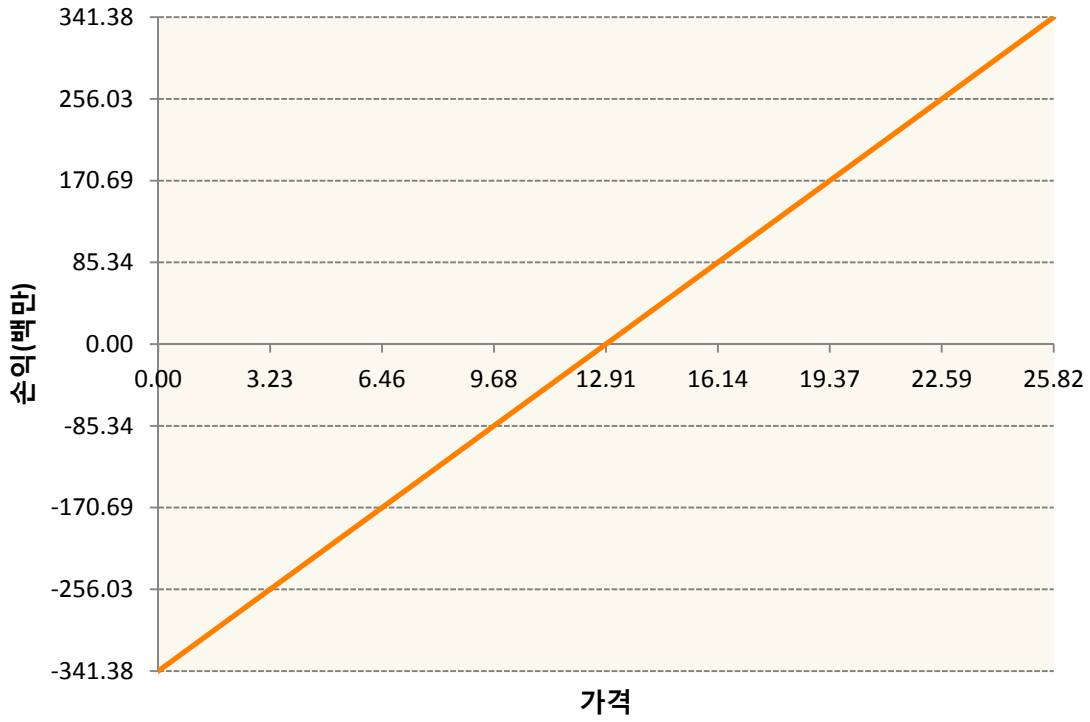
KR4175P70007-2019-07 달러선물



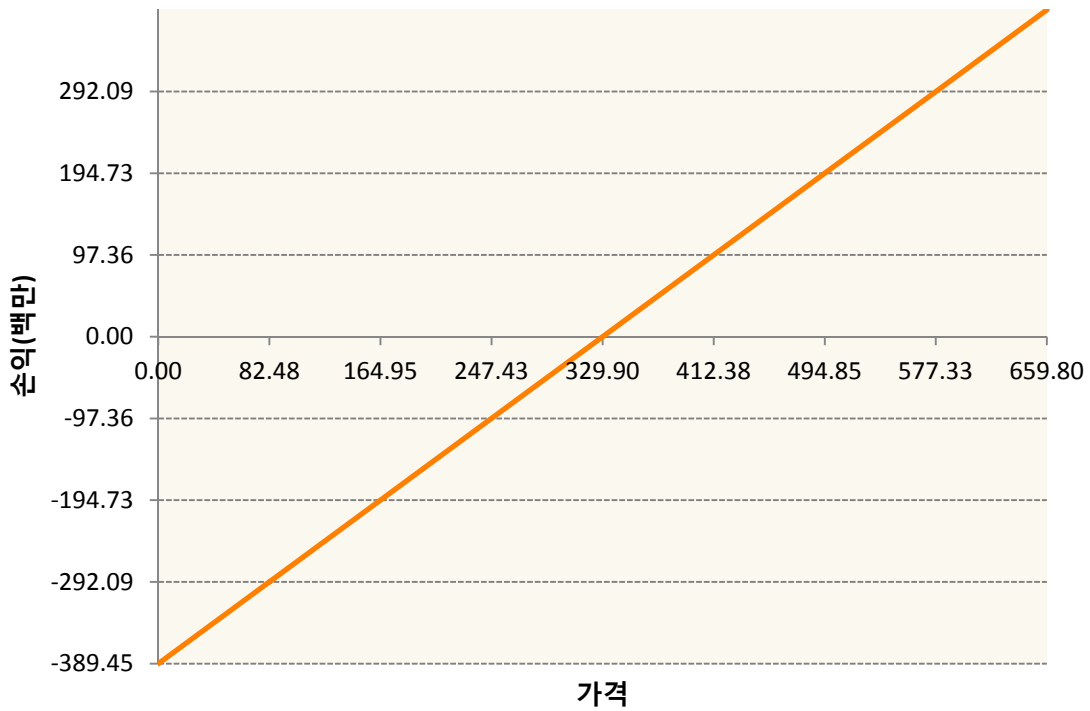
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



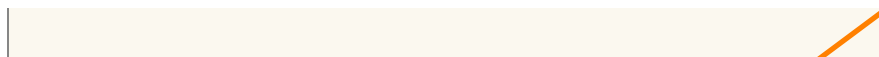
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

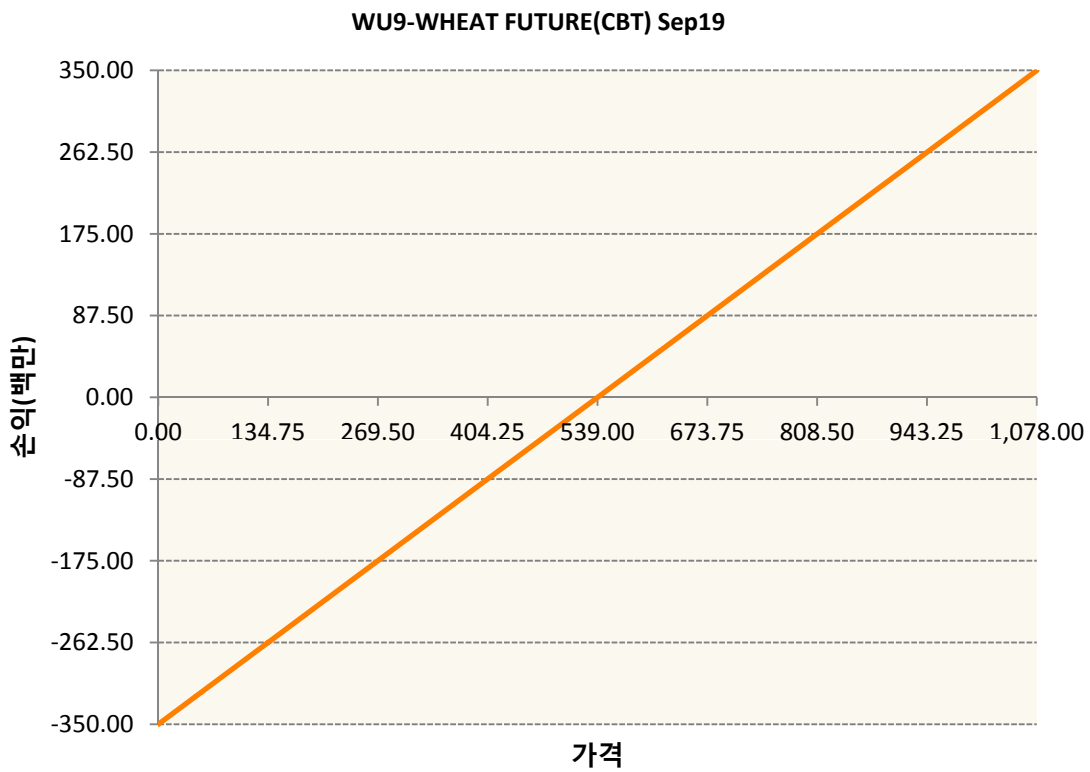
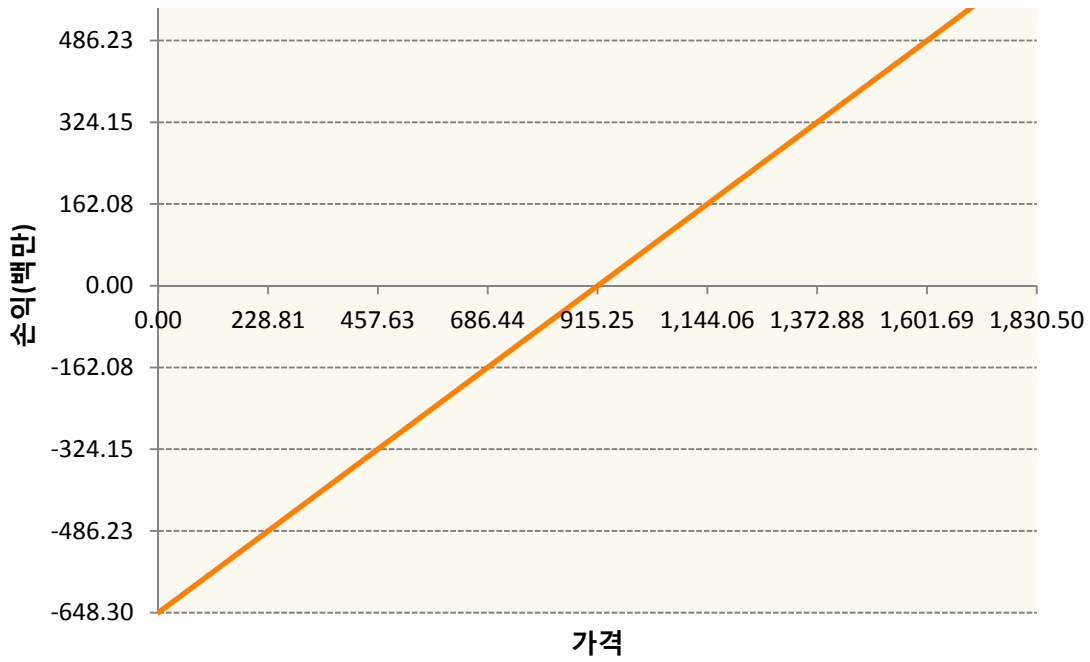


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	28
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	9
CU9	CORN FUTURE Sep19	59
KCU9	COFFEE 'C' FUTURE Sep19	21
KR4175P700	2019-07 달러선물	16

KWU9	KC HRW WHEAT FUT Sep19	9
SBV9	SUGAR #11 (WORLD) Oct19	27
SMZ9	SOYBEAN MEAL FUTR Dec19	31
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	52
WU9	WHEAT FUTURE(CBT) Sep19	28

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

(단위:백만원)

284