

공시일	2019-06-18
기준일	2019-06-17

포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	6	0	6	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	2019-06-18
기준일	2019-06-17

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

1,140

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

690

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-18
기준일	2019-06-17

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)	371
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	136

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

855

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-18
기준일	2019-06-17

유로인덱스모(주식-파생형)

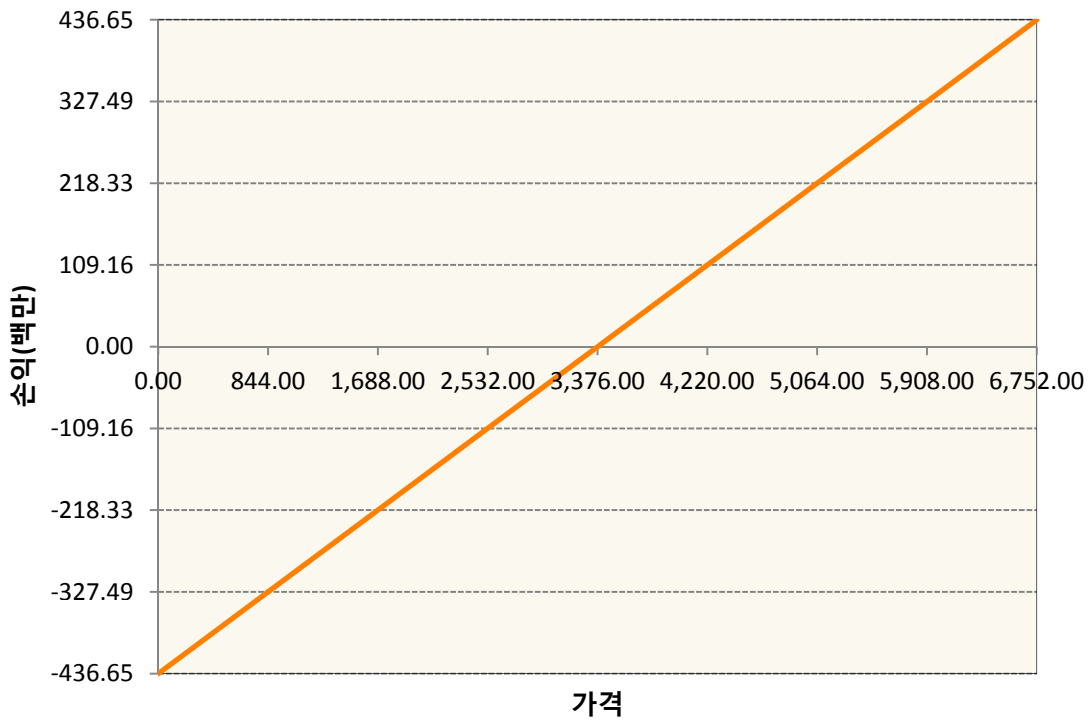
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	437	0	437	

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	2019-06-18
기준일	2019-06-17

차이나인덱스모(주식-파생형)

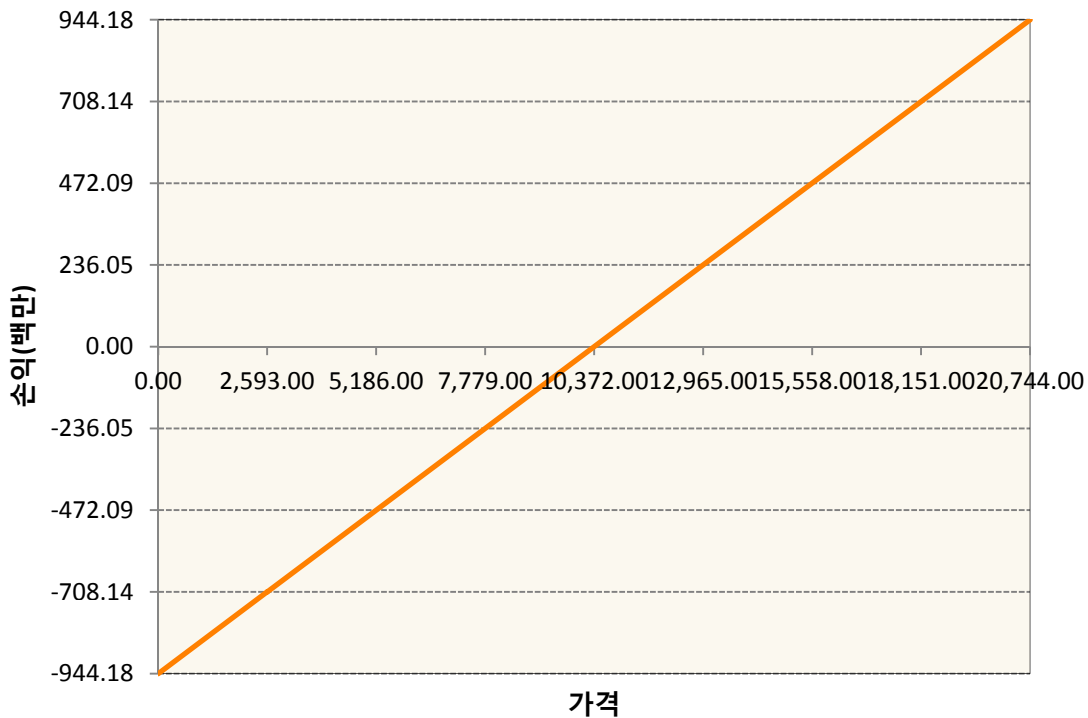
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	944	0	944	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM9	HSCEI Futures Jun19	76
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

77

공시일	2019-06-18
기준일	2019-06-17

커버드콜모(주식혼합-파생형)

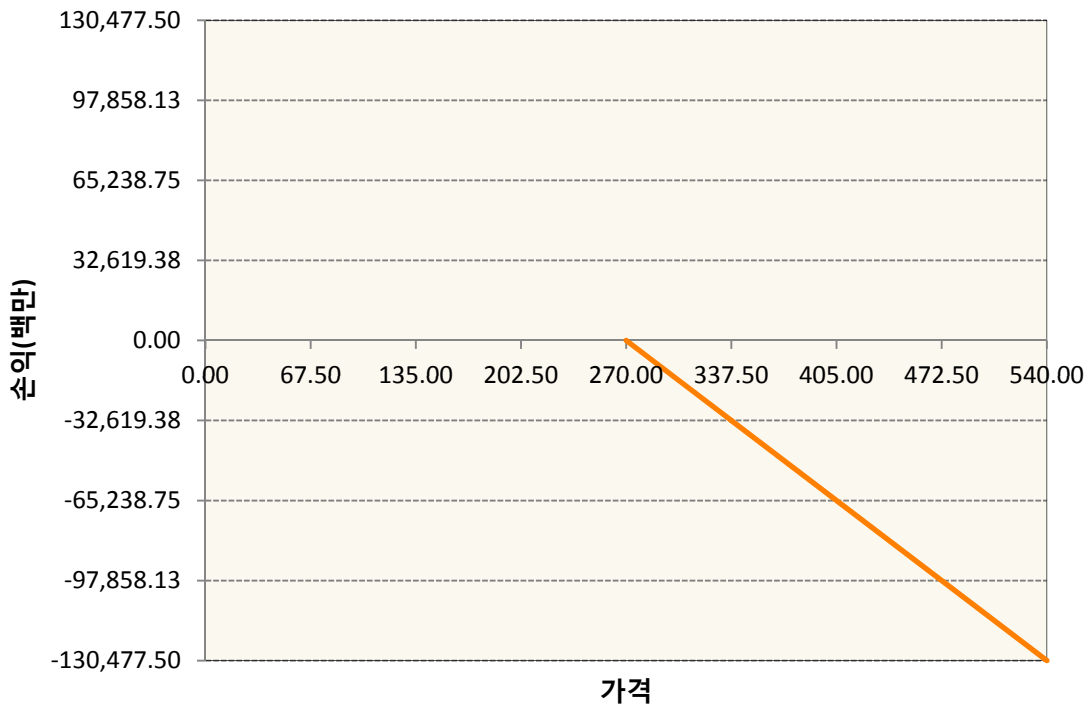
1. 계약금액

(단위:백만원)

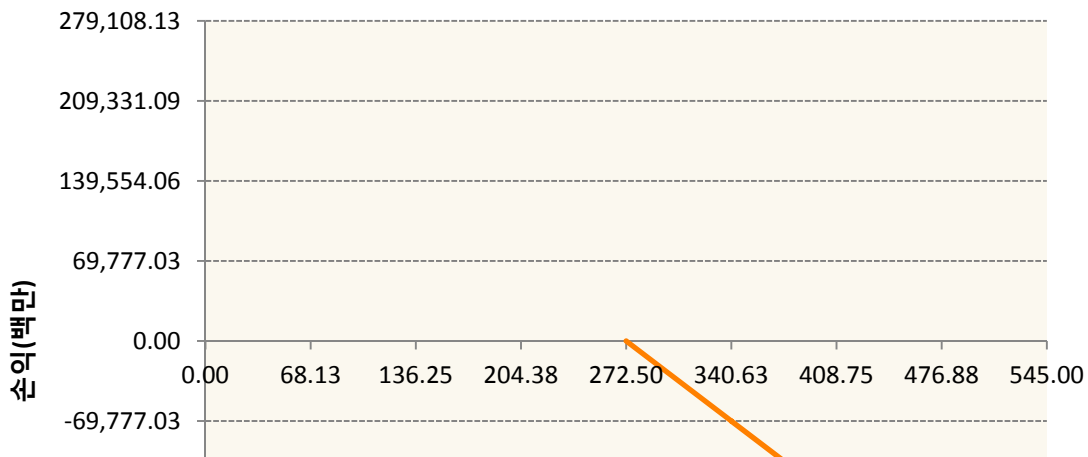
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	612,086	-612,086	장내

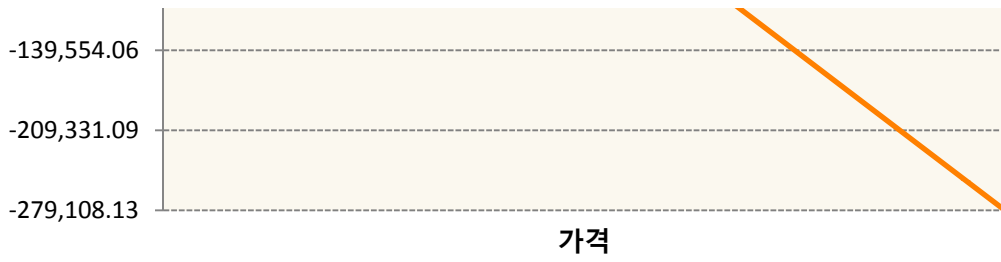
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P72700-2019-07 콜270



KR4201P72726-2019-07 콜272.5





KR4301P72708-2019-07 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P72700		2019-07 콜270					8,045
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,259	3,186	3,094	2,984	2,858	2,717	2,563
-5.33%	2,965	2,810	2,638	2,452	2,255	2,048	1,834
-2.67%	2,236	1,994	1,746	1,493	1,237	977	715
0%	846	564	282	0	-282	-564	-846
2.67%	-1,282	-1,533	-1,791	-2,053	-2,318	-2,587	-2,857
5.33%	-4,032	-4,207	-4,399	-4,604	-4,821	-5,046	-5,280
8.00%	-7,185	-7,282	-7,400	-7,538	-7,693	-7,862	-8,045
KR4201P72726		2019-07 콜272.5					16,172
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,824	5,710	5,558	5,367	5,142	4,884	4,597

-5.33%	5,388	5,119	4,811	4,467	4,094	3,697	3,279
-2.67%	4,207	3,746	3,264	2,765	2,252	1,729	1,197
0%	1,777	1,186	594	0	-595	-1,190	-1,786
2.67%	-2,197	-2,774	-3,356	-3,943	-4,533	-5,126	-5,721
5.33%	-7,602	-8,041	-8,508	-8,997	-9,504	-10,025	-10,558
8.00%	-14,028	-14,293	-14,603	-14,951	-15,331	-15,740	-16,172
KR4301P72708 2019-07 풋270							13,293
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-13,153	-13,158	-13,168	-13,185	-13,211	-13,247	-13,293
-5.33%	-7,813	-7,859	-7,921	-8,000	-8,093	-8,201	-8,321
-2.67%	-2,873	-3,039	-3,218	-3,407	-3,605	-3,810	-4,020
0%	765	510	255	0	-255	-510	-765
2.67%	2,520	2,343	2,153	1,953	1,745	1,531	1,311
5.33%	3,008	2,949	2,871	2,776	2,665	2,539	2,401
8.00%	3,083	3,073	3,054	3,025	2,985	2,932	2,867

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

(단위:백만원)

37,732

공시일	2019-06-18
기준일	2019-06-17

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

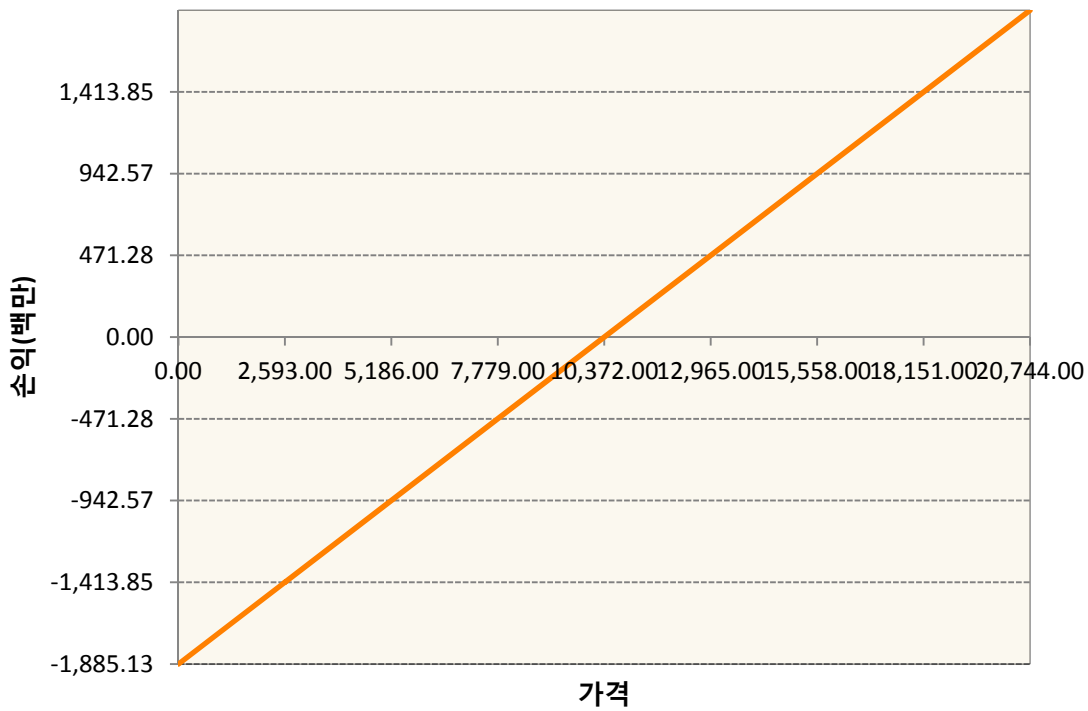
1. 계약금액

(단위:백만원)

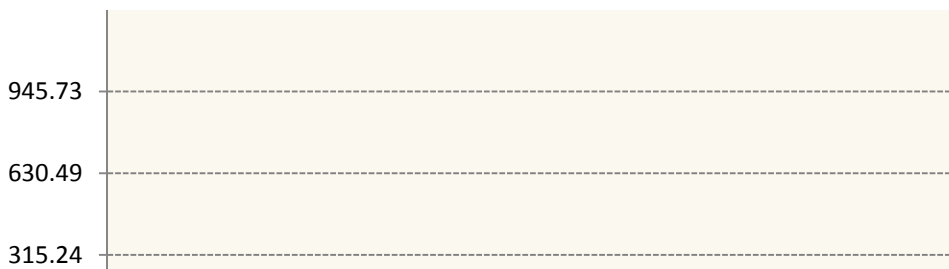
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,885	0	1,885	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,068	-5,068	장내
누계	통화	선도	152	3,183	-3,031	장외

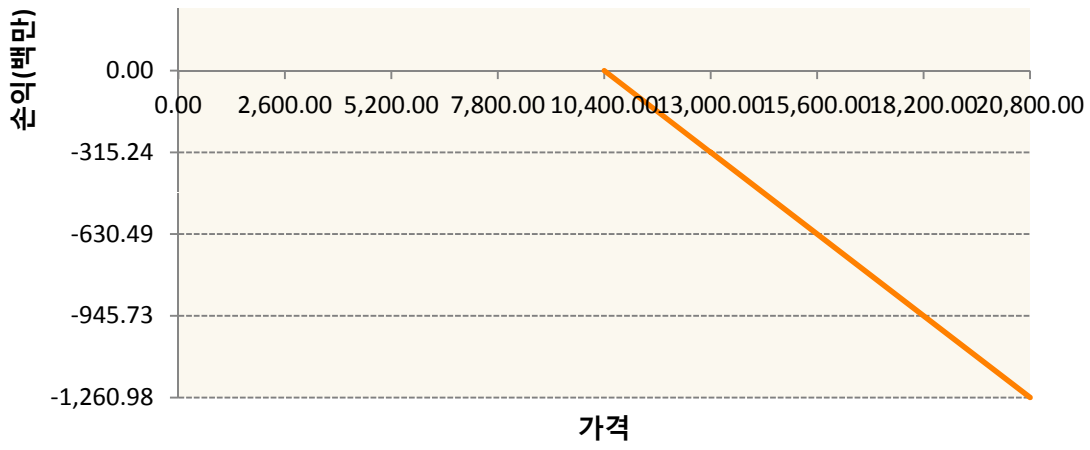
2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19

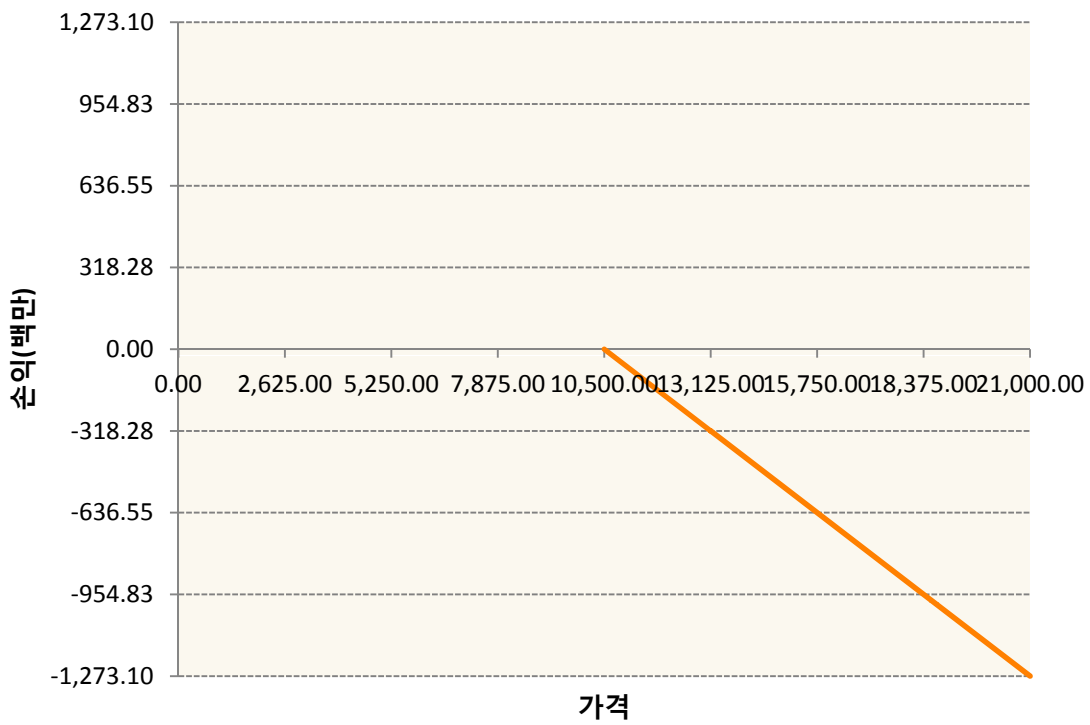


OHHIM9-C104-HSCEI

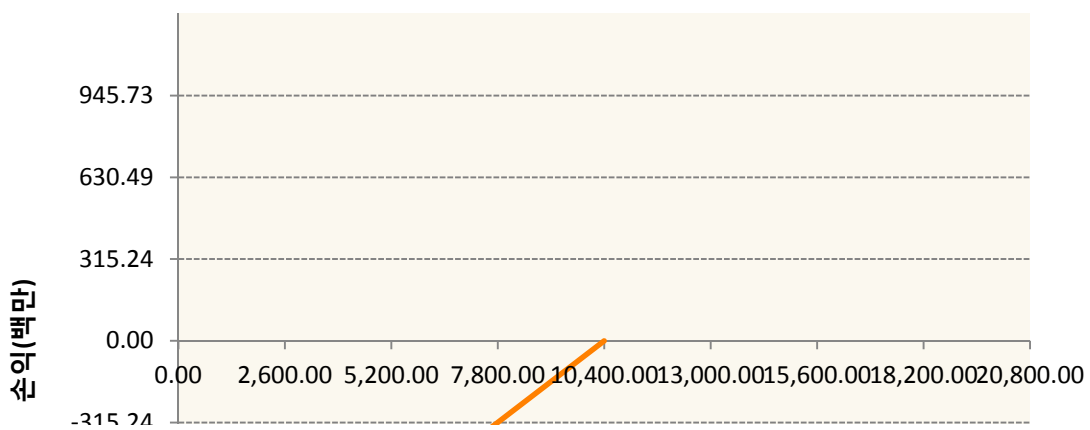


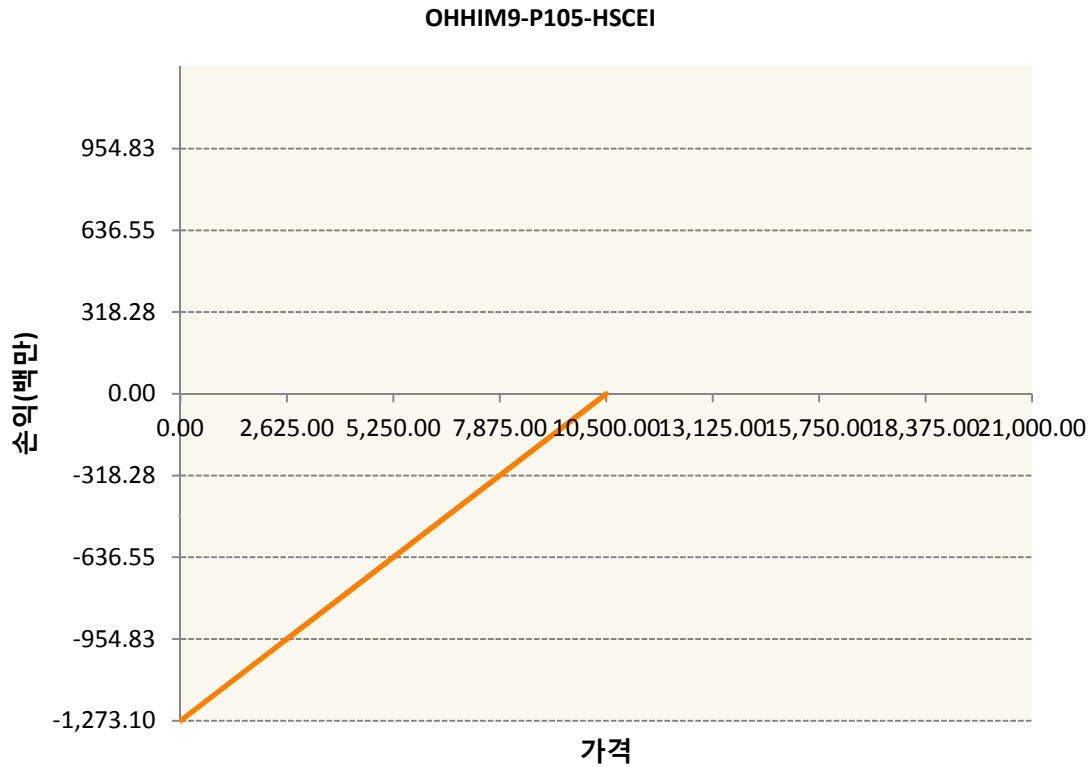


OHHIM9-C105-HSCEI



OHHIM9-P104-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	255
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)

653

공시일	2019-06-18
기준일	2019-06-17

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

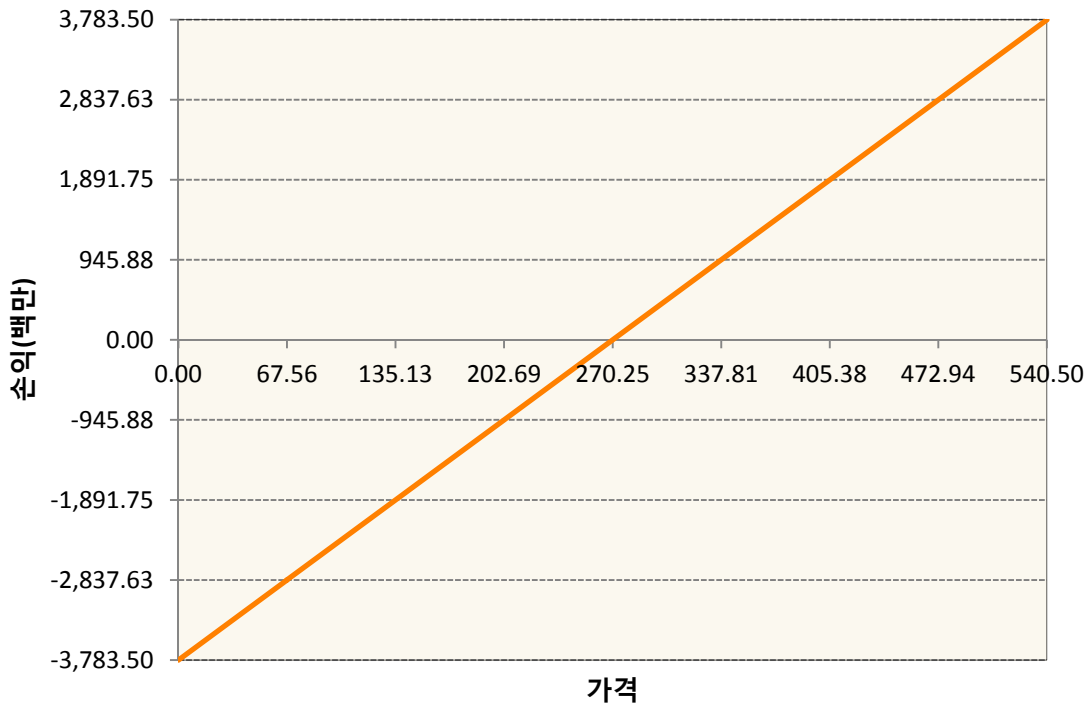
1. 계약금액

(단위:백만원)

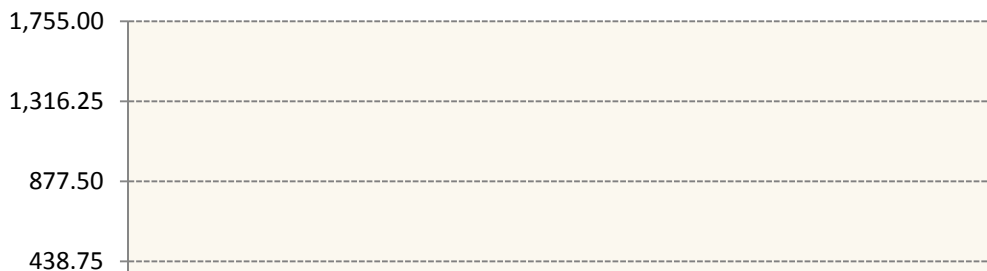
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,784	0	3,784	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	21,555	-21,555	장내

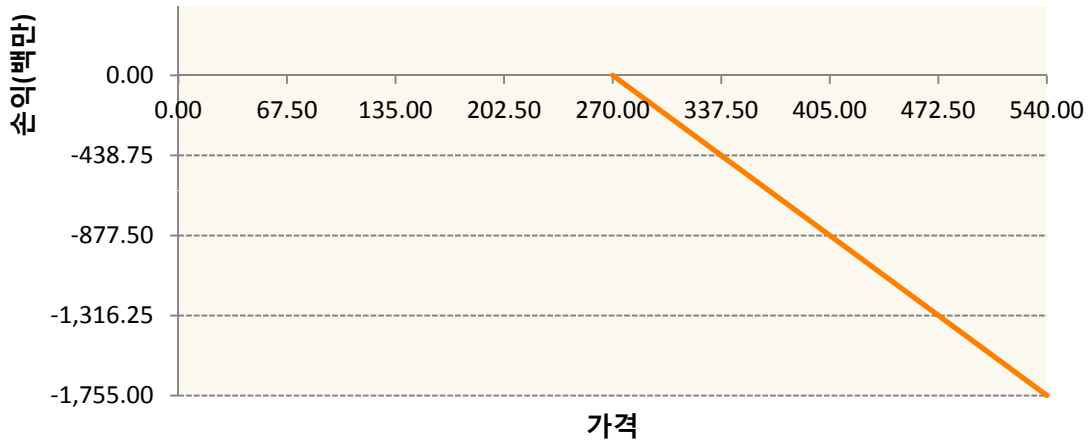
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

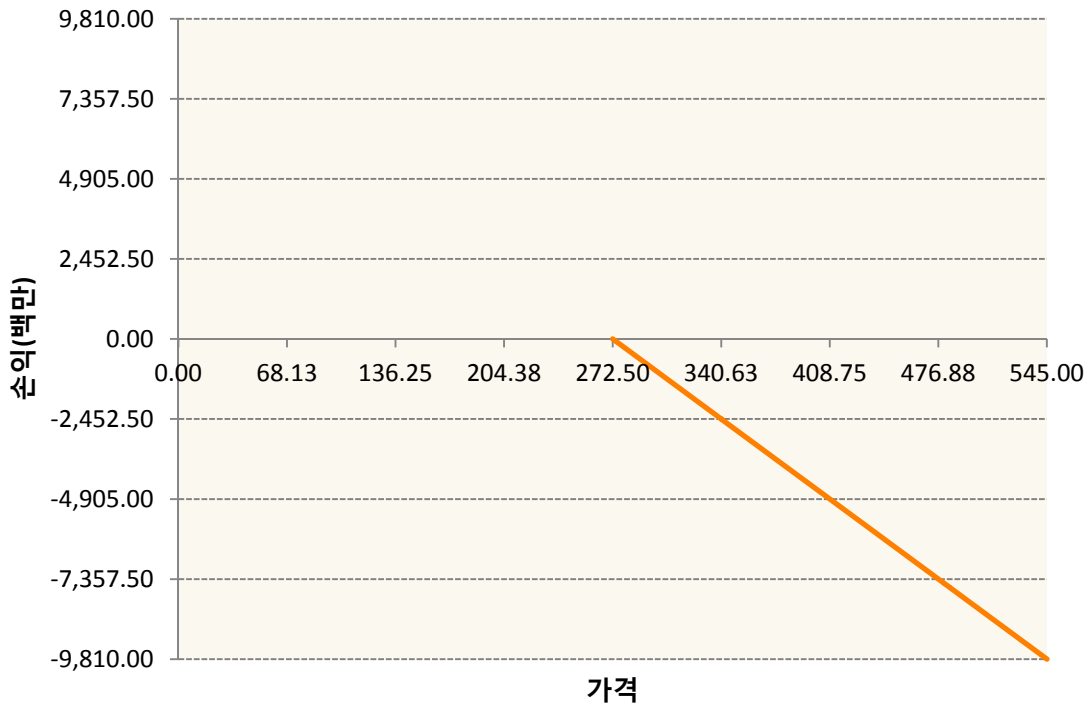


KR4201P72700-2019-07 콜270

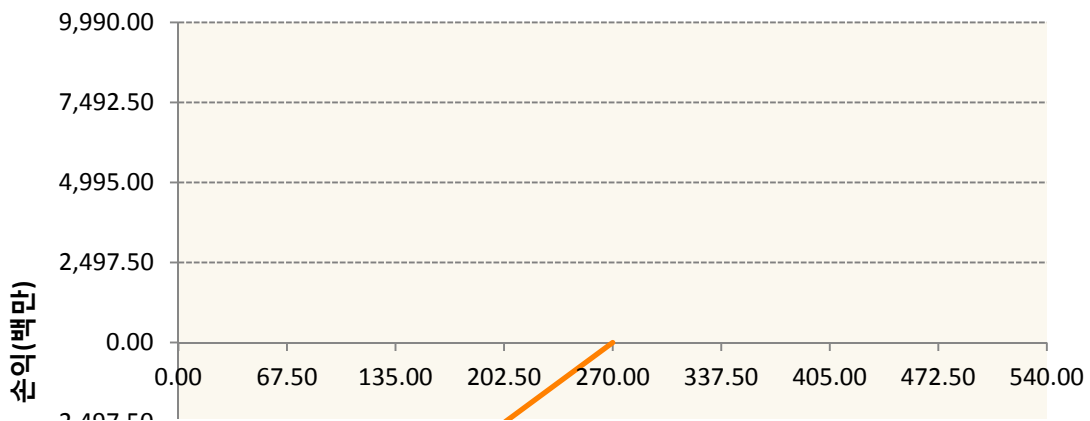




KR4201P72726-2019-07 콜272.5



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						108
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	44	43	42	40	38	37	34
-5.33%	40	38	35	33	30	28	25
-2.67%	30	27	23	20	17	13	10
0%	11	8	4	0	-4	-8	-11
2.67%	-17	-21	-24	-28	-31	-35	-38
5.33%	-54	-57	-59	-62	-65	-68	-71
8.00%	-97	-98	-100	-101	-103	-106	-108
KR4201P72726 2019-07 콜272.5							568
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	205	201	195	189	181	172	162
-5.33%	189	180	169	157	144	130	115
-2.67%	148	132	115	97	79	61	42
0%	62	42	21	0	-21	-42	-63
2.67%	-77	-97	-118	-139	-159	-180	-201
5.33%	-267	-283	-299	-316	-334	-352	-371
8.00%	-493	-502	-513	-525	-539	-553	-568
KR4301P72708 2019-07 풋270							656
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-649	-649	-650	-650	-652	-654	-656
-5.33%	-385	-388	-391	-395	-399	-405	-411
-2.67%	-142	-150	-159	-168	-178	-188	-198
0%	38	25	13	0	-13	-25	-38
2.67%	124	116	106	96	86	76	65
5.33%	148	145	142	137	131	125	118
8.00%	152	152	151	149	147	145	141

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

(단위:백만원)

3,414

공시일	2019-06-18
기준일	2019-06-17

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

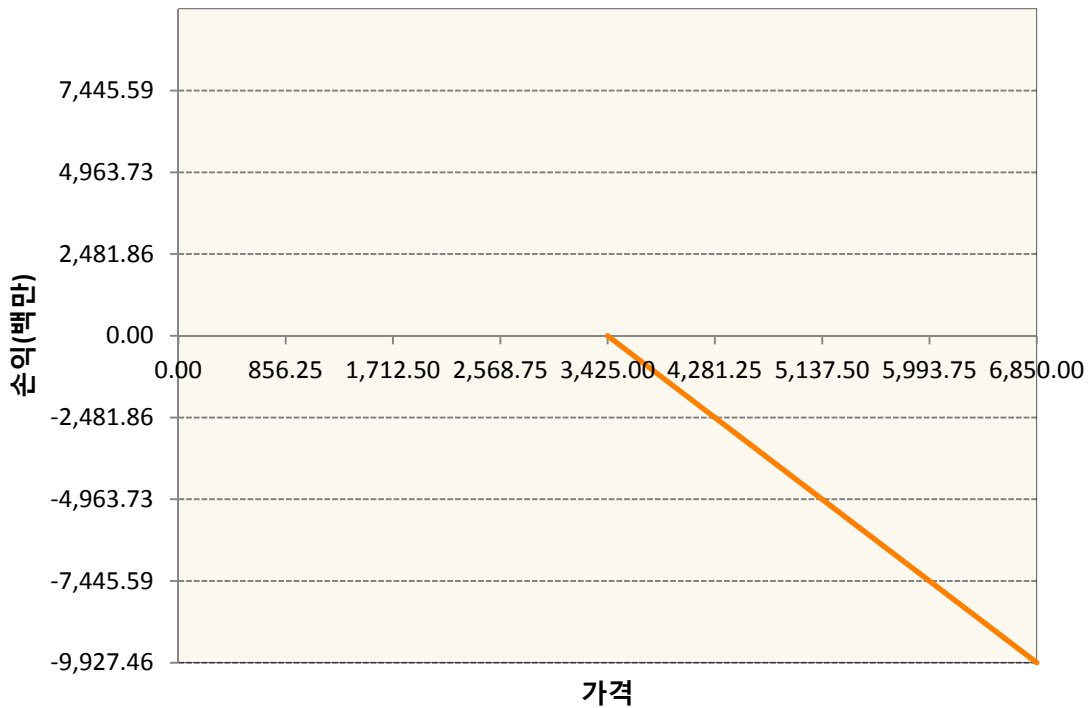
1. 계약금액

(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	3,691	0	3,691	
누계	유가증권	스왑	56,280	0	56,280	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,405	-20,405	장내
누계	통화	선도	0	18,614	-18,614	장외

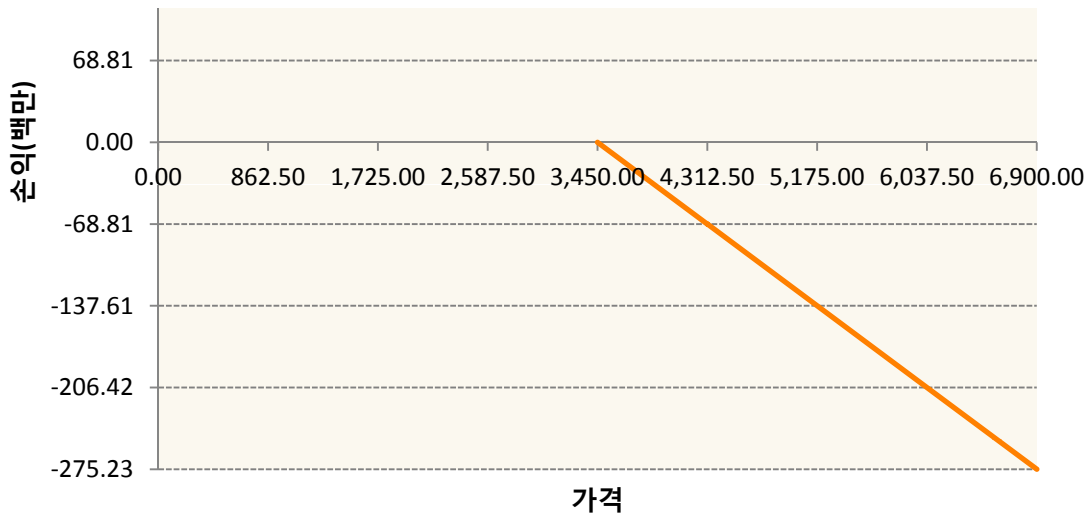
2. 만기시점의 손익구조

OESXM9-C3425-EURO STOXX 50

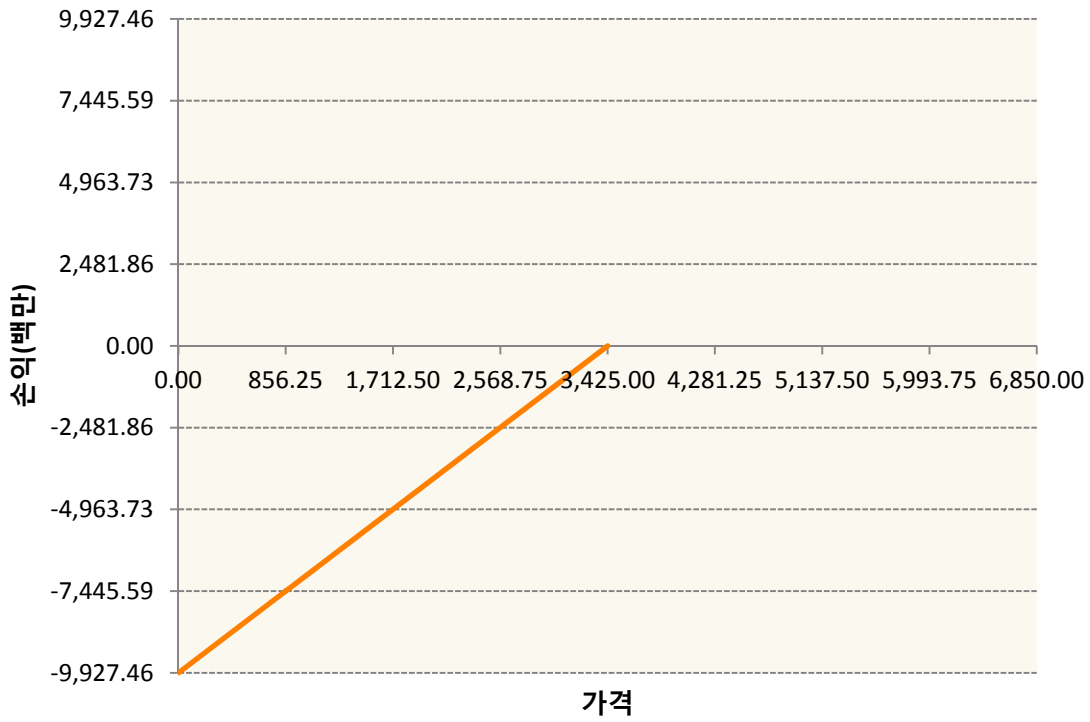


OESXM9-C3450-EURO STOXX 50

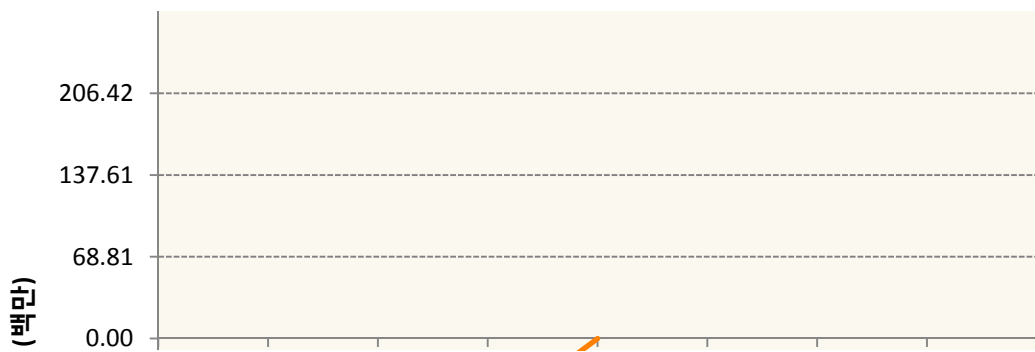


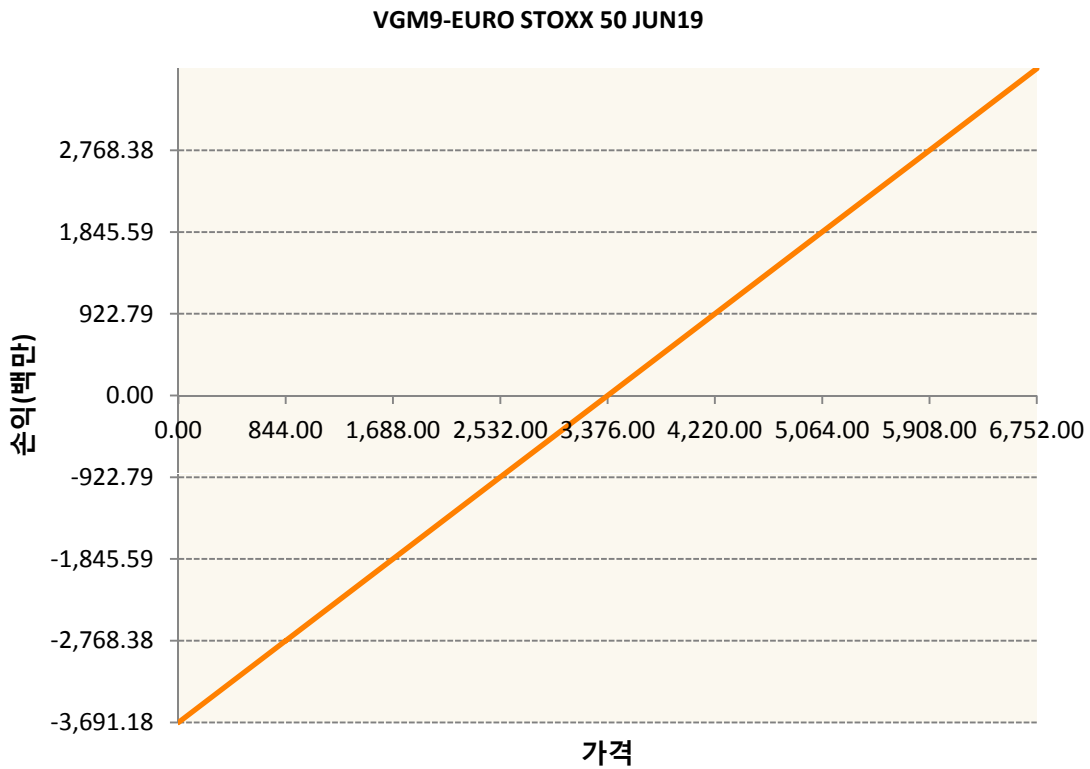
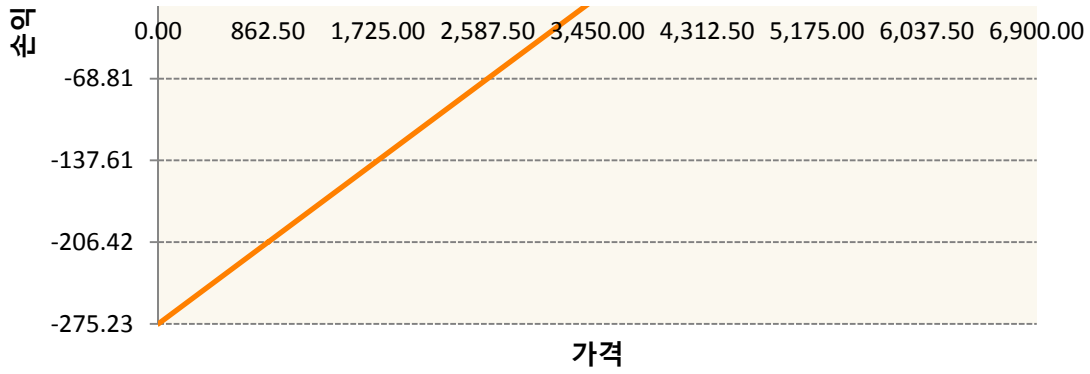


OESXM9-P3425-EURO STOXX 50



OESXM9-P3450-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	15
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	851
FX21019J01: KRW/EUR 28-06-19E	213
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	425
OESXM9-C3·EURO STOXX 50	794
OESXM9-C3·EURO STOXX 50	22
OESXM9-P3·EURO STOXX 50	794
OESXM9-P3·EURO STOXX 50	22
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	295

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

(단위:백만원)

2,128

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

(단위:백만원)

1,028

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

(단위:백만원)

91

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

(단위:백만원)

132

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-06-18
기준일	2019-06-17

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

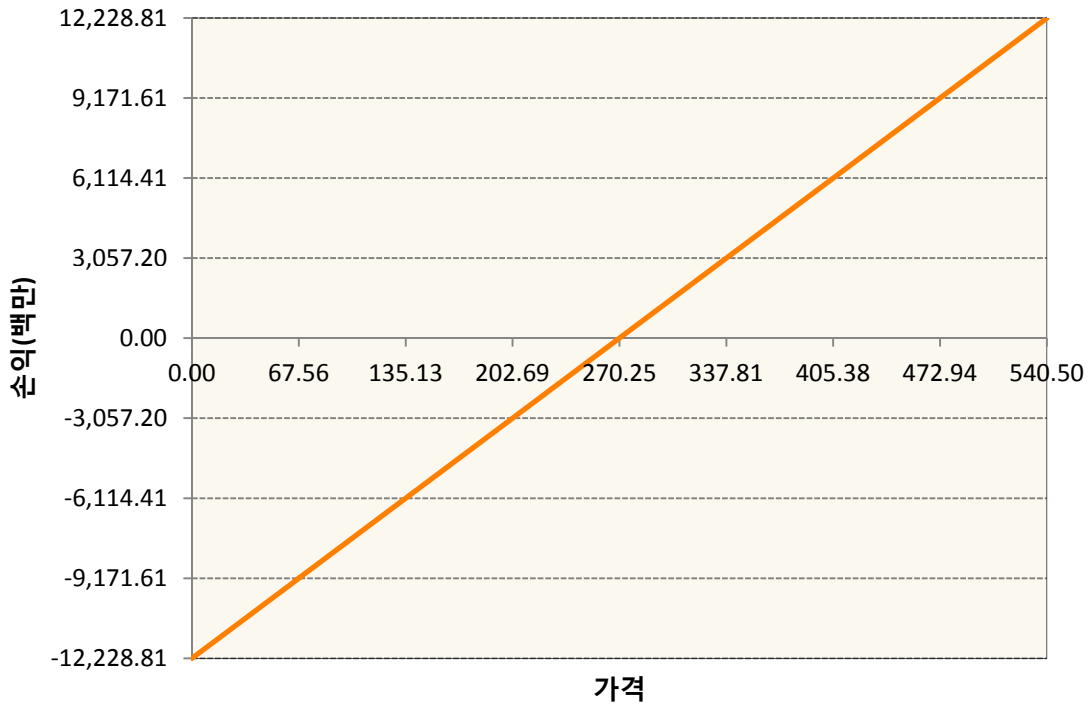
1. 계약금액

(단위:백만원)

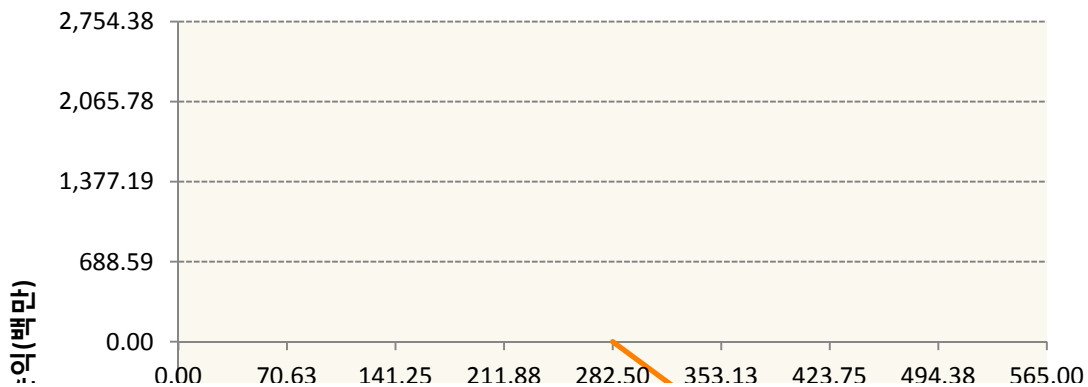
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,229	0	12,229	장내
누계	유가증권	옵션	1,084	22,206	-21,121	장내

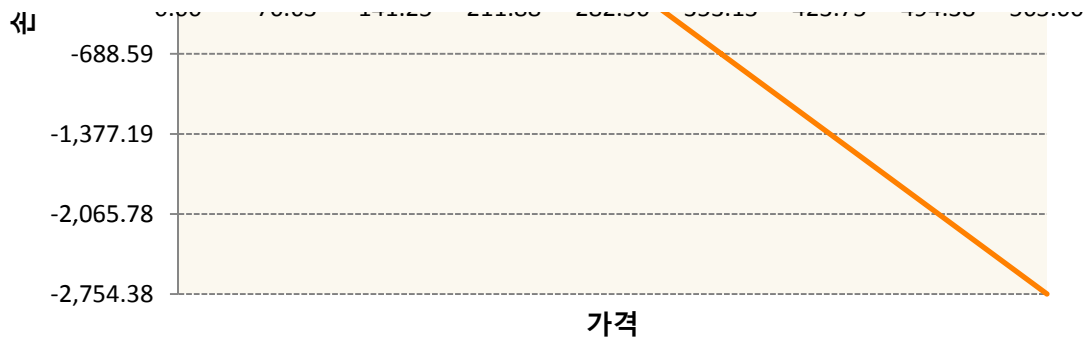
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

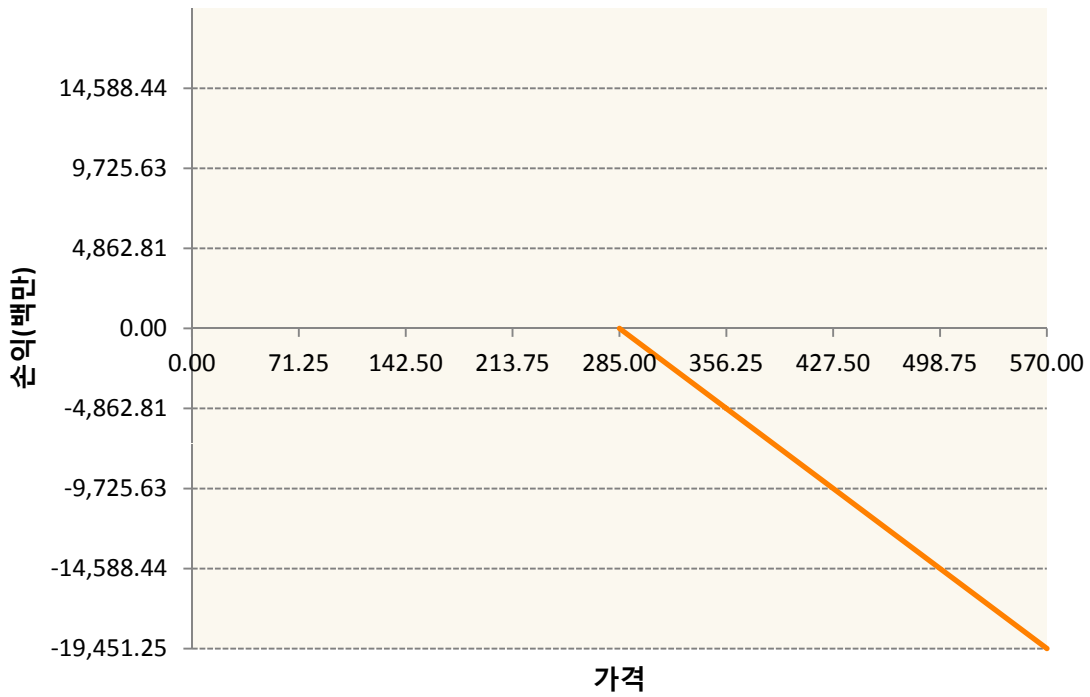


KR4201P72825-2019-07 콜282.5

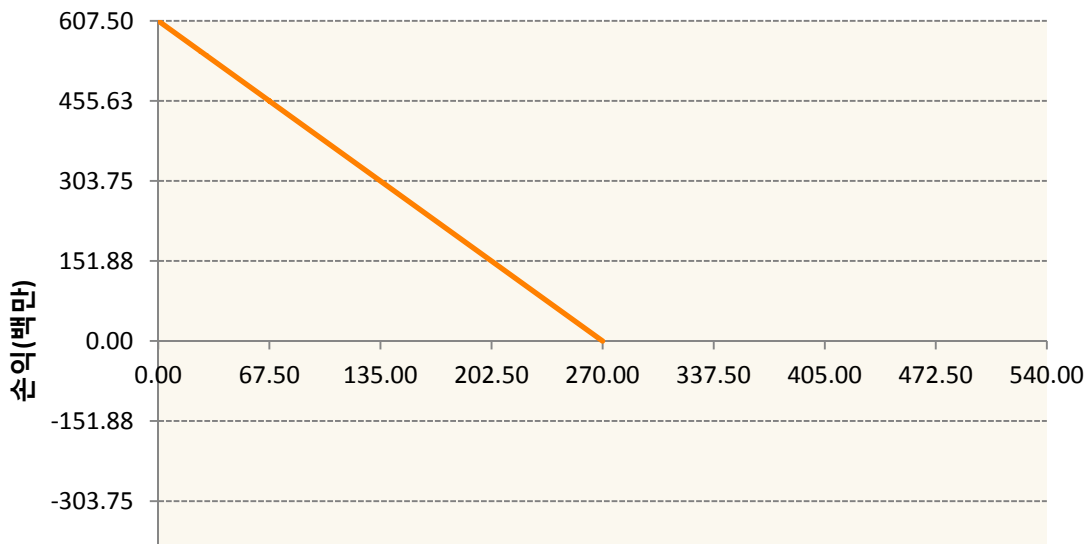


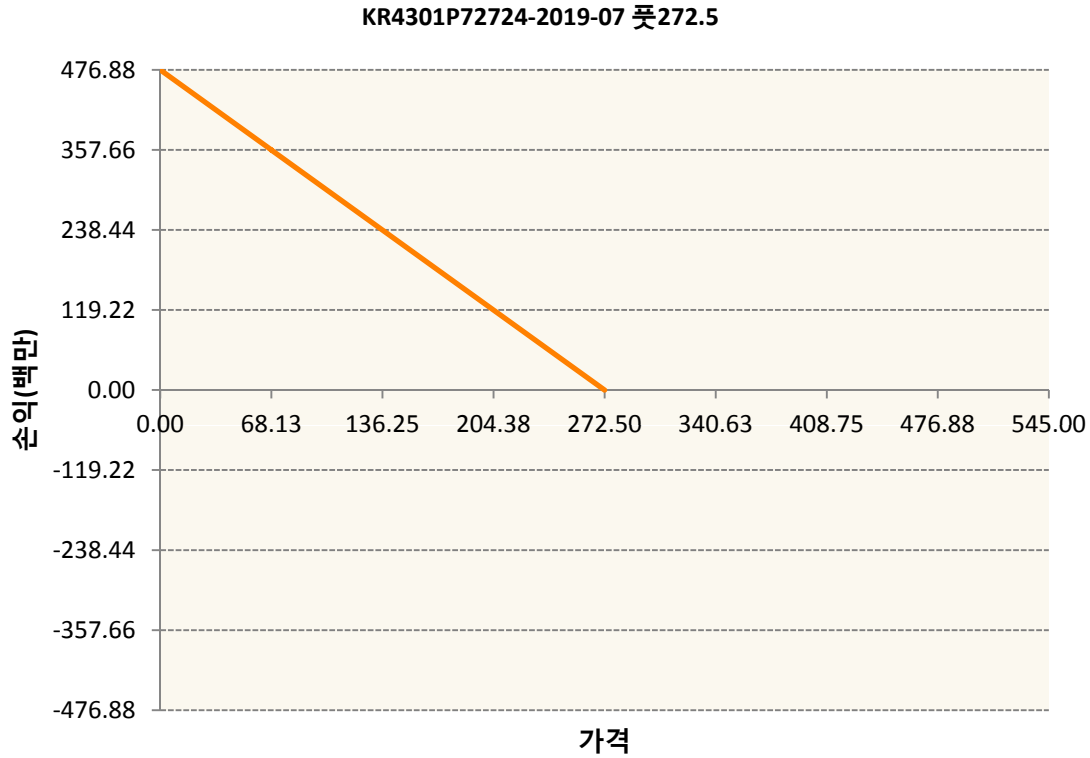
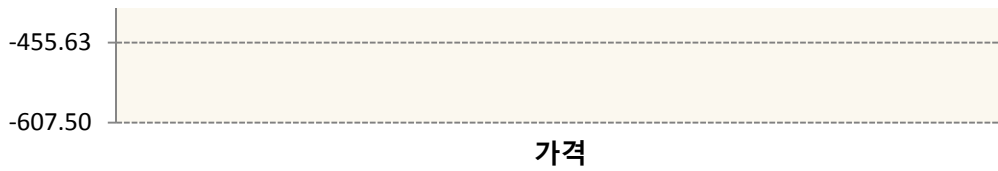


KR4201P72858-2019-07 콜285



KR4301P72708-2019-07 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						978
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-978	-978	-978	-978	-978	-978	-978	
-5.33%	-652	-652	-652	-652	-652	-652	-652	
-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%	652	652	652	652	652	652	652	
8.00%	978	978	978	978	978	978	978	
KR4201P72825		2019-07 콜282.5						116
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	25	25	24	24	23	21	20	
-5.33%	24	23	22	21	19	16	14	
-2.67%	21	19	16	14	10	7	3	

0%	13	9	4	0	-5	-9	-14
2.67%	-6	-11	-17	-23	-28	-34	-40
5.33%	-38	-44	-50	-56	-62	-68	-74
8.00%	-84	-89	-94	-100	-105	-111	-116
KR4201P72858 2019-07 콜285							746
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	139	137	135	132	127	120	112
-5.33%	135	131	125	116	105	92	77
-2.67%	121	110	95	78	58	36	13
0%	77	54	28	0	-30	-61	-93
2.67%	-25	-61	-98	-135	-173	-212	-251
5.33%	-216	-258	-300	-342	-384	-426	-468
8.00%	-506	-545	-584	-624	-664	-705	-746
KR4301P72708 2019-07 풋270							40
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	39	39	40	40	40	40	40
-5.33%	23	24	24	24	24	25	25
-2.67%	9	9	10	10	11	11	12
0%	-2	-2	-1	0	1	2	2
2.67%	-8	-7	-6	-6	-5	-5	-4
5.33%	-9	-9	-9	-8	-8	-8	-7
8.00%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
KR4301P72724 2019-07 풋272.5							33
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	33	33	33	33	33	33	33
-5.33%	20	20	20	20	21	21	21
-2.67%	8	8	9	9	9	10	10
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-7	-7	-6	-6	-5	-5	-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)

1,547

공시일	2019-06-18
기준일	2019-06-17

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	18,936	0	18,936	

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	2019-06-18
기준일	2019-06-17

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	59,166	0	59,166	

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	2019-06-18
기준일	2019-06-17

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	385,643	0	385,643	
누계	통화	선도	0	455,141	-455,141	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		380
FX21019J024 KRW/USD 24-06-19E		949
FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E		380
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		76
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		999
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E		1,025
FX21019K00 KRW/USD 18-06-19E		570
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		570
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		475
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		570
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,424
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,329
FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E		475
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E		797
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E		634
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		475
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		380
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		797
FX21019K02 KRW/USD 24-06-19E		380
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E		949
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E		1,519
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E		285
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E		1,234
FX21019K04 KRW/USD 28-06-19E		1,291
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		664
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		570

FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	759
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	759
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	475
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	285
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	949
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	190
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	883
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	1,054
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	1,898
FX21019M00 KRW/USD 15-07-19E	475
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	380
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	664
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	949
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	664
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	664
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E	570
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E	3,037
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E	2,278
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E	285

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

(단위:백만원)

12,086

공시일	2019-06-18
기준일	2019-06-17

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

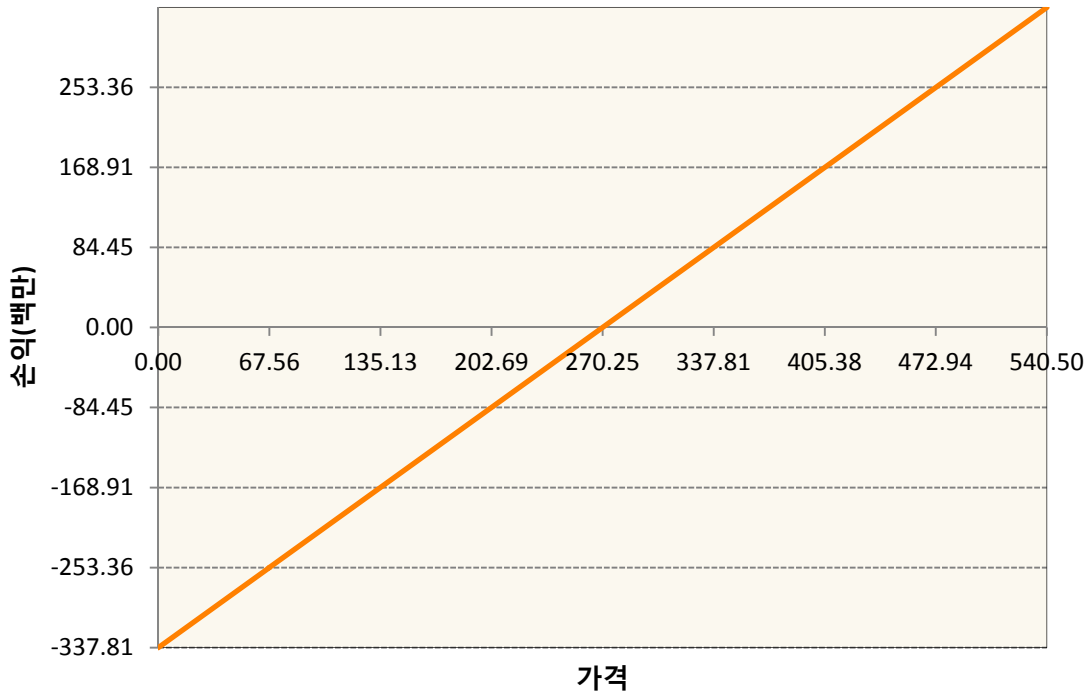
1. 계약금액

(단위:백만원)

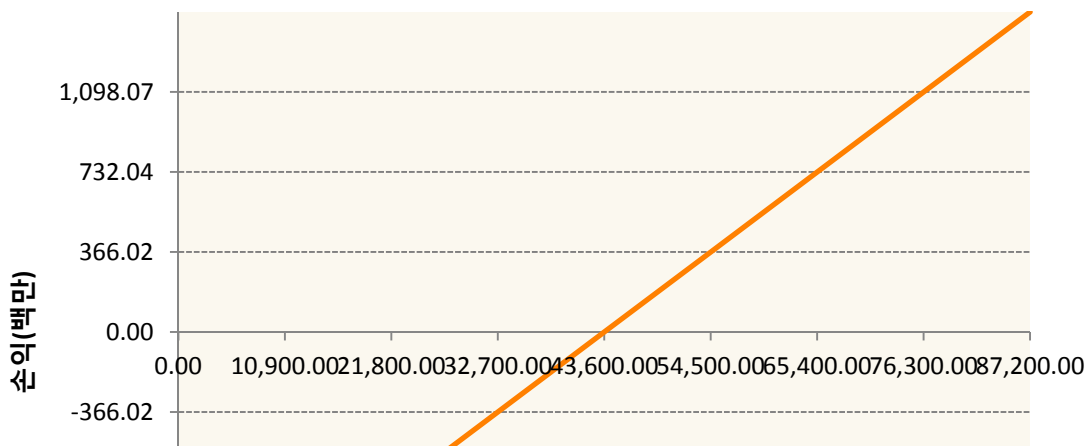
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,802	0	1,802	장내

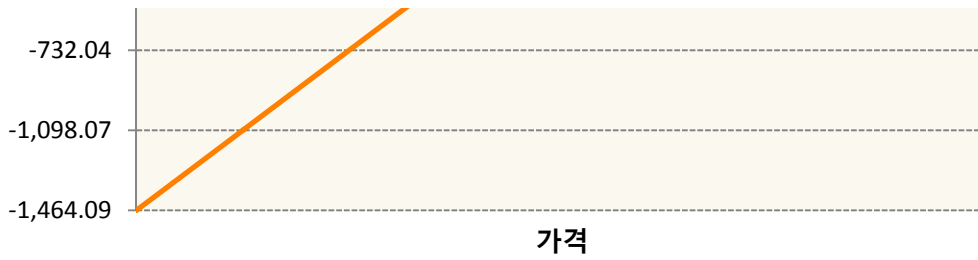
2. 만기시점의 손익구조

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	2019-06-18
기준일	2019-06-17

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

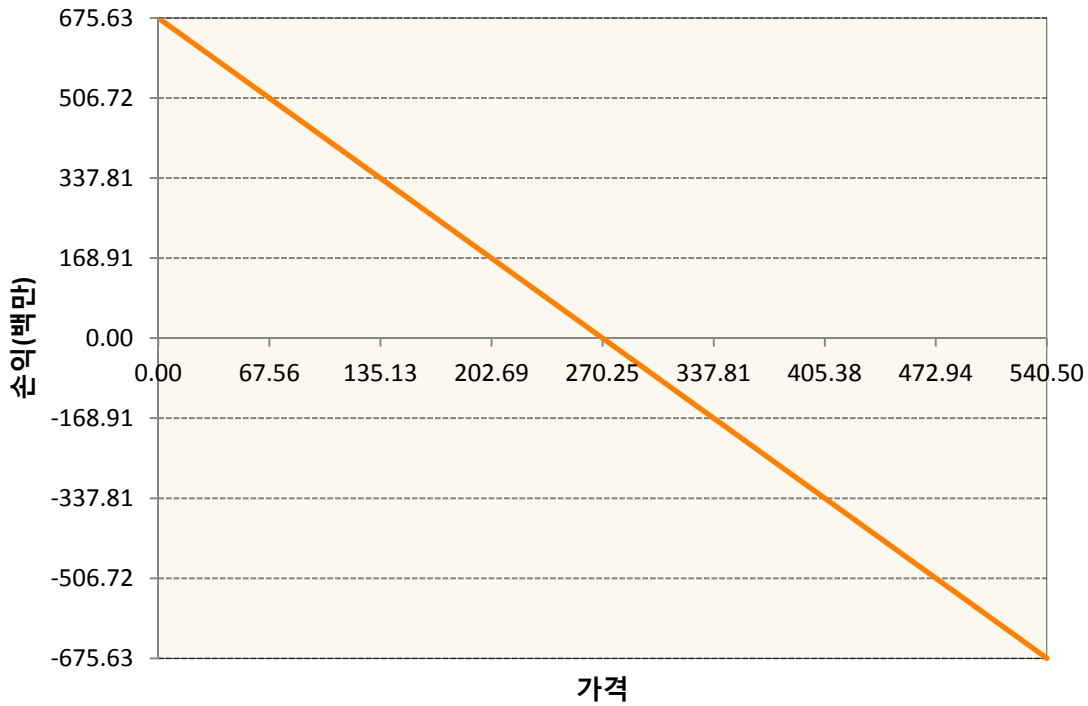
1. 계약금액

(단위:백만원)

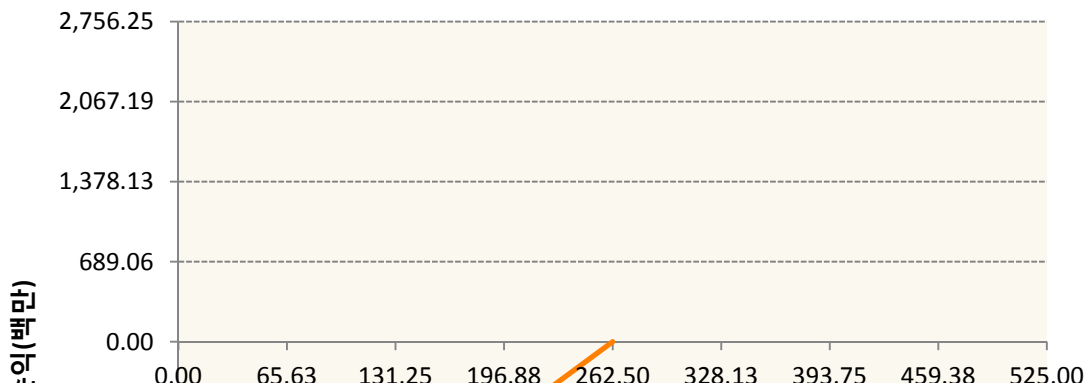
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	66	-66	장내
누계	유가증권	선물	0	676	-676	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,419	-3,419	장내

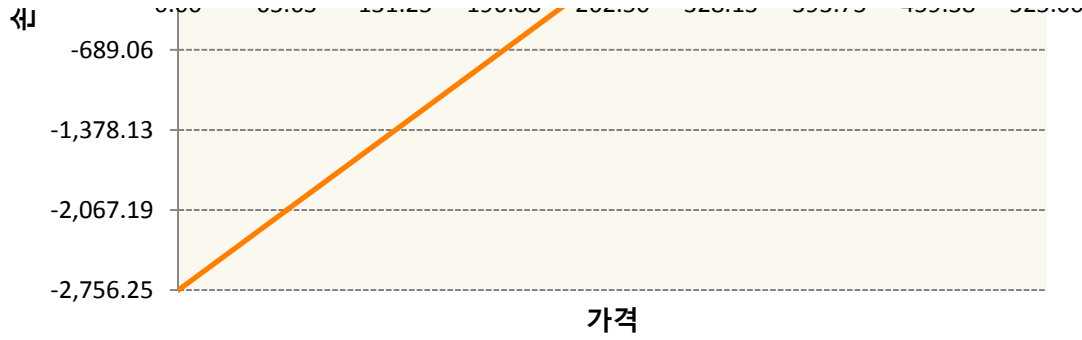
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

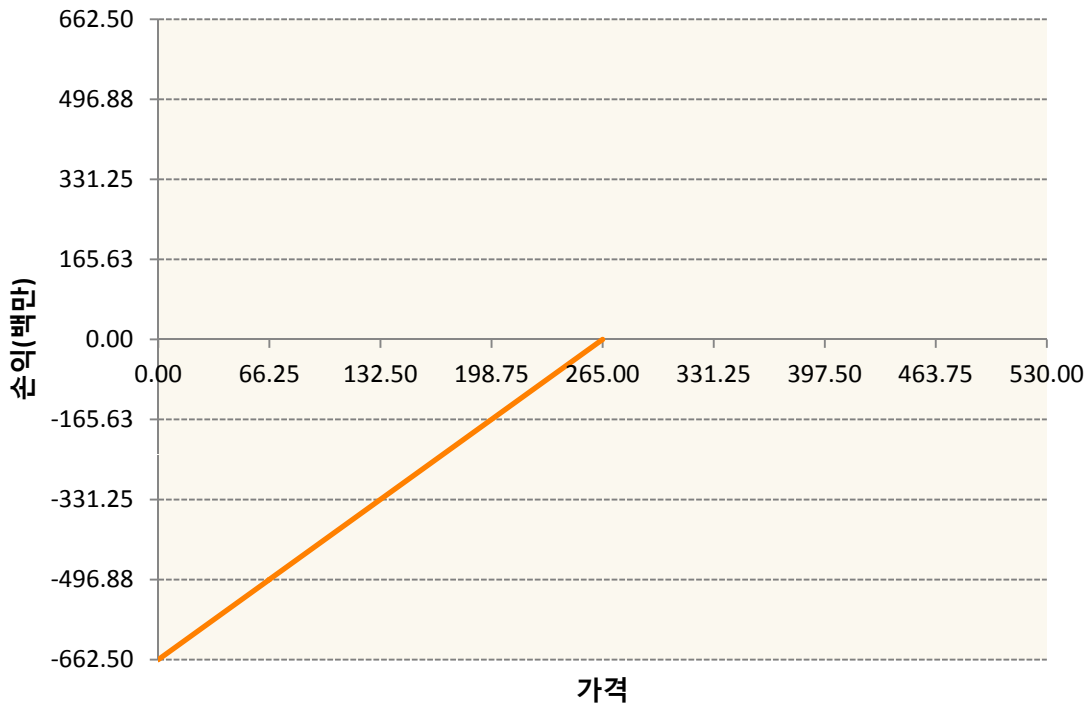


KR4301P72625-2019-07 풋262.5





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						142
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-135	-136	-137	-138	-139	-140	-142
-5.33%	-66	-68	-71	-73	-76	-79	-82
-2.67%	-16	-19	-23	-26	-30	-33	-37
0%	7	5	3	0	-3	-6	-9
2.67%	13	13	12	11	9	8	6
5.33%	14	14	14	14	13	12	12
8.00%	14	14	14	14	14	14	14

KR4301P72658

2019-07 풋265

38

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-38
-5.33%	-19	-20	-20	-21	-21	-22	-22
-2.67%	-6	-6	-7	-8	-9	-10	-10
0%	2	1	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)

209

공시일	2019-06-18
기준일	2019-06-17

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

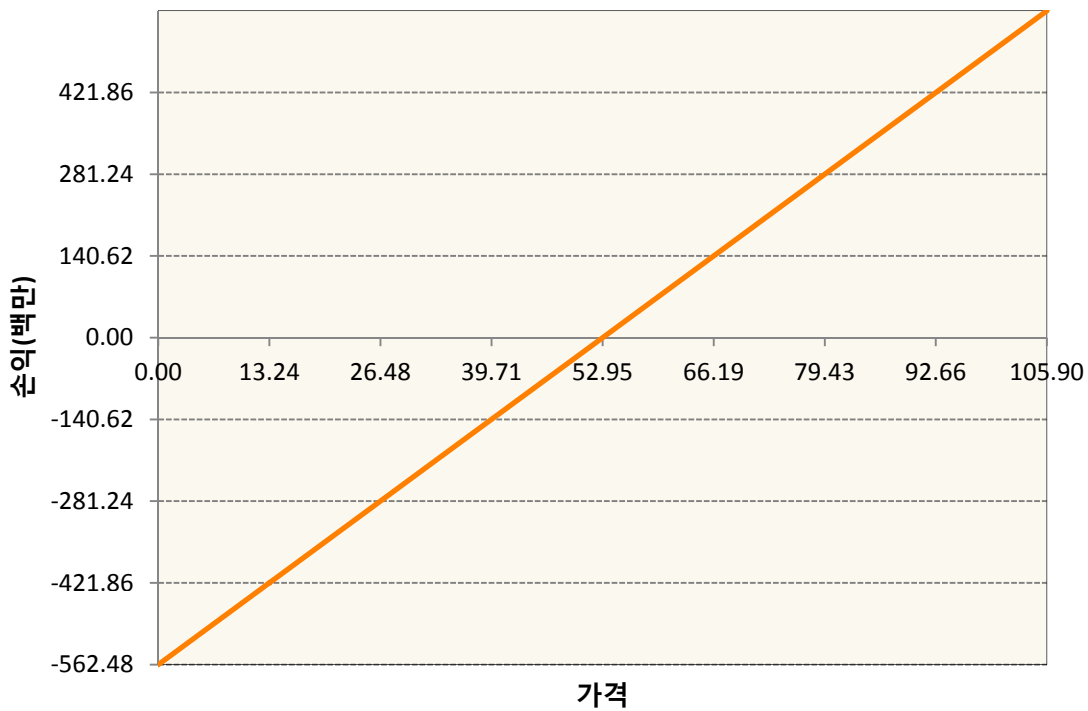
1. 계약금액

(단위:백만원)

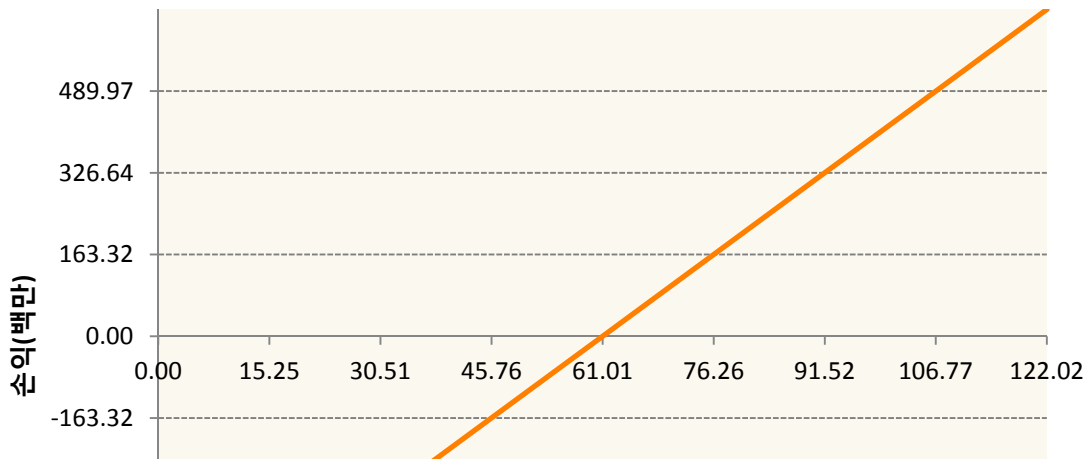
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,504	119	2,385	

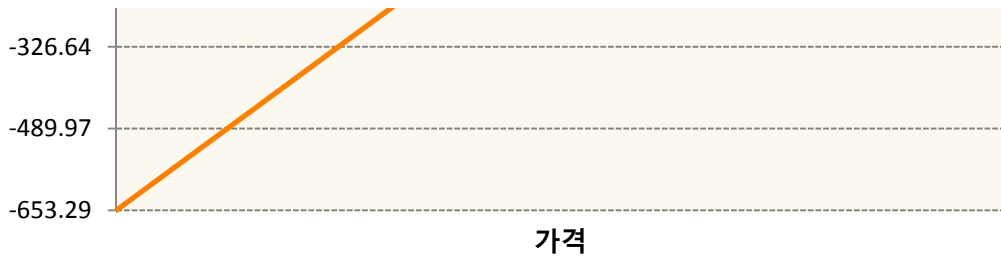
2. 만기시점의 손익구조

CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19

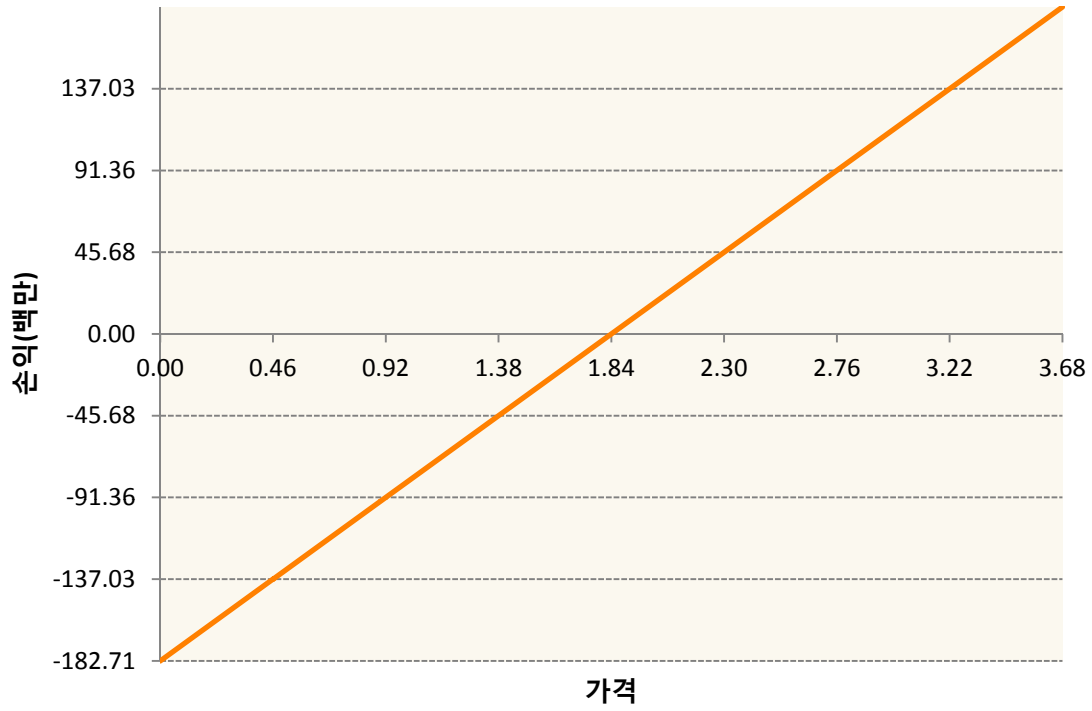


COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19

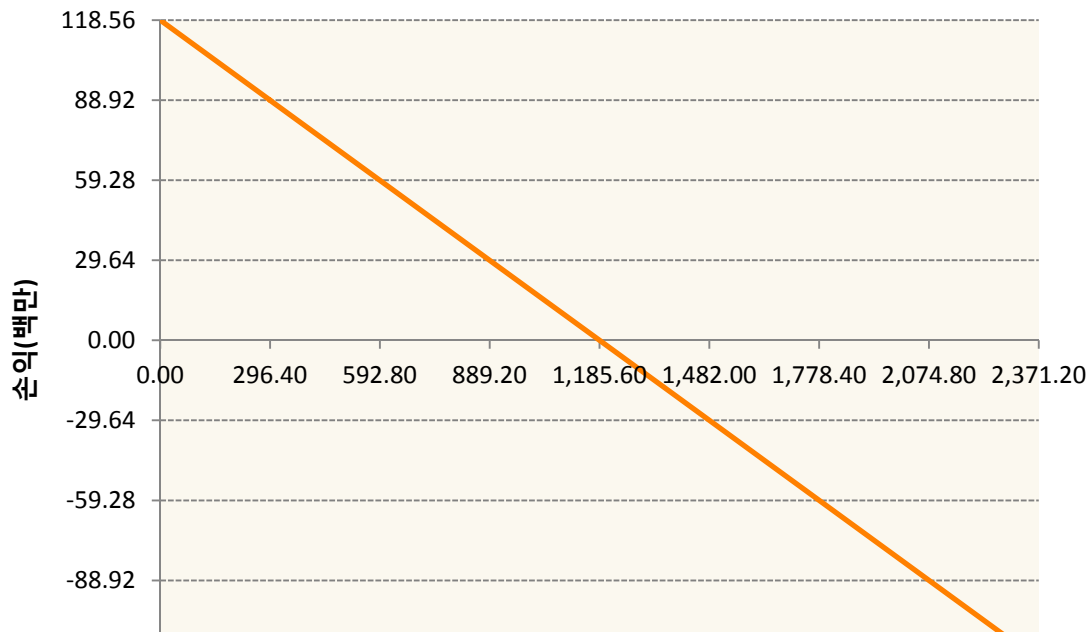


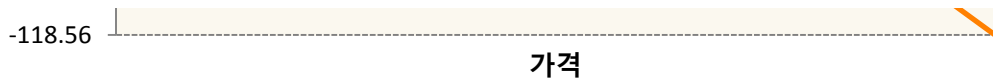


HOU9-NY Harb ULSD Fut Sep19



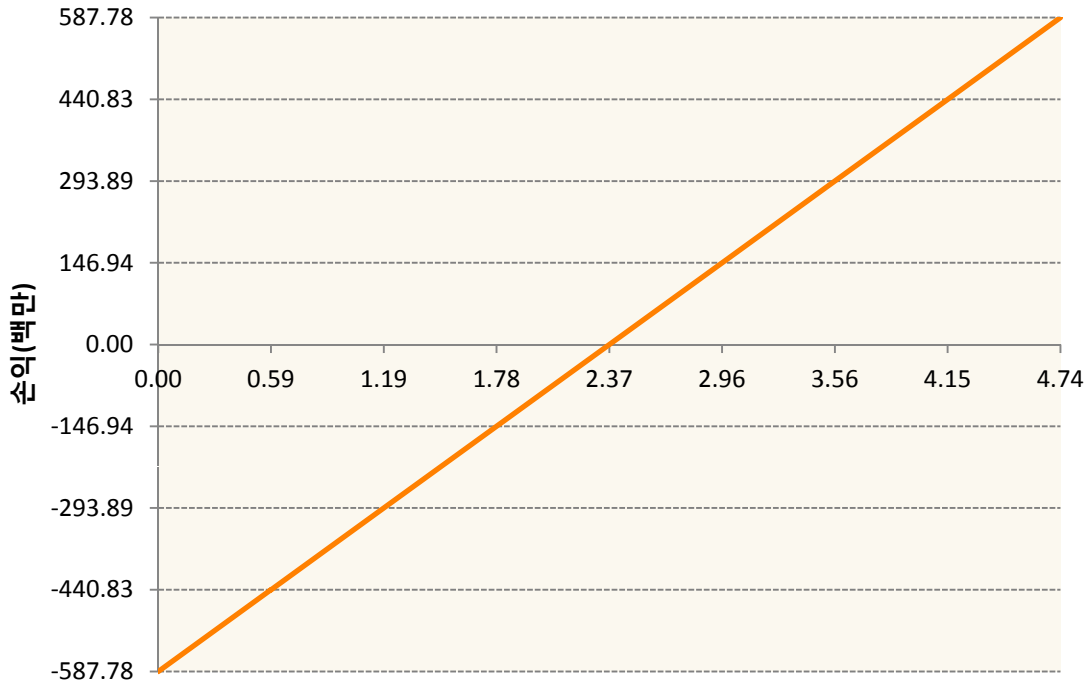
KR4175P70007-2019-07 달러선물





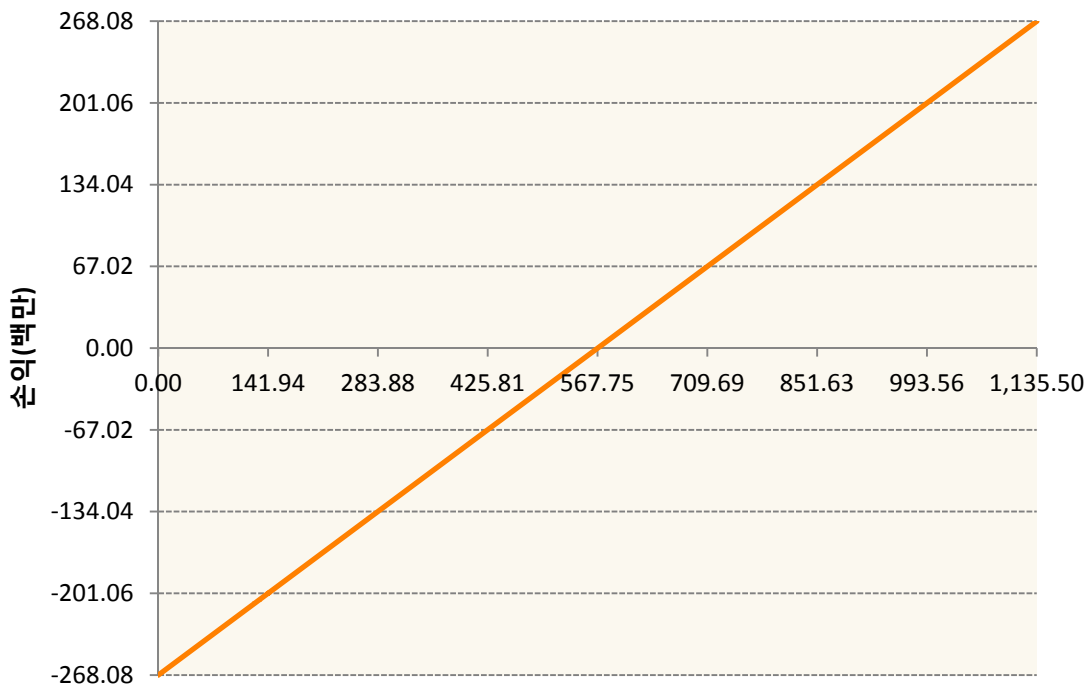
가격

NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



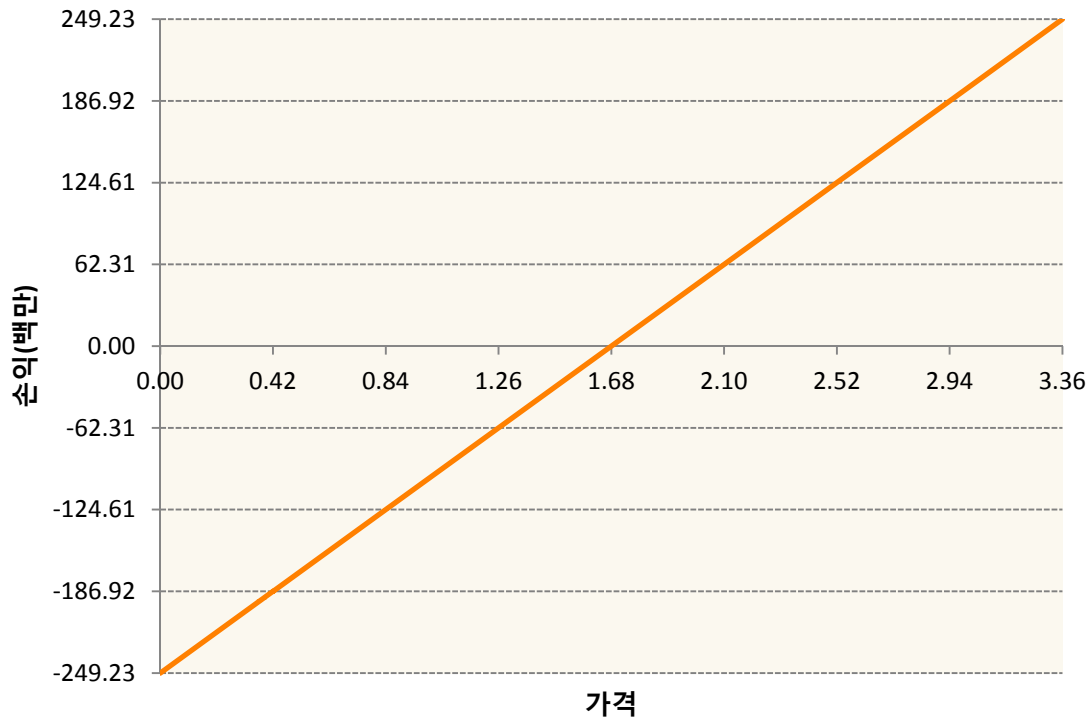
가격

QSU9-Low Su Gasoil G Sep19



가격

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	15
KR4175P700	2019-07 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)

372

공시일	2019-06-18
기준일	2019-06-17

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

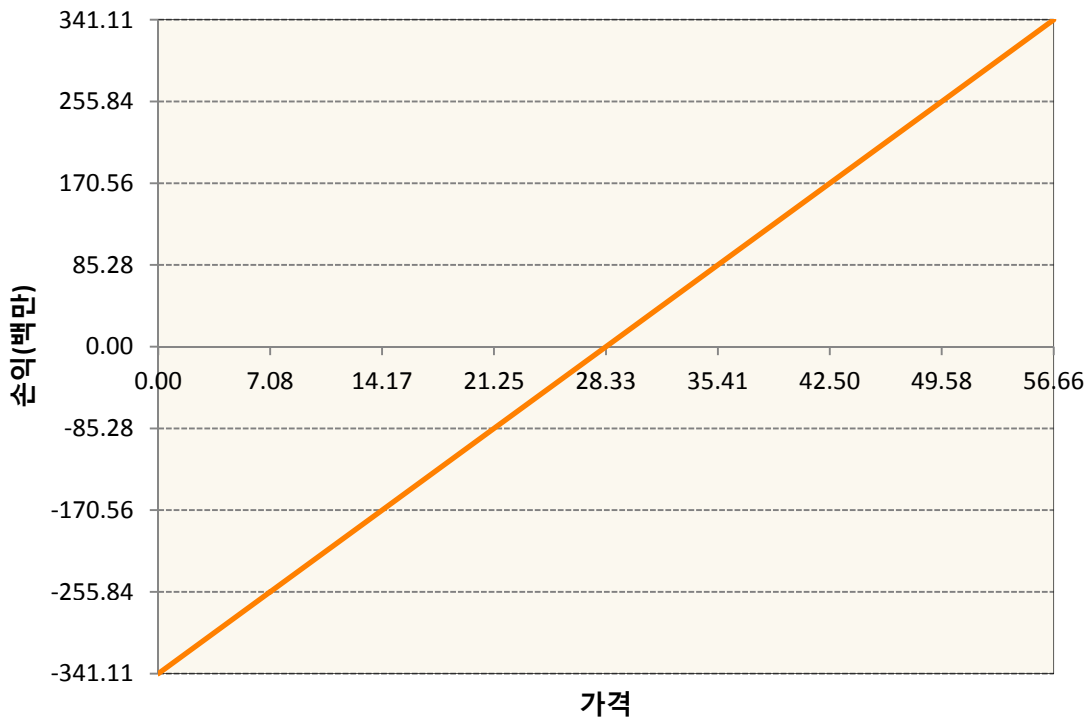
1. 계약금액

(단위:백만원)

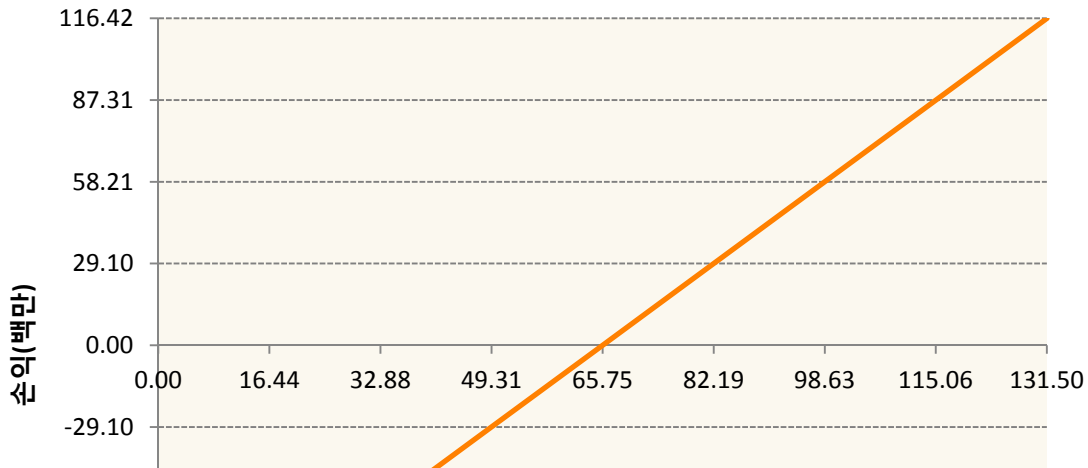
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,330	202	3,129	

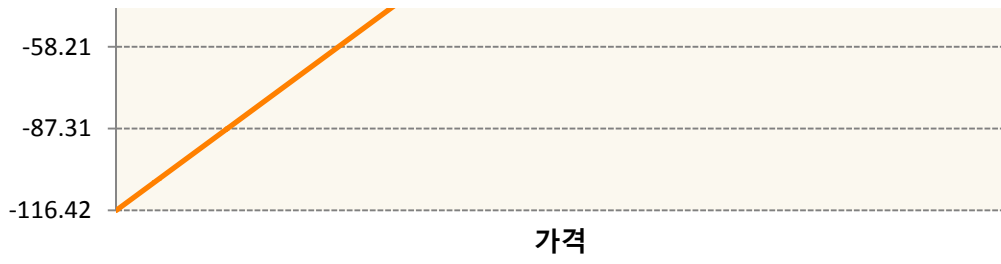
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

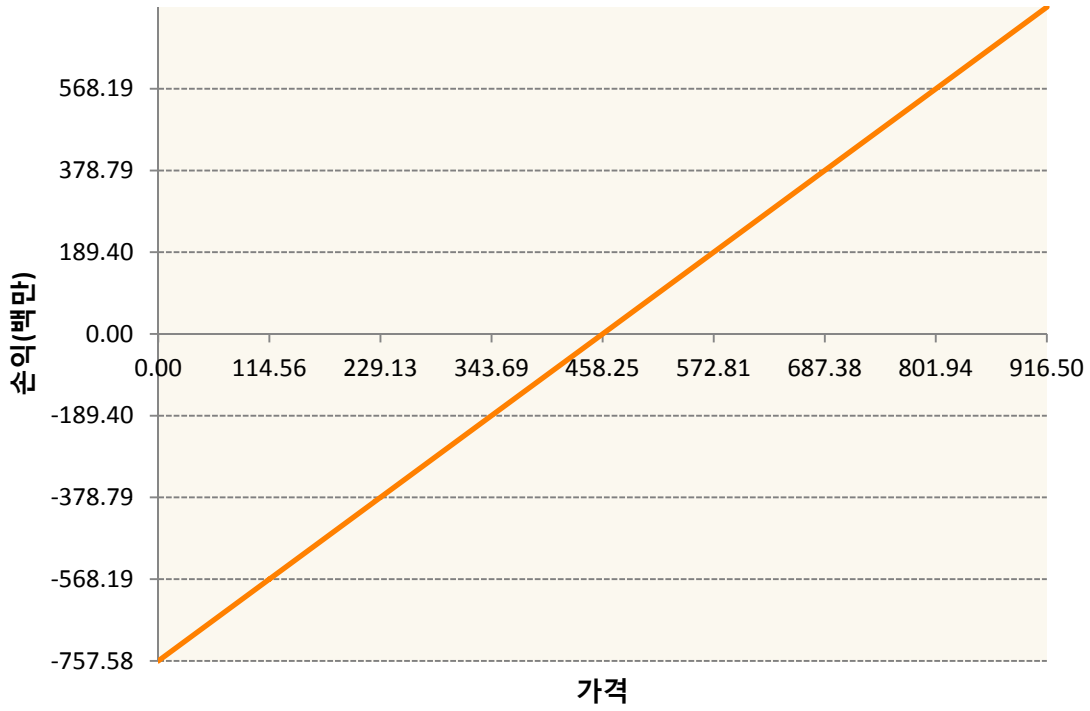


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

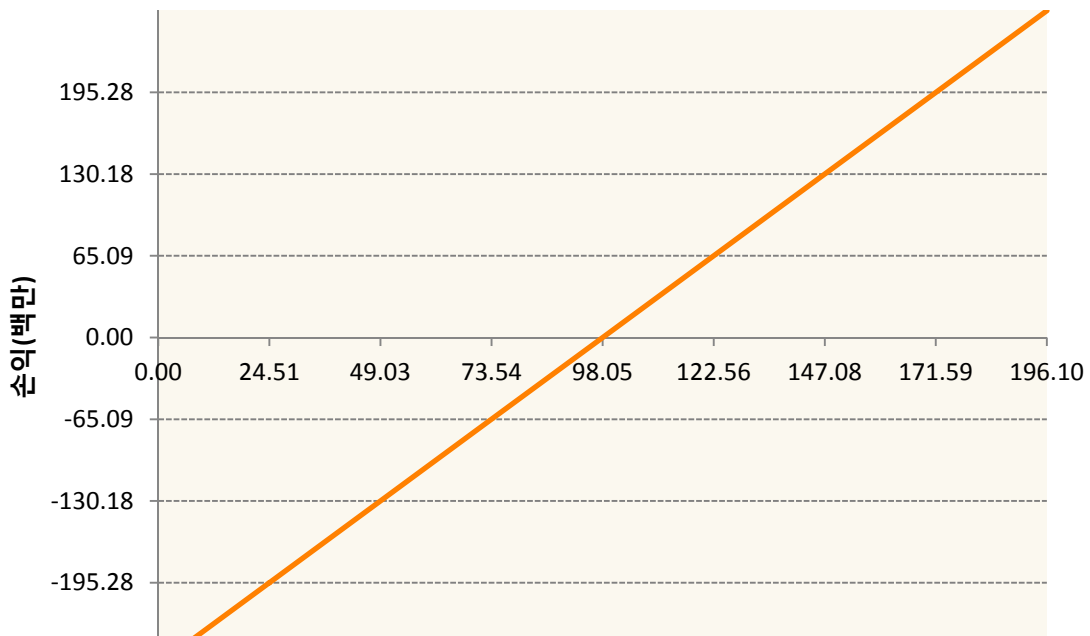


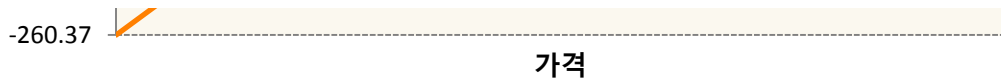


CU9-CORN FUTURE Sep19

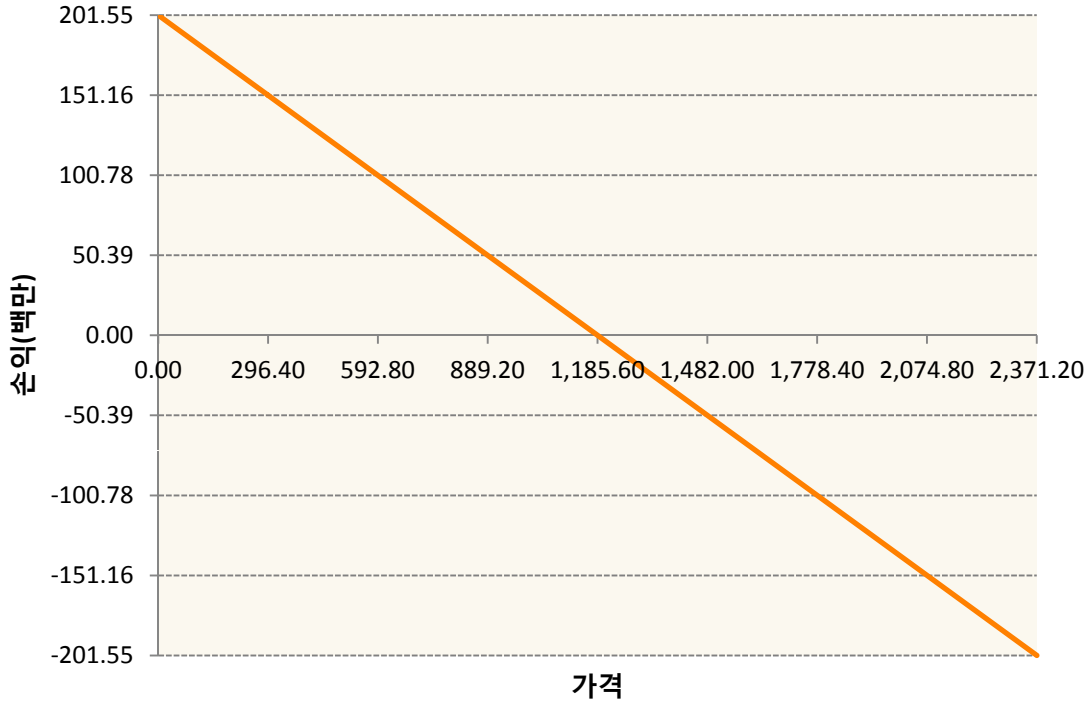


KCU9-COFFEE 'C' FUTURE Sep19

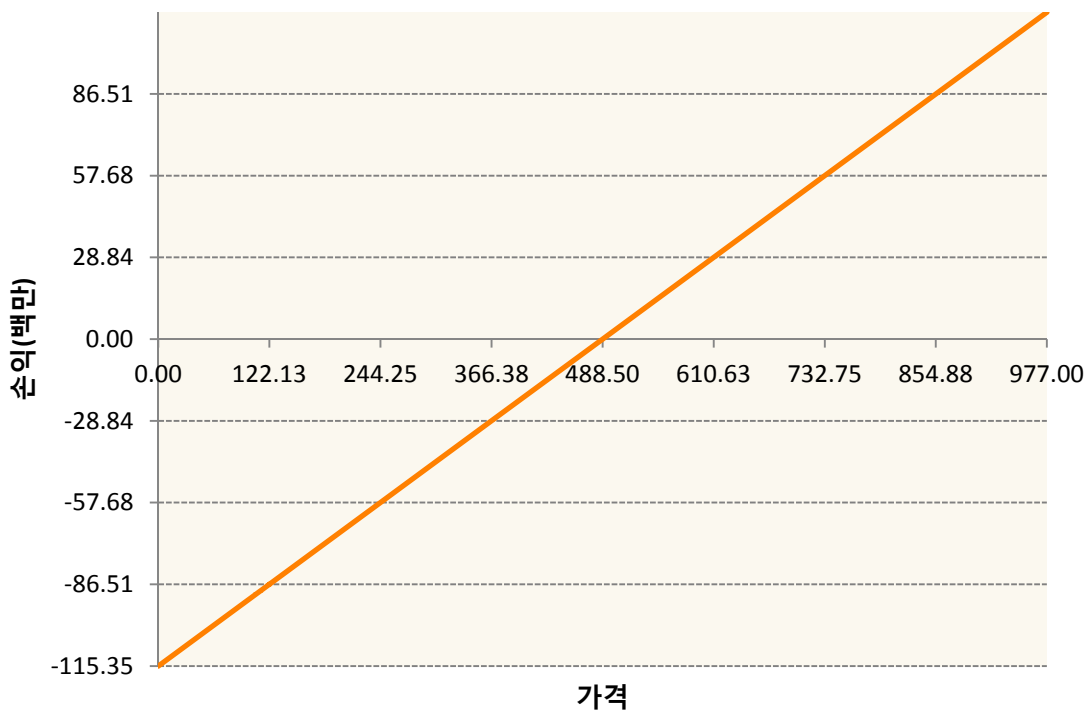




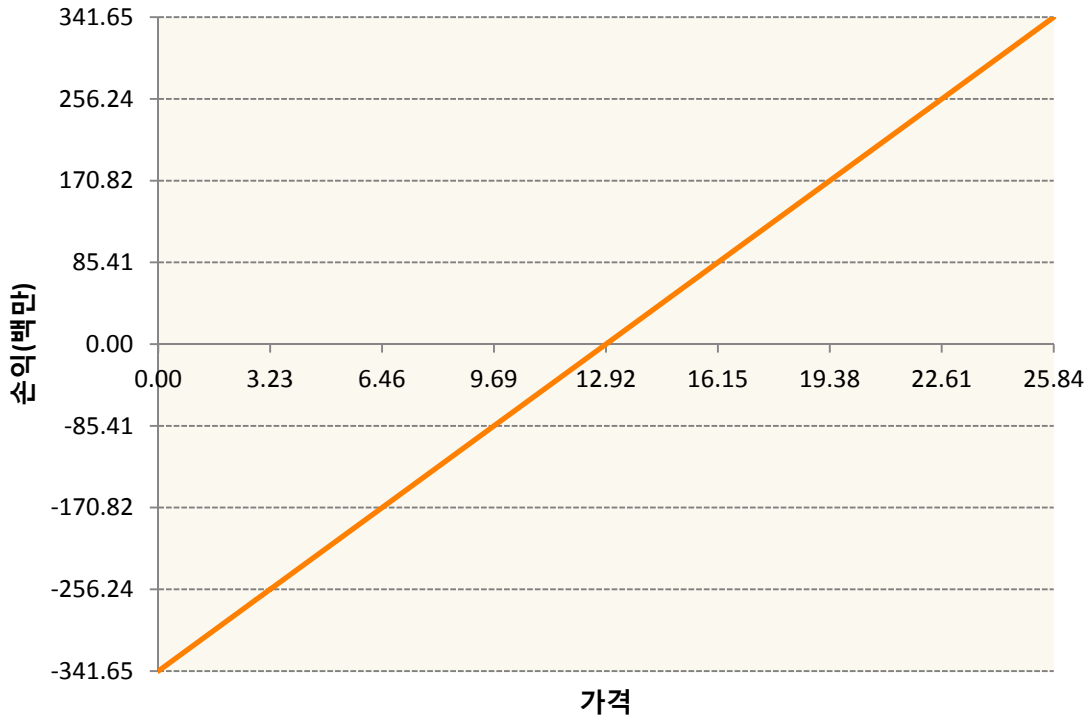
KR4175P70007-2019-07 달러선물



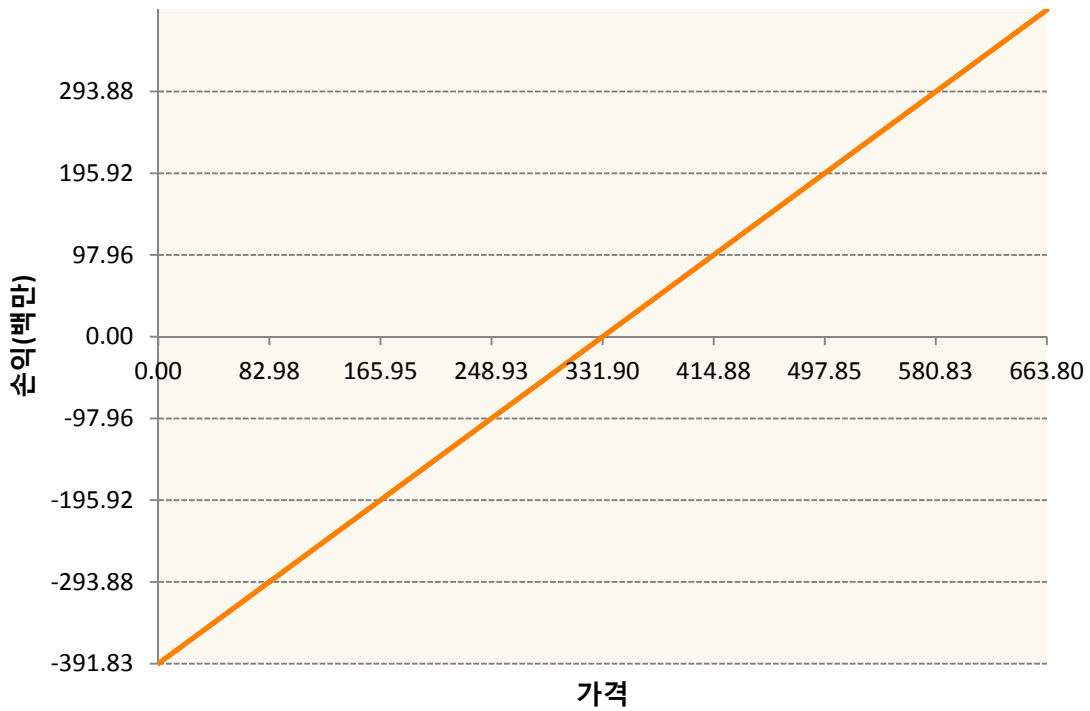
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



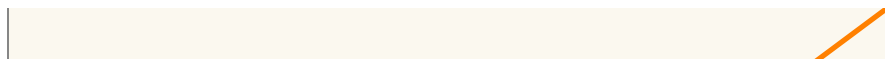
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

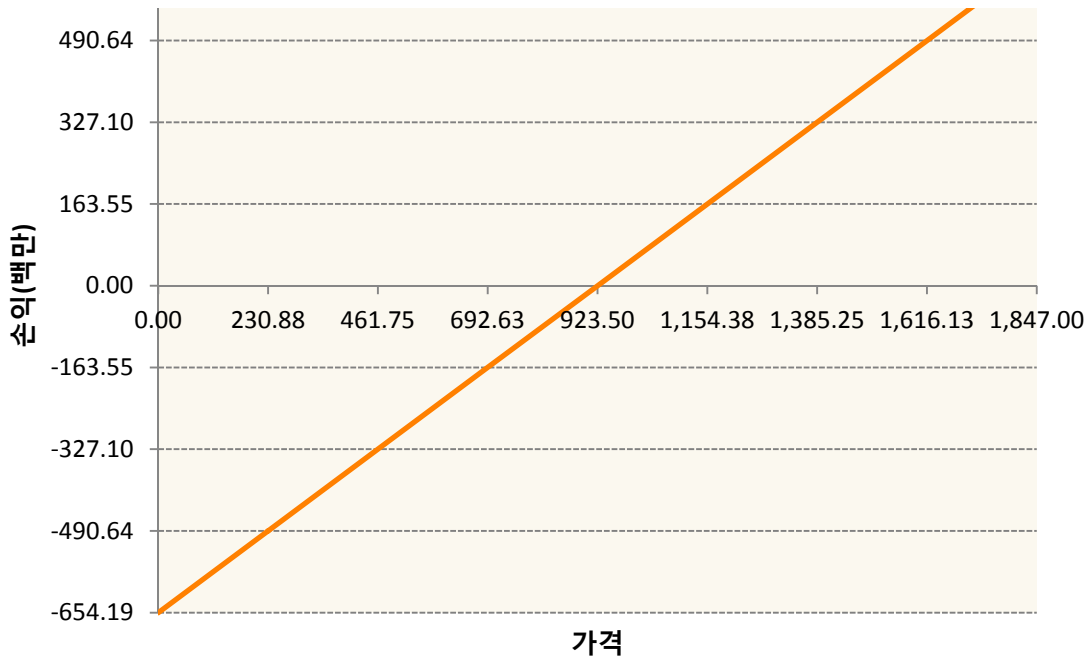


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

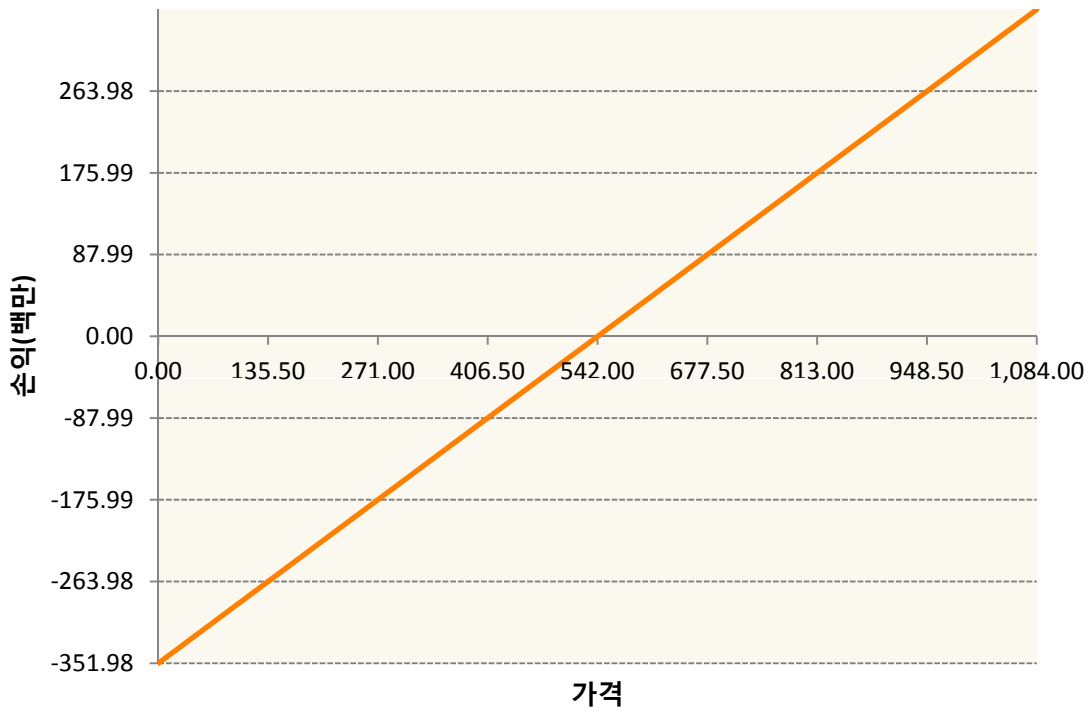


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





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	61
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)

286