

공시일	2019-06-19
기준일	2019-06-18

## 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	2019-06-19
기준일	2019-06-18

## 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)

688

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-19
기준일	2019-06-18

## 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)

<b>854</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-19
기준일	2019-06-18

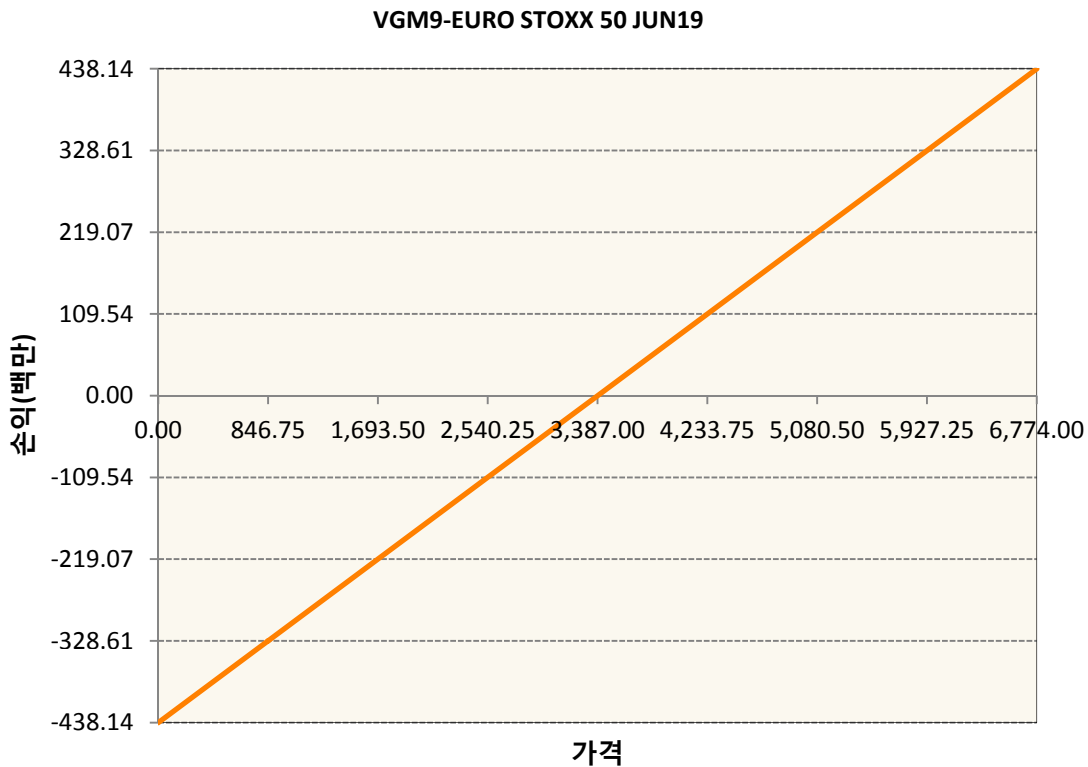
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 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



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

26
----

공시일	2019-06-19
기준일	2019-06-18

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

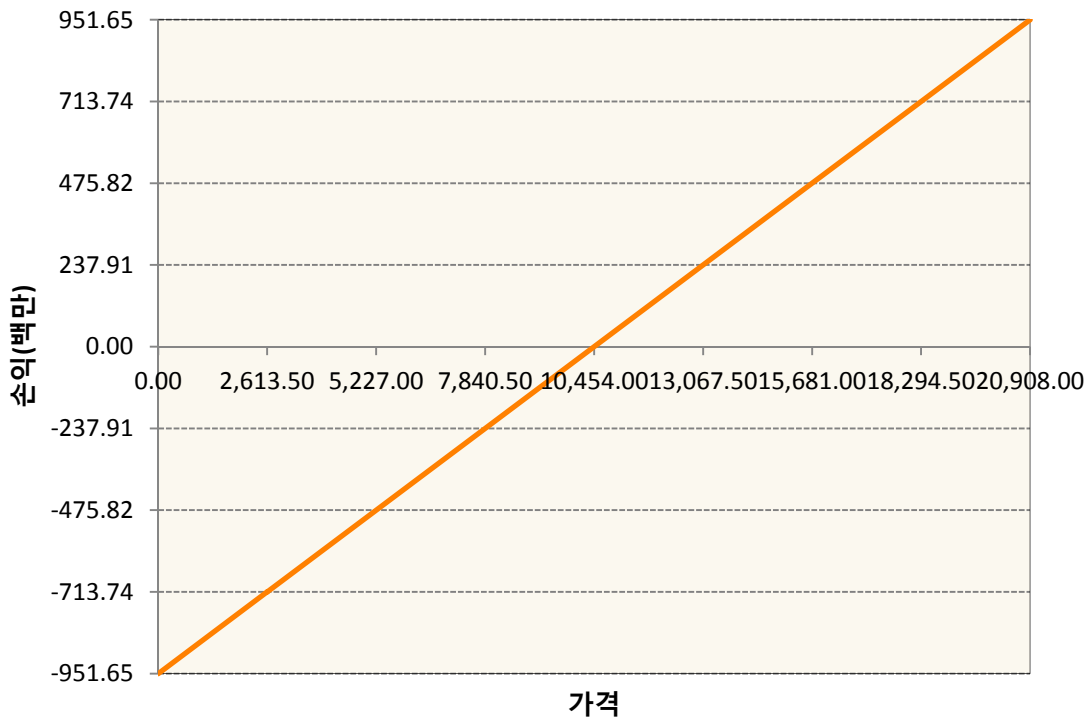
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	952	0	952	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	2019-06-19
기준일	2019-06-18

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

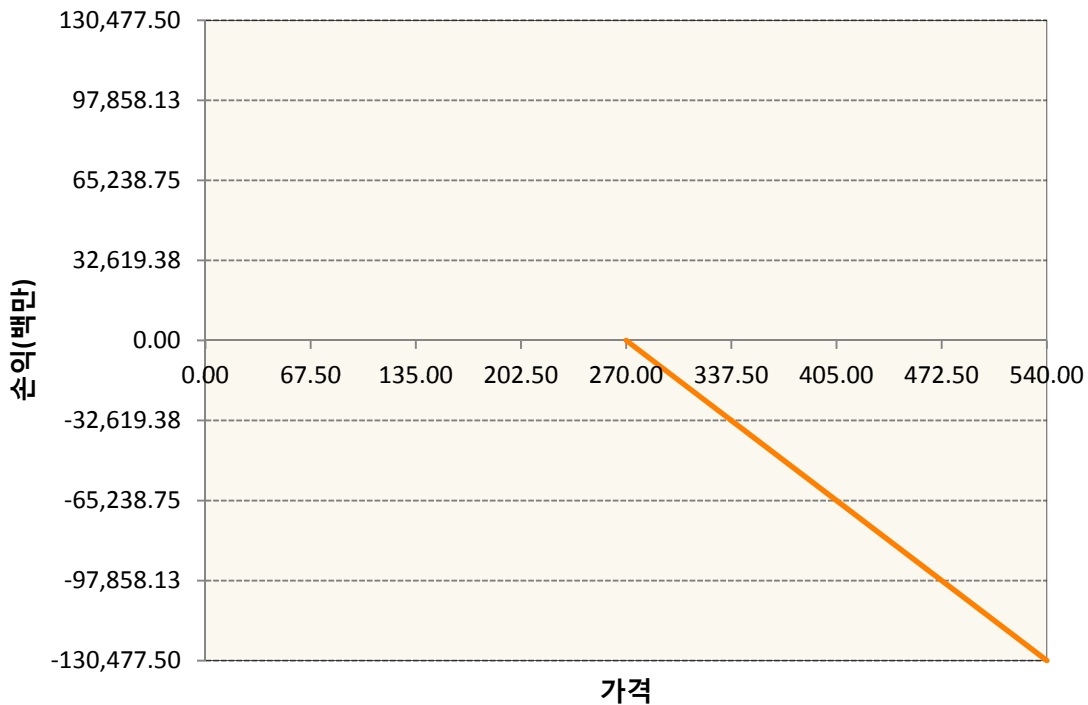
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

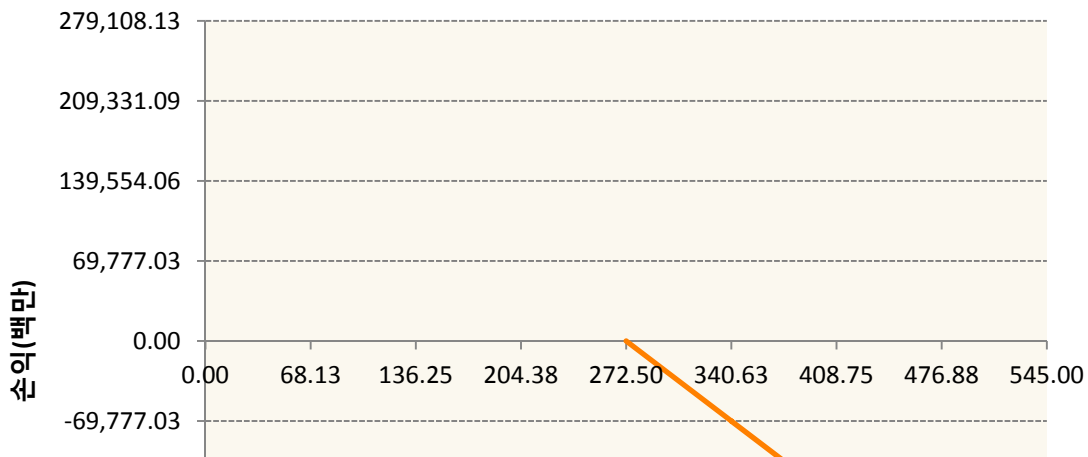
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	612,086	-612,086	장내

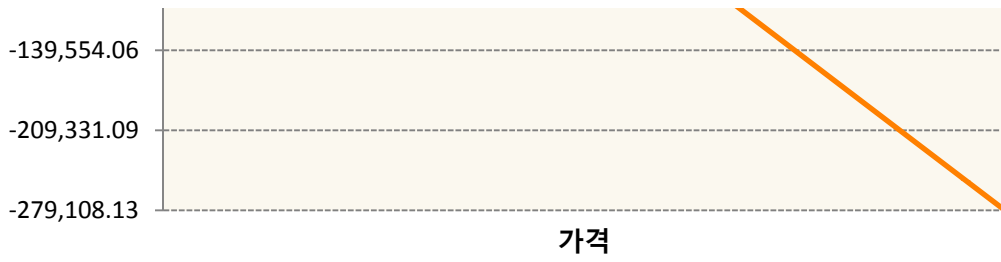
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P72700-2019-07 콜270



KR4201P72726-2019-07 콜272.5





KR4301P72708-2019-07 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P72700		2019-07 콜270					8,302
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,485	3,408	3,312	3,198	3,068	2,925	2,769
-5.33%	3,155	2,993	2,815	2,625	2,424	2,215	1,999
-2.67%	2,343	2,097	1,847	1,593	1,337	1,079	818
0%	824	550	275	0	-275	-550	-825
2.67%	-1,451	-1,682	-1,922	-2,168	-2,418	-2,673	-2,930
5.33%	-4,327	-4,477	-4,646	-4,830	-5,026	-5,233	-5,449
8.00%	-7,564	-7,641	-7,739	-7,856	-7,990	-8,139	-8,302
KR4201P72726		2019-07 콜272.5					16,735
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,239	6,118	5,958	5,762	5,530	5,268	4,978

-5.33%	5,748	5,466	5,145	4,792	4,412	4,009	3,587
-2.67%	4,429	3,955	3,464	2,959	2,444	1,920	1,389
0%	1,754	1,170	585	0	-585	-1,170	-1,756
2.67%	-2,528	-3,071	-3,622	-4,181	-4,744	-5,312	-5,884
5.33%	-8,224	-8,611	-9,031	-9,477	-9,943	-10,427	-10,925
8.00%	-14,862	-15,079	-15,341	-15,642	-15,978	-16,343	-16,735
KR4301P72708                      2019-07 풋270							12,937
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,772	-12,779	-12,792	-12,813	-12,844	-12,885	-12,937
-5.33%	-7,428	-7,485	-7,559	-7,650	-7,756	-7,875	-8,006
-2.67%	-2,594	-2,779	-2,975	-3,178	-3,387	-3,602	-3,821
0%	747	499	250	0	-250	-500	-750
2.67%	2,195	2,047	1,883	1,707	1,521	1,326	1,124
5.33%	2,543	2,501	2,443	2,368	2,278	2,174	2,056
8.00%	2,587	2,581	2,569	2,550	2,520	2,480	2,429

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

(단위:백만원)

**38,325**

공시일	2019-06-19
기준일	2019-06-18

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

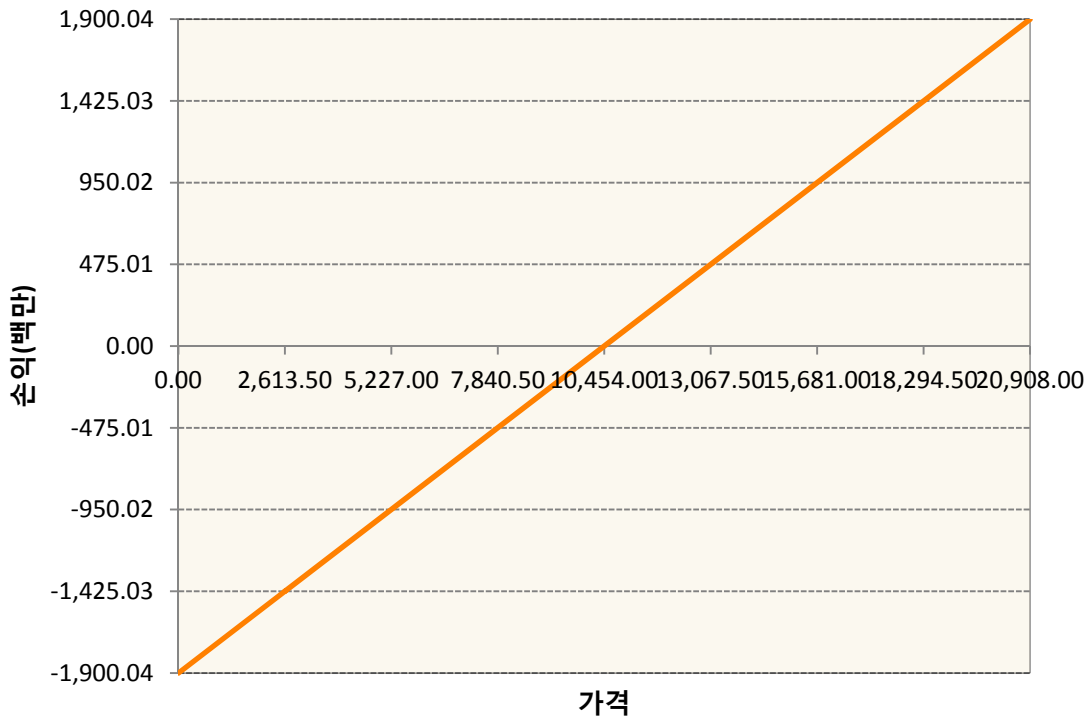
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

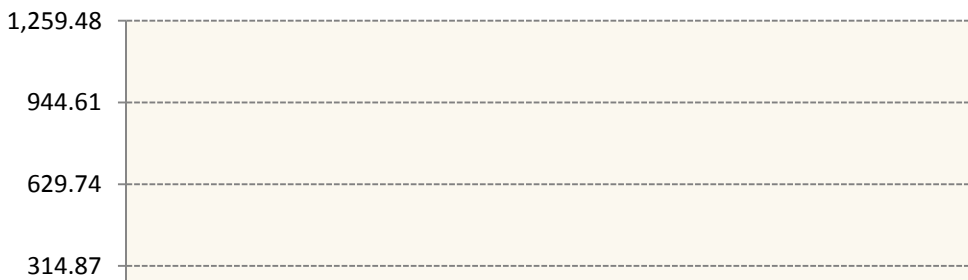
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,900	0	1,900	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,062	-5,062	장내
누계	통화	선도	151	3,179	-3,028	장외

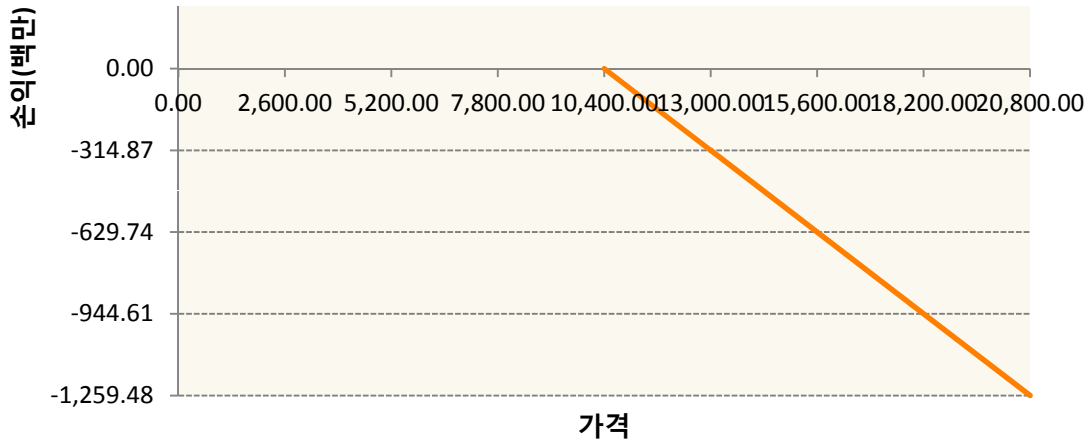
### 2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19

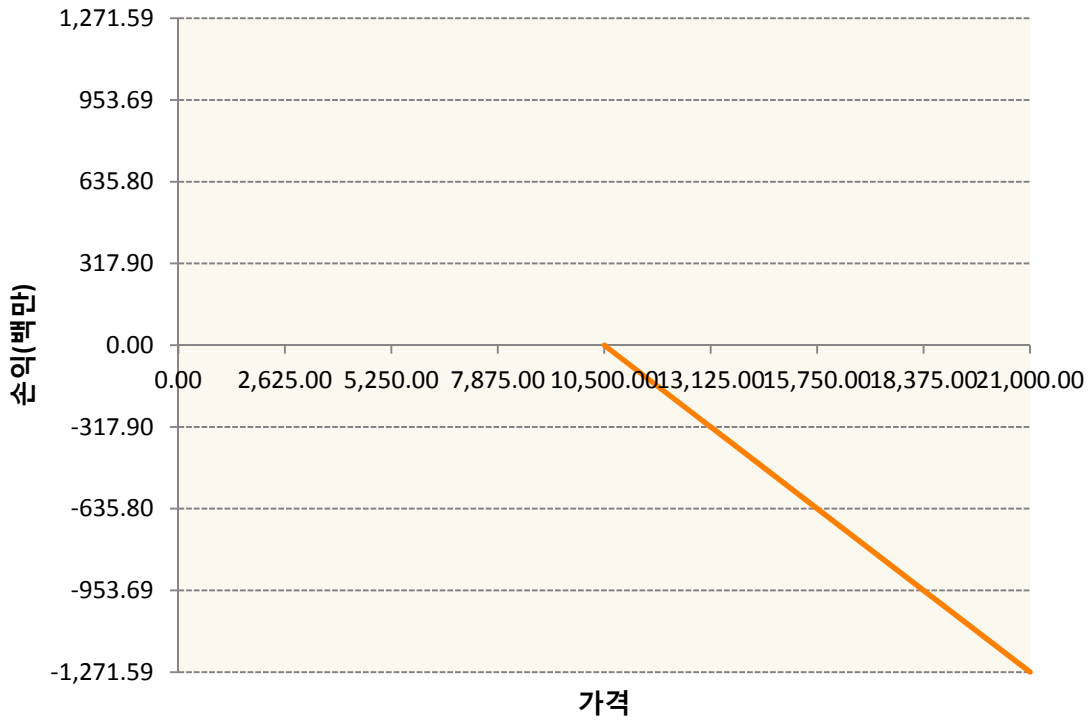


OHHIM9-C104-HSCEI

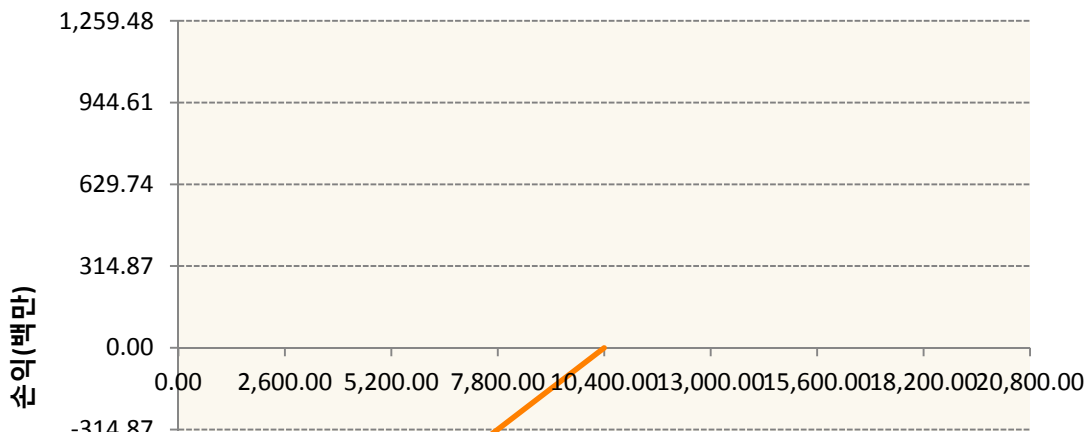


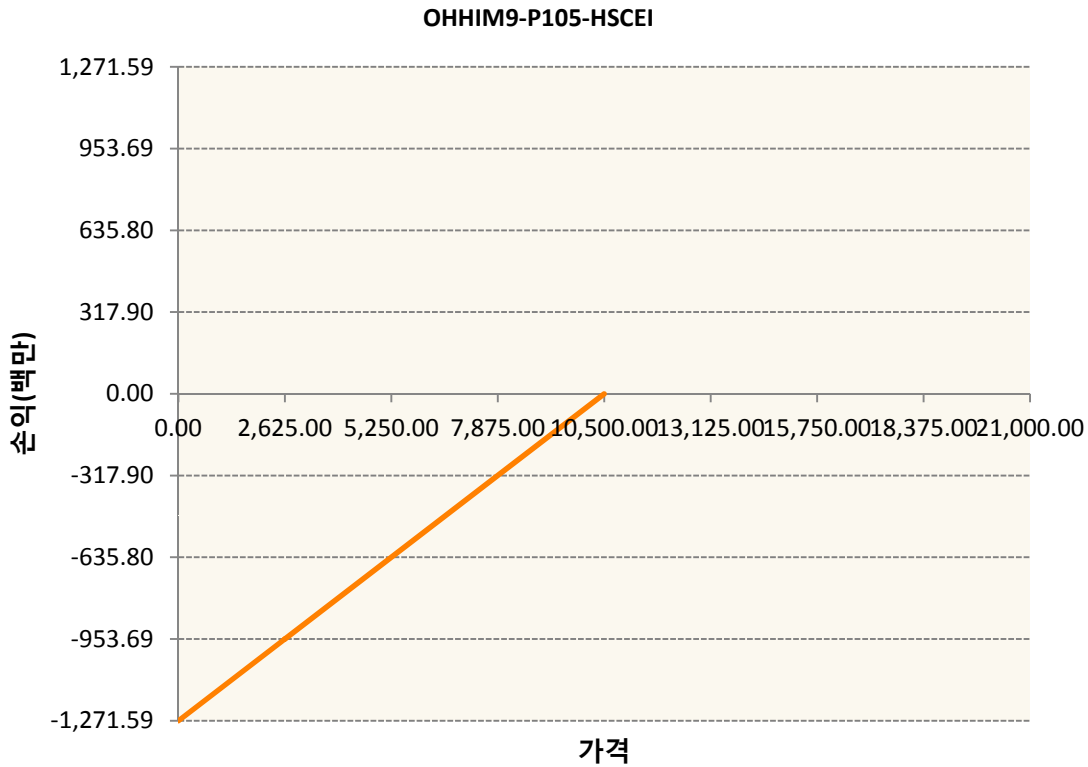


OHHIM9-C105-HSCEI



OHHIM9-P104-HSCEI





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

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	653

공시일	2019-06-19
기준일	2019-06-18

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

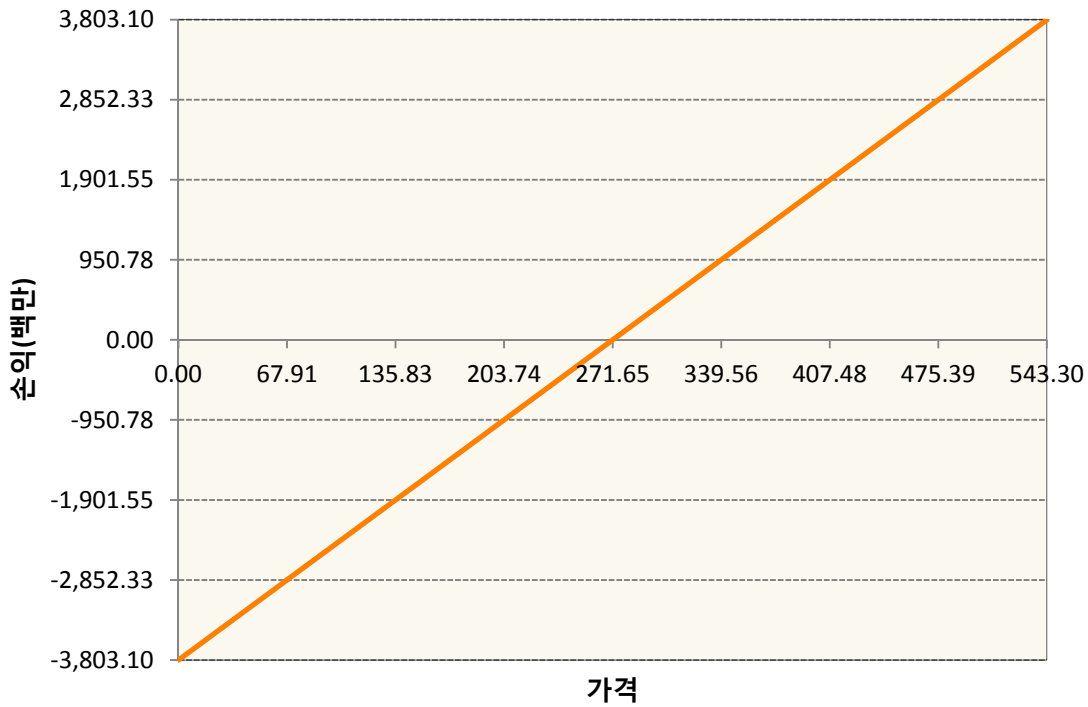
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

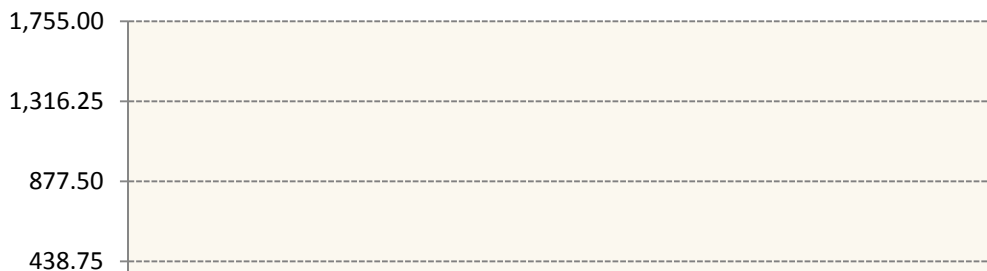
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,803	0	3,803	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	21,555	-21,555	장내

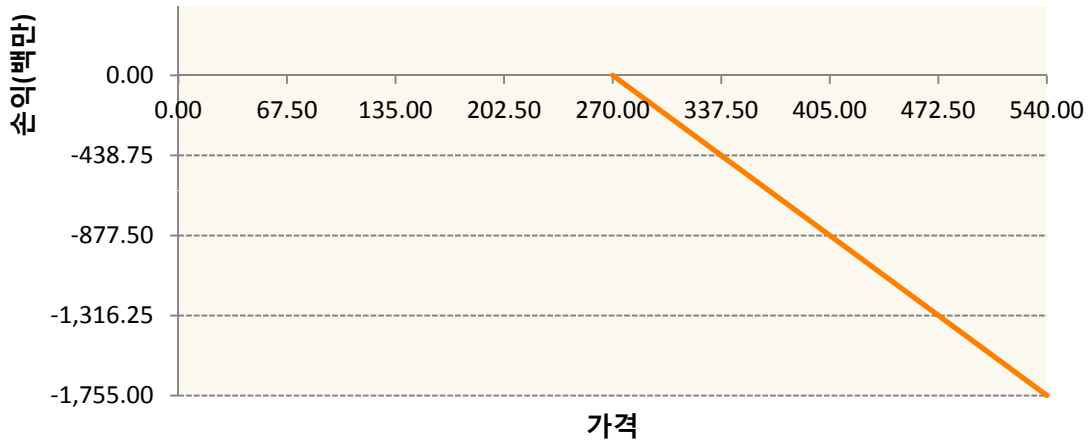
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

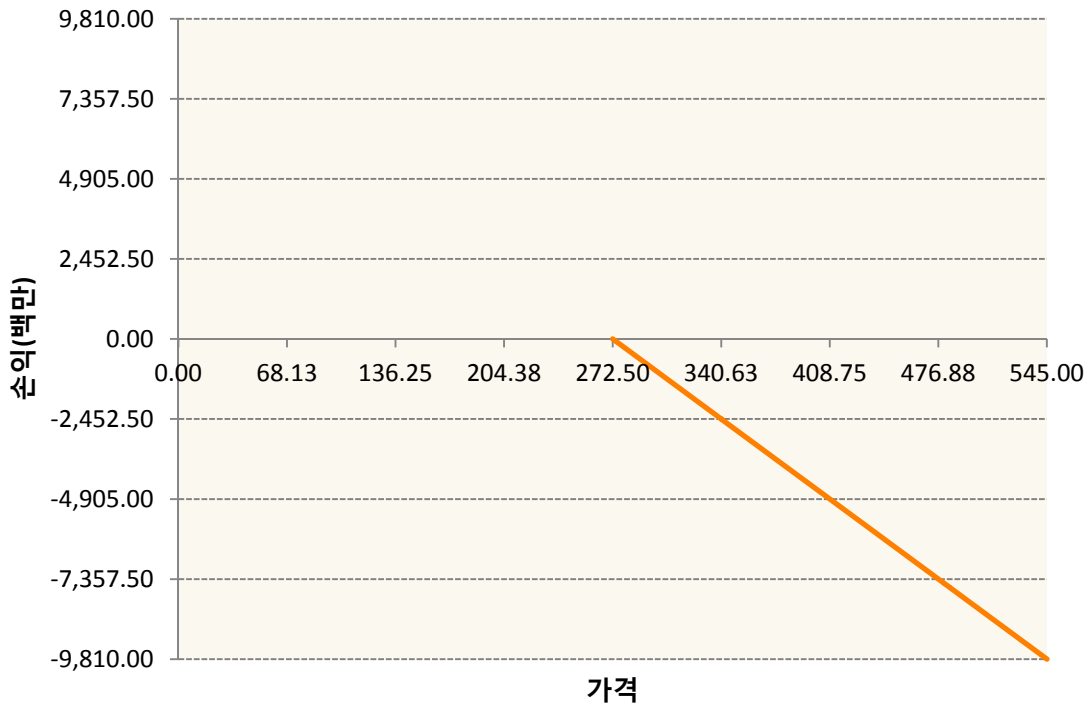


KR4201P72700-2019-07 콜270

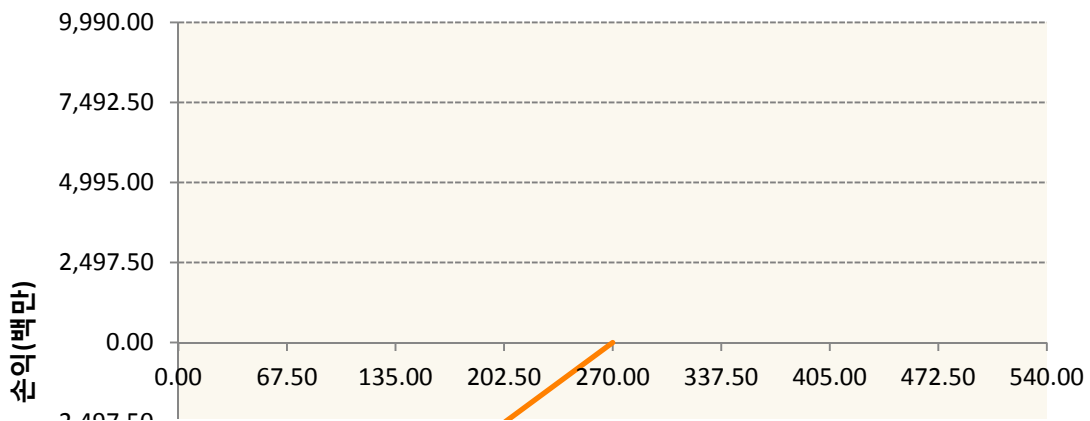




**KR4201P72726-2019-07 콜272.5**



**KR4301P72708-2019-07 풋270**





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,194
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	
-5.33%	-796	-796	-796	-796	-796	-796	-796	
-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%	796	796	796	796	796	796	796	
8.00%	1,194	1,194	1,194	1,194	1,194	1,194	1,194	
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%	-403	-403	-403	-403	-403	-403	-403	
-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%	403	403	403	403	403	403	403	
8.00%	604	604	604	604	604	604	604	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						304
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-304	-304	-304	-304	-304	-304	-304	
-5.33%	-203	-203	-203	-203	-203	-203	-203	
-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%	203	203	203	203	203	203	203	
8.00%	304	304	304	304	304	304	304	
KR4201P72700		2019-07 콜270						112
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	47	46	45	43	41	39	37
-5.33%	42	40	38	35	33	30	27
-2.67%	32	28	25	21	18	15	11
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	-20	-23	-26	-29	-33	-36	-39
5.33%	-58	-60	-62	-65	-68	-70	-73
8.00%	-102	-103	-104	-106	-107	-109	-112
KR4201P72726                      2019-07 콜272.5							588
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	219	215	209	203	194	185	175
-5.33%	202	192	181	168	155	141	126
-2.67%	156	139	122	104	86	67	49
0%	62	41	21	0	-21	-41	-62
2.67%	-89	-108	-127	-147	-167	-187	-207
5.33%	-289	-303	-317	-333	-349	-366	-384
8.00%	-522	-530	-539	-550	-562	-574	-588
KR4301P72708                      2019-07 풋270							638
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-630	-630	-631	-632	-634	-636	-638
-5.33%	-366	-369	-373	-377	-383	-388	-395
-2.67%	-128	-137	-147	-157	-167	-178	-188
0%	37	25	12	0	-12	-25	-37
2.67%	108	101	93	84	75	65	55
5.33%	125	123	121	117	112	107	101
8.00%	128	127	127	126	124	122	120

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

(단위:백만원)

3,419

공시일	2019-06-19
기준일	2019-06-18

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

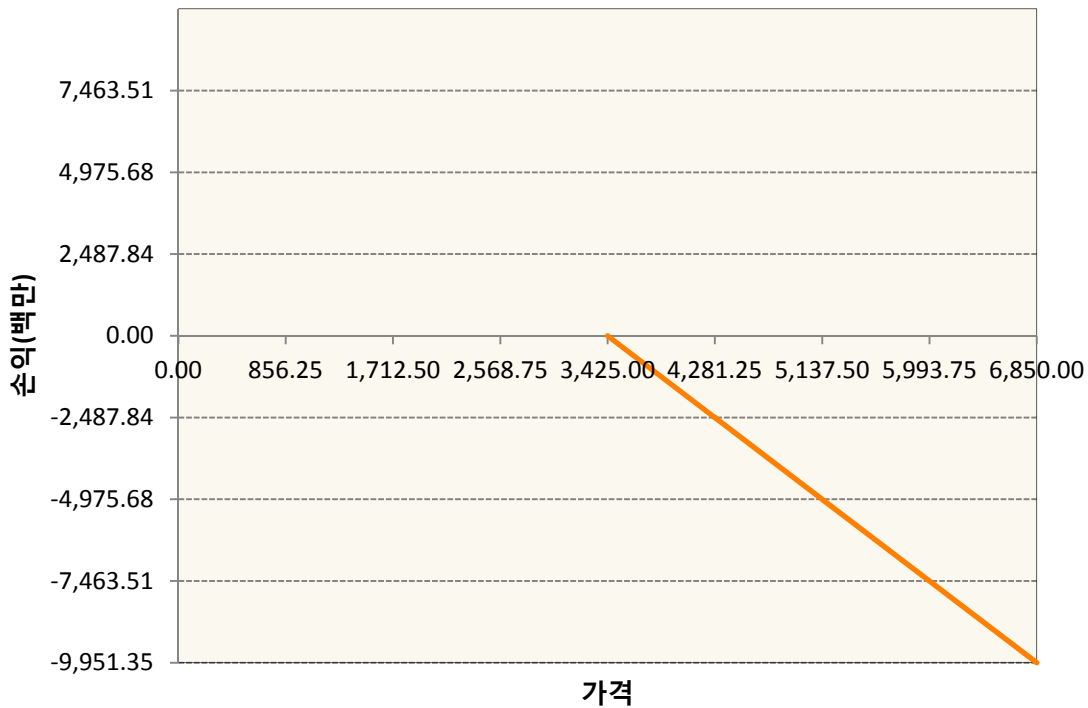
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

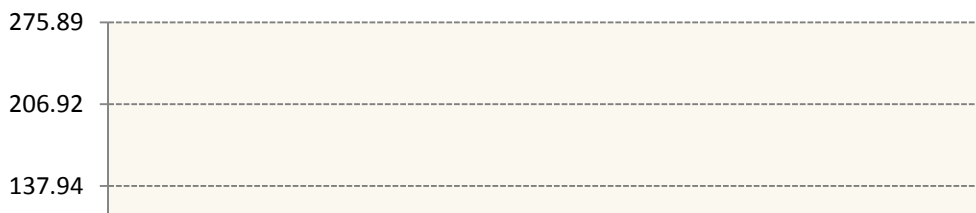
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,703	0	3,703	
누계	유가증권	스왑	56,415	0	56,415	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,454	-20,454	장내
누계	통화	선도	0	18,659	-18,659	장외

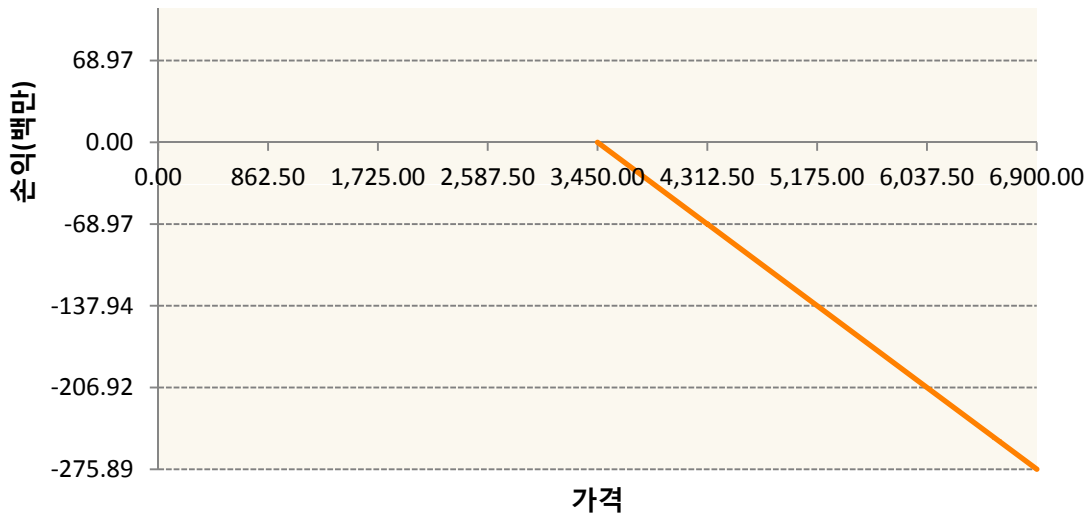
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXM9-C3425-EURO STOXX 50**

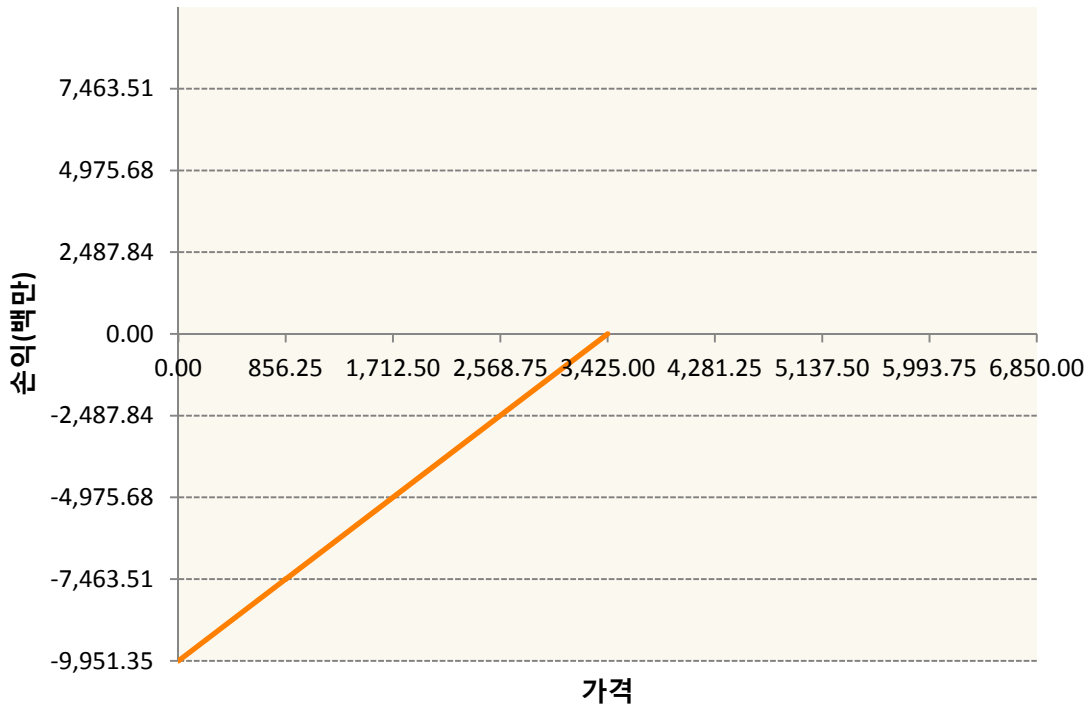


**OESXM9-C3450-EURO STOXX 50**

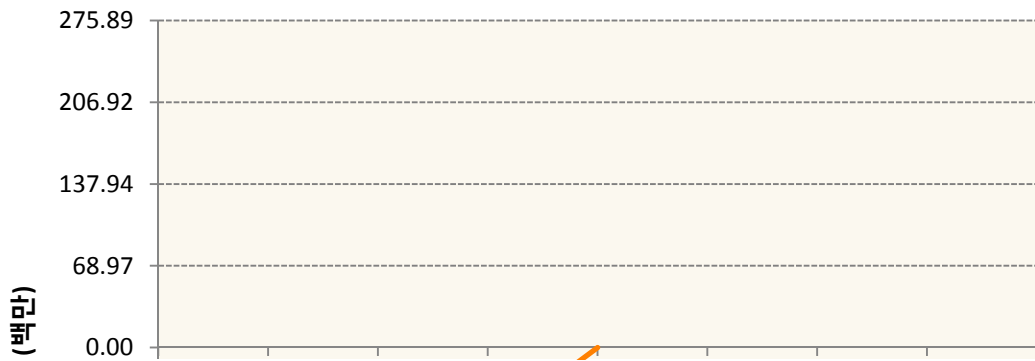


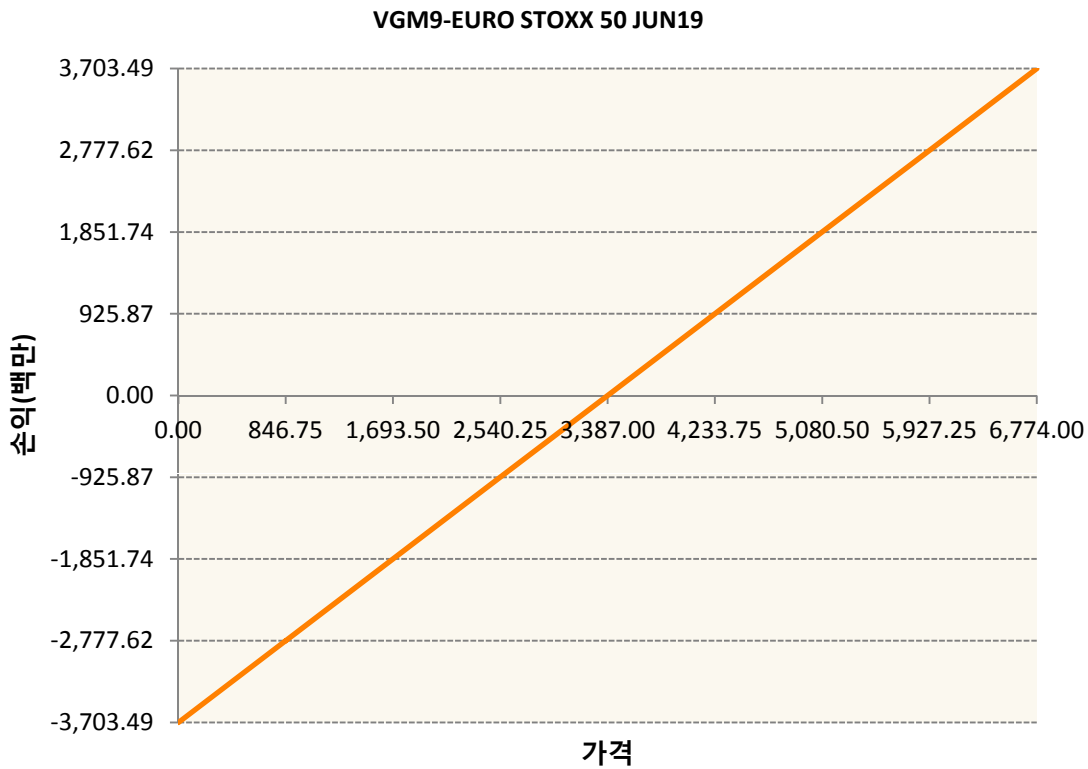
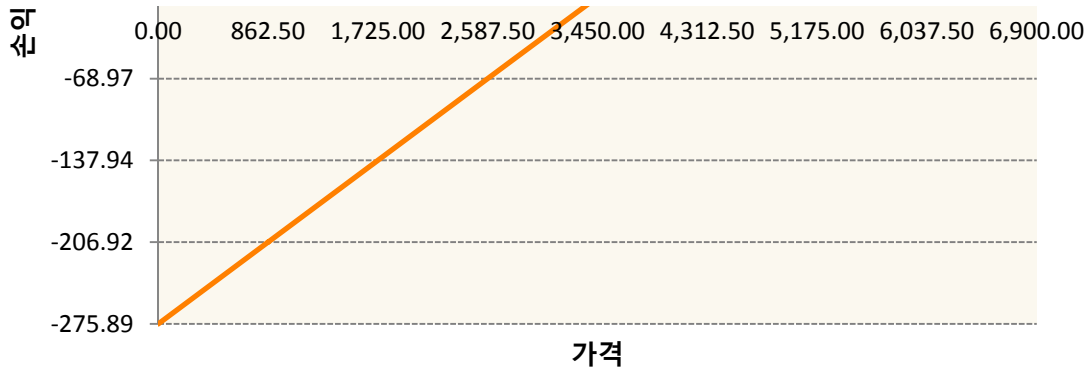


OESXM9-P3425-EURO STOXX 50



OESXM9-P3450-EURO STOXX 50





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	9
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	853
FX21019J01: KRW/EUR 28-06-19E	213
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	426
OESXM9-C3·EURO STOXX 50	796
OESXM9-C3·EURO STOXX 50	22
OESXM9-P3·EURO STOXX 50	796
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)

1,033



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

(단위:백만원)

91



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

(단위:백만원)

132

공시일	2019-06-19
기준일	2019-06-18

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

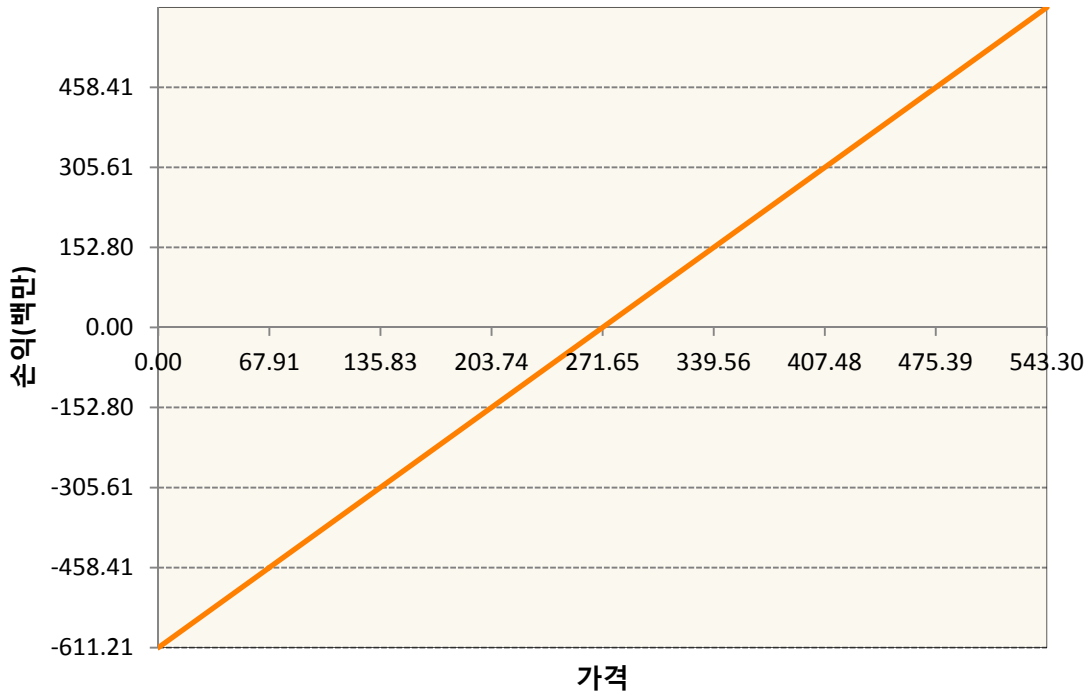
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	611	0	611	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%	-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)

41

공시일	2019-06-19
기준일	2019-06-18

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

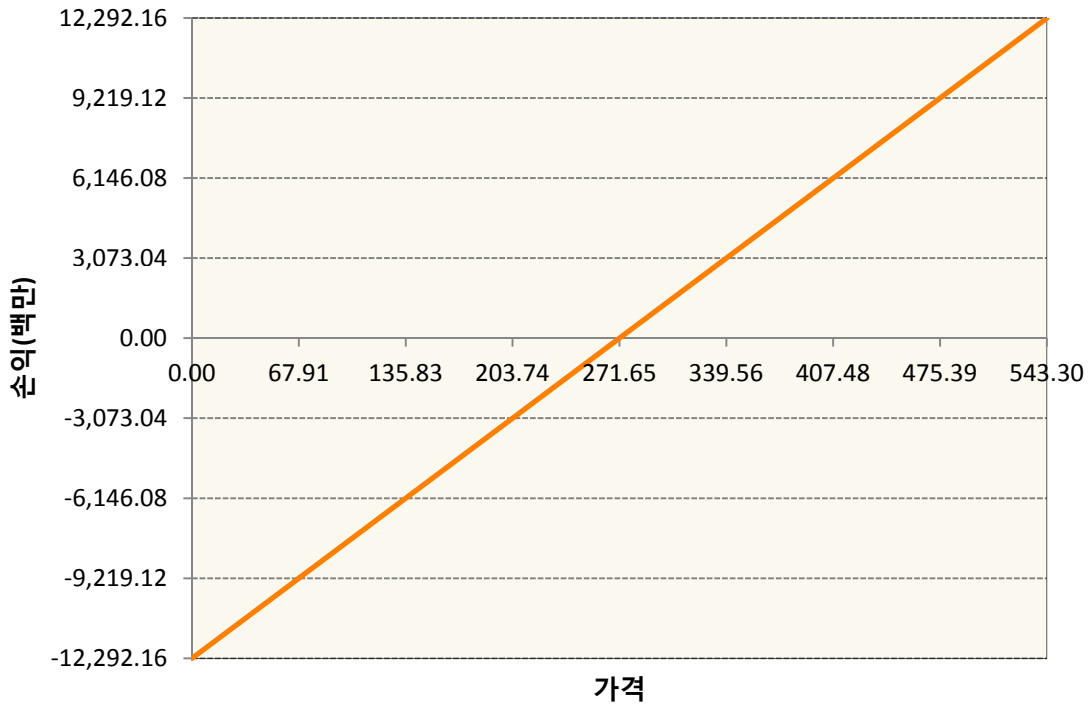
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

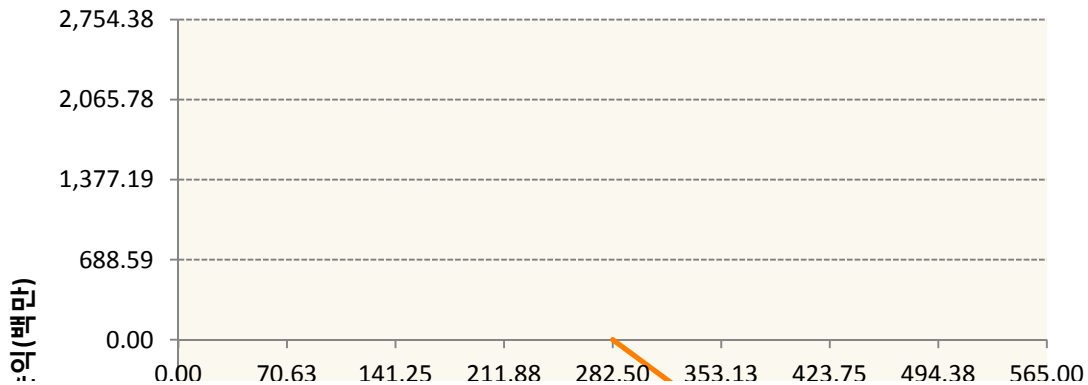
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,292	0	12,292	장내
누계	유가증권	옵션	1,084	22,206	-21,121	장내

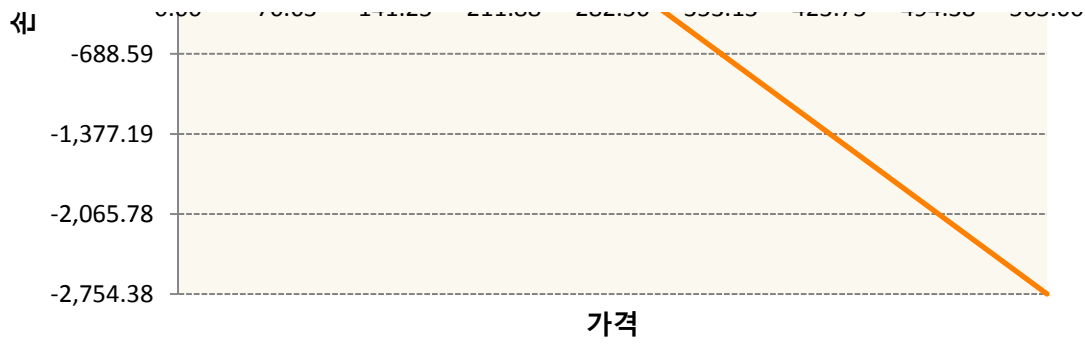
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

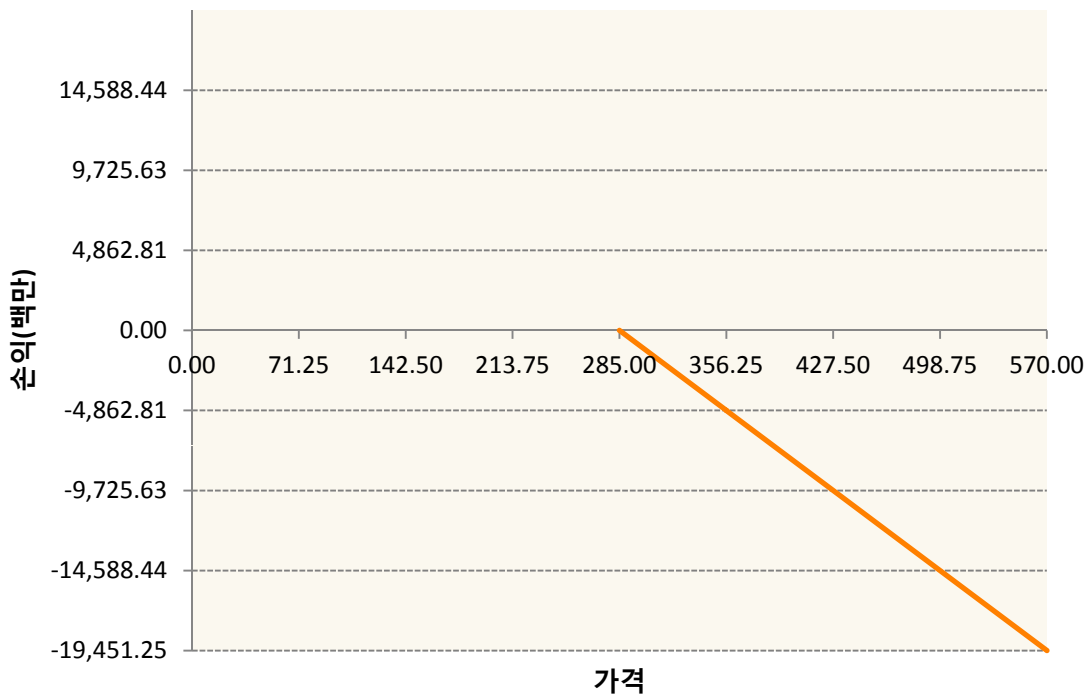


KR4201P72825-2019-07 콜282.5

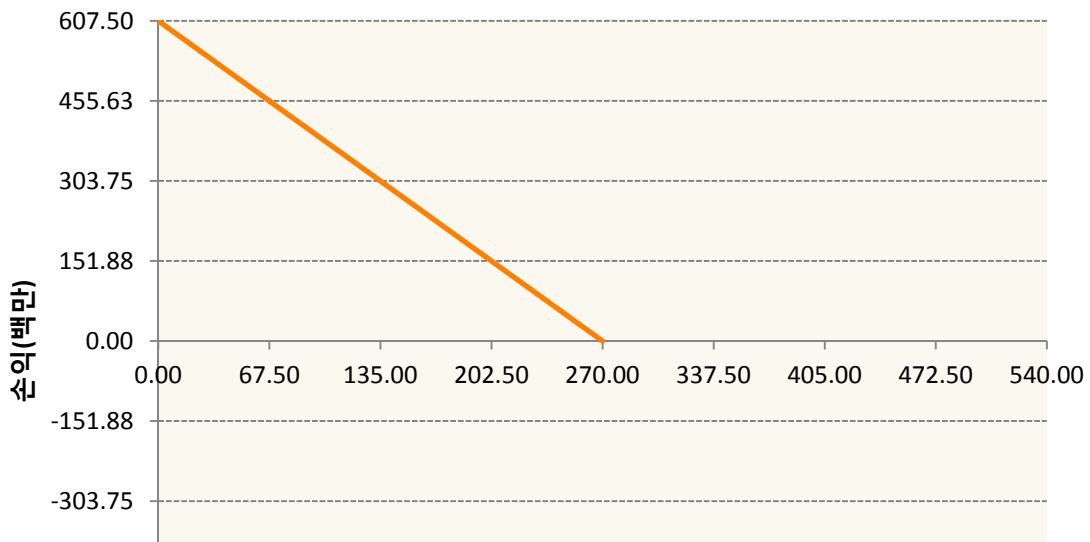


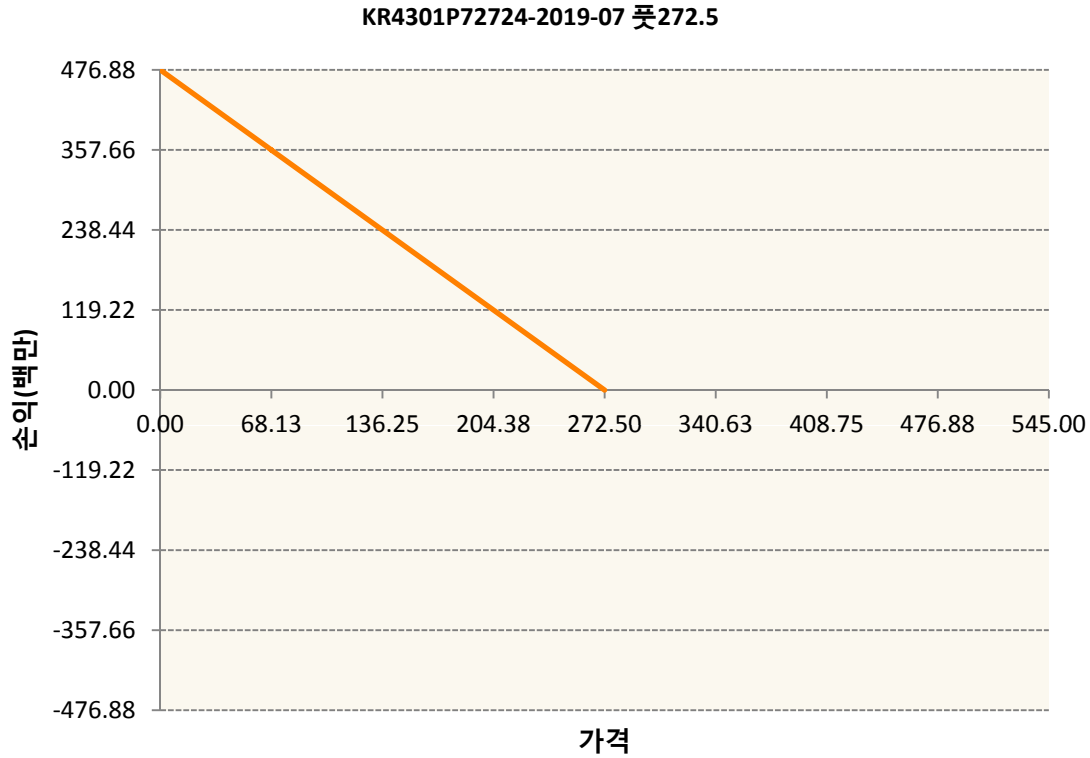
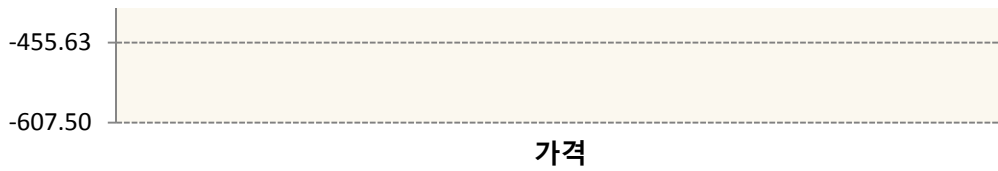


KR4201P72858-2019-07 콜285



KR4301P72708-2019-07 풋270





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

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						982
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-982	-982	-982	-982	-982	-982	-982	-982
-5.33%	-655	-655	-655	-655	-655	-655	-655	-655
-2.67%	-327	-327	-327	-327	-327	-327	-327	-327
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	327	327	327	327	327	327	327	327
5.33%	655	655	655	655	655	655	655	655
8.00%	982	982	982	982	982	982	982	982
KR4201P72825		2019-07 콜282.5						121
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	27	26	26	25	24	23	22	
-5.33%	26	25	24	22	20	18	15	
-2.67%	22	20	18	15	11	8	4	



공시일	2019-06-19
기준일	2019-06-18

## 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	18,982	0	18,982	

### 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	2019-06-19
기준일	2019-06-18

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	593	0	593	
누계	유가증권	수익증권	59,905	0	59,905	

### 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	2019-06-19
기준일	2019-06-18

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	7,115	0	7,115	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	393,703	0	393,703	
누계	통화	선도	0	409,931	-409,931	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019J024 KRW/USD 24-06-19E		949
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		1,025
FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E		474
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E		797
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E		634
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		949
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E		1,518
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E		285
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		285
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		949
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	1,897
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	949
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	3,036
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E	2,277
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E	285
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E	285
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	797
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	636

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

(단위:백만원)

**10,855**

공시일	2019-06-19
기준일	2019-06-18

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

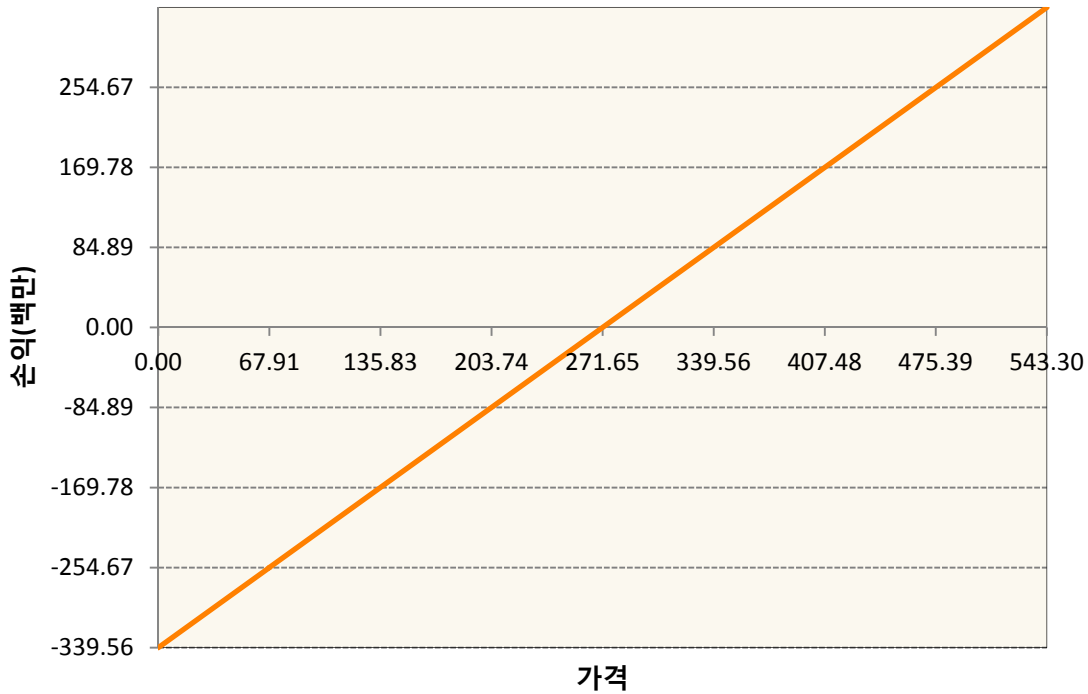
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

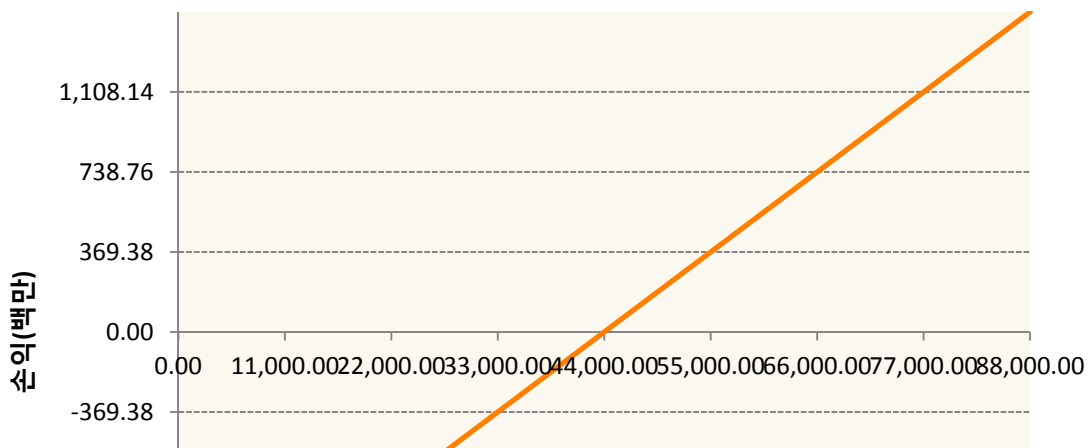
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,817	0	1,817	장내

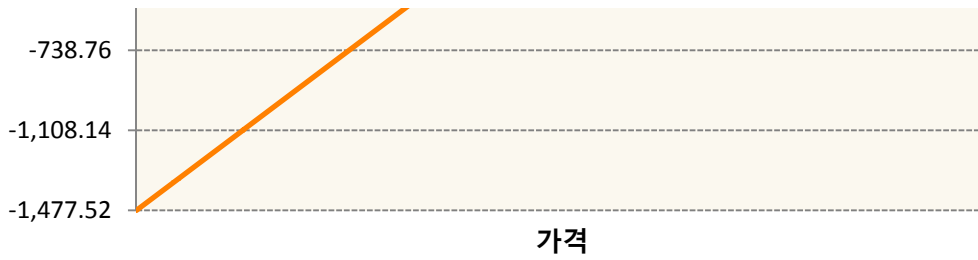
### 2. 만기시점의 손익구조

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						119
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119	
-5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79	
-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%	79	79	79	79	79	79	79	
8.00%	119	119	119	119	119	119	119	

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

**159**

공시일	2019-06-19
기준일	2019-06-18

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

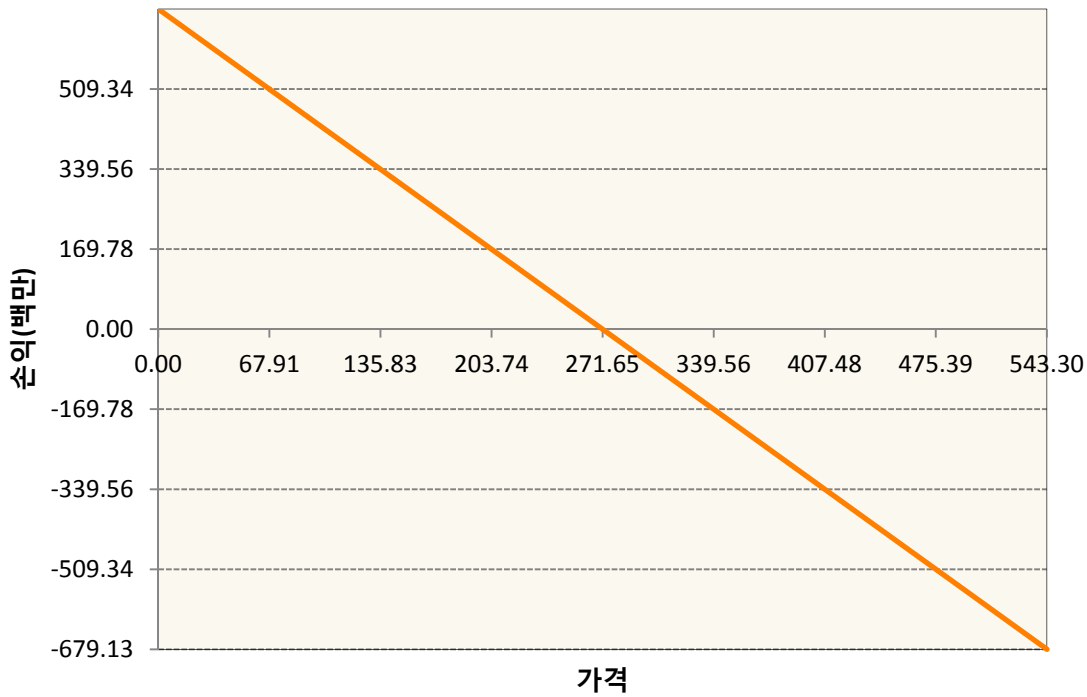
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

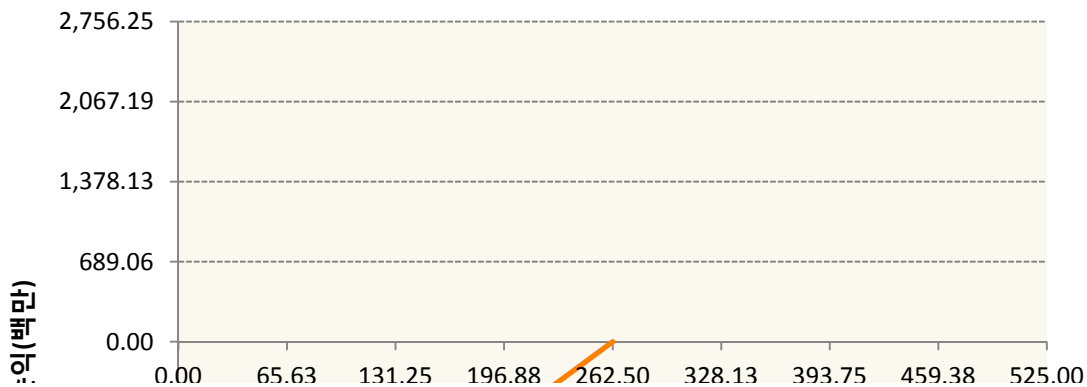
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	679	-679	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,419	-3,419	장내

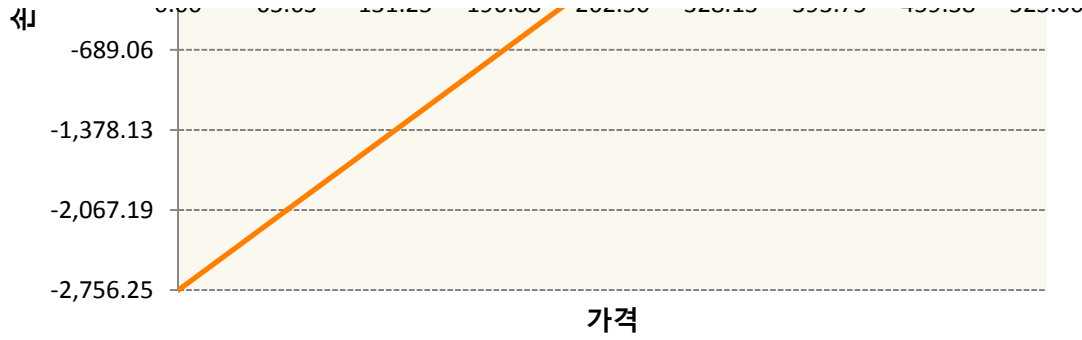
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

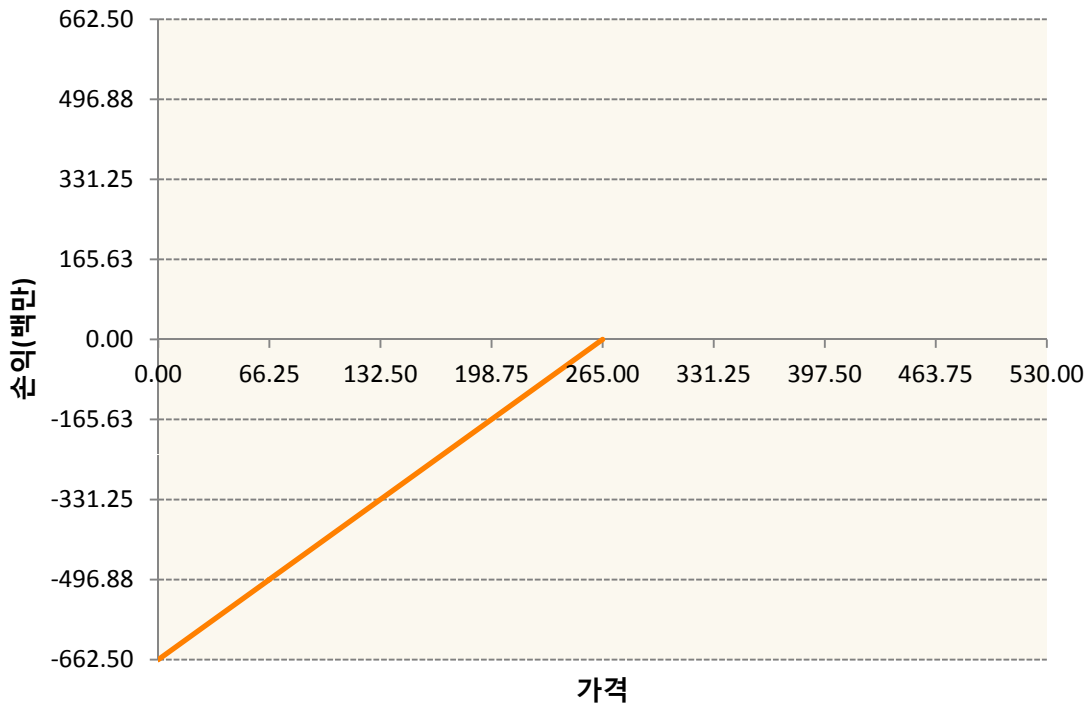


KR4301P72625-2019-07 풋262.5





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						134
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-126	-127	-128	-129	-131	-132	-134
-5.33%	-59	-61	-64	-67	-70	-73	-76
-2.67%	-13	-16	-19	-23	-26	-30	-33
0%	6	4	2	0	-2	-5	-8
2.67%	10	10	9	8	7	6	4
5.33%	11	11	11	11	10	10	9
8.00%	11	11	11	11	11	11	11
KR4301P72658                      2019-07 풋265							36
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-35	-35	-35	-35	-35	-36	-36
-5.33%	-18	-18	-19	-19	-20	-20	-21
-2.67%	-5	-5	-6	-7	-8	-9	-10
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	4	4	3	3	3	2	2
5.33%	4	4	4	4	4	4	3
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

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

(단위:백만원)

**192**

공시일	2019-06-19
기준일	2019-06-18

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

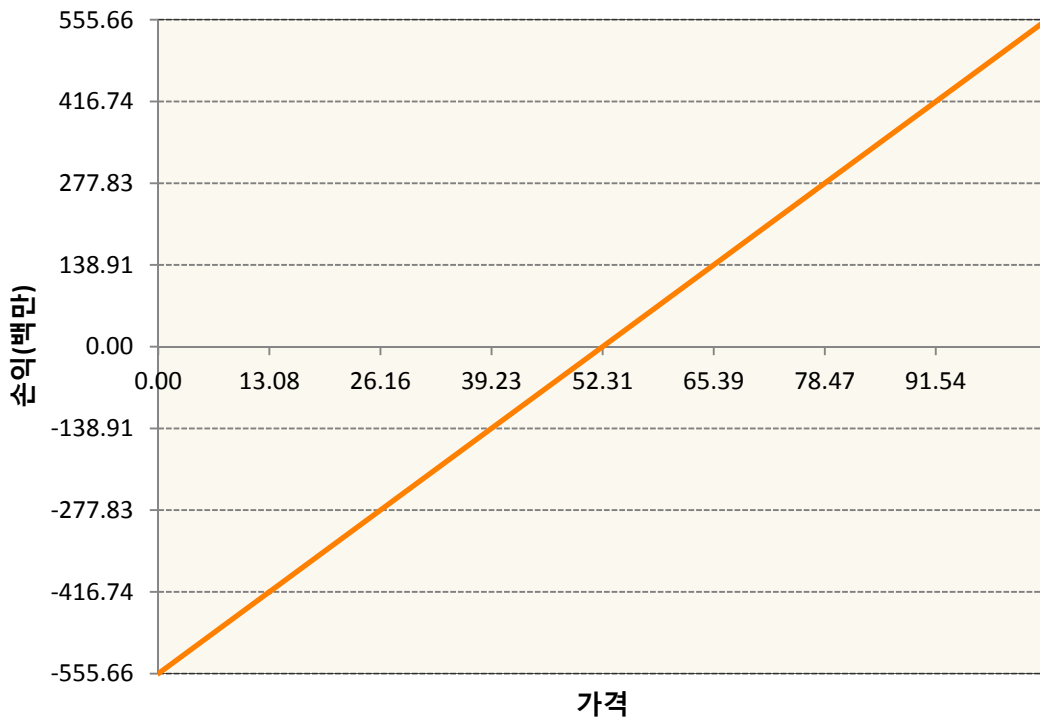
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

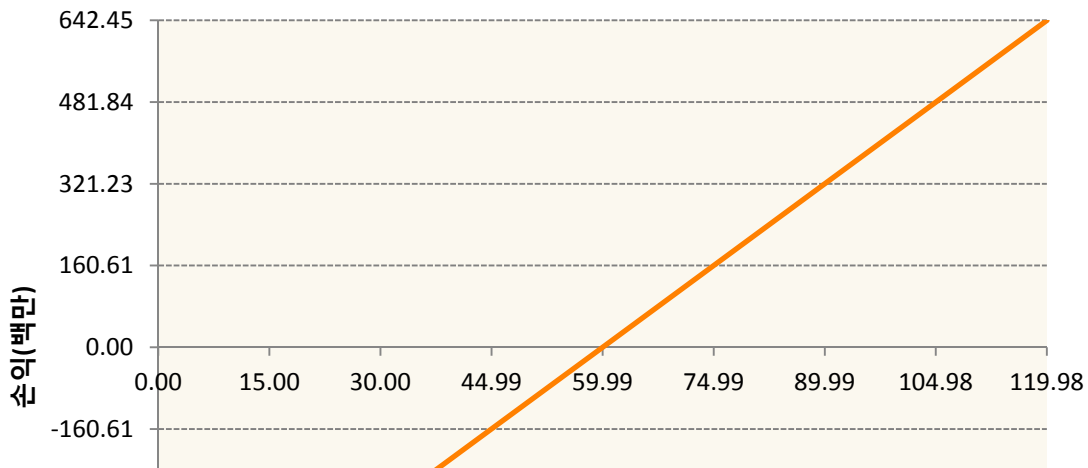
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,473	118	2,354	

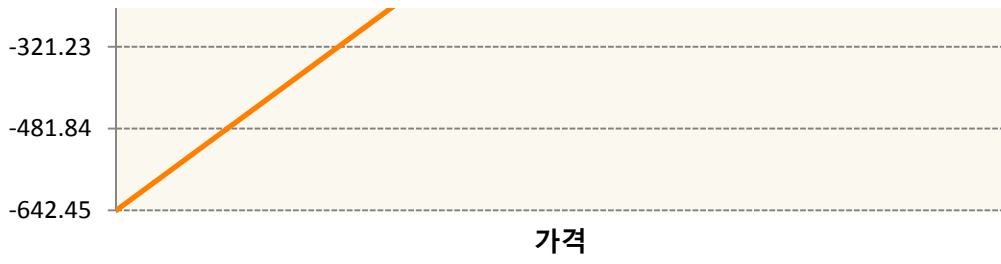
### 2. 만기시점의 손익구조

CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19

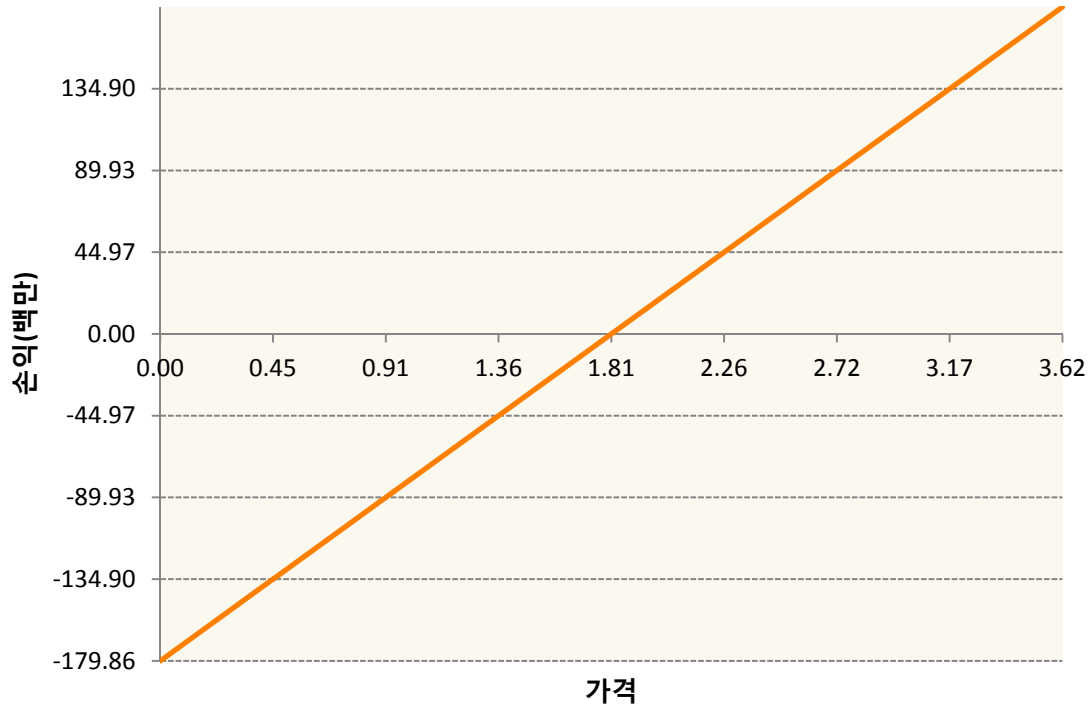


COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19

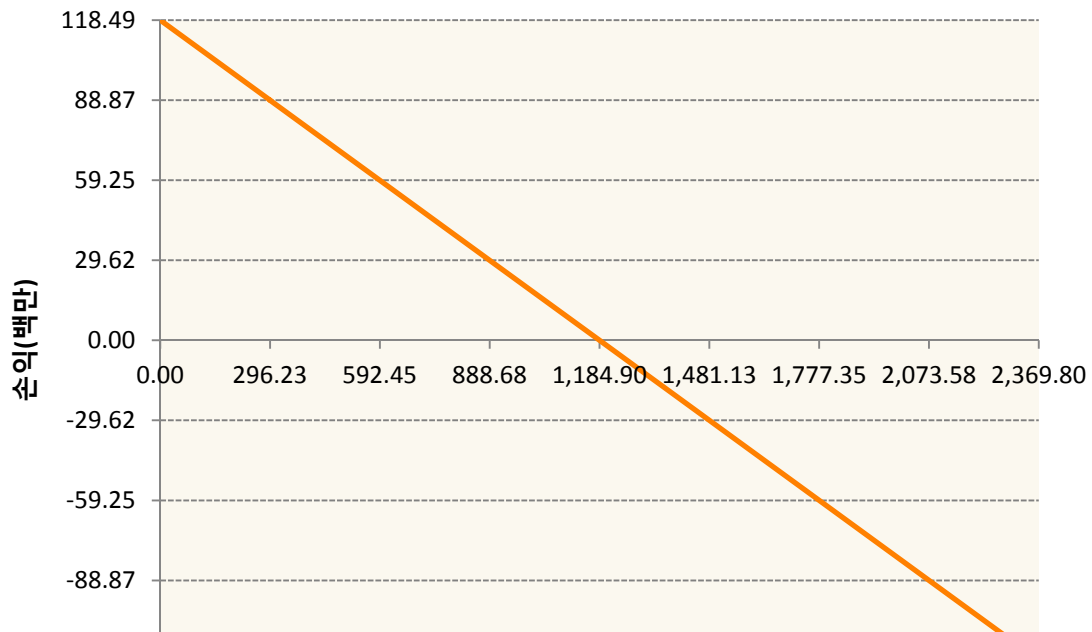


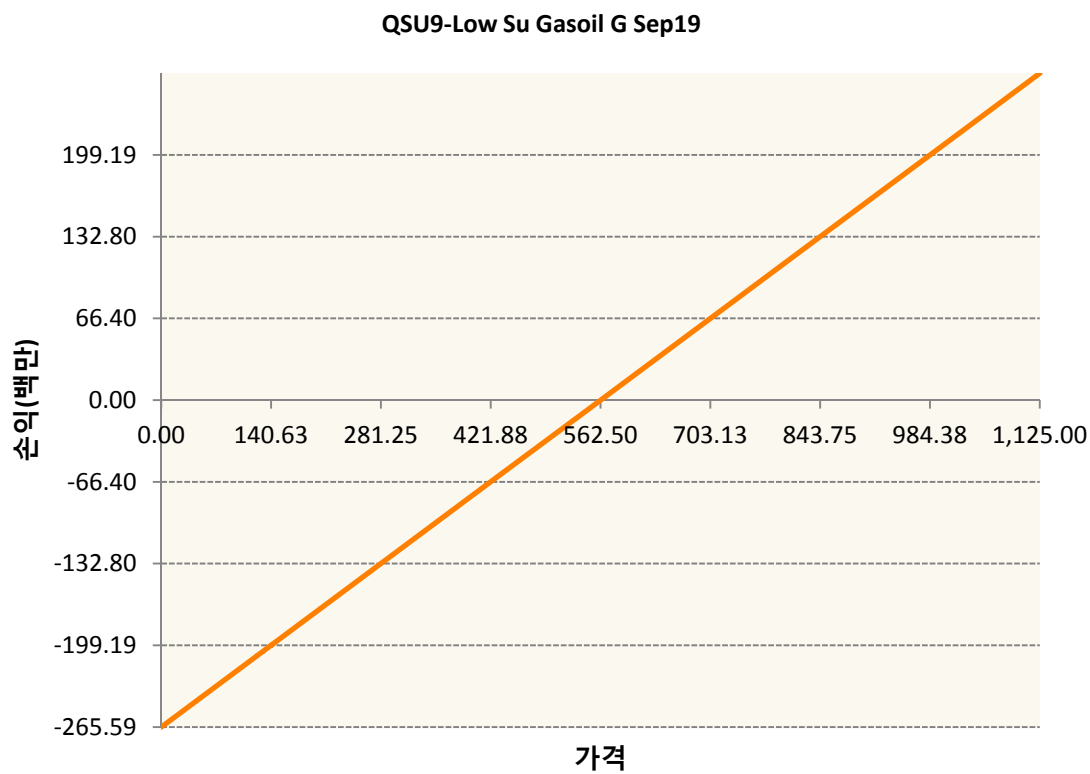
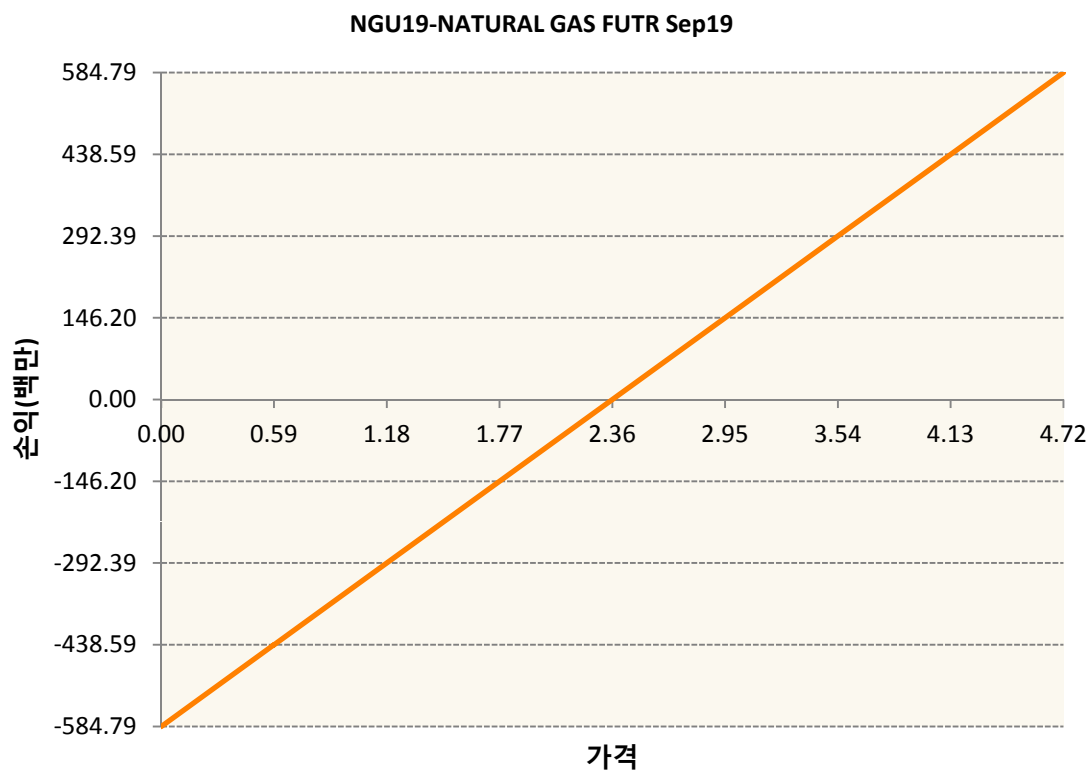
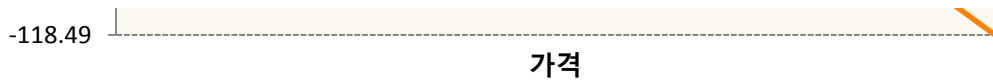


HOU9-NY Harb ULSD Fut Sep19

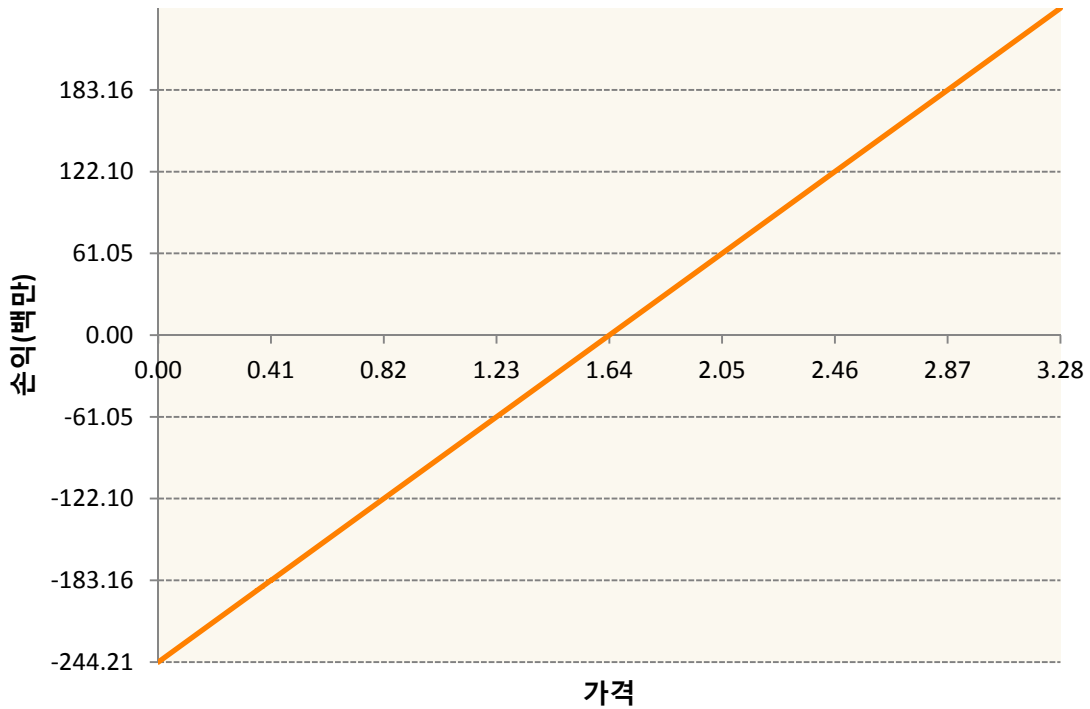


KR4175P70007-2019-07 달러선물





XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	44
COU9	BRENT CRUDE FUTR Sep19	51
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	14
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)

368

공시일	2019-06-19
기준일	2019-06-18

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

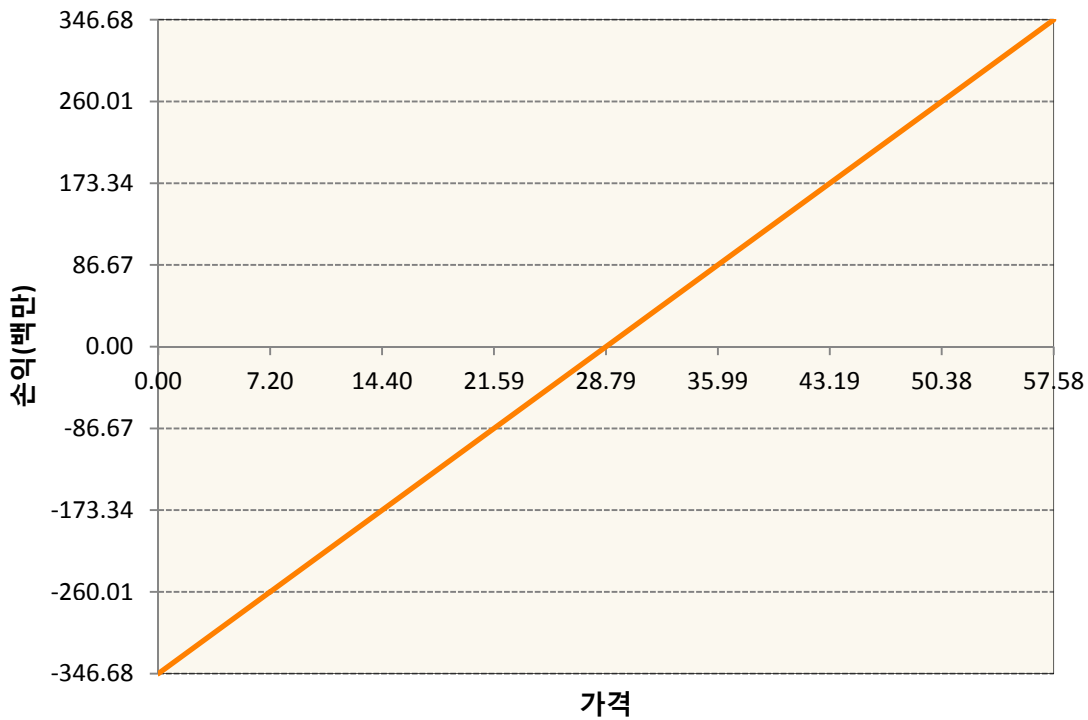
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

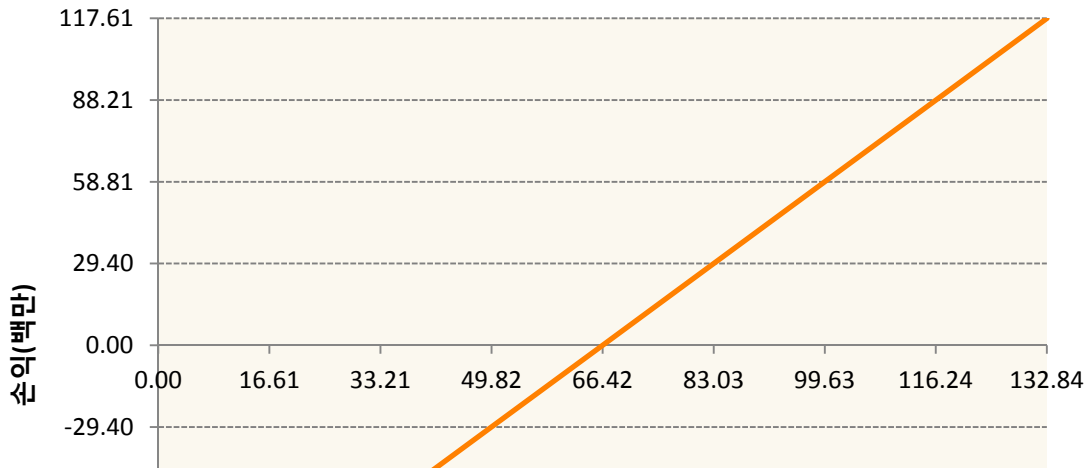
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,354	201	3,152	

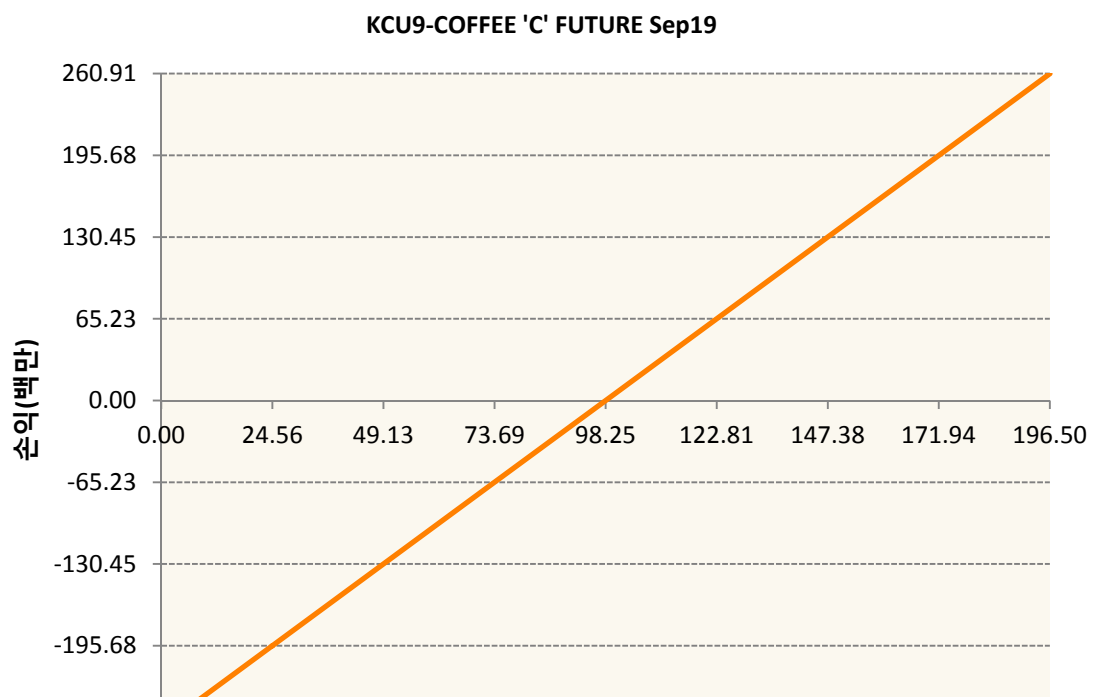
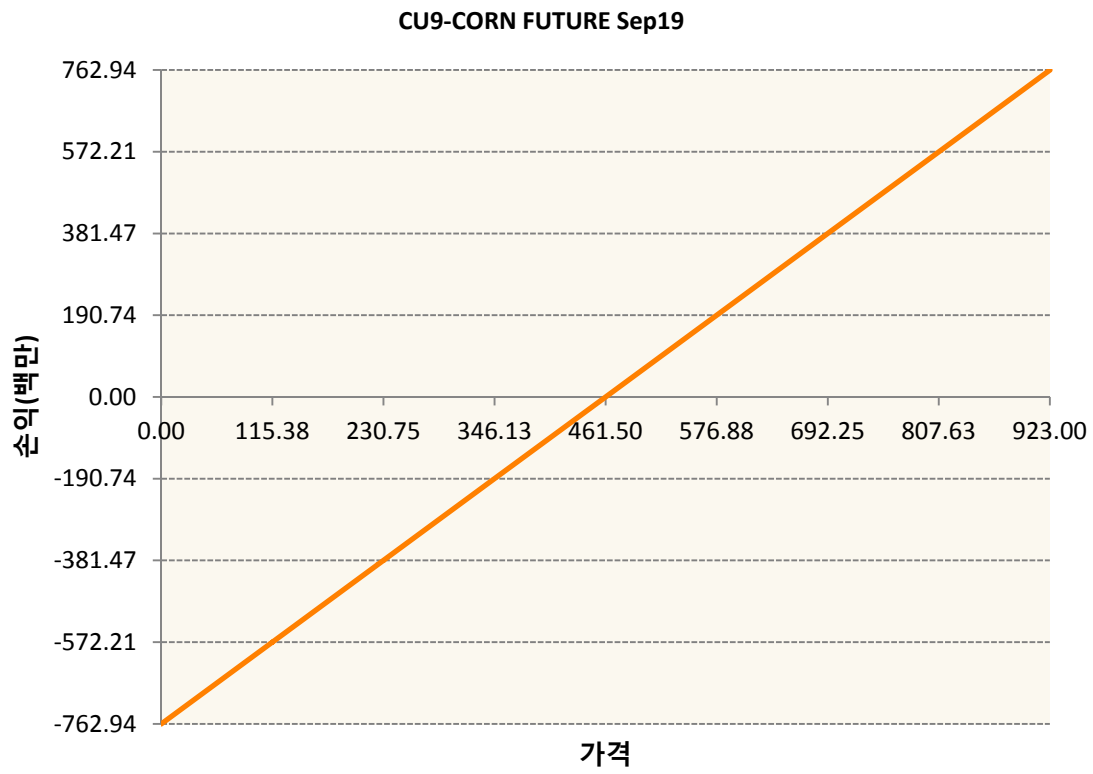
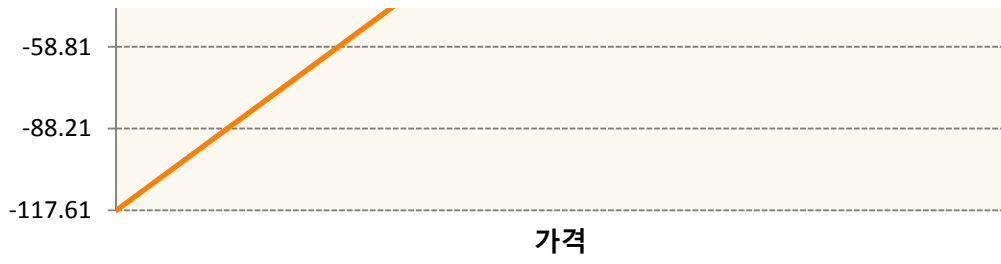
### 2. 만기시점의 손익구조

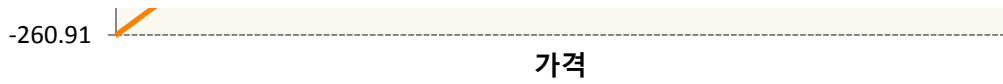
**BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19**



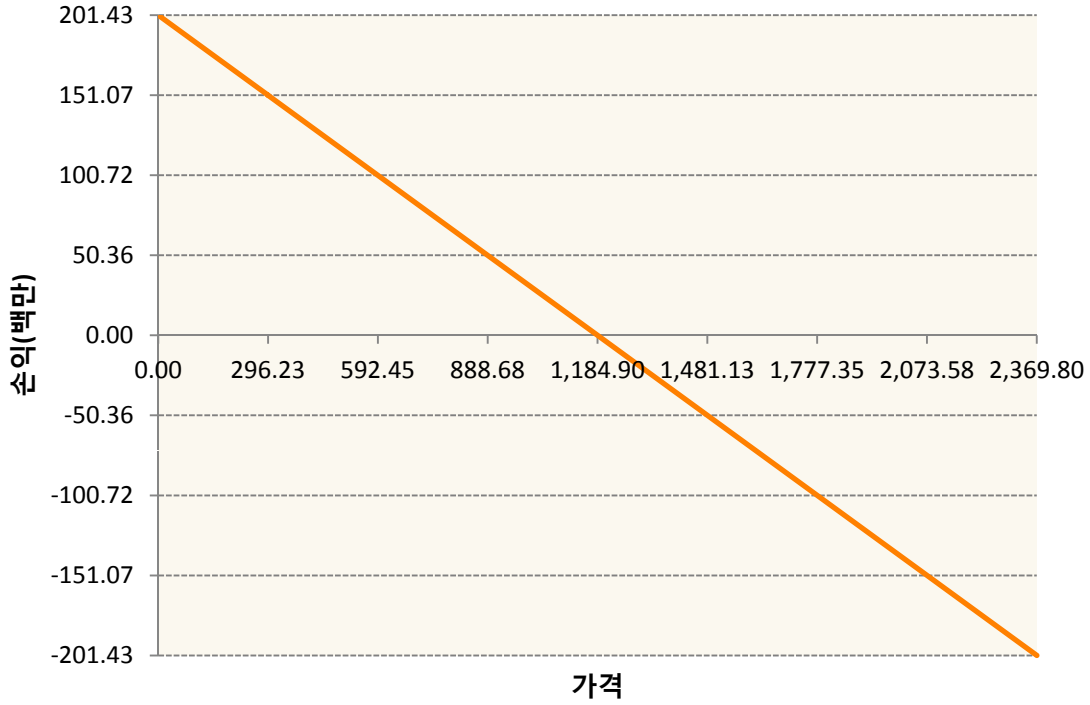
**CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19**



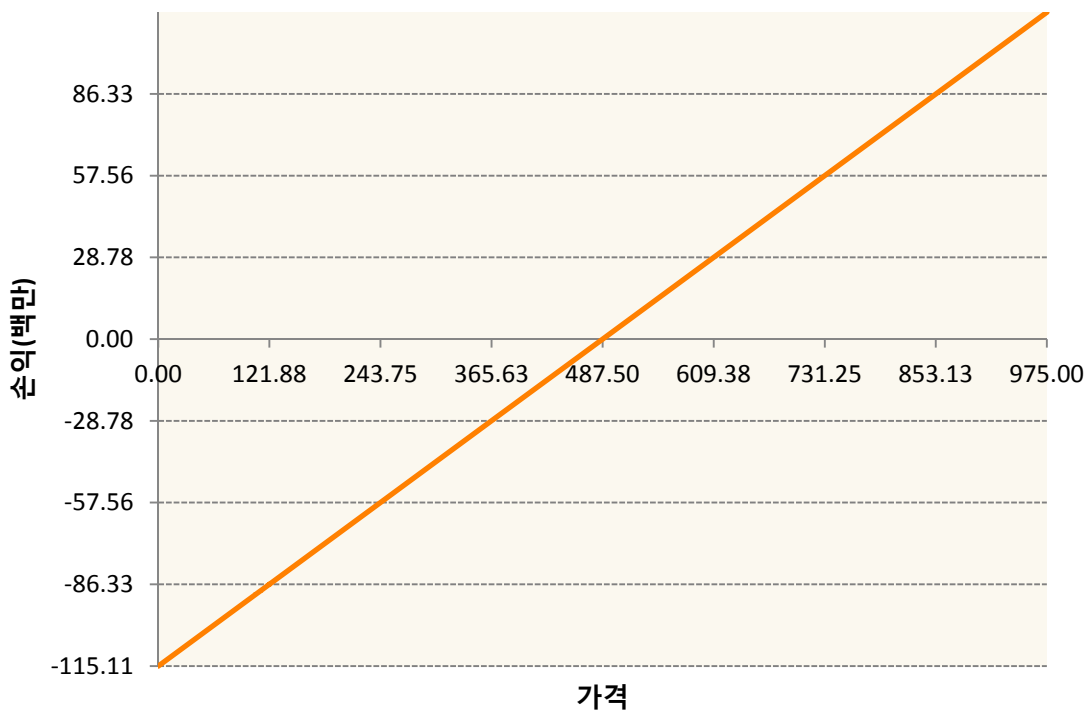




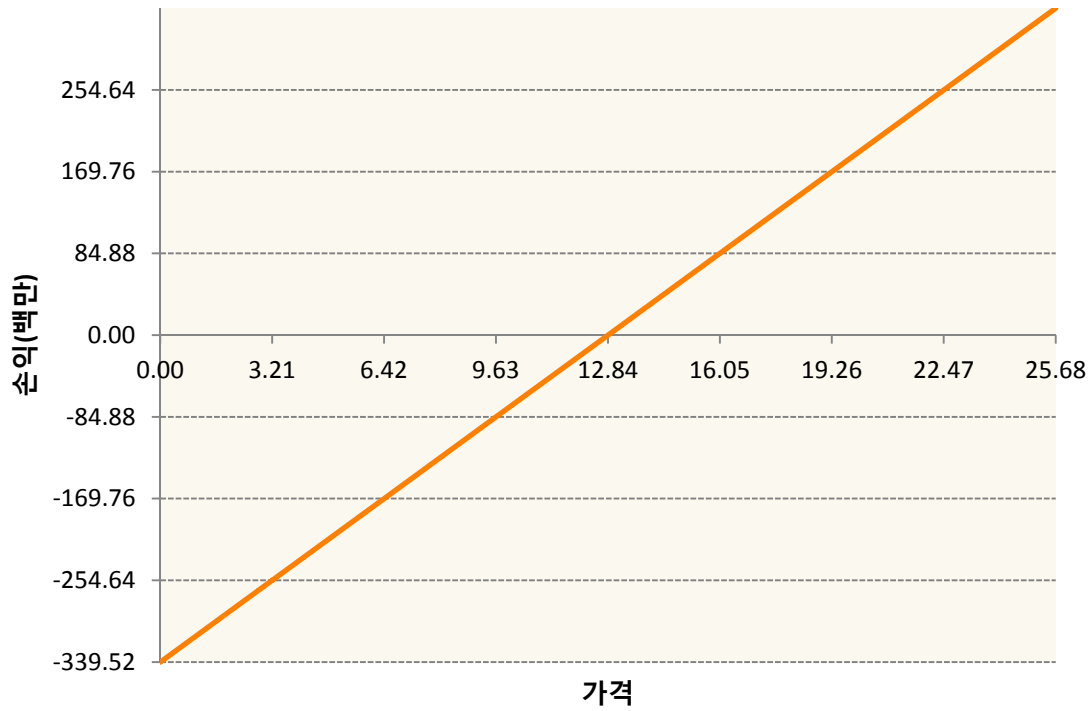
KR4175P70007-2019-07 달러선물



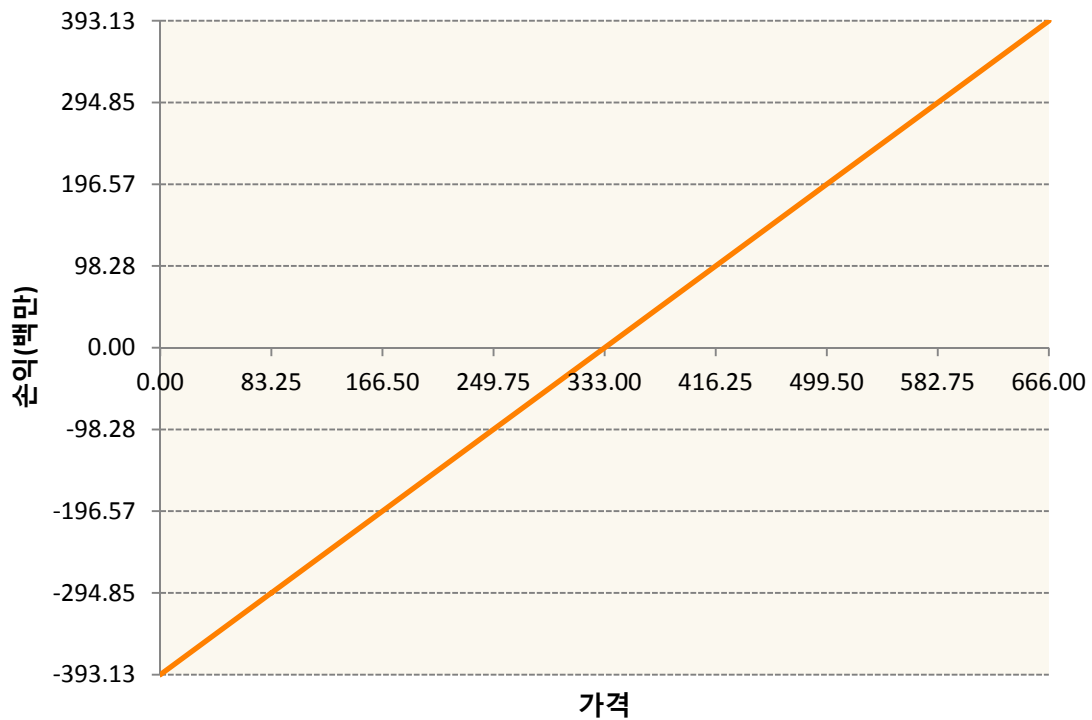
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



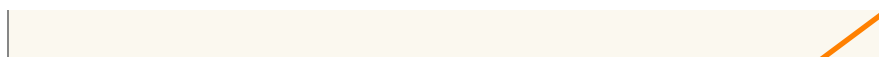
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

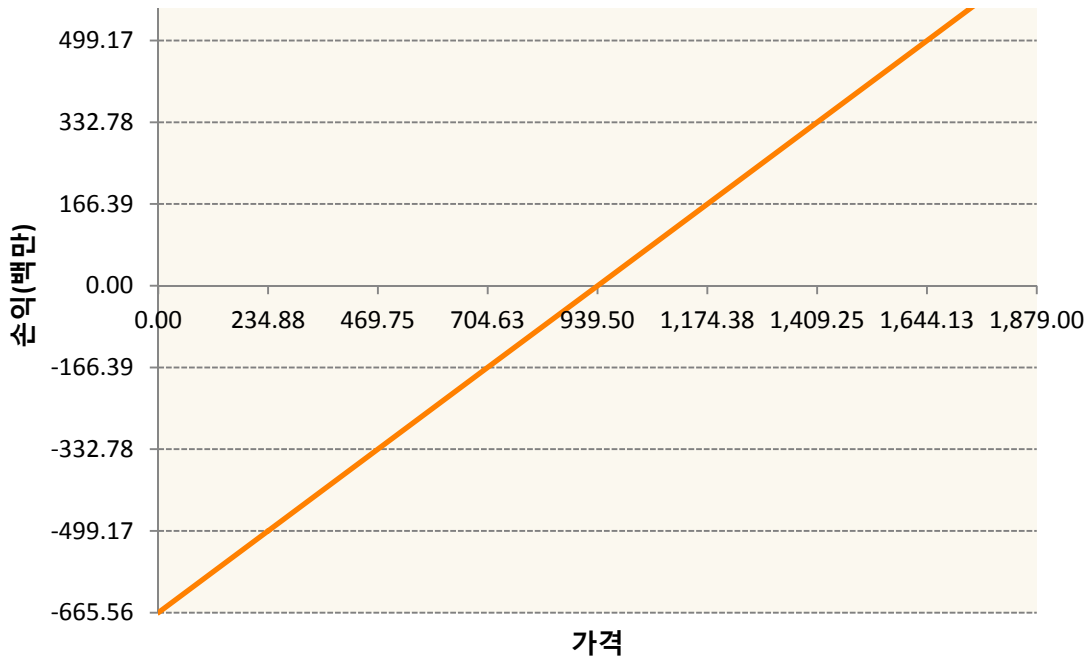


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

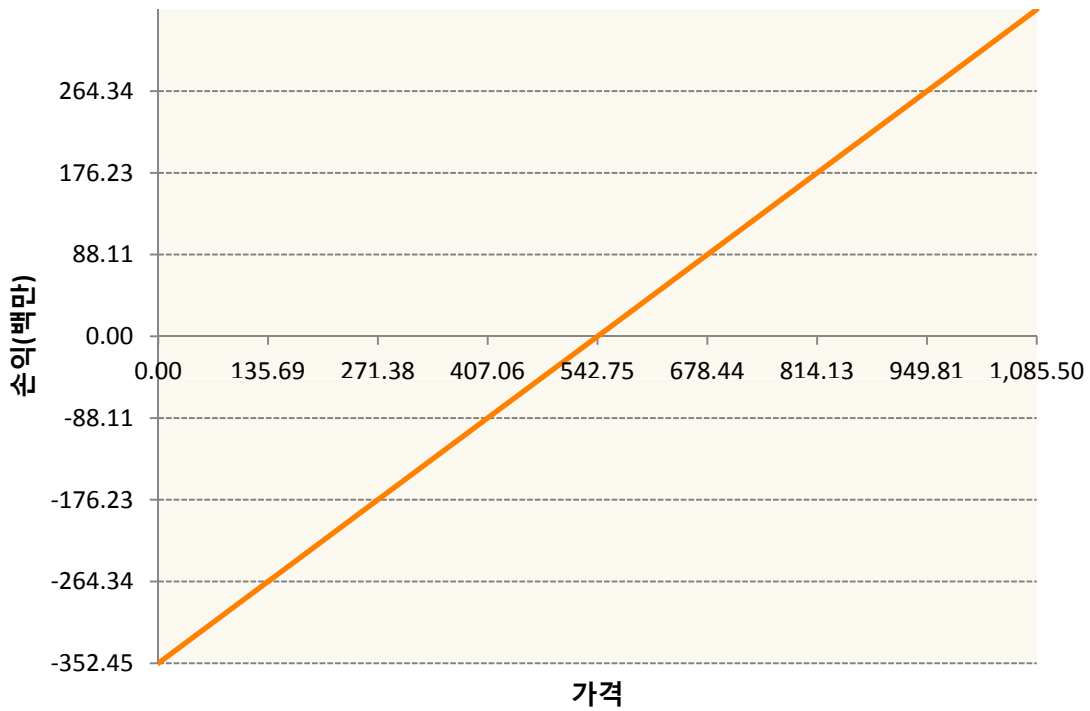


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





WU9-WHEAT FUTURE(CBT) Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	28
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	53
WU9	WHEAT FUTURE(CBT) Sep19	28

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

(단위:백만원)

**288**