

공시일	2019-06-20
기준일	2019-06-19

## 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	2019-06-20
기준일	2019-06-19

## 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

1,151

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

696

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-20
기준일	2019-06-19

## 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)

**863**

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-20
기준일	2019-06-19

## 유로인덱스모(주식-파생형)

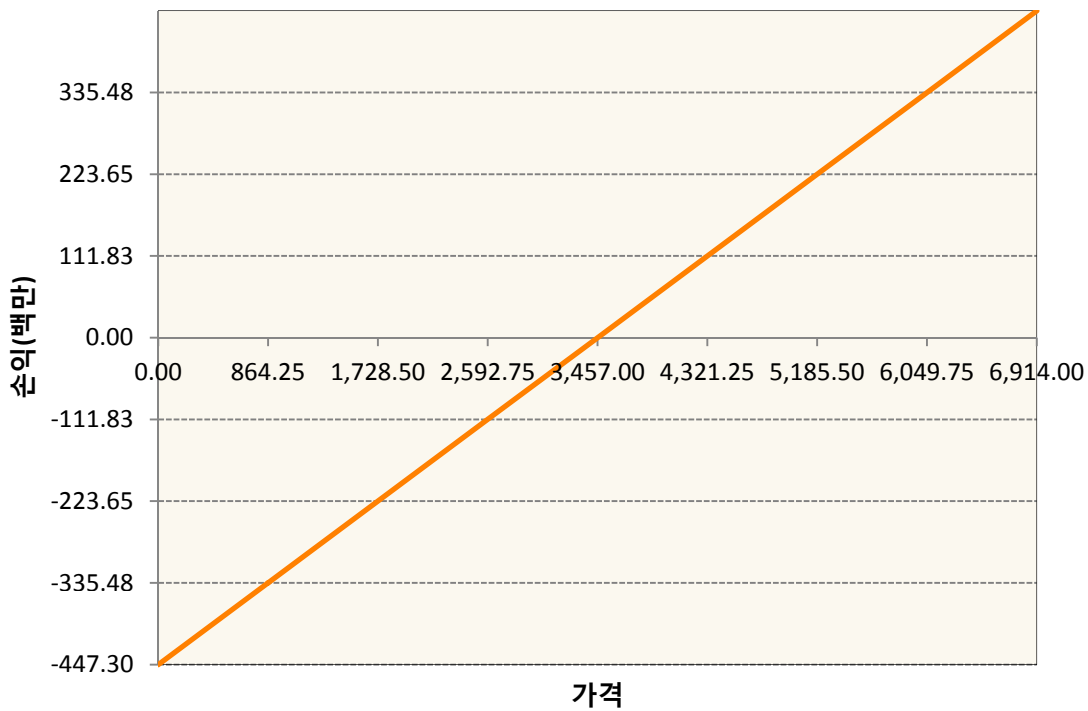
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	447	0	447	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	36
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

26
----

공시일	2019-06-20
기준일	2019-06-19

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

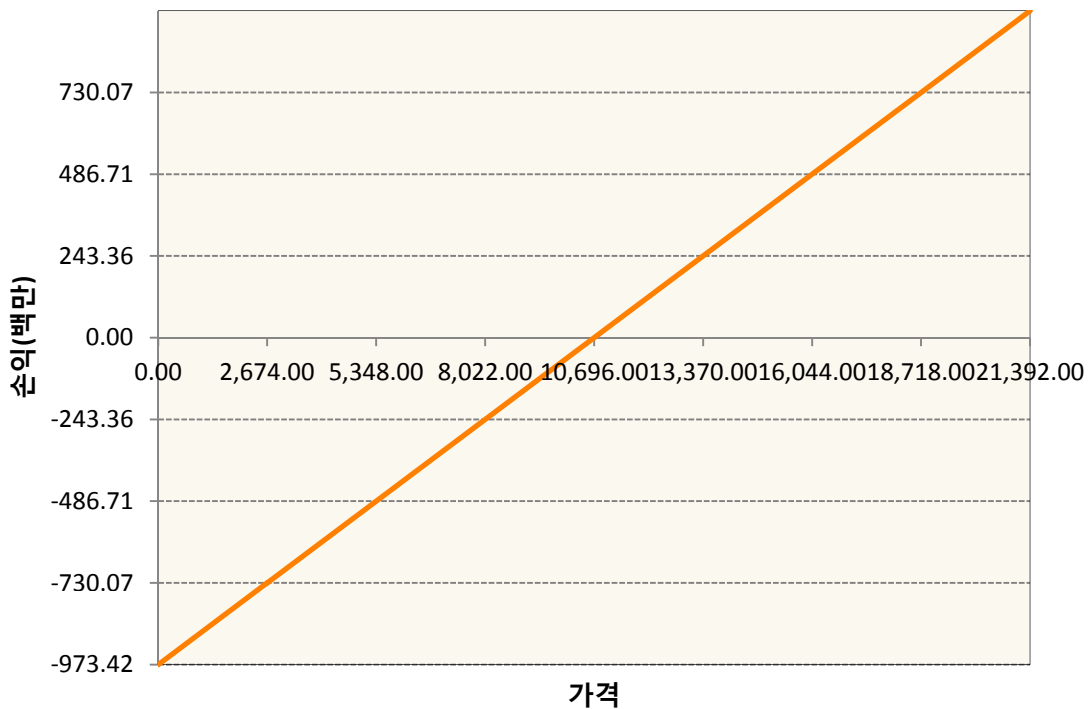
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	973	0	973	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM9	HSCEI Futures Jun19	78
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

79
----

공시일	2019-06-20
기준일	2019-06-19

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

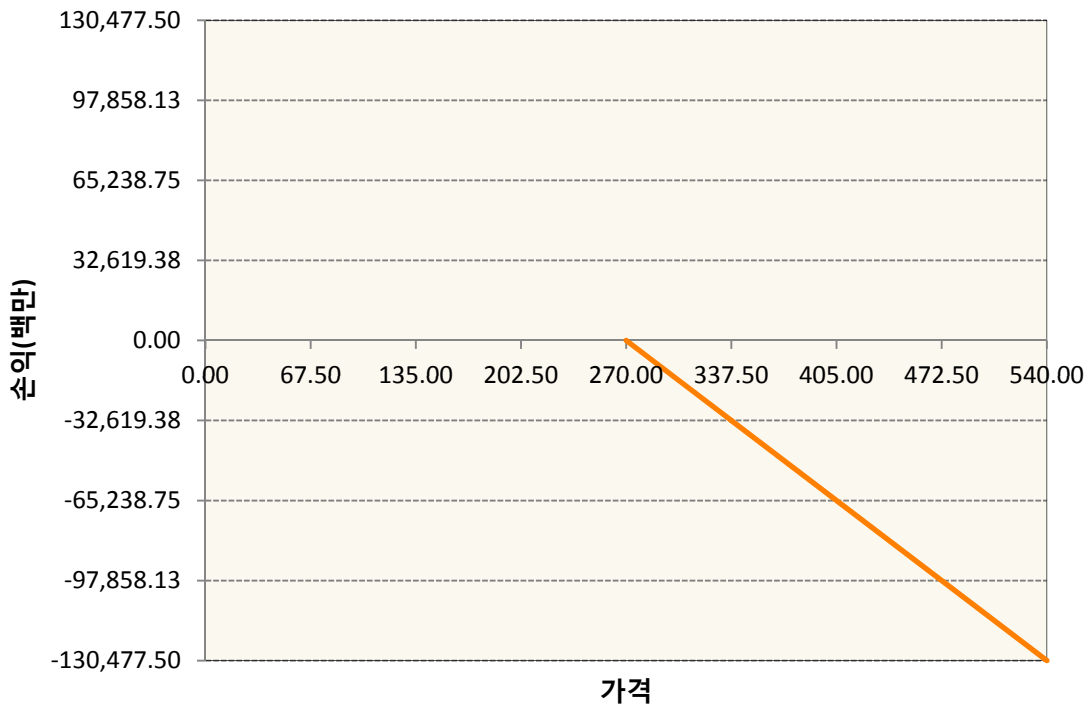
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

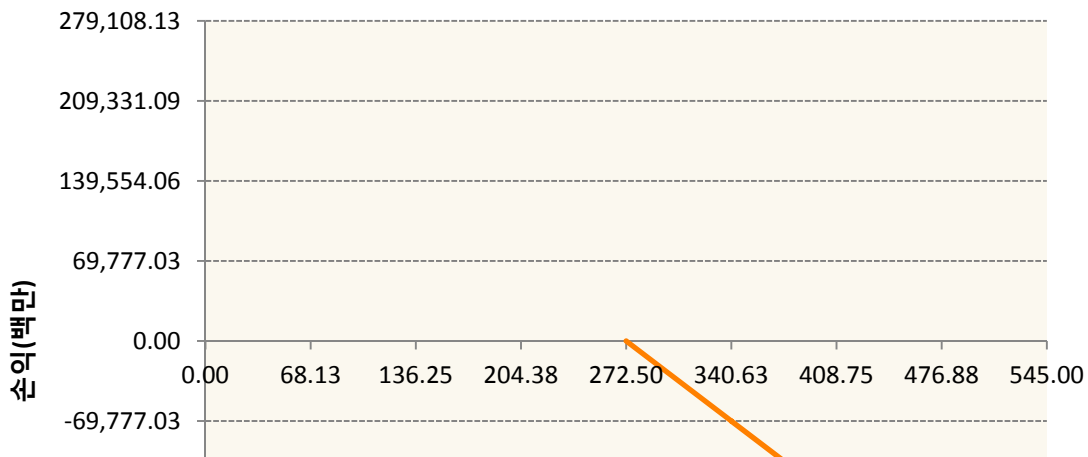
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	6,699	0	6,699	장내
누계	유가증권	옵션	0	605,336	-605,336	장내

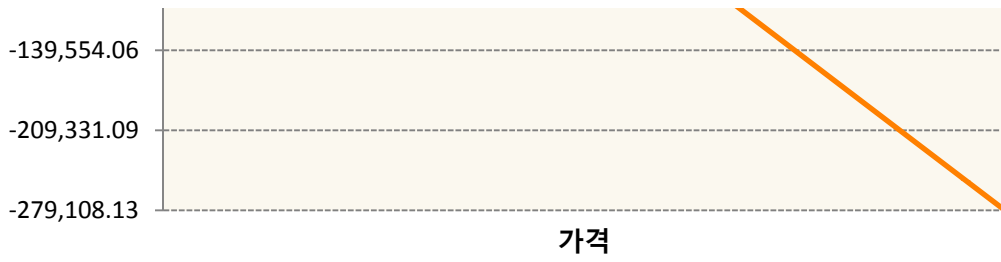
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P72700-2019-07 콜270

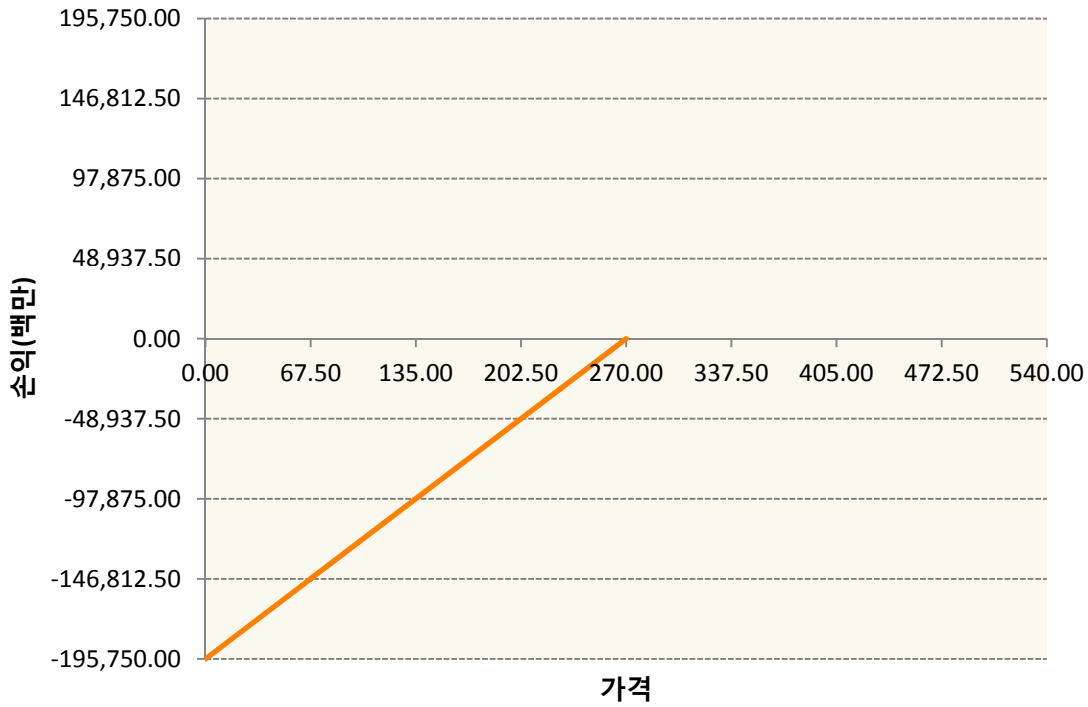


KR4201P72726-2019-07 콜272.5





KR4301P72708-2019-07 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201P72700		2019-07 콜270					9,013
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,441	4,330	4,200	4,054	3,894	3,723	3,542
-5.33%	3,906	3,703	3,489	3,268	3,040	2,807	2,571
-2.67%	2,736	2,470	2,204	1,938	1,671	1,404	1,137
0%	769	516	259	0	-261	-524	-788
2.67%	-1,918	-2,100	-2,295	-2,503	-2,719	-2,943	-3,174
5.33%	-5,087	-5,187	-5,307	-5,445	-5,600	-5,767	-5,947
8.00%	-8,499	-8,542	-8,603	-8,681	-8,776	-8,887	-9,013
KR4201P72726		2019-07 콜272.5					18,354
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,104	7,922	7,698	7,438	7,146	6,825	6,480

-5.33%	7,278	6,906	6,505	6,080	5,637	5,178	4,706
-2.67%	5,301	4,762	4,218	3,669	3,116	2,561	2,003
0%	1,714	1,144	573	0	-574	-1,149	-1,724
2.67%	-3,498	-3,948	-4,421	-4,911	-5,415	-5,930	-6,454
5.33%	-9,914	-10,187	-10,501	-10,851	-11,230	-11,634	-12,060
8.00%	-17,005	-17,134	-17,305	-17,515	-17,763	-18,044	-18,354
KR4301P72708                      2019-07 풋270							11,166
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10,905	-10,921	-10,947	-10,984	-11,033	-11,094	-11,166
-5.33%	-5,787	-5,887	-6,003	-6,133	-6,275	-6,426	-6,586
-2.67%	-1,637	-1,857	-2,079	-2,303	-2,527	-2,752	-2,978
0%	578	393	199	0	-204	-412	-624
2.67%	1,218	1,153	1,072	974	863	739	603
5.33%	1,309	1,299	1,281	1,254	1,215	1,166	1,105
8.00%	1,315	1,314	1,312	1,307	1,299	1,285	1,265

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

(단위:백만원)

**38,548**

공시일	2019-06-20
기준일	2019-06-19

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

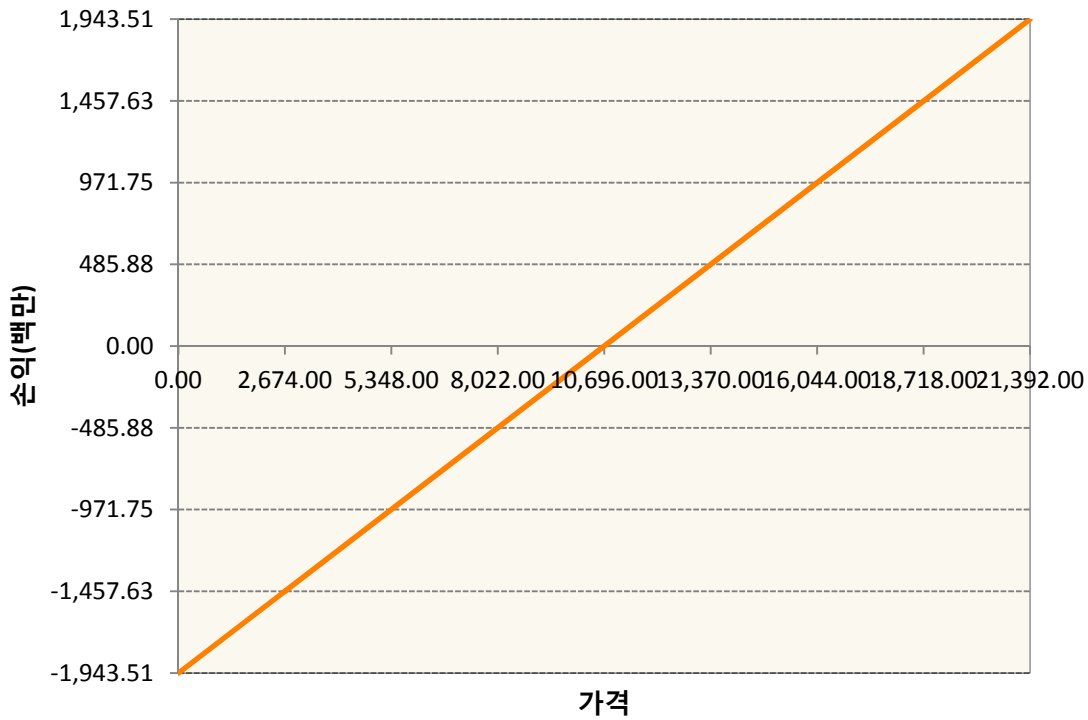
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

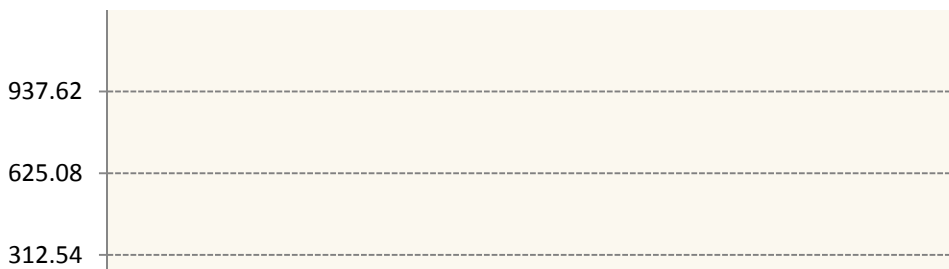
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,944	0	1,944	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,025	-5,025	장내
누계	통화	선도	150	3,155	-3,005	장외

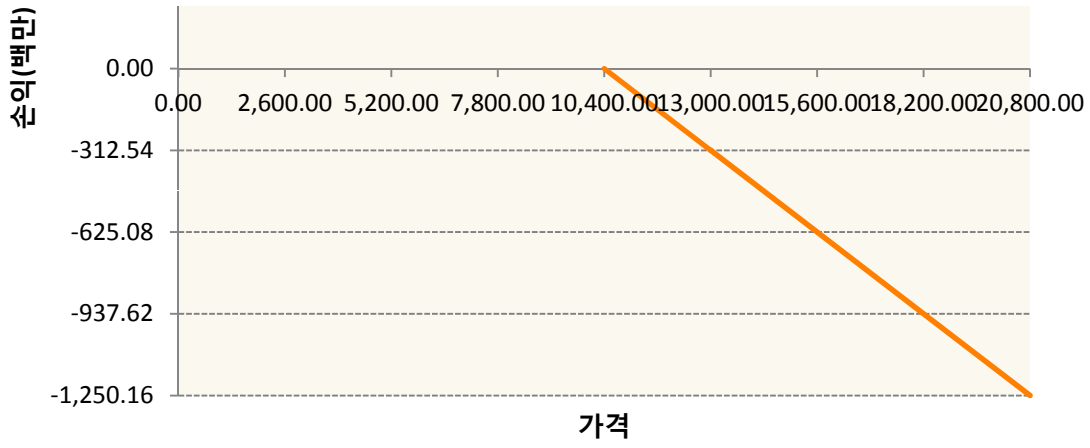
### 2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19

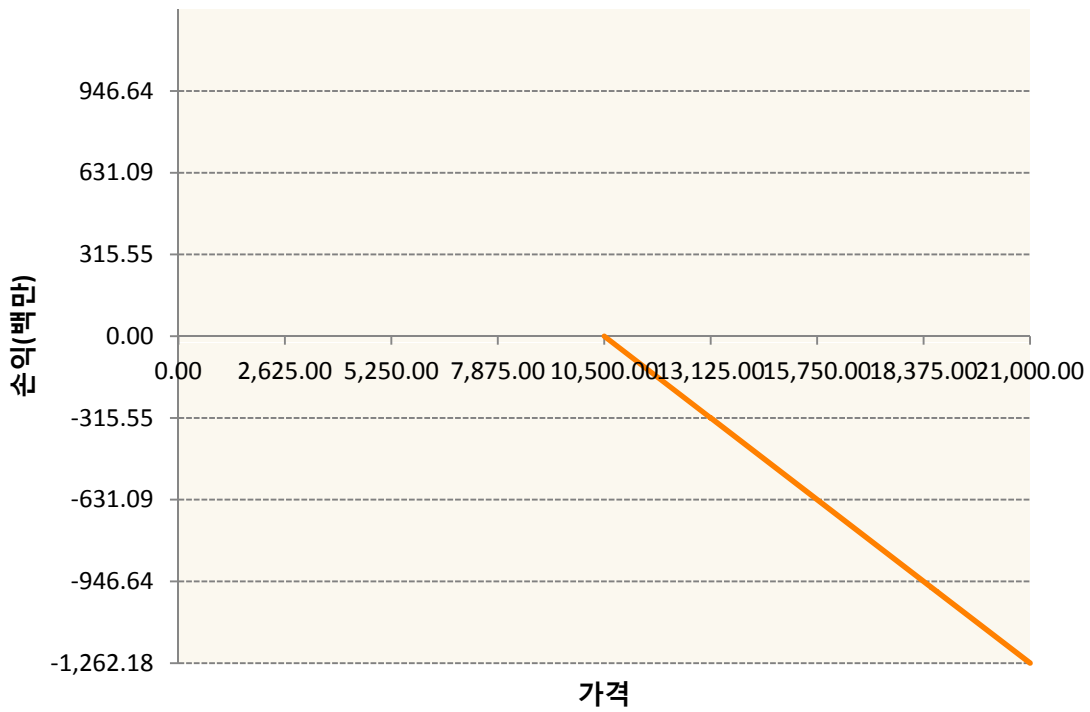


OHHIM9-C104-HSCEI

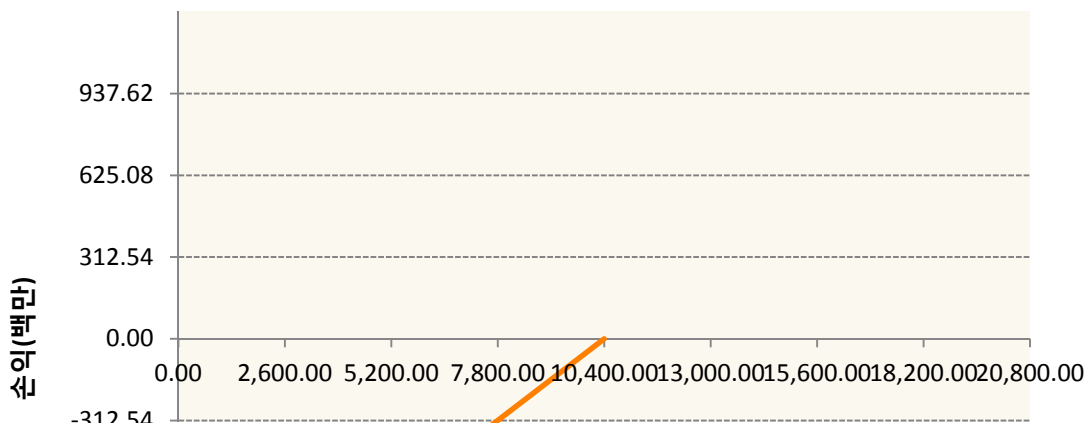


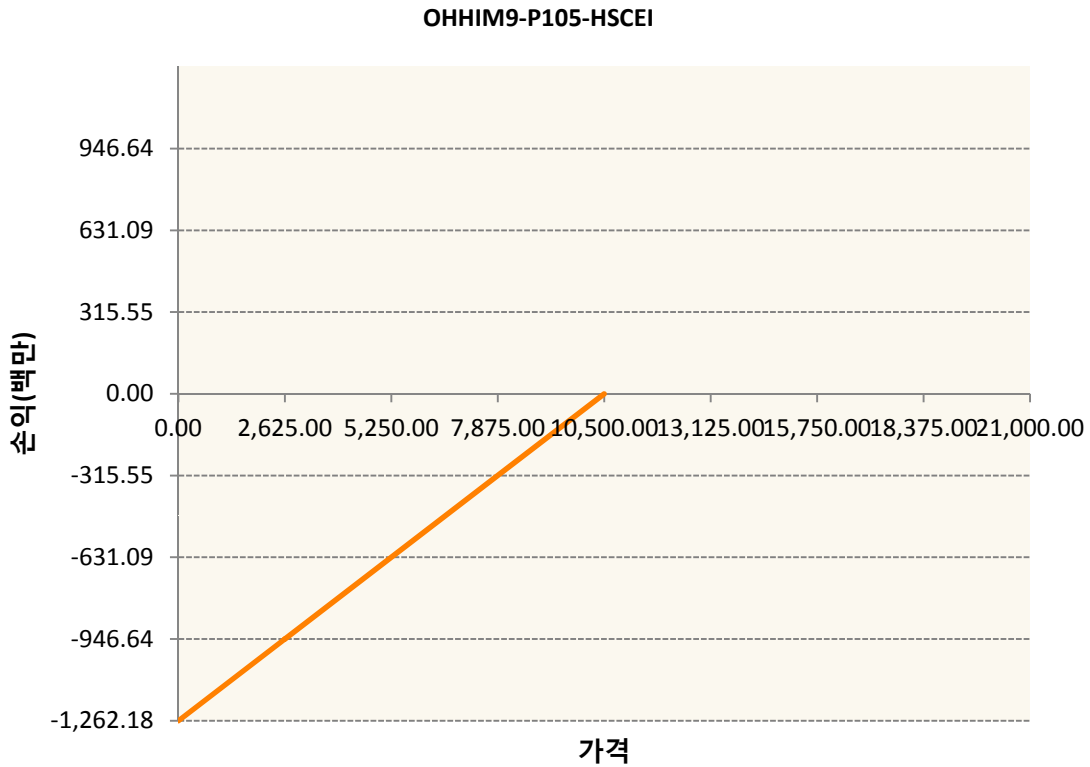


OHHIM9-C105-HSCEI



OHHIM9-P104-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	252
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E	12
HCM9 HSCEI Futures Jun19	155
OHHIM9-C1 HSCEI	100
OHHIM9-C1 HSCEI	101
OHHIM9-P1 HSCEI	100
OHHIM9-P1 HSCEI	101

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

공시일	2019-06-20
기준일	2019-06-19

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

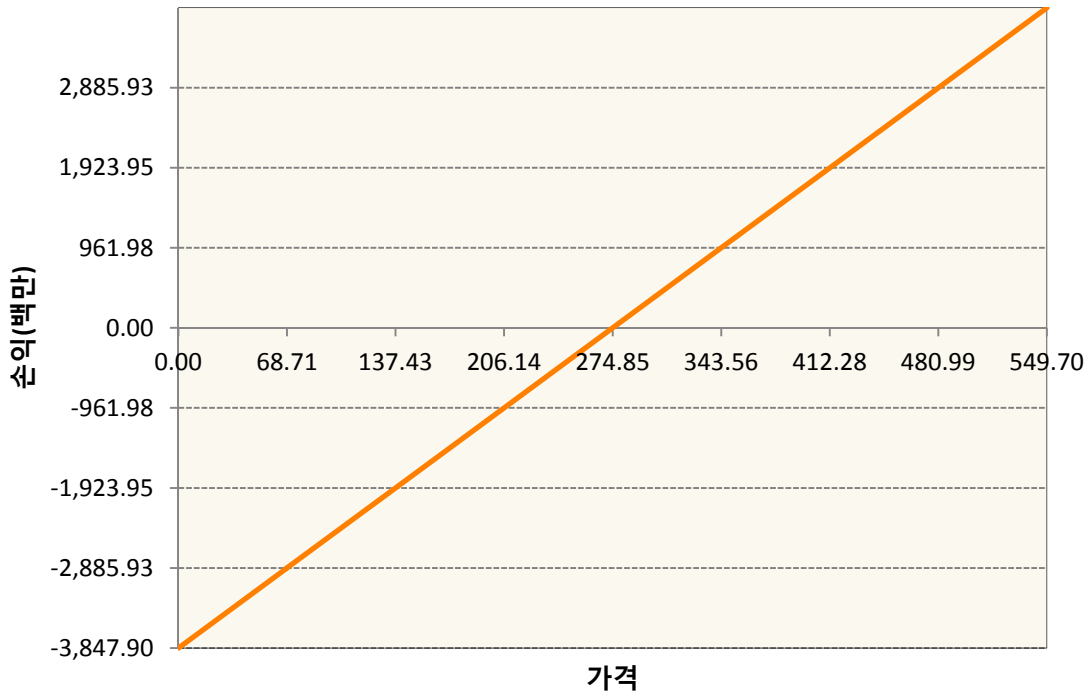
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

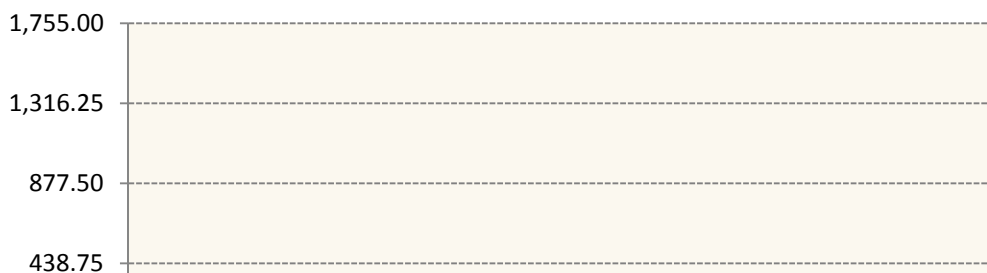
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,848	0	3,848	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	21,555	-21,555	장내

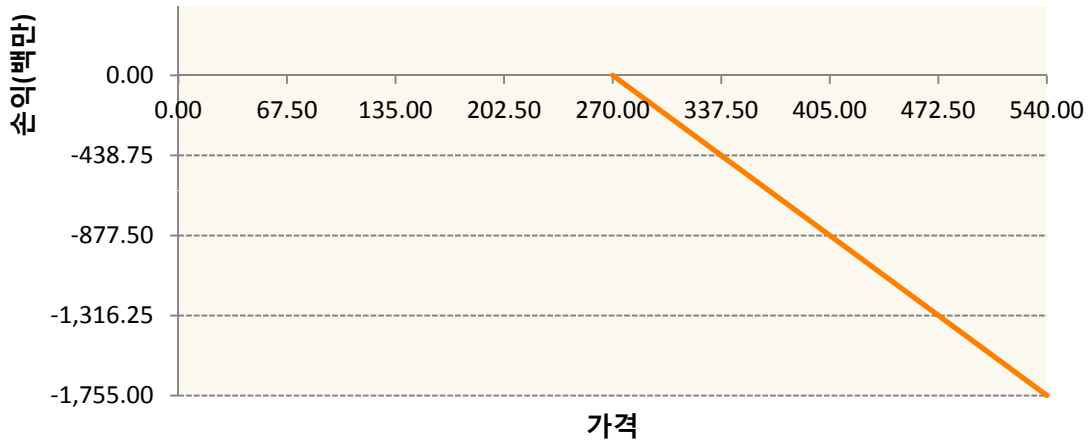
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

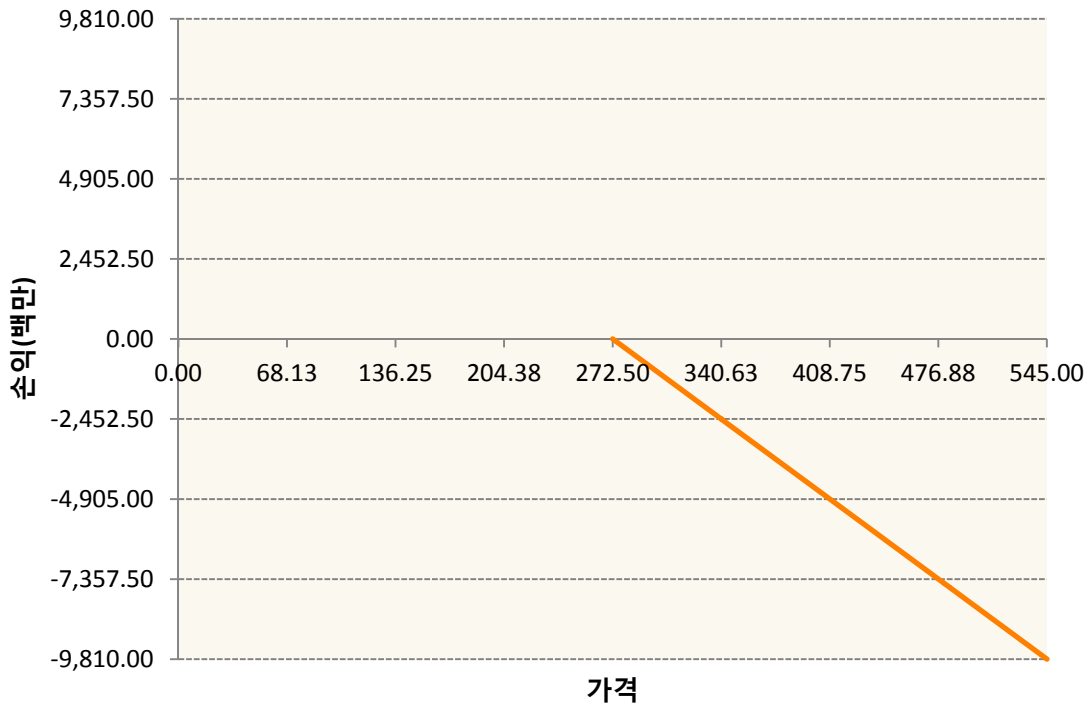


KR4201P72700-2019-07 콜270

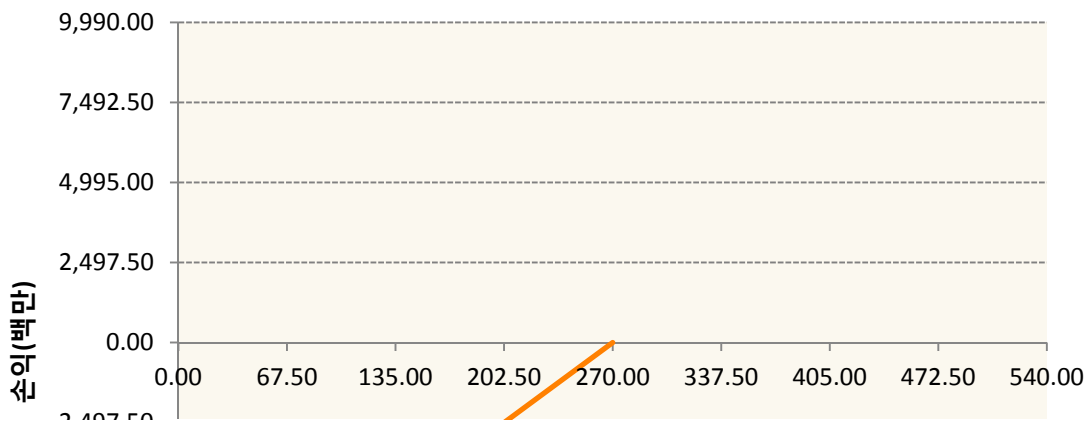




**KR4201P72726-2019-07 콜272.5**



**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						308
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-308	-308	-308	-308	-308	-308	-308	
-5.33%	-206	-206	-206	-206	-206	-206	-206	
-2.67%	-103	-103	-103	-103	-103	-103	-103	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	103	103	103	103	103	103	103	
5.33%	206	206	206	206	206	206	206	
8.00%	308	308	308	308	308	308	308	
KR4201P72700		2019-07 콜270						121
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	60	58	56	55	52	50	48
-5.33%	53	50	47	44	41	38	35
-2.67%	37	33	30	26	22	19	15
0%	10	7	3	0	-4	-7	-11
2.67%	-26	-28	-31	-34	-37	-40	-43
5.33%	-68	-70	-71	-73	-75	-78	-80
8.00%	-114	-115	-116	-117	-118	-120	-121
KR4201P72726                      2019-07 콜272.5							645
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	285	278	271	261	251	240	228
-5.33%	256	243	229	214	198	182	165
-2.67%	186	167	148	129	110	90	70
0%	60	40	20	0	-20	-40	-61
2.67%	-123	-139	-155	-173	-190	-208	-227
5.33%	-348	-358	-369	-381	-395	-409	-424
8.00%	-598	-602	-608	-616	-624	-634	-645
KR4301P72708                      2019-07 풋270							570
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-557	-557	-559	-561	-563	-566	-570
-5.33%	-295	-300	-306	-313	-320	-328	-336
-2.67%	-84	-95	-106	-118	-129	-140	-152
0%	30	20	10	0	-10	-21	-32
2.67%	62	59	55	50	44	38	31
5.33%	67	66	65	64	62	60	56
8.00%	67	67	67	67	66	66	65

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

(단위:백만원)

**3,388**

공시일	2019-06-20
기준일	2019-06-19

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

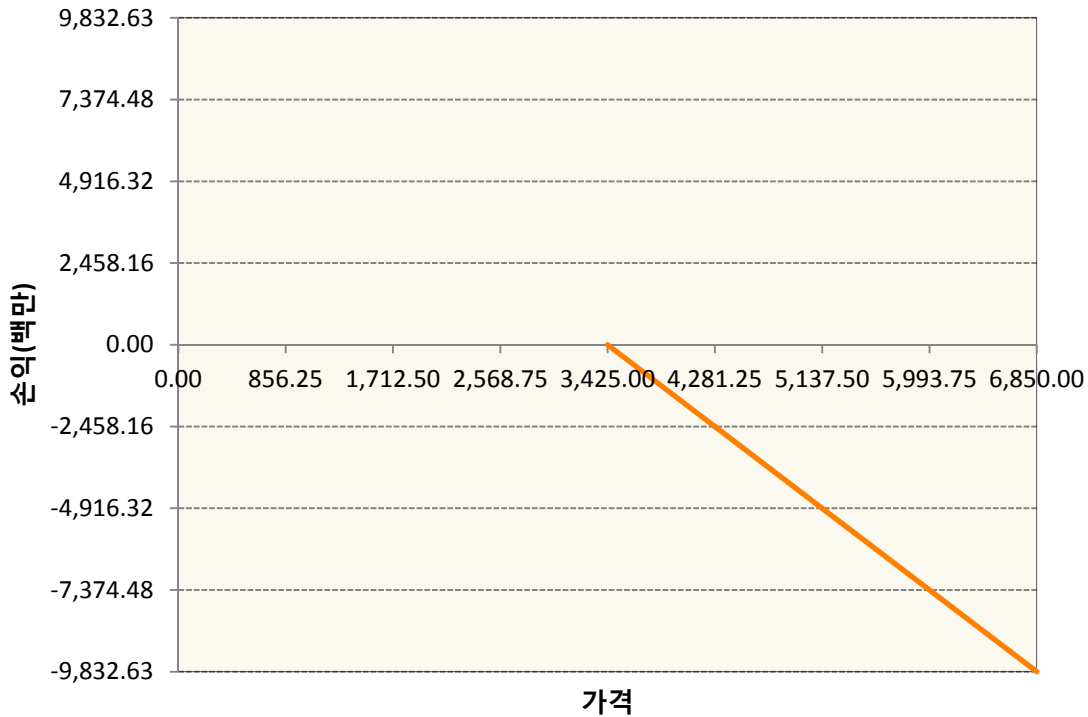
### 1. 계약금액

(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	3,779	0	3,779	
누계	유가증권	스왑	55,742	0	55,742	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,210	-20,210	장내
누계	통화	선도	0	18,436	-18,436	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXM9-C3425-EURO STOXX 50**

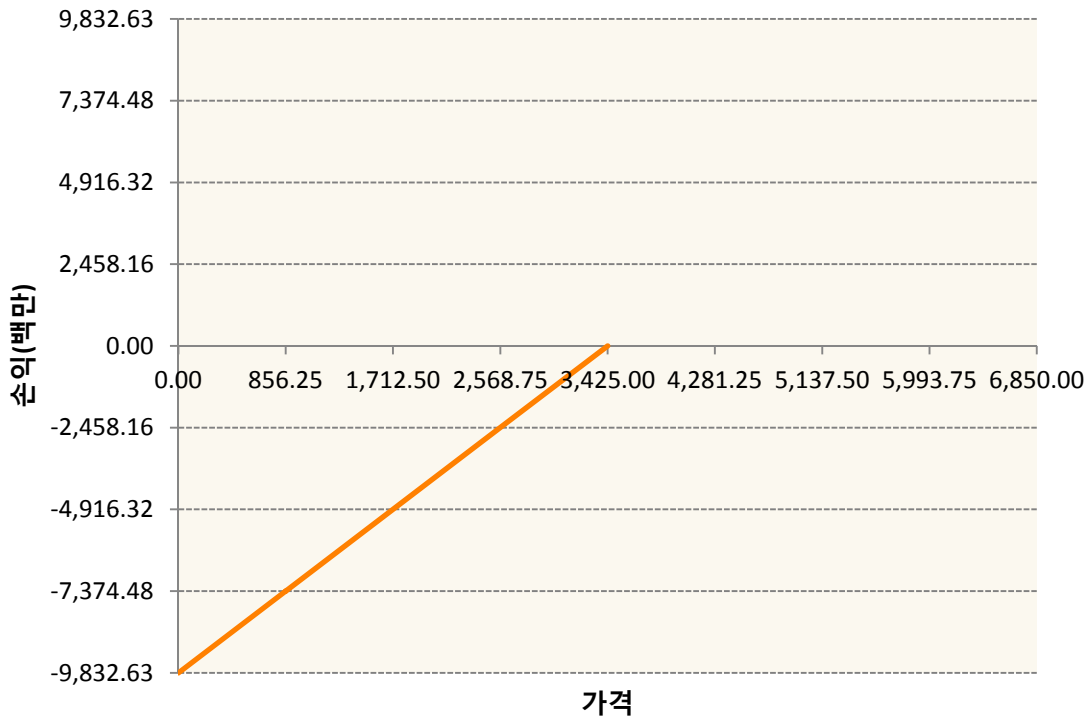


**OESXM9-C3450-EURO STOXX 50**

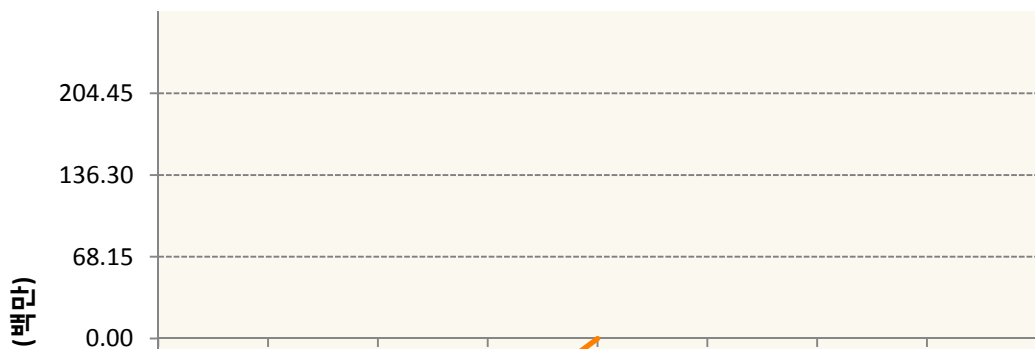


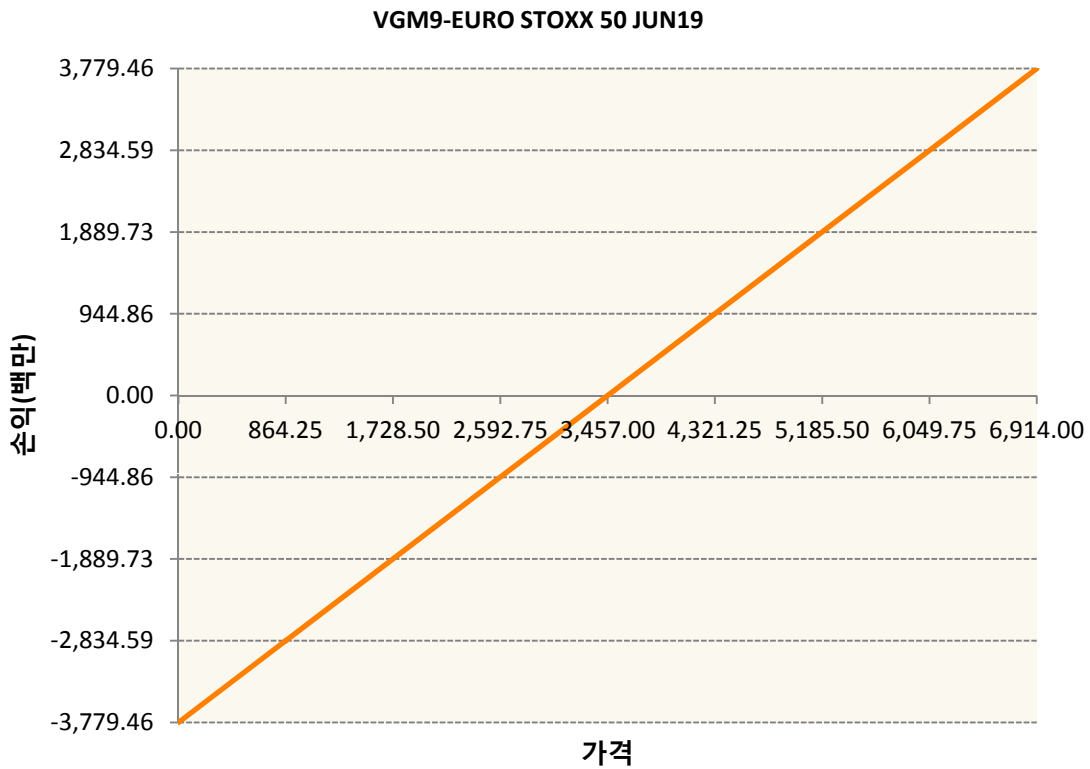
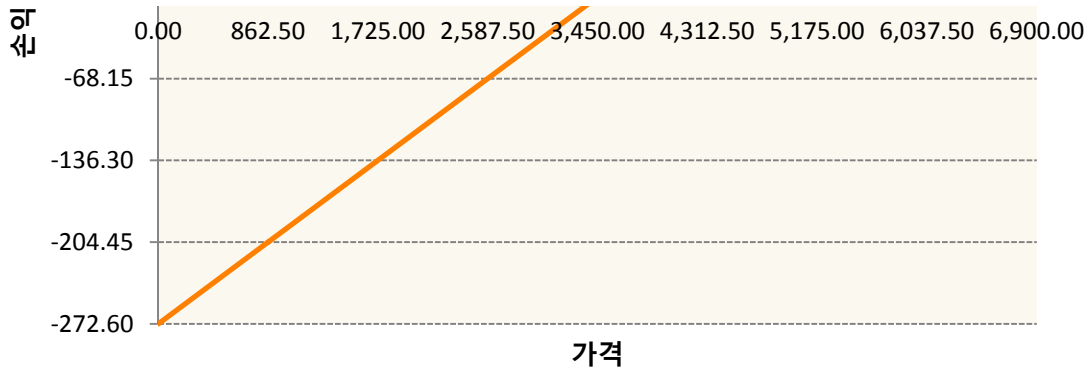


OESXM9-P3425-EURO STOXX 50



OESXM9-P3450-EURO STOXX 50





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	43
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	843
FX21019J01: KRW/EUR 28-06-19E	211
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	421
OESXM9-C3·EURO STOXX 50	787
OESXM9-C3·EURO STOXX 50	22
OESXM9-P3·EURO STOXX 50	787
OESXM9-P3·EURO STOXX 50	22
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	302

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

(단위:백만원)

2,148



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

(단위:백만원)

1,053



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

(단위:백만원)

93



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

(단위:백만원)

135

공시일	2019-06-20
기준일	2019-06-19

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

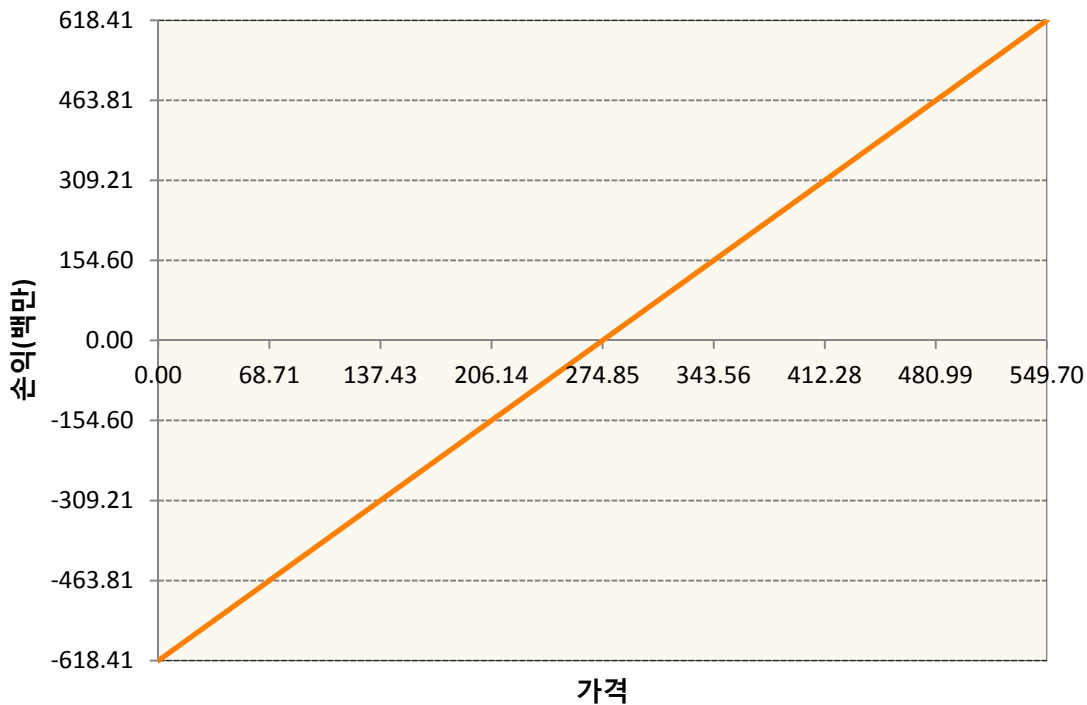
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	618	0	618	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						50
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	17	17	17	17	17	17	17	
5.33%	33	33	33	33	33	33	33	
8.00%	50	50	50	50	50	50	50	

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

(단위:백만원)

42

공시일	2019-06-20
기준일	2019-06-19

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

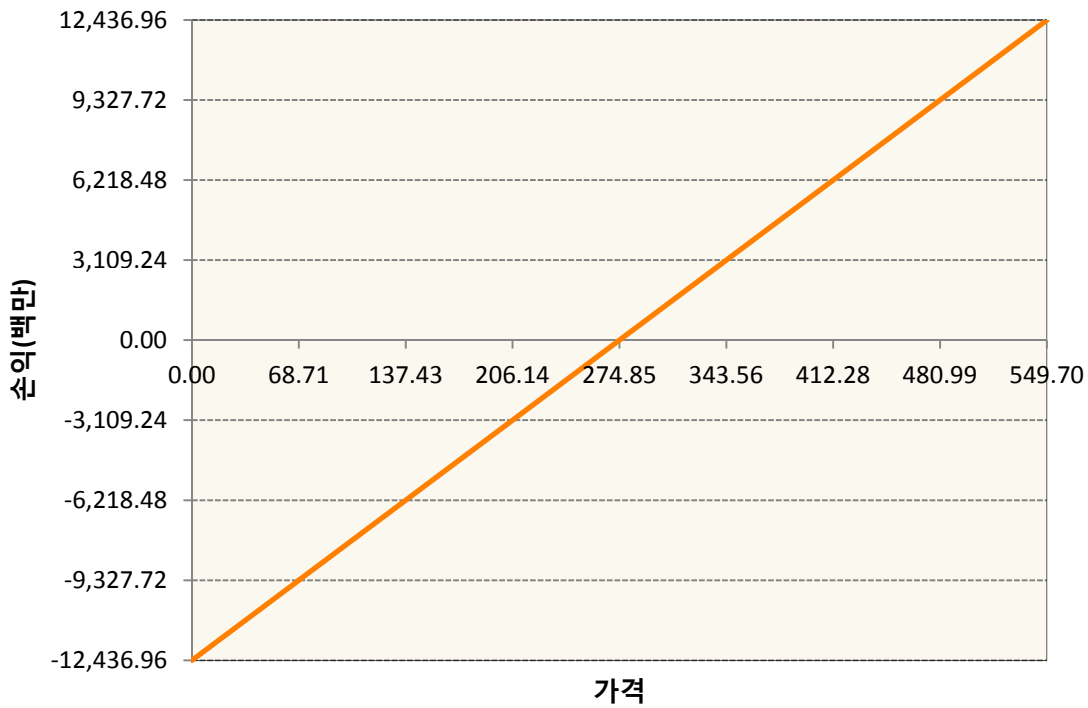
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

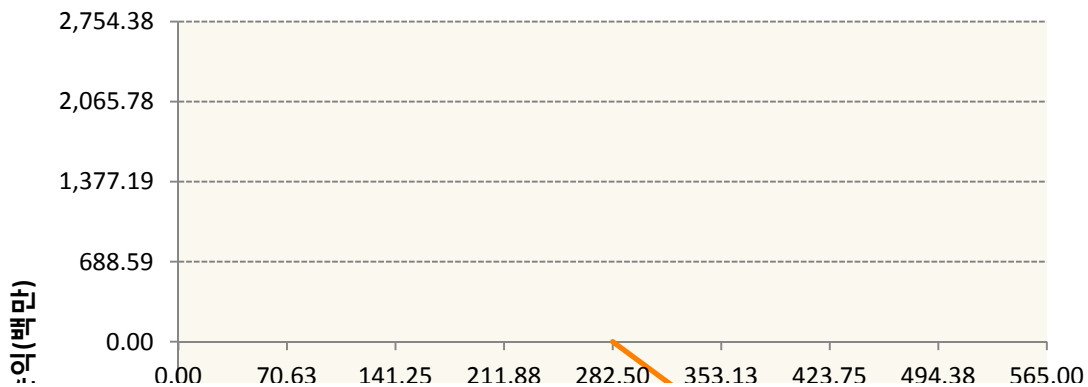
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,437	0	12,437	장내
누계	유가증권	옵션	1,084	22,206	-21,121	장내

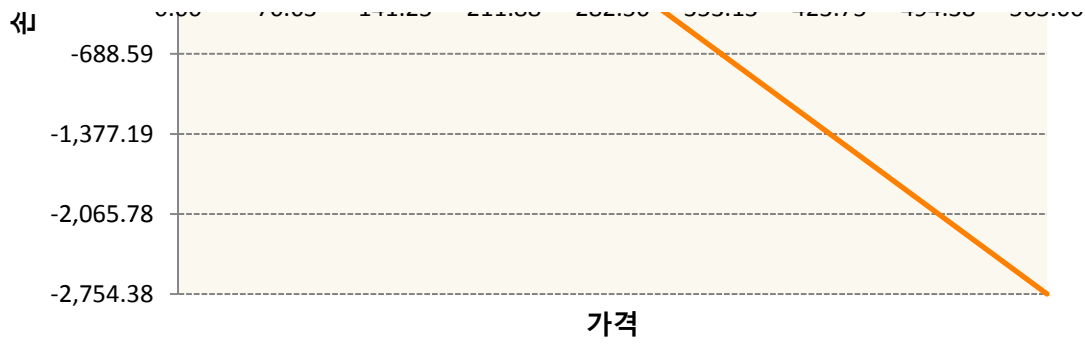
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

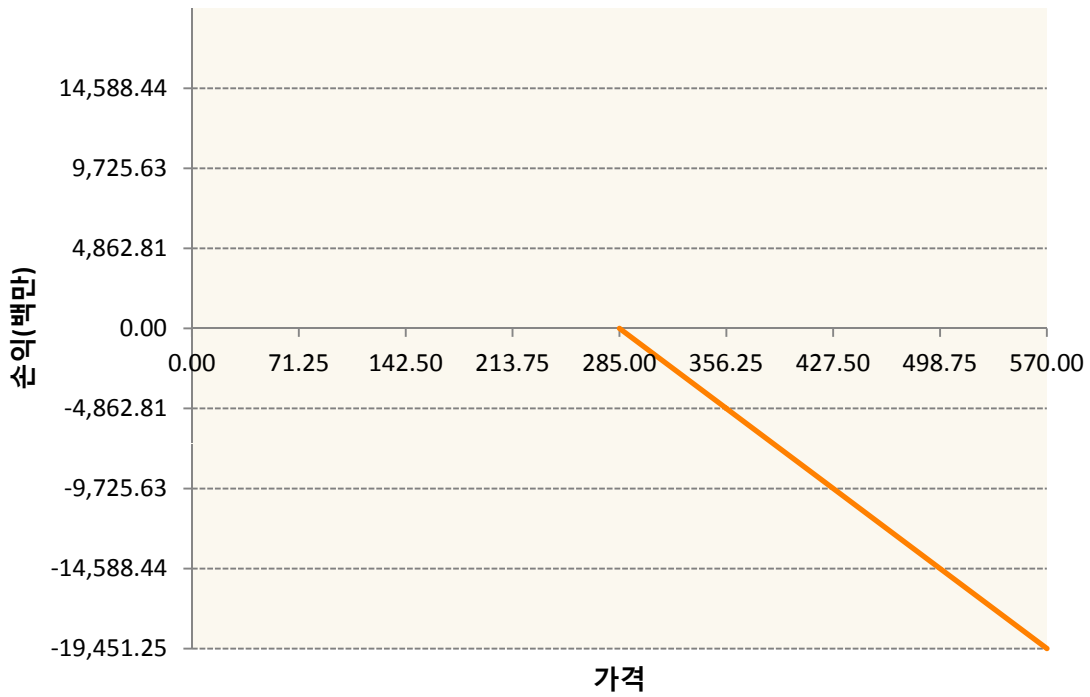


KR4201P72825-2019-07 콜282.5

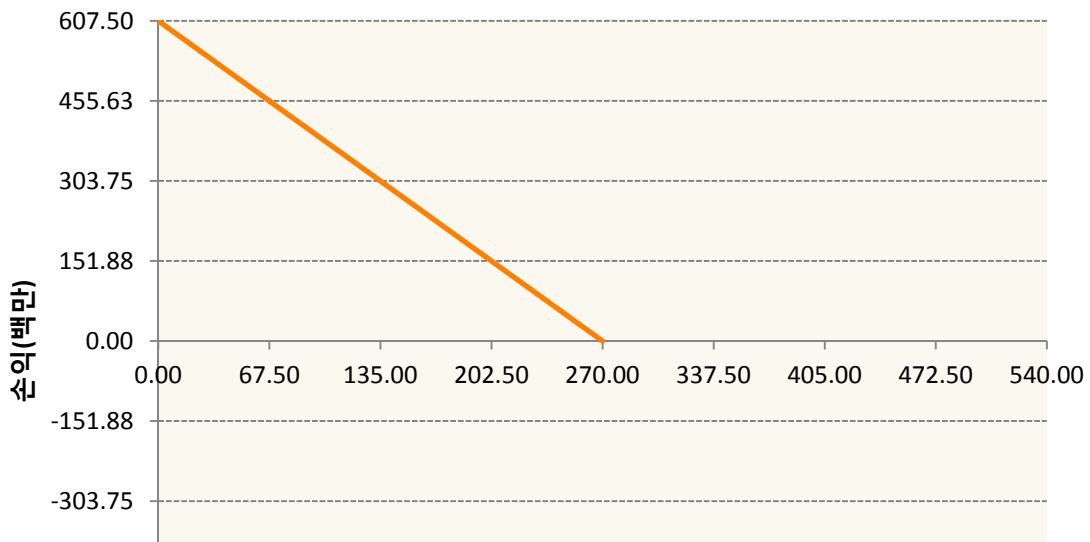


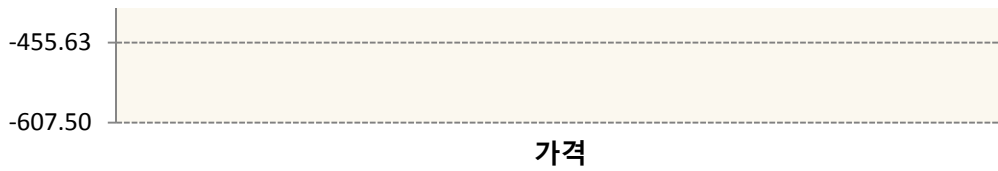


KR4201P72858-2019-07 콜285

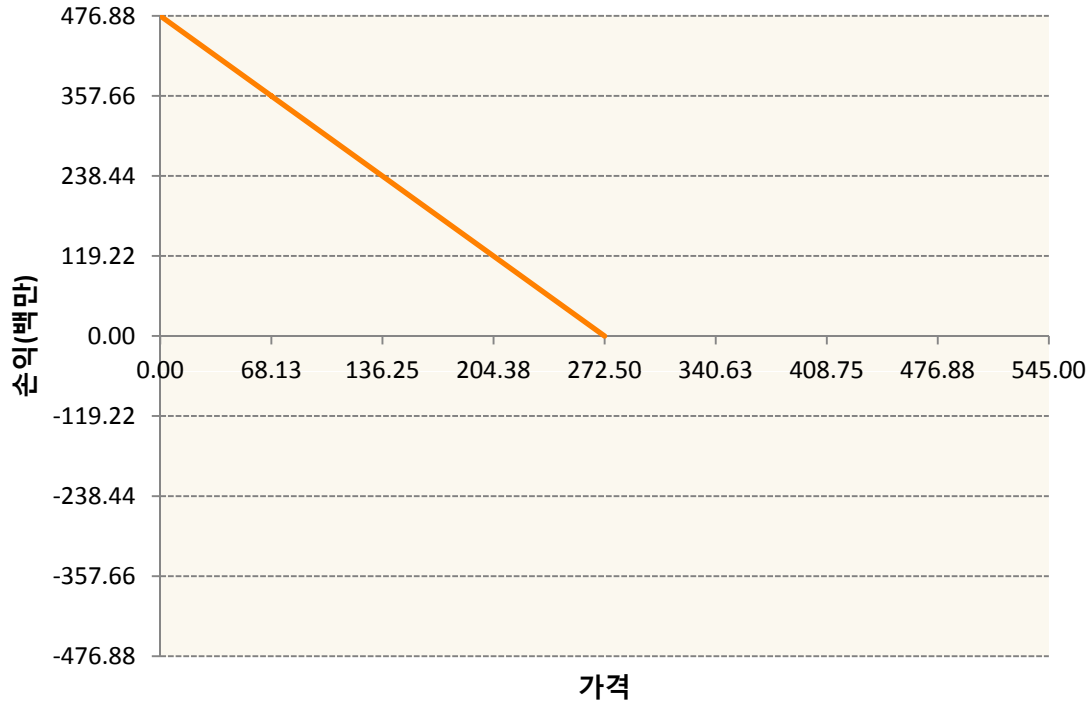


KR4301P72708-2019-07 풋270





KR4301P72724-2019-07 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						997
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-997	-997	-997	-997	-997	-997	-997	
-5.33%	-664	-664	-664	-664	-664	-664	-664	
-2.67%	-332	-332	-332	-332	-332	-332	-332	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	332	332	332	332	332	332	332	
5.33%	664	664	664	664	664	664	664	
8.00%	997	997	997	997	997	997	997	
KR4201P72825		2019-07 콜282.5						139
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	37	37	36	35	34	32	30	
-5.33%	36	34	32	30	28	25	22	
-2.67%	30	27	23	20	16	11	7	

0%	15	10	5	0	-5	-10	-16
2.67%	-14	-19	-25	-31	-36	-42	-48
5.33%	-58	-63	-68	-73	-78	-84	-89
8.00%	-115	-118	-122	-126	-130	-135	-139

KR4201P72858                      2019-07 콜285    906

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	211	209	206	200	193	184	173
-5.33%	204	197	187	174	160	143	124
-2.67%	175	158	137	115	90	64	36
0%	96	65	33	0	-34	-69	-105
2.67%	-69	-109	-148	-188	-227	-267	-307
5.33%	-341	-379	-418	-457	-496	-536	-575
8.00%	-711	-740	-771	-803	-836	-871	-906

KR4301P72708                      2019-07 풋270    35

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	34	34	34	34	34	34	35
-5.33%	18	18	19	19	19	20	20
-2.67%	5	6	6	7	8	9	9
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

KR4301P72724                      2019-07 풋272.5    30

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	29	29	29	29	29	29	30
-5.33%	17	17	17	17	17	18	18
-2.67%	5	6	6	7	7	8	8
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-4	-4	-4	-3	-3	-3	-2
5.33%	-5	-5	-5	-4	-4	-4	-4
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-4

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

(단위:백만원)

**1,785**

공시일	2019-06-20
기준일	2019-06-19

## 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	18,862	0	18,862	

### 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	2019-06-20
기준일	2019-06-19

## 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	59,540	0	59,540	

### 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	2019-06-20
기준일	2019-06-19

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,528	0	3,528	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	394,754	0	394,754	
누계	통화	선도	0	412,458	-412,458	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		941
FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E		376
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		75
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		990
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E		1,016
FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E		470
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E		790
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E		629
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		470
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		376
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		790
FX21019K02 KRW/USD 24-06-19E		376
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E		941
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E		1,505
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E		282
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E		1,223
FX21019K04 KRW/USD 28-06-19E		1,280
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		659
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		565
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		753
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		753
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		470
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		282
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		941
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		188
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		875

FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	1,044
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	1,882
FX21019M00 KRW/USD 15-07-19E	470
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	376
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	659
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	941
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	659
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	659
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E	565
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E	3,011
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E	2,258
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E	282
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E	282
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	790
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	630
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	470

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

(단위:백만원)

**10,925**

공시일	2019-06-20
기준일	2019-06-19

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

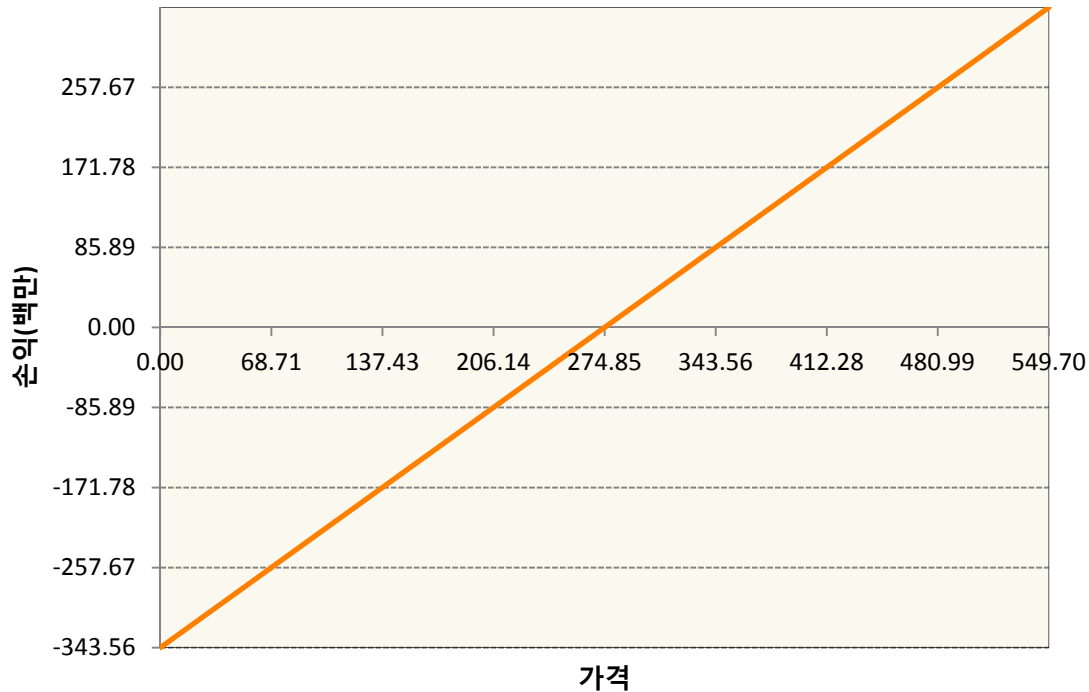
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

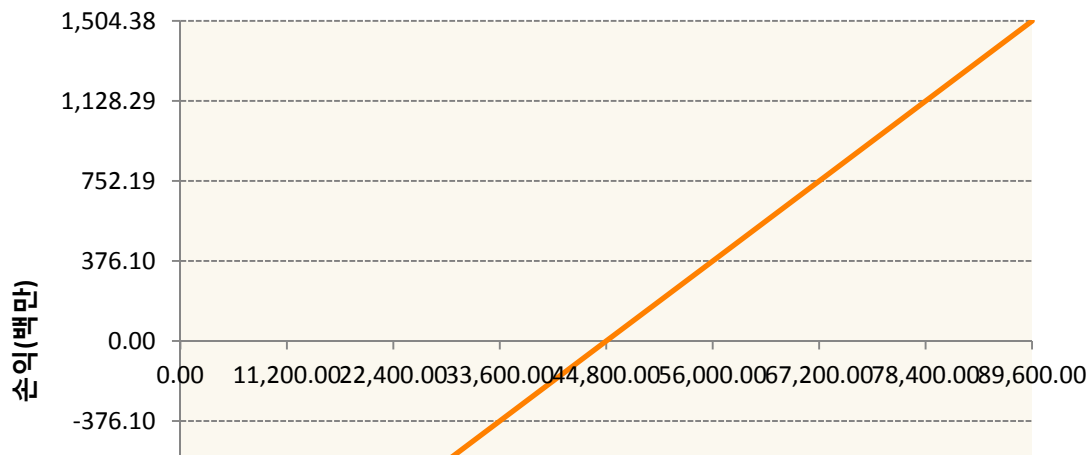
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,848	0	1,848	장내

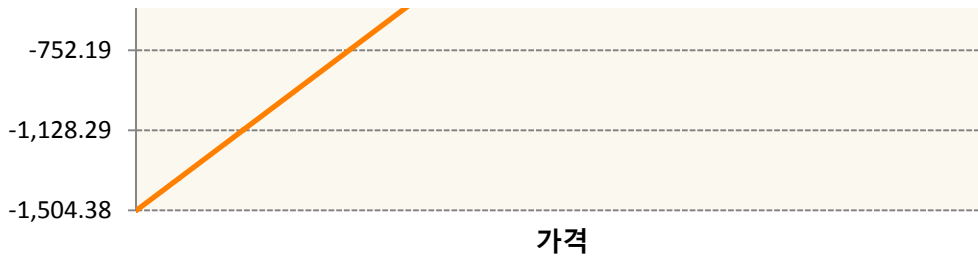
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P70002-2019-07 삼성전자개별선물





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

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						28
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28	
-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%	28	28	28	28	28	28	28	
KR4111P70002		2019-07 삼성전자개별선물						122
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-122	-122	-122	-122	-122	-122	-122	
-5.33%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81	
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	41	41	41	41	41	41	41	
5.33%	81	81	81	81	81	81	81	
8.00%	122	122	122	122	122	122	122	

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

**163**

공시일	2019-06-20
기준일	2019-06-19

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

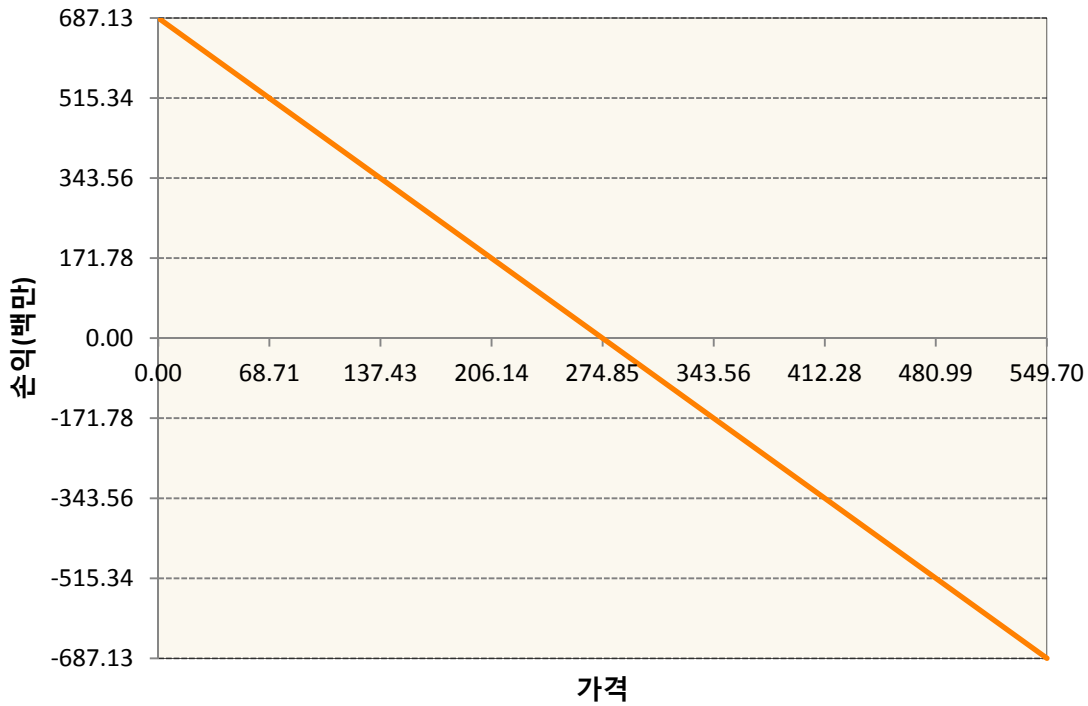
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

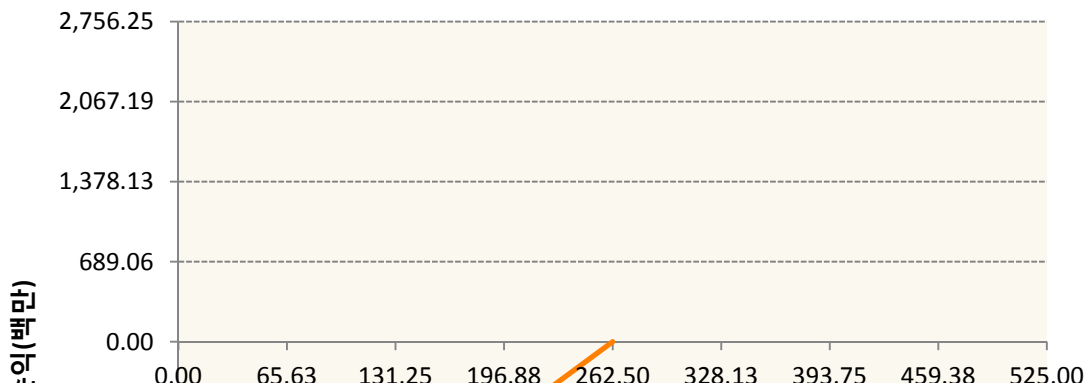
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	687	-687	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,419	-3,419	장내

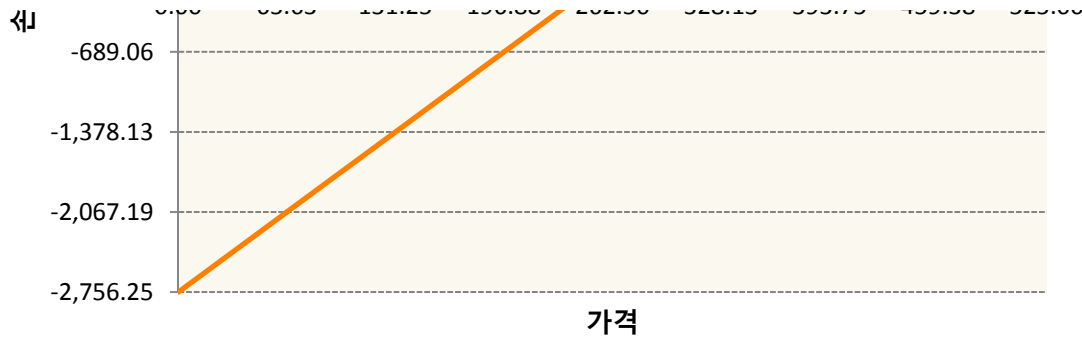
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

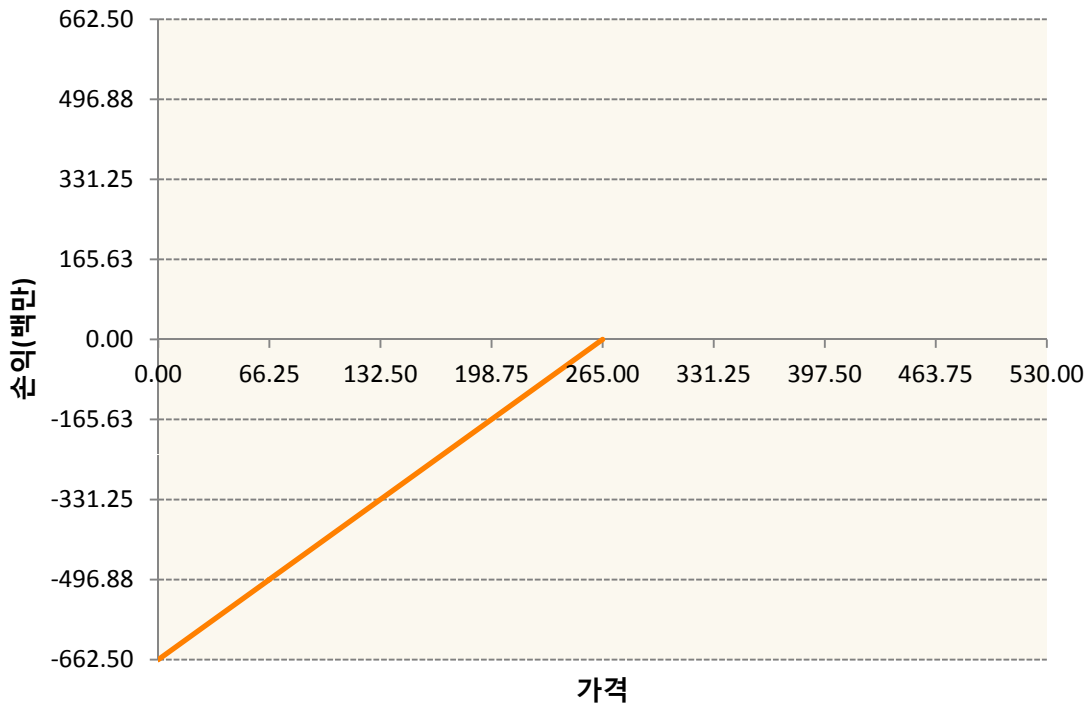


KR4301P72625-2019-07 풋262.5





KR4301P72658-2019-07 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						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%	37	37	37	37	37	37	37	
-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%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37	
8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55	
KR4301P72625		2019-07 풋262.5						108
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-97	-98	-100	-101	-103	-106	-108
-5.33%	-37	-40	-43	-46	-49	-52	-56
-2.67%	-5	-8	-11	-13	-16	-19	-22
0%	3	2	1	0	-1	-3	-5
2.67%	4	4	4	4	3	2	2
5.33%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

KR4301P72658

2019-07 풋265

30

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-28	-28	-29	-29	-29	-30	-30
-5.33%	-12	-13	-14	-14	-15	-16	-16
-2.67%	-2	-3	-4	-5	-5	-6	-7
0%	1	1	0	0	0	-1	-2
2.67%	2	2	2	1	1	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

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

(단위:백만원)

141

공시일	2019-06-20
기준일	2019-06-19

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

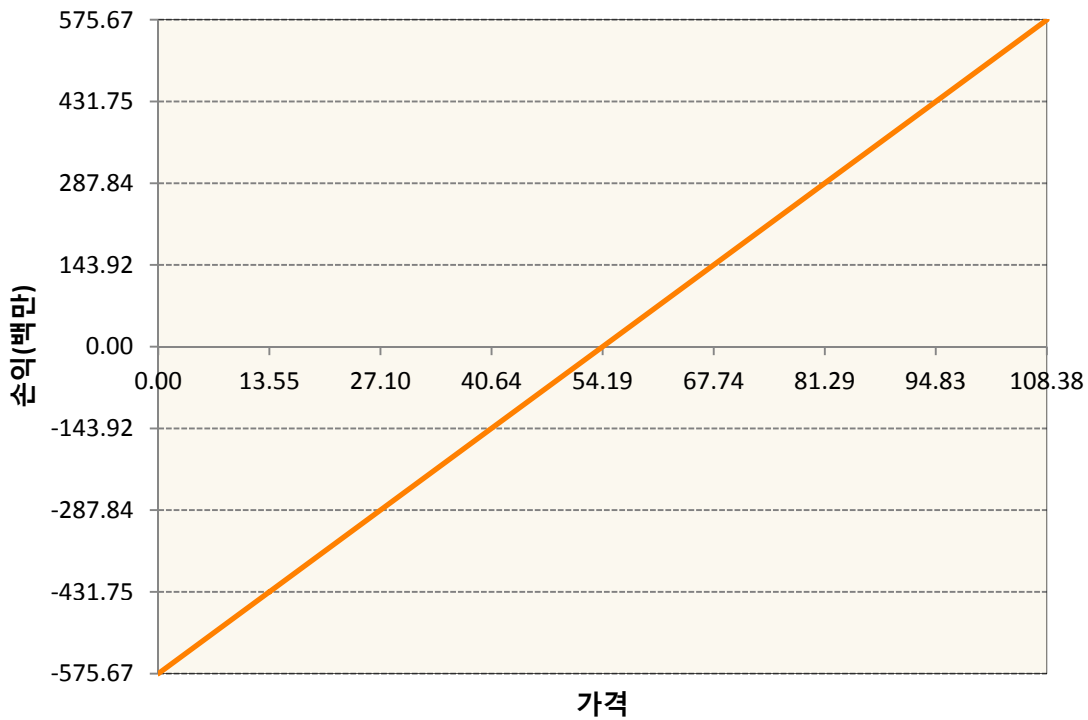
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

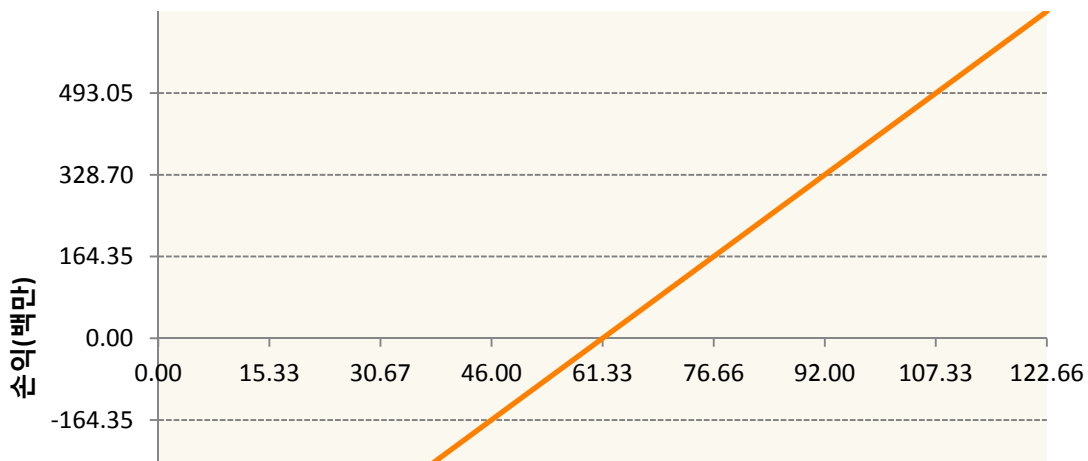
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,529	118	2,411	

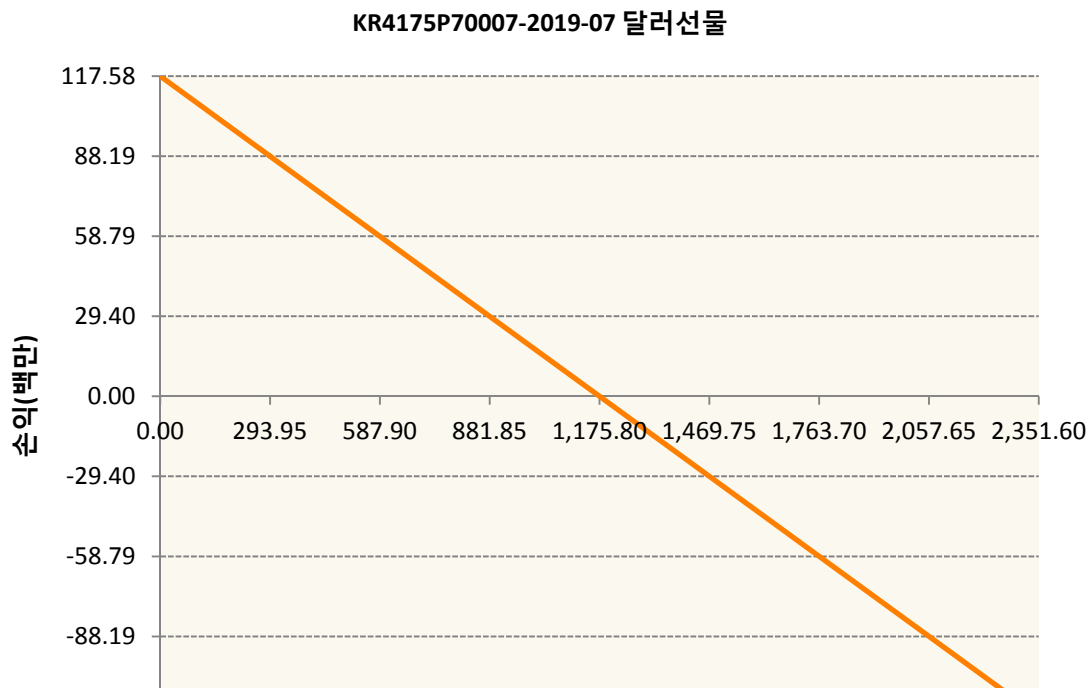
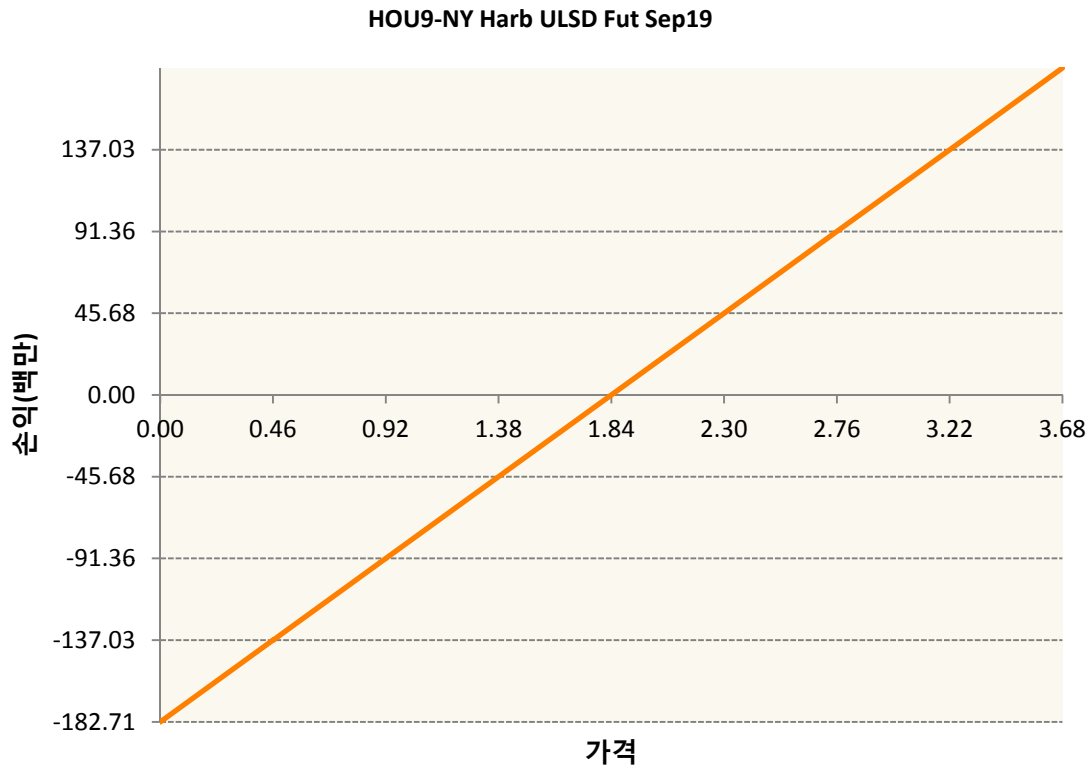
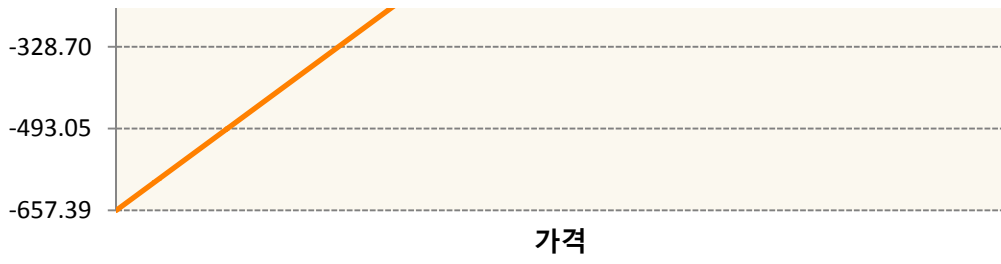
### 2. 만기시점의 손익구조

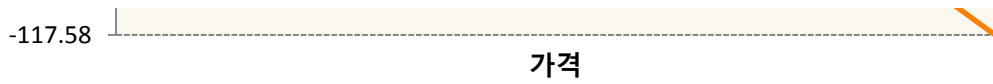
CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19



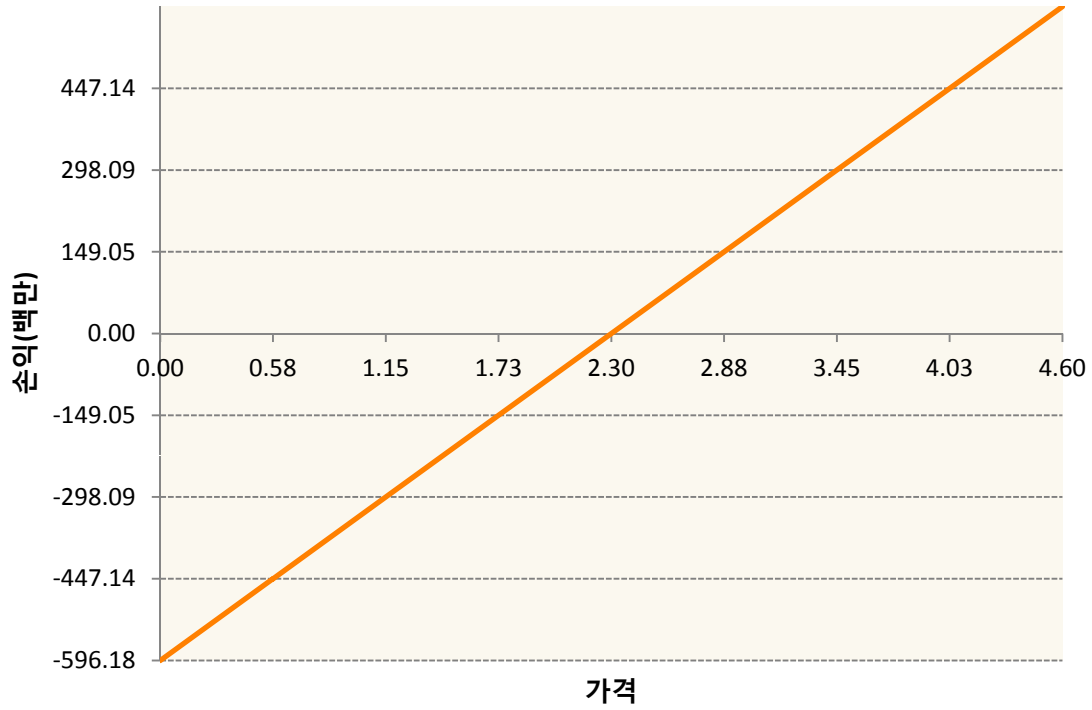
COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19



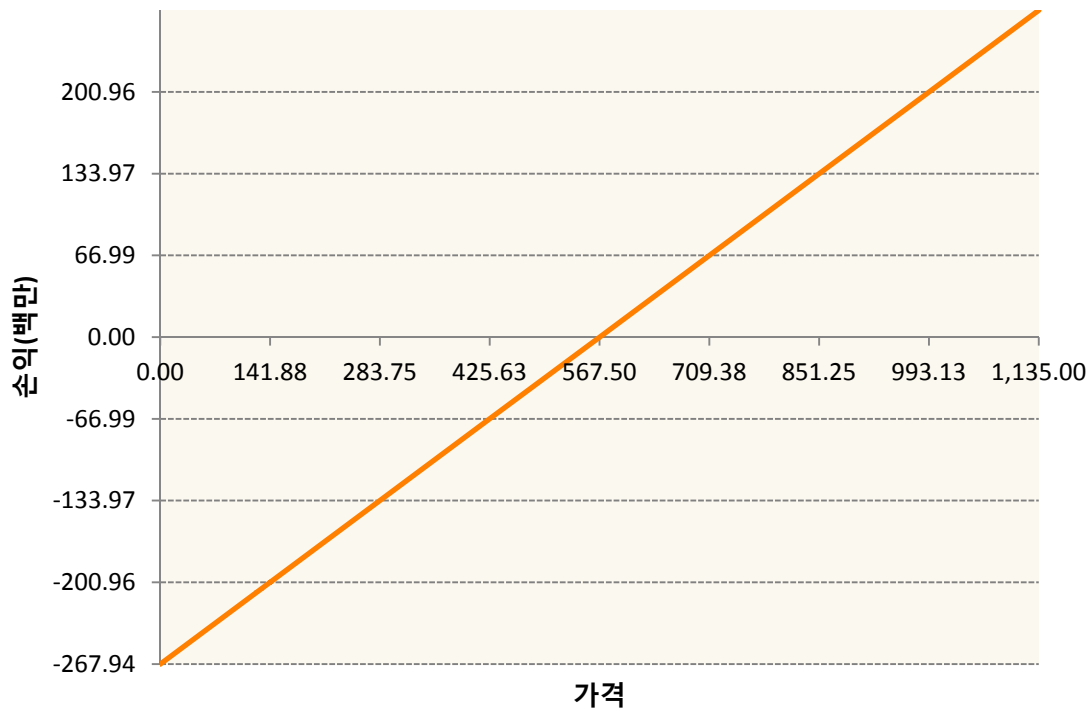




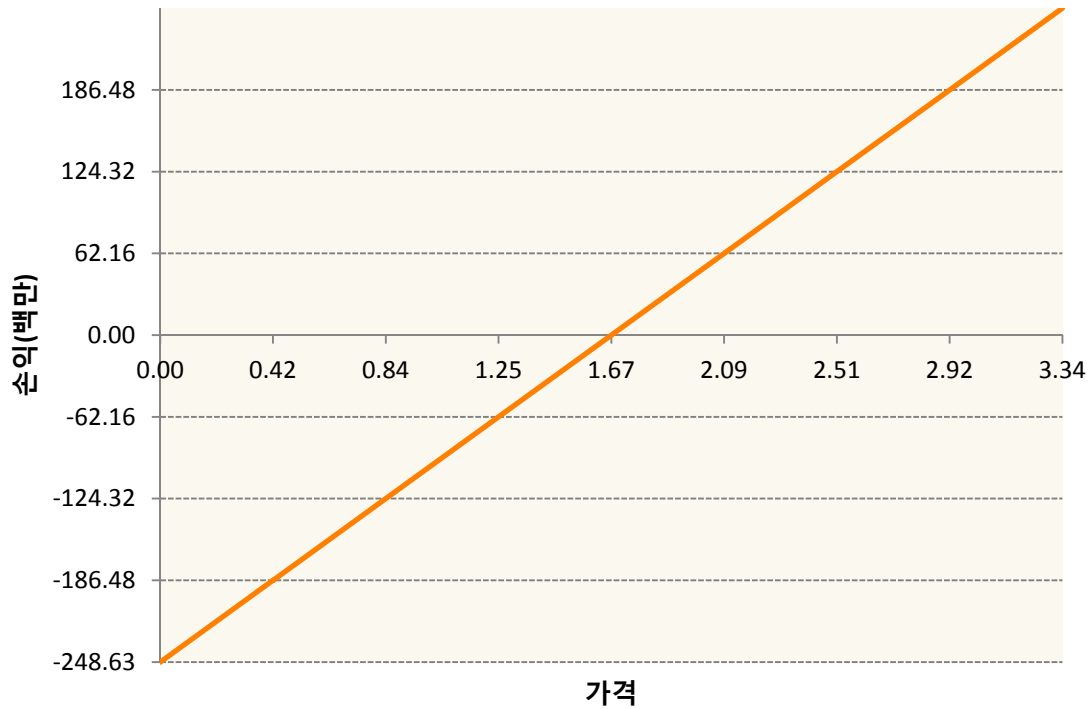
NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



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
KR4175P700	2019-07 달러선물	9
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	48
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	21
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	20

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

(단위:백만원)

377

공시일	2019-06-20
기준일	2019-06-19

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

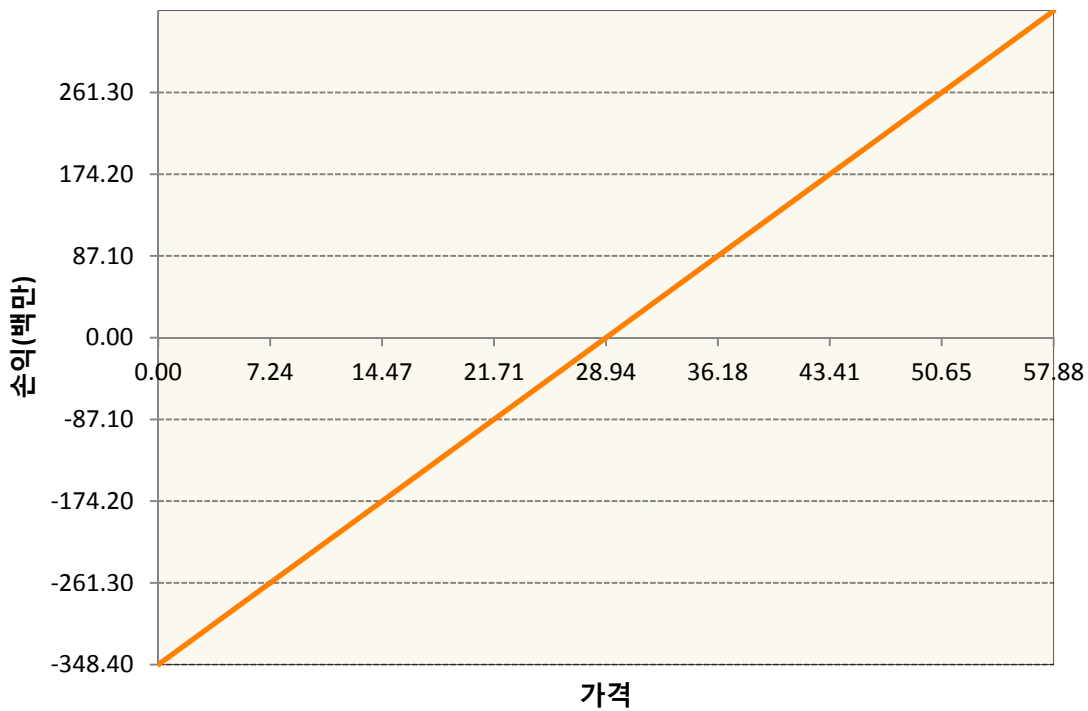
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

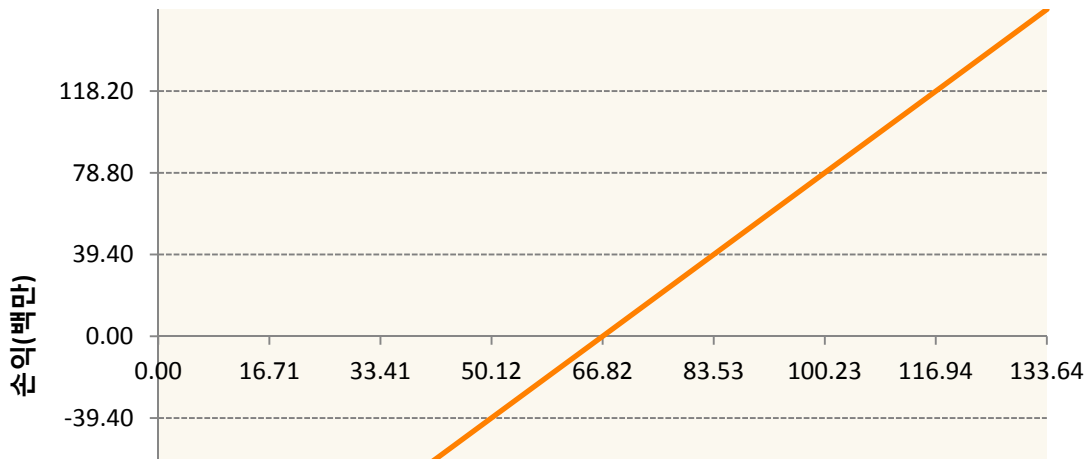
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,250	200	3,050	

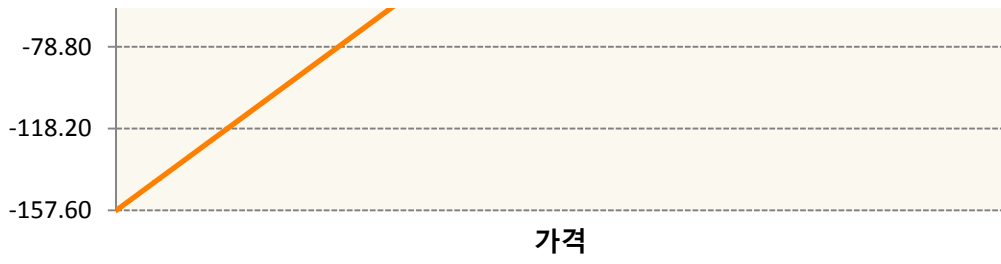
### 2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

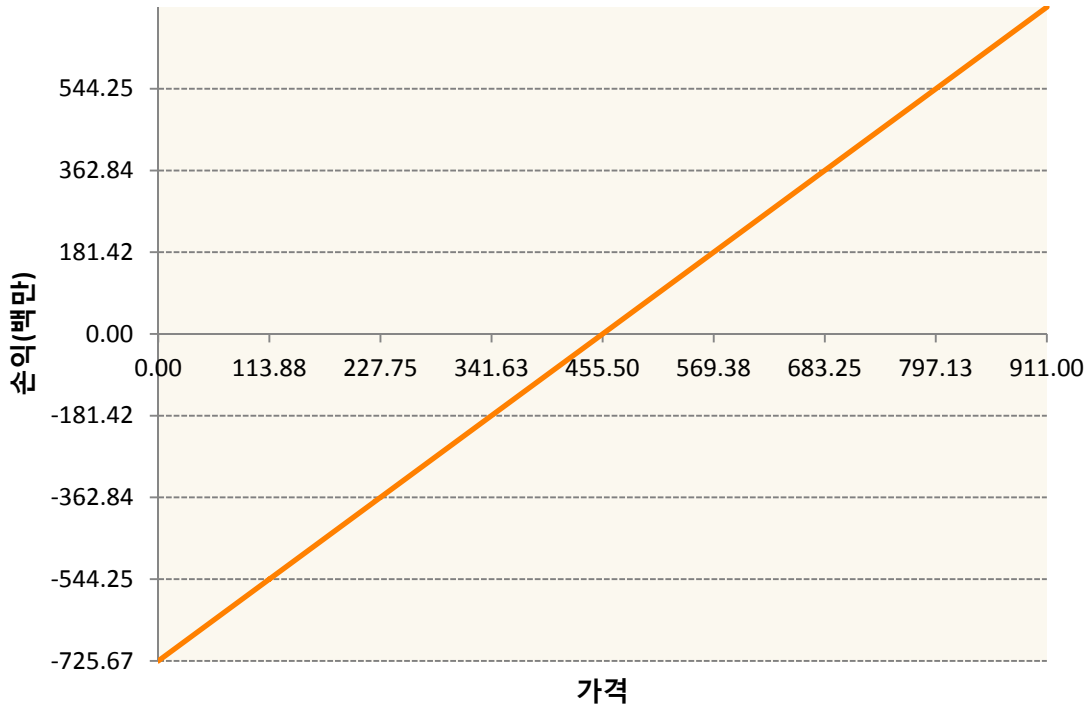


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

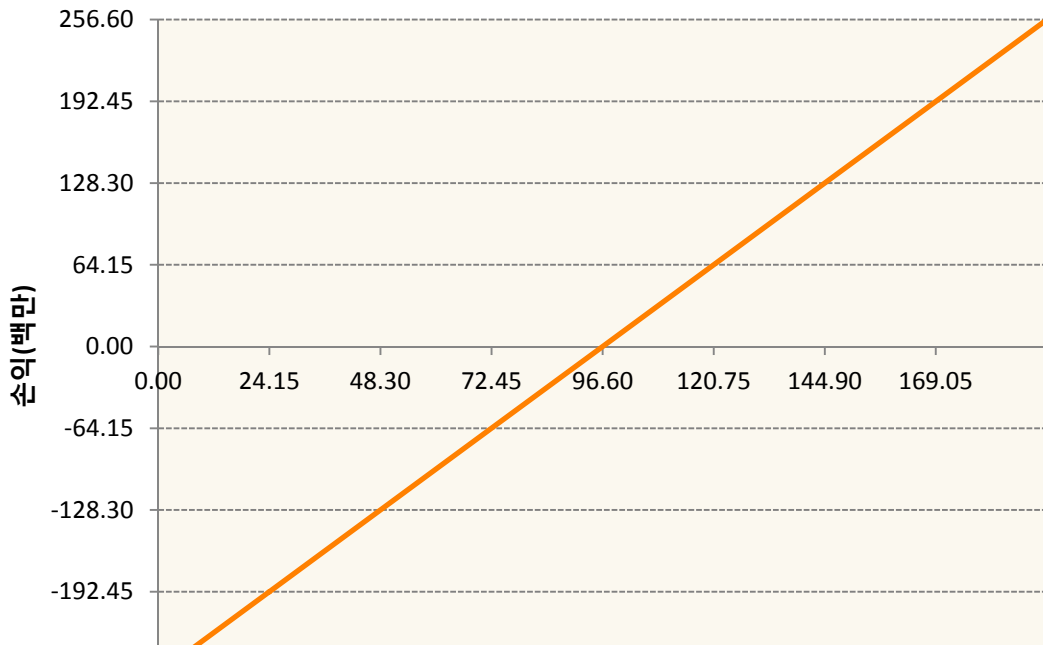


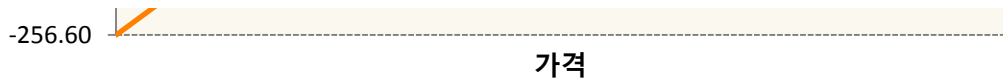


CU9-CORN FUTURE Sep19

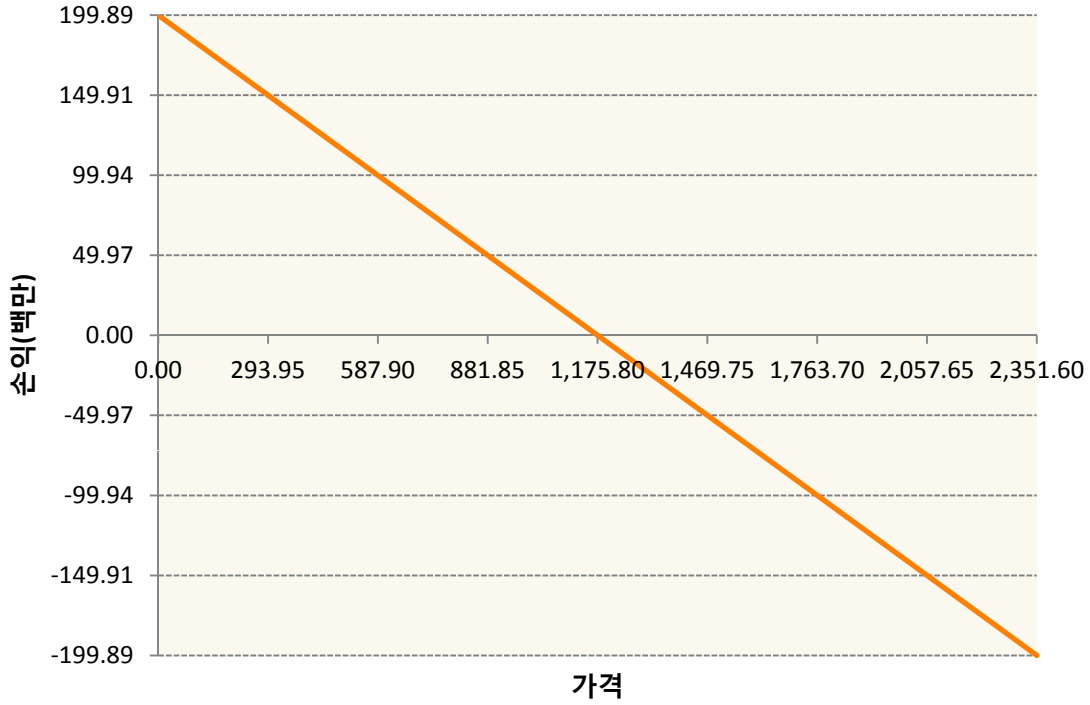


KCU9-COFFEE 'C' FUTURE Sep19

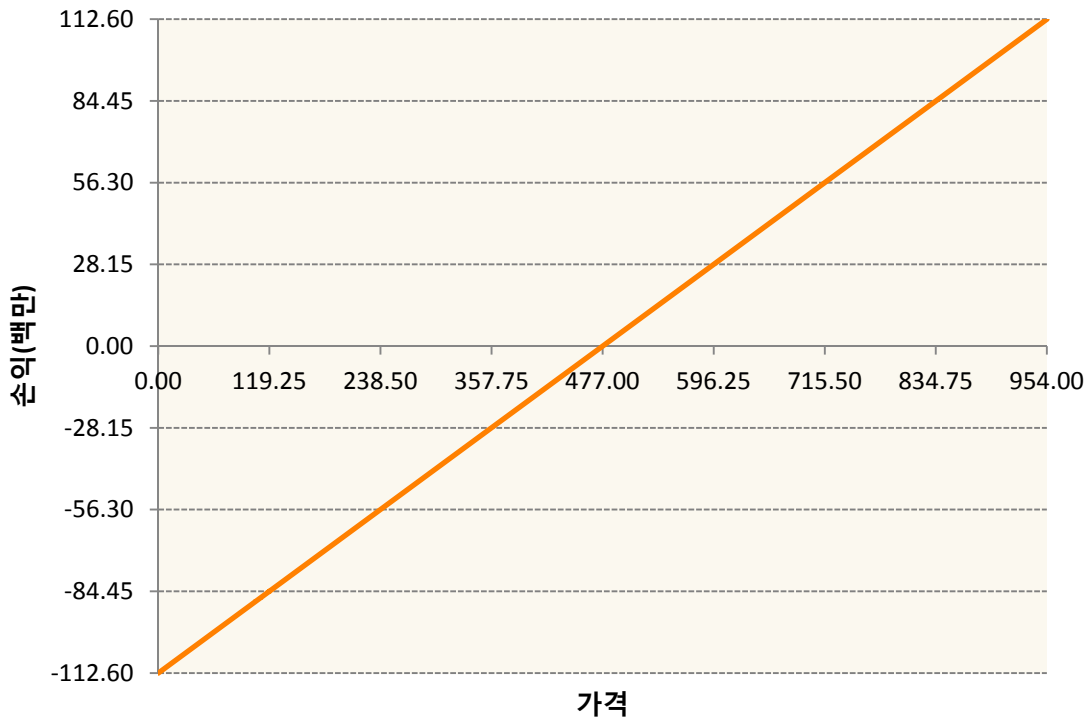




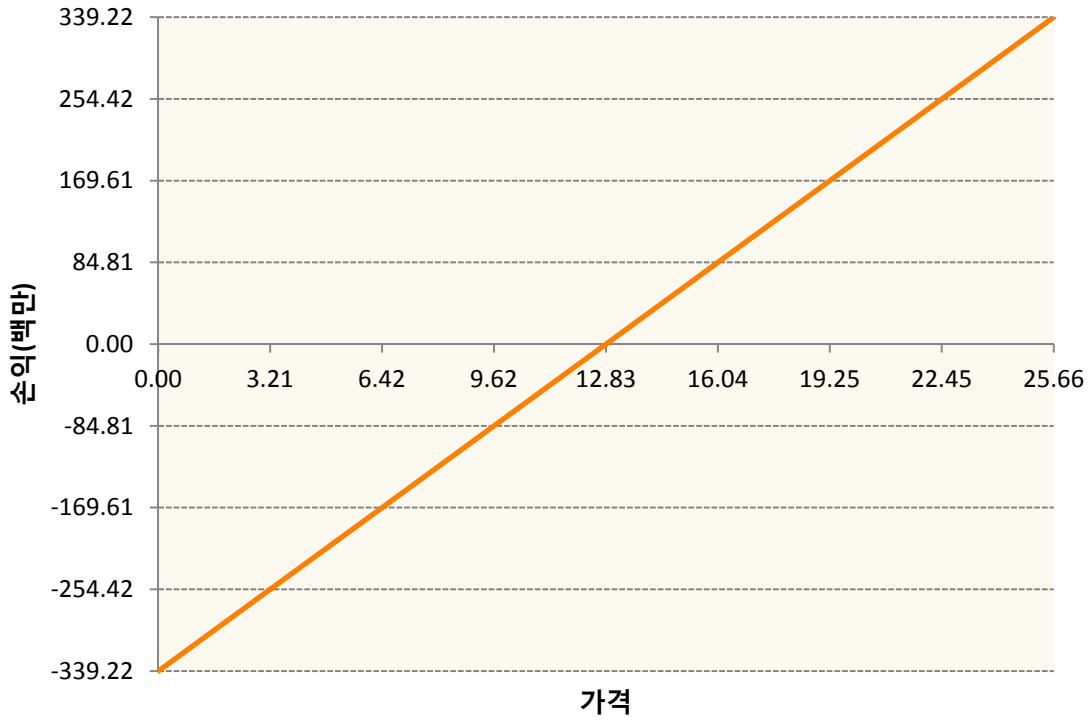
KR4175P70007-2019-07 달러선물



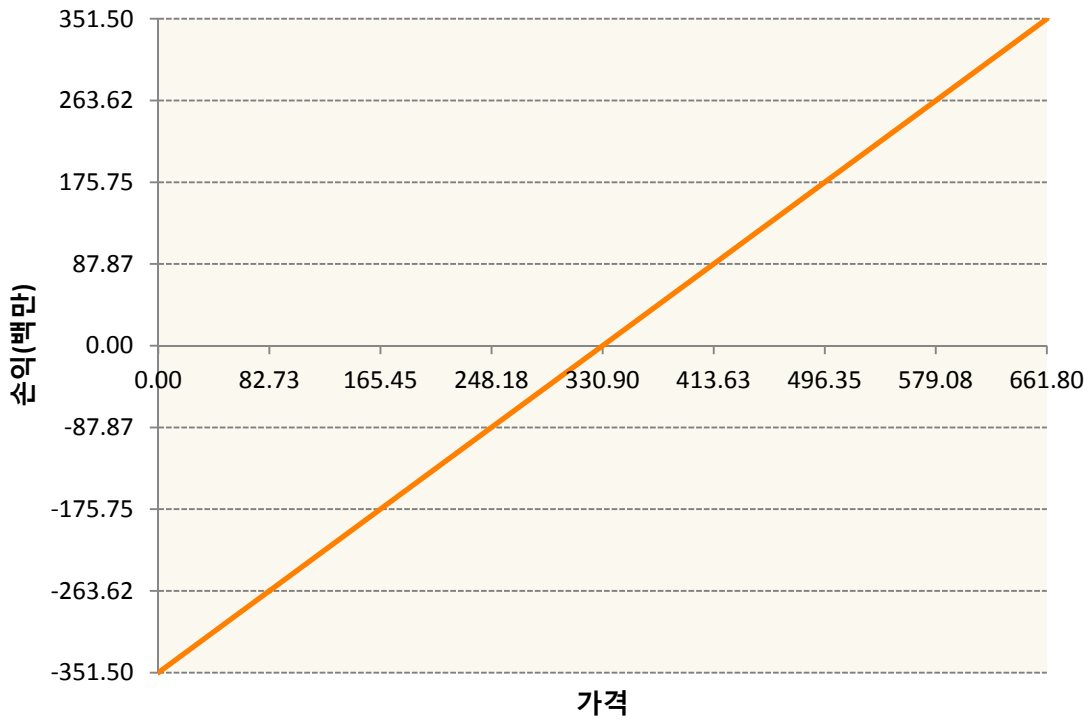
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

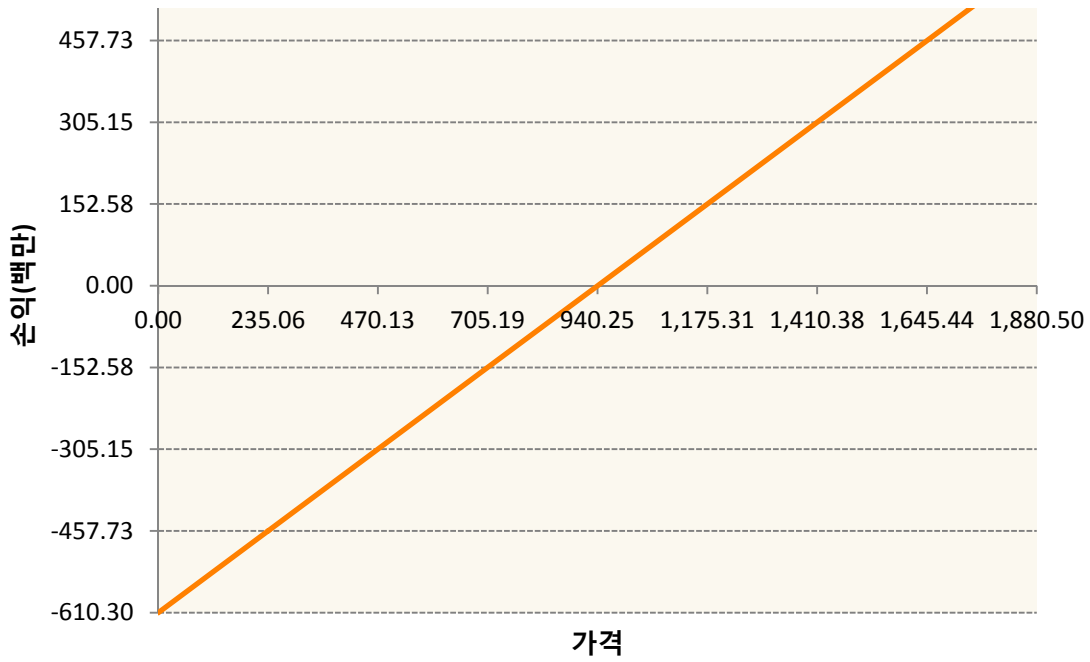


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

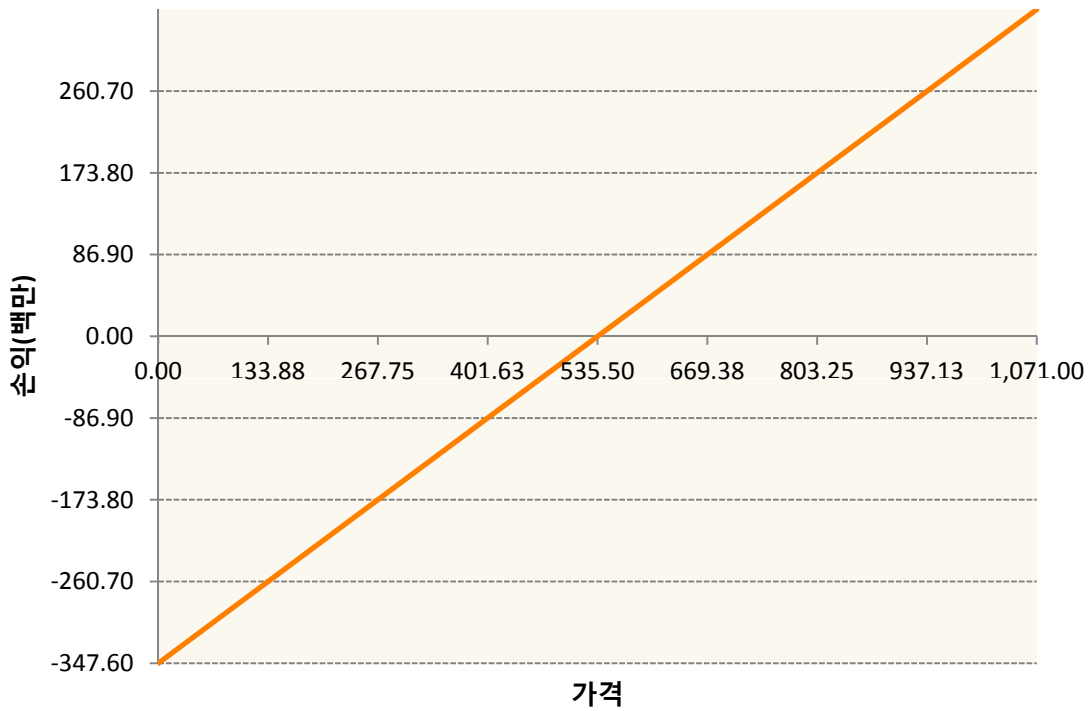


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





WU9-WHEAT FUTURE(CBT) Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	28
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	13
CU9	CORN FUTURE Sep19	58
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	28
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	49
WU9	WHEAT FUTURE(CBT) Sep19	28

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

(단위:백만원)

**281**