

공시일	2019-06-21
기준일	2019-06-20

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)

93

공시일	2019-06-21
기준일	2019-06-20

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

1,156

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

700

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-21
기준일	2019-06-20

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)	387
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	142

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

890

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-21
기준일	2019-06-20

유로인덱스모(주식-파생형)

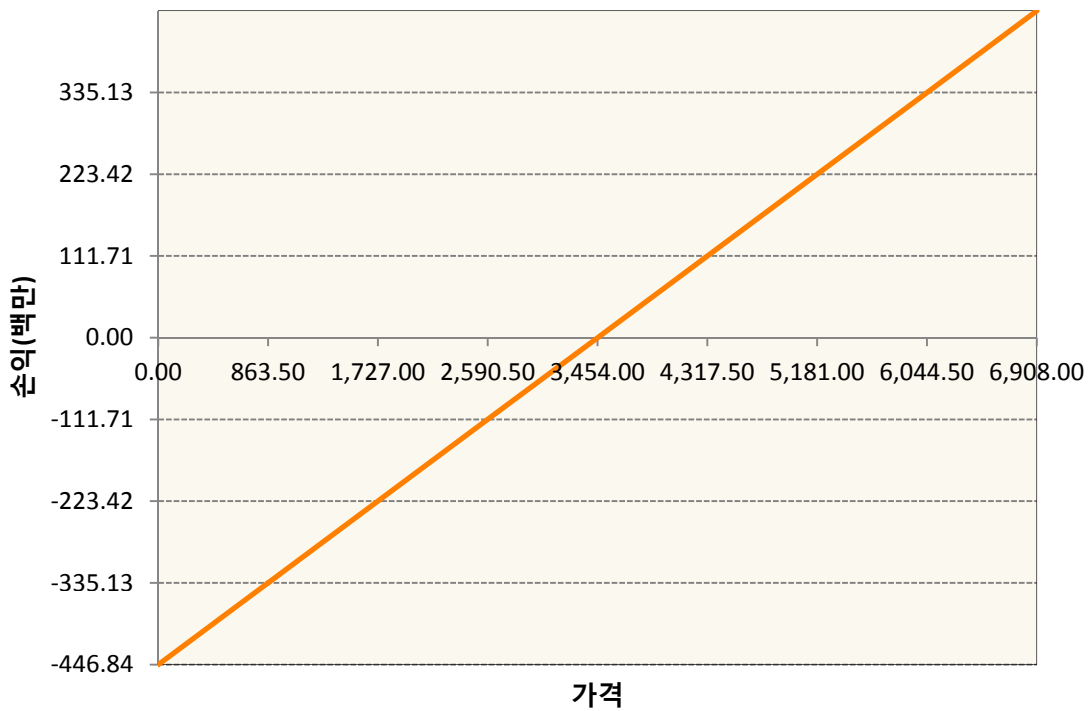
1. 계약금액

(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	2019-06-21
기준일	2019-06-20

차이나인덱스모(주식-파생형)

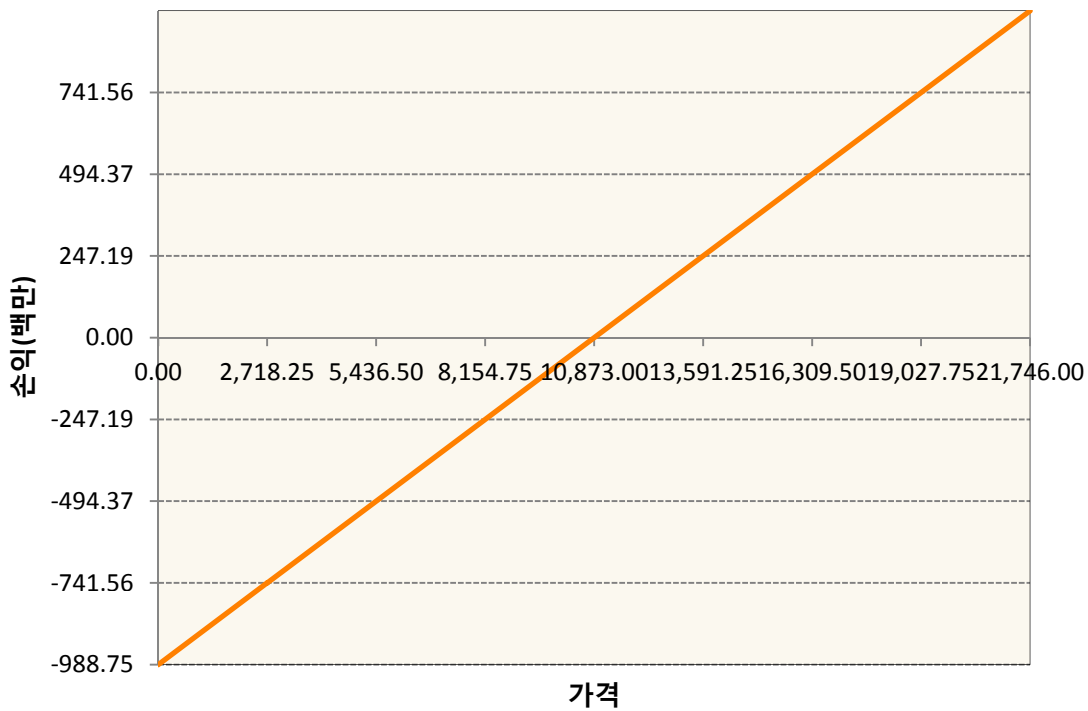
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	989	0	989	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM9	HSCEI Futures Jun19	79
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

81

공시일	2019-06-21
기준일	2019-06-20

커버드콜모(주식혼합-파생형)

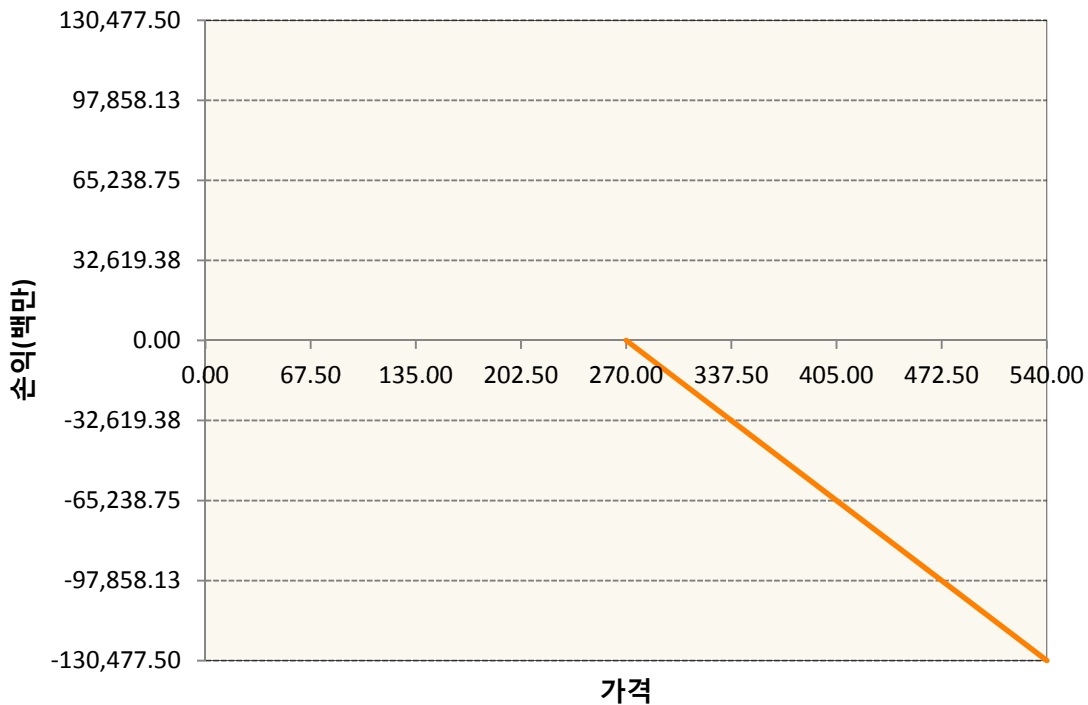
1. 계약금액

(단위:백만원)

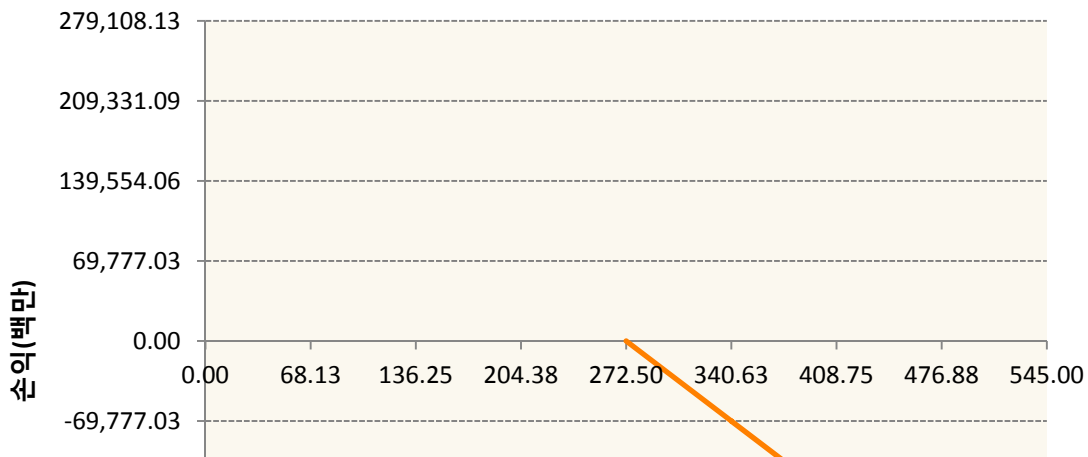
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	605,336	-605,336	장내

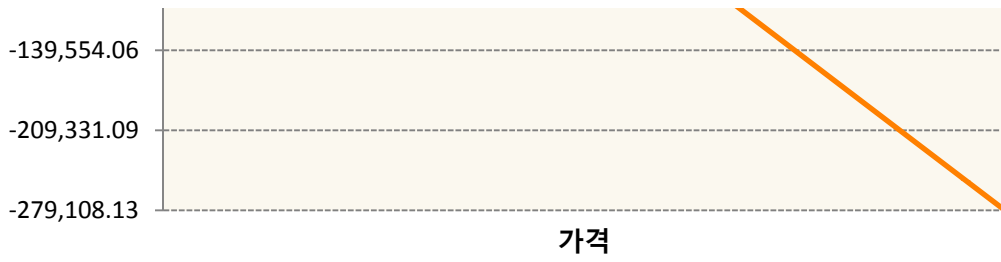
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P72700-2019-07 콜270

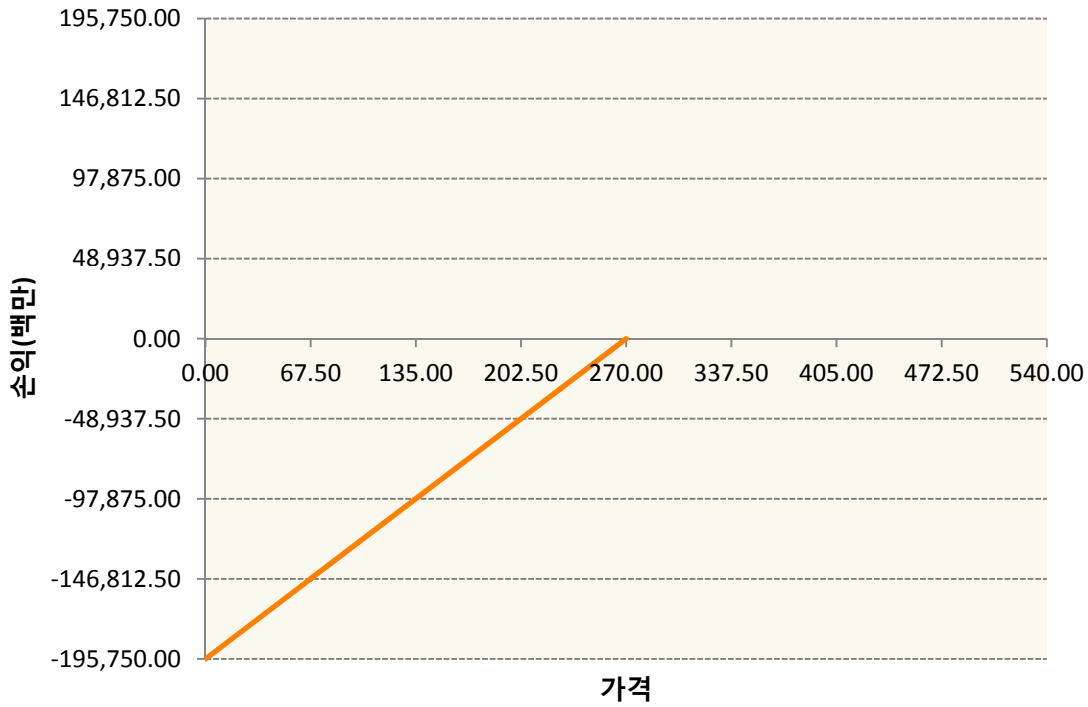


KR4201P72726-2019-07 콜272.5





KR4301P72708-2019-07 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201P72700		2019-07 콜270					9,157
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,575	4,464	4,335	4,190	4,032	3,862	3,684
-5.33%	4,015	3,812	3,599	3,380	3,154	2,925	2,691
-2.67%	2,787	2,526	2,265	2,003	1,742	1,480	1,219
0%	734	494	249	0	-251	-504	-759
2.67%	-2,038	-2,202	-2,382	-2,574	-2,777	-2,988	-3,206
5.33%	-5,268	-5,353	-5,458	-5,581	-5,720	-5,873	-6,039
8.00%	-8,714	-8,749	-8,798	-8,865	-8,947	-9,045	-9,157
KR4201P72726		2019-07 콜272.5					18,675
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,346	8,164	7,943	7,685	7,396	7,080	6,741

-5.33%	7,485	7,112	6,712	6,291	5,851	5,397	4,931
-2.67%	5,409	4,875	4,338	3,797	3,253	2,707	2,159
0%	1,654	1,106	554	0	-556	-1,113	-1,672
2.67%	-3,744	-4,160	-4,601	-5,062	-5,538	-6,027	-6,527
5.33%	-10,311	-10,549	-10,829	-11,145	-11,493	-11,866	-12,262
8.00%	-17,494	-17,600	-17,744	-17,926	-18,143	-18,394	-18,675
KR4301P72708 2019-07 풋270							10,924
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10,675	-10,690	-10,715	-10,750	-10,797	-10,855	-10,924
-5.33%	-5,554	-5,655	-5,771	-5,900	-6,040	-6,188	-6,345
-2.67%	-1,496	-1,711	-1,928	-2,145	-2,363	-2,581	-2,800
0%	514	352	180	0	-186	-377	-572
2.67%	1,016	969	907	830	739	635	520
5.33%	1,074	1,068	1,057	1,039	1,012	976	929
8.00%	1,077	1,076	1,075	1,073	1,068	1,059	1,046

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

(단위:백만원)

38,801

공시일	2019-06-21
기준일	2019-06-20

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

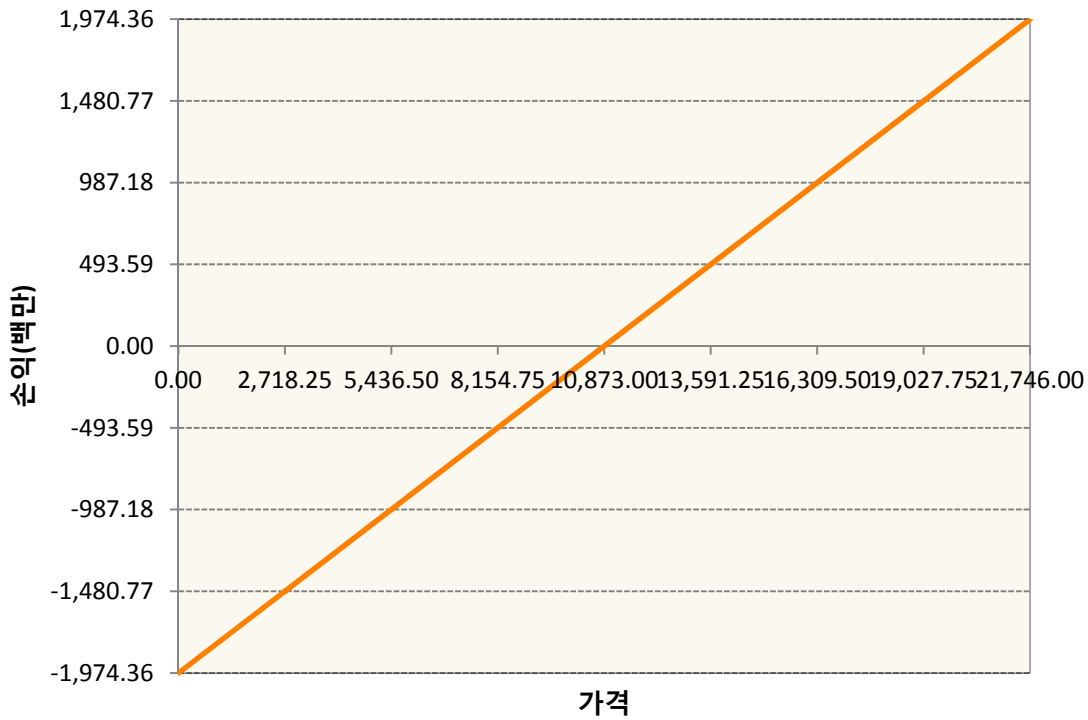
1. 계약금액

(단위:백만원)

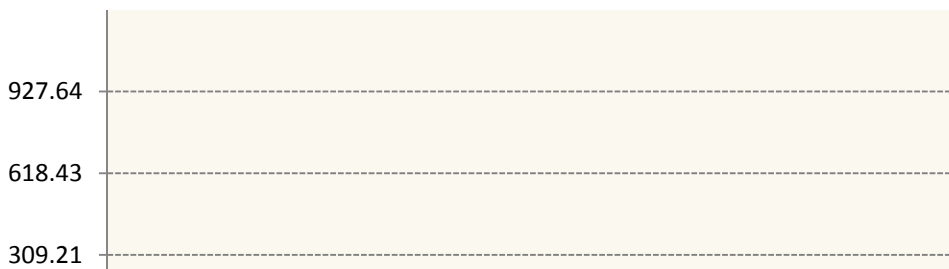
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,974	0	1,974	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,971	-4,971	장내
누계	통화	선도	149	3,122	-2,973	장외

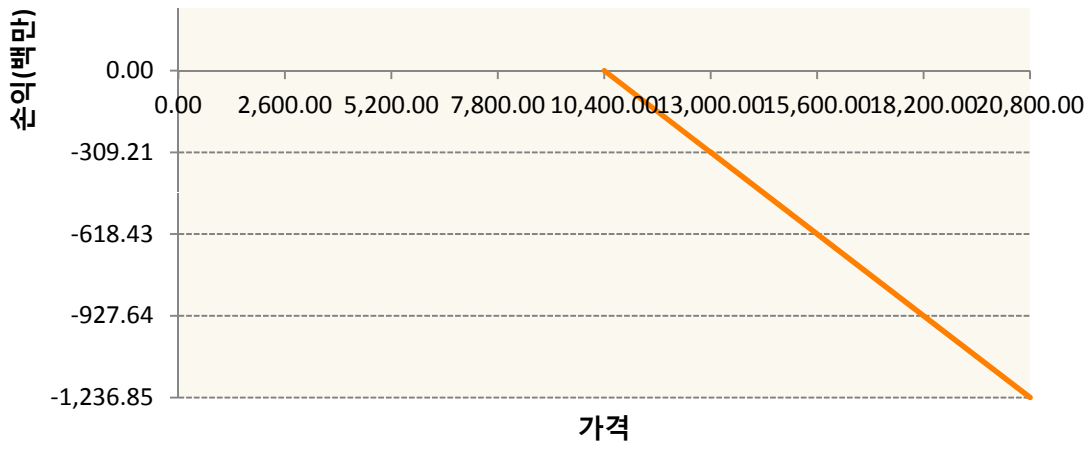
2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19

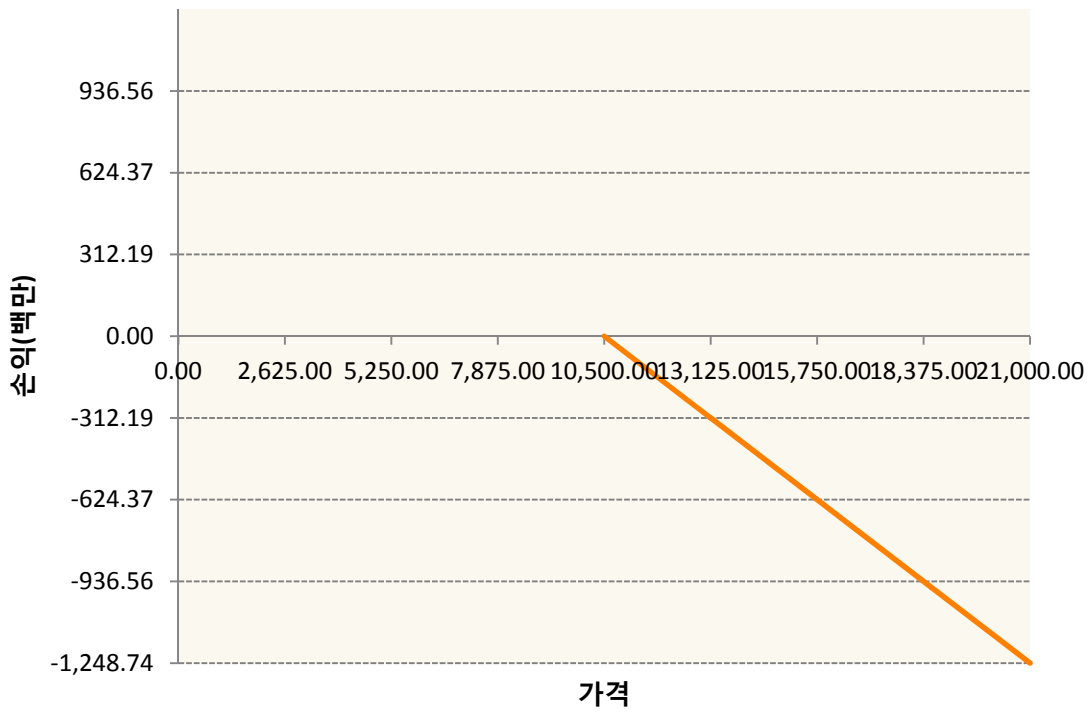


OHHIM9-C104-HSCEI

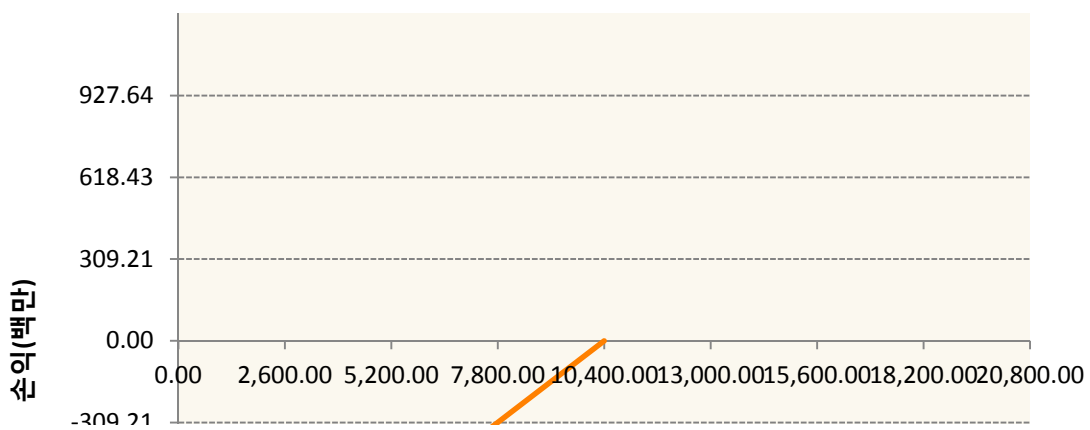


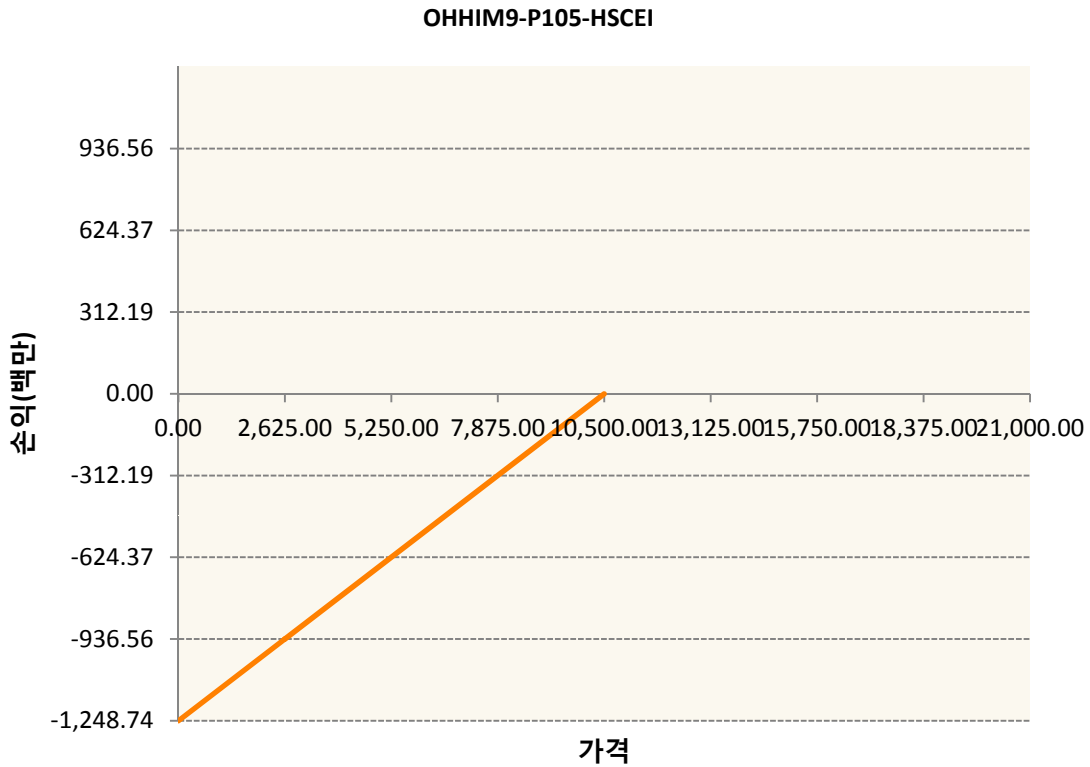


OHHIM9-C105-HSCEI



OHHIM9-P104-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	250
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E	12
HCM9 HSCEI Futures Jun19	158
OHHIM9-C1 HSCEI	99
OHHIM9-C1 HSCEI	100
OHHIM9-P1 HSCEI	99
OHHIM9-P1 HSCEI	100

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

공시일	2019-06-21
기준일	2019-06-20

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

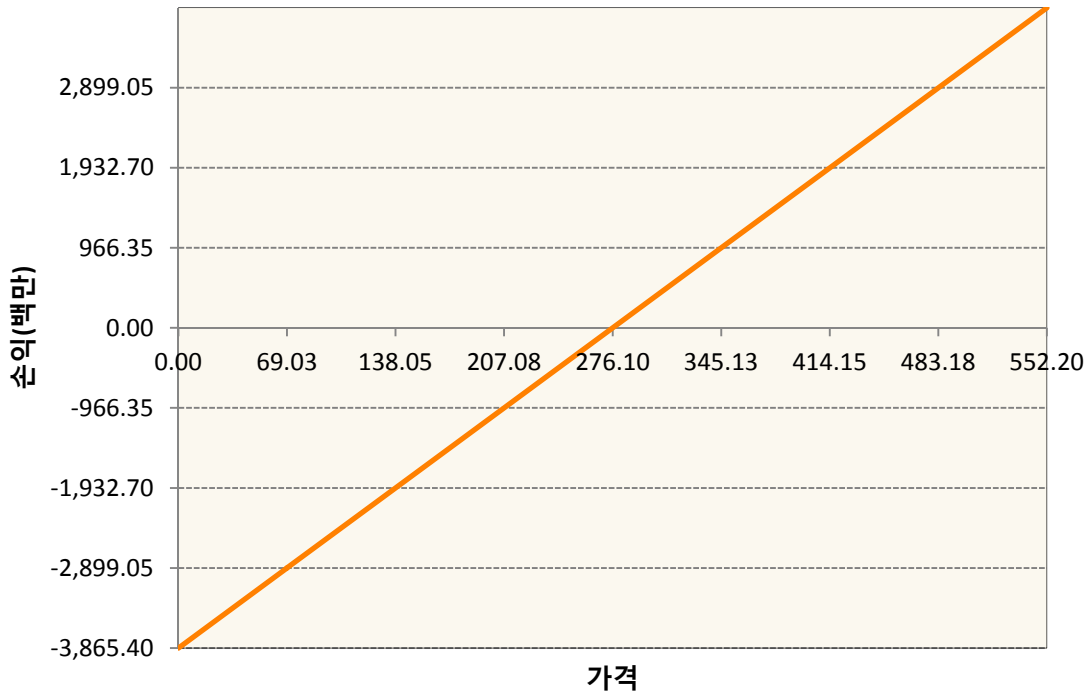
1. 계약금액

(단위:백만원)

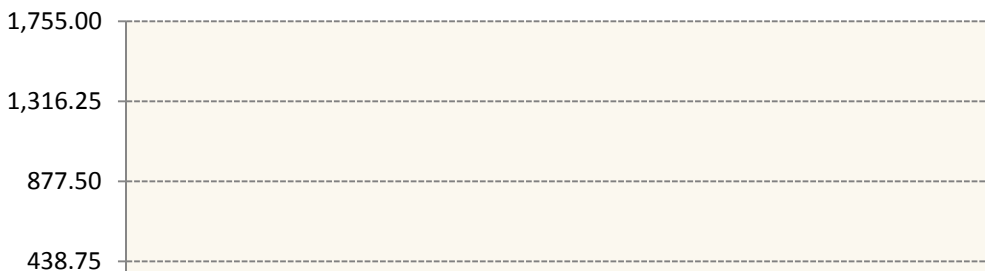
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,865	0	3,865	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	21,555	-21,555	장내

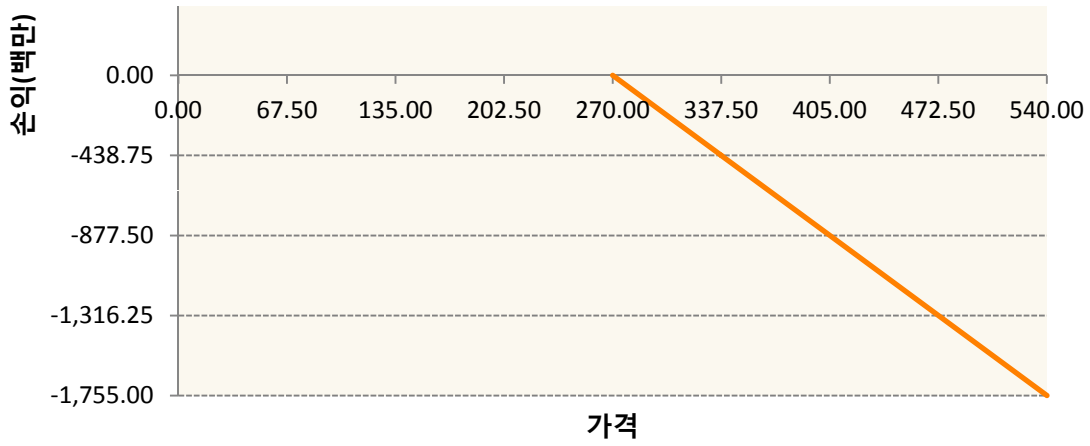
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

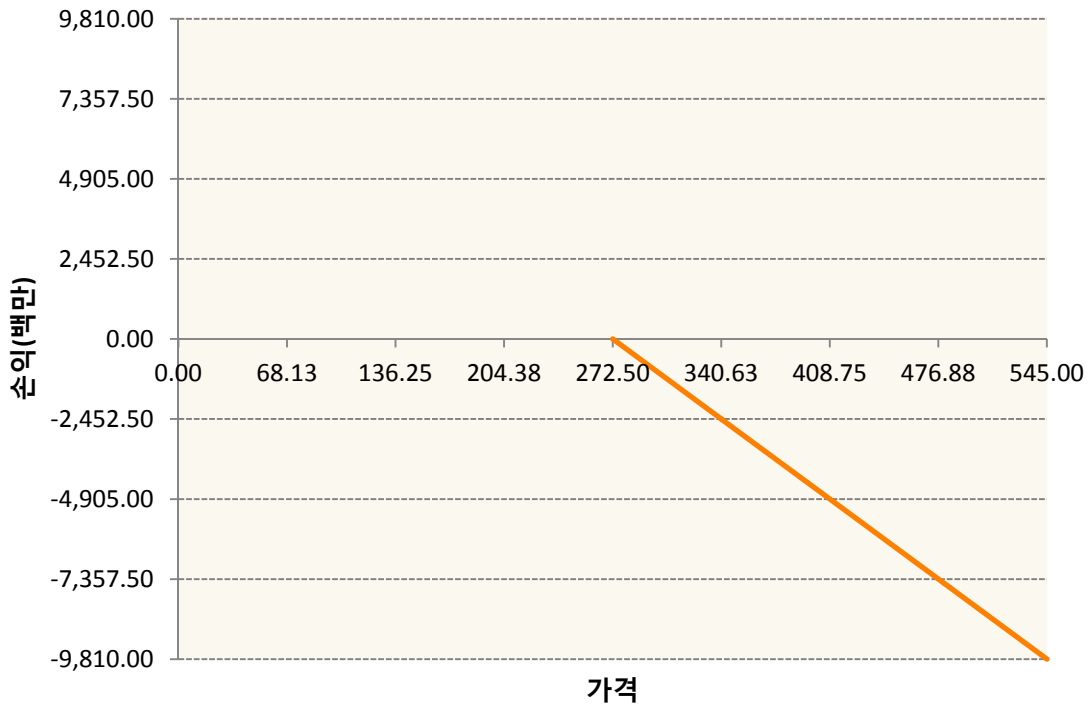


KR4201P72700-2019-07 콜270

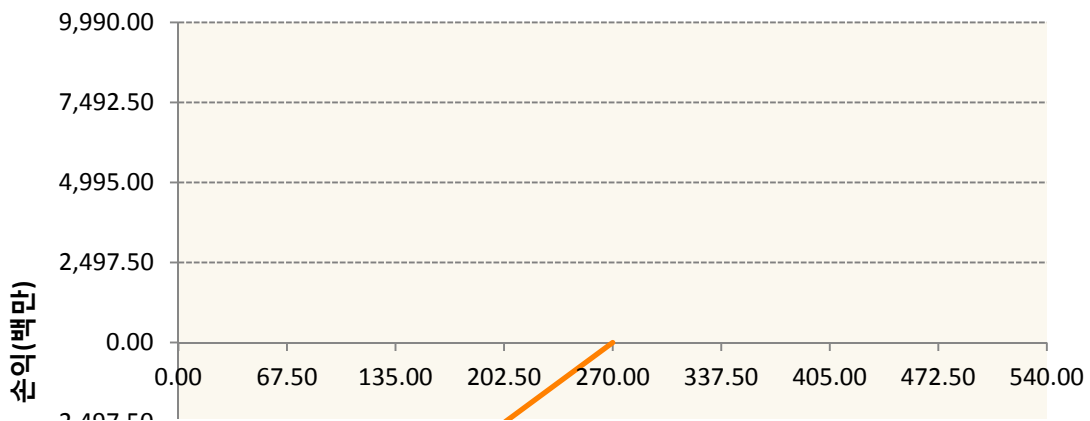




KR4201P72726-2019-07 콜272.5



KR4301P72708-2019-07 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,188
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,188	-1,188	-1,188	-1,188	-1,188	-1,188	-1,188	
-5.33%	-792	-792	-792	-792	-792	-792	-792	
-2.67%	-396	-396	-396	-396	-396	-396	-396	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	396	396	396	396	396	396	396	
5.33%	792	792	792	792	792	792	792	
8.00%	1,188	1,188	1,188	1,188	1,188	1,188	1,188	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						601
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-601	-601	-601	-601	-601	-601	-601	
-5.33%	-401	-401	-401	-401	-401	-401	-401	
-2.67%	-200	-200	-200	-200	-200	-200	-200	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	200	200	200	200	200	200	200	
5.33%	401	401	401	401	401	401	401	
8.00%	601	601	601	601	601	601	601	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						309
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-309	-309	-309	-309	-309	-309	-309	
-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%	309	309	309	309	309	309	309	
KR4201P72700		2019-07 콜270						123
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	62	60	58	56	54	52	50
-5.33%	54	51	48	45	42	39	36
-2.67%	37	34	30	27	23	20	16
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	-27	-30	-32	-35	-37	-40	-43
5.33%	-71	-72	-73	-75	-77	-79	-81
8.00%	-117	-118	-118	-119	-120	-122	-123
KR4201P72726 2019-07 콜272.5							656
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	293	287	279	270	260	249	237
-5.33%	263	250	236	221	206	190	173
-2.67%	190	171	152	133	114	95	76
0%	58	39	19	0	-20	-39	-59
2.67%	-132	-146	-162	-178	-195	-212	-229
5.33%	-362	-371	-381	-392	-404	-417	-431
8.00%	-615	-619	-624	-630	-638	-647	-656
KR4301P72708 2019-07 풋270							557
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-545	-546	-547	-549	-551	-554	-557
-5.33%	-283	-289	-295	-301	-308	-316	-324
-2.67%	-76	-87	-98	-109	-121	-132	-143
0%	26	18	9	0	-9	-19	-29
2.67%	52	49	46	42	38	32	27
5.33%	55	55	54	53	52	50	47
8.00%	55	55	55	55	54	54	53

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

(단위:백만원)

3,375

공시일	2019-06-21
기준일	2019-06-20

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

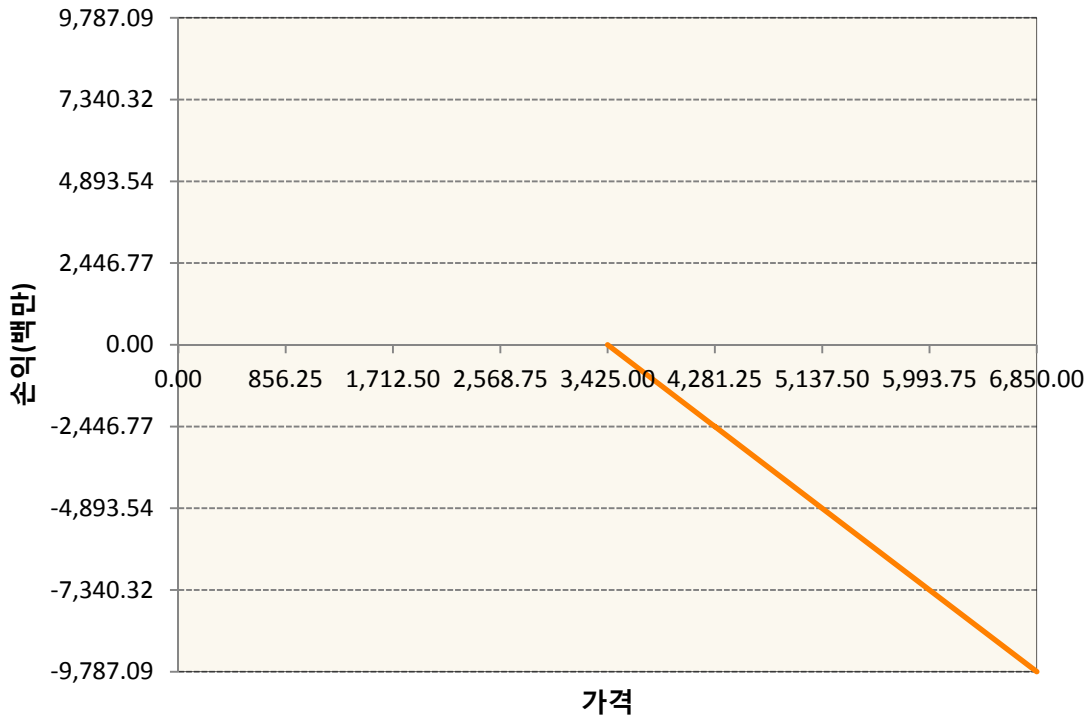
1. 계약금액

(단위:백만원)

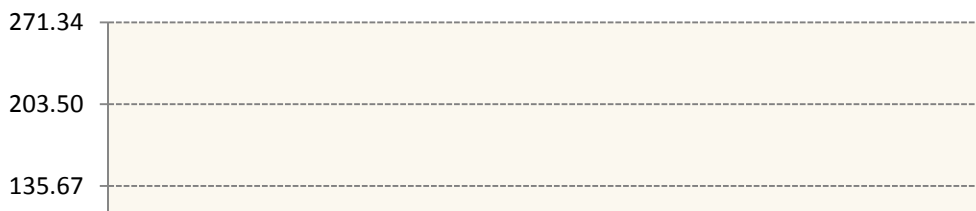
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,776	0	3,776	
누계	유가증권	스왑	55,487	0	55,487	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,117	-20,117	장내
누계	통화	선도	0	18,352	-18,352	장외

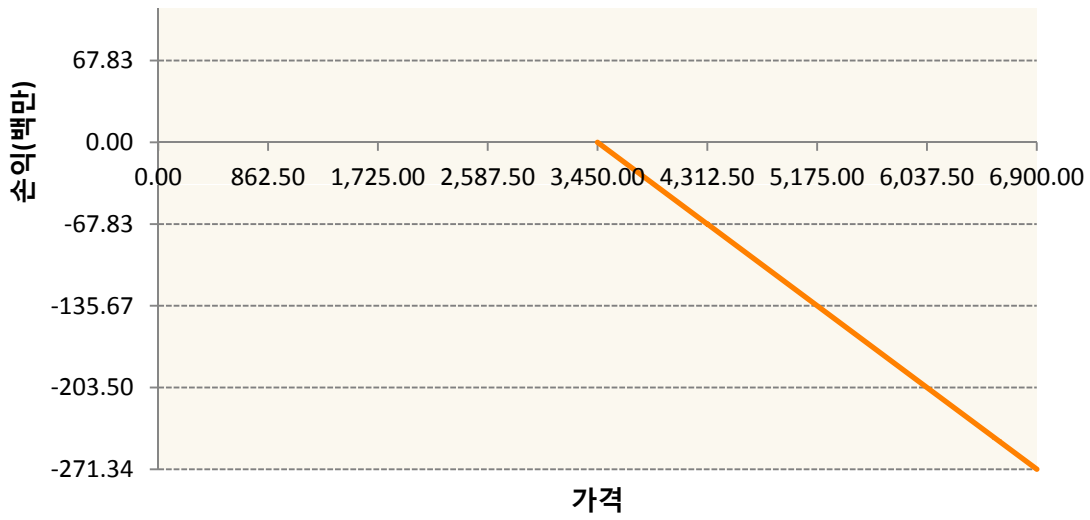
2. 만기시점의 손익구조

OESXM9-C3425-EURO STOXX 50

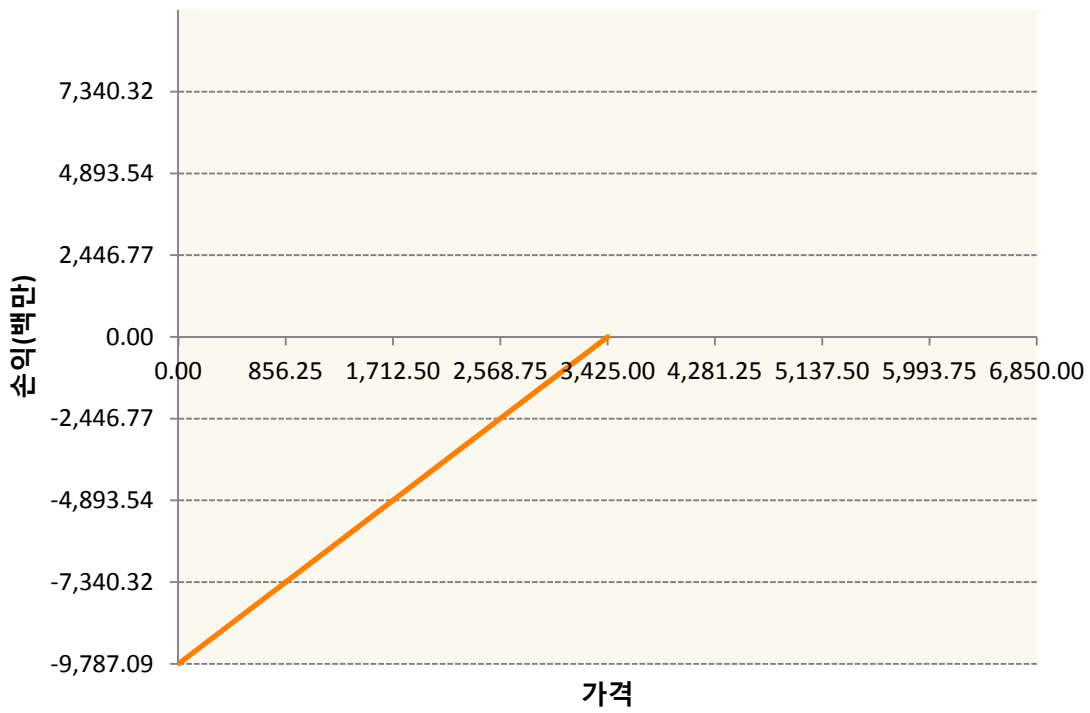


OESXM9-C3450-EURO STOXX 50

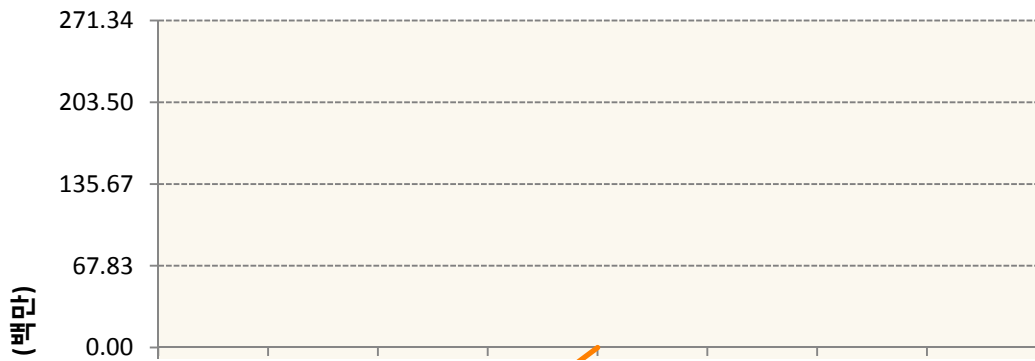


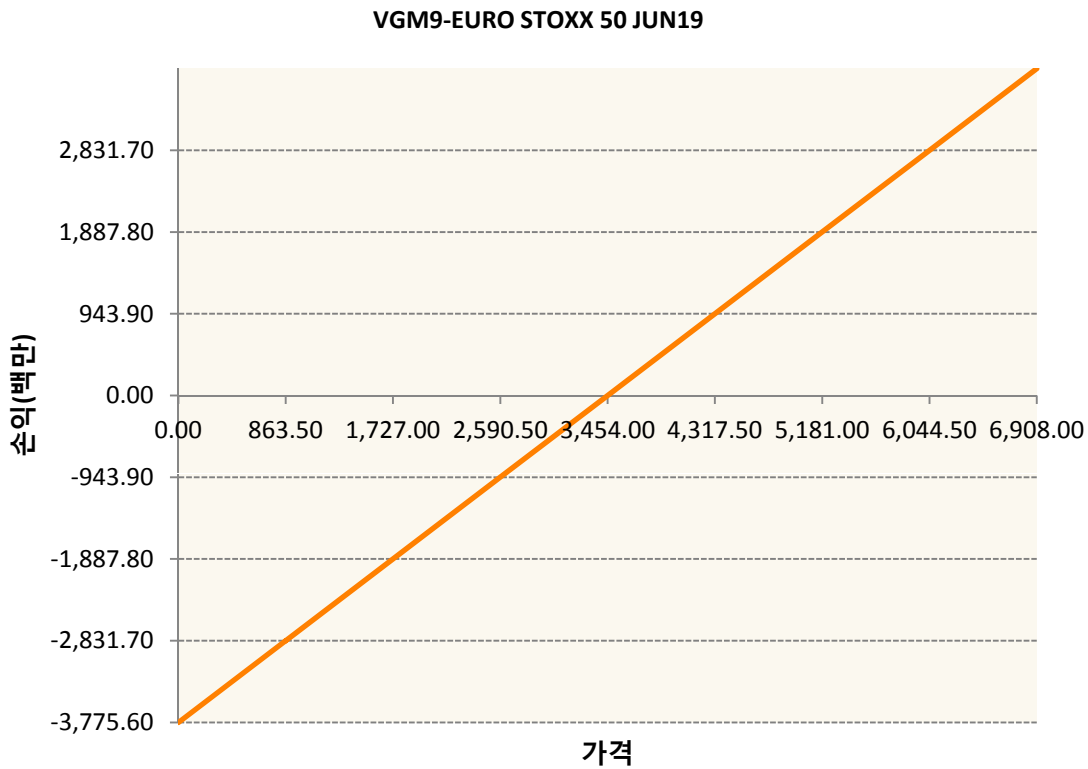
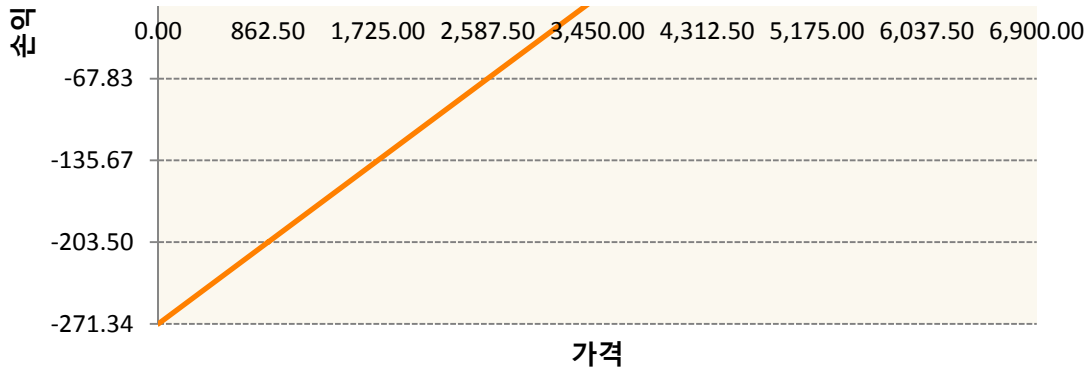


OESXM9-P3425-EURO STOXX 50



OESXM9-P3450-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		42
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E		839
FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E		210
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E		419
OESXM9-C3 EURO STOXX 50		783
OESXM9-C3 EURO STOXX 50		22
OESXM9-P3 EURO STOXX 50		783
OESXM9-P3 EURO STOXX 50		22
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19		302

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

(단위:백만원)

2,145

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

(단위:백만원)

1,049

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

(단위:백만원)

93

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

(단위:백만원)

135

공시일	2019-06-21
기준일	2019-06-20

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

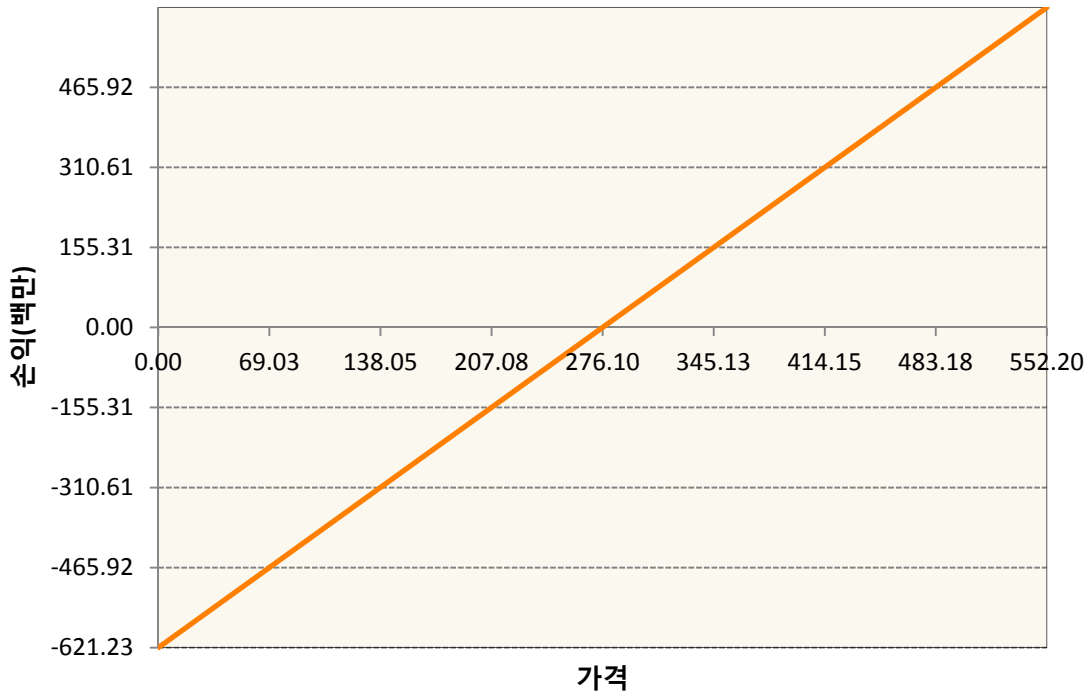
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	621	0	621	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	2019-06-21
기준일	2019-06-20

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

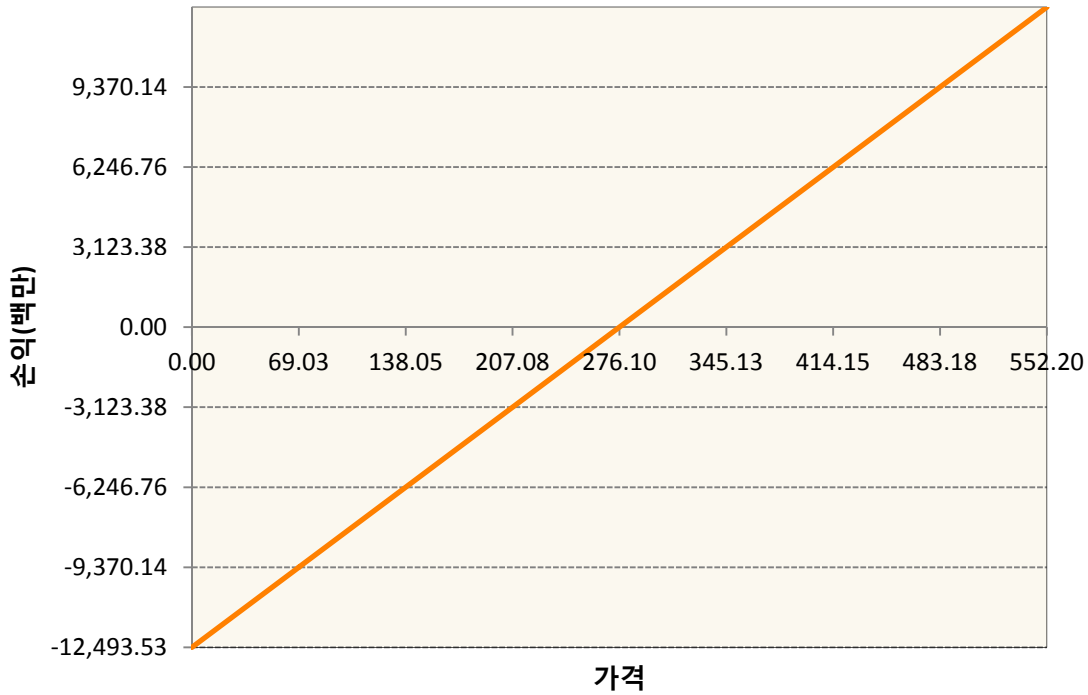
1. 계약금액

(단위:백만원)

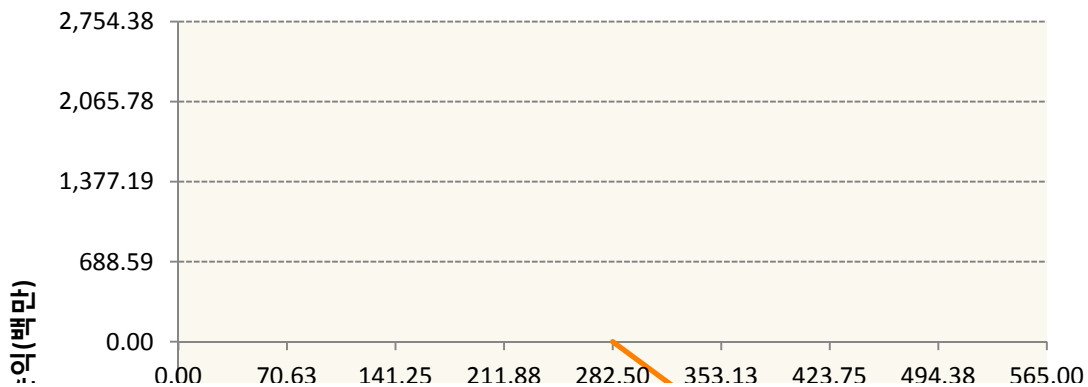
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,494	0	12,494	장내
누계	유가증권	옵션	1,084	22,206	-21,121	장내

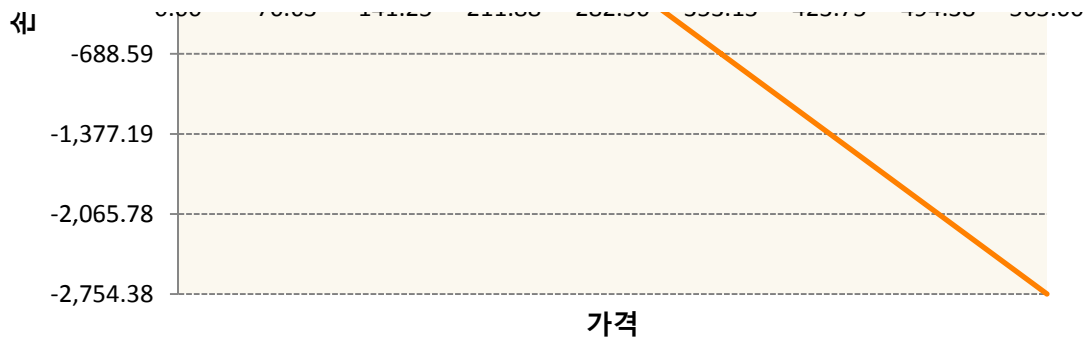
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

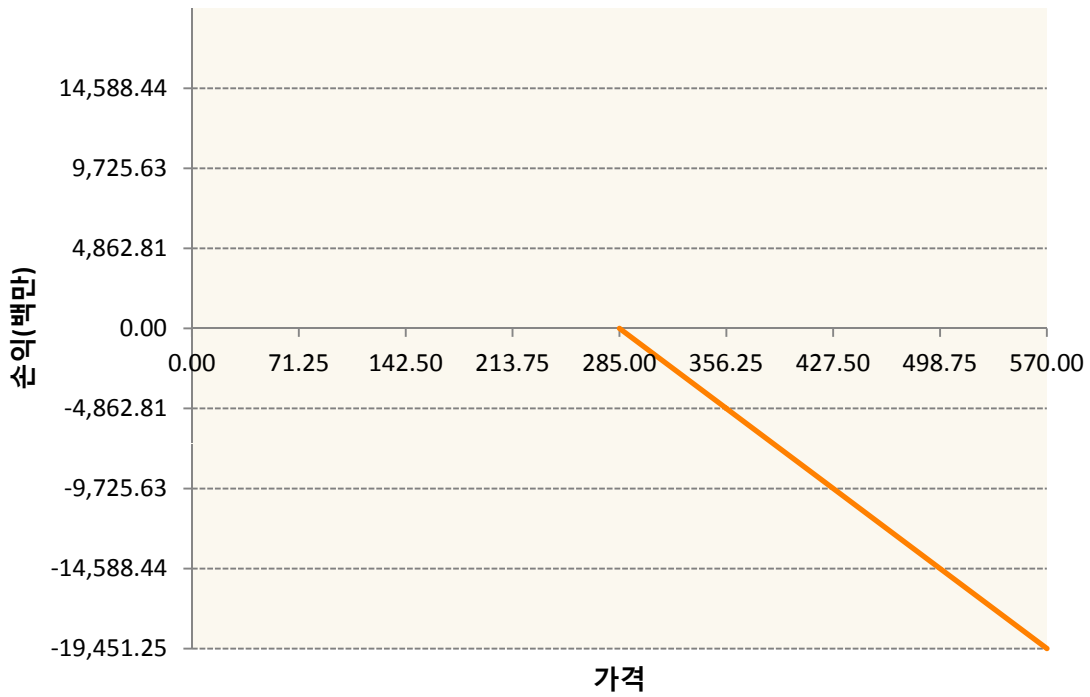


KR4201P72825-2019-07 콜282.5

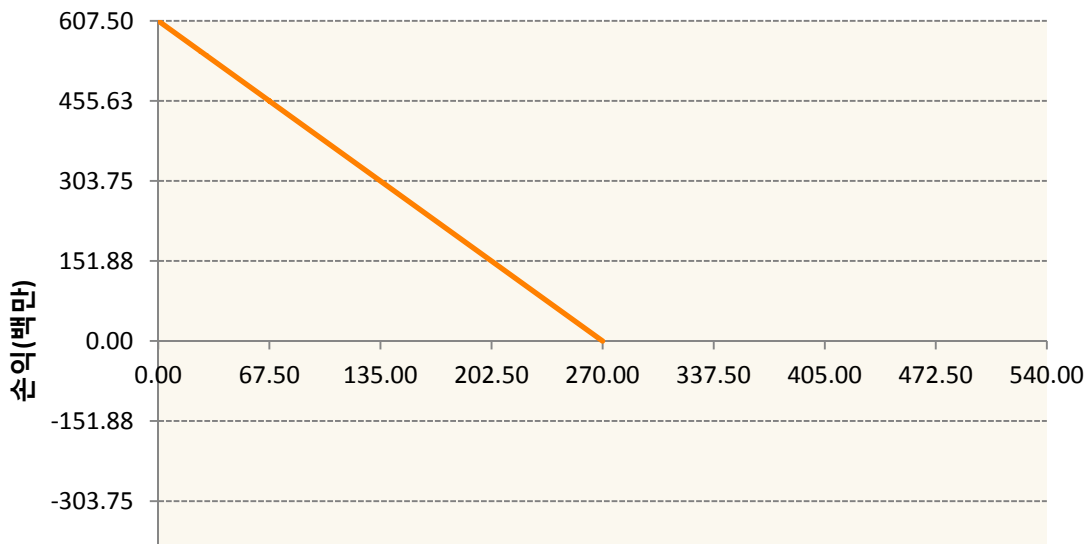


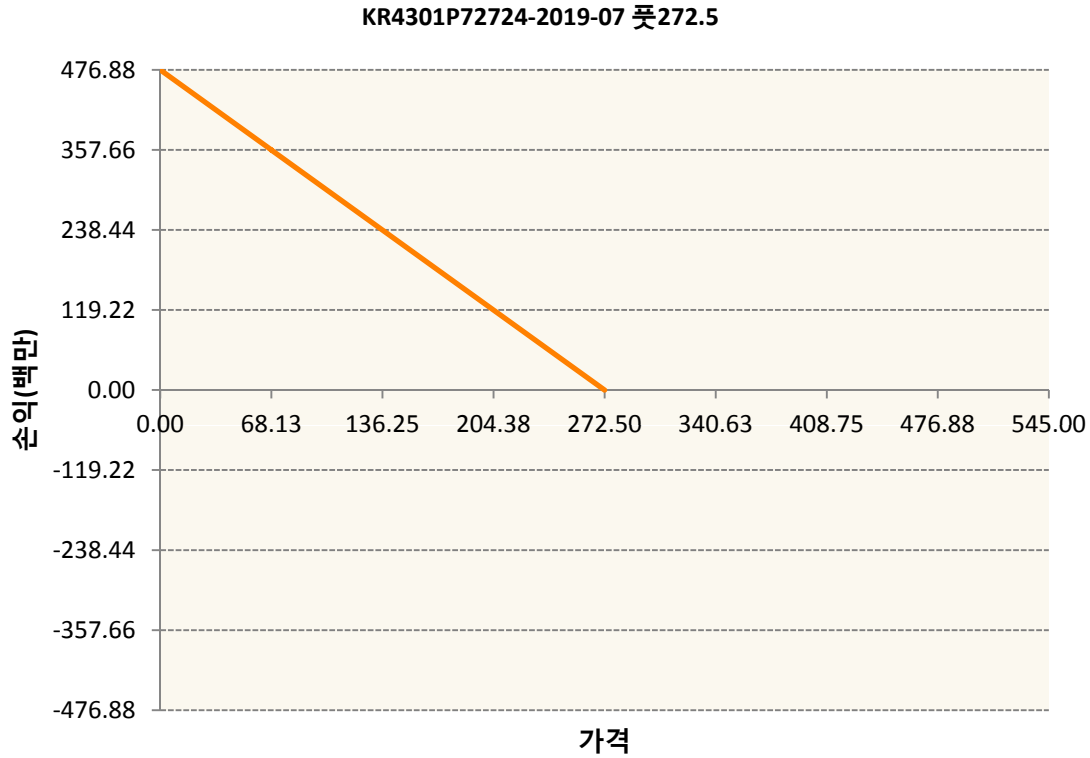
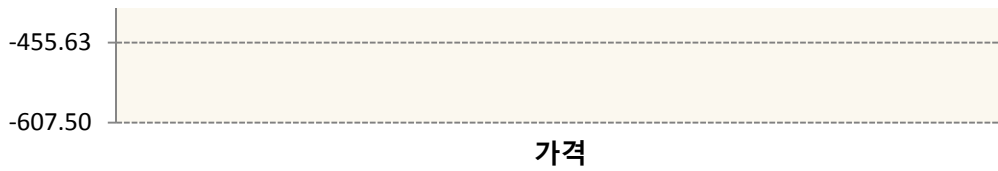


KR4201P72858-2019-07 콜285



KR4301P72708-2019-07 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						999
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-999	-999	-999	-999	-999	-999	-999	
-5.33%	-666	-666	-666	-666	-666	-666	-666	
-2.67%	-333	-333	-333	-333	-333	-333	-333	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	333	333	333	333	333	333	333	
5.33%	666	666	666	666	666	666	666	
8.00%	999	999	999	999	999	999	999	
KR4201P72825		2019-07 콜282.5						142
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	38	38	37	36	35	33	31	
-5.33%	36	35	33	31	29	26	23	
-2.67%	30	27	24	20	16	12	8	

0%	15	10	5	0	-5	-10	-15
2.67%	-15	-21	-26	-32	-37	-43	-48
5.33%	-61	-66	-71	-76	-81	-86	-91
8.00%	-119	-123	-126	-130	-134	-138	-142

KR4201P72858 2019-07 콜285 926

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	216	213	210	205	198	189	179
-5.33%	208	201	191	179	164	148	129
-2.67%	179	161	141	118	94	68	40
0%	96	65	33	0	-34	-68	-103
2.67%	-78	-117	-155	-194	-233	-272	-311
5.33%	-362	-398	-435	-473	-511	-549	-587
8.00%	-744	-770	-799	-829	-860	-892	-926

KR4301P72708 2019-07 풋270 34

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	33	33	33	33	34	34	34
-5.33%	17	18	18	18	19	19	20
-2.67%	5	5	6	7	7	8	9
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-3	-3	-3	-3	-2	-2	-2
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3

KR4301P72724 2019-07 풋272.5 29

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	29	29	29	29	29	29	29
-5.33%	16	16	16	17	17	17	18
-2.67%	5	6	6	7	7	8	8
0%	-1	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-4	-3	-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)

1,812

공시일	2019-06-21
기준일	2019-06-20

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	18,739	0	18,739	

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	2019-06-21
기준일	2019-06-20

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	581	0	581	
누계	유가증권	수익증권	59,756	0	59,756	

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	2019-06-21
기준일	2019-06-20

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,486	0	3,486	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	395,715	0	395,715	
누계	통화	선도	0	436,508	-436,508	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		930
FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E		372
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		74
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		978
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E		1,004
FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E		465
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		465
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		372
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		781
FX21019K02 KRW/USD 24-06-19E		372
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E		930
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E		1,487
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E		279
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E		1,209
FX21019K04 KRW/USD 28-06-19E		1,264
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		651
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		558
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		744
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		744
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		465
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		279
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		930
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		186
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		865
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		1,032
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		1,859

FX21019M00 KRW/USD 15-07-19E	465
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	372
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	651
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	930
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	651
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	651
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E	558
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E	2,975
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E	2,231
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E	279
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E	279
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	781
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	623
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	465
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E	1,859
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E	1,859

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

(단위:백만원)

11,651

공시일	2019-06-21
기준일	2019-06-20

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

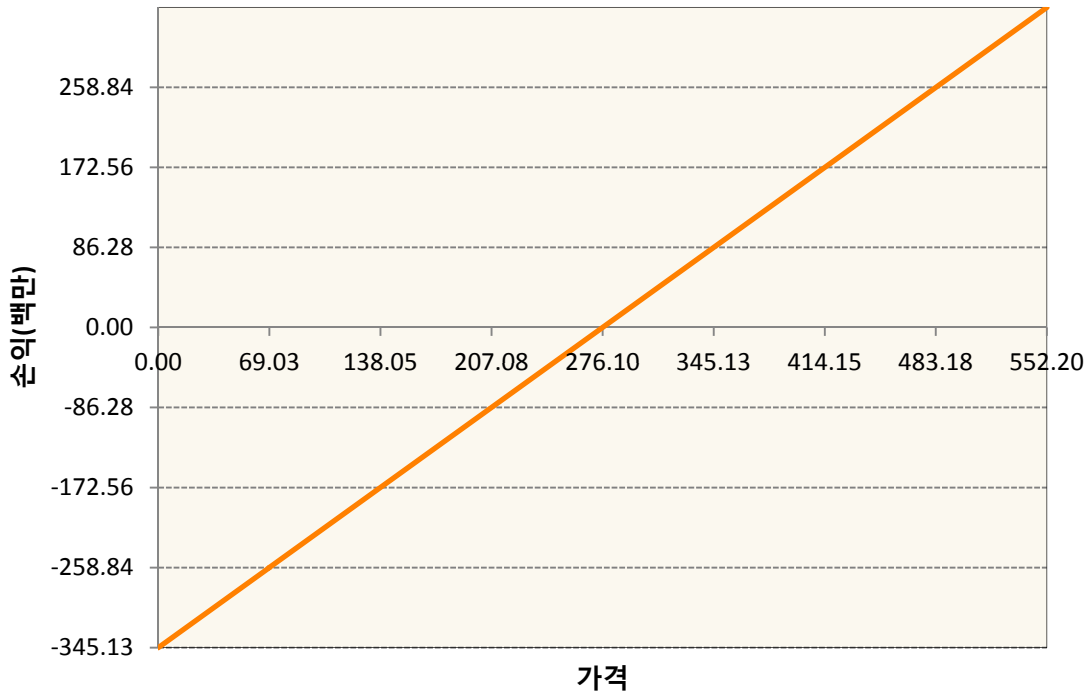
1. 계약금액

(단위:백만원)

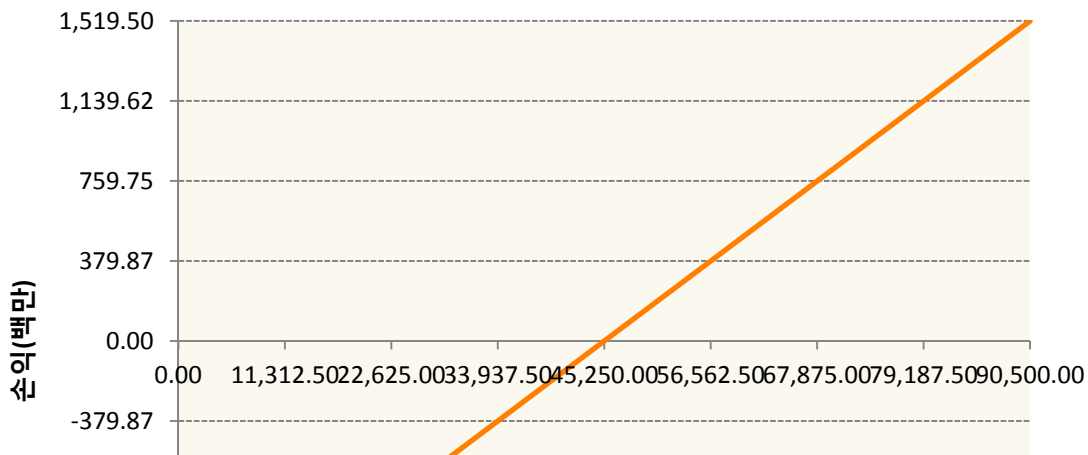
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,865	0	1,865	장내

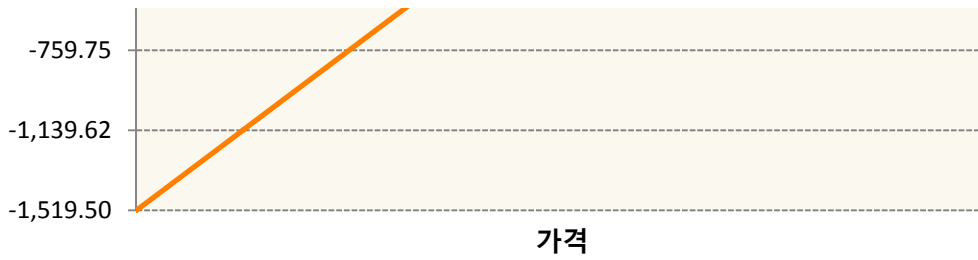
2. 만기시점의 손익구조

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)

162

공시일	2019-06-21
기준일	2019-06-20

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

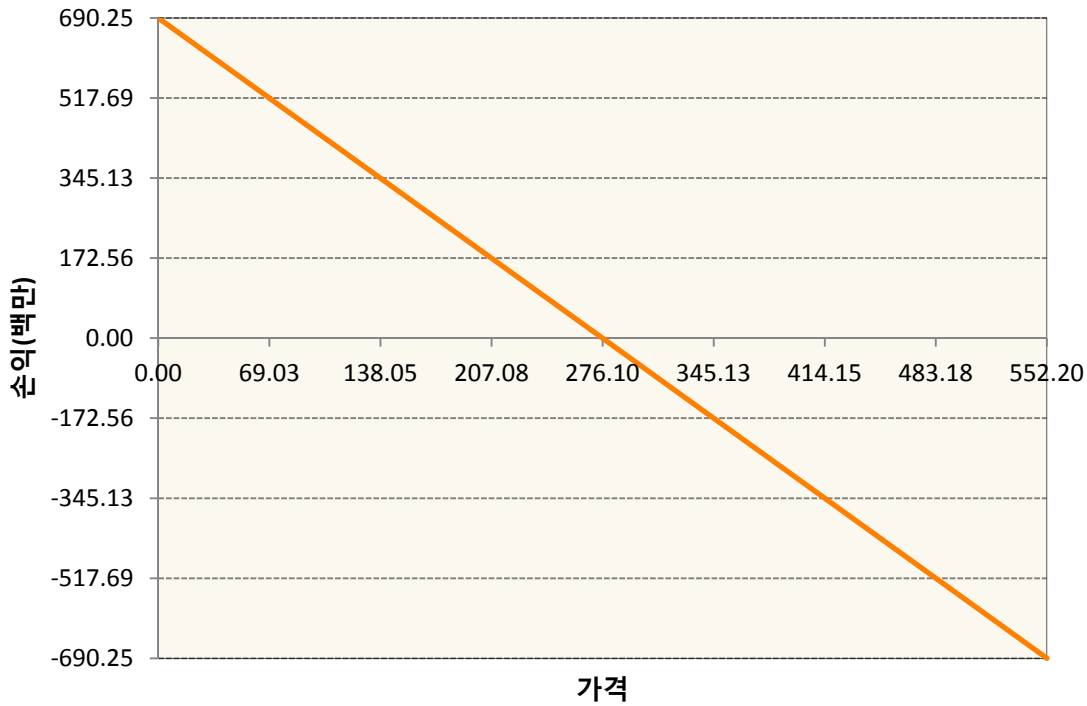
1. 계약금액

(단위:백만원)

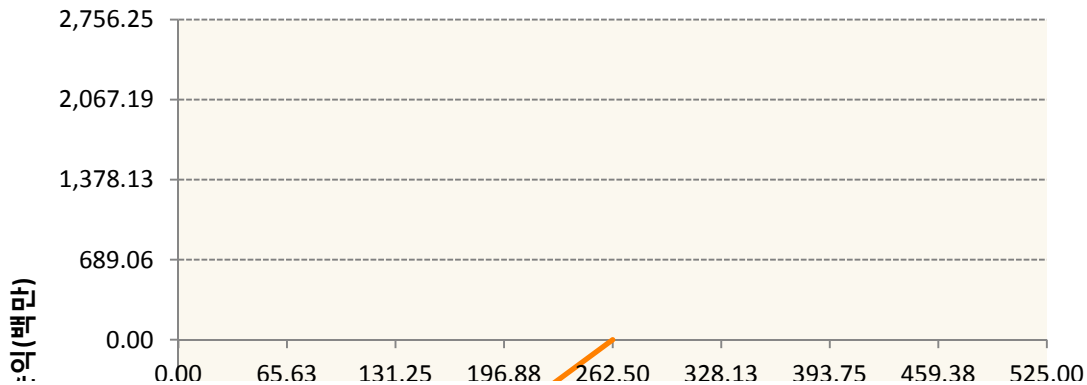
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	690	-690	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,419	-3,419	장내

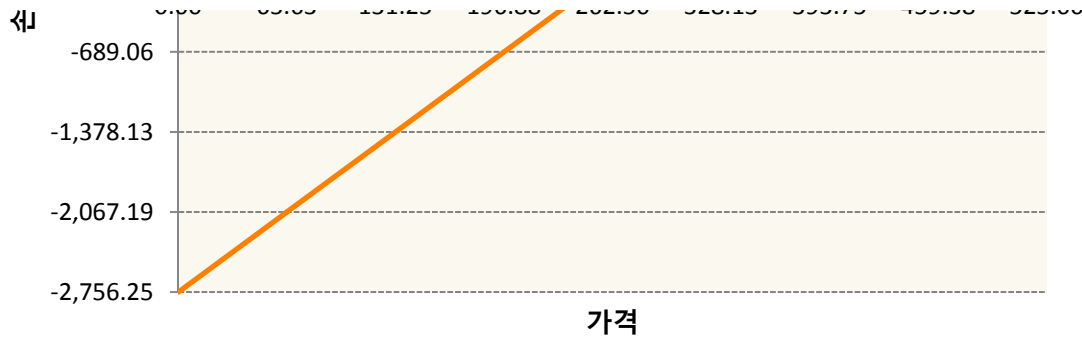
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

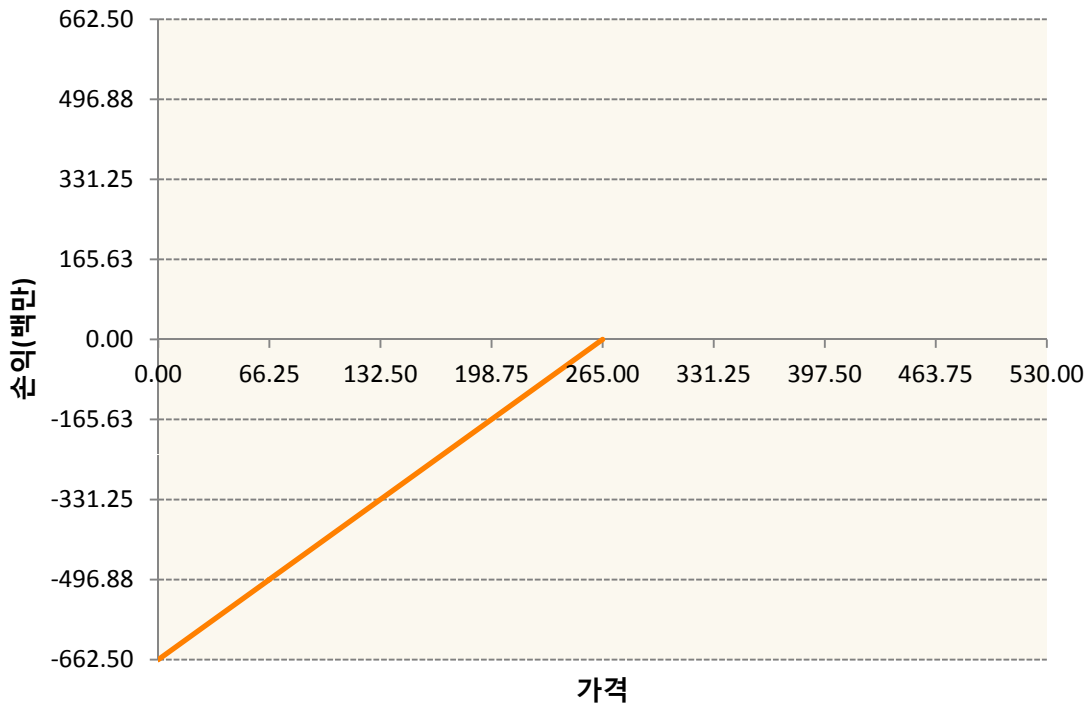


KR4301P72625-2019-07 풋262.5





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						102
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-91	-93	-94	-96	-98	-100	-102
-5.33%	-33	-36	-39	-42	-45	-48	-51
-2.67%	-4	-6	-9	-11	-14	-16	-19
0%	2	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	3	3	3	3	2	2	1
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

KR4301P72658

2019-07 풋265

29

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-27	-27	-27	-28	-28	-28	-29
-5.33%	-11	-12	-13	-13	-14	-15	-15
-2.67%	-2	-3	-3	-4	-5	-5	-6
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

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

(단위:백만원)

129

공시일	2019-06-21
기준일	2019-06-20

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	0	3,951	-3,951	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019M0:KRW/USD 24-07-19E	139
FX21019M0:KRW/USD 24-07-19E	177

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

(단위:백만원)

105

공시일	2019-06-21
기준일	2019-06-20

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

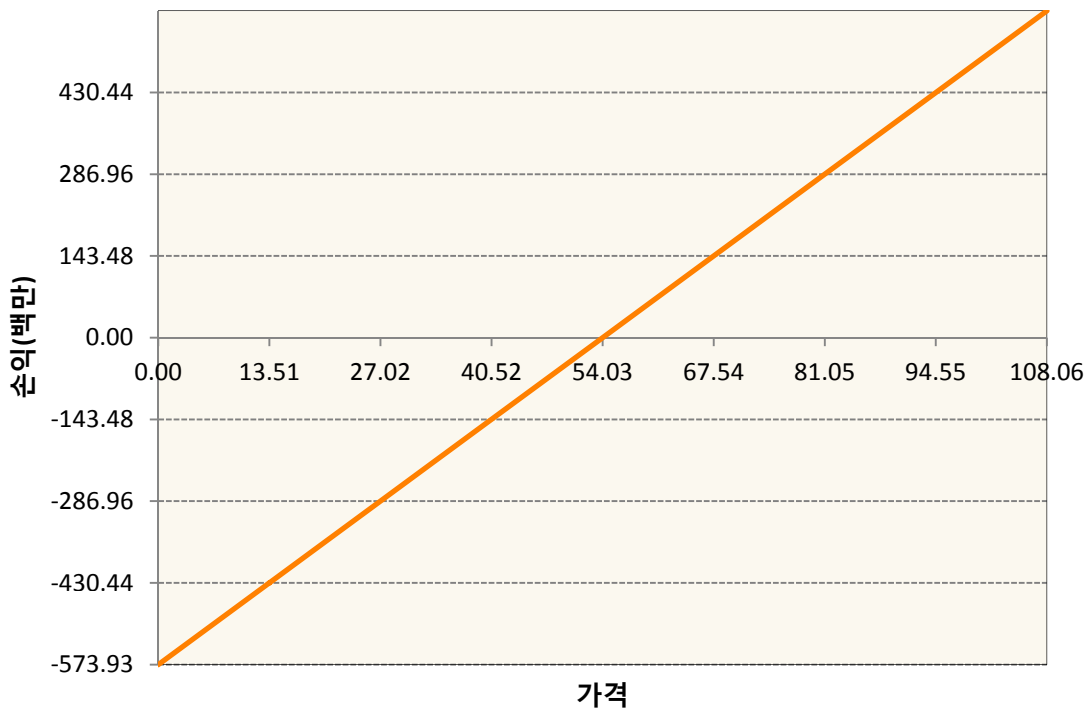
1. 계약금액

(단위:백만원)

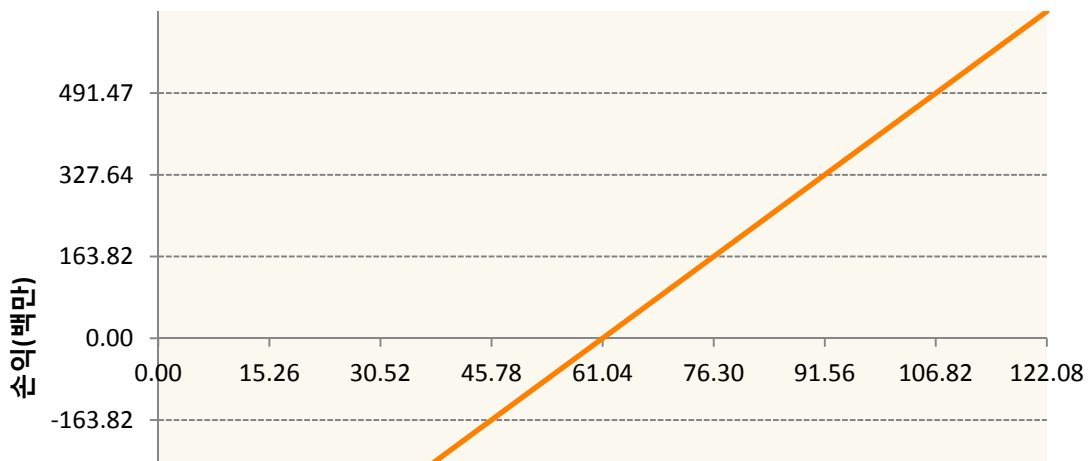
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,512	116	2,395	

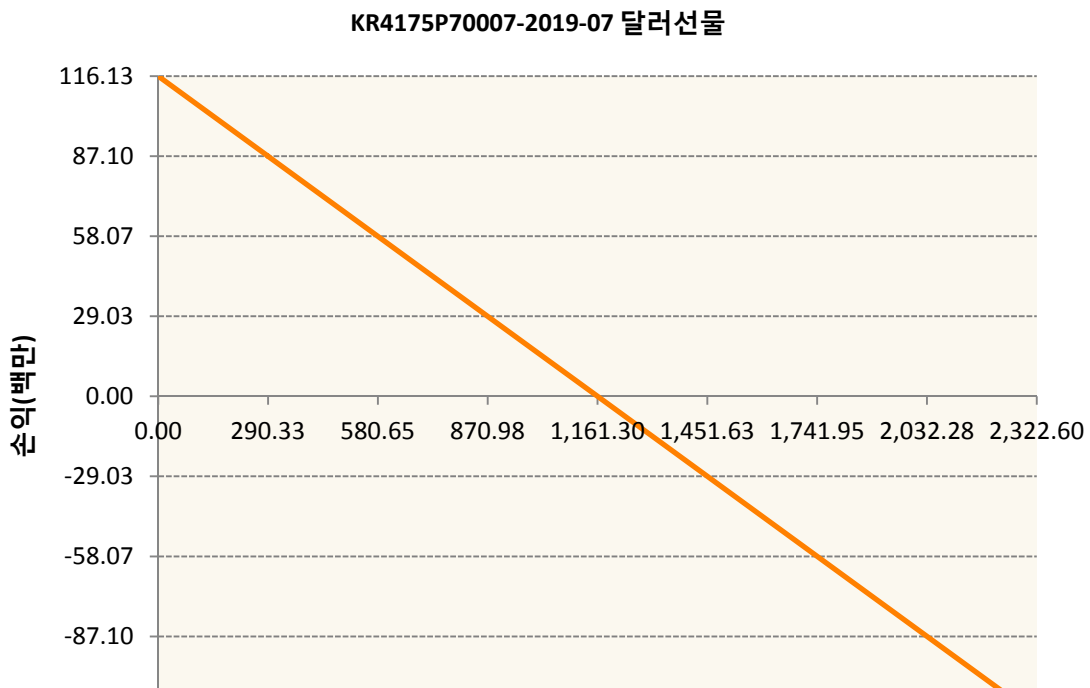
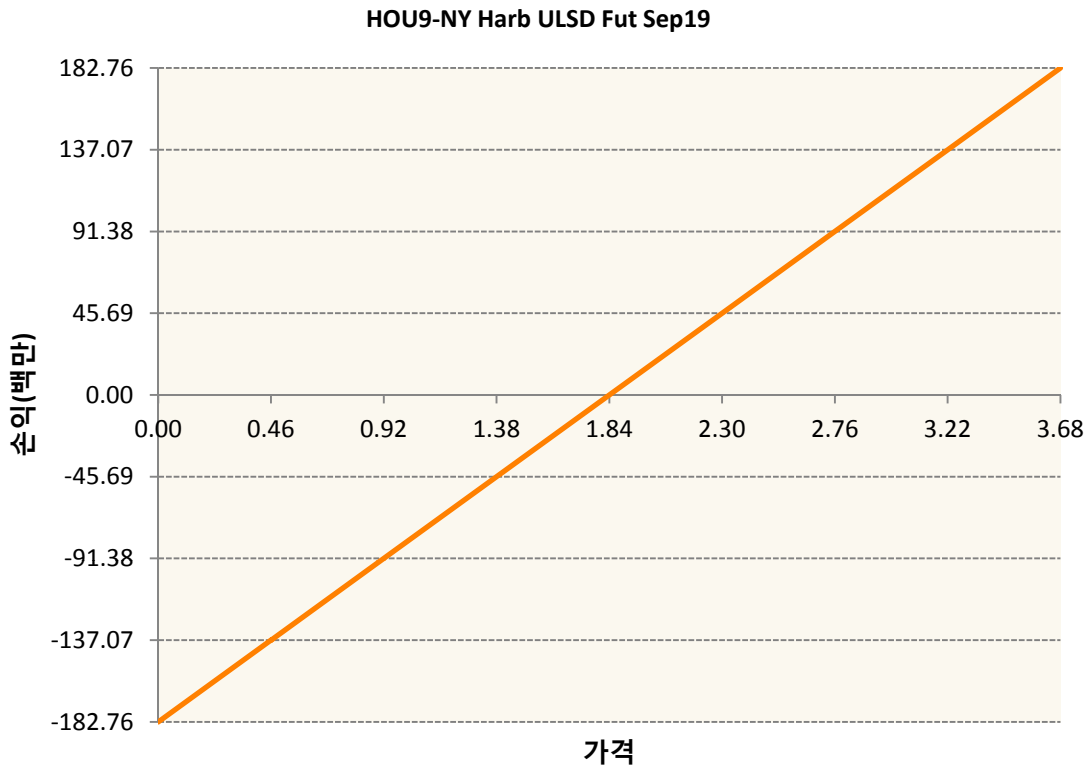
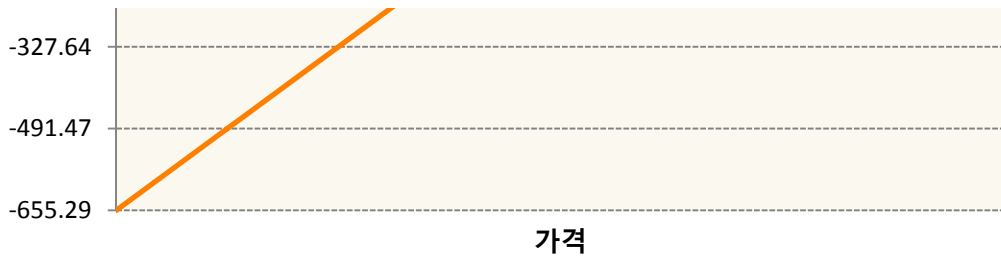
2. 만기시점의 손익구조

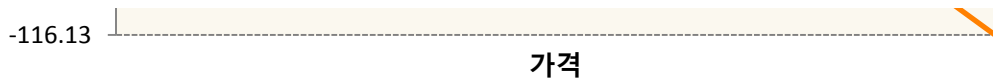
CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19



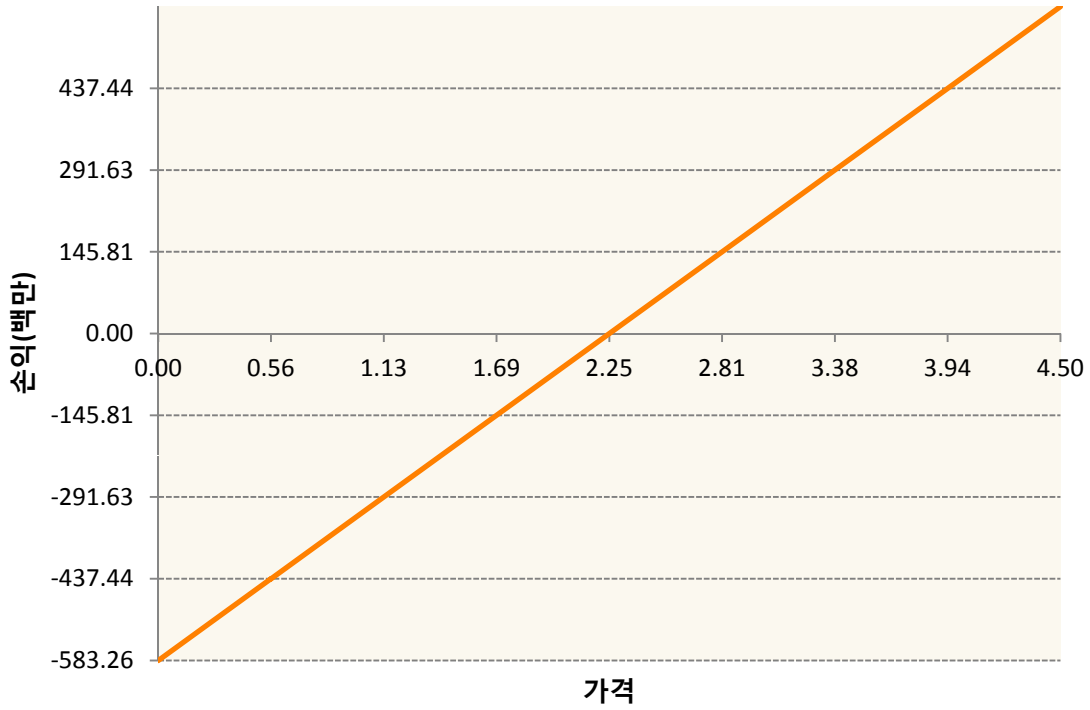
COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19



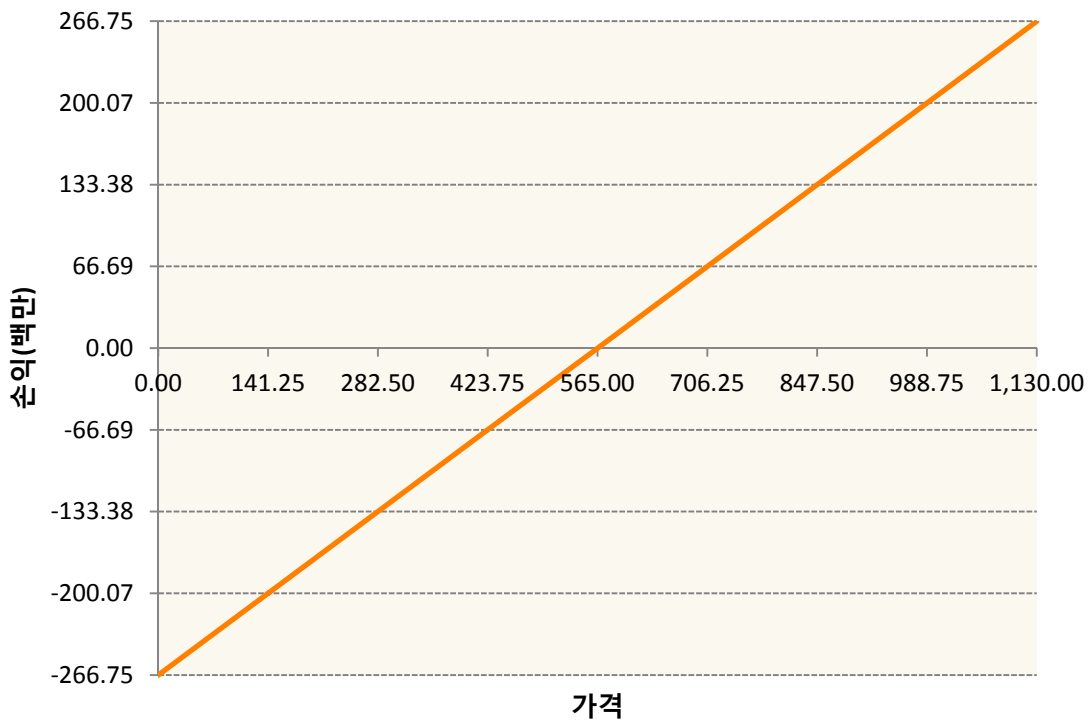




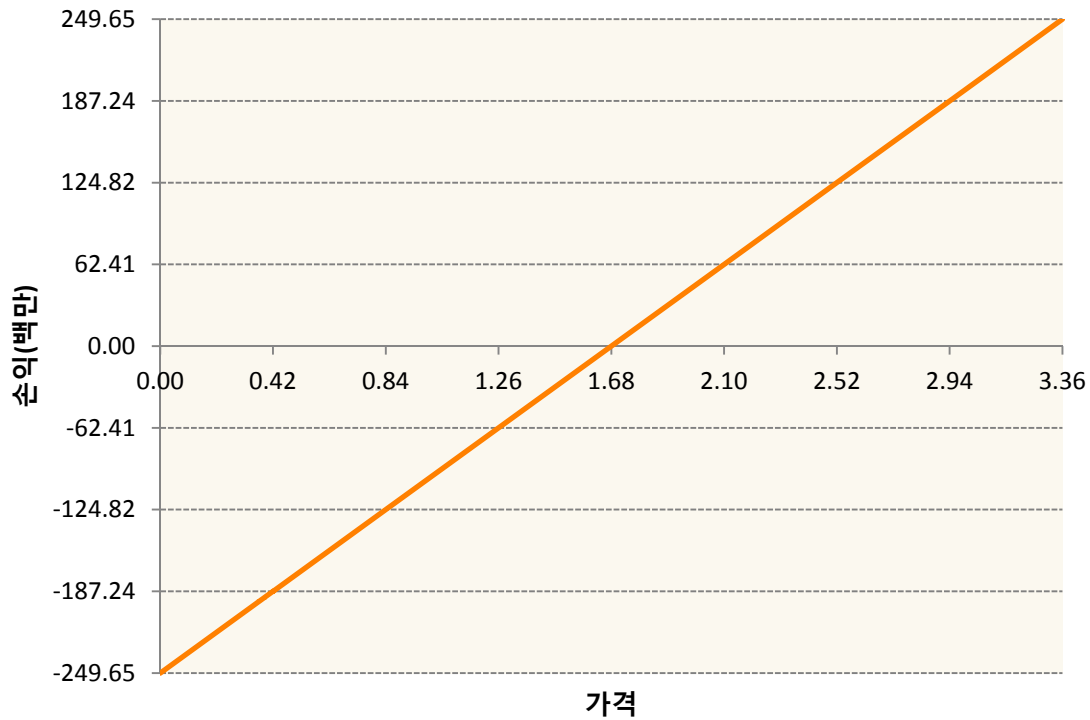
NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



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	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)

374

공시일	2019-06-21
기준일	2019-06-20

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

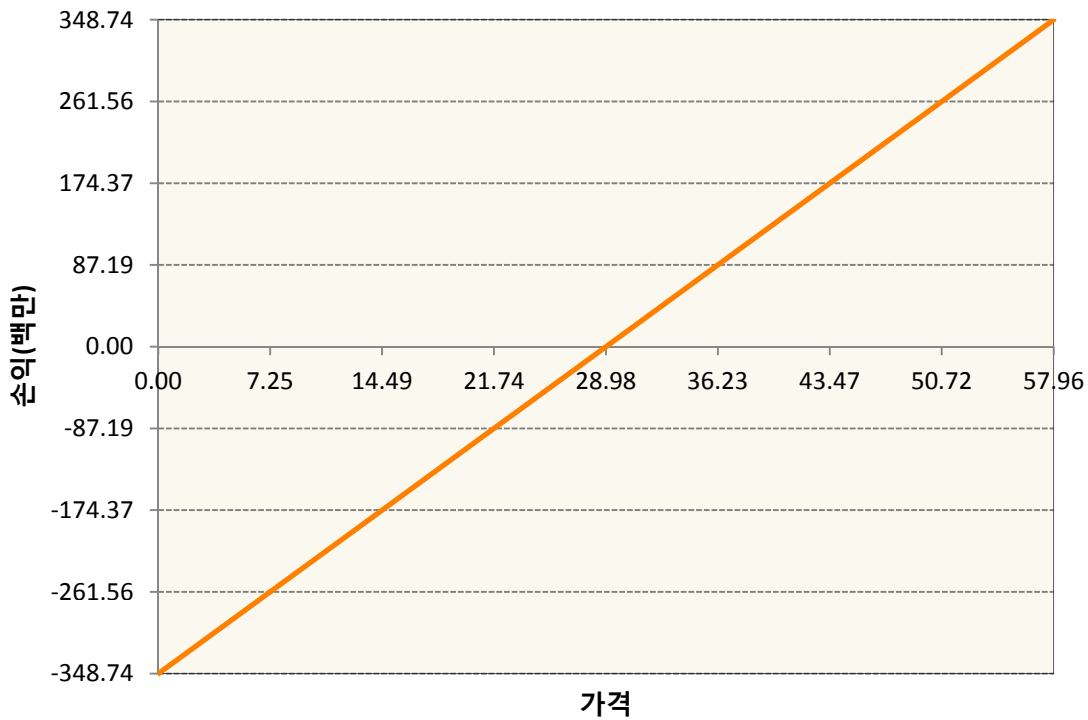
1. 계약금액

(단위:백만원)

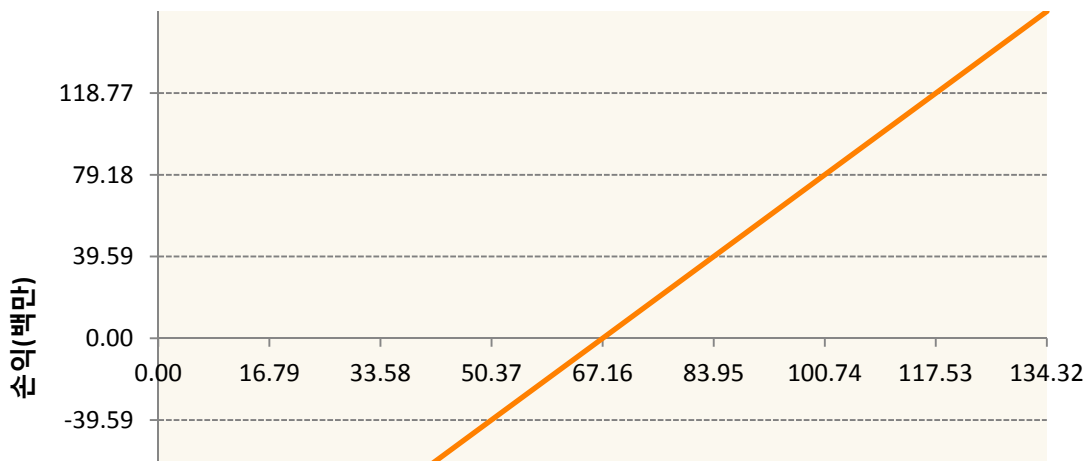
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,215	197	3,017	

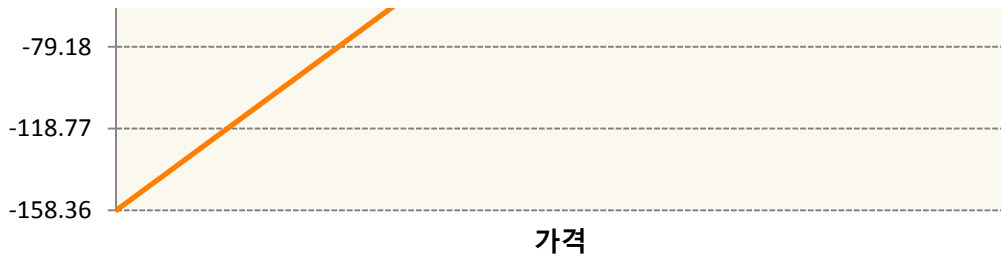
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

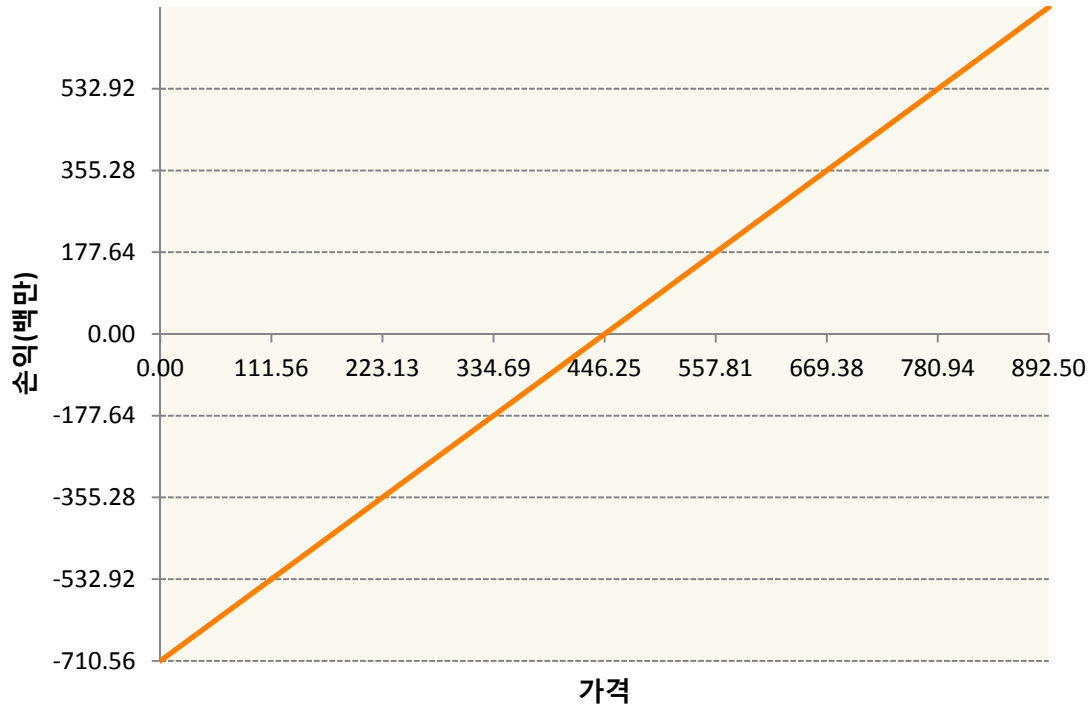


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

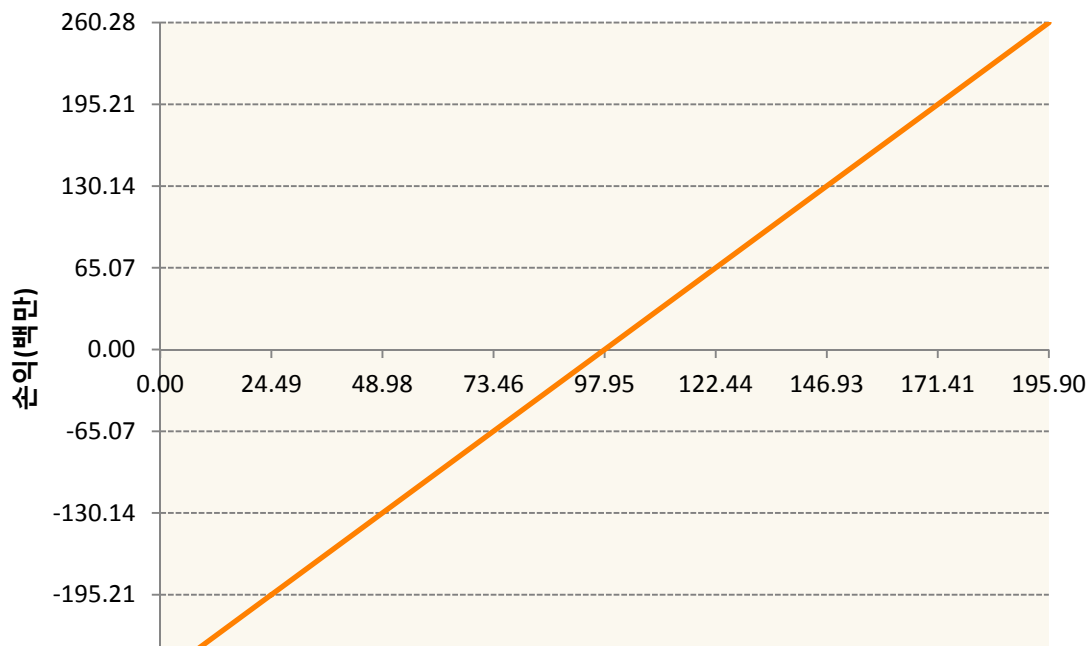


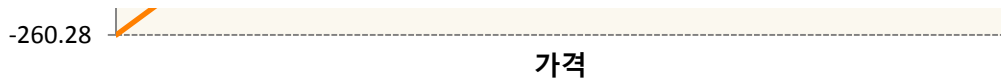


CU9-CORN FUTURE Sep19

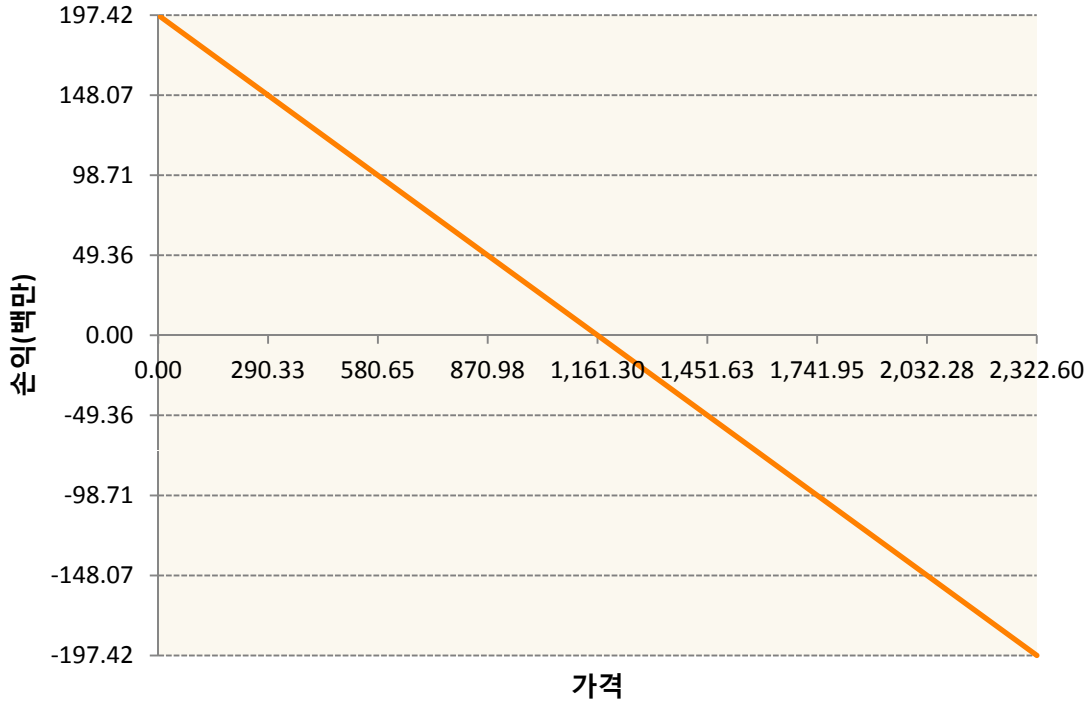


KCU9-COFFEE 'C' FUTURE Sep19

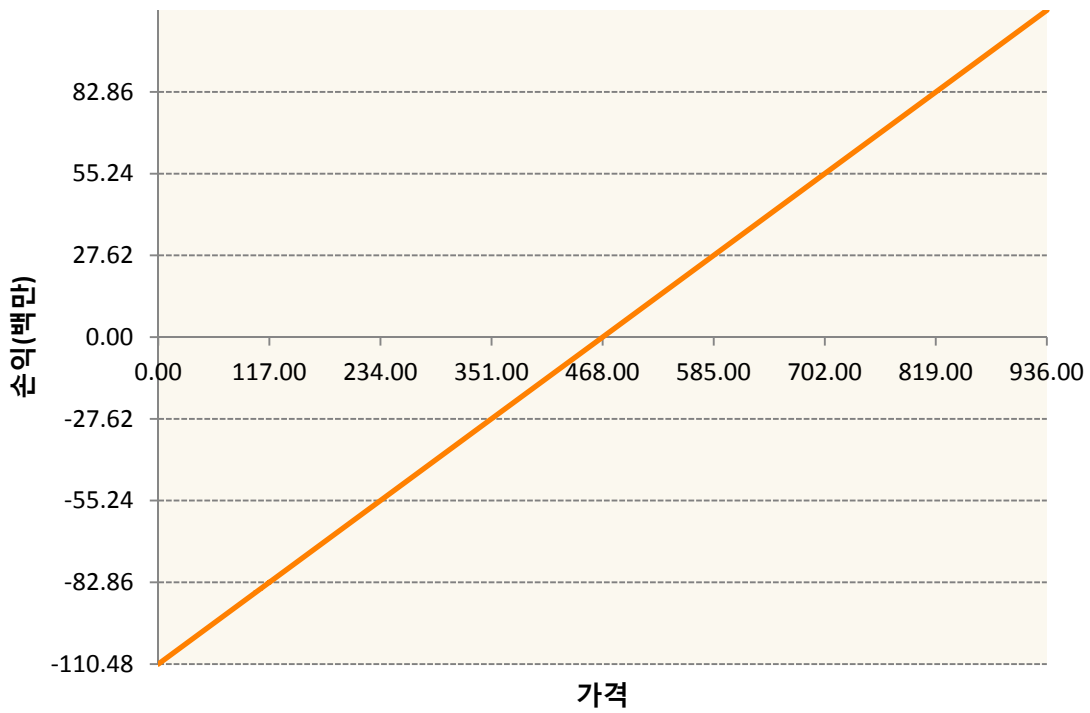




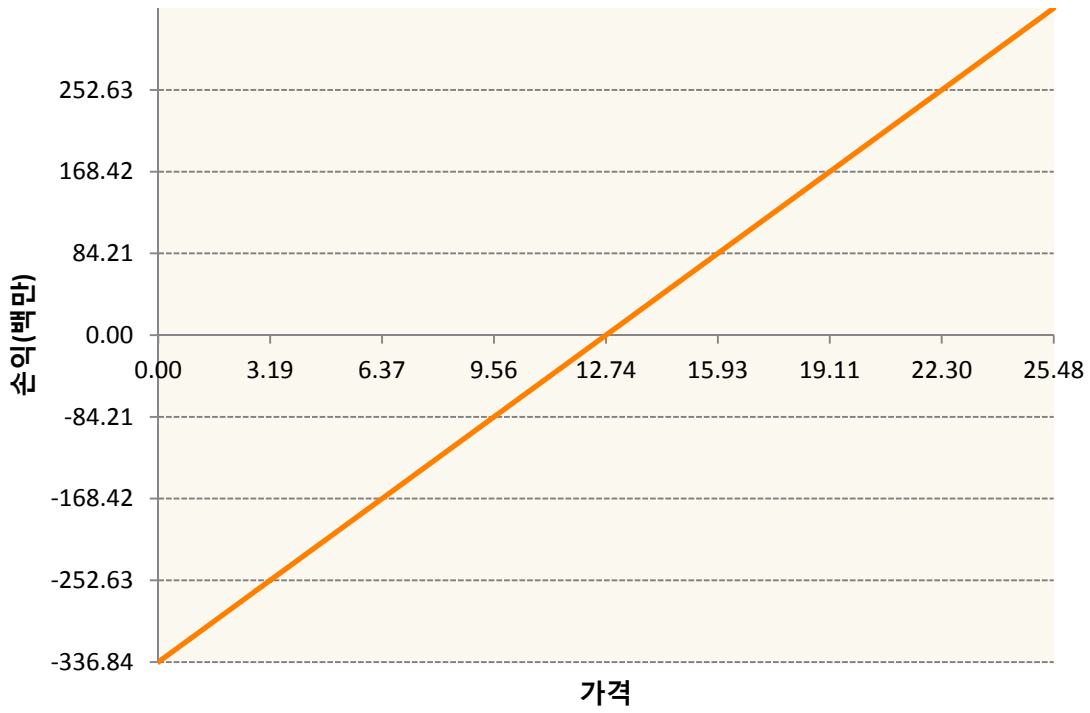
KR4175P70007-2019-07 달러선물



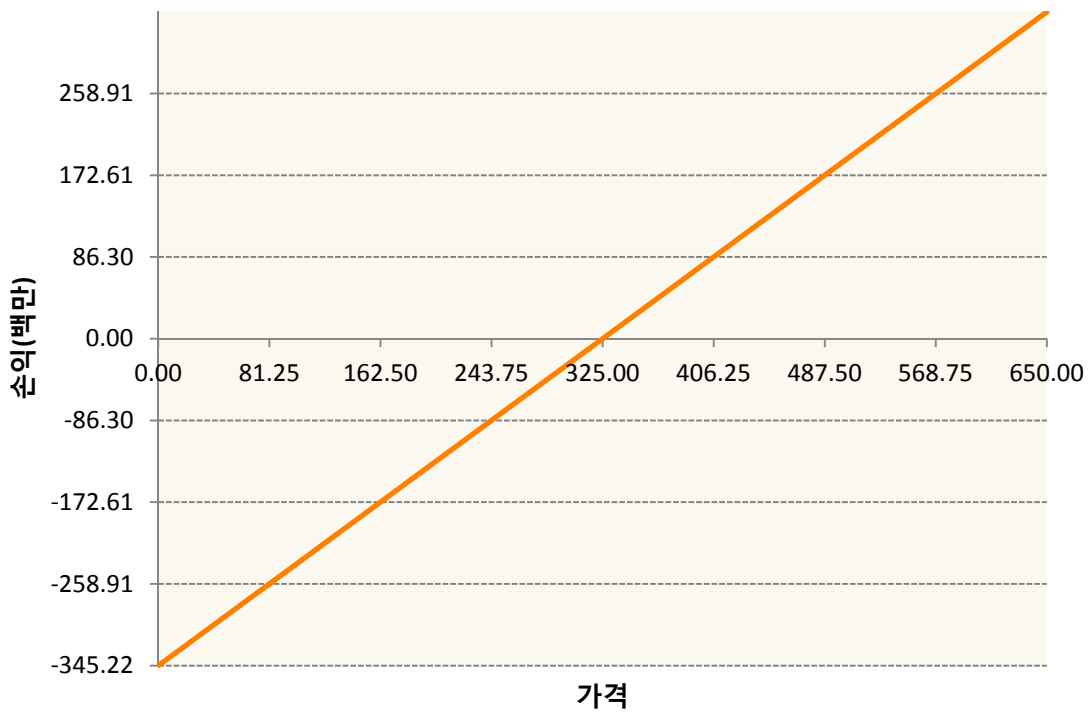
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



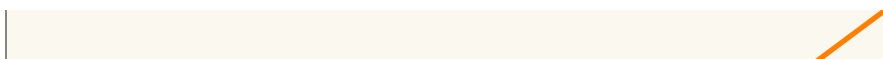
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

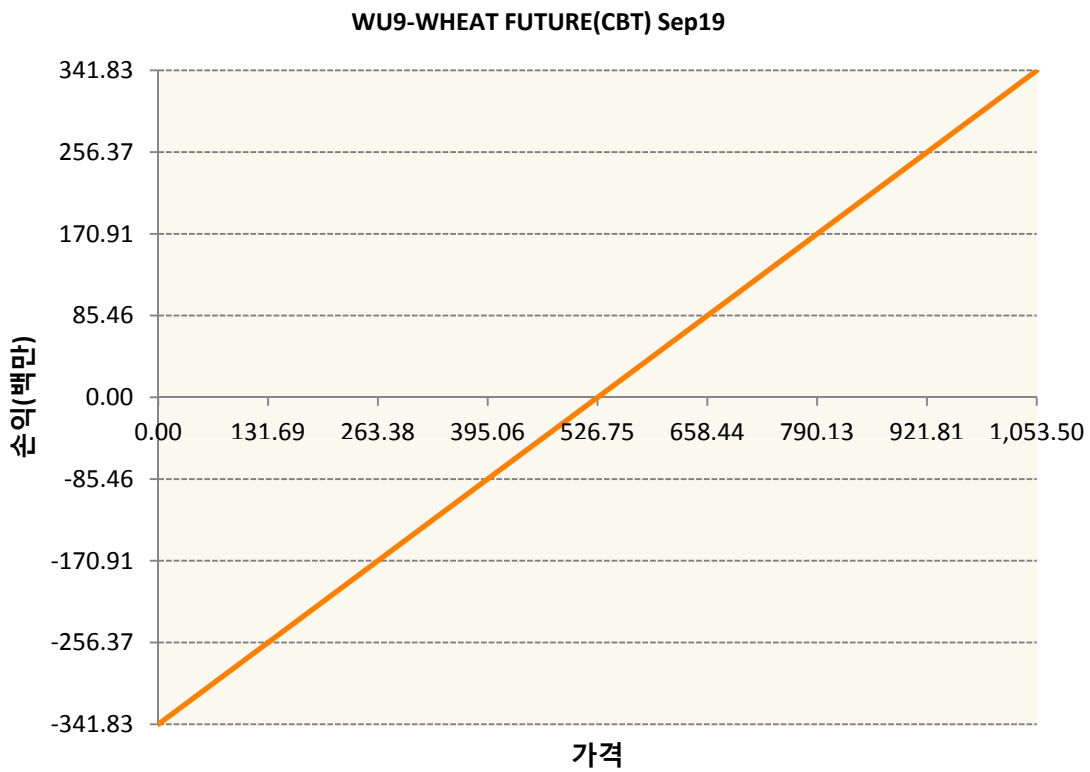
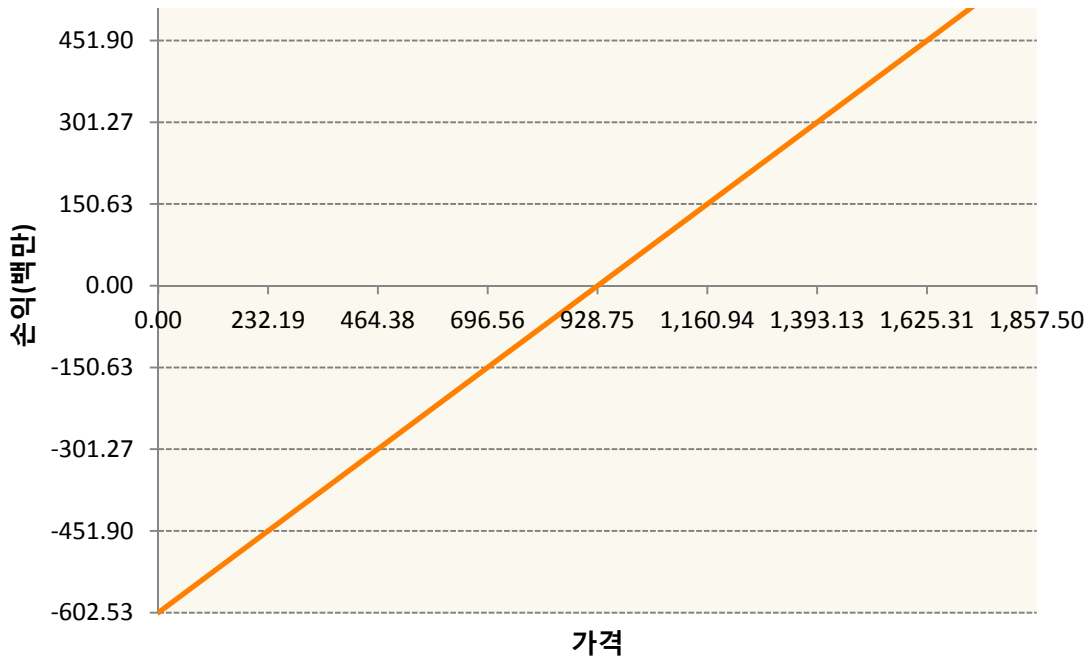


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	28
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	13
CU9	CORN FUTURE Sep19	57
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	48
WU9	WHEAT FUTURE(CBT) Sep19	27

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

(단위:백만원)

278