

공시일	2019-06-24
기준일	2019-06-21

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)

92

공시일	2019-06-24
기준일	2019-06-21

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

1,167

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

707

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-24
기준일	2019-06-21

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)	390
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	143

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

899

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-24
기준일	2019-06-21

유로인덱스모(주식-파생형)

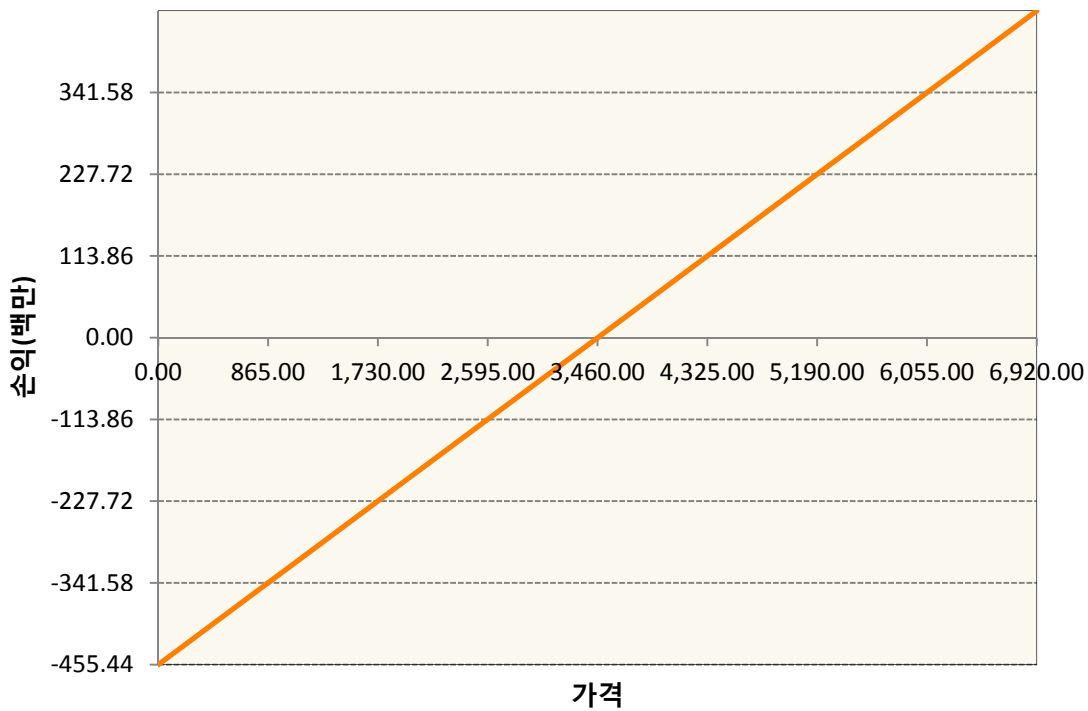
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	455	0	455	

2. 만기시점의 손익구조

VGU9-EURO STOXX 50 Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU9	EURO STOXX 50 Sep19	36
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

27

공시일	2019-06-24
기준일	2019-06-21

차이나인덱스모(주식-파생형)

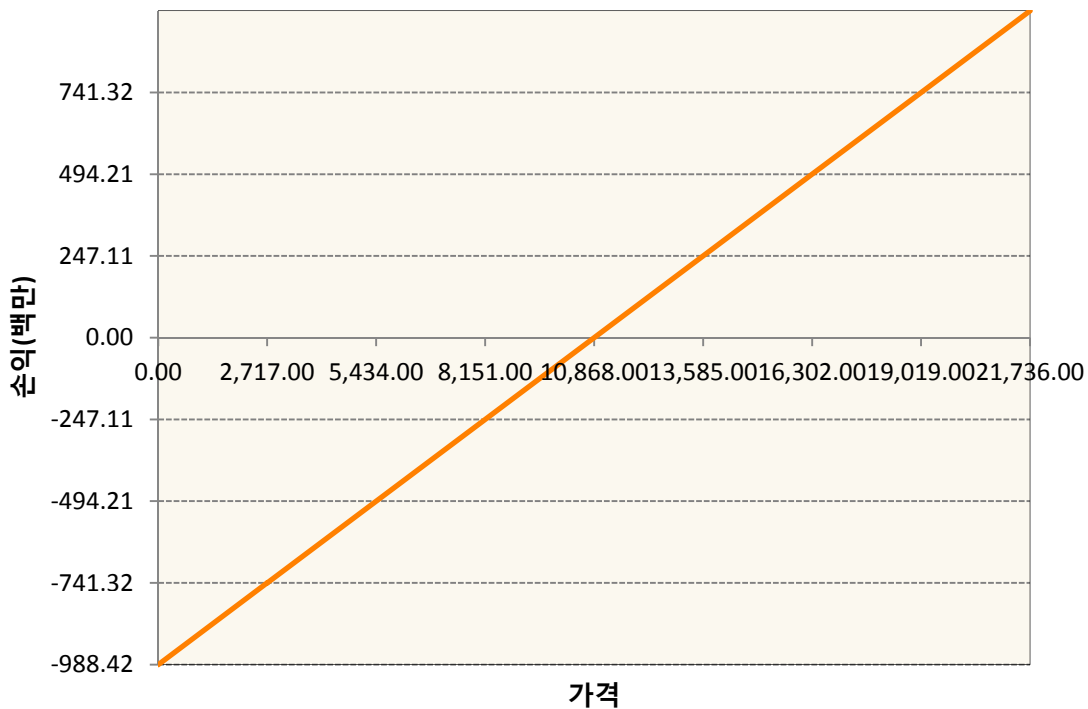
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	988	0	988	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	2019-06-24
기준일	2019-06-21

커버드콜모(주식혼합-파생형)

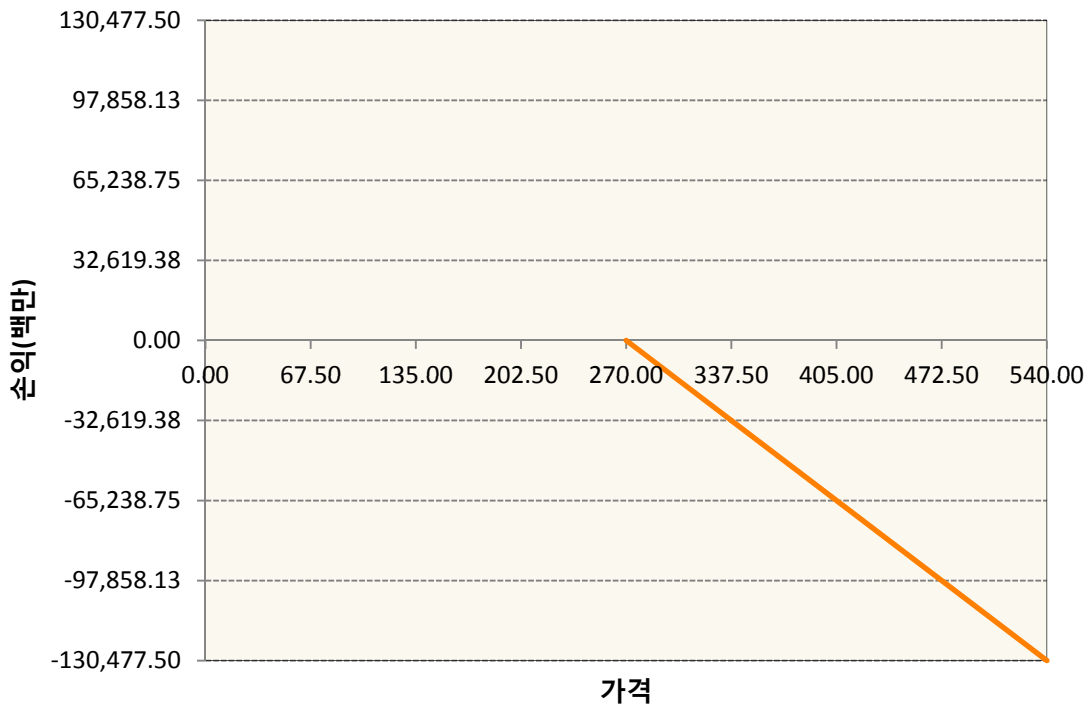
1. 계약금액

(단위:백만원)

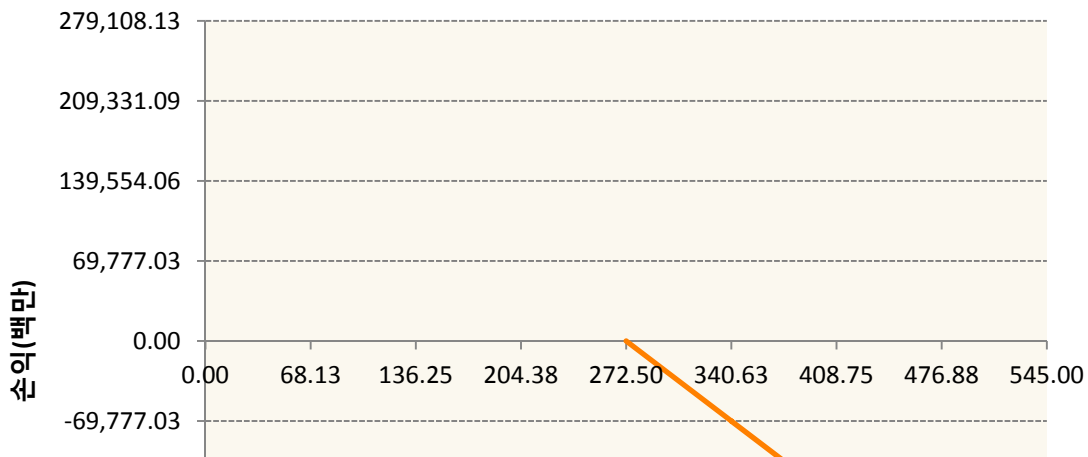
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	2,348	0	2,348	장내
누계	유가증권	옵션	0	602,973	-602,973	장내

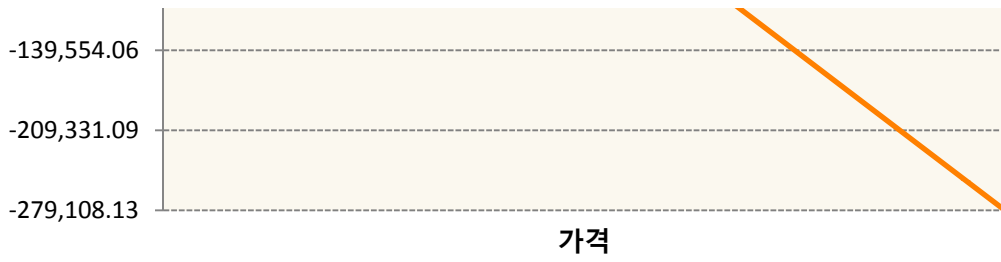
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P72700-2019-07 콜270

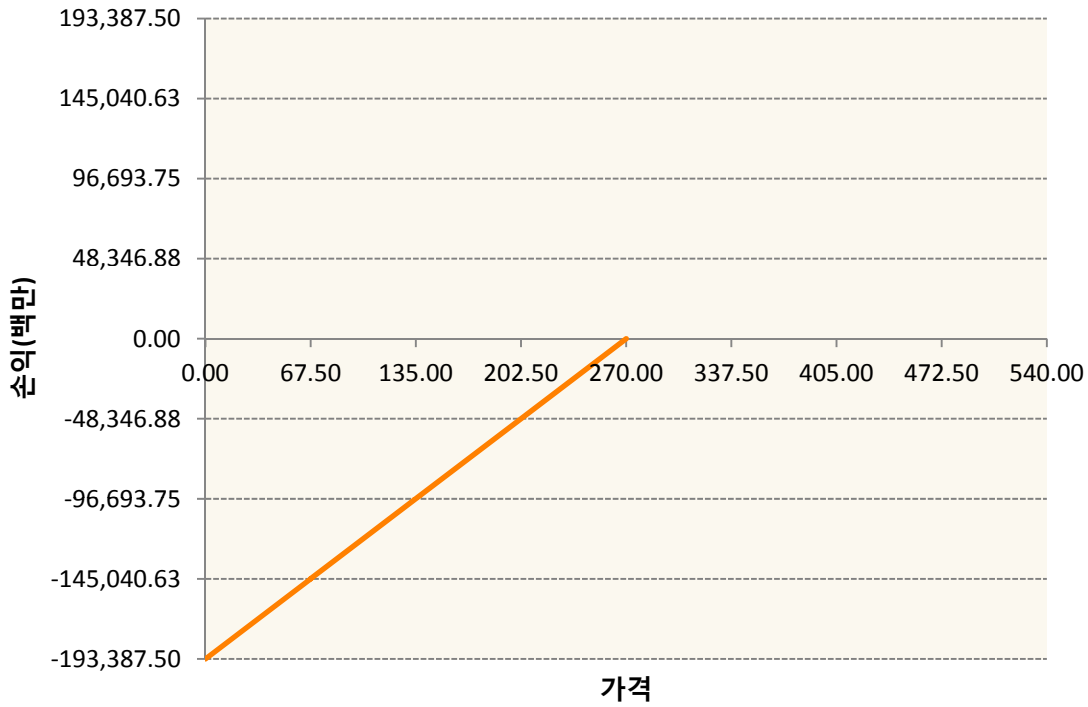


KR4201P72726-2019-07 콜272.5





KR4301P72708-2019-07 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P72700		2019-07 콜270					9,100
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,384	4,284	4,167	4,035	3,888	3,731	3,563
-5.33%	3,879	3,688	3,487	3,279	3,064	2,844	2,620
-2.67%	2,719	2,466	2,213	1,959	1,704	1,450	1,195
0%	725	487	245	0	-247	-496	-746
2.67%	-2,015	-2,178	-2,356	-2,546	-2,746	-2,954	-3,168
5.33%	-5,232	-5,315	-5,418	-5,539	-5,676	-5,826	-5,988
8.00%	-8,672	-8,705	-8,753	-8,817	-8,897	-8,991	-9,100
KR4201P72726		2019-07 콜272.5					18,528
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,940	7,781	7,584	7,351	7,087	6,795	6,479

-5.33%	7,177	6,834	6,461	6,064	5,649	5,218	4,774
-2.67%	5,244	4,732	4,214	3,691	3,165	2,636	2,105
0%	1,626	1,086	544	0	-545	-1,092	-1,639
2.67%	-3,685	-4,098	-4,535	-4,990	-5,460	-5,941	-6,433
5.33%	-10,212	-10,448	-10,724	-11,035	-11,377	-11,744	-12,133
8.00%	-17,379	-17,481	-17,621	-17,798	-18,010	-18,254	-18,528
KR4301P72708 2019-07 풋270							11,084
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10,913	-10,921	-10,936	-10,959	-10,992	-11,033	-11,084
-5.33%	-5,797	-5,874	-5,966	-6,070	-6,186	-6,312	-6,445
-2.67%	-1,615	-1,811	-2,009	-2,208	-2,408	-2,609	-2,810
0%	486	332	170	0	-175	-354	-537
2.67%	984	943	888	819	738	644	540
5.33%	1,033	1,029	1,021	1,007	985	956	917
8.00%	1,035	1,035	1,035	1,033	1,030	1,024	1,014

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

(단위:백만원)

39,054

공시일	2019-06-24
기준일	2019-06-21

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

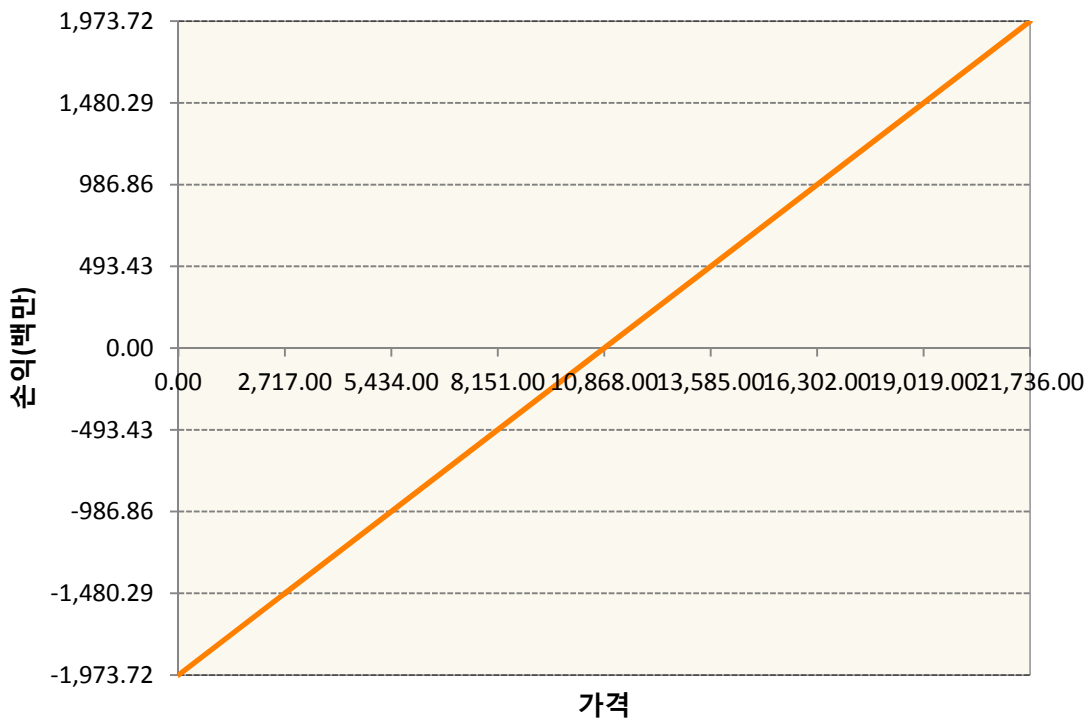
1. 계약금액

(단위:백만원)

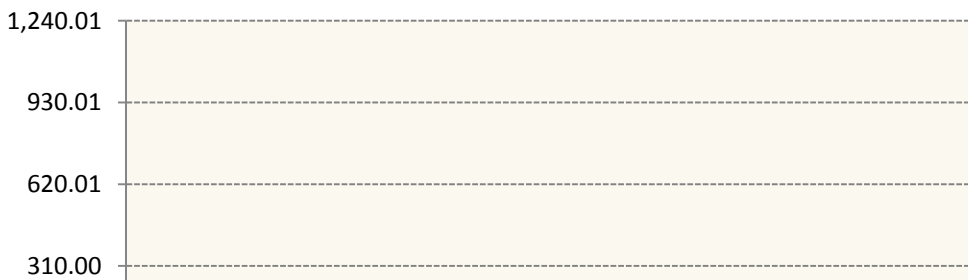
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,974	0	1,974	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,984	-4,984	장내
누계	통화	선도	149	3,130	-2,981	장외

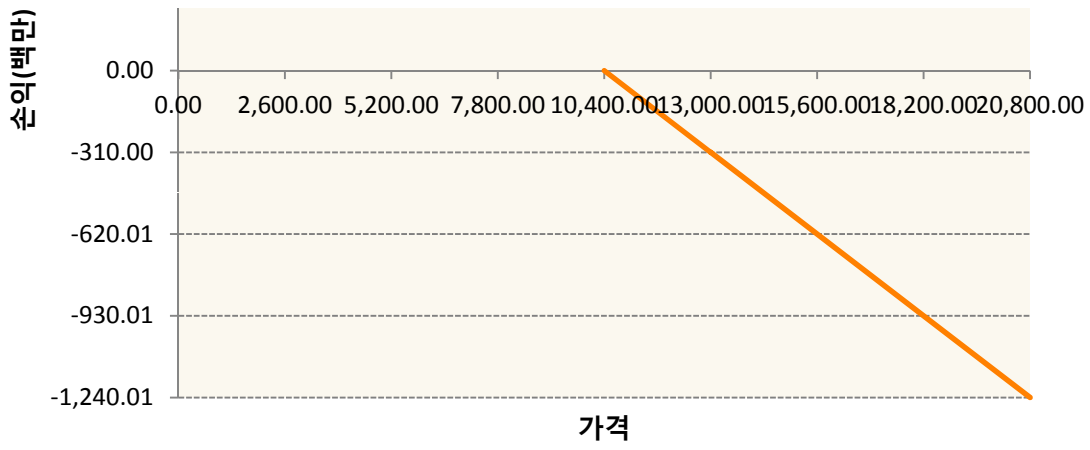
2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19

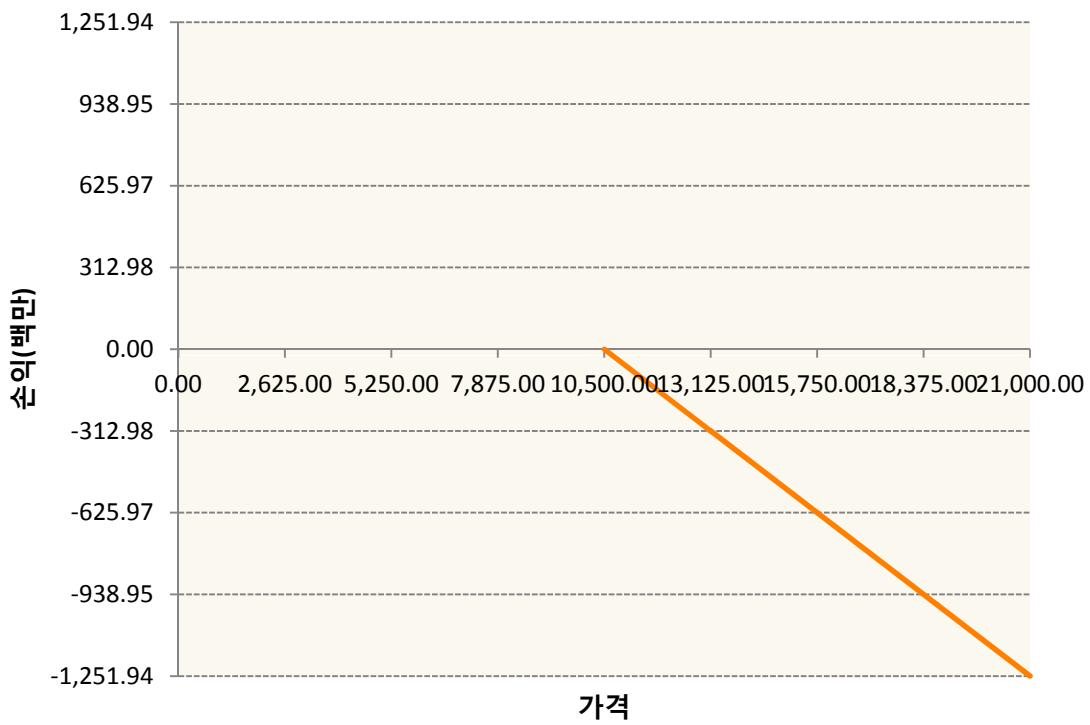


OHHIM9-C104-HSCEI

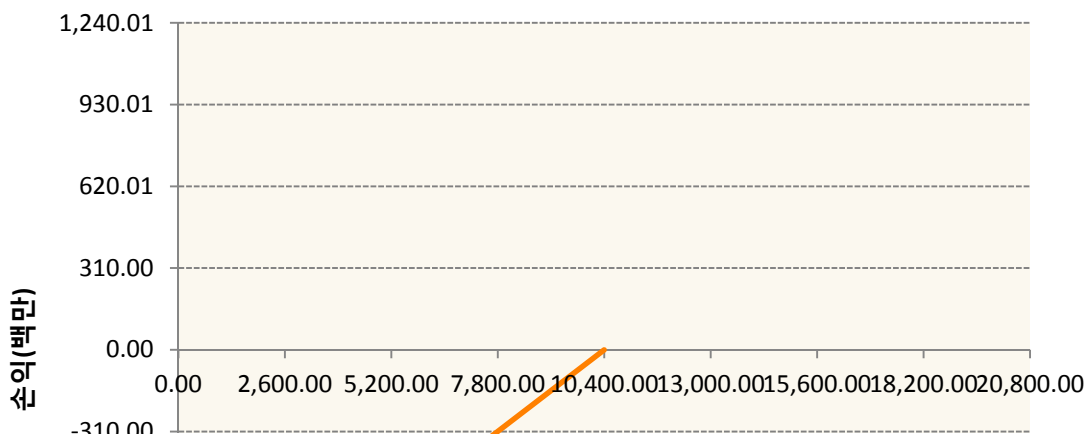


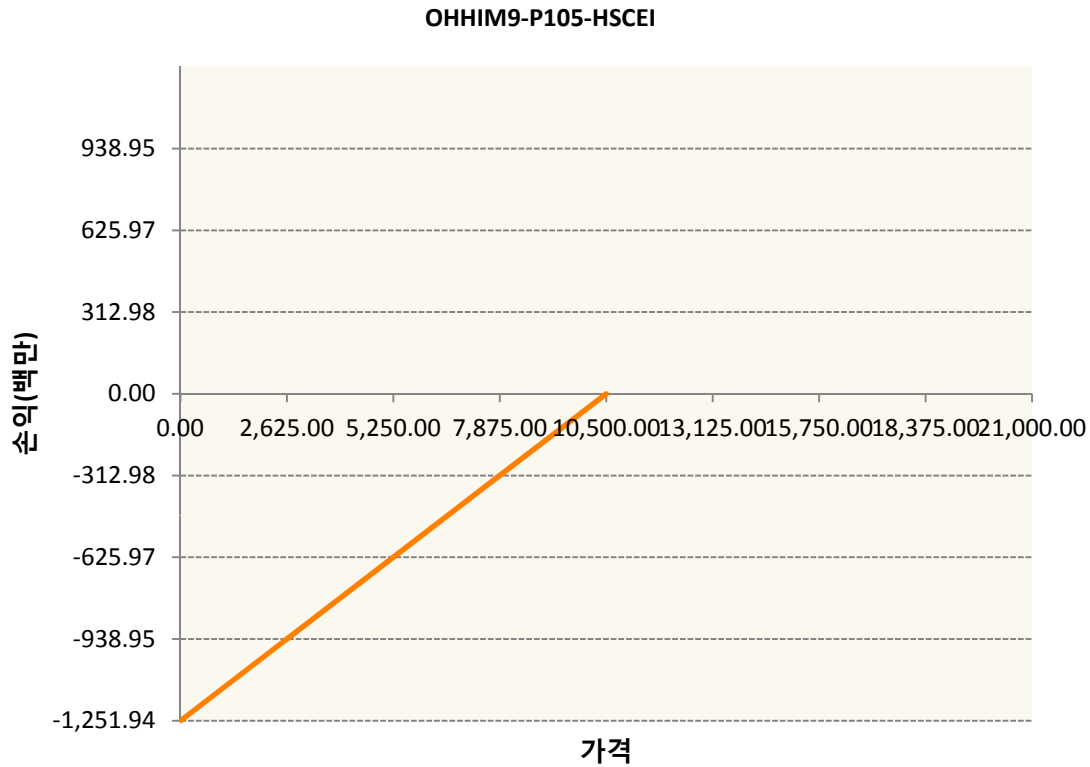
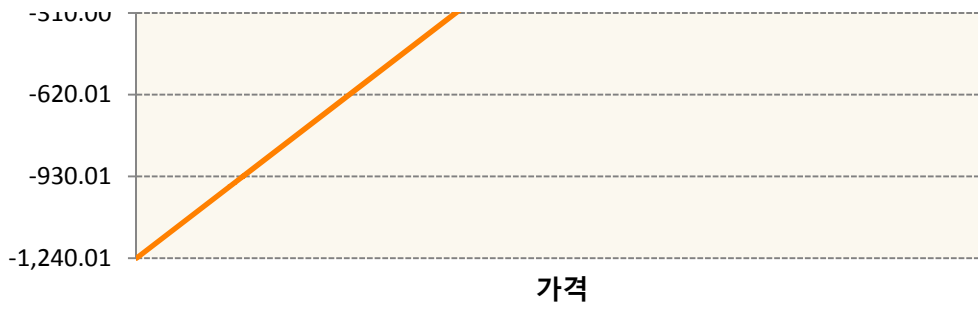


OHHIM9-C105-HSCEI



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)
	656

공시일	2019-06-24
기준일	2019-06-21

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

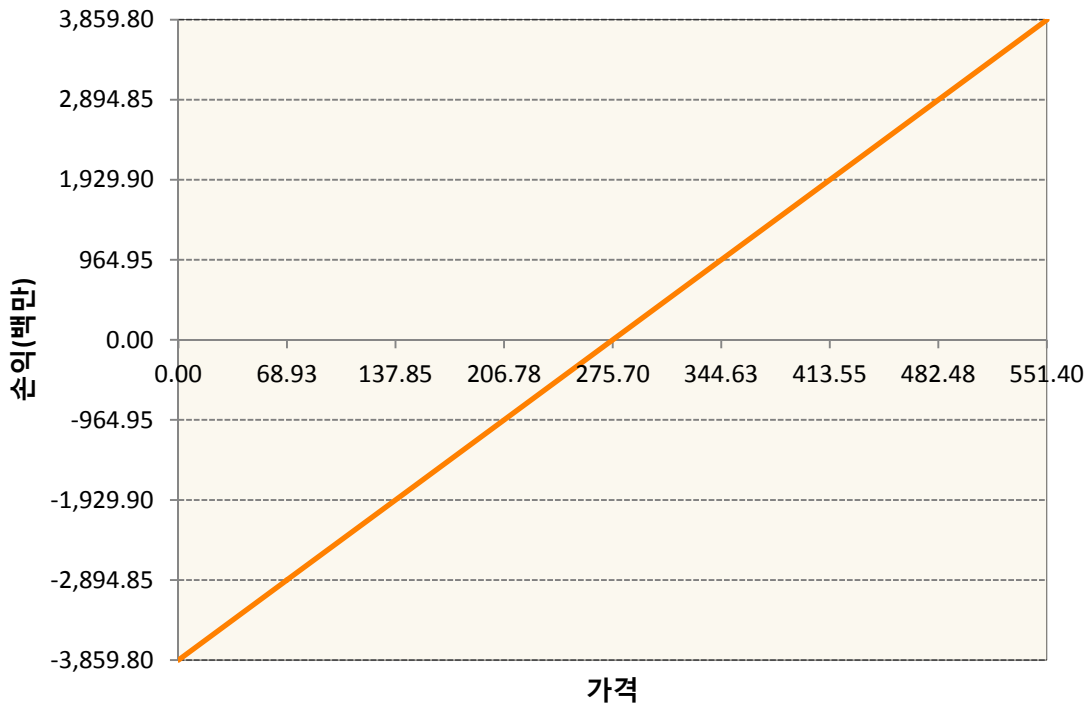
1. 계약금액

(단위:백만원)

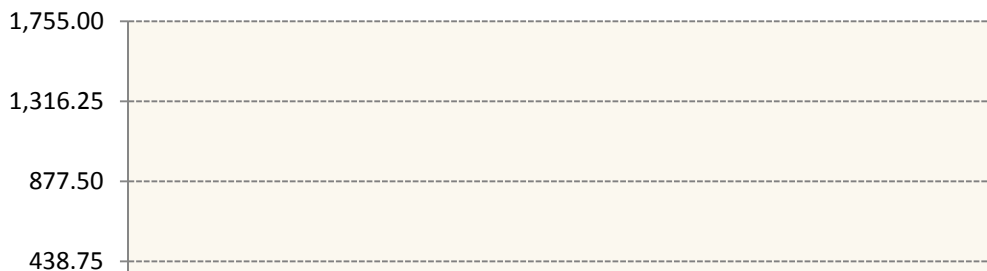
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,860	0	3,860	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	21,555	-21,555	장내

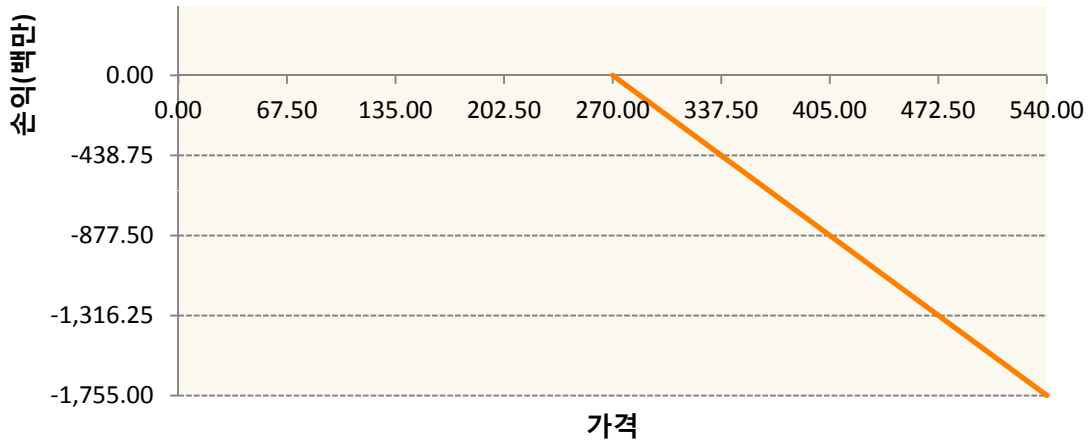
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

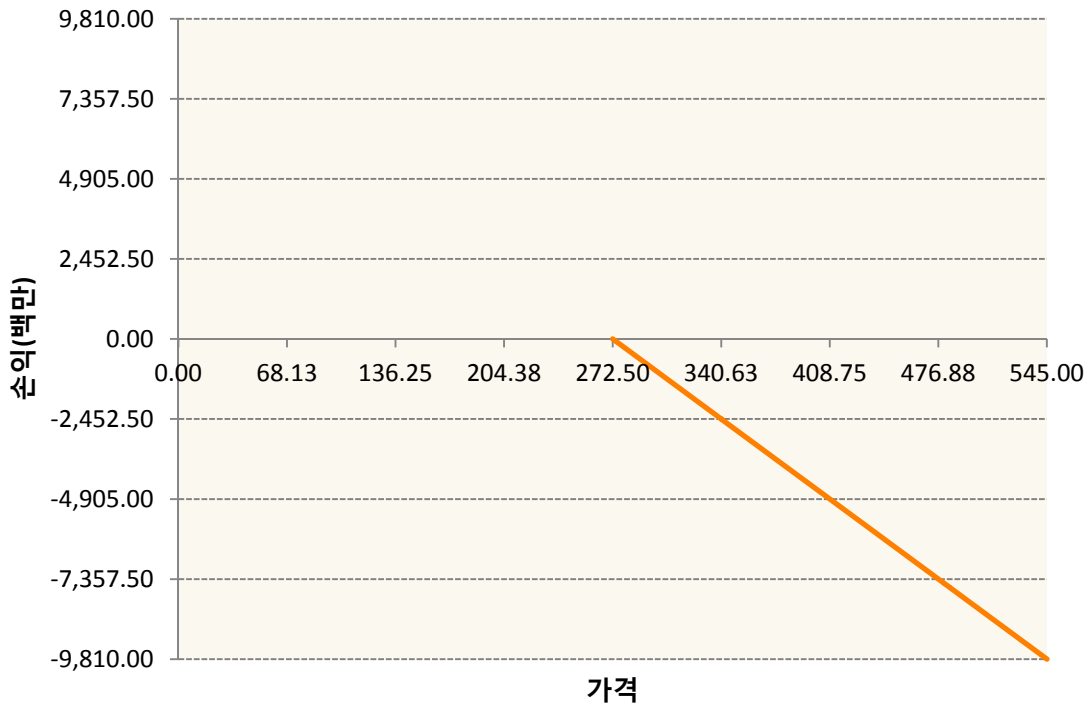


KR4201P72700-2019-07 콜270

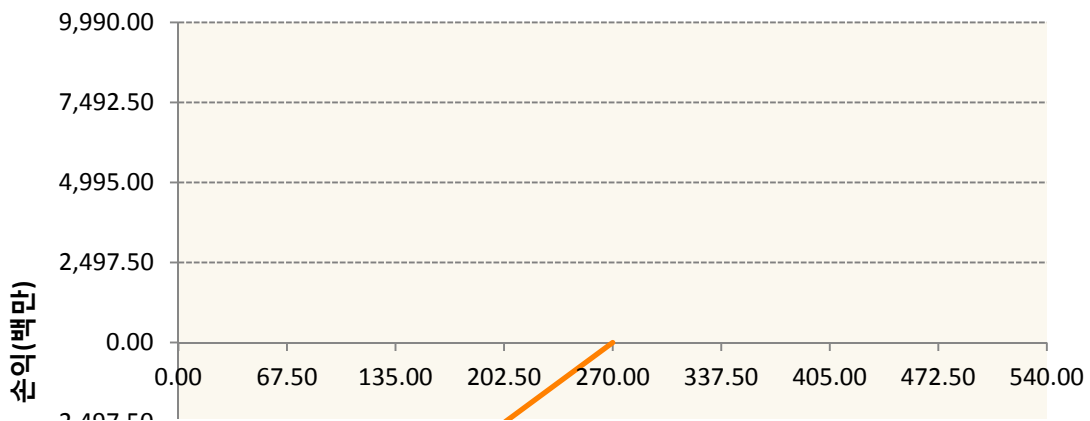




KR4201P72726-2019-07 콜272.5



KR4301P72708-2019-07 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,177
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177	
-5.33%	-784	-784	-784	-784	-784	-784	-784	
-2.67%	-392	-392	-392	-392	-392	-392	-392	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	392	392	392	392	392	392	392	
5.33%	784	784	784	784	784	784	784	
8.00%	1,177	1,177	1,177	1,177	1,177	1,177	1,177	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						595
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-595	-595	-595	-595	-595	-595	-595	
-5.33%	-397	-397	-397	-397	-397	-397	-397	
-2.67%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	198	198	198	198	198	198	198	
5.33%	397	397	397	397	397	397	397	
8.00%	595	595	595	595	595	595	595	
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						122
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	59	58	56	54	52	50	48
-5.33%	52	50	47	44	41	38	35
-2.67%	37	33	30	26	23	19	16
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	-27	-29	-32	-34	-37	-40	-43
5.33%	-70	-71	-73	-75	-76	-78	-81
8.00%	-117	-117	-118	-119	-120	-121	-122
KR4201P72726 2019-07 콜272.5							651
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	279	273	267	258	249	239	228
-5.33%	252	240	227	213	199	183	168
-2.67%	184	166	148	130	111	93	74
0%	57	38	19	0	-19	-38	-58
2.67%	-130	-144	-159	-175	-192	-209	-226
5.33%	-359	-367	-377	-388	-400	-413	-426
8.00%	-611	-614	-619	-626	-633	-642	-651
KR4301P72708 2019-07 풋270							573
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-564	-564	-565	-566	-568	-570	-573
-5.33%	-299	-303	-308	-314	-320	-326	-333
-2.67%	-83	-94	-104	-114	-124	-135	-145
0%	25	17	9	0	-9	-18	-28
2.67%	51	49	46	42	38	33	28
5.33%	53	53	53	52	51	49	47
8.00%	53	53	53	53	53	53	52

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

(단위:백만원)

3,379

공시일	2019-06-24
기준일	2019-06-21

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

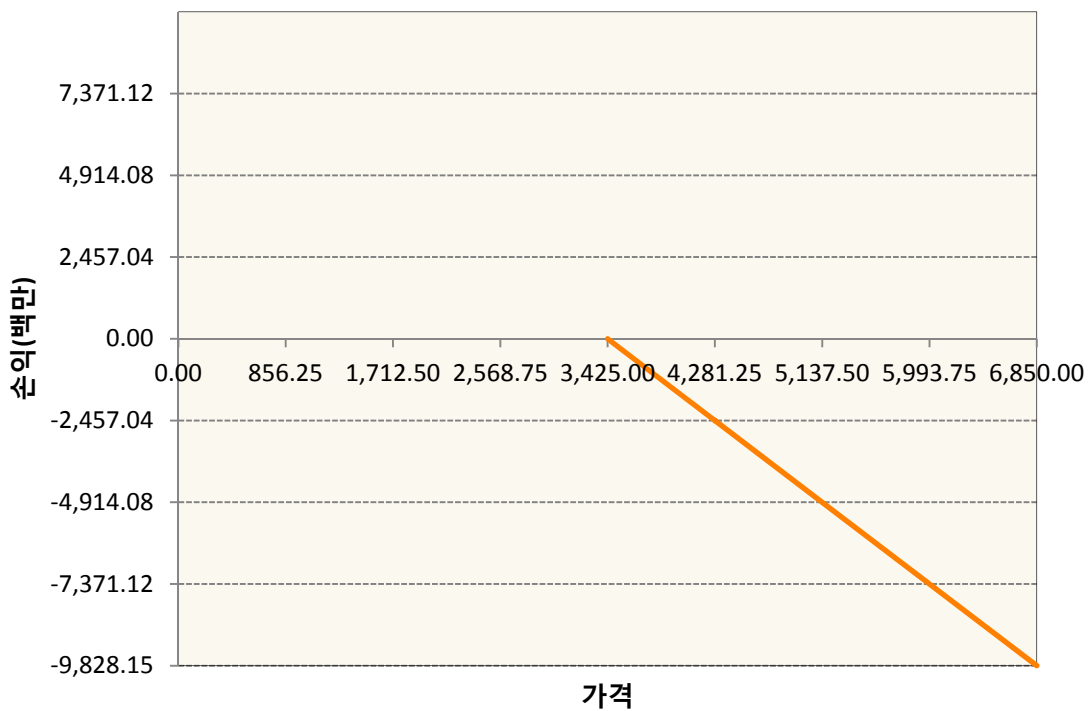
1. 계약금액

(단위:백만원)

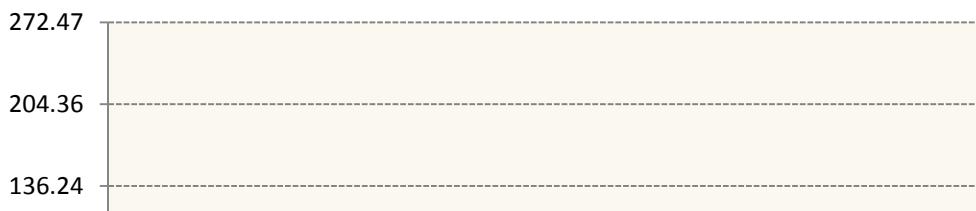
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,795	0	3,795	
누계	유가증권	스왑	55,718	0	55,718	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,201	-20,201	장내
누계	통화	선도	0	18,428	-18,428	장외

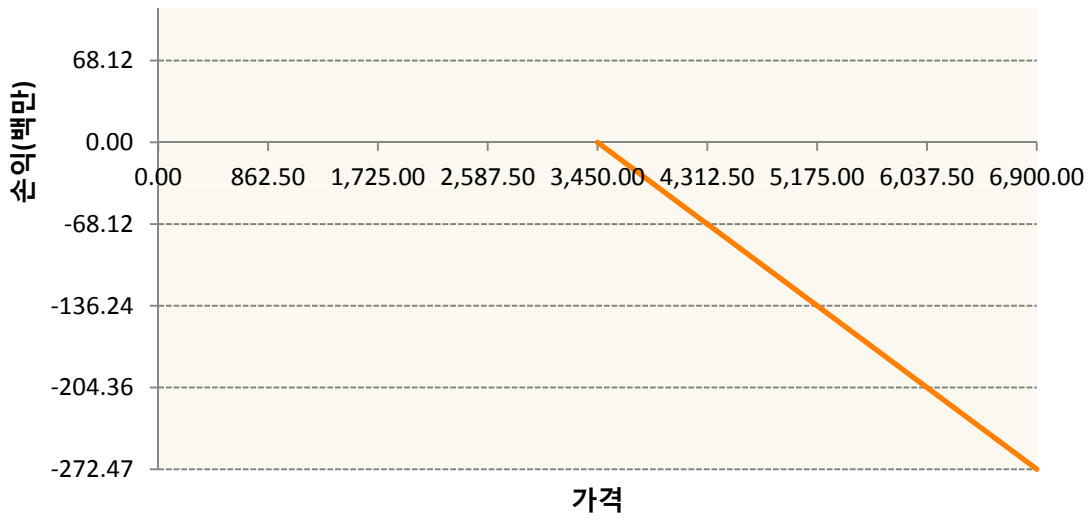
2. 만기시점의 손익구조

OESXM9-C3425-EURO STOXX 50

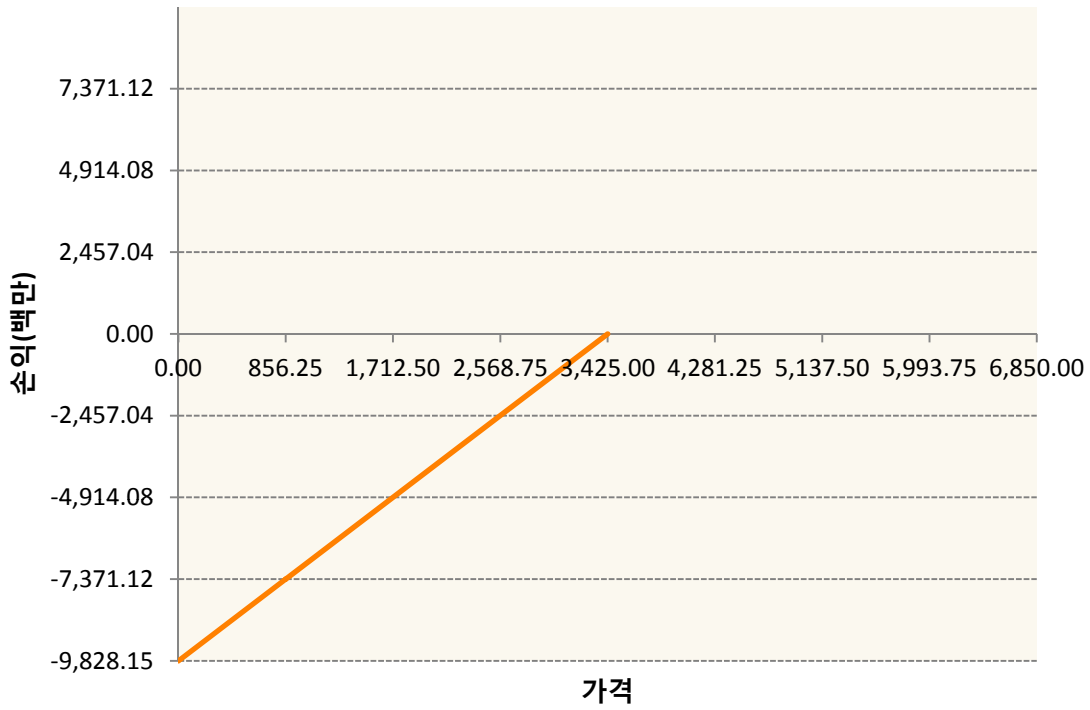


OESXM9-C3450-EURO STOXX 50

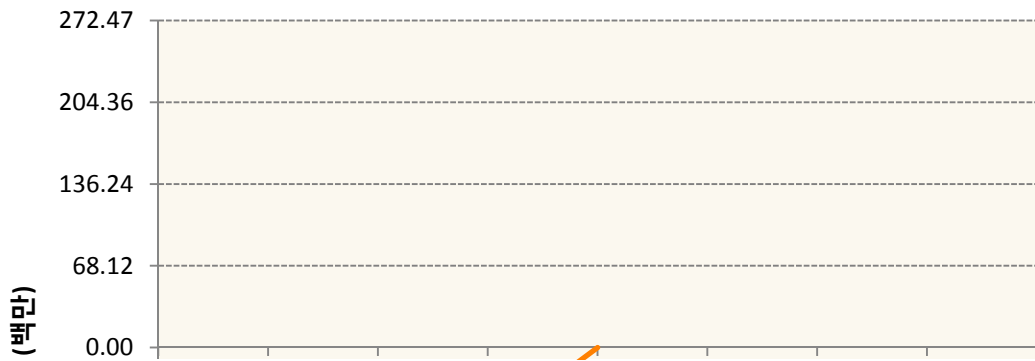


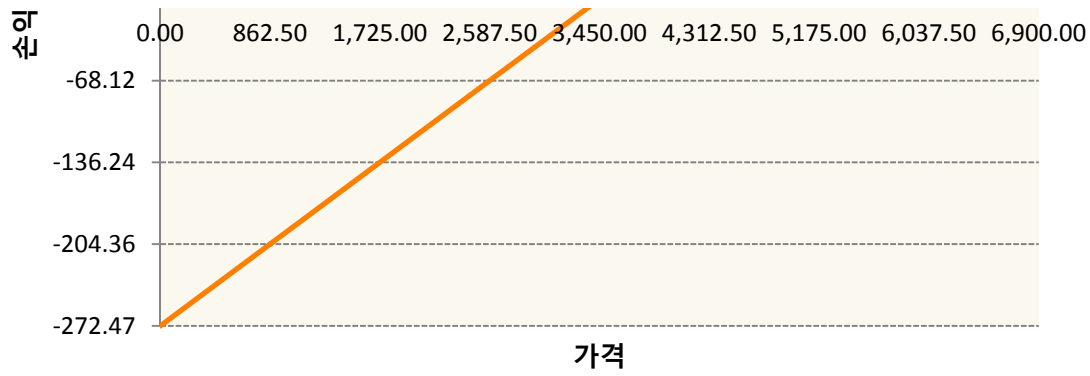


OESXM9-P3425-EURO STOXX 50

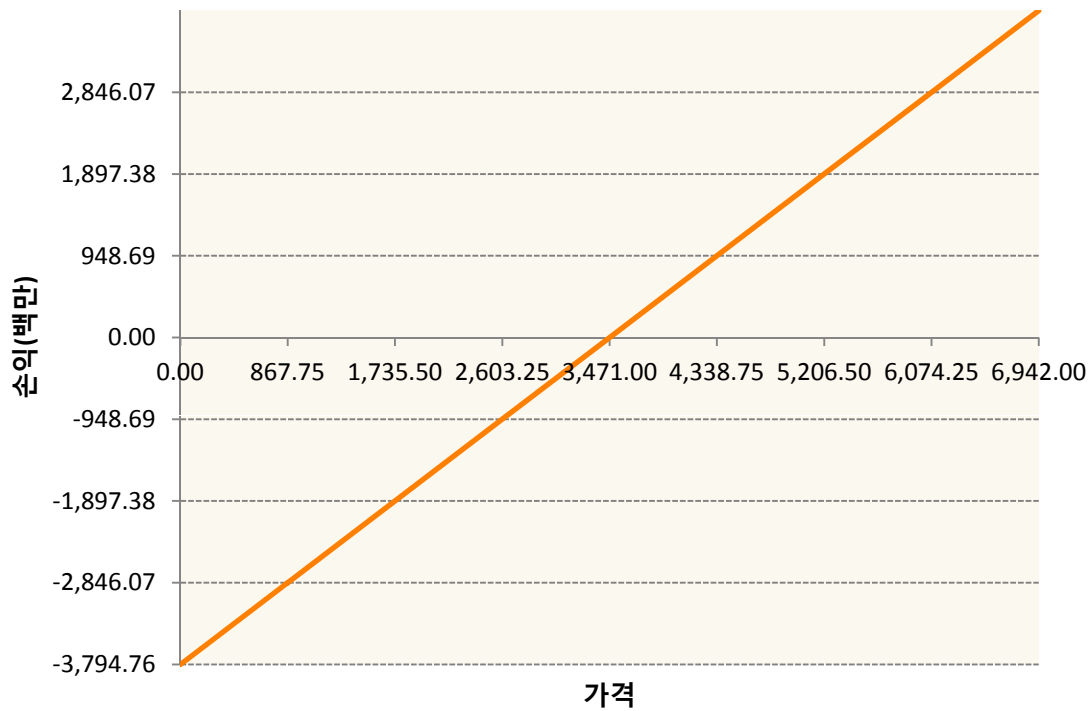


OESXM9-P3450-EURO STOXX 50





VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	51
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	842
FX21019J01: KRW/EUR 28-06-19E	211
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	421
OESXM9-C3·EURO STOXX 50	786
OESXM9-C3·EURO STOXX 50	22
OESXM9-P3·EURO STOXX 50	786
OESXM9-P3·EURO STOXX 50	22
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	304

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

(단위:백만원)

2,157

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

(단위:백만원)

1,045

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

(단위:백만원)

92

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

(단위:백만원)

134

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

(단위:백만원)

42

공시일	2019-06-24
기준일	2019-06-21

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

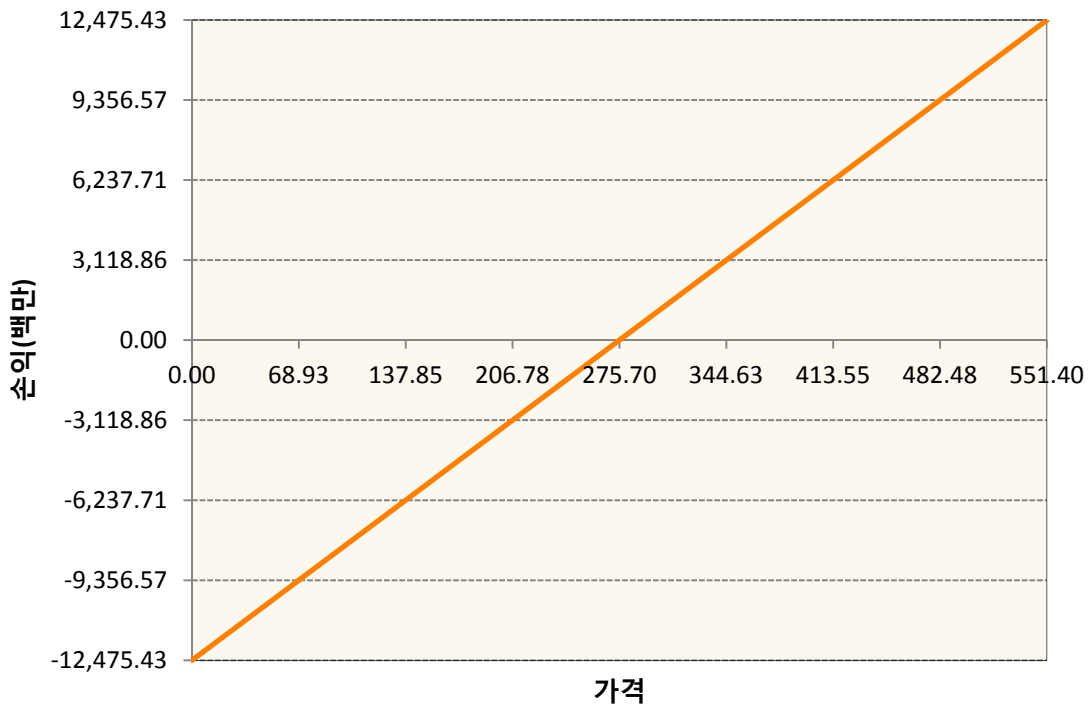
1. 계약금액

(단위:백만원)

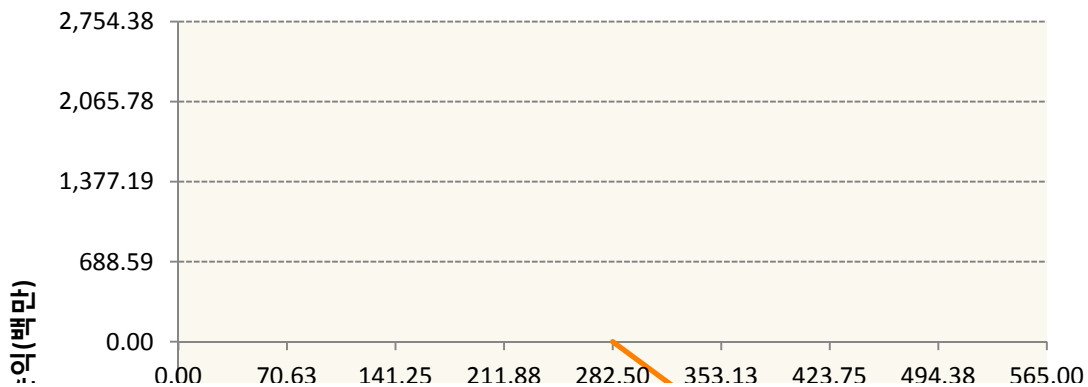
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,475	0	12,475	장내
누계	유가증권	옵션	1,084	22,206	-21,121	장내

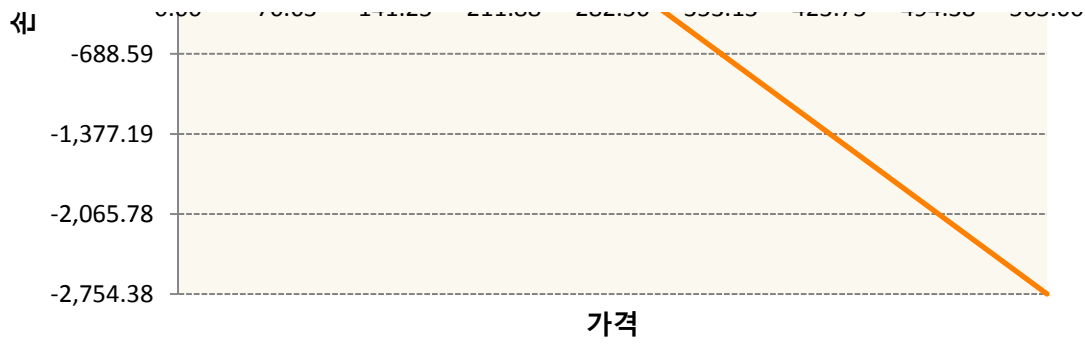
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

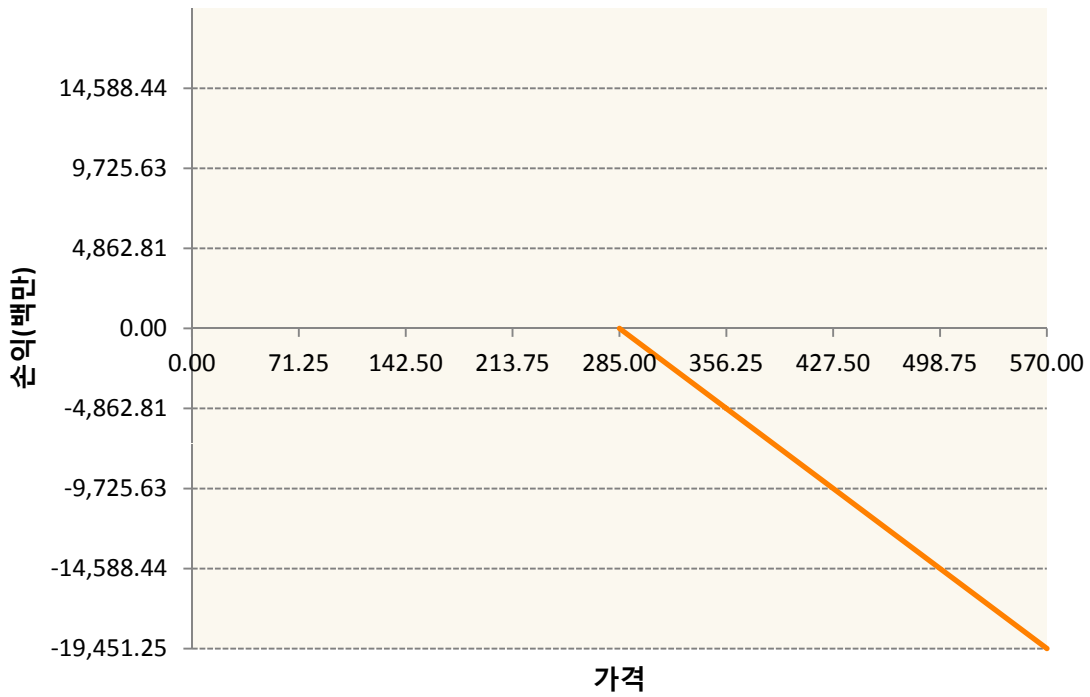


KR4201P72825-2019-07 콜282.5

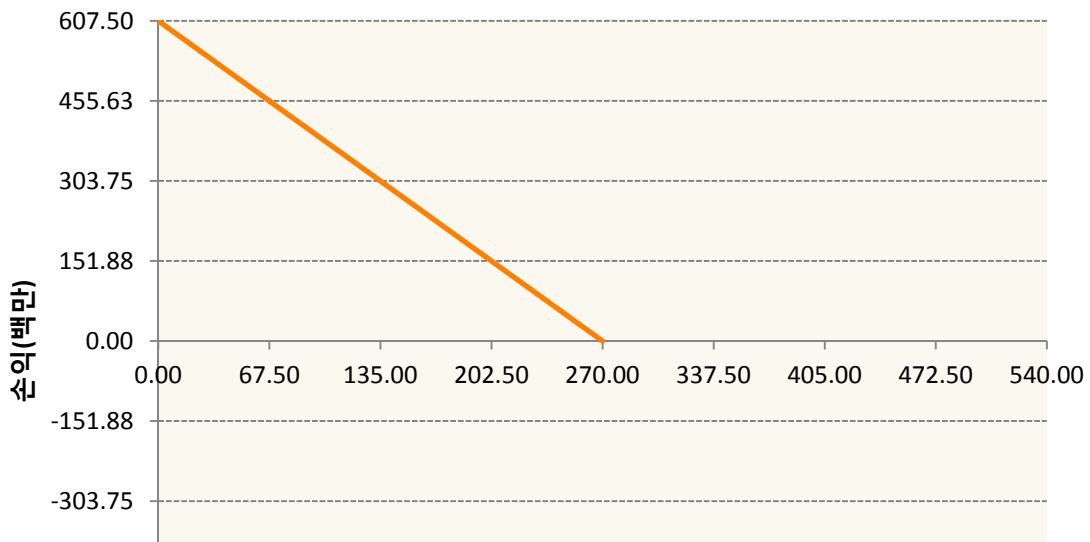


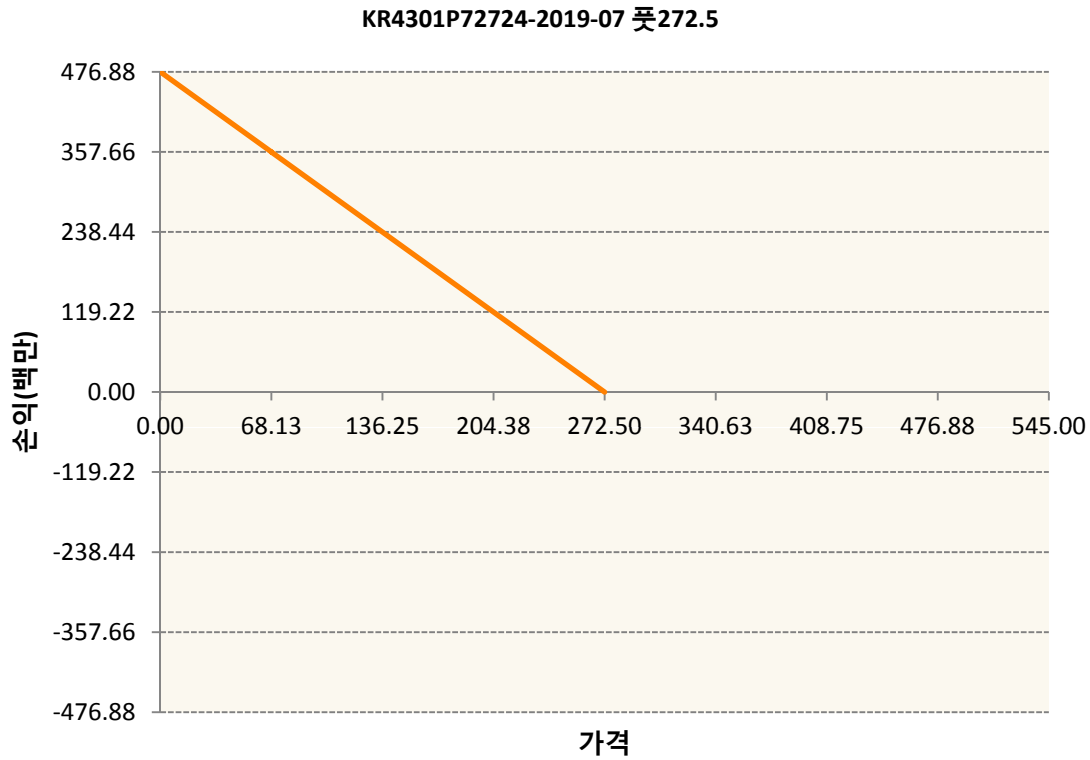
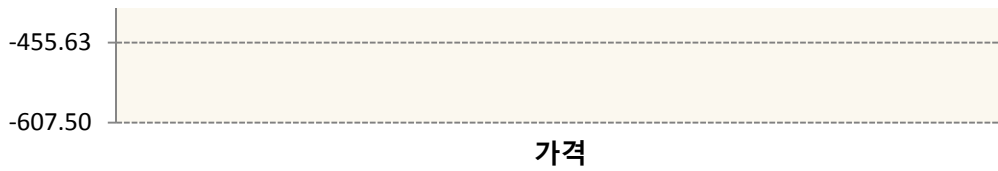


KR4201P72858-2019-07 콜285



KR4301P72708-2019-07 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						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%	-665	-665	-665	-665	-665	-665	-665	
-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%	665	665	665	665	665	665	665	
8.00%	997	997	997	997	997	997	997	
KR4201P72825		2019-07 콜282.5						140
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	35	35	34	33	32	31	29	
-5.33%	34	33	31	29	27	24	22	
-2.67%	28	26	22	19	15	12	7	

공시일	2019-06-24
기준일	2019-06-21

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	349	0	349	
누계	유가증권	수익증권	19,035	0	19,035	

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	2019-06-24
기준일	2019-06-21

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	698	0	698	
누계	유가증권	수익증권	60,272	0	60,272	

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	2019-06-24
기준일	2019-06-21

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	4,656	0	4,656	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	399,215	0	399,215	
누계	통화	선도	0	437,222	-437,222	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		931
FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E		372
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		74
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		980
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E		1,006
FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E		466
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		466
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		372
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		782
FX21019K02 KRW/USD 24-06-19E		372
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E		931
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E		1,490
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E		279
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E		1,211
FX21019K04 KRW/USD 28-06-19E		1,266
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		652
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		559
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		745
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		745
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		466
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		279
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		931
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		186
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		866
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		1,034
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		1,862

FX21019M00 KRW/USD 15-07-19E	466
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	372
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	652
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	931
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	652
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	652
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E	559
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E	2,980
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E	2,235
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E	279
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E	279
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	782
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	624
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	466
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E	1,862
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E	1,862

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

(단위:백만원)

11,716

공시일	2019-06-24
기준일	2019-06-21

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

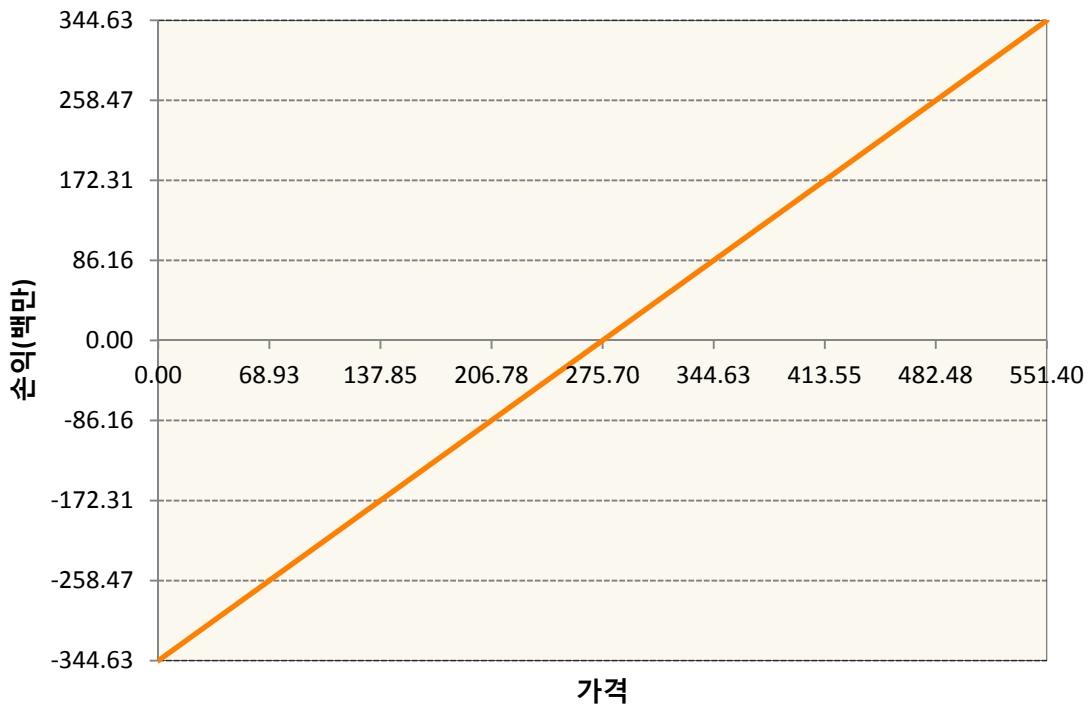
1. 계약금액

(단위:백만원)

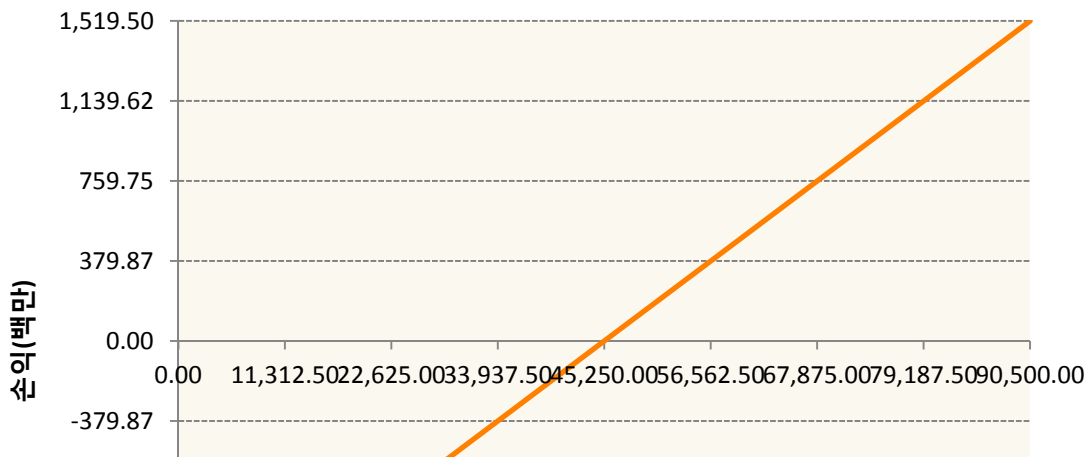
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,864	0	1,864	장내

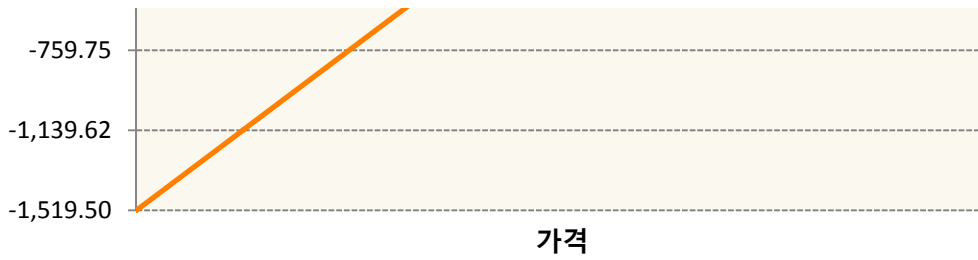
2. 만기시점의 손익구조

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						123
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123	
-5.33%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82	
-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%	82	82	82	82	82	82	82	
8.00%	123	123	123	123	123	123	123	

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

163

공시일	2019-06-24
기준일	2019-06-21

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

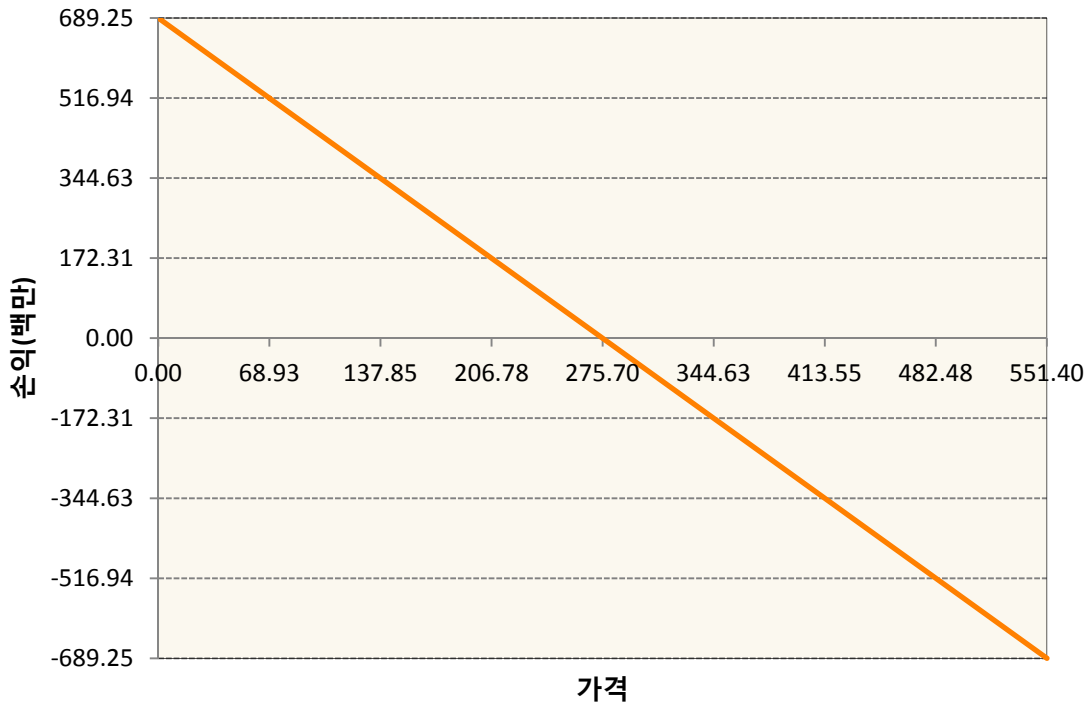
1. 계약금액

(단위:백만원)

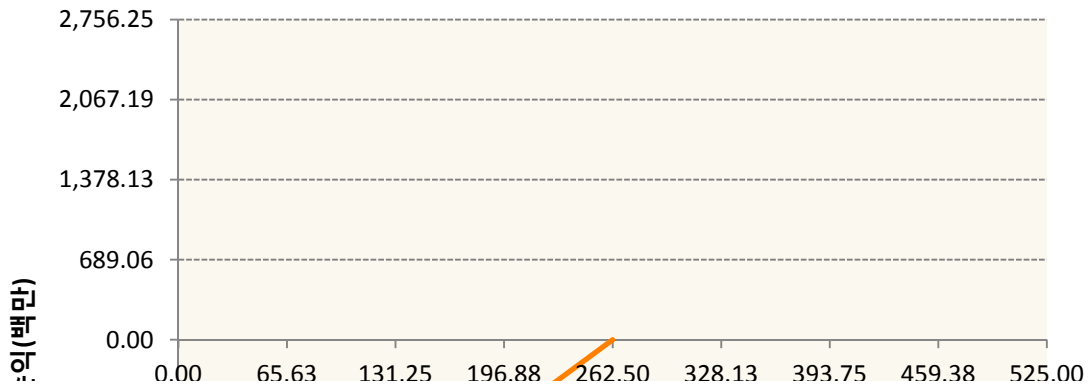
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	689	-689	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,419	-3,419	장내

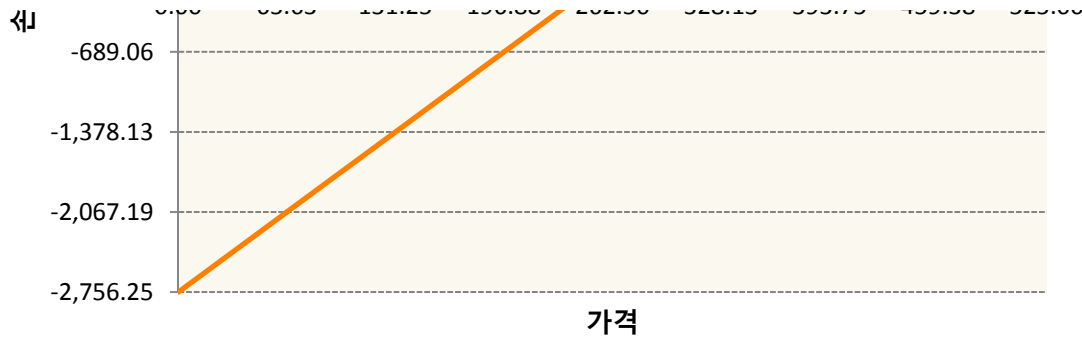
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

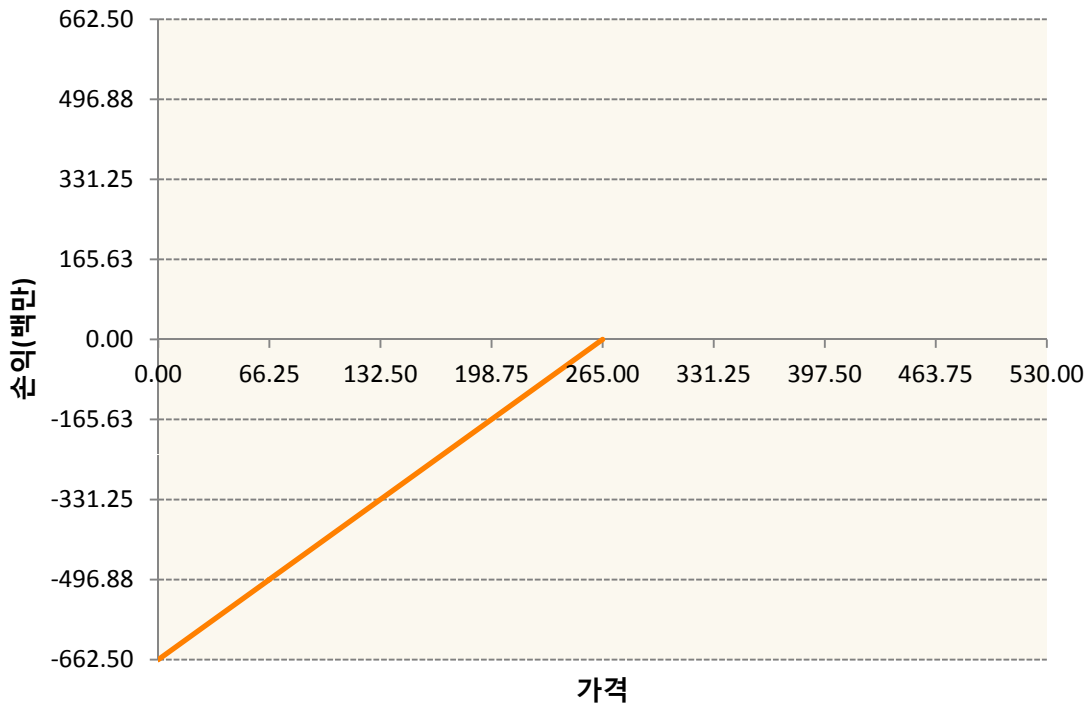


KR4301P72625-2019-07 풋262.5





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						105
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-96	-97	-98	-99	-101	-103	-105
-5.33%	-34	-37	-40	-43	-46	-49	-51
-2.67%	-4	-7	-9	-11	-14	-16	-19
0%	2	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	3	3	3	2	2	2	1
5.33%	3	3	3	3	3	3	2
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

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	-28	-29	-29	-29	-30
-5.33%	-12	-12	-13	-14	-14	-15	-16
-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)

130

공시일	2019-06-24
기준일	2019-06-21

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	3,958	-3,958	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019M0:KRW/USD 24-07-19E	140
FX21019M0:KRW/USD 24-07-19E	177

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

(단위:백만원)

106

공시일	2019-06-24
기준일	2019-06-21

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

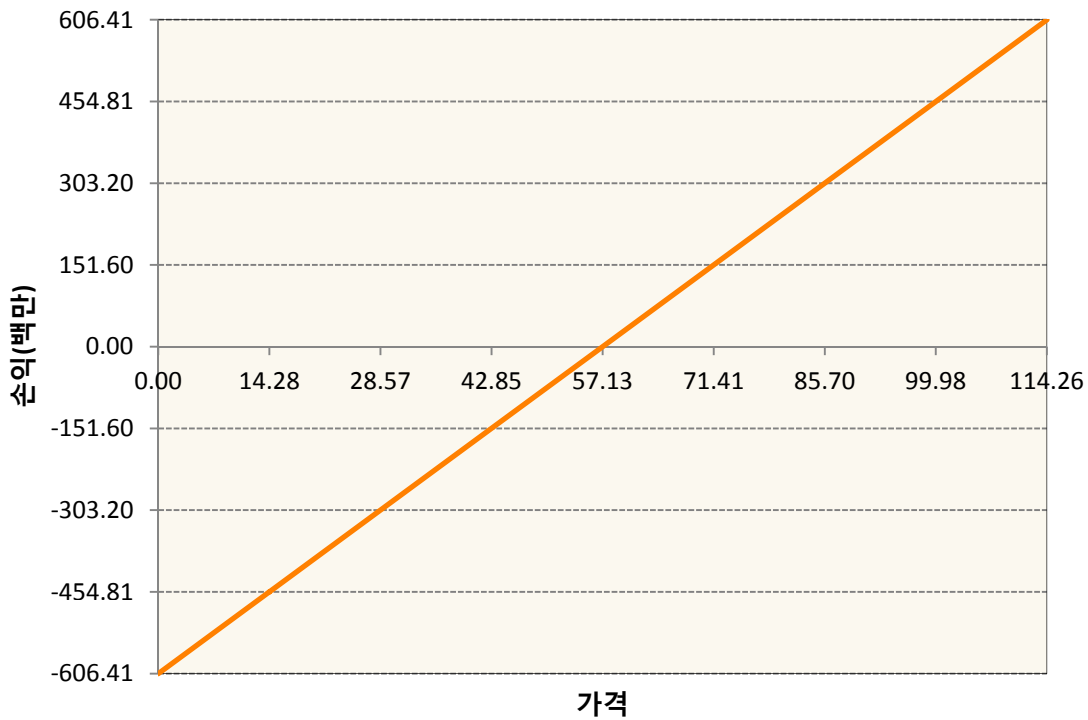
1. 계약금액

(단위:백만원)

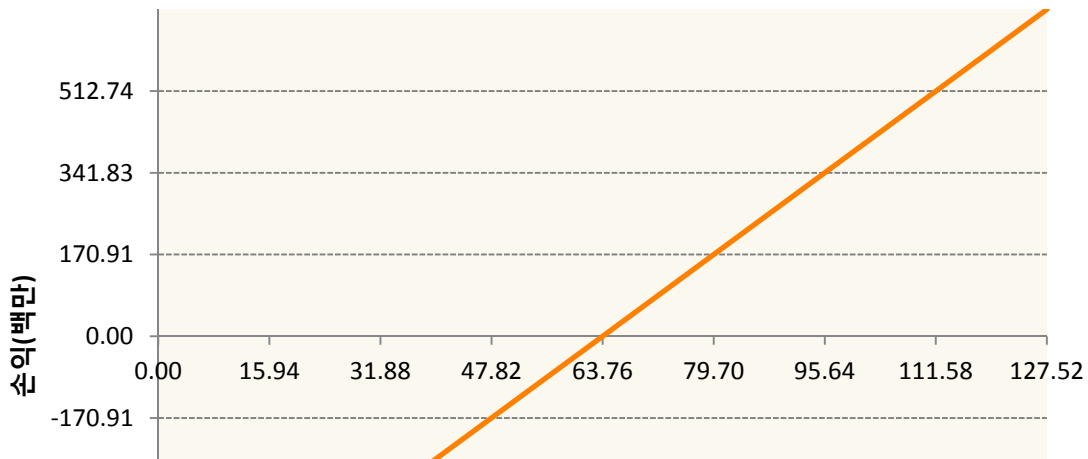
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,570	116	2,454	

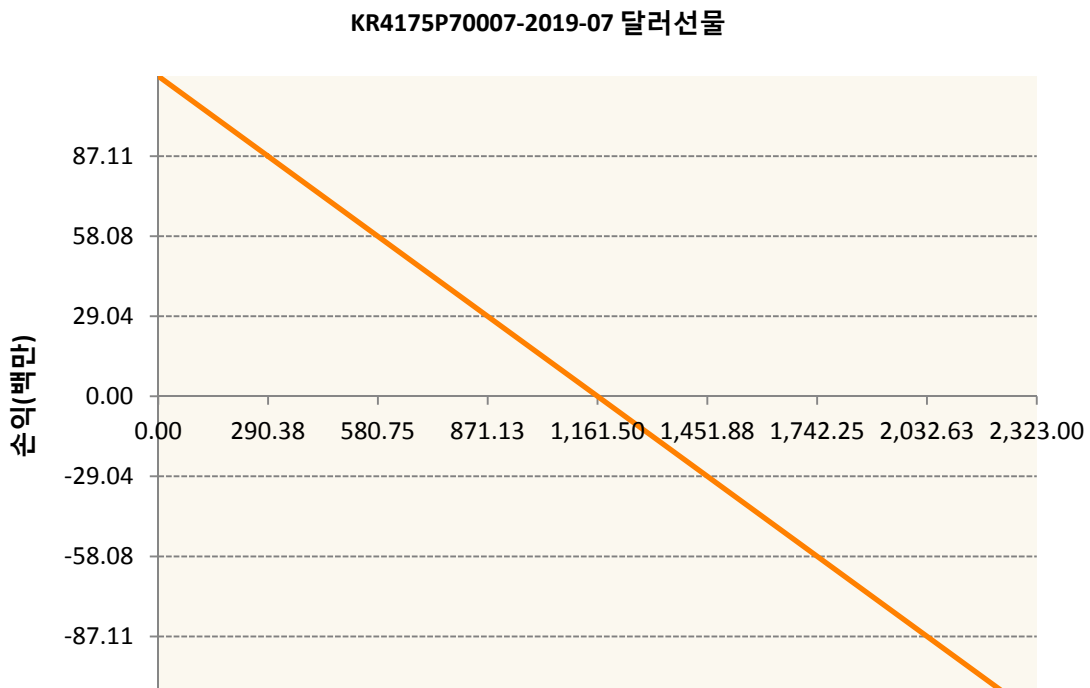
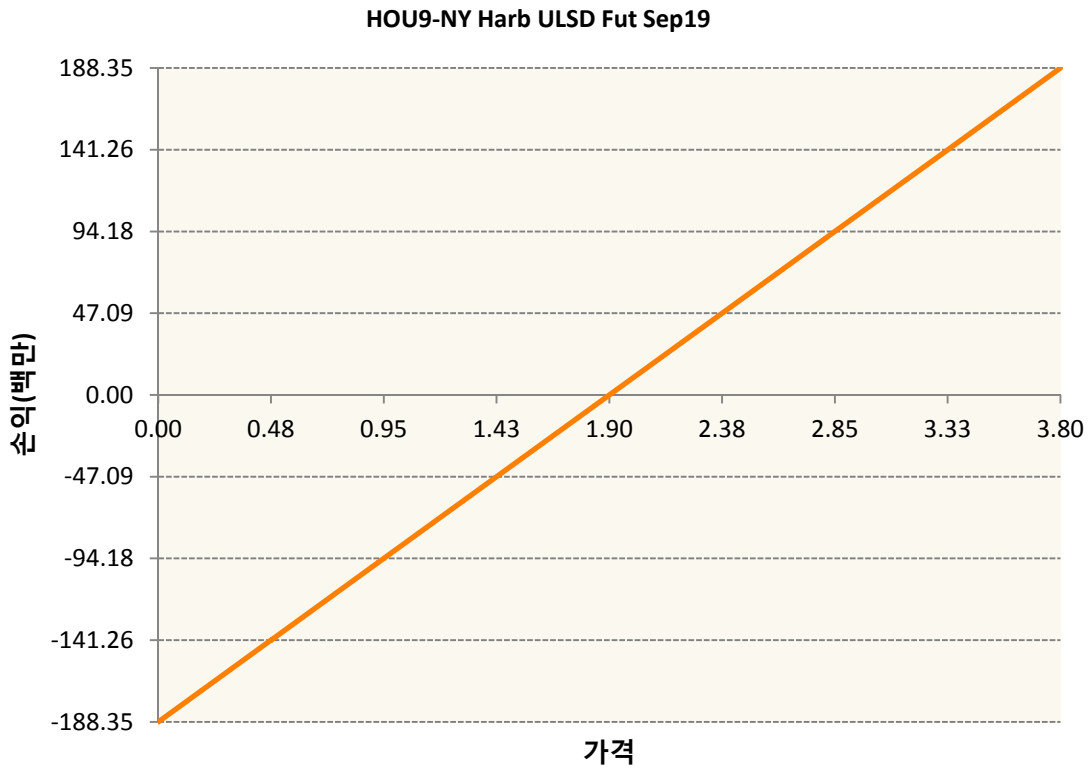
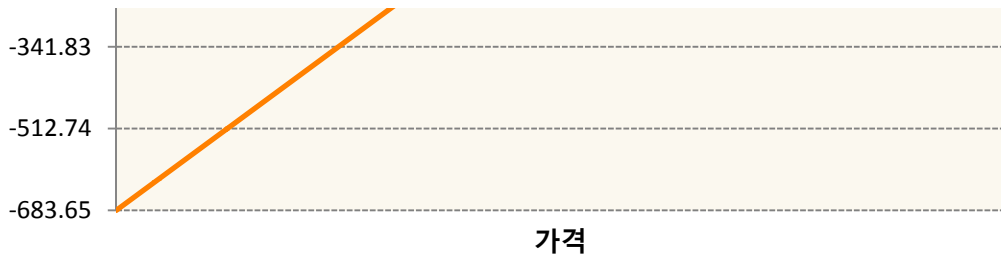
2. 만기시점의 손익구조

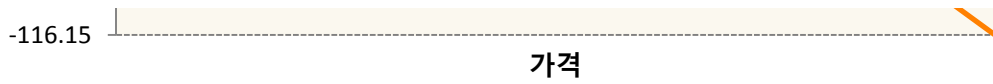
CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19



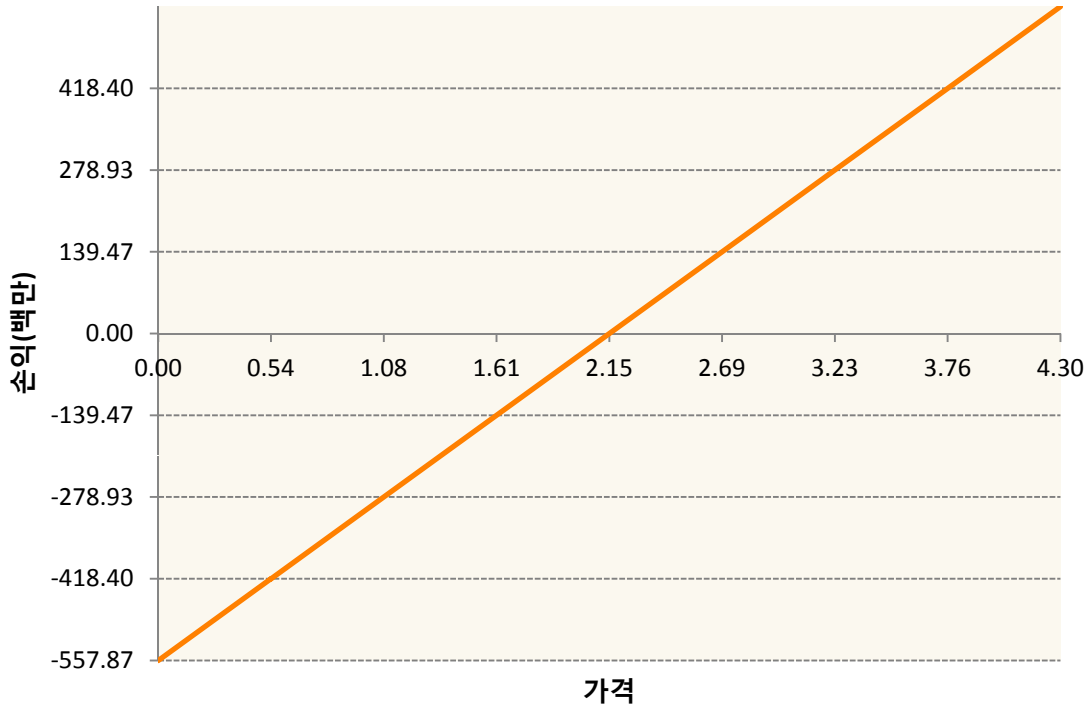
COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19



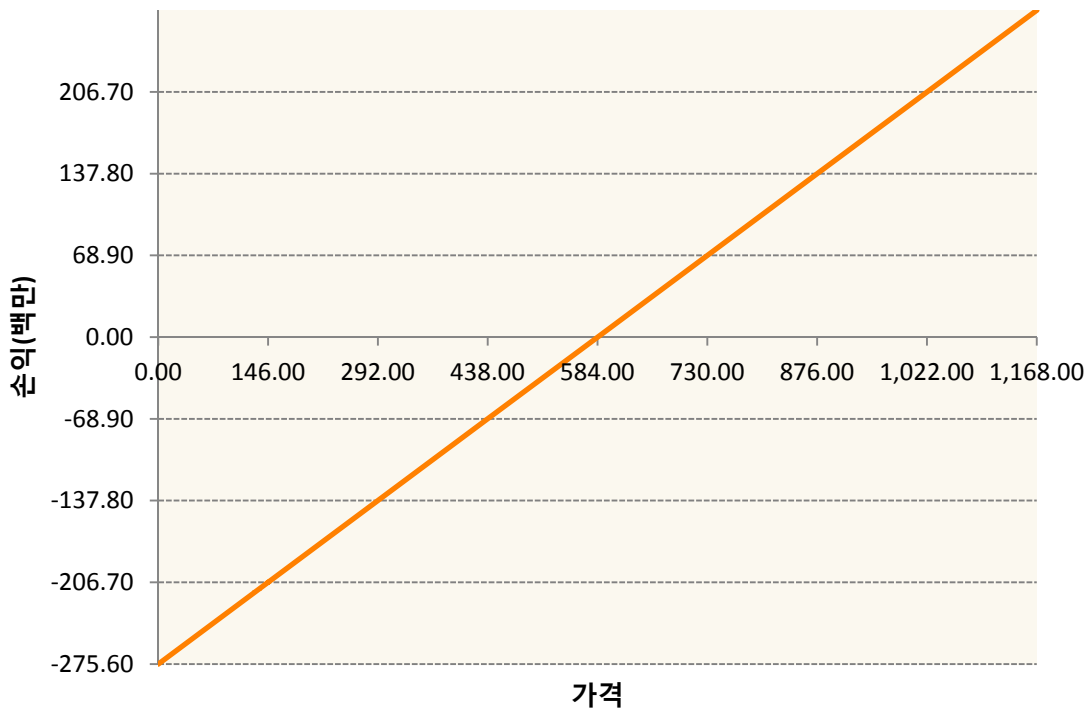




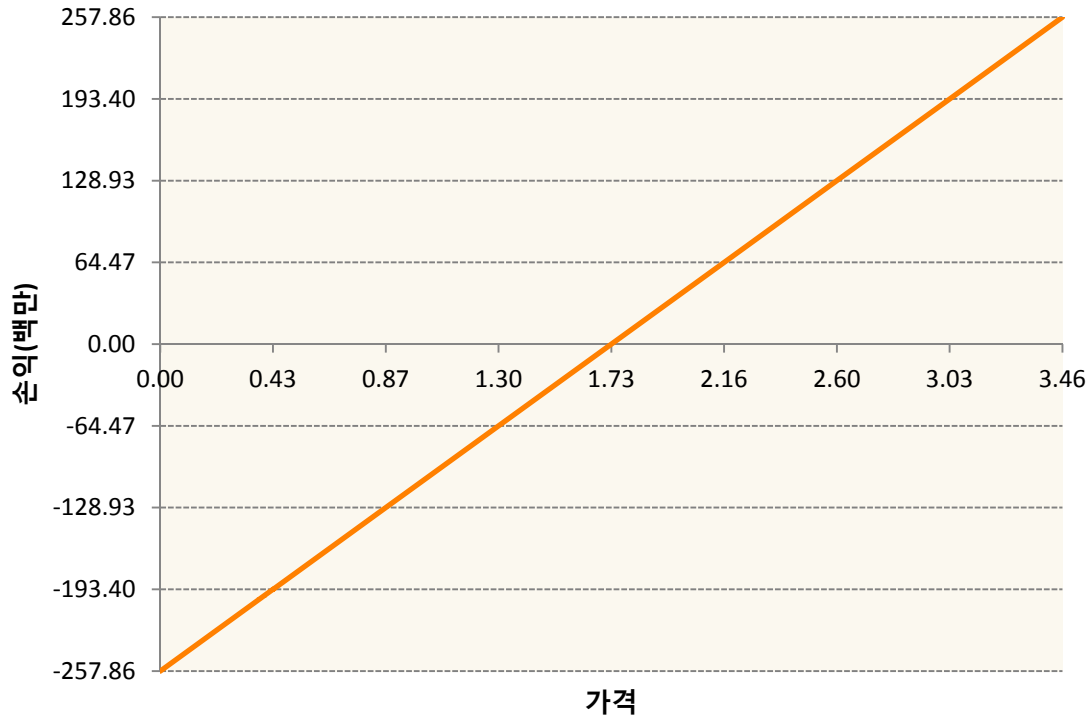
NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



QSU9-Low Su Gasoil G Sep19



XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	49
COU9	BRENT CRUDE FUTR Sep19	55
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	15
KR4175P700	2019-07 달러선물	9
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	45
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	22
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	21

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

(단위:백만원)

382

공시일	2019-06-24
기준일	2019-06-21

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

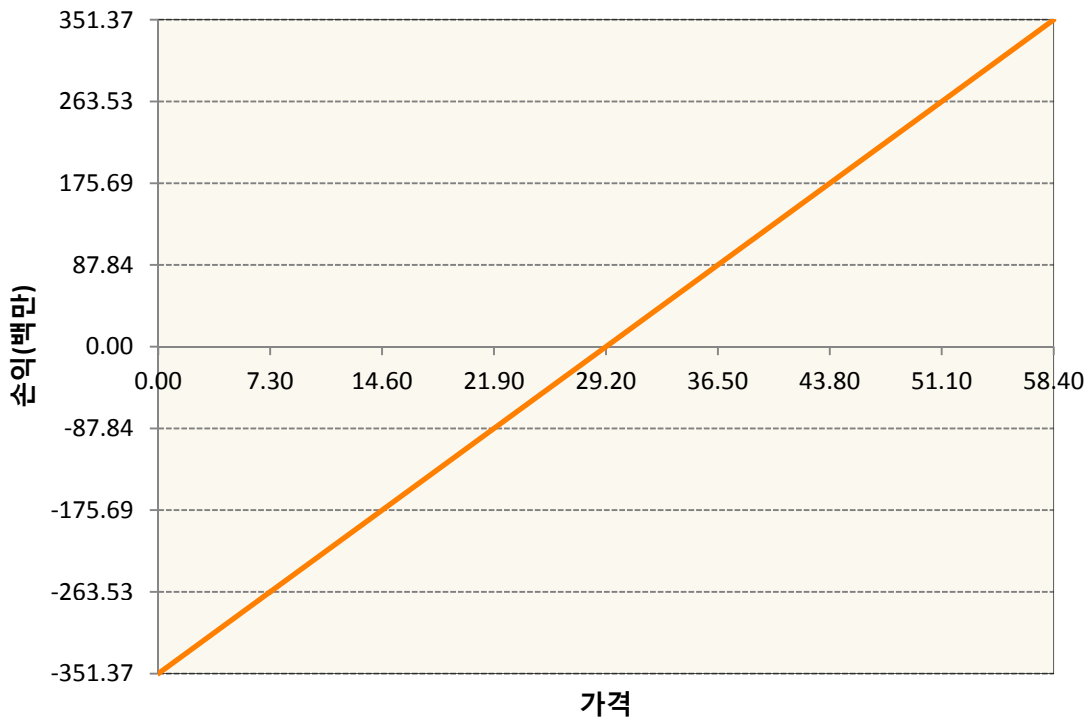
1. 계약금액

(단위:백만원)

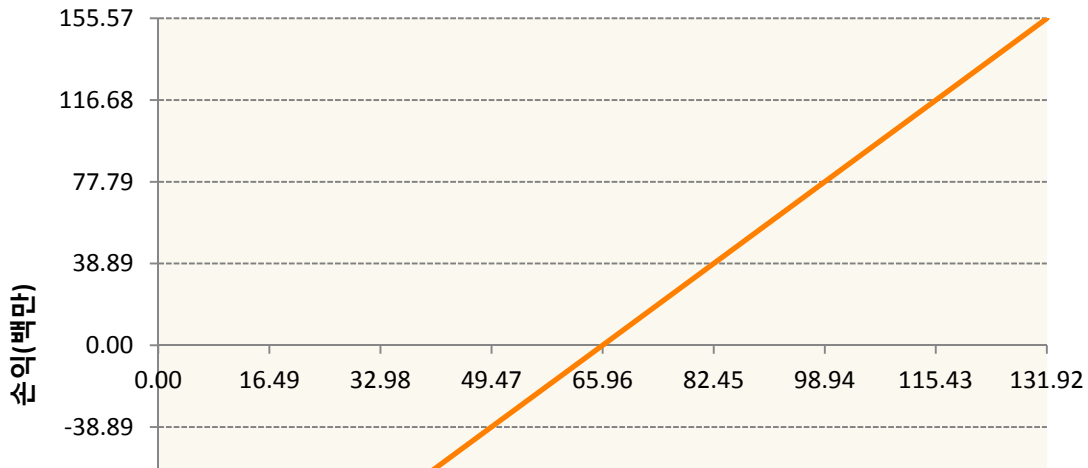
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,255	197	3,057	

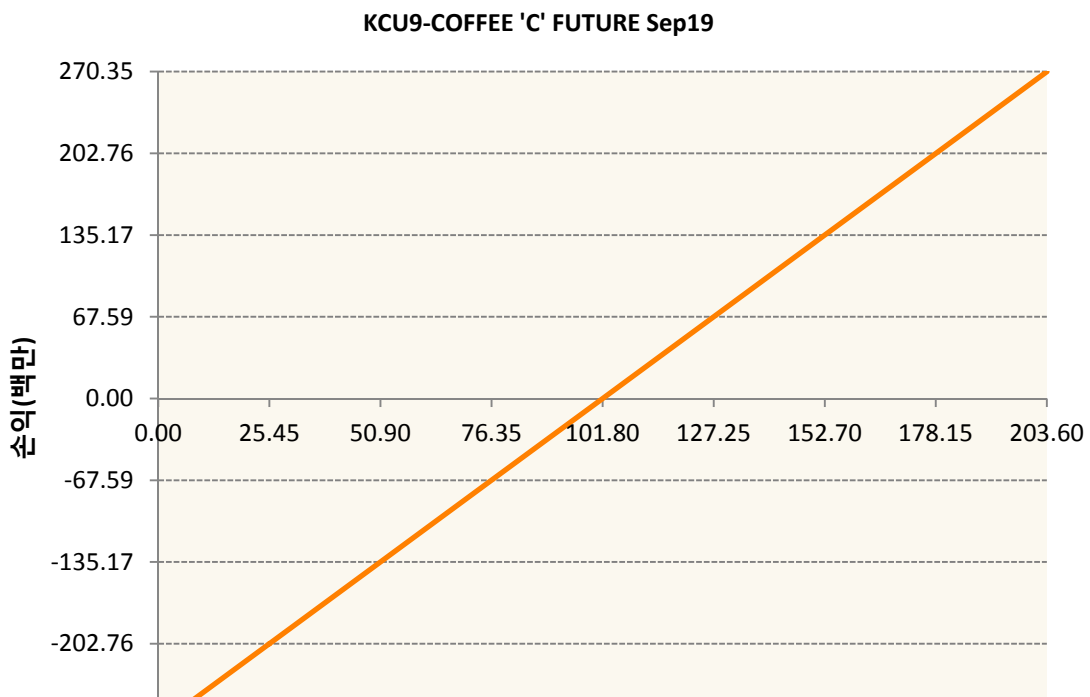
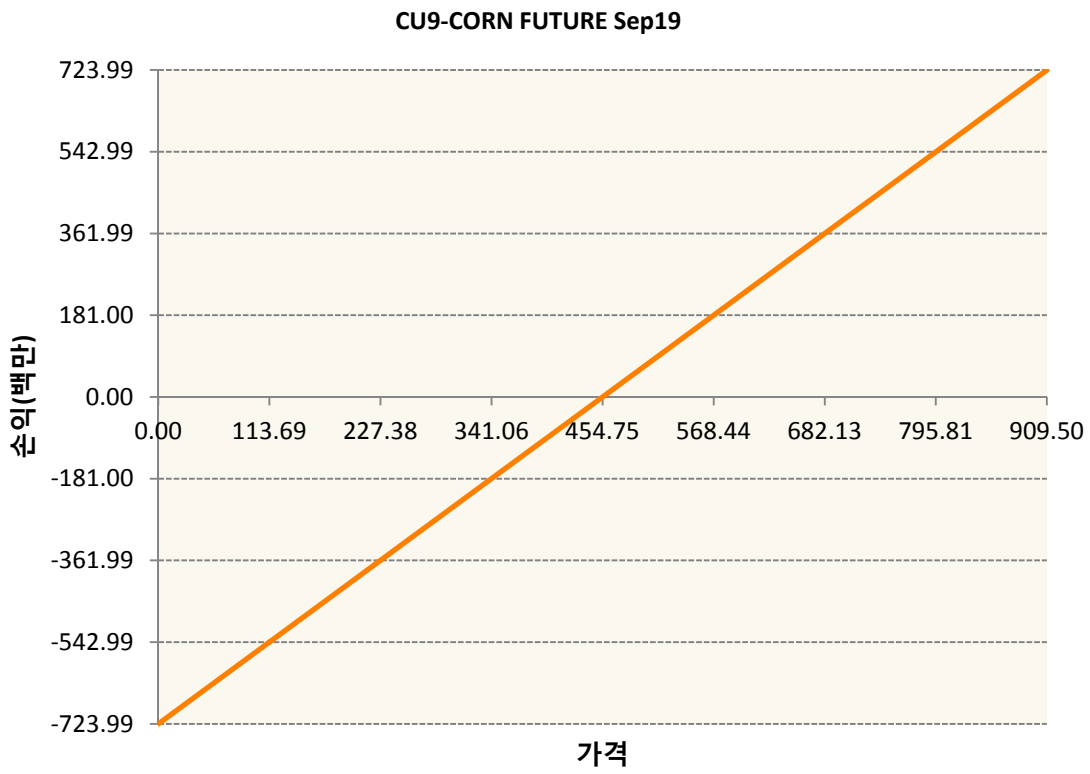
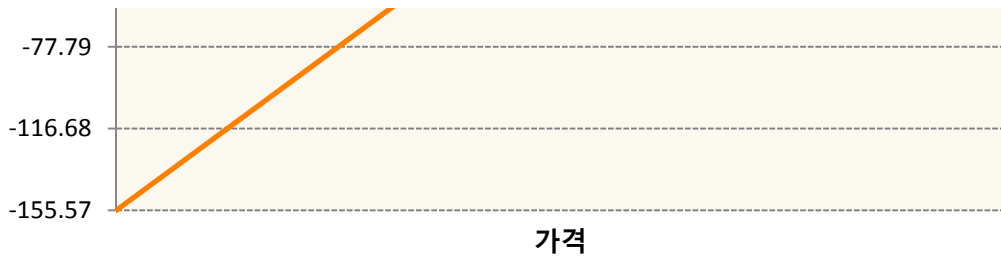
2. 만기시점의 손익구조

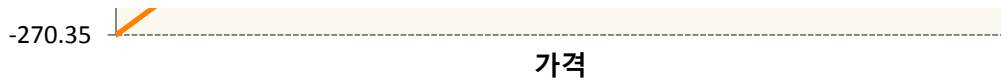
BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19



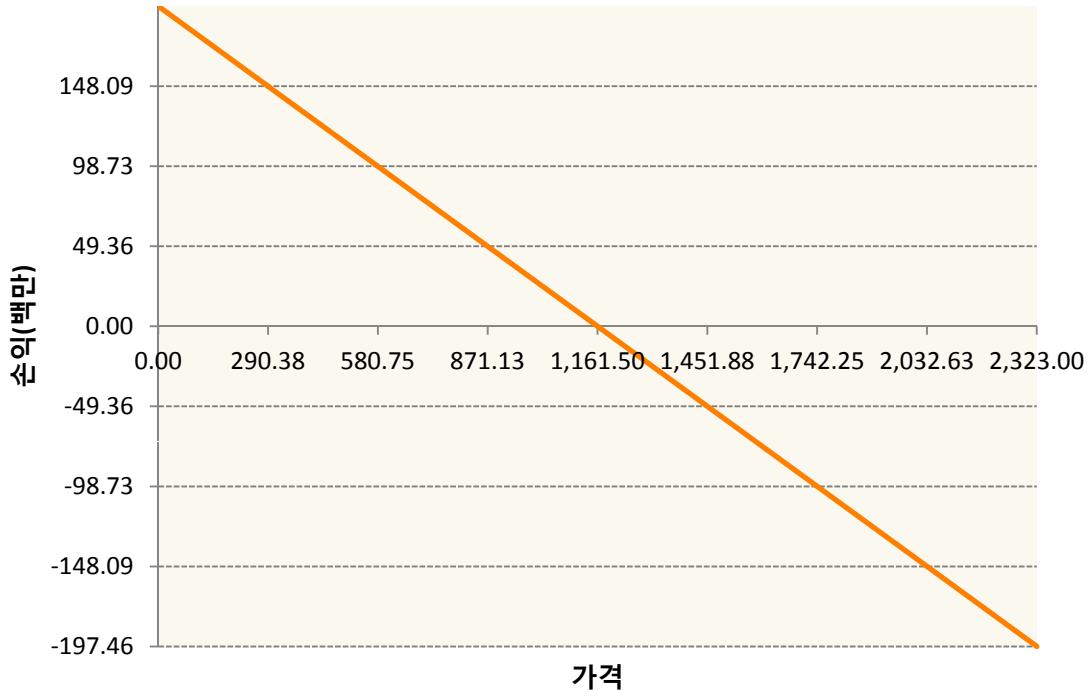
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



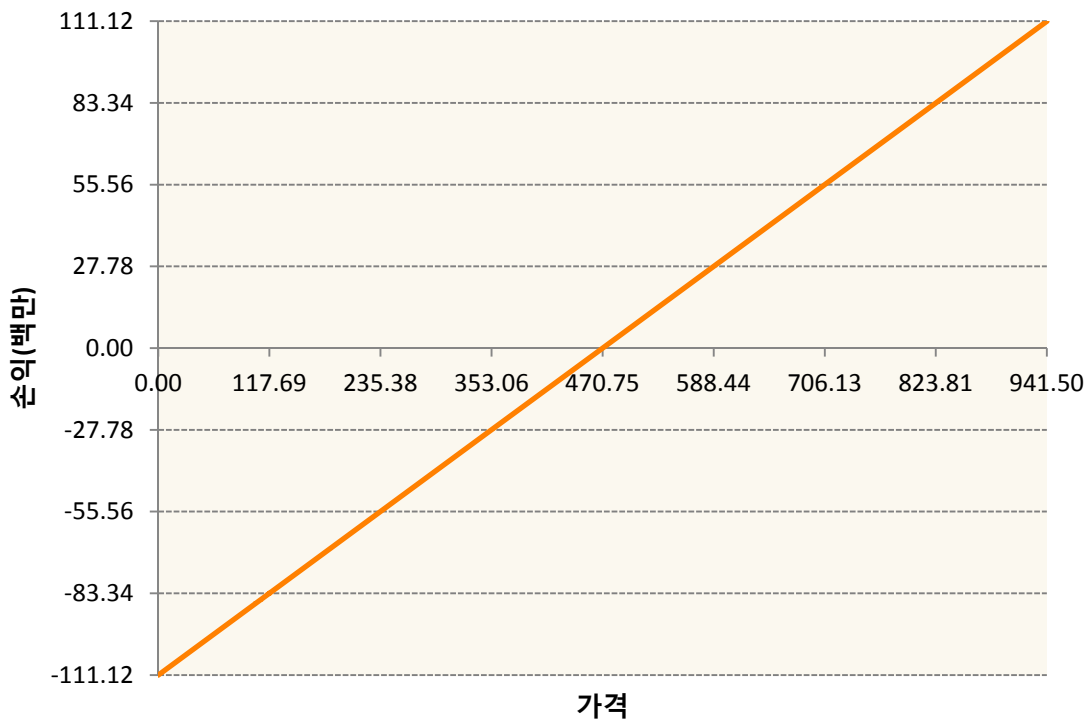




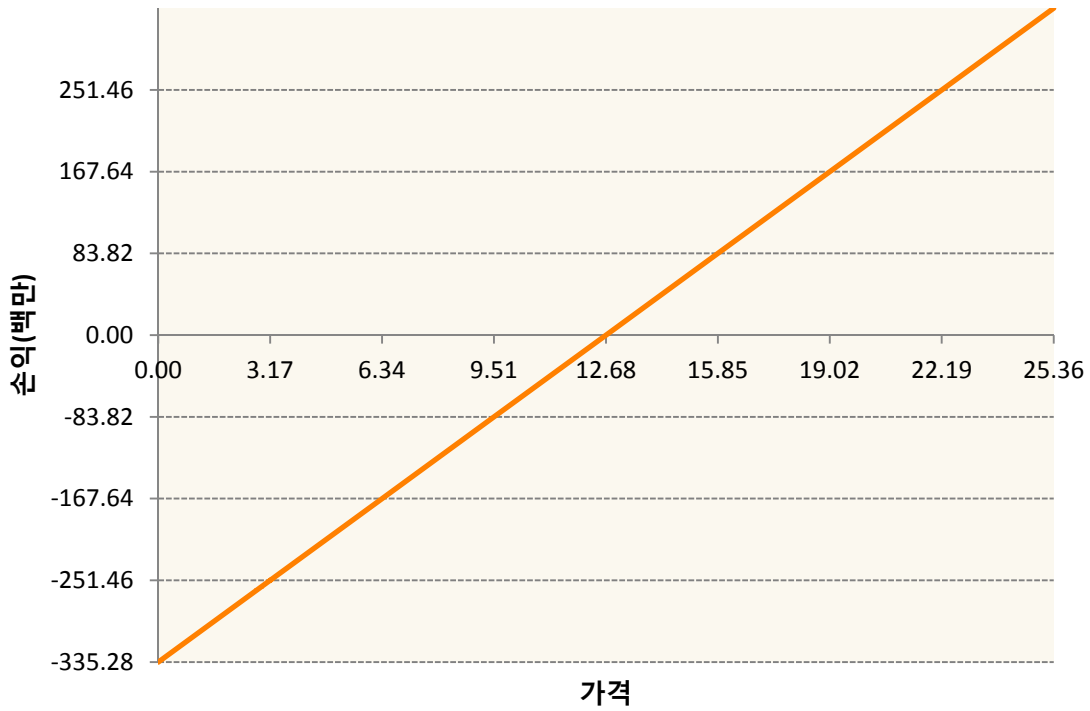
KR4175P70007-2019-07 달러선물



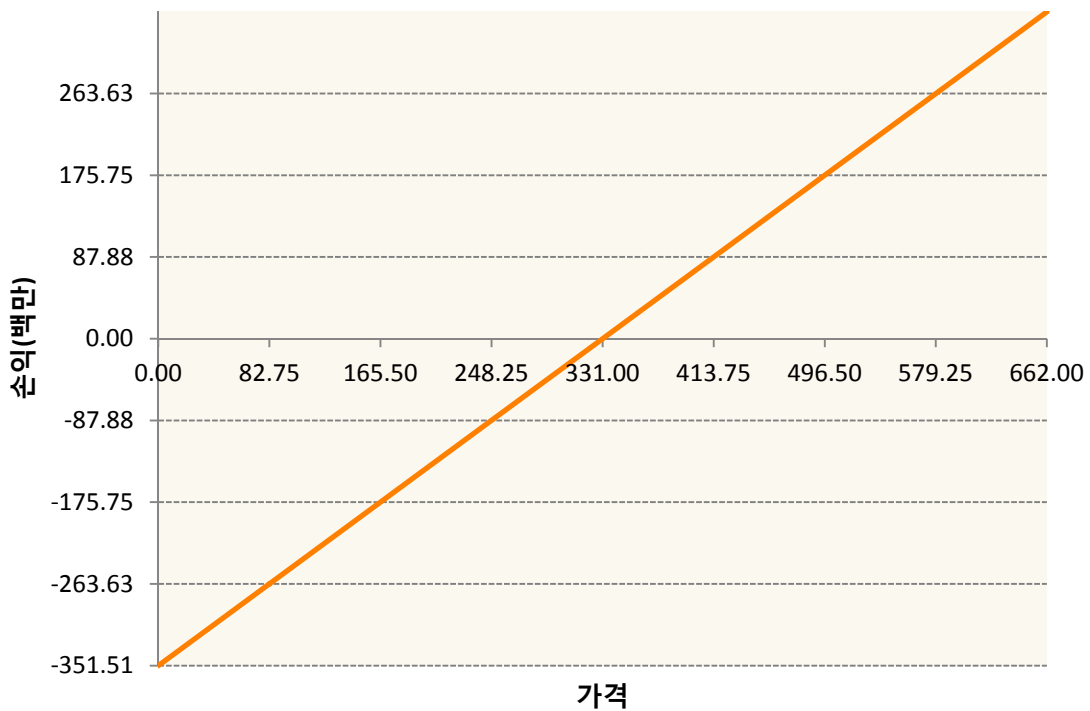
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

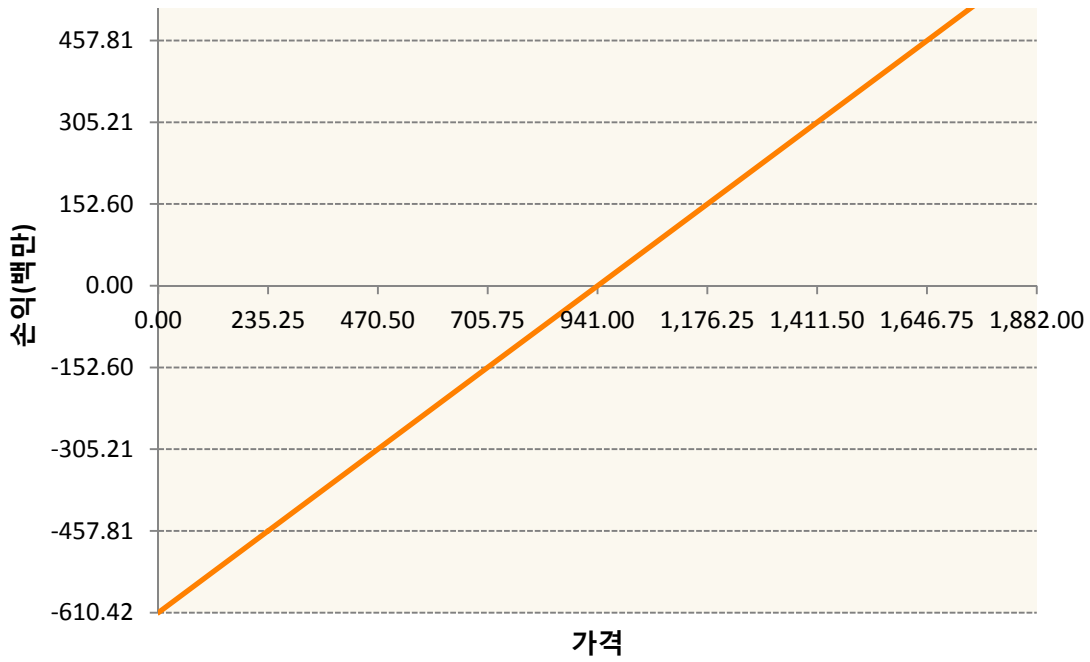


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

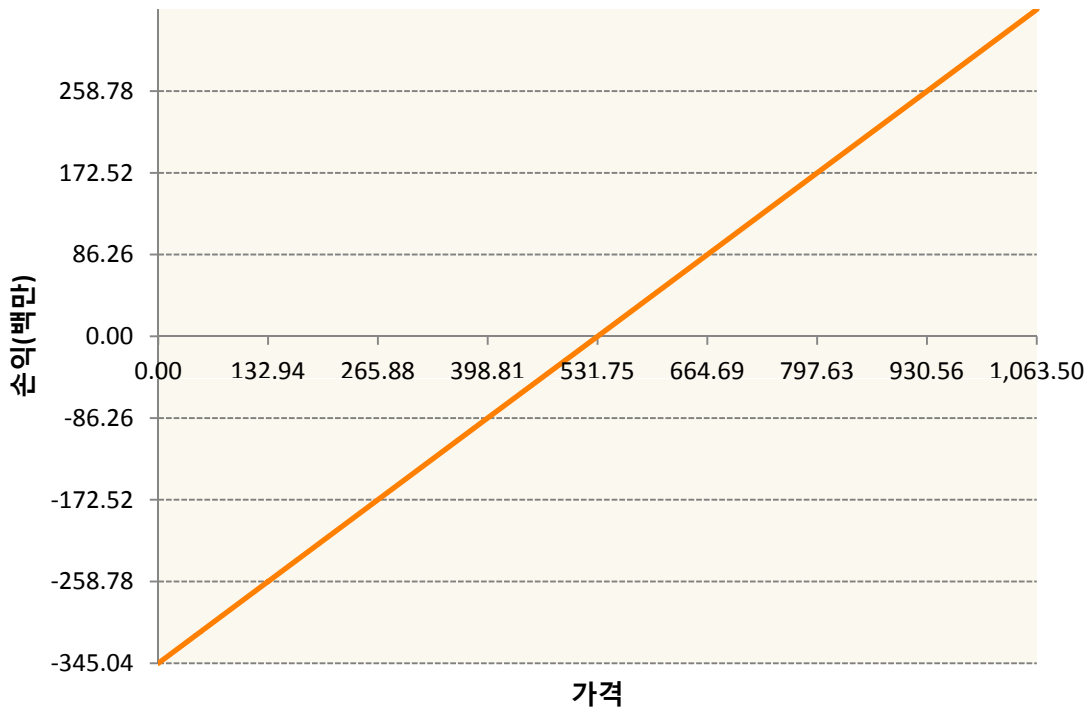


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





WU9-WHEAT FUTURE(CBT) Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	28
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	12
CU9	CORN FUTURE Sep19	58
KCU9	COFFEE 'C' FUTURE Sep19	22
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