

공시일	2019-06-25
기준일	2019-06-24

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	2019-06-25
기준일	2019-06-24

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

1,165

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

683

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-25
기준일	2019-06-24

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)

901

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-25
기준일	2019-06-24

유로인덱스모(주식-파생형)

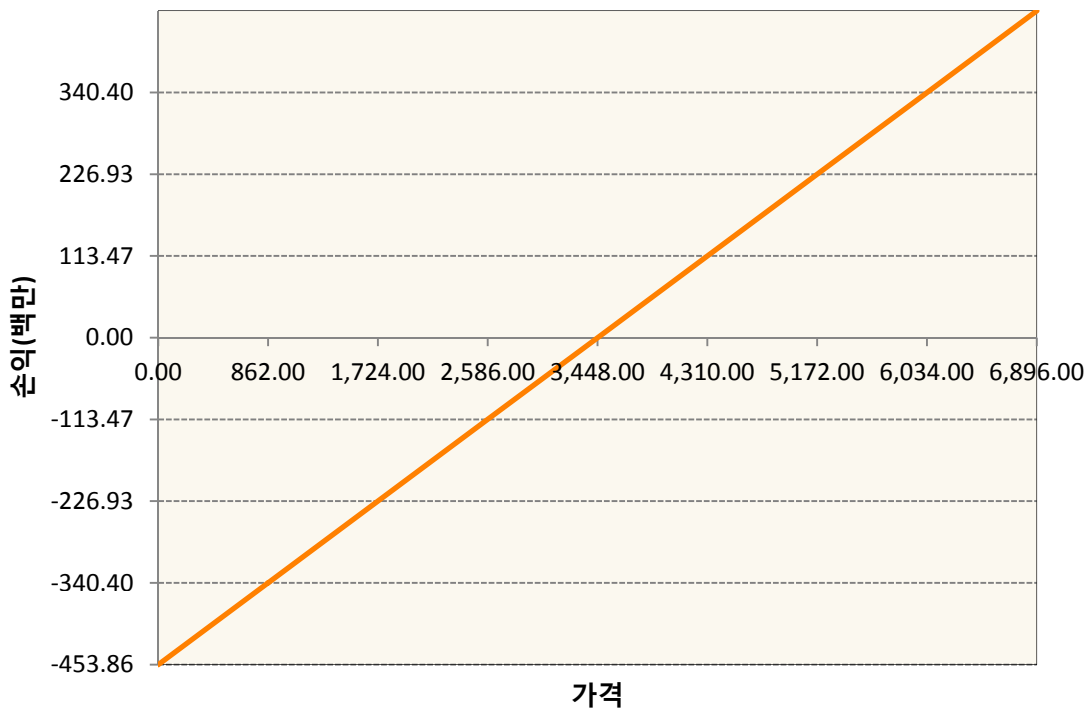
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

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	2019-06-25
기준일	2019-06-24

차이나인덱스모(주식-파생형)

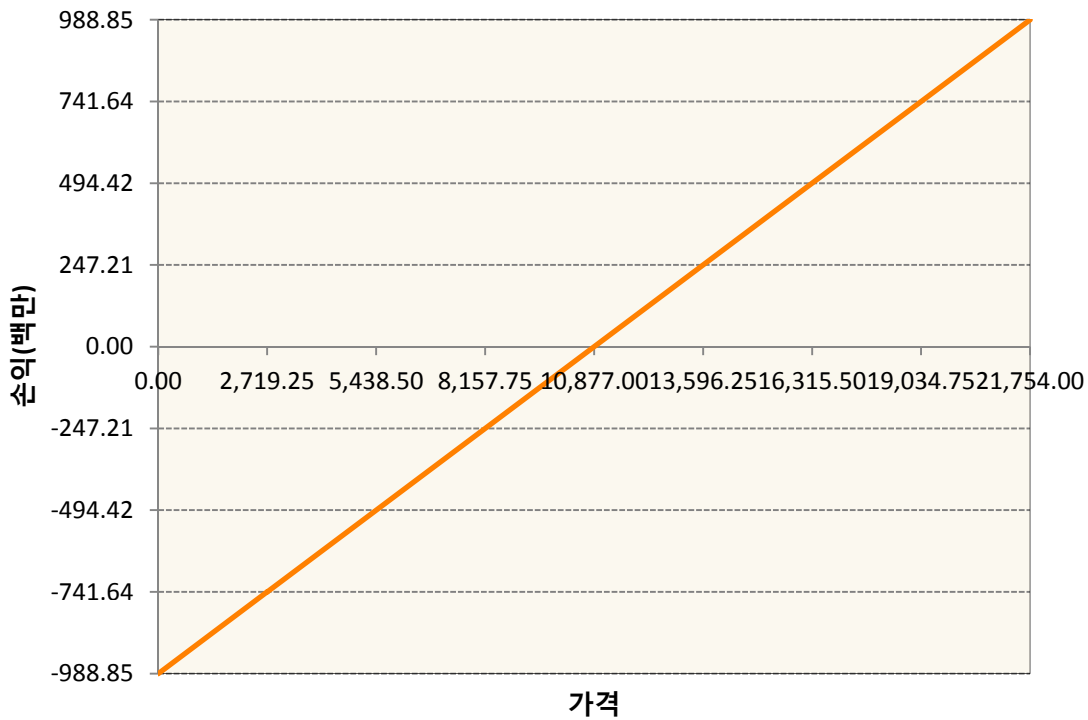
1. 계약금액

(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)

80

공시일	2019-06-25
기준일	2019-06-24

커버드콜모(주식혼합-파생형)

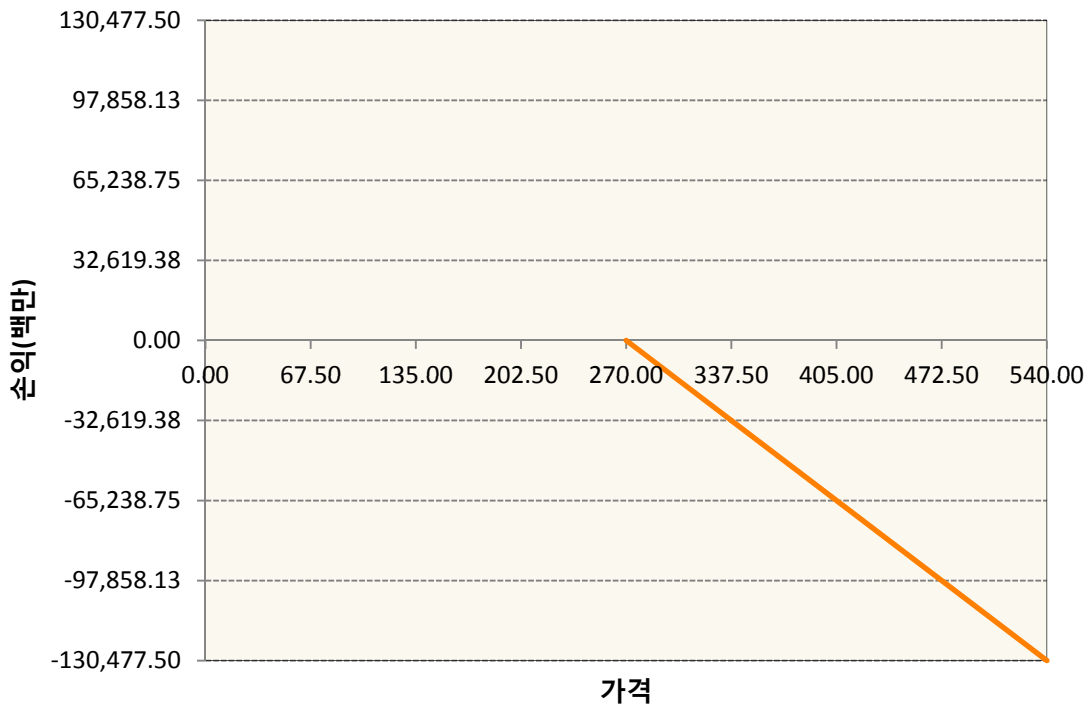
1. 계약금액

(단위:백만원)

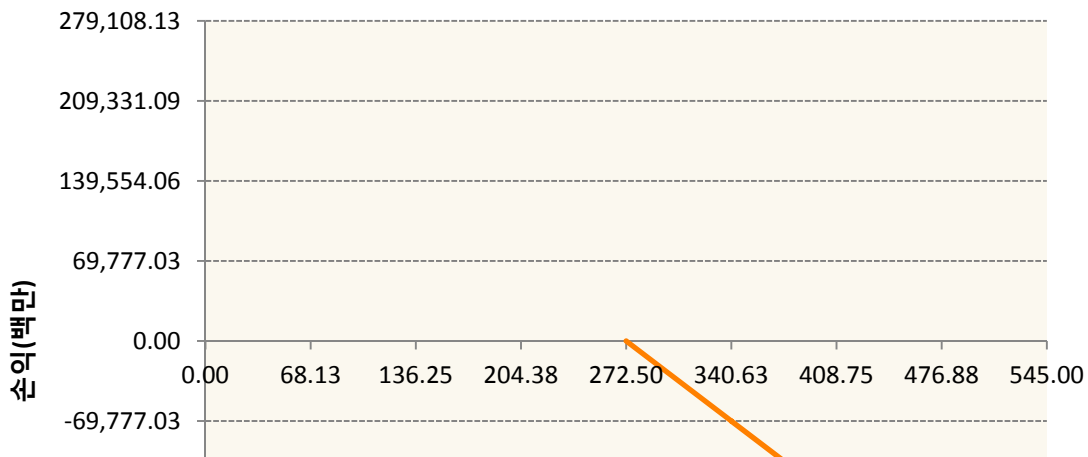
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	602,973	-602,973	장내

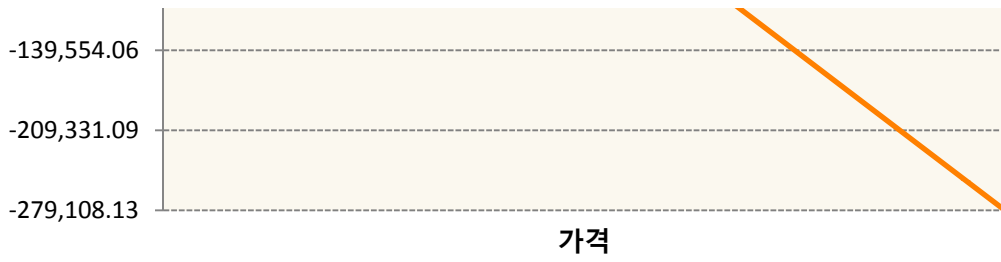
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P72700-2019-07 콜270

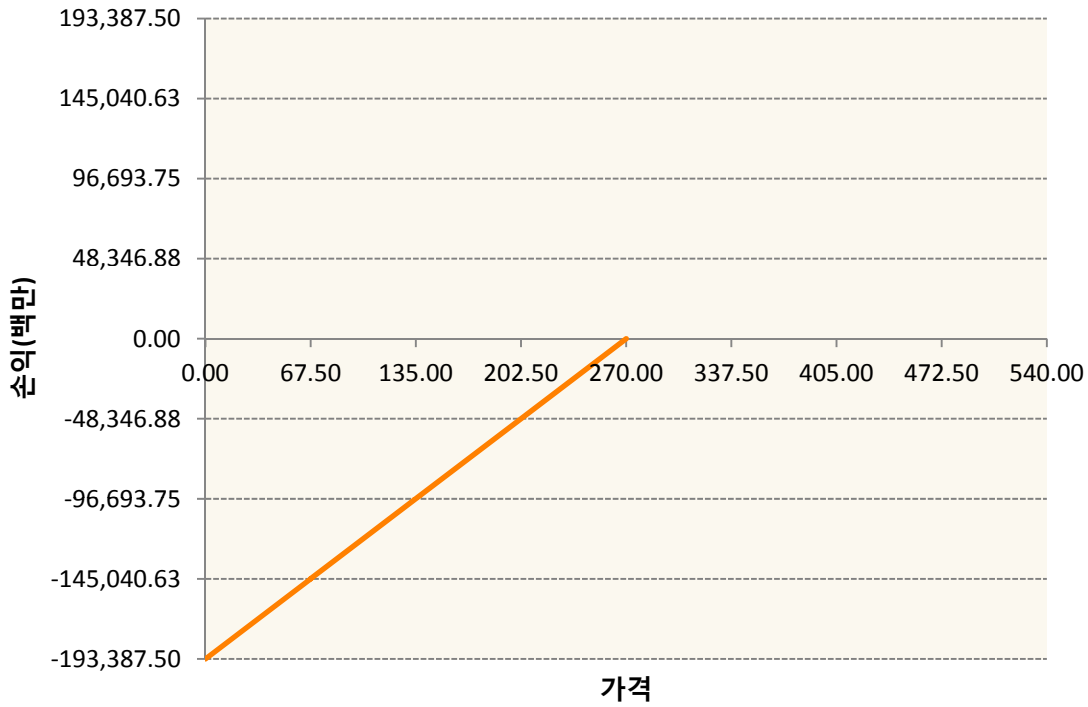


KR4201P72726-2019-07 콜272.5





KR4301P72708-2019-07 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P72700		2019-07 콜270					9,221
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,253	4,173	4,077	3,965	3,841	3,705	3,559
-5.33%	3,807	3,637	3,457	3,270	3,075	2,876	2,672
-2.67%	2,683	2,449	2,214	1,979	1,744	1,508	1,273
0%	660	444	223	0	-226	-454	-683
2.67%	-2,150	-2,288	-2,441	-2,606	-2,781	-2,965	-3,156
5.33%	-5,430	-5,492	-5,573	-5,669	-5,781	-5,906	-6,043
8.00%	-8,904	-8,925	-8,958	-9,003	-9,063	-9,135	-9,221
KR4201P72726		2019-07 콜272.5					18,763
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,601	7,479	7,323	7,133	6,914	6,668	6,399

-5.33%	6,955	6,657	6,330	5,979	5,609	5,223	4,824
-2.67%	5,126	4,656	4,179	3,698	3,213	2,725	2,236
0%	1,496	1,000	501	0	-503	-1,006	-1,511
2.67%	-3,946	-4,305	-4,690	-5,094	-5,513	-5,946	-6,389
5.33%	-10,621	-10,806	-11,030	-11,287	-11,575	-11,888	-12,223
8.00%	-17,883	-17,952	-18,052	-18,185	-18,348	-18,542	-18,763
KR4301P72708 2019-07 풋270							11,099
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10,962	-10,968	-10,979	-10,997	-11,022	-11,056	-11,099
-5.33%	-5,820	-5,887	-5,968	-6,062	-6,166	-6,280	-6,403
-2.67%	-1,600	-1,786	-1,974	-2,162	-2,352	-2,542	-2,733
0%	443	304	155	0	-161	-327	-497
2.67%	871	840	796	740	672	593	503
5.33%	905	903	897	888	873	851	821
8.00%	906	906	906	905	903	899	893

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

(단위:백만원)

39,911

공시일	2019-06-25
기준일	2019-06-24

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

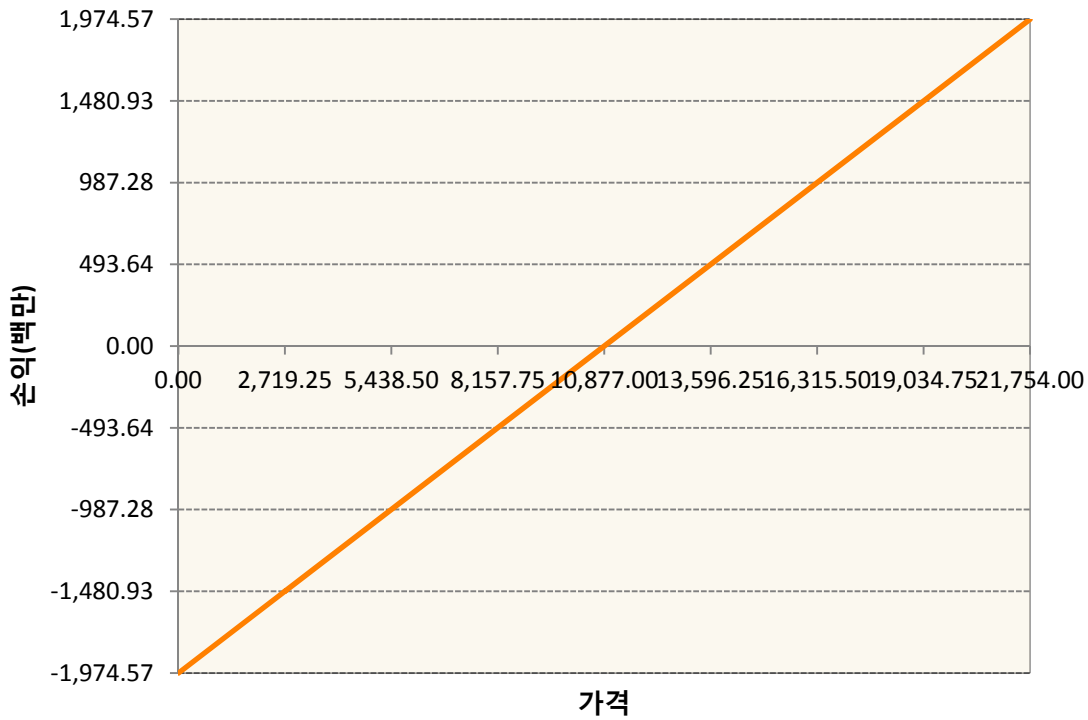
1. 계약금액

(단위:백만원)

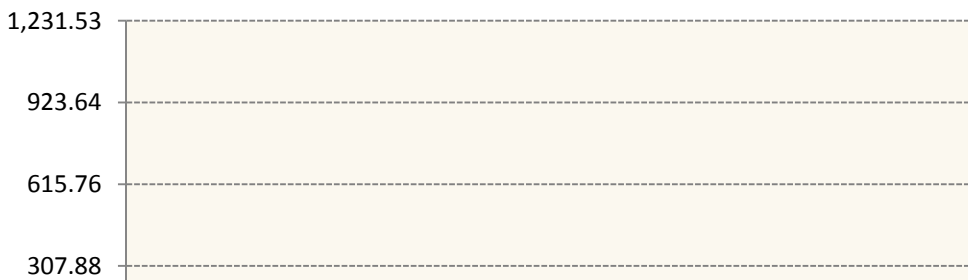
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,975	0	1,975	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,950	-4,950	장내
누계	통화	선도	148	3,109	-2,961	장외

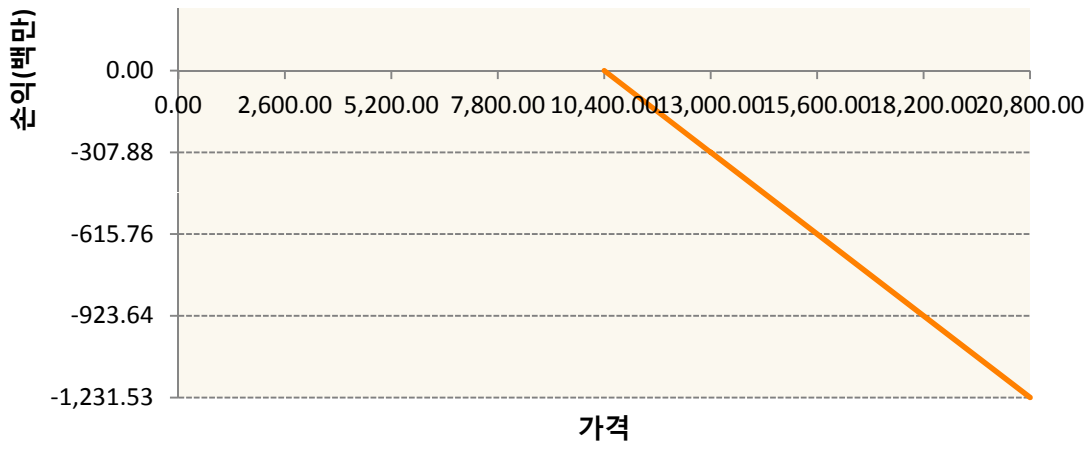
2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19

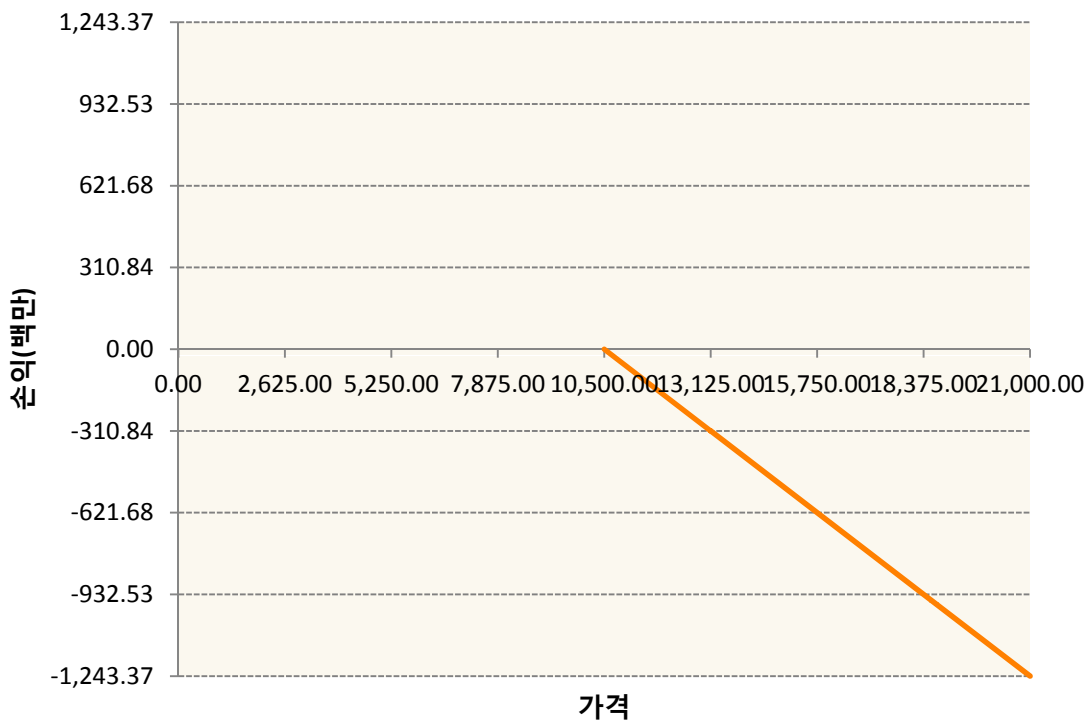


OHHIM9-C104-HSCEI

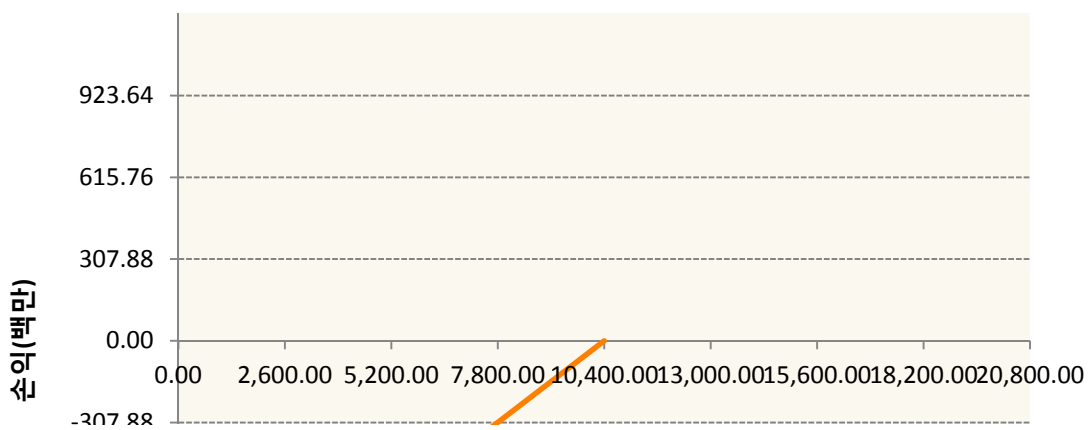


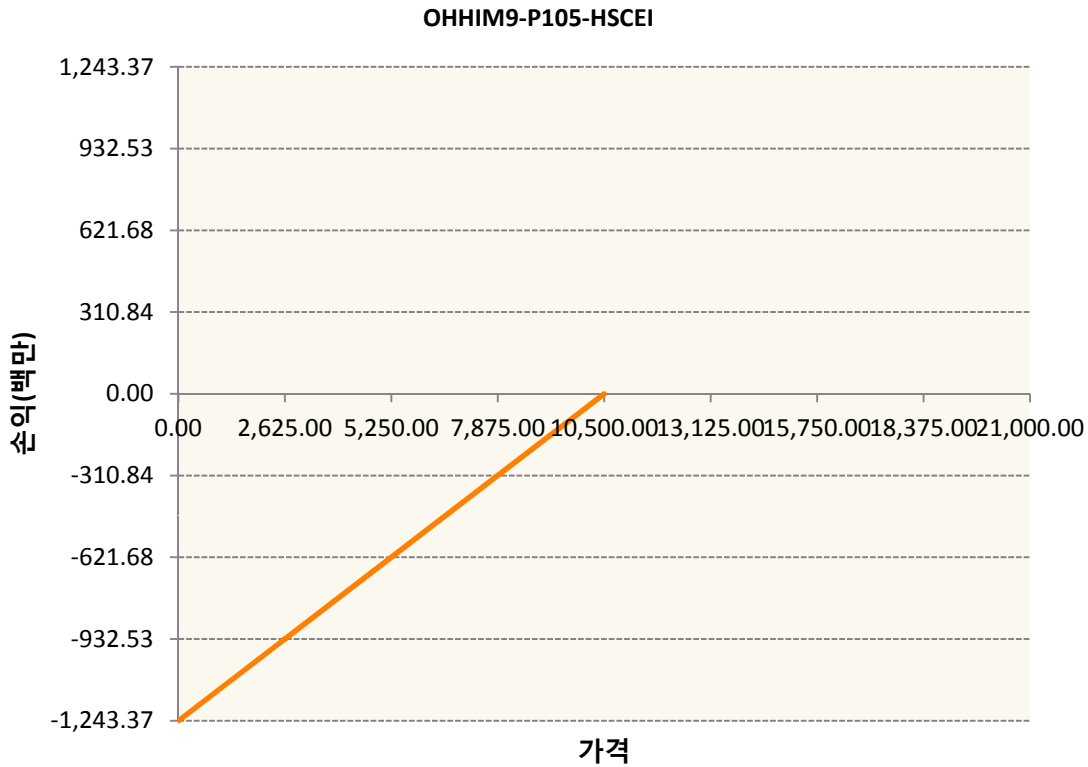


OHHIM9-C105-HSCEI



OHHIM9-P104-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E		249
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E		12
HCM9 HSCEI Futures Jun19		158
OHHIM9-C1 HSCEI		99
OHHIM9-C1 HSCEI		99
OHHIM9-P1 HSCEI		99
OHHIM9-P1 HSCEI		99

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		648

공시일	2019-06-25
기준일	2019-06-24

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

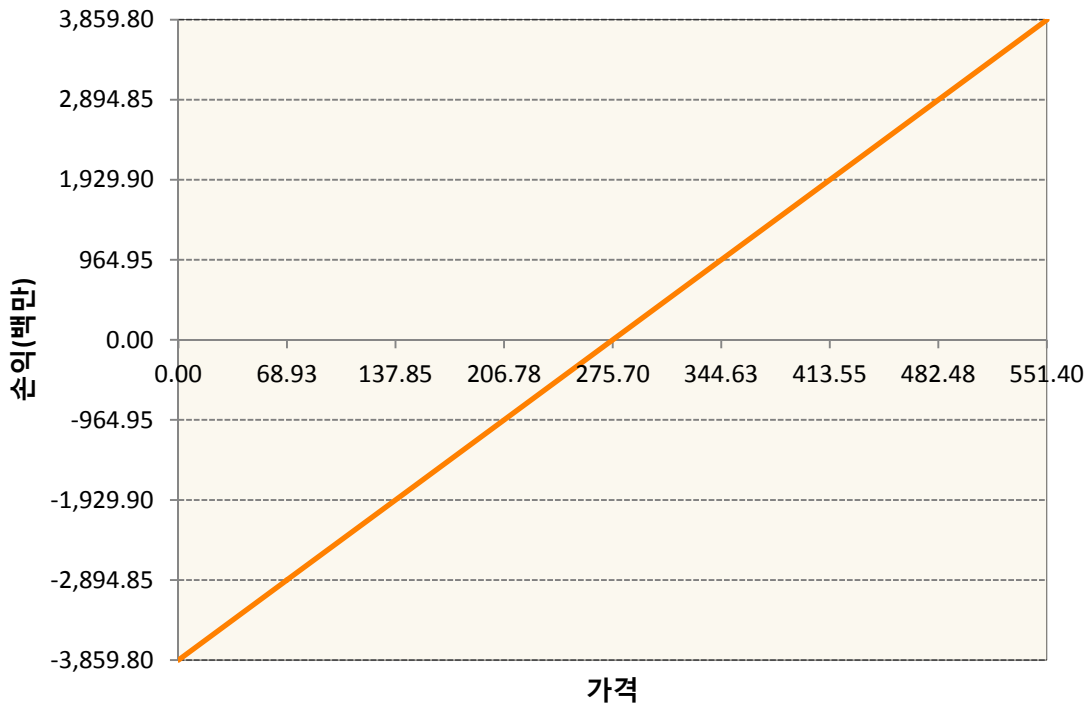
1. 계약금액

(단위:백만원)

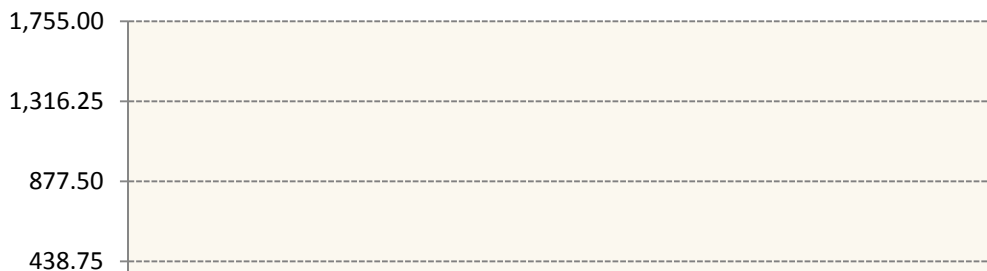
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	671	0	671	장내
누계	유가증권	선물	3,860	0	3,860	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,880	-20,880	장내

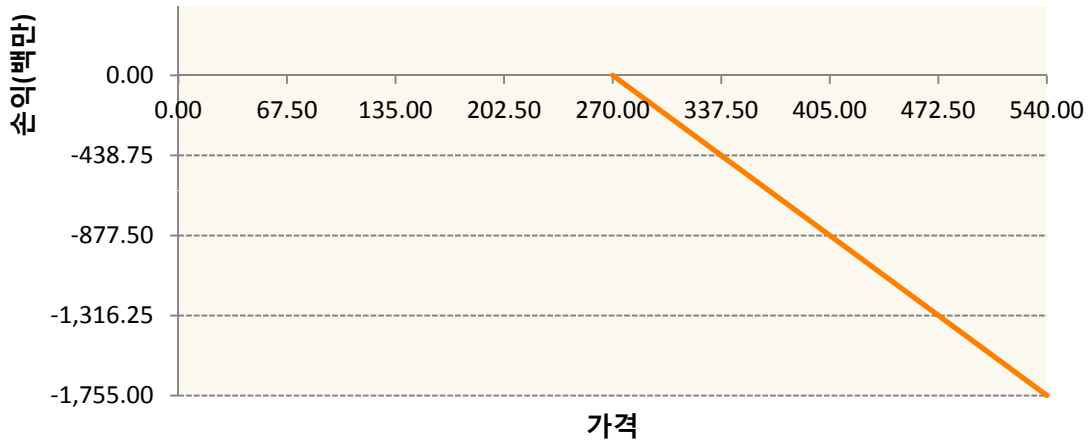
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

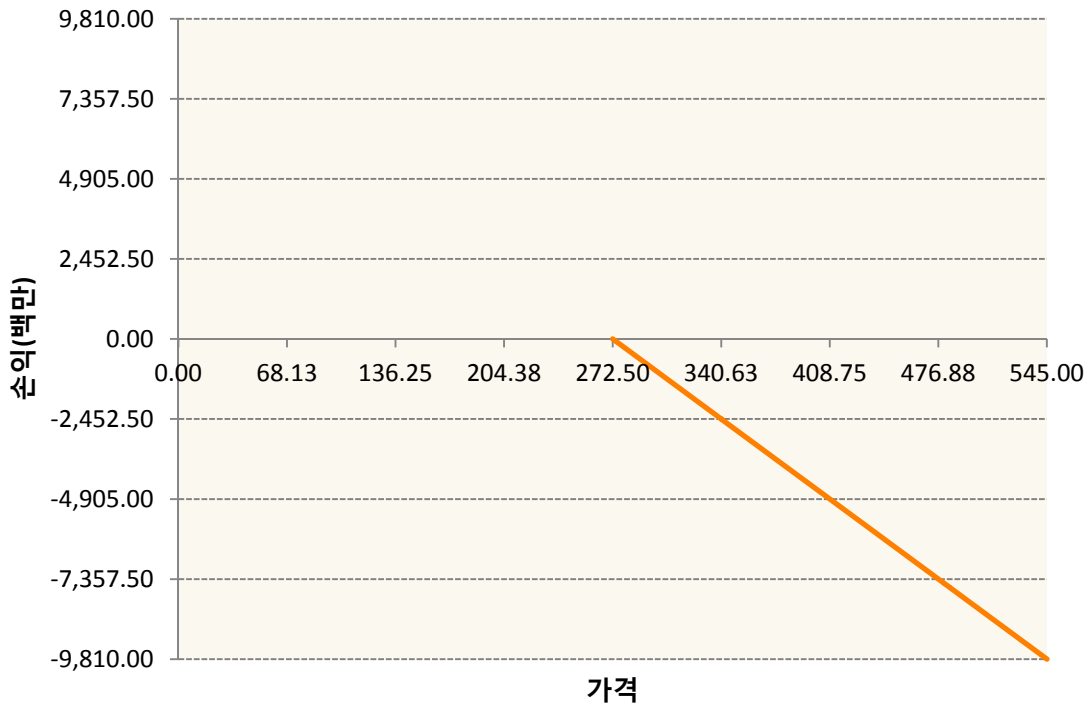


KR4201P72700-2019-07 콜270

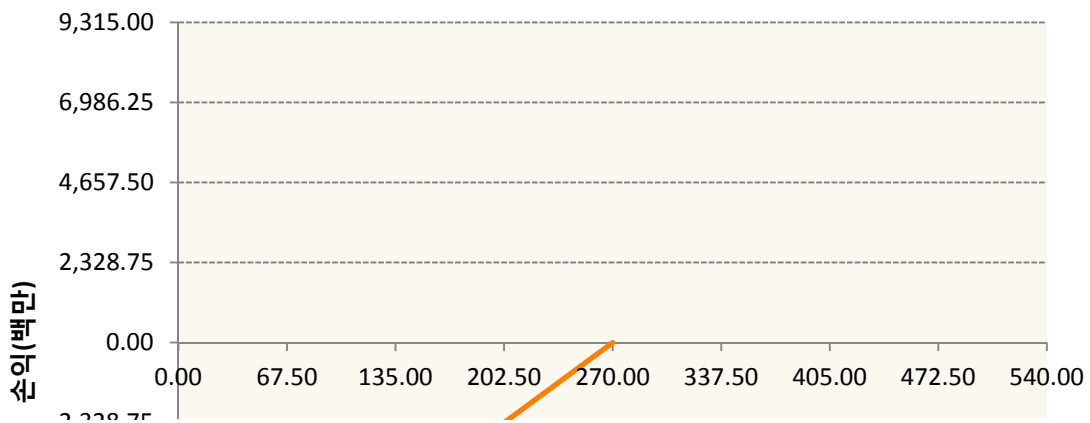




KR4201P72726-2019-07 콜272.5



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						124
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	57	56	55	53	52	50	48
-5.33%	51	49	47	44	41	39	36
-2.67%	36	33	30	27	23	20	17
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	-29	-31	-33	-35	-37	-40	-42
5.33%	-73	-74	-75	-76	-78	-79	-81
8.00%	-120	-120	-120	-121	-122	-123	-124
KR4201P72726 2019-07 콜272.5							659
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	267	263	257	251	243	234	225
-5.33%	244	234	222	210	197	184	170
-2.67%	180	164	147	130	113	96	79
0%	53	35	18	0	-18	-35	-53
2.67%	-139	-151	-165	-179	-194	-209	-225
5.33%	-373	-380	-388	-397	-407	-418	-430
8.00%	-629	-631	-635	-639	-645	-652	-659
KR4301P72708 2019-07 풋270							535
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-528	-528	-529	-530	-531	-533	-535
-5.33%	-280	-284	-287	-292	-297	-303	-308
-2.67%	-77	-86	-95	-104	-113	-122	-132
0%	21	15	7	0	-8	-16	-24
2.67%	42	40	38	36	32	29	24
5.33%	44	43	43	43	42	41	40
8.00%	44	44	44	44	43	43	43

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

(단위:백만원)

3,364

공시일	2019-06-25
기준일	2019-06-24

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

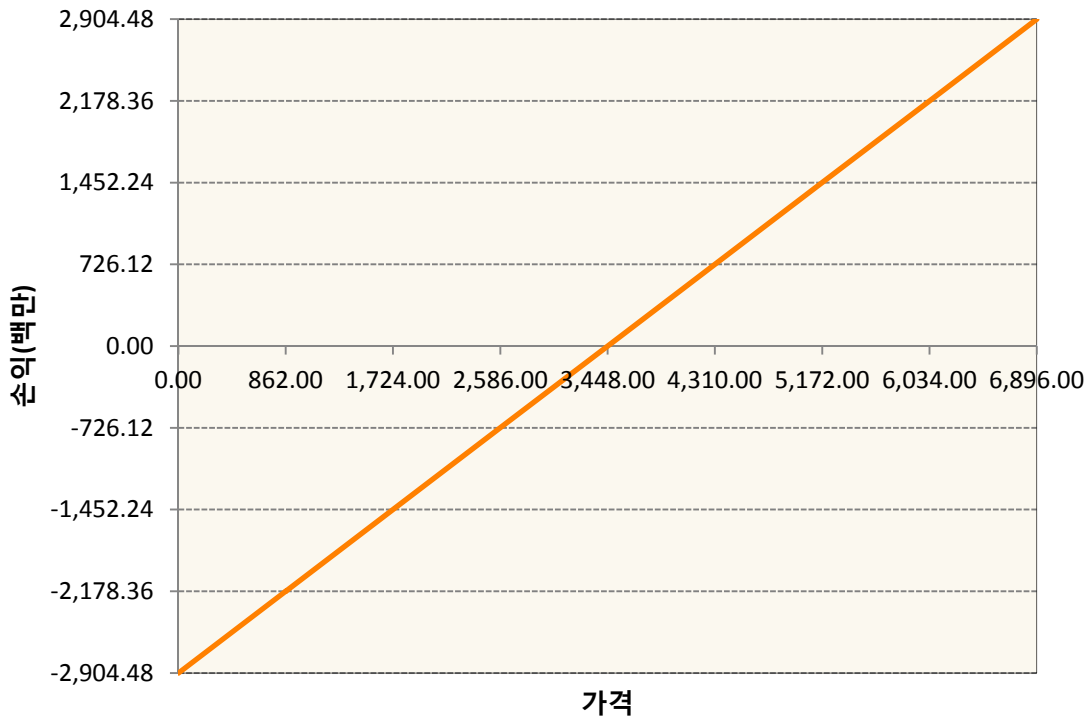
1. 계약금액

(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	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,904	0	2,904	
누계	유가증권	스왑	55,714	0	55,714	장외
누계	통화	선도	0	18,427	-18,427	장외

2. 만기시점의 손익구조

VGU9-EURO STOXX 50 Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	52
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	842
FX21019J01: KRW/EUR 28-06-19E	211
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	421
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	232

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

(단위:백만원)

916

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

(단위:백만원)

1,043

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	2019-06-25
기준일	2019-06-24

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

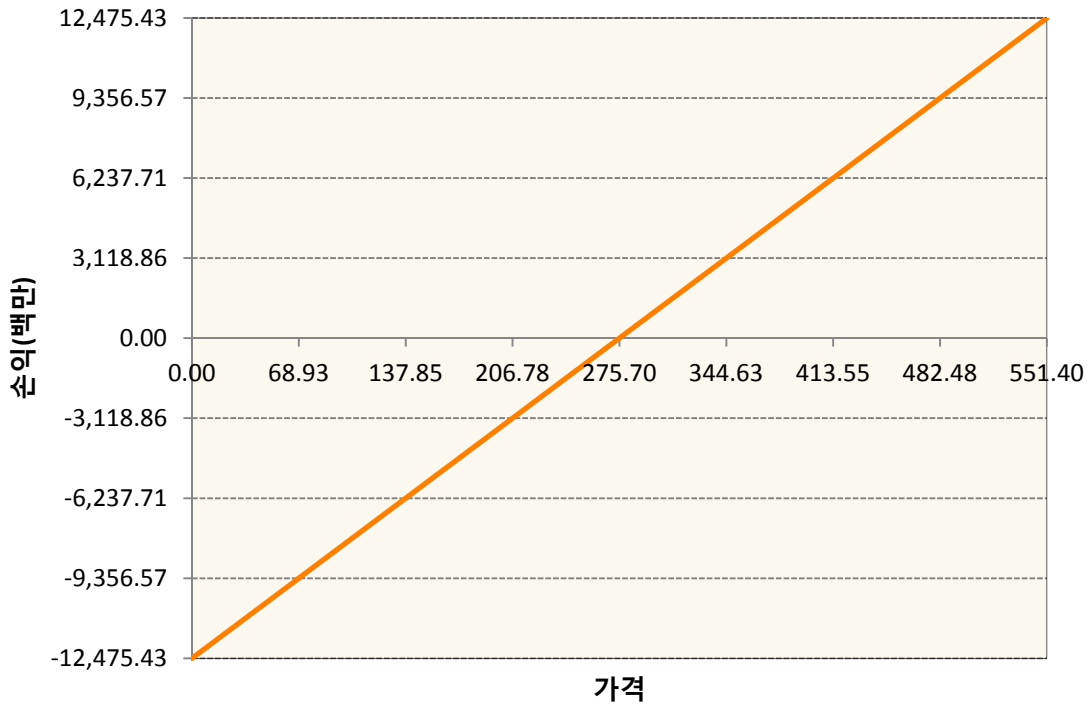
1. 계약금액

(단위:백만원)

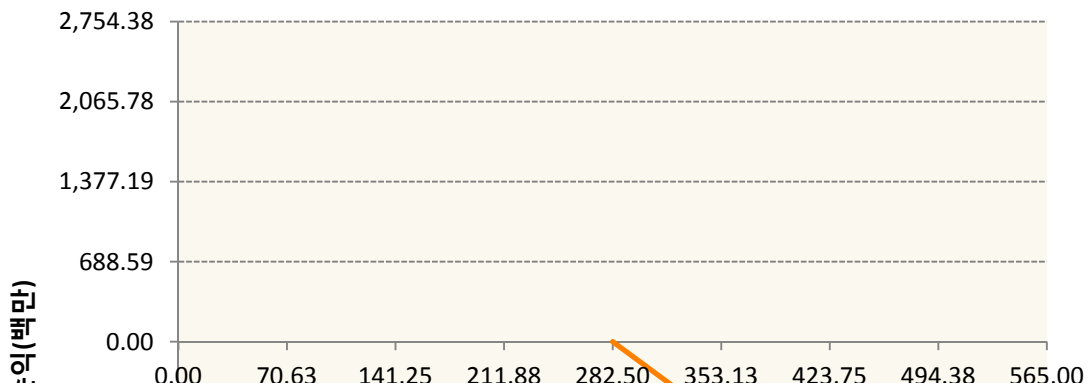
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,475	0	12,475	장내
누계	유가증권	옵션	1,084	22,206	-21,121	장내

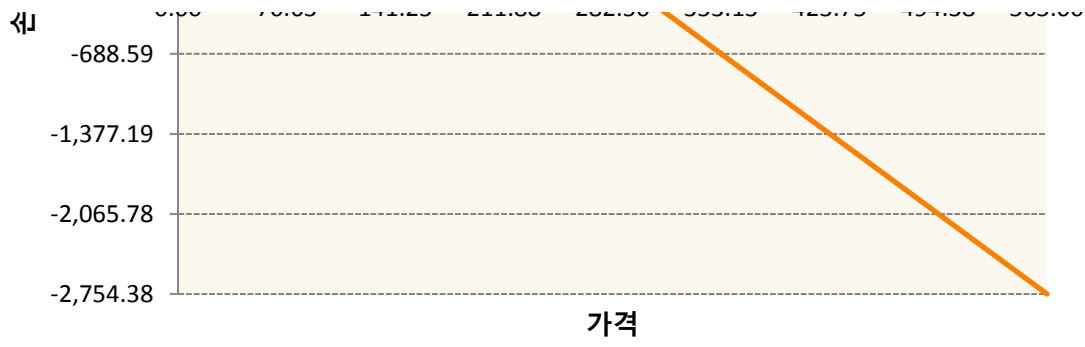
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

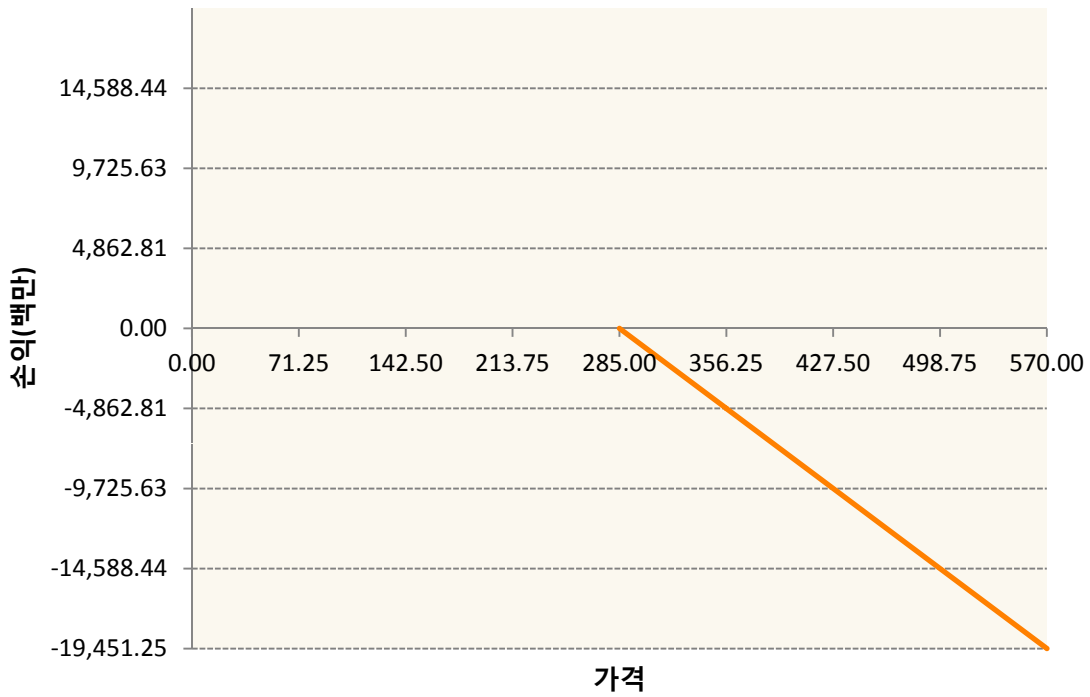


KR4201P72825-2019-07 콜282.5

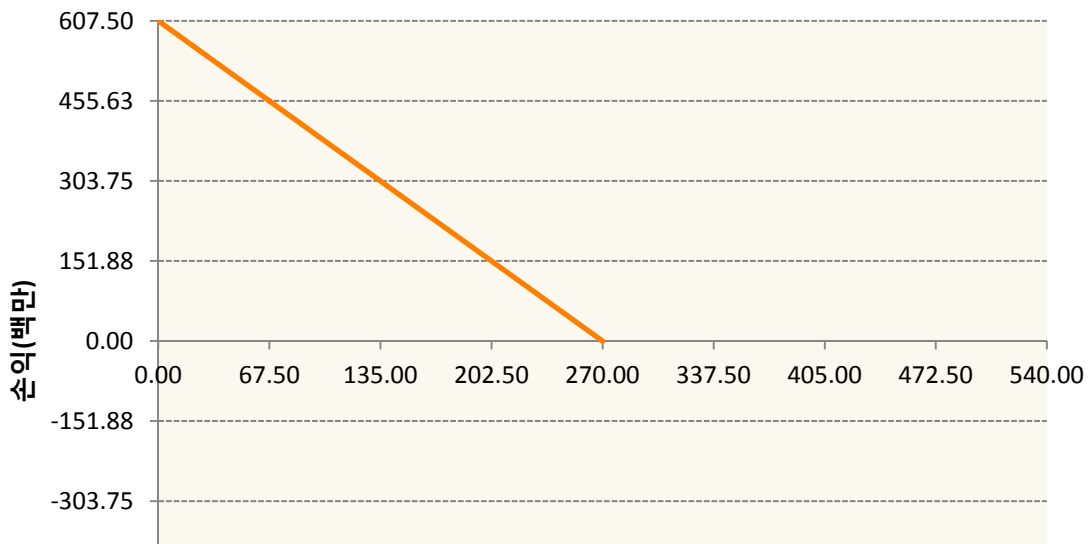


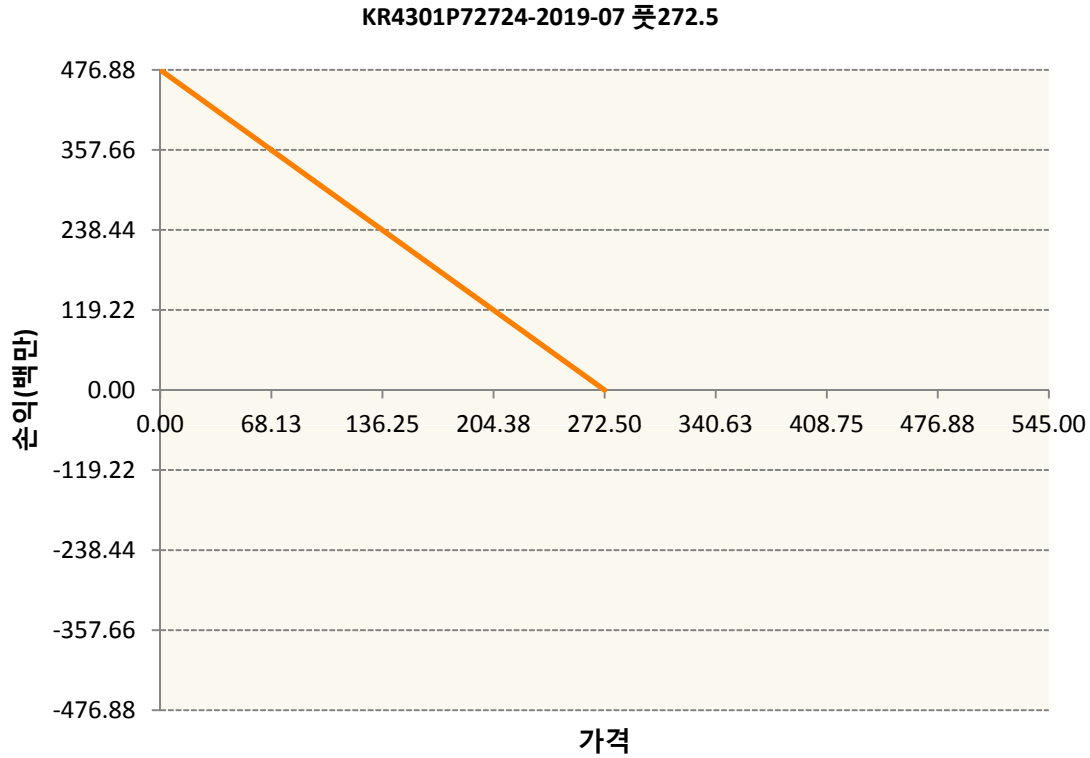
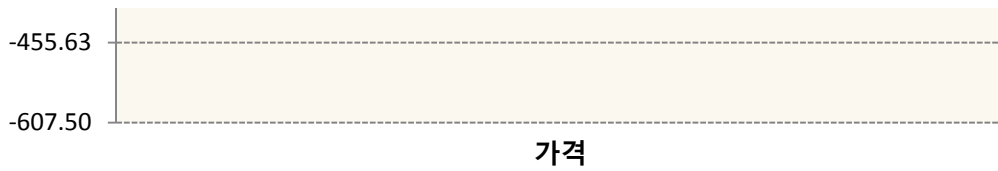


KR4201P72858-2019-07 콜285



KR4301P72708-2019-07 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						998
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-998	-998	-998	-998	-998	-998	-998	
-5.33%	-665	-665	-665	-665	-665	-665	-665	
-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%	665	665	665	665	665	665	665	
8.00%	998	998	998	998	998	998	998	
KR4201P72825		2019-07 콜282.5						140
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	31	31	31	30	29	28	27	
-5.33%	30	29	28	27	25	23	21	
-2.67%	26	24	21	18	15	11	8	

공시일	2019-06-25
기준일	2019-06-24

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	18,863	0	18,863	

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	2019-06-25
기준일	2019-06-24

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	59,696	0	59,696	

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	2019-06-25
기준일	2019-06-24

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	395,554	0	395,554	
누계	통화	선도	0	405,261	-405,261	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E		370
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		74
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		973
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E		999
FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E		463
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		463
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		370
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		777
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E		278
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E		1,203
FX21019K04 KRW/USD 28-06-19E		1,258
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		648
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		555
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		740
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		740
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		463
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		278
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		925
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		185
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		860
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		1,027
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		1,850
FX21019M00 KRW/USD 15-07-19E		463
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		370
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		648
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		925

FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	648
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	648
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E	555
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E	2,961
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E	2,220
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E	278
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E	278
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	777
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	620
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	463
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E	1,850
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E	1,850
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E	685
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E	685

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

(단위:백만원)

10,801

공시일	2019-06-25
기준일	2019-06-24

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

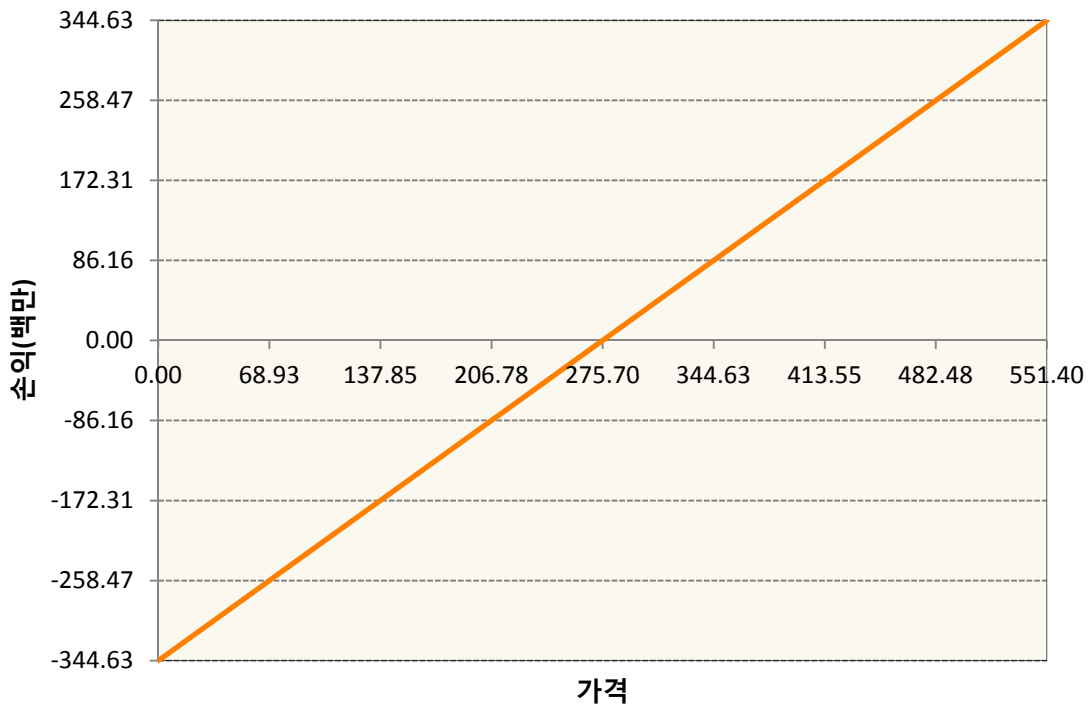
1. 계약금액

(단위:백만원)

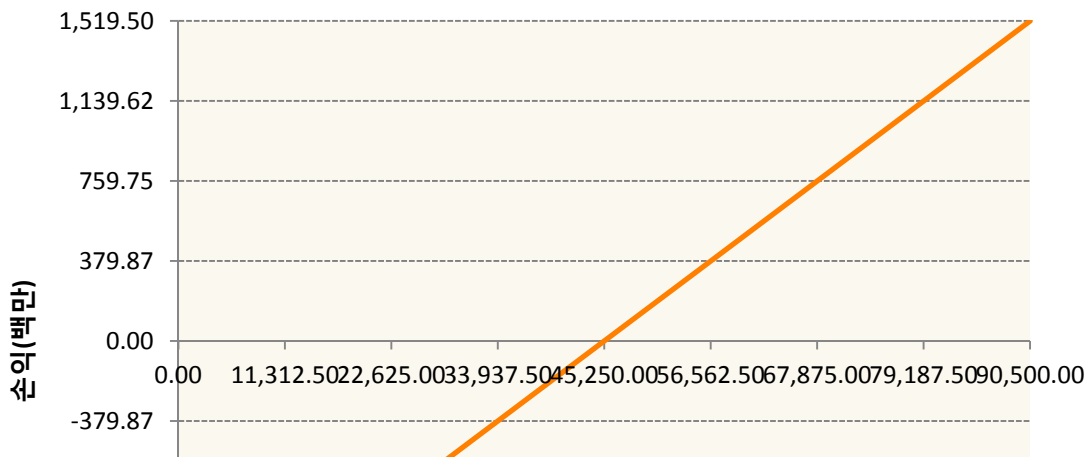
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,864	0	1,864	장내

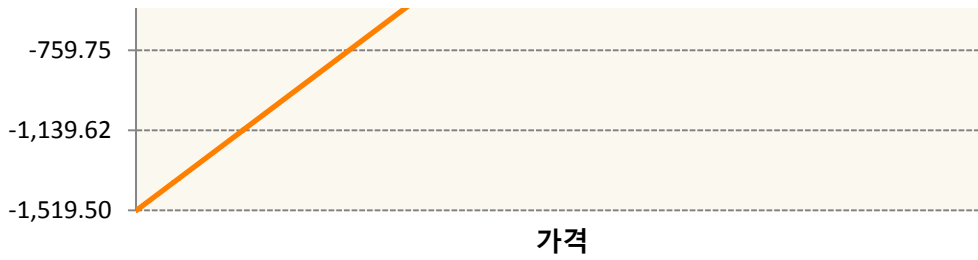
2. 만기시점의 손익구조

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						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)

161

공시일	2019-06-25
기준일	2019-06-24

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

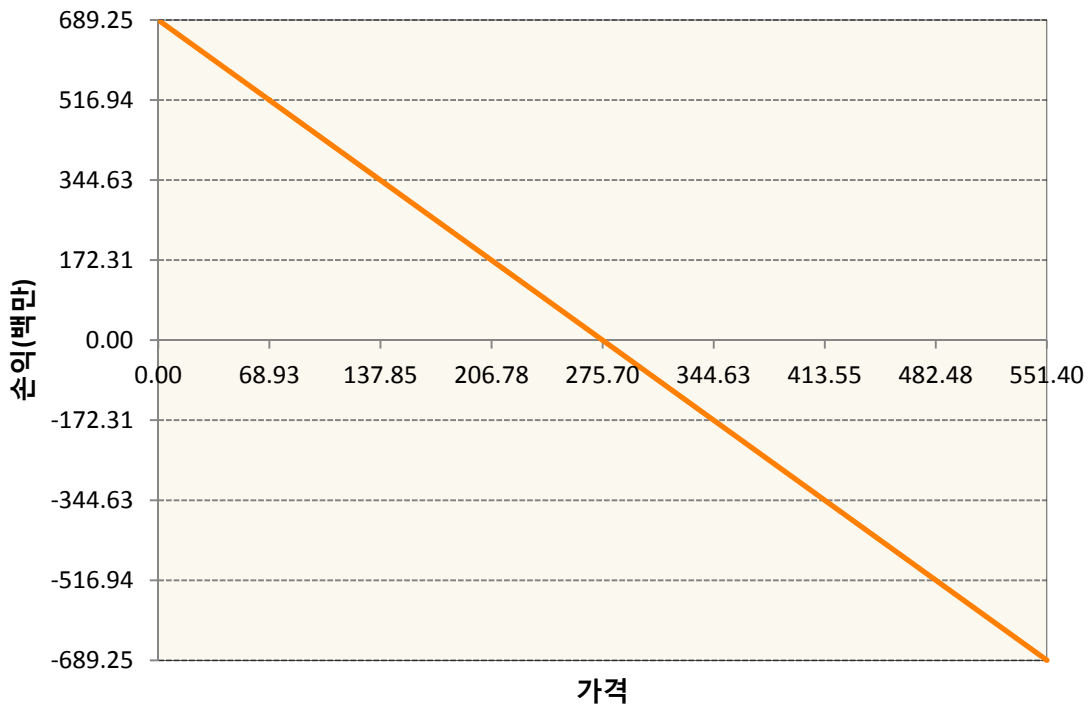
1. 계약금액

(단위:백만원)

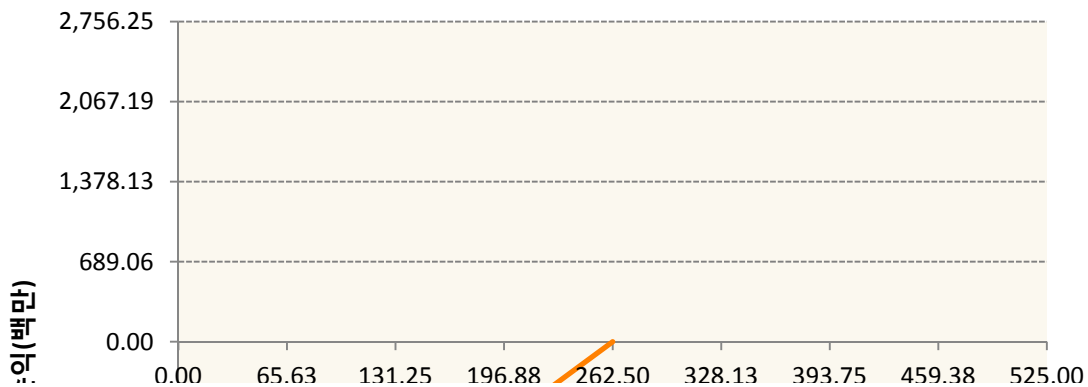
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	689	-689	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,419	-3,419	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

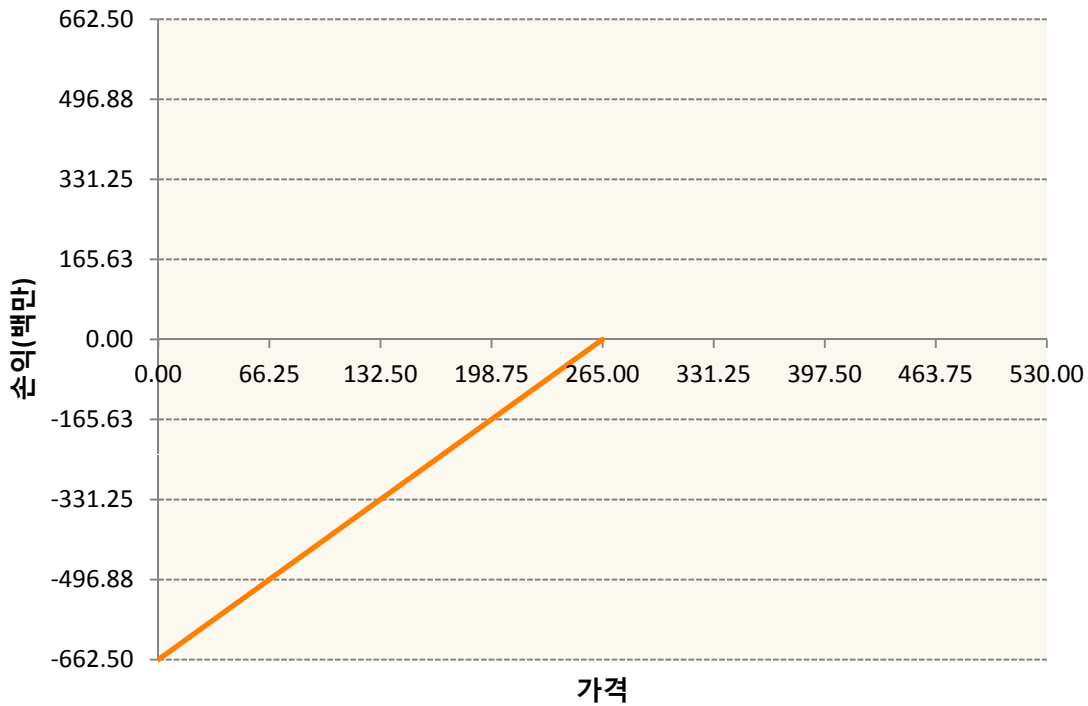


KR4301P72625-2019-07 풋262.5





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						103
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-95	-96	-97	-98	-100	-101	-103
-5.33%	-33	-36	-38	-41	-44	-46	-49
-2.67%	-4	-6	-8	-10	-12	-15	-17
0%	2	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	2	2	2	2	2	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

KR4301P72658

2019-07 풋265

29

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-28	-28	-28	-29	-29	-29	-29
-5.33%	-12	-12	-13	-13	-14	-15	-15
-2.67%	-2	-3	-3	-4	-4	-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)

124

공시일	2019-06-25
기준일	2019-06-24

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	3,932	-3,932	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019M0:KRW/USD 24-07-19E	139
FX21019M0:KRW/USD 24-07-19E	176

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

(단위:백만원)

105

공시일	2019-06-25
기준일	2019-06-24

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

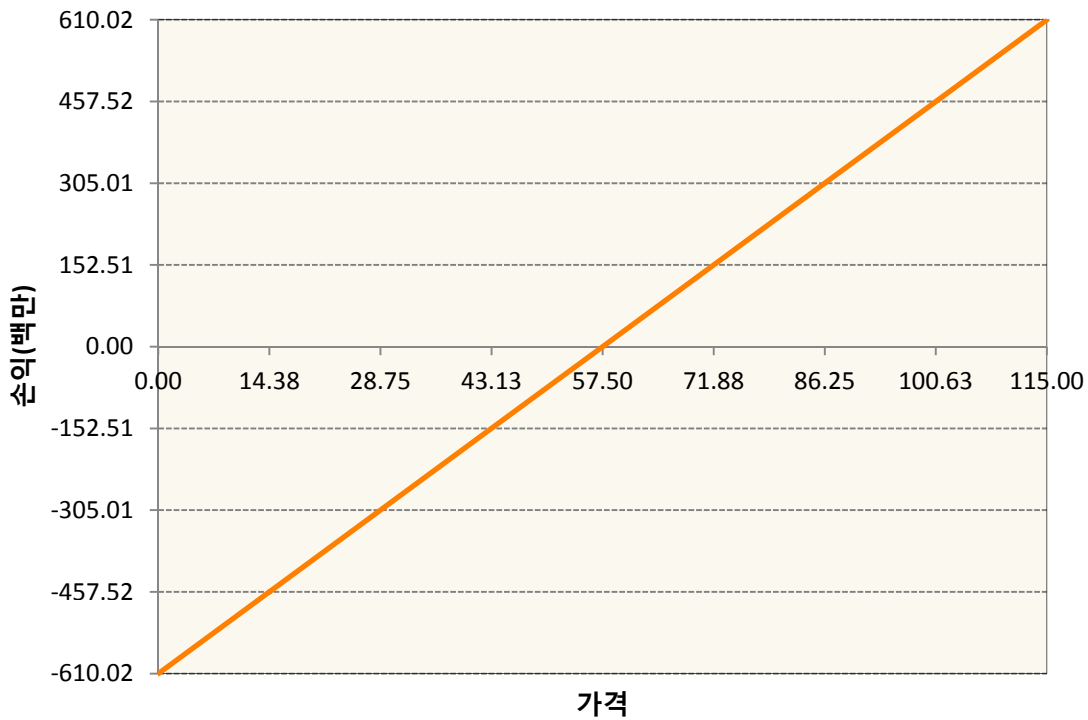
1. 계약금액

(단위:백만원)

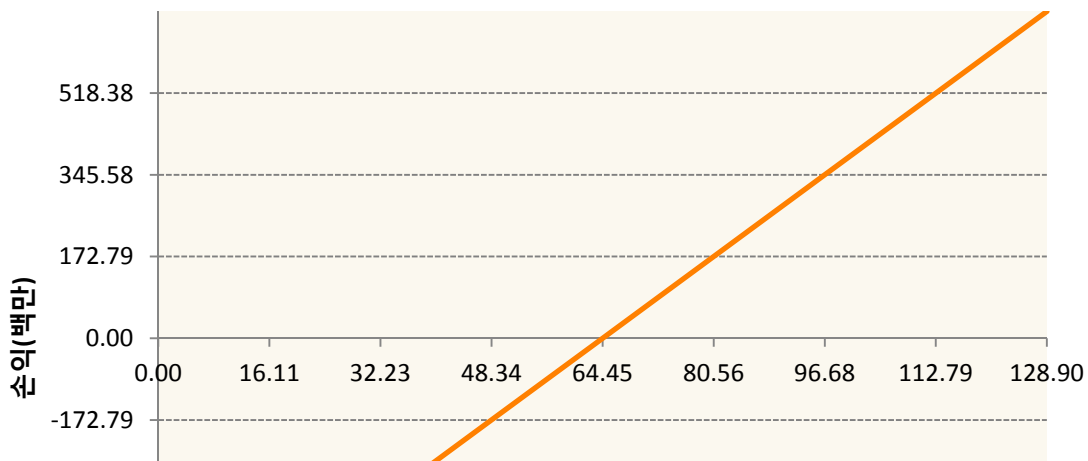
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,593	116	2,477	

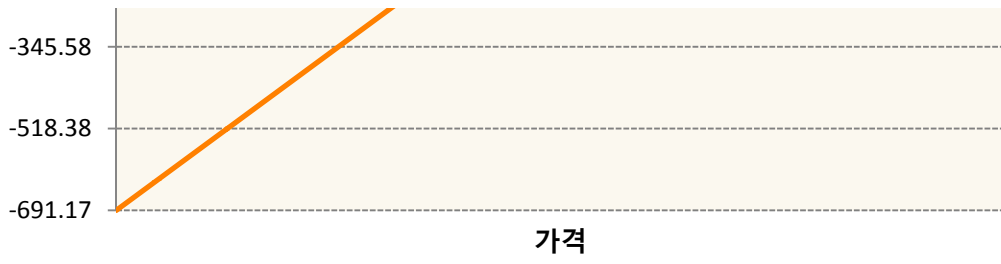
2. 만기시점의 손익구조

CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19

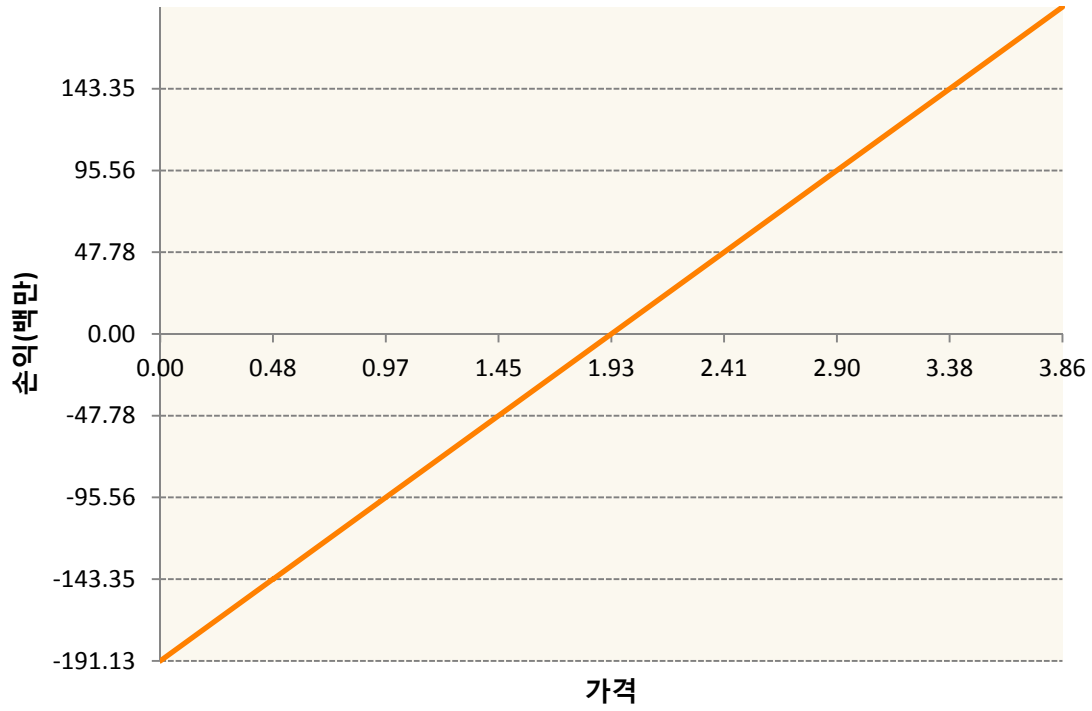


COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19

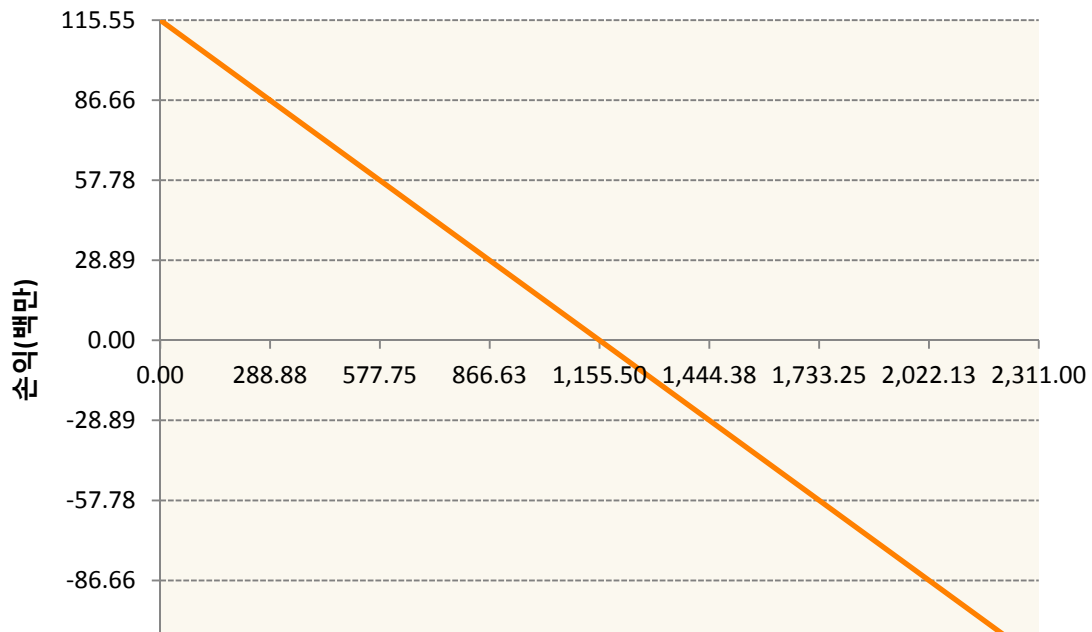


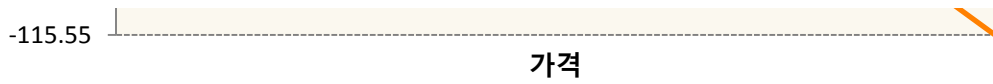


HOU9-NY Harb ULSD Fut Sep19

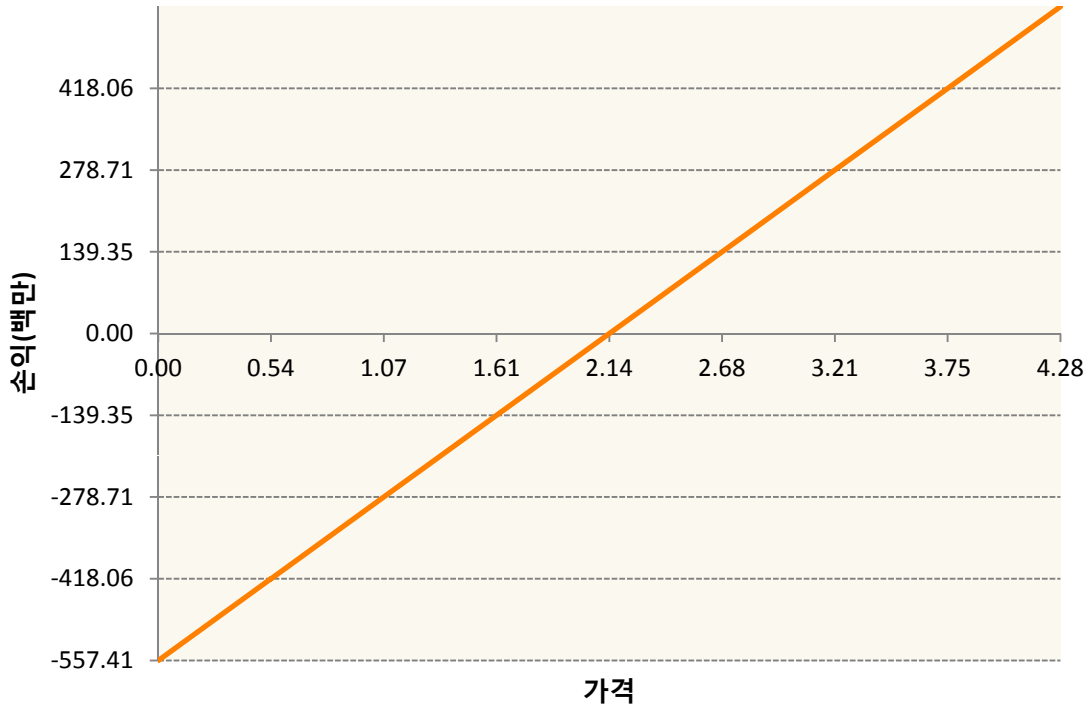


KR4175P70007-2019-07 달러선물

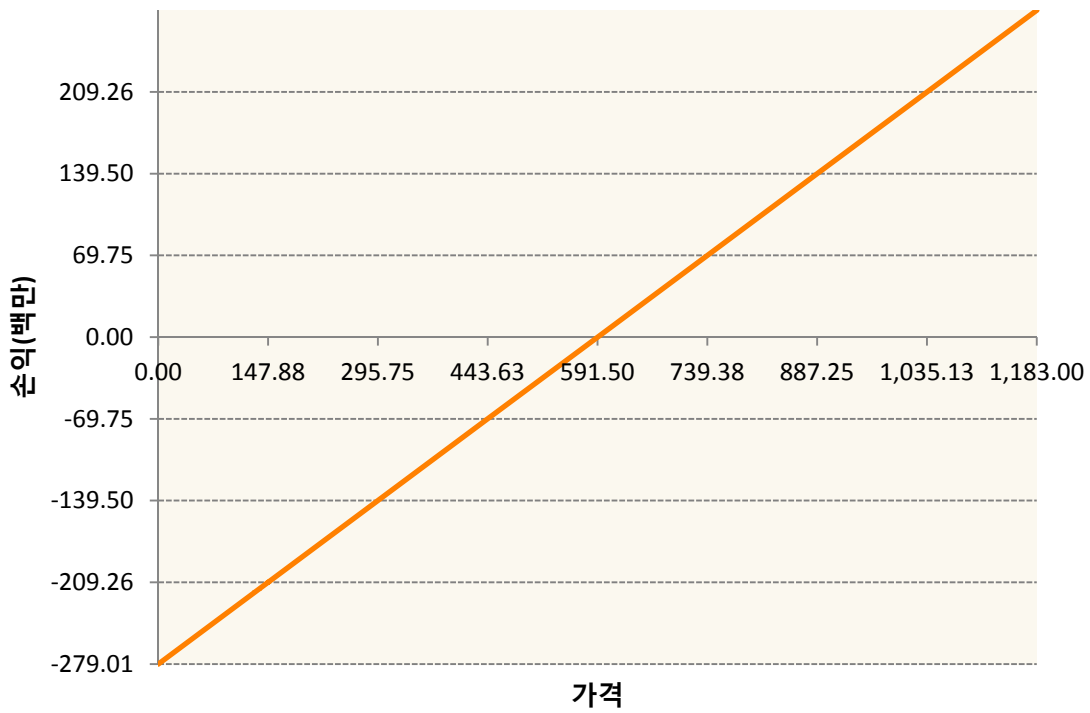




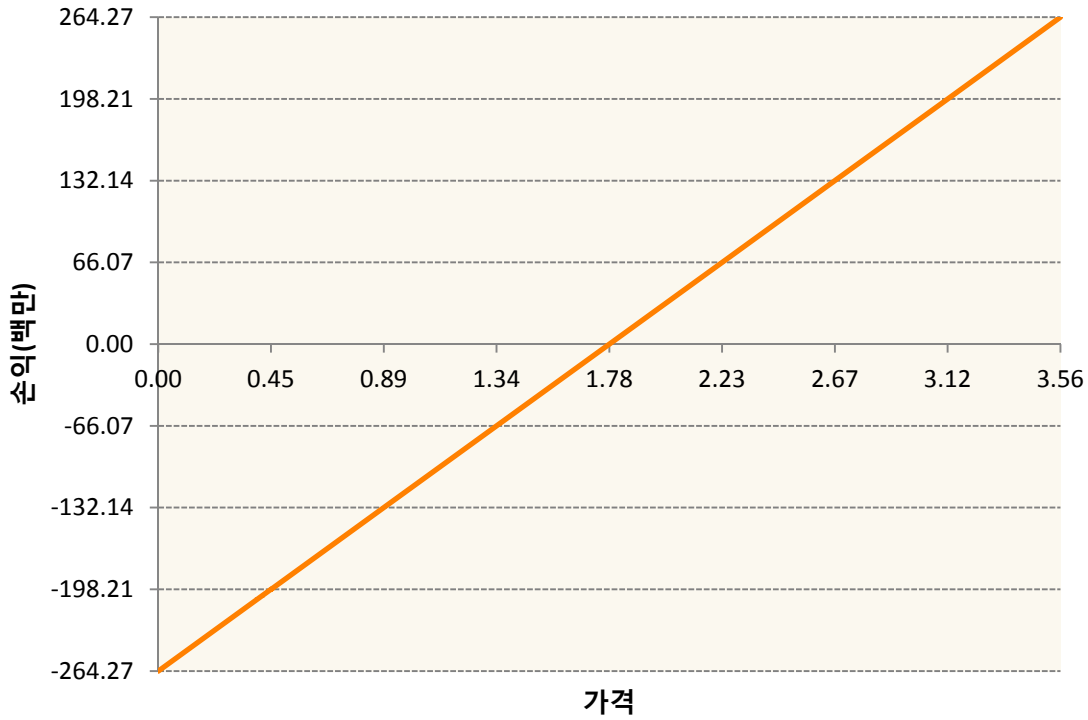
NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



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)

385

공시일	2019-06-25
기준일	2019-06-24

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

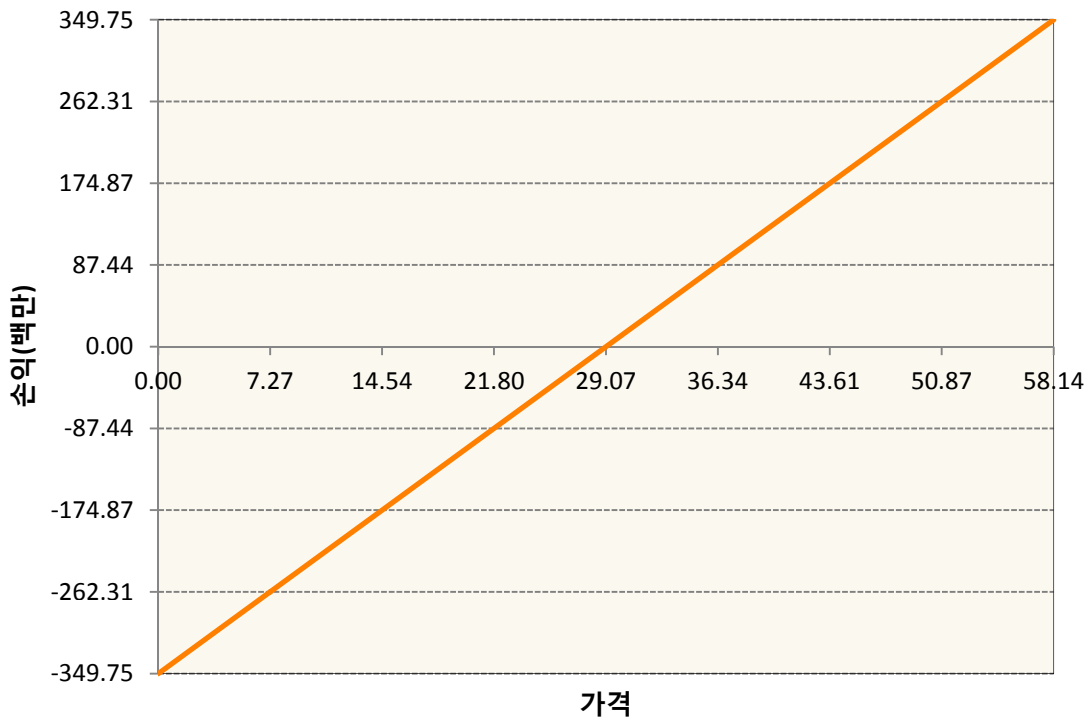
1. 계약금액

(단위:백만원)

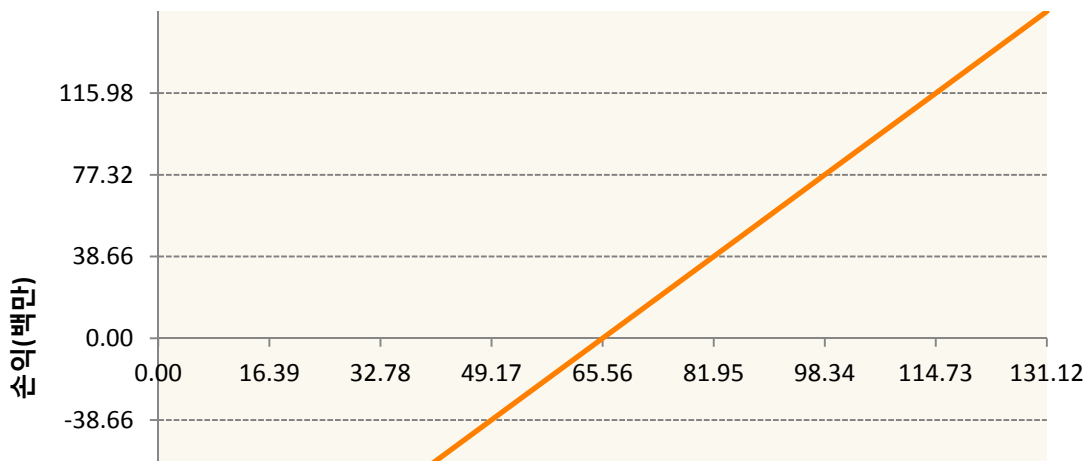
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,214	196	3,018	

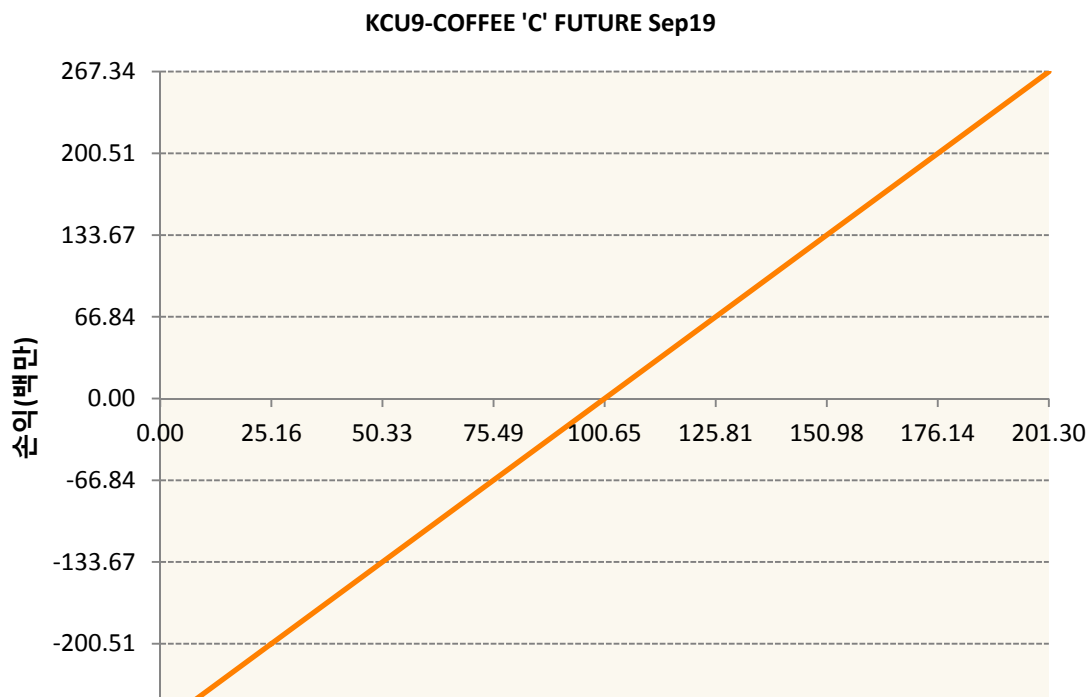
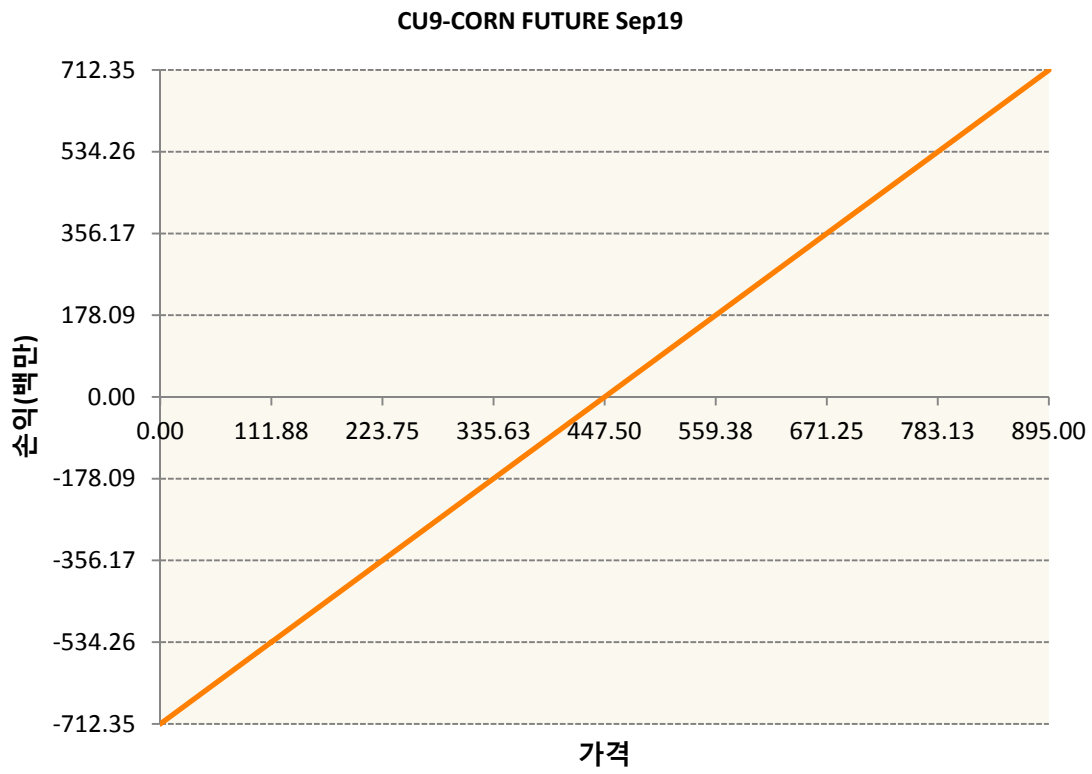
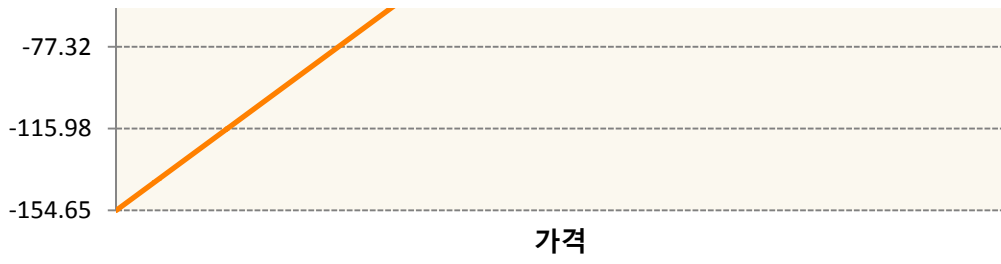
2. 만기시점의 손익구조

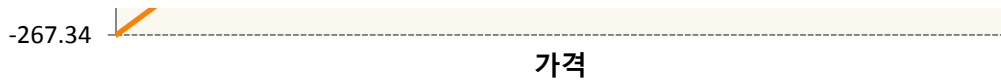
BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19



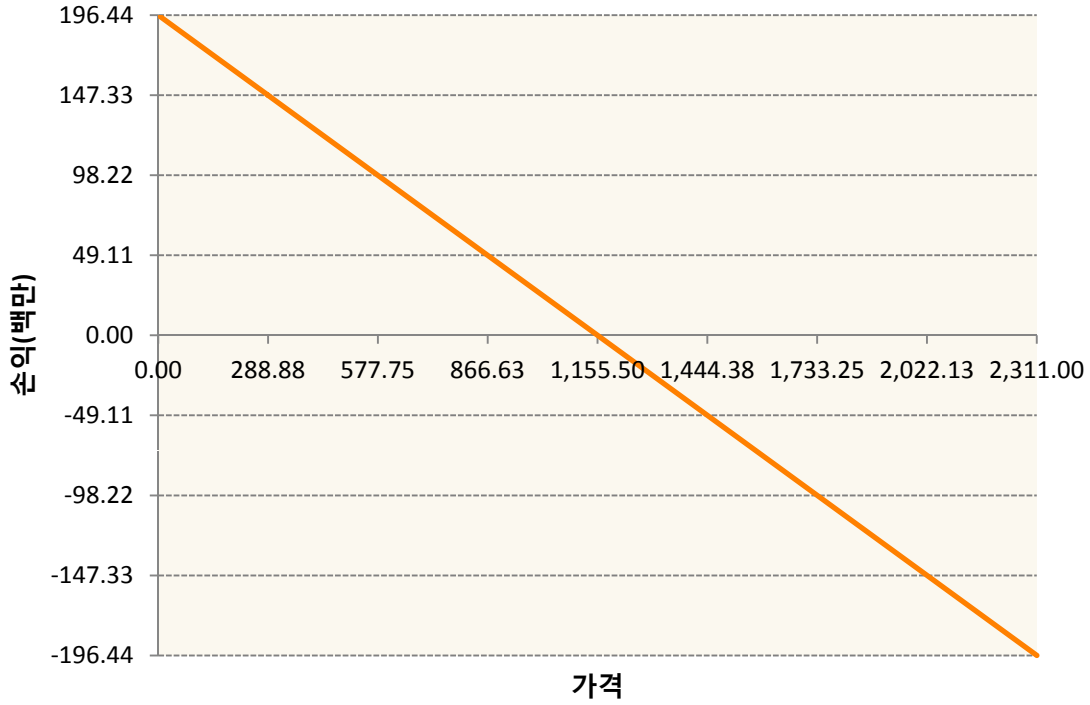
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



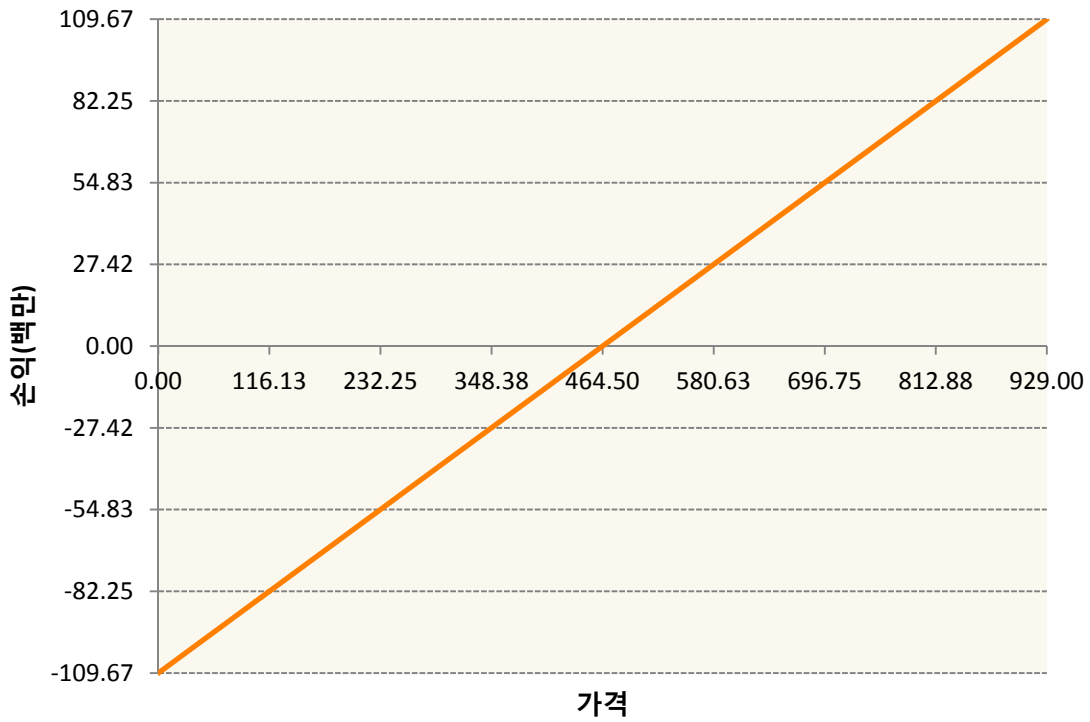




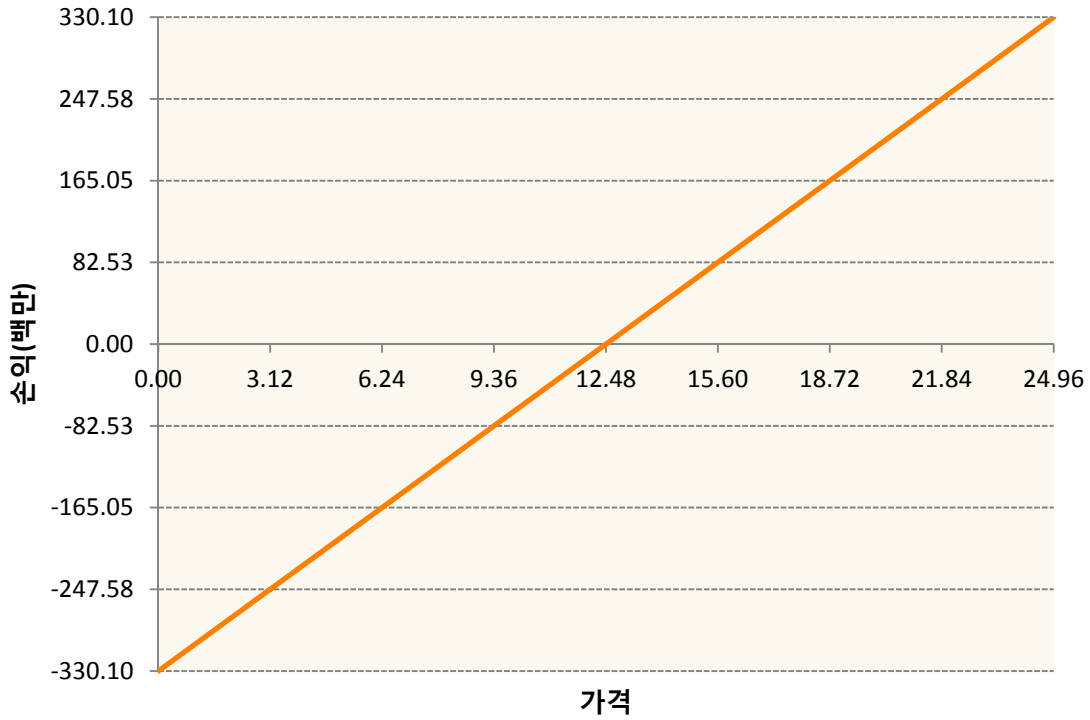
KR4175P70007-2019-07 달러선물



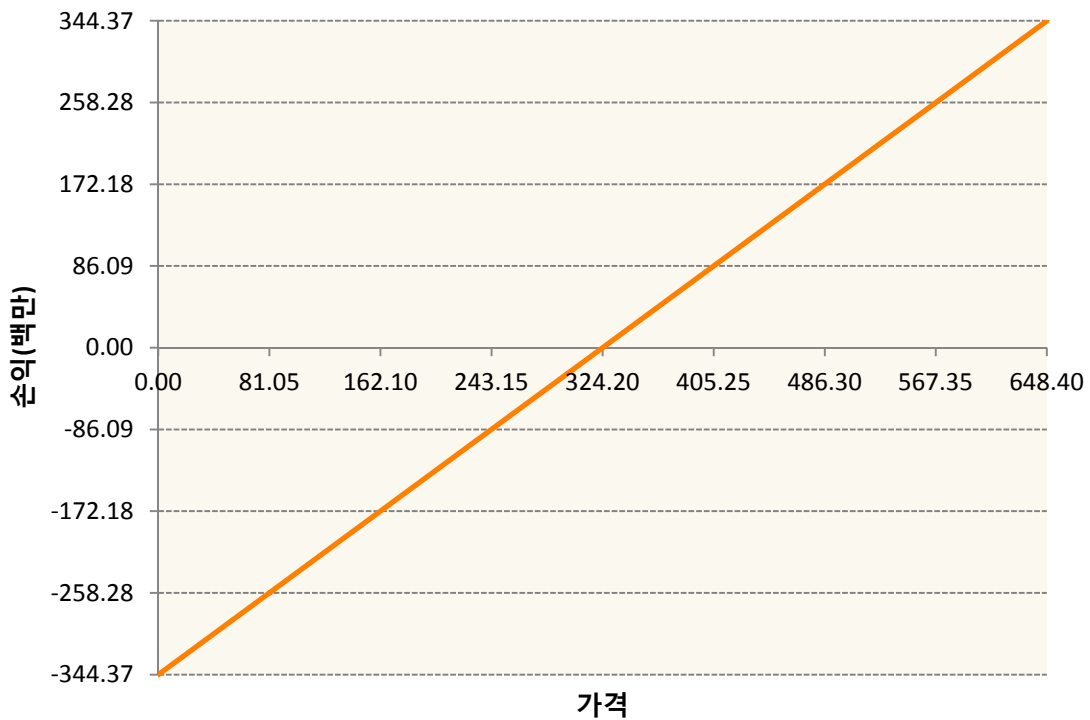
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

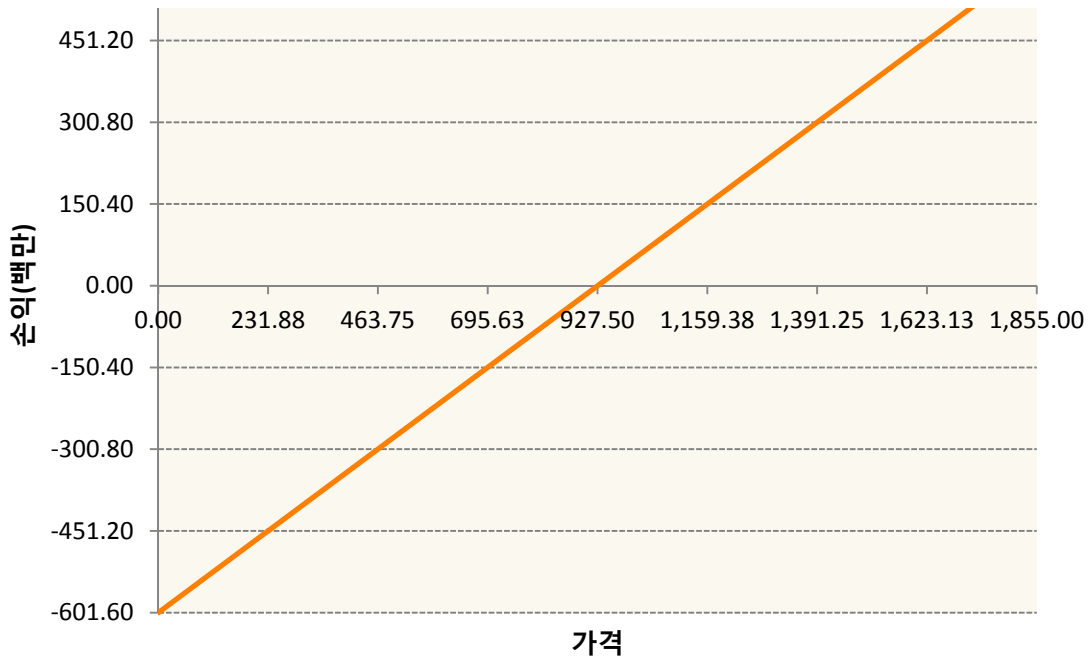


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

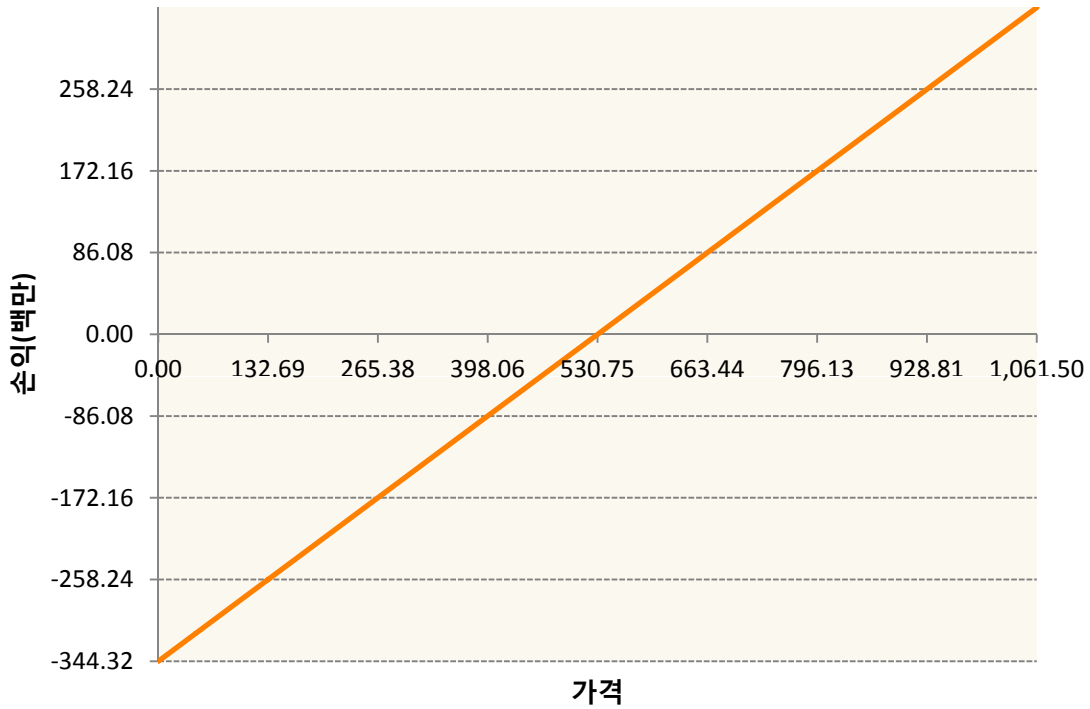


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





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	57
KCU9	COFFEE 'C' FUTURE Sep19	21
KR4175P700	2019-07 달러선물	16

KWU9	KC HRW WHEAT FUT Sep19	9
SBV9	SUGAR #11 (WORLD) Oct19	26
SMZ9	SOYBEAN MEAL FUTR Dec19	28
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	48
WU9	WHEAT FUTURE(CBT) Sep19	28

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

(단위:백만원)

278