

공시일	2019-06-26
기준일	2019-06-25

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	2019-06-26
기준일	2019-06-25

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	2019-06-26
기준일	2019-06-25

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)

865

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-26
기준일	2019-06-25

유로인덱스모(주식-파생형)

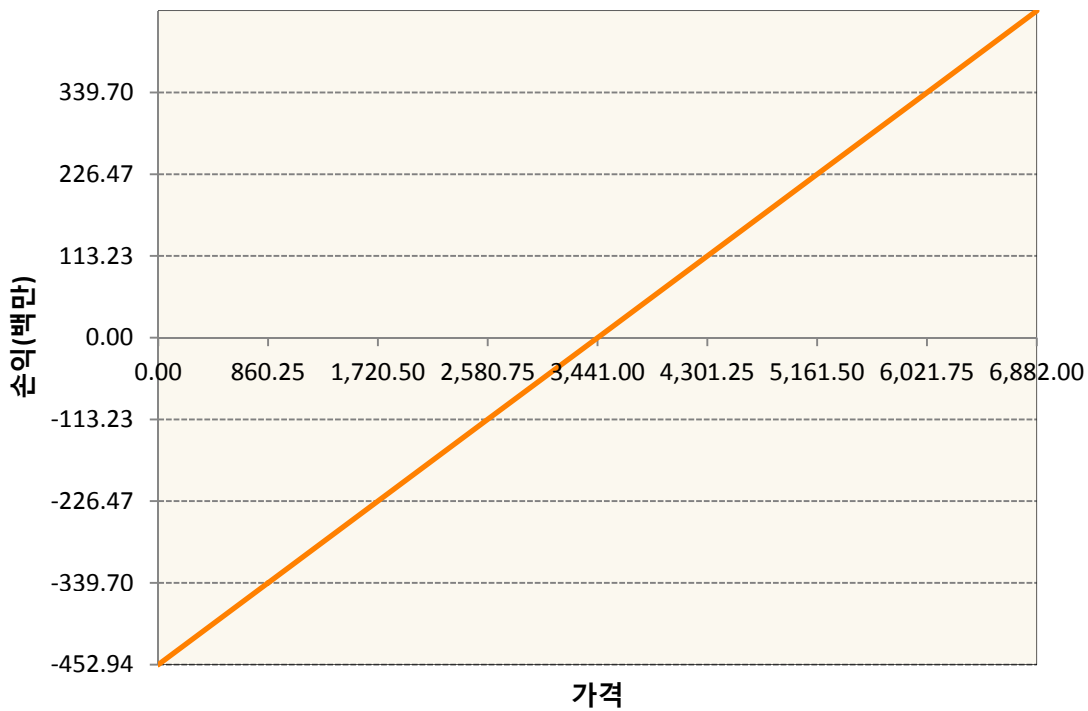
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	453	0	453	

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	2019-06-26
기준일	2019-06-25

차이나인덱스모(주식-파생형)

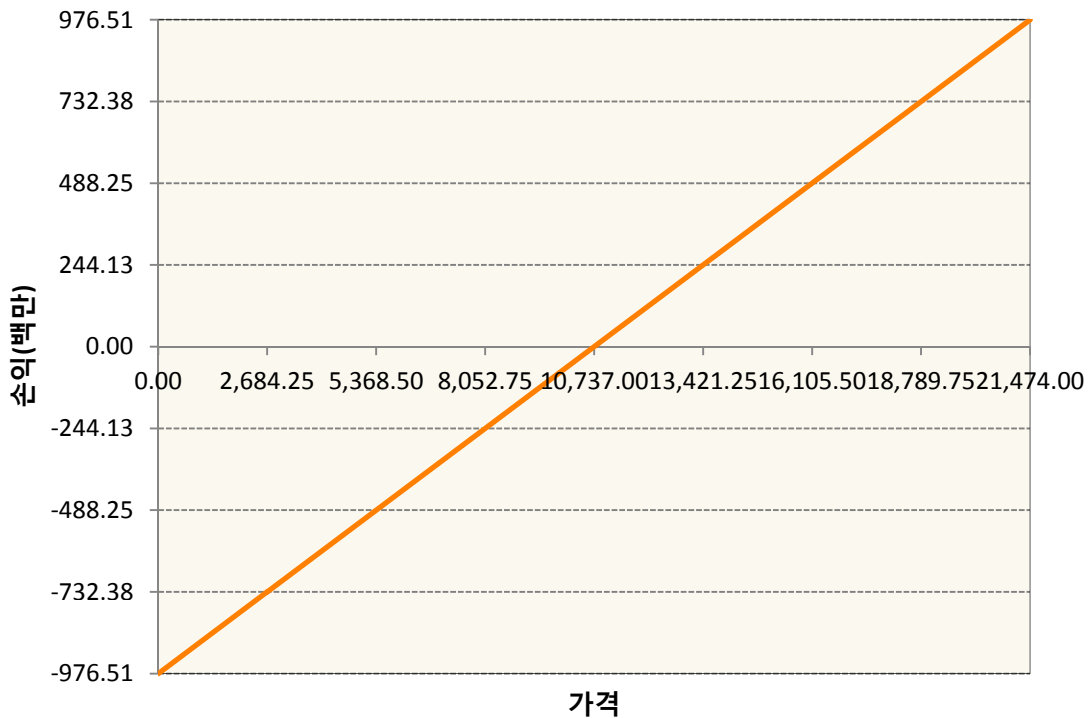
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	977	0	977	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	2019-06-26
기준일	2019-06-25

커버드콜모(주식혼합-파생형)

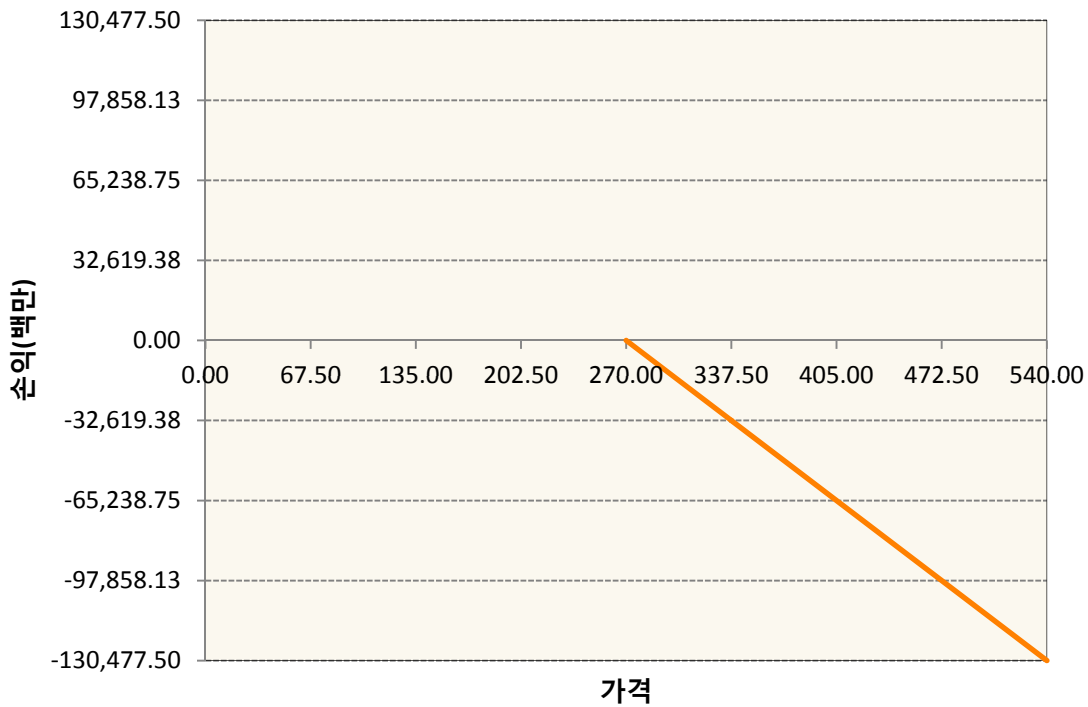
1. 계약금액

(단위:백만원)

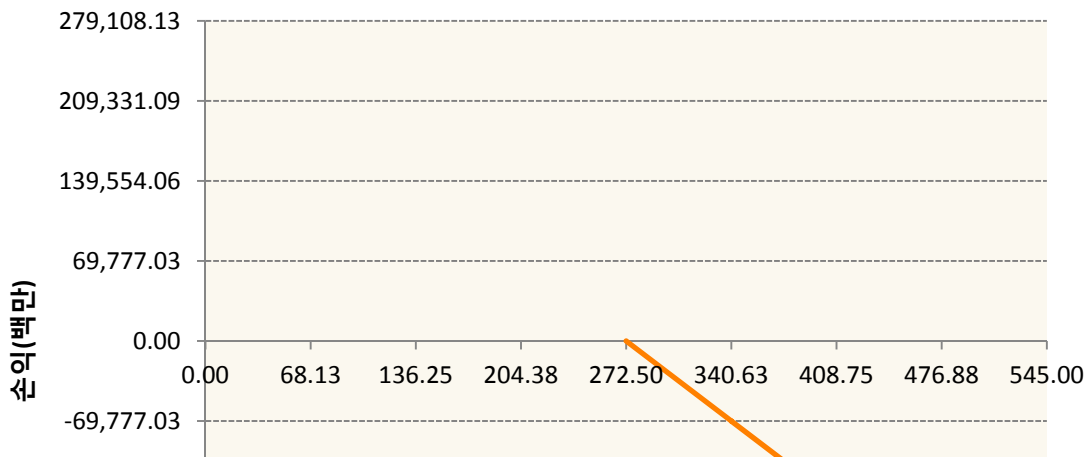
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	602,973	-602,973	장내

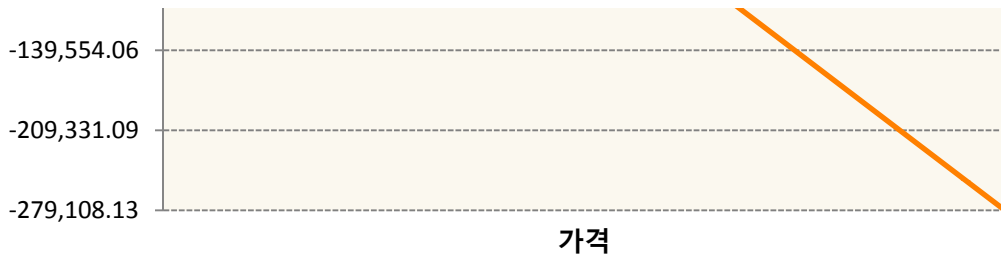
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P72700-2019-07 콜270

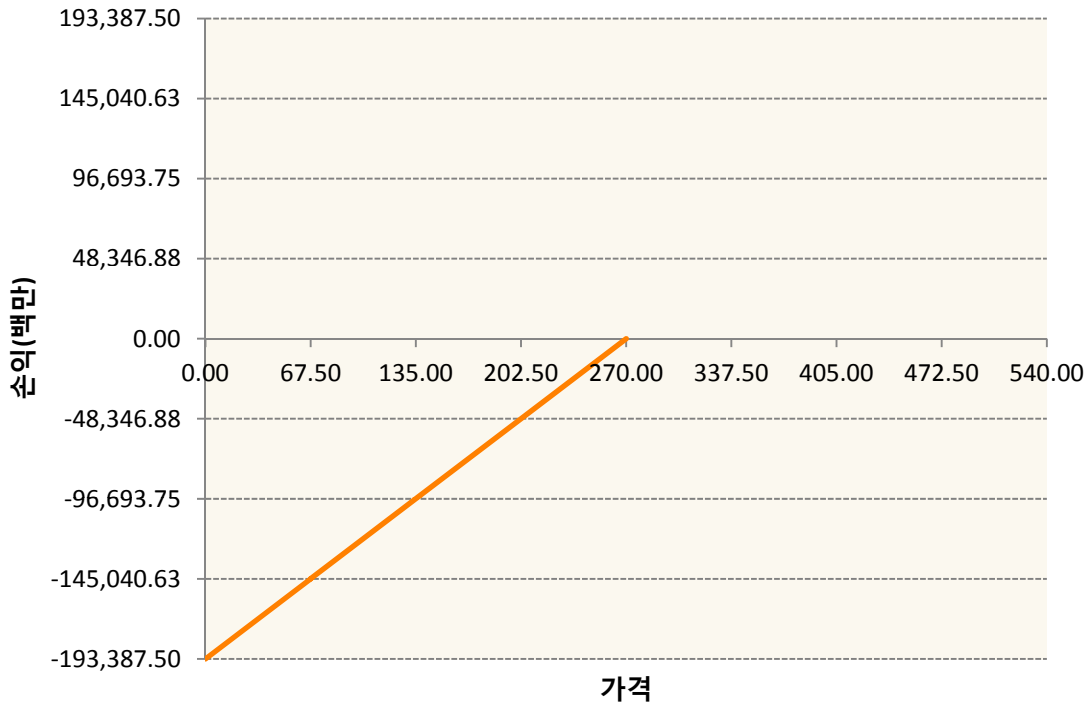


KR4201P72726-2019-07 콜272.5





KR4301P72708-2019-07 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P72700		2019-07 콜270					9,211
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,109	4,039	3,953	3,852	3,738	3,612	3,477
-5.33%	3,705	3,547	3,378	3,201	3,017	2,827	2,633
-2.67%	2,633	2,407	2,181	1,953	1,726	1,498	1,269
0%	643	432	218	0	-220	-442	-665
2.67%	-2,160	-2,293	-2,440	-2,600	-2,769	-2,947	-3,131
5.33%	-5,443	-5,502	-5,577	-5,668	-5,774	-5,893	-6,023
8.00%	-8,919	-8,938	-8,967	-9,009	-9,063	-9,131	-9,211
KR4201P72726		2019-07 콜272.5					18,720
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,288	7,184	7,047	6,879	6,681	6,457	6,209

-5.33%	6,717	6,444	6,141	5,814	5,466	5,102	4,724
-2.67%	4,999	4,549	4,091	3,628	3,162	2,692	2,219
0%	1,457	974	488	0	-489	-979	-1,470
2.67%	-3,953	-4,302	-4,675	-5,067	-5,475	-5,895	-6,325
5.33%	-10,633	-10,808	-11,020	-11,266	-11,541	-11,841	-12,163
8.00%	-17,901	-17,964	-18,055	-18,178	-18,330	-18,512	-18,720
KR4301P72708 2019-07 풋270							11,262
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11,150	-11,154	-11,163	-11,177	-11,197	-11,225	-11,262
-5.33%	-5,990	-6,047	-6,119	-6,202	-6,297	-6,402	-6,514
-2.67%	-1,681	-1,859	-2,040	-2,221	-2,404	-2,588	-2,772
0%	438	300	153	0	-159	-322	-488
2.67%	876	846	804	750	684	607	520
5.33%	908	906	902	893	879	859	831
8.00%	909	909	909	908	907	903	898

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

(단위:백만원)

40,315

공시일	2019-06-26
기준일	2019-06-25

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

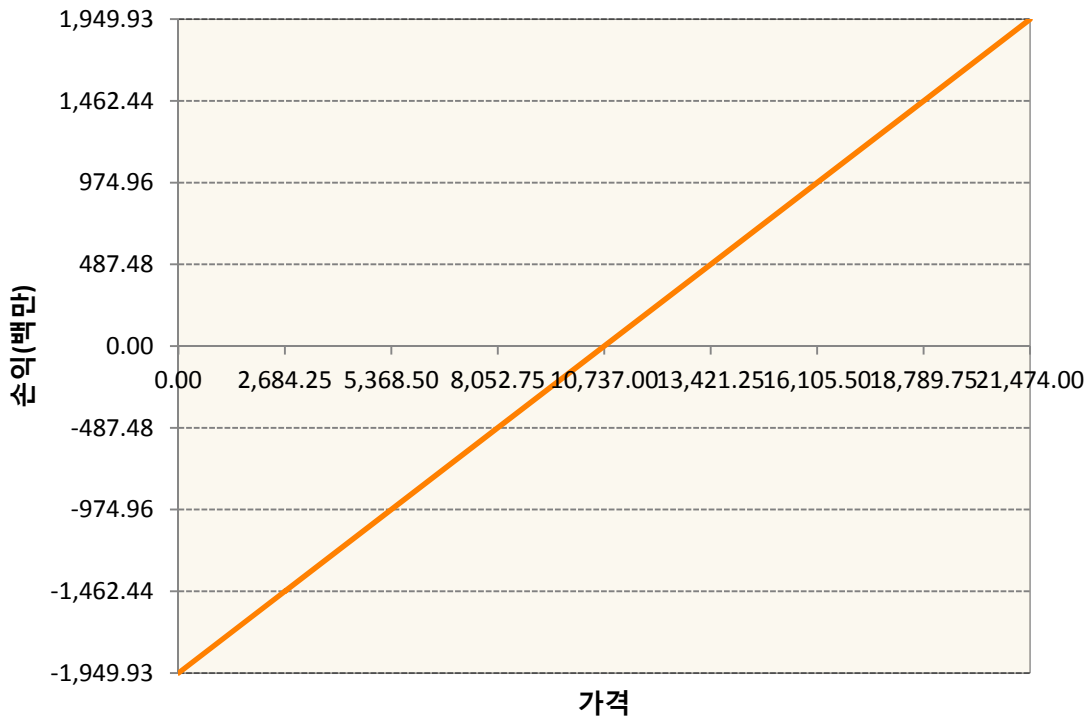
1. 계약금액

(단위:백만원)

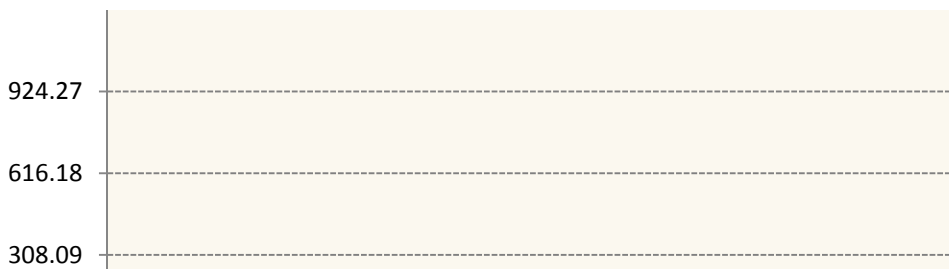
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,950	0	1,950	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,953	-4,953	장내
누계	통화	선도	148	3,110	-2,962	장외

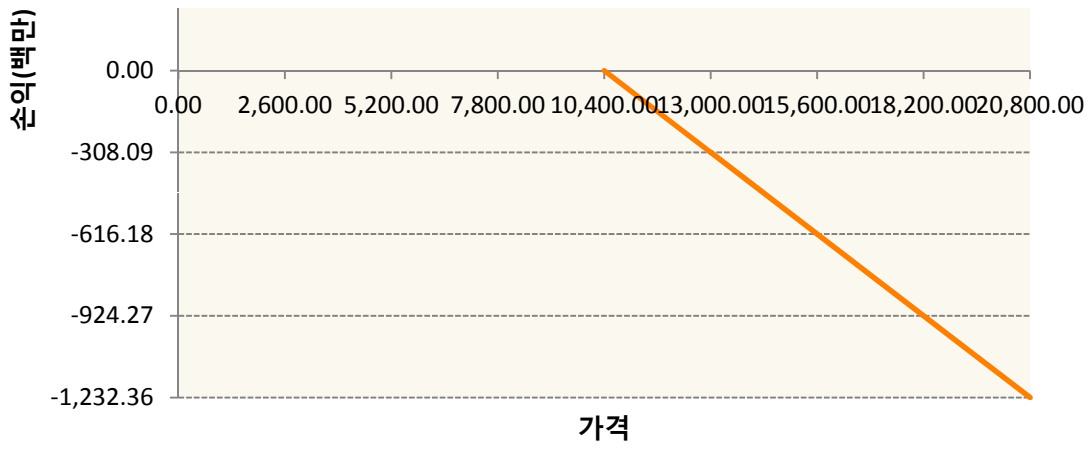
2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19

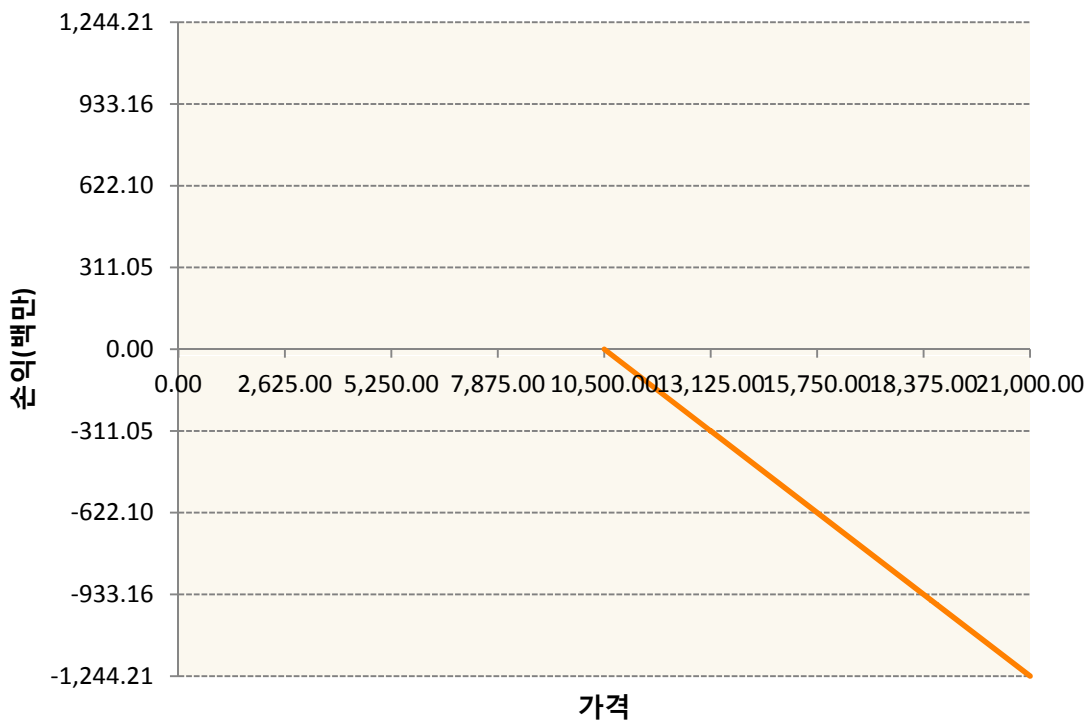


OHHIM9-C104-HSCEI

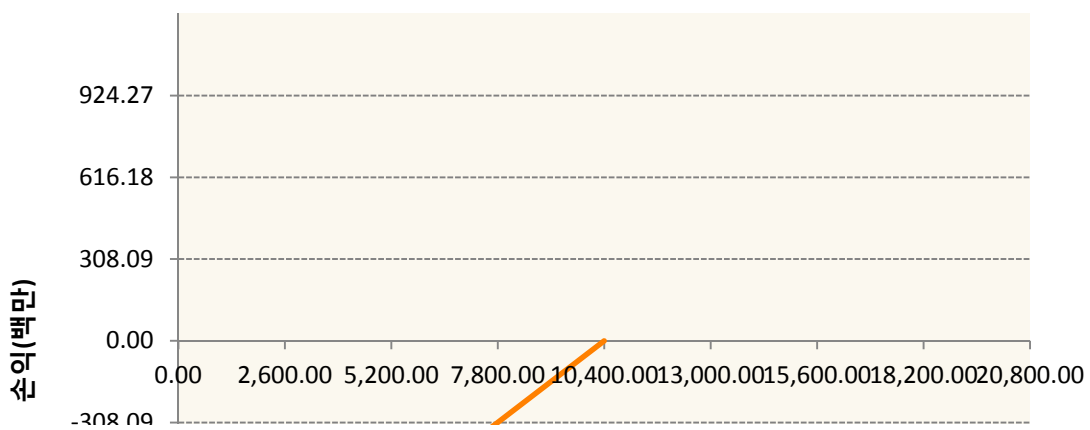


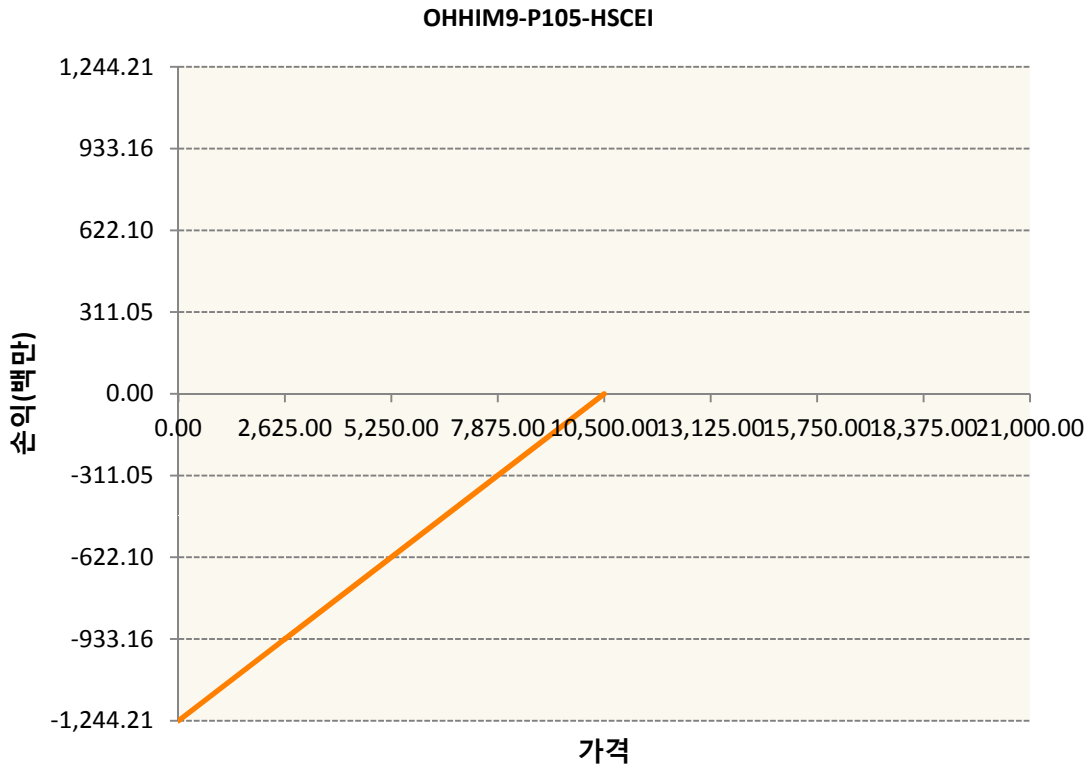


OHHIM9-C105-HSCEI



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	156
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)

644

공시일	2019-06-26
기준일	2019-06-25

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

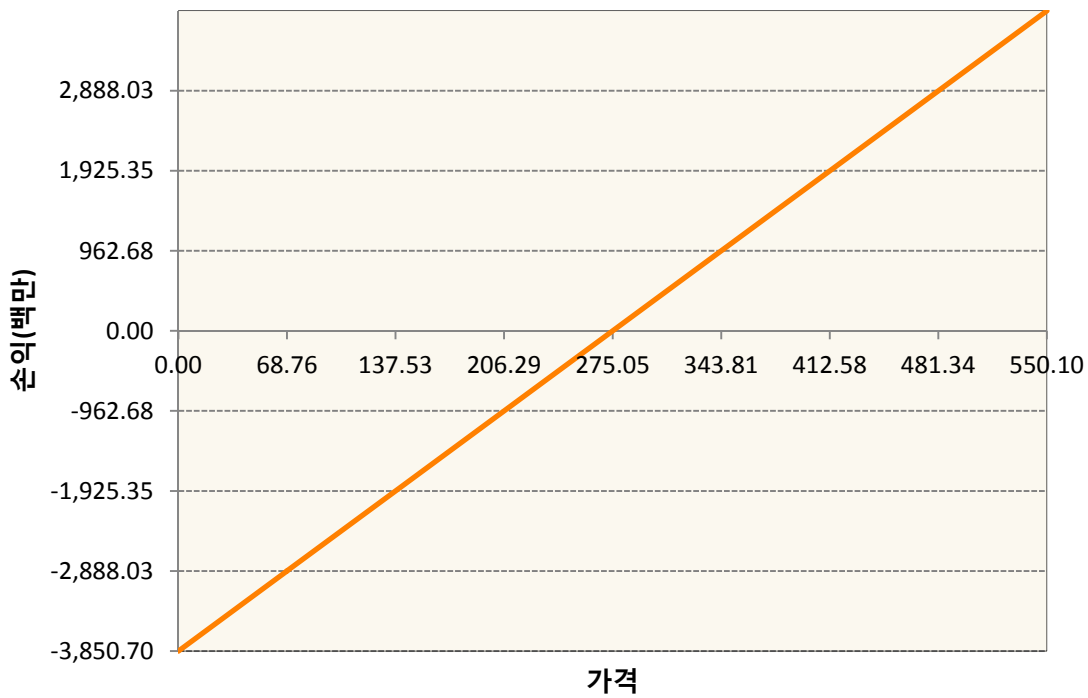
1. 계약금액

(단위:백만원)

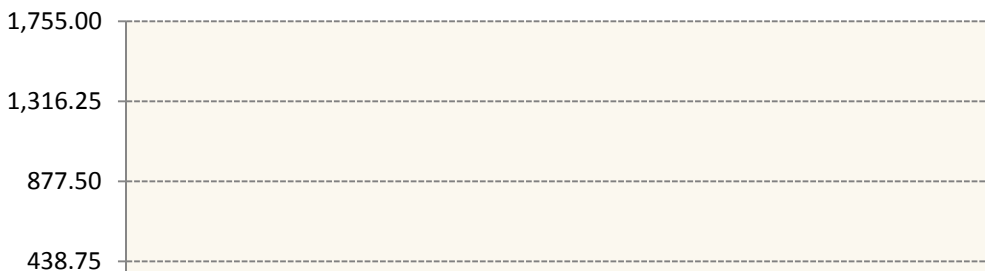
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,851	0	3,851	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,880	-20,880	장내

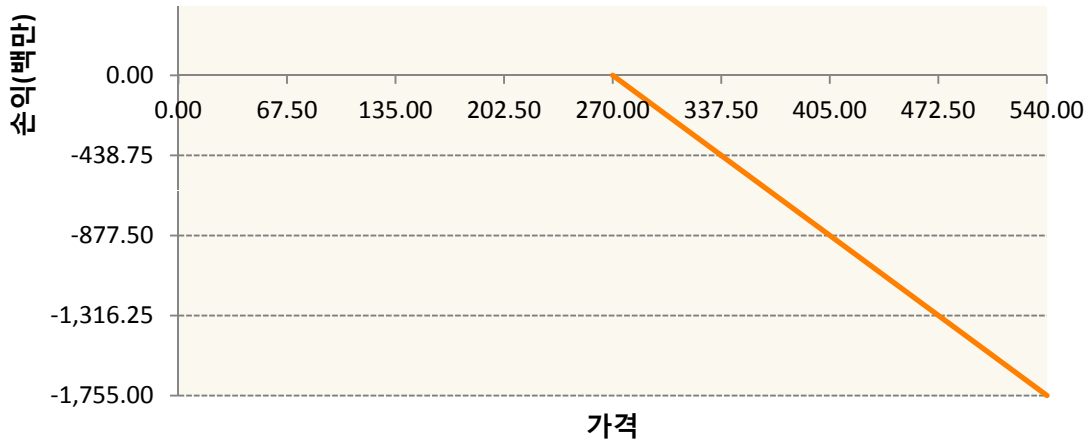
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

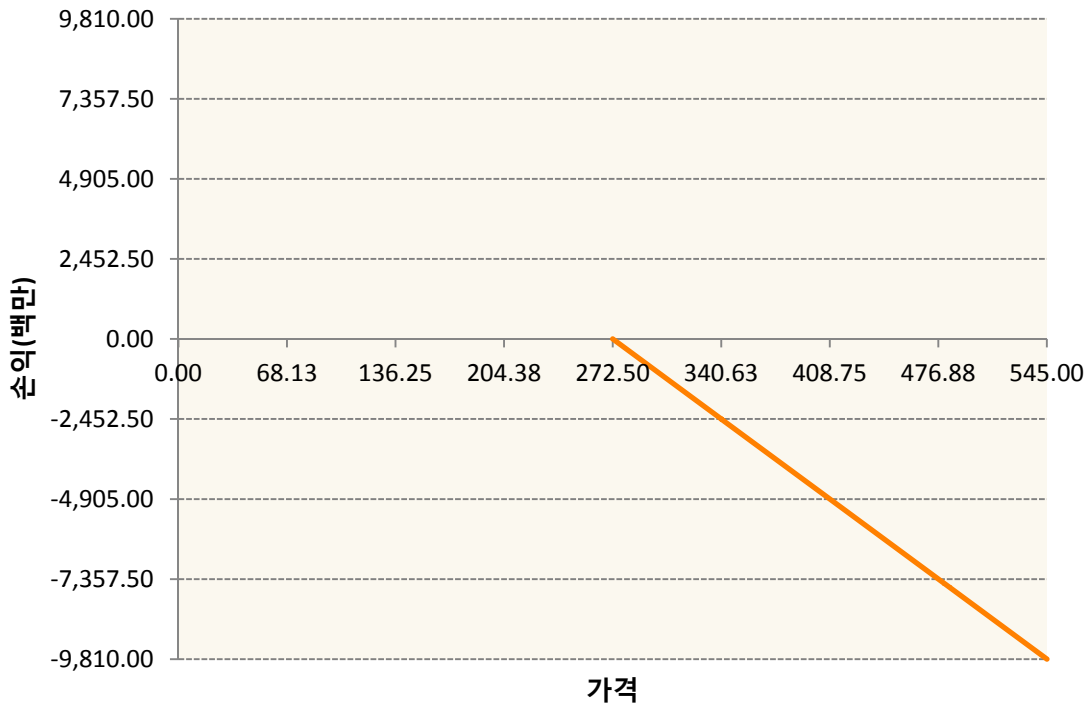


KR4201P72700-2019-07 콜270

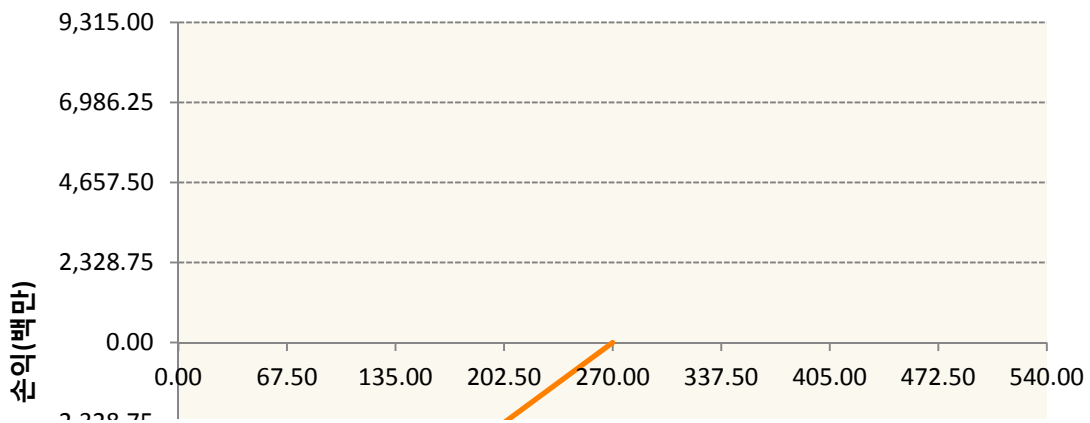


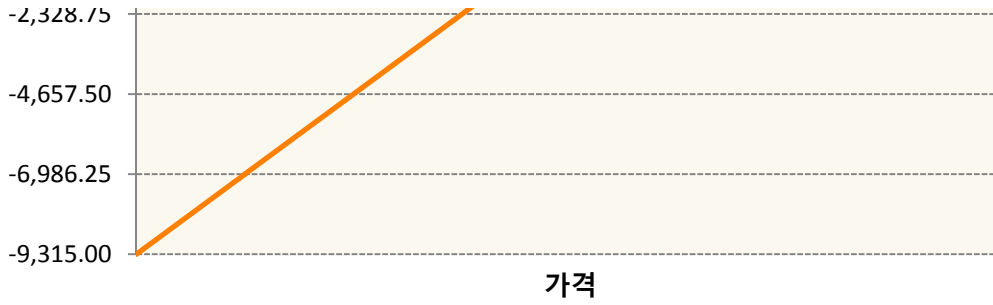


KR4201P72726-2019-07 콜272.5



KR4301P72708-2019-07 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,175
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,175	-1,175	-1,175	-1,175	-1,175	-1,175	-1,175	
-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%	1,175	1,175	1,175	1,175	1,175	1,175	1,175	
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%	-396	-396	-396	-396	-396	-396	-396	
-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%	396	396	396	396	396	396	396	
8.00%	595	595	595	595	595	595	595	
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						124
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	55	54	53	52	50	49	47
-5.33%	50	48	45	43	41	38	35
-2.67%	35	32	29	26	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	-121	-121	-122	-123	-124
KR4201P72726 2019-07 콜272.5							658
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	256	253	248	242	235	227	218
-5.33%	236	226	216	204	192	179	166
-2.67%	176	160	144	128	111	95	78
0%	51	34	17	0	-17	-34	-52
2.67%	-139	-151	-164	-178	-192	-207	-222
5.33%	-374	-380	-387	-396	-406	-416	-427
8.00%	-629	-631	-635	-639	-644	-651	-658
KR4301P72708 2019-07 풋270							542
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-537	-537	-538	-538	-539	-541	-542
-5.33%	-289	-291	-295	-299	-303	-308	-314
-2.67%	-81	-90	-98	-107	-116	-125	-134
0%	21	14	7	0	-8	-15	-24
2.67%	42	41	39	36	33	29	25
5.33%	44	44	43	43	42	41	40
8.00%	44	44	44	44	44	44	43

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

(단위:백만원)

3,378

공시일	2019-06-26
기준일	2019-06-25

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

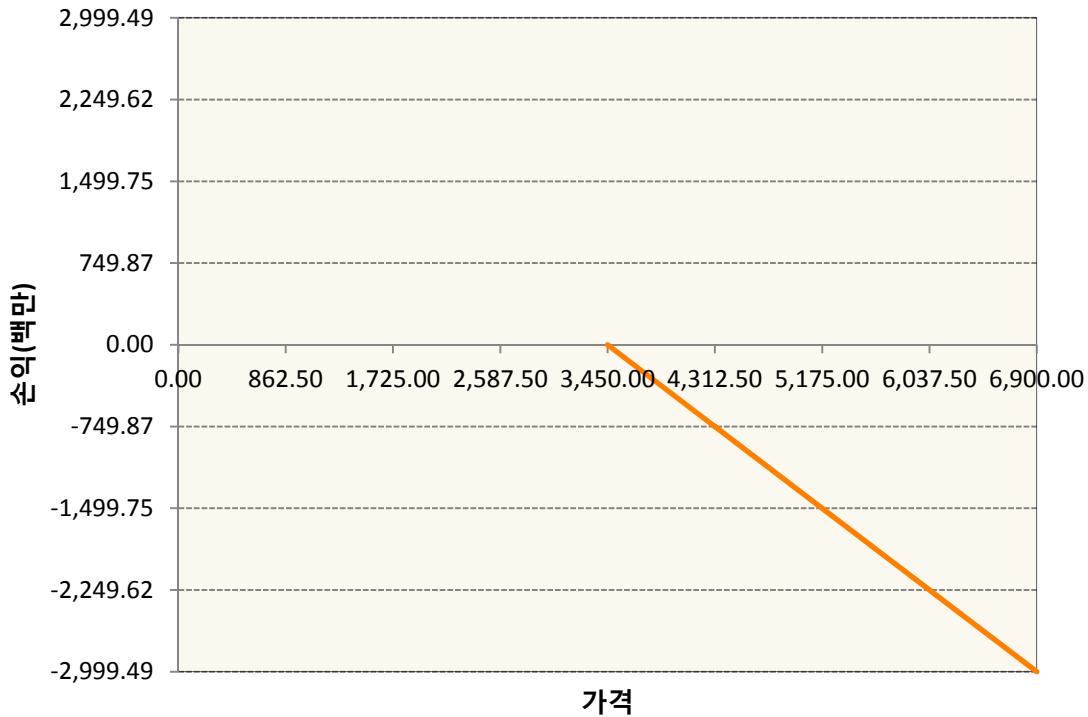
1. 계약금액

(단위:백만원)

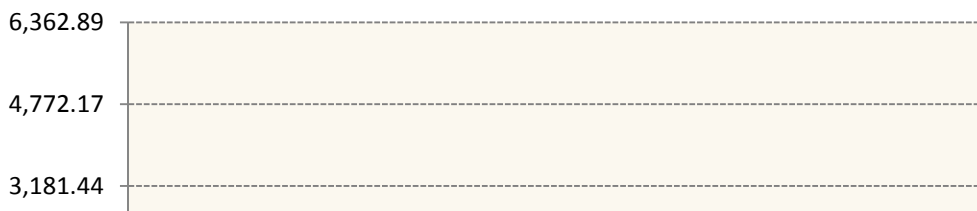
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,899	0	2,899	
누계	유가증권	스왑	55,758	0	55,758	장외
누계	유가증권	옵션	0	18,725	-18,725	장내
누계	통화	선도	0	18,442	-18,442	장외

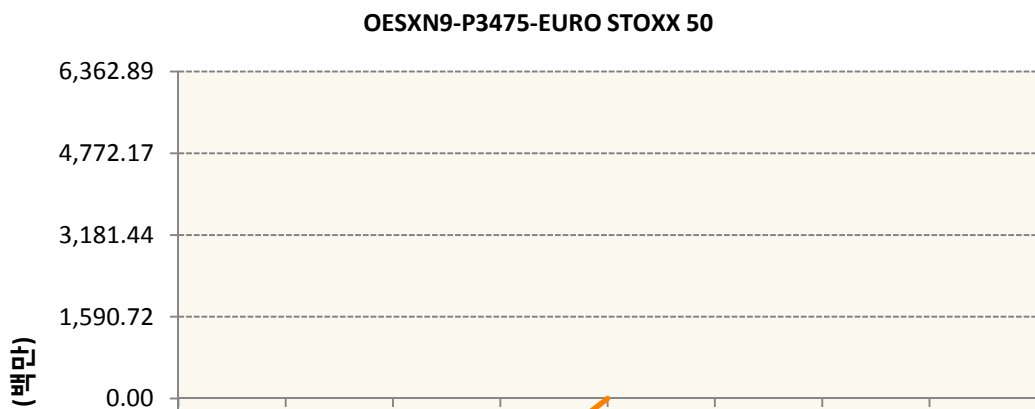
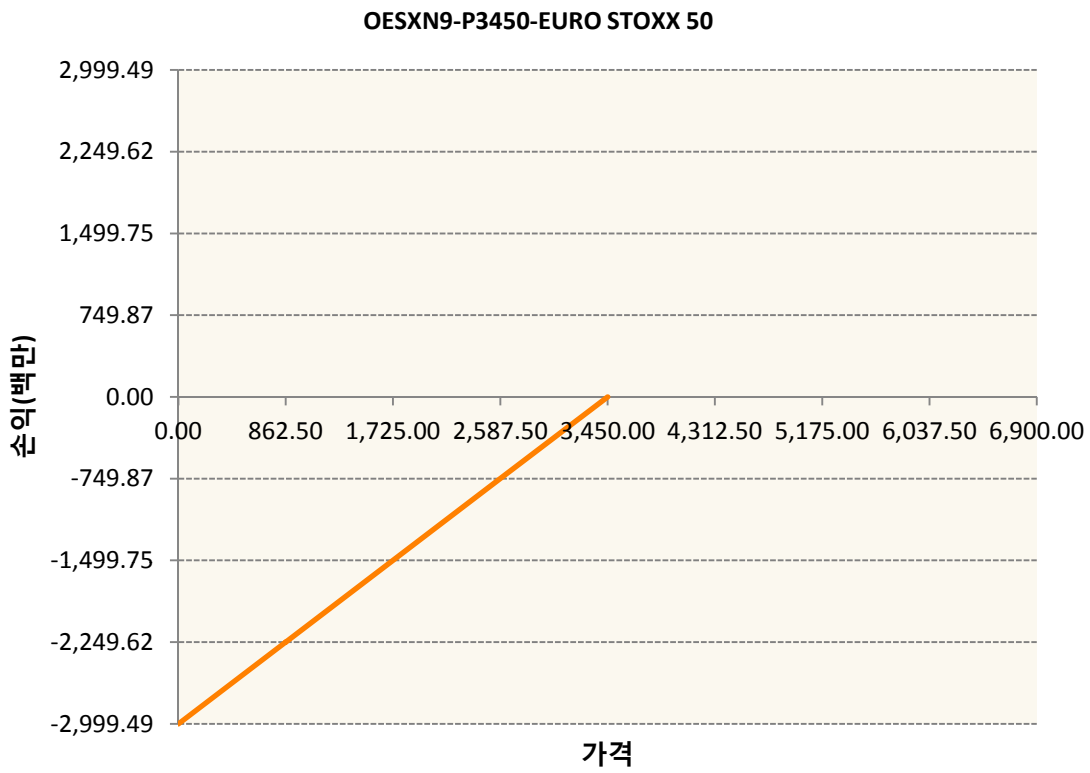
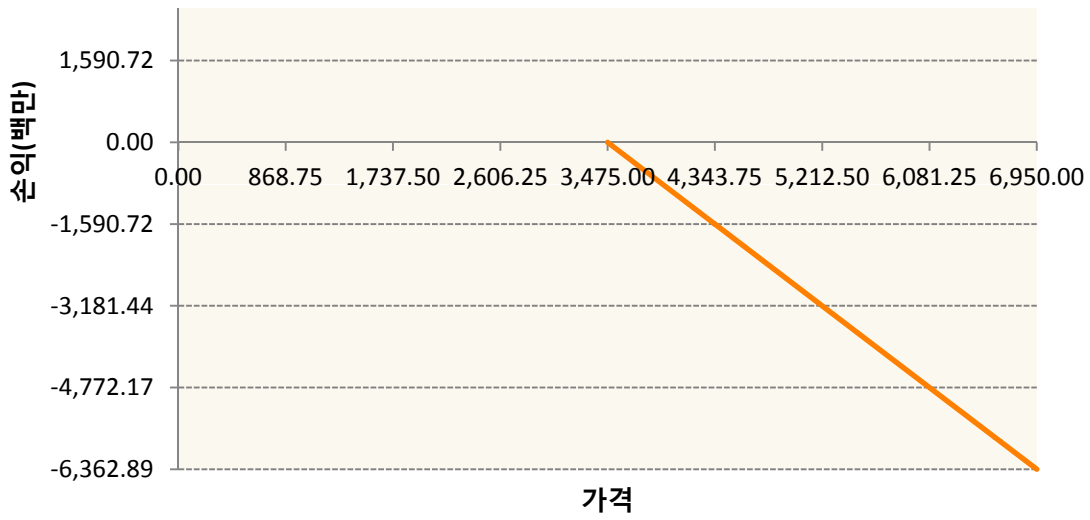
2. 만기시점의 손익구조

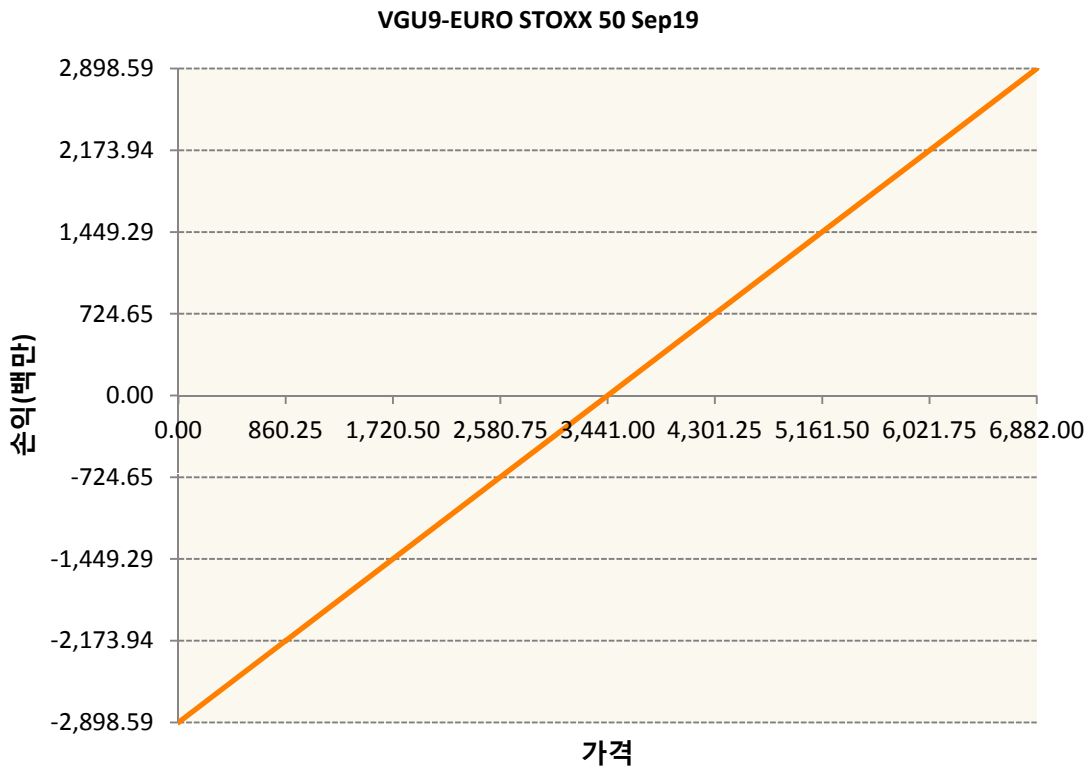
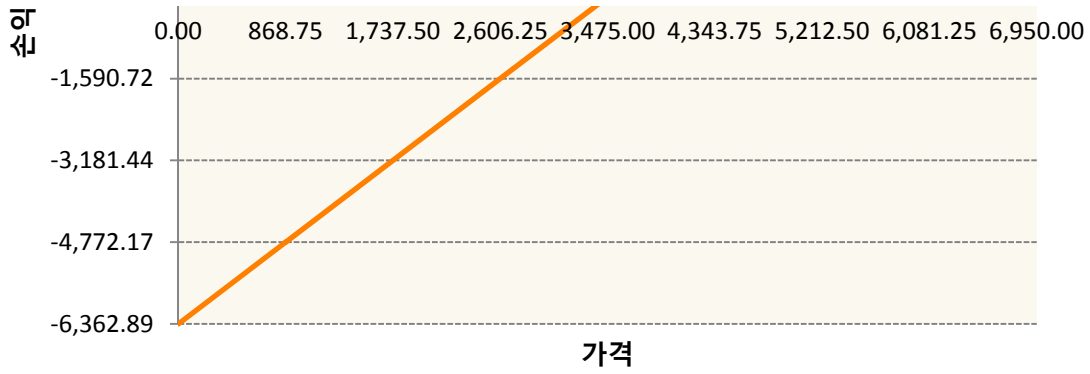
OESXN9-C3450-EURO STOXX 50



OESXN9-C3475-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	46
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	843
FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E	211
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	422
OESXN9-C3 EURO STOXX 50	240
OESXN9-C3 EURO STOXX 50	509
OESXN9-P3 EURO STOXX 50	240
OESXN9-P3 EURO STOXX 50	509
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	232

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

(단위:백만원)

1,999

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

(단위:백만원)

1,037

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

(단위:백만원)

92

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

(단위:백만원)

133

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-06-26
기준일	2019-06-25

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

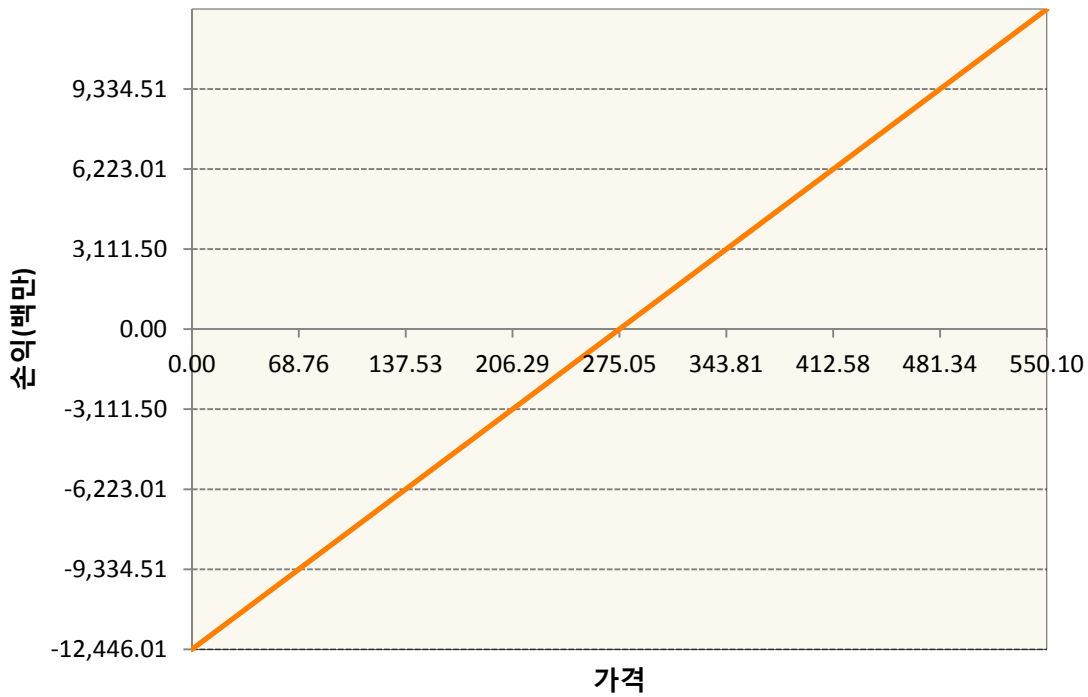
1. 계약금액

(단위:백만원)

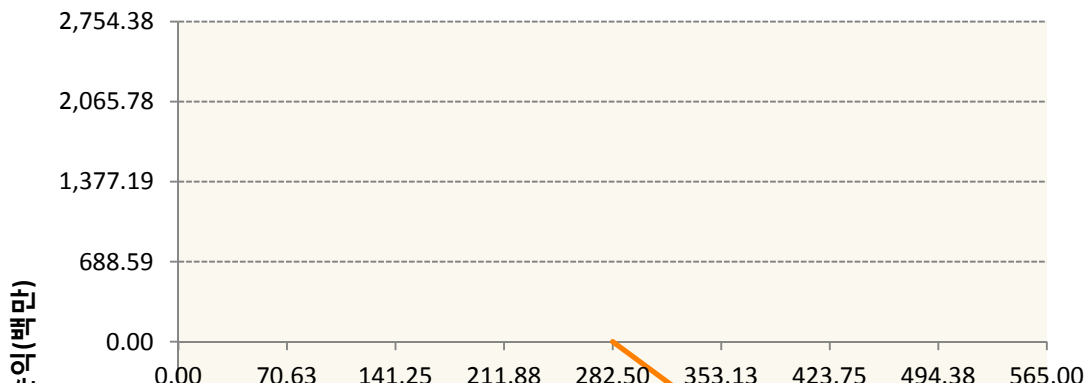
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	71	0	71	장내
누계	유가증권	선물	12,446	0	12,446	장내
누계	유가증권	옵션	1,084	22,134	-21,050	장내

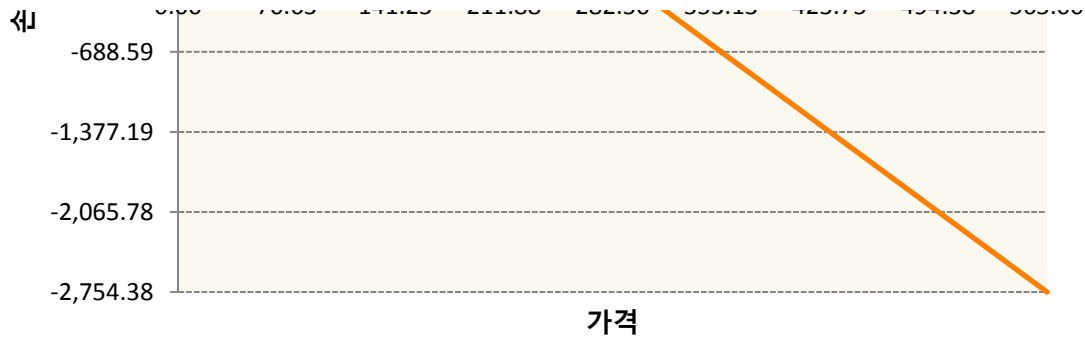
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

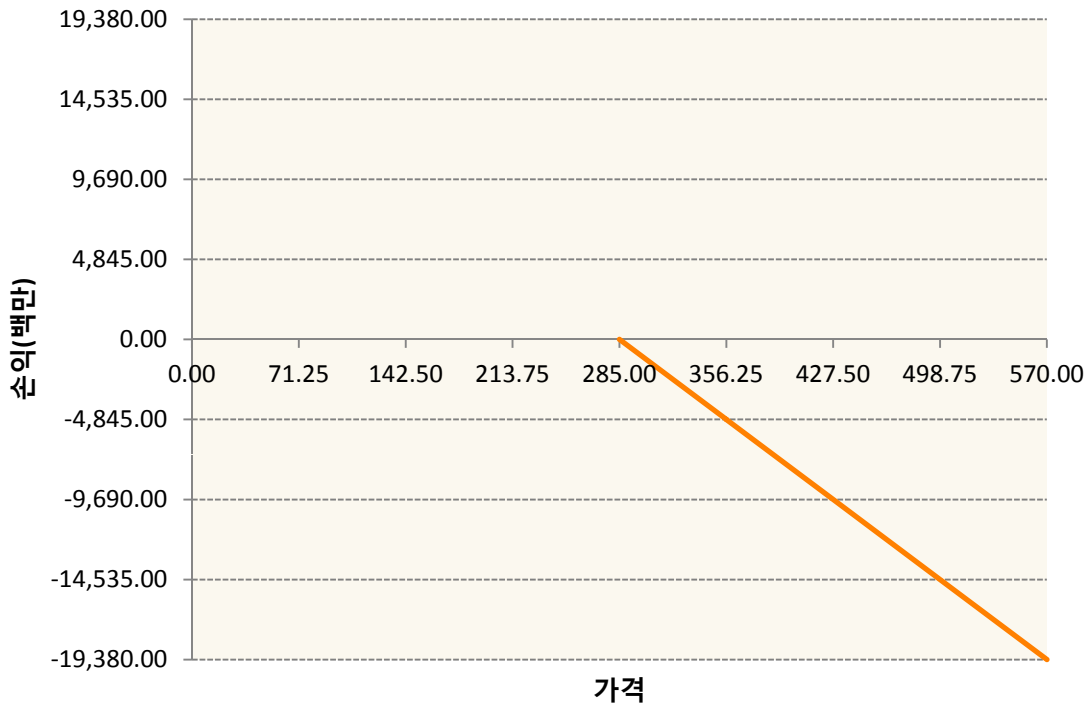


KR4201P72825-2019-07 콜282.5

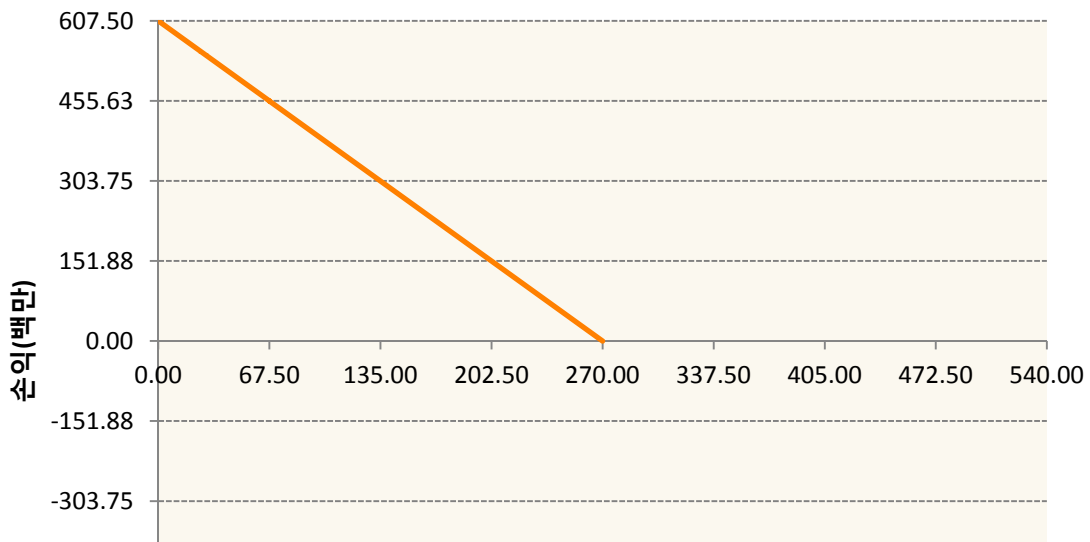


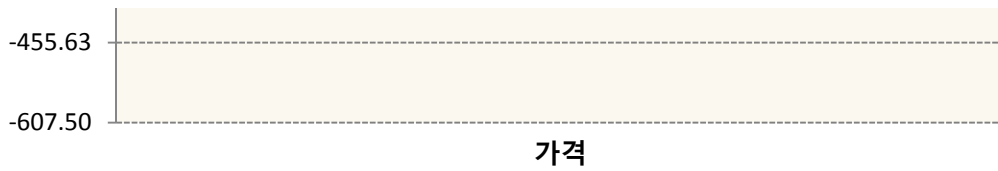


KR4201P72858-2019-07 콜285

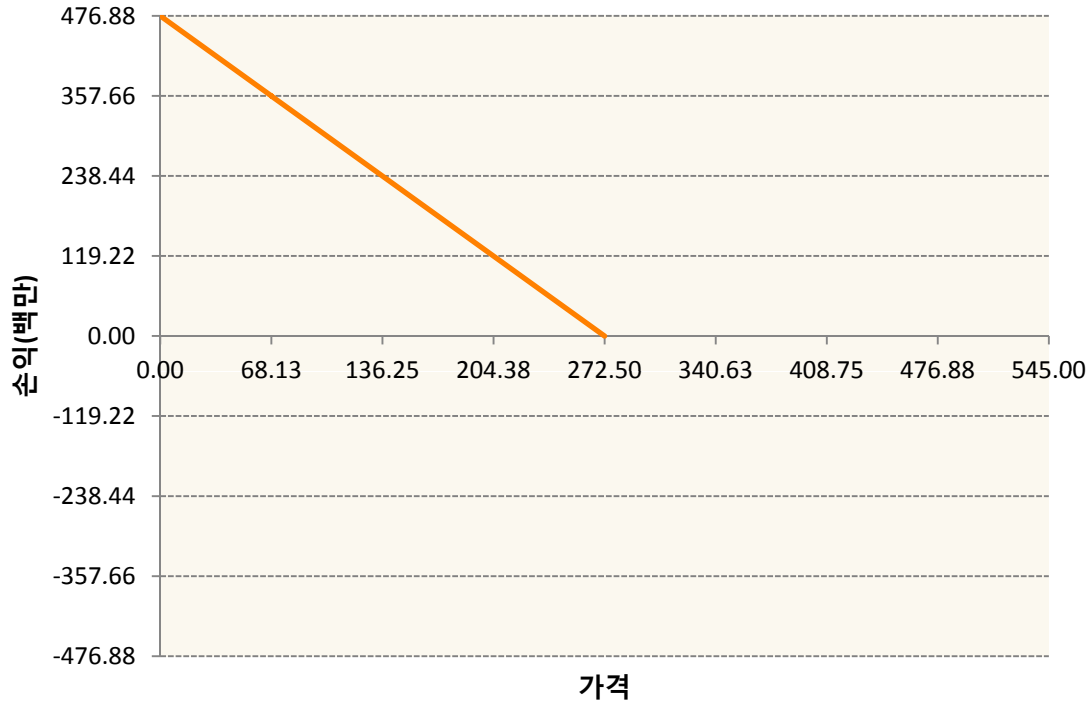


KR4301P72708-2019-07 풋270





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						138
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	29	29	28	28	27	26	25	
-5.33%	28	27	26	25	23	22	19	
-2.67%	24	22	20	17	14	11	7	

0%	12	8	4	0	-4	-9	-13
2.67%	-15	-20	-25	-30	-35	-39	-44
5.33%	-60	-64	-69	-73	-77	-82	-86
8.00%	-120	-122	-125	-128	-131	-135	-138
KR4201P72858 2019-07 콜285							885
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	155	154	153	151	148	143	137
-5.33%	152	149	144	137	128	117	105
-2.67%	136	125	111	95	77	58	37
0%	76	52	27	0	-28	-56	-85
2.67%	-75	-108	-142	-176	-209	-243	-277
5.33%	-348	-380	-412	-445	-478	-511	-545
8.00%	-733	-754	-778	-803	-829	-856	-885
KR4301P72708 2019-07 풋270							35
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	35	35	35	35	35	35	35
-5.33%	19	19	19	19	20	20	20
-2.67%	5	6	6	7	8	8	9
0%	-1	-1	0	0	0	1	2
2.67%	-3	-3	-3	-2	-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							30
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	30	30	30	30	30	30	30
-5.33%	17	18	18	18	18	18	18
-2.67%	6	6	7	7	7	8	8
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-2	-2
5.33%	-4	-4	-4	-4	-3	-3	-3
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4

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

(단위:백만원)

1,757

공시일	2019-06-26
기준일	2019-06-25

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	18,852	0	18,852	

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	2019-06-26
기준일	2019-06-25

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	59,663	0	59,663	

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	2019-06-26
기준일	2019-06-25

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	395,336	0	395,336	
누계	통화	선도	0	405,156	-405,156	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		462
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		462
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		370
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		777
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E		277
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E		1,202
FX21019K04 KRW/USD 28-06-19E		1,258
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		647
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		462
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		277
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		462
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		370
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		647
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		925

FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	647
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	647
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E	555
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E	2,960
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E	2,220
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E	277
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E	277
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	777
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	620
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	462
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E	1,850
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E	1,850
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E	684
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E	684

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

(단위:백만원)

10,596

공시일	2019-06-26
기준일	2019-06-25

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

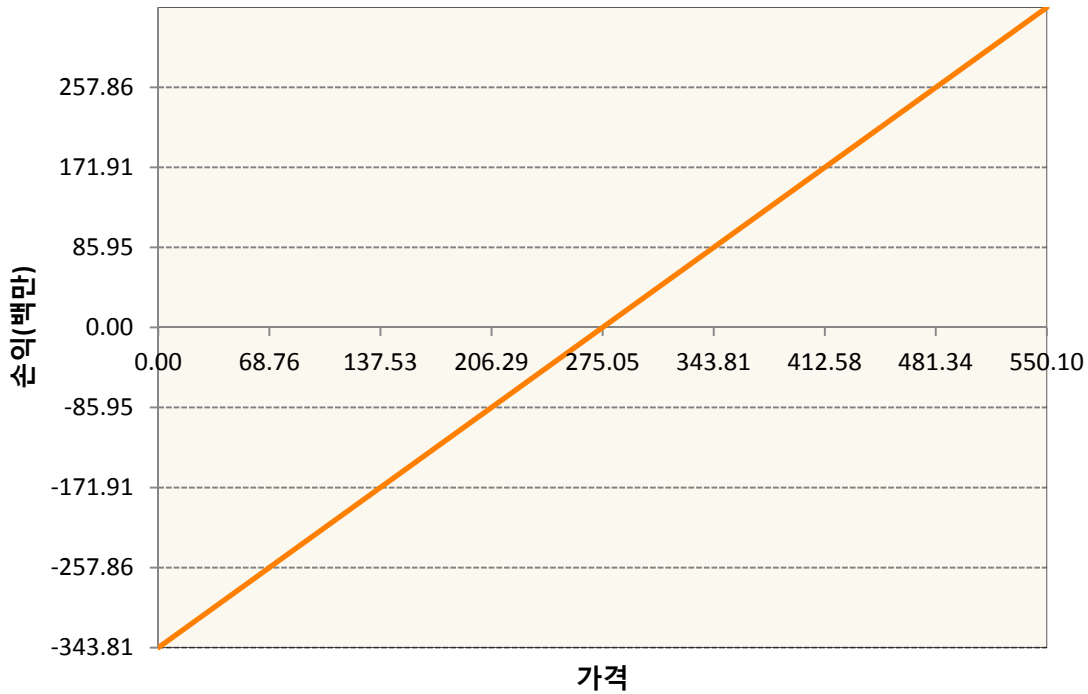
1. 계약금액

(단위:백만원)

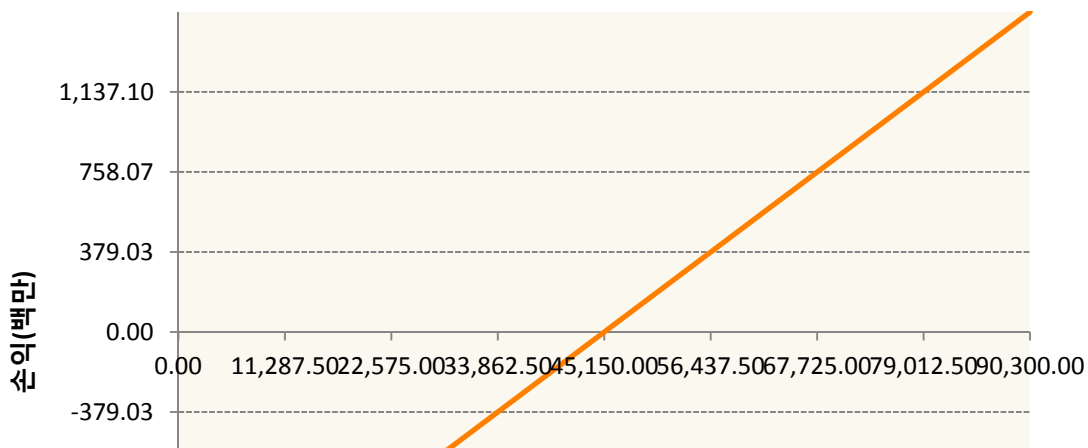
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,860	0	1,860	장내

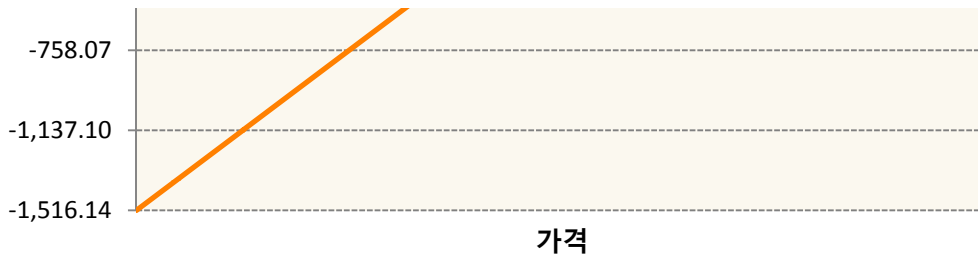
2. 만기시점의 손익구조

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%	-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%	122	122	122	122	122	122	122	

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

161

공시일	2019-06-26
기준일	2019-06-25

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

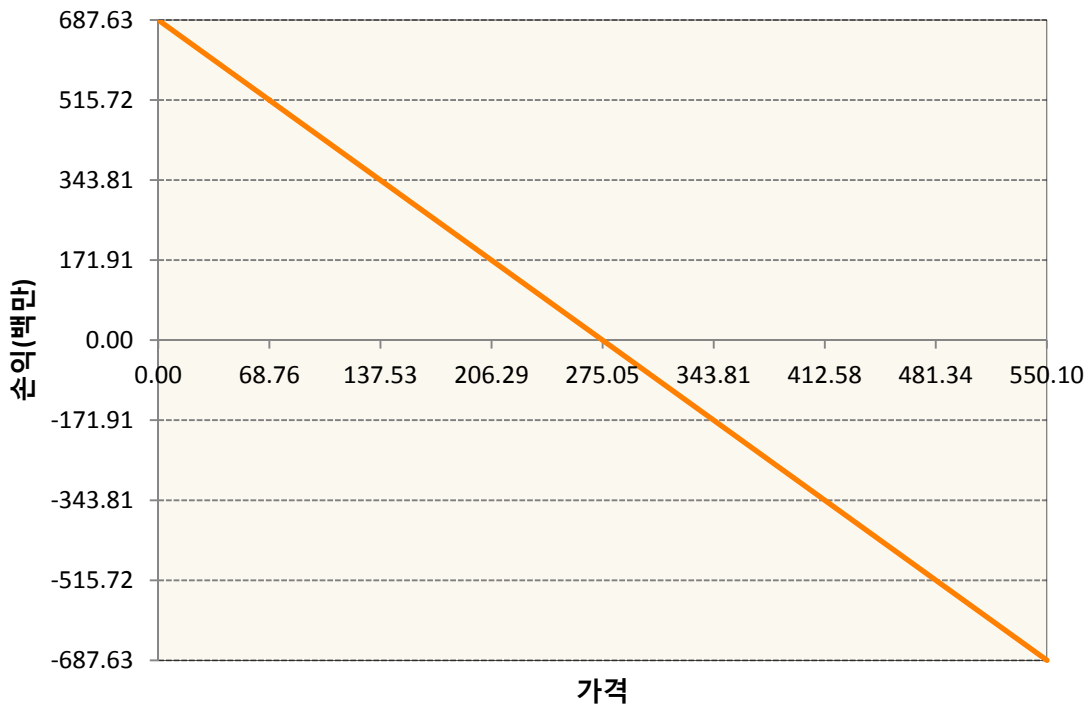
1. 계약금액

(단위:백만원)

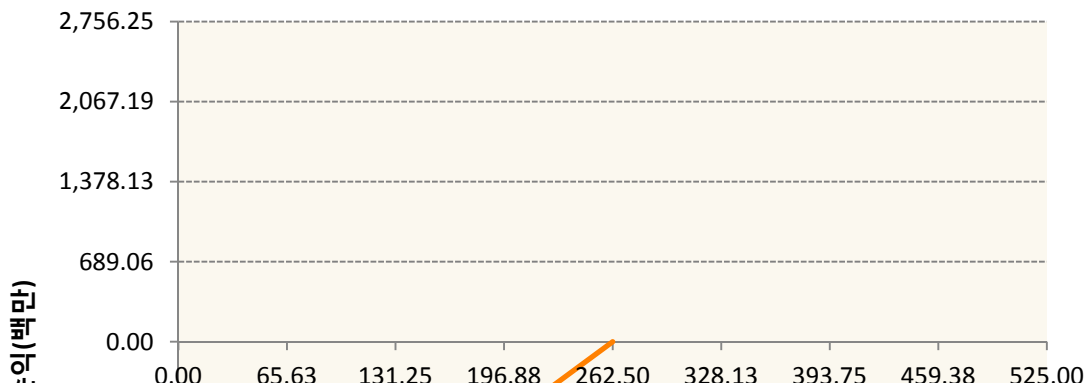
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	688	-688	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,419	-3,419	장내

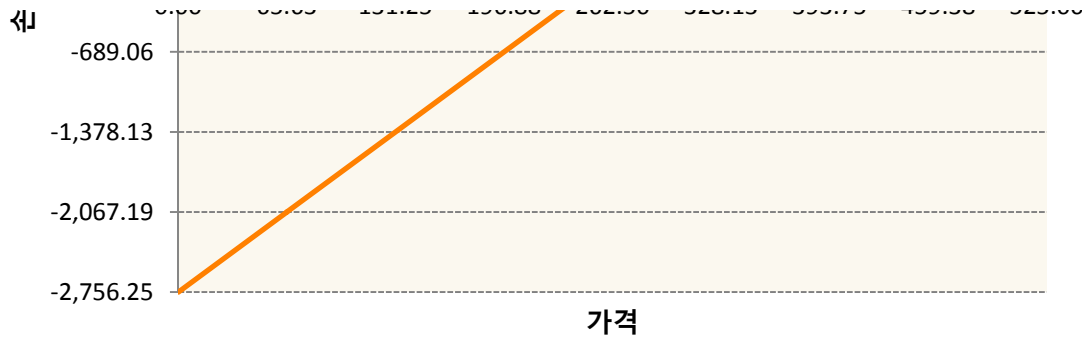
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

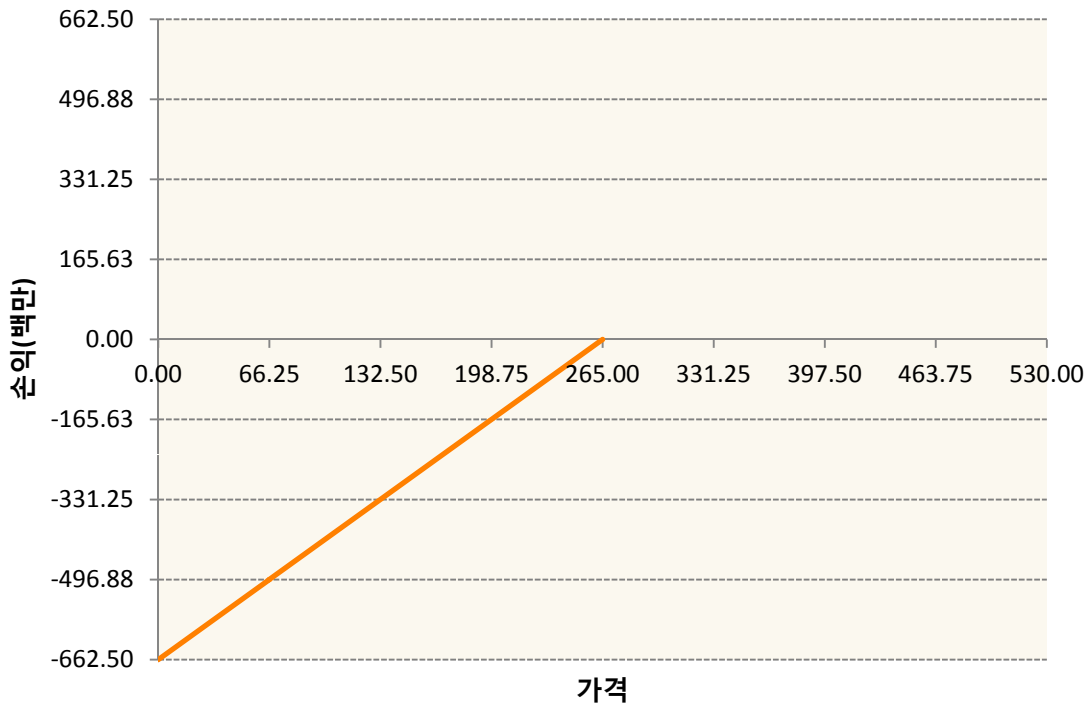


KR4301P72625-2019-07 풋262.5





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%	-97	-98	-99	-100	-102	-103	-105
-5.33%	-34	-37	-39	-42	-45	-47	-50
-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

30

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-29	-29	-29	-29	-29	-30	-30
-5.33%	-12	-13	-13	-14	-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)

125

공시일	2019-06-26
기준일	2019-06-25

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	3,931	-3,931	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)

103

공시일	2019-06-26
기준일	2019-06-25

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

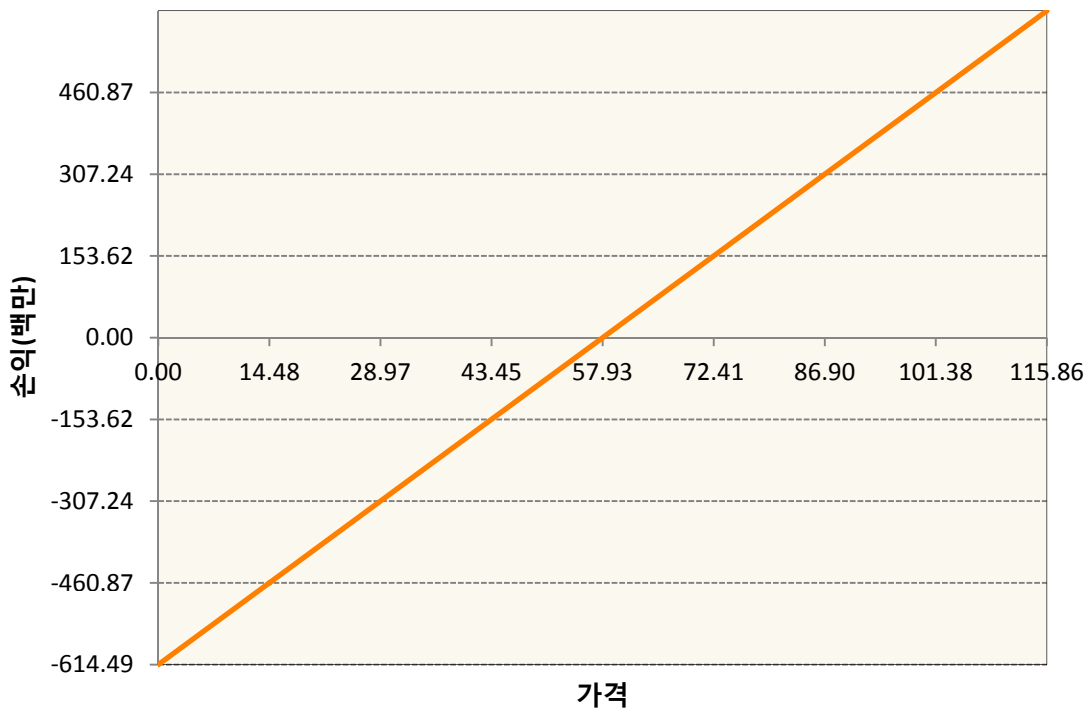
1. 계약금액

(단위:백만원)

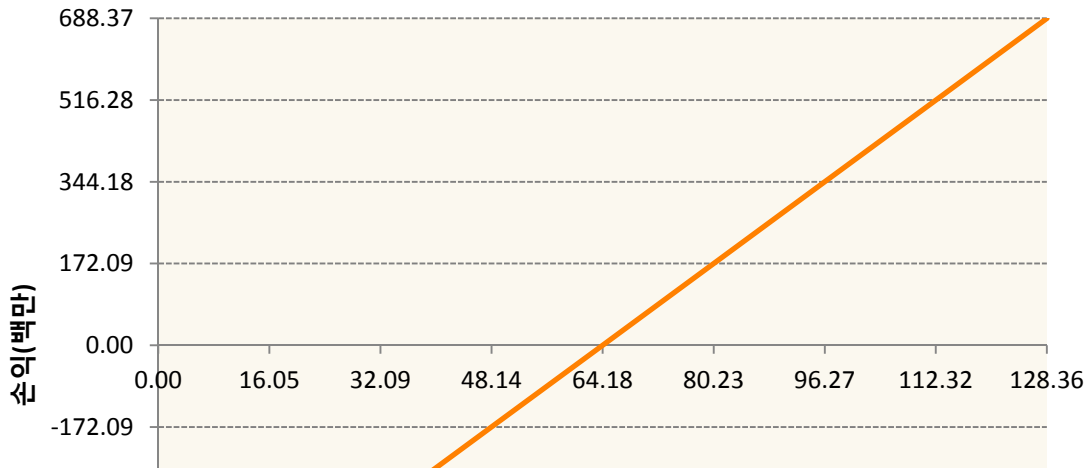
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,620	116	2,504	

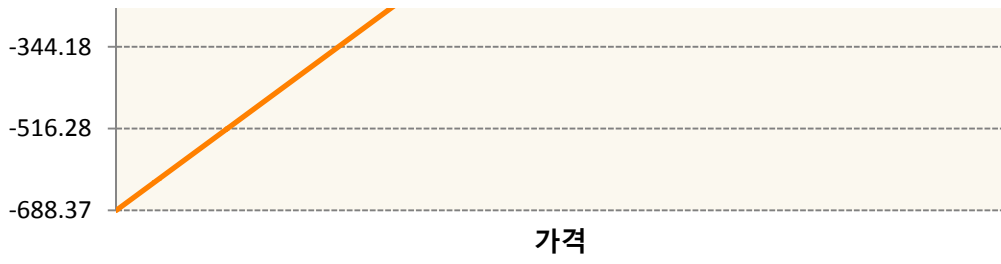
2. 만기시점의 손익구조

CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19

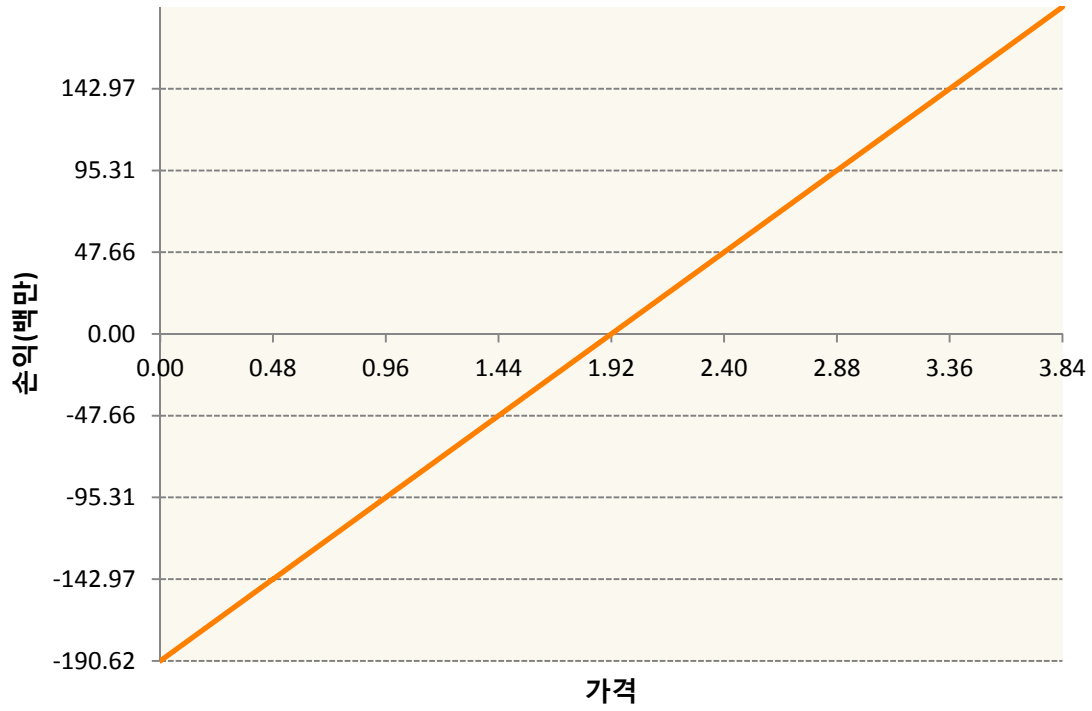


COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19

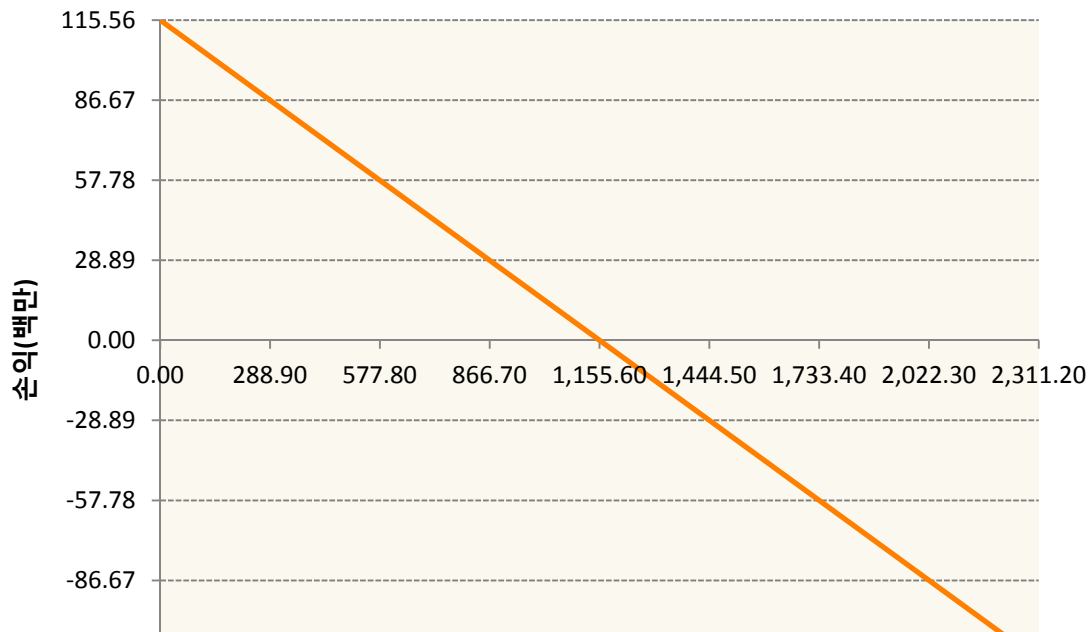


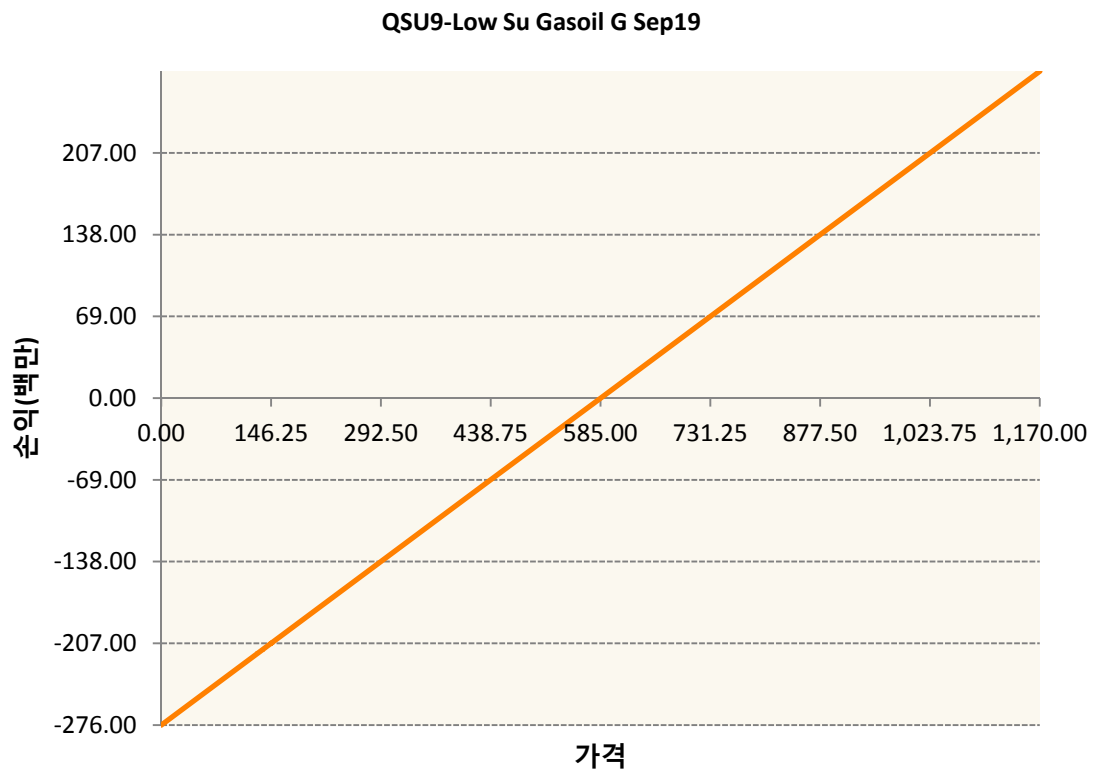
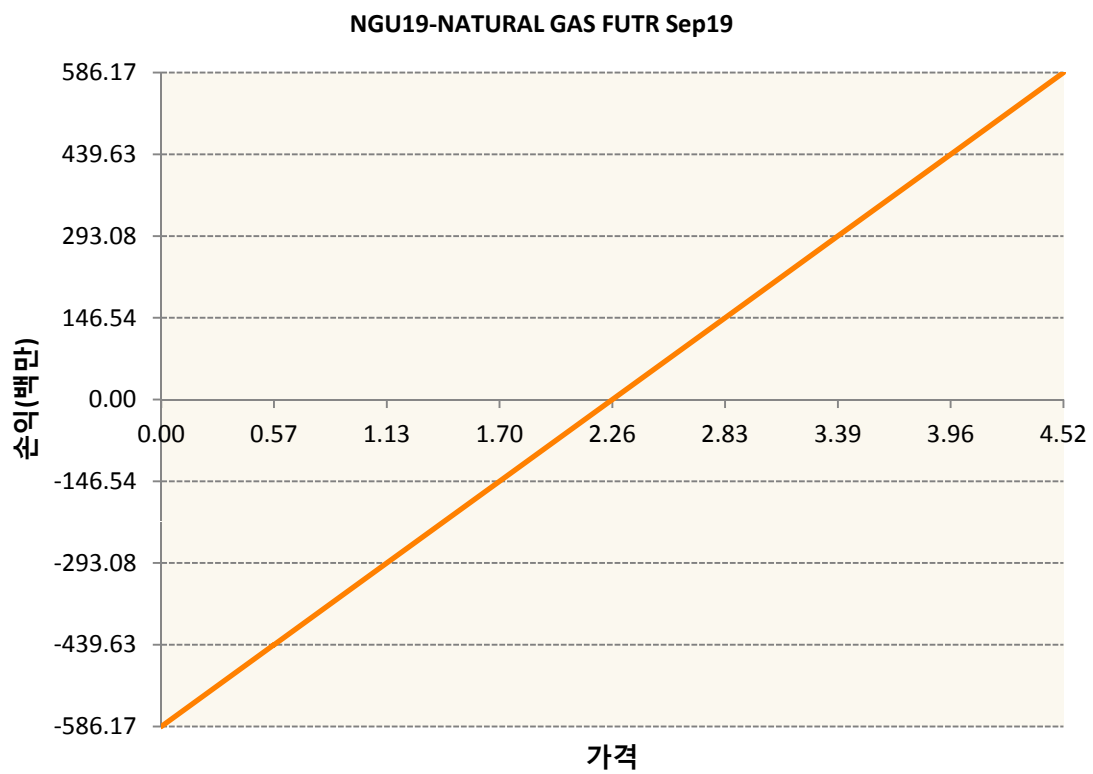
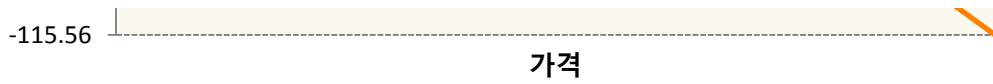


HOU9-NY Harb ULSD Fut Sep19

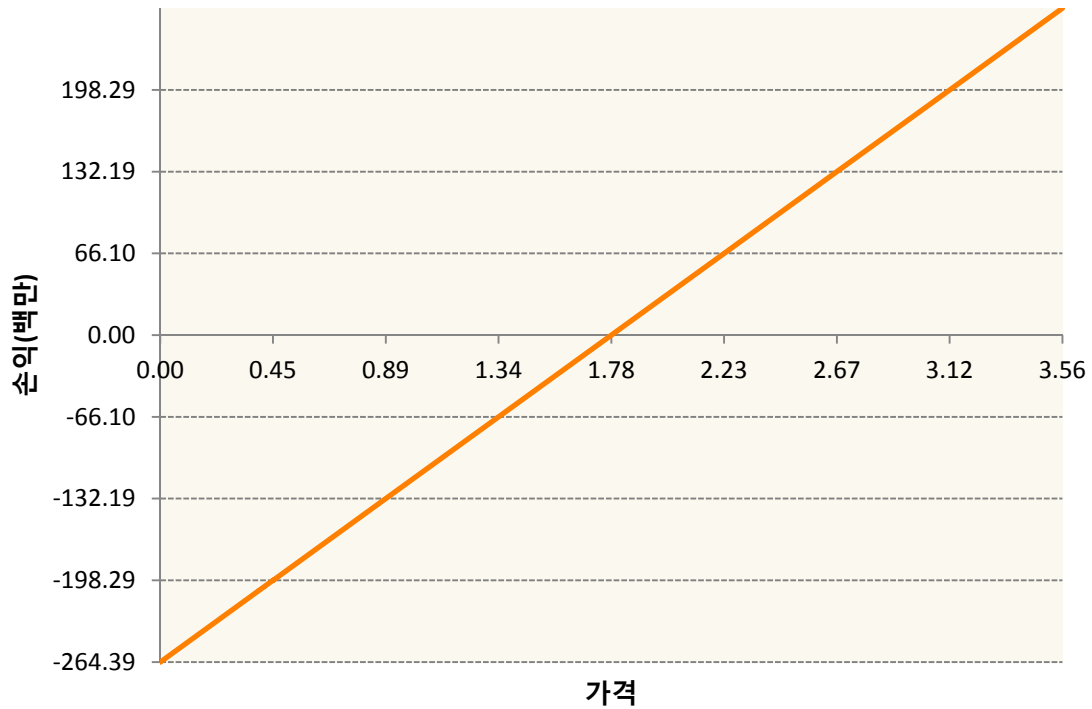


KR4175P70007-2019-07 달러선물





XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	49
COU9	BRENT CRUDE FUTR Sep19	55
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	15
KR4175P700	2019-07 달러선물	9
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	47
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	22
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	21

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

(단위:백만원)

391

공시일	2019-06-26
기준일	2019-06-25

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

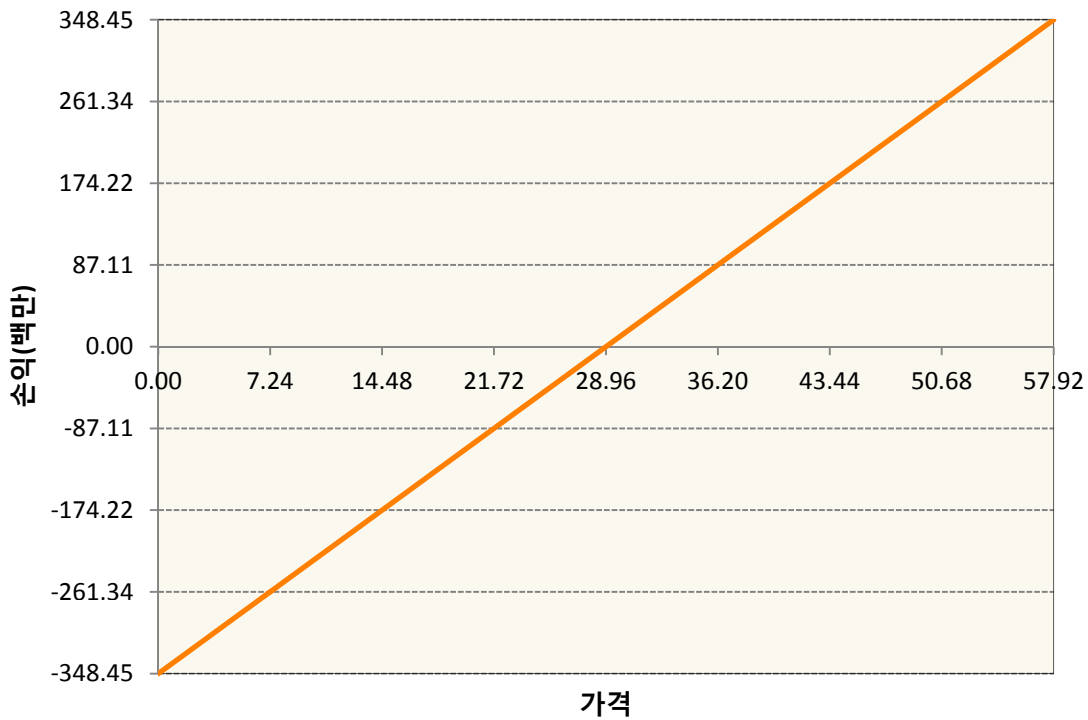
1. 계약금액

(단위:백만원)

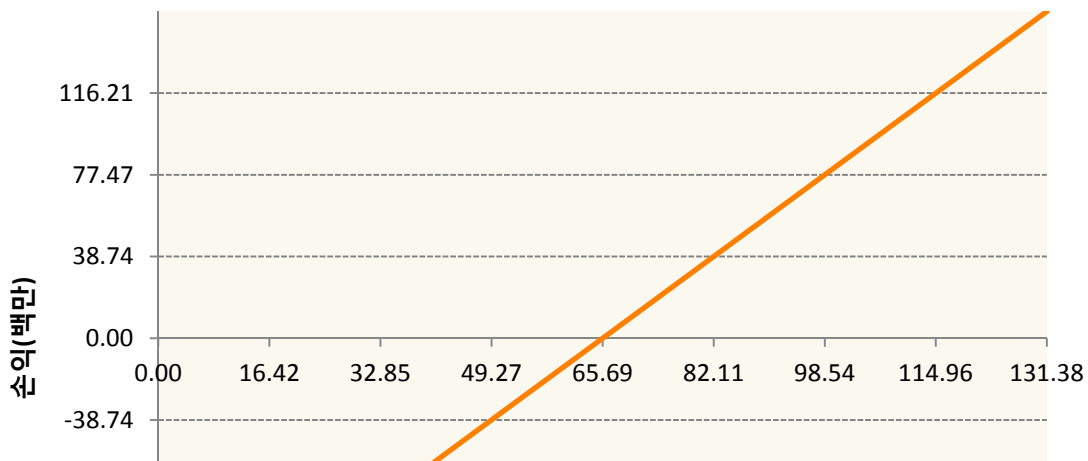
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,241	196	3,045	

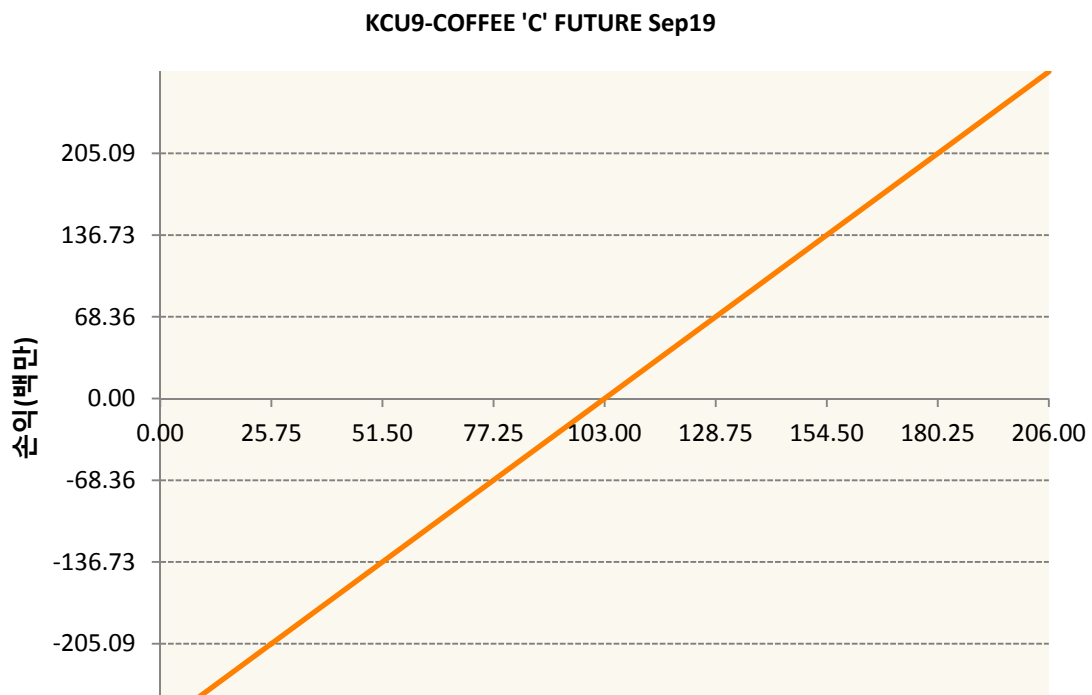
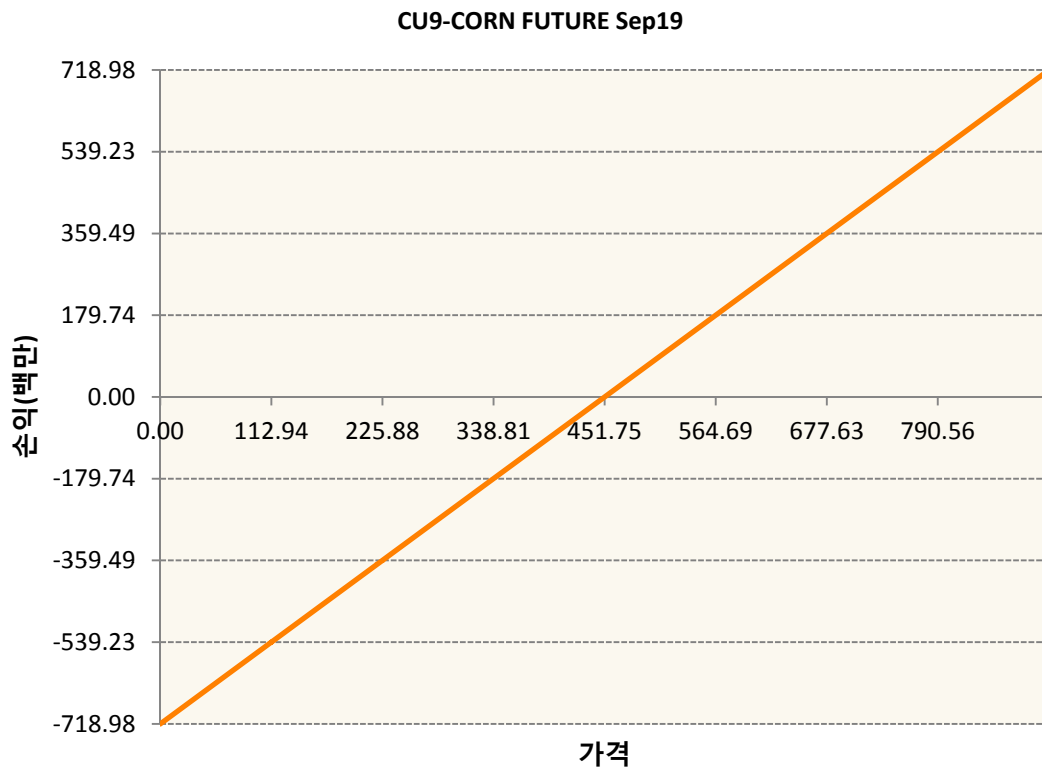
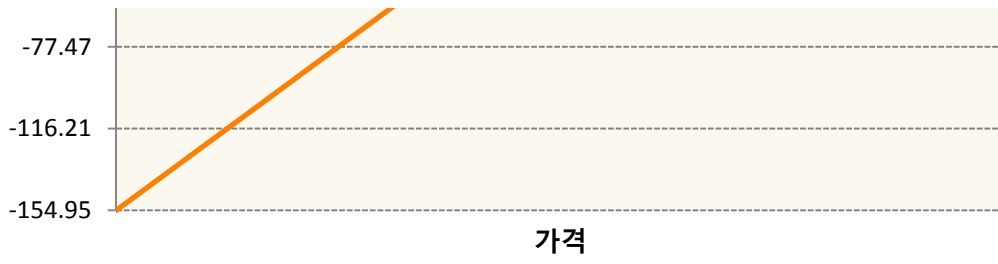
2. 만기시점의 손익구조

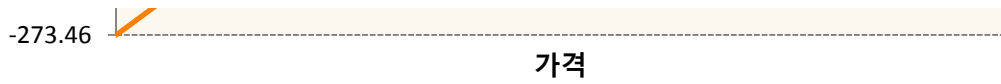
BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19



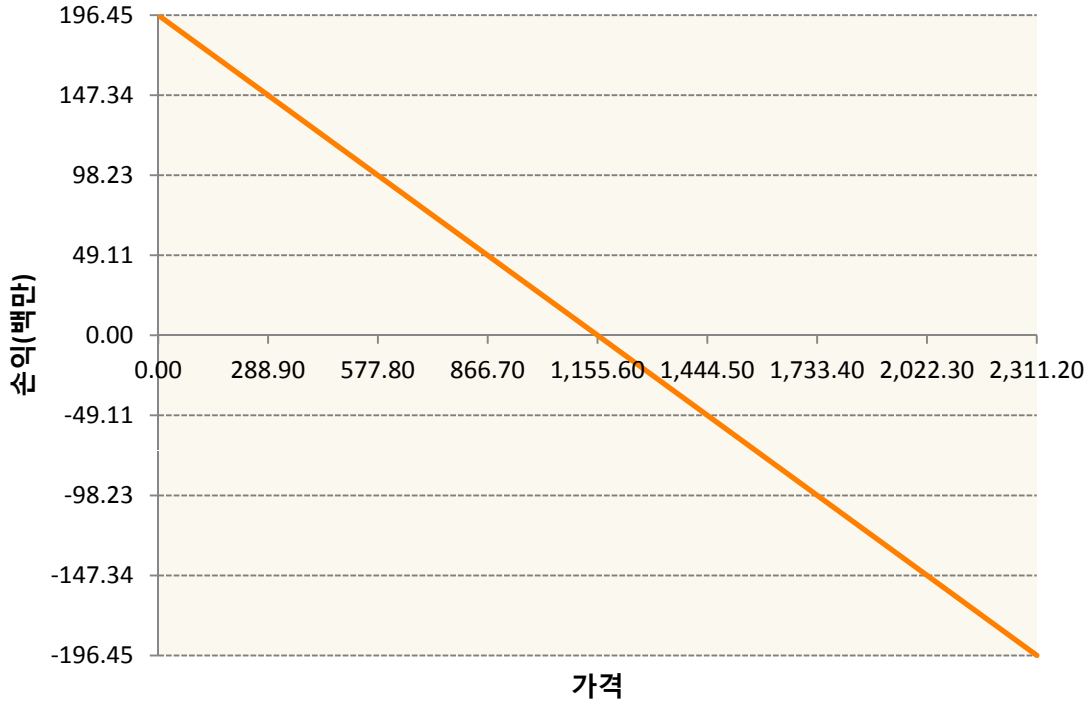
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



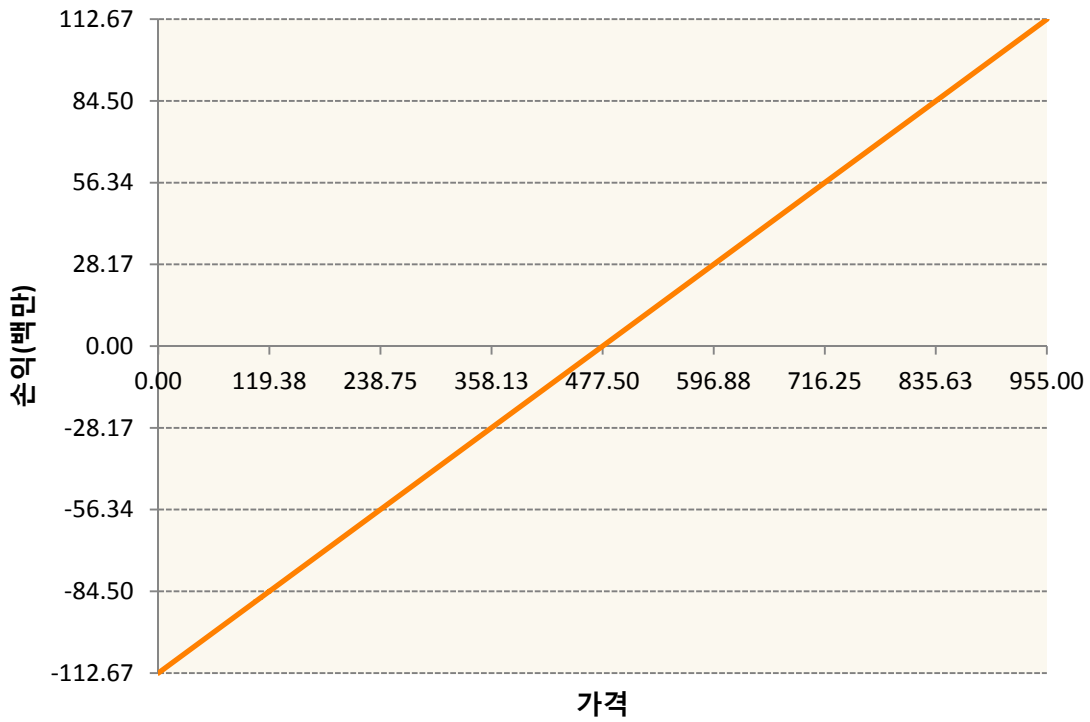




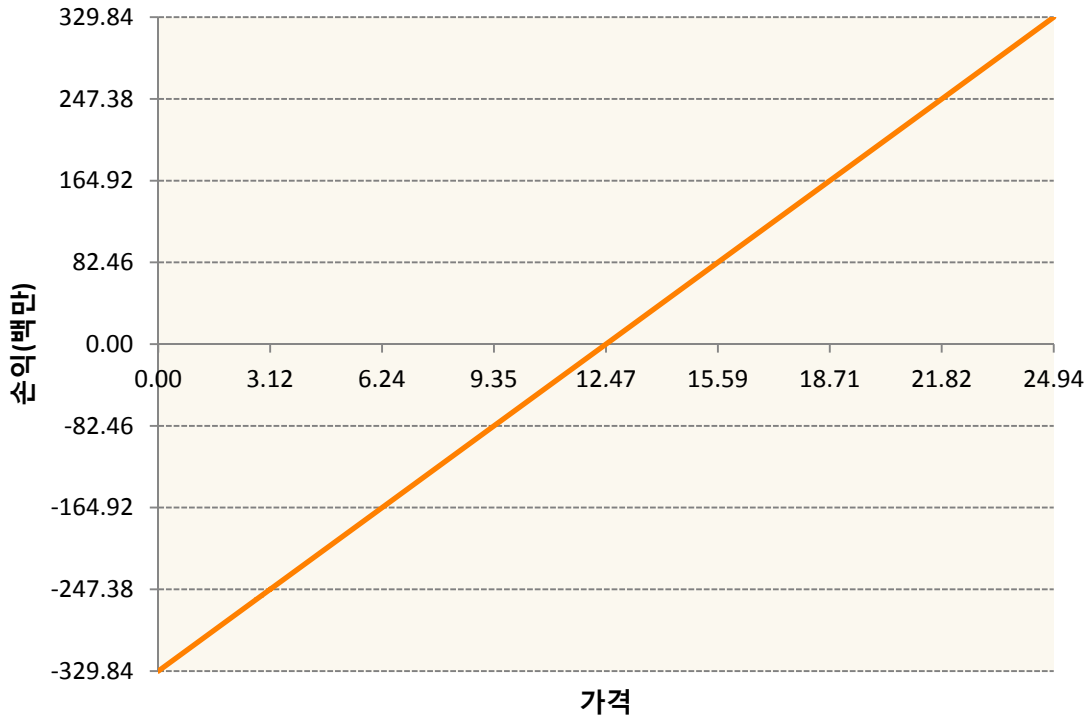
KR4175P70007-2019-07 달러선물



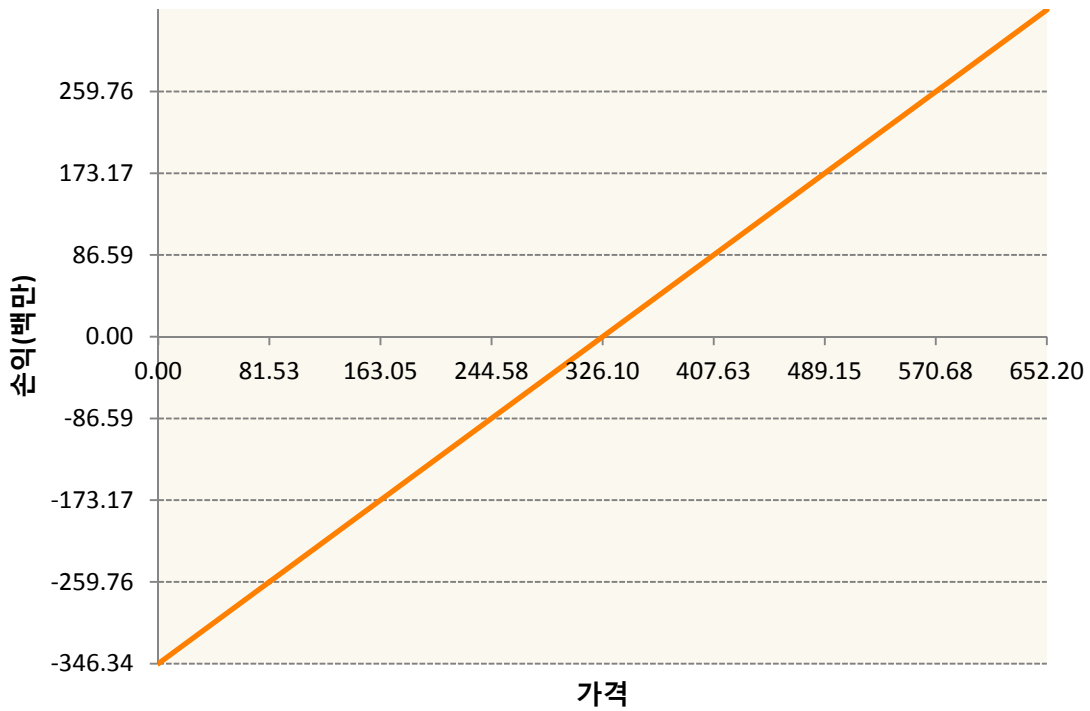
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

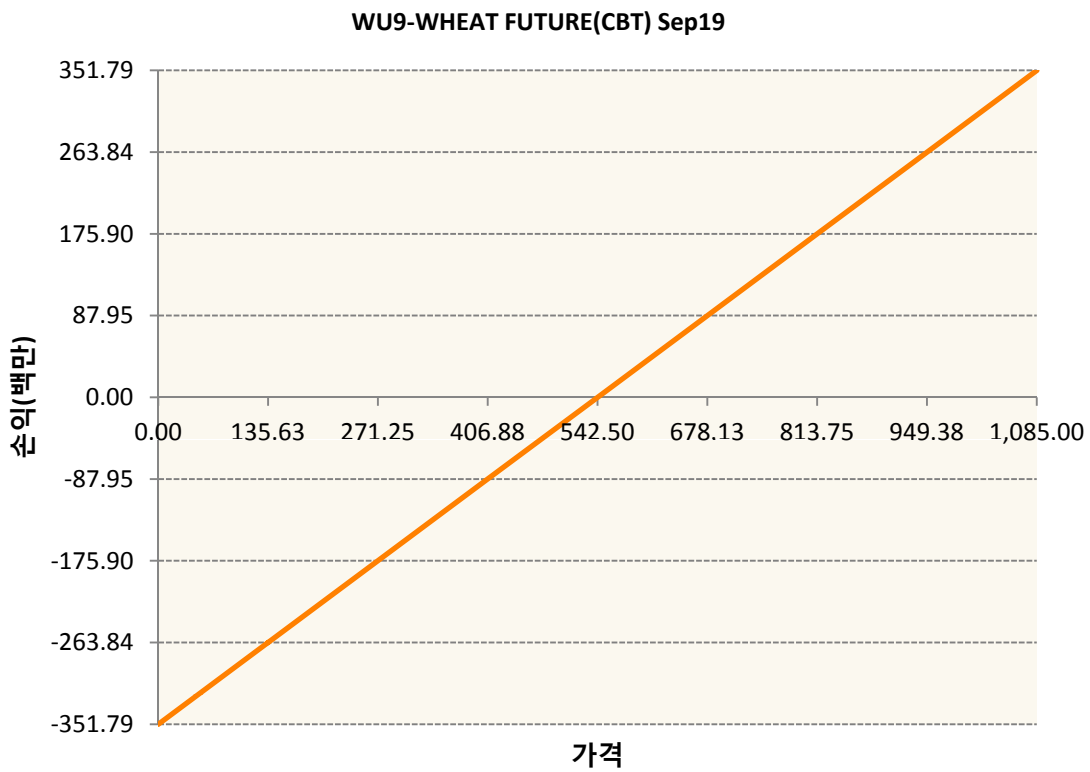
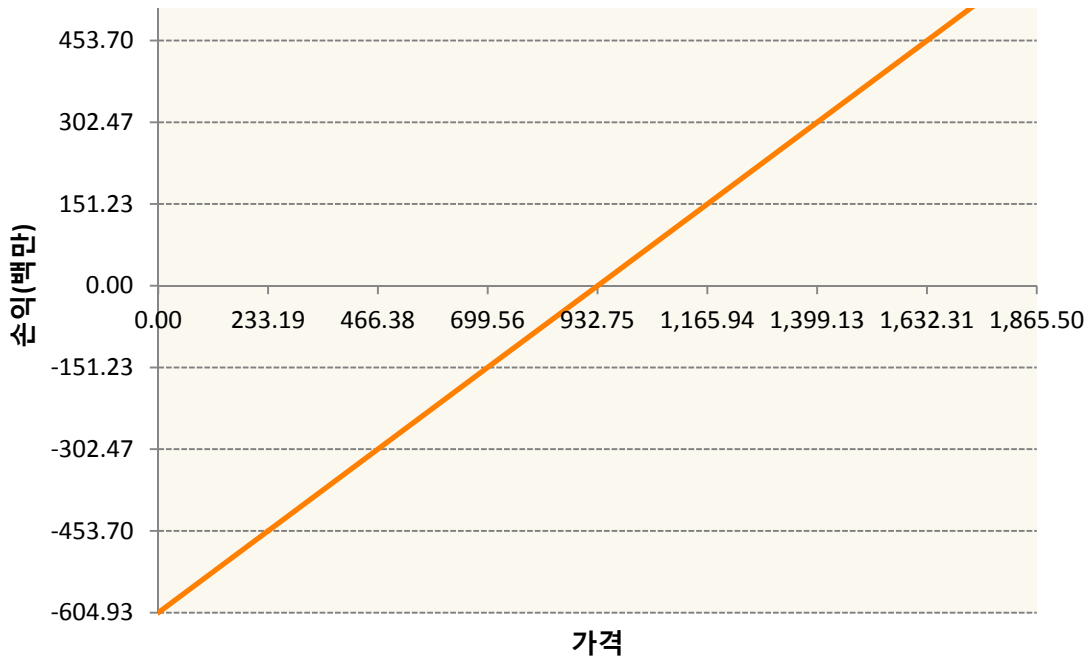


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





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	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)

281