

공시일	2019-06-27
기준일	2019-06-26

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	2019-06-27
기준일	2019-06-26

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

1,157

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

680

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-27
기준일	2019-06-26

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)	385
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	141

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

862

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-27
기준일	2019-06-26

유로인덱스모(주식-파생형)

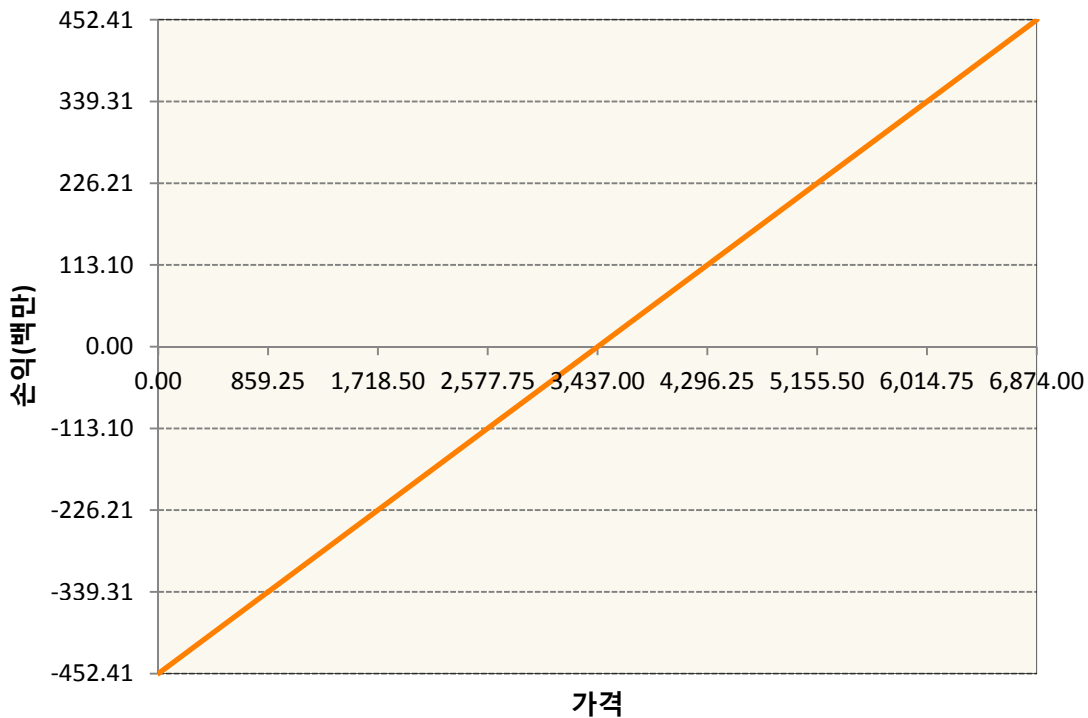
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	452	0	452	

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	2019-06-27
기준일	2019-06-26

차이나인덱스모(주식-파생형)

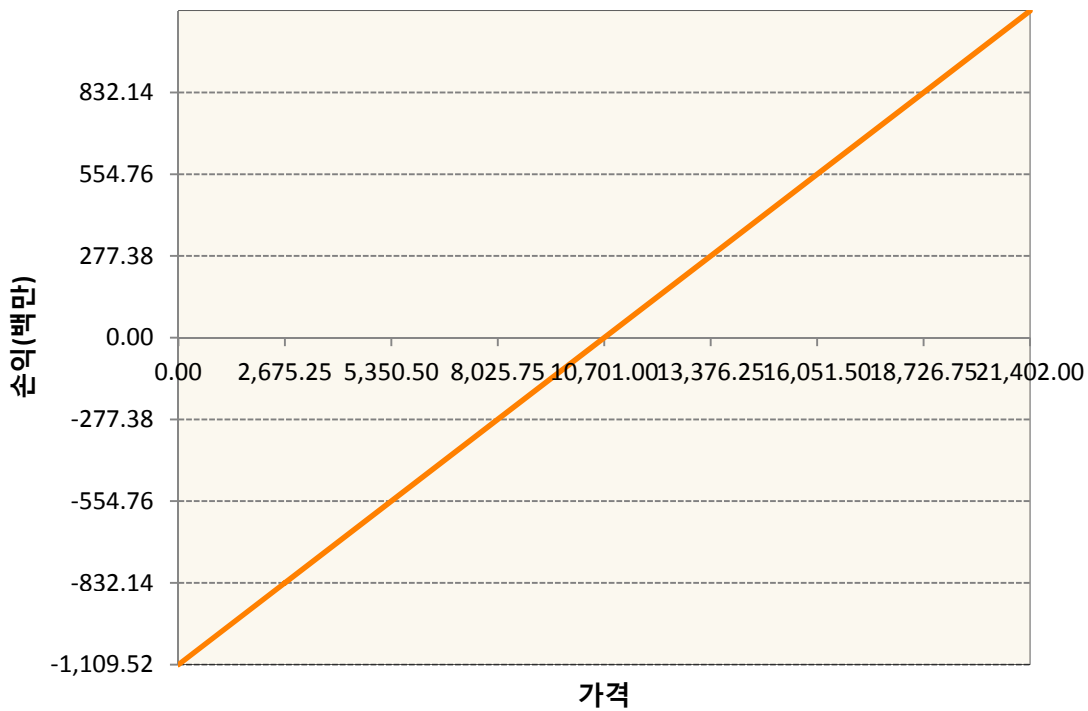
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,110	0	1,110	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCN9-HSCEI Futures Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN9	HSCEI Futures Jul19	89
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

90

공시일	2019-06-27
기준일	2019-06-26

커버드콜모(주식혼합-파생형)

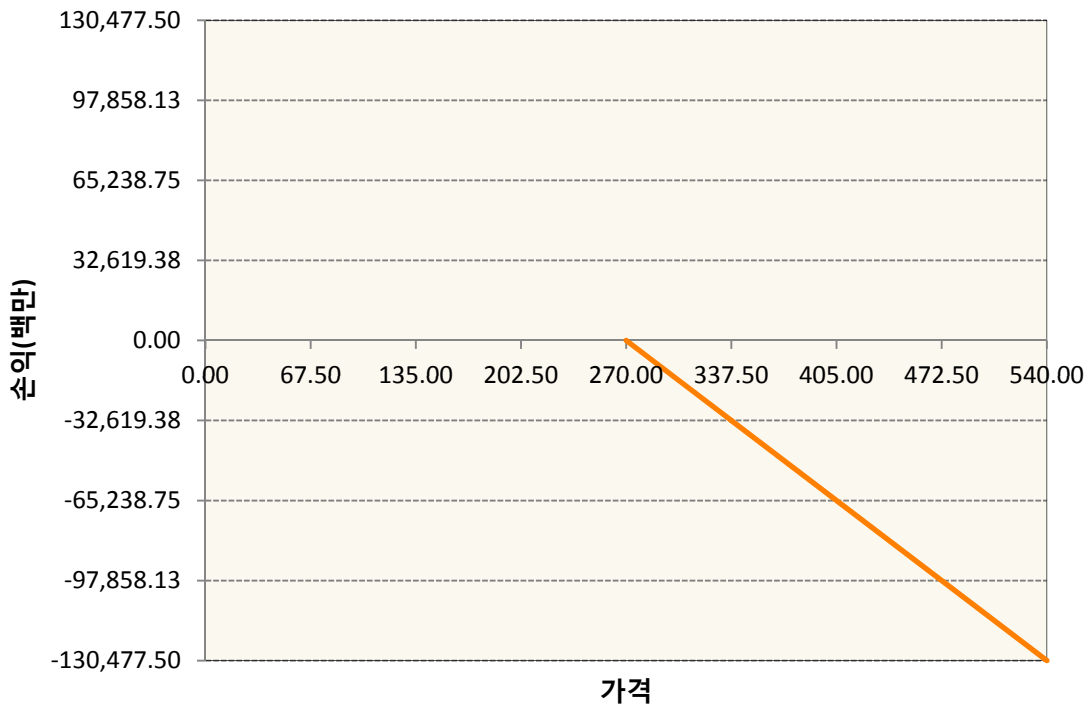
1. 계약금액

(단위:백만원)

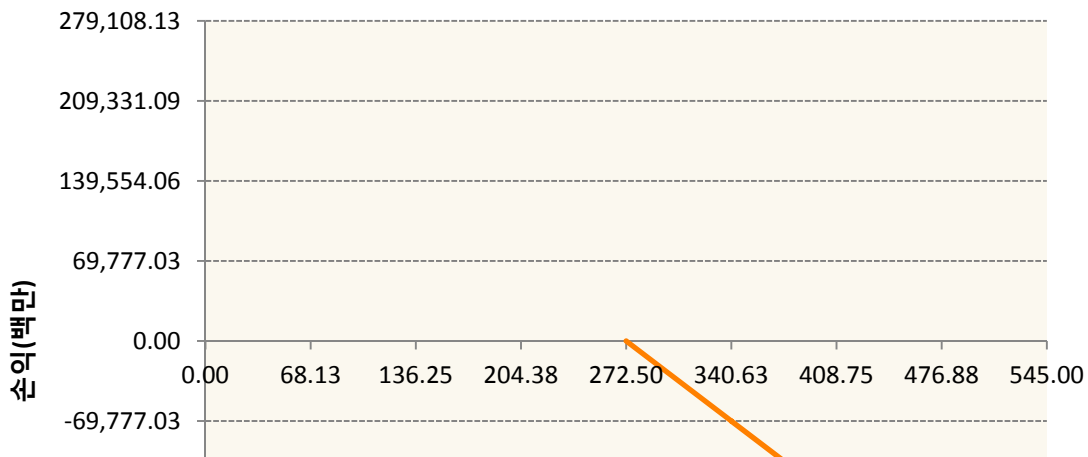
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	602,973	-602,973	장내

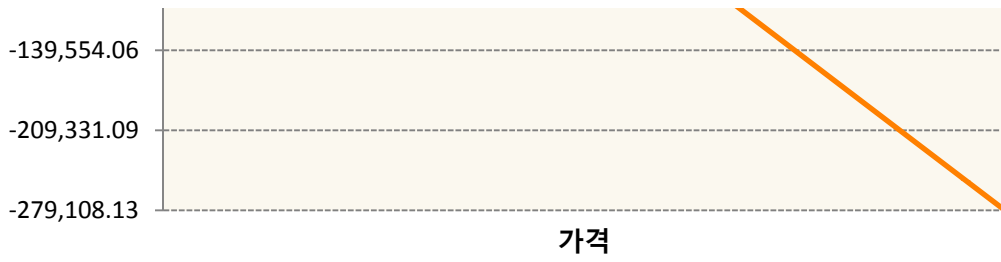
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P72700-2019-07 콜270

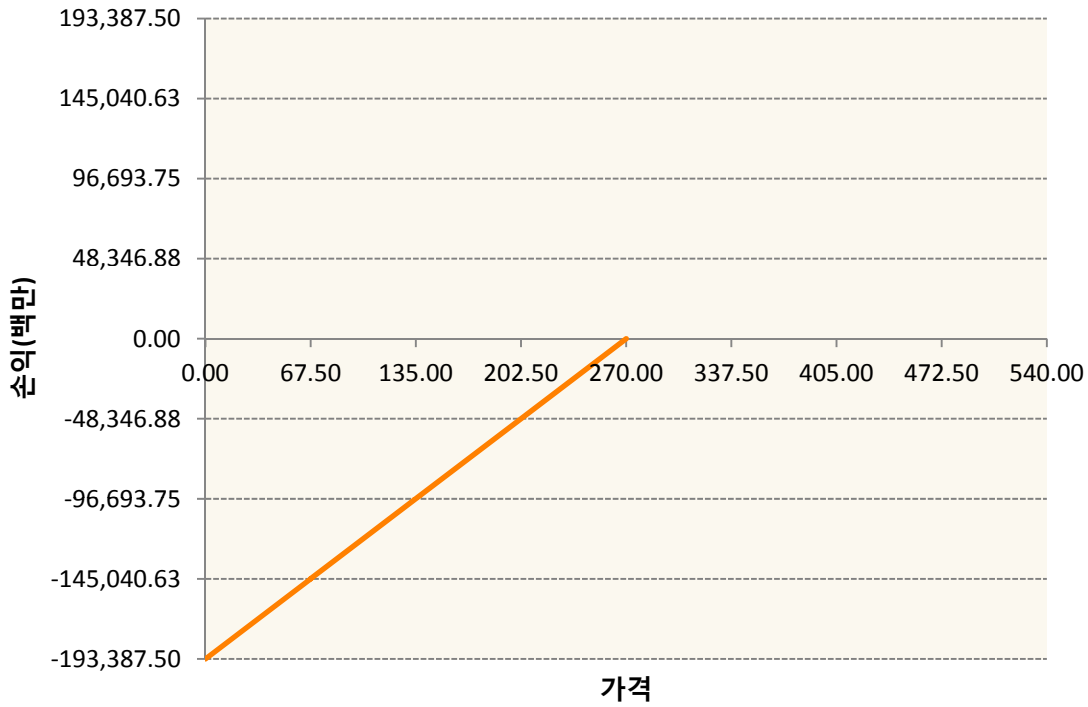


KR4201P72726-2019-07 콜272.5





KR4301P72708-2019-07 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P72700		2019-07 콜270					9,294
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,126	4,060	3,979	3,883	3,774	3,654	3,524
-5.33%	3,730	3,576	3,412	3,240	3,061	2,876	2,688
-2.67%	2,646	2,426	2,205	1,983	1,761	1,539	1,317
0%	617	415	209	0	-212	-426	-641
2.67%	-2,235	-2,356	-2,493	-2,642	-2,801	-2,969	-3,144
5.33%	-5,551	-5,601	-5,667	-5,749	-5,845	-5,953	-6,074
8.00%	-9,042	-9,057	-9,081	-9,116	-9,163	-9,223	-9,294
KR4201P72726		2019-07 콜272.5					18,900
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,293	7,197	7,069	6,910	6,723	6,511	6,275

-5.33%	6,740	6,476	6,184	5,867	5,531	5,179	4,812
-2.67%	5,015	4,575	4,129	3,678	3,223	2,765	2,304
0%	1,408	942	472	0	-474	-948	-1,424
2.67%	-4,104	-4,430	-4,780	-5,151	-5,538	-5,937	-6,348
5.33%	-10,868	-11,023	-11,213	-11,437	-11,689	-11,968	-12,268
8.00%	-18,181	-18,233	-18,310	-18,416	-18,550	-18,712	-18,900
KR4301P72708 2019-07 풋270							11,135
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11,012	-11,017	-11,026	-11,042	-11,065	-11,096	-11,135
-5.33%	-5,860	-5,923	-5,999	-6,089	-6,189	-6,298	-6,416
-2.67%	-1,612	-1,795	-1,979	-2,164	-2,350	-2,536	-2,723
0%	432	296	152	0	-158	-320	-486
2.67%	847	818	777	724	659	584	498
5.33%	877	875	871	862	849	829	802
8.00%	878	878	878	877	876	873	867

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

(단위:백만원)

40,559

공시일	2019-06-27
기준일	2019-06-26

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

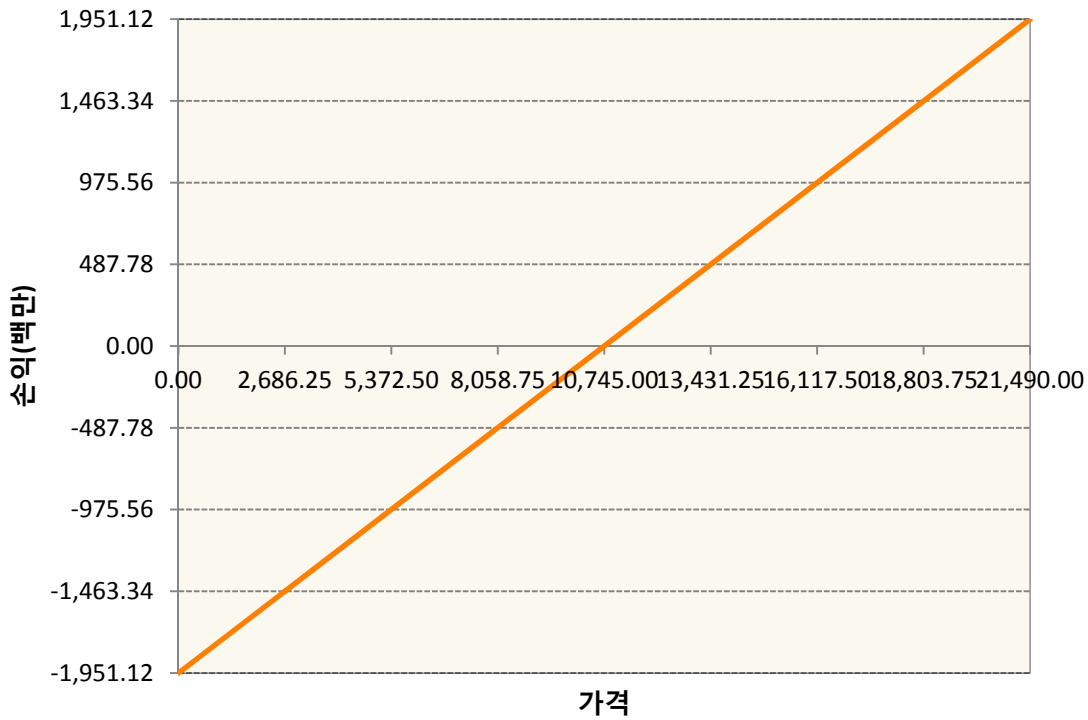
1. 계약금액

(단위:백만원)

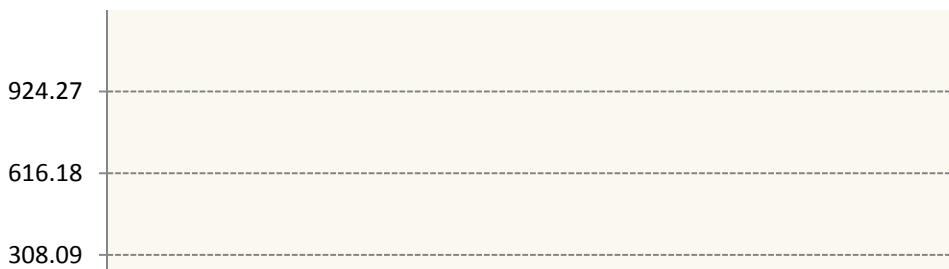
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,951	0	1,951	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,953	-4,953	장내
누계	통화	선도	148	3,111	-2,962	장외

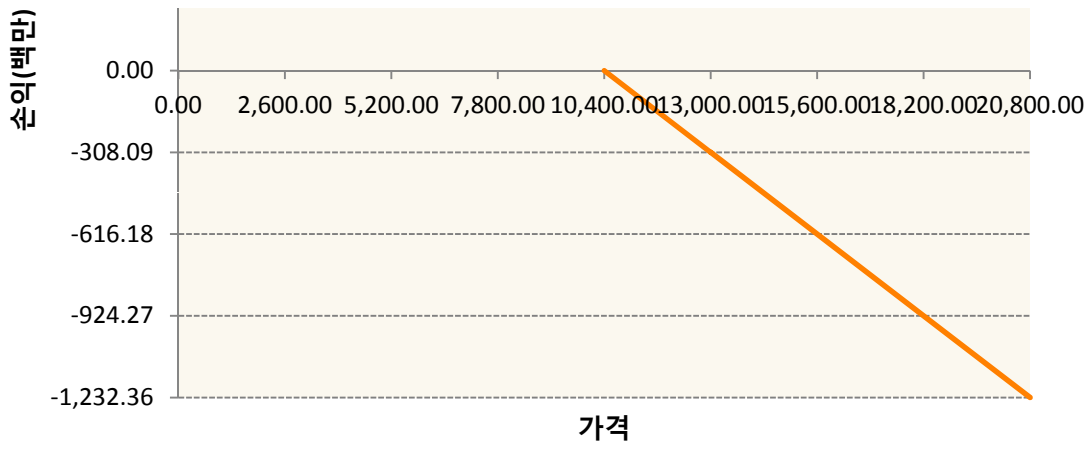
2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19

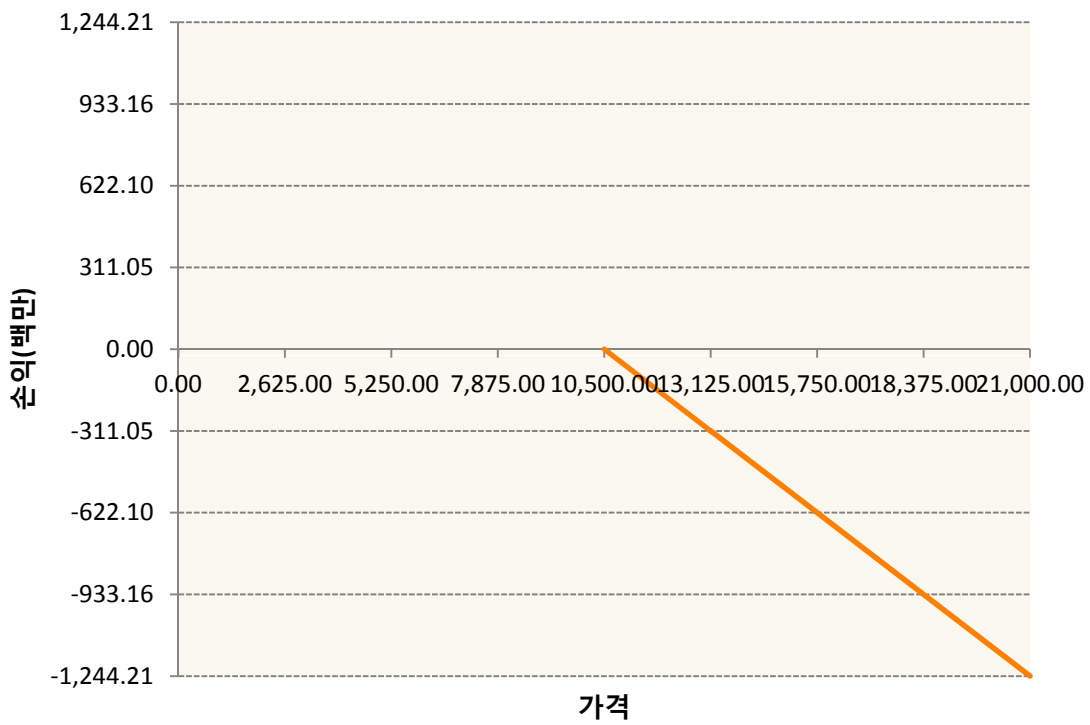


OHHIM9-C104-HSCEI

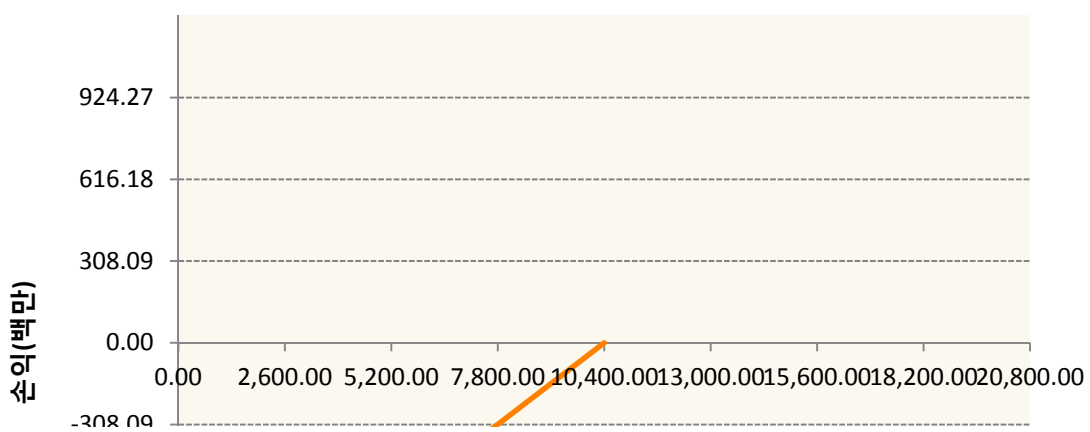


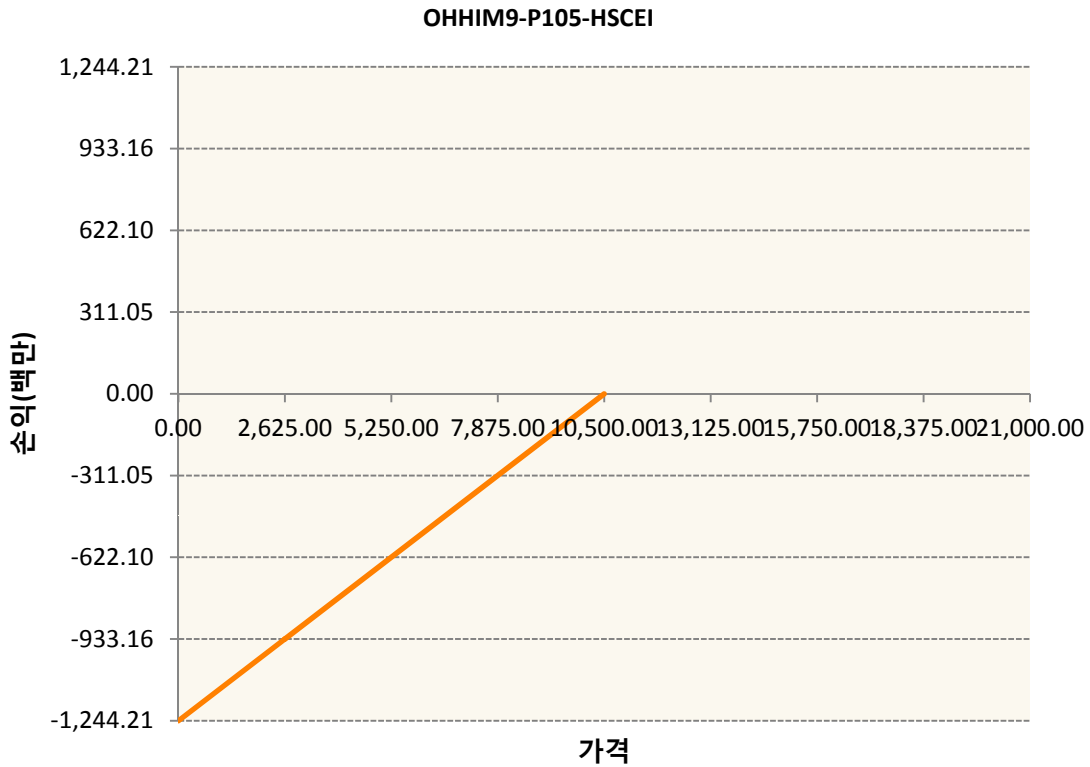


OHHIM9-C105-HSCEI



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)
	645

공시일	2019-06-27
기준일	2019-06-26

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

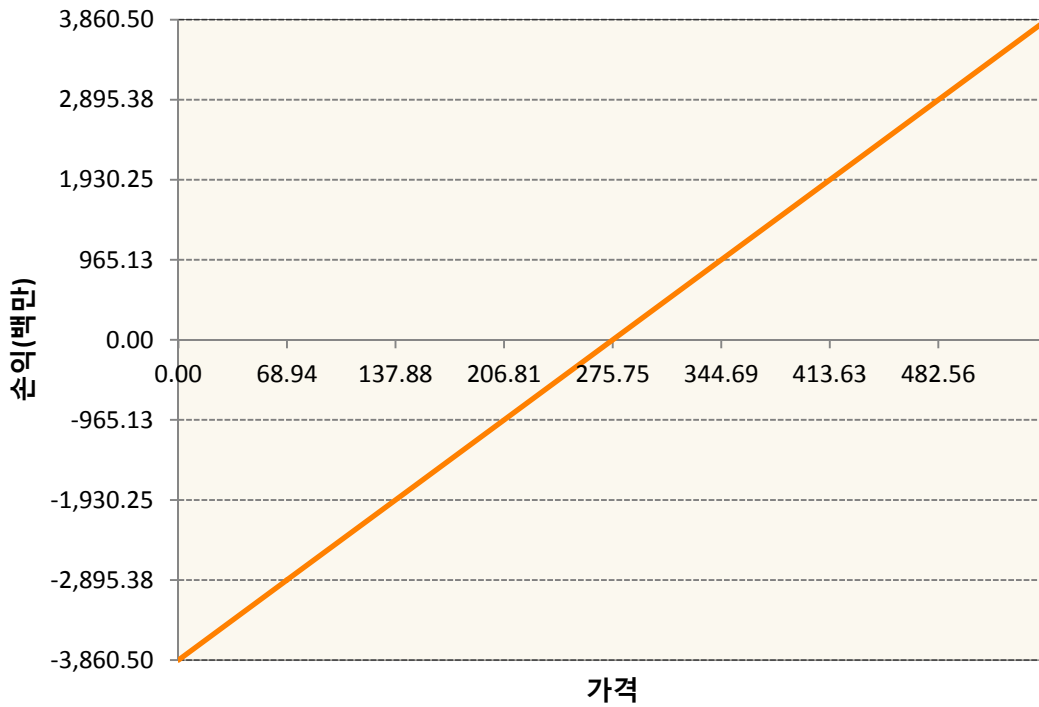
1. 계약금액

(단위:백만원)

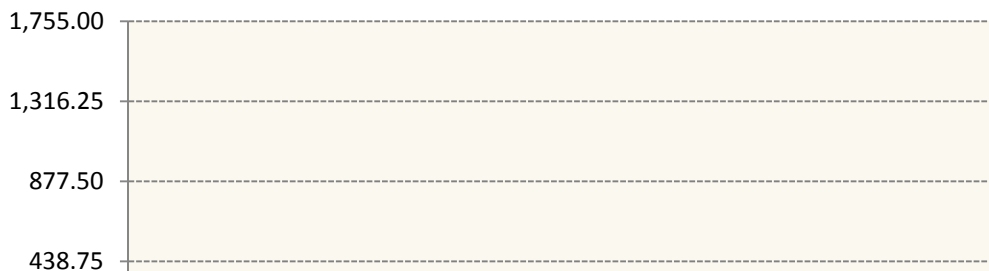
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,861	0	3,861	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,880	-20,880	장내

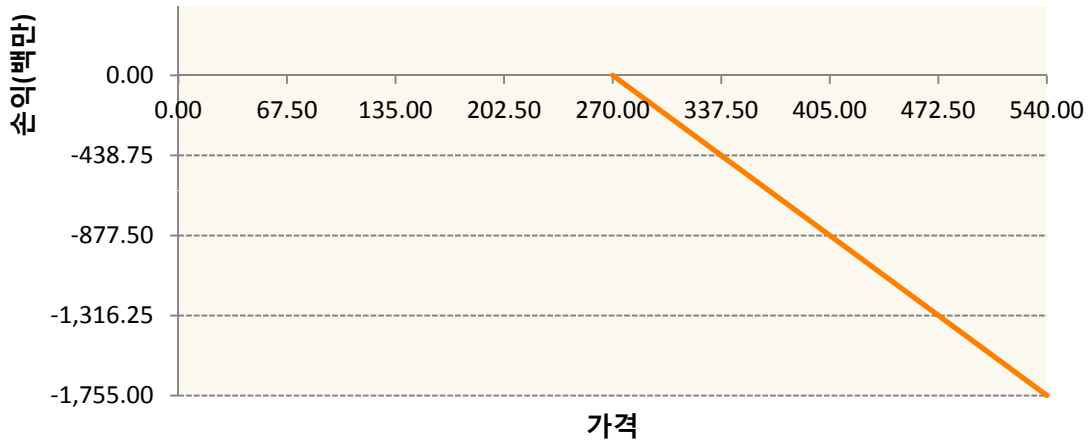
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

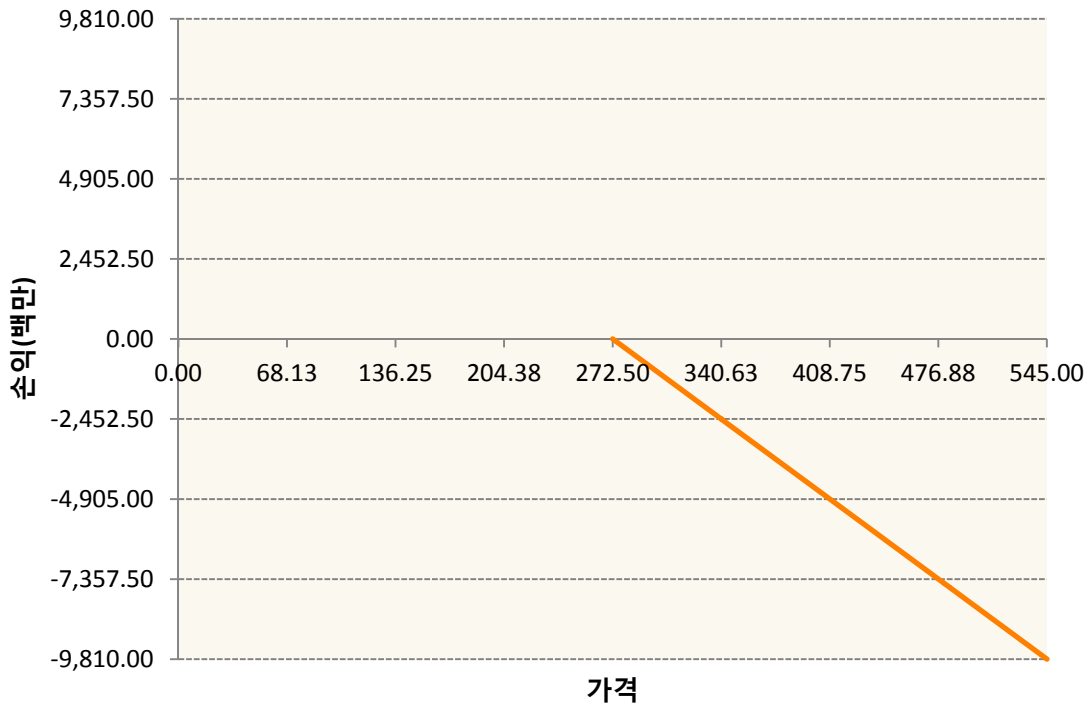


KR4201P72700-2019-07 콜270

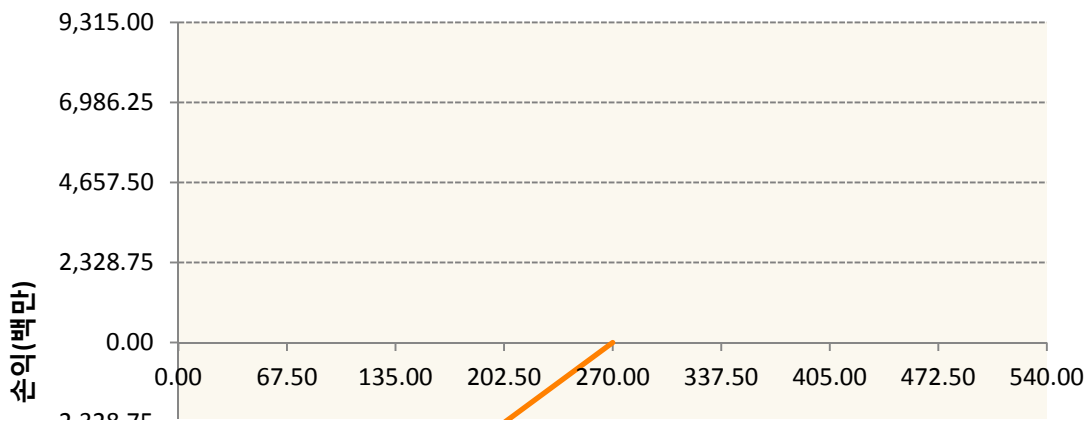




KR4201P72726-2019-07 콜272.5



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						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						125
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	55	55	54	52	51	49	47
-5.33%	50	48	46	44	41	39	36
-2.67%	36	33	30	27	24	21	18
0%	8	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	-30	-32	-34	-36	-38	-40	-42
5.33%	-75	-75	-76	-77	-79	-80	-82
8.00%	-122	-122	-122	-123	-123	-124	-125
KR4201P72726 2019-07 콜272.5							664
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	256	253	248	243	236	229	221
-5.33%	237	228	217	206	194	182	169
-2.67%	176	161	145	129	113	97	81
0%	50	33	17	0	-17	-33	-50
2.67%	-144	-156	-168	-181	-195	-209	-223
5.33%	-382	-387	-394	-402	-411	-421	-431
8.00%	-639	-641	-644	-647	-652	-658	-664
KR4301P72708 2019-07 풋270							536
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-530	-531	-531	-532	-533	-534	-536
-5.33%	-282	-285	-289	-293	-298	-303	-309
-2.67%	-78	-86	-95	-104	-113	-122	-131
0%	21	14	7	0	-8	-15	-23
2.67%	41	39	37	35	32	28	24
5.33%	42	42	42	42	41	40	39
8.00%	42	42	42	42	42	42	42

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

(단위:백만원)

3,380

공시일	2019-06-27
기준일	2019-06-26

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

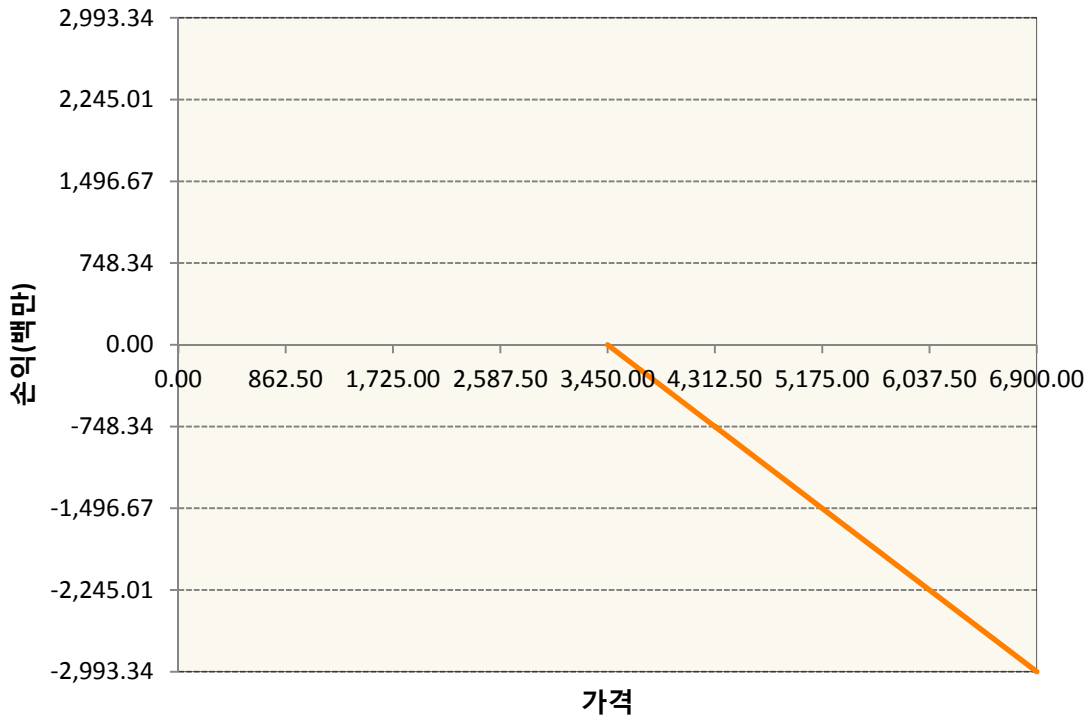
1. 계약금액

(단위:백만원)

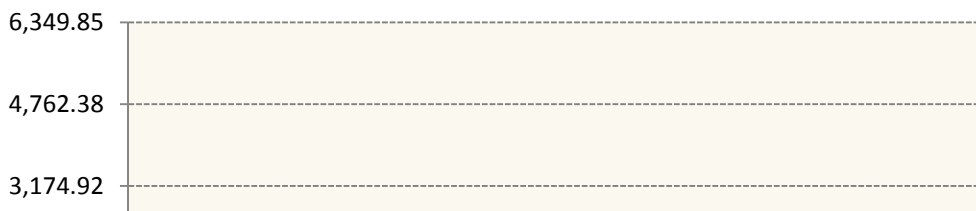
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,895	0	2,895	
누계	유가증권	스왑	55,645	0	55,645	장외
누계	유가증권	옵션	0	18,686	-18,686	장내
누계	통화	선도	0	31,550	-31,550	장외

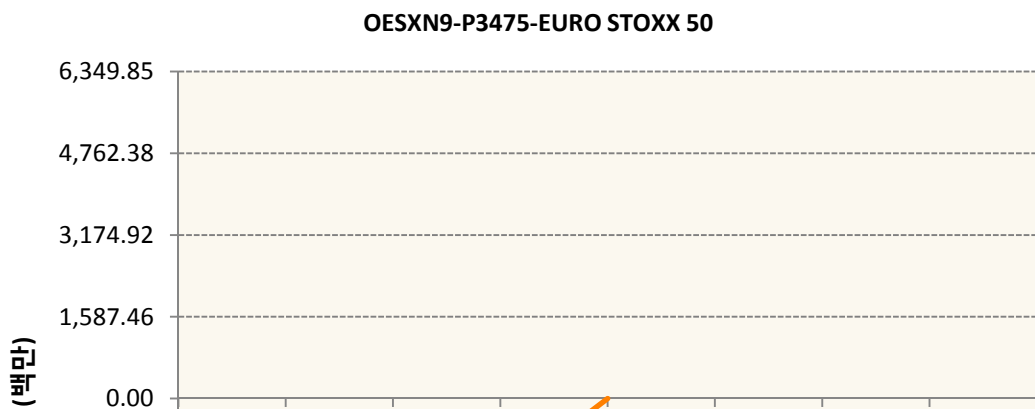
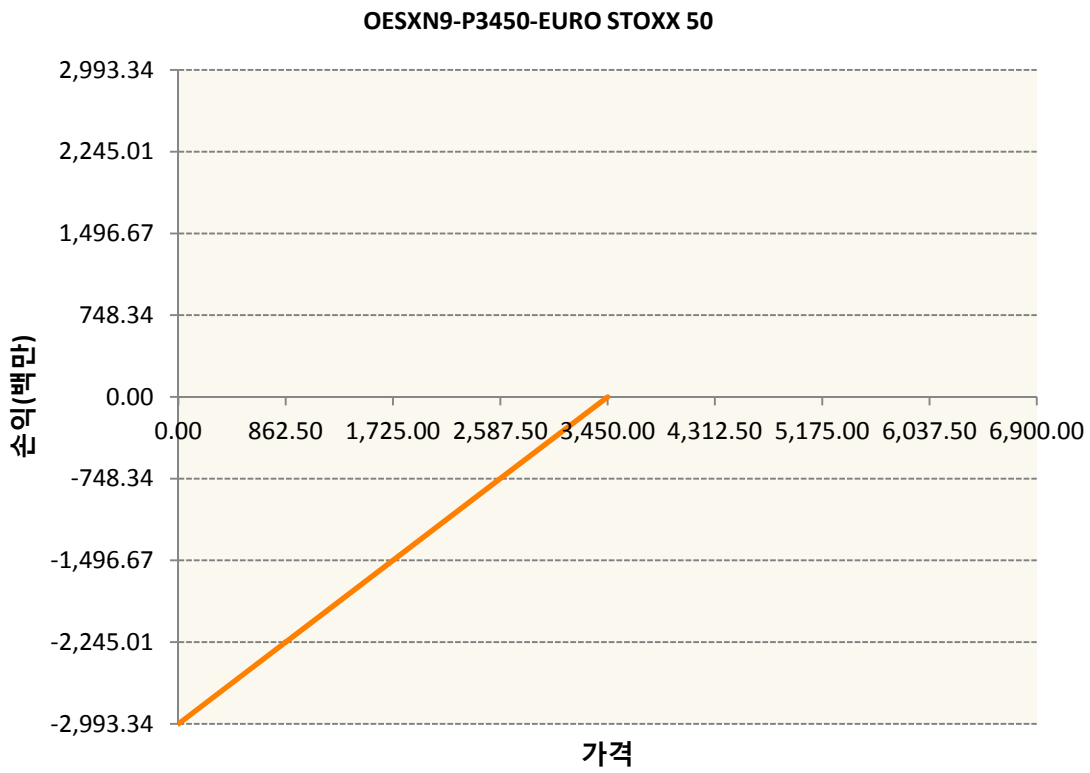
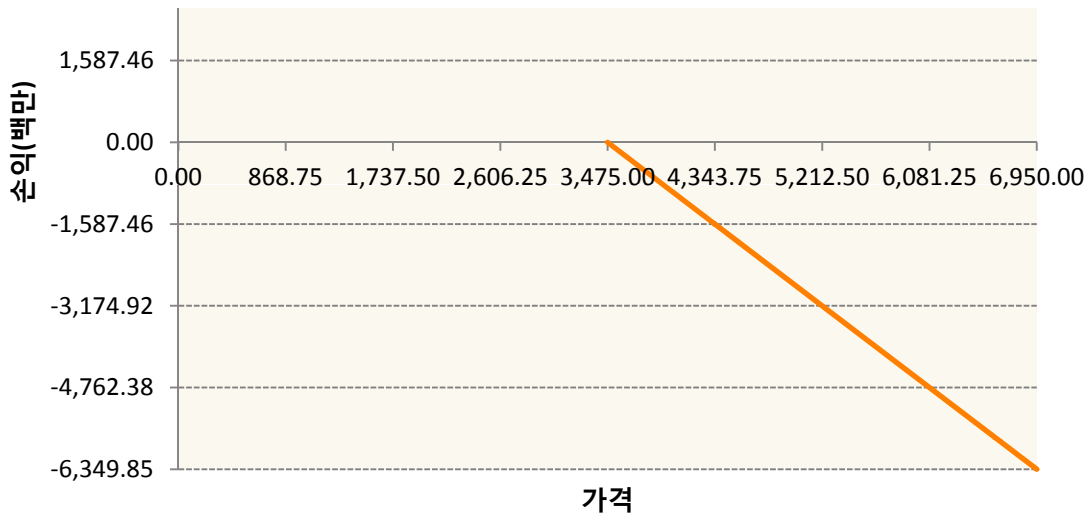
2. 만기시점의 손익구조

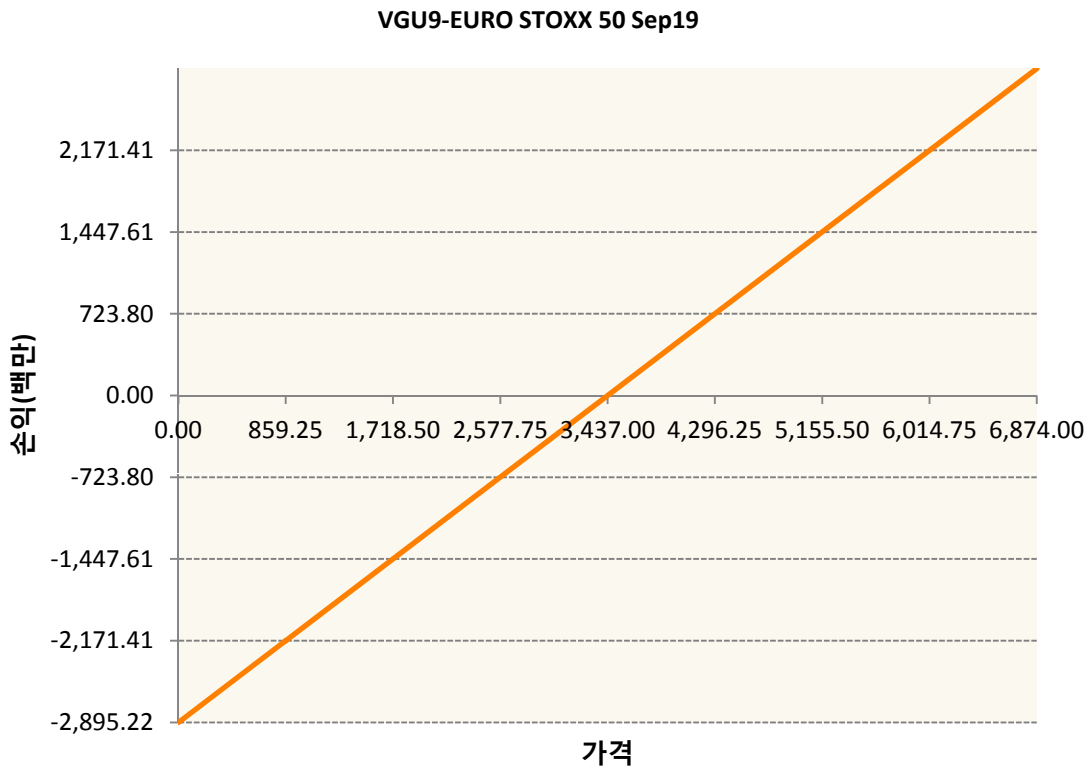
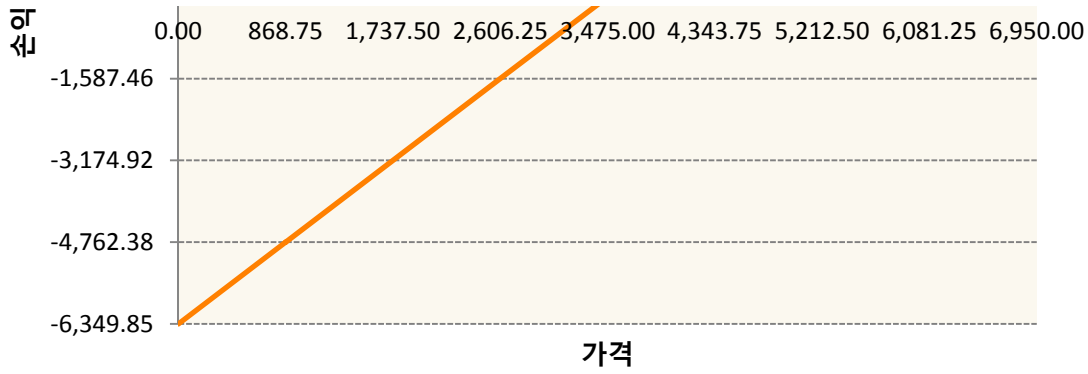
OESXN9-C3450-EURO STOXX 50



OESXN9-C3475-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	39
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	841
FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E	210
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	421
FX21019M0 KRW/EUR 27-09-19E	1,052
OESXN9-C3 EURO STOXX 50	239
OESXN9-C3 EURO STOXX 50	508
OESXN9-P3 EURO STOXX 50	239
OESXN9-P3 EURO STOXX 50	508
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	232

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

(단위:백만원)

2,470

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

(단위:백만원)

1,036

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	2019-06-27
기준일	2019-06-26

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

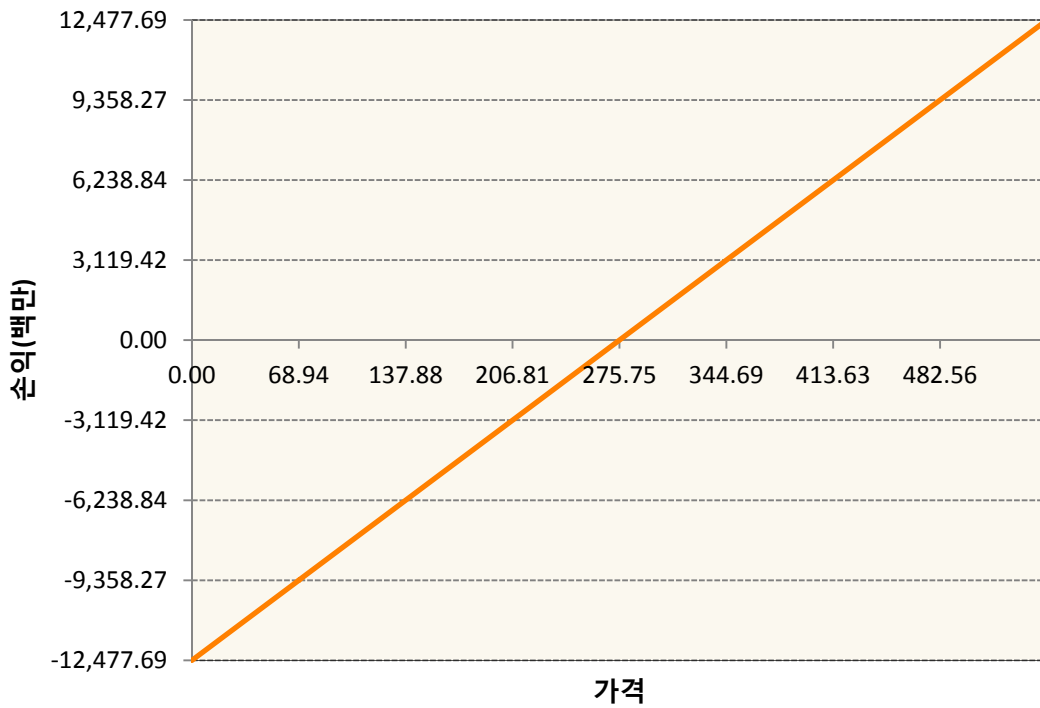
1. 계약금액

(단위:백만원)

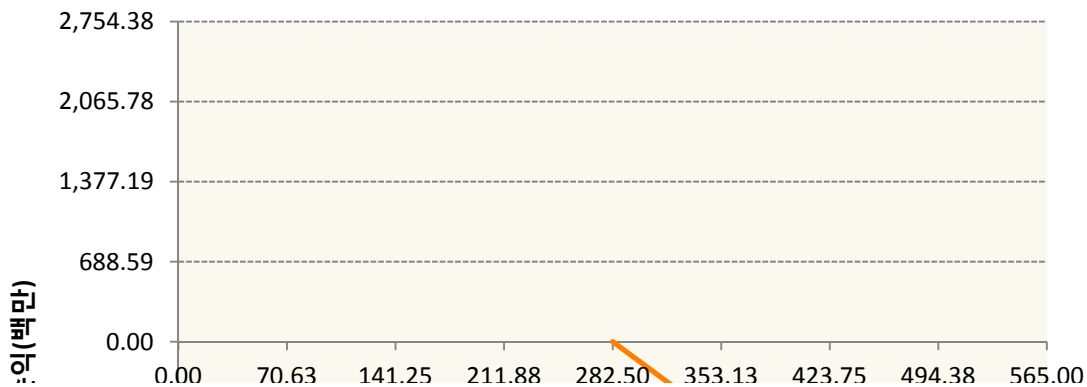
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,478	0	12,478	장내
누계	유가증권	옵션	1,084	22,134	-21,050	장내

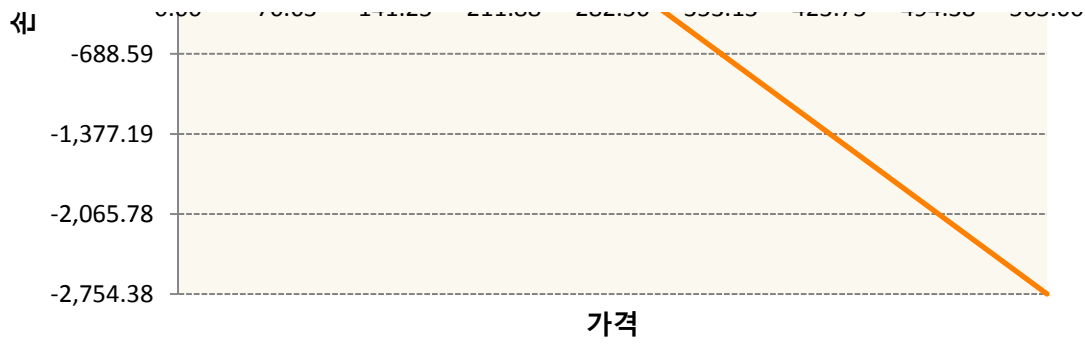
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

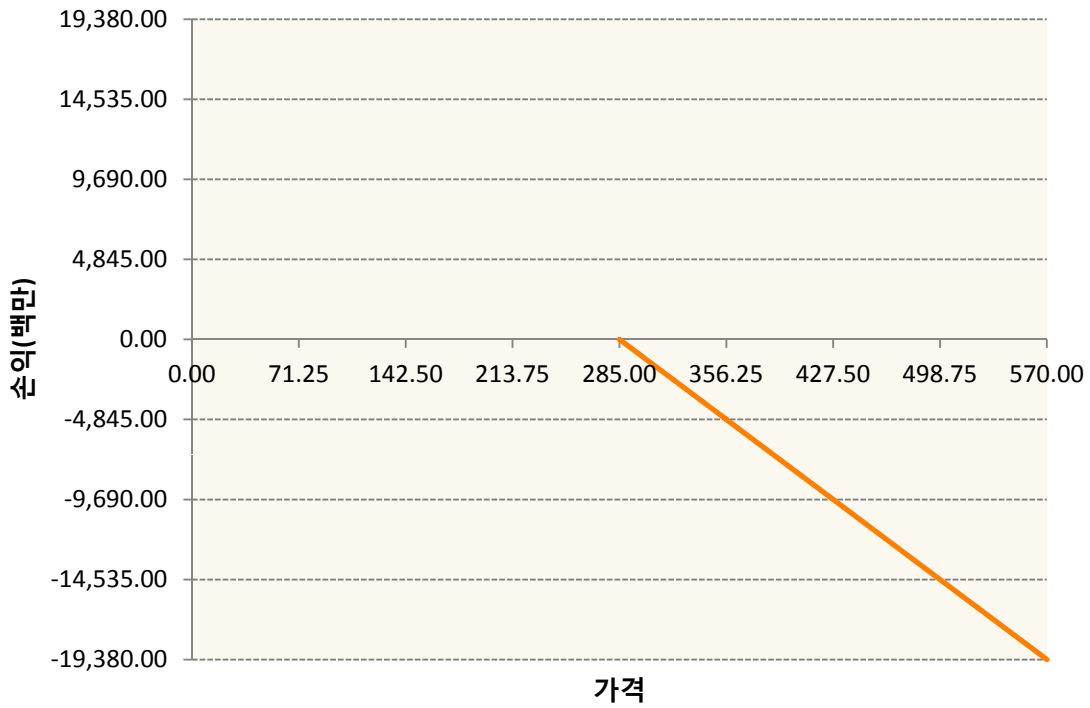


KR4201P72825-2019-07 콜282.5

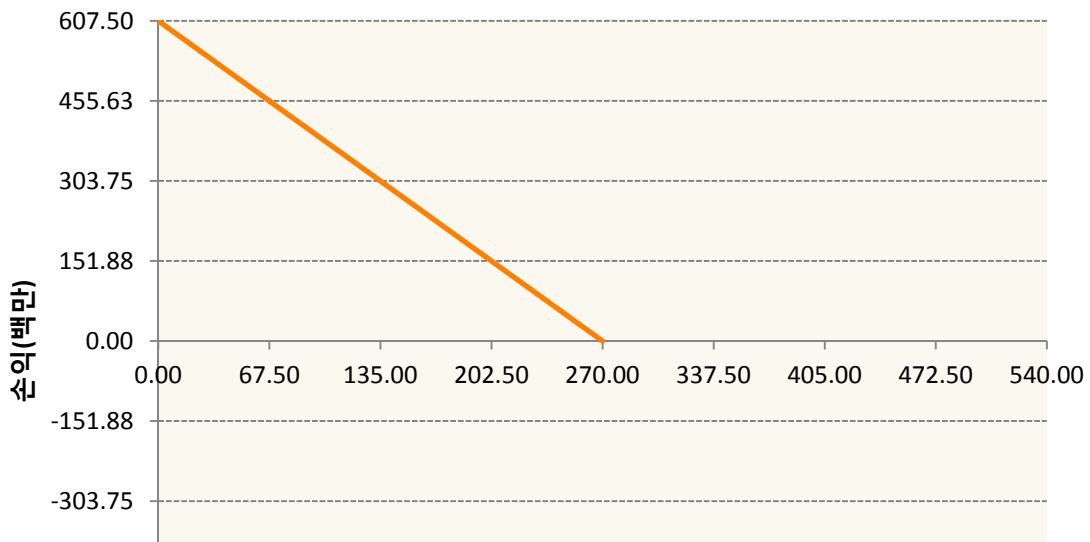


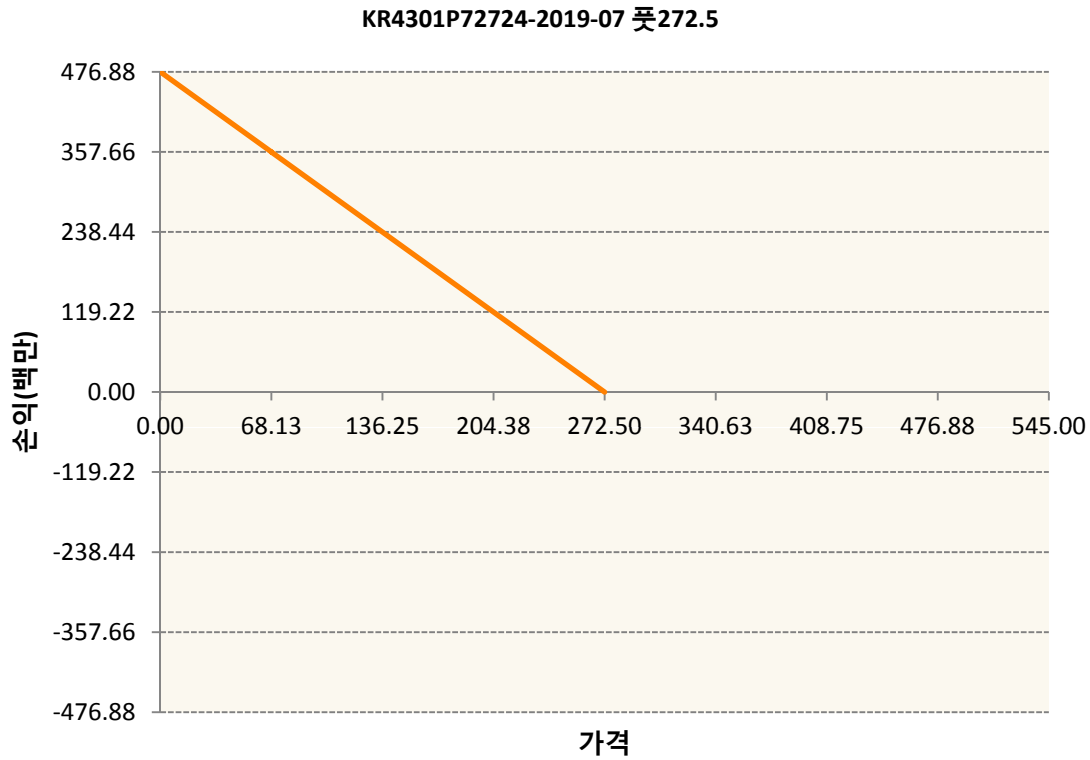
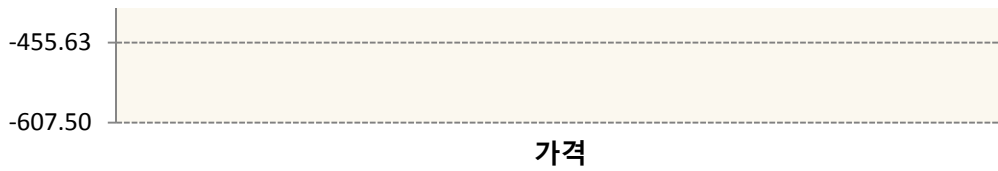


KR4201P72858-2019-07 콜285



KR4301P72708-2019-07 풋270





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	-997
-5.33%	-665	-665	-665	-665	-665	-665	-665	-665
-2.67%	-332	-332	-332	-332	-332	-332	-332	-332
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	332	332	332	332	332	332	332	332
5.33%	665	665	665	665	665	665	665	665
8.00%	997	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%	28	28	28	27	27	26	25	
-5.33%	28	27	26	25	23	21	19	
-2.67%	24	22	20	17	14	11	8	

0%	12	8	4	0	-4	-8	-13
2.67%	-16	-20	-25	-30	-35	-39	-44
5.33%	-62	-66	-70	-74	-78	-82	-87
8.00%	-122	-124	-127	-130	-133	-136	-140

KR4201P72858 2019-07 콜285 892

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	151	150	149	147	144	140	135
-5.33%	148	145	140	134	126	116	104
-2.67%	133	122	109	94	77	59	38
0%	74	51	26	0	-27	-54	-83
2.67%	-79	-111	-144	-177	-210	-243	-275
5.33%	-357	-388	-419	-450	-482	-514	-547
8.00%	-749	-768	-790	-814	-839	-865	-892

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%	18	19	19	19	19	20	20
-2.67%	5	6	6	7	7	8	9
0%	-1	-1	0	0	0	1	2
2.67%	-3	-3	-2	-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	17	17	17	18	18	18
-2.67%	6	6	6	7	7	8	8
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-2	-2
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-4	-4	-3	-3	-3	-3	-3

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

(단위:백만원)

1,768

공시일	2019-06-27
기준일	2019-06-26

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	18,795	0	18,795	

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	2019-06-27
기준일	2019-06-26

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	59,484	0	59,484	

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	2019-06-27
기준일	2019-06-26

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	394,136	0	394,136	
누계	통화	선도	0	435,506	-435,506	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		74
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		973
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		861
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		1,027
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		1,851
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	2,221
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	1,851
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E	1,851
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E	685
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E	685
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E	1,277
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E	2,509

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

(단위:백만원)

11,405

공시일	2019-06-27
기준일	2019-06-26

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

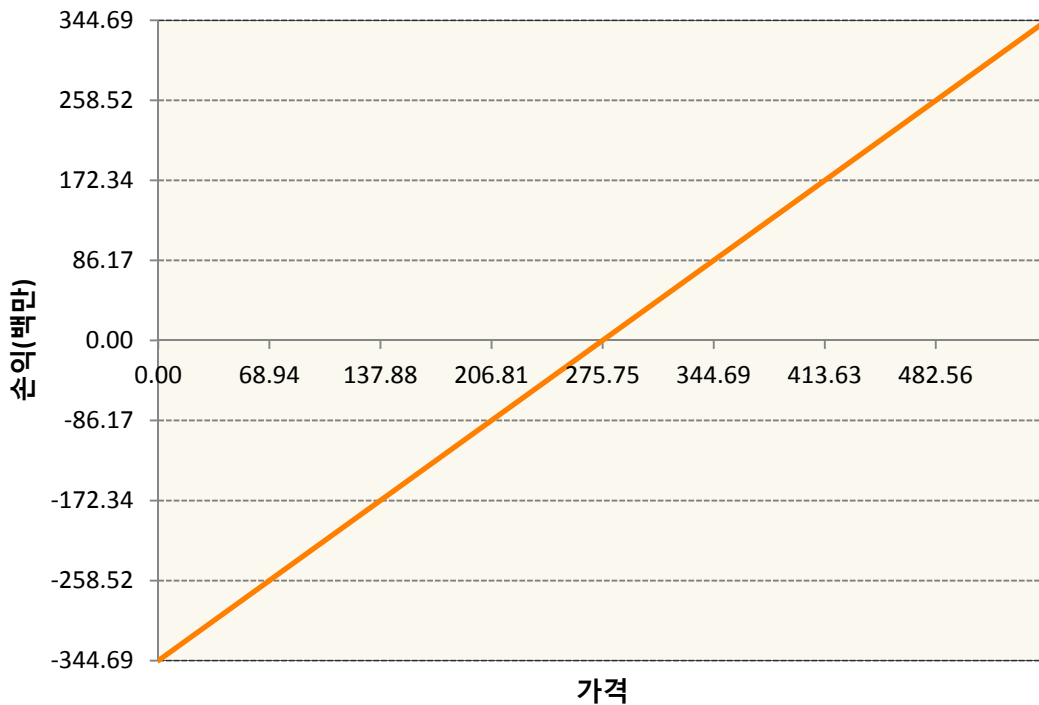
1. 계약금액

(단위:백만원)

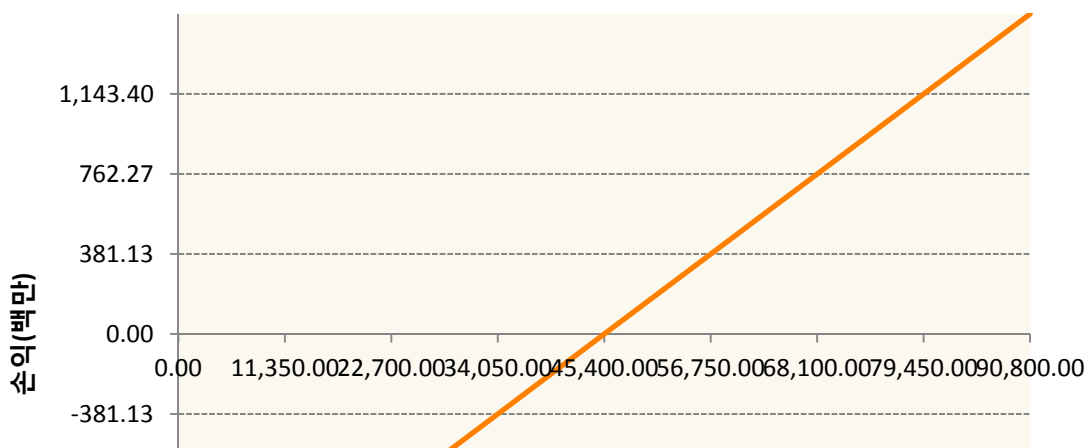
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,869	0	1,869	장내

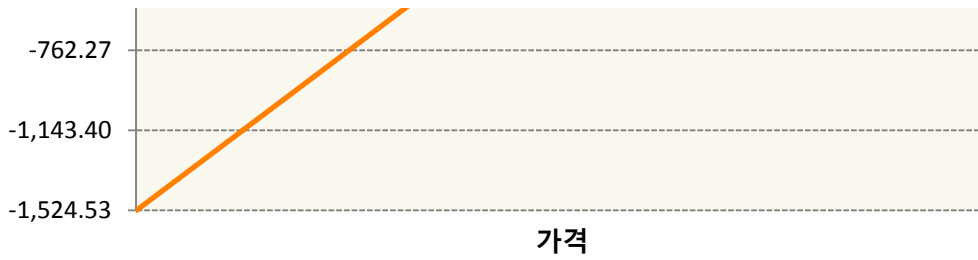
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P70002-2019-07 삼성전자개별선물





3. 시나리오 별 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)

161

공시일	2019-06-27
기준일	2019-06-26

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

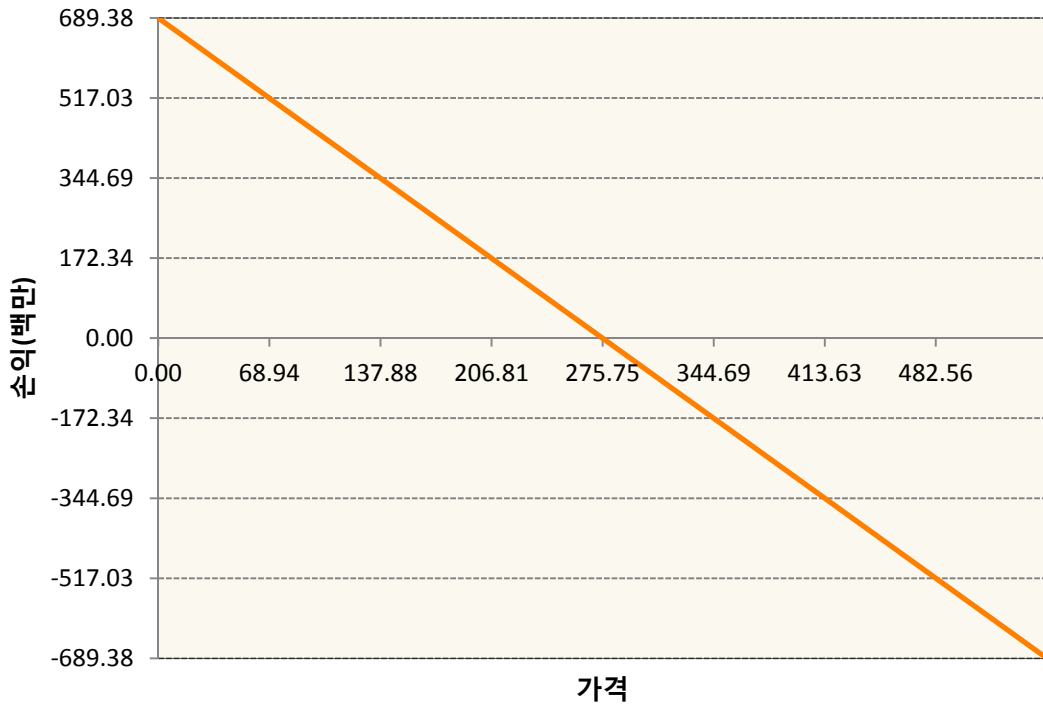
1. 계약금액

(단위:백만원)

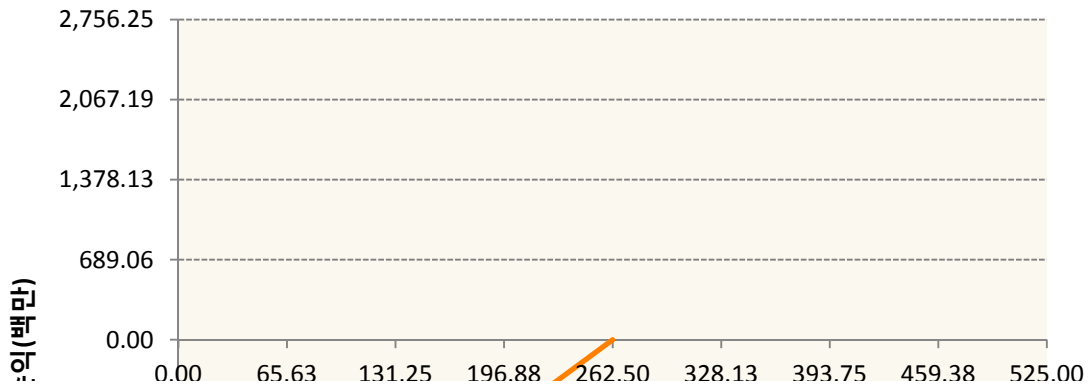
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	689	-689	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,419	-3,419	장내

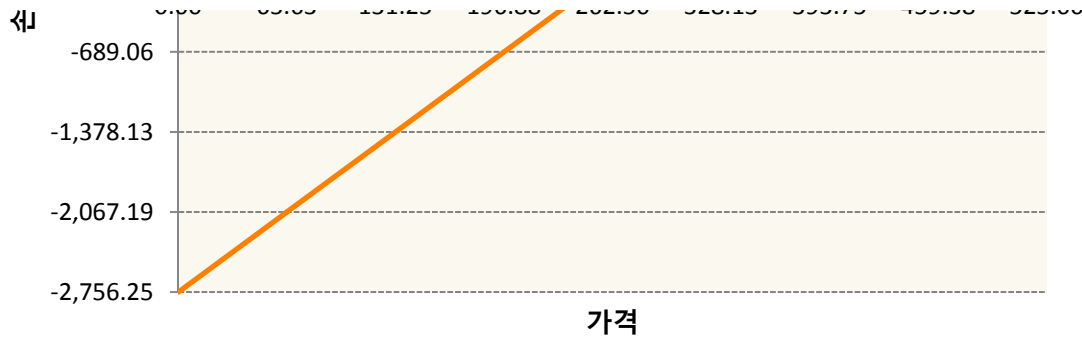
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

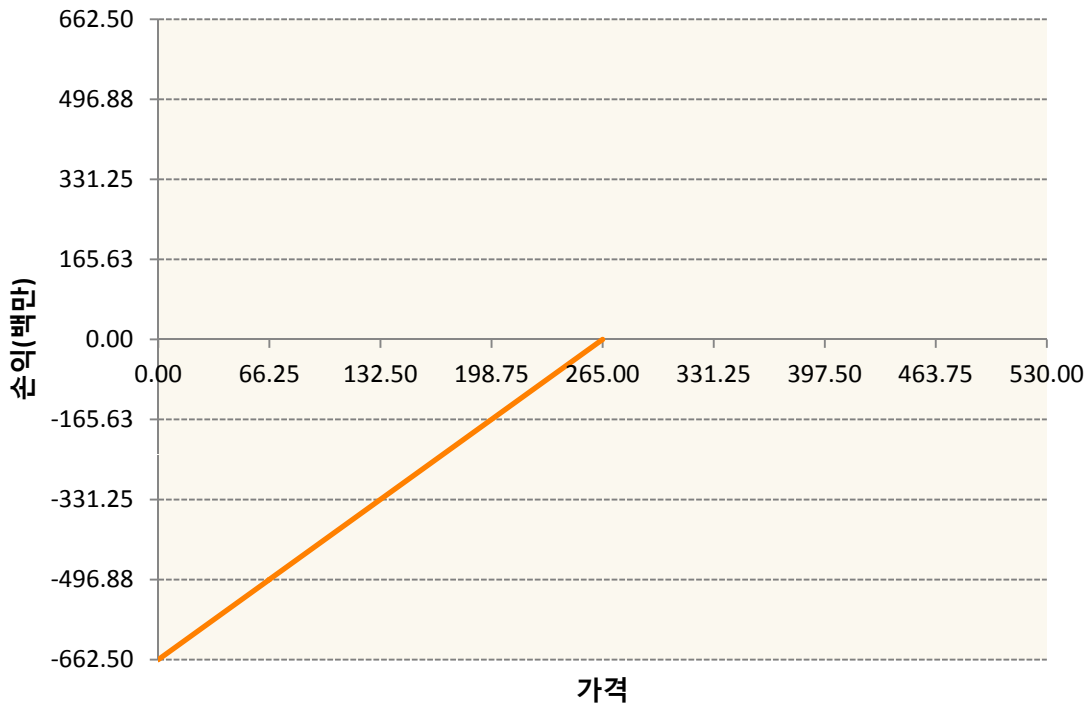


KR4301P72625-2019-07 풋262.5





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	-43	-46	-49
-2.67%	-4	-6	-8	-10	-12	-14	-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	-14	-15
-2.67%	-2	-3	-3	-4	-4	-5	-6
0%	1	0	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)

122

공시일	2019-06-27
기준일	2019-06-26

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)

103

공시일	2019-06-27
기준일	2019-06-26

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

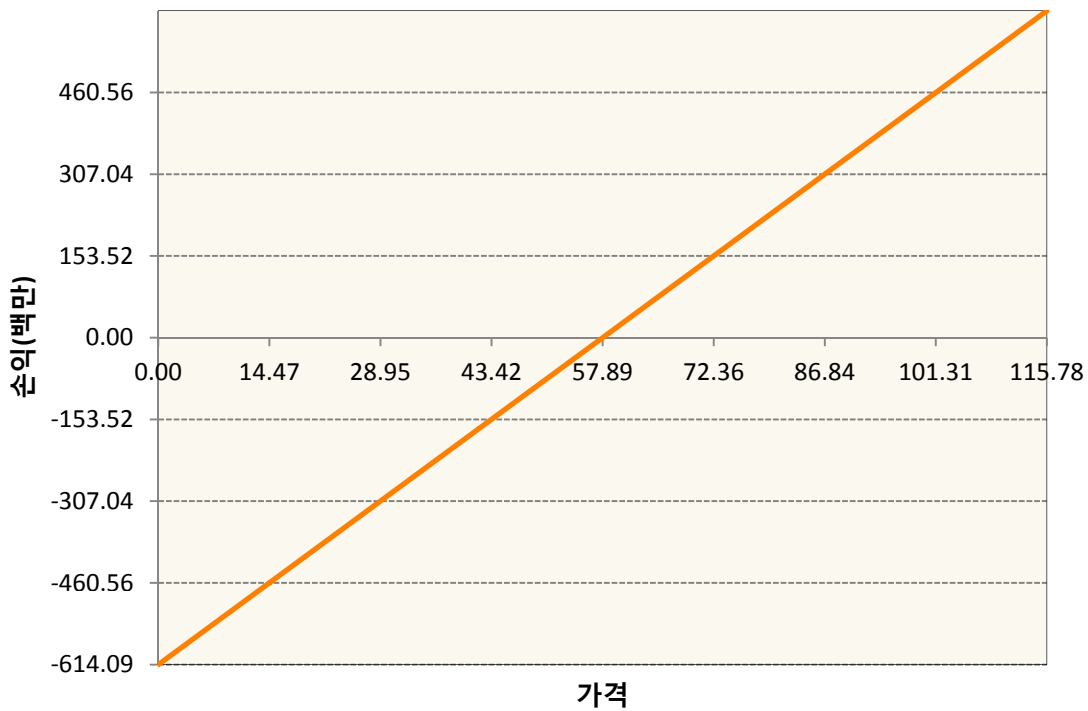
1. 계약금액

(단위:백만원)

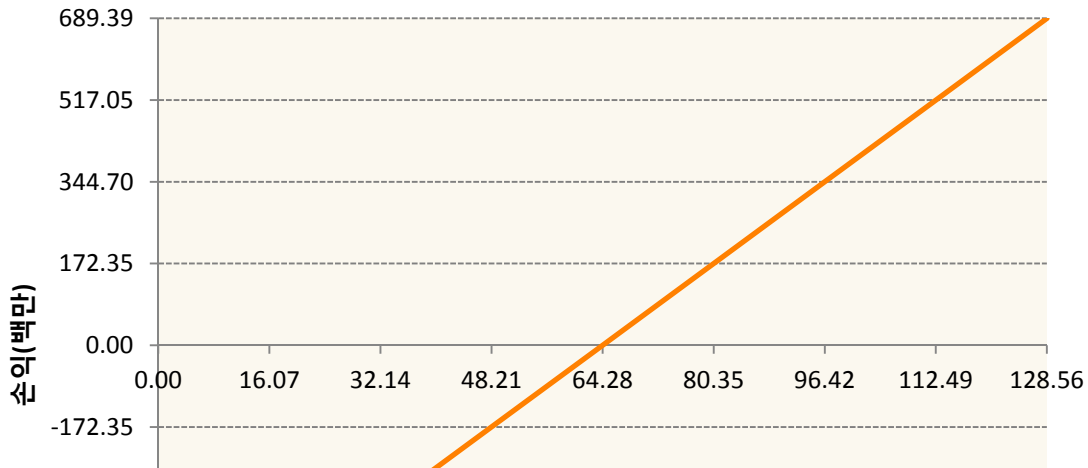
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,631	116	2,515	

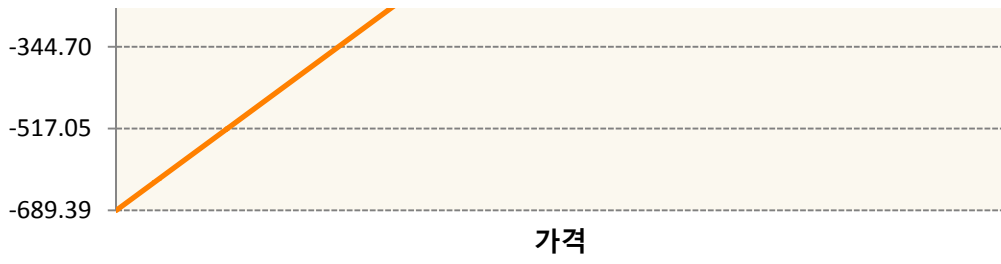
2. 만기시점의 손익구조

CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19

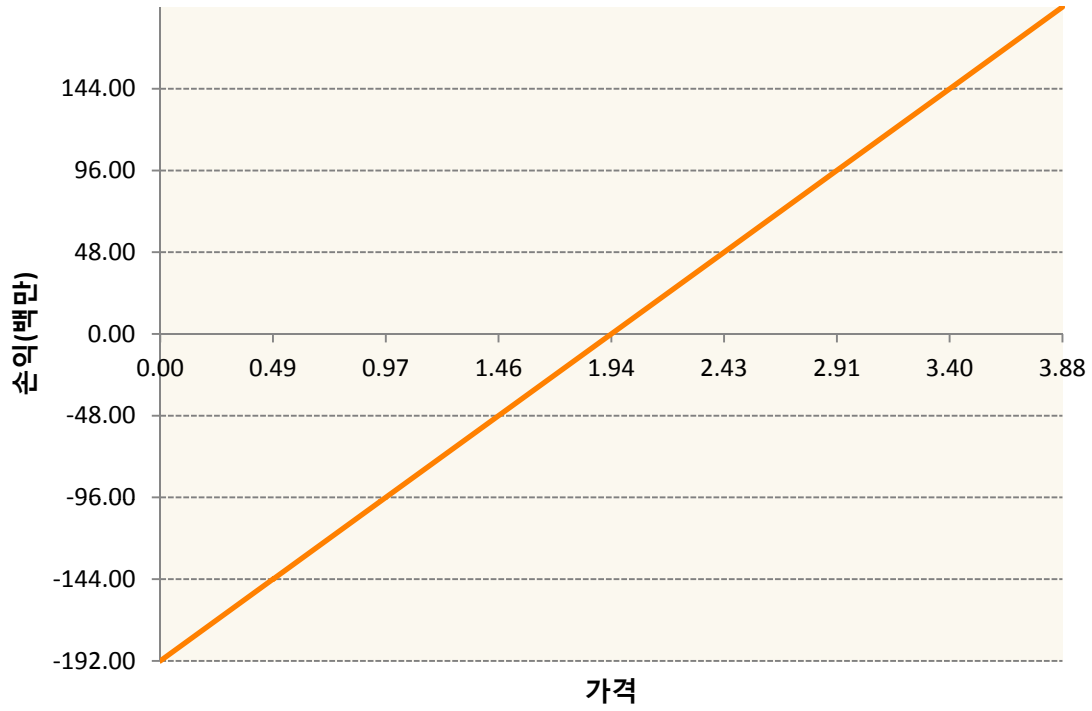


COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19

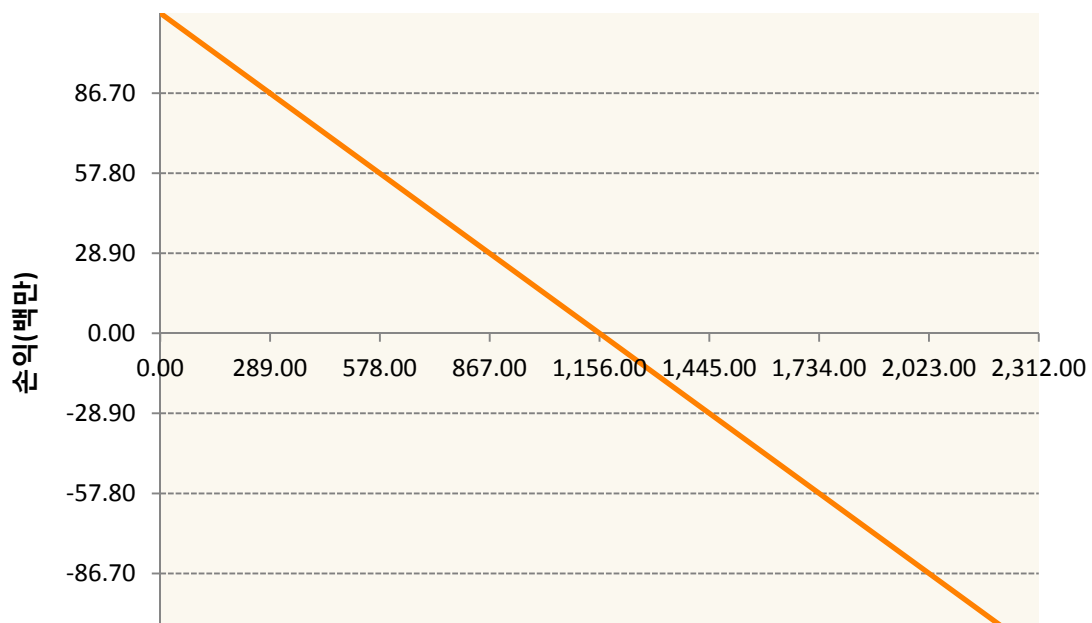


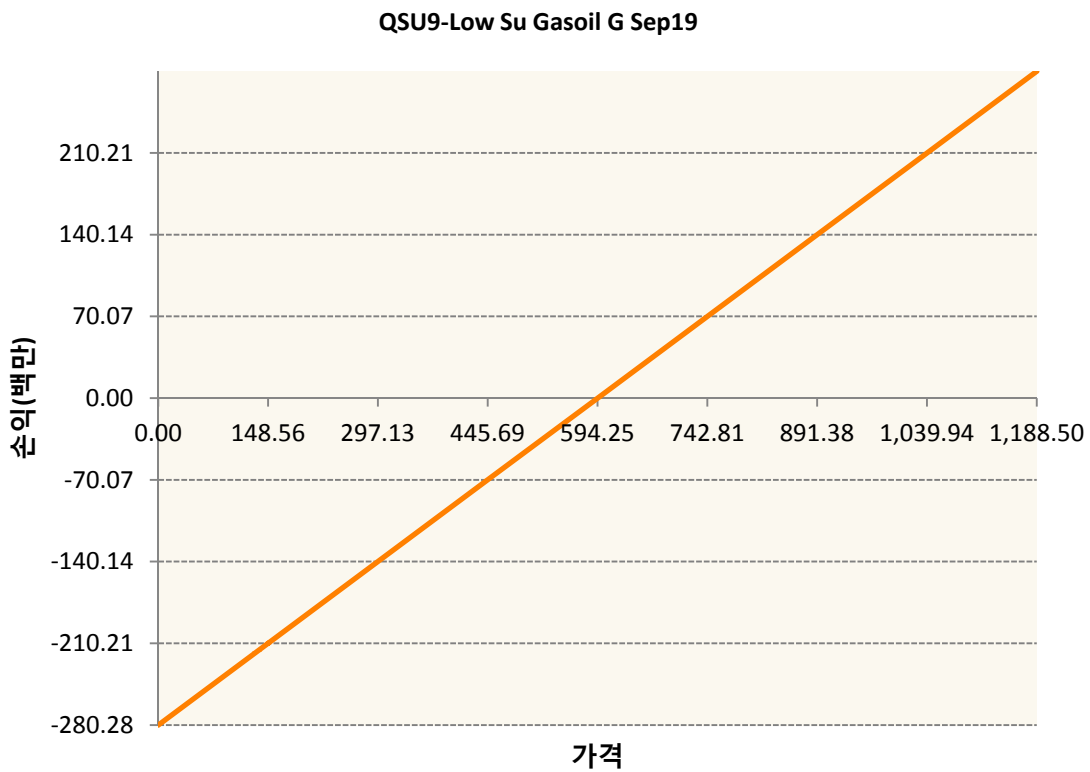
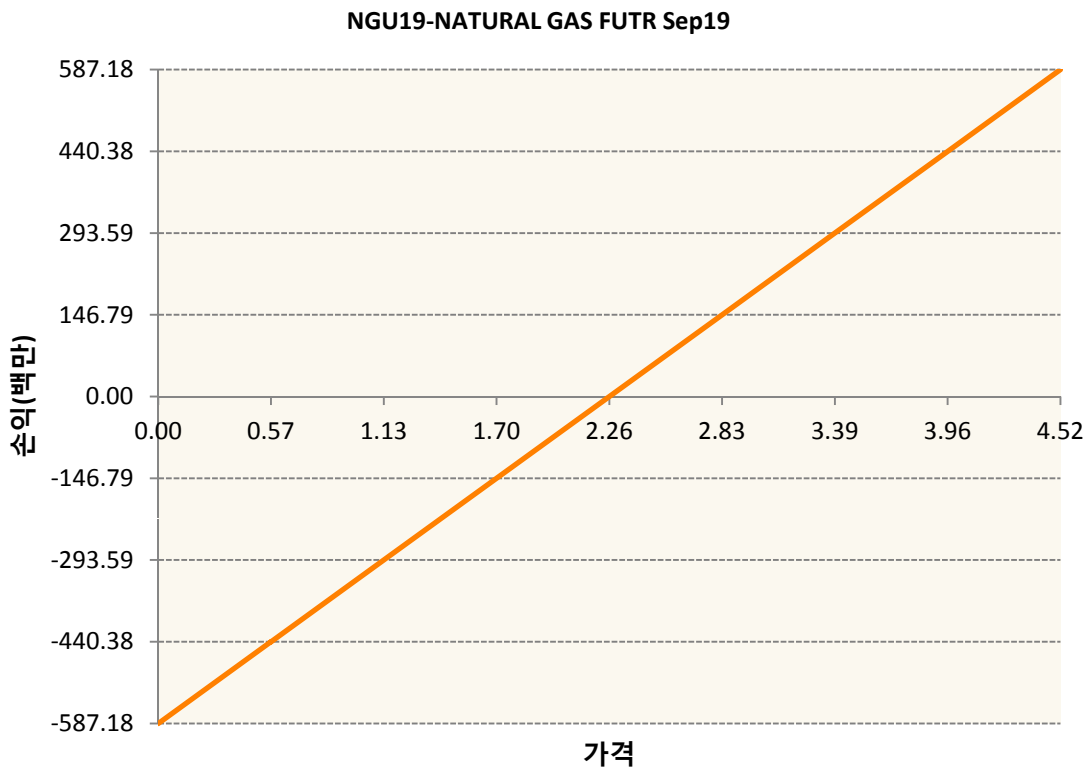
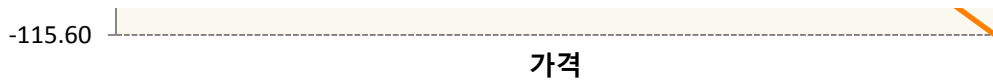


HOU9-NY Harb ULSD Fut Sep19

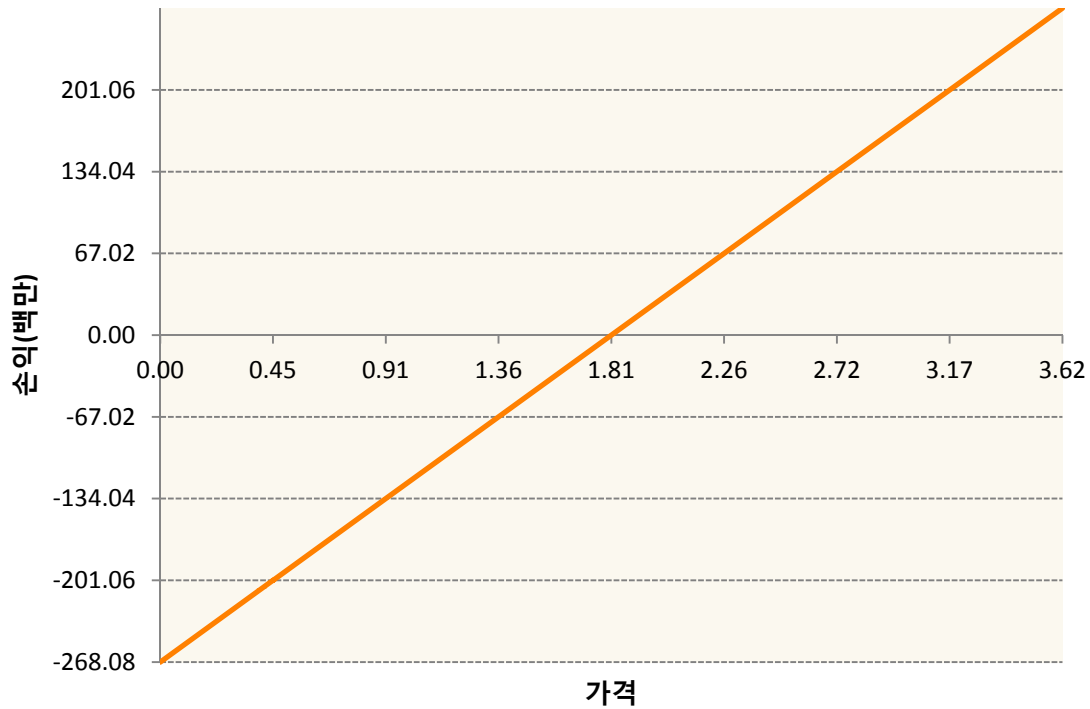


KR4175P70007-2019-07 달러선물





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)

392

공시일	2019-06-27
기준일	2019-06-26

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

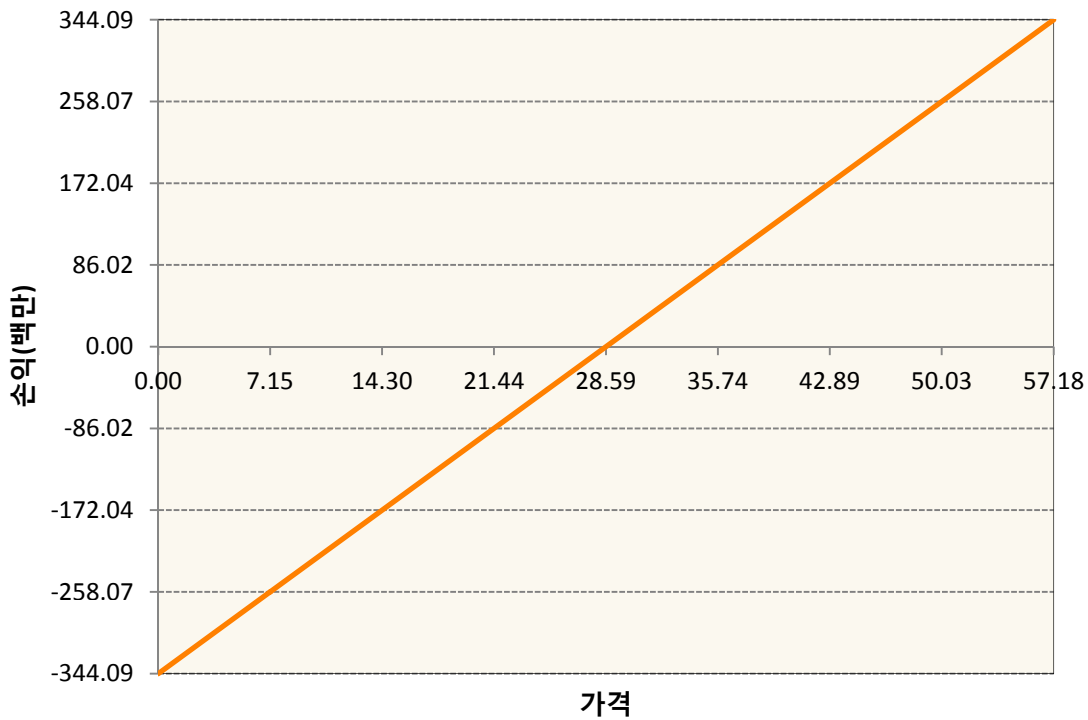
1. 계약금액

(단위:백만원)

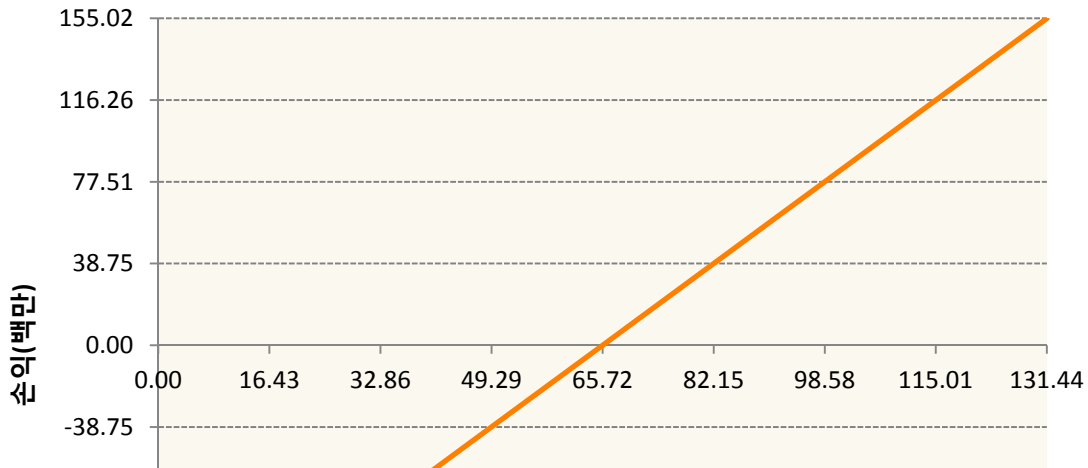
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,245	197	3,049	

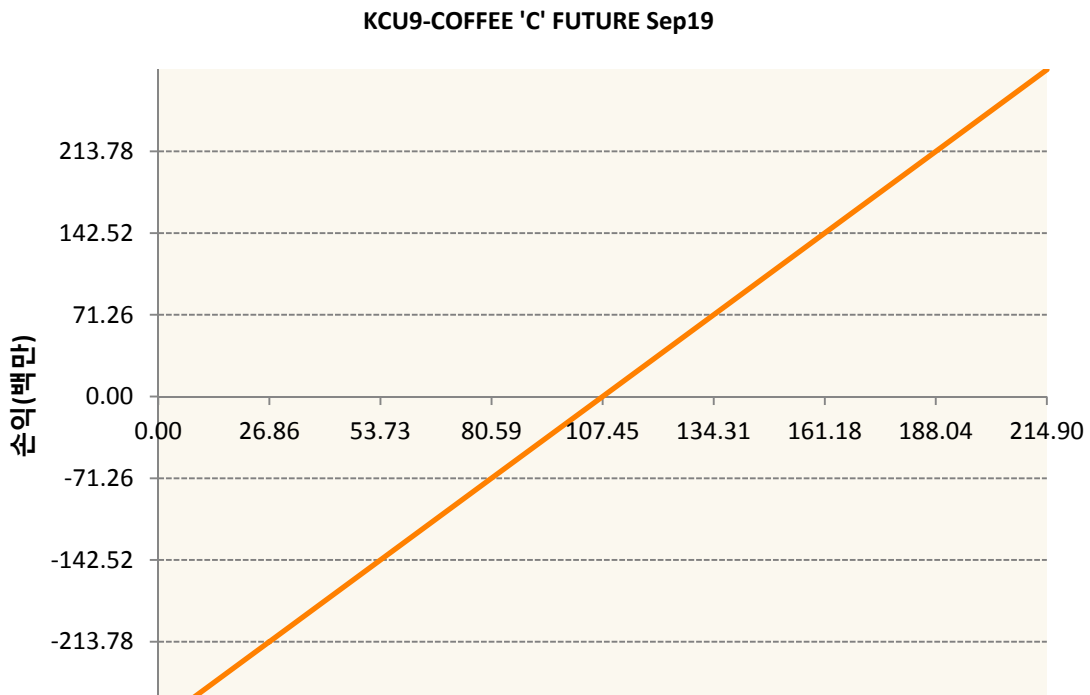
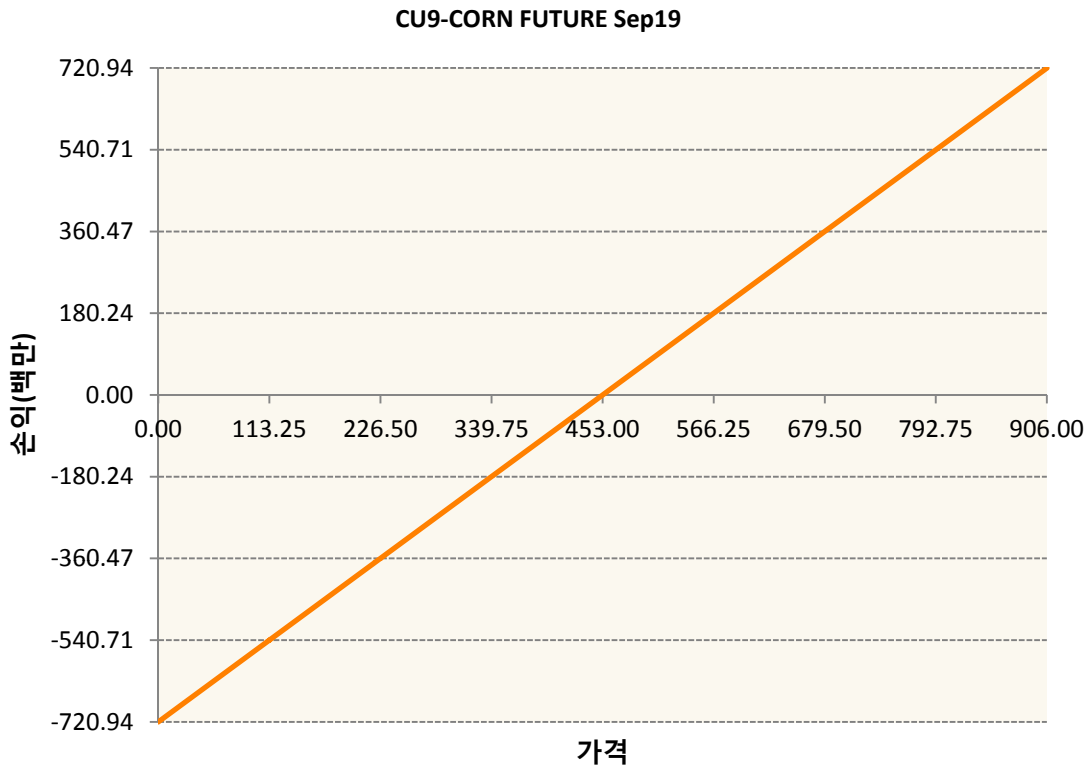
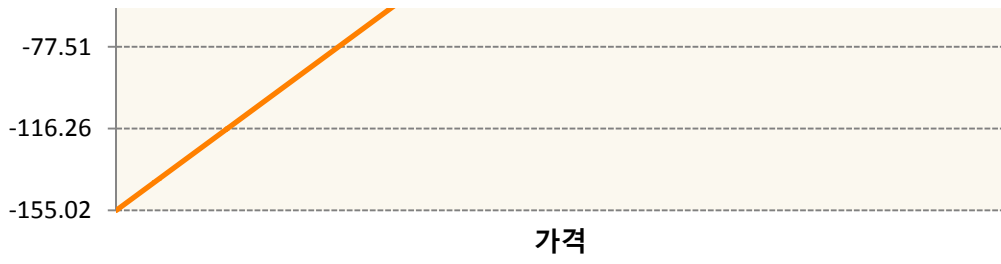
2. 만기시점의 손익구조

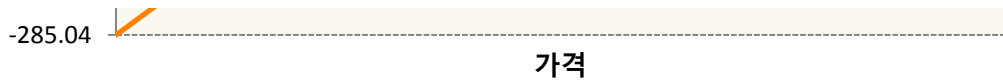
BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19



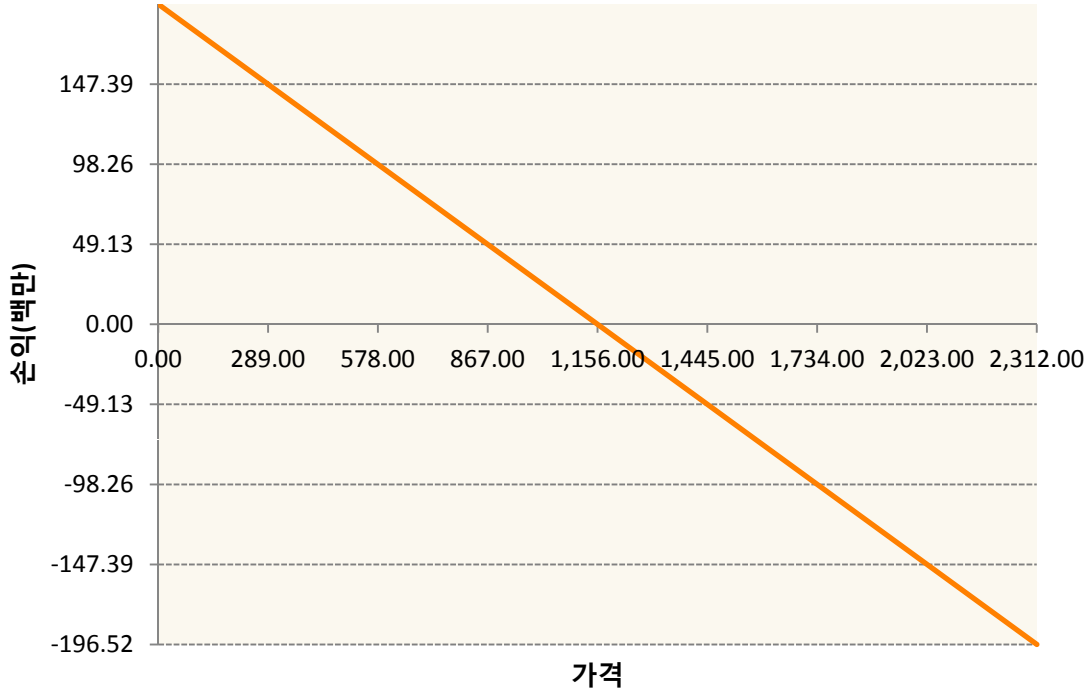
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



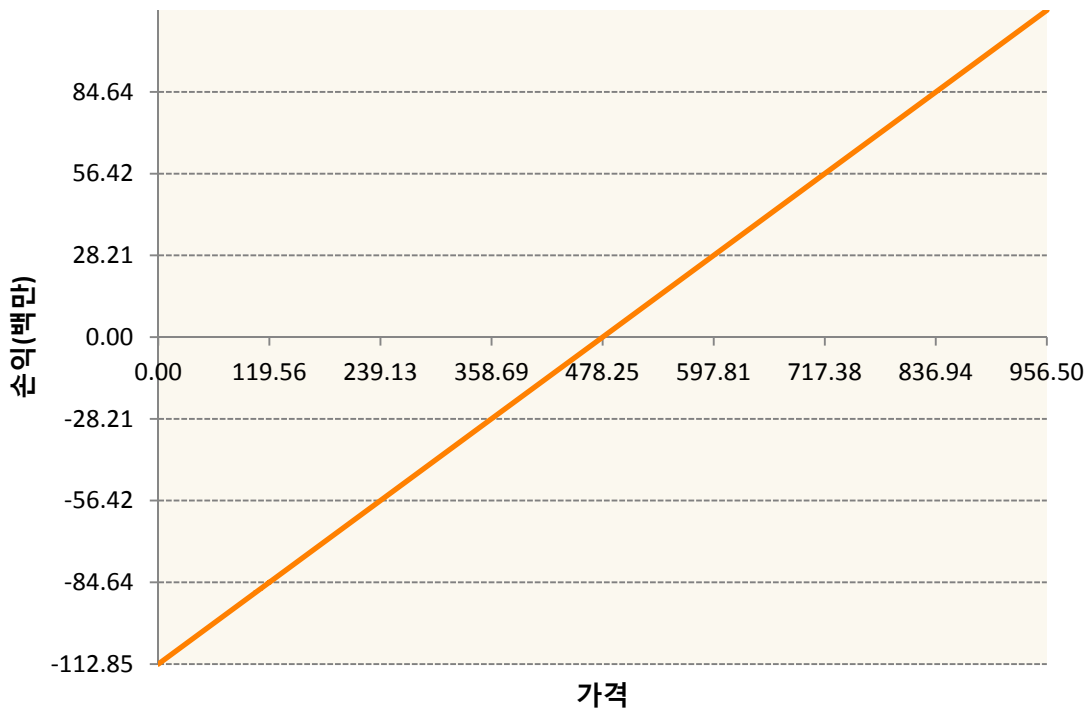




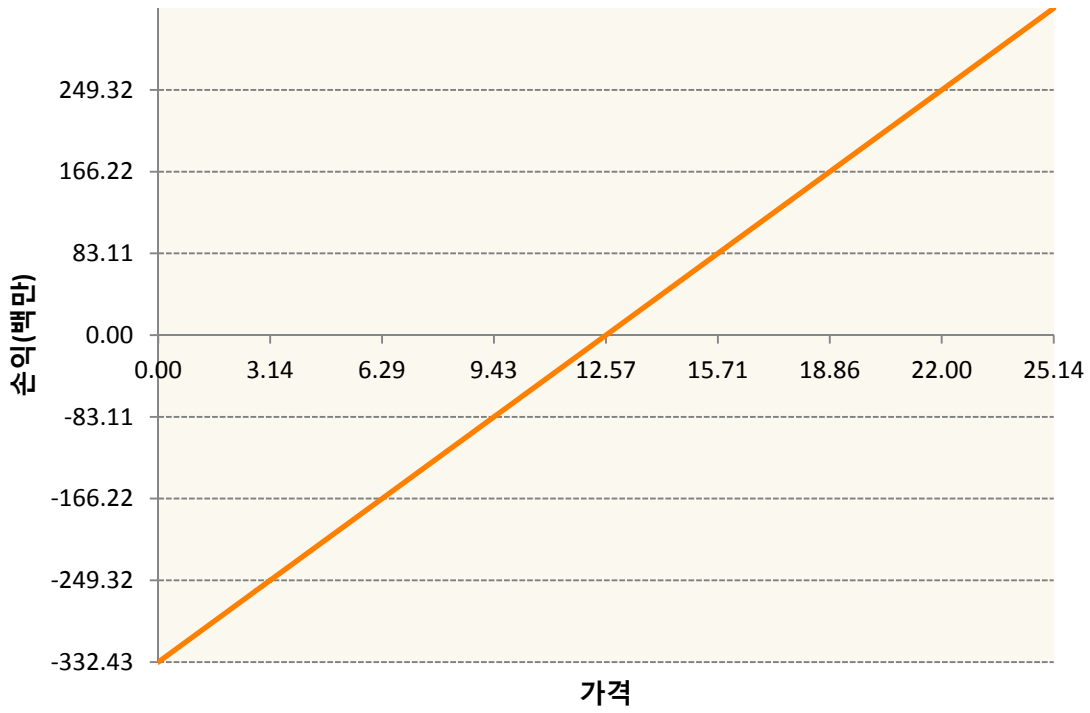
KR4175P70007-2019-07 달러선물



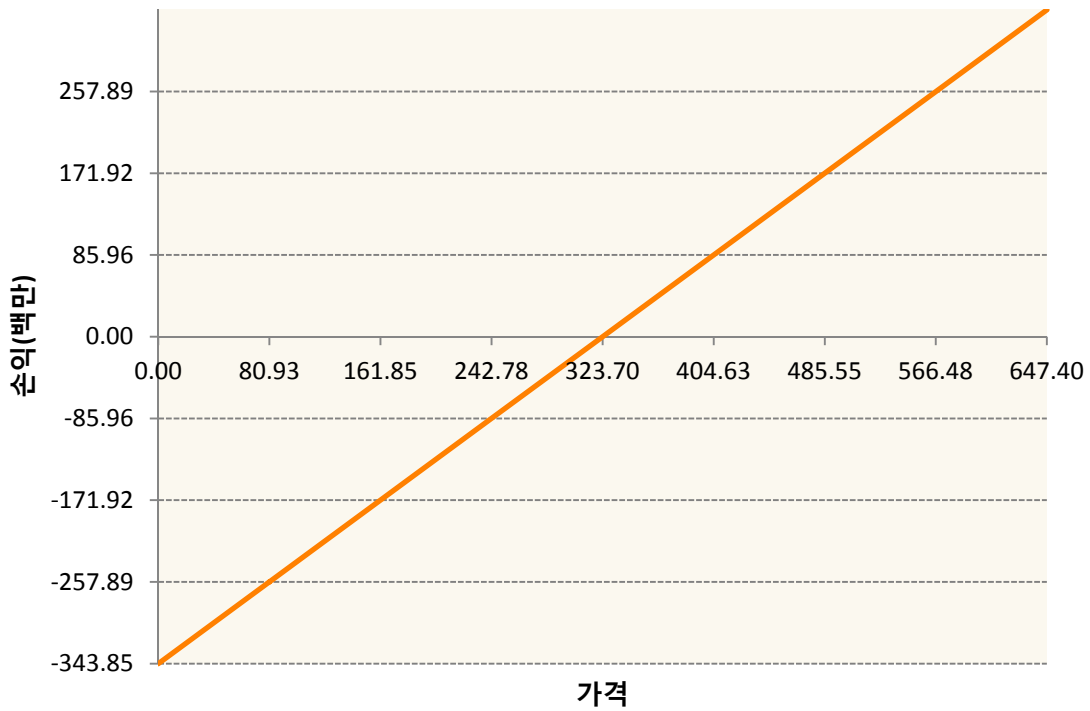
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

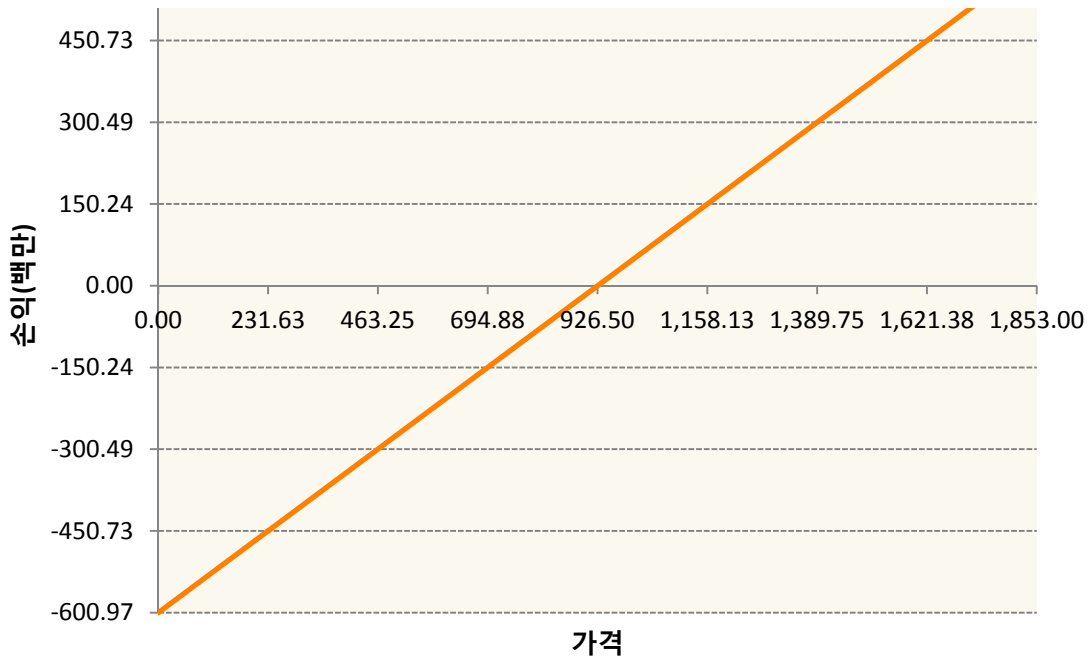


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

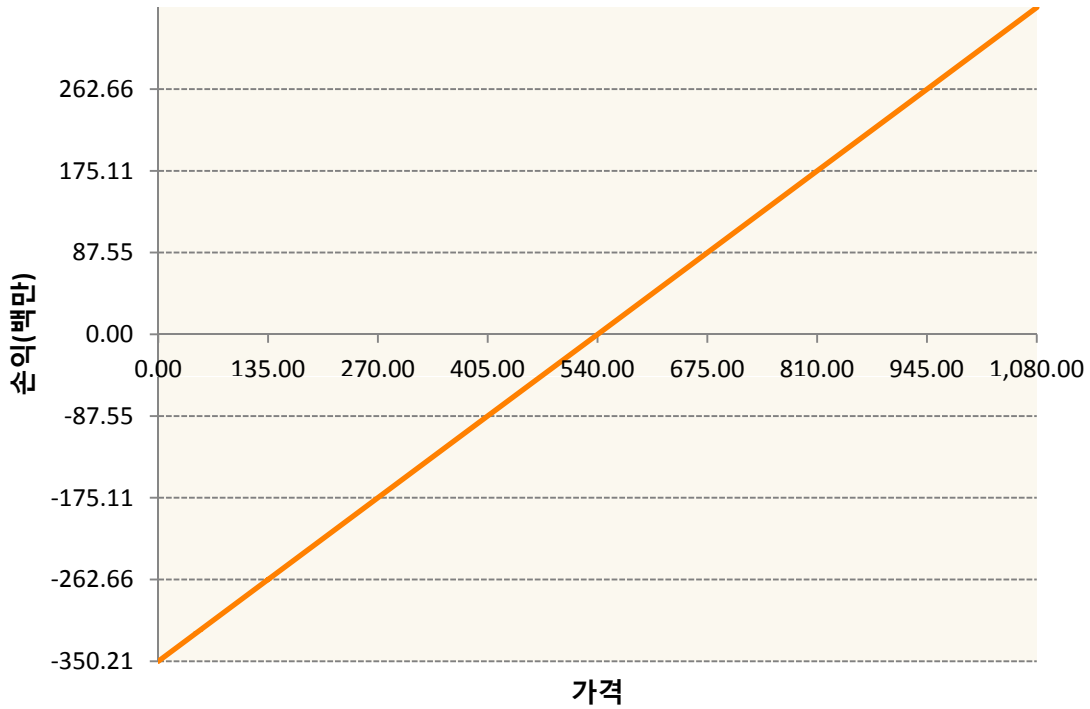


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





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	23
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	28

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

(단위:백만원)

283