

공시일	2019-06-28
기준일	2019-06-27

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	2019-06-28
기준일	2019-06-27

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

1,154

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

666

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-28
기준일	2019-06-27

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)	389
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	143

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

867

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-28
기준일	2019-06-27

유로인덱스모(주식-파생형)

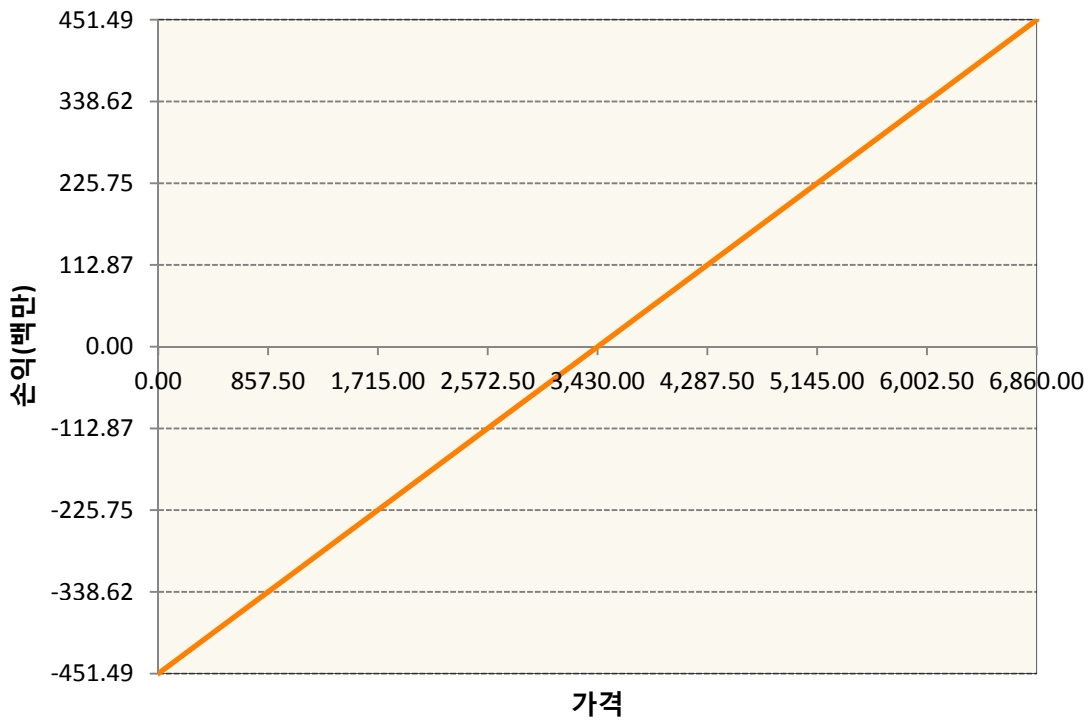
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	451	0	451	

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	2019-06-28
기준일	2019-06-27

차이나인덱스모(주식-파생형)

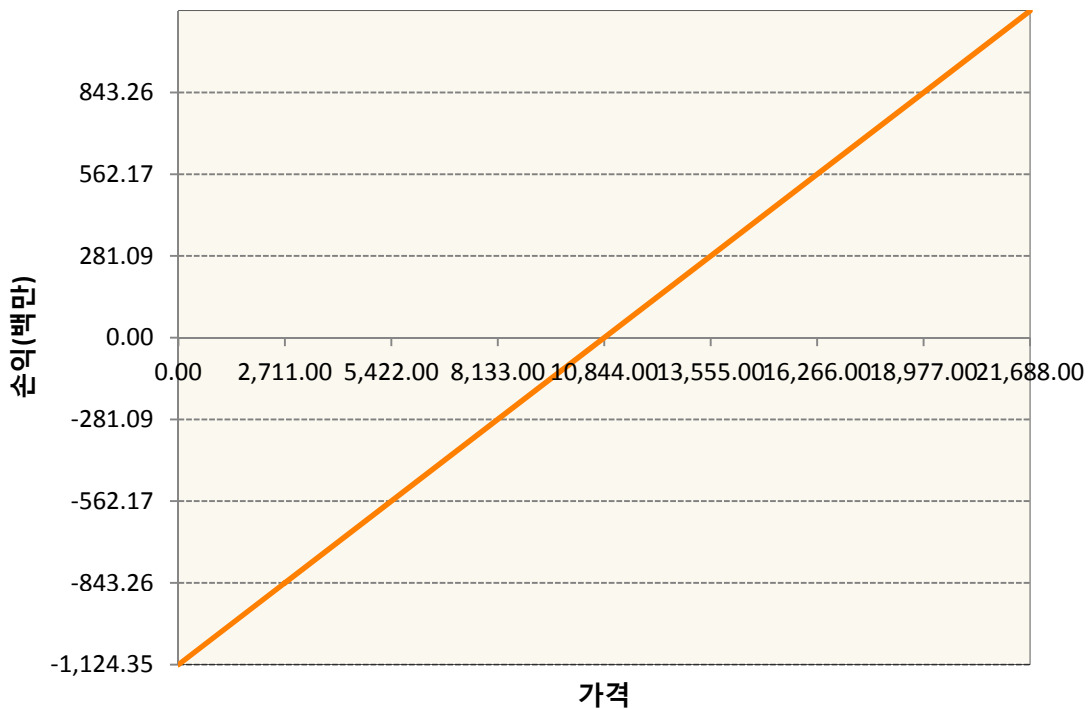
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,124	0	1,124	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCN9-HSCEI Futures Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN9	HSCEI Futures Jul19	90
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

91

공시일	2019-06-28
기준일	2019-06-27

커버드콜모(주식혼합-파생형)

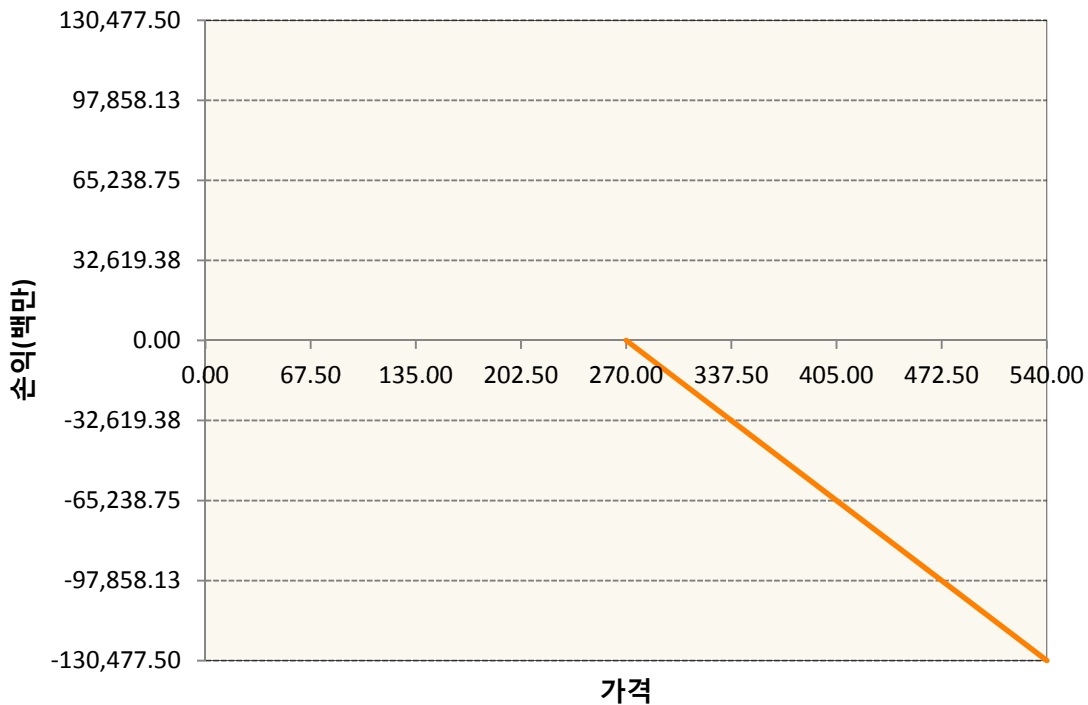
1. 계약금액

(단위:백만원)

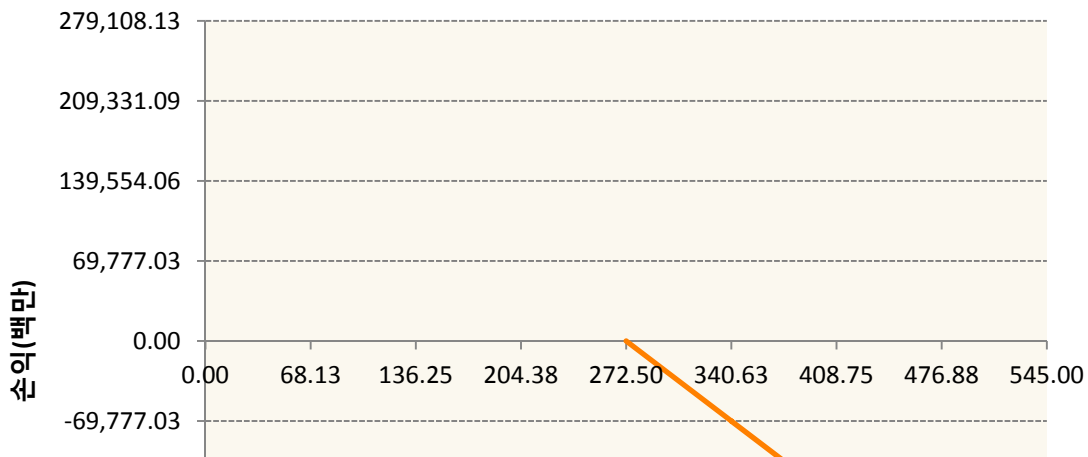
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	602,973	-602,973	장내

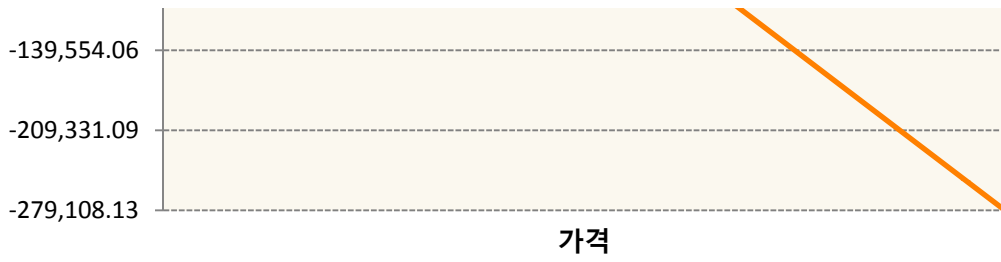
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P72700-2019-07 콜270

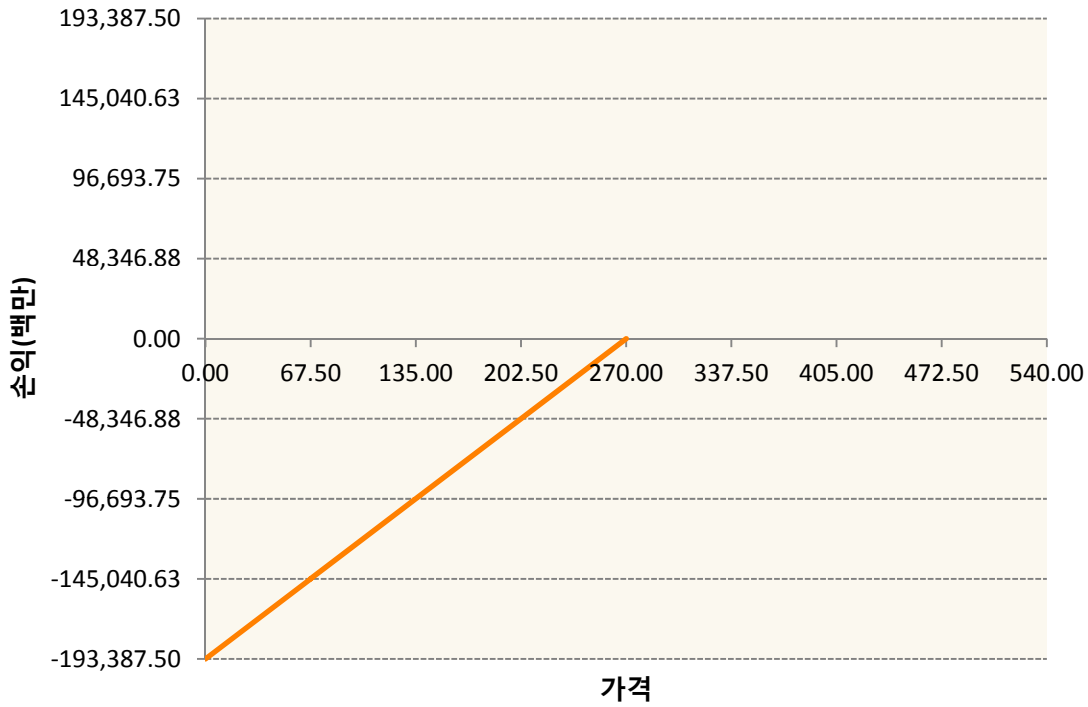


KR4201P72726-2019-07 콜272.5





KR4301P72708-2019-07 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P72700		2019-07 콜270					9,709
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,735	4,657	4,564	4,457	4,339	4,210	4,073
-5.33%	4,214	4,046	3,870	3,688	3,502	3,312	3,120
-2.67%	2,874	2,658	2,443	2,227	2,011	1,795	1,579
0%	532	362	184	0	-189	-382	-579
2.67%	-2,558	-2,644	-2,746	-2,862	-2,990	-3,128	-3,276
5.33%	-6,000	-6,029	-6,071	-6,126	-6,195	-6,276	-6,368
8.00%	-9,551	-9,558	-9,570	-9,591	-9,620	-9,659	-9,709
KR4201P72726		2019-07 콜272.5					19,883
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,452	8,336	8,187	8,009	7,804	7,574	7,323

-5.33%	7,714	7,416	7,094	6,754	6,398	6,030	5,651
-2.67%	5,534	5,085	4,633	4,181	3,727	3,272	2,817
0%	1,272	856	431	0	-436	-877	-1,320
2.67%	-4,824	-5,070	-5,346	-5,648	-5,971	-6,313	-6,669
5.33%	-11,936	-12,032	-12,160	-12,319	-12,508	-12,723	-12,962
8.00%	-19,412	-19,438	-19,481	-19,546	-19,634	-19,747	-19,883
KR4301P72708 2019-07 풋270							10,112
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,947	-9,956	-9,970	-9,993	-10,024	-10,063	-10,112
-5.33%	-4,842	-4,931	-5,031	-5,142	-5,261	-5,388	-5,521
-2.67%	-1,077	-1,259	-1,442	-1,625	-1,807	-1,990	-2,172
0%	293	208	109	0	-118	-245	-378
2.67%	471	461	443	418	383	338	284
5.33%	478	478	477	474	469	461	448
8.00%	478	478	478	478	478	477	475

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

(단위:백만원)

40,360

공시일	2019-06-28
기준일	2019-06-27

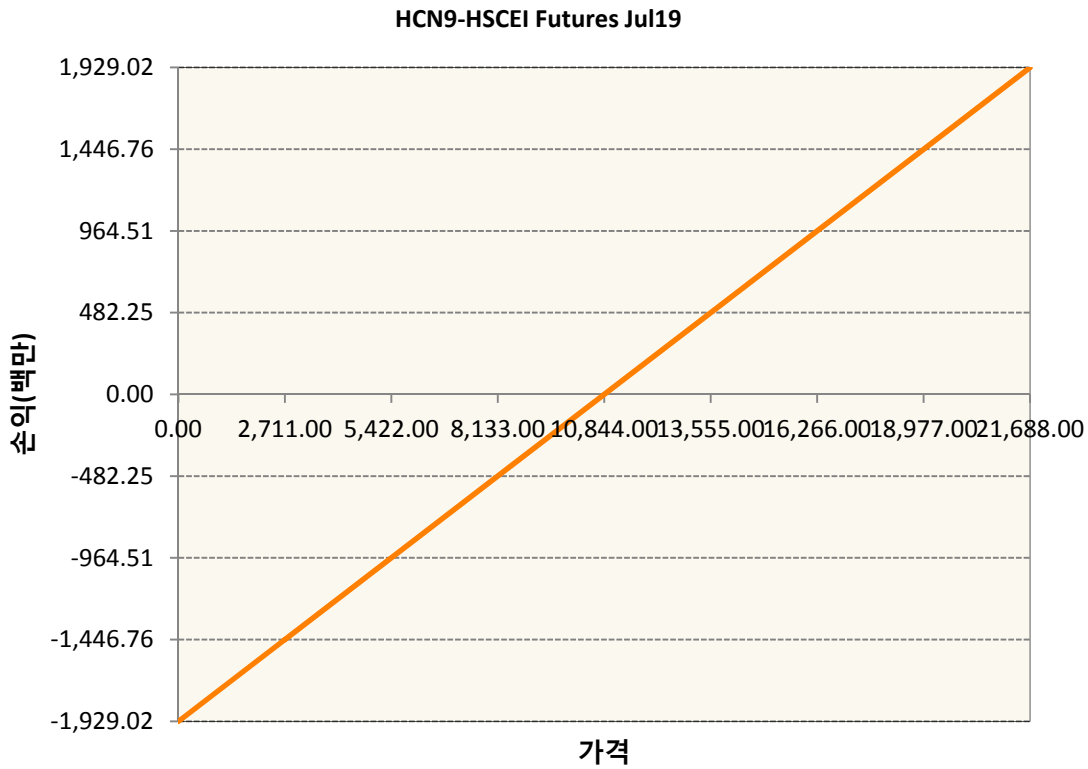
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,929	0	1,929	장내
누계	통화	선도	148	3,113	-2,965	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	249
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E	12
HCN9 HSCEI Futures Jul19	154

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

(단위:백만원)

241

공시일	2019-06-28
기준일	2019-06-27

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

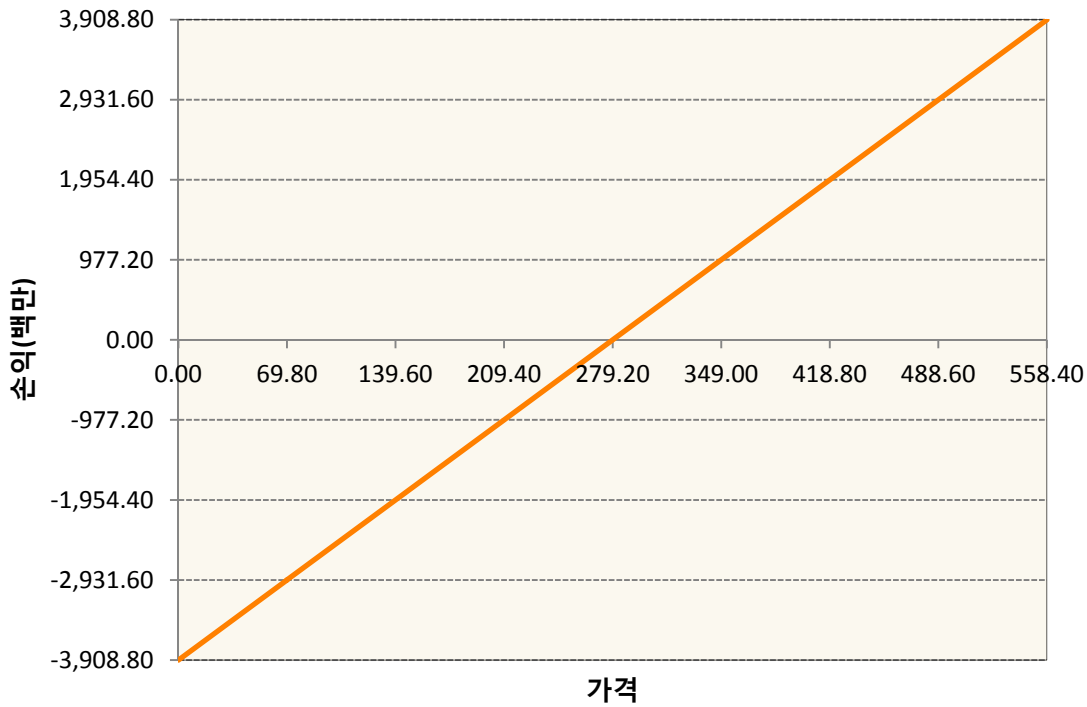
1. 계약금액

(단위:백만원)

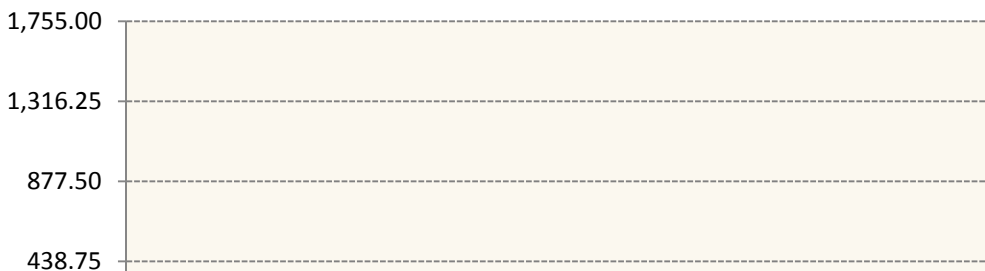
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,909	0	3,909	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,880	-20,880	장내

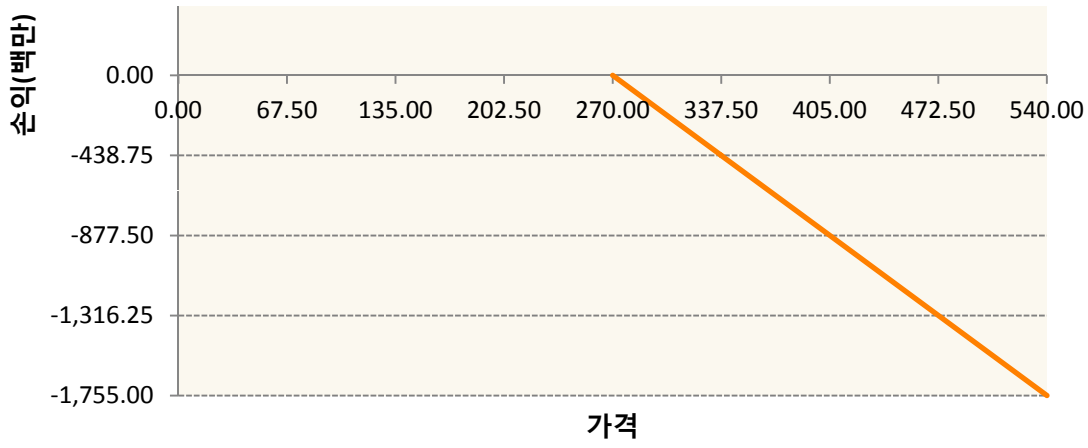
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

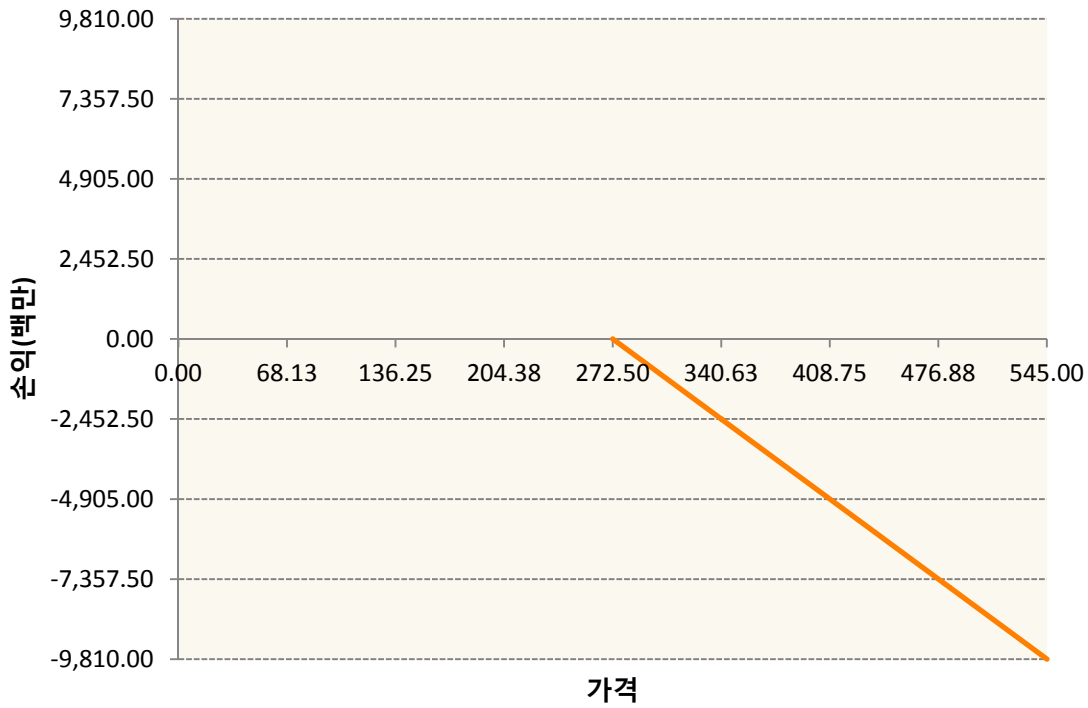


KR4201P72700-2019-07 콜270

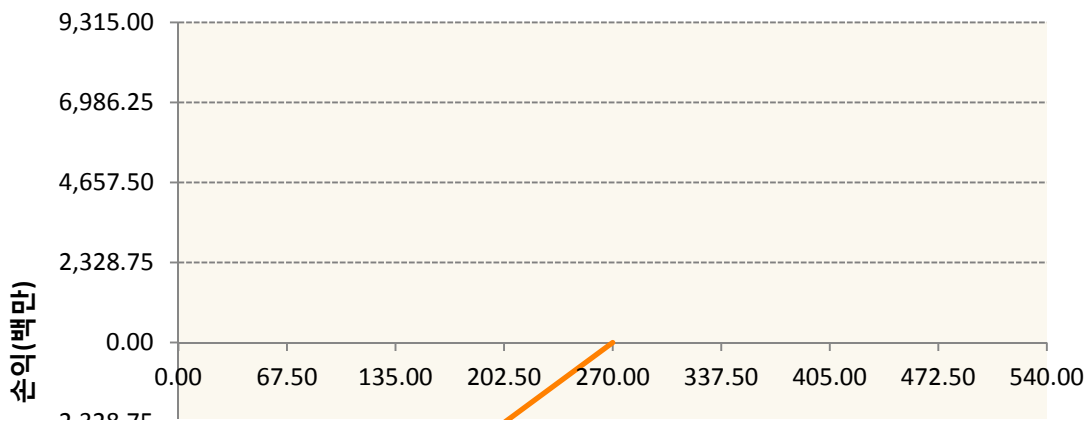




KR4201P72726-2019-07 콜272.5



KR4301P72708-2019-07 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,174
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,174	-1,174	-1,174	-1,174	-1,174	-1,174	-1,174	
-5.33%	-783	-783	-783	-783	-783	-783	-783	
-2.67%	-391	-391	-391	-391	-391	-391	-391	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	391	391	391	391	391	391	391	
5.33%	783	783	783	783	783	783	783	
8.00%	1,174	1,174	1,174	1,174	1,174	1,174	1,174	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						594
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-594	-594	-594	-594	-594	-594	-594	
-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%	594	594	594	594	594	594	594	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						311
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-311	-311	-311	-311	-311	-311	-311	
-5.33%	-207	-207	-207	-207	-207	-207	-207	
-2.67%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	104	104	104	104	104	104	104	
5.33%	207	207	207	207	207	207	207	
8.00%	311	311	311	311	311	311	311	
KR4201P72700		2019-07 콜270						131
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	64	63	61	60	58	57	55
-5.33%	57	54	52	50	47	45	42
-2.67%	39	36	33	30	27	24	21
0%	7	5	2	0	-3	-5	-8
2.67%	-34	-36	-37	-38	-40	-42	-44
5.33%	-81	-81	-82	-82	-83	-84	-86
8.00%	-128	-129	-129	-129	-129	-130	-131

KR4201P72726 2019-07 콜272.5 699

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	297	293	288	281	274	266	257
-5.33%	271	261	249	237	225	212	199
-2.67%	195	179	163	147	131	115	99
0%	45	30	15	0	-15	-31	-46
2.67%	-170	-178	-188	-199	-210	-222	-234
5.33%	-420	-423	-427	-433	-440	-447	-456
8.00%	-682	-683	-685	-687	-690	-694	-699

KR4301P72708 2019-07 풋270 487

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-479	-480	-480	-481	-483	-485	-487
-5.33%	-233	-238	-242	-248	-253	-260	-266
-2.67%	-52	-61	-69	-78	-87	-96	-105
0%	14	10	5	0	-6	-12	-18
2.67%	23	22	21	20	18	16	14
5.33%	23	23	23	23	23	22	22
8.00%	23	23	23	23	23	23	23

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

(단위:백만원)

3,330

공시일	2019-06-28
기준일	2019-06-27

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

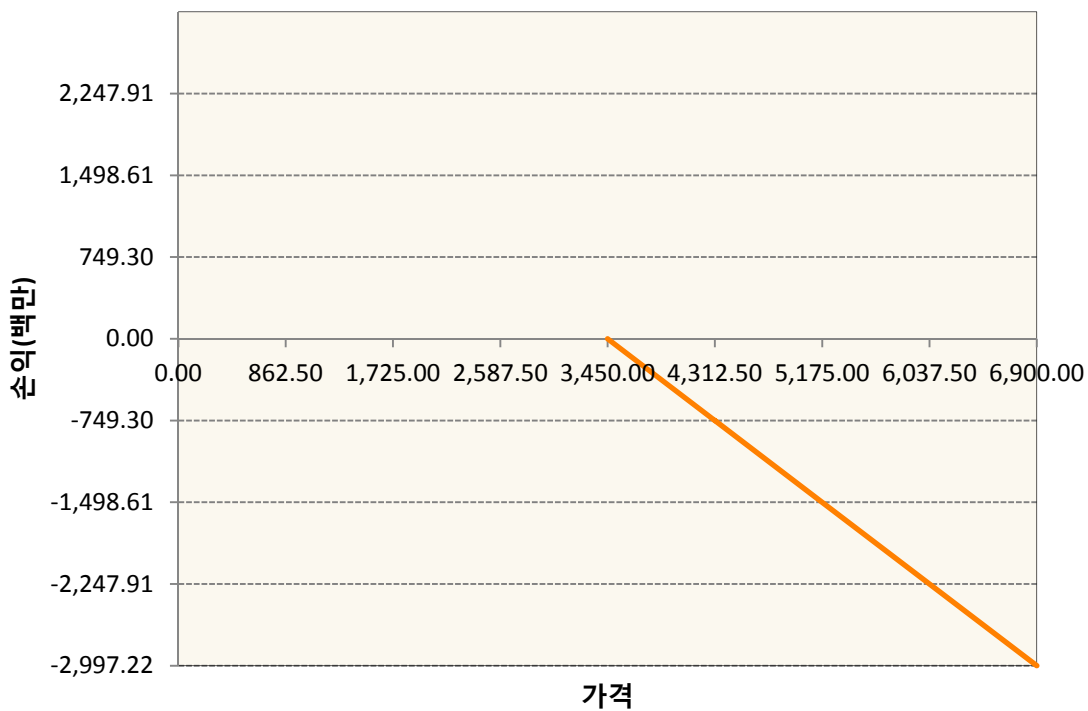
1. 계약금액

(단위:백만원)

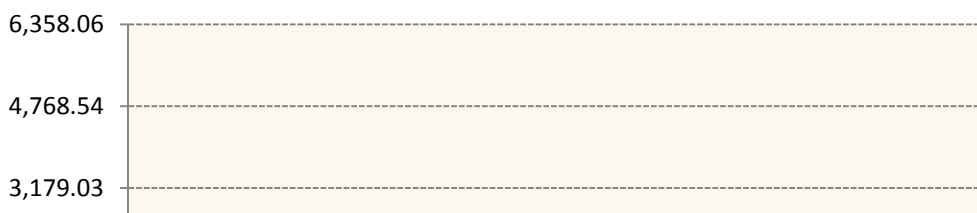
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,889	0	2,889	
누계	유가증권	스왑	55,718	0	55,718	장외
누계	유가증권	옵션	0	18,711	-18,711	장내
누계	통화	선도	0	31,591	-31,591	장외

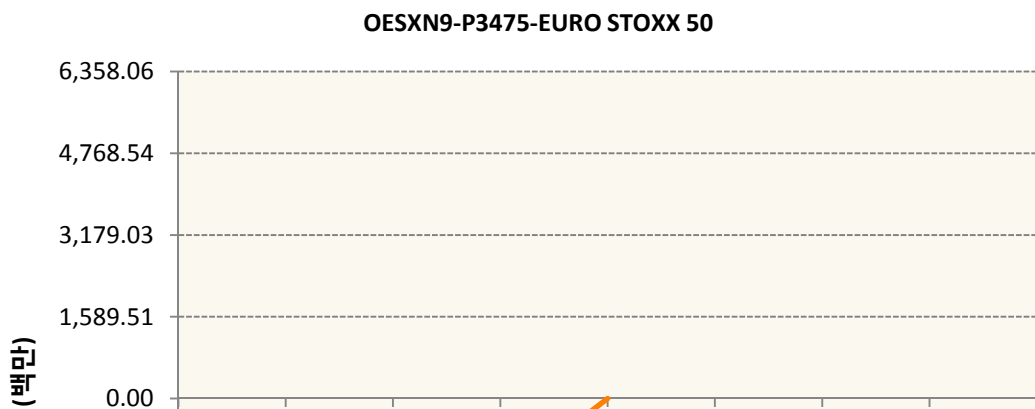
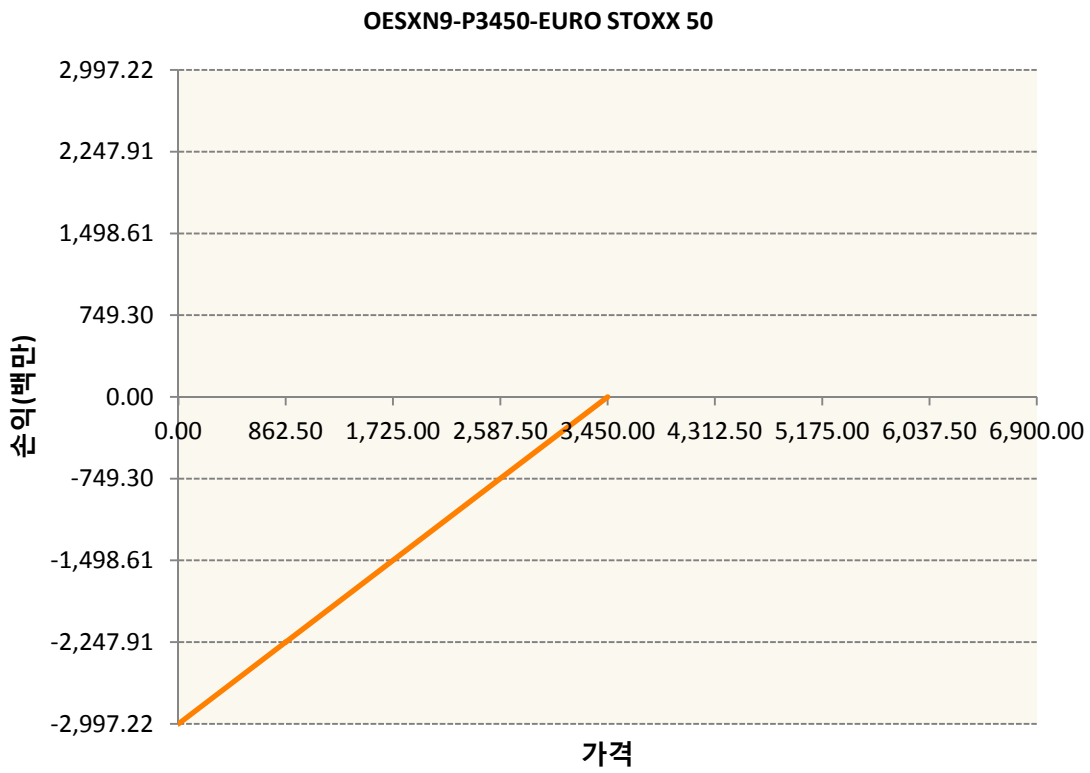
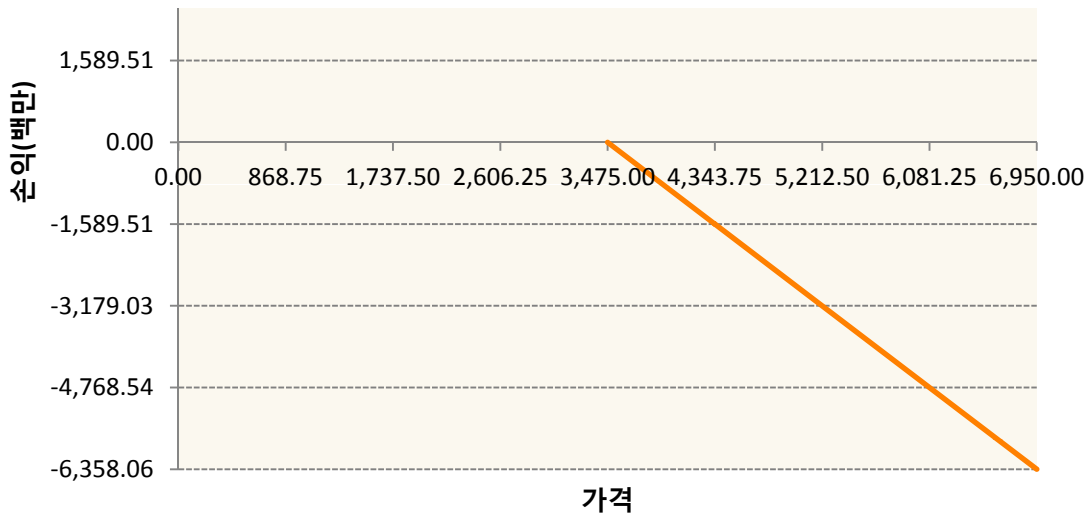
2. 만기시점의 손익구조

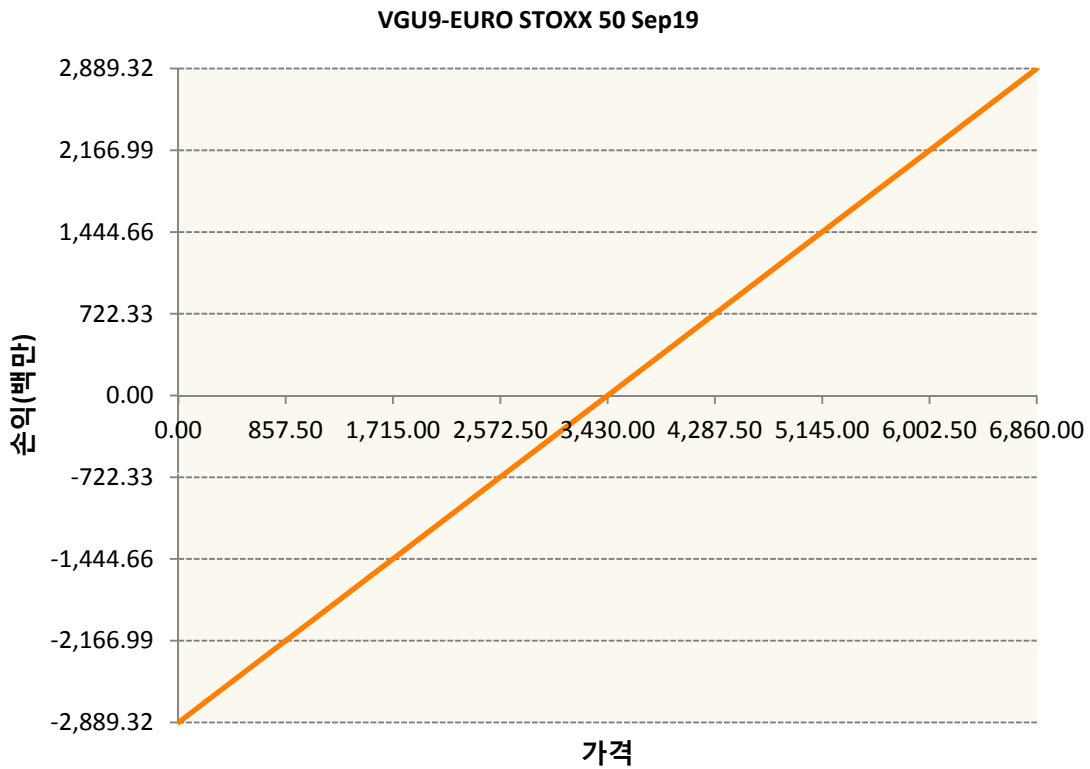
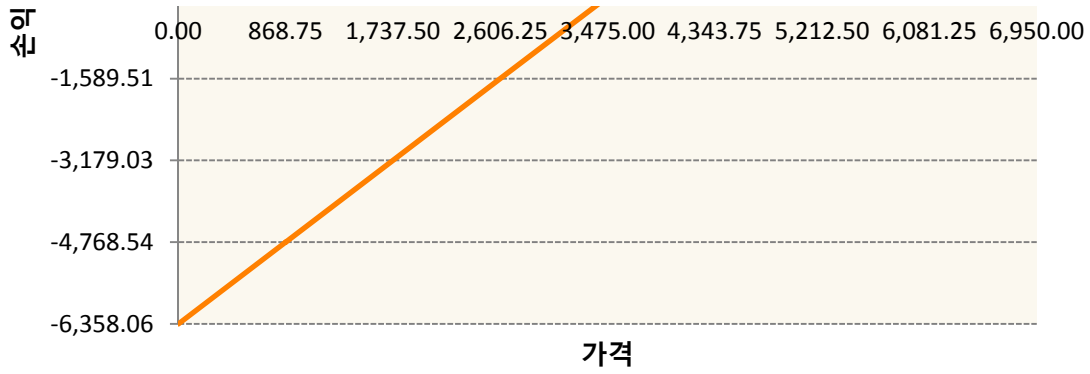
OESXN9-C3450-EURO STOXX 50



OESXN9-C3475-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	39
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	842
FX21019J01 KRW/EUR 28-06-19E	211
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	421
FX21019M0 KRW/EUR 27-09-19E	1,053
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	231

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

(단위:백만원)

2,475

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

(단위:백만원)

1,044

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

(단위:백만원)

92

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

(단위:백만원)

134

공시일	2019-06-28
기준일	2019-06-27

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

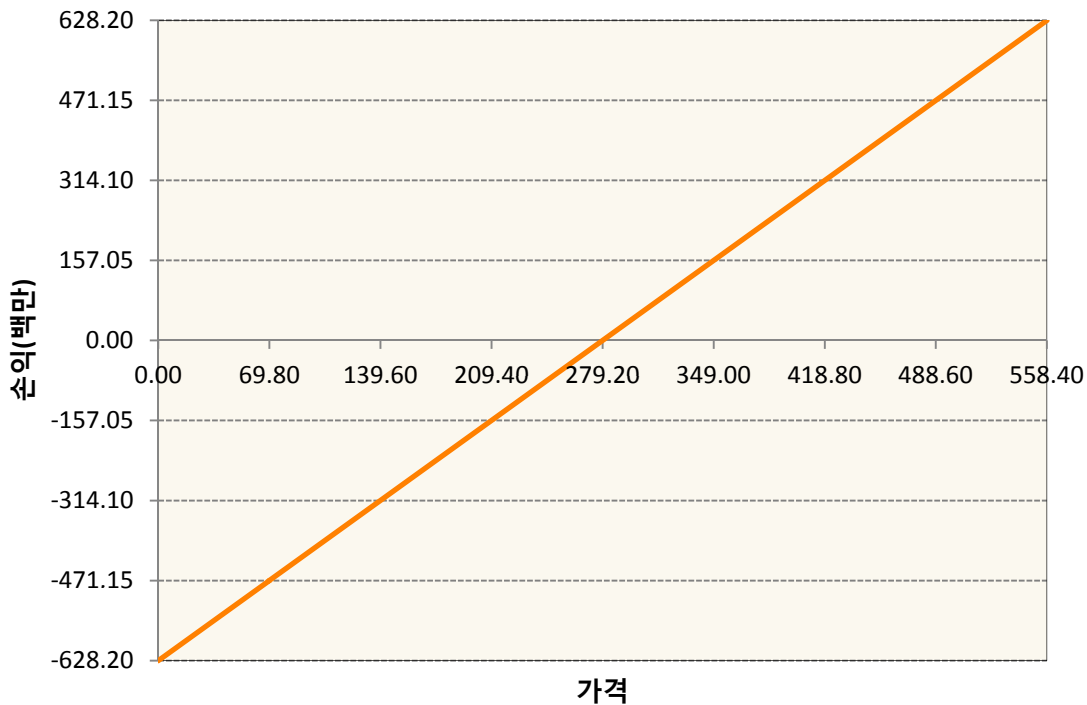
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	628	0	628	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						50
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	17	17	17	17	17	17	17	
5.33%	33	33	33	33	33	33	33	
8.00%	50	50	50	50	50	50	50	

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

(단위:백만원)

42

공시일	2019-06-28
기준일	2019-06-27

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

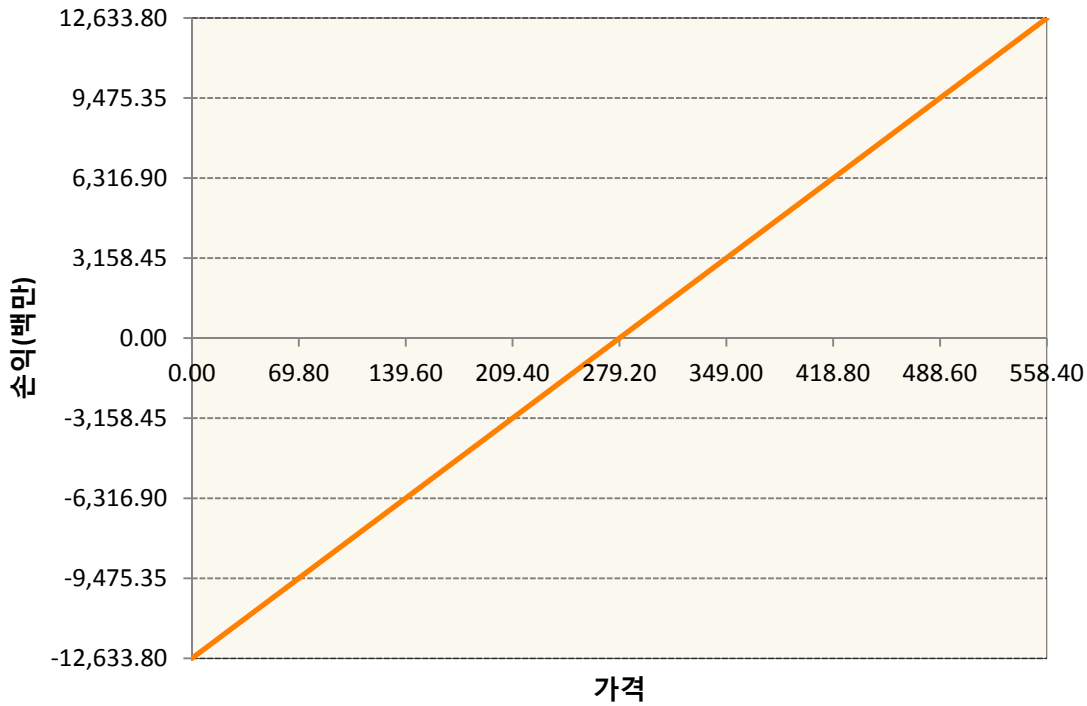
1. 계약금액

(단위:백만원)

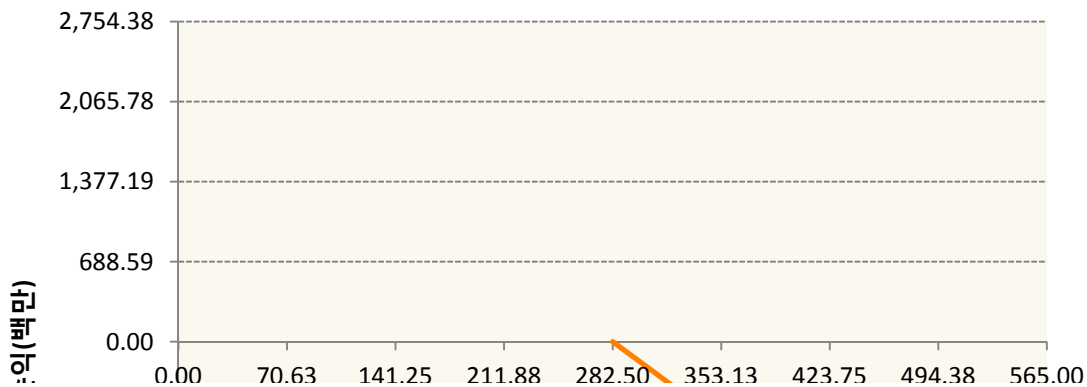
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,634	0	12,634	장내
누계	유가증권	옵션	1,084	22,134	-21,050	장내

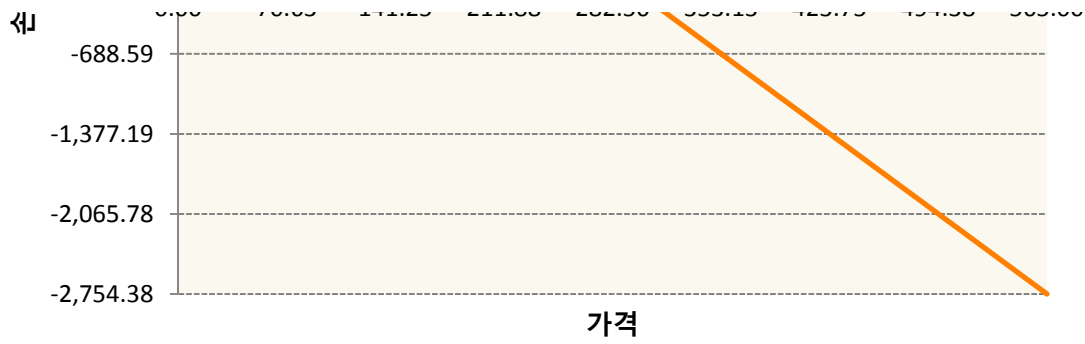
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

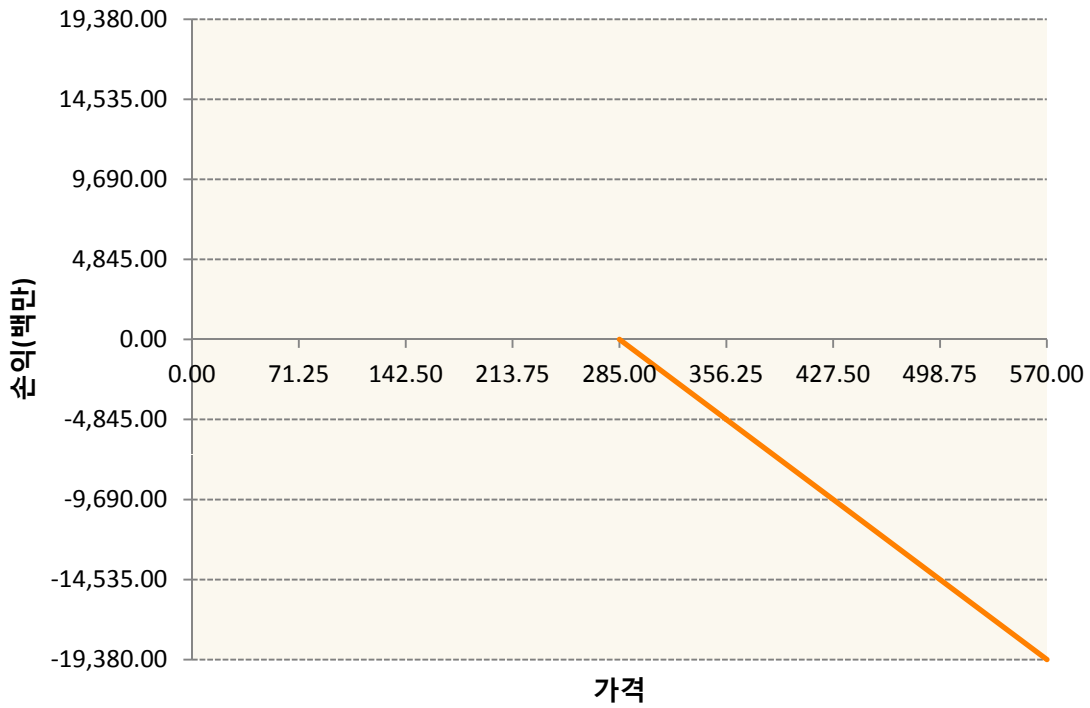


KR4201P72825-2019-07 콜282.5

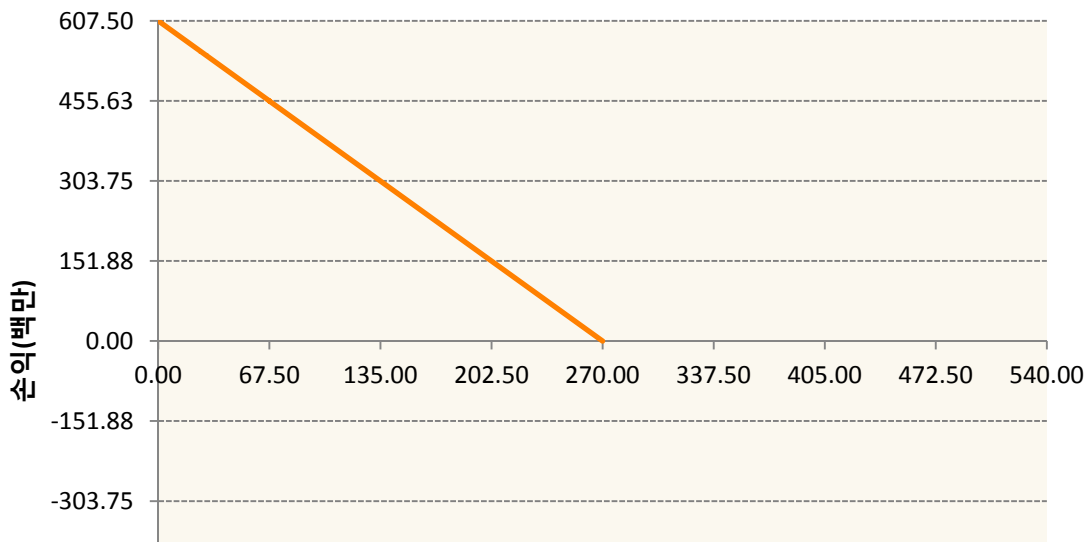


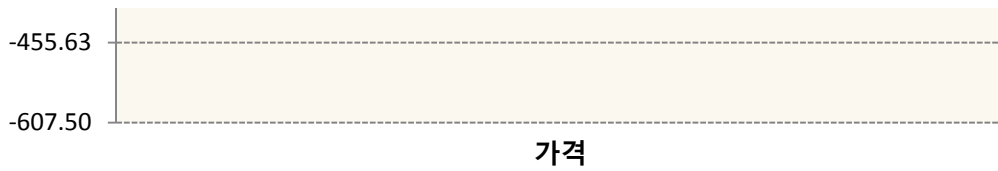


KR4201P72858-2019-07 콜285

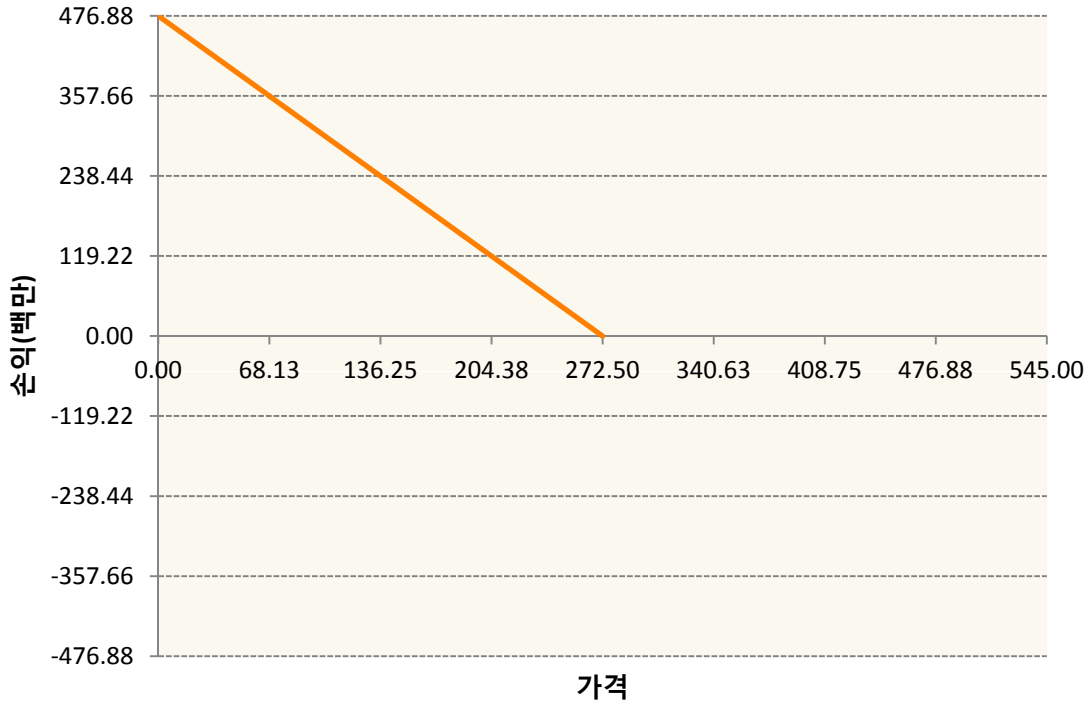


KR4301P72708-2019-07 풋270





KR4301P72724-2019-07 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						1,005
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,005	-1,005	-1,005	-1,005	-1,005	-1,005	-1,005	
-5.33%	-670	-670	-670	-670	-670	-670	-670	
-2.67%	-335	-335	-335	-335	-335	-335	-335	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	335	335	335	335	335	335	335	
5.33%	670	670	670	670	670	670	670	
8.00%	1,005	1,005	1,005	1,005	1,005	1,005	1,005	
KR4201P72825		2019-07 콜282.5						151
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	34	34	33	33	32	31	30	
-5.33%	33	32	31	29	28	26	24	
-2.67%	28	26	23	20	17	14	10	

공시일	2019-06-28
기준일	2019-06-27

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	18,785	0	18,785	

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	2019-06-28
기준일	2019-06-27

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	59,456	0	59,456	

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	2019-06-28
기준일	2019-06-27

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	393,932	0	393,932	
누계	통화	선도	0	436,071	-436,071	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		975
FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E		463
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		463
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		371
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		778
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E		278
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E		1,204
FX21019K04 KRW/USD 28-06-19E		1,260
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		649
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		556
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		741
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		741
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		463
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		278
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		926
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		185
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		862
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		1,028
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		1,853
FX21019M00 KRW/USD 15-07-19E		463
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		371
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		649
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		926
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		649
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		649

FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E	556
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E	2,965
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E	2,224
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E	278
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E	278
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	778
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	621
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	463
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E	1,853
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E	1,853
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E	686
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E	686
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E	1,279
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E	2,513

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

(단위:백만원)

11,426

공시일	2019-06-28
기준일	2019-06-27

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

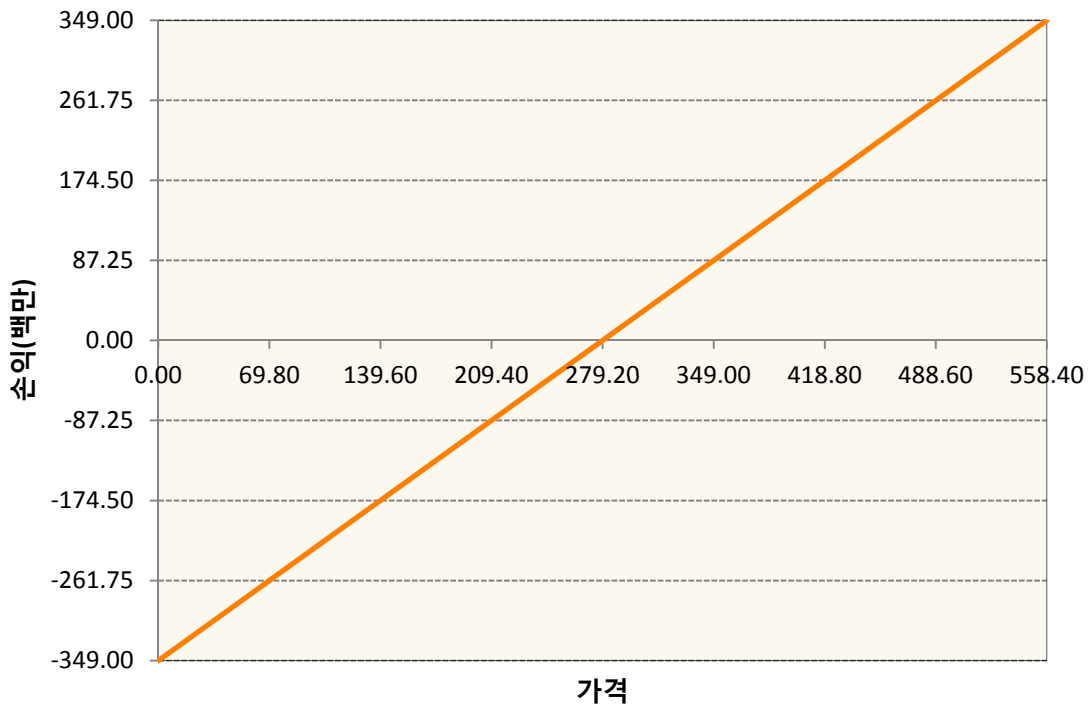
1. 계약금액

(단위:백만원)

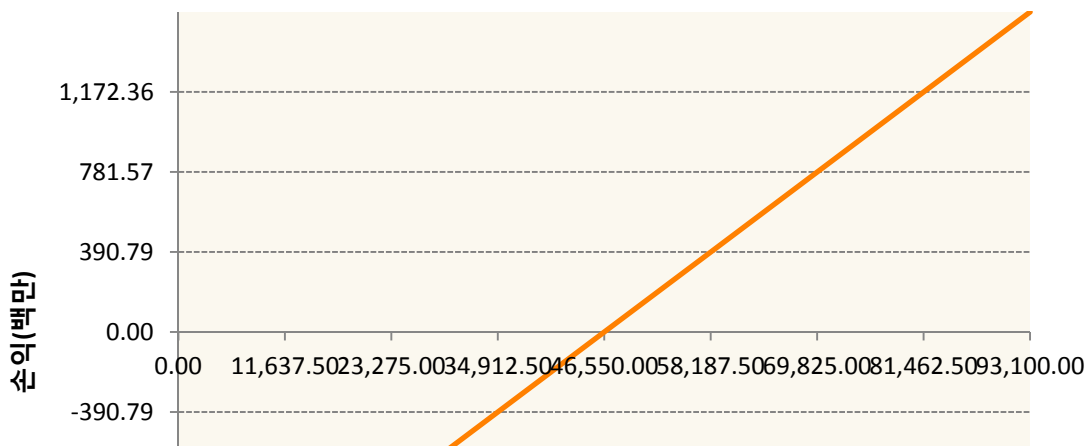
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,912	0	1,912	장내

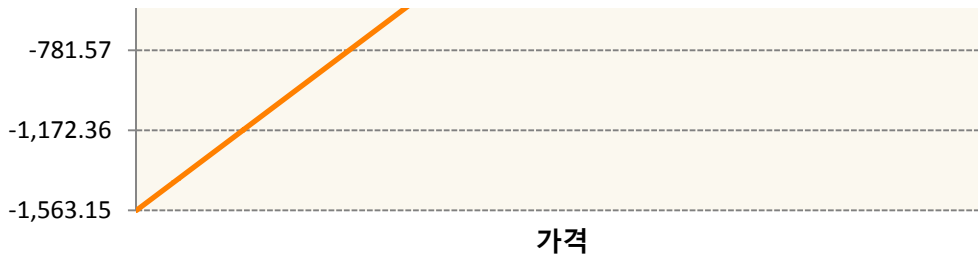
2. 만기시점의 손익구조

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%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
-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%	19	19	19	19	19	19	19	
8.00%	28	28	28	28	28	28	28	

KR4111P70002		2019-07 삼성전자개별선물						125
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125	
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83	
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	42	42	42	42	42	42	42	
5.33%	83	83	83	83	83	83	83	
8.00%	125	125	125	125	125	125	125	

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

164

공시일	2019-06-28
기준일	2019-06-27

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

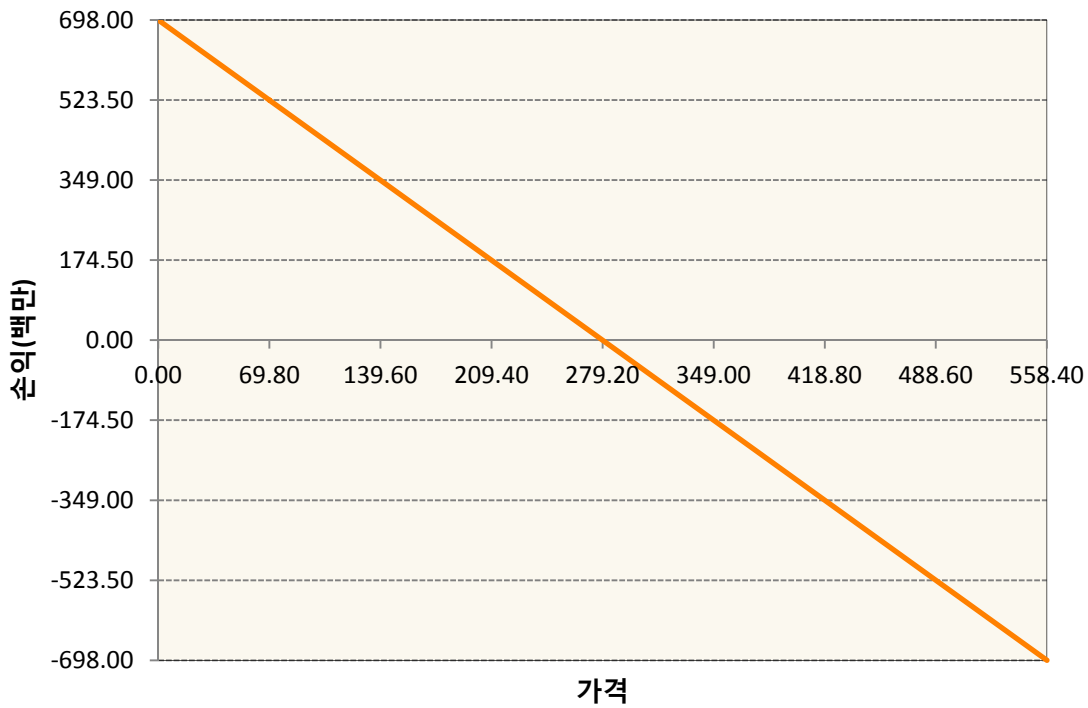
1. 계약금액

(단위:백만원)

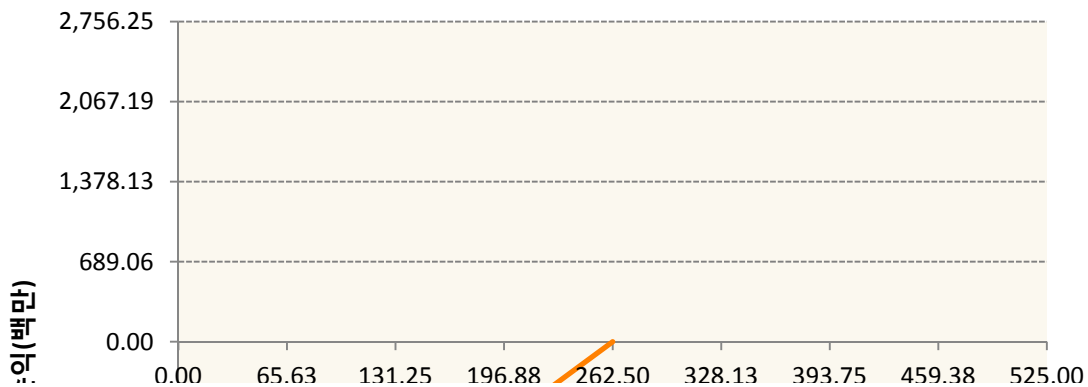
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	698	-698	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,419	-3,419	장내

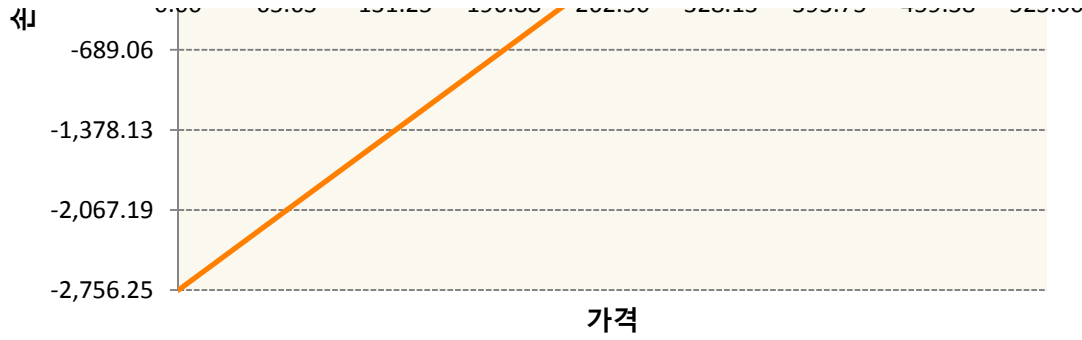
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

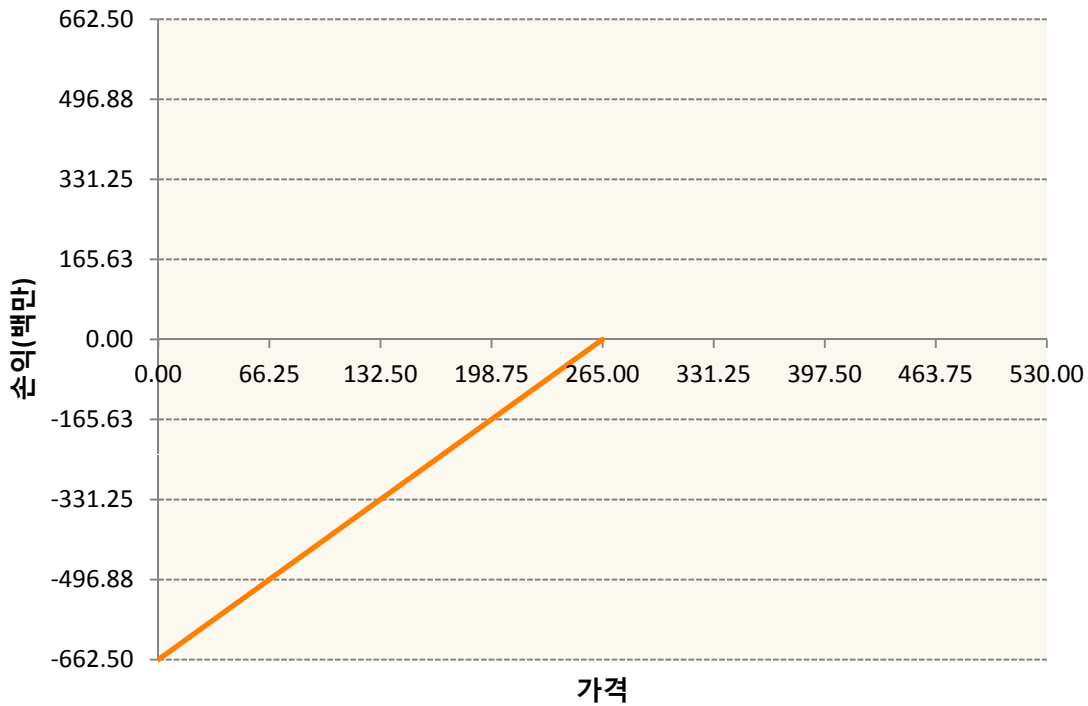


KR4301P72625-2019-07 풋262.5





KR4301P72658-2019-07 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						56
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	56	56	56	56	56	56	56	
-5.33%	37	37	37	37	37	37	37	
-2.67%	19	19	19	19	19	19	19	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
5.33%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37	
8.00%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56	
KR4301P72625		2019-07 풋262.5						86
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-76	-77	-79	-80	-82	-84	-86
-5.33%	-21	-24	-26	-29	-31	-34	-37
-2.67%	-2	-3	-4	-6	-7	-9	-11
0%	1	1	0	0	0	-1	-2
2.67%	1	1	1	1	1	1	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

KR4301P72658

2019-07 풋265

25

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-24	-24	-24	-24	-25	-25	-25
-5.33%	-8	-9	-9	-10	-11	-11	-12
-2.67%	-1	-1	-2	-2	-3	-3	-4
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

93

공시일	2019-06-28
기준일	2019-06-27

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	3,938	-3,938	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	2019-06-28
기준일	2019-06-27

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

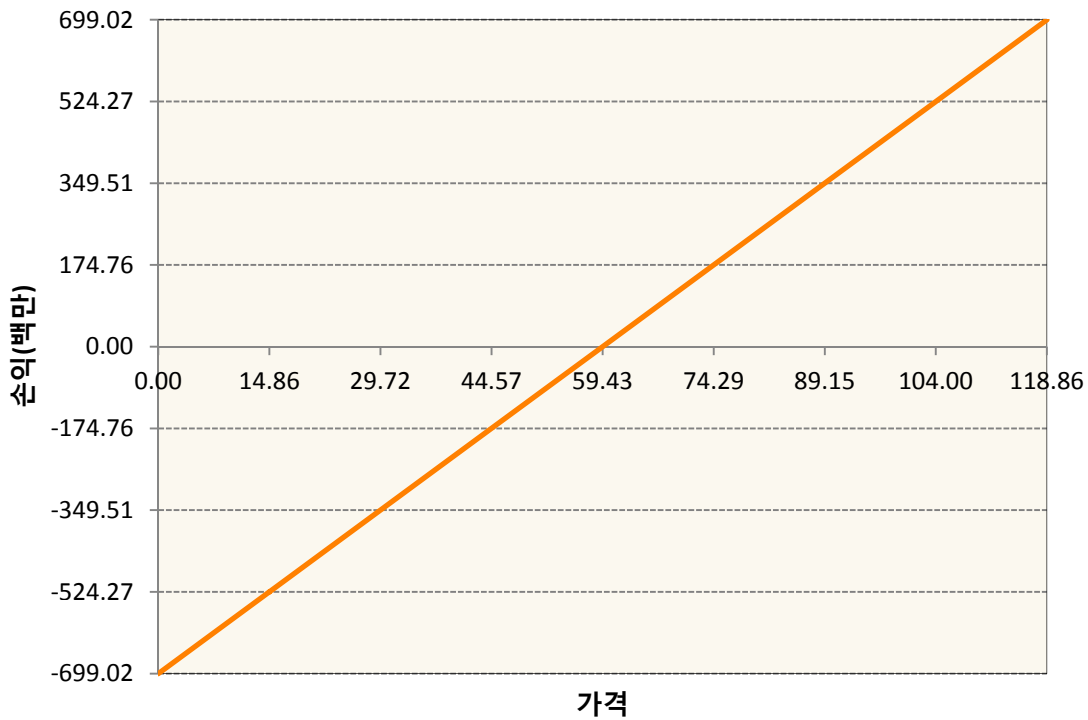
1. 계약금액

(단위:백만원)

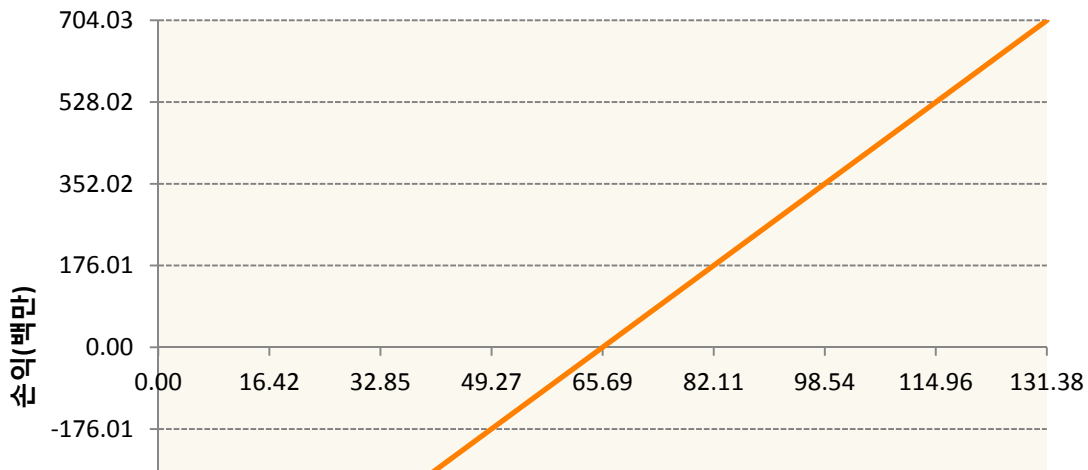
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,747	116	2,631	

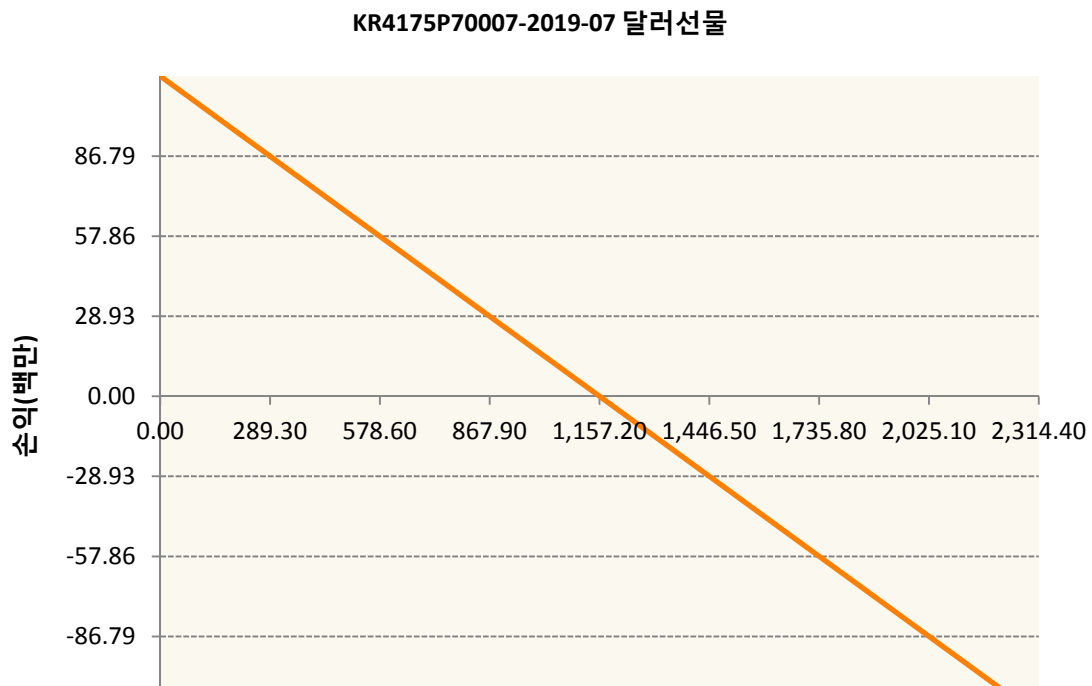
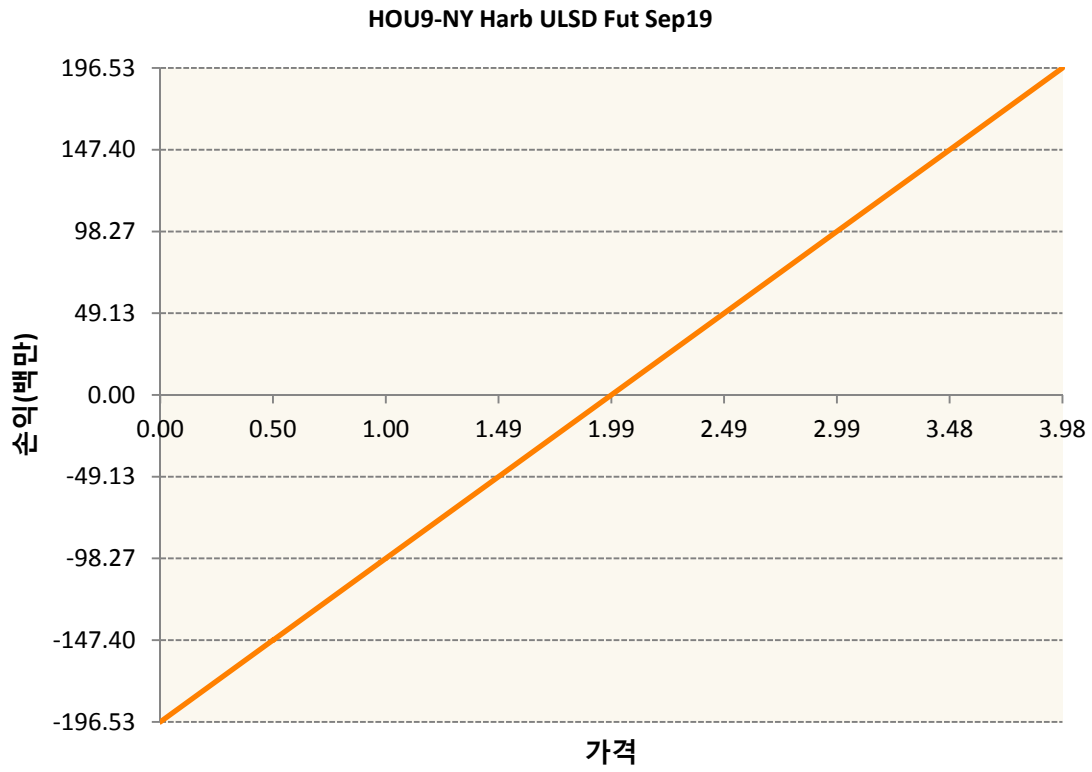
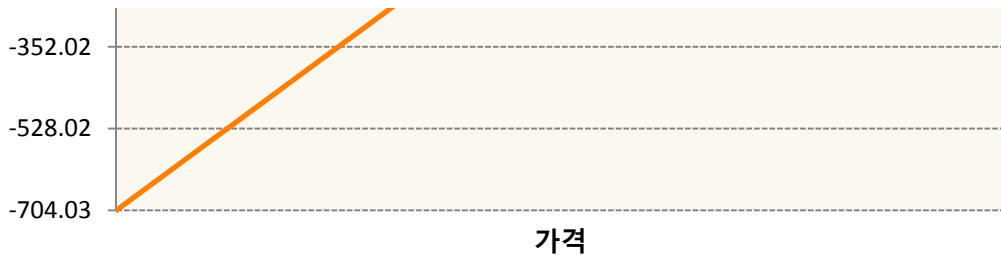
2. 만기시점의 손익구조

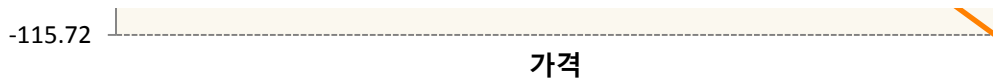
CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19



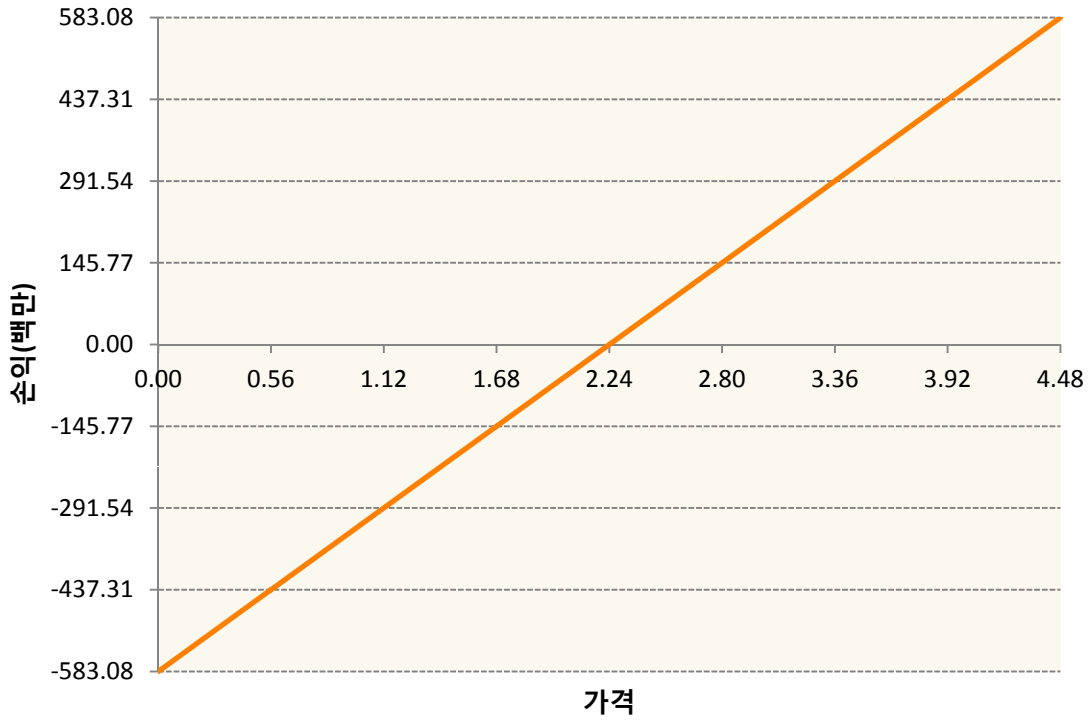
COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19



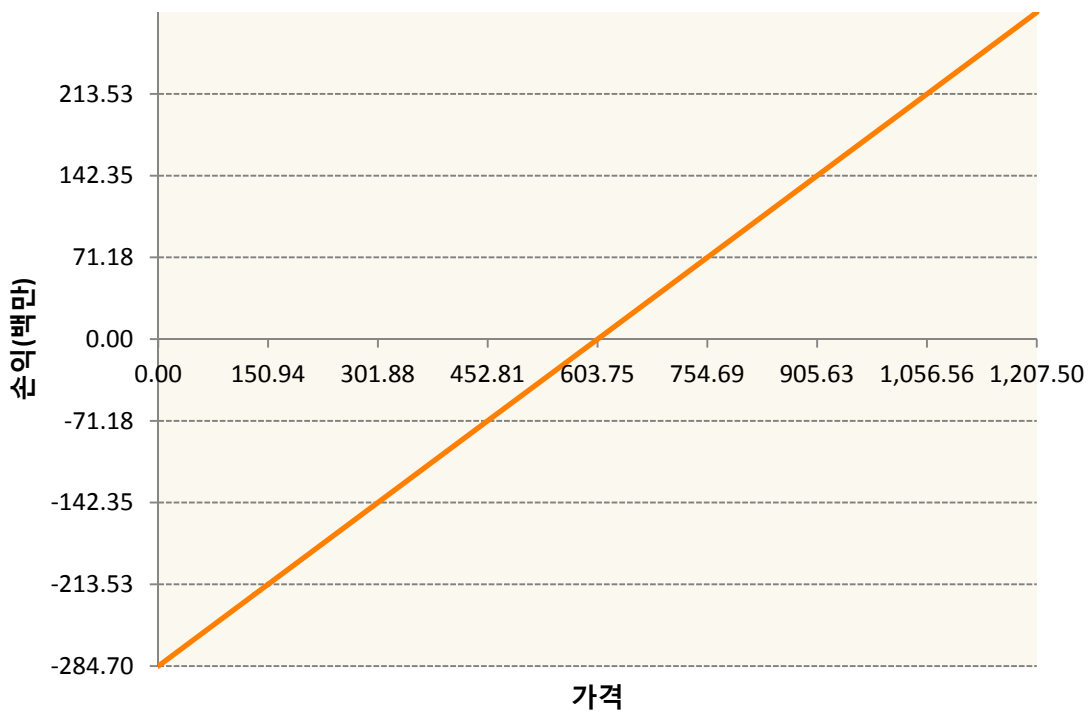




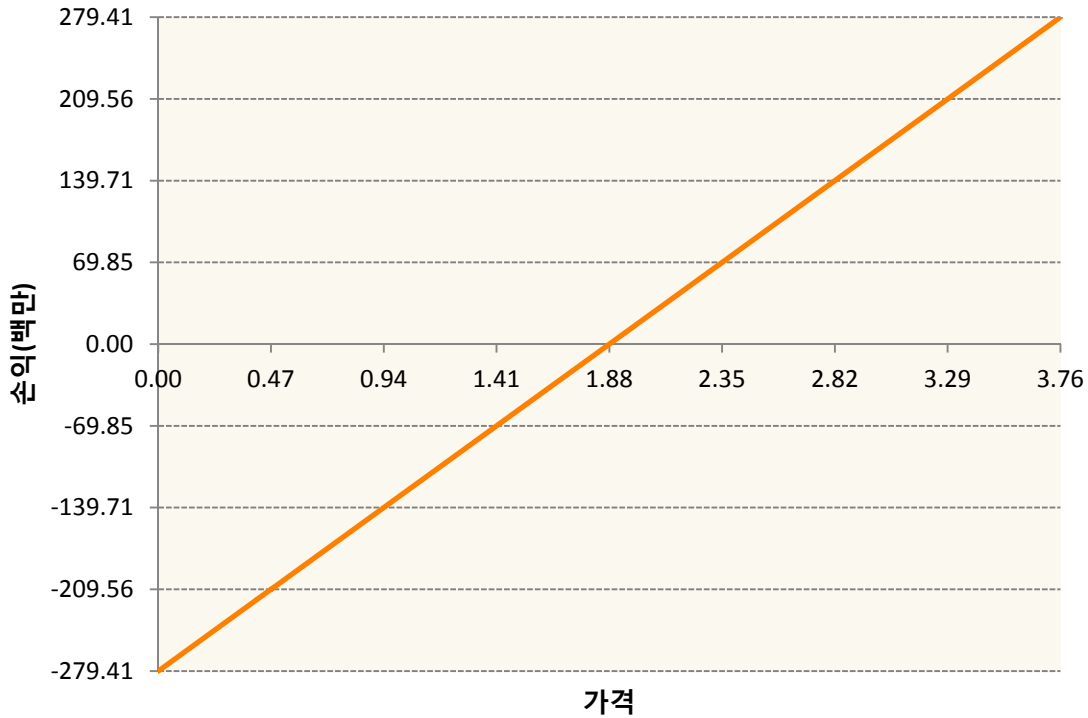
NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



QSU9-Low Su Gasoil G Sep19



XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	56
COU9	BRENT CRUDE FUTR Sep19	56
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	16
KR4175P700	2019-07 달러선물	9
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	47
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	23
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	22

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

(단위:백만원)

409

공시일	2019-06-28
기준일	2019-06-27

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

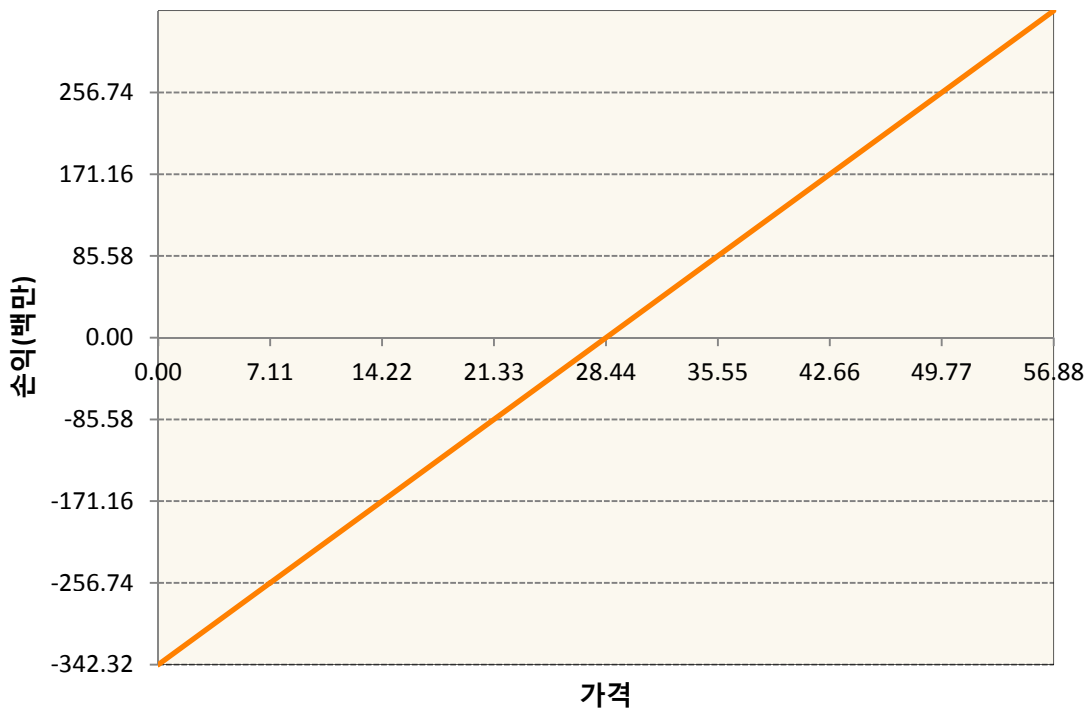
1. 계약금액

(단위:백만원)

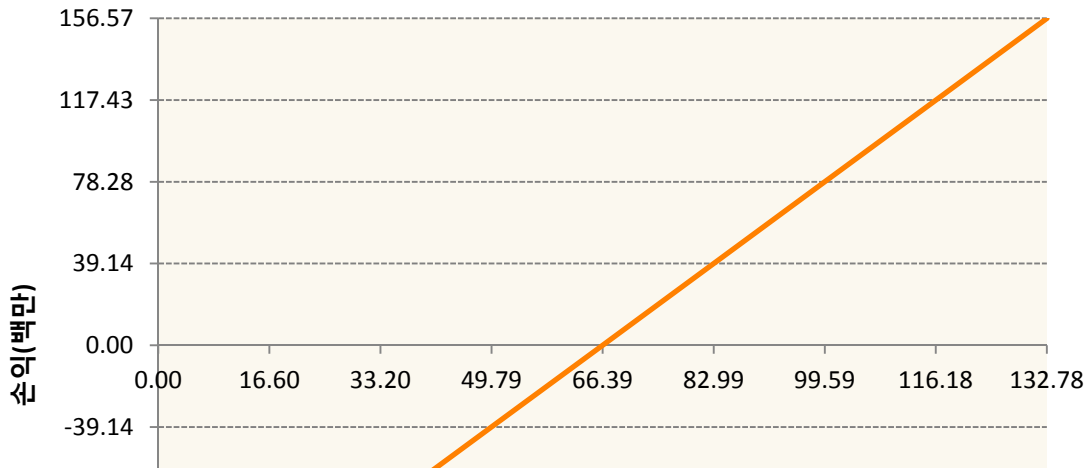
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,306	197	3,109	

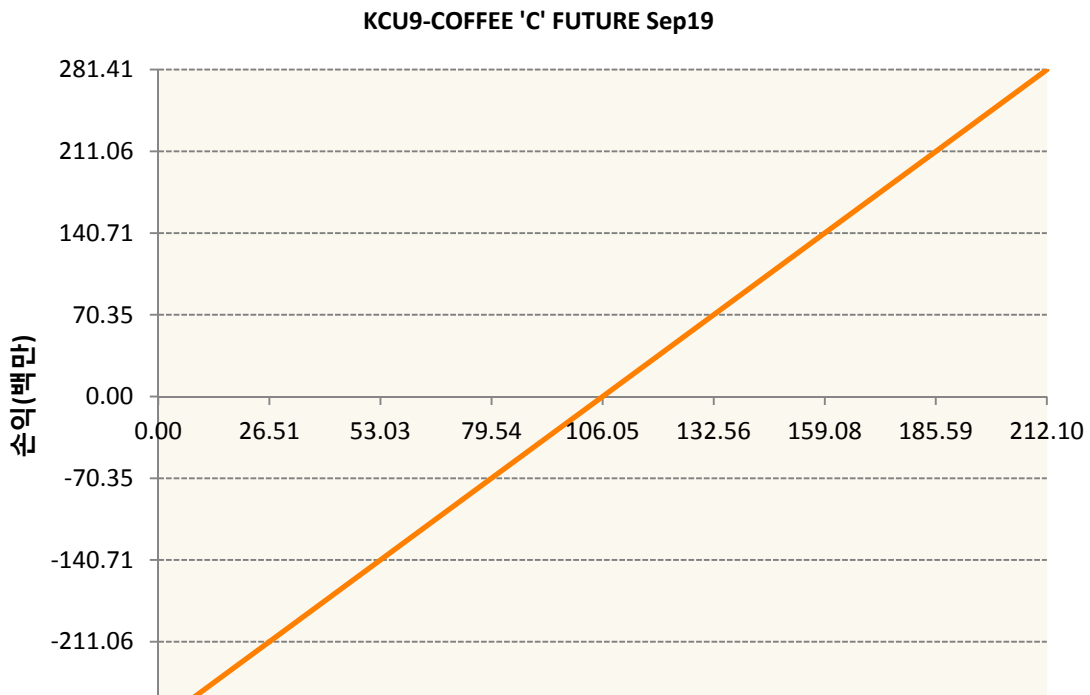
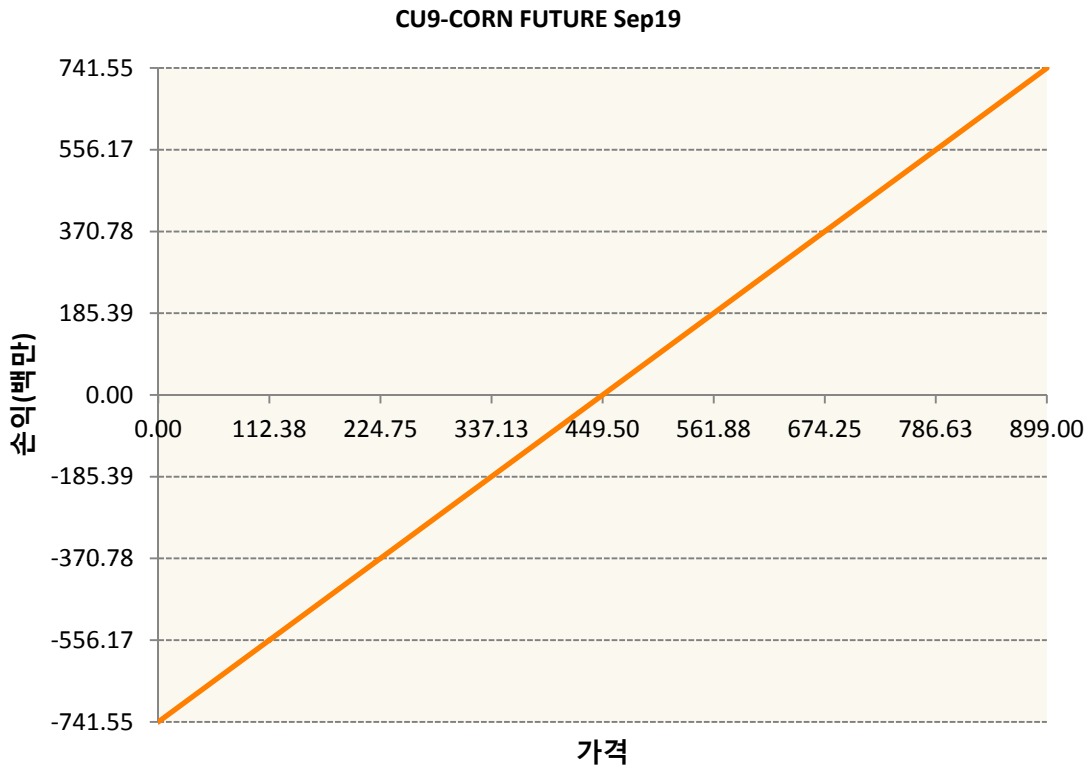
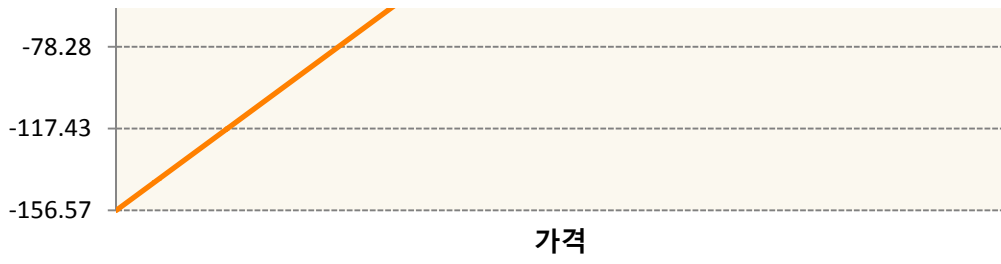
2. 만기시점의 손익구조

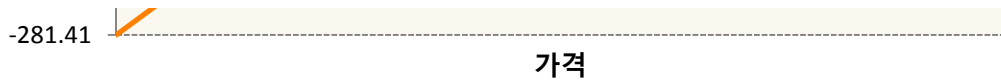
BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19



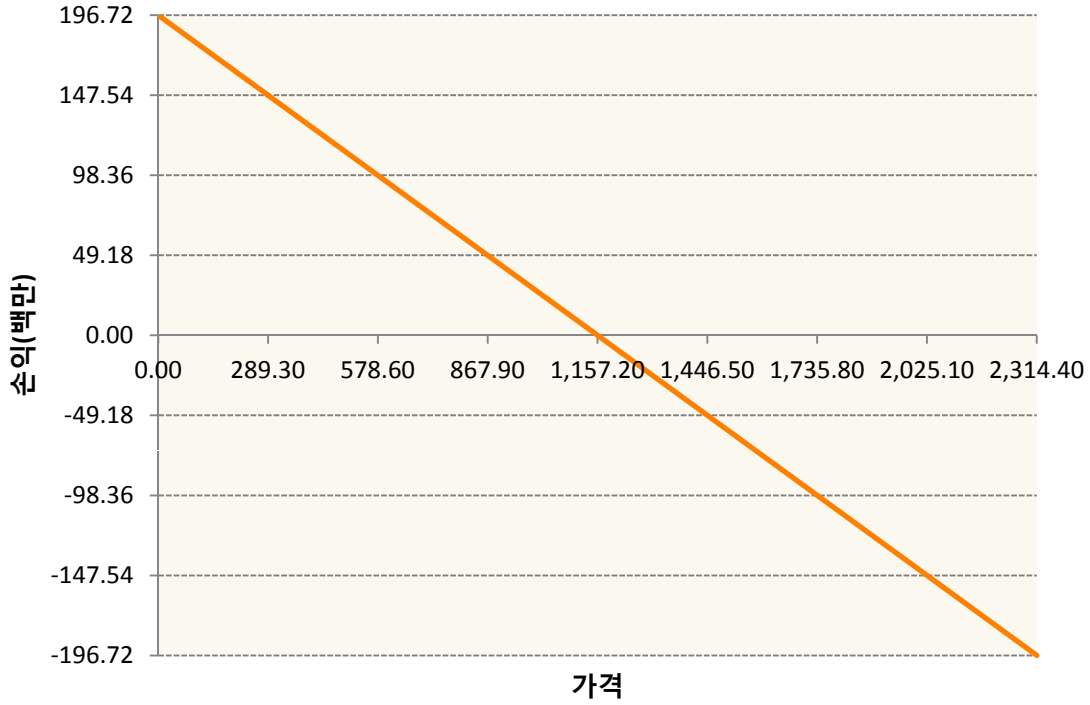
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



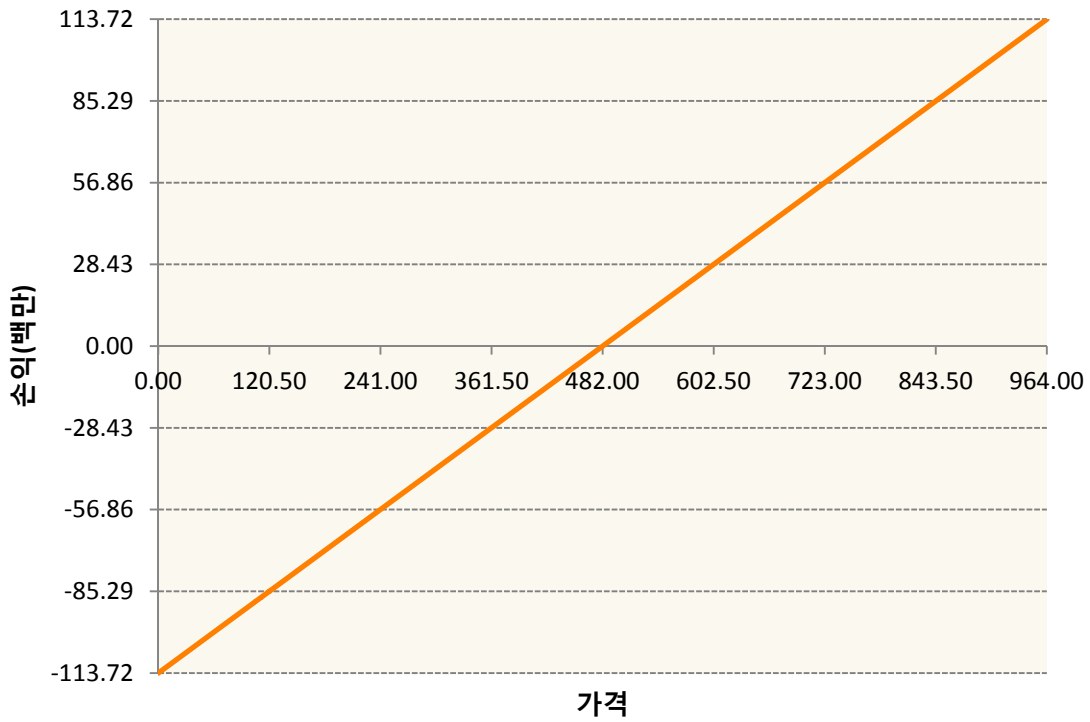




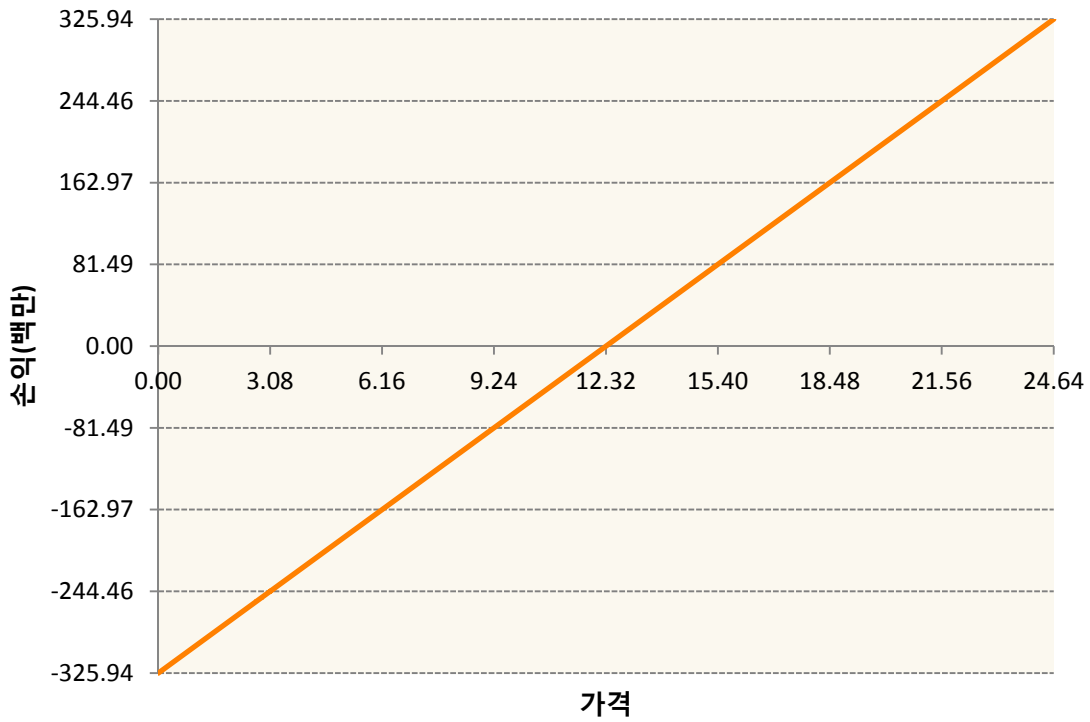
KR4175P70007-2019-07 달러선물



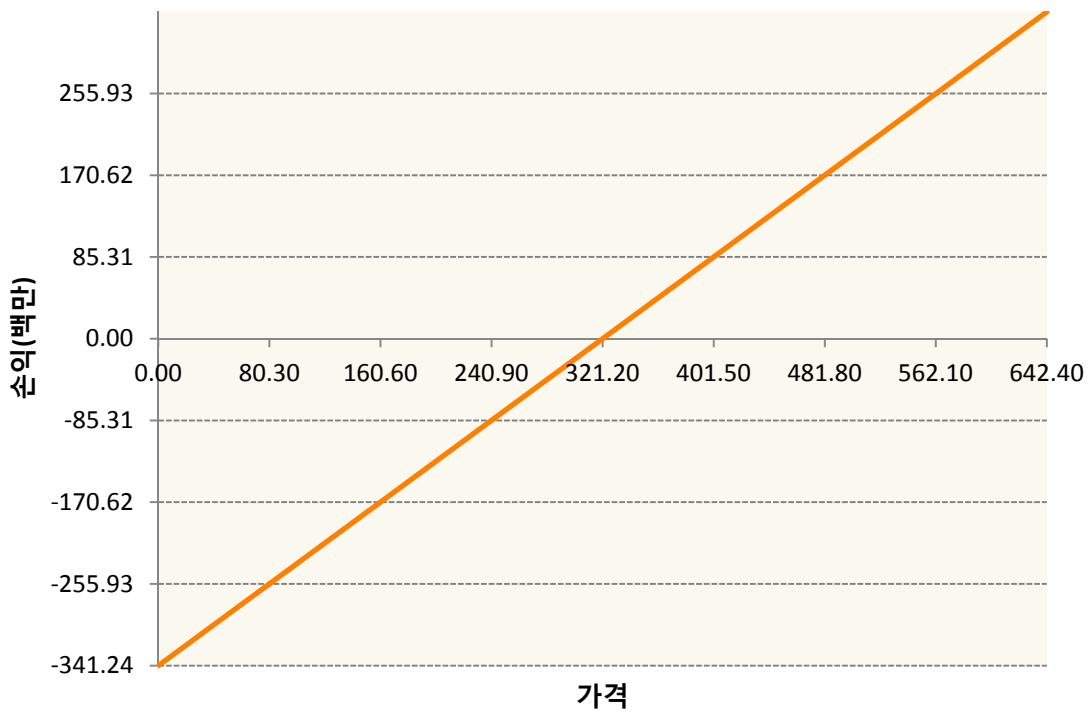
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



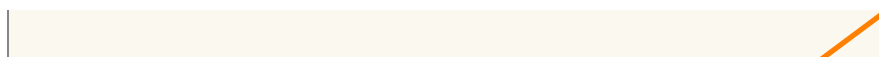
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

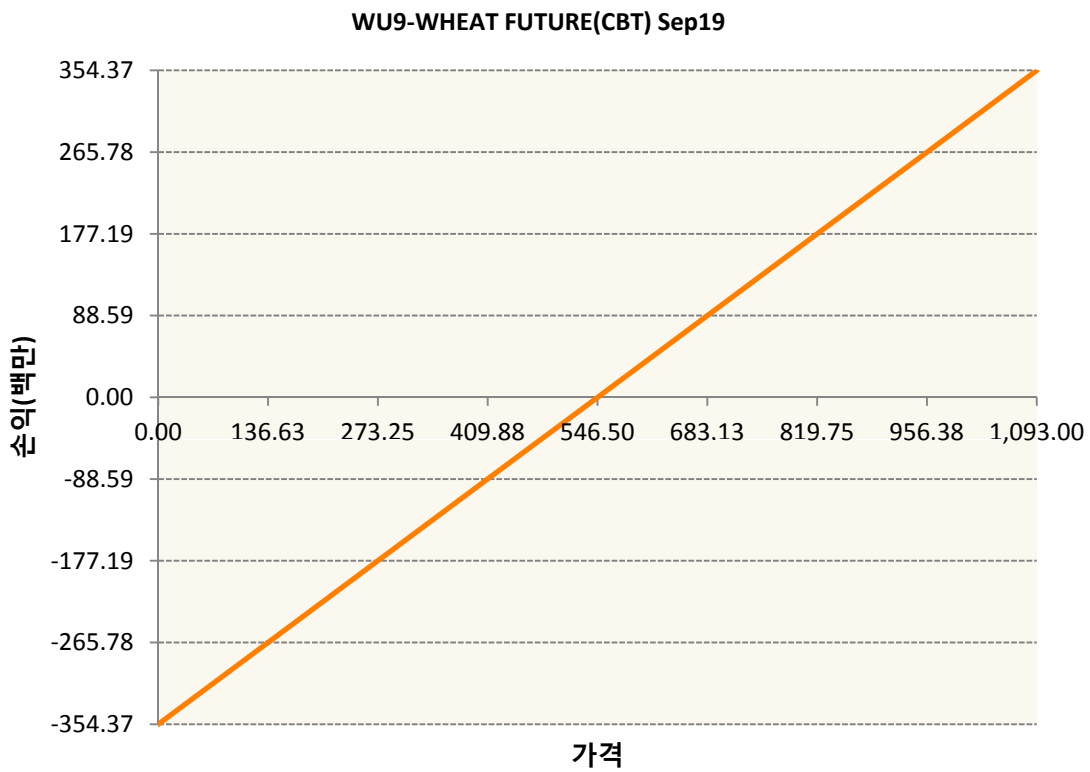
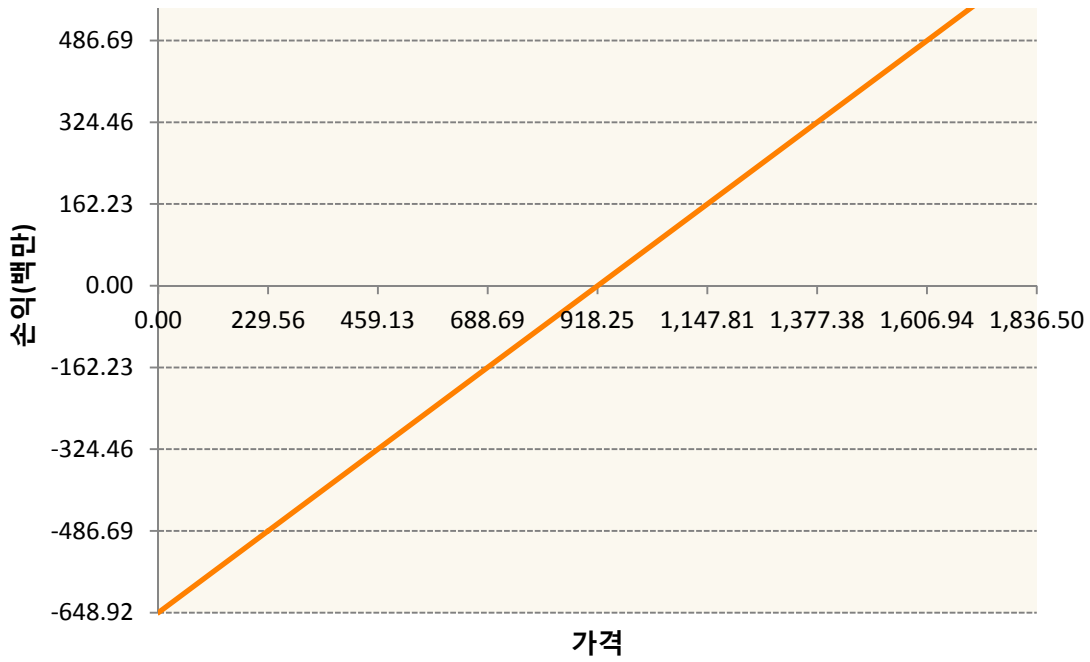


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	27
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	13
CU9	CORN FUTURE Sep19	59
KCU9	COFFEE 'C' FUTURE Sep19	23
KR4175P700	2019-07 달러선물	16

KWU9	KC HRW WHEAT FUT Sep19	9
SBV9	SUGAR #11 (WORLD) Oct19	26
SMZ9	SOYBEAN MEAL FUTR Dec19	27
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	52
WU9	WHEAT FUTURE(CBT) Sep19	28

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

(단위:백만원)

287