

공시일	2019-07-01
기준일	2019-06-28

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	2019-07-01
기준일	2019-06-28

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

1,159

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

669

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-01
기준일	2019-06-28

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)	386
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	141

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

858

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-01
기준일	2019-06-28

유로인덱스모(주식-파생형)

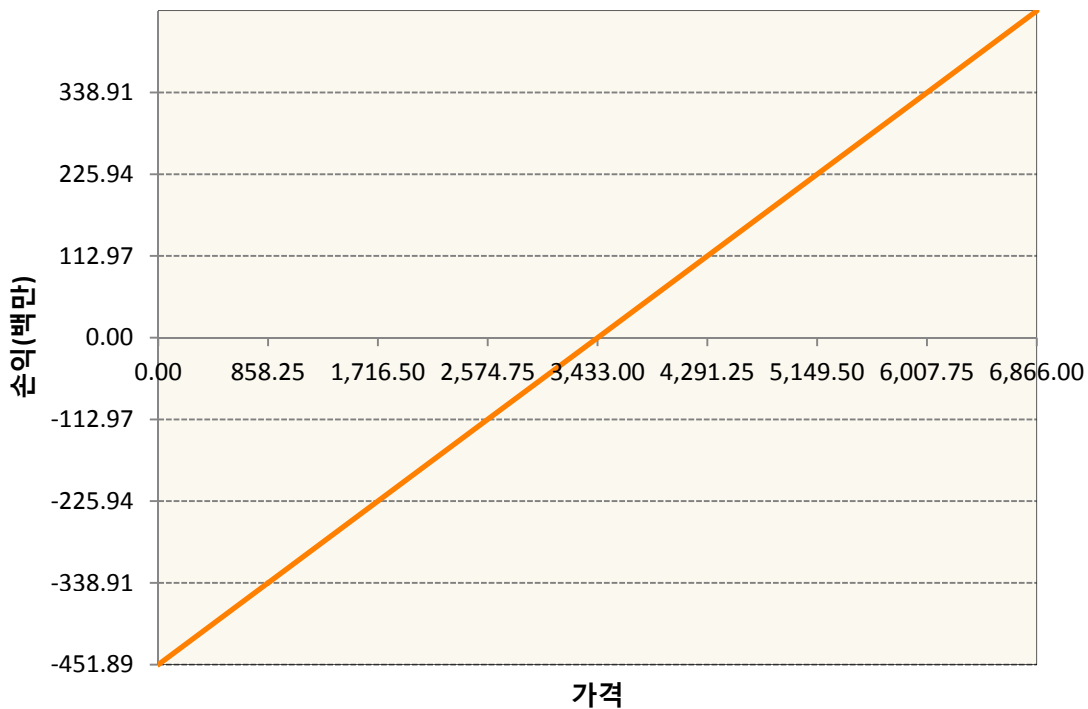
1. 계약금액

(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	2019-07-01
기준일	2019-06-28

차이나인덱스모(주식-파생형)

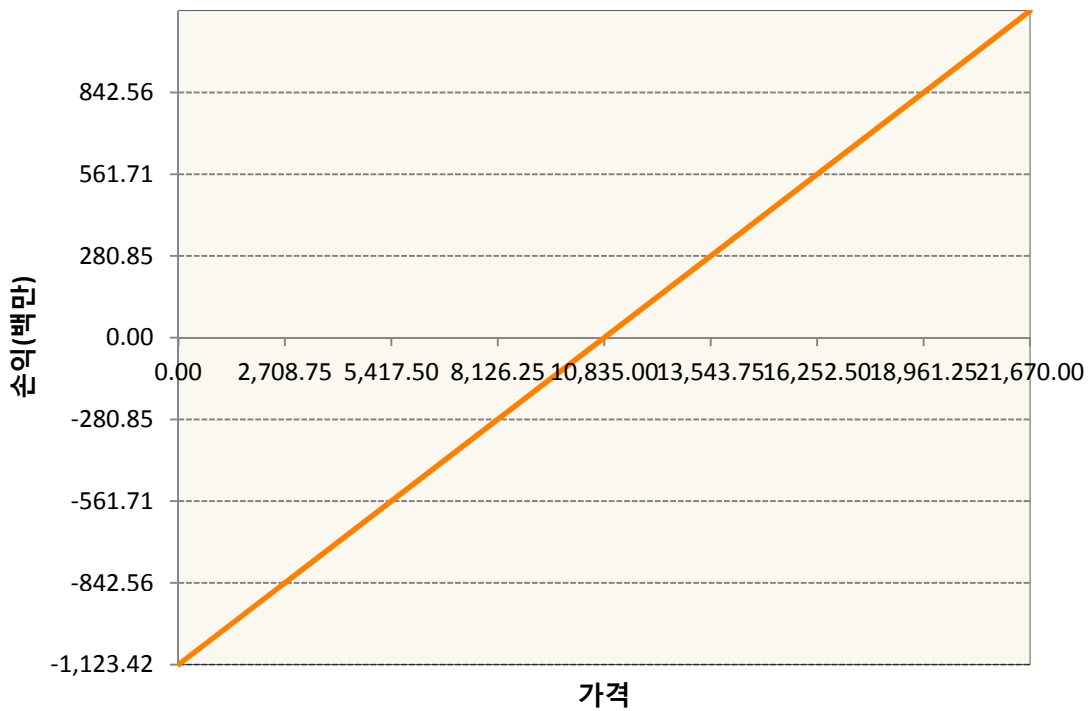
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,123	0	1,123	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	2019-07-01
기준일	2019-06-28

커버드콜모(주식혼합-파생형)

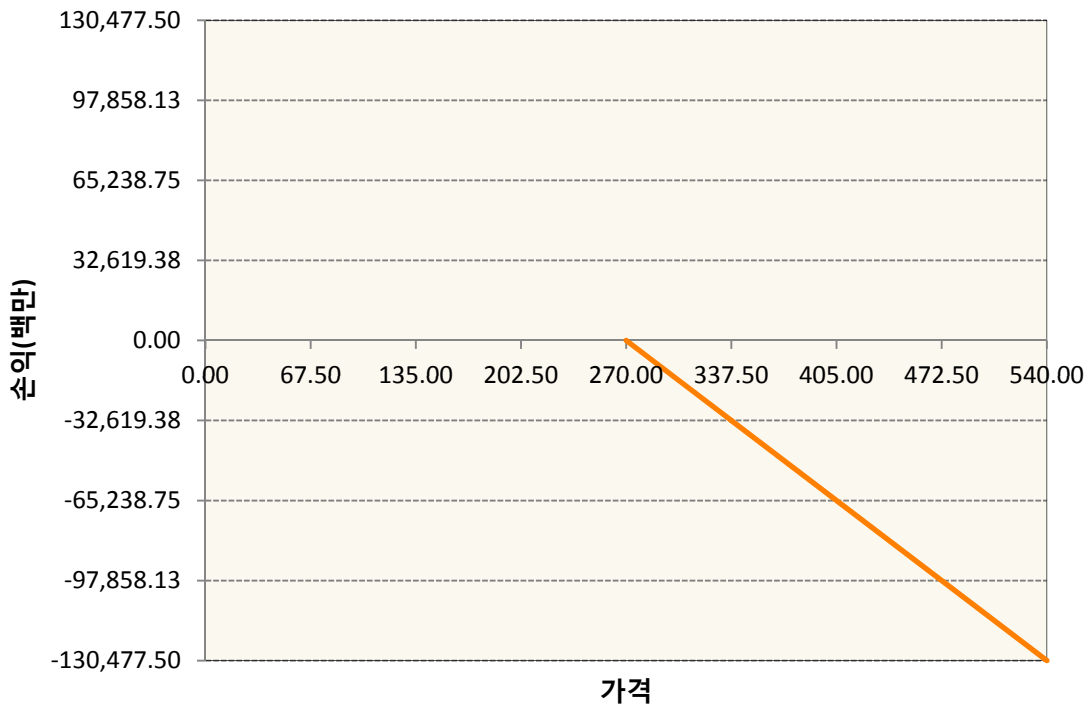
1. 계약금액

(단위:백만원)

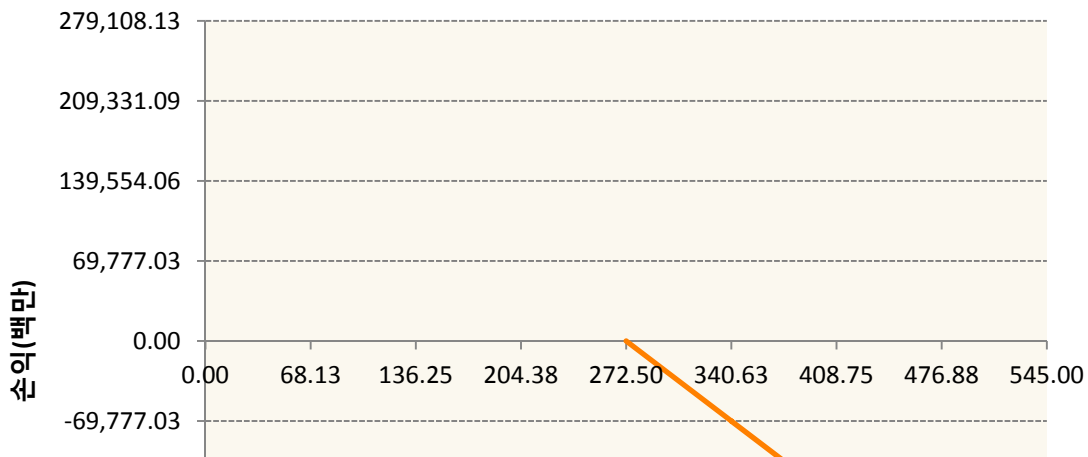
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	6,730	0	6,730	장내
누계	유가증권	옵션	0	596,223	-596,223	장내

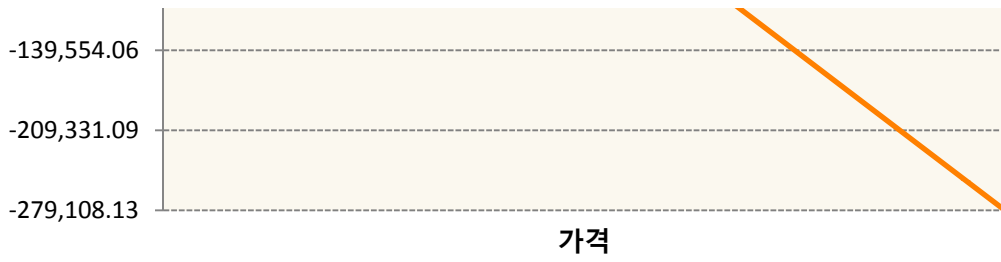
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P72700-2019-07 콜270

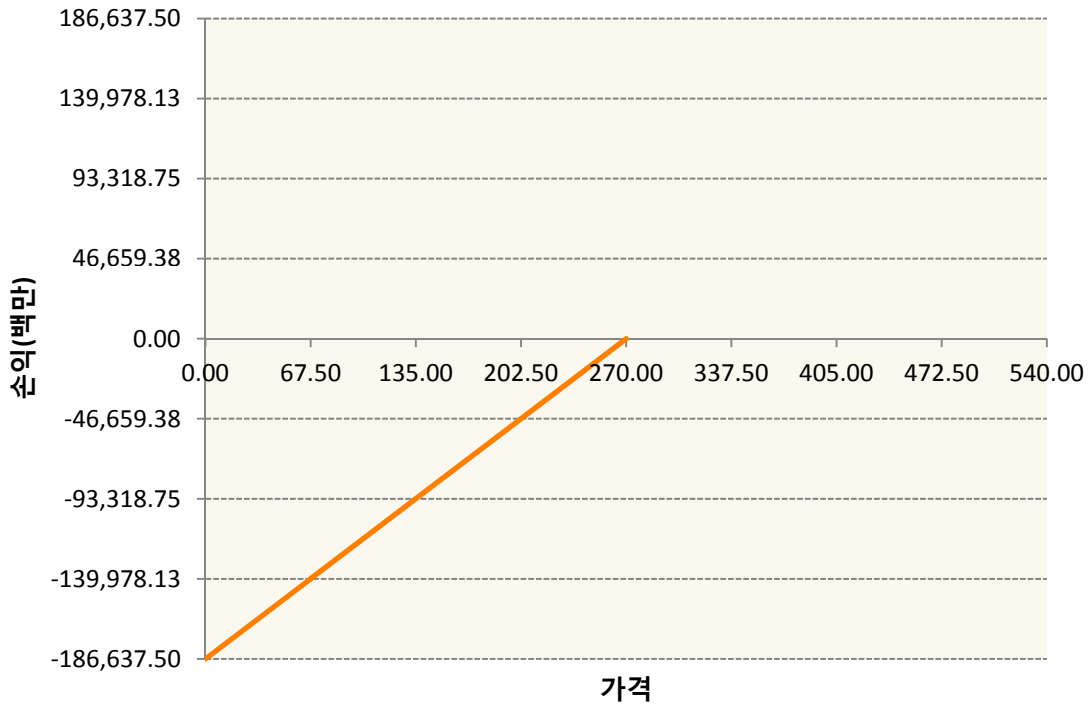


KR4201P72726-2019-07 콜272.5





KR4301P72708-2019-07 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P72700		2019-07 콜270					9,728	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4,609	4,541	4,458	4,362	4,255	4,137	4,010	
-5.33%	4,135	3,978	3,812	3,641	3,464	3,284	3,101	
-2.67%	2,841	2,633	2,424	2,216	2,008	1,800	1,592	
0%	512	348	177	0	-182	-368	-557	
2.67%	-2,588	-2,668	-2,763	-2,872	-2,992	-3,123	-3,263	
5.33%	-6,040	-6,065	-6,101	-6,151	-6,213	-6,287	-6,372	
8.00%	-9,592	-9,597	-9,607	-9,624	-9,649	-9,684	-9,728	
KR4201P72726		2019-07 콜272.5					19,911	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	8,163	8,065	7,937	7,780	7,596	7,389	7,161	

-5.33%	7,509	7,236	6,938	6,621	6,288	5,941	5,584
-2.67%	5,437	5,006	4,573	4,138	3,702	3,265	2,827
0%	1,228	826	416	0	-421	-846	-1,275
2.67%	-4,879	-5,110	-5,371	-5,658	-5,965	-6,290	-6,631
5.33%	-12,014	-12,099	-12,214	-12,360	-12,533	-12,733	-12,956
8.00%	-19,498	-19,519	-19,556	-19,611	-19,689	-19,788	-19,911
KR4301P72708 2019-07 풋270							9,895
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,776	-9,781	-9,791	-9,806	-9,828	-9,858	-9,895
-5.33%	-4,809	-4,881	-4,964	-5,058	-5,160	-5,269	-5,384
-2.67%	-1,072	-1,240	-1,407	-1,575	-1,742	-1,910	-2,077
0%	261	185	98	0	-106	-220	-340
2.67%	415	407	394	374	346	309	264
5.33%	420	420	419	417	414	408	399
8.00%	420	420	420	420	420	419	418

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

(단위:백만원)

40,467

공시일	2019-07-01
기준일	2019-06-28

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

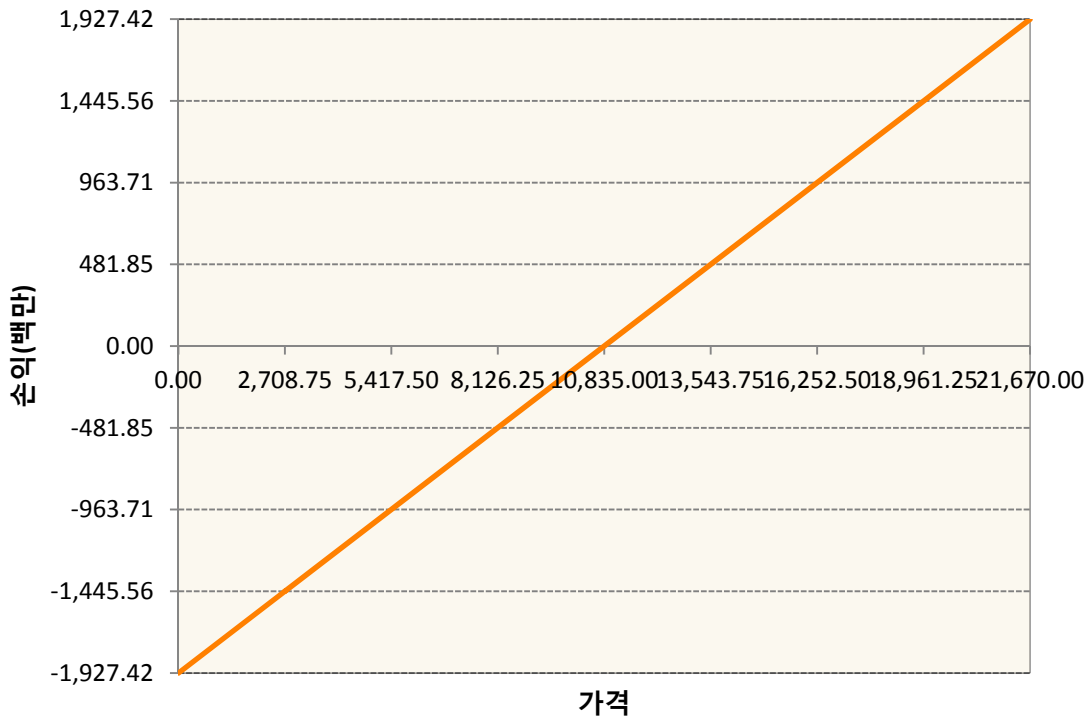
1. 계약금액

(단위:백만원)

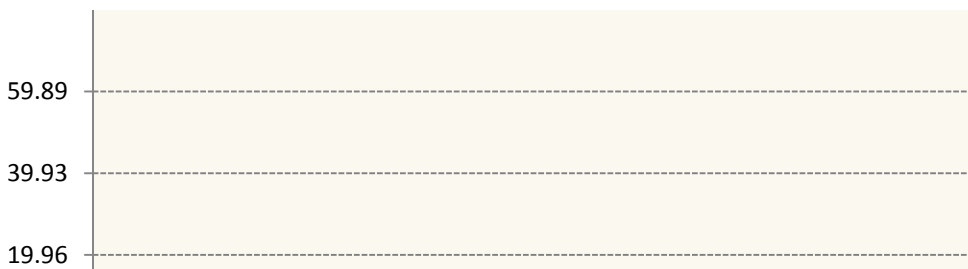
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,927	0	1,927	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,157	-5,157	장내
누계	통화	선도	148	3,105	-2,957	장외

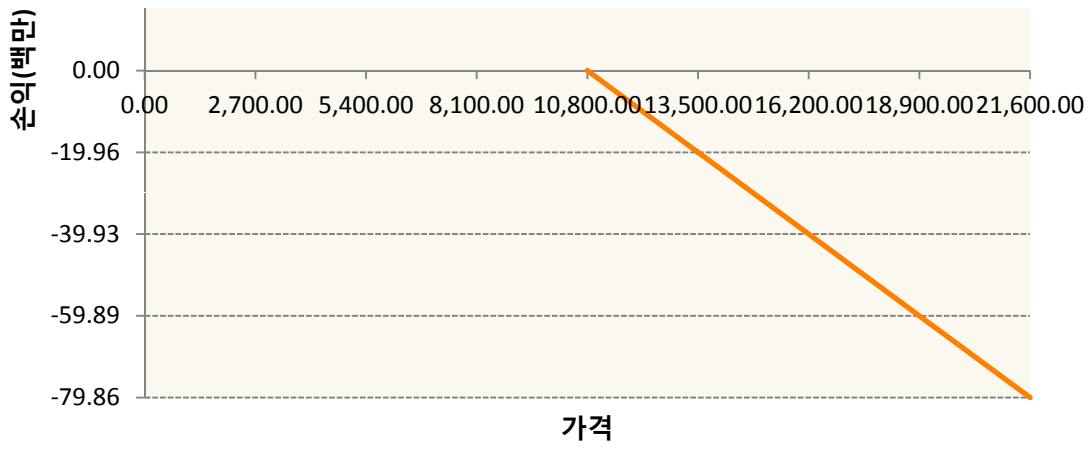
2. 만기시점의 손익구조

HCN9-HSCEI Futures Jul19

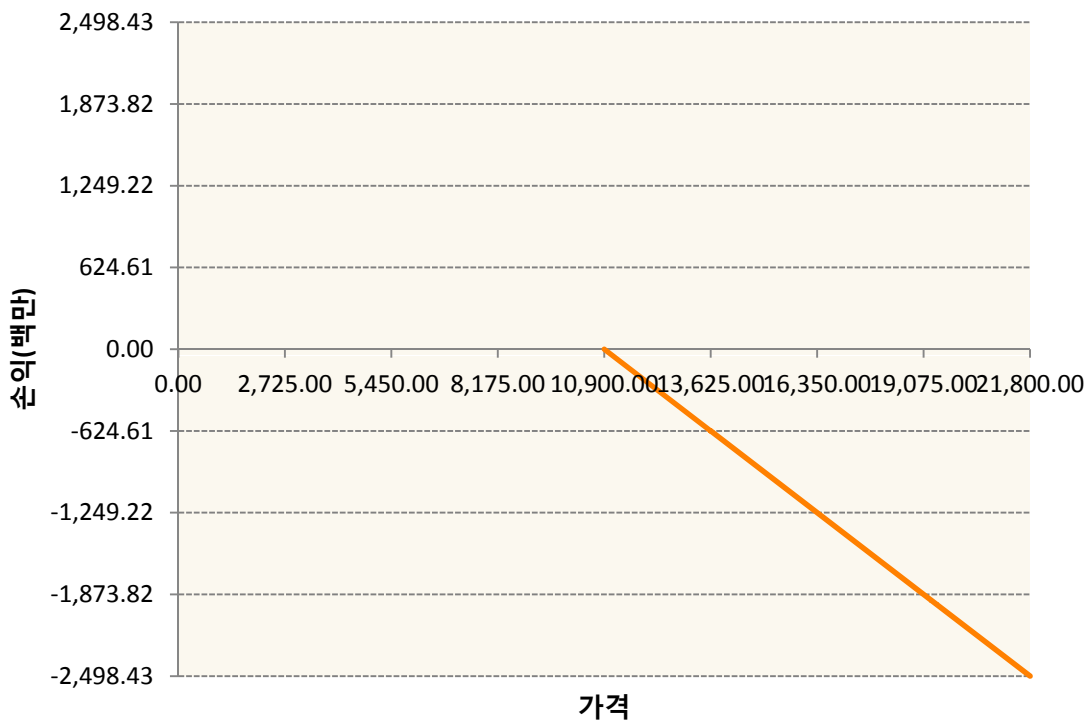


OHHIN9-C108-HSCEI

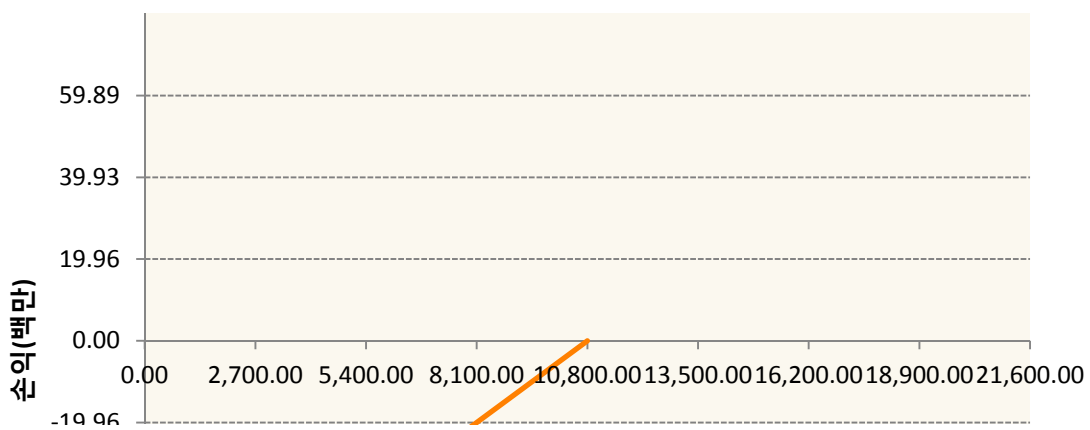


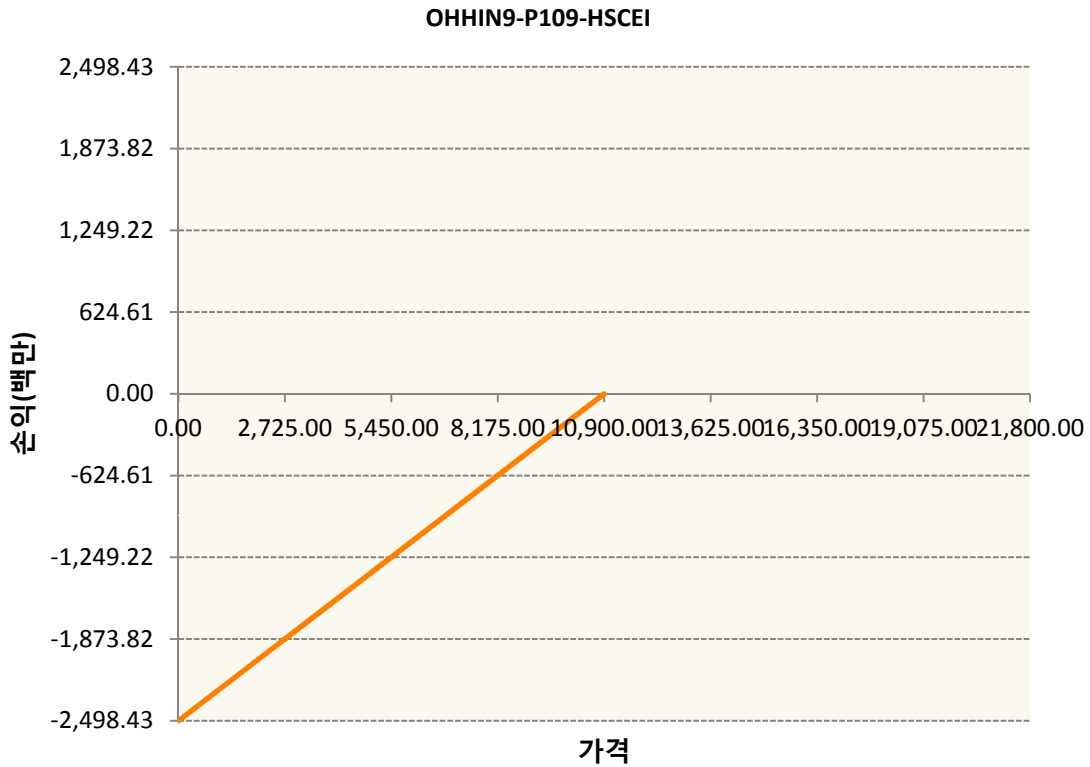
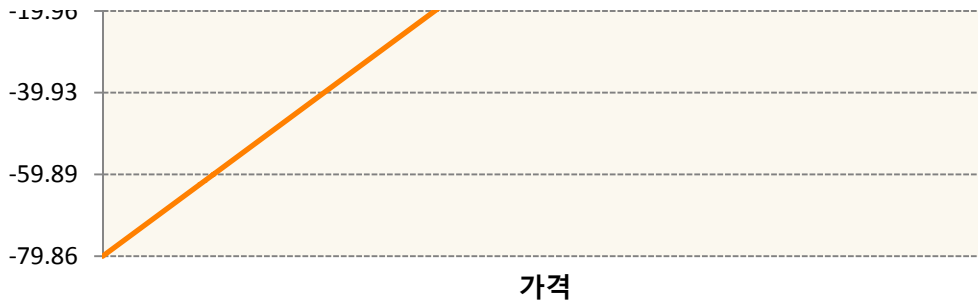


OHHIN9-C109-HSCEI



OHHIN9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	248
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E	12
HCN9 HSCEI Futures Jul19	154
OHHIN9-C1(HSCEI	6
OHHIN9-C1(HSCEI	200
OHHIN9-P1(HSCEI	6
OHHIN9-P1(HSCEI	200

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	660

공시일	2019-07-01
기준일	2019-06-28

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

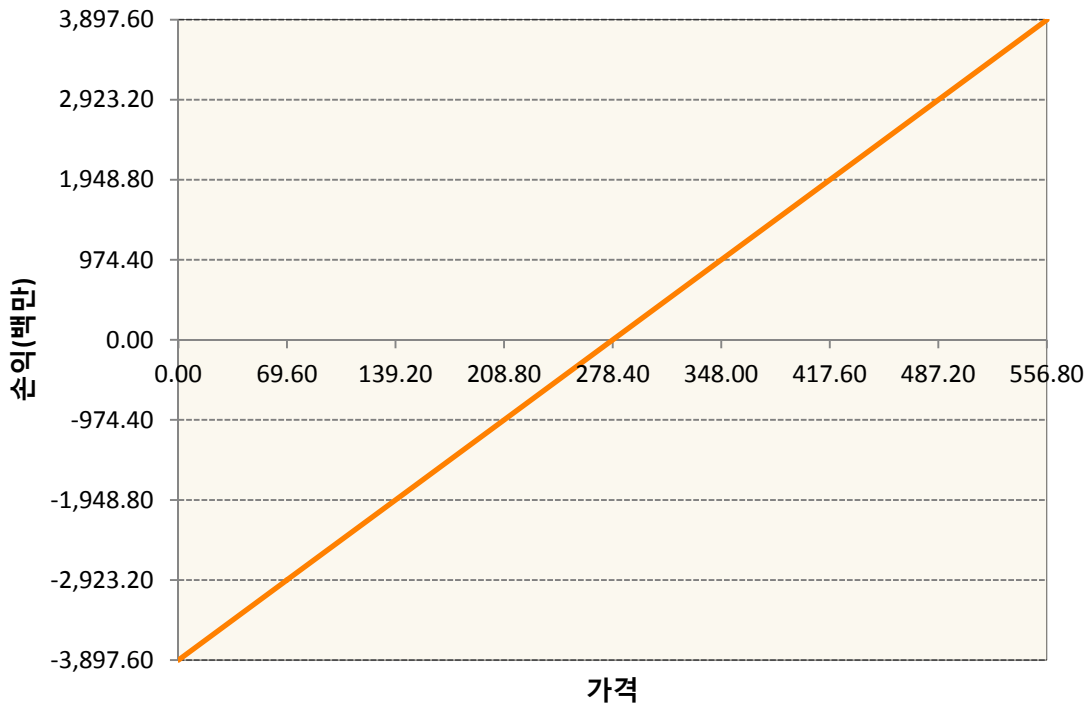
1. 계약금액

(단위:백만원)

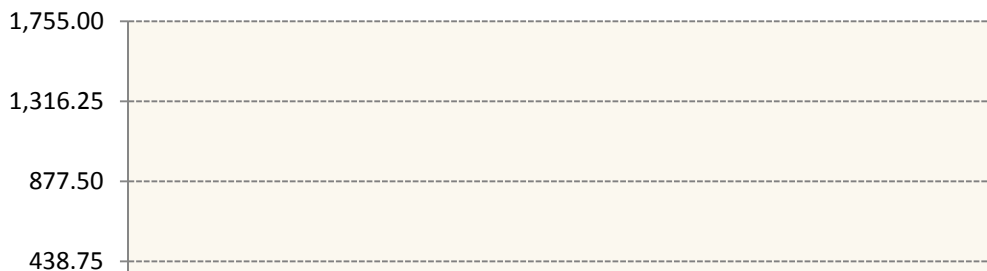
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	337	0	337	장내
누계	유가증권	선물	3,898	0	3,898	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,543	-20,543	장내

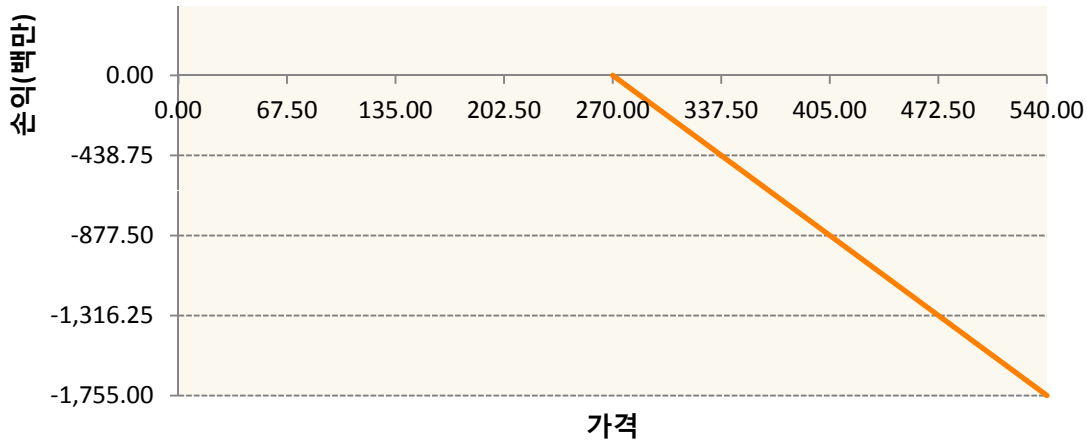
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

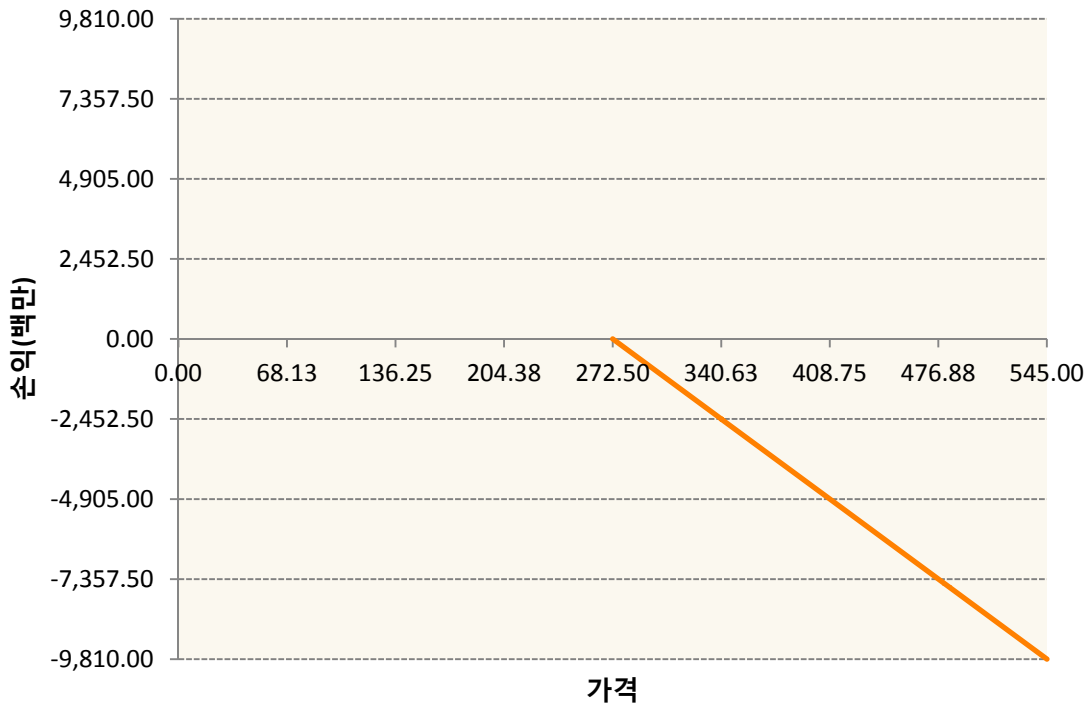


KR4201P72700-2019-07 콜270

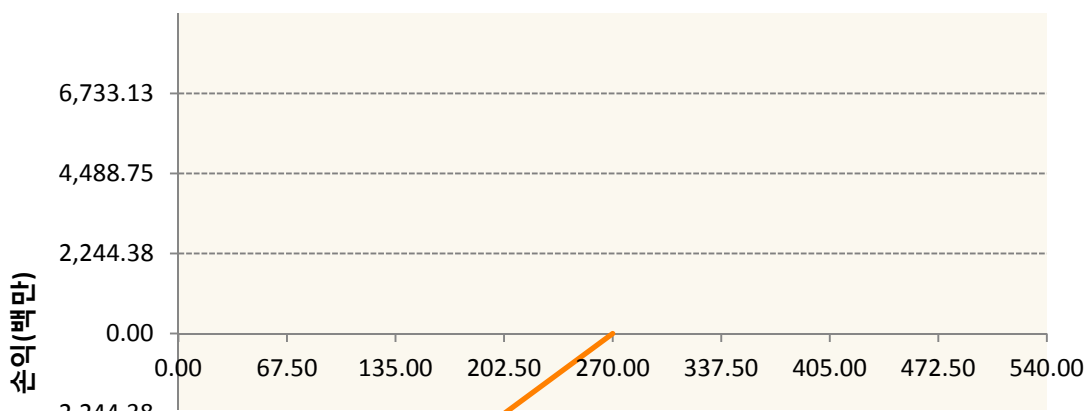




KR4201P72726-2019-07 콜272.5



KR4301P72708-2019-07 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,172
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,172	-1,172	-1,172	-1,172	-1,172	-1,172	-1,172	
-5.33%	-782	-782	-782	-782	-782	-782	-782	
-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%	782	782	782	782	782	782	782	
8.00%	1,172	1,172	1,172	1,172	1,172	1,172	1,172	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						593
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-593	-593	-593	-593	-593	-593	-593	
-5.33%	-395	-395	-395	-395	-395	-395	-395	
-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%	395	395	395	395	395	395	395	
8.00%	593	593	593	593	593	593	593	
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%	62	61	60	59	57	56	54
-5.33%	56	54	51	49	47	44	42
-2.67%	38	35	33	30	27	24	21
0%	7	5	2	0	-2	-5	-7
2.67%	-35	-36	-37	-39	-40	-42	-44
5.33%	-81	-82	-82	-83	-84	-85	-86
8.00%	-129	-129	-129	-129	-130	-130	-131
KR4201P72726 2019-07 콜272.5							700
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	287	283	279	273	267	260	252
-5.33%	264	254	244	233	221	209	196
-2.67%	191	176	161	145	130	115	99
0%	43	29	15	0	-15	-30	-45
2.67%	-171	-180	-189	-199	-210	-221	-233
5.33%	-422	-425	-429	-434	-441	-448	-455
8.00%	-685	-686	-687	-689	-692	-696	-700
KR4301P72708 2019-07 풋270							476
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-470	-470	-471	-472	-473	-474	-476
-5.33%	-231	-235	-239	-243	-248	-253	-259
-2.67%	-52	-60	-68	-76	-84	-92	-100
0%	13	9	5	0	-5	-11	-16
2.67%	20	20	19	18	17	15	13
5.33%	20	20	20	20	20	20	19
8.00%	20	20	20	20	20	20	20

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

(단위:백만원)

3,327

공시일	2019-07-01
기준일	2019-06-28

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

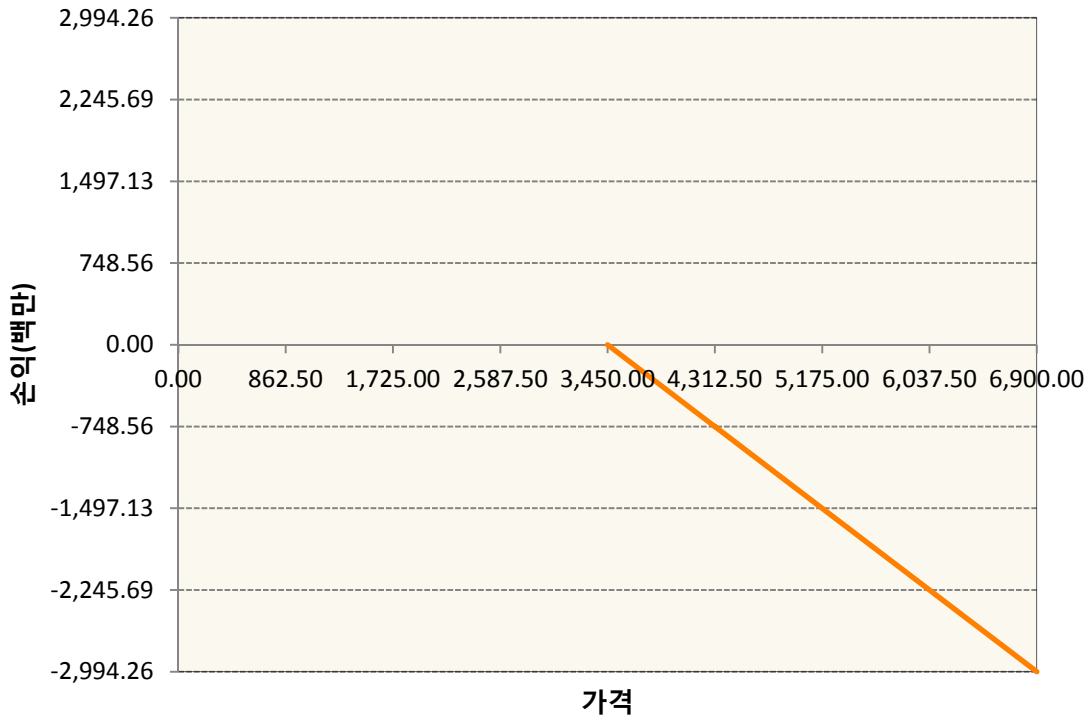
1. 계약금액

(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	2,892	0	2,892	
누계	유가증권	스왑	55,664	0	55,664	장외
누계	유가증권	옵션	0	18,692	-18,692	장내
누계	통화	선도	0	18,410	-18,410	장외

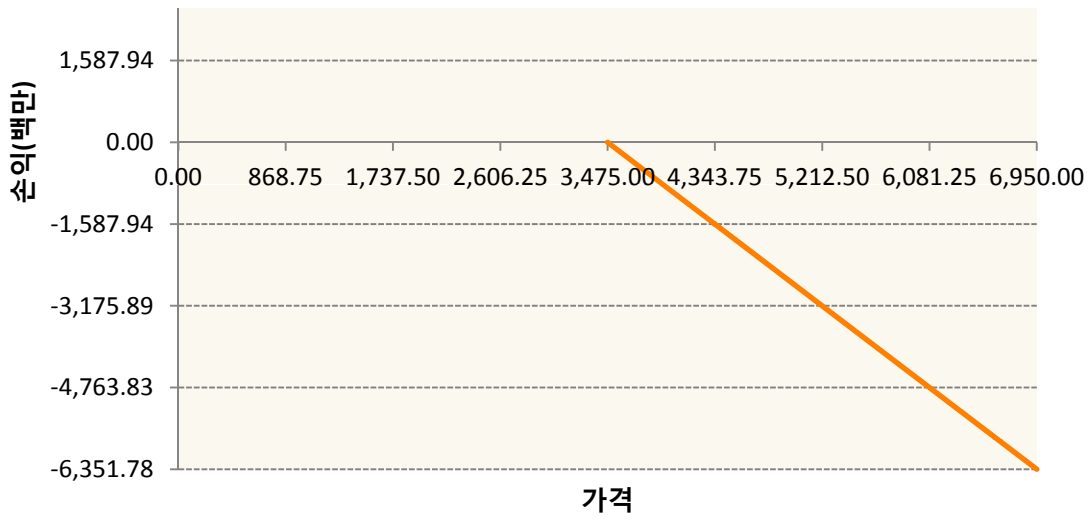
2. 만기시점의 손익구조

OESXN9-C3450-EURO STOXX 50

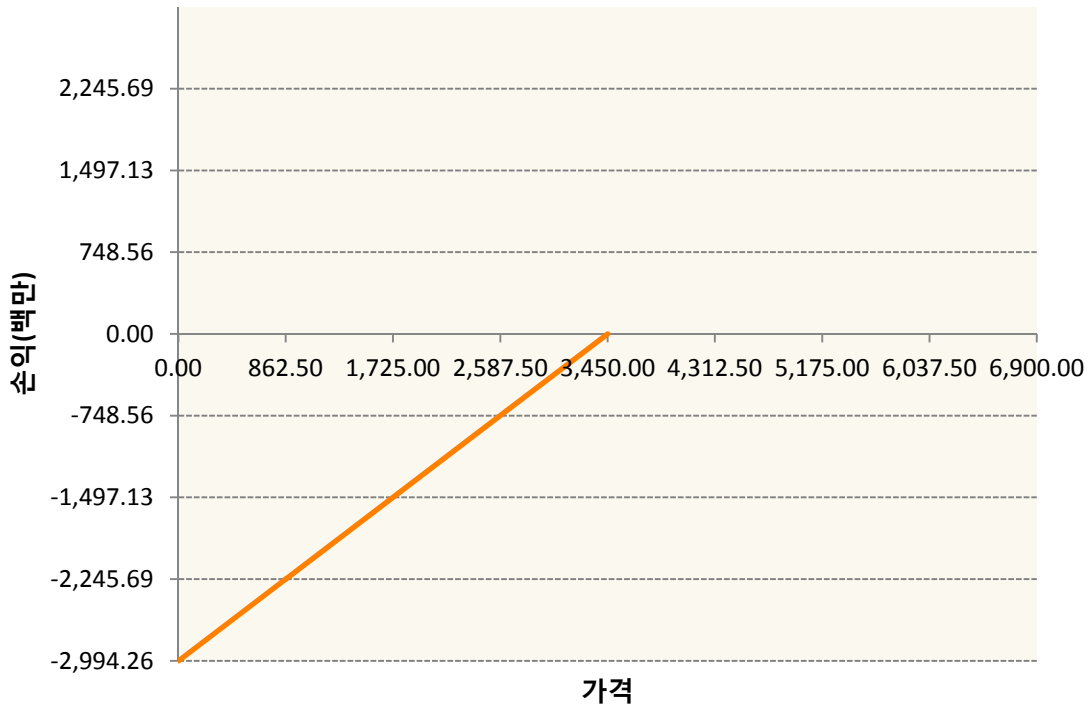


OESXN9-C3475-EURO STOXX 50

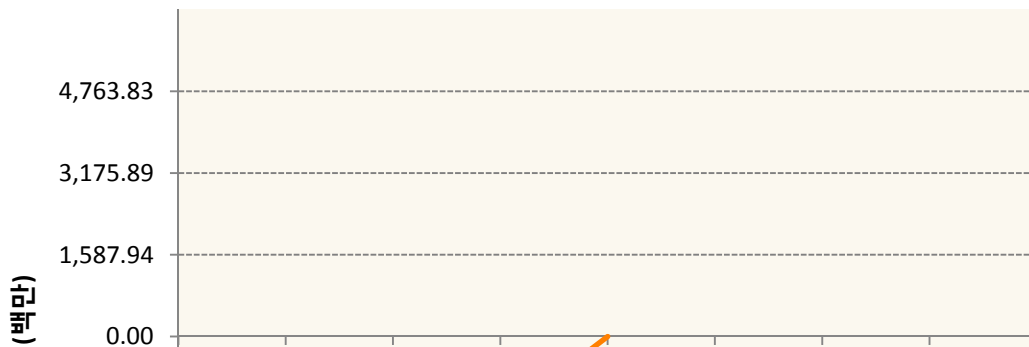


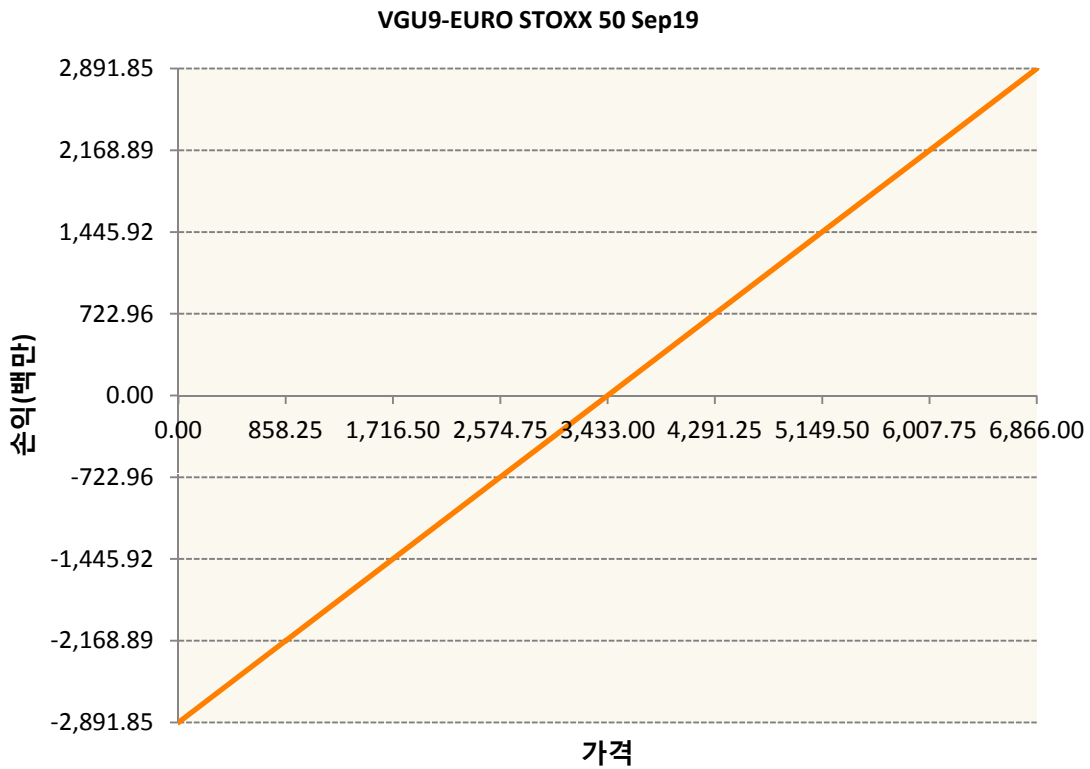
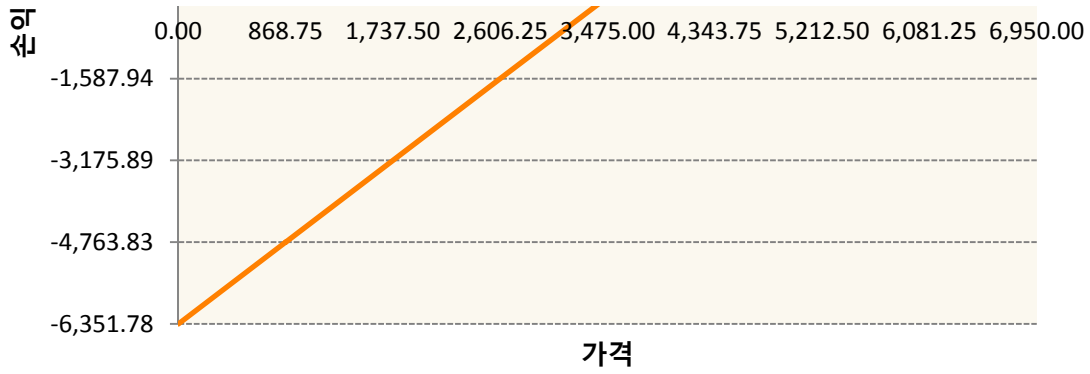


OESXN9-P3450-EURO STOXX 50



OESXN9-P3475-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	40
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	421
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E	1,052
OESXN9-C34 EURO STOXX 50	240
OESXN9-C34 EURO STOXX 50	508
OESXN9-P34 EURO STOXX 50	240
OESXN9-P34 EURO STOXX 50	508
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	231

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

(단위:백만원)

1,989

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

(단위:백만원)

1,041

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)

41

공시일	2019-07-01
기준일	2019-06-28

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

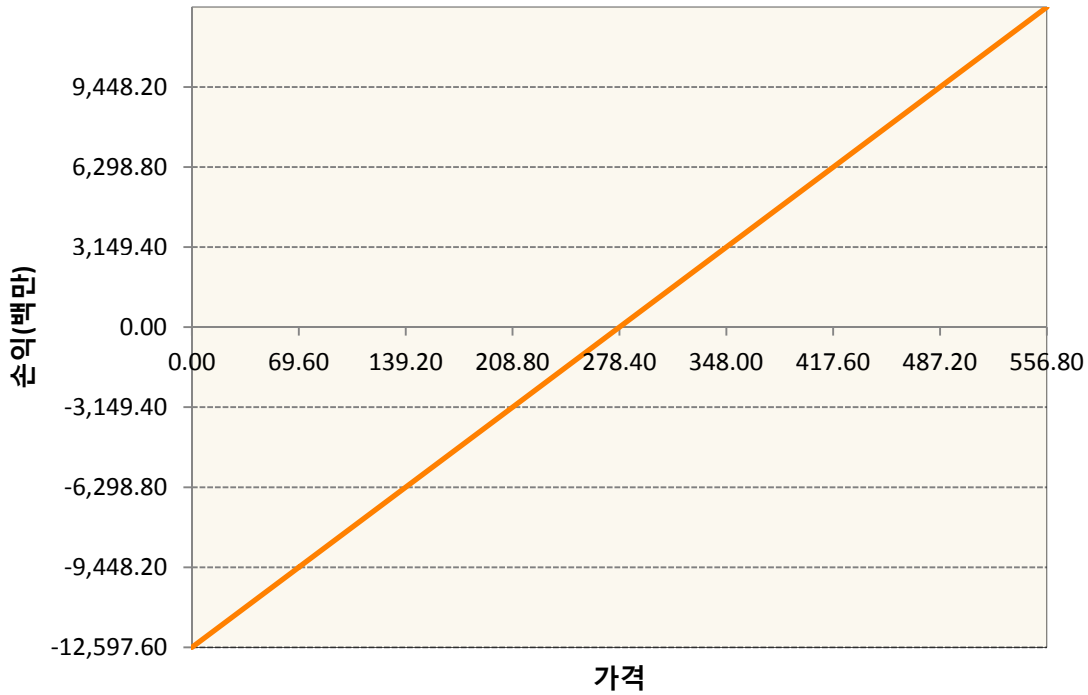
1. 계약금액

(단위:백만원)

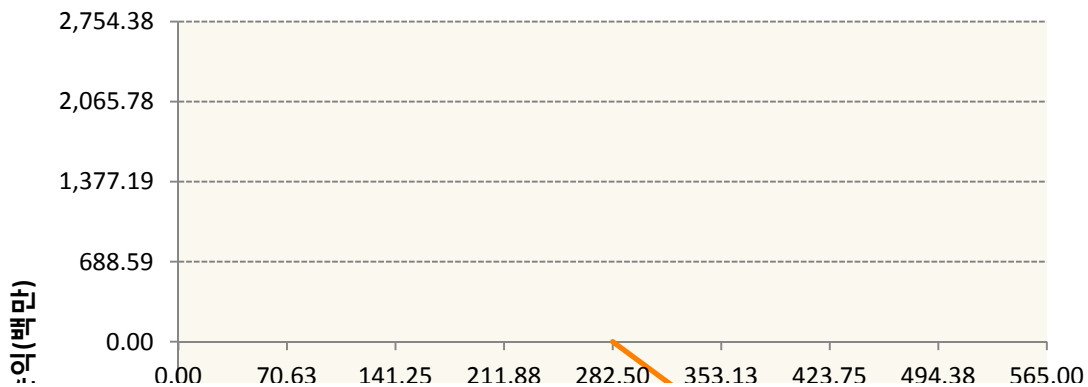
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,598	0	12,598	장내
누계	유가증권	옵션	1,084	22,134	-21,050	장내

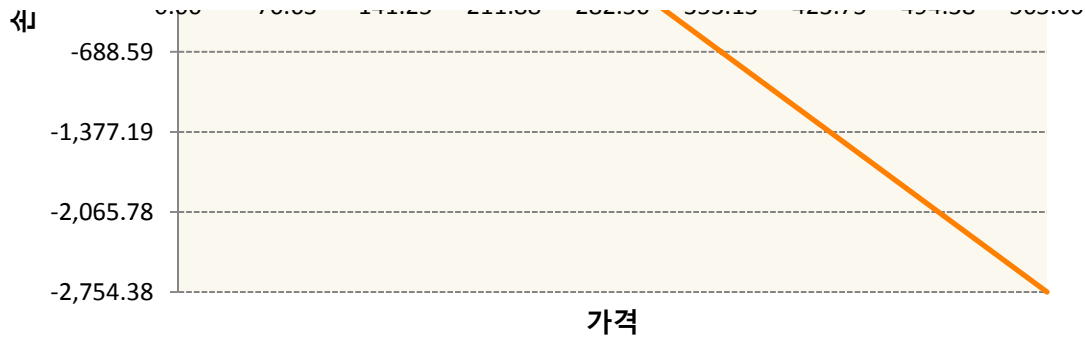
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

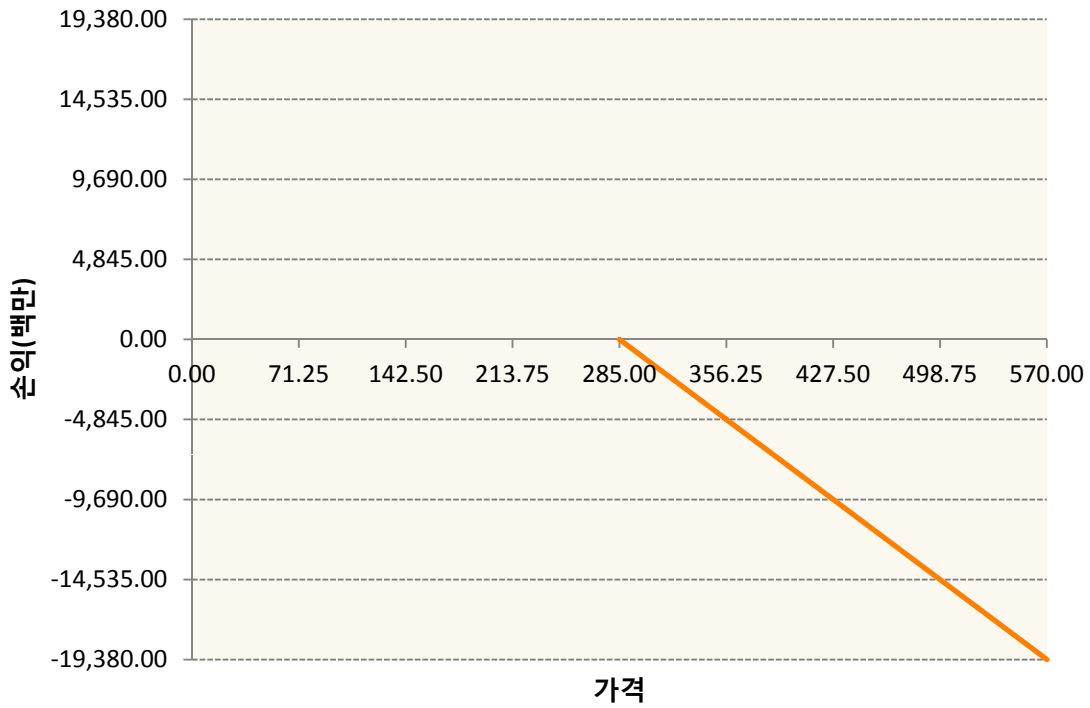


KR4201P72825-2019-07 콜282.5

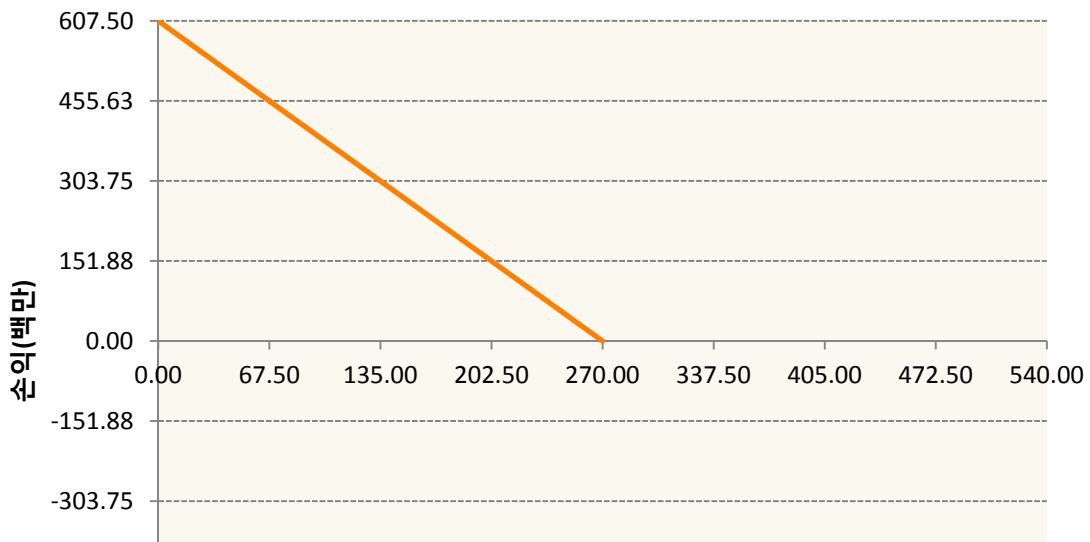


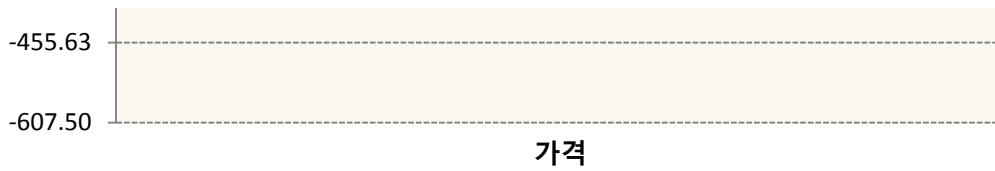


KR4201P72858-2019-07 콜285

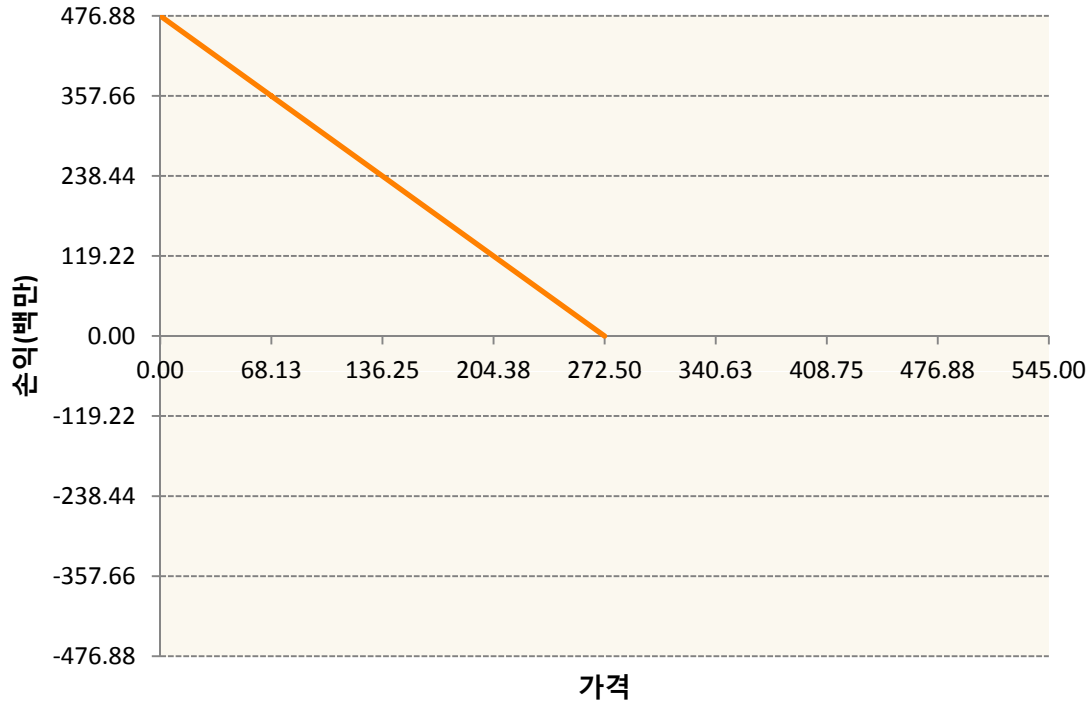


KR4301P72708-2019-07 풋270





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						150
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	31	31	31	31	30	29	28	
-5.33%	31	30	29	28	26	25	23	
-2.67%	26	24	22	19	16	13	10	

0%	12	8	4	0	-4	-8	-12
2.67%	-21	-25	-30	-34	-38	-43	-47
5.33%	-73	-76	-79	-83	-86	-90	-94
8.00%	-138	-139	-141	-143	-145	-148	-150
KR4201P72858 2019-07 콜285							964
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	165	165	164	162	159	156	151
-5.33%	163	160	155	149	141	132	121
-2.67%	145	134	121	106	89	71	51
0%	74	51	26	0	-26	-53	-81
2.67%	-108	-139	-169	-200	-231	-262	-293
5.33%	-428	-454	-480	-507	-534	-562	-591
8.00%	-856	-870	-885	-903	-922	-943	-964
KR4301P72708 2019-07 풋270							32
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	32	32	32	32	32	32	32
-5.33%	16	16	16	16	17	17	18
-2.67%	3	4	5	5	6	6	7
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
KR4301P72724 2019-07 풋272.5							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%	15	15	16	16	16	16	16
-2.67%	4	5	5	6	6	6	7
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
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

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

(단위:백만원)

1,887

공시일	2019-07-01
기준일	2019-06-28

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	18,801	0	18,801	

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	2019-07-01
기준일	2019-06-28

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	59,511	0	59,511	

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	2019-07-01
기준일	2019-06-28

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	394,283	0	394,283	
누계	통화	선도	0	387,540	-387,540	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
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		776
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		647
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		554
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		739
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		739
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		462
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		277
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		924
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		185
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		859
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		1,025
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		1,848
FX21019M0(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		924
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		647
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		647
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		554
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		2,956
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		2,217
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E		277
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E		277

FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	776
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	619
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	462
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E	1,848
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E	1,848
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E	684
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E	684
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E	1,275
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E	2,505

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

(단위:백만원)

10,157

공시일	2019-07-01
기준일	2019-06-28

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

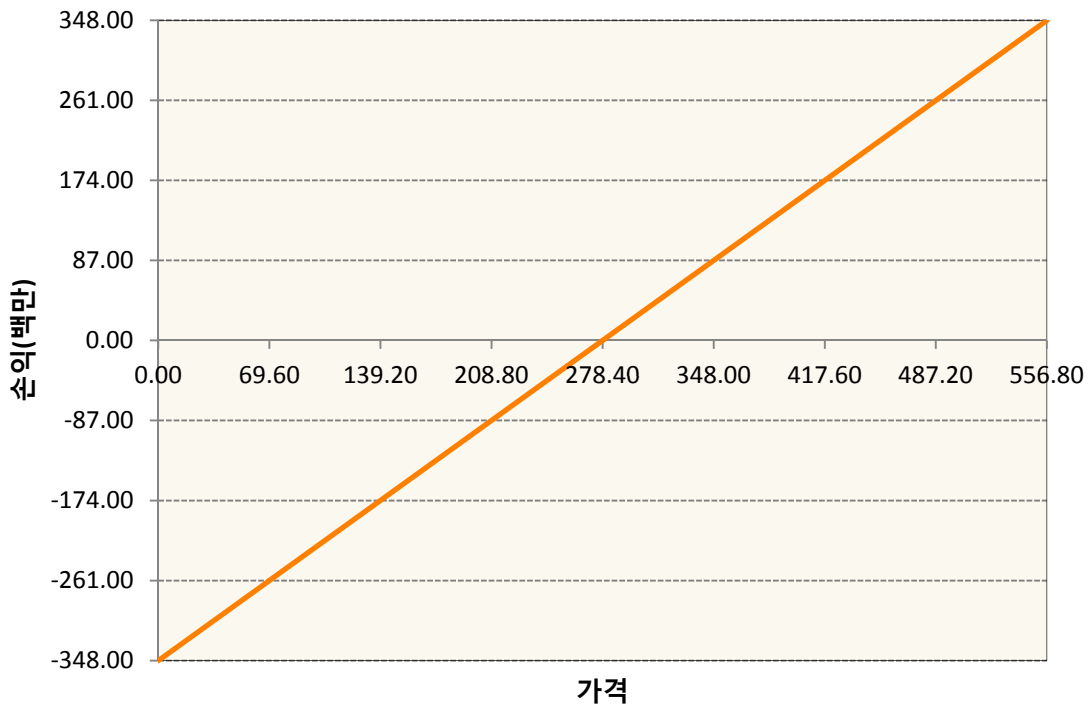
1. 계약금액

(단위:백만원)

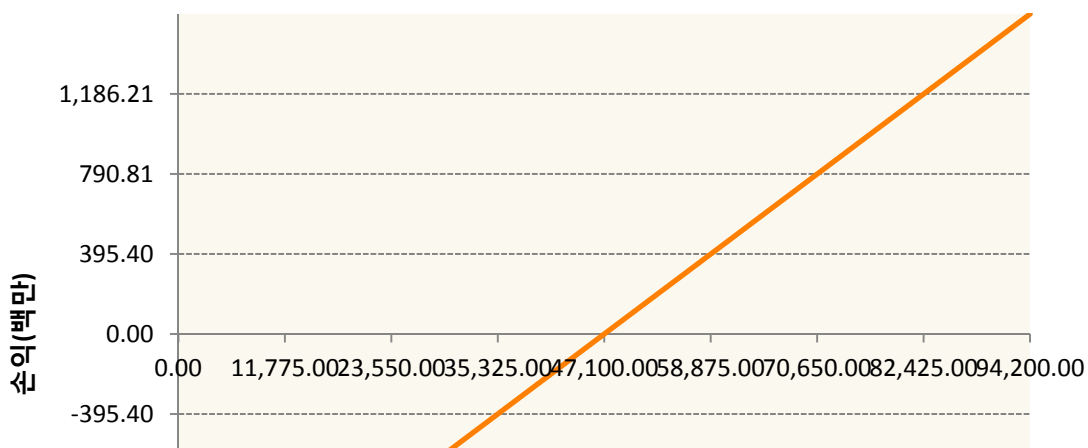
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,930	0	1,930	장내

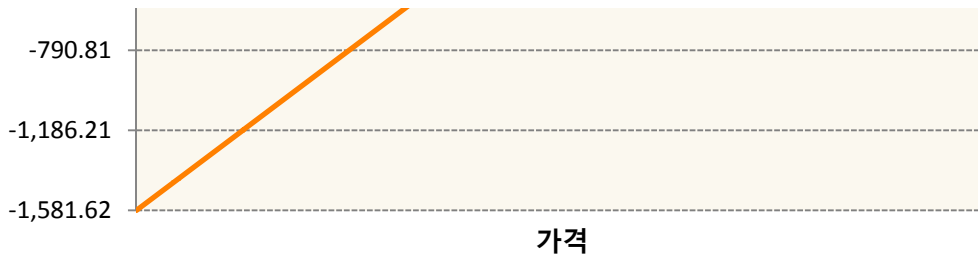
2. 만기시점의 손익구조

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						126
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126	
-5.33%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84	
-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%	84	84	84	84	84	84	84	
8.00%	126	126	126	126	126	126	126	

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

165

공시일	2019-07-01
기준일	2019-06-28

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

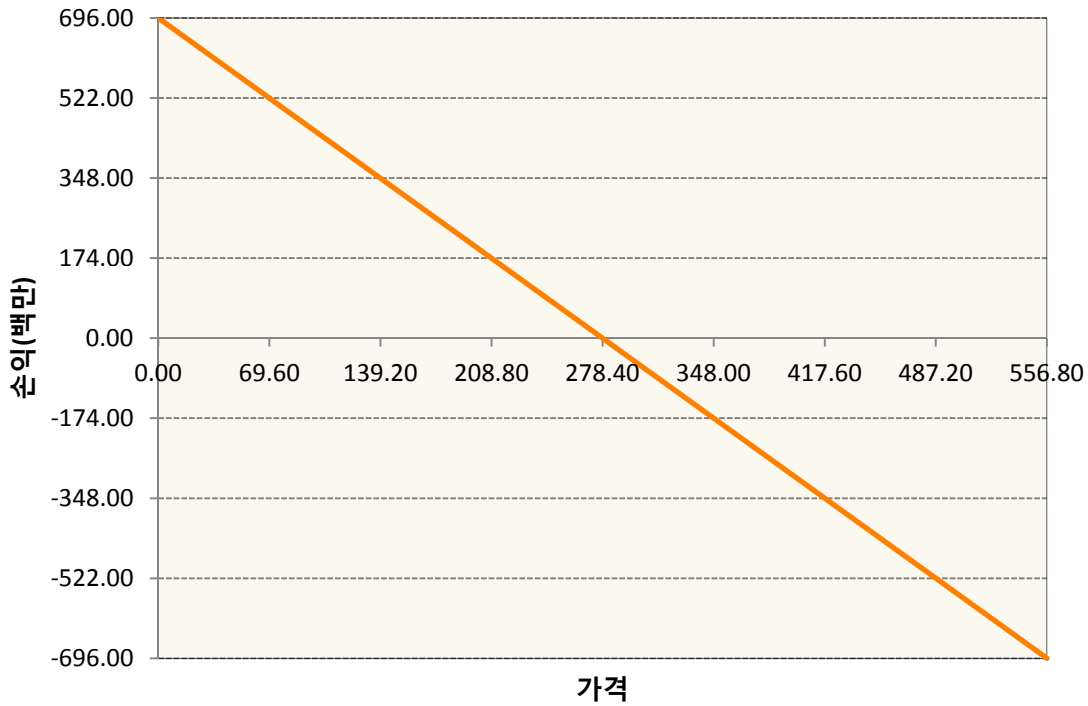
1. 계약금액

(단위:백만원)

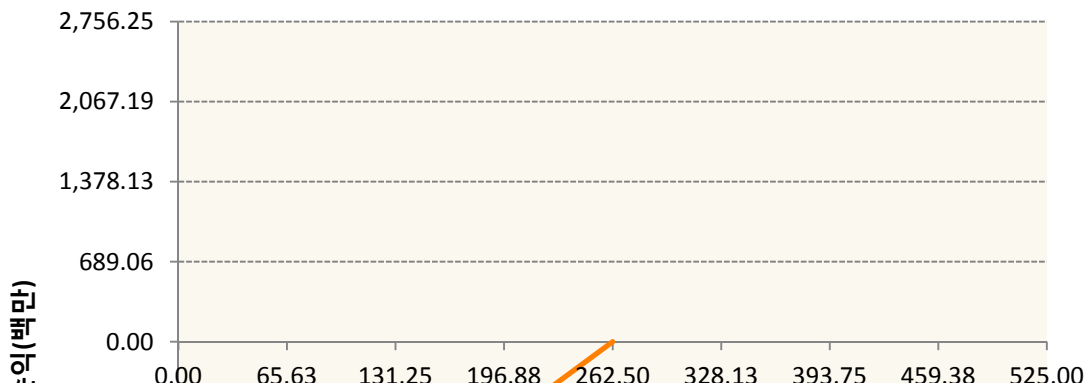
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	66	-66	장내
누계	유가증권	선물	0	696	-696	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,485	-3,485	장내

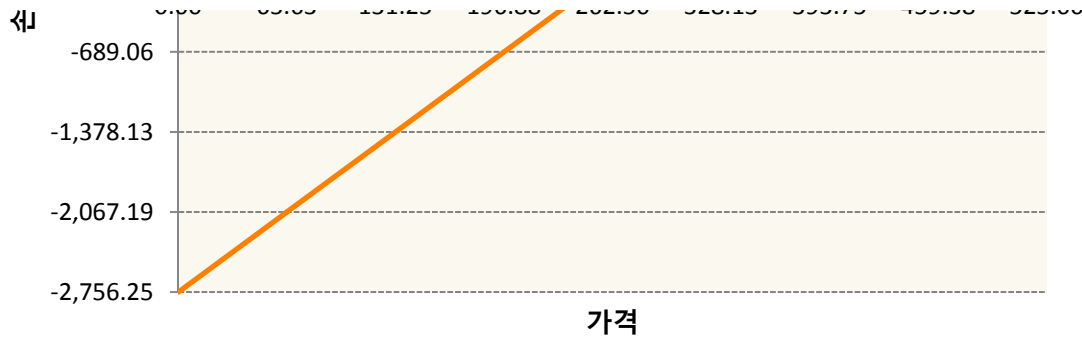
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

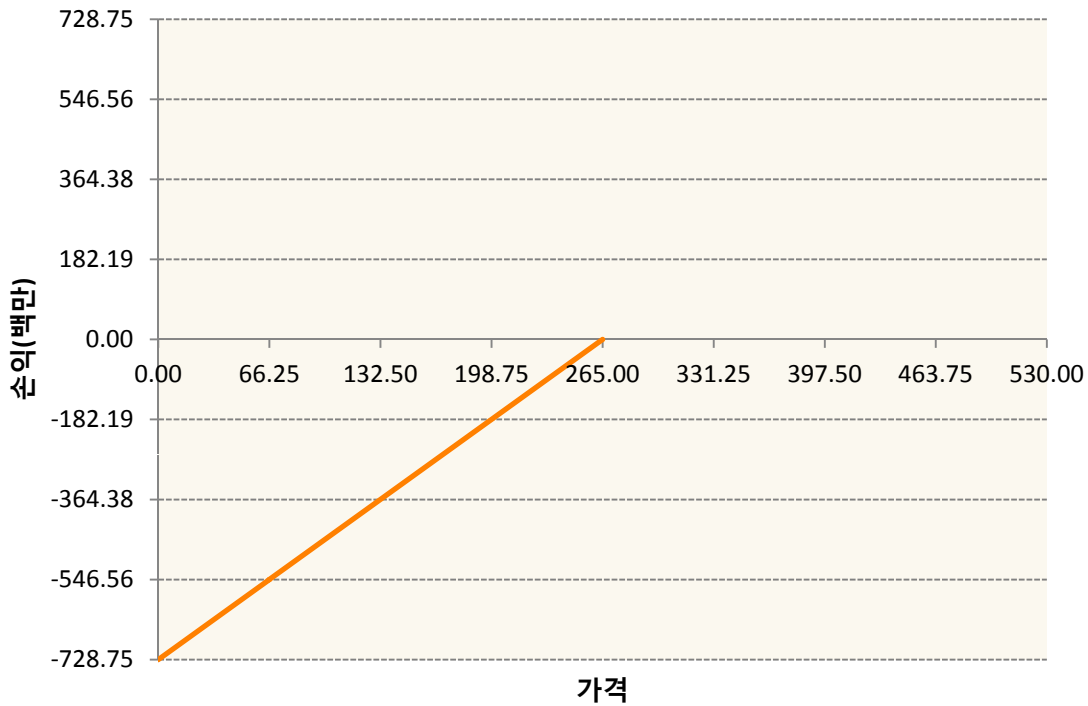


KR4301P72625-2019-07 풋262.5





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%	-78	-79	-80	-81	-83	-84	-86
-5.33%	-21	-23	-26	-28	-31	-33	-36
-2.67%	-2	-3	-4	-5	-7	-8	-10
0%	1	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	1	1	1	1	1	0	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

KR4301P72658

2019-07 풋265

28

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-27	-27	-27	-27	-27	-28	-28
-5.33%	-9	-10	-10	-11	-12	-12	-13
-2.67%	-1	-1	-2	-2	-3	-4	-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)

92

공시일	2019-07-01
기준일	2019-06-28

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	3,926	-3,926	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	2019-07-01
기준일	2019-06-28

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

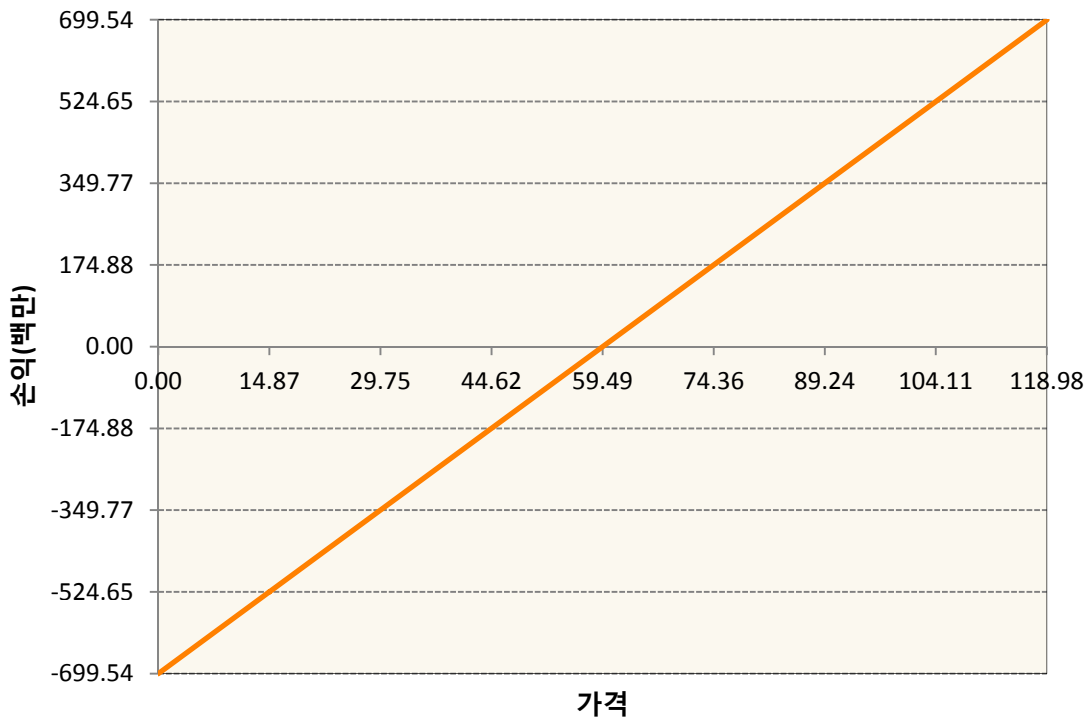
1. 계약금액

(단위:백만원)

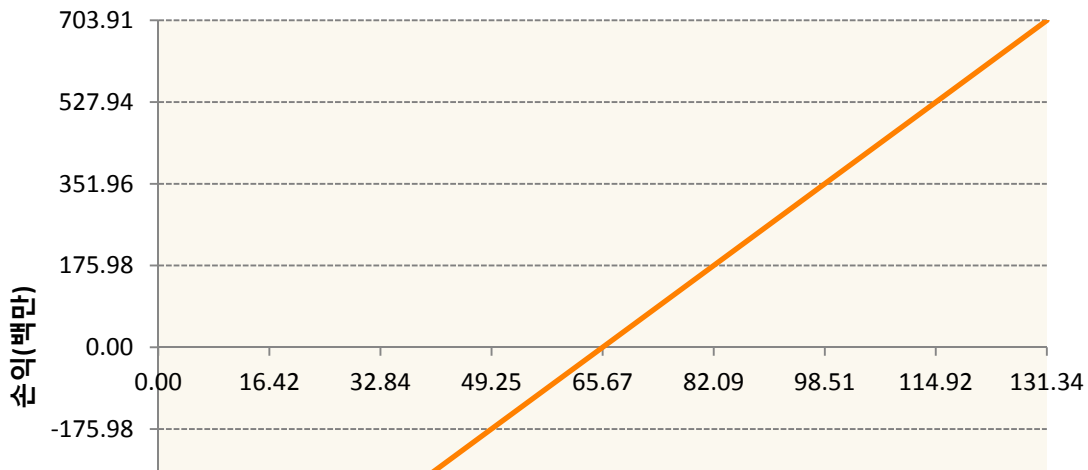
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,756	115	2,640	

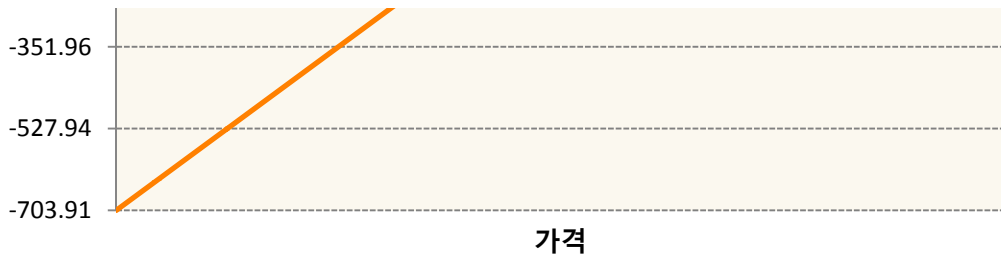
2. 만기시점의 손익구조

CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19

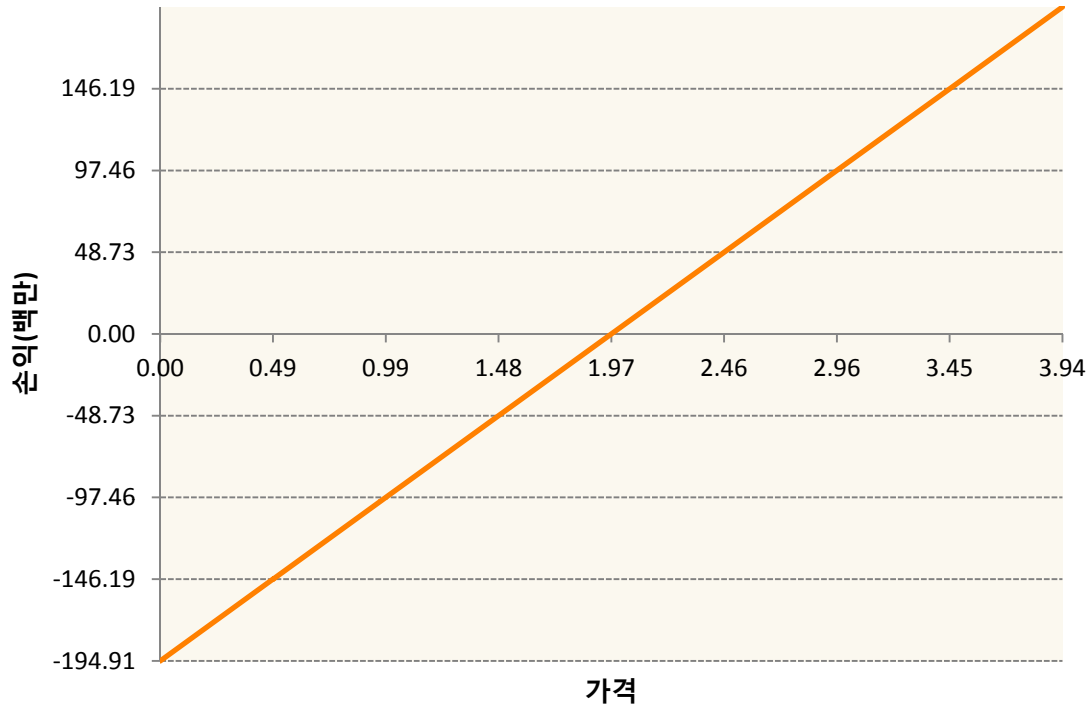


COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19

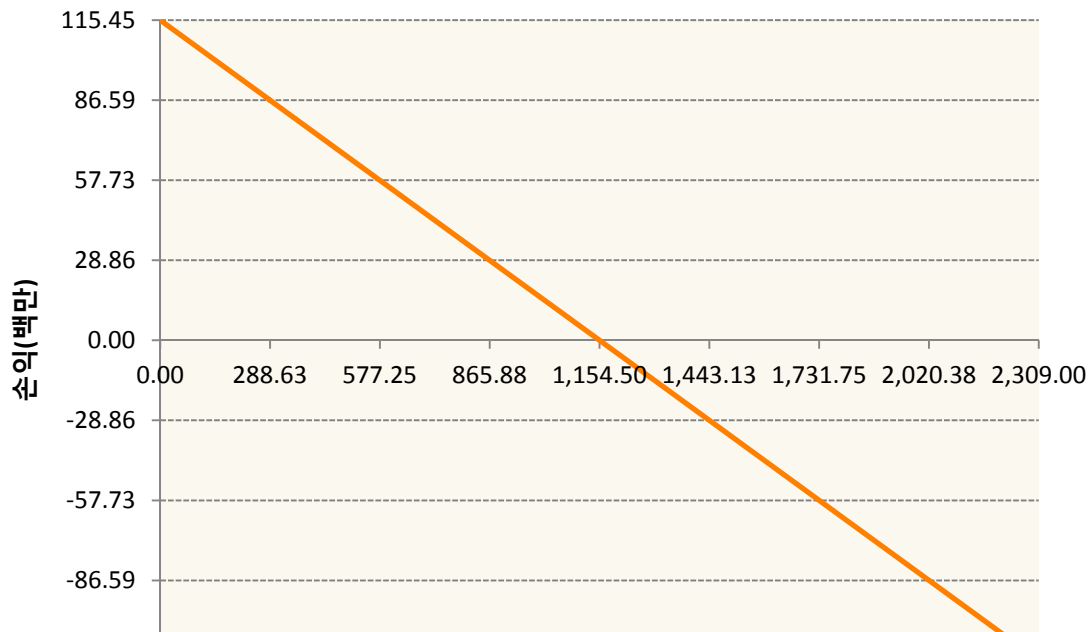


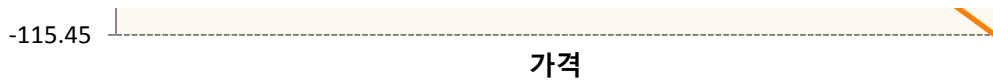


HOU9-NY Harb ULSD Fut Sep19

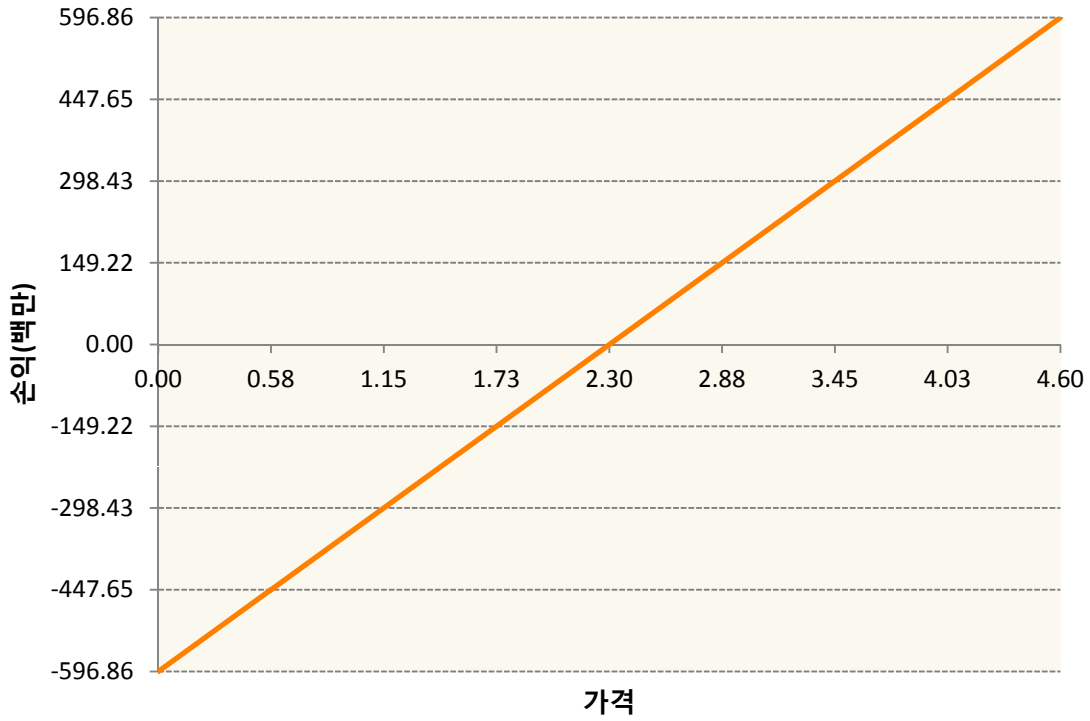


KR4175P70007-2019-07 달러선물

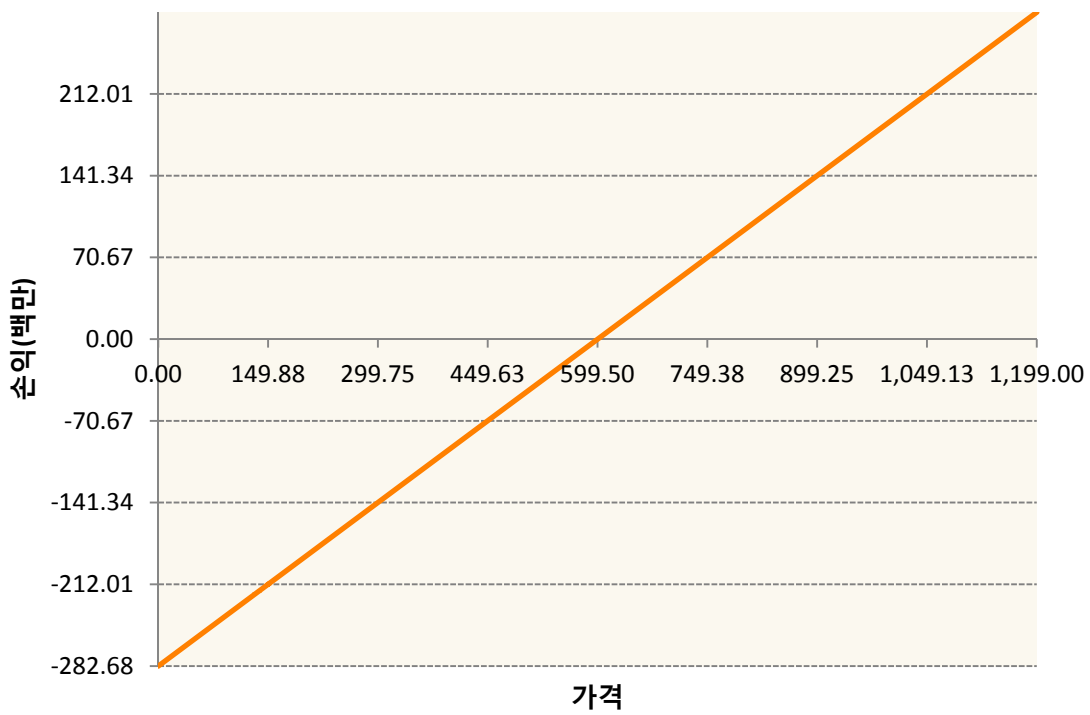




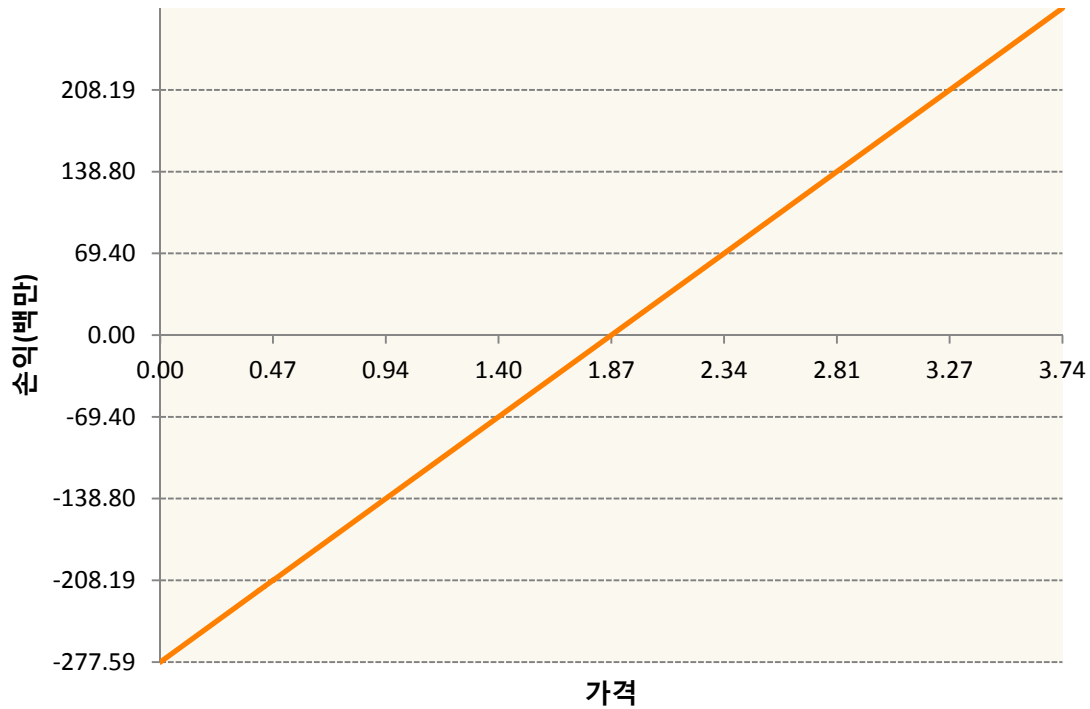
NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



QSU9-Low Su Gasoil G Sep19



XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	56
COU9	BRENT CRUDE FUTR Sep19	56
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	16
KR4175P700	2019-07 달러선물	9
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	48
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	23
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	22

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

(단위:백만원)

410

공시일	2019-07-01
기준일	2019-06-28

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

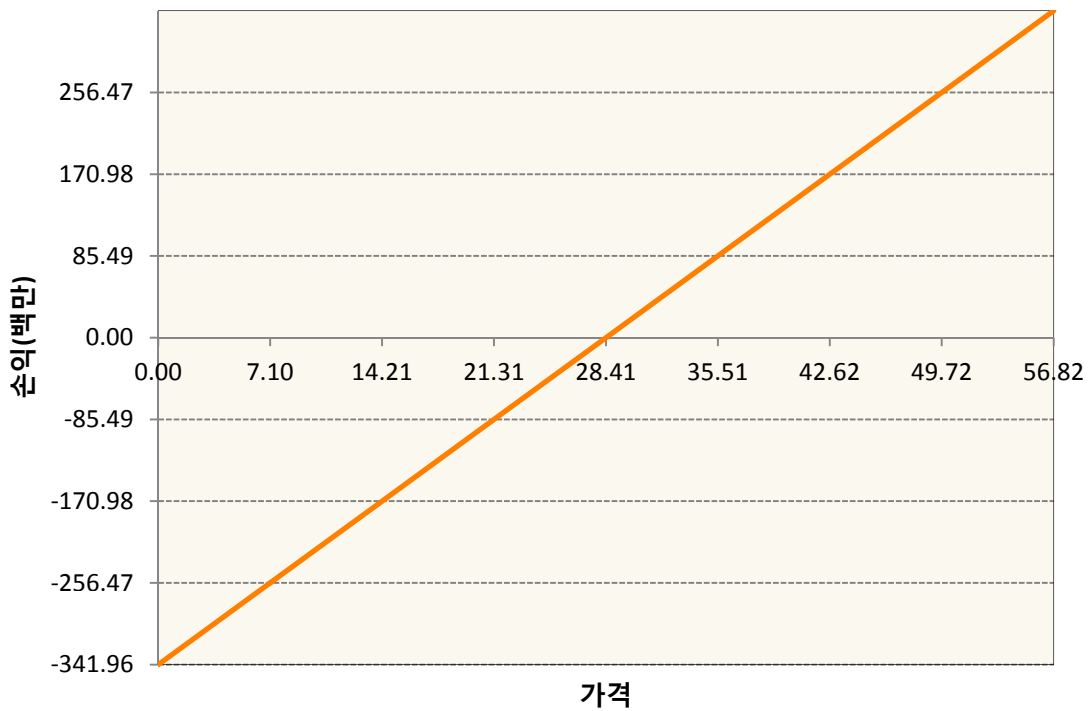
1. 계약금액

(단위:백만원)

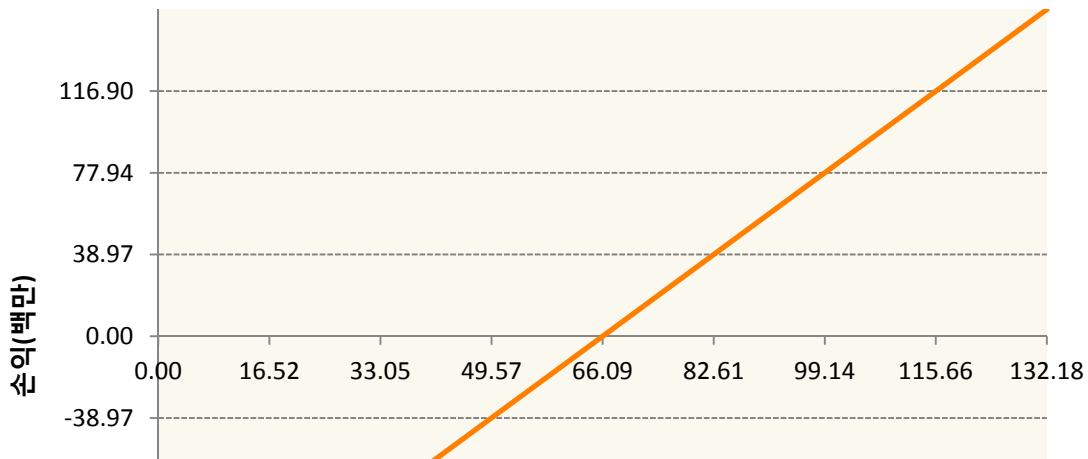
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,307	196	3,111	

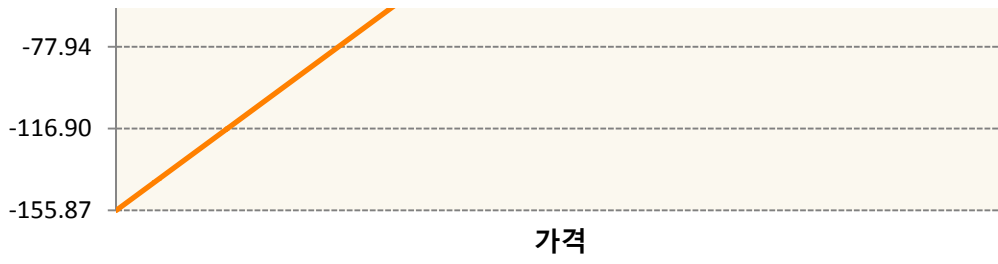
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

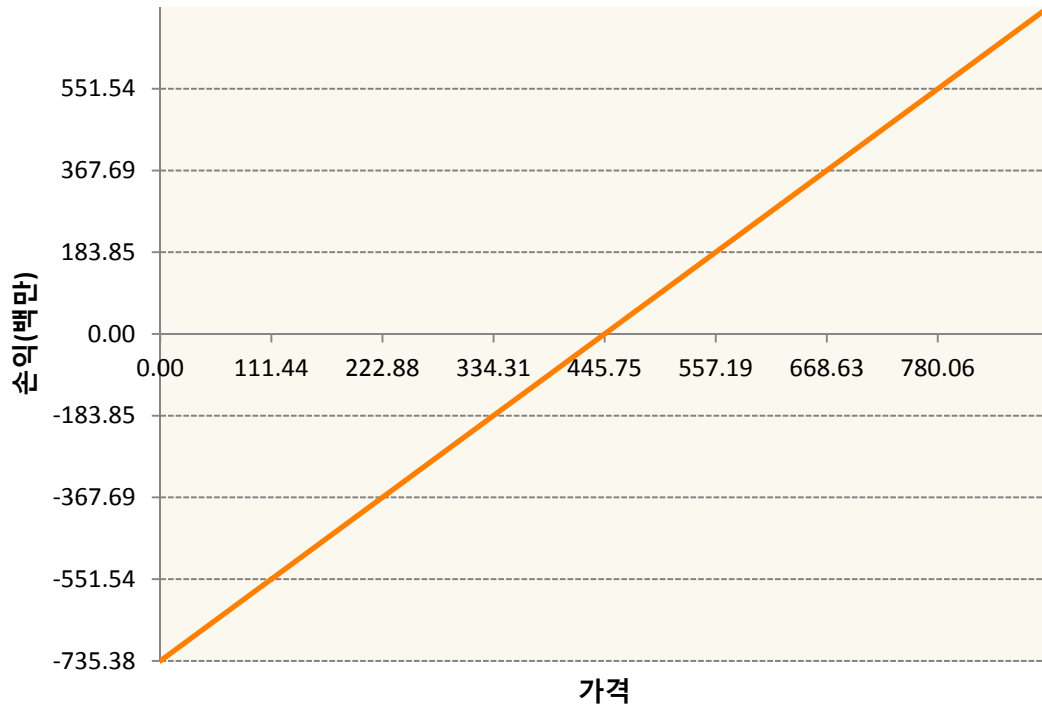


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

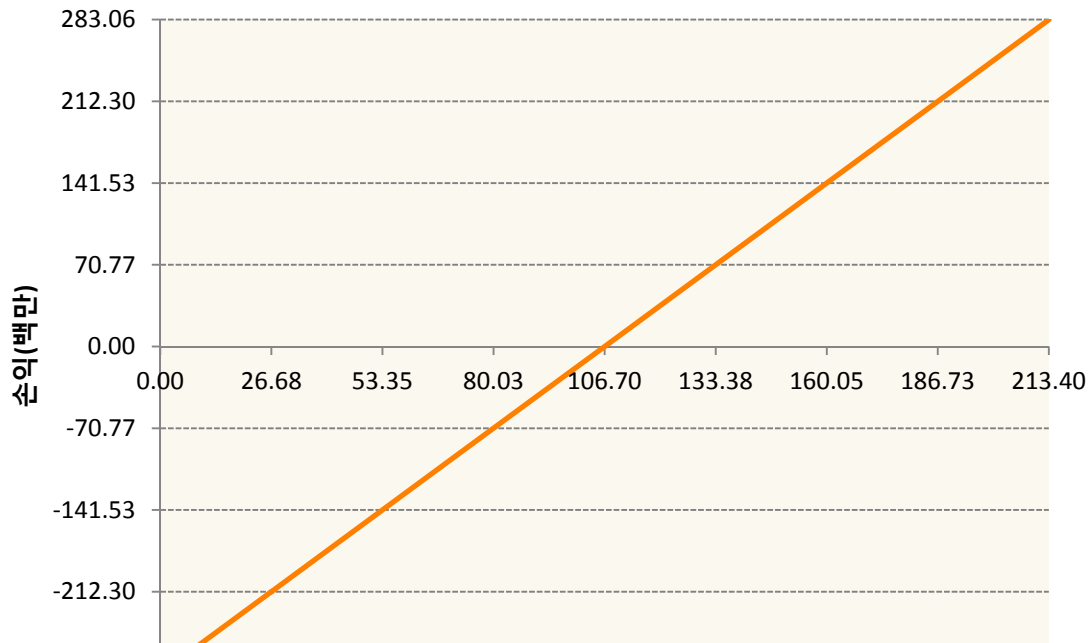


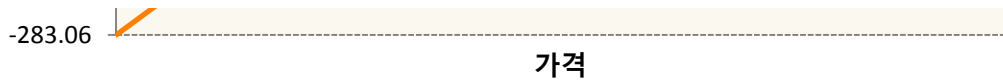


CU9-CORN FUTURE Sep19

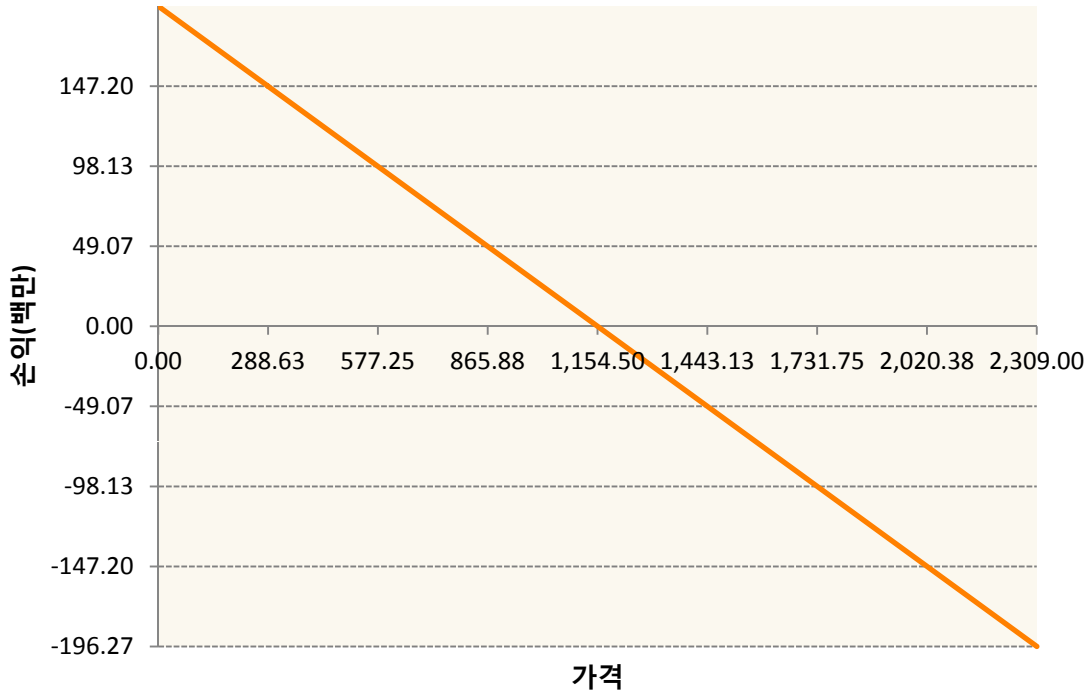


KCU9-COFFEE 'C' FUTURE Sep19

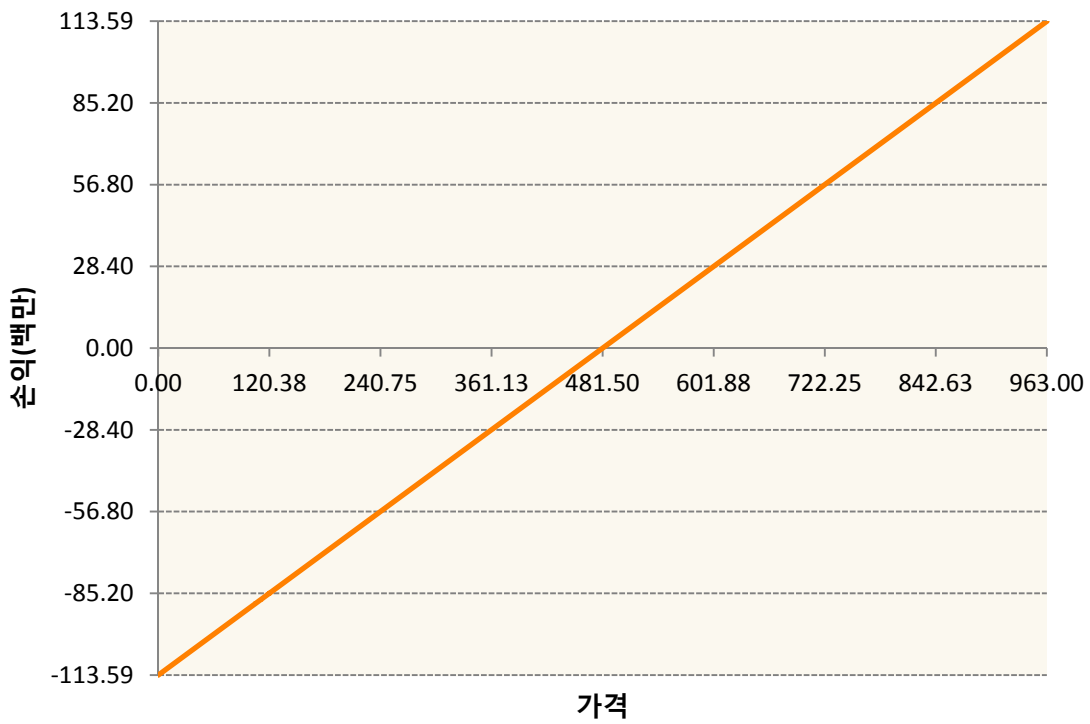




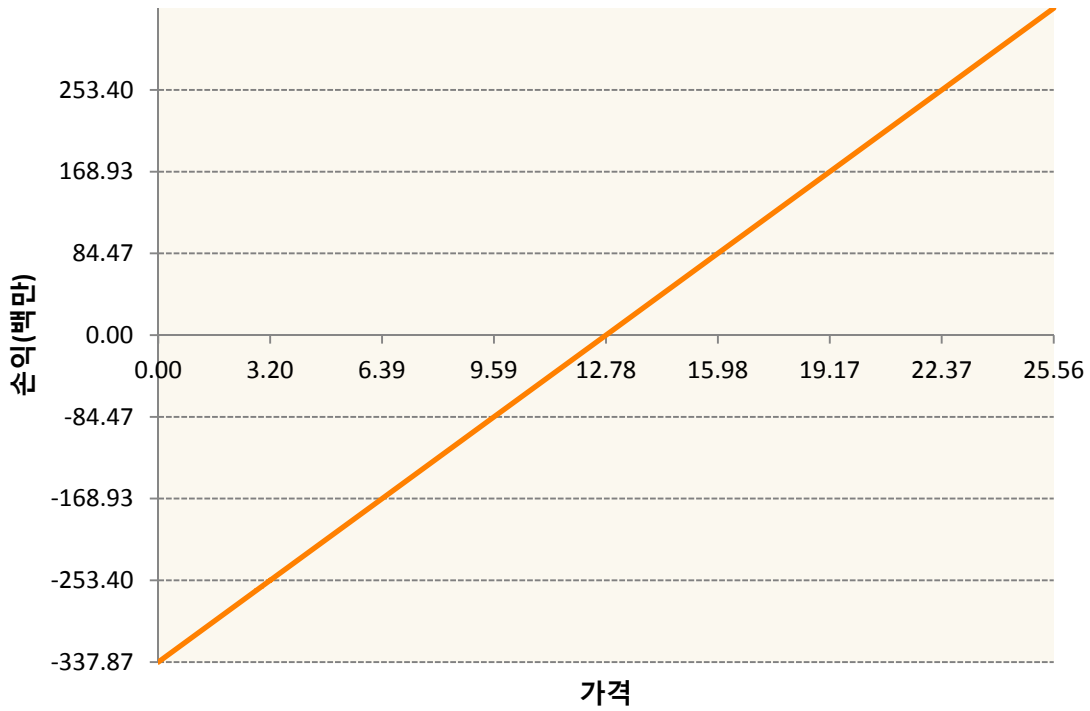
KR4175P70007-2019-07 달러선물



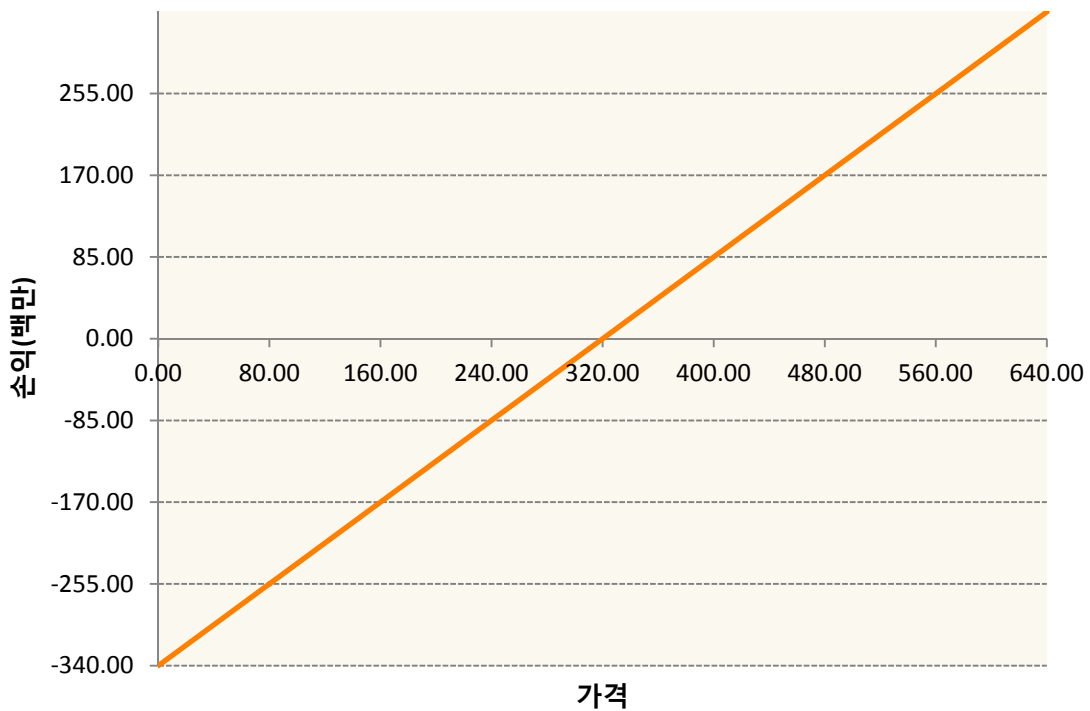
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

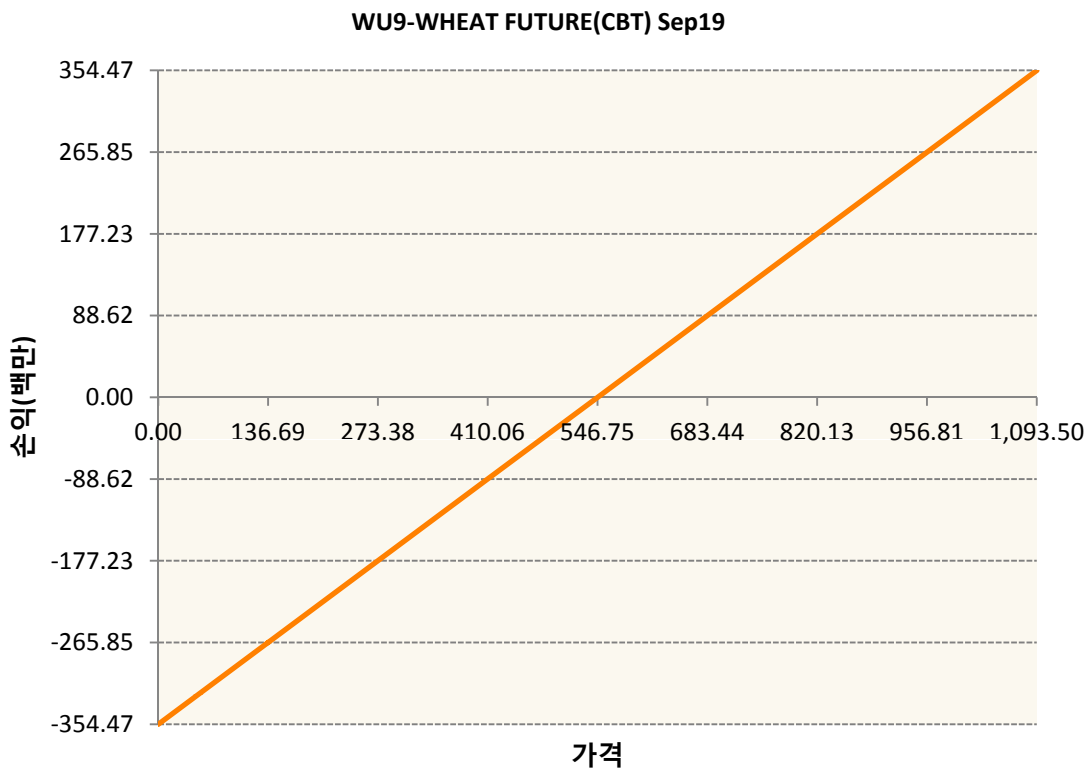
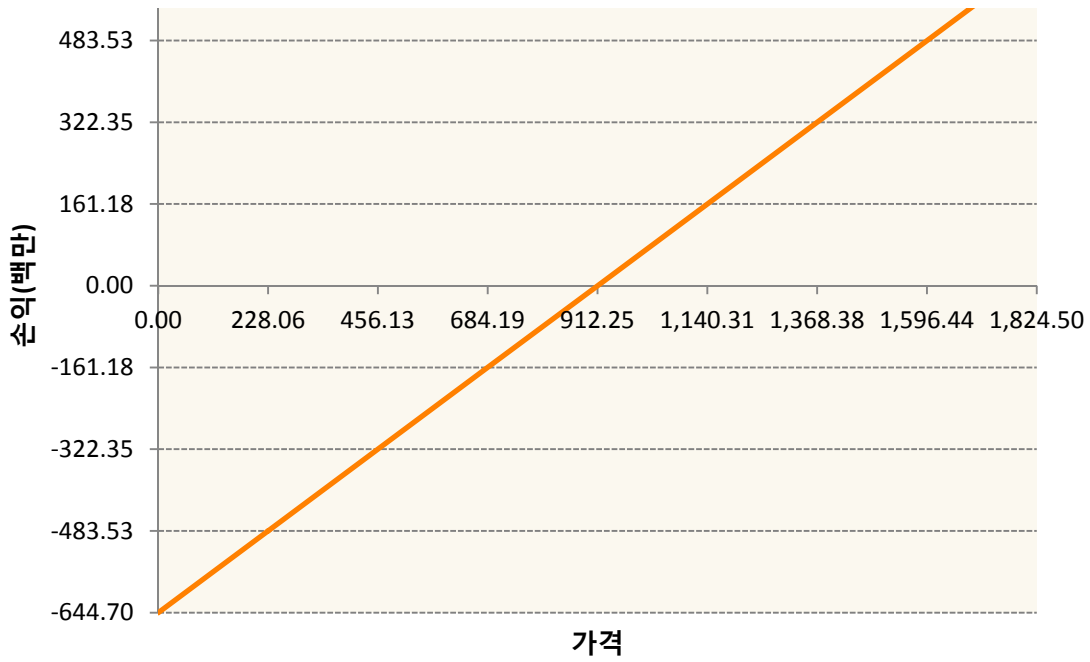


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	27
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	12
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	27
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)

288