

공시일	2019-07-02
기준일	2019-07-01

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	2019-07-02
기준일	2019-07-01

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)

670

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-02
기준일	2019-07-01

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)	399
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	146

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

887

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-02
기준일	2019-07-01

유로인덱스모(주식-파생형)

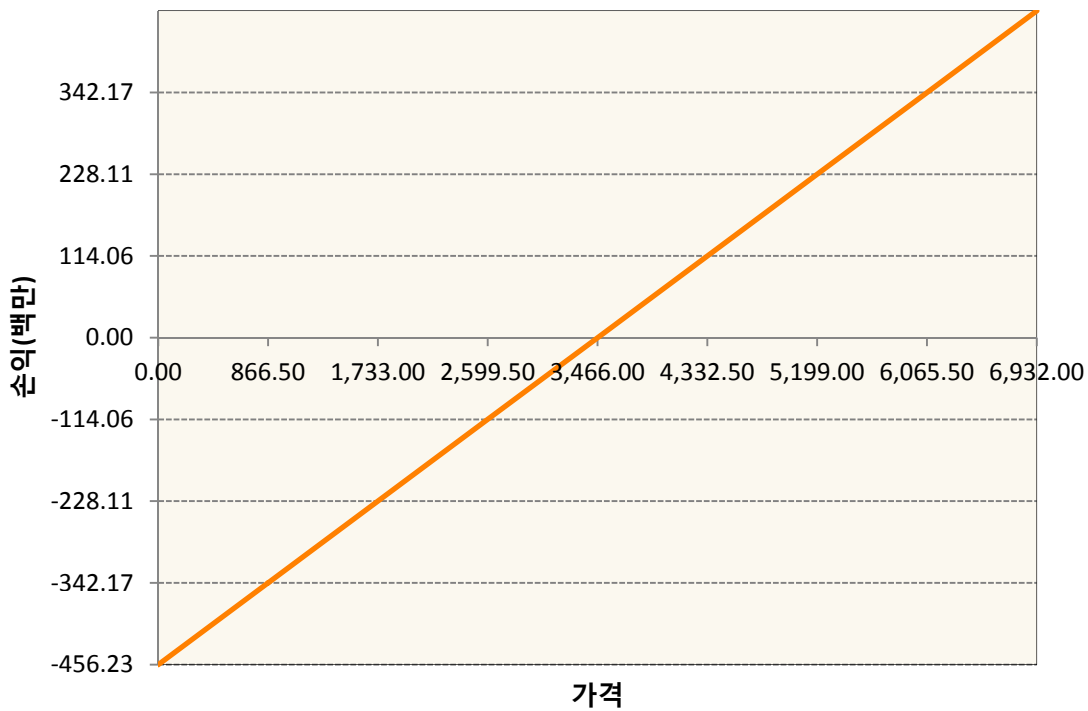
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	456	0	456	

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	2019-07-02
기준일	2019-07-01

차이나인덱스모(주식-파생형)

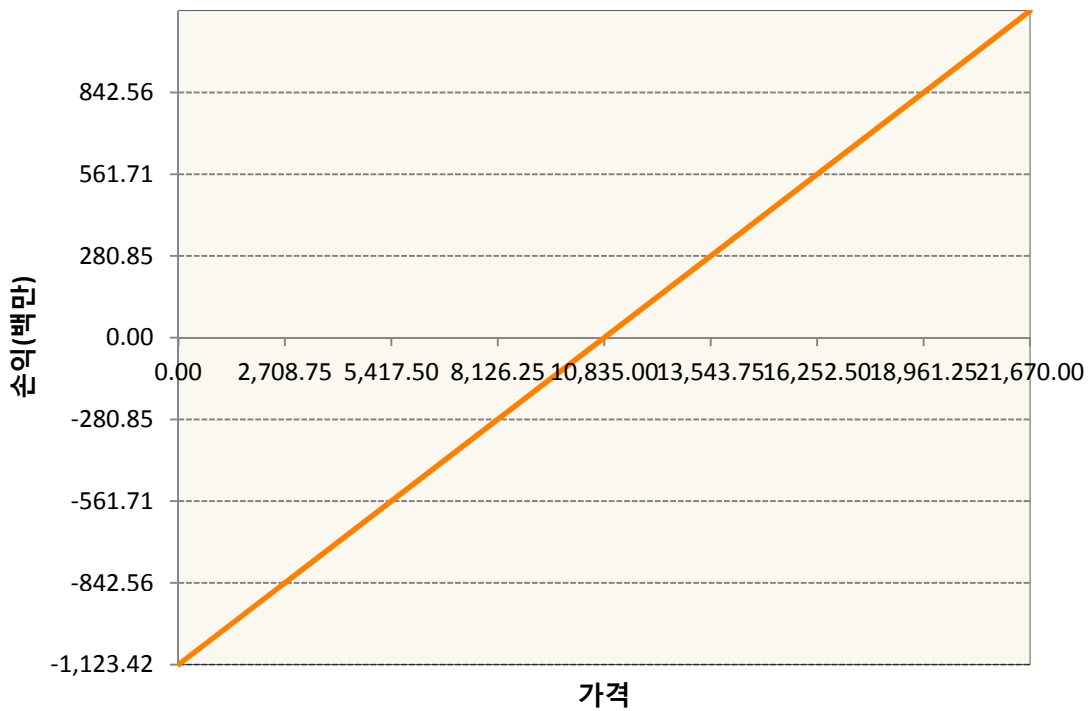
1. 계약금액

(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	2019-07-02
기준일	2019-07-01

커버드콜모(주식혼합-파생형)

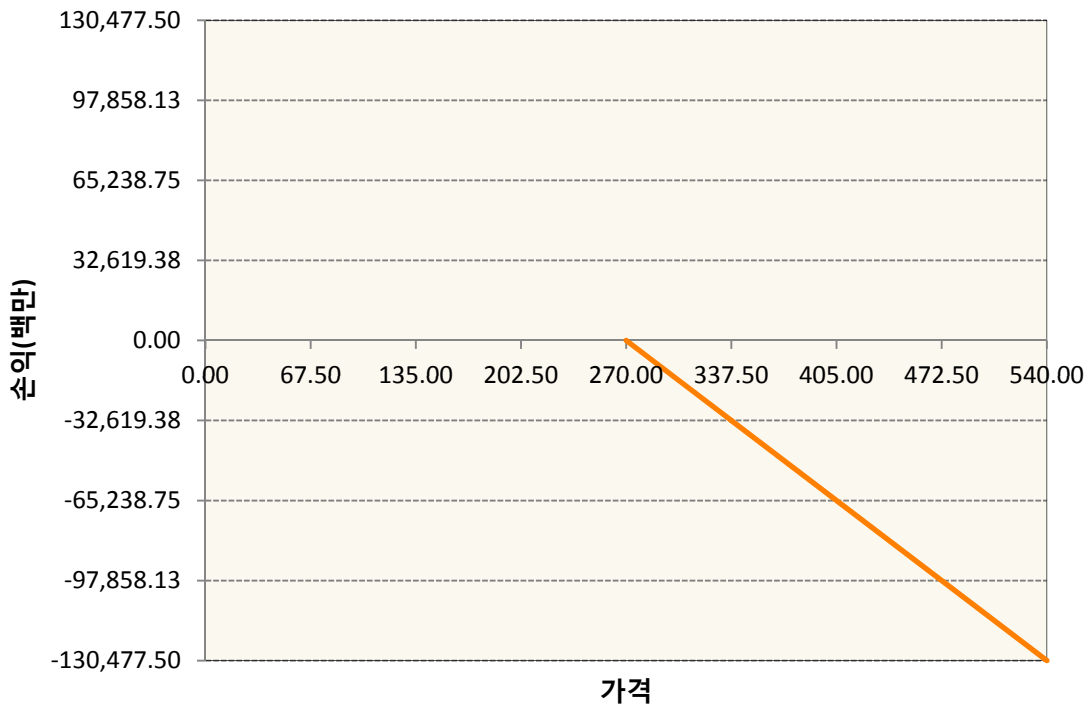
1. 계약금액

(단위:백만원)

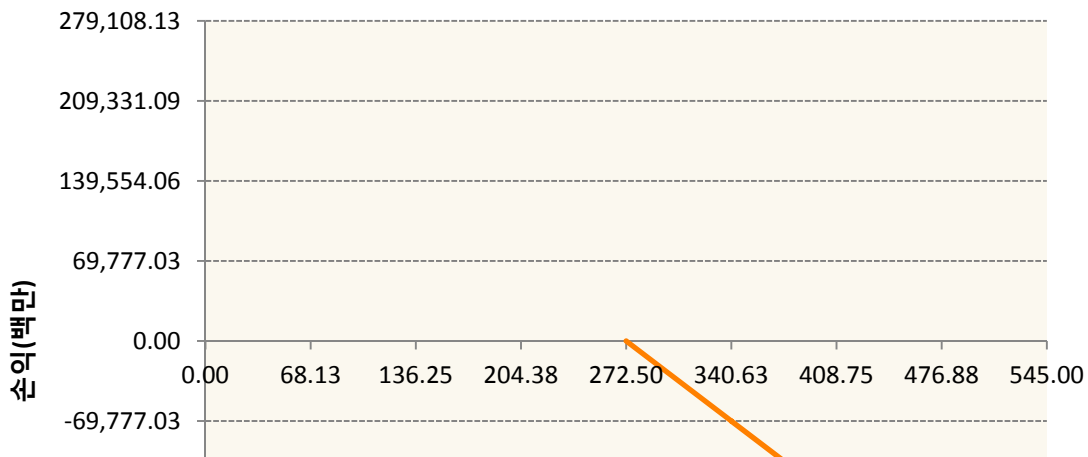
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	4,716	0	4,716	장내
누계	유가증권	옵션	0	591,498	-591,498	장내

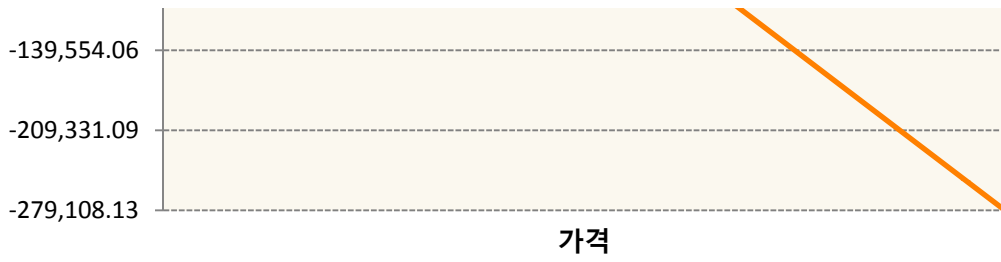
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P72700-2019-07 콜270

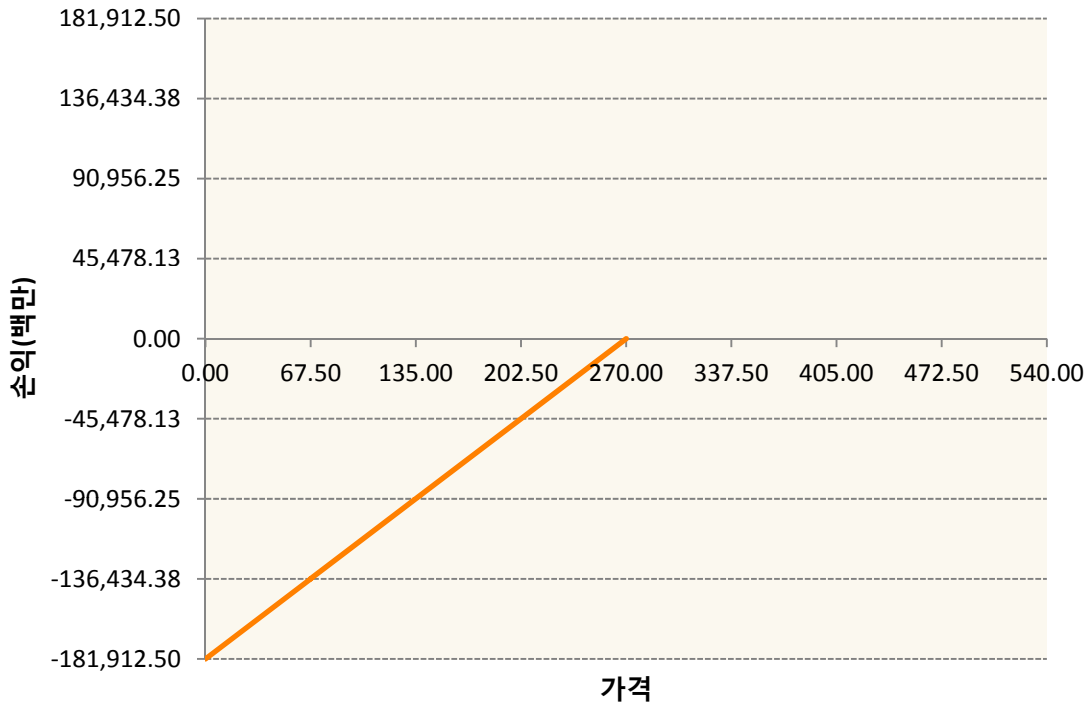


KR4201P72726-2019-07 콜272.5





KR4301P72708-2019-07 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P72700		2019-07 콜270					9,888
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,326	4,286	4,233	4,168	4,092	4,007	3,913
-5.33%	3,977	3,853	3,720	3,580	3,435	3,285	3,132
-2.67%	2,785	2,603	2,421	2,239	2,058	1,876	1,694
0%	425	291	149	0	-154	-311	-472
2.67%	-2,762	-2,815	-2,881	-2,960	-3,050	-3,150	-3,259
5.33%	-6,260	-6,271	-6,291	-6,319	-6,357	-6,405	-6,462
8.00%	-9,822	-9,824	-9,828	-9,835	-9,847	-9,864	-9,888
KR4201P72726		2019-07 콜272.5					20,247
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,465	7,413	7,339	7,242	7,122	6,982	6,821

-5.33%	7,031	6,830	6,605	6,358	6,095	5,817	5,527
-2.67%	5,230	4,860	4,486	4,111	3,733	3,354	2,974
0%	1,053	710	358	0	-363	-730	-1,101
2.67%	-5,230	-5,398	-5,595	-5,816	-6,058	-6,318	-6,593
5.33%	-12,501	-12,548	-12,616	-12,708	-12,823	-12,961	-13,119
8.00%	-20,029	-20,037	-20,052	-20,078	-20,118	-20,174	-20,247
KR4301P72708 2019-07 풋270							9,850
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,804	-9,805	-9,808	-9,812	-9,821	-9,833	-9,850
-5.33%	-4,890	-4,931	-4,982	-5,042	-5,110	-5,186	-5,268
-2.67%	-1,045	-1,184	-1,324	-1,463	-1,602	-1,742	-1,881
0%	179	129	69	0	-77	-161	-251
2.67%	266	263	258	250	237	219	195
5.33%	267	267	266	266	265	264	261
8.00%	267	267	267	267	267	266	266

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

(단위:백만원)

41,674

공시일	2019-07-02
기준일	2019-07-01

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

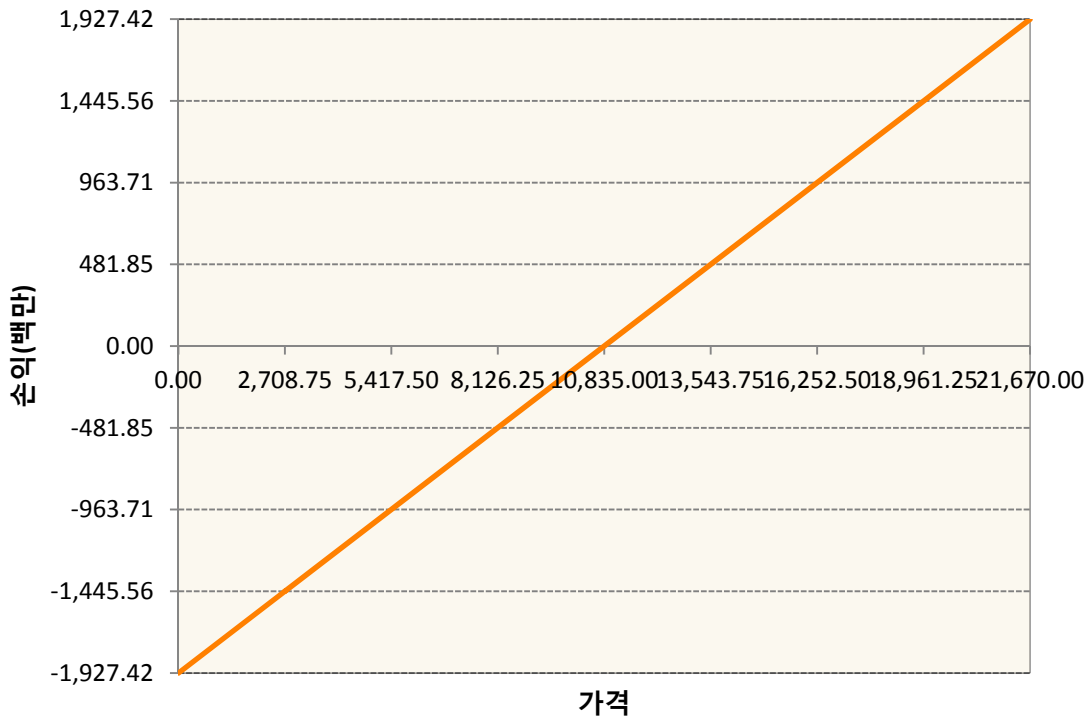
1. 계약금액

(단위:백만원)

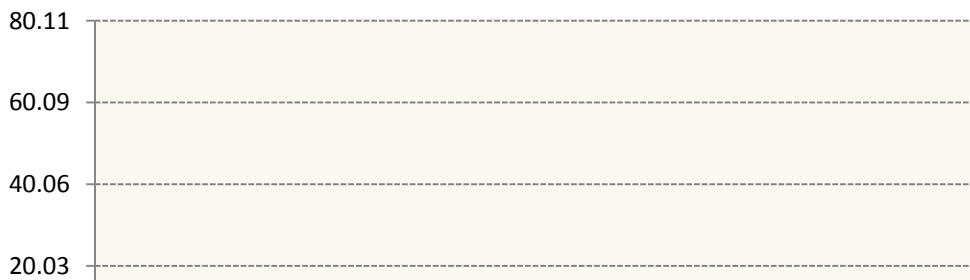
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,927	0	1,927	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,173	-5,173	장내
누계	통화	선도	148	3,116	-2,967	장외

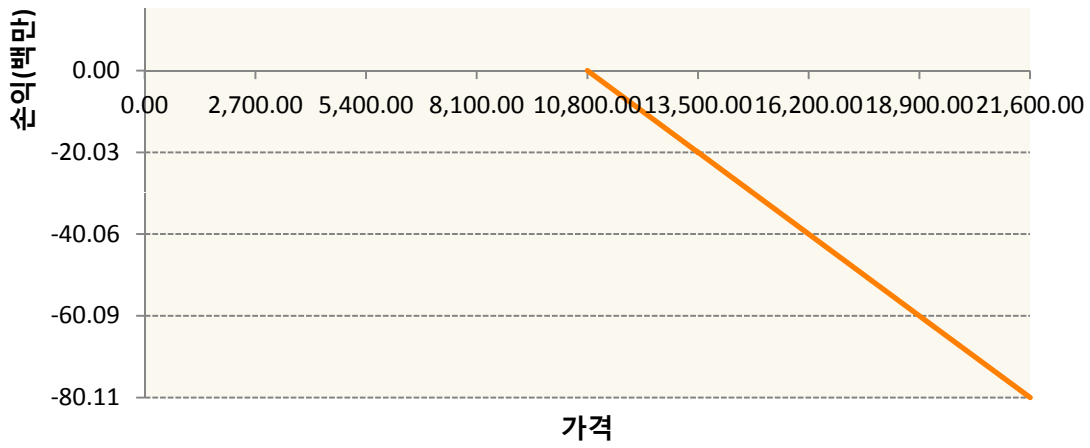
2. 만기시점의 손익구조

HCN9-HSCEI Futures Jul19

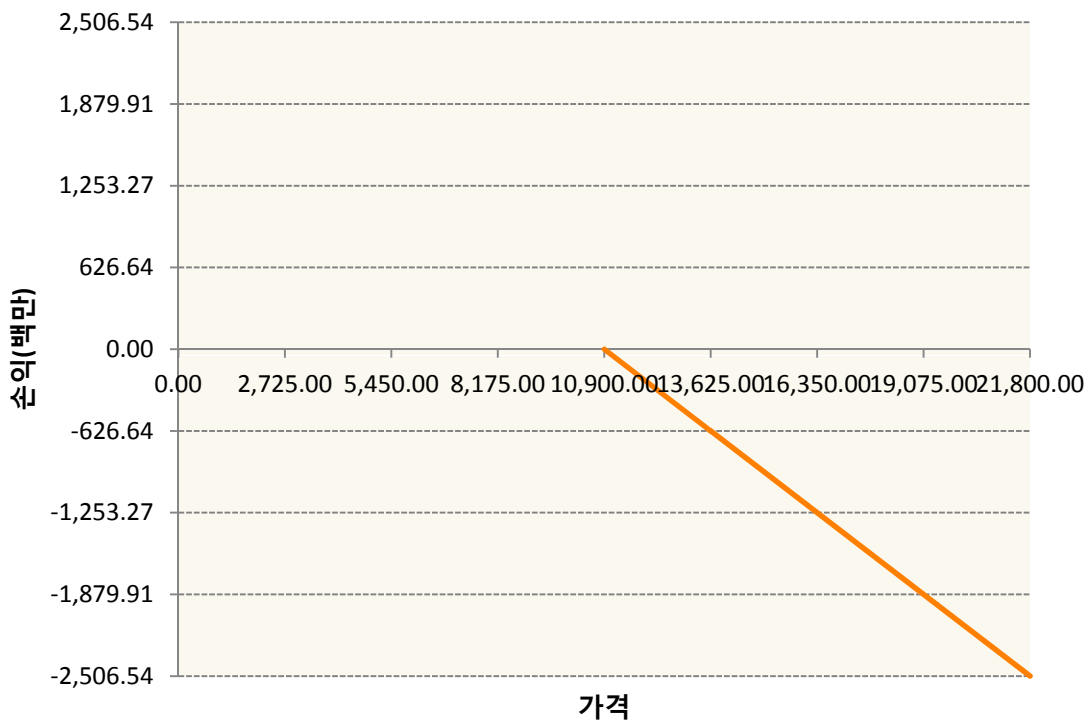


OHHIN9-C108-HSCEI

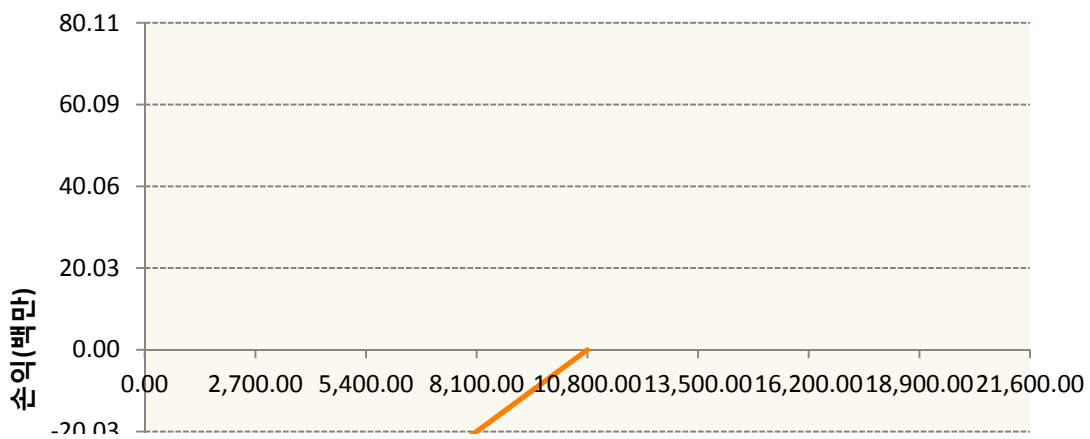


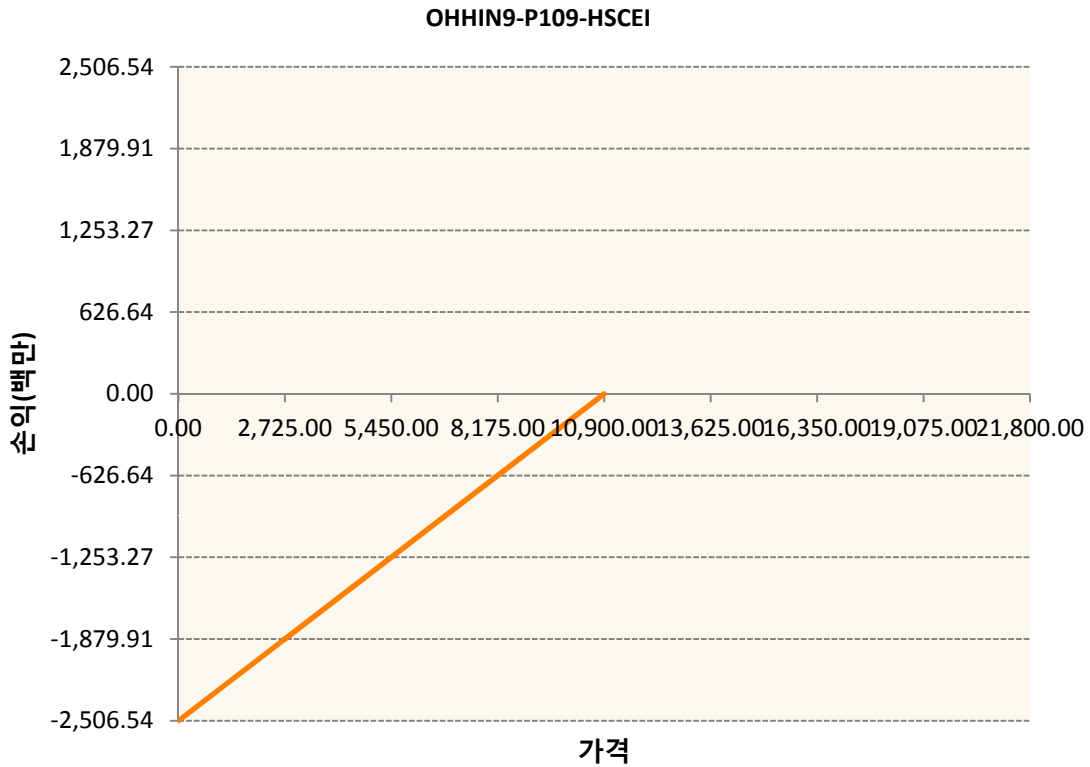


OHHIN9-C109-HSCEI



OHHIN9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	249
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E	12
HCN9 HSCEI Futures Jul19	154
OHHIN9-C1(HSCEI	6
OHHIN9-C1(HSCEI	201
OHHIN9-P1(HSCEI	6
OHHIN9-P1(HSCEI	201

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	662

공시일	2019-07-02
기준일	2019-07-01

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

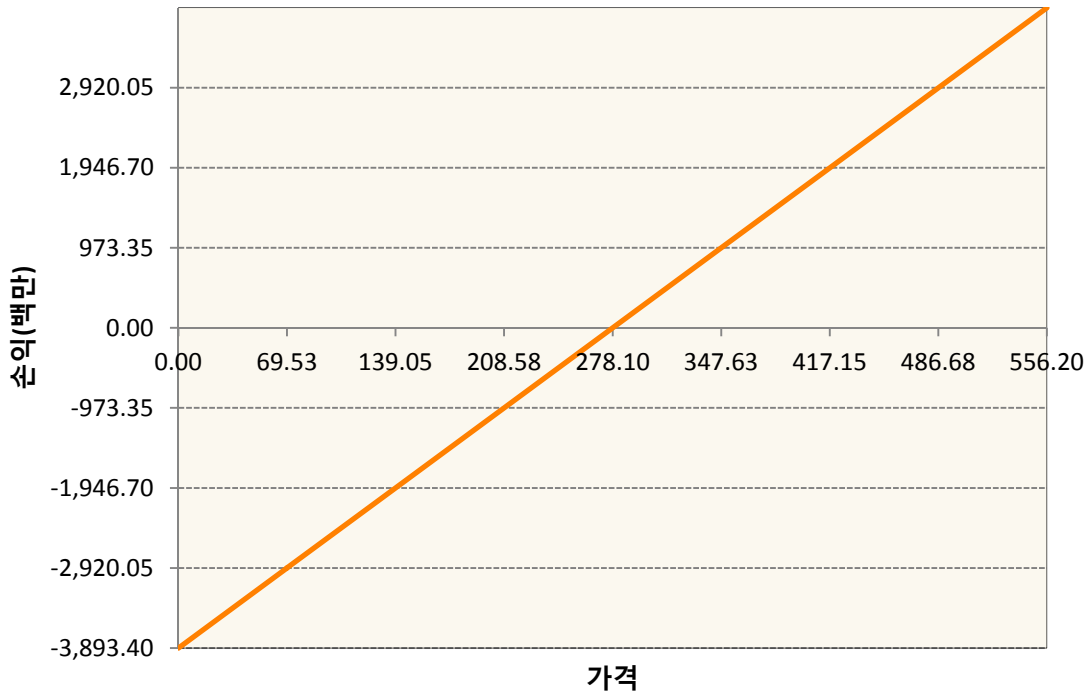
1. 계약금액

(단위:백만원)

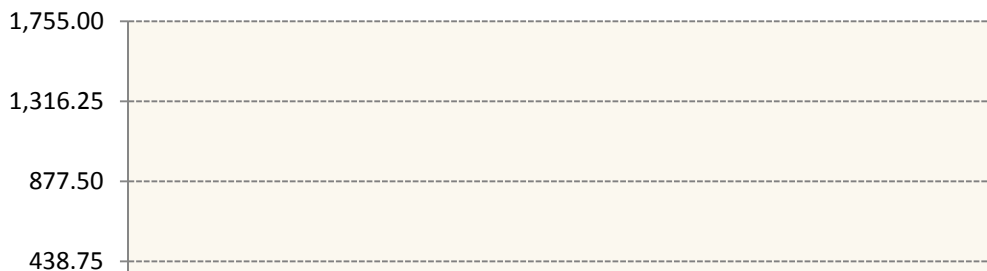
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	202	0	202	장내
누계	유가증권	선물	3,893	0	3,893	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,340	-20,340	장내

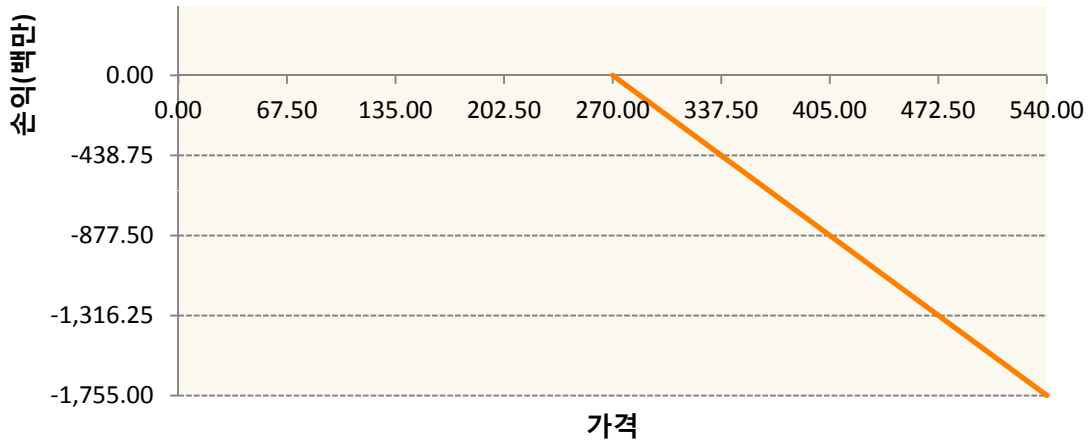
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

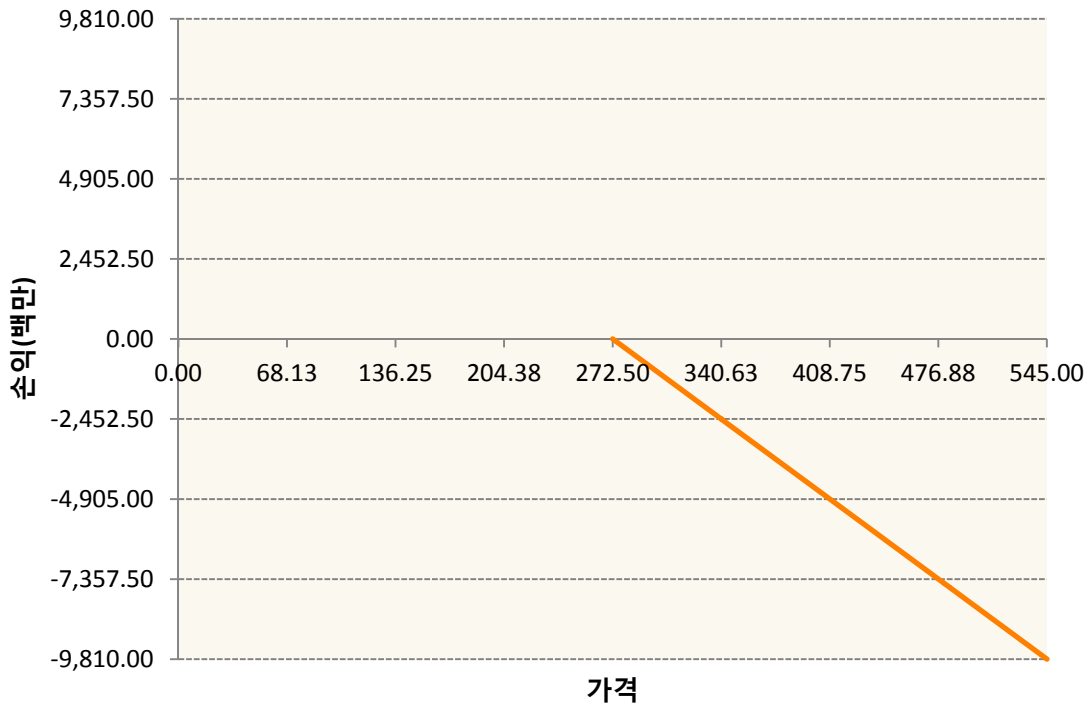


KR4201P72700-2019-07 콜270

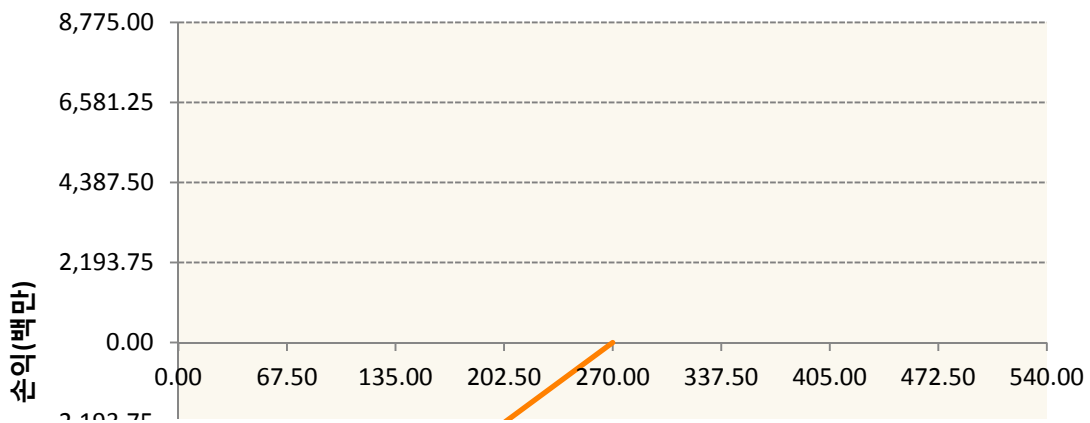




KR4201P72726-2019-07 콜272.5



KR4301P72708-2019-07 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,171
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,171	-1,171	-1,171	-1,171	-1,171	-1,171	-1,171	
-5.33%	-781	-781	-781	-781	-781	-781	-781	
-2.67%	-390	-390	-390	-390	-390	-390	-390	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	390	390	390	390	390	390	390	
5.33%	781	781	781	781	781	781	781	
8.00%	1,171	1,171	1,171	1,171	1,171	1,171	1,171	
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						133
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	58	58	57	56	55	54	53
-5.33%	53	52	50	48	46	44	42
-2.67%	37	35	33	30	28	25	23
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	-37	-38	-39	-40	-41	-42	-44
5.33%	-84	-84	-85	-85	-86	-86	-87
8.00%	-132	-132	-132	-132	-132	-133	-133
KR4201P72726 2019-07 콜272.5							712
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	262	261	258	255	250	245	240
-5.33%	247	240	232	223	214	204	194
-2.67%	184	171	158	144	131	118	105
0%	37	25	13	0	-13	-26	-39
2.67%	-184	-190	-197	-204	-213	-222	-232
5.33%	-439	-441	-443	-447	-451	-456	-461
8.00%	-704	-704	-705	-706	-707	-709	-712
KR4301P72708 2019-07 풋270							475
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-473	-473	-473	-473	-474	-474	-475
-5.33%	-236	-238	-240	-243	-247	-250	-254
-2.67%	-50	-57	-64	-71	-77	-84	-91
0%	9	6	3	0	-4	-8	-12
2.67%	13	13	12	12	11	11	9
5.33%	13	13	13	13	13	13	13
8.00%	13	13	13	13	13	13	13

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

(단위:백만원)

3,355

공시일	2019-07-02
기준일	2019-07-01

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

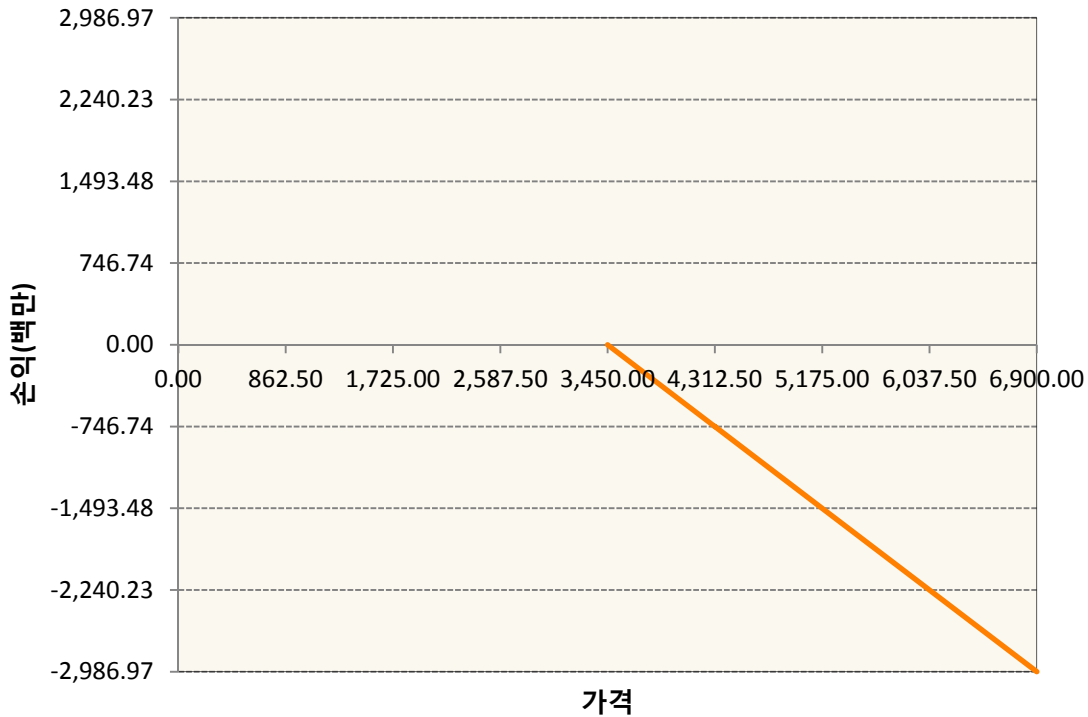
1. 계약금액

(단위:백만원)

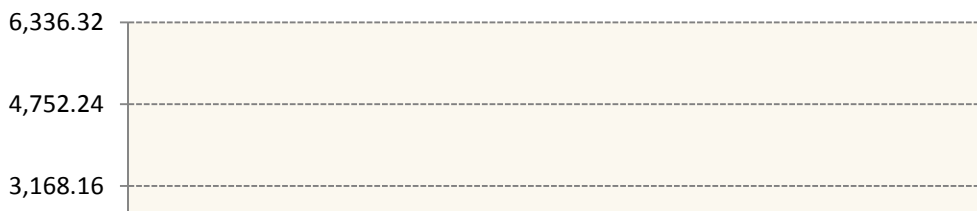
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,920	0	2,920	
누계	유가증권	스왑	55,526	0	55,526	장외
누계	유가증권	옵션	0	18,647	-18,647	장내
누계	통화	선도	0	18,365	-18,365	장외

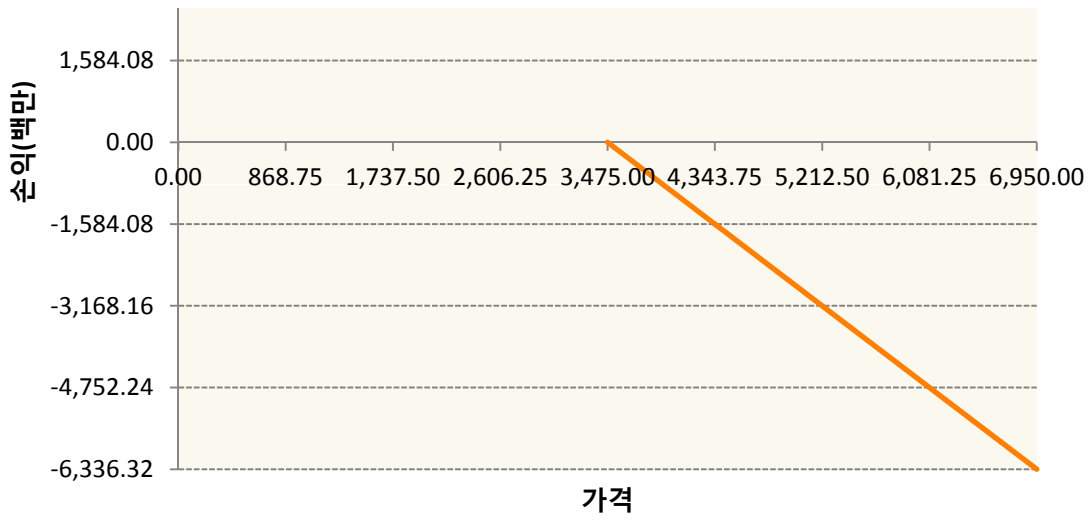
2. 만기시점의 손익구조

OESXN9-C3450-EURO STOXX 50

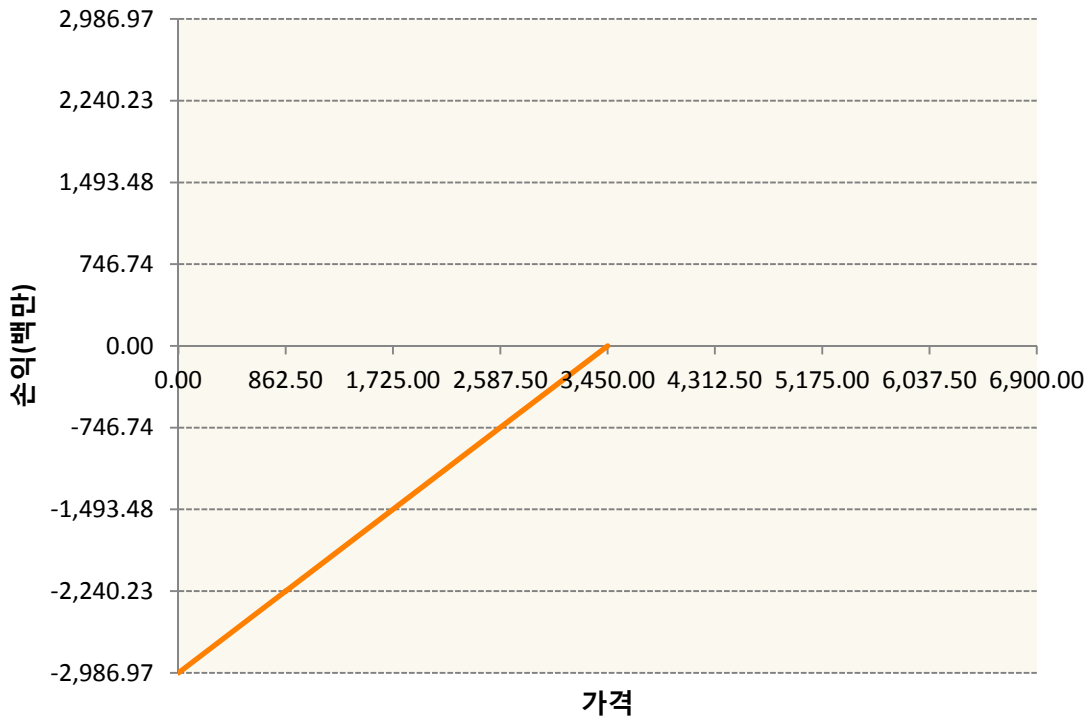


OESXN9-C3475-EURO STOXX 50

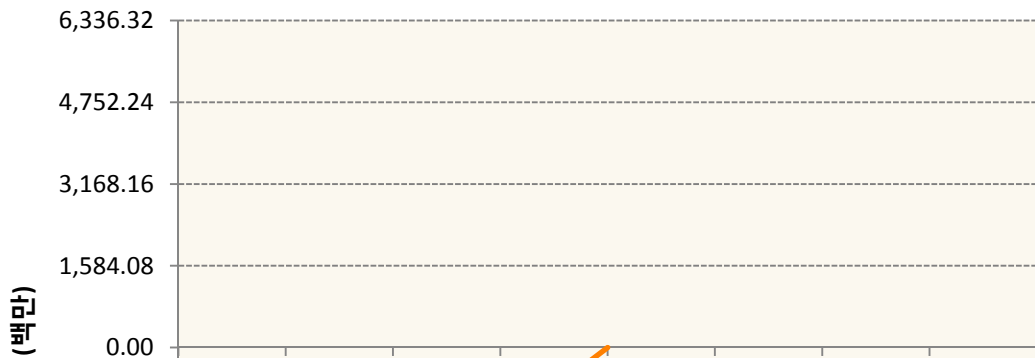


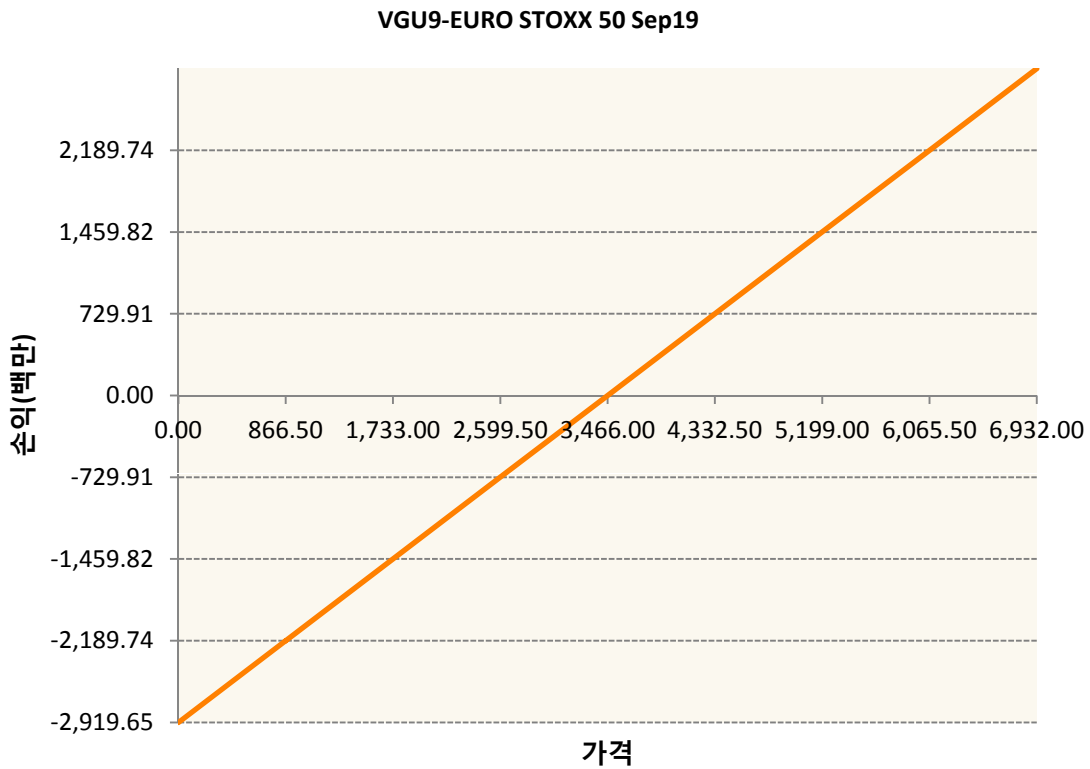
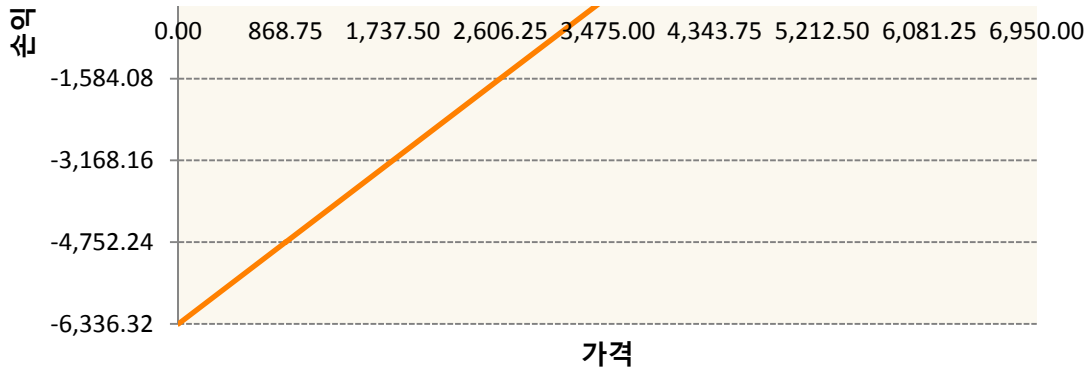


OESXN9-P3450-EURO STOXX 50



OESXN9-P3475-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		61
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E		420
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E		1,049
OESXN9-C34 EURO STOXX 50		239
OESXN9-C34 EURO STOXX 50		507
OESXN9-P34 EURO STOXX 50		239
OESXN9-P34 EURO STOXX 50		507
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19		234

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

(단위:백만원)

2,009

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

(단위:백만원)

1,040

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	2019-07-02
기준일	2019-07-01

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

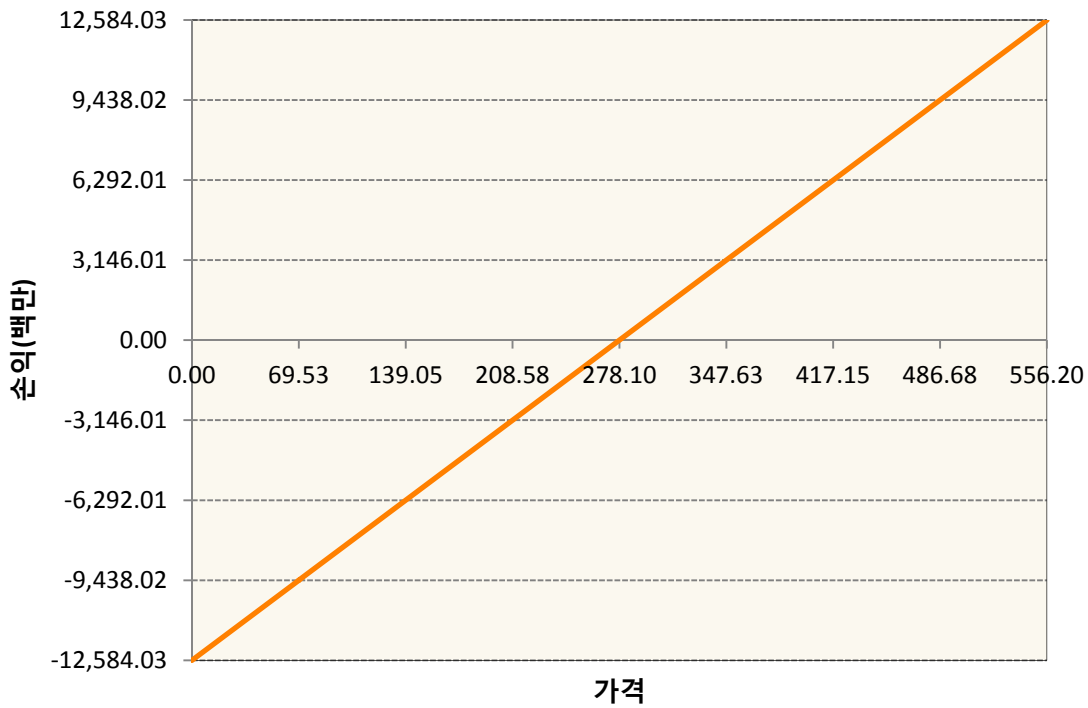
1. 계약금액

(단위:백만원)

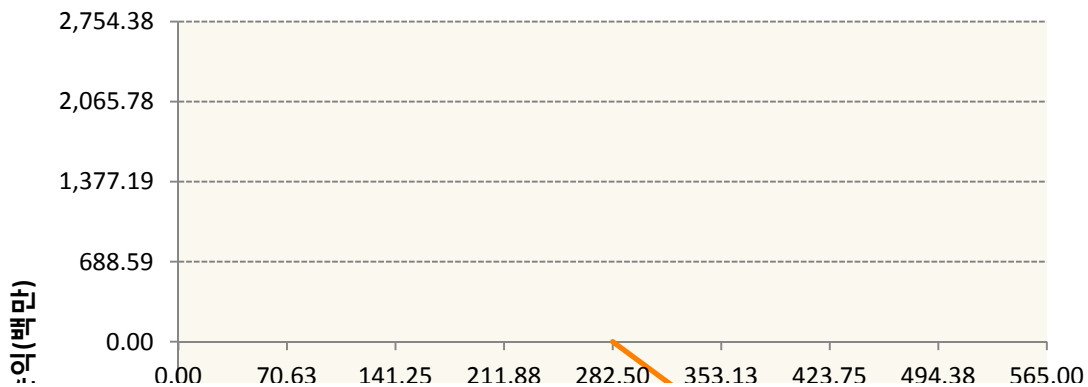
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,584	0	12,584	장내
누계	유가증권	옵션	1,084	22,134	-21,050	장내

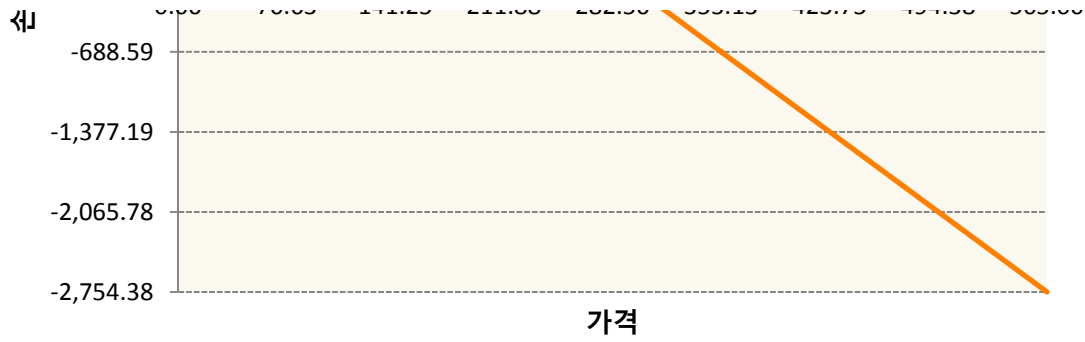
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

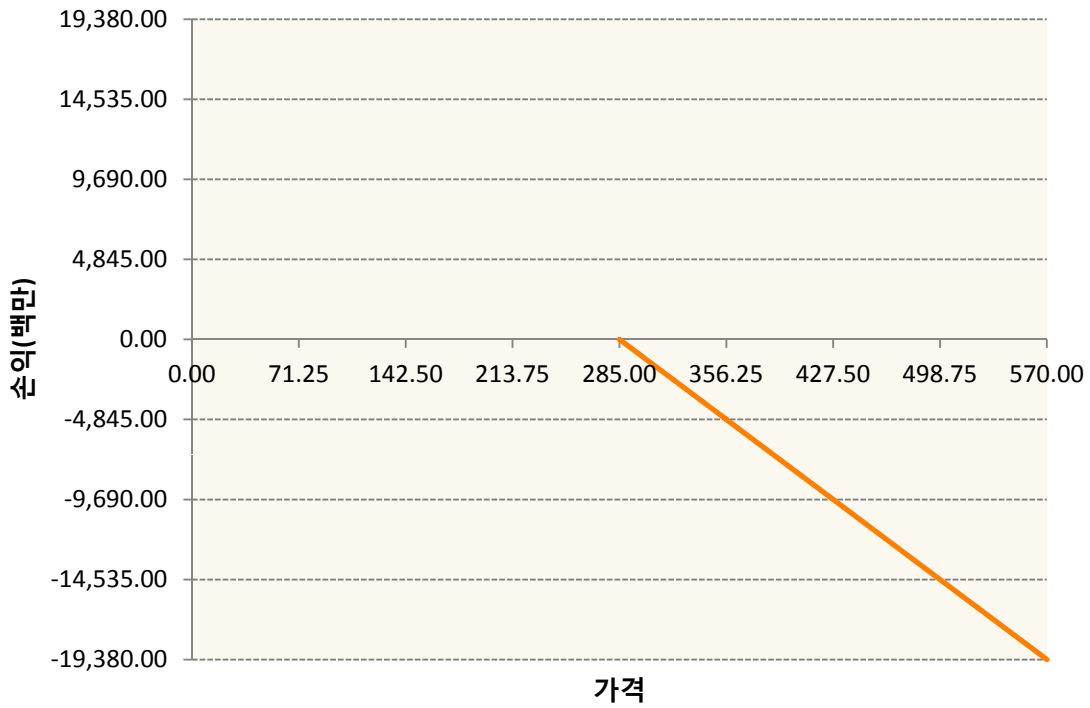


KR4201P72825-2019-07 콜282.5

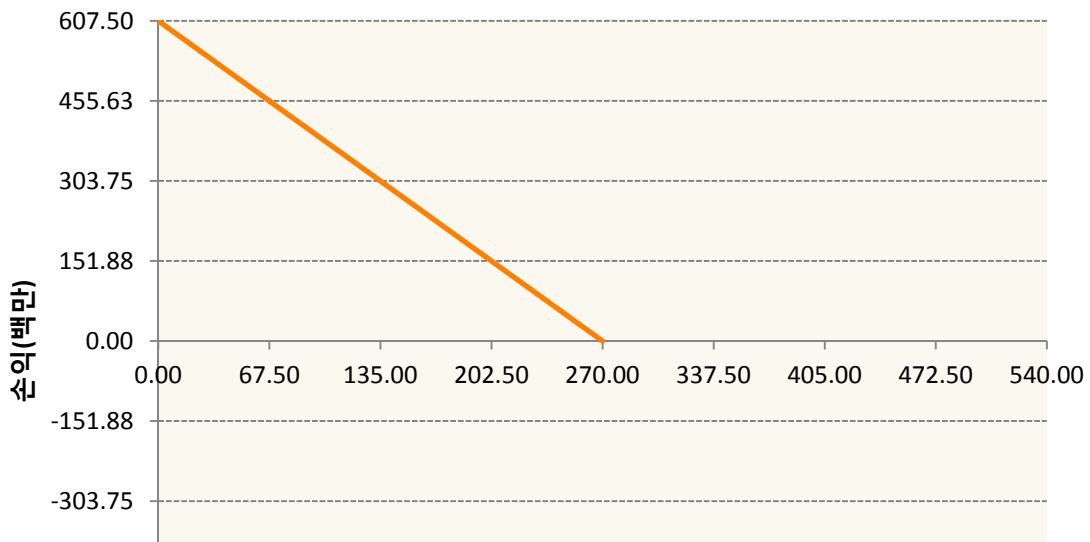


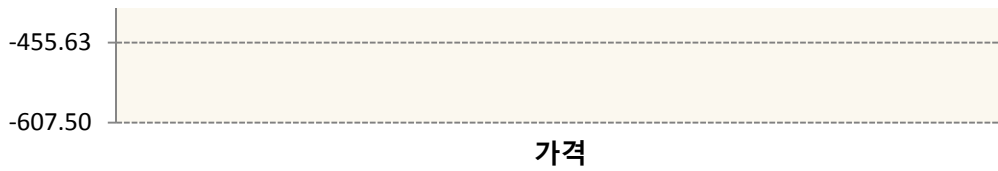


KR4201P72858-2019-07 콜285

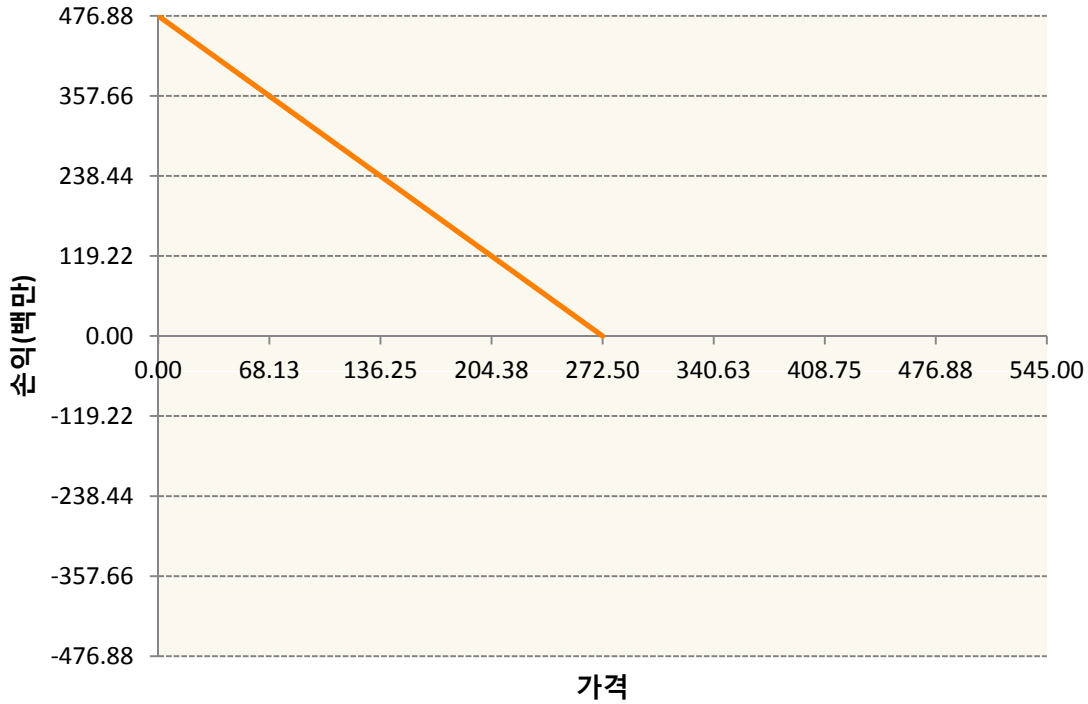


KR4301P72708-2019-07 풋270





KR4301P72724-2019-07 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						1,004
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,004	-1,004	-1,004	-1,004	-1,004	-1,004	-1,004	-1,004
-5.33%	-669	-669	-669	-669	-669	-669	-669	-669
-2.67%	-335	-335	-335	-335	-335	-335	-335	-335
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	335	335	335	335	335	335	335	335
5.33%	669	669	669	669	669	669	669	669
8.00%	1,004	1,004	1,004	1,004	1,004	1,004	1,004	1,004
KR4201P72825		2019-07 콜282.5						150
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	24	24	24	24	24	24	24	23
-5.33%	24	24	23	23	22	21	19	
-2.67%	22	20	19	17	14	12	10	

0%	10	7	3	0	-3	-7	-11
2.67%	-22	-25	-29	-33	-37	-40	-44
5.33%	-75	-77	-80	-83	-86	-89	-92
8.00%	-141	-142	-143	-145	-146	-148	-150

KR4201P72858 2019-07 콜285 954

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	123	123	122	122	121	119	117
-5.33%	122	121	119	115	111	105	98
-2.67%	113	106	97	87	75	61	47
0%	60	41	21	0	-22	-44	-67
2.67%	-108	-135	-162	-189	-216	-243	-270
5.33%	-432	-453	-475	-497	-521	-545	-569
8.00%	-872	-881	-893	-906	-920	-936	-954

KR4301P72708 2019-07 풋270 33

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	33	33	33	33	33	33	33
-5.33%	16	16	17	17	17	17	18
-2.67%	3	4	4	5	5	6	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

KR4301P72724 2019-07 풋272.5 29

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	29	29	29	29	29	29	29
-5.33%	16	16	16	16	16	17	17
-2.67%	5	5	5	6	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

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

(단위:백만원)

1,873

공시일	2019-07-02
기준일	2019-07-01

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	18,873	0	18,873	

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	2019-07-02
기준일	2019-07-01

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	59,736	0	59,736	

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	2019-07-02
기준일	2019-07-01

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	47,594	-47,594	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	348,193	0	348,193	
누계	통화	선도	0	388,916	-388,916	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		464
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		464
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		371
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		779
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		649
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		556
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		742
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		742
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		464
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		278
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		927
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		185
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		862
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		1,029
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		1,854
FX21019M0(KRW/USD 15-07-19E		464
FX21019M01KRW/USD 15-07-19E		371
FX21019M01KRW/USD 15-07-19E		649
FX21019M01KRW/USD 15-07-19E		927
FX21019M01KRW/USD 15-07-19E		649
FX21019M01KRW/USD 15-07-19E		649
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		556
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		2,967
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		2,225
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E		278
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E		278

FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	779
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	621
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	464
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E	1,854
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E	1,854
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	2,514

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

(단위:백만원)

10,193

공시일	2019-07-02
기준일	2019-07-01

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

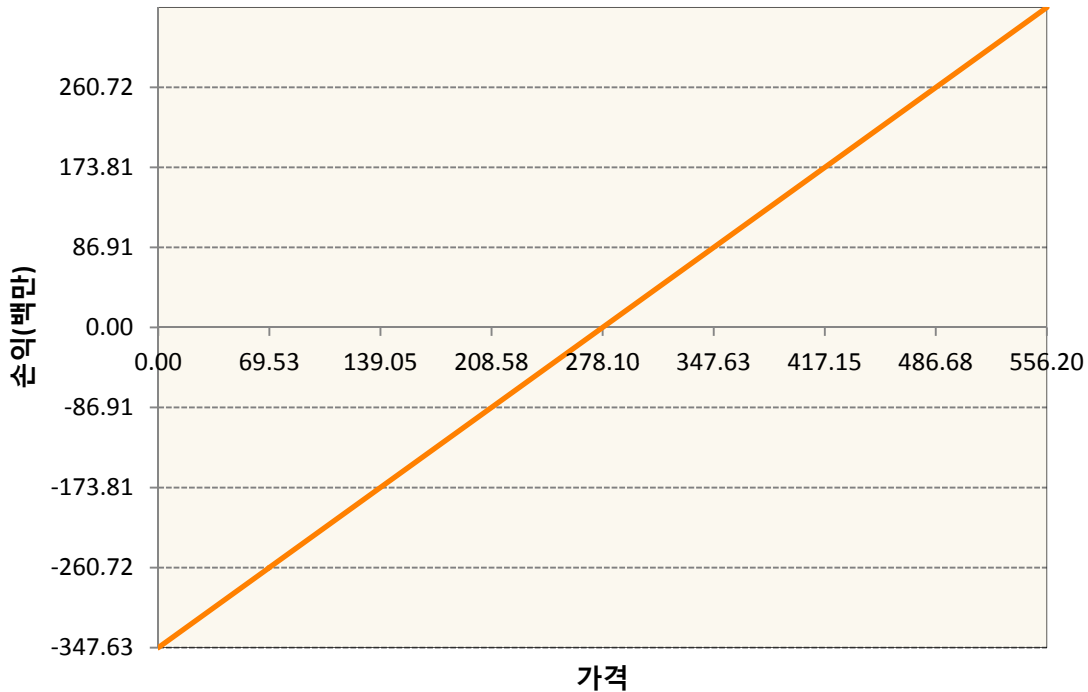
1. 계약금액

(단위:백만원)

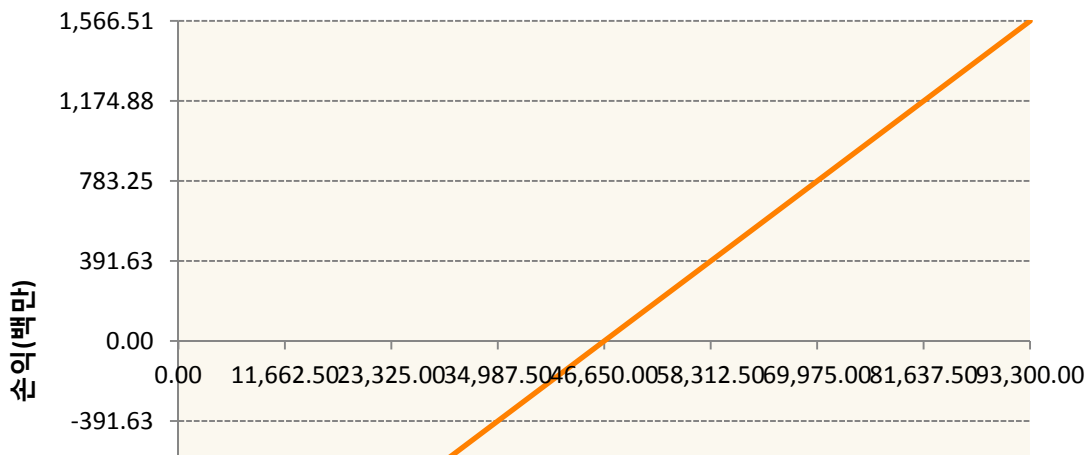
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,914	0	1,914	장내

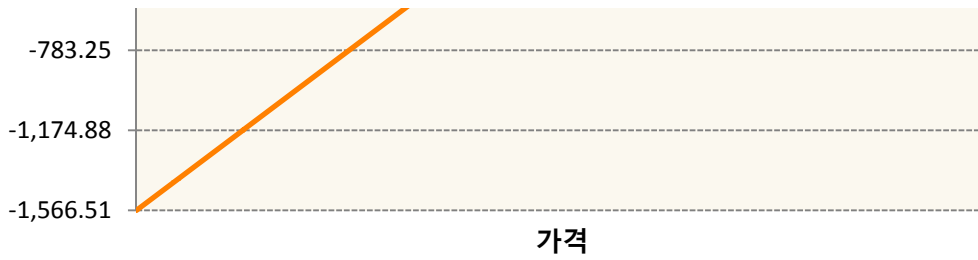
2. 만기시점의 손익구조

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						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	2019-07-02
기준일	2019-07-01

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

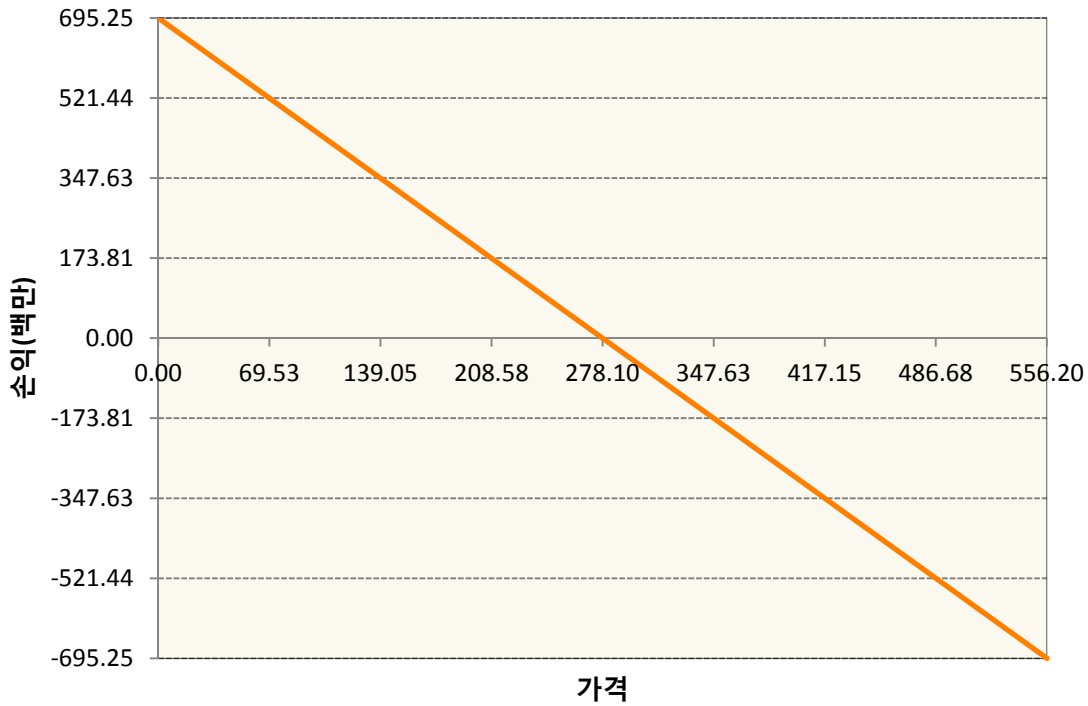
1. 계약금액

(단위:백만원)

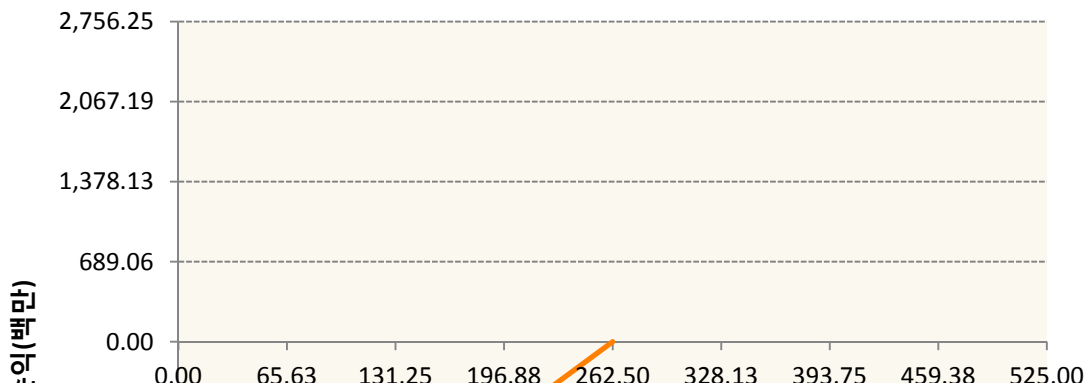
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	695	-695	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,485	-3,485	장내

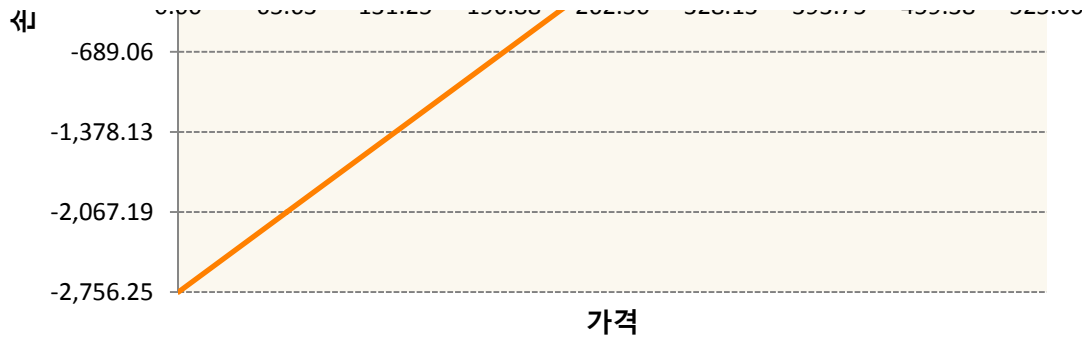
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

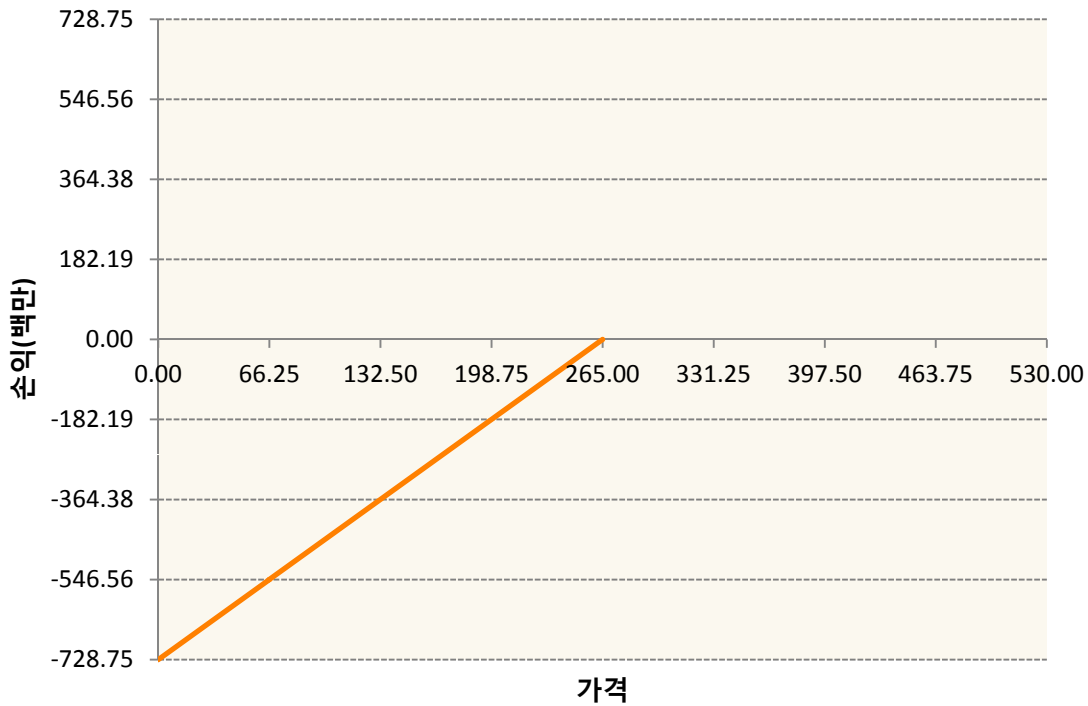


KR4301P72625-2019-07 풋262.5





KR4301P72658-2019-07 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						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						85
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-79	-80	-80	-81	-82	-83	-85
-5.33%	-19	-21	-23	-25	-28	-30	-32
-2.67%	-1	-2	-2	-3	-5	-6	-7
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

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	-28	-28	-28	-28
-5.33%	-9	-10	-10	-11	-11	-12	-12
-2.67%	-1	-1	-2	-2	-2	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
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)

81

공시일	2019-07-02
기준일	2019-07-01

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	3,940	-3,940	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	2019-07-02
기준일	2019-07-01

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

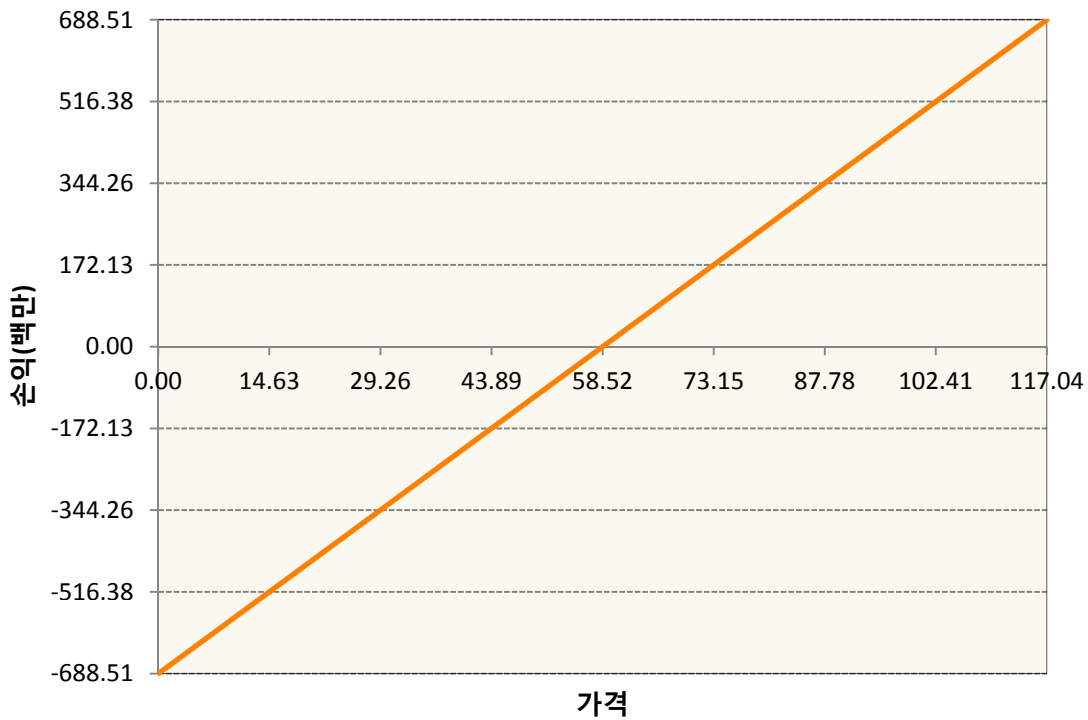
1. 계약금액

(단위:백만원)

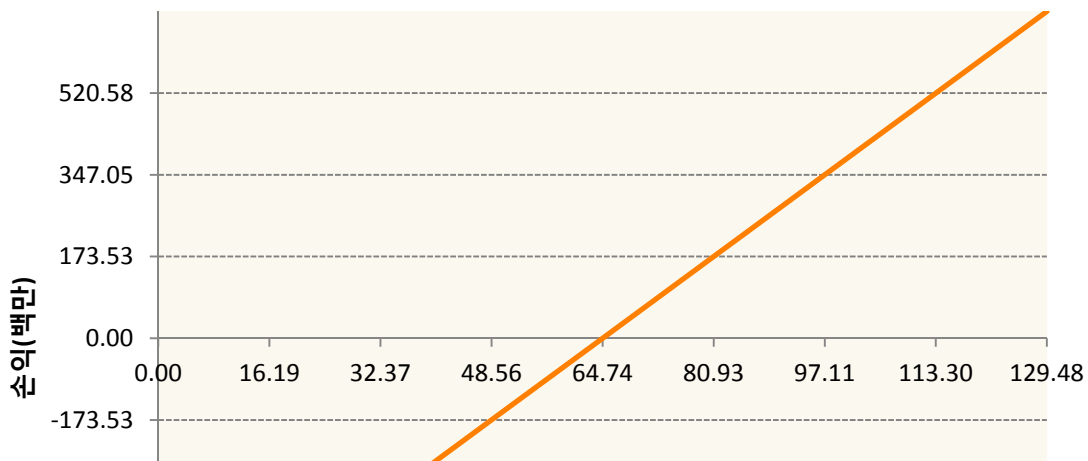
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,727	116	2,611	

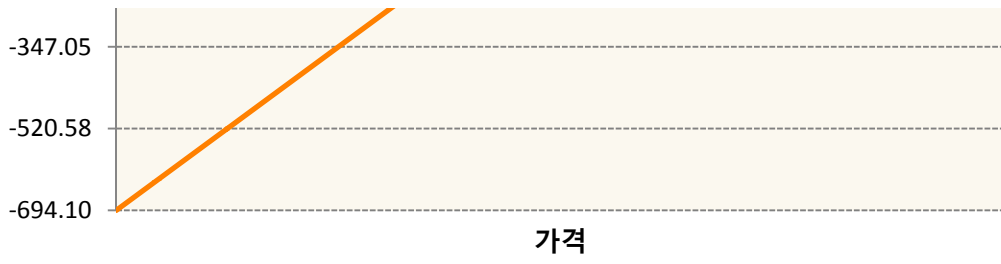
2. 만기시점의 손익구조

CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19

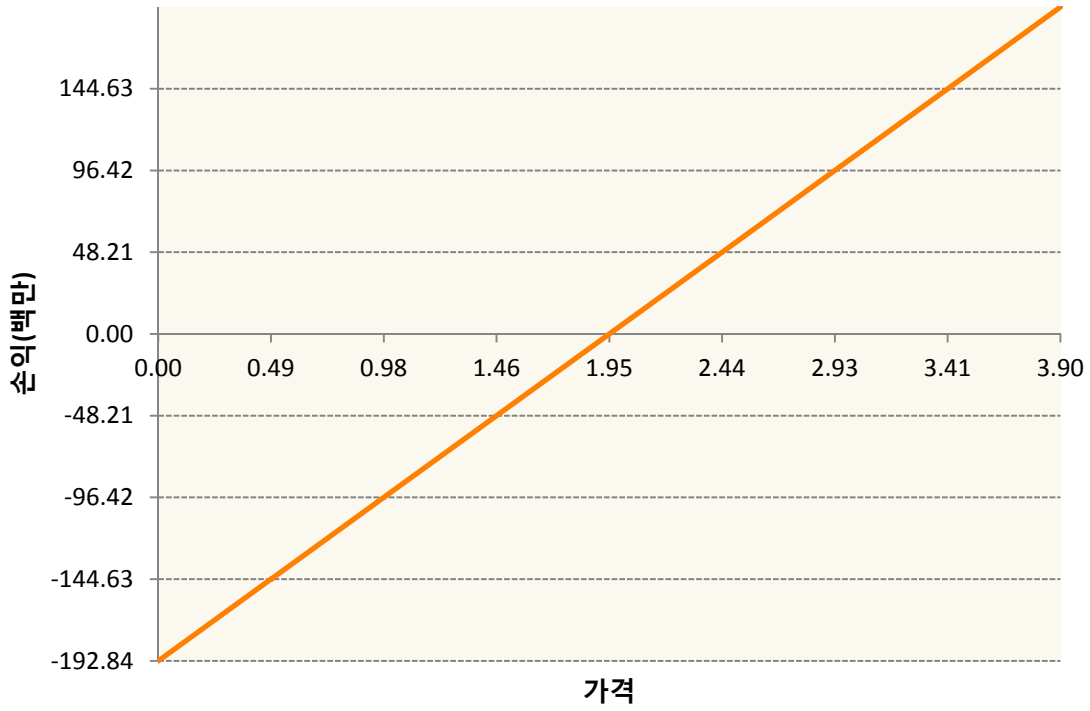


COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19

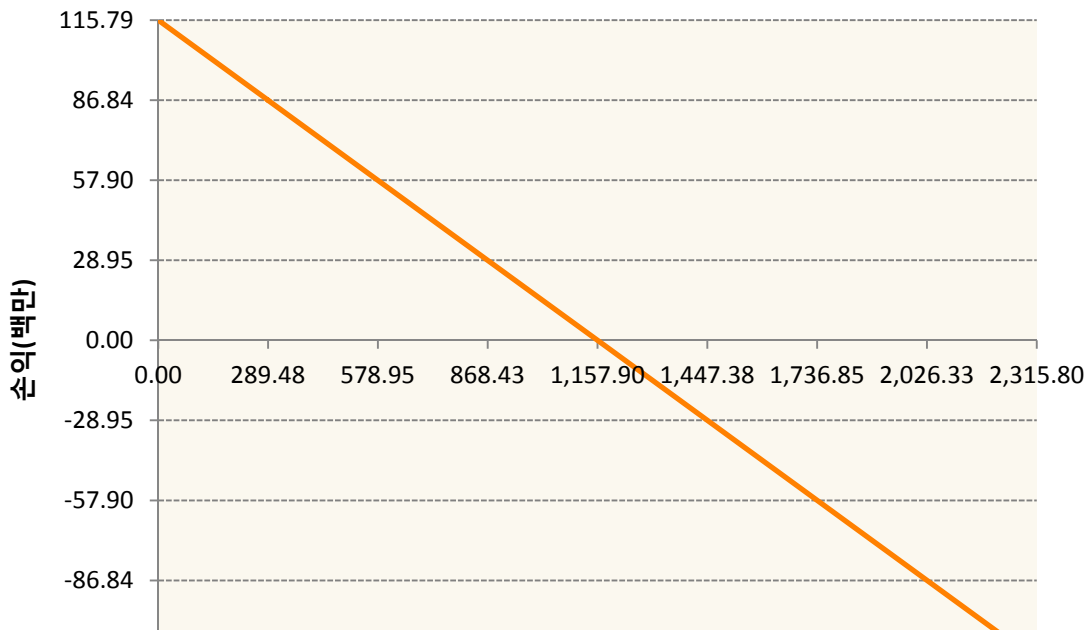


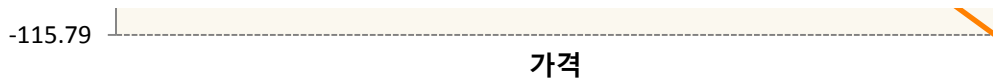


HOU9-NY Harb ULSD Fut Sep19

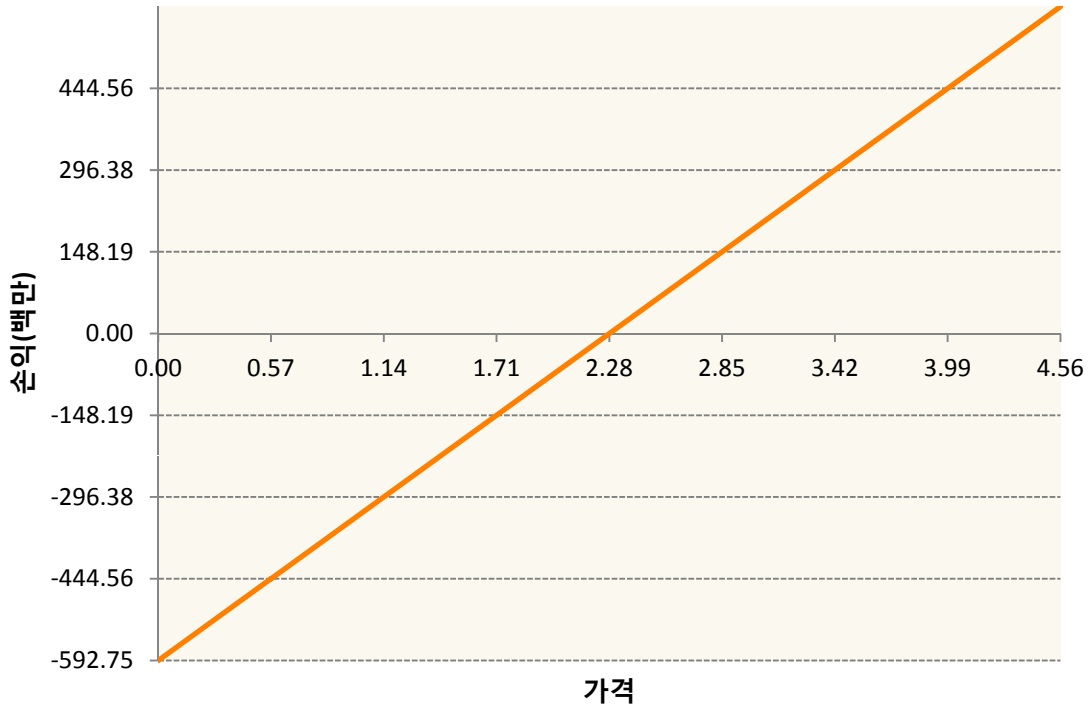


KR4175P70007-2019-07 달러선물

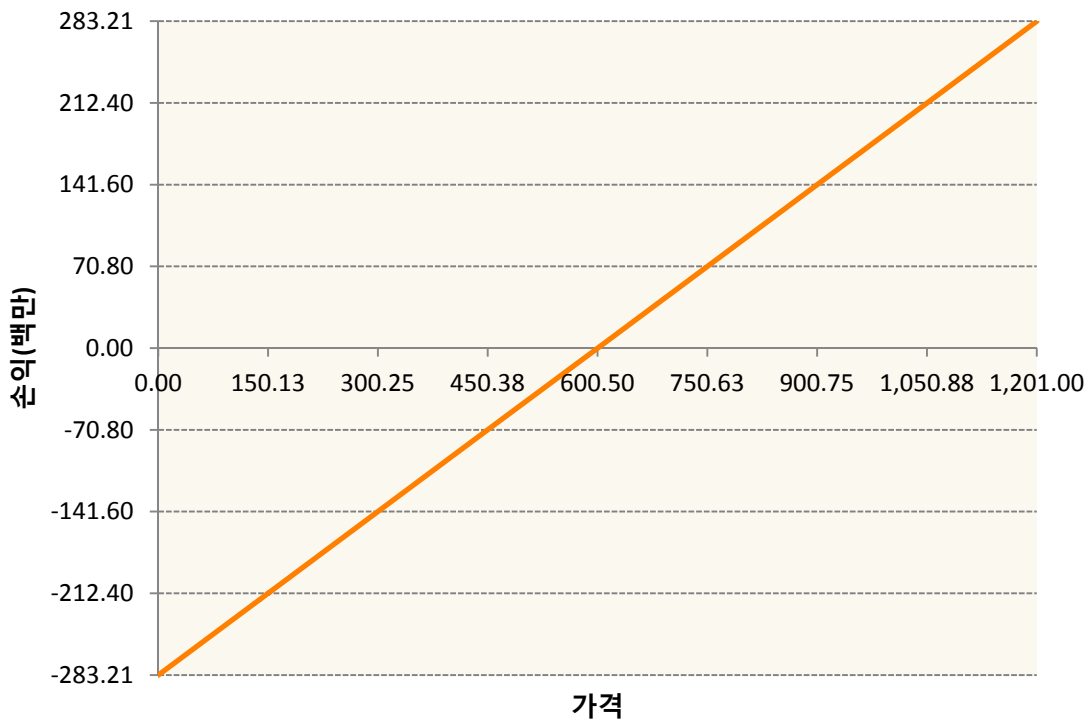




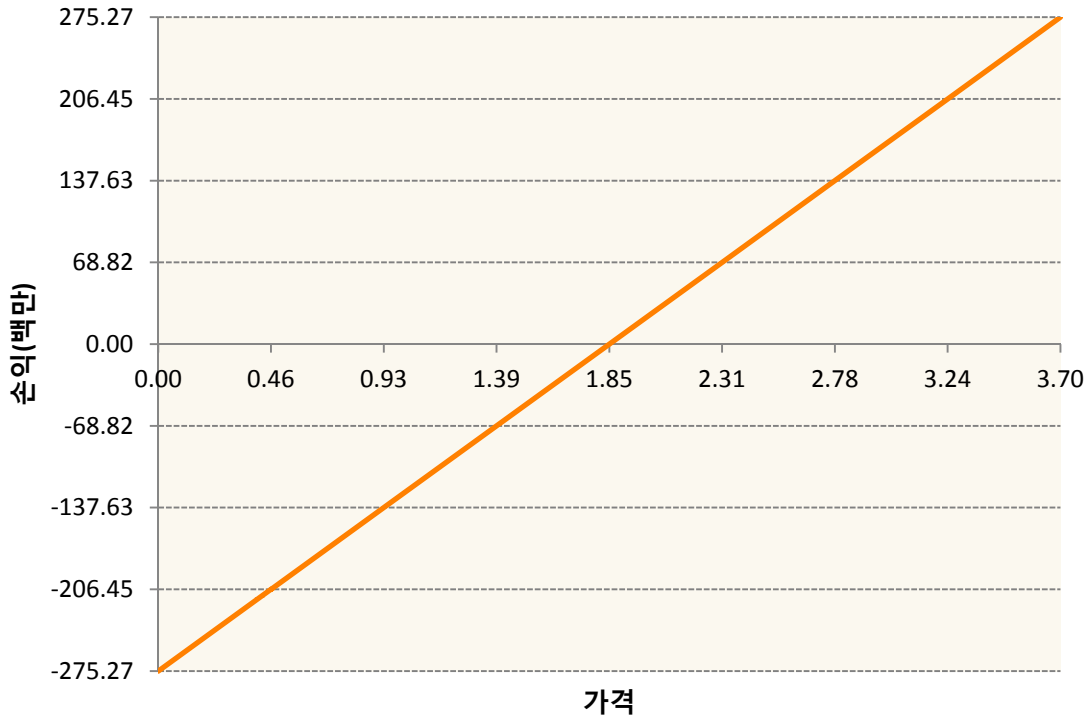
NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



QSU9-Low Su Gasoil G Sep19



XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	55
COU9	BRENT CRUDE FUTR Sep19	56
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	15
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)

405

공시일	2019-07-02
기준일	2019-07-01

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

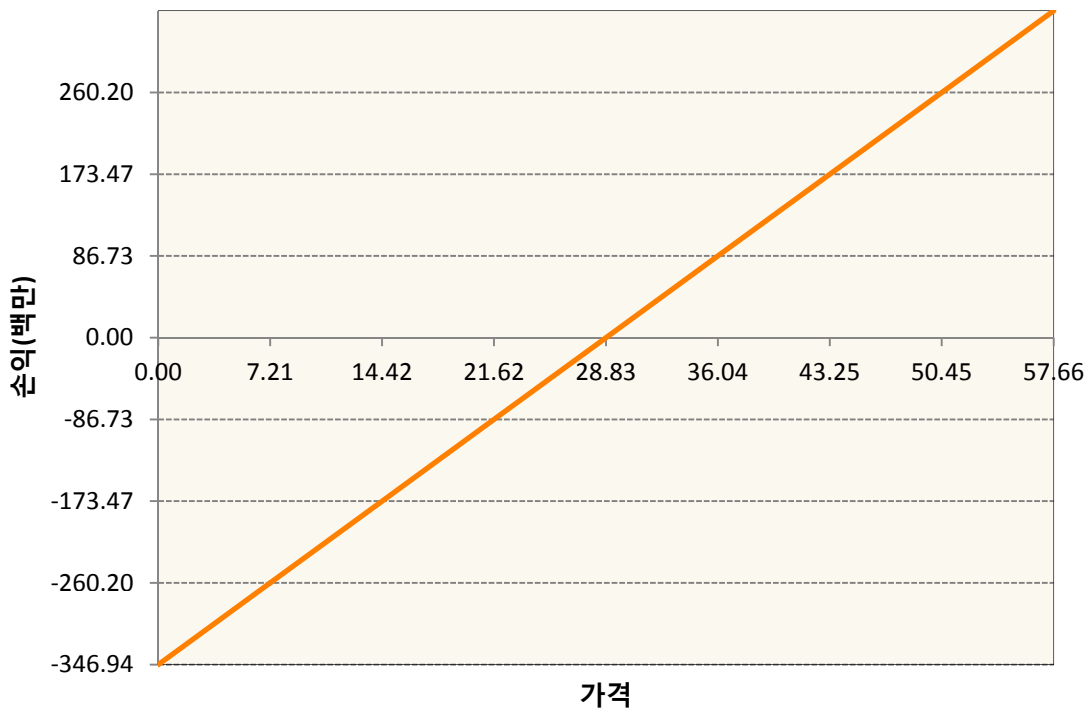
1. 계약금액

(단위:백만원)

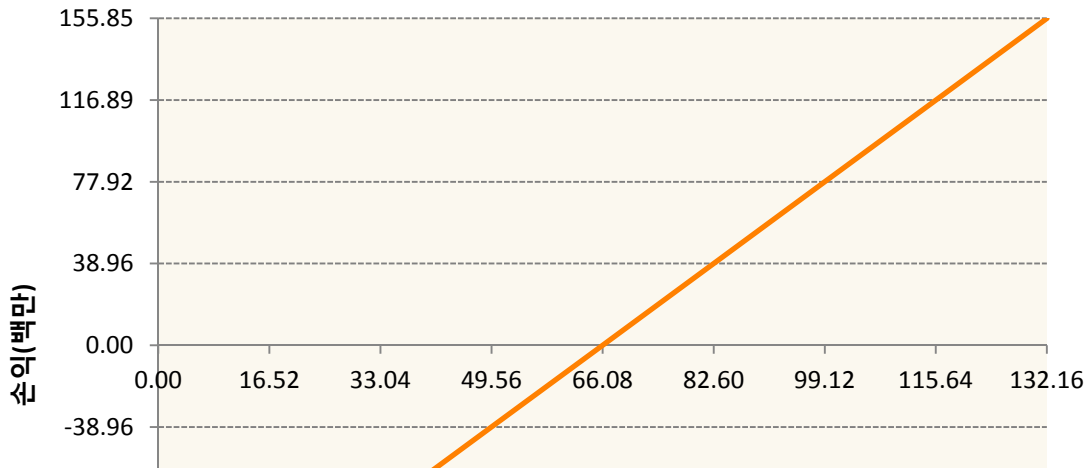
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,275	197	3,078	

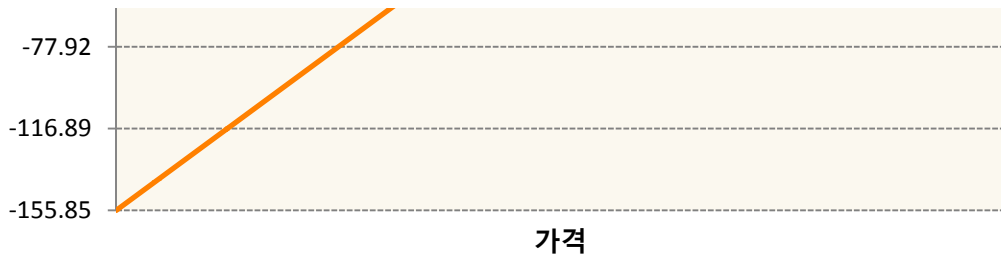
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

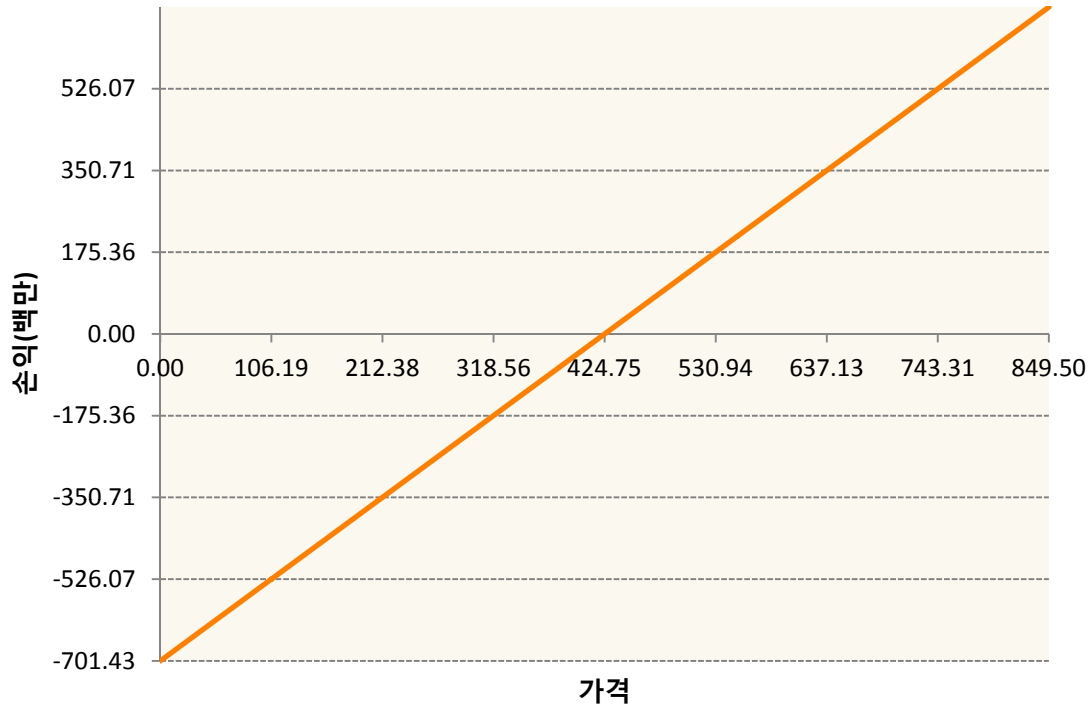


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

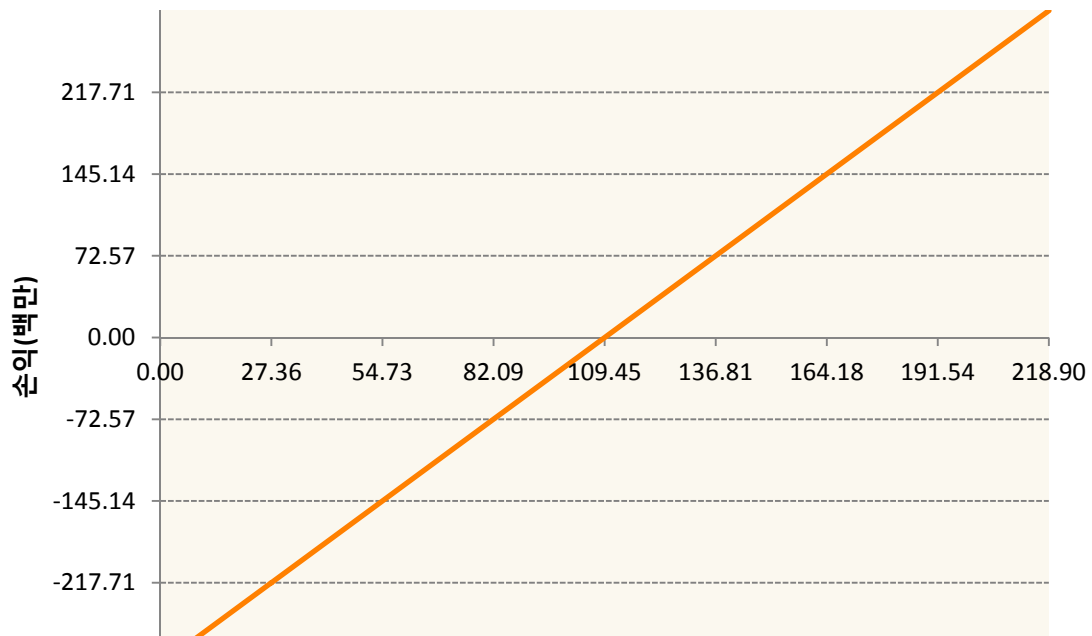


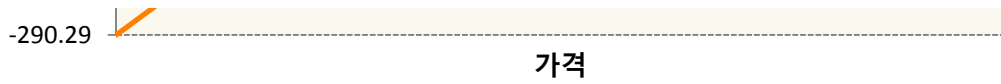


CU9-CORN FUTURE Sep19

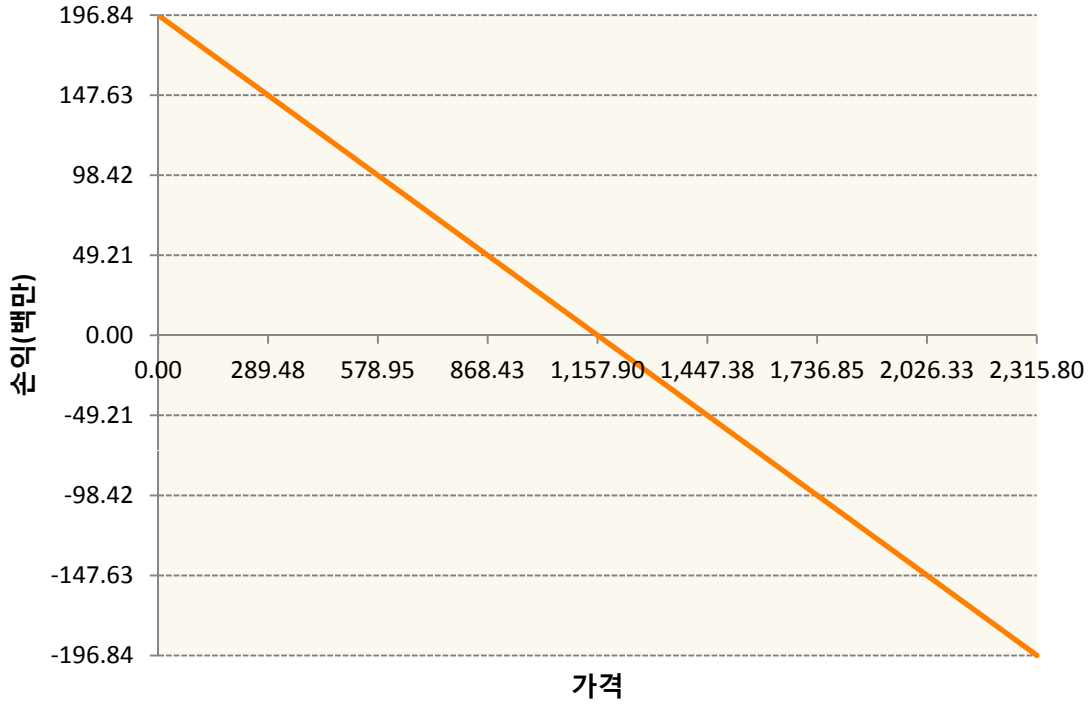


KCU9-COFFEE 'C' FUTURE Sep19

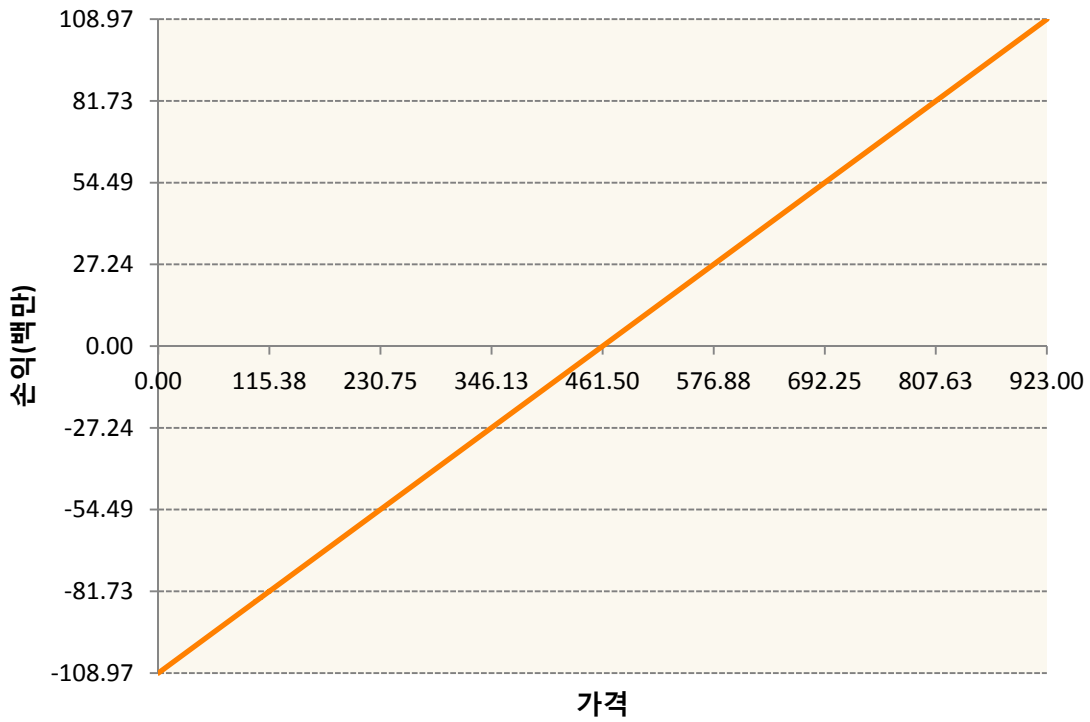




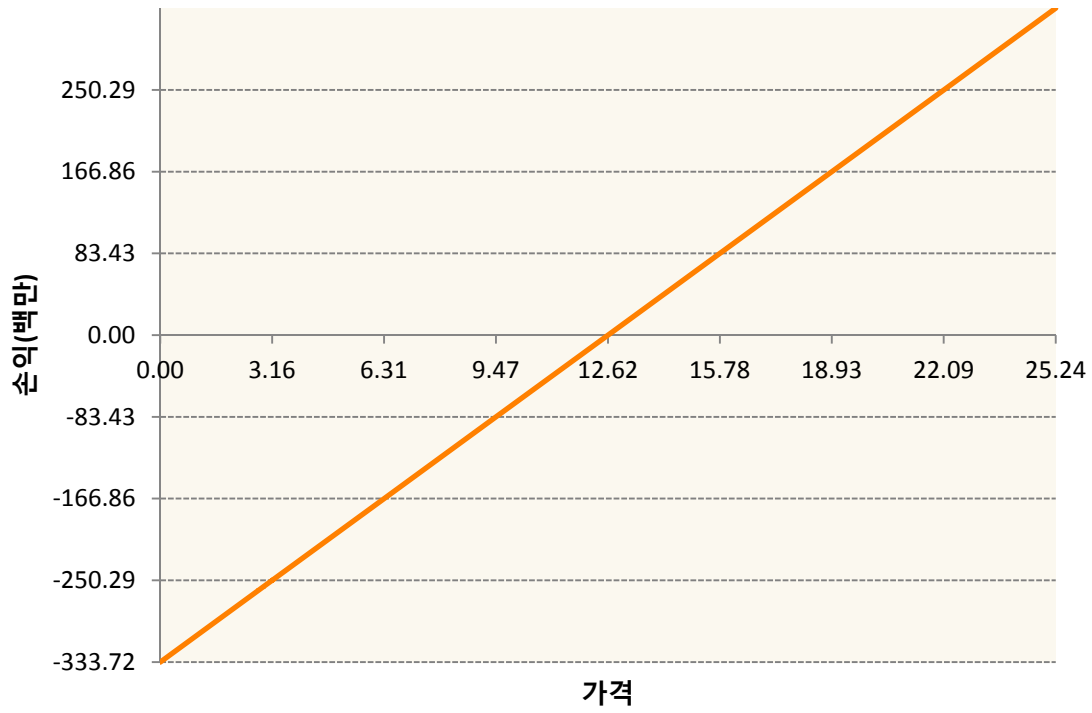
KR4175P70007-2019-07 달러선물



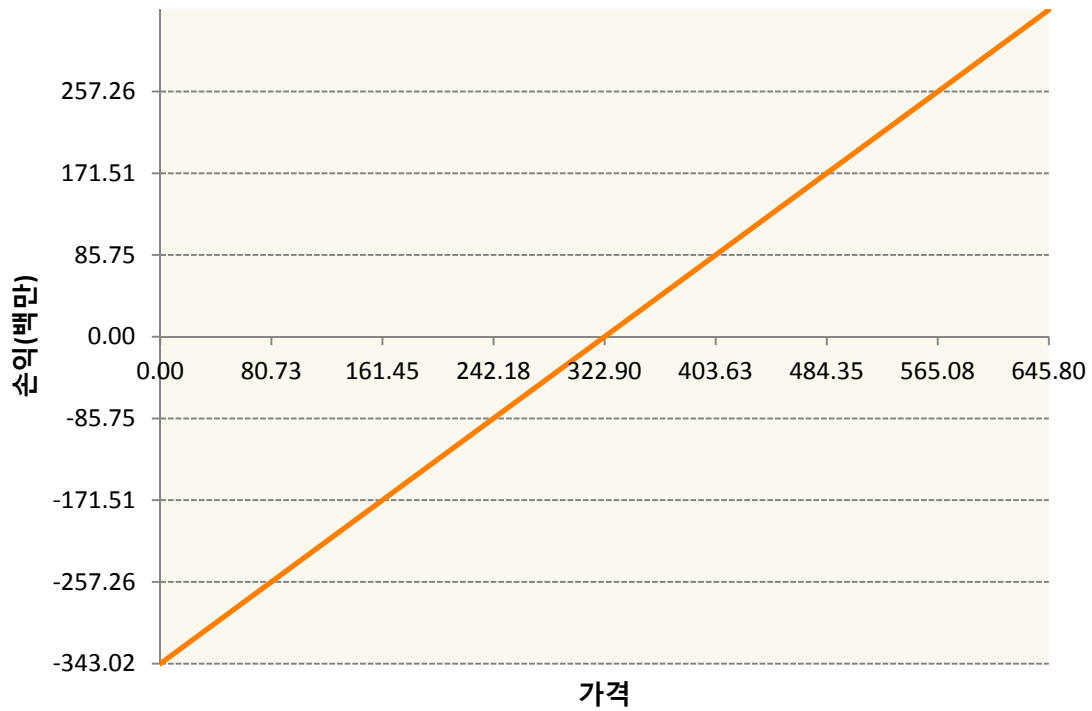
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



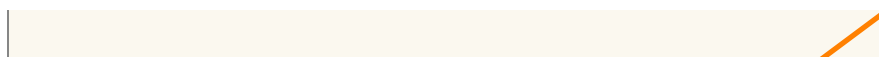
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

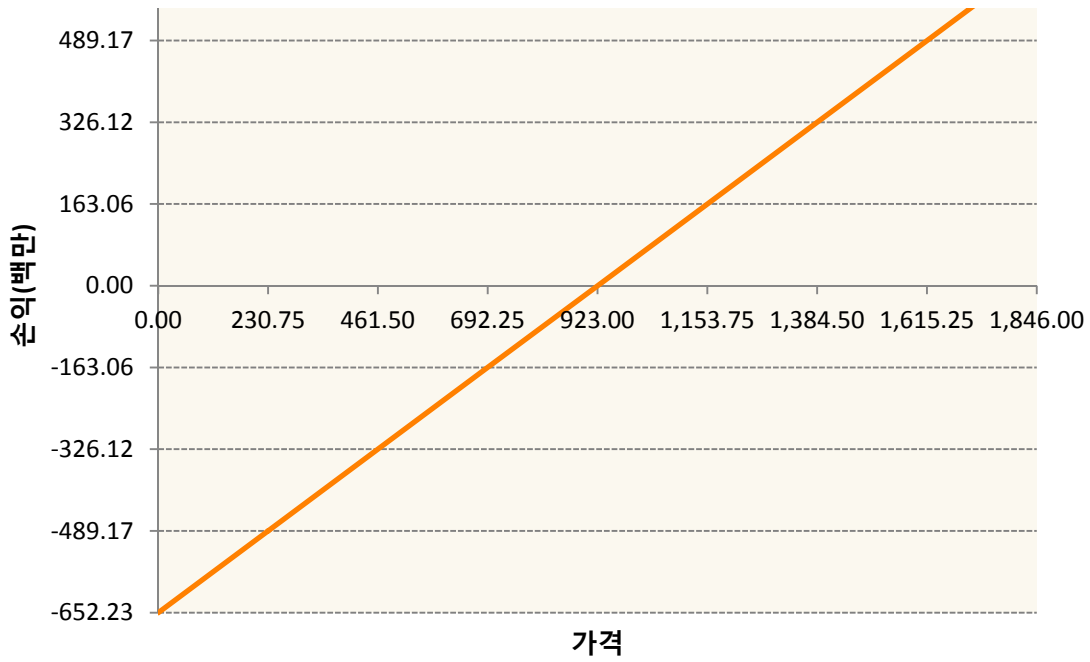


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

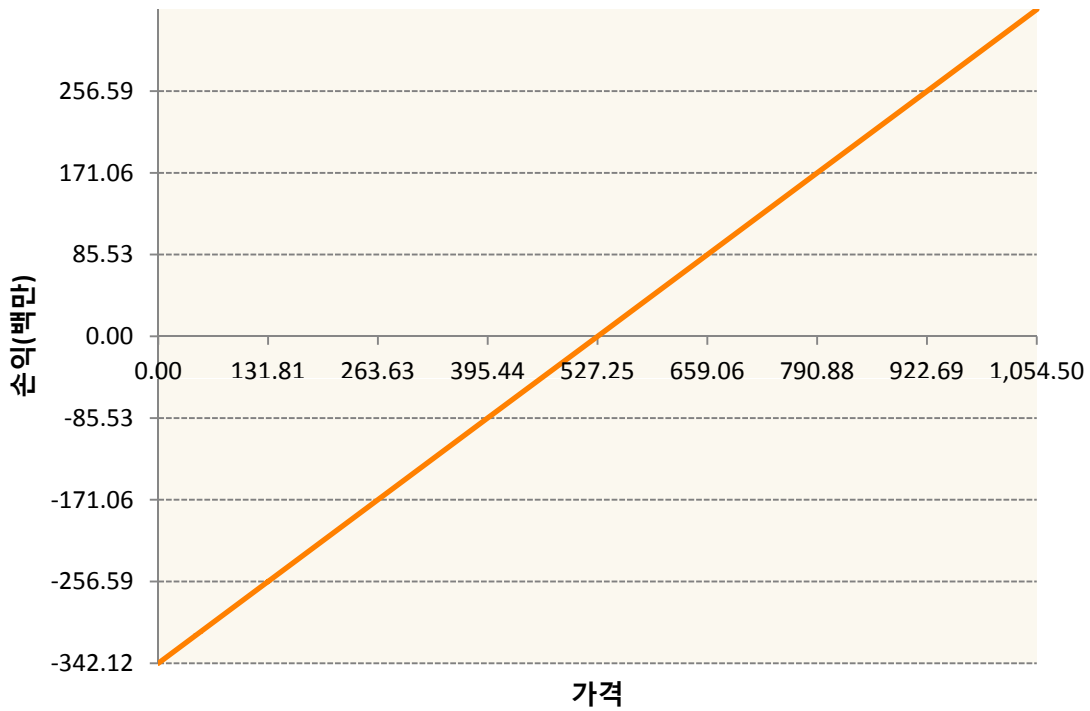


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





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	56
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	27

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

(단위:백만원)

286