

공시일	2019-07-03
기준일	2019-07-02

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	2019-07-03
기준일	2019-07-02

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

1,172

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

675

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-03
기준일	2019-07-02

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)	396
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	145

* 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	2019-07-03
기준일	2019-07-02

유로인덱스모(주식-파생형)

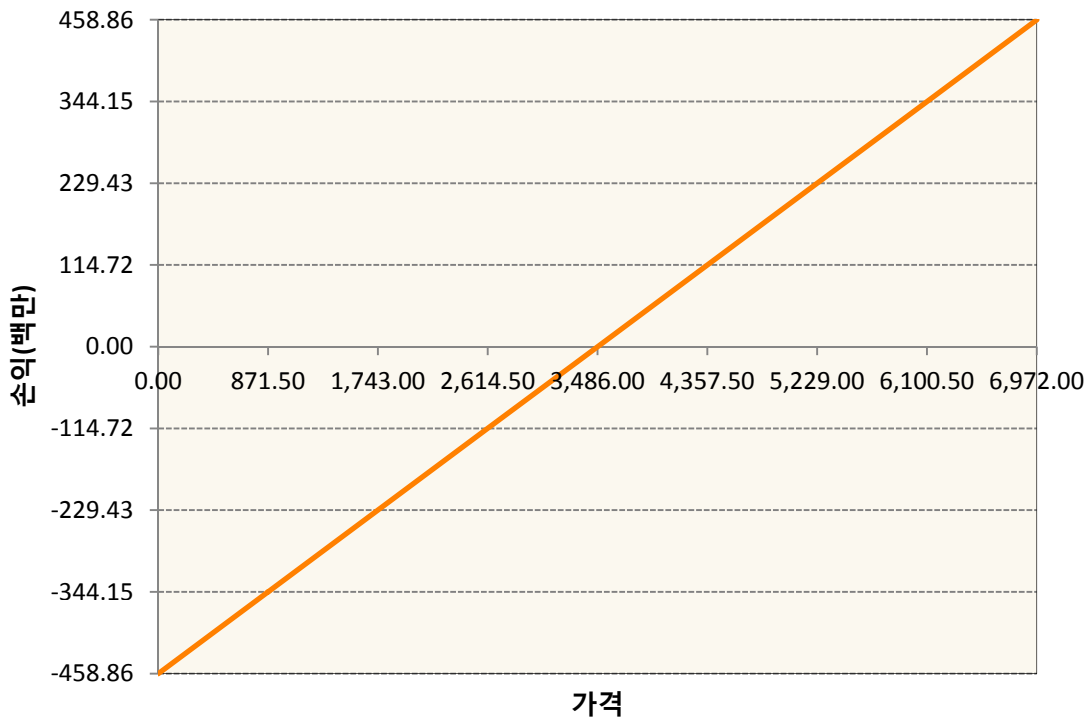
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	459	0	459	

2. 만기시점의 손익구조

VGU9-EURO STOXX 50 Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU9	EURO STOXX 50 Sep19	37
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

27

공시일	2019-07-03
기준일	2019-07-02

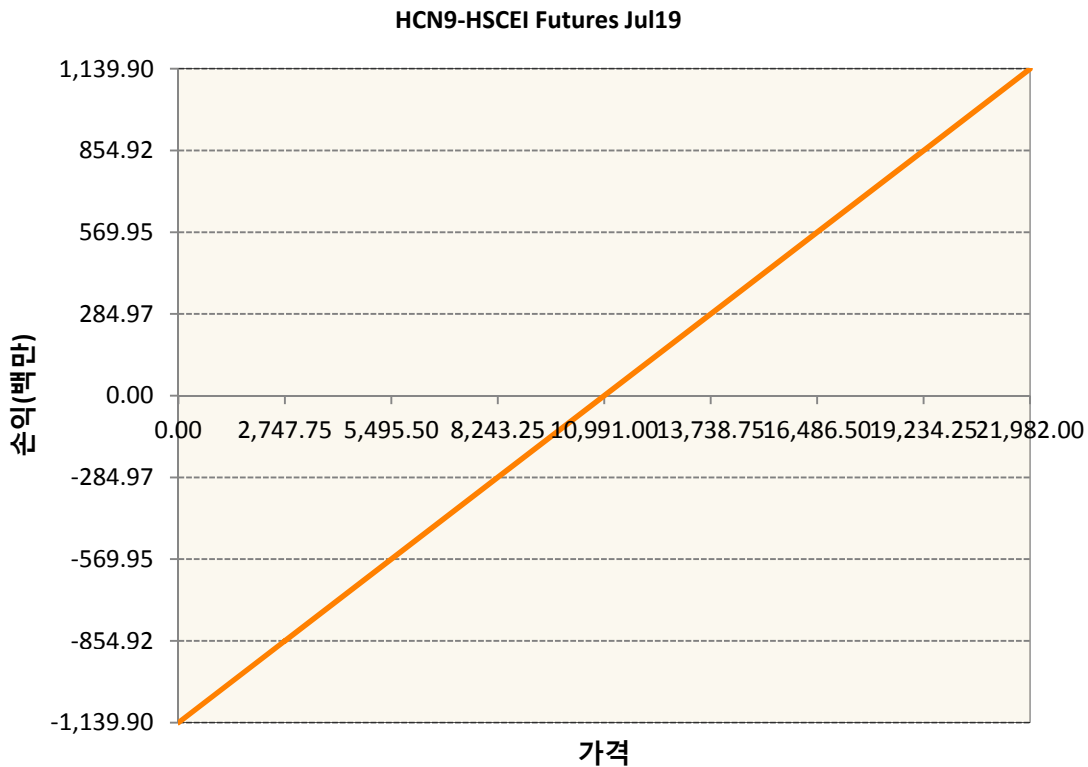
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,140	0	1,140	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN9	HSCEI Futures Jul19	91
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

93

공시일	2019-07-03
기준일	2019-07-02

커버드콜모(주식혼합-파생형)

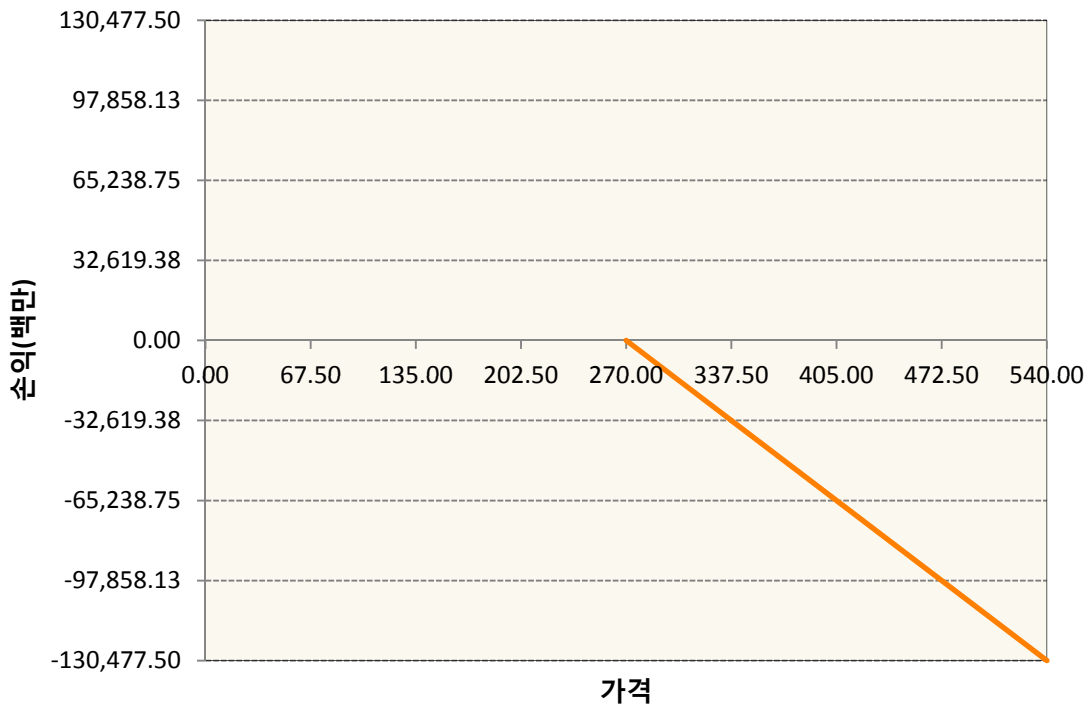
1. 계약금액

(단위:백만원)

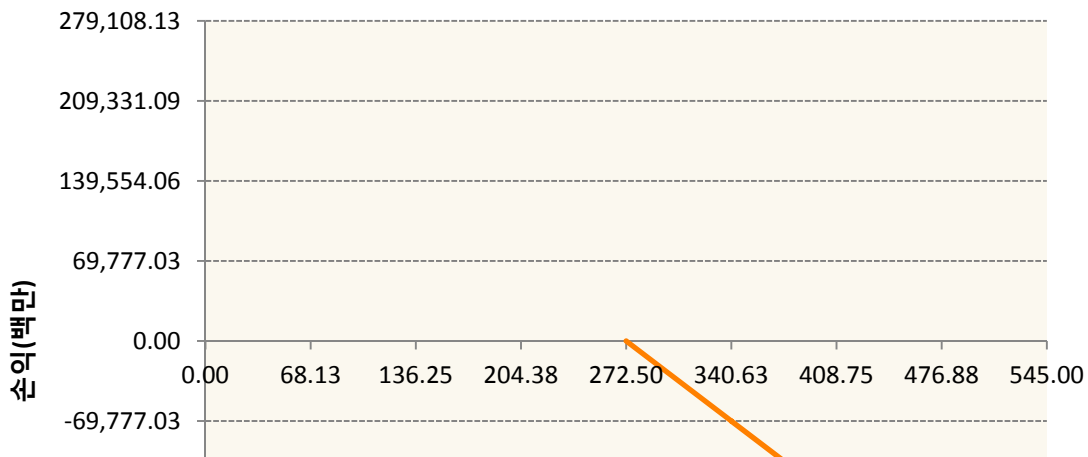
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	591,498	-591,498	장내

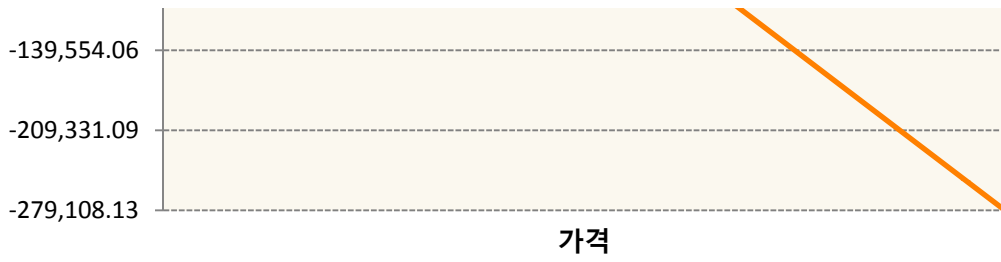
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P72700-2019-07 콜270

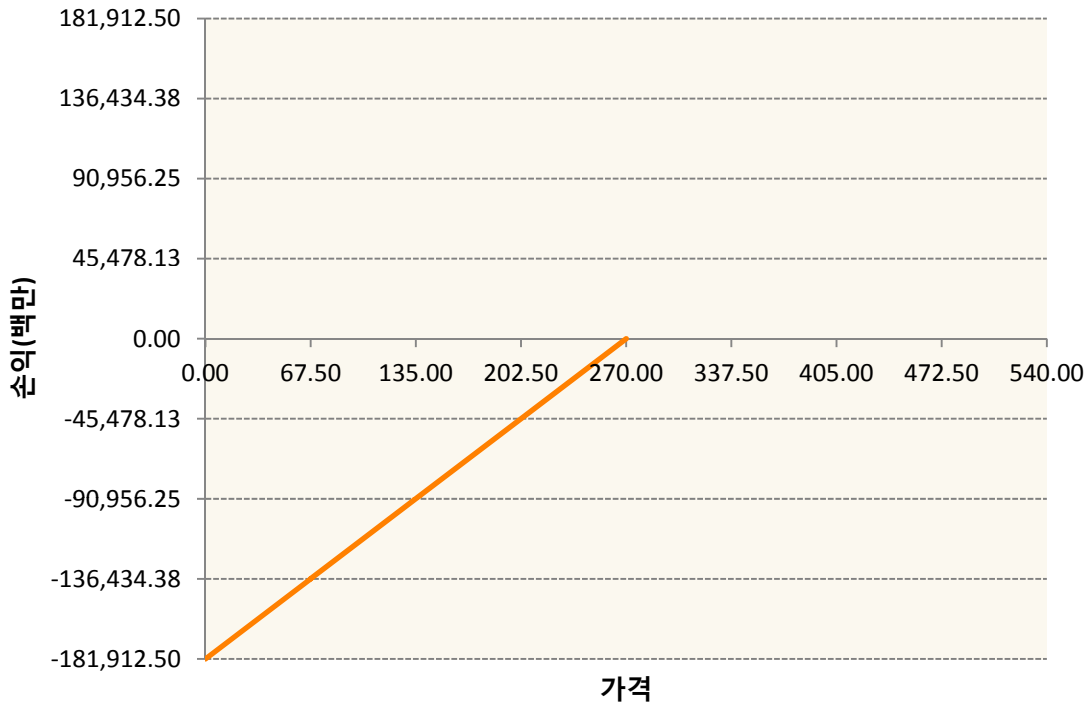


KR4201P72726-2019-07 콜272.5





KR4301P72708-2019-07 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201P72700		2019-07 콜270					9,764
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,797	3,773	3,739	3,694	3,639	3,575	3,502
-5.33%	3,568	3,471	3,364	3,248	3,126	2,997	2,864
-2.67%	2,601	2,432	2,262	2,092	1,922	1,752	1,582
0%	427	290	148	0	-151	-306	-462
2.67%	-2,685	-2,739	-2,807	-2,886	-2,975	-3,074	-3,180
5.33%	-6,159	-6,170	-6,189	-6,216	-6,252	-6,298	-6,353
8.00%	-9,705	-9,706	-9,710	-9,716	-9,726	-9,742	-9,764
KR4201P72726		2019-07 콜272.5					19,901
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,393	6,365	6,321	6,259	6,177	6,077	5,958

-5.33%	6,133	5,988	5,817	5,623	5,410	5,180	4,937
-2.67%	4,757	4,429	4,094	3,755	3,412	3,066	2,717
0%	1,039	697	351	0	-353	-709	-1,067
2.67%	-5,010	-5,184	-5,385	-5,607	-5,848	-6,105	-6,375
5.33%	-12,209	-12,255	-12,323	-12,413	-12,525	-12,659	-12,812
8.00%	-19,700	-19,707	-19,721	-19,745	-19,782	-19,834	-19,901
KR4301P72708 2019-07 풋270							10,580
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10,564	-10,565	-10,565	-10,566	-10,569	-10,573	-10,580
-5.33%	-5,628	-5,646	-5,672	-5,705	-5,746	-5,794	-5,849
-2.67%	-1,385	-1,506	-1,629	-1,752	-1,876	-2,001	-2,126
0%	194	138	73	0	-80	-165	-255
2.67%	308	306	301	293	281	264	241
5.33%	309	309	309	309	308	307	305
8.00%	309	309	309	309	309	309	309

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

(단위:백만원)

43,048

공시일	2019-07-03
기준일	2019-07-02

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

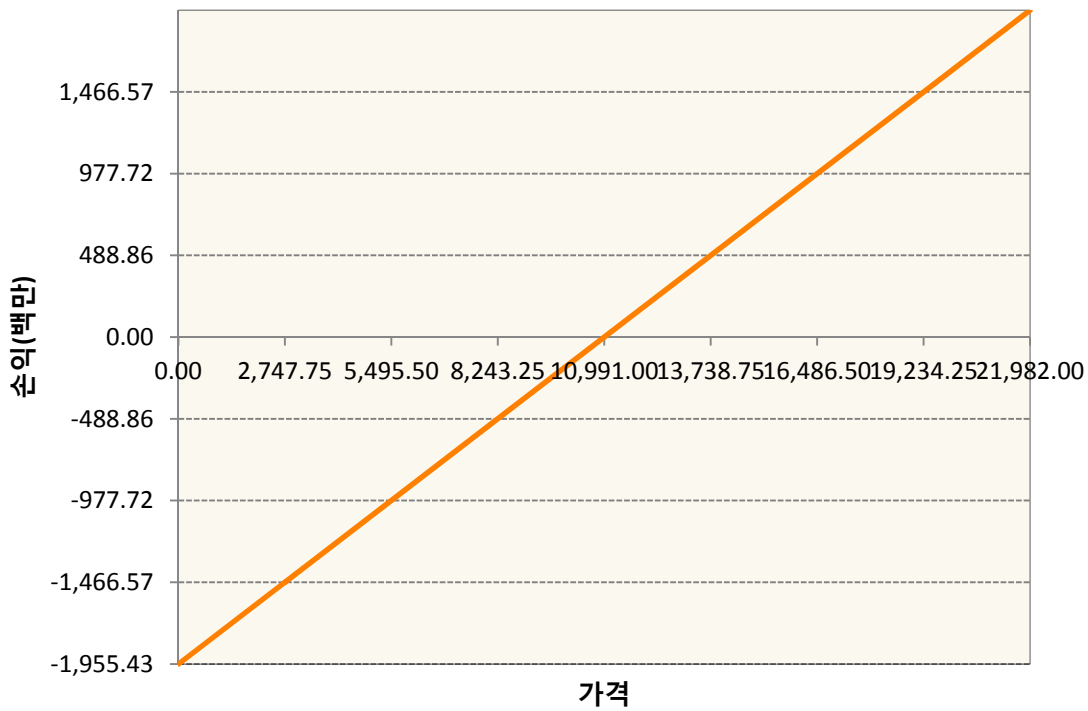
1. 계약금액

(단위:백만원)

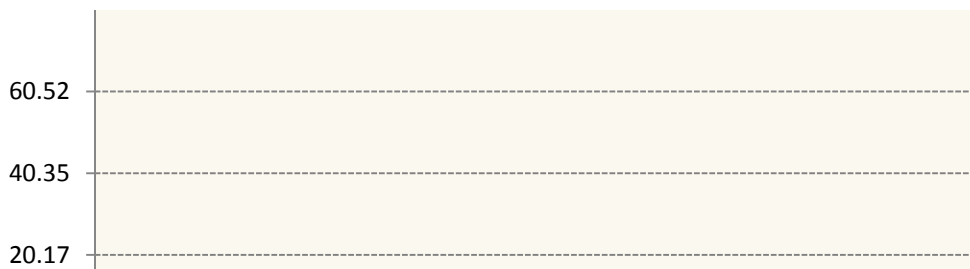
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,955	0	1,955	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,211	-5,211	장내
누계	통화	선도	149	3,138	-2,989	장외

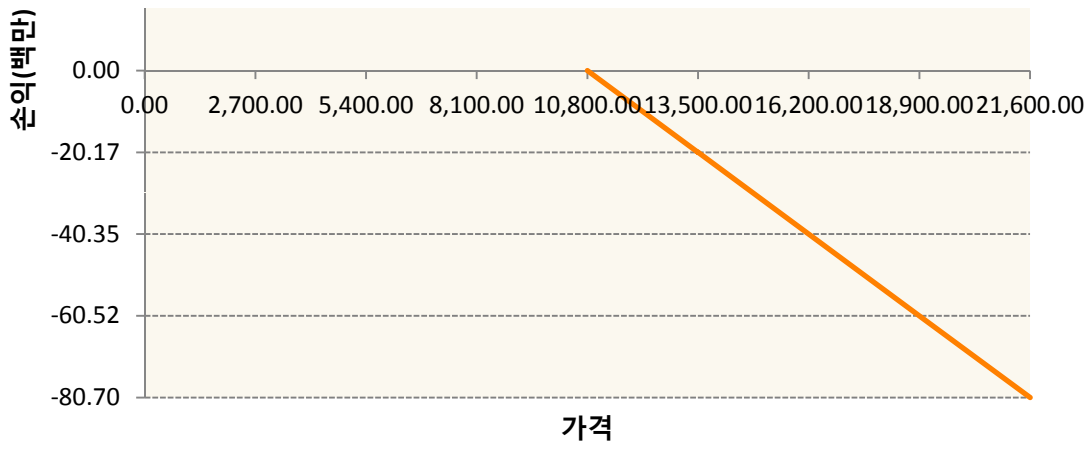
2. 만기시점의 손익구조

HCN9-HSCEI Futures Jul19

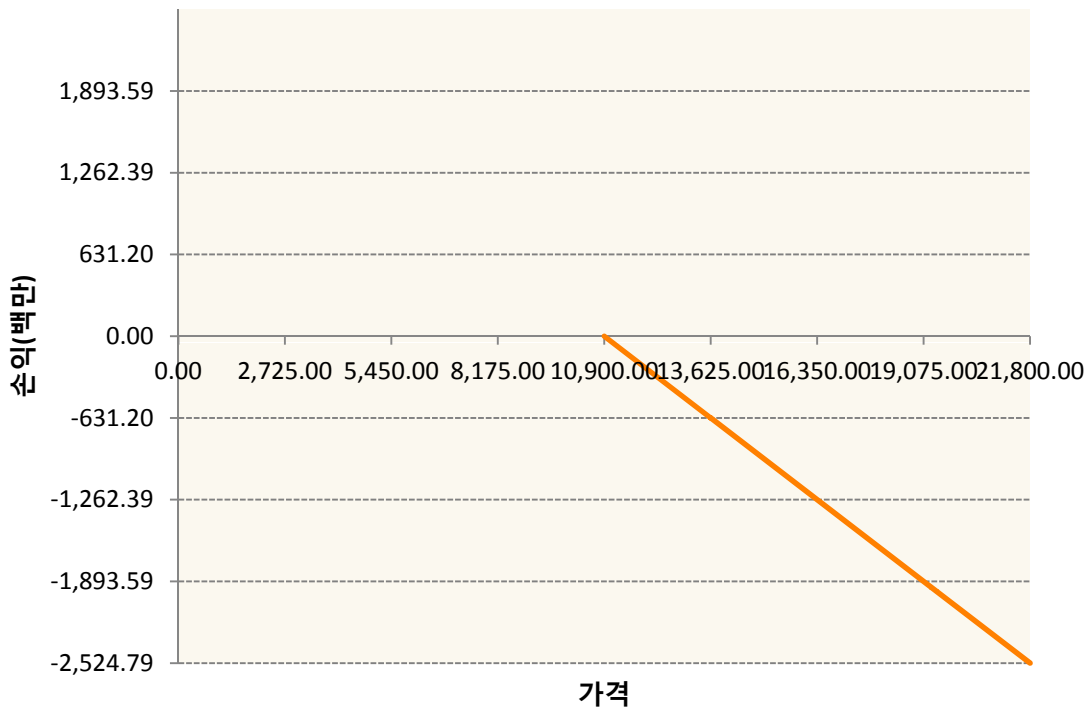


OHHIN9-C108-HSCEI

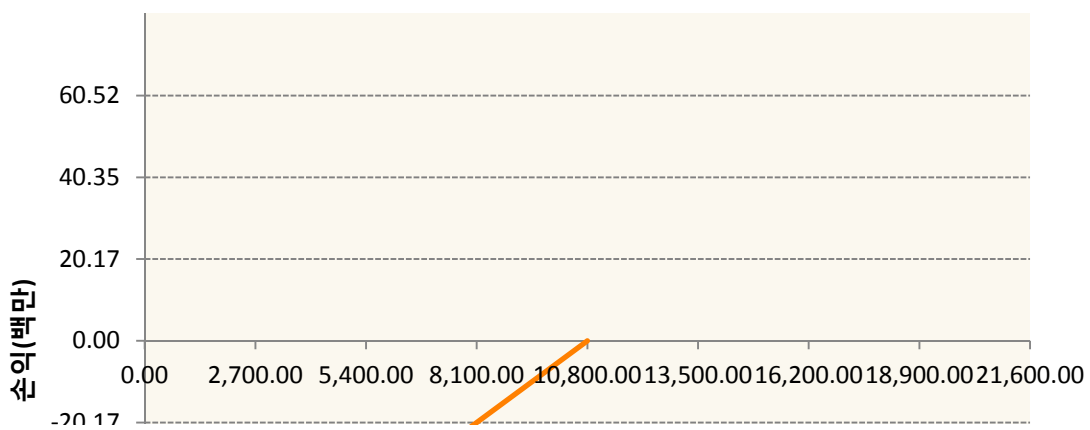


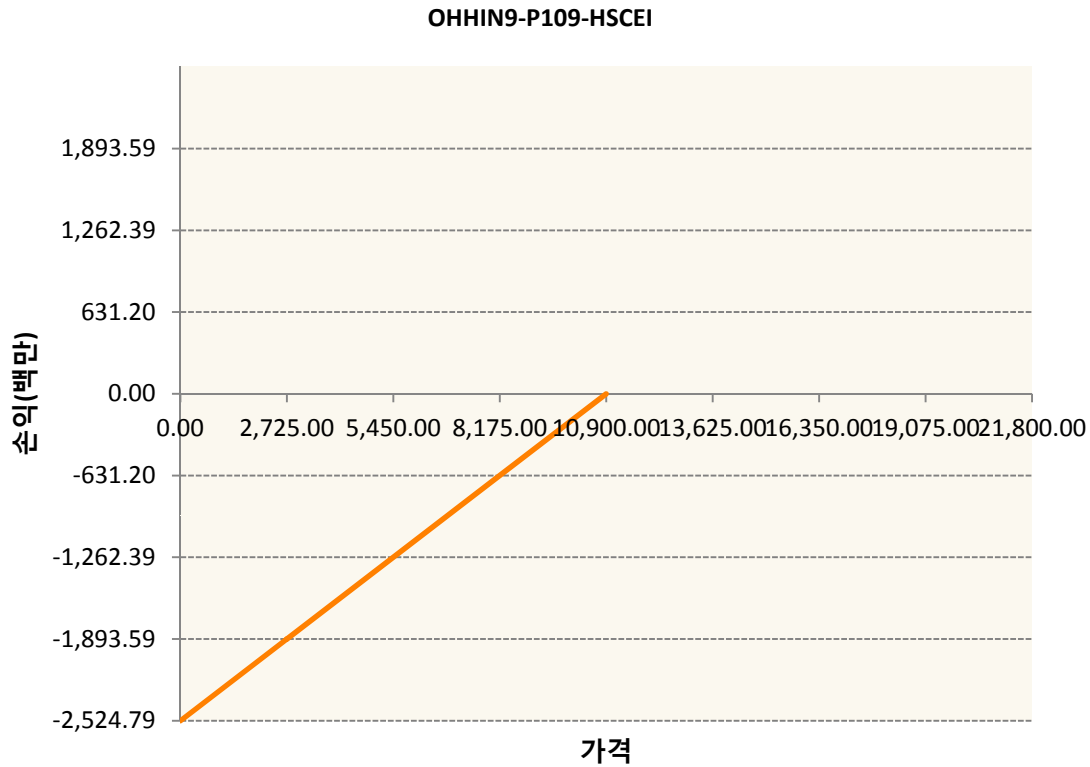
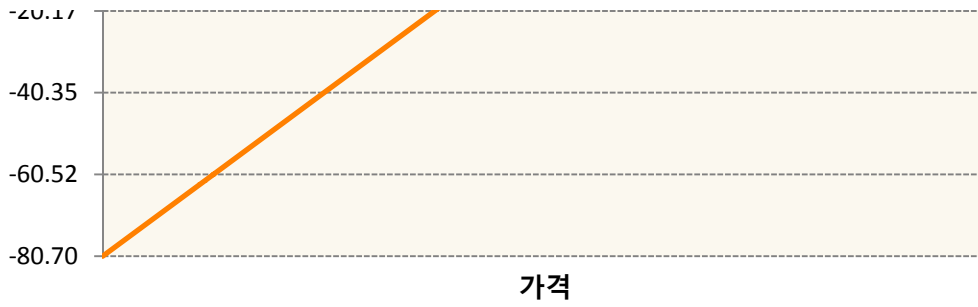


OHHIN9-C109-HSCEI



OHHIN9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	251
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E	12
HCN9 HSCEI Futures Jul19	156
OHHIN9-C1(HSCEI	6
OHHIN9-C1(HSCEI	202
OHHIN9-P1(HSCEI	6
OHHIN9-P1(HSCEI	202

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

667

공시일	2019-07-03
기준일	2019-07-02

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

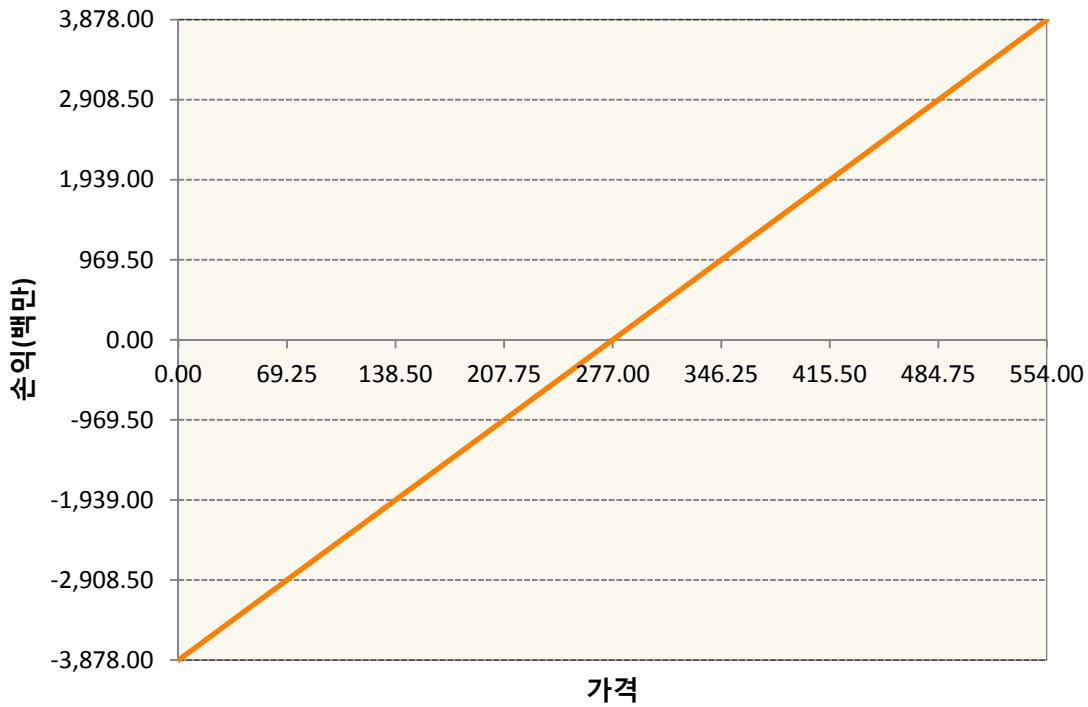
1. 계약금액

(단위:백만원)

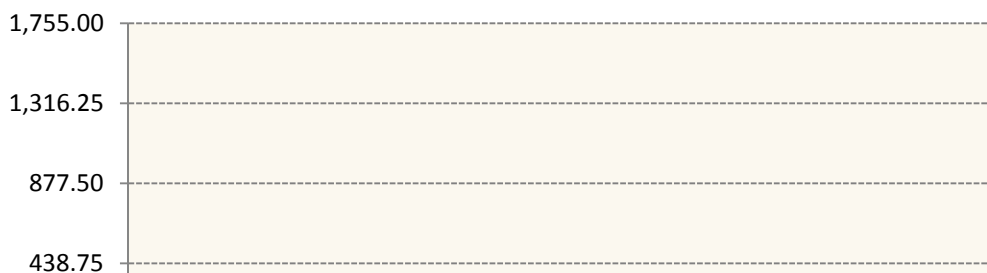
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,878	0	3,878	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,340	-20,340	장내

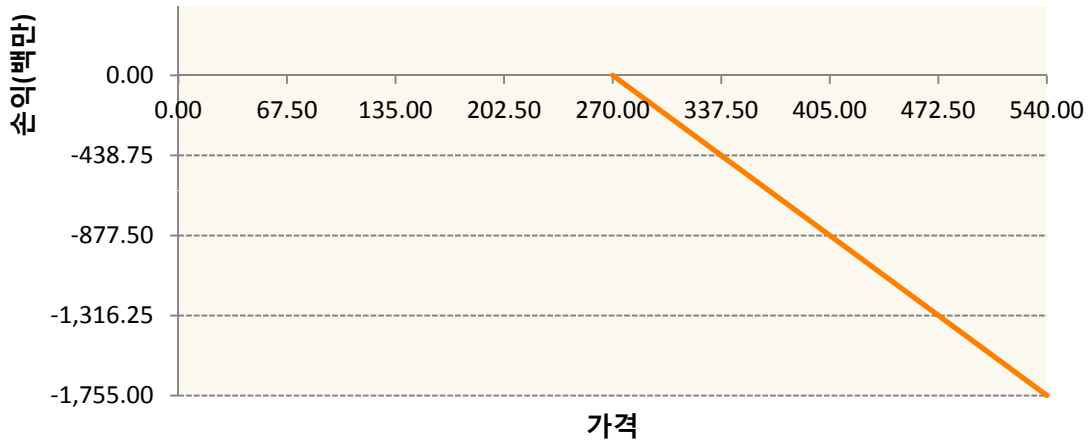
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

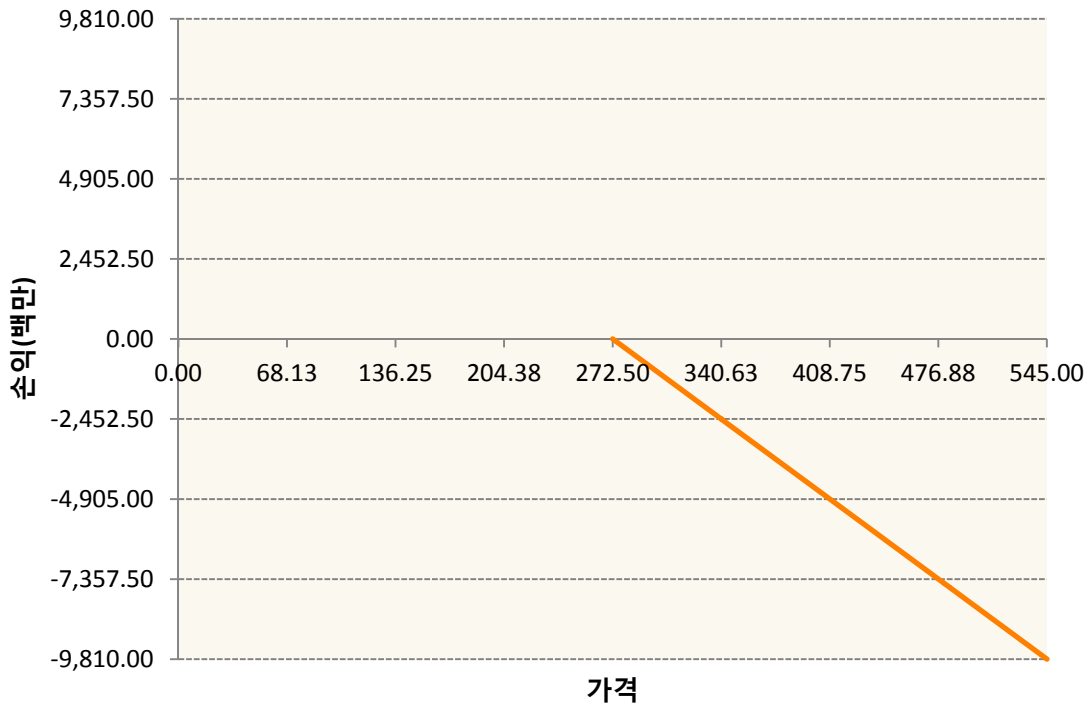


KR4201P72700-2019-07 콜270

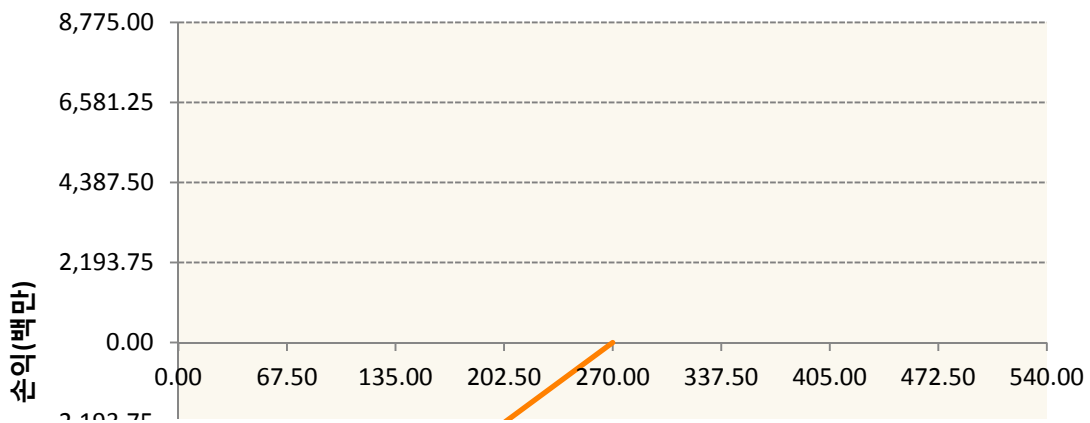




KR4201P72726-2019-07 콜272.5



KR4301P72708-2019-07 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,180
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,180	-1,180	-1,180	-1,180	-1,180	-1,180	-1,180	
-5.33%	-786	-786	-786	-786	-786	-786	-786	
-2.67%	-393	-393	-393	-393	-393	-393	-393	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	393	393	393	393	393	393	393	
5.33%	786	786	786	786	786	786	786	
8.00%	1,180	1,180	1,180	1,180	1,180	1,180	1,180	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						597
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-597	-597	-597	-597	-597	-597	-597	
-5.33%	-398	-398	-398	-398	-398	-398	-398	
-2.67%	-199	-199	-199	-199	-199	-199	-199	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	199	199	199	199	199	199	199	
5.33%	398	398	398	398	398	398	398	
8.00%	597	597	597	597	597	597	597	
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						131
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	51	51	50	50	49	48	47
-5.33%	48	47	45	44	42	40	39
-2.67%	35	33	30	28	26	24	21
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	-36	-37	-38	-39	-40	-41	-43
5.33%	-83	-83	-83	-84	-84	-85	-85
8.00%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-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%	225	224	222	220	217	214	209
-5.33%	216	210	204	198	190	182	174
-2.67%	167	156	144	132	120	108	96
0%	37	25	12	0	-12	-25	-37
2.67%	-176	-182	-189	-197	-206	-215	-224
5.33%	-429	-431	-433	-436	-440	-445	-450
8.00%	-692	-693	-693	-694	-695	-697	-699

KR4301P72708 2019-07 풋270 510

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-510	-510	-510	-510	-510	-510	-510
-5.33%	-271	-272	-274	-275	-277	-279	-282
-2.67%	-67	-73	-79	-85	-91	-97	-103
0%	9	7	4	0	-4	-8	-12
2.67%	15	15	15	14	14	13	12
5.33%	15	15	15	15	15	15	15
8.00%	15	15	15	15	15	15	15

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

(단위:백만원)

3,436

공시일	2019-07-03
기준일	2019-07-02

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

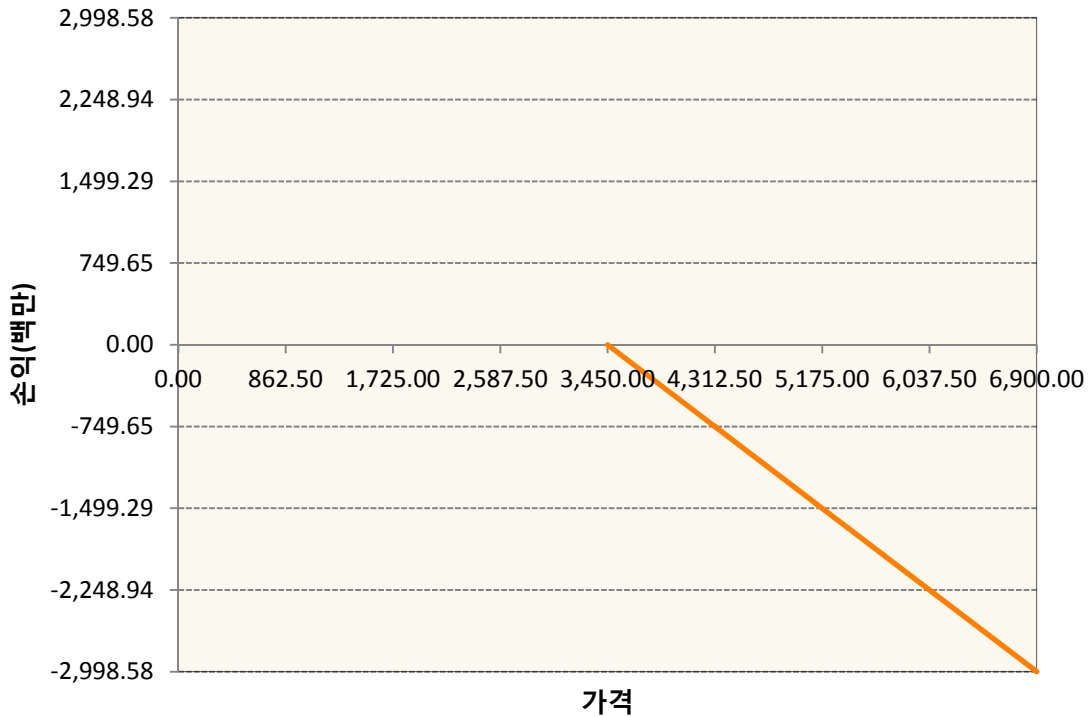
1. 계약금액

(단위:백만원)

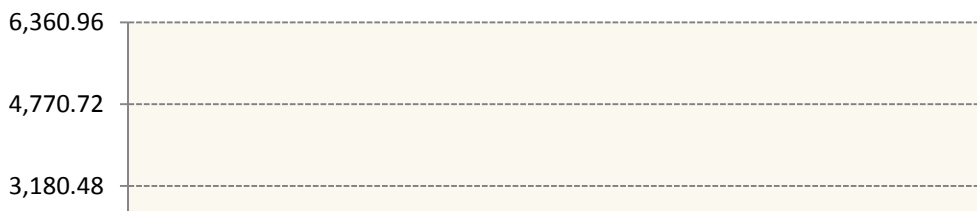
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,936	0	2,936	
누계	유가증권	스왑	55,742	0	55,742	장외
누계	유가증권	옵션	0	18,719	-18,719	장내
누계	통화	선도	0	18,436	-18,436	장외

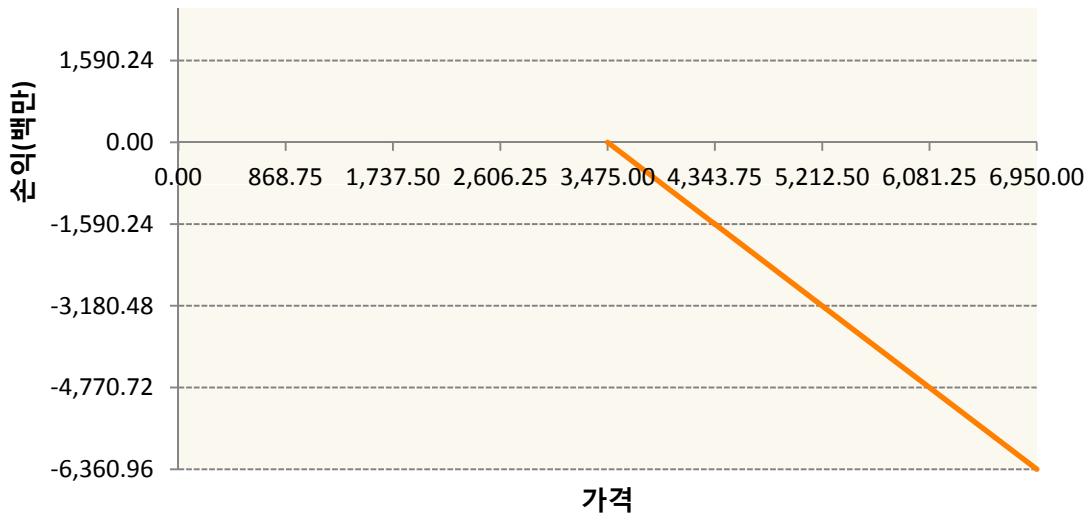
2. 만기시점의 손익구조

OESXN9-C3450-EURO STOXX 50

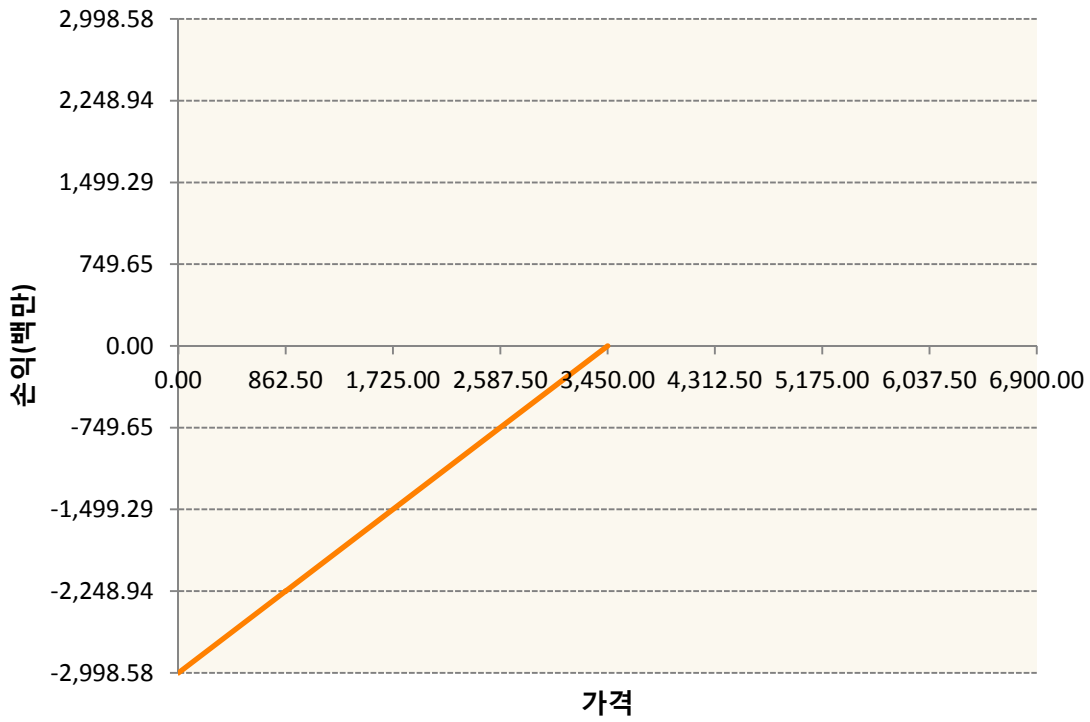


OESXN9-C3475-EURO STOXX 50

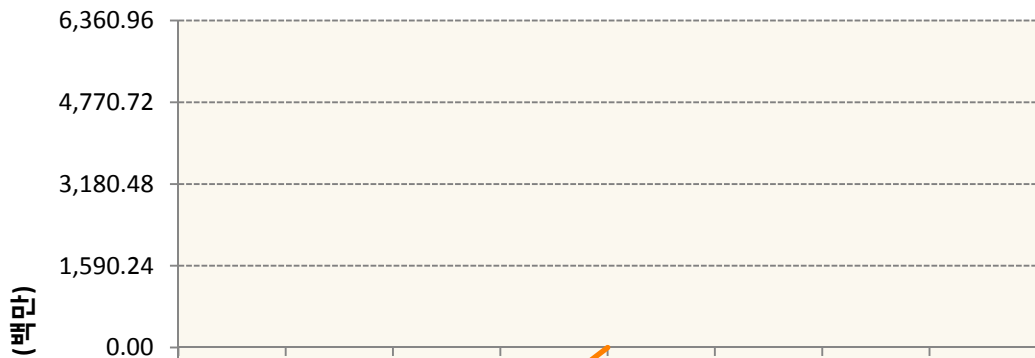


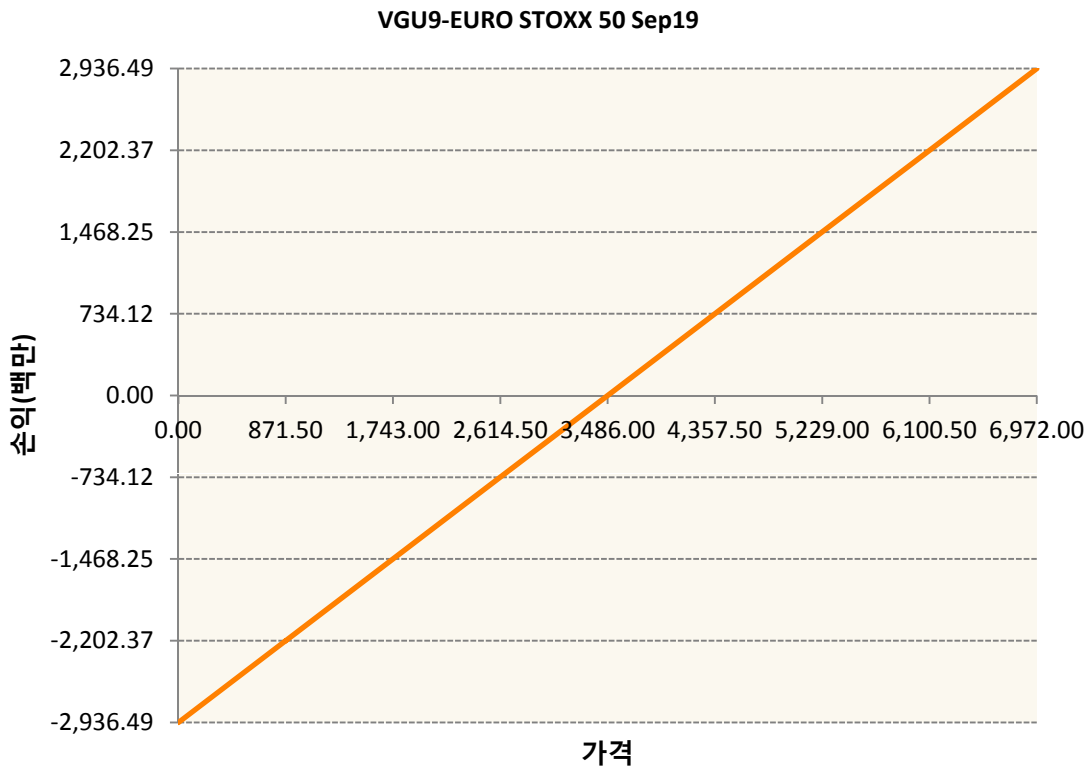
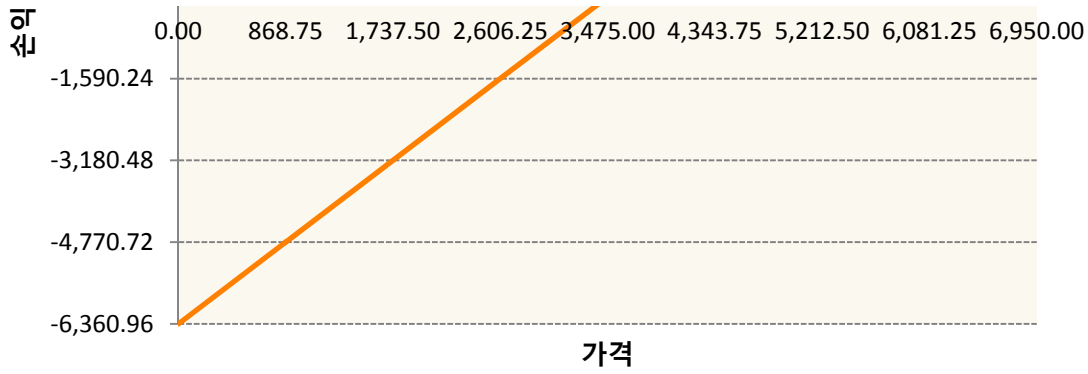


OESXN9-P3450-EURO STOXX 50



OESXN9-P3475-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		84
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E		421
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E		1,054
OESXN9-C34 EURO STOXX 50		240
OESXN9-C34 EURO STOXX 50		509
OESXN9-P34 EURO STOXX 50		240
OESXN9-P34 EURO STOXX 50		509
VGU9	EURO STOXX 50 Sep19	235

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

(단위:백만원)

2,042

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	2019-07-03
기준일	2019-07-02

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

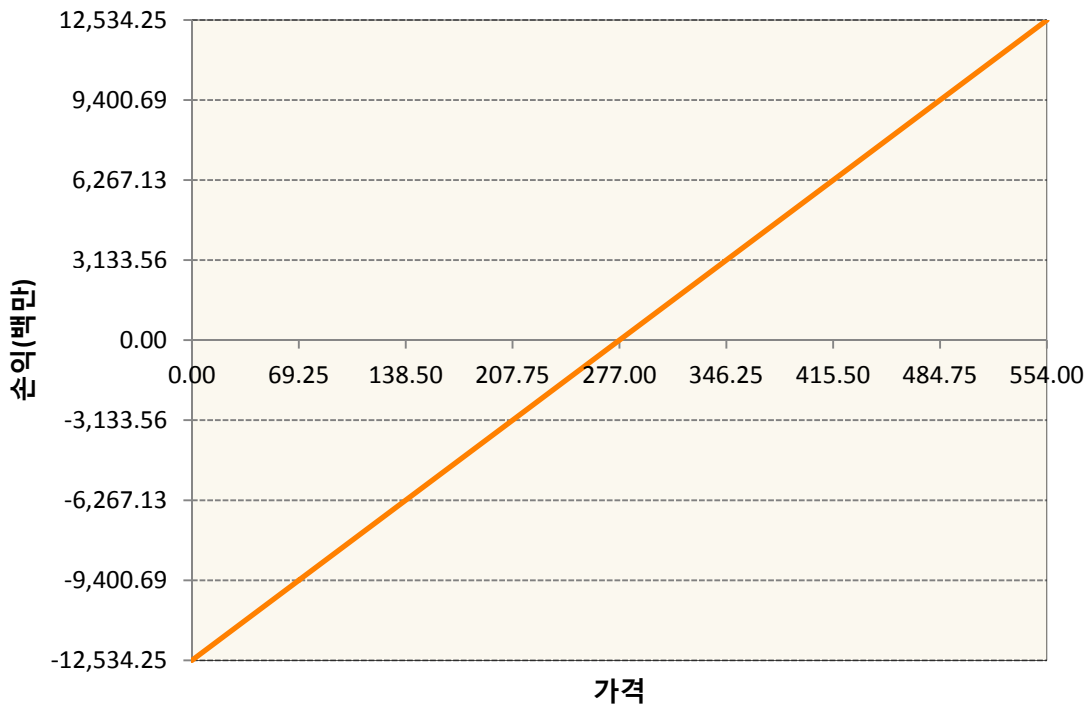
1. 계약금액

(단위:백만원)

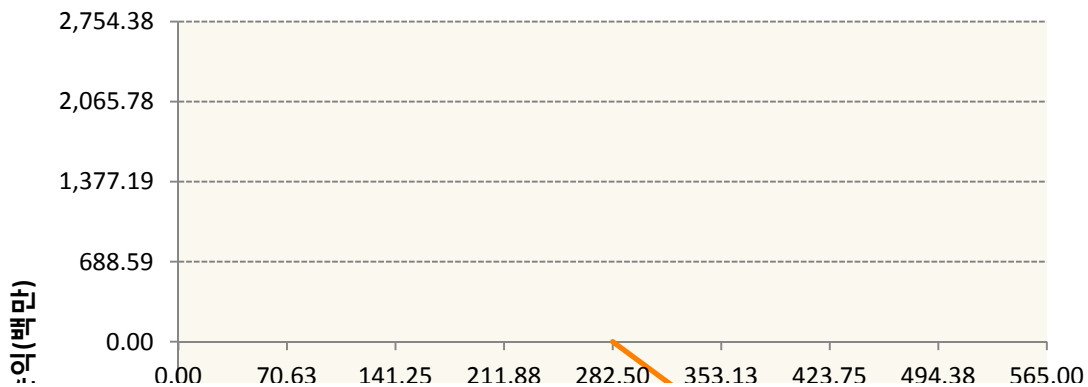
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,534	0	12,534	장내
누계	유가증권	옵션	1,084	22,134	-21,050	장내

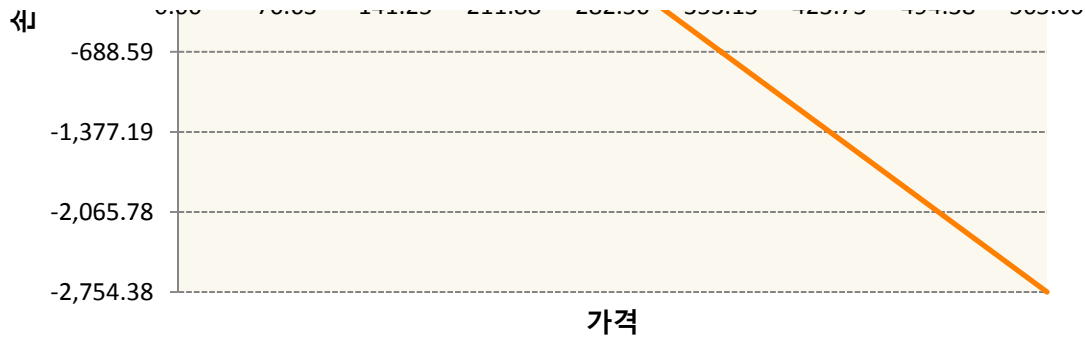
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

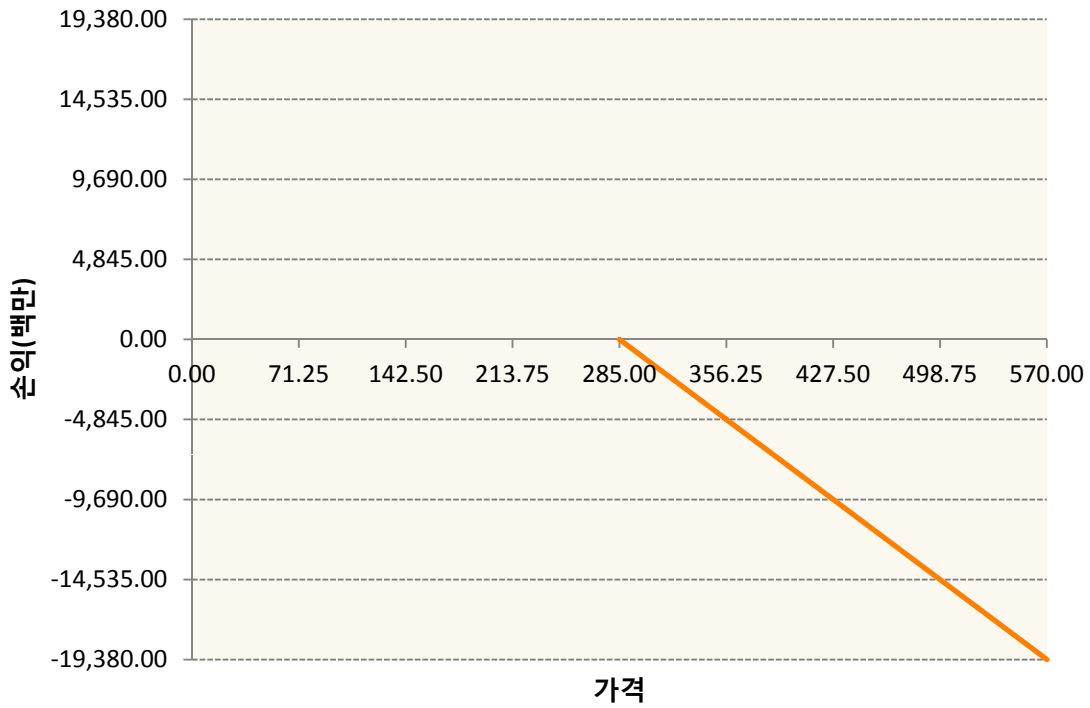


KR4201P72825-2019-07 콜282.5

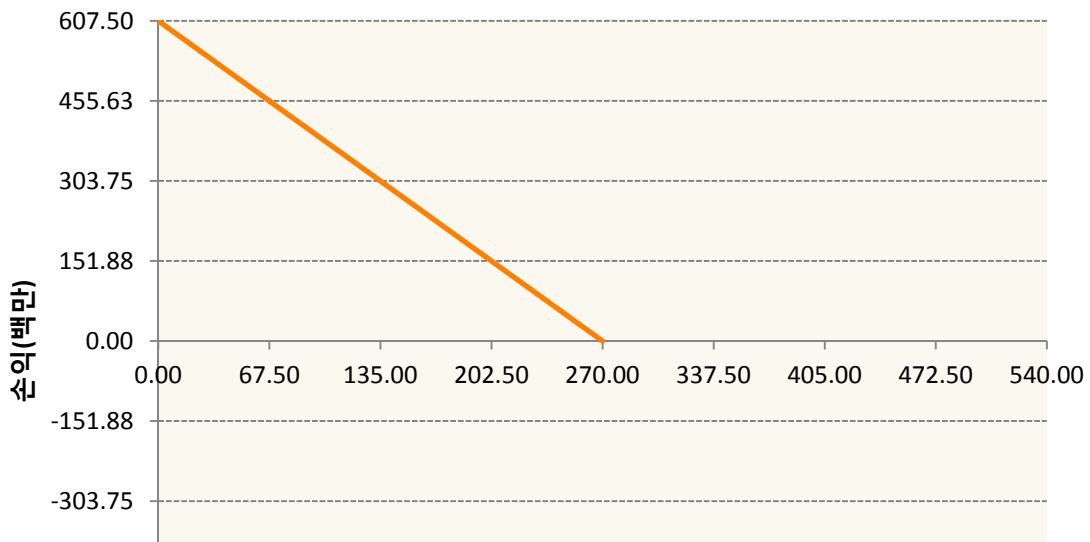


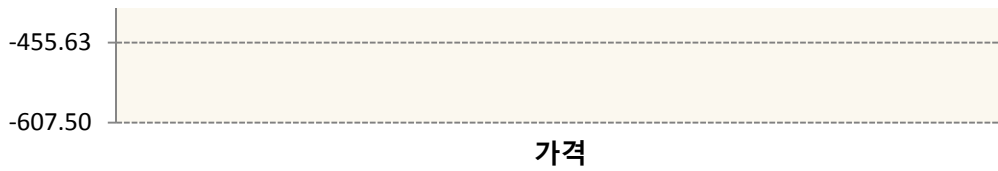


KR4201P72858-2019-07 콜285

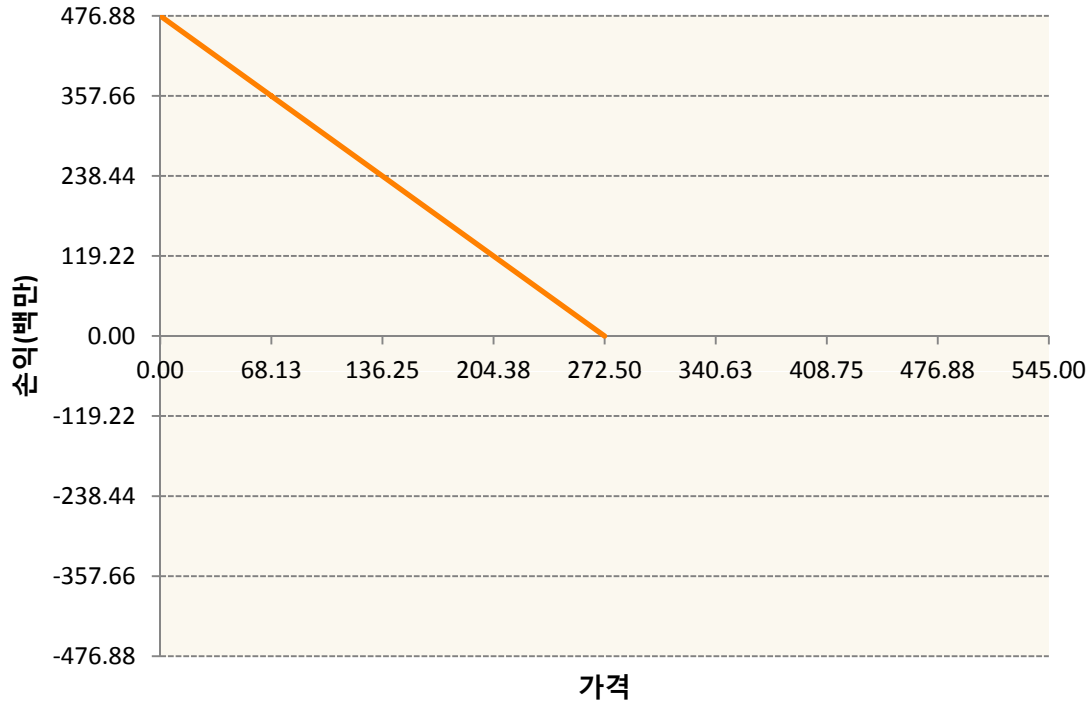


KR4301P72708-2019-07 풋270





KR4301P72724-2019-07 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						999
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-999	-999	-999	-999	-999	-999	-999	
-5.33%	-666	-666	-666	-666	-666	-666	-666	
-2.67%	-333	-333	-333	-333	-333	-333	-333	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	333	333	333	333	333	333	333	
5.33%	666	666	666	666	666	666	666	
8.00%	999	999	999	999	999	999	999	
KR4201P72825		2019-07 콜282.5						143
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	18	18	18	18	18	18	18	
-5.33%	18	18	18	17	17	16	15	
-2.67%	17	16	15	13	12	10	8	

0%	9	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	-18	-22	-26	-29	-33	-36	-40
5.33%	-69	-71	-74	-76	-79	-82	-85
8.00%	-134	-135	-136	-137	-139	-141	-143
KR4201P72858 2019-07 콜285							894
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	88	88	88	88	88	87	85
-5.33%	88	88	87	85	82	78	74
-2.67%	84	79	74	66	58	47	36
0%	49	34	17	0	-18	-38	-58
2.67%	-87	-112	-137	-162	-188	-213	-238
5.33%	-384	-406	-428	-450	-473	-497	-520
8.00%	-813	-822	-834	-847	-861	-877	-894
KR4301P72708 2019-07 풋270							35
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	35	35	35	35	35	35	35
-5.33%	19	19	19	19	19	19	20
-2.67%	5	5	5	6	6	7	7
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							31
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	31	31	31	31	31	31	31
-5.33%	18	18	18	18	18	18	18
-2.67%	6	6	6	7	7	7	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)

1,769

공시일	2019-07-03
기준일	2019-07-02

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	18,990	0	18,990	

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	2019-07-03
기준일	2019-07-02

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	60,107	0	60,107	

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	2019-07-03
기준일	2019-07-02

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	350,356	0	350,356	
누계	통화	선도	0	391,333	-391,333	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		466
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		466
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		373
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		784
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		653
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		560
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		746
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		746
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		466
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		280
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		933
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		187
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		868
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		1,035
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		1,866
FX21019M0(KRW/USD 15-07-19E		466
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		373
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		653
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		933
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		653
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		653
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		560
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		2,985
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		2,239
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E		280
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E		280

FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	784
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	625
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	466
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E	1,866
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E	1,866
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E	690
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E	690
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E	1,287
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E	2,530

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

(단위:백만원)

10,193

공시일	2019-07-03
기준일	2019-07-02

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

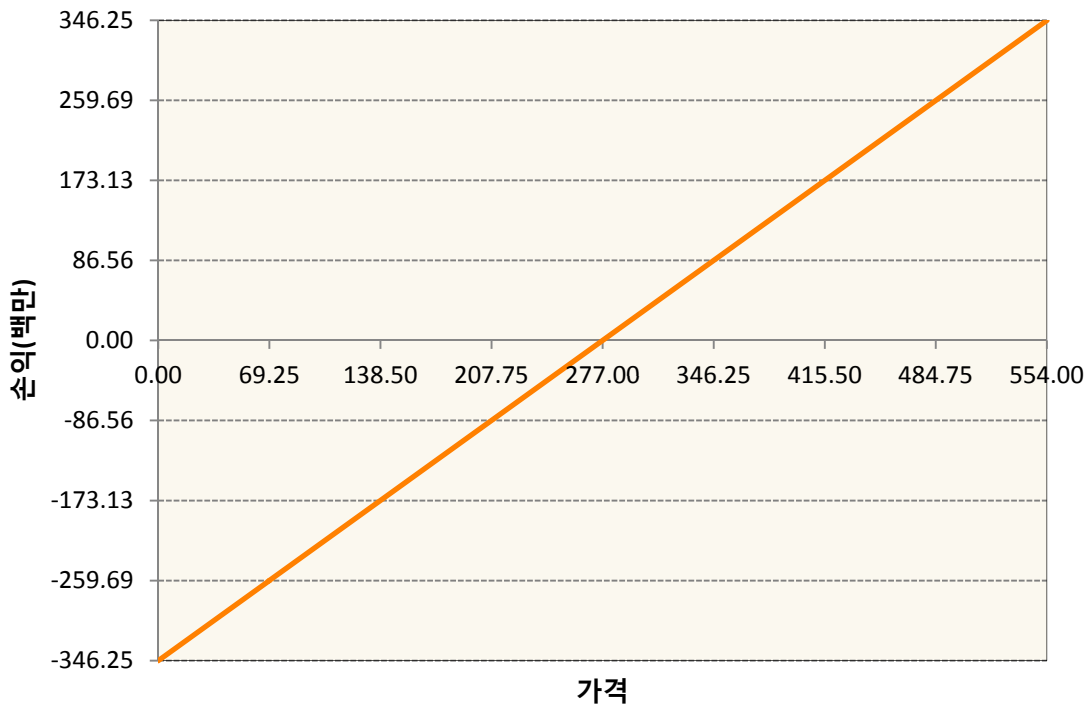
1. 계약금액

(단위:백만원)

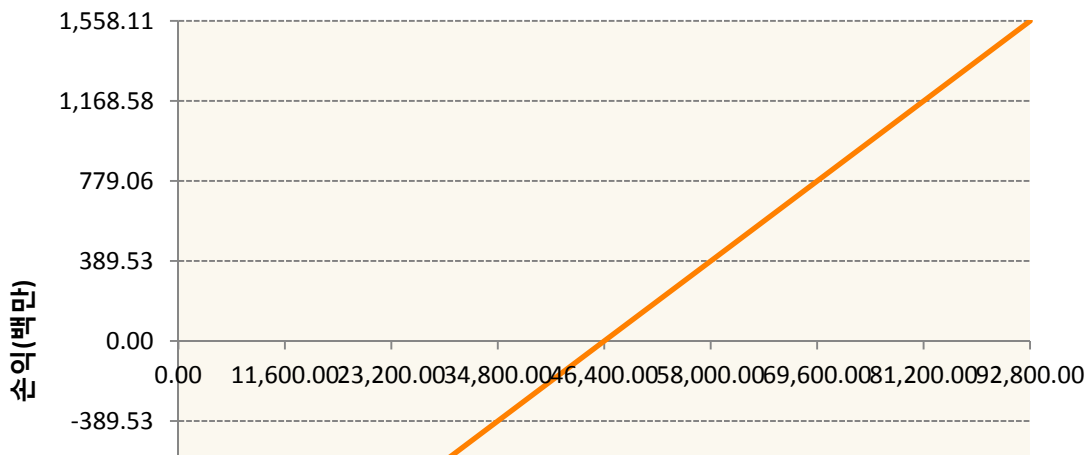
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,904	0	1,904	장내

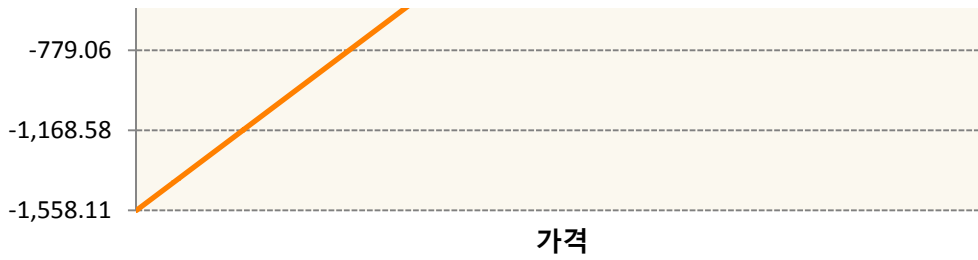
2. 만기시점의 손익구조

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						124
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124	
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83	
-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%	83	83	83	83	83	83	83	
8.00%	124	124	124	124	124	124	124	

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

164

공시일	2019-07-03
기준일	2019-07-02

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

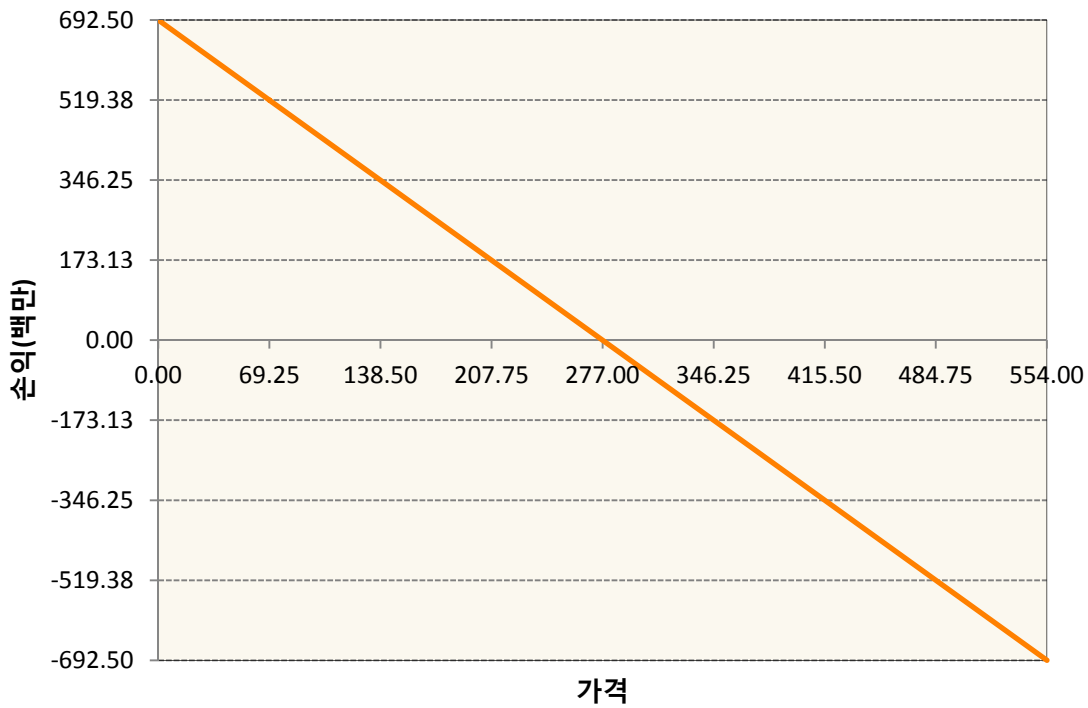
1. 계약금액

(단위:백만원)

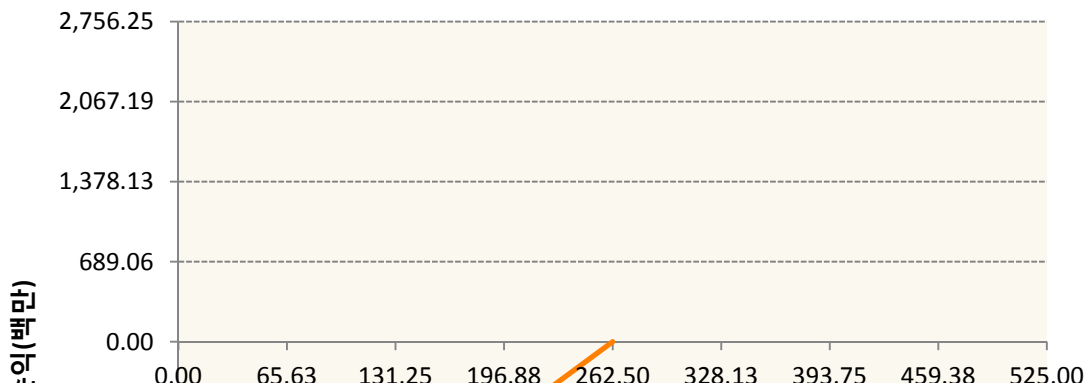
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	693	-693	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,485	-3,485	장내

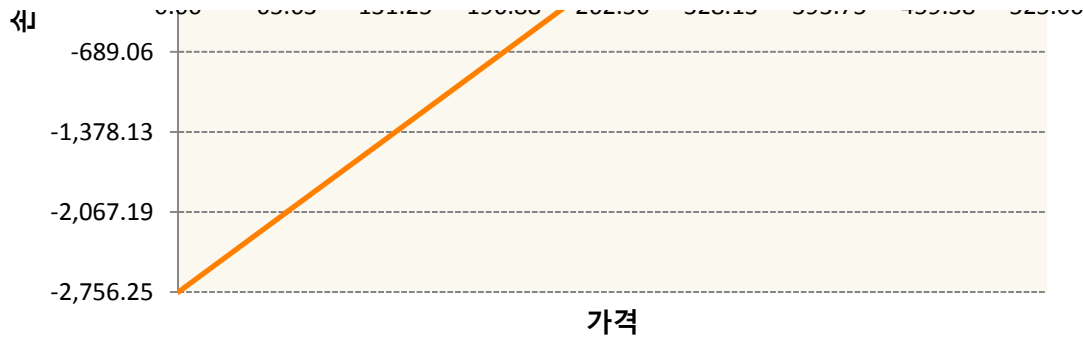
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

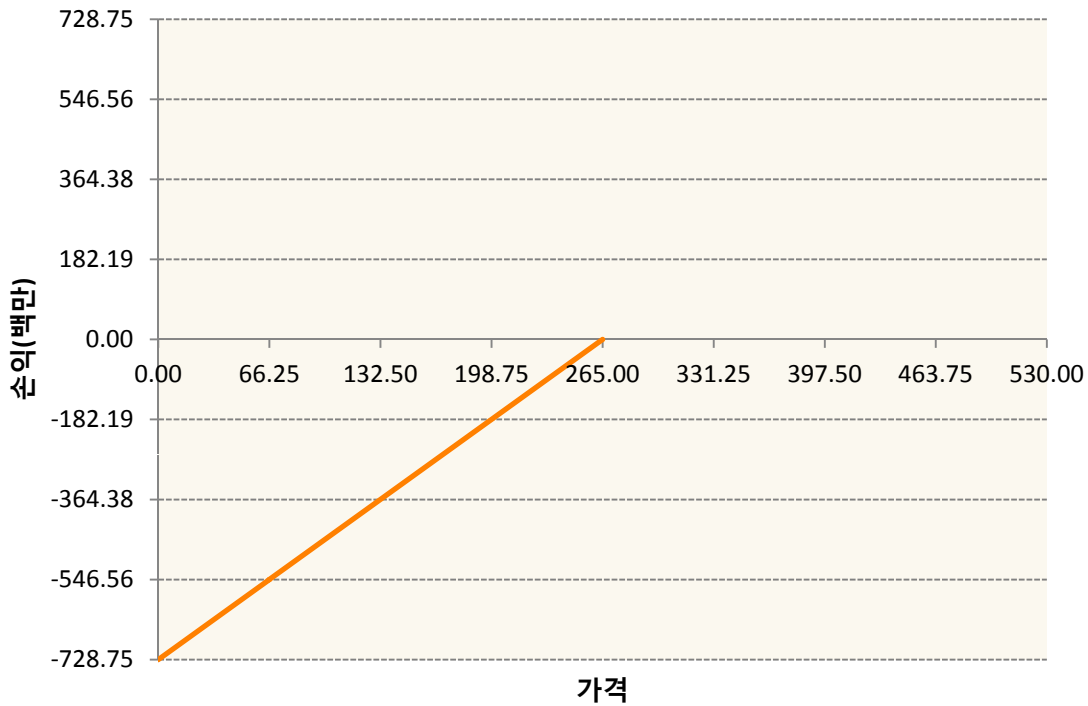


KR4301P72625-2019-07 풋262.5





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						94
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-91	-91	-91	-92	-93	-93	-94
-5.33%	-25	-27	-29	-30	-32	-34	-36
-2.67%	-1	-2	-3	-4	-5	-6	-8
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

31

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-30	-30	-31	-31	-31	-31	-31
-5.33%	-11	-12	-12	-13	-13	-13	-14
-2.67%	-1	-2	-2	-2	-3	-3	-4
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)

87

공시일	2019-07-03
기준일	2019-07-02

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	3,964	-3,964	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019M0:KRW/USD 24-07-19E	140
FX21019M0:KRW/USD 24-07-19E	177

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

(단위:백만원)

103

공시일	2019-07-03
기준일	2019-07-02

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

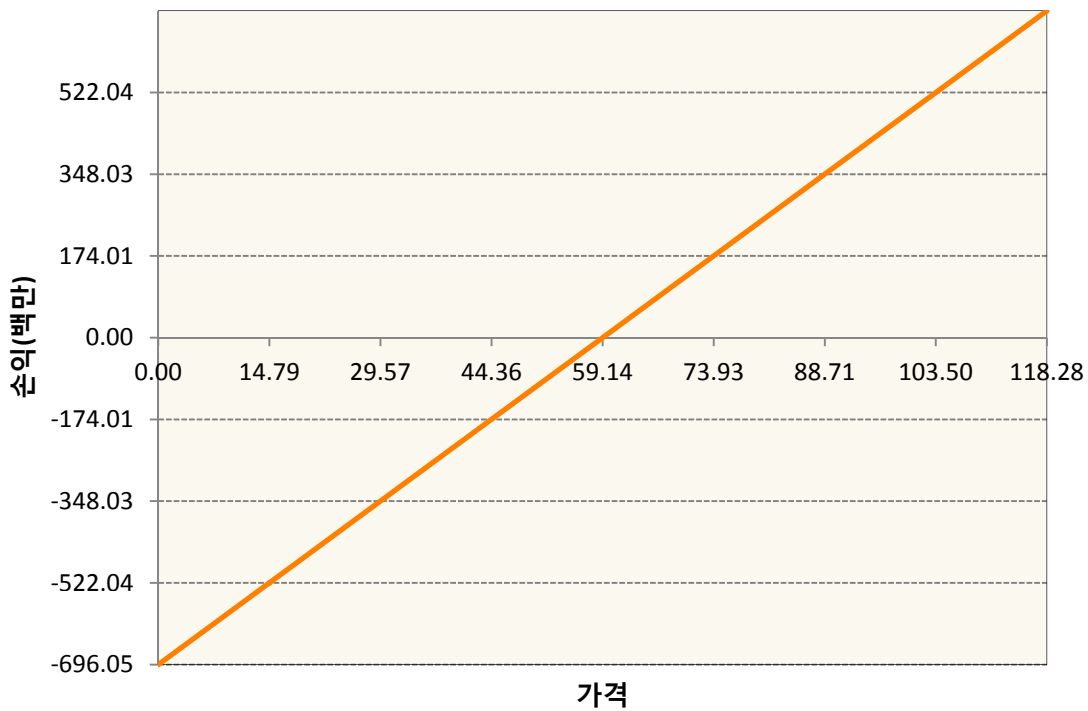
1. 계약금액

(단위:백만원)

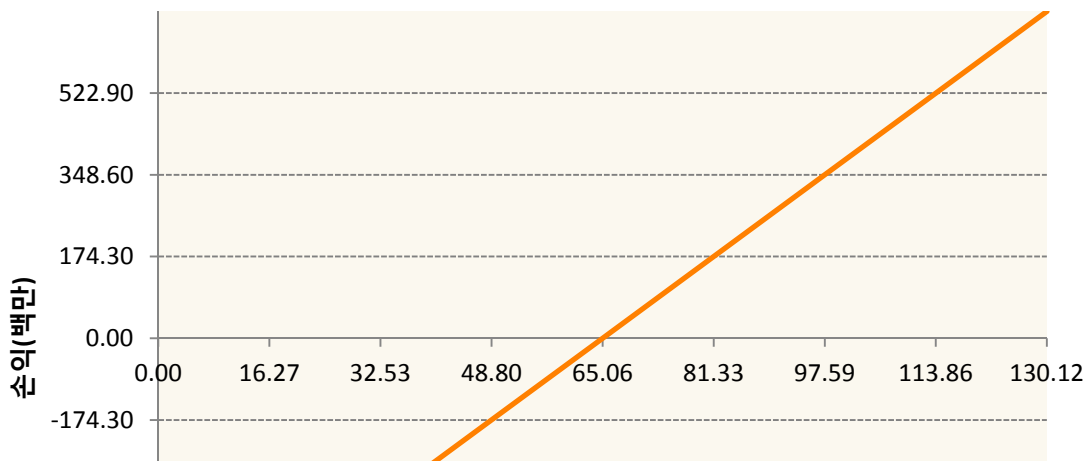
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,731	117	2,614	

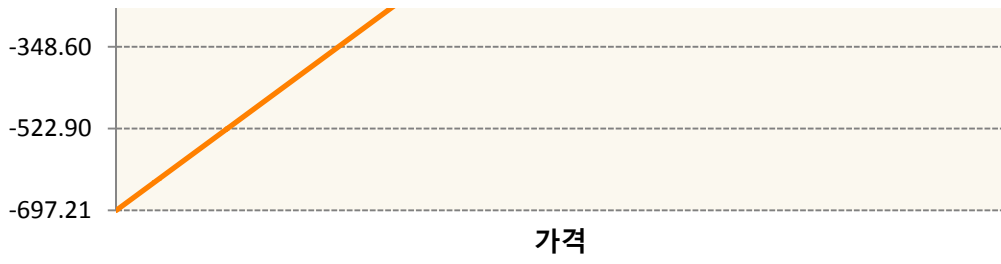
2. 만기시점의 손익구조

CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19

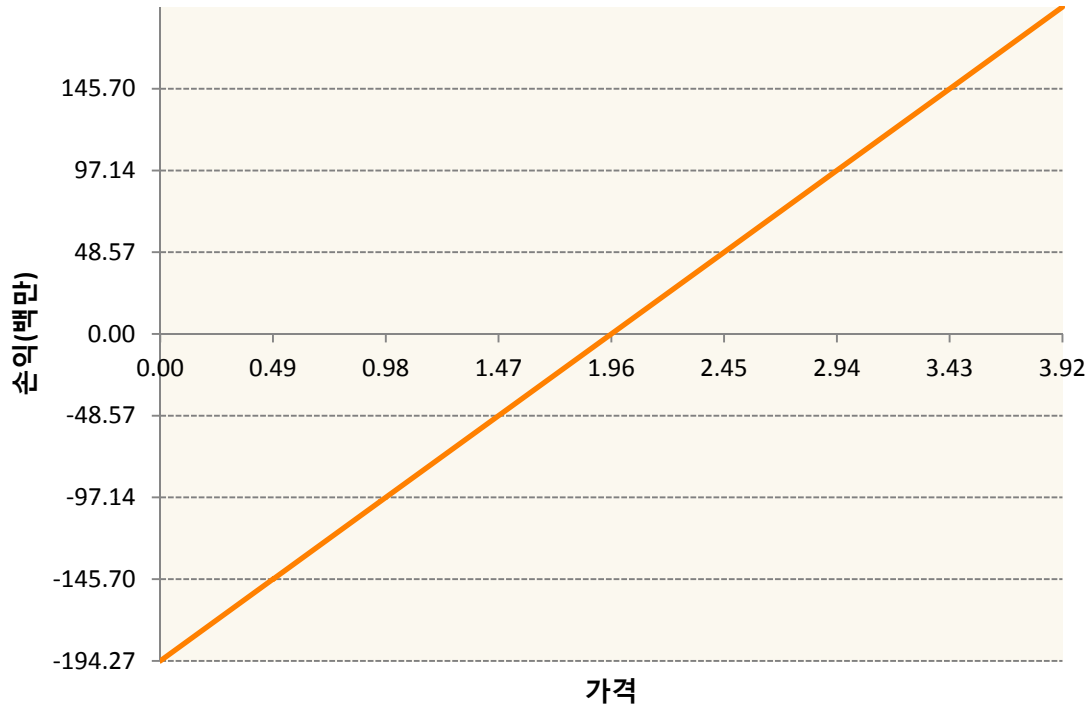


COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19

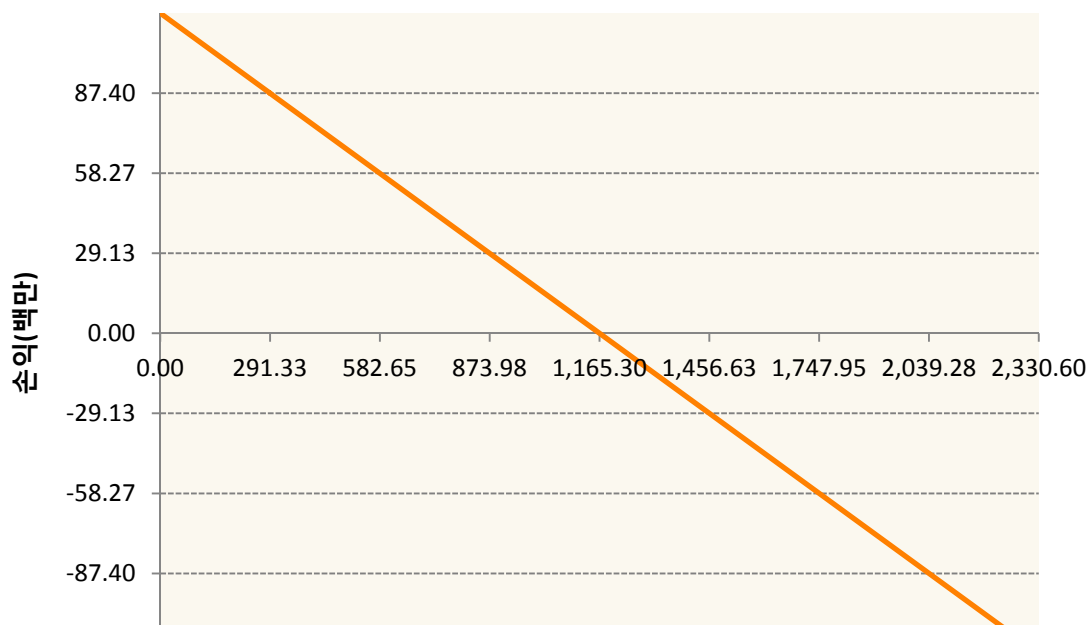


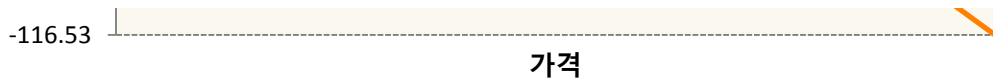


HOU9-NY Harb ULSD Fut Sep19

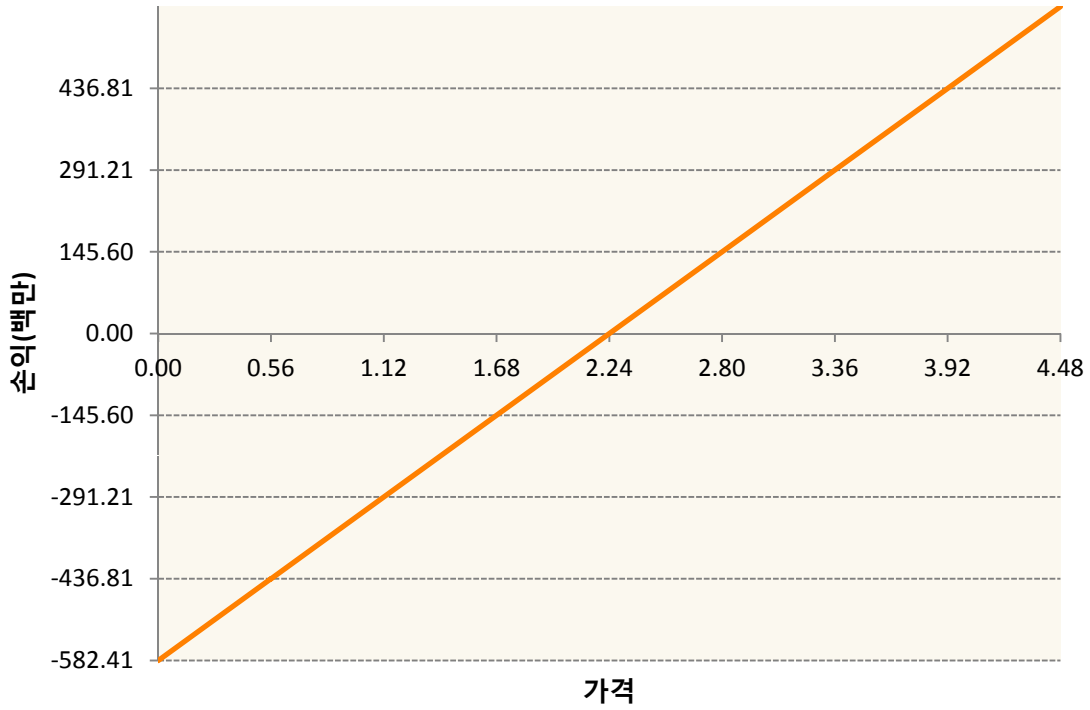


KR4175P70007-2019-07 달러선물

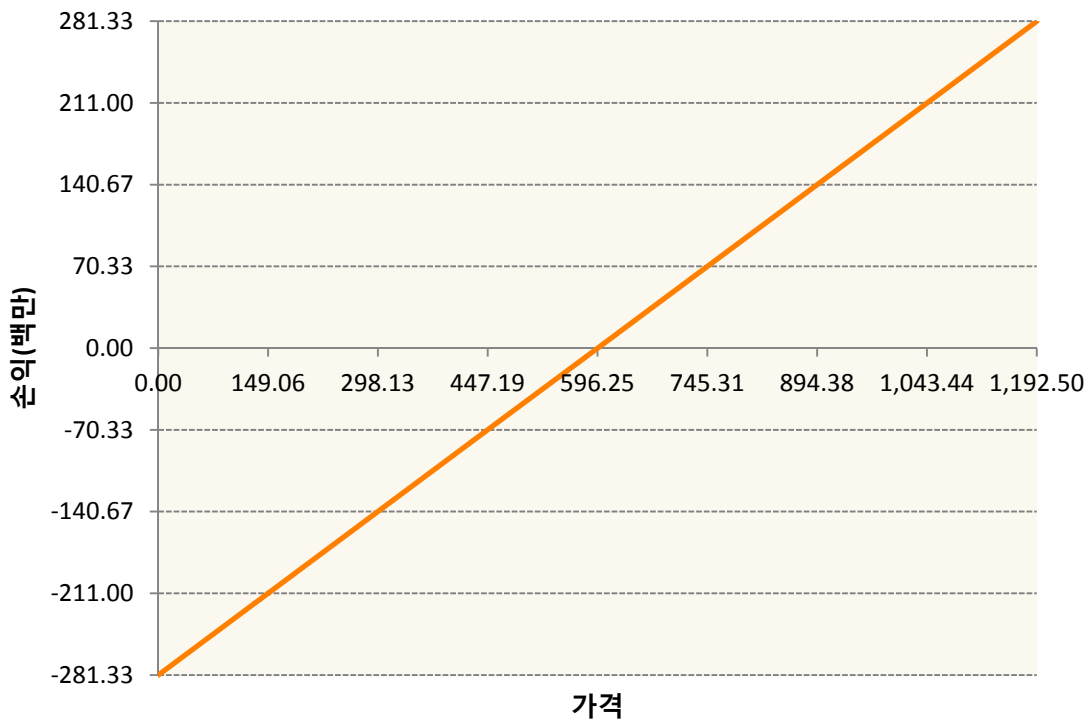




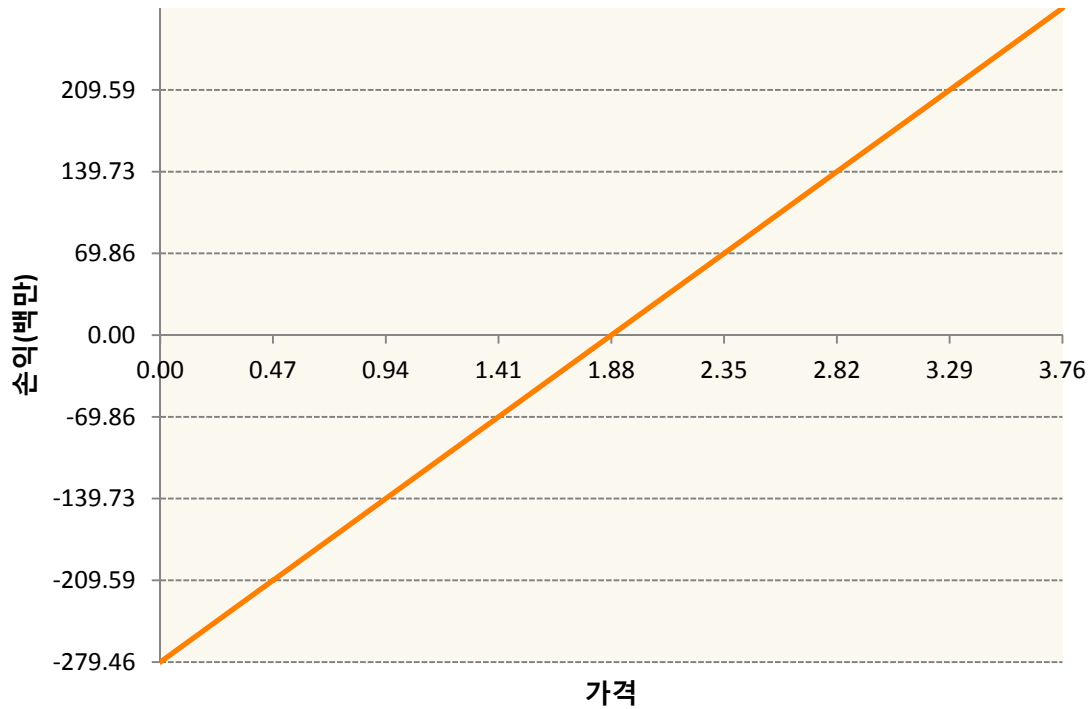
NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



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	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	2019-07-03
기준일	2019-07-02

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

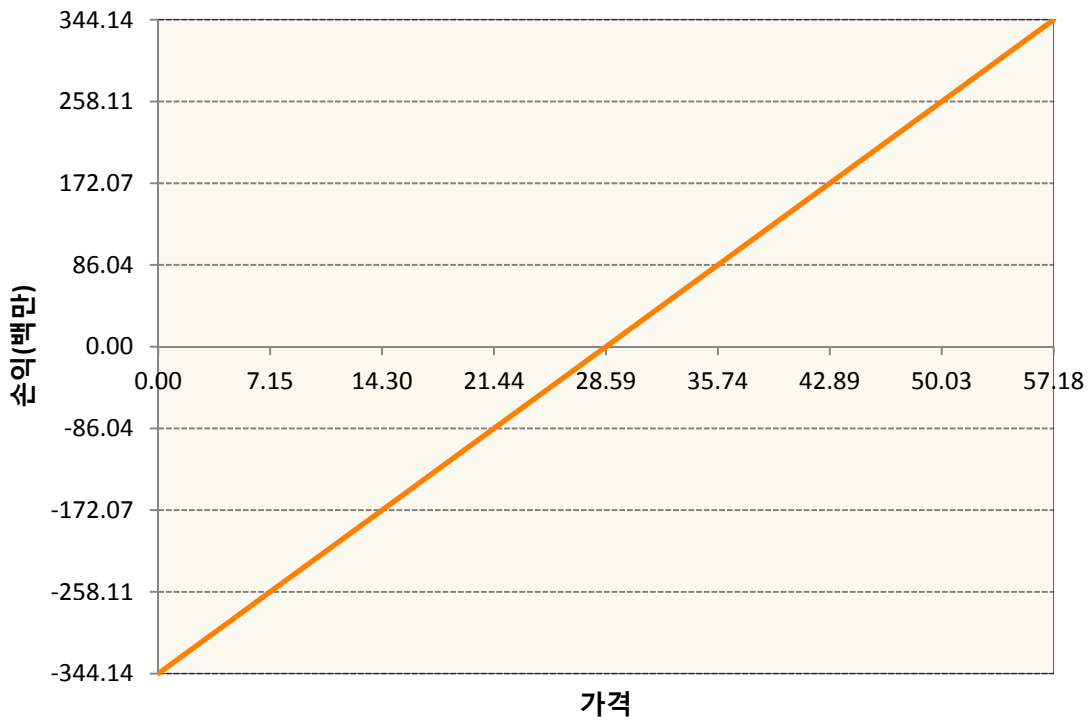
1. 계약금액

(단위:백만원)

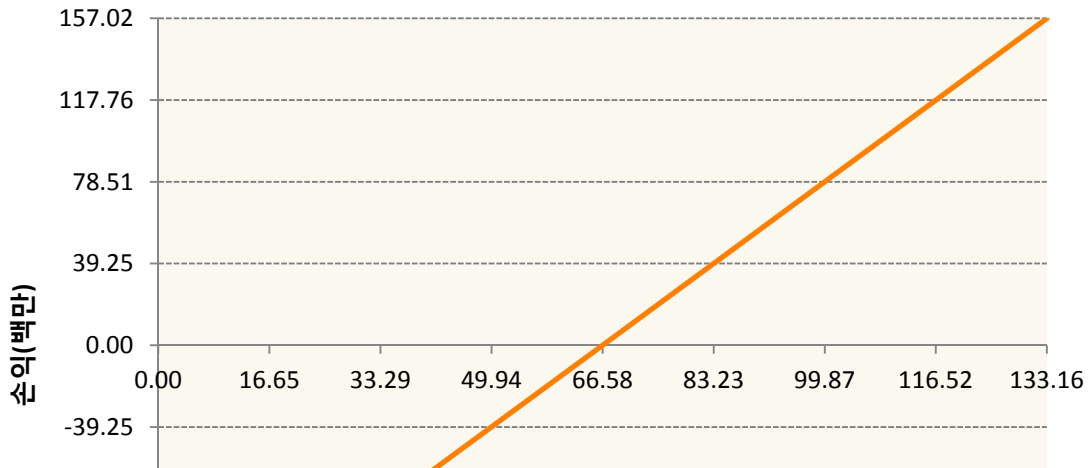
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,229	198	3,031	

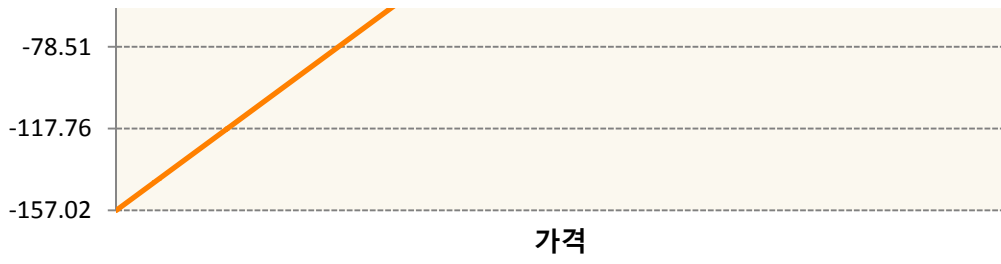
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

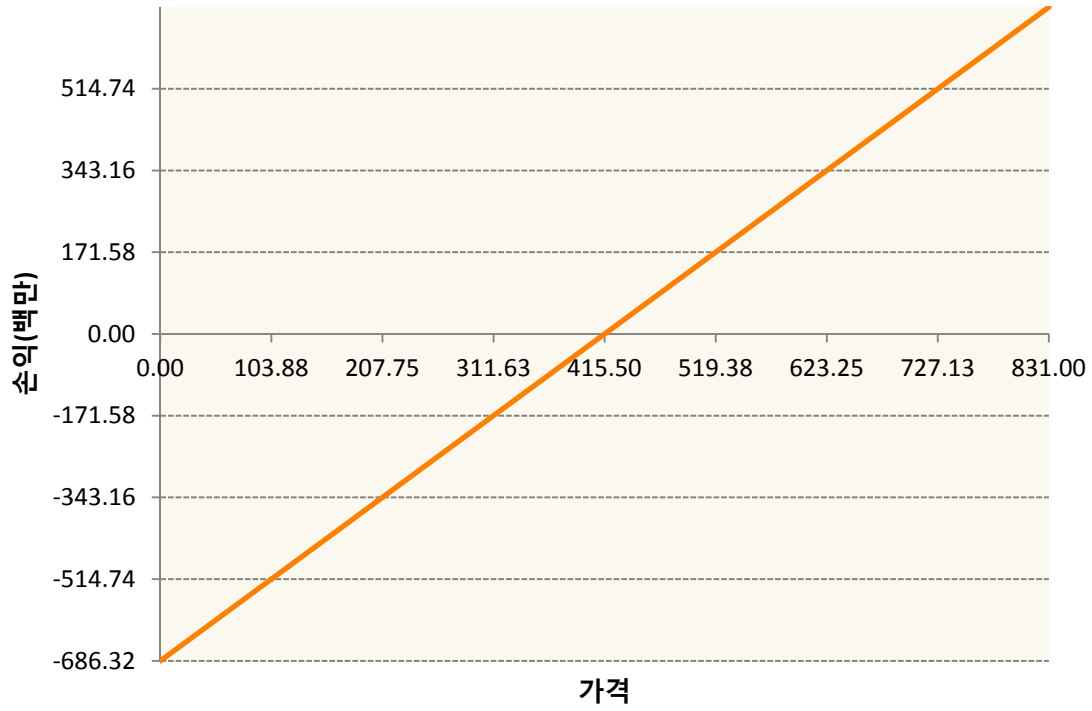


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

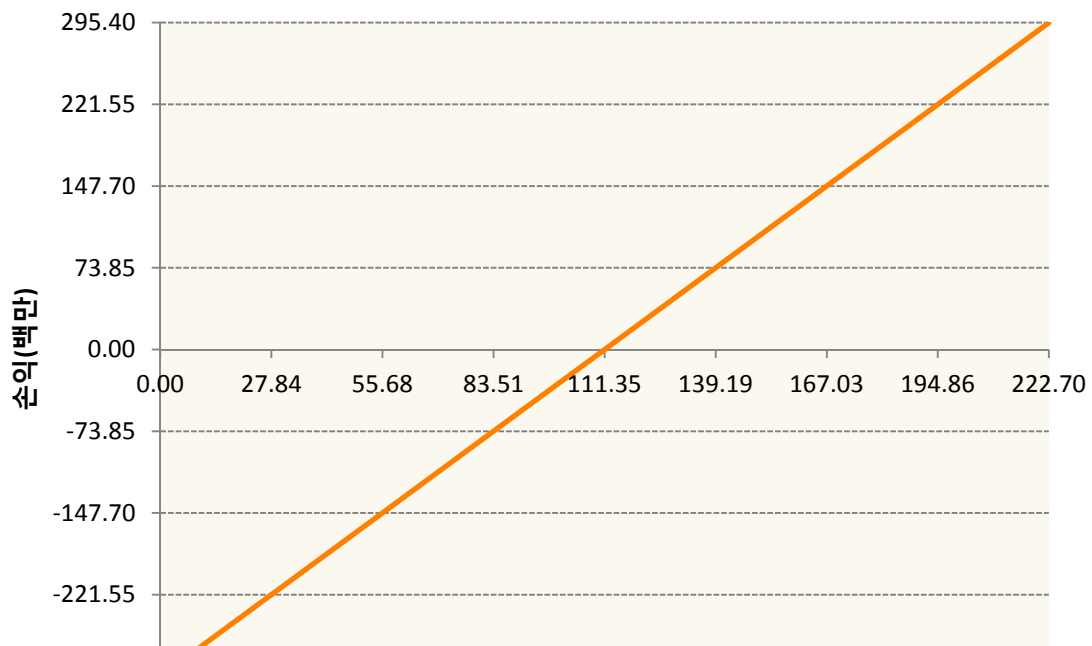


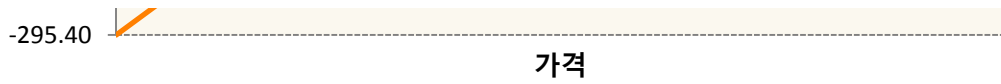


CU9-CORN FUTURE Sep19

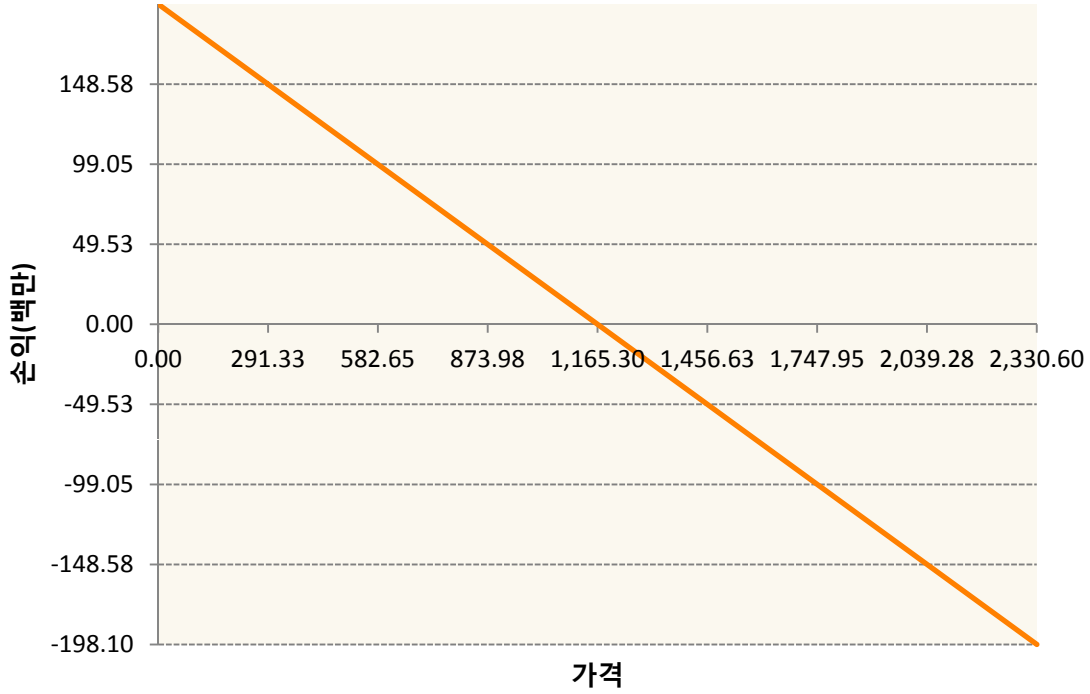


KCU9-COFFEE 'C' FUTURE Sep19

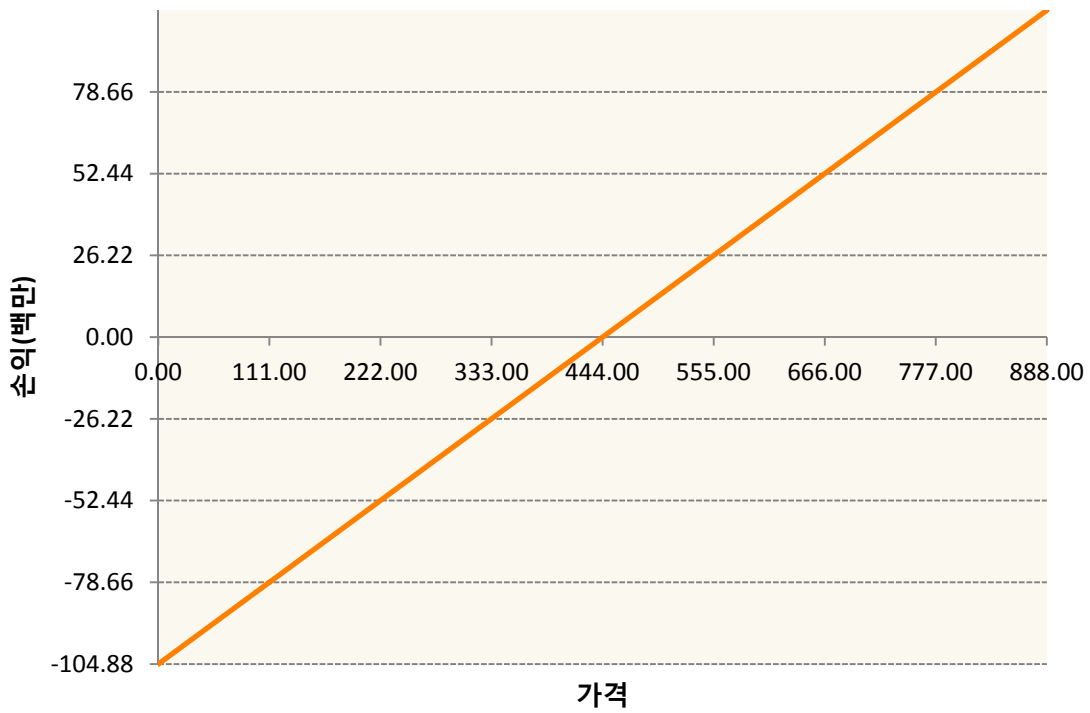




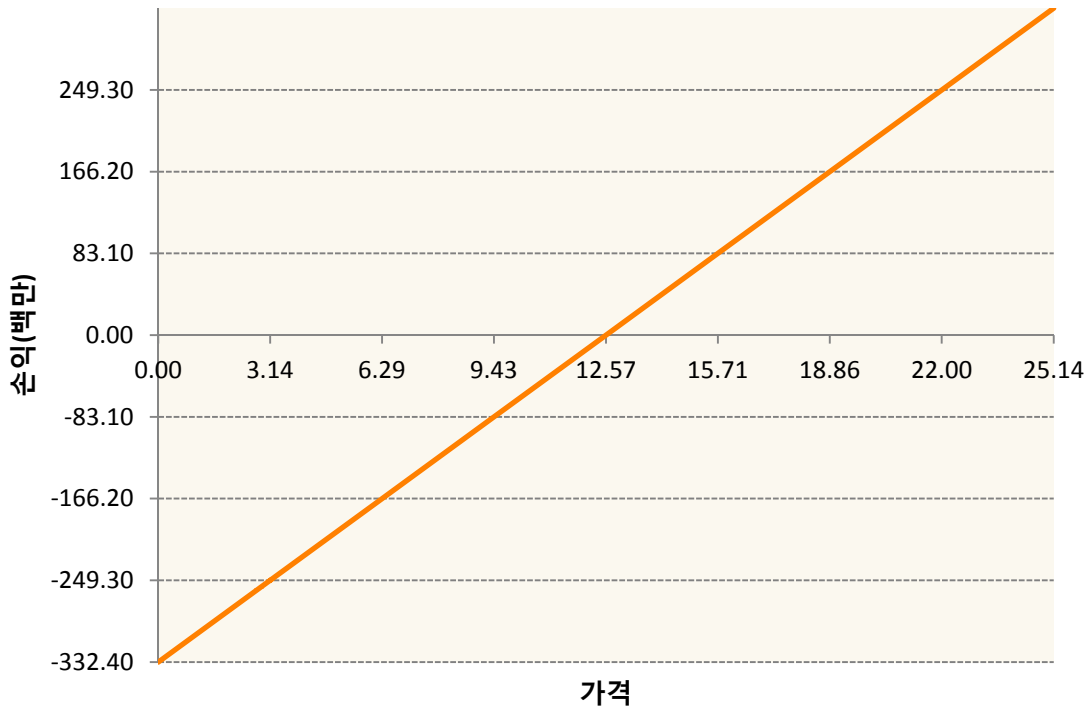
KR4175P70007-2019-07 달러선물



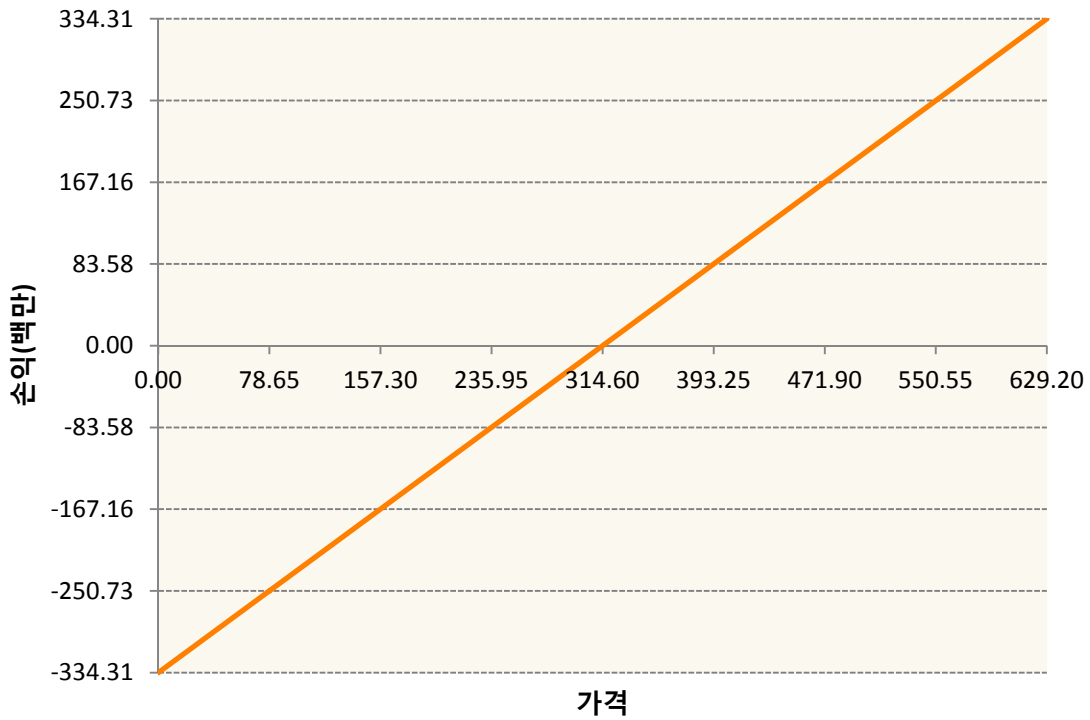
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

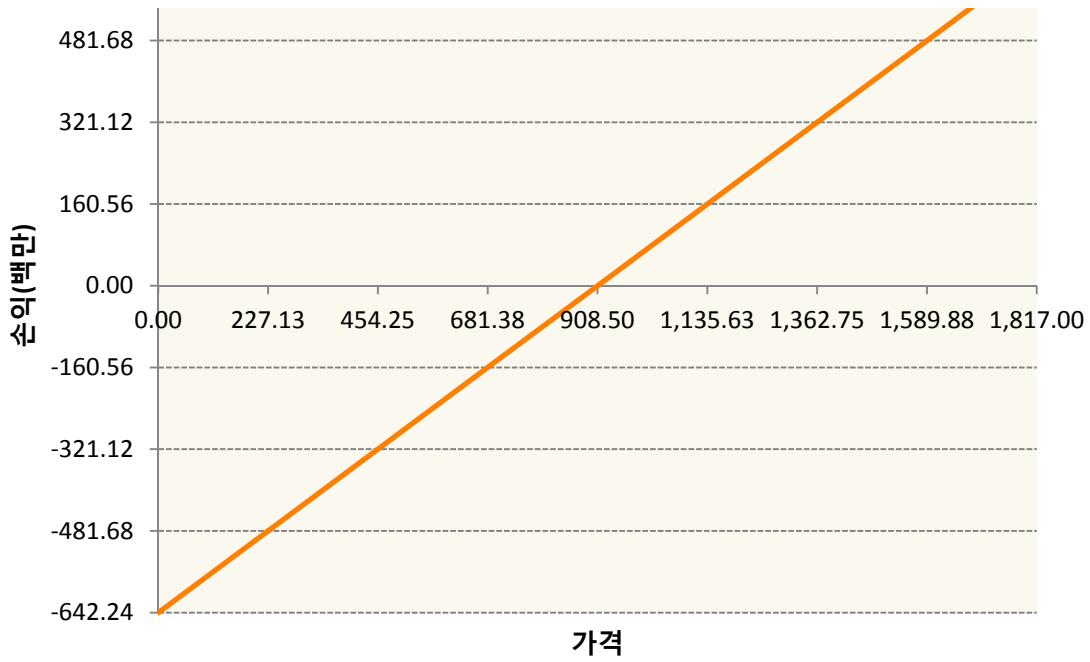


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

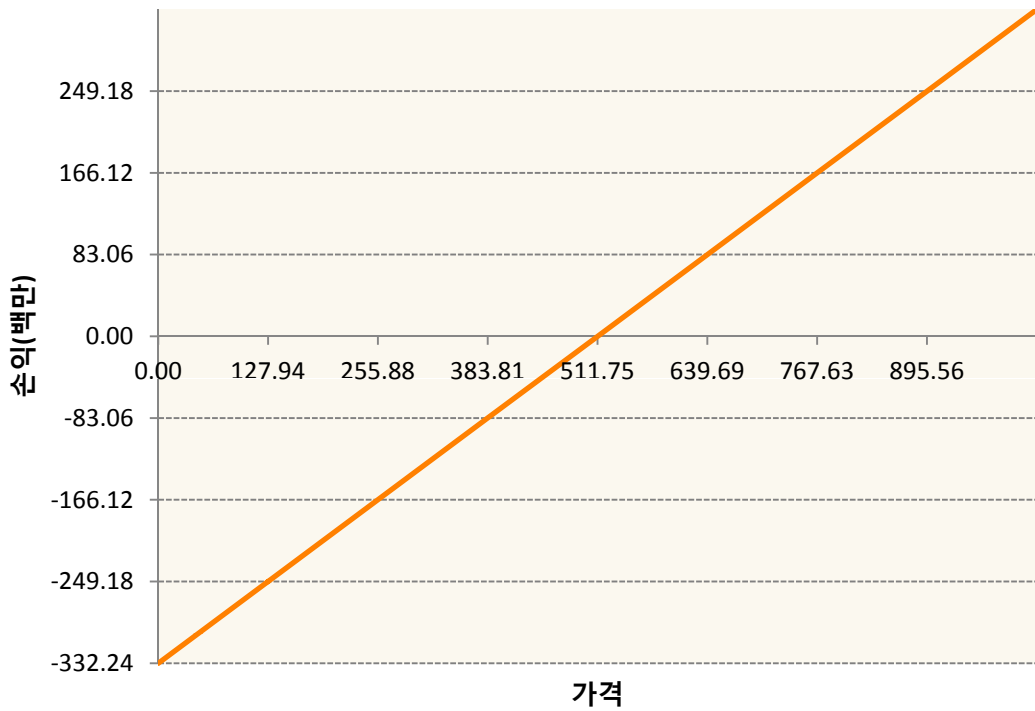


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





WU9-WHEAT FUTURE(CBT) Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	28
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	13
CU9	CORN FUTURE Sep19	55
KCU9	COFFEE 'C' FUTURE Sep19	24
KR4175P700	2019-07 달러선물	16

KWU9	KC HRW WHEAT FUT Sep19	8
SBV9	SUGAR #11 (WORLD) Oct19	27
SMZ9	SOYBEAN MEAL FUTR Dec19	27
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	51
WU9	WHEAT FUTURE(CBT) Sep19	27

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

(단위:백만원)

283