

공시일	2019-07-04
기준일	2019-07-03

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)

91

공시일	2019-07-04
기준일	2019-07-03

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

1,176

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

677

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-04
기준일	2019-07-03

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)	393
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	144

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

878

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-04
기준일	2019-07-03

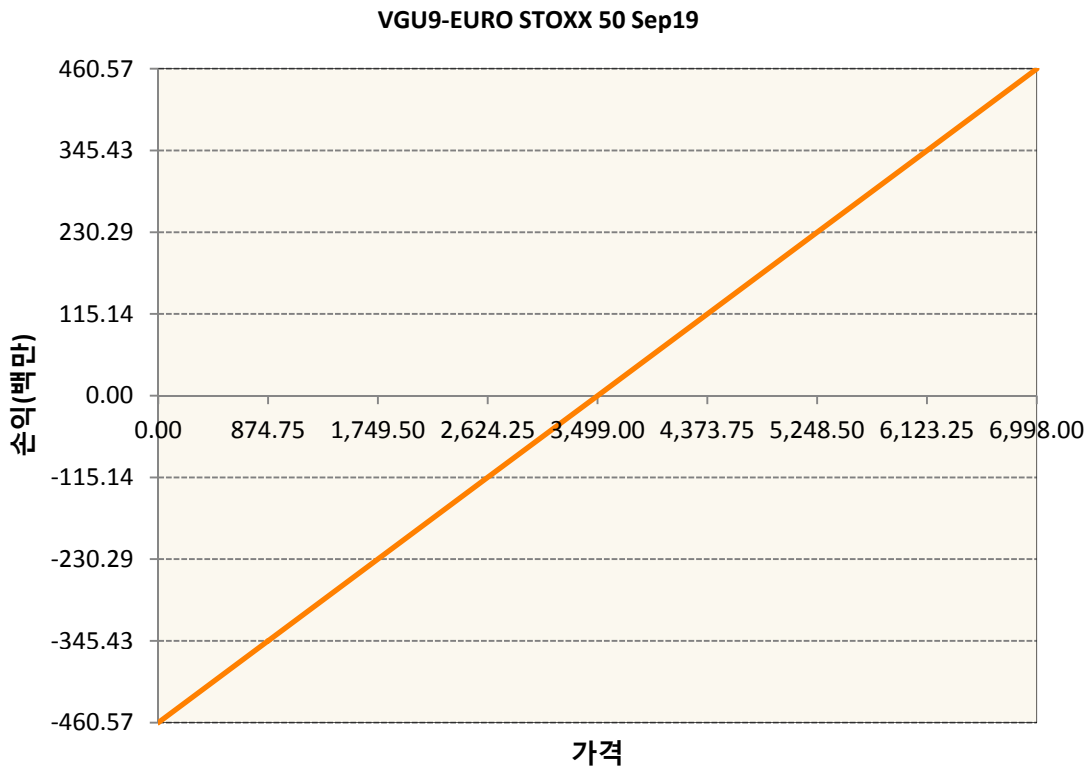
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	461	0	461	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

27

공시일	2019-07-04
기준일	2019-07-03

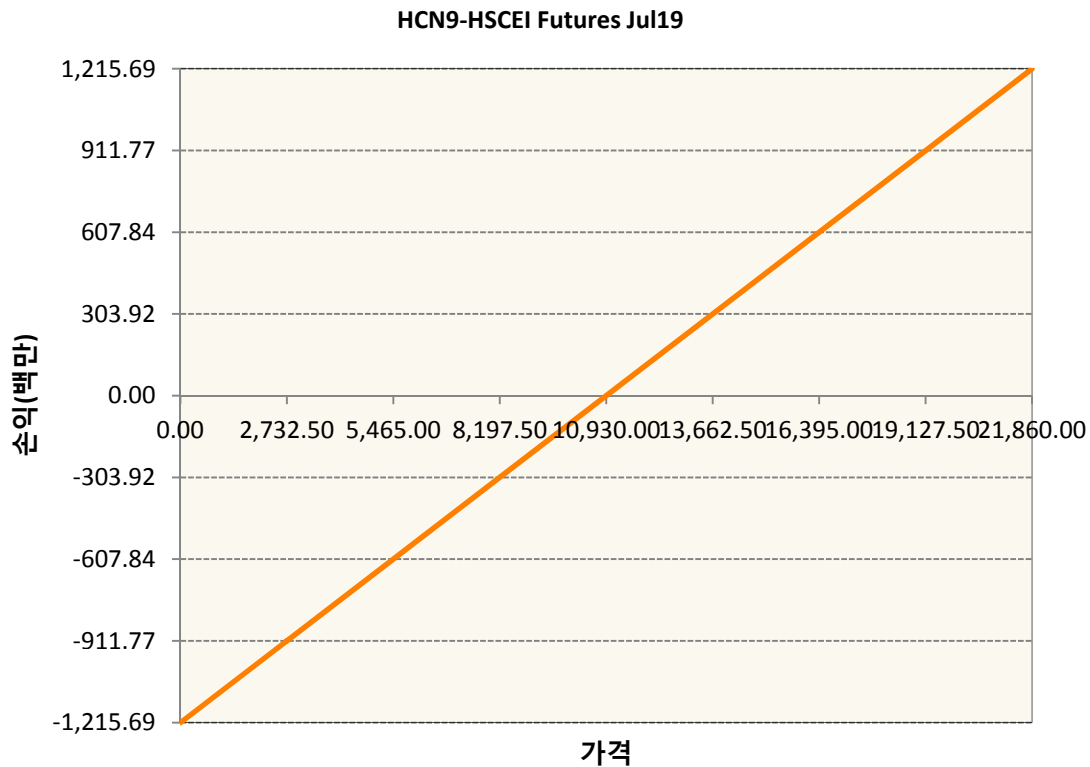
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,216	0	1,216	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN9	HSCEI Futures Jul19	97
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

99

공시일	2019-07-04
기준일	2019-07-03

커버드콜모(주식혼합-파생형)

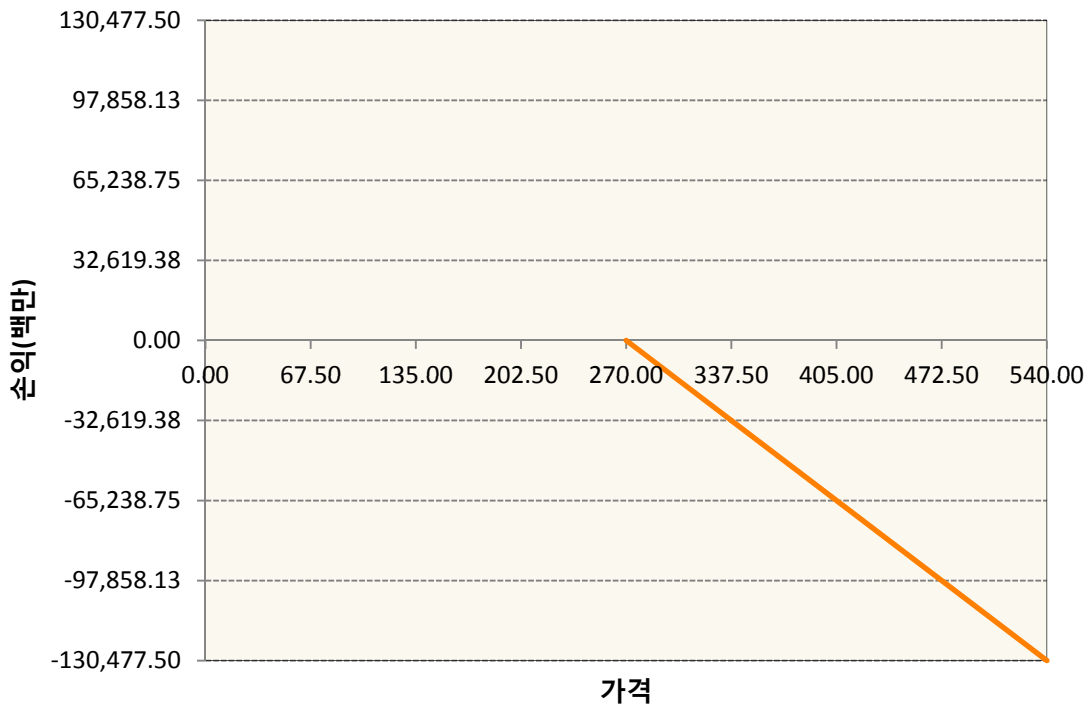
1. 계약금액

(단위:백만원)

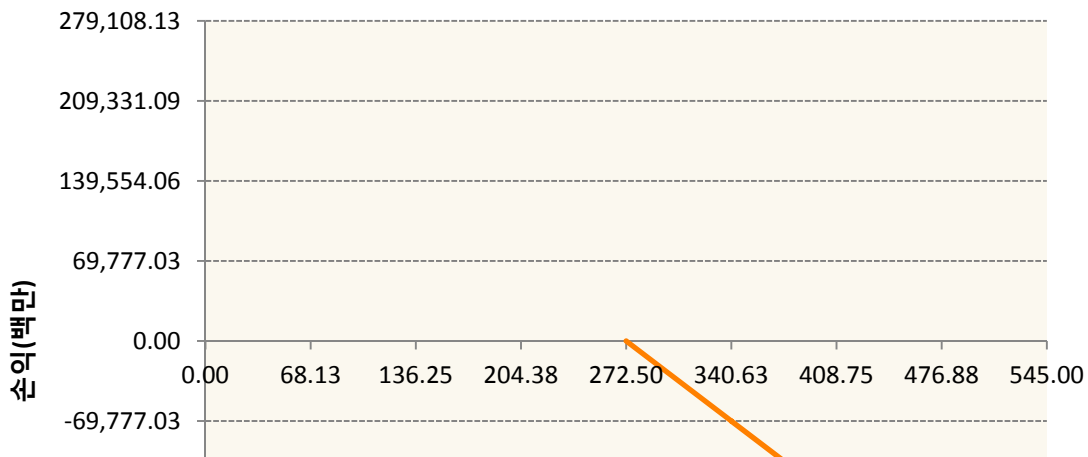
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	591,498	-591,498	장내

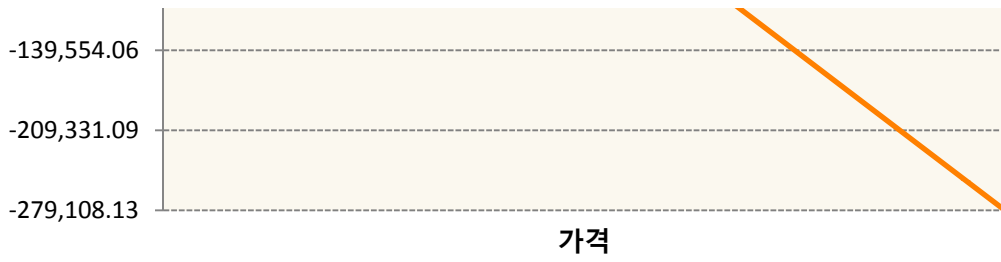
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P72700-2019-07 콜270

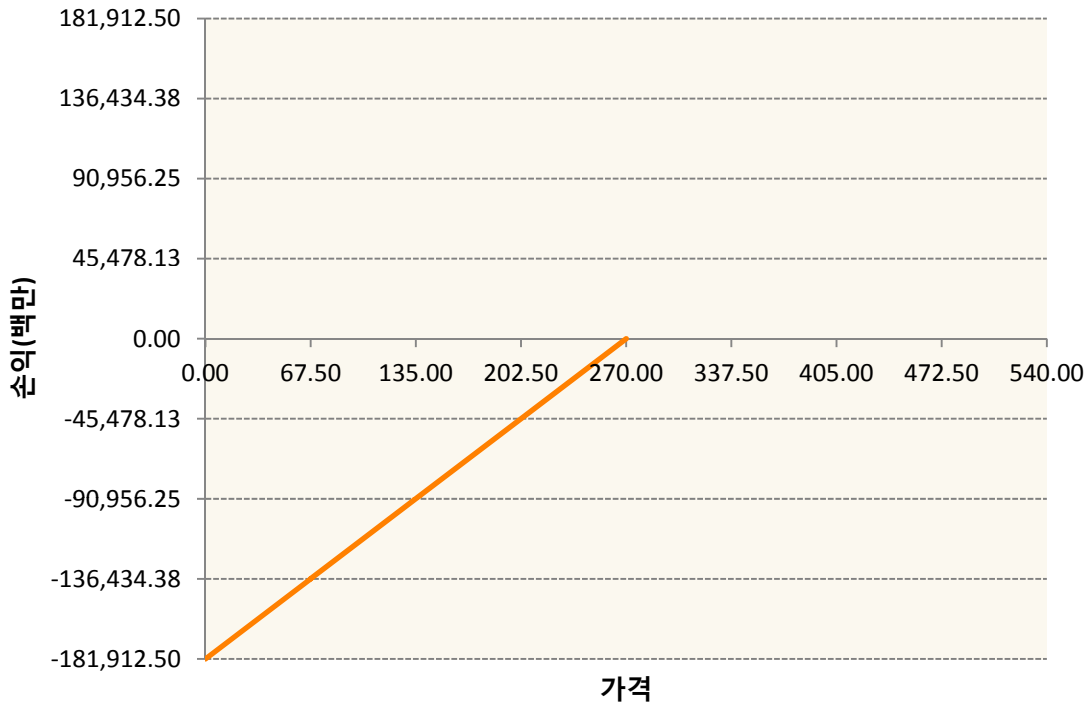


KR4201P72726-2019-07 콜272.5





KR4301P72708-2019-07 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P72700		2019-07 콜270					9,182
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,546	2,540	2,529	2,512	2,489	2,458	2,420
-5.33%	2,479	2,434	2,377	2,310	2,234	2,149	2,057
-2.67%	2,005	1,875	1,739	1,600	1,459	1,314	1,168
0%	466	312	156	0	-157	-315	-473
2.67%	-2,269	-2,349	-2,440	-2,541	-2,649	-2,764	-2,884
5.33%	-5,613	-5,633	-5,661	-5,700	-5,748	-5,806	-5,872
8.00%	-9,103	-9,106	-9,111	-9,120	-9,134	-9,155	-9,182
KR4201P72726		2019-07 콜272.5					18,380
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,031	4,025	4,014	3,994	3,963	3,920	3,864

-5.33%	3,969	3,913	3,836	3,737	3,619	3,481	3,326
-2.67%	3,392	3,175	2,940	2,690	2,429	2,157	1,877
0%	1,029	686	343	0	-343	-686	-1,029
2.67%	-3,982	-4,219	-4,473	-4,740	-5,018	-5,305	-5,600
5.33%	-10,767	-10,843	-10,943	-11,067	-11,212	-11,376	-11,558
8.00%	-18,110	-18,122	-18,145	-18,180	-18,230	-18,297	-18,380
KR4301P72708 2019-07 풋270							12,291
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,289	-12,289	-12,289	-12,289	-12,289	-12,290	-12,291
-5.33%	-7,398	-7,400	-7,404	-7,411	-7,421	-7,436	-7,456
-2.67%	-2,653	-2,715	-2,785	-2,861	-2,943	-3,030	-3,120
0%	325	219	111	0	-112	-226	-341
2.67%	804	793	775	751	720	682	638
5.33%	814	814	813	812	810	807	801
8.00%	814	814	814	814	814	814	813

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

(단위:백만원)

45,441

공시일	2019-07-04
기준일	2019-07-03

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

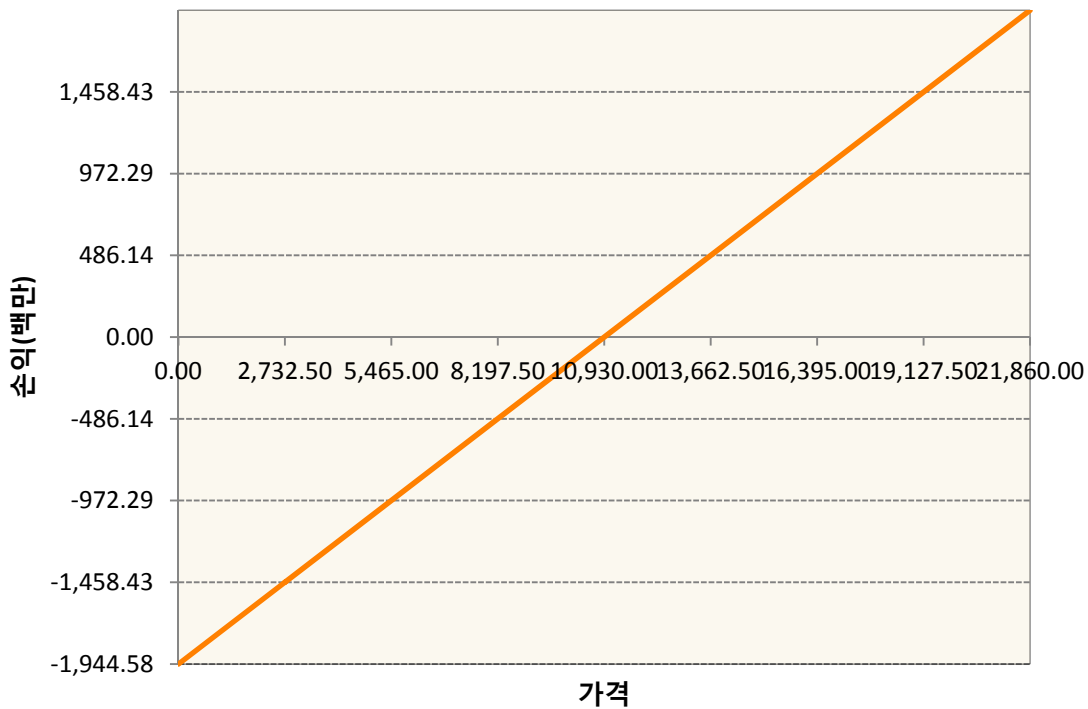
1. 계약금액

(단위:백만원)

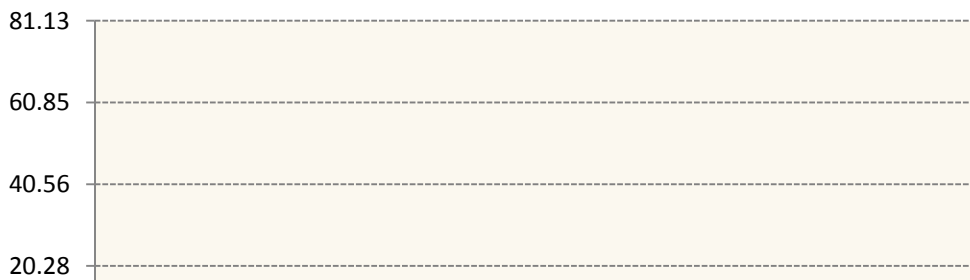
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,945	0	1,945	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,239	-5,239	장내
누계	통화	선도	150	3,155	-3,005	장외

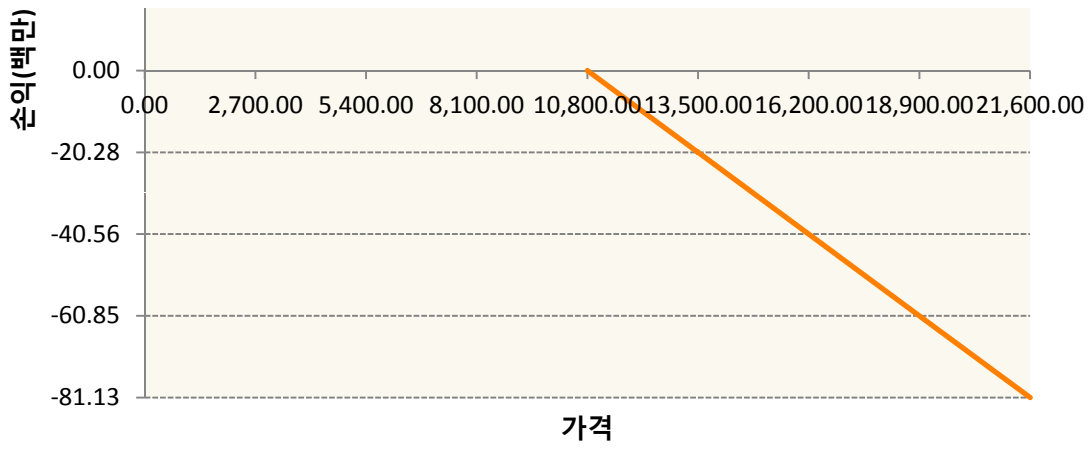
2. 만기시점의 손익구조

HCN9-HSCEI Futures Jul19

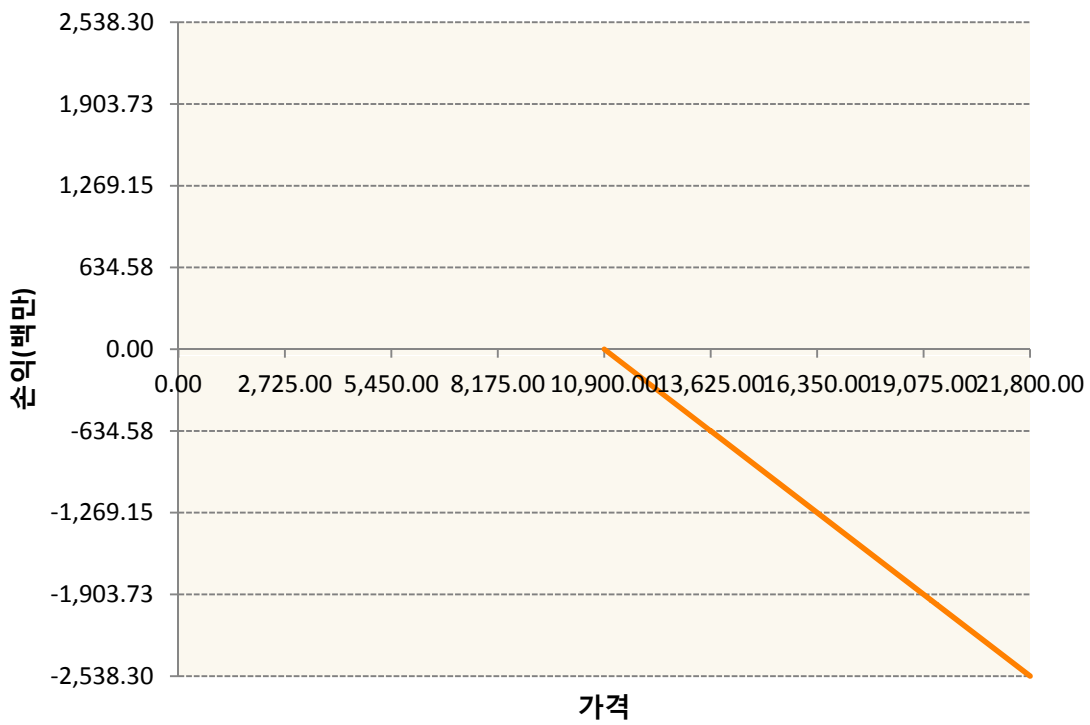


OHHIN9-C108-HSCEI

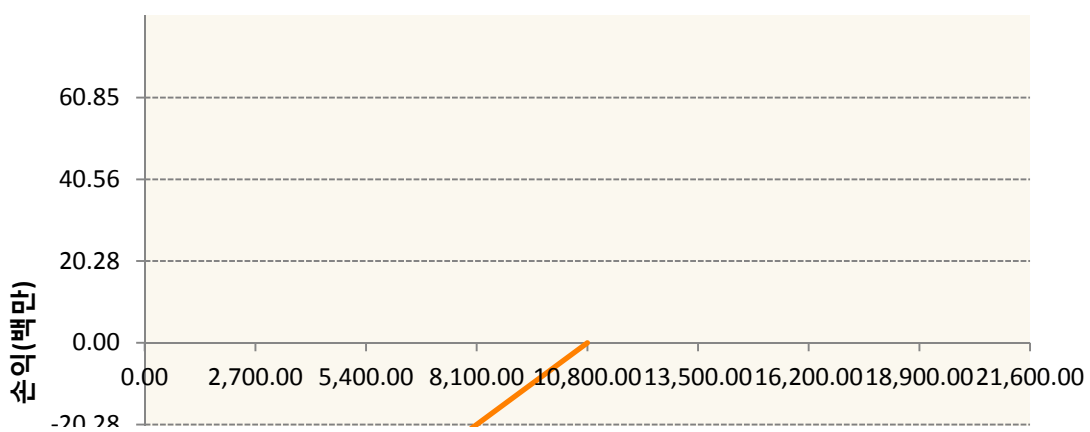


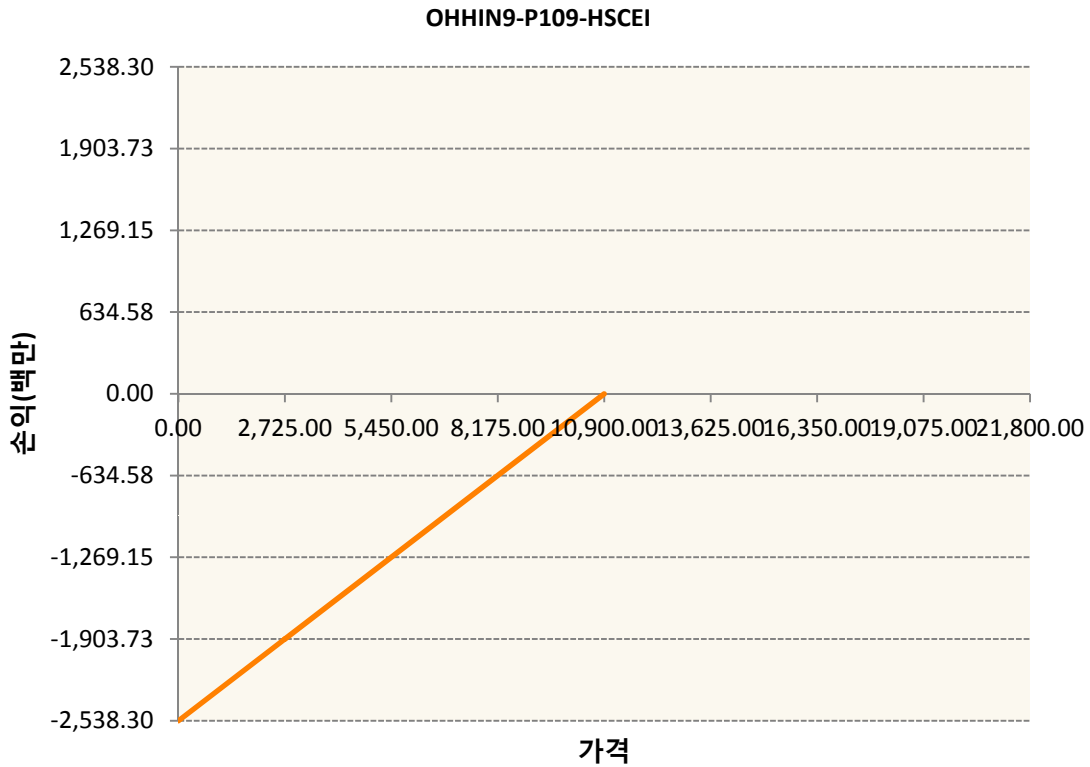
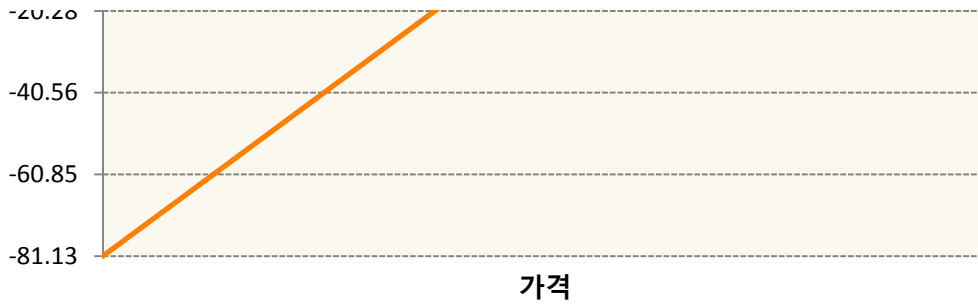


OHHIN9-C109-HSCEI



OHHIN9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E		252
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E		12
HCN9 HSCEI Futures Jul19		156
OHHIN9-C1(HSCEI		6
OHHIN9-C1(HSCEI		203
OHHIN9-P1(HSCEI		6
OHHIN9-P1(HSCEI		203

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	670

공시일	2019-07-04
기준일	2019-07-03

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

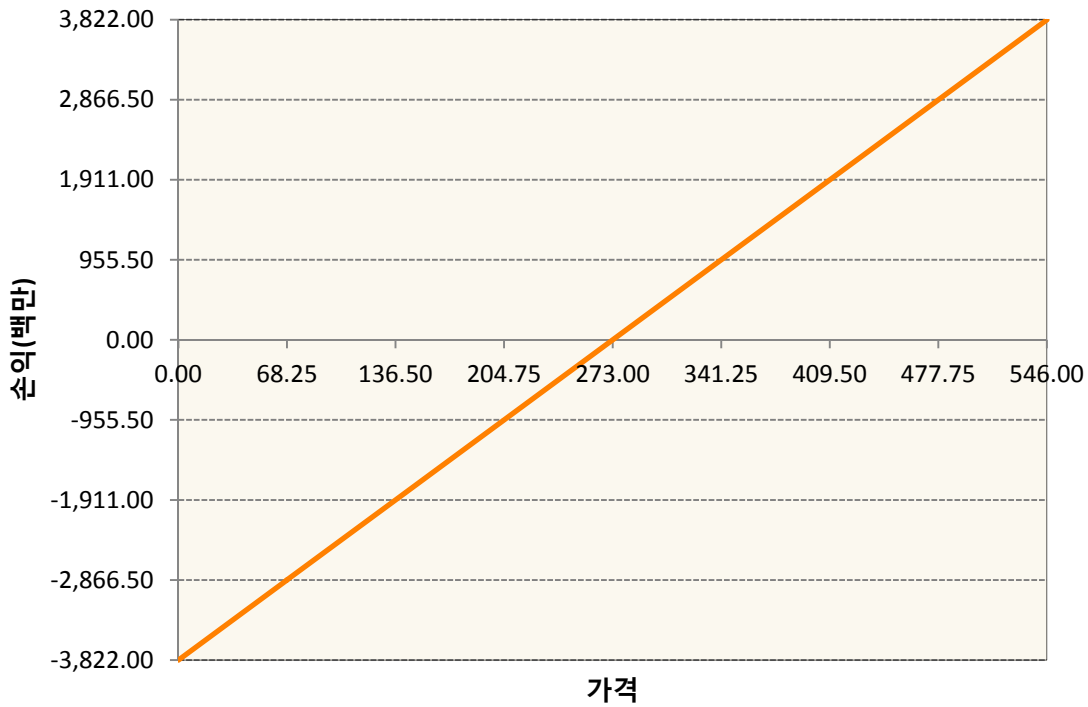
1. 계약금액

(단위:백만원)

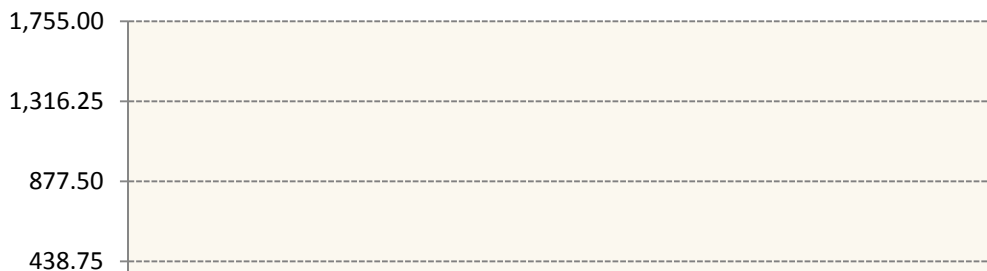
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,822	0	3,822	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,340	-20,340	장내

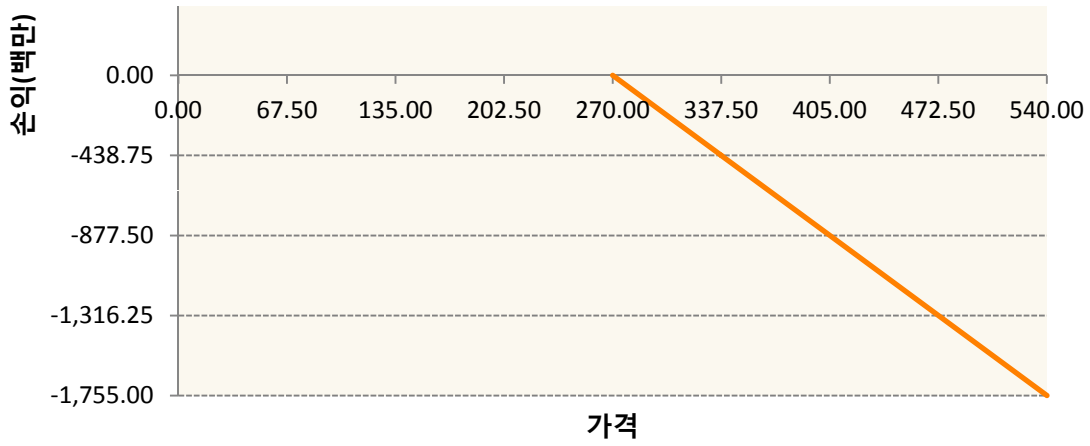
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

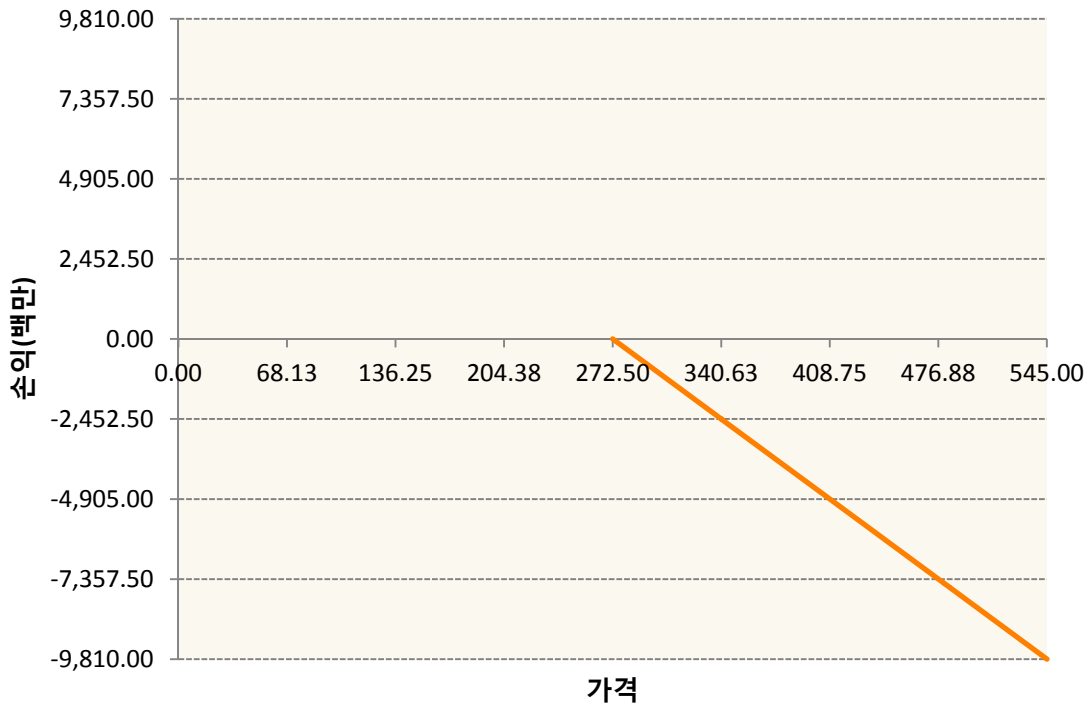


KR4201P72700-2019-07 콜270

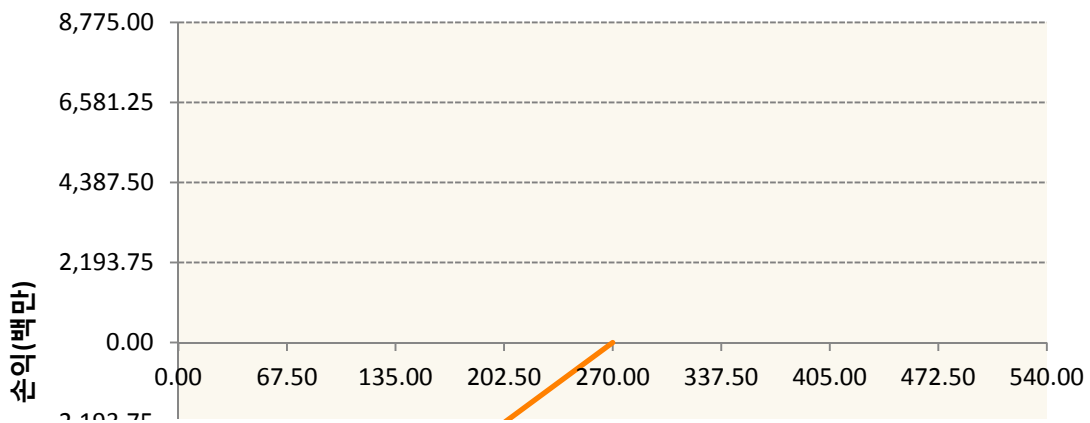




KR4201P72726-2019-07 콜272.5



KR4301P72708-2019-07 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,181
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,181	-1,181	-1,181	-1,181	-1,181	-1,181	-1,181	
-5.33%	-787	-787	-787	-787	-787	-787	-787	
-2.67%	-394	-394	-394	-394	-394	-394	-394	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	394	394	394	394	394	394	394	
5.33%	787	787	787	787	787	787	787	
8.00%	1,181	1,181	1,181	1,181	1,181	1,181	1,181	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						598
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-598	-598	-598	-598	-598	-598	-598	
-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%	598	598	598	598	598	598	598	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						305
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-305	-305	-305	-305	-305	-305	-305	
-5.33%	-203	-203	-203	-203	-203	-203	-203	
-2.67%	-102	-102	-102	-102	-102	-102	-102	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	102	102	102	102	102	102	102	
5.33%	203	203	203	203	203	203	203	
8.00%	305	305	305	305	305	305	305	
KR4201P72700		2019-07 콜270						123
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	34	34	34	34	33	33	33
-5.33%	33	33	32	31	30	29	28
-2.67%	27	25	23	22	20	18	16
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	-31	-32	-33	-34	-36	-37	-39
5.33%	-75	-76	-76	-77	-77	-78	-79
8.00%	-122	-122	-123	-123	-123	-123	-123
KR4201P72726 2019-07 콜272.5							646
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	142	141	141	140	139	138	136
-5.33%	139	138	135	131	127	122	117
-2.67%	119	112	103	95	85	76	66
0%	36	24	12	0	-12	-24	-36
2.67%	-140	-148	-157	-167	-176	-186	-197
5.33%	-378	-381	-385	-389	-394	-400	-406
8.00%	-637	-637	-638	-639	-641	-643	-646
KR4301P72708 2019-07 풋270							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%	-357	-357	-357	-357	-358	-359	-360
-2.67%	-128	-131	-134	-138	-142	-146	-151
0%	16	11	5	0	-5	-11	-16
2.67%	39	38	37	36	35	33	31
5.33%	39	39	39	39	39	39	39
8.00%	39	39	39	39	39	39	39

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

(단위:백만원)

3,598

공시일	2019-07-04
기준일	2019-07-03

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

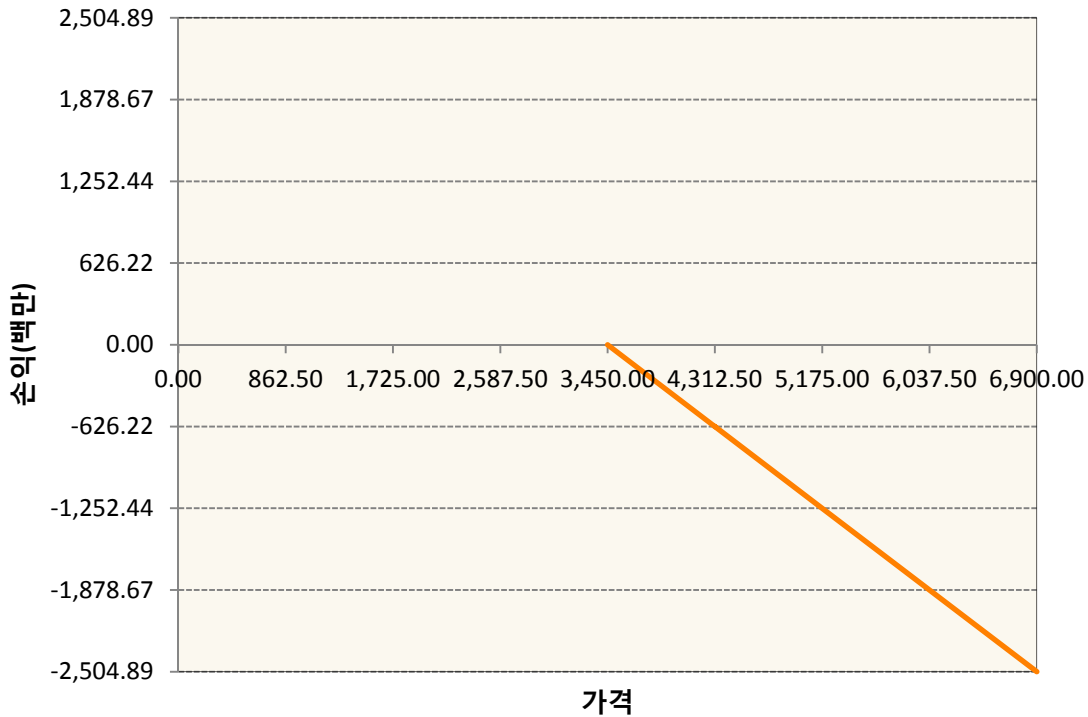
1. 계약금액

(단위:백만원)

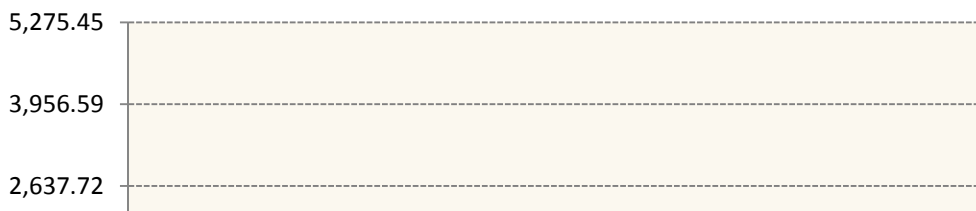
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,336	0	1,336	
누계	유가증권	스왑	55,877	0	55,877	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,561	-15,561	장내
누계	통화	선도	0	18,481	-18,481	장외

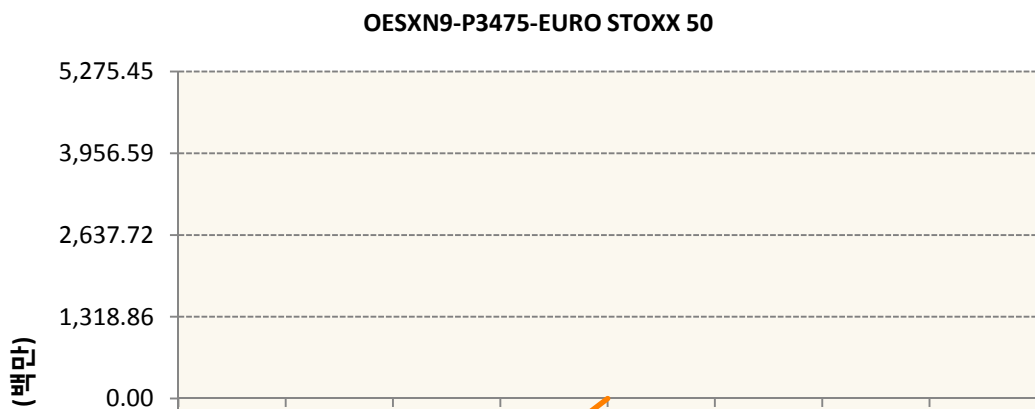
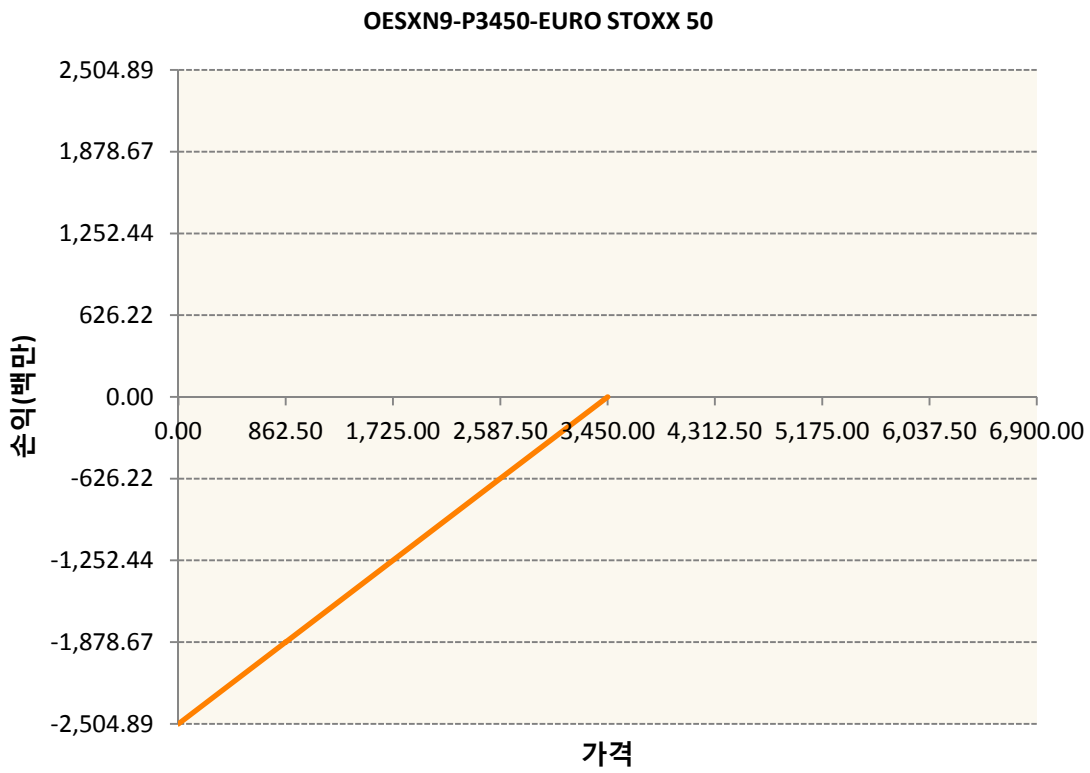
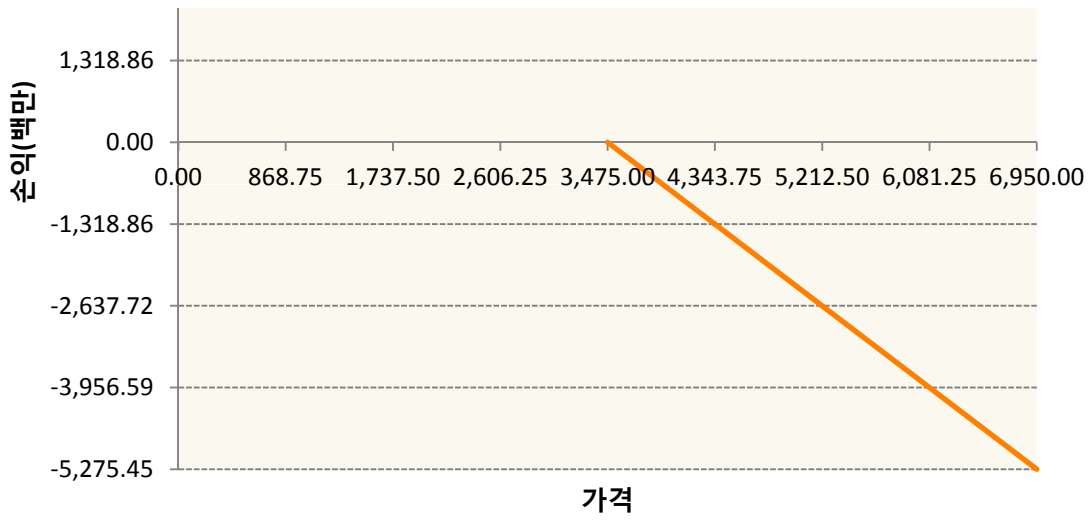
2. 만기시점의 손익구조

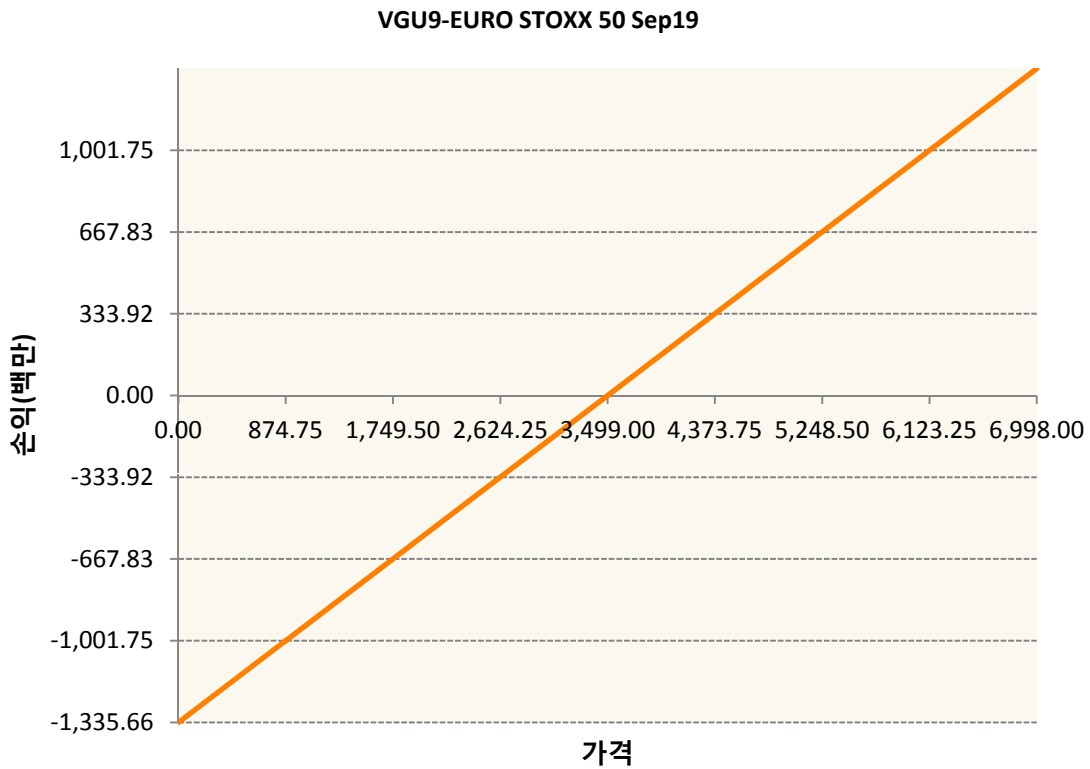
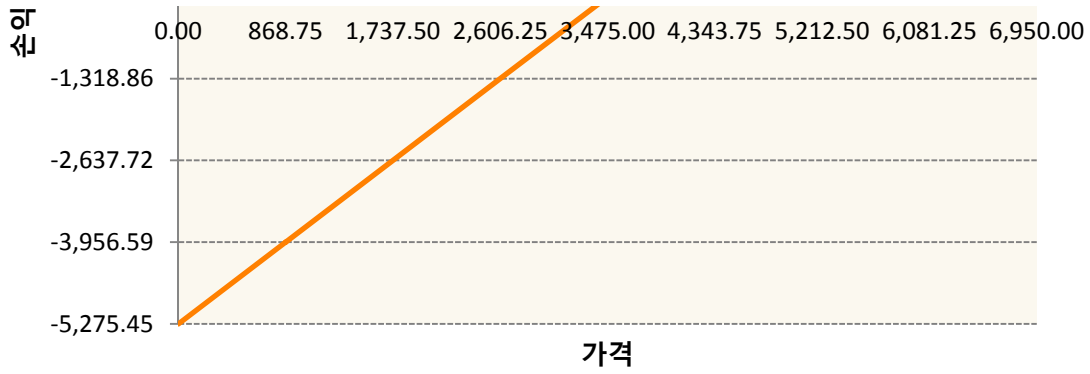
OESXN9-C3450-EURO STOXX 50



OESXN9-C3475-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	92
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	422
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E	1,056
OESXN9-C34 EURO STOXX 50	200
OESXN9-C34 EURO STOXX 50	422
OESXN9-P34 EURO STOXX 50	200
OESXN9-P34 EURO STOXX 50	422
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	107

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

(단위:백만원)

1,775

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

(단위:백만원)

1,026

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

(단위:백만원)

91

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

(단위:백만원)

132

공시일	2019-07-04
기준일	2019-07-03

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

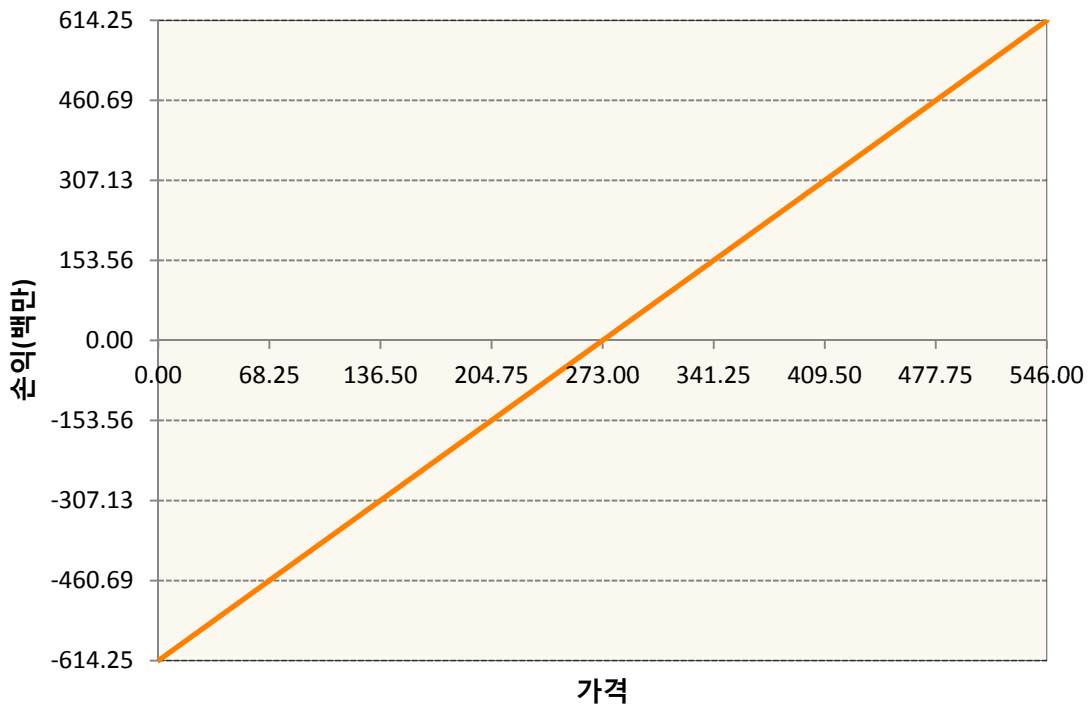
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						49
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	16	16	16	16	16	16	16	
5.33%	33	33	33	33	33	33	33	
8.00%	49	49	49	49	49	49	49	

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-07-04
기준일	2019-07-03

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

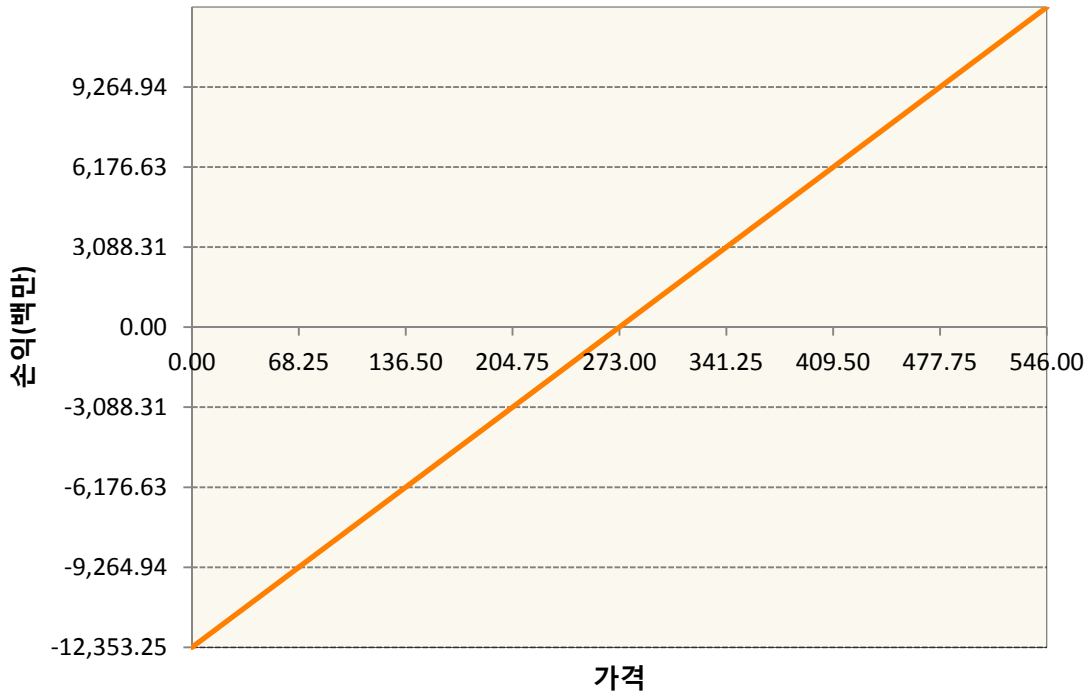
1. 계약금액

(단위:백만원)

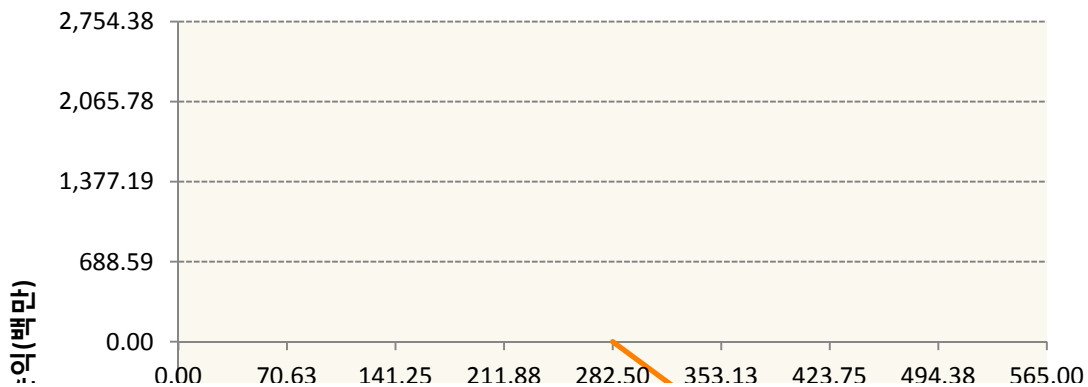
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,353	0	12,353	장내
누계	유가증권	옵션	1,084	22,134	-21,050	장내

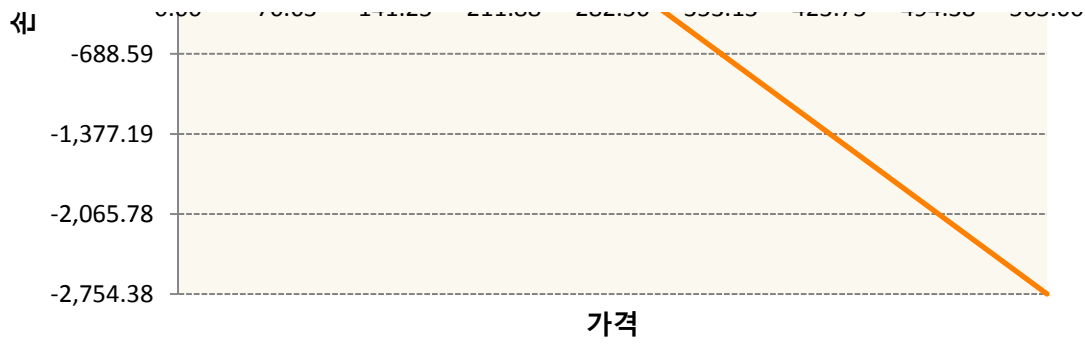
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

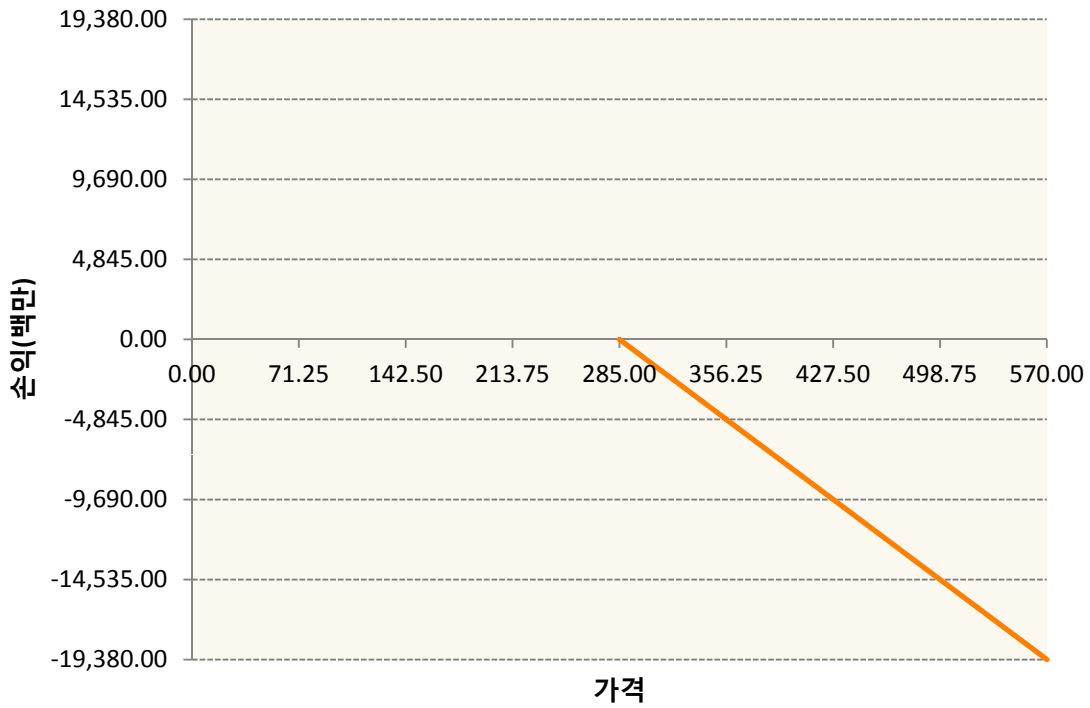


KR4201P72825-2019-07 콜282.5

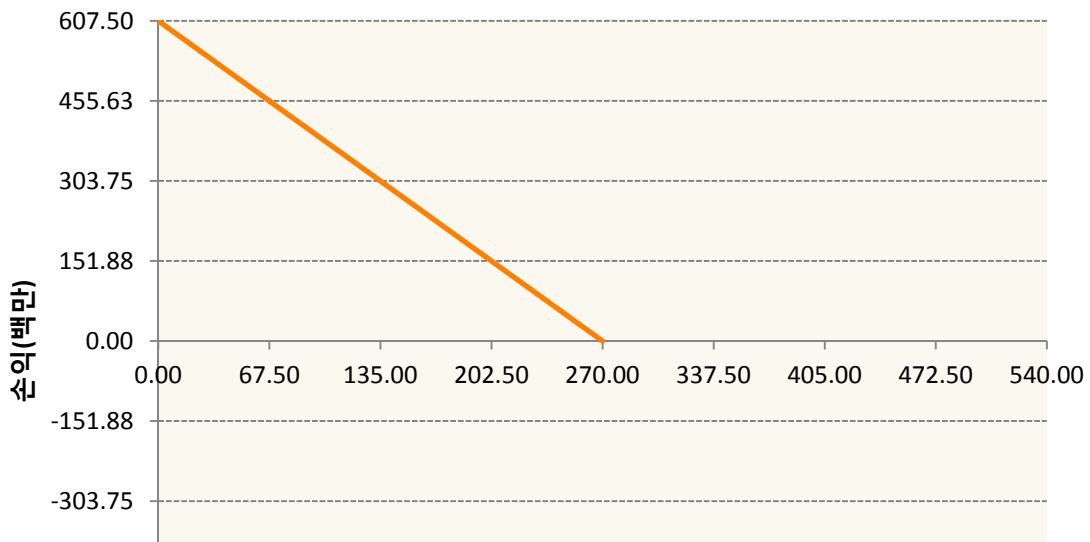


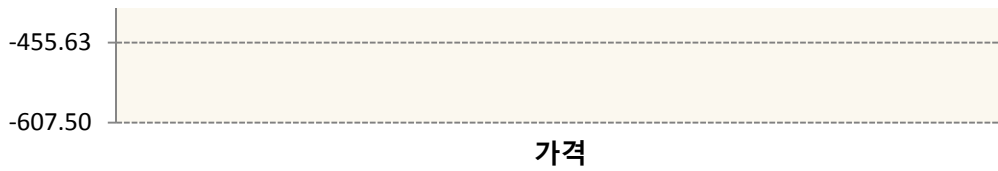


KR4201P72858-2019-07 콜285

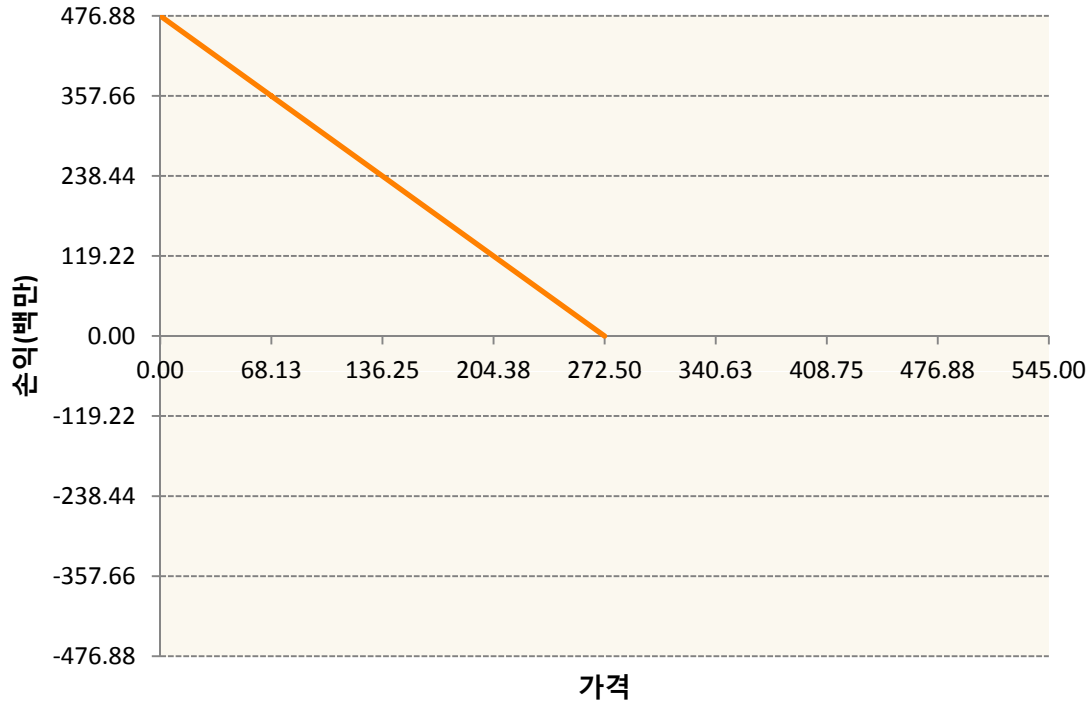


KR4301P72708-2019-07 풋270





KR4301P72724-2019-07 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						986
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-986	-986	-986	-986	-986	-986	-986	
-5.33%	-657	-657	-657	-657	-657	-657	-657	
-2.67%	-329	-329	-329	-329	-329	-329	-329	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	329	329	329	329	329	329	329	
5.33%	657	657	657	657	657	657	657	
8.00%	986	986	986	986	986	986	986	
KR4201P72825		2019-07 콜282.5						119
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	8	8	8	8	8	8	8	
-5.33%	8	8	8	8	8	8	7	
-2.67%	8	8	7	7	6	5	4	

0%	5	4	2	0	-2	-4	-7
2.67%	-10	-13	-16	-19	-23	-26	-29
5.33%	-48	-51	-54	-57	-60	-64	-67
8.00%	-107	-109	-110	-112	-114	-116	-119
KR4201P72858 2019-07 콜285							717
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	37	37	37	37	37	37	36
-5.33%	37	37	37	36	36	34	33
-2.67%	36	35	33	31	27	22	15
0%	26	19	10	0	-12	-24	-38
2.67%	-40	-59	-79	-100	-120	-142	-163
5.33%	-247	-270	-294	-317	-341	-365	-388
8.00%	-618	-631	-646	-663	-680	-698	-717
KR4301P72708 2019-07 풋270							41
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	41	41	41	41	41	41	41
-5.33%	25	25	25	25	25	25	25
-2.67%	9	9	9	10	10	10	10
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-3	-3	-3	-3	-2	-2	-2
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
KR4301P72724 2019-07 풋272.5							34
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	34	34	34	34	34	34	34
-5.33%	22	22	22	22	22	22	22
-2.67%	9	9	9	9	10	10	10
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-4	-4	-4	-4	-3	-3	-3
5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4

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

(단위:백만원)

1,471

공시일	2019-07-04
기준일	2019-07-03

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	19,371	0	19,371	

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	2019-07-04
기준일	2019-07-03

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	61,305	0	61,305	

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	2019-07-04
기준일	2019-07-03

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	357,367	0	357,367	
누계	통화	선도	0	353,288	-353,288	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		469
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		469
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		375
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		787
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		281
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		937
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		187
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		871
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		1,040
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		1,874
FX21019M00 KRW/USD 15-07-19E		469
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		375
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		656
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		937
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		656
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		656
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		562
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		2,999
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		2,249
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E		281
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E		281
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E		787
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E		628
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E		469
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		1,874
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		1,874

FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E	693
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E	693
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E	1,293
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E	2,541

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

(단위:백만원)

9,293

공시일	2019-07-04
기준일	2019-07-03

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

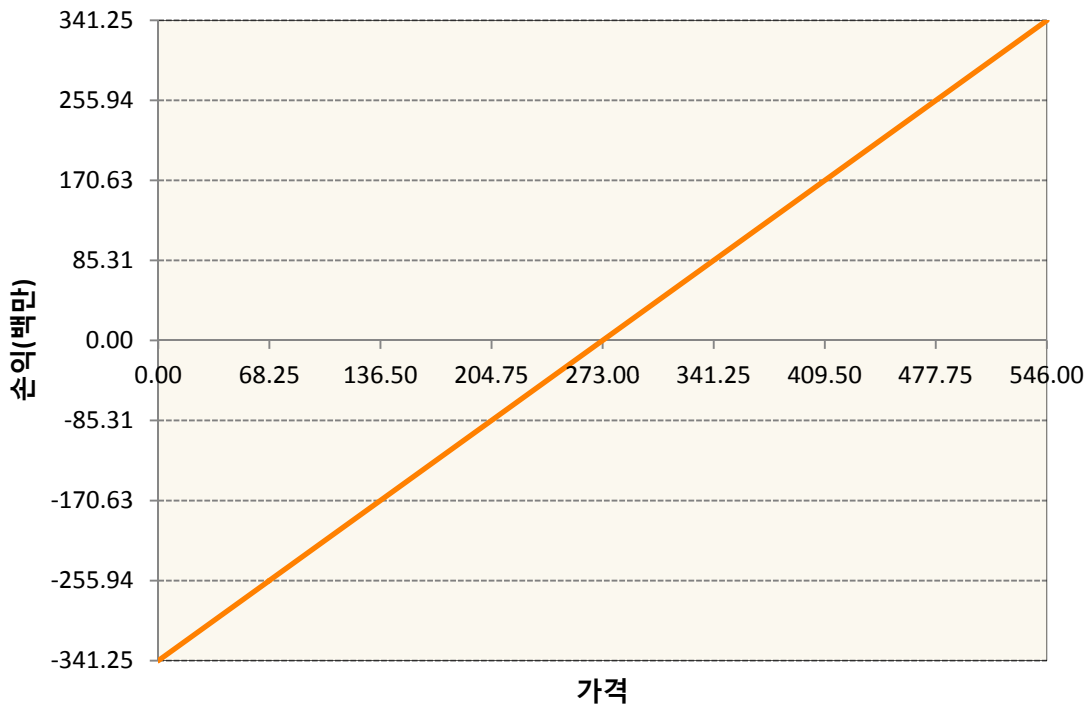
1. 계약금액

(단위:백만원)

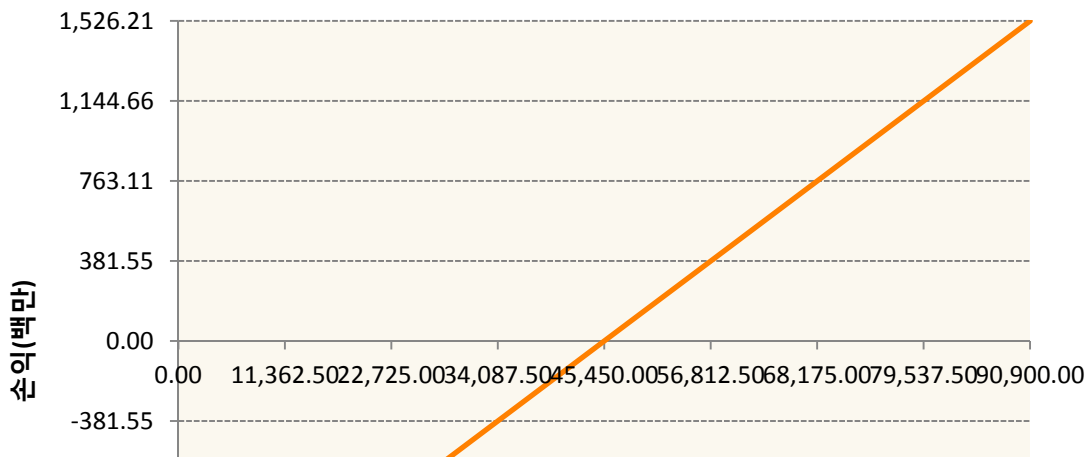
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,867	0	1,867	장내

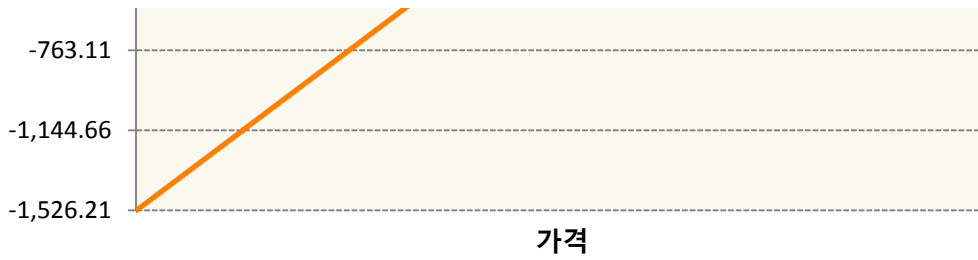
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P70002-2019-07 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						27
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27	
-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%	27	27	27	27	27	27	27	
KR4111P70002		2019-07 삼성전자개별선물						122
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-122	-122	-122	-122	-122	-122	-122	
-5.33%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81	
-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%	81	81	81	81	81	81	81	
8.00%	122	122	122	122	122	122	122	

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

165

공시일	2019-07-04
기준일	2019-07-03

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

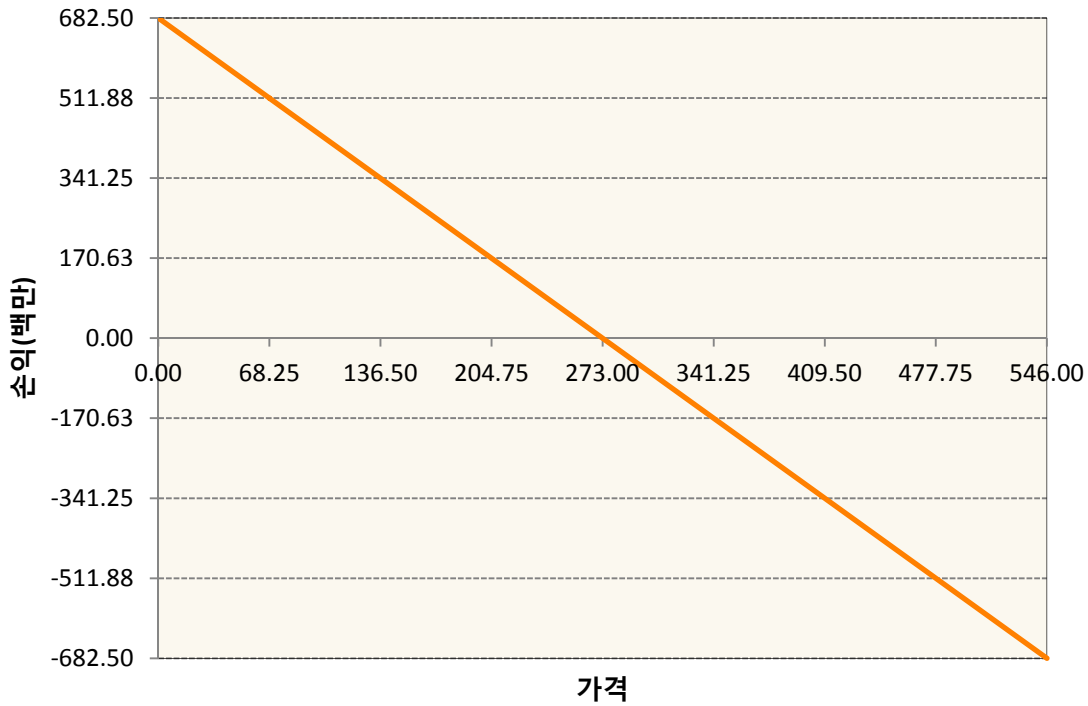
1. 계약금액

(단위:백만원)

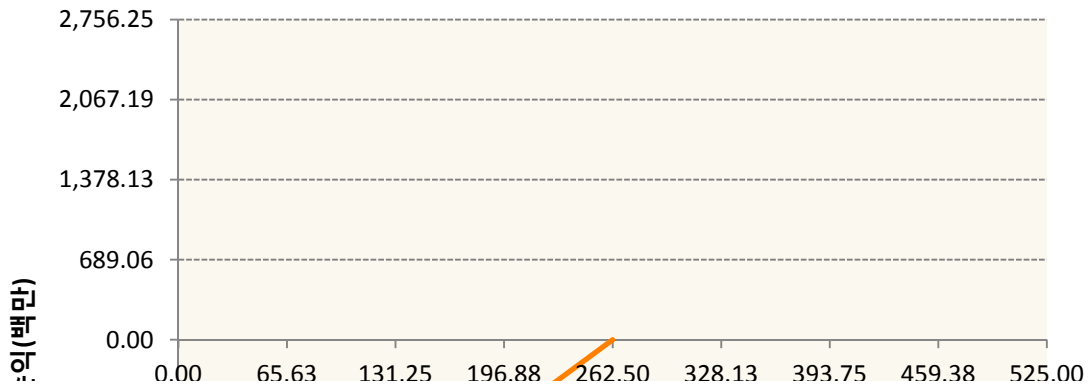
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	683	-683	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,485	-3,485	장내

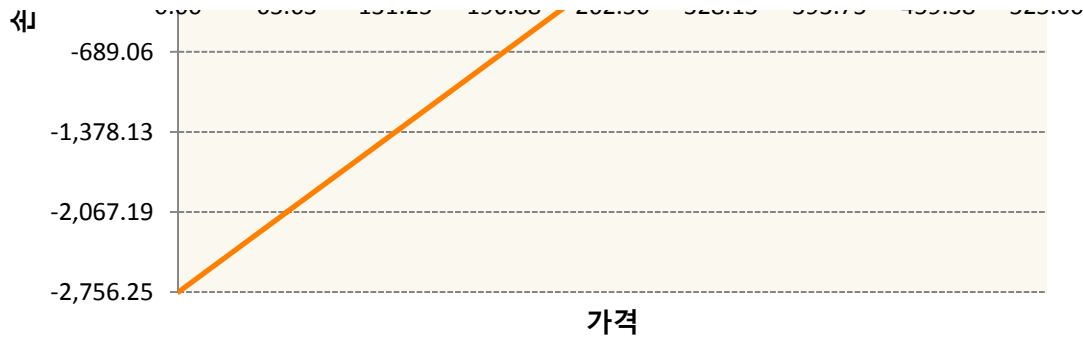
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

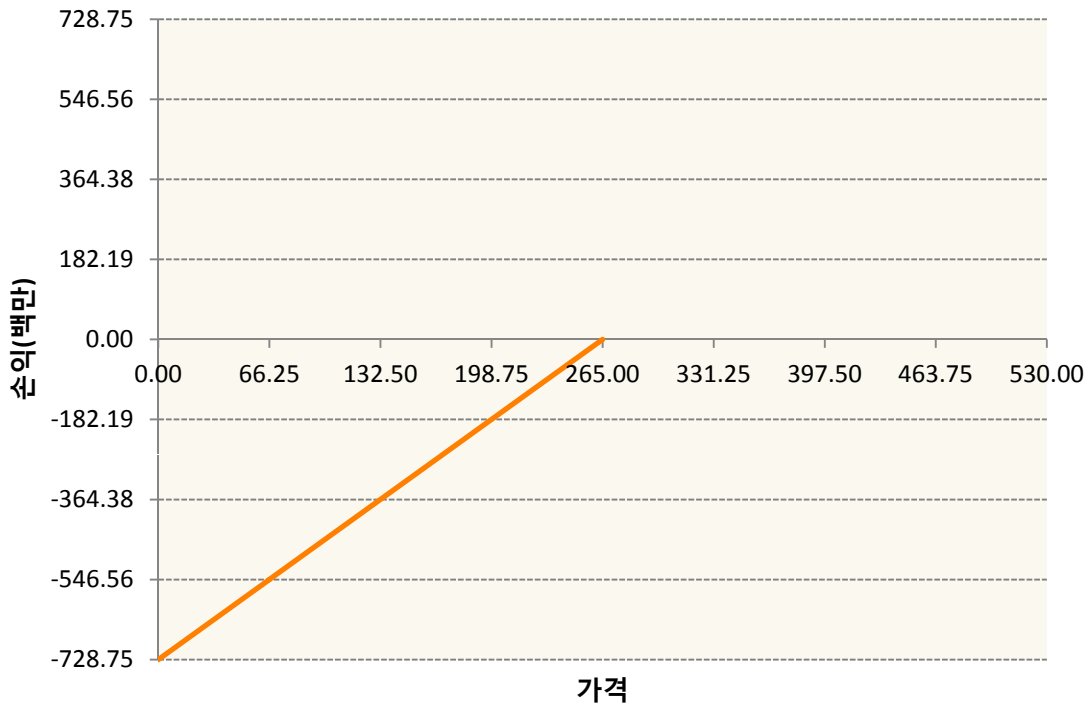


KR4301P72625-2019-07 풋262.5





KR4301P72658-2019-07 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						54
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	54	54	54	54	54	54	54	
-5.33%	36	36	36	36	36	36	36	
-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%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	
8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54	
KR4301P72625		2019-07 풋262.5						126
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-126
-5.33%	-51	-52	-53	-54	-55	-57	-58
-2.67%	-6	-7	-9	-11	-12	-14	-16
0%	1	1	0	0	0	-1	-2
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

KR4301P72658

2019-07 풋265

39

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-5.33%	-19	-19	-20	-20	-20	-20	-20
-2.67%	-4	-4	-5	-5	-6	-6	-7
0%	0	0	0	0	0	0	-1
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

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

(단위:백만원)

142

공시일	2019-07-04
기준일	2019-07-03

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	3,982	-3,982	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019M0:KRW/USD 24-07-19E	141
FX21019M0:KRW/USD 24-07-19E	178

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

(단위:백만원)

105

공시일	2019-07-04
기준일	2019-07-03

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

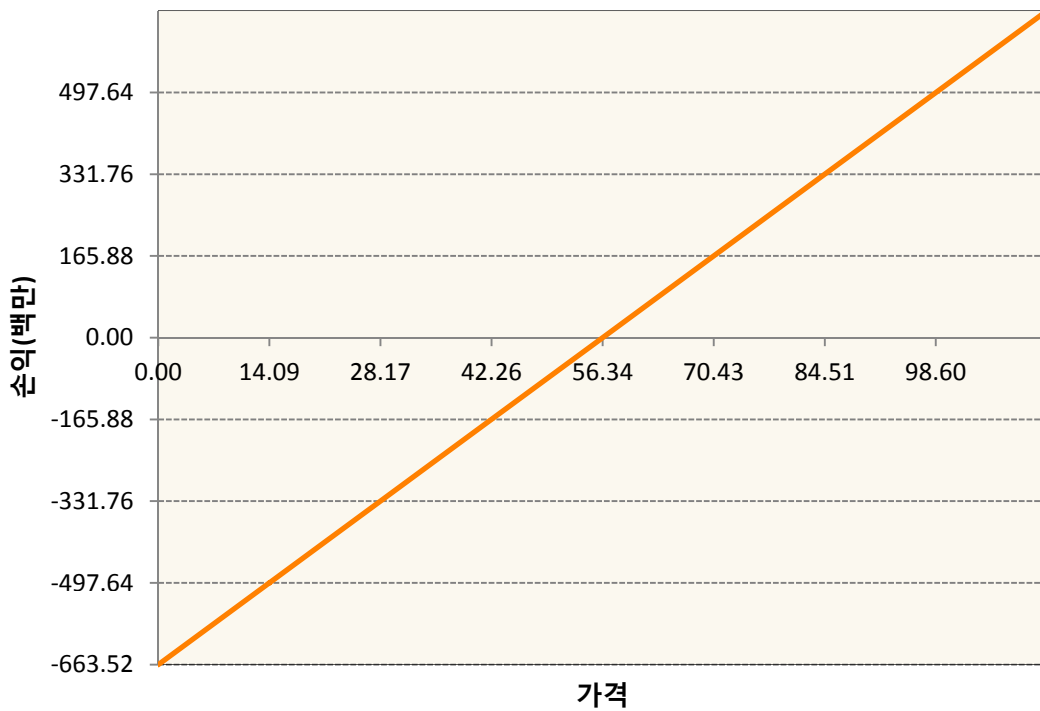
1. 계약금액

(단위:백만원)

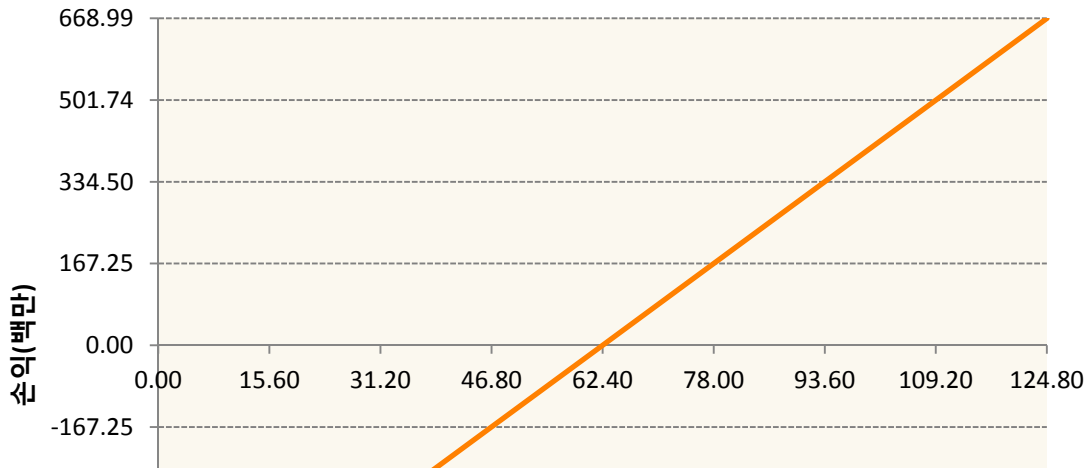
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,642	117	2,525	

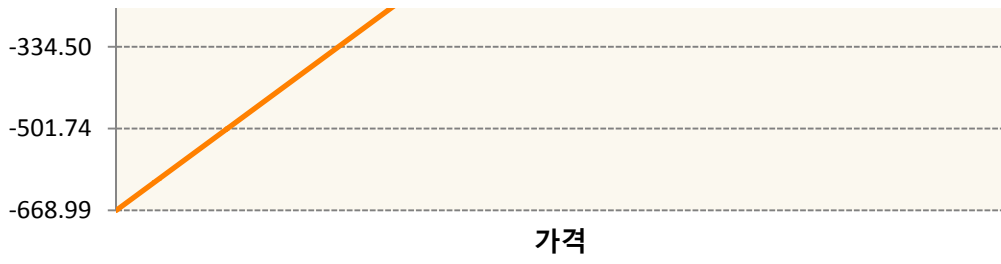
2. 만기시점의 손익구조

CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19

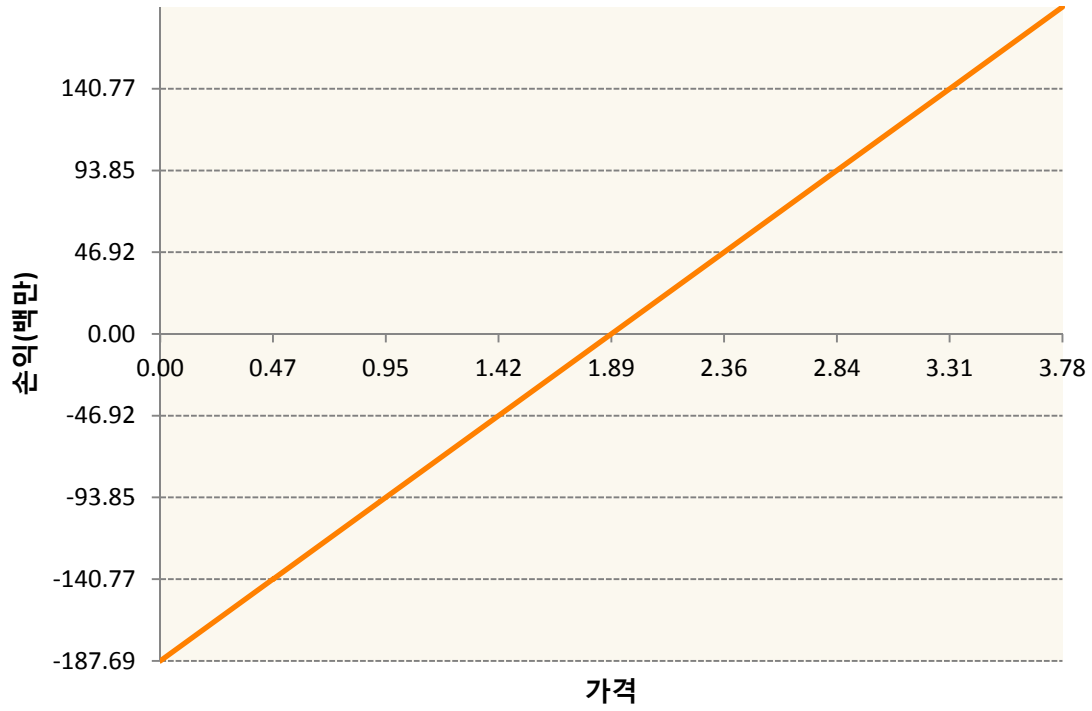


COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19

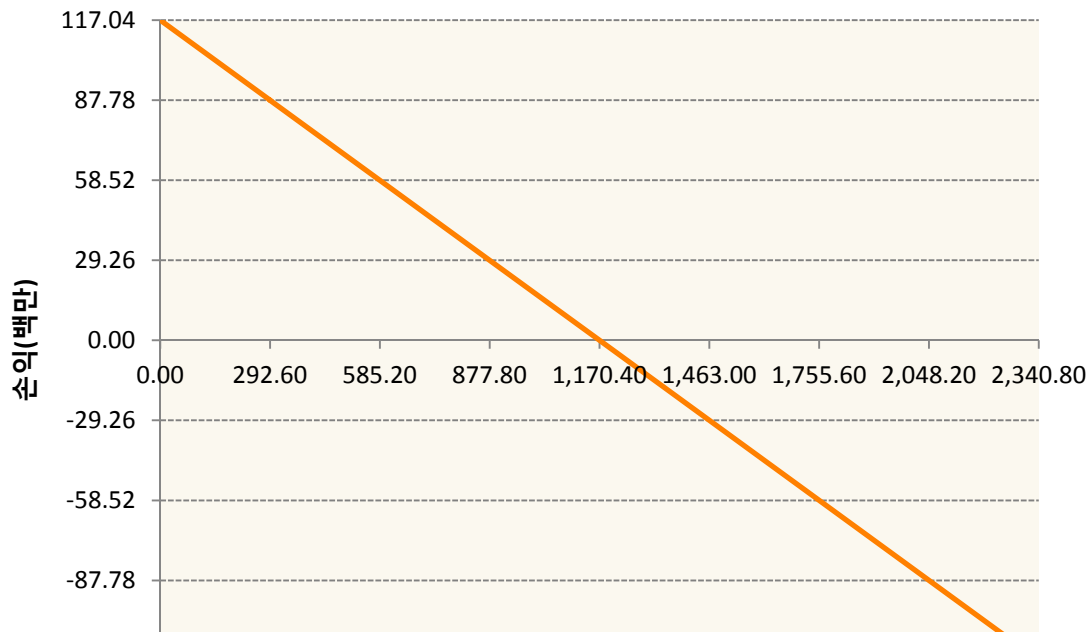


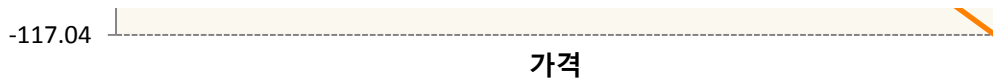


HOU9-NY Harb ULSD Fut Sep19

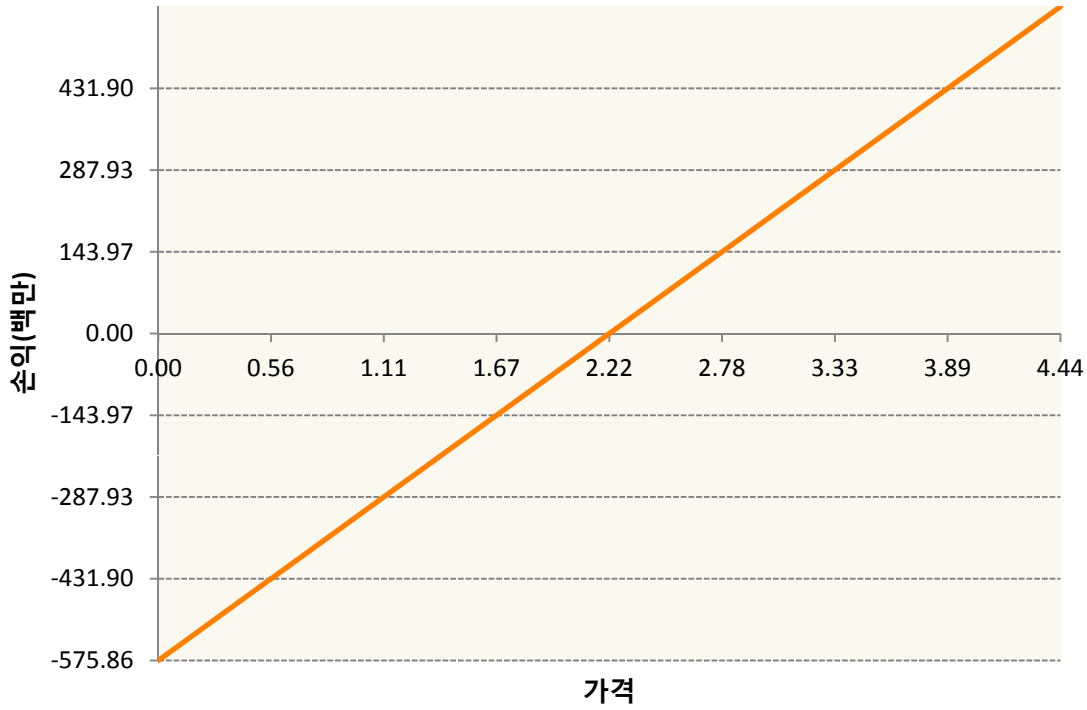


KR4175P70007-2019-07 달러선물

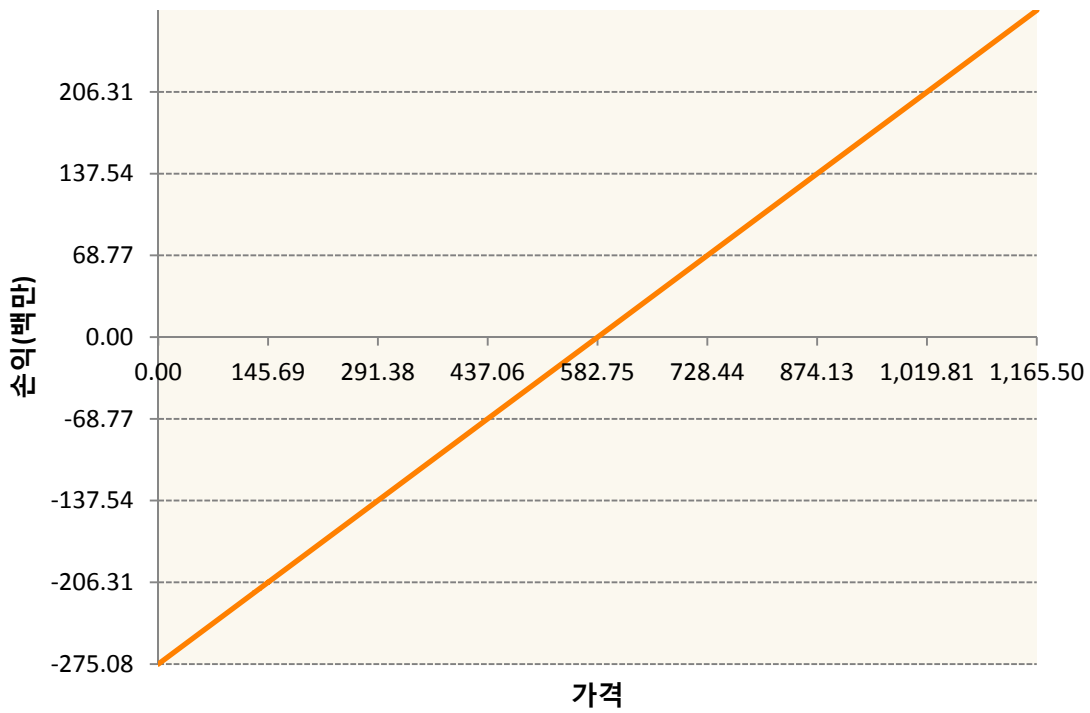




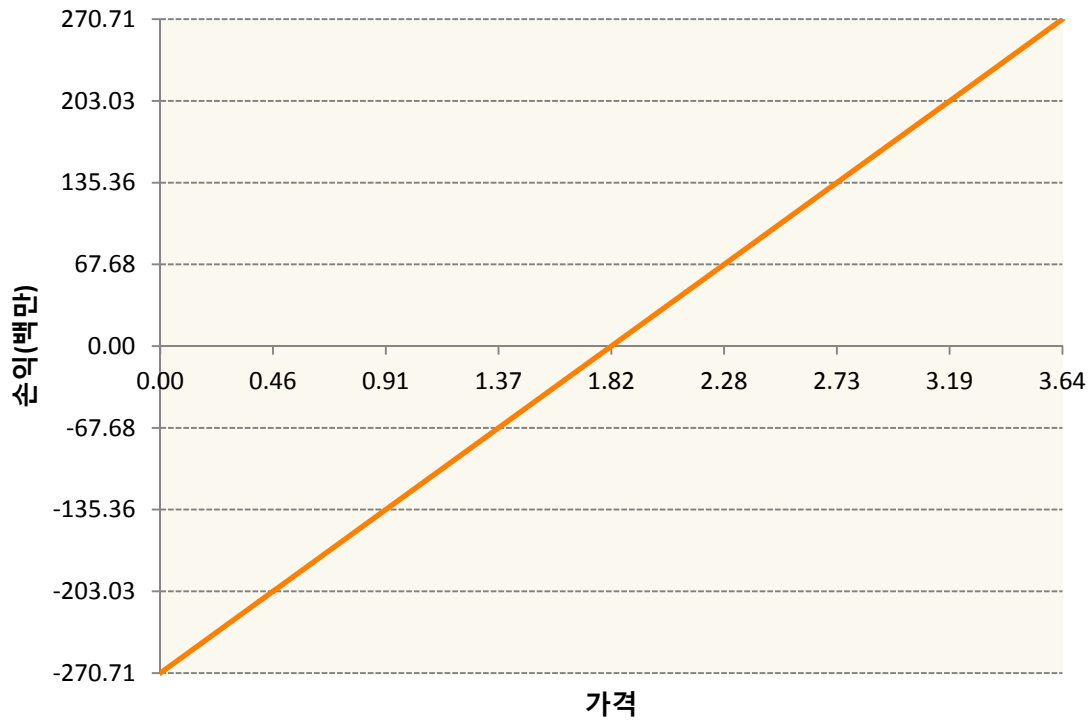
NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



QSU9-Low Su Gasoil G Sep19



XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	53
COU9	BRENT CRUDE FUTR Sep19	54
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	15
KR4175P700	2019-07 달러선물	9
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	46
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	22
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	22

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

393

공시일	2019-07-04
기준일	2019-07-03

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

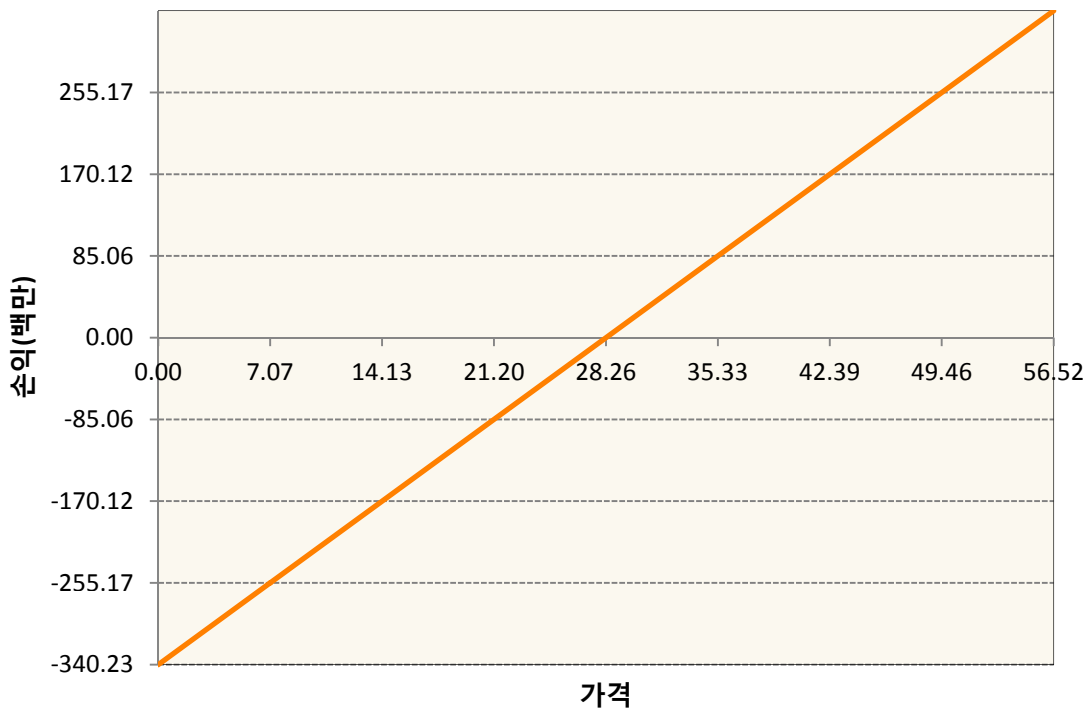
1. 계약금액

(단위:백만원)

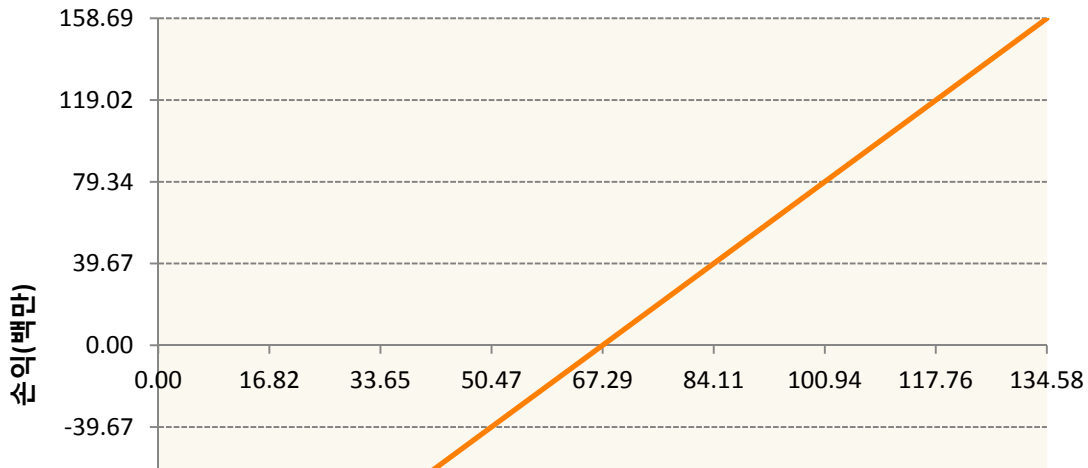
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,206	199	3,007	

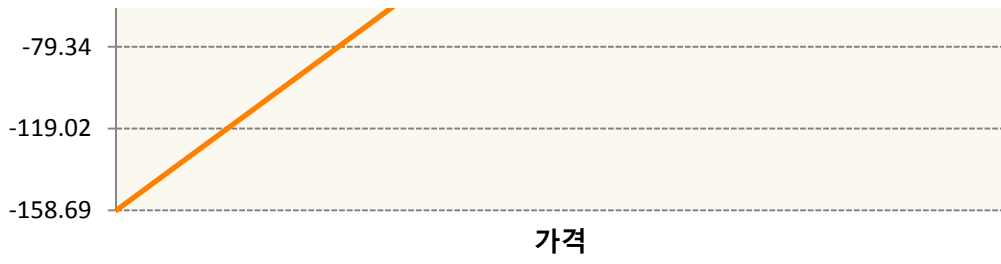
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

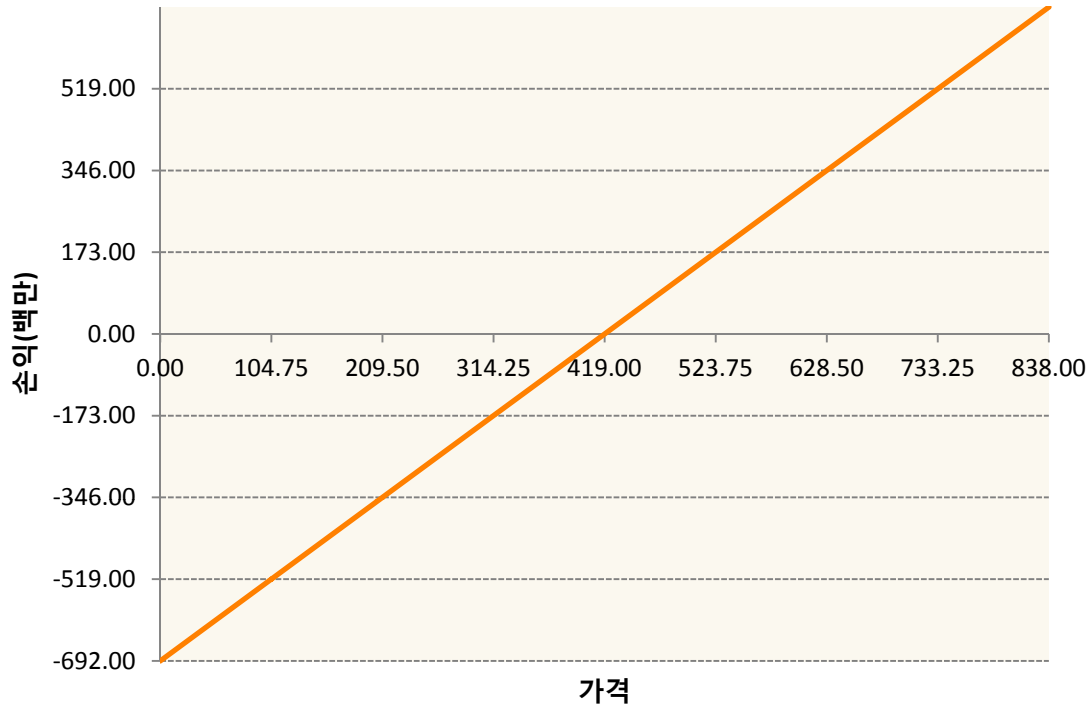


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

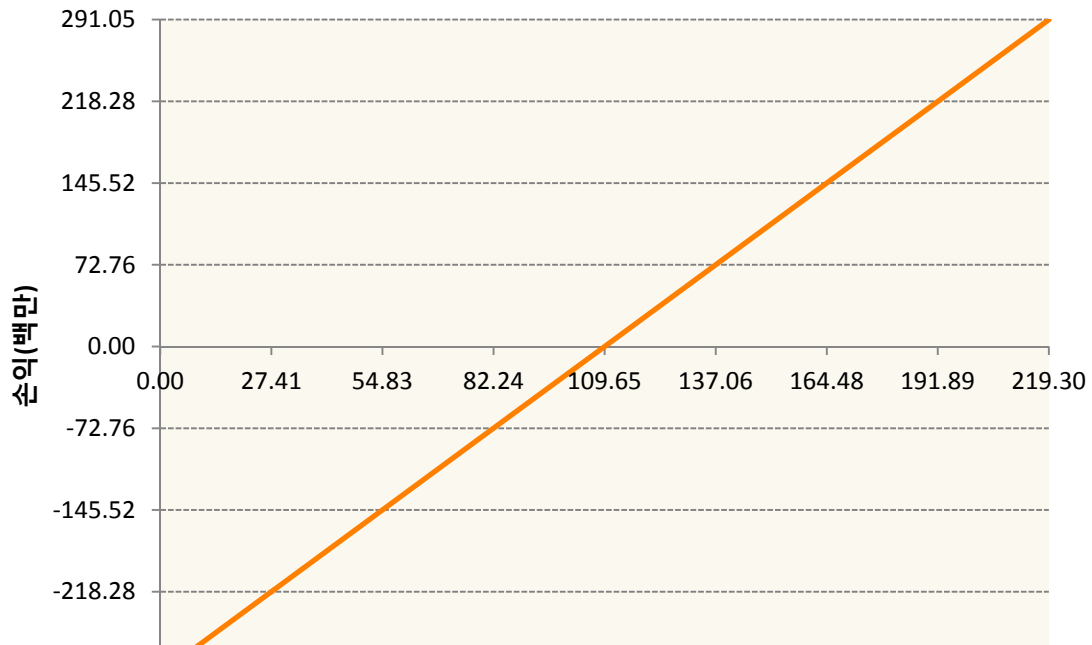


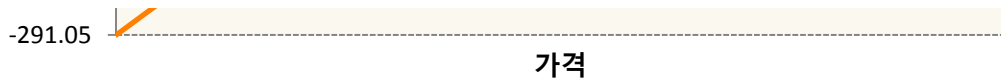


CU9-CORN FUTURE Sep19

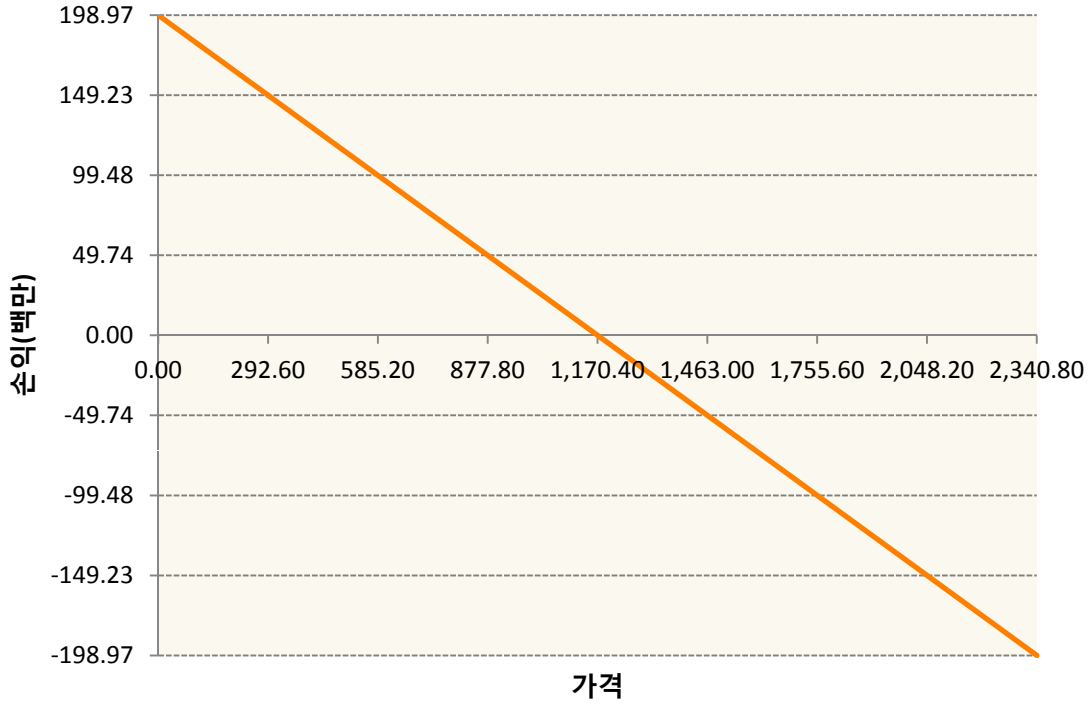


KCU9-COFFEE 'C' FUTURE Sep19

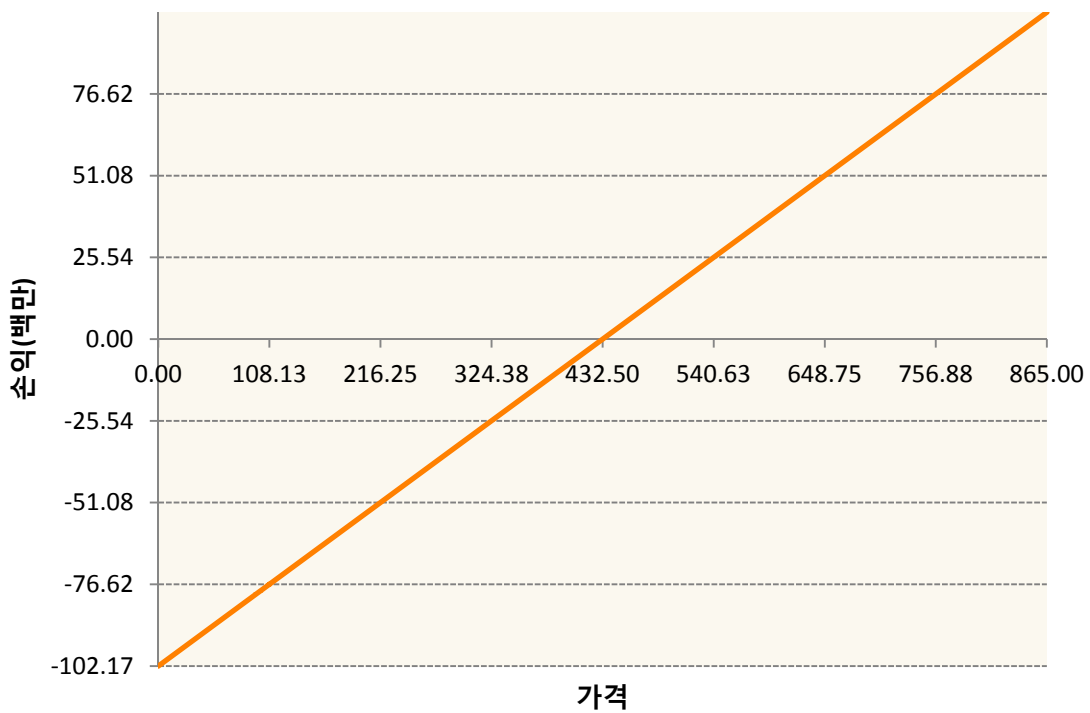




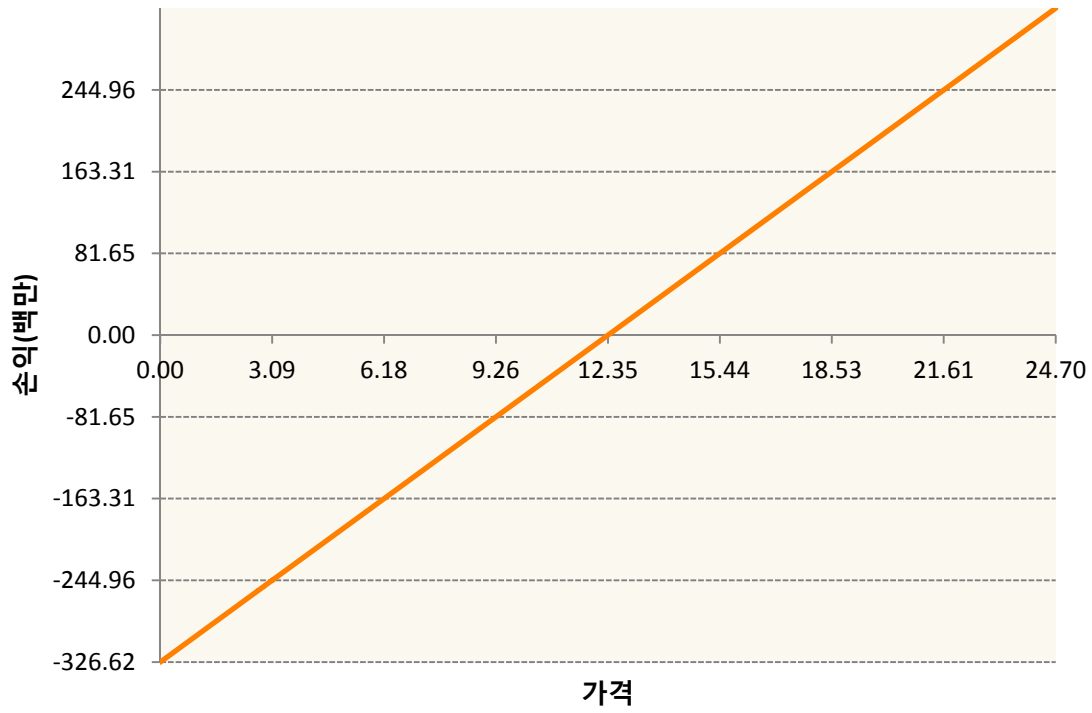
KR4175P70007-2019-07 달러선물



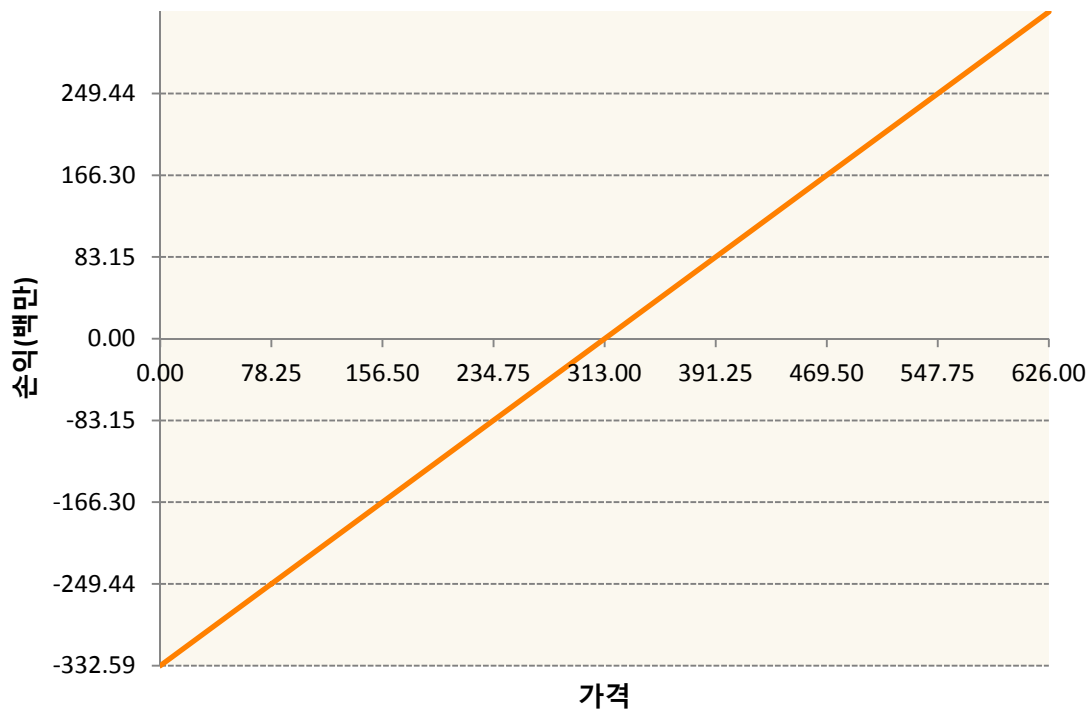
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



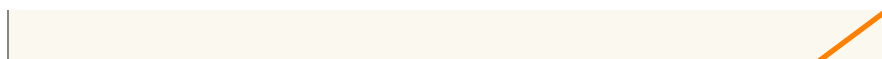
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

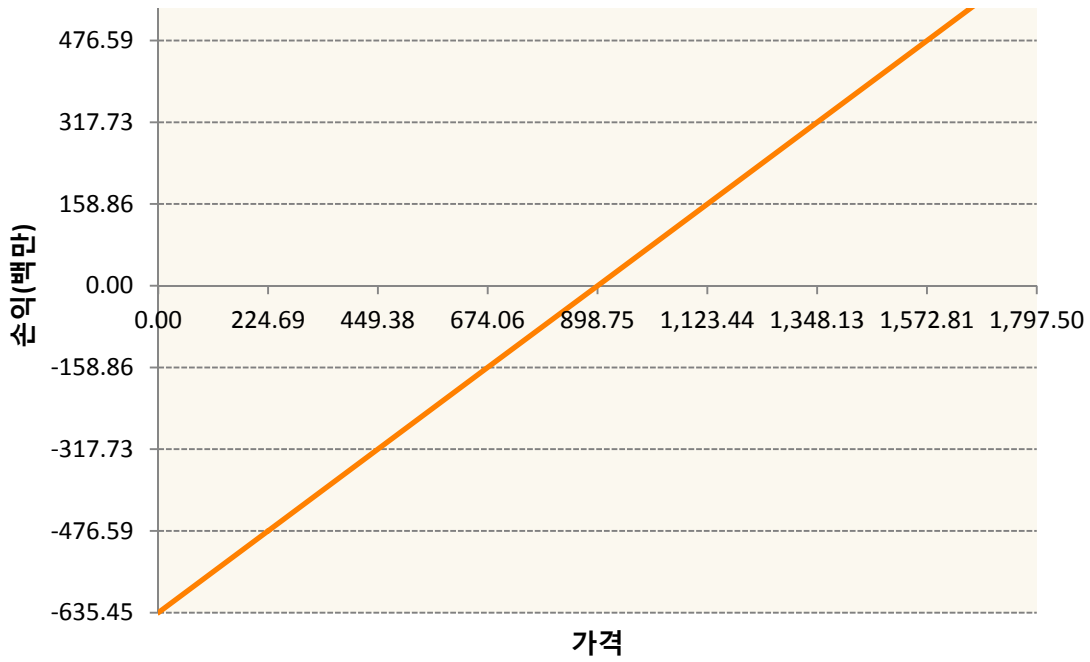


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

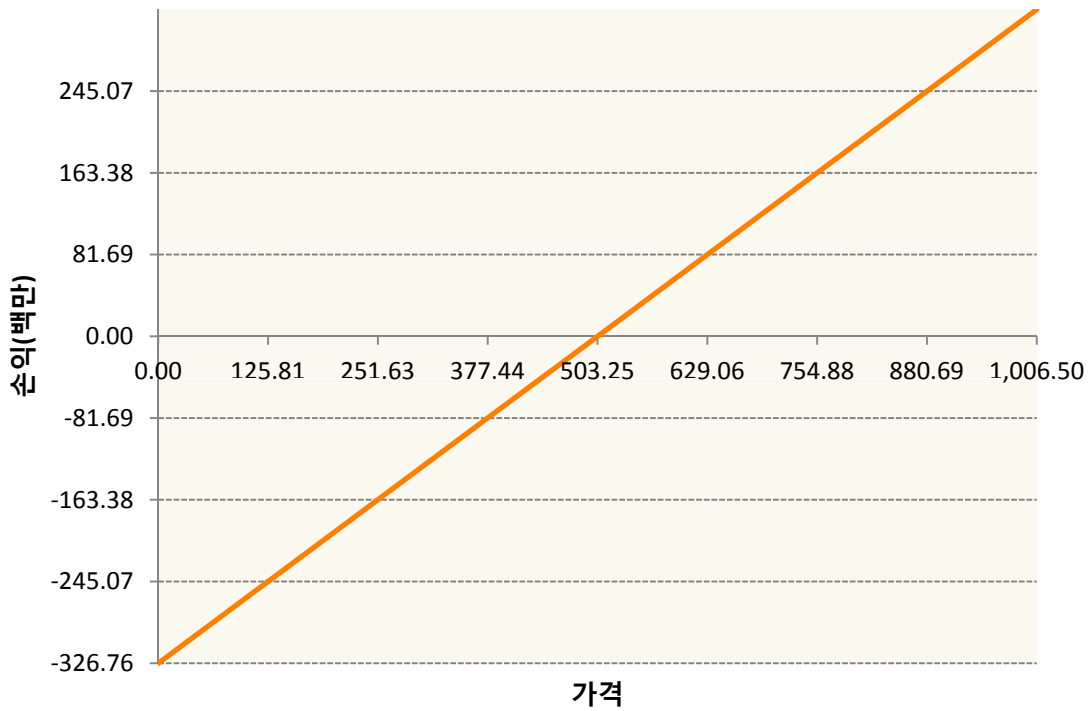


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





WU9-WHEAT FUTURE(CBT) Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	27
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	13
CU9	CORN FUTURE Sep19	55
KCU9	COFFEE 'C' FUTURE Sep19	23
KR4175P700	2019-07 달러선물	16

KWU9	KC HRW WHEAT FUT Sep19	8
SBV9	SUGAR #11 (WORLD) Oct19	26
SMZ9	SOYBEAN MEAL FUTR Dec19	27
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	51
WU9	WHEAT FUTURE(CBT) Sep19	26

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

(단위:백만원)

281