

공시일	2019-07-05
기준일	2019-07-04

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	2019-07-05
기준일	2019-07-04

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

1,184

* 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	2019-07-05
기준일	2019-07-04

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)	392
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	143

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

875

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-05
기준일	2019-07-04

유로인덱스모(주식-파생형)

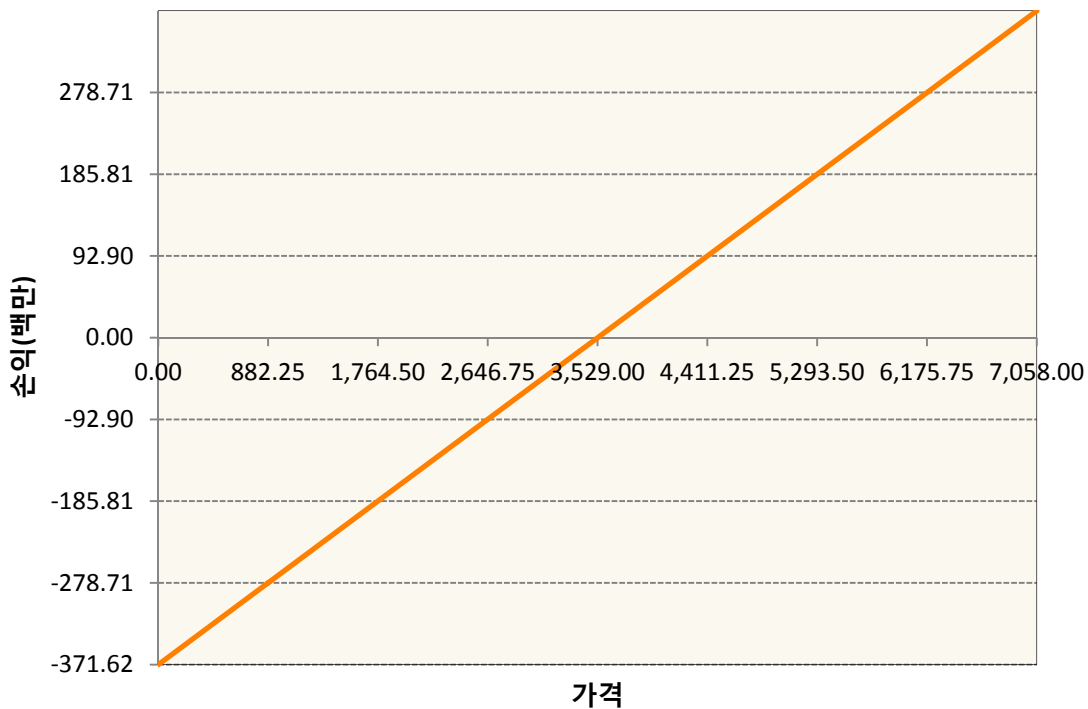
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	372	0	372	

2. 만기시점의 손익구조

VGU9-EURO STOXX 50 Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU9	EURO STOXX 50 Sep19	30
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

22

공시일	2019-07-05
기준일	2019-07-04

차이나인덱스모(주식-파생형)

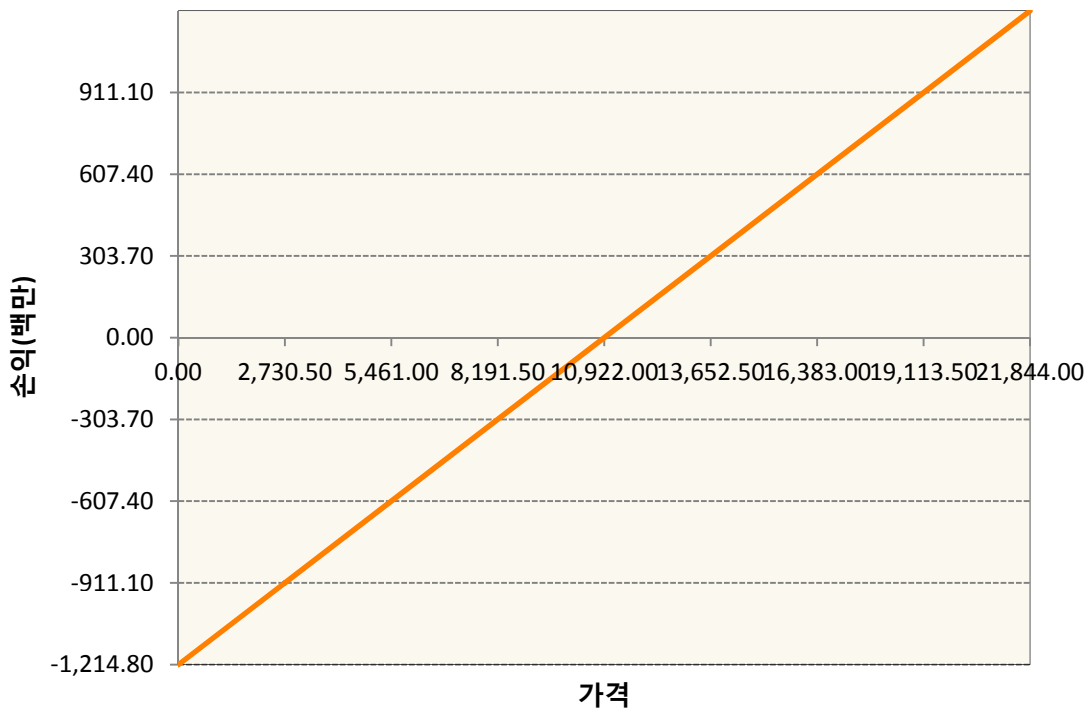
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,215	0	1,215	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCN9-HSCEI Futures Jul19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

99

공시일	2019-07-05
기준일	2019-07-04

커버드콜모(주식혼합-파생형)

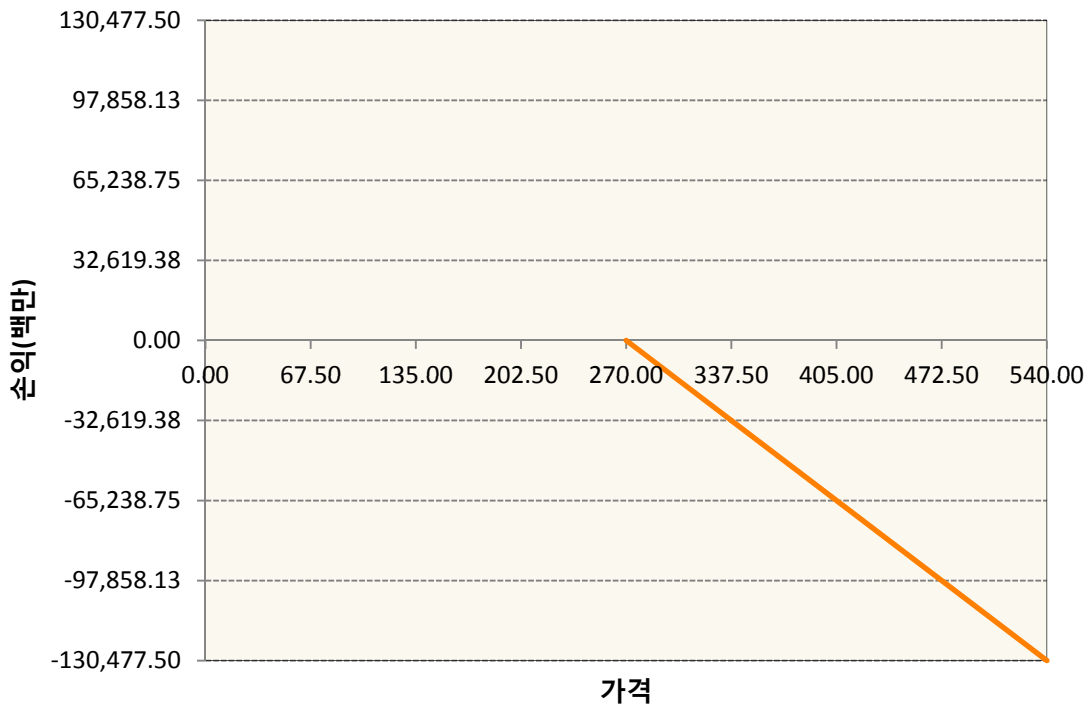
1. 계약금액

(단위:백만원)

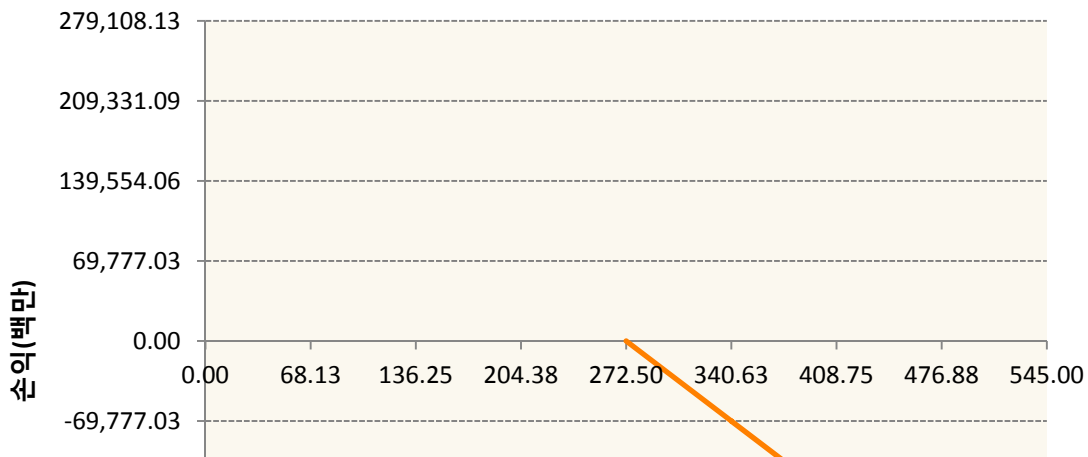
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	591,498	-591,498	장내

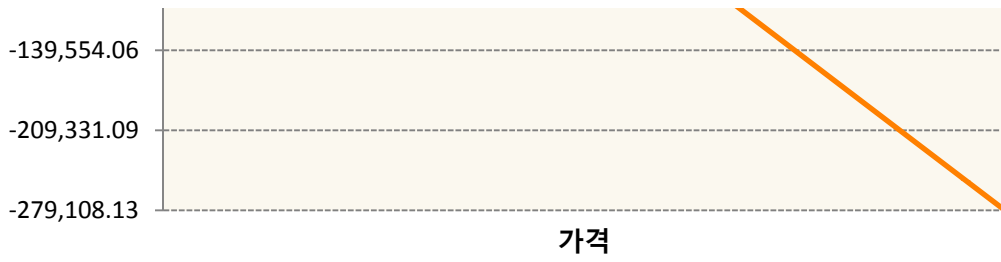
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P72700-2019-07 콜270

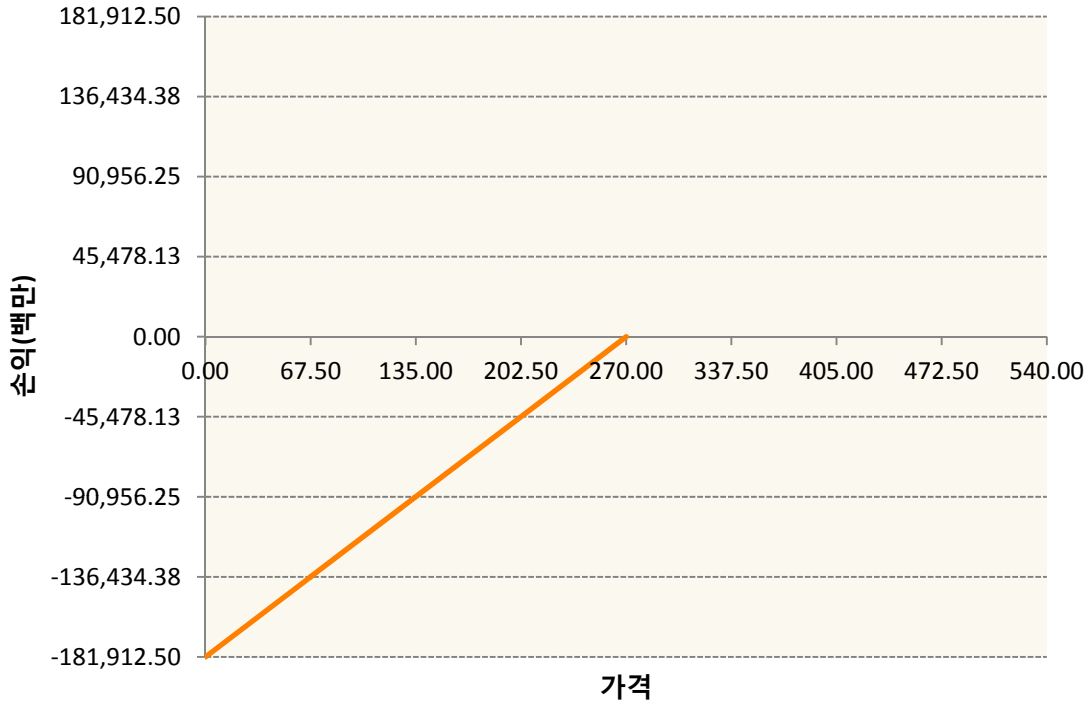


KR4201P72726-2019-07 콜272.5





KR4301P72708-2019-07 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P72700		2019-07 콜270					9,710
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,104	3,097	3,084	3,065	3,039	3,005	2,965
-5.33%	3,006	2,950	2,884	2,808	2,724	2,634	2,537
-2.67%	2,337	2,198	2,057	1,915	1,772	1,628	1,483
0%	390	264	134	0	-136	-275	-414
2.67%	-2,676	-2,721	-2,777	-2,844	-2,920	-3,003	-3,094
5.33%	-6,146	-6,153	-6,165	-6,183	-6,209	-6,242	-6,282
8.00%	-9,678	-9,678	-9,680	-9,683	-9,688	-9,697	-9,710
KR4201P72726		2019-07 콜272.5					19,682
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,980	4,973	4,960	4,937	4,904	4,858	4,798

-5.33%	4,889	4,819	4,727	4,614	4,482	4,333	4,169
-2.67%	4,055	3,809	3,552	3,285	3,011	2,732	2,447
0%	939	628	315	0	-316	-632	-950
2.67%	-4,907	-5,060	-5,236	-5,431	-5,643	-5,867	-6,104
5.33%	-12,093	-12,125	-12,173	-12,240	-12,326	-12,430	-12,551
8.00%	-19,561	-19,564	-19,571	-19,584	-19,606	-19,638	-19,682
KR4301P72708 2019-07 풋270							11,426
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11,424	-11,424	-11,424	-11,424	-11,425	-11,425	-11,426
-5.33%	-6,496	-6,499	-6,505	-6,515	-6,529	-6,548	-6,572
-2.67%	-1,879	-1,964	-2,052	-2,144	-2,238	-2,334	-2,432
0%	193	136	71	0	-76	-156	-240
2.67%	331	329	326	320	312	299	282
5.33%	331	331	331	331	331	330	330
8.00%	331	331	331	331	331	331	331

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

(단위:백만원)

45,830

공시일	2019-07-05
기준일	2019-07-04

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

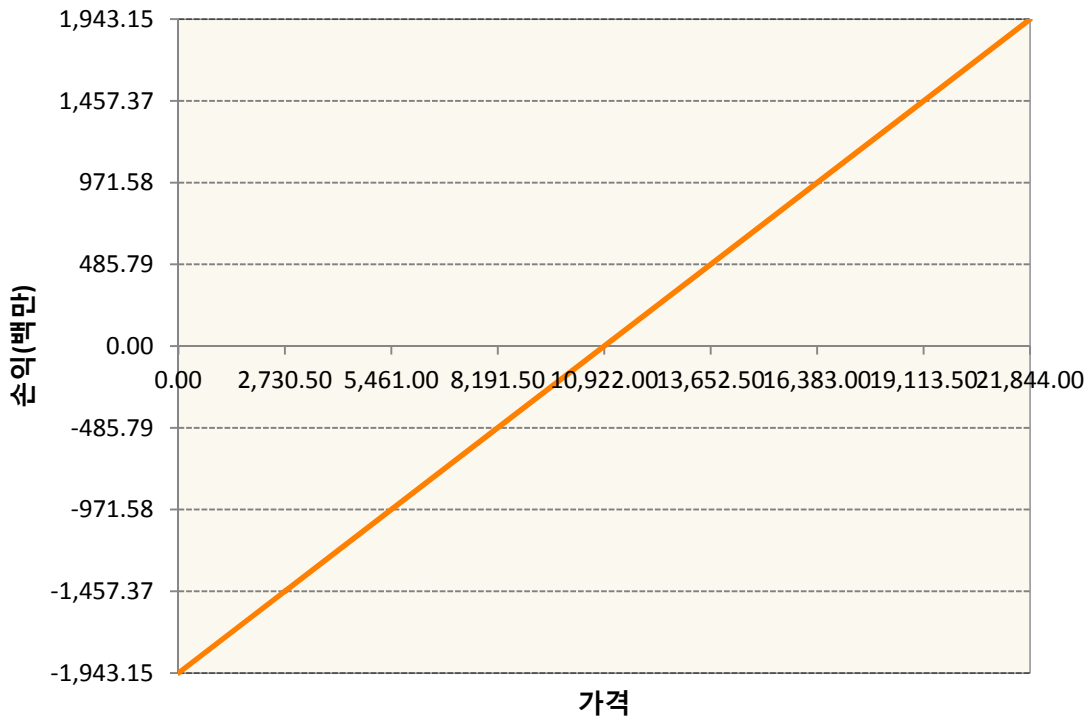
1. 계약금액

(단위:백만원)

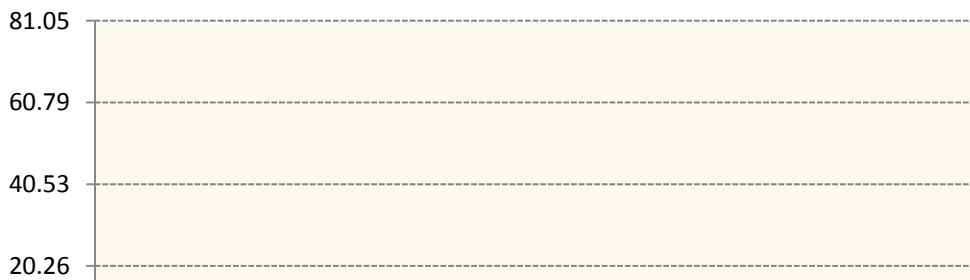
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,943	0	1,943	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,234	-5,234	장내
누계	통화	선도	150	3,152	-3,002	장외

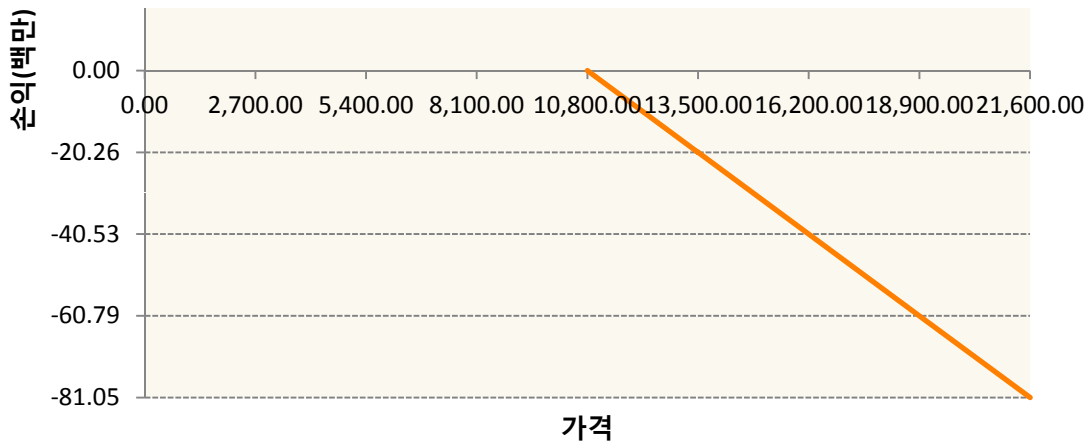
2. 만기시점의 손익구조

HCN9-HSCEI Futures Jul19

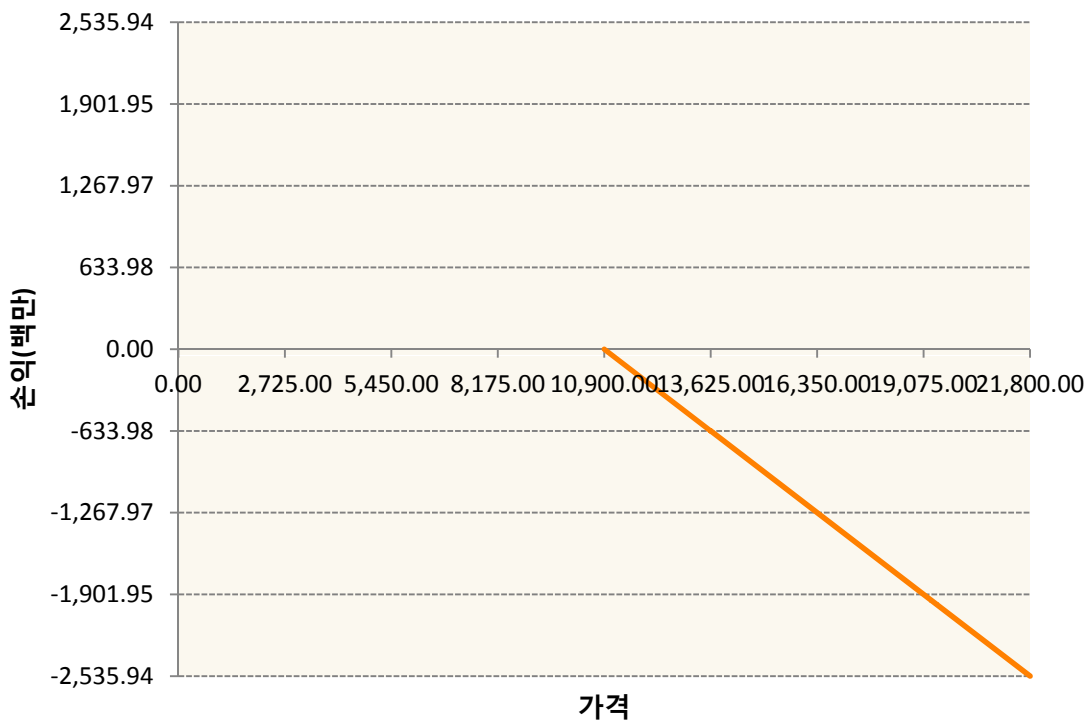


OHHIN9-C108-HSCEI

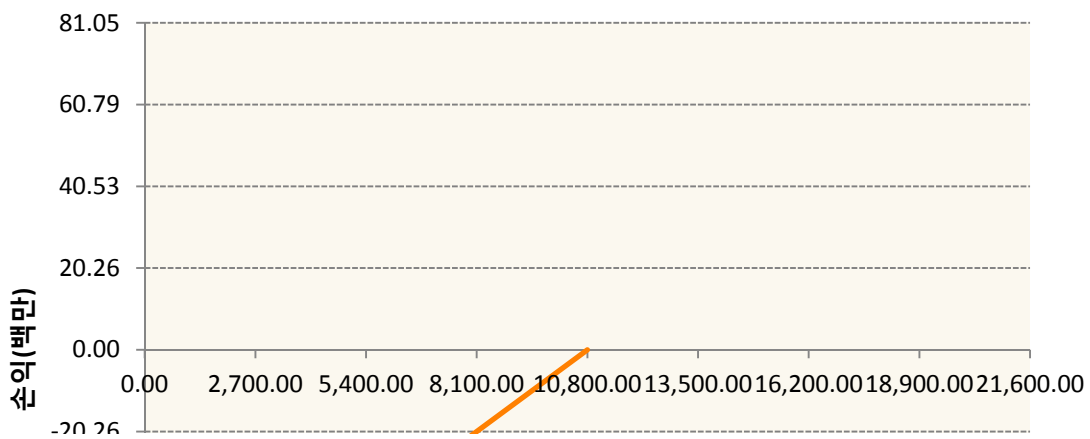


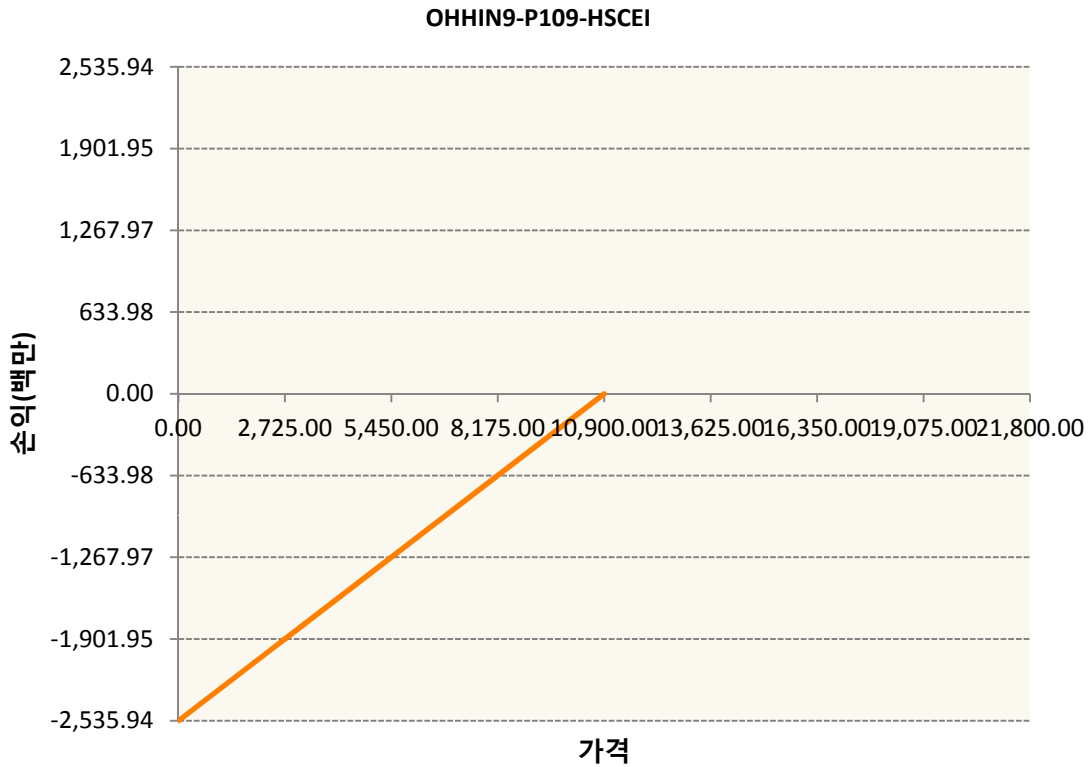
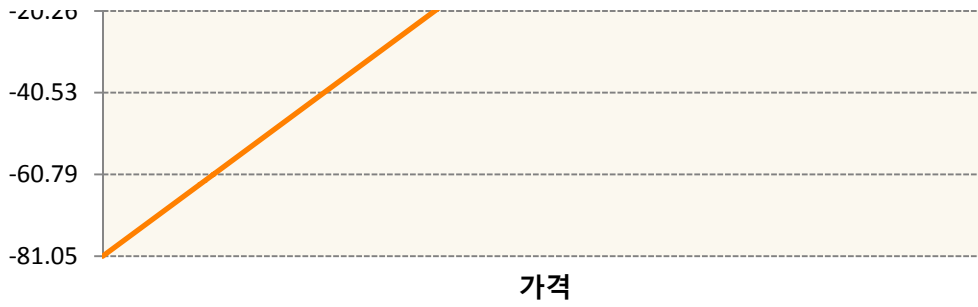


OHHIN9-C109-HSCEI



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	155
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)
	671

공시일	2019-07-05
기준일	2019-07-04

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

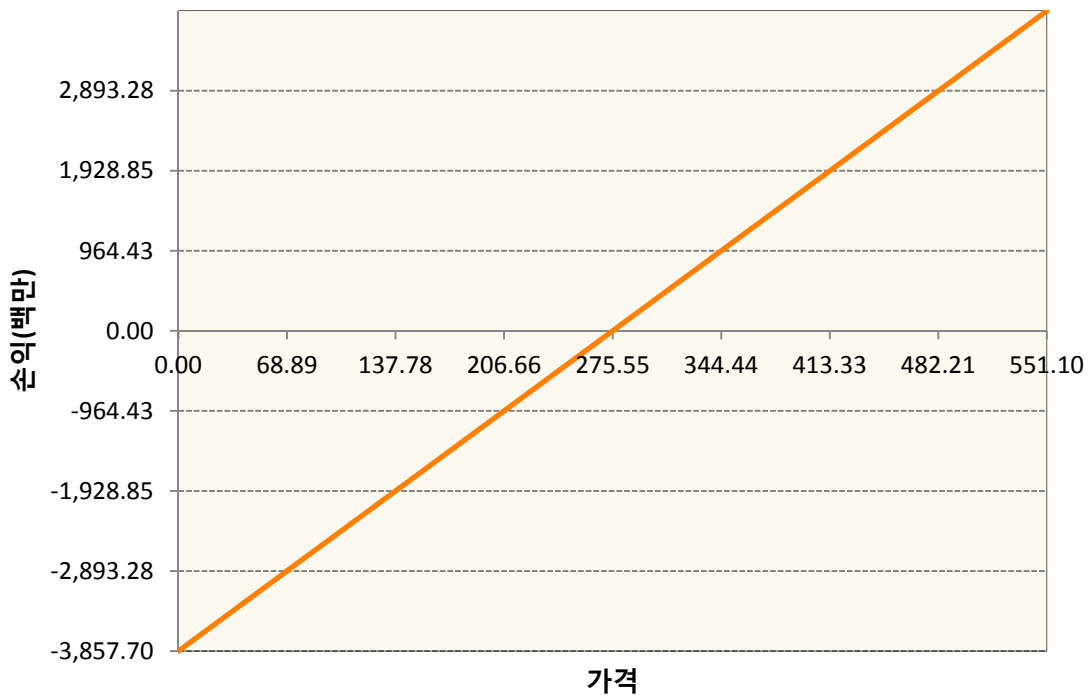
1. 계약금액

(단위:백만원)

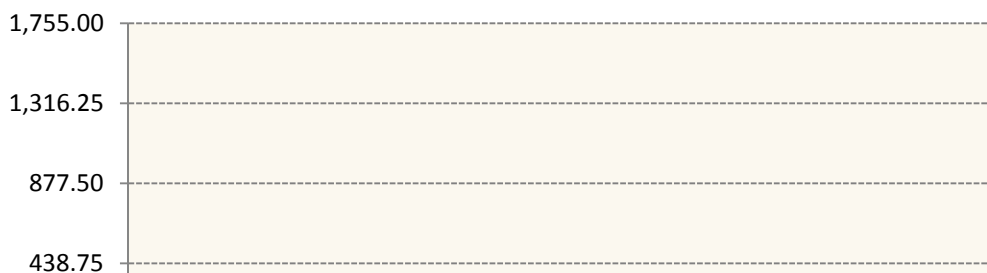
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,858	0	3,858	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,340	-20,340	장내

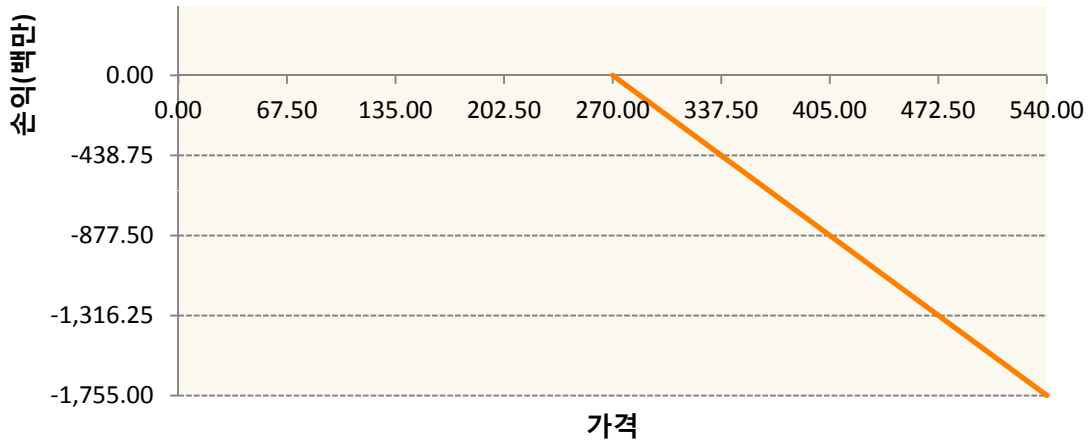
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

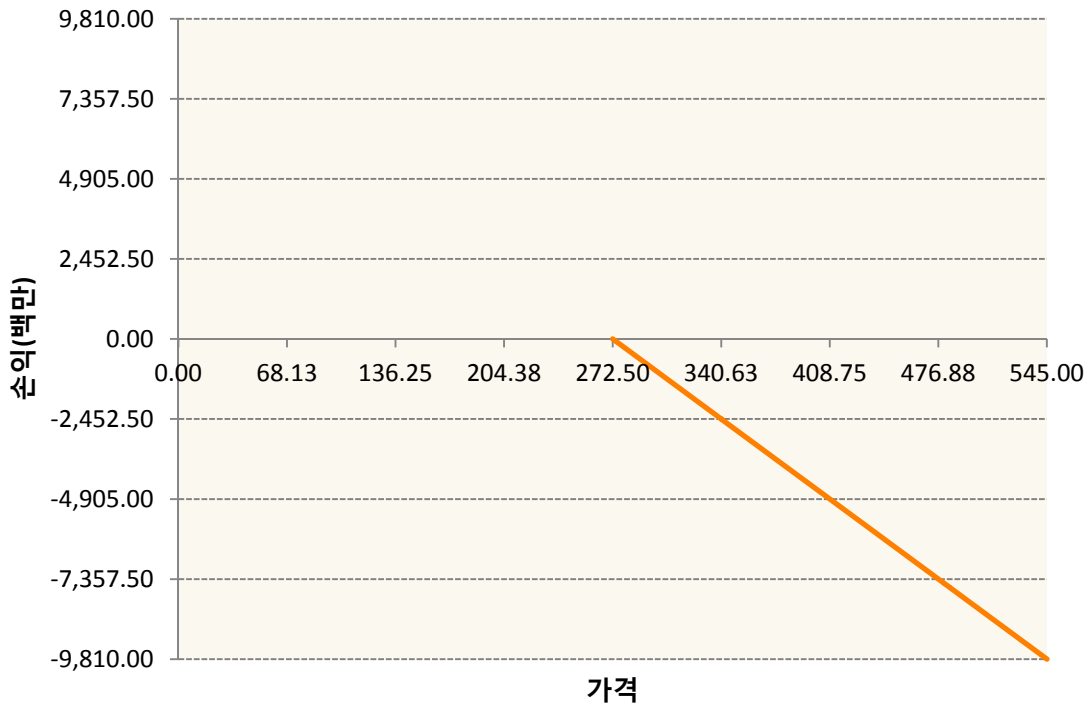


KR4201P72700-2019-07 콜270

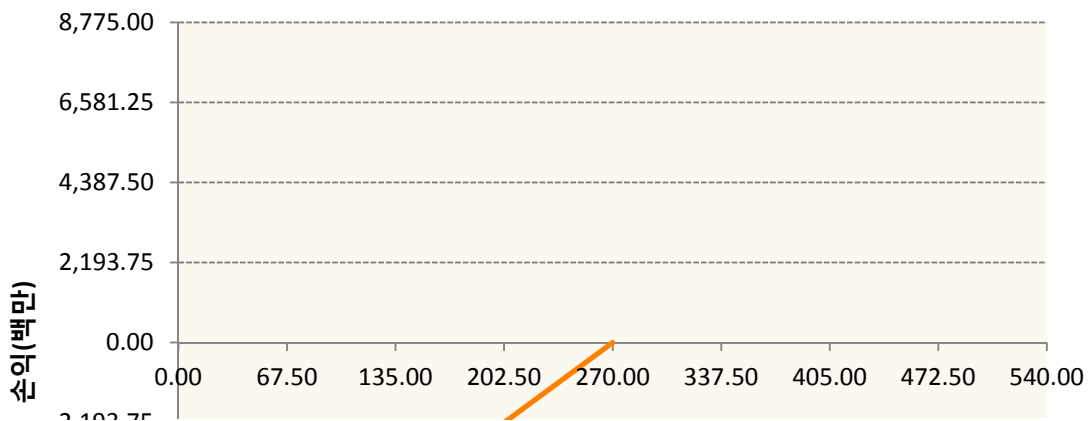


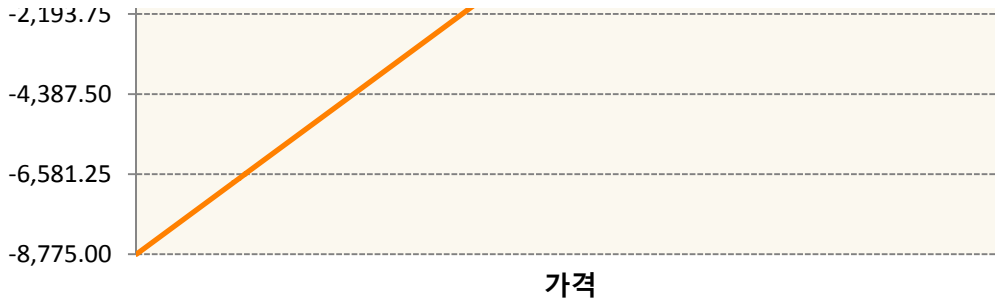


KR4201P72726-2019-07 콜272.5



KR4301P72708-2019-07 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,186
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,186	-1,186	-1,186	-1,186	-1,186	-1,186	-1,186	
-5.33%	-791	-791	-791	-791	-791	-791	-791	
-2.67%	-395	-395	-395	-395	-395	-395	-395	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	395	395	395	395	395	395	395	
5.33%	791	791	791	791	791	791	791	
8.00%	1,186	1,186	1,186	1,186	1,186	1,186	1,186	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						600
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-600	-600	-600	-600	-600	-600	-600	
-5.33%	-400	-400	-400	-400	-400	-400	-400	
-2.67%	-200	-200	-200	-200	-200	-200	-200	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	200	200	200	200	200	200	200	
5.33%	400	400	400	400	400	400	400	
8.00%	600	600	600	600	600	600	600	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						307
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-307	-307	-307	-307	-307	-307	-307	
-5.33%	-205	-205	-205	-205	-205	-205	-205	
-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%	205	205	205	205	205	205	205	
8.00%	307	307	307	307	307	307	307	
KR4201P72700		2019-07 콜270						131
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	42	42	41	41	41	40	40
-5.33%	40	40	39	38	37	35	34
-2.67%	31	30	28	26	24	22	20
0%	5	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	-36	-37	-37	-38	-39	-40	-42
5.33%	-83	-83	-83	-83	-84	-84	-85
8.00%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-131

KR4201P72726 2019-07 콜272.5 692

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	175	175	174	174	172	171	169
-5.33%	172	169	166	162	158	152	147
-2.67%	143	134	125	115	106	96	86
0%	33	22	11	0	-11	-22	-33
2.67%	-172	-178	-184	-191	-198	-206	-215
5.33%	-425	-426	-428	-430	-433	-437	-441
8.00%	-688	-688	-688	-688	-689	-690	-692

KR4301P72708 2019-07 풋270 551

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-551	-551	-551	-551	-551	-551	-551
-5.33%	-313	-313	-314	-314	-315	-316	-317
-2.67%	-91	-95	-99	-103	-108	-113	-117
0%	9	7	3	0	-4	-8	-12
2.67%	16	16	16	15	15	14	14
5.33%	16	16	16	16	16	16	16
8.00%	16	16	16	16	16	16	16

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

(단위:백만원)

3,566

공시일	2019-07-05
기준일	2019-07-04

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

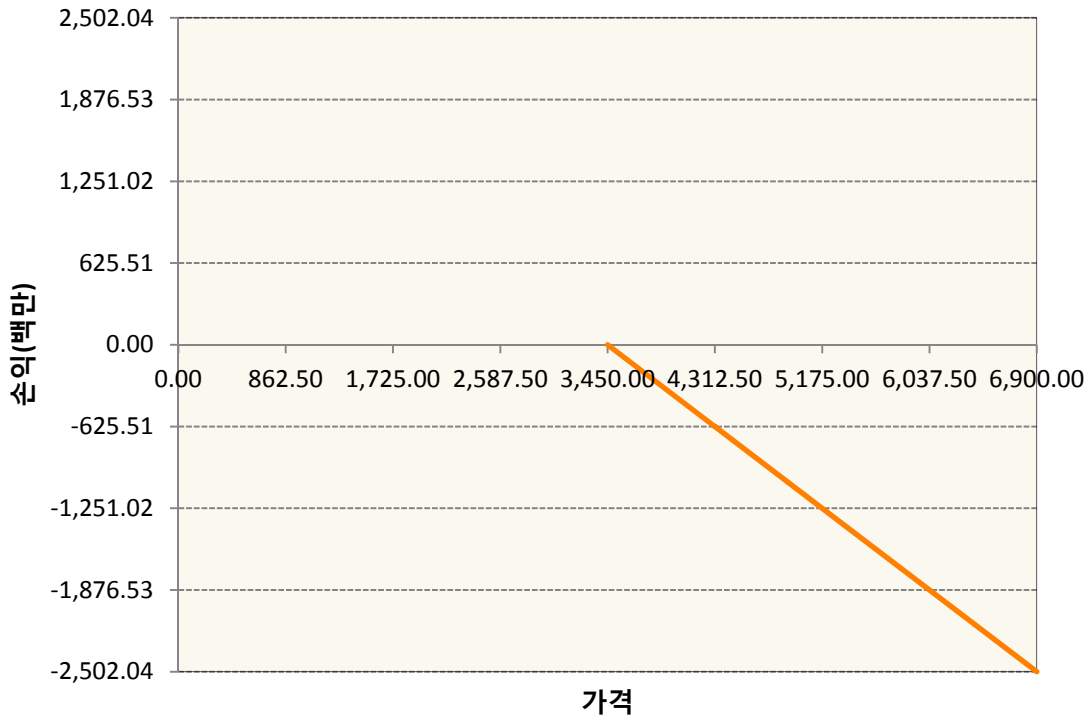
1. 계약금액

(단위:백만원)

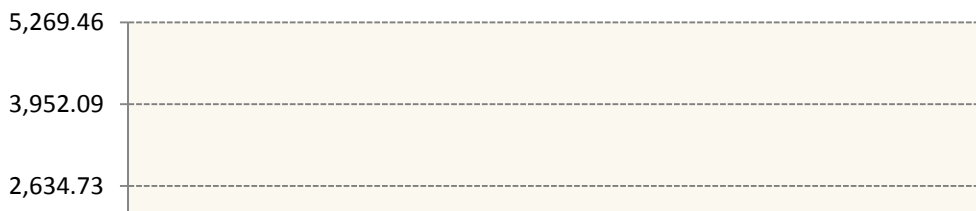
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,347	0	1,347	
누계	유가증권	스왑	55,817	0	55,817	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,543	-15,543	장내
누계	통화	선도	0	18,461	-18,461	장외

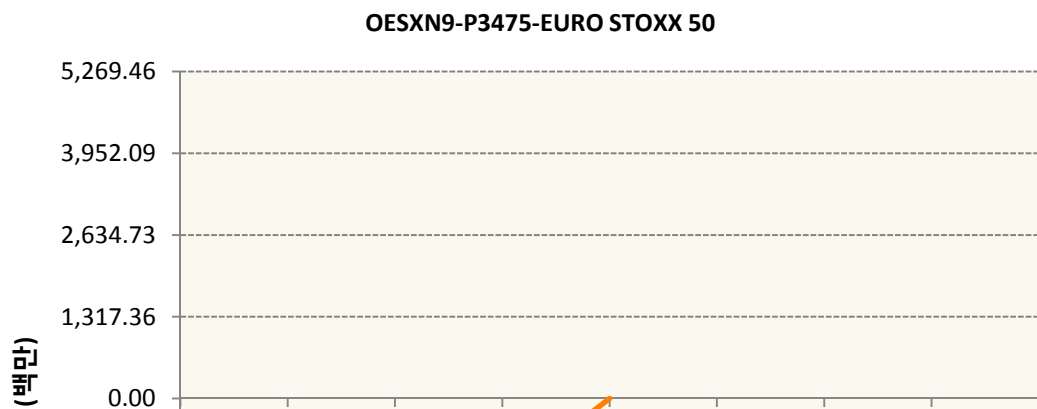
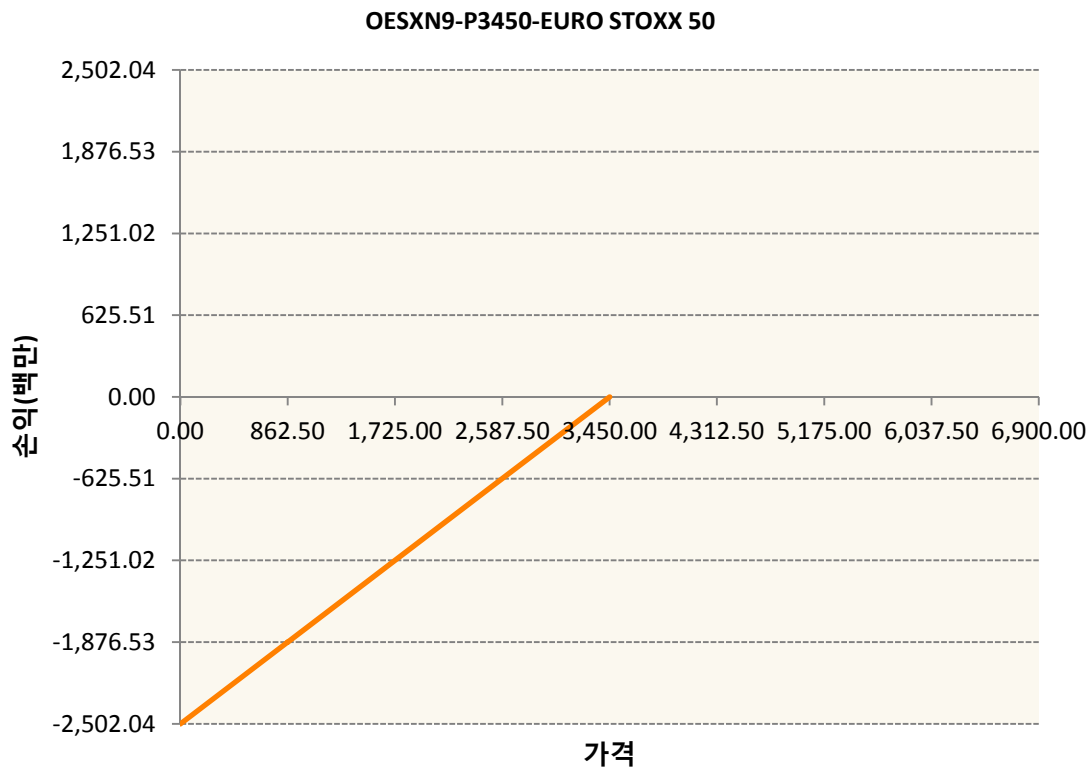
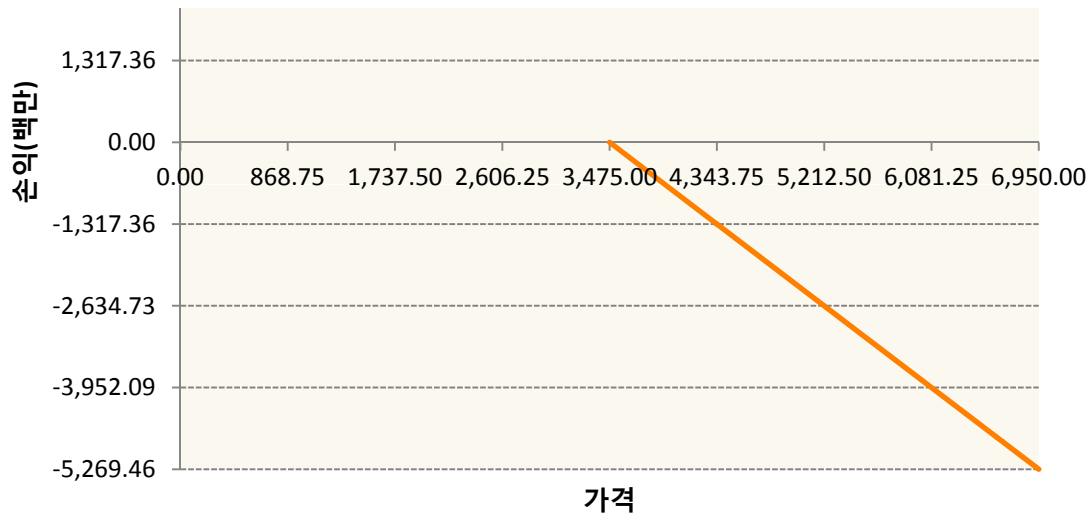
2. 만기시점의 손익구조

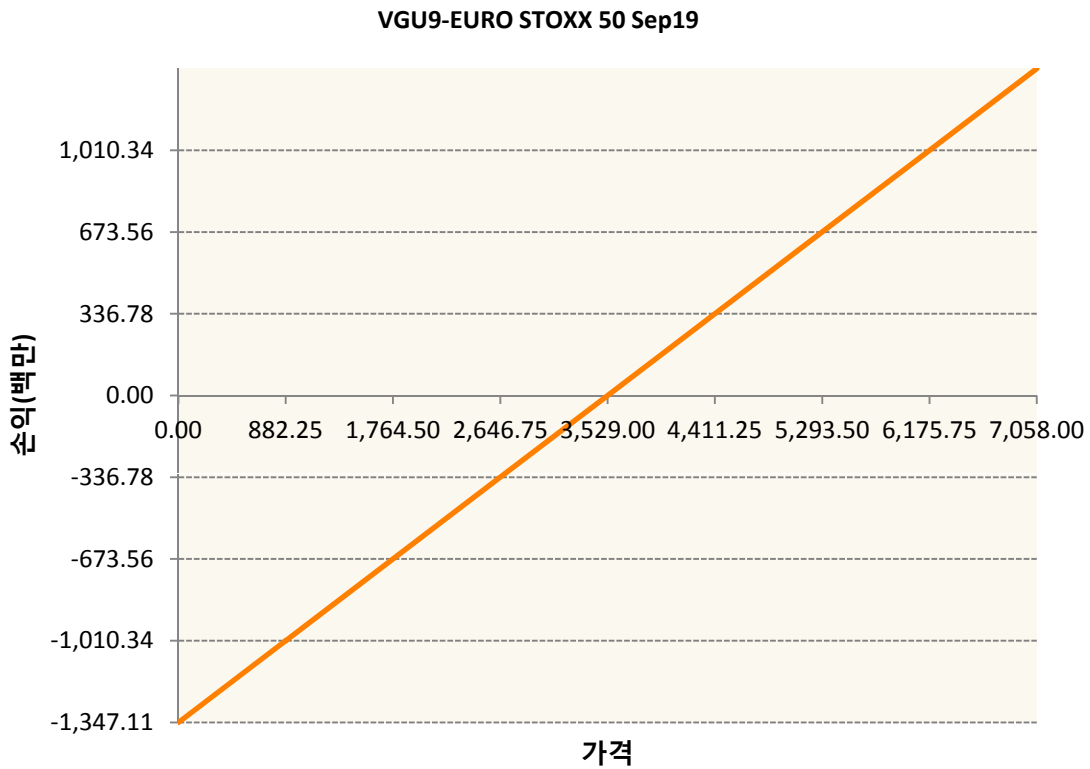
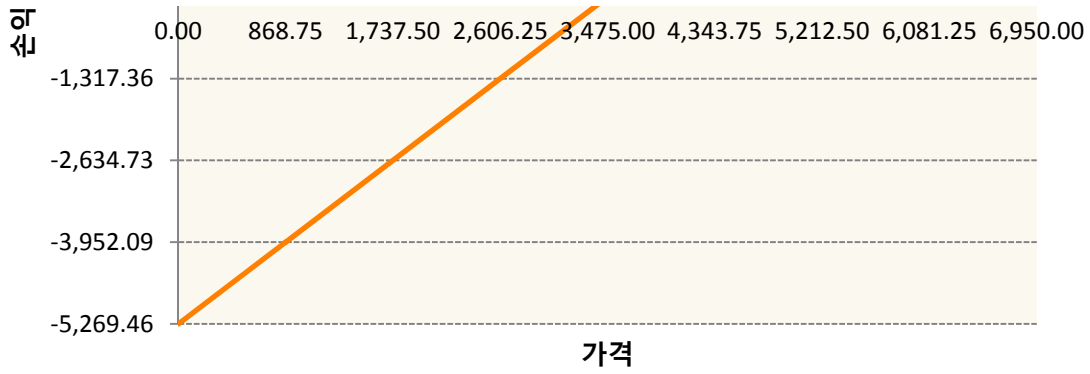
OESXN9-C3450-EURO STOXX 50



OESXN9-C3475-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	101
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	422
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E	1,055
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	108

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

(단위:백만원)

1,780

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

(단위:백만원)

1,032

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

(단위:백만원)

91

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

(단위:백만원)

132

공시일	2019-07-05
기준일	2019-07-04

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

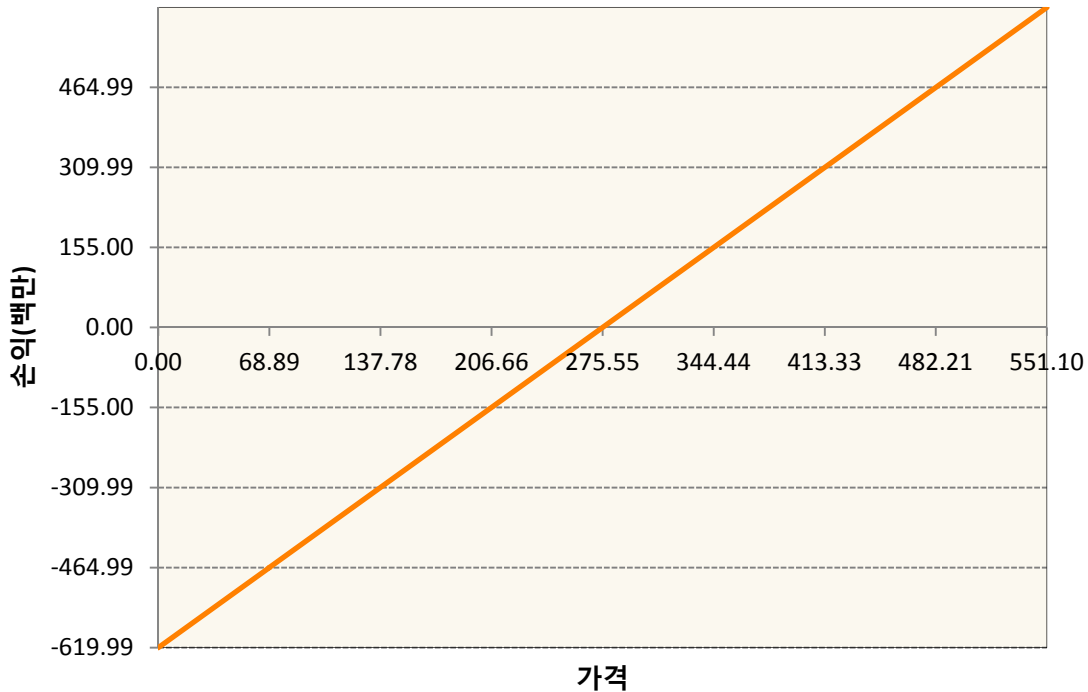
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	620	0	620	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001 2019-09 코스피200지수선물 49

가격	기초자산의 변동성						
	-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	2019-07-05
기준일	2019-07-04

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

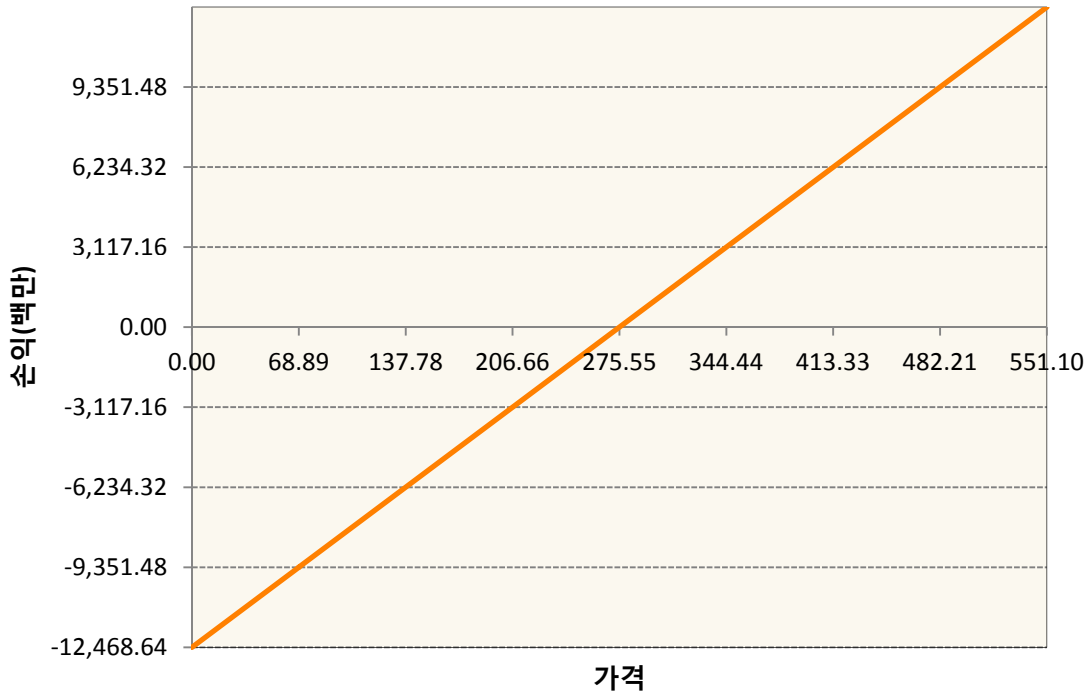
1. 계약금액

(단위:백만원)

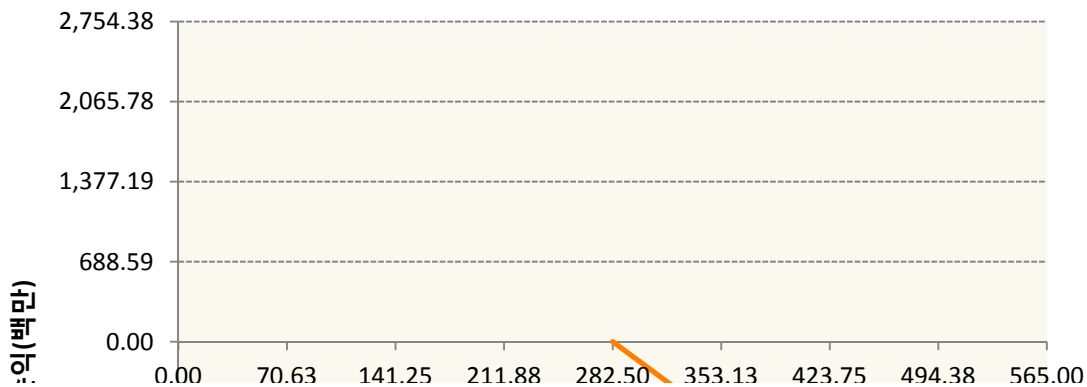
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,469	0	12,469	장내
누계	유가증권	옵션	1,084	22,134	-21,050	장내

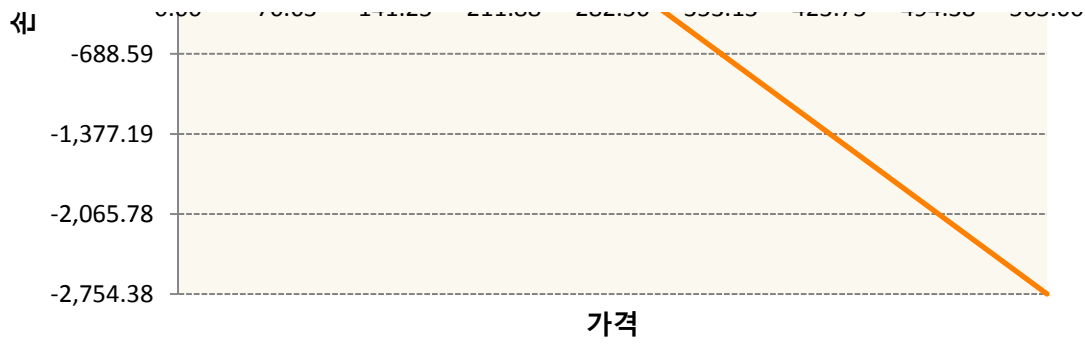
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

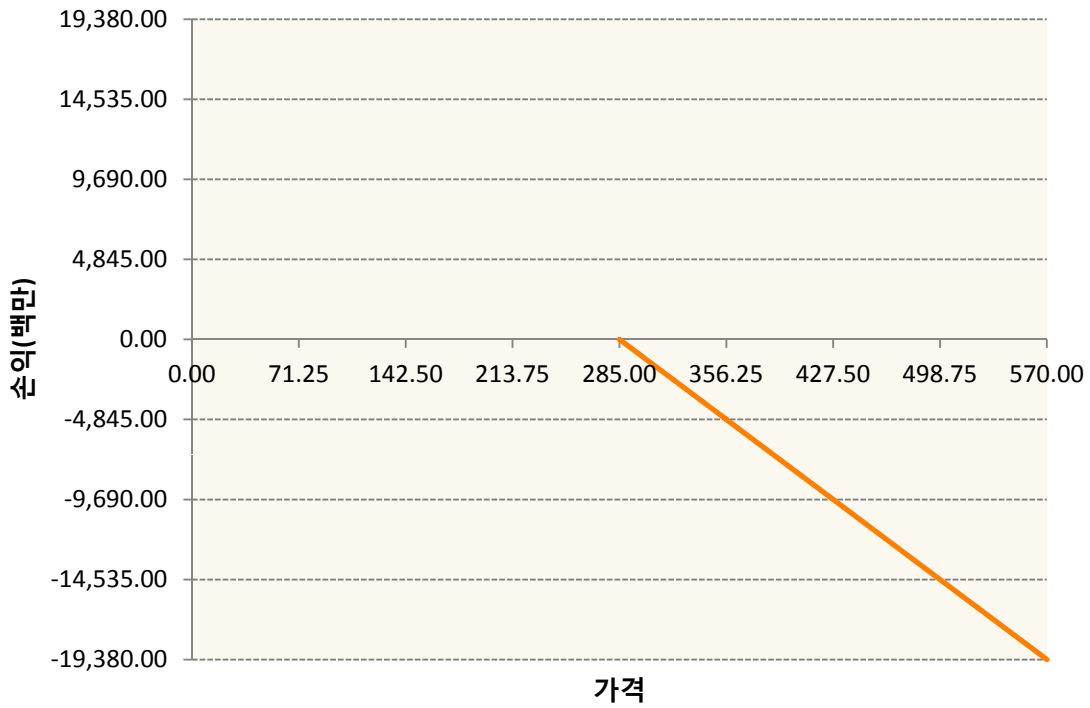


KR4201P72825-2019-07 콜282.5

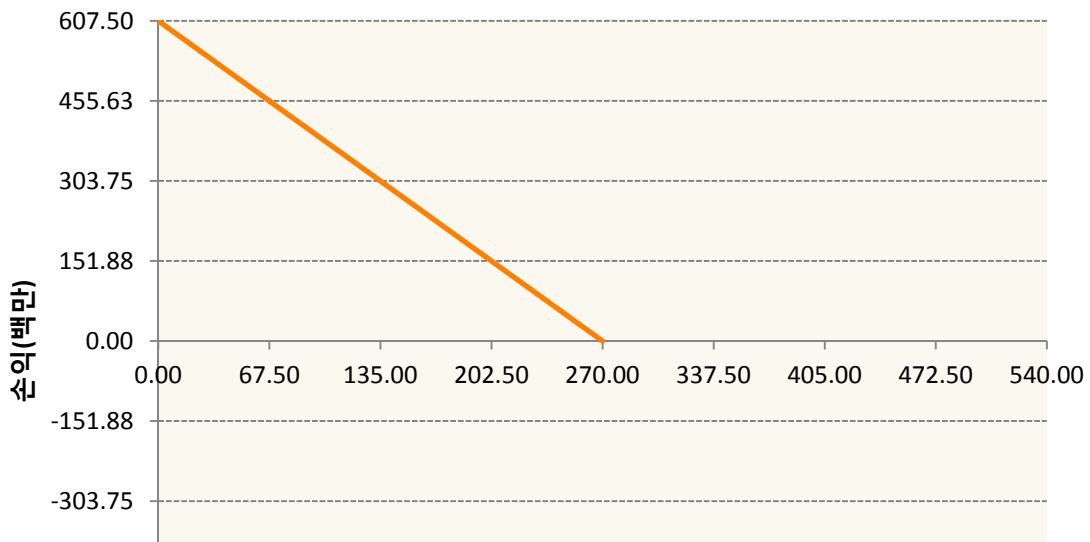


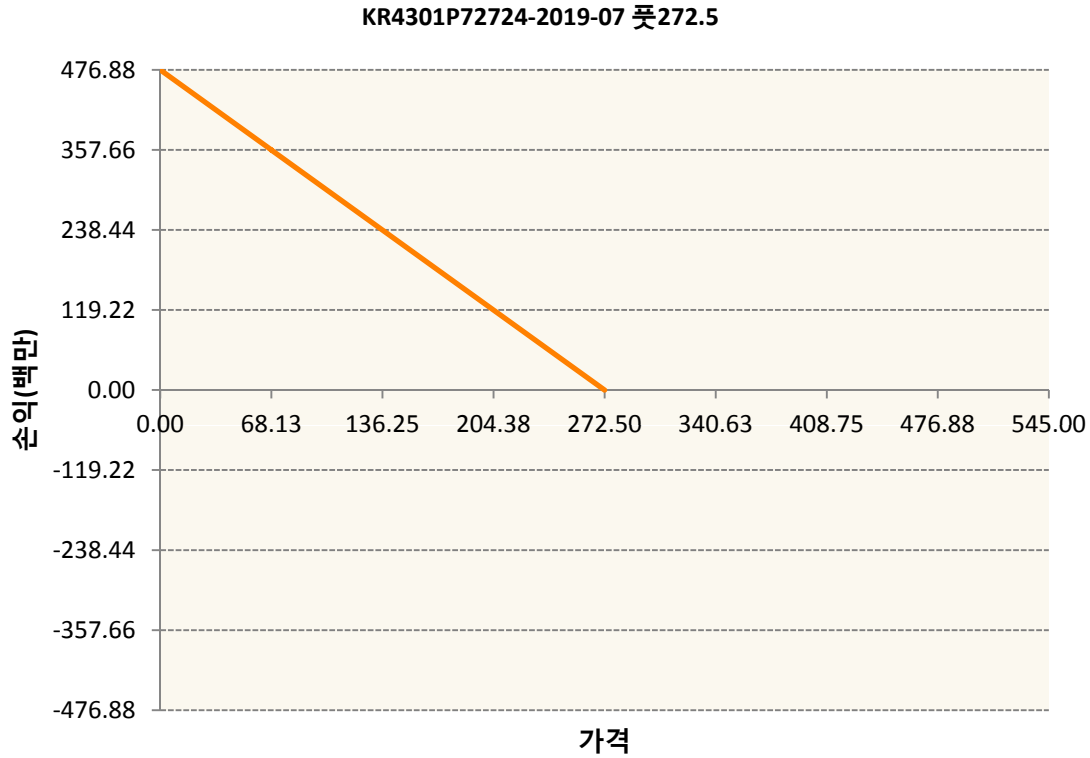
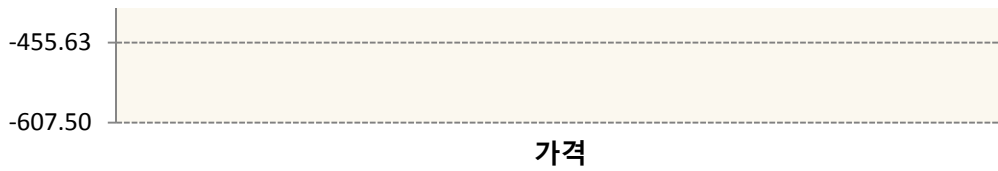


KR4201P72858-2019-07 콜285



KR4301P72708-2019-07 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						994
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-994	-994	-994	-994	-994	-994	-994	
-5.33%	-663	-663	-663	-663	-663	-663	-663	
-2.67%	-331	-331	-331	-331	-331	-331	-331	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	331	331	331	331	331	331	331	
5.33%	663	663	663	663	663	663	663	
8.00%	994	994	994	994	994	994	994	
KR4201P72825		2019-07 콜282.5						134
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	11	11	11	11	11	11	11	
-5.33%	11	11	11	10	10	10	10	
-2.67%	10	10	9	9	8	7	5	

0%	6	4	2	0	-2	-5	-7
2.67%	-15	-18	-21	-24	-27	-30	-34
5.33%	-61	-64	-66	-69	-71	-74	-77
8.00%	-126	-127	-128	-129	-130	-132	-134
KR4201P72858 2019-07 콜285							817
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	47	47	47	47	47	46	46
-5.33%	47	47	46	46	45	44	42
-2.67%	46	44	42	39	34	29	22
0%	30	22	12	0	-13	-26	-41
2.67%	-63	-84	-104	-125	-147	-168	-189
5.33%	-327	-347	-367	-387	-408	-429	-450
8.00%	-747	-755	-765	-776	-789	-802	-817
KR4301P72708 2019-07 풋270							38
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	38	38	38	38	38	38	38
-5.33%	22	22	22	22	22	22	22
-2.67%	6	7	7	7	7	8	8
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							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%	20	20	20	20	20	20	20
-2.67%	8	8	8	8	8	8	8
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
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)

1,618

공시일	2019-07-05
기준일	2019-07-04

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	19,399	0	19,399	

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	2019-07-05
기준일	2019-07-04

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	61,392	0	61,392	

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	2019-07-05
기준일	2019-07-04

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	357,876	0	357,876	
누계	통화	선도	0	352,473	-352,473	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		467
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		467
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		374
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		785
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		280
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		935
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		187
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		869
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		1,038
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E		1,870
FX21019M00 KRW/USD 15-07-19E		467
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		374
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		654
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		935
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		654
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		654
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		561
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		2,992
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		2,244
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E		280
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E		280
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E		785
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E		626
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E		467
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		1,870
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		1,870

FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E	692
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E	692
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E	1,290
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E	2,535

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

(단위:백만원)

9,296

공시일	2019-07-05
기준일	2019-07-04

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

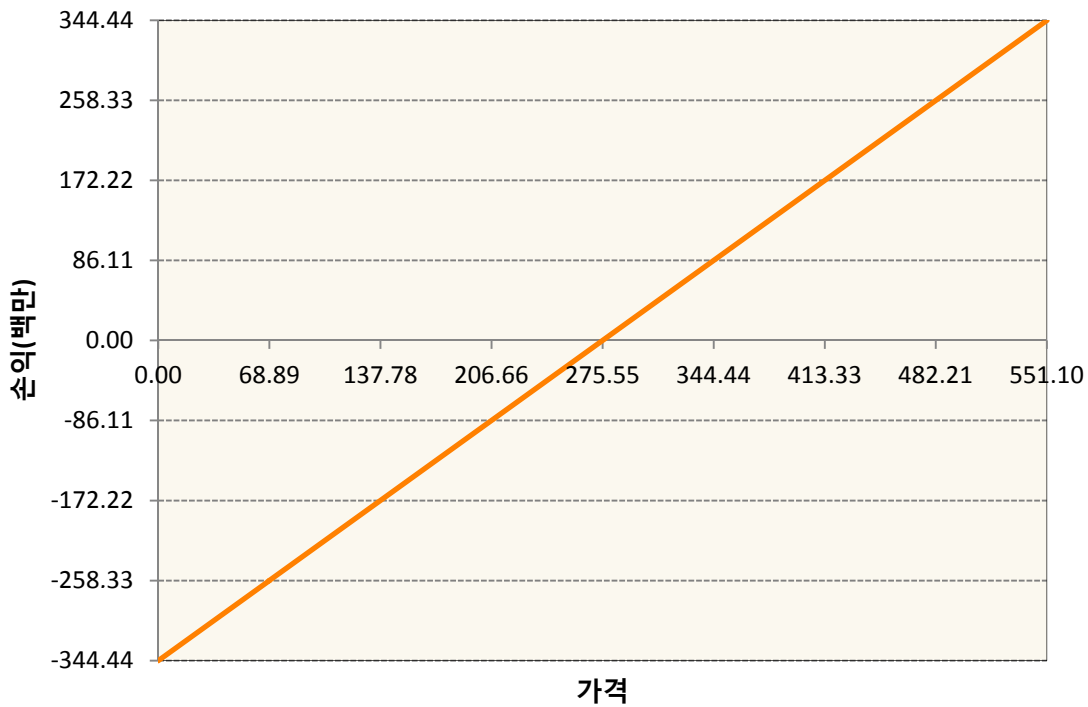
1. 계약금액

(단위:백만원)

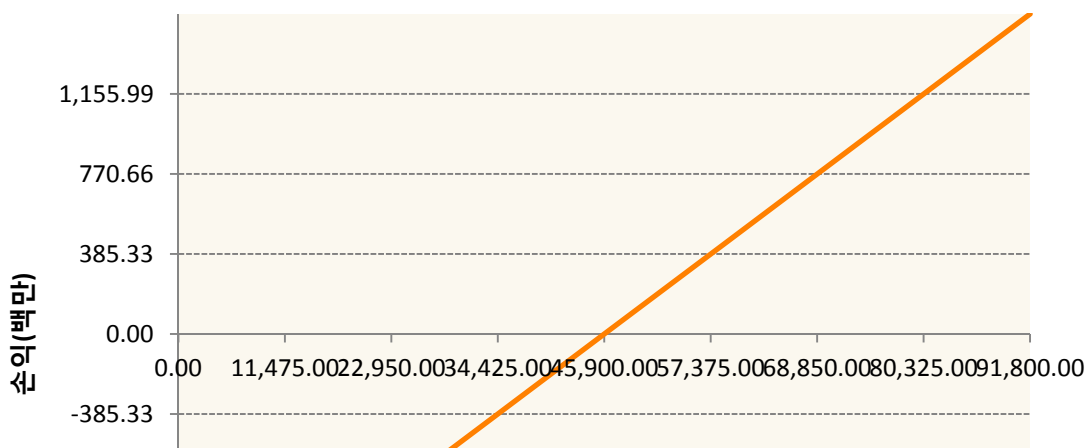
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,886	0	1,886	장내

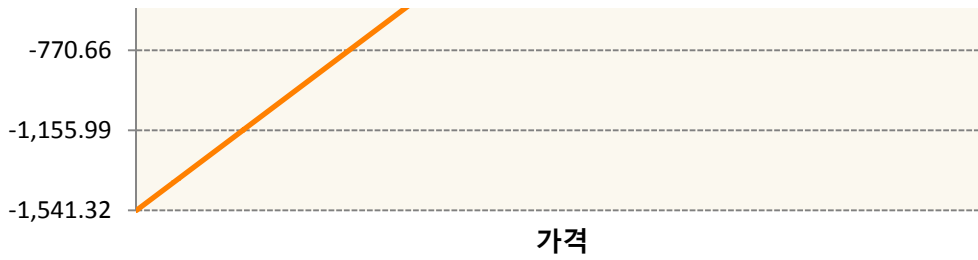
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P70002-2019-07 삼성전자개별선물





3. 시나리오 별 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						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%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82	
-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%	82	82	82	82	82	82	82	
8.00%	124	124	124	124	124	124	124	

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

167

공시일	2019-07-05
기준일	2019-07-04

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

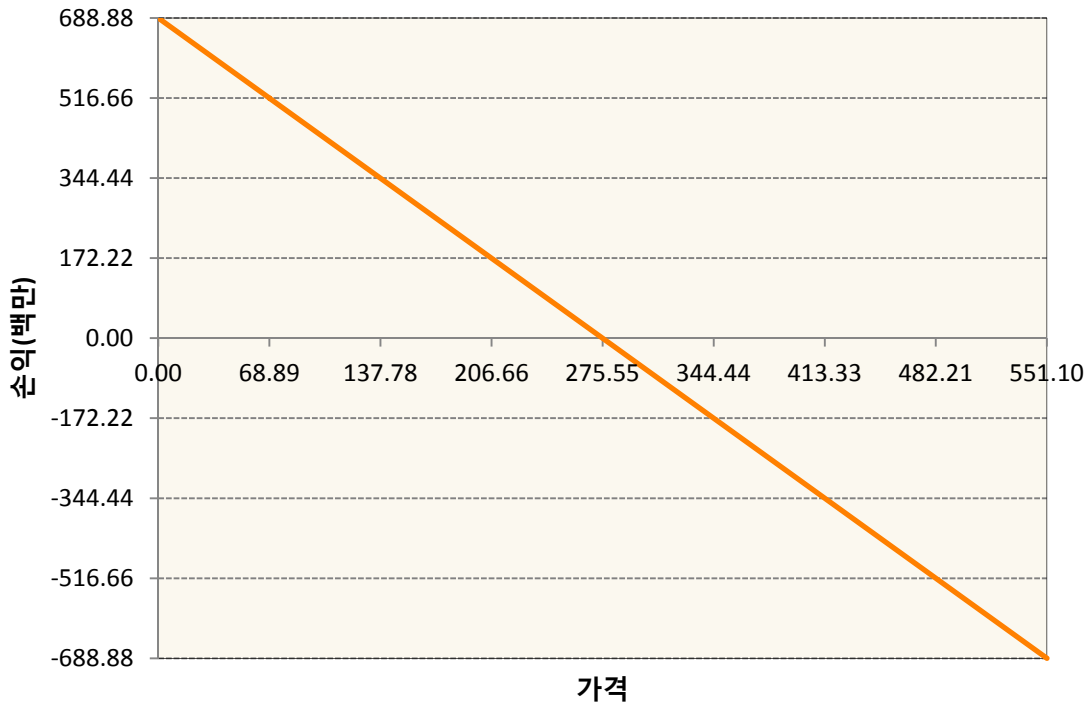
1. 계약금액

(단위:백만원)

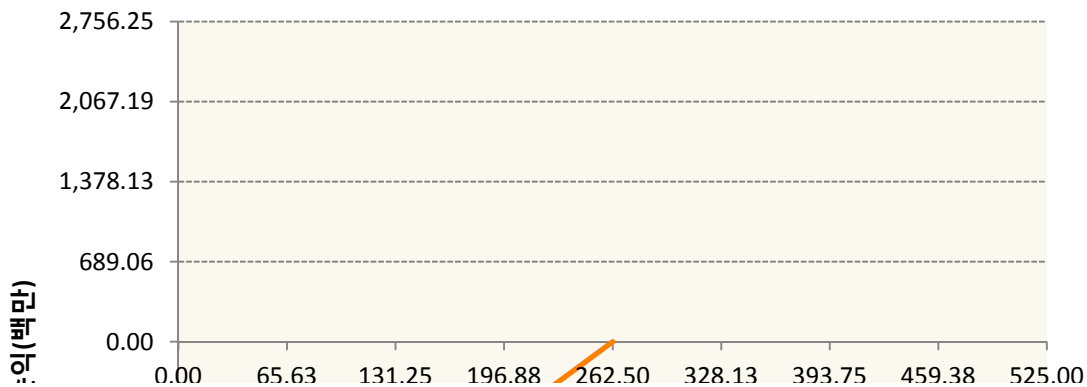
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	689	-689	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,485	-3,485	장내

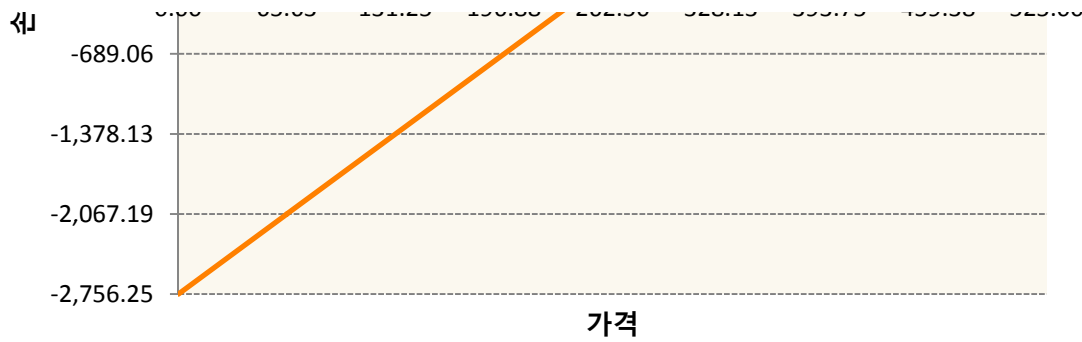
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

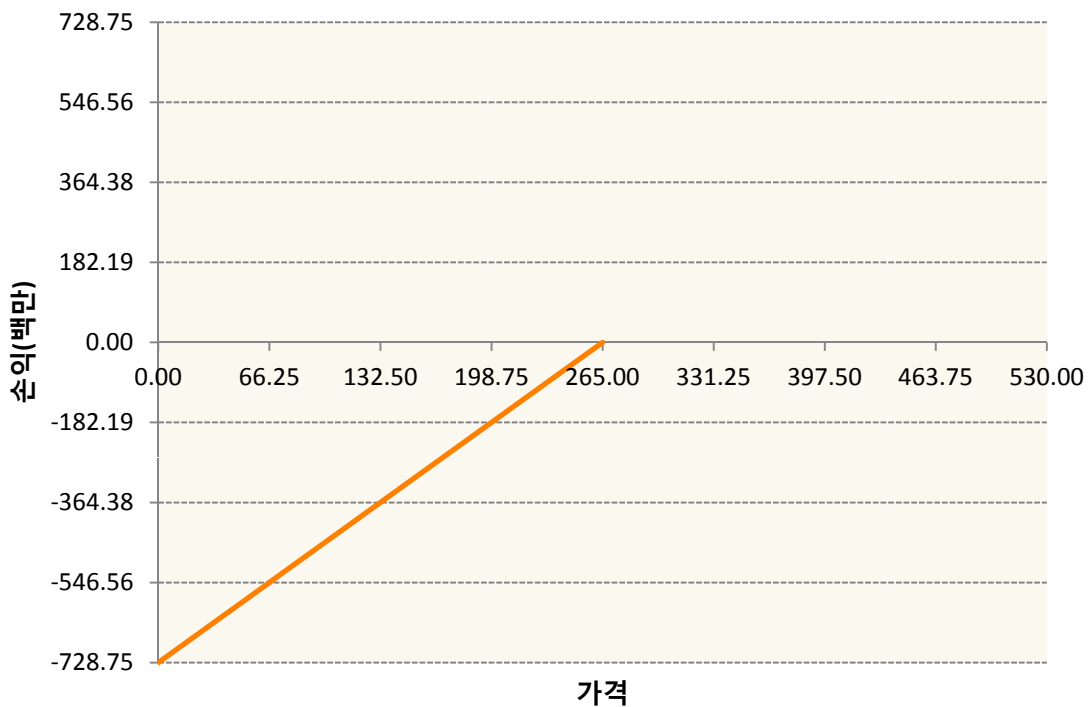


KR4301P72625-2019-07 풋262.5





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						105
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-104	-104	-105	-105	-105	-105	-105
-5.33%	-33	-34	-35	-37	-38	-40	-41
-2.67%	-2	-2	-3	-4	-5	-7	-8
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

KR4301P72658

2019-07 풋265

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%	-14	-14	-15	-15	-15	-15	-16
-2.67%	-2	-2	-2	-3	-3	-4	-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)

93

공시일	2019-07-05
기준일	2019-07-04

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	3,973	-3,973	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019M0:KRW/USD 24-07-19E	140
FX21019M0:KRW/USD 24-07-19E	178

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

(단위:백만원)

105

공시일	2019-07-05
기준일	2019-07-04

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

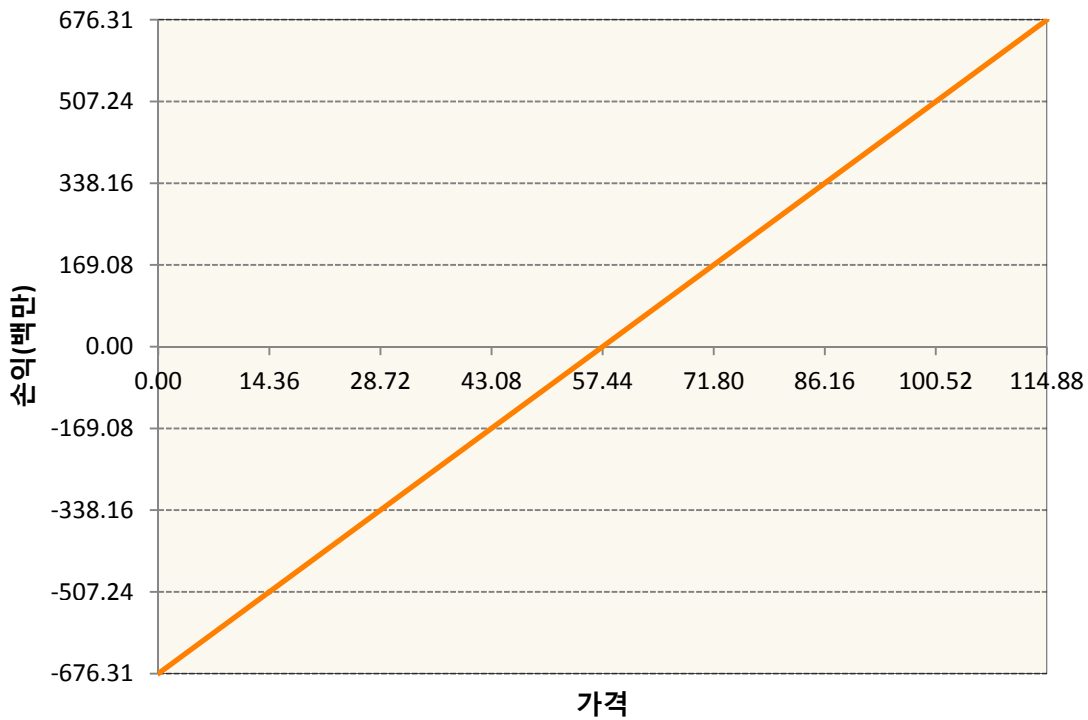
1. 계약금액

(단위:백만원)

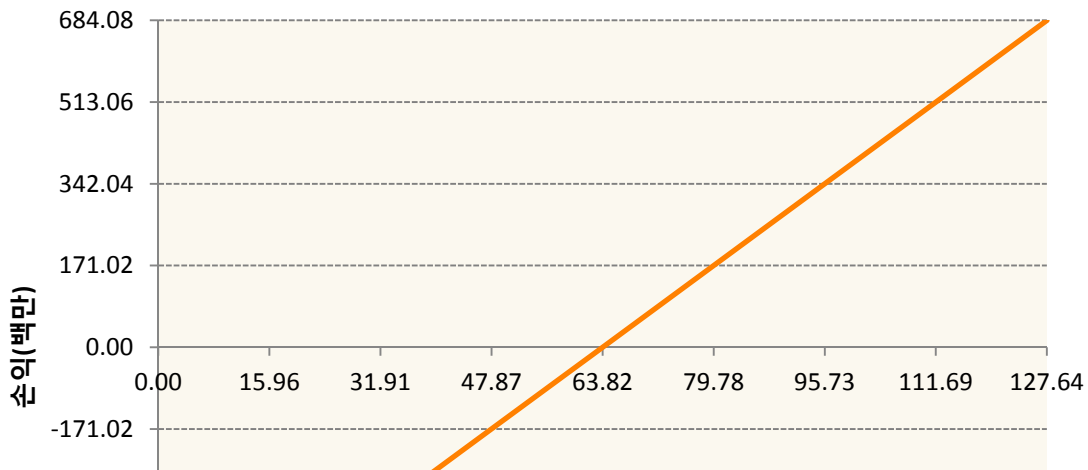
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,688	117	2,571	

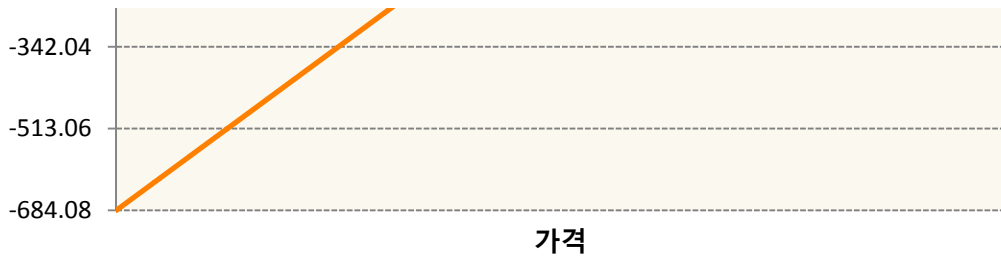
2. 만기시점의 손익구조

CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19

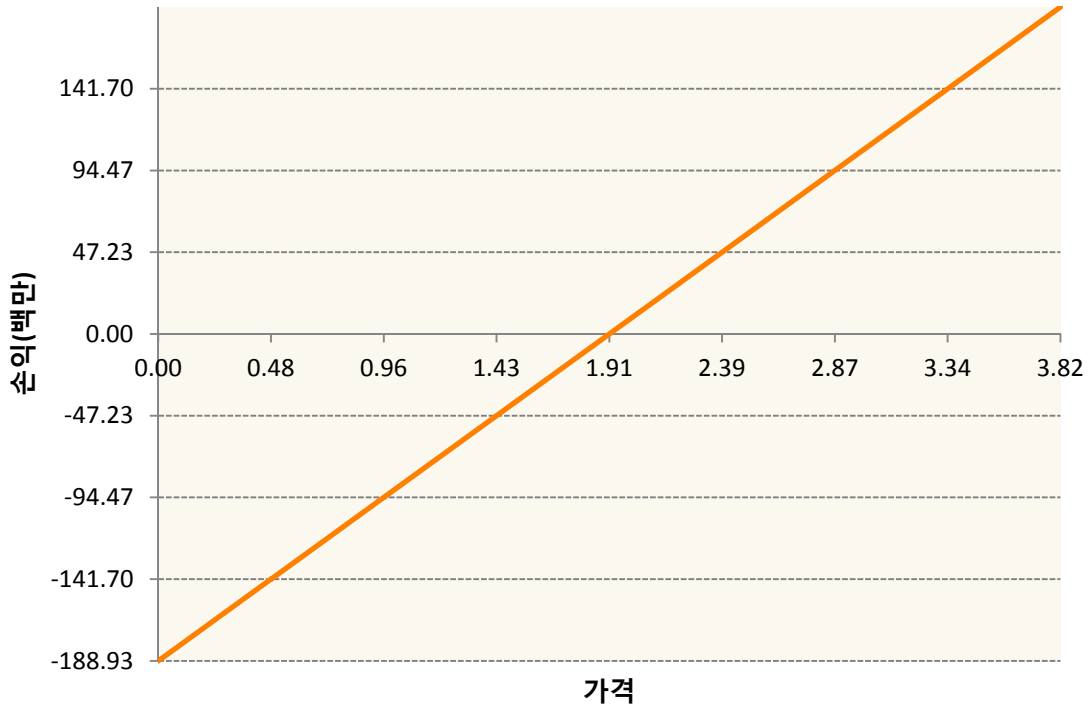


COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19

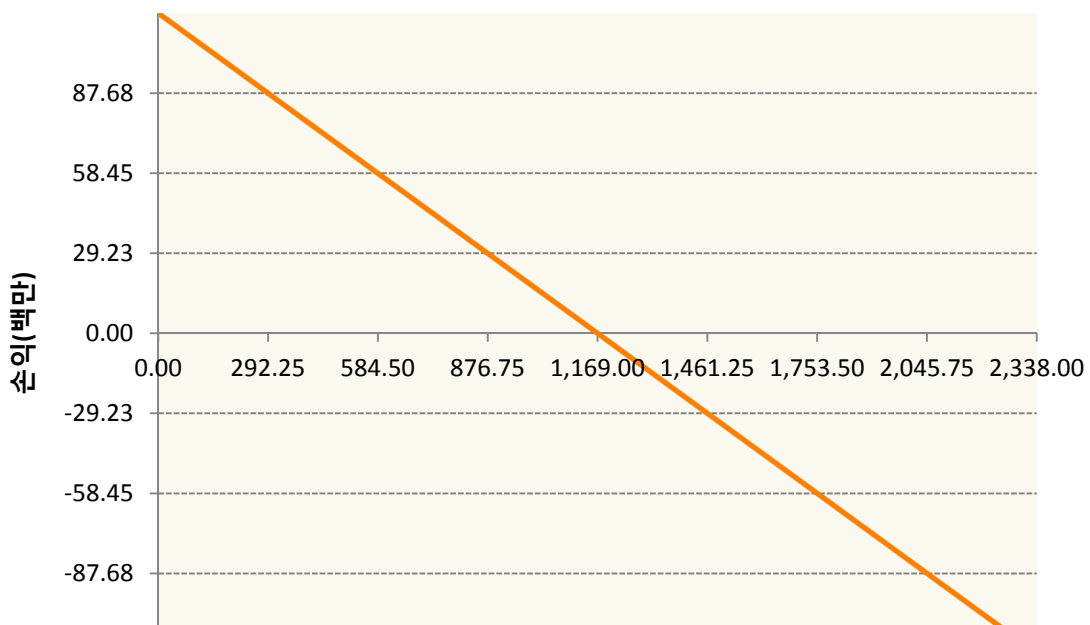


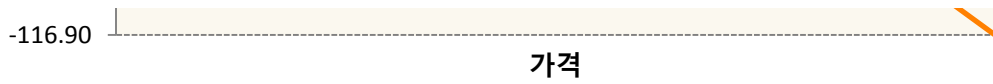


HOU9-NY Harb ULSD Fut Sep19

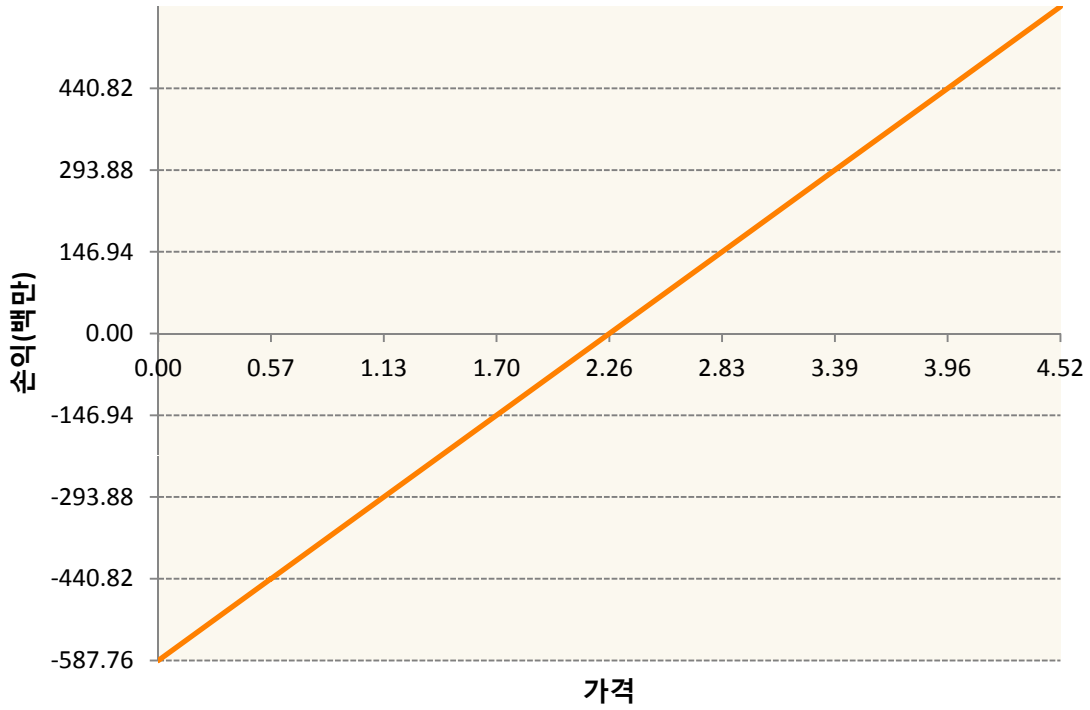


KR4175P70007-2019-07 달러선물

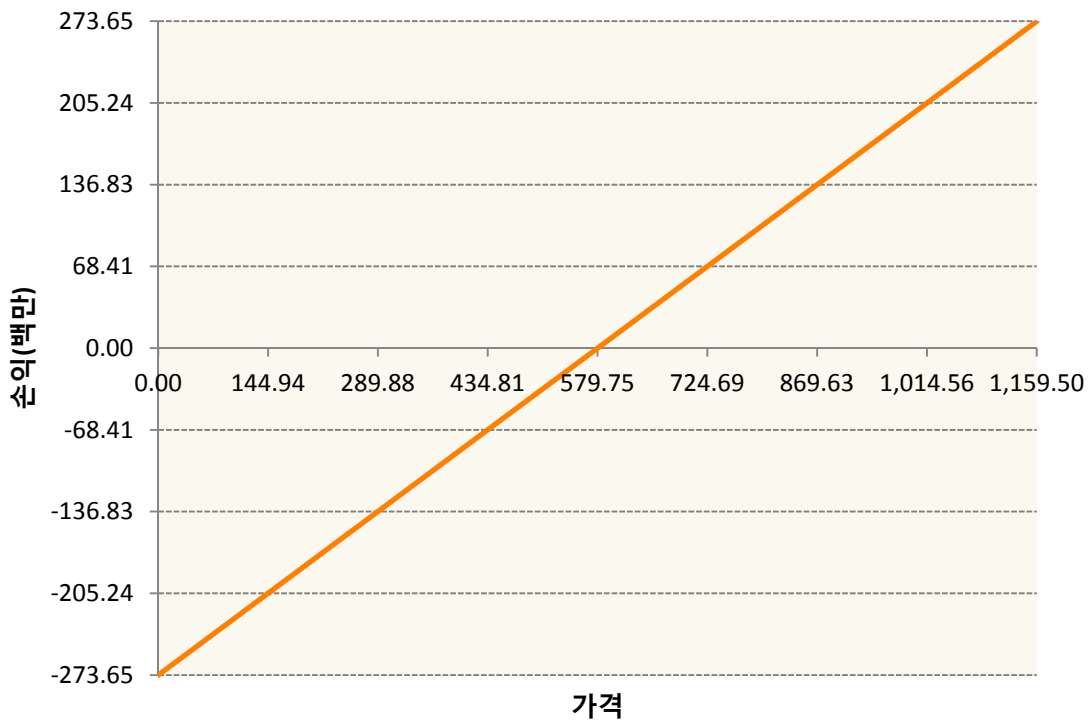




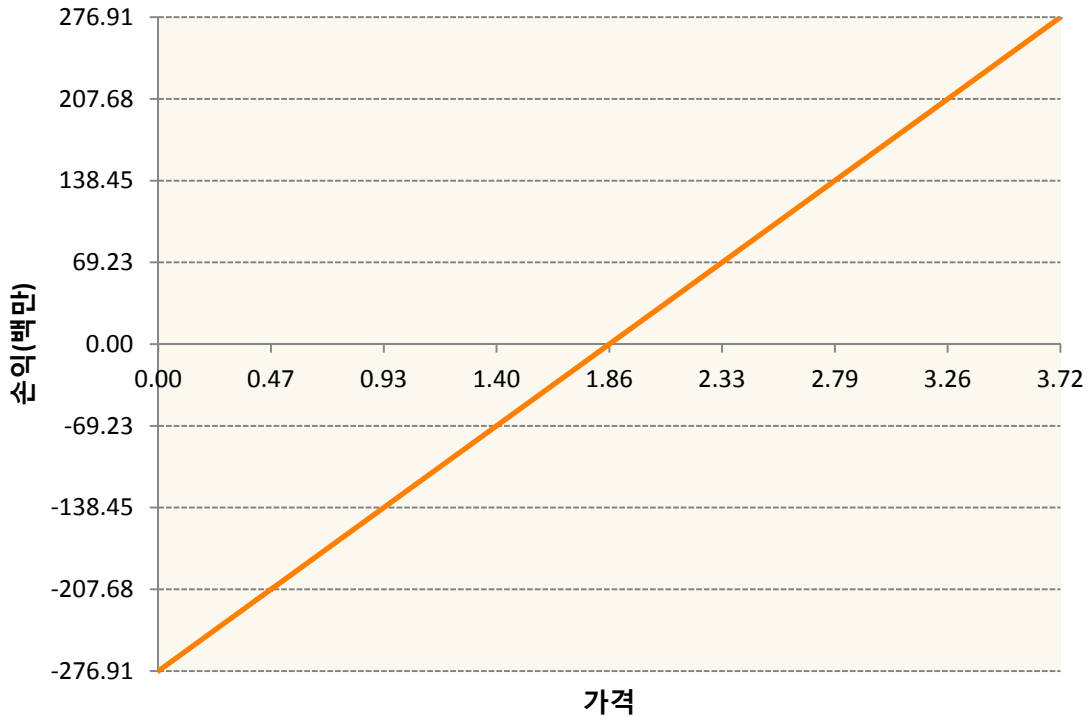
NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



QSU9-Low Su Gasoil G Sep19



XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	54
COU9	BRENT CRUDE FUTR Sep19	55
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	15
KR4175P700	2019-07 달러선물	9
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	47
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	22
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	22

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

398

공시일	2019-07-05
기준일	2019-07-04

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

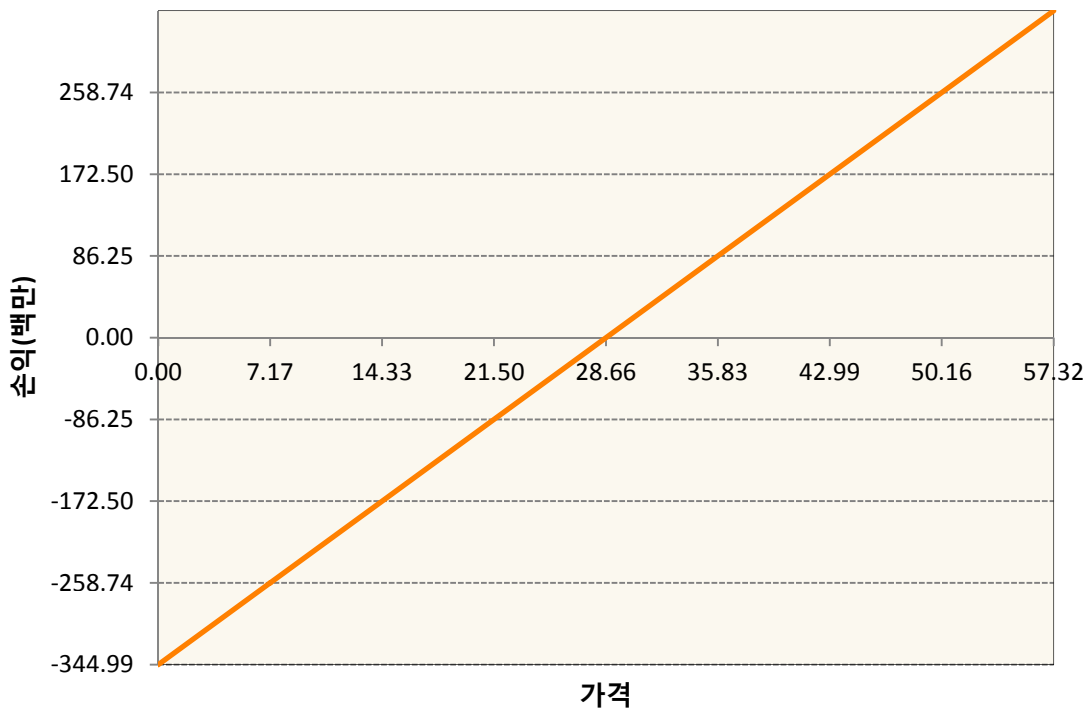
1. 계약금액

(단위:백만원)

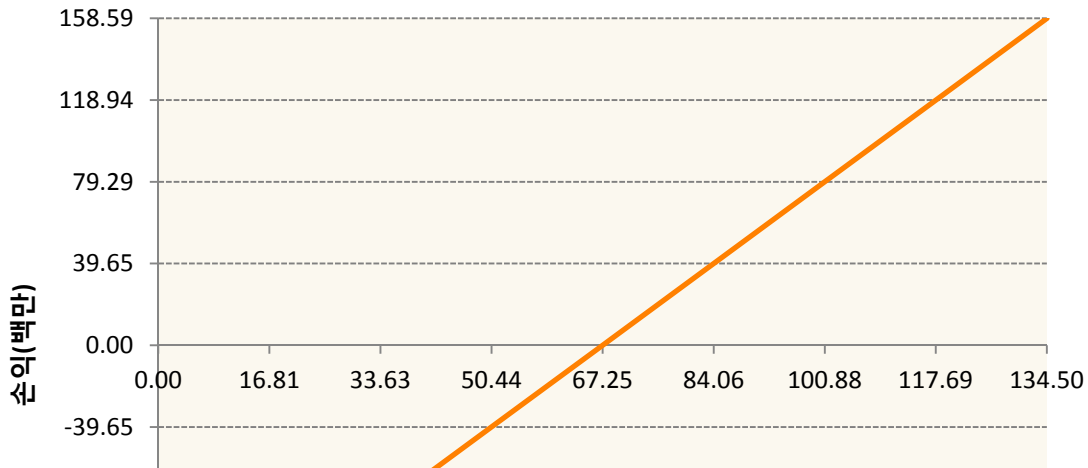
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,274	199	3,075	

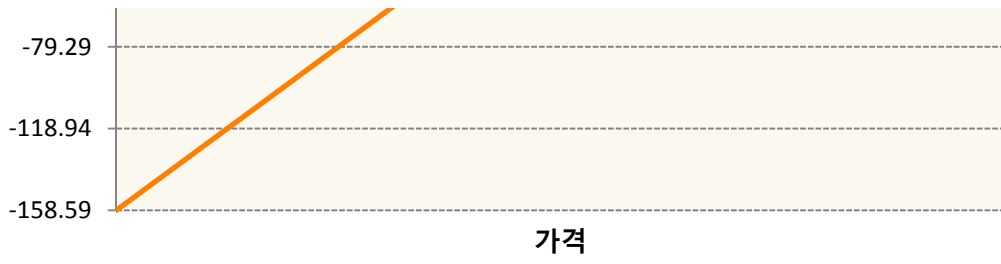
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

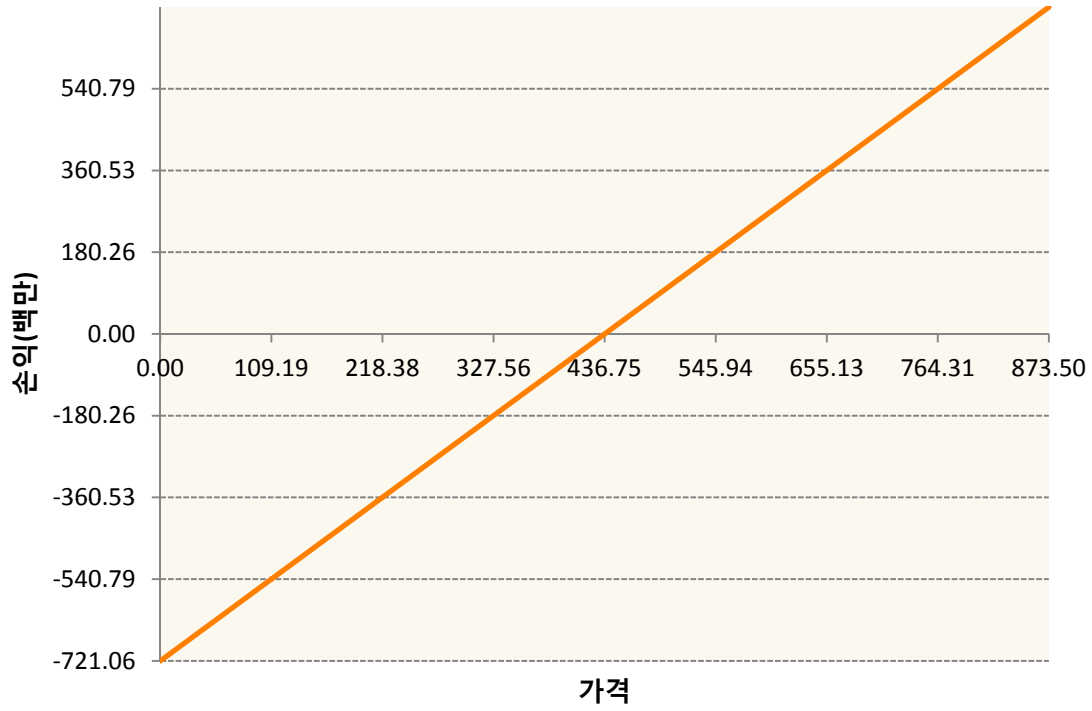


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

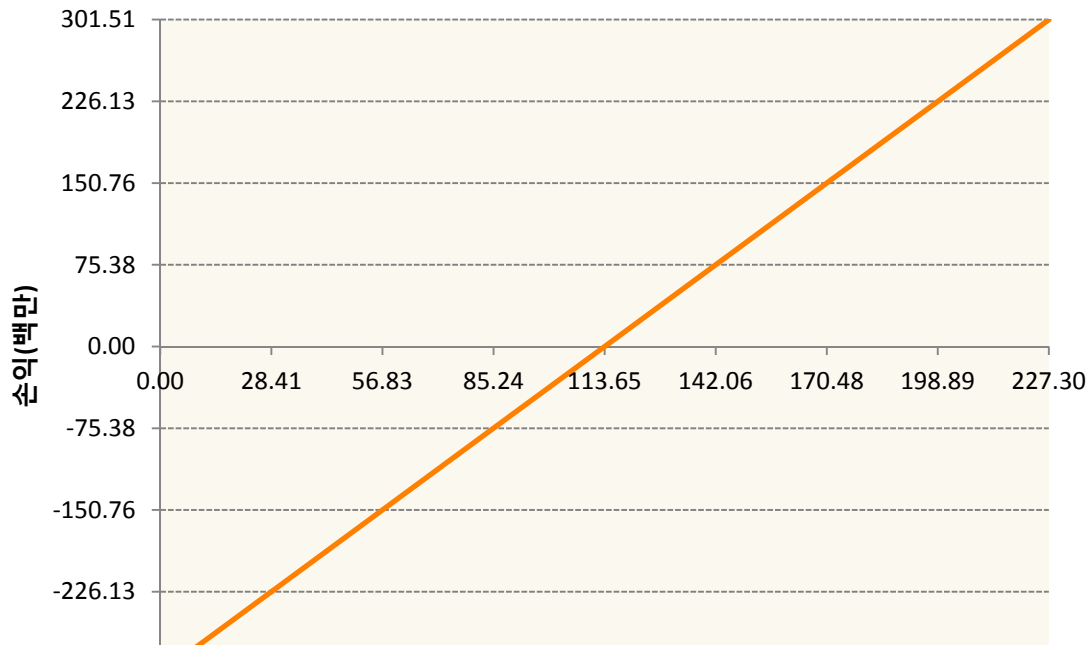


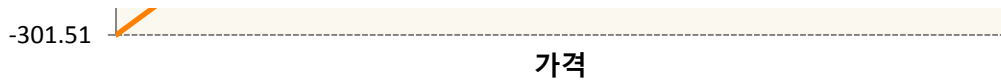


CU9-CORN FUTURE Sep19

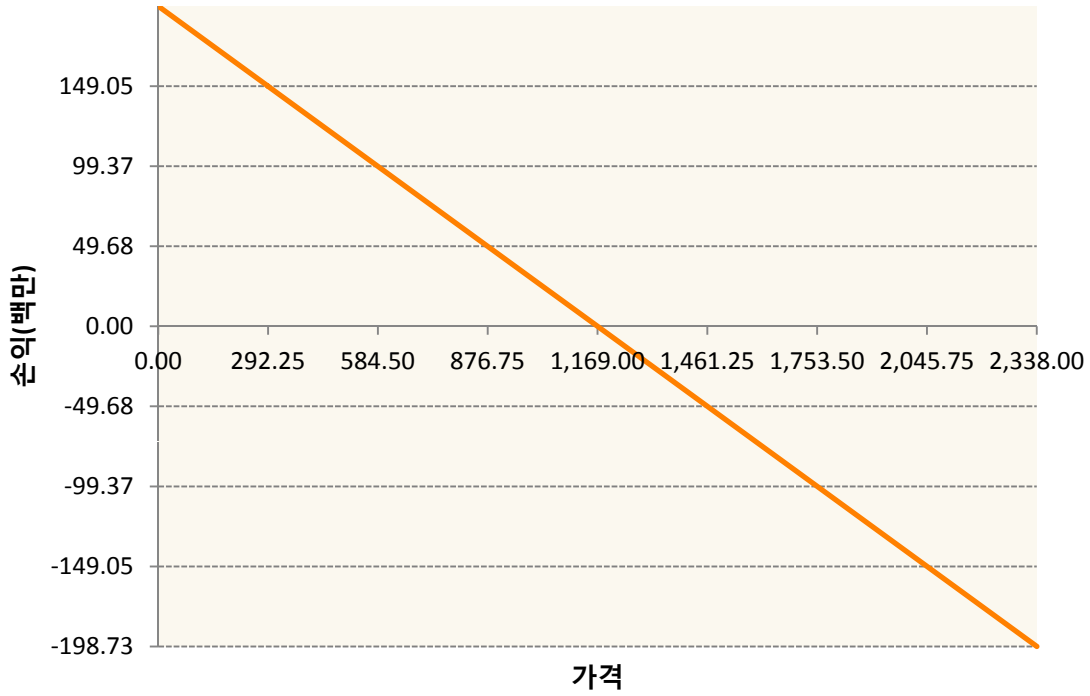


KCU9-COFFEE 'C' FUTURE Sep19

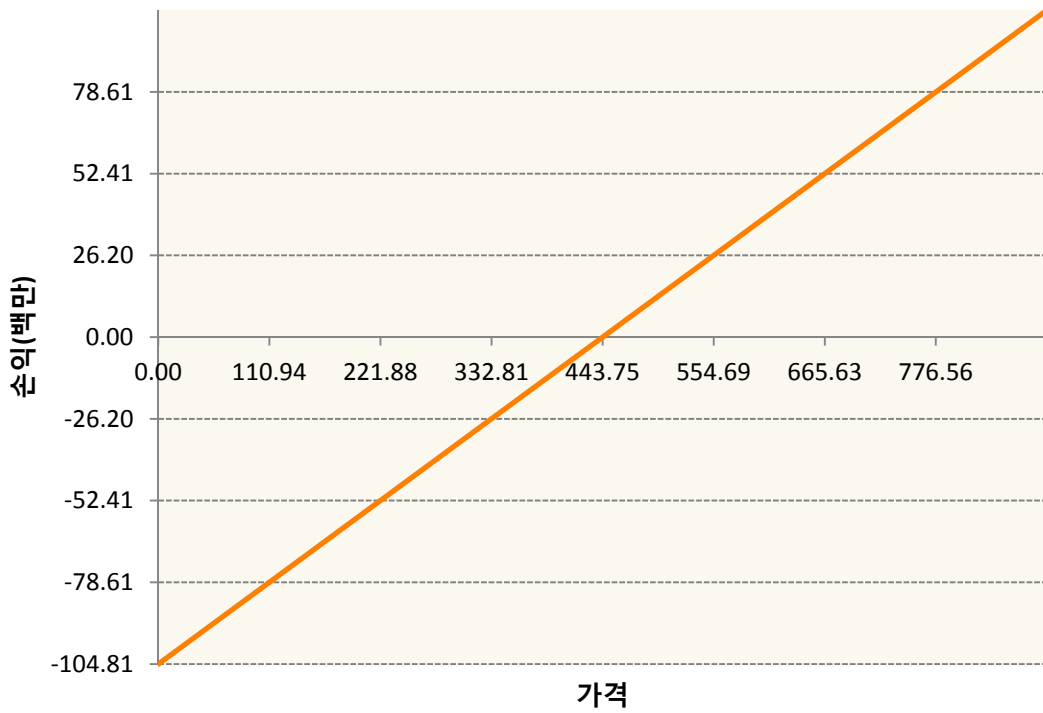




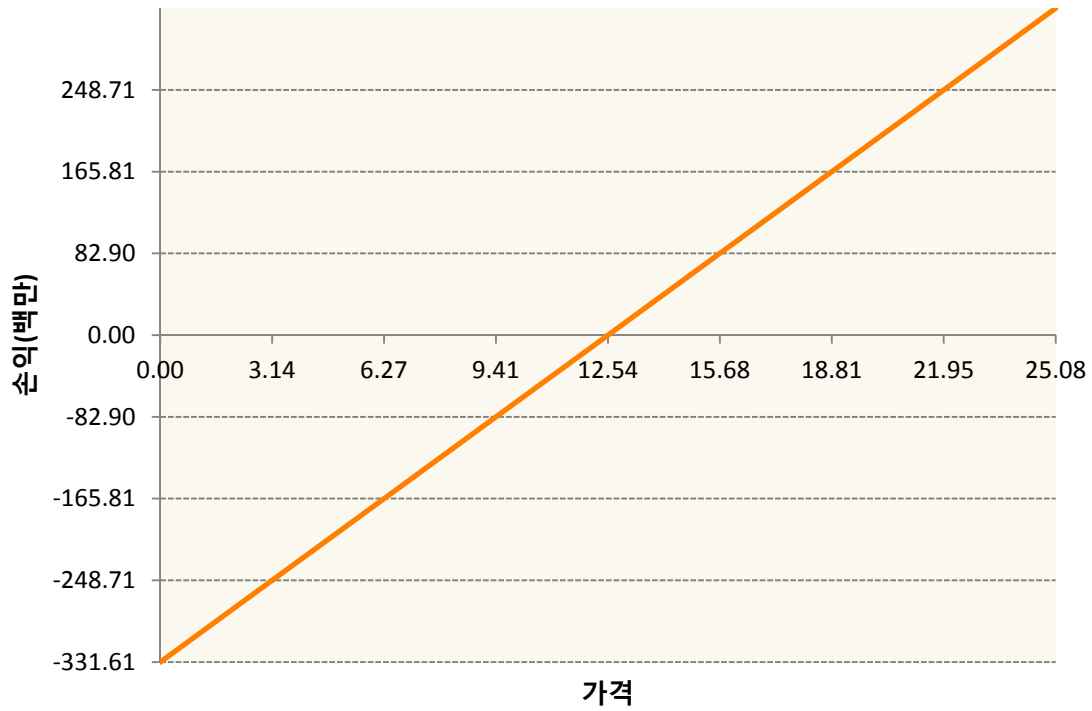
KR4175P70007-2019-07 달러선물



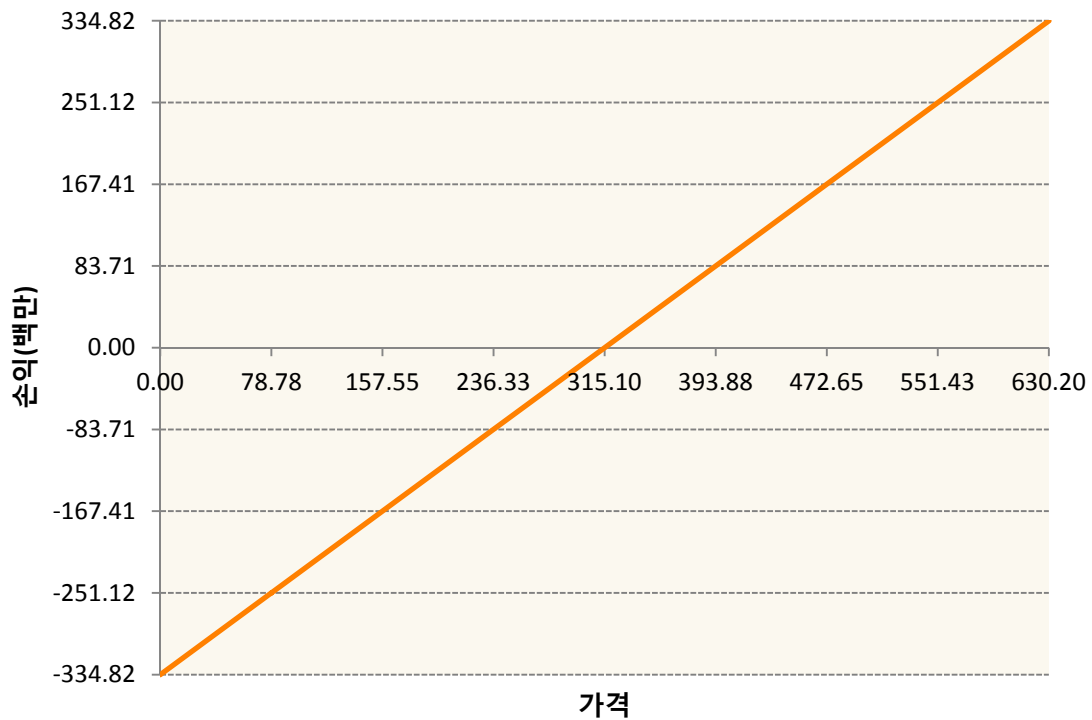
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



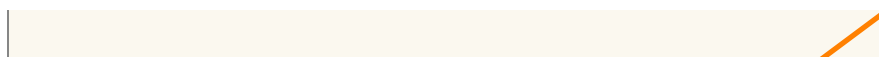
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

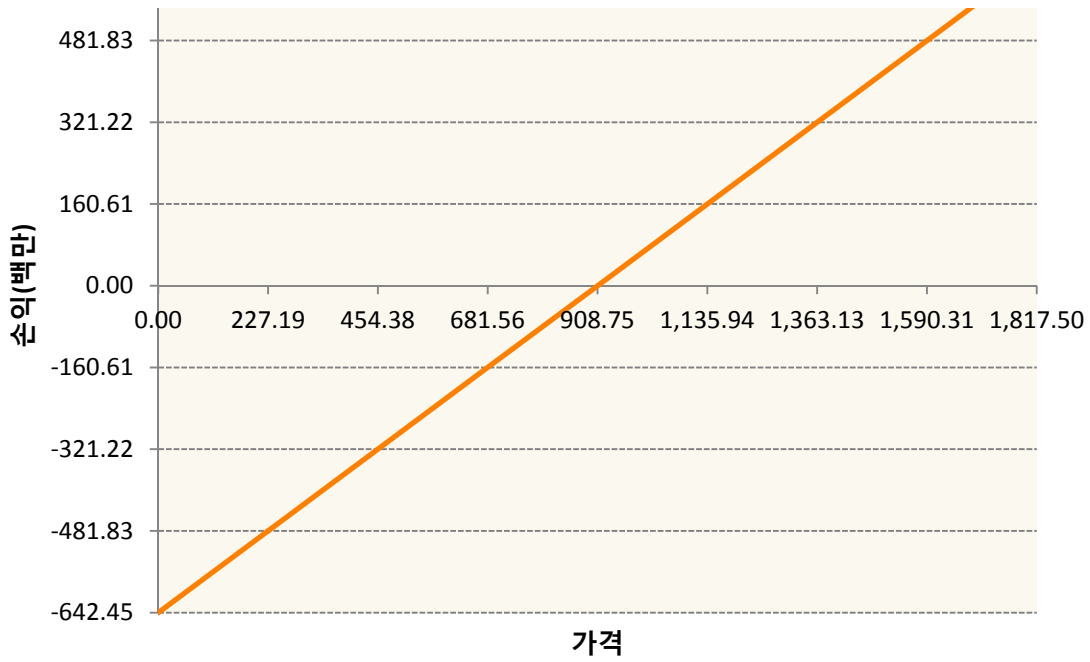


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

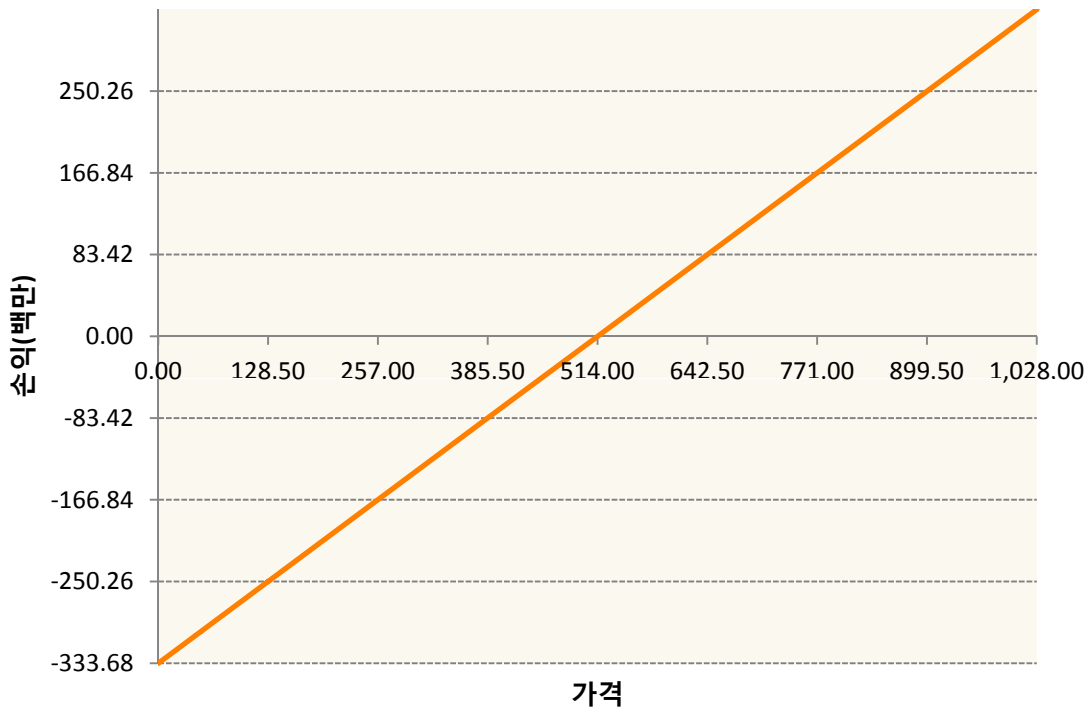


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





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	58
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)

288