

공시일	2019-07-08
기준일	2019-07-05

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	2019-07-08
기준일	2019-07-05

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

1,185

* 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	2019-07-08
기준일	2019-07-05

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)

873

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-08
기준일	2019-07-05

유로인덱스모(주식-파생형)

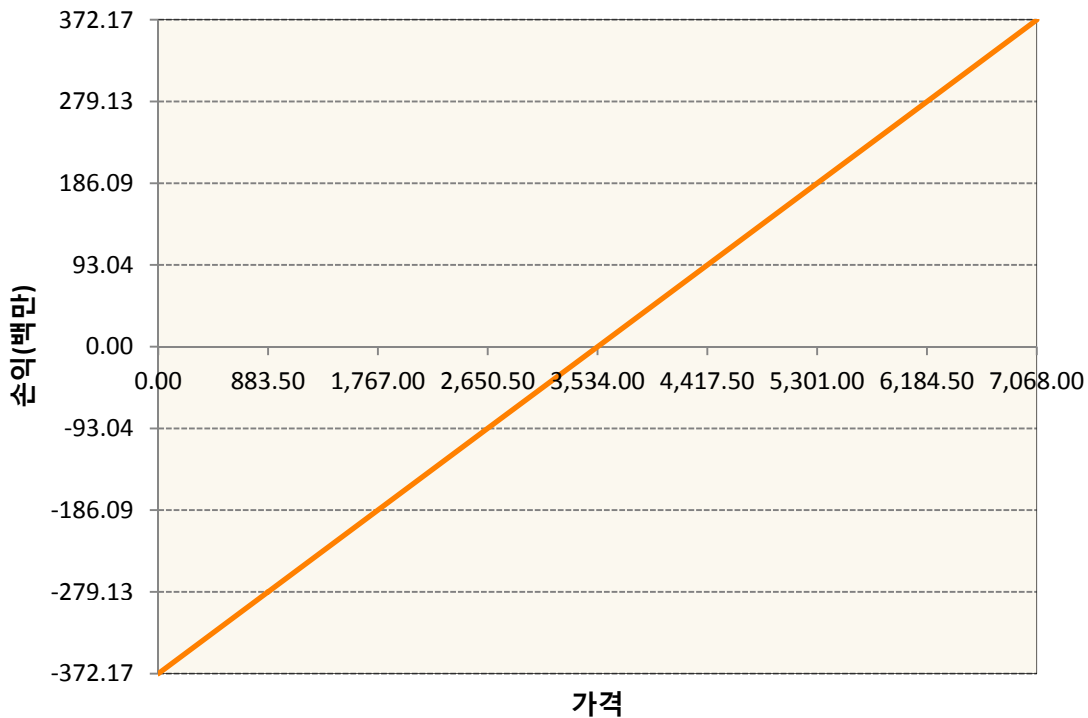
1. 계약금액

(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	2019-07-08
기준일	2019-07-05

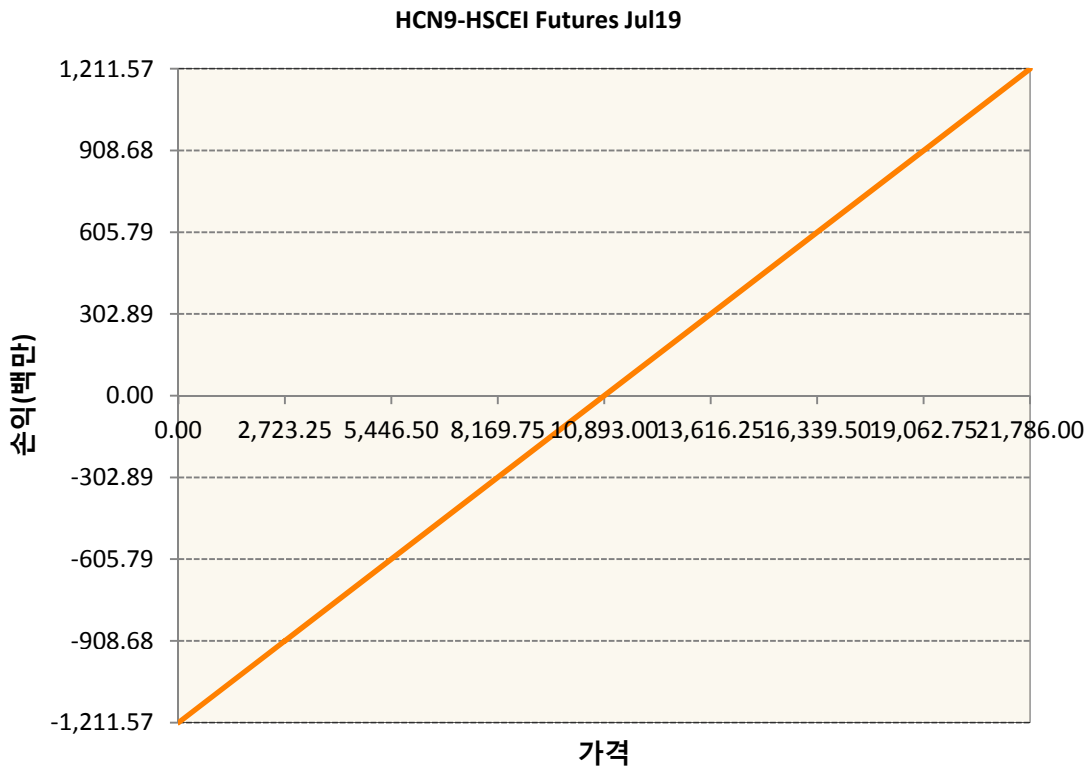
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,212	0	1,212	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	2019-07-08
기준일	2019-07-05

커버드콜모(주식혼합-파생형)

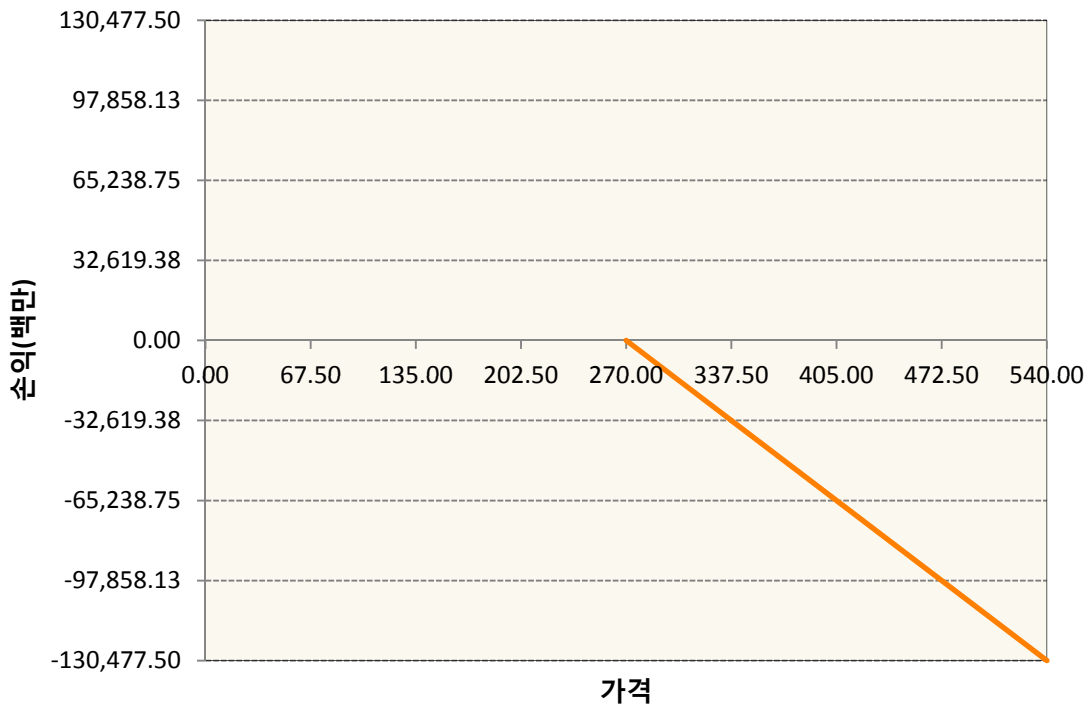
1. 계약금액

(단위:백만원)

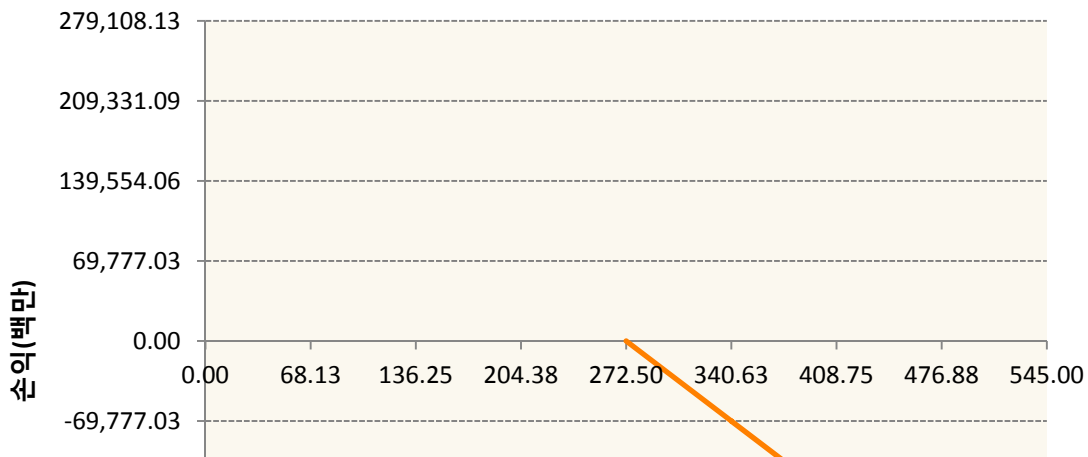
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	591,498	-591,498	장내

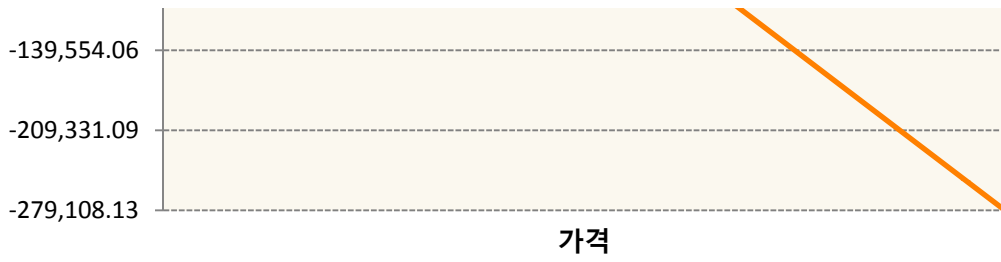
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P72700-2019-07 콜270

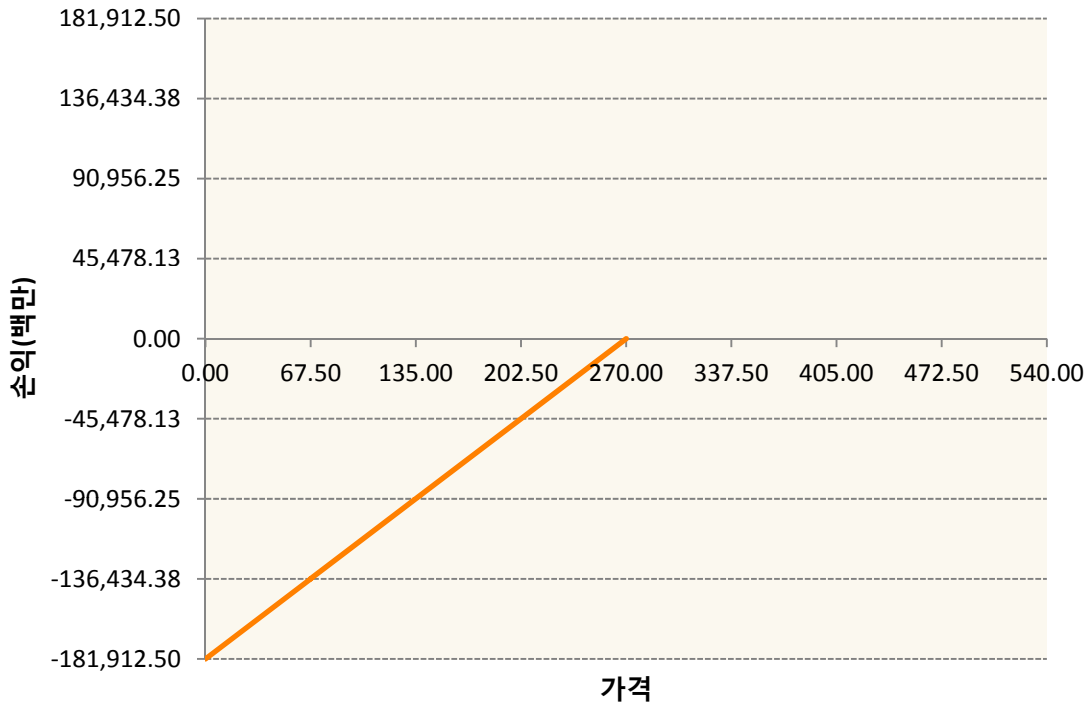


KR4201P72726-2019-07 콜272.5





KR4301P72708-2019-07 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P72700		2019-07 콜270					9,784
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,924	2,920	2,913	2,901	2,883	2,860	2,831
-5.33%	2,858	2,816	2,765	2,704	2,635	2,559	2,477
-2.67%	2,275	2,150	2,022	1,893	1,762	1,631	1,498
0%	357	242	122	0	-125	-252	-381
2.67%	-2,747	-2,783	-2,828	-2,883	-2,947	-3,018	-3,096
5.33%	-6,233	-6,237	-6,244	-6,257	-6,275	-6,300	-6,330
8.00%	-9,765	-9,765	-9,766	-9,767	-9,770	-9,775	-9,784
KR4201P72726		2019-07 콜272.5					19,829
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,586	4,583	4,576	4,563	4,543	4,513	4,473

-5.33%	4,532	4,484	4,418	4,333	4,231	4,112	3,979
-2.67%	3,854	3,642	3,416	3,180	2,936	2,686	2,430
0%	869	581	291	0	-292	-585	-879
2.67%	-5,035	-5,164	-5,315	-5,485	-5,670	-5,868	-6,078
5.33%	-12,278	-12,299	-12,333	-12,382	-12,448	-12,529	-12,626
8.00%	-19,752	-19,754	-19,757	-19,765	-19,778	-19,799	-19,829
KR4301P72708 2019-07 풋270							11,576
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11,576	-11,576	-11,576	-11,576	-11,576	-11,576	-11,576
-5.33%	-6,649	-6,651	-6,654	-6,660	-6,669	-6,682	-6,699
-2.67%	-1,965	-2,037	-2,115	-2,196	-2,280	-2,366	-2,455
0%	175	123	65	0	-69	-143	-220
2.67%	295	294	292	288	282	273	260
5.33%	295	295	295	295	295	295	294
8.00%	295	295	295	295	295	295	295

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

(단위:백만원)

47,131

공시일	2019-07-08
기준일	2019-07-05

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

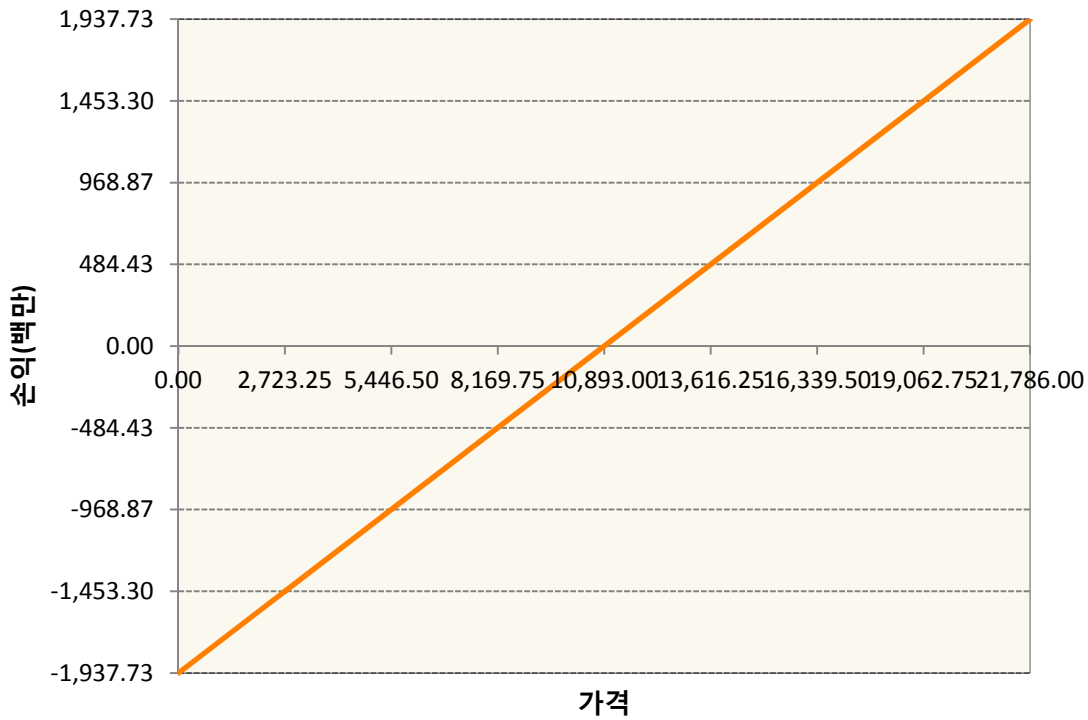
1. 계약금액

(단위:백만원)

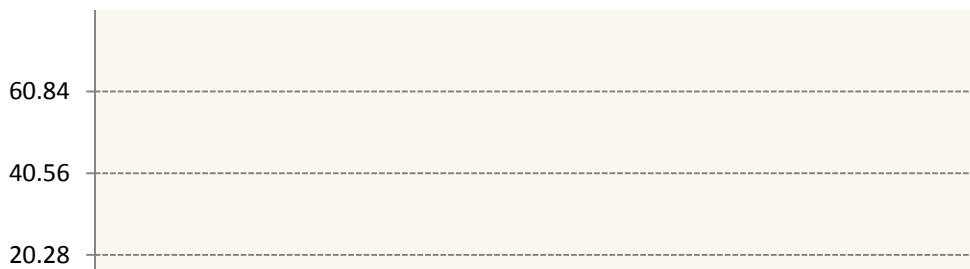
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,938	0	1,938	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,238	-5,238	장내
누계	통화	선도	150	3,155	-3,004	장외

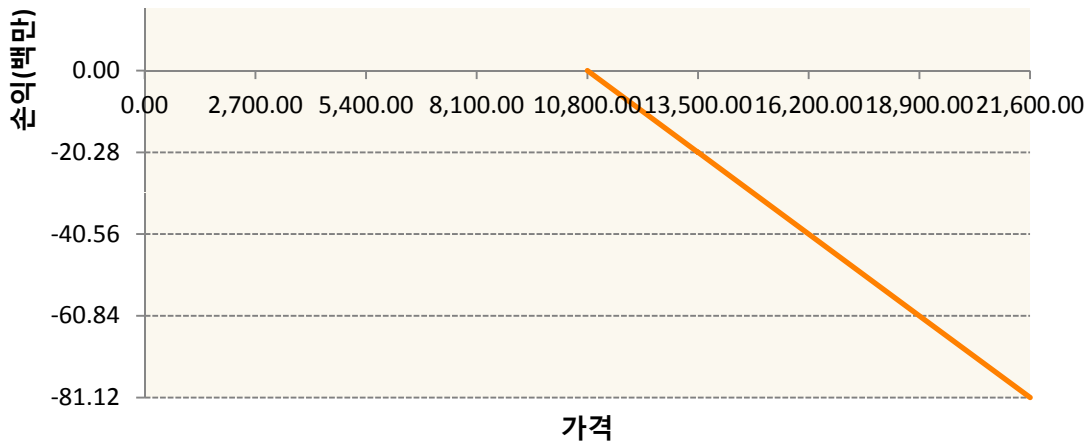
2. 만기시점의 손익구조

HCN9-HSCEI Futures Jul19

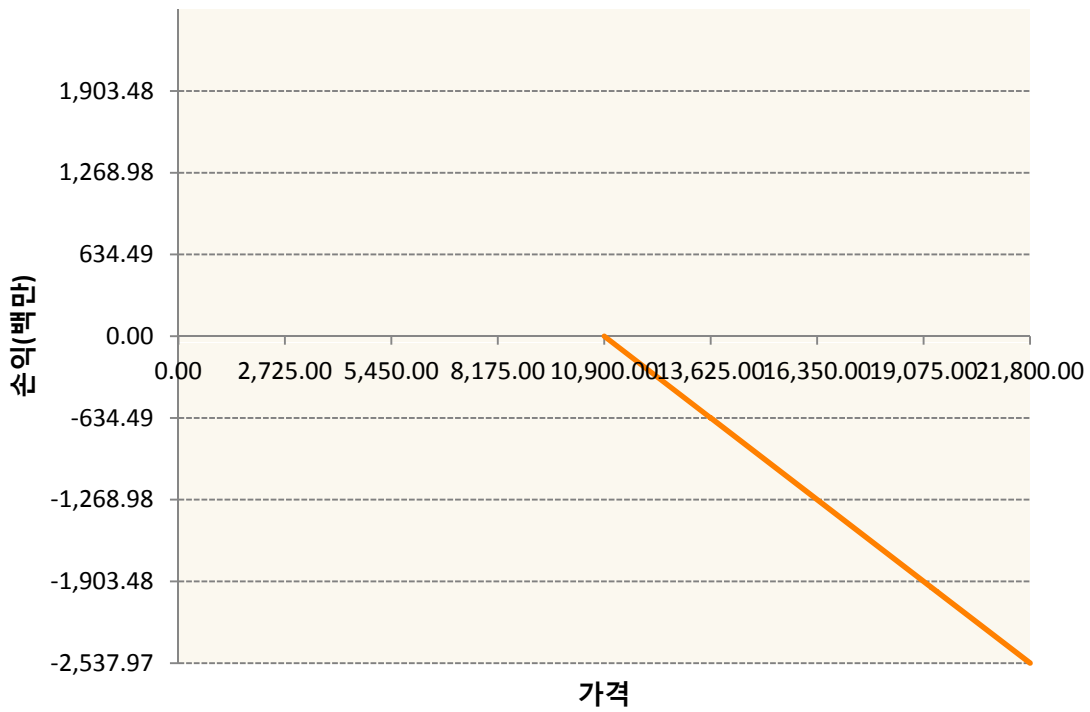


OHHIN9-C108-HSCEI

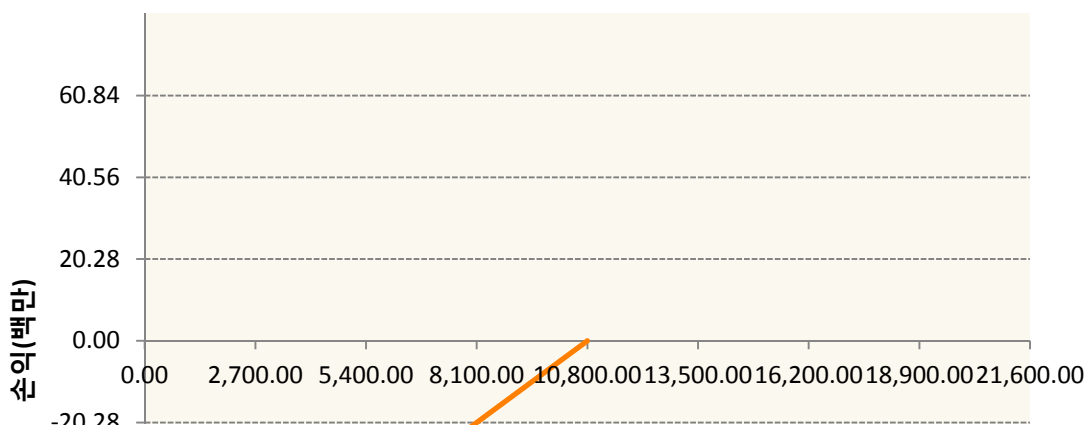


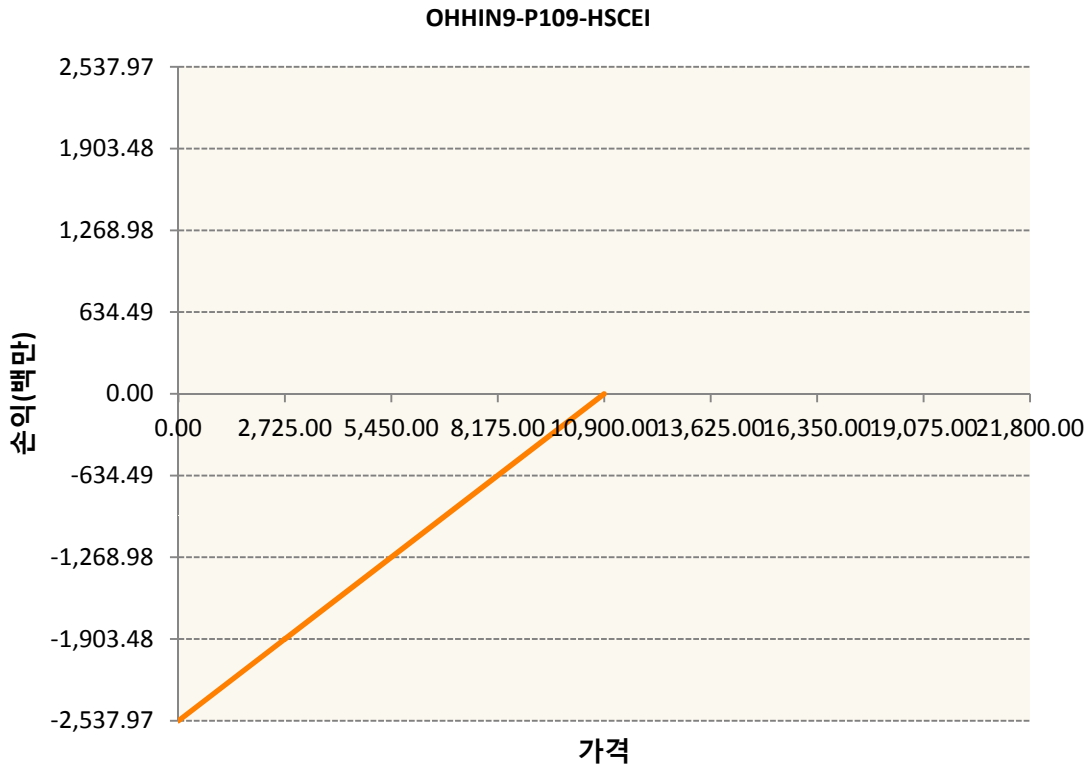
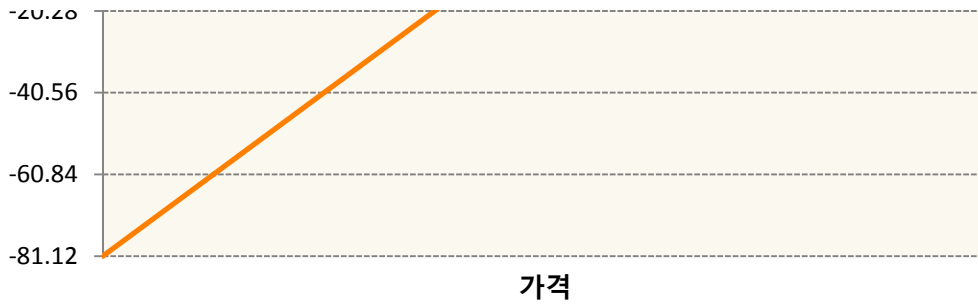


OHHIN9-C109-HSCEI



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)

670

공시일	2019-07-08
기준일	2019-07-05

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

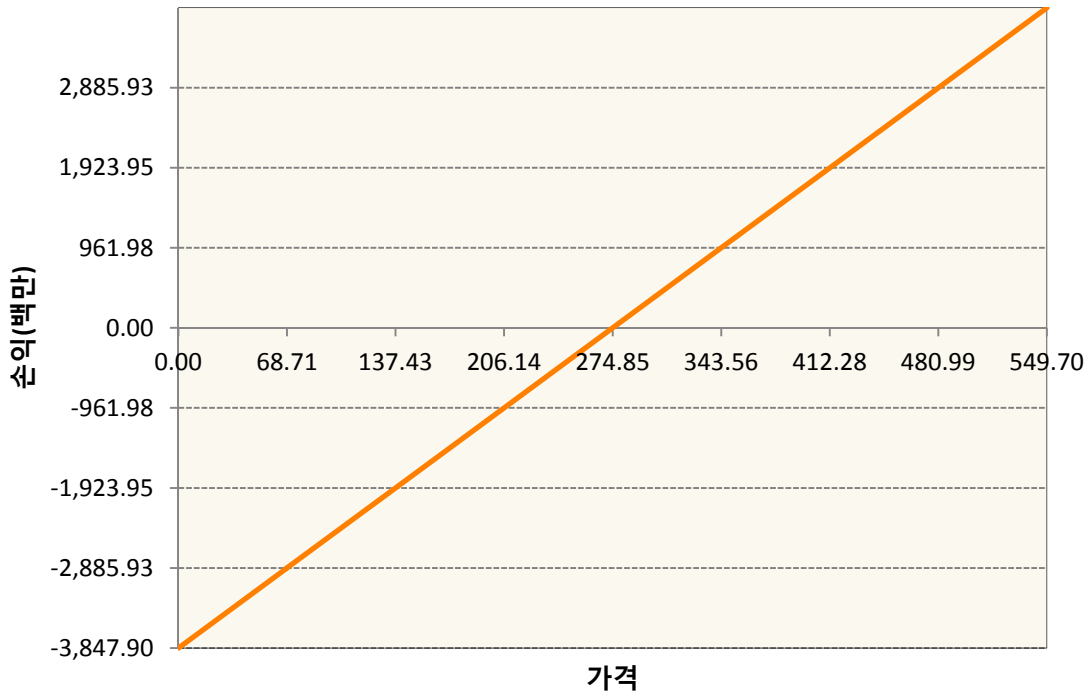
1. 계약금액

(단위:백만원)

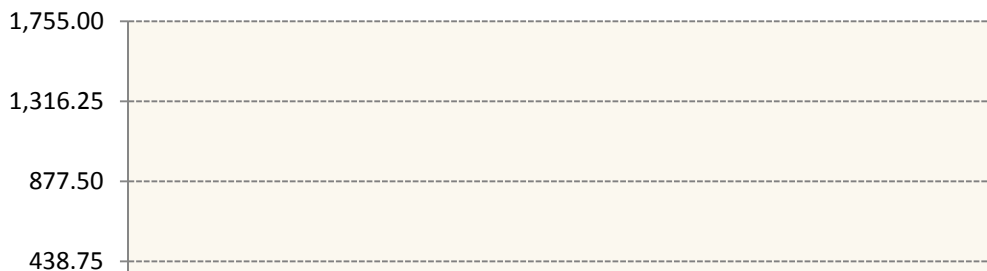
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,848	0	3,848	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,340	-20,340	장내

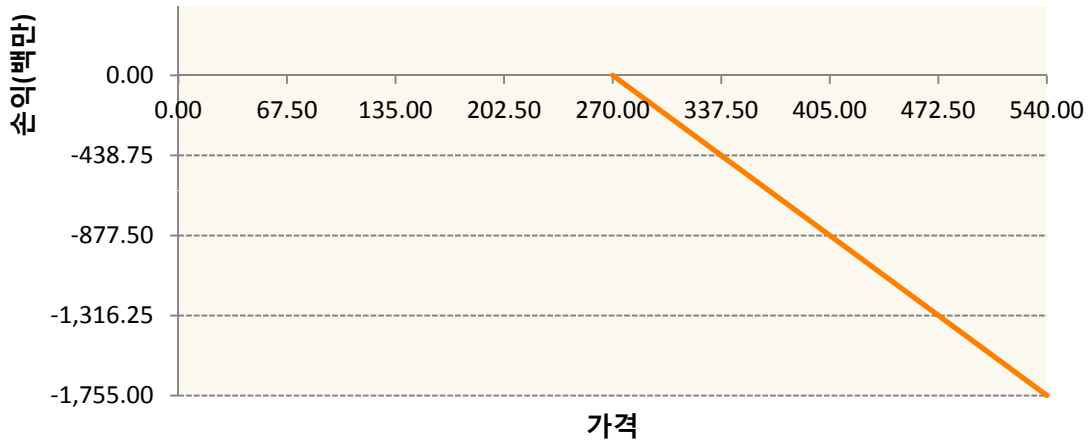
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

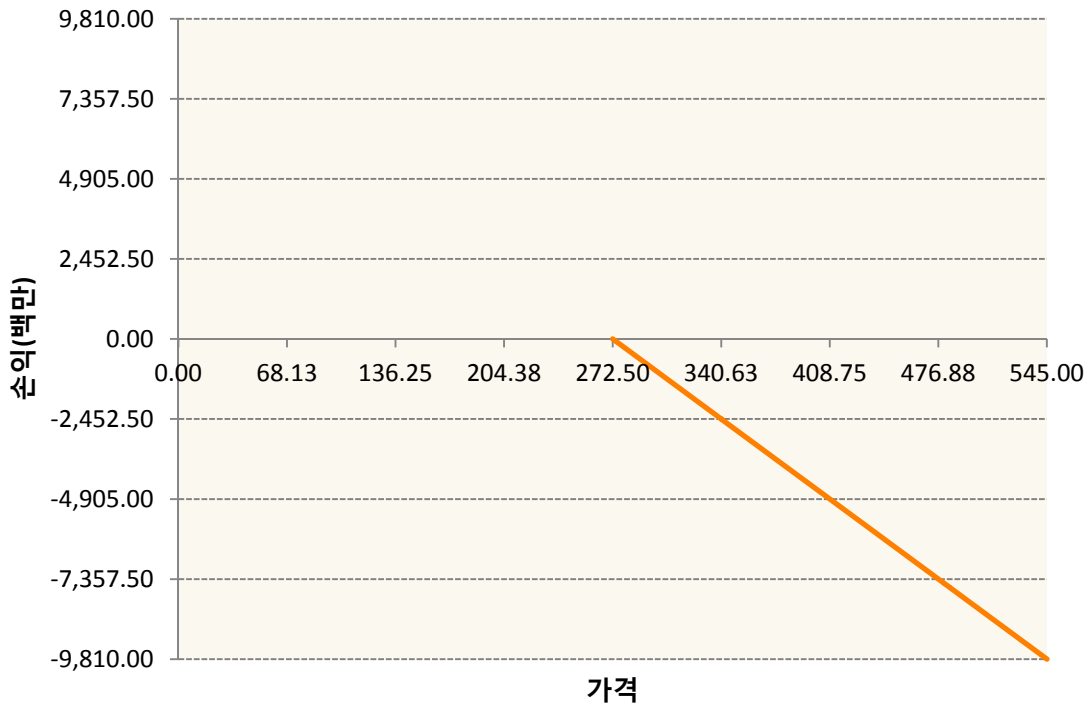


KR4201P72700-2019-07 콜270

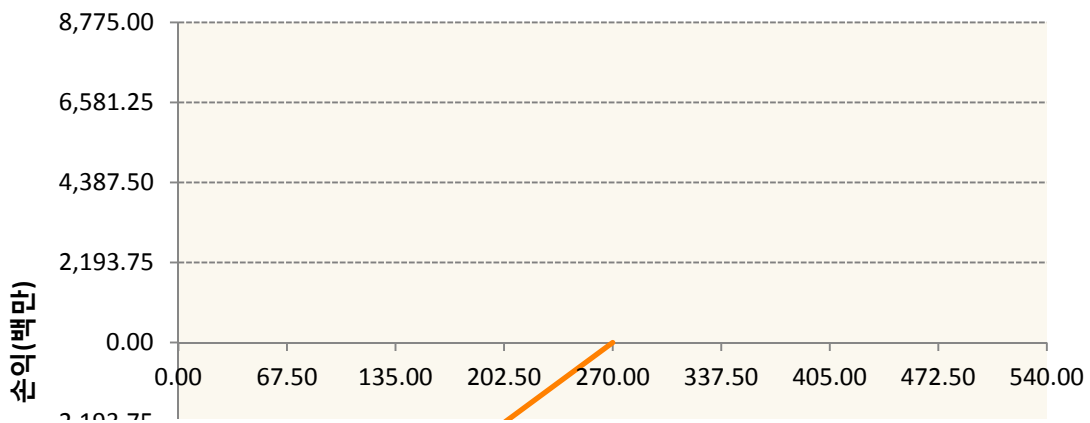




KR4201P72726-2019-07 콜272.5



KR4301P72708-2019-07 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,185
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,185	-1,185	-1,185	-1,185	-1,185	-1,185	-1,185	
-5.33%	-790	-790	-790	-790	-790	-790	-790	
-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%	790	790	790	790	790	790	790	
8.00%	1,185	1,185	1,185	1,185	1,185	1,185	1,185	
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						132
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	39	39	39	39	39	38	38
-5.33%	38	38	37	36	35	34	33
-2.67%	31	29	27	25	24	22	20
0%	5	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	-37	-37	-38	-39	-40	-41	-42
5.33%	-84	-84	-84	-84	-84	-85	-85
8.00%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-132
KR4201P72726 2019-07 콜272.5							697
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	161	161	161	160	160	159	157
-5.33%	159	158	155	152	149	145	140
-2.67%	135	128	120	112	103	94	85
0%	31	20	10	0	-10	-21	-31
2.67%	-177	-182	-187	-193	-199	-206	-214
5.33%	-432	-432	-433	-435	-438	-440	-444
8.00%	-694	-694	-694	-695	-695	-696	-697
KR4301P72708 2019-07 풋270							558
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-558	-558	-558	-558	-558	-558	-558
-5.33%	-321	-321	-321	-321	-322	-322	-323
-2.67%	-95	-98	-102	-106	-110	-114	-118
0%	8	6	3	0	-3	-7	-11
2.67%	14	14	14	14	14	13	13
5.33%	14	14	14	14	14	14	14
8.00%	14	14	14	14	14	14	14

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

(단위:백만원)

3,609

공시일	2019-07-08
기준일	2019-07-05

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

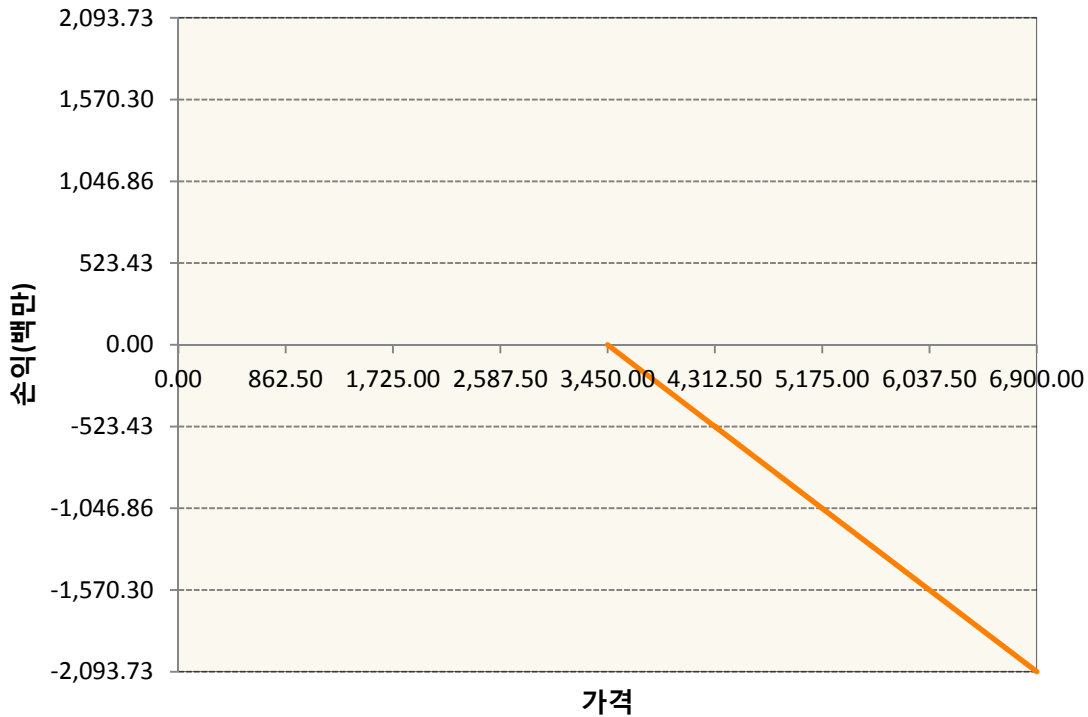
1. 계약금액

(단위:백만원)

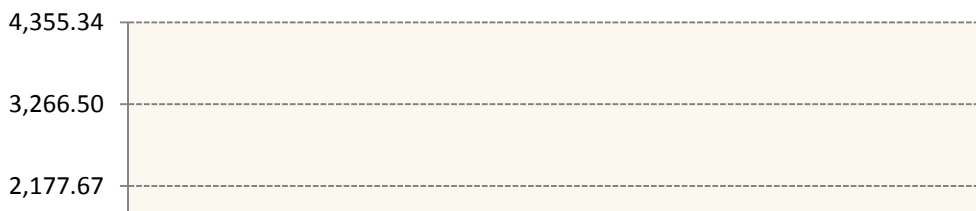
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,349	0	1,349	
누계	유가증권	스왑	55,846	0	55,846	장외
누계	유가증권	옵션	0	12,898	-12,898	장내
누계	통화	선도	0	22,429	-22,429	장외

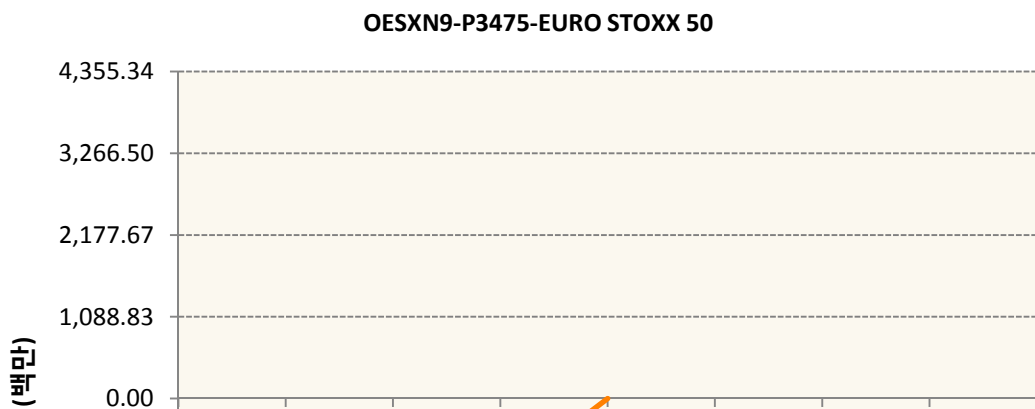
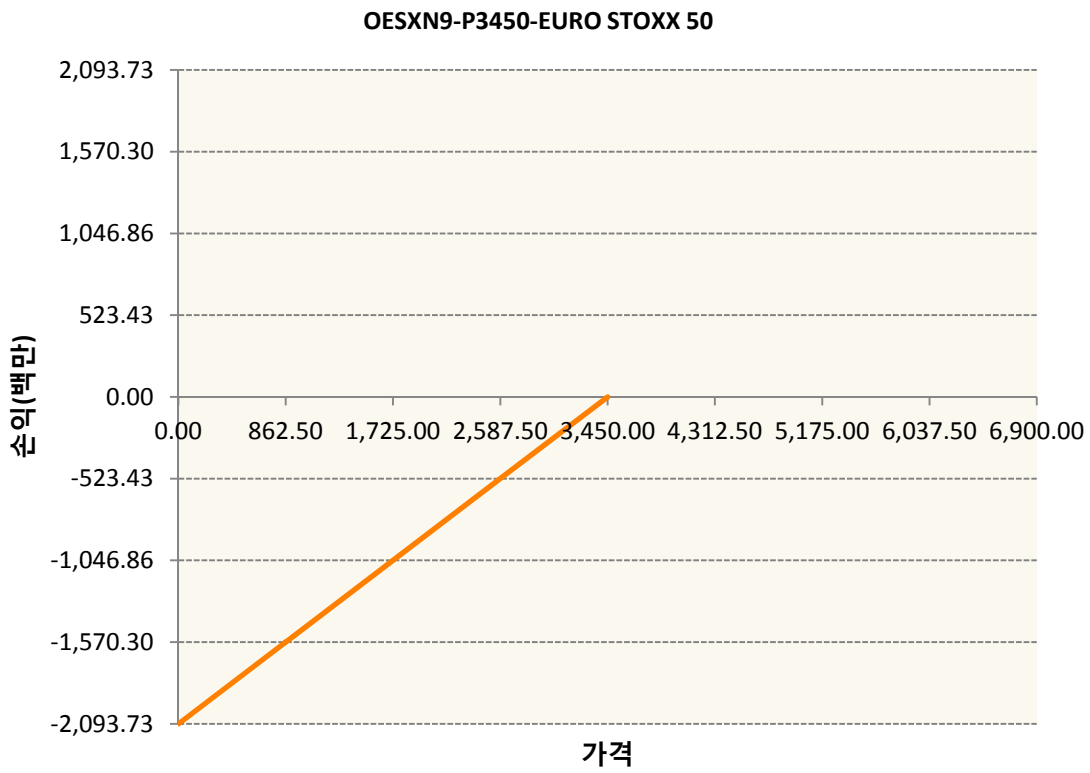
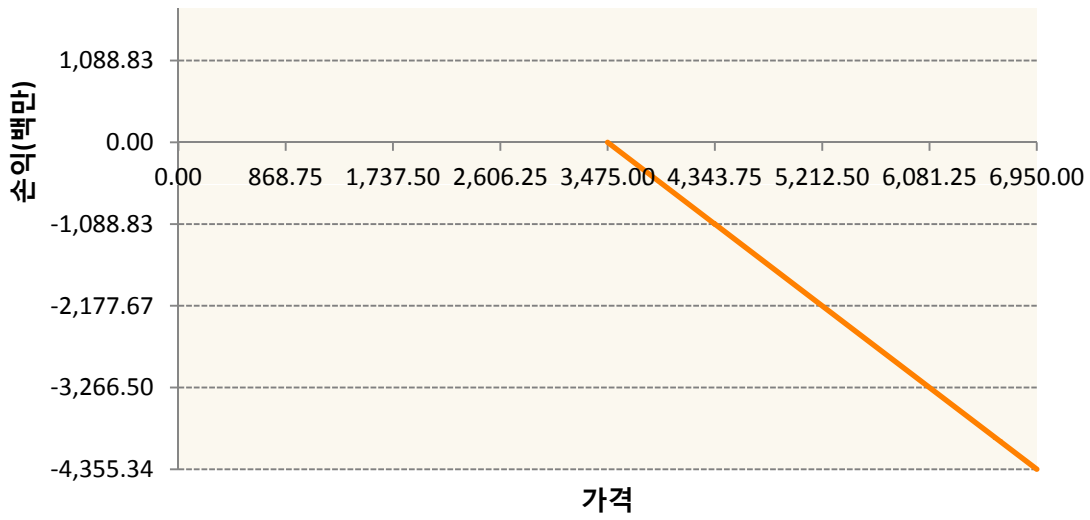
2. 만기시점의 손익구조

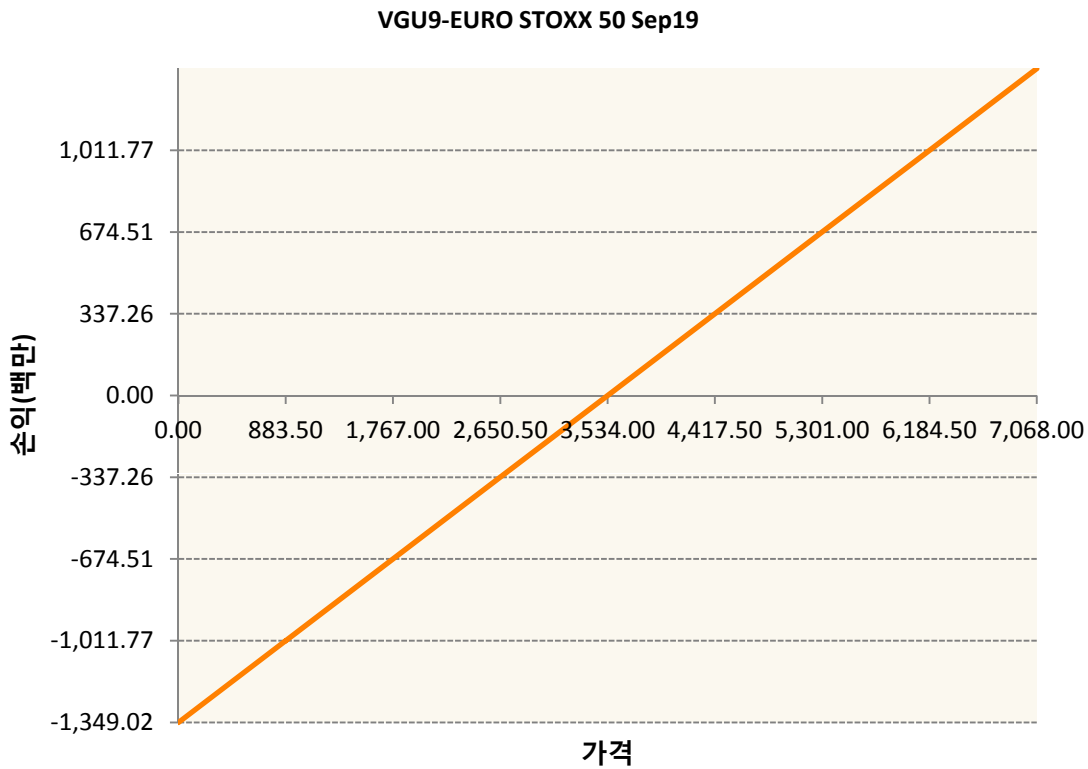
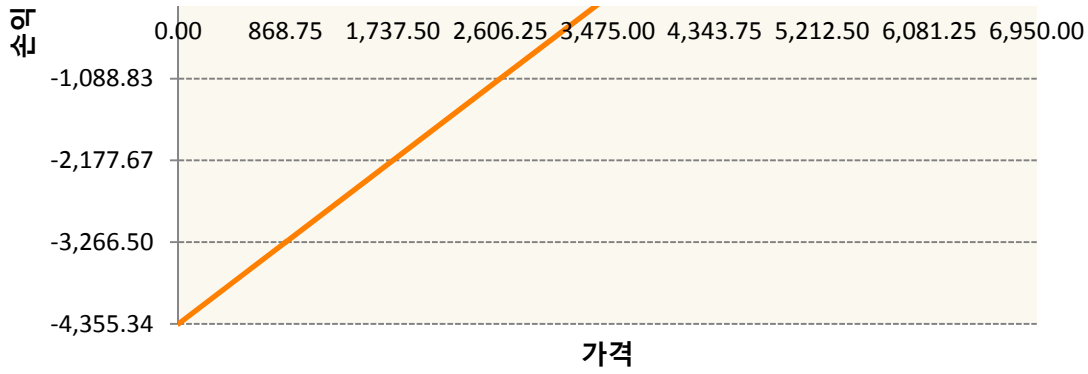
OESXN9-C3450-EURO STOXX 50



OESXN9-C3475-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	102
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	422
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E	1,055
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	317
OESXN9-C34 EURO STOXX 50	168
OESXN9-C34 EURO STOXX 50	348
OESXN9-P34 EURO STOXX 50	168
OESXN9-P34 EURO STOXX 50	348
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	108

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

(단위:백만원)

1,768

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

(단위:백만원)

1,031

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

(단위:백만원)

91

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

(단위:백만원)

132

공시일	2019-07-08
기준일	2019-07-05

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

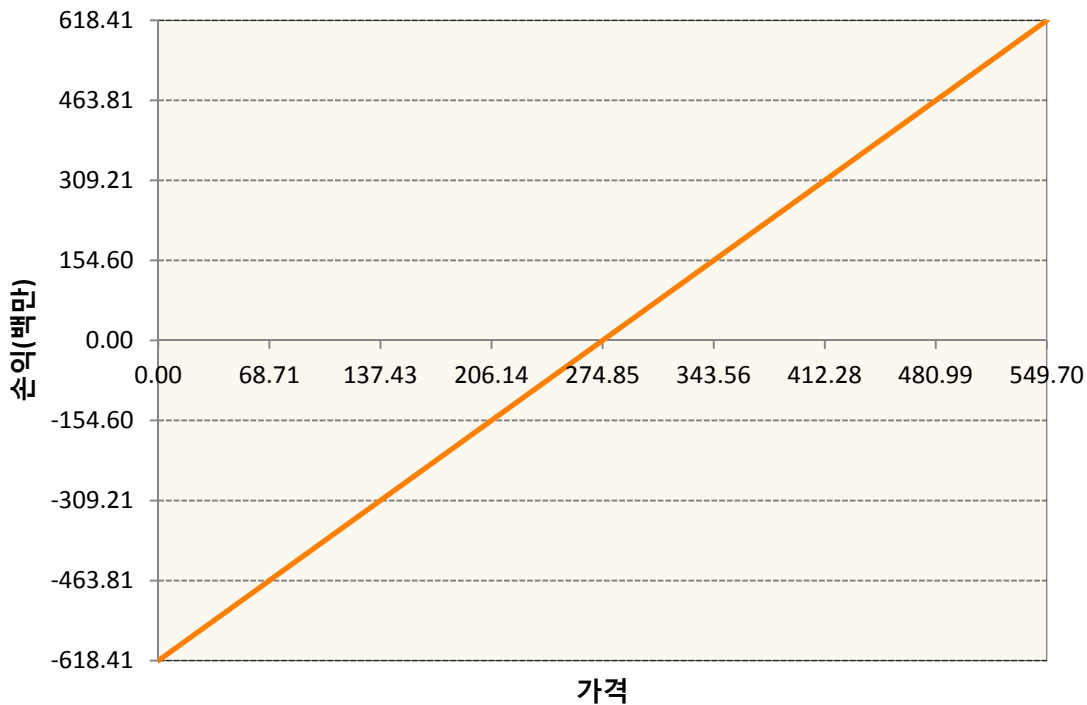
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	618	0	618	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	2019-07-08
기준일	2019-07-05

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

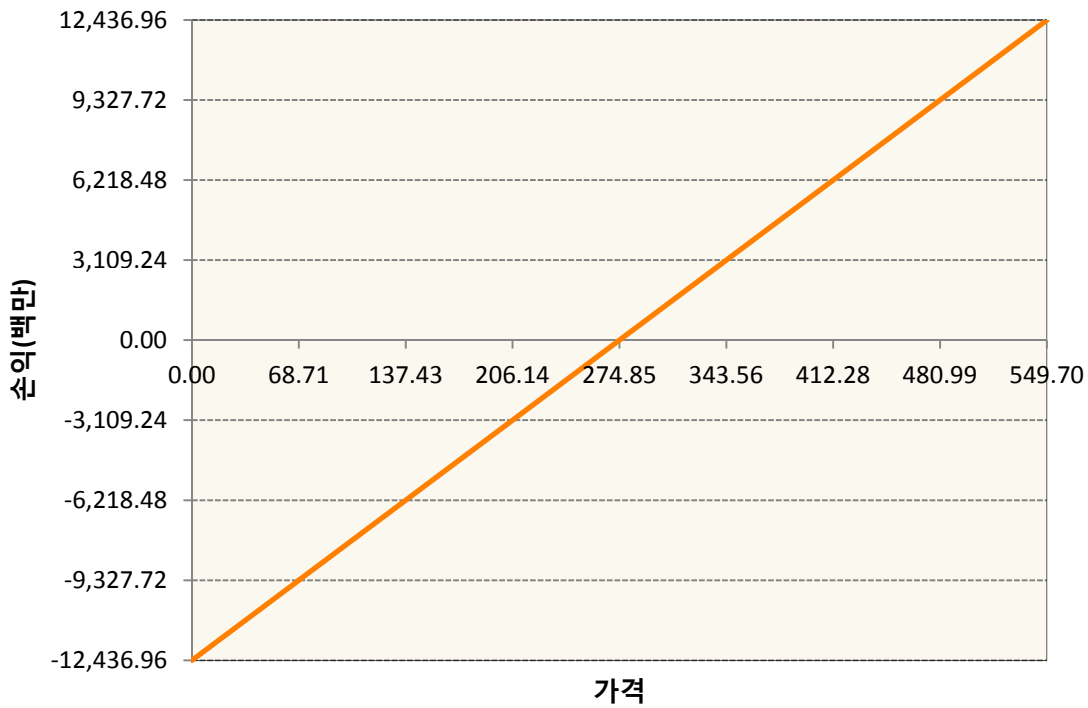
1. 계약금액

(단위:백만원)

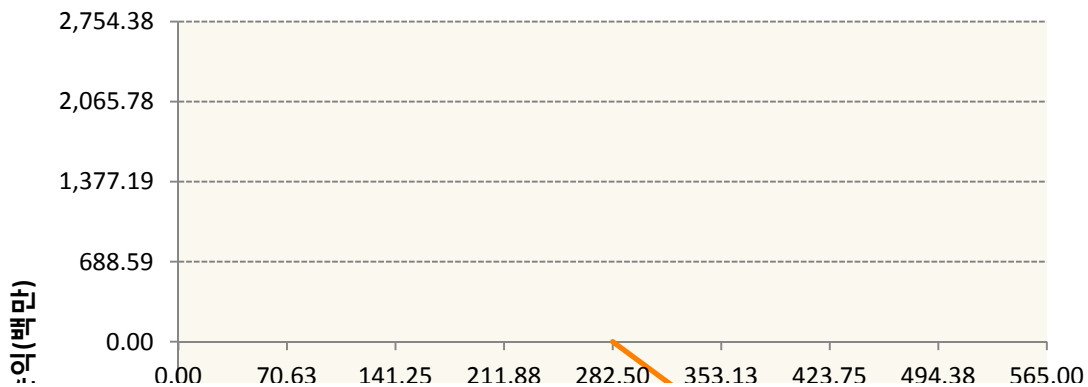
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,437	0	12,437	장내
누계	유가증권	옵션	1,084	22,134	-21,050	장내

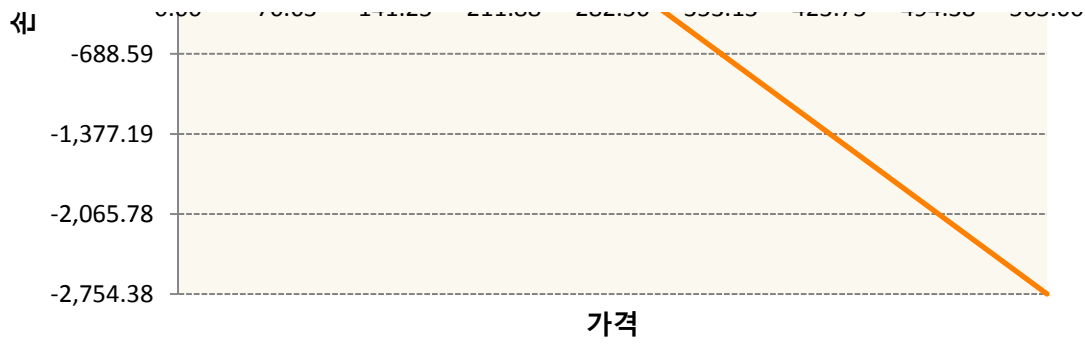
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

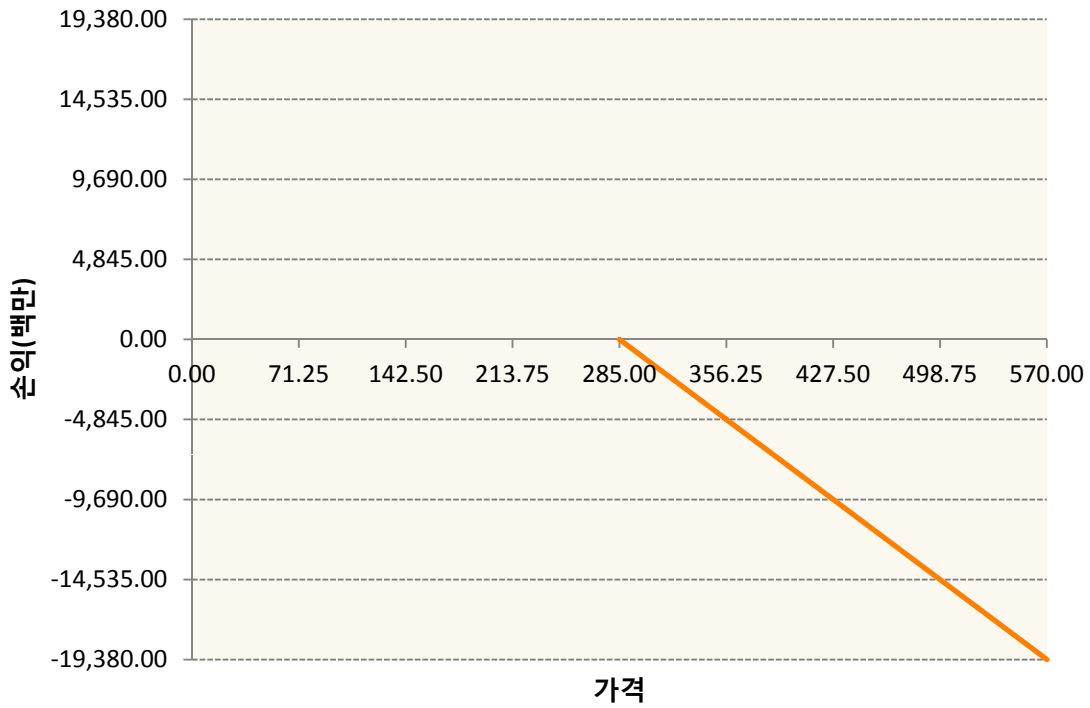


KR4201P72825-2019-07 콜282.5

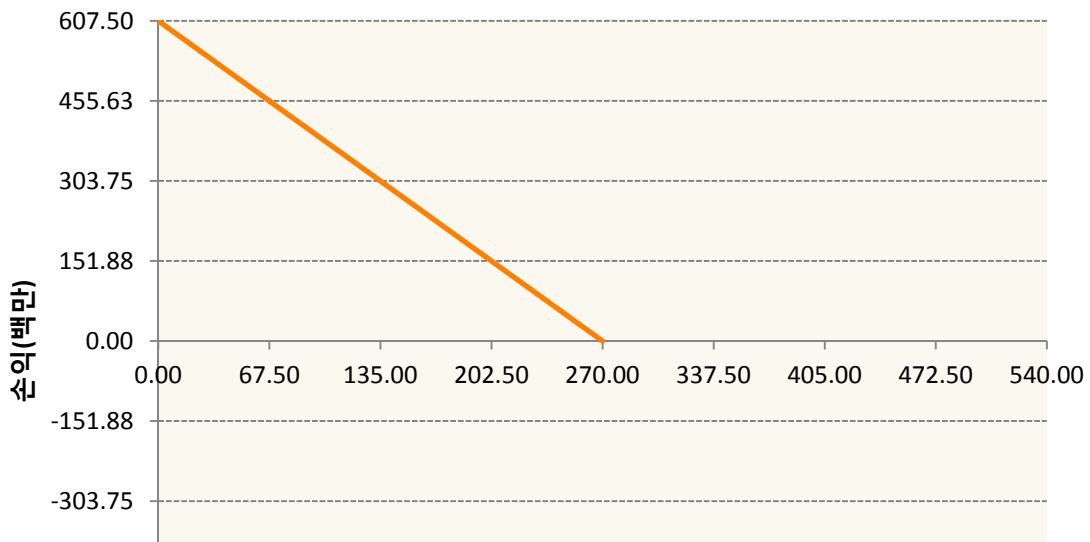


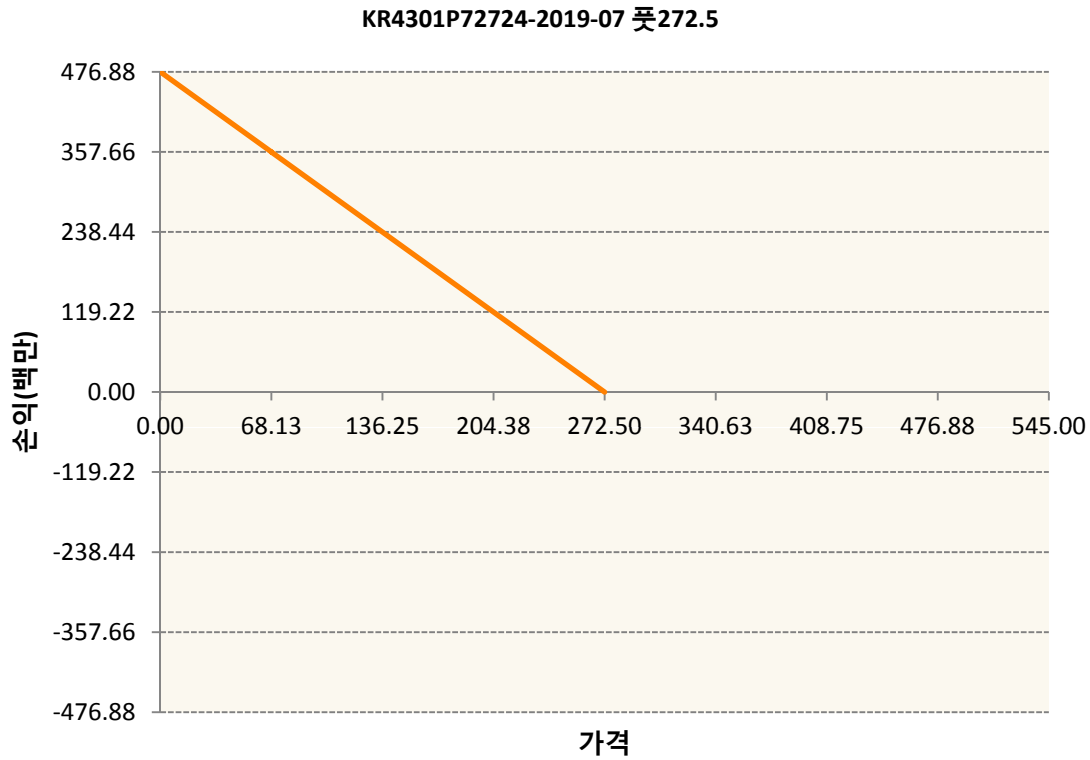
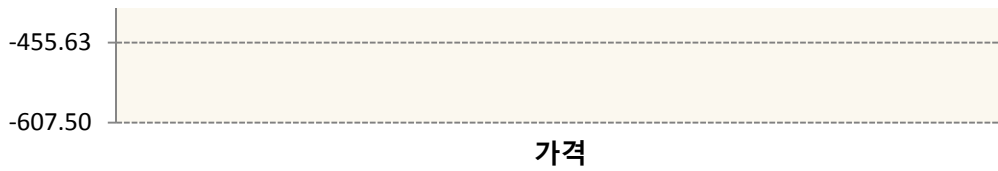


KR4201P72858-2019-07 콜285



KR4301P72708-2019-07 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						993
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-993	-993	-993	-993	-993	-993	-993	
-5.33%	-662	-662	-662	-662	-662	-662	-662	
-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%	662	662	662	662	662	662	662	
8.00%	993	993	993	993	993	993	993	
KR4201P72825		2019-07 콜282.5						132
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	8	
-2.67%	8	8	8	7	6	6	5	

0%	5	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	-14	-17	-20	-23	-26	-28	-31
5.33%	-61	-63	-65	-67	-69	-72	-74
8.00%	-126	-127	-128	-128	-130	-131	-132
KR4201P72858 2019-07 콜285							801
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	35	35	35	35	35	35	34
-5.33%	35	35	35	34	34	33	32
-2.67%	34	33	32	30	27	23	18
0%	24	17	9	0	-11	-22	-34
2.67%	-58	-76	-95	-114	-133	-152	-172
5.33%	-317	-334	-353	-372	-391	-410	-429
8.00%	-742	-749	-757	-766	-777	-789	-801
KR4301P72708 2019-07 풋270							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%	22	22	22	22	22	22	22
-2.67%	7	7	7	7	8	8	8
0%	-1	0	0	0	0	0	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%	21	21	21	21	21	21	21
-2.67%	8	8	8	8	8	8	9
0%	-1	0	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)

1,572

공시일	2019-07-08
기준일	2019-07-05

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	19,631	0	19,631	

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	2019-07-08
기준일	2019-07-05

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	62,128	0	62,128	

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	2019-07-08
기준일	2019-07-05

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	362,163	0	362,163	
누계	통화	선도	0	353,016	-353,016	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		468
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		468
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		375
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		787
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		281
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		936
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		187
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		871
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		1,039
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		1,873
FX21019M0(KRW/USD 15-07-19E		468
FX21019M01KRW/USD 15-07-19E		375
FX21019M01KRW/USD 15-07-19E		655
FX21019M01KRW/USD 15-07-19E		936
FX21019M01KRW/USD 15-07-19E		655
FX21019M01KRW/USD 15-07-19E		655
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		562
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		2,996
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		2,247
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		627
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E		468
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		1,873
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		1,873

FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E

693
693
1,292
2,539

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

(단위:백만원)

9,297

공시일	2019-07-08
기준일	2019-07-05

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

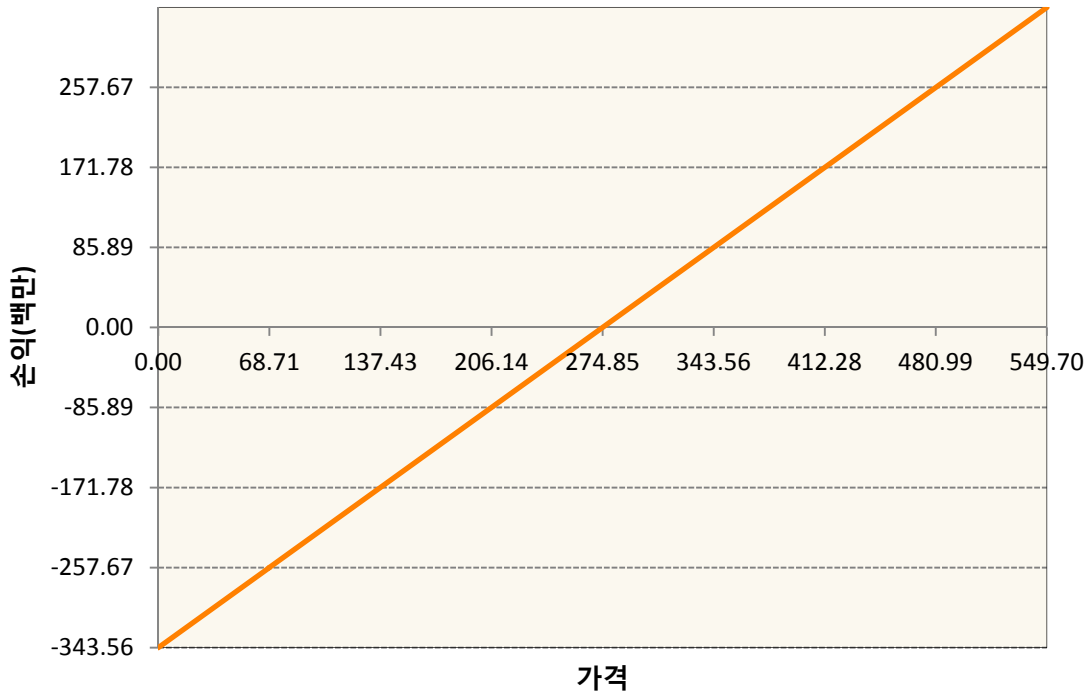
1. 계약금액

(단위:백만원)

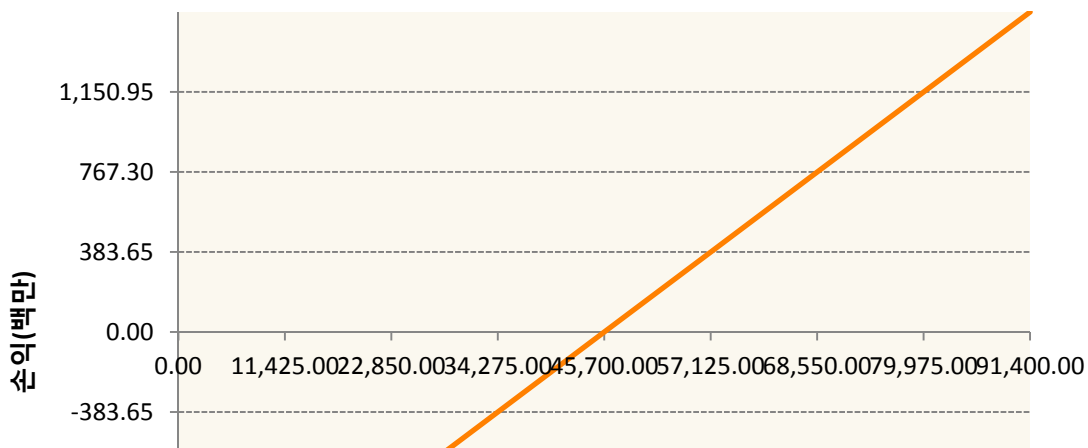
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,878	0	1,878	장내

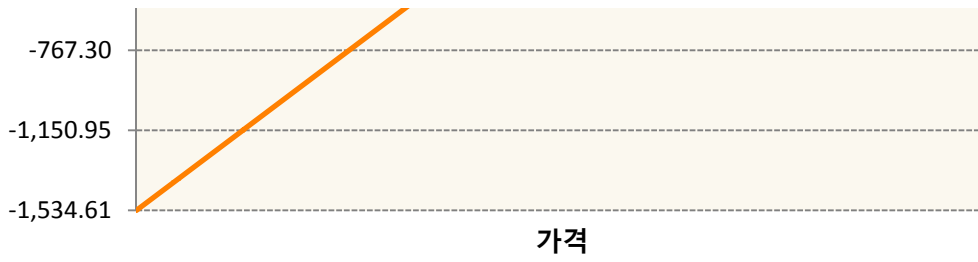
2. 만기시점의 손익구조

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						123
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123	
-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%	123	123	123	123	123	123	123	

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

166

공시일	2019-07-08
기준일	2019-07-05

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

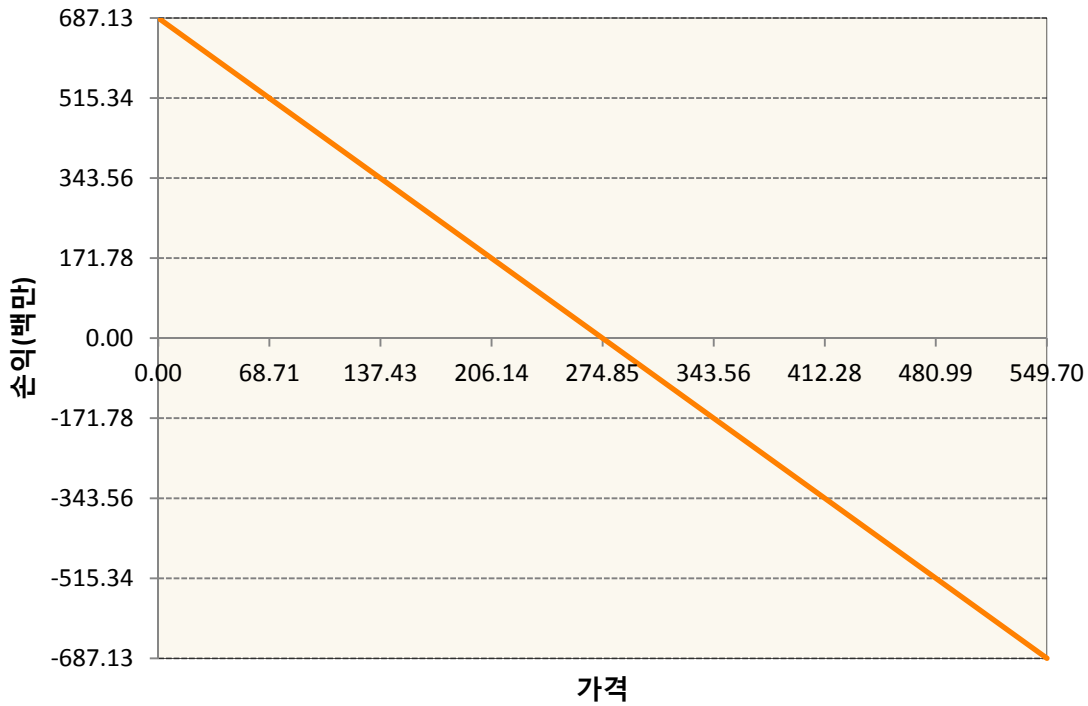
1. 계약금액

(단위:백만원)

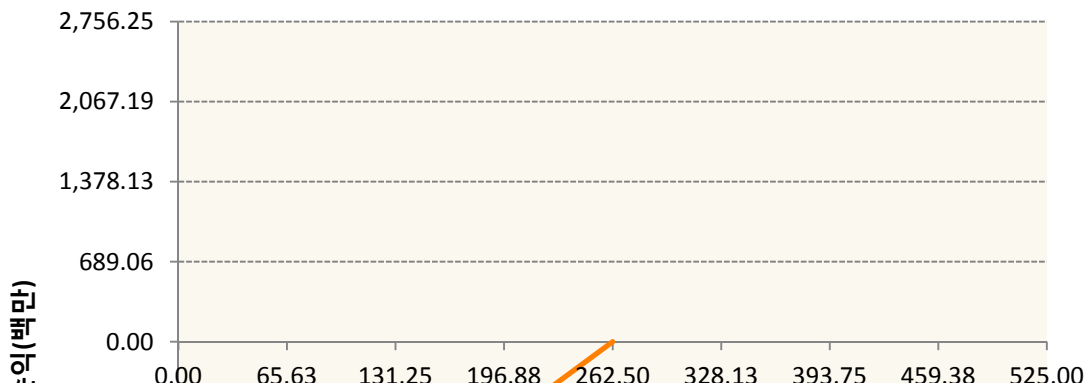
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	687	-687	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,485	-3,485	장내

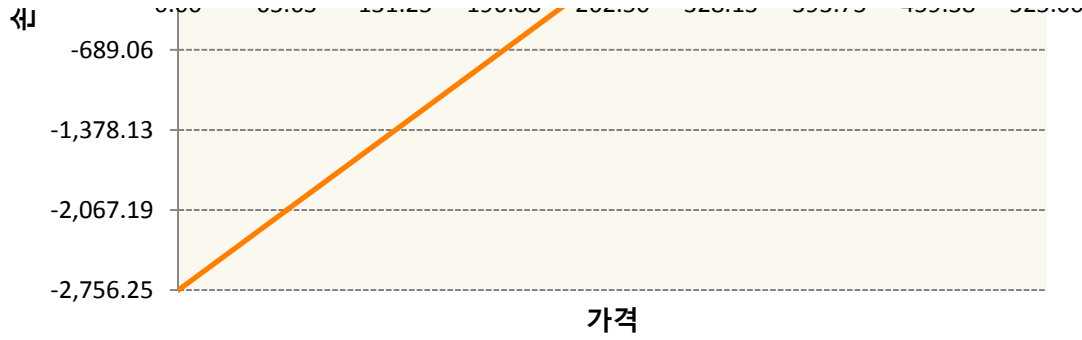
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

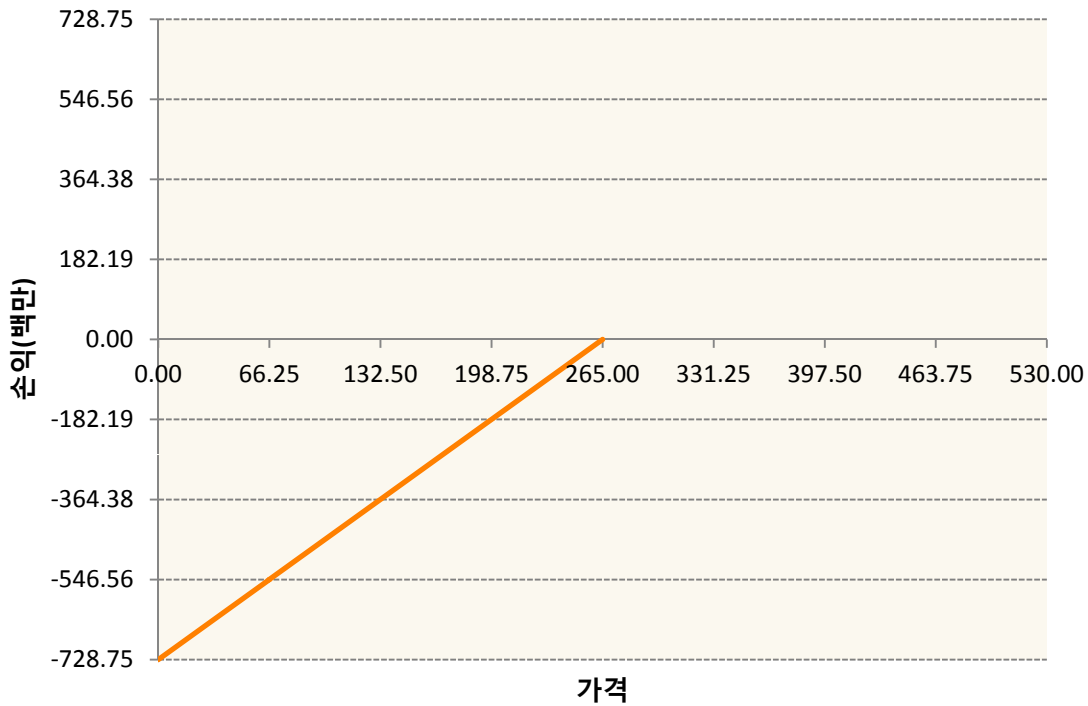


KR4301P72625-2019-07 풋262.5





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						107
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-106	-106	-106	-106	-106	-107	-107
-5.33%	-33	-34	-36	-37	-38	-39	-41
-2.67%	-1	-2	-3	-4	-5	-6	-7
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

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

90

공시일	2019-07-08
기준일	2019-07-05

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	3,979	-3,979	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	2019-07-08
기준일	2019-07-05

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

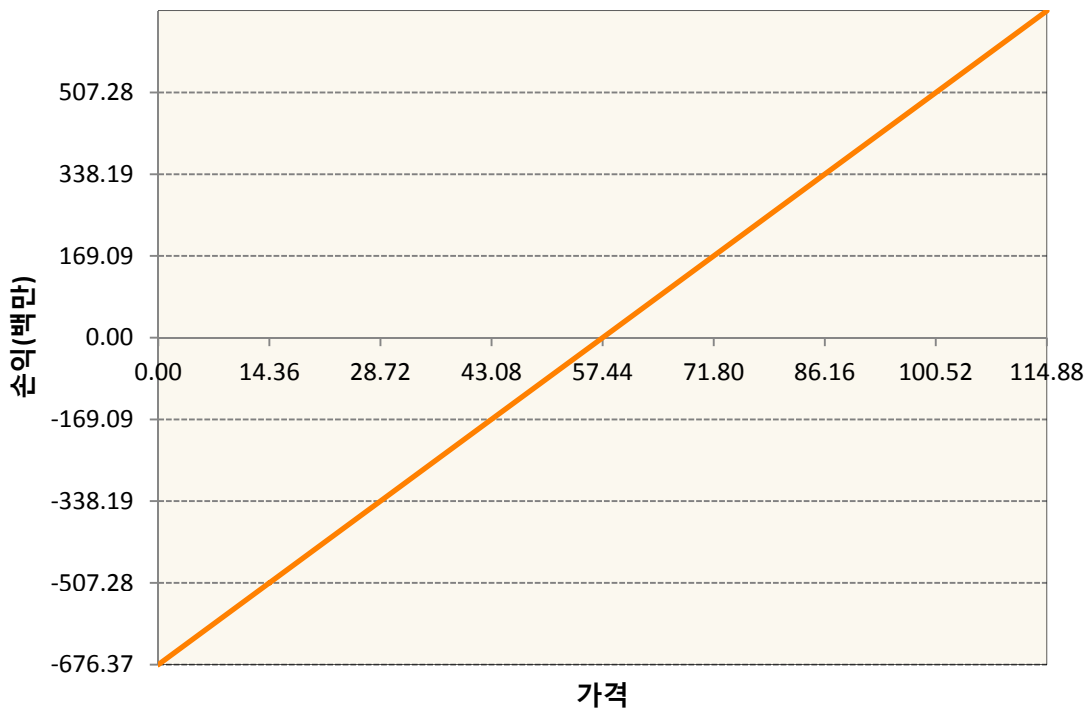
1. 계약금액

(단위:백만원)

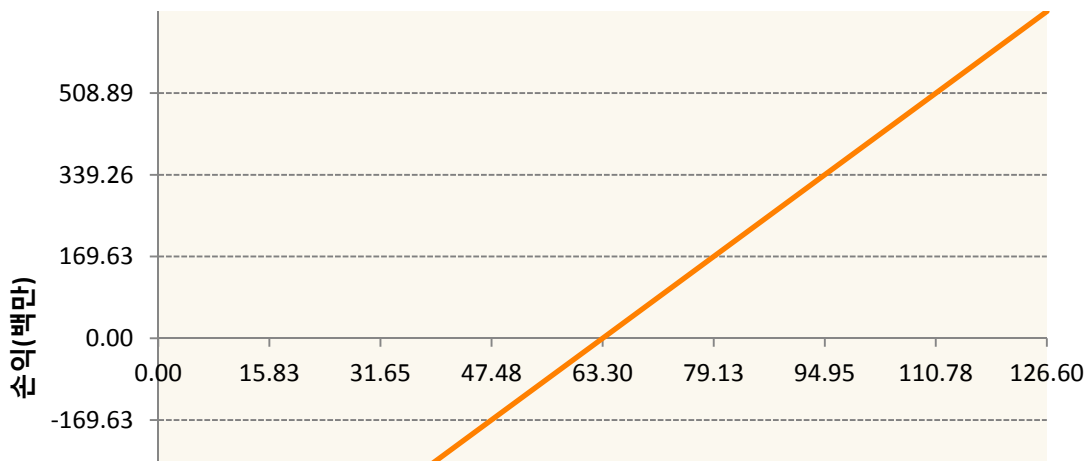
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,683	117	2,566	

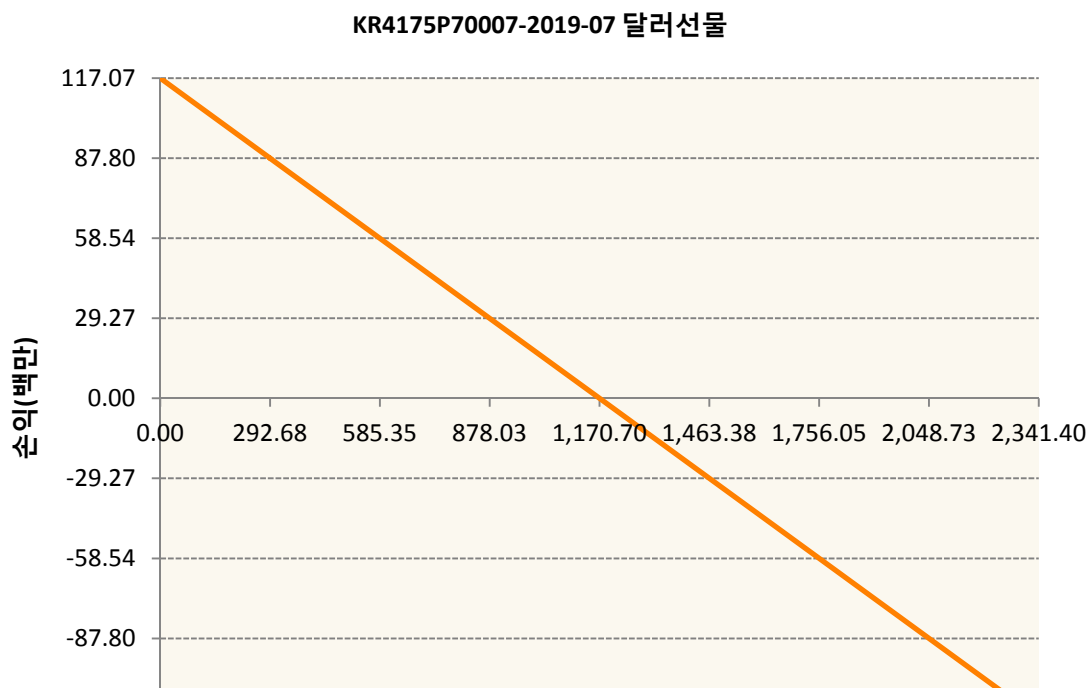
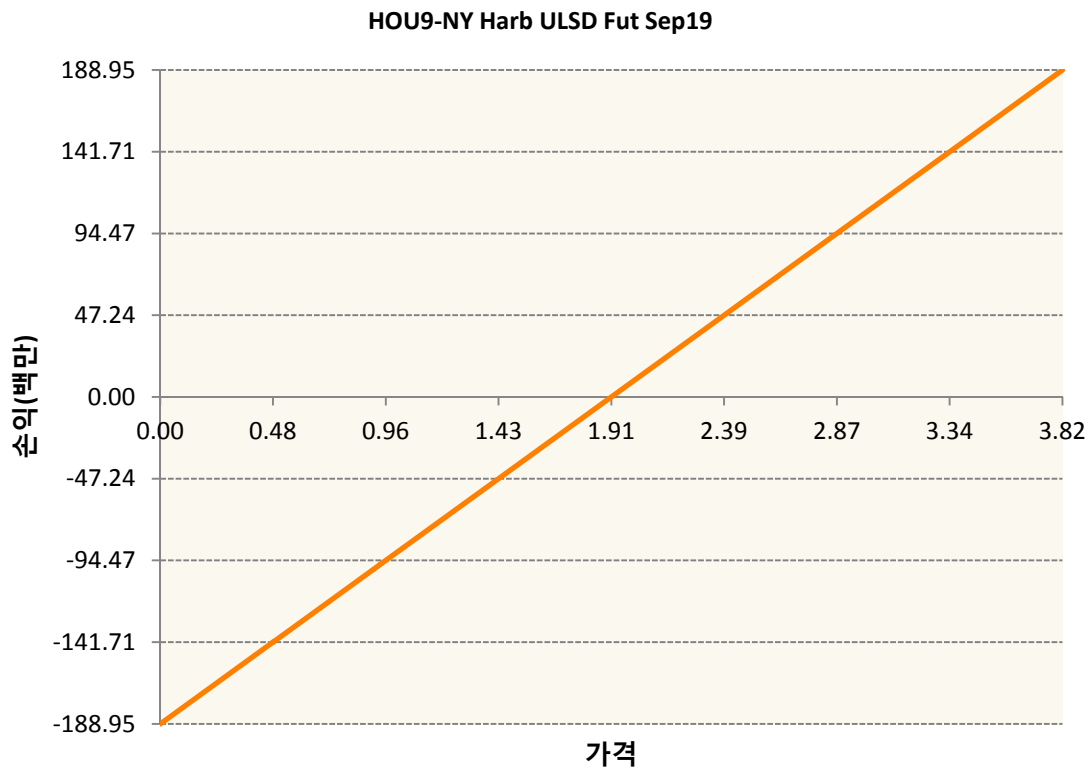
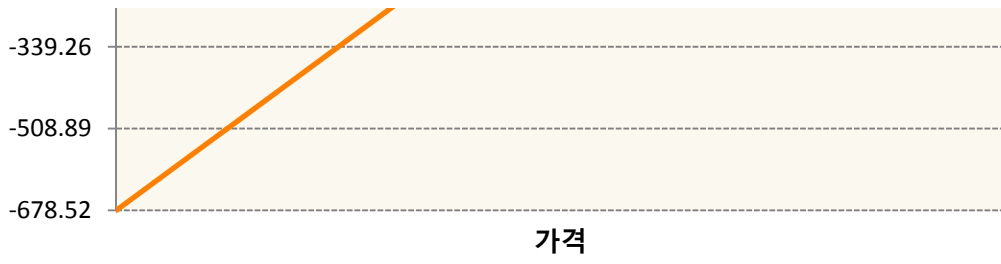
2. 만기시점의 손익구조

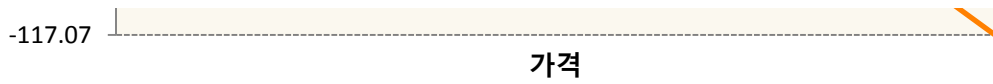
CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19



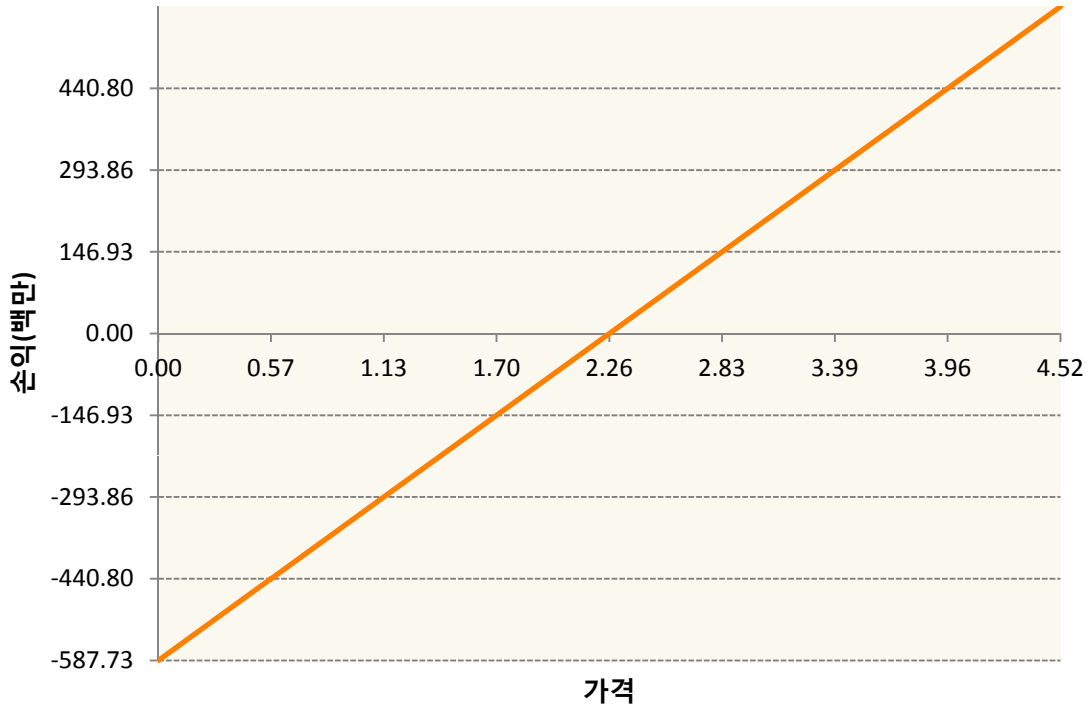
COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19



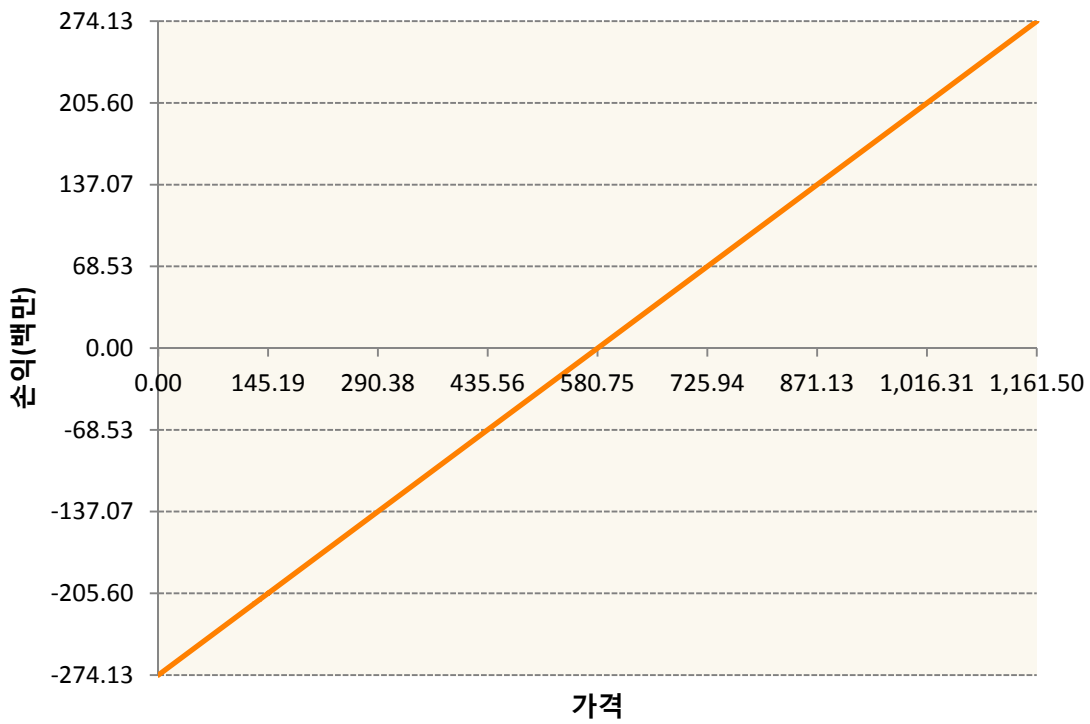




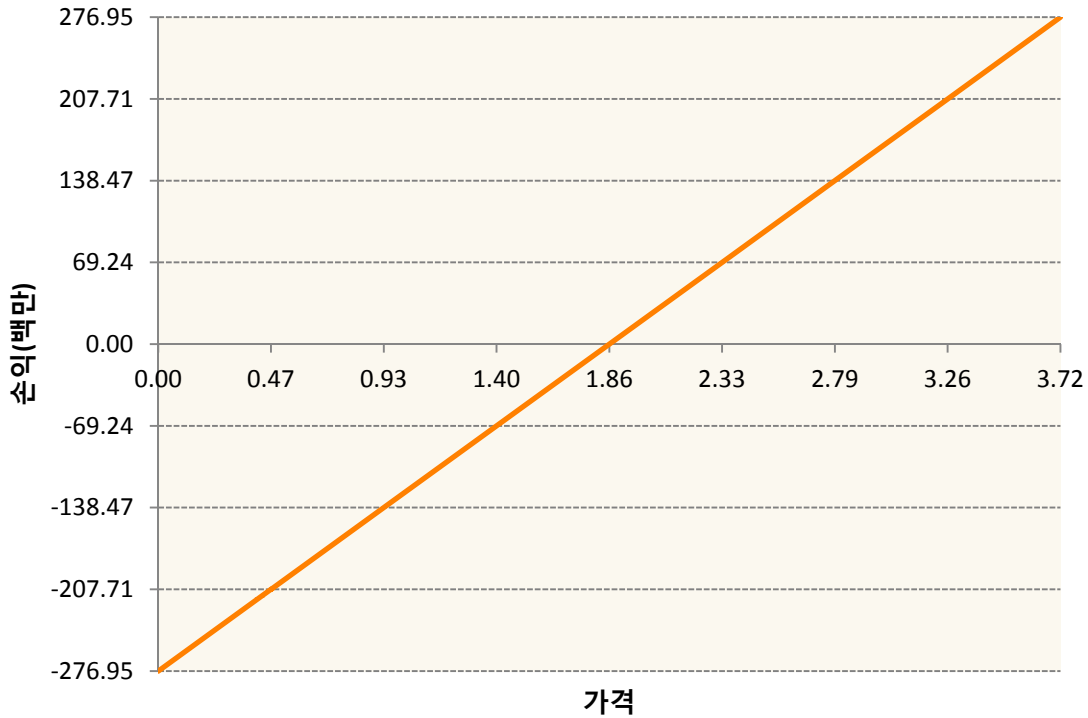
NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



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	54
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)

397

공시일	2019-07-08
기준일	2019-07-05

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

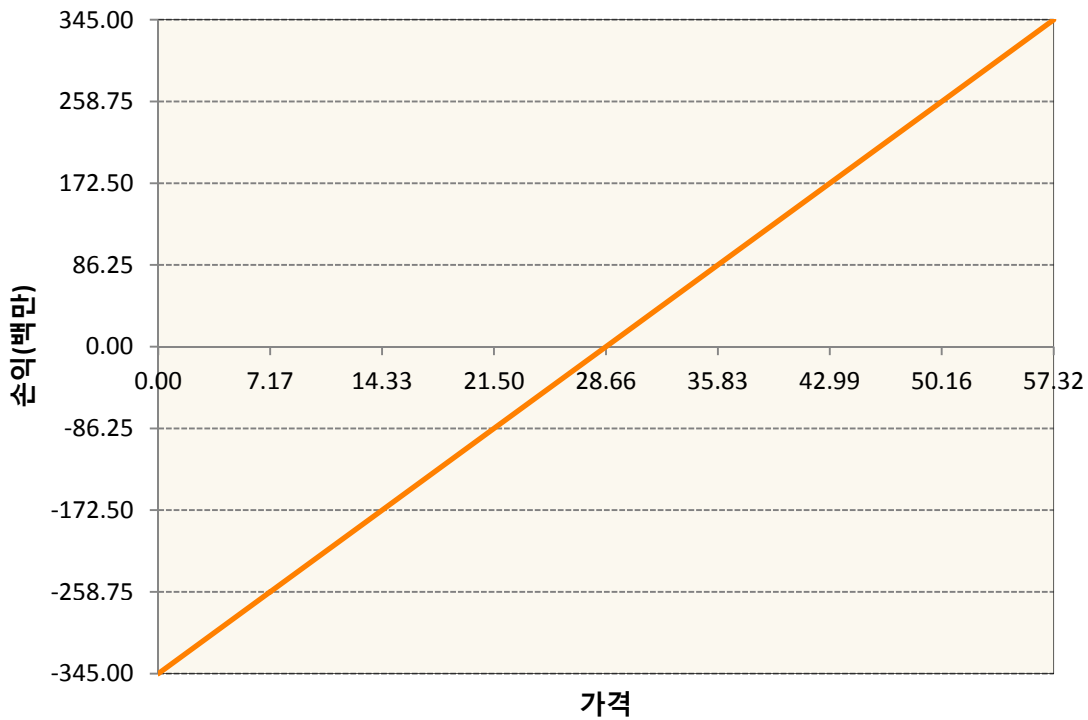
1. 계약금액

(단위:백만원)

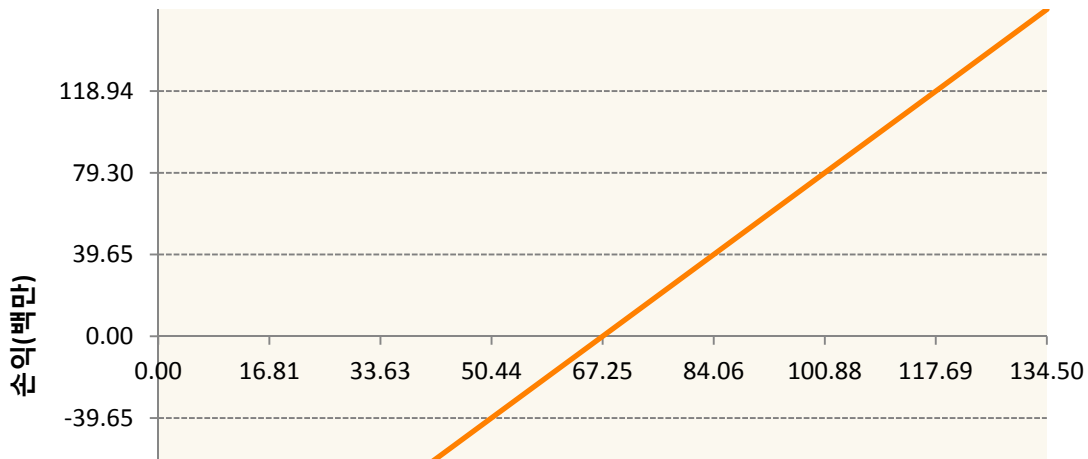
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,274	199	3,075	

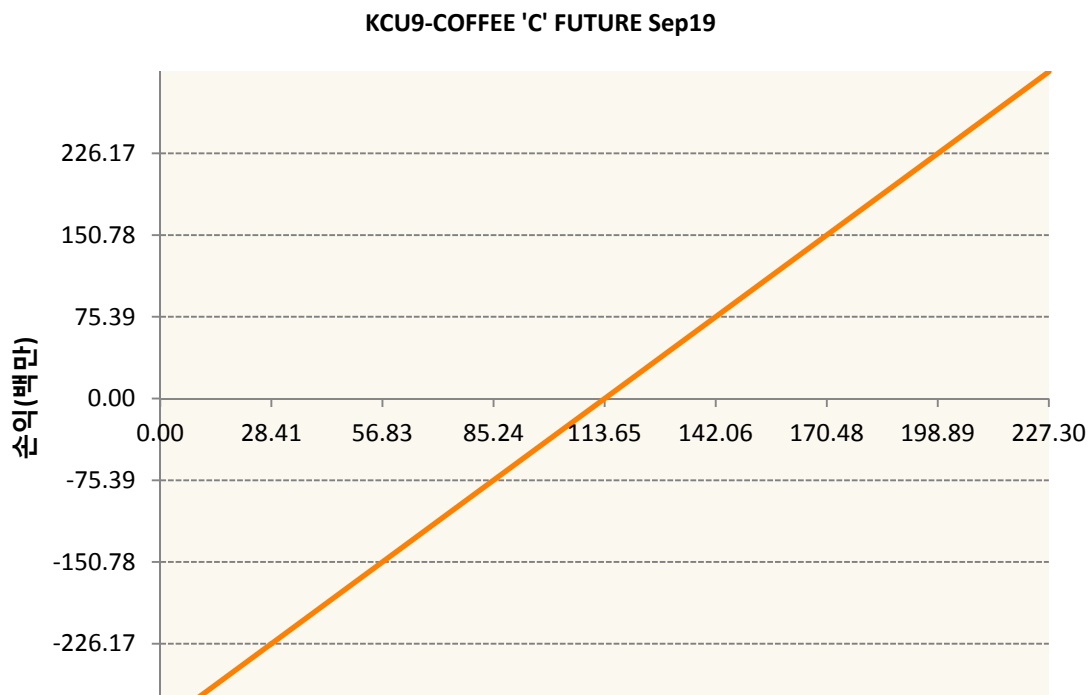
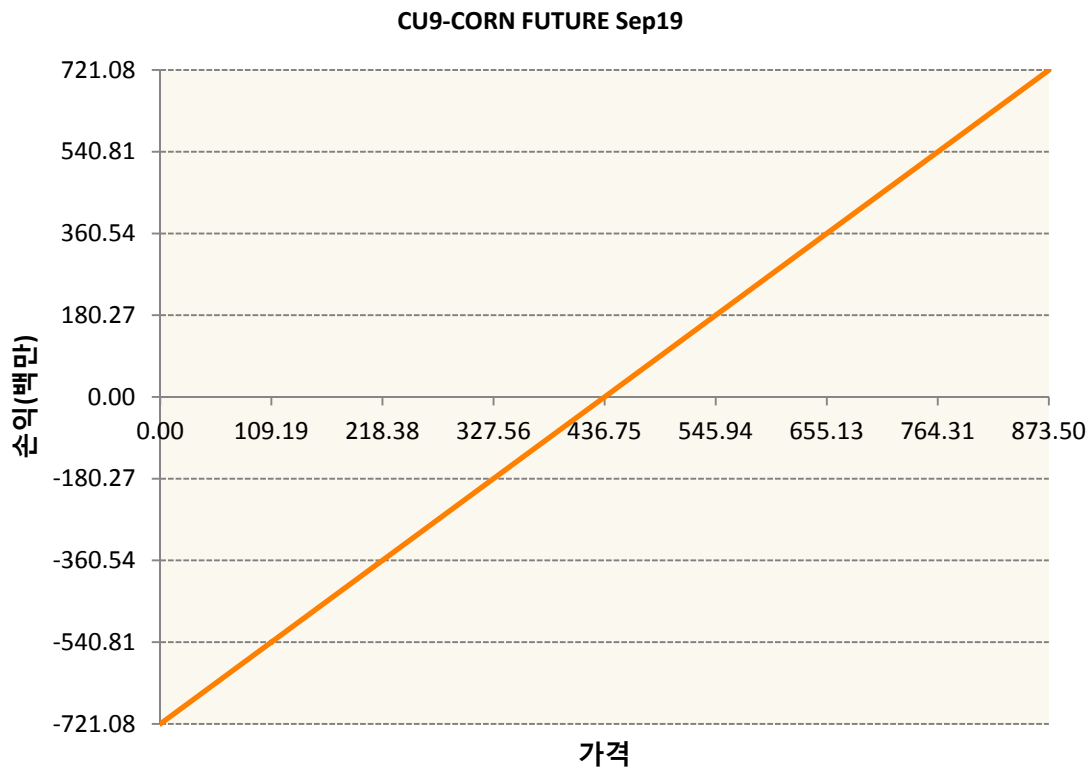
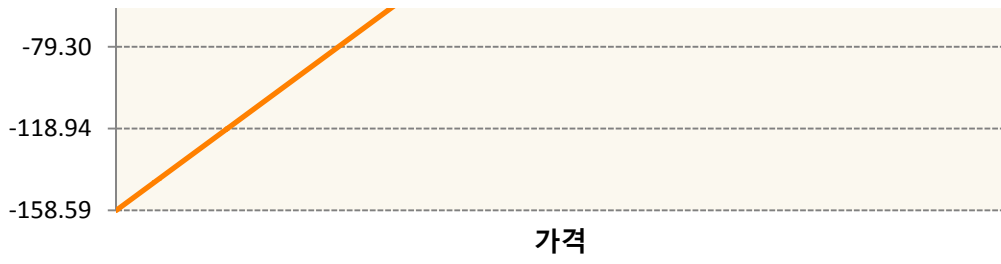
2. 만기시점의 손익구조

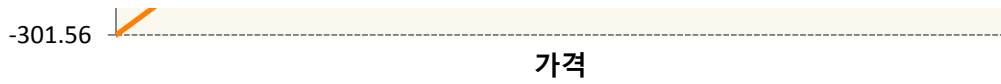
BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19



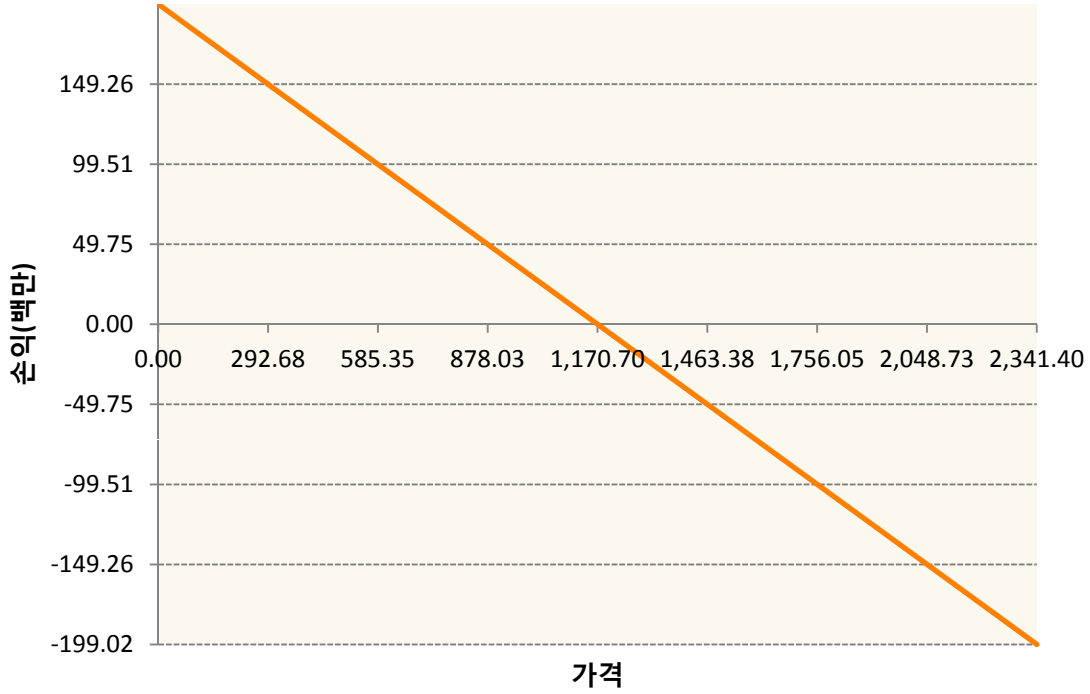
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



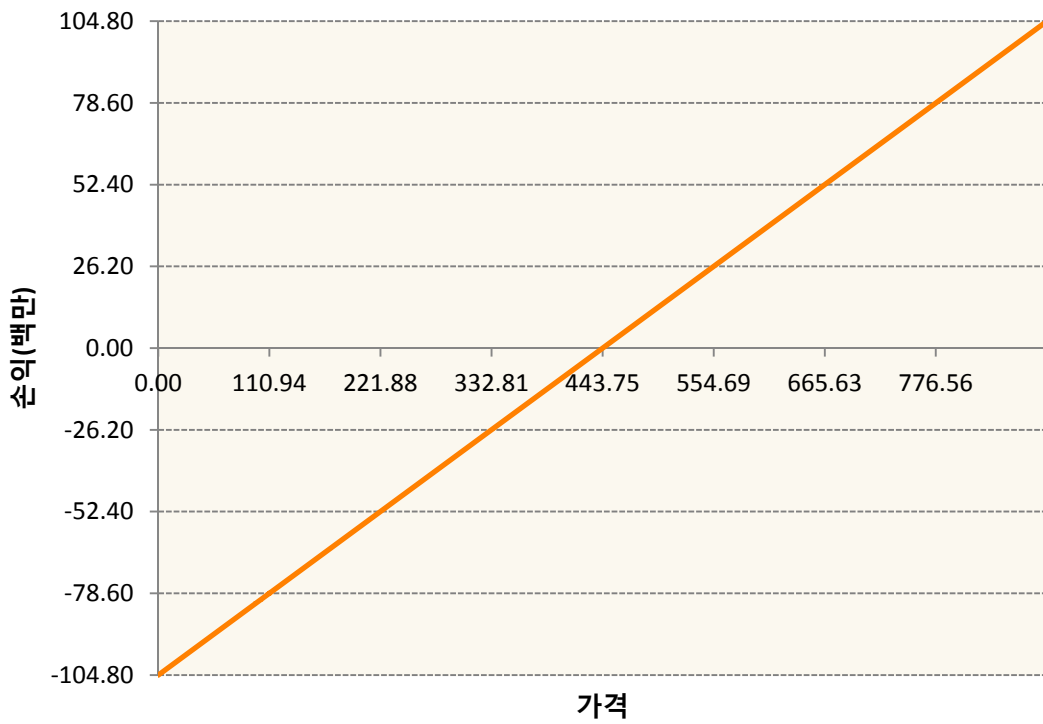




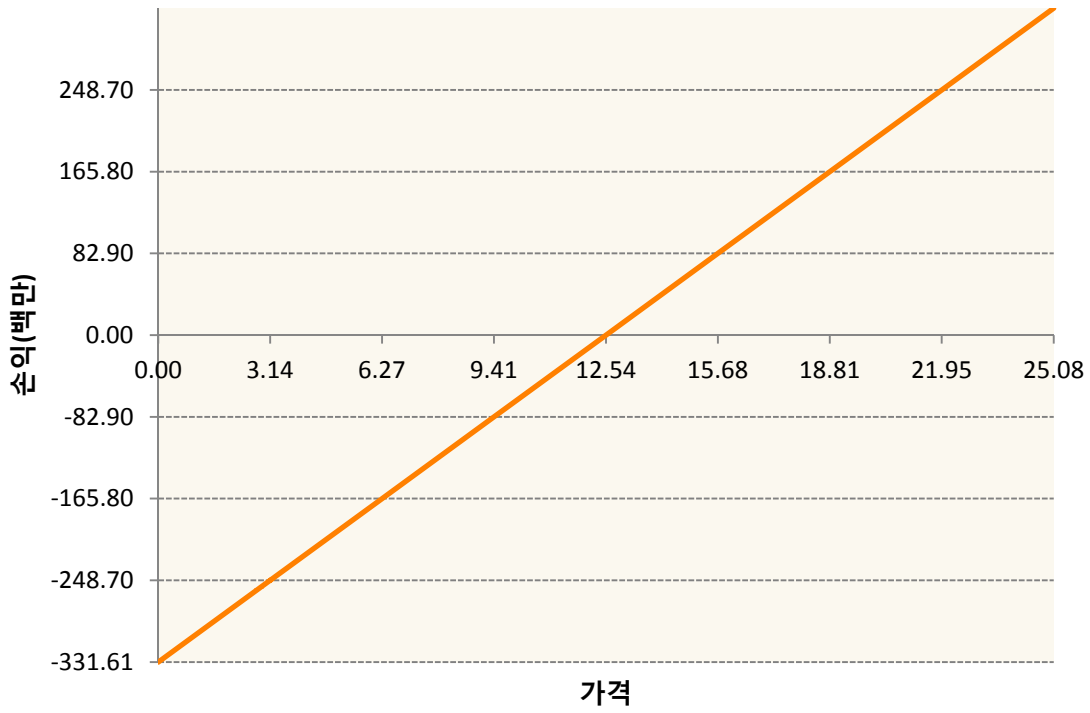
KR4175P70007-2019-07 달러선물



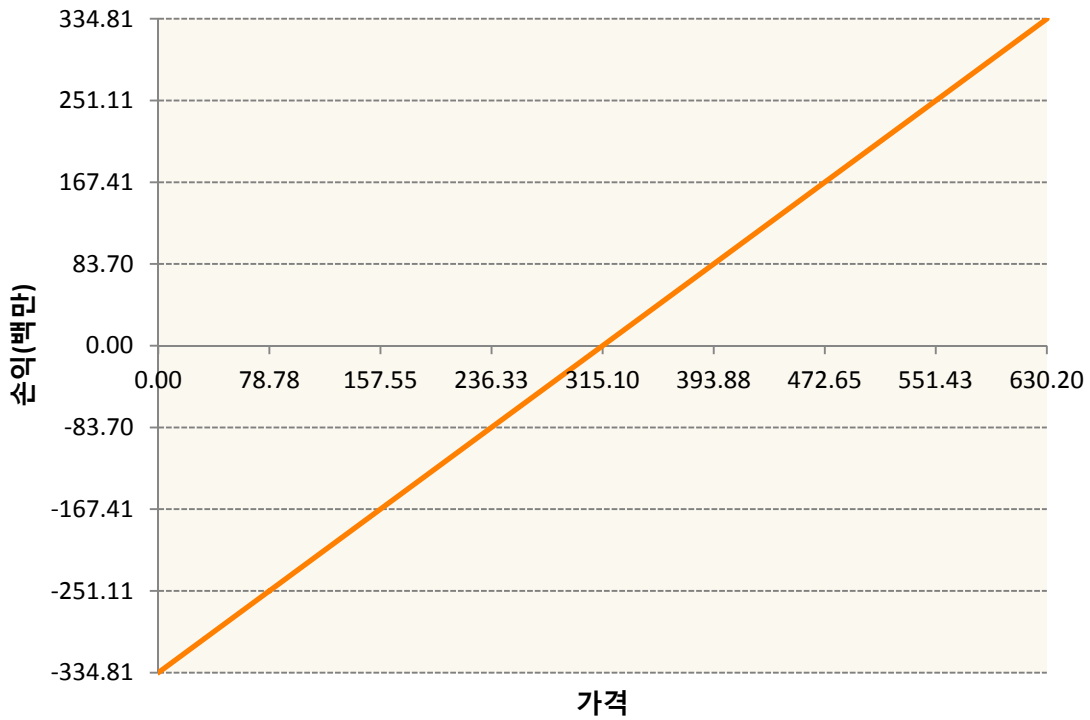
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

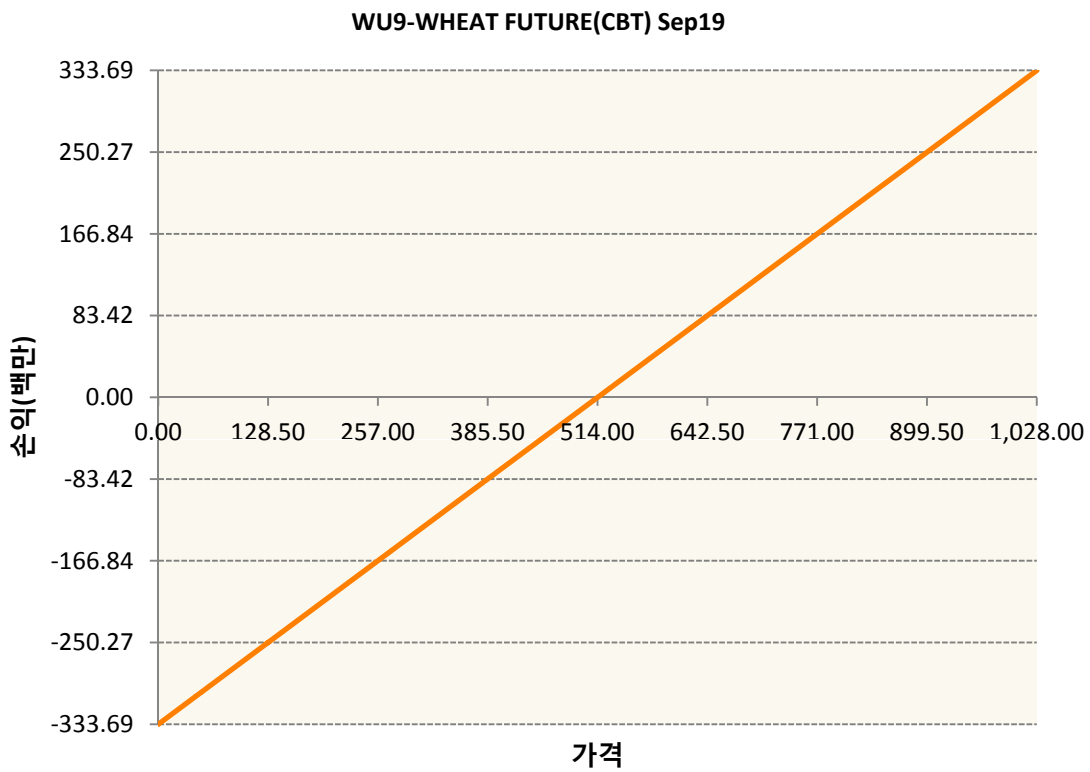
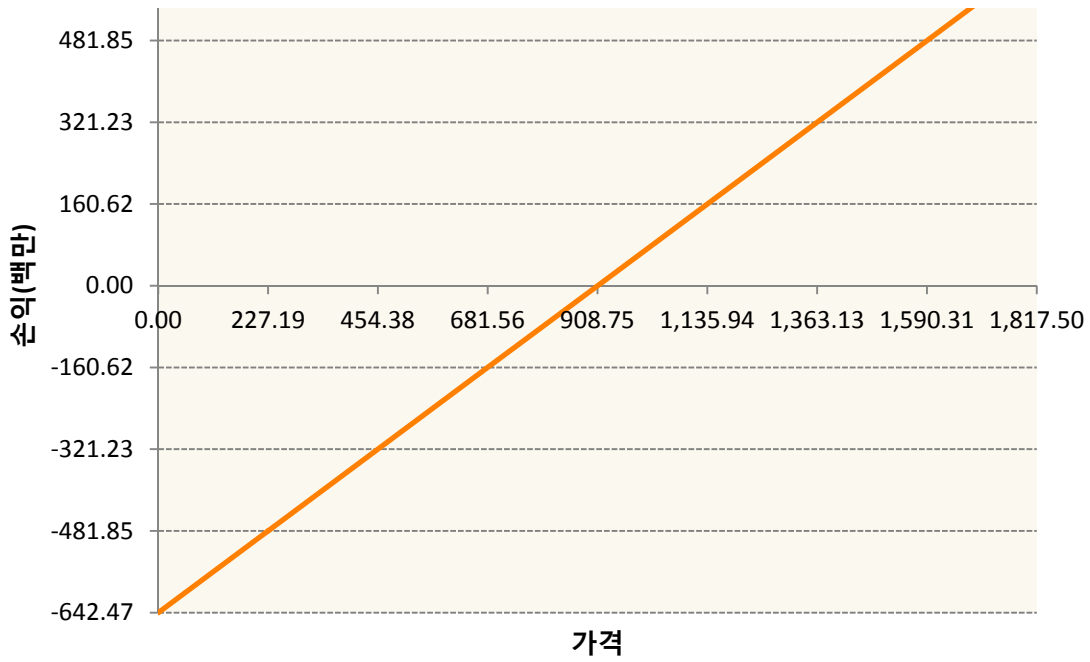


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	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