

공시일	2019-07-09
기준일	2019-07-08

## 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)

89

공시일	2019-07-09
기준일	2019-07-08

## 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

1,180

\* 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	2019-07-09
기준일	2019-07-08

## 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)	381
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	139

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

<b>844</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-09
기준일	2019-07-08

## 유로인덱스모(주식-파생형)

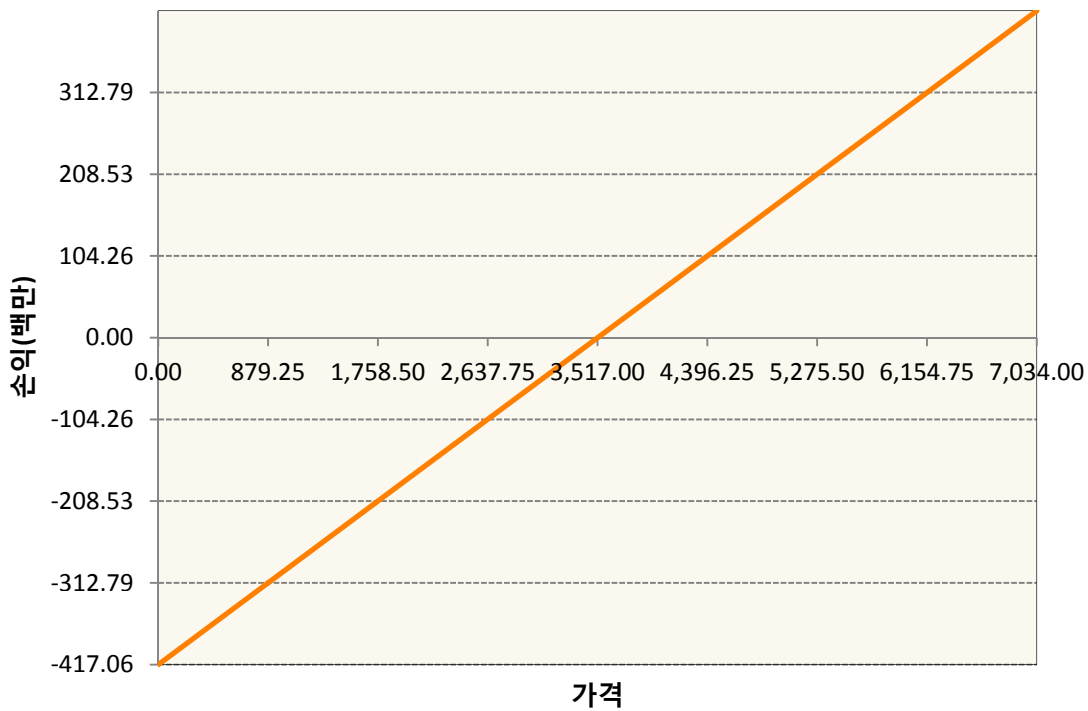
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	417	0	417	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGU9-EURO STOXX 50 Sep19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU9	EURO STOXX 50 Sep19	33
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

24
----

공시일	2019-07-09
기준일	2019-07-08

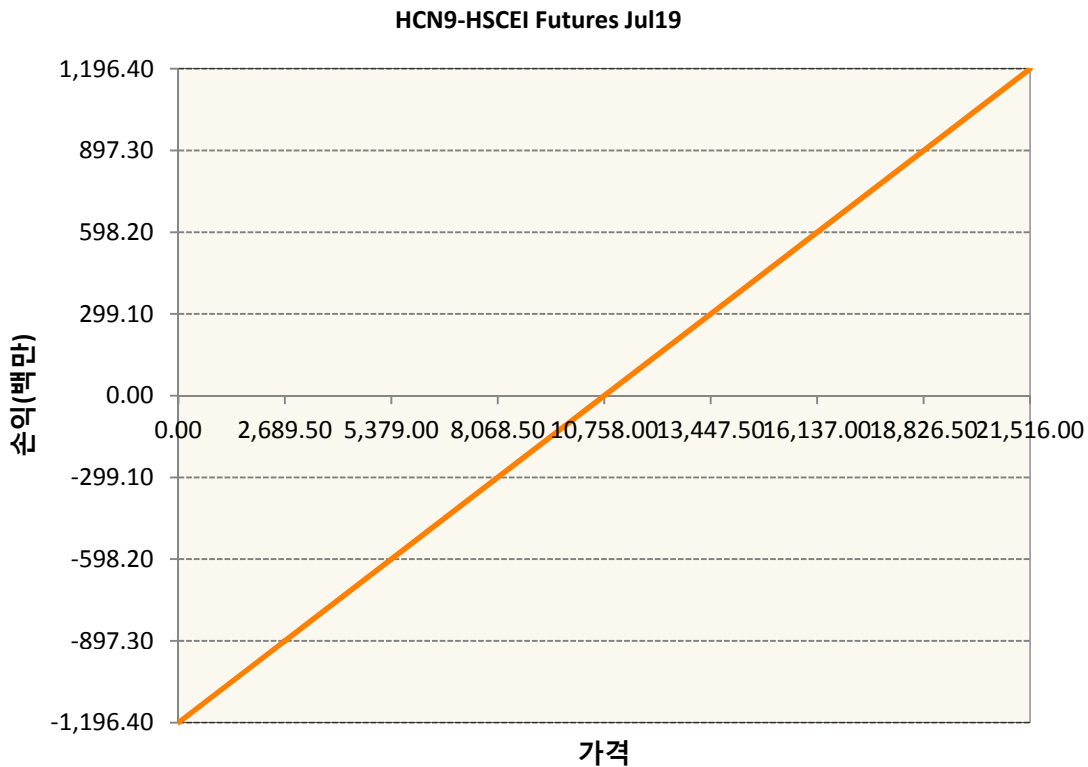
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,196	0	1,196	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN9	HSCEI Futures Jul19	96
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

97
----

공시일	2019-07-09
기준일	2019-07-08

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

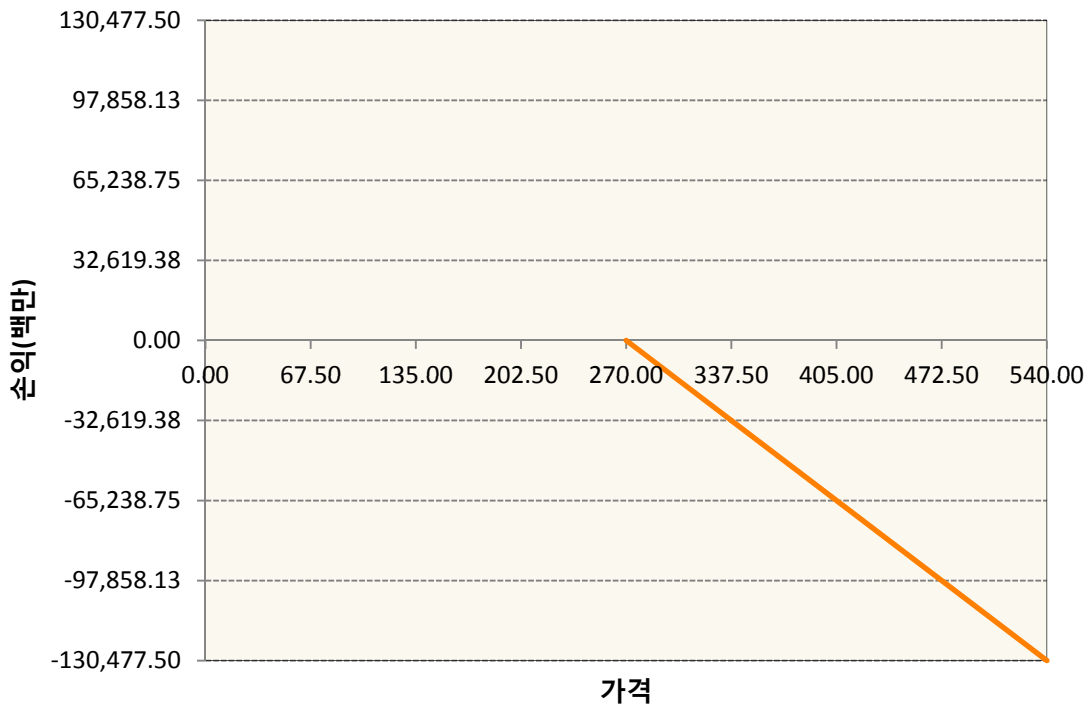
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

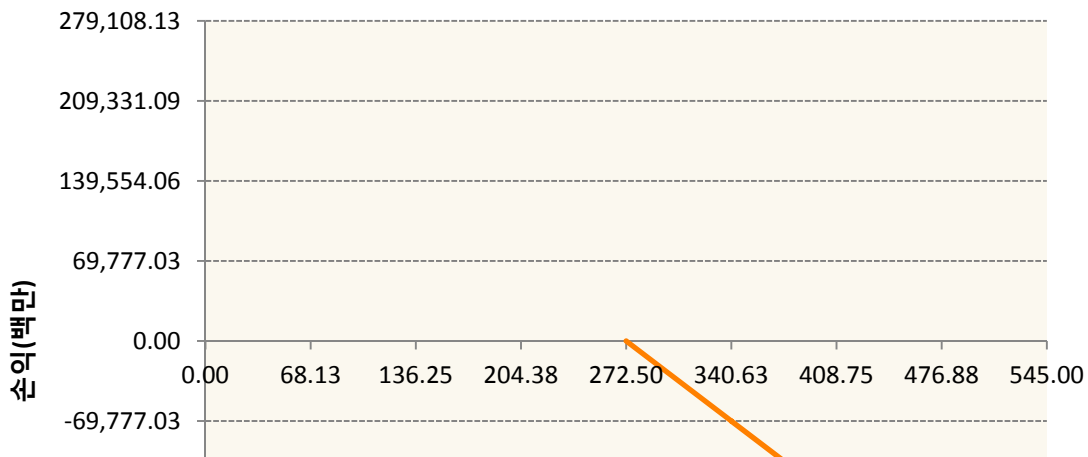
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	591,498	-591,498	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P72700-2019-07 콜270



KR4201P72726-2019-07 콜272.5





-5.33%	997	997	996	995	992	987	978
-2.67%	985	971	947	913	868	813	746
0%	480	329	168	0	-174	-353	-535
2.67%	-2,986	-3,159	-3,339	-3,524	-3,713	-3,905	-4,100
5.33%	-9,636	-9,661	-9,699	-9,750	-9,813	-9,888	-9,975
8.00%	-16,944	-16,945	-16,947	-16,950	-16,958	-16,969	-16,986
KR4301P72708                      2019-07 풋270							13,956
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-13,956	-13,956	-13,956	-13,956	-13,956	-13,956	-13,956
-5.33%	-9,132	-9,132	-9,132	-9,132	-9,132	-9,132	-9,132
-2.67%	-4,308	-4,308	-4,309	-4,312	-4,316	-4,322	-4,330
0%	206	139	70	0	-71	-143	-216
2.67%	1,494	1,484	1,471	1,452	1,429	1,402	1,370
5.33%	1,503	1,503	1,503	1,503	1,503	1,503	1,502
8.00%	1,503	1,503	1,503	1,503	1,503	1,503	1,503

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

(단위:백만원)

**49,809**

공시일	2019-07-09
기준일	2019-07-08

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

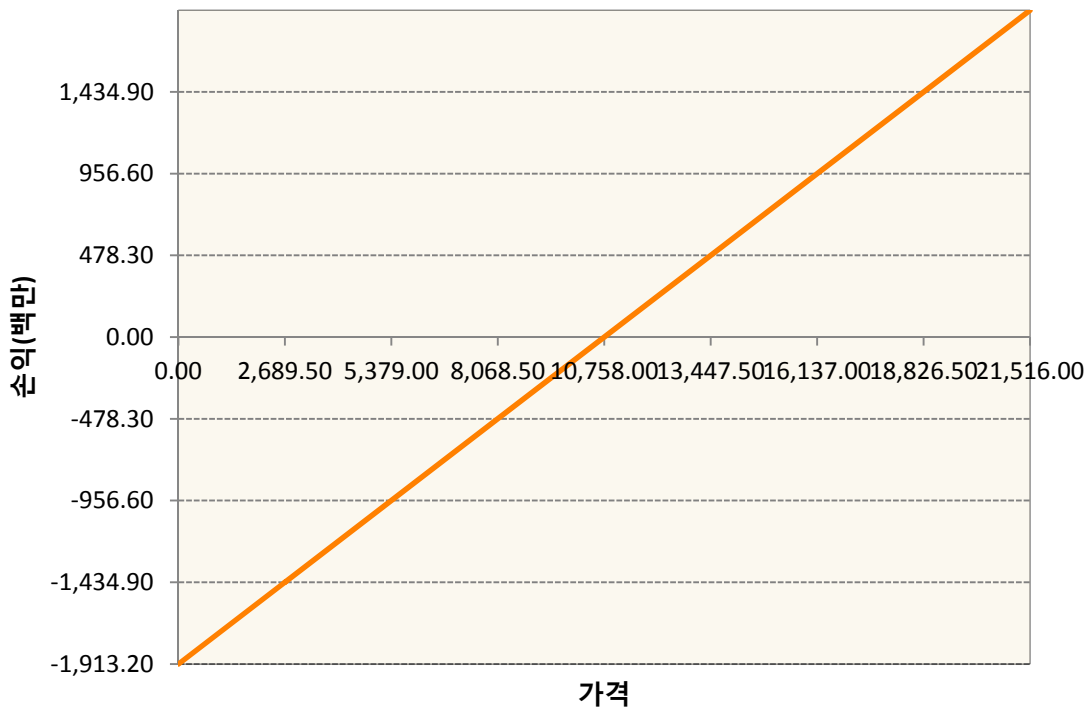
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

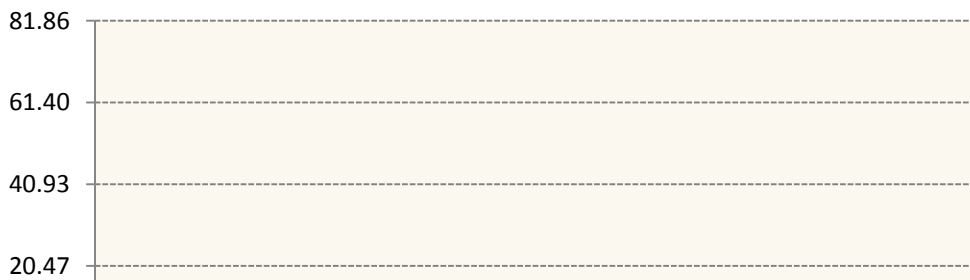
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,913	0	1,913	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,286	-5,286	장내
누계	통화	선도	152	3,183	-3,032	장외

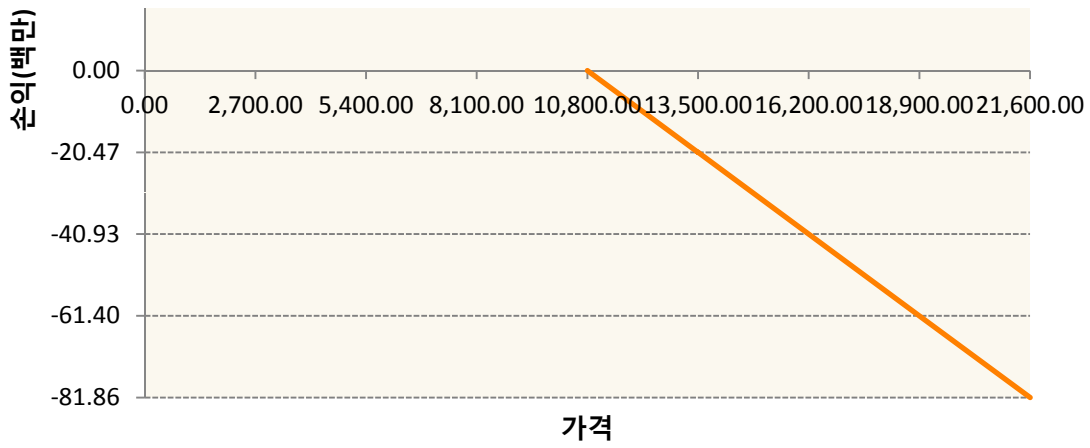
### 2. 만기시점의 손익구조

HCN9-HSCEI Futures Jul19

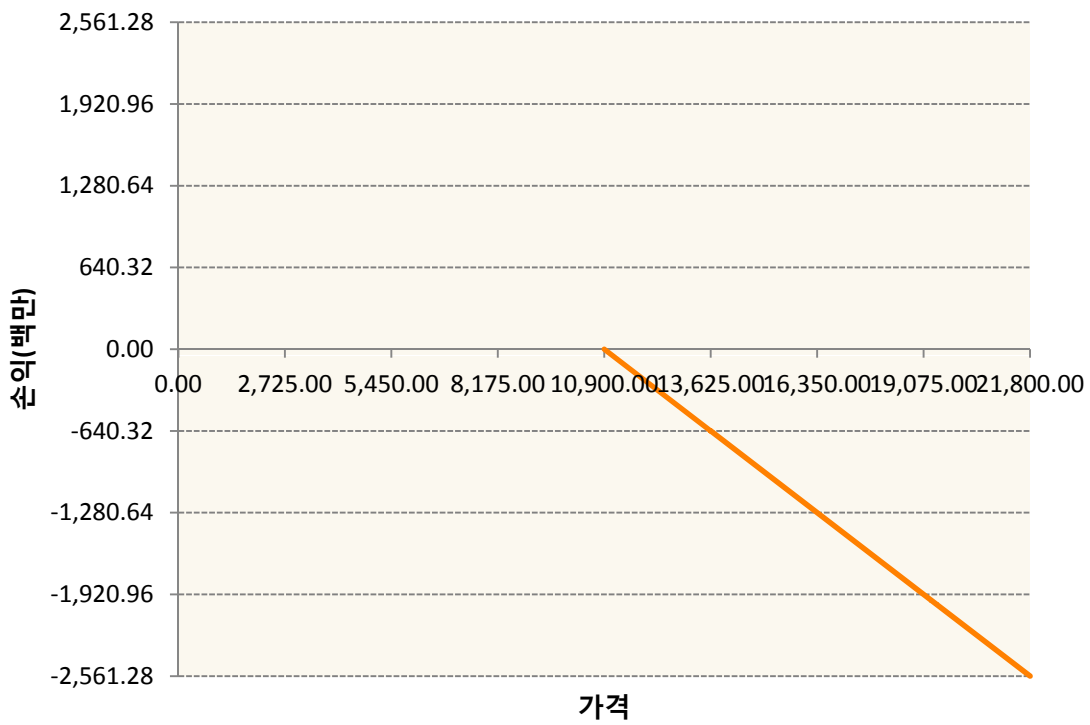


OHHIN9-C108-HSCEI

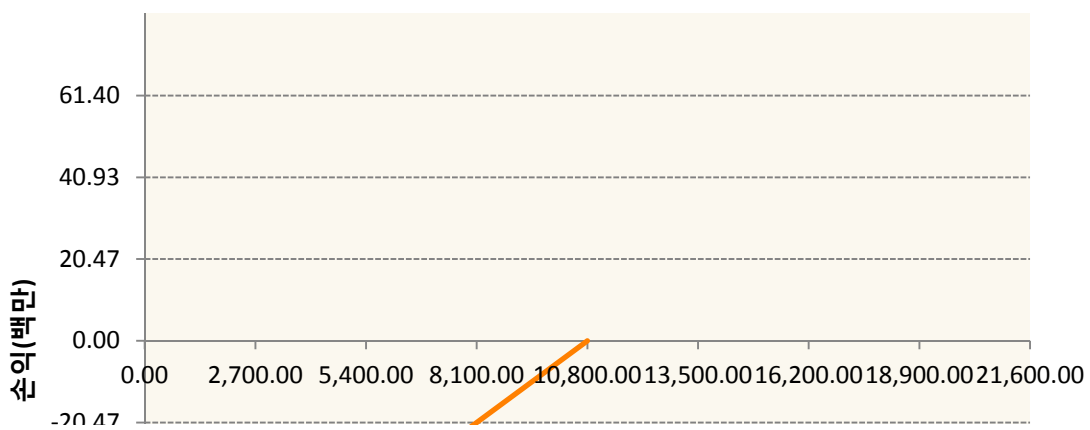


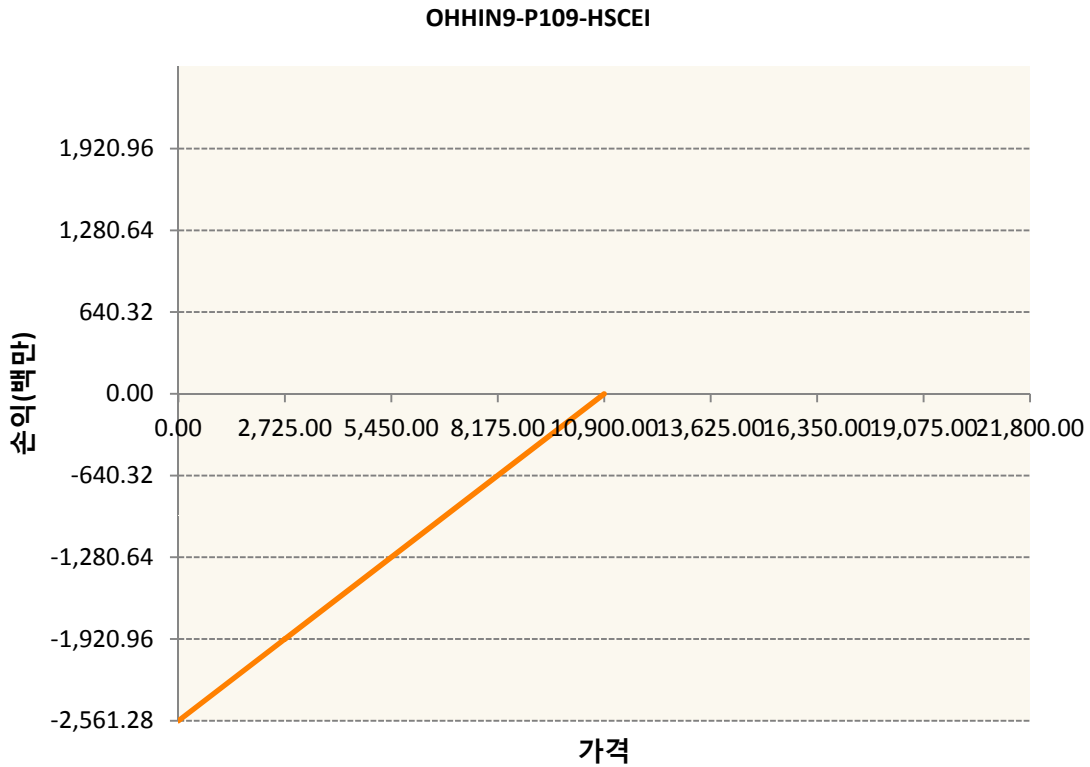


OHHIN9-C109-HSCEI



OHHIN9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E		255
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E		12
HCN9 HSCEI Futures Jul19		153
OHHIN9-C1(HSCEI		7
OHHIN9-C1(HSCEI		205
OHHIN9-P1(HSCEI		7
OHHIN9-P1(HSCEI		205

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		672

공시일	2019-07-09
기준일	2019-07-08

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

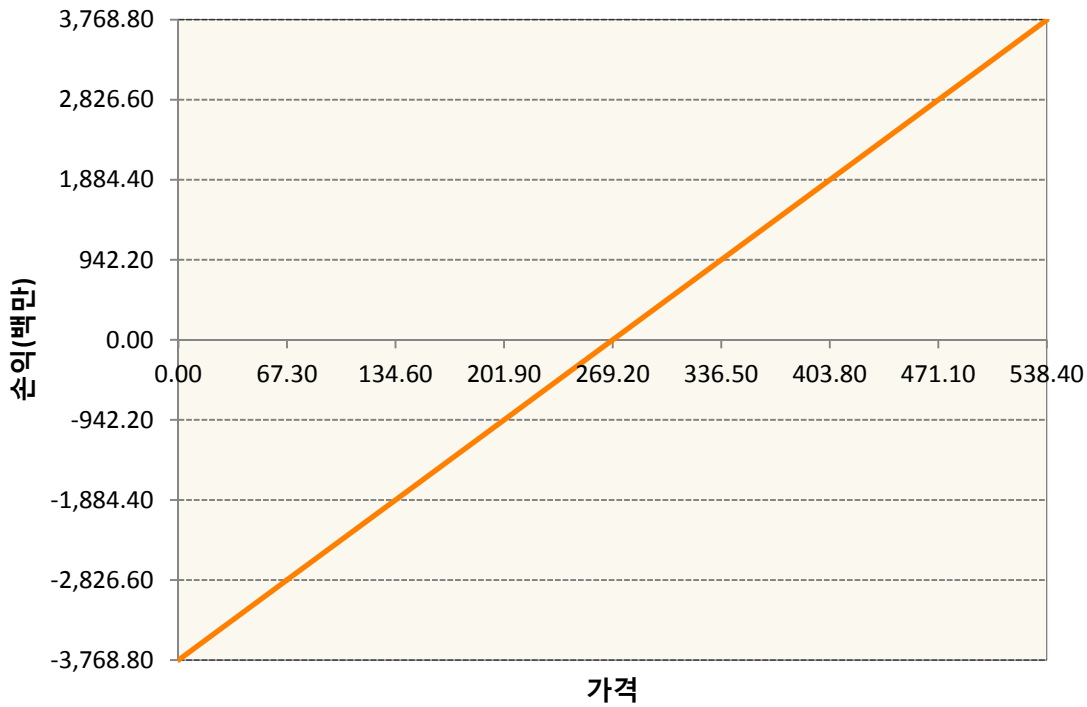
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

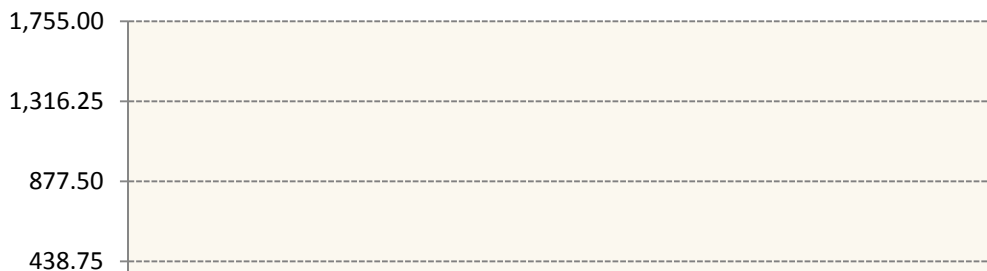
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,769	0	3,769	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,340	-20,340	장내

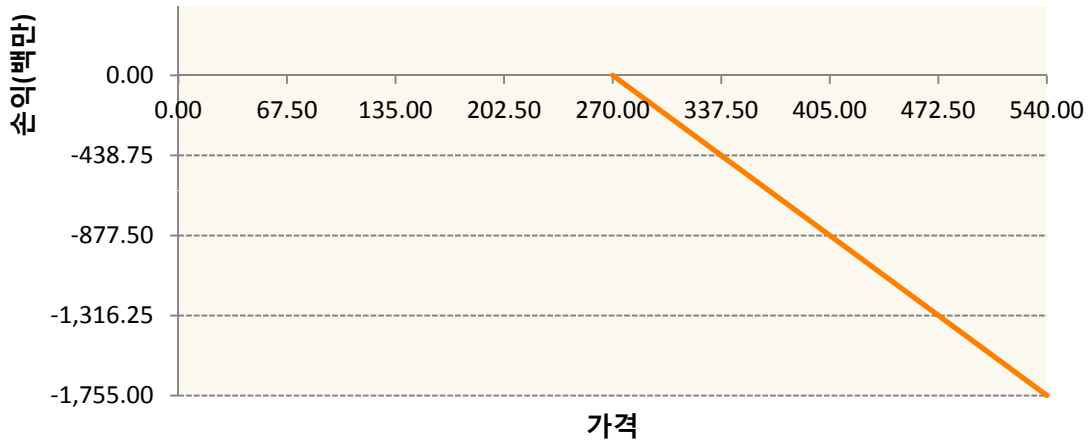
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

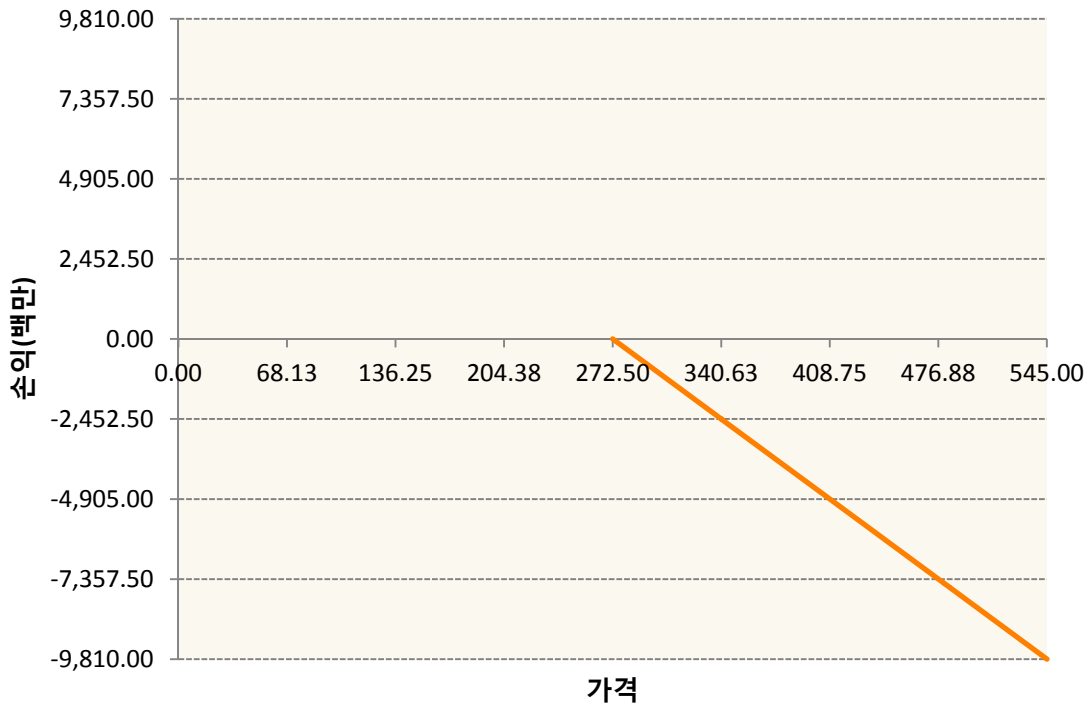


KR4201P72700-2019-07 콜270

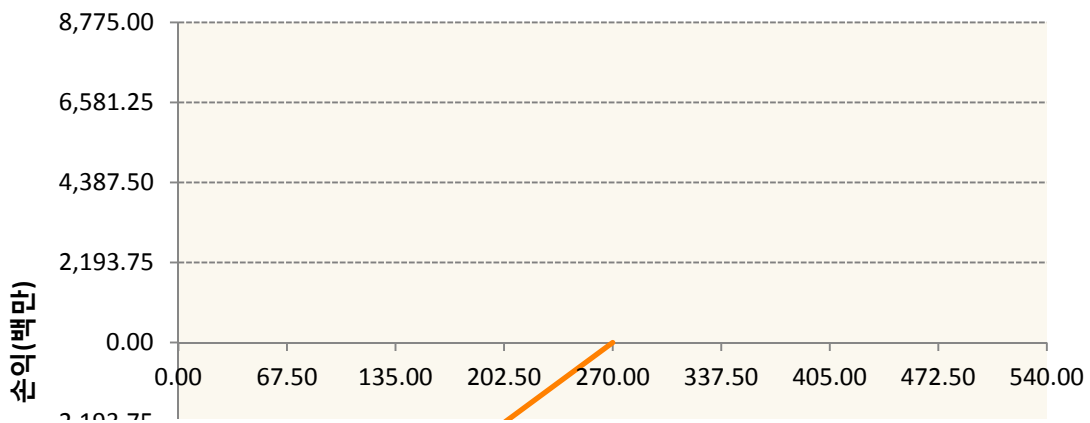




**KR4201P72726-2019-07 콜272.5**



**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						301
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-301	-301	-301	-301	-301	-301	-301	
-5.33%	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-201	
-2.67%	-100	-100	-100	-100	-100	-100	-100	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	100	100	100	100	100	100	100	
5.33%	201	201	201	201	201	201	201	
8.00%	301	301	301	301	301	301	301	
KR4201P72700		2019-07 콜270						119
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	12	12	12	12	12	12	12
-5.33%	12	12	12	12	12	11	11
-2.67%	11	11	11	10	10	9	8
0%	4	3	1	0	-1	-3	-4
2.67%	-27	-28	-28	-29	-30	-31	-32
5.33%	-72	-72	-72	-72	-72	-73	-73
8.00%	-118	-118	-118	-118	-118	-119	-119
KR4201P72726      2019-07 콜272.5							597
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%	35	35	35	35	35	35	34
-2.67%	35	34	33	32	31	29	26
0%	17	12	6	0	-6	-12	-19
2.67%	-105	-111	-117	-124	-131	-137	-144
5.33%	-339	-340	-341	-343	-345	-348	-351
8.00%	-596	-596	-596	-596	-596	-596	-597
KR4301P72708      2019-07 풋270							673
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-673	-673	-673	-673	-673	-673	-673
-5.33%	-440	-440	-440	-440	-440	-440	-440
-2.67%	-208	-208	-208	-208	-208	-208	-209
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	72	72	71	70	69	68	66
5.33%	73	73	73	73	73	72	72
8.00%	73	73	73	73	73	73	73

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

(단위:백만원)

3,825

공시일	2019-07-09
기준일	2019-07-08

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

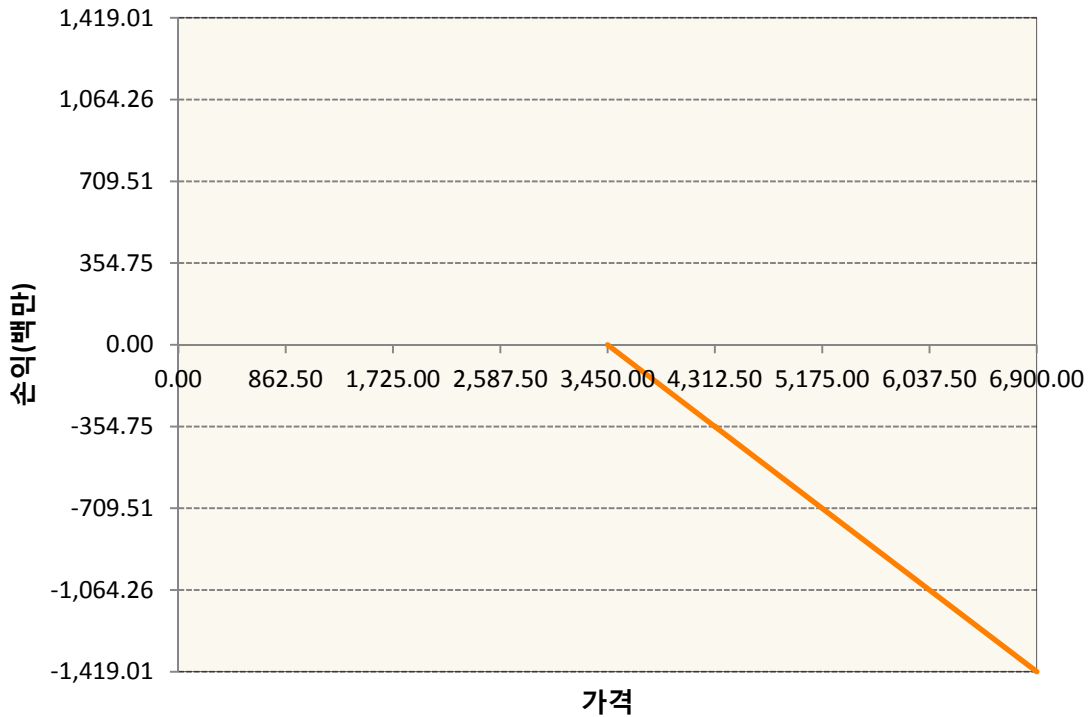
### 1. 계약금액

(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	1,343	0	1,343	
누계	유가증권	스왑	56,162	0	56,162	장외
누계	유가증권	옵션	0	8,647	-8,647	장내
누계	통화	선도	0	22,556	-22,556	장외

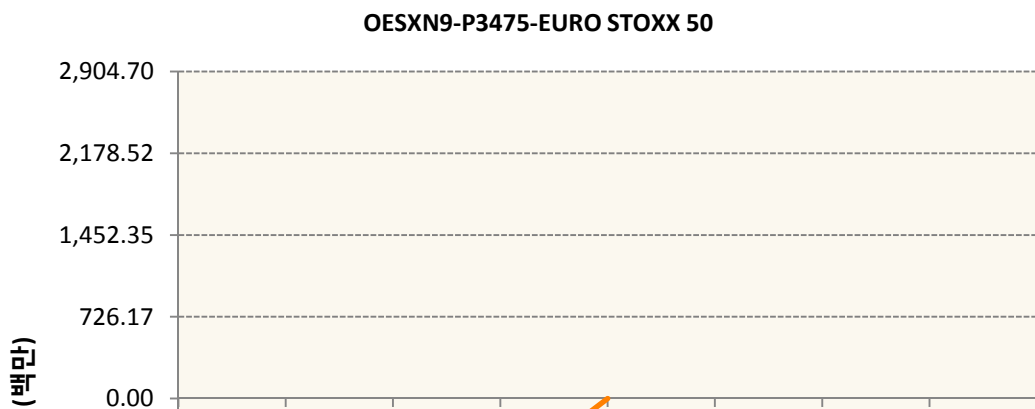
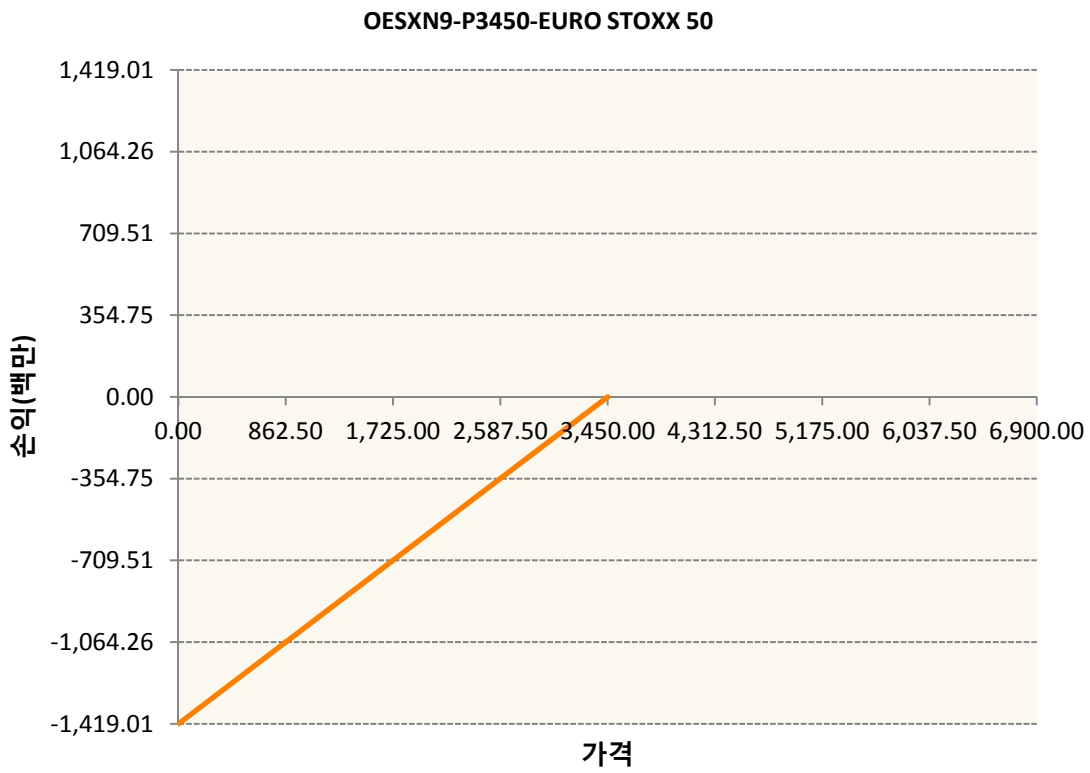
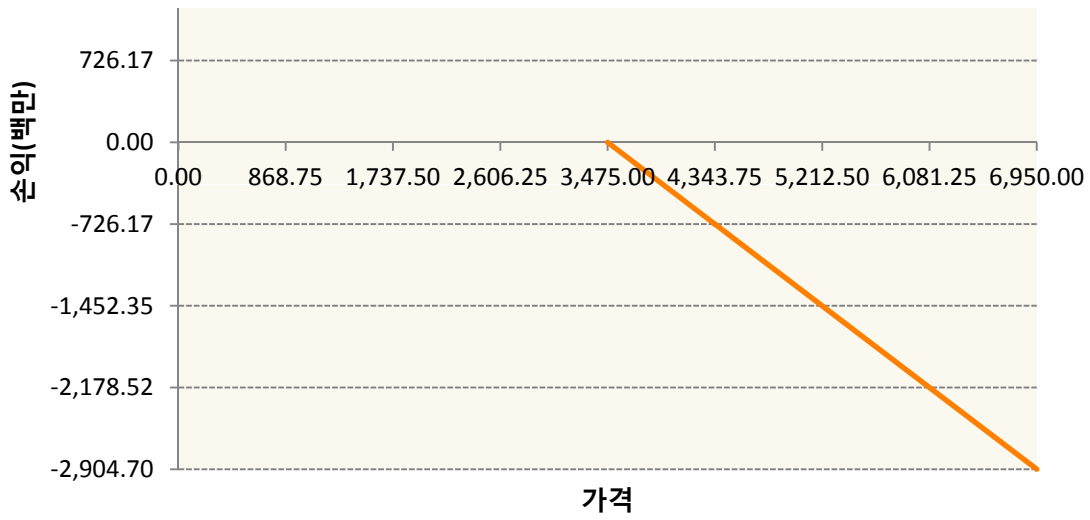
### 2. 만기시점의 손익구조

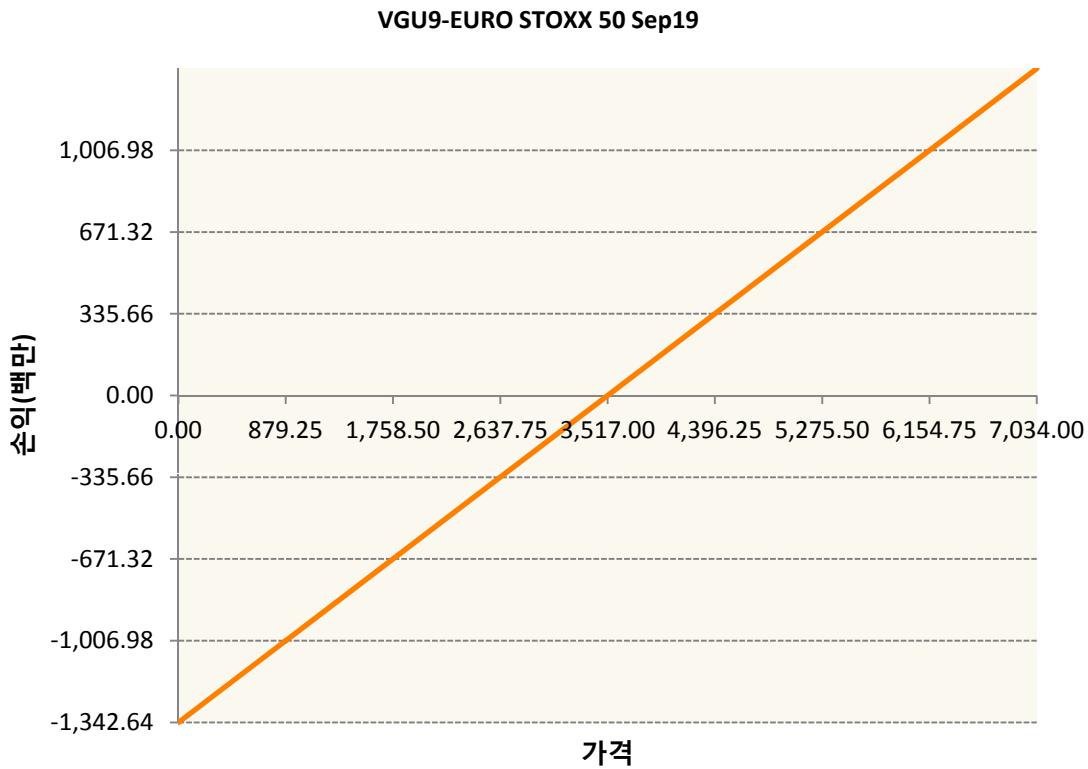
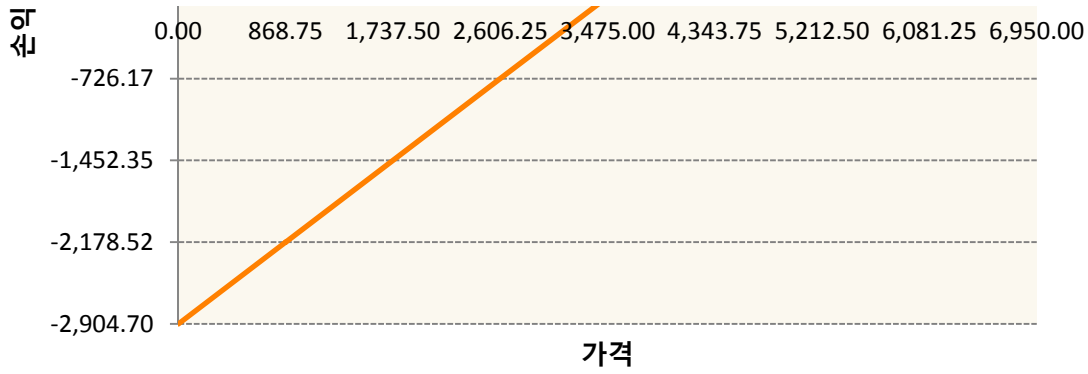
OESXN9-C3450-EURO STOXX 50



OESXN9-C3475-EURO STOXX 50







**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)**

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	102
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	425
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E	1,061
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	318
OESXN9-C34 EURO STOXX 50	114
OESXN9-C34 EURO STOXX 50	232
OESXN9-P34 EURO STOXX 50	114
OESXN9-P34 EURO STOXX 50	232
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	107

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

(단위:백만원)

1,517



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

(단위:백만원)

1,007



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

(단위:백만원)

89



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

(단위:백만원)

129

공시일	2019-07-09
기준일	2019-07-08

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

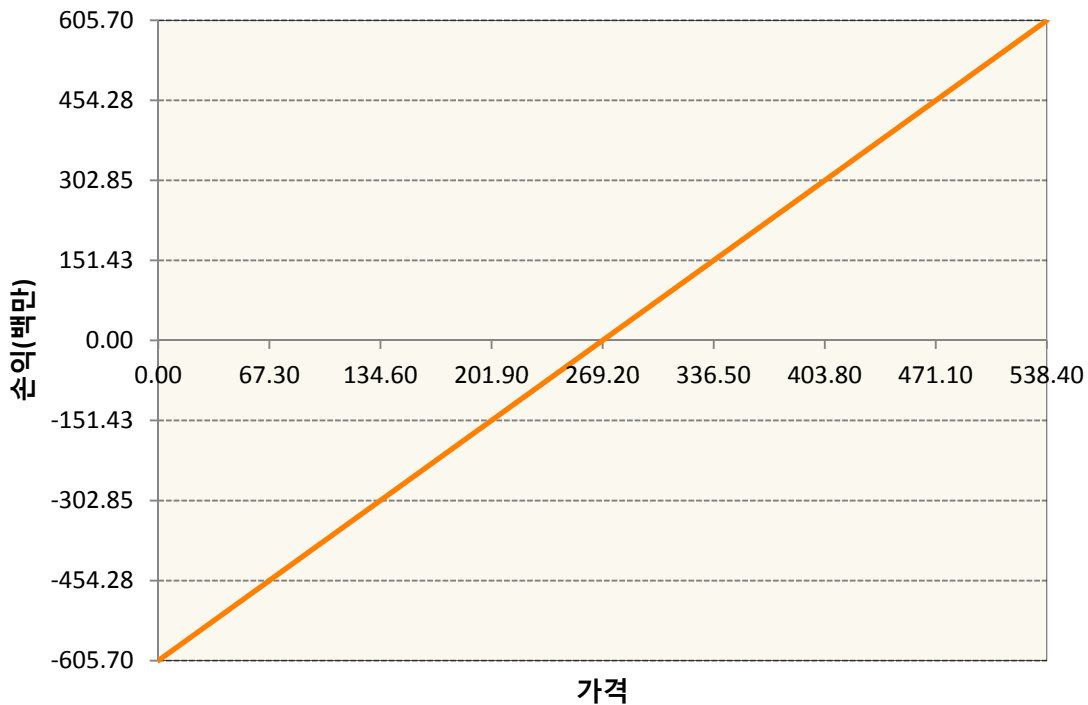
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	606	0	606	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						48
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48	
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
-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%	32	32	32	32	32	32	32	
8.00%	48	48	48	48	48	48	48	

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

(단위:백만원)

40

공시일	2019-07-09
기준일	2019-07-08

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

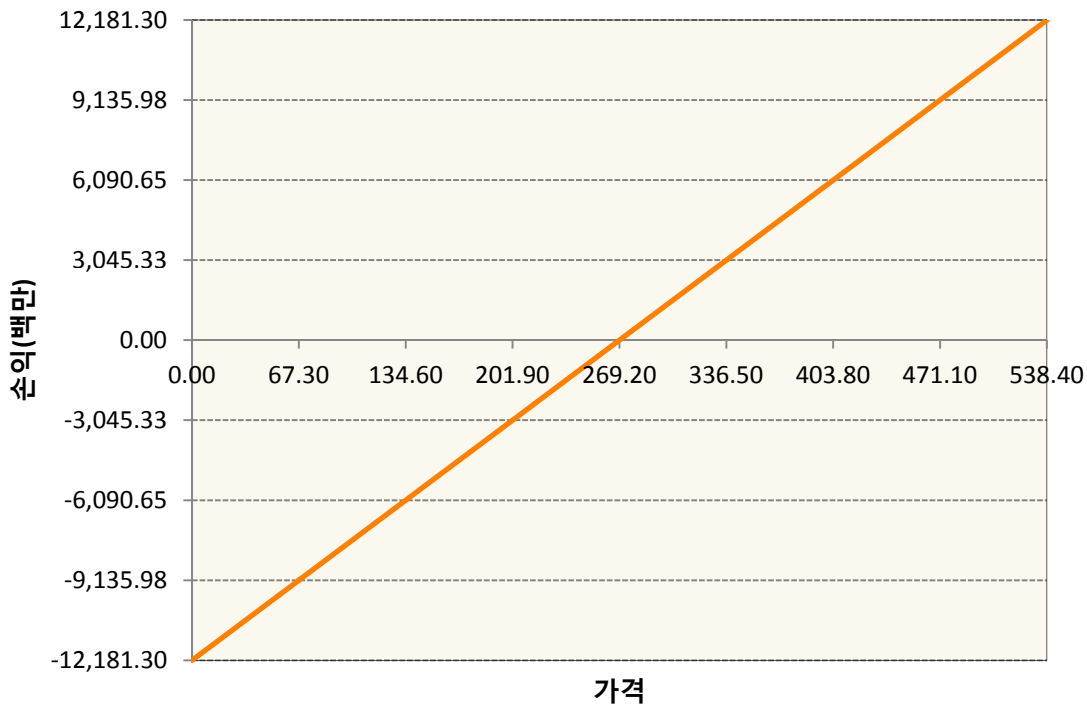
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

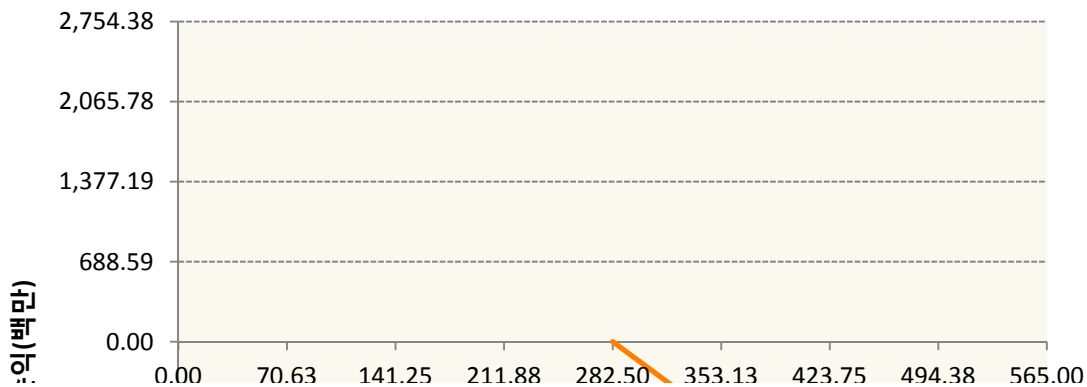
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,181	0	12,181	장내
누계	유가증권	옵션	1,084	22,134	-21,050	장내

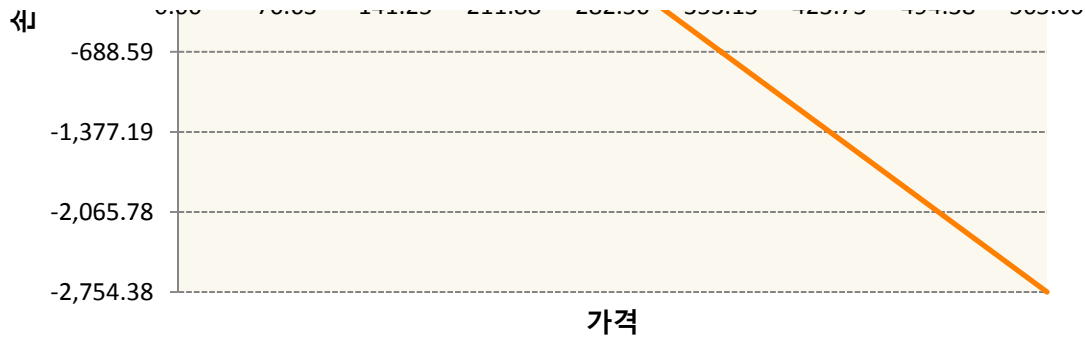
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

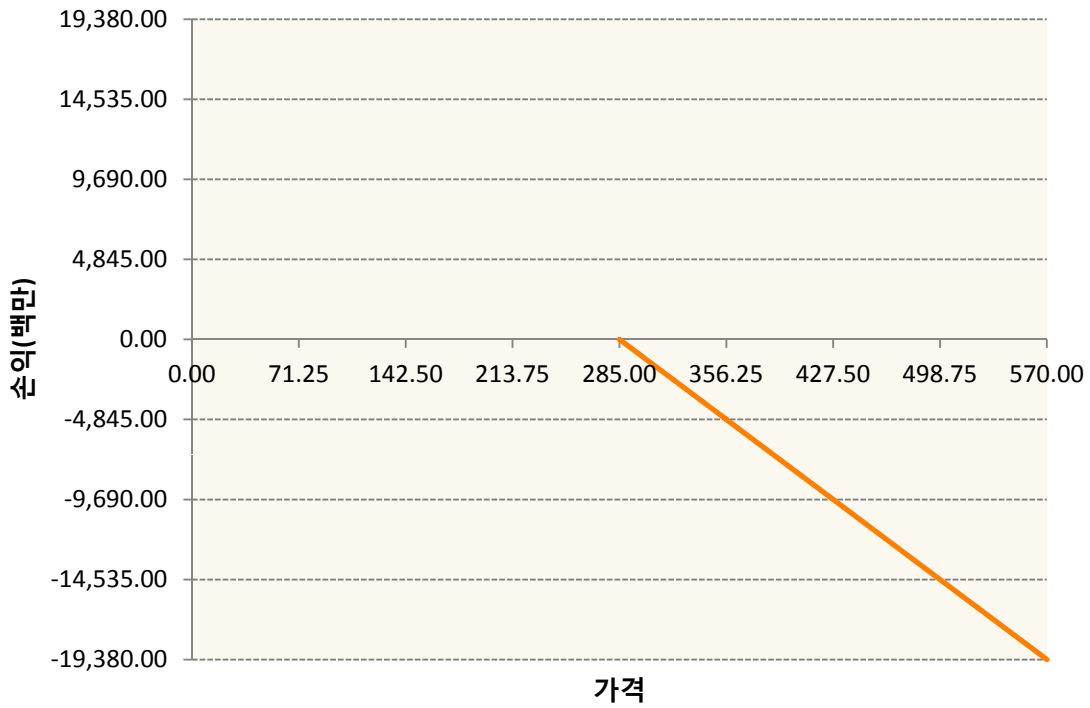


KR4201P72825-2019-07 콜282.5

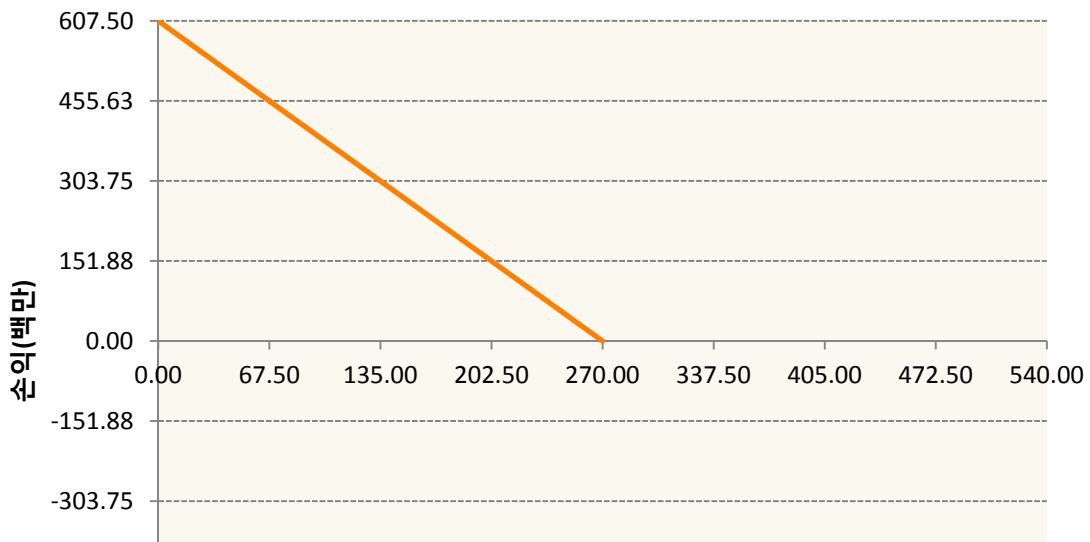


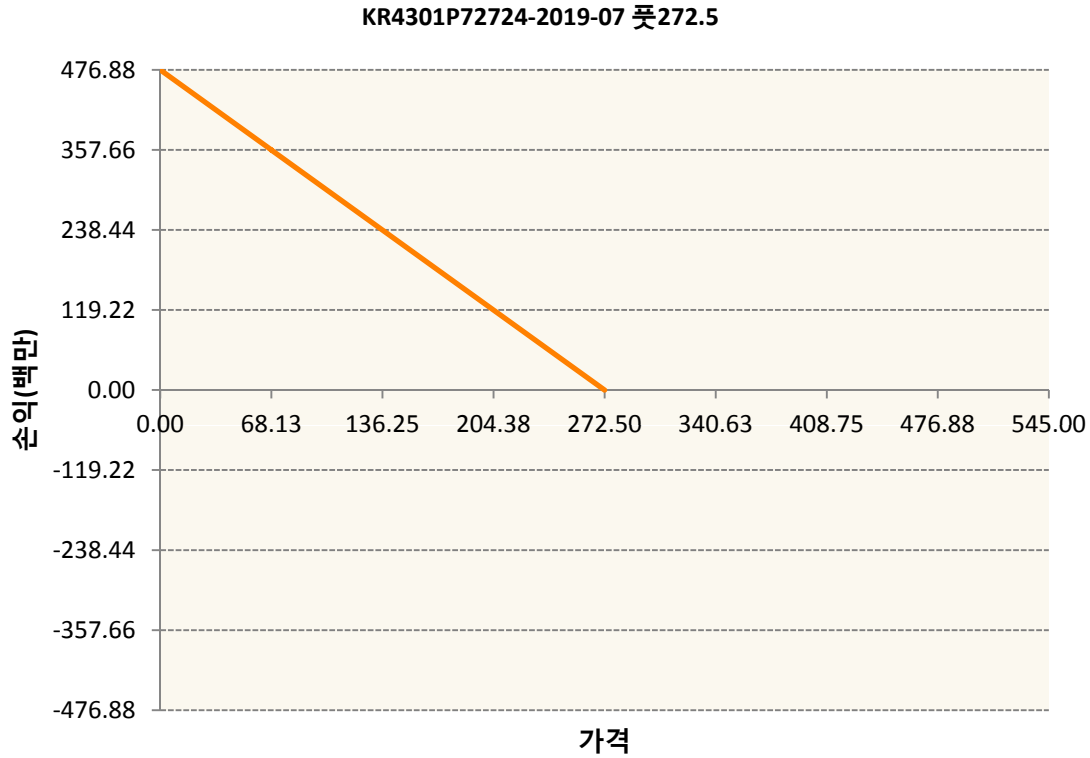
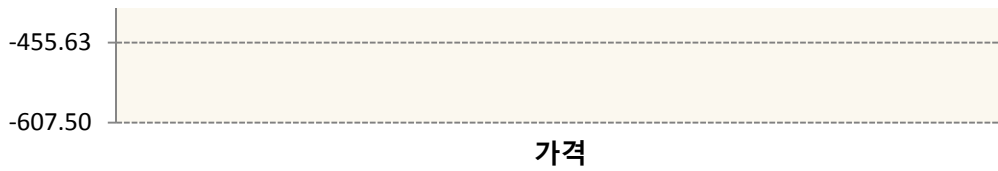


KR4201P72858-2019-07 콜285



KR4301P72708-2019-07 풋270





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						972
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-972	-972	-972	-972	-972	-972	-972	
-5.33%	-648	-648	-648	-648	-648	-648	-648	
-2.67%	-324	-324	-324	-324	-324	-324	-324	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	324	324	324	324	324	324	324	
5.33%	648	648	648	648	648	648	648	
8.00%	972	972	972	972	972	972	972	
KR4201P72825		2019-07 콜282.5						81
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0	
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0	
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	

0%	0	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	-1	-2	-3	-4	-5	-7	-8
5.33%	-20	-22	-25	-27	-29	-31	-33
8.00%	-74	-75	-76	-77	-78	-79	-81

KR4201P72858                      2019-07 콜285    433

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1
-2.67%	1	1	1	1	1	1	0
0%	1	1	0	0	-1	-2	-3
2.67%	-3	-5	-9	-14	-19	-25	-32
5.33%	-71	-85	-98	-112	-126	-140	-154
8.00%	-367	-377	-387	-398	-409	-421	-433

KR4301P72708                      2019-07 풋270    47

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	47	47	47	47	47	47	47
-5.33%	30	30	30	30	30	30	30
-2.67%	14	14	14	14	14	14	14
0%	-1	0	0	0	0	0	1
2.67%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5

KR4301P72724                      2019-07 풋272.5    37

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	37	37	37	37	37	37	37
-5.33%	25	25	25	25	25	25	25
-2.67%	12	12	12	12	12	12	12
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-6	-6
5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7

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

(단위:백만원)

**980**

공시일	2019-07-09
기준일	2019-07-08

## 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	19,783	0	19,783	

### 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	2019-07-09
기준일	2019-07-08

## 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	62,606	0	62,606	

### 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	2019-07-09
기준일	2019-07-08

## 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	364,954	0	364,954	
누계	통화	선도	0	356,515	-356,515	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		473
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		473
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		378
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		794
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		284
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		946
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		189
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		879
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		1,050
FX21019M0(KRW/USD 10-07-19E		1,891
FX21019M0(KRW/USD 15-07-19E		473
FX21019M01KRW/USD 15-07-19E		378
FX21019M01KRW/USD 15-07-19E		662
FX21019M01KRW/USD 15-07-19E		946
FX21019M01KRW/USD 15-07-19E		662
FX21019M01KRW/USD 15-07-19E		662
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		567
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		3,026
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		2,269
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E		284
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E		284
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E		794
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E		634
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E		473
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		1,891
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		1,891

FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E	700
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E	700
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E	1,305
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E	2,564

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

(단위:백만원)

**9,364**

공시일	2019-07-09
기준일	2019-07-08

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

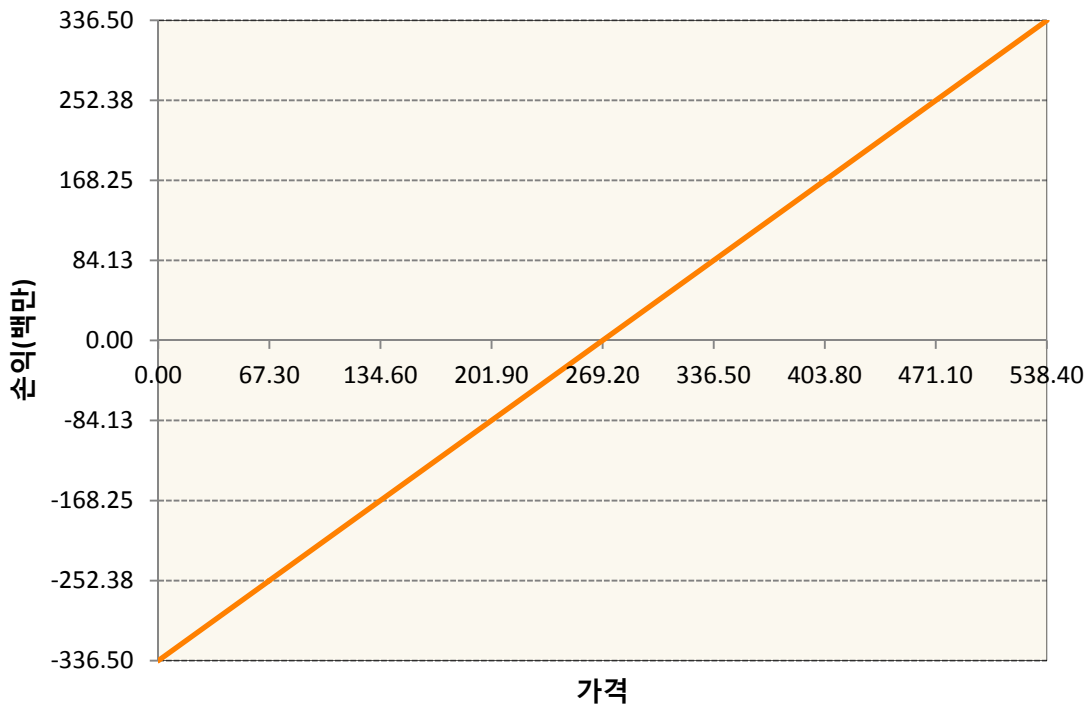
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

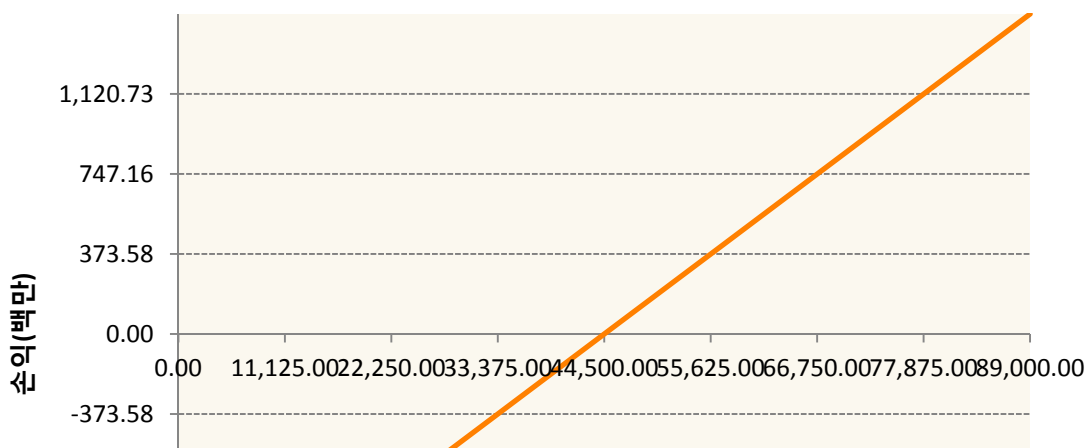
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,831	0	1,831	장내

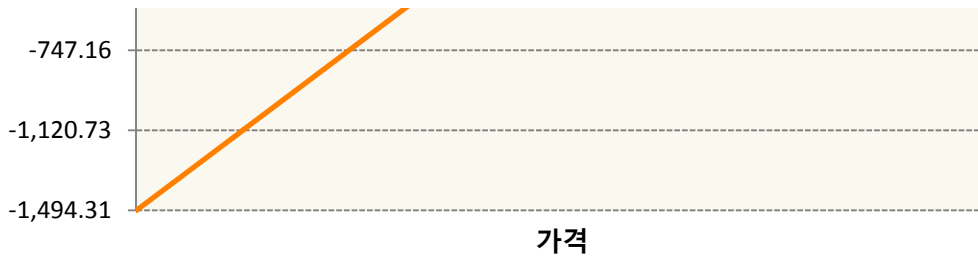
### 2. 만기시점의 손익구조

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						119
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119	
-5.33%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80	
-2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	40	40	40	40	40	40	40	
5.33%	80	80	80	80	80	80	80	
8.00%	119	119	119	119	119	119	119	

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

**161**

공시일	2019-07-09
기준일	2019-07-08

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

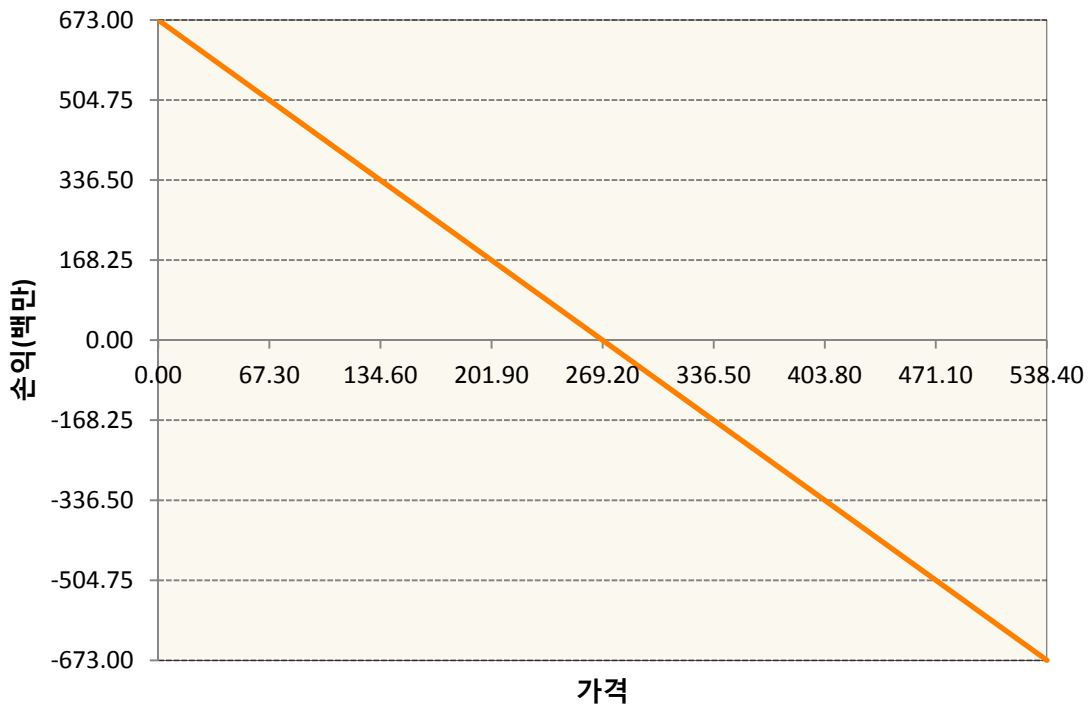
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

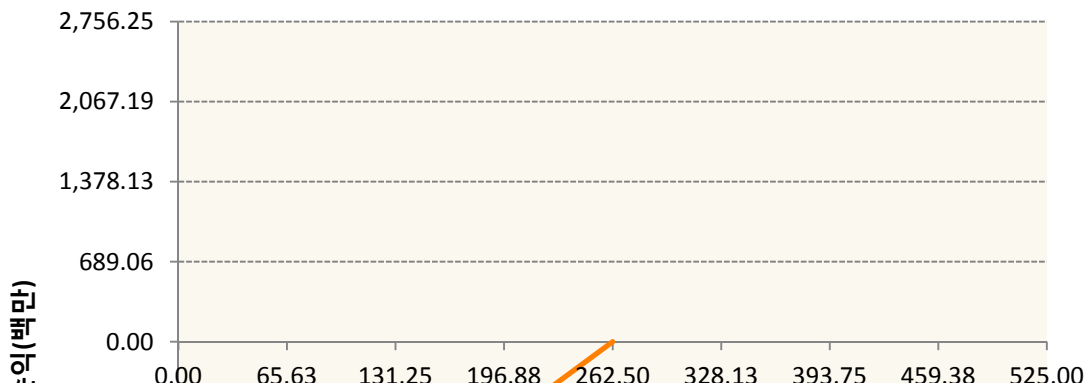
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	673	-673	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,485	-3,485	장내

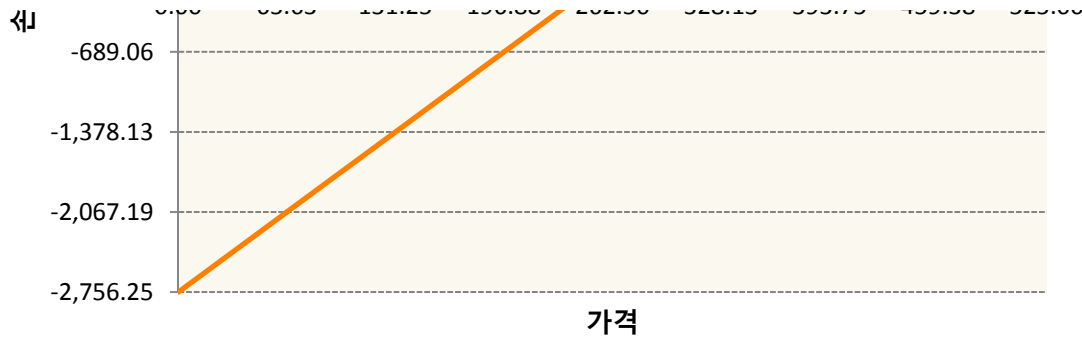
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

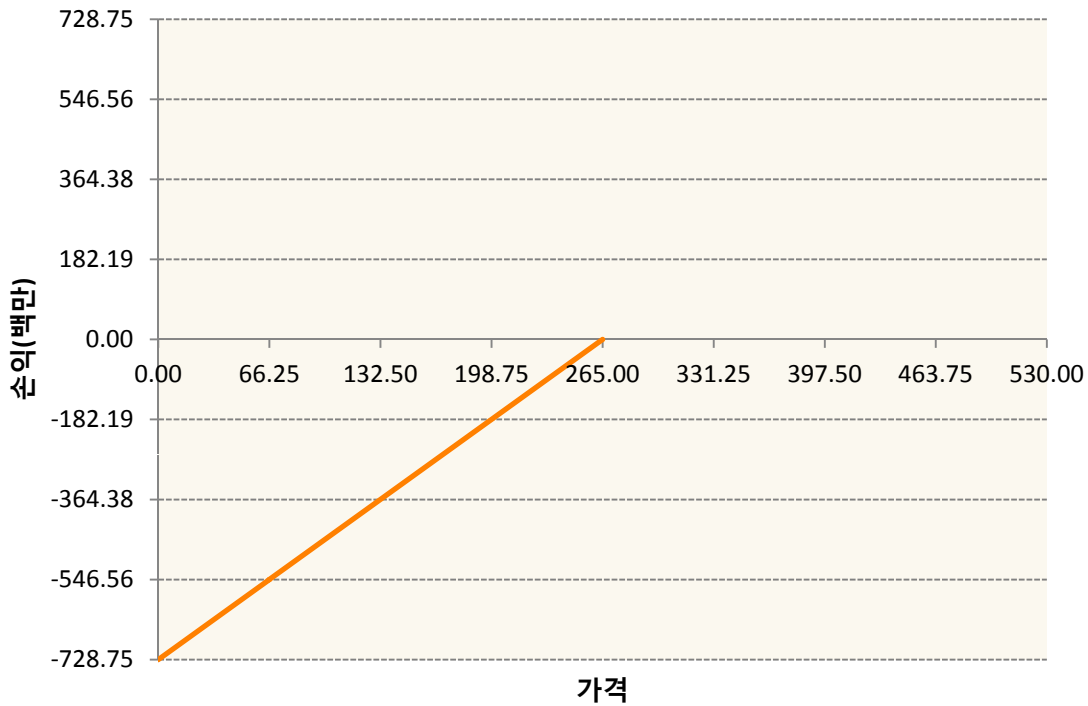


KR4301P72625-2019-07 풋262.5





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						162
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-162	-162	-162	-162	-162	-162	-162
-5.33%	-86	-86	-86	-87	-87	-87	-87
-2.67%	-17	-18	-19	-20	-21	-22	-24
0%	0	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

KR4301P72658

2019-07 풋265

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%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
-2.67%	-9	-10	-10	-10	-10	-10	-10
0%	0	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

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

(단위:백만원)

231

공시일	2019-07-09
기준일	2019-07-08

## 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	4,019	-4,019	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

#### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019M0:KRW/USD 24-07-19E	142
FX21019M0:KRW/USD 24-07-19E	180

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

(단위:백만원)

<b>106</b>
------------

공시일	2019-07-09
기준일	2019-07-08

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

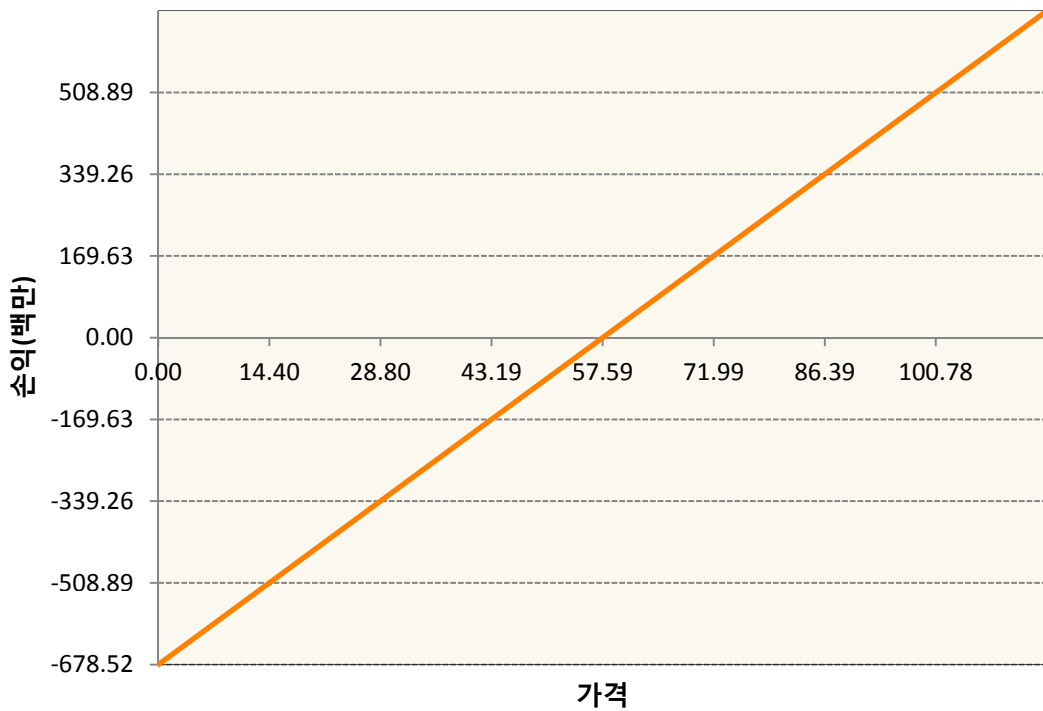
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

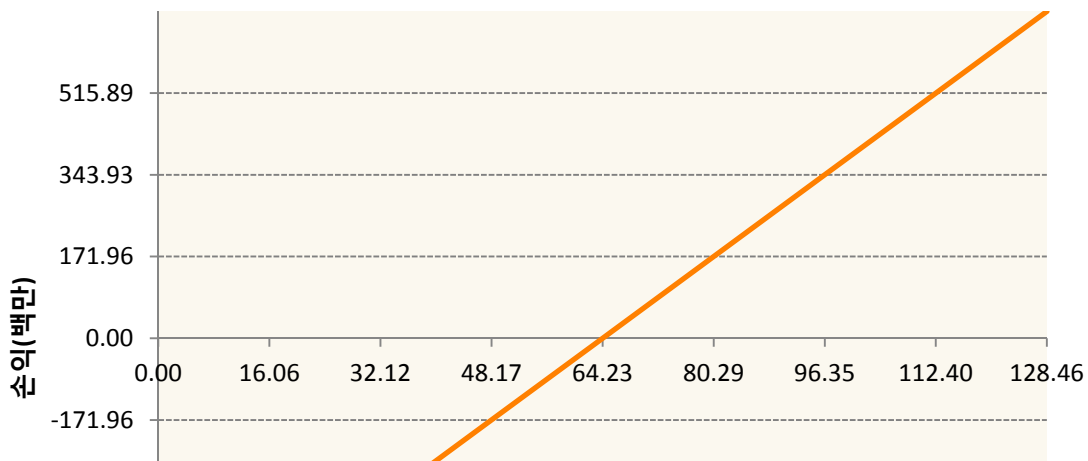
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,730	118	2,612	

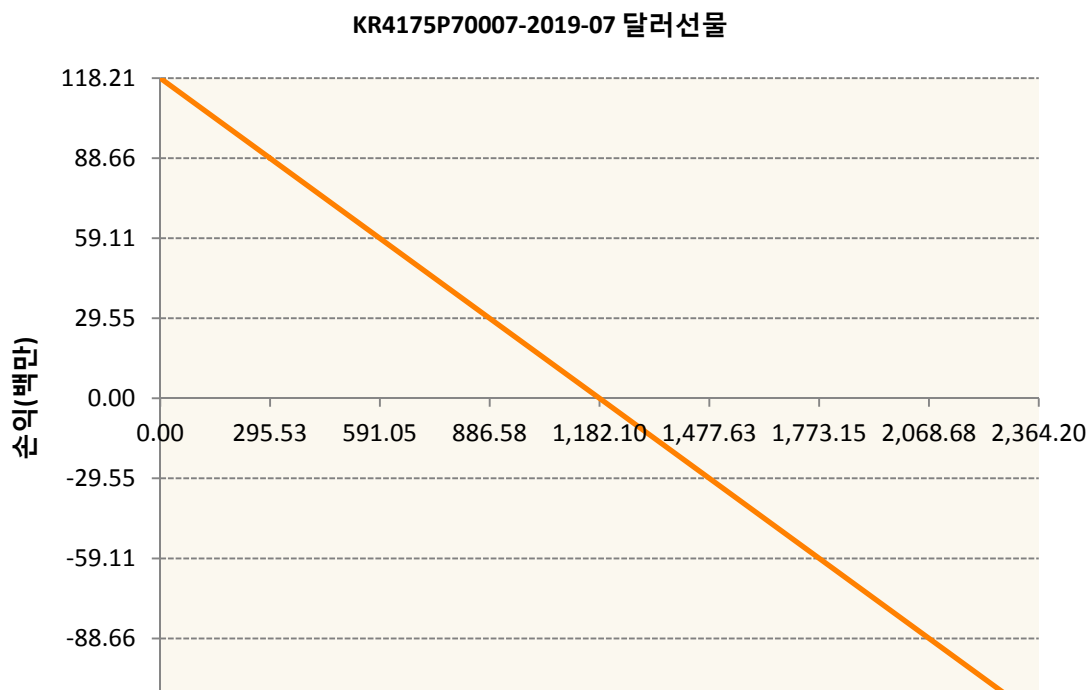
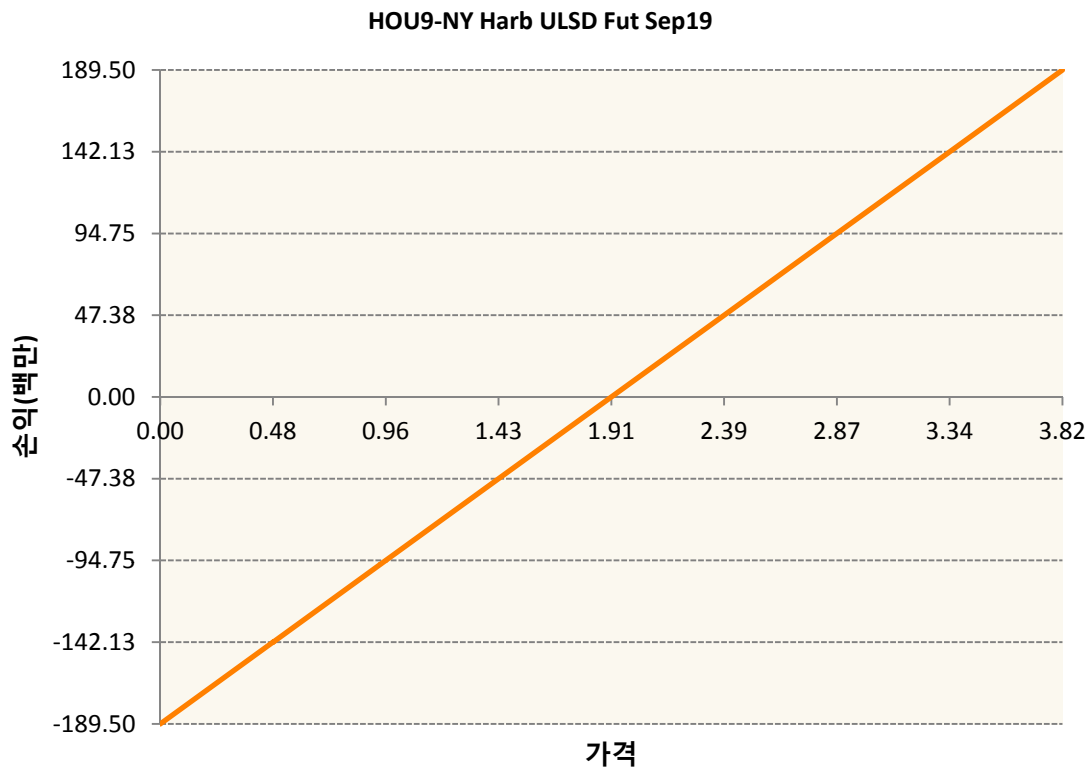
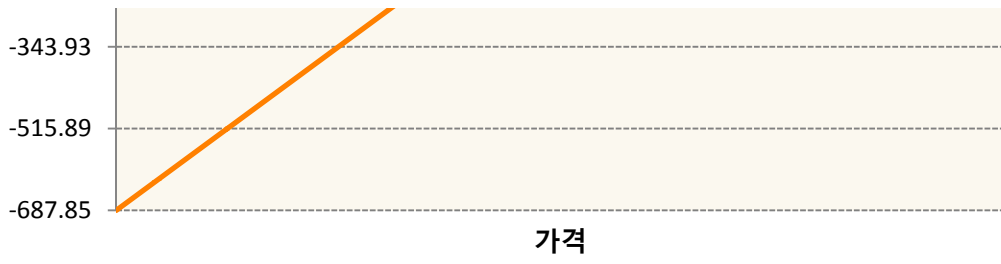
### 2. 만기시점의 손익구조

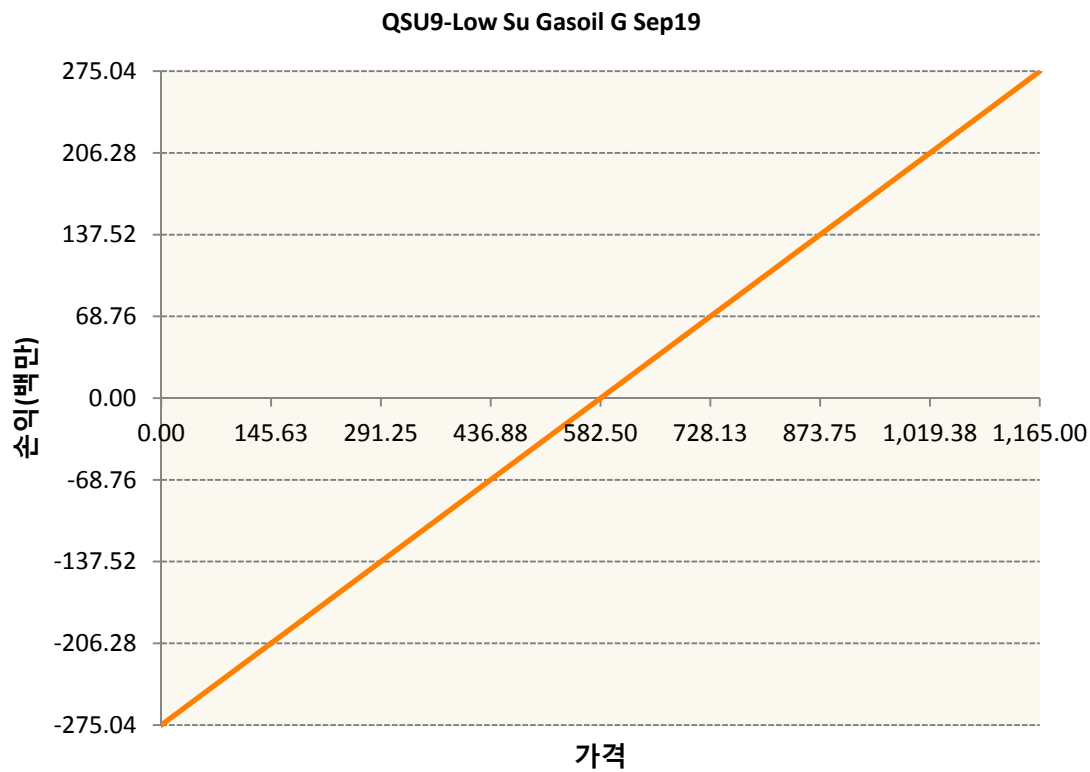
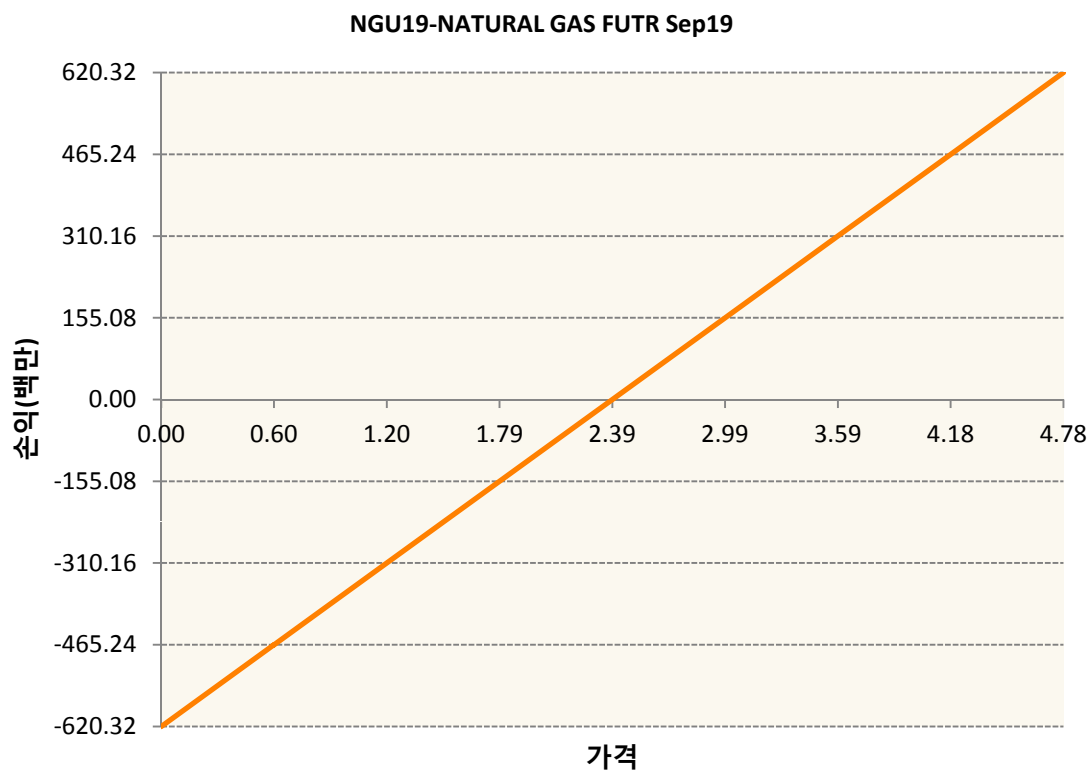
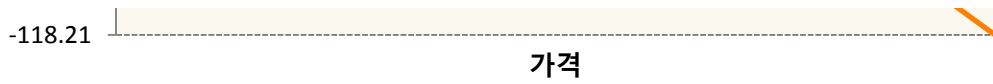
CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19



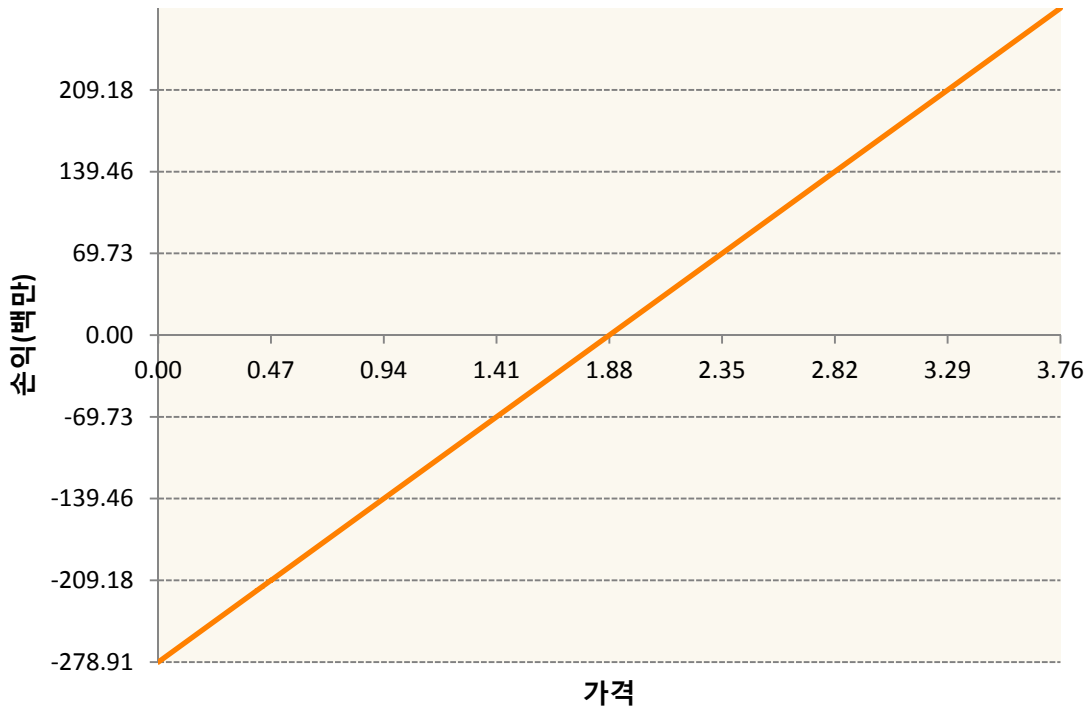
COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19







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	50
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	22
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	22

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

(단위:백만원)

405

공시일	2019-07-09
기준일	2019-07-08

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

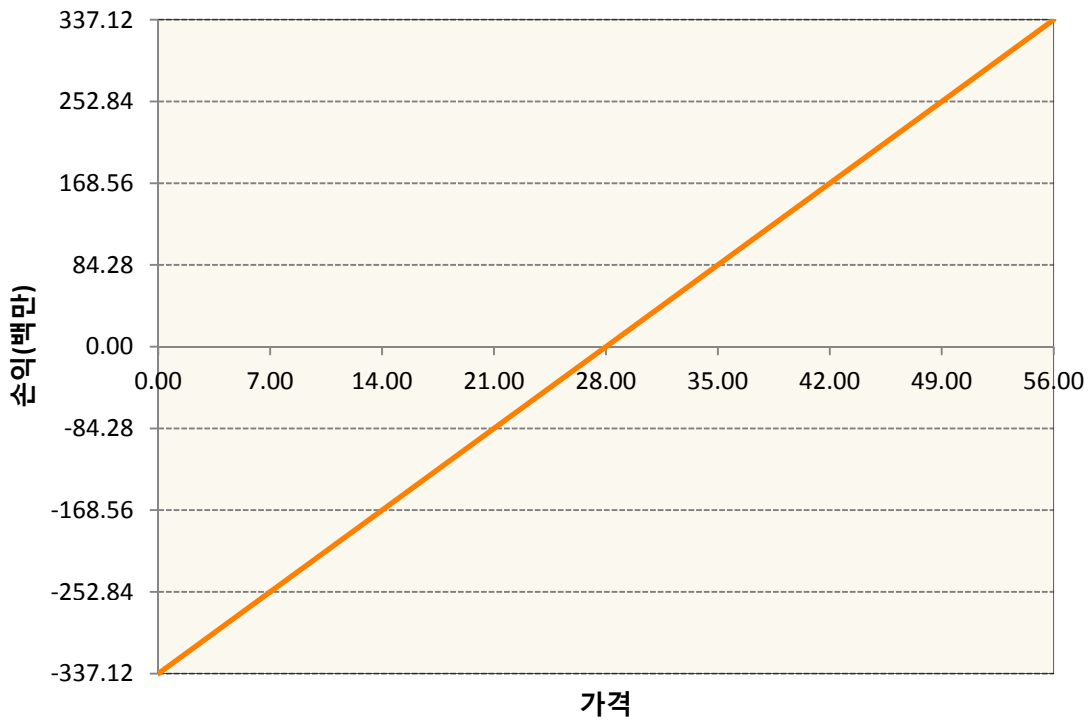
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

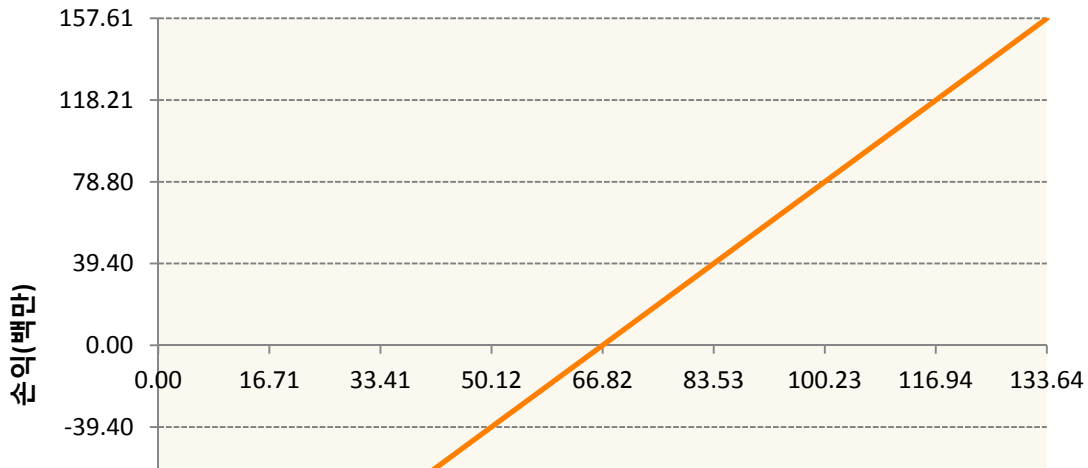
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,245	201	3,044	

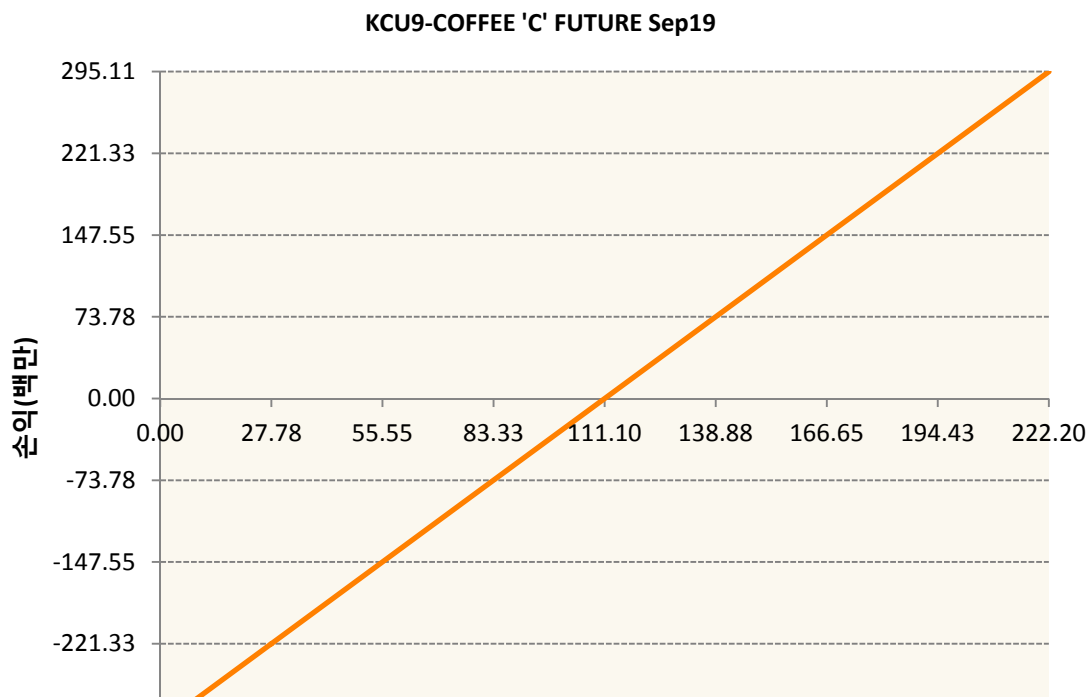
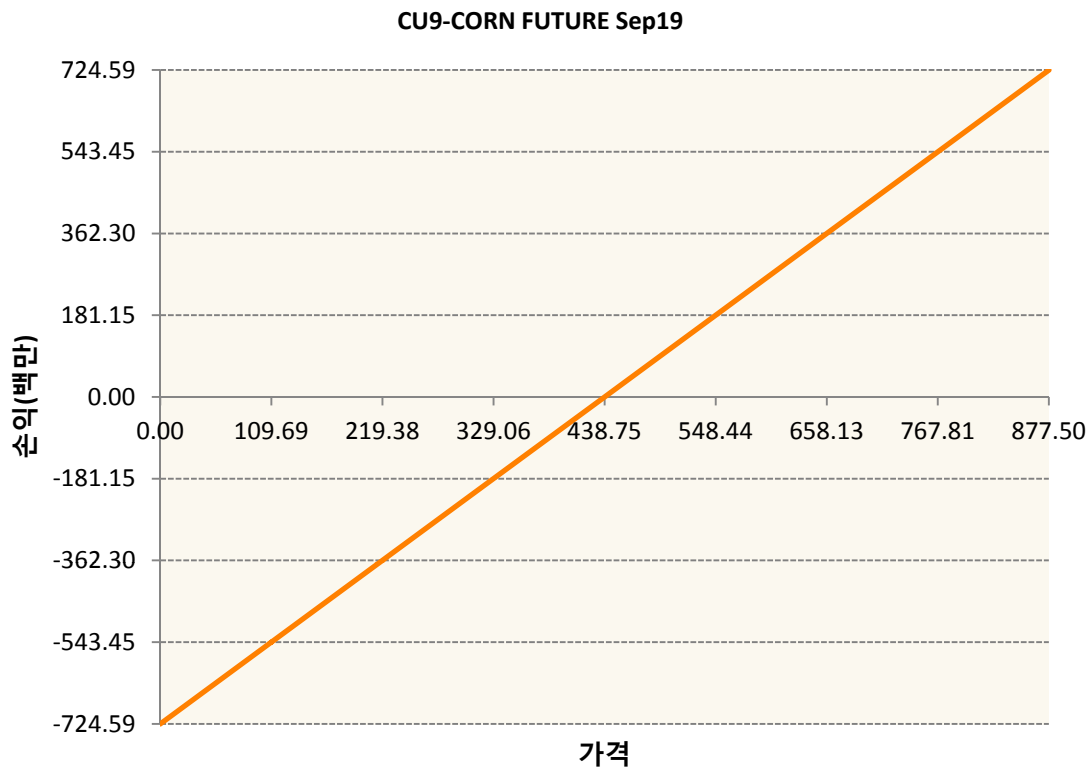
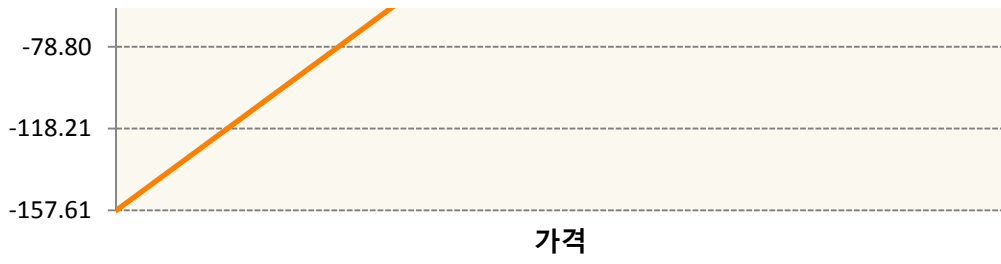
### 2. 만기시점의 손익구조

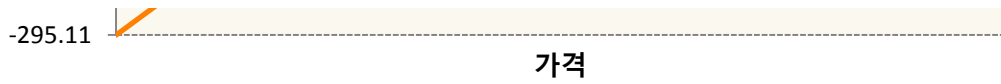
**BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19**



**CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19**

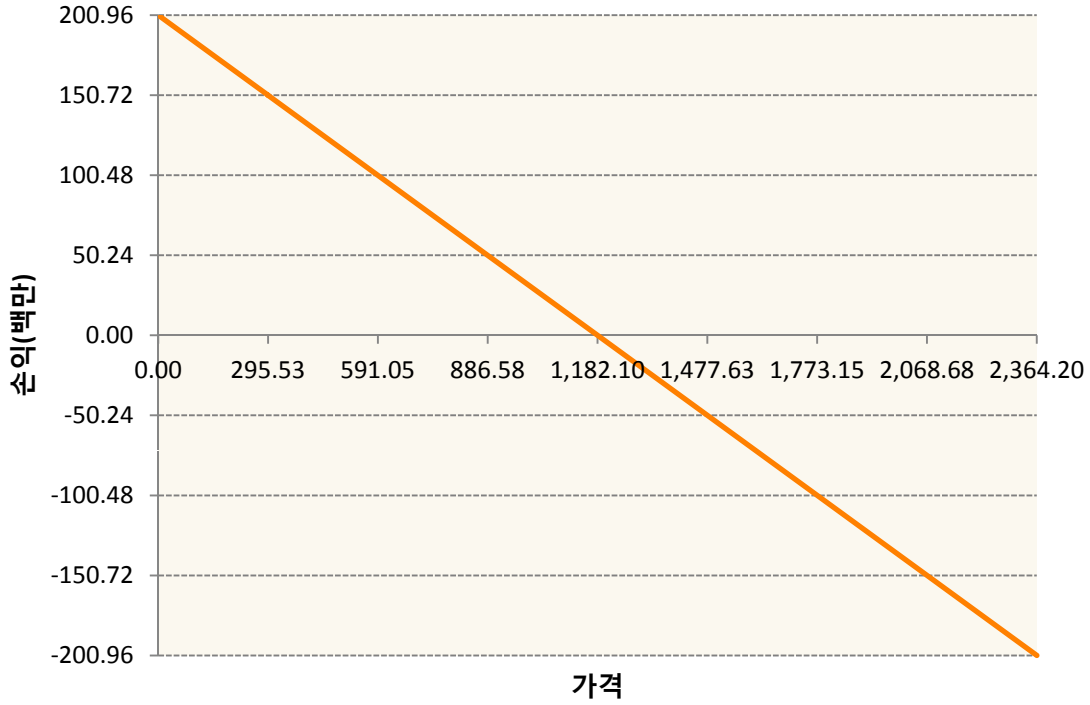






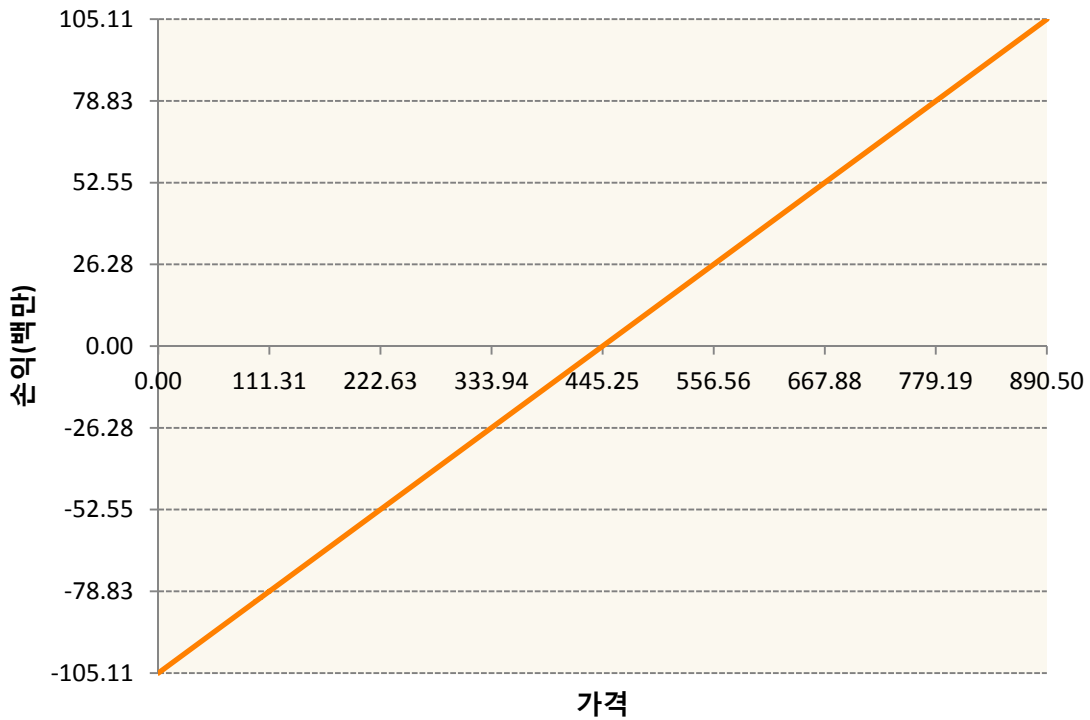
가격

KR4175P70007-2019-07 달러선물



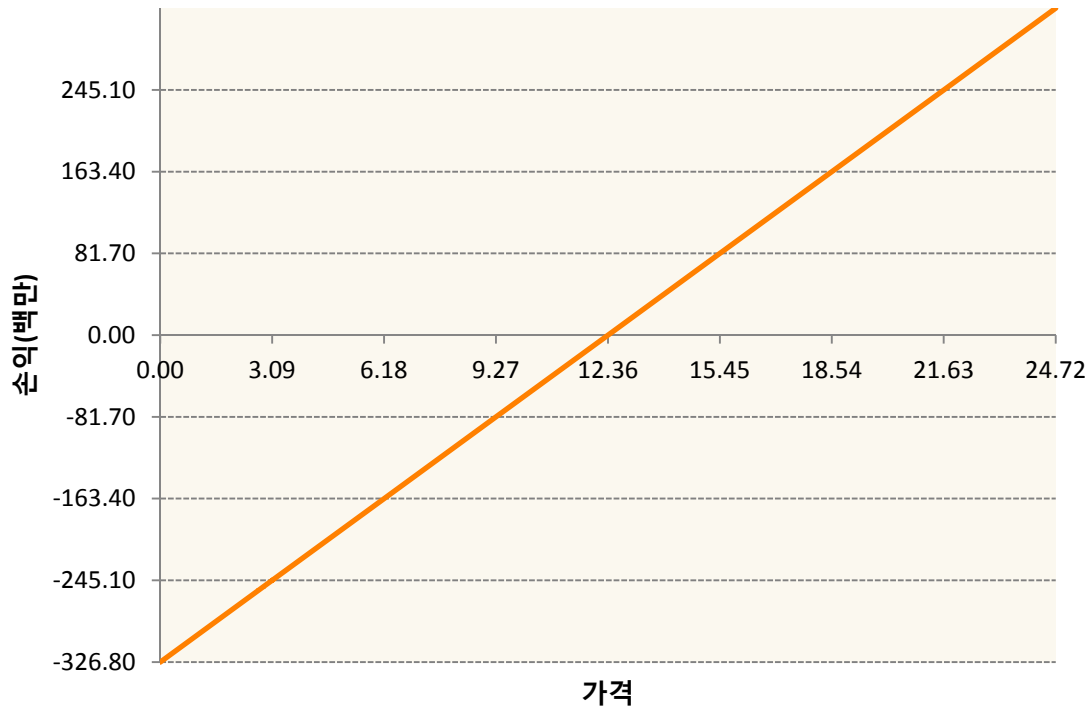
가격

KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19

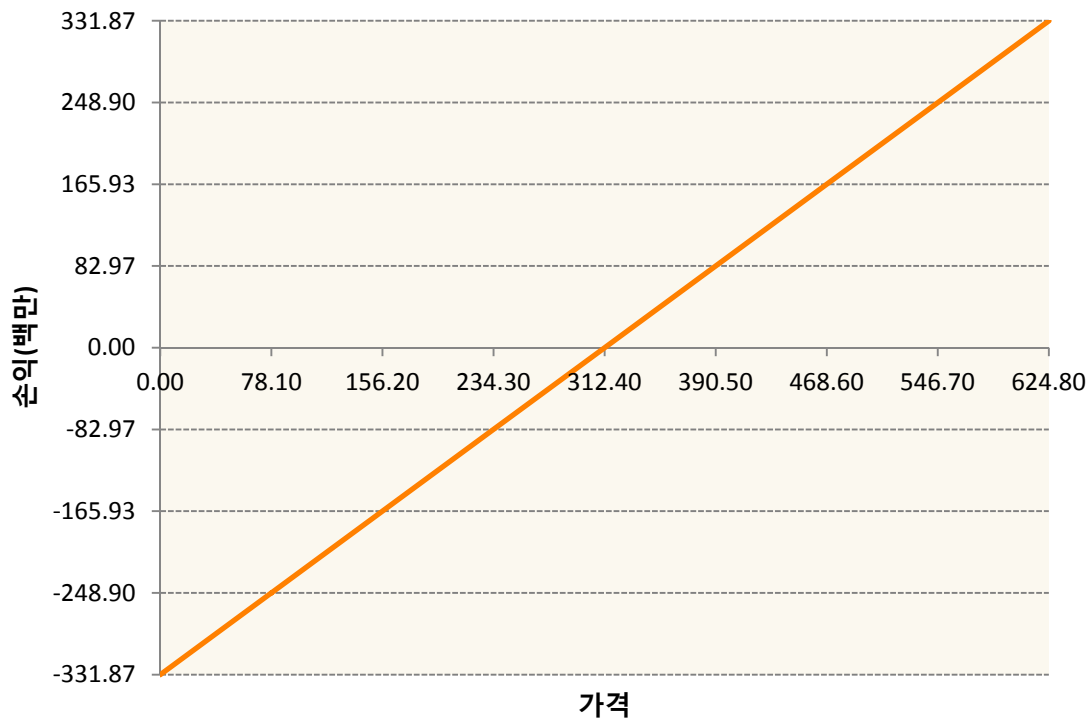


가격

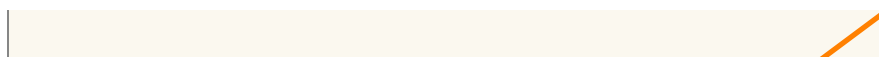
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

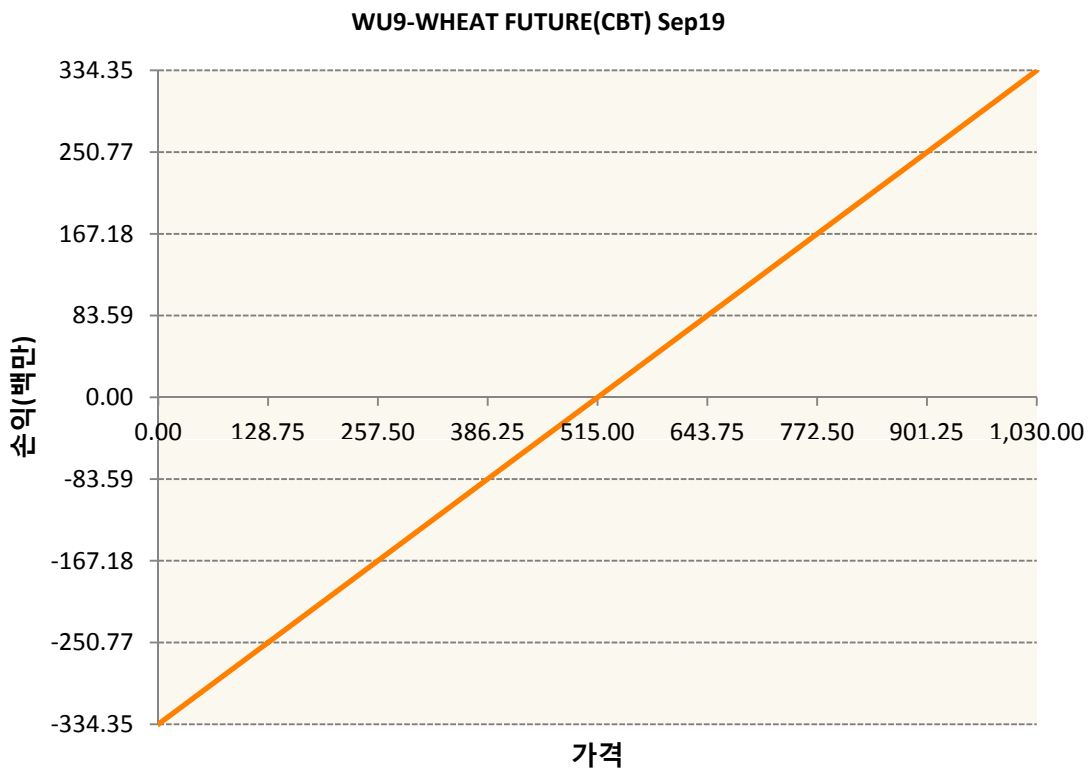
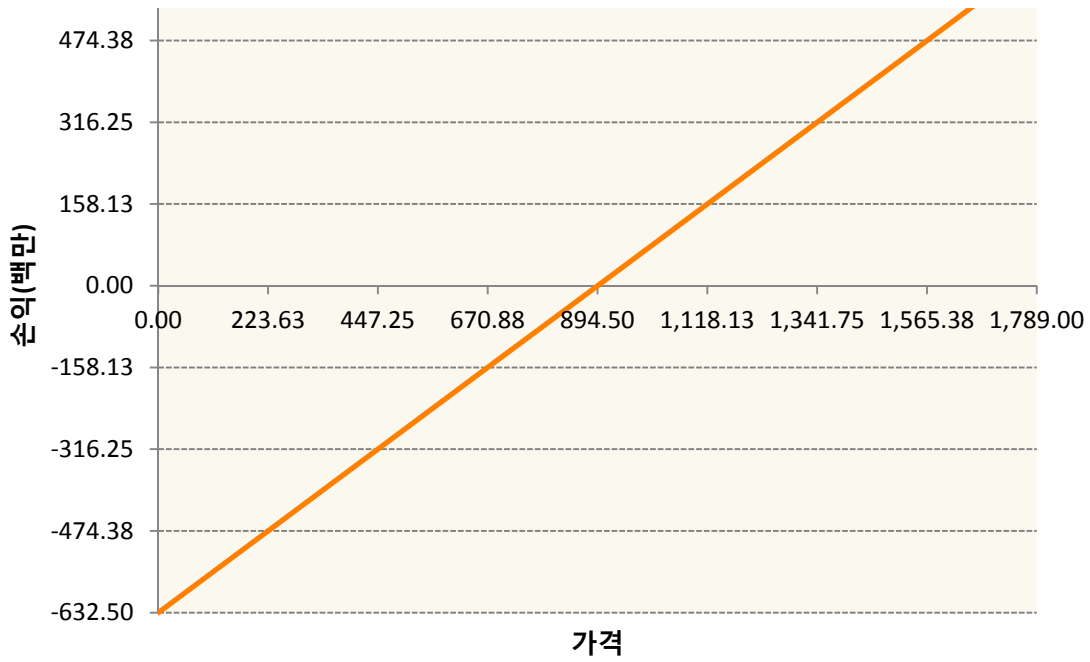


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	27
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	26
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)

**286**