

공시일	2019-07-17
기준일	2019-07-16

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	2019-07-17
기준일	2019-07-16

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)

673

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-17
기준일	2019-07-16

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)	386
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	141

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

854

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-17
기준일	2019-07-16

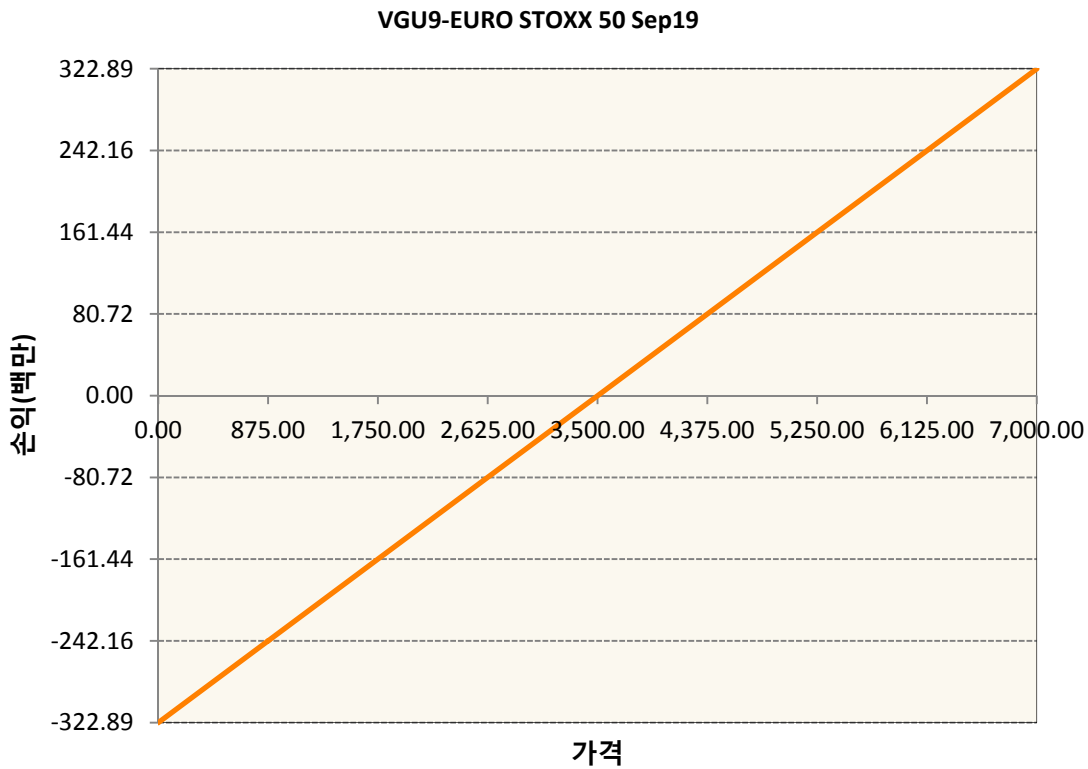
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	323	0	323	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU9	EURO STOXX 50 Sep19	26
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

18

공시일	2019-07-17
기준일	2019-07-16

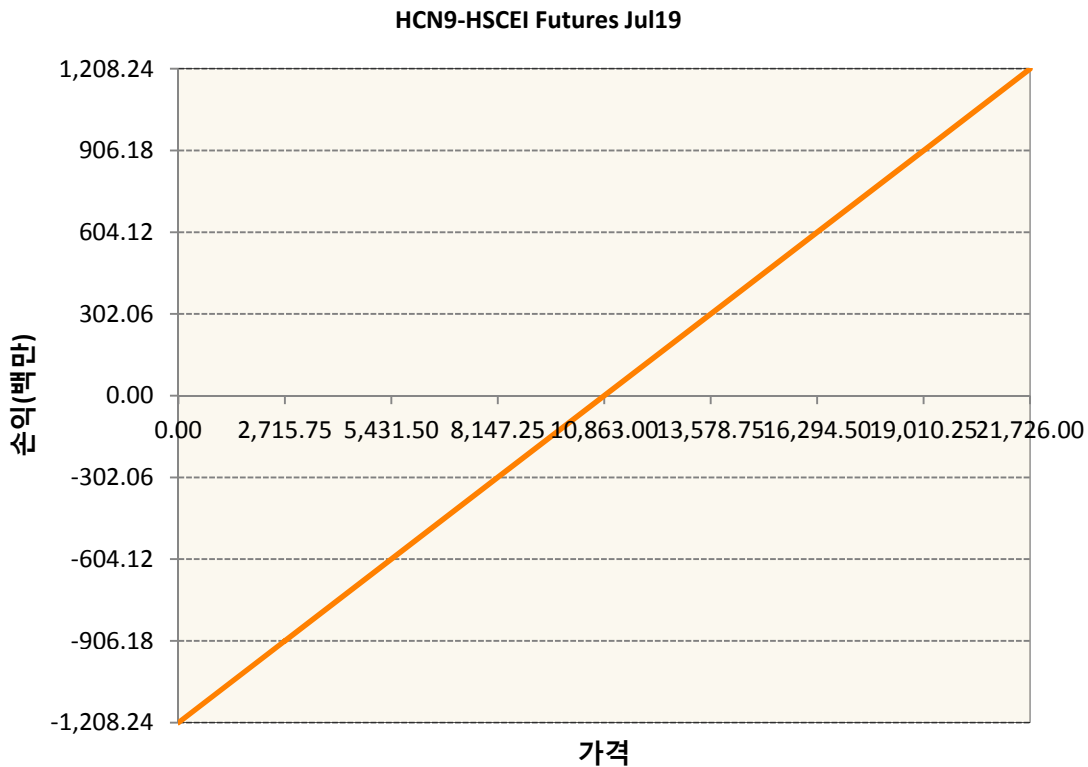
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,208	0	1,208	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

97

공시일	2019-07-17
기준일	2019-07-16

커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

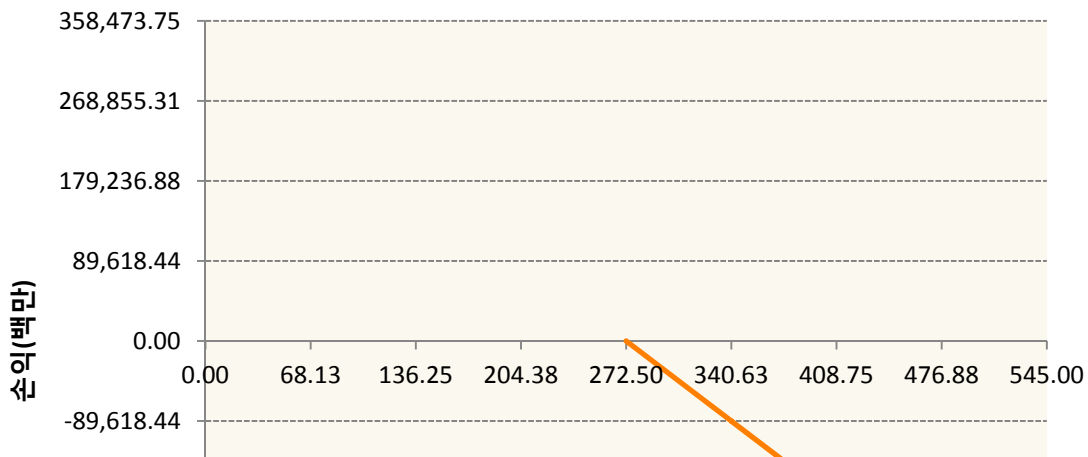
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	3,304	0	3,304	장내
누계	유가증권	옵션	0	597,914	-597,914	장내

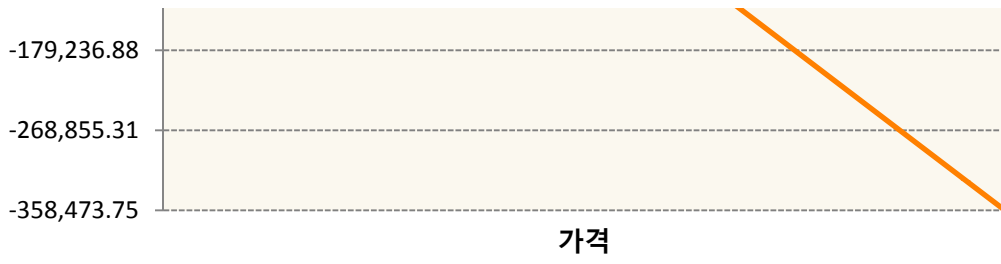
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P82709-2019-08 콜270

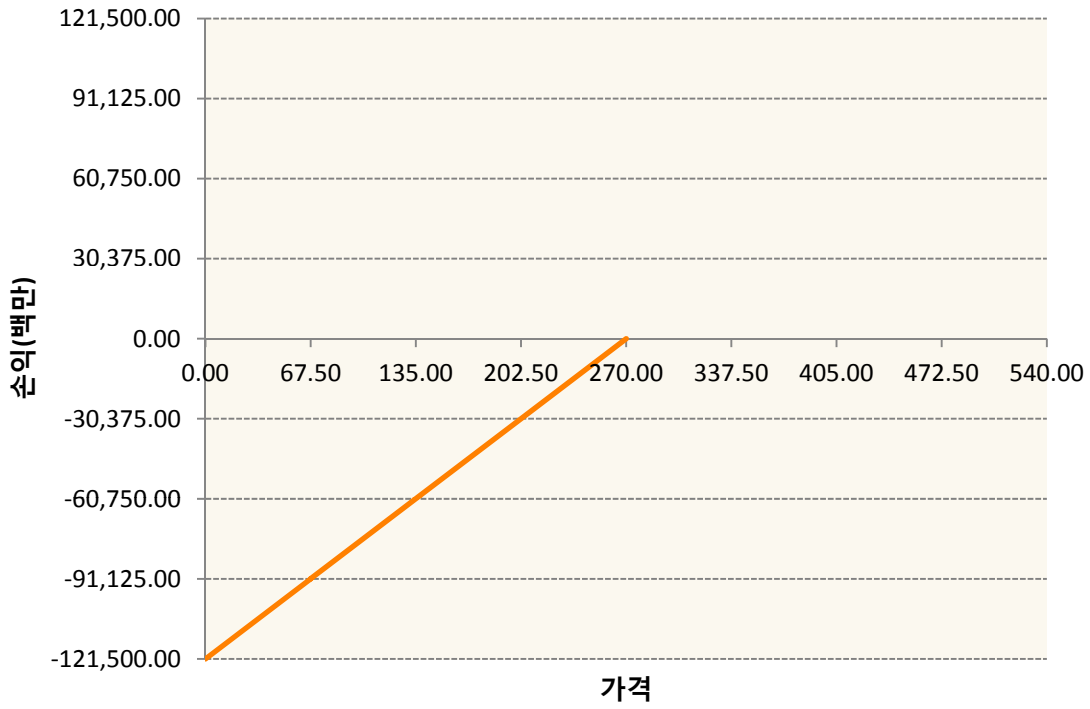


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

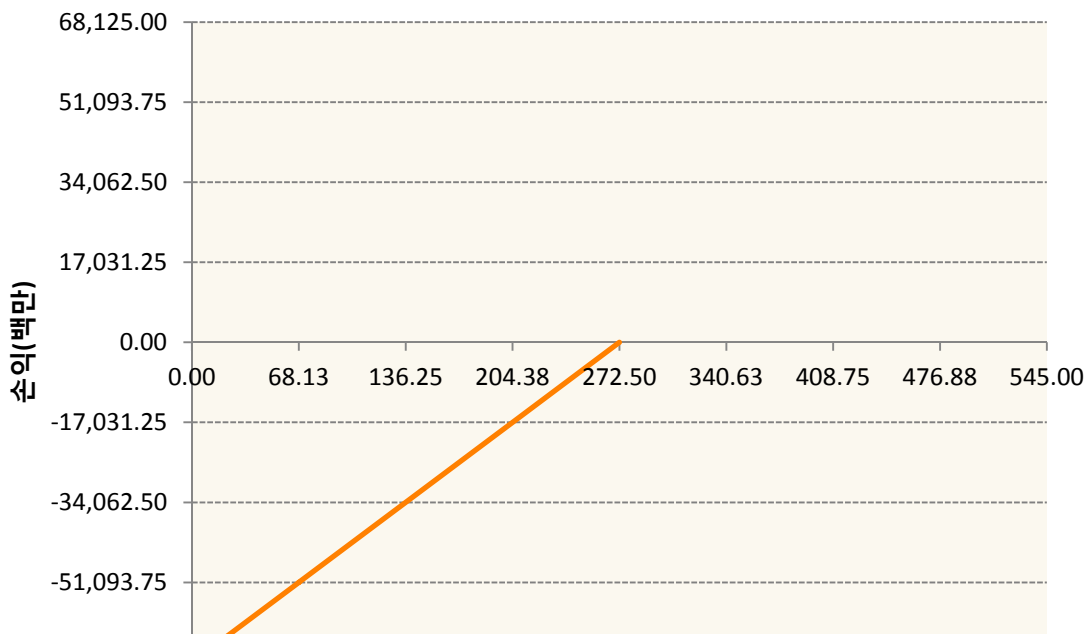




KR4301P82707-2019-08 풋270



KR4301P82723-2019-08 풋272.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P82709 2019-08 콜270							3,365
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,568	1,531	1,487	1,436	1,380	1,320	1,255
-5.33%	1,395	1,323	1,247	1,167	1,084	999	913
-2.67%	996	897	798	699	599	498	398
0%	299	200	100	0	-101	-202	-303
2.67%	-683	-757	-836	-919	-1,005	-1,093	-1,183
5.33%	-1,865	-1,908	-1,958	-2,014	-2,077	-2,144	-2,215
8.00%	-3,152	-3,171	-3,197	-3,230	-3,269	-3,314	-3,365
KR4201P82725 2019-08 콜272.5							22,978
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,549	9,349	9,098	8,799	8,458	8,080	7,668
-5.33%	8,664	8,232	7,758	7,250	6,714	6,155	5,577
-2.67%	6,434	5,772	5,099	4,417	3,728	3,033	2,334
0%	2,208	1,473	737	0	-737	-1,475	-2,212
2.67%	-4,138	-4,747	-5,380	-6,030	-6,695	-7,371	-8,056
5.33%	-12,139	-12,523	-12,958	-13,435	-13,947	-14,489	-15,056
8.00%	-21,106	-21,295	-21,539	-21,833	-22,175	-22,558	-22,978
KR4301P82707 2019-08 풋270							7,353
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,282	-7,284	-7,290	-7,298	-7,311	-7,329	-7,353
-5.33%	-4,045	-4,078	-4,120	-4,170	-4,227	-4,291	-4,361
-2.67%	-1,242	-1,353	-1,465	-1,580	-1,697	-1,815	-1,933
0%	331	224	113	0	-115	-232	-350
2.67%	753	720	677	626	568	502	430
5.33%	799	796	789	778	761	739	711
8.00%	801	801	801	799	797	792	785
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							4,452
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,430	-4,431	-4,432	-4,434	-4,438	-4,444	-4,452
-5.33%	-2,615	-2,625	-2,638	-2,656	-2,678	-2,703	-2,732
-2.67%	-932	-979	-1,031	-1,084	-1,140	-1,198	-1,257
0%	209	140	70	0	-70	-140	-211
2.67%	617	585	548	507	462	414	363

5.33%	680	675	667	655	639	620	597
8.00%	684	684	683	681	678	673	666

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

(단위:백만원)

38,888

공시일	2019-07-17
기준일	2019-07-16

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

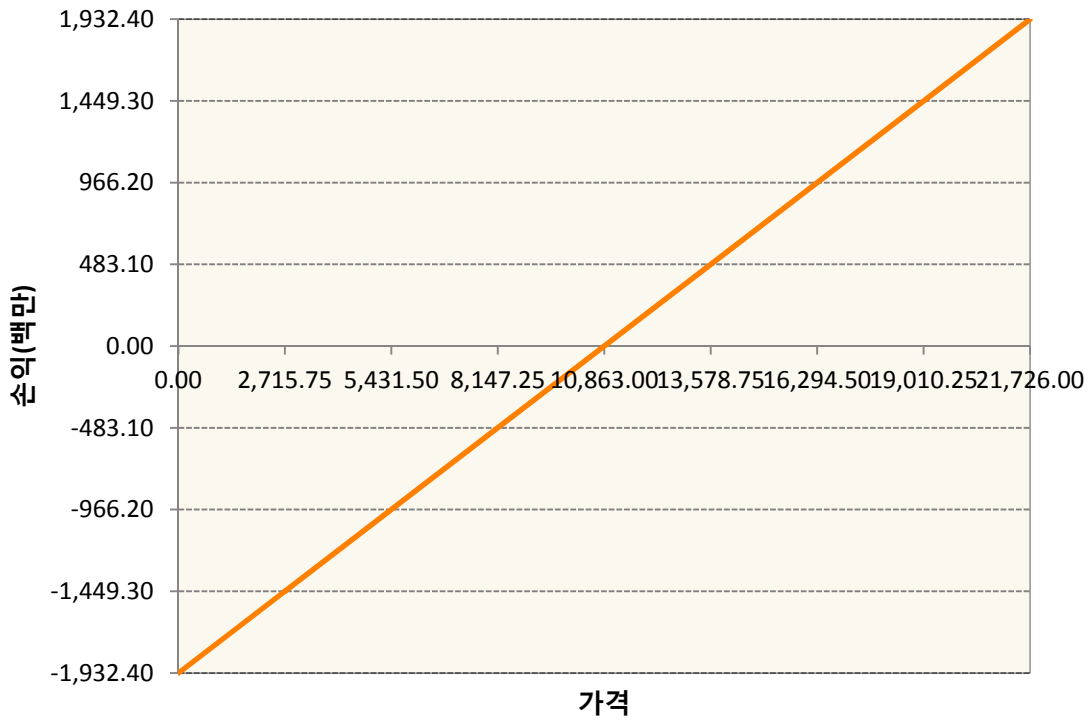
1. 계약금액

(단위:백만원)

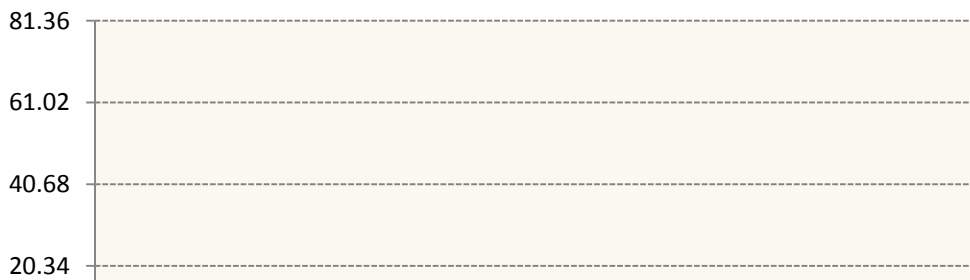
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,932	0	1,932	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,254	-5,254	장내
누계	통화	선도	151	3,164	-3,013	장외

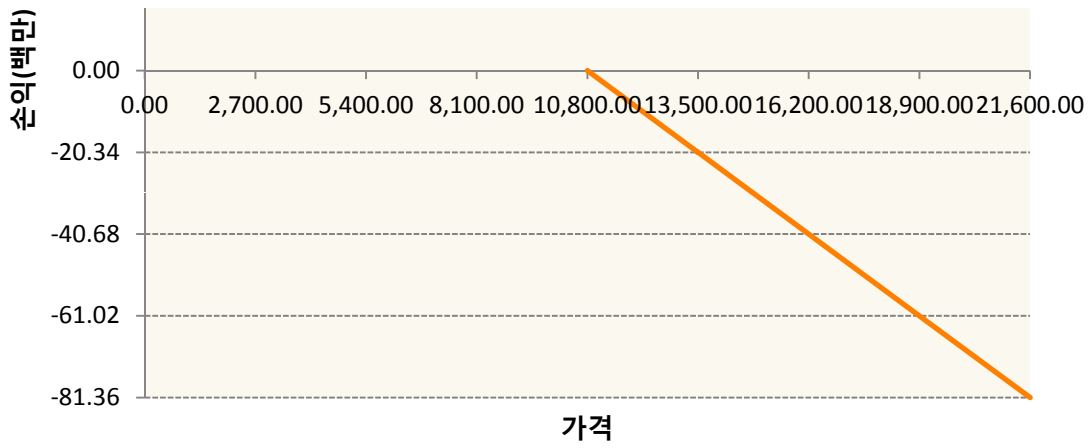
2. 만기시점의 손익구조

HCN9-HSCEI Futures Jul19

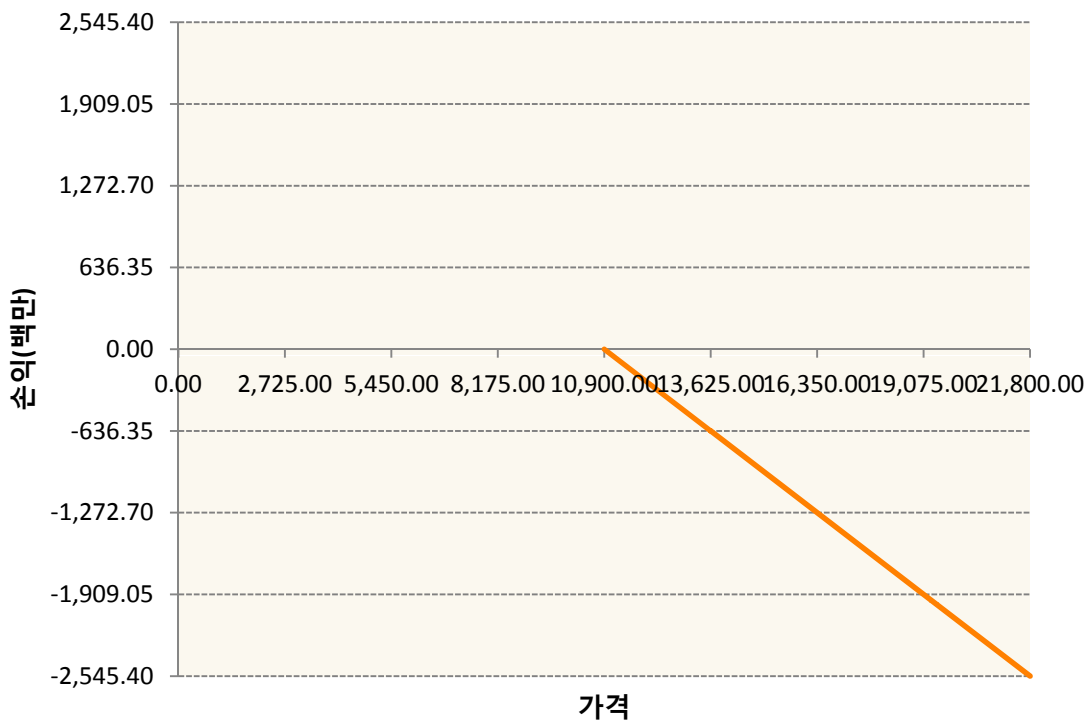


OHHIN9-C108-HSCEI

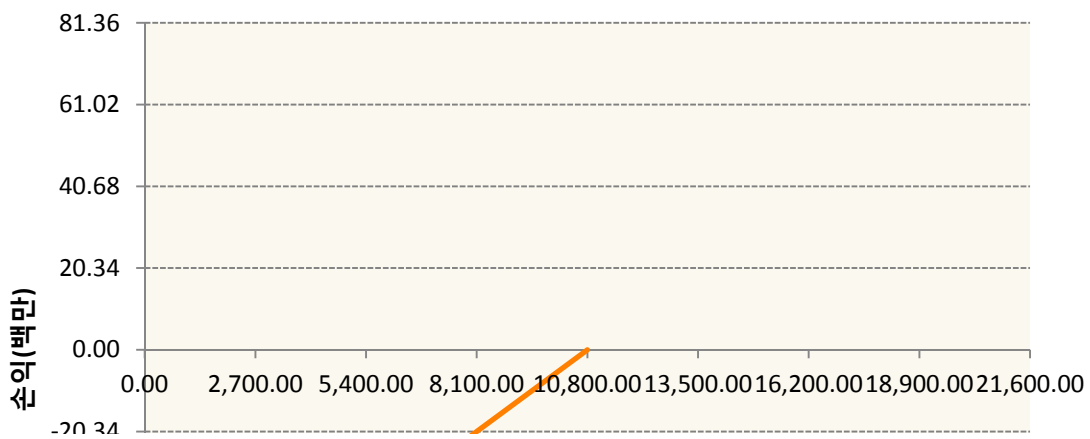


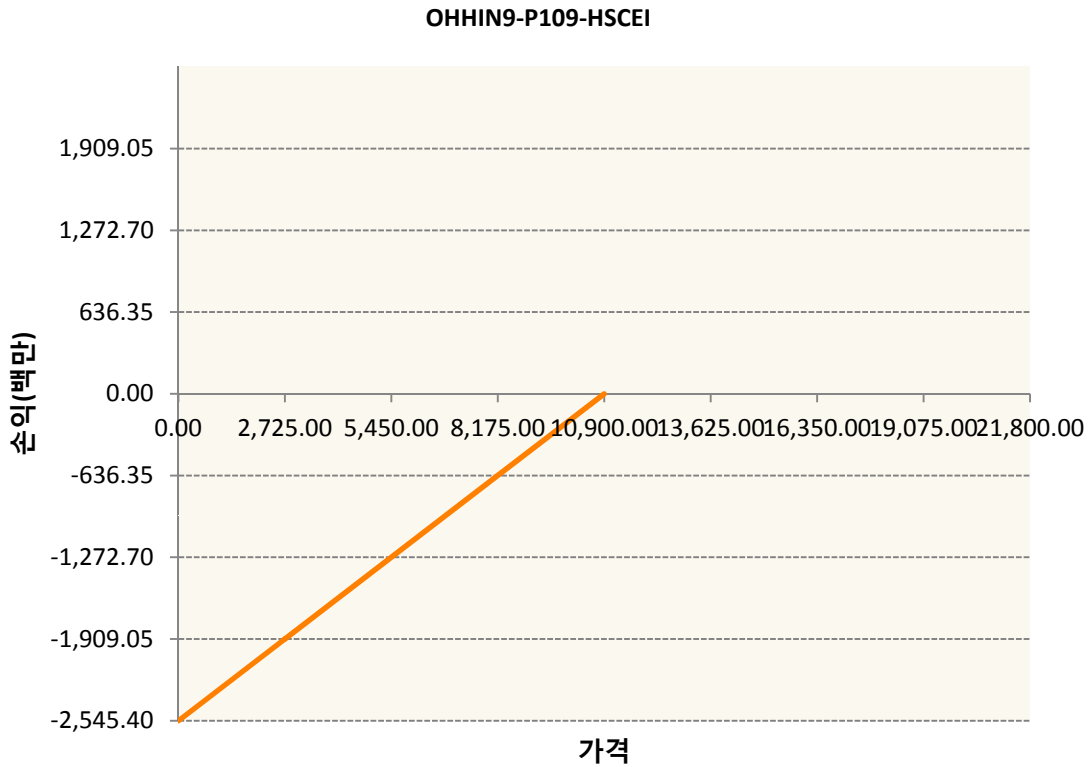
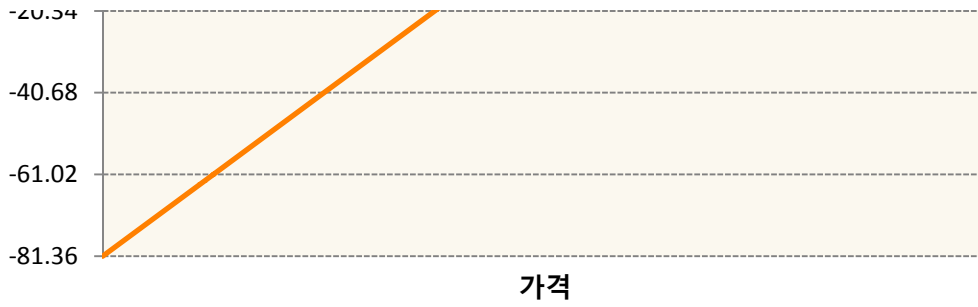


OHHIN9-C109-HSCEI



OHHIN9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E		253
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E		12
HCN9 HSCEI Futures Jul19		155
OHHIN9-C1(HSCEI		7
OHHIN9-C1(HSCEI		204
OHHIN9-P1(HSCEI		7
OHHIN9-P1(HSCEI		204

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		666

공시일	2019-07-17
기준일	2019-07-16

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

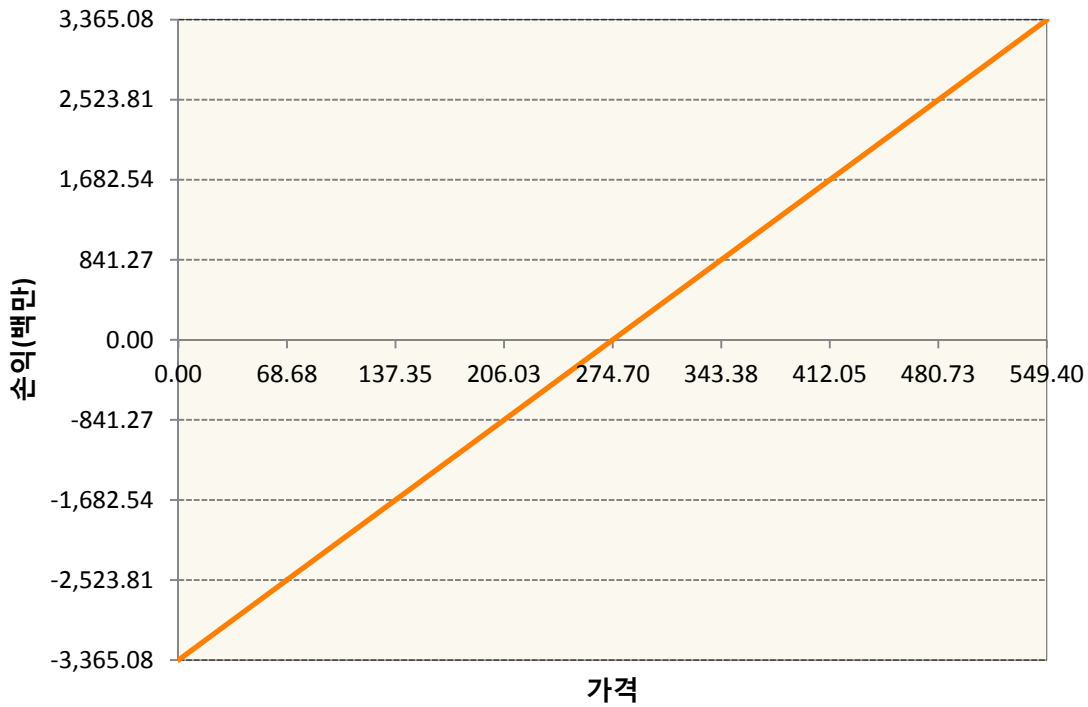
1. 계약금액

(단위:백만원)

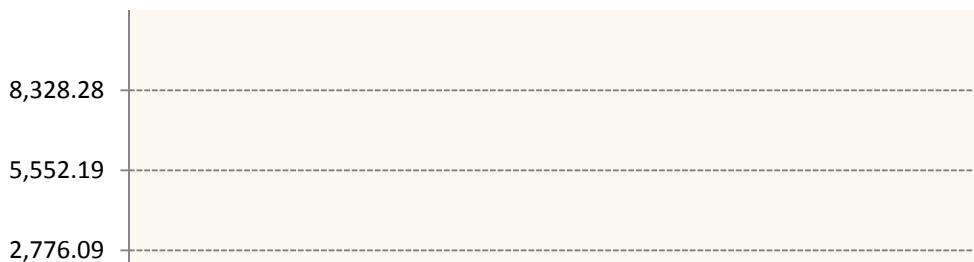
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	480	-480	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	470	0	470	장내
누계	유가증권	선물	3,365	0	3,365	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,519	-20,519	장내

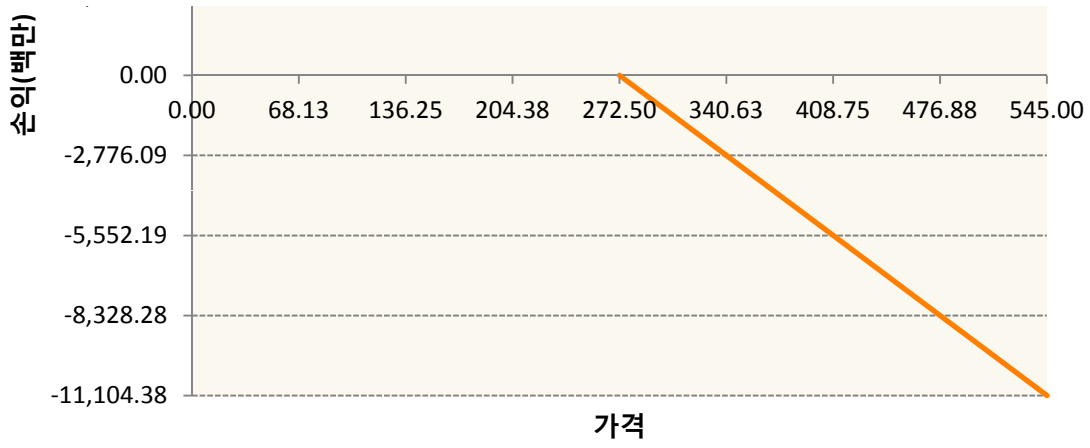
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

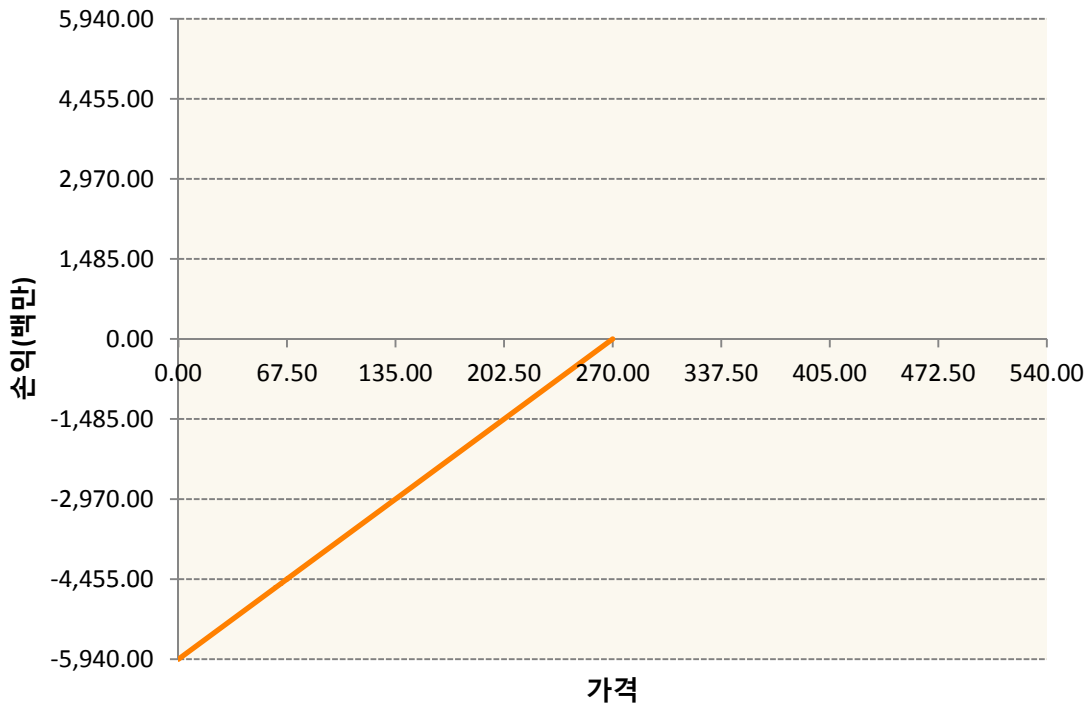


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

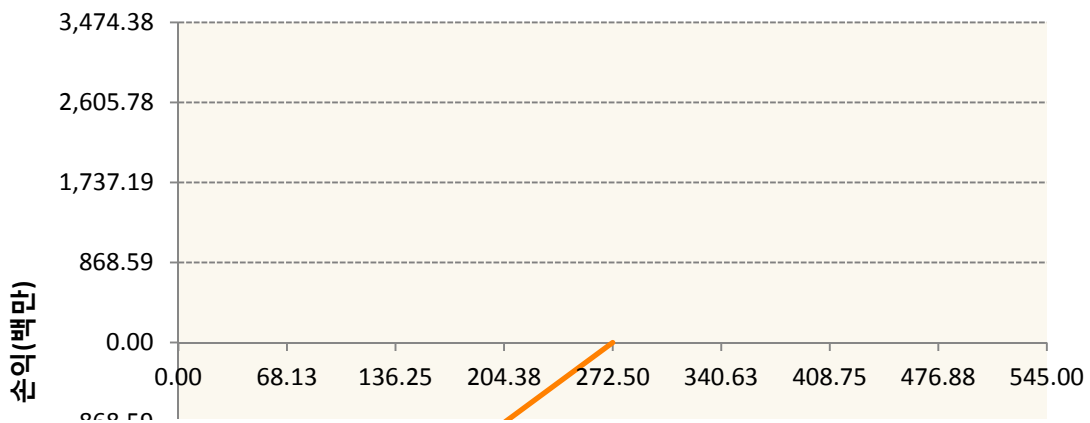




KR4301P82707-2019-08 풋270



KR4301P82723-2019-08 풋272.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,194
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	
-5.33%	-796	-796	-796	-796	-796	-796	-796	
-2.67%	-398	-398	-398	-398	-398	-398	-398	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	398	398	398	398	398	398	398	
5.33%	796	796	796	796	796	796	796	
8.00%	1,194	1,194	1,194	1,194	1,194	1,194	1,194	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						604
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-604	-604	-604	-604	-604	-604	-604	
-5.33%	-403	-403	-403	-403	-403	-403	-403	
-2.67%	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-201	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	201	201	201	201	201	201	201	
5.33%	403	403	403	403	403	403	403	
8.00%	604	604	604	604	604	604	604	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						269
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-269	-269	-269	-269	-269	-269	-269	
-5.33%	-179	-179	-179	-179	-179	-179	-179	
-2.67%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	90	90	90	90	90	90	90	
5.33%	179	179	179	179	179	179	179	
8.00%	269	269	269	269	269	269	269	
KR4201P82725		2019-08 콜272.5						712
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	296	290	282	273	262	250	238
-5.33%	268	255	240	225	208	191	173
-2.67%	199	179	158	137	115	94	72
0%	68	46	23	0	-23	-46	-69
2.67%	-128	-147	-167	-187	-207	-228	-250
5.33%	-376	-388	-401	-416	-432	-449	-466
8.00%	-654	-660	-667	-676	-687	-699	-712
KR4301P82707 2019-08 풋270							359
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-356	-356	-356	-357	-357	-358	-359
-5.33%	-198	-199	-201	-204	-207	-210	-213
-2.67%	-61	-66	-72	-77	-83	-89	-95
0%	16	11	6	0	-6	-11	-17
2.67%	37	35	33	31	28	25	21
5.33%	39	39	39	38	37	36	35
8.00%	39	39	39	39	39	39	38
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							227
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-226	-226	-226	-226	-226	-227	-227
-5.33%	-133	-134	-135	-135	-137	-138	-139
-2.67%	-48	-50	-53	-55	-58	-61	-64
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	31	30	28	26	24	21	19
5.33%	35	34	34	33	33	32	30
8.00%	35	35	35	35	35	34	34

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

(단위:백만원)

3,356

공시일	2019-07-17
기준일	2019-07-16

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

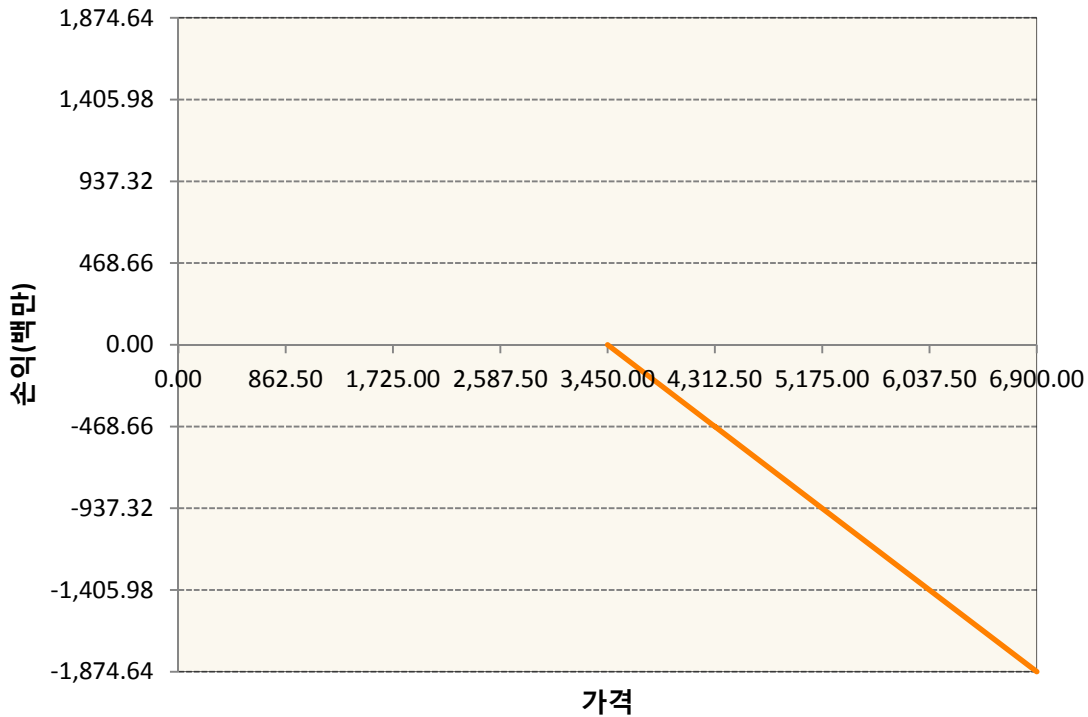
1. 계약금액

(단위:백만원)

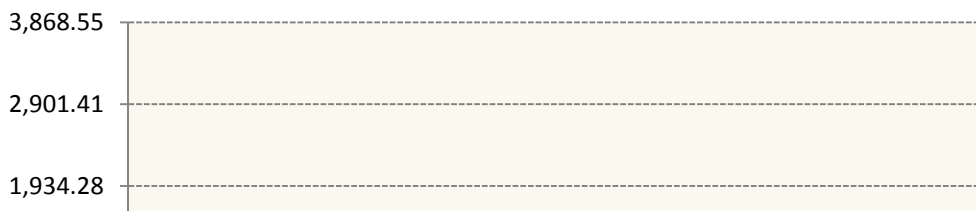
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,777	0	2,777	
누계	유가증권	스왑	46,905	0	46,905	장외
누계	유가증권	옵션	0	11,486	-11,486	장내
누계	통화	선도	5,301	22,530	-17,229	장외

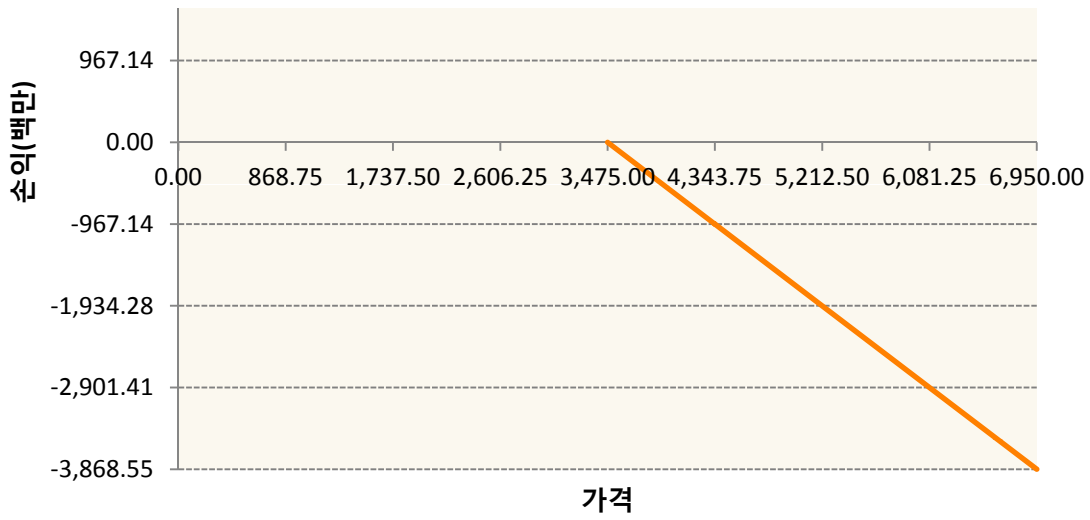
2. 만기시점의 손익구조

OESXN9-C3450-EURO STOXX 50

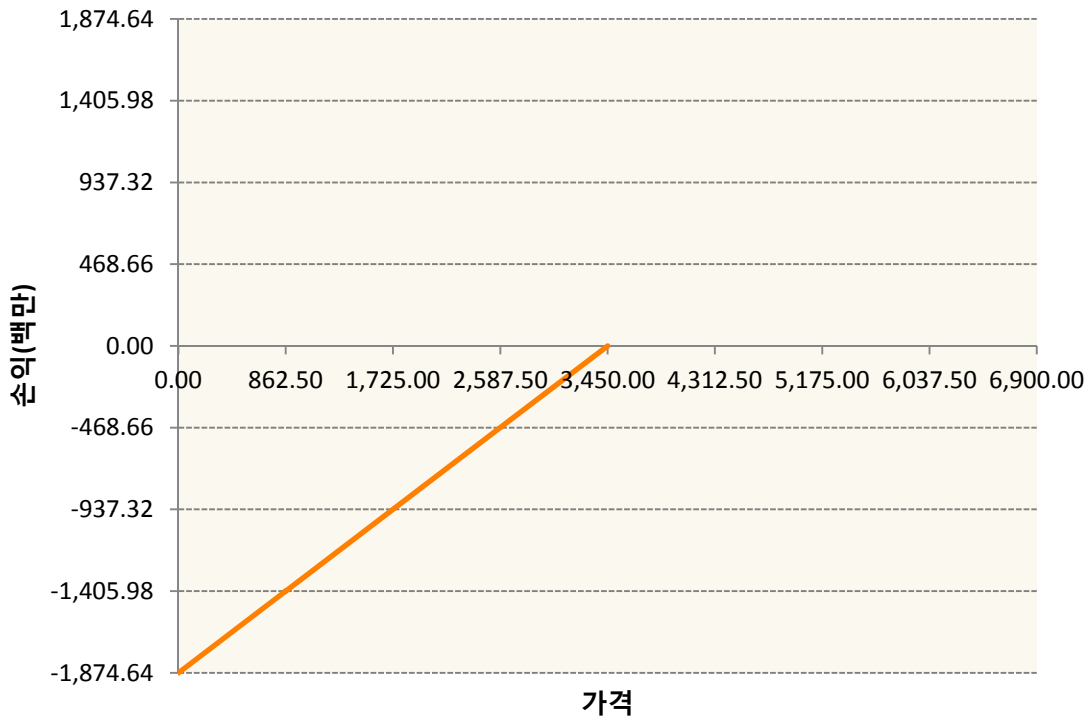


OESXN9-C3475-EURO STOXX 50

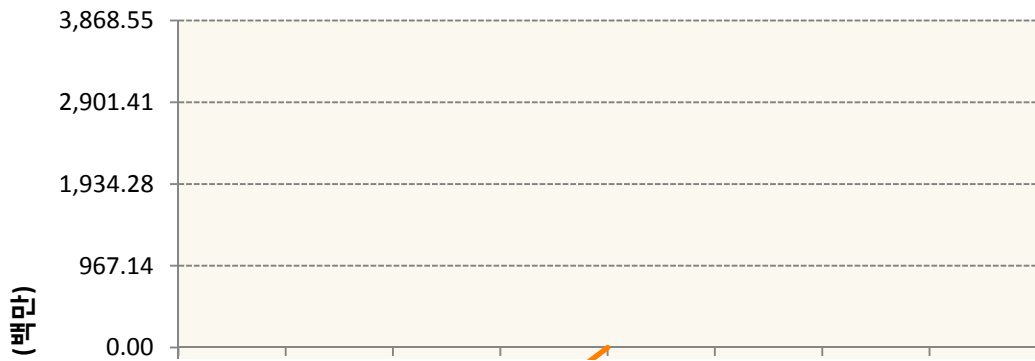


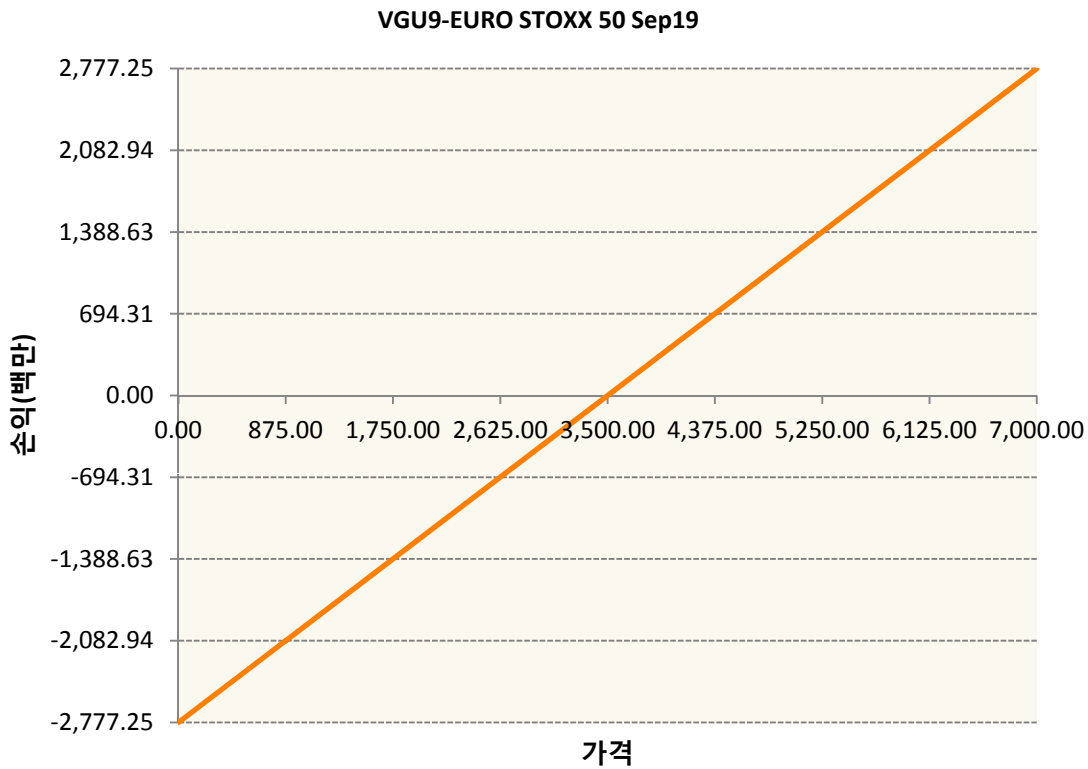
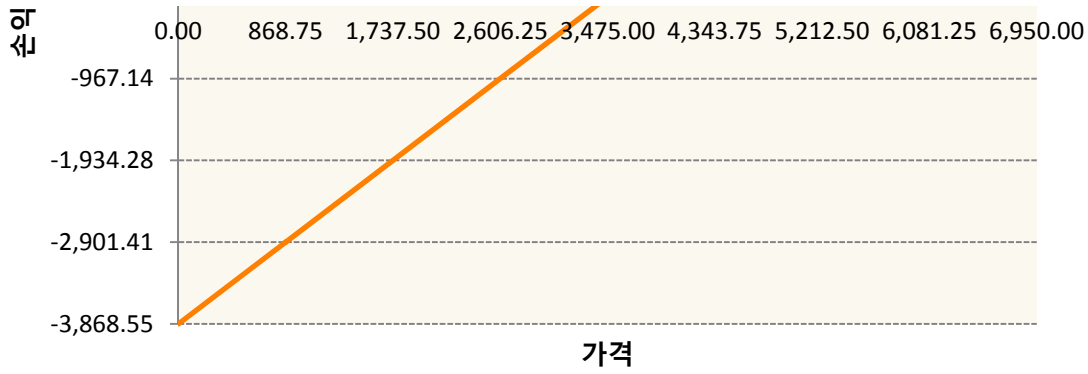


OESXN9-P3450-EURO STOXX 50



OESXN9-P3475-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	86
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	424
FX21019M0< KRW/EUR 27-09-19E	1,060
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	318
FX21019N01 EUR/KRW 23-08-19E	424
OESXN9-C3< EURO STOXX 50	150
OESXN9-C3< EURO STOXX 50	309
OESXN9-P3< EURO STOXX 50	150
OESXN9-P3< EURO STOXX 50	309
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	222

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

(단위:백만원)

1,913

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

(단위:백만원)

1,021

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

(단위:백만원)

87

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

(단위:백만원)

132

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-07-17
기준일	2019-07-16

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

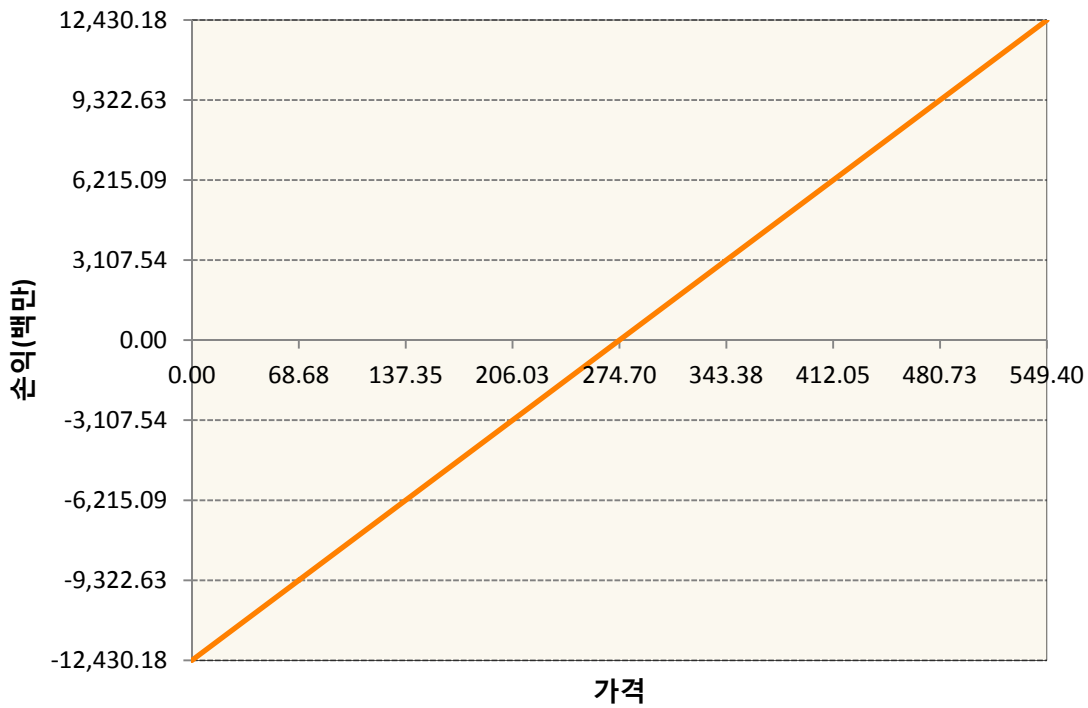
1. 계약금액

(단위:백만원)

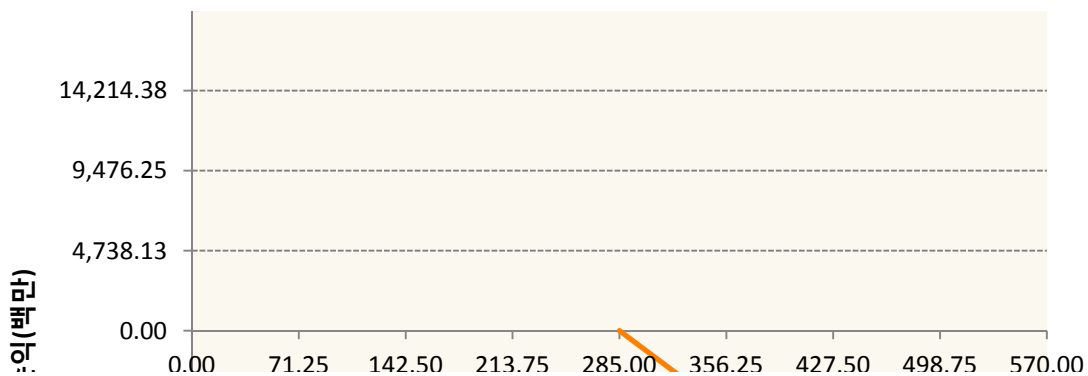
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,430	0	12,430	장내
누계	유가증권	옵션	1,698	22,259	-20,561	장내

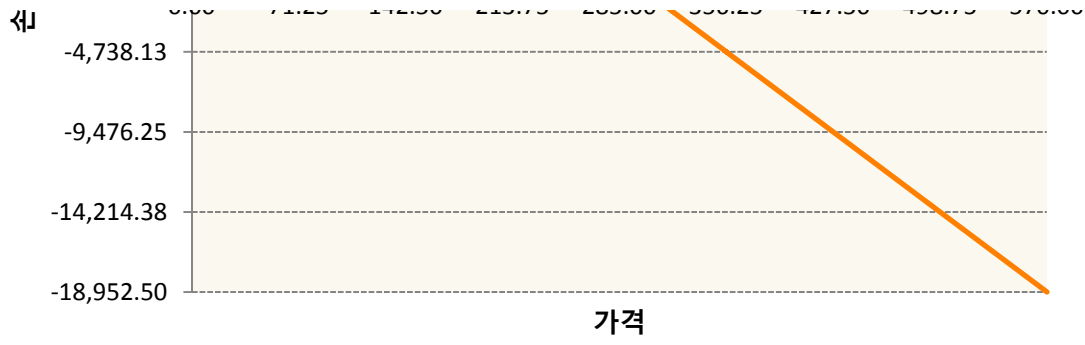
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

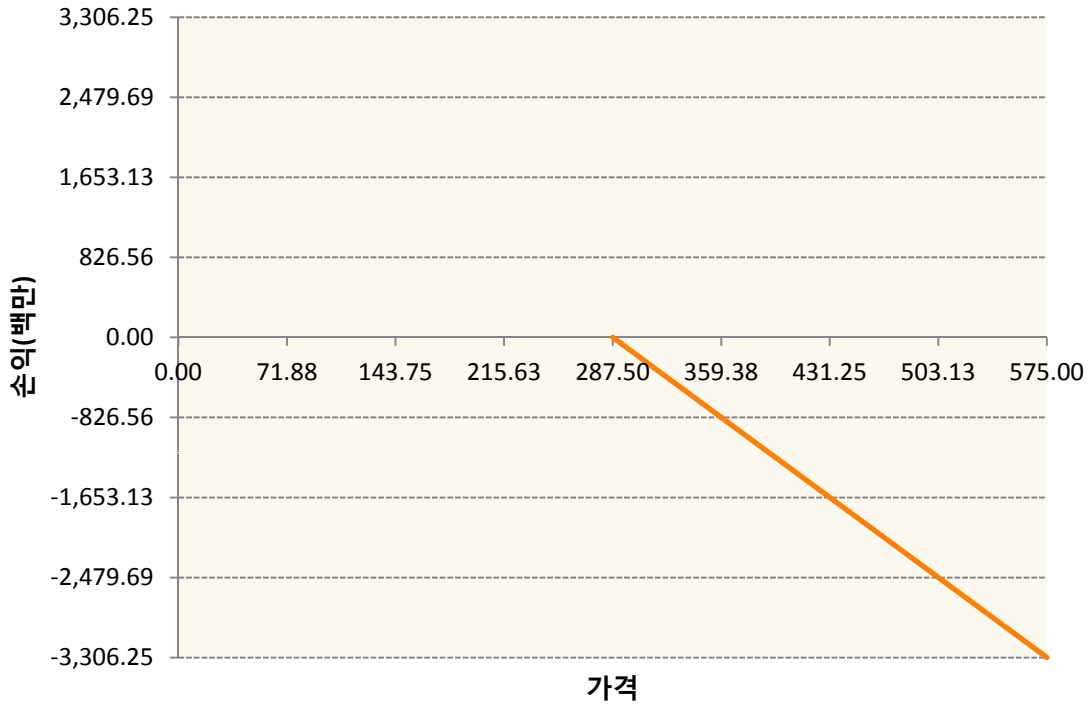


KR4201P82857-2019-08 콜285

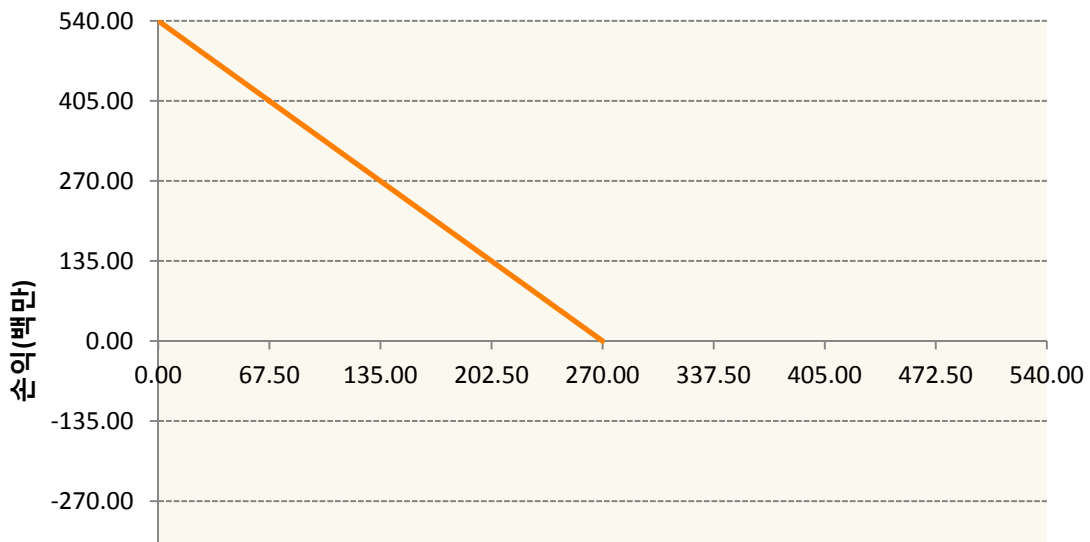


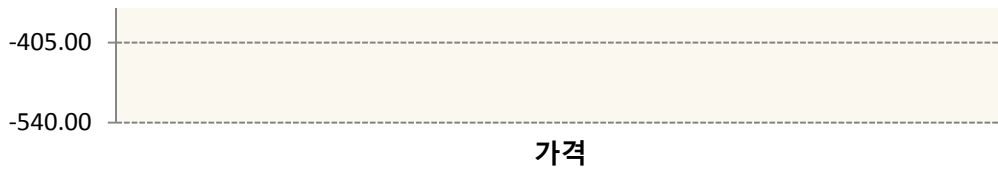


KR4201P82873-2019-08 콜287.5

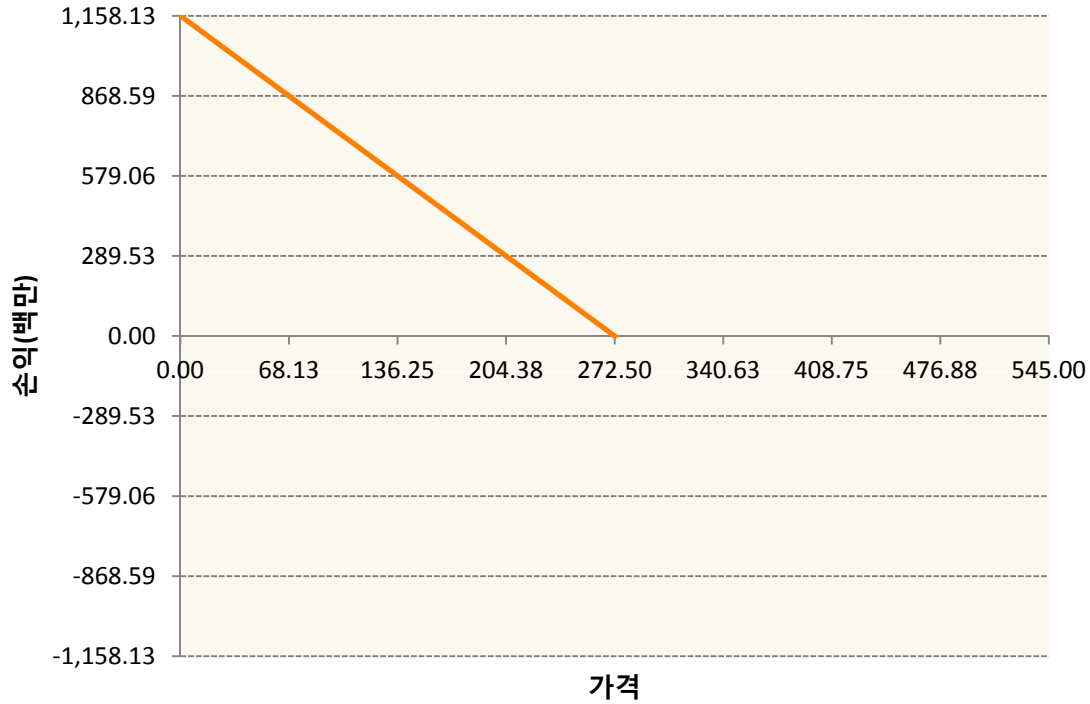


KR4301P82707-2019-08 풋270





KR4301P82723-2019-08 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						992
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-992	-992	-992	-992	-992	-992	-992	
-5.33%	-661	-661	-661	-661	-661	-661	-661	
-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%	661	661	661	661	661	661	661	
8.00%	992	992	992	992	992	992	992	
KR4201P82857		2019-08 콜285						843
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	181	179	177	172	166	159	149	
-5.33%	176	170	162	151	138	123	107	
-2.67%	153	138	120	100	78	54	29	

0%	87	60	31	0	-32	-64	-97
2.67%	-56	-93	-131	-169	-207	-245	-283
5.33%	-302	-340	-378	-416	-455	-493	-532
8.00%	-646	-676	-707	-740	-773	-808	-843
KR4201P82873 2019-08 콜287.5							134
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	25	25	24	24	23	22	21
-5.33%	24	24	22	21	19	17	15
-2.67%	22	20	17	14	11	7	3
0%	13	9	5	0	-5	-10	-16
2.67%	-6	-12	-19	-25	-31	-38	-44
5.33%	-43	-49	-56	-63	-70	-77	-84
8.00%	-97	-102	-108	-115	-121	-127	-134
KR4301P82707 2019-08 풋270							33
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	32	32	32	32	32	33	33
-5.33%	18	18	18	19	19	19	19
-2.67%	6	6	7	7	8	8	9
0%	-1	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-2	-2
5.33%	-4	-4	-4	-3	-3	-3	-3
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-3
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							76
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	75	75	75	75	75	76	76
-5.33%	44	45	45	45	46	46	46
-2.67%	16	17	18	18	19	20	21
0%	-4	-2	-1	0	1	2	4
2.67%	-10	-10	-9	-9	-8	-7	-6
5.33%	-12	-11	-11	-11	-11	-11	-10
8.00%	-12	-12	-12	-12	-12	-11	-11

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

(단위:백만원)

1,702

공시일	2019-07-17
기준일	2019-07-16

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	353	0	353	
누계	유가증권	수익증권	31,928	0	31,928	

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	2019-07-17
기준일	2019-07-16

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	745	-745	
누계	유가증권	수익증권	53,546	0	53,546	

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	2019-07-17
기준일	2019-07-16

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	14,131	0	14,131	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	363,992	0	363,992	
누계	통화	선도	0	442,801	-442,801	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		471
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		471
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		377
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		791
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		565
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		3,015
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		2,261
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E		283
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E		283
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E		791
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E		631
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E		471
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		1,884
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		1,884
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E		697
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E		697
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E		1,300
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E		2,555
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		3,109
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		2,110
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		1,696
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,073
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		132
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		565
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		3,015
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		3,297

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

(단위:백만원)

11,683

공시일	2019-07-17
기준일	2019-07-16

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

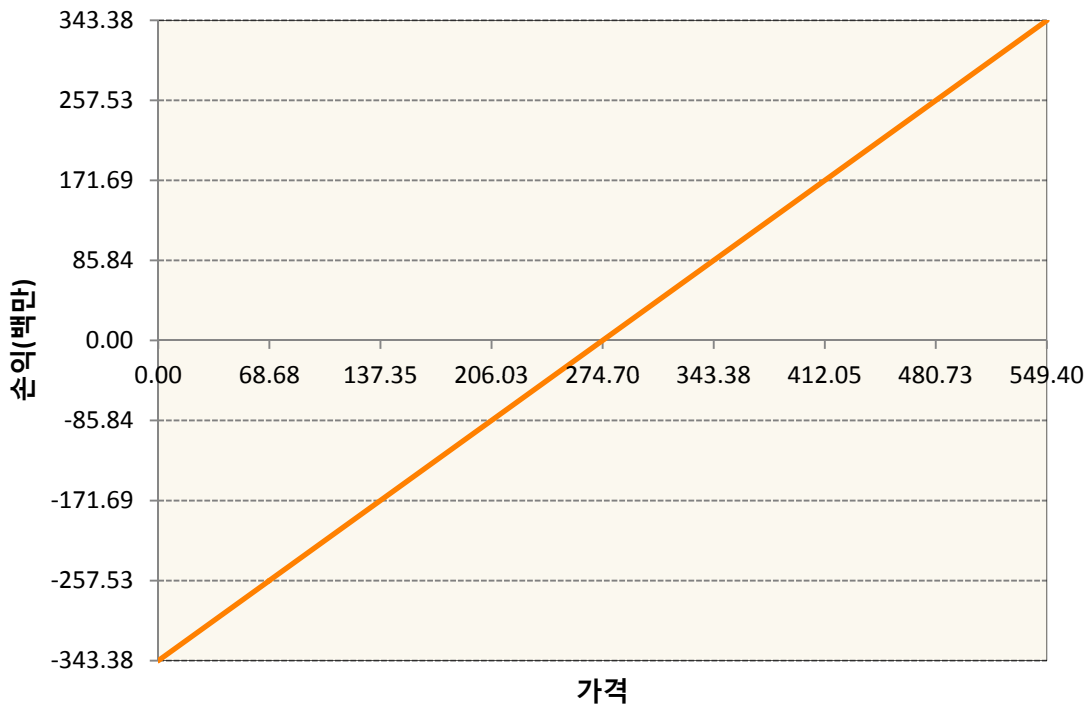
1. 계약금액

(단위:백만원)

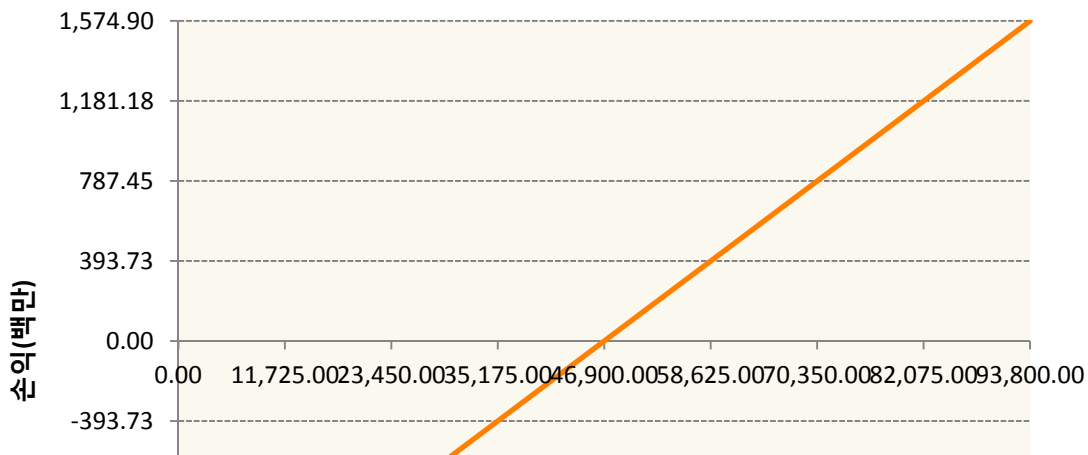
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,918	0	1,918	장내

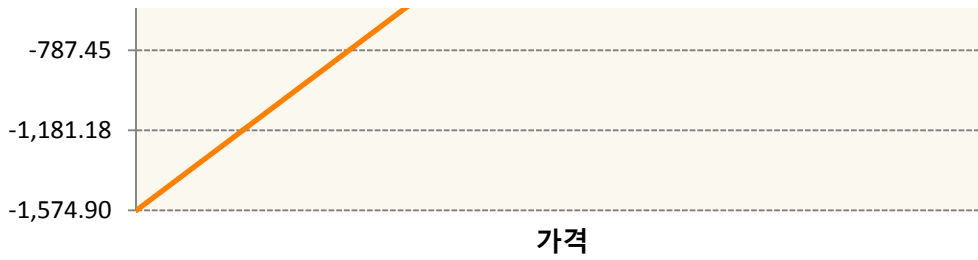
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P80001-2019-08 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	
KR4111P80001		2019-08 삼성전자개별선물						126
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126	
-5.33%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84	
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	42	42	42	42	42	42	42	
5.33%	84	84	84	84	84	84	84	
8.00%	126	126	126	126	126	126	126	

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

175

공시일	2019-07-17
기준일	2019-07-16

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

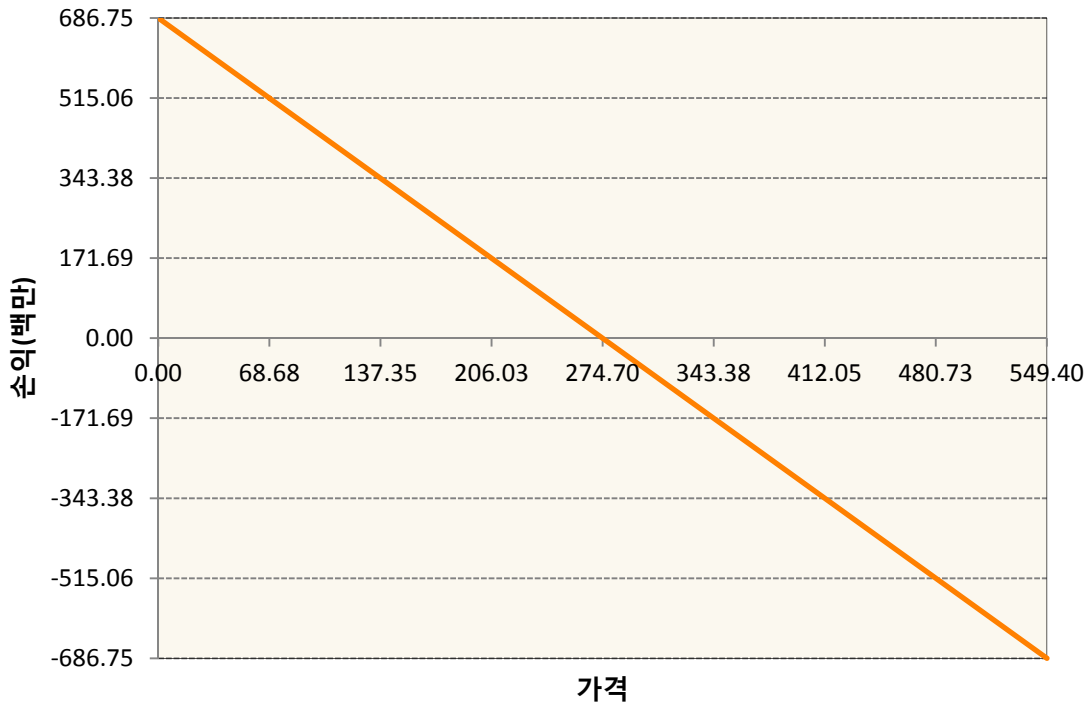
1. 계약금액

(단위:백만원)

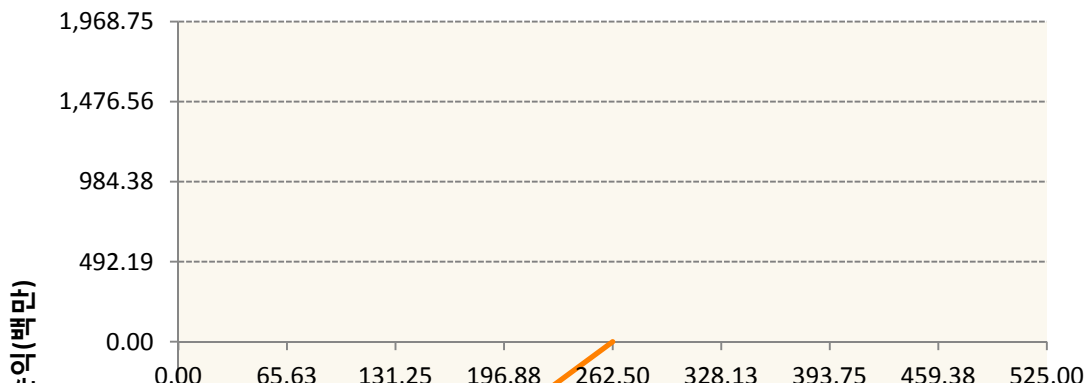
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	687	-687	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,625	-3,625	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

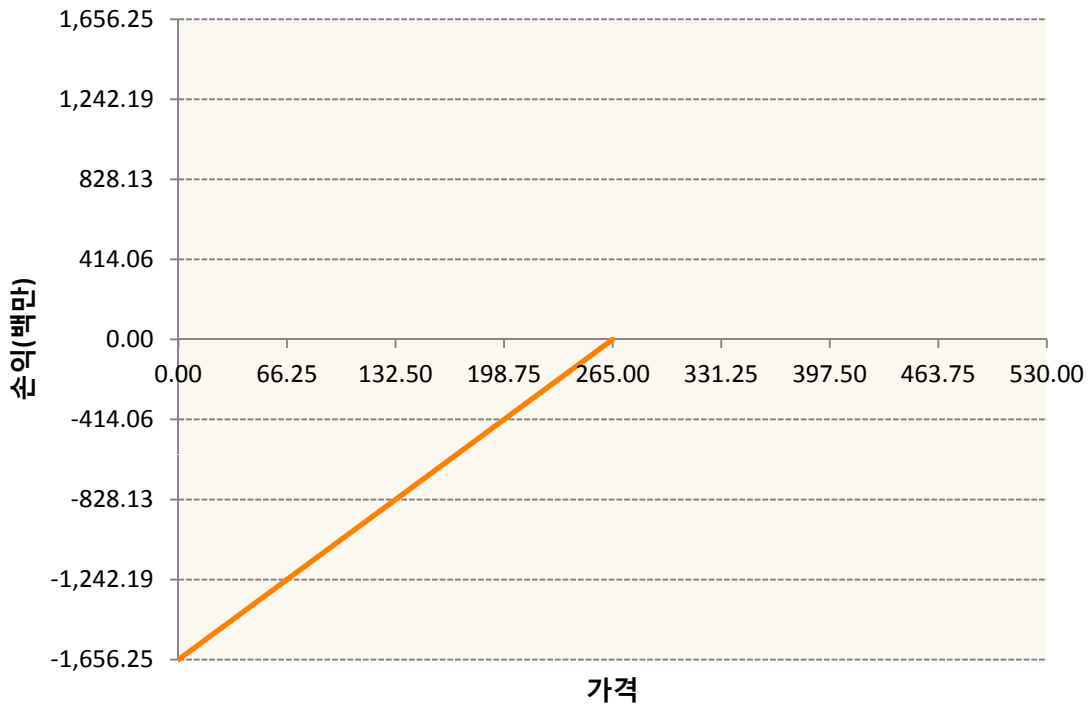


KR4301P82624-2019-08 풋262.5





KR4301P82657-2019-08 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	
KR4301P82624		2019-08 풋262.5						82
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-77	-77	-78	-79	-80	-81	-82
-5.33%	-30	-32	-34	-36	-37	-39	-41
-2.67%	-5	-6	-8	-10	-12	-13	-15
0%	2	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	2	2	2	2	2	2	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

KR4301P82657

2019-08 풋265

80

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-77	-78	-78	-78	-79	-79	-80
-5.33%	-35	-36	-38	-39	-40	-42	-43
-2.67%	-7	-9	-10	-12	-14	-16	-17
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	4	4	4	3	3	3	2
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)

163

공시일	2019-07-17
기준일	2019-07-16

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

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	18,335	0	18,335	
누계	통화	선도	0	18,253	-18,253	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		141
FX21019M05 KRW/USD 24-07-19E		179
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		980
FX21019N01 KRW/USD 12-08-19E		160

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

(단위:백만원)

482

공시일	2019-07-17
기준일	2019-07-16

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	50	-50	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019N01 KRW/EUR 25-10-19E

4

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

(단위:백만원)

2

공시일	2019-07-17
기준일	2019-07-16

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

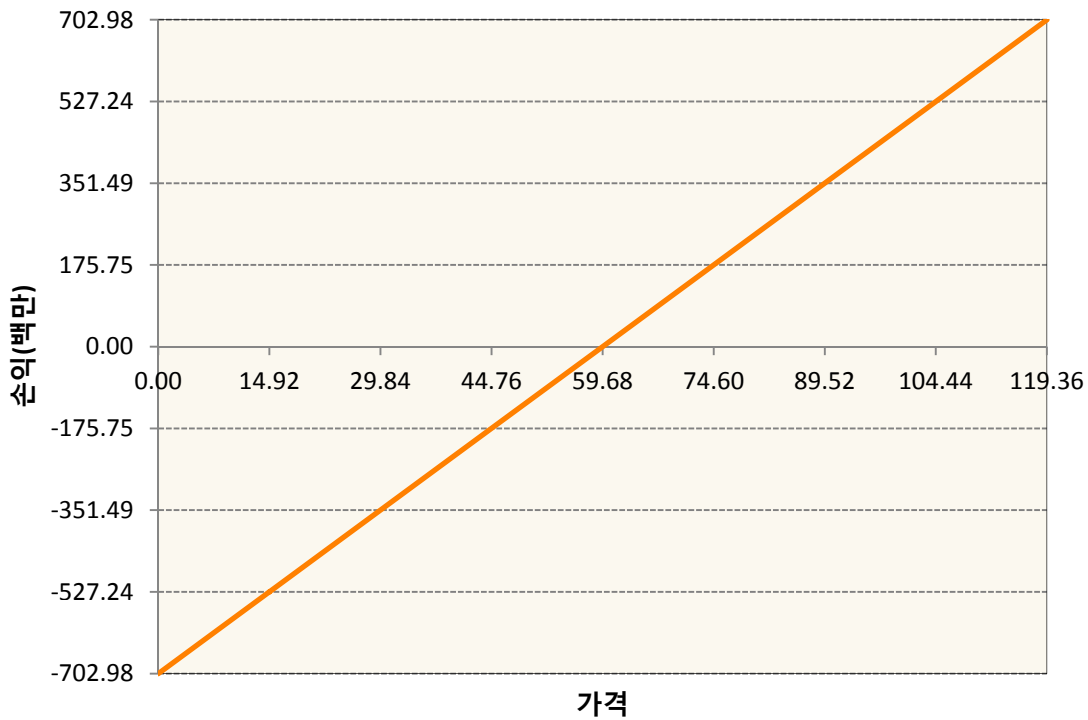
1. 계약금액

(단위:백만원)

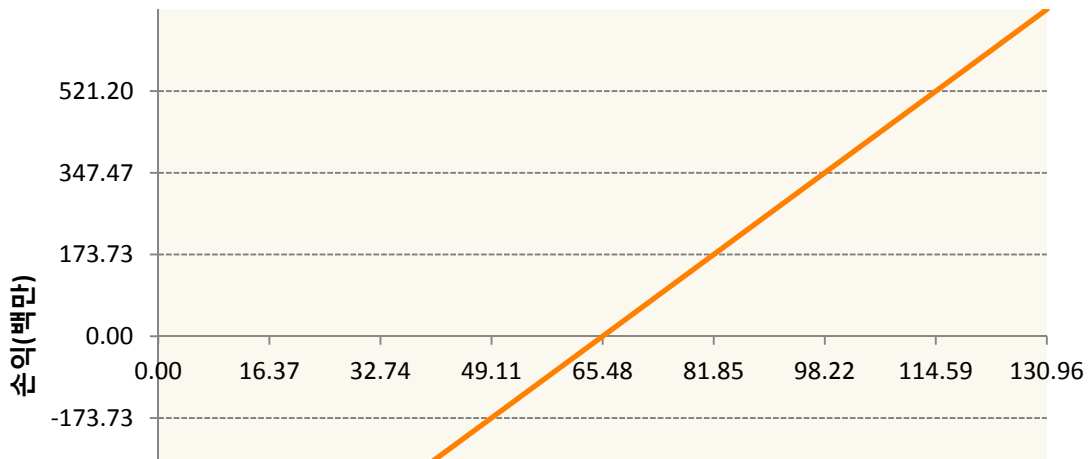
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,749	118	2,631	

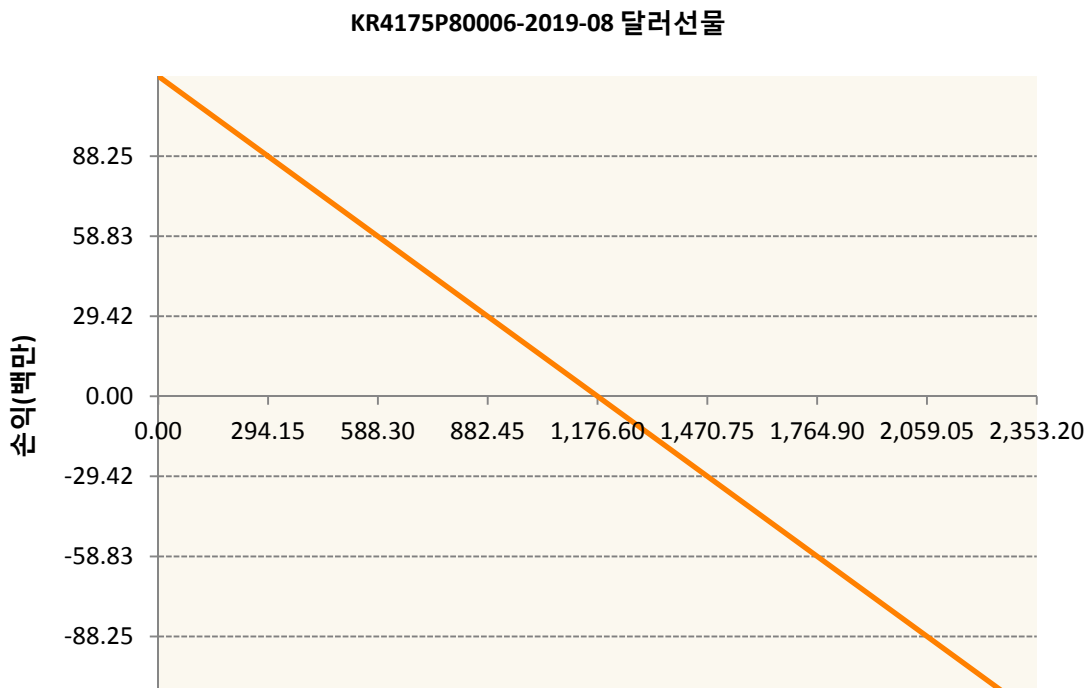
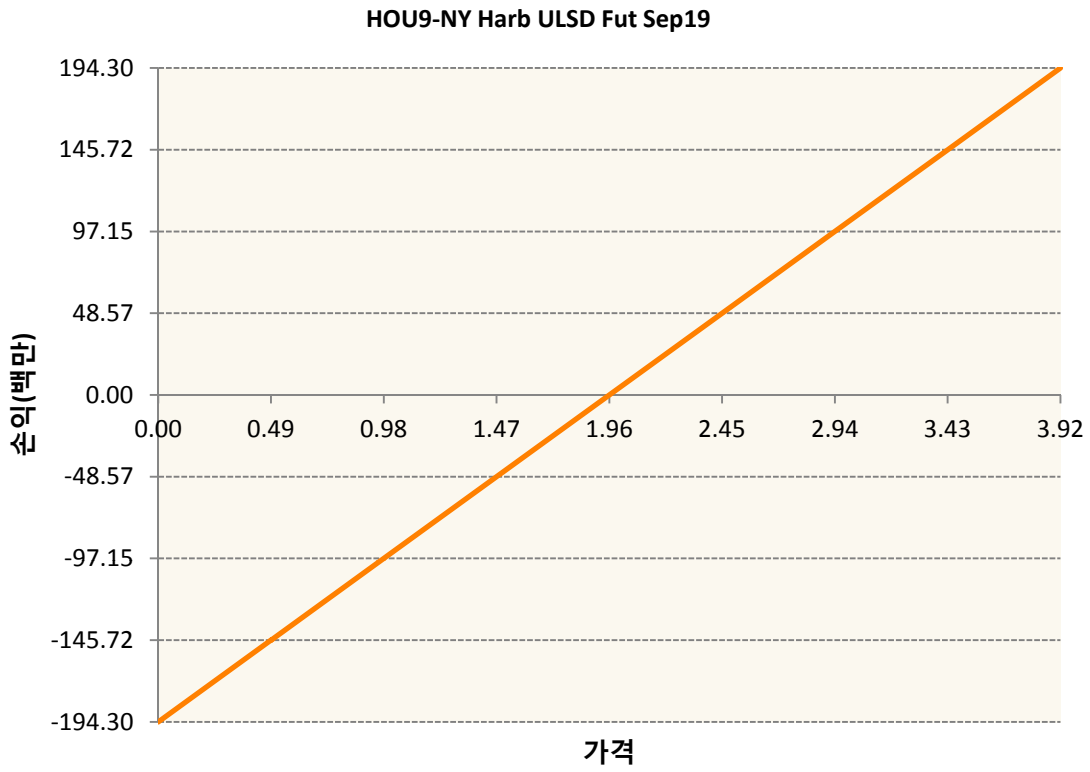
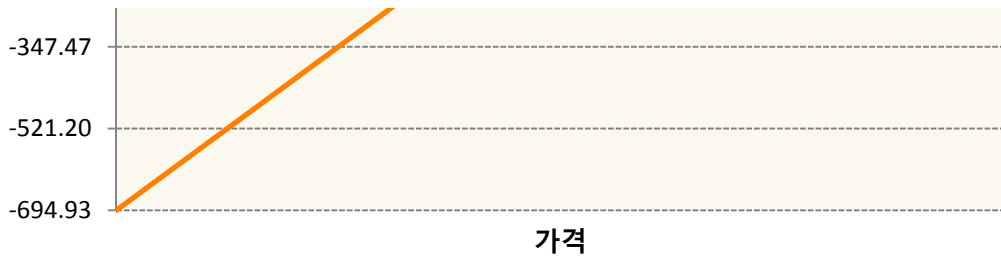
2. 만기시점의 손익구조

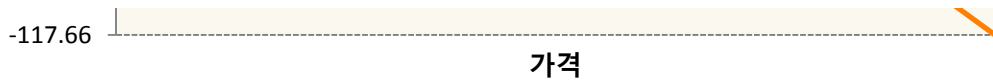
CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19



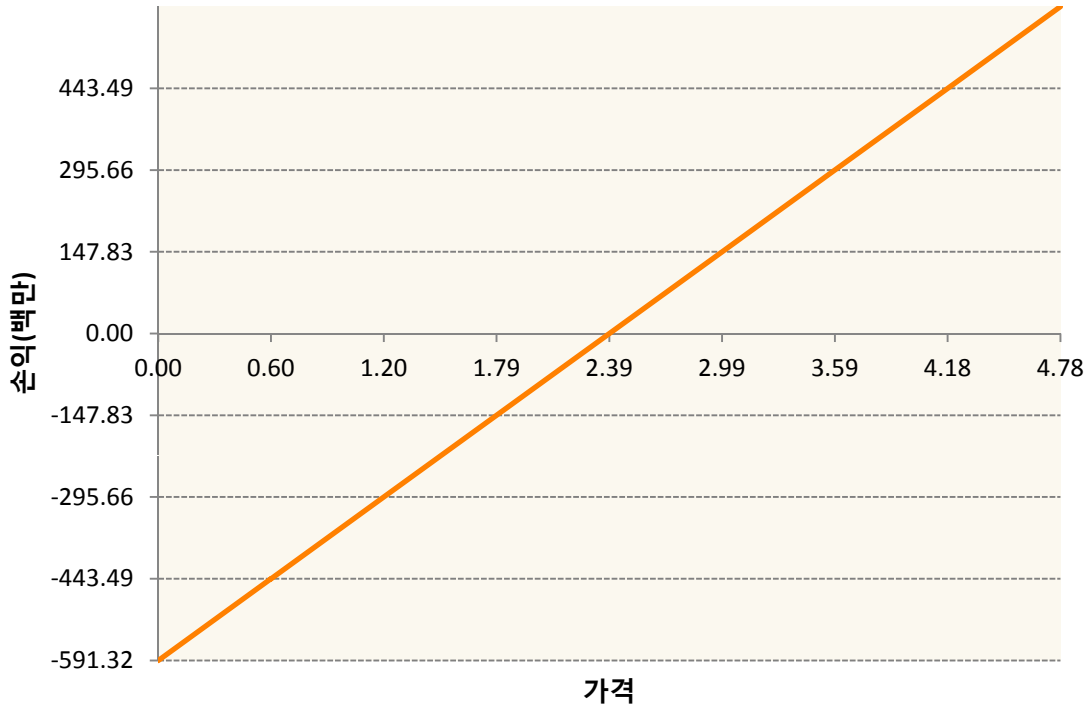
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19



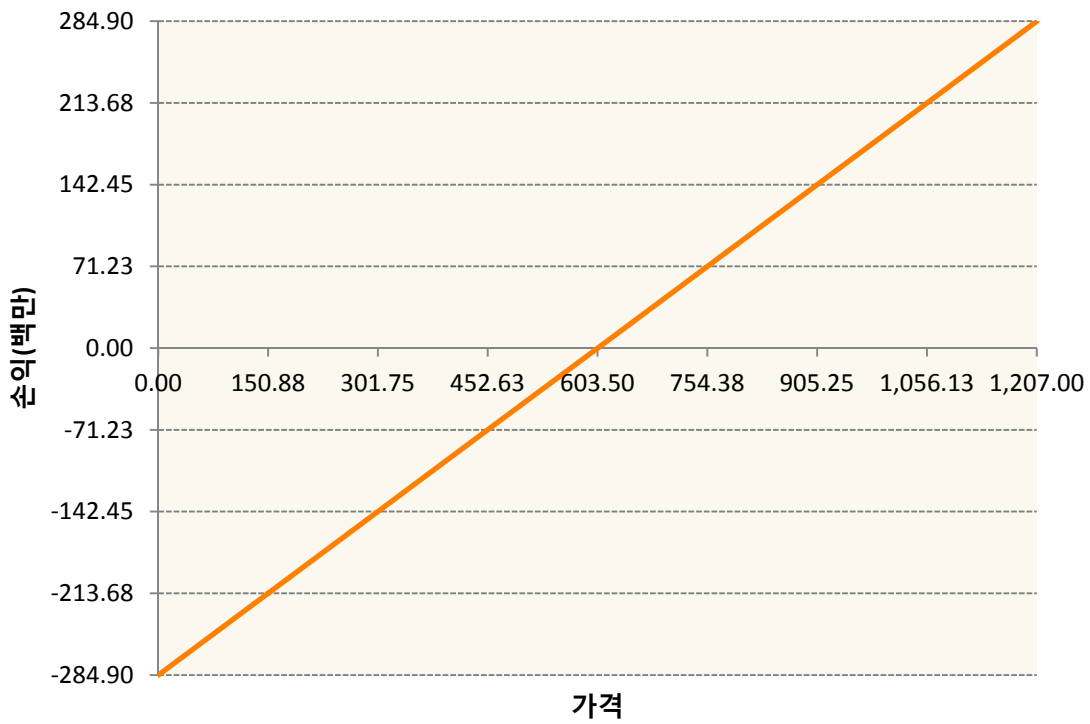




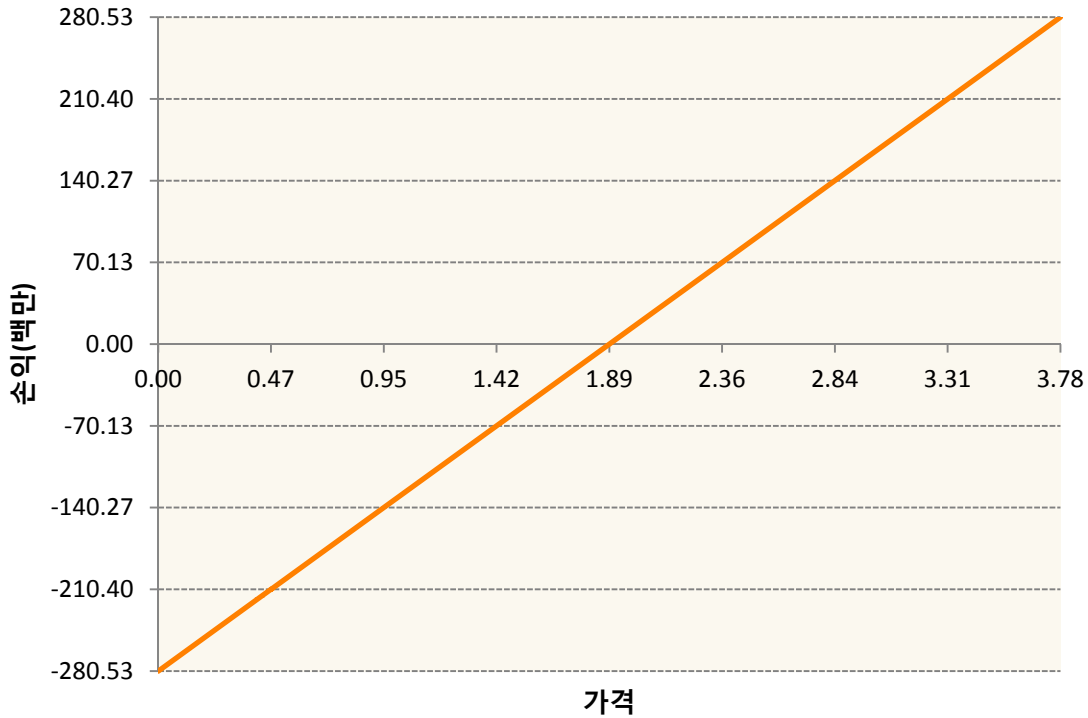
NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



QSU9-Low Su Gasoil G Sep19



XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	56
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	56
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	16
KR4175P800	2019-08 달러선물	9
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	47
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	23
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	22

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

407

공시일	2019-07-17
기준일	2019-07-16

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

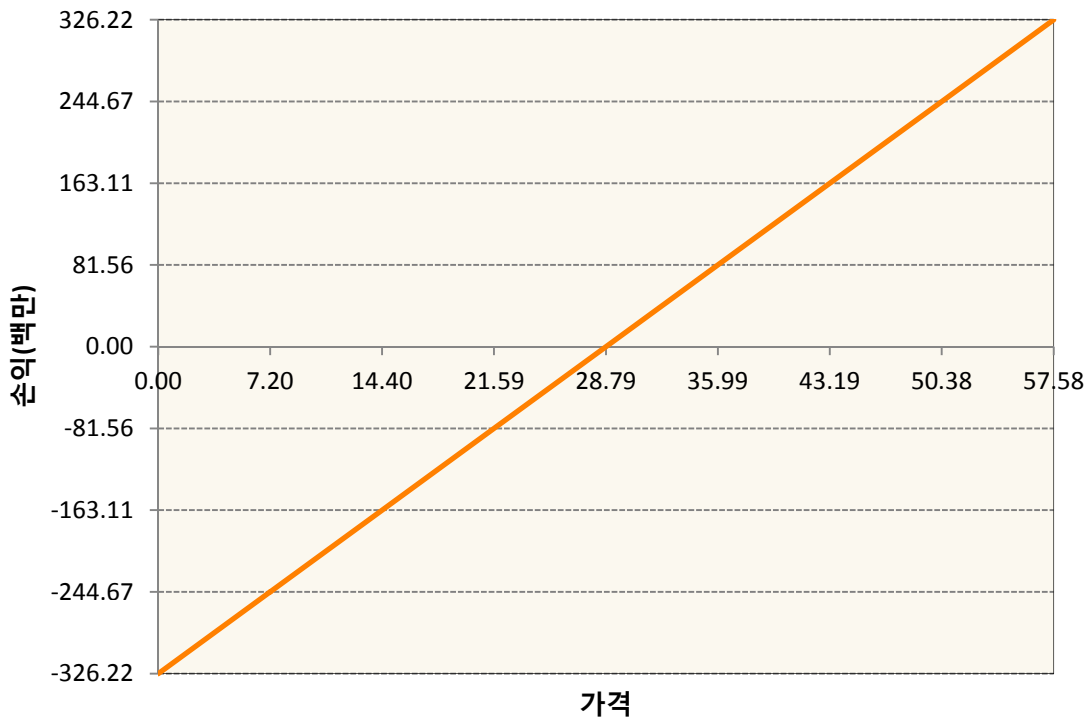
1. 계약금액

(단위:백만원)

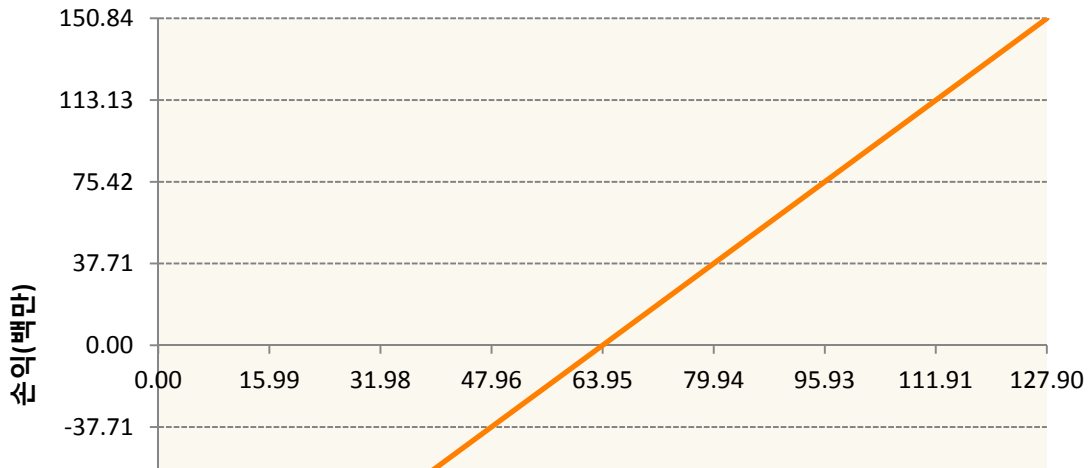
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,166	200	2,966	

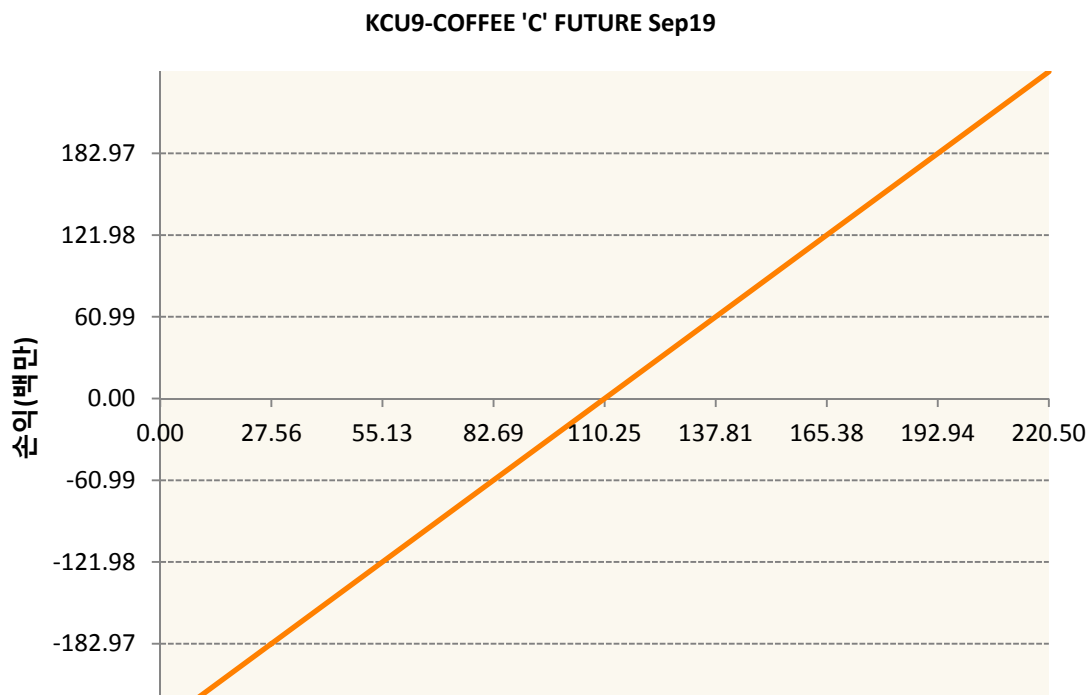
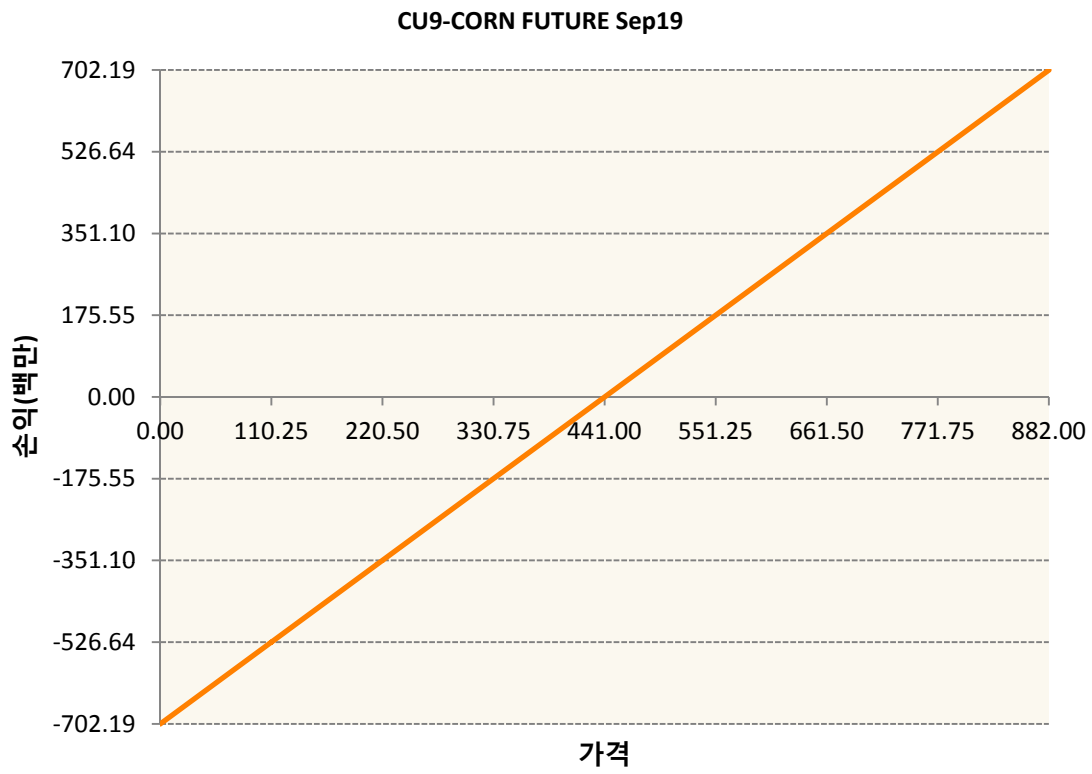
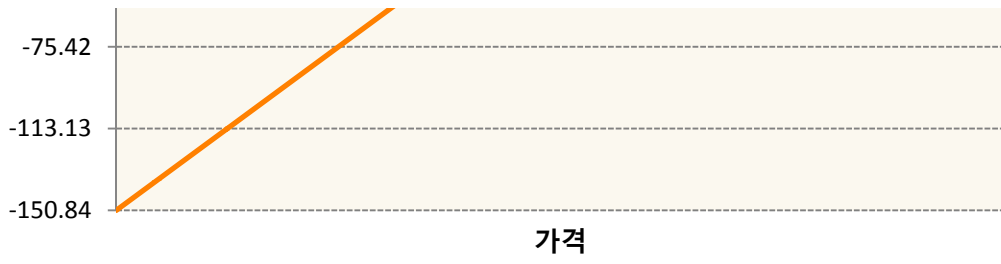
2. 만기시점의 손익구조

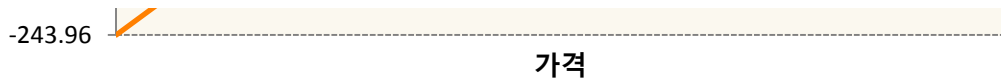
BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19



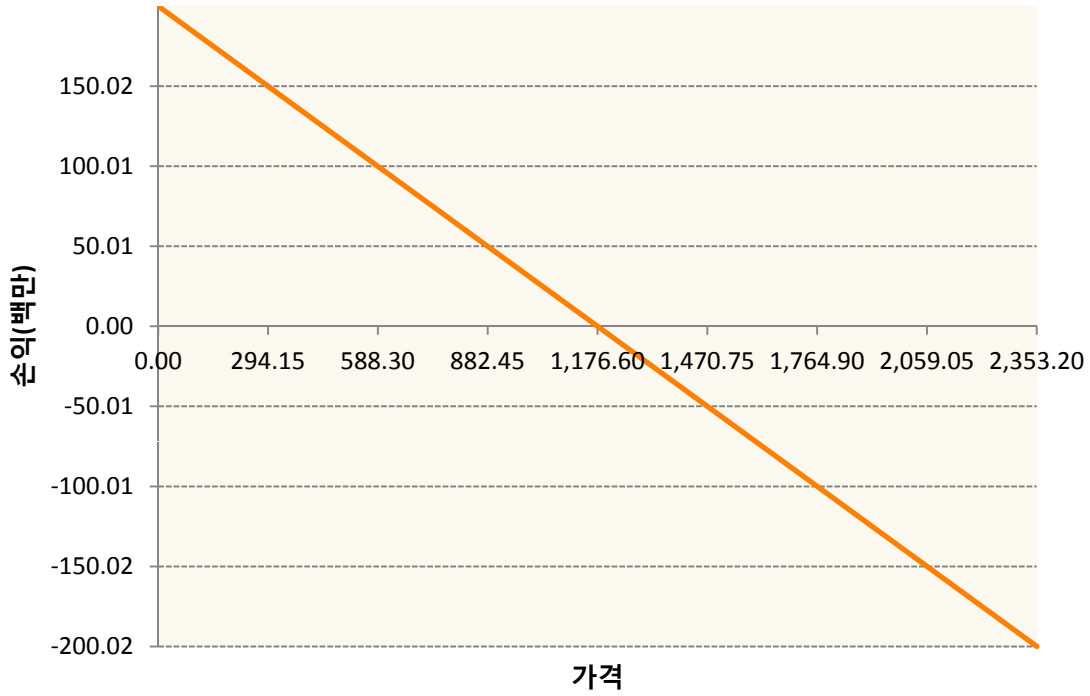
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



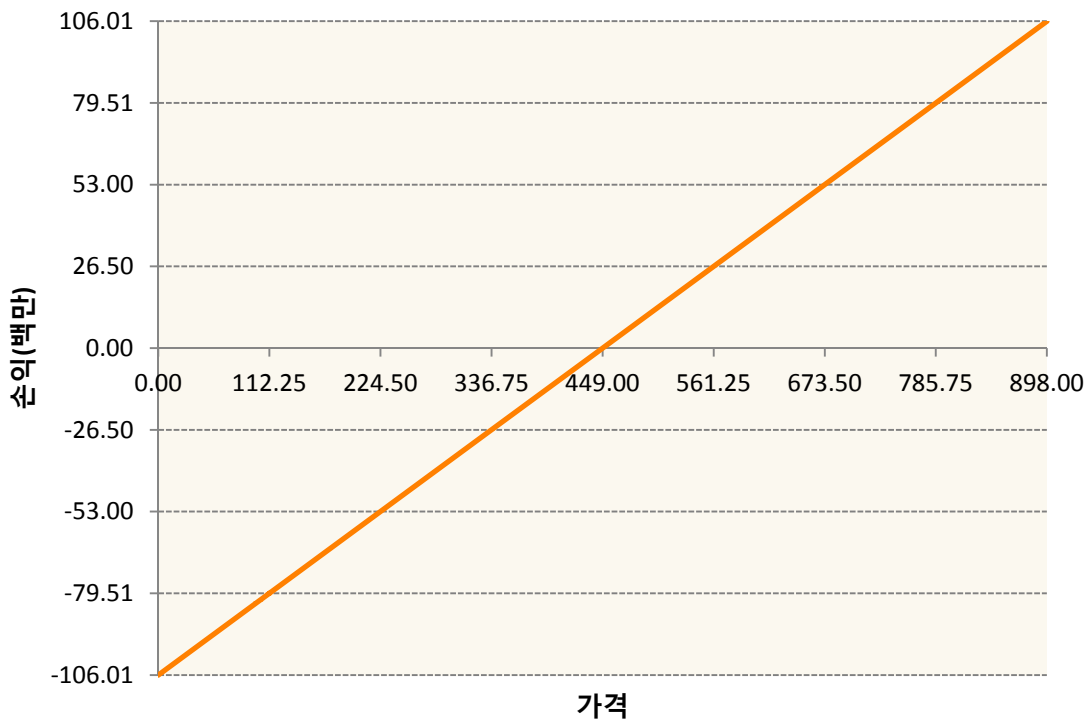




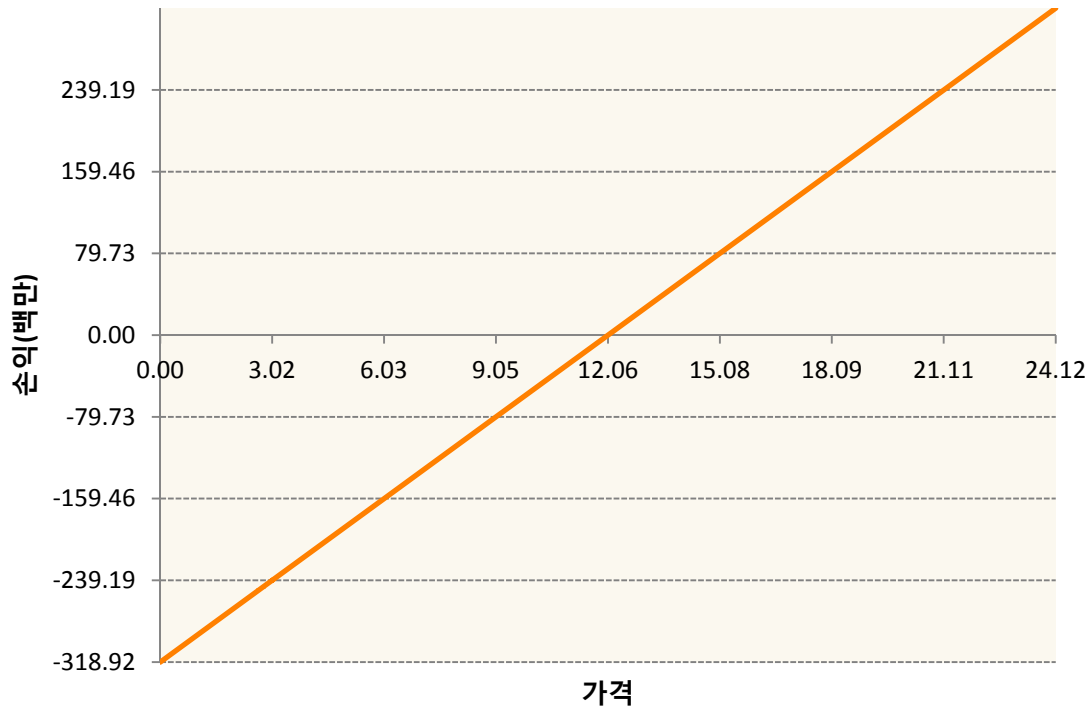
KR4175P80006-2019-08 달러선물



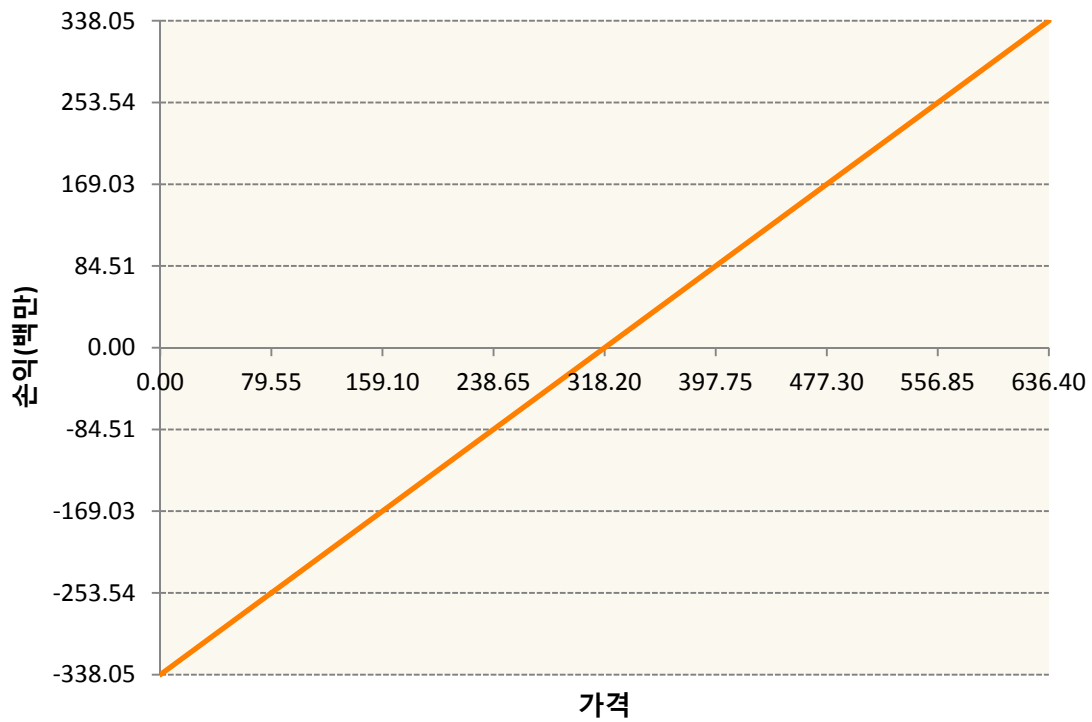
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

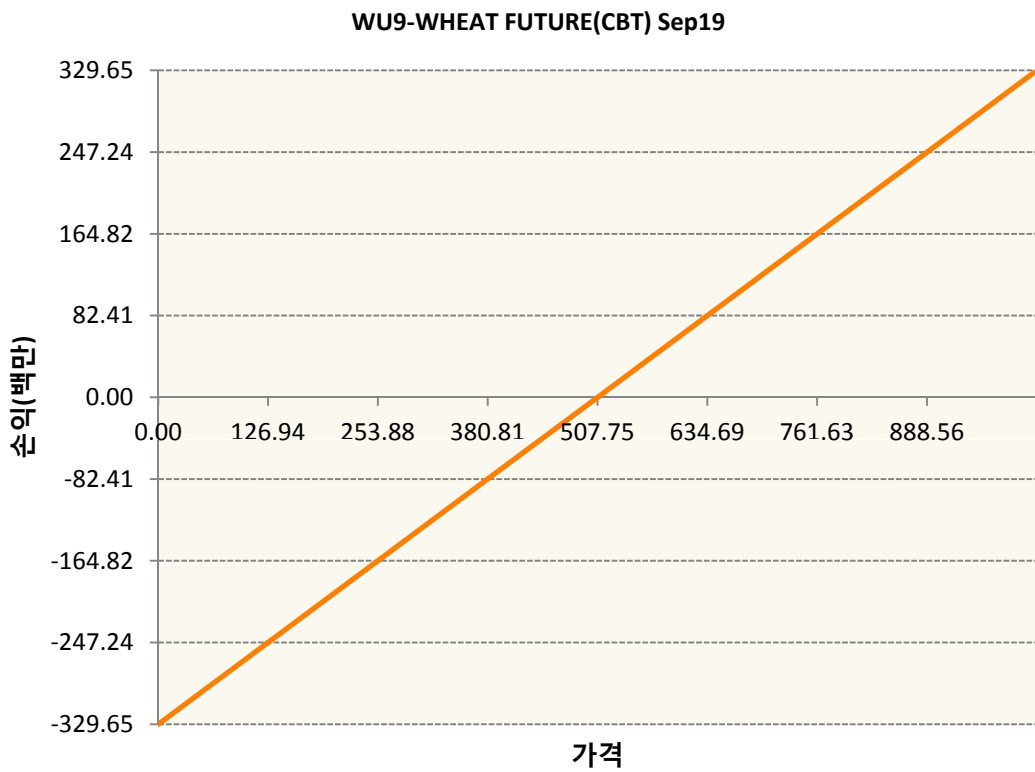
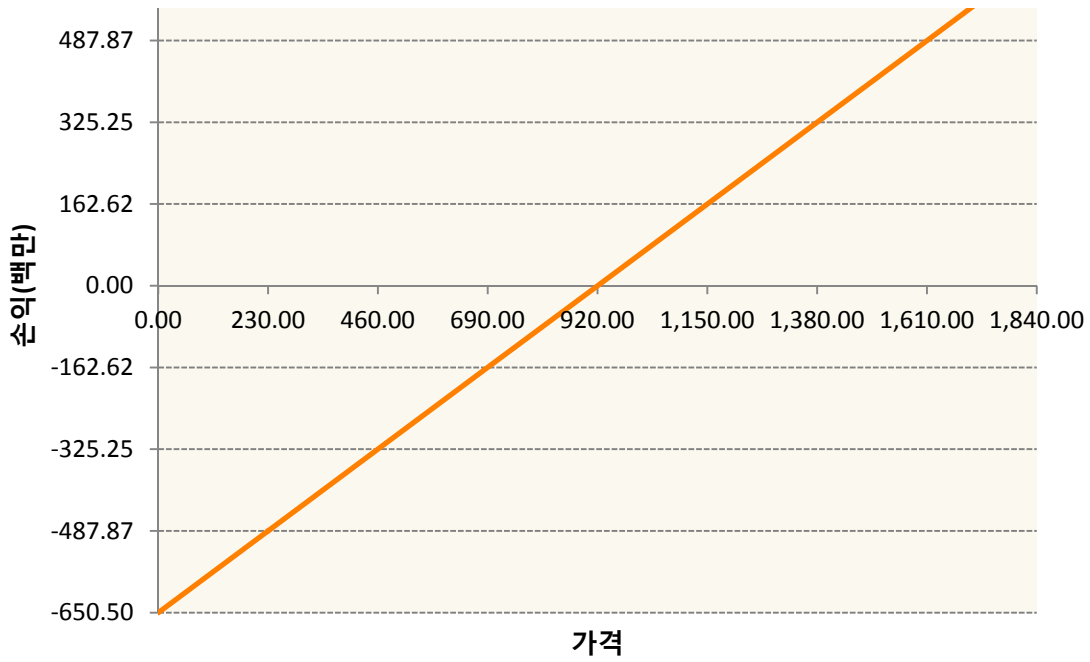


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	26
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	12
CU9	CORN FUTURE Sep19	56
KCU9	COFFEE 'C' FUTURE Sep19	20
KR4175P800	2019-08 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	52
WU9	WHEAT FUTURE(CBT) Sep19	26

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

(단위:백만원)

278