

공시일	2019-07-22
기준일	2019-07-19

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	2019-07-22
기준일	2019-07-19

SMART합성-MSCI선진국증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	14,160	0	14,160	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S190522

1,176

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

664

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-22
기준일	2019-07-19

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)	382
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	140

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

839

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-22
기준일	2019-07-19

유로인덱스모(주식-파생형)

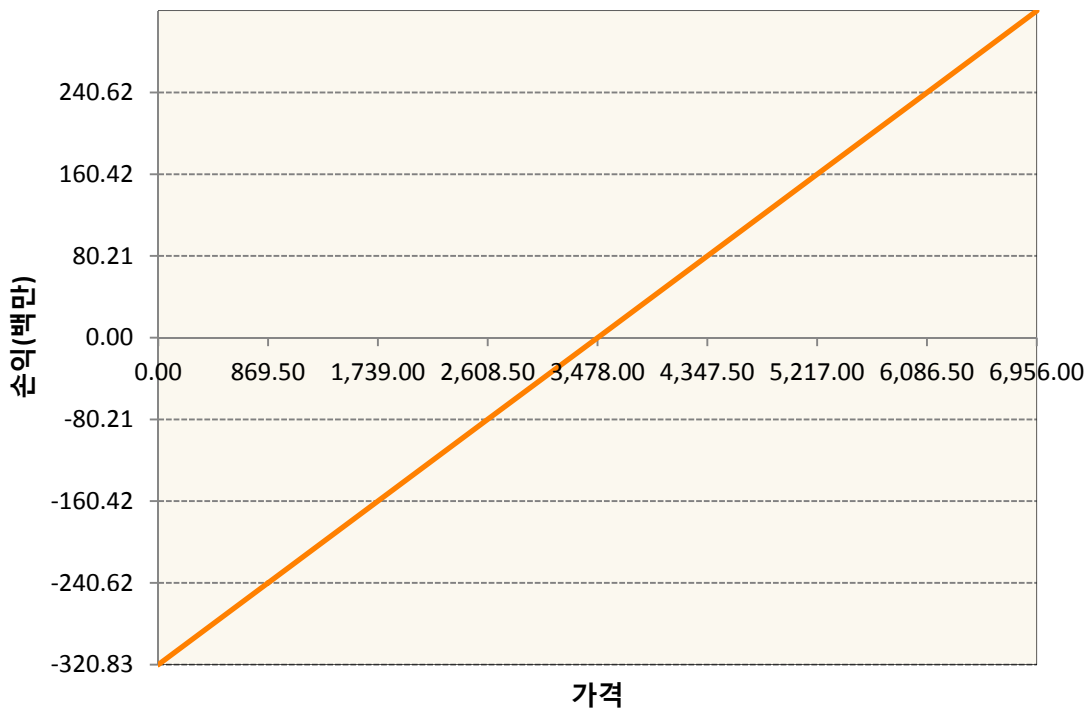
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	321	0	321	

2. 만기시점의 손익구조

VGU9-EURO STOXX 50 Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

18

공시일	2019-07-22
기준일	2019-07-19

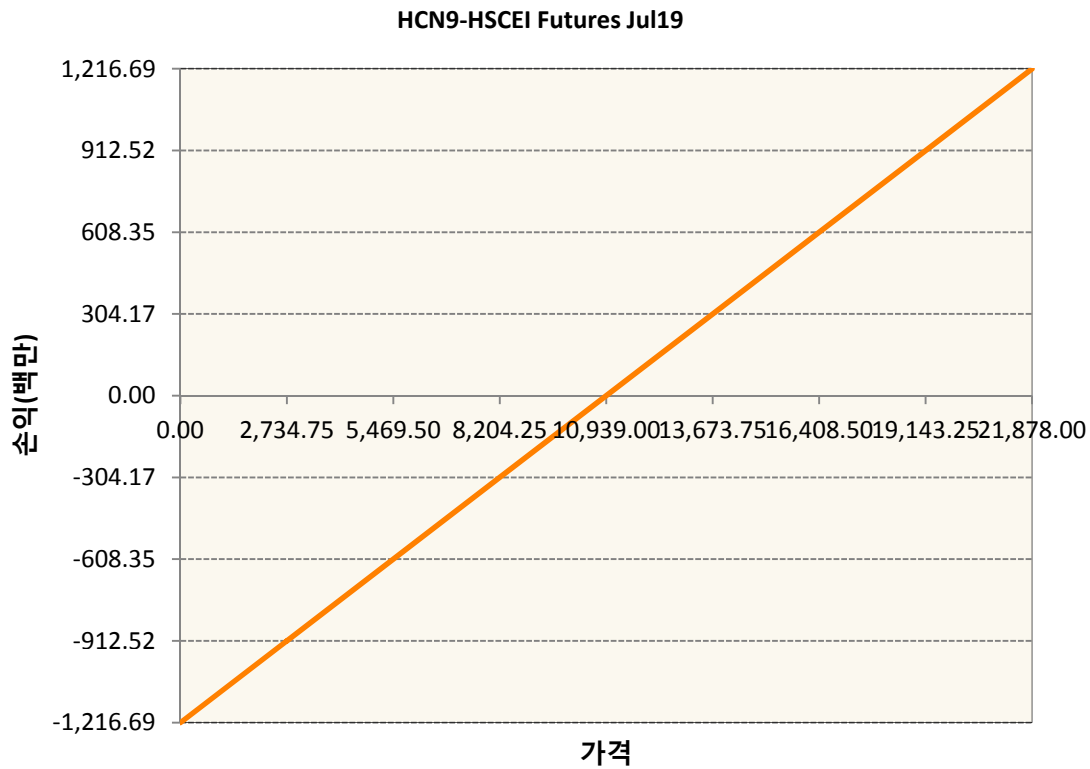
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,217	0	1,217	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	2019-07-22
기준일	2019-07-19

커버드콜모(주식혼합-파생형)

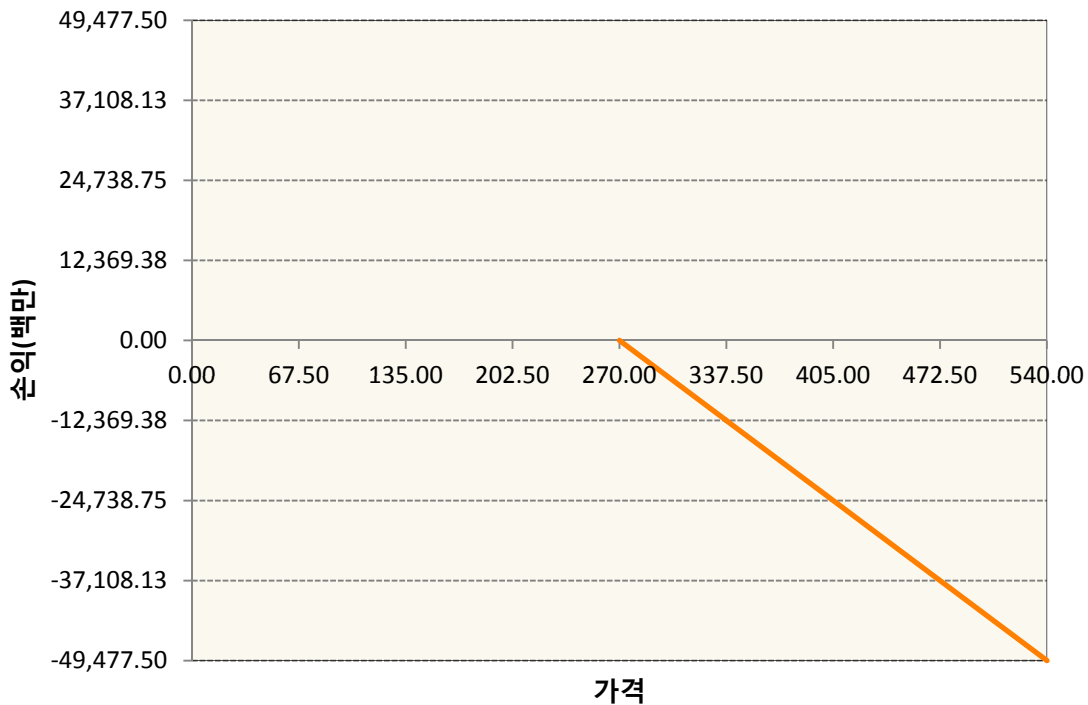
1. 계약금액

(단위:백만원)

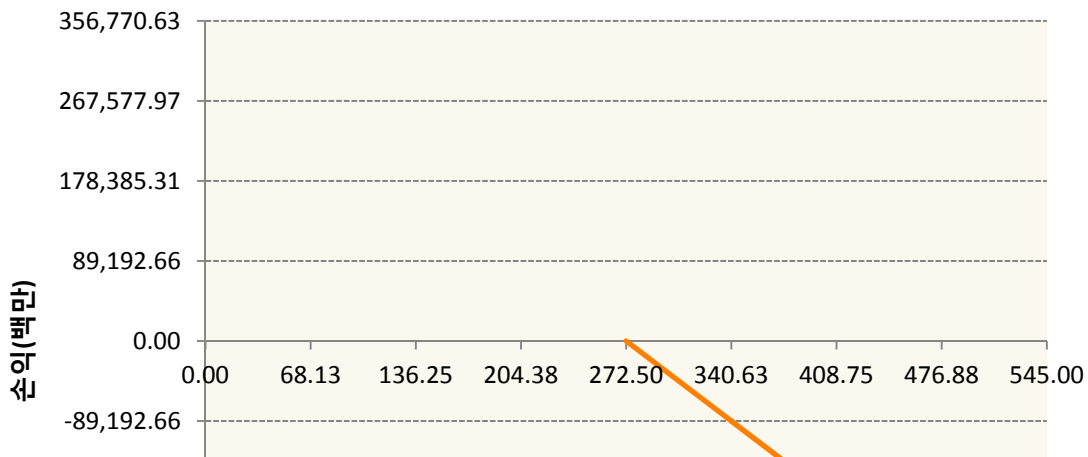
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	3,365	0	3,365	장내
누계	유가증권	옵션	0	592,486	-592,486	장내

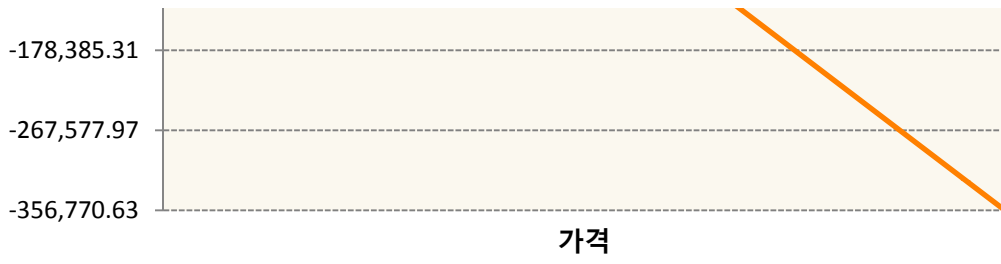
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P82709-2019-08 콜270



KR4201P82725-2019-08 콜272.5

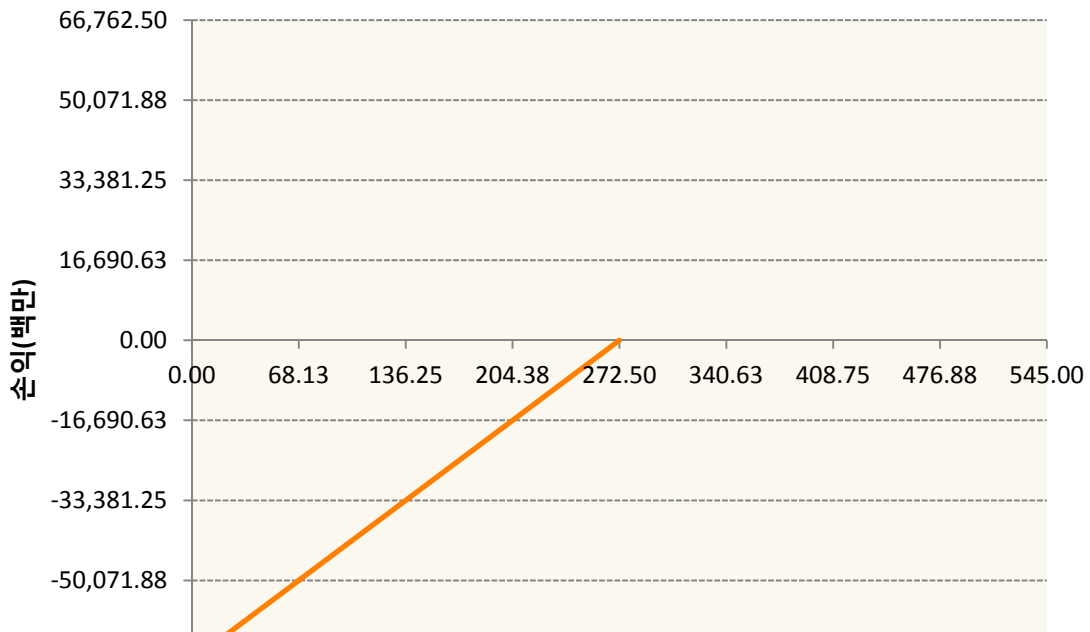




KR4301P82707-2019-08 풋270



KR4301P82723-2019-08 풋272.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P82709 2019-08 콜270							3,407
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,545	1,514	1,476	1,432	1,383	1,329	1,272
-5.33%	1,384	1,319	1,250	1,177	1,101	1,023	943
-2.67%	988	896	804	712	619	526	433
0%	272	182	91	0	-92	-185	-277
2.67%	-742	-804	-872	-944	-1,019	-1,097	-1,177
5.33%	-1,949	-1,981	-2,020	-2,066	-2,117	-2,173	-2,234
8.00%	-3,247	-3,260	-3,277	-3,301	-3,331	-3,366	-3,407
KR4201P82725 2019-08 콜272.5							23,312
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,328	9,166	8,956	8,703	8,409	8,080	7,720
-5.33%	8,534	8,148	7,722	7,263	6,776	6,268	5,740
-2.67%	6,353	5,738	5,113	4,479	3,839	3,194	2,545
0%	2,036	1,359	680	0	-681	-1,362	-2,044
2.67%	-4,530	-5,061	-5,618	-6,197	-6,792	-7,400	-8,019
5.33%	-12,755	-13,059	-13,414	-13,811	-14,245	-14,709	-15,200
8.00%	-21,860	-21,991	-22,169	-22,393	-22,660	-22,968	-23,312
KR4301P82707 2019-08 풋270							7,082
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,994	-6,998	-7,005	-7,017	-7,033	-7,055	-7,082
-5.33%	-3,821	-3,861	-3,909	-3,966	-4,030	-4,101	-4,177
-2.67%	-1,134	-1,250	-1,367	-1,486	-1,606	-1,727	-1,849
0%	324	220	111	0	-114	-230	-347
2.67%	708	676	635	586	528	464	393
5.33%	750	747	740	729	713	691	663
8.00%	752	752	752	750	748	743	736
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							4,289
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,261	-4,262	-4,263	-4,267	-4,272	-4,279	-4,289
-5.33%	-2,483	-2,495	-2,511	-2,532	-2,557	-2,586	-2,618
-2.67%	-858	-910	-965	-1,022	-1,081	-1,141	-1,203
0%	207	139	69	0	-70	-140	-210
2.67%	578	548	512	472	429	382	332

5.33%	636	631	623	611	596	577	554
8.00%	639	639	638	636	633	628	621

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

(단위:백만원)

39,097

공시일	2019-07-22
기준일	2019-07-19

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

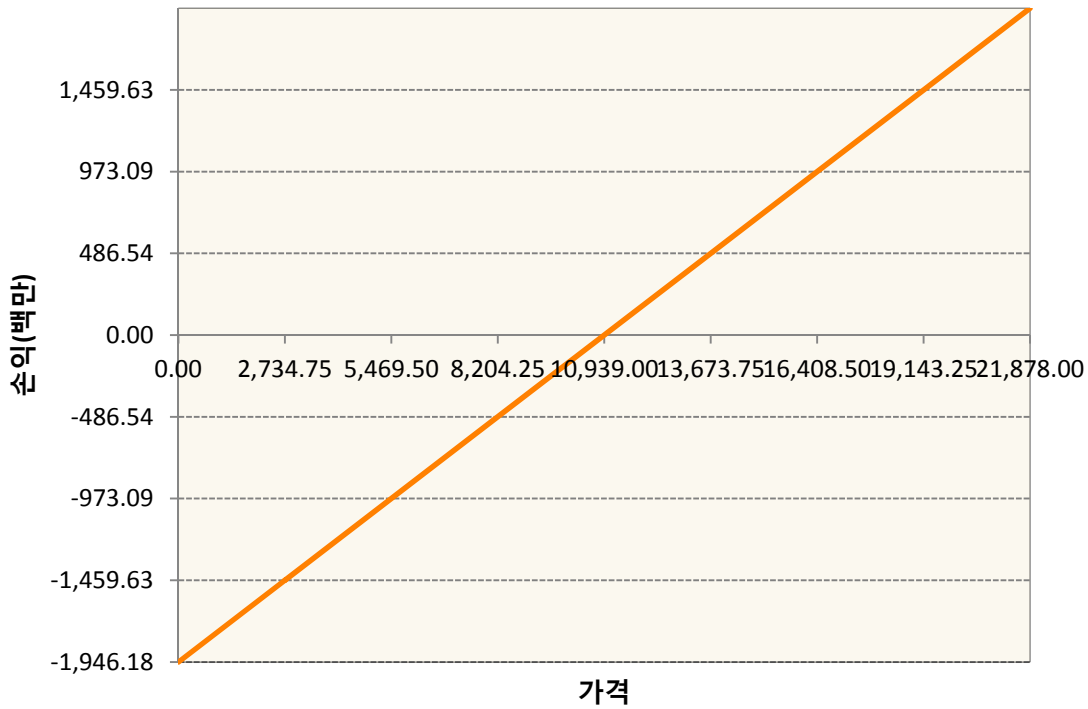
1. 계약금액

(단위:백만원)

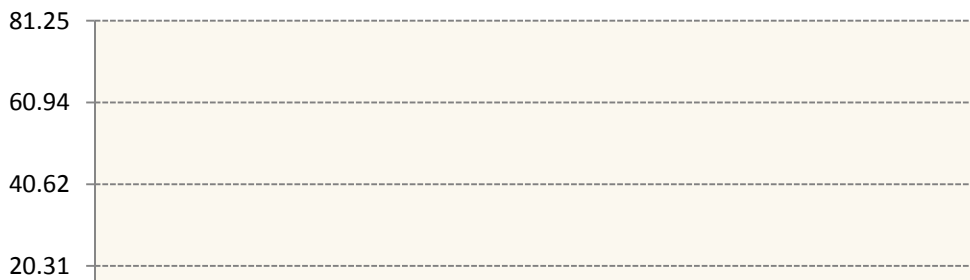
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,946	0	1,946	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,247	-5,247	장내
누계	통화	선도	150	3,160	-3,009	장외

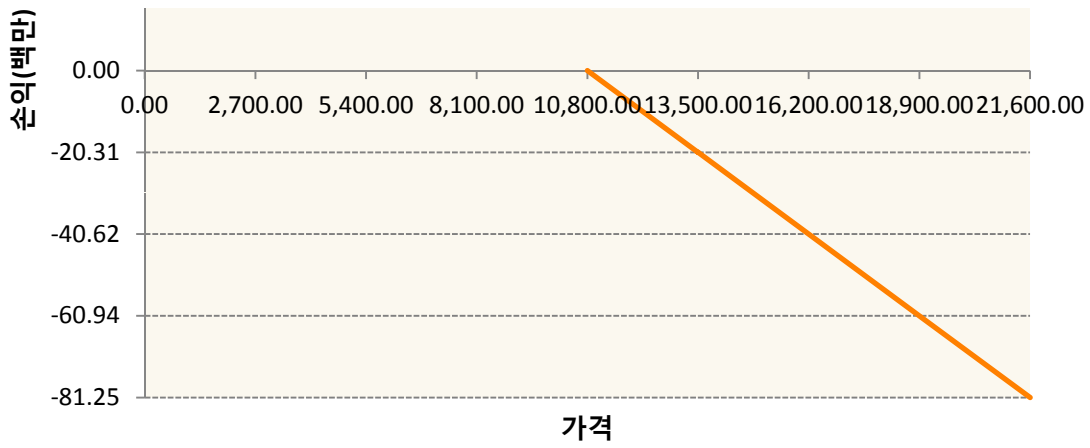
2. 만기시점의 손익구조

HCN9-HSCEI Futures Jul19

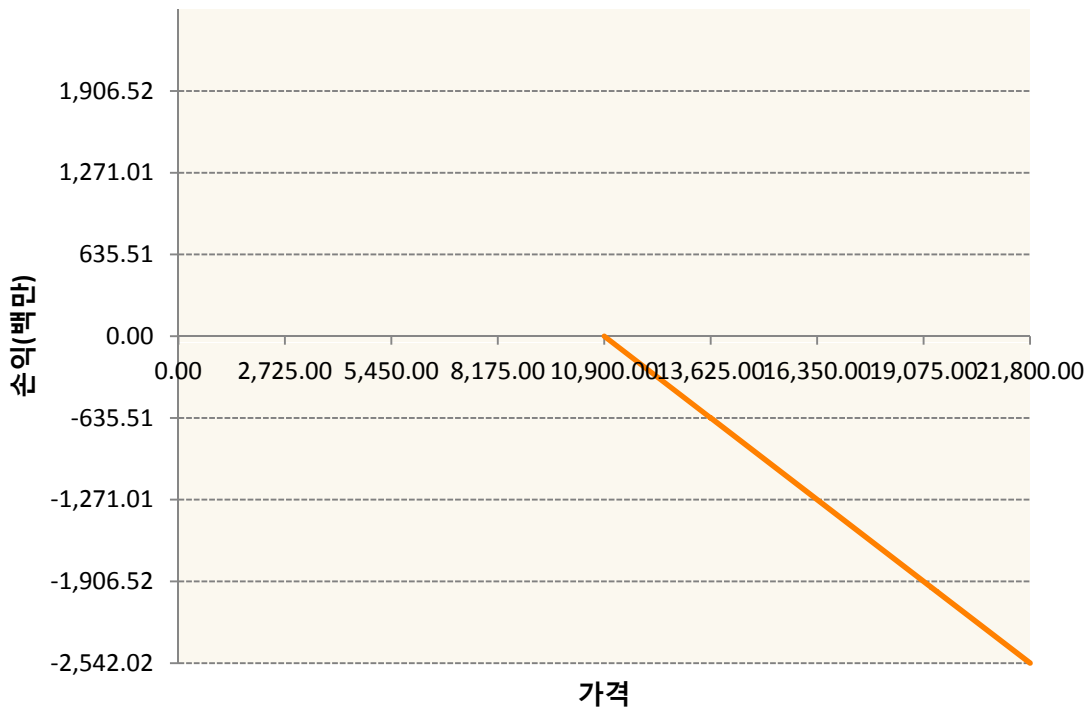


OHHIN9-C108-HSCEI

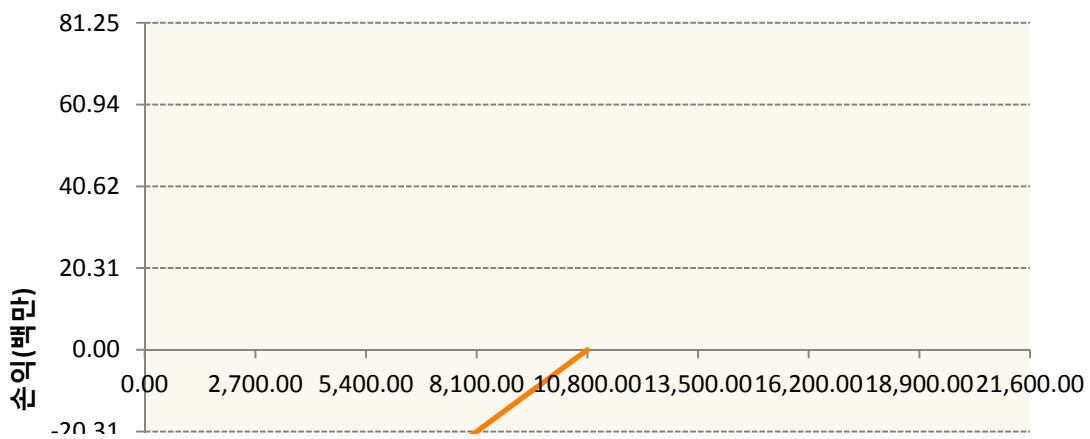


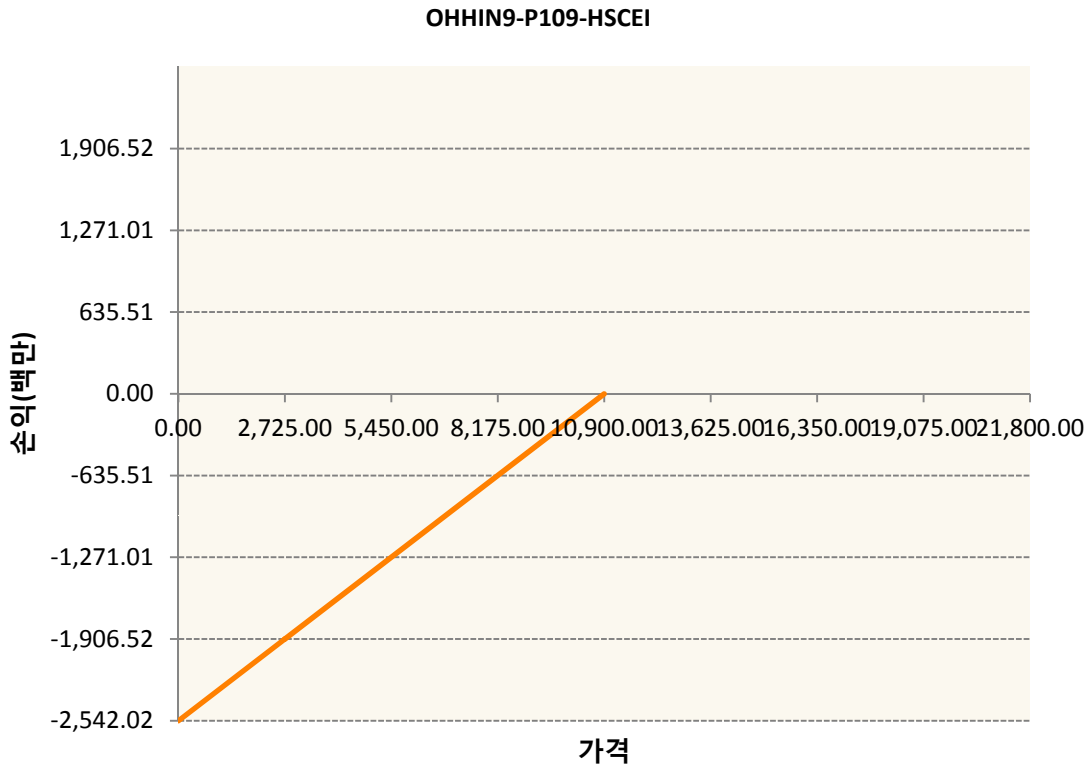
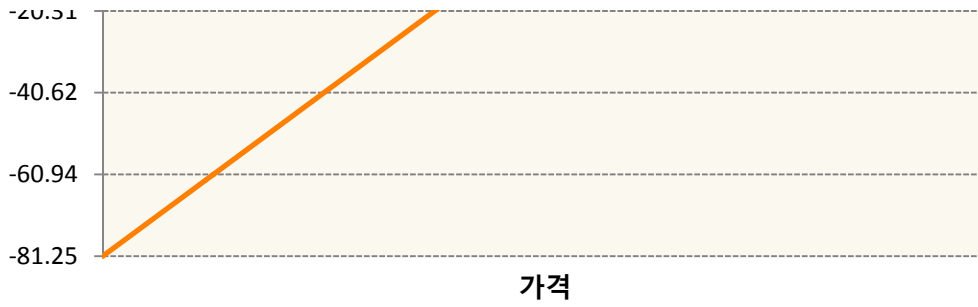


OHHIN9-C109-HSCEI



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		156
OHHIN9-C1(HSCEI		7
OHHIN9-C1(HSCEI		203
OHHIN9-P1(HSCEI		7
OHHIN9-P1(HSCEI		203

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		660

공시일	2019-07-22
기준일	2019-07-19

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

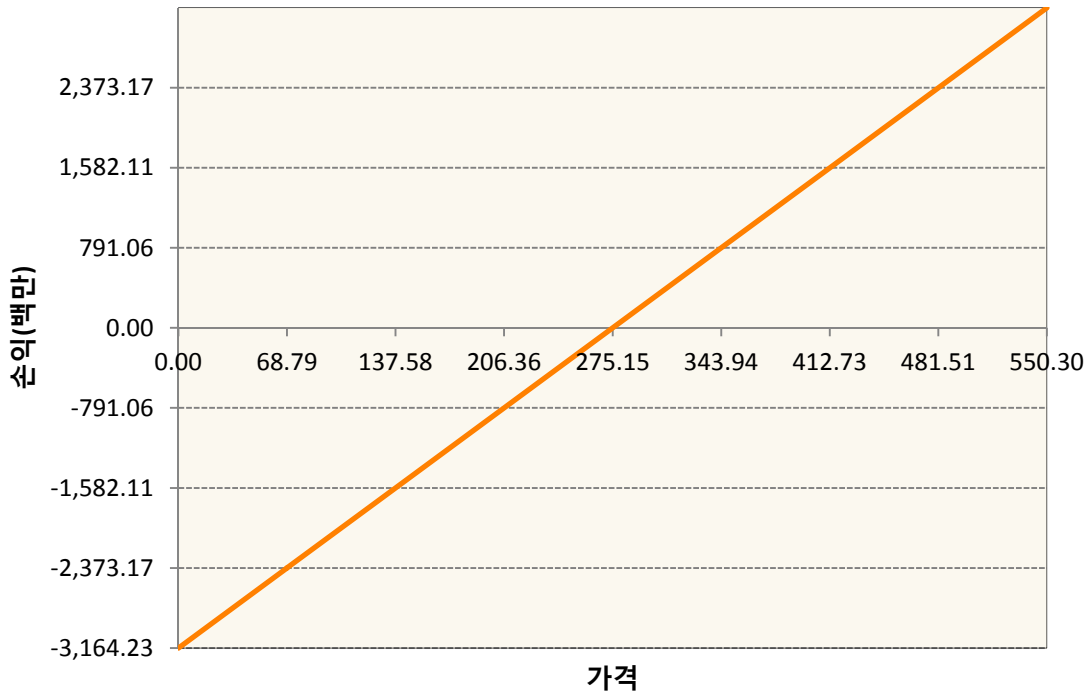
1. 계약금액

(단위:백만원)

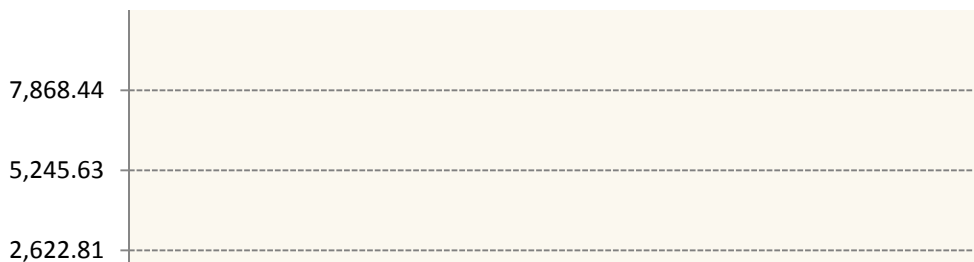
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	413	-413	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	402	0	402	장내
누계	유가증권	선물	3,164	0	3,164	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	19,906	-19,906	장내

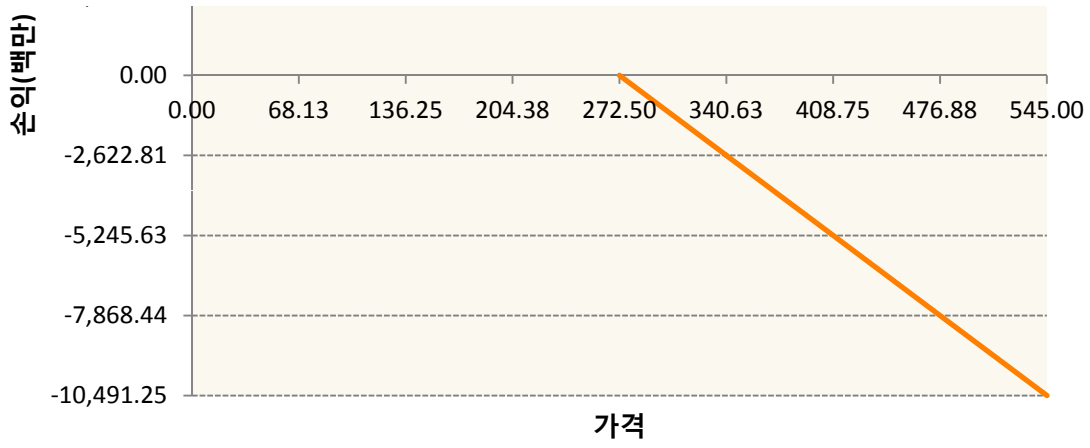
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

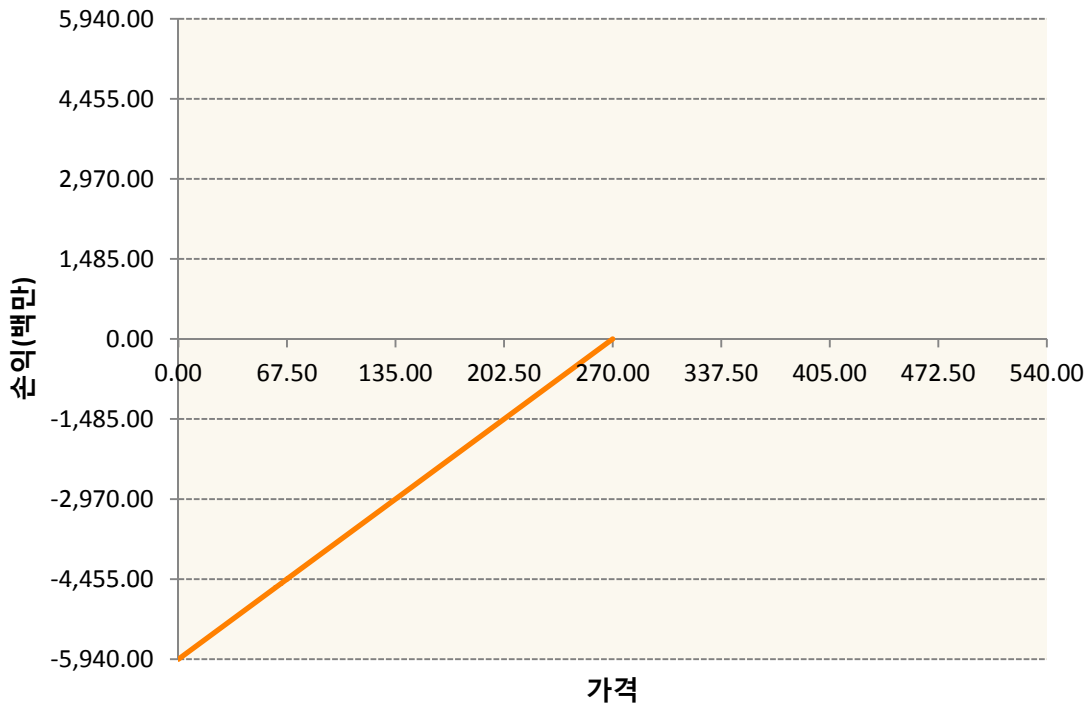


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

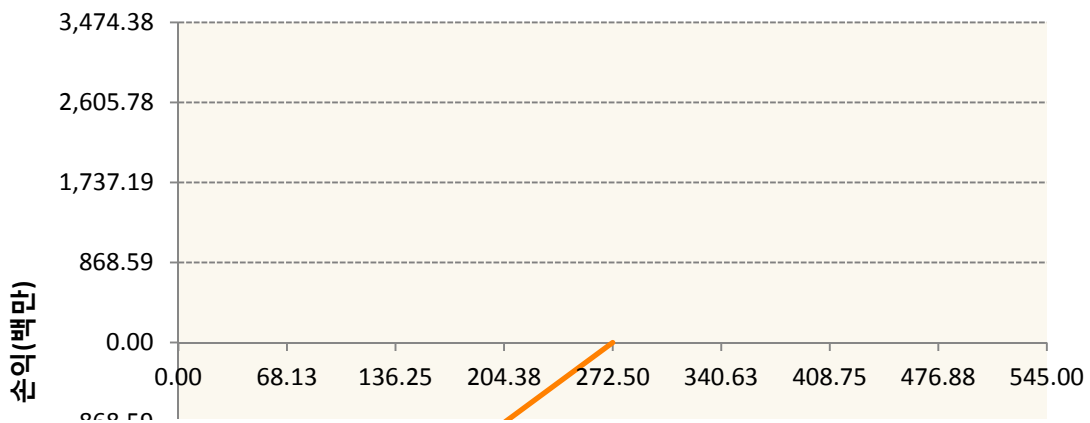




KR4301P82707-2019-08 풋270



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						253
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-253	-253	-253	-253	-253	-253	-253	
-5.33%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168	
-2.67%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	84	84	84	84	84	84	84	
5.33%	168	168	168	168	168	168	168	
8.00%	253	253	253	253	253	253	253	
KR4201P82725		2019-08 콜272.5						686
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	274	270	263	256	247	238	227
-5.33%	251	240	227	214	199	184	169
-2.67%	187	169	150	132	113	94	75
0%	60	40	20	0	-20	-40	-60
2.67%	-133	-149	-165	-182	-200	-218	-236
5.33%	-375	-384	-394	-406	-419	-433	-447
8.00%	-643	-647	-652	-658	-666	-675	-686
KR4301P82707 2019-08 풋270							352
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-348	-348	-348	-349	-350	-351	-352
-5.33%	-190	-192	-194	-197	-200	-204	-208
-2.67%	-56	-62	-68	-74	-80	-86	-92
0%	16	11	6	0	-6	-11	-17
2.67%	35	34	32	29	26	23	20
5.33%	37	37	37	36	35	34	33
8.00%	37	37	37	37	37	37	37
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							223
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-222	-222	-222	-222	-222	-223	-223
-5.33%	-129	-130	-131	-132	-133	-135	-136
-2.67%	-45	-47	-50	-53	-56	-59	-63
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	30	29	27	25	22	20	17
5.33%	33	33	32	32	31	30	29
8.00%	33	33	33	33	33	33	32

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

(단위:백만원)

3,306

공시일	2019-07-22
기준일	2019-07-19

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

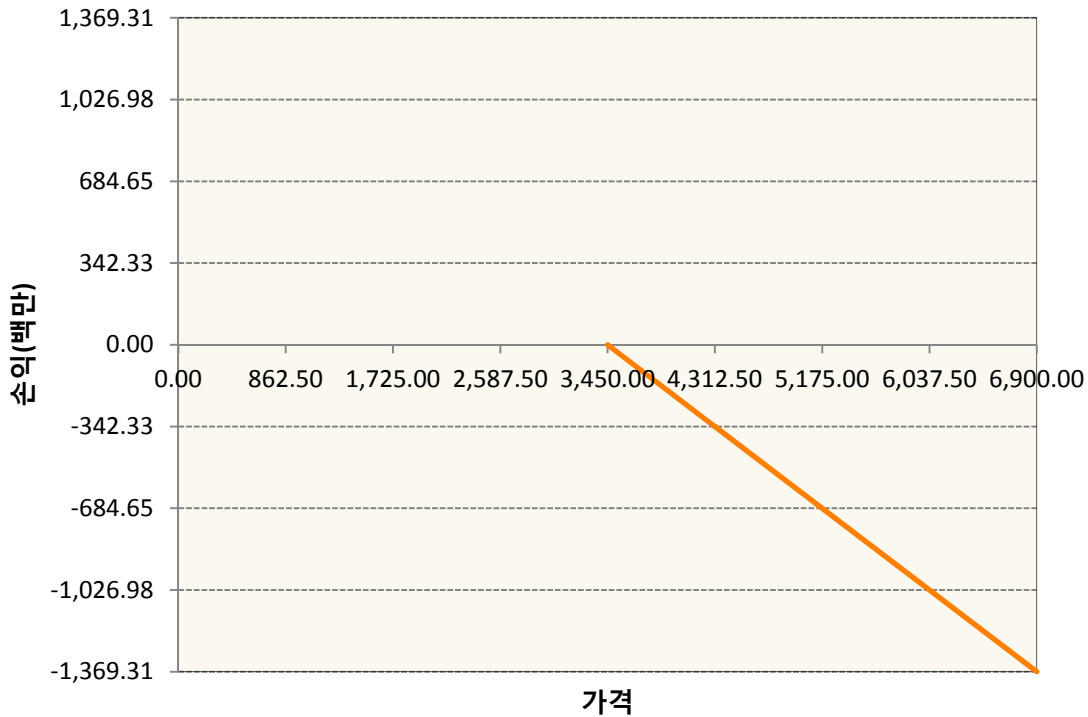
1. 계약금액

(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	1,150	0	1,150	
누계	유가증권	스왑	46,823	0	46,823	장외
누계	유가증권	옵션	0	8,256	-8,256	장내
누계	통화	선도	5,292	22,490	-17,198	장외

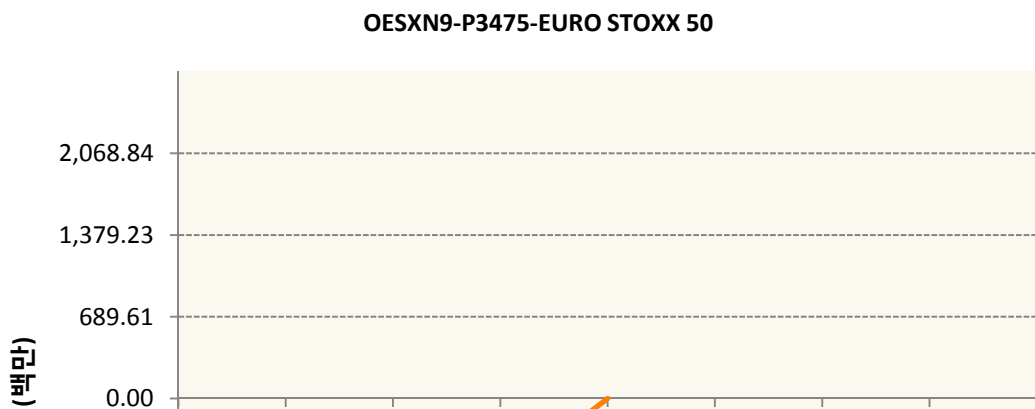
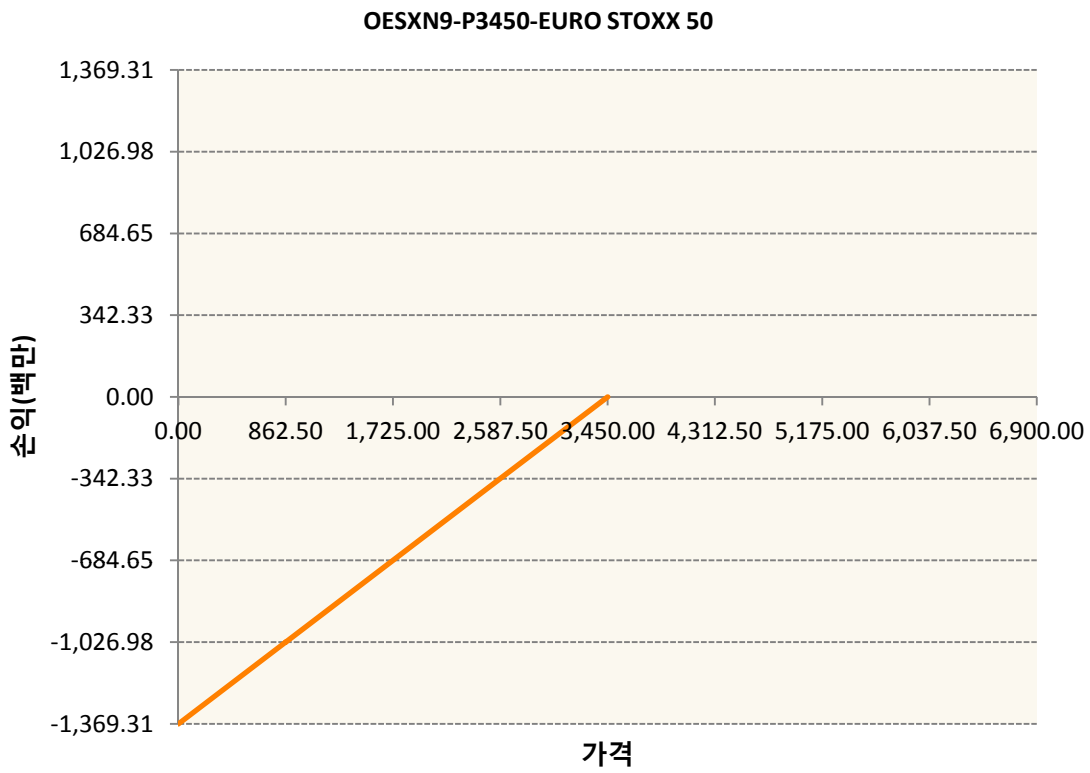
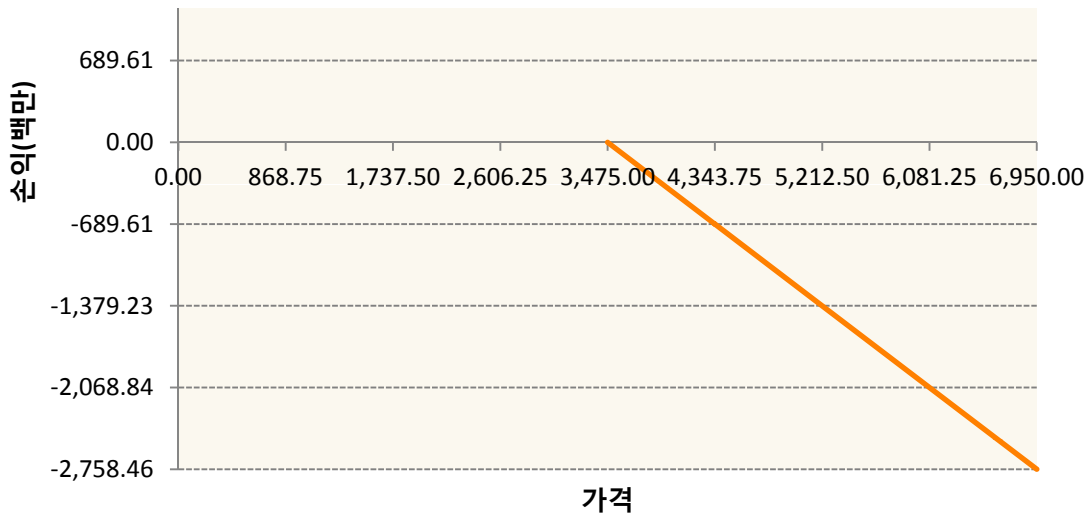
2. 만기시점의 손익구조

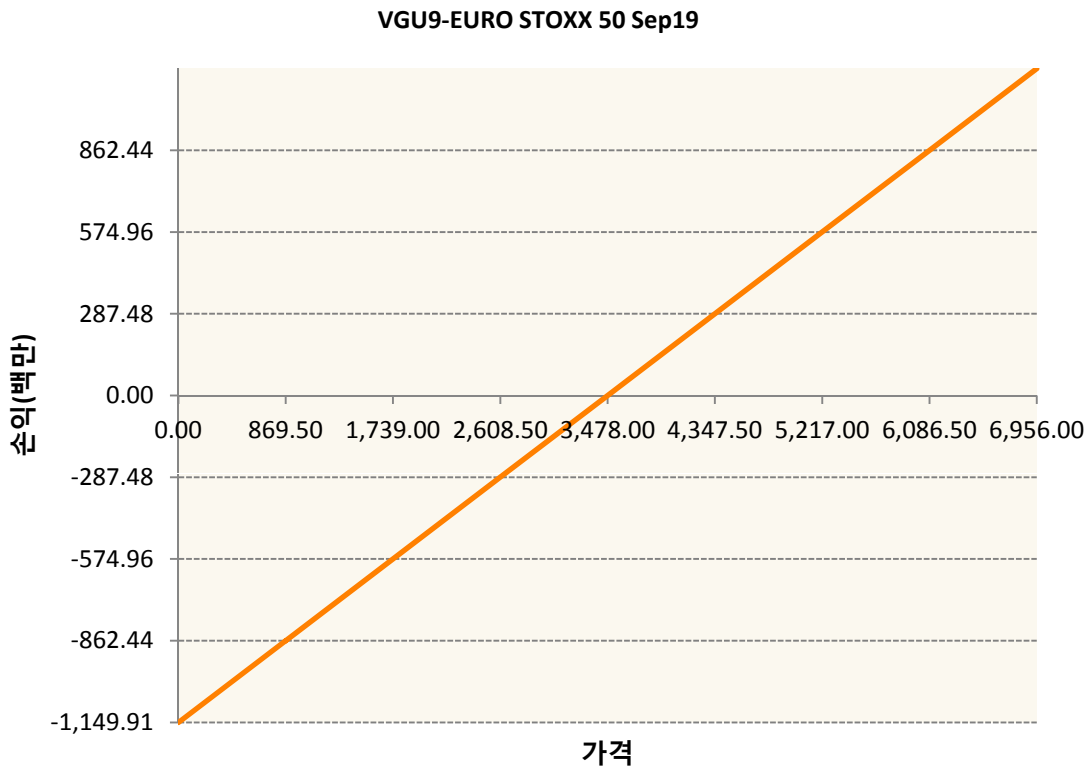
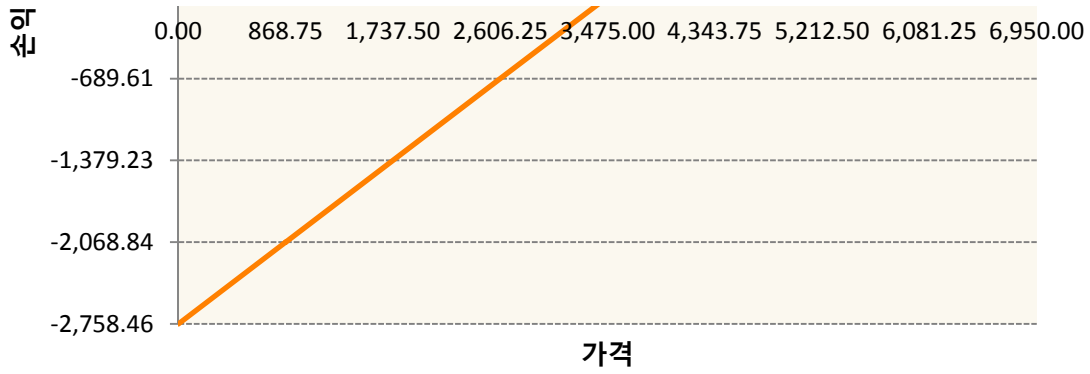
OESXN9-C3450-EURO STOXX 50



OESXN9-C3475-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	89
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	423
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E	1,058
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	318
FX21019N01 EUR/KRW 23-08-19E	423
OESXN9-C34 EURO STOXX 50	110
OESXN9-C34 EURO STOXX 50	221
OESXN9-P34 EURO STOXX 50	110
OESXN9-P34 EURO STOXX 50	221
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	92

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

(단위:백만원)

1,641

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

(단위:백만원)

1,024

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

(단위:백만원)

87

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

(단위:백만원)

133

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-07-22
기준일	2019-07-19

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

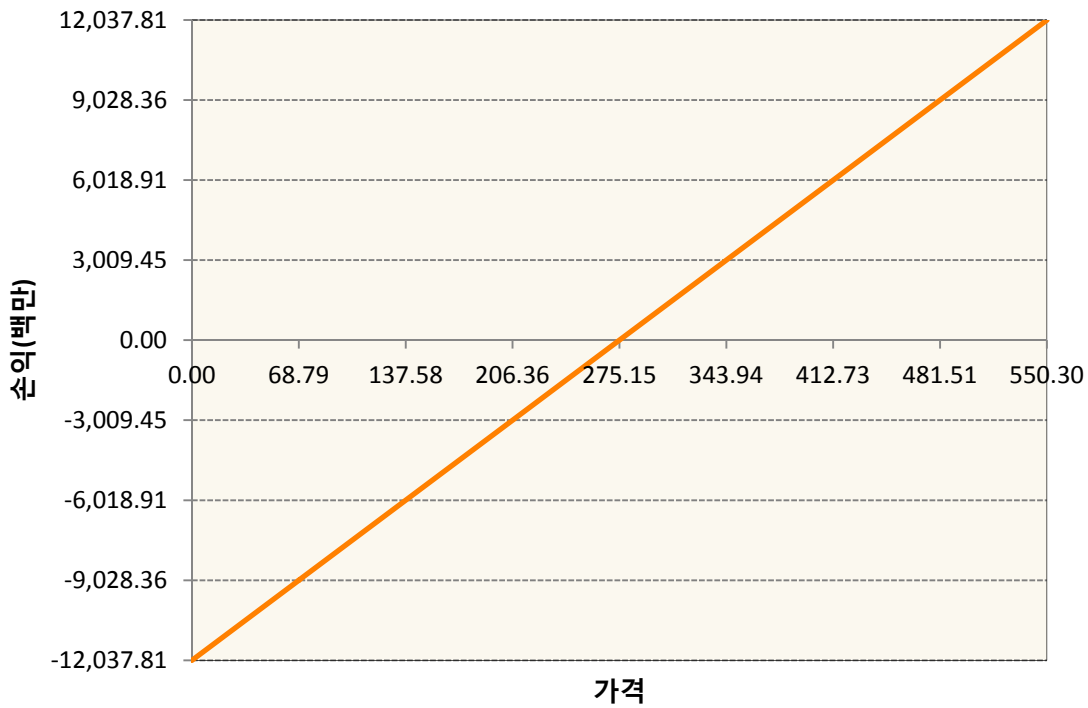
1. 계약금액

(단위:백만원)

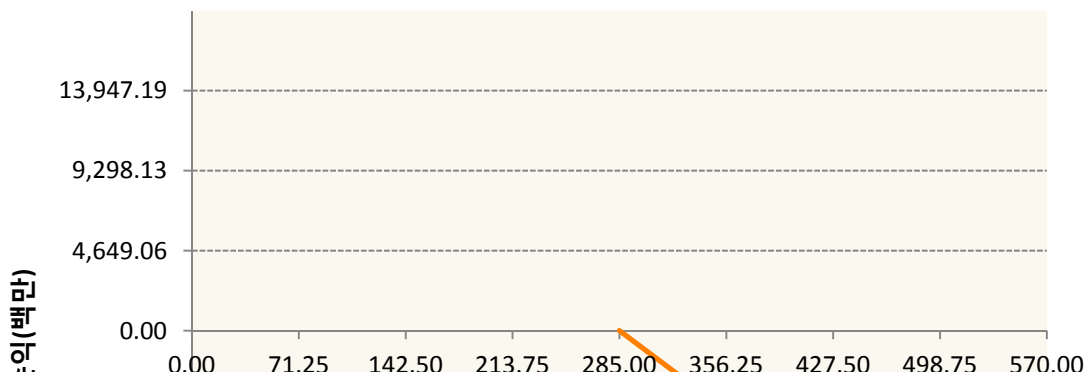
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,038	0	12,038	장내
누계	유가증권	옵션	1,698	21,831	-20,133	장내

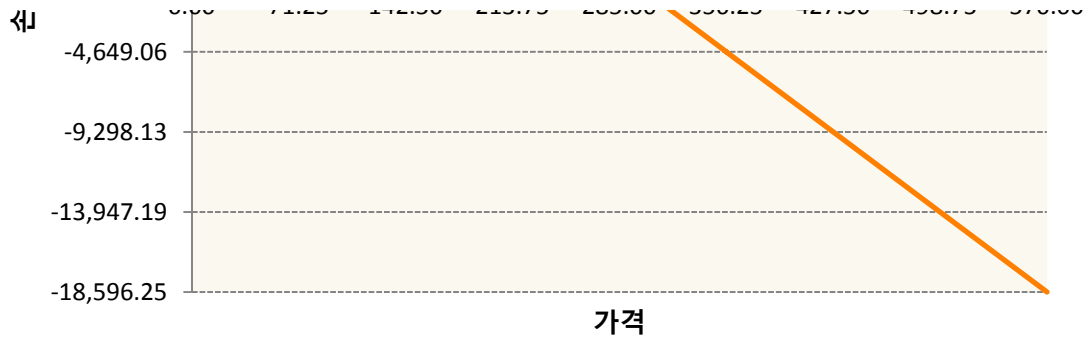
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

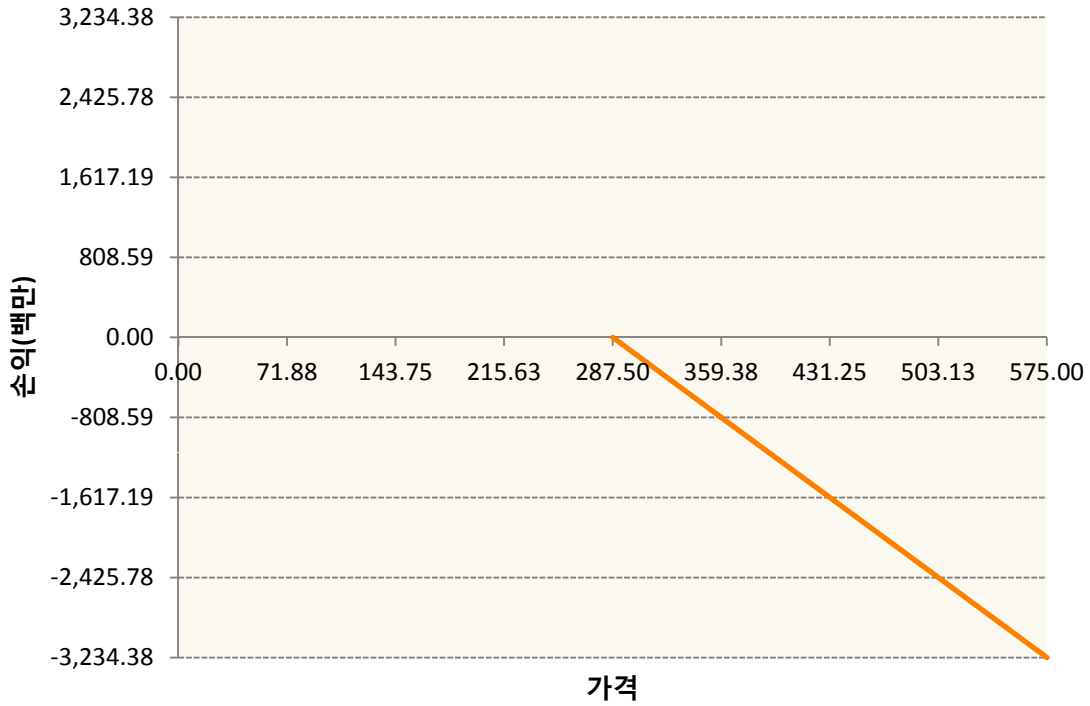


KR4201P82857-2019-08 콜285

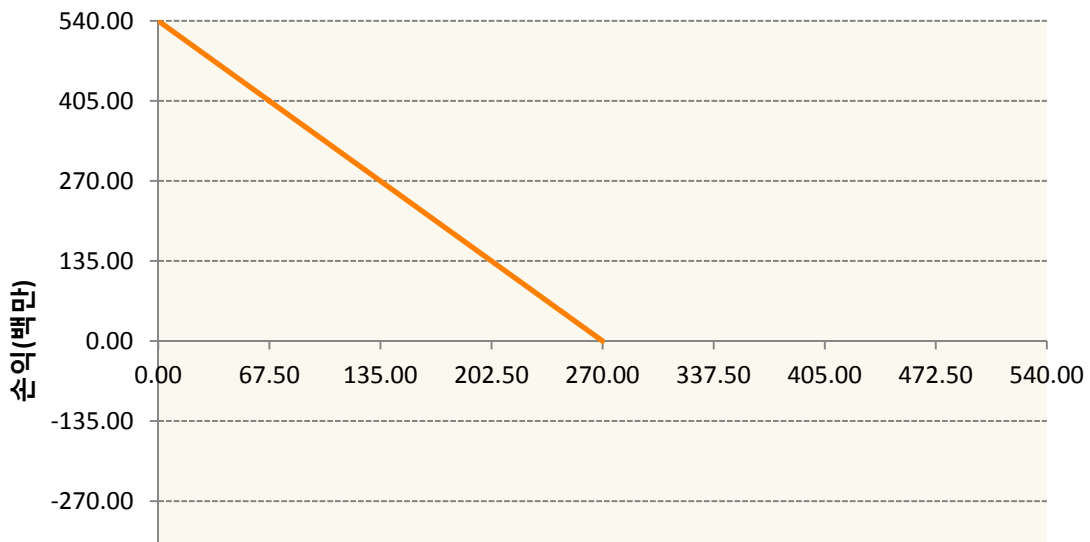


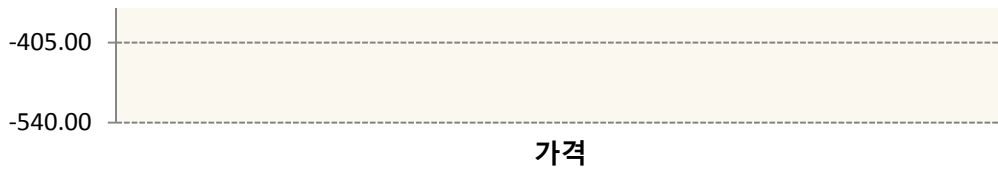


KR4201P82873-2019-08 콜287.5

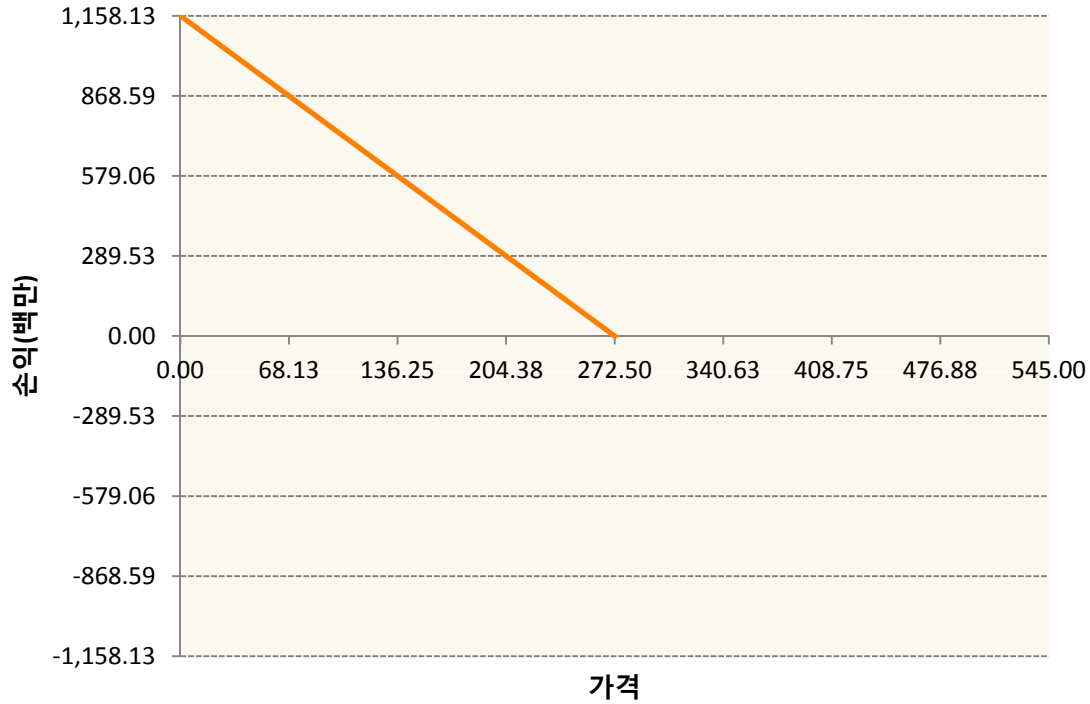


KR4301P82707-2019-08 풋270





KR4301P82723-2019-08 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						961
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-961	-961	-961	-961	-961	-961	-961	
-5.33%	-641	-641	-641	-641	-641	-641	-641	
-2.67%	-320	-320	-320	-320	-320	-320	-320	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	320	320	320	320	320	320	320	
5.33%	641	641	641	641	641	641	641	
8.00%	961	961	961	961	961	961	961	
KR4201P82857		2019-08 콜285						833
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	161	160	159	156	151	145	138	
-5.33%	158	153	147	139	128	116	102	
-2.67%	139	127	111	94	75	54	32	

0%	79	54	28	0	-29	-58	-88
2.67%	-62	-96	-131	-166	-200	-235	-270
5.33%	-311	-345	-380	-414	-449	-484	-519
8.00%	-662	-687	-714	-742	-772	-802	-833
KR4201P82873 2019-08 콜287.5							131
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	22	21	21	21	20	20	19
-5.33%	21	21	20	19	17	16	14
-2.67%	19	18	15	13	10	7	4
0%	12	8	4	0	-4	-9	-14
2.67%	-7	-13	-18	-24	-30	-36	-42
5.33%	-44	-50	-56	-62	-68	-74	-81
8.00%	-98	-104	-109	-114	-120	-125	-131
KR4301P82707 2019-08 풋270							32
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	32	32	32	32	32	32	32
-5.33%	17	17	18	18	18	19	19
-2.67%	5	6	6	7	7	8	8
0%	-1	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-3	-3	-3	-3	-2	-2	-2
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							74
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	74	74	74	74	74	74	74
-5.33%	43	43	44	44	44	45	45
-2.67%	15	16	17	18	19	20	21
0%	-4	-2	-1	0	1	2	4
2.67%	-10	-10	-9	-8	-7	-7	-6
5.33%	-11	-11	-11	-11	-10	-10	-10
8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11

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

(단위:백만원)

1,673

공시일	2019-07-22
기준일	2019-07-19

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	15,446	0	15,446	
누계	유가증권	수익증권	33,010	0	33,010	

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	2019-07-22
기준일	2019-07-19

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	52,594	0	52,594	

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	2019-07-22
기준일	2019-07-19

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	183,446	0	183,446	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	383,067	0	383,067	
누계	통화	선도	0	443,397	-443,397	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E	470
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E	470
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E	376
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E	789
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E	282
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E	282
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	789
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	630
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E	470
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E	1,879
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E	1,879
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E	695
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E	695
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E	1,297
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E	2,548
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E	3,101
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E	2,105
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E	1,691
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E	2,067
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E	132
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	564
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	3,007
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	3,289
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	470
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E	940
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E	2,922
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E	1,635

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

(단위:백만원)

11,569

공시일	2019-07-22
기준일	2019-07-19

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

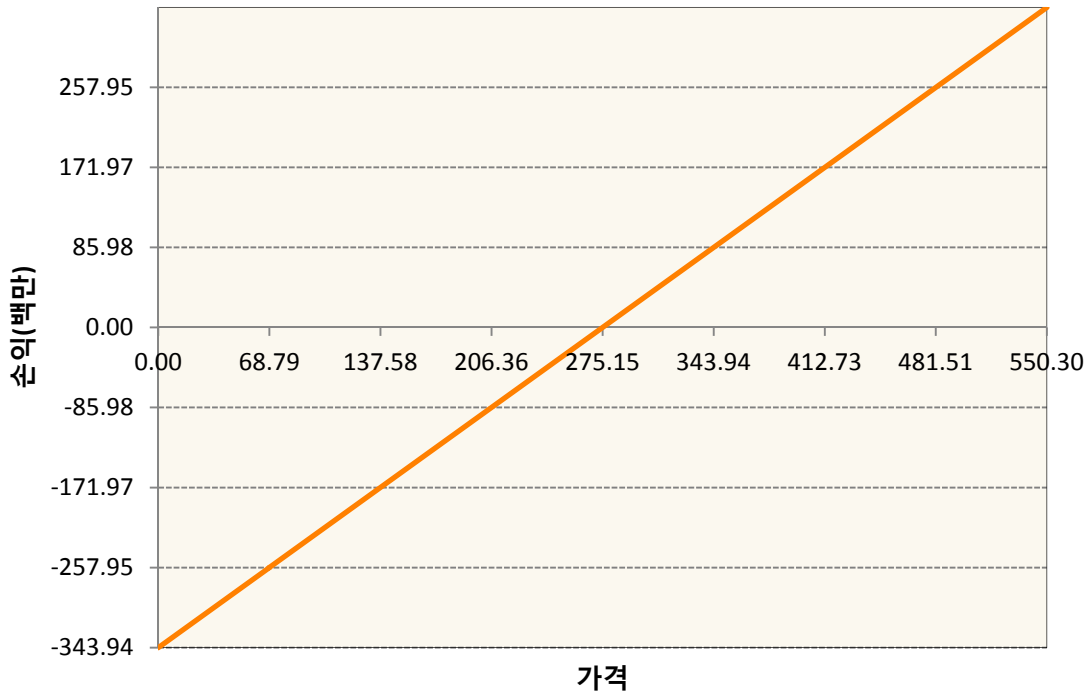
1. 계약금액

(단위:백만원)

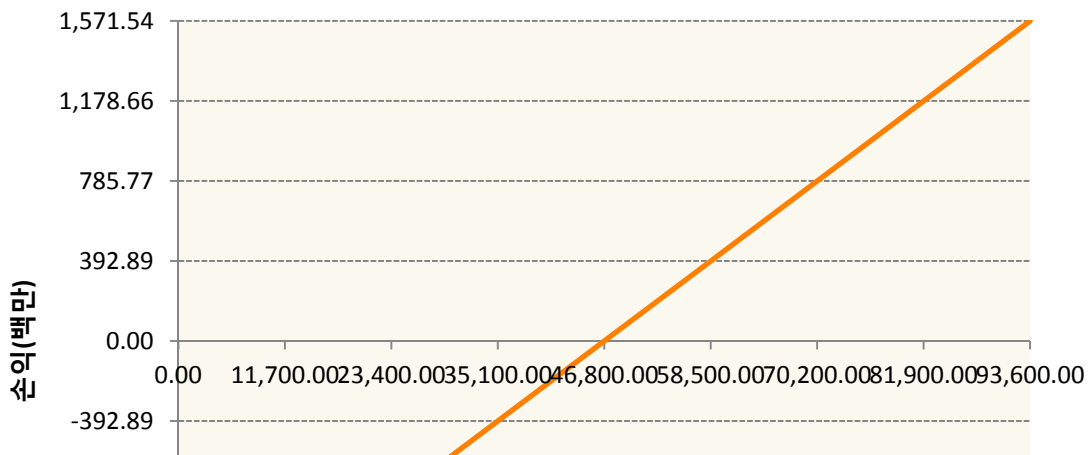
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,915	0	1,915	장내

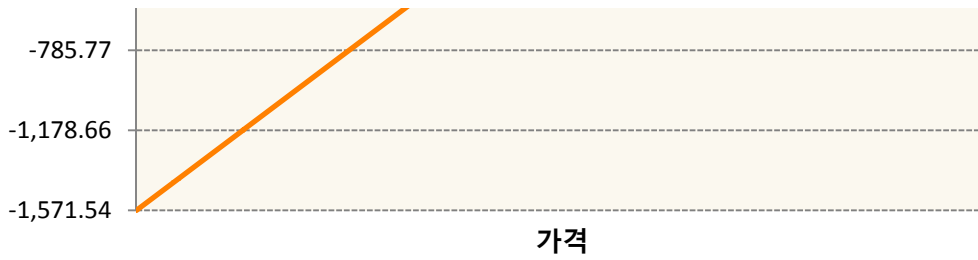
2. 만기시점의 손익구조

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)

177

공시일	2019-07-22
기준일	2019-07-19

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

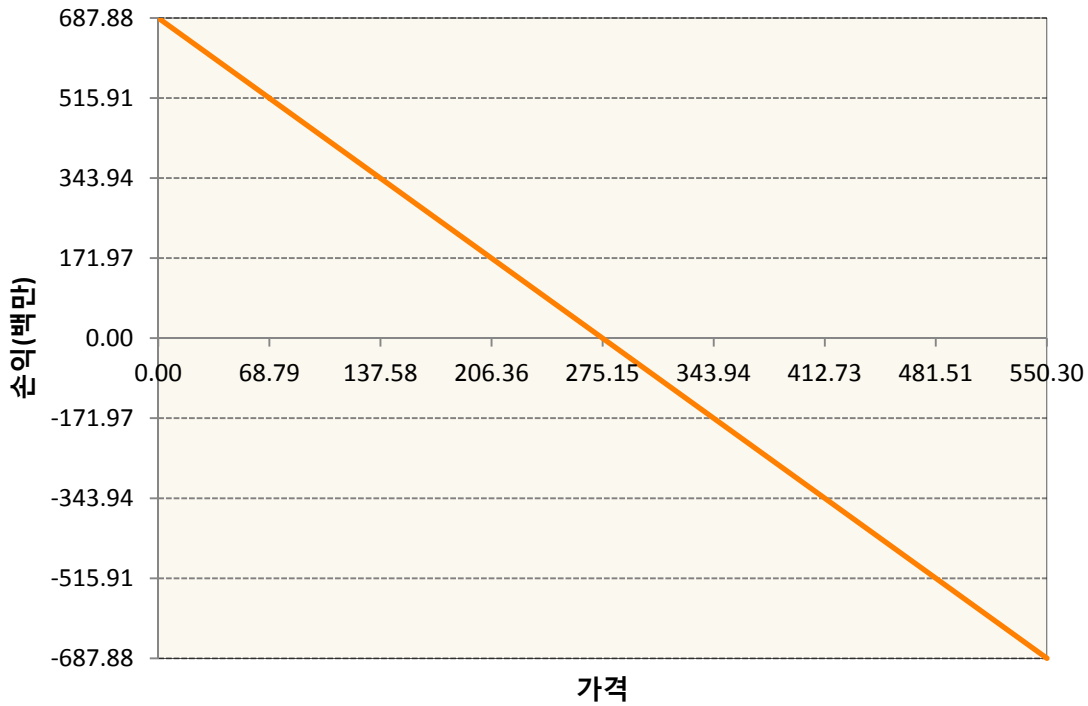
1. 계약금액

(단위:백만원)

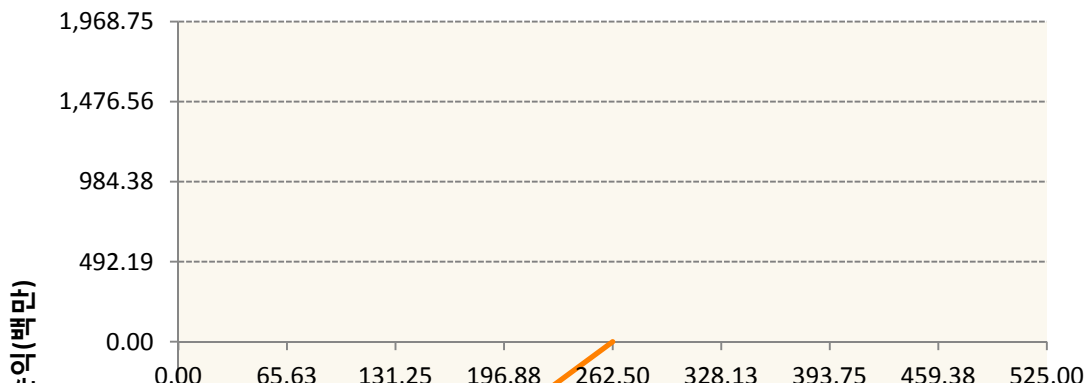
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	688	-688	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,625	-3,625	장내

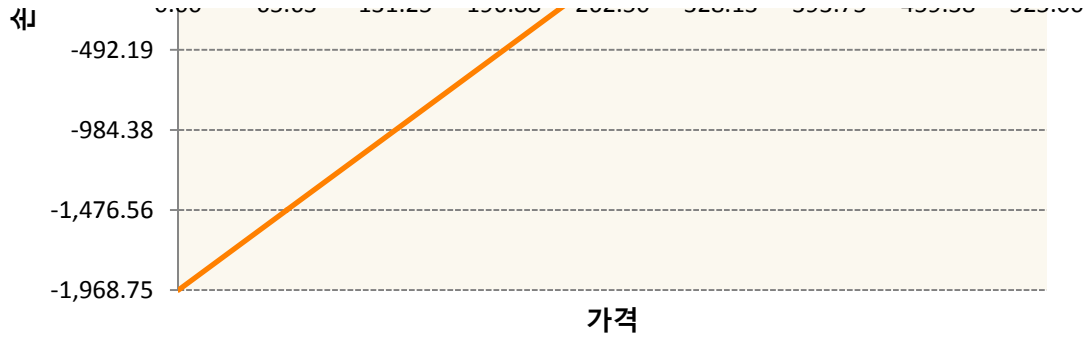
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

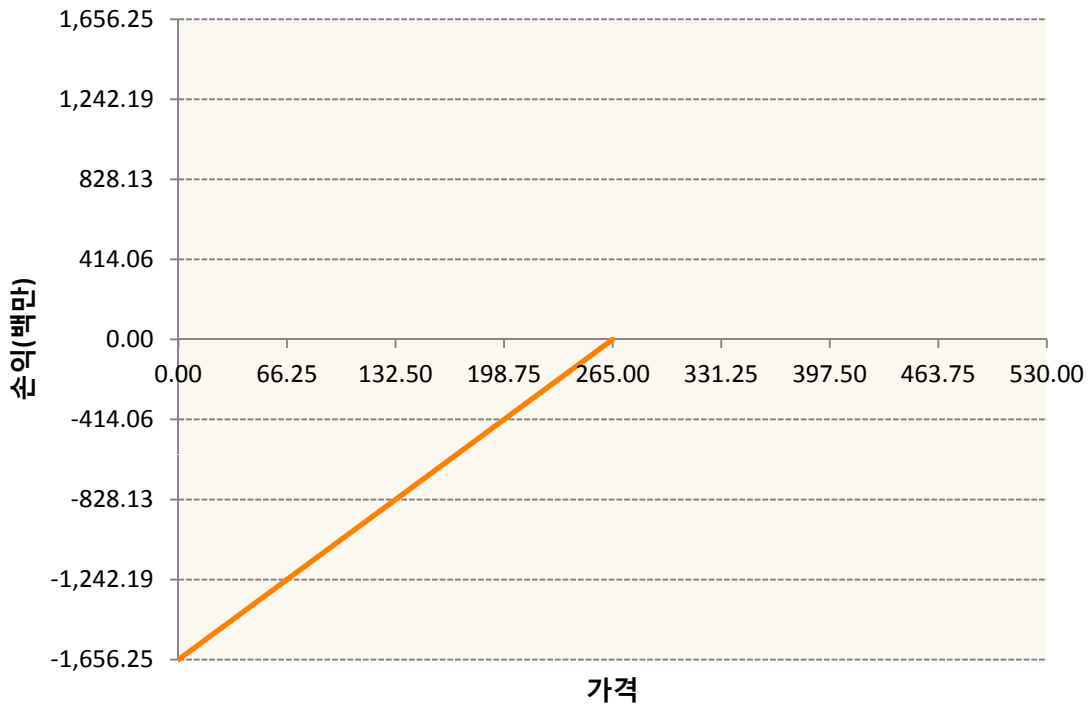


KR4301P82624-2019-08 풋262.5





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						79
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-74	-74	-75	-76	-77	-78	-79
-5.33%	-28	-30	-32	-34	-36	-38	-40
-2.67%	-4	-6	-8	-9	-11	-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

78

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-75	-75	-75	-76	-76	-77	-78
-5.33%	-33	-35	-36	-37	-39	-40	-42
-2.67%	-6	-8	-10	-12	-13	-15	-17
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	4	4	3	3	3	2	2
5.33%	4	4	4	4	4	4	3
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

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

(단위:백만원)

157

공시일	2019-07-22
기준일	2019-07-19

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	18,349	0	18,349	
누계	통화	선도	0	18,205	-18,205	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		977
FX21019N01 KRW/USD 12-08-19E		160

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

(단위:백만원)

475

공시일	2019-07-22
기준일	2019-07-19

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	49	-49	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	2019-07-22
기준일	2019-07-19

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

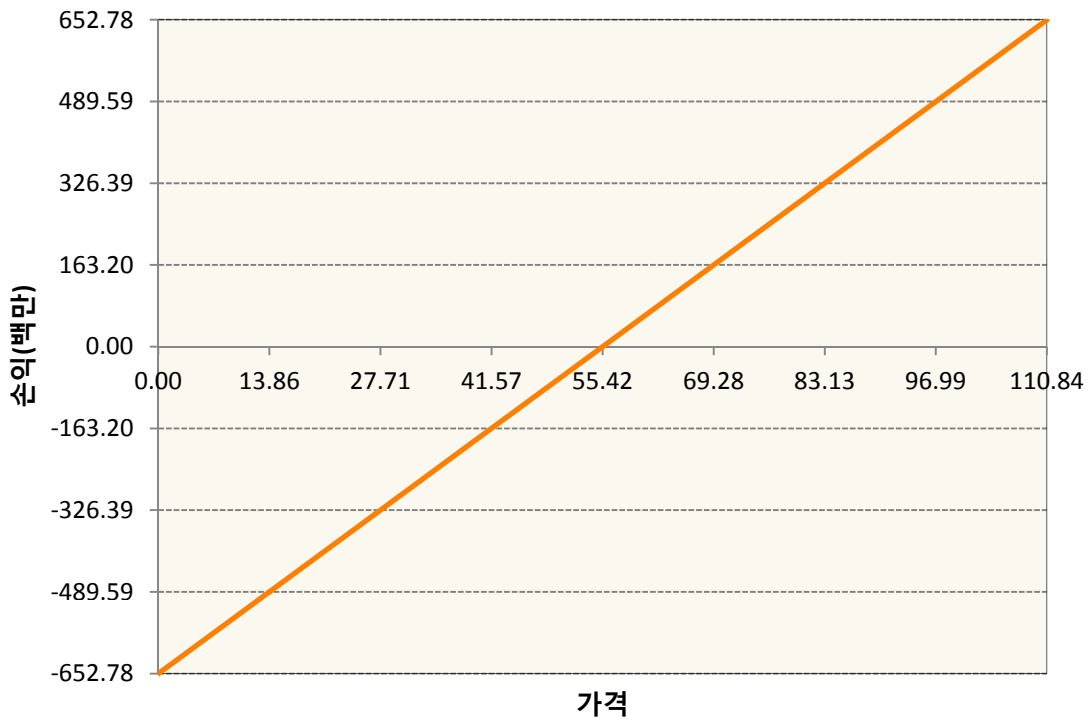
1. 계약금액

(단위:백만원)

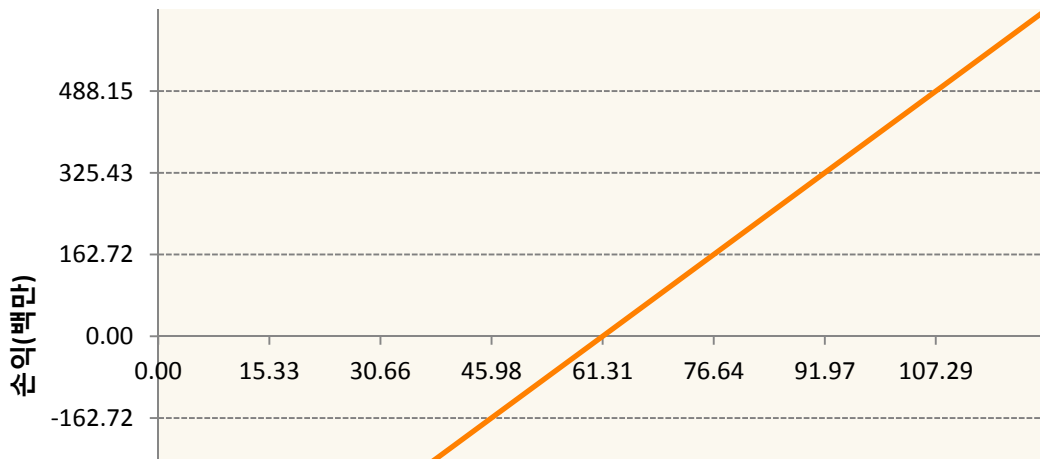
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,585	117	2,468	

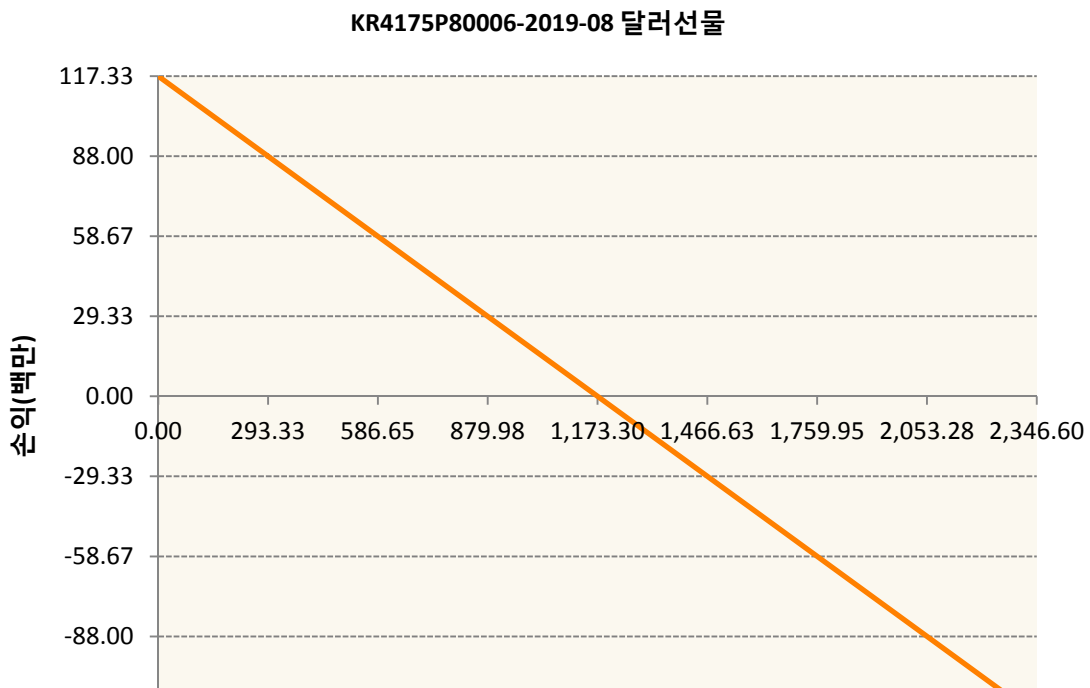
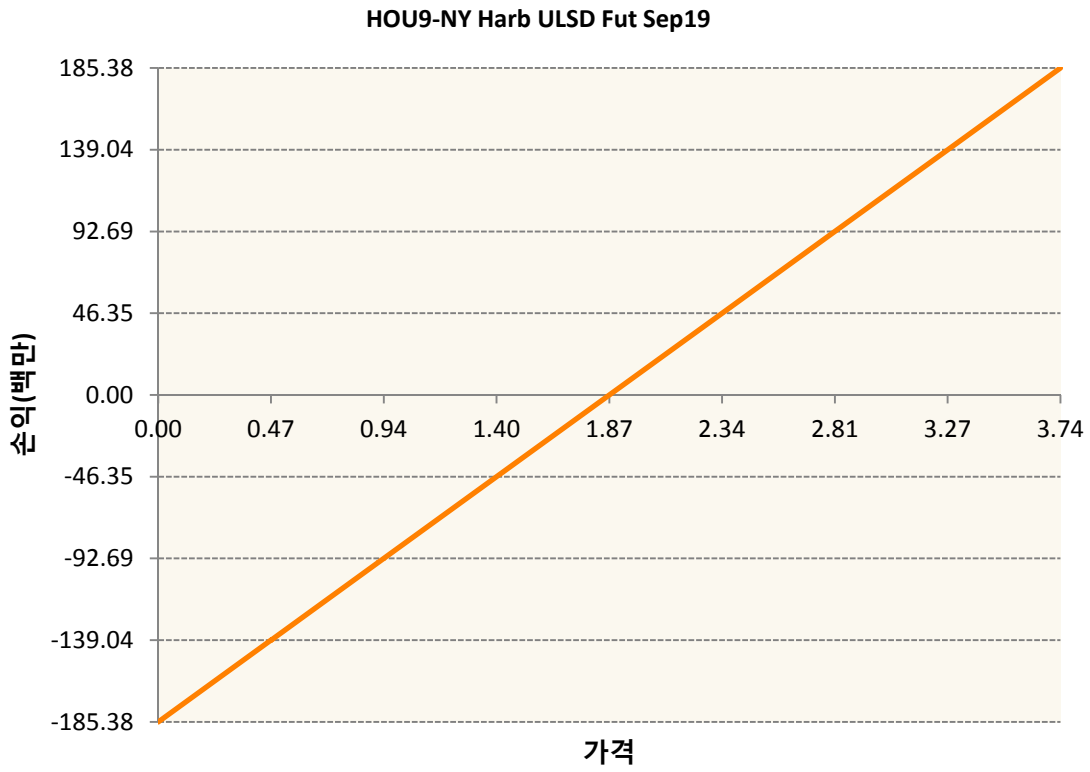
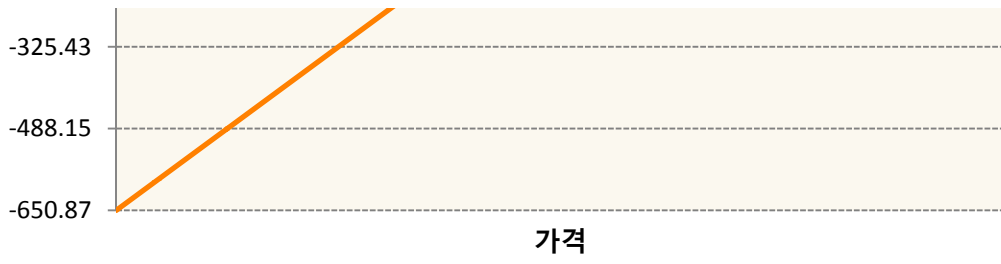
2. 만기시점의 손익구조

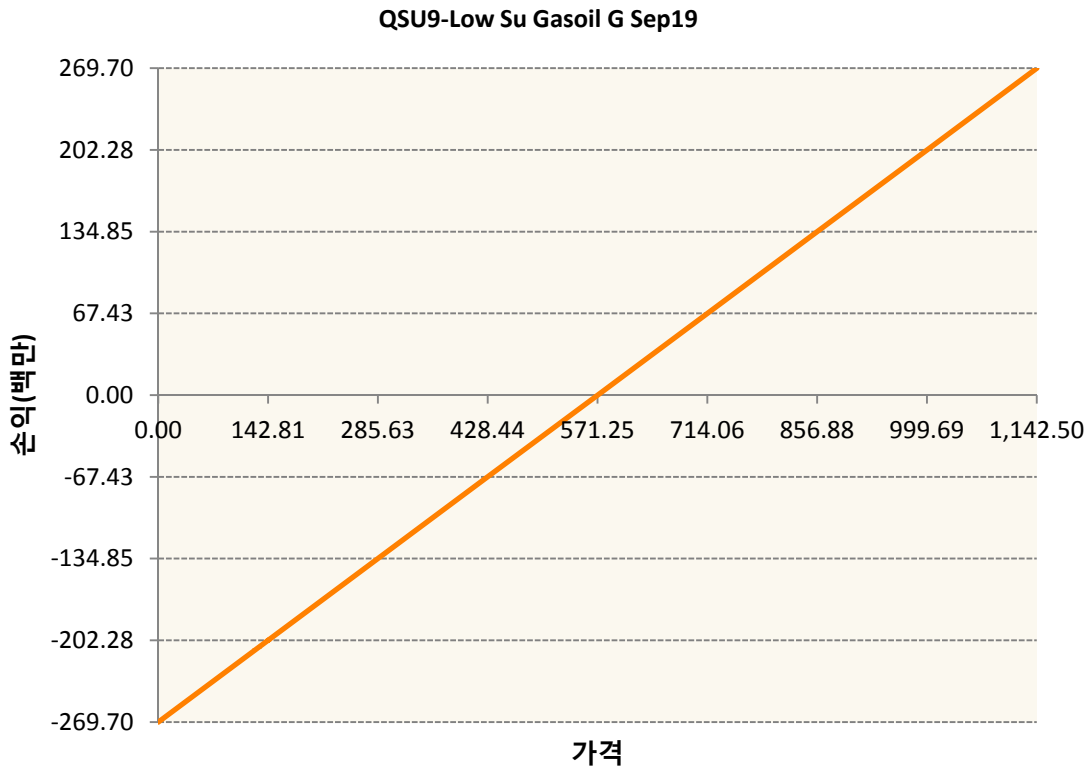
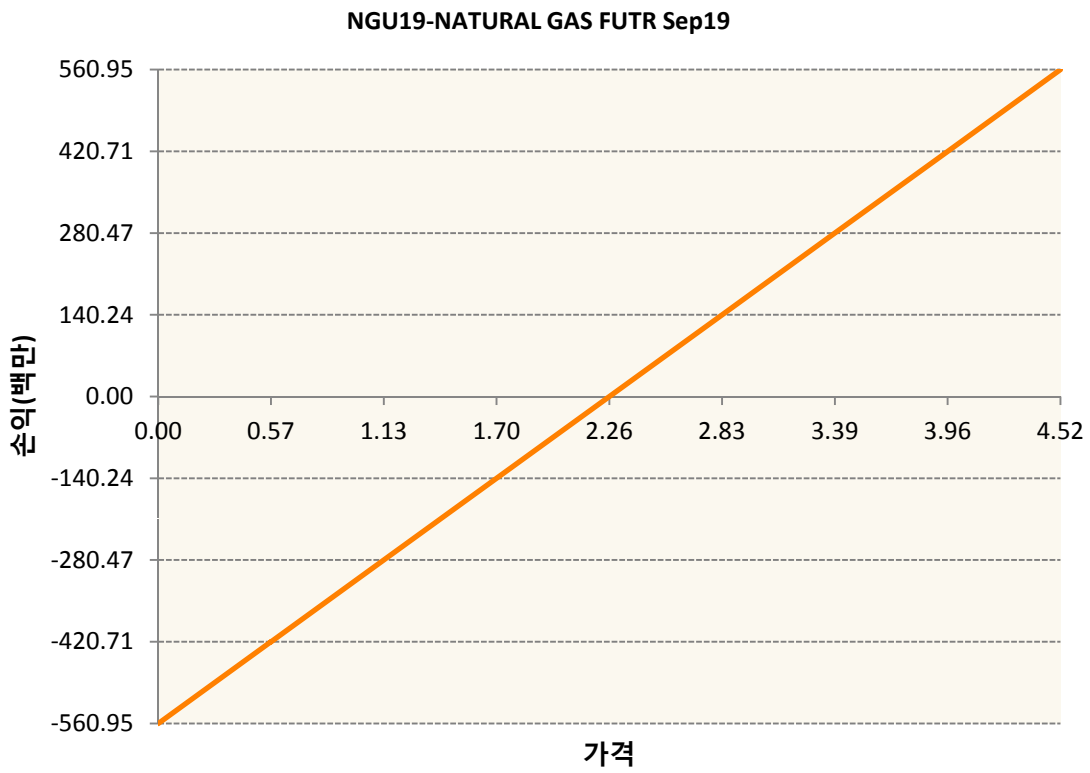
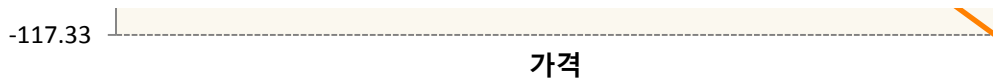
CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19



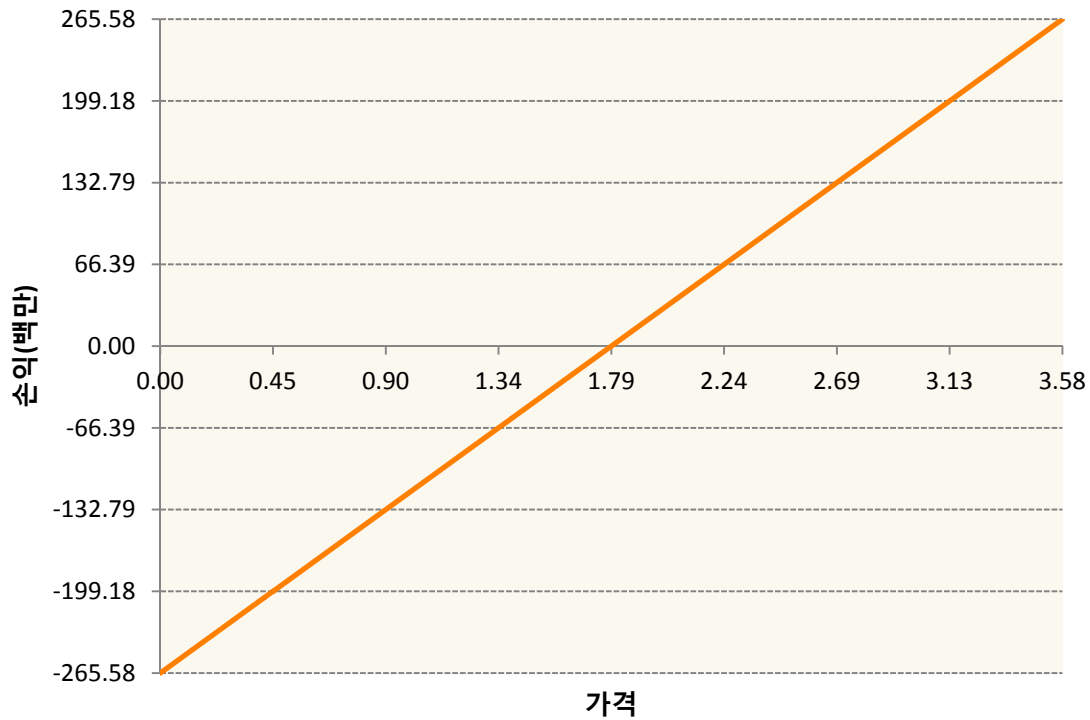
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19







XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	52
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	52
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	15
KR4175P800	2019-08 달러선물	9
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	45
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	22
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	21

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

(단위:백만원)

381

공시일	2019-07-22
기준일	2019-07-19

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

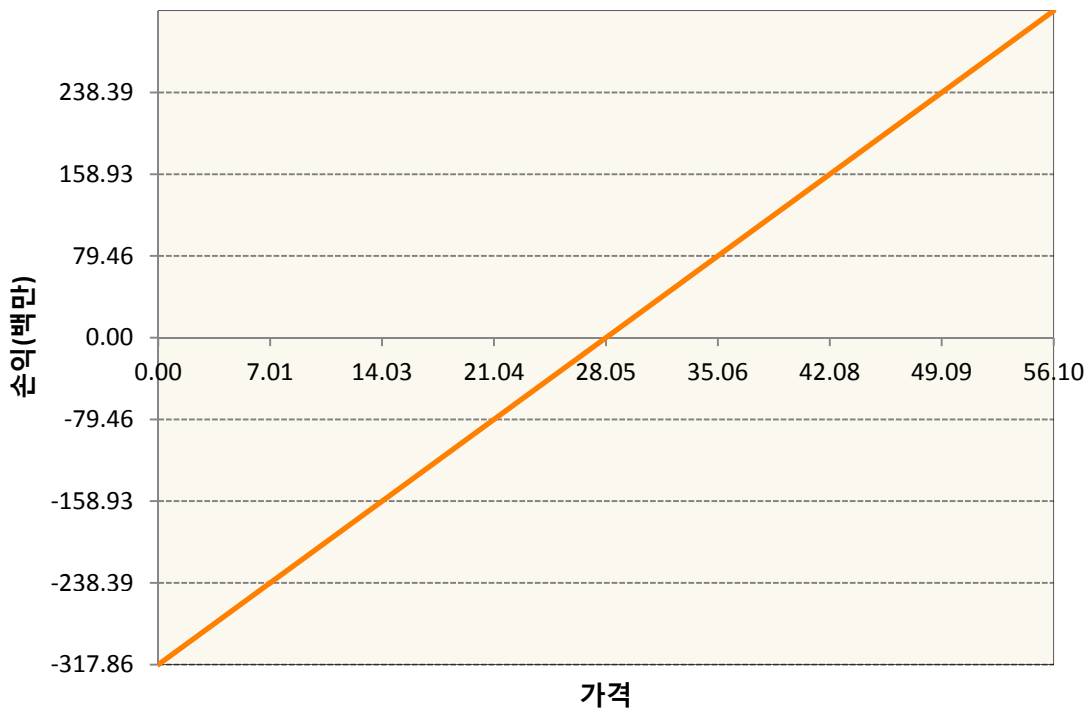
1. 계약금액

(단위:백만원)

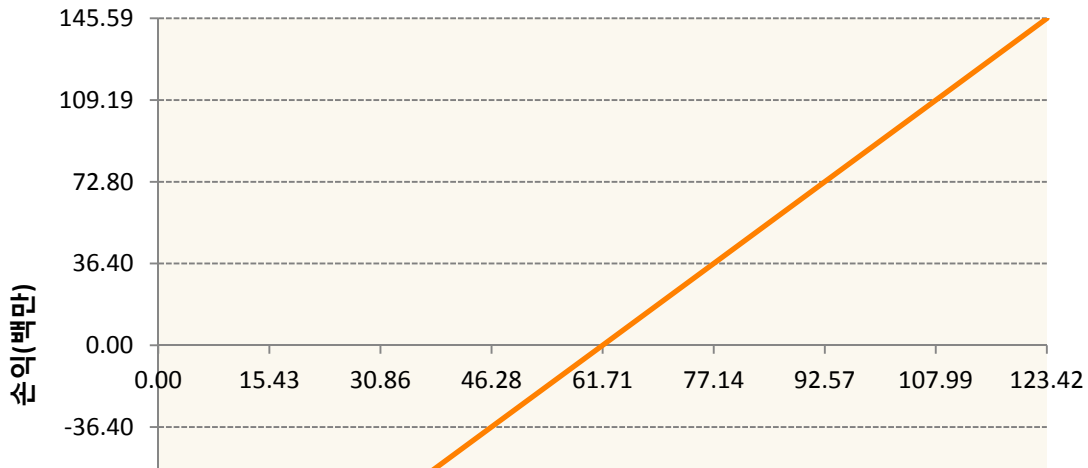
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,076	199	2,876	

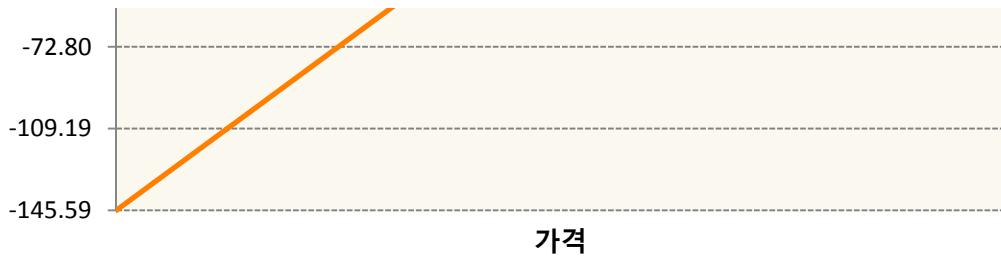
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

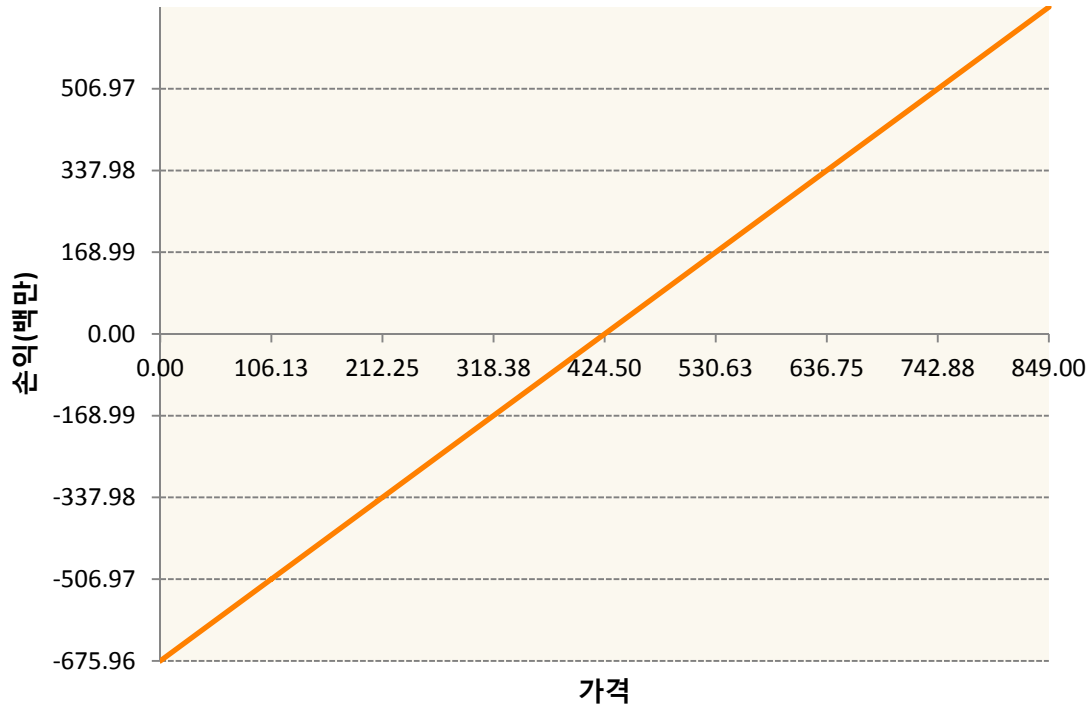


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

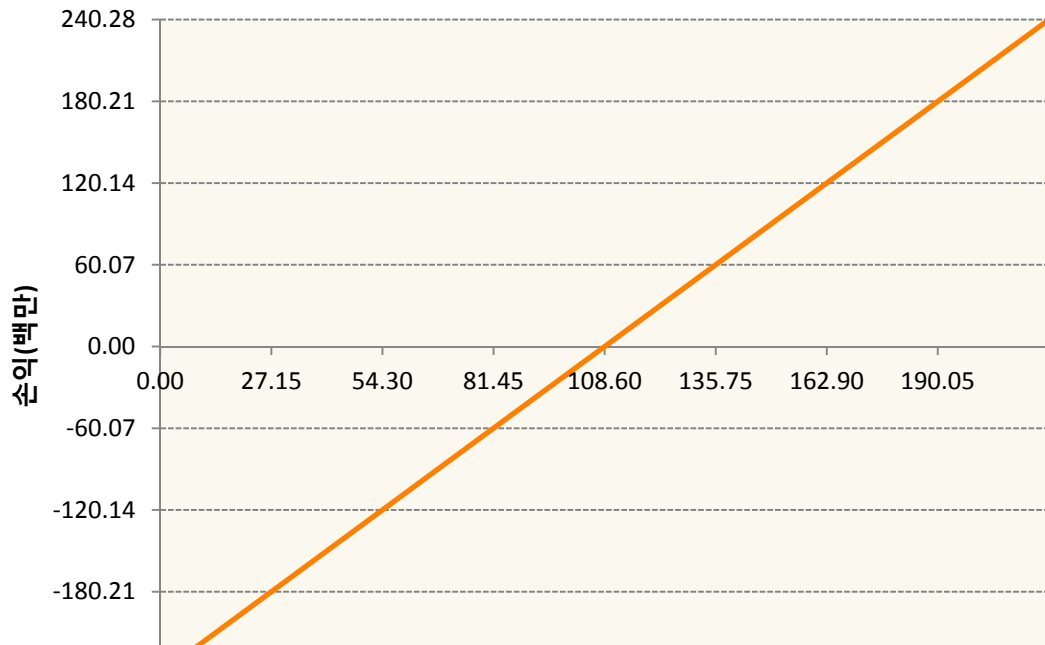


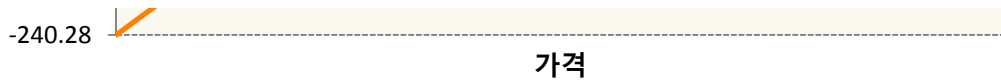


CU9-CORN FUTURE Sep19

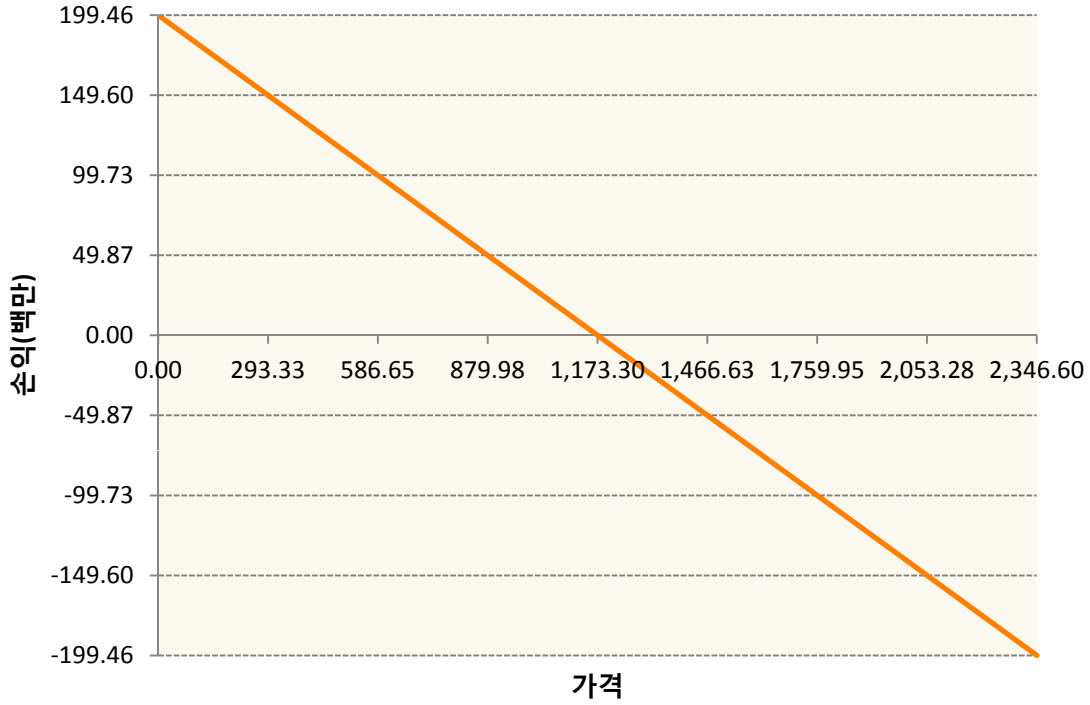


KCU9-COFFEE 'C' FUTURE Sep19

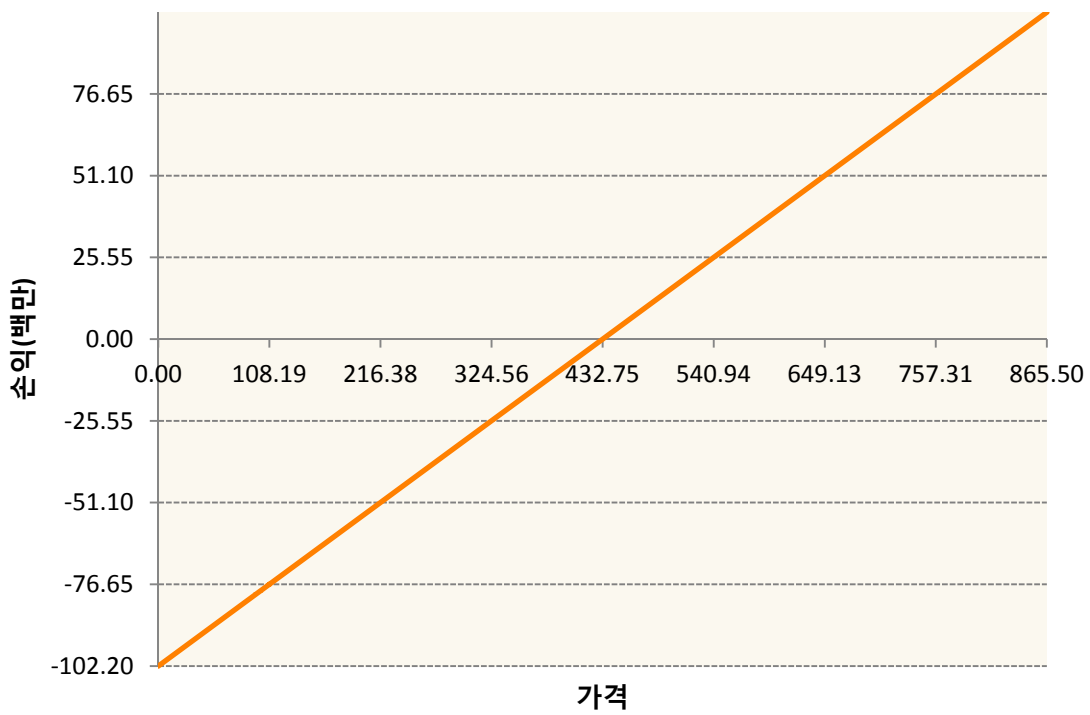




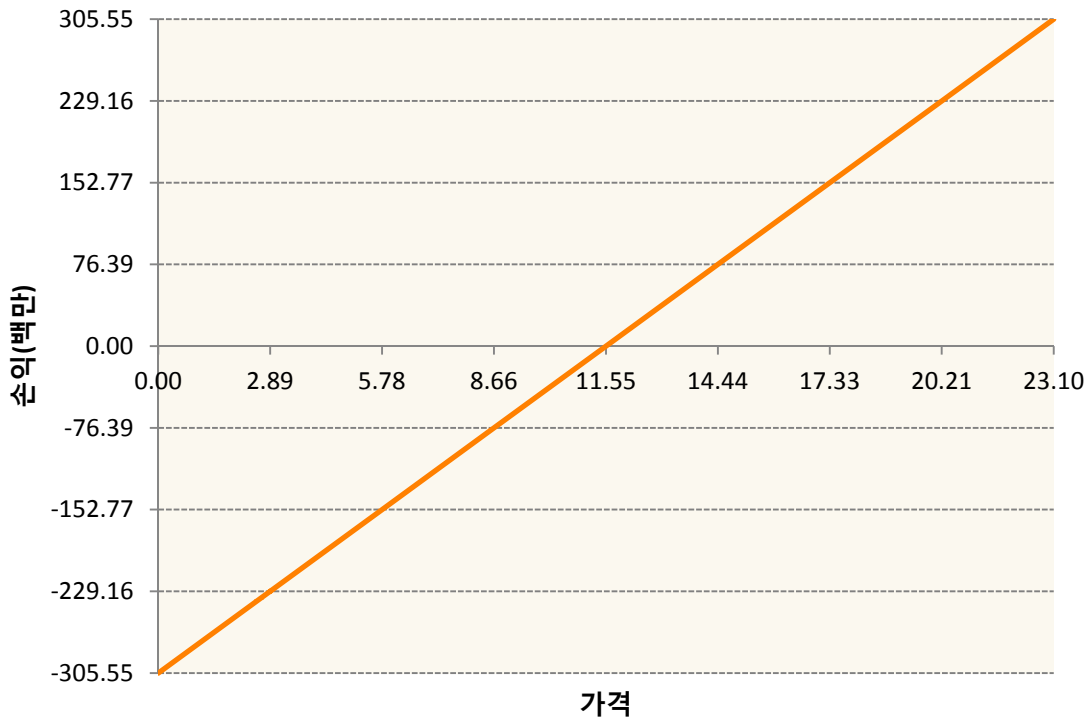
KR4175P80006-2019-08 달러선물



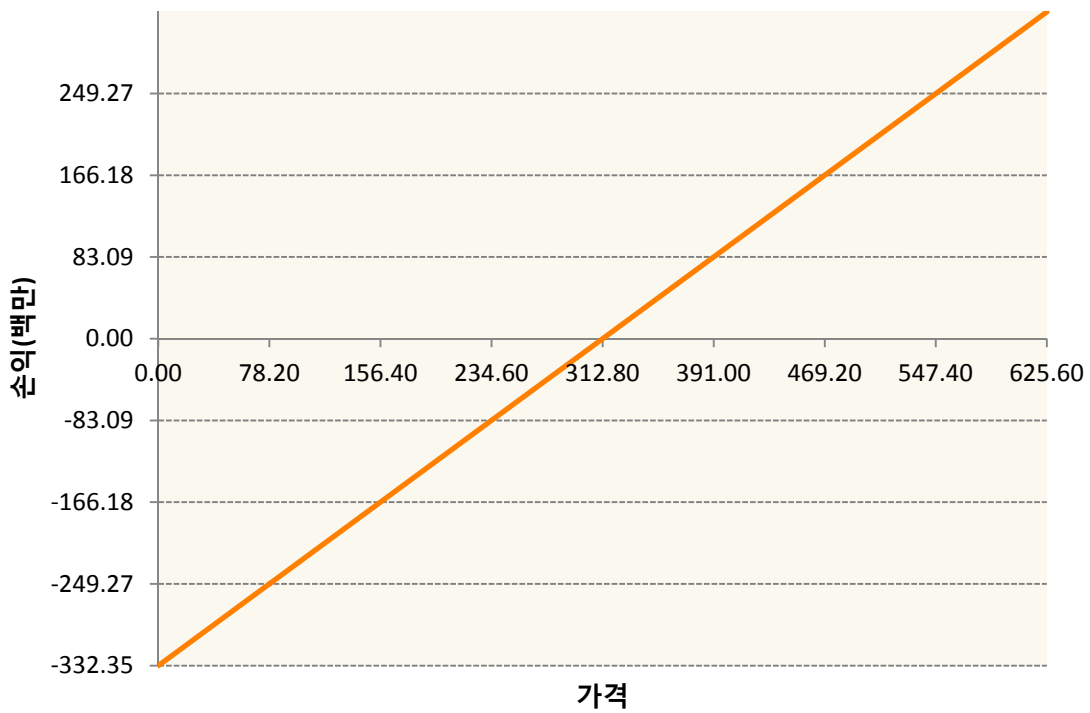
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

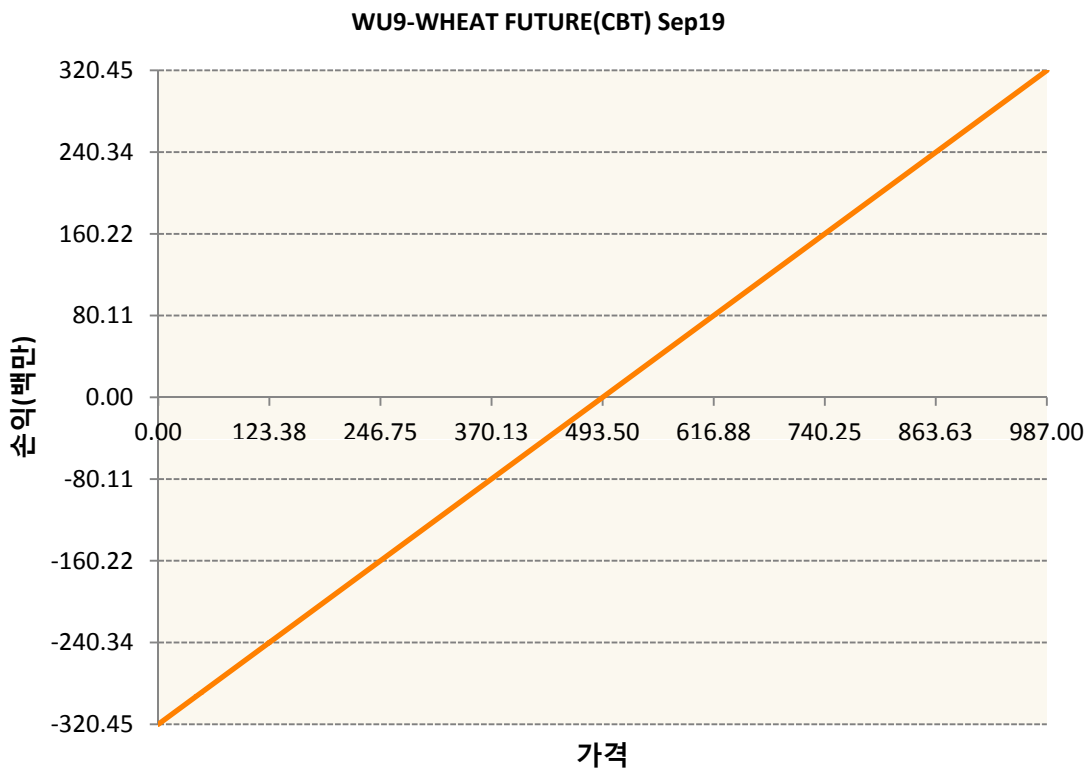
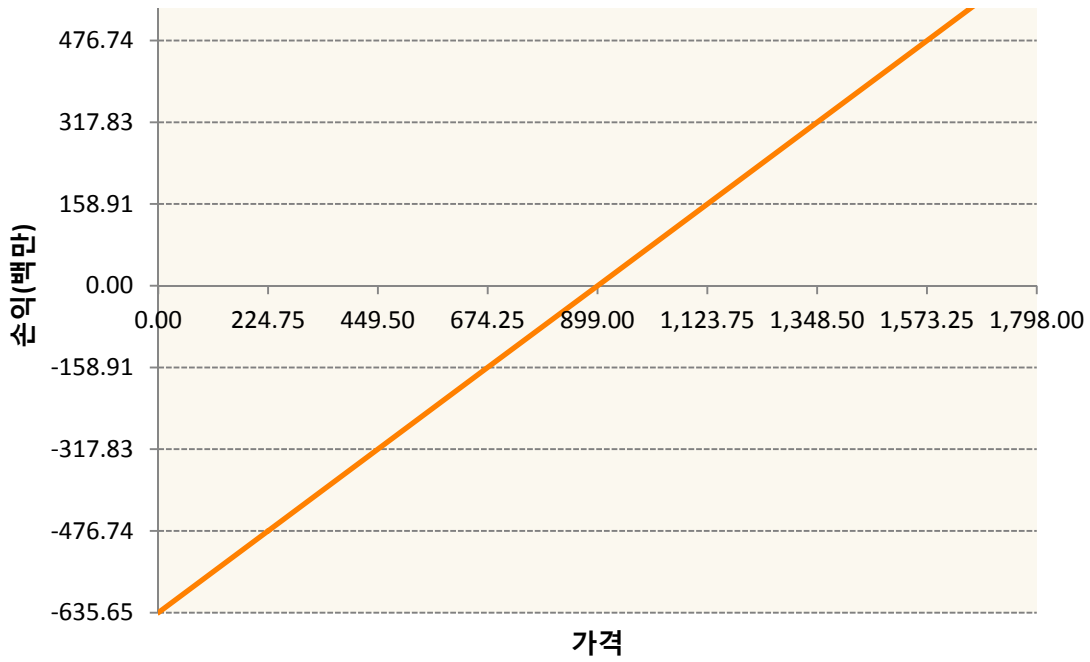


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	25
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	12
CU9	CORN FUTURE Sep19	54
KCU9	COFFEE 'C' FUTURE Sep19	19
KR4175P800	2019-08 달러선물	16

KWU9	KC HRW WHEAT FUT Sep19	8
SBV9	SUGAR #11 (WORLD) Oct19	24
SMZ9	SOYBEAN MEAL FUTR Dec19	27
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	51
WU9	WHEAT FUTURE(CBT) Sep19	26

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

(단위:백만원)

270