

공시일	2019-07-23
기준일	2019-07-22

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	2019-07-23
기준일	2019-07-22

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

1,174

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

662

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-23
기준일	2019-07-22

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)	374
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	137

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

822

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-23
기준일	2019-07-22

유로인덱스모(주식-파생형)

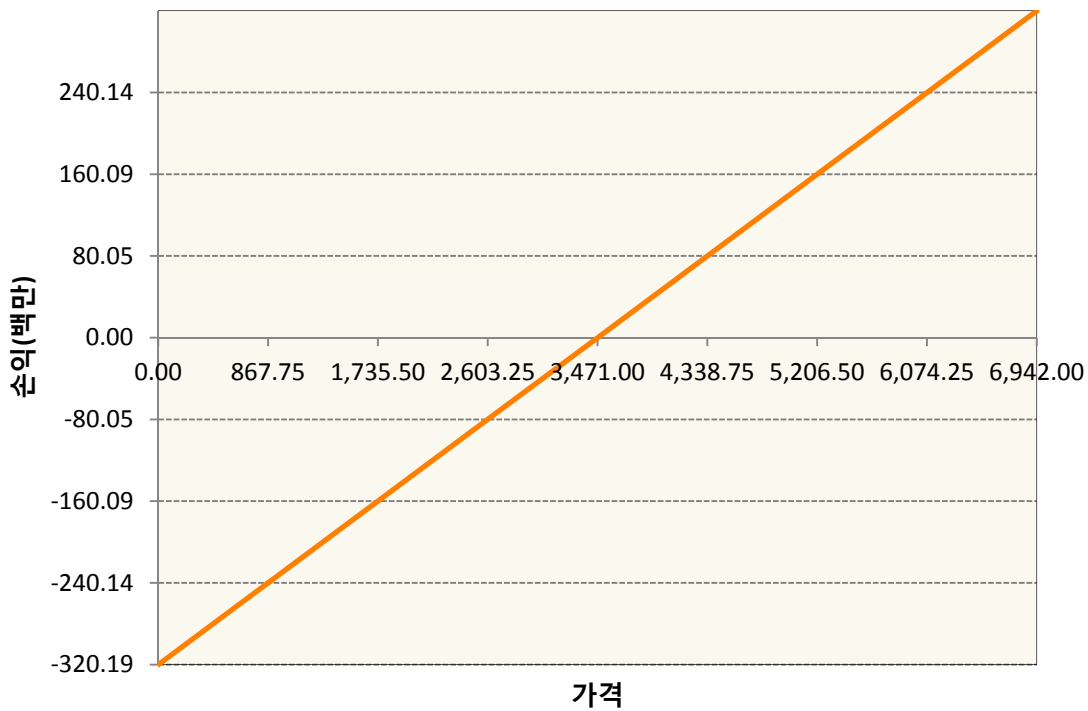
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	320	0	320	

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	2019-07-23
기준일	2019-07-22

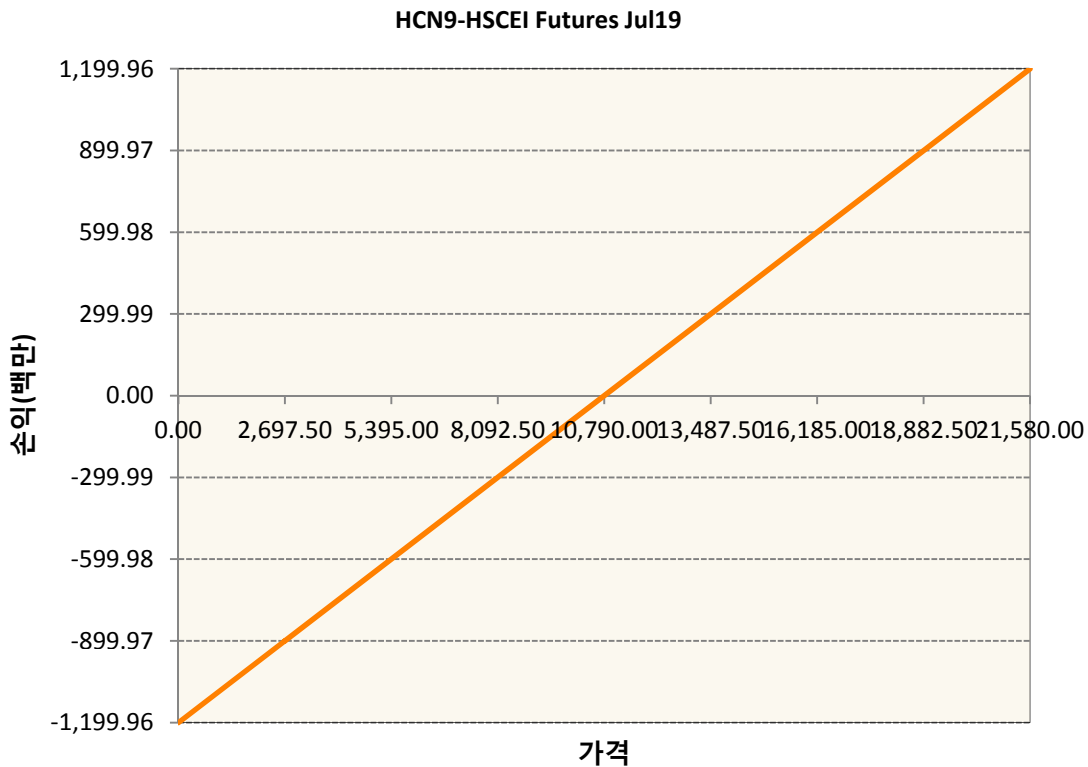
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,200	0	1,200	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

96

공시일	2019-07-23
기준일	2019-07-22

커버드콜모(주식혼합-파생형)

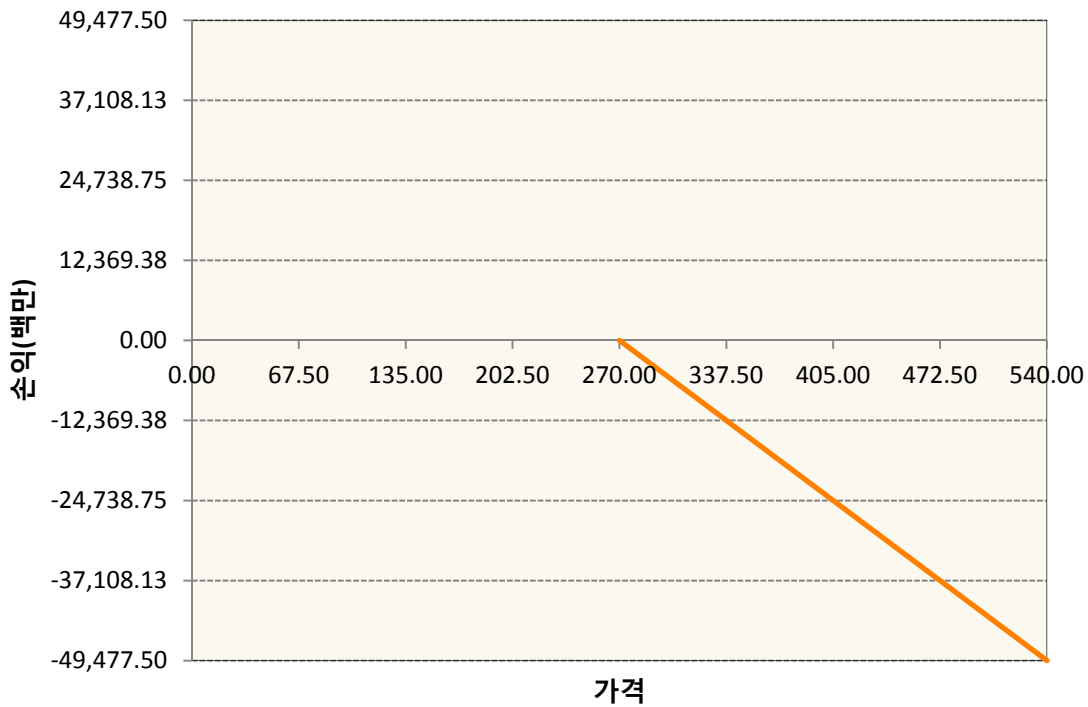
1. 계약금액

(단위:백만원)

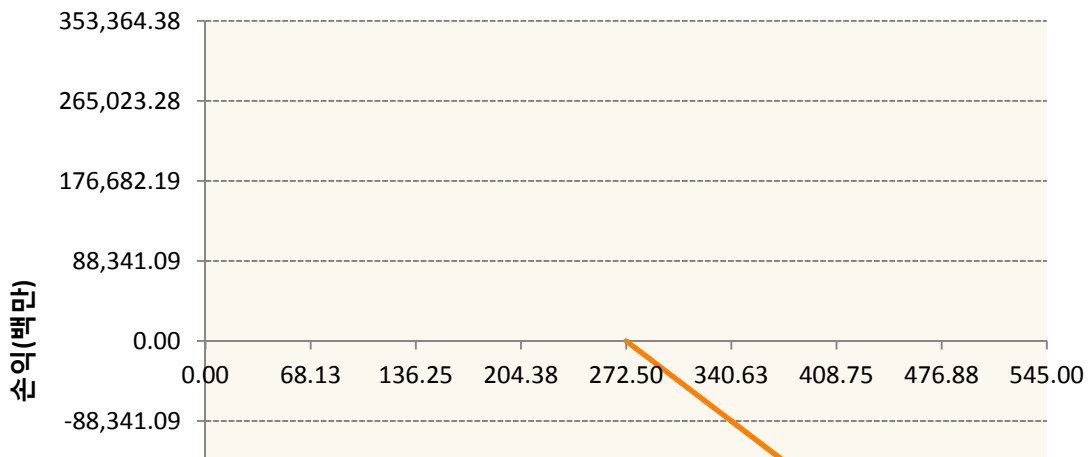
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	3,350	0	3,350	장내
누계	유가증권	옵션	0	589,079	-589,079	장내

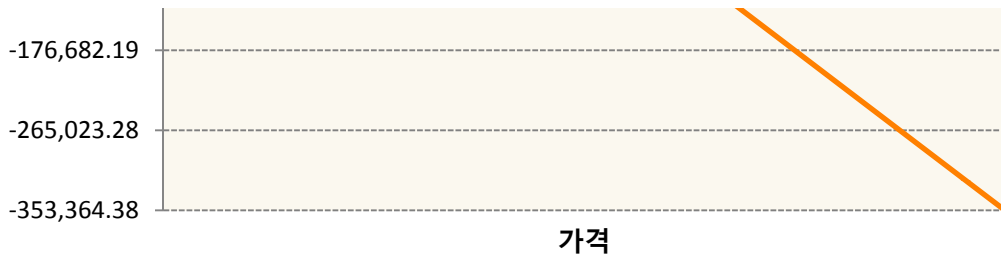
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P82709-2019-08 콜270

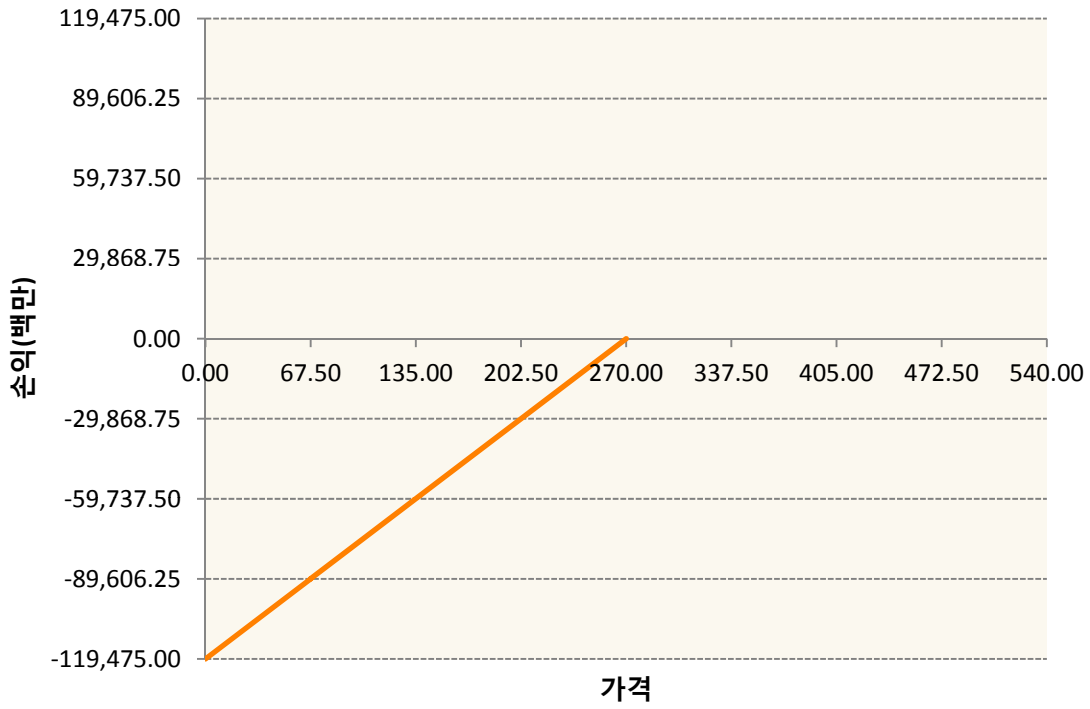


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

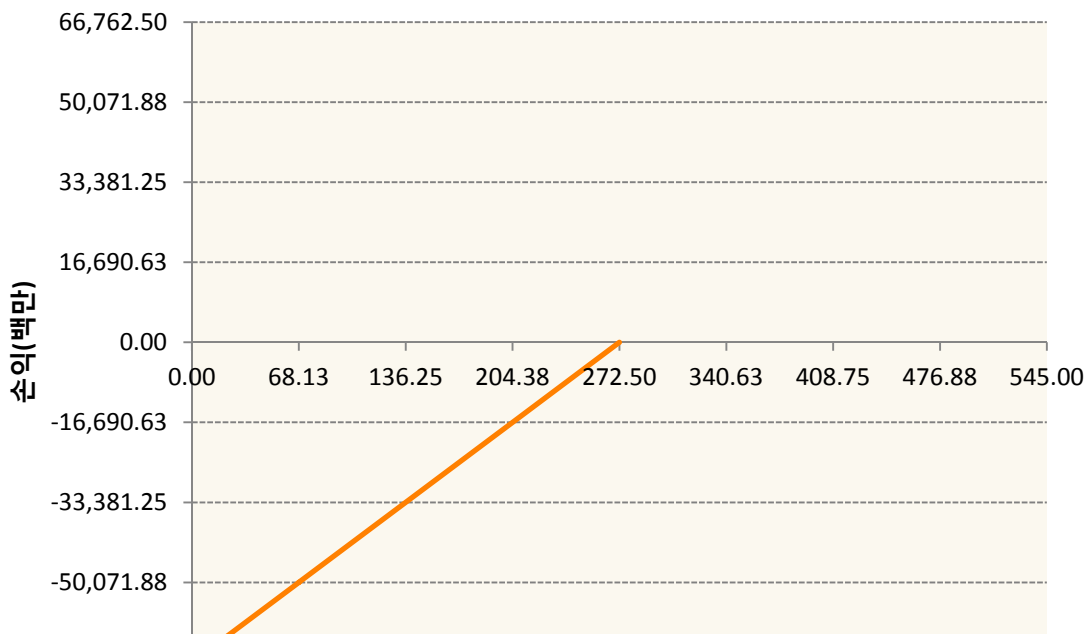




KR4301P82707-2019-08 풋270



KR4301P82723-2019-08 풋272.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P82709 2019-08 콜270							3,448
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,477	1,454	1,424	1,388	1,348	1,303	1,254
-5.33%	1,342	1,285	1,225	1,160	1,093	1,024	952
-2.67%	967	883	798	713	628	543	457
0%	248	166	83	0	-84	-169	-254
2.67%	-789	-842	-900	-963	-1,029	-1,098	-1,169
5.33%	-2,019	-2,043	-2,074	-2,110	-2,152	-2,199	-2,250
8.00%	-3,330	-3,338	-3,350	-3,367	-3,389	-3,416	-3,448
KR4201P82725 2019-08 콜272.5							23,341
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,696	8,580	8,424	8,229	7,997	7,732	7,436
-5.33%	8,065	7,746	7,386	6,994	6,575	6,133	5,672
-2.67%	6,084	5,532	4,969	4,398	3,820	3,236	2,649
0%	1,853	1,237	619	0	-620	-1,241	-1,862
2.67%	-4,779	-5,240	-5,728	-6,238	-6,765	-7,306	-7,859
5.33%	-13,104	-13,343	-13,628	-13,954	-14,316	-14,709	-15,129
8.00%	-22,241	-22,329	-22,455	-22,621	-22,825	-23,066	-23,341
KR4301P82707 2019-08 풋270							7,155
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,098	-7,100	-7,104	-7,111	-7,121	-7,136	-7,155
-5.33%	-3,904	-3,933	-3,971	-4,016	-4,068	-4,127	-4,190
-2.67%	-1,157	-1,262	-1,368	-1,477	-1,586	-1,696	-1,807
0%	288	196	100	0	-102	-206	-312
2.67%	614	592	562	524	478	426	368
5.33%	641	639	635	629	619	604	585
8.00%	641	641	641	641	639	637	633
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							4,344
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,327	-4,327	-4,328	-4,330	-4,333	-4,337	-4,344
-5.33%	-2,543	-2,551	-2,562	-2,578	-2,597	-2,619	-2,645
-2.67%	-889	-934	-982	-1,033	-1,085	-1,139	-1,194
0%	189	126	63	0	-64	-128	-192
2.67%	528	504	475	443	406	366	324

5.33%	568	565	561	553	543	529	512
8.00%	570	570	569	569	567	564	560

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

(단위:백만원)

39,963

공시일	2019-07-23
기준일	2019-07-22

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

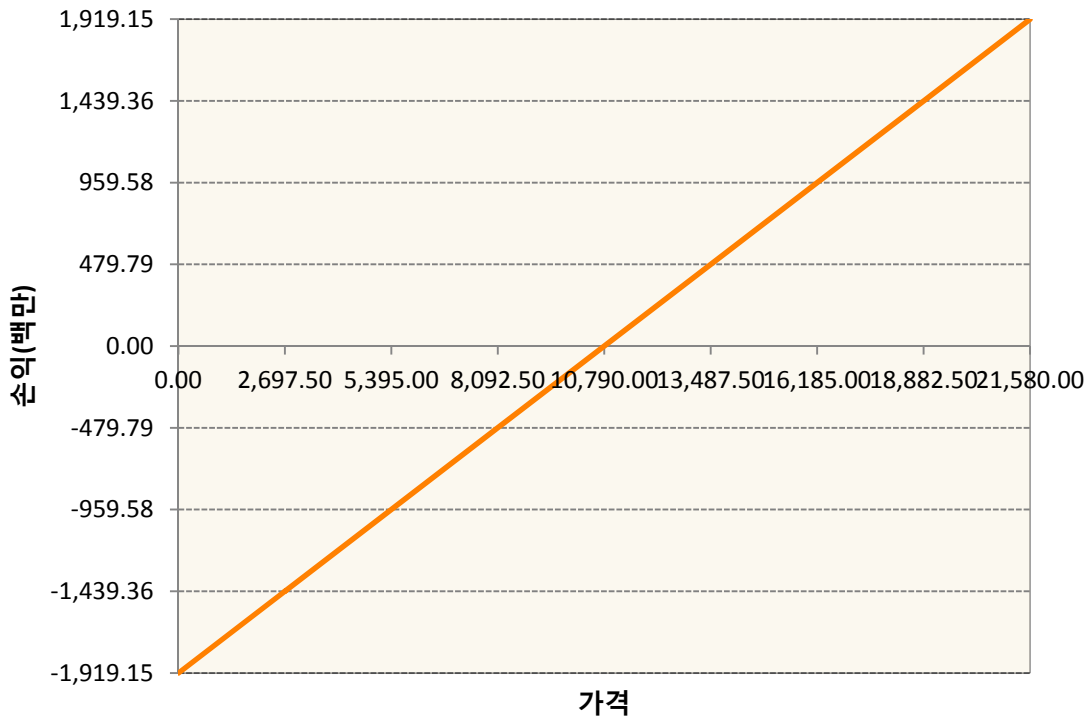
1. 계약금액

(단위:백만원)

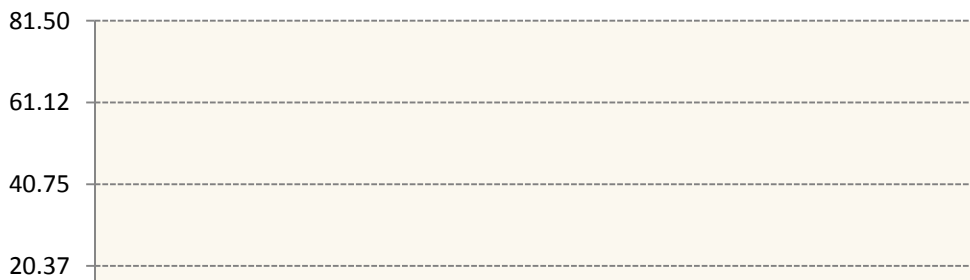
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,919	0	1,919	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,263	-5,263	장내
누계	통화	선도	151	3,169	-3,018	장외

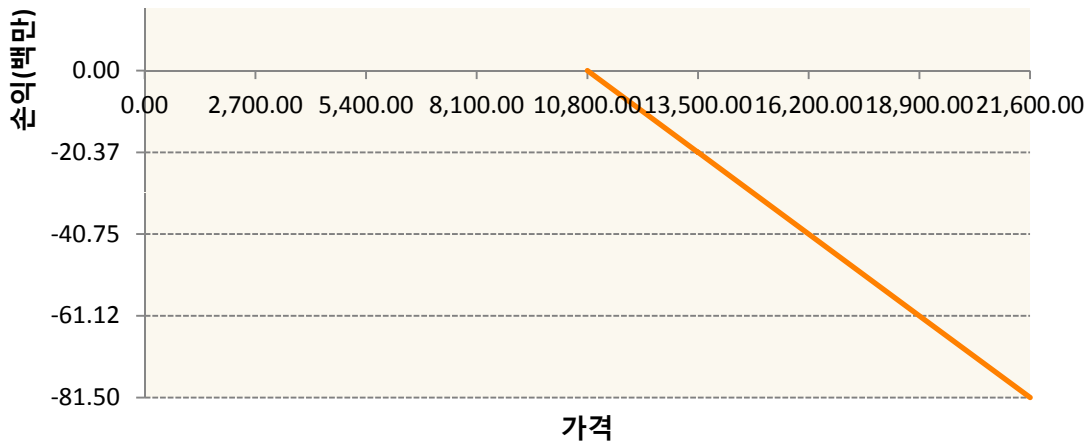
2. 만기시점의 손익구조

HCN9-HSCEI Futures Jul19

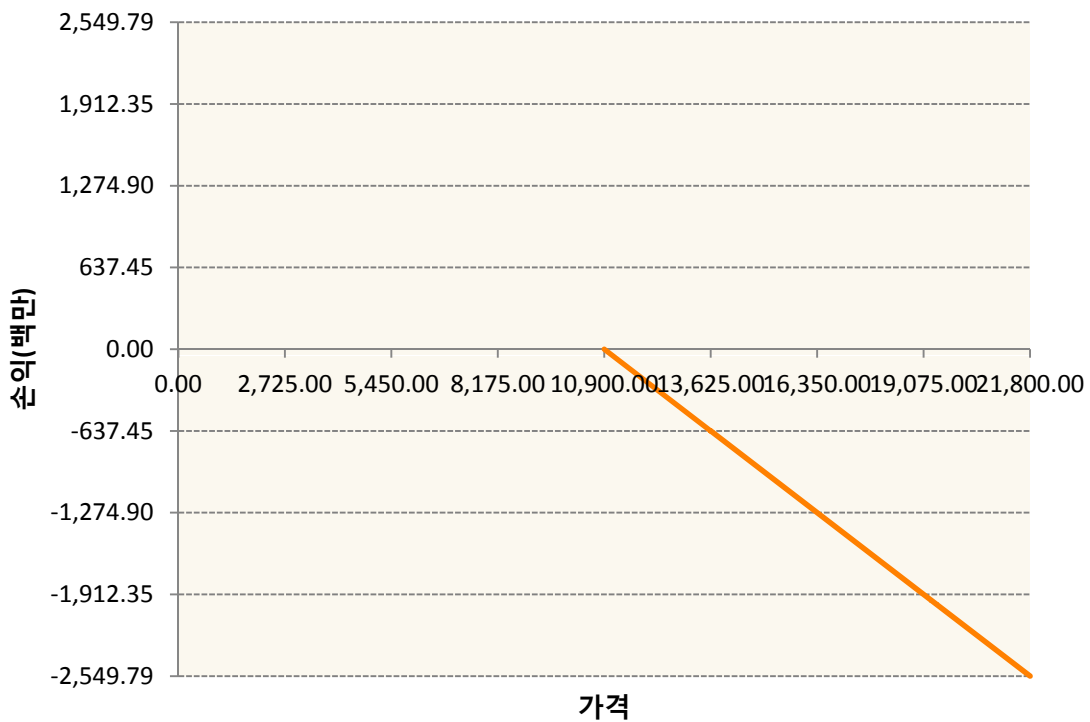


OHHIN9-C108-HSCEI

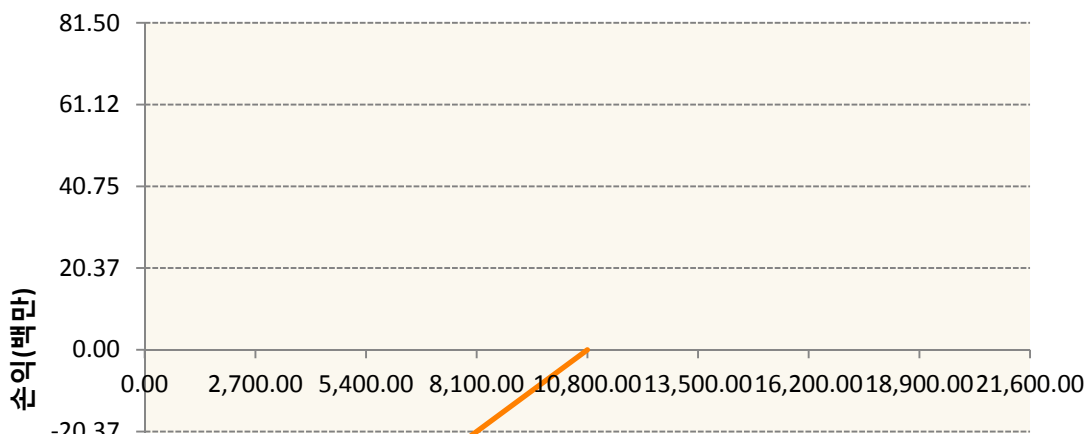


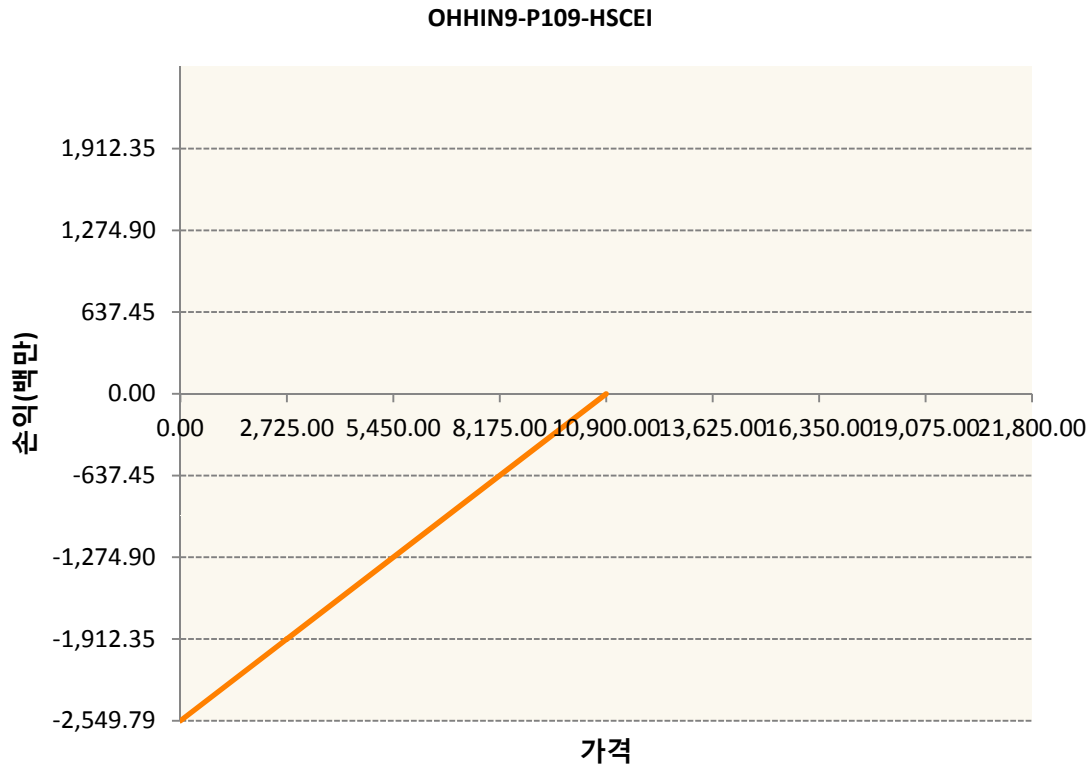
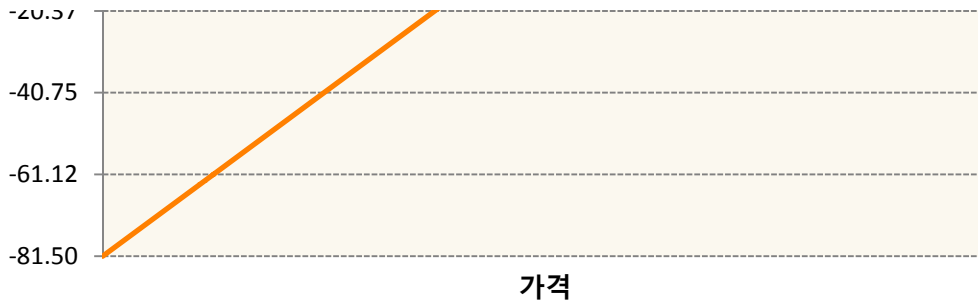


OHHIN9-C109-HSCEI



OHHIN9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	254
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E	12
HCN9 HSCEI Futures Jul19	154
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)

660

공시일	2019-07-23
기준일	2019-07-22

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

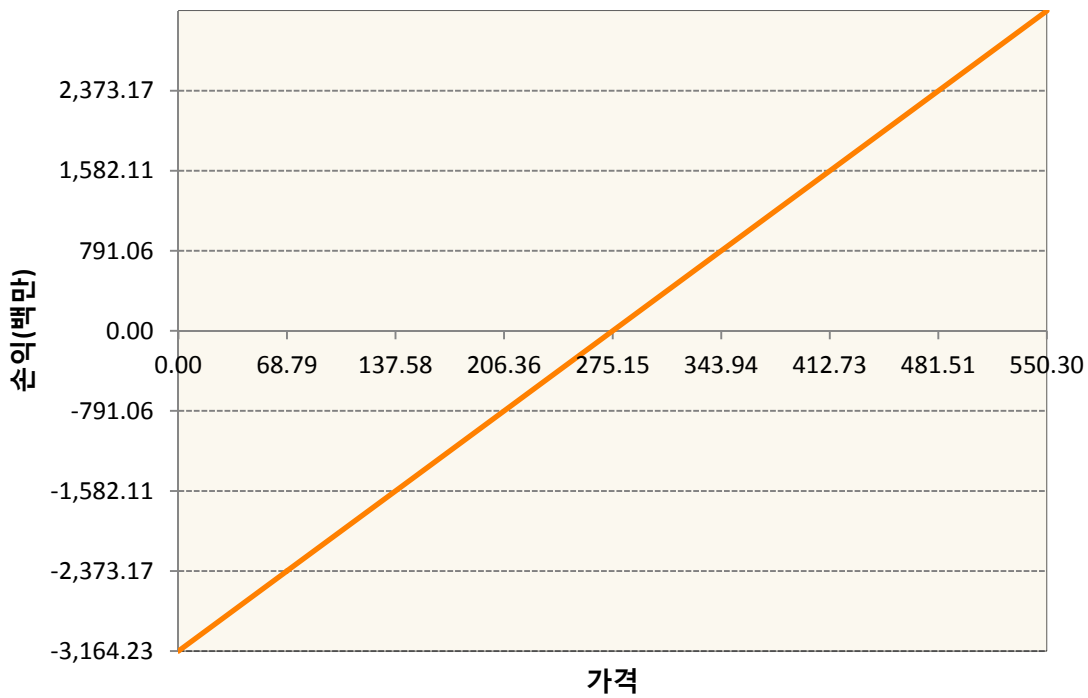
1. 계약금액

(단위:백만원)

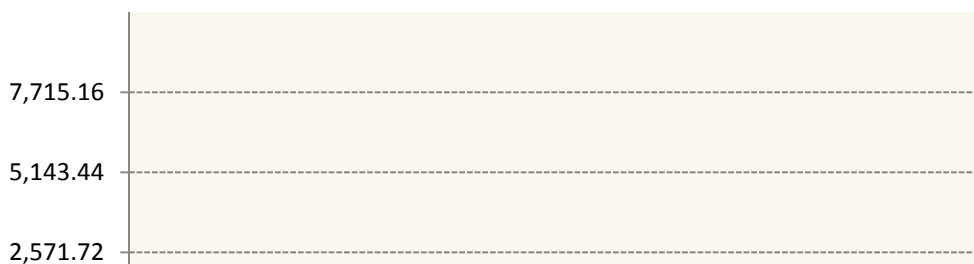
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	201	0	201	장내
누계	유가증권	선물	3,164	0	3,164	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	19,701	-19,701	장내

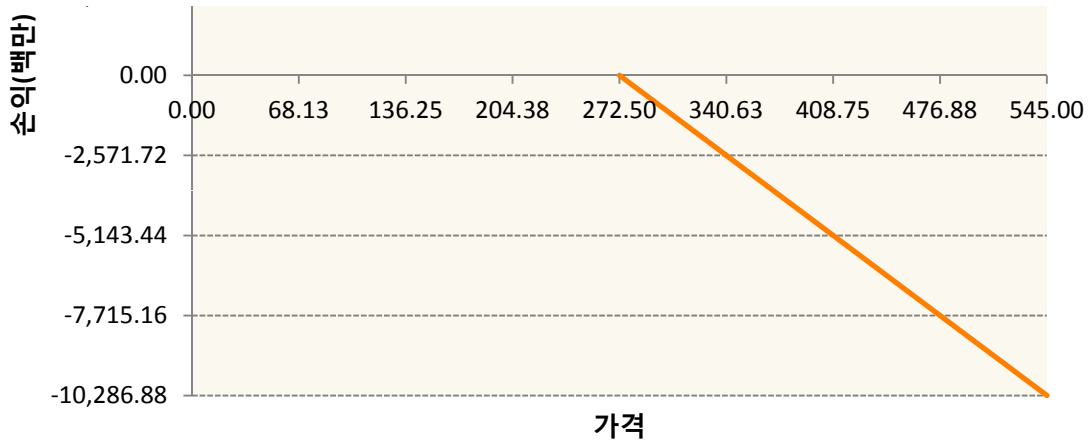
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

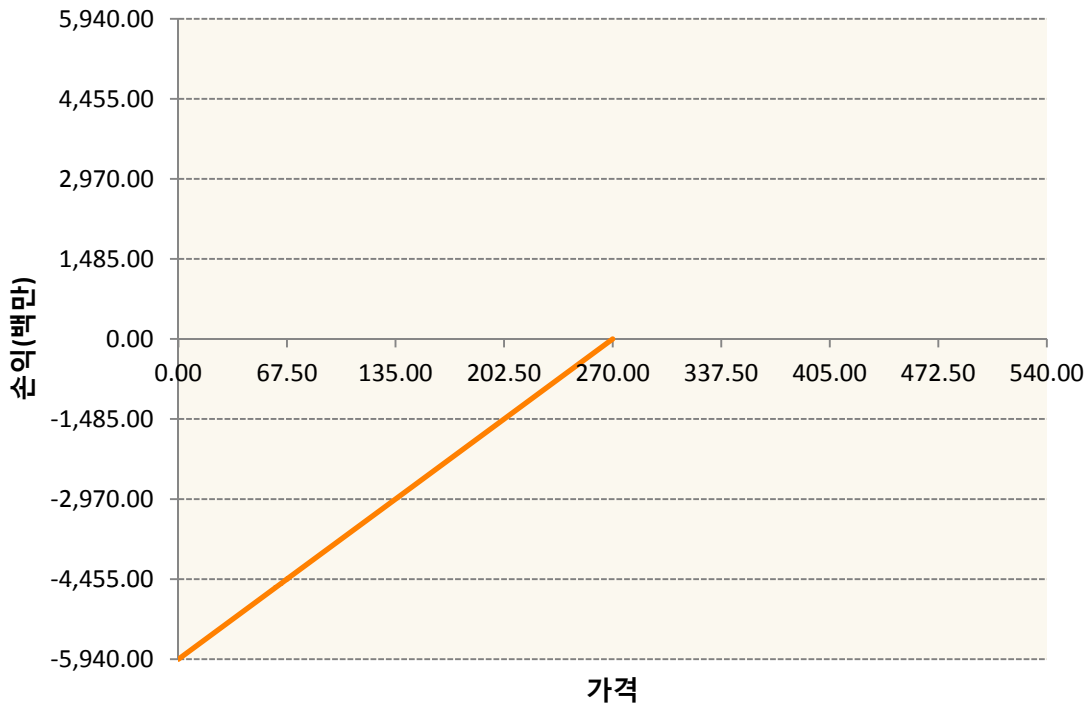


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

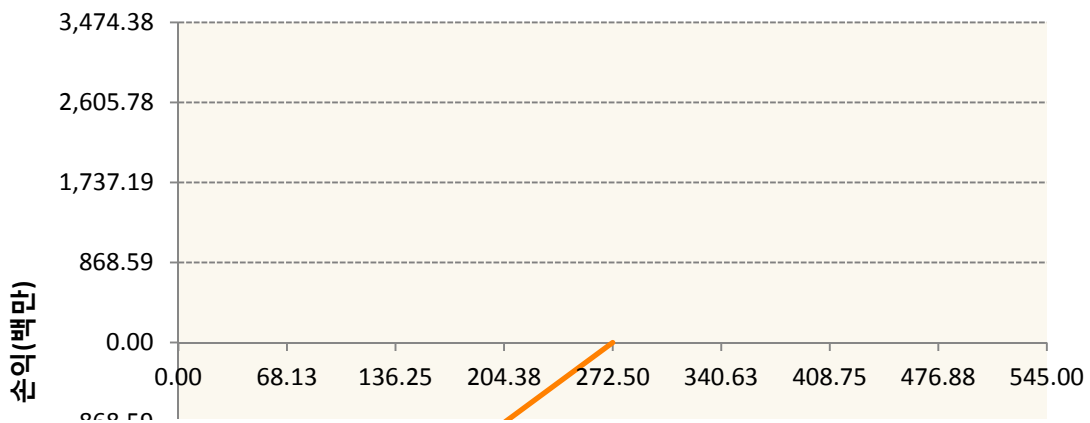




KR4301P82707-2019-08 풋270



KR4301P82723-2019-08 풋272.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,193
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	
-5.33%	-795	-795	-795	-795	-795	-795	-795	
-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%	795	795	795	795	795	795	795	
8.00%	1,193	1,193	1,193	1,193	1,193	1,193	1,193	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						603
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-603	-603	-603	-603	-603	-603	-603	
-5.33%	-402	-402	-402	-402	-402	-402	-402	
-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%	402	402	402	402	402	402	402	
8.00%	603	603	603	603	603	603	603	
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						679
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	253	250	245	240	233	225	216
-5.33%	235	225	215	204	191	179	165
-2.67%	177	161	145	128	111	94	77
0%	54	36	18	0	-18	-36	-54
2.67%	-139	-153	-167	-182	-197	-213	-229
5.33%	-381	-388	-397	-406	-417	-428	-440
8.00%	-647	-650	-654	-659	-664	-671	-679
KR4301P82707 2019-08 풋270							356
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-353	-353	-353	-354	-354	-355	-356
-5.33%	-194	-196	-197	-200	-202	-205	-208
-2.67%	-58	-63	-68	-73	-79	-84	-90
0%	14	10	5	0	-5	-10	-16
2.67%	31	29	28	26	24	21	18
5.33%	32	32	32	31	31	30	29
8.00%	32	32	32	32	32	32	31
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							226
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-225	-225	-225	-225	-225	-226	-226
-5.33%	-132	-133	-133	-134	-135	-136	-138
-2.67%	-46	-49	-51	-54	-56	-59	-62
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	27	26	25	23	21	19	17
5.33%	30	29	29	29	28	28	27
8.00%	30	30	30	30	30	29	29

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

(단위:백만원)

3,325

공시일	2019-07-23
기준일	2019-07-22

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

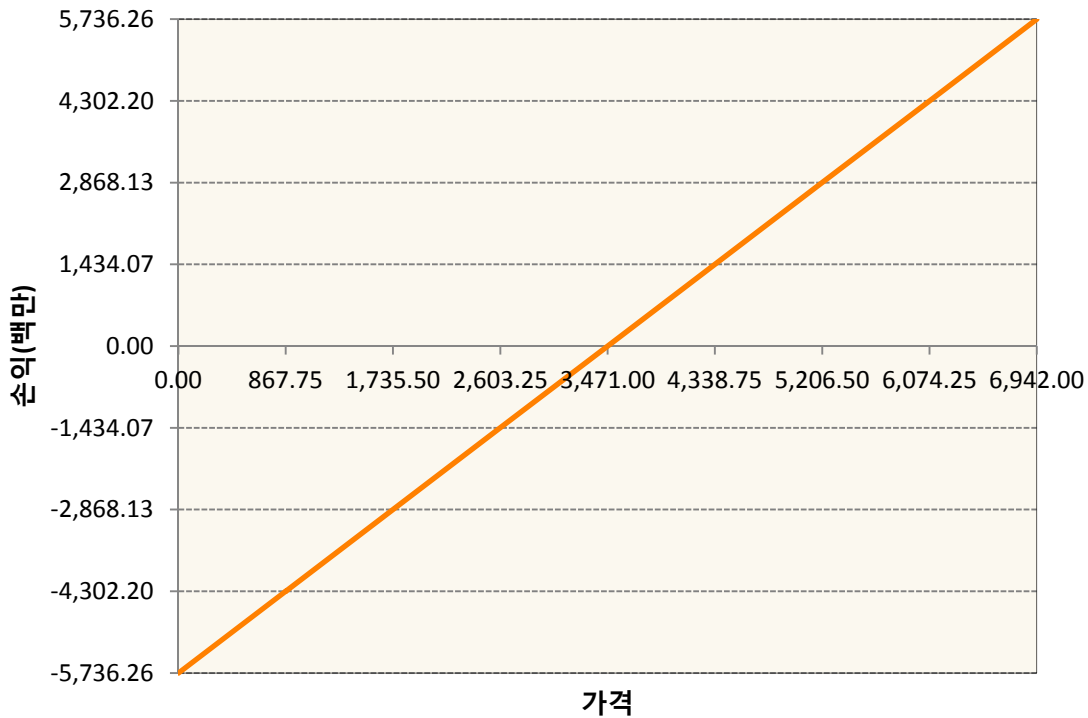
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	7	-7	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,736	0	5,736	
누계	유가증권	스왑	37,748	0	37,748	장외
누계	통화	선도	5,288	22,473	-17,185	장외

2. 만기시점의 손익구조

VGU9-EURO STOXX 50 Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	0
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	423
FX21019M02 KRW/EUR 27-09-19E	1,058
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	317
FX21019N01 EUR/KRW 23-08-19E	423
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	459

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

(단위:백만원)

1,343

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

공시일	2019-07-23
기준일	2019-07-22

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

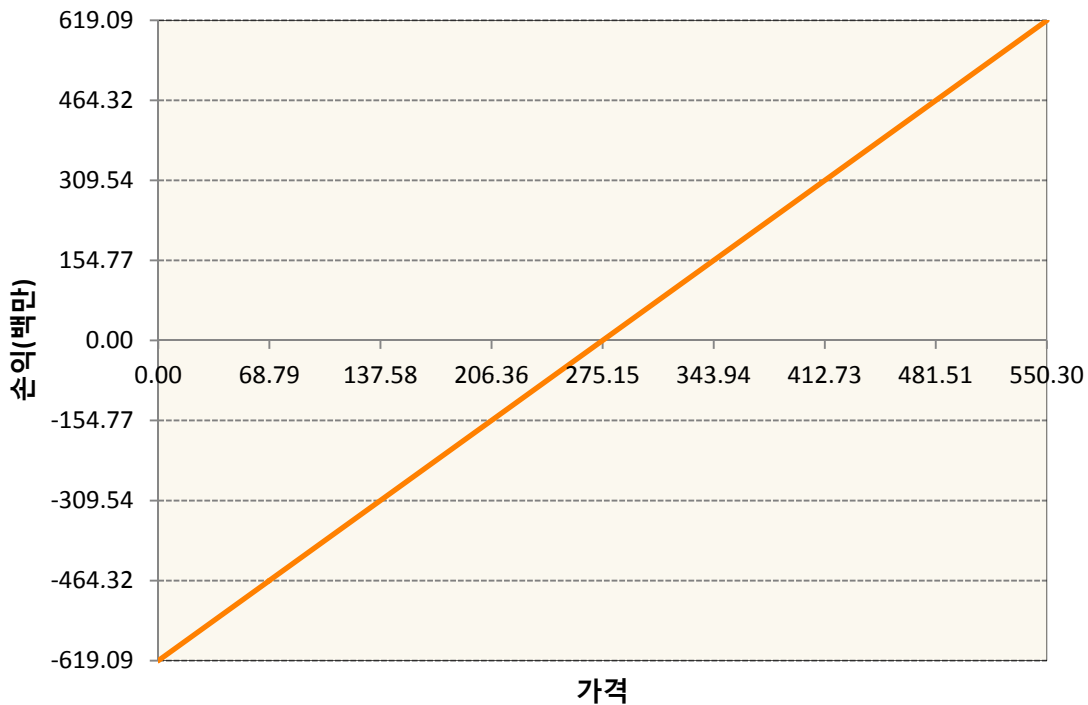
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	619	0	619	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	2019-07-23
기준일	2019-07-22

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

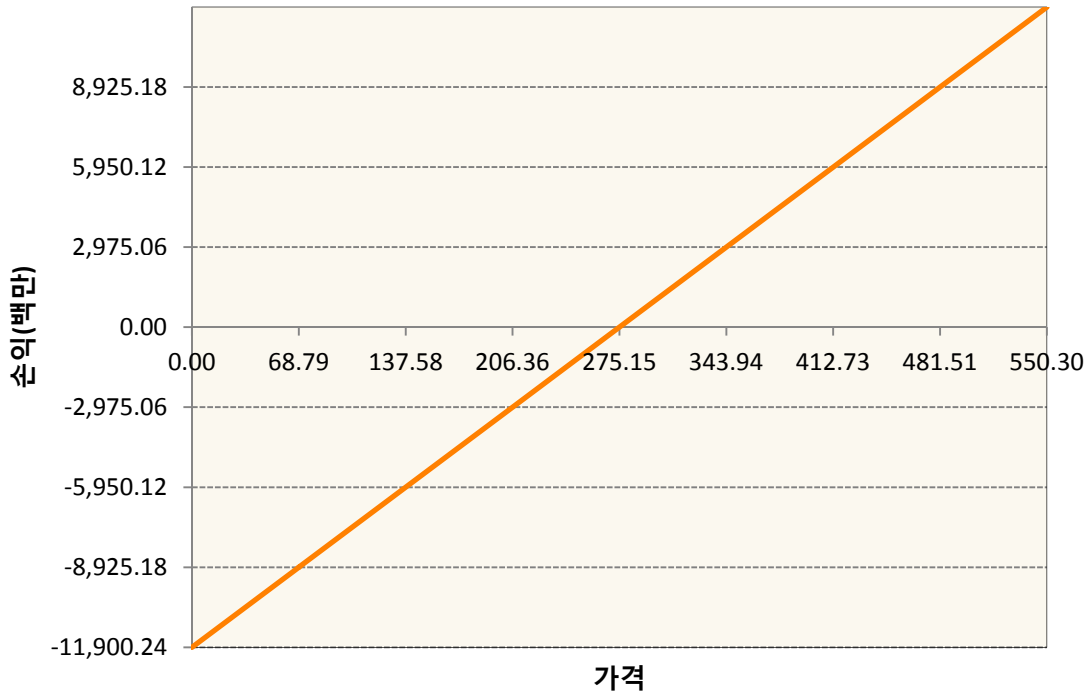
1. 계약금액

(단위:백만원)

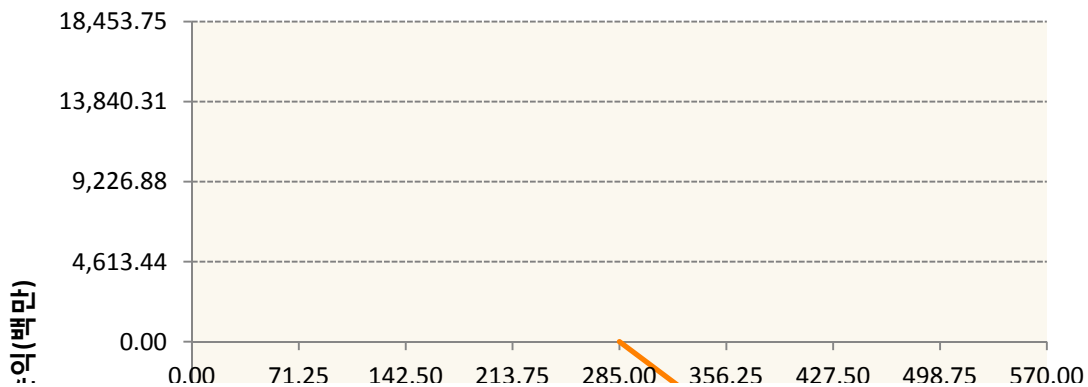
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	137	-137	장내
신규	유가증권	옵션	142	0	142	장내
누계	유가증권	선물	11,900	0	11,900	장내
누계	유가증권	옵션	1,698	21,688	-19,990	장내

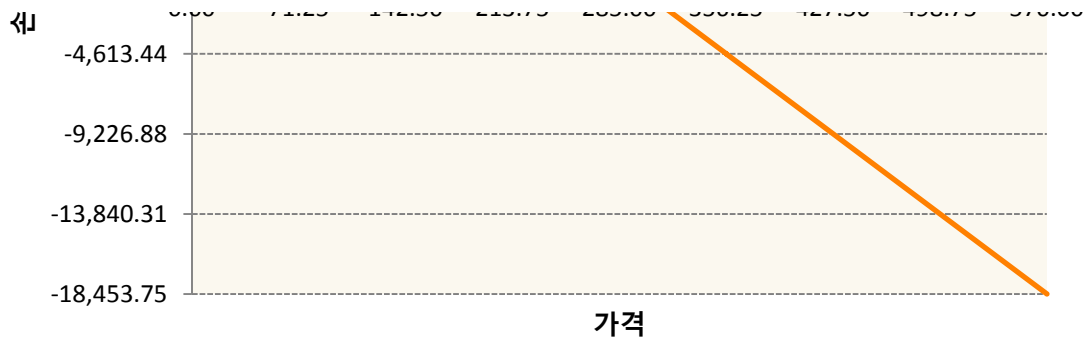
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

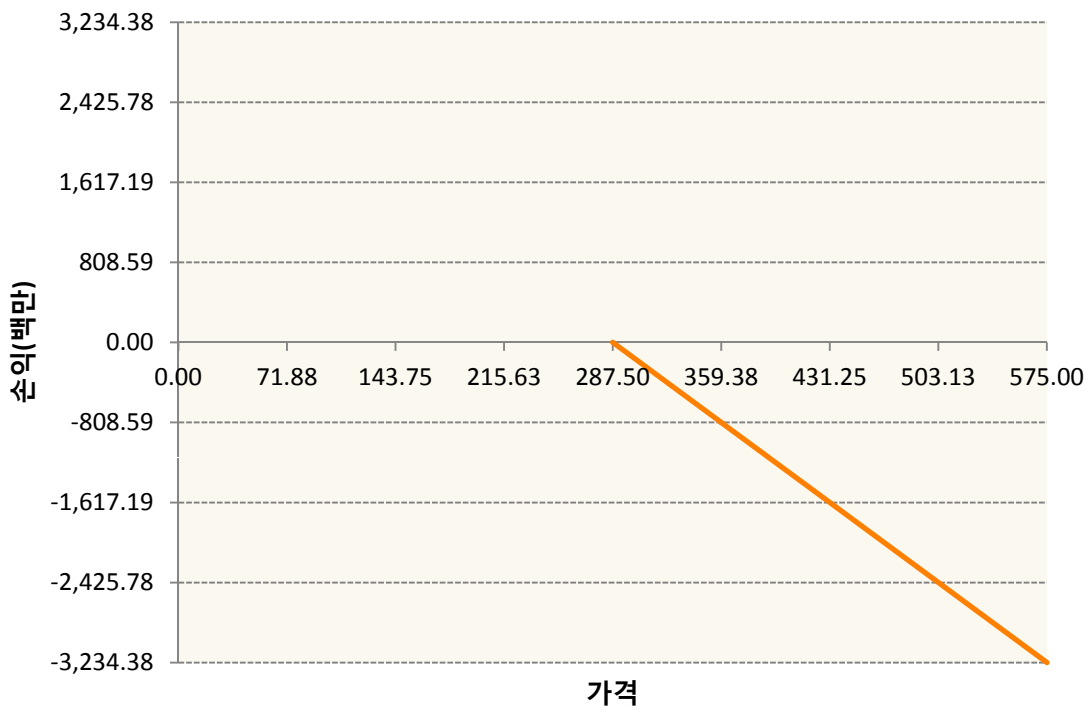


KR4201P82857-2019-08 콜285

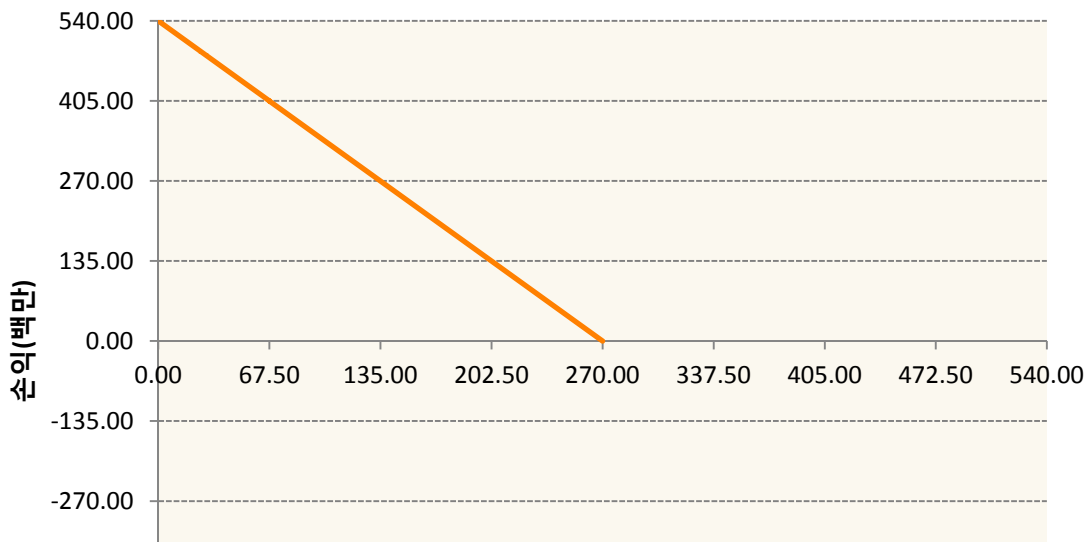


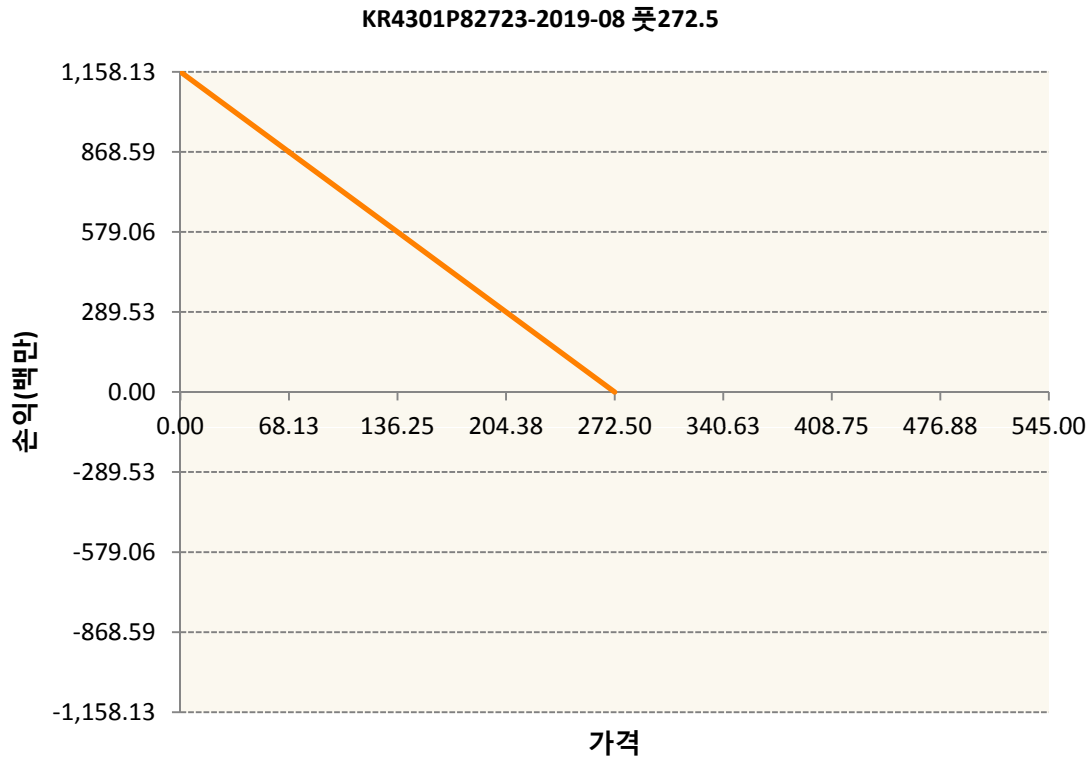
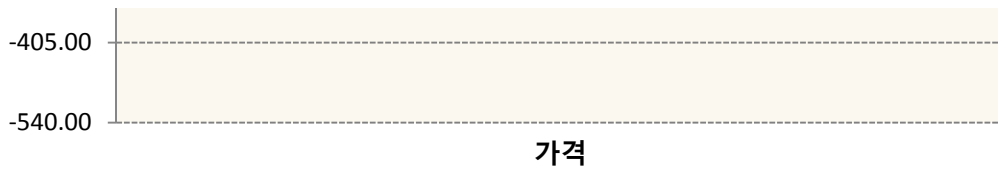


KR4201P82873-2019-08 콜287.5



KR4301P82707-2019-08 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						950
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-950	-950	-950	-950	-950	-950	-950	
-5.33%	-633	-633	-633	-633	-633	-633	-633	
-2.67%	-317	-317	-317	-317	-317	-317	-317	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	317	317	317	317	317	317	317	
5.33%	633	633	633	633	633	633	633	
8.00%	950	950	950	950	950	950	950	
KR4201P82857		2019-08 콜285						817
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	135	134	133	131	129	125	119	
-5.33%	132	130	125	119	112	102	92	
-2.67%	119	110	98	84	68	50	32	

0%	69	47	24	0	-25	-51	-78
2.67%	-64	-95	-126	-158	-190	-221	-253
5.33%	-311	-342	-373	-405	-437	-469	-500
8.00%	-668	-689	-712	-737	-763	-789	-817
KR4201P82873 2019-08 콜287.5							128
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	18	18	17	17	17	16	16
-5.33%	17	17	17	16	15	14	12
-2.67%	16	15	13	11	9	6	4
0%	10	7	4	0	-4	-8	-12
2.67%	-7	-12	-18	-23	-28	-33	-39
5.33%	-43	-49	-55	-60	-66	-72	-77
8.00%	-99	-104	-108	-113	-118	-123	-128
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%	18	18	18	18	18	19	19
-2.67%	5	6	6	7	7	8	8
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-3	-3	-3	-2	-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							75
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	75	75	75	75	75	75	75
-5.33%	44	44	44	45	45	45	46
-2.67%	15	16	17	18	19	20	21
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-9	-9	-8	-8	-7	-6	-6
5.33%	-10	-10	-10	-10	-9	-9	-9
8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10

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

(단위:백만원)

1,645

공시일	2019-07-23
기준일	2019-07-22

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,532	0	1,532	
누계	유가증권	수익증권	34,691	0	34,691	

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	2019-07-23
기준일	2019-07-22

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	52,831	0	52,831	

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	2019-07-23
기준일	2019-07-22

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	11,783	0	11,783	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	396,580	0	396,580	
누계	통화	선도	0	444,243	-444,243	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		1,885
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		1,885
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E		698
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E		698
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E		1,301
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E		2,556
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		3,111
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		2,112
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		1,697
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,074
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		132
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		566
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		3,016
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		3,299
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		471
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		943
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		2,932
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		1,640
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		754
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,885
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,885

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

(단위:백만원)

11,613

공시일	2019-07-23
기준일	2019-07-22

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

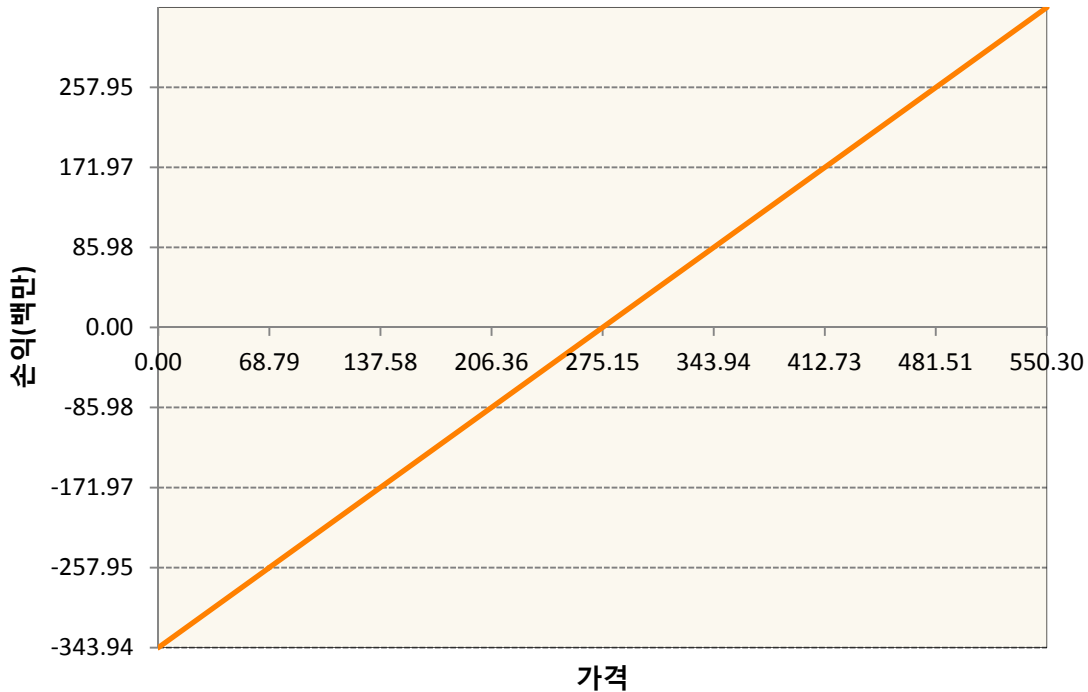
1. 계약금액

(단위:백만원)

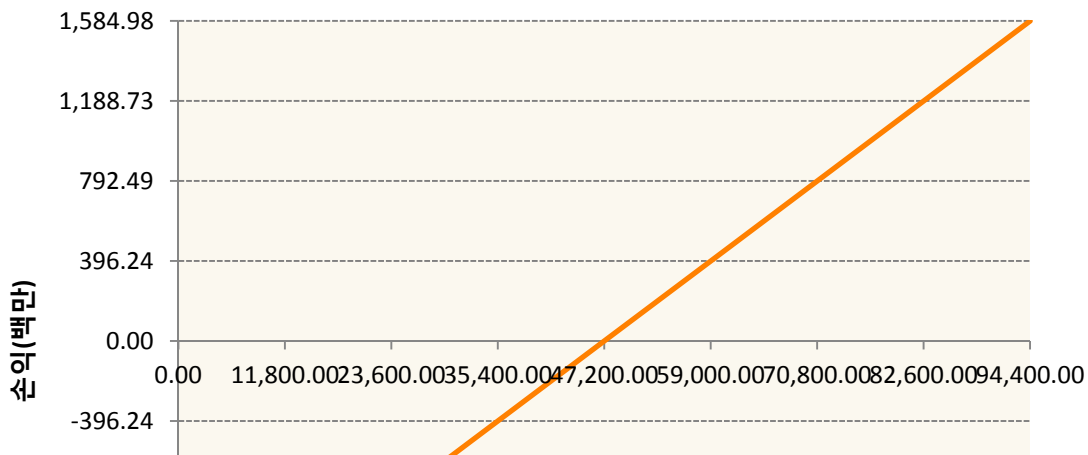
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,929	0	1,929	장내

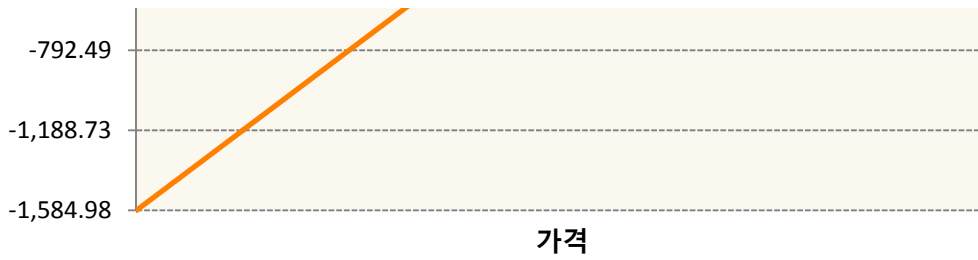
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P80001-2019-08 삼성전자개별선물





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						27
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27	
-5.33%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
-2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	9	9	9	9	9	9	9	
5.33%	18	18	18	18	18	18	18	
8.00%	27	27	27	27	27	27	27	
KR4111P80001		2019-08 삼성전자개별선물						127
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127	
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85	
-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%	85	85	85	85	85	85	85	
8.00%	127	127	127	127	127	127	127	

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

177

공시일	2019-07-23
기준일	2019-07-22

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

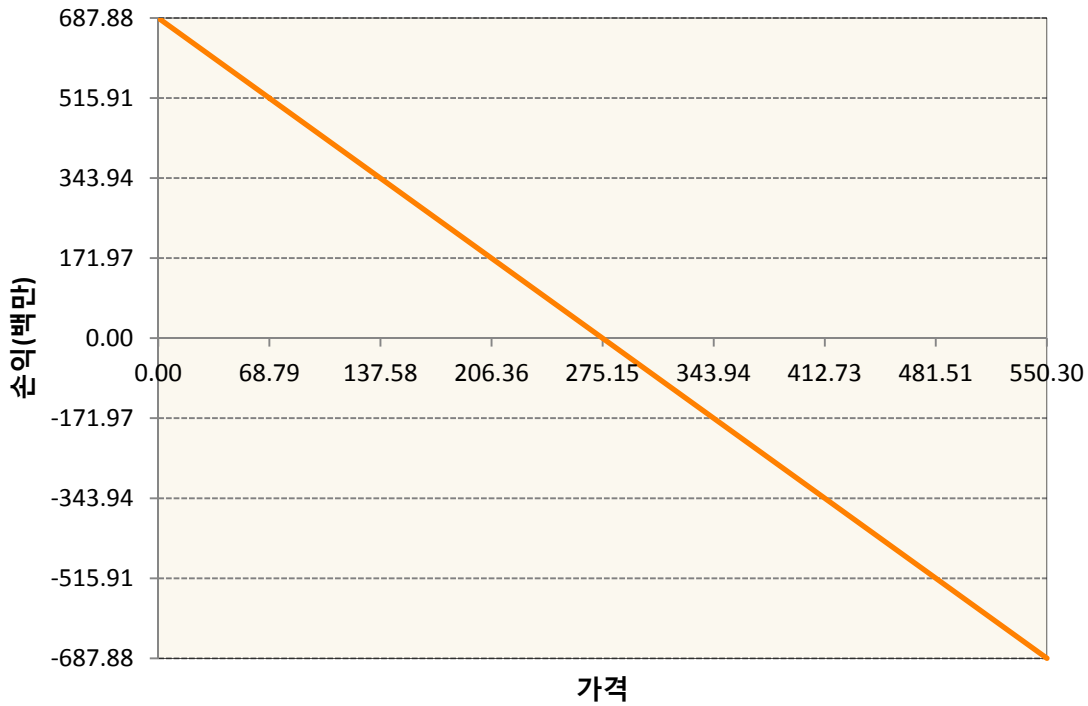
1. 계약금액

(단위:백만원)

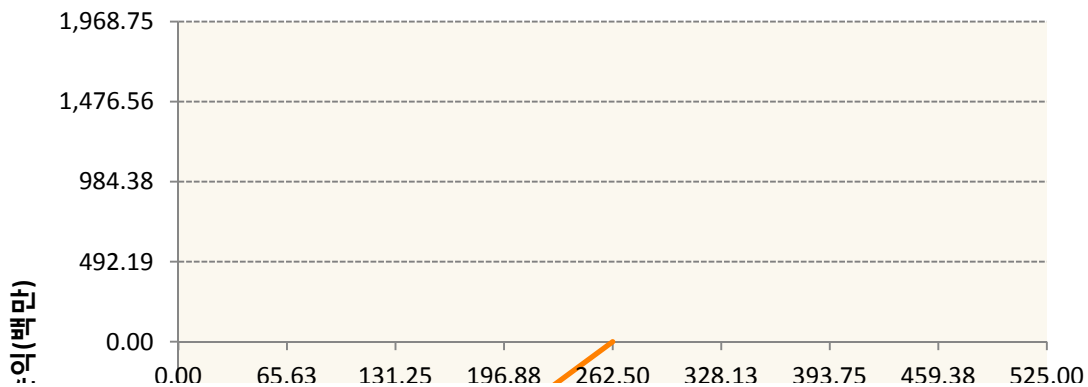
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	688	-688	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,625	-3,625	장내

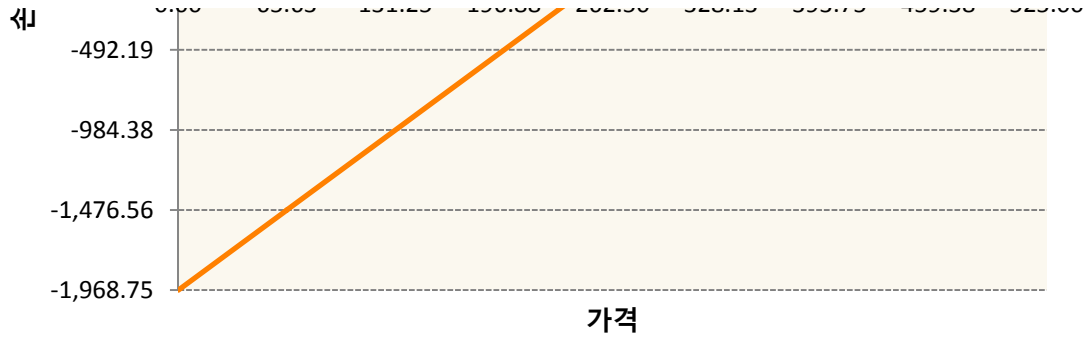
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

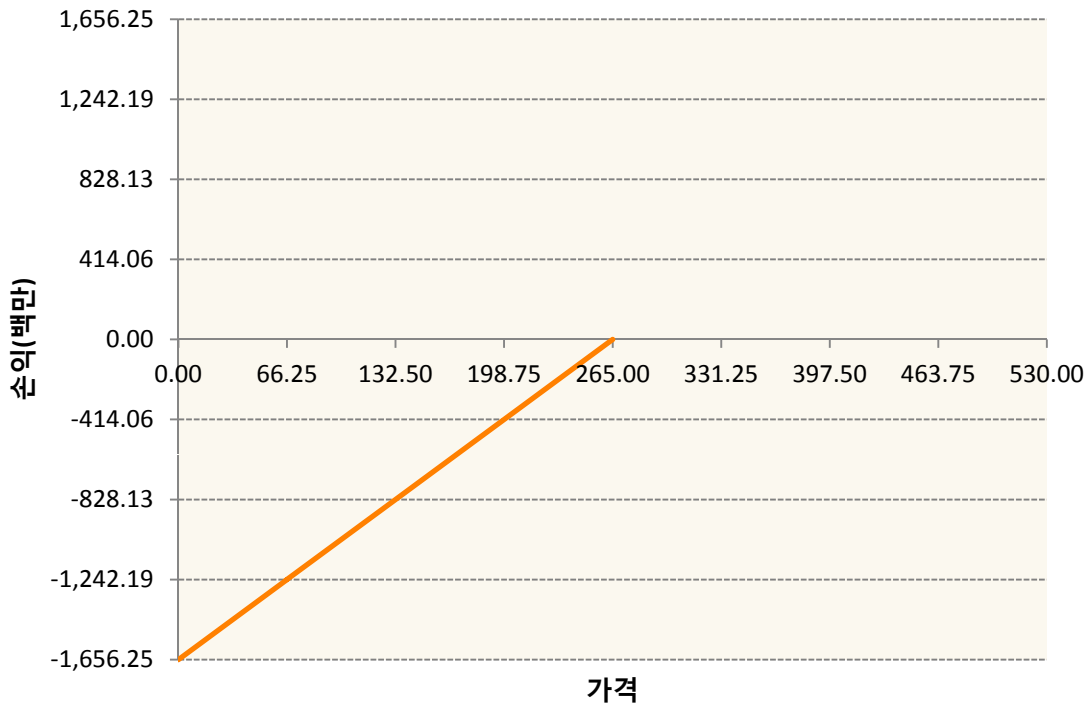


KR4301P82624-2019-08 풋262.5





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%	-27	-29	-31	-33	-35	-36	-38
-2.67%	-4	-5	-7	-8	-10	-12	-13
0%	1	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	2	2	2	2	1	1	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	-76	-76	-76	-77	-77	-78
-5.33%	-33	-34	-36	-37	-38	-39	-41
-2.67%	-6	-8	-9	-11	-12	-14	-15
0%	2	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	3	3	3	2	2	2	2
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

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

(단위:백만원)

150

공시일	2019-07-23
기준일	2019-07-22

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	18,432	0	18,432	
누계	통화	선도	0	22,270	-22,270	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		141
FX21019M04 KRW/USD 24-07-19E		179
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		980
FX21019N01 KRW/USD 12-08-19E		160
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		320

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

(단위:백만원)

582

공시일	2019-07-23
기준일	2019-07-22

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	2019-07-23
기준일	2019-07-22

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

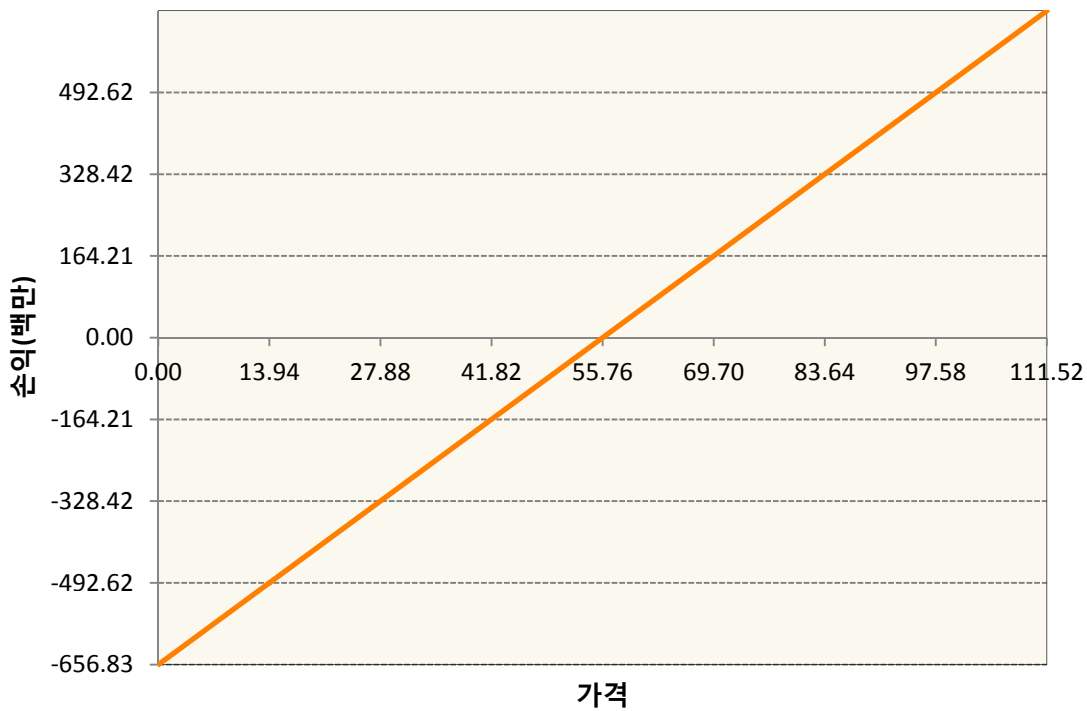
1. 계약금액

(단위:백만원)

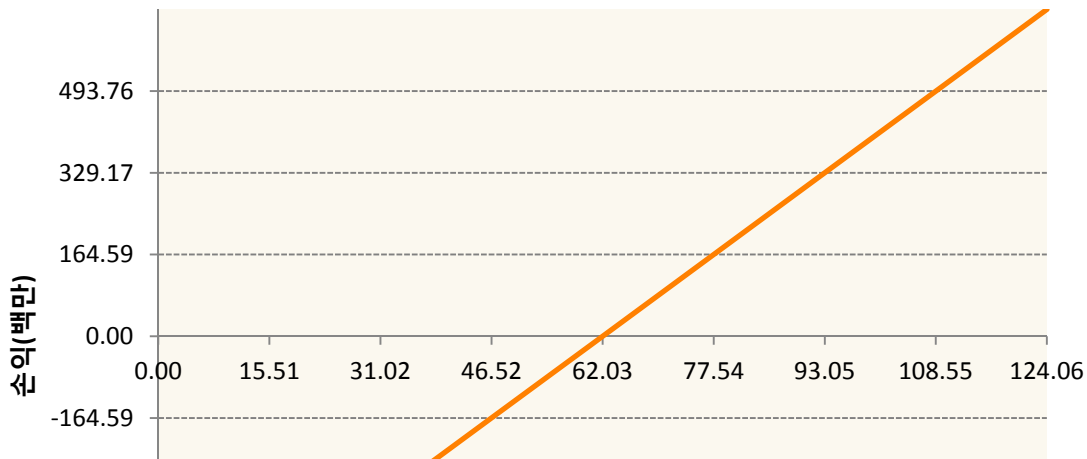
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,595	118	2,477	

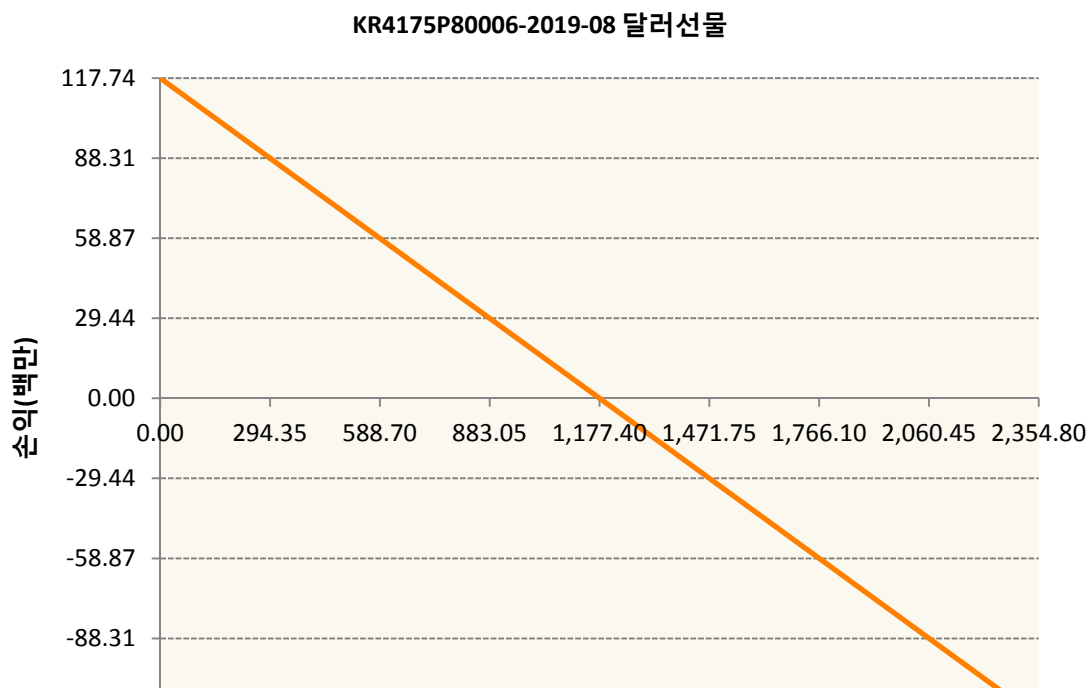
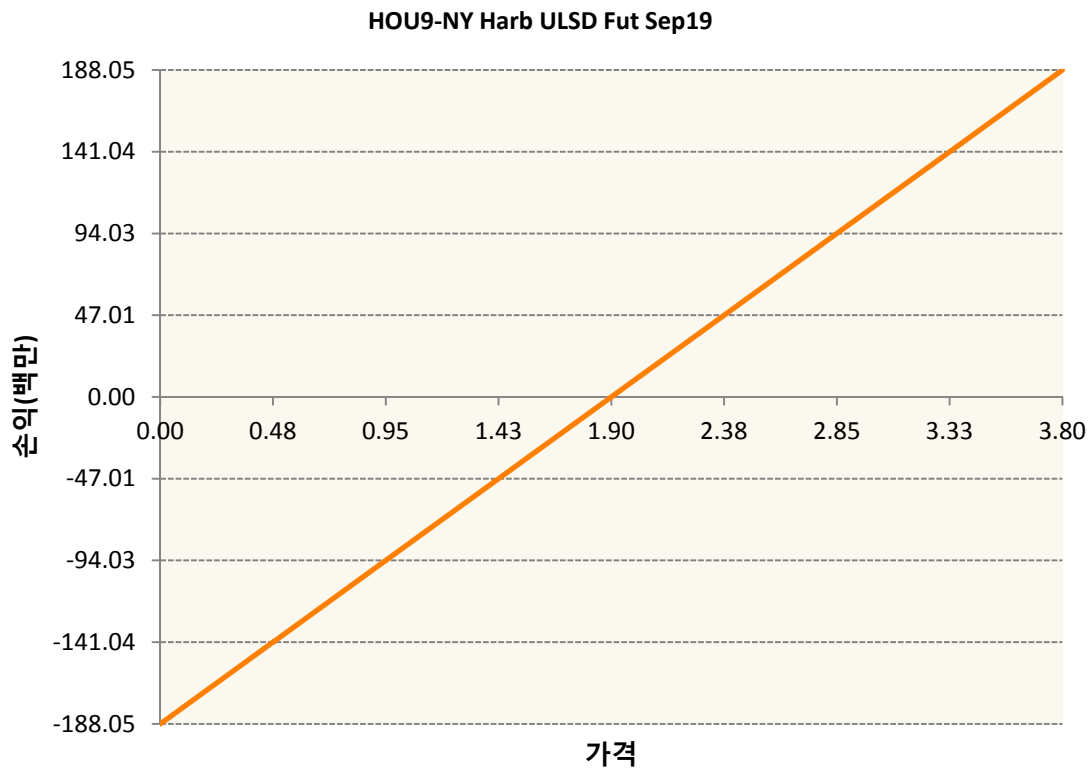
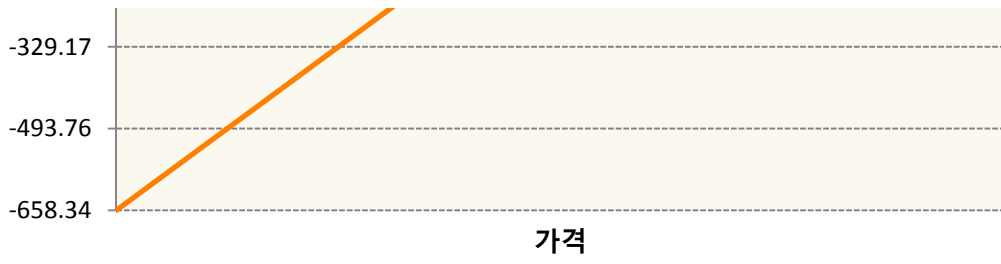
2. 만기시점의 손익구조

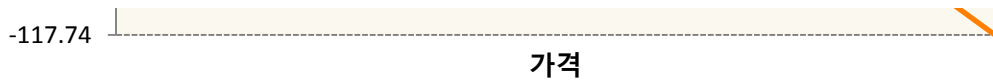
CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19



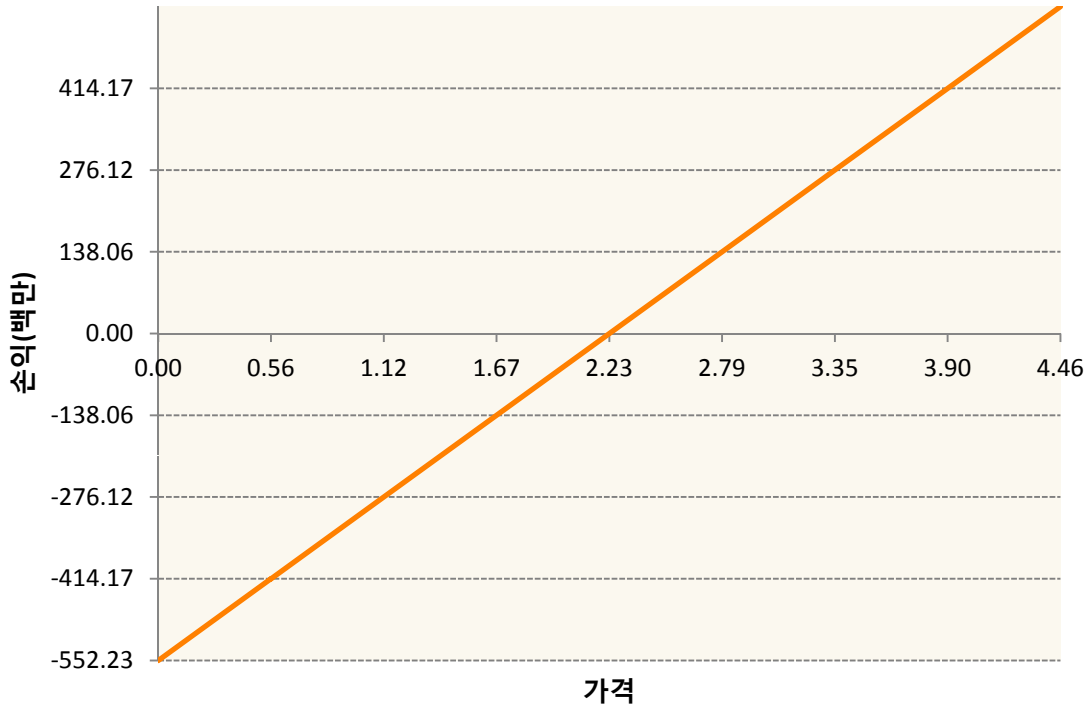
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19



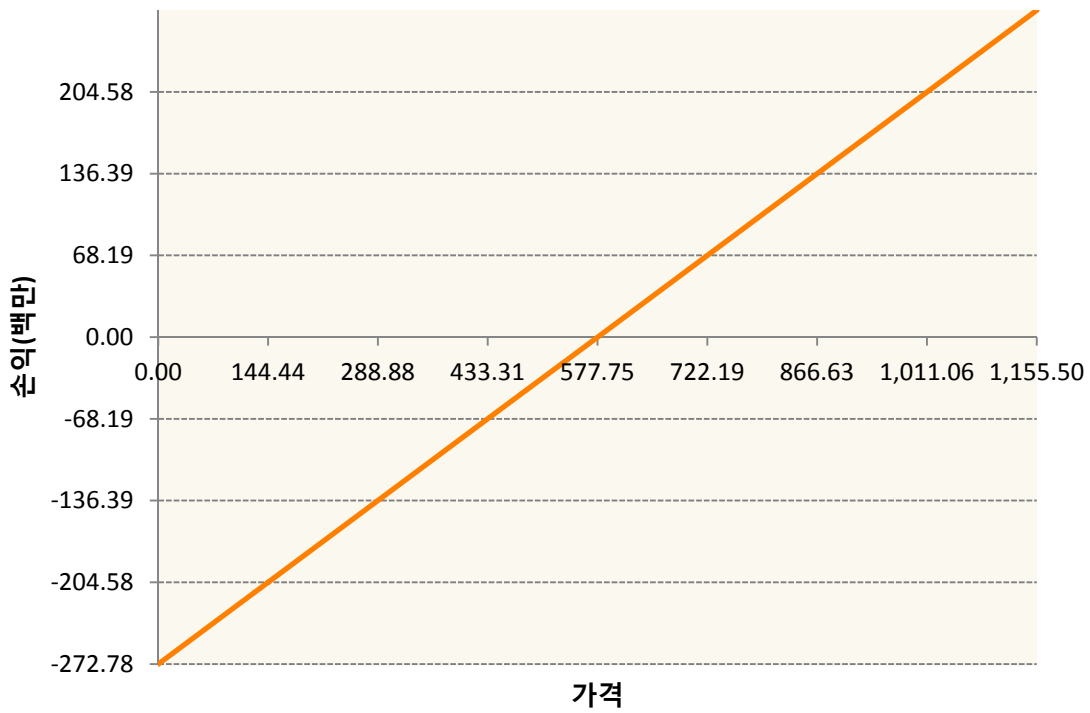




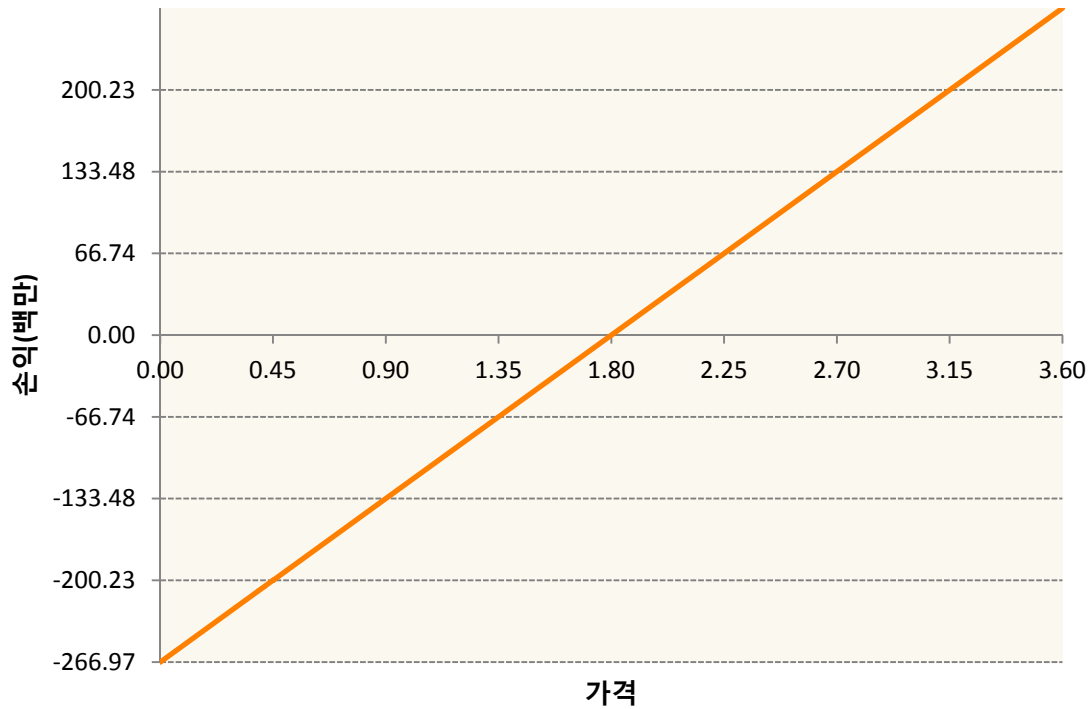
NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



QSU9-Low Su Gasoil G Sep19



XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	53
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	53
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	15
KR4175P800	2019-08 달러선물	9
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	44
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	22
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	21

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

(단위:백만원)

380

공시일	2019-07-23
기준일	2019-07-22

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

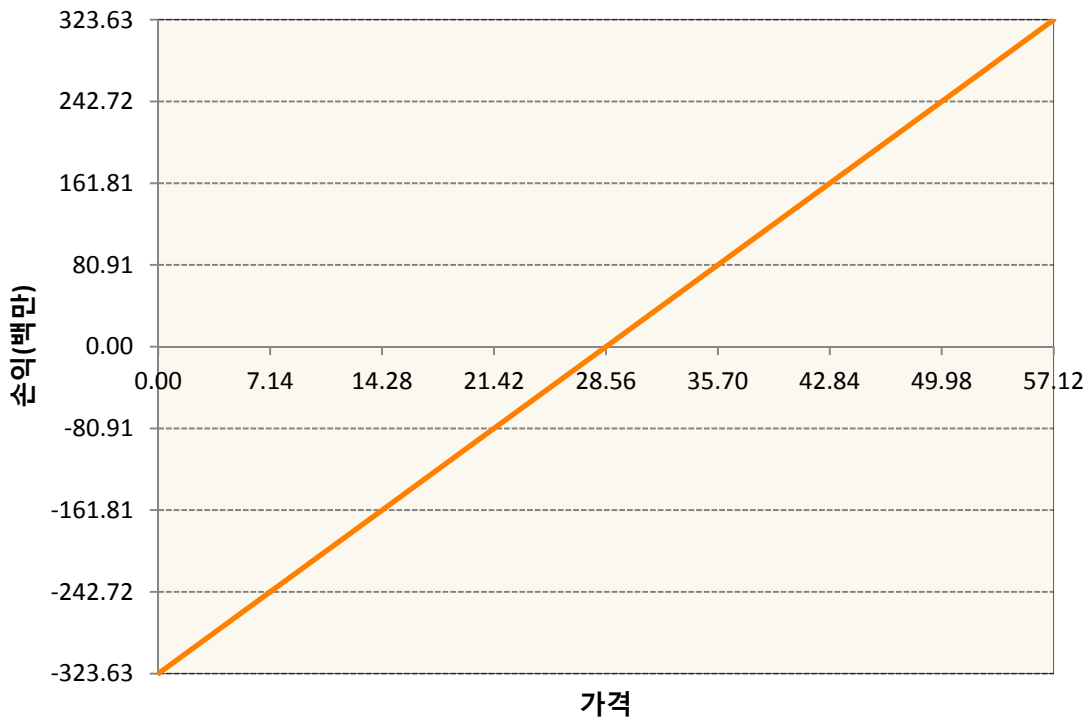
1. 계약금액

(단위:백만원)

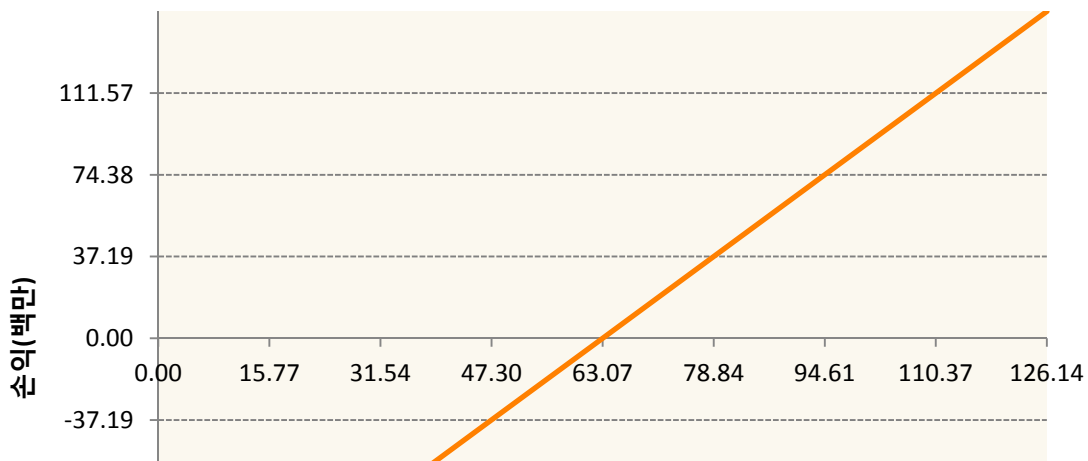
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,120	200	2,920	

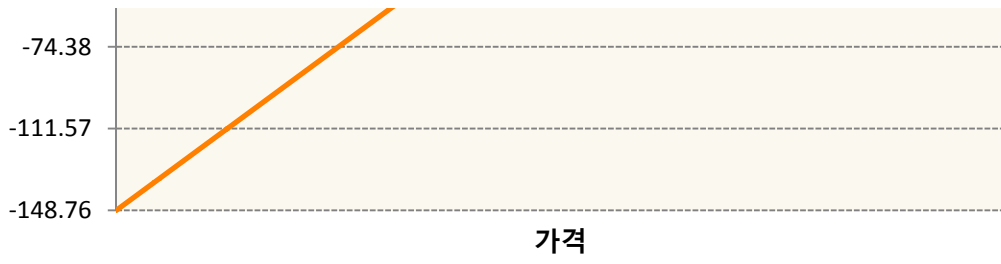
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

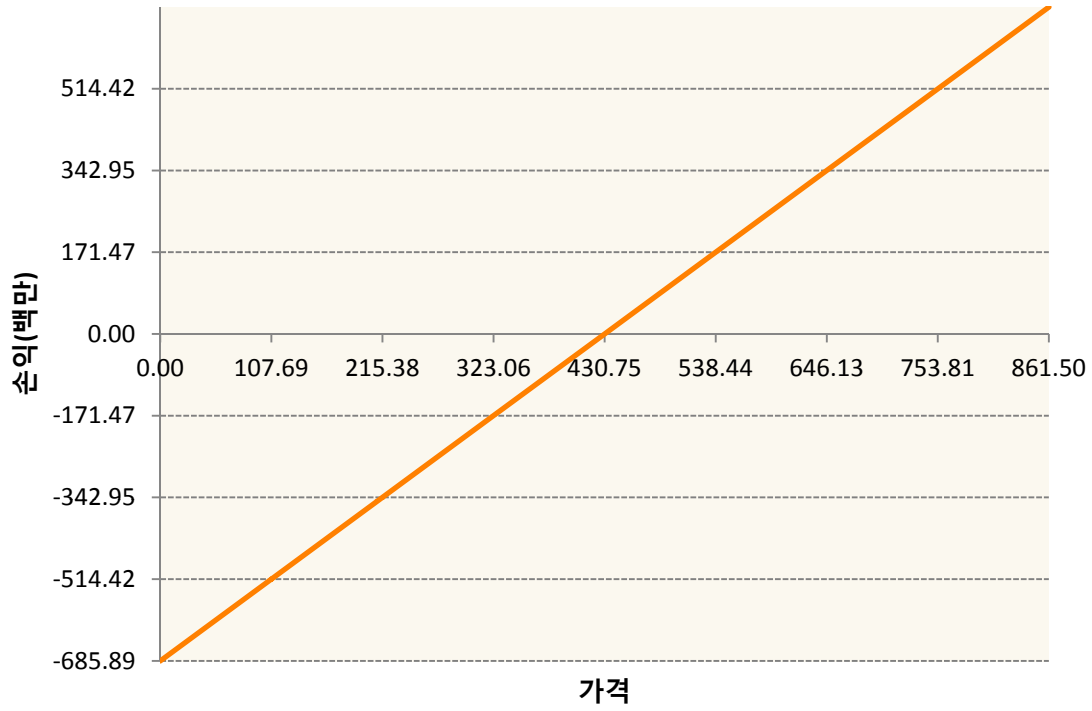


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

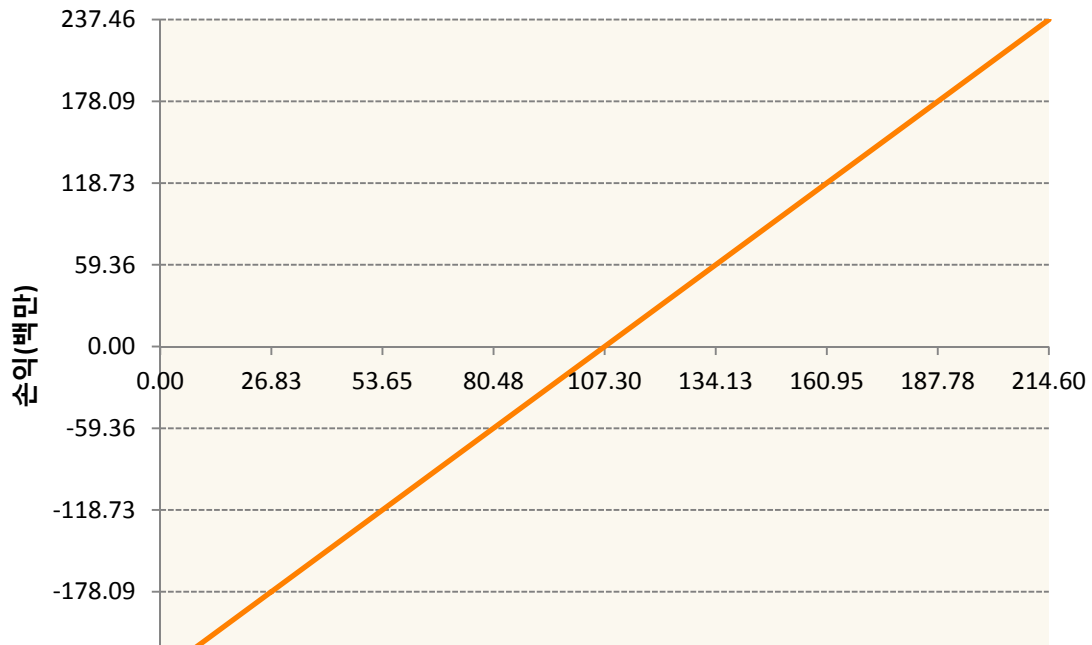


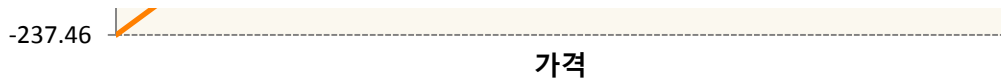


CU9-CORN FUTURE Sep19

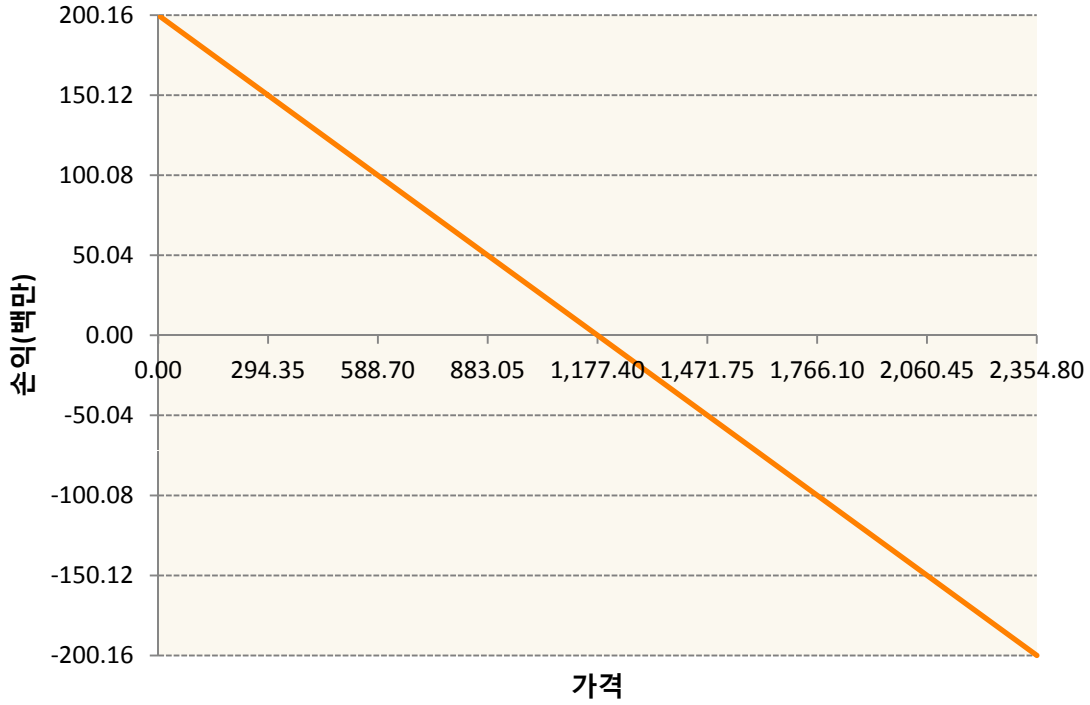


KCU9-COFFEE 'C' FUTURE Sep19

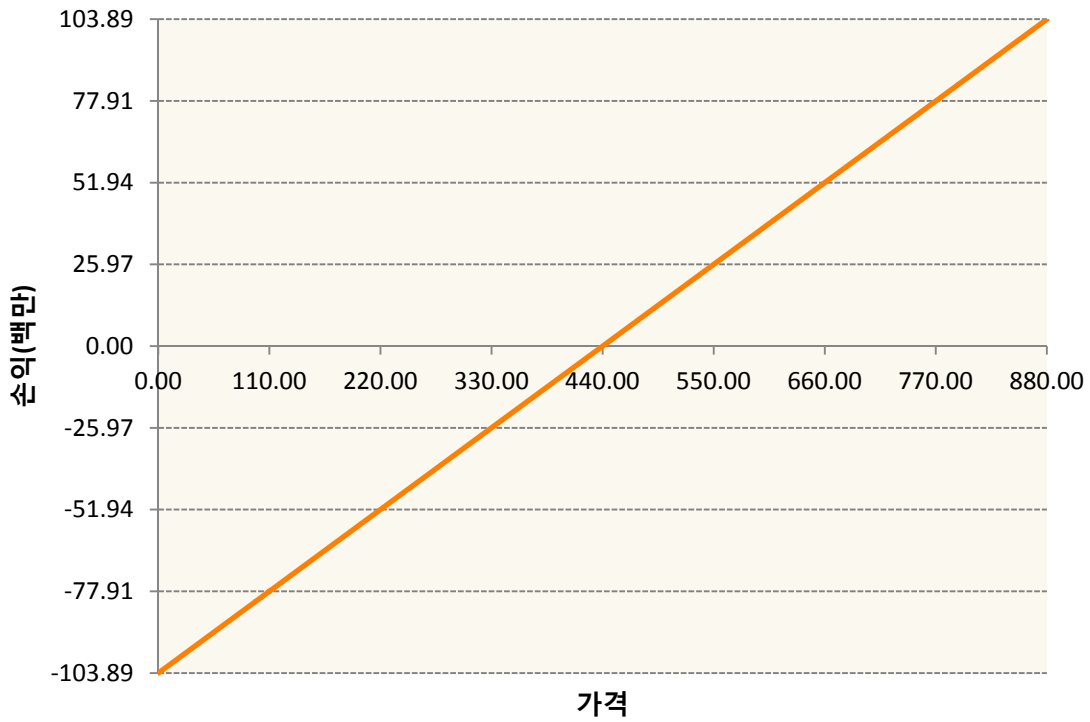




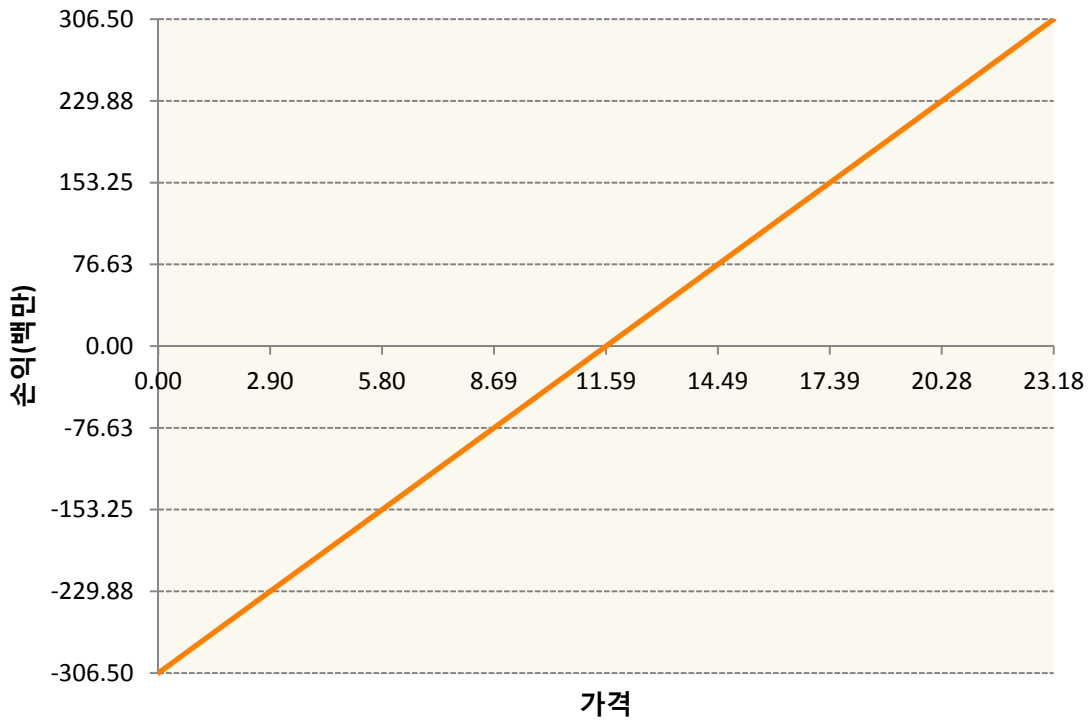
KR4175P80006-2019-08 달러선물



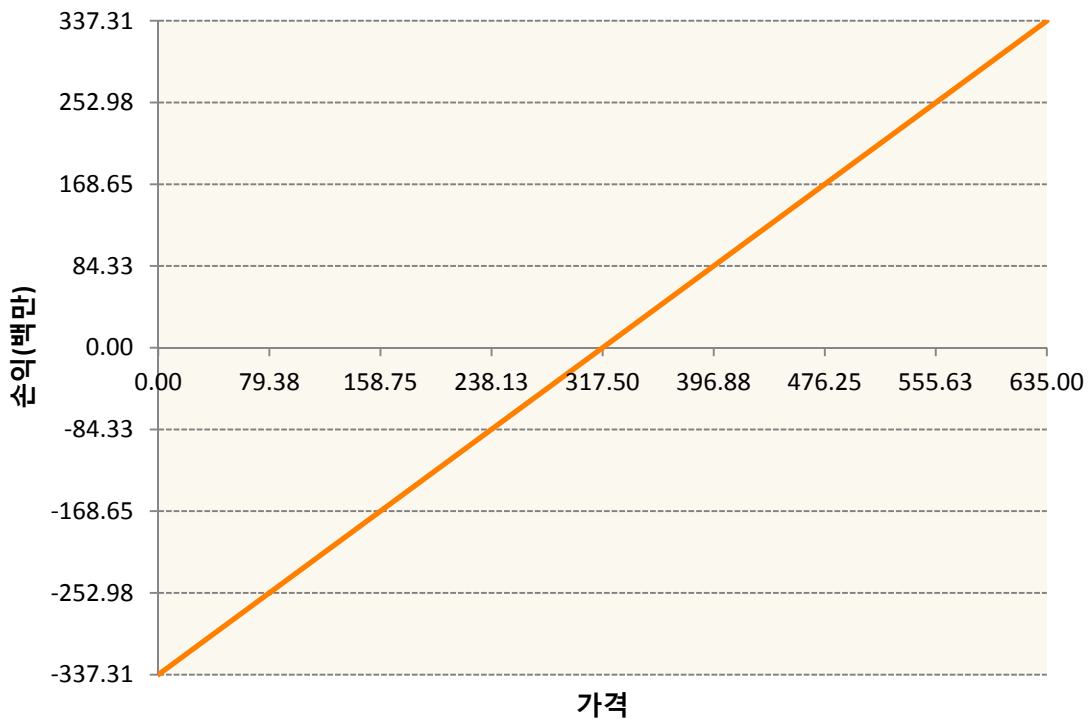
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

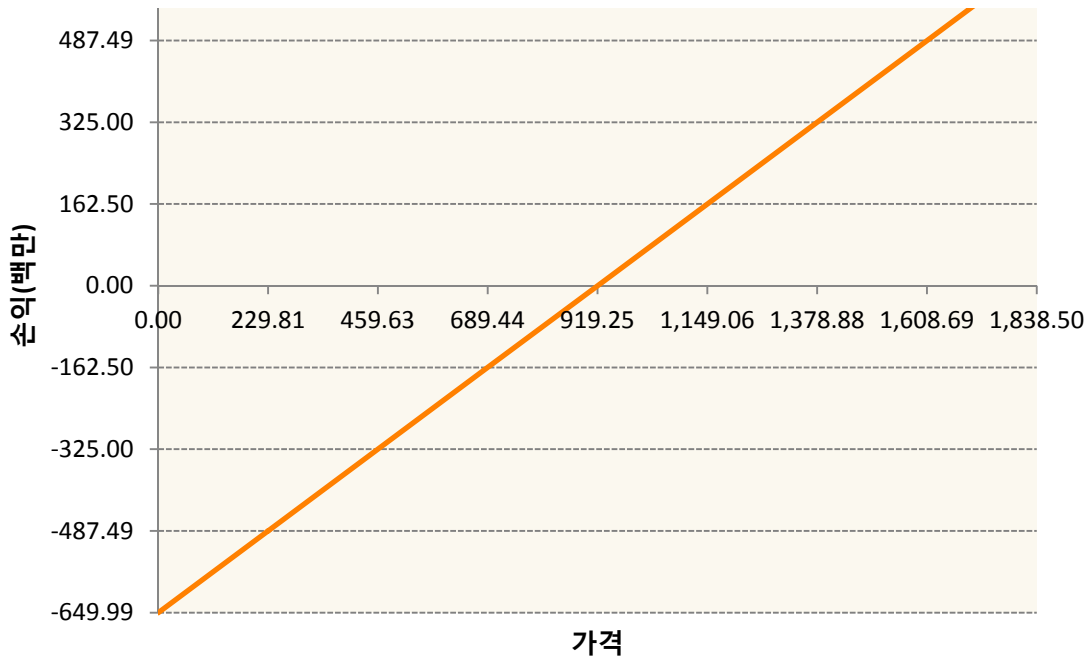


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

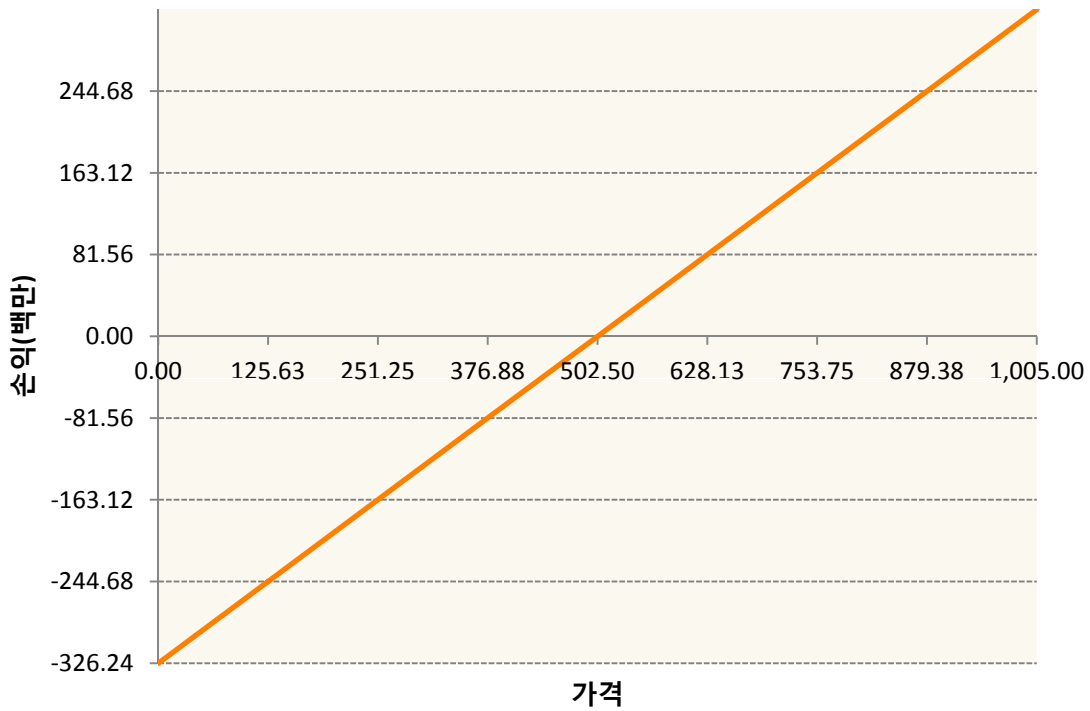


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





WU9-WHEAT FUTURE(CBT) Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	26
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	12
CU9	CORN FUTURE Sep19	55
KCU9	COFFEE 'C' FUTURE Sep19	19
KR4175P800	2019-08 달러선물	16

KWU9	KC HRW WHEAT FUT Sep19	8
SBV9	SUGAR #11 (WORLD) Oct19	25
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)

274