

공시일	2019-07-26
기준일	2019-07-25

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	2019-07-26
기준일	2019-07-25

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

1,186

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

669

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-26
기준일	2019-07-25

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)	383
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	140

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

842

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-26
기준일	2019-07-25

유로인덱스모(주식-파생형)

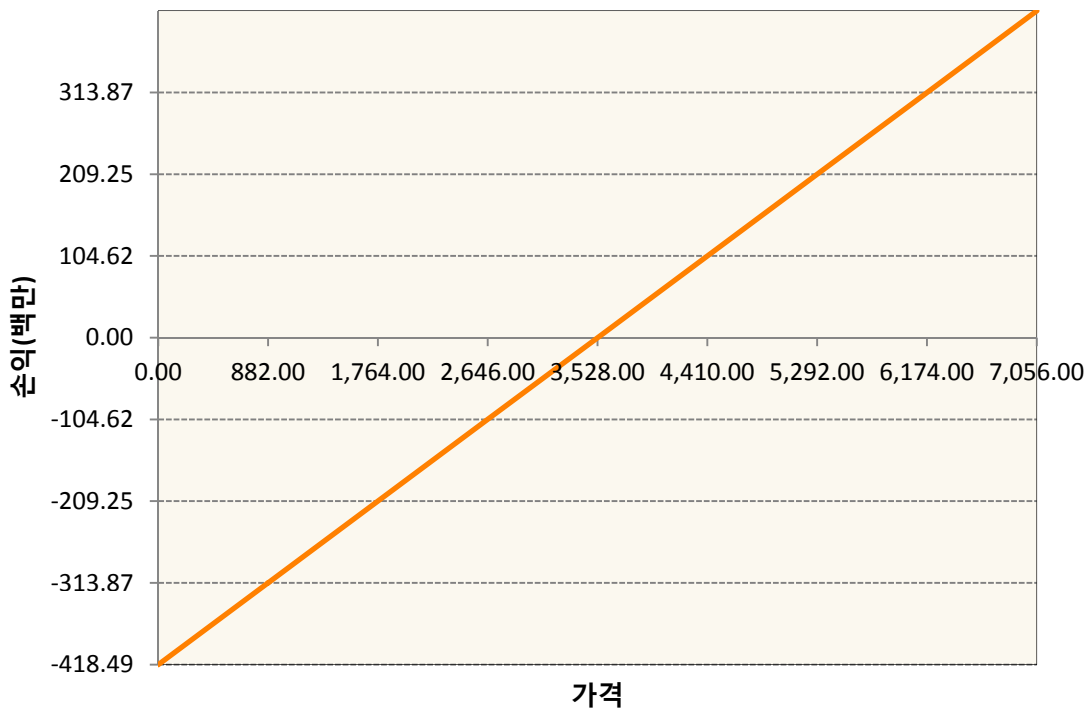
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	418	0	418	

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)

23

공시일	2019-07-26
기준일	2019-07-25

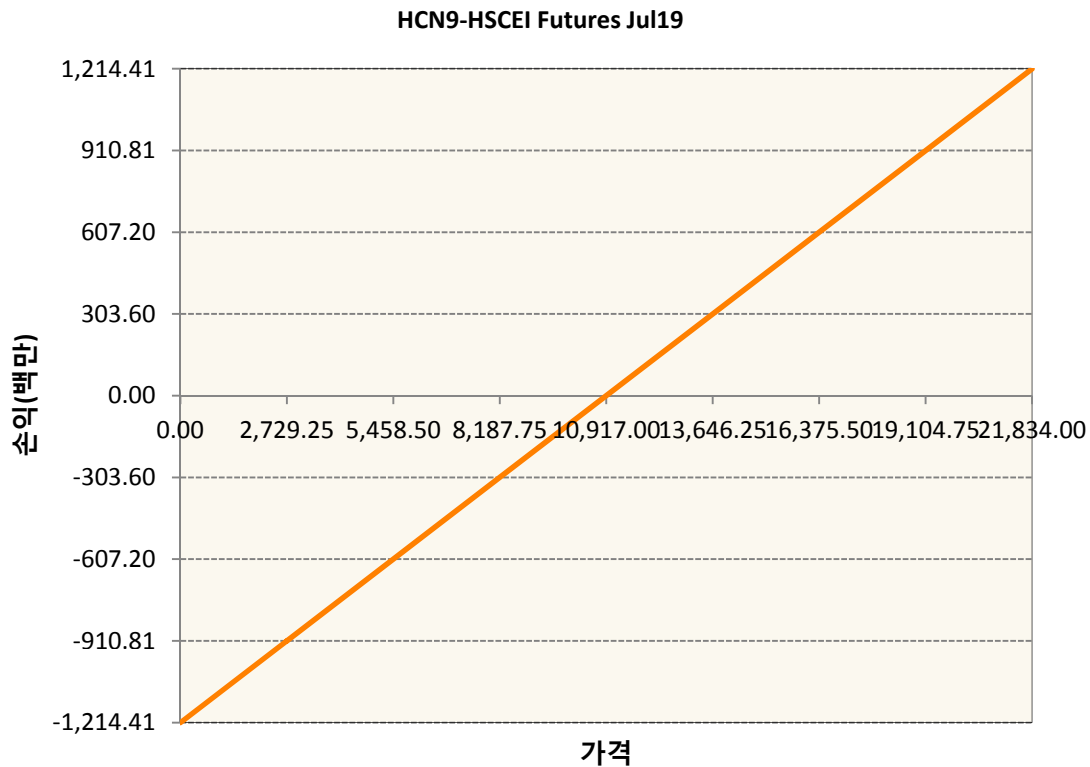
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,214	0	1,214	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	2019-07-26
기준일	2019-07-25

커버드콜모(주식혼합-파생형)

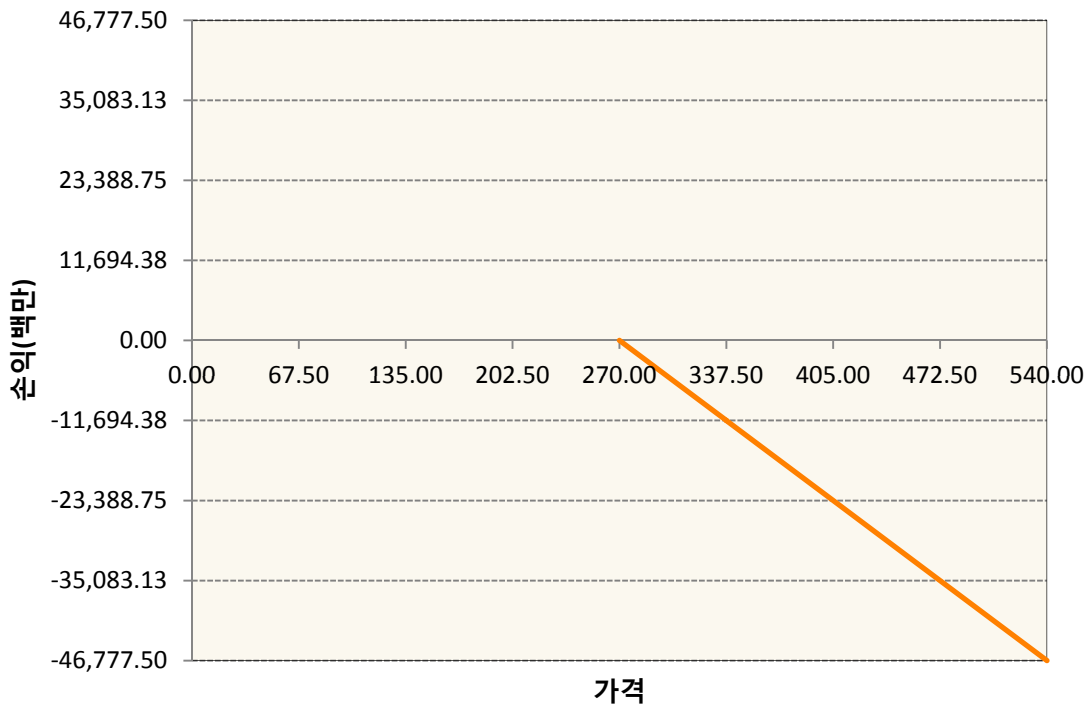
1. 계약금액

(단위:백만원)

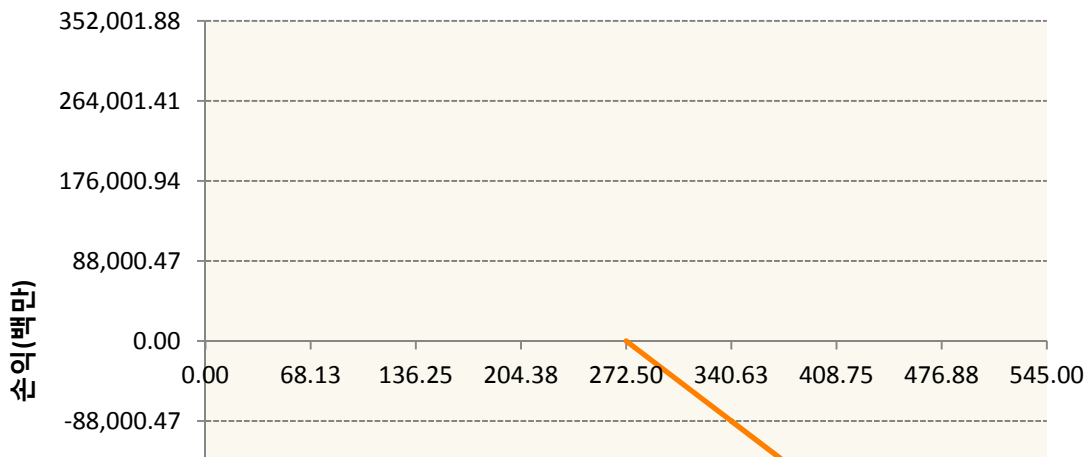
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	1,347	0	1,347	장내
누계	유가증권	옵션	0	585,017	-585,017	장내

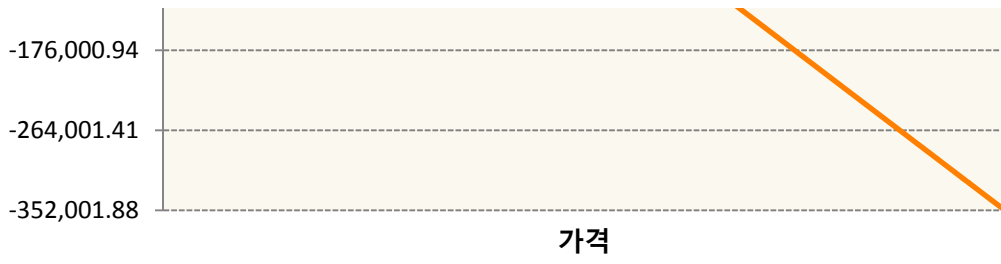
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P82709-2019-08 콜270

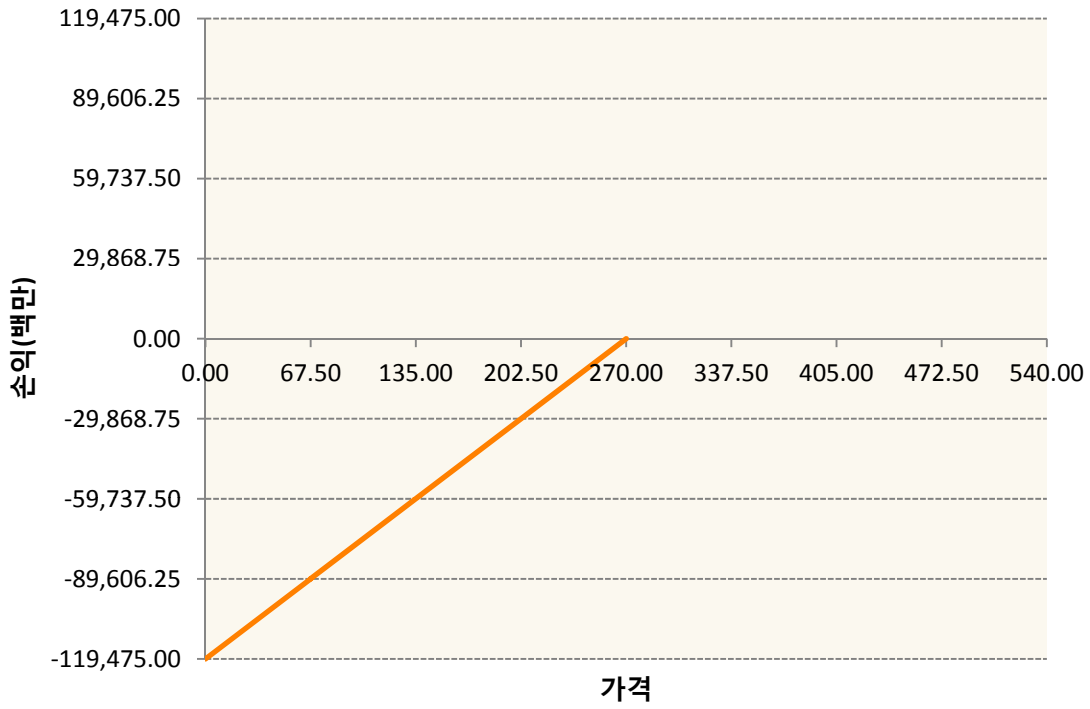


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

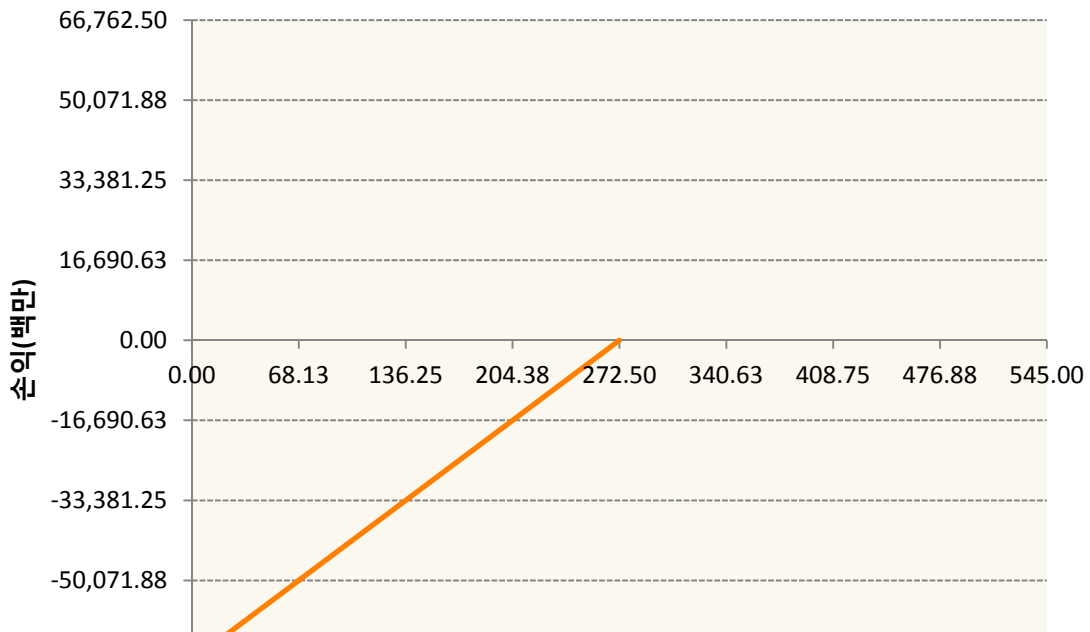




KR4301P82707-2019-08 풋270



KR4301P82723-2019-08 풋272.5



가격

3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P82709 2019-08 콜270							3,206
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,167	1,156	1,139	1,118	1,093	1,064	1,031
-5.33%	1,092	1,054	1,012	965	915	863	808
-2.67%	822	754	685	616	545	474	403
0%	218	146	73	0	-73	-147	-221
2.67%	-726	-773	-825	-880	-938	-998	-1,060
5.33%	-1,880	-1,900	-1,925	-1,956	-1,991	-2,030	-2,073
8.00%	-3,116	-3,122	-3,131	-3,144	-3,160	-3,181	-3,206
KR4201P82725 2019-08 콜272.5							22,712
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,005	6,951	6,869	6,757	6,614	6,441	6,240
-5.33%	6,670	6,463	6,216	5,935	5,623	5,285	4,924
-2.67%	5,273	4,828	4,365	3,888	3,399	2,902	2,397
0%	1,688	1,125	563	0	-563	-1,125	-1,688
2.67%	-4,546	-4,981	-5,438	-5,912	-6,400	-6,899	-7,407
5.33%	-12,723	-12,937	-13,193	-13,487	-13,812	-14,166	-14,543
8.00%	-21,795	-21,865	-21,967	-22,103	-22,274	-22,478	-22,712
KR4301P82707 2019-08 풋270							7,660
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,643	-7,643	-7,644	-7,645	-7,648	-7,653	-7,660
-5.33%	-4,433	-4,444	-4,461	-4,483	-4,510	-4,544	-4,583
-2.67%	-1,473	-1,549	-1,630	-1,714	-1,800	-1,889	-1,980
0%	280	189	95	0	-97	-194	-293
2.67%	681	660	632	596	554	507	454
5.33%	707	706	704	699	692	680	666
8.00%	708	708	708	708	707	706	703
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							4,596
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,592	-4,592	-4,592	-4,593	-4,593	-4,594	-4,596
-5.33%	-2,811	-2,813	-2,817	-2,823	-2,832	-2,843	-2,857
-2.67%	-1,087	-1,115	-1,146	-1,180	-1,217	-1,257	-1,299
0%	174	116	58	0	-58	-116	-174
2.67%	597	574	546	514	479	442	402

5.33%	642	640	636	630	621	610	596
8.00%	644	643	643	643	642	640	637

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

(단위:백만원)

41,129

공시일	2019-07-26
기준일	2019-07-25

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

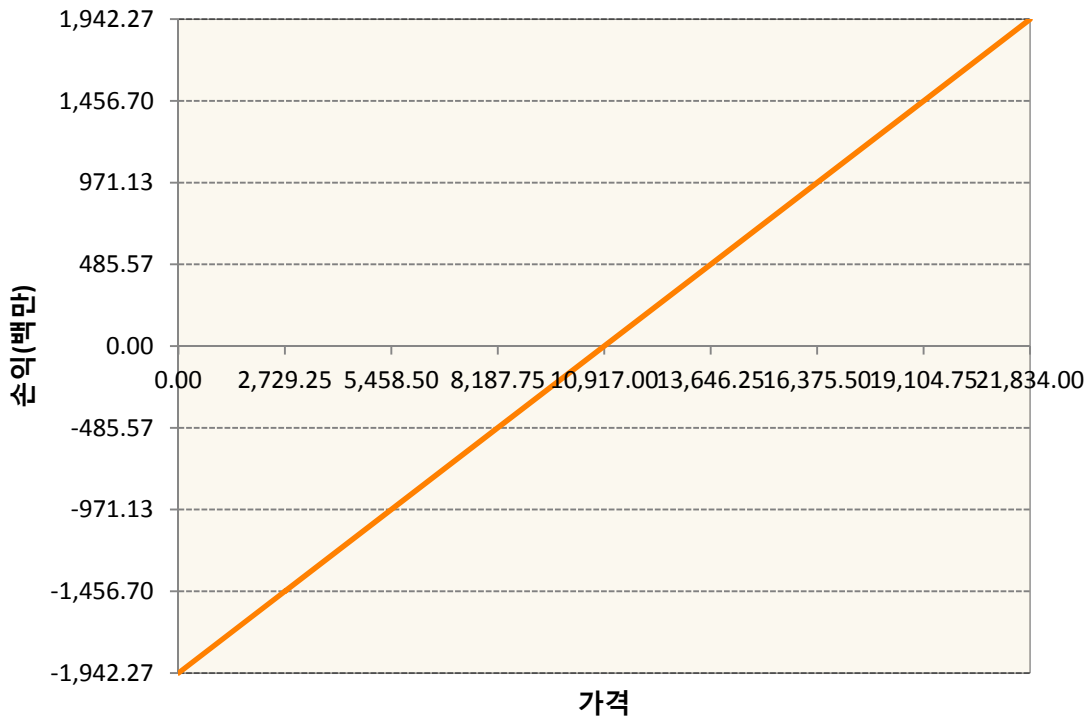
1. 계약금액

(단위:백만원)

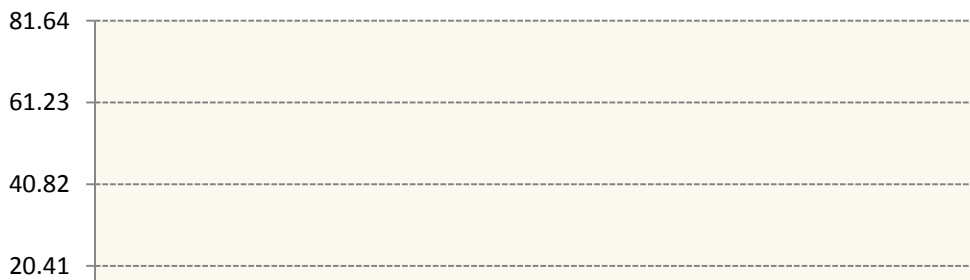
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,942	0	1,942	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,272	-5,272	장내
누계	통화	선도	151	3,175	-3,024	장외

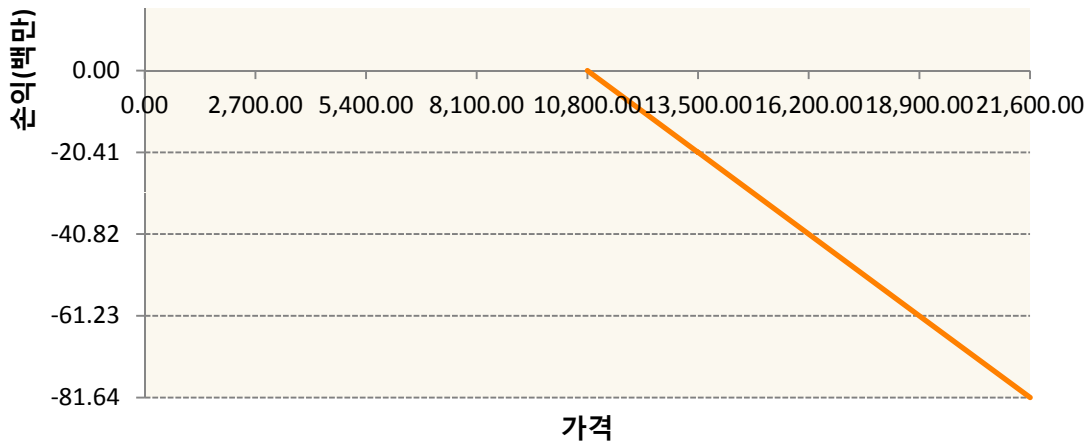
2. 만기시점의 손익구조

HCN9-HSCEI Futures Jul19

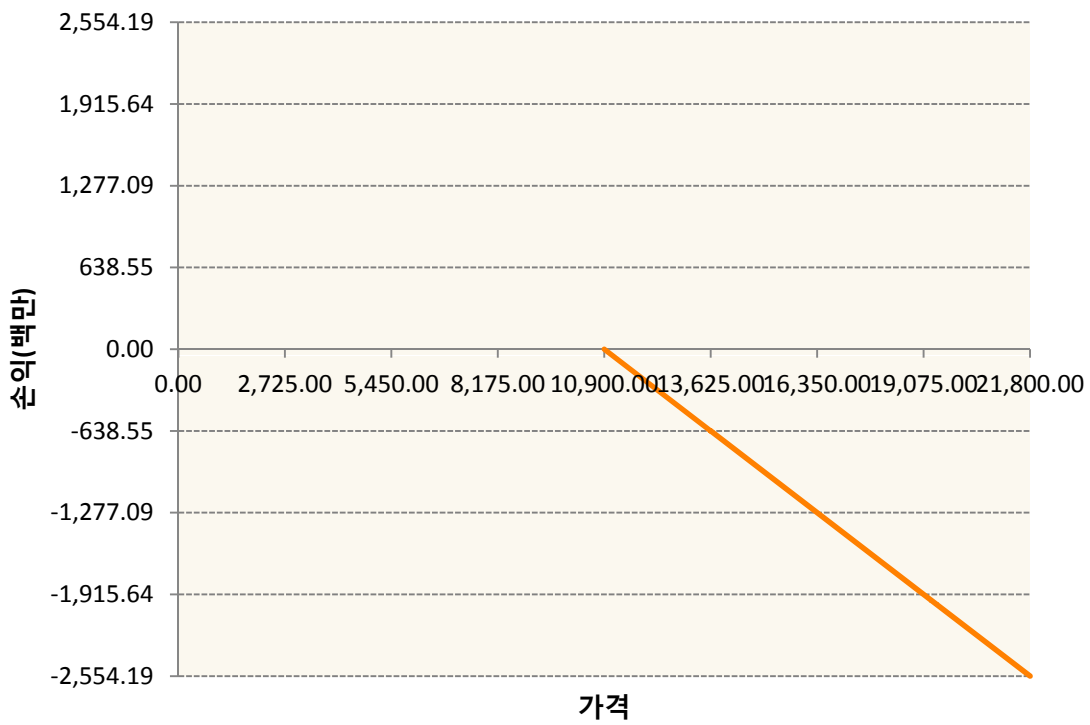


OHHIN9-C108-HSCEI

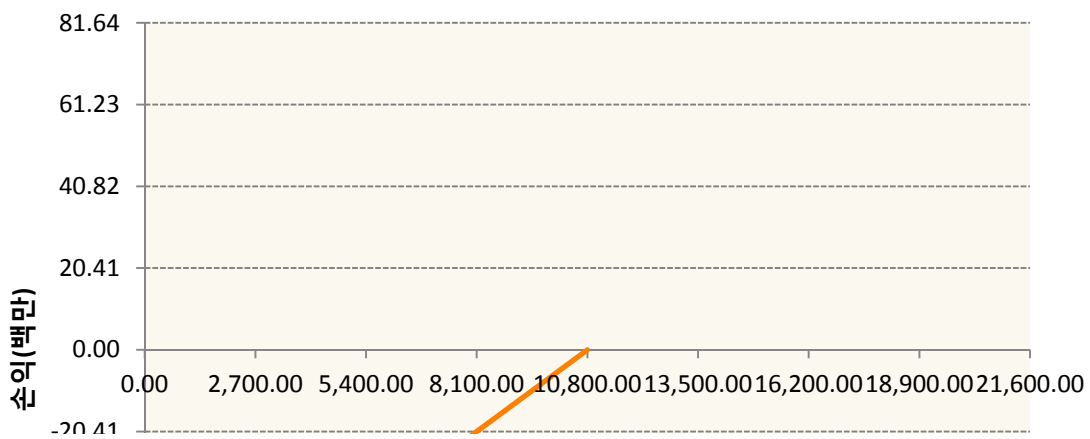


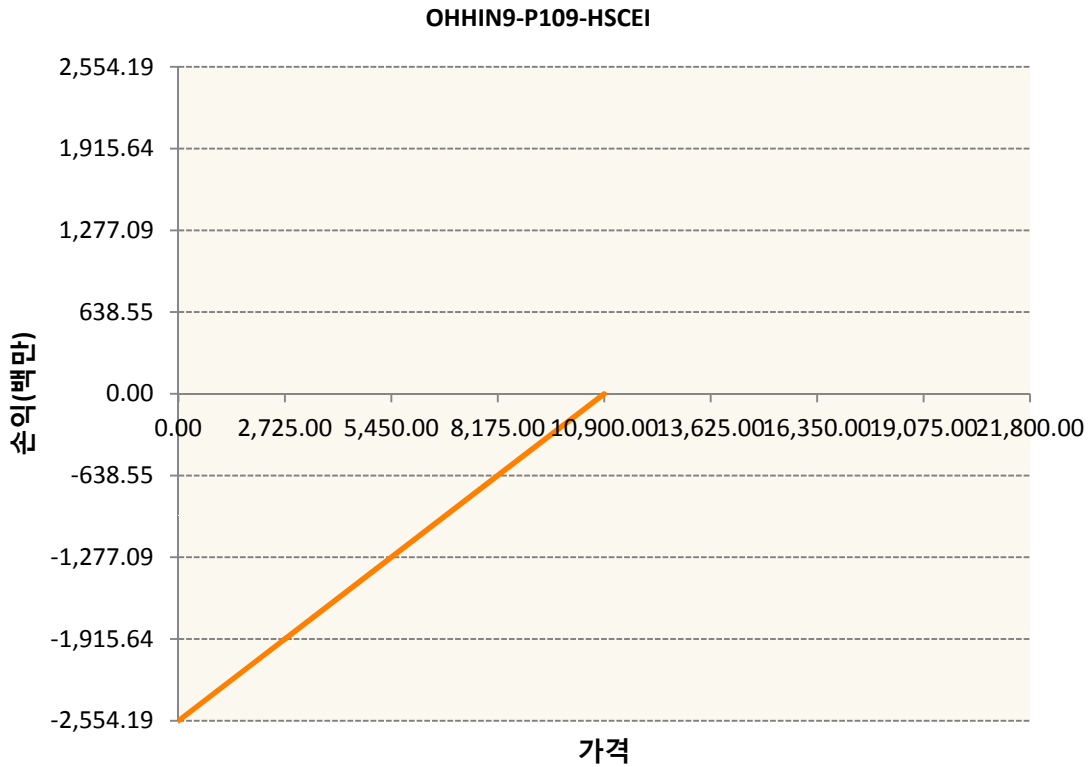
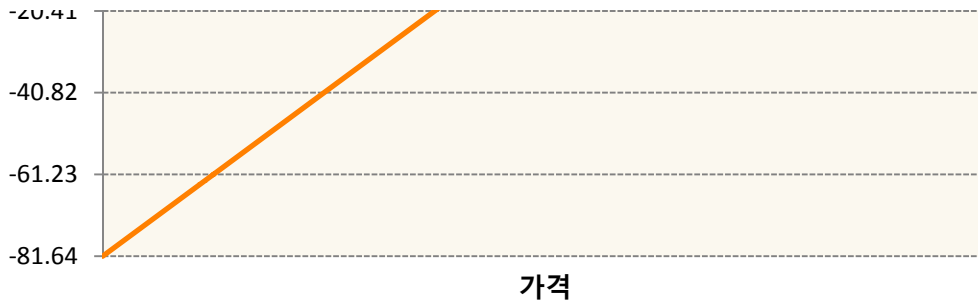


OHHIN9-C109-HSCEI



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	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)

662

공시일	2019-07-26
기준일	2019-07-25

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

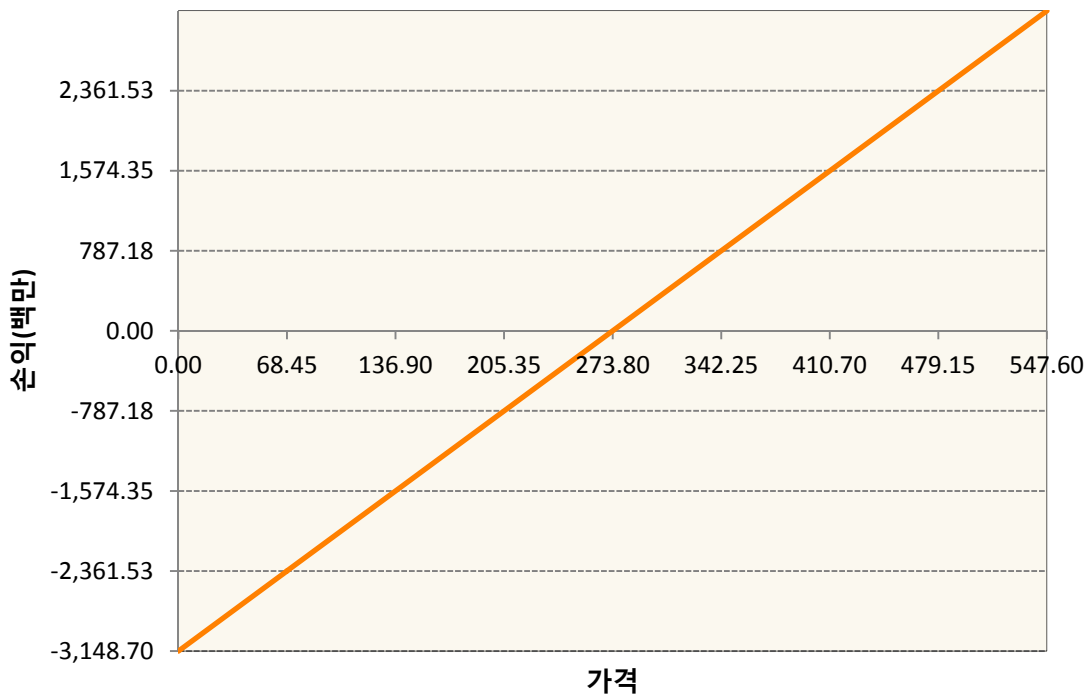
1. 계약금액

(단위:백만원)

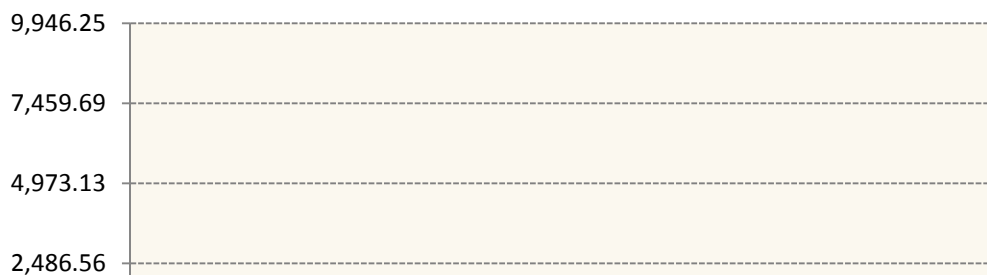
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	67	0	67	장내
누계	유가증권	선물	3,149	0	3,149	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	19,361	-19,361	장내

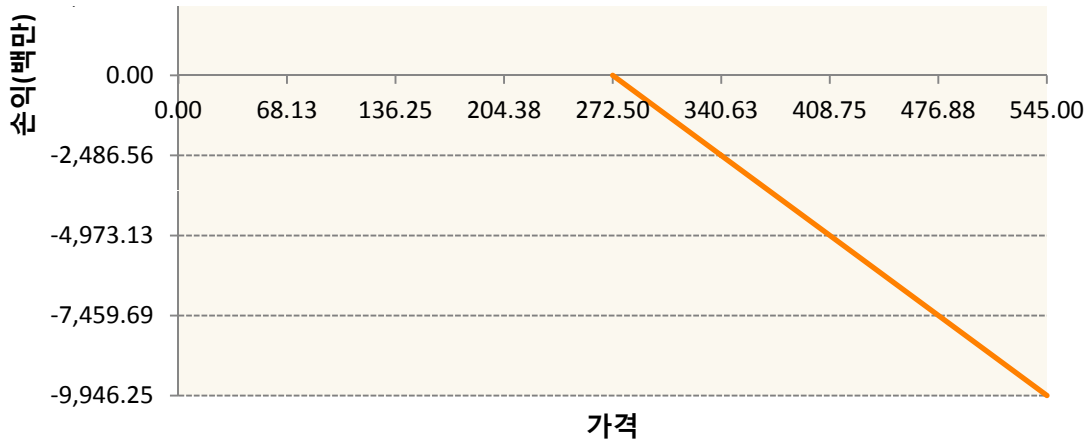
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

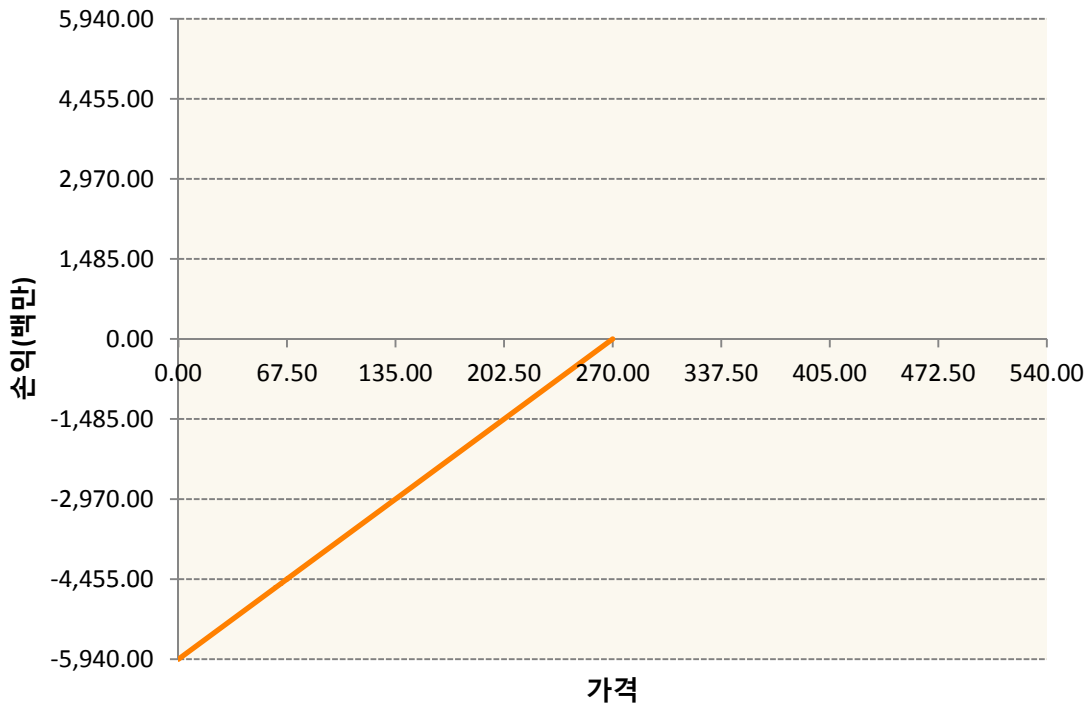


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

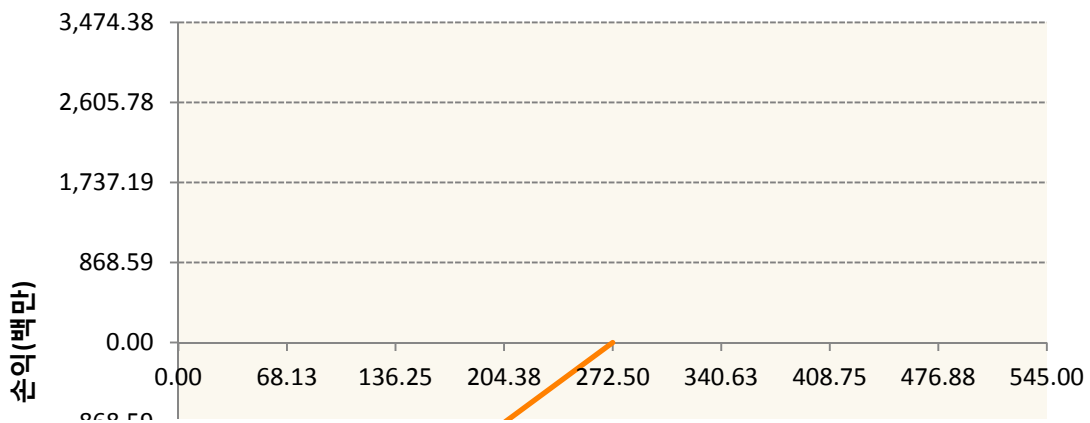




KR4301P82707-2019-08 풋270



KR4301P82723-2019-08 풋272.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,195
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,195	-1,195	-1,195	-1,195	-1,195	-1,195	-1,195	
-5.33%	-797	-797	-797	-797	-797	-797	-797	
-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%	797	797	797	797	797	797	797	
8.00%	1,195	1,195	1,195	1,195	1,195	1,195	1,195	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						605
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-605	-605	-605	-605	-605	-605	-605	
-5.33%	-403	-403	-403	-403	-403	-403	-403	
-2.67%	-202	-202	-202	-202	-202	-202	-202	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	202	202	202	202	202	202	202	
5.33%	403	403	403	403	403	403	403	
8.00%	605	605	605	605	605	605	605	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						251
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-251	-251	-251	-251	-251	-251	-251	
-5.33%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167	
-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%	167	167	167	167	167	167	167	
8.00%	251	251	251	251	251	251	251	
KR4201P82725		2019-08 콜272.5						642
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	198	196	194	191	187	182	176
-5.33%	188	183	176	168	159	149	139
-2.67%	149	136	123	110	96	82	68
0%	48	32	16	0	-16	-32	-48
2.67%	-128	-141	-154	-167	-181	-195	-209
5.33%	-360	-366	-373	-381	-390	-400	-411
8.00%	-616	-618	-621	-625	-629	-635	-642
KR4301P82707 2019-08 풋270							381
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-380	-380	-380	-380	-380	-380	-381
-5.33%	-220	-221	-222	-223	-224	-226	-228
-2.67%	-73	-77	-81	-85	-90	-94	-98
0%	14	9	5	0	-5	-10	-15
2.67%	34	33	31	30	28	25	23
5.33%	35	35	35	35	34	34	33
8.00%	35	35	35	35	35	35	35
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							239
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-239	-239	-239	-239	-239	-239	-239
-5.33%	-146	-146	-147	-147	-147	-148	-149
-2.67%	-57	-58	-60	-61	-63	-65	-68
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	31	30	28	27	25	23	21
5.33%	33	33	33	33	32	32	31
8.00%	33	33	33	33	33	33	33

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

(단위:백만원)

3,387

공시일	2019-07-26
기준일	2019-07-25

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

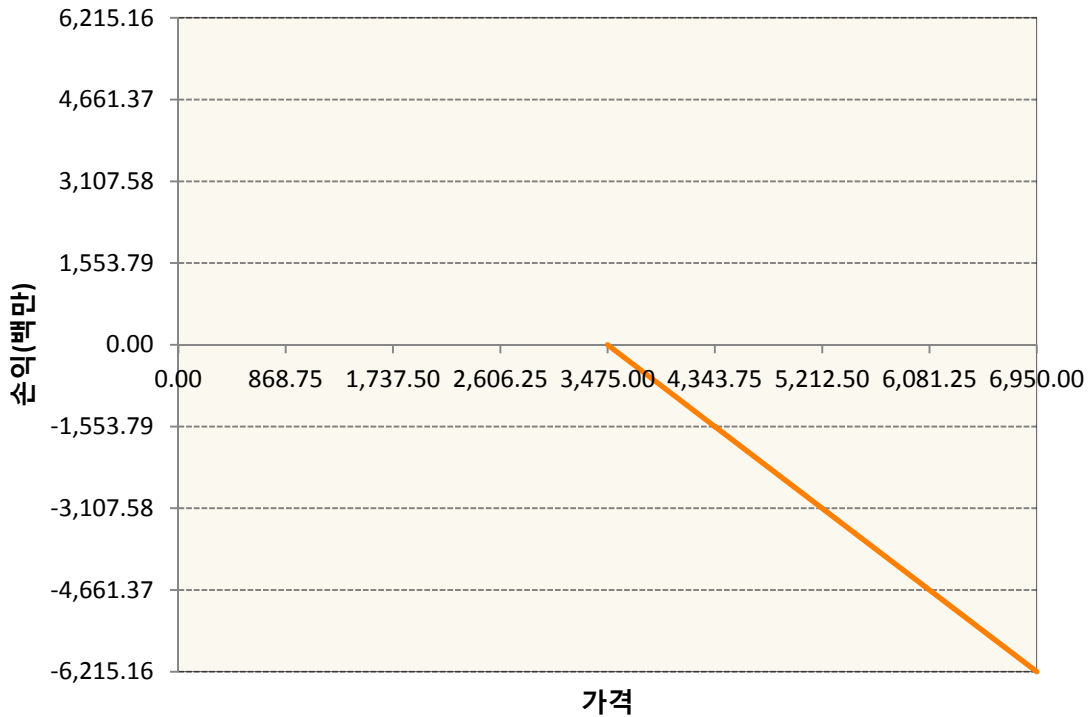
1. 계약금액

(단위:백만원)

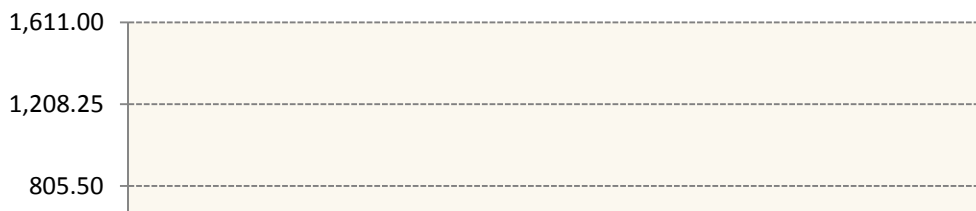
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,990	0	4,990	
누계	유가증권	스왑	37,553	0	37,553	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,652	-15,652	장내
누계	통화	선도	9,206	22,357	-13,151	장외

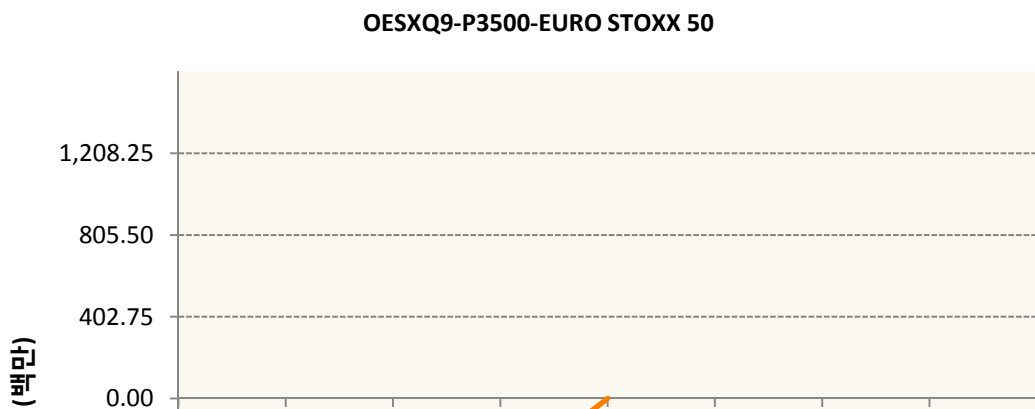
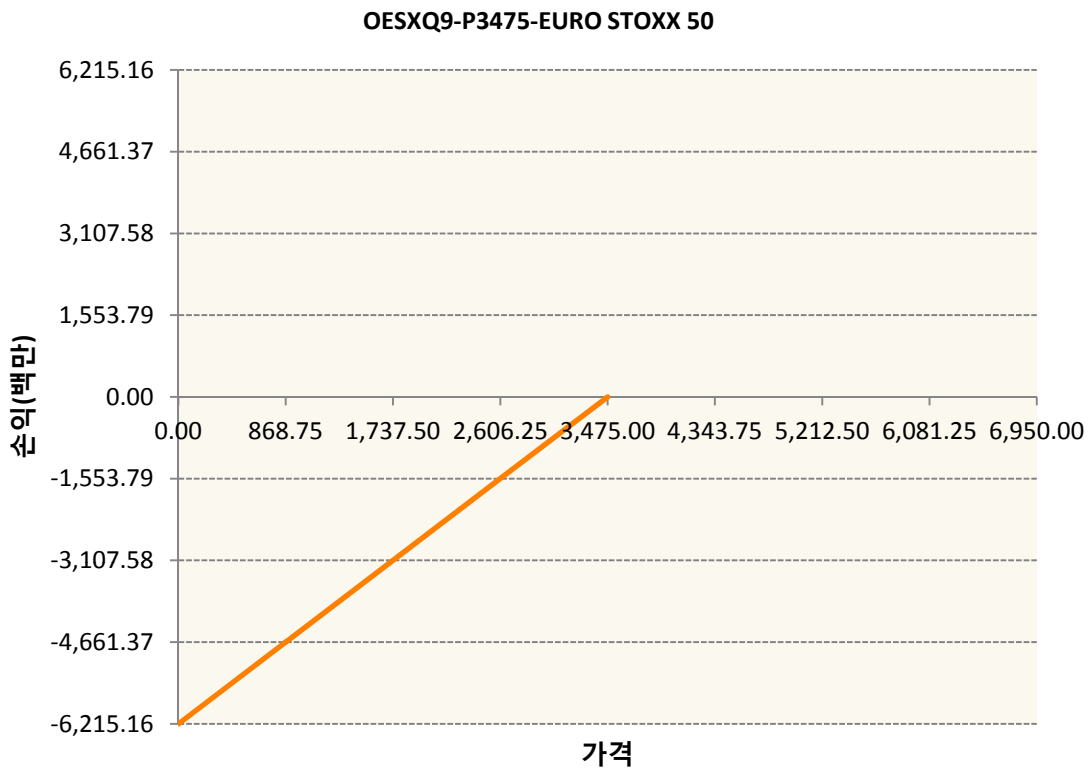
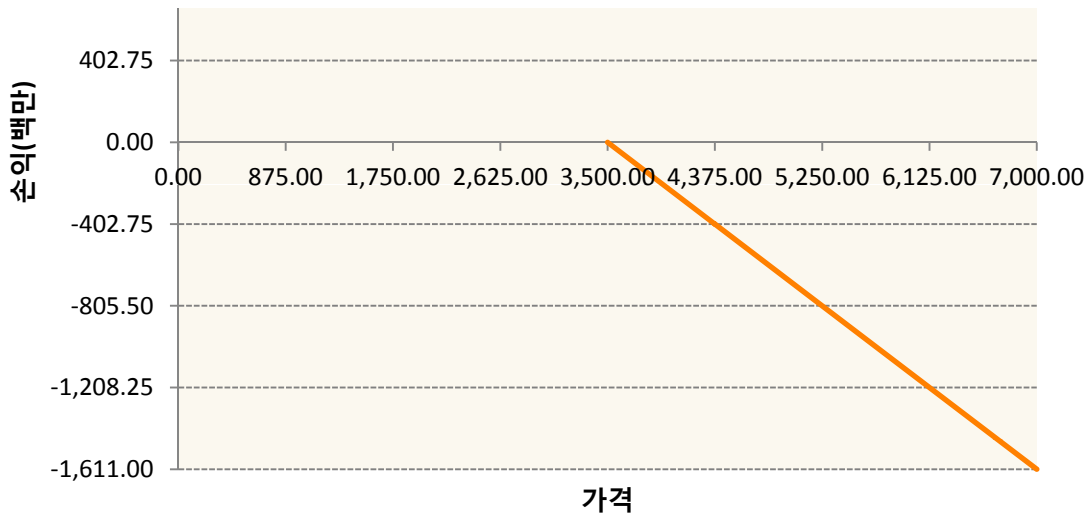
2. 만기시점의 손익구조

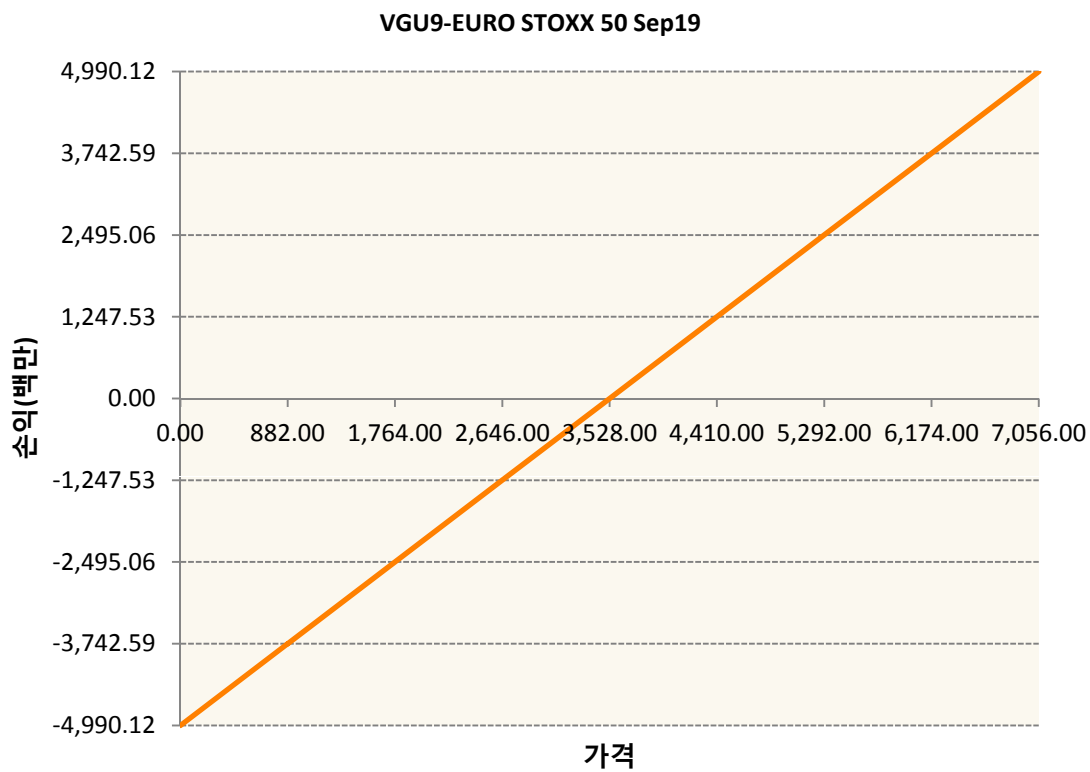
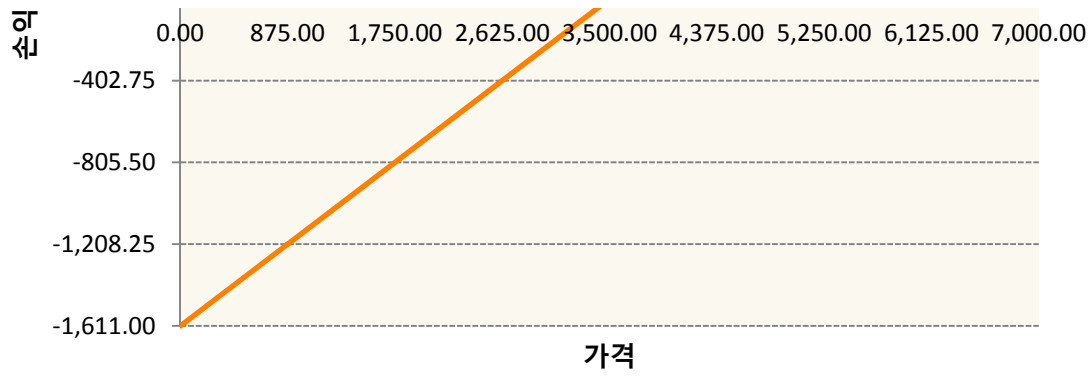
OESXQ9-C3475-EURO STOXX 50



OESXQ9-C3500-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	19
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	421
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E	1,052
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	316
FX21019N01 EUR/KRW 23-08-19E	421
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E	316
OESXQ9-C34 EURO STOXX 50	497
OESXQ9-C35 EURO STOXX 50	129
OESXQ9-P34 EURO STOXX 50	497
OESXQ9-P35 EURO STOXX 50	129
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	399

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

(단위:백만원)

2,333

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	2019-07-26
기준일	2019-07-25

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

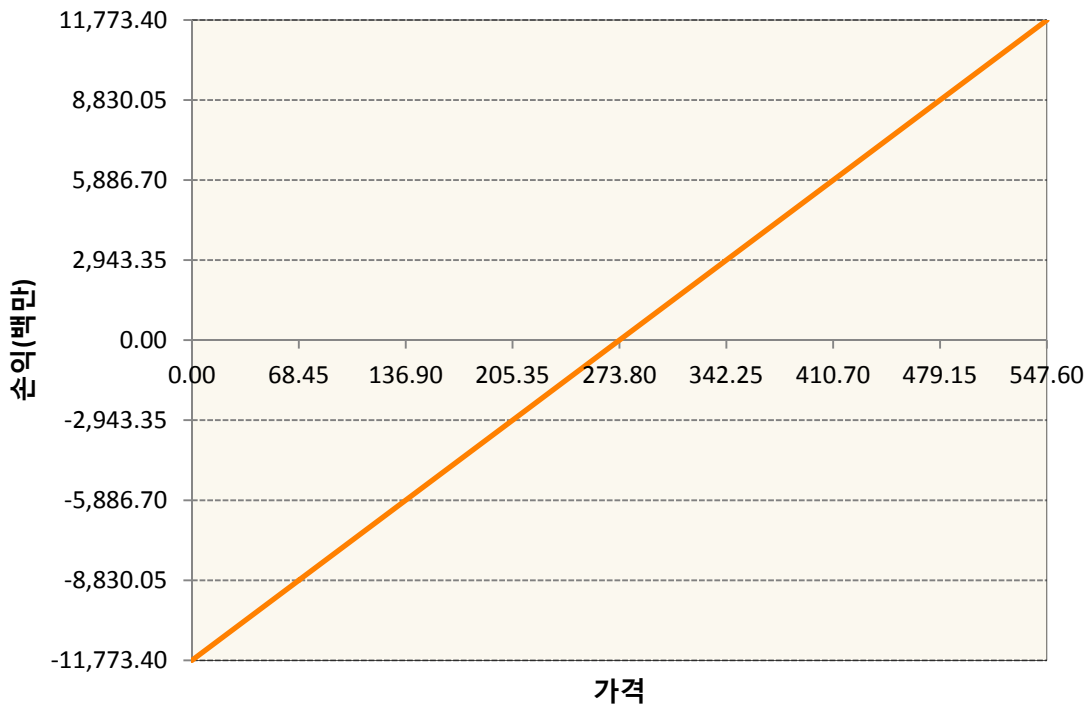
1. 계약금액

(단위:백만원)

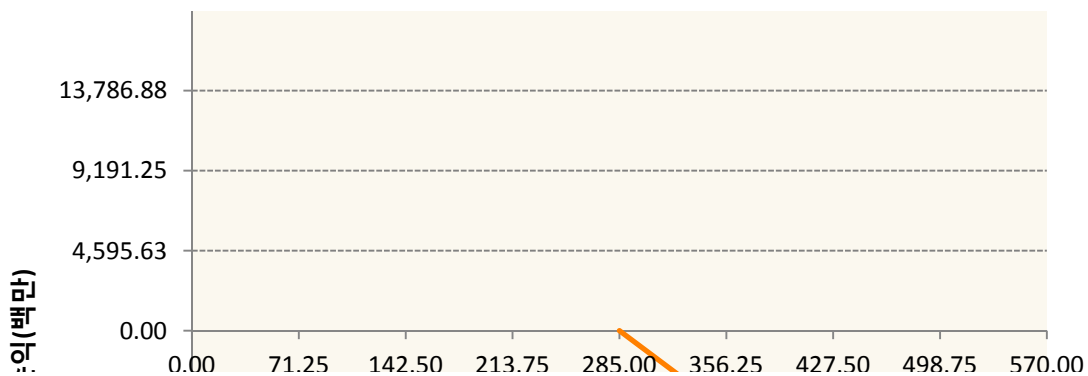
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	69	-69	장내
신규	유가증권	옵션	71	0	71	장내
누계	유가증권	선물	11,773	0	11,773	장내
누계	유가증권	옵션	1,698	21,617	-19,919	장내

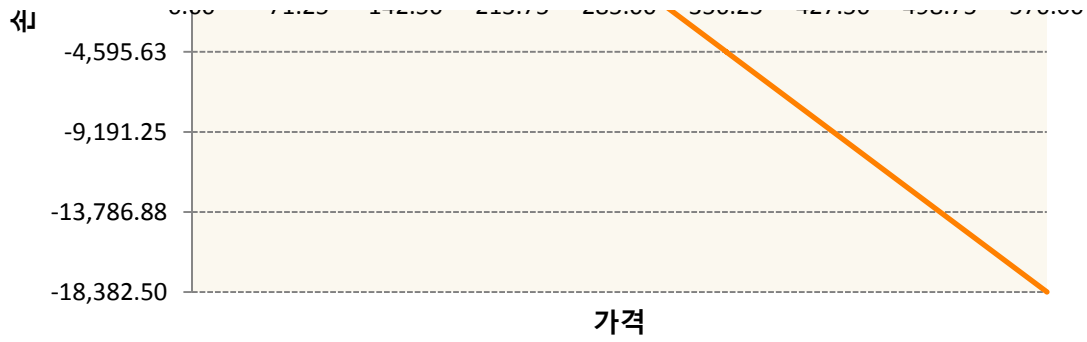
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

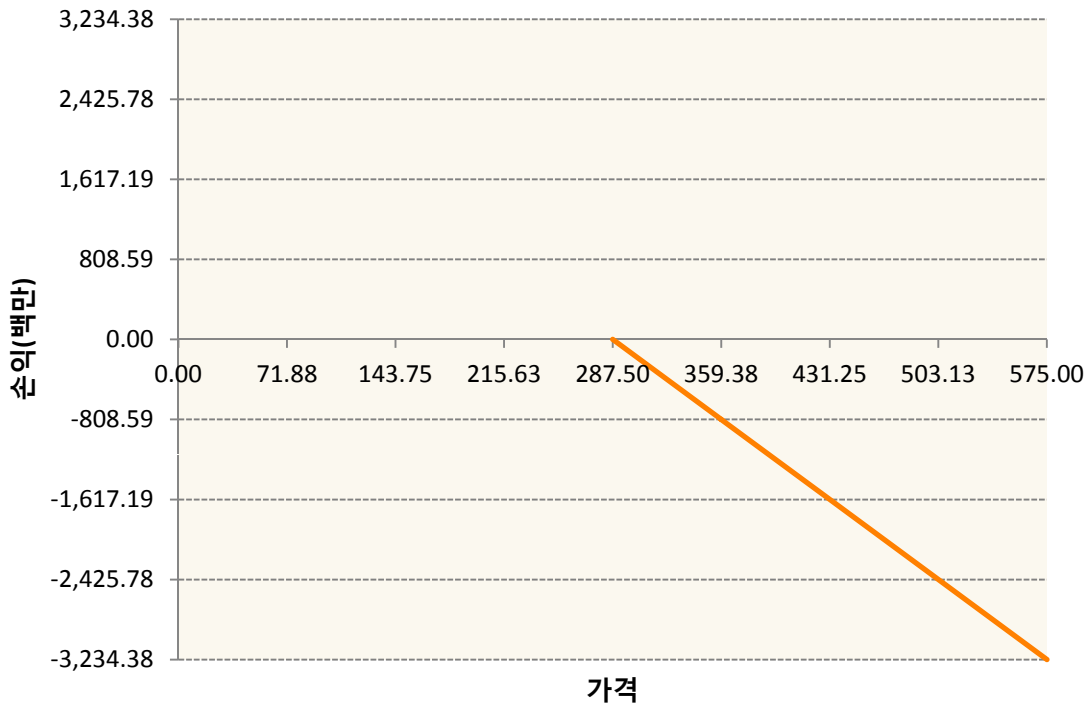


KR4201P82857-2019-08 콜285

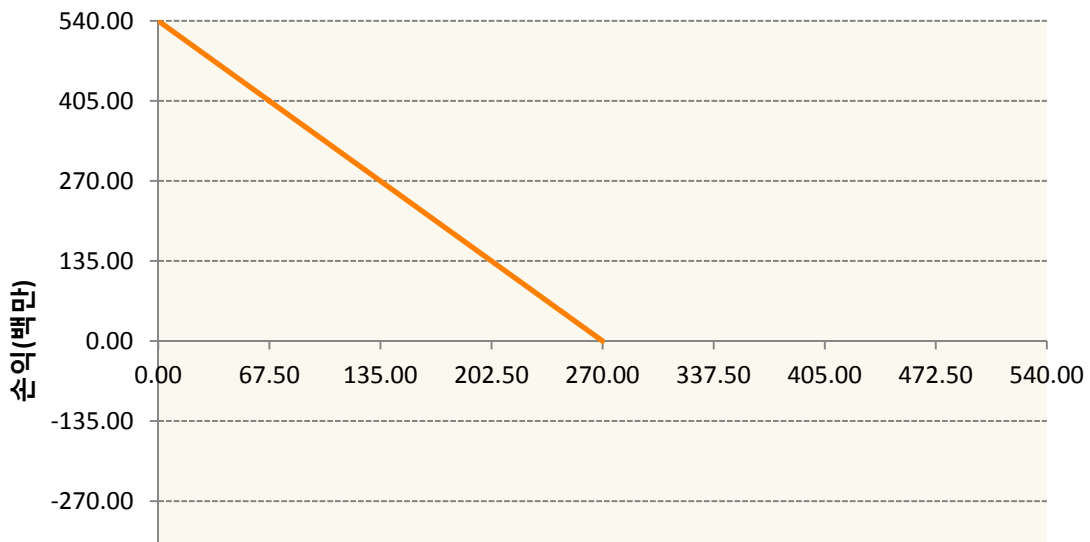


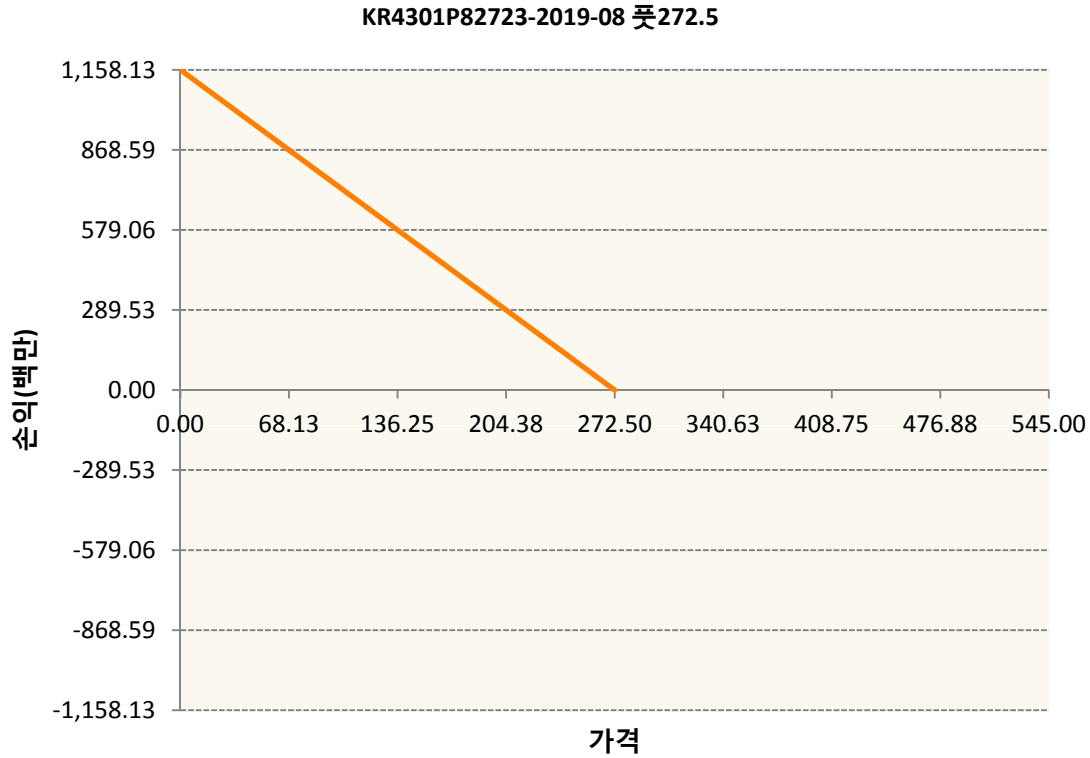
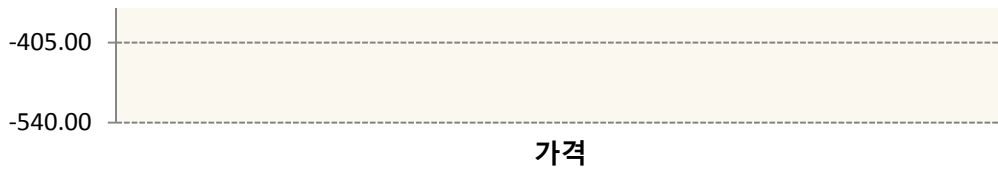


KR4201P82873-2019-08 콜287.5



KR4301P82707-2019-08 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						939
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-939	-939	-939	-939	-939	-939	-939	
-5.33%	-626	-626	-626	-626	-626	-626	-626	
-2.67%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	313	313	313	313	313	313	313	
5.33%	626	626	626	626	626	626	626	
8.00%	939	939	939	939	939	939	939	
KR4201P82857		2019-08 콜285						746
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	87	87	87	86	85	83	81	
-5.33%	87	86	84	81	77	71	64	
-2.67%	81	76	69	60	49	37	23	

0%	51	35	19	0	-20	-41	-63
2.67%	-50	-76	-103	-130	-158	-185	-213
5.33%	-267	-296	-325	-354	-383	-412	-441
8.00%	-607	-628	-649	-672	-696	-720	-746
KR4201P82873 2019-08 콜287.5							115
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11	11	11	11	11	10	10
-5.33%	11	11	10	10	10	9	8
-2.67%	10	10	9	8	6	5	3
0%	7	5	3	0	-3	-6	-9
2.67%	-5	-9	-14	-18	-23	-27	-32
5.33%	-36	-41	-46	-51	-56	-62	-67
8.00%	-88	-92	-97	-101	-106	-111	-115
KR4301P82707 2019-08 풋270							35
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	35	35	35	35	35	35	35
-5.33%	20	20	20	20	20	21	21
-2.67%	7	7	7	8	8	9	9
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-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							80
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	80	80	80	80	80	80	80
-5.33%	49	49	49	49	49	49	50
-2.67%	19	19	20	20	21	22	23
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-10	-10	-9	-9	-8	-8	-7
5.33%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-10
8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11

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

(단위:백만원)

1,535

공시일	2019-07-26
기준일	2019-07-25

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	5,317	0	5,317	
누계	유가증권	수익증권	44,866	0	44,866	

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	2019-07-26
기준일	2019-07-25

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	54,015	0	54,015	

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	2019-07-26
기준일	2019-07-25

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,544	0	3,544	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	411,019	0	411,019	
누계	통화	선도	0	423,946	-423,946	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E		699
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E		699
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E		1,304
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E		2,563
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		3,119
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		2,117
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		1,701
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,079
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		132
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		567
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		3,025
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		3,308
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		473
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		945
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		2,940
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		1,645
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		756
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,890
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,890
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		284
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		95
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		699
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		699
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		284

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

(단위:백만원)

11,031

공시일	2019-07-26
기준일	2019-07-25

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

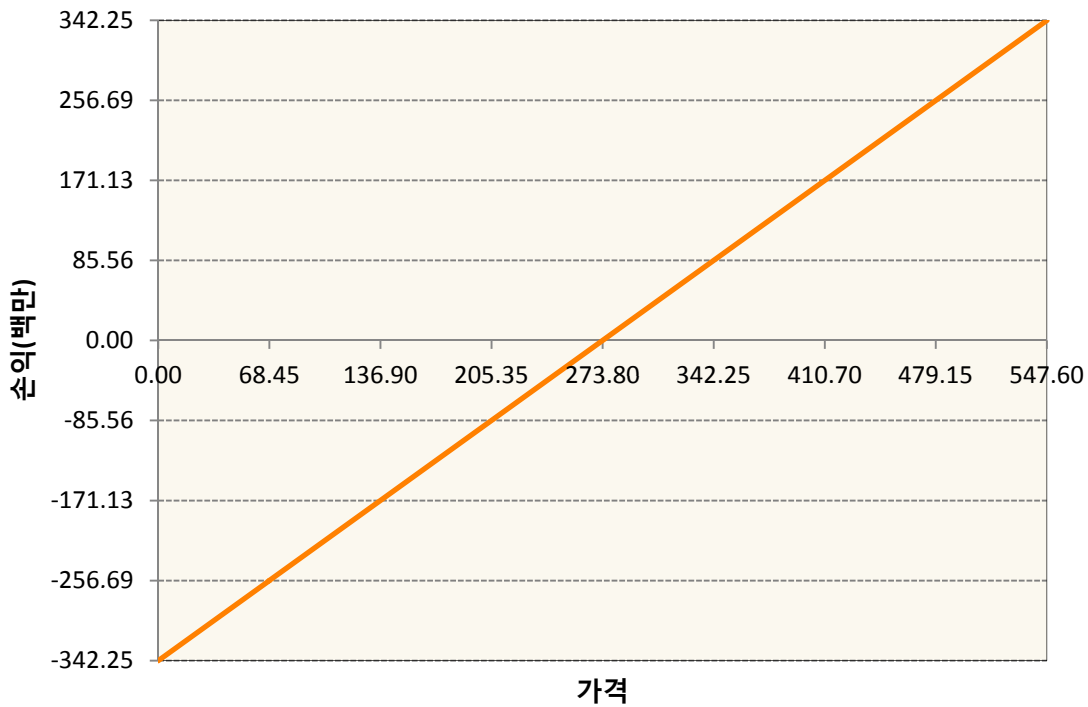
1. 계약금액

(단위:백만원)

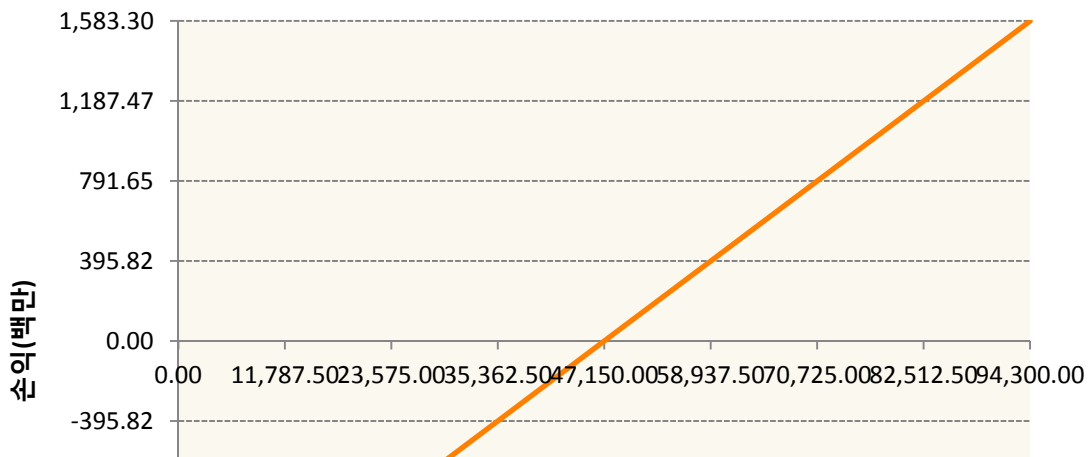
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,926	0	1,926	장내

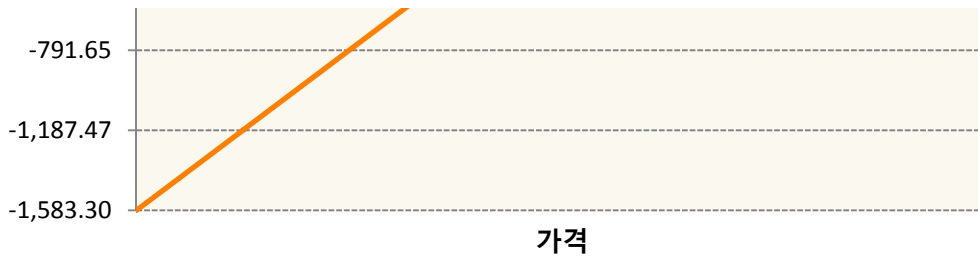
2. 만기시점의 손익구조

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						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)

180

공시일	2019-07-26
기준일	2019-07-25

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

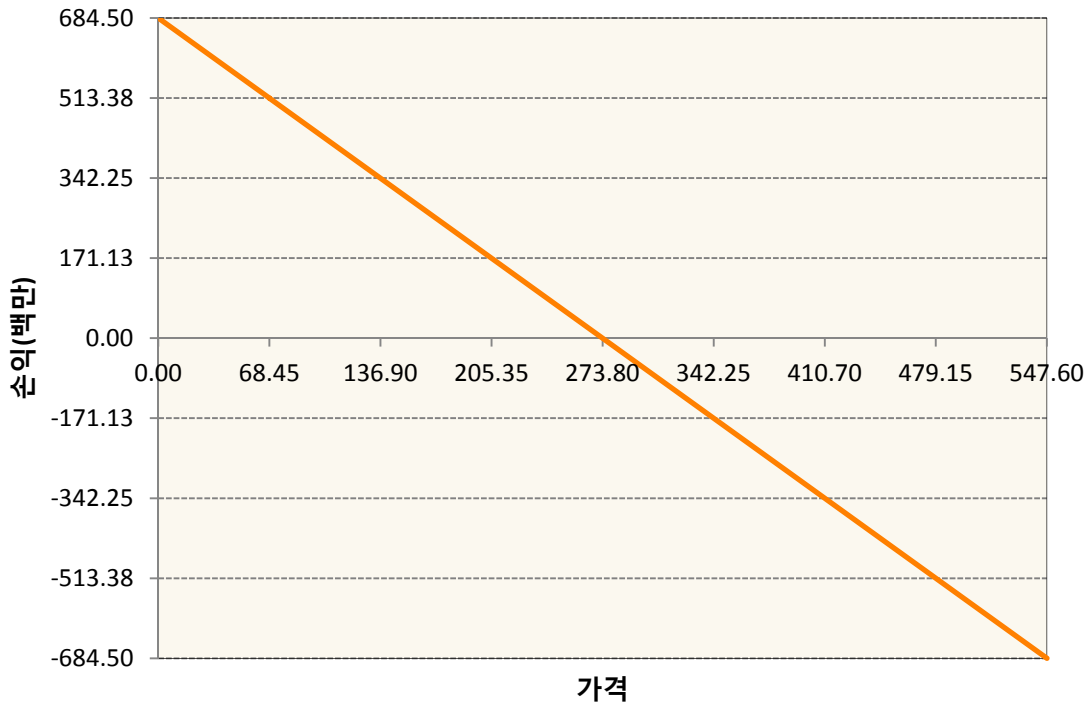
1. 계약금액

(단위:백만원)

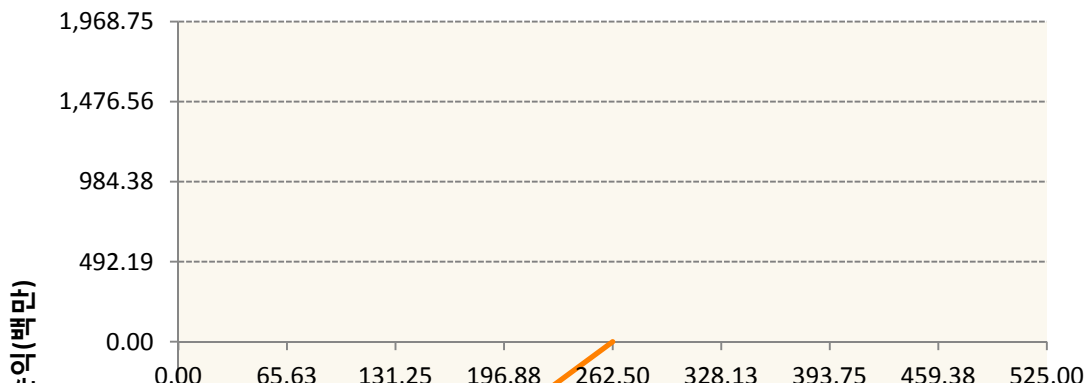
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	685	-685	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,625	-3,625	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

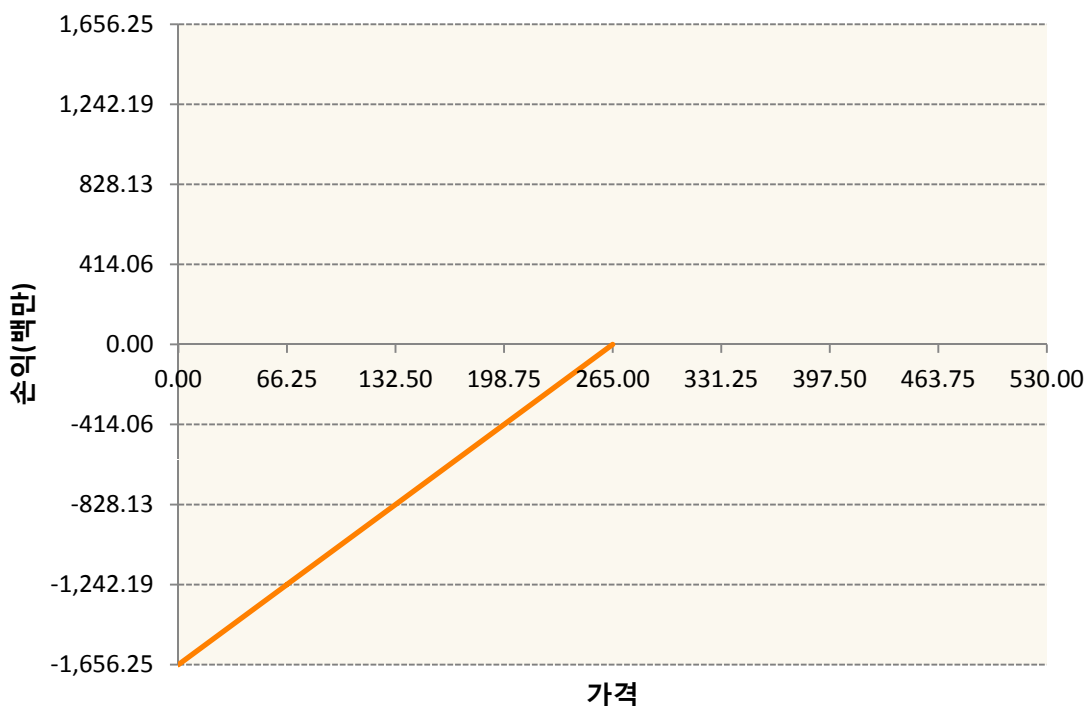


KR4301P82624-2019-08 풋262.5





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%	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%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55	
KR4301P82624		2019-08 풋262.5						86
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-84	-84	-84	-85	-85	-86	-86
-5.33%	-34	-35	-36	-38	-39	-41	-42
-2.67%	-5	-6	-8	-9	-11	-13	-14
0%	1	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	2	2	2	1	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

85

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-84	-84	-84	-84	-84	-85	-85
-5.33%	-40	-41	-41	-42	-43	-44	-45
-2.67%	-8	-10	-11	-12	-14	-15	-17
0%	2	1	1	0	-1	-2	-3
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

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

(단위:백만원)

168

공시일	2019-07-26
기준일	2019-07-25

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	18,498	0	18,498	
누계	통화	선도	0	18,313	-18,313	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		983
FX21019N01 KRW/USD 12-08-19E		161
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		321

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

(단위:백만원)

477

공시일	2019-07-26
기준일	2019-07-25

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	375	0	375	장외
누계	통화	선도	0	49	-49	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	30
FX21019N01 KRW/EUR 25-10-19E	4

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

(단위:백만원)

31

공시일	2019-07-26
기준일	2019-07-25

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

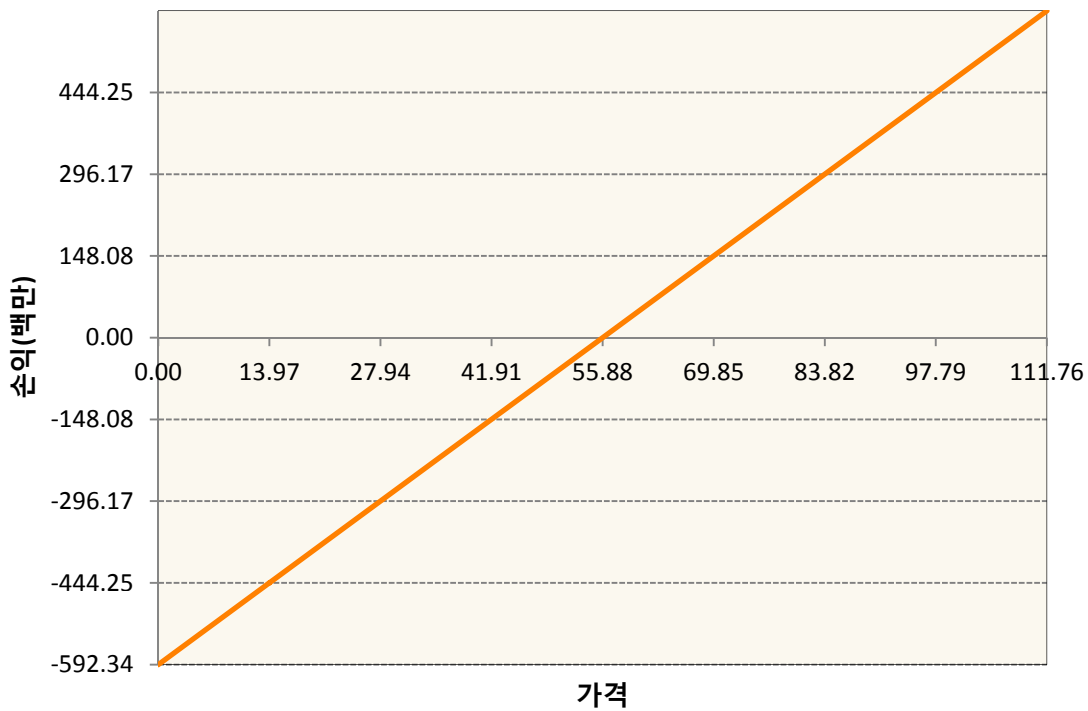
1. 계약금액

(단위:백만원)

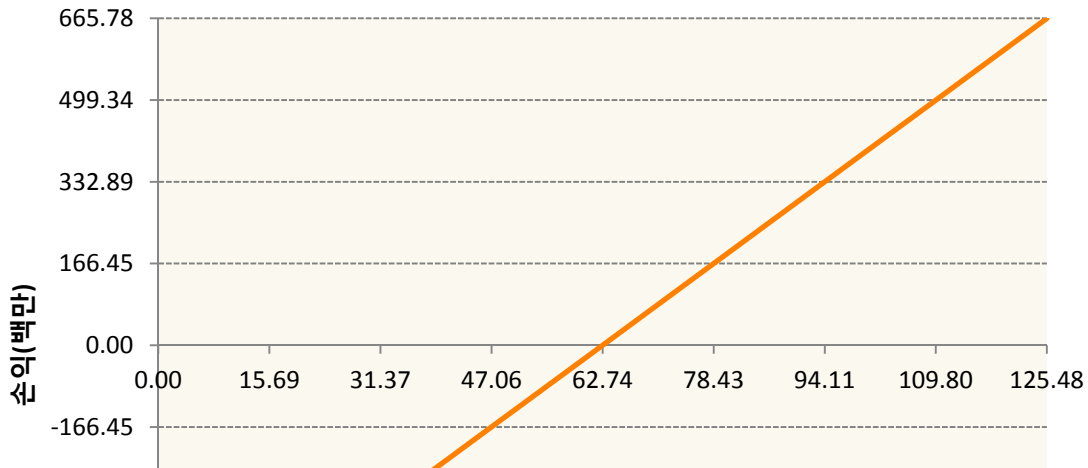
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,517	118	2,399	

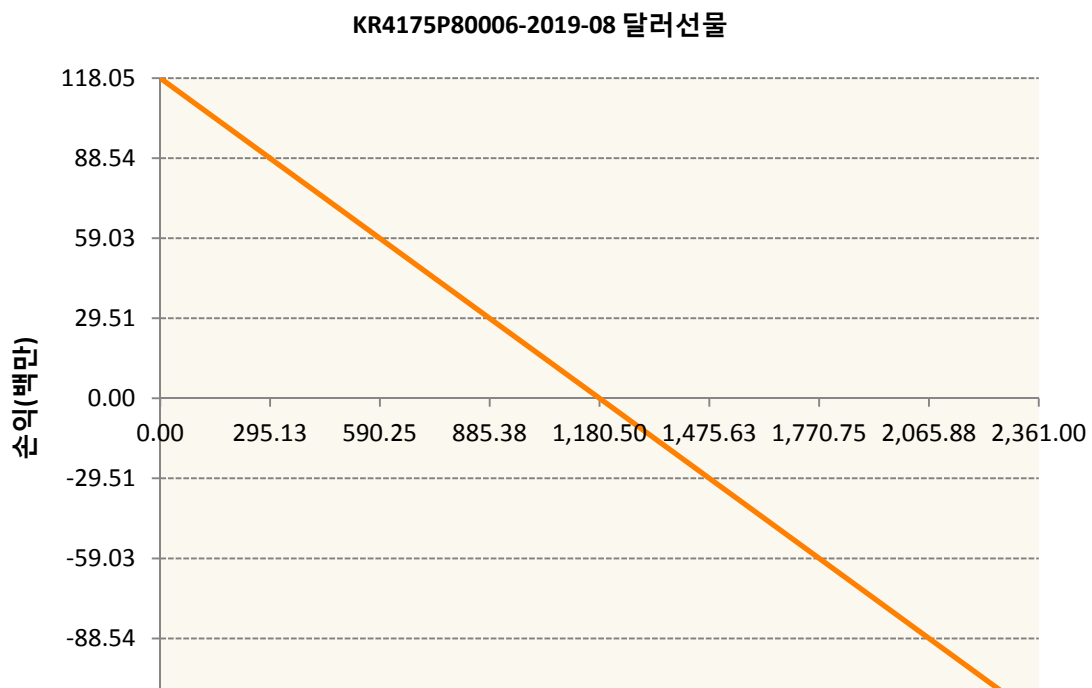
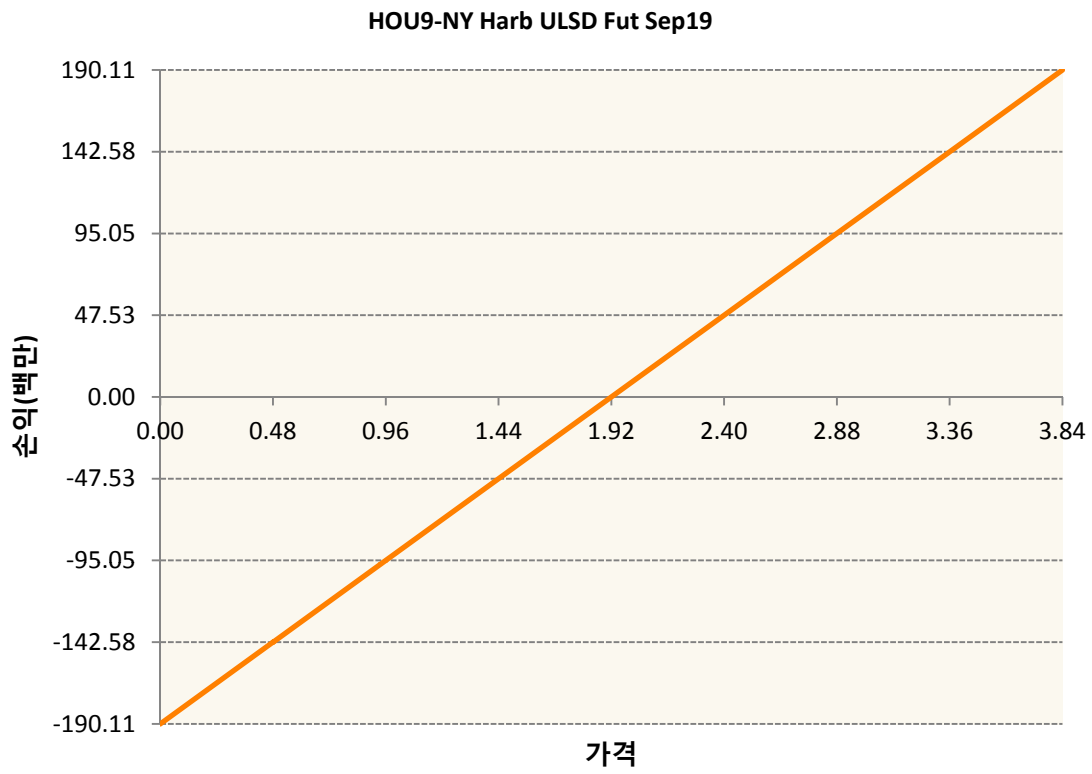
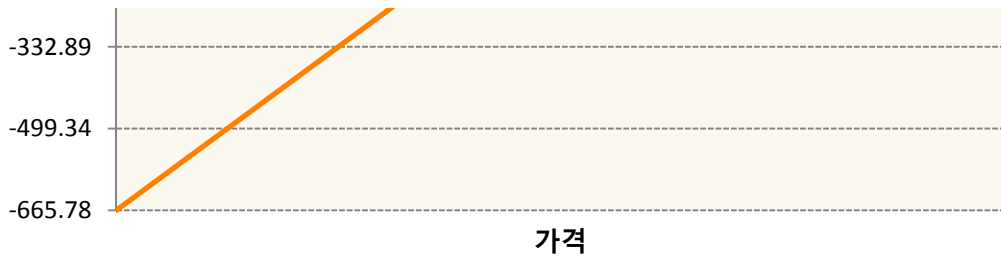
2. 만기시점의 손익구조

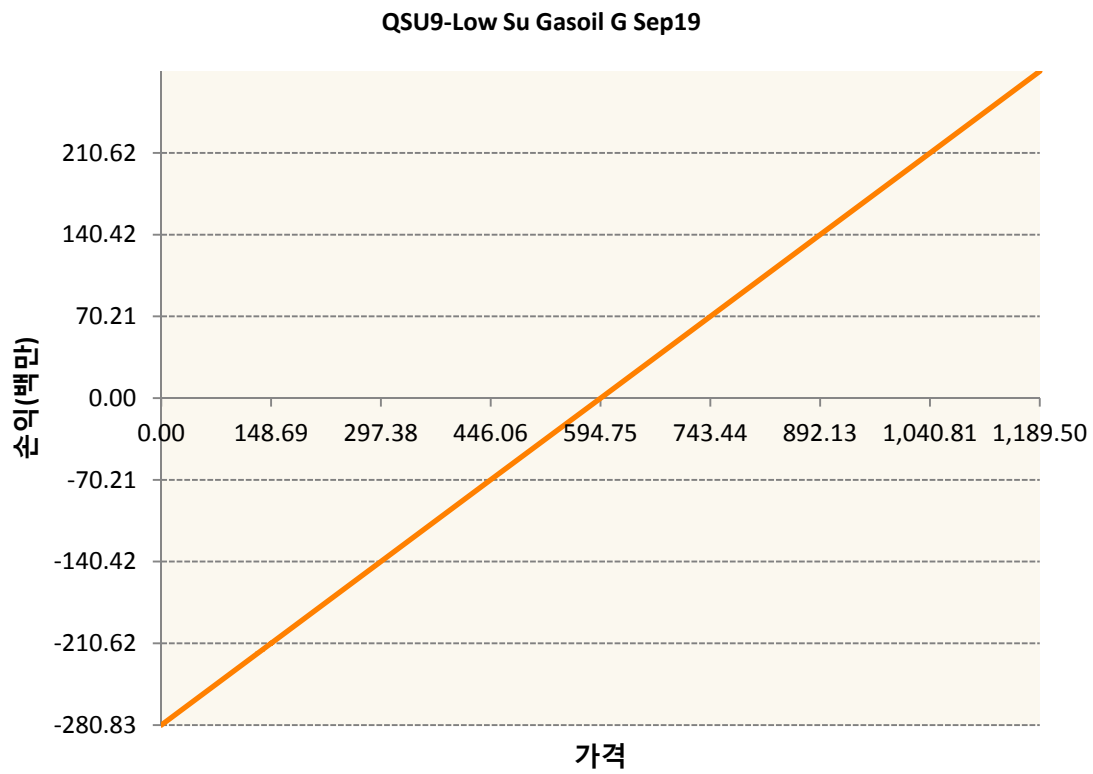
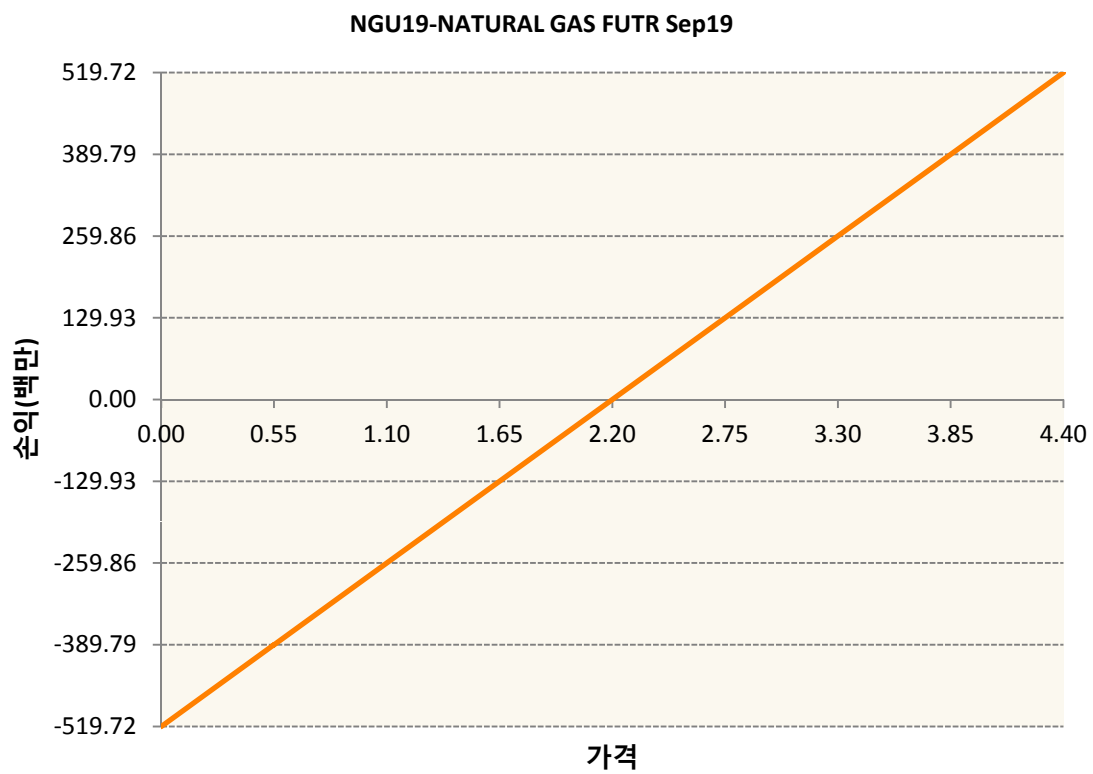
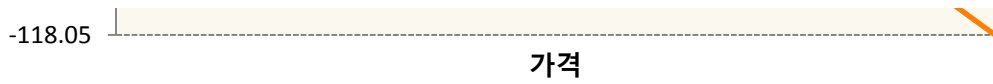
CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19



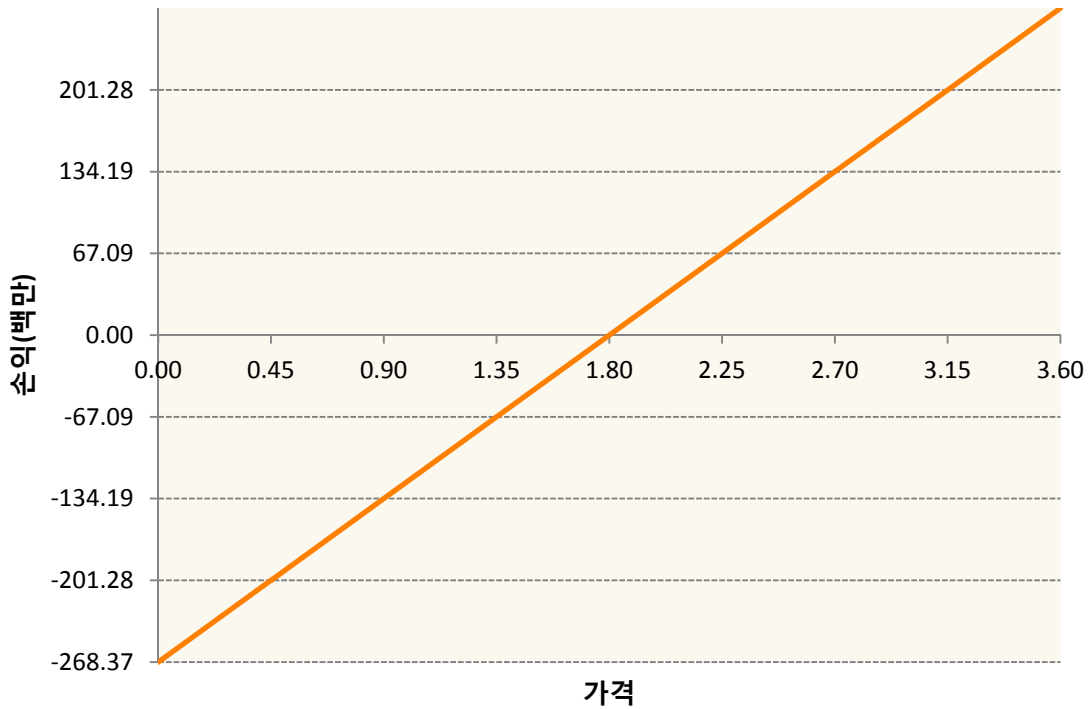
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19







XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	47
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	53
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	15
KR4175P800	2019-08 달러선물	9
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	42
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	22
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	21

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

(단위:백만원)

366

공시일	2019-07-26
기준일	2019-07-25

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

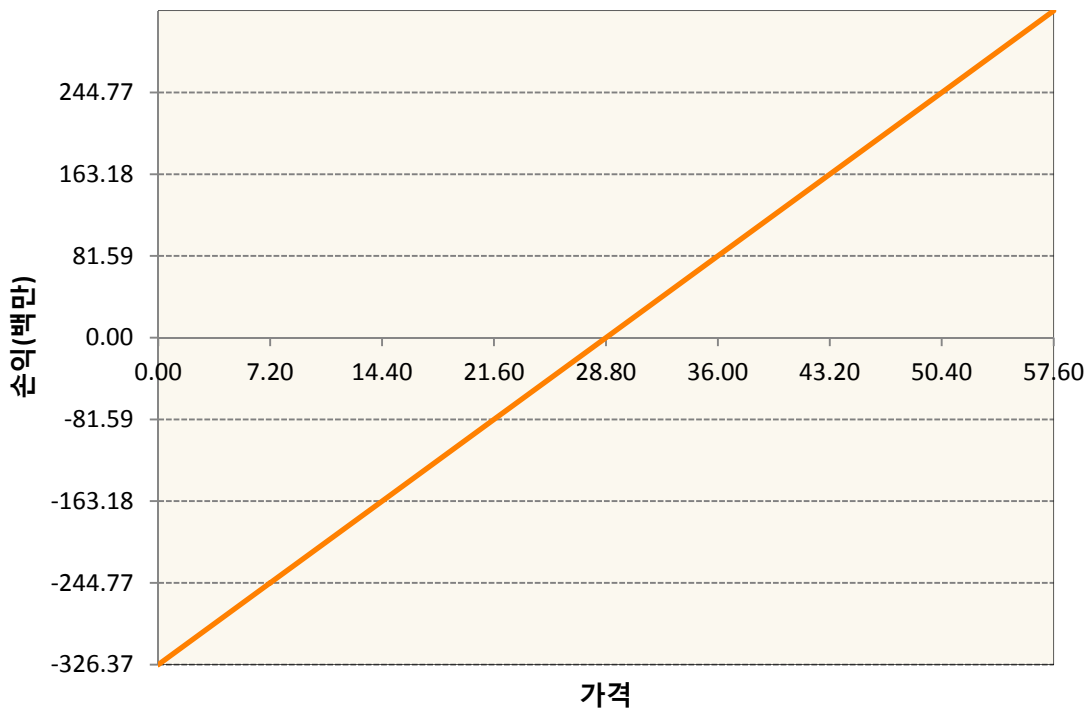
1. 계약금액

(단위:백만원)

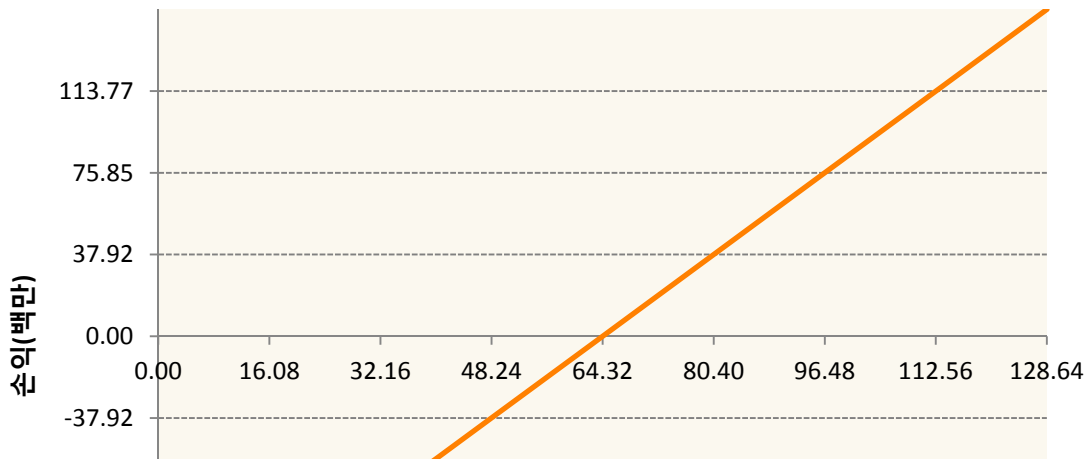
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,998	201	2,797	

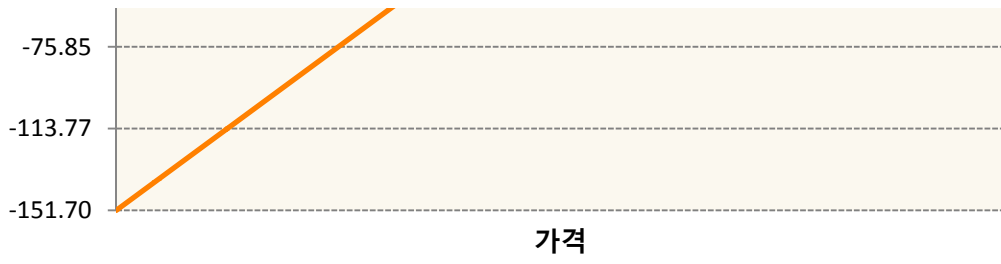
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

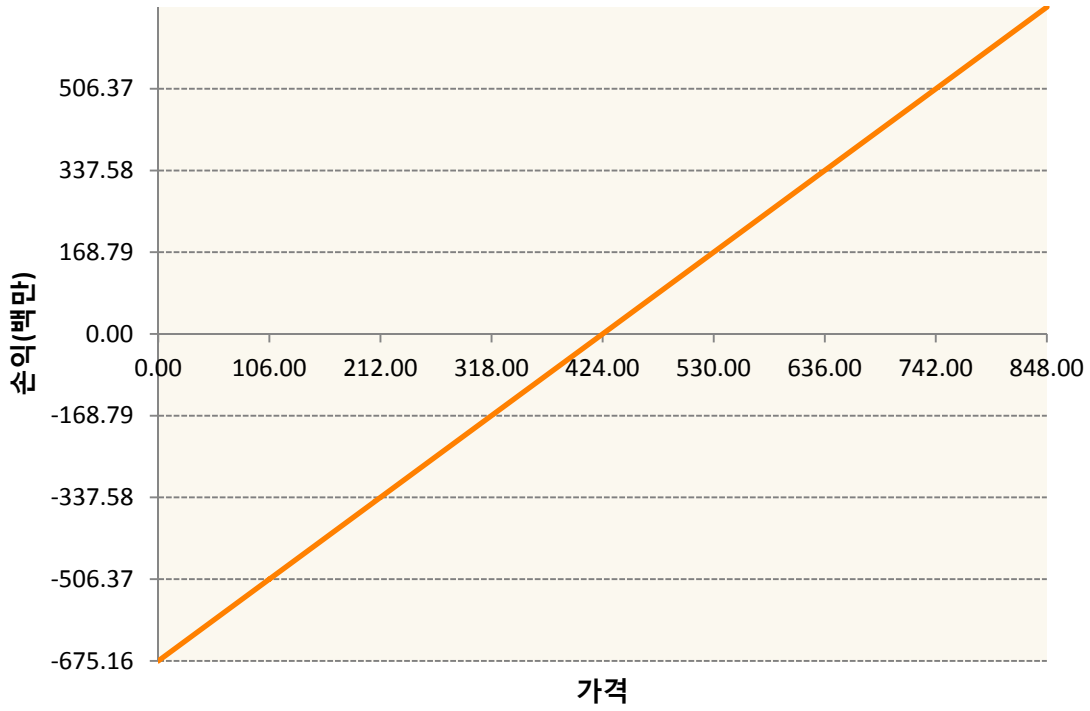


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

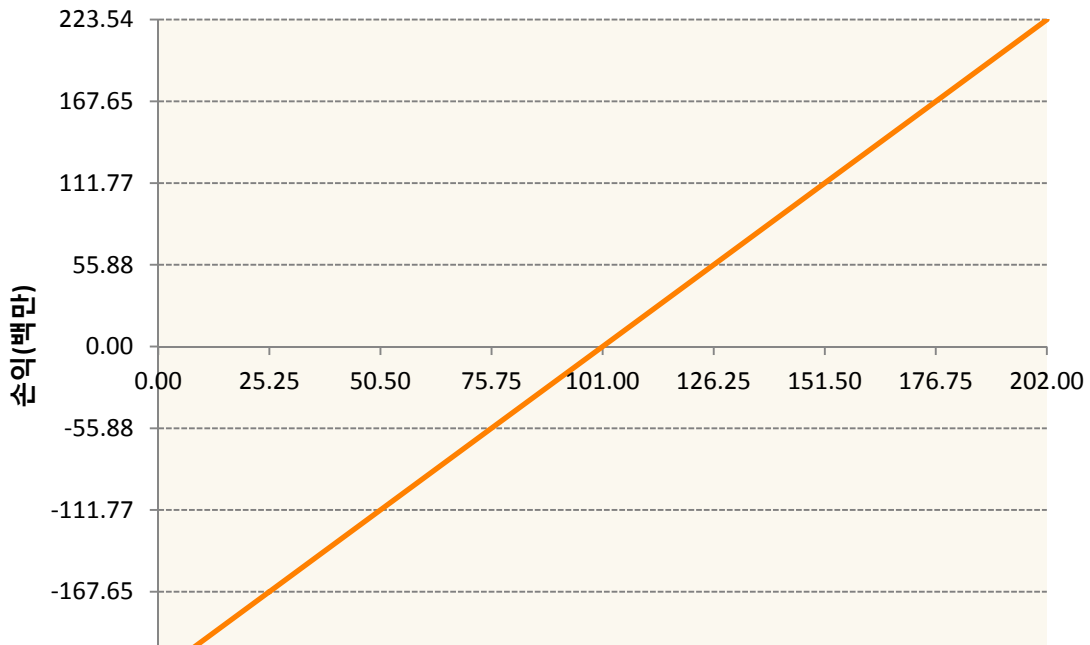


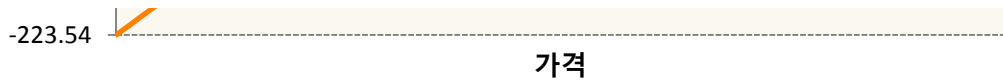


CU9-CORN FUTURE Sep19

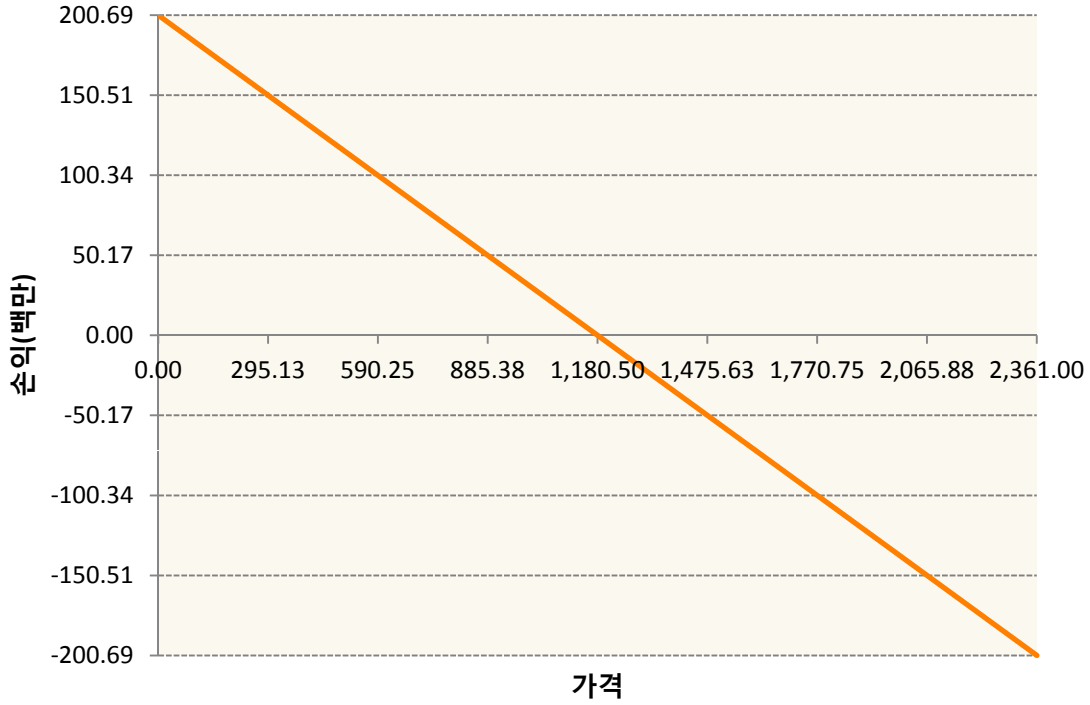


KCU9-COFFEE 'C' FUTURE Sep19

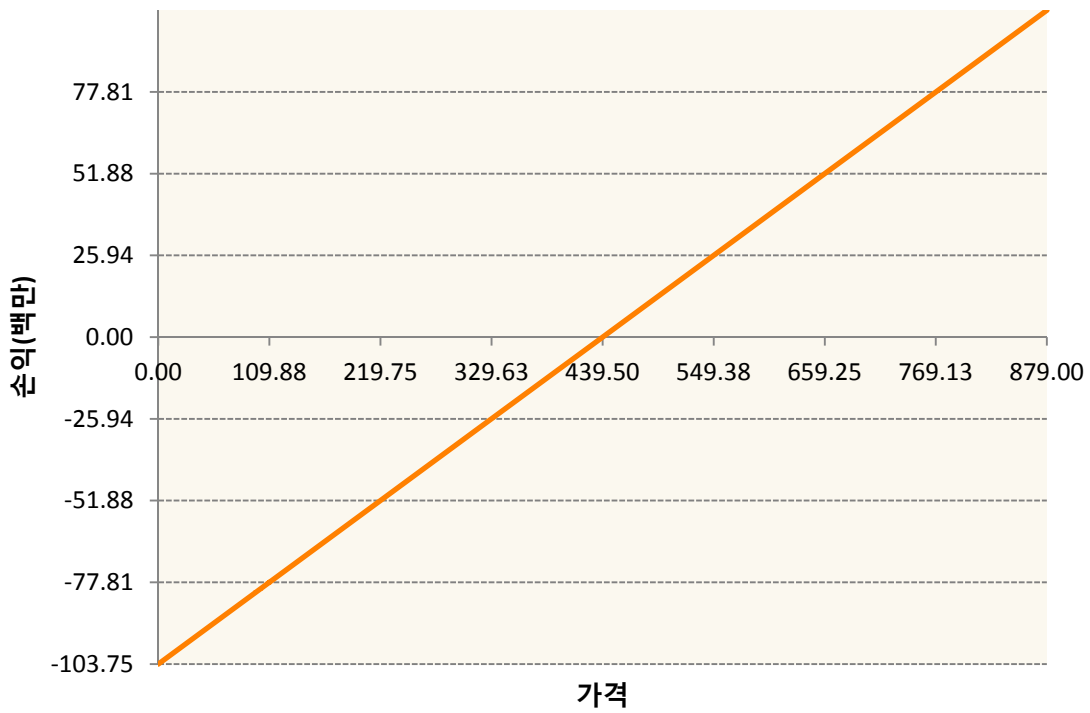




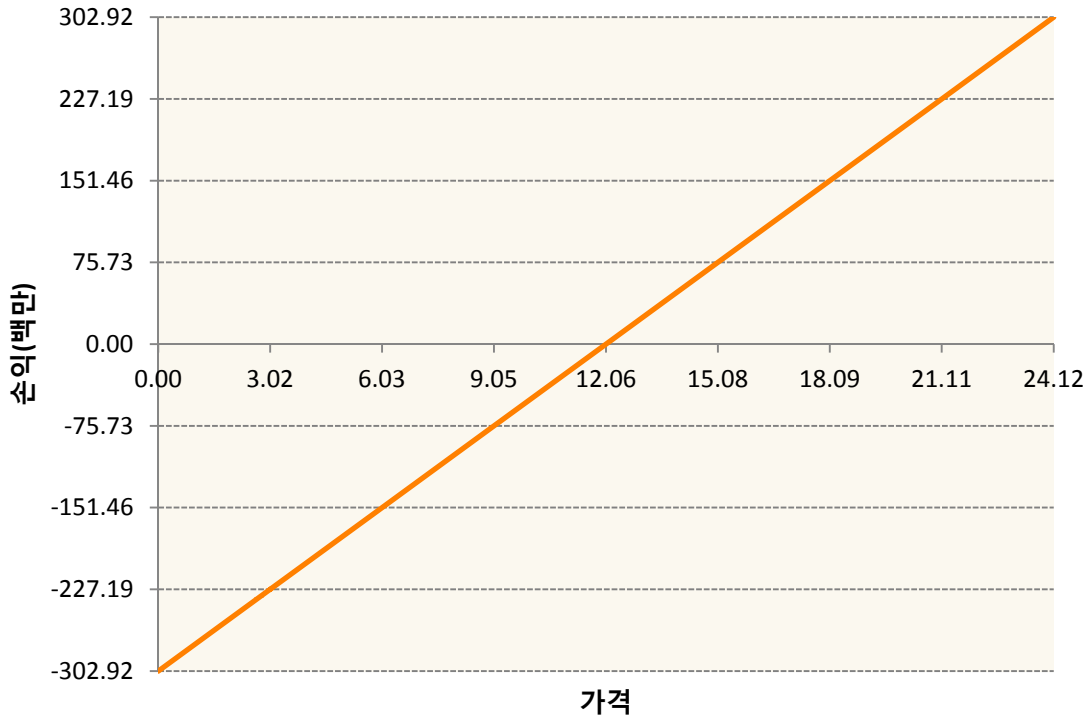
KR4175P80006-2019-08 달러선물



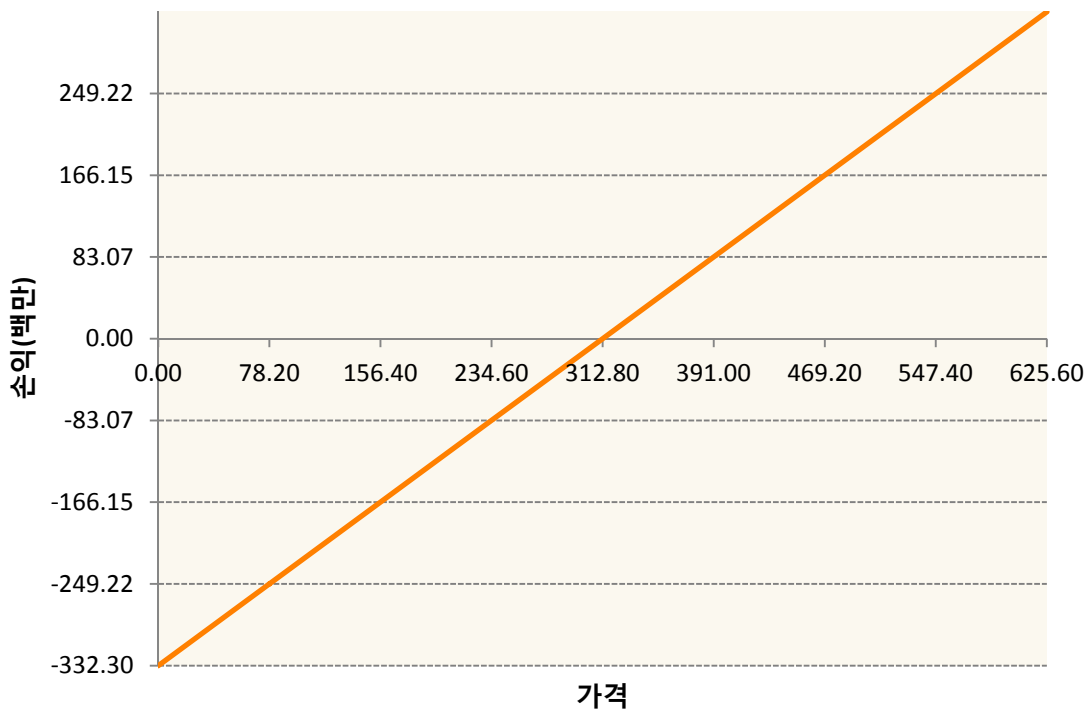
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



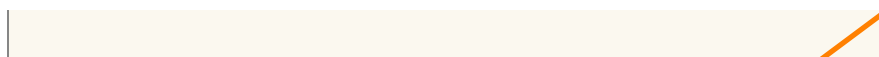
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

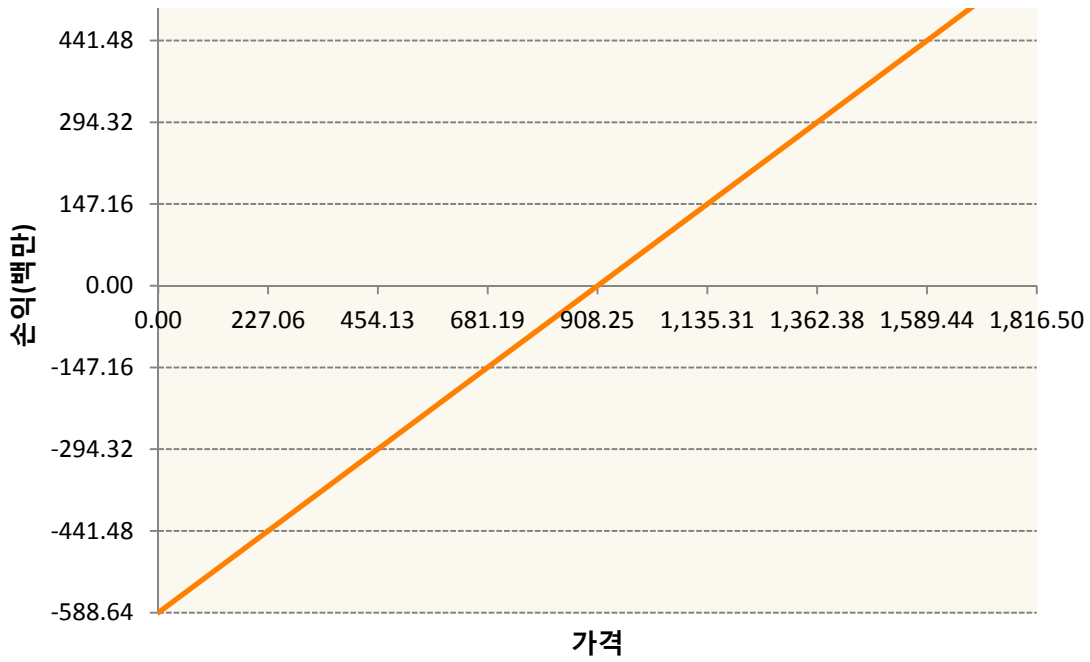


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

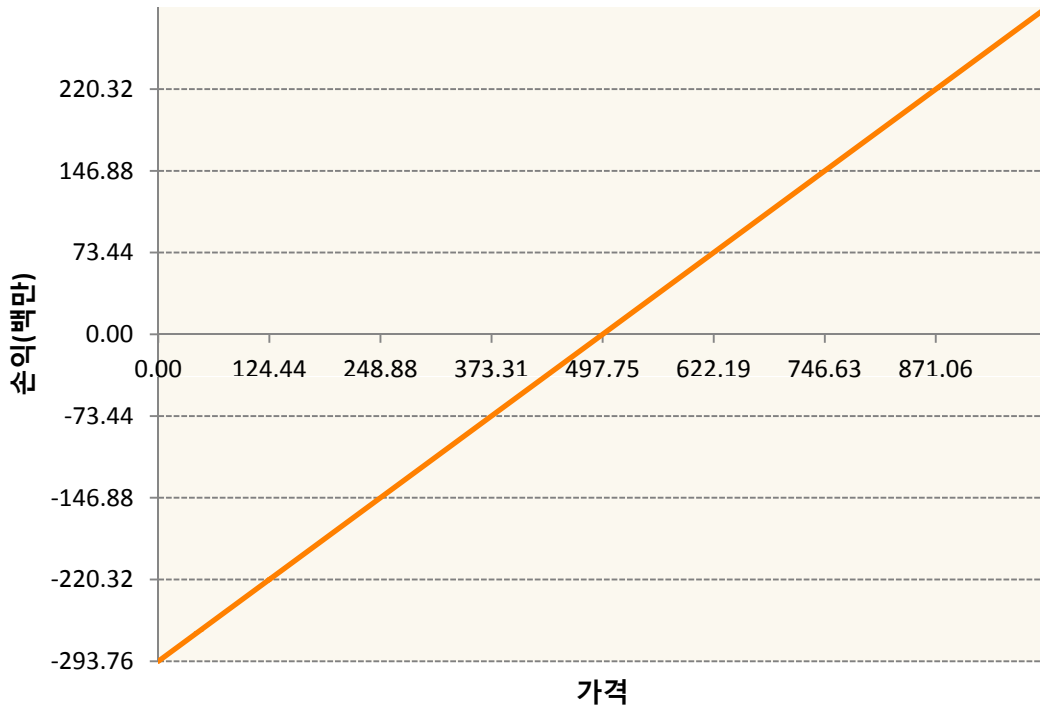


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





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	54
KCU9	COFFEE 'C' FUTURE Sep19	18
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	47
WU9	WHEAT FUTURE(CBT) Sep19	24

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

(단위:백만원)

264