

공시일	2019-07-29
기준일	2019-07-26

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	2019-07-29
기준일	2019-07-26

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

1,181

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

665

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-29
기준일	2019-07-26

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)	384
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	140

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

844

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-29
기준일	2019-07-26

유로인덱스모(주식-파생형)

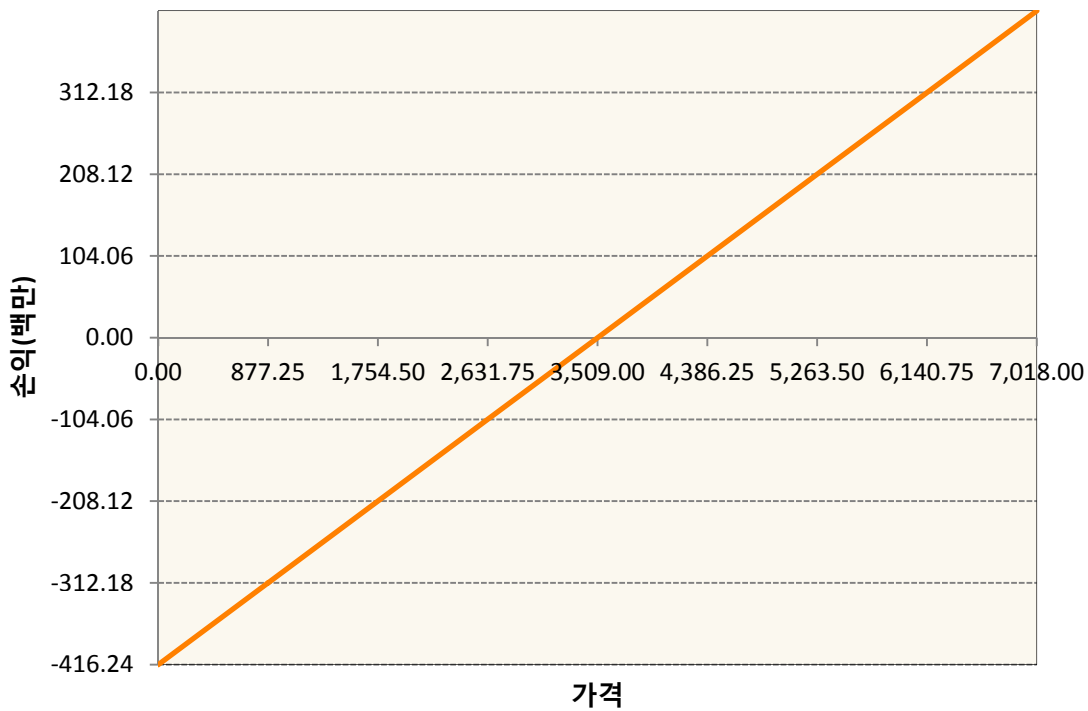
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	416	0	416	

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	2019-07-29
기준일	2019-07-26

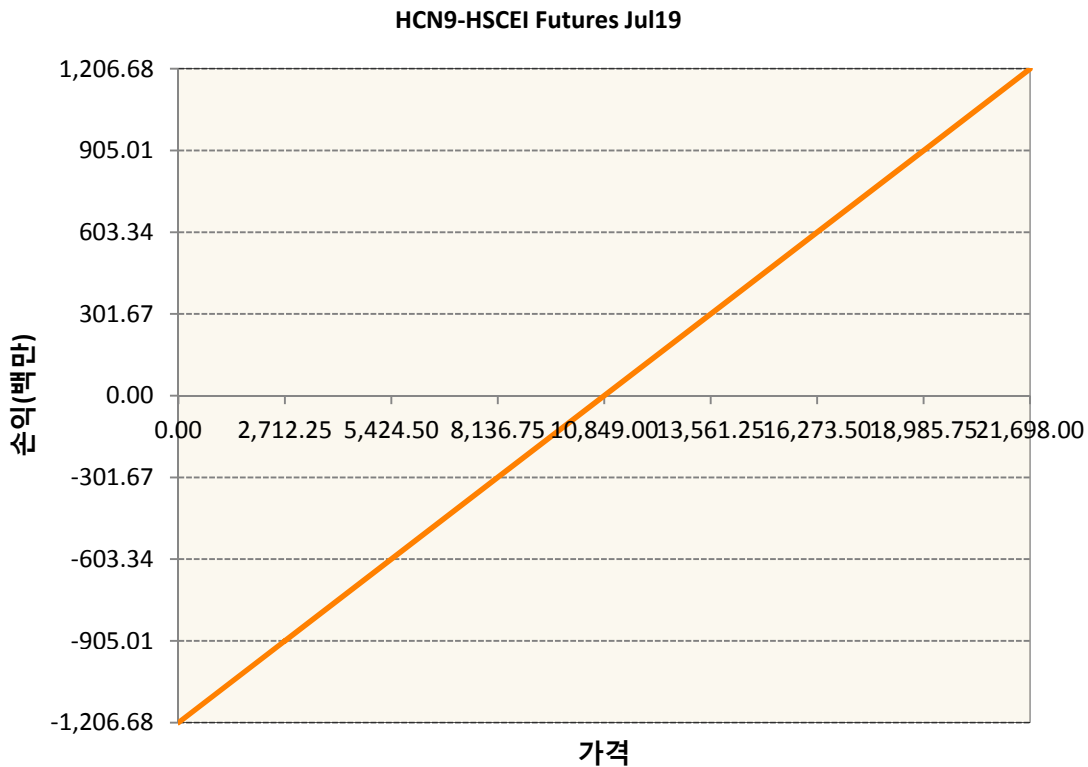
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,207	0	1,207	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

96

공시일	2019-07-29
기준일	2019-07-26

커버드콜모(주식혼합-파생형)

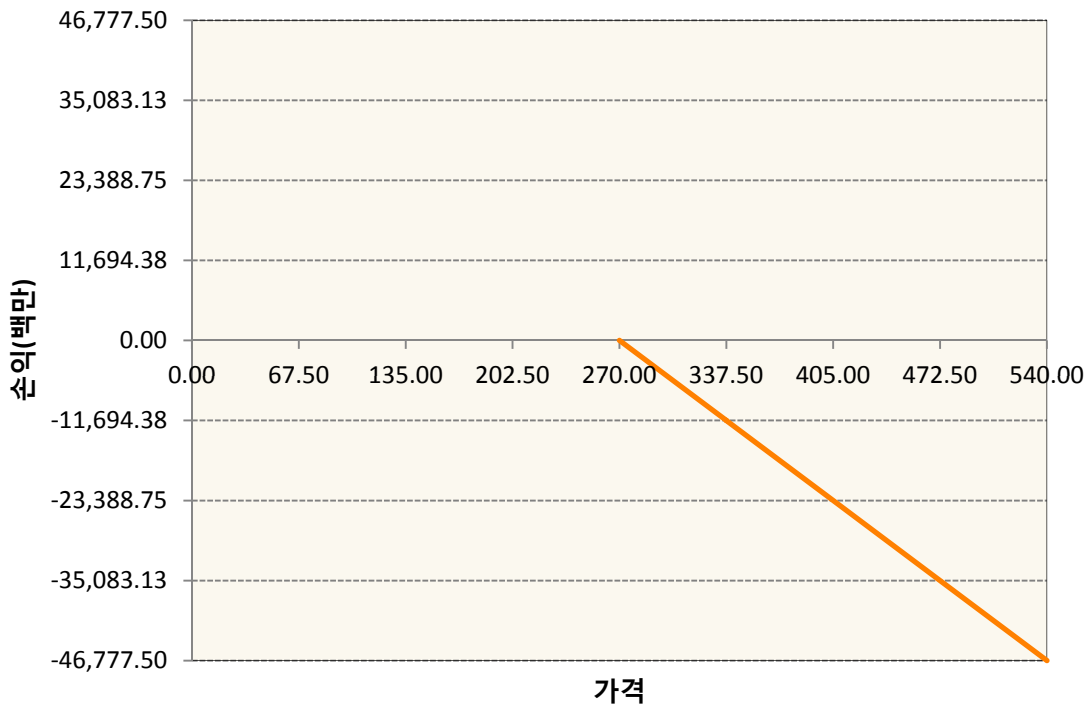
1. 계약금액

(단위:백만원)

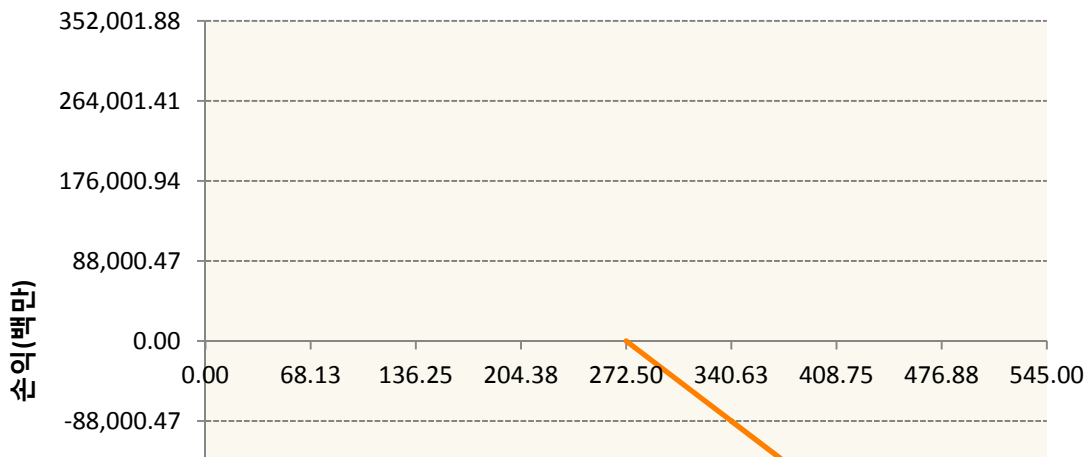
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	1,340	0	1,340	장내
누계	유가증권	옵션	0	583,667	-583,667	장내

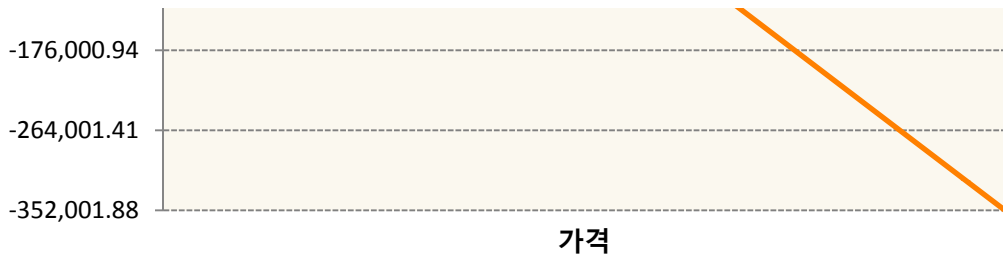
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P82709-2019-08 콜270

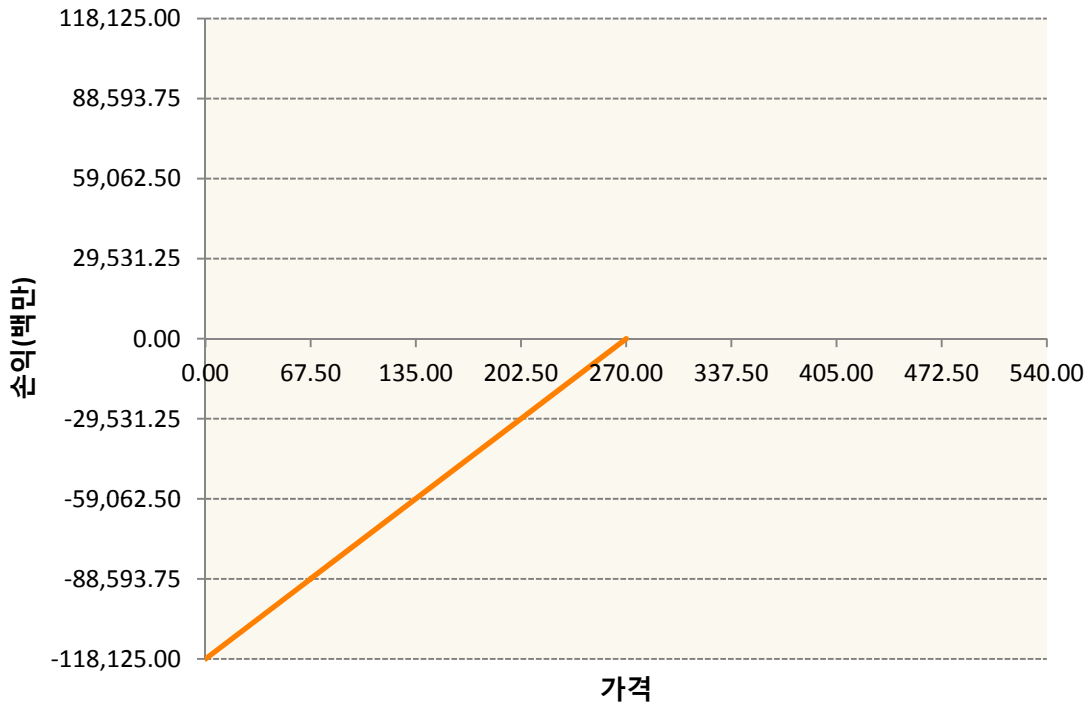


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

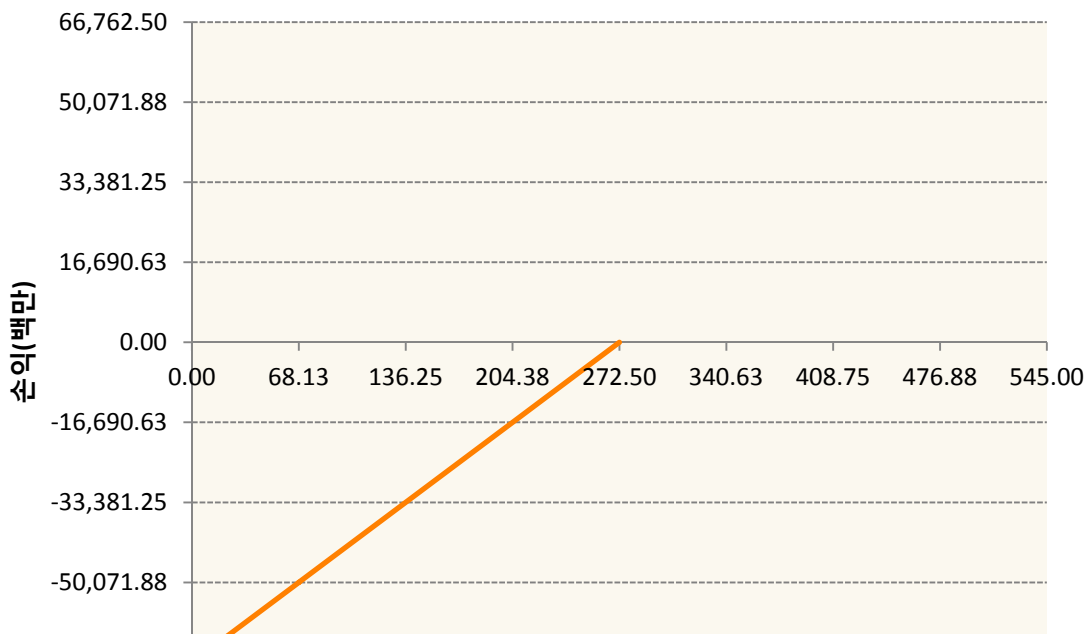




KR4301P82707-2019-08 풋270



KR4301P82723-2019-08 풋272.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P82709 2019-08 콜270							3,170
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,056	1,048	1,036	1,020	1,000	976	948
-5.33%	1,000	969	934	894	850	804	755
-2.67%	772	710	646	581	516	450	383
0%	211	141	71	0	-71	-142	-213
2.67%	-707	-754	-805	-859	-915	-974	-1,034
5.33%	-1,853	-1,873	-1,897	-1,926	-1,960	-1,998	-2,039
8.00%	-3,086	-3,091	-3,099	-3,111	-3,127	-3,146	-3,170
KR4201P82725 2019-08 콜272.5							22,361
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,228	6,193	6,136	6,053	5,943	5,807	5,644
-5.33%	5,994	5,833	5,633	5,398	5,133	4,841	4,525
-2.67%	4,856	4,462	4,047	3,613	3,166	2,708	2,241
0%	1,616	1,077	539	0	-539	-1,077	-1,616
2.67%	-4,373	-4,804	-5,253	-5,718	-6,194	-6,679	-7,172
5.33%	-12,454	-12,664	-12,915	-13,200	-13,517	-13,859	-14,224
8.00%	-21,495	-21,561	-21,657	-21,785	-21,947	-22,139	-22,361
KR4301P82707 2019-08 풋270							7,791
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,779	-7,780	-7,780	-7,781	-7,783	-7,786	-7,791
-5.33%	-4,611	-4,618	-4,629	-4,644	-4,665	-4,691	-4,722
-2.67%	-1,621	-1,685	-1,754	-1,828	-1,905	-1,984	-2,067
0%	283	190	95	0	-96	-193	-290
2.67%	759	735	704	665	621	571	516
5.33%	792	791	788	783	775	763	747
8.00%	793	793	793	792	792	790	788
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							4,694
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,692	-4,692	-4,692	-4,692	-4,692	-4,693	-4,694
-5.33%	-2,915	-2,916	-2,919	-2,923	-2,929	-2,937	-2,948
-2.67%	-1,176	-1,197	-1,222	-1,251	-1,283	-1,318	-1,354
0%	170	113	57	0	-57	-113	-170
2.67%	663	637	606	572	535	496	455

5.33%	719	717	712	706	696	684	669
8.00%	721	721	721	720	719	717	714

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

(단위:백만원)

41,454

공시일	2019-07-29
기준일	2019-07-26

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

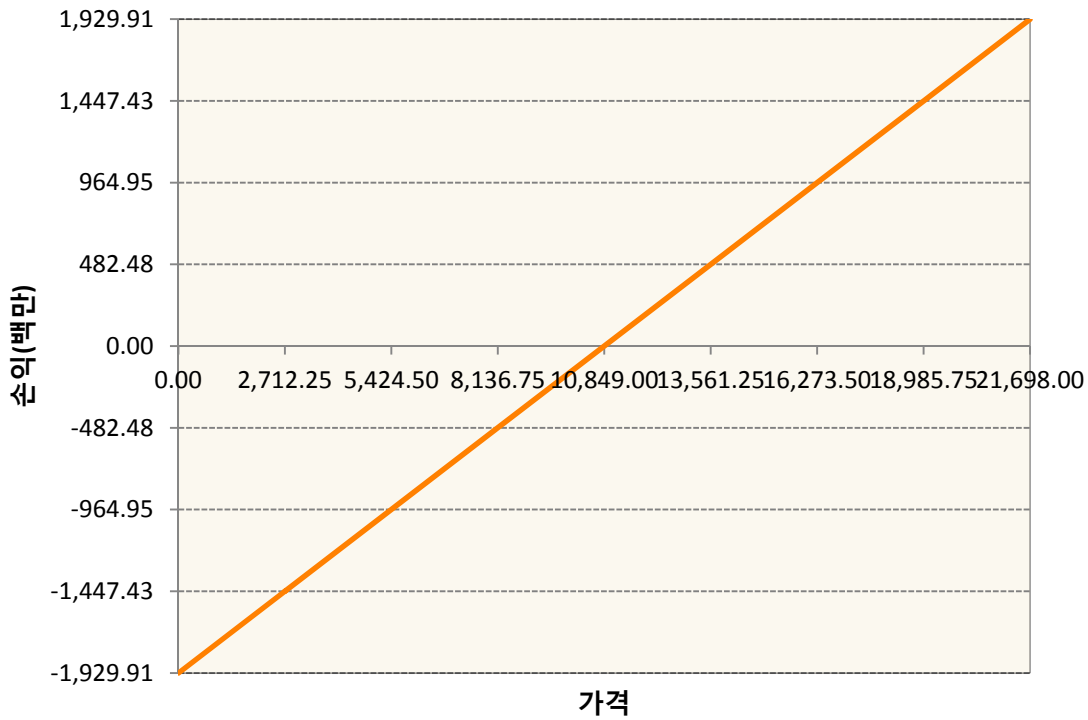
1. 계약금액

(단위:백만원)

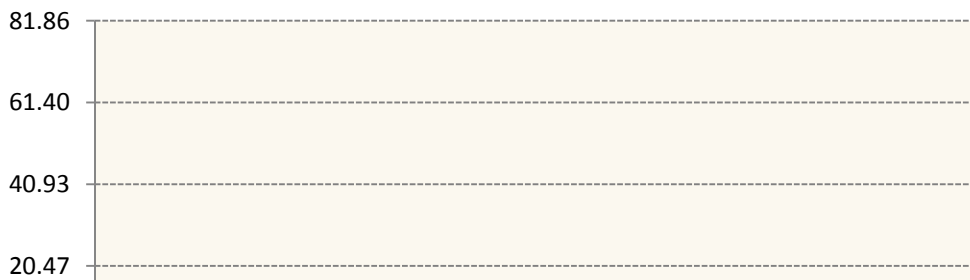
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,930	0	1,930	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,286	-5,286	장내
누계	통화	선도	152	3,184	-3,032	장외

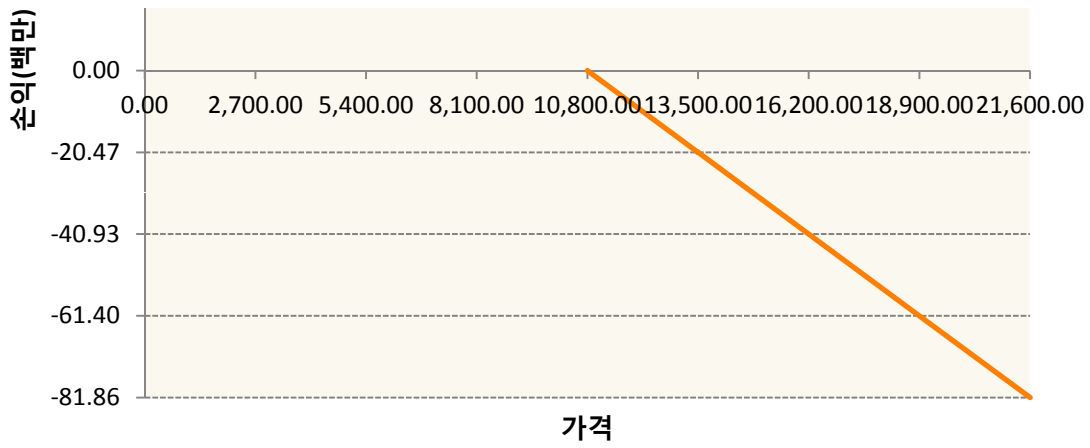
2. 만기시점의 손익구조

HCN9-HSCEI Futures Jul19

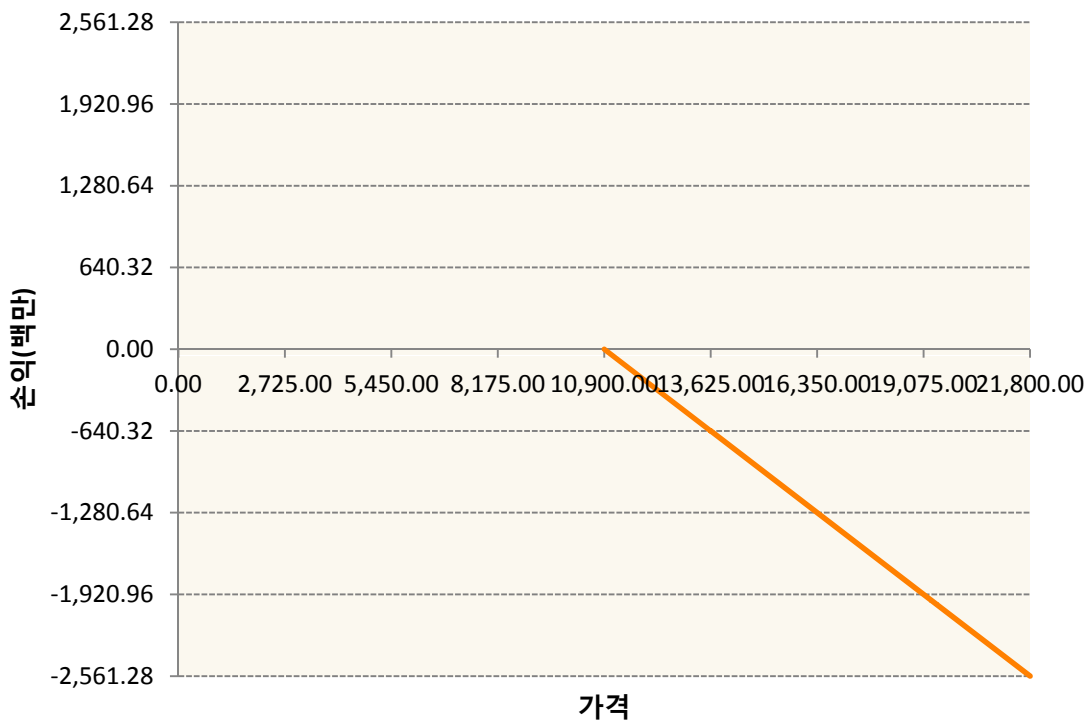


OHHIN9-C108-HSCEI

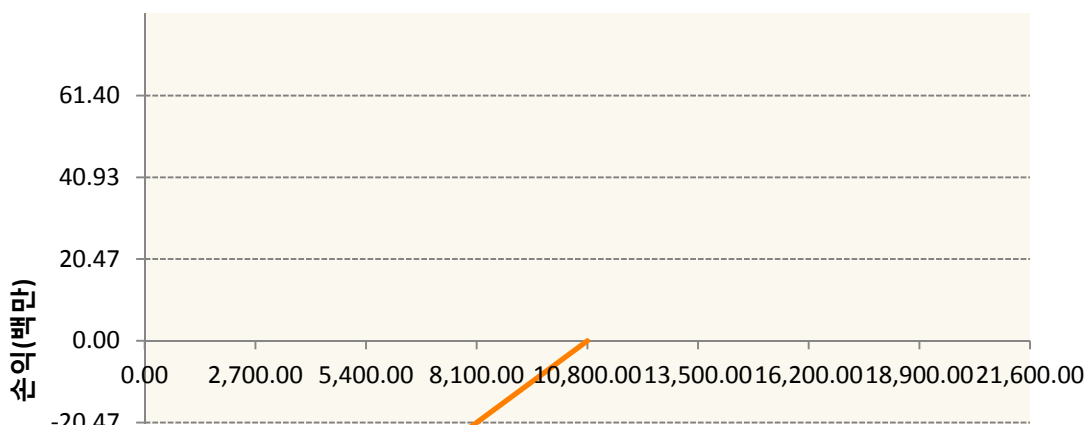


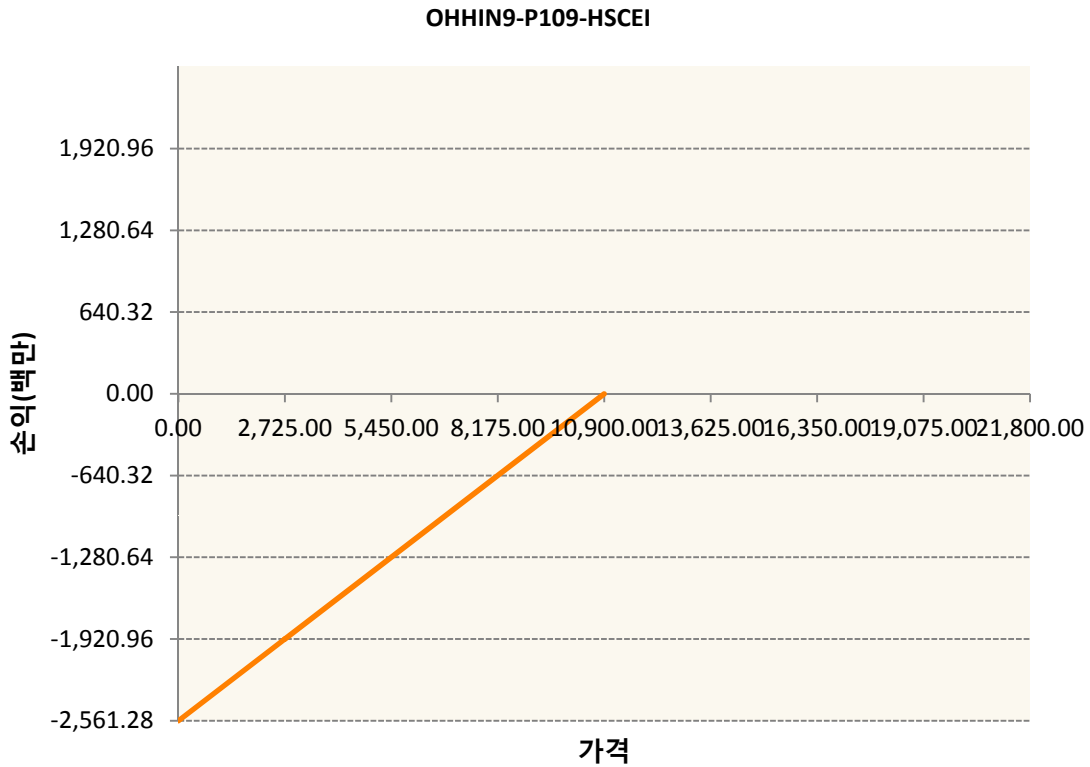


OHHIN9-C109-HSCEI



OHHIN9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	255
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E	12
HCN9 HSCEI Futures Jul19	154
OHHIN9-C1(HSCEI	7
OHHIN9-C1(HSCEI	205
OHHIN9-P1(HSCEI	7
OHHIN9-P1(HSCEI	205

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	662

공시일	2019-07-29
기준일	2019-07-26

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

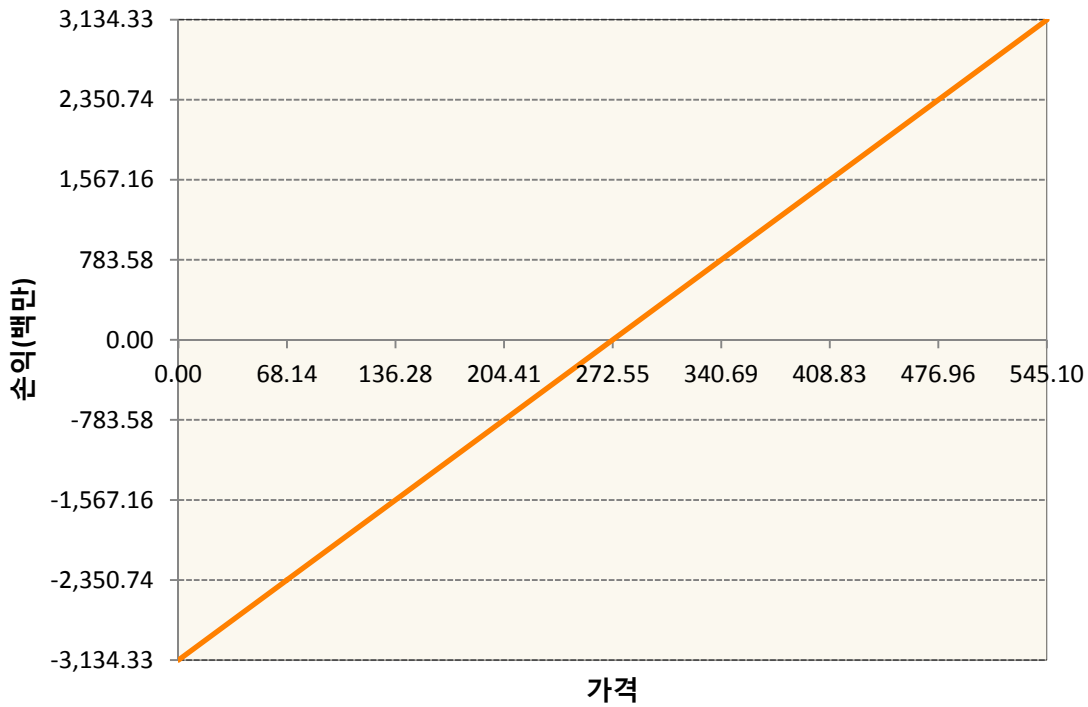
1. 계약금액

(단위:백만원)

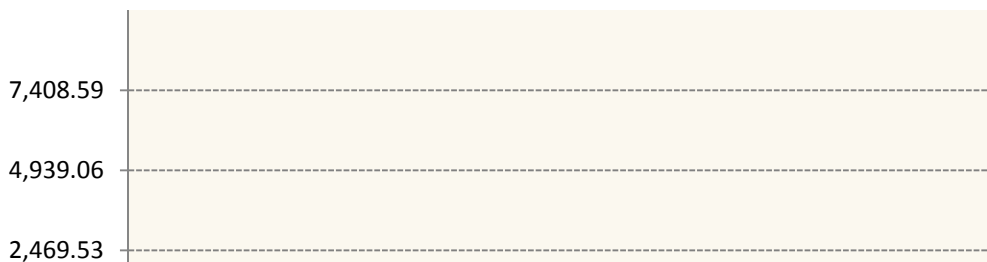
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	67	0	67	장내
누계	유가증권	선물	3,134	0	3,134	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	19,293	-19,293	장내

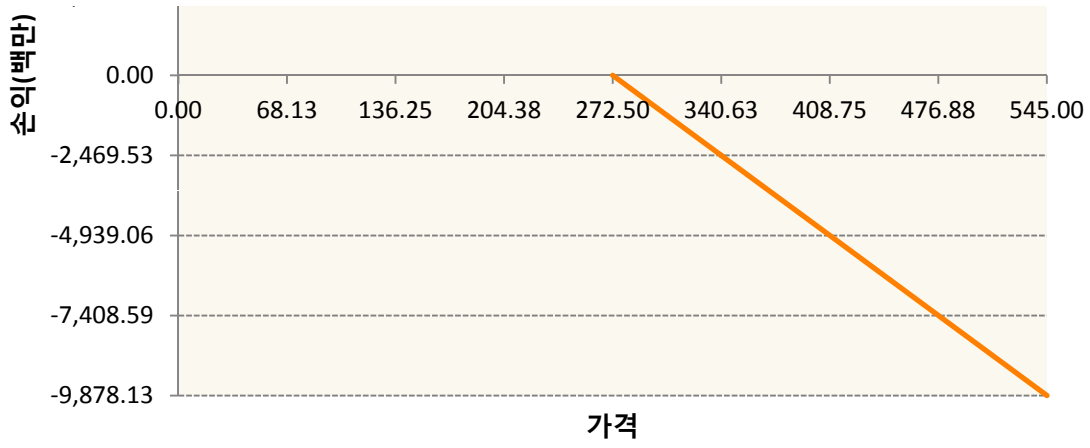
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

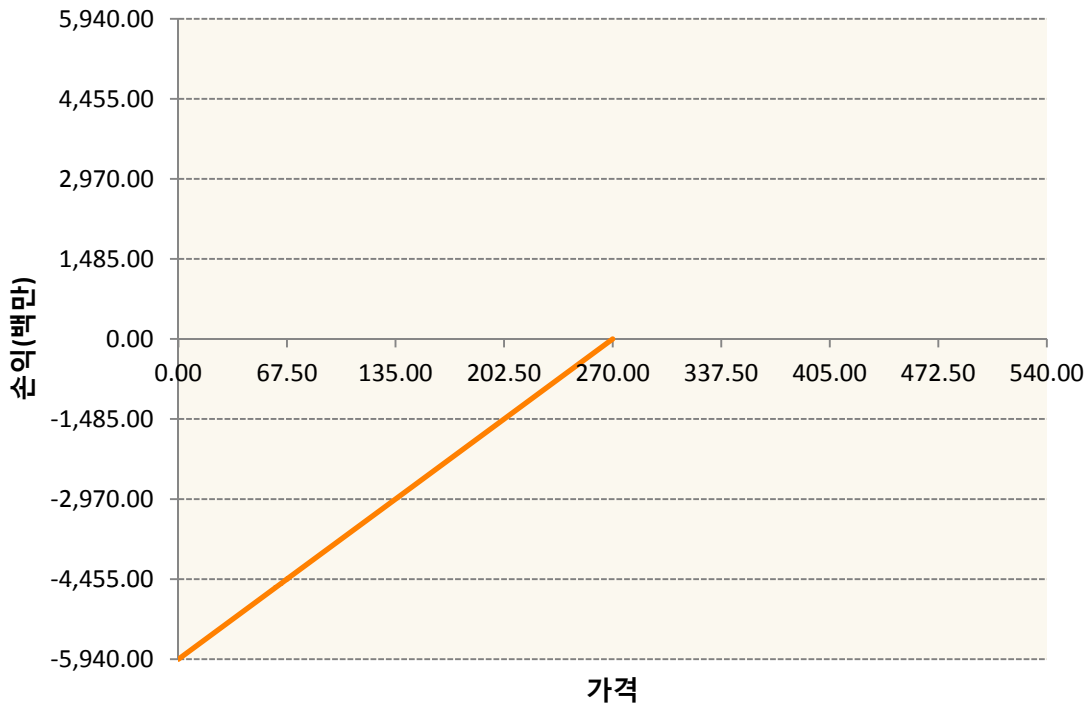


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

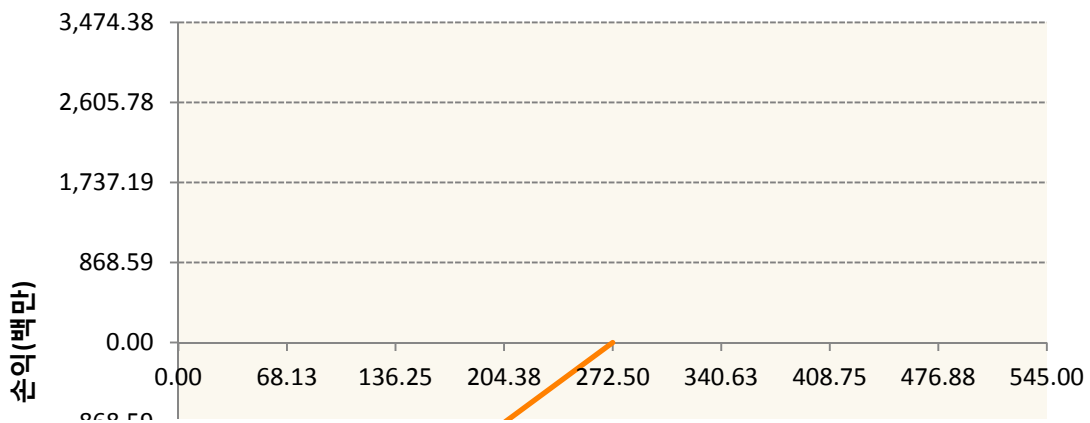




KR4301P82707-2019-08 풋270



KR4301P82723-2019-08 풋272.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,197
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,197	-1,197	-1,197	-1,197	-1,197	-1,197	-1,197	
-5.33%	-798	-798	-798	-798	-798	-798	-798	
-2.67%	-399	-399	-399	-399	-399	-399	-399	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	399	399	399	399	399	399	399	
5.33%	798	798	798	798	798	798	798	
8.00%	1,197	1,197	1,197	1,197	1,197	1,197	1,197	
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%	-404	-404	-404	-404	-404	-404	-404	
-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%	404	404	404	404	404	404	404	
8.00%	605	605	605	605	605	605	605	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						250
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-250	-250	-250	-250	-250	-250	-250	
-5.33%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167	
-2.67%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	83	83	83	83	83	83	83	
5.33%	167	167	167	167	167	167	167	
8.00%	250	250	250	250	250	250	250	
KR4201P82725		2019-08 콜272.5						628
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	175	174	172	170	167	163	158
-5.33%	168	164	158	151	144	136	127
-2.67%	136	125	114	101	89	76	63
0%	45	30	15	0	-15	-30	-45
2.67%	-123	-135	-147	-160	-174	-187	-201
5.33%	-350	-355	-362	-370	-379	-389	-399
8.00%	-603	-605	-608	-611	-616	-621	-628
KR4301P82707 2019-08 풋270							392
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-391	-391	-391	-391	-391	-392	-392
-5.33%	-232	-232	-233	-234	-235	-236	-237
-2.67%	-82	-85	-88	-92	-96	-100	-104
0%	14	10	5	0	-5	-10	-15
2.67%	38	37	35	33	31	29	26
5.33%	40	40	40	39	39	38	38
8.00%	40	40	40	40	40	40	40
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							244
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-244	-244	-244	-244	-244	-244	-244
-5.33%	-152	-152	-152	-152	-152	-153	-153
-2.67%	-61	-62	-64	-65	-67	-69	-70
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	35	33	32	30	28	26	24
5.33%	37	37	37	37	36	36	35
8.00%	38	38	38	37	37	37	37

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

(단위:백만원)

3,415

공시일	2019-07-29
기준일	2019-07-26

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

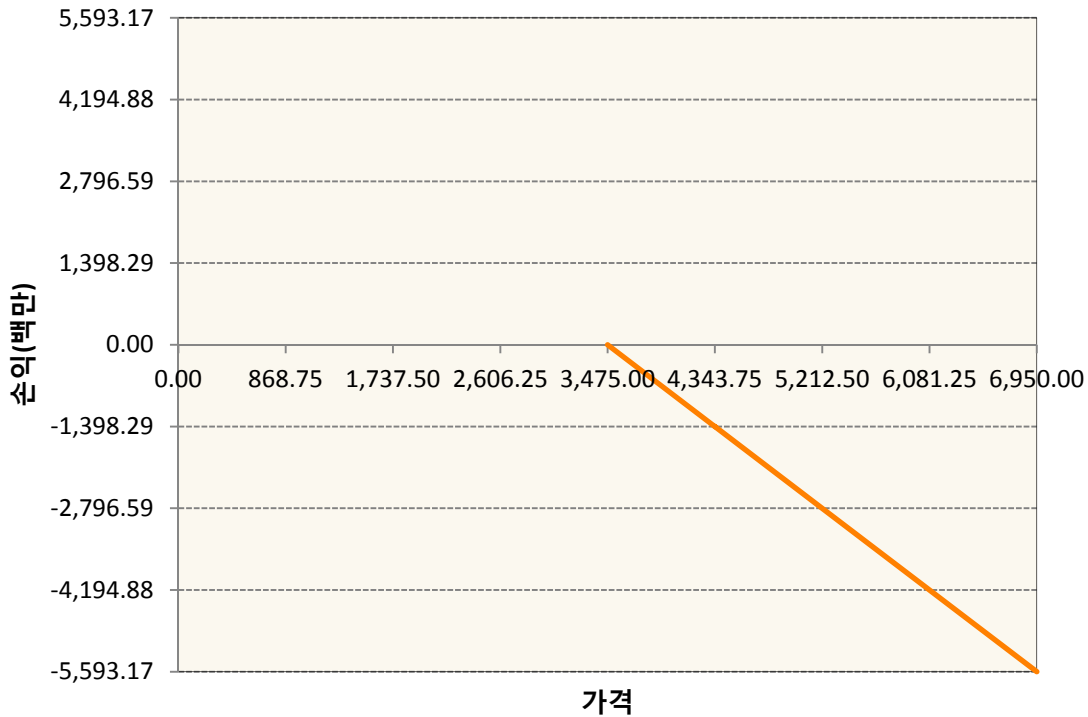
1. 계약금액

(단위:백만원)

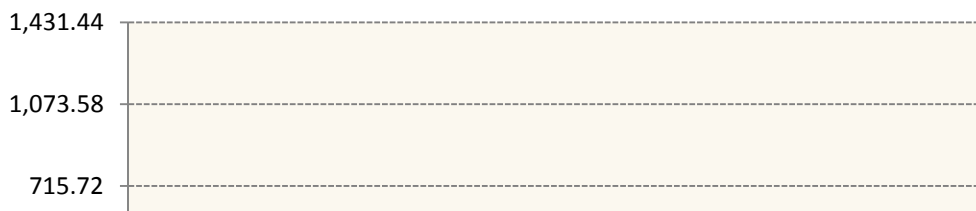
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,128	0	4,128	
누계	유가증권	스왑	37,673	0	37,673	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,049	-14,049	장내
누계	통화	선도	9,235	22,429	-13,193	장외

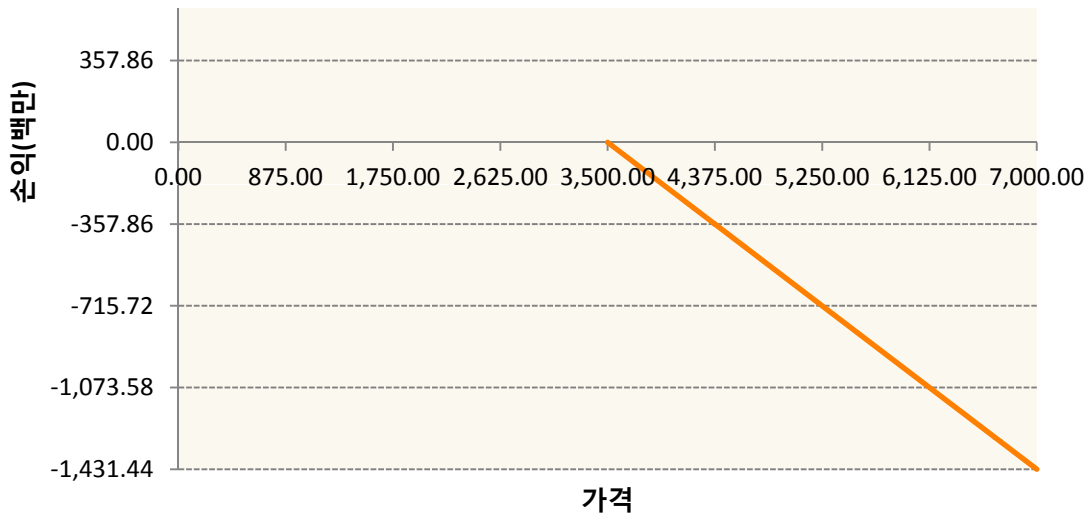
2. 만기시점의 손익구조

OESXQ9-C3475-EURO STOXX 50

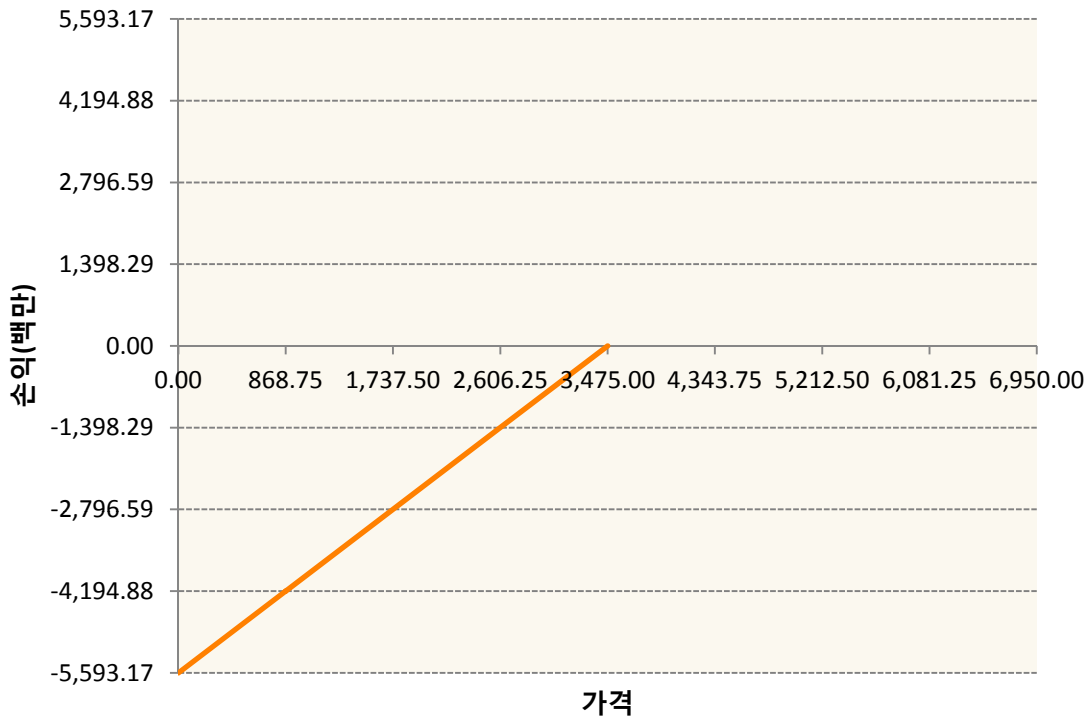


OESXQ9-C3500-EURO STOXX 50

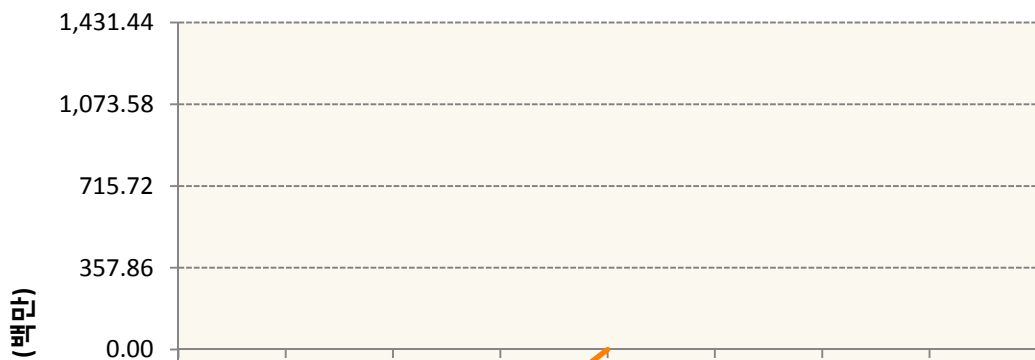


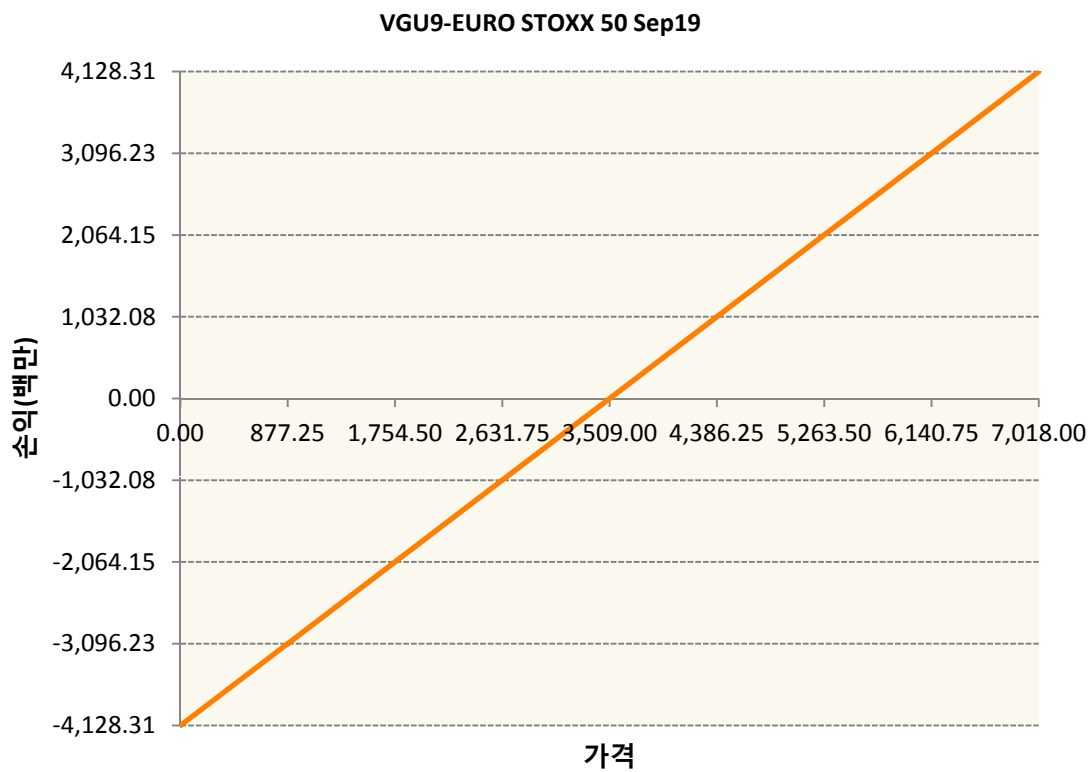
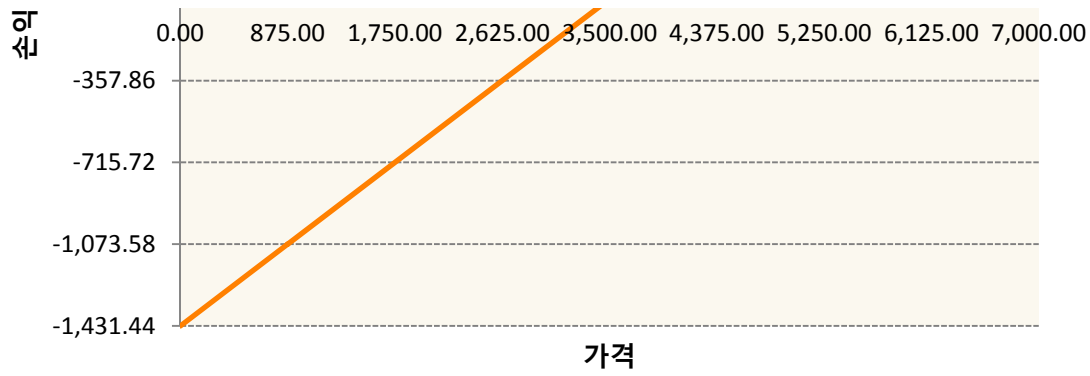


OESXQ9-P3475-EURO STOXX 50



OESXQ9-P3500-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	15
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	422
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E	1,055
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	317
FX21019N01 EUR/KRW 23-08-19E	422
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E	317
OESXQ9-C34 EURO STOXX 50	447
OESXQ9-C35 EURO STOXX 50	115
OESXQ9-P34 EURO STOXX 50	447
OESXQ9-P35 EURO STOXX 50	115
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	330

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

(단위:백만원)

2,193

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

(단위:백만원)

1,018

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

(단위:백만원)

86

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

(단위:백만원)

132

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-07-29
기준일	2019-07-26

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

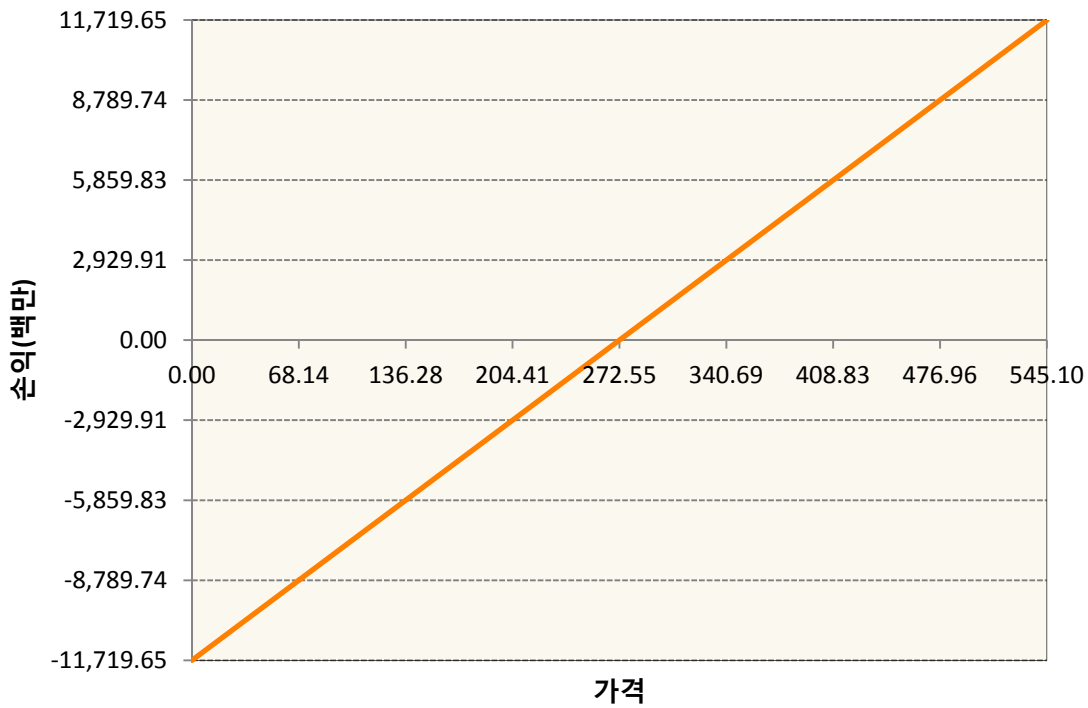
1. 계약금액

(단위:백만원)

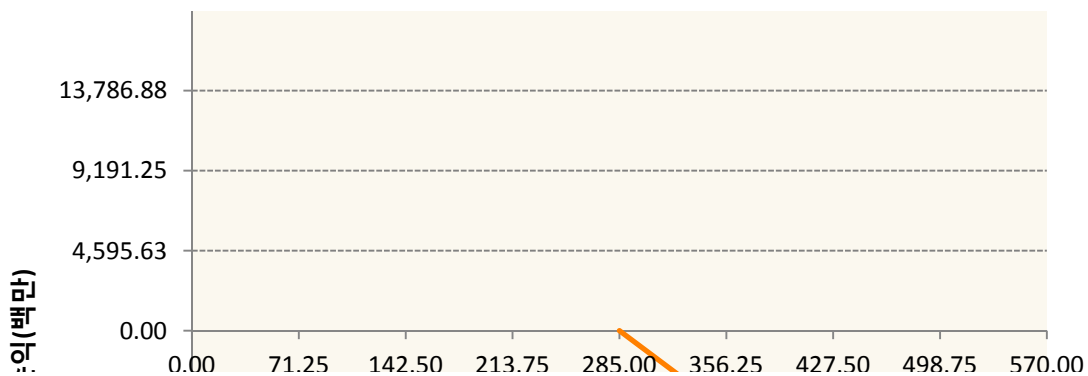
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,720	0	11,720	장내
누계	유가증권	옵션	1,698	21,617	-19,919	장내

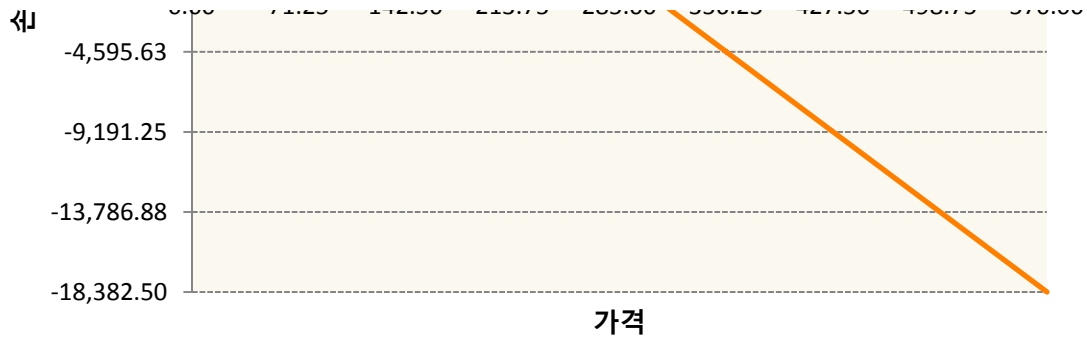
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

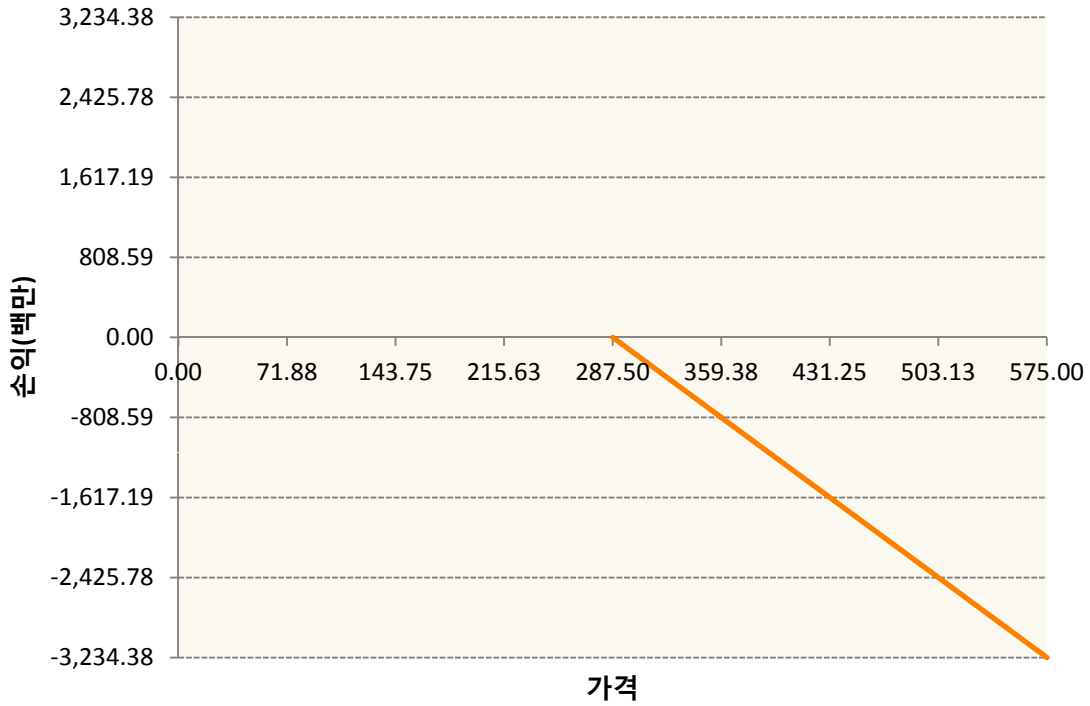


KR4201P82857-2019-08 콜285

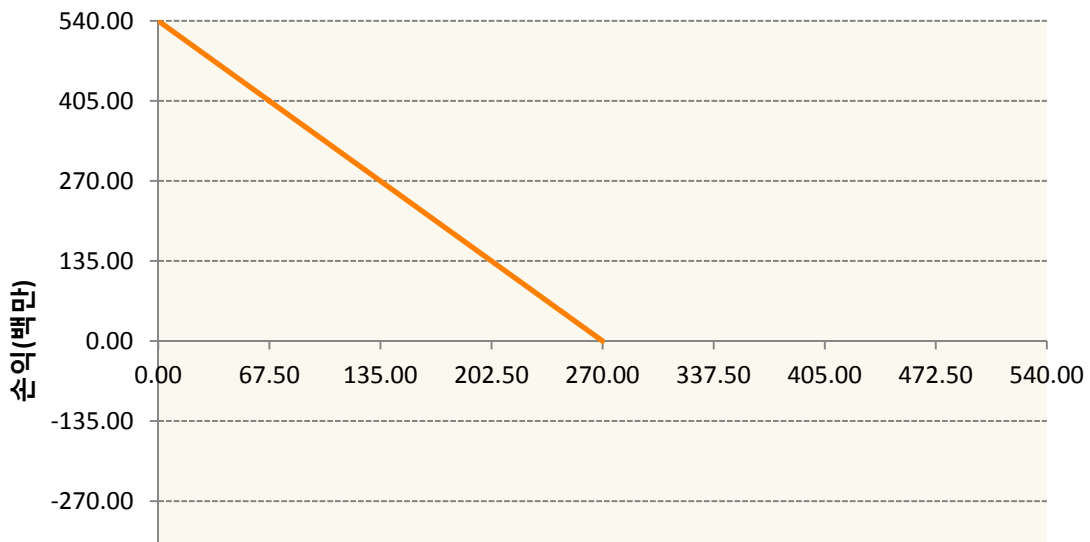


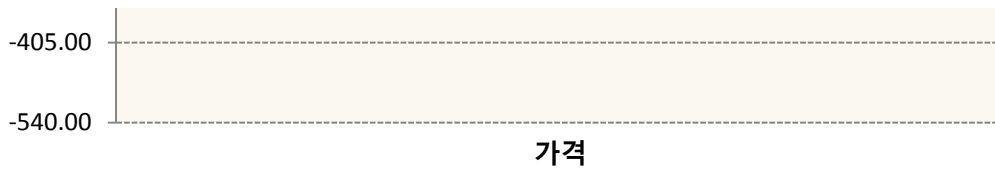


KR4201P82873-2019-08 콜287.5

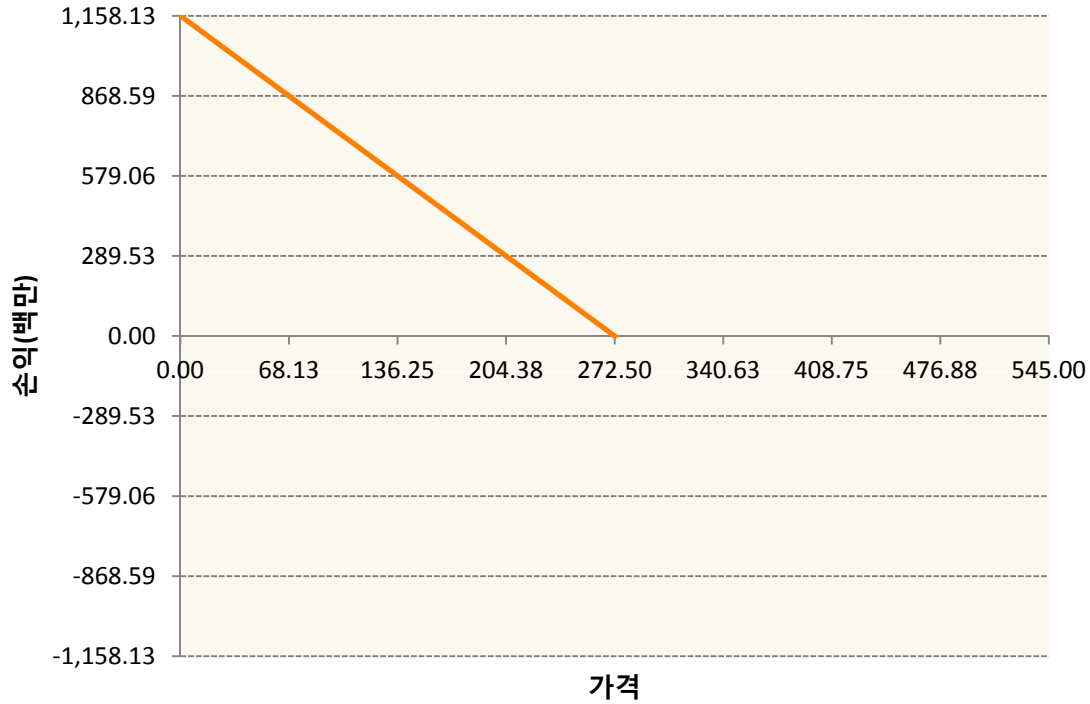


KR4301P82707-2019-08 풋270





KR4301P82723-2019-08 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물					937
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-937	-937	-937	-937	-937	-937	-937
-5.33%	-624	-624	-624	-624	-624	-624	-624
-2.67%	-312	-312	-312	-312	-312	-312	-312
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	312	312	312	312	312	312	312
5.33%	624	624	624	624	624	624	624
8.00%	937	937	937	937	937	937	937
KR4201P82857		2019-08 콜285					708
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	69	69	69	68	68	67	65
-5.33%	69	68	67	65	62	58	53
-2.67%	65	62	56	49	41	31	19

0%	43	30	16	0	-17	-36	-55
2.67%	-42	-66	-91	-116	-142	-168	-194
5.33%	-243	-271	-299	-327	-355	-383	-411
8.00%	-573	-593	-614	-637	-660	-684	-708
KR4201P82873 2019-08 콜287.5							109
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8	8	8	8	8	8	8
-5.33%	8	8	8	8	8	7	6
-2.67%	8	8	7	6	5	4	2
0%	6	4	2	0	-3	-5	-8
2.67%	-4	-8	-12	-16	-20	-24	-28
5.33%	-32	-37	-42	-47	-52	-56	-61
8.00%	-82	-86	-90	-95	-99	-104	-109
KR4301P82707 2019-08 풋270							36
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	36	36	36	36	36	36	36
-5.33%	21	21	21	21	21	21	22
-2.67%	7	8	8	8	9	9	9
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-2
5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-3	-3
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							81
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	81	81	81	81	81	81	81
-5.33%	51	51	51	51	51	51	51
-2.67%	20	21	21	22	22	23	23
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-12	-11	-11	-10	-9	-9	-8
5.33%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
8.00%	-13	-13	-13	-12	-12	-12	-12

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

(단위:백만원)

1,476

공시일	2019-07-29
기준일	2019-07-26

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	474	0	474	
누계	유가증권	수익증권	45,708	0	45,708	

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	2019-07-29
기준일	2019-07-26

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,540	0	1,540	
누계	유가증권	수익증권	55,997	0	55,997	

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	2019-07-29
기준일	2019-07-26

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,185	0	1,185	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	415,569	0	415,569	
누계	통화	선도	0	415,888	-415,888	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E	1,308
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E	2,571
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E	3,128
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E	2,123
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E	1,706
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E	2,085
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E	133
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	569
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	3,033
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	3,317
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	474
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E	948
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E	2,948
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E	1,649
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E	758
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E	1,896
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E	1,896
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	284
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	95
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	701
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	701
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	284
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	663

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

(단위:백만원)

공시일	2019-07-29
기준일	2019-07-26

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

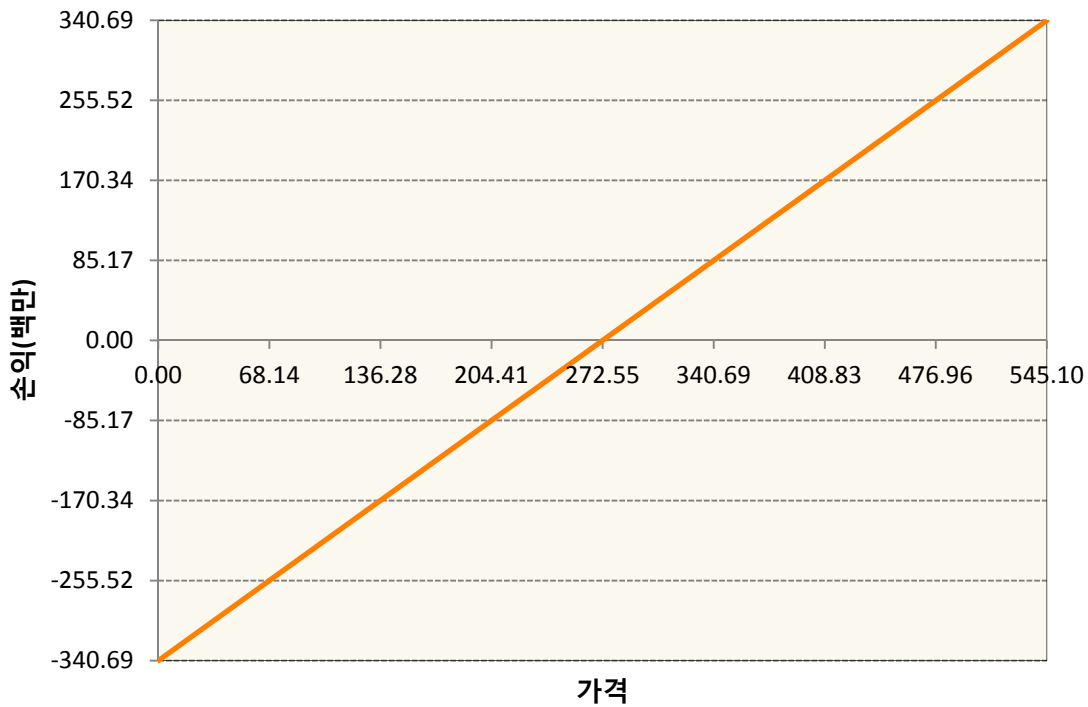
1. 계약금액

(단위:백만원)

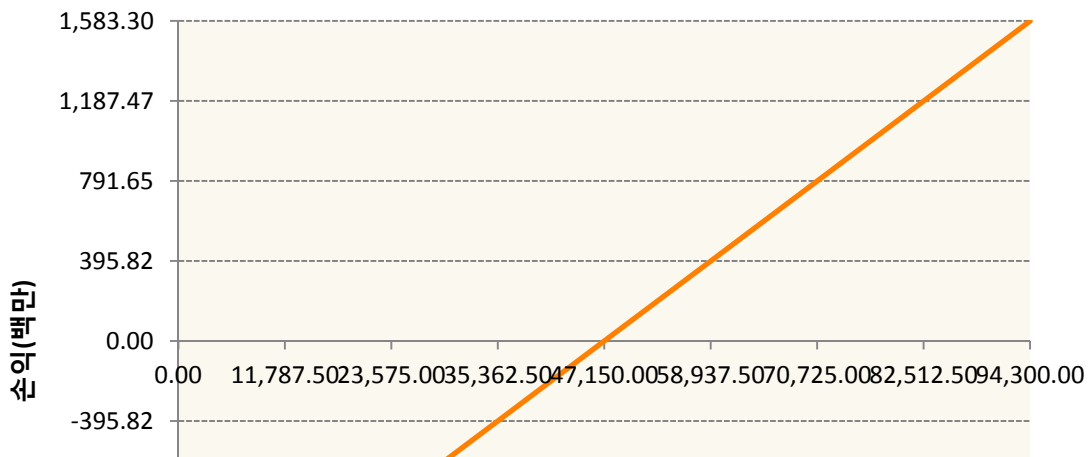
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,924	0	1,924	장내

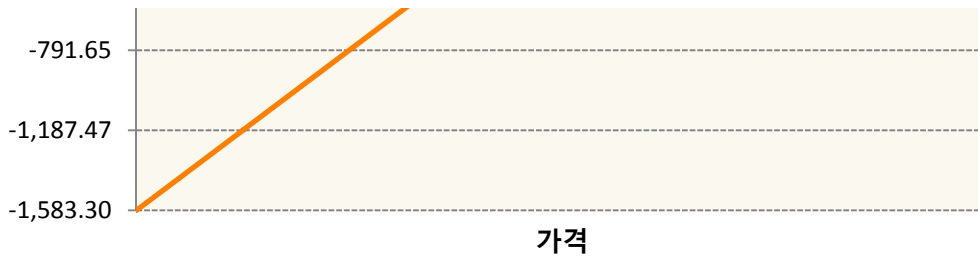
2. 만기시점의 손익구조

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%	-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%	127	127	127	127	127	127	127	

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

180

공시일	2019-07-29
기준일	2019-07-26

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

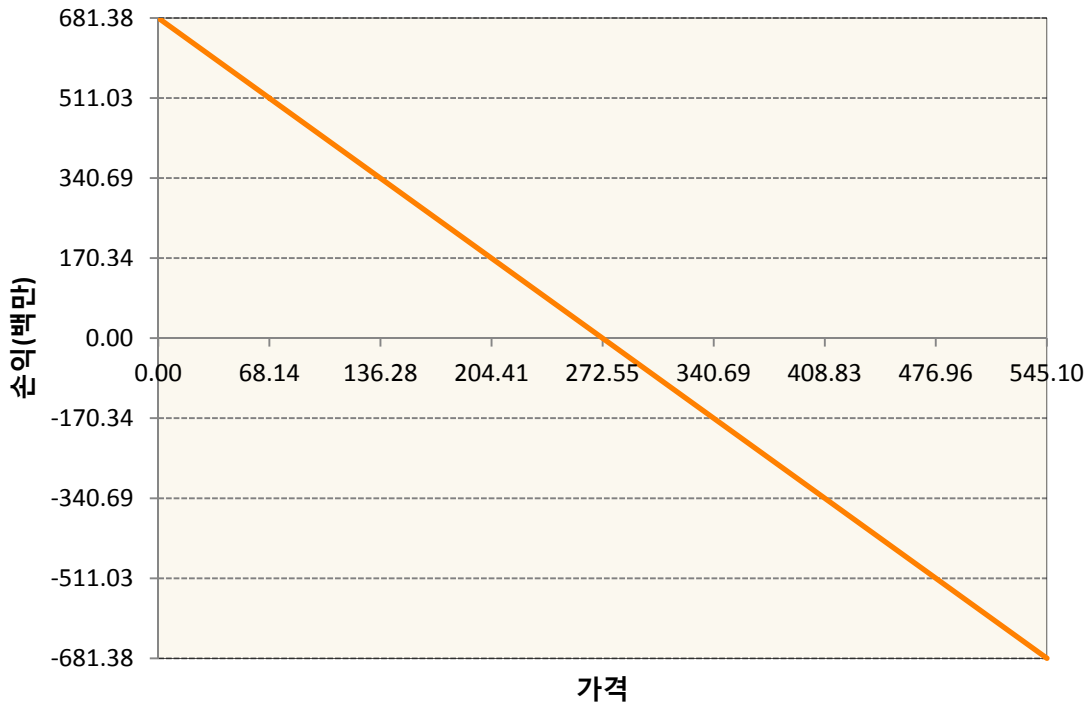
1. 계약금액

(단위:백만원)

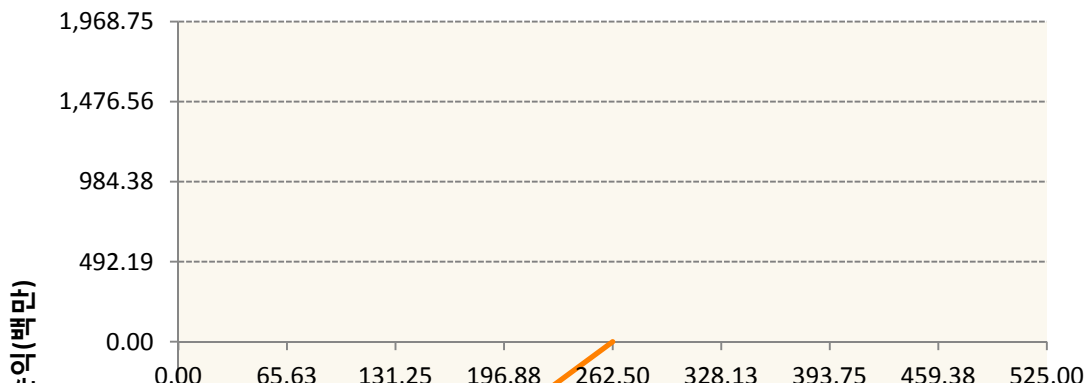
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	681	-681	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,625	-3,625	장내

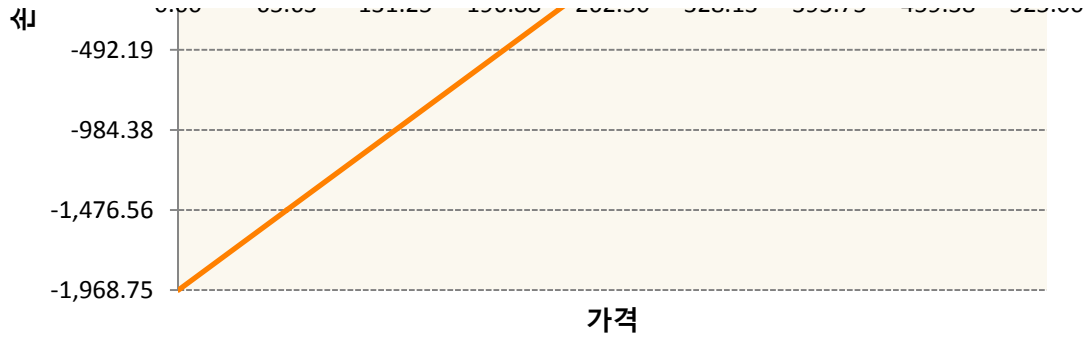
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

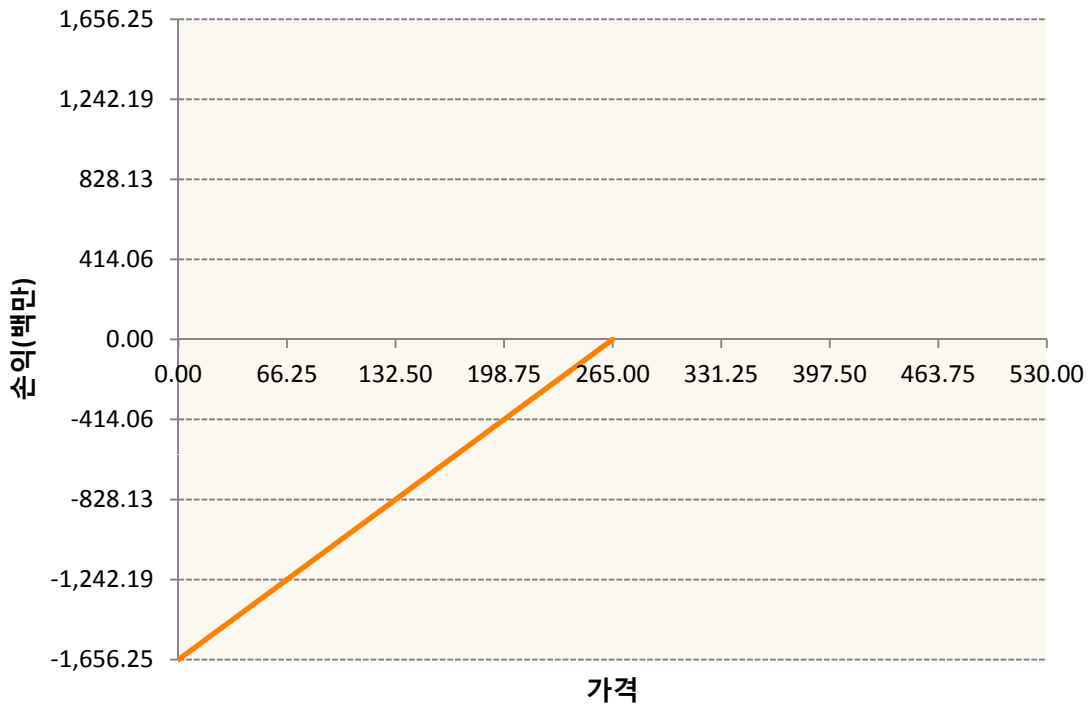


KR4301P82624-2019-08 풋262.5





KR4301P82657-2019-08 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						54
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	54	54	54	54	54	54	54	
-5.33%	36	36	36	36	36	36	36	
-2.67%	18	18	18	18	18	18	18	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	
8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54	
KR4301P82624		2019-08 풋262.5						91
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-89	-89	-89	-90	-90	-90	-91
-5.33%	-38	-39	-40	-41	-43	-44	-45
-2.67%	-6	-7	-9	-11	-12	-14	-15
0%	1	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	2	2	2	2	2	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

KR4301P82657

2019-08 풋265

89

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-89
-5.33%	-44	-44	-45	-45	-46	-47	-48
-2.67%	-10	-11	-12	-14	-15	-17	-18
0%	2	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	3	3	3	3	3	3	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)

182

공시일	2019-07-29
기준일	2019-07-26

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	18,649	0	18,649	
누계	통화	선도	0	18,364	-18,364	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		986
FX21019N01 KRW/USD 12-08-19E		161
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		322

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

(단위:백만원)

478

공시일	2019-07-29
기준일	2019-07-26

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	376	0	376	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	2019-07-29
기준일	2019-07-26

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

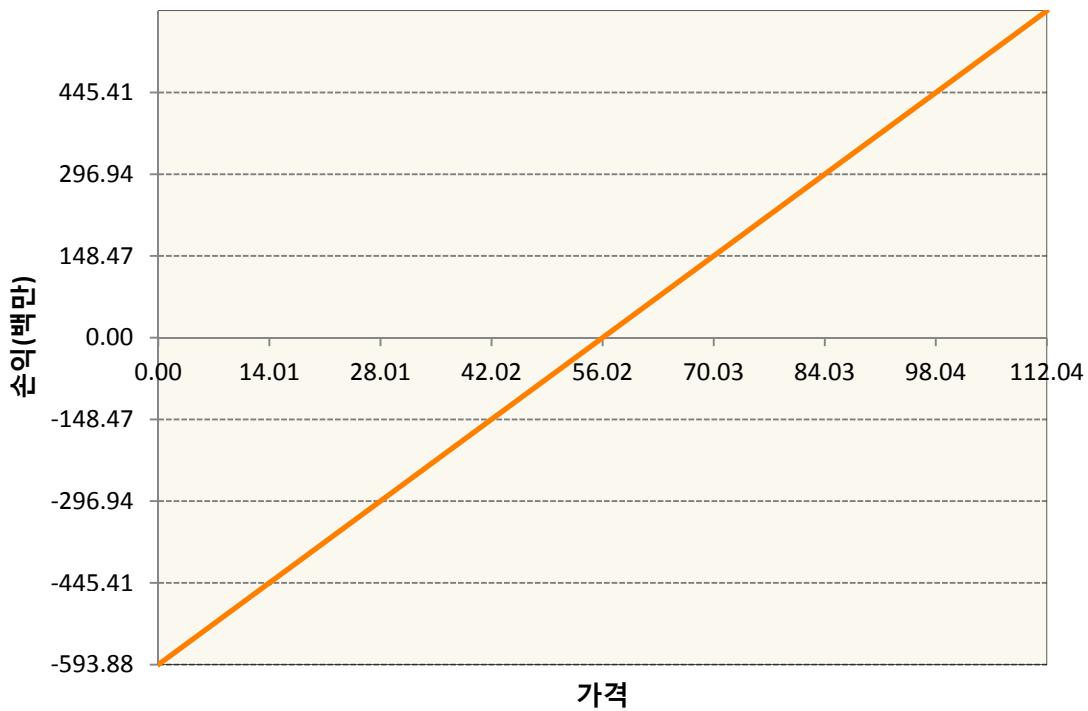
1. 계약금액

(단위:백만원)

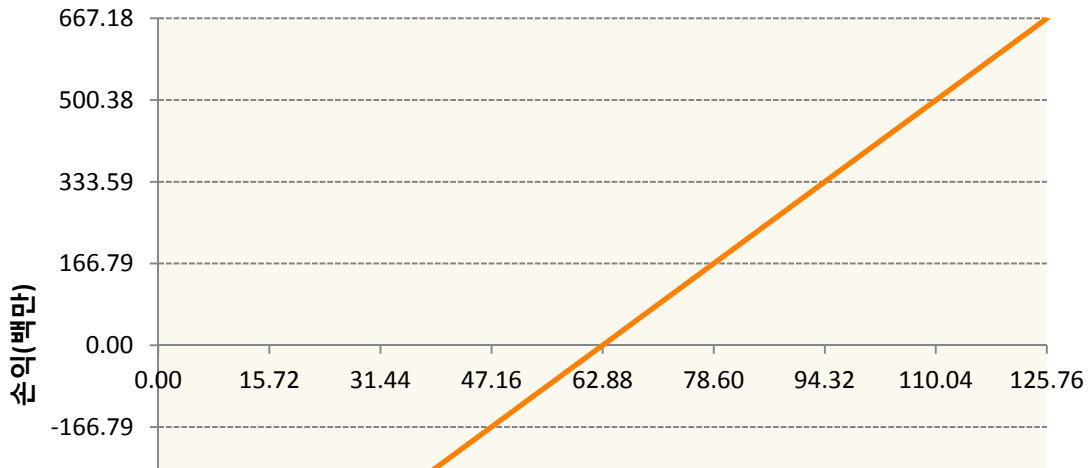
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,528	118	2,409	

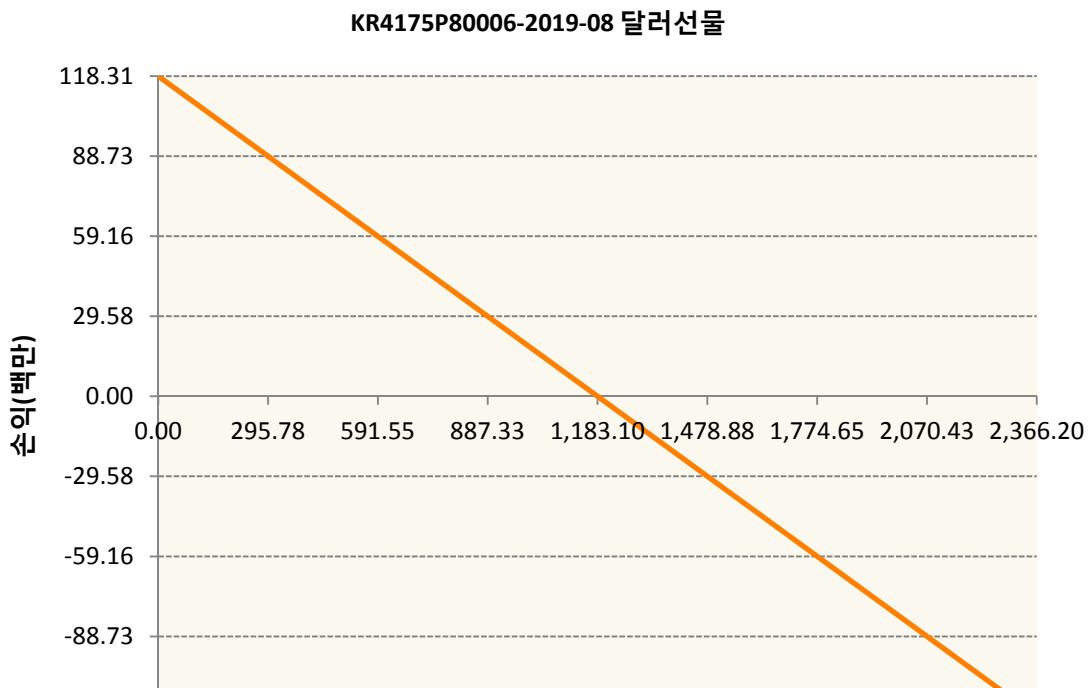
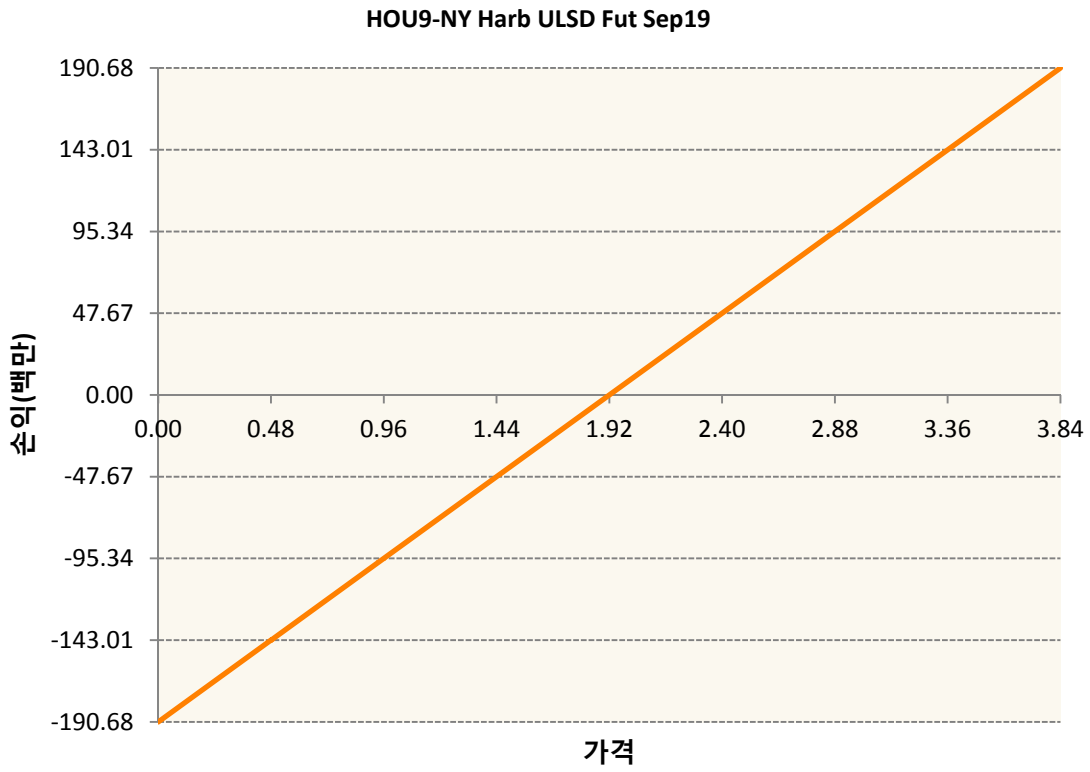
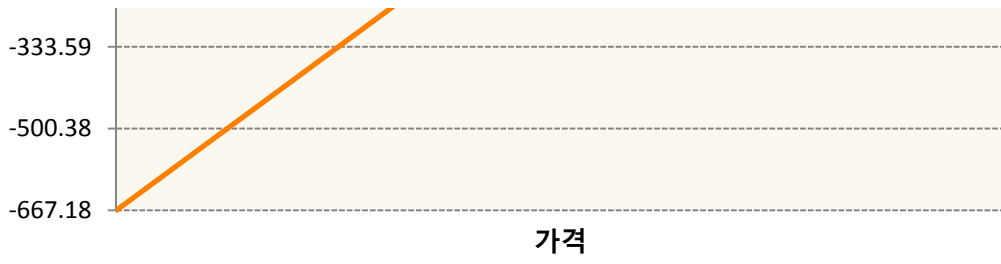
2. 만기시점의 손익구조

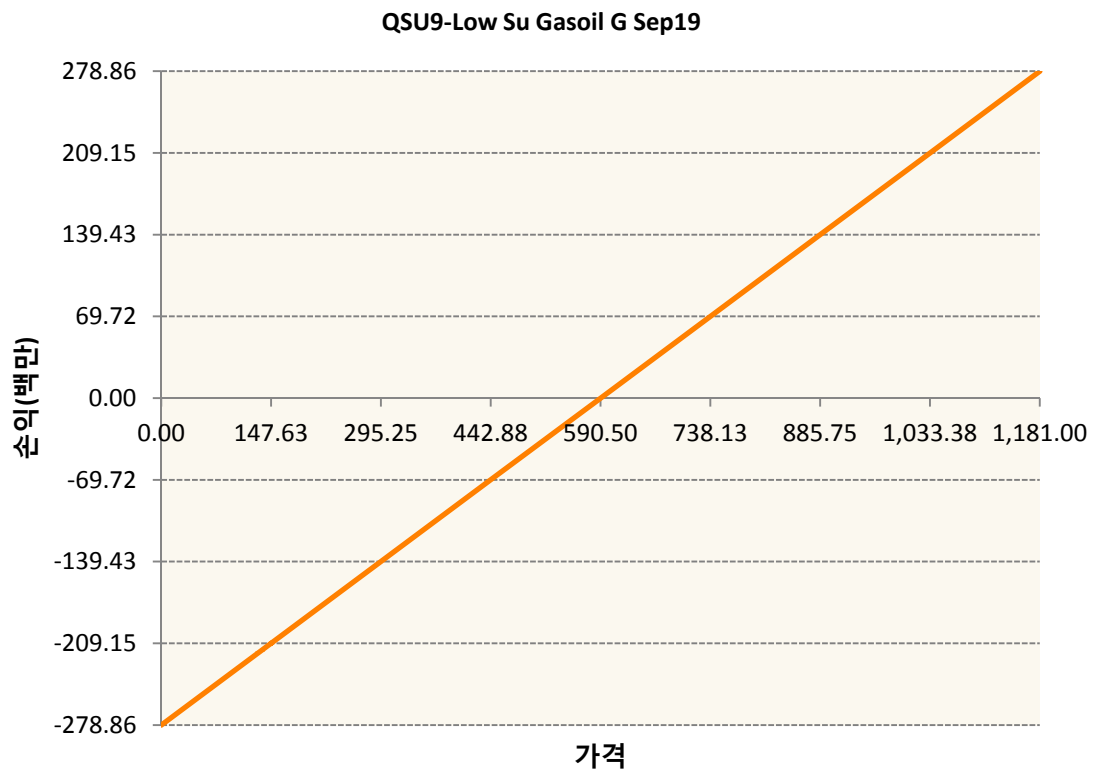
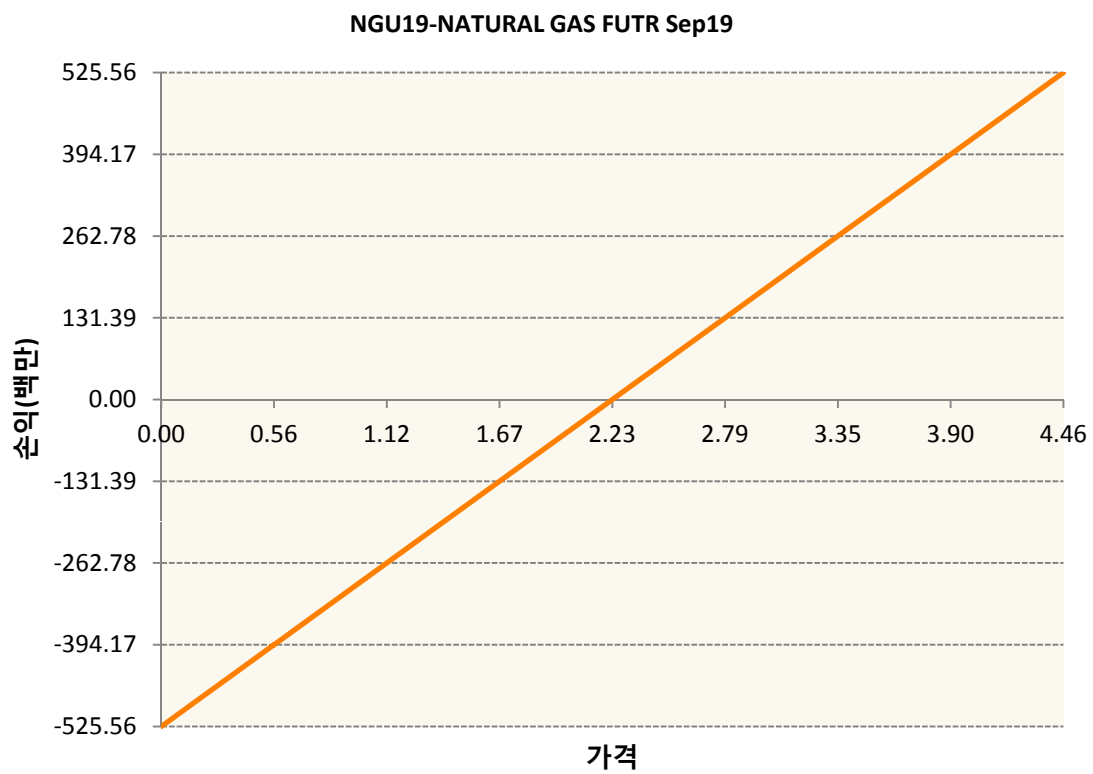
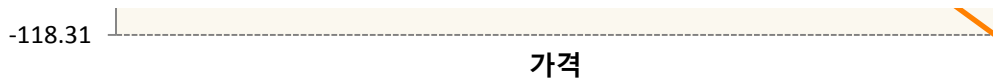
CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19



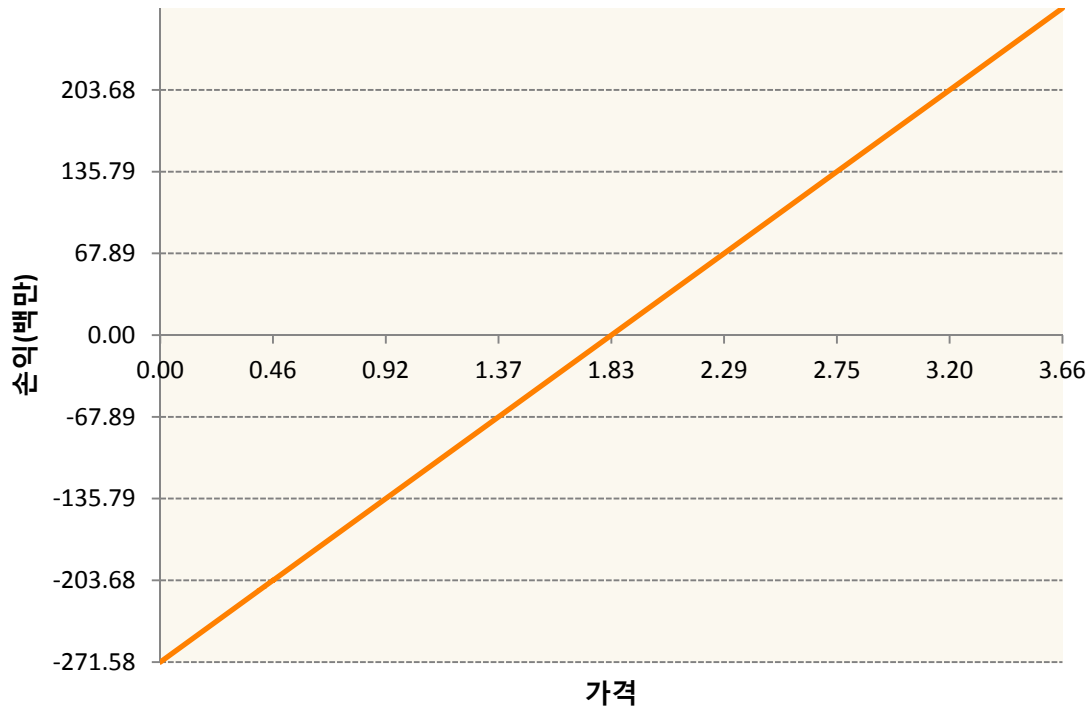
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19







XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	48
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	22

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

(단위:백만원)

368

공시일	2019-07-29
기준일	2019-07-26

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

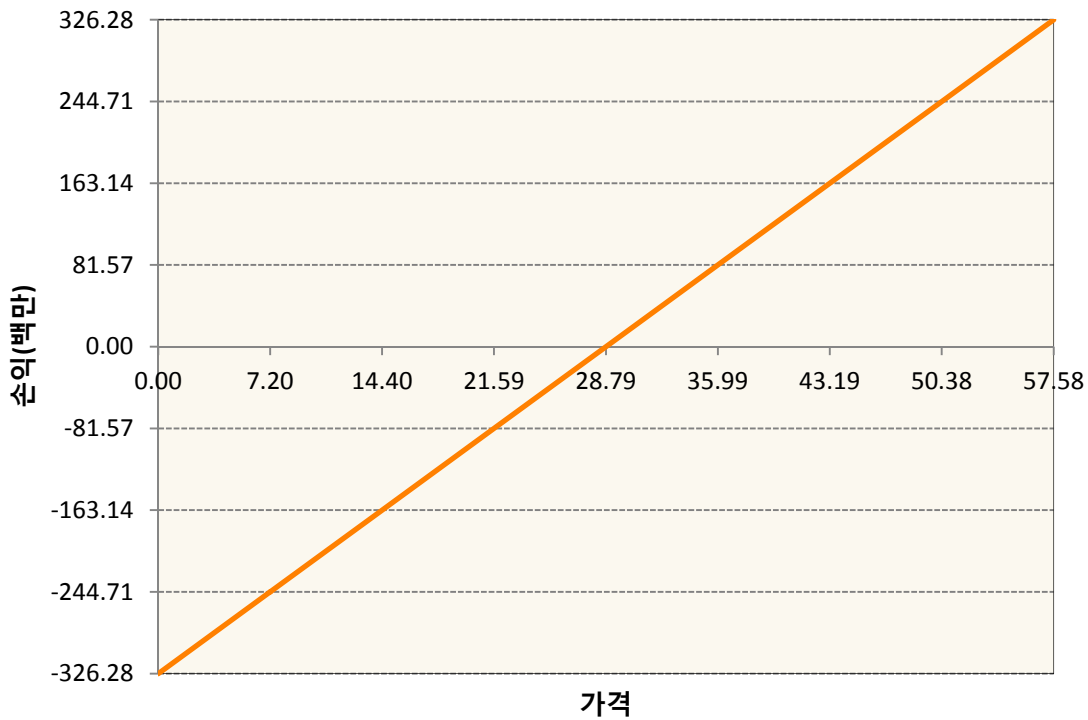
1. 계약금액

(단위:백만원)

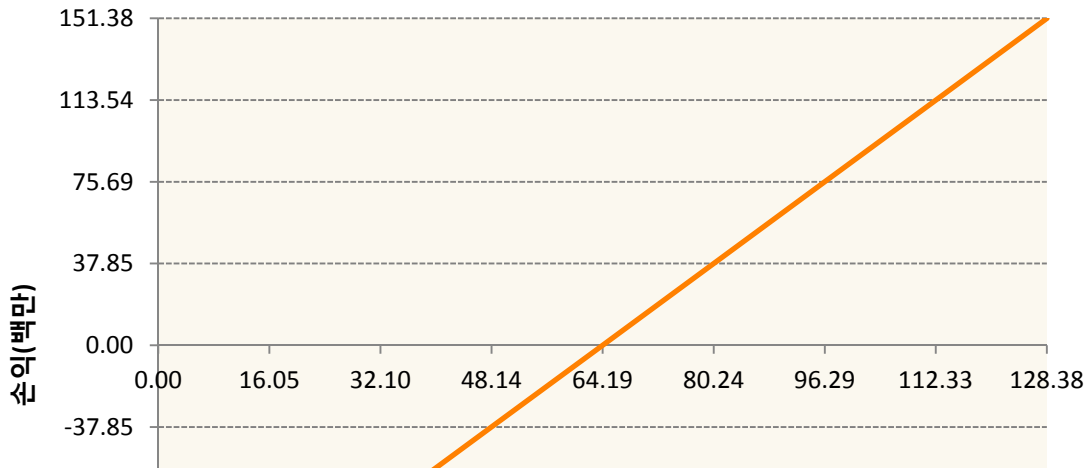
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,978	201	2,777	

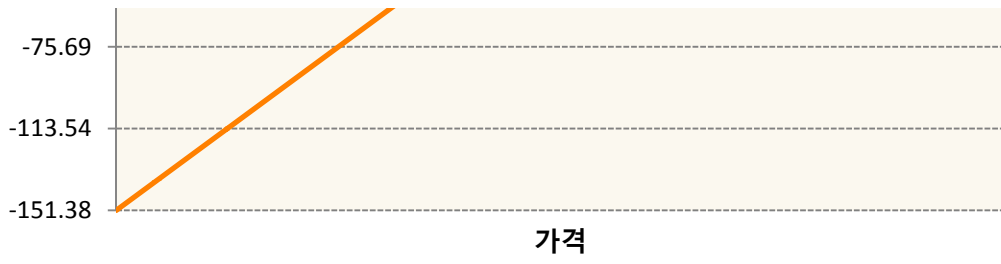
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

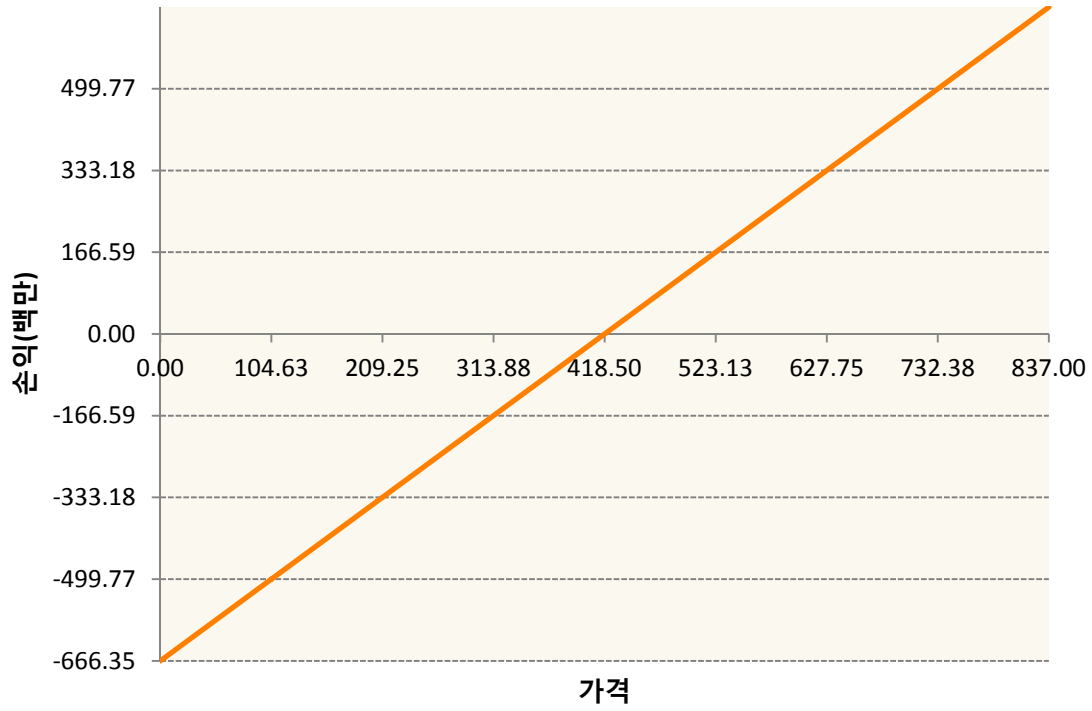


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

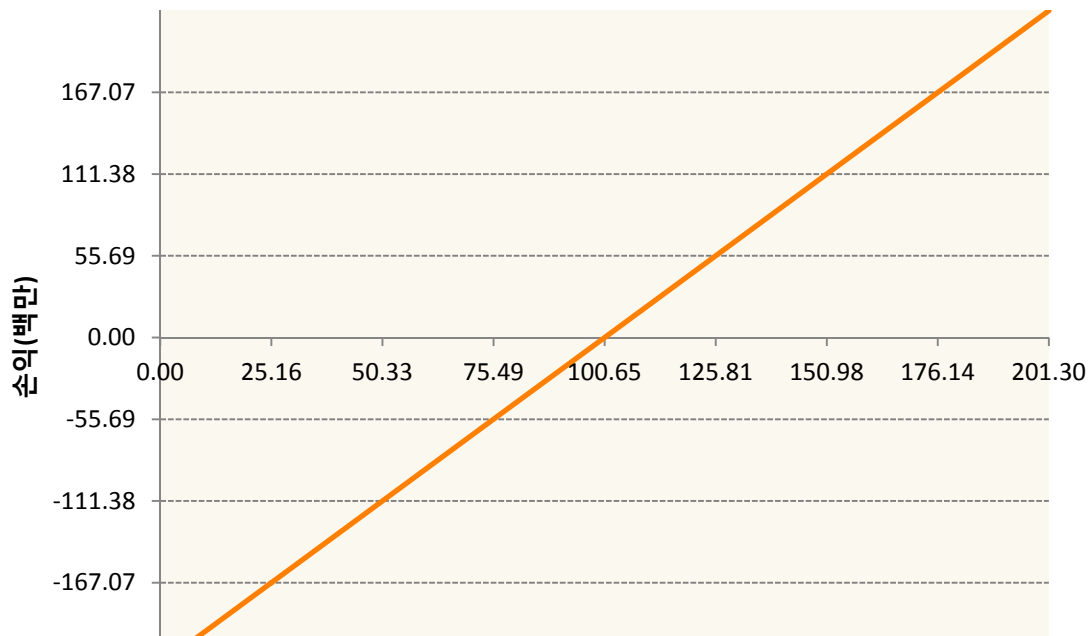


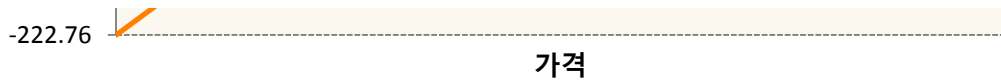


CU9-CORN FUTURE Sep19

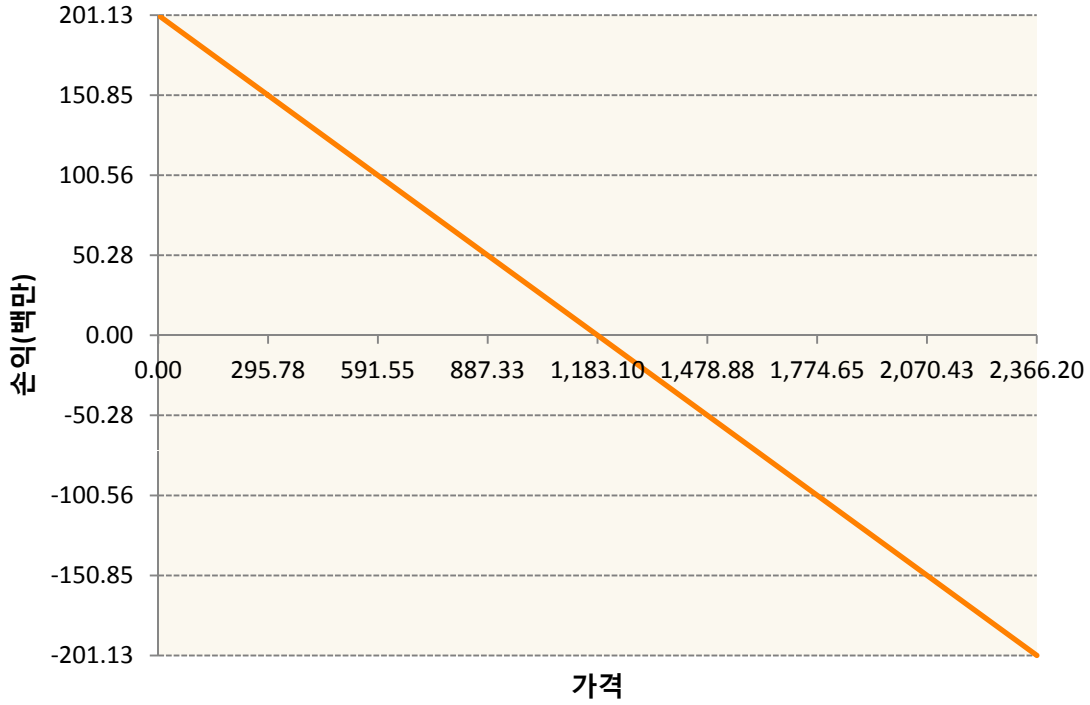


KCU9-COFFEE 'C' FUTURE Sep19

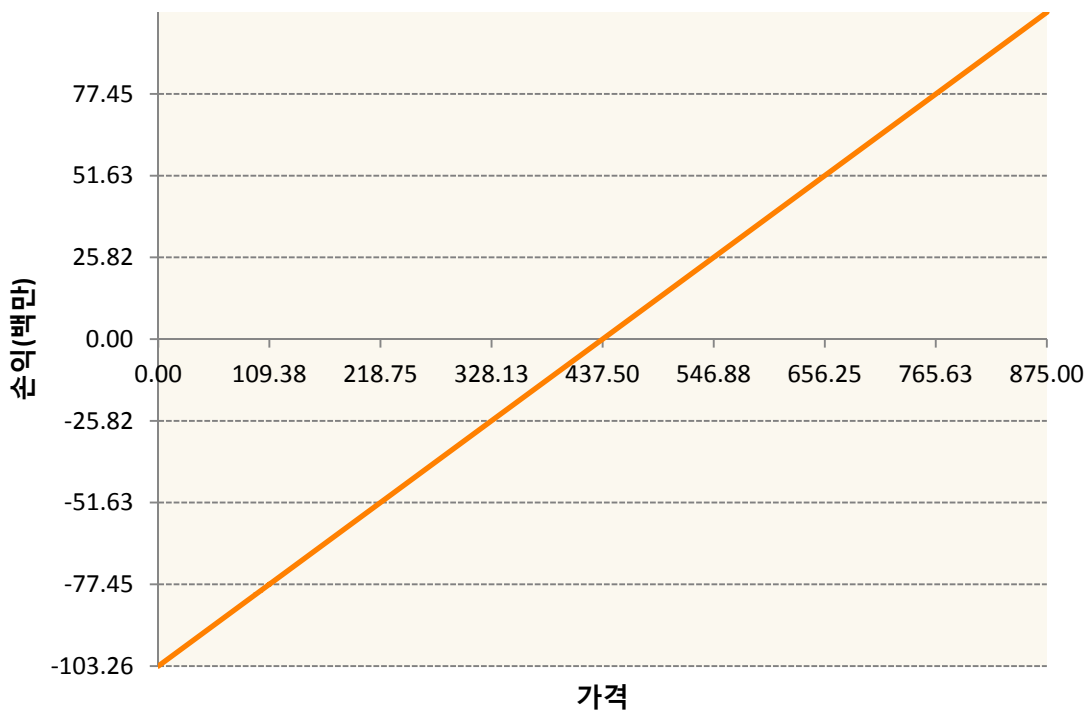




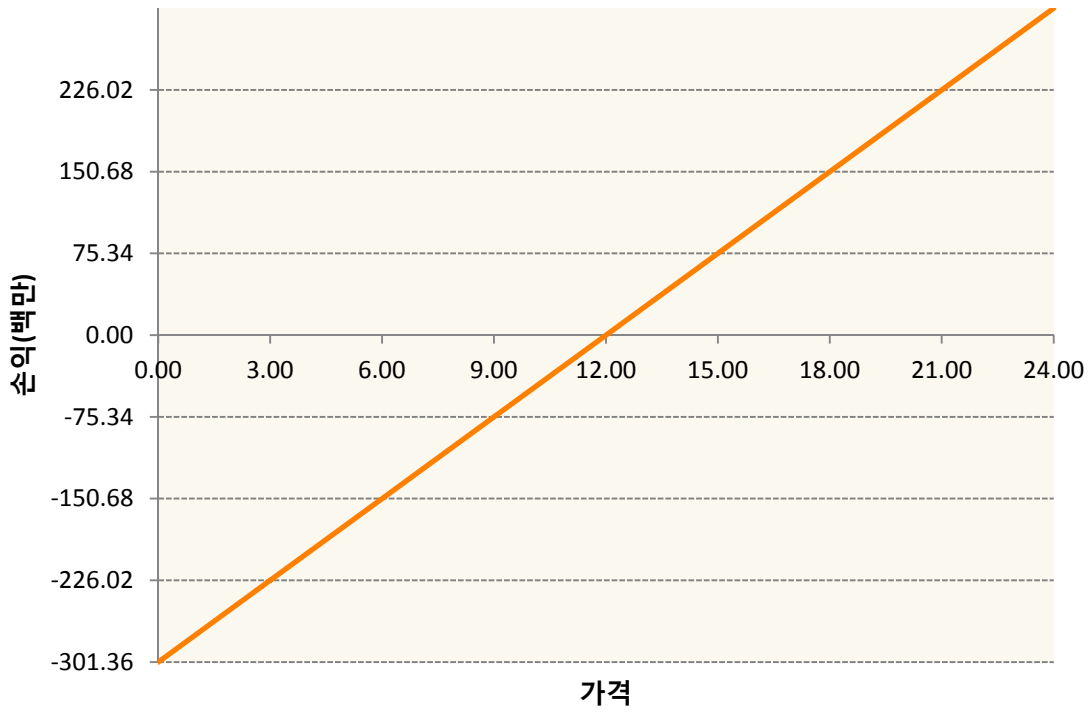
KR4175P80006-2019-08 달러선물



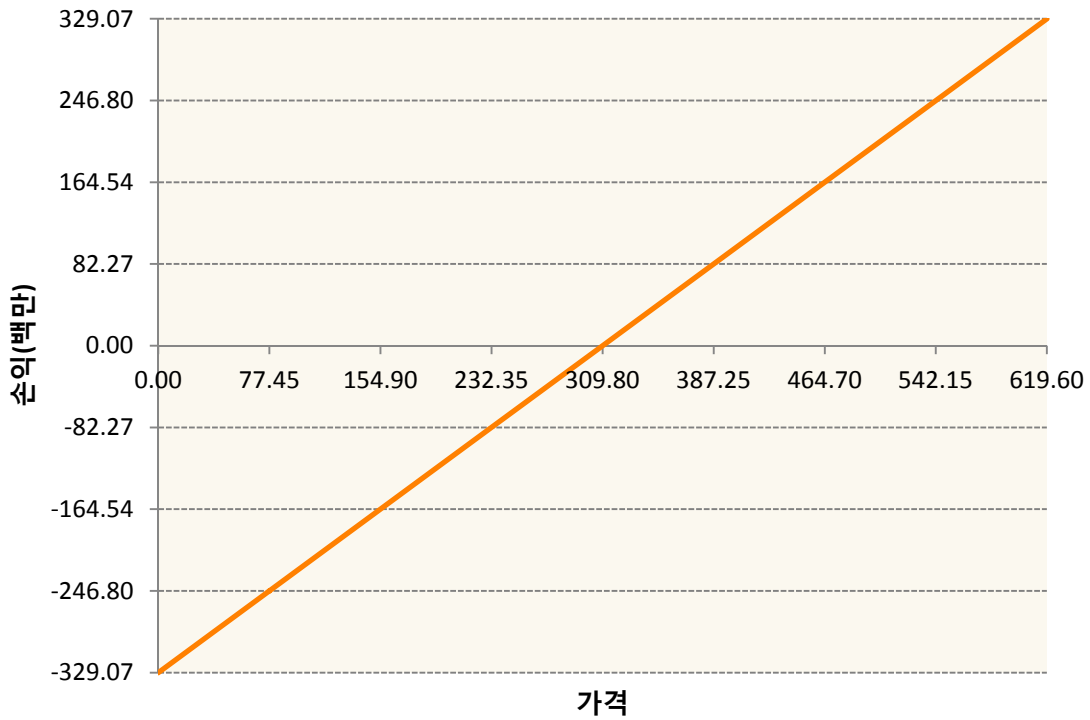
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



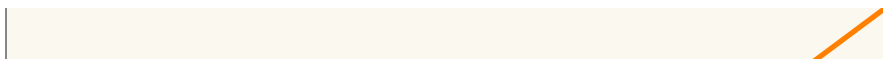
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

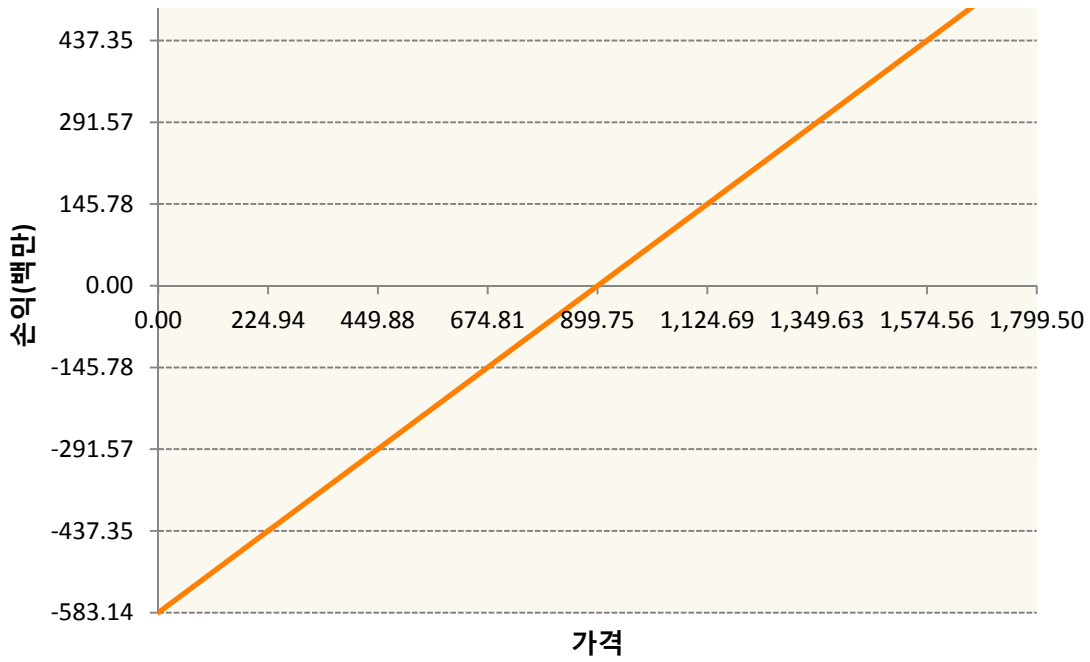


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

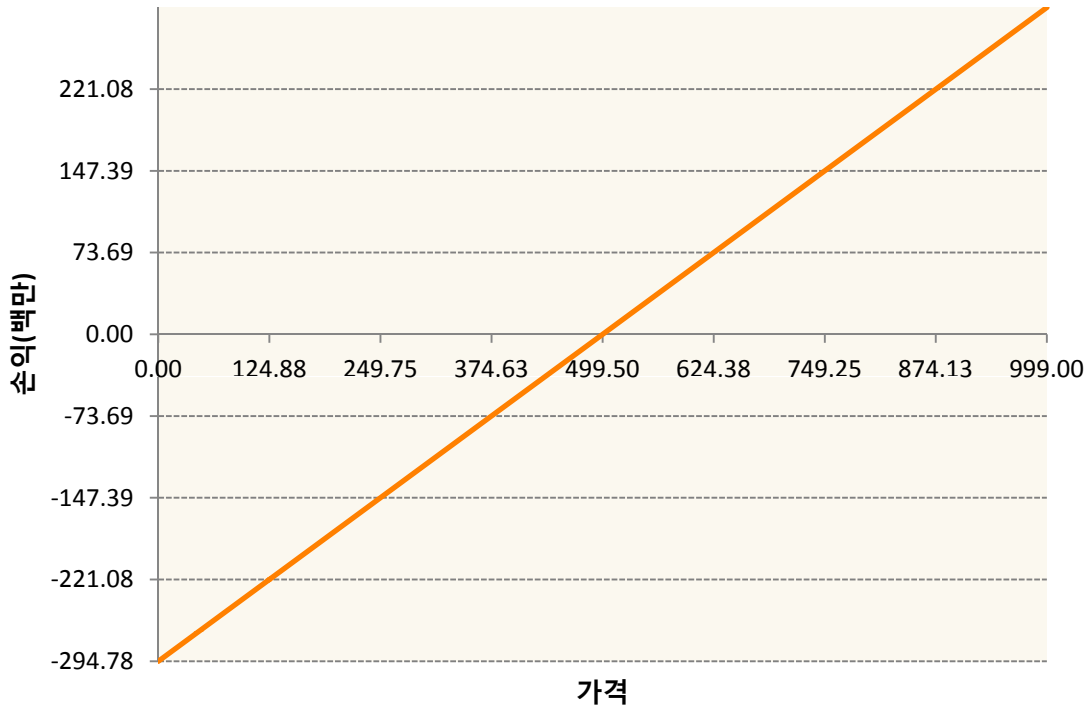


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





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	53
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	26
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	47
WU9	WHEAT FUTURE(CBT) Sep19	24

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

(단위:백만원)

262