

공시일	2019-07-11
기준일	2019-07-10

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)

89

공시일	2019-07-11
기준일	2019-07-10

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)

672

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-11
기준일	2019-07-10

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)	378
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	138

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

845

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-11
기준일	2019-07-10

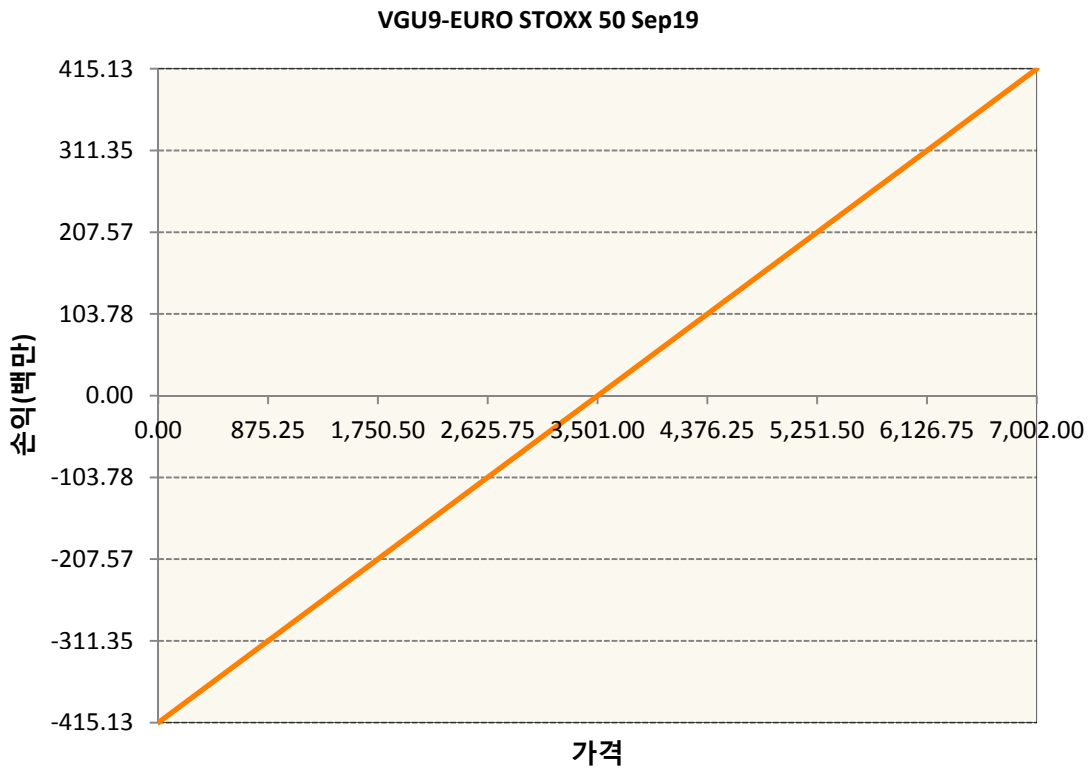
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	415	0	415	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU9	EURO STOXX 50 Sep19	33
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

24

공시일	2019-07-11
기준일	2019-07-10

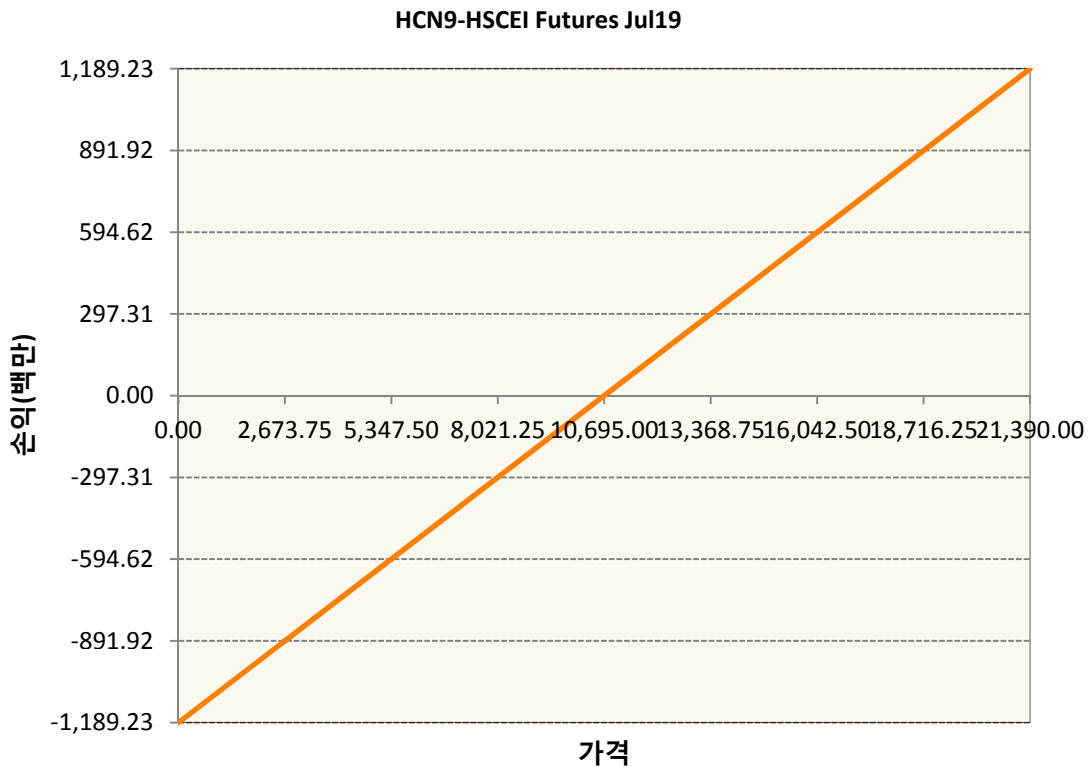
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,189	0	1,189	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN9	HSCEI Futures Jul19	95
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

96

공시일	2019-07-11
기준일	2019-07-10

커버드콜모(주식혼합-파생형)

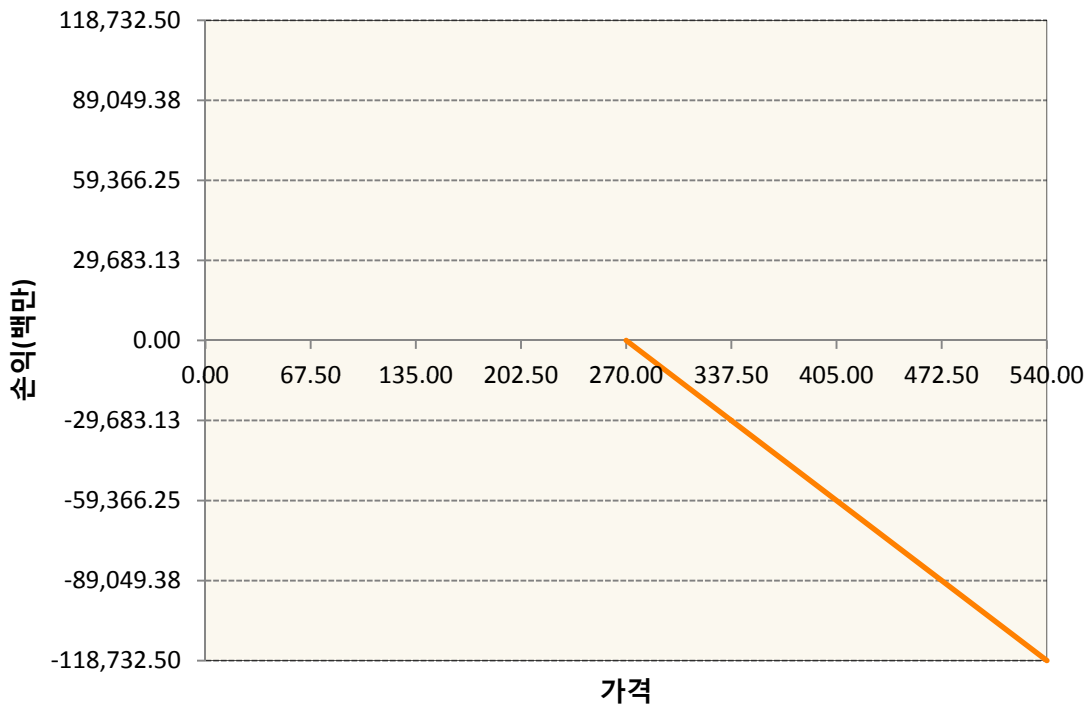
1. 계약금액

(단위:백만원)

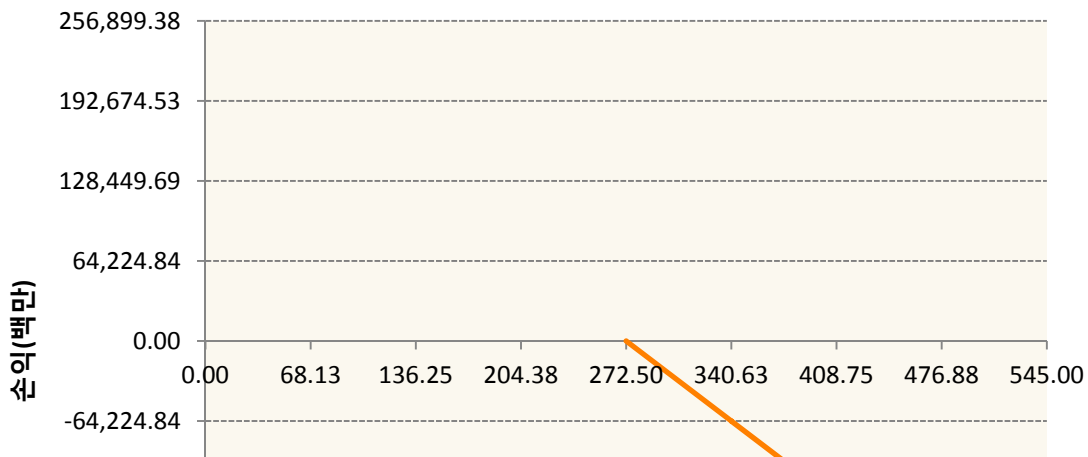
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	33,883	34,239	-356	장내
누계	유가증권	옵션	0	591,294	-591,294	장내

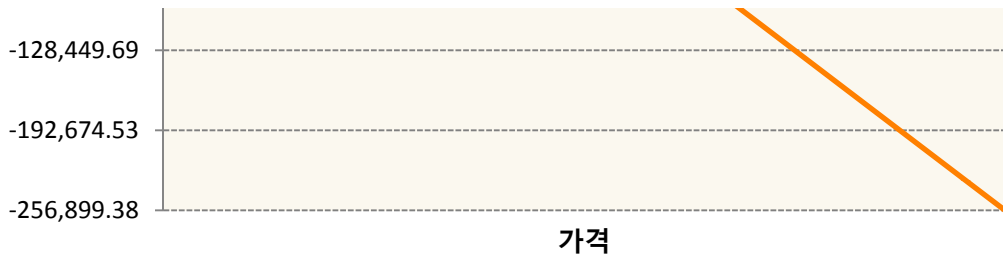
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P72700-2019-07 콜270

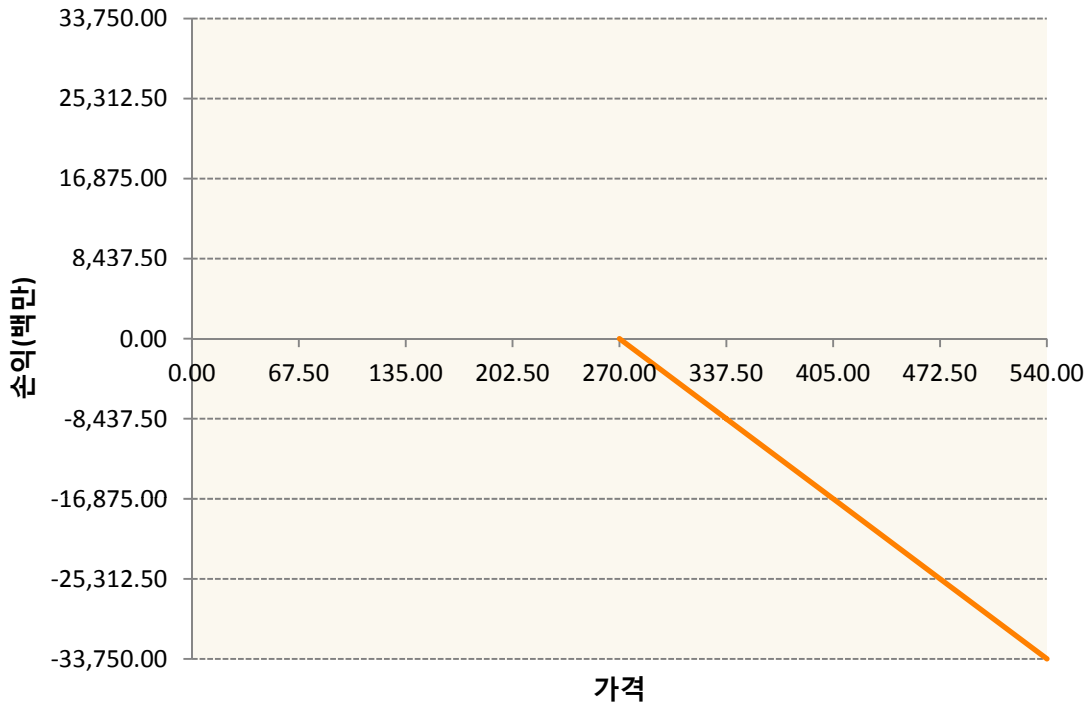


KR4201P72726-2019-07 콜272.5

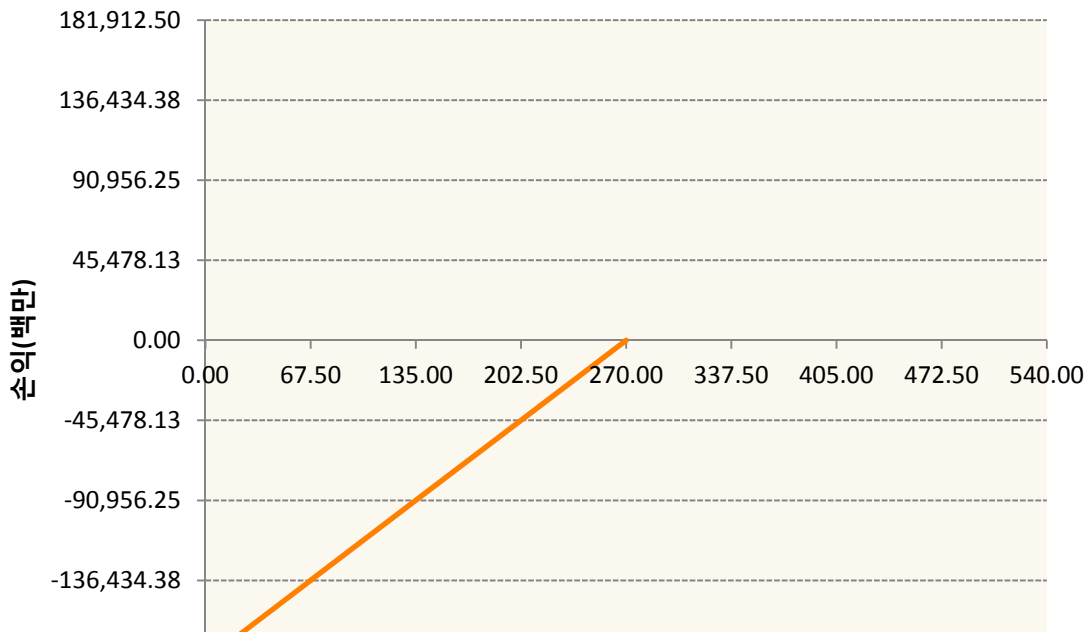




KR4201P82709-2019-08 콜270



KR4301P72708-2019-07 풋270



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P72700 2019-07 콜270							8,515
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	387	387	387	387	387	387	387
-5.33%	387	387	387	387	387	387	387
-2.67%	387	387	385	383	379	374	367
0%	144	97	49	0	-49	-99	-149
2.67%	-2,218	-2,225	-2,234	-2,246	-2,261	-2,280	-2,301
5.33%	-5,364	-5,364	-5,364	-5,364	-5,364	-5,364	-5,365
8.00%	-8,515	-8,515	-8,515	-8,515	-8,515	-8,515	-8,515
KR4201P72726 2019-07 콜272.5							16,473
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	256	256	256	256	256	256	256
-5.33%	256	256	256	256	256	256	256
-2.67%	256	255	255	255	253	251	247
0%	163	116	62	0	-67	-140	-217
2.67%	-3,089	-3,145	-3,209	-3,279	-3,354	-3,434	-3,518
5.33%	-9,717	-9,717	-9,717	-9,719	-9,721	-9,726	-9,732
8.00%	-16,473	-16,473	-16,473	-16,473	-16,473	-16,473	-16,473
KR4201P82709 2019-08 콜270							2,008
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	836	814	786	753	716	674	629
-5.33%	756	712	664	611	555	497	436
-2.67%	573	507	438	368	296	224	151
0%	238	159	79	0	-79	-159	-238
2.67%	-272	-347	-423	-500	-577	-655	-733
5.33%	-938	-995	-1,057	-1,121	-1,188	-1,257	-1,328
8.00%	-1,716	-1,753	-1,795	-1,843	-1,894	-1,950	-2,008
KR4301P72708 2019-07 풋270							14,268
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,268	-14,268	-14,268	-14,268	-14,268	-14,268	-14,268
-5.33%	-9,440	-9,440	-9,440	-9,440	-9,440	-9,440	-9,440
-2.67%	-4,612	-4,612	-4,612	-4,612	-4,612	-4,612	-4,612
0%	103	71	36	0	-37	-75	-114
2.67%	1,062	1,062	1,061	1,061	1,060	1,059	1,056

5.33%	1,062	1,062	1,062	1,062	1,062	1,062	1,062
8.00%	1,062	1,062	1,062	1,062	1,062	1,062	1,062

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

(단위:백만원)

56,015

공시일	2019-07-11
기준일	2019-07-10

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

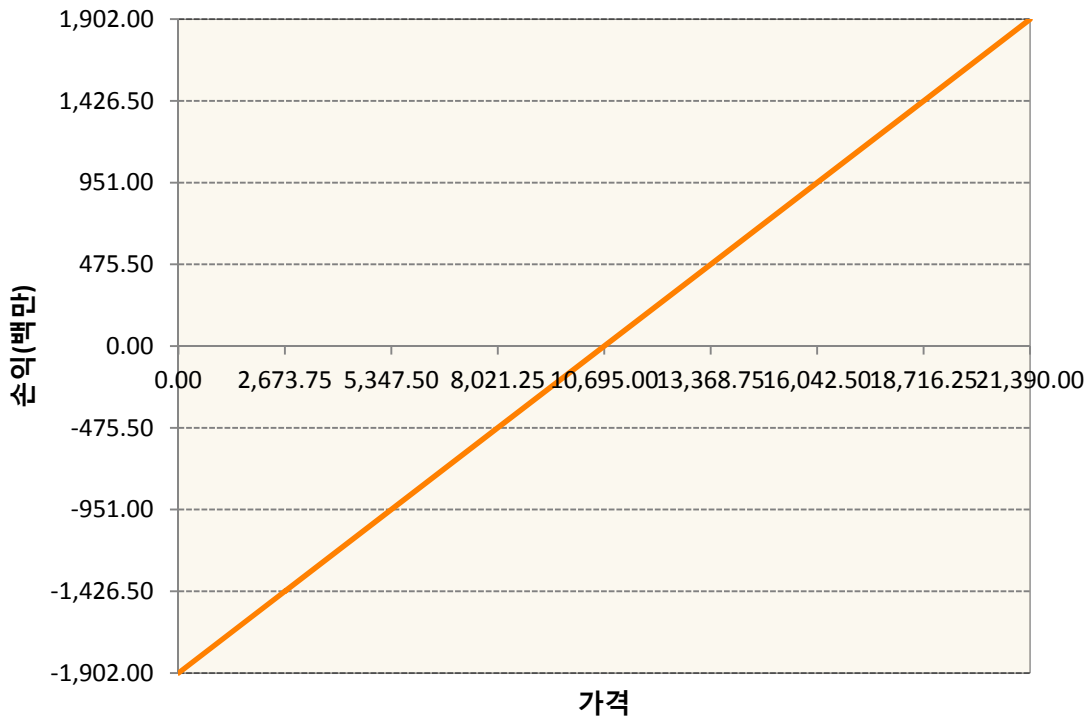
1. 계약금액

(단위:백만원)

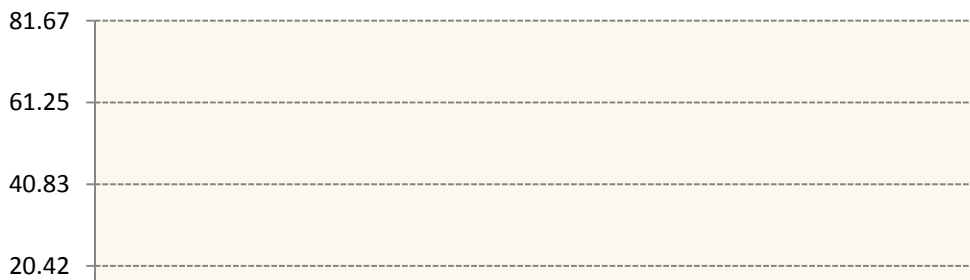
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,902	0	1,902	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,274	-5,274	장내
누계	통화	선도	151	3,176	-3,025	장외

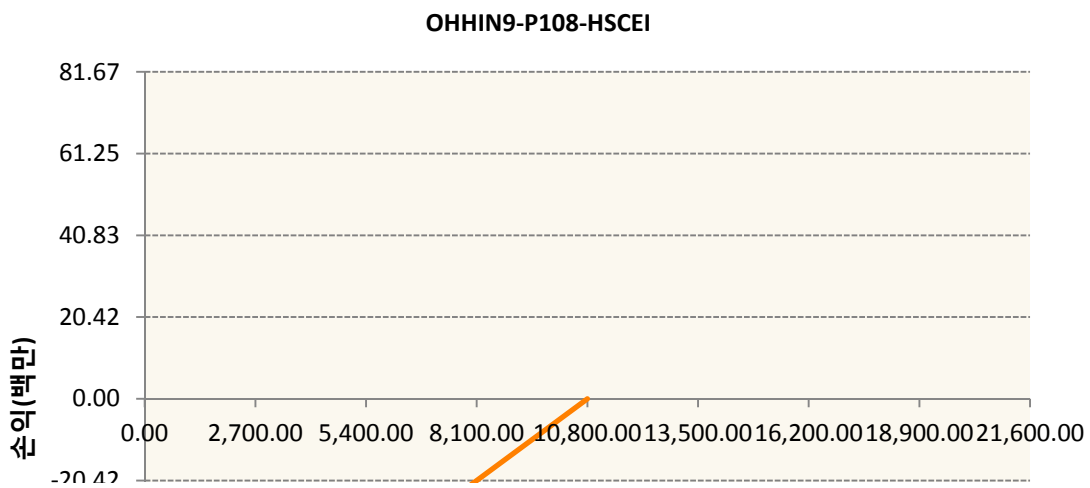
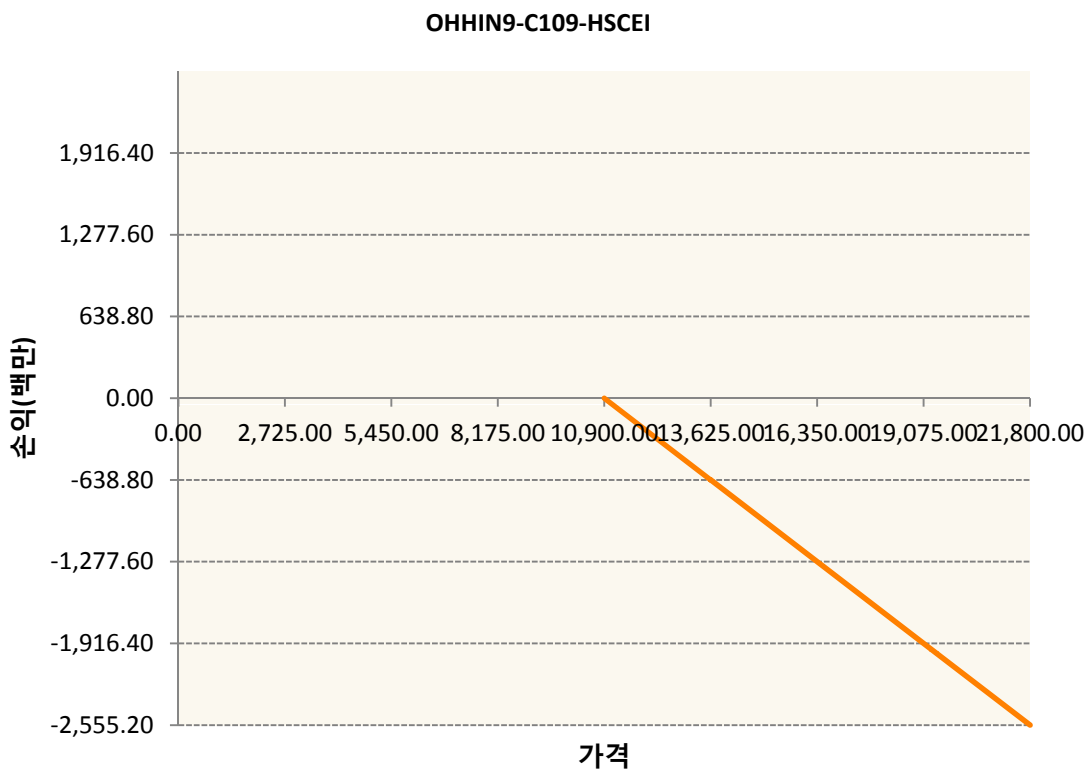
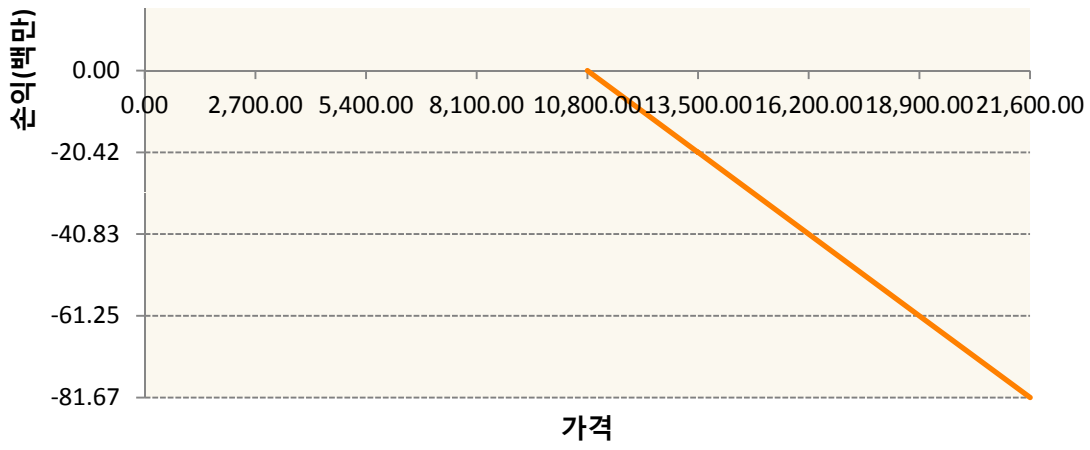
2. 만기시점의 손익구조

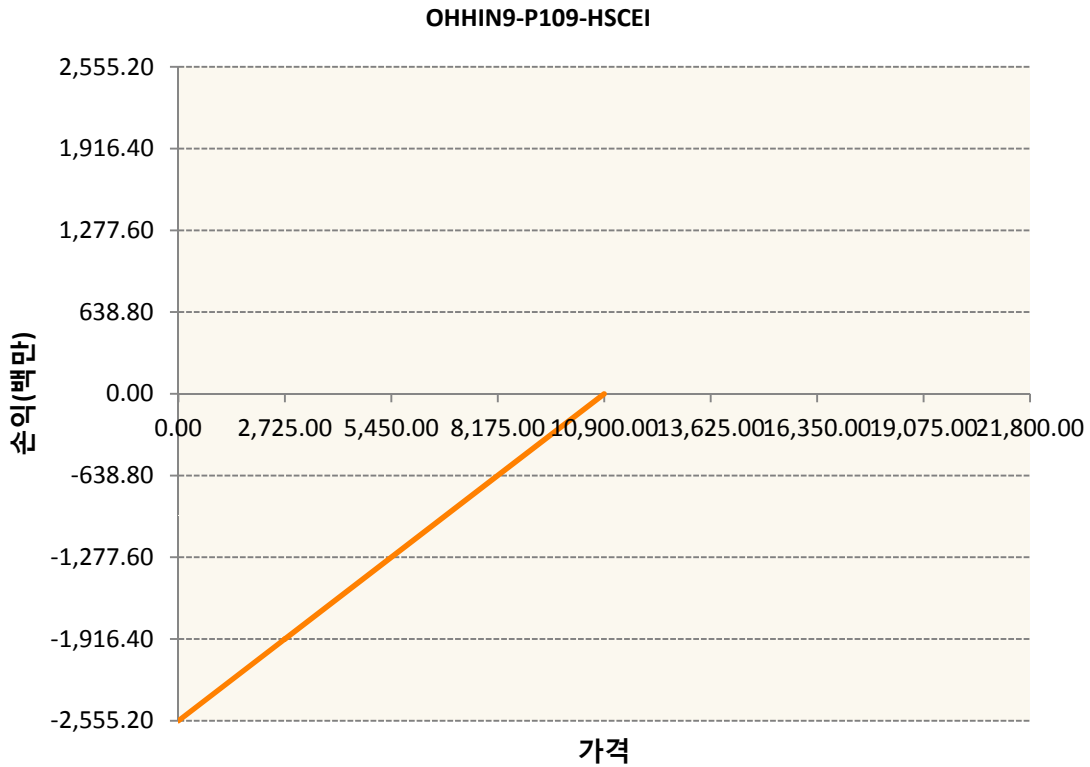
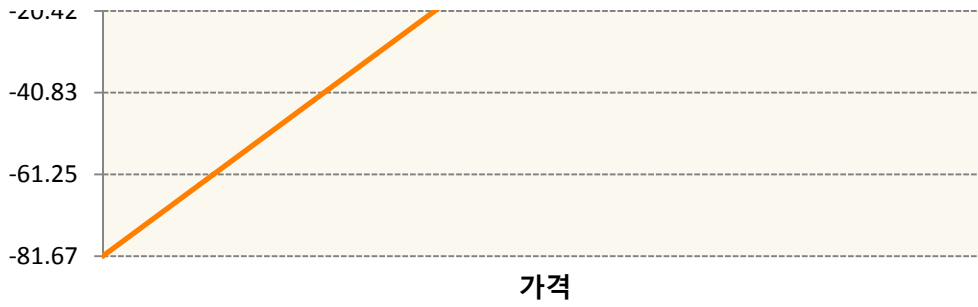
HCN9-HSCEI Futures Jul19



OHHIN9-C108-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	152
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)
	669

공시일	2019-07-11
기준일	2019-07-10

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

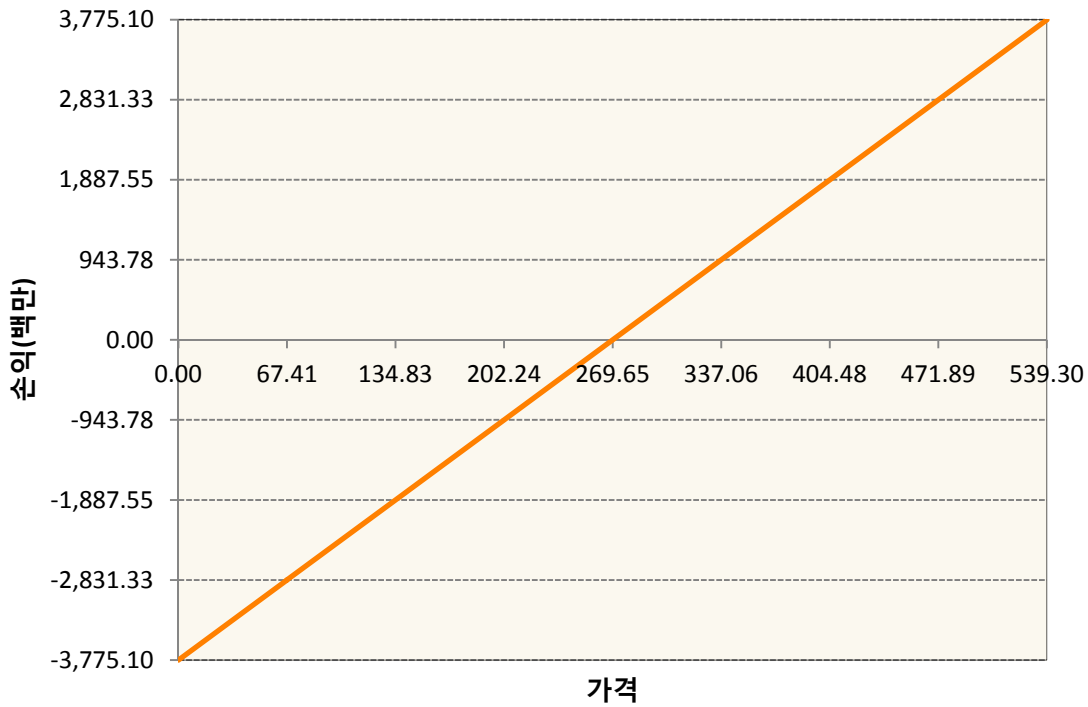
1. 계약금액

(단위:백만원)

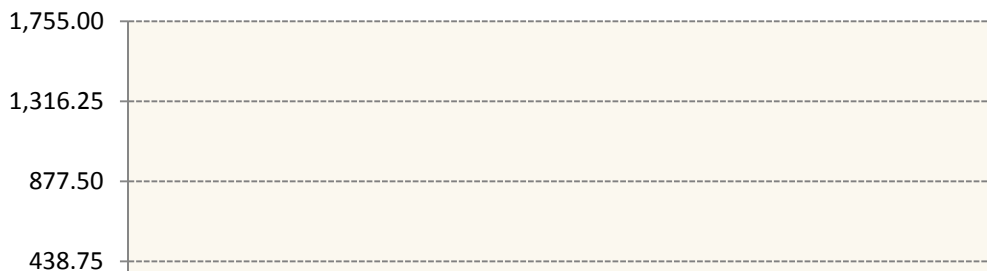
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,775	0	3,775	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,340	-20,340	장내

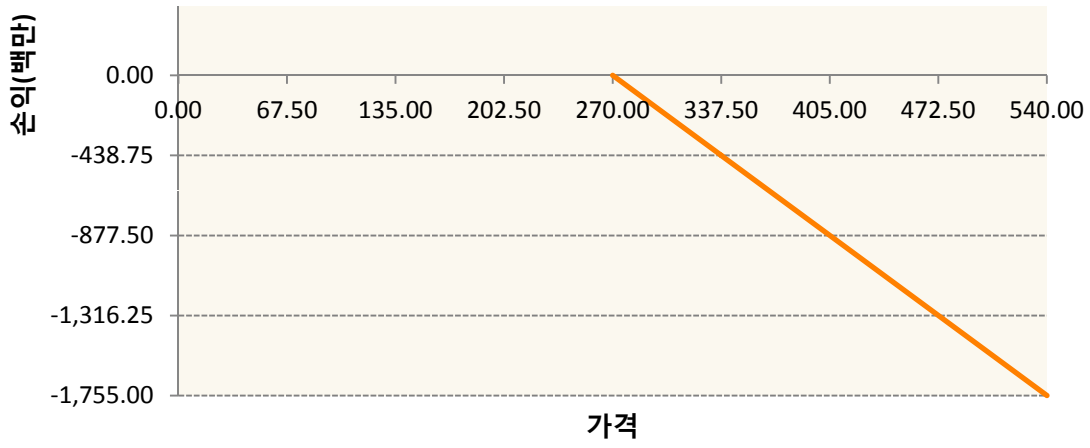
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

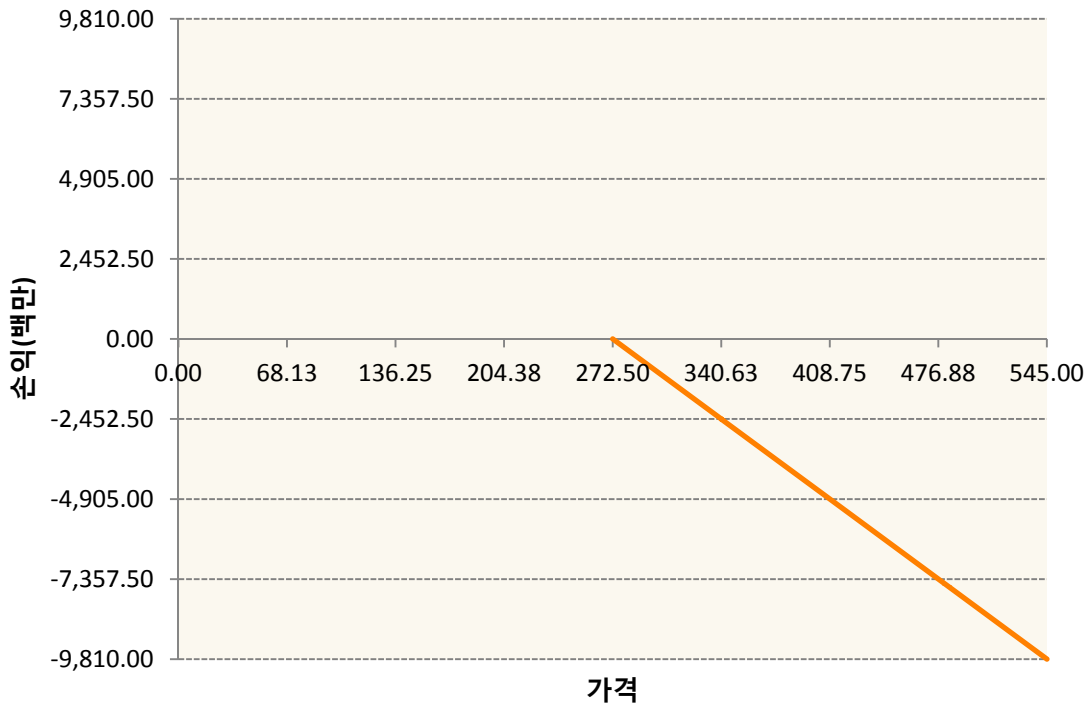


KR4201P72700-2019-07 콜270

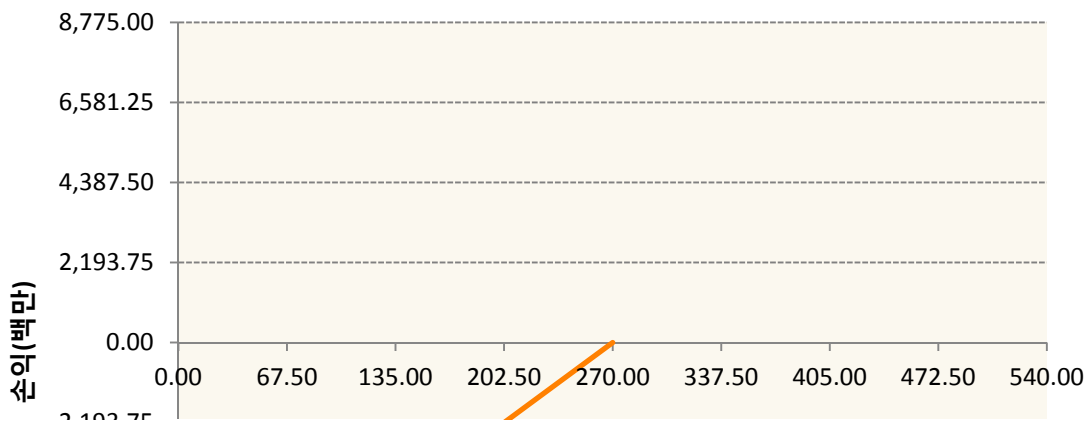




KR4201P72726-2019-07 콜272.5



KR4301P72708-2019-07 풋270





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						301
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-301	-301	-301	-301	-301	-301	-301	
-5.33%	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-201	
-2.67%	-100	-100	-100	-100	-100	-100	-100	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	100	100	100	100	100	100	100	
5.33%	201	201	201	201	201	201	201	
8.00%	301	301	301	301	301	301	301	
KR4201P72700		2019-07 콜270						126
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	6	6	6	6	6	6	6
-5.33%	6	6	6	6	6	6	6
-2.67%	6	6	6	6	6	6	5
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	-33	-33	-33	-33	-33	-34	-34
5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
8.00%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
KR4201P72726 2019-07 콜272.5							629
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10	10	10	10	10	10	10
-5.33%	10	10	10	10	10	10	10
-2.67%	10	10	10	10	10	10	9
0%	6	4	2	0	-3	-5	-8
2.67%	-118	-120	-123	-125	-128	-131	-134
5.33%	-371	-371	-371	-371	-371	-371	-372
8.00%	-629	-629	-629	-629	-629	-629	-629
KR4301P72708 2019-07 풋270							688
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-688	-688	-688	-688	-688	-688	-688
-5.33%	-455	-455	-455	-455	-455	-455	-455
-2.67%	-222	-222	-222	-222	-222	-222	-222
0%	5	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	51	51	51	51	51	51	51
5.33%	51	51	51	51	51	51	51
8.00%	51	51	51	51	51	51	51

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

(단위:백만원)

4,071

공시일	2019-07-11
기준일	2019-07-10

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

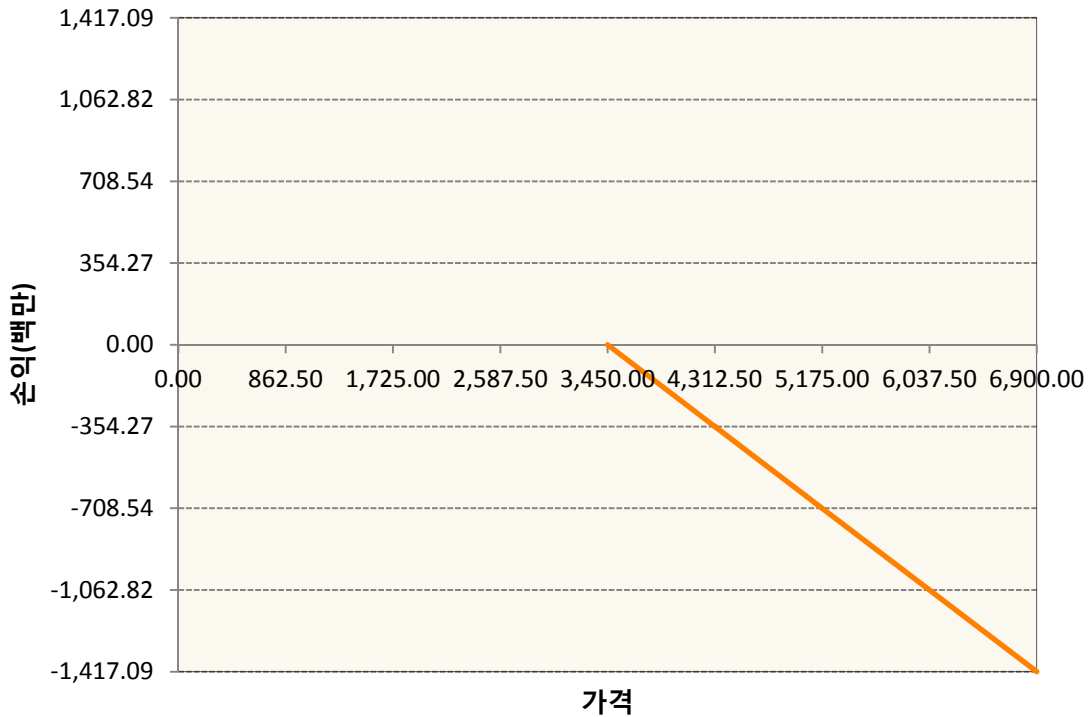
1. 계약금액

(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	1,336	0	1,336	
누계	유가증권	스왑	56,088	0	56,088	장외
누계	유가증권	옵션	0	8,636	-8,636	장내
누계	통화	선도	5,300	22,526	-17,226	장외

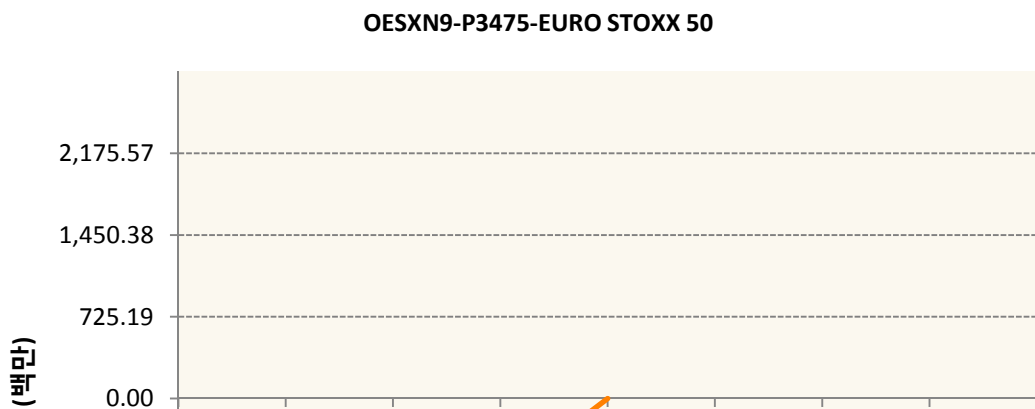
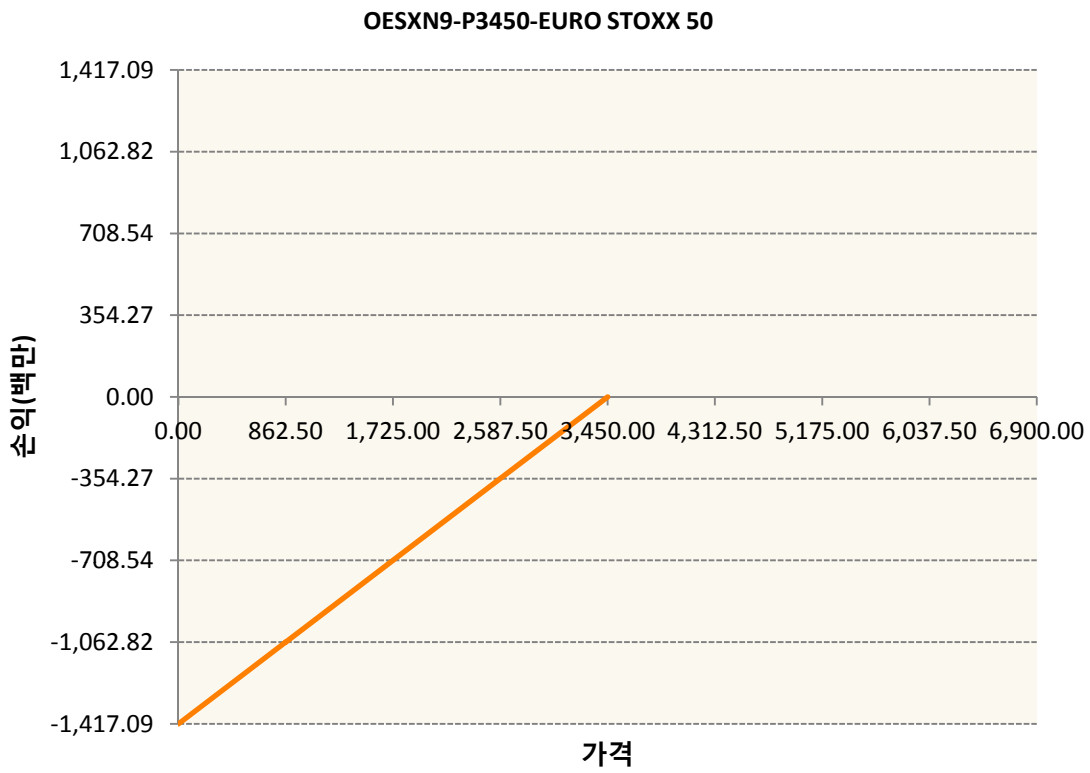
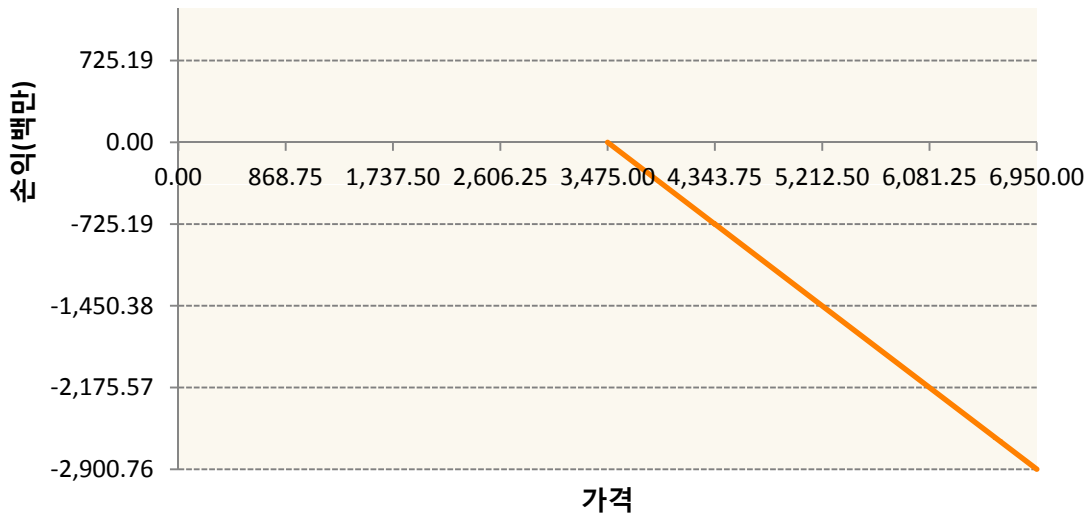
2. 만기시점의 손익구조

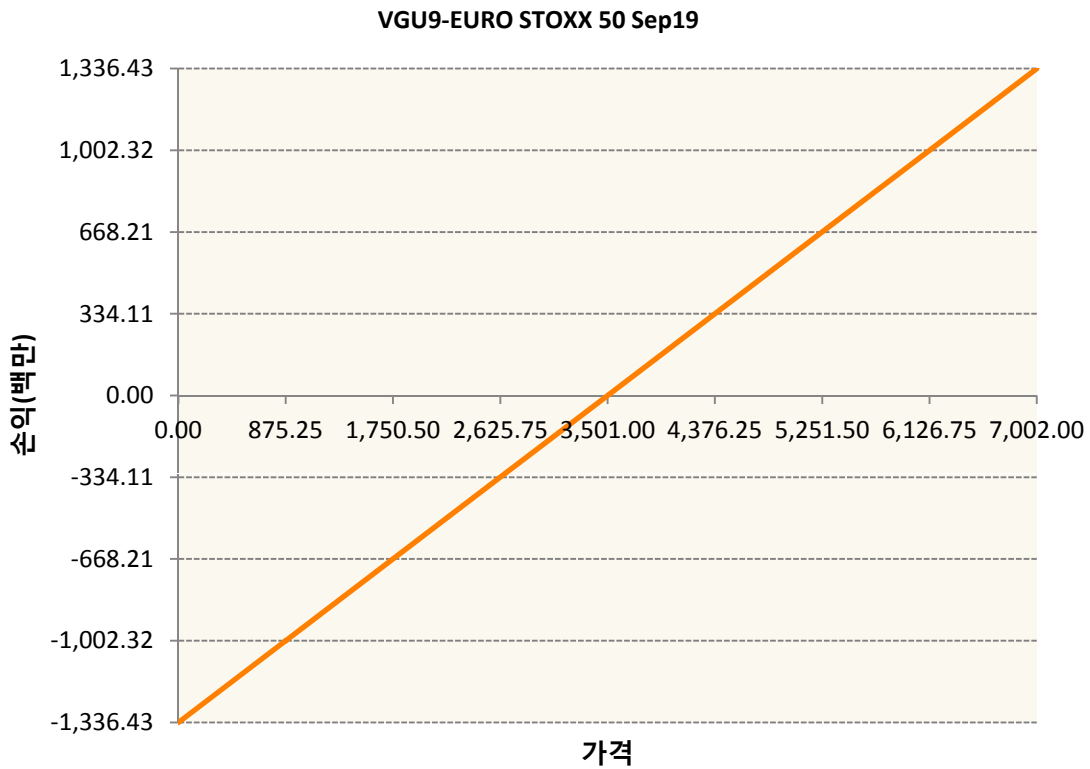
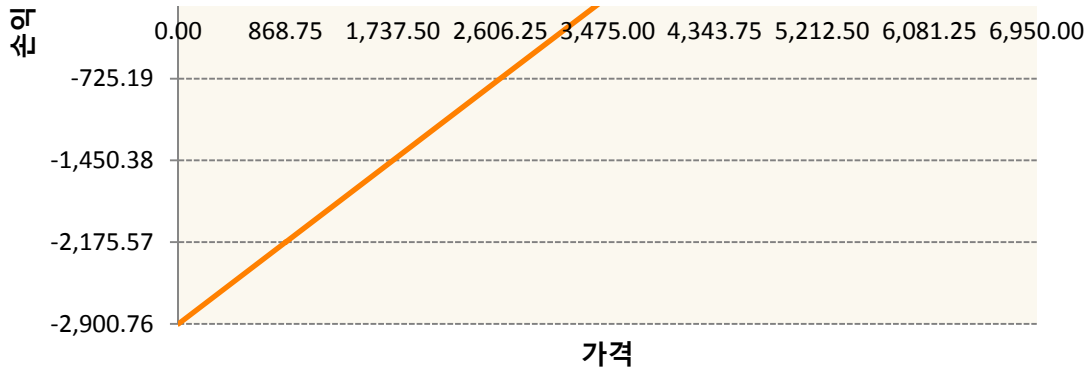
OESXN9-C3450-EURO STOXX 50



OESXN9-C3475-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	97
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	424
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E	1,060
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	318
FX21019N01 EUR/KRW 23-08-19E	424
OESXN9-C34 EURO STOXX 50	113
OESXN9-C34 EURO STOXX 50	232
OESXN9-P34 EURO STOXX 50	113
OESXN9-P34 EURO STOXX 50	232
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	107

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

(단위:백만원)

1,693

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

(단위:백만원)

1,008

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

(단위:백만원)

89

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

(단위:백만원)

129

공시일	2019-07-11
기준일	2019-07-10

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

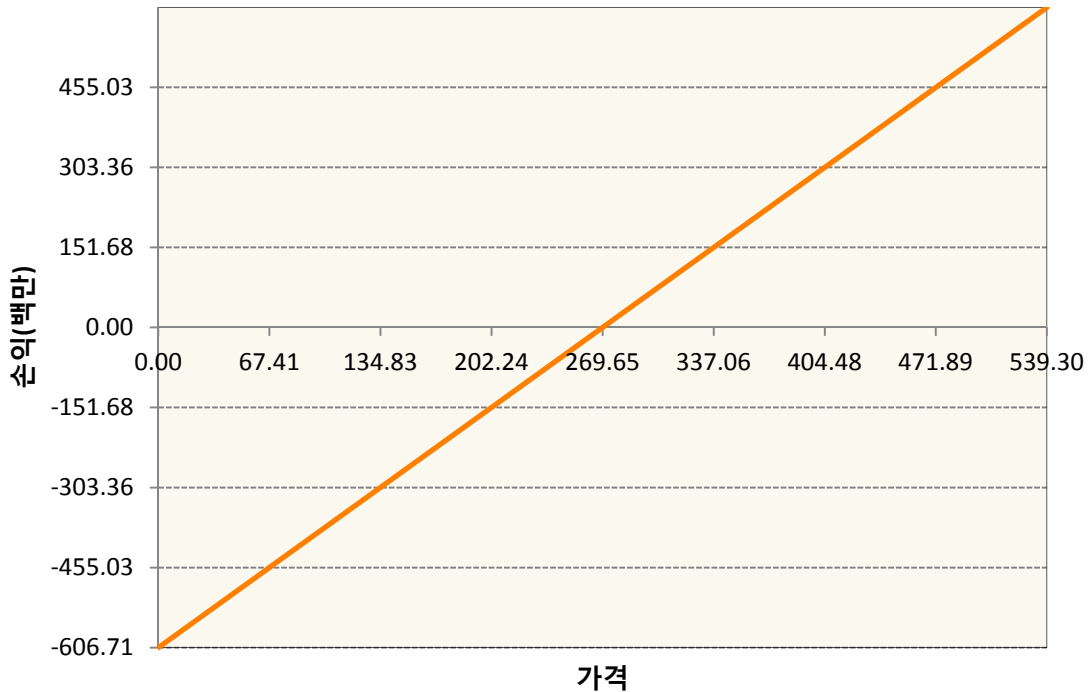
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	607	0	607	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						48
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48	
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
-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%	32	32	32	32	32	32	32	
8.00%	48	48	48	48	48	48	48	

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

(단위:백만원)

40

공시일	2019-07-11
기준일	2019-07-10

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

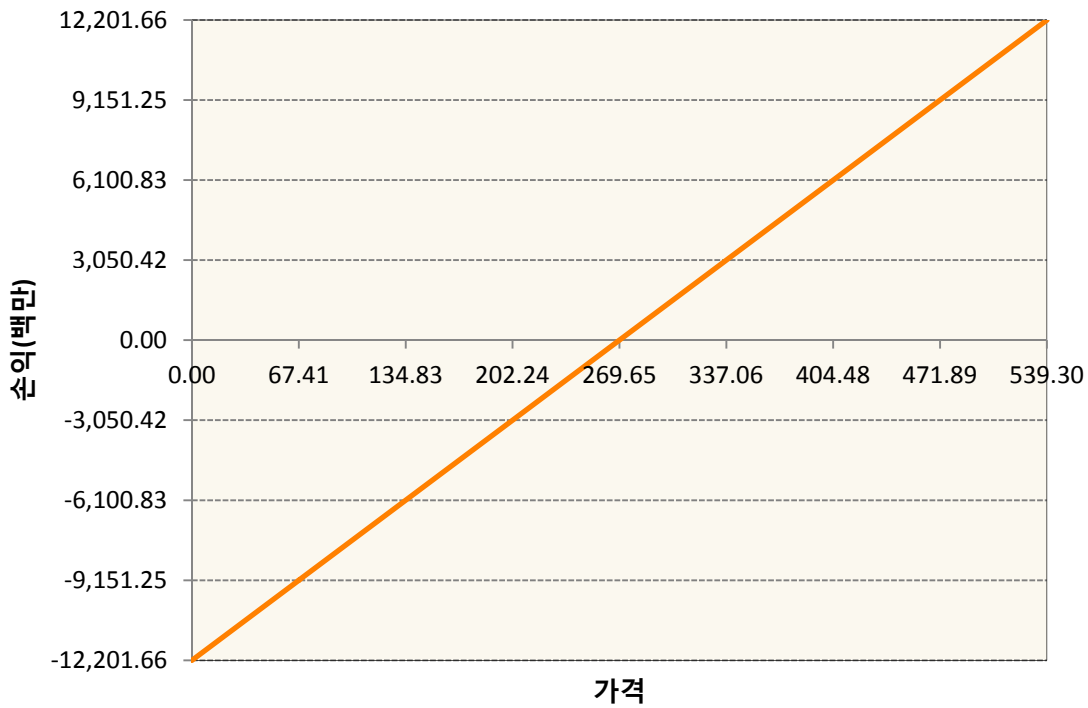
1. 계약금액

(단위:백만원)

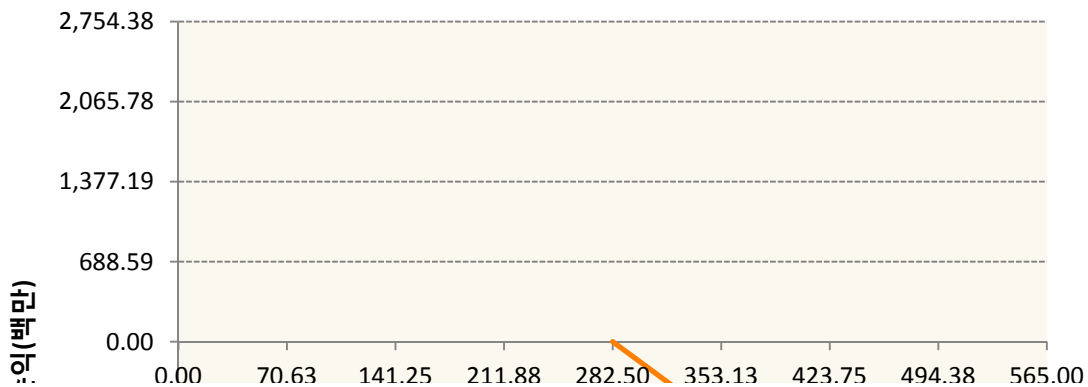
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,202	0	12,202	장내
누계	유가증권	옵션	1,084	22,134	-21,050	장내

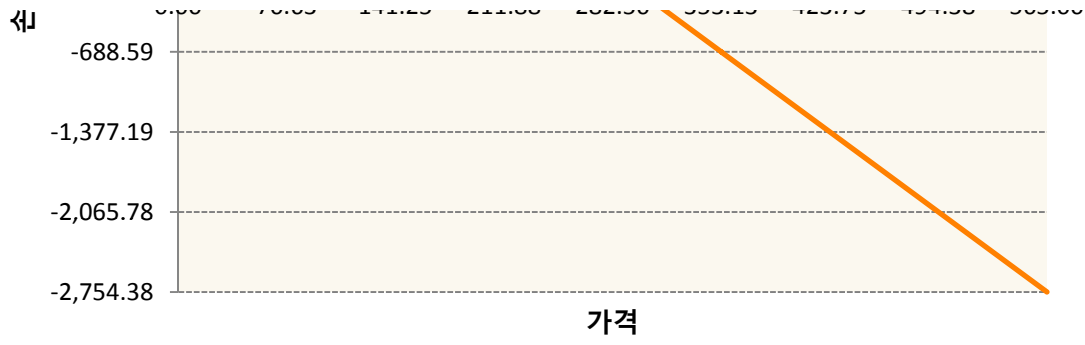
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

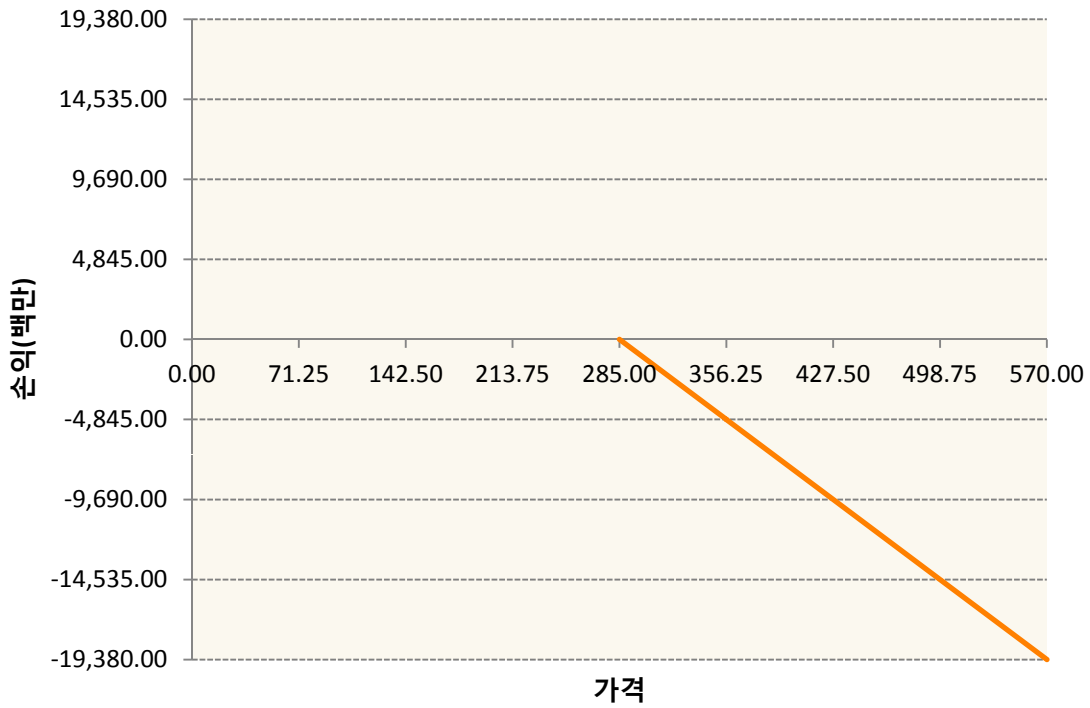


KR4201P72825-2019-07 콜282.5

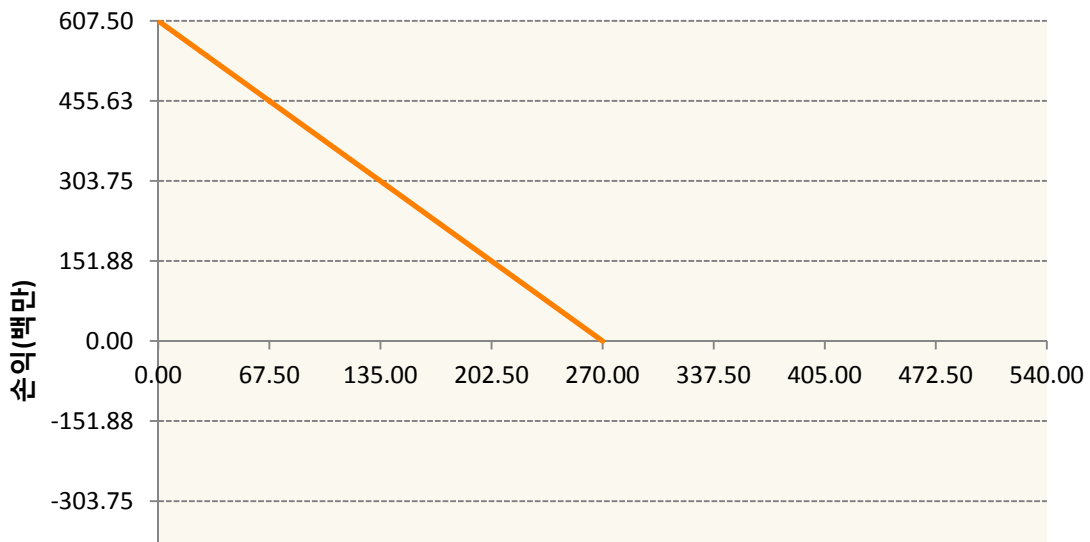


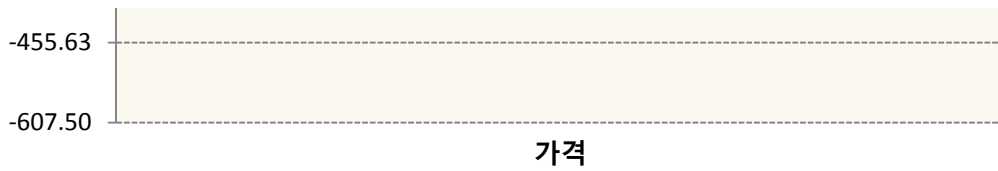


KR4201P72858-2019-07 콜285

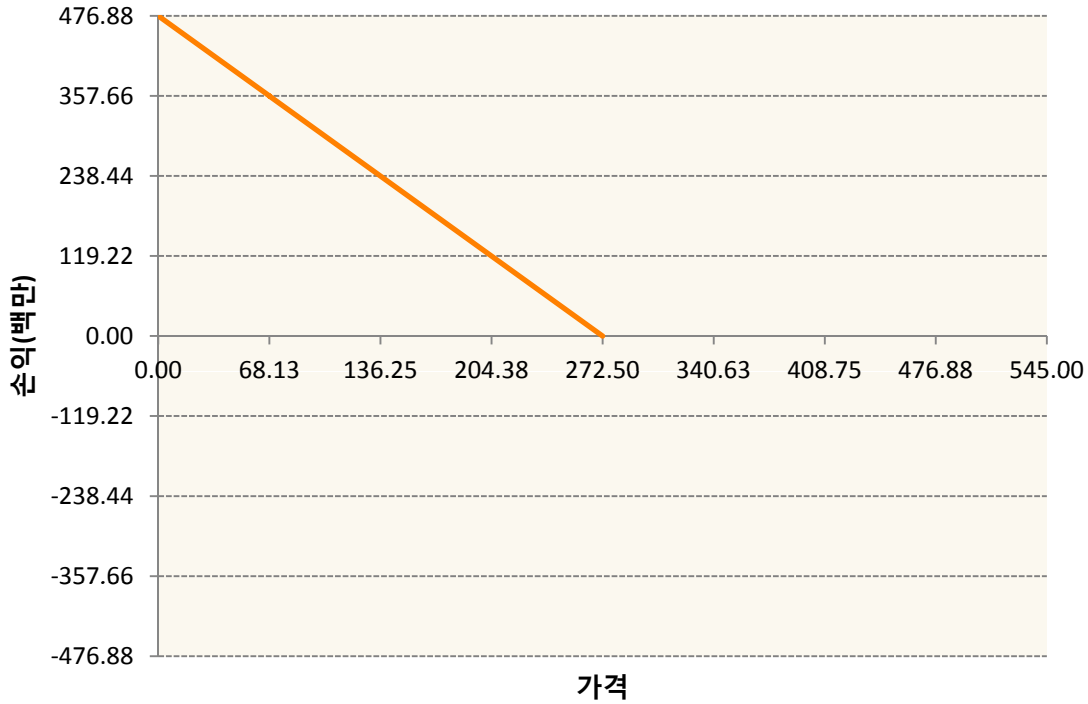


KR4301P72708-2019-07 풋270





KR4301P72724-2019-07 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						973
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-973	-973	-973	-973	-973	-973	-973	
-5.33%	-649	-649	-649	-649	-649	-649	-649	
-2.67%	-324	-324	-324	-324	-324	-324	-324	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	324	324	324	324	324	324	324	
5.33%	649	649	649	649	649	649	649	
8.00%	973	973	973	973	973	973	973	
KR4201P72825		2019-07 콜282.5						76
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0	
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0	
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	

0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	-1	-1	-1	-2
5.33%	-14	-15	-16	-18	-19	-20	-21
8.00%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
KR4201P72858 2019-07 콜285							379
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	-1	-1	-2	-3
5.33%	-28	-35	-42	-50	-57	-65	-73
8.00%	-359	-361	-364	-367	-370	-374	-379
KR4301P72708 2019-07 풋270							48
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	48	48	48	48	48	48	48
-5.33%	32	32	32	32	32	32	32
-2.67%	15	15	15	15	15	15	15
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
KR4301P72724 2019-07 풋272.5							38
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	38	38	38	38	38	38	38
-5.33%	25	25	25	25	25	25	25
-2.67%	12	12	12	12	12	12	12
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-6	-6
5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7

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

(단위:백만원)

874

공시일	2019-07-11
기준일	2019-07-10

H2O글로벌본드(USD)(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	28,937	0	28,937	

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	2019-07-11
기준일	2019-07-10

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	59,558	0	59,558	

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	2019-07-11
기준일	2019-07-10

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

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	366,147	0	366,147	
누계	통화	선도	0	356,394	-356,394	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E		473
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		473
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		378
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		794
FX21019M00 KRW/USD 15-07-19E		473
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		378
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		662
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		945
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		662
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		662
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		567
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		3,025
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		2,269
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E		284
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E		284
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E		794
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E		633
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E		473
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		1,891
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		1,891
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E		700
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E		700
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E		1,304
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E		2,564
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		3,119
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		2,117

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

(단위:백만원)

9,414

공시일	2019-07-11
기준일	2019-07-10

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

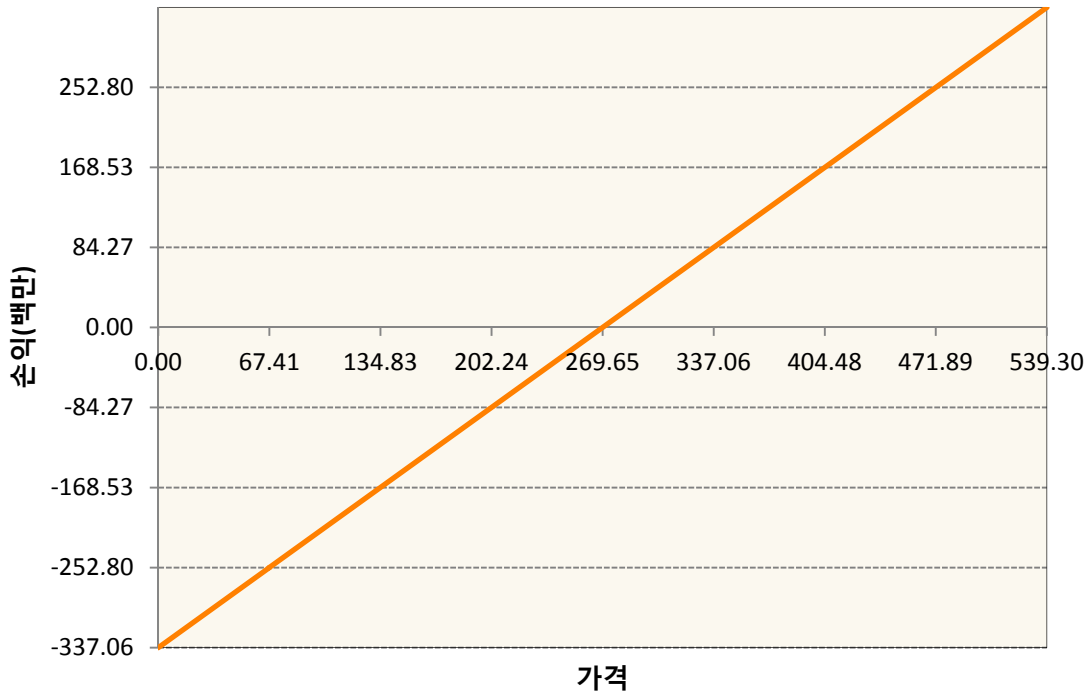
1. 계약금액

(단위:백만원)

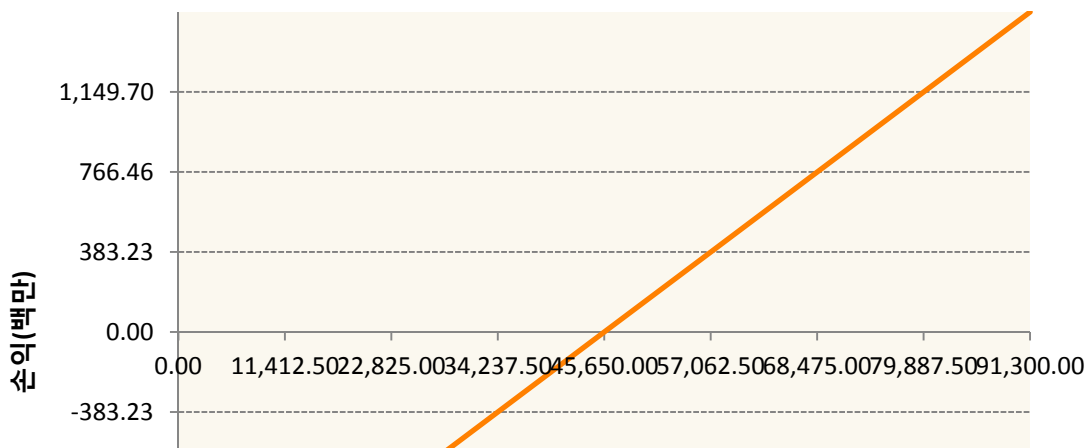
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,545	0	1,545	장내
누계	유가증권	선물	1,870	0	1,870	장내

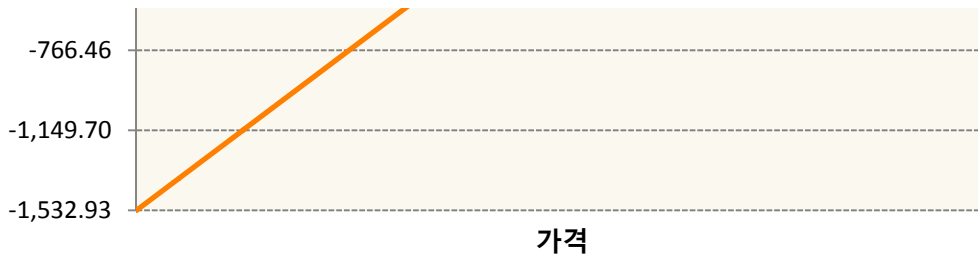
2. 만기시점의 손익구조

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						122
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-122	-122	-122	-122	-122	-122	-122	
-5.33%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82	
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	41	41	41	41	41	41	41	
5.33%	82	82	82	82	82	82	82	
8.00%	122	122	122	122	122	122	122	

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

165

공시일	2019-07-11
기준일	2019-07-10

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

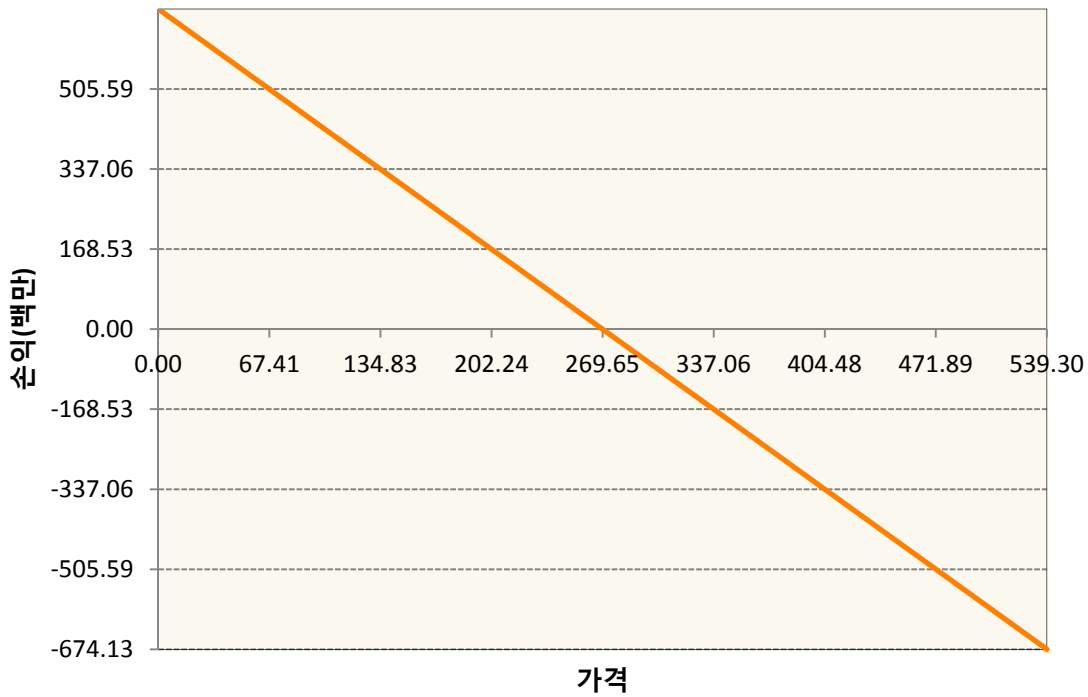
1. 계약금액

(단위:백만원)

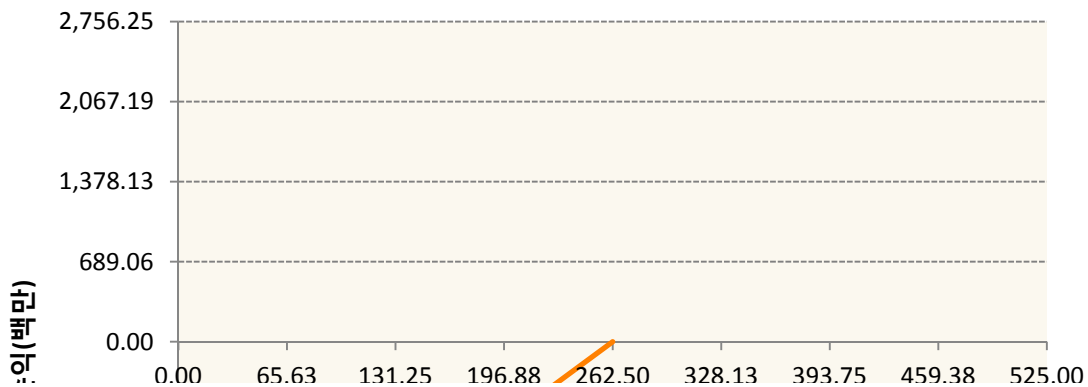
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	674	-674	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,485	-3,485	장내

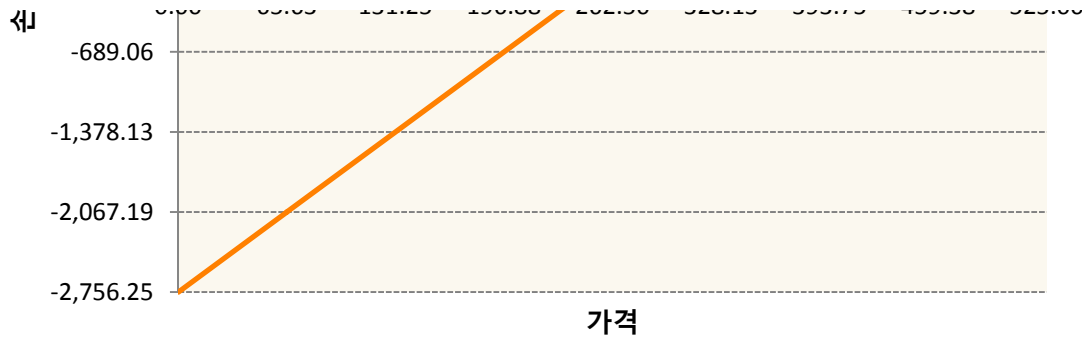
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

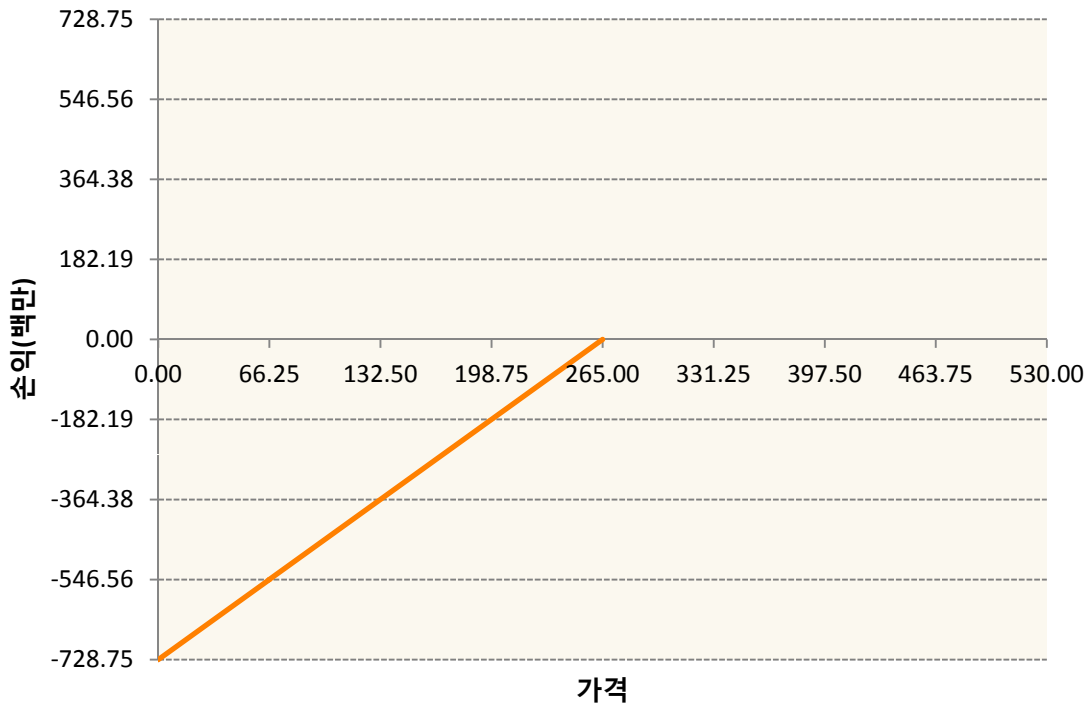


KR4301P72625-2019-07 풋262.5





KR4301P72658-2019-07 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	
KR4301P72625		2019-07 풋262.5						160
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-160	-160	-160	-160	-160	-160	-160
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
-2.67%	-12	-13	-13	-14	-14	-15	-16
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

KR4301P72658

2019-07 풋265

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%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
-2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-10	-10
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

205

공시일	2019-07-11
기준일	2019-07-10

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	16,526	0	16,526	
누계	통화	선도	0	18,315	-18,315	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		142
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		180
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		983
FX21019N01 KRW/USD 12-08-19E		161

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

(단위:백만원)

484

공시일	2019-07-11
기준일	2019-07-10

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	0	50	-50	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019N01 KRW/EUR 25-10-19E

4

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

(단위:백만원)

2

공시일	2019-07-11
기준일	2019-07-10

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

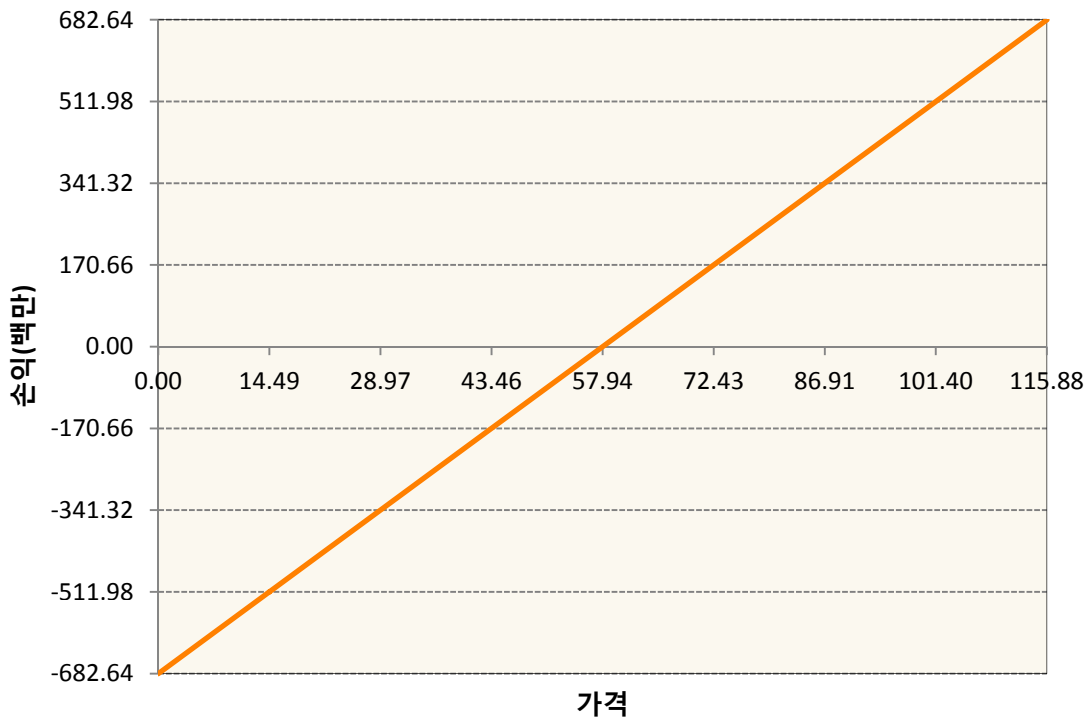
1. 계약금액

(단위:백만원)

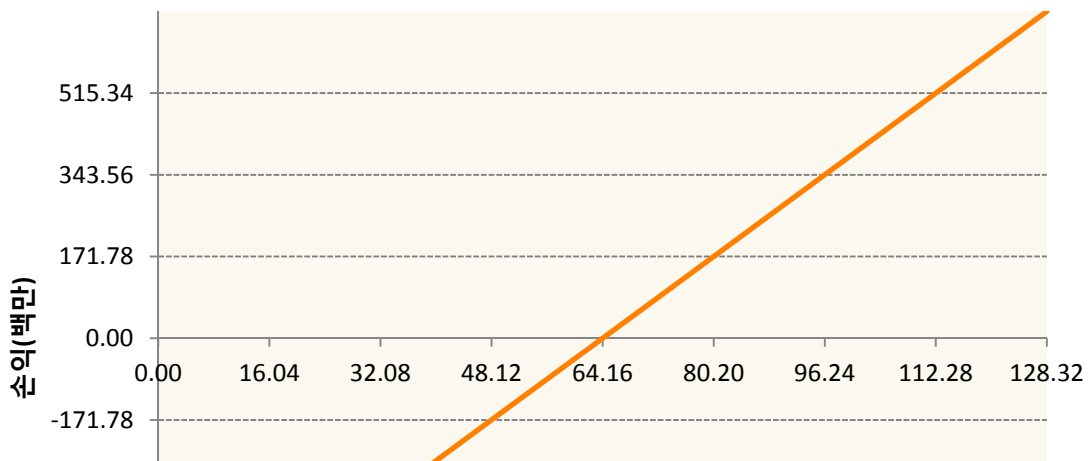
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,741	118	2,623	

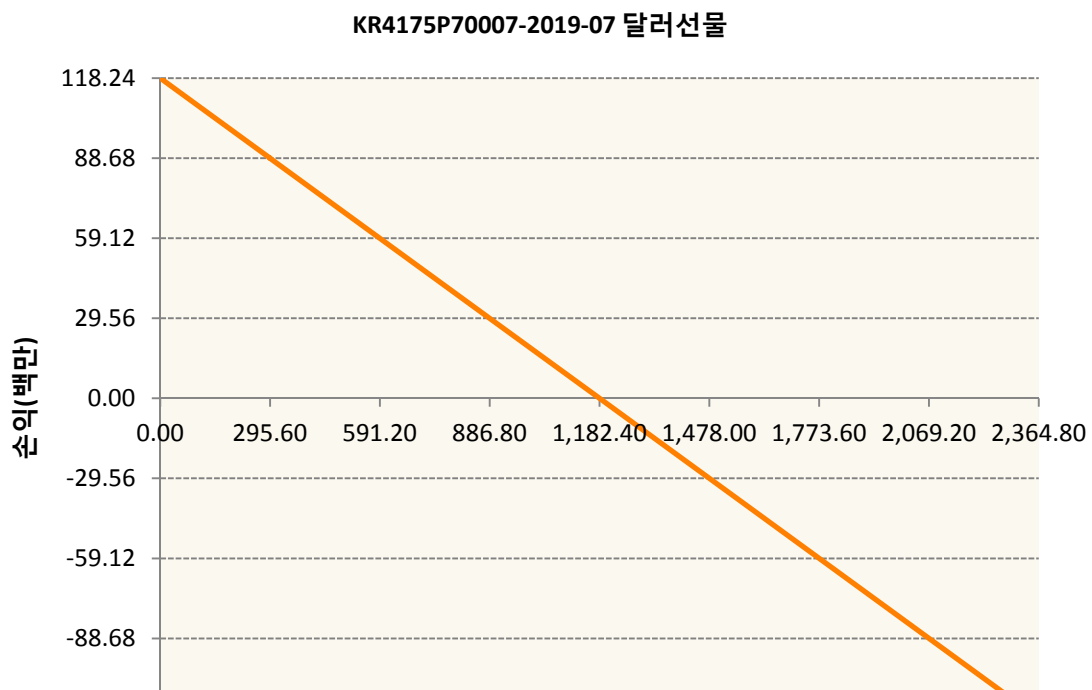
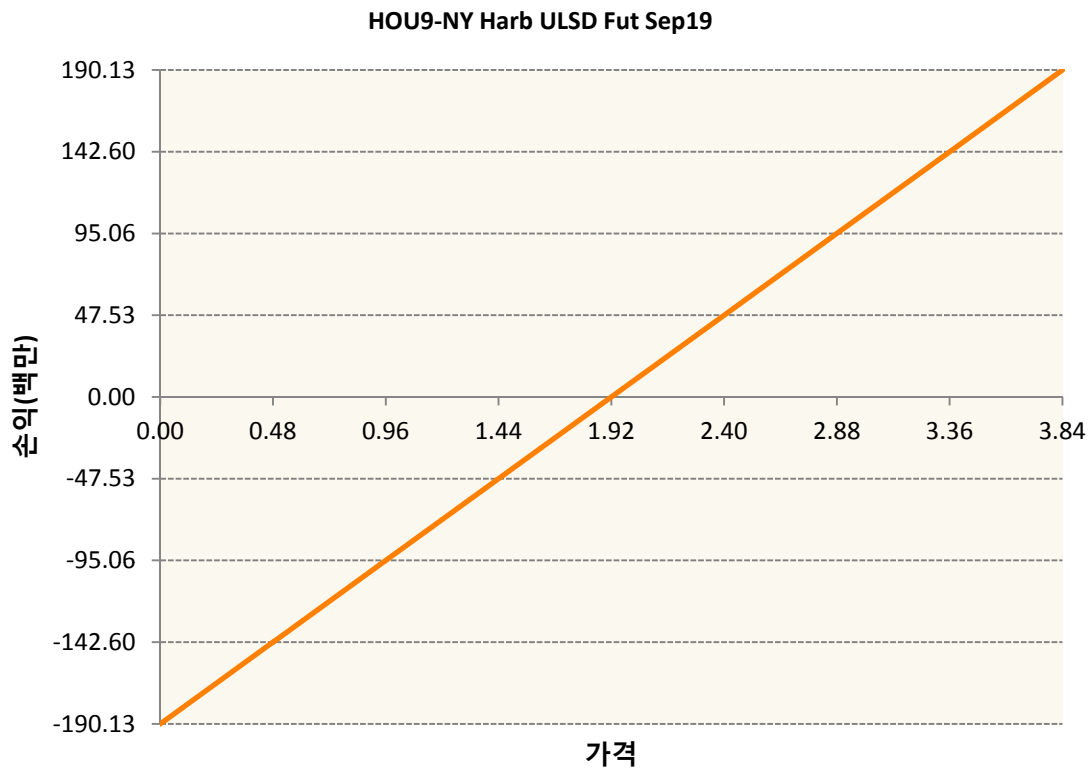
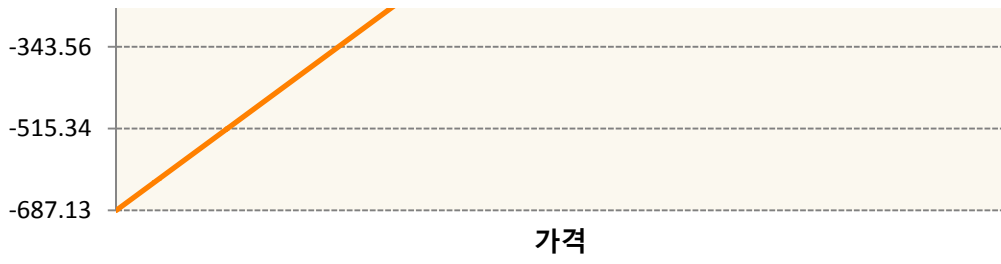
2. 만기시점의 손익구조

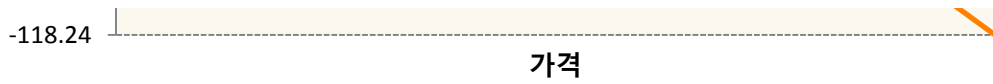
CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19



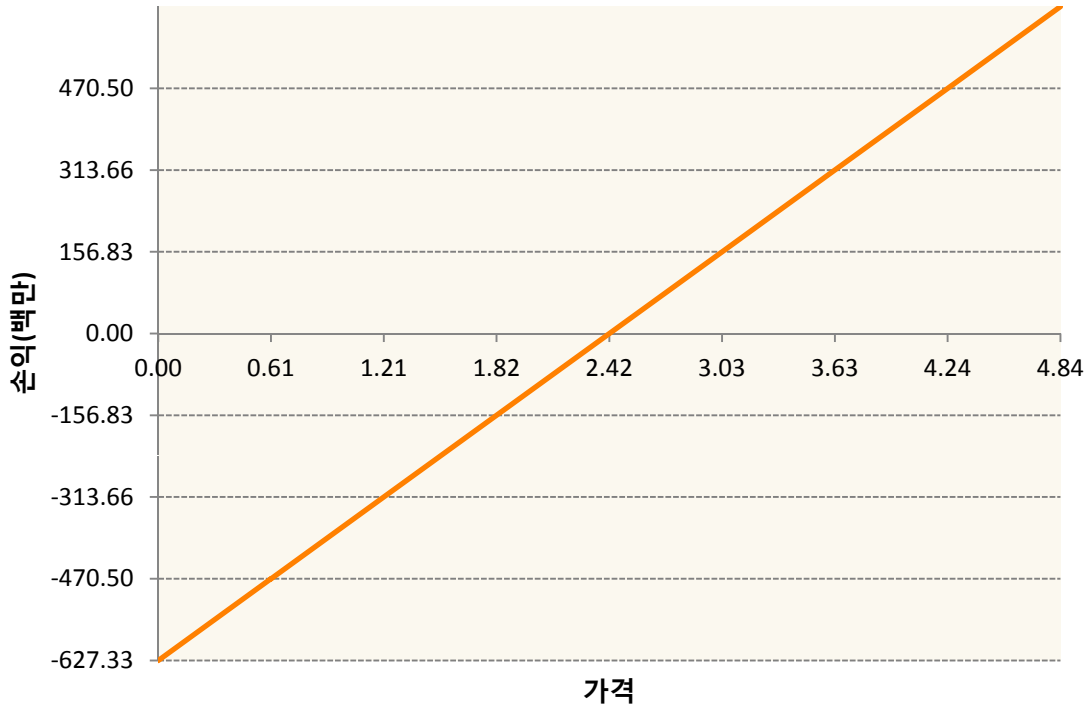
COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19



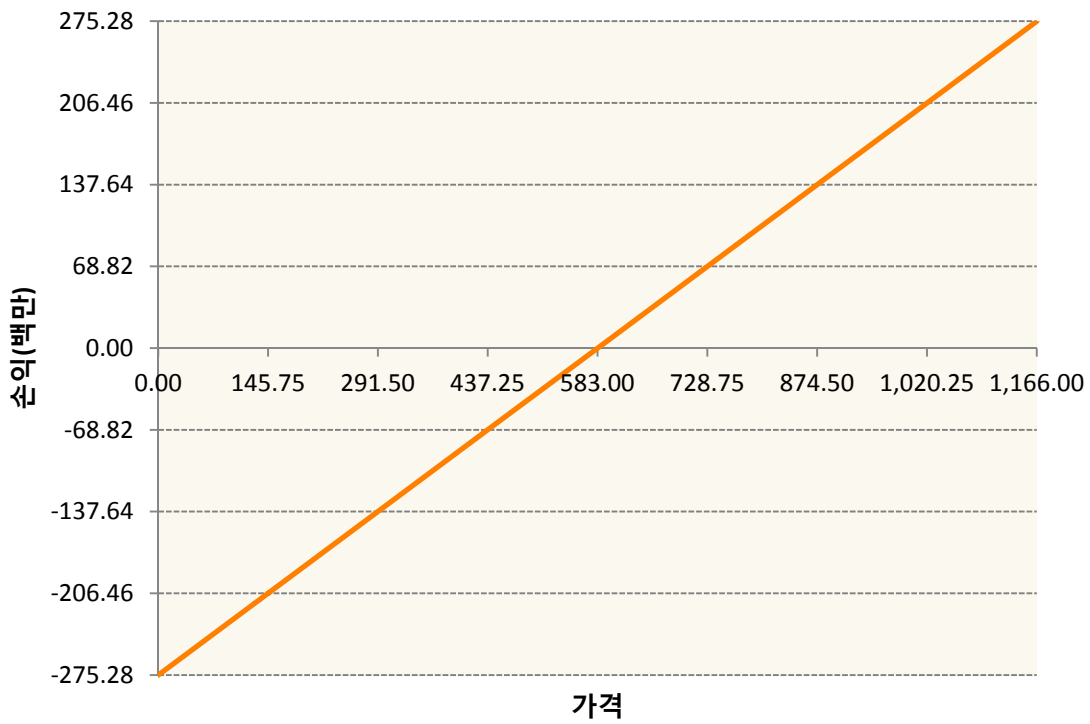




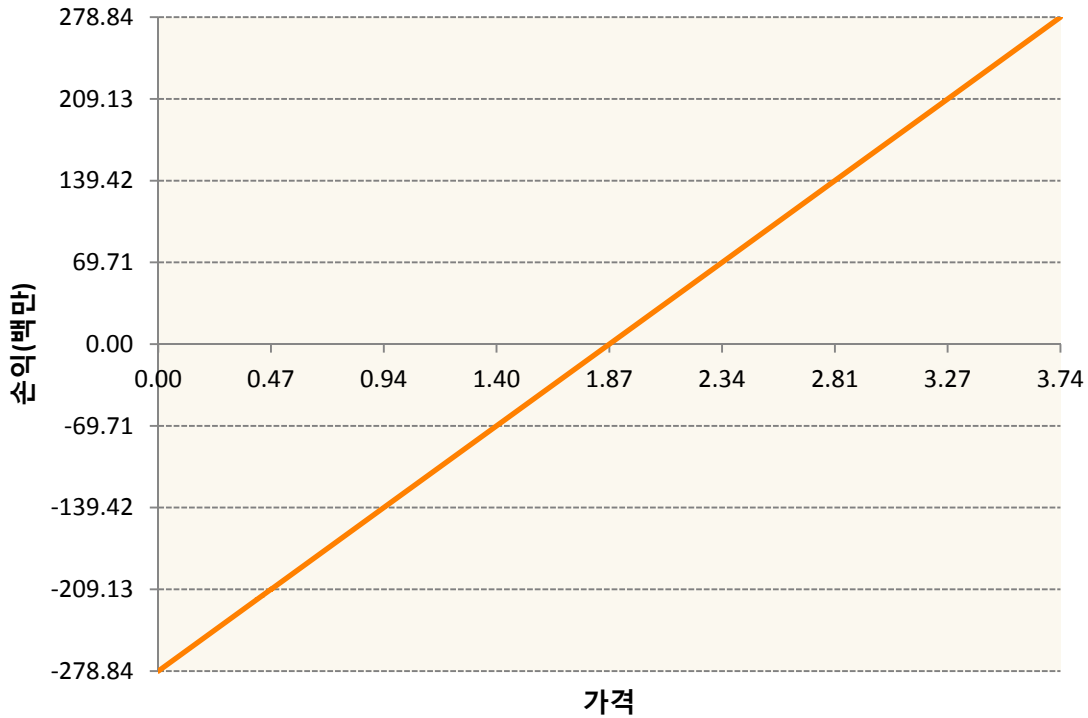
NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



QSU9-Low Su Gasoil G Sep19



XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	55
COU9	BRENT CRUDE FUTR Sep19	55
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	15
KR4175P700	2019-07 달러선물	9
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	50
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	22
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	22

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

406

공시일	2019-07-11
기준일	2019-07-10

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

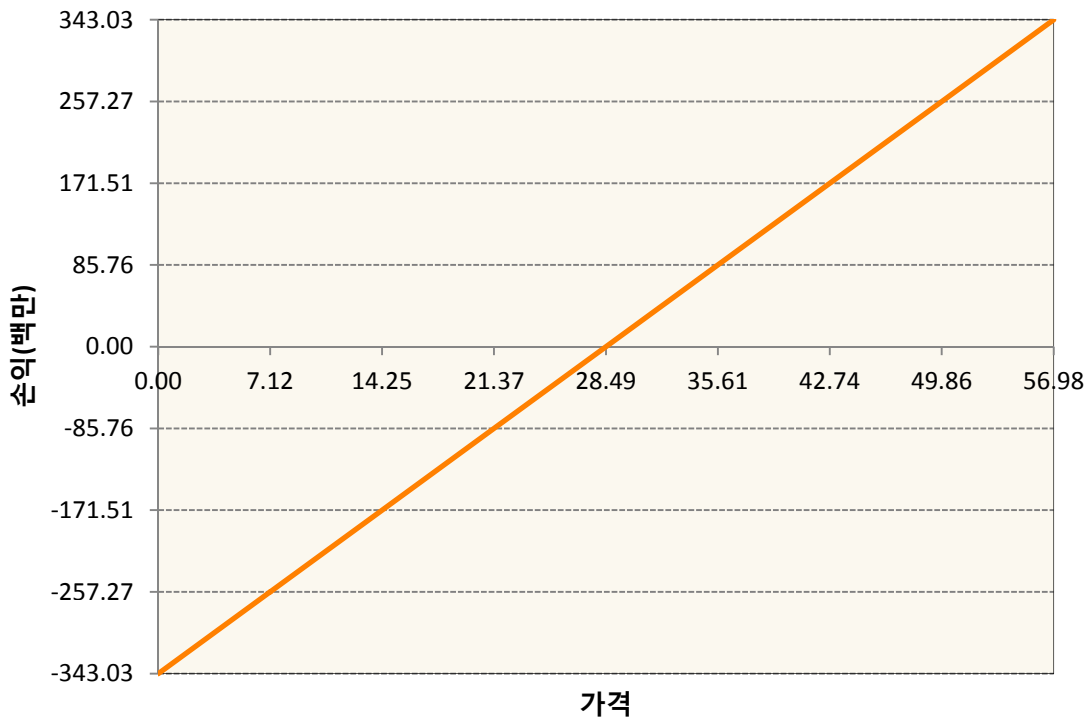
1. 계약금액

(단위:백만원)

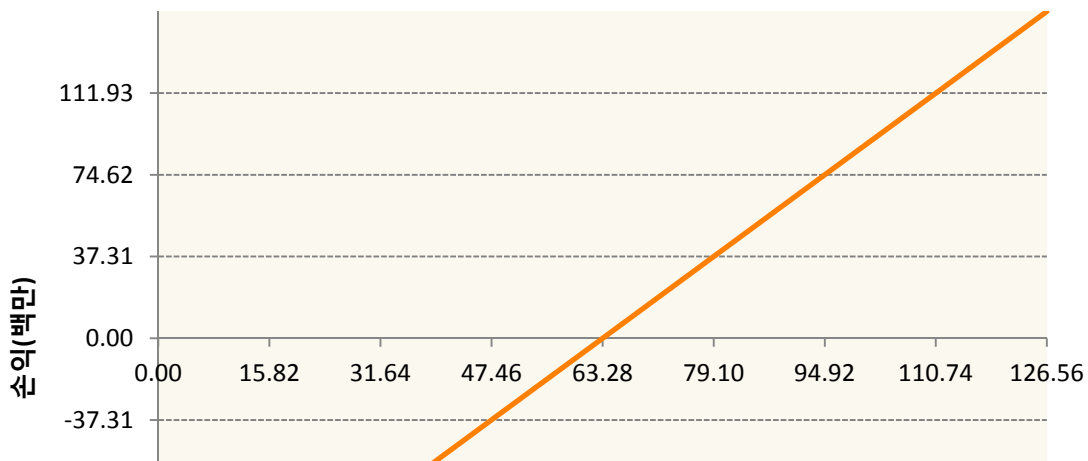
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,224	201	3,023	

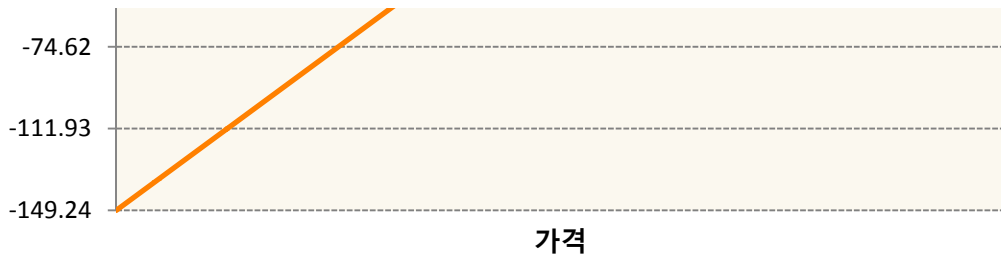
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

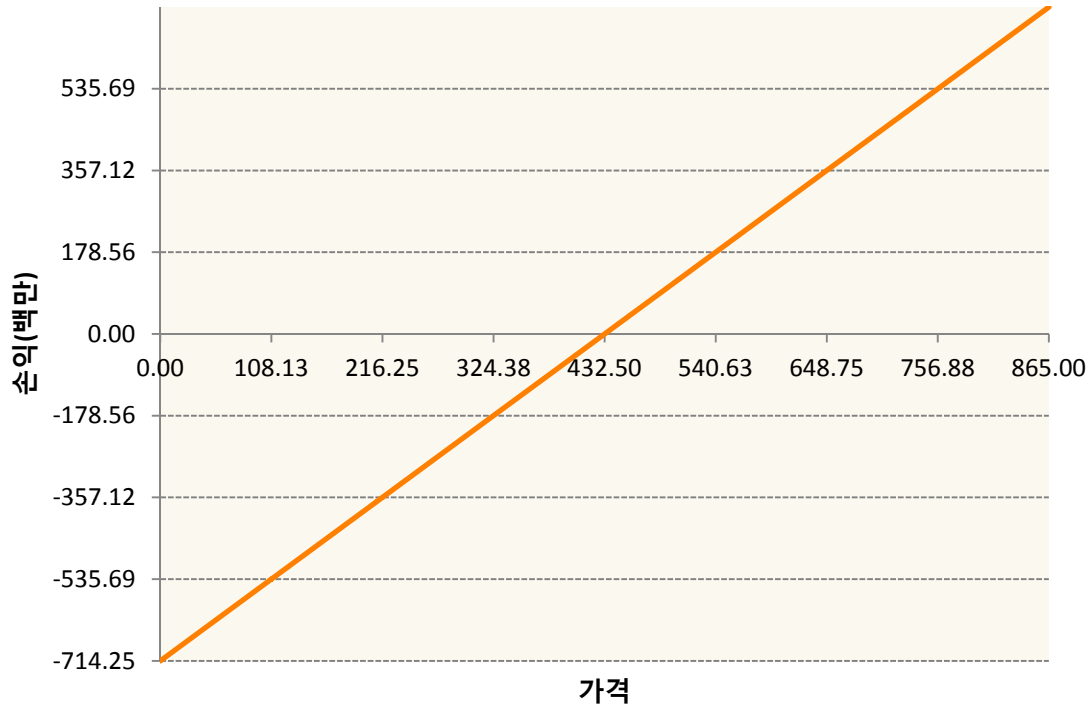


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

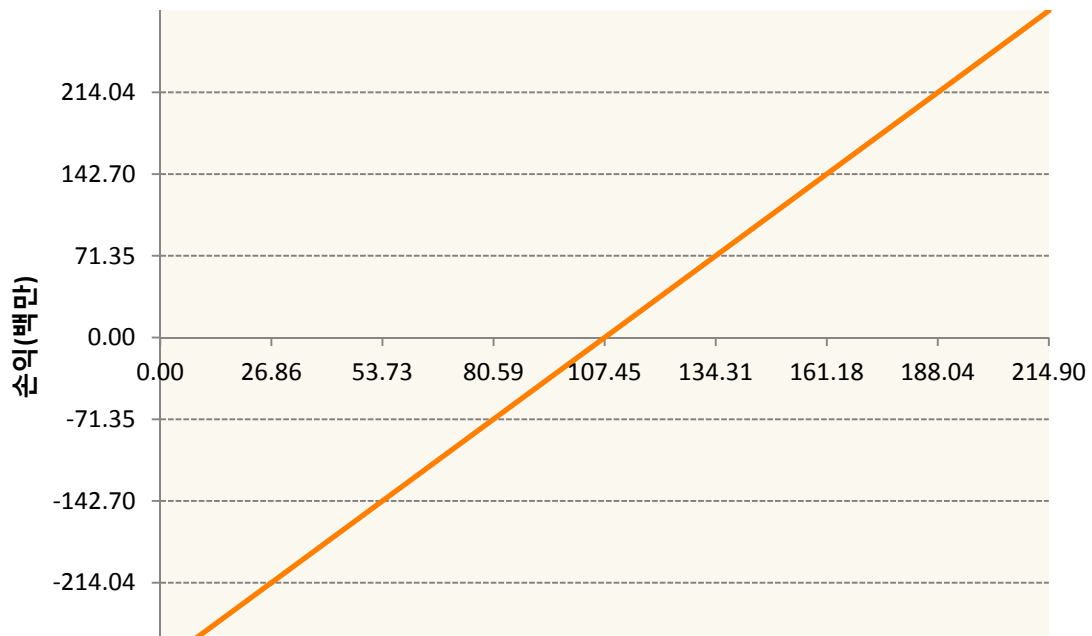


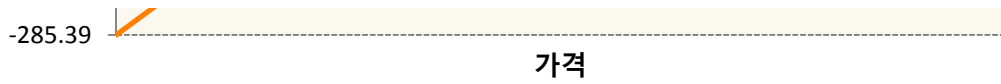


CU9-CORN FUTURE Sep19

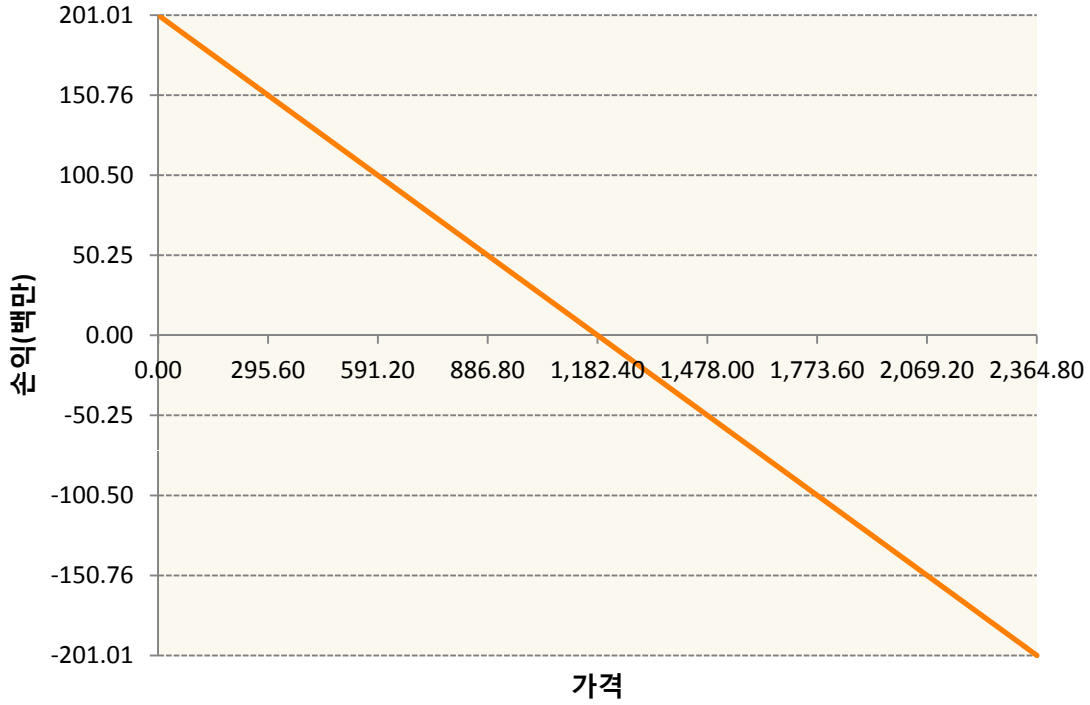


KCU9-COFFEE 'C' FUTURE Sep19

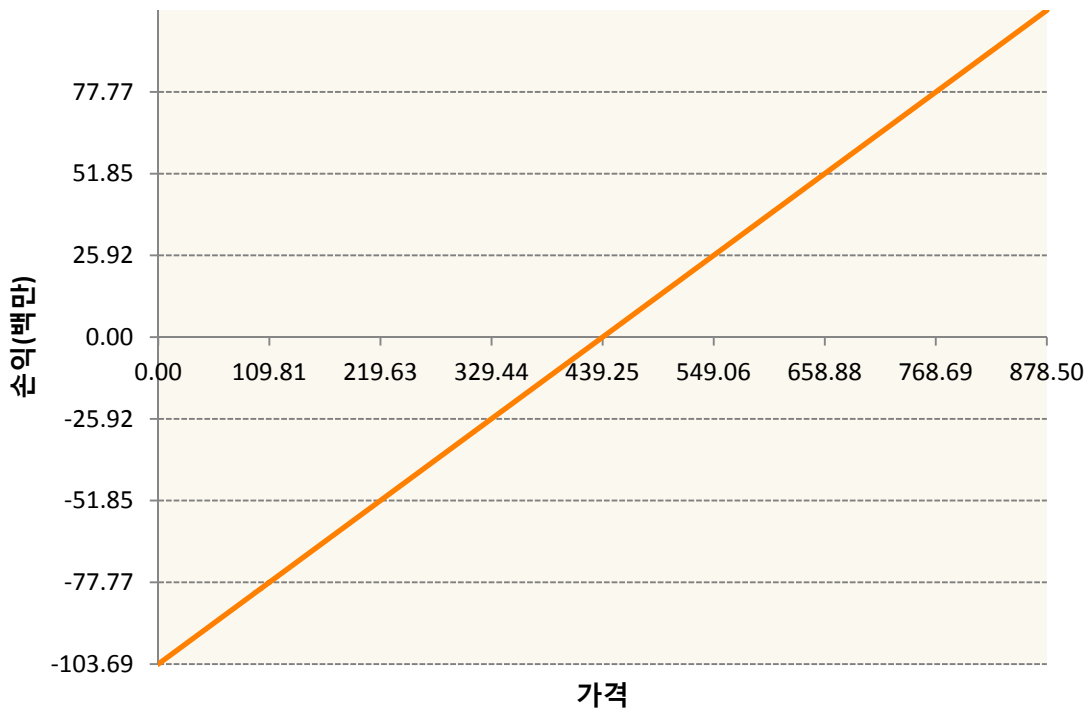




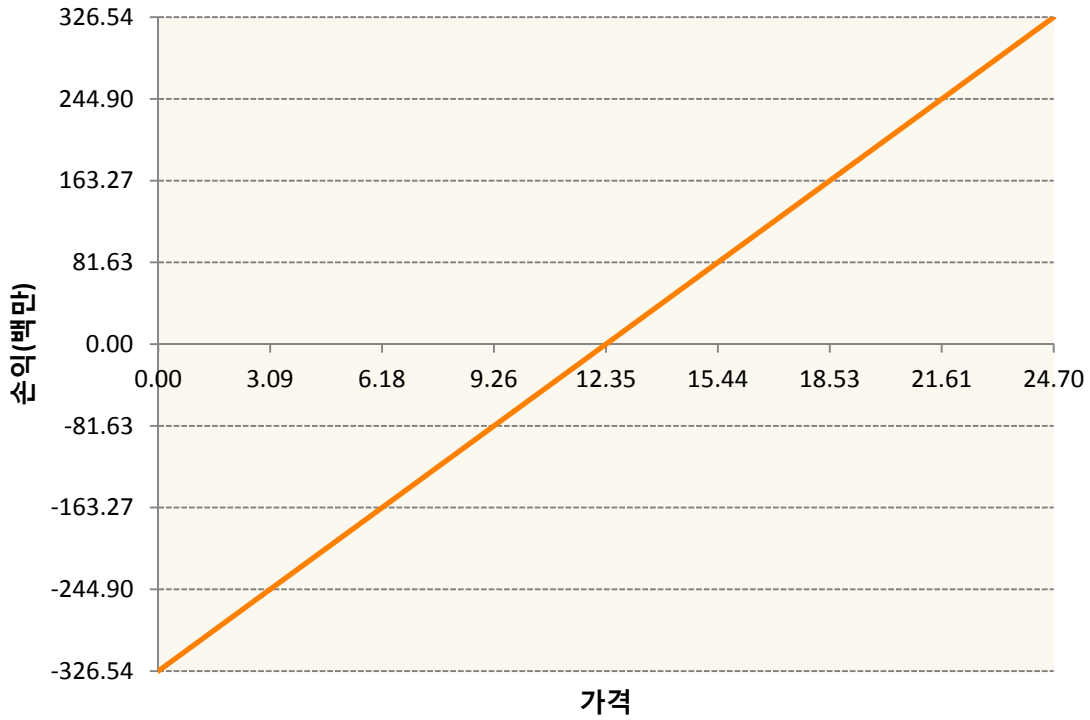
KR4175P70007-2019-07 달러선물



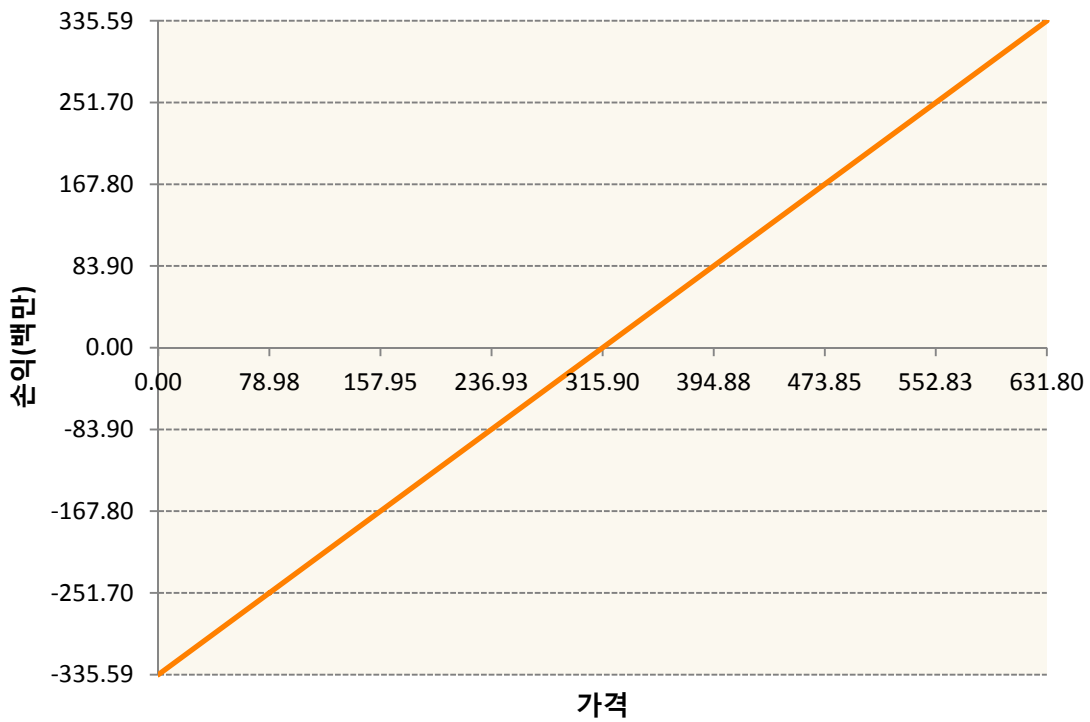
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

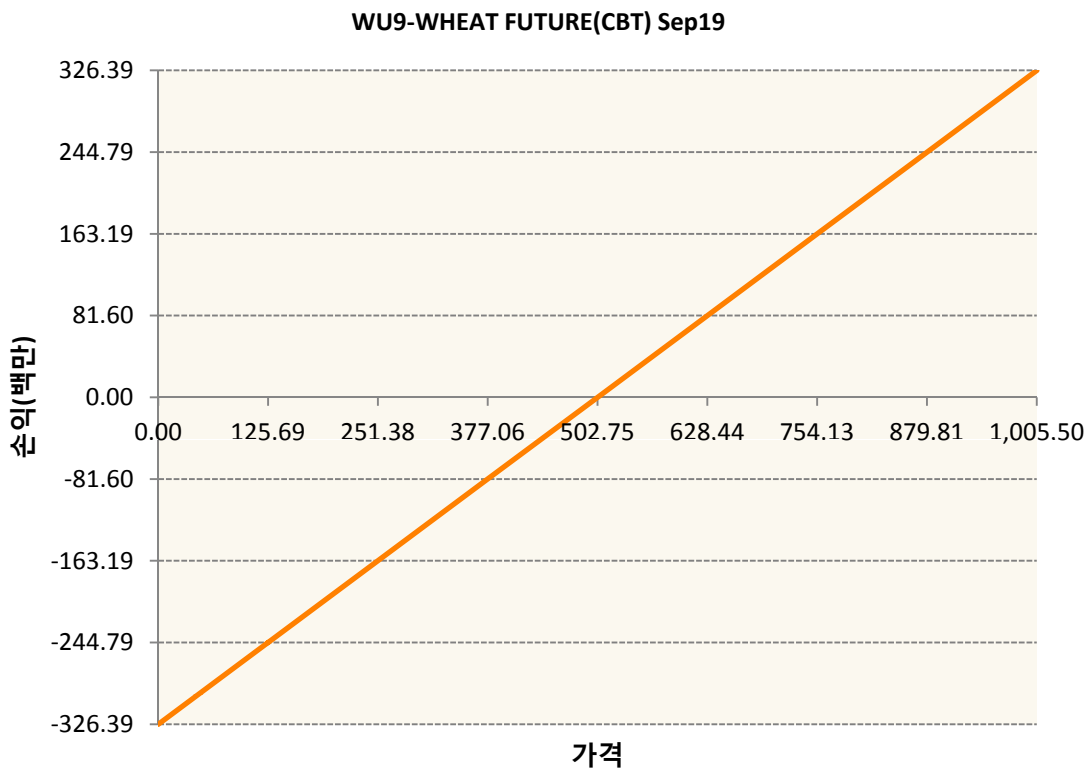
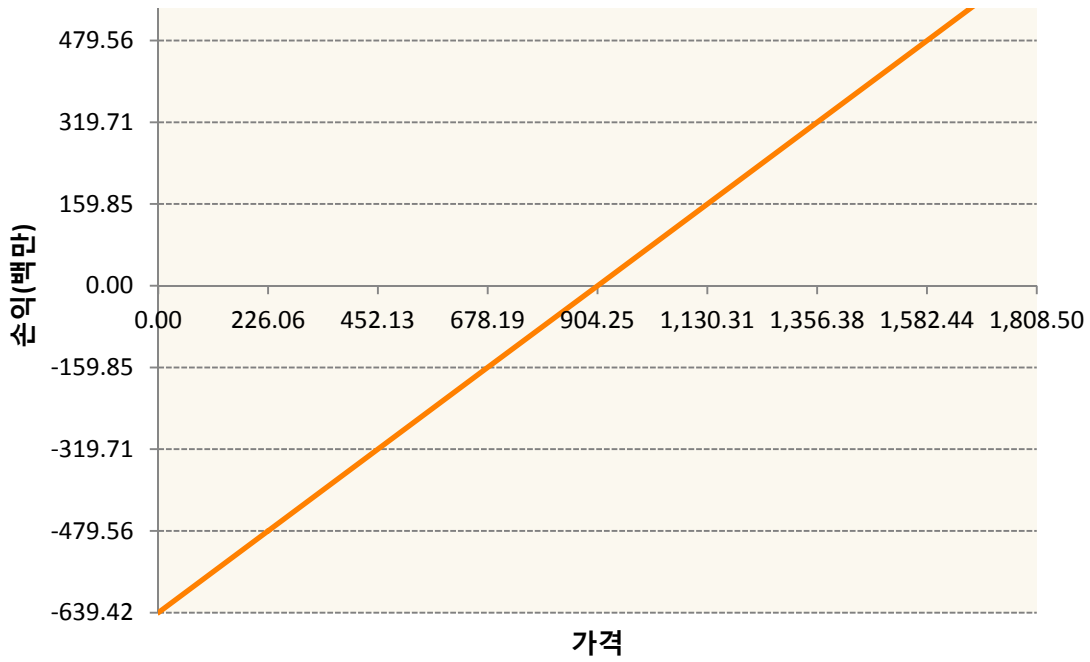


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	27
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	12
CU9	CORN FUTURE Sep19	57
KCU9	COFFEE 'C' FUTURE Sep19	23
KR4175P700	2019-07 달러선물	16

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

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

(단위:백만원)

283