

공시일	2019-07-12
기준일	2019-07-11

## 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	2019-07-12
기준일	2019-07-11

## 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

1,177

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

674

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-12
기준일	2019-07-11

## 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)

**840**

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-12
기준일	2019-07-11

## 유로인덱스모(주식-파생형)

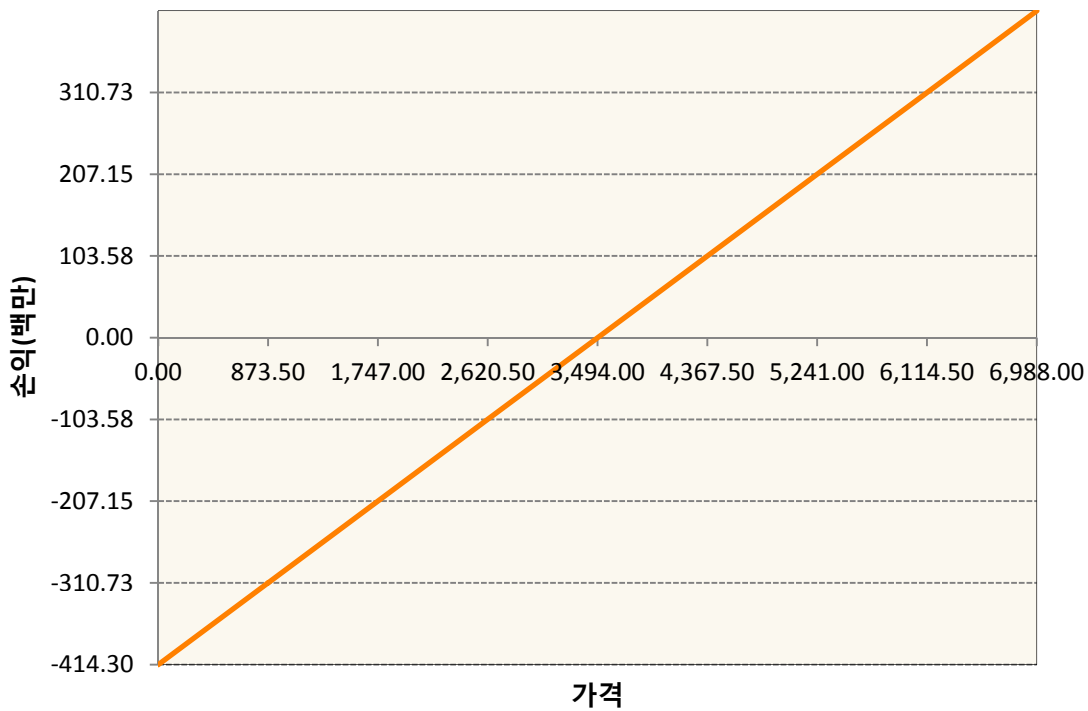
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	414	0	414	

### 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	2019-07-12
기준일	2019-07-11

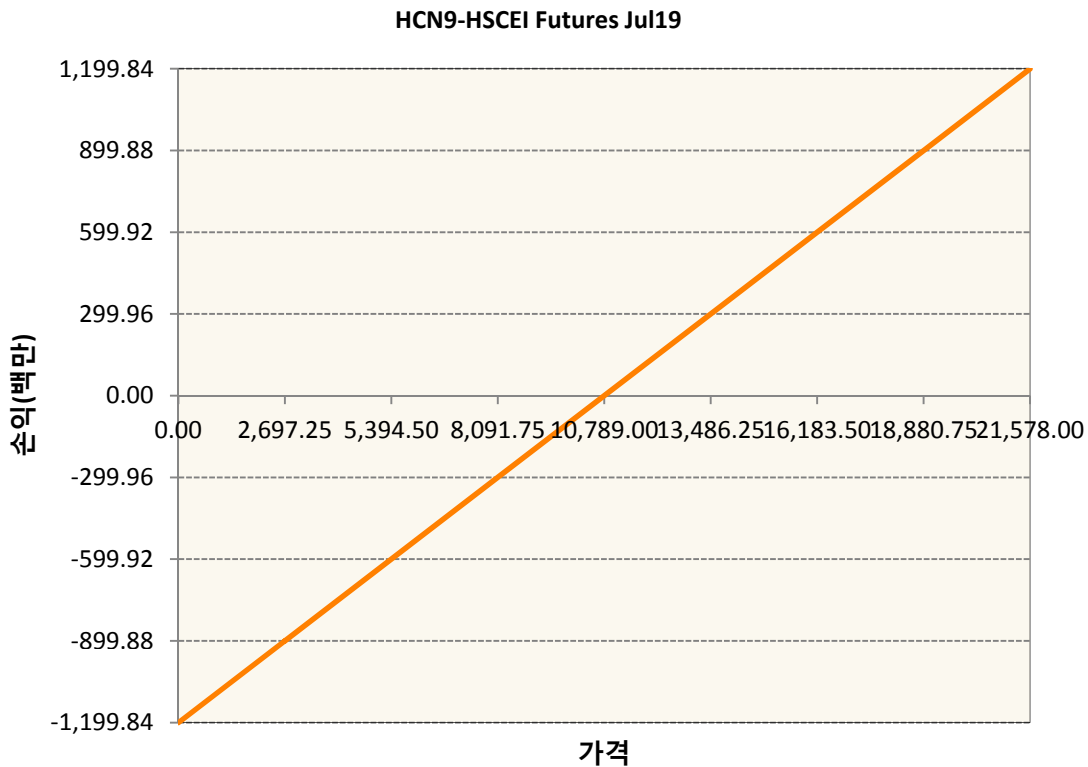
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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)

97
----

공시일	2019-07-12
기준일	2019-07-11

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

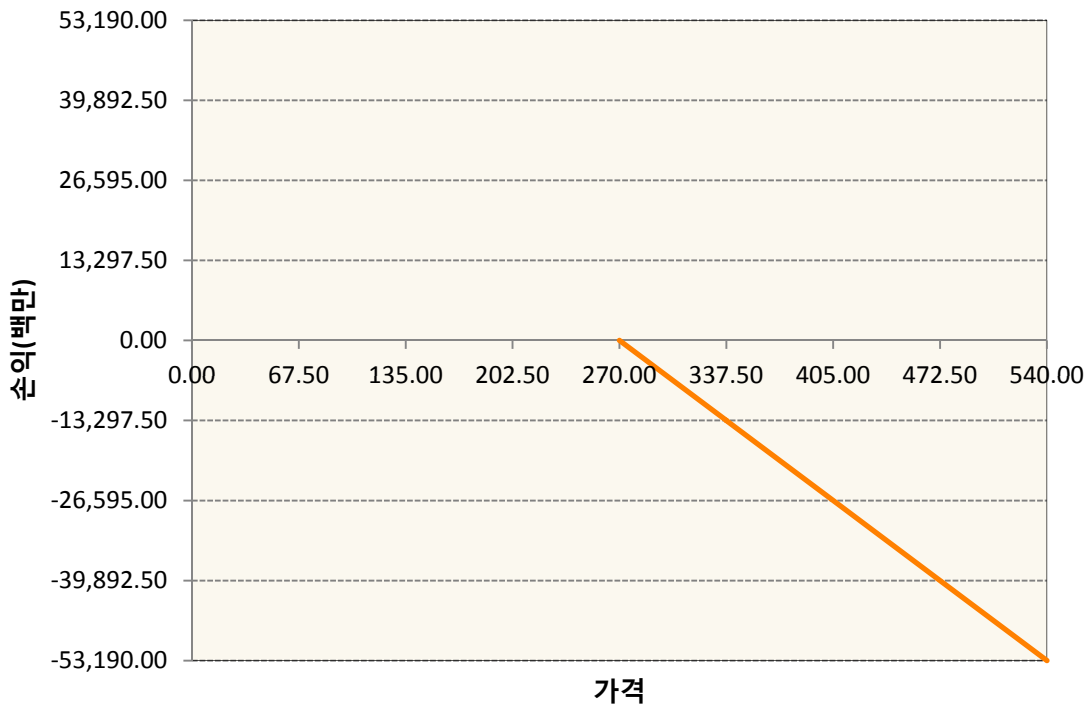
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

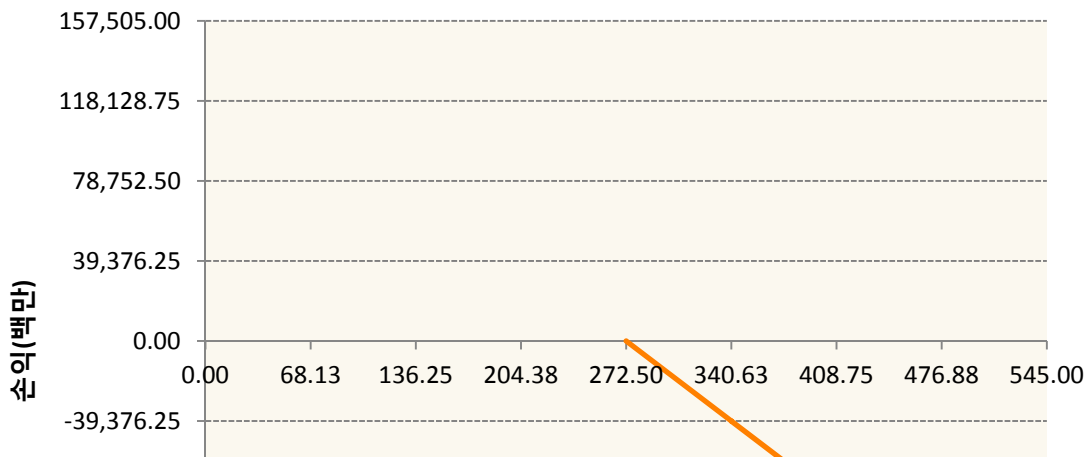
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	179,409	-179,409	장내
누계	유가증권	옵션	0	210,695	-210,695	장내

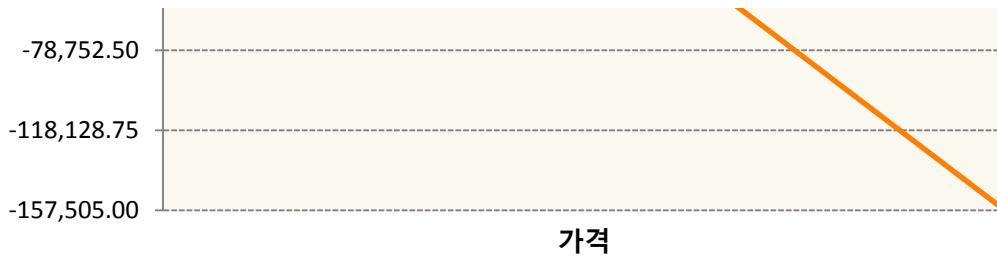
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P82709-2019-08 콜270



KR4201P82725-2019-08 콜272.5





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4201P82709		2019-08 콜270						3,390
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,568	1,524	1,470	1,410	1,342	1,270	1,192	
-5.33%	1,393	1,312	1,225	1,132	1,036	937	836	
-2.67%	1,017	904	789	673	556	438	320	
0%	369	246	123	0	-123	-246	-369	
2.67%	-560	-666	-775	-886	-999	-1,114	-1,230	
5.33%	-1,717	-1,790	-1,870	-1,957	-2,050	-2,146	-2,246	
8.00%	-3,019	-3,060	-3,111	-3,170	-3,237	-3,311	-3,390	
KR4201P82725		2019-08 콜272.5						9,499
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,968	3,865	3,738	3,586	3,415	3,224	3,018	
-5.33%	3,589	3,384	3,159	2,915	2,658	2,388	2,108	
-2.67%	2,709	2,399	2,081	1,757	1,427	1,094	757	
0%	1,091	728	364	0	-364	-728	-1,092	
2.67%	-1,358	-1,696	-2,039	-2,387	-2,737	-3,091	-3,446	
5.33%	-4,538	-4,791	-5,063	-5,349	-5,647	-5,955	-6,271	
8.00%	-8,229	-8,384	-8,566	-8,772	-8,998	-9,241	-9,499	

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

**12,347**

공시일	2019-07-12
기준일	2019-07-11

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

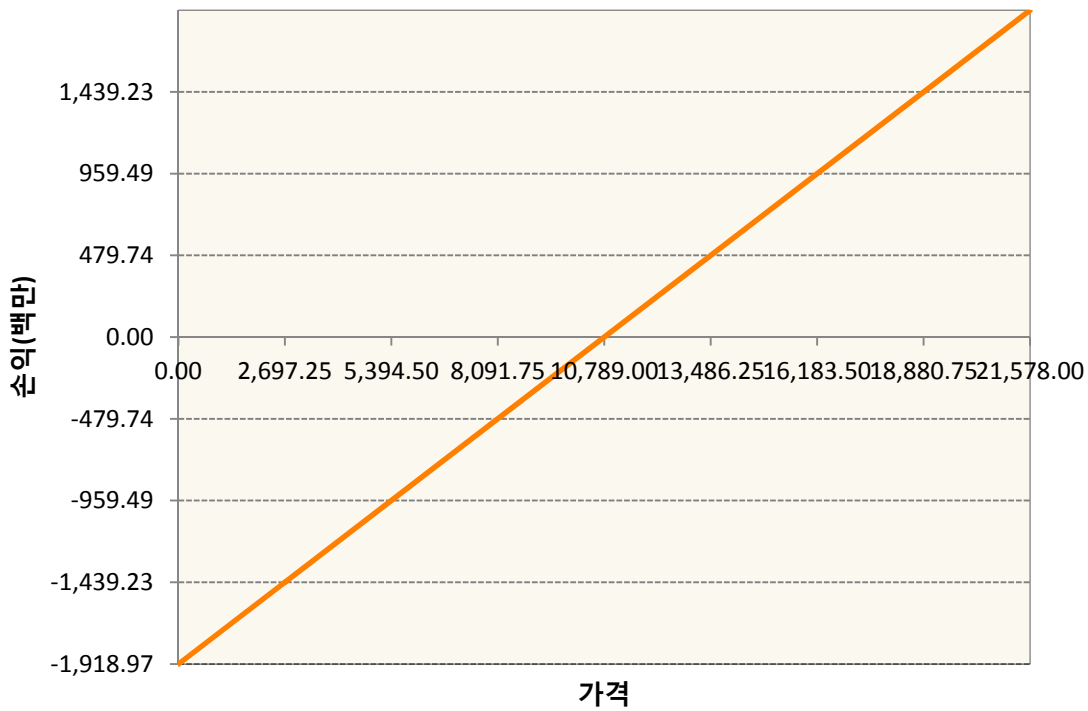
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

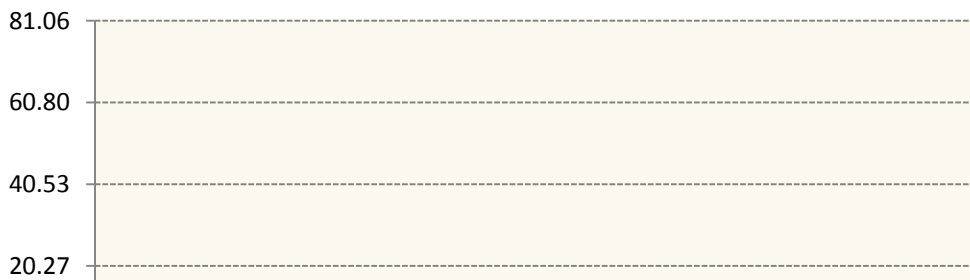
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,919	0	1,919	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,235	-5,235	장내
누계	통화	선도	150	3,153	-3,003	장외

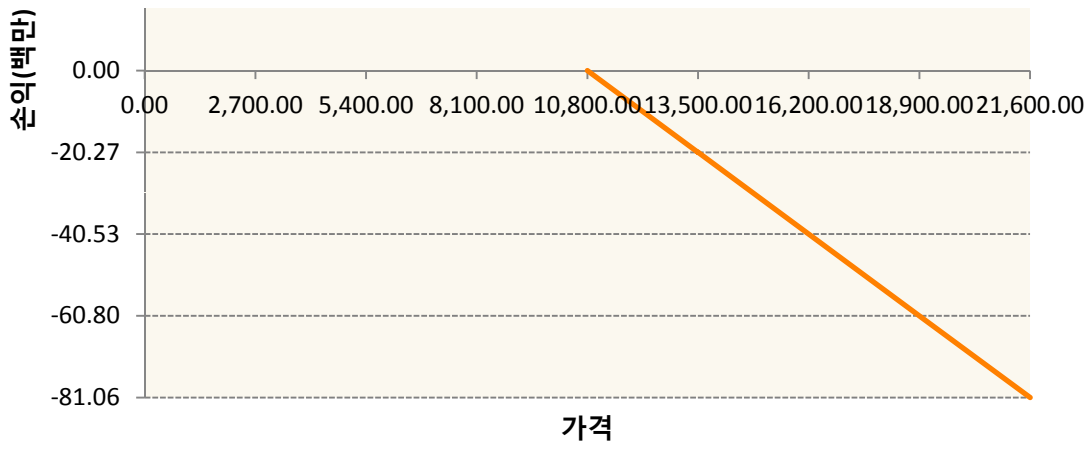
### 2. 만기시점의 손익구조

HCN9-HSCEI Futures Jul19

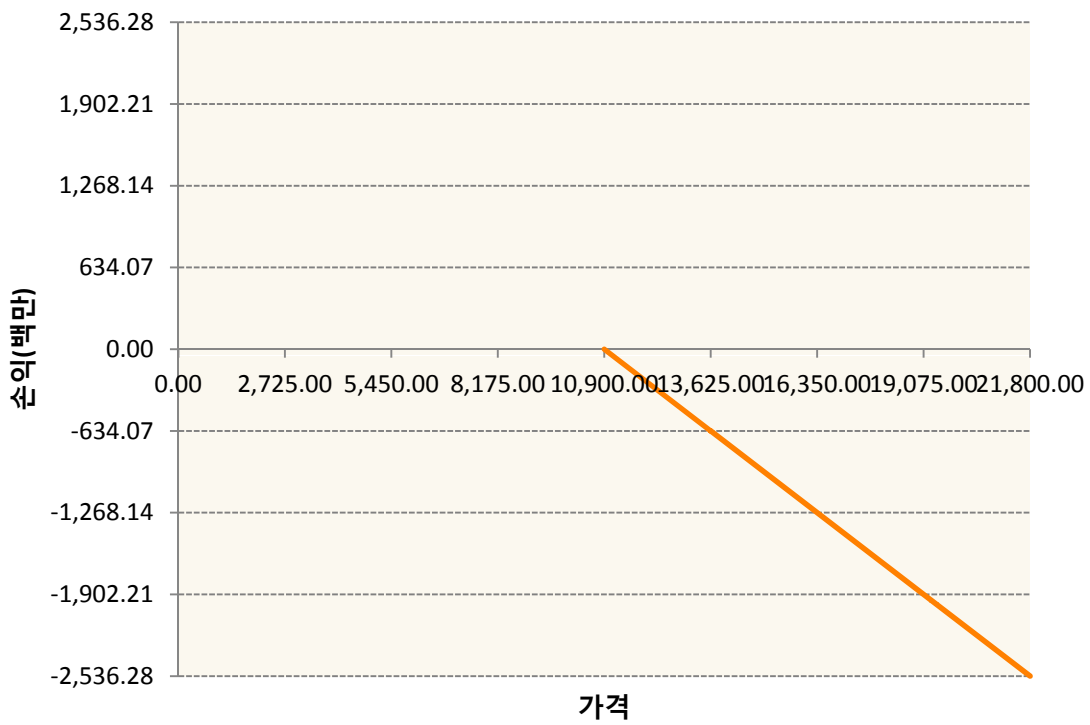


OHHIN9-C108-HSCEI

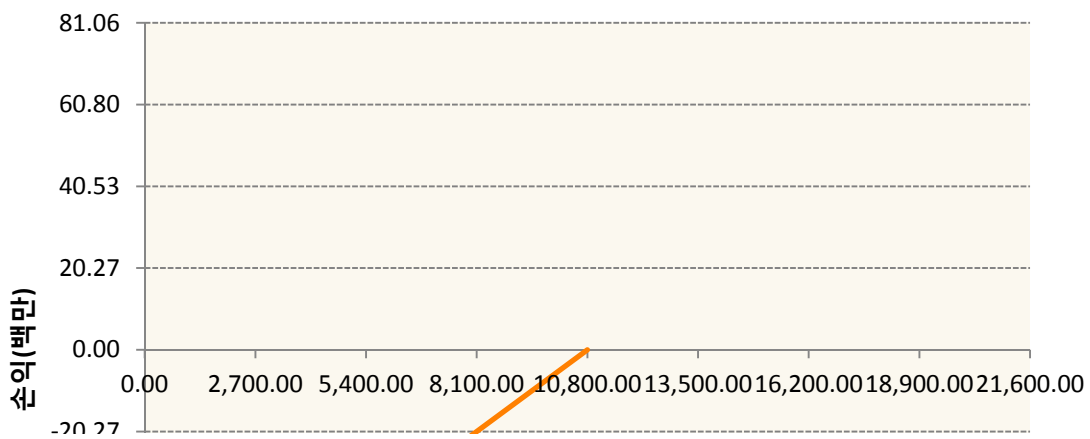


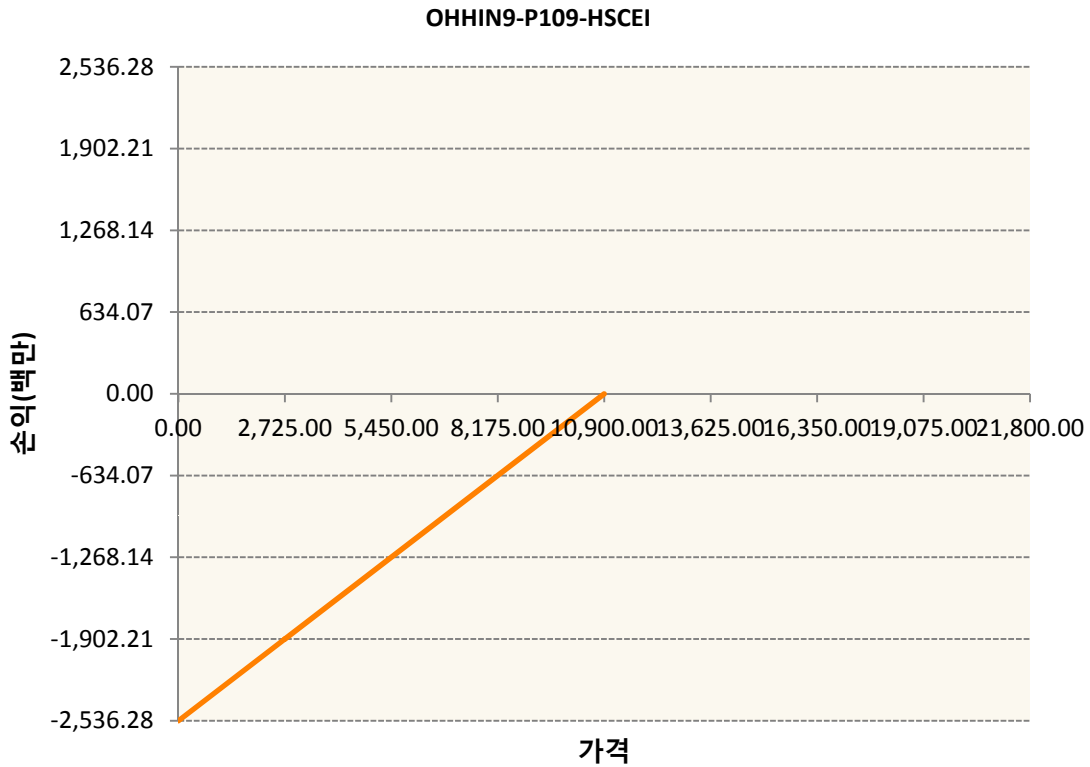
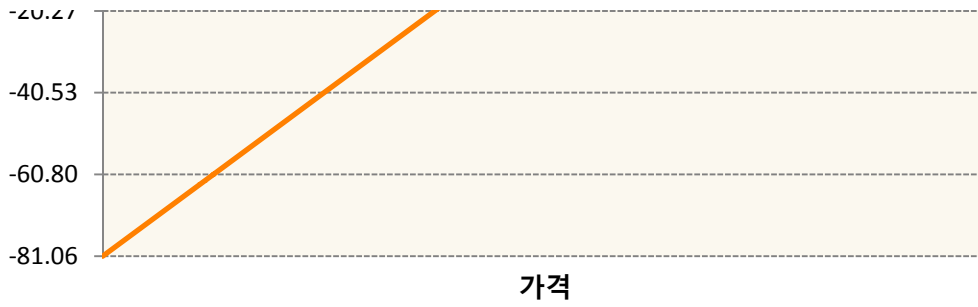


OHHIN9-C109-HSCEI



OHHIN9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	252
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E	12
HCN9 HSCEI Futures Jul19	154
OHHIN9-C1(HSCEI	6
OHHIN9-C1(HSCEI	203
OHHIN9-P1(HSCEI	6
OHHIN9-P1(HSCEI	203

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	665



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							304
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-304	-304	-304	-304	-304	-304	-304
-5.33%	-203	-203	-203	-203	-203	-203	-203
-2.67%	-101	-101	-101	-101	-101	-101	-101
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	101	101	101	101	101	101	101
5.33%	203	203	203	203	203	203	203
8.00%	304	304	304	304	304	304	304

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

(단위:백만원)

2,056

공시일	2019-07-12
기준일	2019-07-11

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

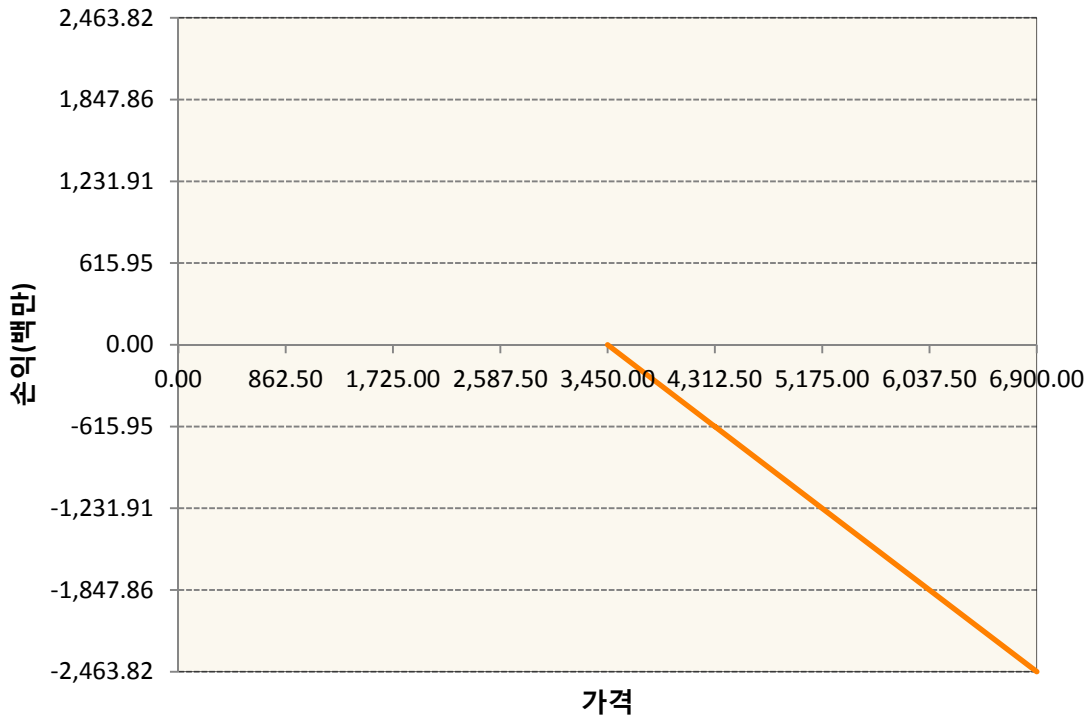
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

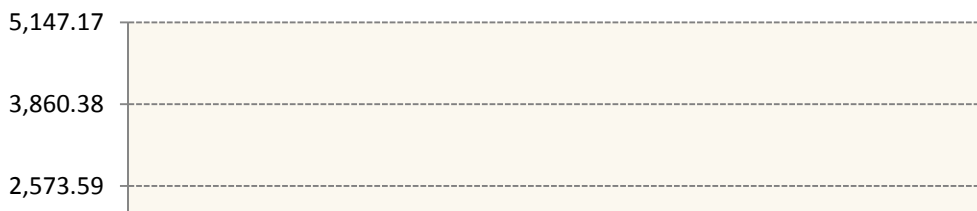
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	7	-7	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,661	0	4,661	
누계	유가증권	스왑	46,808	0	46,808	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,222	-15,222	장내
누계	통화	선도	5,290	22,483	-17,193	장외

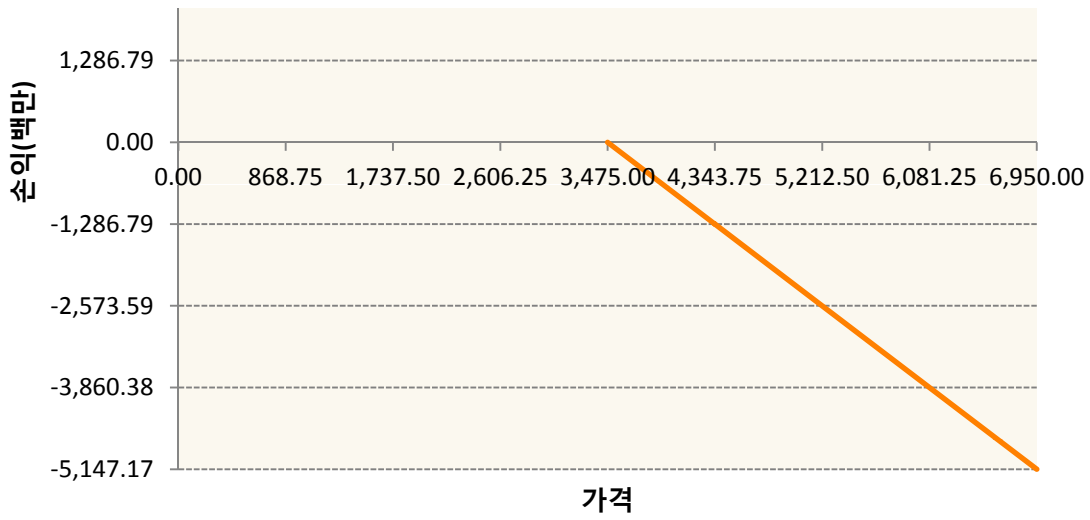
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXN9-C3450-EURO STOXX 50

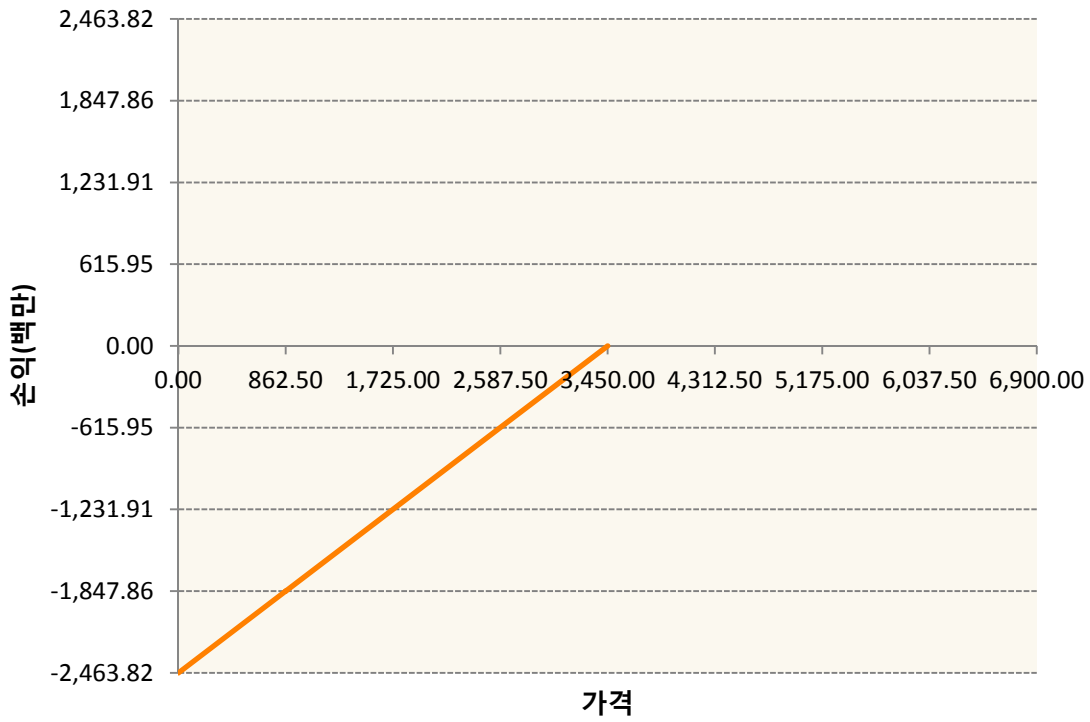


OESXN9-C3475-EURO STOXX 50

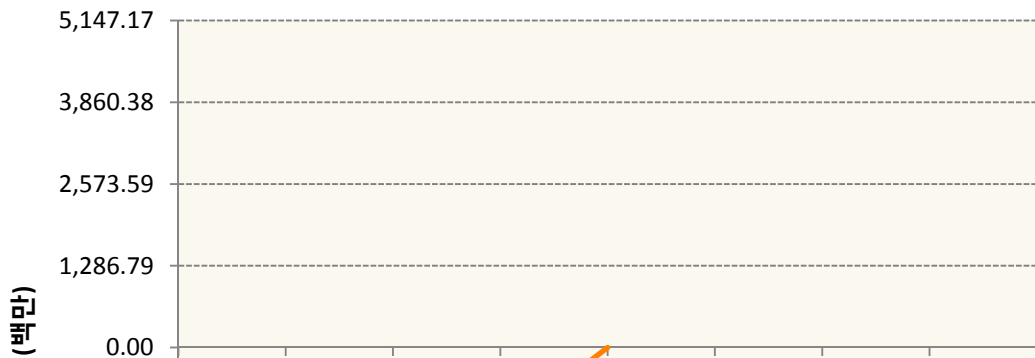


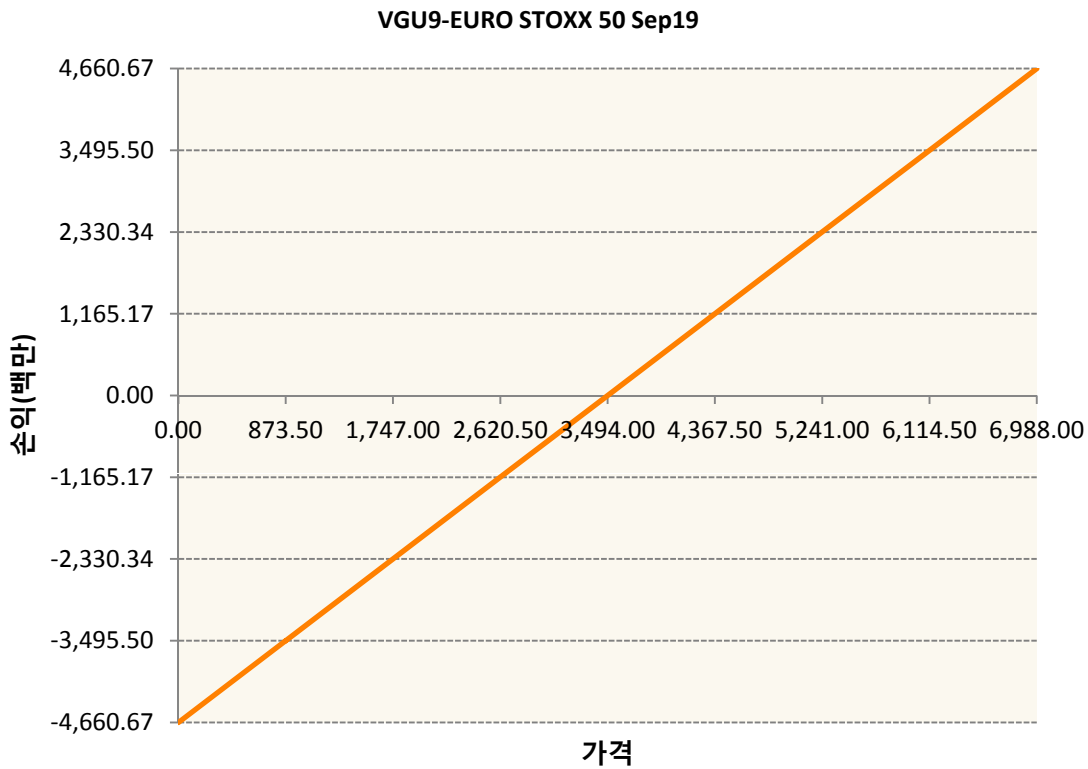
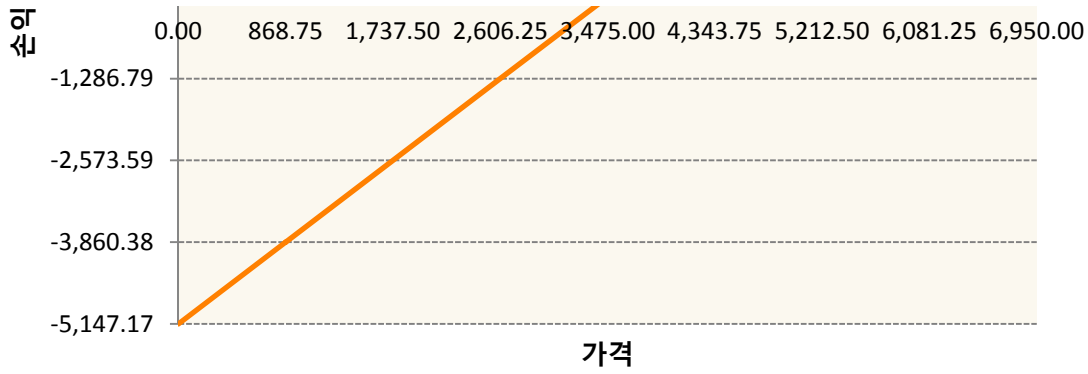


OESXN9-P3450-EURO STOXX 50



OESXN9-P3475-EURO STOXX 50





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)**

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	80
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	423
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E	1,058
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	317
FX21019N01 EUR/KRW 23-08-19E	423
OESXN9-C34 EURO STOXX 50	197
OESXN9-C34 EURO STOXX 50	412
OESXN9-P34 EURO STOXX 50	197
OESXN9-P34 EURO STOXX 50	412
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	373

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

(단위:백만원)

2,232



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

(단위:백만원)

1,023



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

(단위:백만원)

86



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

(단위:백만원)

131

공시일	2019-07-12
기준일	2019-07-11

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

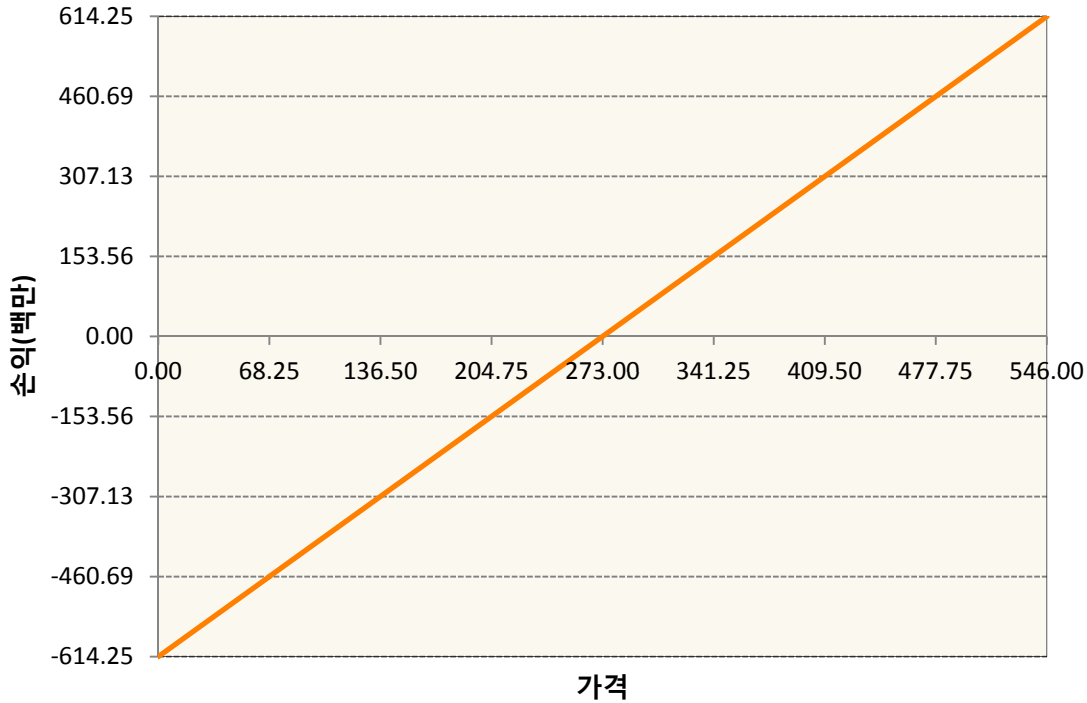
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	614	0	614	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	2019-07-12
기준일	2019-07-11

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

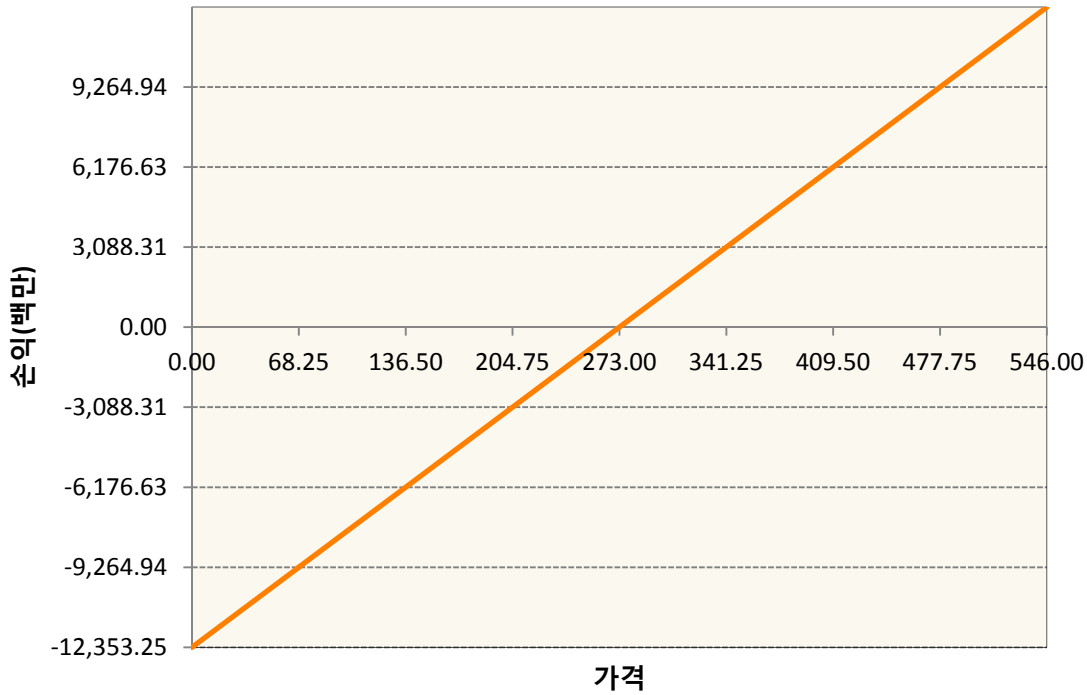
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

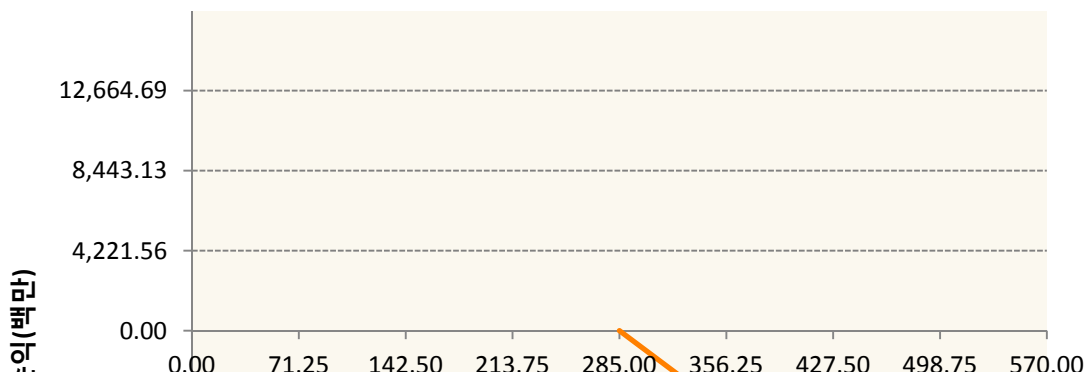
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	1,545	22,301	-20,756	장내
누계	유가증권	선물	12,353	0	12,353	장내
누계	유가증권	옵션	1,564	22,277	-20,713	장내

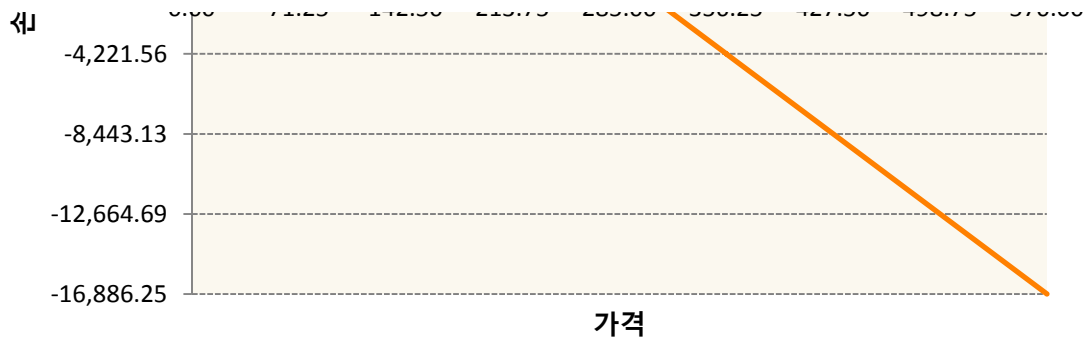
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

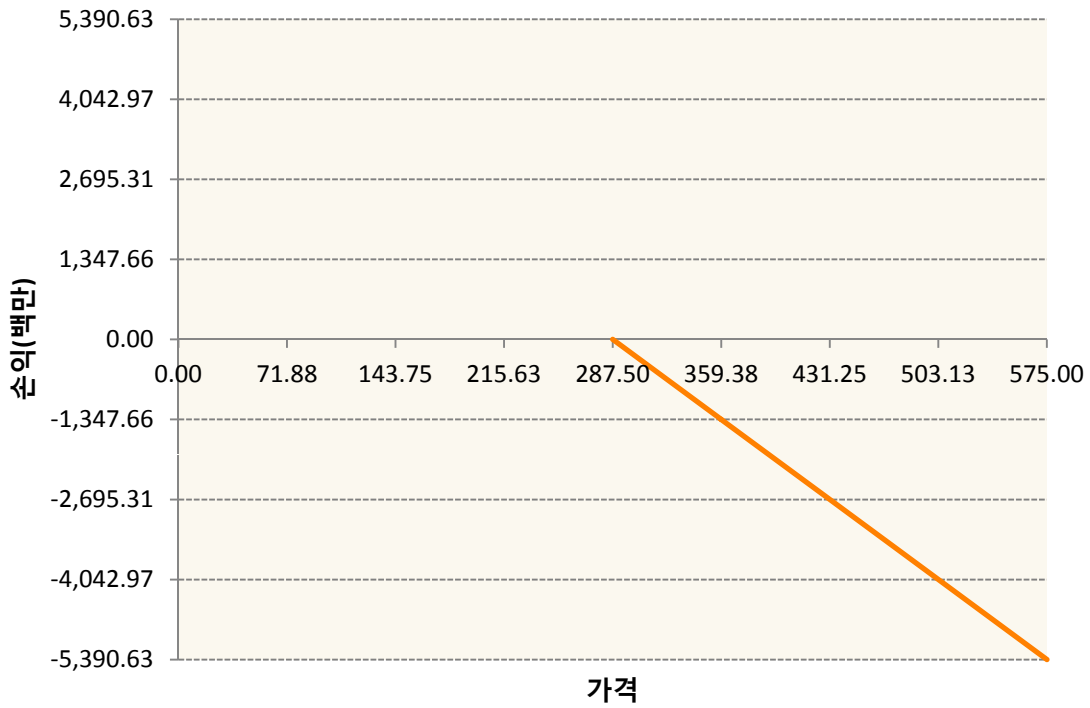


KR4201P82857-2019-08 콜285

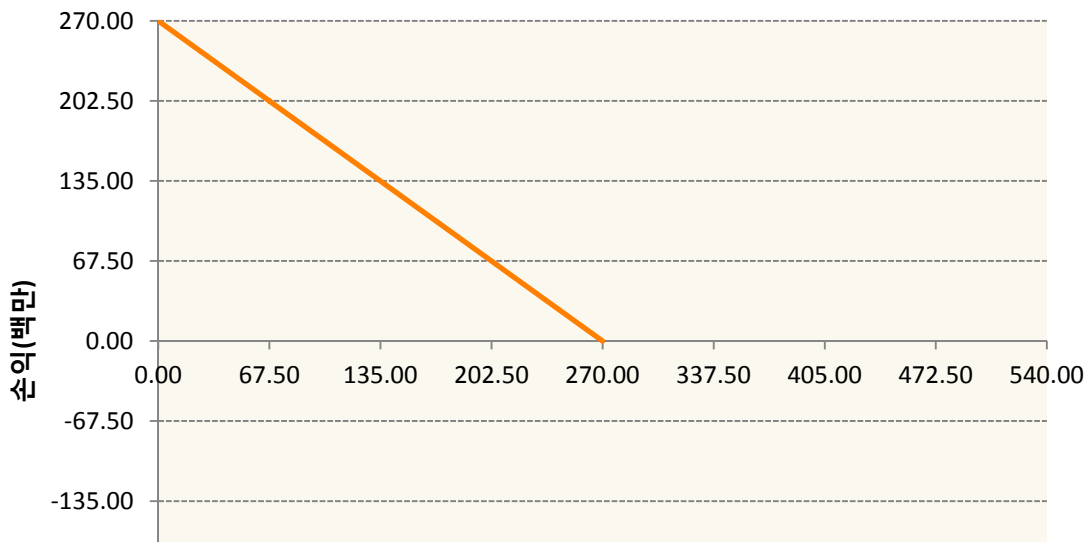


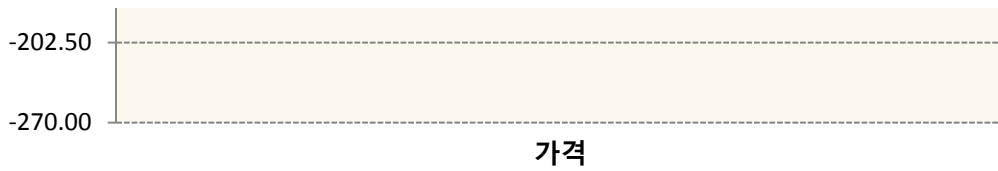


KR4201P82873-2019-08 콜287.5

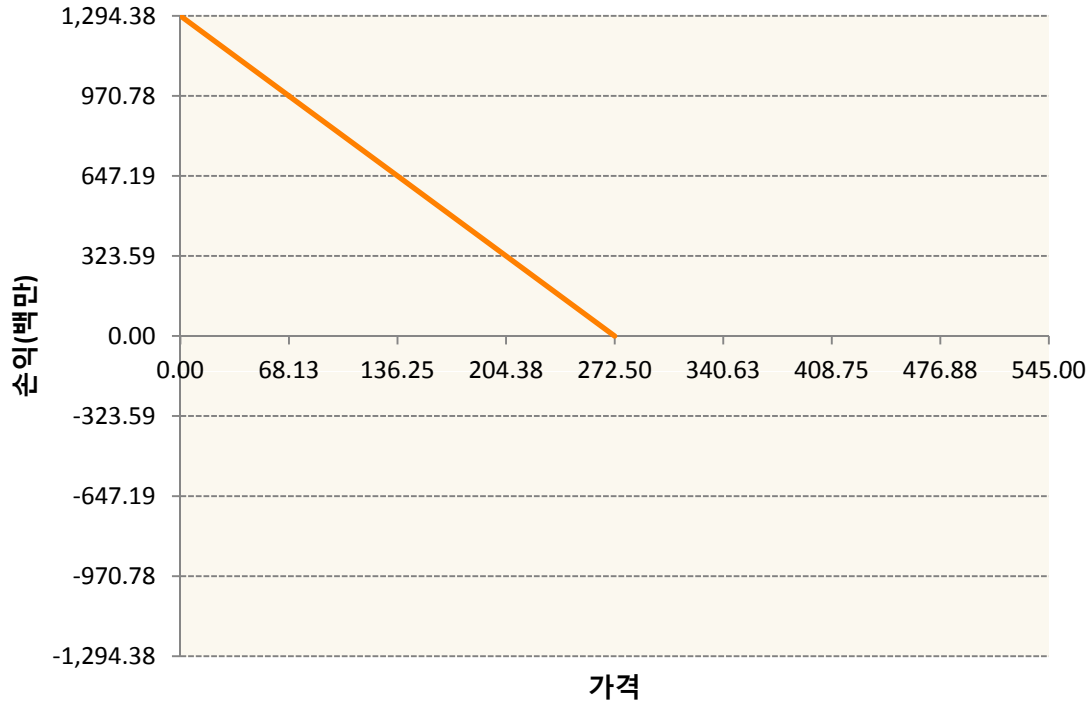


KR4301P82707-2019-08 풋270





KR4301P82723-2019-08 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						984
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-984	-984	-984	-984	-984	-984	-984	
-5.33%	-656	-656	-656	-656	-656	-656	-656	
-2.67%	-328	-328	-328	-328	-328	-328	-328	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	328	328	328	328	328	328	328	
5.33%	656	656	656	656	656	656	656	
8.00%	984	984	984	984	984	984	984	
KR4201P82857		2019-08 콜285						708
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	166	164	160	155	148	139	128	
-5.33%	160	153	144	133	119	103	86	
-2.67%	139	124	106	86	64	40	15	

0%	84	58	29	0	-31	-62	-95
2.67%	-29	-65	-102	-138	-175	-212	-250
5.33%	-220	-259	-298	-337	-376	-415	-454
8.00%	-491	-526	-561	-597	-634	-671	-708
KR4201P82873                      2019-08 콜287.5							206
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	43	42	41	40	38	36	33
-5.33%	41	40	38	35	31	27	22
-2.67%	37	33	28	23	17	10	2
0%	23	16	8	0	-9	-18	-28
2.67%	-5	-16	-27	-38	-49	-61	-72
5.33%	-57	-69	-82	-94	-107	-119	-131
8.00%	-134	-146	-158	-170	-182	-194	-206
KR4301P82707                      2019-08 풋270							17
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17	17	17	17	17	17	17
-5.33%	10	10	10	10	10	10	10
-2.67%	3	4	4	4	4	5	5
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-3	-3	-2	-2	-2	-2	-1
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
KR4301P82723                      2019-08 풋272.5							86
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	85	85	85	86	86	86	86
-5.33%	51	52	52	52	53	54	54
-2.67%	19	20	21	23	24	25	26
0%	-5	-3	-2	0	2	3	5
2.67%	-17	-16	-15	-13	-12	-11	-9
5.33%	-21	-21	-20	-19	-19	-18	-17
8.00%	-22	-22	-22	-21	-21	-21	-20

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

(단위:백만원)

**1,616**

공시일	2019-07-12
기준일	2019-07-11

## 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	28,756	0	28,756	

### 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	2019-07-12
기준일	2019-07-11

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	995	-995	
누계	유가증권	수익증권	58,188	0	58,188	

### 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	2019-07-12
기준일	2019-07-11

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	12,436	-12,436	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	351,425	0	351,425	
누계	통화	선도	0	400,891	-400,891	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		469
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		469
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		376
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		789
FX21019M00 KRW/USD 15-07-19E		469
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		376
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		657
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		939
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		657
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		657
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		563
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		3,004
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		2,253
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E		282
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E		282
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E		789
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E		629
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E		469
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		1,878
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		1,878
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E		695
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E		695
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E		1,296
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E		2,546
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		3,098
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		2,103

FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E

1,690

FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E

2,065

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

(단위:백만원)

**10,543**

공시일	2019-07-12
기준일	2019-07-11

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

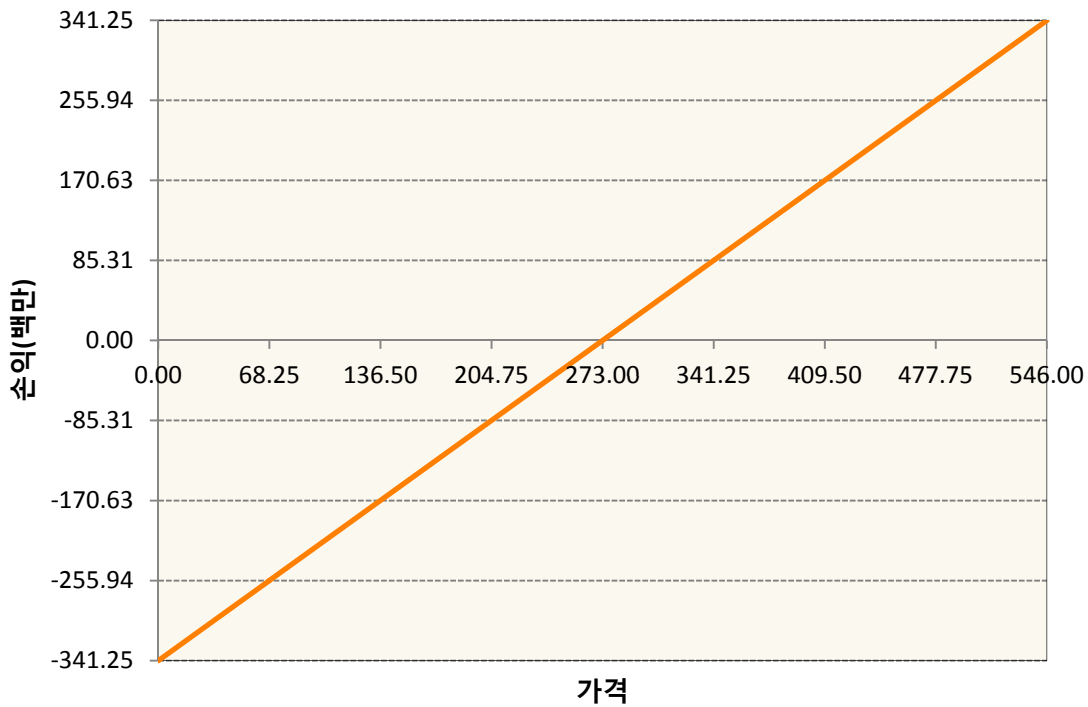
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

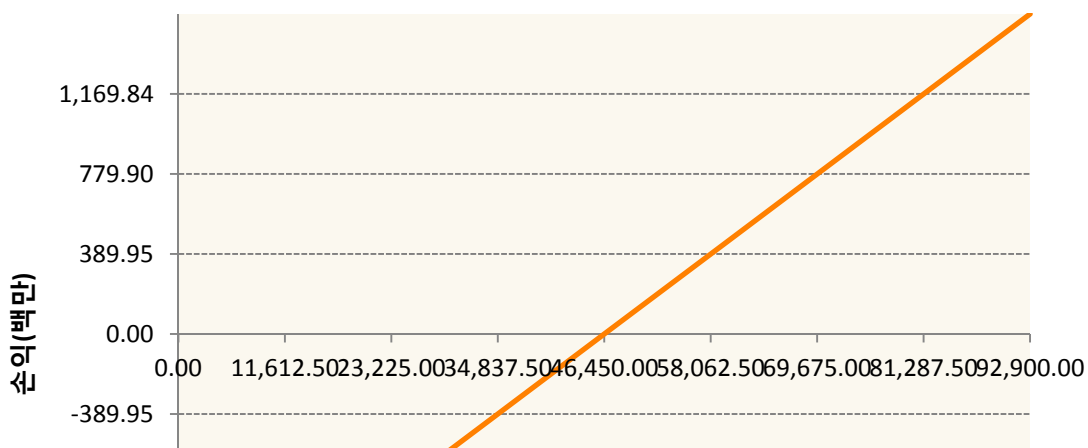
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,901	0	1,901	장내

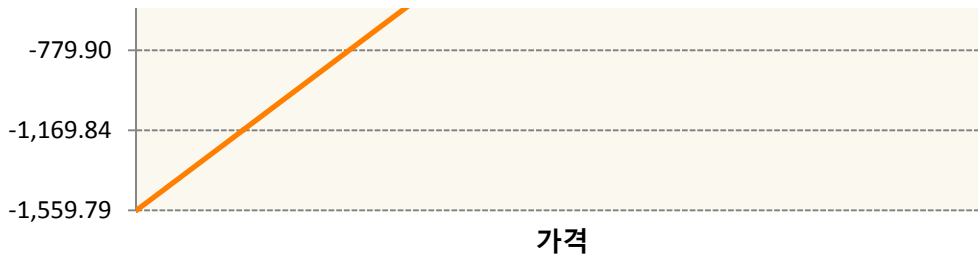
### 2. 만기시점의 손익구조

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						124
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124	
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83	
-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%	83	83	83	83	83	83	83	
8.00%	124	124	124	124	124	124	124	

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

**168**

공시일	2019-07-12
기준일	2019-07-11

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

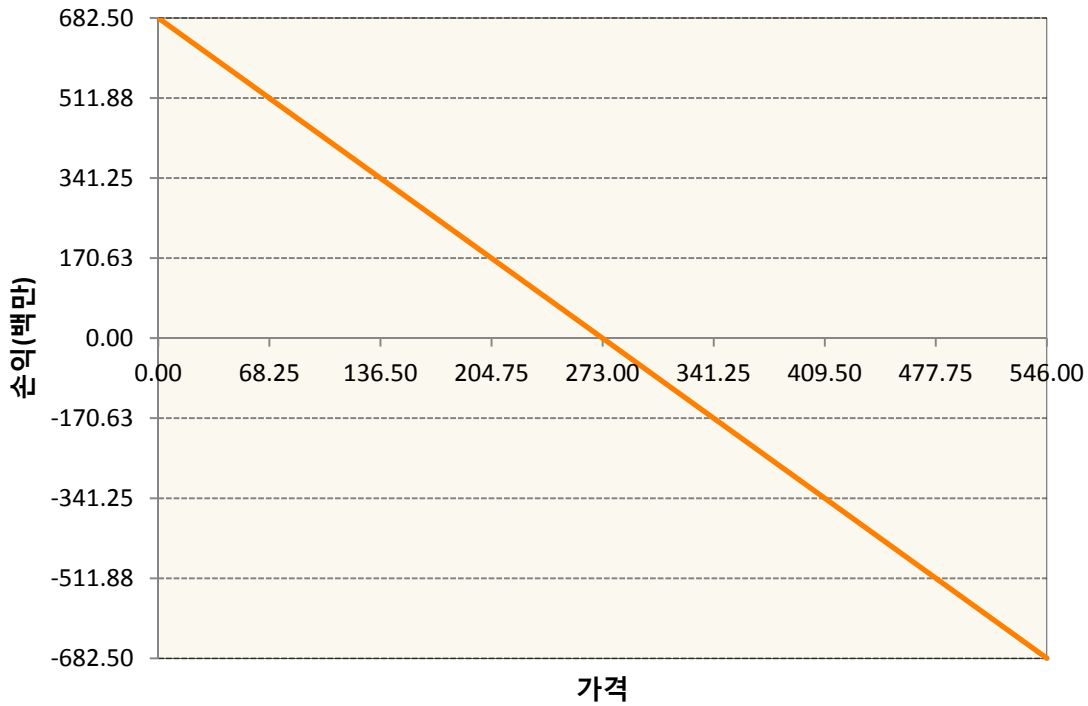
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

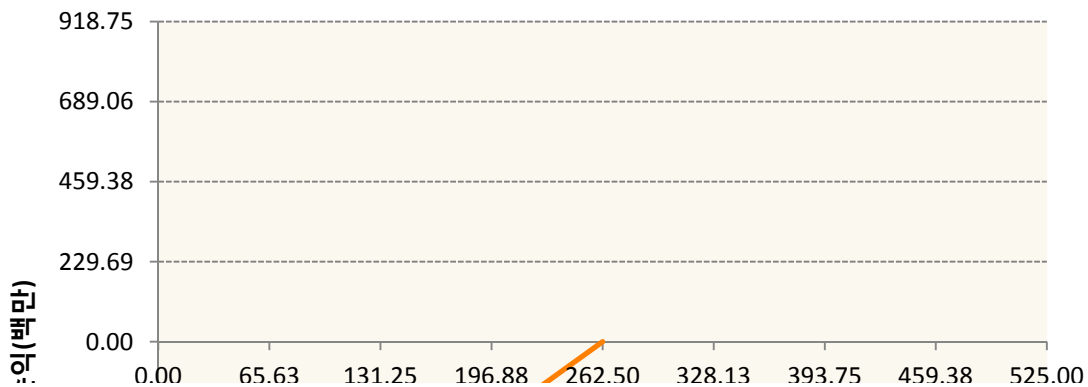
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	3,586	-3,586	장내
누계	유가증권	선물	0	683	-683	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,569	-3,569	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

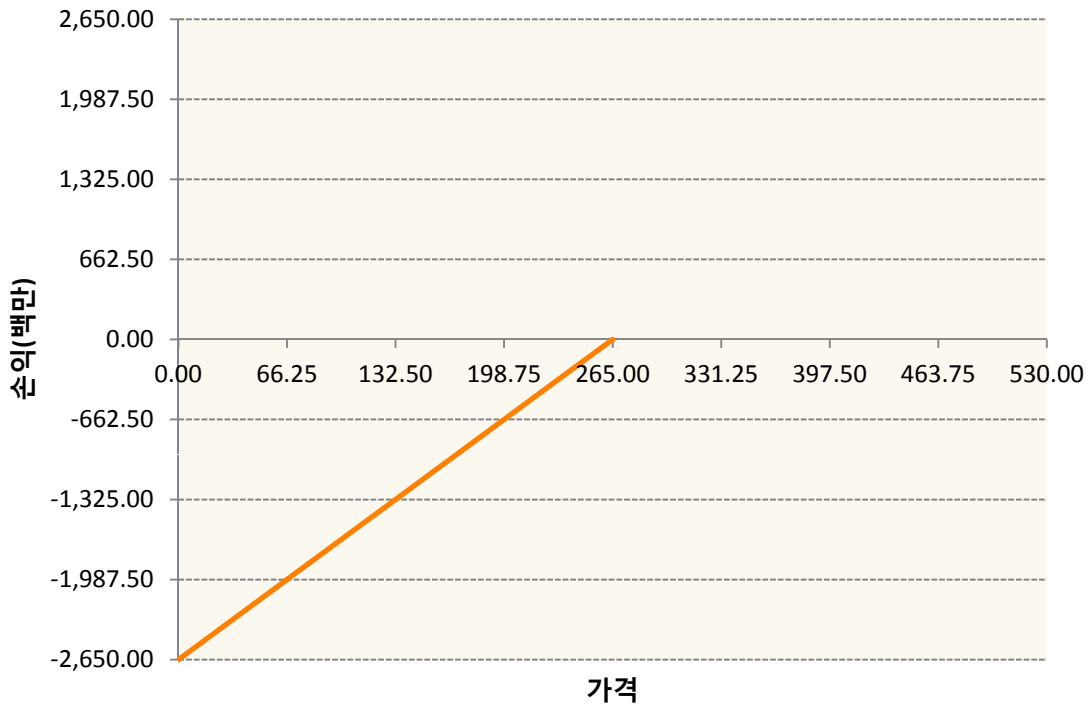


KR4301P82624-2019-08 풋262.5





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						44
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-41	-41	-42	-42	-43	-43	-44
-5.33%	-19	-20	-21	-22	-23	-24	-25
-2.67%	-4	-5	-6	-7	-9	-10	-11
0%	2	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	3	3	3	3	2	2	1
5.33%	4	4	4	3	3	3	3
8.00%	4	4	4	4	4	4	3

KR4301P82657

2019-08 풋265

141

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-135	-136	-136	-137	-138	-140	-141
-5.33%	-68	-70	-72	-75	-77	-80	-82
-2.67%	-17	-21	-24	-27	-31	-34	-38
0%	8	5	3	0	-3	-6	-9
2.67%	15	14	13	12	10	8	7
5.33%	16	16	16	15	15	14	13
8.00%	16	16	16	16	16	16	15

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

(단위:백만원)

212

공시일	2019-07-12
기준일	2019-07-11

## H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,995	0	1,995	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	18,417	0	18,417	
누계	통화	선도	0	18,189	-18,189	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		141
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		178
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		976
FX21019N01 KRW/USD 12-08-19E		160

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

(단위:백만원)

478

공시일	2019-07-12
기준일	2019-07-11

## 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	2019-07-12
기준일	2019-07-11

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

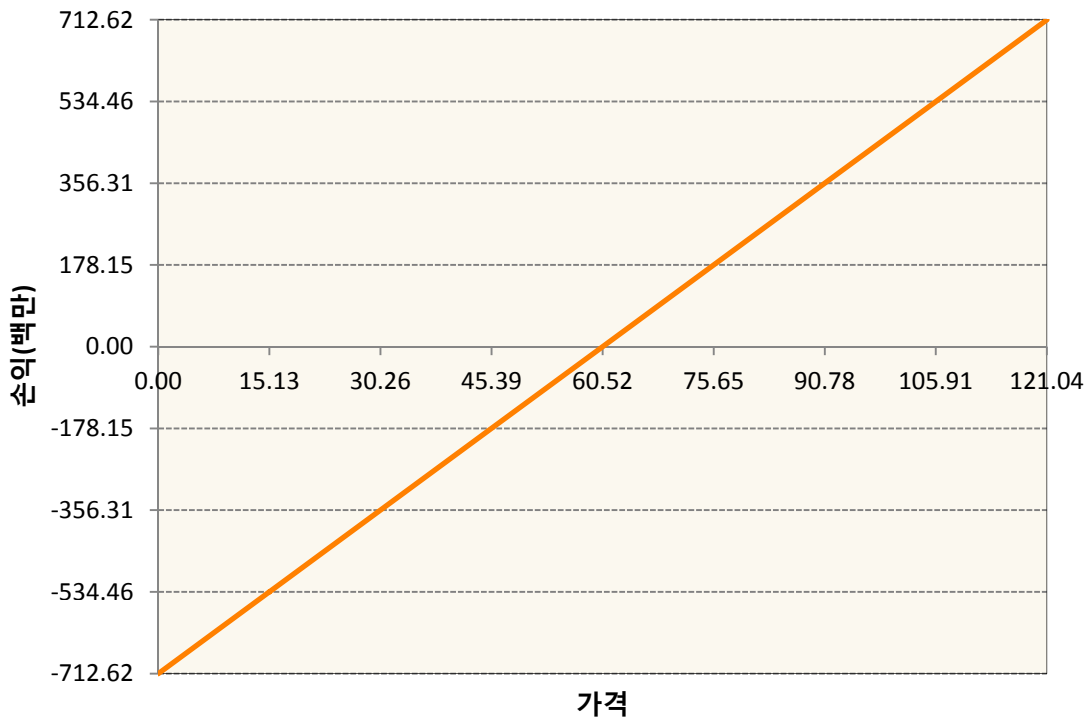
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

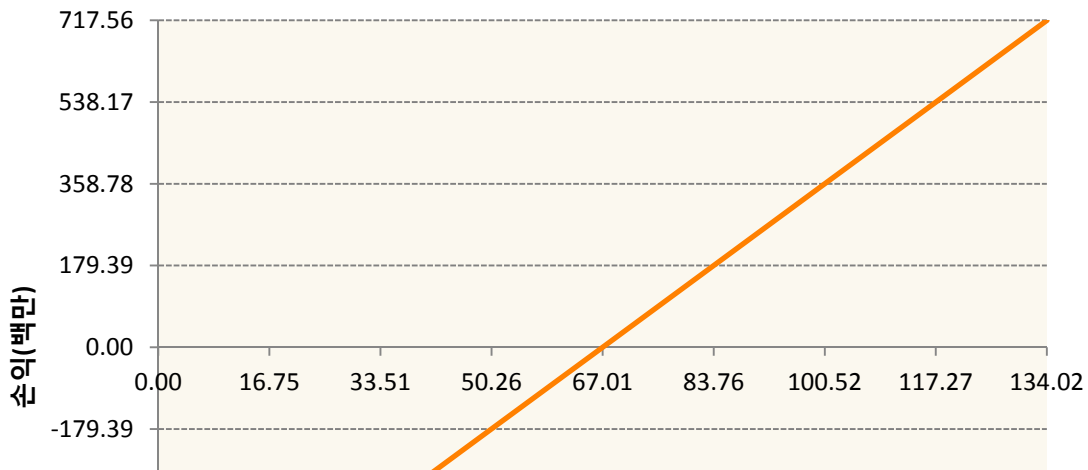
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,833	117	2,716	

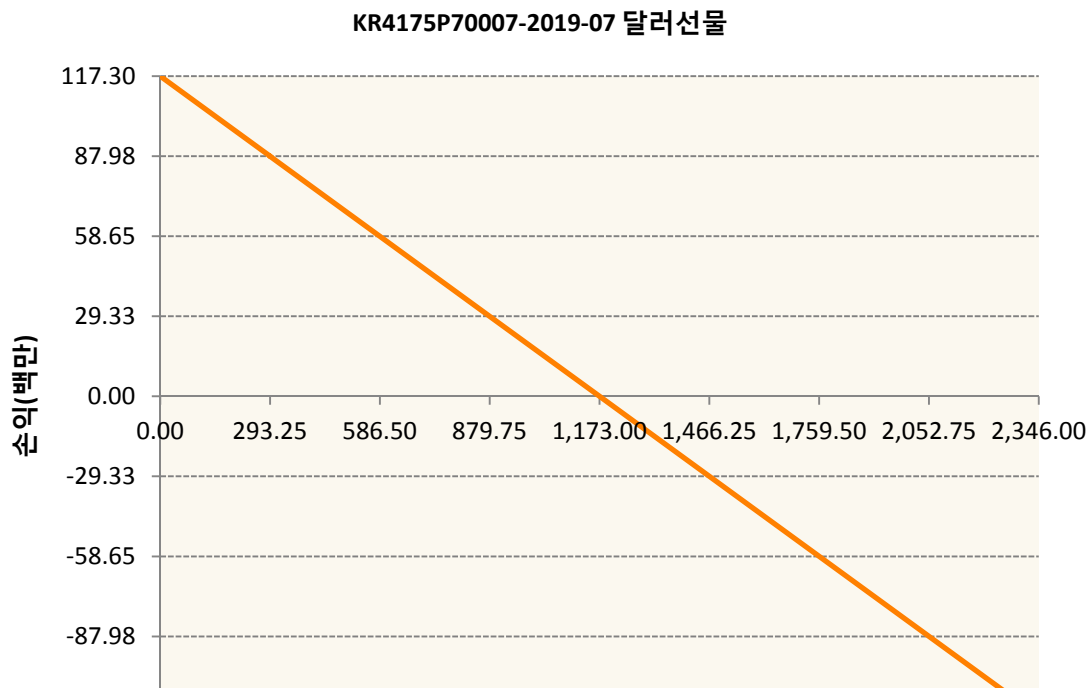
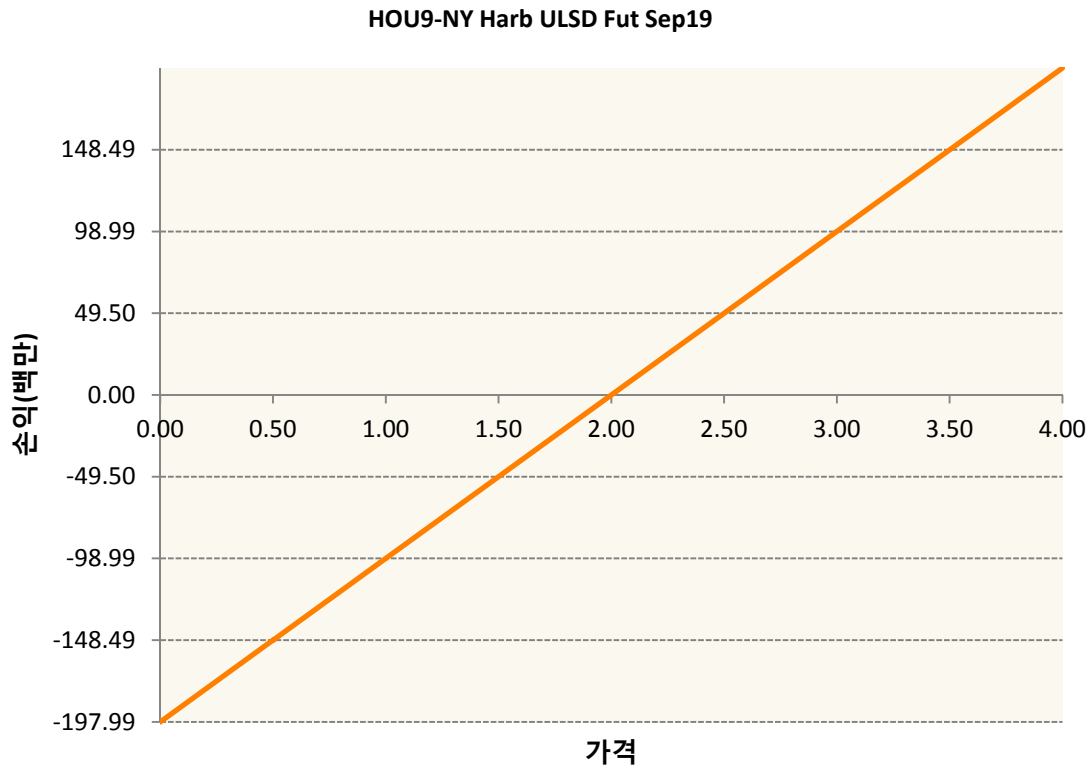
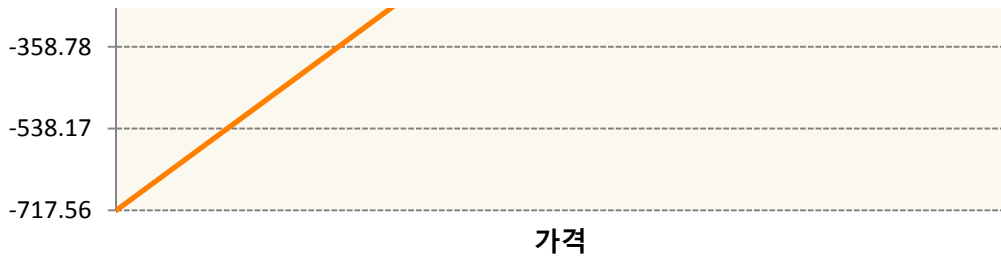
### 2. 만기시점의 손익구조

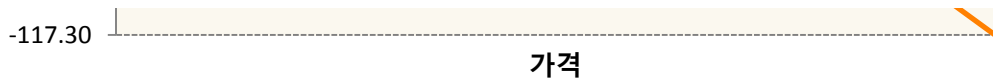
CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19



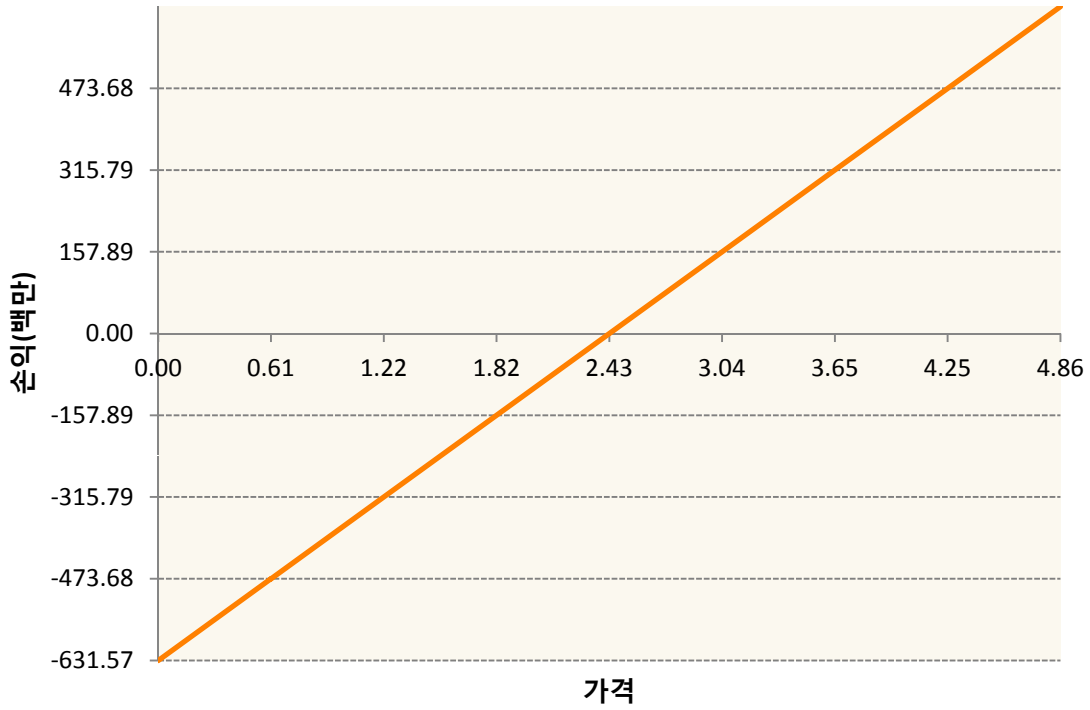
COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19



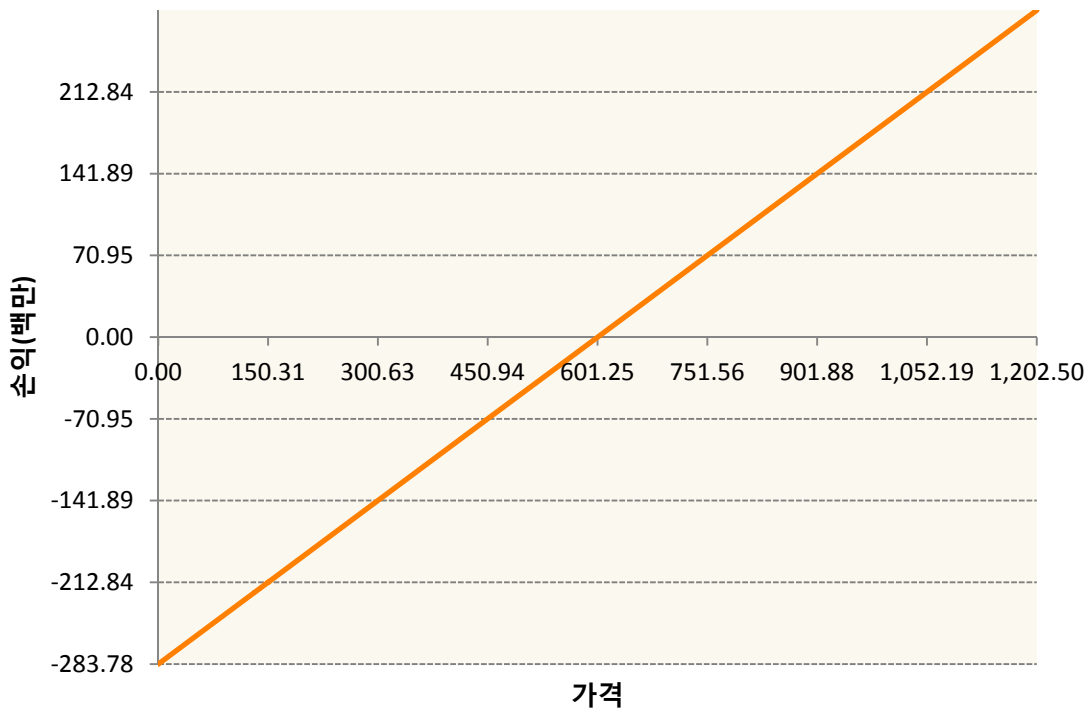




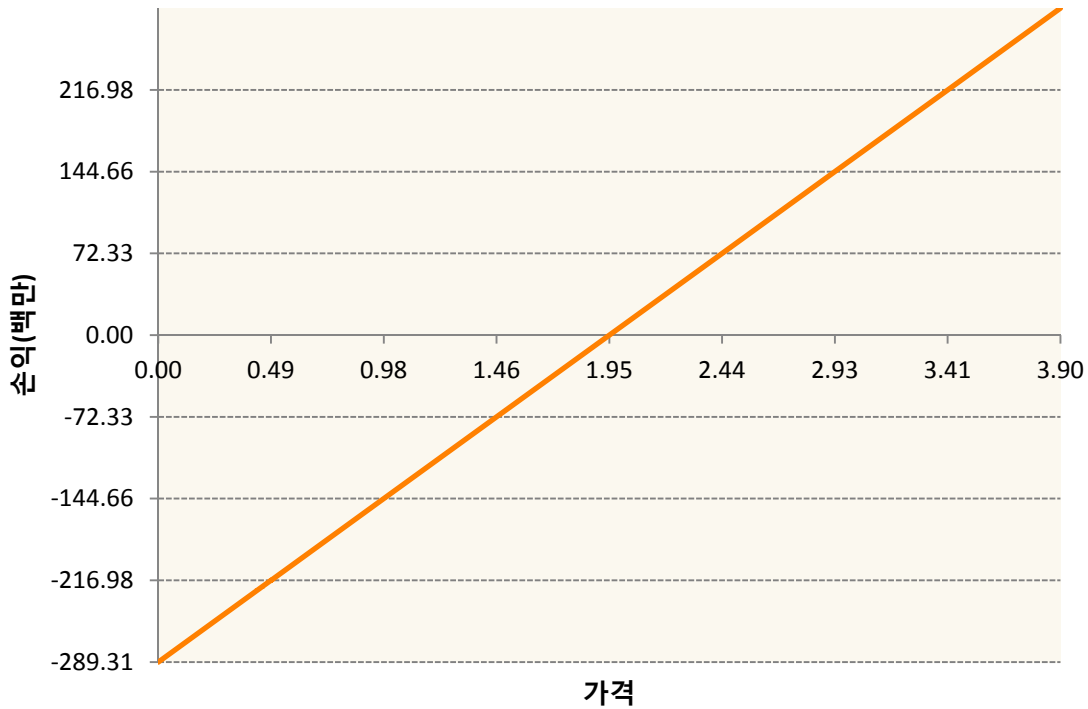
NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



QSU9-Low Su Gasoil G Sep19



XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	57
COU9	BRENT CRUDE FUTR Sep19	57
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	16
KR4175P700	2019-07 달러선물	9
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	51
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	23
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	23

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

421

공시일	2019-07-12
기준일	2019-07-11

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

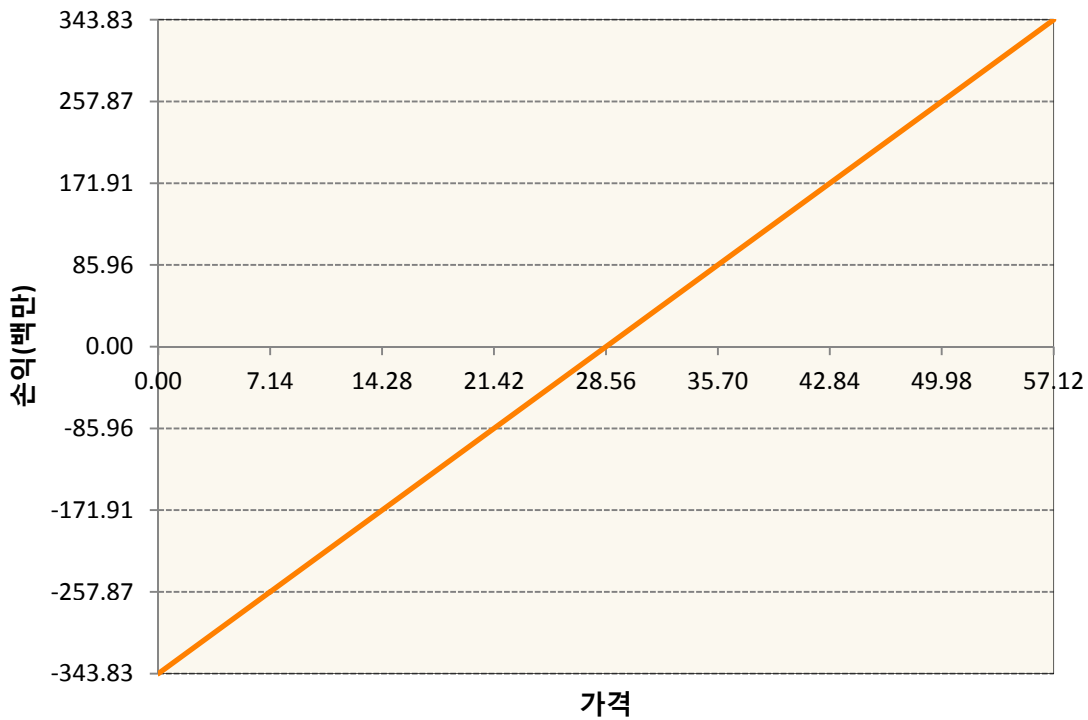
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

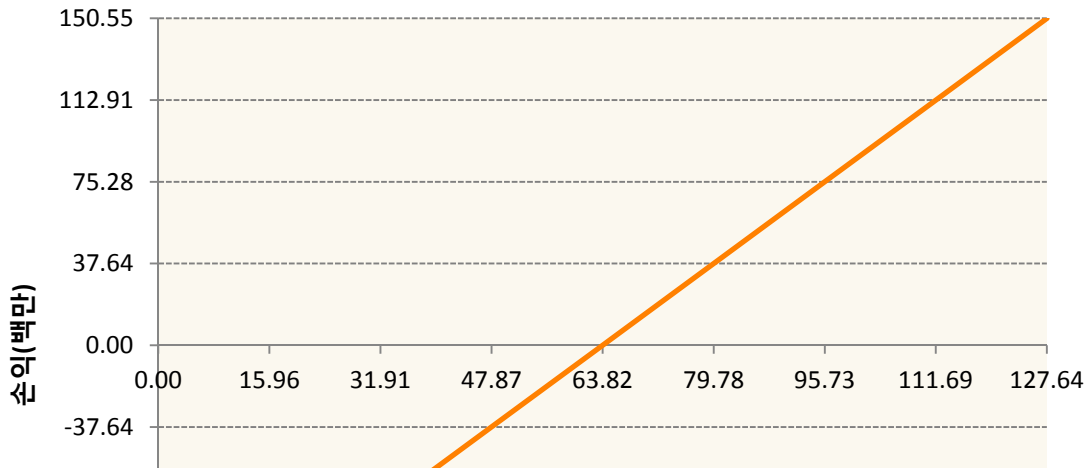
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,239	199	3,040	

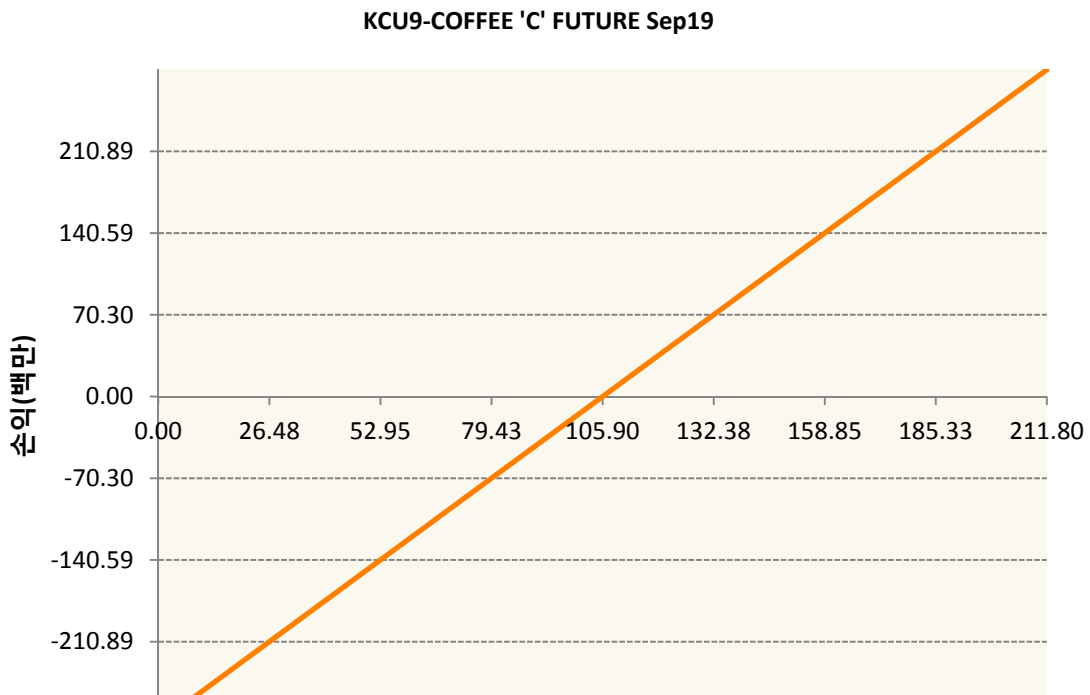
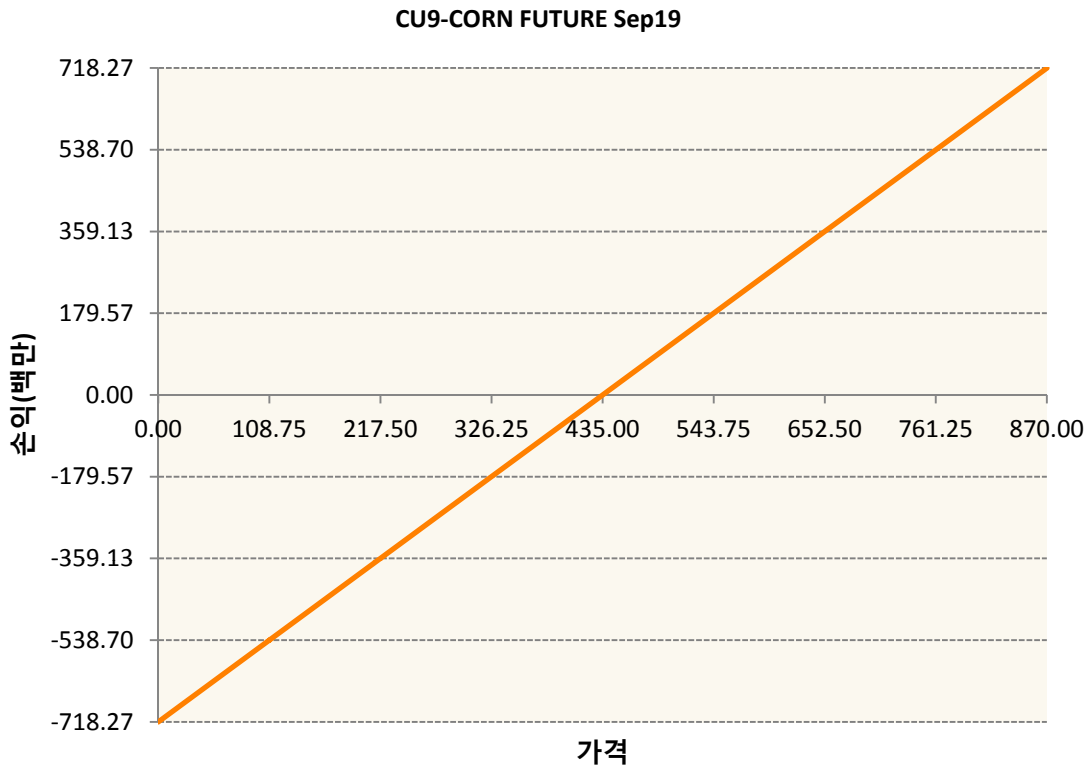
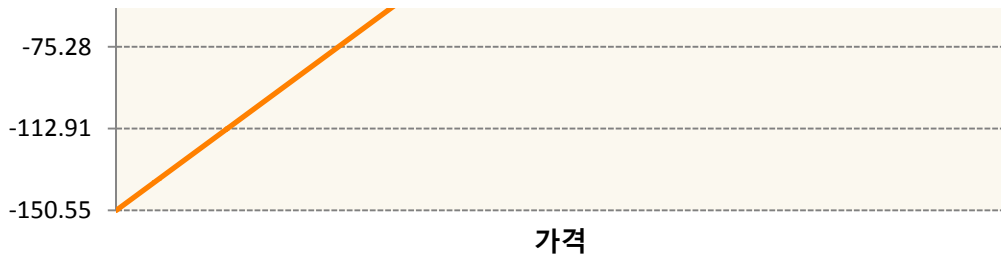
### 2. 만기시점의 손익구조

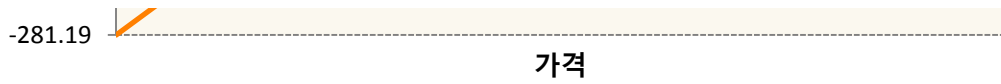
**BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19**



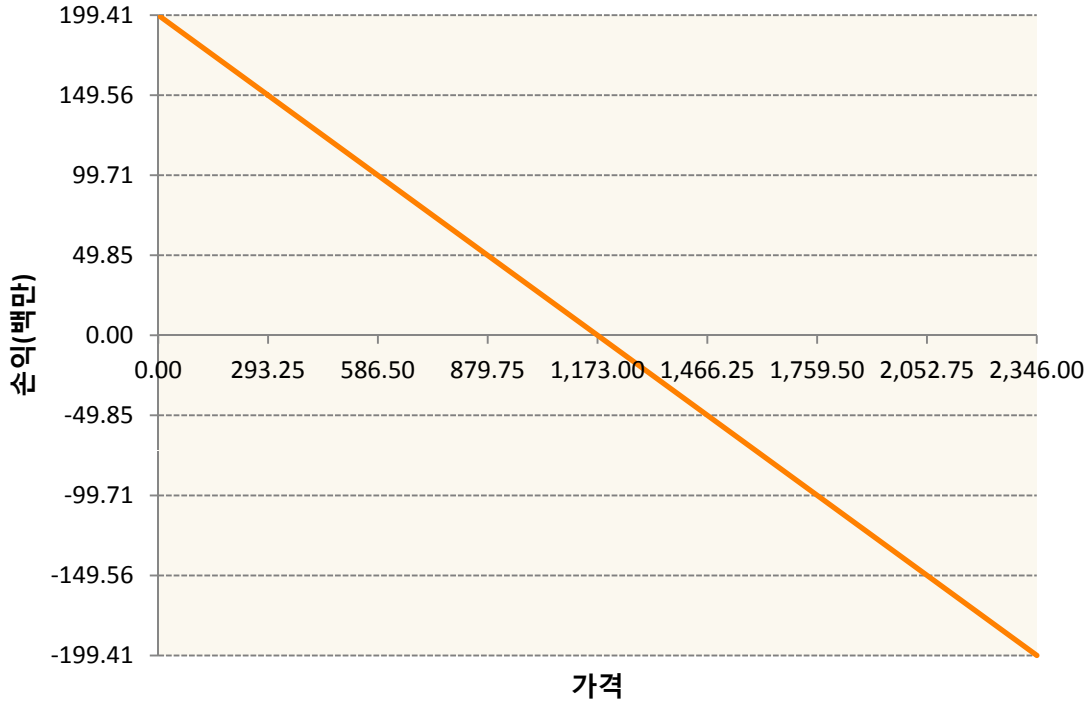
**CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19**



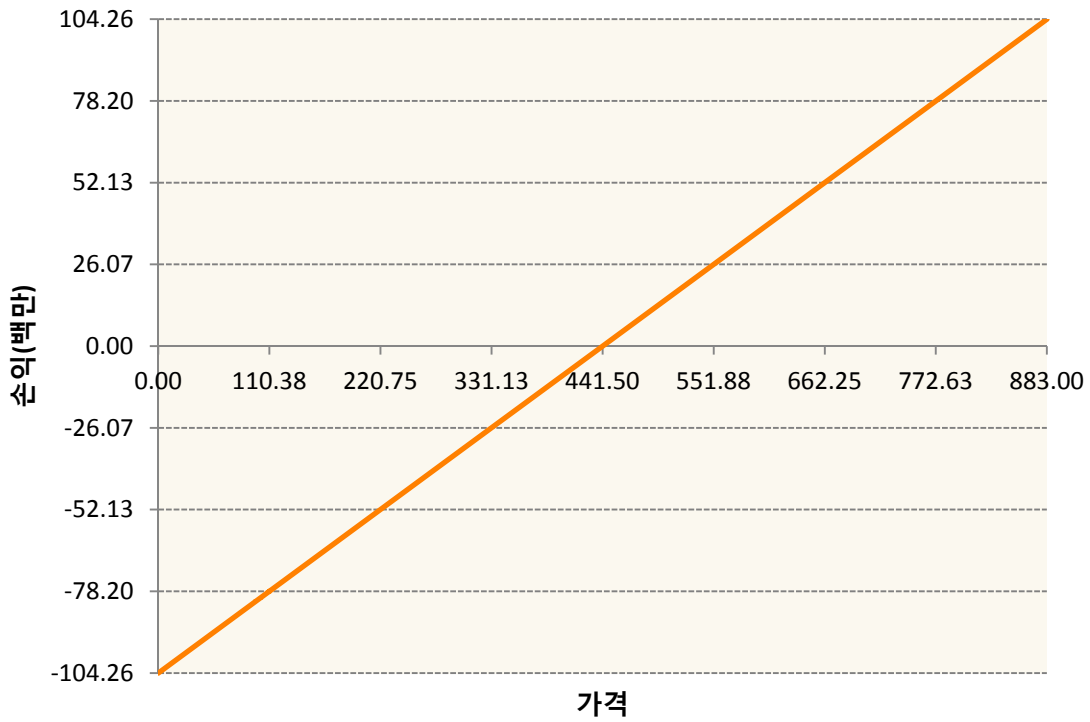




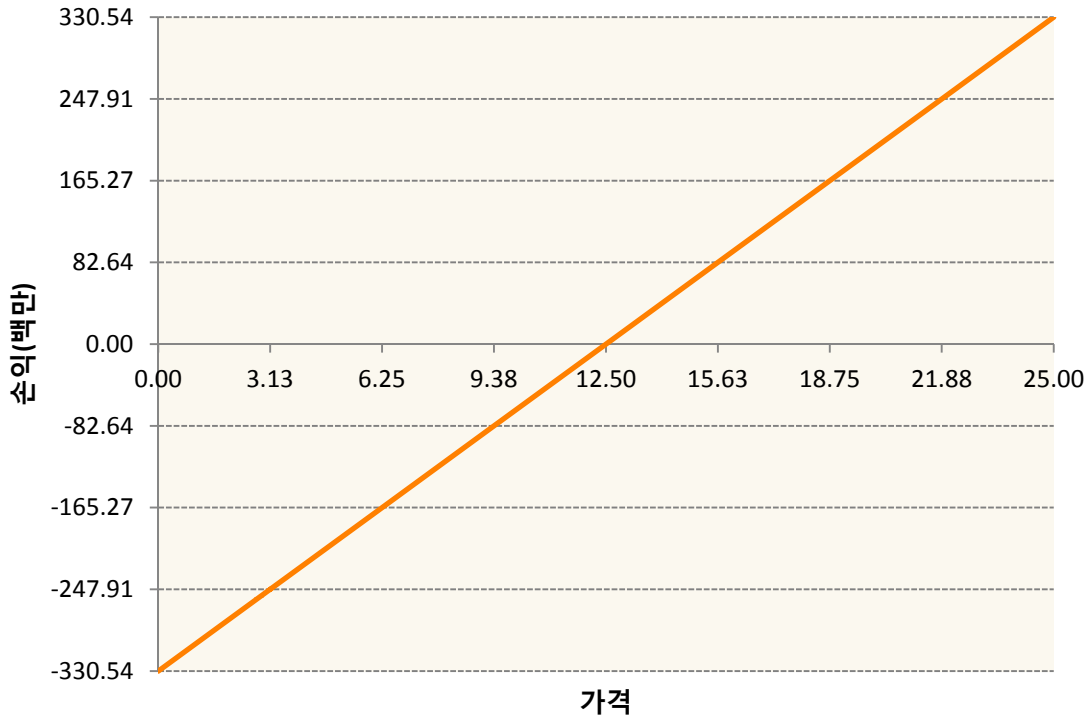
KR4175P70007-2019-07 달러선물



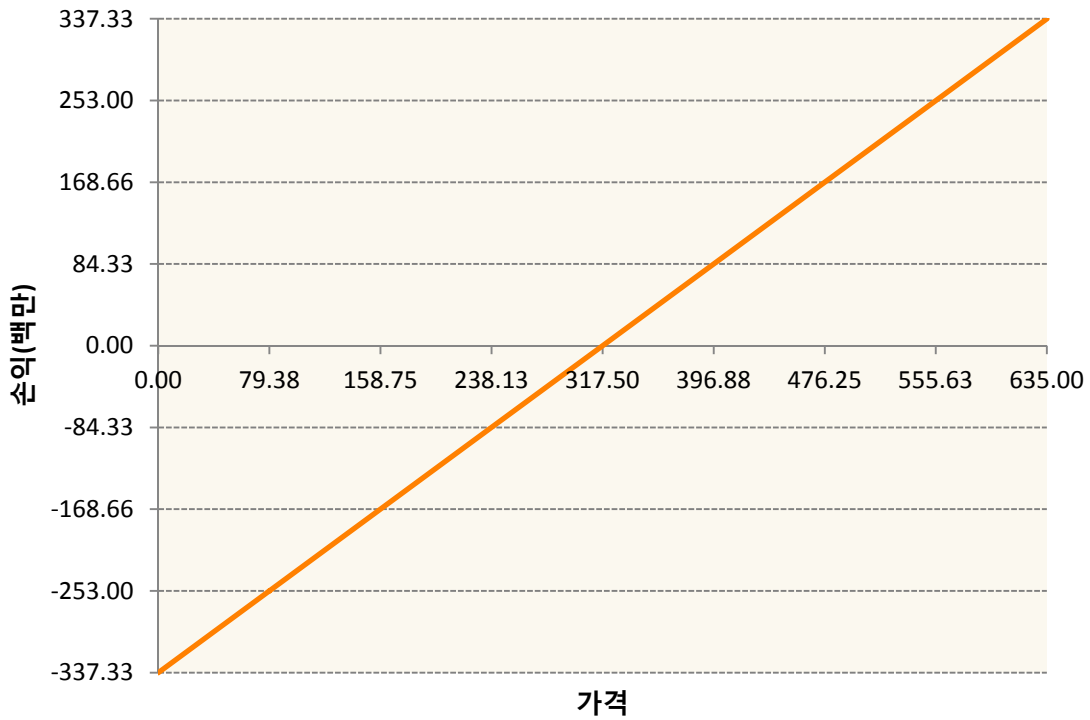
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

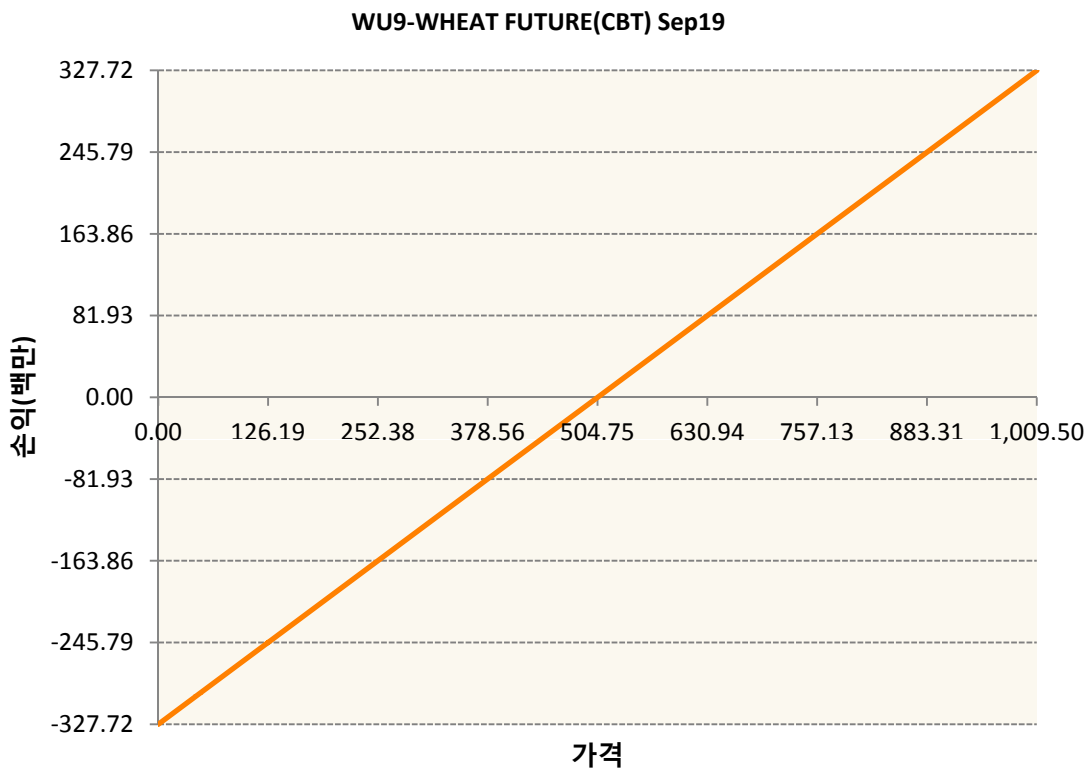
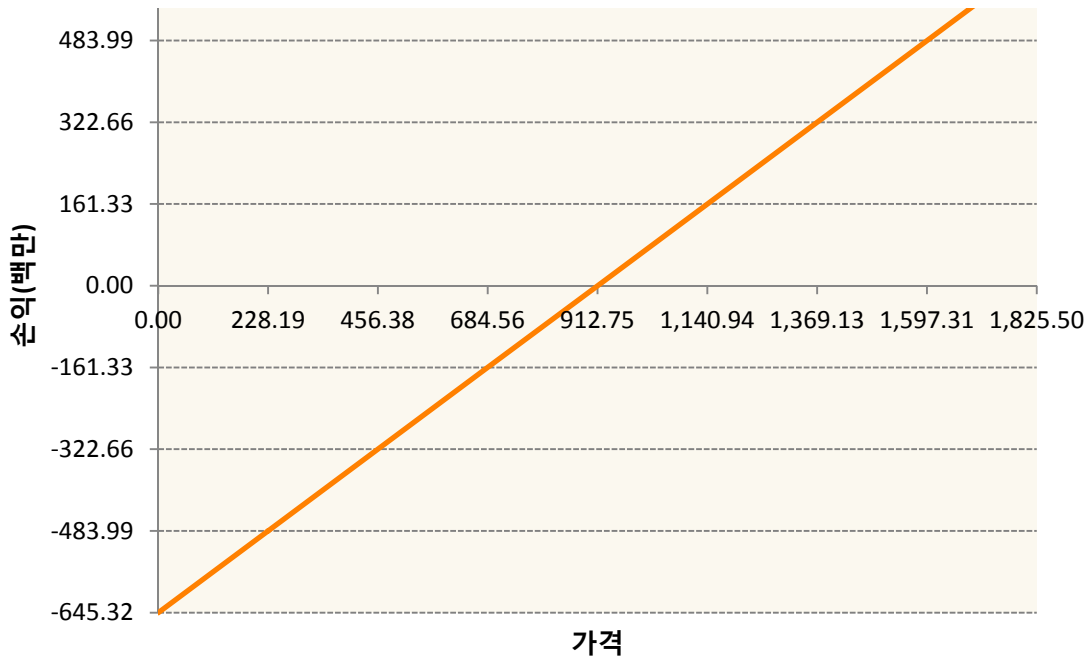


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	28
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	12
CU9	CORN FUTURE Sep19	57
KCU9	COFFEE 'C' FUTURE Sep19	22
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	52
WU9	WHEAT FUTURE(CBT) Sep19	26

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

(단위:백만원)

**284**