

공시일	2019-07-15
기준일	2019-07-12

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	2019-07-15
기준일	2019-07-12

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

1,180

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

673

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-15
기준일	2019-07-12

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)	380
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	139

* 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	2019-07-15
기준일	2019-07-12

유로인덱스모(주식-파생형)

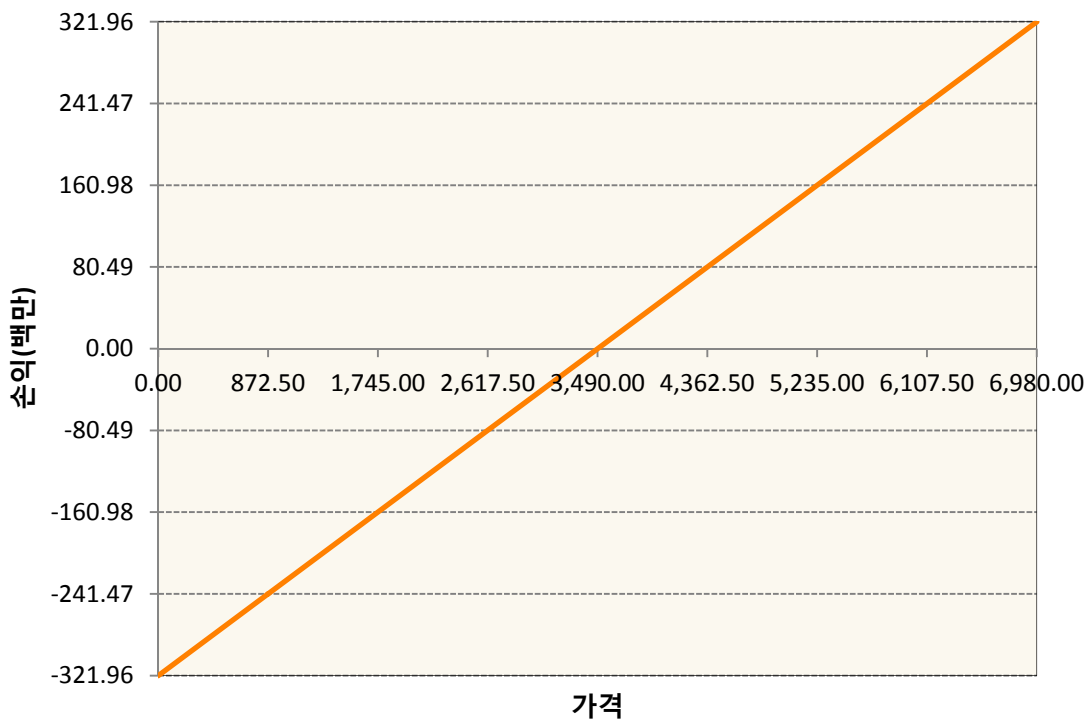
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	322	0	322	

2. 만기시점의 손익구조

VGU9-EURO STOXX 50 Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU9	EURO STOXX 50 Sep19	26
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

18

공시일	2019-07-15
기준일	2019-07-12

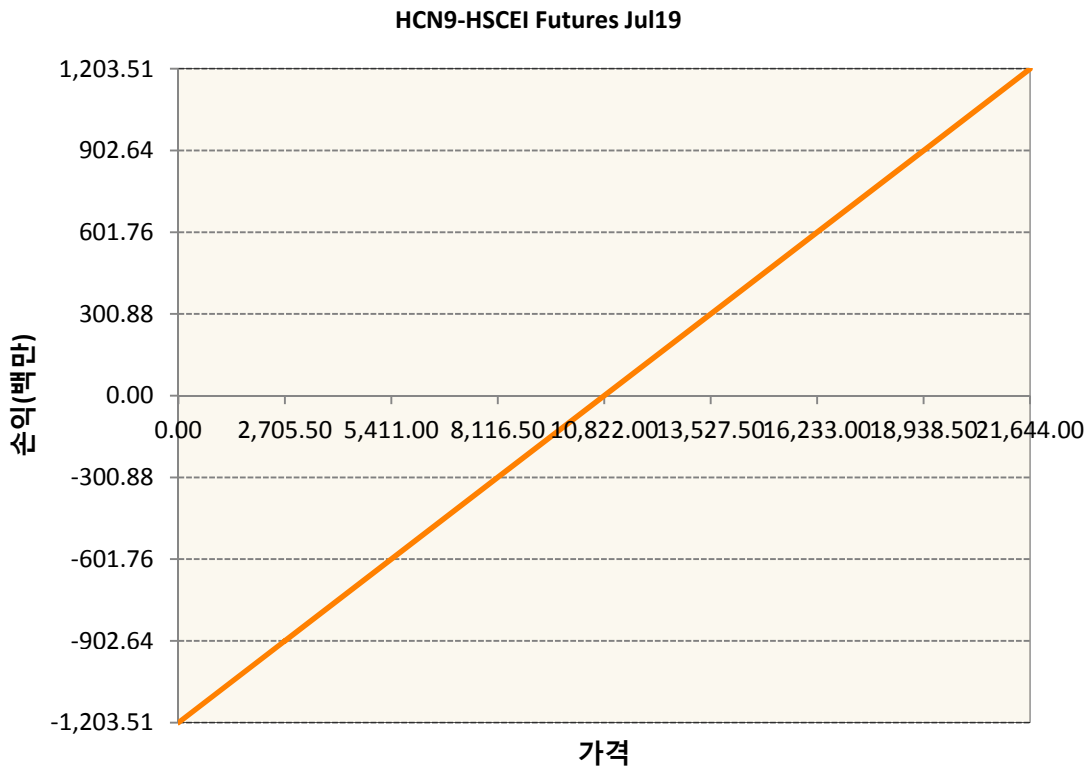
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,204	0	1,204	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	2019-07-15
기준일	2019-07-12

커버드콜모(주식혼합-파생형)

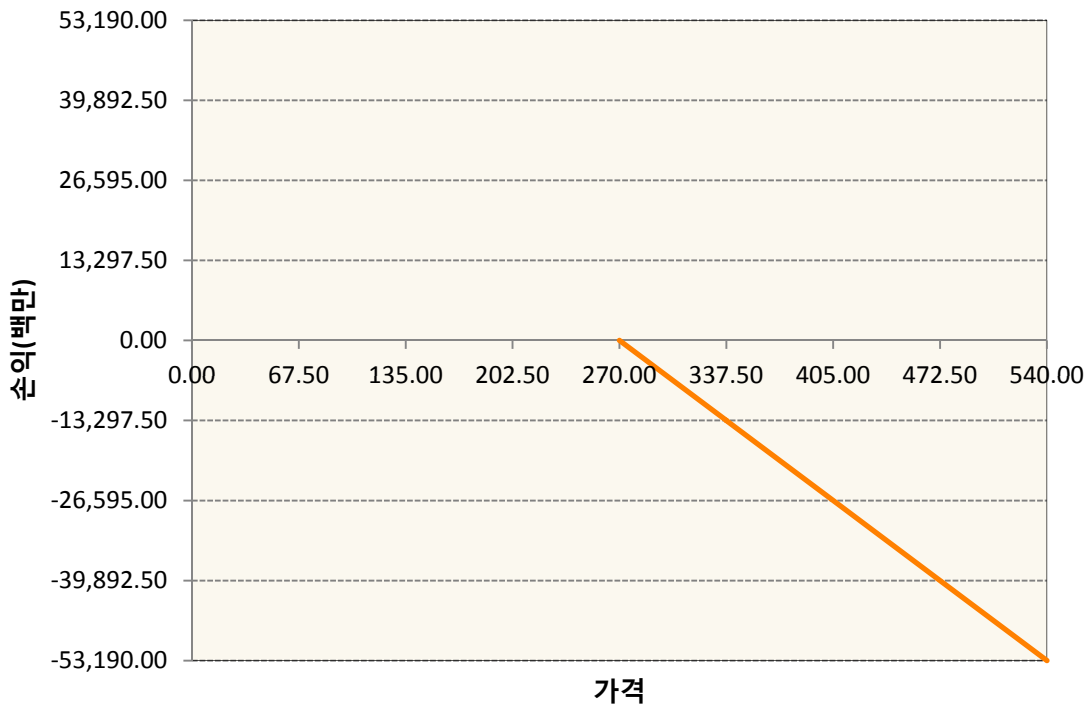
1. 계약금액

(단위:백만원)

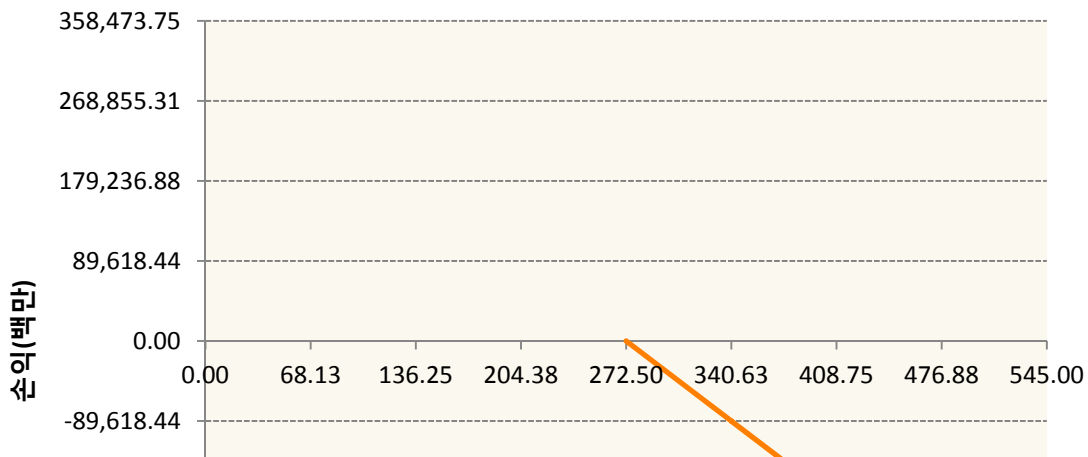
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	395,397	-395,397	장내
누계	유가증권	옵션	0	601,289	-601,289	장내

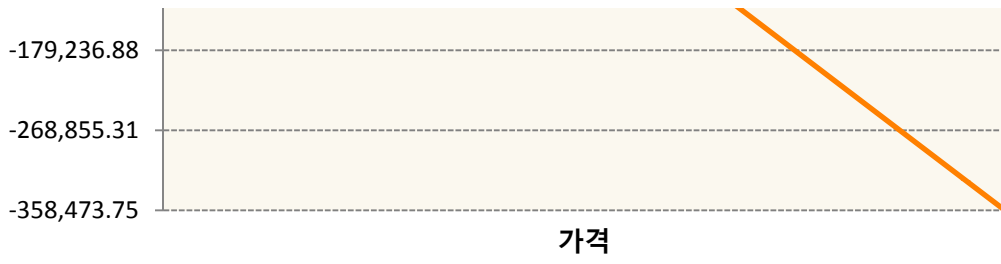
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P82709-2019-08 콜270

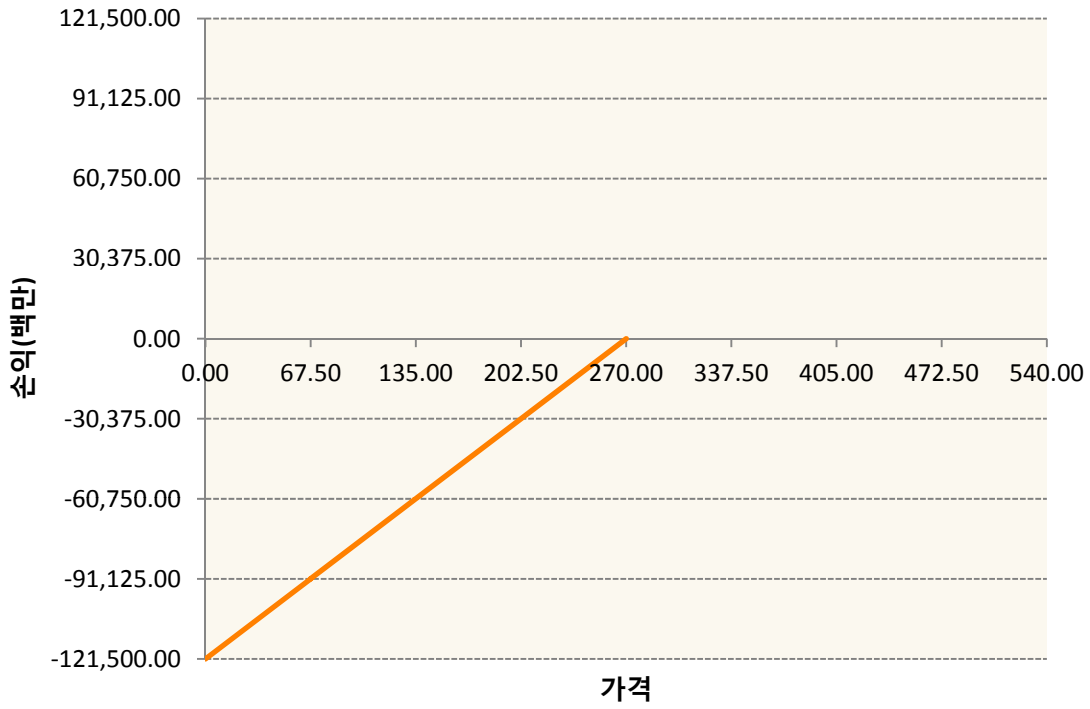


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

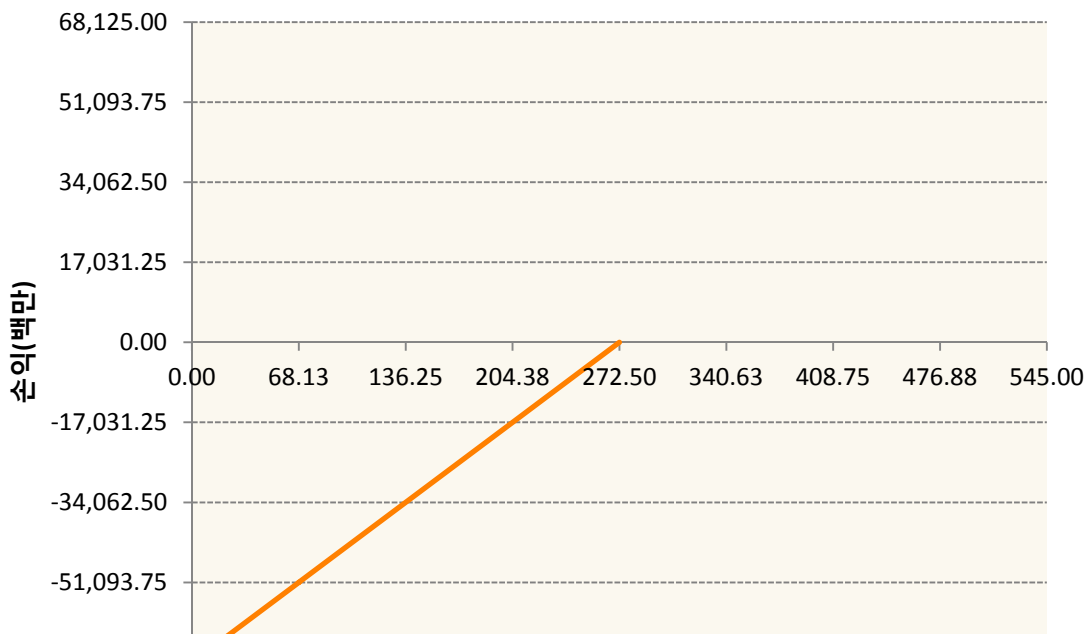




KR4301P82707-2019-08 풋270



KR4301P82723-2019-08 풋272.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P82709 2019-08 콜270							3,460
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,630	1,584	1,531	1,470	1,402	1,329	1,252
-5.33%	1,444	1,361	1,273	1,181	1,085	986	885
-2.67%	1,043	930	816	701	585	469	352
0%	358	239	120	0	-120	-240	-360
2.67%	-612	-710	-813	-918	-1,026	-1,136	-1,247
5.33%	-1,803	-1,868	-1,941	-2,021	-2,106	-2,196	-2,290
8.00%	-3,130	-3,165	-3,209	-3,261	-3,321	-3,388	-3,460
KR4201P82725 2019-08 콜272.5							22,100
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,387	9,150	8,856	8,510	8,119	7,688	7,221
-5.33%	8,469	7,997	7,478	6,922	6,335	5,723	5,090
-2.67%	6,335	5,628	4,905	4,170	3,425	2,673	1,914
0%	2,434	1,622	811	0	-811	-1,622	-2,433
2.67%	-3,411	-4,140	-4,884	-5,641	-6,407	-7,181	-7,962
5.33%	-10,904	-11,425	-11,993	-12,598	-13,234	-13,894	-14,575
8.00%	-19,494	-19,797	-20,162	-20,582	-21,049	-21,556	-22,100
KR4301P82707 2019-08 풋270							7,546
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,447	-7,452	-7,460	-7,472	-7,491	-7,515	-7,546
-5.33%	-4,234	-4,272	-4,319	-4,376	-4,442	-4,515	-4,594
-2.67%	-1,396	-1,512	-1,633	-1,757	-1,883	-2,011	-2,141
0%	411	275	138	0	-139	-279	-419
2.67%	1,075	1,010	935	852	761	663	561
5.33%	1,199	1,185	1,165	1,136	1,099	1,054	1,001
8.00%	1,210	1,209	1,206	1,200	1,190	1,176	1,156
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							4,511
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,478	-4,479	-4,481	-4,485	-4,491	-4,499	-4,511
-5.33%	-2,675	-2,687	-2,703	-2,725	-2,751	-2,781	-2,816
-2.67%	-993	-1,043	-1,097	-1,155	-1,215	-1,278	-1,343
0%	240	160	80	0	-80	-160	-240
2.67%	802	750	694	634	571	506	439

5.33%	938	924	904	878	848	813	774
8.00%	955	953	949	943	933	920	904

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

(단위:백만원)

37,711

공시일	2019-07-15
기준일	2019-07-12

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

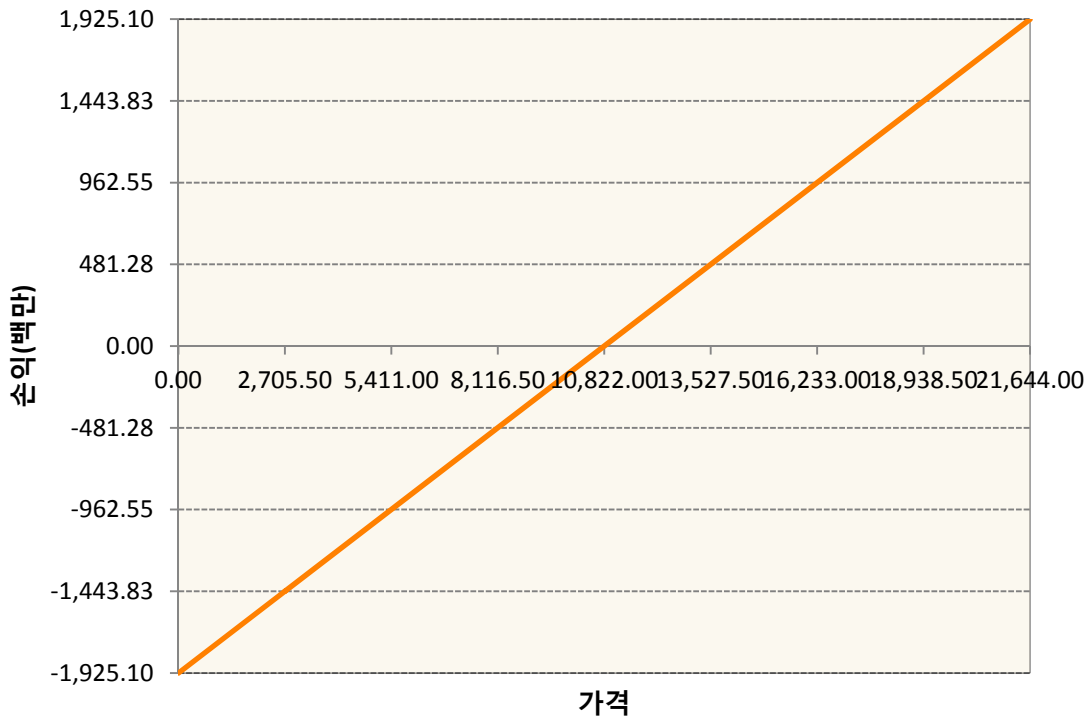
1. 계약금액

(단위:백만원)

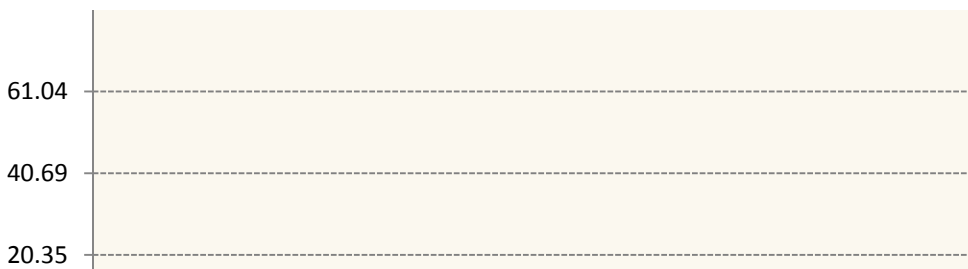
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,925	0	1,925	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,256	-5,256	장내
누계	통화	선도	151	3,165	-3,014	장외

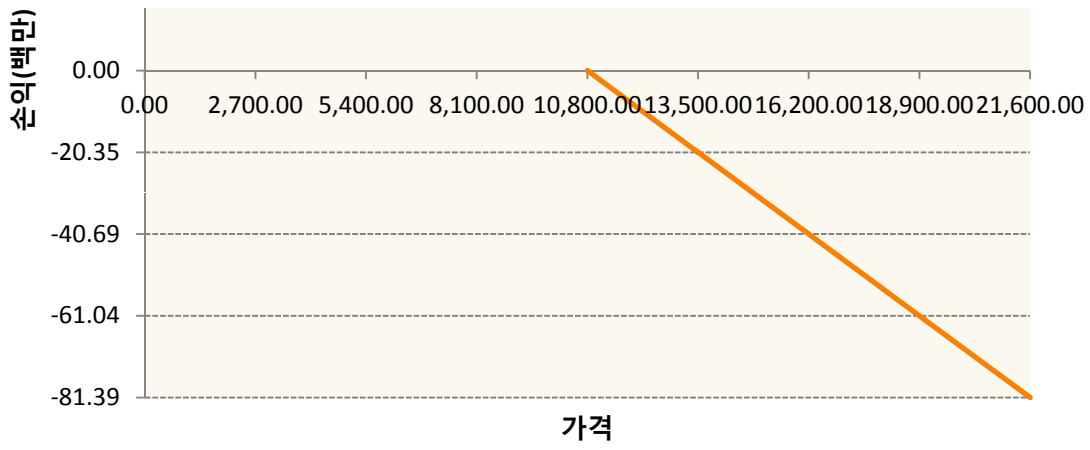
2. 만기시점의 손익구조

HCN9-HSCEI Futures Jul19

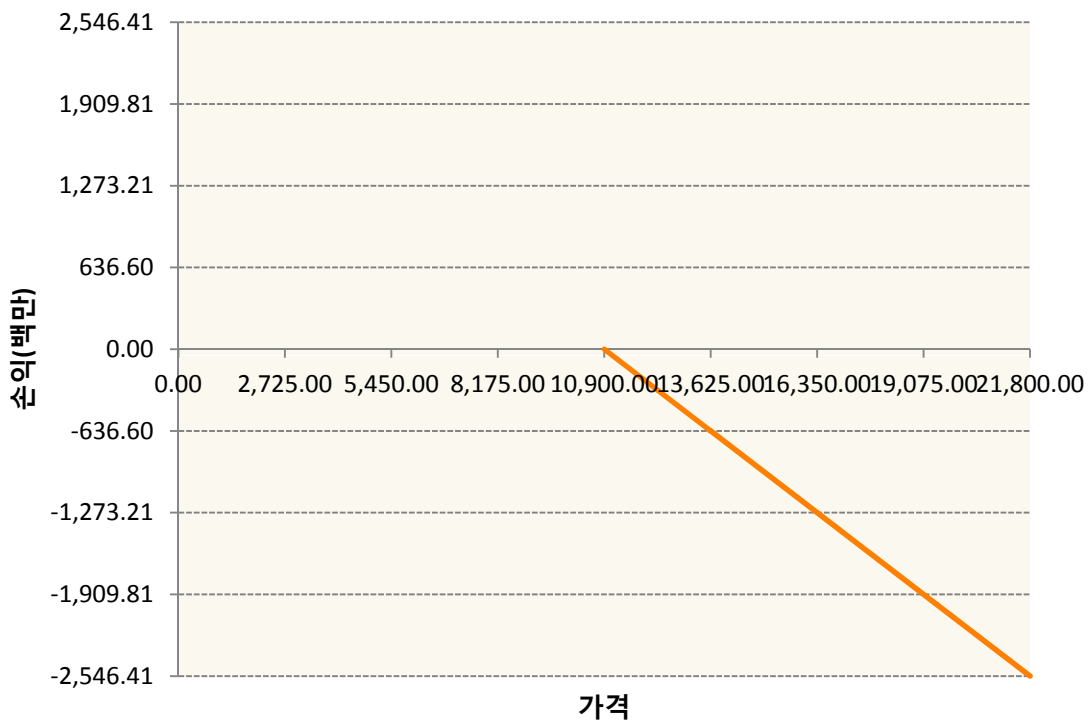


OHHIN9-C108-HSCEI

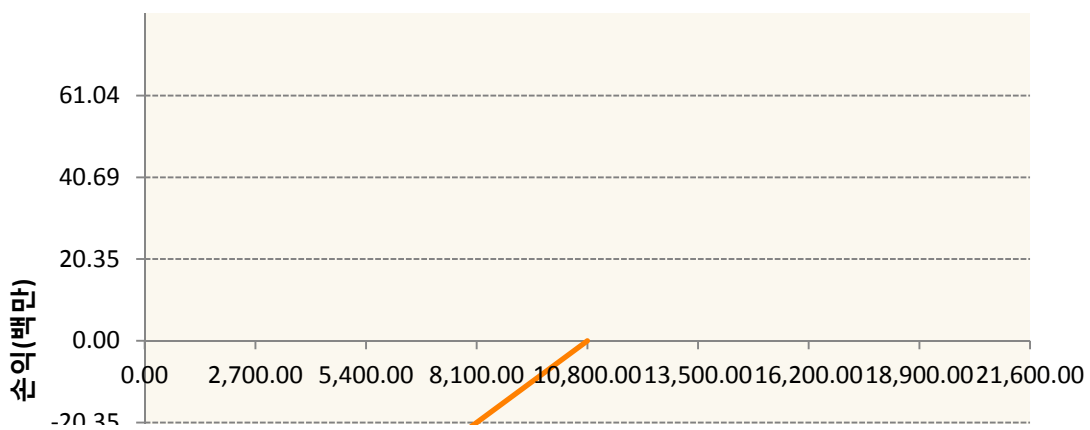


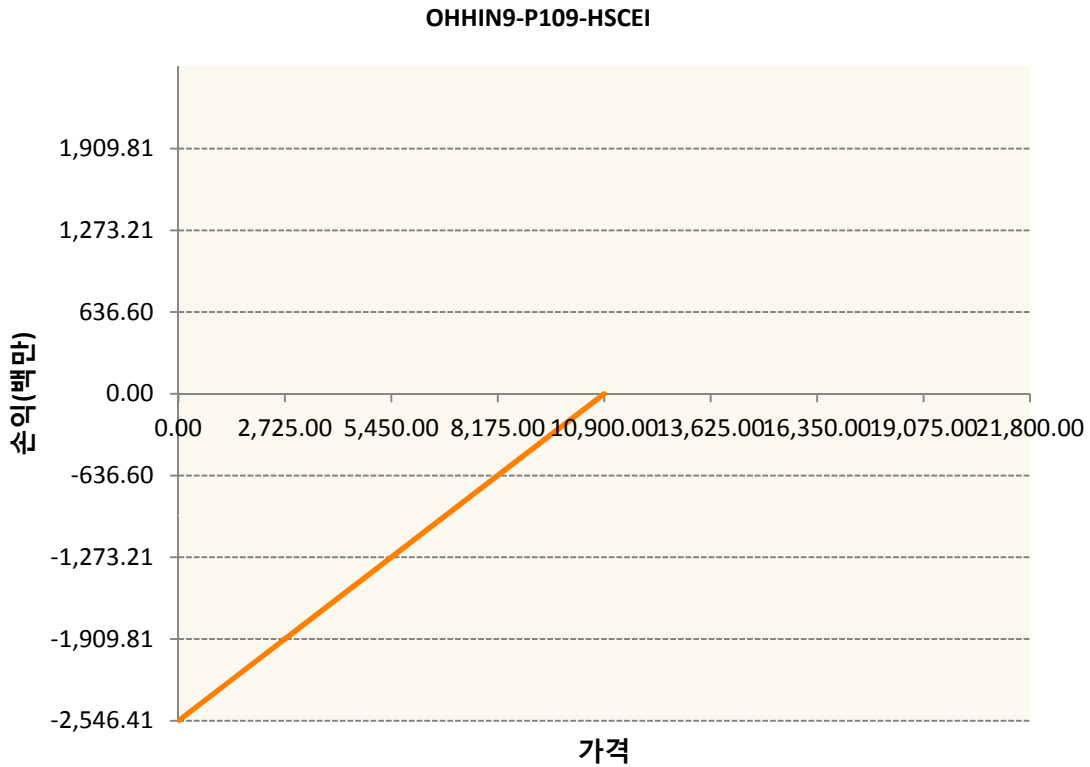
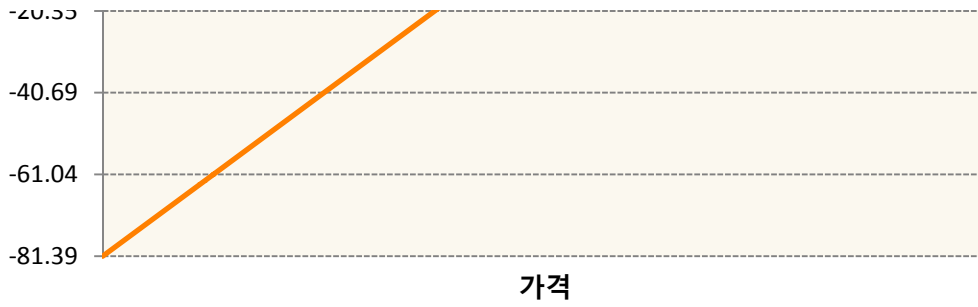


OHHIN9-C109-HSCEI



OHHIN9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	253
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E	12
HCN9 HSCEI Futures Jul19	154
OHHIN9-C1(HSCEI	7
OHHIN9-C1(HSCEI	204
OHHIN9-P1(HSCEI	7
OHHIN9-P1(HSCEI	204

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	668

공시일	2019-07-15
기준일	2019-07-12

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

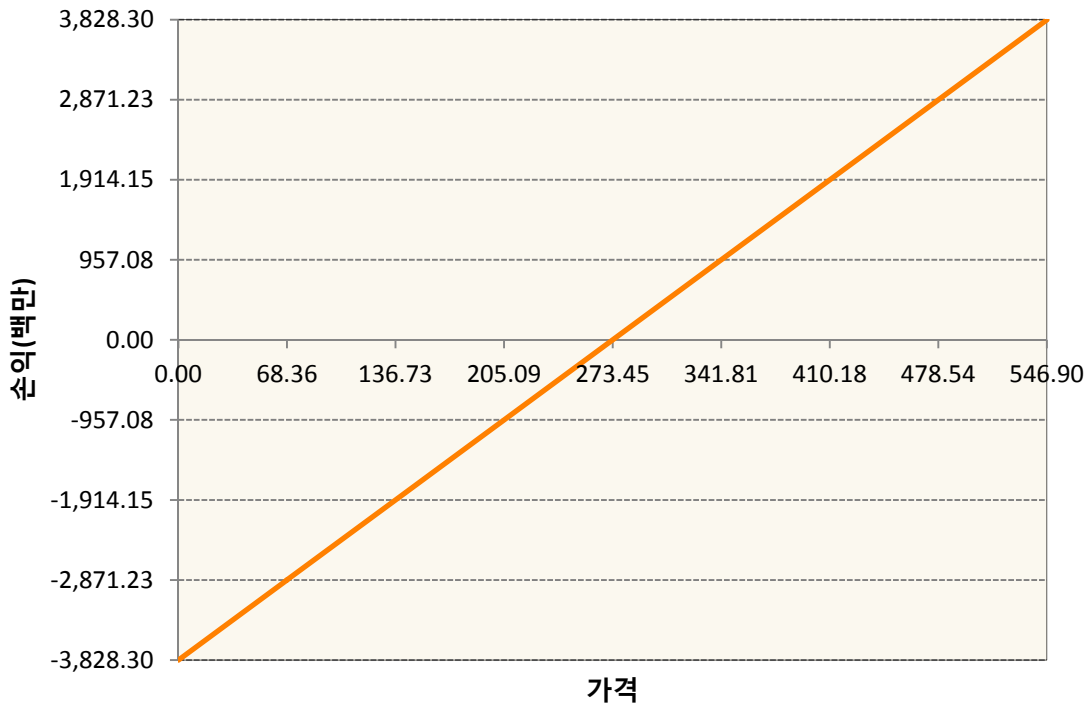
1. 계약금액

(단위:백만원)

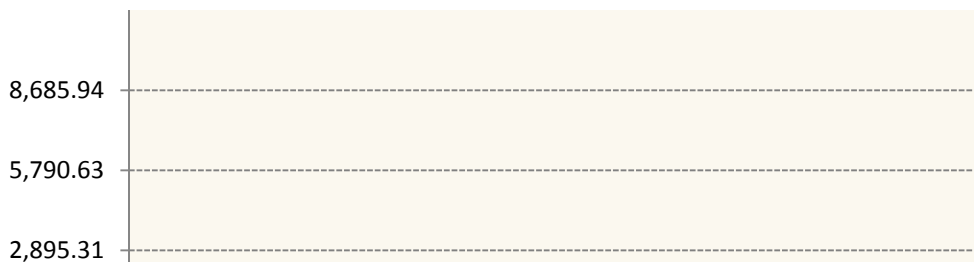
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	21,462	-21,462	장내
누계	유가증권	선물	3,828	0	3,828	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	21,199	-21,199	장내

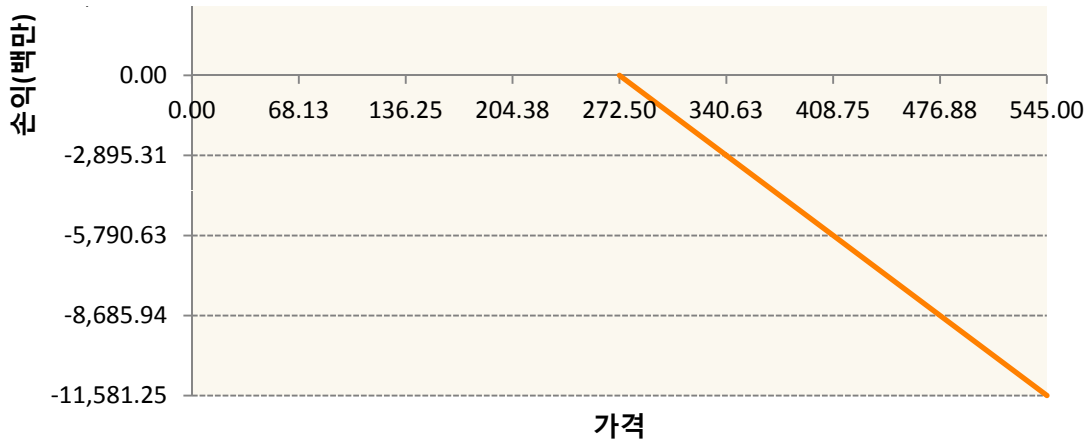
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

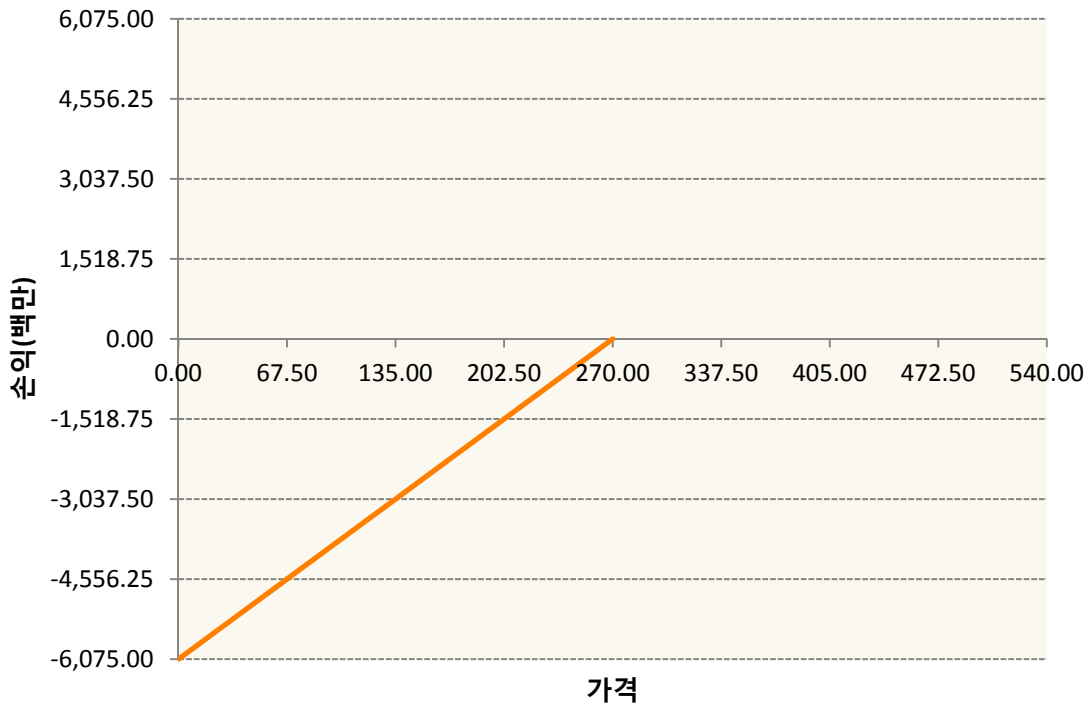


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

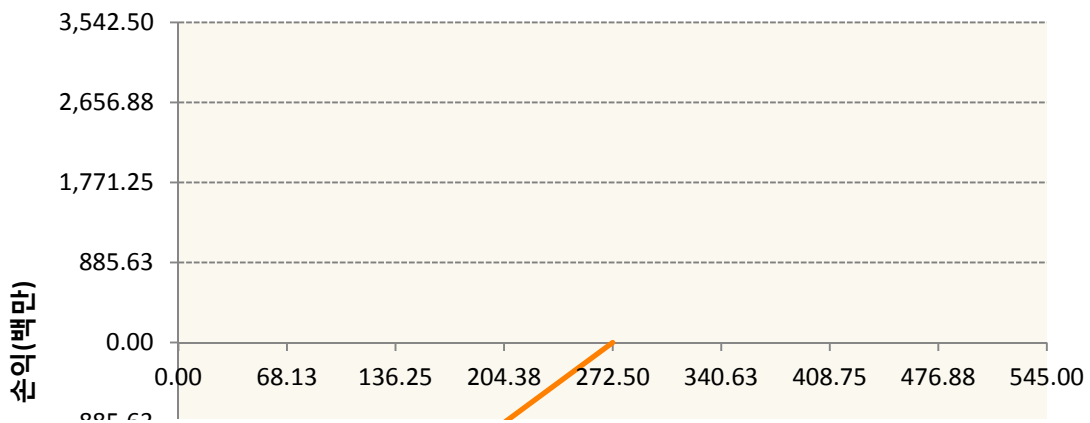




KR4301P82707-2019-08 풋270



KR4301P82723-2019-08 풋272.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,191
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,191	-1,191	-1,191	-1,191	-1,191	-1,191	-1,191	
-5.33%	-794	-794	-794	-794	-794	-794	-794	
-2.67%	-397	-397	-397	-397	-397	-397	-397	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	397	397	397	397	397	397	397	
5.33%	794	794	794	794	794	794	794	
8.00%	1,191	1,191	1,191	1,191	1,191	1,191	1,191	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						603
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-603	-603	-603	-603	-603	-603	-603	
-5.33%	-402	-402	-402	-402	-402	-402	-402	
-2.67%	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-201	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	201	201	201	201	201	201	201	
5.33%	402	402	402	402	402	402	402	
8.00%	603	603	603	603	603	603	603	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						305
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-305	-305	-305	-305	-305	-305	-305	
-5.33%	-204	-204	-204	-204	-204	-204	-204	
-2.67%	-102	-102	-102	-102	-102	-102	-102	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	102	102	102	102	102	102	102	
5.33%	204	204	204	204	204	204	204	
8.00%	305	305	305	305	305	305	305	
KR4201P82725		2019-08 콜272.5						714
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	303	296	286	275	262	248	233
-5.33%	274	258	242	224	205	185	164
-2.67%	205	182	158	135	111	86	62
0%	79	52	26	0	-26	-52	-79
2.67%	-110	-134	-158	-182	-207	-232	-257
5.33%	-352	-369	-387	-407	-428	-449	-471
8.00%	-630	-640	-651	-665	-680	-696	-714
KR4301P82707 2019-08 풋270							377
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-372	-373	-373	-374	-375	-376	-377
-5.33%	-212	-214	-216	-219	-222	-226	-230
-2.67%	-70	-76	-82	-88	-94	-101	-107
0%	21	14	7	0	-7	-14	-21
2.67%	54	51	47	43	38	33	28
5.33%	60	59	58	57	55	53	50
8.00%	61	60	60	60	60	59	58
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							235
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-233	-233	-233	-233	-234	-234	-235
-5.33%	-139	-140	-141	-142	-143	-145	-146
-2.67%	-52	-54	-57	-60	-63	-66	-70
0%	13	8	4	0	-4	-8	-13
2.67%	42	39	36	33	30	26	23
5.33%	49	48	47	46	44	42	40
8.00%	50	50	49	49	49	48	47

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

(단위:백만원)

3,396

공시일	2019-07-15
기준일	2019-07-12

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

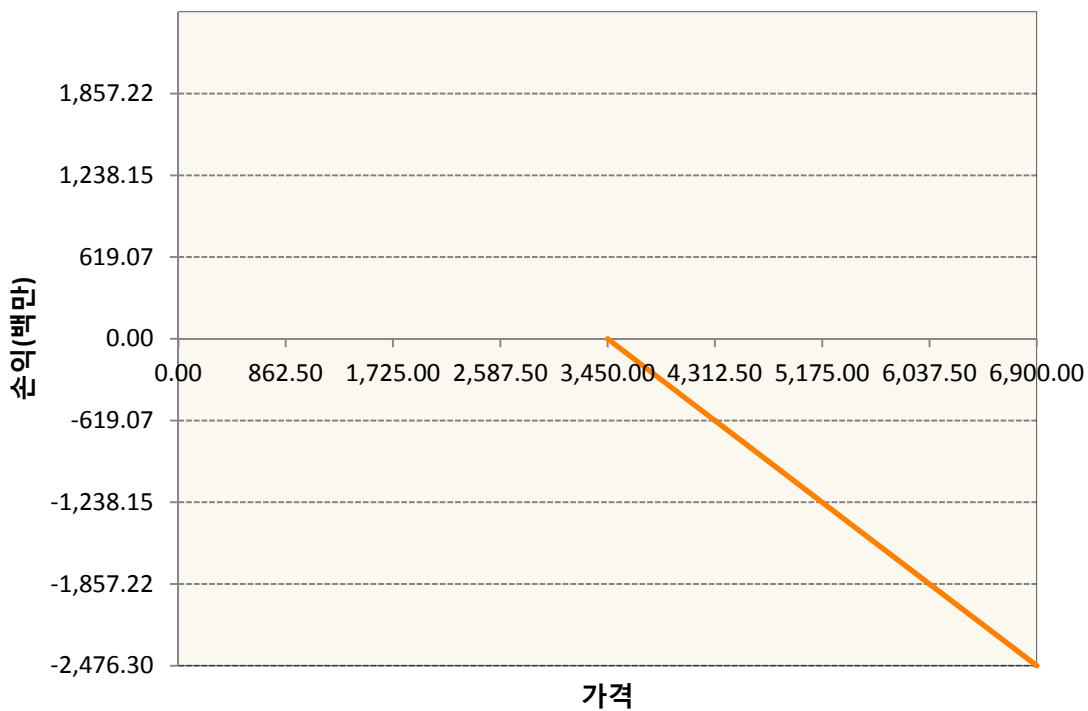
1. 계약금액

(단위:백만원)

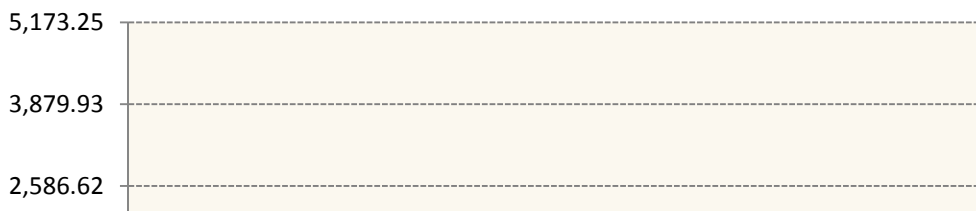
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,655	0	4,655	
누계	유가증권	스왑	47,044	0	47,044	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,299	-15,299	장내
누계	통화	선도	5,317	22,596	-17,279	장외

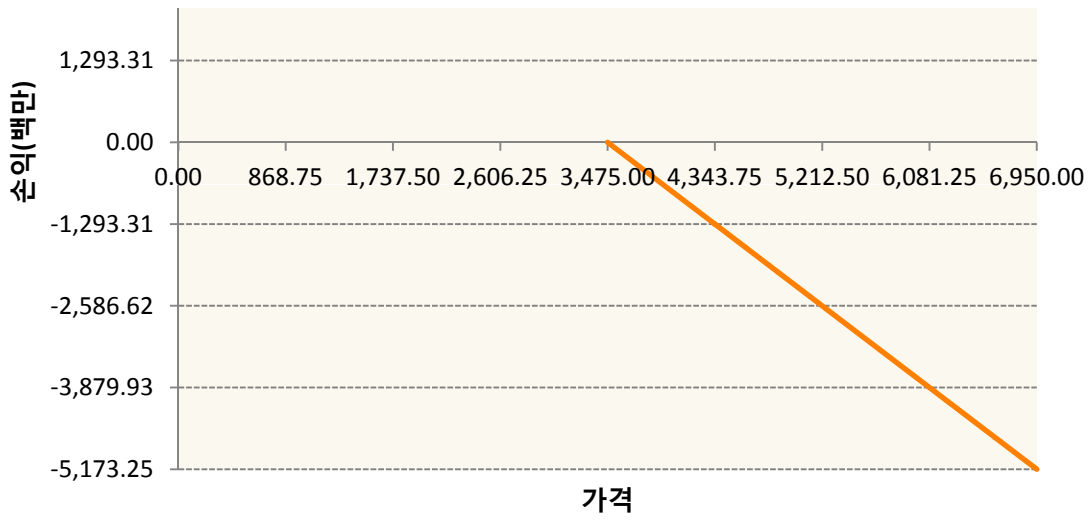
2. 만기시점의 손익구조

OESXN9-C3450-EURO STOXX 50

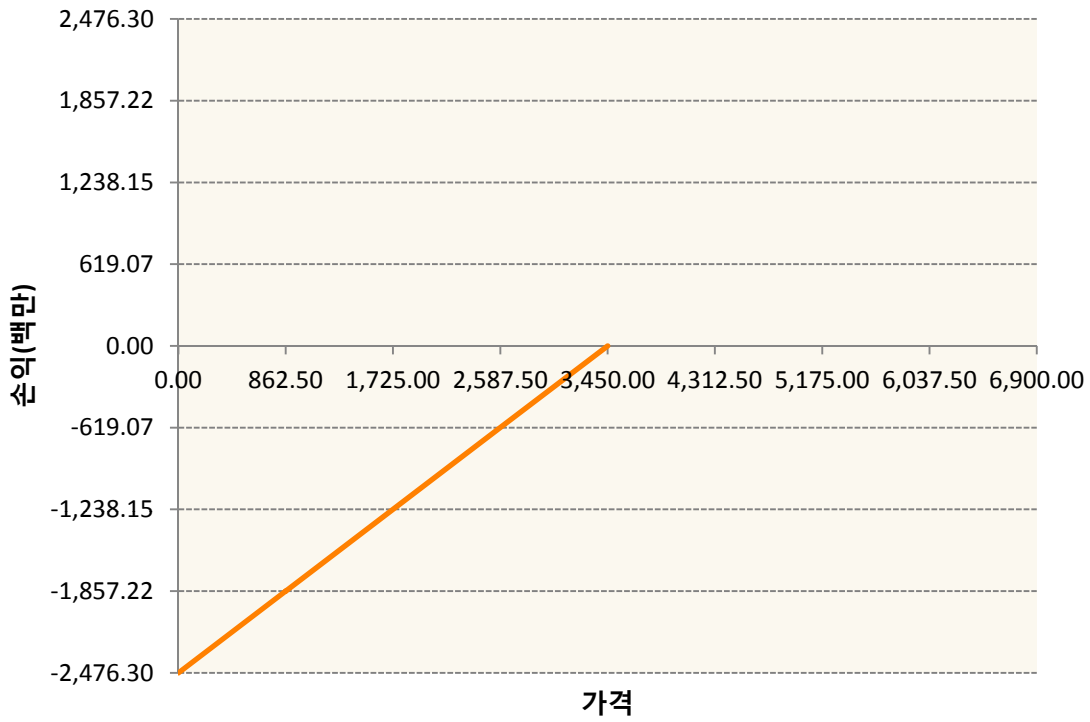


OESXN9-C3475-EURO STOXX 50

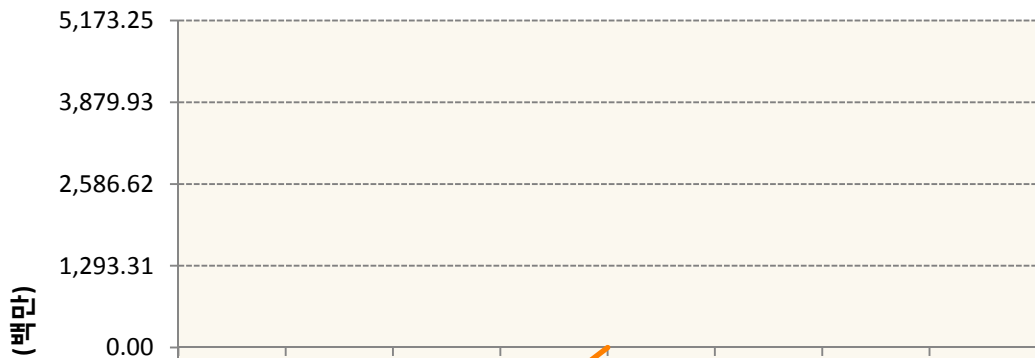


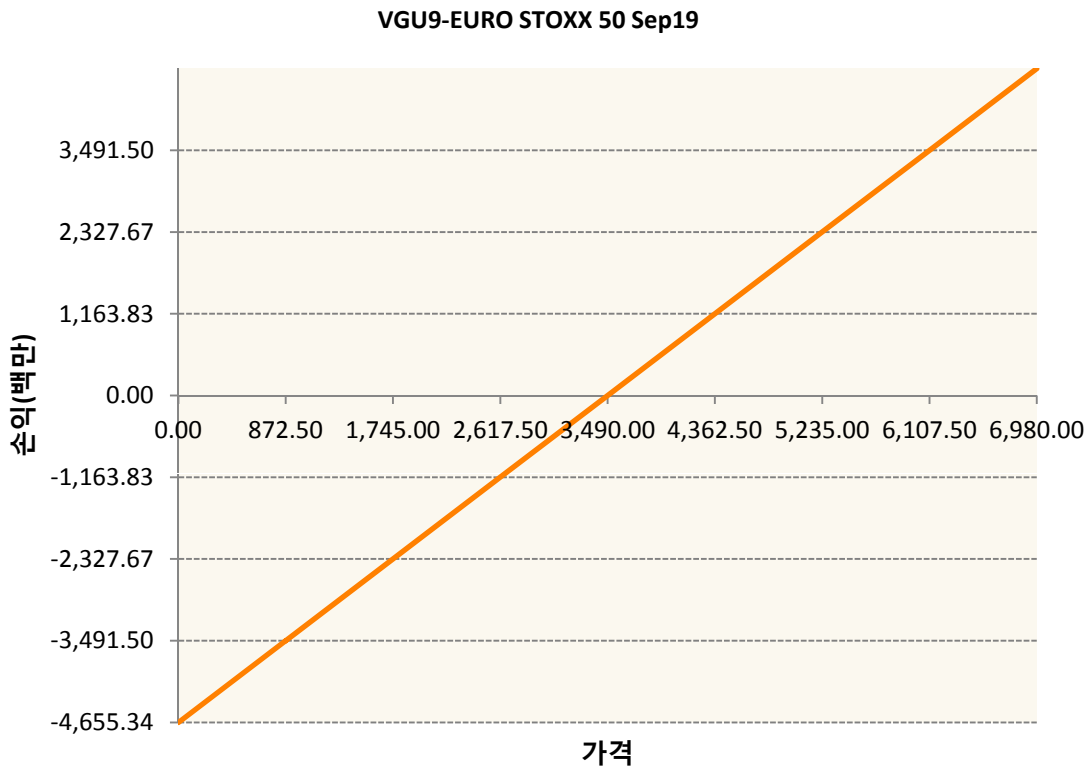
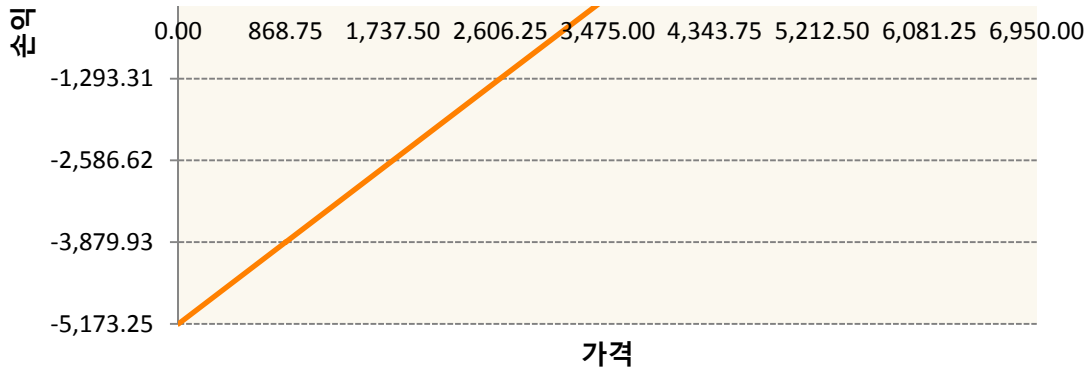


OESXN9-P3450-EURO STOXX 50



OESXN9-P3475-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	81
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	425
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E	1,063
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	319
FX21019N01 EUR/KRW 23-08-19E	425
OESXN9-C34 EURO STOXX 50	198
OESXN9-C34 EURO STOXX 50	414
OESXN9-P34 EURO STOXX 50	198
OESXN9-P34 EURO STOXX 50	414
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	372

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

(단위:백만원)

2,236

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

(단위:백만원)

1,026

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

(단위:백만원)

86

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

(단위:백만원)

132

공시일	2019-07-15
기준일	2019-07-12

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

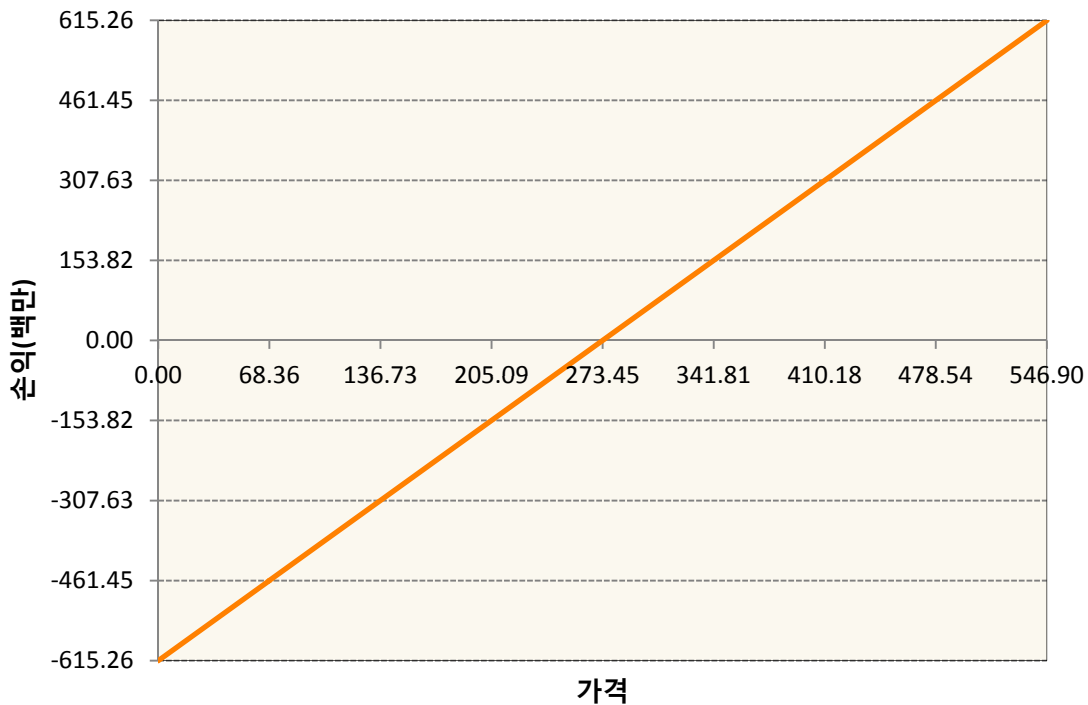
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	615	0	615	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001 2019-09 코스피200지수선물 49

가격	기초자산의 변동성						
	-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	2019-07-15
기준일	2019-07-12

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

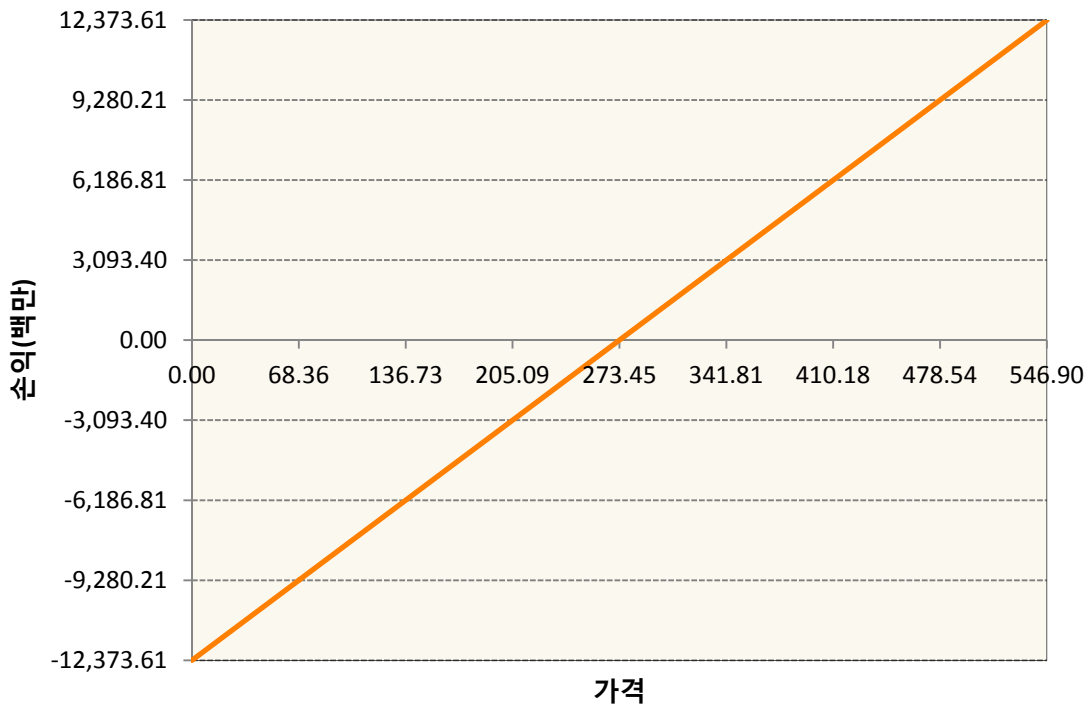
1. 계약금액

(단위:백만원)

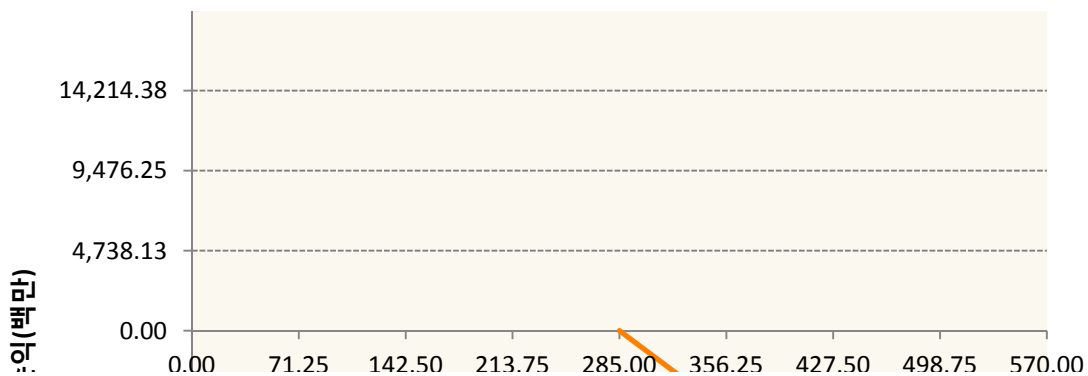
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	2,351	2,206	144	장내
누계	유가증권	선물	12,374	0	12,374	장내
누계	유가증권	옵션	1,698	22,259	-20,561	장내

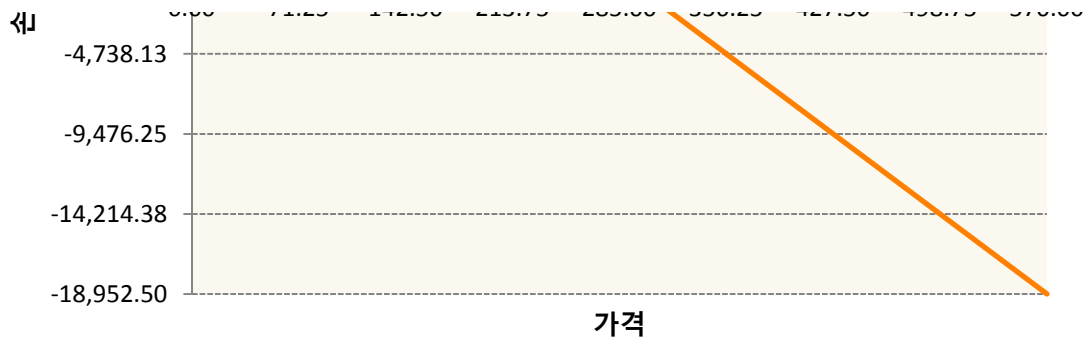
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

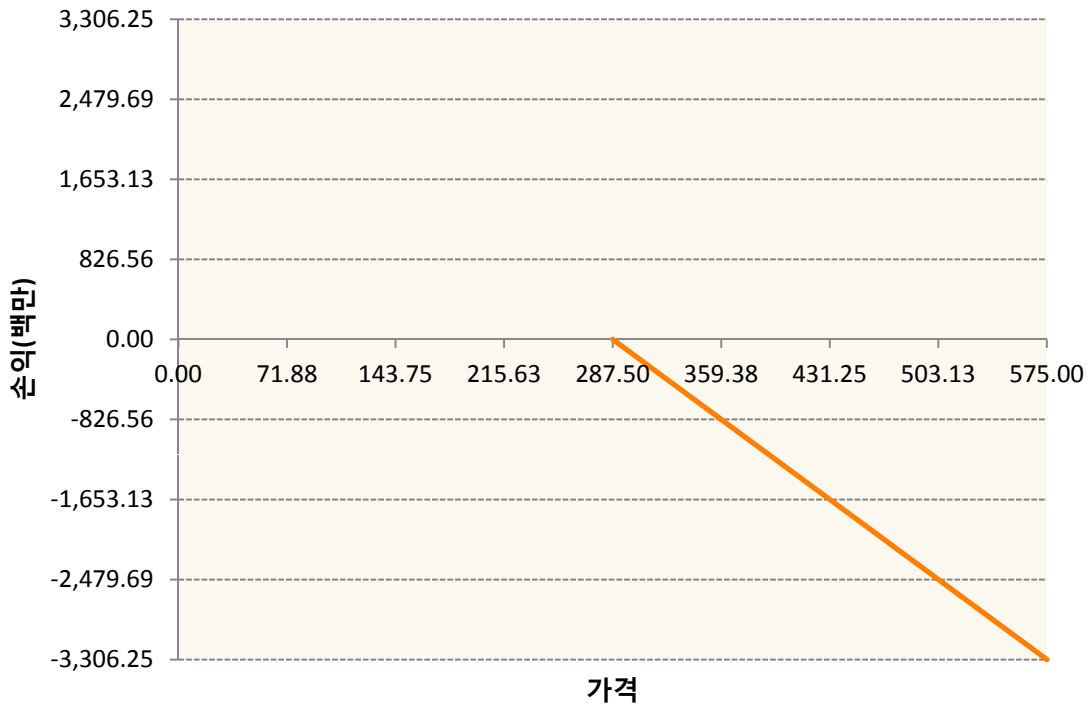


KR4201P82857-2019-08 콜285

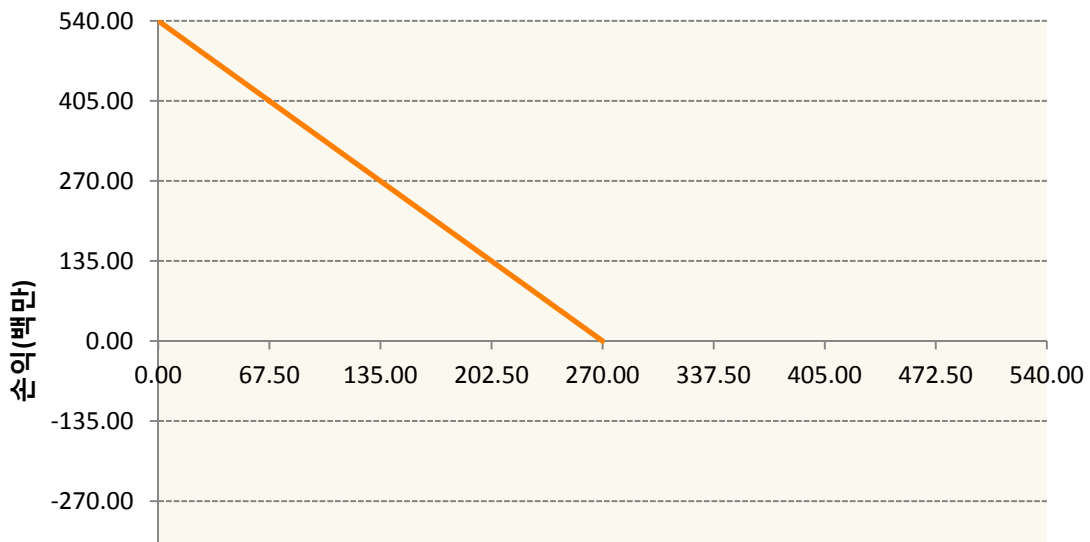


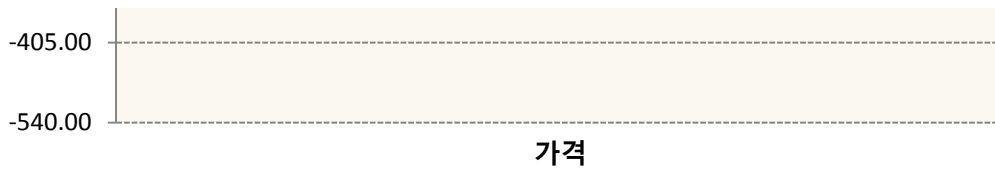


KR4201P82873-2019-08 콜287.5

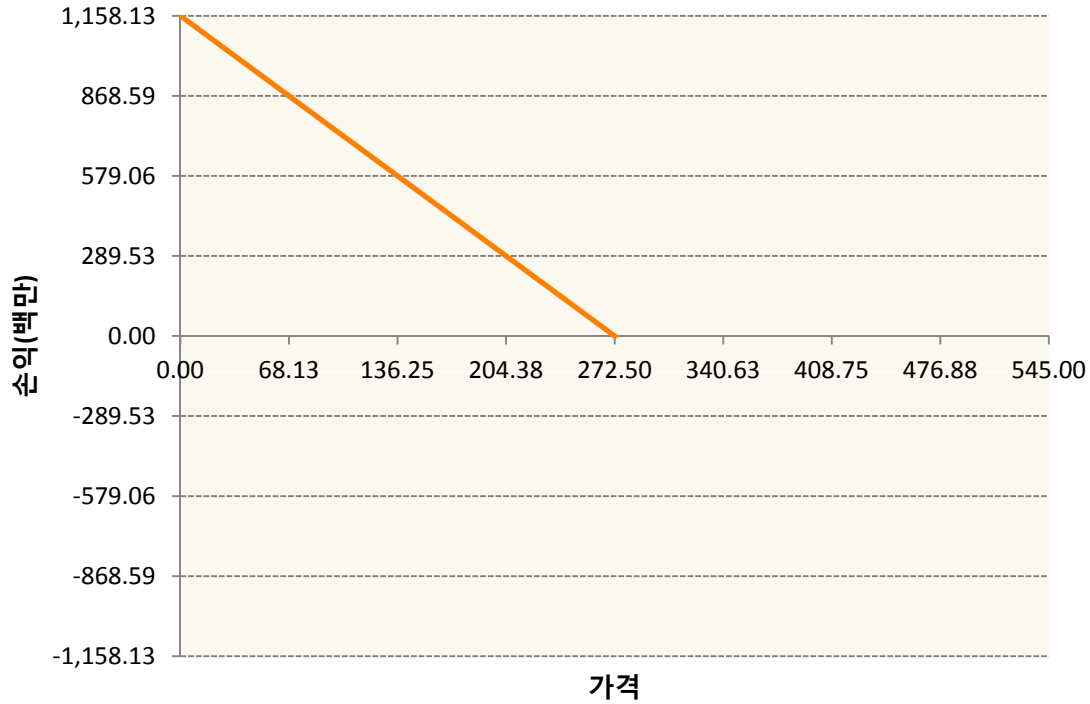


KR4301P82707-2019-08 풋270





KR4301P82723-2019-08 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						987
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-987	-987	-987	-987	-987	-987	-987	
-5.33%	-658	-658	-658	-658	-658	-658	-658	
-2.67%	-329	-329	-329	-329	-329	-329	-329	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	329	329	329	329	329	329	329	
5.33%	658	658	658	658	658	658	658	
8.00%	987	987	987	987	987	987	987	
KR4201P82857		2019-08 콜285						817
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	192	190	186	180	172	162	150	
-5.33%	185	178	168	155	140	122	102	
-2.67%	160	143	123	100	76	49	21	

0%	95	65	33	0	-34	-70	-106
2.67%	-41	-81	-121	-162	-203	-244	-286
5.33%	-266	-309	-352	-395	-437	-480	-523
8.00%	-585	-621	-659	-697	-736	-776	-817
KR4201P82873 2019-08 콜287.5							130
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	27	27	26	25	24	23	21
-5.33%	26	25	24	22	20	17	14
-2.67%	23	21	18	14	11	7	2
0%	15	10	5	0	-5	-11	-17
2.67%	-4	-11	-17	-24	-31	-38	-45
5.33%	-38	-45	-53	-60	-68	-75	-83
8.00%	-88	-94	-101	-108	-116	-123	-130
KR4301P82707 2019-08 풋270							34
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	33	33	33	33	33	33	34
-5.33%	19	19	19	19	20	20	20
-2.67%	6	7	7	8	8	9	10
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-5	-4	-4	-4	-3	-3	-2
5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-4
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							77
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	76	76	76	76	76	76	77
-5.33%	45	46	46	46	47	47	48
-2.67%	17	18	19	20	21	22	23
0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-14	-13	-12	-11	-10	-9	-7
5.33%	-16	-16	-15	-15	-14	-14	-13
8.00%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-15

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

(단위:백만원)

1,660

공시일	2019-07-15
기준일	2019-07-12

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	472	0	472	
누계	유가증권	수익증권	29,144	0	29,144	

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	2019-07-15
기준일	2019-07-12

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	1,989	-1,989	
누계	유가증권	수익증권	55,701	0	55,701	

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	2019-07-15
기준일	2019-07-12

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	350,407	0	350,407	
누계	통화	선도	0	404,489	-404,489	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		472
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		472
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		377
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		792
FX21019M00 KRW/USD 15-07-19E		472
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		377
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		660
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		943
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		660
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E		660
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		566
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		3,019
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		2,264
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E		283
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E		283
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E		792
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E		632
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E		472
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		1,887
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		1,887
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E		698
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E		698
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E		1,302
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E		2,558
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		3,113
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		2,113

FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E

1,698
2,075
132

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

(단위:백만원)

10,701

공시일	2019-07-15
기준일	2019-07-12

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

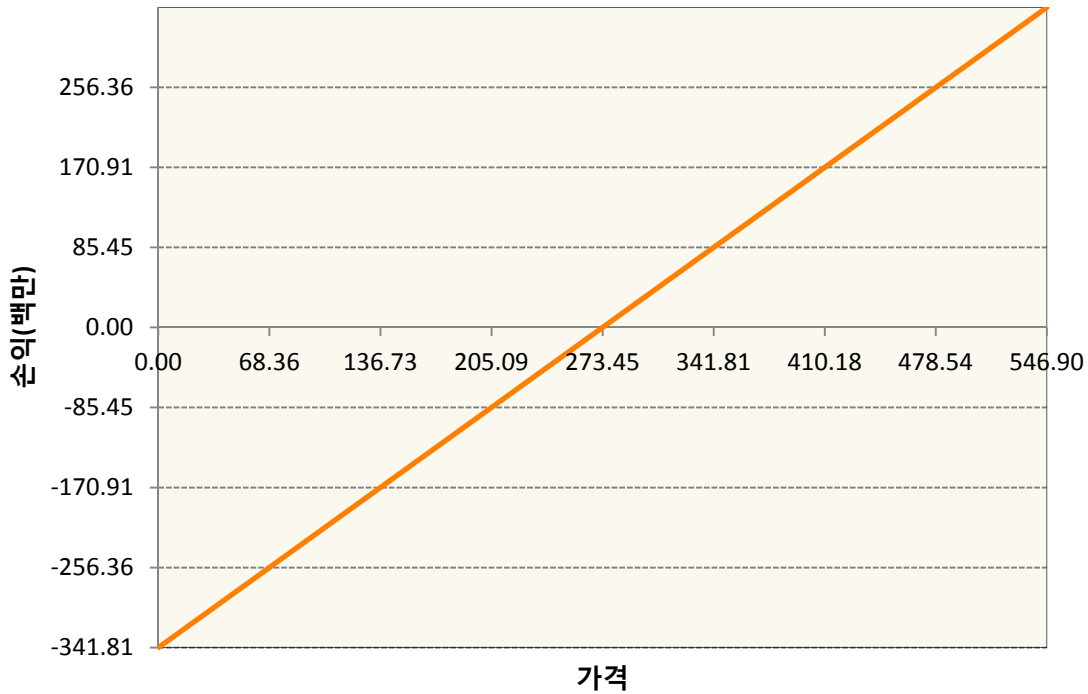
1. 계약금액

(단위:백만원)

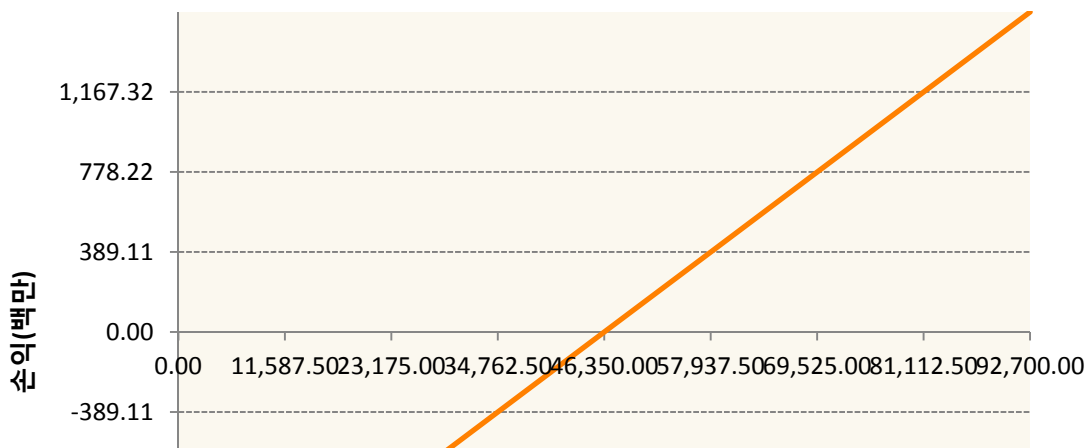
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,898	0	1,898	장내

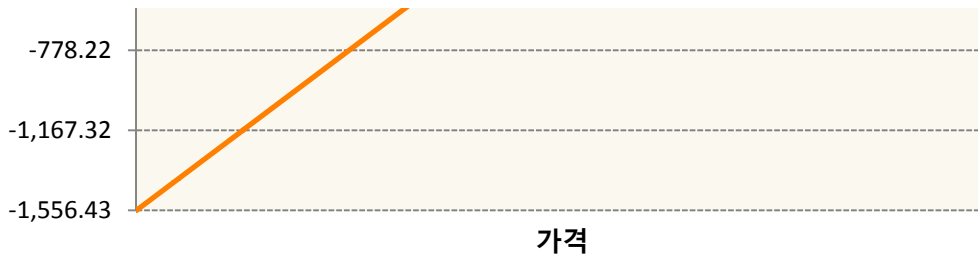
2. 만기시점의 손익구조

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)

169

공시일	2019-07-15
기준일	2019-07-12

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

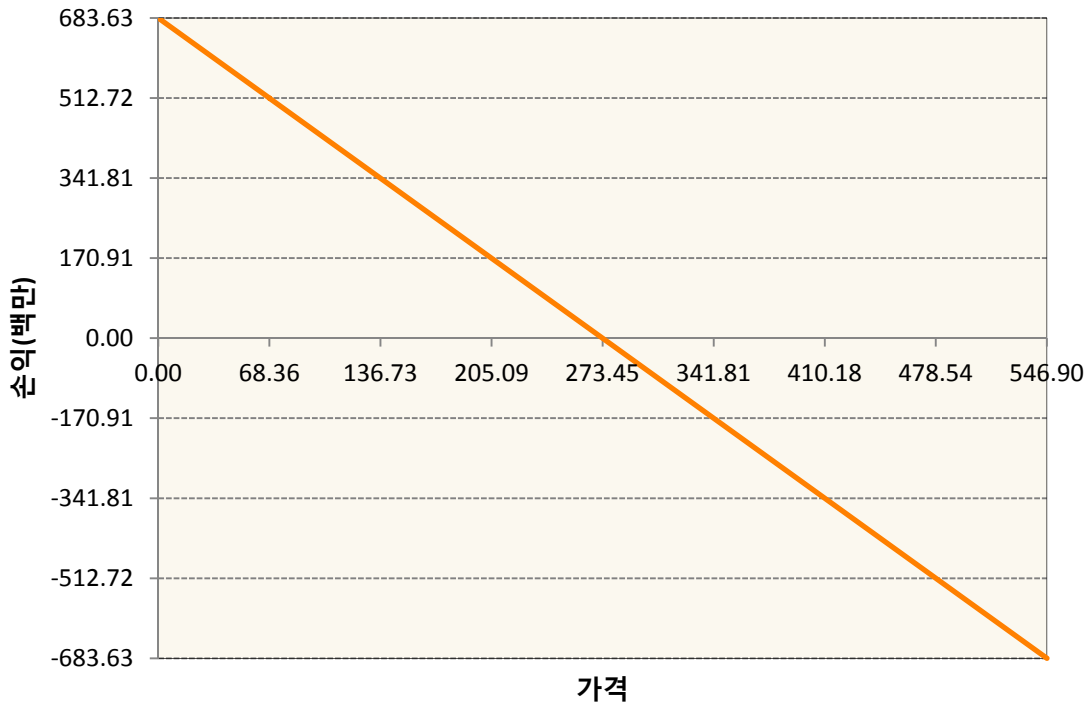
1. 계약금액

(단위:백만원)

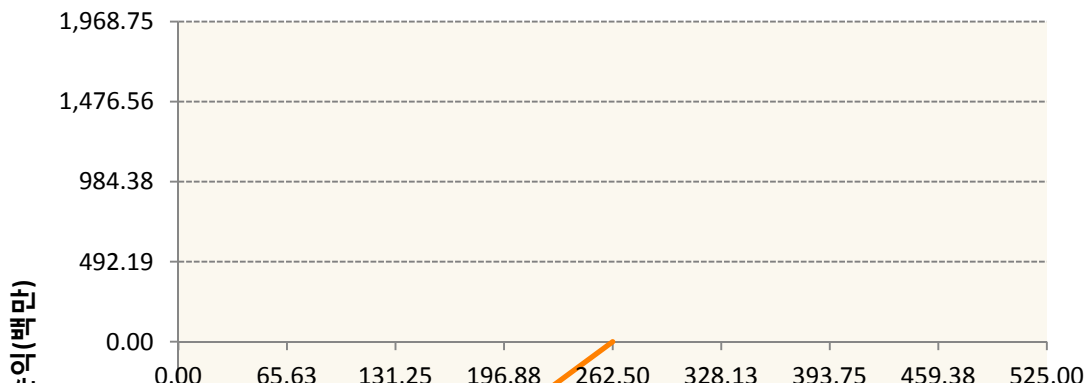
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	988	1,054	-66	장내
누계	유가증권	선물	0	684	-684	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,625	-3,625	장내

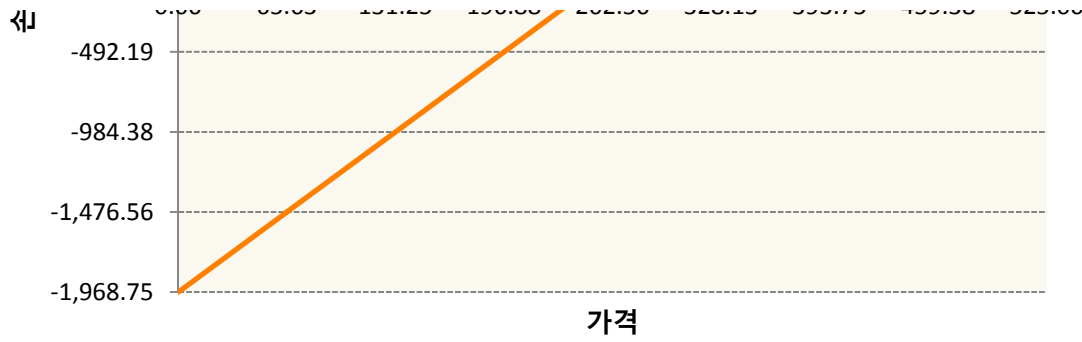
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

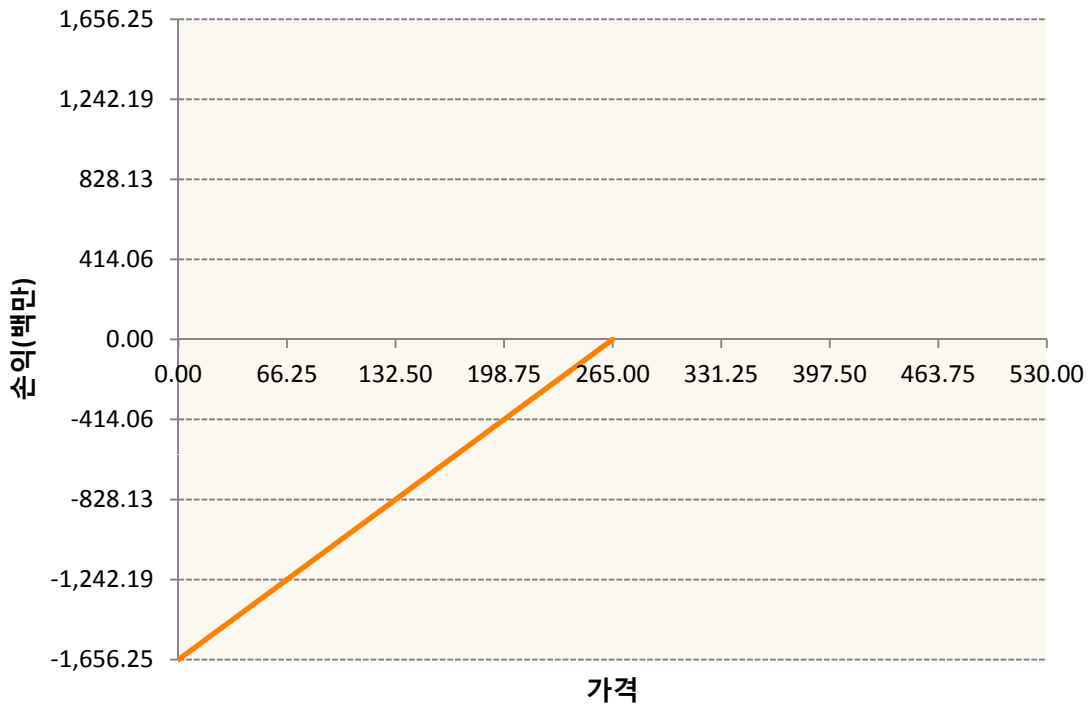


KR4301P82624-2019-08 풋262.5





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						89
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-84	-84	-85	-86	-87	-88	-89
-5.33%	-36	-38	-40	-42	-44	-46	-49
-2.67%	-7	-9	-11	-13	-16	-18	-20
0%	3	2	1	0	-1	-3	-5
2.67%	5	5	5	4	4	3	2
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	5	5	5	5	5	5	5
KR4301P82657 2019-08 풋265							85
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-82	-82	-83	-83	-84	-85	-85
-5.33%	-40	-41	-43	-44	-45	-47	-49
-2.67%	-9	-11	-13	-15	-17	-19	-21
0%	4	3	1	0	-1	-3	-5
2.67%	7	7	6	6	5	4	3
5.33%	7	7	7	7	7	7	6
8.00%	7	7	7	7	7	7	7

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

(단위:백만원)

190

공시일	2019-07-15
기준일	2019-07-12

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	18,364	0	18,364	
누계	통화	선도	0	18,278	-18,278	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		179
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		981
FX21019N01 KRW/USD 12-08-19E		160

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

(단위:백만원)

484

공시일	2019-07-15
기준일	2019-07-12

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	2019-07-15
기준일	2019-07-12

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

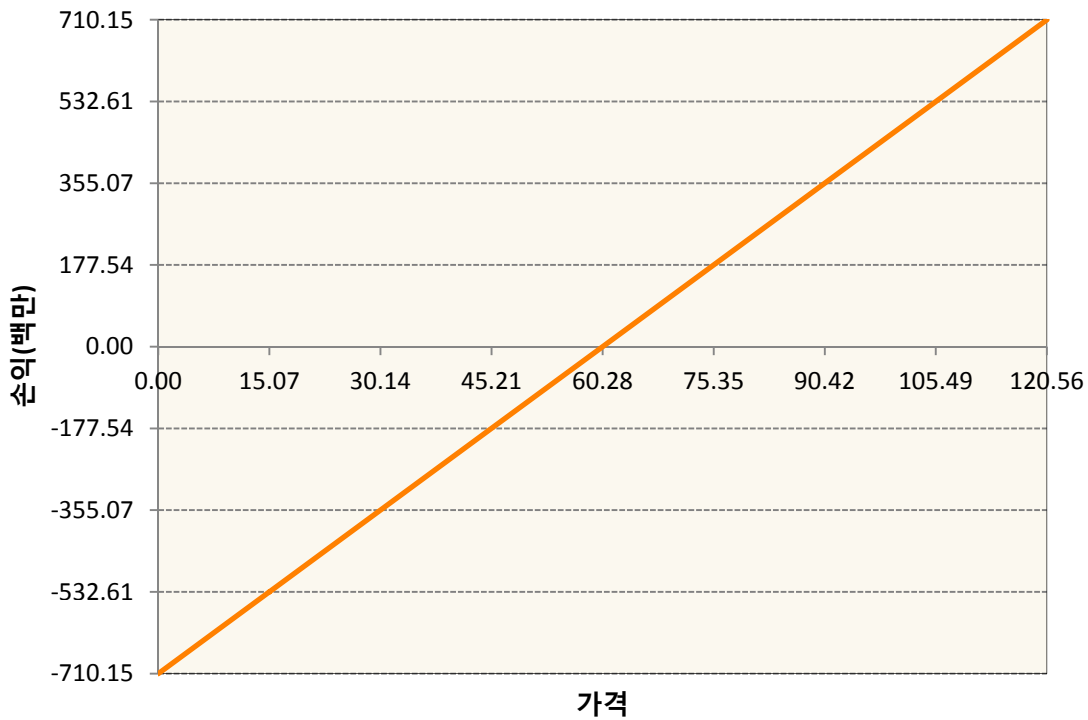
1. 계약금액

(단위:백만원)

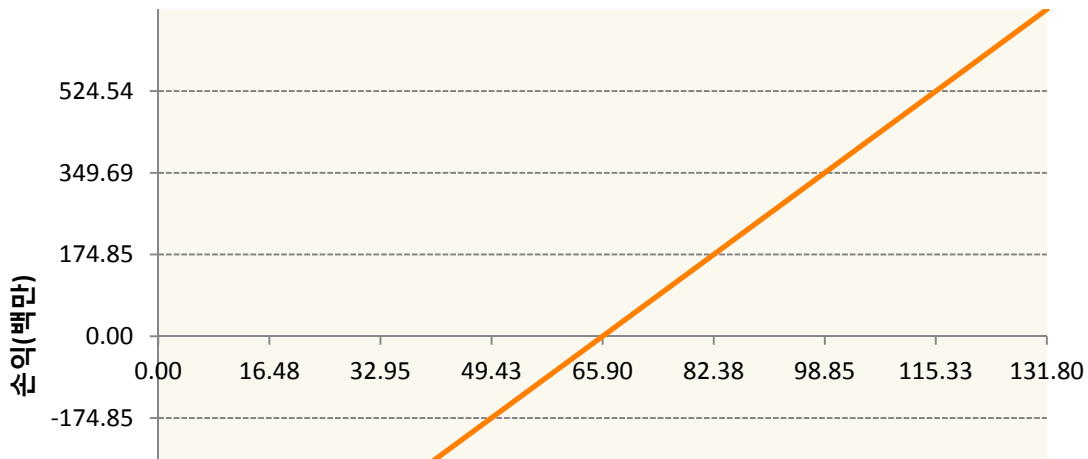
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,777	118	2,660	

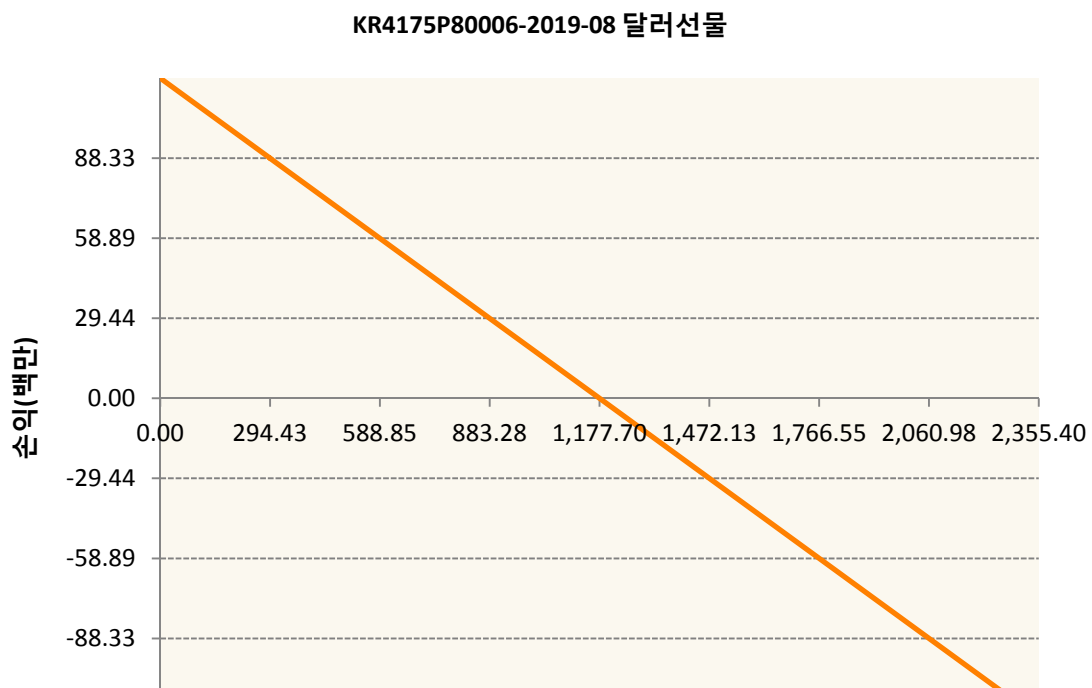
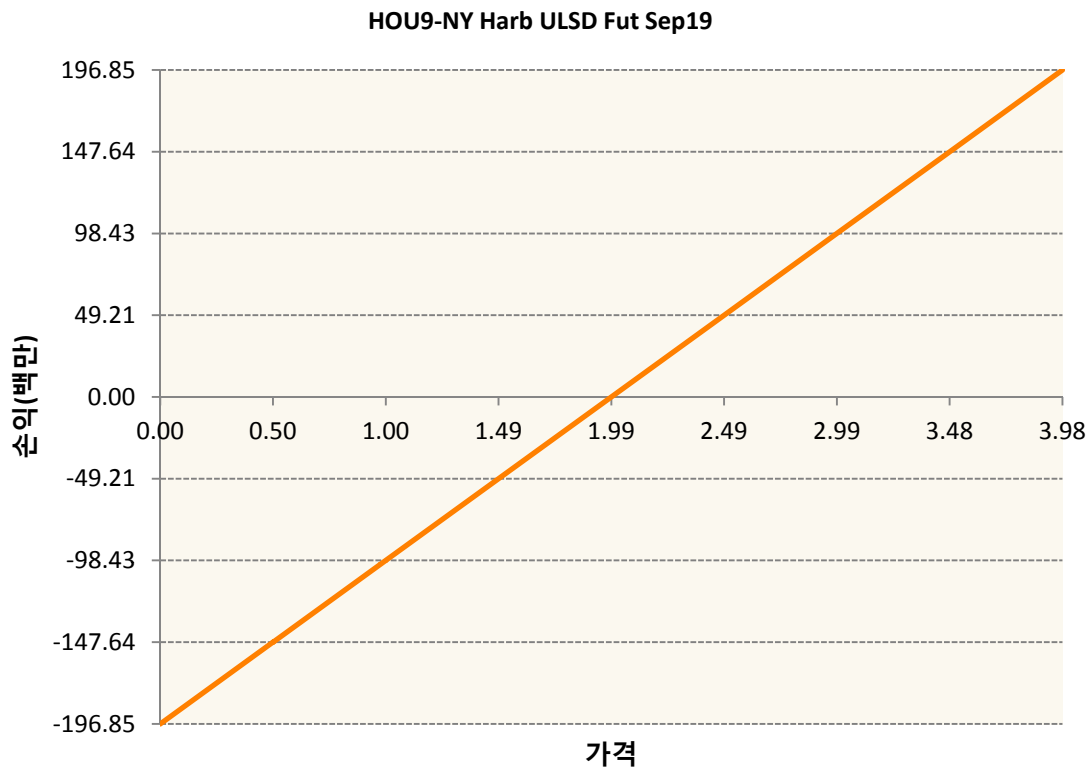
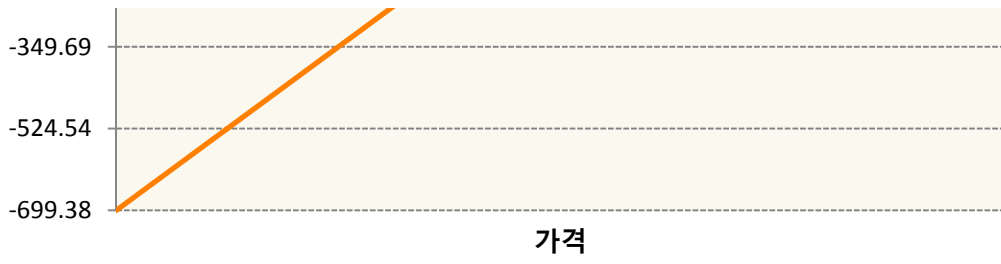
2. 만기시점의 손익구조

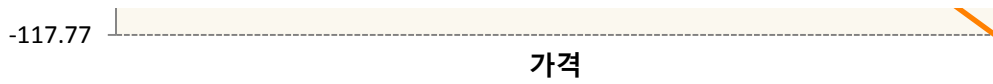
CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19



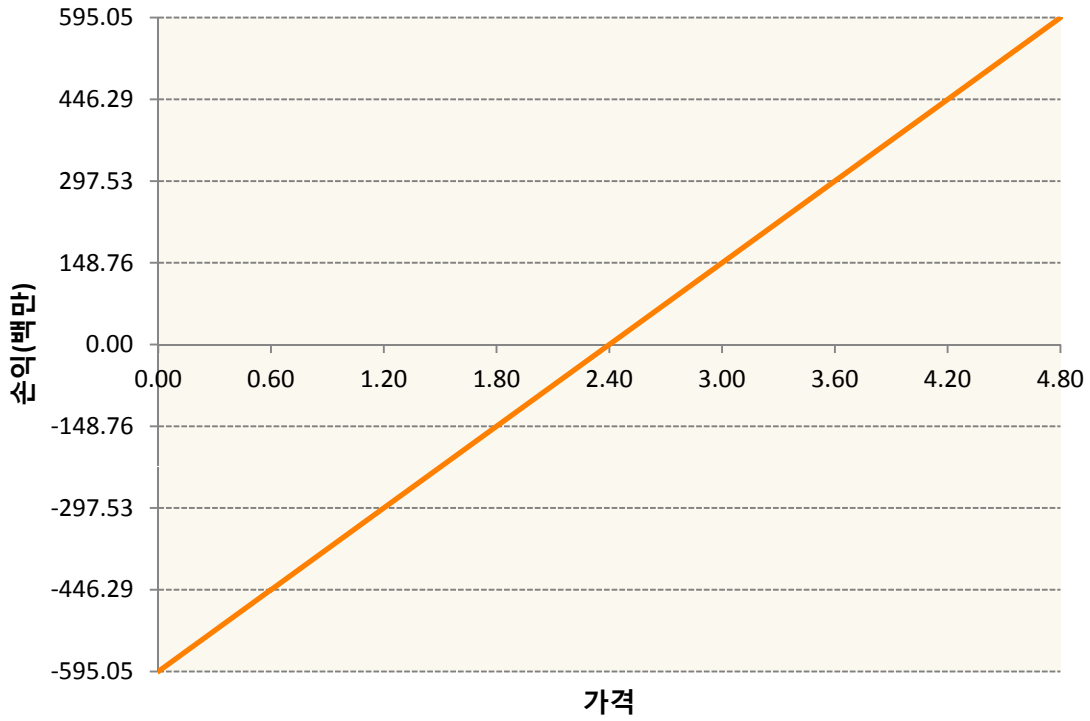
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19



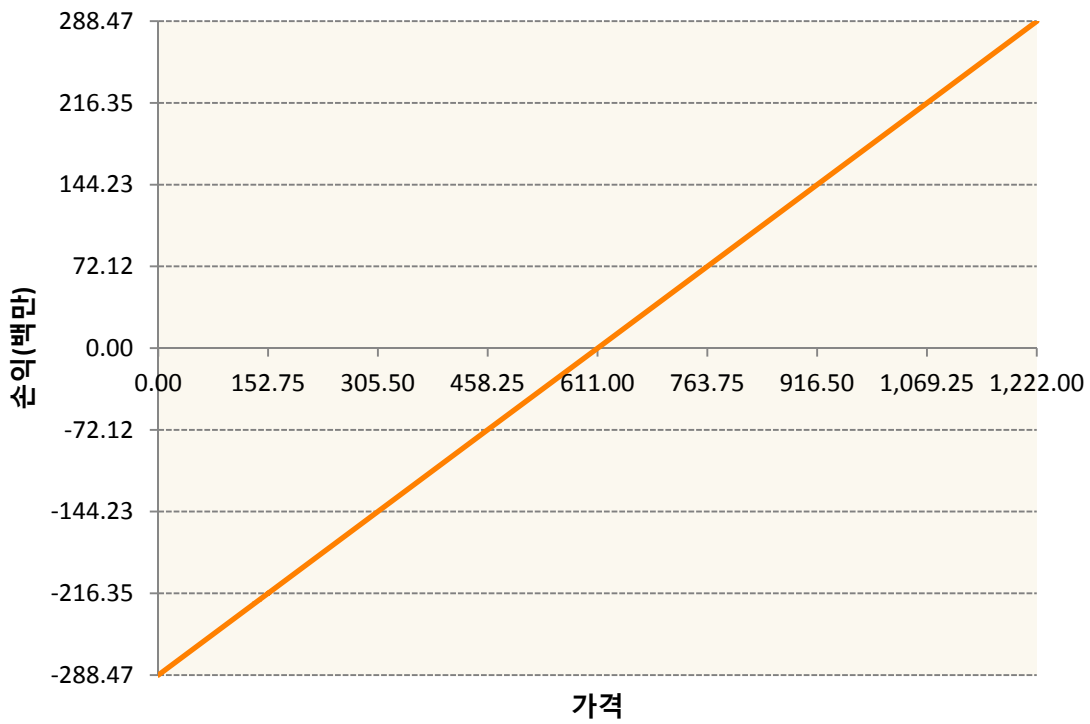




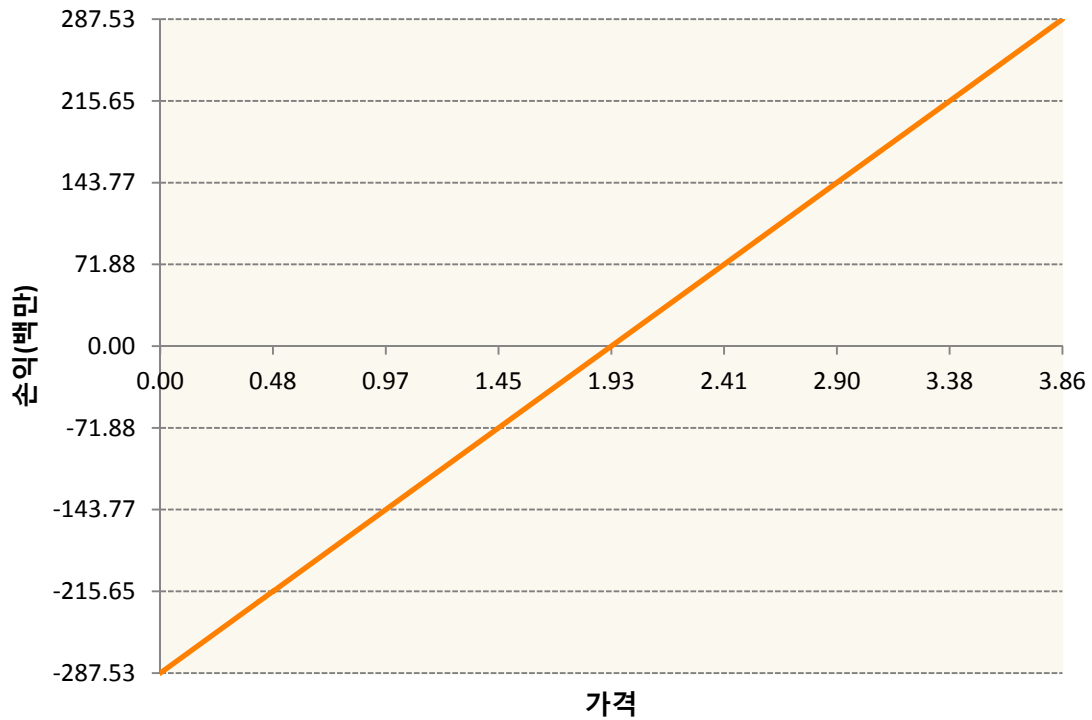
NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



QSU9-Low Su Gasoil G Sep19



XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	57
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	56
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	16
KR4175P800	2019-08 달러선물	9
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	48
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	23
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	23

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

(단위:백만원)

411

공시일	2019-07-15
기준일	2019-07-12

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

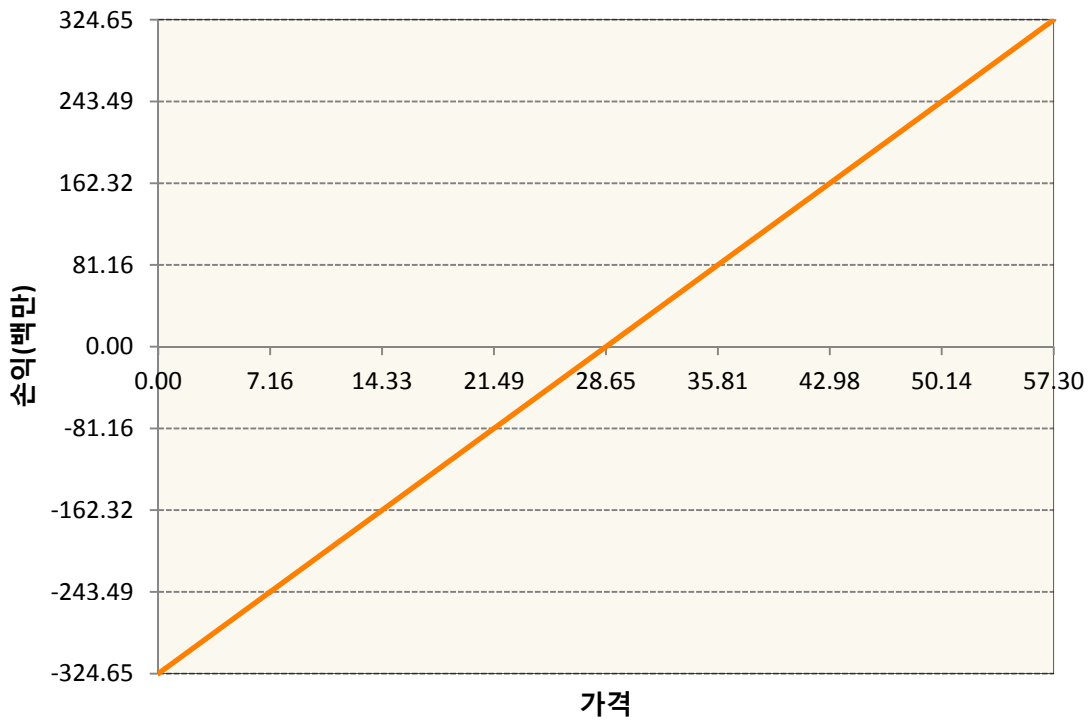
1. 계약금액

(단위:백만원)

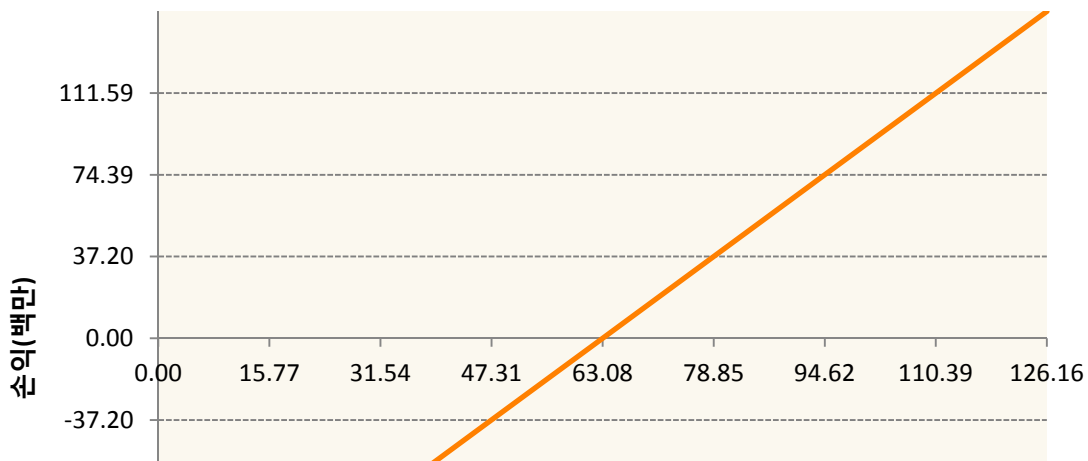
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,180	200	2,980	

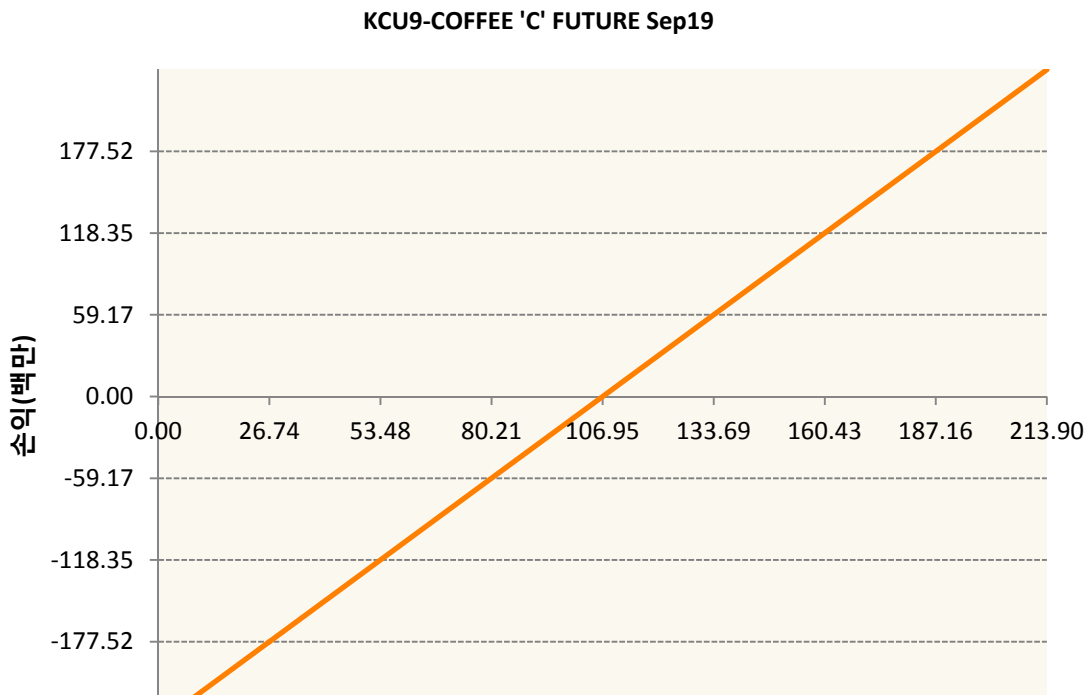
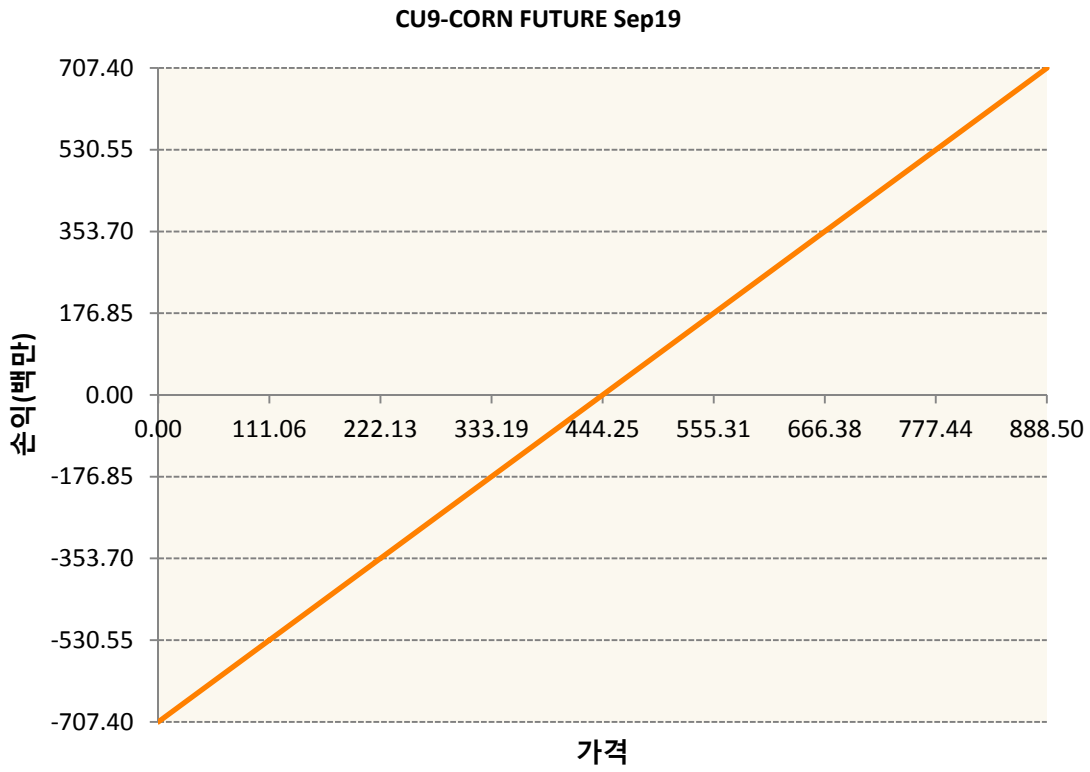
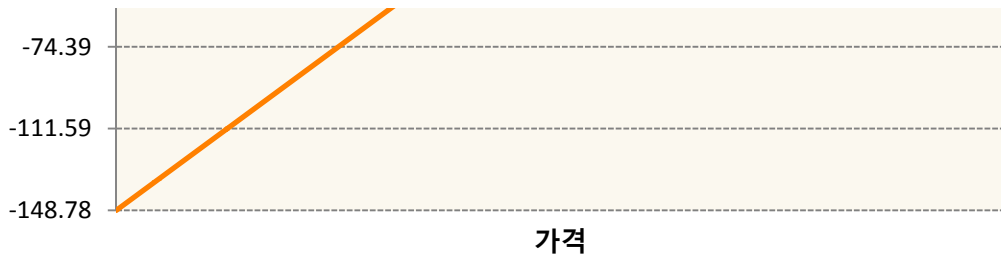
2. 만기시점의 손익구조

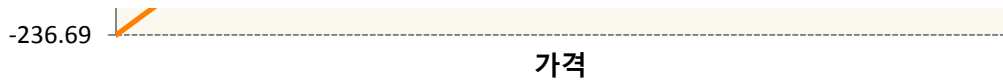
BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19



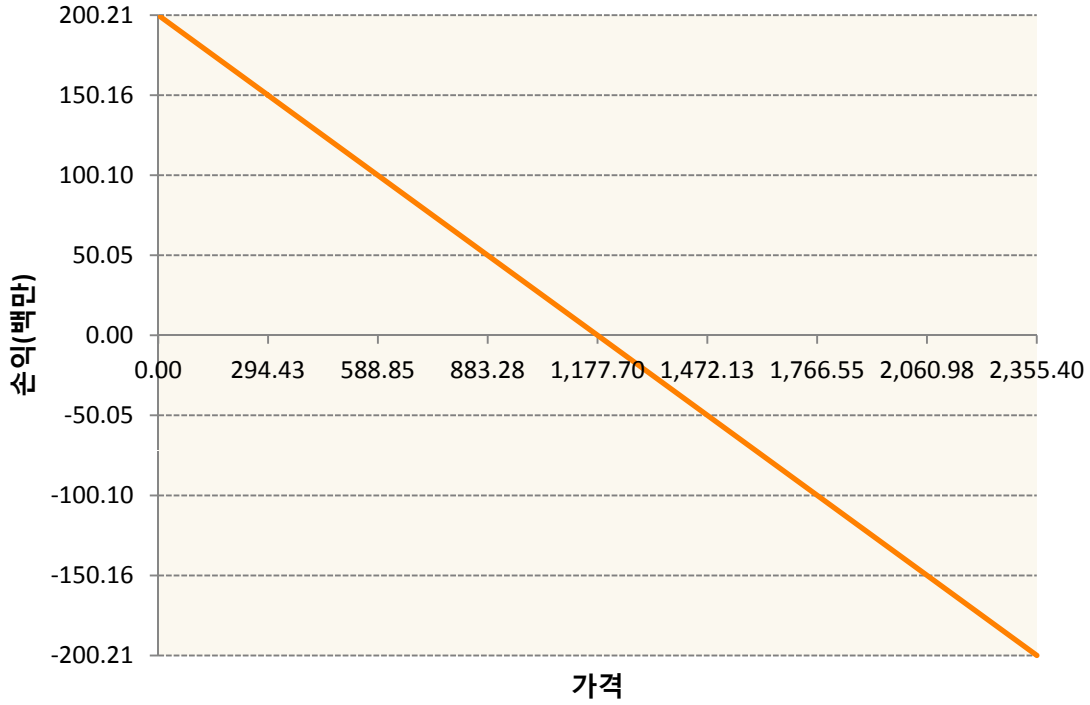
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



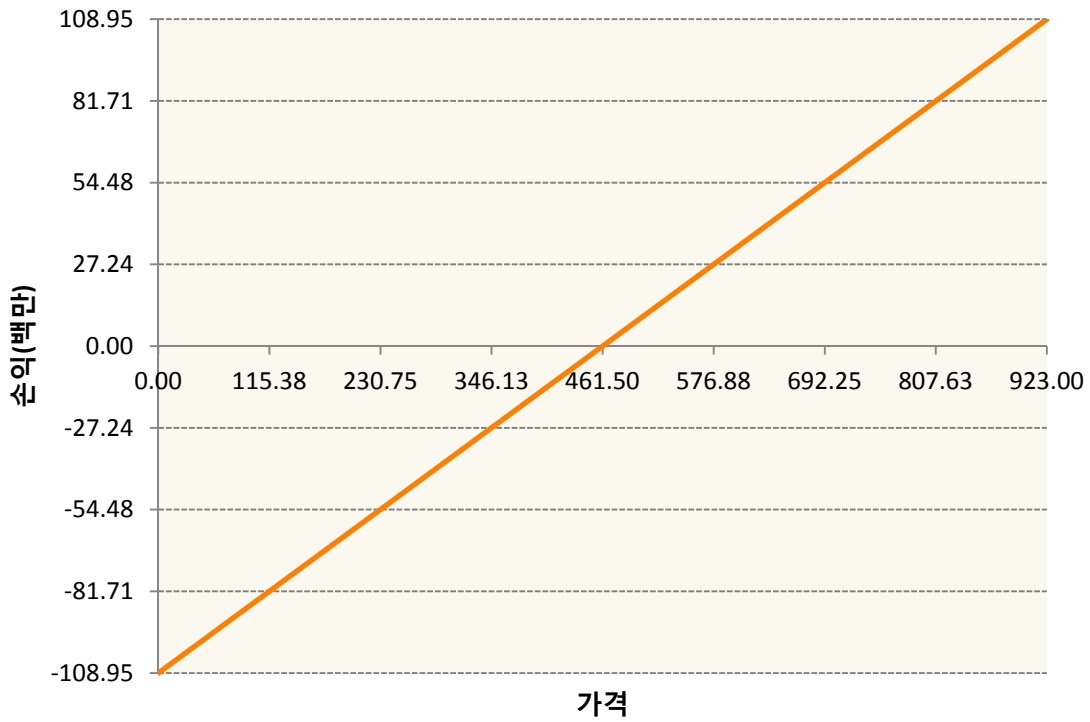




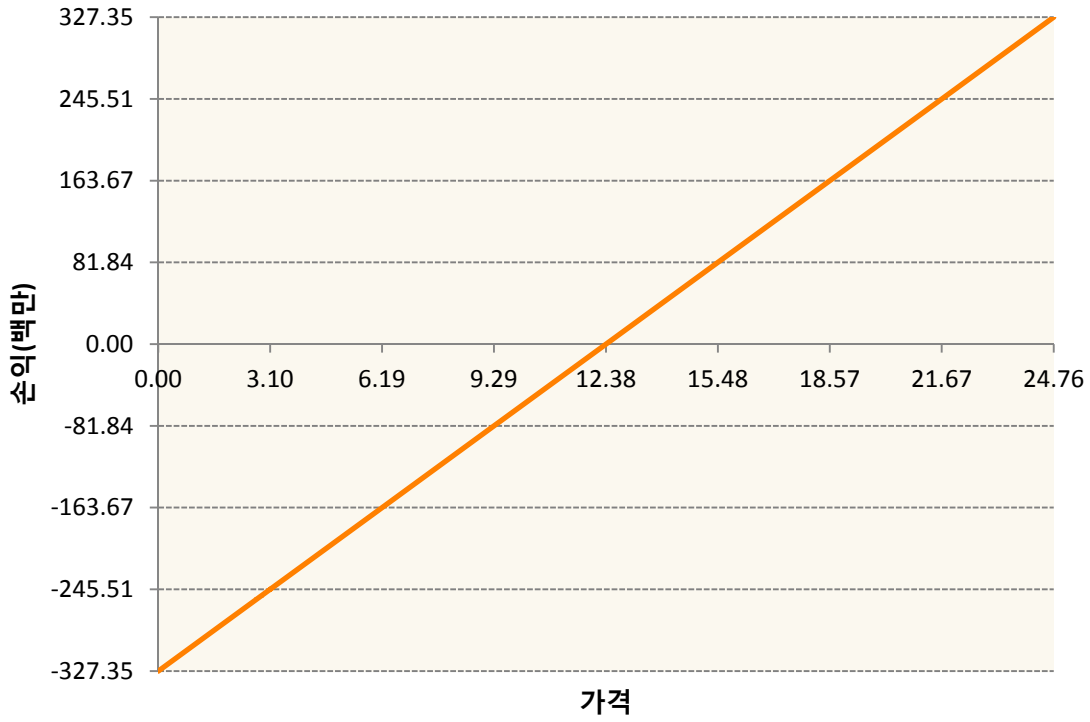
KR4175P80006-2019-08 달러선물



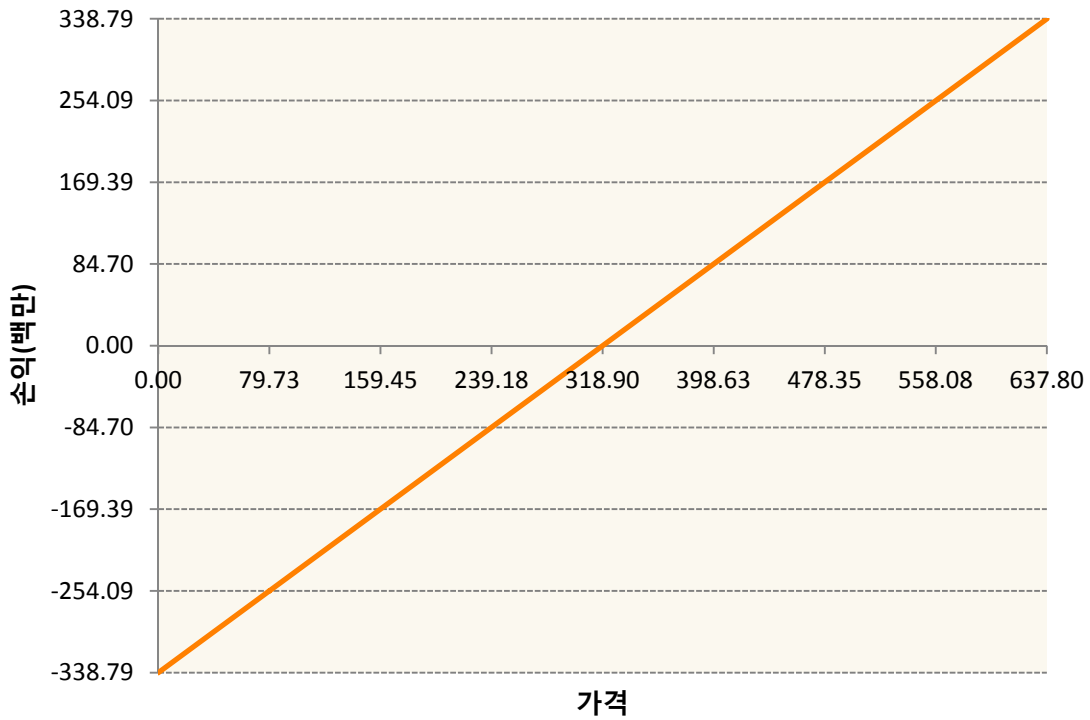
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

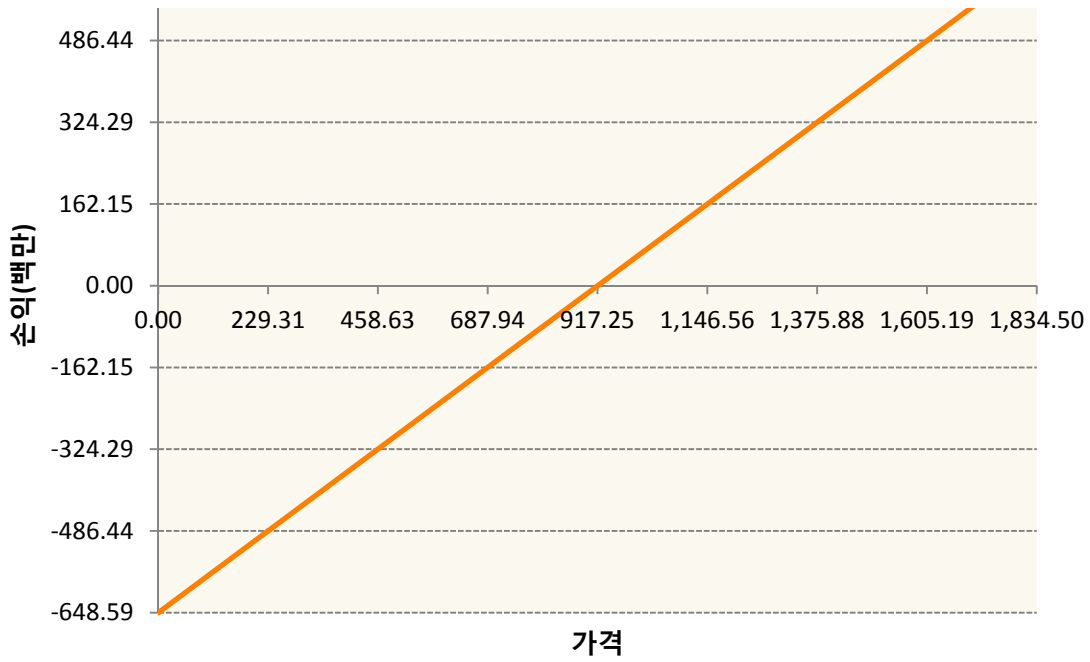


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

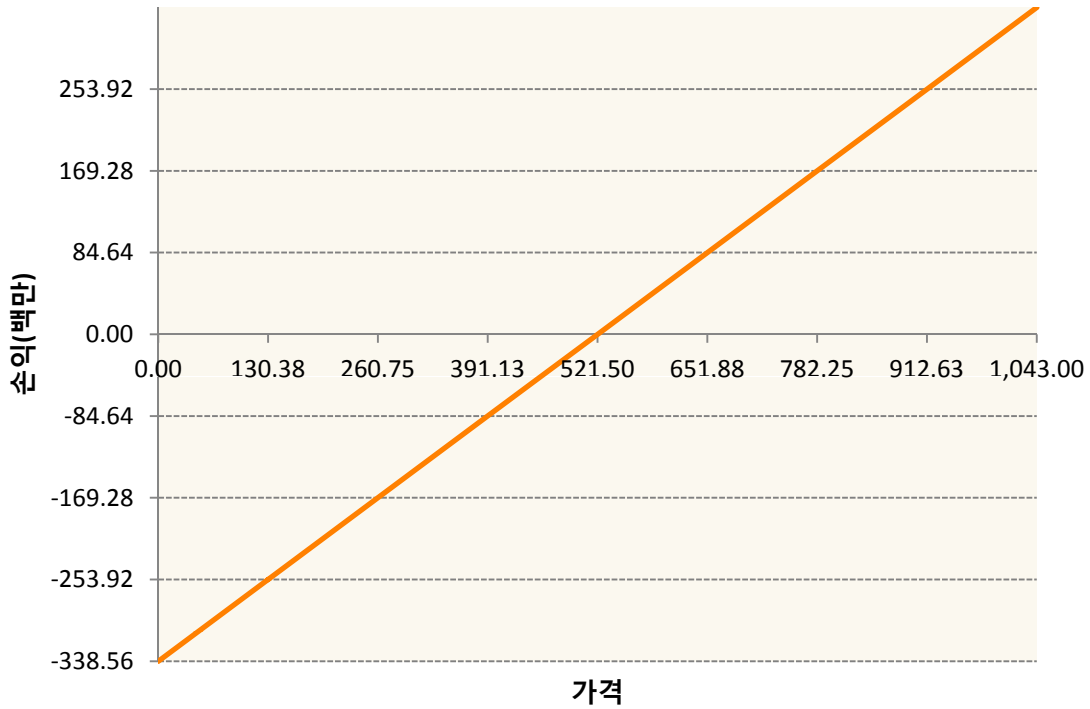


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





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	57
KCU9	COFFEE 'C' FUTURE Sep19	19
KR4175P800	2019-08 달러선물	16

KWU9	KC HRW WHEAT FUT Sep19	9
SBV9	SUGAR #11 (WORLD) Oct19	26
SMZ9	SOYBEAN MEAL FUTR Dec19	27
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	52
WU9	WHEAT FUTURE(CBT) Sep19	27

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

(단위:백만원)

279