

공시일	2019-07-18
기준일	2019-07-17

## 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)

90

공시일	2019-07-18
기준일	2019-07-17

## 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)

670

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-18
기준일	2019-07-17

## 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)	386
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	141

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

<b>849</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-18
기준일	2019-07-17

## 유로인덱스모(주식-파생형)

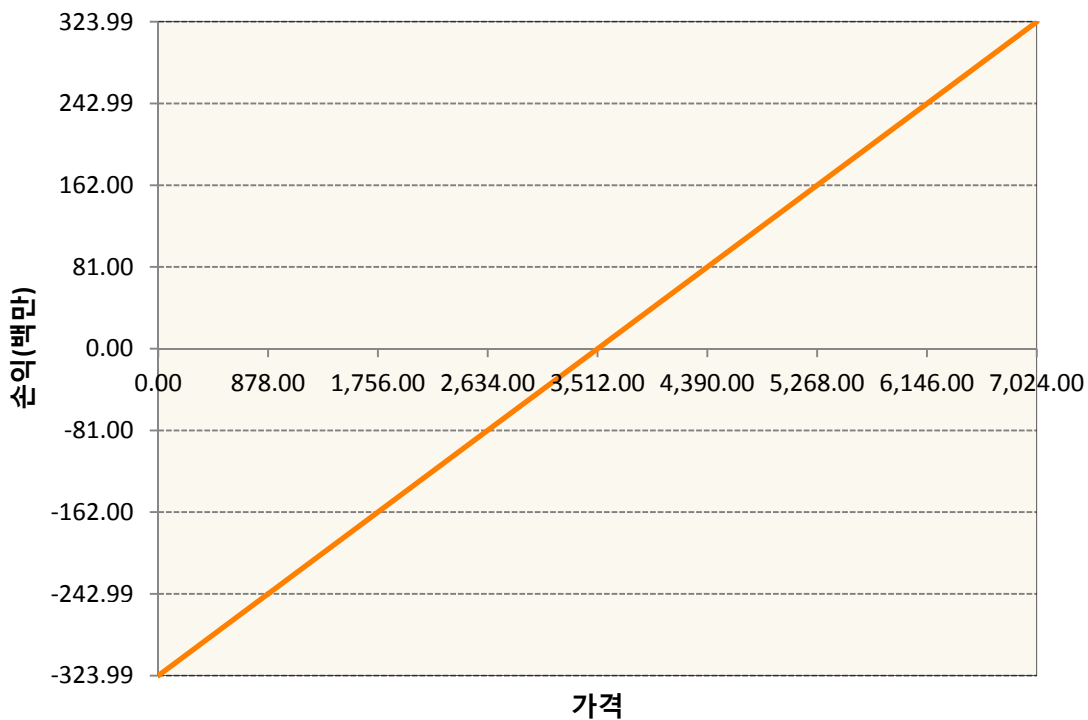
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	324	0	324	

### 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	2019-07-18
기준일	2019-07-17

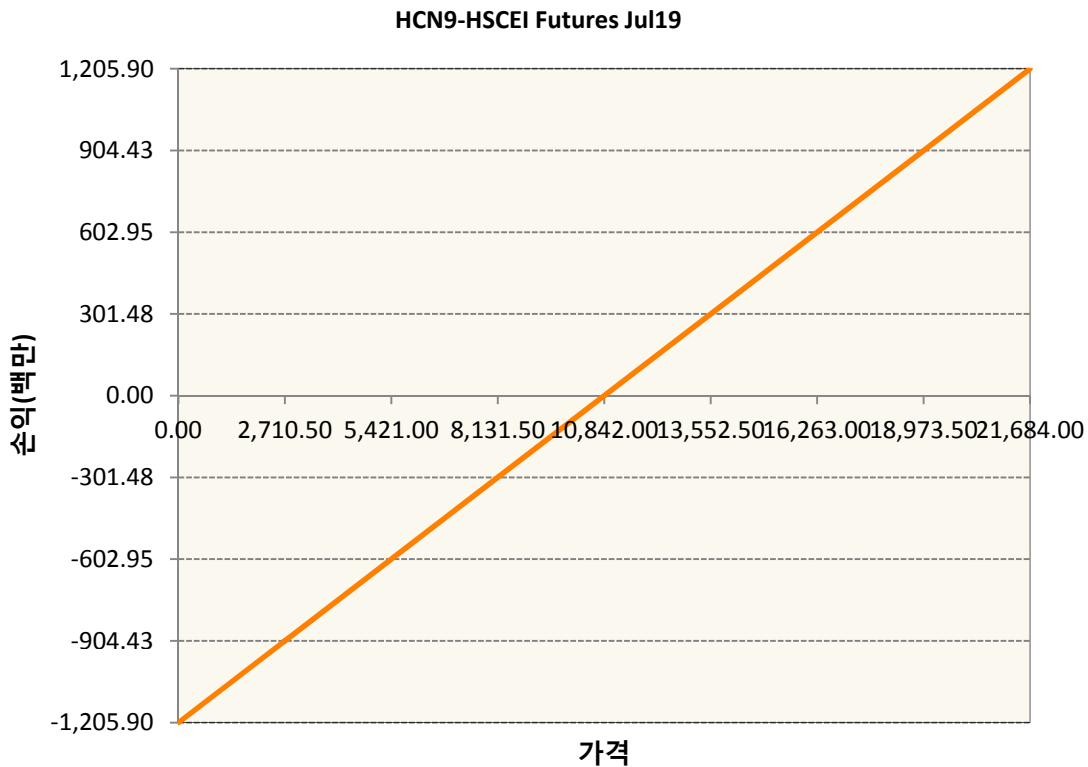
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,206	0	1,206	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	2019-07-18
기준일	2019-07-17

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

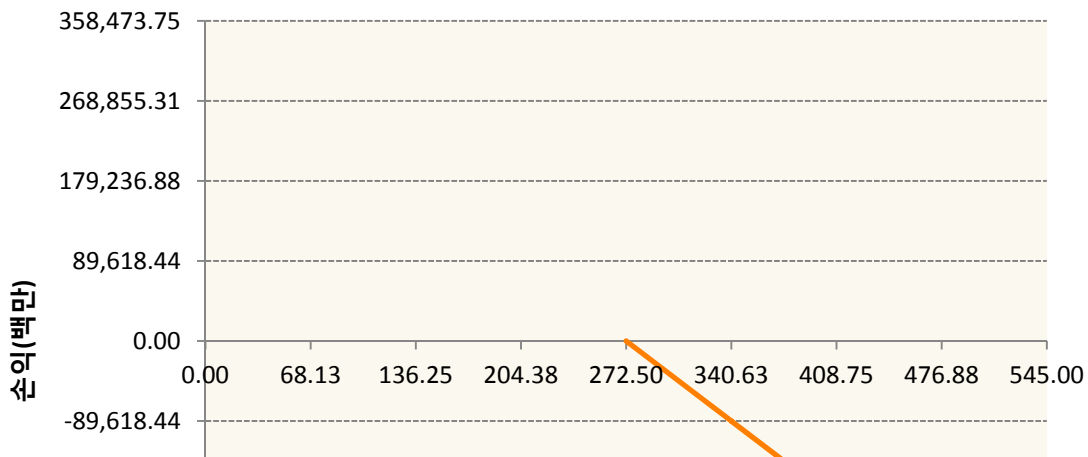
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	597,914	-597,914	장내

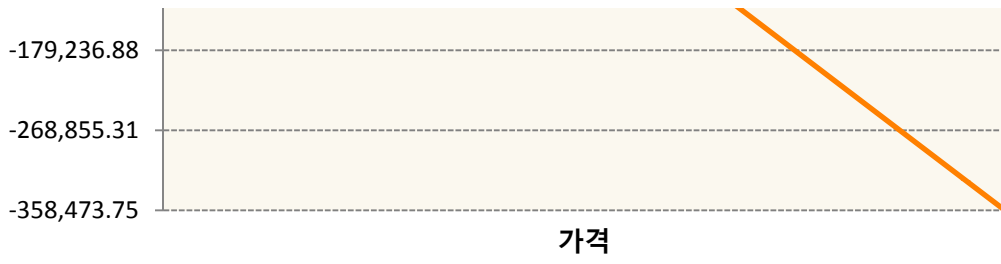
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P82709-2019-08 콜270

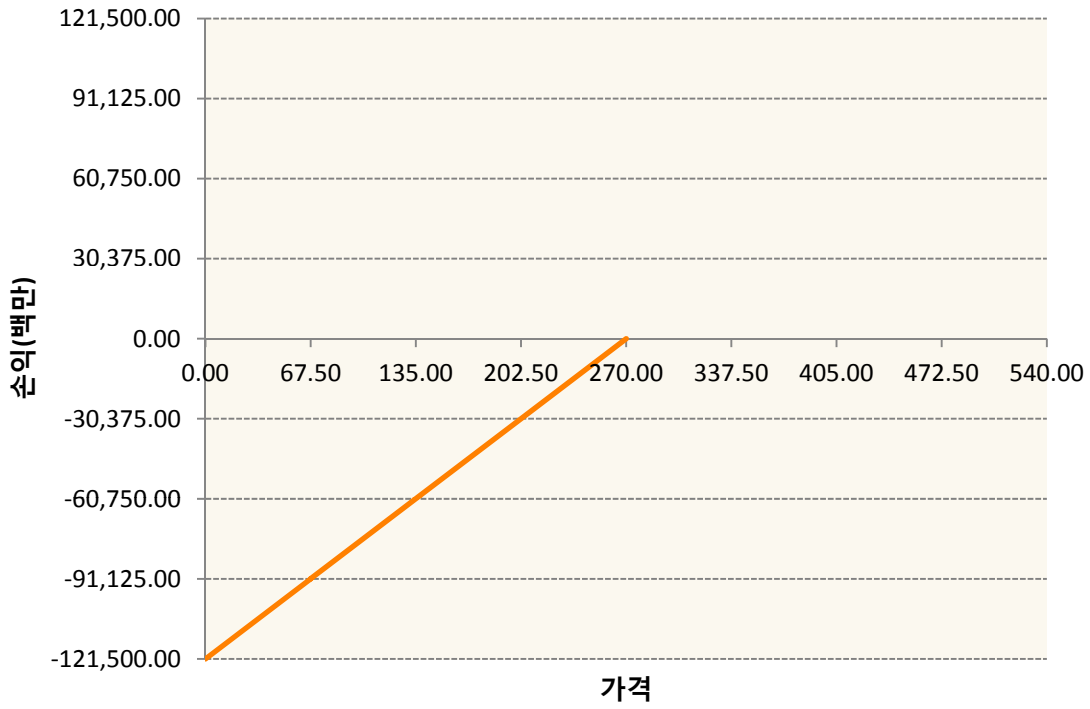


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

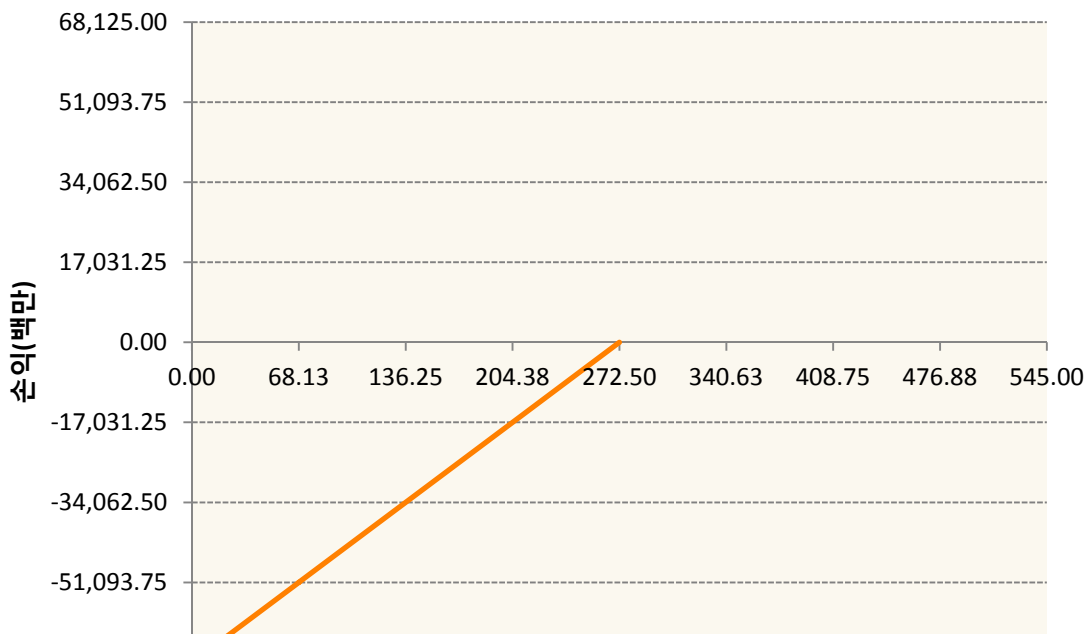




**KR4301P82707-2019-08 풋270**



**KR4301P82723-2019-08 풋272.5**



가격

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

KR4201P82709 2019-08 콜270							3,196
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,302	1,276	1,243	1,204	1,159	1,109	1,055
-5.33%	1,185	1,128	1,065	997	925	850	772
-2.67%	884	794	703	610	517	422	327
0%	301	201	100	0	-100	-201	-301
2.67%	-582	-665	-750	-839	-929	-1,021	-1,114
5.33%	-1,698	-1,749	-1,807	-1,872	-1,940	-2,013	-2,090
8.00%	-2,948	-2,973	-3,004	-3,043	-3,088	-3,139	-3,196
KR4201P82725 2019-08 콜272.5							21,648
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,776	7,644	7,466	7,242	6,976	6,671	6,332
-5.33%	7,209	6,878	6,499	6,078	5,624	5,140	4,631
-2.67%	5,583	5,006	4,406	3,790	3,159	2,518	1,867
0%	2,159	1,440	720	0	-720	-1,441	-2,161
2.67%	-3,419	-4,077	-4,747	-5,427	-6,115	-6,809	-7,508
5.33%	-10,863	-11,315	-11,809	-12,338	-12,894	-13,474	-14,074
8.00%	-19,502	-19,740	-20,034	-20,377	-20,764	-21,189	-21,648
KR4301P82707 2019-08 풋270							7,953
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,915	-7,916	-7,918	-7,922	-7,929	-7,939	-7,953
-5.33%	-4,678	-4,694	-4,718	-4,749	-4,788	-4,833	-4,885
-2.67%	-1,672	-1,756	-1,847	-1,942	-2,041	-2,144	-2,250
0%	373	249	125	0	-125	-250	-376
2.67%	1,110	1,052	986	912	831	745	654
5.33%	1,224	1,215	1,200	1,179	1,151	1,116	1,074
8.00%	1,231	1,231	1,229	1,226	1,220	1,212	1,199
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							4,720
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,709	-4,709	-4,709	-4,710	-4,712	-4,715	-4,720
-5.33%	-2,904	-2,908	-2,915	-2,925	-2,938	-2,955	-2,976
-2.67%	-1,161	-1,192	-1,229	-1,269	-1,313	-1,360	-1,410
0%	209	140	70	0	-70	-140	-210
2.67%	847	799	748	693	636	578	517

5.33%	984	973	957	937	912	883	851
8.00%	996	995	993	989	983	975	963

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

(단위:백만원)

**38,755**

공시일	2019-07-18
기준일	2019-07-17

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

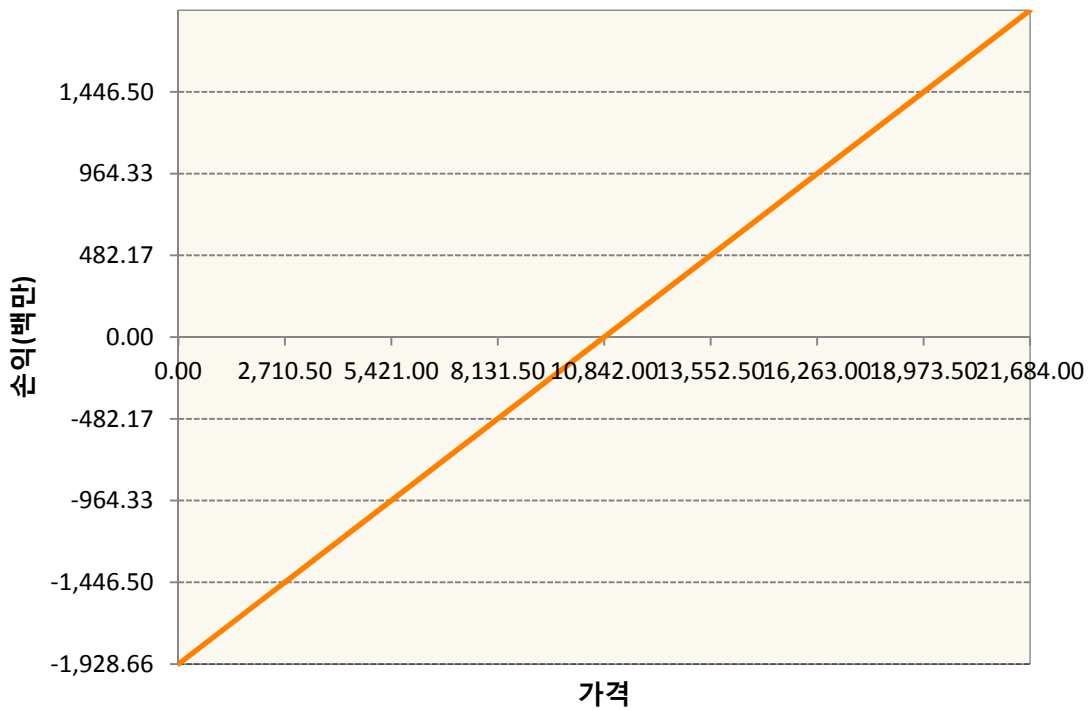
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

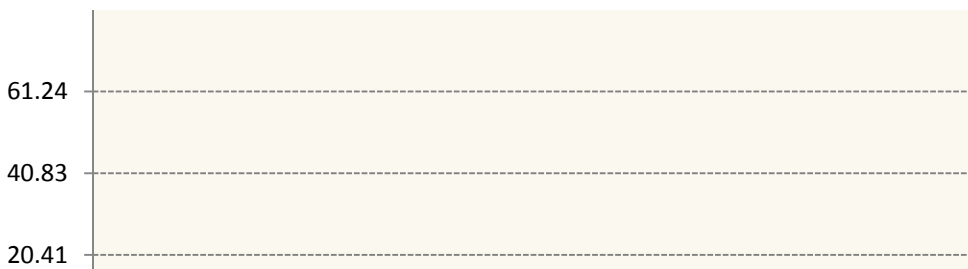
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,929	0	1,929	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,273	-5,273	장내
누계	통화	선도	151	3,176	-3,024	장외

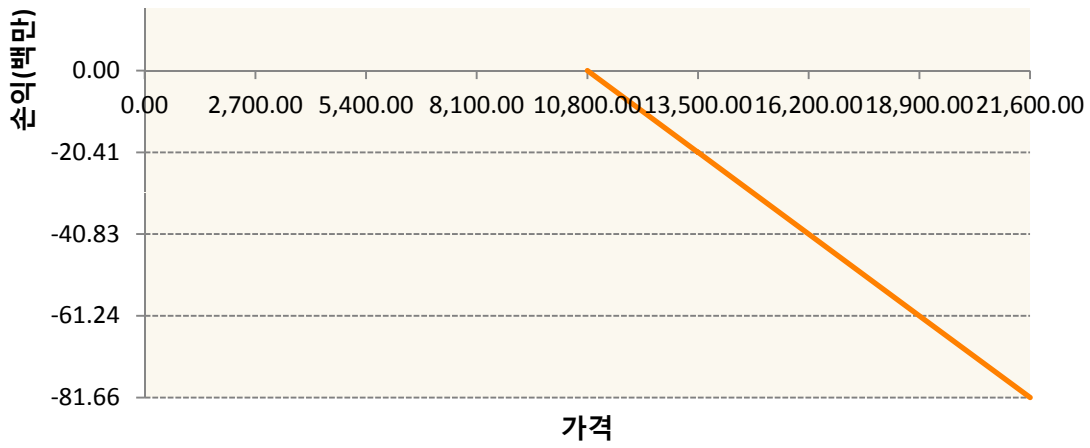
### 2. 만기시점의 손익구조

HCN9-HSCEI Futures Jul19

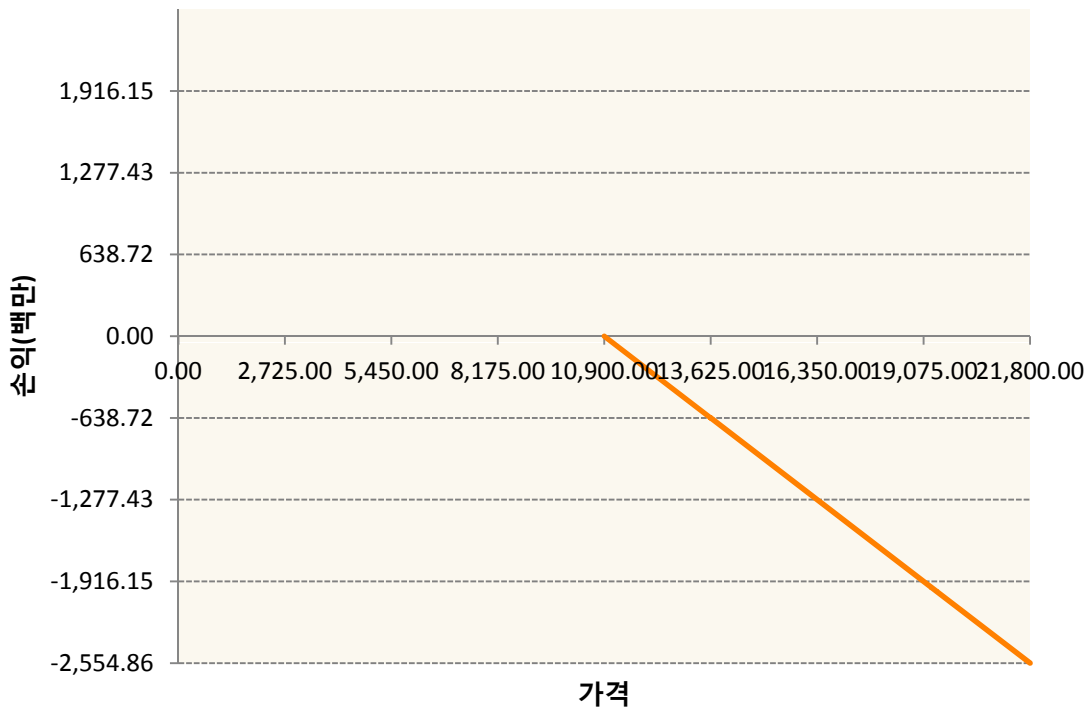


OHHIN9-C108-HSCEI

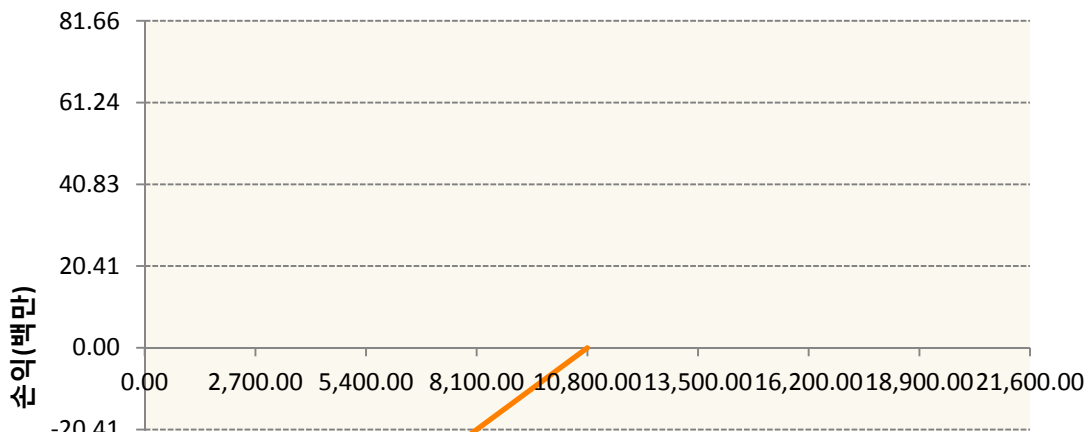


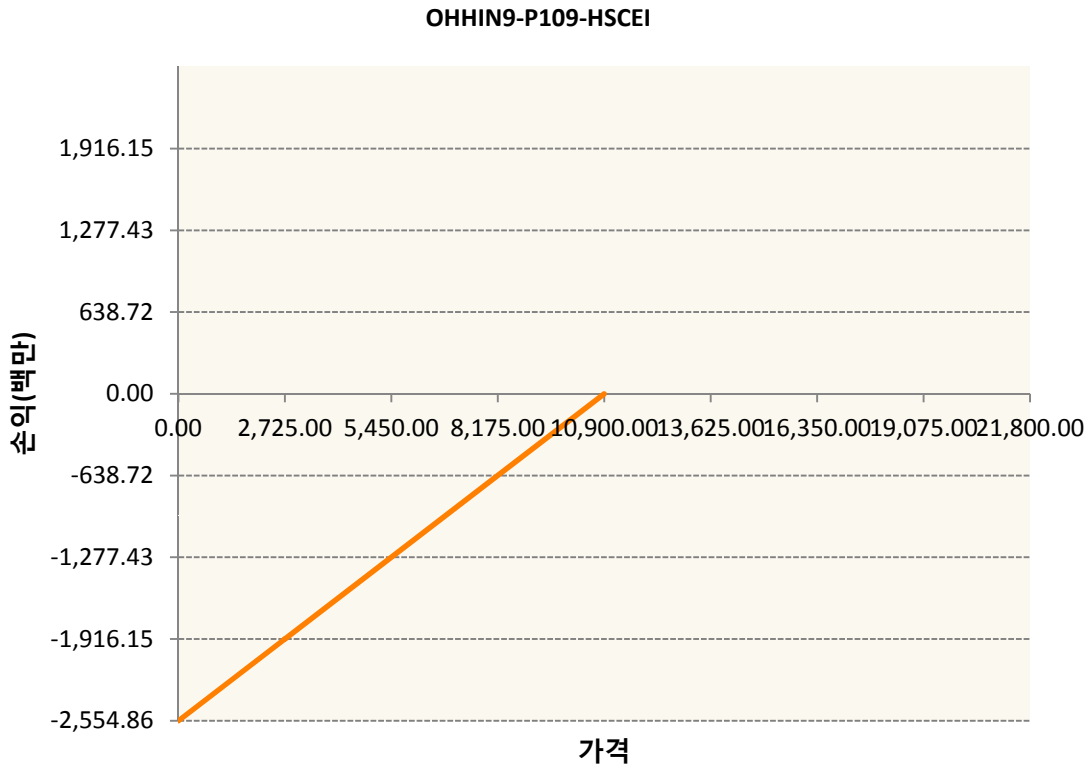
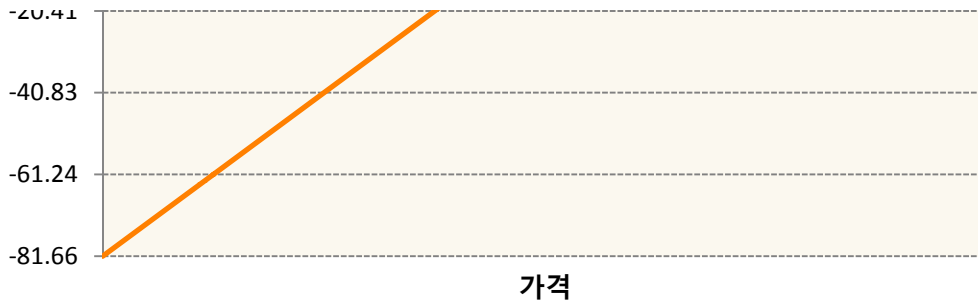


OHHIN9-C109-HSCEI



OHHIN9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	254
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E	12
HCN9 HSCEI Futures Jul19	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)
	<b>667</b>

공시일	2019-07-18
기준일	2019-07-17

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

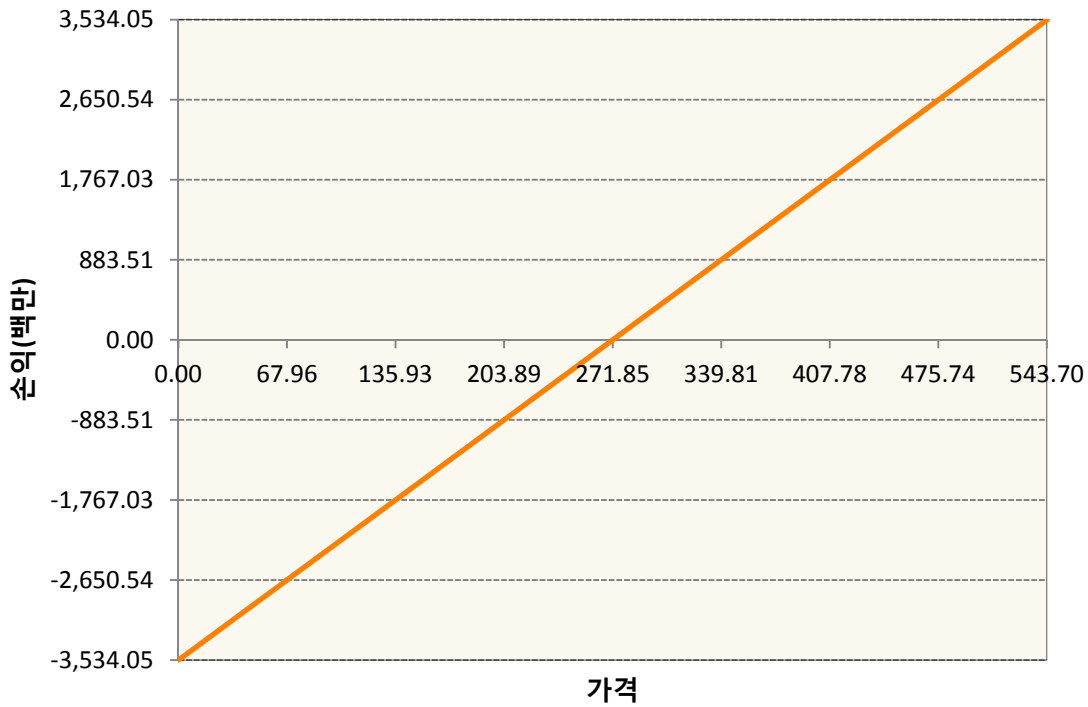
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

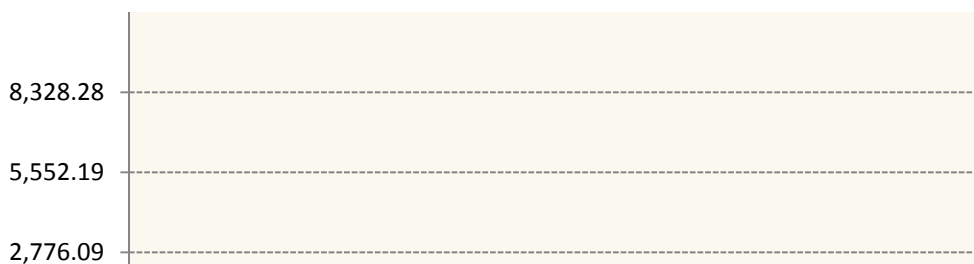
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	204	0	204	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,534	0	3,534	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,519	-20,519	장내

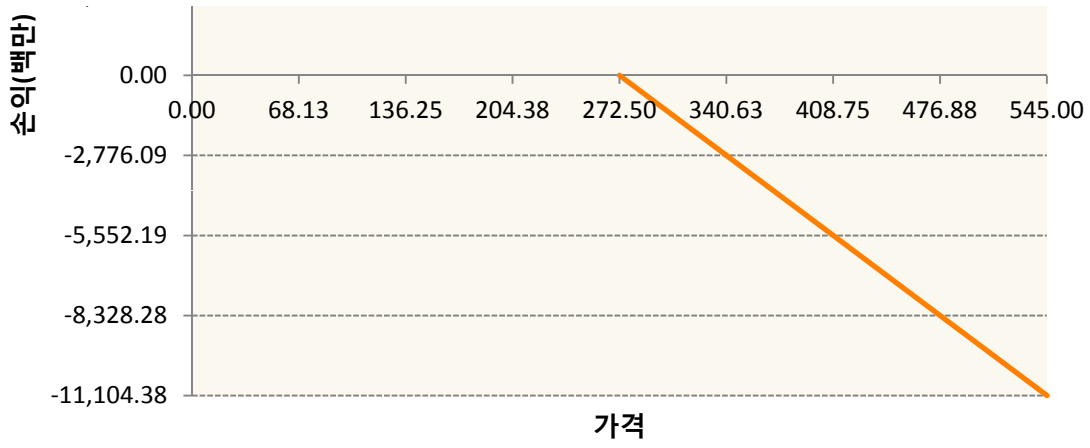
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

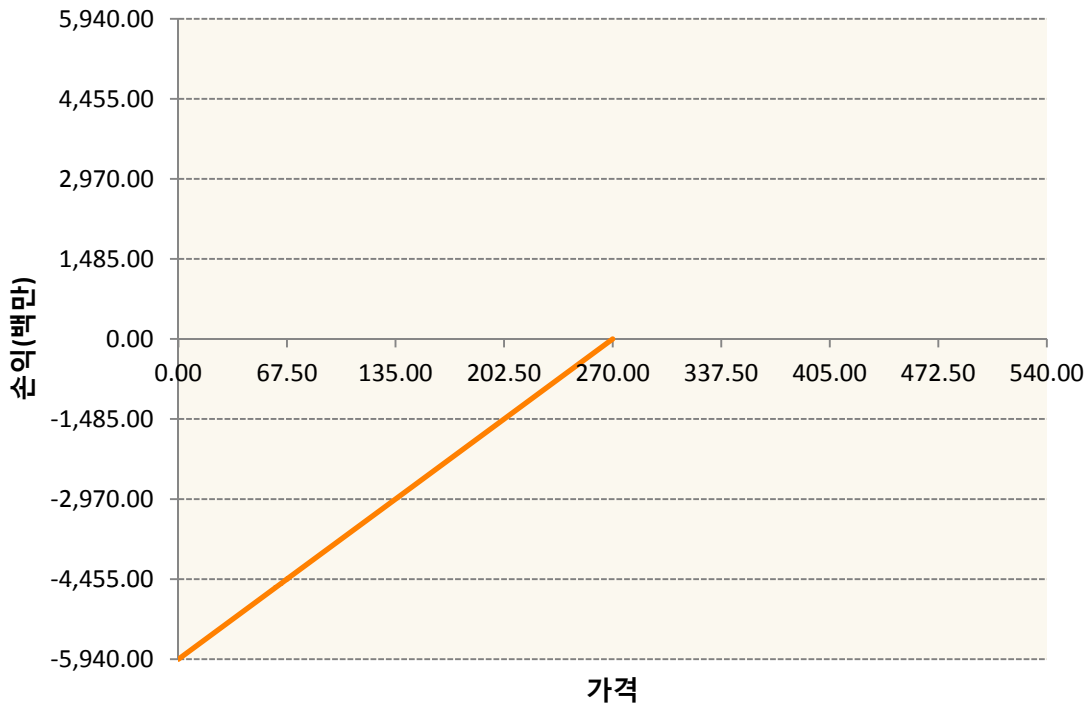


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

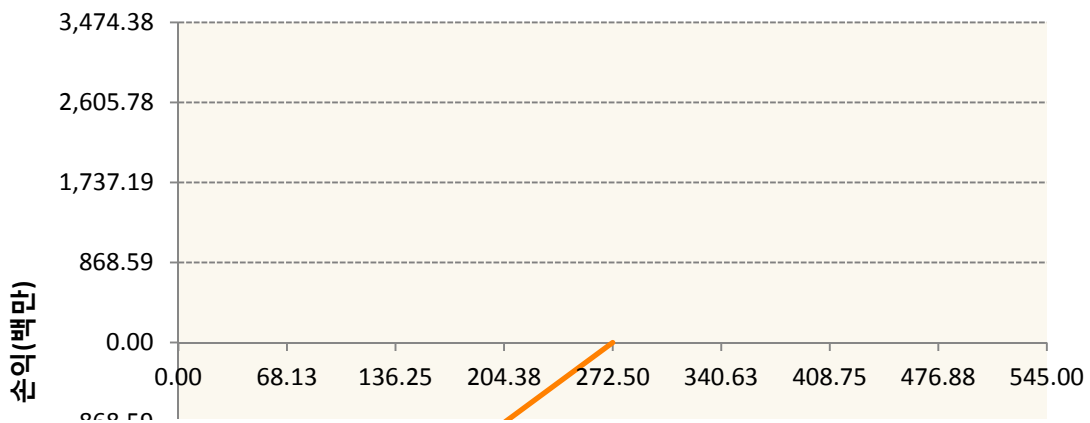




**KR4301P82707-2019-08 풋270**



**KR4301P82723-2019-08 풋272.5**





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,194
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	
-5.33%	-796	-796	-796	-796	-796	-796	-796	
-2.67%	-398	-398	-398	-398	-398	-398	-398	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	398	398	398	398	398	398	398	
5.33%	796	796	796	796	796	796	796	
8.00%	1,194	1,194	1,194	1,194	1,194	1,194	1,194	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						604
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-604	-604	-604	-604	-604	-604	-604	
-5.33%	-403	-403	-403	-403	-403	-403	-403	
-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%	403	403	403	403	403	403	403	
8.00%	604	604	604	604	604	604	604	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						282
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-282	-282	-282	-282	-282	-282	-282	
-5.33%	-188	-188	-188	-188	-188	-188	-188	
-2.67%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	94	94	94	94	94	94	94	
5.33%	188	188	188	188	188	188	188	
8.00%	282	282	282	282	282	282	282	
KR4201P82725		2019-08 콜272.5						671
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	241	237	231	224	216	207	196
-5.33%	223	213	201	188	174	159	143
-2.67%	173	155	136	117	98	78	58
0%	67	45	22	0	-22	-45	-67
2.67%	-106	-126	-147	-168	-189	-211	-233
5.33%	-336	-350	-366	-382	-399	-417	-436
8.00%	-604	-611	-621	-631	-643	-656	-671
KR4301P82707                      2019-08 풋270							389
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-387	-387	-387	-387	-388	-388	-389
-5.33%	-229	-230	-231	-232	-234	-236	-239
-2.67%	-82	-86	-90	-95	-100	-105	-110
0%	18	12	6	0	-6	-12	-18
2.67%	54	51	48	45	41	36	32
5.33%	60	59	59	58	56	55	53
8.00%	60	60	60	60	60	59	59
KR4301P82723                      2019-08 풋272.5							241
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-240	-240	-240	-240	-240	-240	-241
-5.33%	-148	-148	-149	-149	-150	-151	-152
-2.67%	-59	-61	-63	-65	-67	-69	-72
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	43	41	38	35	32	29	26
5.33%	50	50	49	48	47	45	43
8.00%	51	51	51	50	50	50	49

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

(단위:백만원)

**3,404**

공시일	2019-07-18
기준일	2019-07-17

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

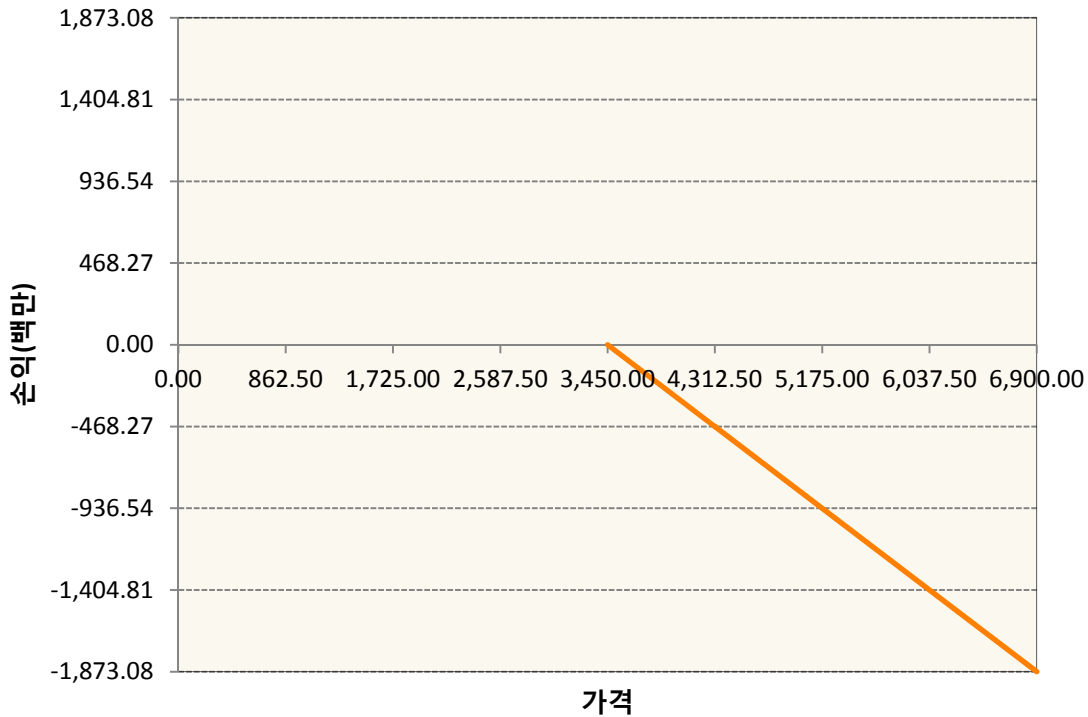
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

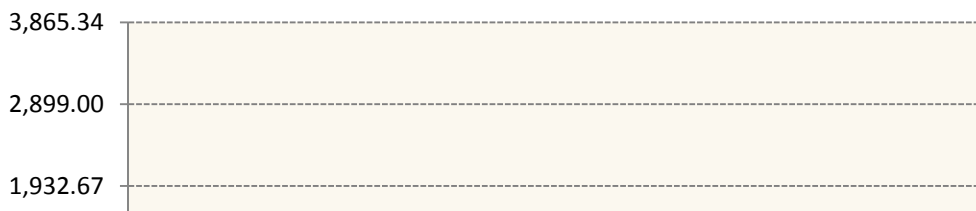
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,787	0	2,787	
누계	유가증권	스왑	46,867	0	46,867	장외
누계	유가증권	옵션	0	11,477	-11,477	장내
누계	통화	선도	5,297	22,511	-17,214	장외

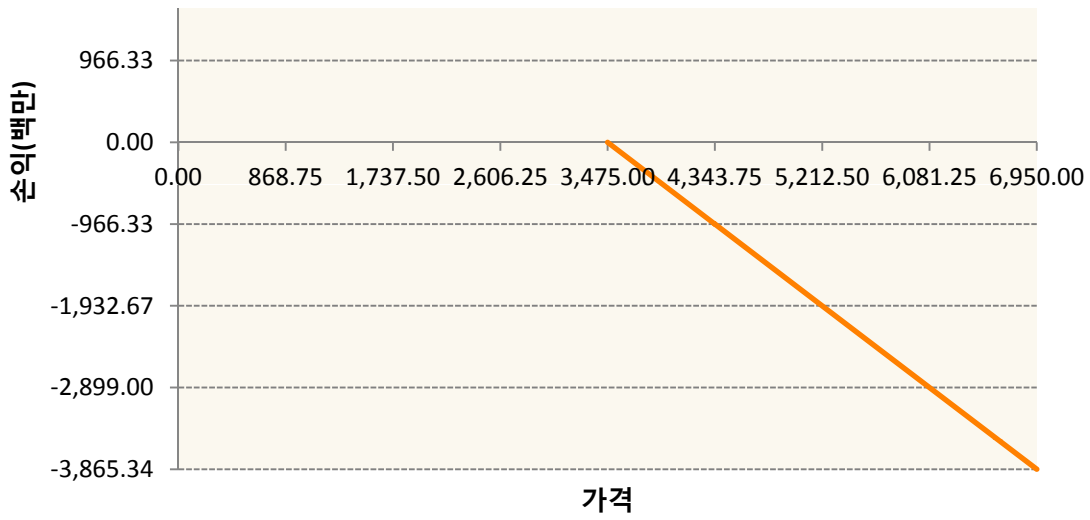
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXN9-C3450-EURO STOXX 50

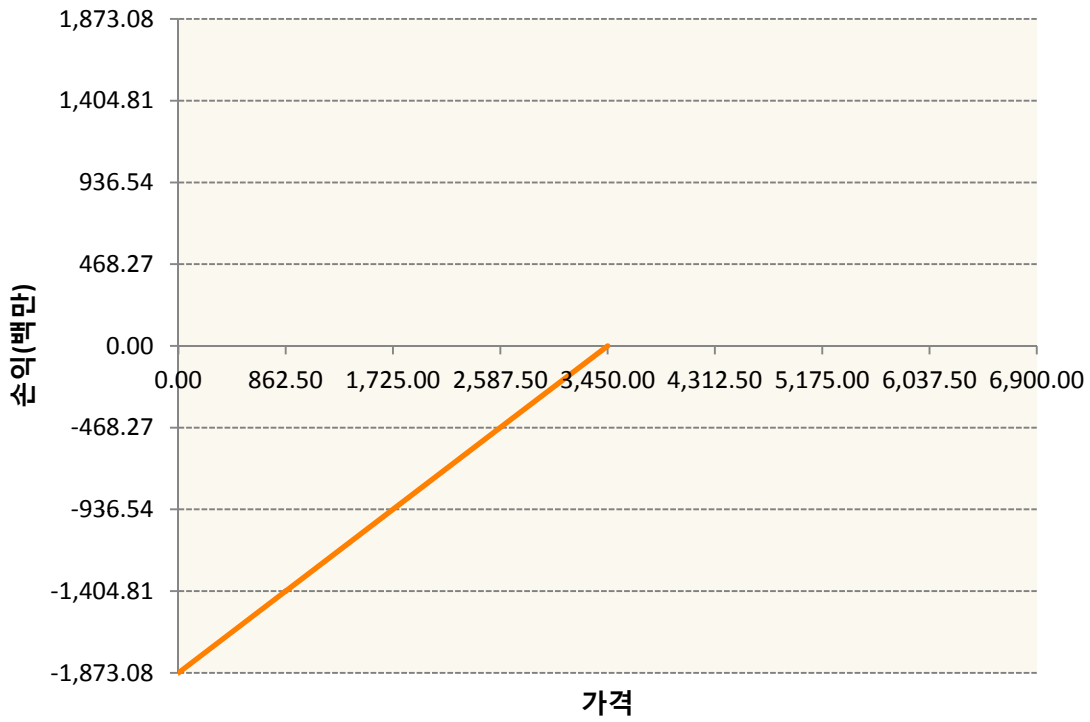


OESXN9-C3475-EURO STOXX 50

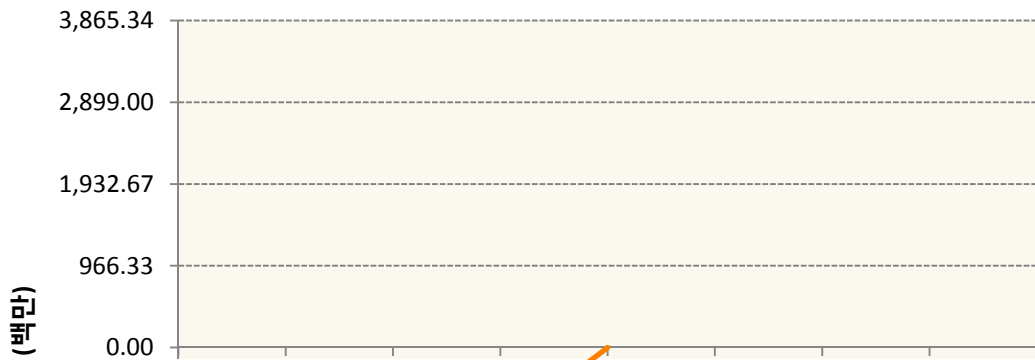


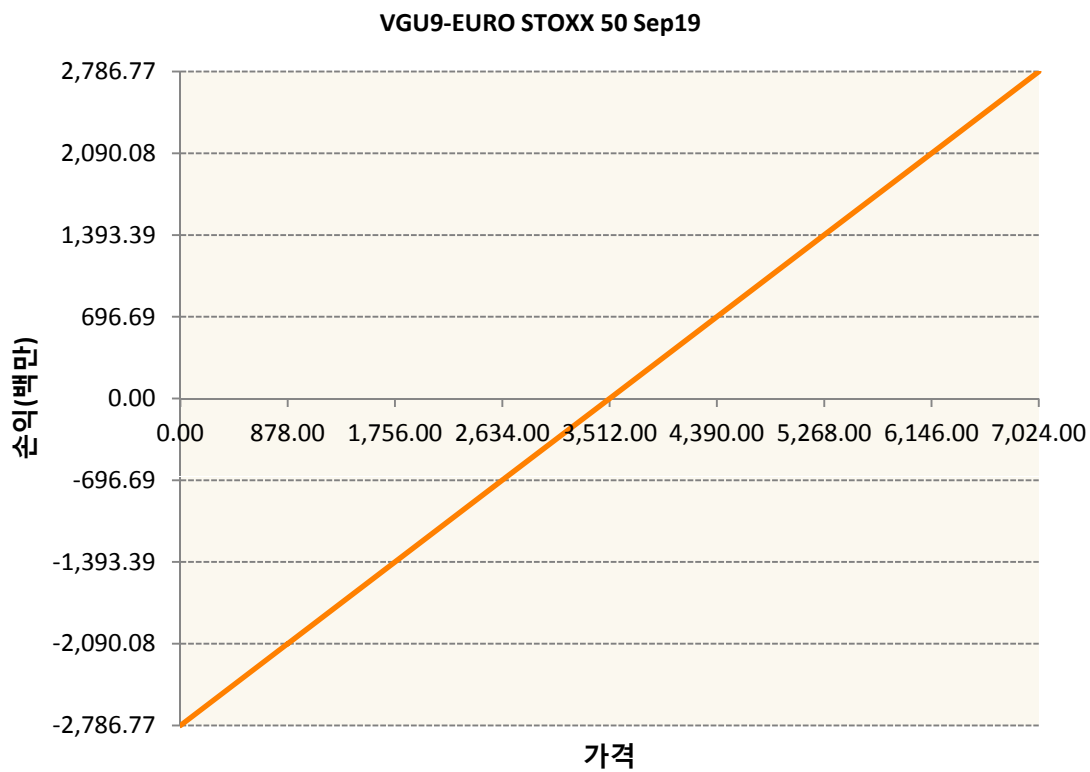
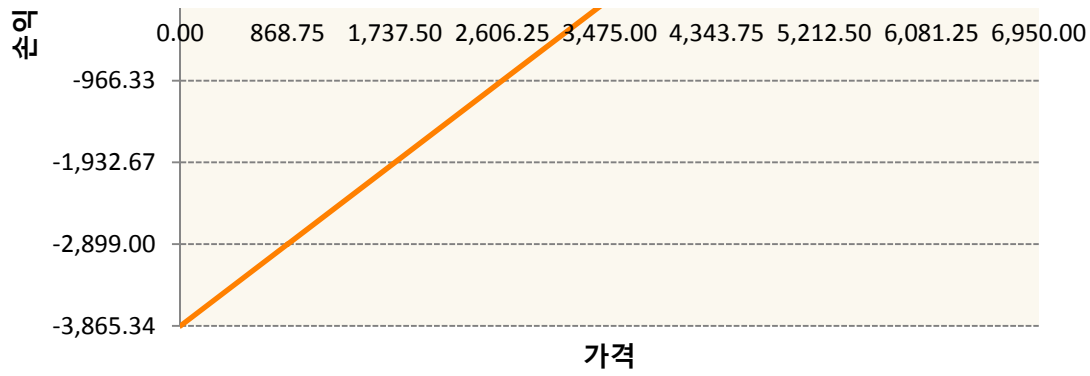


OESXN9-P3450-EURO STOXX 50



OESXN9-P3475-EURO STOXX 50





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	89
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	424
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E	1,059
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	318
FX21019N01 EUR/KRW 23-08-19E	424
OESXN9-C34 EURO STOXX 50	150
OESXN9-C34 EURO STOXX 50	309
OESXN9-P34 EURO STOXX 50	150
OESXN9-P34 EURO STOXX 50	309
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	223

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

(단위:백만원)

1,917



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

(단위:백만원)

1,013



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

(단위:백만원)

86



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

(단위:백만원)

131

공시일	2019-07-18
기준일	2019-07-17

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

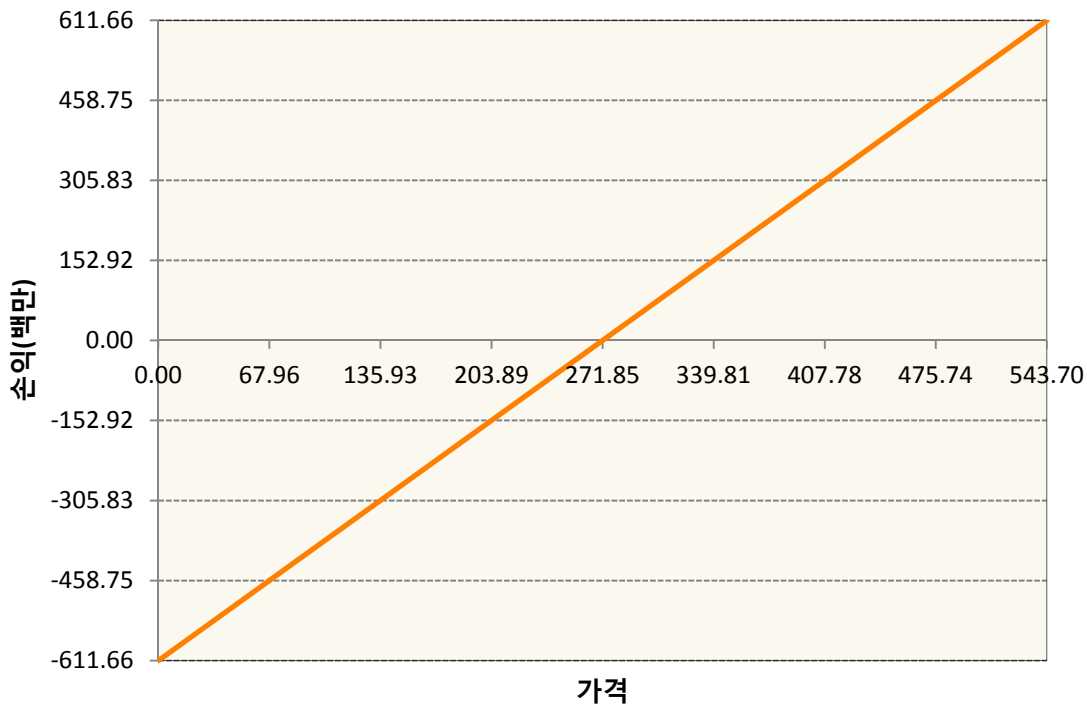
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	612	0	612	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	2019-07-18
기준일	2019-07-17

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

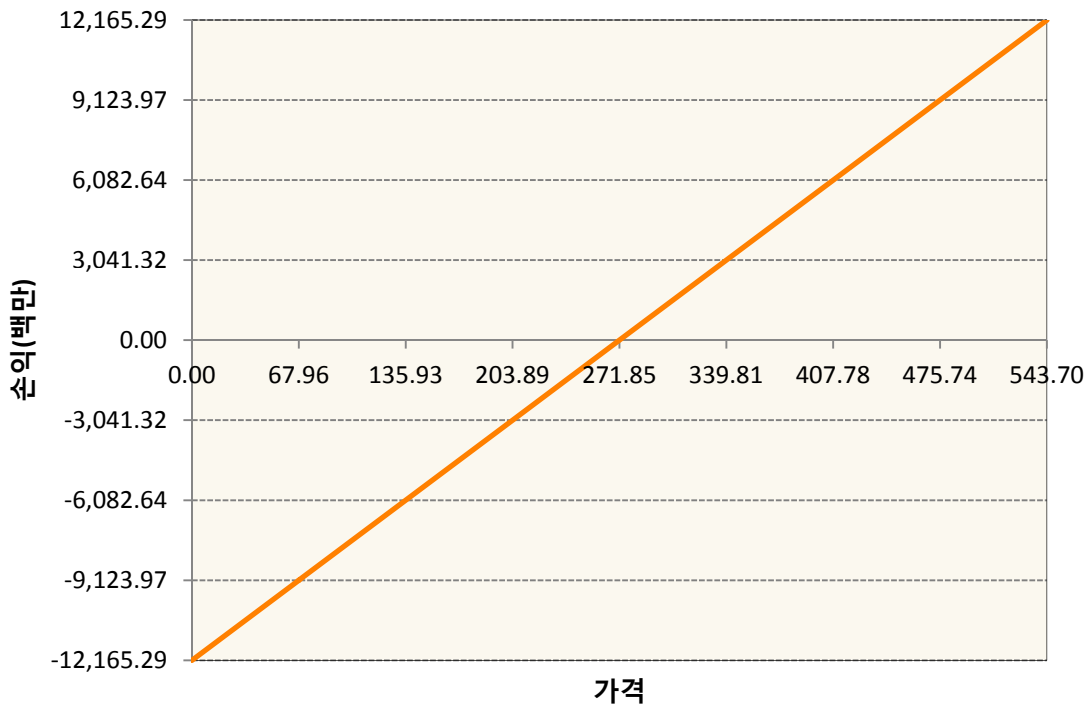
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

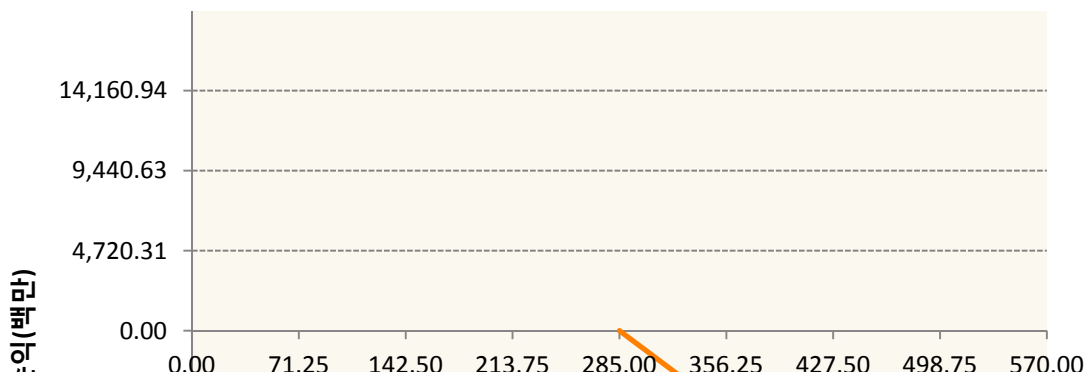
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	136	-136	장내
신규	유가증권	옵션	143	0	143	장내
누계	유가증권	선물	12,165	0	12,165	장내
누계	유가증권	옵션	1,698	22,116	-20,418	장내

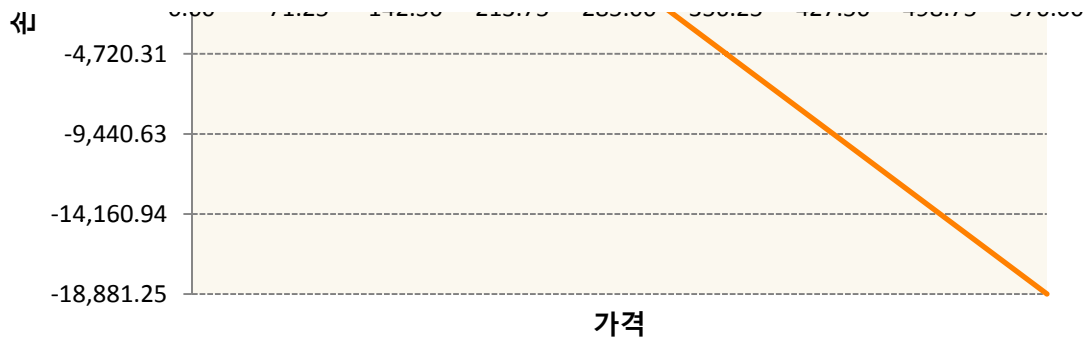
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

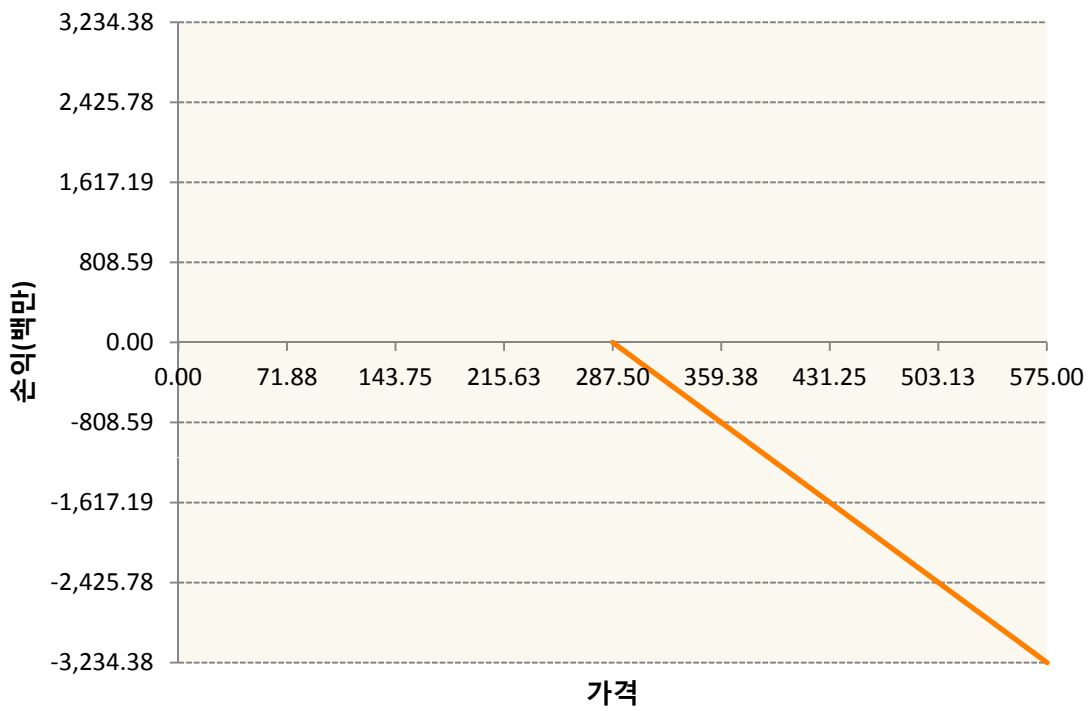


KR4201P82857-2019-08 콜285

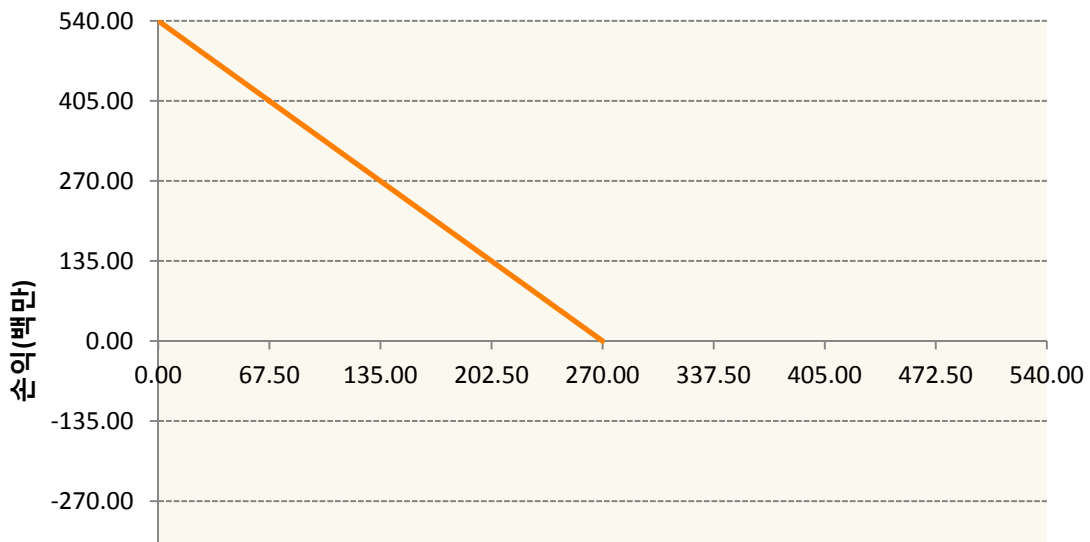


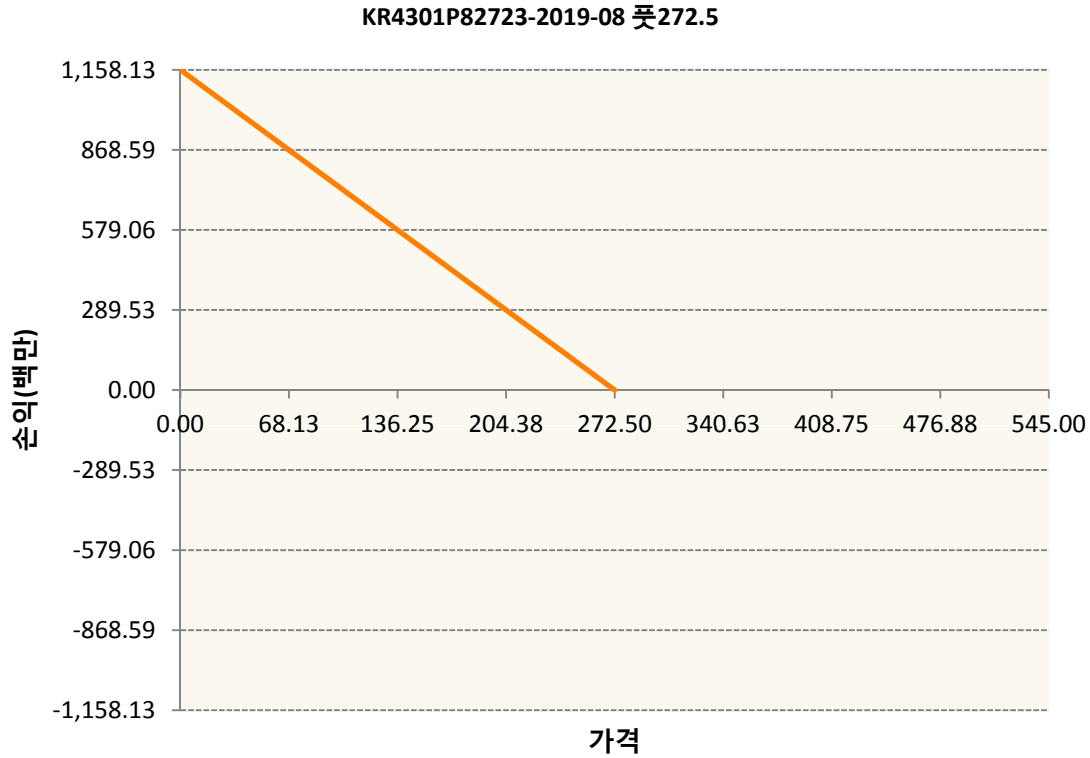
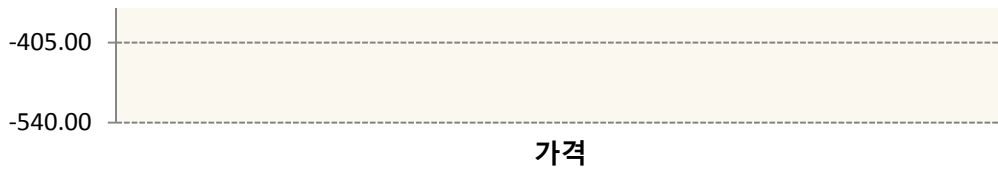


KR4201P82873-2019-08 콜287.5



KR4301P82707-2019-08 풋270





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

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						972
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-972	-972	-972	-972	-972	-972	-972	
-5.33%	-648	-648	-648	-648	-648	-648	-648	
-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%	648	648	648	648	648	648	648	
8.00%	972	972	972	972	972	972	972	
KR4201P82857		2019-08 콜285						753
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	132	132	130	127	123	118	111	
-5.33%	130	126	121	113	104	93	79	
-2.67%	117	106	93	77	59	40	18	

0%	72	50	26	0	-28	-56	-86
2.67%	-36	-69	-104	-139	-174	-210	-246
5.33%	-239	-277	-315	-353	-392	-430	-468
8.00%	-546	-578	-612	-646	-681	-717	-753
KR4201P82873                      2019-08 콜287.5							116
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17	17	17	17	16	16	15
-5.33%	17	17	16	15	14	12	10
-2.67%	16	14	13	10	8	5	2
0%	10	7	4	0	-4	-9	-13
2.67%	-4	-9	-14	-20	-25	-31	-37
5.33%	-32	-39	-45	-52	-58	-65	-71
8.00%	-78	-84	-91	-97	-103	-110	-116
KR4301P82707                      2019-08 풋270							35
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	35	35	35	35	35	35	35
-5.33%	21	21	21	21	21	21	22
-2.67%	7	8	8	9	9	10	10
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-5	-5	-4	-4	-4	-3	-3
5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
KR4301P82723                      2019-08 풋272.5							80
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	80	80	80	80	80	80	80
-5.33%	49	49	50	50	50	50	51
-2.67%	20	20	21	22	22	23	24
0%	-4	-2	-1	0	1	2	4
2.67%	-14	-14	-13	-12	-11	-10	-9
5.33%	-17	-17	-16	-16	-16	-15	-14
8.00%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-16

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

(단위:백만원)

**1,569**

공시일	2019-07-18
기준일	2019-07-17

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	473	0	473	
누계	유가증권	수익증권	32,606	0	32,606	

### 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	2019-07-18
기준일	2019-07-17

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	999	-999	
누계	유가증권	수익증권	52,891	0	52,891	

### 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	2019-07-18
기준일	2019-07-17

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	7,088	0	7,088	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	373,429	0	373,429	
누계	통화	선도	0	450,099	-450,099	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
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		567
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		3,024
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		2,268
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		1,890
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		1,890
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E		699
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E		699
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E		1,304
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E		2,563
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		3,119
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		2,117
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		1,701
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,079
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		132
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		567
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		3,024
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		3,308

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

(단위:백만원)

**11,874**

공시일	2019-07-18
기준일	2019-07-17

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

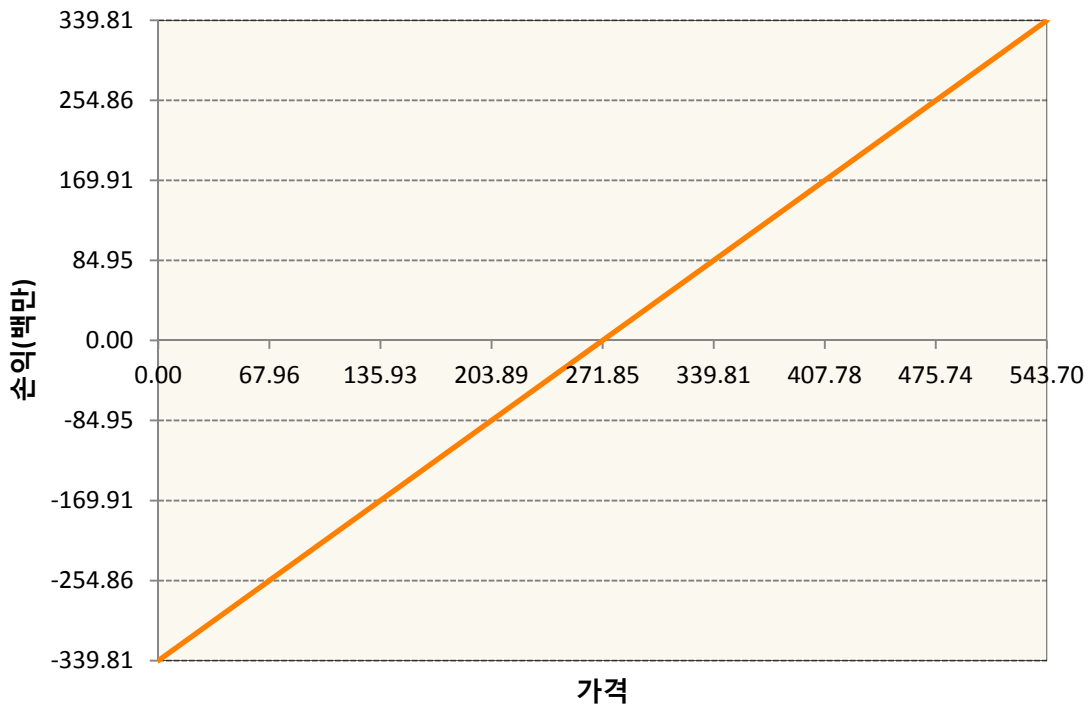
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

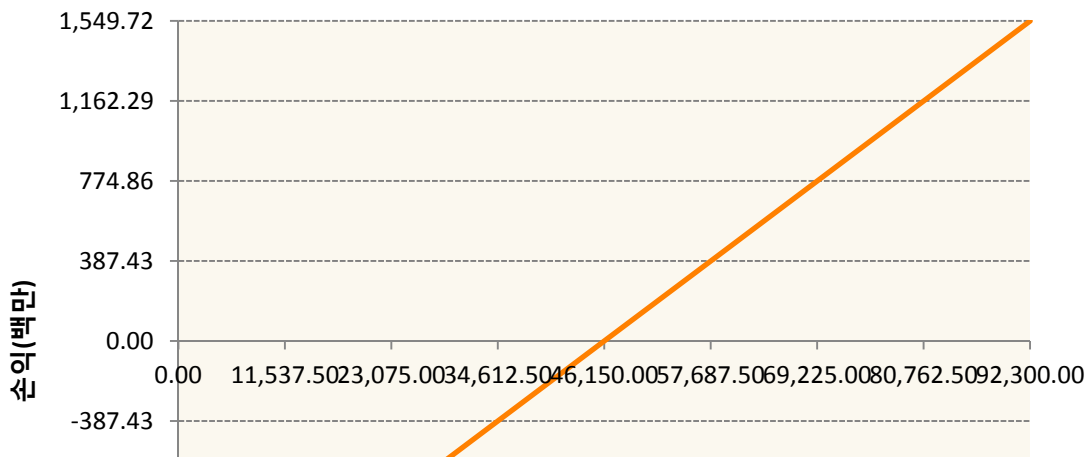
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,890	0	1,890	장내

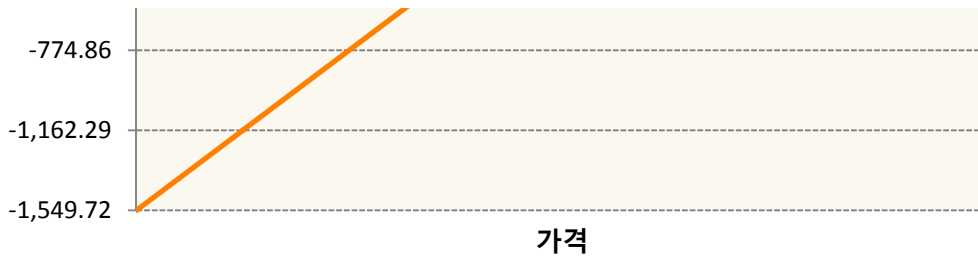
### 2. 만기시점의 손익구조

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%	-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%	124	124	124	124	124	124	124	

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

**171**

공시일	2019-07-18
기준일	2019-07-17

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

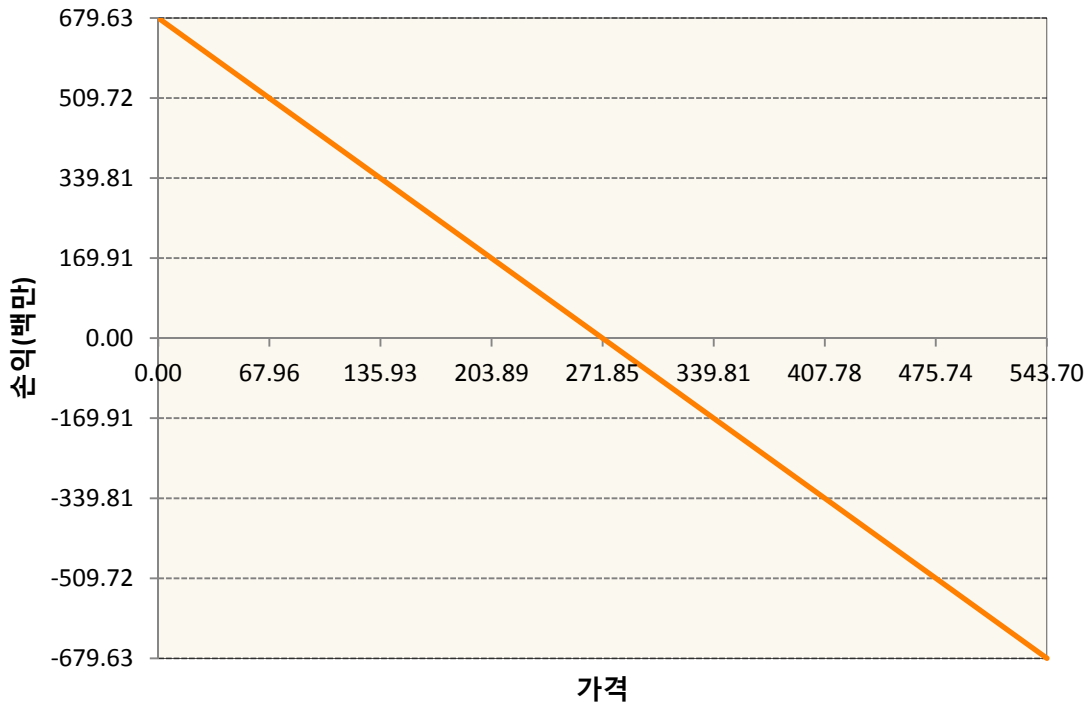
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

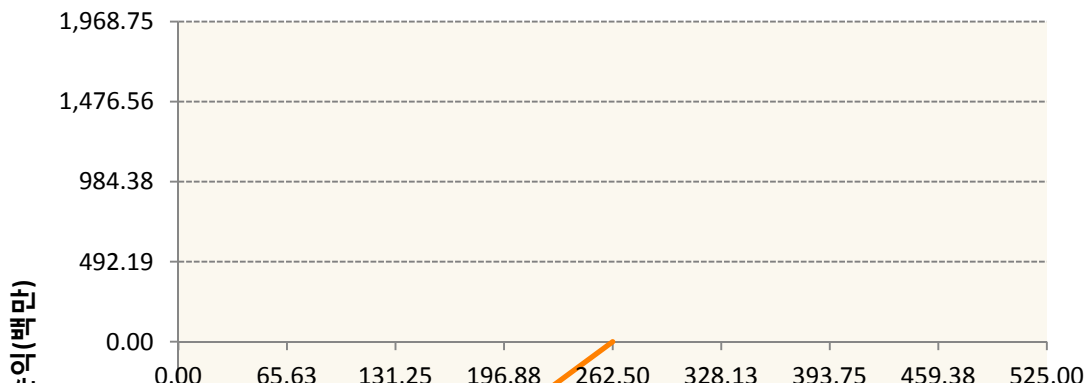
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	680	-680	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,625	-3,625	장내

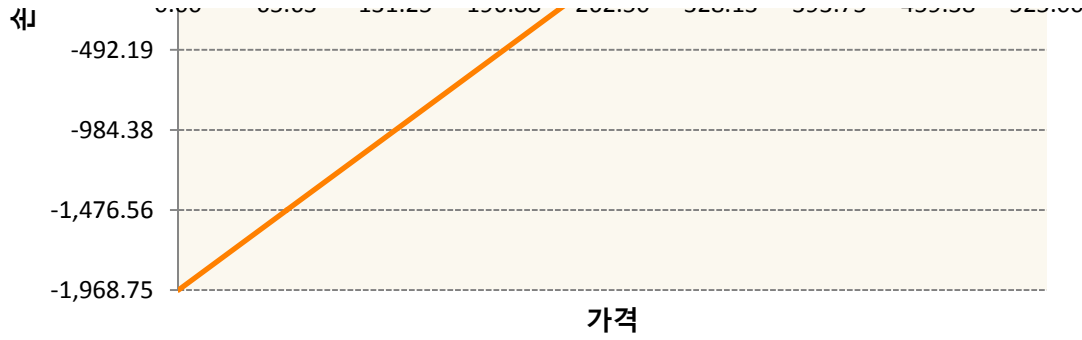
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

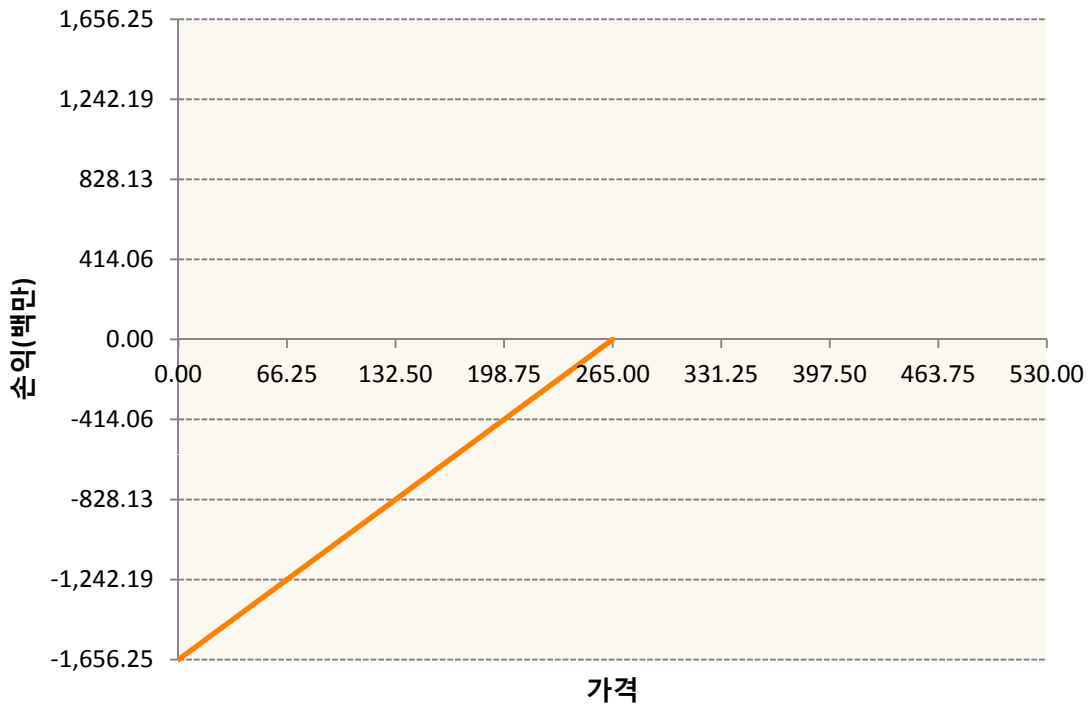


KR4301P82624-2019-08 풋262.5





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						95
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-92	-92	-92	-93	-94	-94	-95
-5.33%	-42	-43	-45	-46	-48	-50	-51
-2.67%	-8	-10	-12	-14	-16	-18	-20
0%	3	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	5	4	4	4	4	3	2
5.33%	5	5	5	5	4	4	4
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

KR4301P82657

2019-08 풋265

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%	-46	-46	-47	-48	-49	-50	-52
-2.67%	-12	-13	-15	-17	-18	-20	-22
0%	4	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	7	6	6	6	5	4	4
5.33%	7	7	7	7	7	6	6
8.00%	7	7	7	7	7	7	7

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

(단위:백만원)

205

공시일	2019-07-18
기준일	2019-07-17

## 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	18,453	0	18,453	
누계	통화	선도	0	18,310	-18,310	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		142
FX21019M04 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)

<b>483</b>
------------

공시일	2019-07-18
기준일	2019-07-17

## 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	2019-07-18
기준일	2019-07-17

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

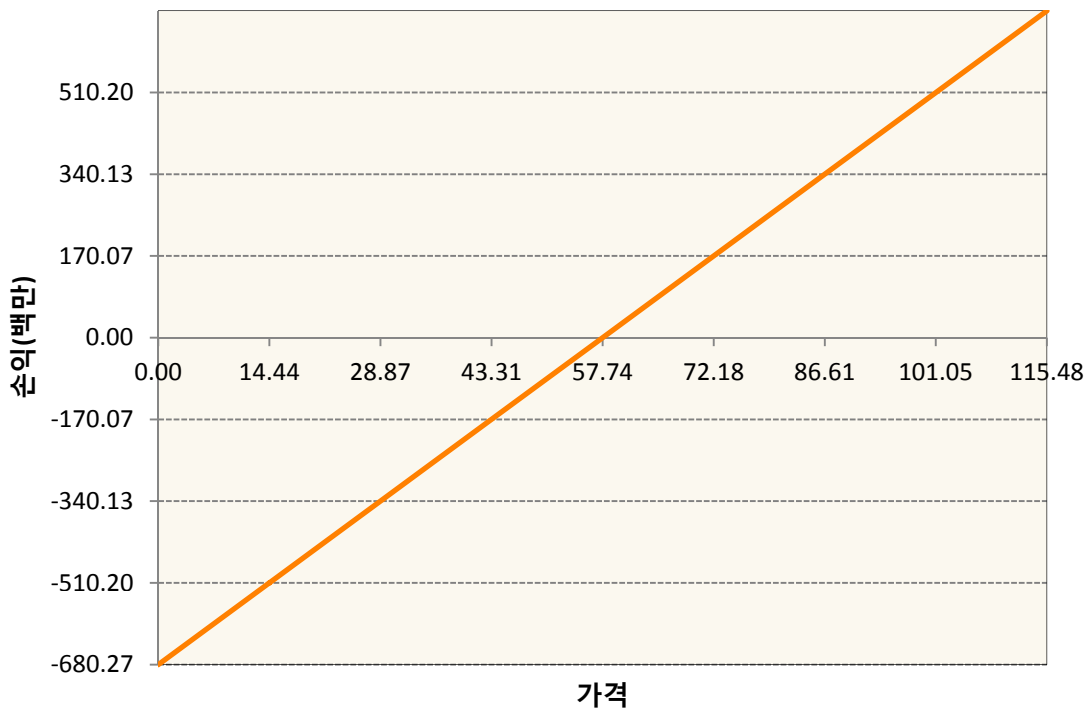
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

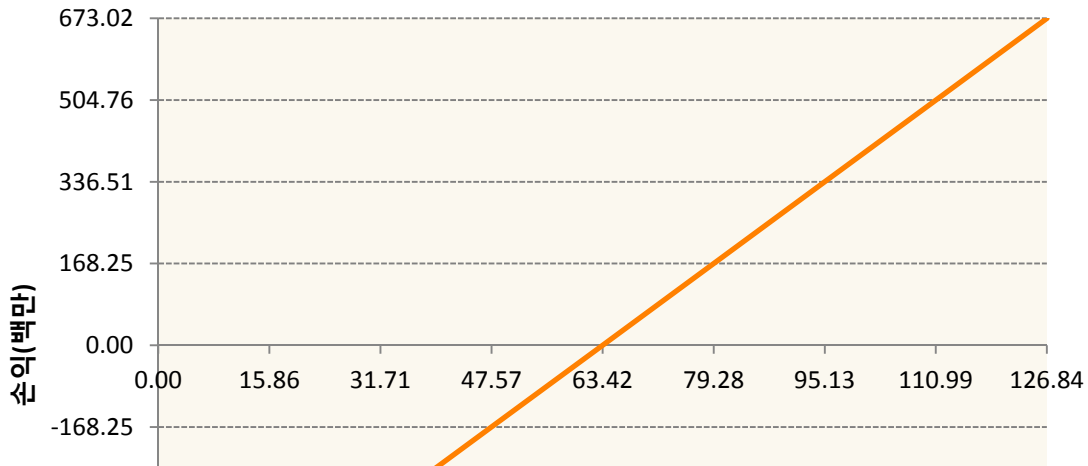
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,669	118	2,551	

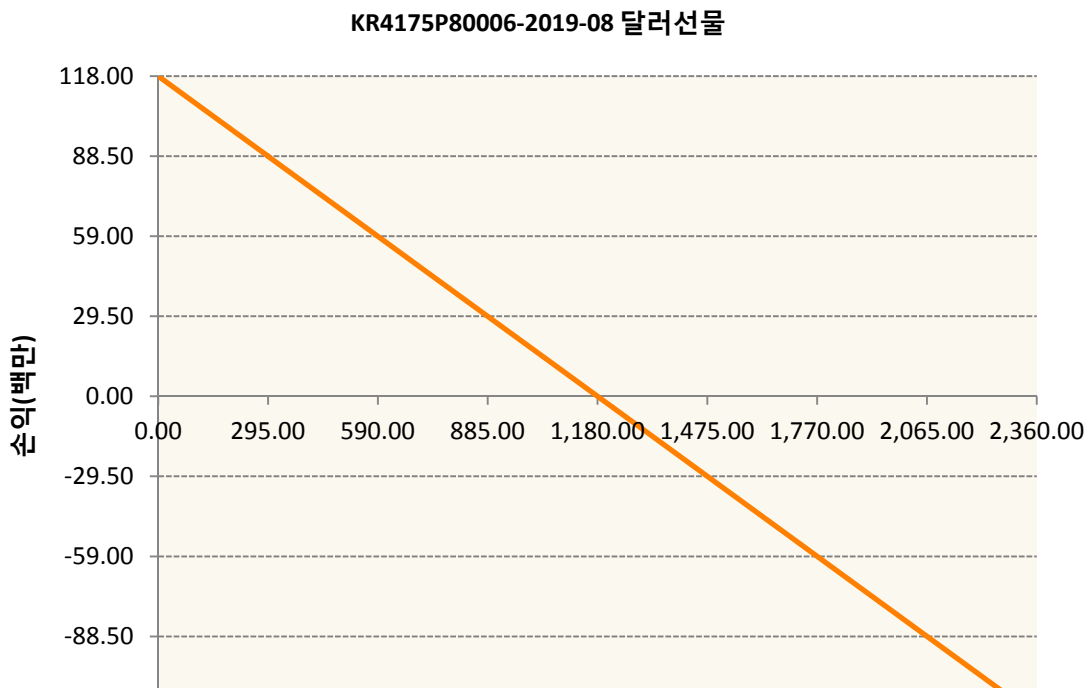
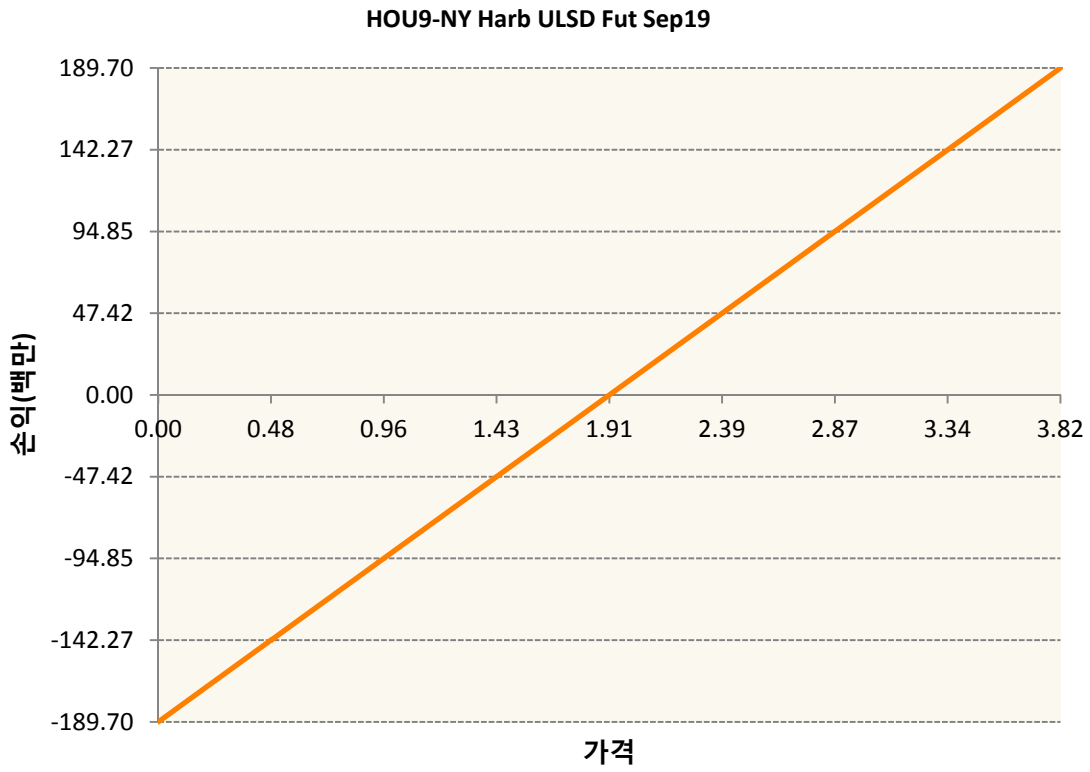
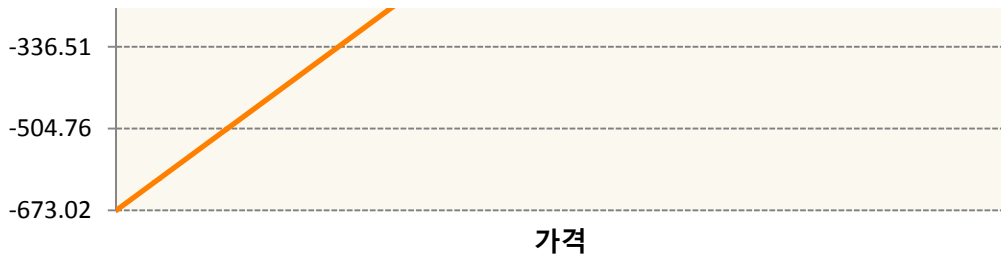
### 2. 만기시점의 손익구조

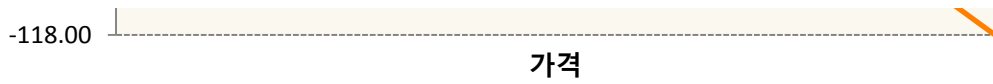
CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19



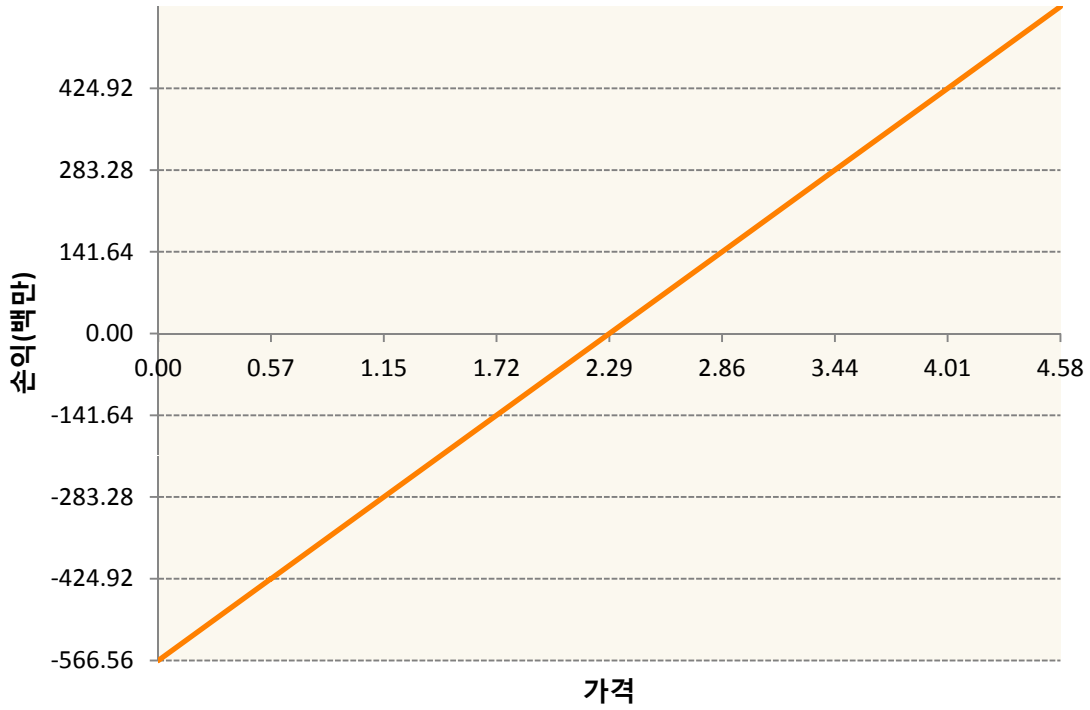
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19



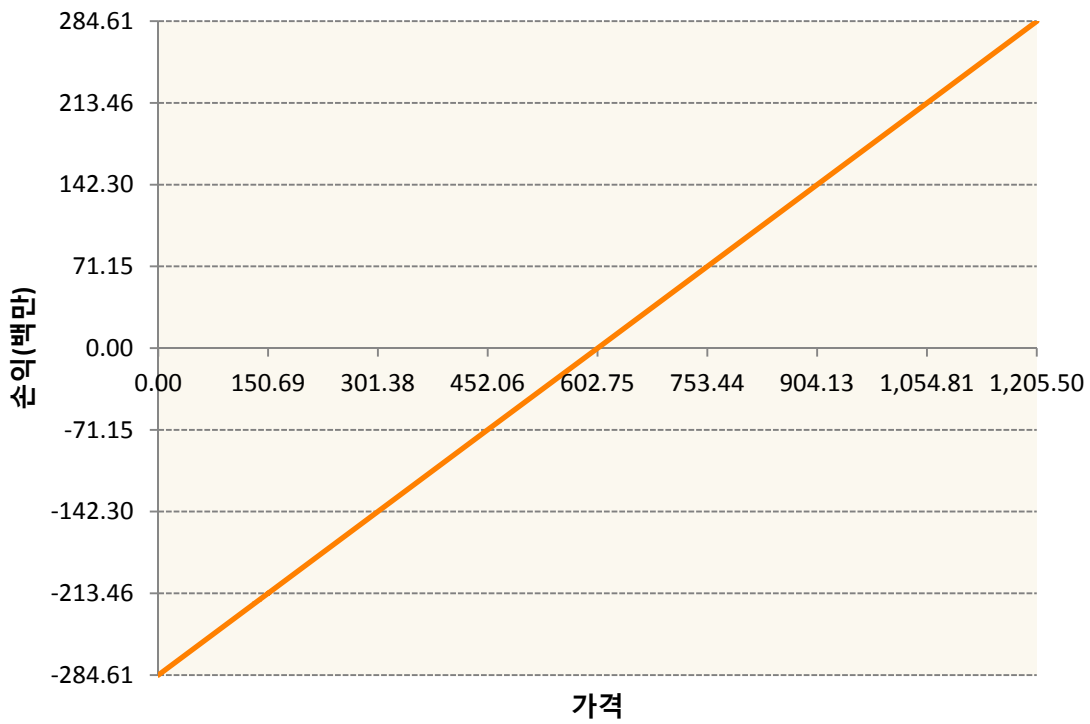




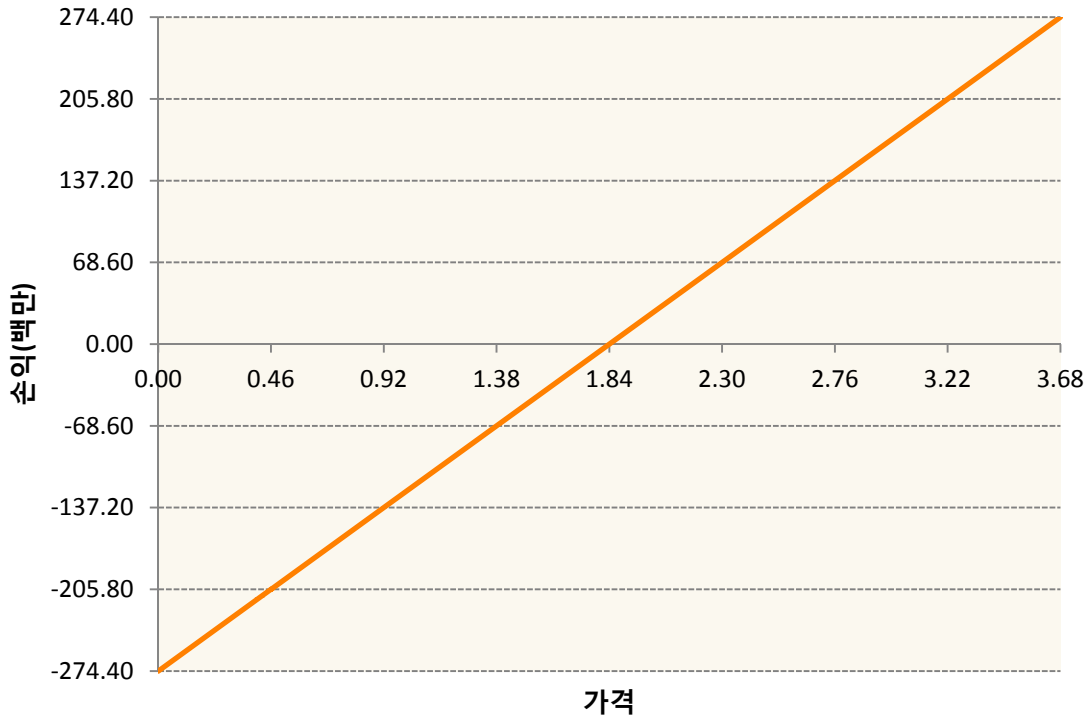
NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



QSU9-Low Su Gasoil G Sep19



XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	54
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	54
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	15
KR4175P800	2019-08 달러선물	9
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	45
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	23
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	22

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

392

공시일	2019-07-18
기준일	2019-07-17

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

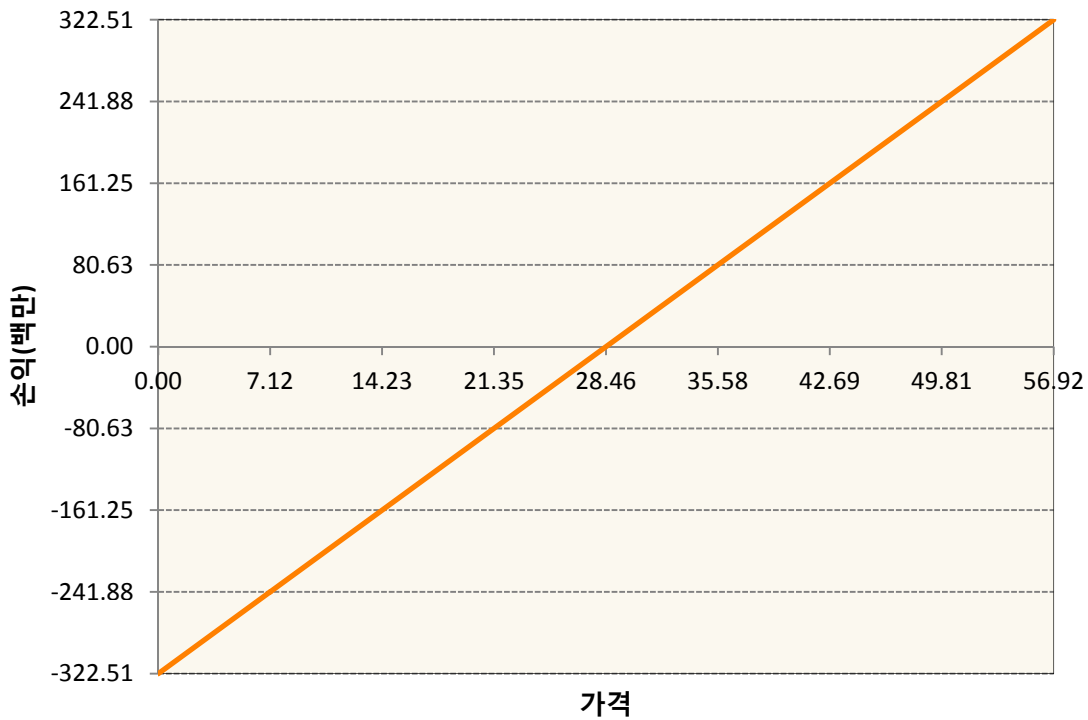
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

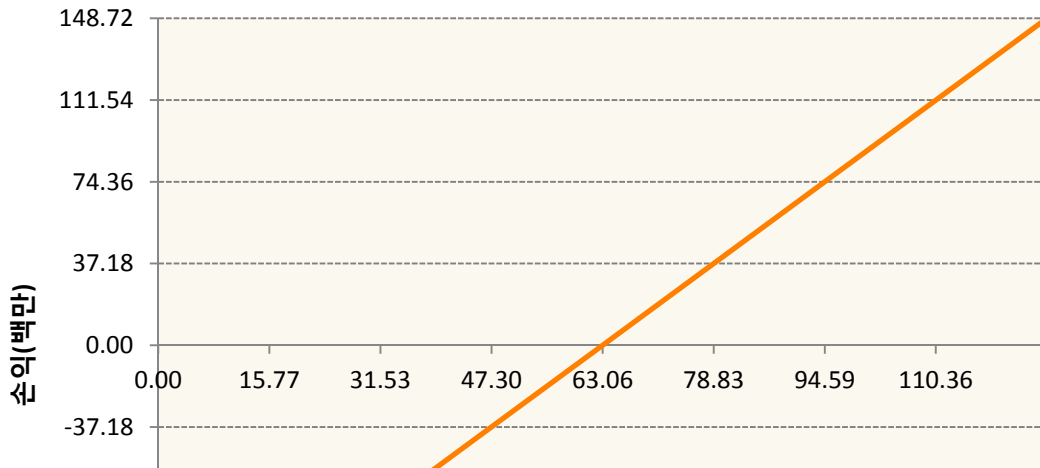
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,125	201	2,924	

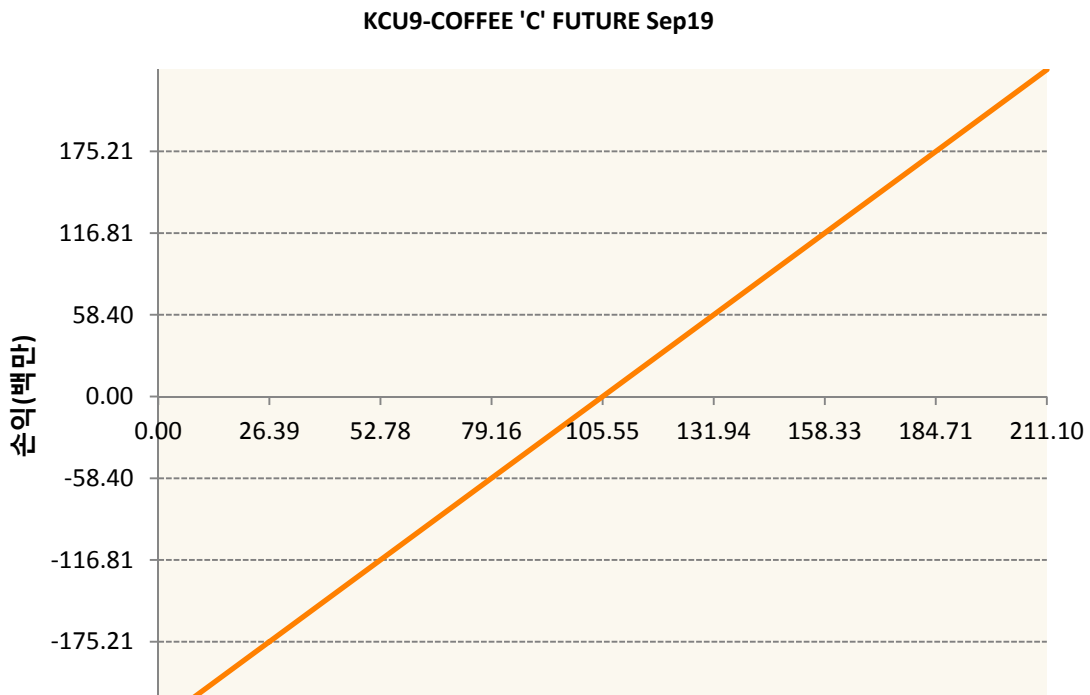
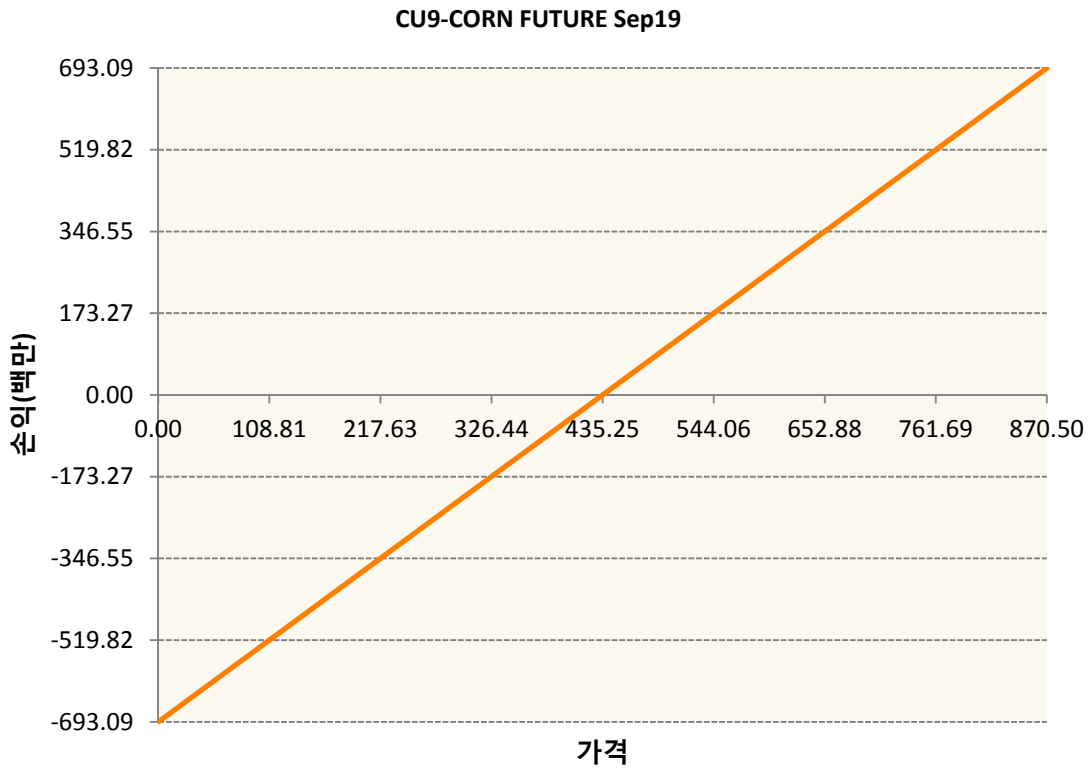
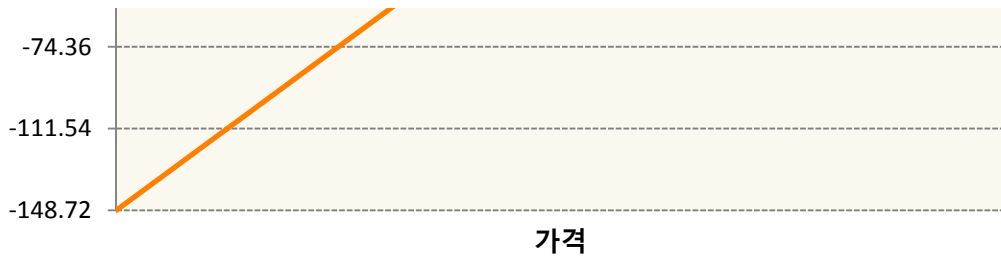
### 2. 만기시점의 손익구조

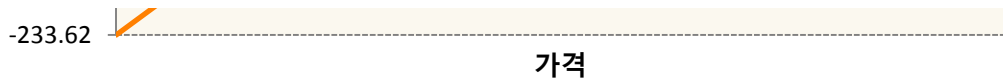
**BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19**



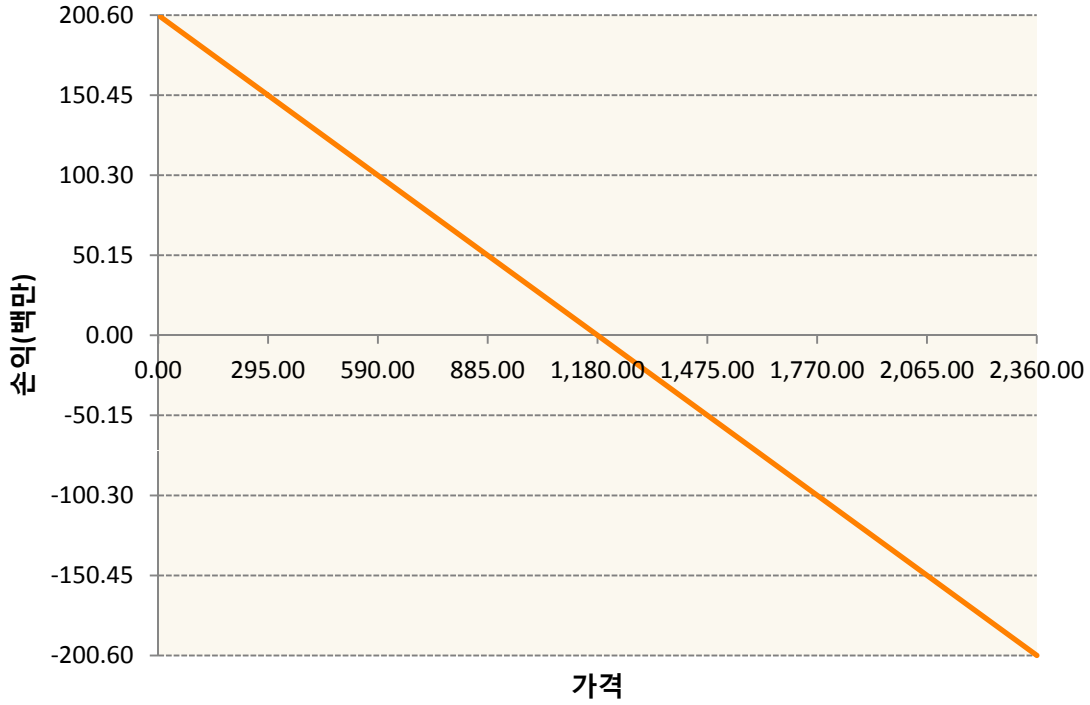
**CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19**



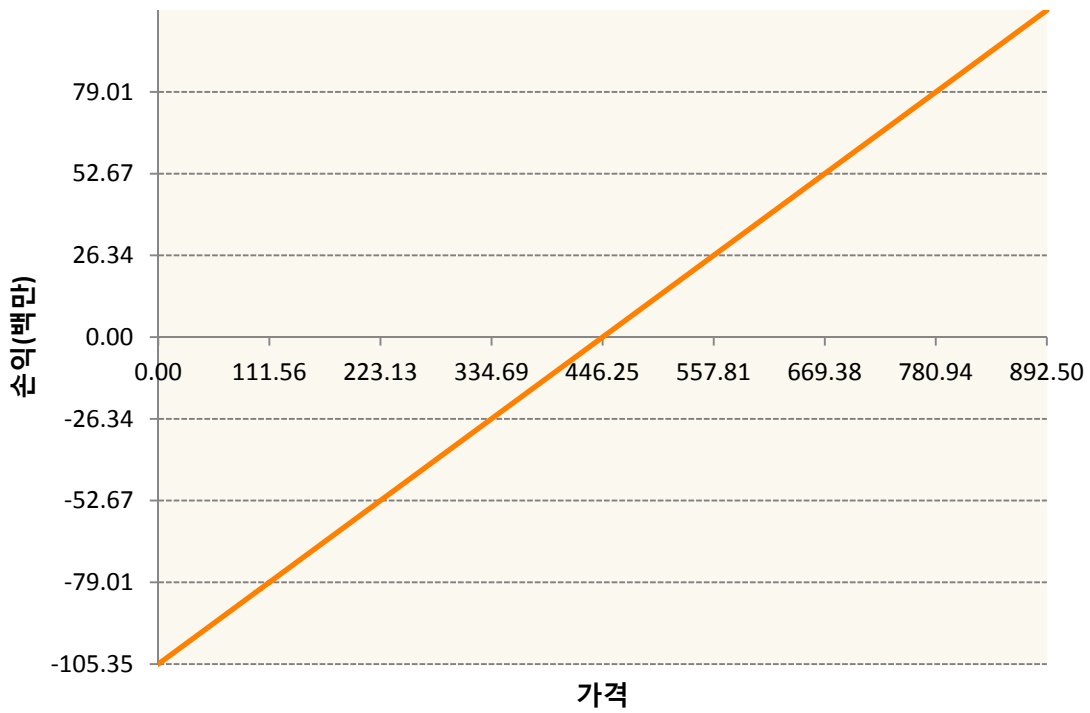




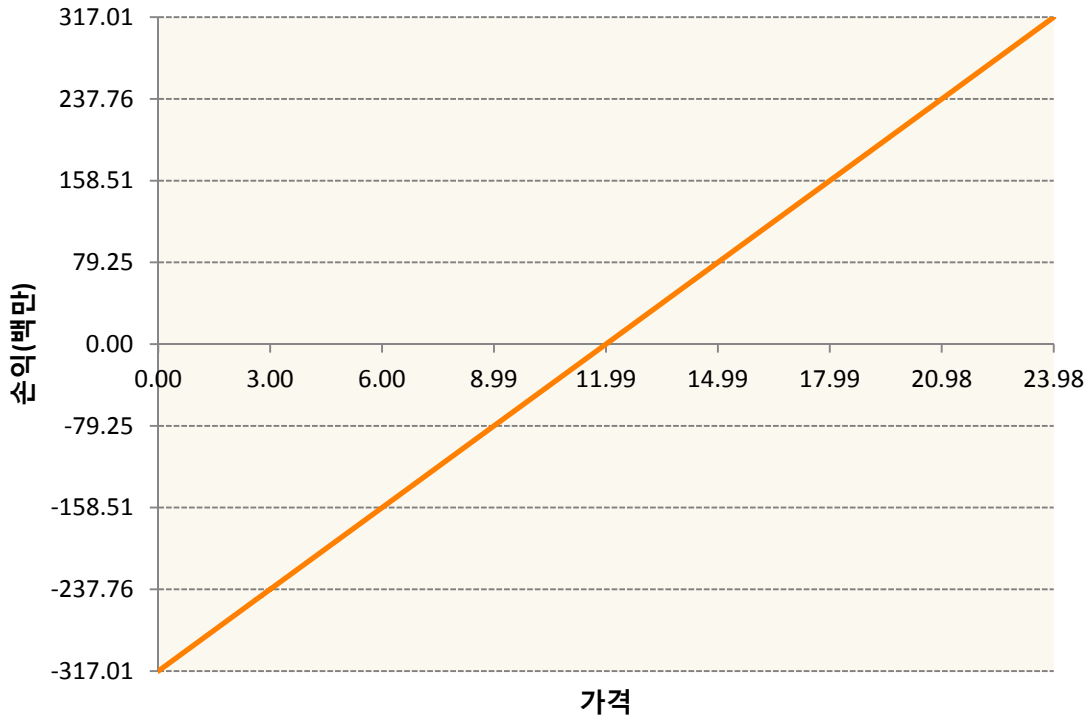
KR4175P80006-2019-08 달러선물



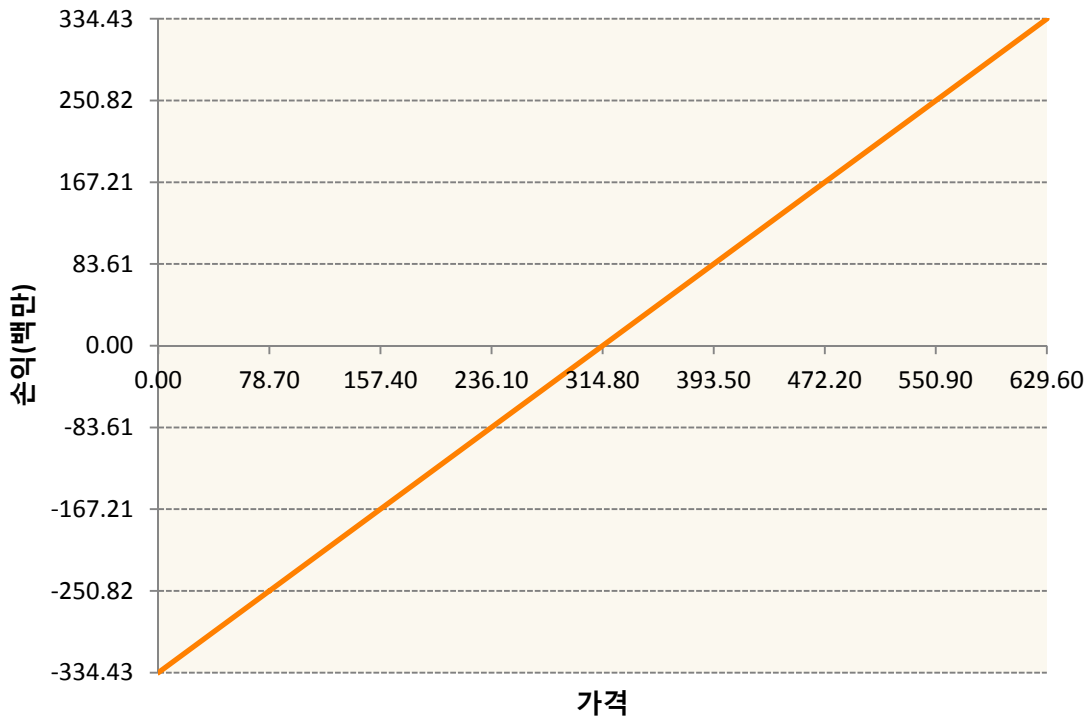
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

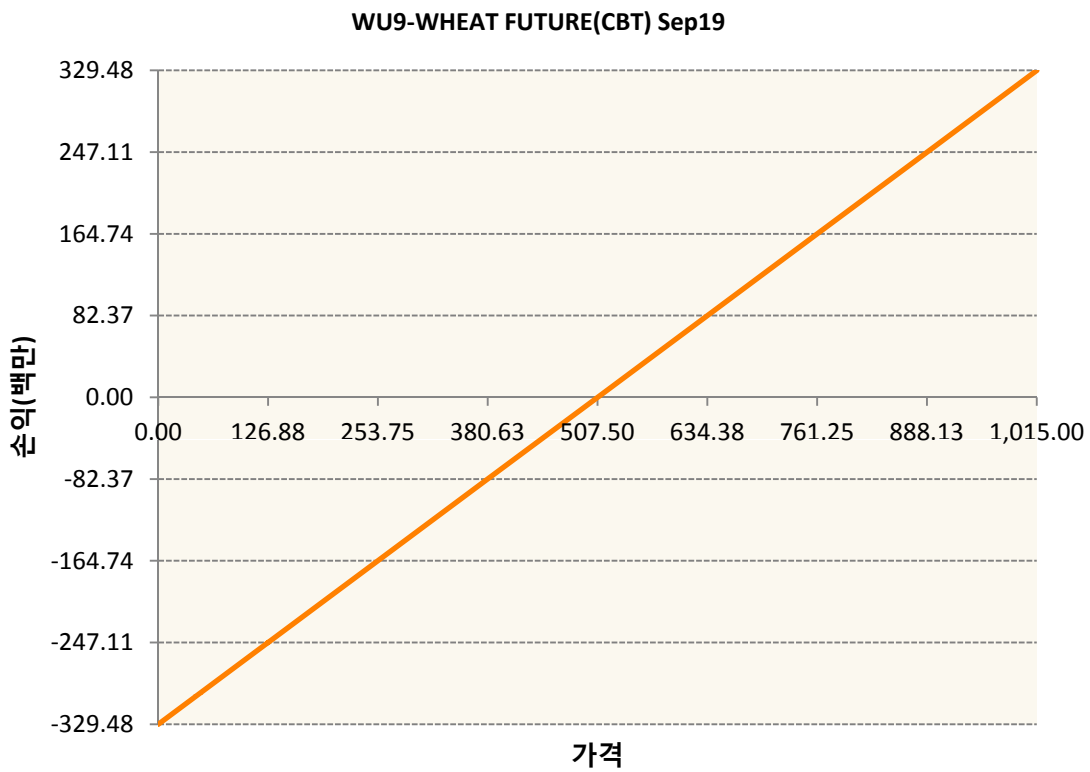
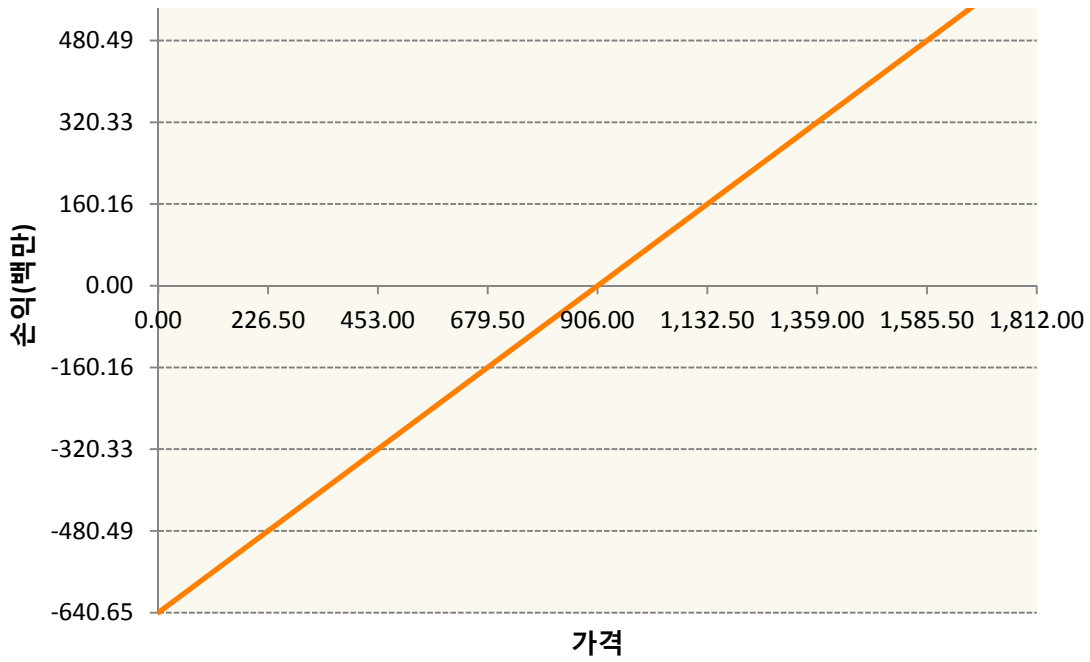


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	26
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	12
CU9	CORN FUTURE Sep19	55
KCU9	COFFEE 'C' FUTURE Sep19	19
KR4175P800	2019-08 달러선물	16

KWU9	KC HRW WHEAT FUT Sep19	8
SBV9	SUGAR #11 (WORLD) Oct19	25
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)

275