

공시일	2019-07-24
기준일	2019-07-23

## 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)

92

공시일	2019-07-24
기준일	2019-07-23

## 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

1,176

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

662

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-24
기준일	2019-07-23

## 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)

<b>832</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-24
기준일	2019-07-23

## 유로인덱스모(주식-파생형)

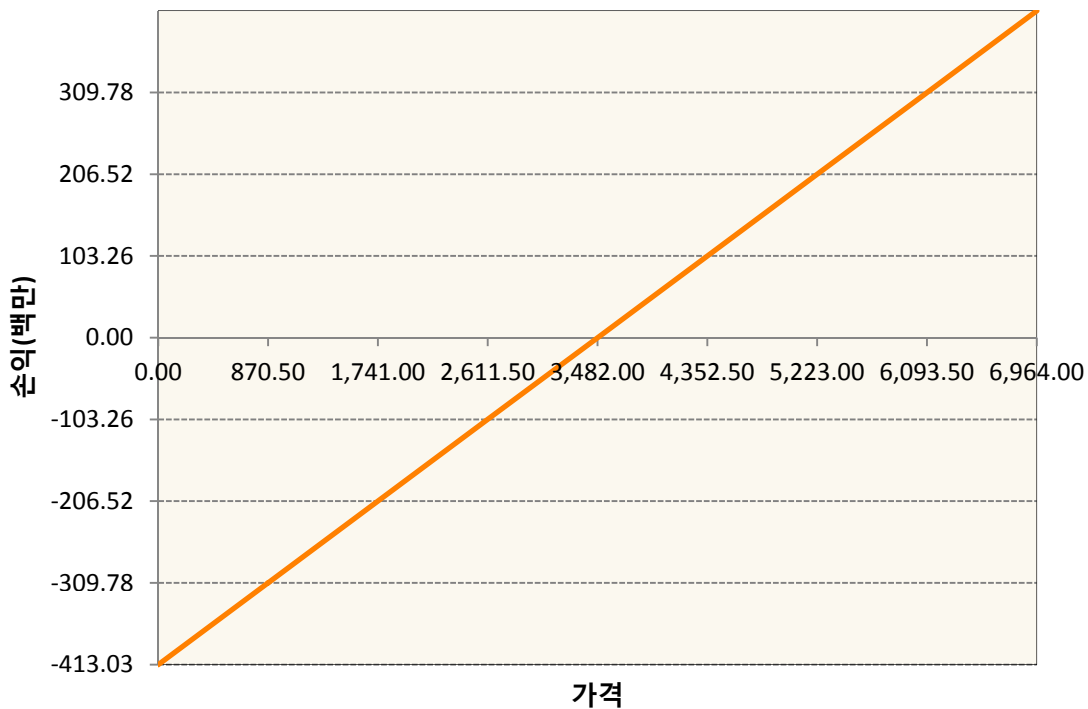
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	413	0	413	

### 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	2019-07-24
기준일	2019-07-23

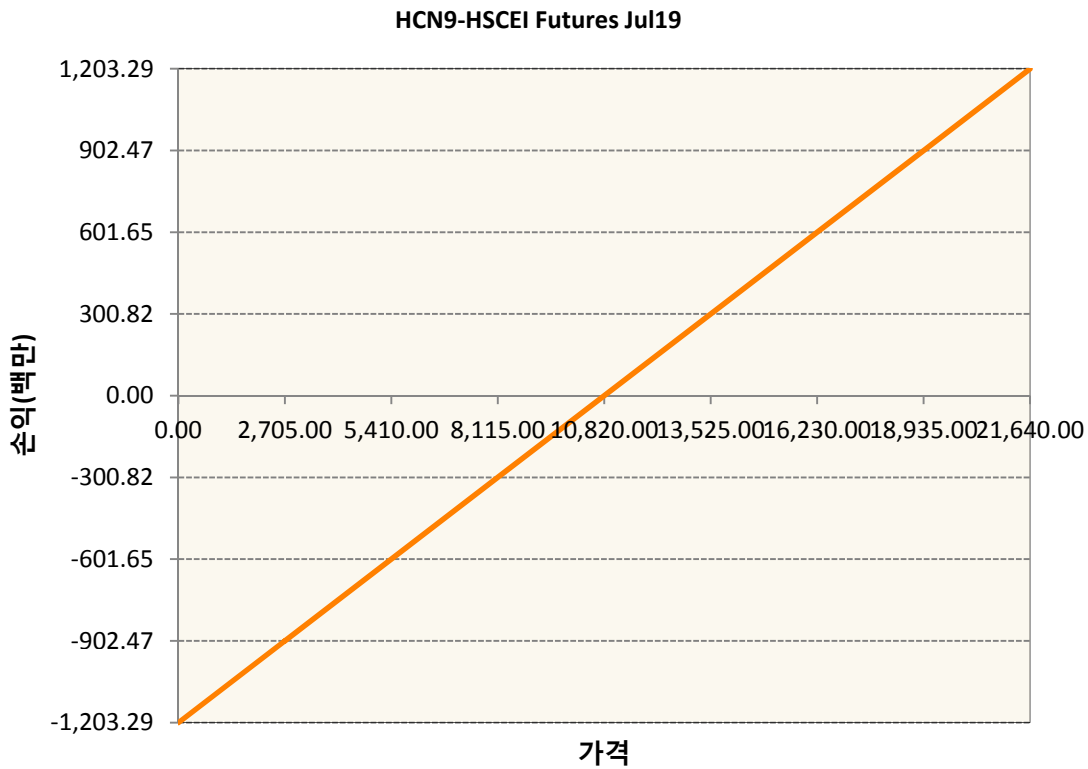
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,203	0	1,203	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN9	HSCEI Futures Jul19	96
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

96
----

공시일	2019-07-24
기준일	2019-07-23

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

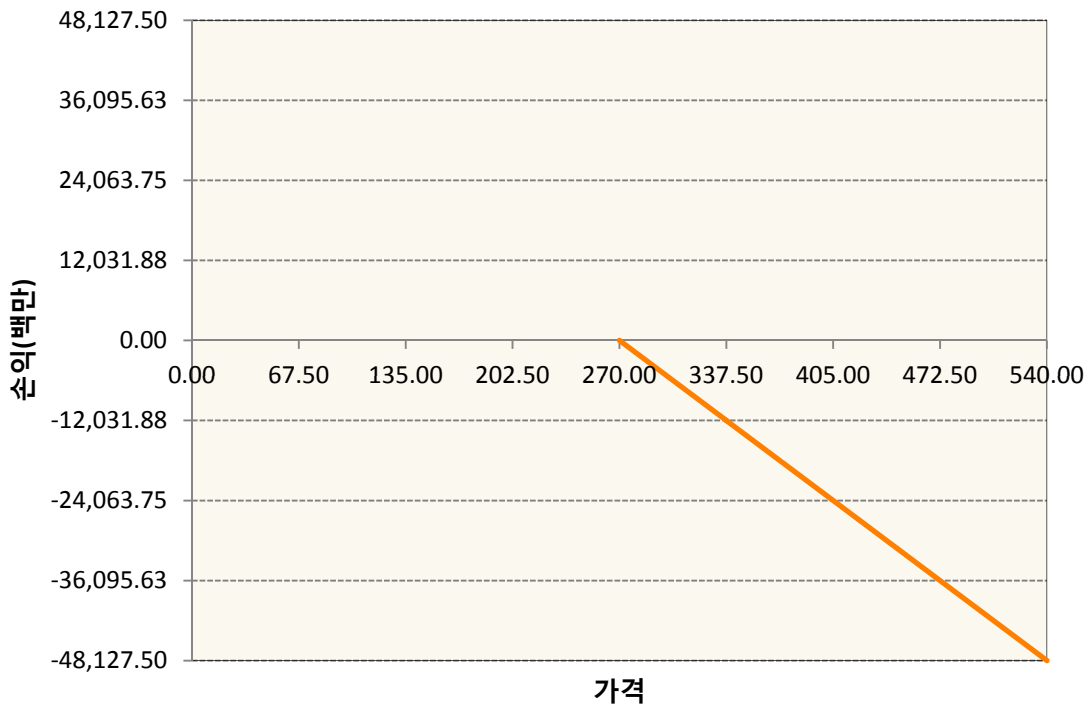
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

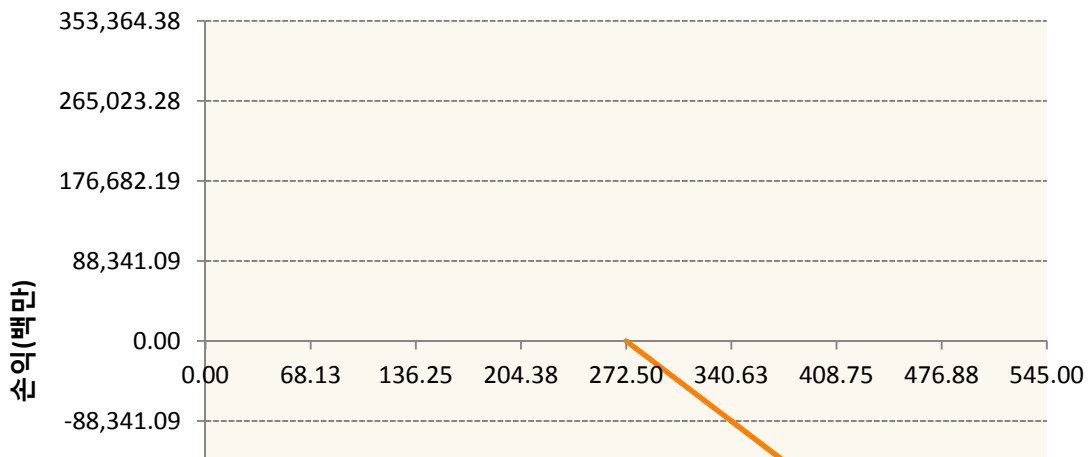
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	1,314	0	1,314	장내
누계	유가증권	옵션	0	587,729	-587,729	장내

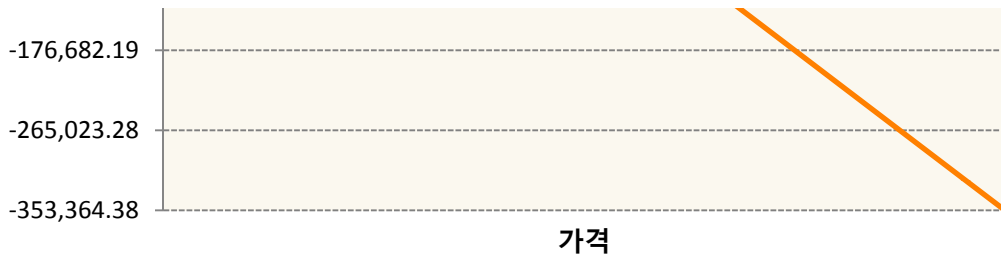
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P82709-2019-08 콜270

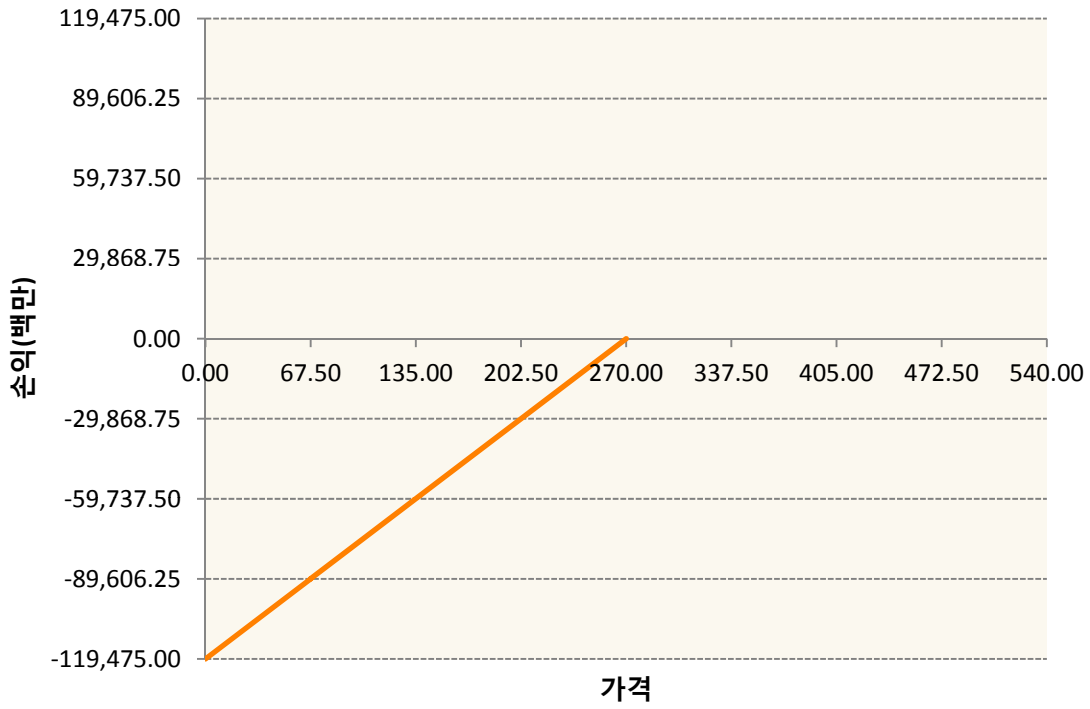


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

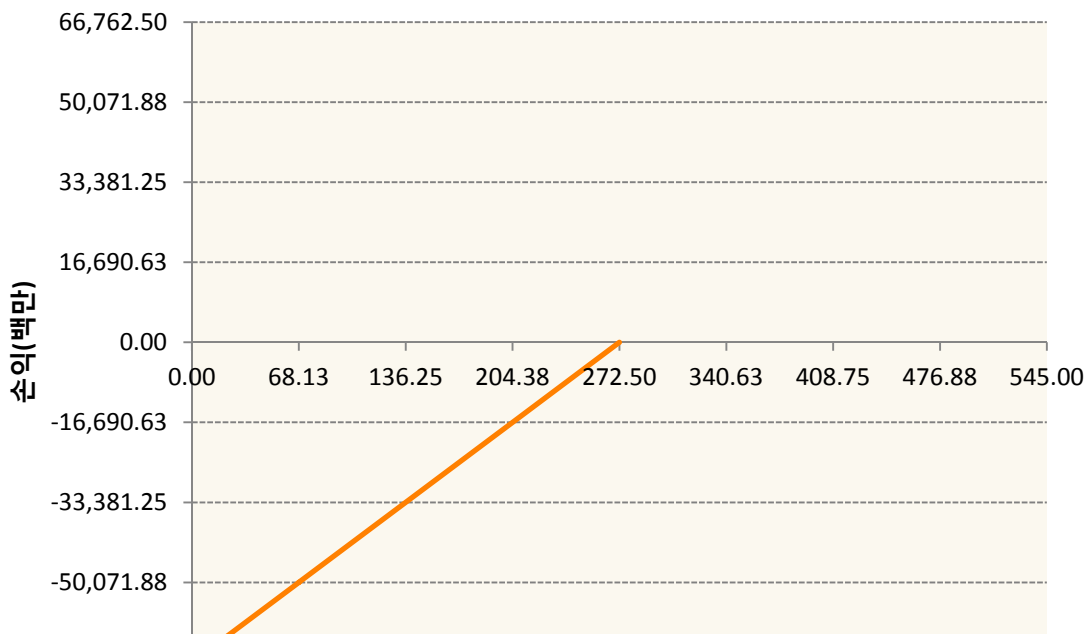




**KR4301P82707-2019-08 풋270**



**KR4301P82723-2019-08 풋272.5**



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P82709		2019-08 콜270						3,458
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,558	1,534	1,503	1,467	1,427	1,382	1,334	
-5.33%	1,406	1,348	1,287	1,223	1,157	1,089	1,019	
-2.67%	991	910	829	748	666	585	504	
0%	221	149	75	0	-76	-154	-232	
2.67%	-848	-890	-938	-990	-1,046	-1,106	-1,169	
5.33%	-2,081	-2,098	-2,120	-2,148	-2,181	-2,219	-2,261	
8.00%	-3,374	-3,379	-3,386	-3,398	-3,414	-3,434	-3,458	
KR4201P82725		2019-08 콜272.5						24,171
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	9,466	9,341	9,176	8,973	8,735	8,464	8,164	
-5.33%	8,734	8,395	8,020	7,616	7,188	6,740	6,275	
-2.67%	6,462	5,903	5,338	4,767	4,192	3,614	3,034	
0%	1,750	1,171	587	0	-590	-1,182	-1,776	
2.67%	-5,372	-5,764	-6,189	-6,640	-7,113	-7,605	-8,111	
5.33%	-14,029	-14,208	-14,432	-14,697	-15,000	-15,335	-15,698	
8.00%	-23,333	-23,390	-23,478	-23,600	-23,756	-23,947	-24,171	
KR4301P82707		2019-08 풋270						6,800
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-6,734	-6,737	-6,742	-6,750	-6,762	-6,778	-6,800	
-5.33%	-3,542	-3,579	-3,624	-3,676	-3,734	-3,798	-3,867	
-2.67%	-937	-1,046	-1,155	-1,265	-1,375	-1,486	-1,597	
0%	235	162	84	0	-88	-179	-272	
2.67%	436	424	405	381	349	311	267	
5.33%	447	446	445	442	436	428	416	
8.00%	447	447	447	447	447	445	443	
KR4301P82723		2019-08 풋272.5						4,186
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-4,167	-4,167	-4,168	-4,170	-4,174	-4,179	-4,186	
-5.33%	-2,377	-2,388	-2,402	-2,420	-2,441	-2,467	-2,495	
-2.67%	-766	-817	-869	-923	-978	-1,034	-1,090	
0%	168	114	57	0	-58	-117	-177	
2.67%	401	386	366	343	315	284	250	

5.33%	420	419	417	413	407	398	387
8.00%	421	421	421	421	420	418	416

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

(단위:백만원)

**40,155**

공시일	2019-07-24
기준일	2019-07-23

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

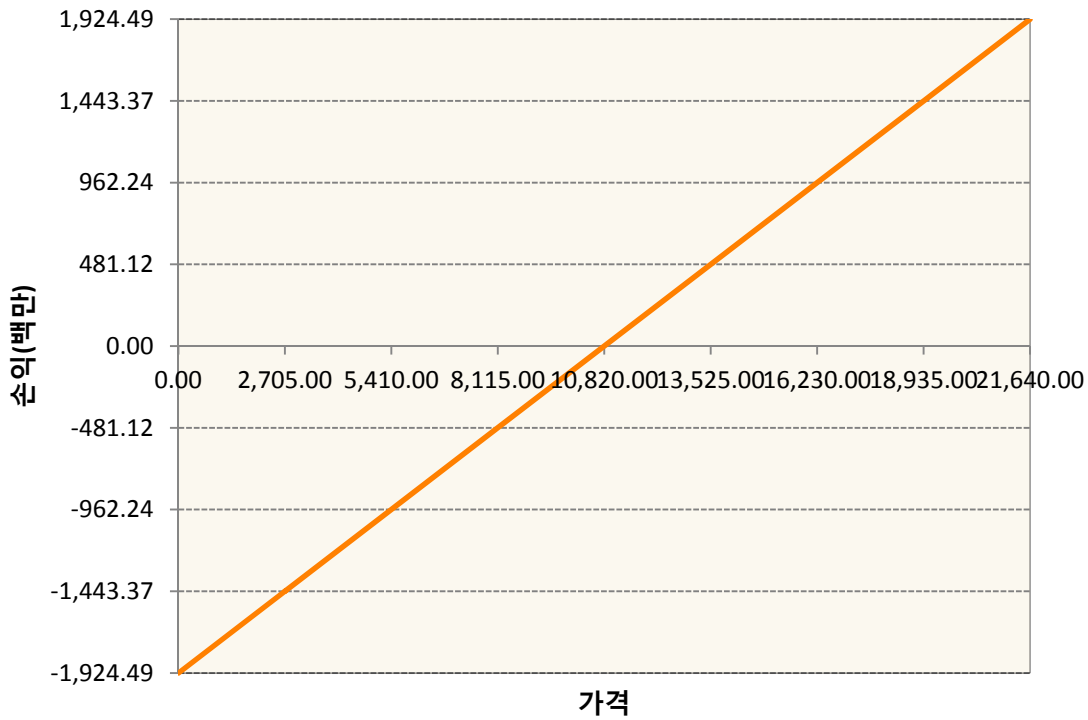
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

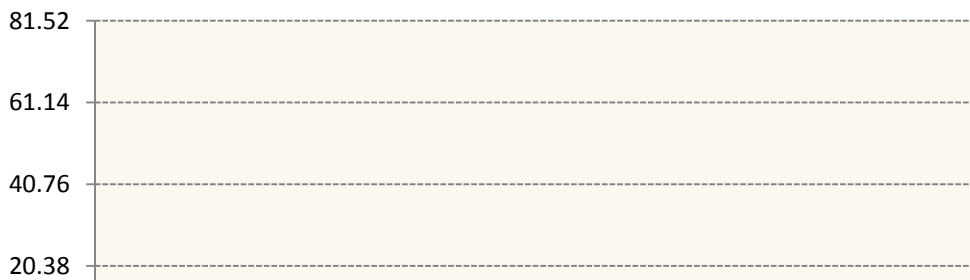
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,924	0	1,924	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,264	-5,264	장내
누계	통화	선도	151	3,170	-3,019	장외

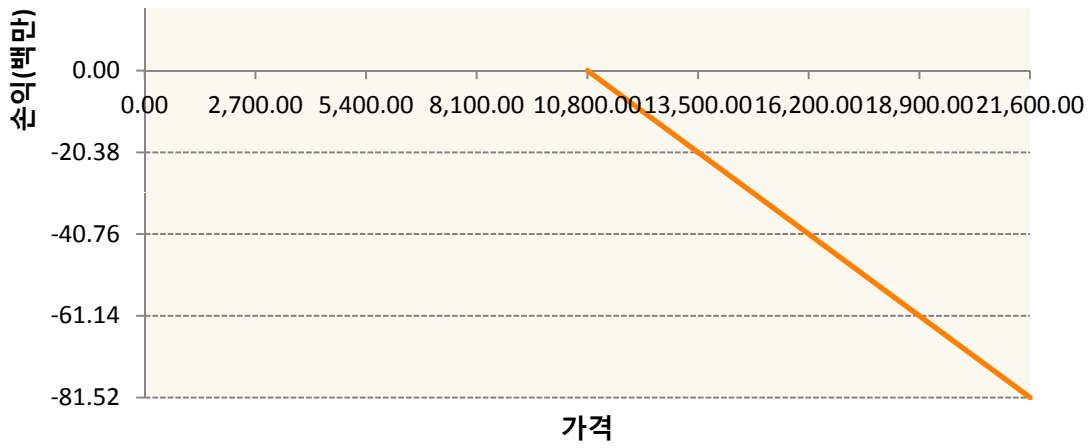
### 2. 만기시점의 손익구조

HCN9-HSCEI Futures Jul19

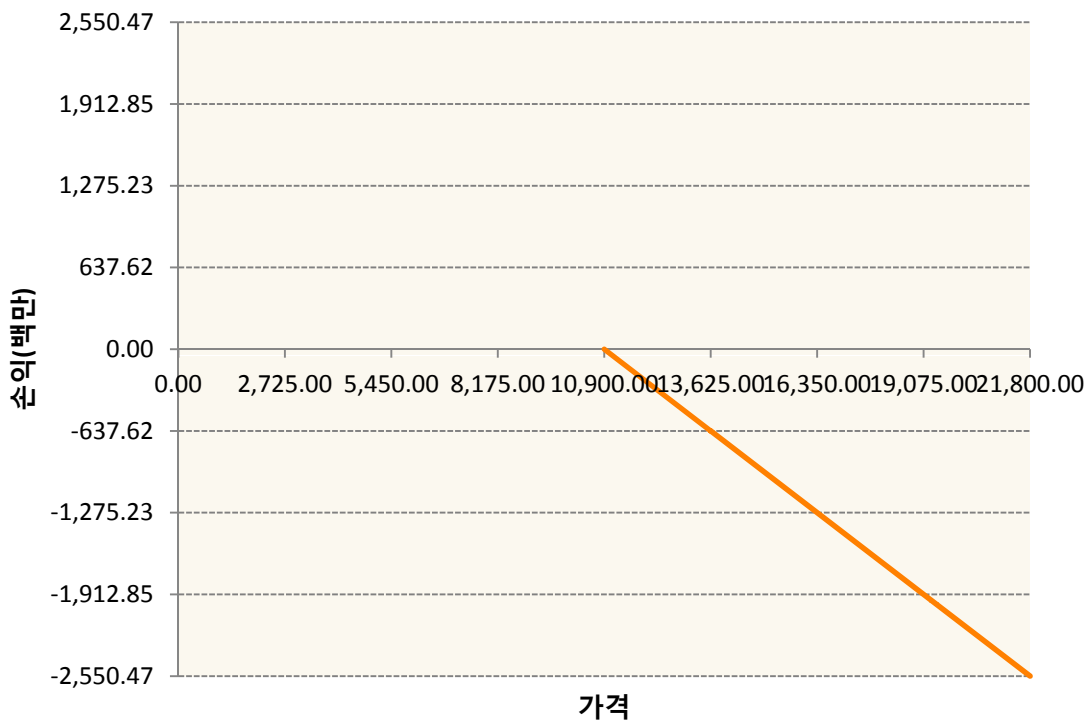


OHHIN9-C108-HSCEI

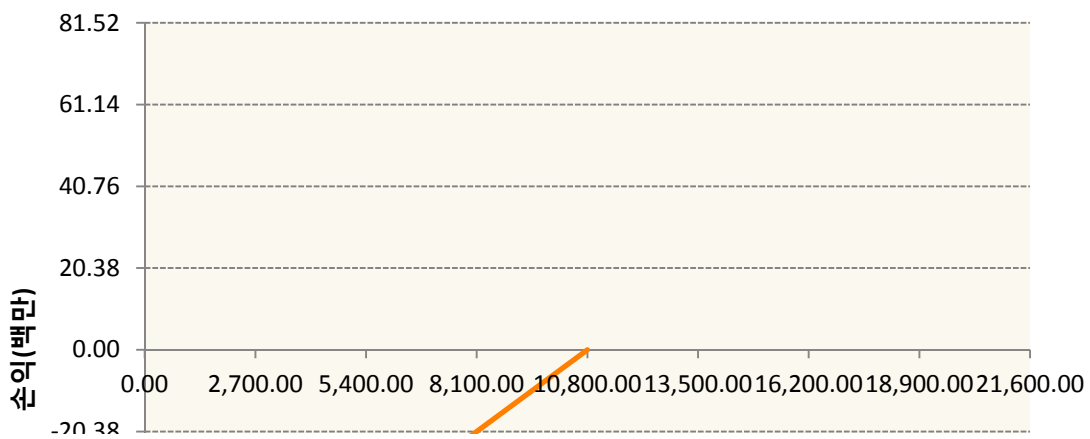


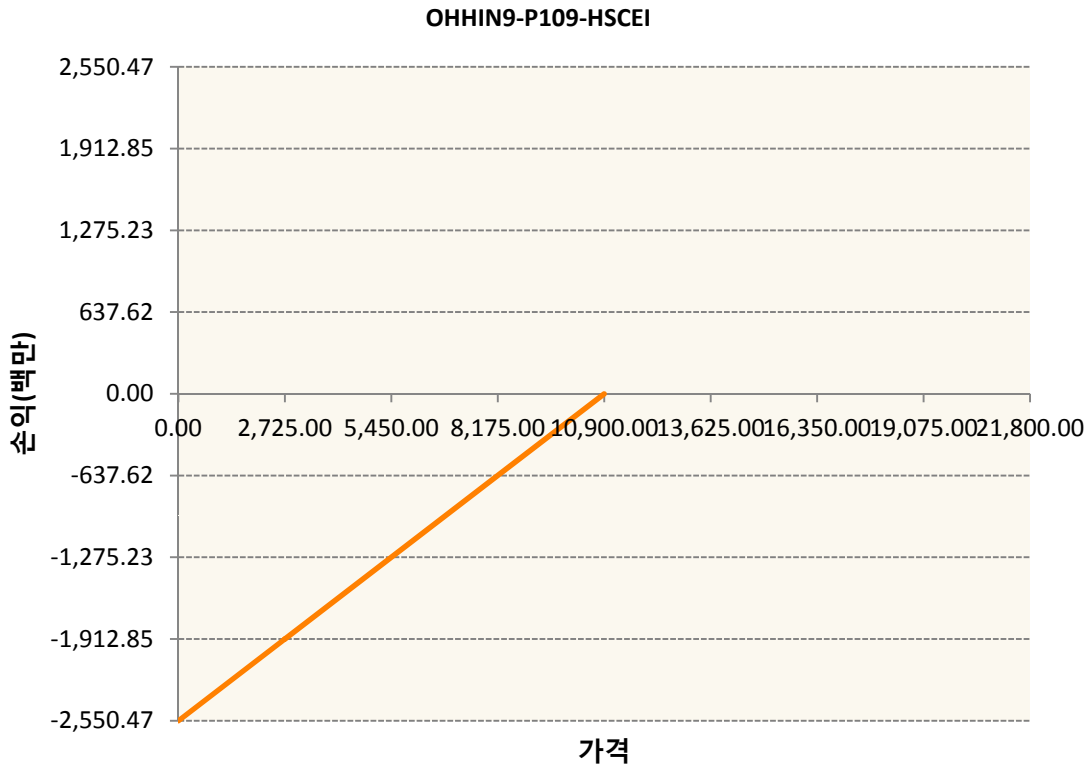
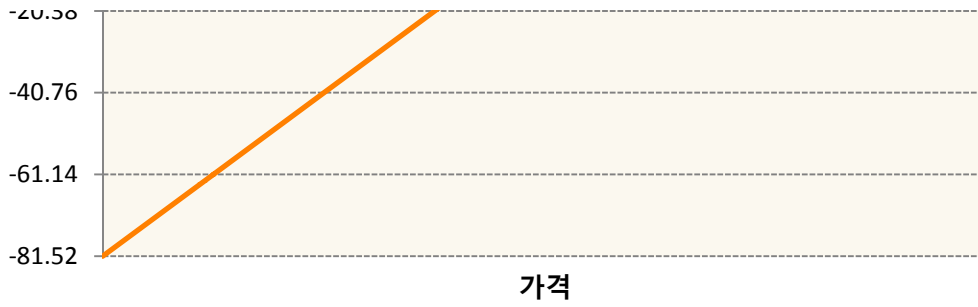


OHHIN9-C109-HSCEI



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)
	660

공시일	2019-07-24
기준일	2019-07-23

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

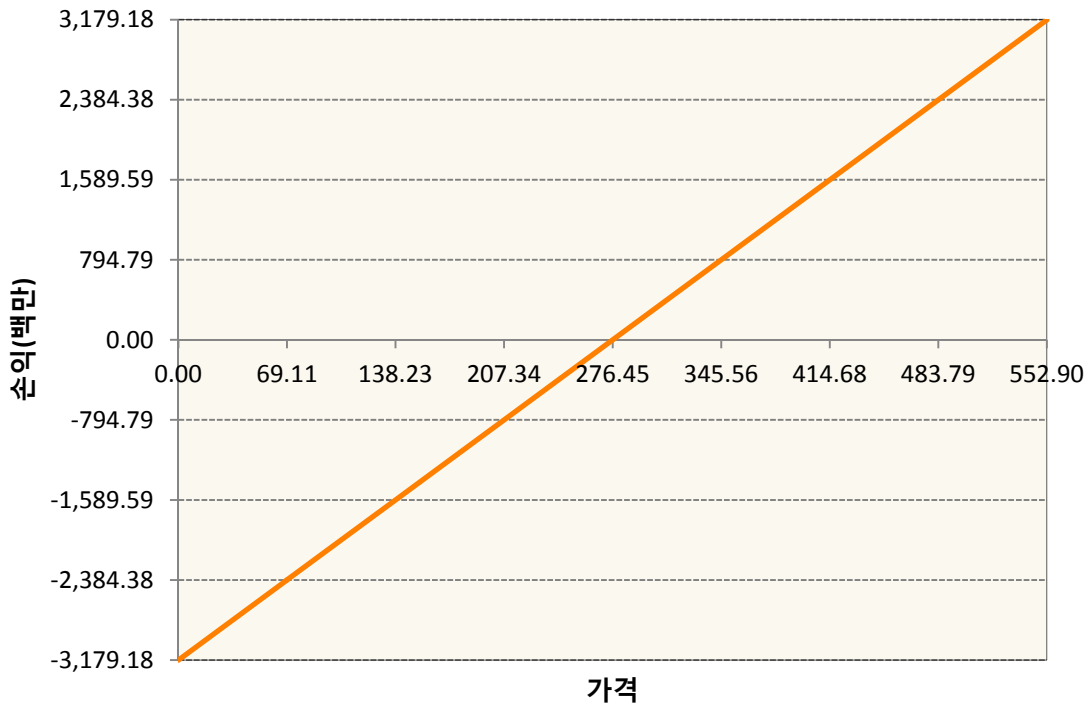
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

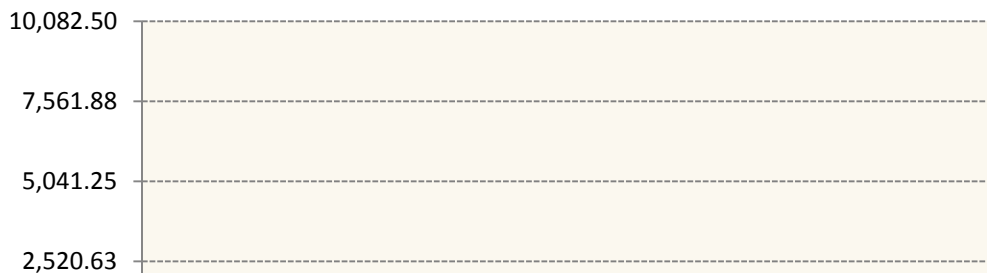
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	200	0	200	장내
누계	유가증권	선물	3,179	0	3,179	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	19,497	-19,497	장내

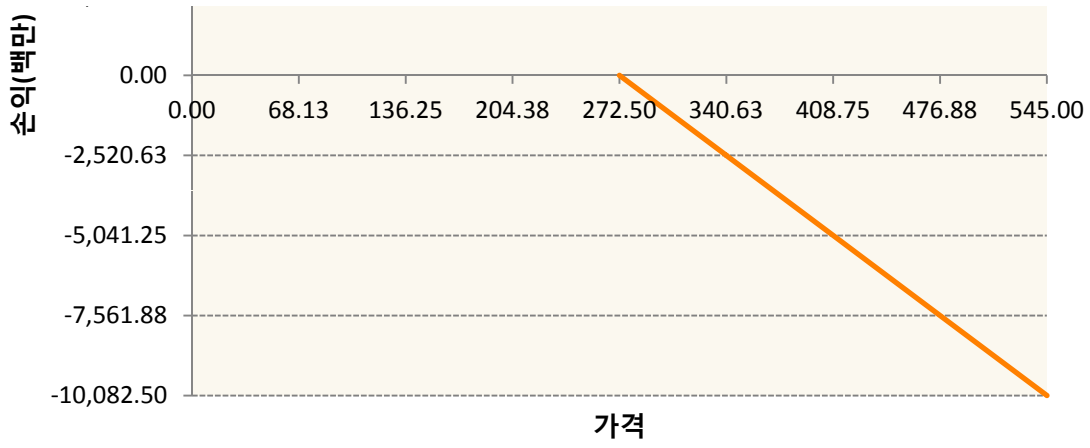
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

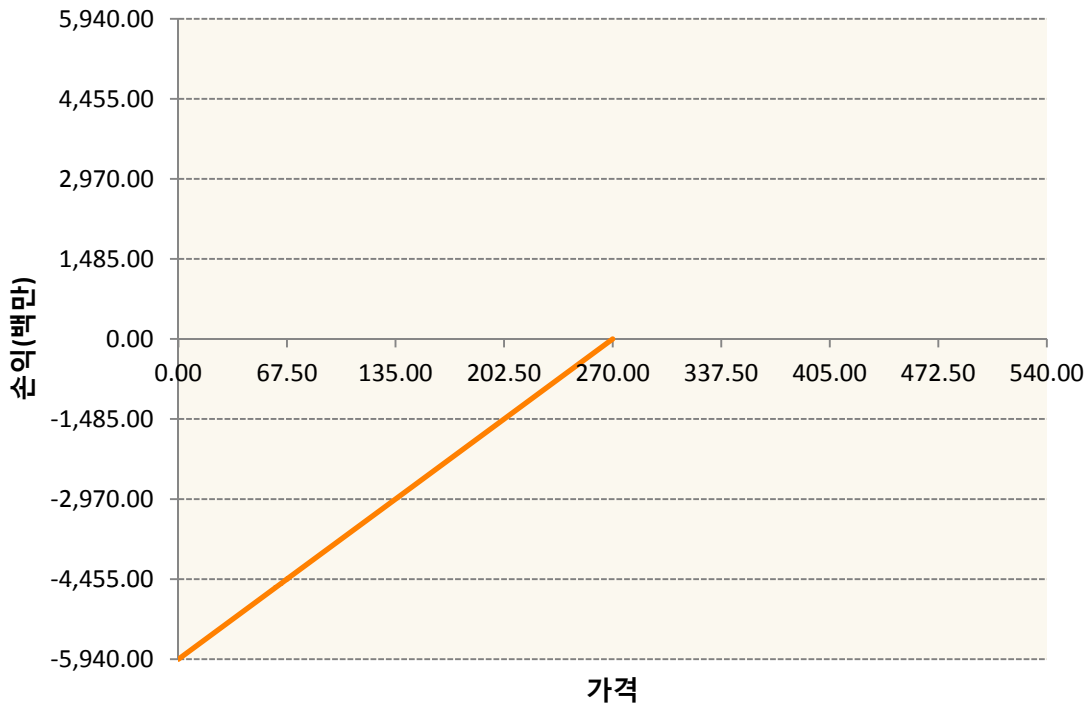


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

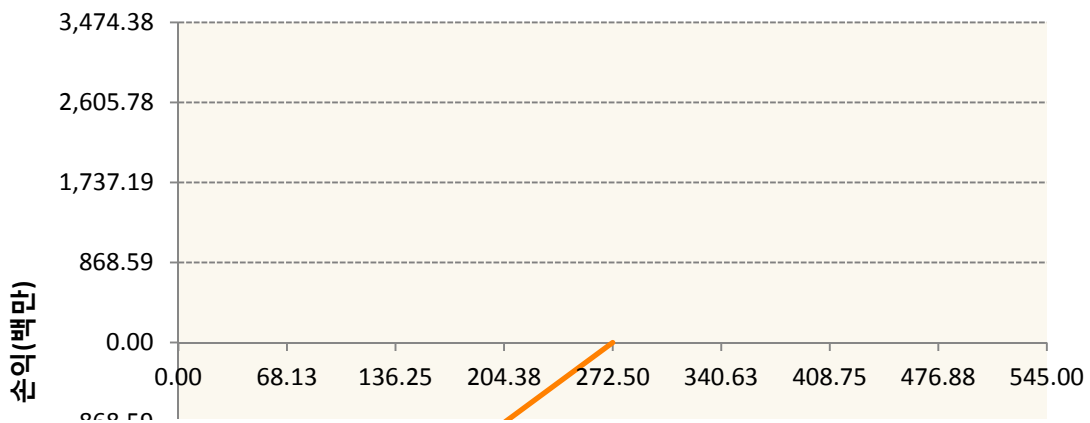




KR4301P82707-2019-08 풋270



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						254
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-254	-254	-254	-254	-254	-254	-254	
-5.33%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169	
-2.67%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	85	85	85	85	85	85	85	
5.33%	169	169	169	169	169	169	169	
8.00%	254	254	254	254	254	254	254	
KR4201P82725		2019-08 콜272.5						690
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	



공시일	2019-07-24
기준일	2019-07-23

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

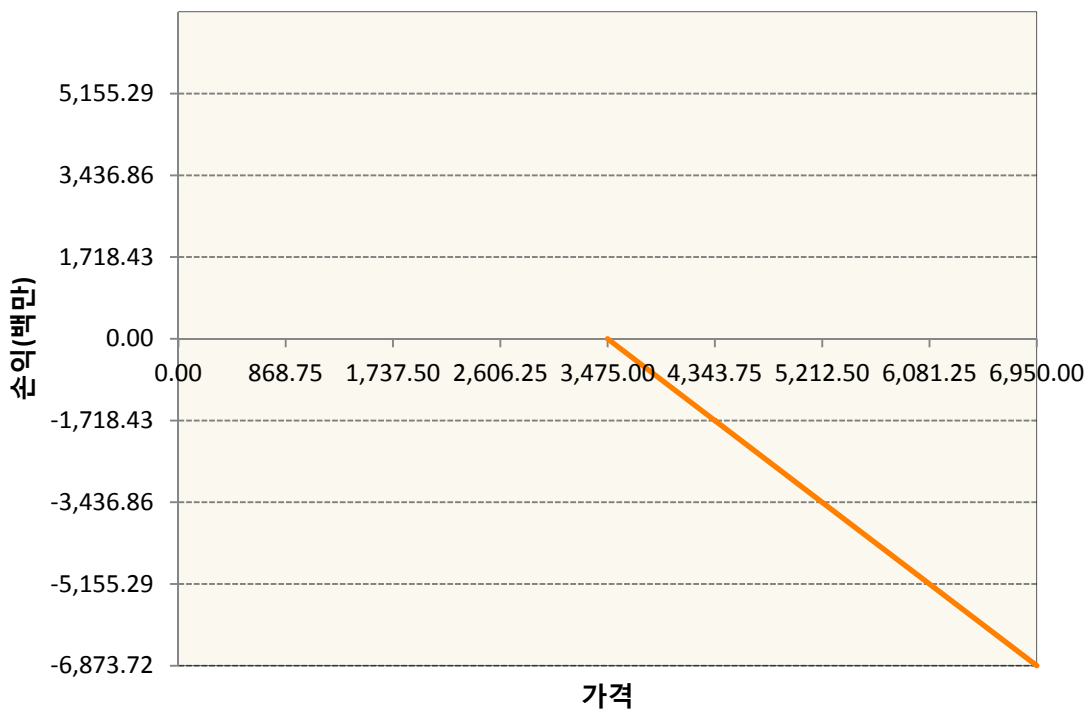
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

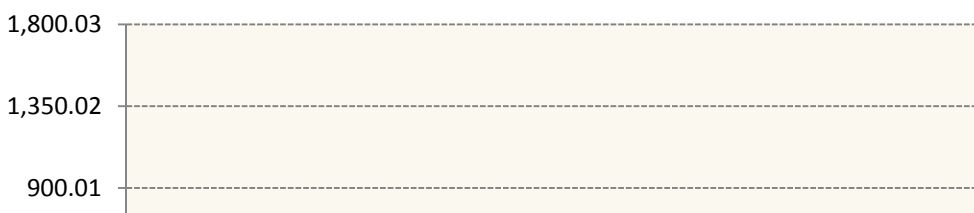
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,754	0	5,754	
누계	유가증권	스왑	37,654	0	37,654	장외
누계	유가증권	옵션	0	17,347	-17,347	장내
누계	통화	선도	5,275	22,417	-17,143	장외

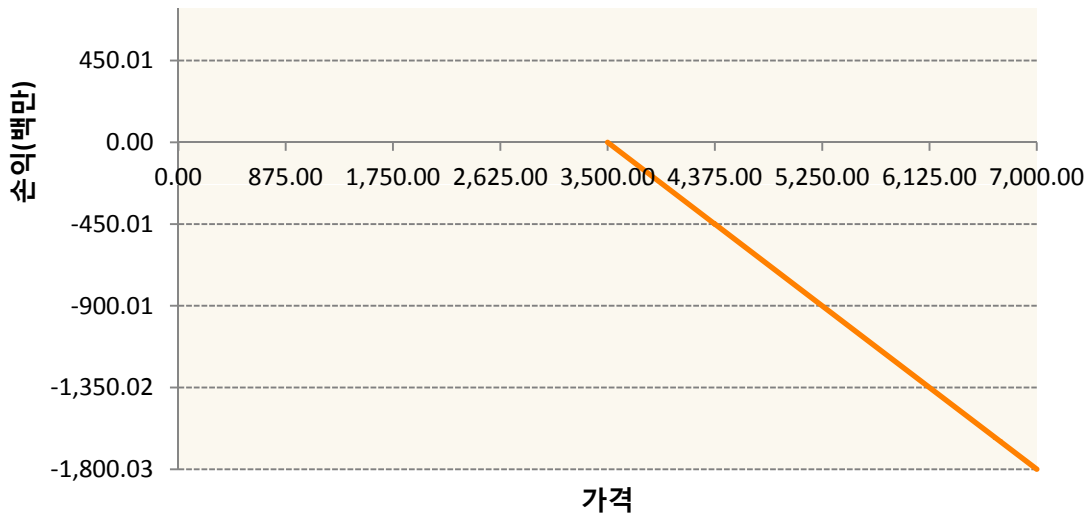
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXQ9-C3475-EURO STOXX 50**

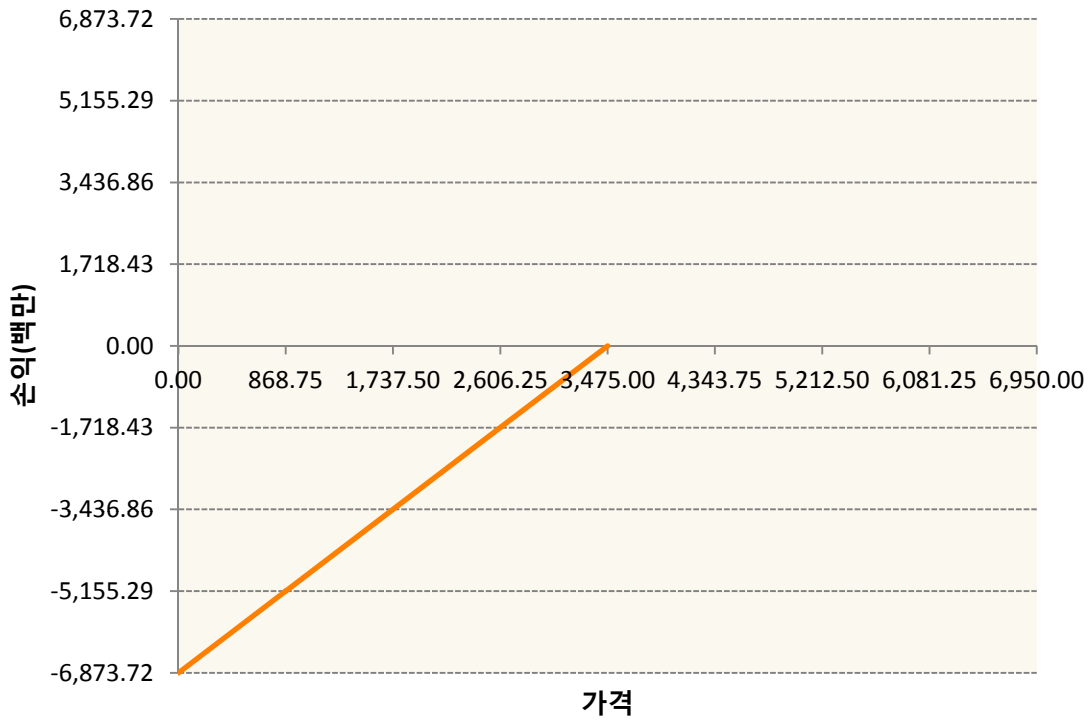


**OESXQ9-C3500-EURO STOXX 50**

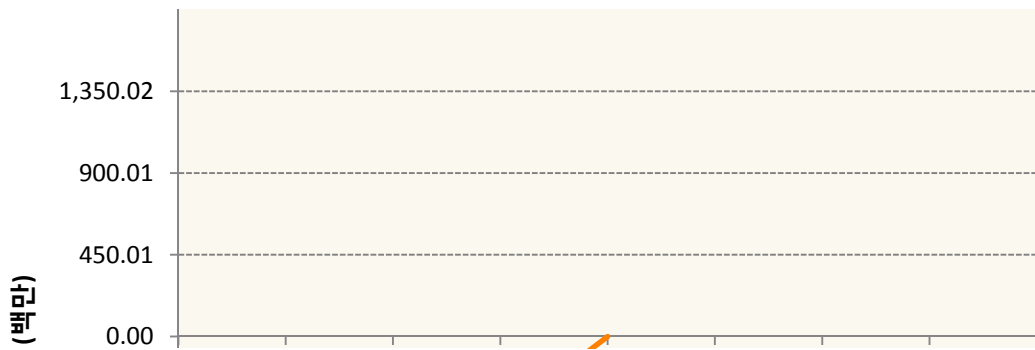


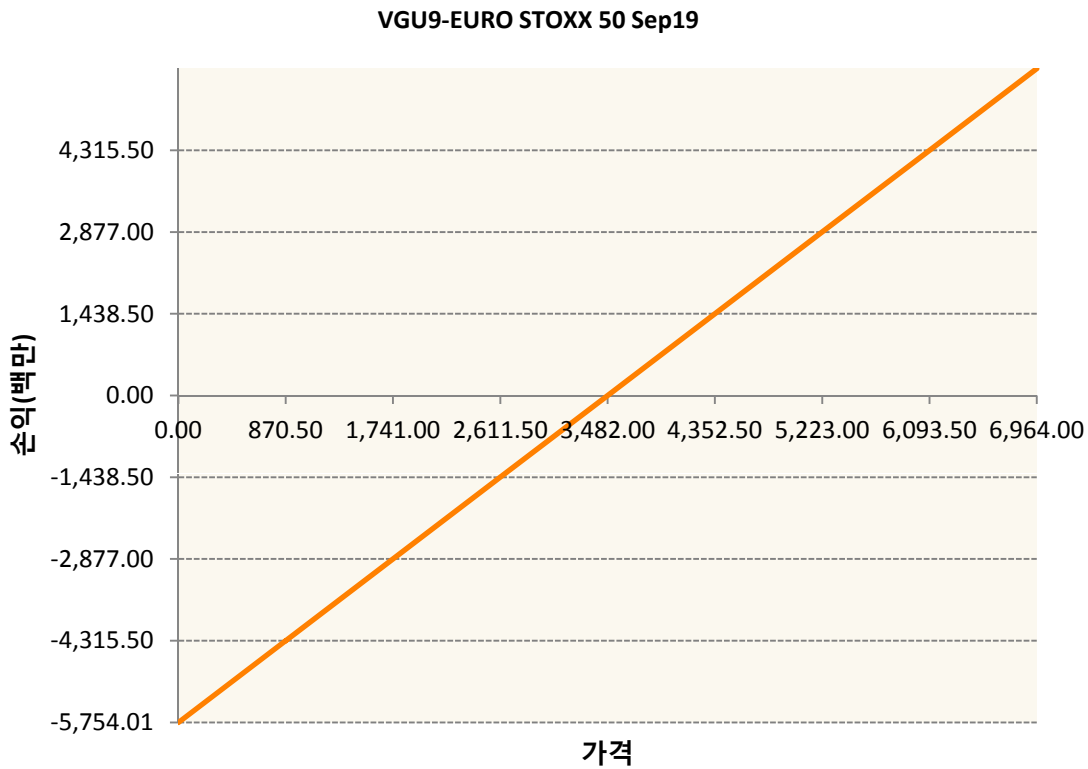
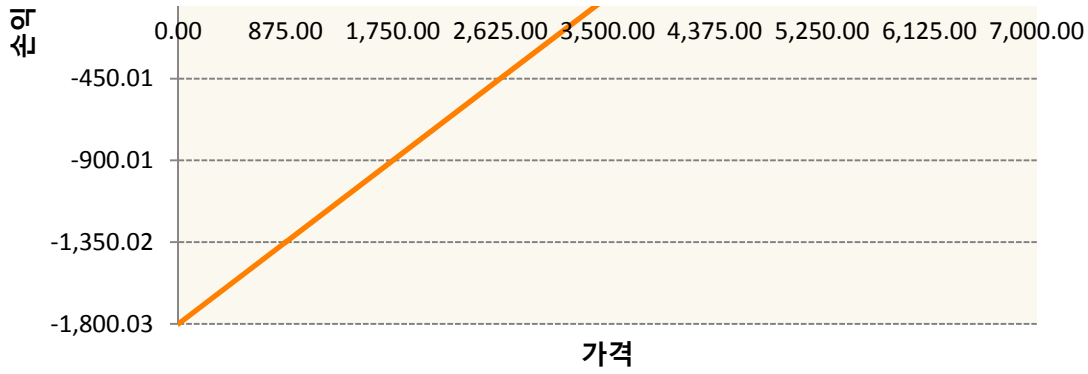


OESXQ9-P3475-EURO STOXX 50



OESXQ9-P3500-EURO STOXX 50





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	6
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	422
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E	1,055
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	316
FX21019N01 EUR/KRW 23-08-19E	422
OESXQ9-C34 EURO STOXX 50	550
OESXQ9-C35 EURO STOXX 50	144
OESXQ9-P34 EURO STOXX 50	550
OESXQ9-P35 EURO STOXX 50	144
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	460

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

(단위:백만원)

2,314



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

(단위:백만원)

1,030



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

(단위:백만원)

87



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

(단위:백만원)

133

공시일	2019-07-24
기준일	2019-07-23

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

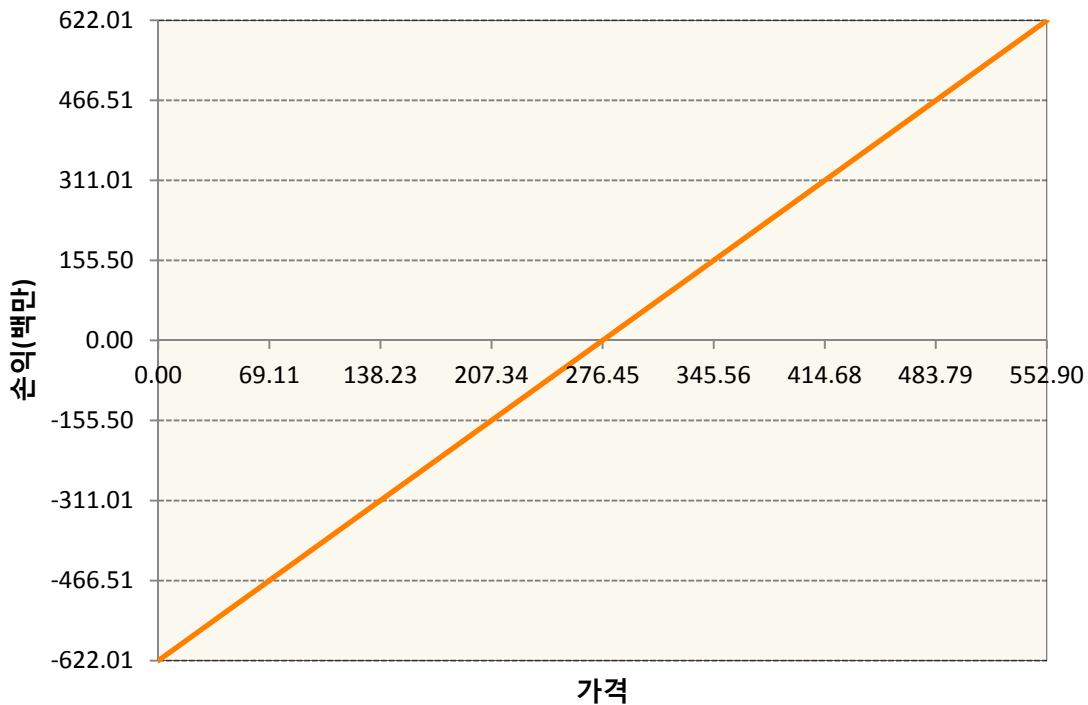
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	622	0	622	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						50
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	17	17	17	17	17	17	17	
5.33%	33	33	33	33	33	33	33	
8.00%	50	50	50	50	50	50	50	

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-07-24
기준일	2019-07-23

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

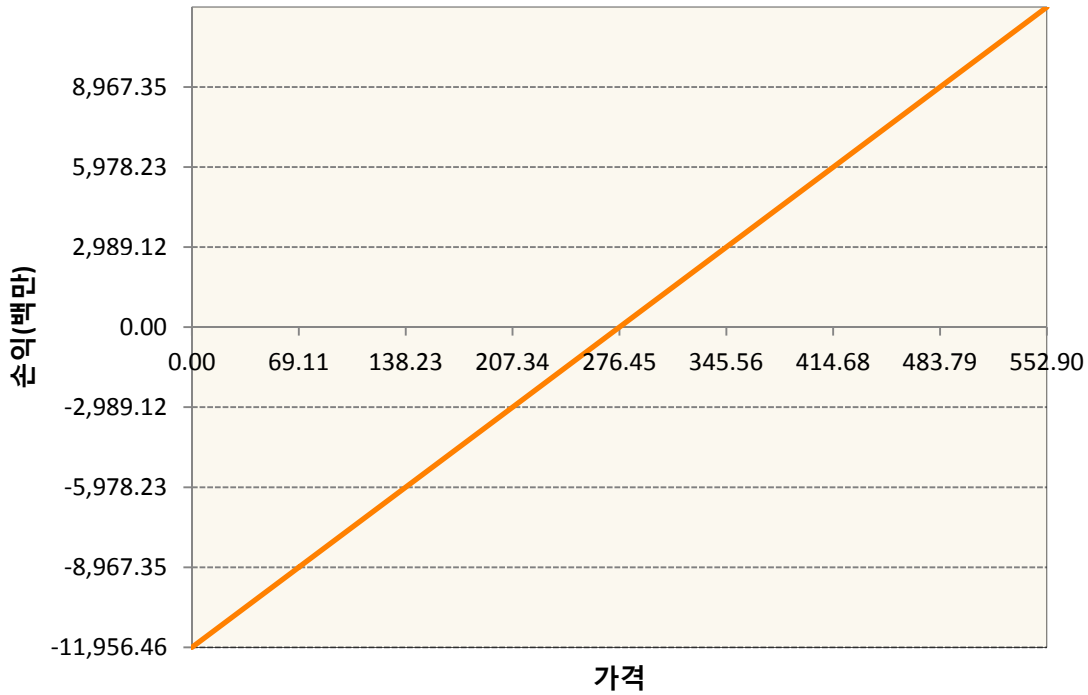
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

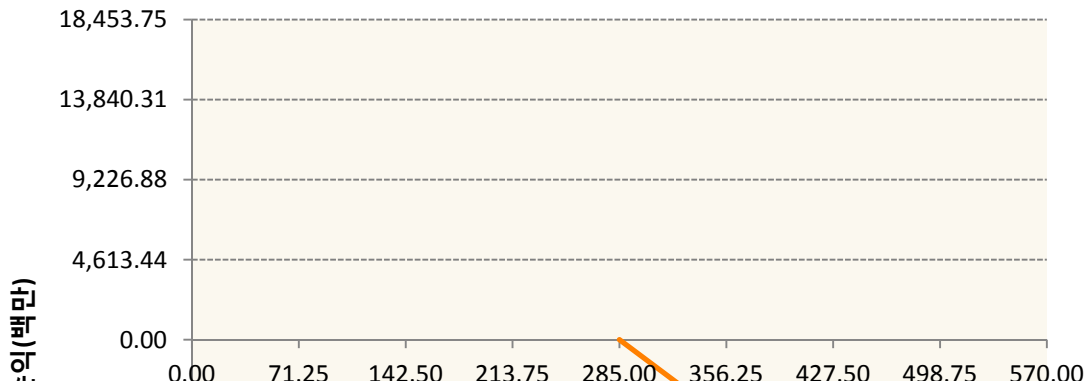
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,956	0	11,956	장내
누계	유가증권	옵션	1,698	21,688	-19,990	장내

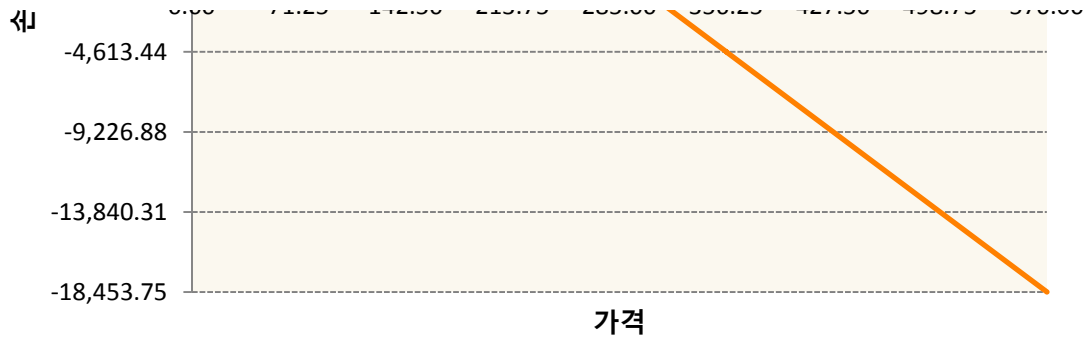
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

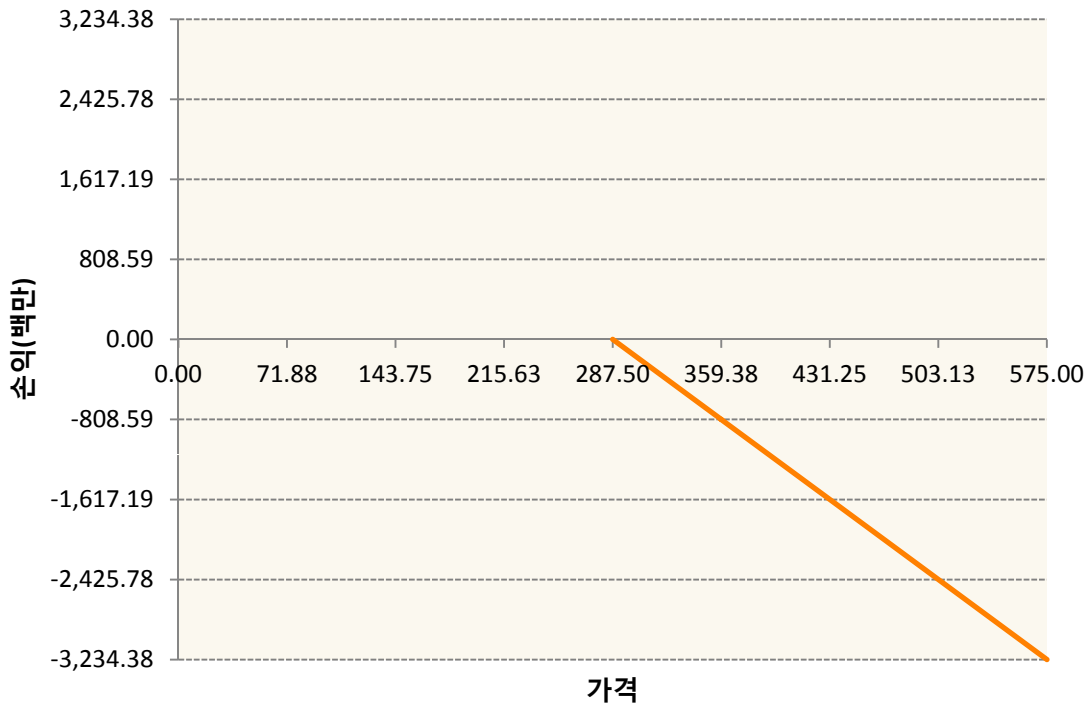


KR4201P82857-2019-08 콜285

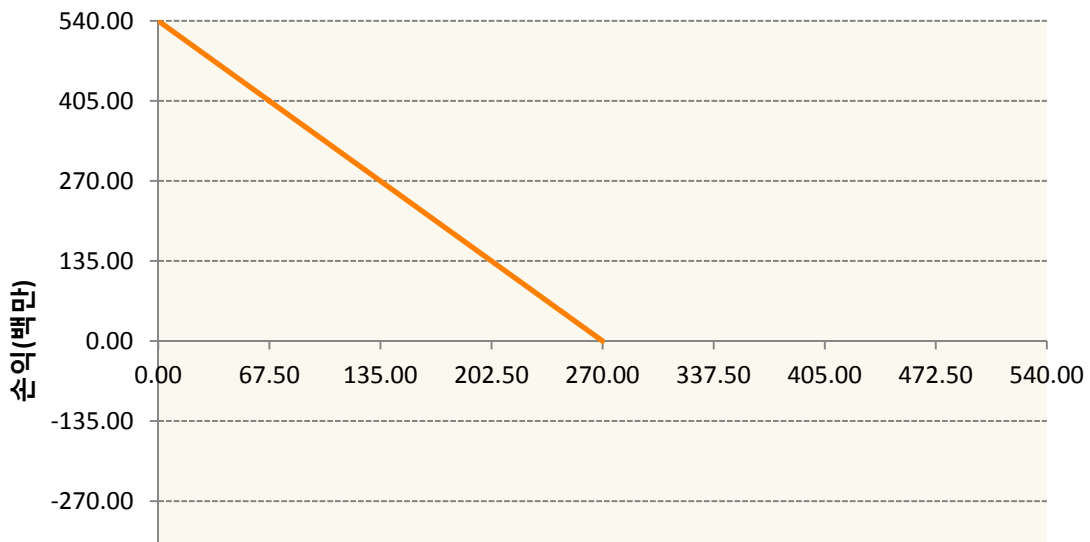


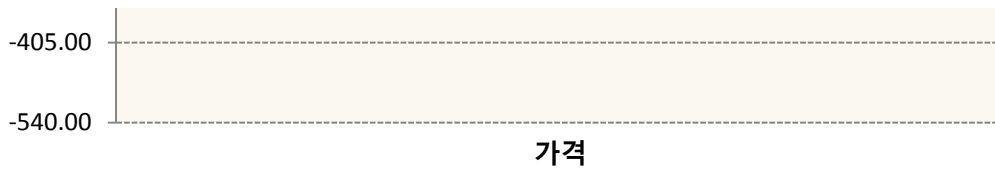


KR4201P82873-2019-08 콜287.5

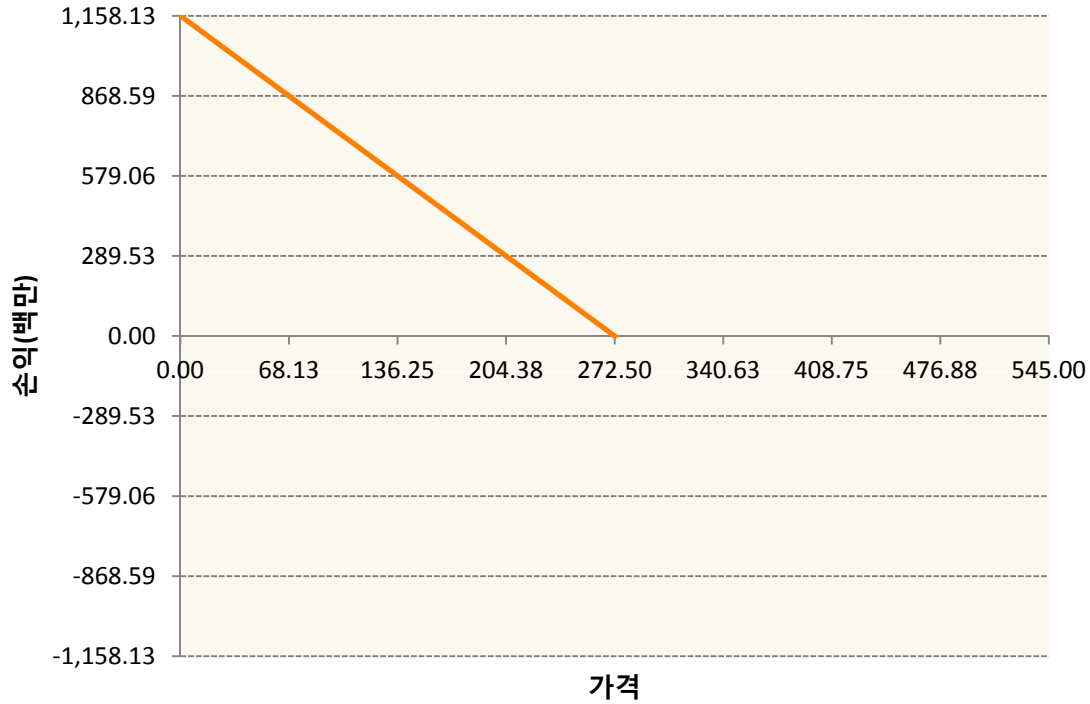


KR4301P82707-2019-08 풋270





KR4301P82723-2019-08 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						955
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-955	-955	-955	-955	-955	-955	-955	
-5.33%	-636	-636	-636	-636	-636	-636	-636	
-2.67%	-318	-318	-318	-318	-318	-318	-318	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	318	318	318	318	318	318	318	
5.33%	636	636	636	636	636	636	636	
8.00%	955	955	955	955	955	955	955	
KR4201P82857		2019-08 콜285						863
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	147	147	146	144	141	137	132	
-5.33%	145	142	137	131	123	114	103	
-2.67%	130	119	107	92	76	58	39	

0%	71	48	25	0	-26	-52	-79
2.67%	-80	-111	-142	-173	-204	-235	-266
5.33%	-353	-381	-410	-439	-469	-499	-529
8.00%	-732	-750	-769	-791	-814	-838	-863

KR4201P82873                      2019-08 콜287.5                      136

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19	19	19	19	19	18	17
-5.33%	19	19	18	17	16	15	13
-2.67%	17	16	14	12	10	8	5
0%	11	7	4	0	-4	-8	-12
2.67%	-9	-15	-20	-25	-30	-36	-41
5.33%	-50	-55	-60	-66	-71	-77	-82
8.00%	-110	-114	-118	-122	-127	-131	-136

KR4301P82707                      2019-08 풋270                      31

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	30	30	30	31	31	31	31
-5.33%	16	16	16	17	17	17	17
-2.67%	4	5	5	6	6	7	7
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-1	-1
5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2

KR4301P82723                      2019-08 풋272.5                      73

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	72	72	72	72	72	72	73
-5.33%	41	41	42	42	42	43	43
-2.67%	13	14	15	16	17	18	19
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-7	-7	-6	-6	-5	-5	-4
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)

**1,715**

공시일	2019-07-24
기준일	2019-07-23

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	4,716	0	4,716	
누계	유가증권	수익증권	39,387	0	39,387	

### 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	2019-07-24
기준일	2019-07-23

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	589	0	589	
누계	유가증권	수익증권	53,391	0	53,391	

### 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	2019-07-24
기준일	2019-07-23

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	5,895	0	5,895	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	402,255	0	402,255	
누계	통화	선도	0	448,006	-448,006	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		1,886
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		1,886
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		3,112
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		2,113
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		1,698
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,075
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		132
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		566
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		3,018
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		3,301
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		472
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		943
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		2,933
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		1,641
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		754
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,886
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,886
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		283

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

(단위:백만원)

11,695

공시일	2019-07-24
기준일	2019-07-23

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

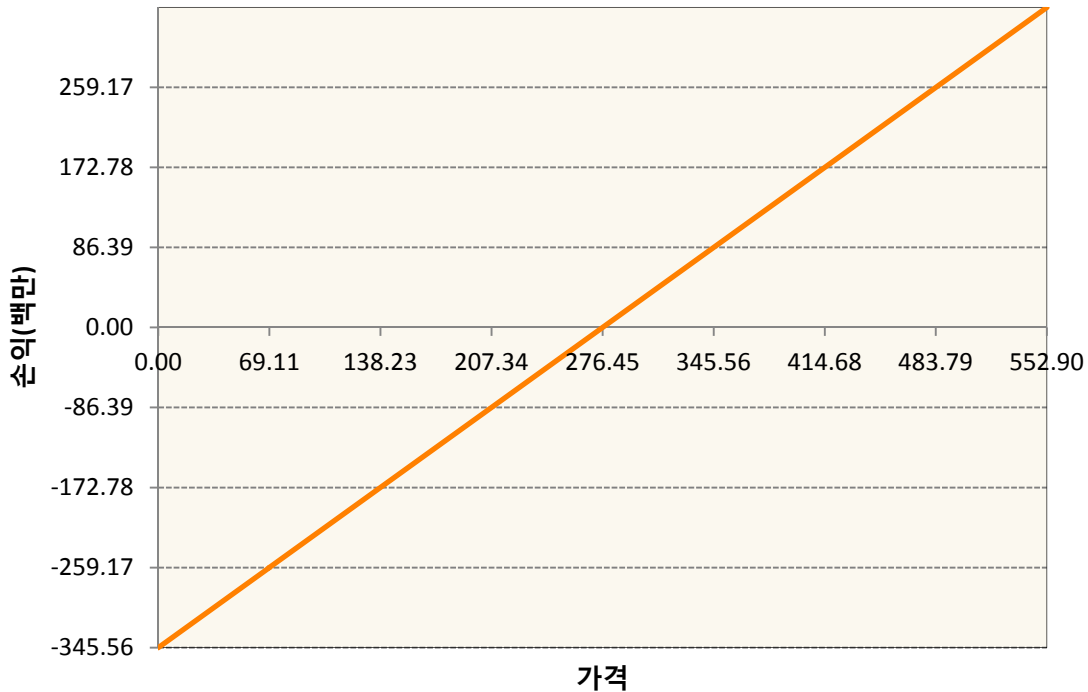
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

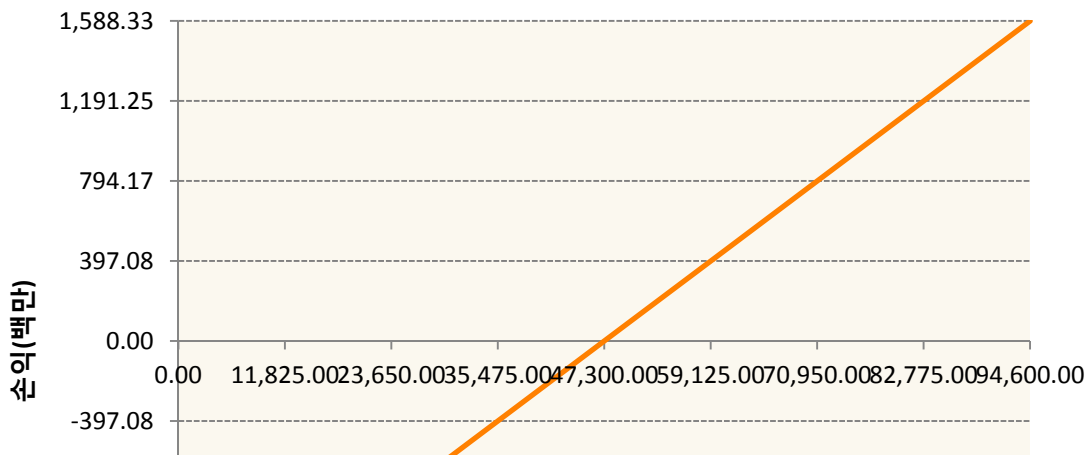
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,934	0	1,934	장내

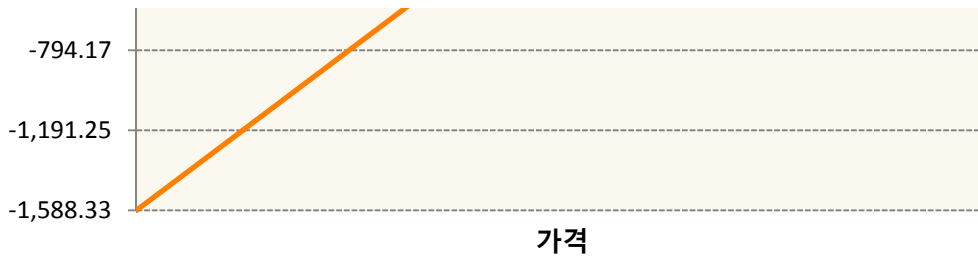
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P80001-2019-08 삼성전자개별선물





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

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						28
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28	
-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%	28	28	28	28	28	28	28	
KR4111P80001		2019-08 삼성전자개별선물						127
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127	
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85	
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	42	42	42	42	42	42	42	
5.33%	85	85	85	85	85	85	85	
8.00%	127	127	127	127	127	127	127	

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

**178**

공시일	2019-07-24
기준일	2019-07-23

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

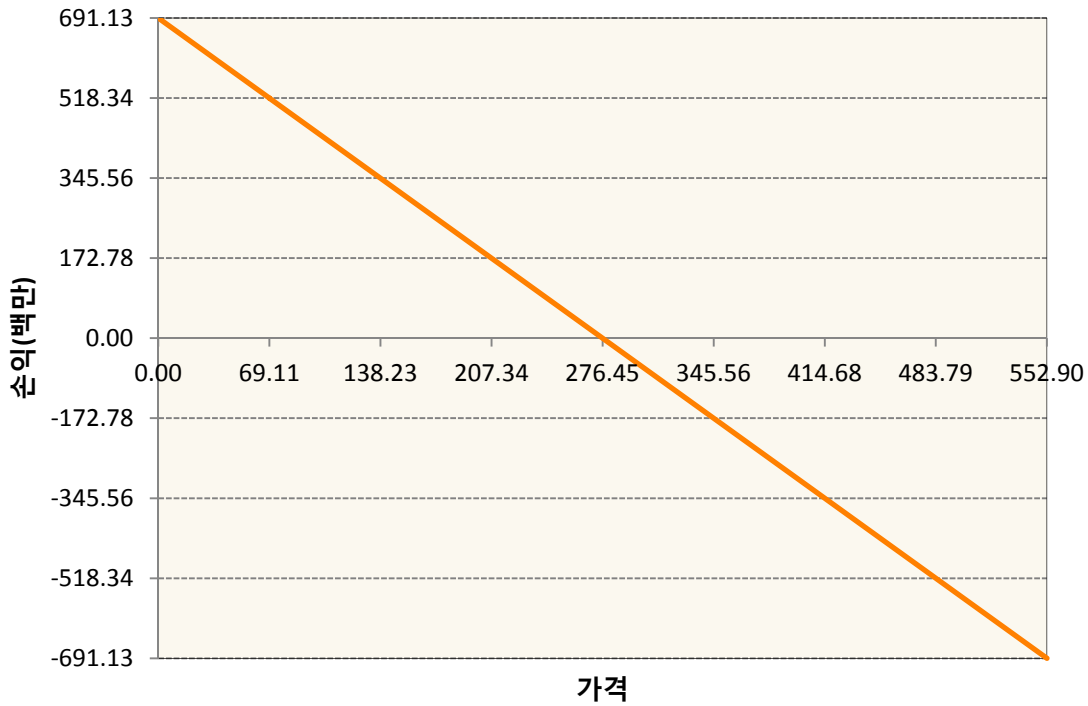
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

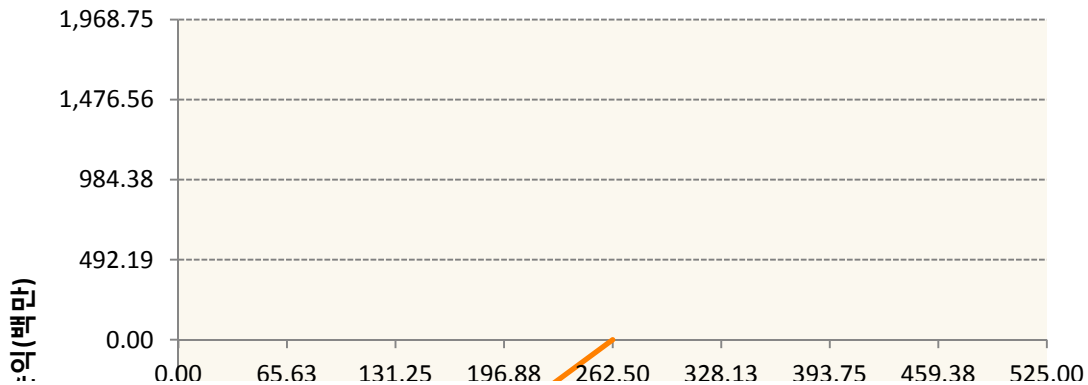
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	691	-691	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,625	-3,625	장내

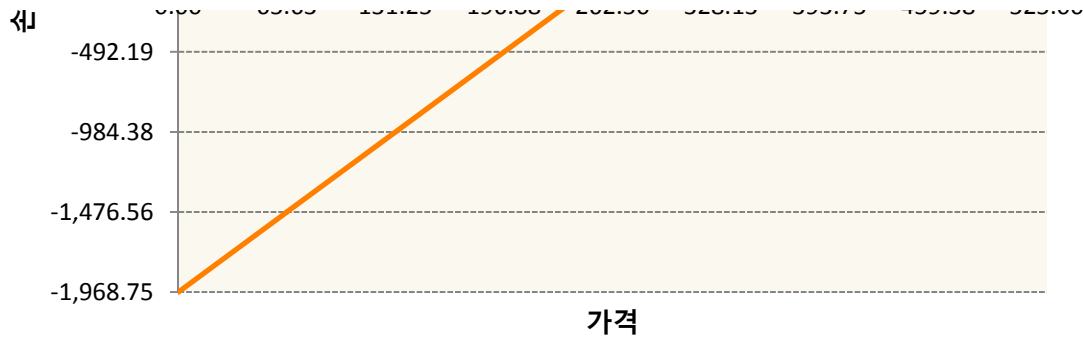
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

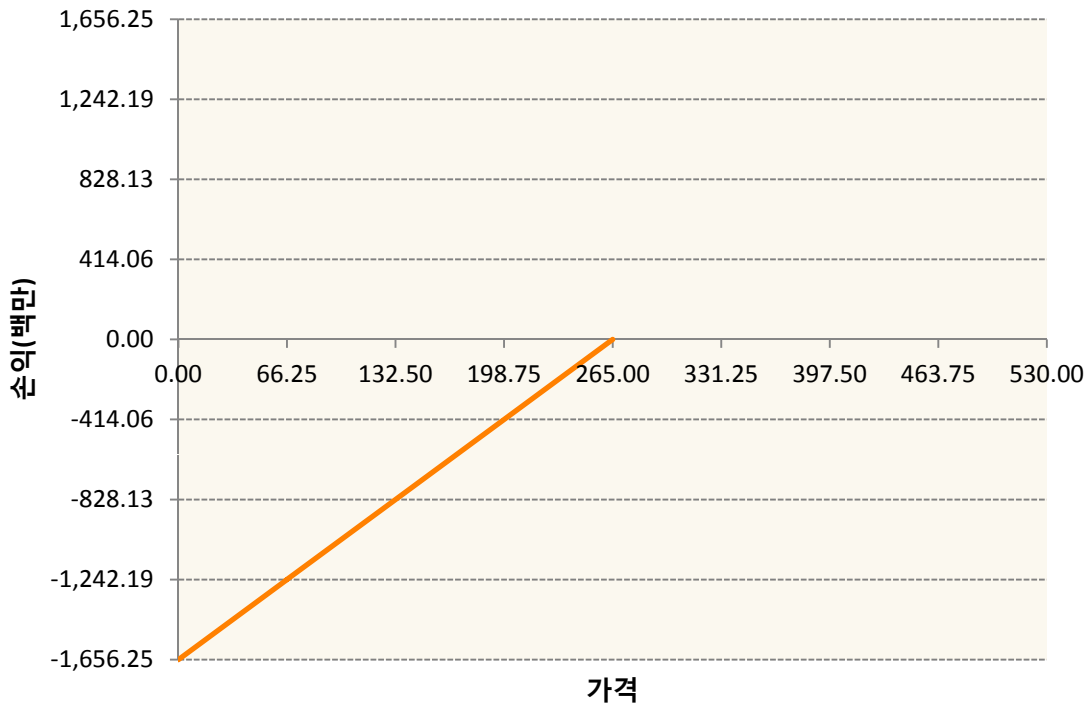


KR4301P82624-2019-08 풋262.5





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%	37	37	37	37	37	37	37	
-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%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37	
8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55	
KR4301P82624		2019-08 풋262.5						71
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-66	-66	-67	-68	-69	-70	-71
-5.33%	-21	-23	-25	-27	-29	-30	-32
-2.67%	-2	-3	-5	-6	-7	-9	-10
0%	1	1	0	0	0	-1	-2
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

KR4301P82657

2019-08 풋265

72

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-69	-69	-69	-70	-70	-71	-72
-5.33%	-28	-29	-30	-31	-33	-34	-36
-2.67%	-4	-5	-7	-8	-10	-11	-13
0%	1	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	2	2	2	2	1	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

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

(단위:백만원)

127

공시일	2019-07-24
기준일	2019-07-23

## 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	18,422	0	18,422	
누계	통화	선도	0	22,281	-22,281	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		141
FX21019M04 KRW/USD 24-07-19E		179
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		981
FX21019N01 KRW/USD 12-08-19E		160
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		321

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

(단위:백만원)

582
-----

공시일	2019-07-24
기준일	2019-07-23

## 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	2019-07-24
기준일	2019-07-23

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

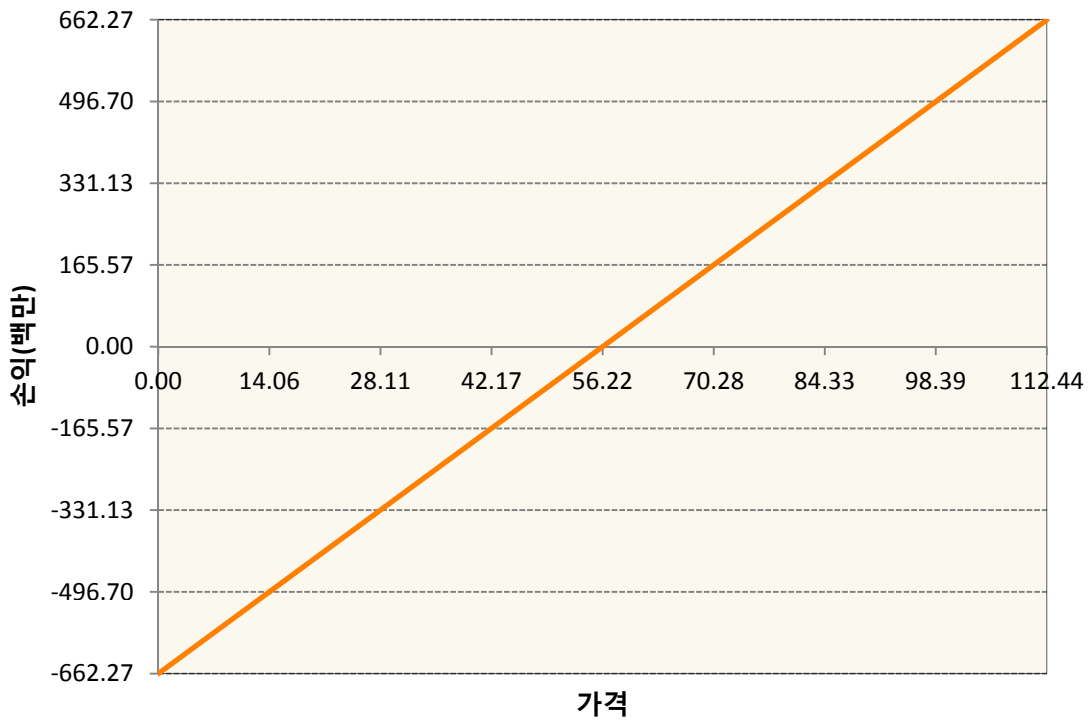
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

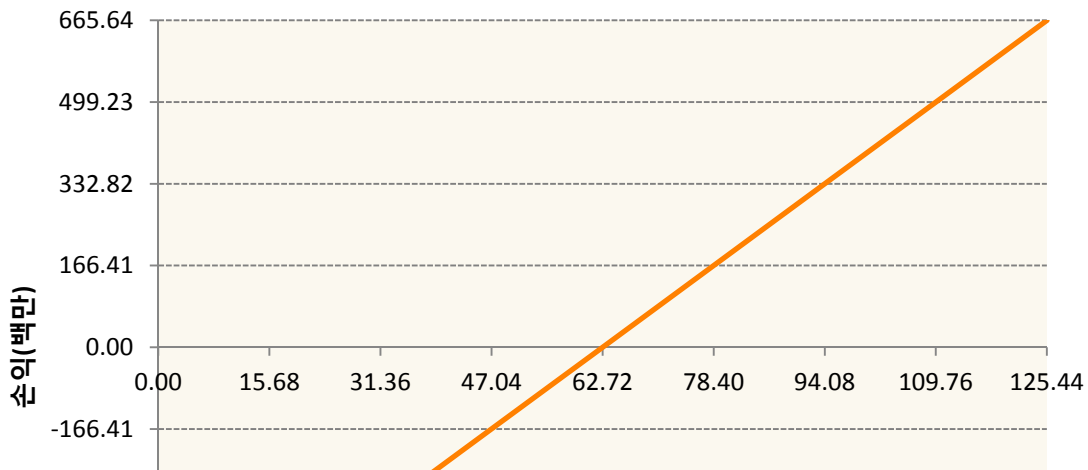
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,628	118	2,511	

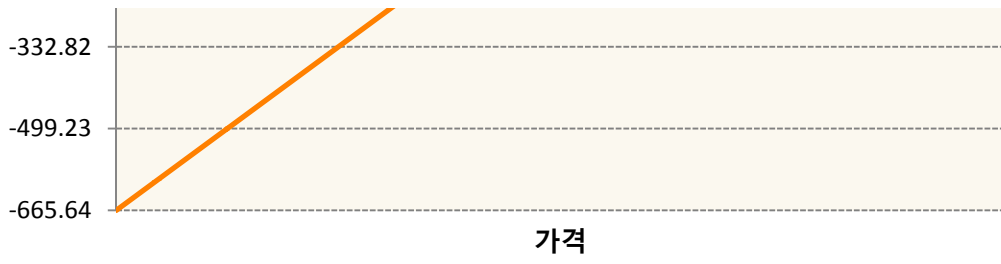
### 2. 만기시점의 손익구조

CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19

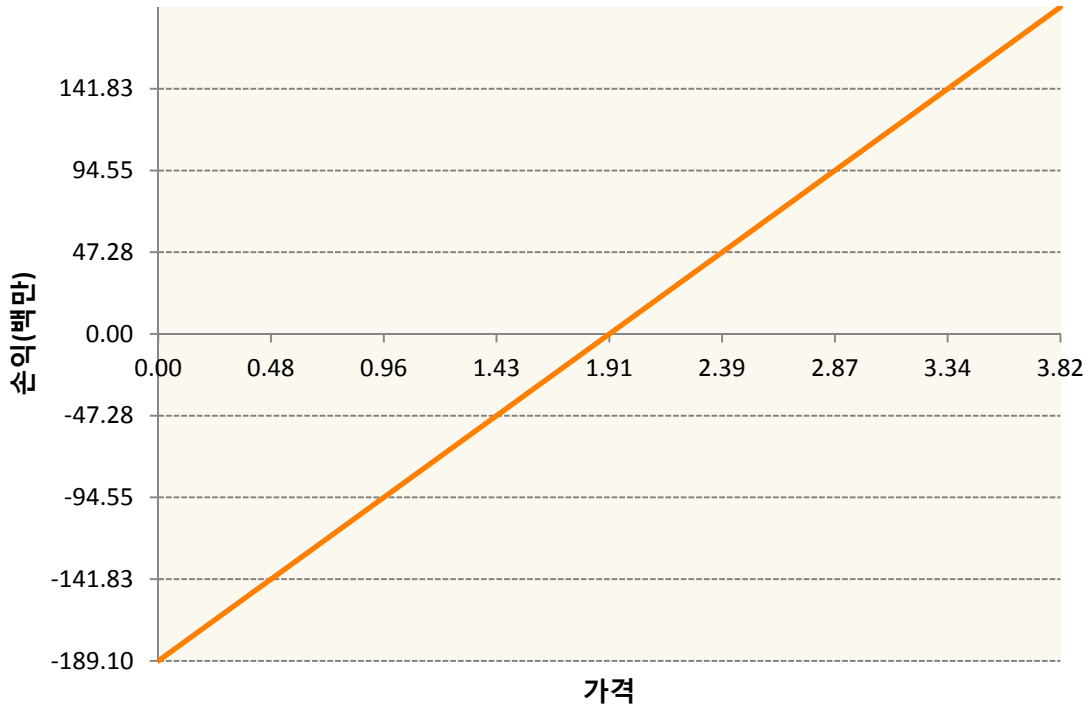


COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19

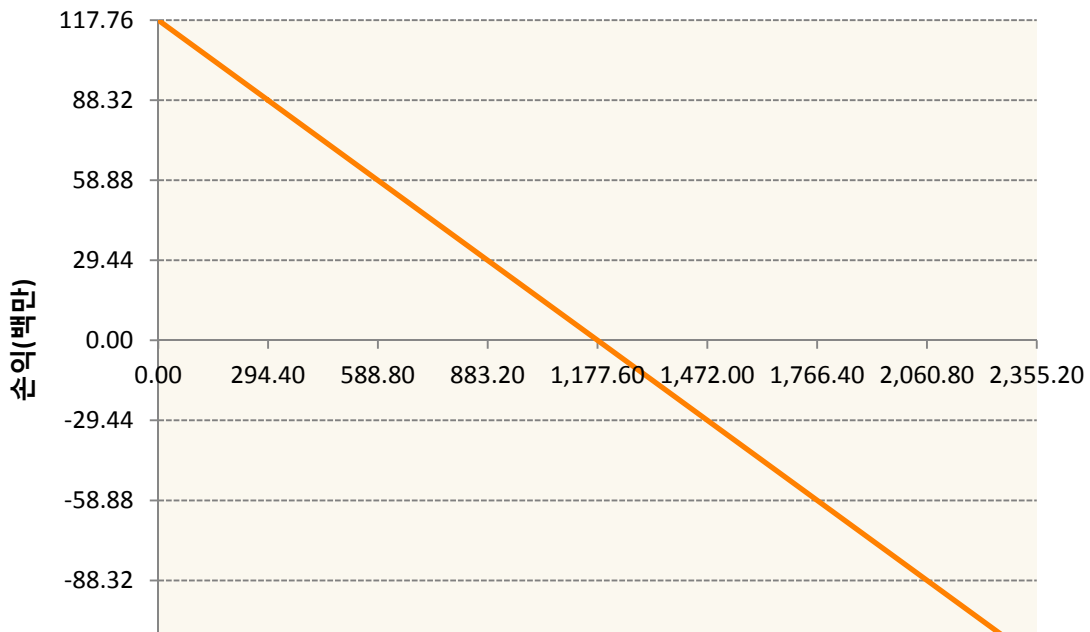


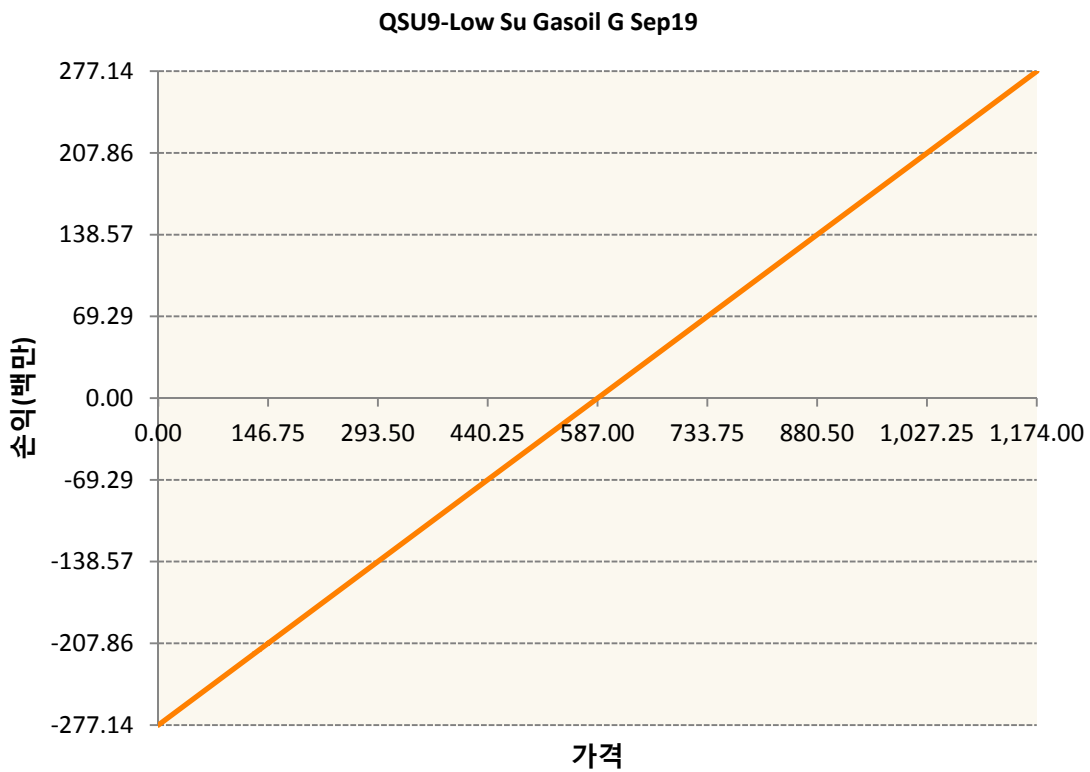
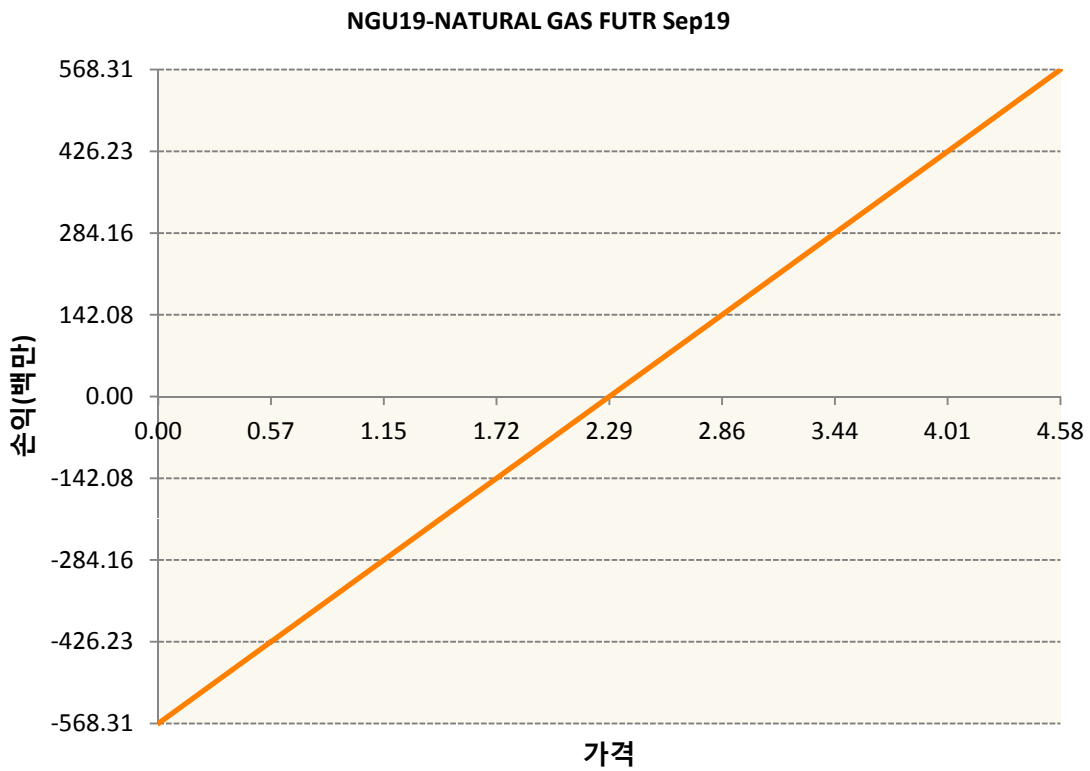
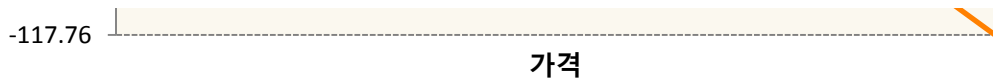


HOU9-NY Harb ULSD Fut Sep19

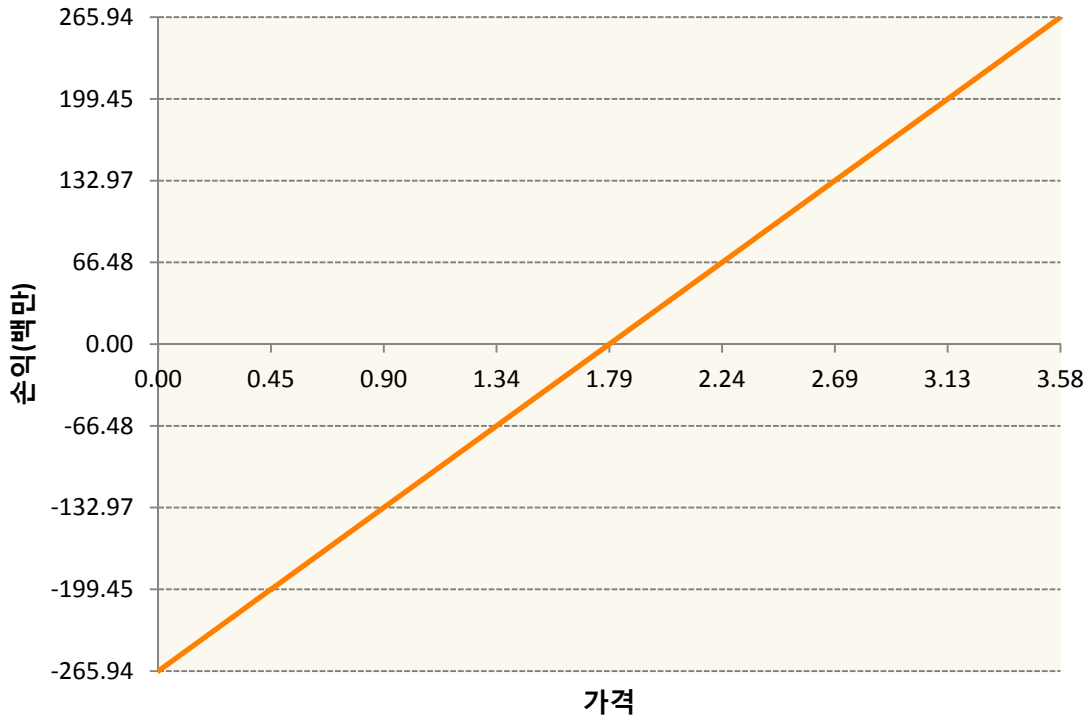


KR4175P80006-2019-08 달러선물





XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	53
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	53
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	15
KR4175P800	2019-08 달러선물	9
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	45
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	22
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	21

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

385

공시일	2019-07-24
기준일	2019-07-23

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

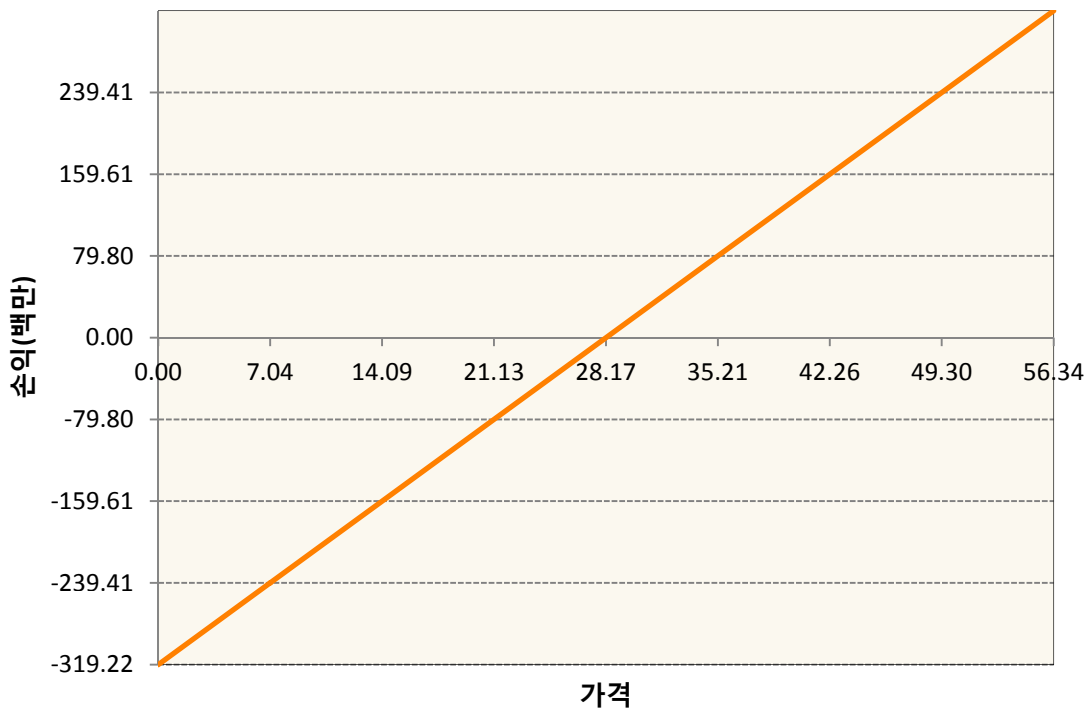
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

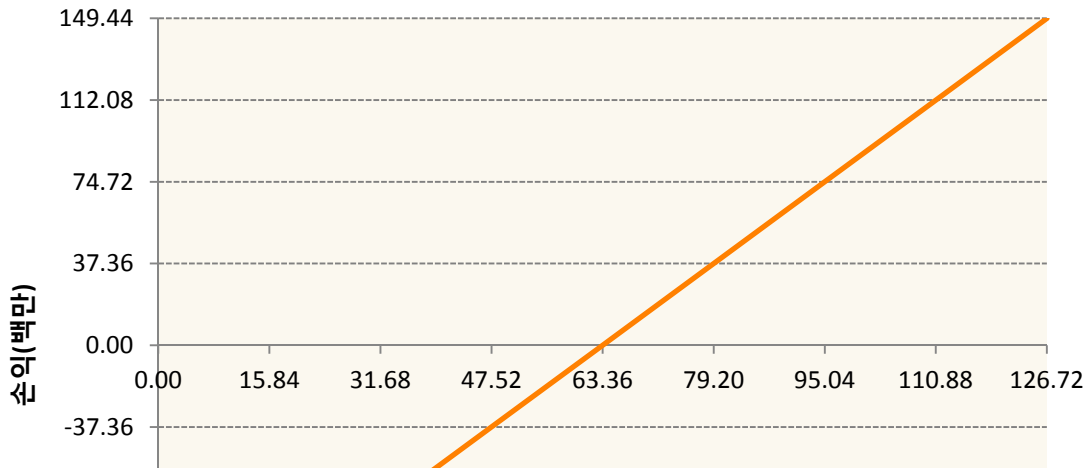
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,072	200	2,871	

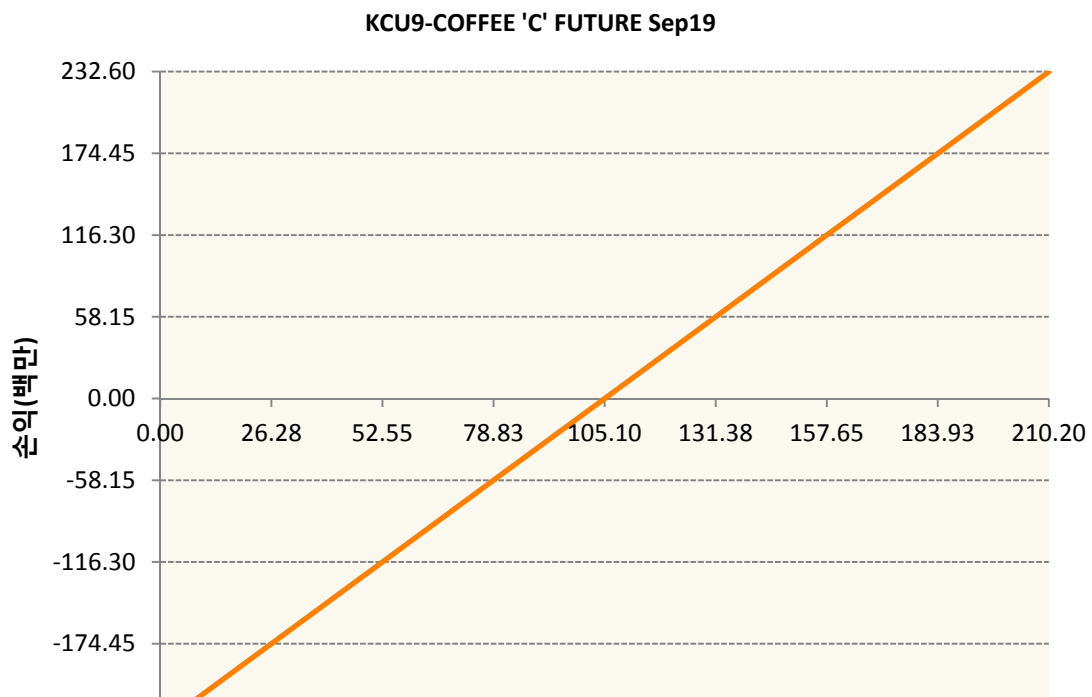
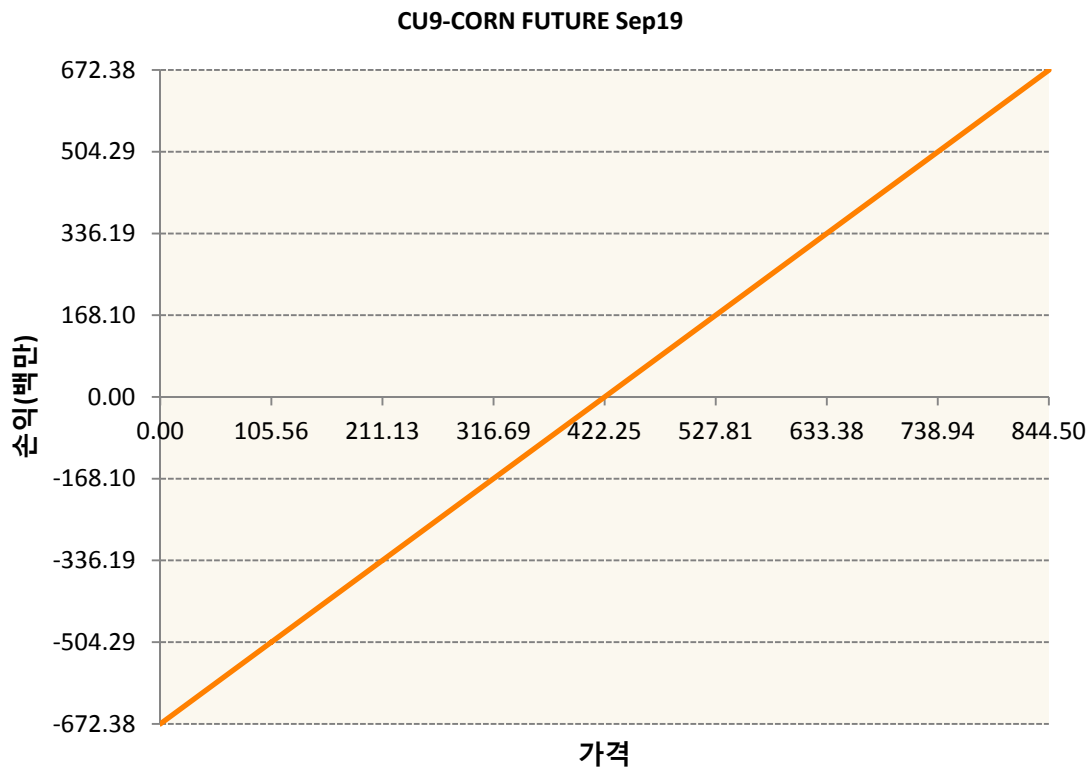
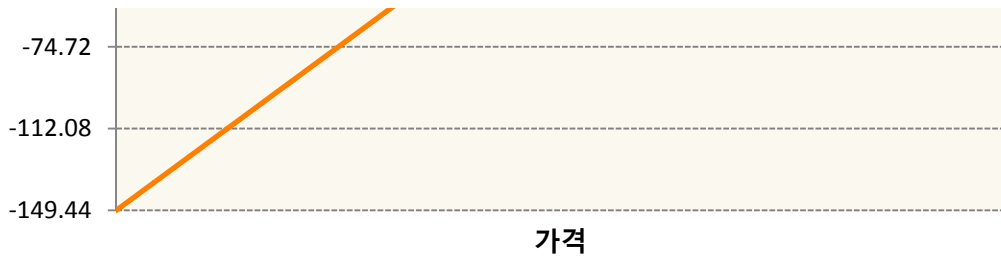
### 2. 만기시점의 손익구조

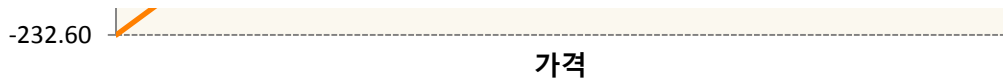
**BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19**



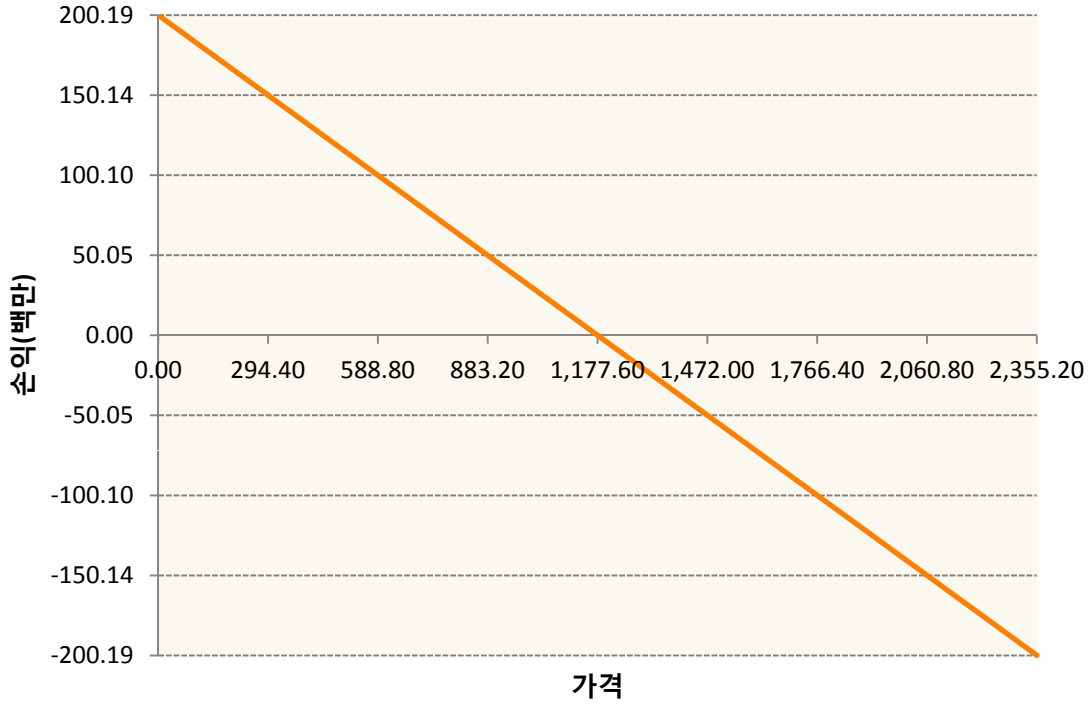
**CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19**



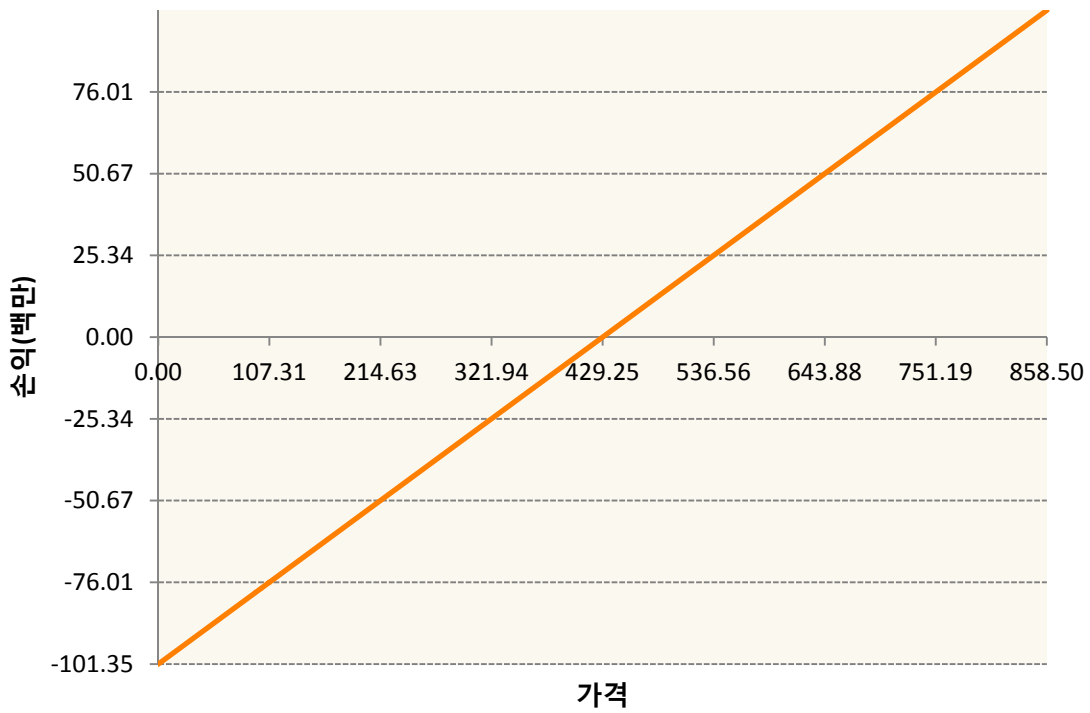




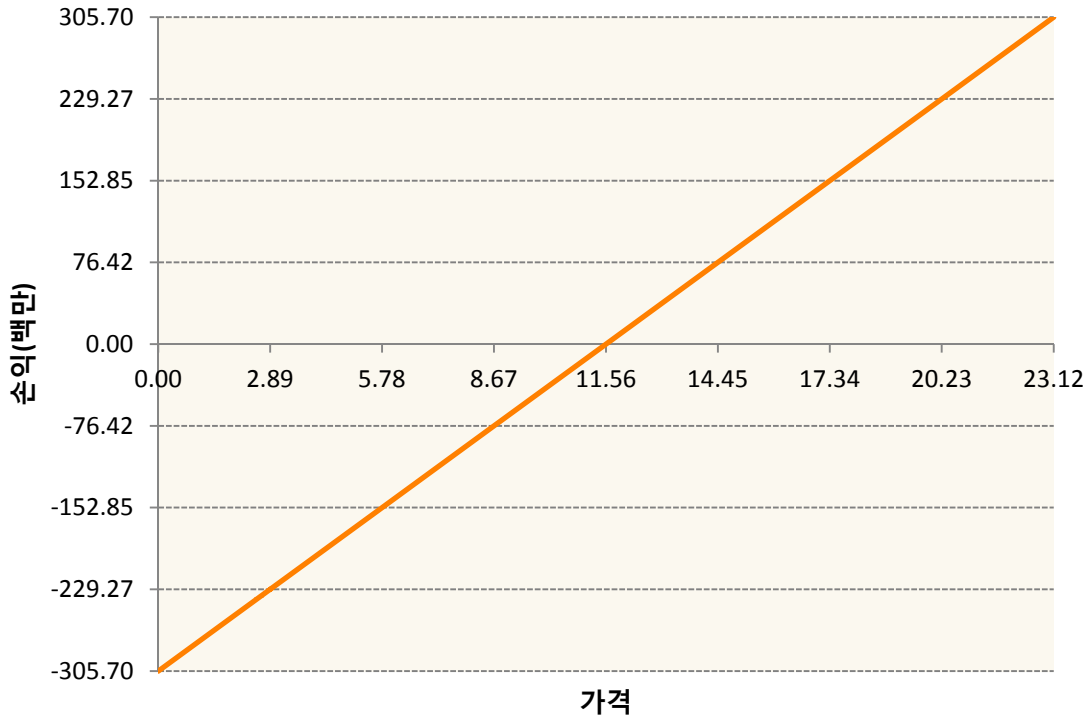
KR4175P80006-2019-08 달러선물



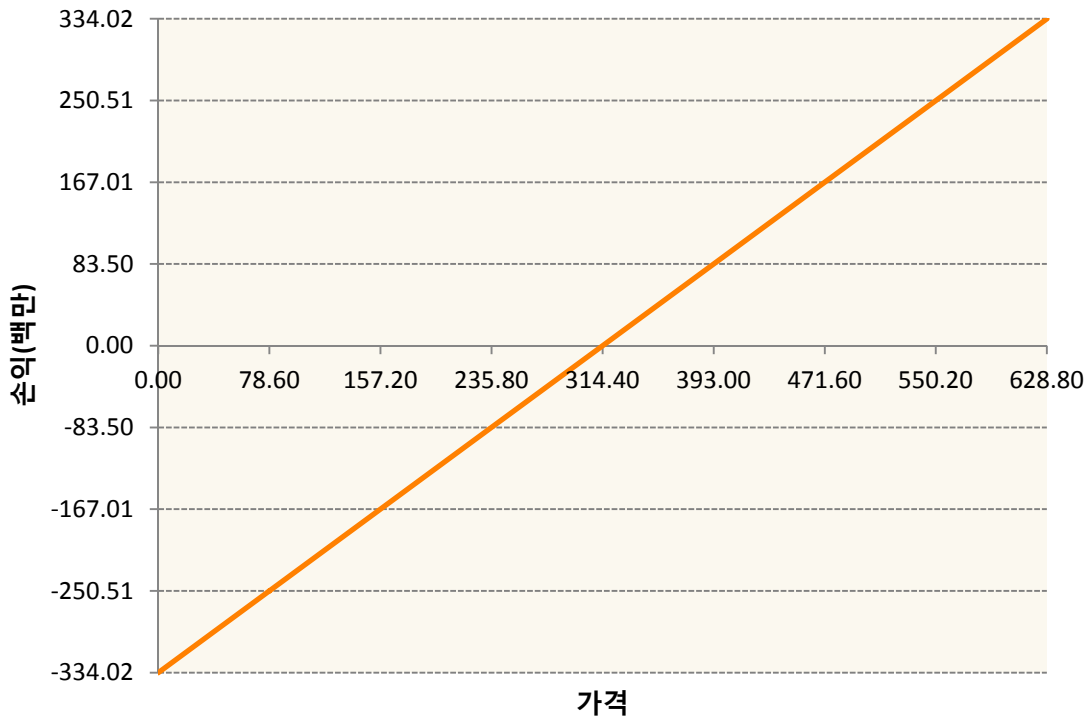
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

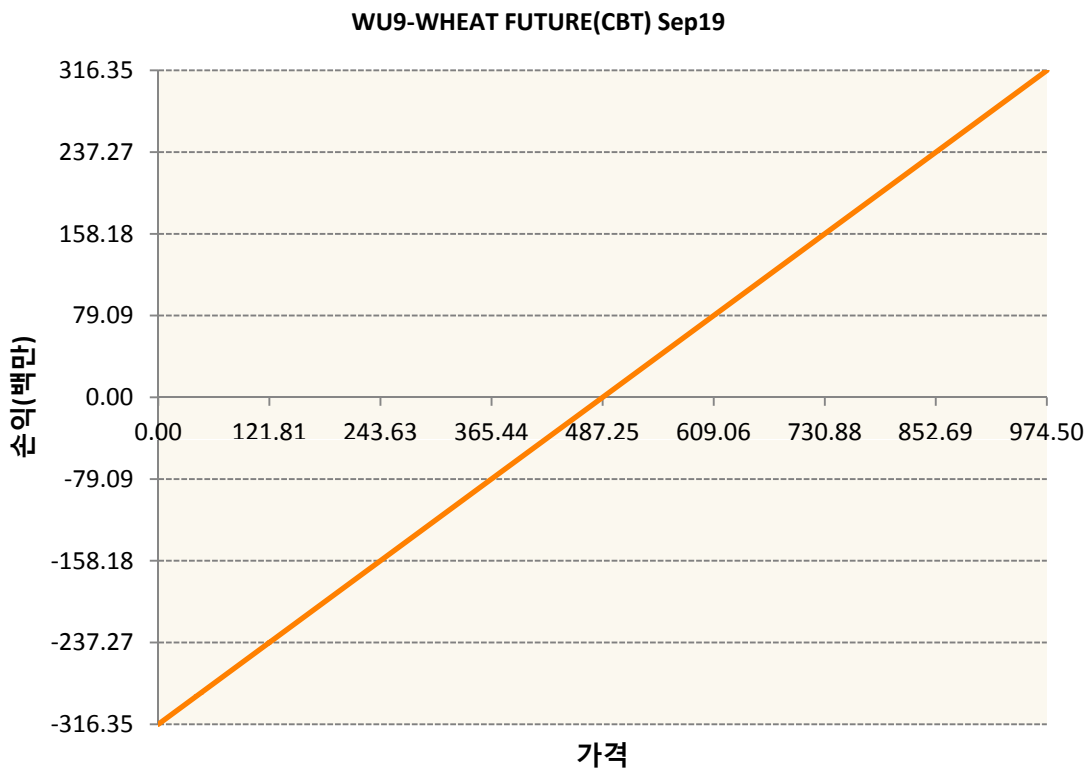
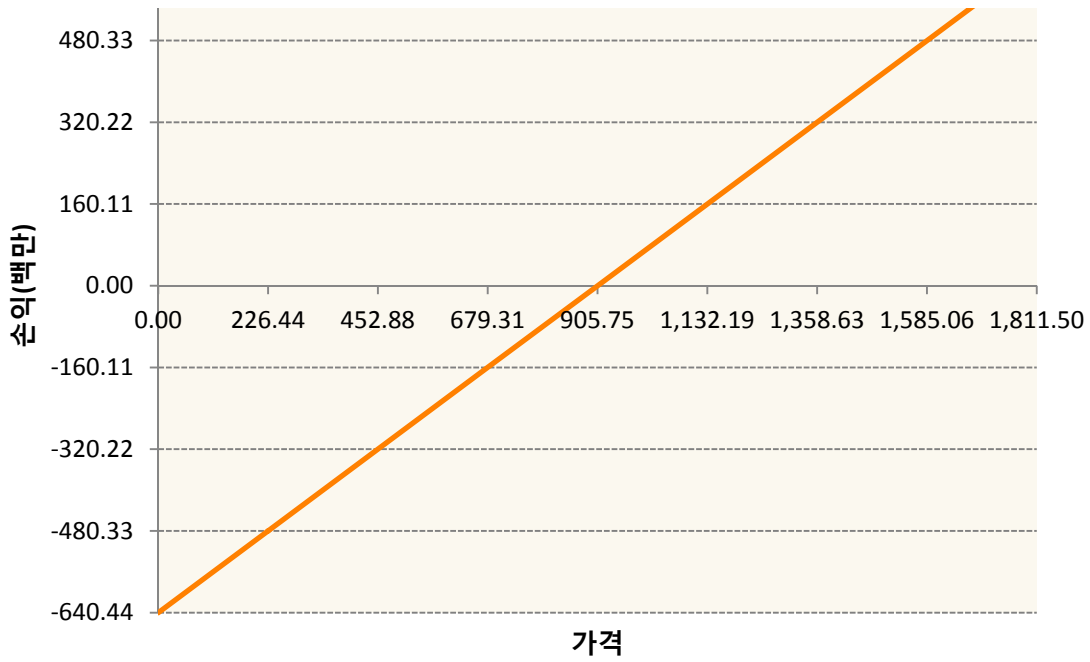


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



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	54
KCU9	COFFEE 'C' FUTURE Sep19	19
KR4175P800	2019-08 달러선물	16

KWU9	KC HRW WHEAT FUT Sep19	8
SBV9	SUGAR #11 (WORLD) Oct19	24
SMZ9	SOYBEAN MEAL FUTR Dec19	27
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	51
WU9	WHEAT FUTURE(CBT) Sep19	25

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

(단위:백만원)

**270**