

공시일	2019-07-25
기준일	2019-07-24

## 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	2019-07-25
기준일	2019-07-24

## 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

1,182

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

666

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-25
기준일	2019-07-24

## 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)	382
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	139

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

**841**

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-25
기준일	2019-07-24

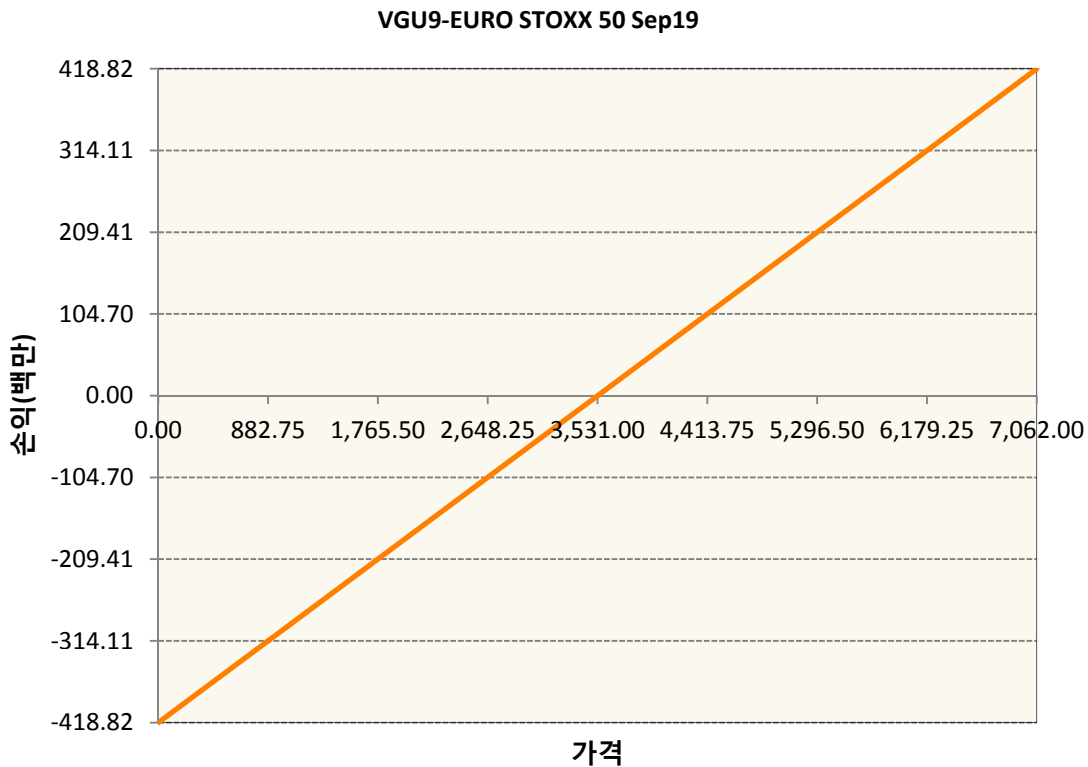
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	419	0	419	

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU9	EURO STOXX 50 Sep19	34
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

24
----

공시일	2019-07-25
기준일	2019-07-24

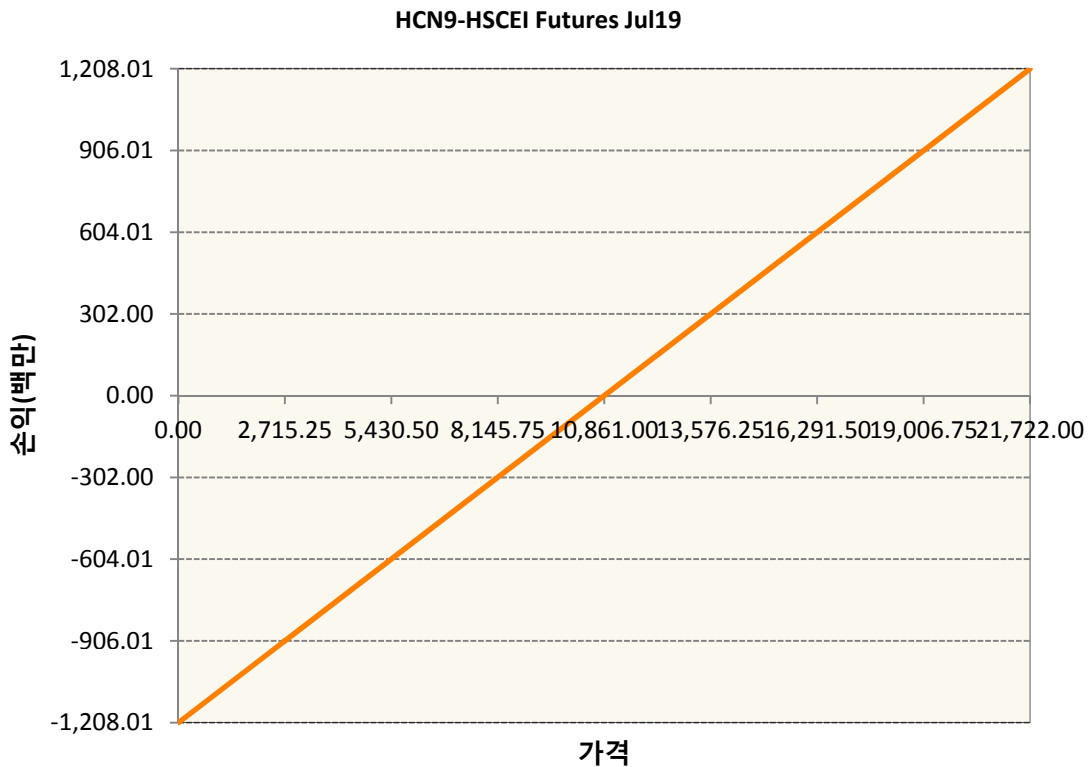
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,208	0	1,208	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN9	HSCEI Futures Jul19	97
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

96
----

공시일	2019-07-25
기준일	2019-07-24

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

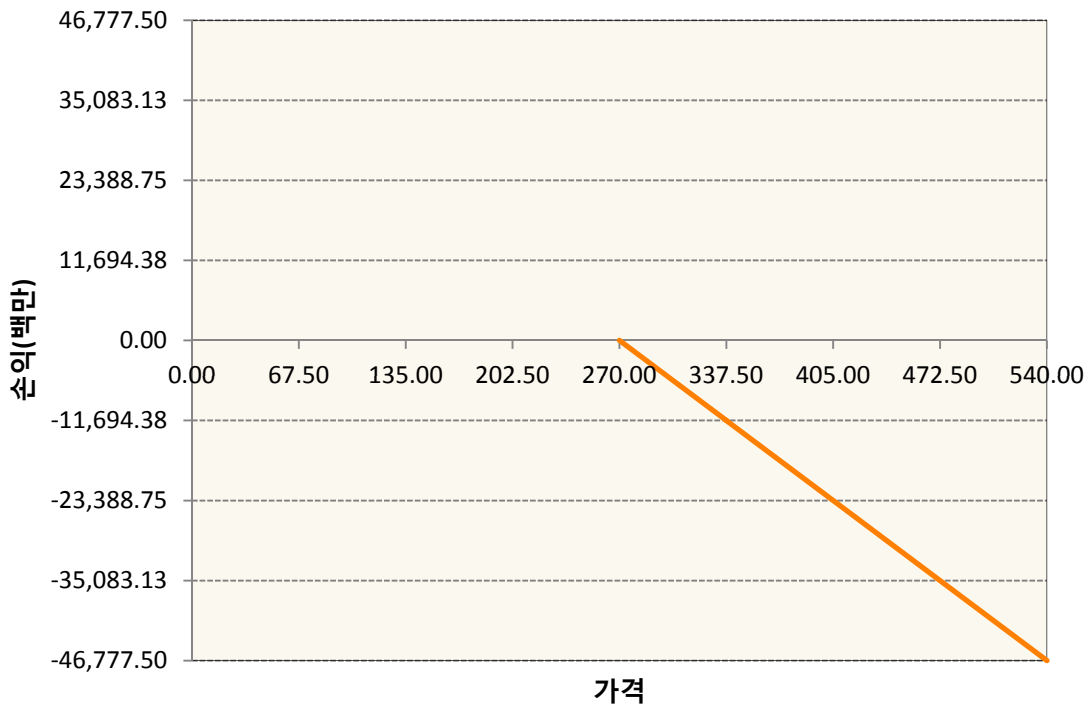
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

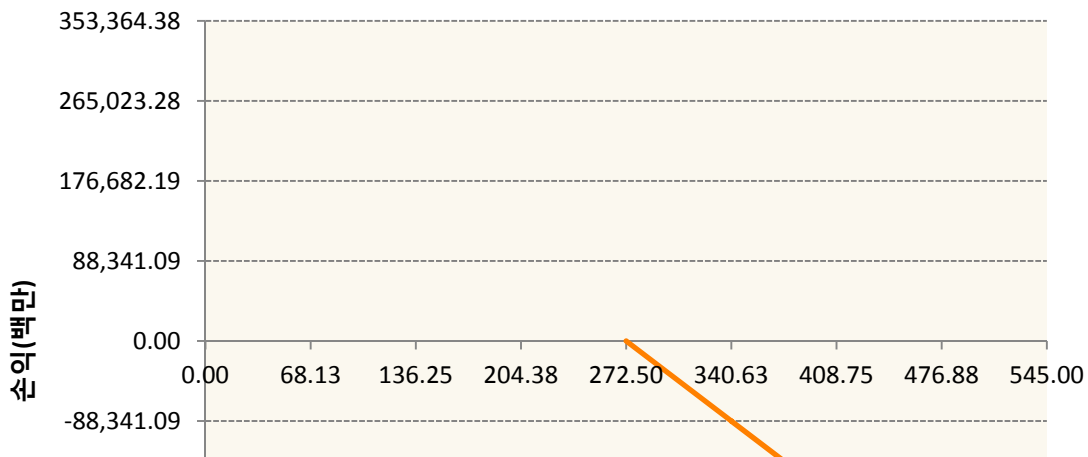
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	1,318	0	1,318	장내
누계	유가증권	옵션	0	586,379	-586,379	장내

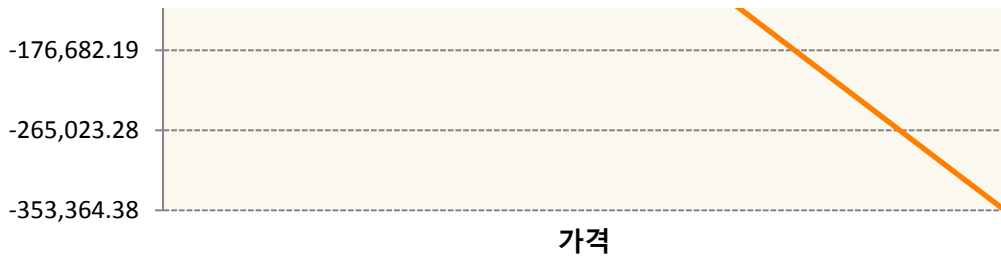
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P82709-2019-08 콜270

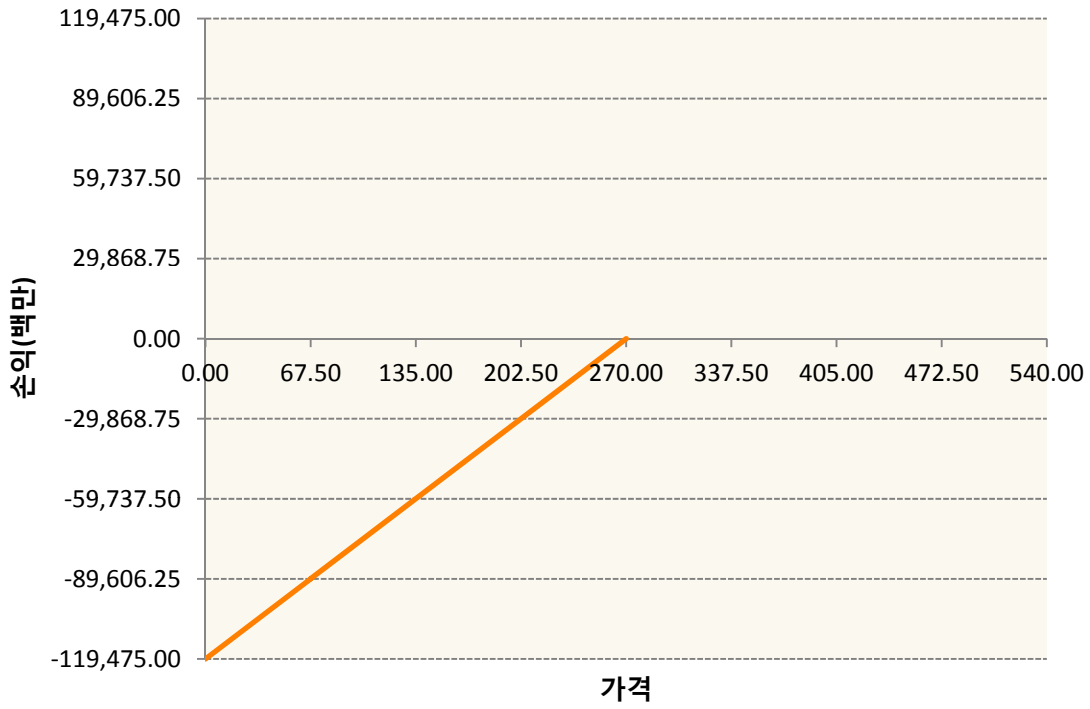


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

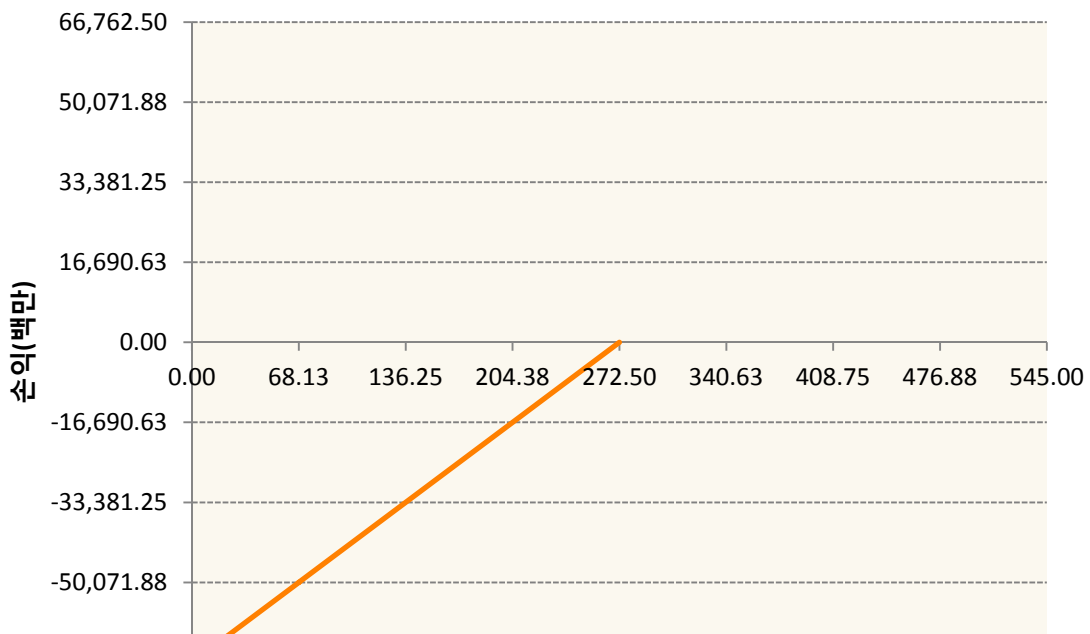




KR4301P82707-2019-08 풋270



KR4301P82723-2019-08 풋272.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P82709 2019-08 콜270							3,205
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,208	1,194	1,176	1,152	1,124	1,092	1,055
-5.33%	1,123	1,082	1,036	987	934	878	820
-2.67%	838	768	696	624	551	477	403
0%	224	150	75	0	-75	-151	-227
2.67%	-721	-770	-823	-880	-940	-1,002	-1,067
5.33%	-1,872	-1,893	-1,920	-1,953	-1,990	-2,031	-2,076
8.00%	-3,106	-3,112	-3,122	-3,137	-3,155	-3,178	-3,205
KR4201P82725 2019-08 콜272.5							22,816
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,336	7,270	7,173	7,044	6,881	6,688	6,465
-5.33%	6,946	6,716	6,444	6,137	5,800	5,437	5,052
-2.67%	5,440	4,969	4,481	3,980	3,469	2,948	2,422
0%	1,743	1,162	581	0	-581	-1,162	-1,744
2.67%	-4,541	-4,992	-5,466	-5,957	-6,462	-6,978	-7,504
5.33%	-12,729	-12,958	-13,230	-13,540	-13,883	-14,254	-14,650
8.00%	-21,818	-21,897	-22,010	-22,160	-22,345	-22,565	-22,816
KR4301P82707 2019-08 풋270							7,598
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,577	-7,577	-7,578	-7,580	-7,584	-7,590	-7,598
-5.33%	-4,368	-4,381	-4,399	-4,424	-4,455	-4,491	-4,533
-2.67%	-1,431	-1,512	-1,596	-1,683	-1,773	-1,864	-1,958
0%	282	190	96	0	-98	-196	-296
2.67%	674	653	624	588	545	497	443
5.33%	701	700	697	692	684	672	657
8.00%	701	701	701	701	700	699	696
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							4,566
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,561	-4,561	-4,561	-4,561	-4,562	-4,563	-4,566
-5.33%	-2,779	-2,781	-2,786	-2,793	-2,803	-2,815	-2,830
-2.67%	-1,062	-1,091	-1,125	-1,161	-1,200	-1,242	-1,285
0%	177	118	59	0	-59	-118	-177
2.67%	589	565	537	505	470	432	392

5.33%	634	631	627	621	612	600	586
8.00%	635	635	635	634	633	631	628

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

(단위:백만원)

**40,867**

공시일	2019-07-25
기준일	2019-07-24

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

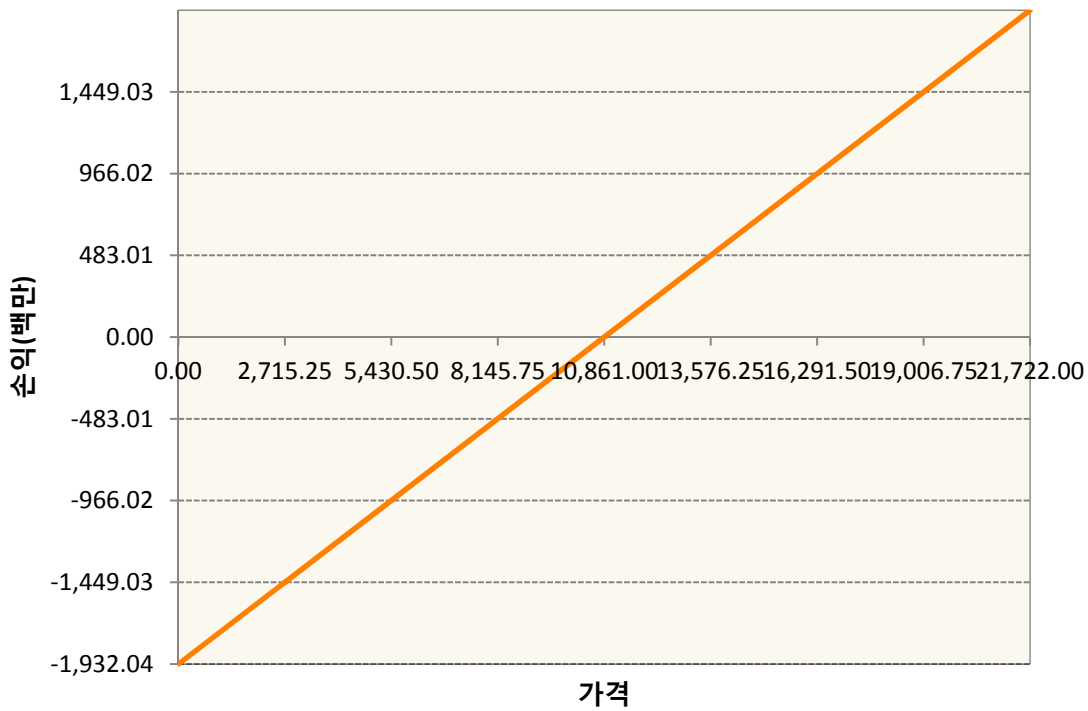
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

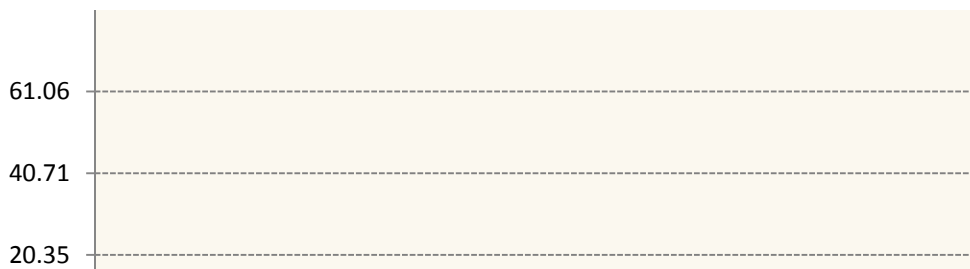
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,932	0	1,932	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,257	-5,257	장내
누계	통화	선도	151	3,166	-3,015	장외

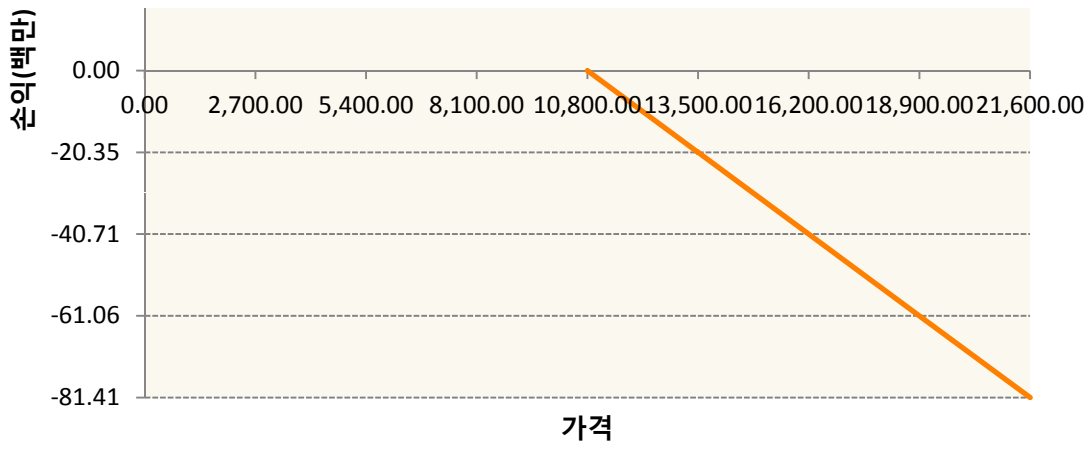
### 2. 만기시점의 손익구조

HCN9-HSCEI Futures Jul19

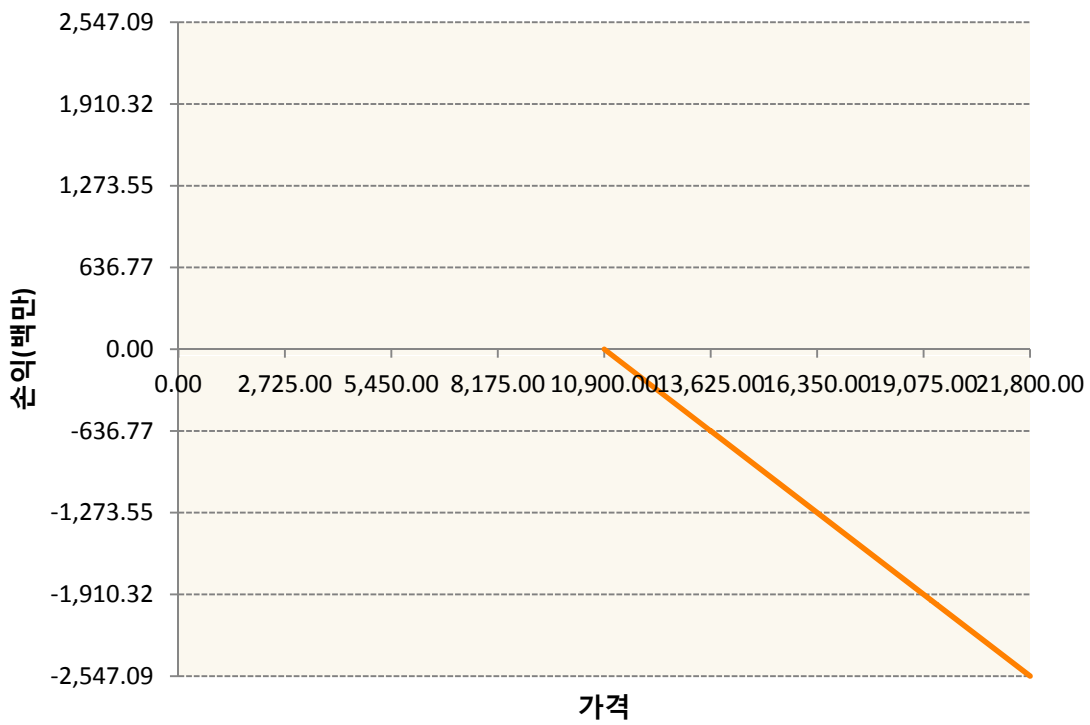


OHHIN9-C108-HSCEI

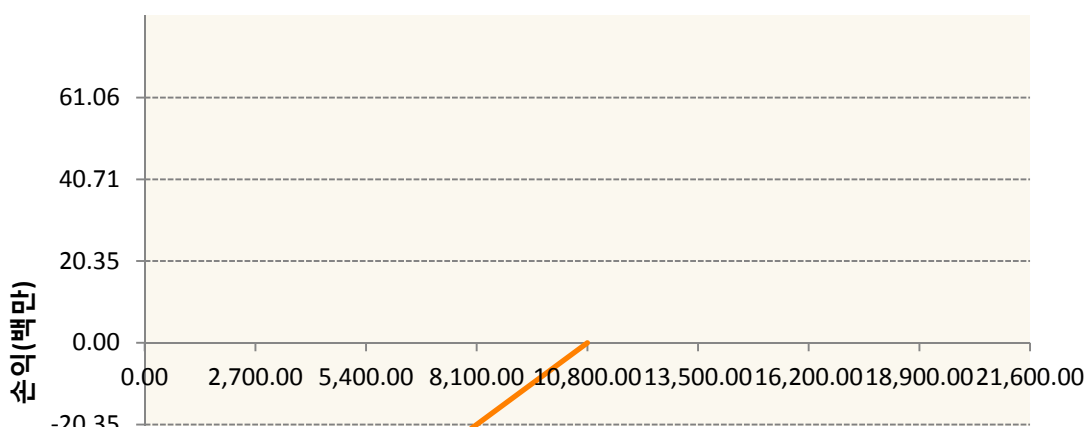


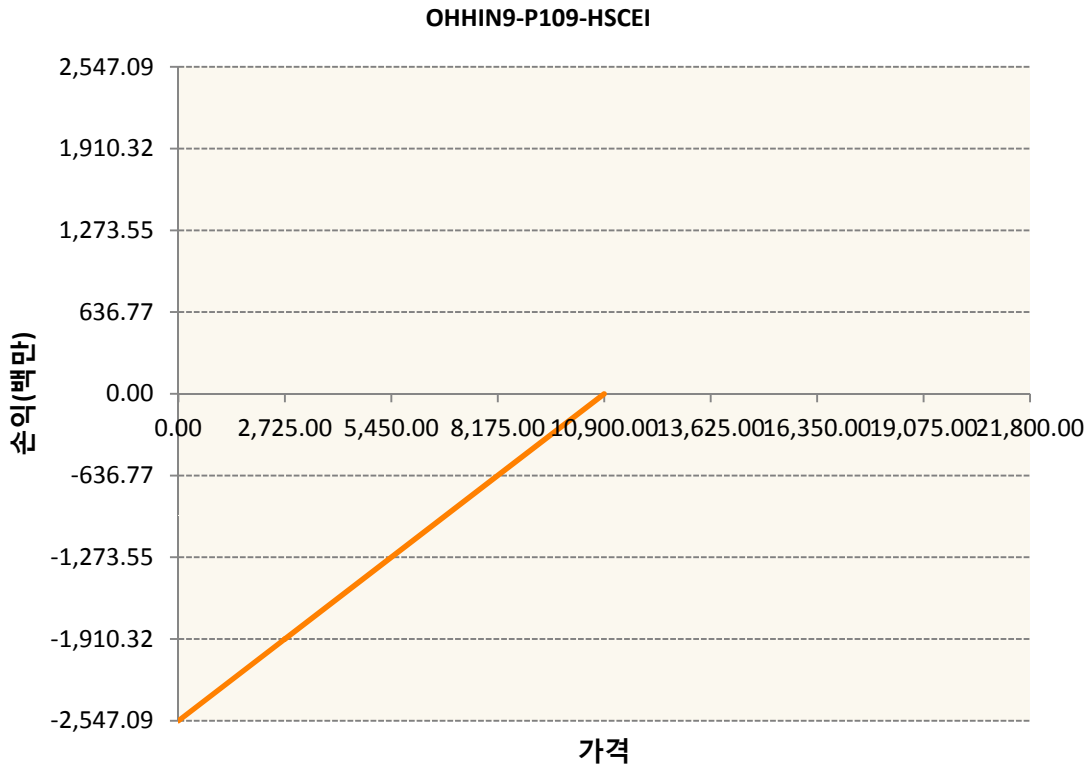
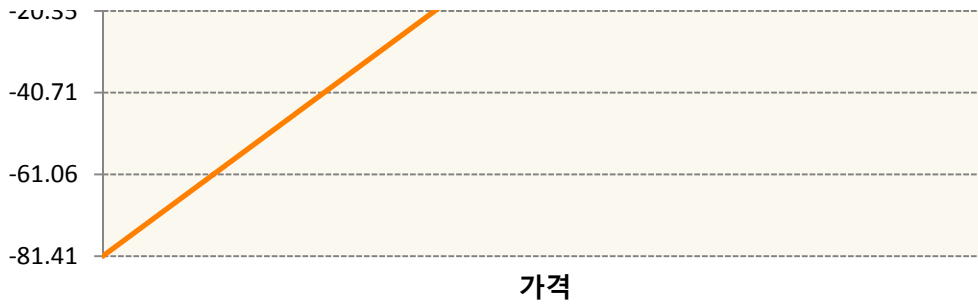


**OHHIN9-C109-HSCEI**



**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	155
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	2019-07-25
기준일	2019-07-24

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

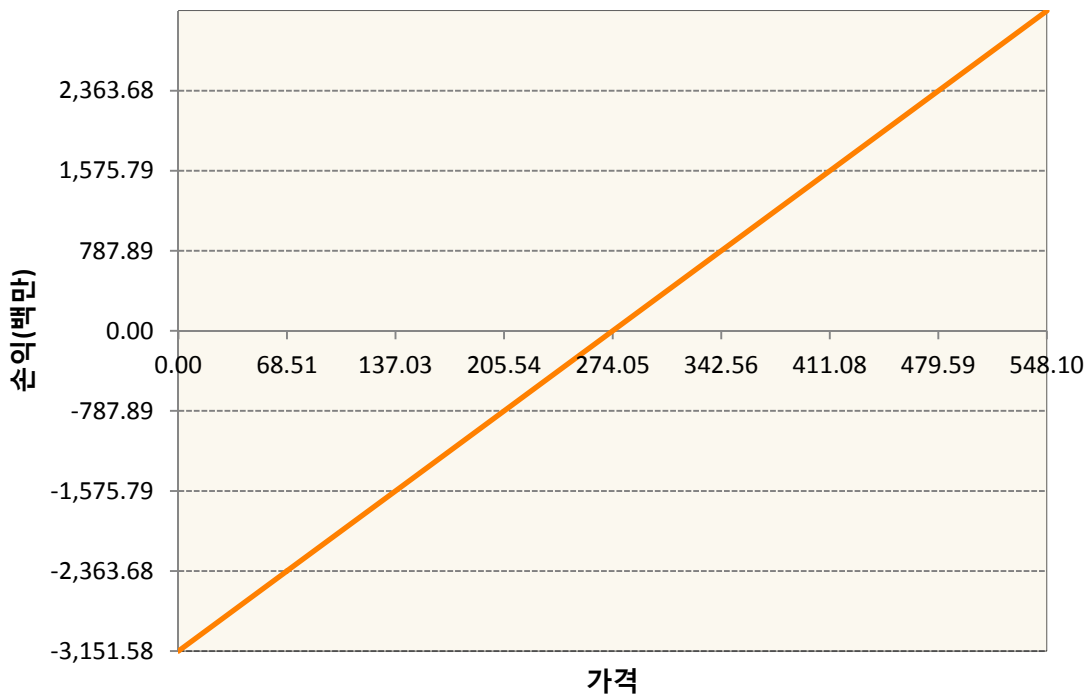
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

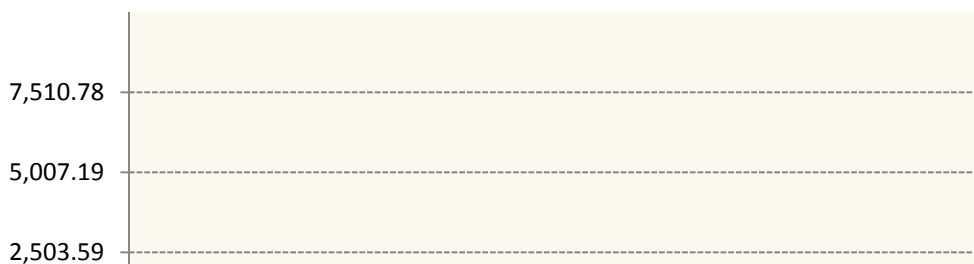
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	67	0	67	장내
누계	유가증권	선물	3,152	0	3,152	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	19,429	-19,429	장내

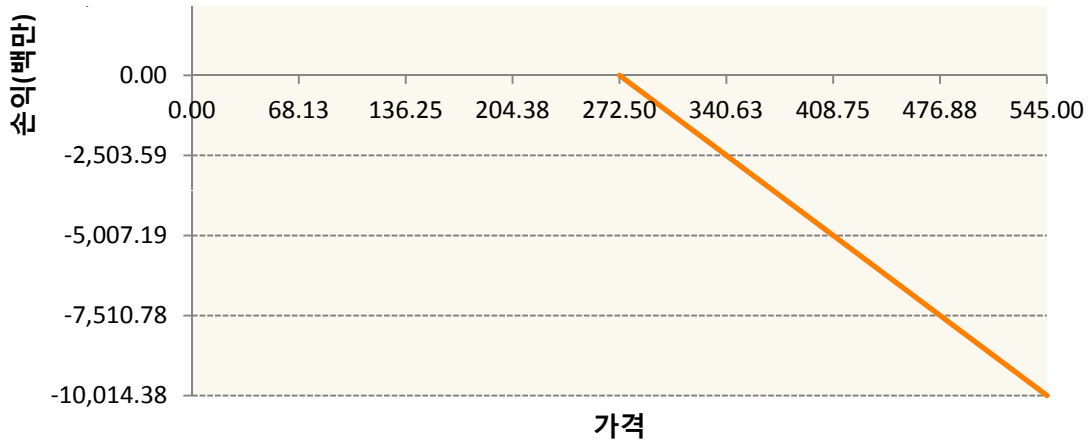
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

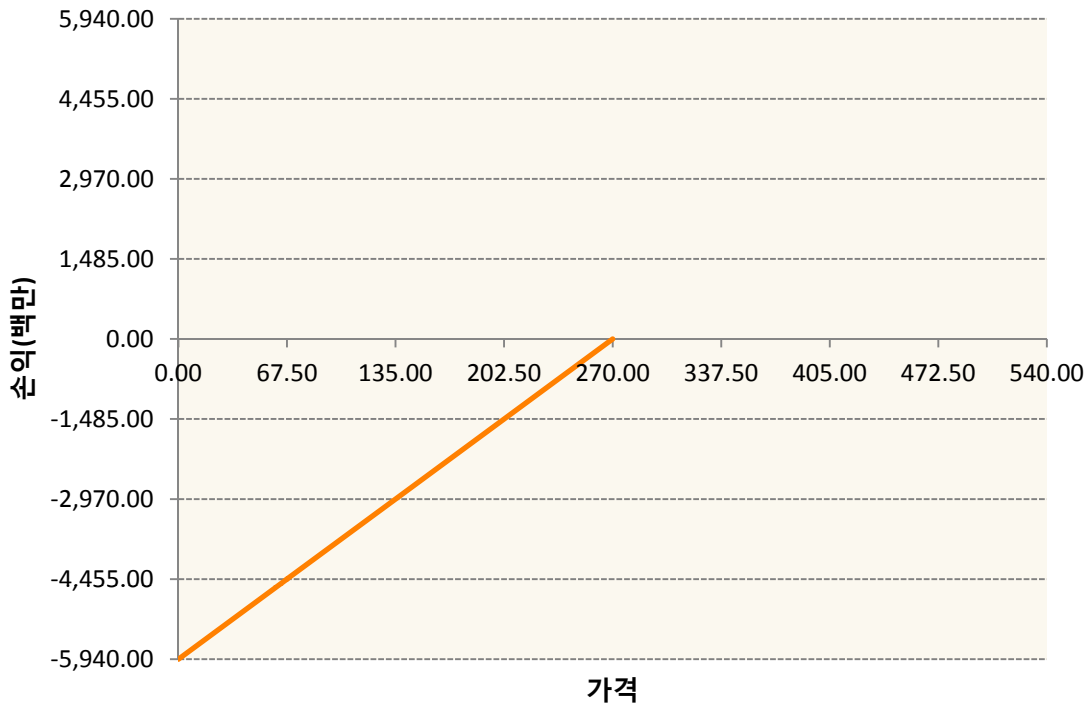


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

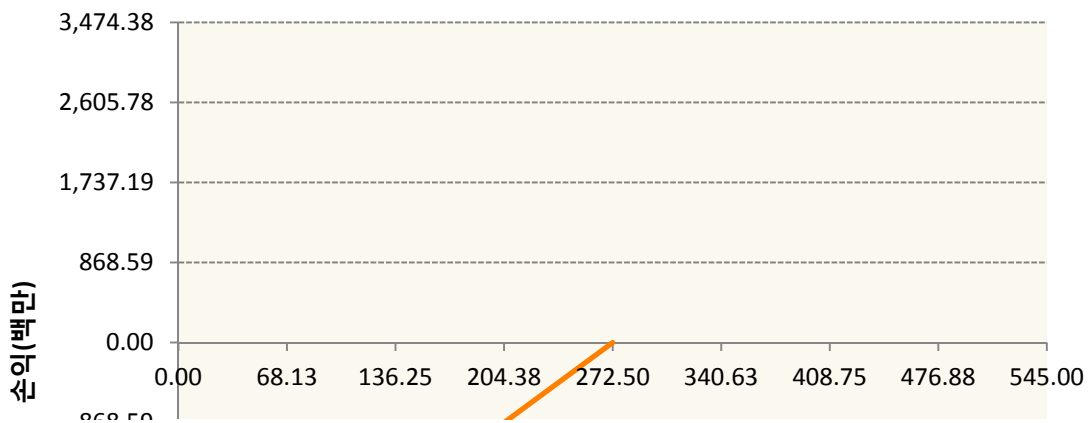




**KR4301P82707-2019-08 풋270**



**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						251
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-251	-251	-251	-251	-251	-251	-251	
-5.33%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168	
-2.67%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	84	84	84	84	84	84	84	
5.33%	168	168	168	168	168	168	168	
8.00%	251	251	251	251	251	251	251	
KR4201P82725		2019-08 콜272.5						647
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	208	206	203	200	195	190	183
-5.33%	197	190	183	174	164	154	143
-2.67%	154	141	127	113	98	84	69
0%	49	33	16	0	-16	-33	-49
2.67%	-129	-141	-155	-169	-183	-198	-213
5.33%	-361	-367	-375	-384	-393	-404	-415
8.00%	-618	-621	-624	-628	-633	-639	-647
KR4301P82707                      2019-08 풋270							378
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-377	-377	-377	-377	-377	-377	-378
-5.33%	-217	-218	-219	-220	-221	-223	-225
-2.67%	-71	-75	-79	-84	-88	-93	-97
0%	14	9	5	0	-5	-10	-15
2.67%	34	32	31	29	27	25	22
5.33%	35	35	35	34	34	33	33
8.00%	35	35	35	35	35	35	35
KR4301P82723                      2019-08 풋272.5							238
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-237	-237	-237	-237	-237	-237	-238
-5.33%	-145	-145	-145	-145	-146	-146	-147
-2.67%	-55	-57	-59	-60	-62	-65	-67
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	31	29	28	26	24	22	20
5.33%	33	33	33	32	32	31	30
8.00%	33	33	33	33	33	33	33

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

(단위:백만원)

3,376

공시일	2019-07-25
기준일	2019-07-24

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

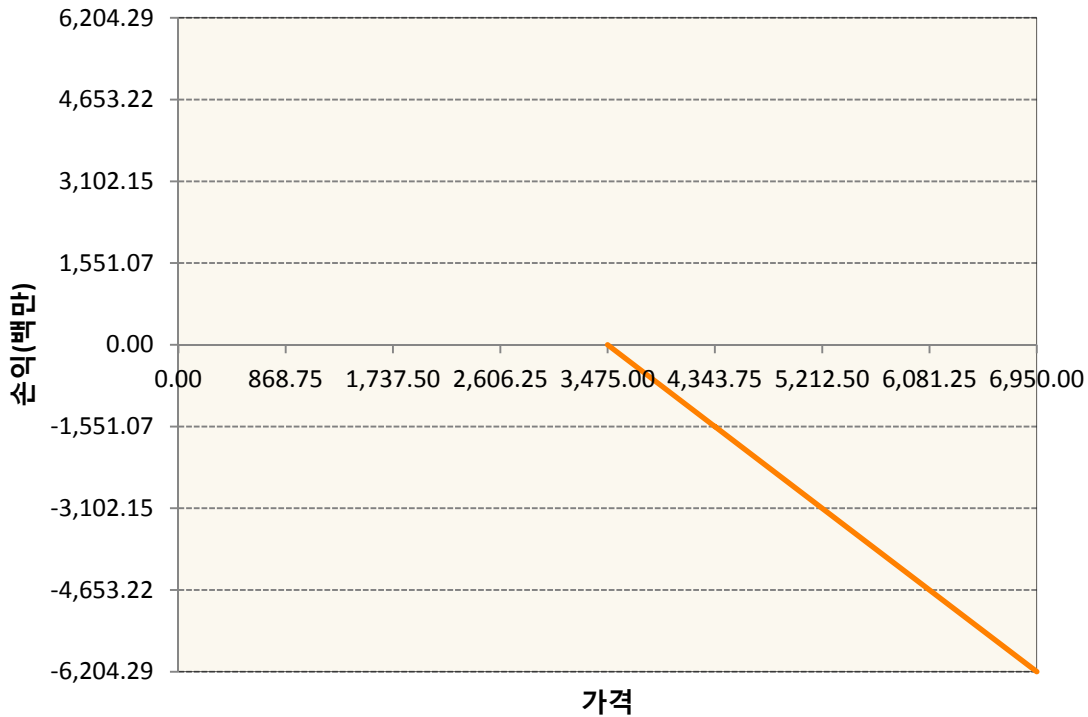
### 1. 계약금액

(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	4,994	0	4,994	
누계	유가증권	스왑	37,486	0	37,486	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,625	-15,625	장내
누계	통화	선도	9,189	22,317	-13,128	장외

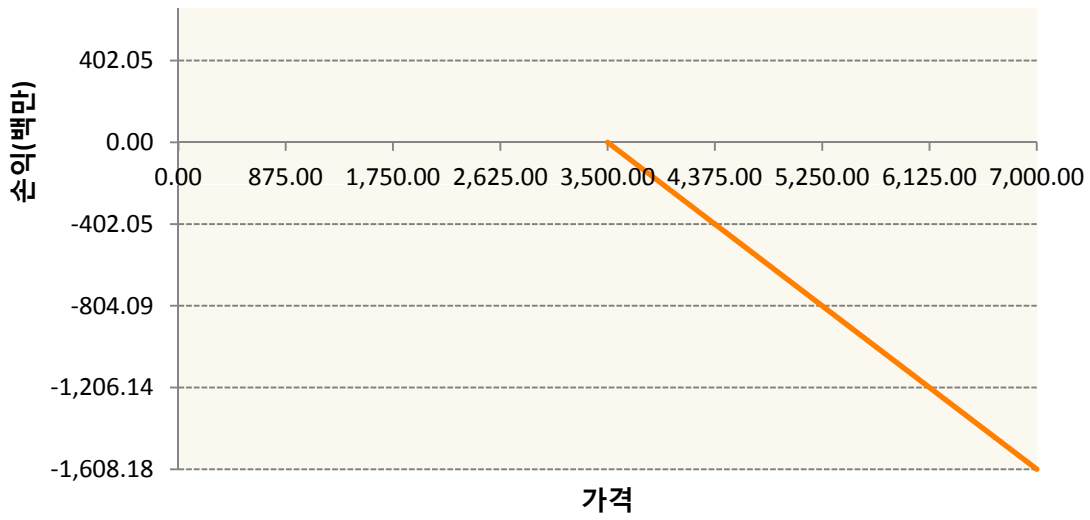
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXQ9-C3475-EURO STOXX 50**

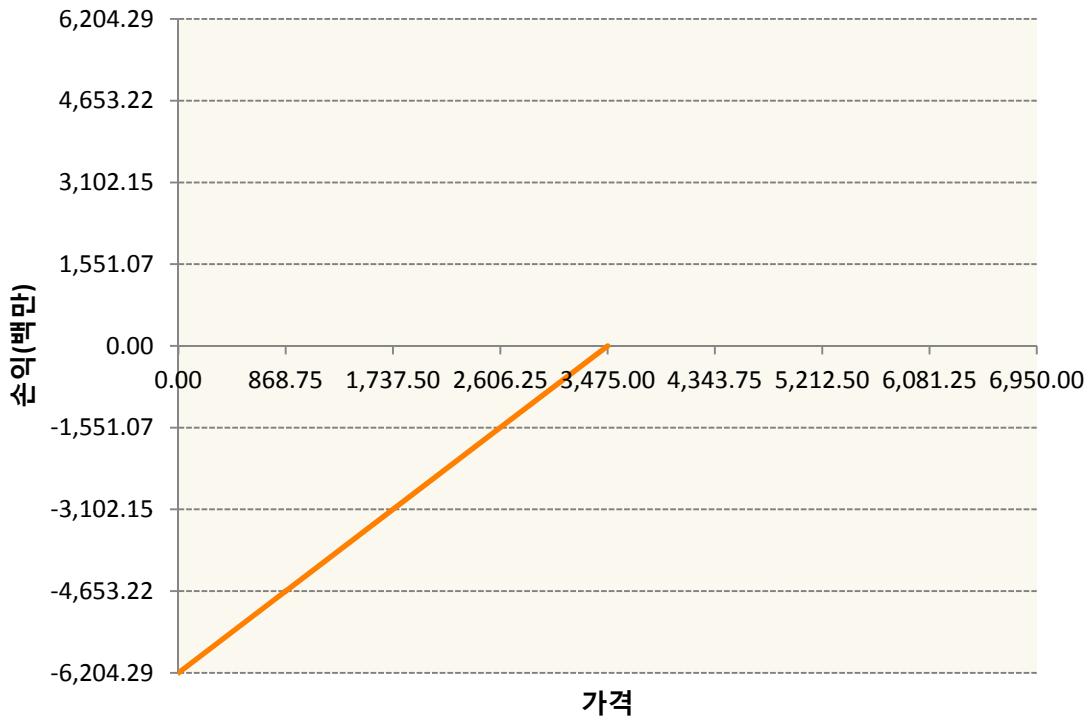


**OESXQ9-C3500-EURO STOXX 50**

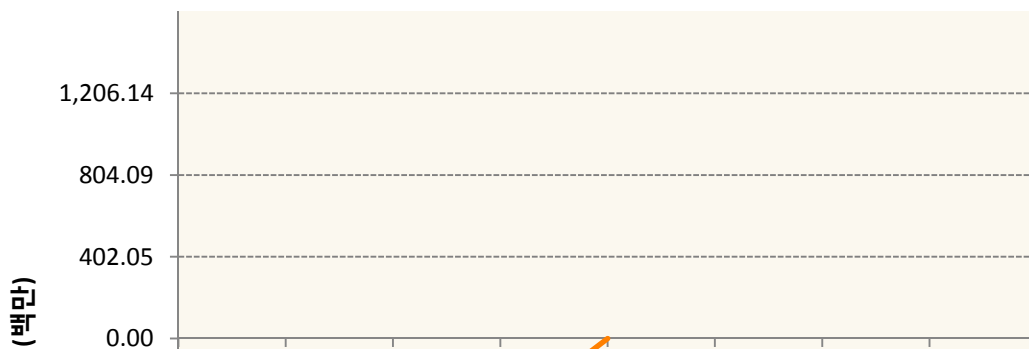


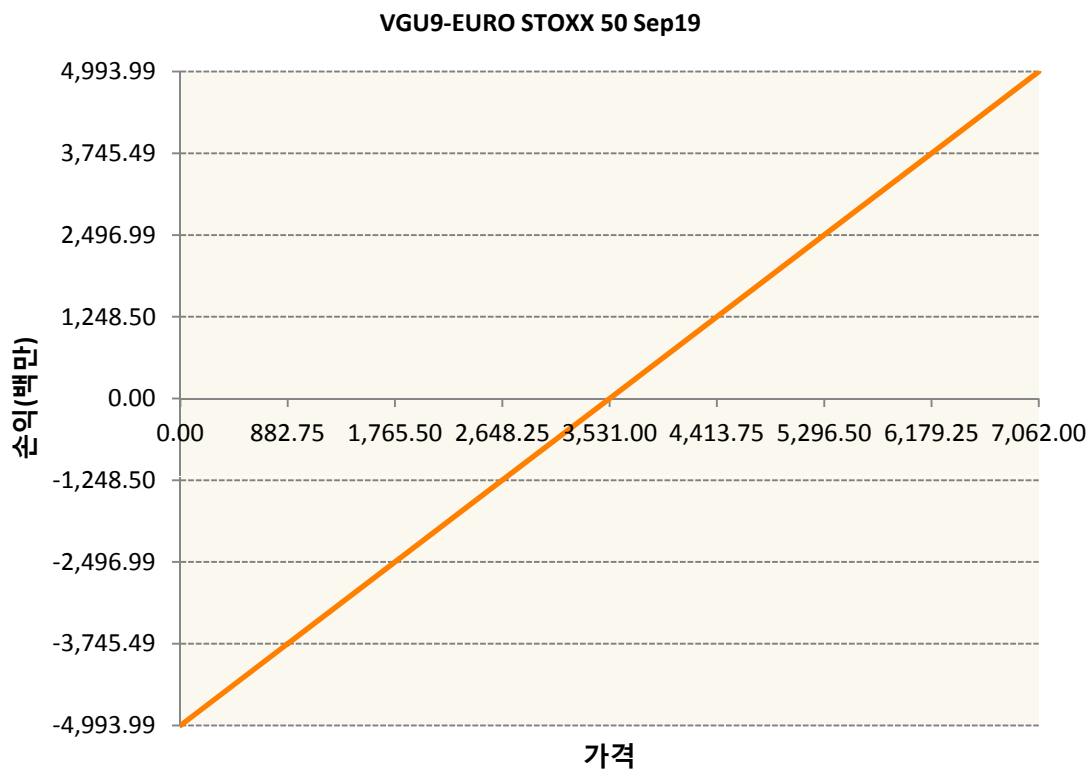
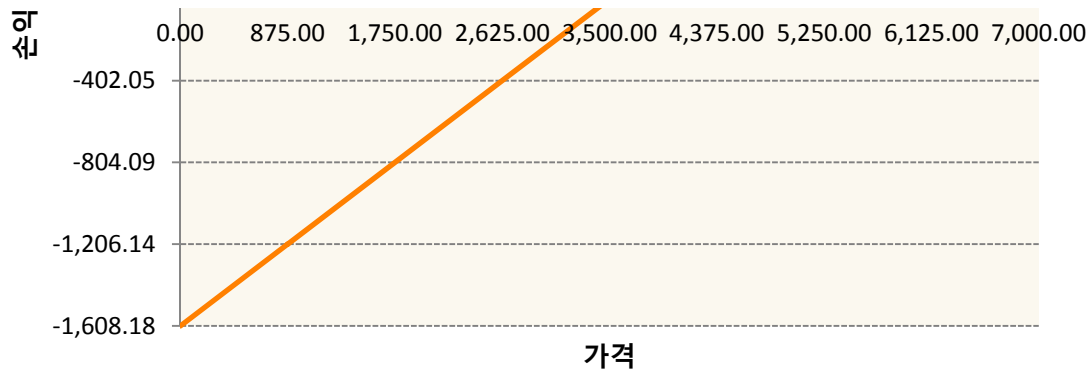


OESXQ9-P3475-EURO STOXX 50



OESXQ9-P3500-EURO STOXX 50





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	20
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	420
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E	1,050
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	315
FX21019N01 EUR/KRW 23-08-19E	420
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E	315
OESXQ9-C34 EURO STOXX 50	496
OESXQ9-C35 EURO STOXX 50	129
OESXQ9-P34 EURO STOXX 50	496
OESXQ9-P35 EURO STOXX 50	129
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	400

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

(단위:백만원)

2,330



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

(단위:백만원)

1,022



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

(단위:백만원)

87



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

(단위:백만원)

132

공시일	2019-07-25
기준일	2019-07-24

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

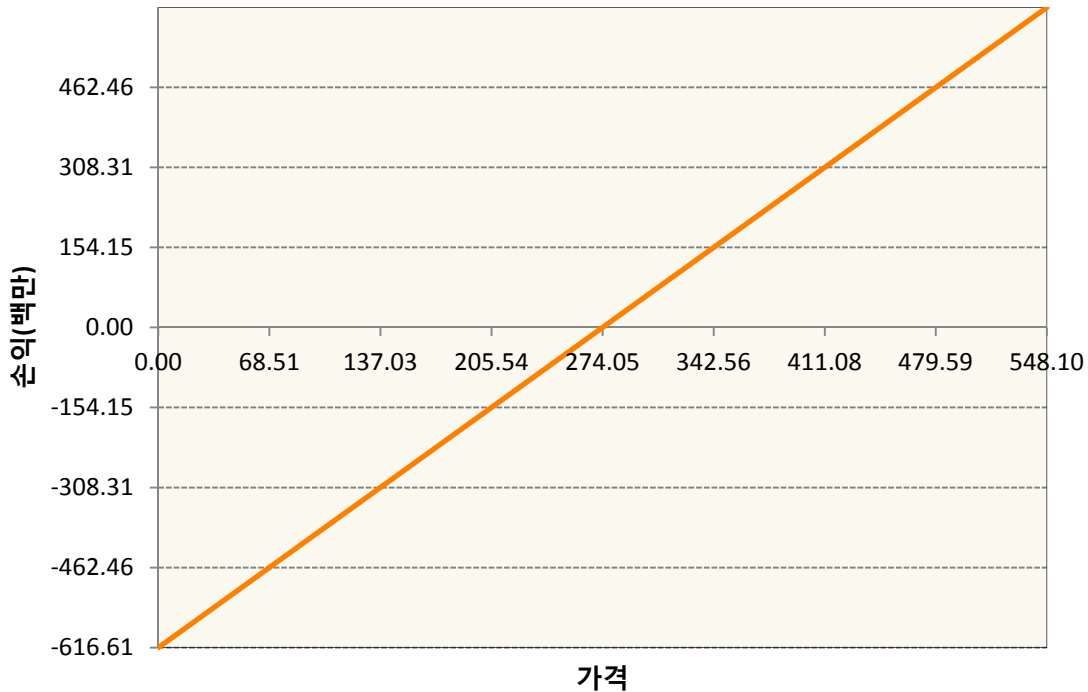
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	617	0	617	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	2019-07-25
기준일	2019-07-24

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

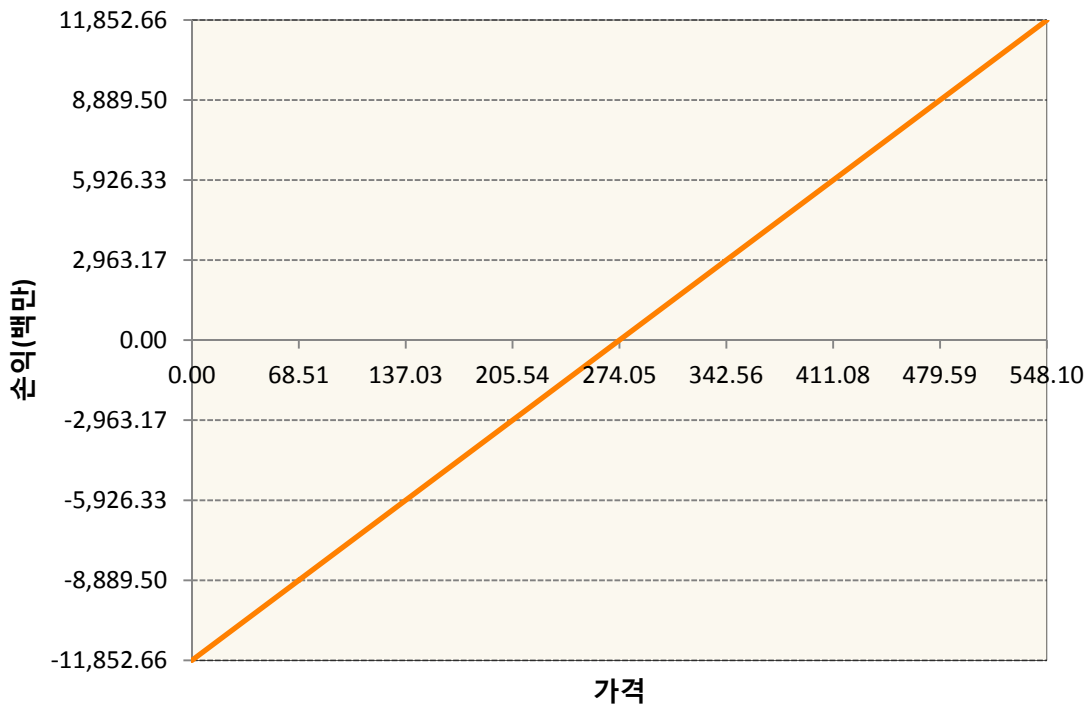
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

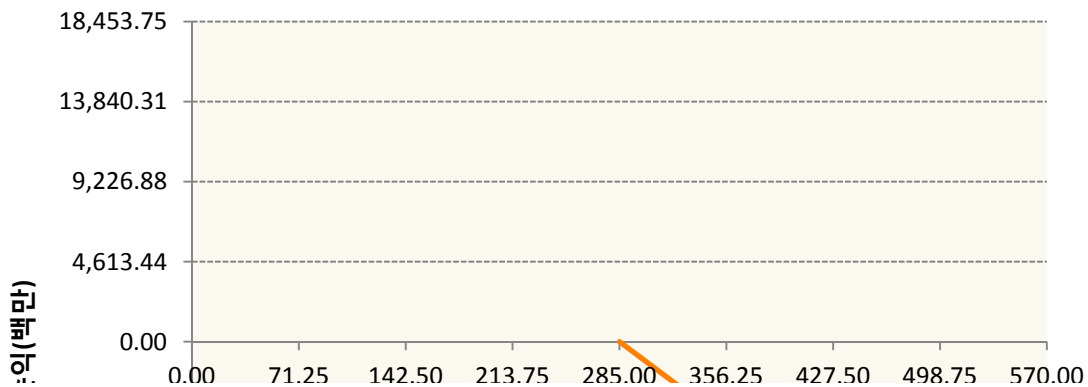
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,853	0	11,853	장내
누계	유가증권	옵션	1,698	21,688	-19,990	장내

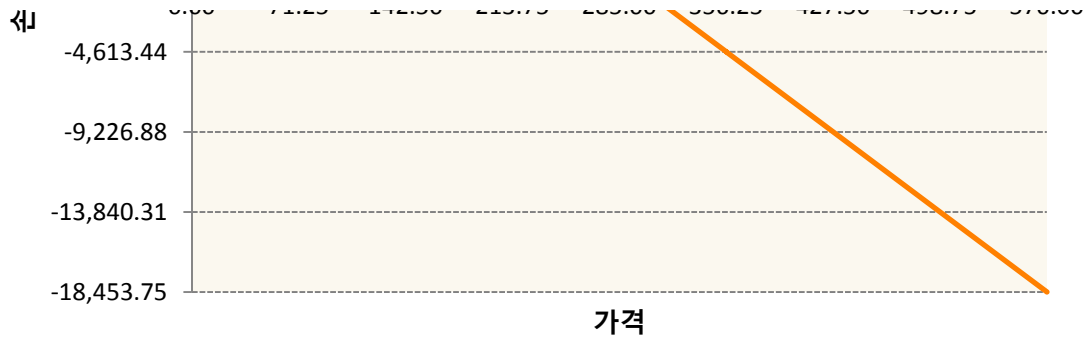
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

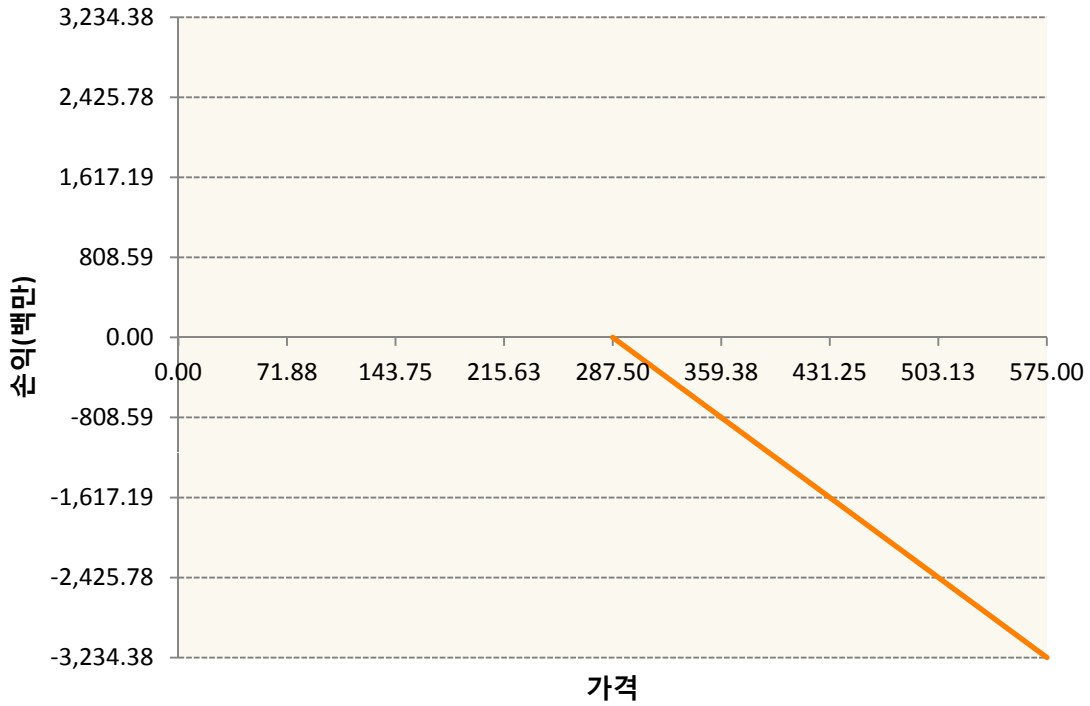


KR4201P82857-2019-08 콜285

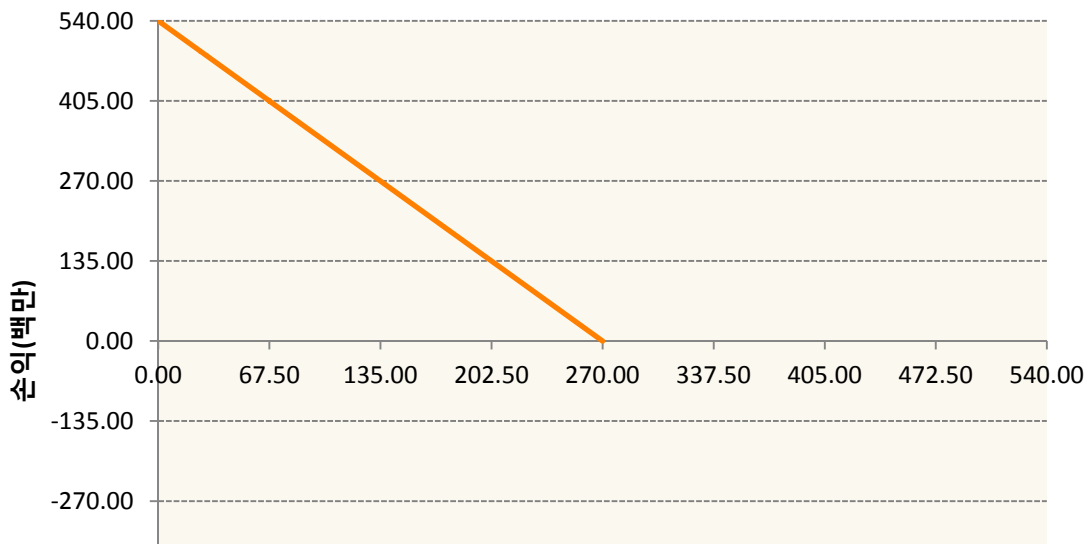


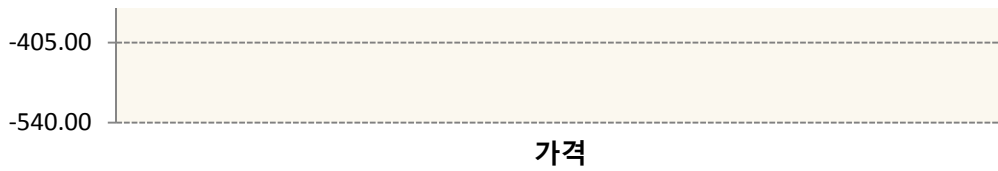


KR4201P82873-2019-08 콜287.5

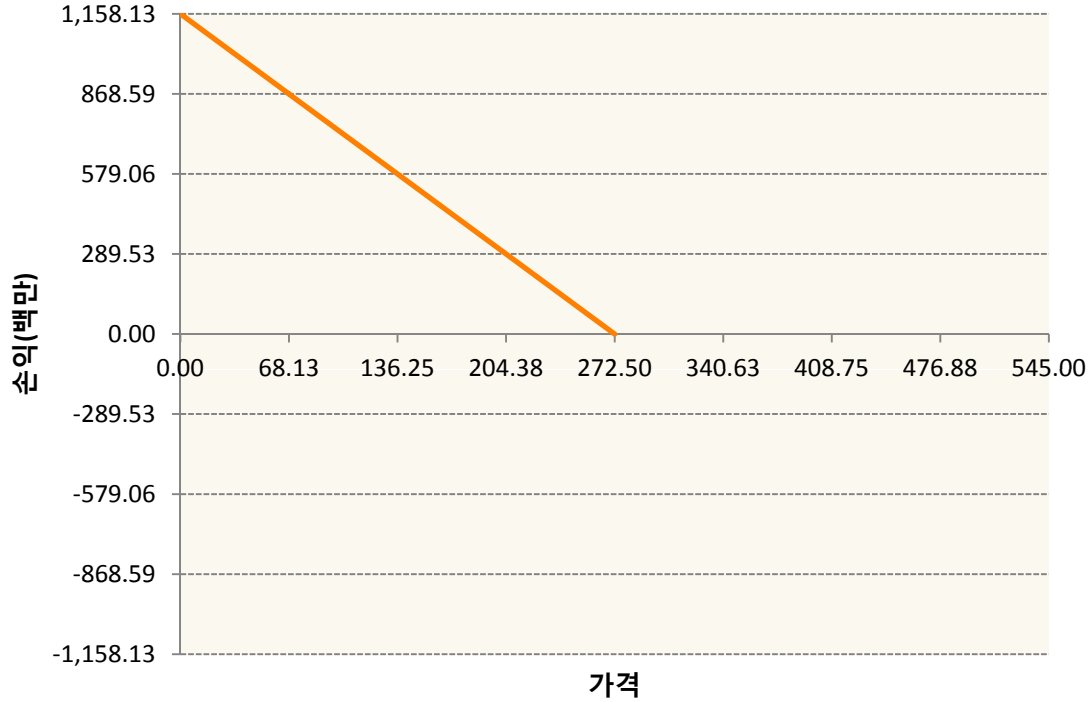


KR4301P82707-2019-08 풋270





KR4301P82723-2019-08 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						945
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-945	-945	-945	-945	-945	-945	-945	
-5.33%	-630	-630	-630	-630	-630	-630	-630	
-2.67%	-315	-315	-315	-315	-315	-315	-315	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	315	315	315	315	315	315	315	
5.33%	630	630	630	630	630	630	630	
8.00%	945	945	945	945	945	945	945	
KR4201P82857		2019-08 콜285						759
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	97	96	96	95	94	92	88	
-5.33%	96	94	92	89	84	77	70	
-2.67%	89	83	75	65	53	39	25	

0%	55	38	20	0	-21	-43	-66
2.67%	-51	-79	-107	-136	-164	-193	-222
5.33%	-274	-304	-333	-363	-393	-423	-453
8.00%	-616	-637	-659	-683	-708	-733	-759
KR4201P82873                      2019-08 콜287.5							118
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12	12	12	12	12	12	11
-5.33%	12	12	12	11	11	10	9
-2.67%	11	11	10	8	7	5	3
0%	8	5	3	0	-3	-7	-10
2.67%	-6	-10	-14	-19	-24	-28	-33
5.33%	-37	-42	-48	-53	-58	-63	-69
8.00%	-90	-94	-98	-103	-108	-113	-118
KR4301P82707                      2019-08 풋270							34
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	34	34	34	34	34	34	34
-5.33%	20	20	20	20	20	20	20
-2.67%	6	7	7	8	8	8	9
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-3	-3	-3	-3	-2	-2	-2
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
KR4301P82723                      2019-08 풋272.5							79
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	79	79	79	79	79	79	79
-5.33%	48	48	48	48	49	49	49
-2.67%	18	19	20	20	21	22	22
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-10	-10	-9	-9	-8	-7	-7
5.33%	-11	-11	-11	-11	-11	-10	-10
8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11

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

(단위:백만원)

**1,560**

공시일	2019-07-25
기준일	2019-07-24

## 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	39,250	0	39,250	

### 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	2019-07-25
기준일	2019-07-24

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	400	0	400	
누계	유가증권	수익증권	53,606	0	53,606	

### 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	2019-07-25
기준일	2019-07-24

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,534	0	3,534	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	404,393	0	404,393	
누계	통화	선도	0	419,120	-419,120	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E	697
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E	697
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E	1,300
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E	2,556
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E	3,110
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E	2,111
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E	1,696
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E	2,073
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E	132
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	565
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	3,015
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	3,298
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	471
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E	942
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E	2,931
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E	1,640
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E	754
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E	1,885
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E	1,885
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	283
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	94
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	697
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	697

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

(단위:백만원)



공시일	2019-07-25
기준일	2019-07-24

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

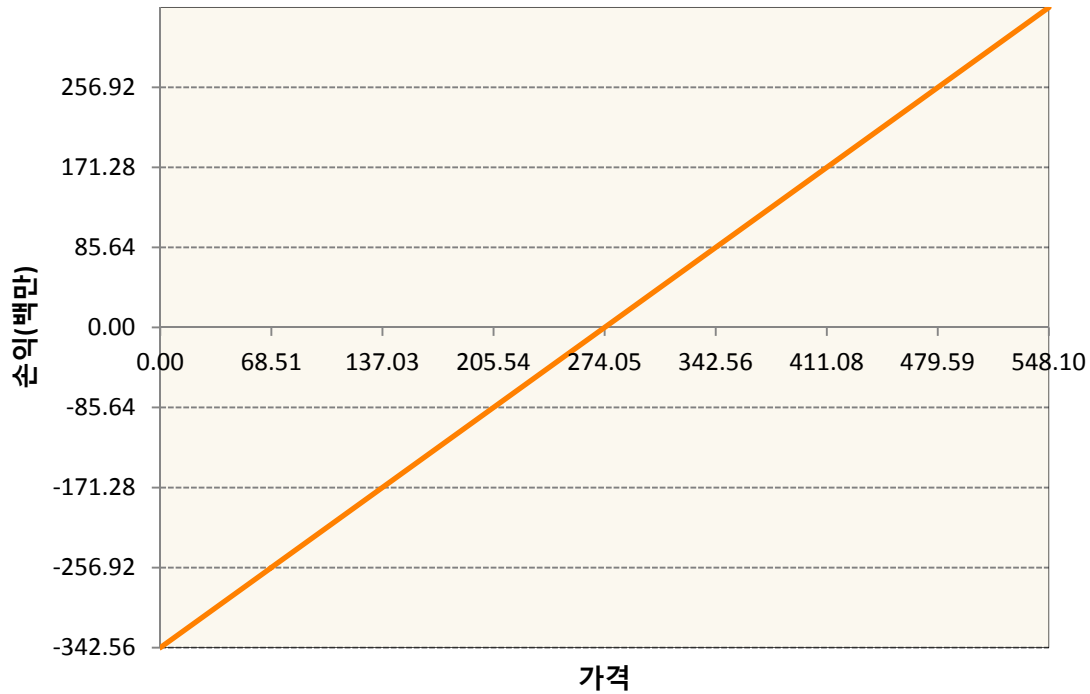
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

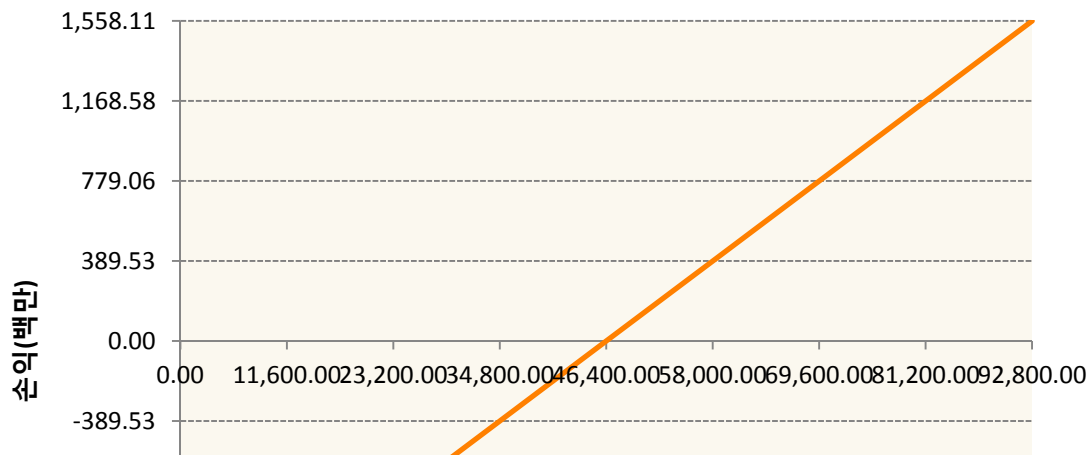
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,901	0	1,901	장내

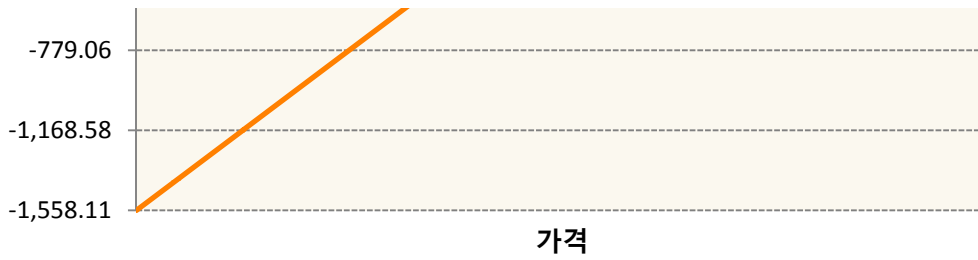
### 2. 만기시점의 손익구조

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						125
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125	
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83	
-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%	83	83	83	83	83	83	83	
8.00%	125	125	125	125	125	125	125	

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

**176**

공시일	2019-07-25
기준일	2019-07-24

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

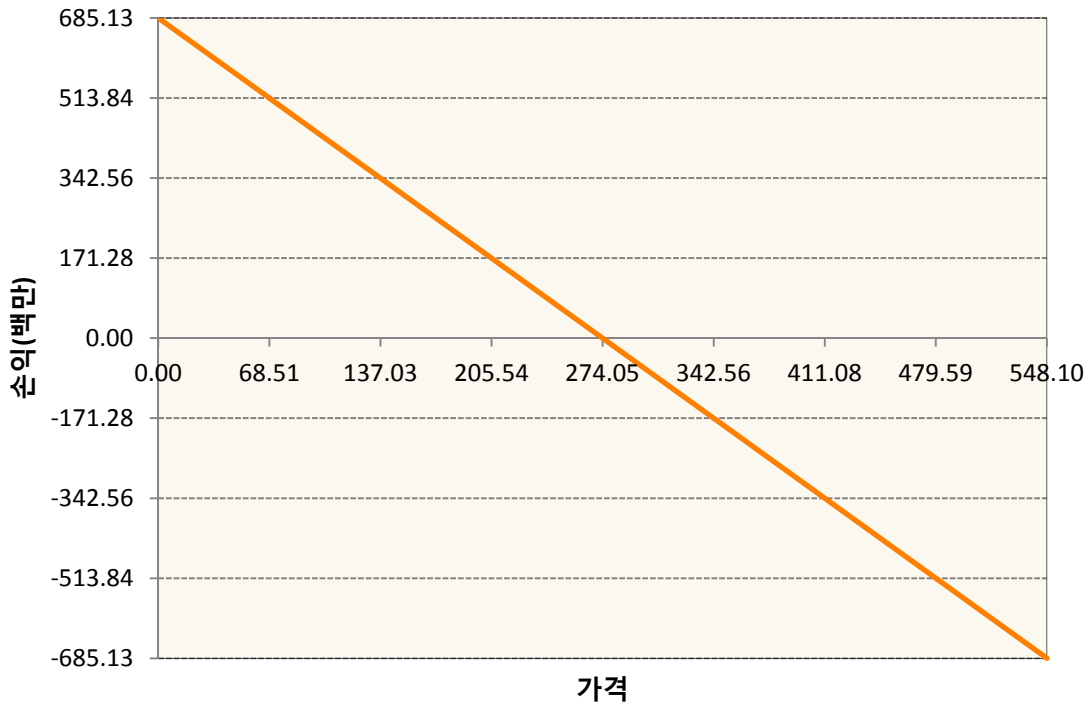
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

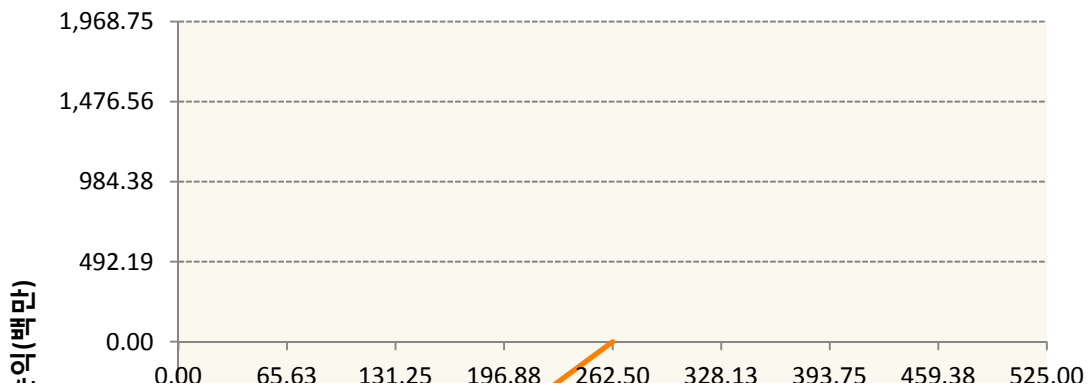
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	685	-685	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,625	-3,625	장내

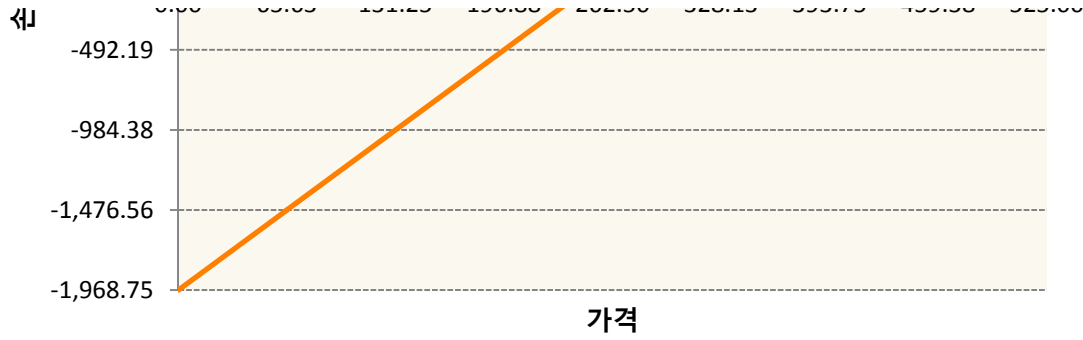
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

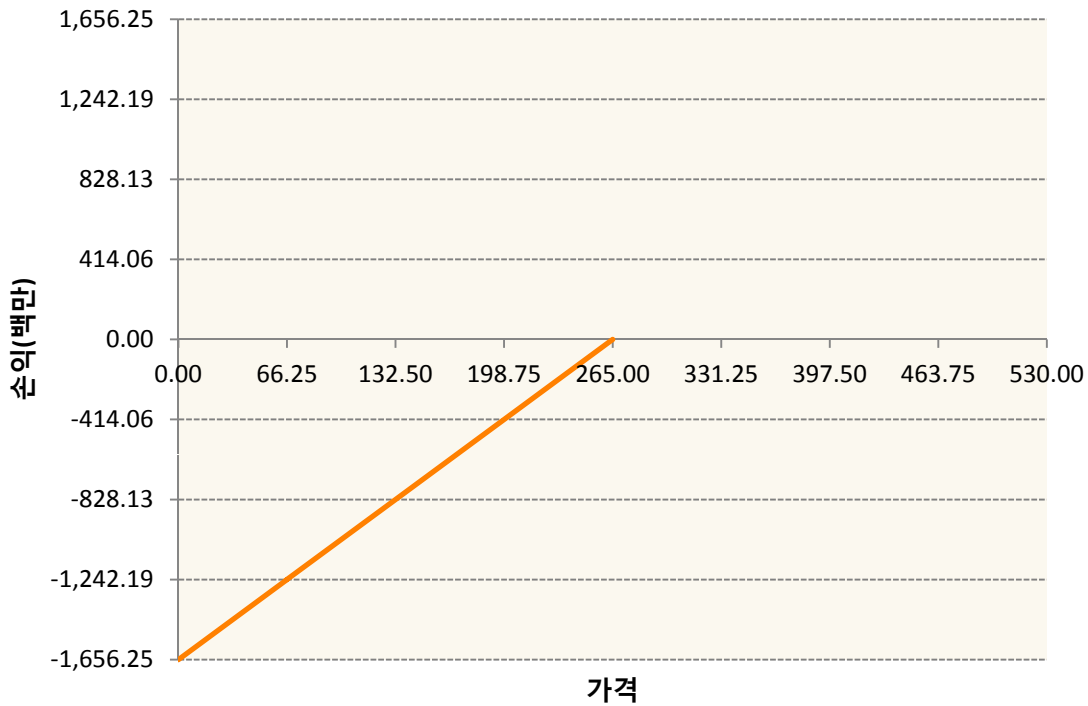


KR4301P82624-2019-08 풋262.5





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						85
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-83	-83	-83	-84	-84	-85	-85
-5.33%	-33	-34	-36	-37	-39	-40	-42
-2.67%	-5	-6	-8	-9	-11	-12	-14
0%	1	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	2	2	2	1	1	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

KR4301P82657

2019-08 풋265

84

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-83	-83	-83	-83	-83	-84	-84
-5.33%	-39	-40	-41	-42	-42	-44	-45
-2.67%	-8	-9	-11	-12	-14	-15	-17
0%	2	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	3	3	3	3	2	2	2
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

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

(단위:백만원)

166

공시일	2019-07-25
기준일	2019-07-24

## 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	18,358	0	18,358	
누계	통화	선도	0	18,257	-18,257	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		980
FX21019N01 KRW/USD 12-08-19E		160
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		320

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

(단위:백만원)

<b>476</b>
------------

공시일	2019-07-25
기준일	2019-07-24

## 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	2019-07-25
기준일	2019-07-24

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

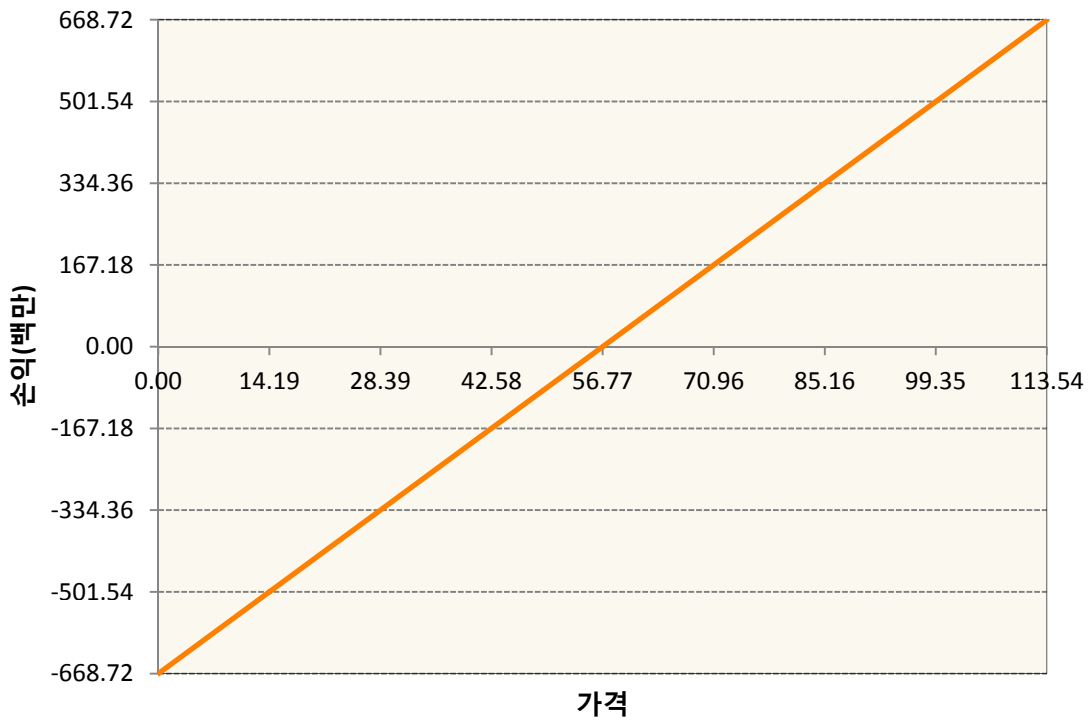
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

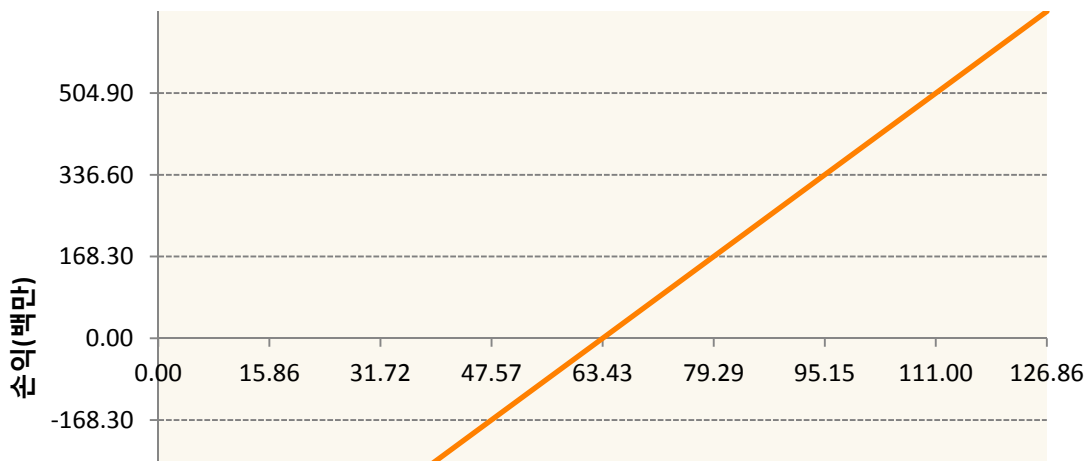
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,644	118	2,526	

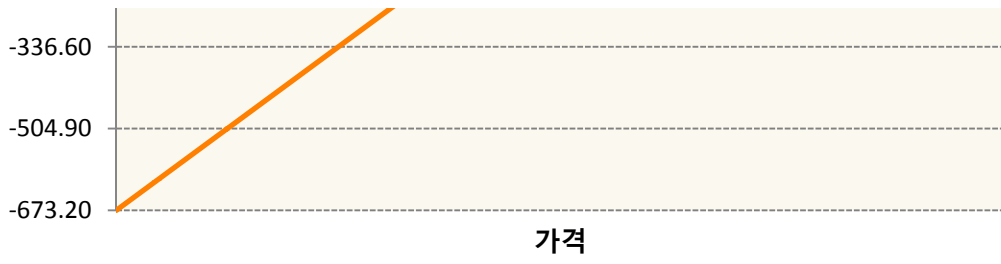
### 2. 만기시점의 손익구조

CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19

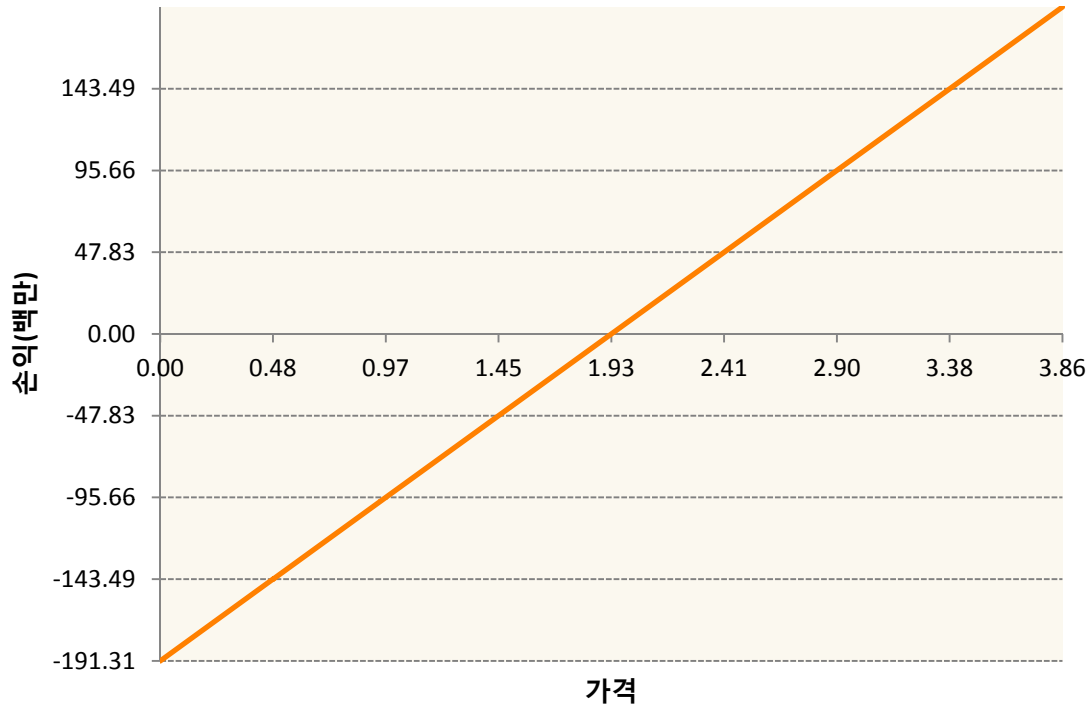


COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19

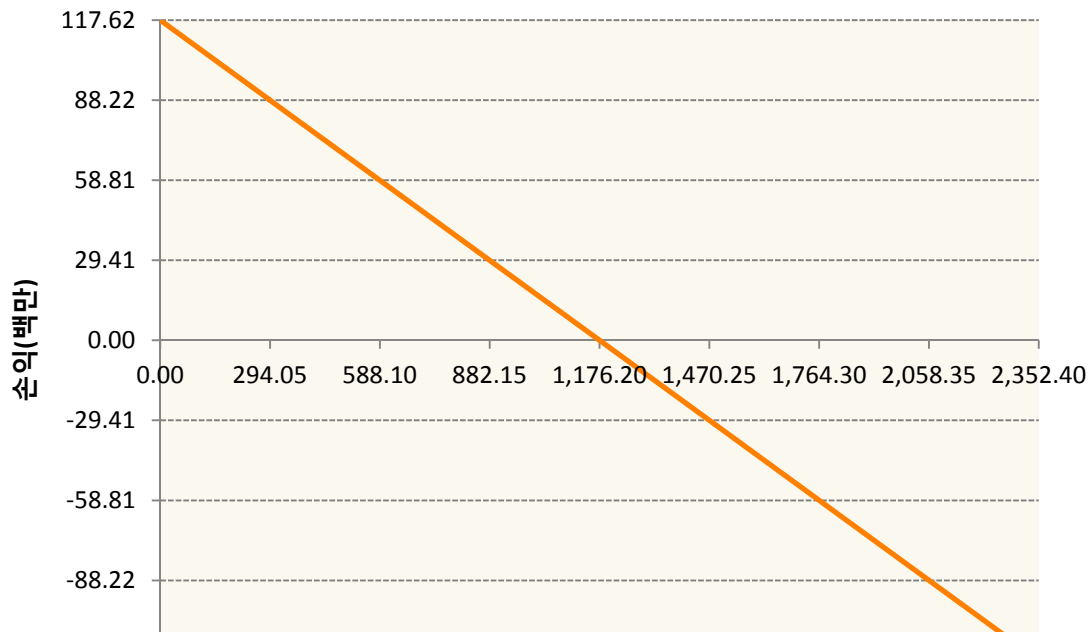


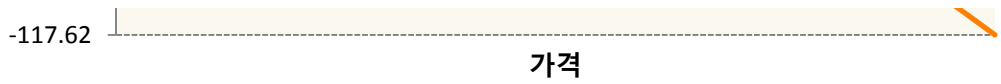


HOU9-NY Harb ULSD Fut Sep19

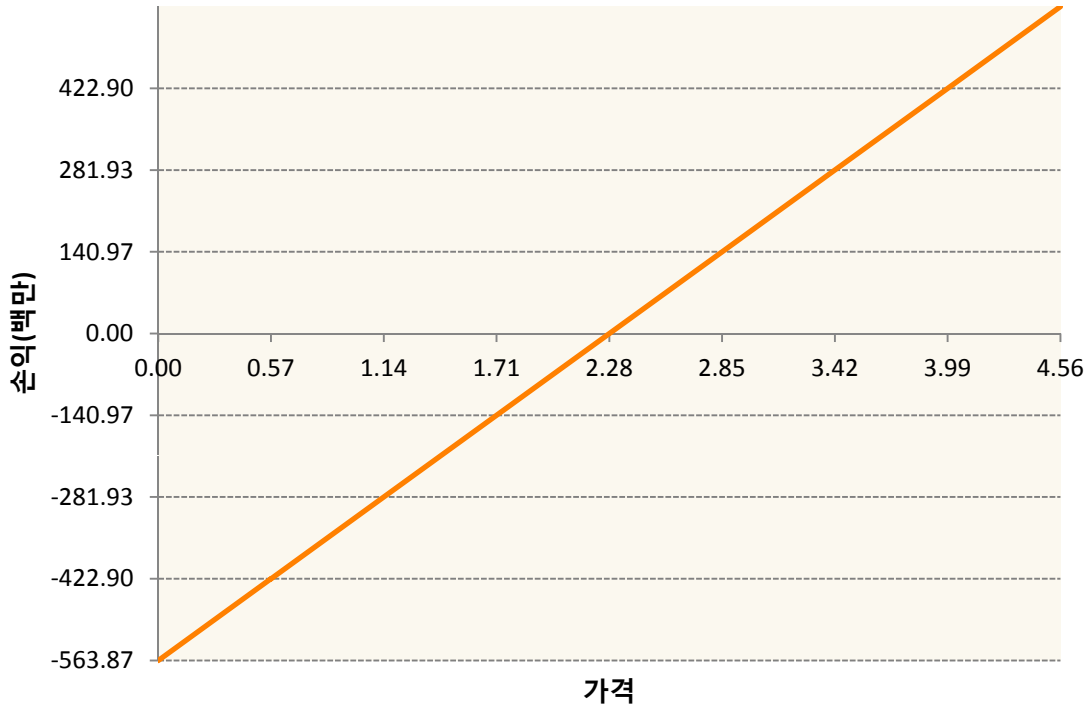


KR4175P80006-2019-08 달러선물

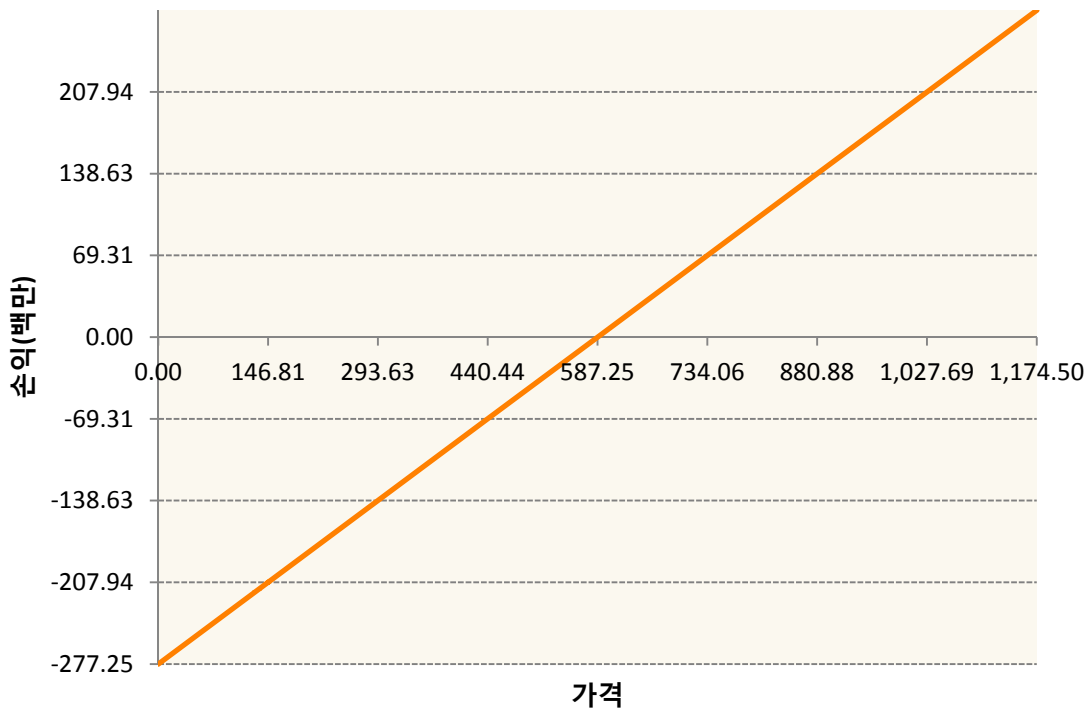




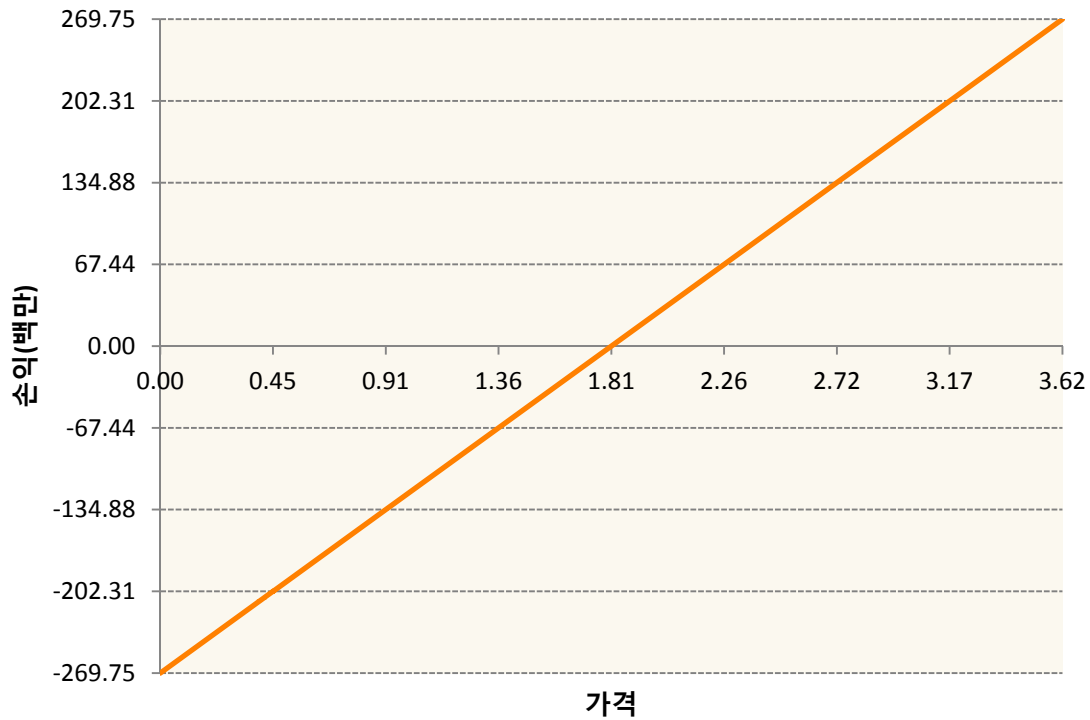
NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



QSU9-Low Su Gasoil G Sep19



XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



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

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	53
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	22
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	22

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

**387**

공시일	2019-07-25
기준일	2019-07-24

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

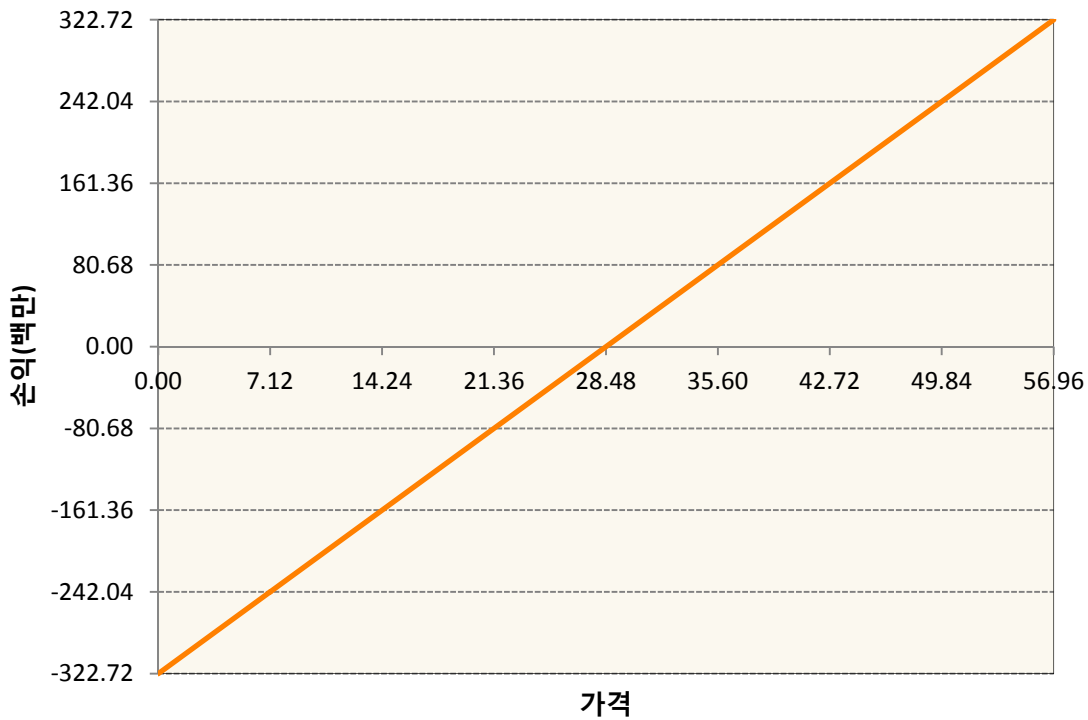
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

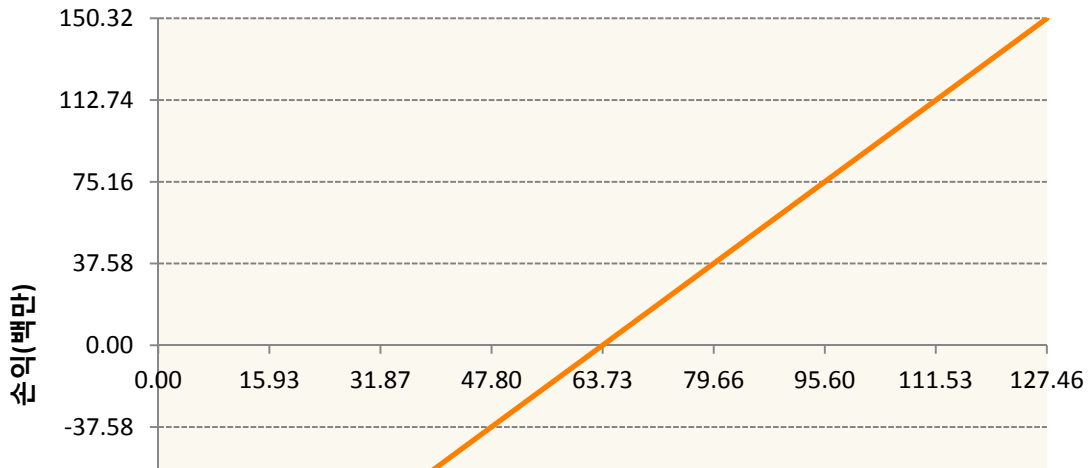
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,083	200	2,883	

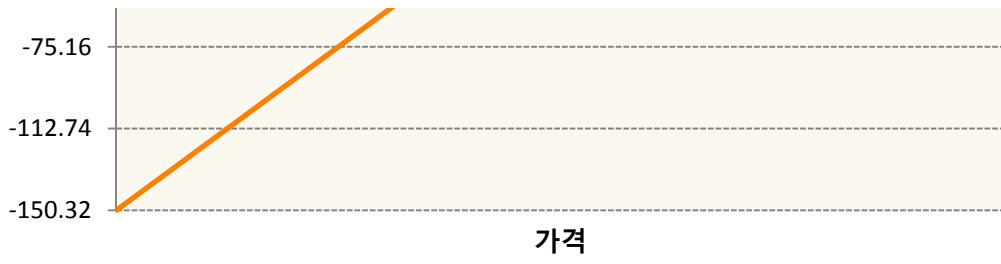
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19**

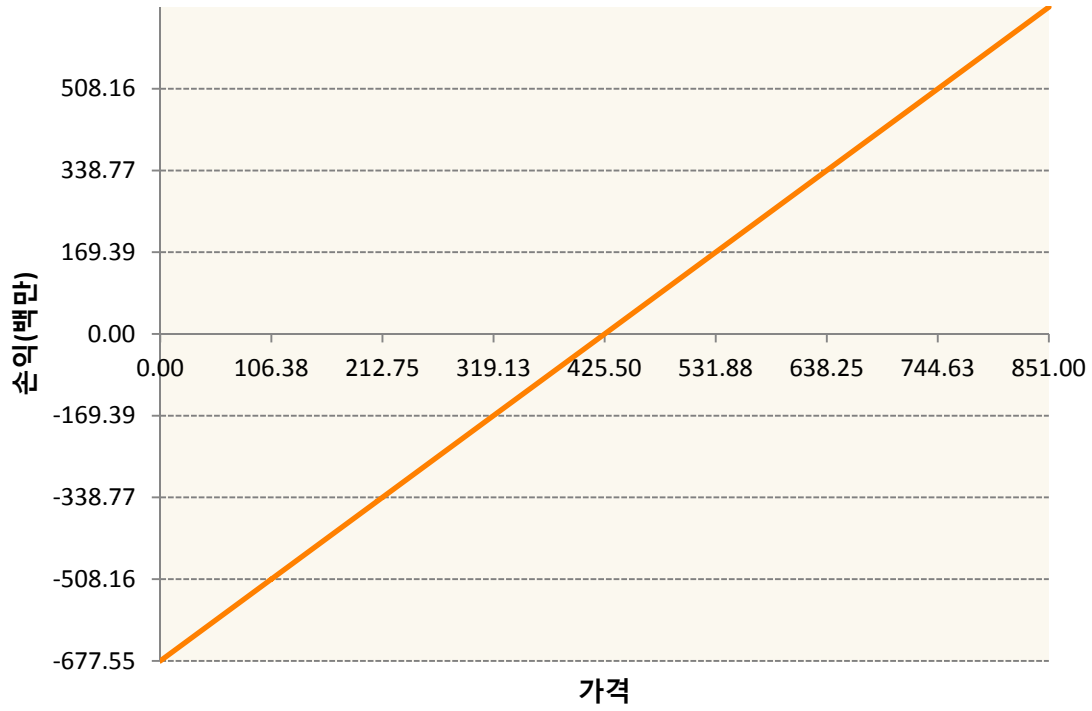


**CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19**

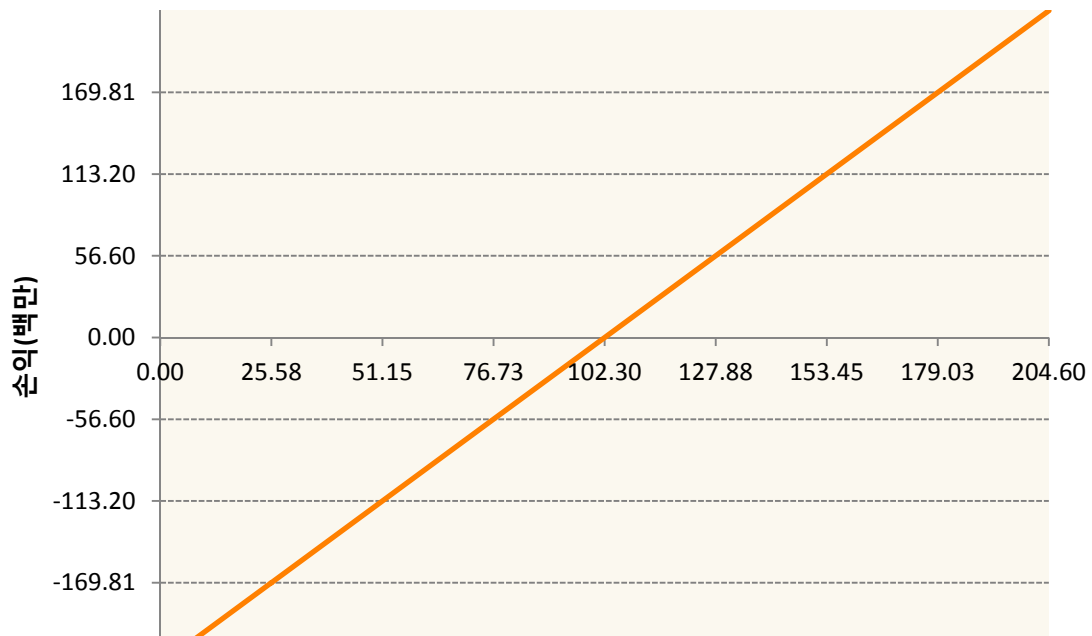


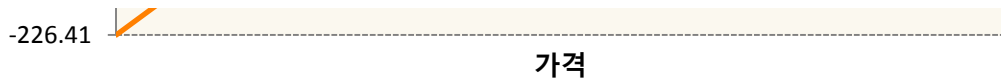


CU9-CORN FUTURE Sep19

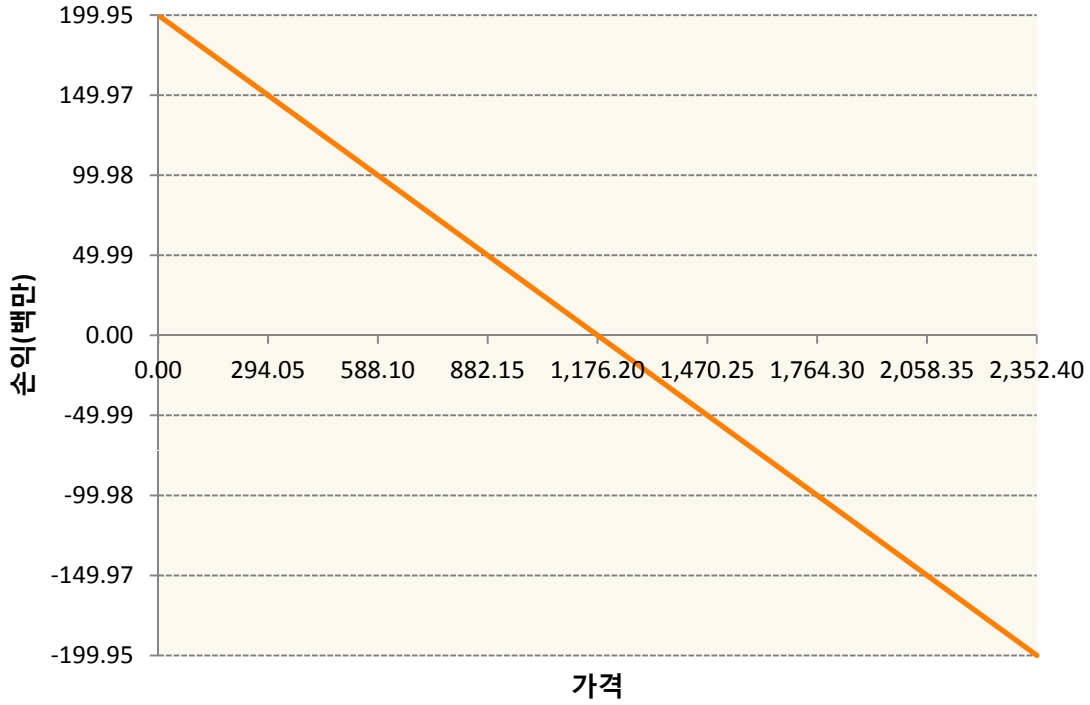


KCU9-COFFEE 'C' FUTURE Sep19

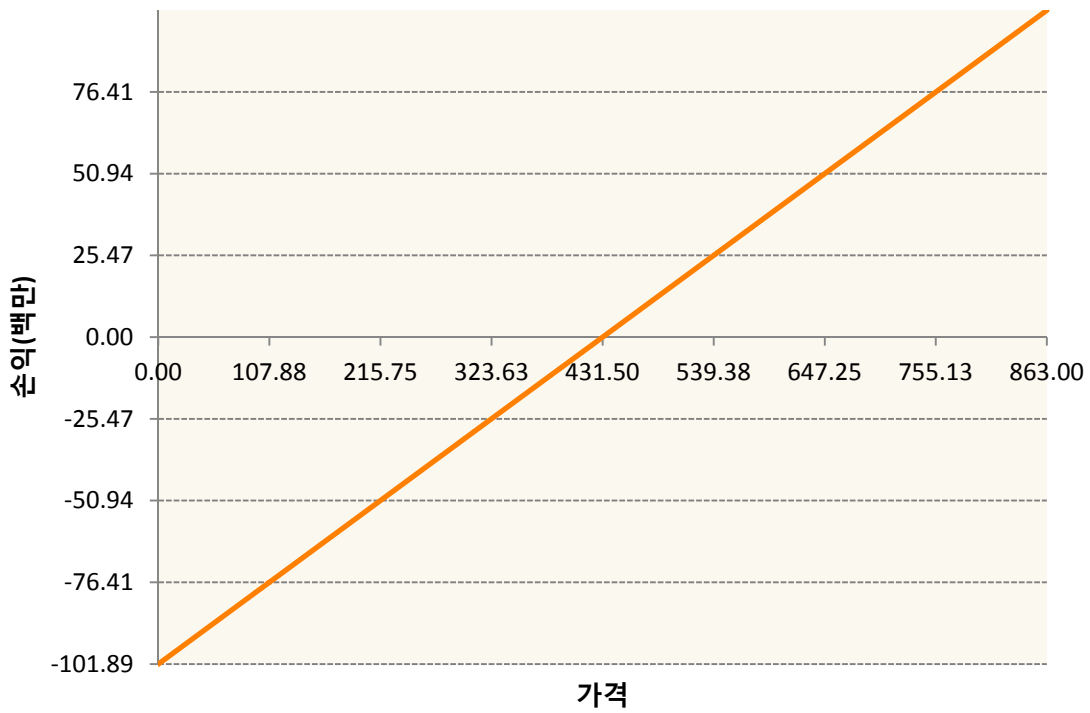




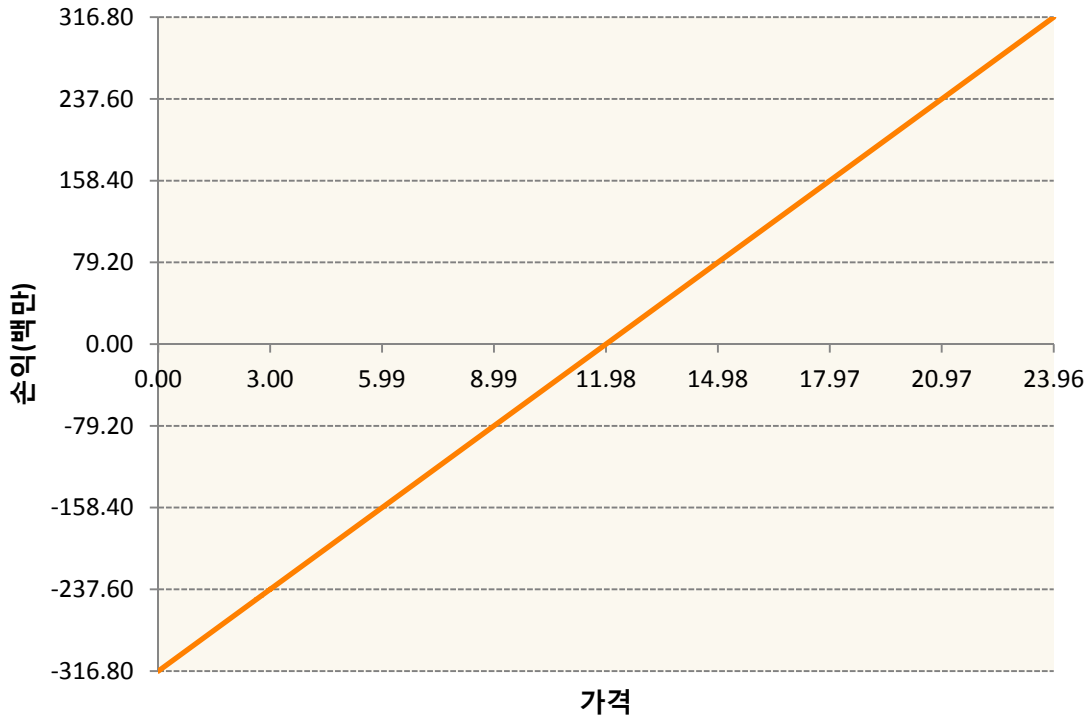
KR4175P80006-2019-08 달러선물



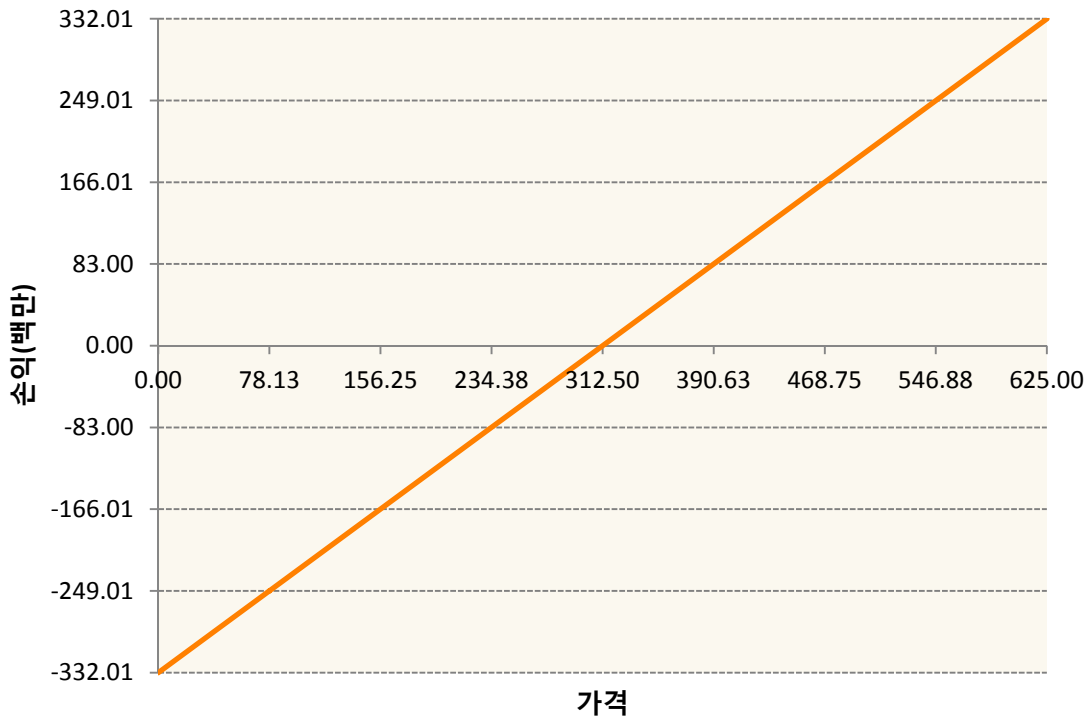
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

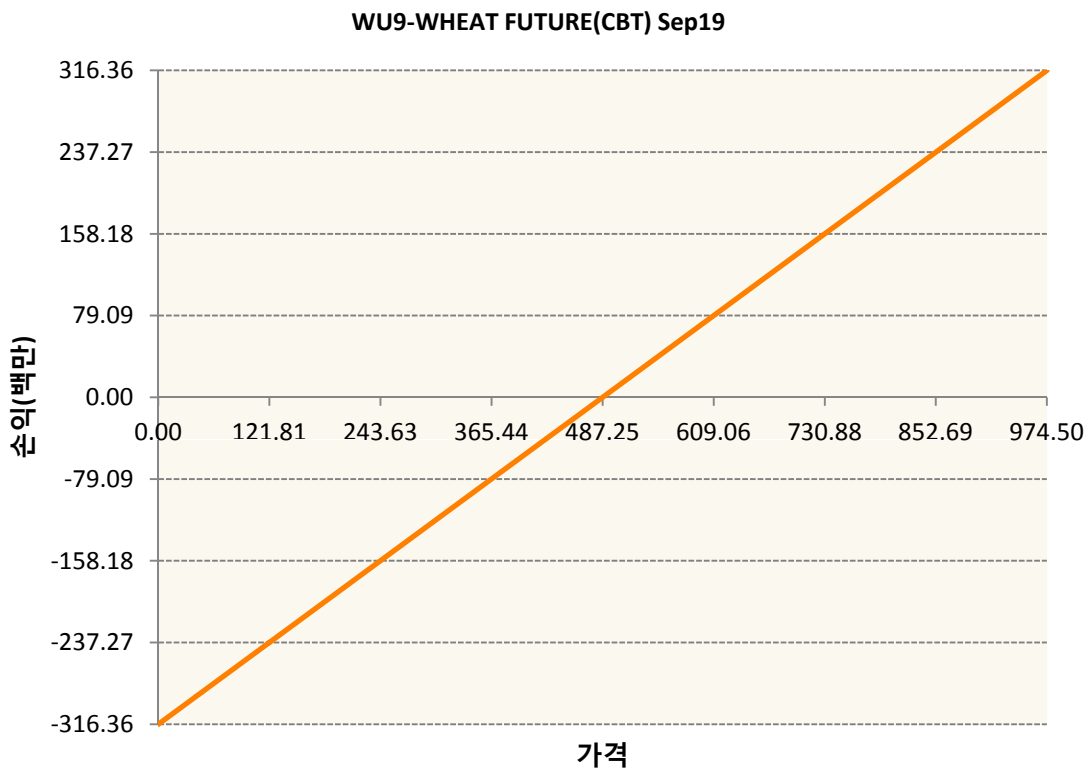
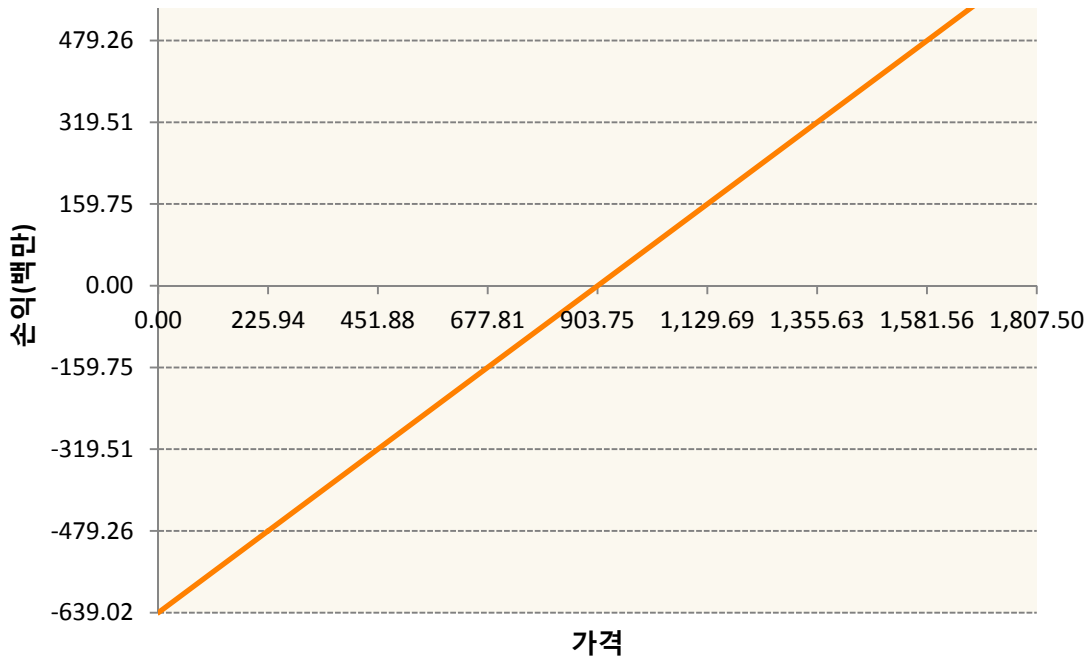


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



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	18
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	25

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

(단위:백만원)

272