

공시일	2019-07-30
기준일	2019-07-29

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	2019-07-30
기준일	2019-07-29

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

1,185

* 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	2019-07-30
기준일	2019-07-29

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)

383

SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)

140

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

843

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-30
기준일	2019-07-29

유로인덱스모(주식-파생형)

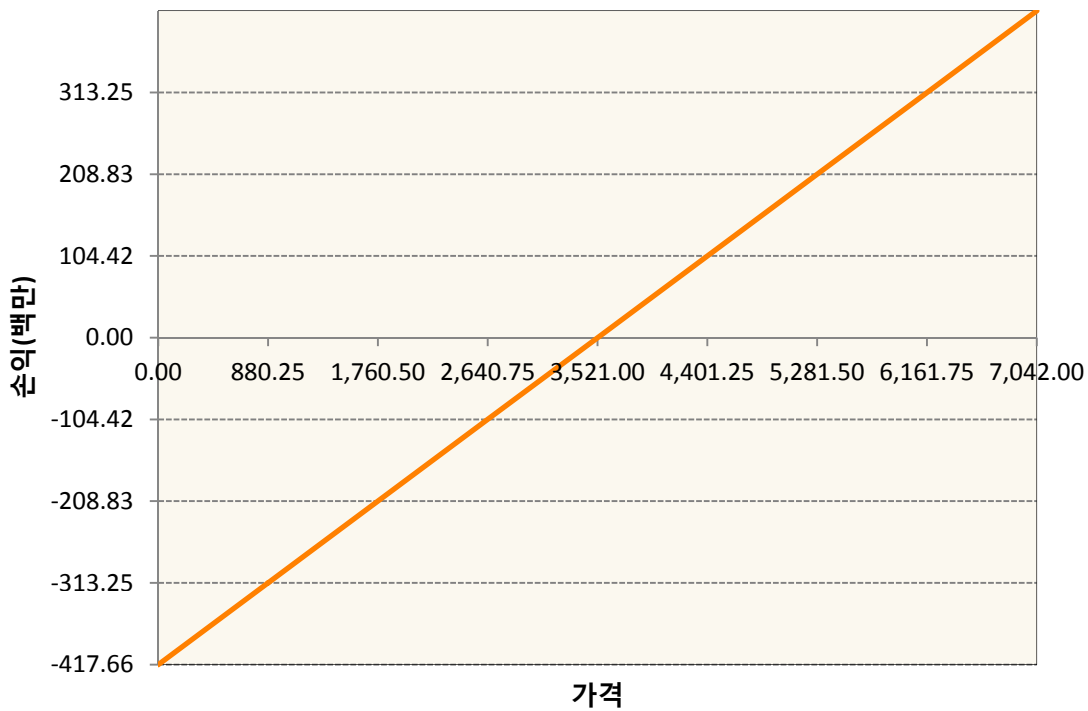
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	418	0	418	

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	2019-07-30
기준일	2019-07-29

차이나인덱스모(주식-파생형)

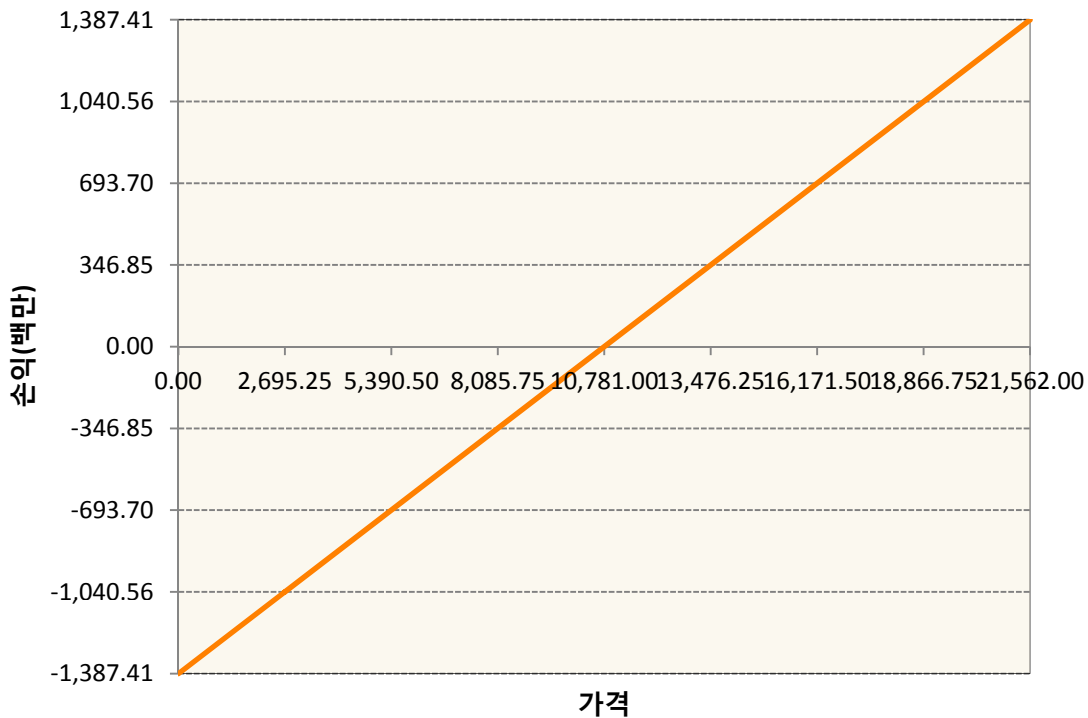
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,387	0	1,387	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCQ9	HSCEI Futures Aug19	111
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

111

공시일	2019-07-30
기준일	2019-07-29

커버드콜모(주식혼합-파생형)

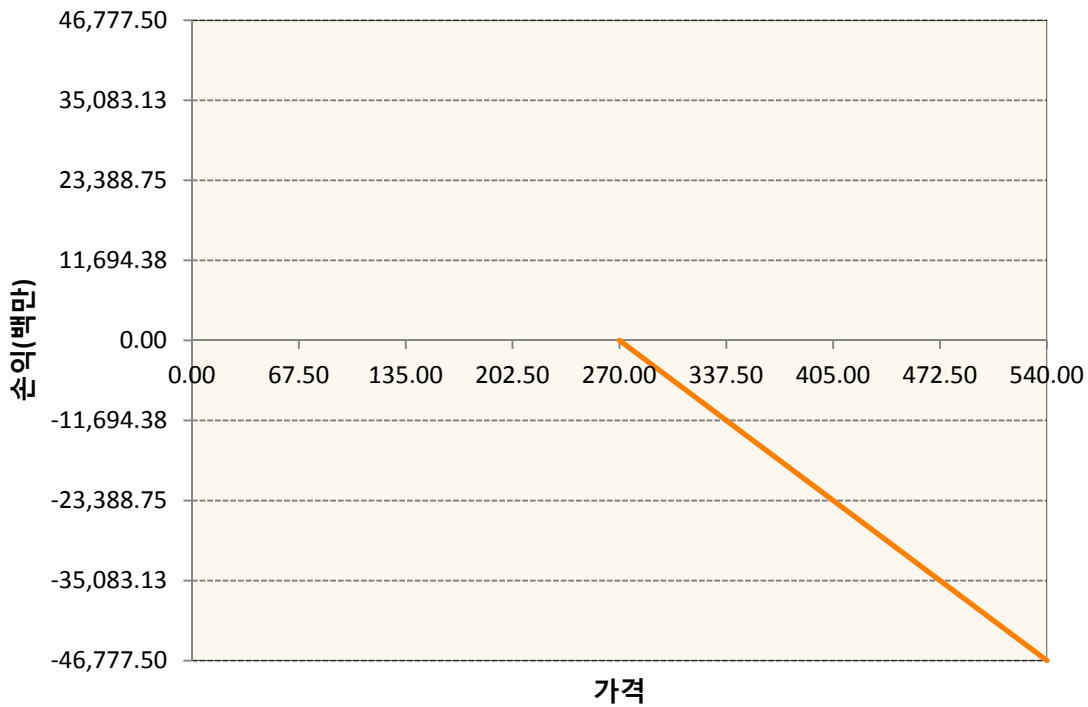
1. 계약금액

(단위:백만원)

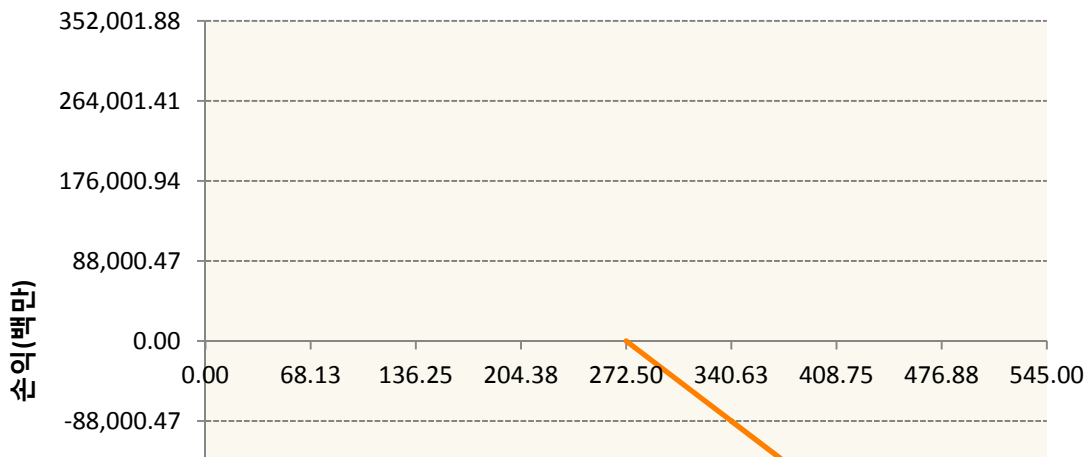
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	583,667	-583,667	장내

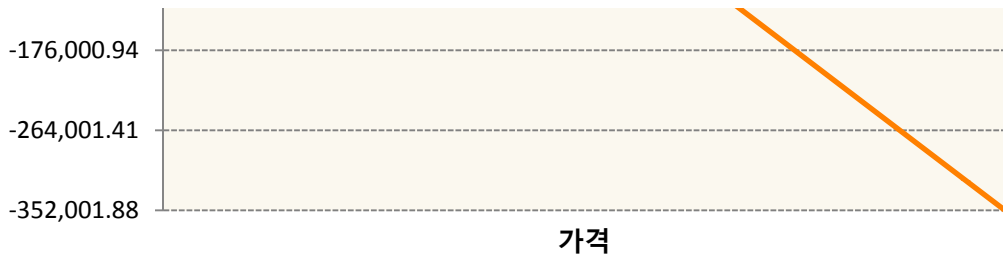
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P82709-2019-08 콜270

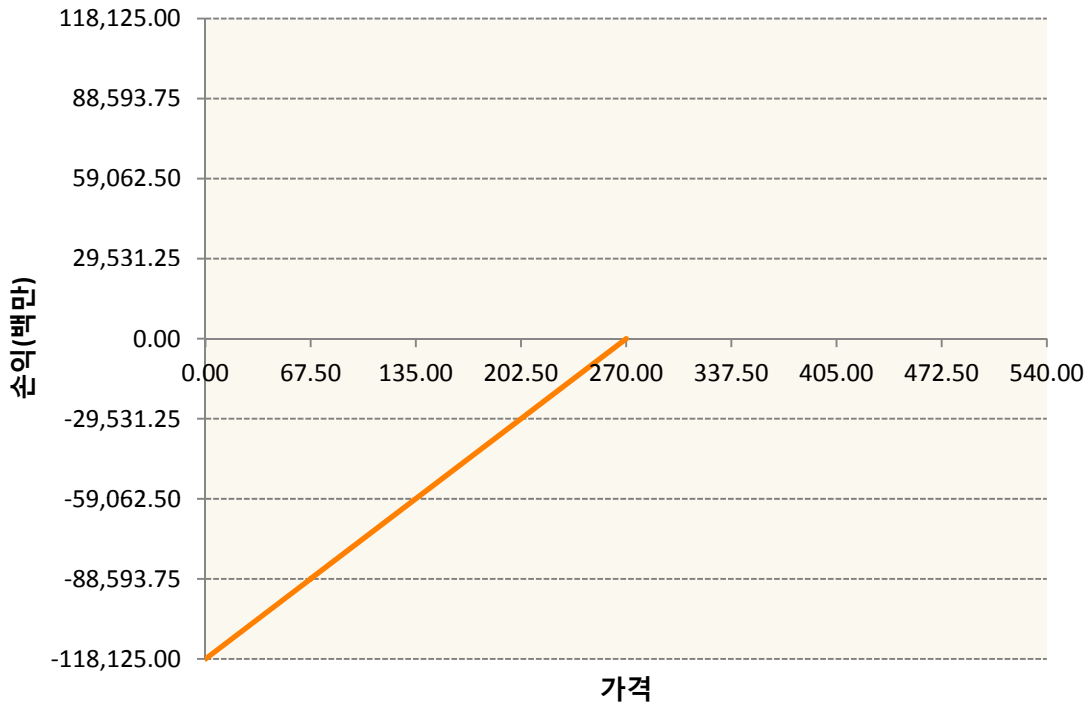


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

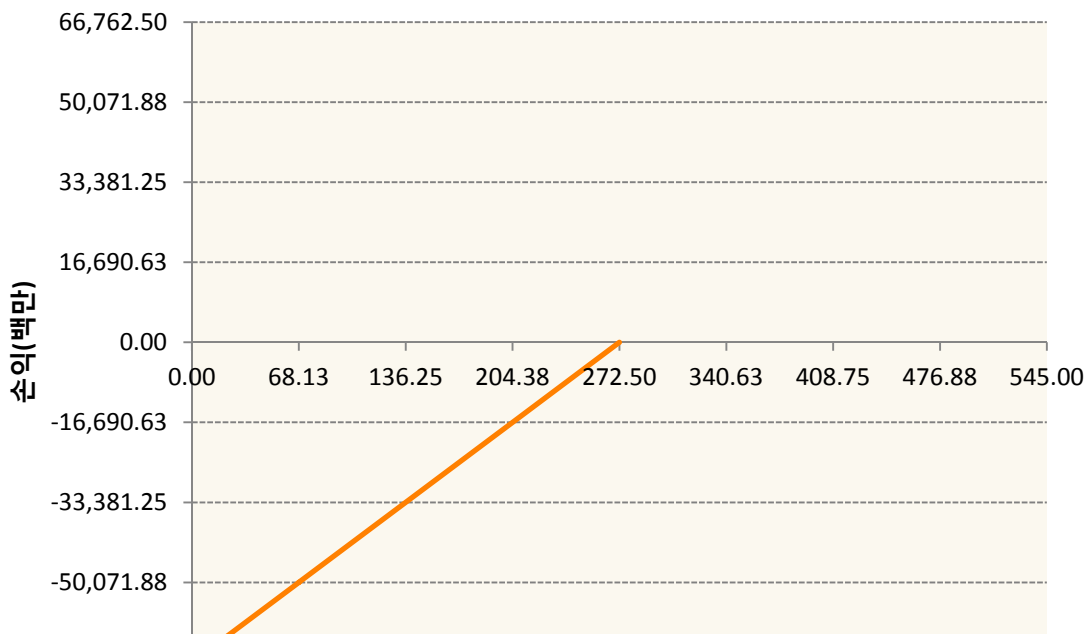




KR4301P82707-2019-08 풋270



KR4301P82723-2019-08 풋272.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P82709 2019-08 콜270							2,837
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	572	571	569	565	560	552	541
-5.33%	563	554	542	525	505	482	455
-2.67%	489	455	417	376	333	287	239
0%	184	123	62	0	-62	-124	-186
2.67%	-514	-569	-625	-683	-741	-800	-860
5.33%	-1,550	-1,576	-1,607	-1,642	-1,680	-1,722	-1,765
8.00%	-2,741	-2,748	-2,759	-2,773	-2,791	-2,812	-2,837
KR4201P82725 2019-08 콜272.5							19,462
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,091	3,088	3,079	3,064	3,037	2,998	2,943
-5.33%	3,062	3,026	2,968	2,886	2,780	2,650	2,495
-2.67%	2,761	2,584	2,374	2,133	1,867	1,579	1,271
0%	1,247	842	425	0	-432	-870	-1,312
2.67%	-2,879	-3,341	-3,806	-4,273	-4,742	-5,213	-5,684
5.33%	-9,849	-10,126	-10,432	-10,763	-11,113	-11,480	-11,861
8.00%	-18,453	-18,545	-18,669	-18,824	-19,010	-19,223	-19,462
KR4301P82707 2019-08 풋270							8,629
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,627	-8,627	-8,627	-8,627	-8,628	-8,628	-8,629
-5.33%	-5,506	-5,506	-5,508	-5,511	-5,516	-5,523	-5,534
-2.67%	-2,408	-2,427	-2,453	-2,485	-2,523	-2,567	-2,615
0%	272	183	92	0	-93	-186	-280
2.67%	1,543	1,476	1,404	1,329	1,250	1,168	1,085
5.33%	1,743	1,734	1,719	1,700	1,674	1,643	1,607
8.00%	1,751	1,751	1,750	1,748	1,745	1,739	1,731
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							5,013
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,012	-5,012	-5,012	-5,012	-5,012	-5,012	-5,013
-5.33%	-3,264	-3,264	-3,264	-3,265	-3,266	-3,268	-3,271
-2.67%	-1,519	-1,523	-1,530	-1,540	-1,552	-1,568	-1,586
0%	118	81	42	0	-44	-89	-135
2.67%	1,143	1,092	1,040	988	935	882	828

5.33%	1,394	1,381	1,365	1,344	1,320	1,293	1,263
8.00%	1,412	1,411	1,409	1,407	1,402	1,396	1,387

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

(단위:백만원)

39,192

공시일	2019-07-30
기준일	2019-07-29

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

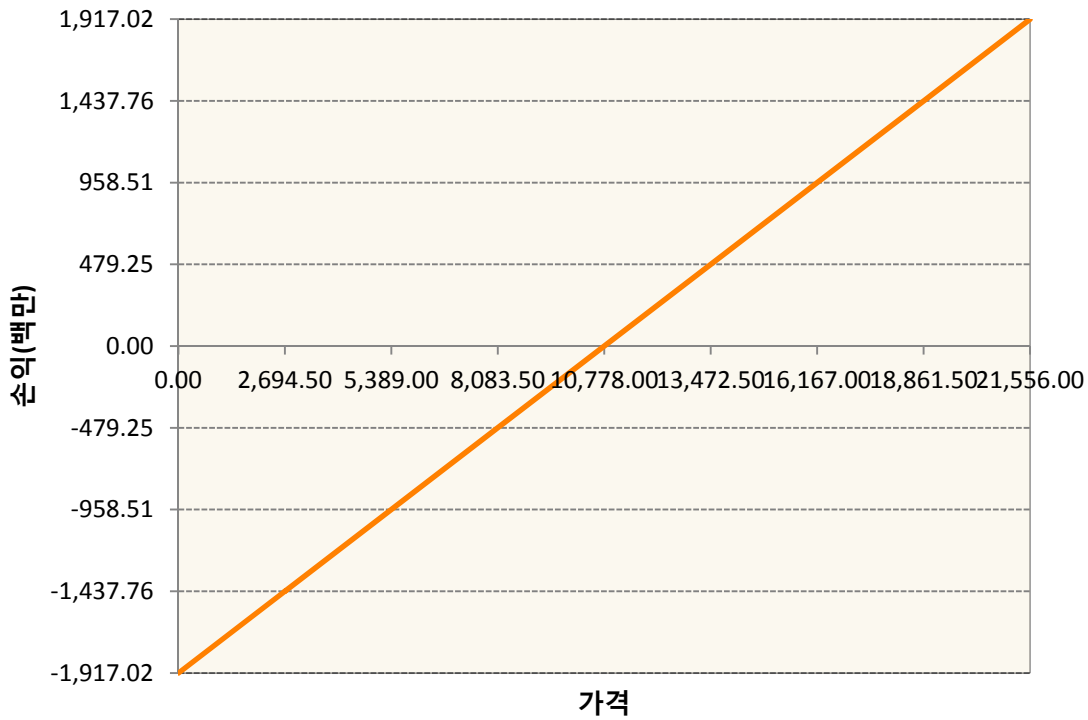
1. 계약금액

(단위:백만원)

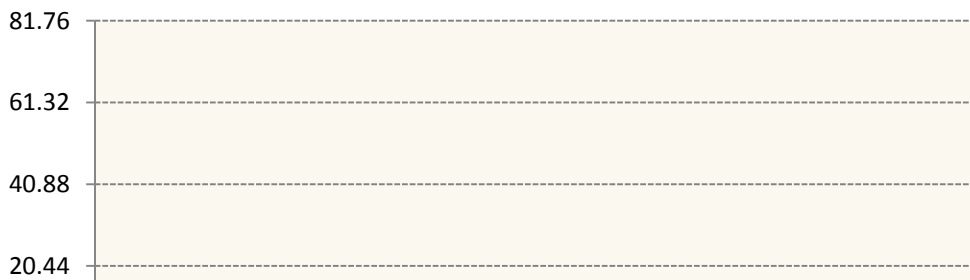
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,917	0	1,917	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,279	-5,279	장내
누계	통화	선도	151	3,179	-3,028	장외

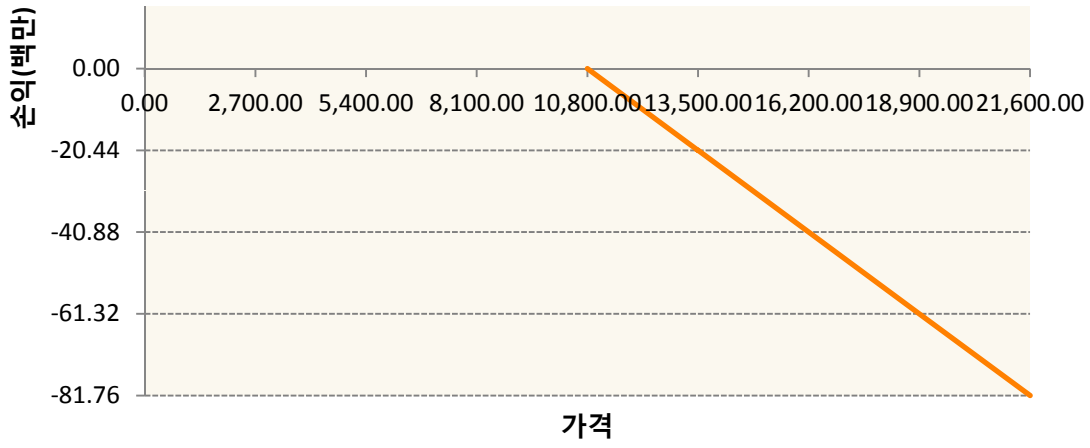
2. 만기시점의 손익구조

HCN9-HSCEI Futures Jul19

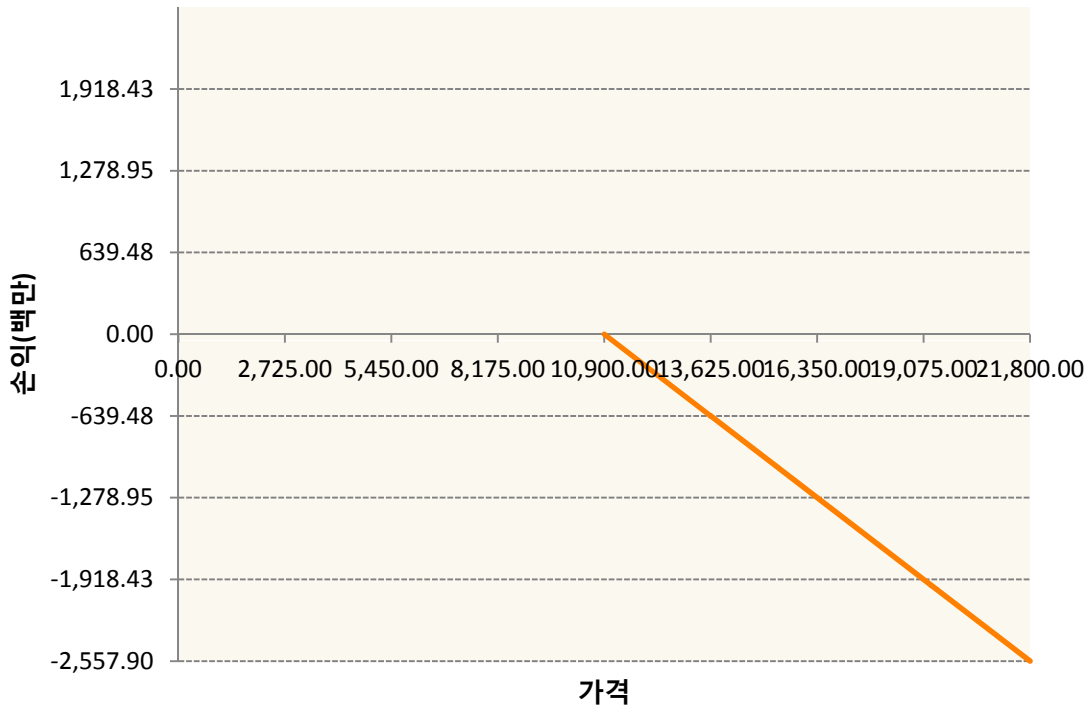


OHHIN9-C108-HSCEI

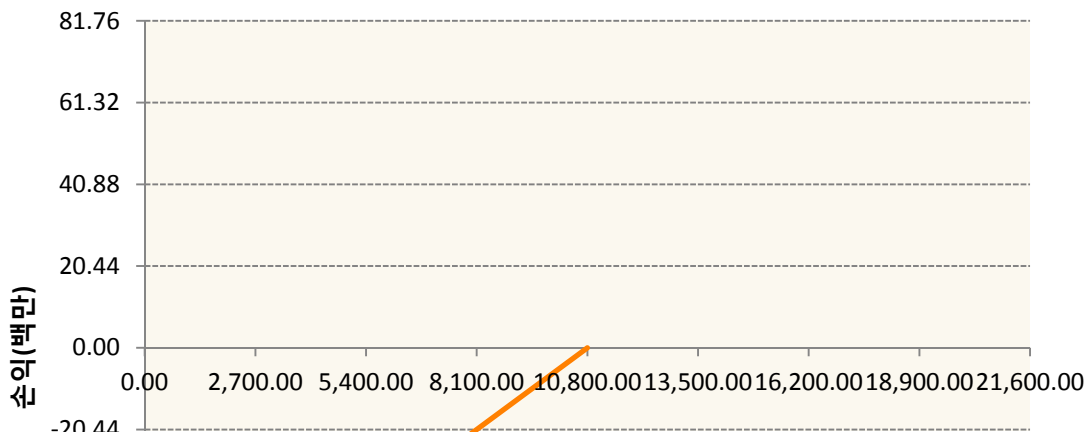


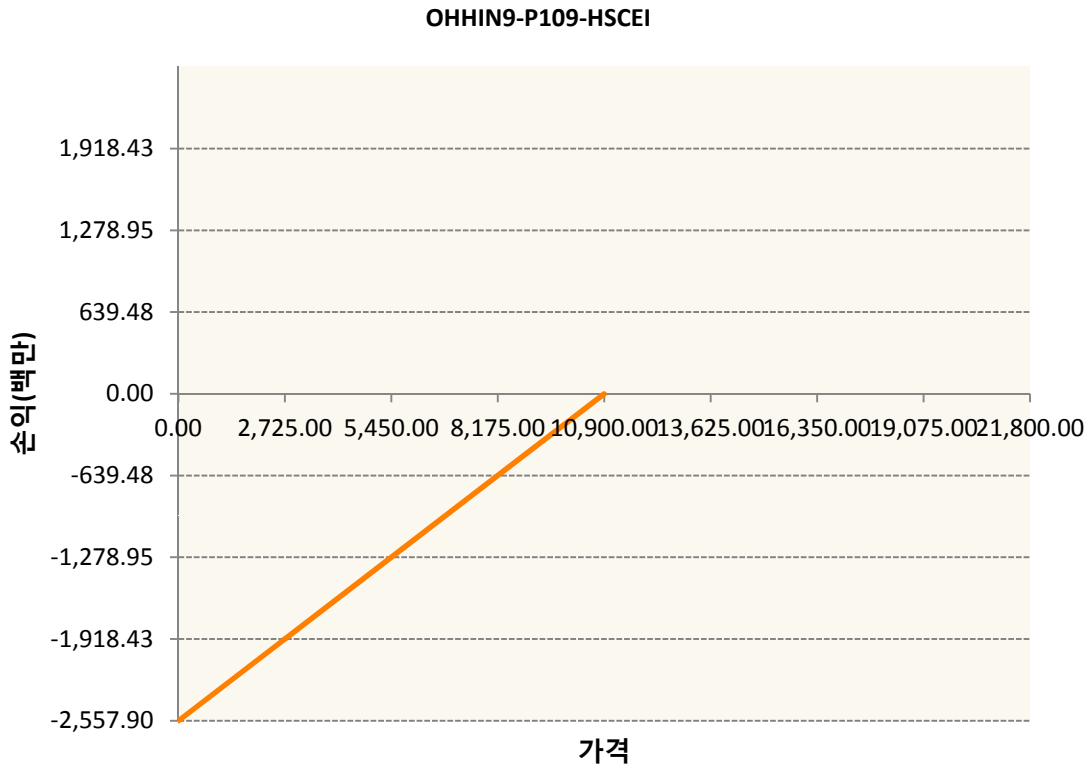
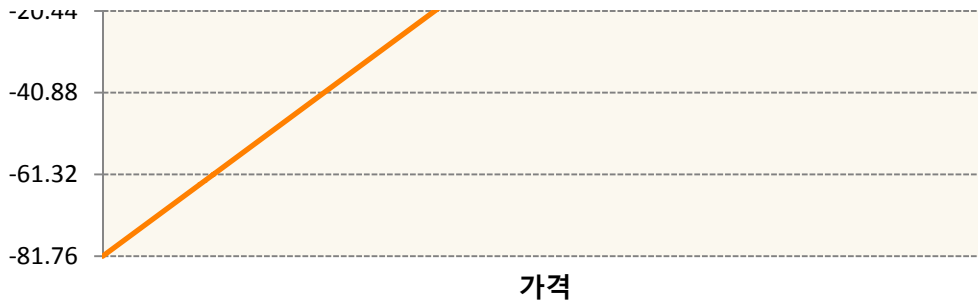


OHHIN9-C109-HSCEI



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	153
OHHIN9-C1(HSCEI	7
OHHIN9-C1(HSCEI	205
OHHIN9-P1(HSCEI	7
OHHIN9-P1(HSCEI	205

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

660

공시일	2019-07-30
기준일	2019-07-29

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

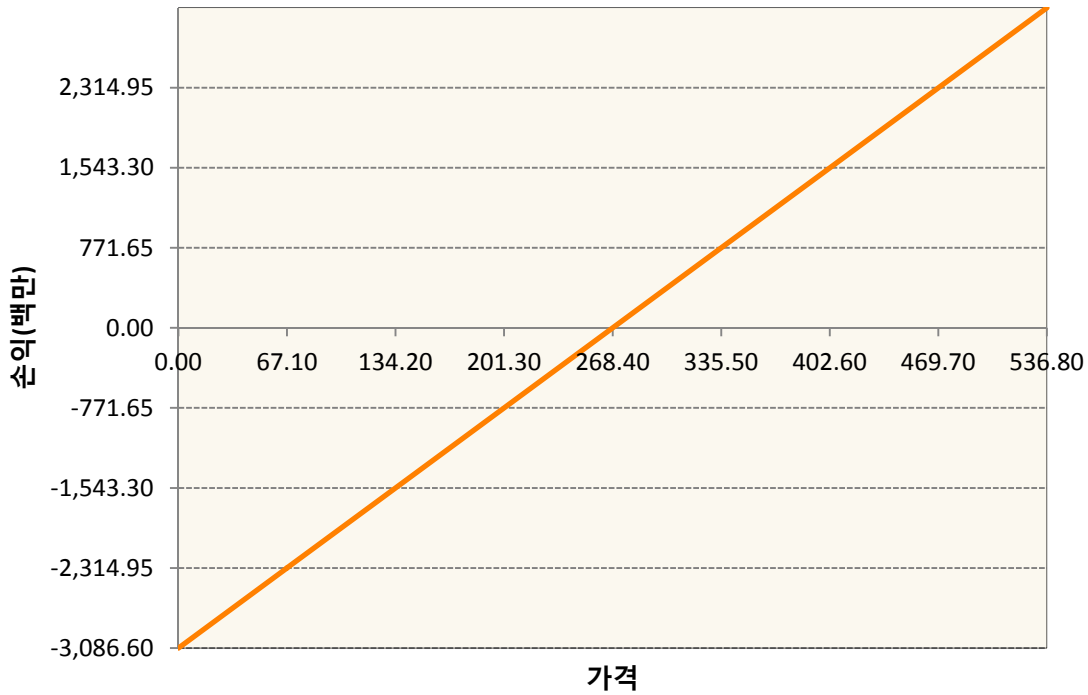
1. 계약금액

(단위:백만원)

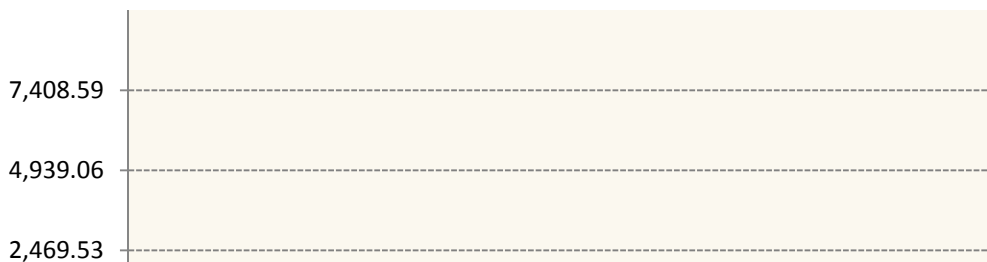
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,087	0	3,087	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	19,293	-19,293	장내

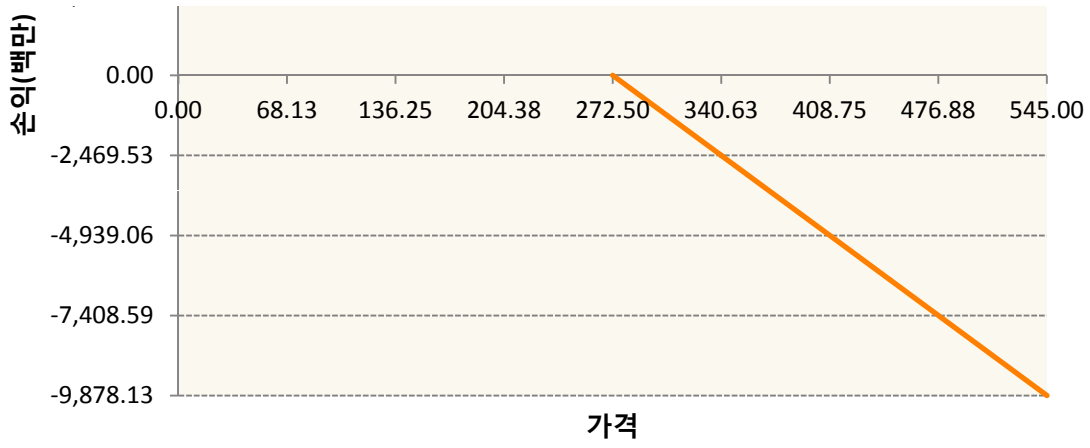
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

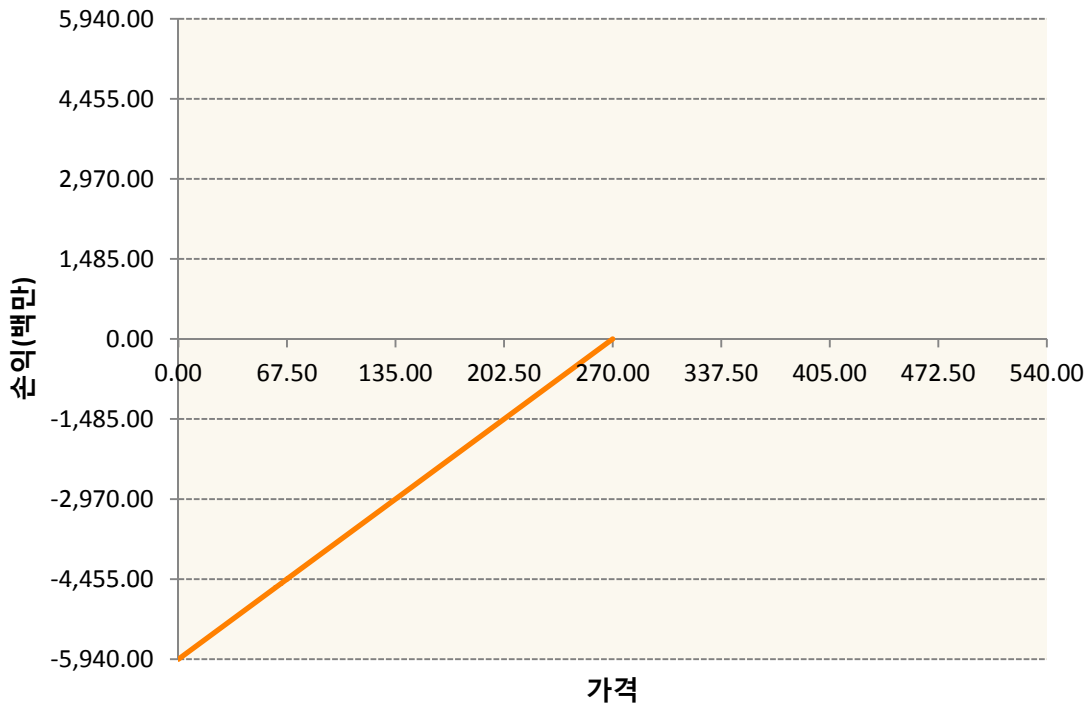


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

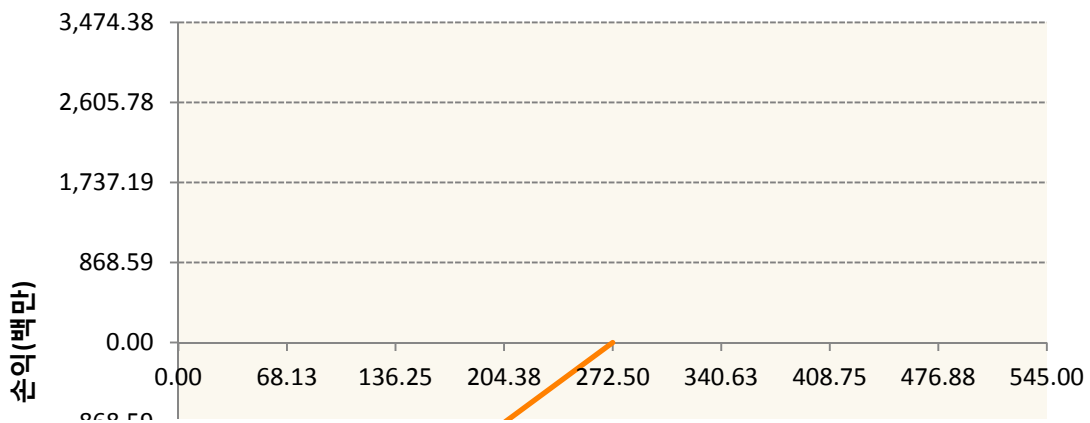




KR4301P82707-2019-08 풋270



KR4301P82723-2019-08 풋272.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,196
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,196	-1,196	-1,196	-1,196	-1,196	-1,196	-1,196	
-5.33%	-798	-798	-798	-798	-798	-798	-798	
-2.67%	-399	-399	-399	-399	-399	-399	-399	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	399	399	399	399	399	399	399	
5.33%	798	798	798	798	798	798	798	
8.00%	1,196	1,196	1,196	1,196	1,196	1,196	1,196	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						605
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-605	-605	-605	-605	-605	-605	-605	
-5.33%	-403	-403	-403	-403	-403	-403	-403	
-2.67%	-202	-202	-202	-202	-202	-202	-202	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	202	202	202	202	202	202	202	
5.33%	403	403	403	403	403	403	403	
8.00%	605	605	605	605	605	605	605	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						246
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-246	-246	-246	-246	-246	-246	-246	
-5.33%	-164	-164	-164	-164	-164	-164	-164	
-2.67%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	82	82	82	82	82	82	82	
5.33%	164	164	164	164	164	164	164	
8.00%	246	246	246	246	246	246	246	
KR4201P82725		2019-08 콜272.5						546
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	87	87	86	86	85	84	83
-5.33%	86	85	83	81	78	74	70
-2.67%	77	73	67	60	52	44	36
0%	35	24	12	0	-12	-24	-37
2.67%	-81	-94	-107	-120	-133	-146	-160
5.33%	-276	-284	-293	-302	-312	-322	-333
8.00%	-518	-520	-524	-528	-533	-539	-546
KR4301P82707 2019-08 풋270							434
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-434	-434	-434	-434	-434	-434	-434
-5.33%	-277	-277	-277	-277	-277	-278	-278
-2.67%	-121	-122	-123	-125	-127	-129	-132
0%	14	9	5	0	-5	-9	-14
2.67%	78	74	71	67	63	59	55
5.33%	88	87	86	85	84	83	81
8.00%	88	88	88	88	88	87	87
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							261
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-261	-261	-261	-261	-261	-261	-261
-5.33%	-170	-170	-170	-170	-170	-170	-170
-2.67%	-79	-79	-80	-80	-81	-82	-83
0%	6	4	2	0	-2	-5	-7
2.67%	59	57	54	51	49	46	43
5.33%	73	72	71	70	69	67	66
8.00%	73	73	73	73	73	73	72

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

(단위:백만원)

3,413

공시일	2019-07-30
기준일	2019-07-29

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

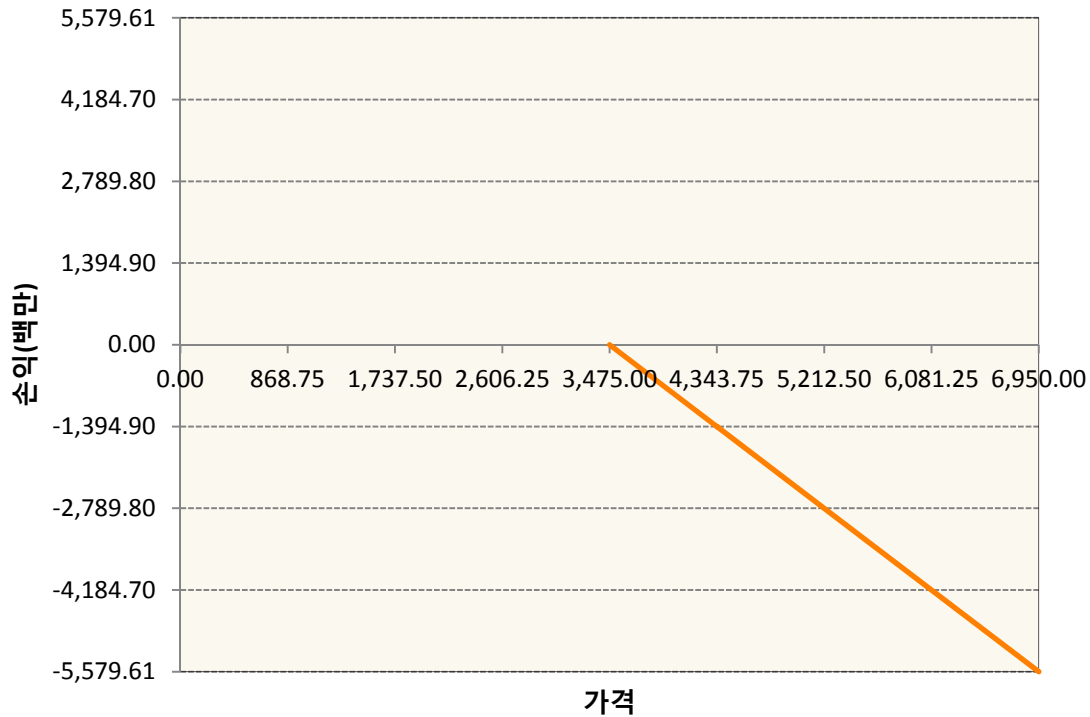
1. 계약금액

(단위:백만원)

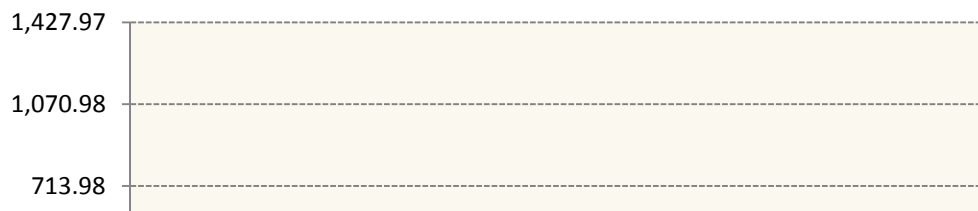
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,142	0	4,142	
누계	유가증권	스왑	37,580	0	37,580	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,015	-14,015	장내
누계	통화	선도	9,212	22,373	-13,161	장외

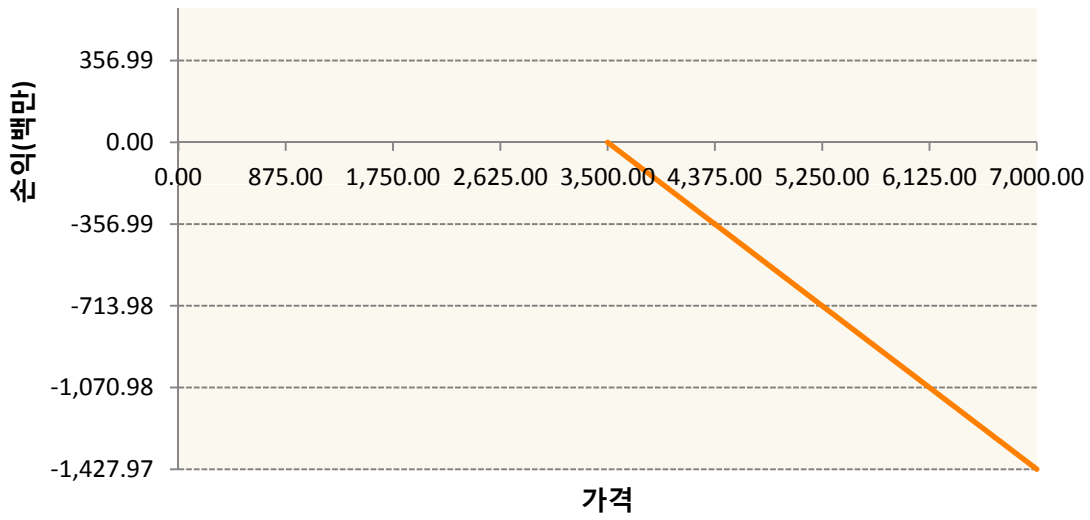
2. 만기시점의 손익구조

OESXQ9-C3475-EURO STOXX 50

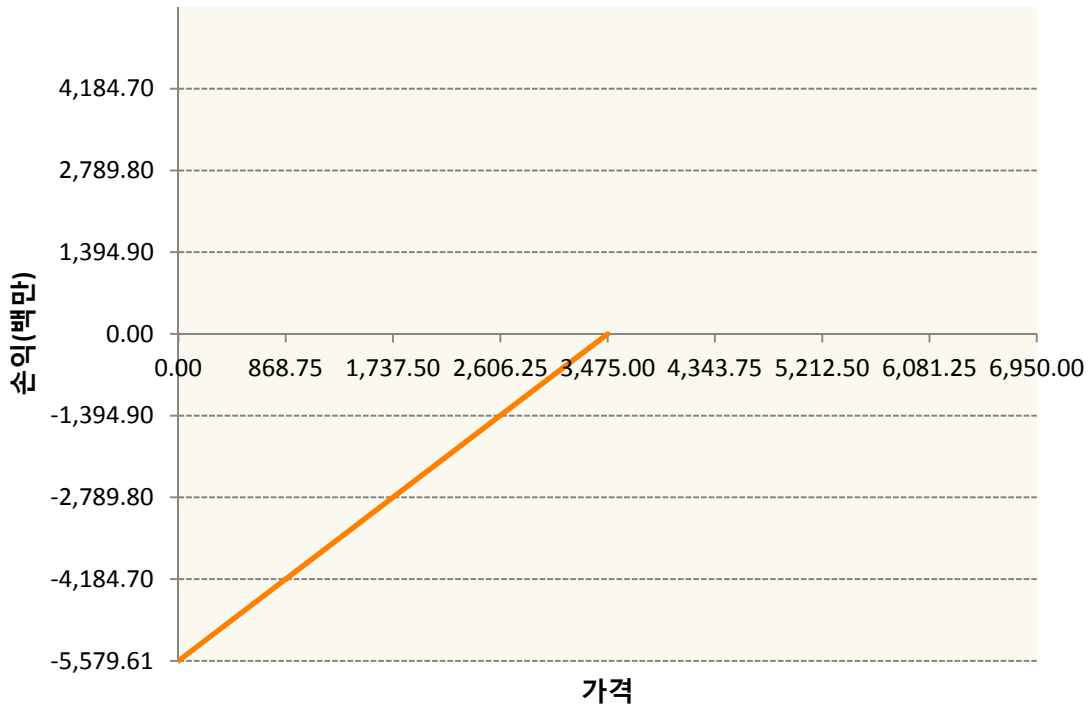


OESXQ9-C3500-EURO STOXX 50

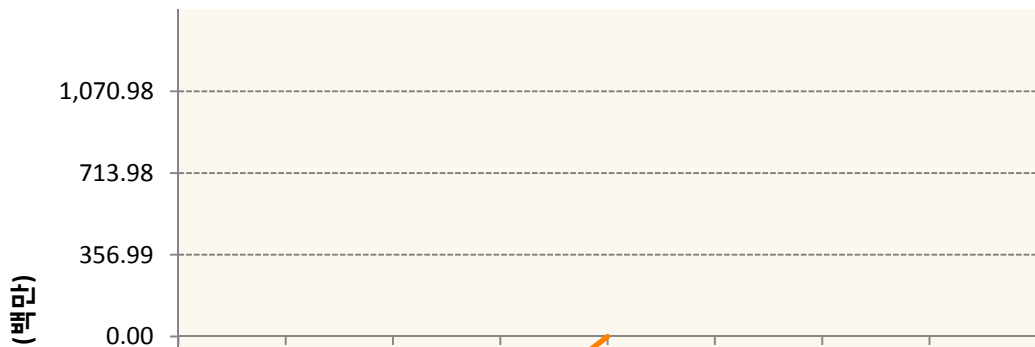


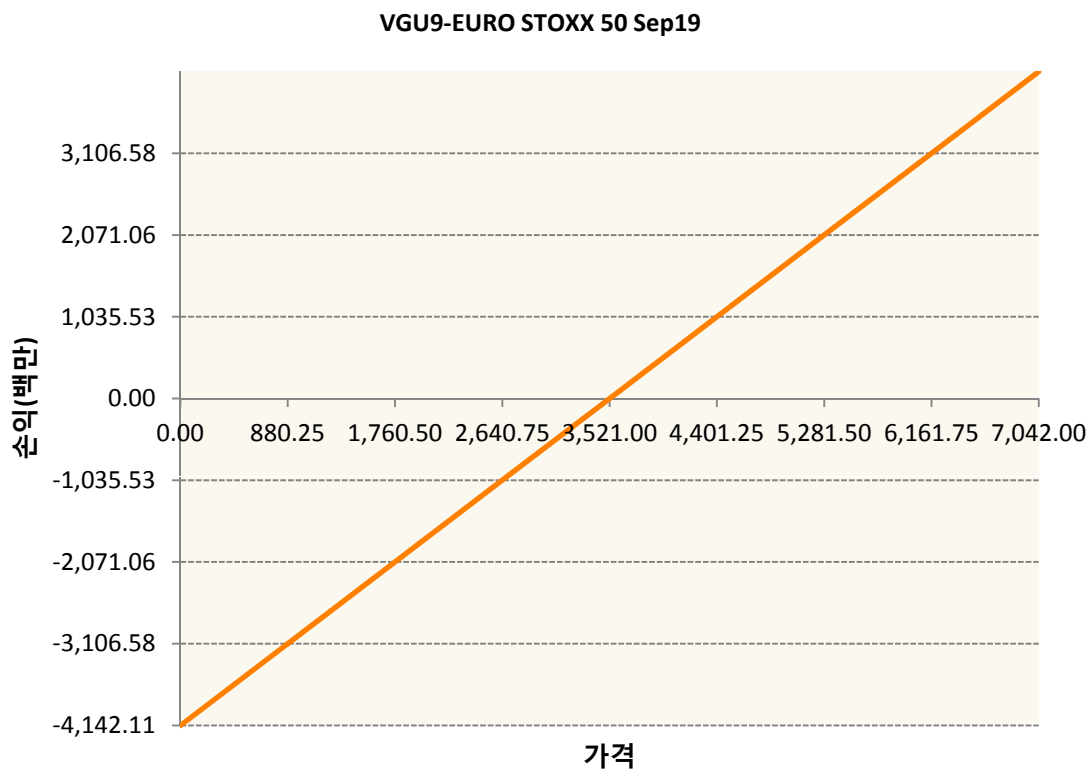
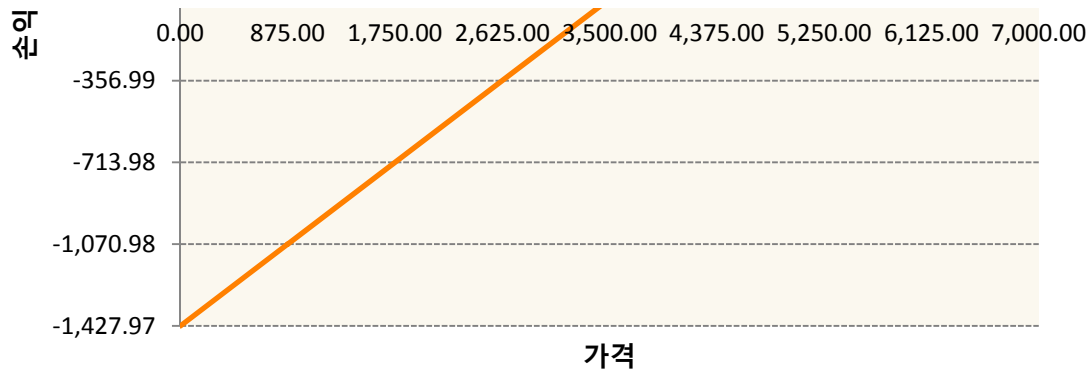


OESXQ9-P3475-EURO STOXX 50



OESXQ9-P3500-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	17
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	421
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E	1,053
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	316
FX21019N01 EUR/KRW 23-08-19E	421
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E	316
OESXQ9-C34 EURO STOXX 50	446
OESXQ9-C35 EURO STOXX 50	114
OESXQ9-P34 EURO STOXX 50	446
OESXQ9-P35 EURO STOXX 50	114
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	331

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

(단위:백만원)

2,179

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

(단위:백만원)

1,006

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

(단위:백만원)

85

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

(단위:백만원)

130

공시일	2019-07-30
기준일	2019-07-29

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

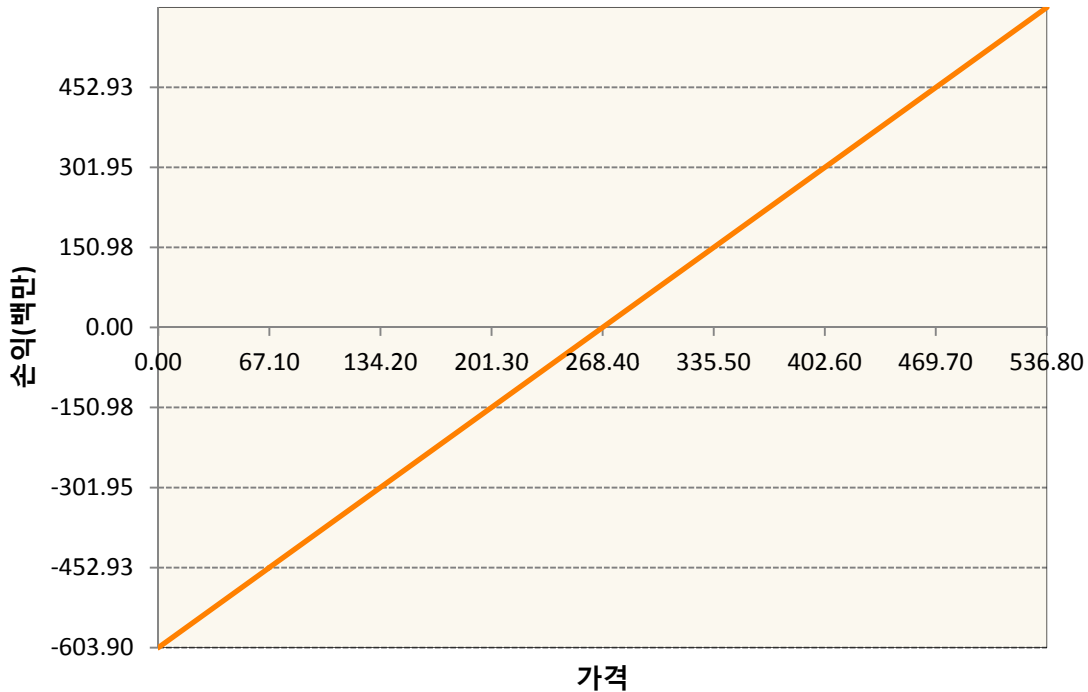
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	604	0	604	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						48
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48	
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
-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%	32	32	32	32	32	32	32	
8.00%	48	48	48	48	48	48	48	

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

(단위:백만원)

40

공시일	2019-07-30
기준일	2019-07-29

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

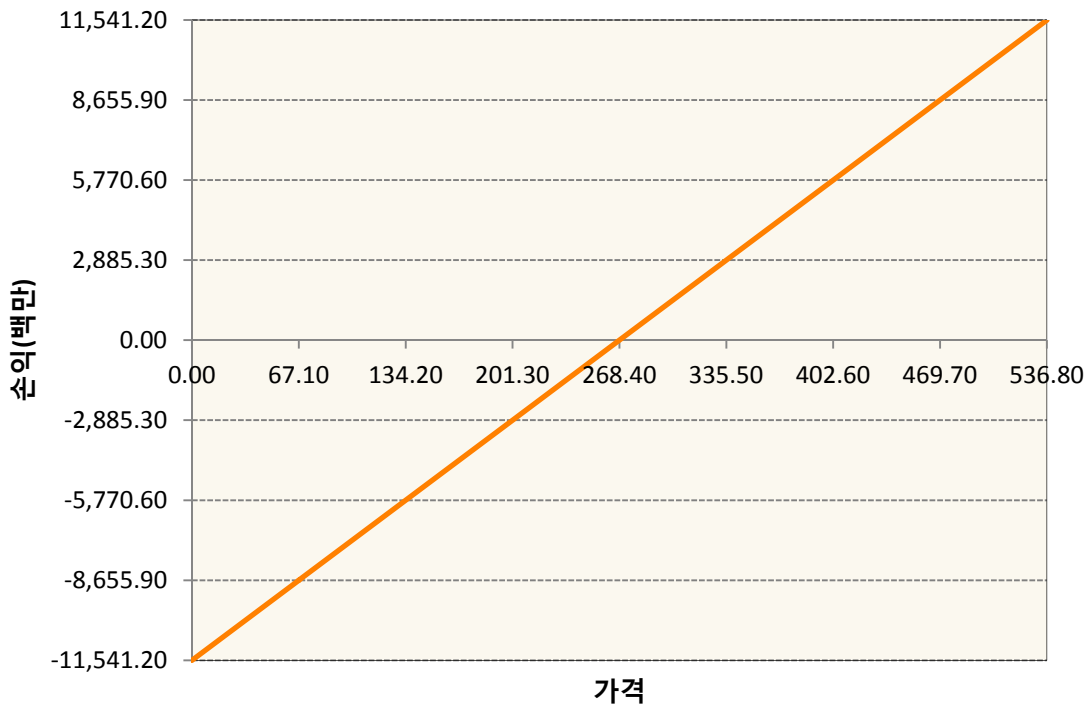
1. 계약금액

(단위:백만원)

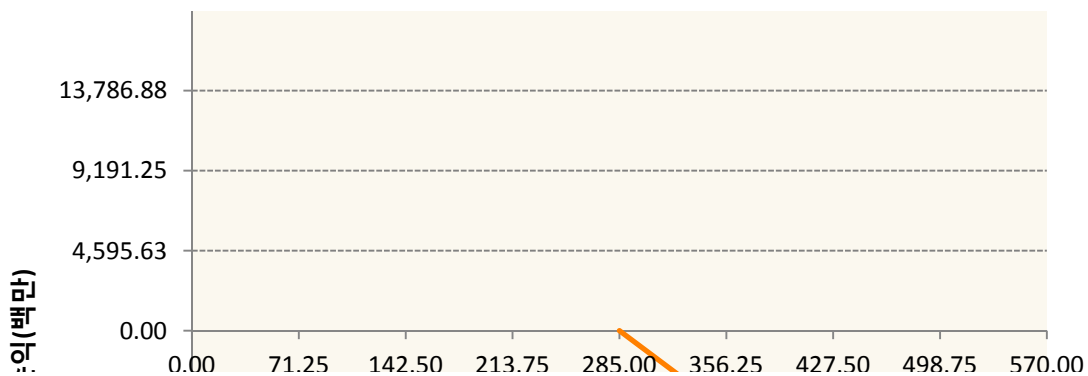
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,541	0	11,541	장내
누계	유가증권	옵션	1,698	21,617	-19,919	장내

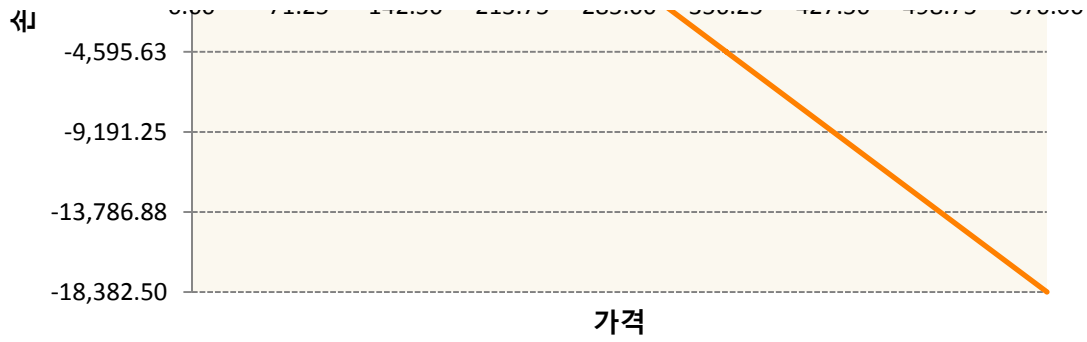
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

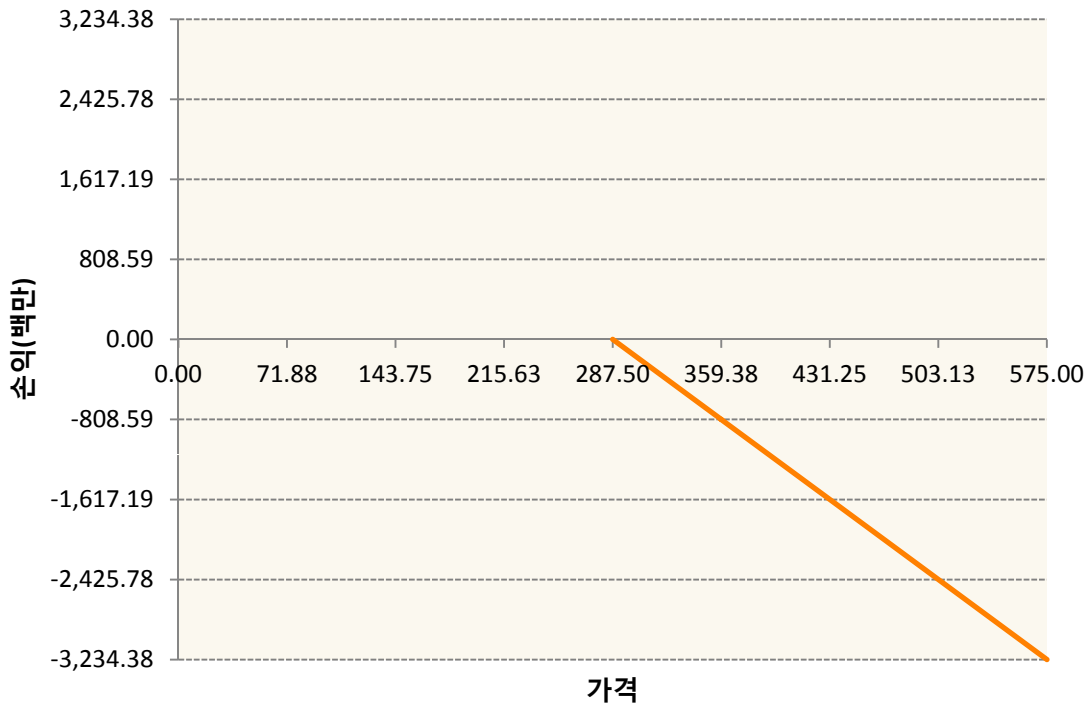


KR4201P82857-2019-08 콜285

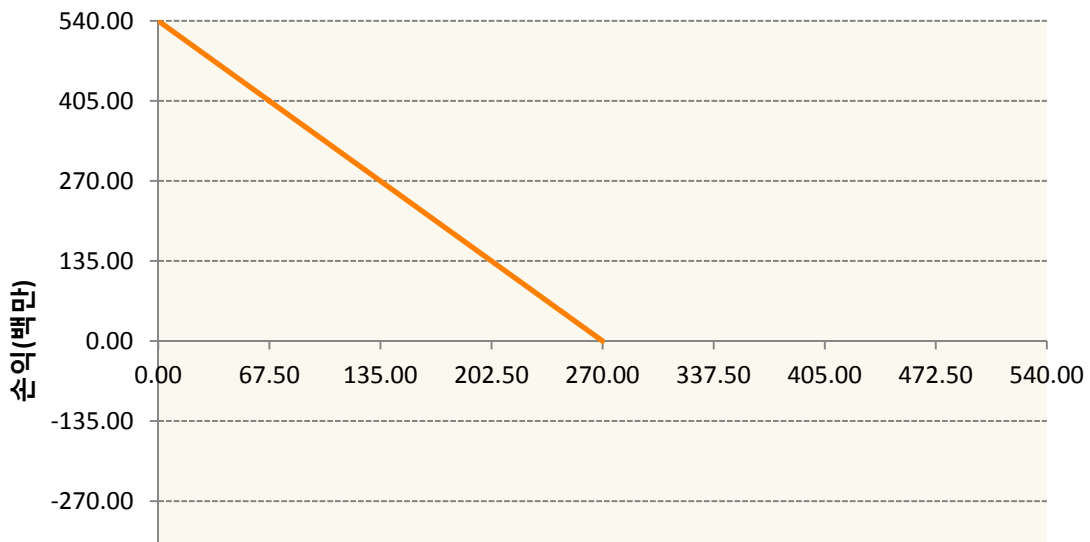


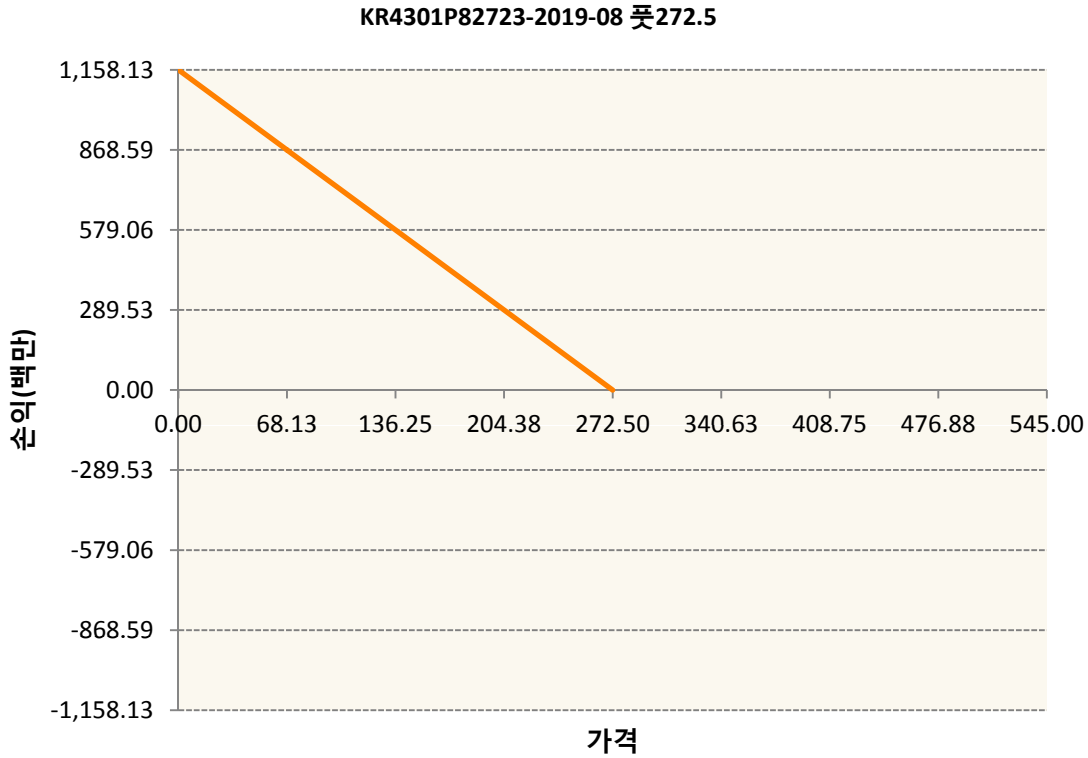
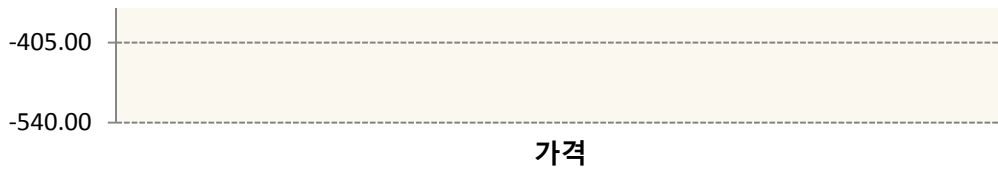


KR4201P82873-2019-08 콜287.5



KR4301P82707-2019-08 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						921
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-921	-921	-921	-921	-921	-921	-921	
-5.33%	-614	-614	-614	-614	-614	-614	-614	
-2.67%	-307	-307	-307	-307	-307	-307	-307	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	307	307	307	307	307	307	307	
5.33%	614	614	614	614	614	614	614	
8.00%	921	921	921	921	921	921	921	
KR4201P82857		2019-08 콜285						503
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	19	19	19	19	19	19	19	
-5.33%	19	19	19	19	19	18	16	
-2.67%	19	19	18	16	13	10	5	

0%	15	12	7	0	-8	-18	-28
2.67%	-12	-25	-40	-55	-72	-90	-109
5.33%	-119	-142	-166	-190	-214	-238	-262
8.00%	-362	-385	-408	-432	-455	-479	-503
KR4201P82873 2019-08 콜287.5							73
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2	2	2	2	2	2	2
-5.33%	2	2	2	2	2	2	2
-2.67%	2	2	2	2	1	1	0
0%	2	1	1	0	-1	-2	-4
2.67%	-1	-3	-4	-7	-9	-12	-15
5.33%	-13	-17	-21	-25	-29	-33	-37
8.00%	-47	-51	-56	-60	-64	-69	-73
KR4301P82707 2019-08 풋270							39
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	39	39	39	39	39	39	39
-5.33%	25	25	25	25	25	25	25
-2.67%	11	11	11	11	12	12	12
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-7	-7	-6	-6	-6	-5	-5
5.33%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-7
8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							87
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	87	87	87	87	87	87	87
-5.33%	57	57	57	57	57	57	57
-2.67%	26	26	27	27	27	27	28
0%	-2	-1	-1	0	1	2	2
2.67%	-20	-19	-18	-17	-16	-15	-14
5.33%	-24	-24	-24	-23	-23	-22	-22
8.00%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24

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

(단위:백만원)

1,190

공시일	2019-07-30
기준일	2019-07-29

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,894	0	1,894	
누계	유가증권	수익증권	47,731	0	47,731	

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	2019-07-30
기준일	2019-07-29

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,184	0	1,184	
누계	유가증권	수익증권	57,340	0	57,340	

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	2019-07-30
기준일	2019-07-29

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,551	0	3,551	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	420,300	0	420,300	
누계	통화	선도	0	474,607	-474,607	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E	1,307
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E	2,568
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E	3,124
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E	2,121
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E	1,704
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E	2,083
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E	133
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	568
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	3,030
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	3,314
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	473
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E	947
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E	2,945
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E	1,647
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E	757
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E	1,894
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E	1,894
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	284
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	95
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	701
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	701
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	284
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	663
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E	2,651
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E	1,326
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E	757

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

(단위:백만원)

12,353

공시일	2019-07-30
기준일	2019-07-29

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

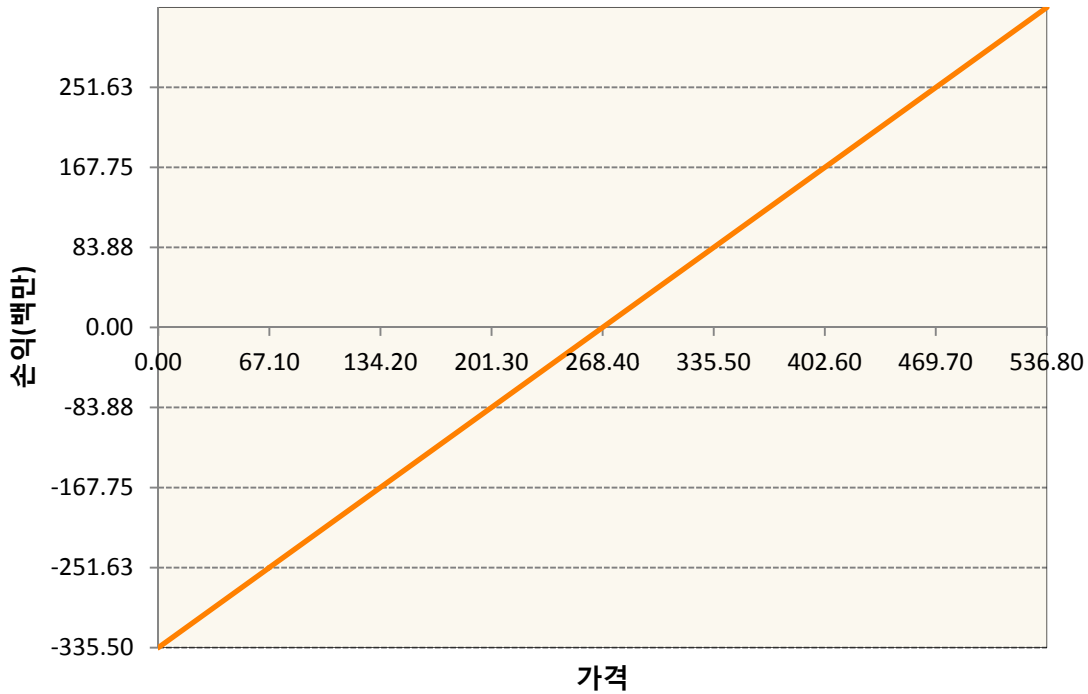
1. 계약금액

(단위:백만원)

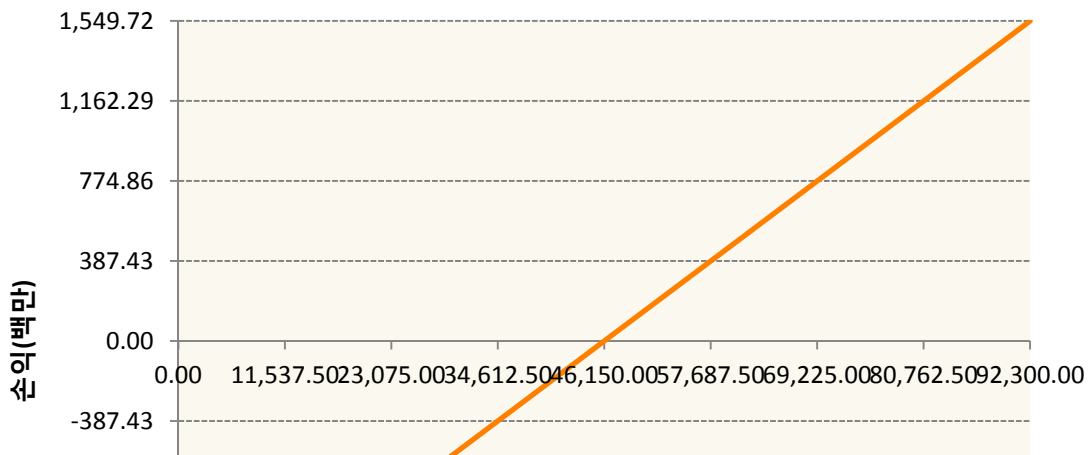
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,885	0	1,885	장내

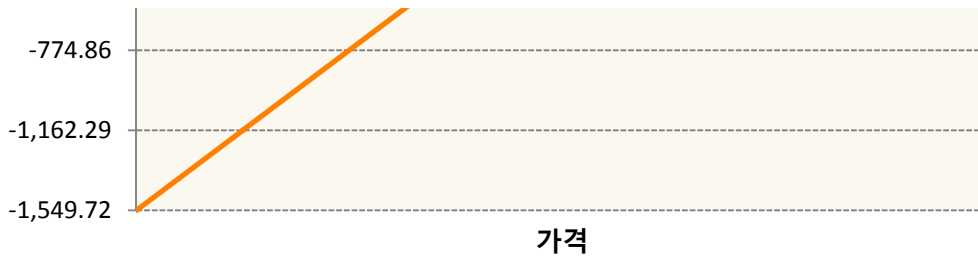
2. 만기시점의 손익구조

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)

177

공시일	2019-07-30
기준일	2019-07-29

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

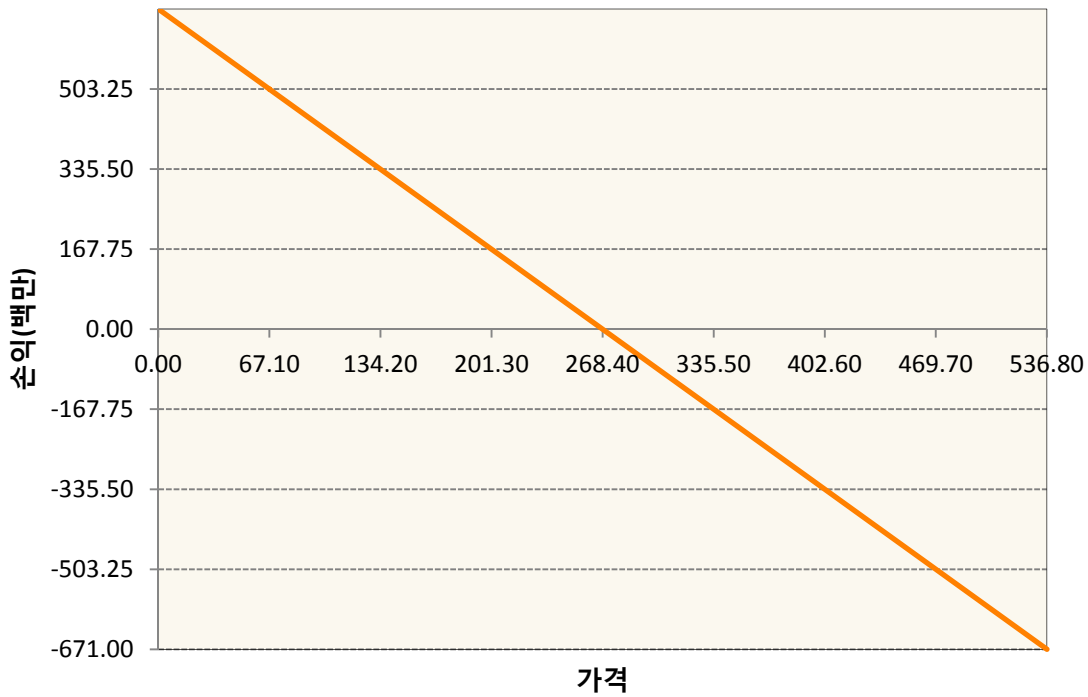
1. 계약금액

(단위:백만원)

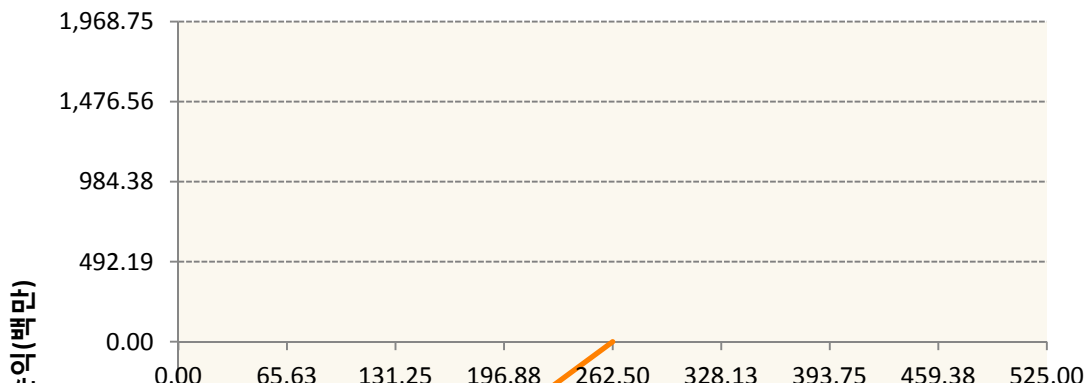
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	671	-671	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,625	-3,625	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

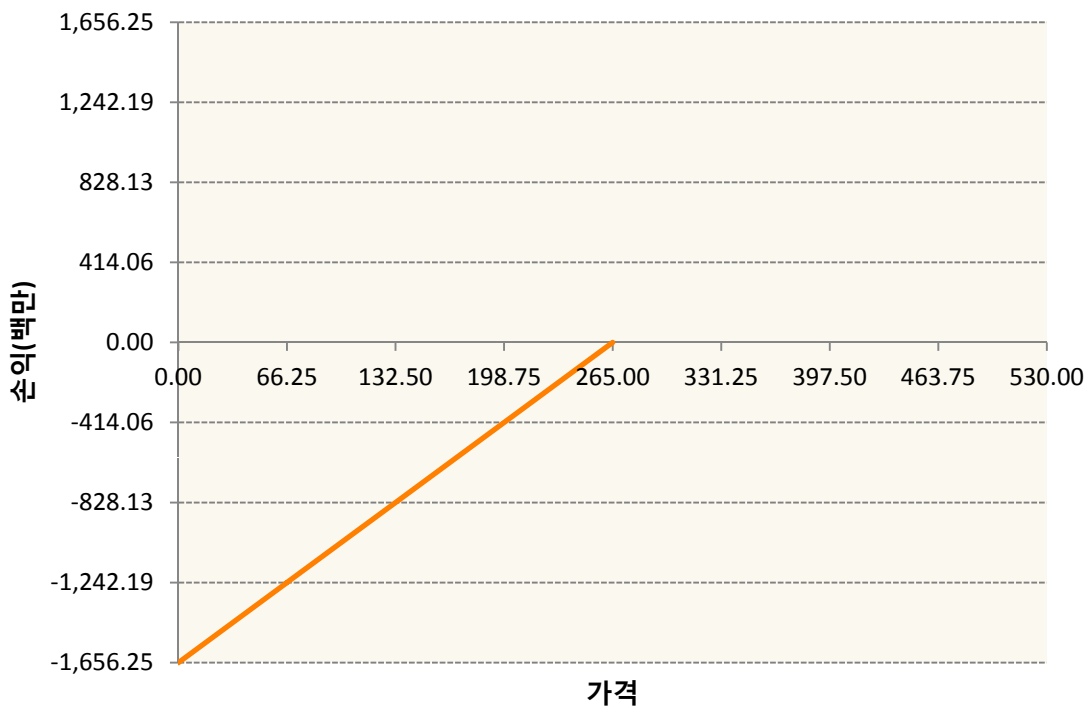


KR4301P82624-2019-08 풋262.5





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						116
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-115	-115	-116	-116	-116	-116	-116
-5.33%	-62	-63	-63	-64	-64	-65	-66
-2.67%	-17	-18	-20	-22	-23	-25	-26
0%	3	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	6	6	6	6	5	5	4
5.33%	6	6	6	6	6	6	6
8.00%	6	6	6	6	6	6	6

KR4301P82657

2019-08 풋265

108

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-107	-107	-107	-107	-107	-108	-108
-5.33%	-63	-63	-63	-63	-64	-64	-65
-2.67%	-21	-22	-23	-24	-25	-27	-28
0%	4	3	1	0	-1	-3	-4
2.67%	9	9	9	8	8	7	6
5.33%	10	10	10	9	9	9	9
8.00%	10	10	10	10	10	10	10

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

(단위:백만원)

280

공시일	2019-07-30
기준일	2019-07-29

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	18,702	0	18,702	
누계	통화	선도	0	18,344	-18,344	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		985
FX21019N01 KRW/USD 12-08-19E		161
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		322

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

(단위:백만원)

477

공시일	2019-07-30
기준일	2019-07-29

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	375	0	375	장외
누계	통화	선도	0	49	-49	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	30
FX21019N01 KRW/EUR 25-10-19E	4

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

(단위:백만원)

30

공시일	2019-07-30
기준일	2019-07-29

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

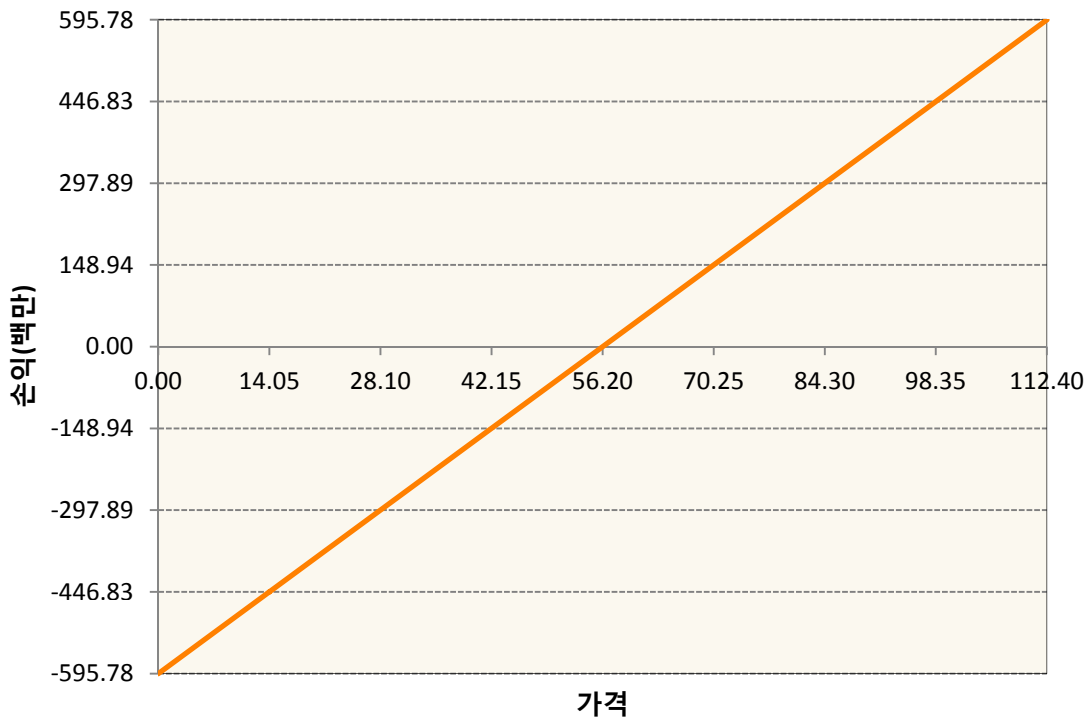
1. 계약금액

(단위:백만원)

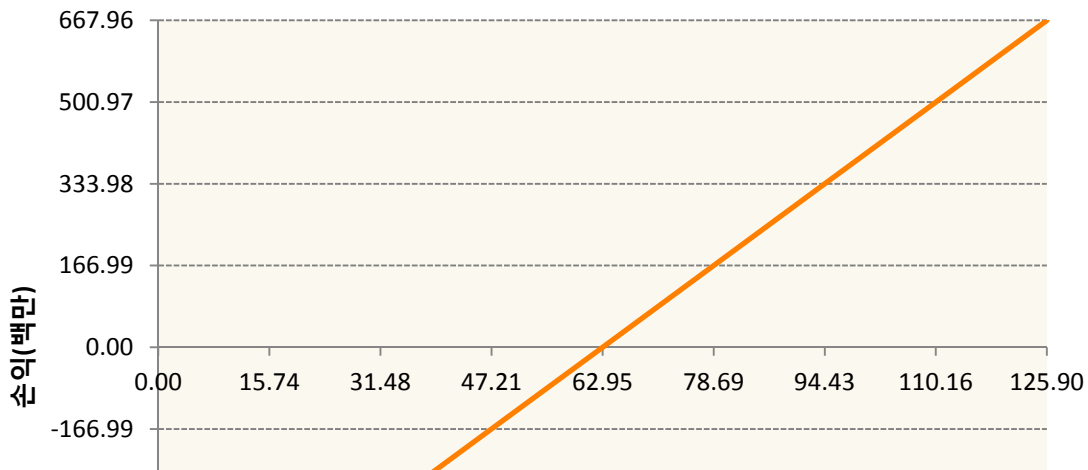
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,509	118	2,390	

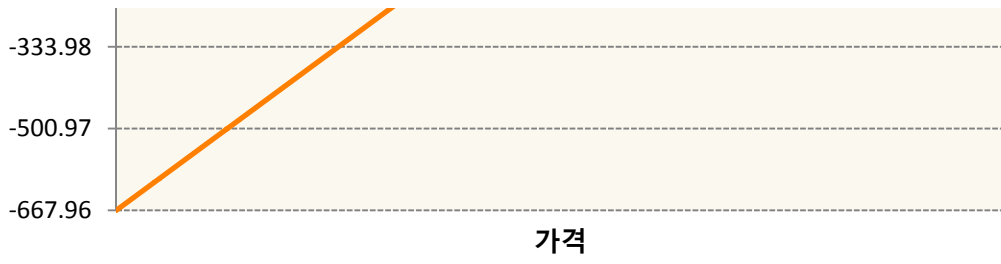
2. 만기시점의 손익구조

CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19

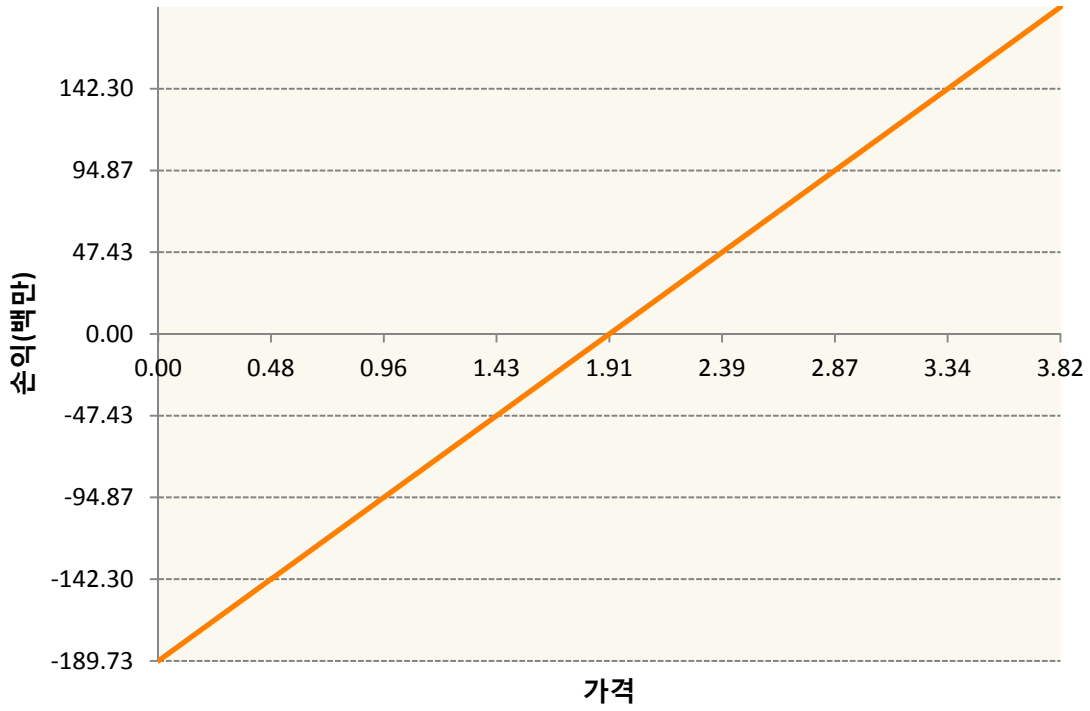


COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19

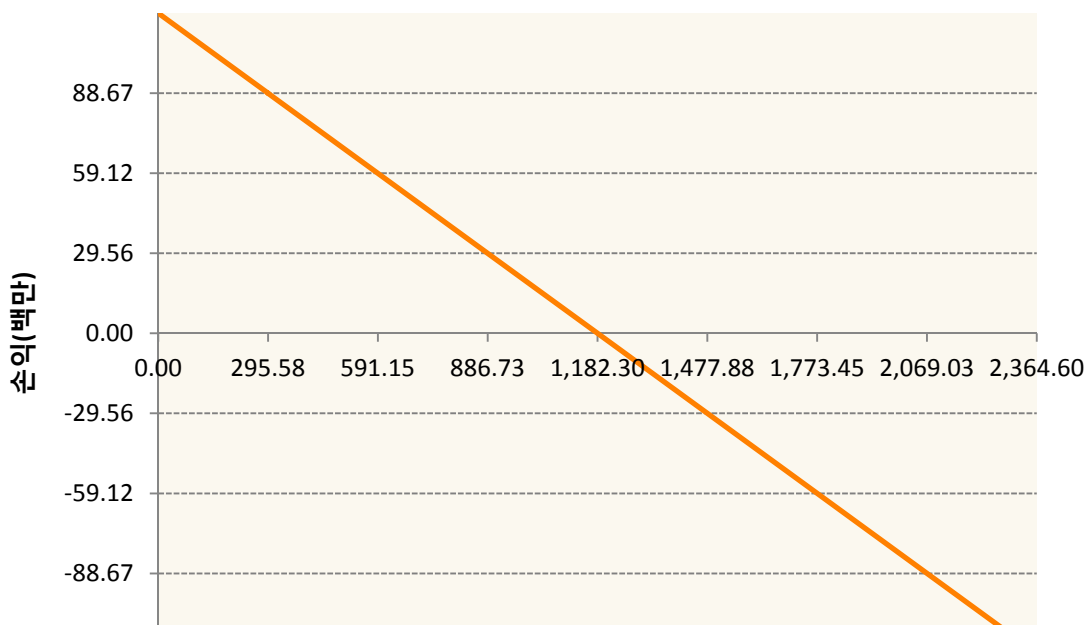


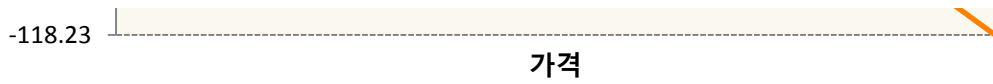


HOU9-NY Harb ULSD Fut Sep19

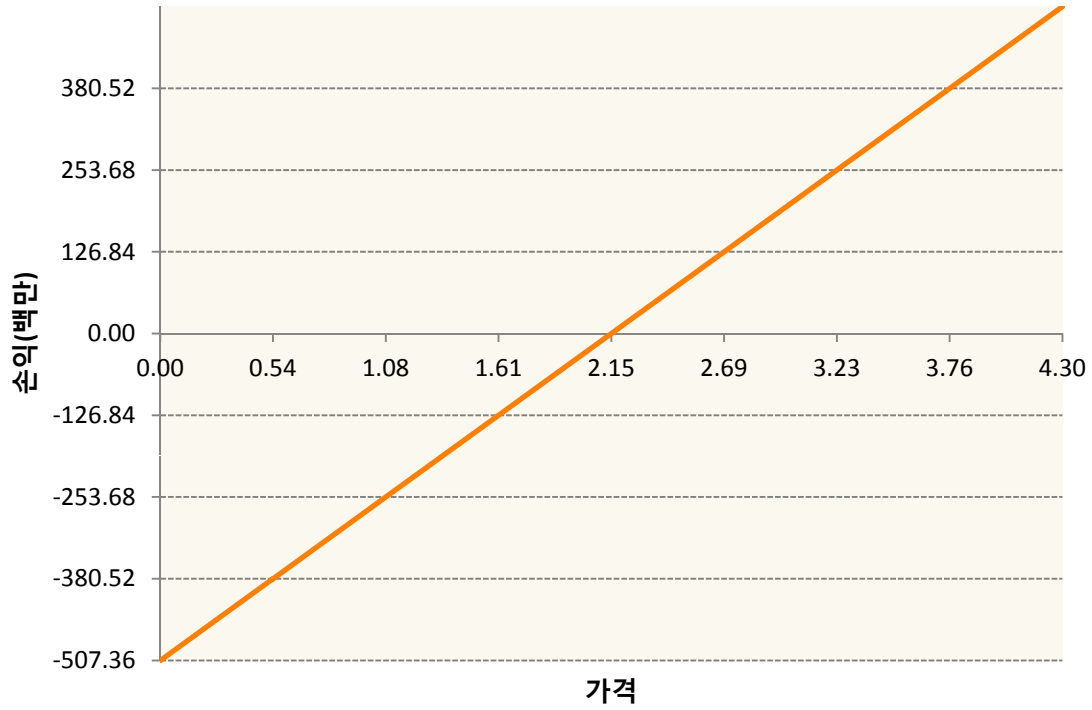


KR4175P80006-2019-08 달러선물

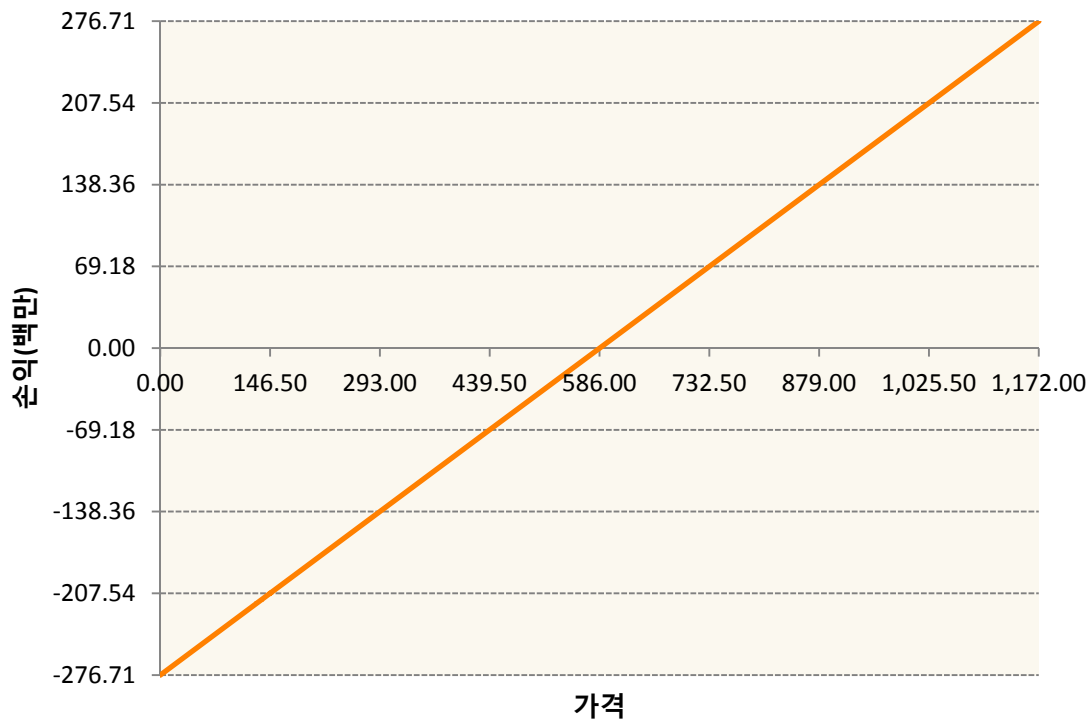




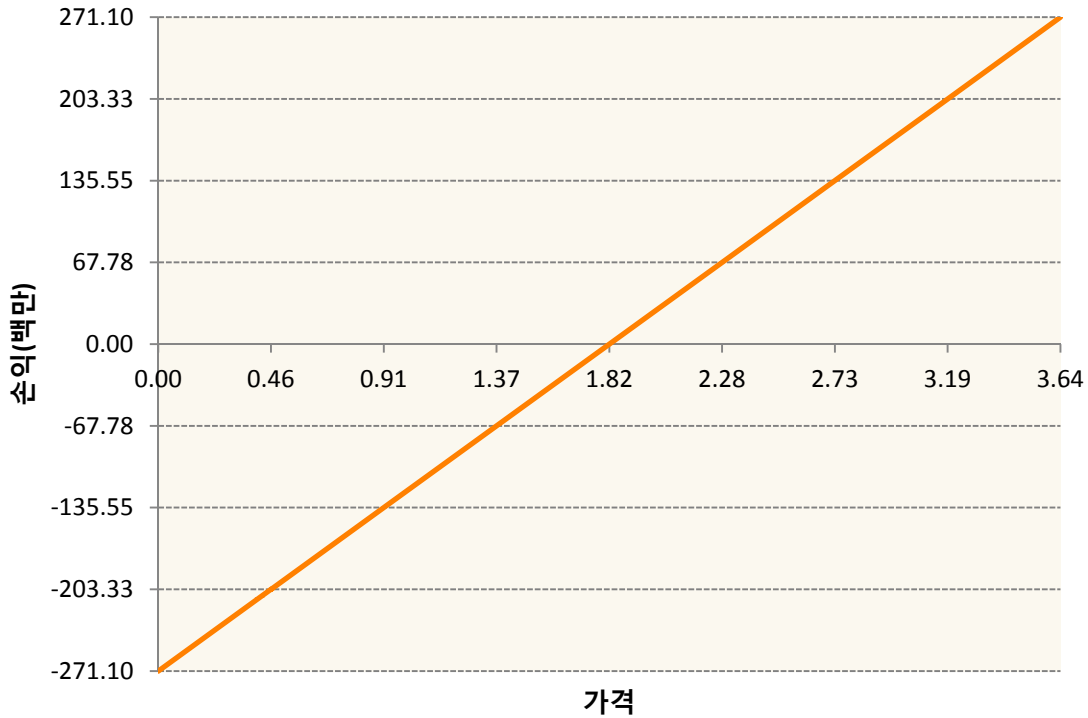
NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



QSU9-Low Su Gasoil G Sep19



XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	48
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	53
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	15
KR4175P800	2019-08 달러선물	9
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	41
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	22
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	22

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

364

공시일	2019-07-30
기준일	2019-07-29

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

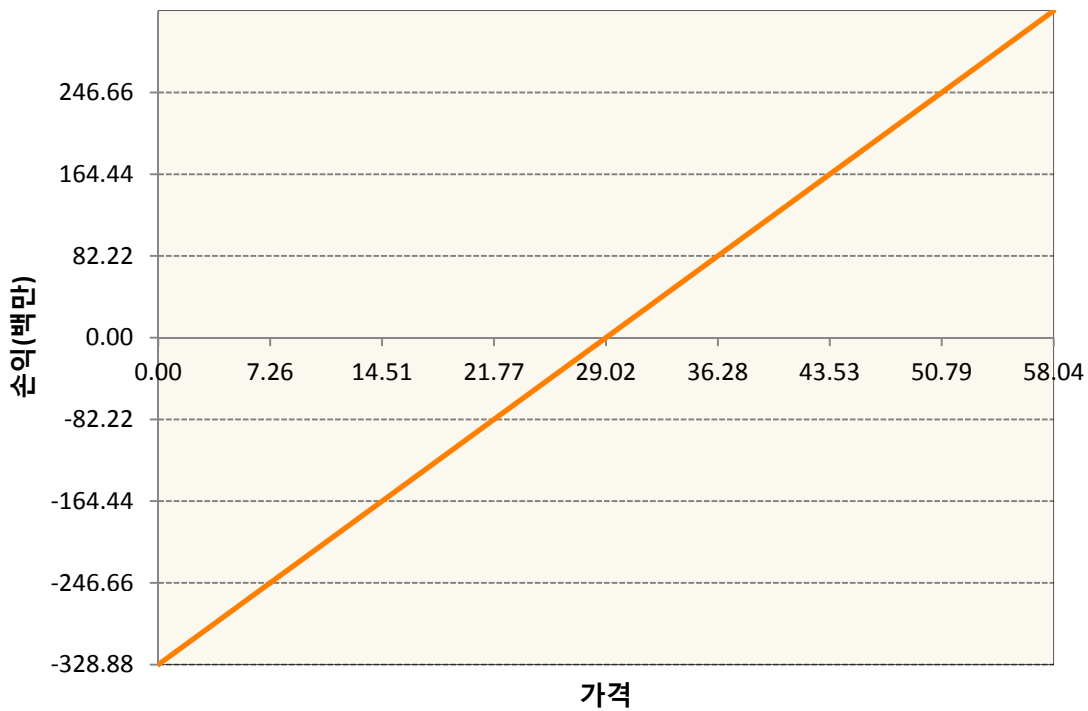
1. 계약금액

(단위:백만원)

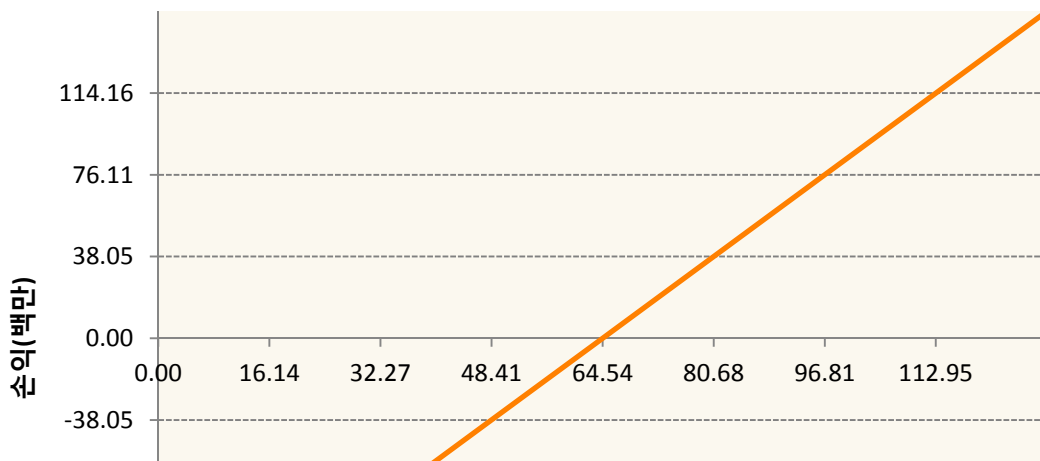
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,971	201	2,770	

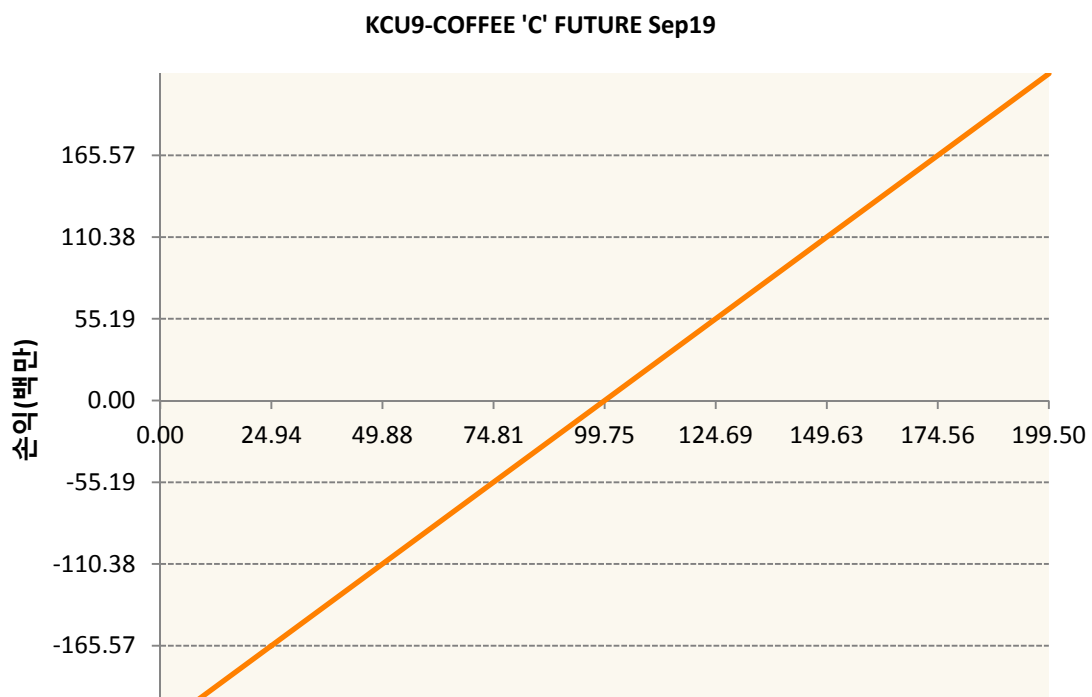
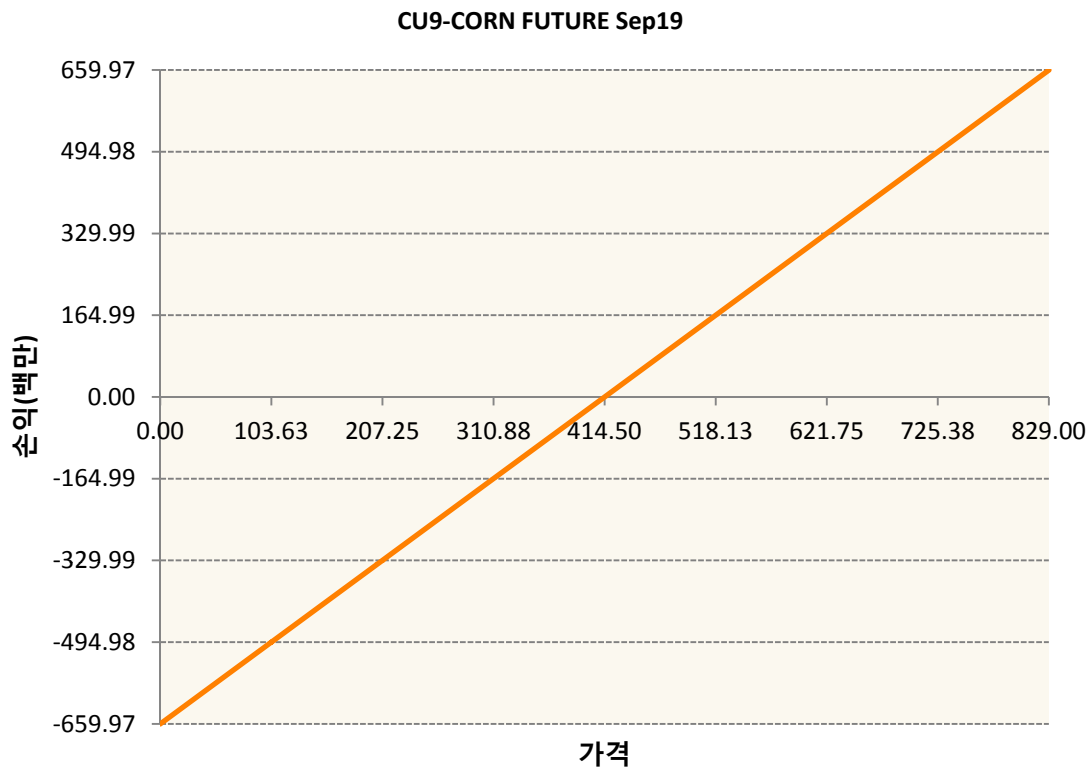
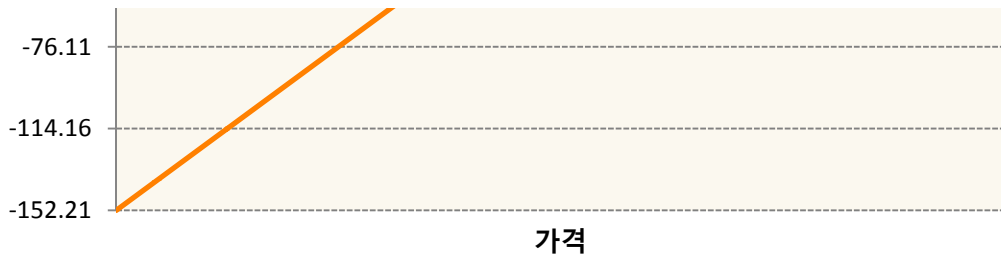
2. 만기시점의 손익구조

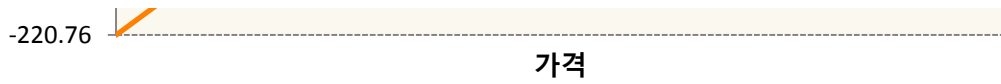
BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19



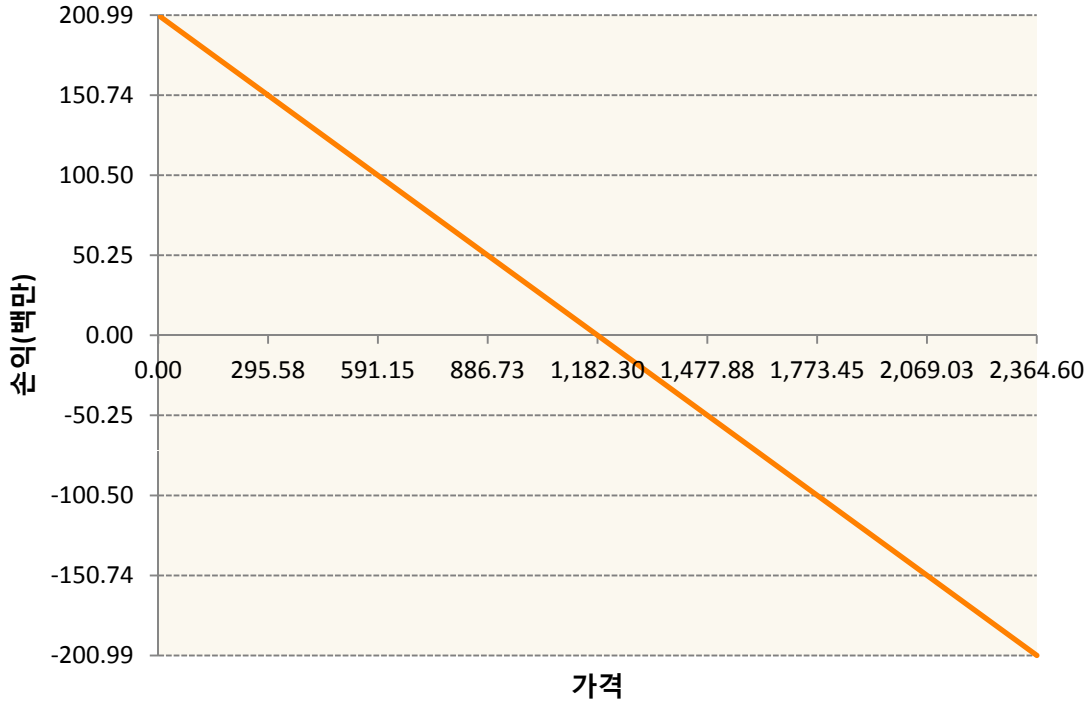
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



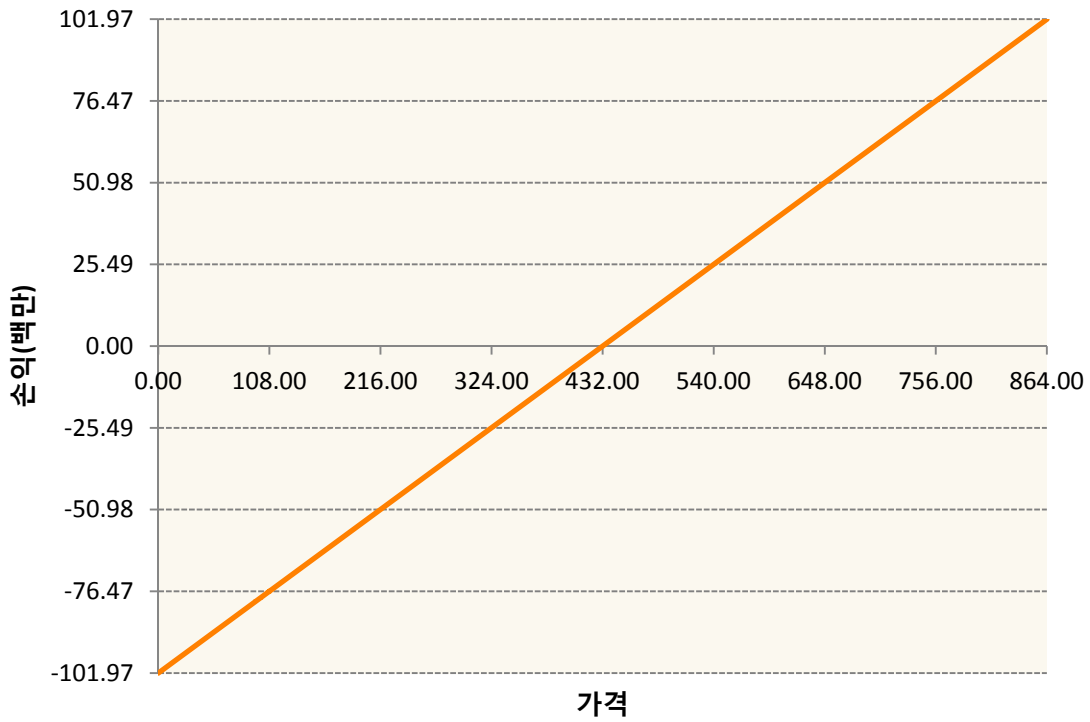




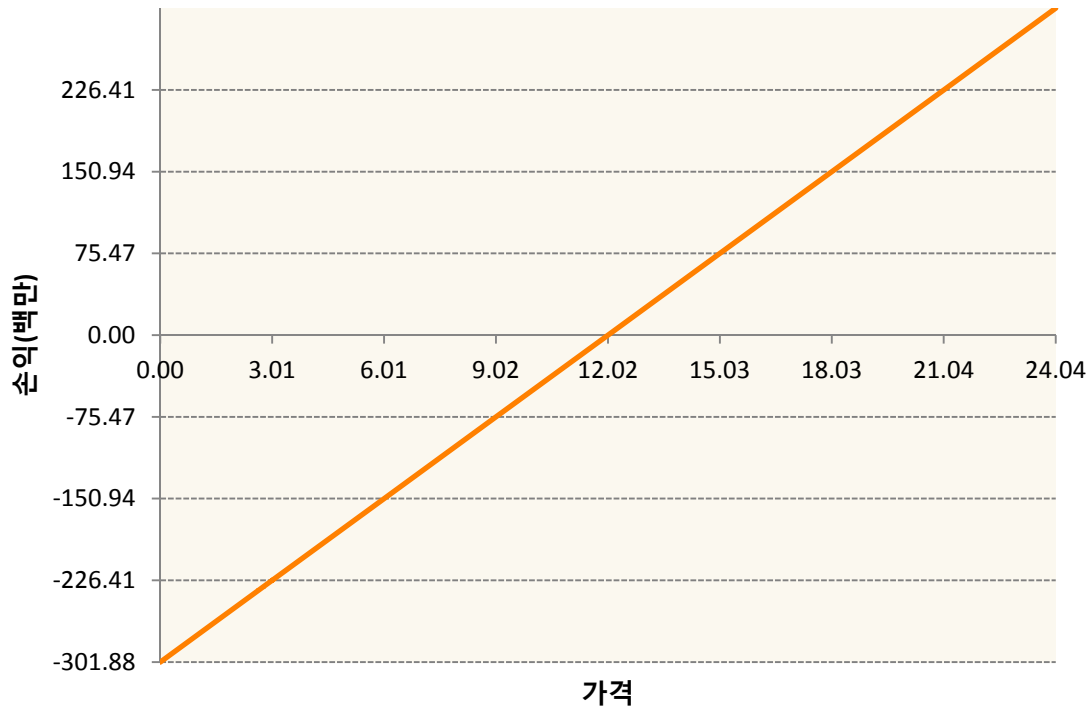
KR4175P80006-2019-08 달러선물



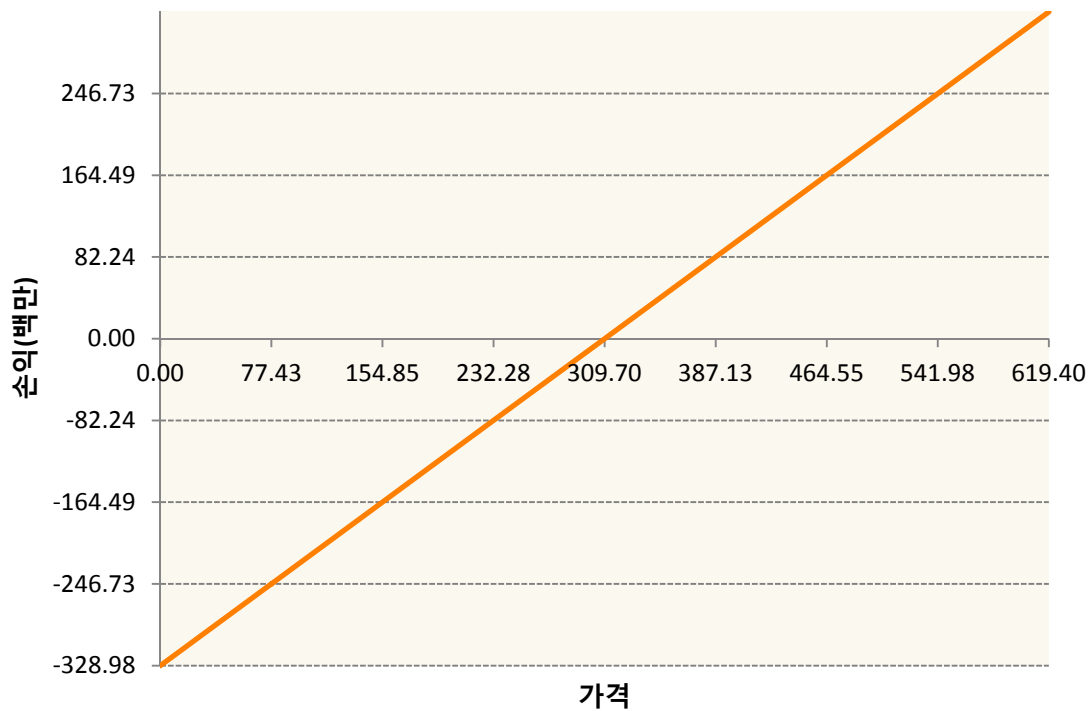
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

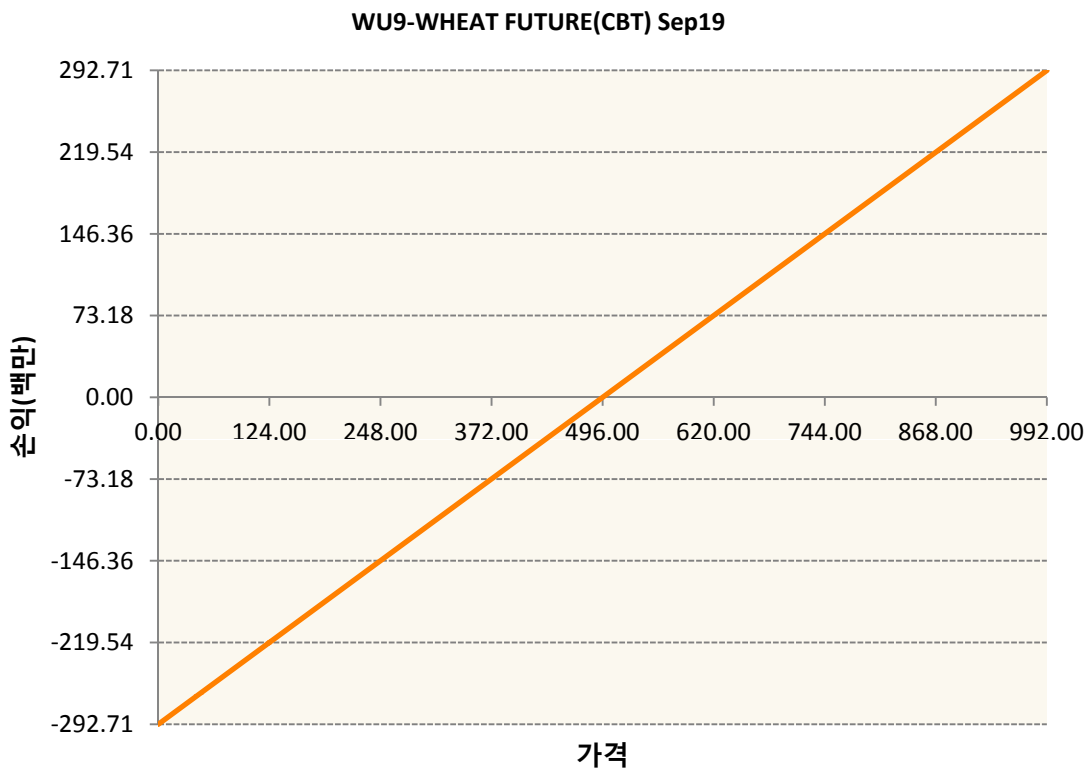
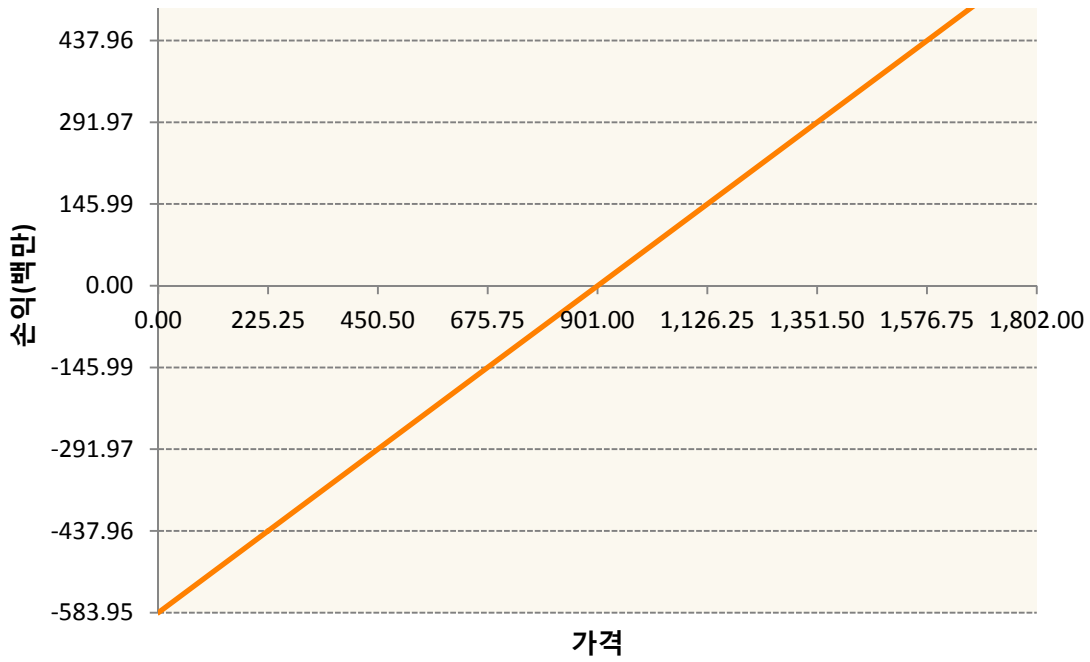


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



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	53
KCU9	COFFEE 'C' FUTURE Sep19	18
KR4175P800	2019-08 달러선물	16

KWU9	KC HRW WHEAT FUT Sep19	8
SBV9	SUGAR #11 (WORLD) Oct19	24
SMZ9	SOYBEAN MEAL FUTR Dec19	26
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	47
WU9	WHEAT FUTURE(CBT) Sep19	23

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

(단위:백만원)

261