

공시일	2019-07-31
기준일	2019-07-30

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	2019-07-31
기준일	2019-07-30

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

1,183

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

665

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-31
기준일	2019-07-30

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)

848

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-31
기준일	2019-07-30

유로인덱스모(주식-파생형)

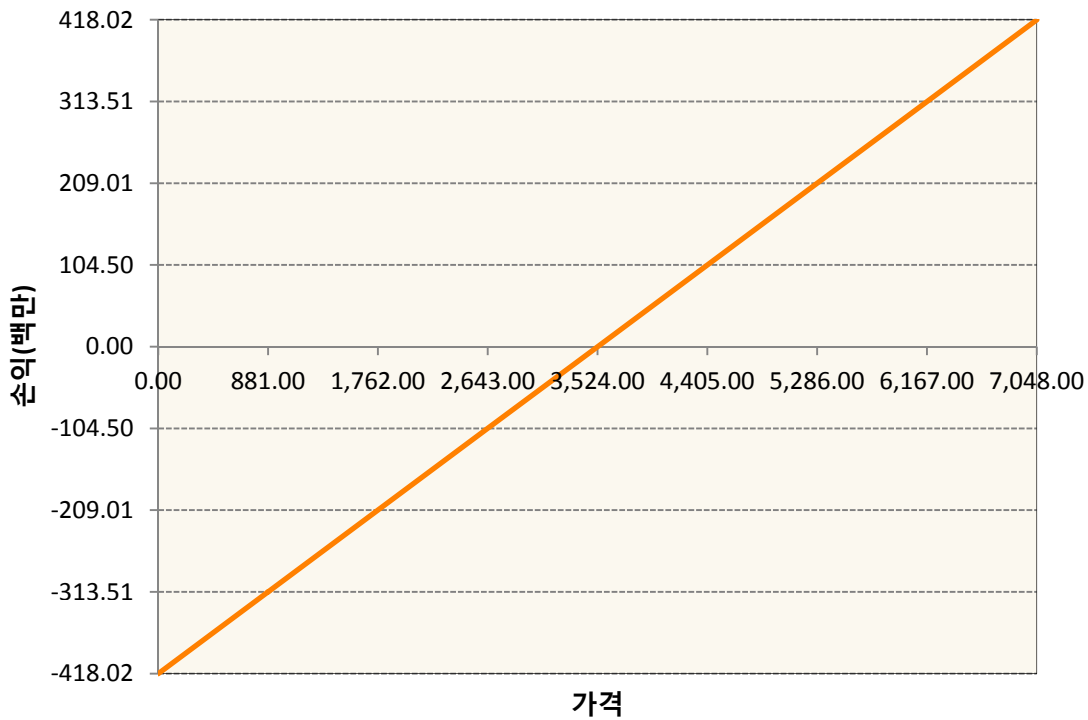
1. 계약금액

(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	2019-07-31
기준일	2019-07-30

차이나인덱스모(주식-파생형)

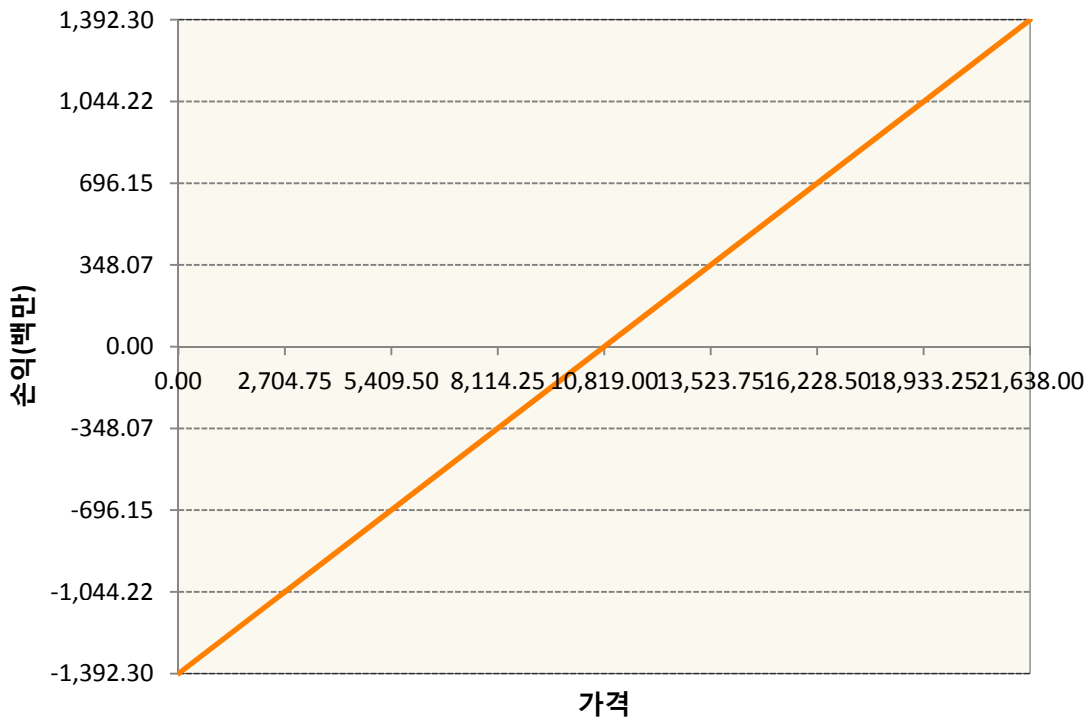
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,392	0	1,392	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)

109

공시일	2019-07-31
기준일	2019-07-30

커버드콜모(주식혼합-파생형)

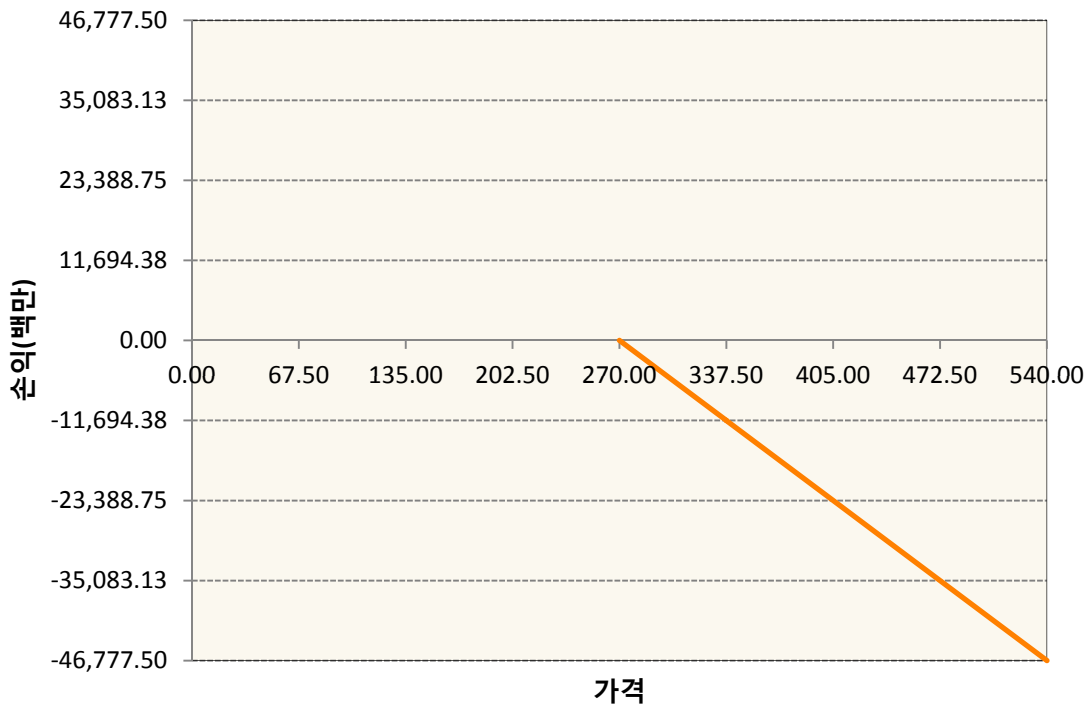
1. 계약금액

(단위:백만원)

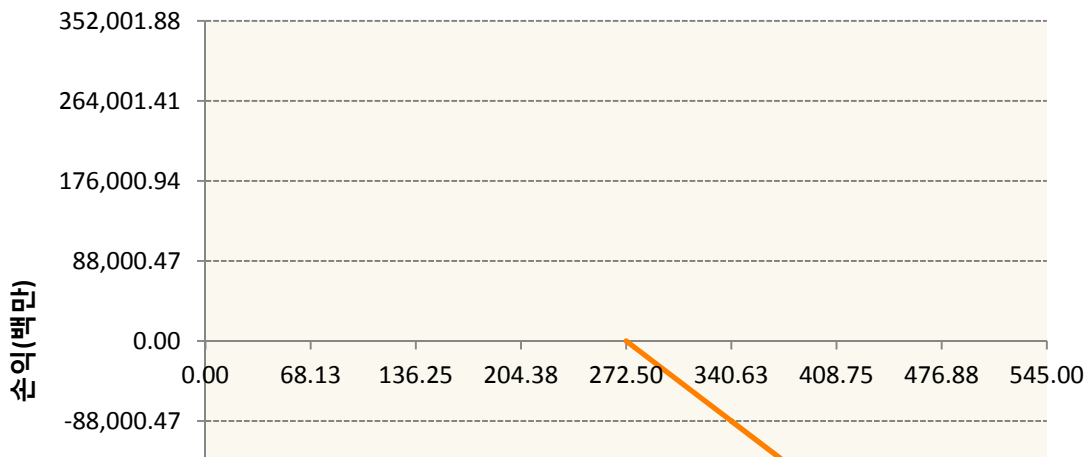
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	583,667	-583,667	장내

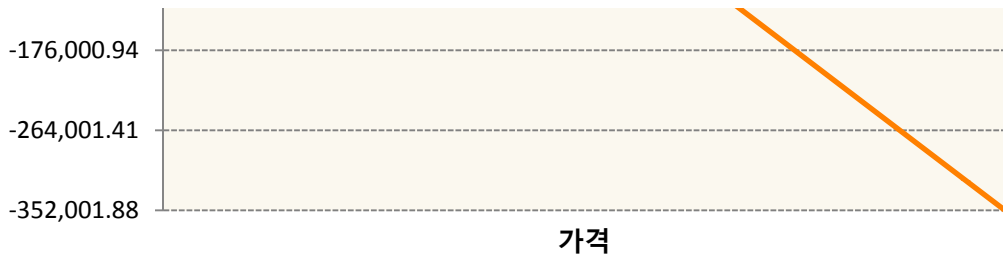
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P82709-2019-08 콜270

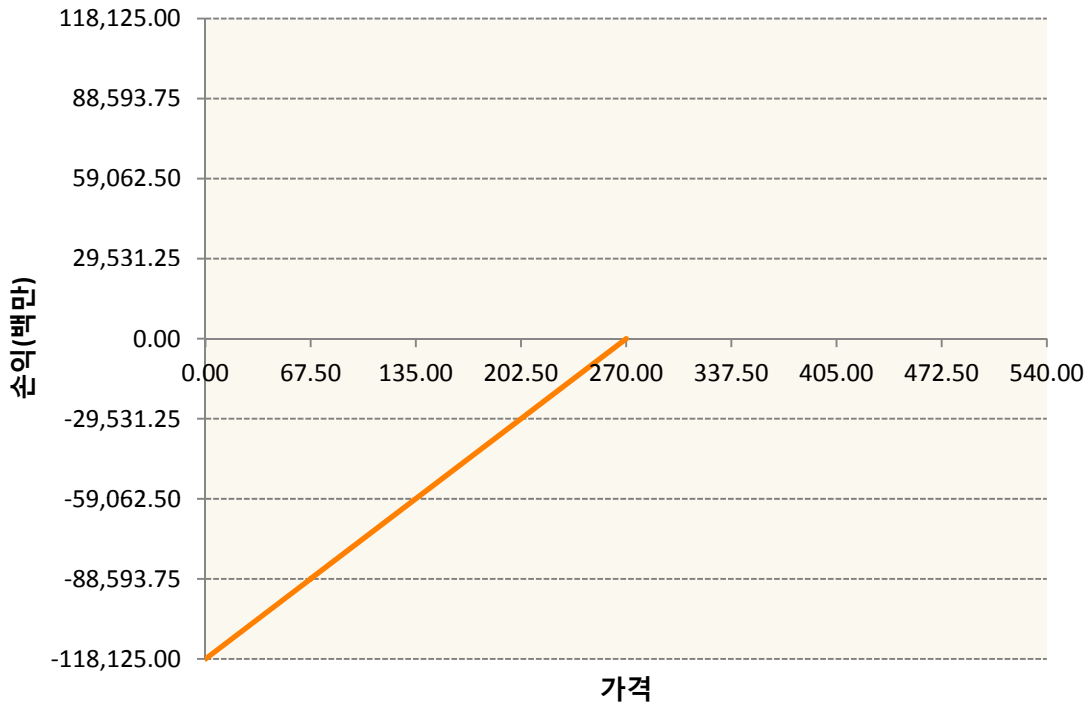


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

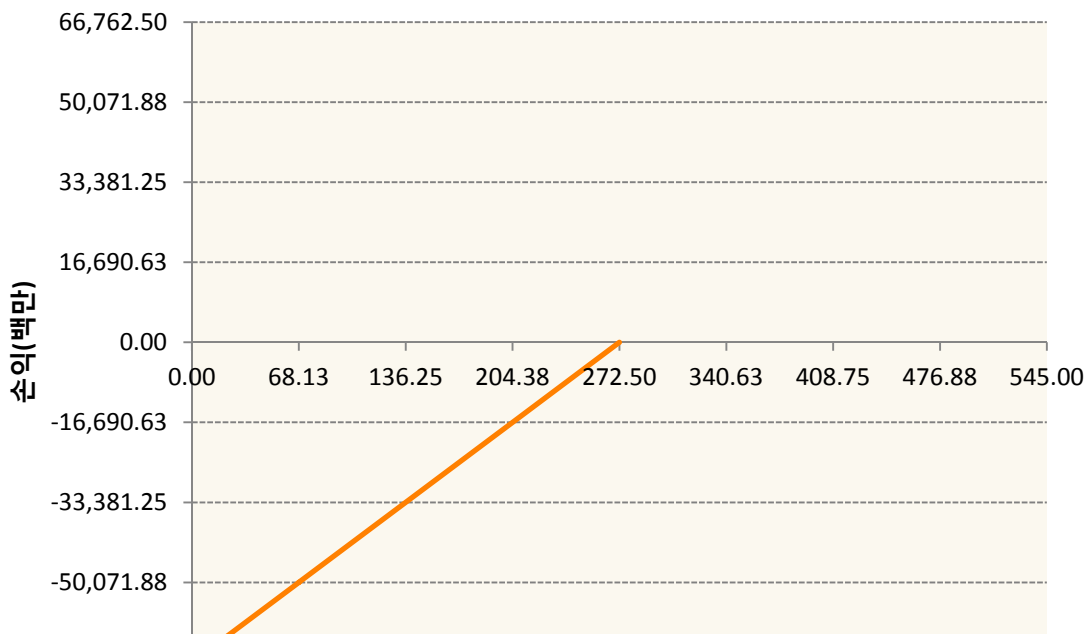




KR4301P82707-2019-08 풋270



KR4301P82723-2019-08 풋272.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P82709 2019-08 콜270							2,971
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	631	630	628	624	619	611	601
-5.33%	621	612	599	582	562	538	511
-2.67%	534	498	459	417	373	327	279
0%	180	120	60	0	-60	-120	-180
2.67%	-595	-642	-692	-743	-795	-849	-904
5.33%	-1,689	-1,708	-1,731	-1,758	-1,789	-1,823	-1,859
8.00%	-2,904	-2,908	-2,915	-2,924	-2,936	-2,952	-2,971
KR4201P82725 2019-08 콜272.5							20,497
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,406	3,403	3,395	3,380	3,355	3,317	3,265
-5.33%	3,375	3,337	3,277	3,195	3,088	2,957	2,804
-2.67%	3,025	2,837	2,617	2,369	2,098	1,807	1,498
0%	1,253	842	424	0	-428	-859	-1,293
2.67%	-3,414	-3,832	-4,258	-4,689	-5,124	-5,562	-6,002
5.33%	-10,902	-11,112	-11,356	-11,627	-11,921	-12,235	-12,565
8.00%	-19,763	-19,819	-19,901	-20,010	-20,147	-20,310	-20,497
KR4301P82707 2019-08 풋270							8,468
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,466	-8,466	-8,466	-8,466	-8,466	-8,467	-8,468
-5.33%	-5,330	-5,331	-5,334	-5,338	-5,346	-5,356	-5,370
-2.67%	-2,236	-2,264	-2,298	-2,339	-2,386	-2,438	-2,494
0%	287	192	96	0	-96	-193	-289
2.67%	1,300	1,248	1,190	1,126	1,057	985	910
5.33%	1,424	1,419	1,410	1,397	1,378	1,355	1,327
8.00%	1,428	1,428	1,427	1,426	1,424	1,421	1,416
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							4,961
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,961	-4,961	-4,961	-4,961	-4,961	-4,961	-4,961
-5.33%	-3,204	-3,205	-3,205	-3,206	-3,208	-3,210	-3,214
-2.67%	-1,455	-1,461	-1,471	-1,484	-1,500	-1,519	-1,541
0%	136	92	47	0	-48	-97	-147
2.67%	1,012	967	921	873	824	774	724

5.33%	1,183	1,175	1,163	1,148	1,130	1,108	1,084
8.00%	1,192	1,192	1,191	1,189	1,187	1,182	1,176

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

(단위:백만원)

40,928

공시일	2019-07-31
기준일	2019-07-30

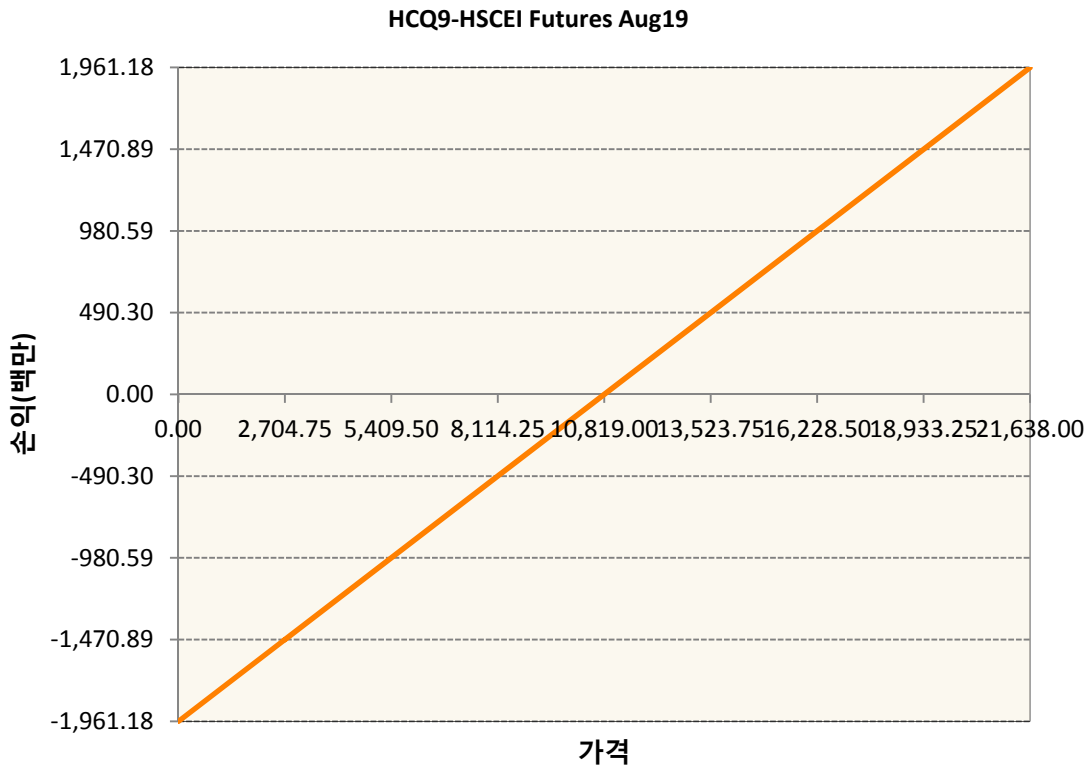
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,961	0	1,961	장내
누계	통화	선도	151	3,172	-3,021	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	254
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E	12
HCQ9 HSCEI Futures Aug19	157

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

(단위:백만원)

239

공시일	2019-07-31
기준일	2019-07-30

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

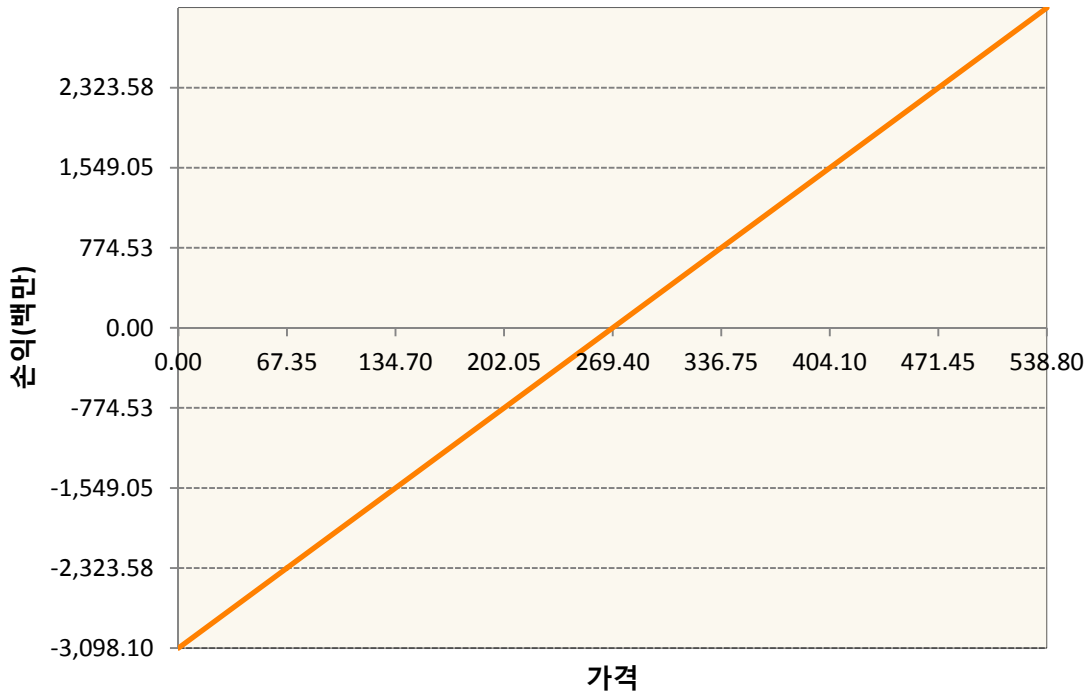
1. 계약금액

(단위:백만원)

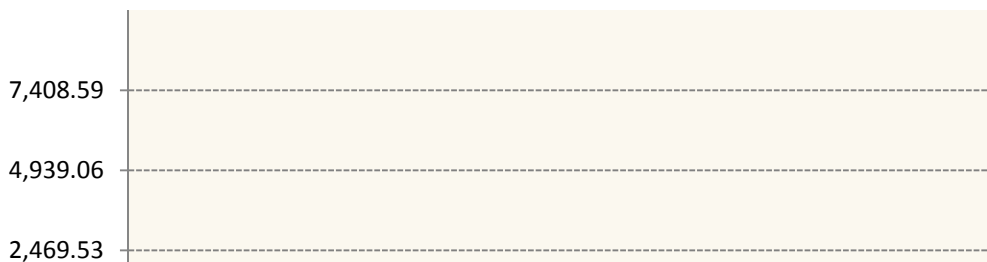
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	2,000	-2,000	장외
신규	유가증권	옵션	67	0	67	장내
누계	유가증권	선물	3,098	0	3,098	장내
누계	유가증권	스왑	18,836	0	18,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	19,225	-19,225	장내

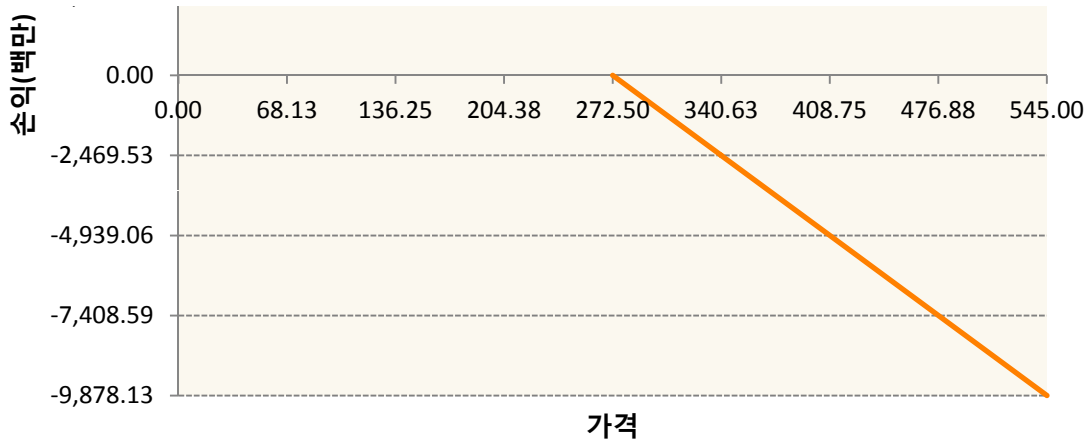
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

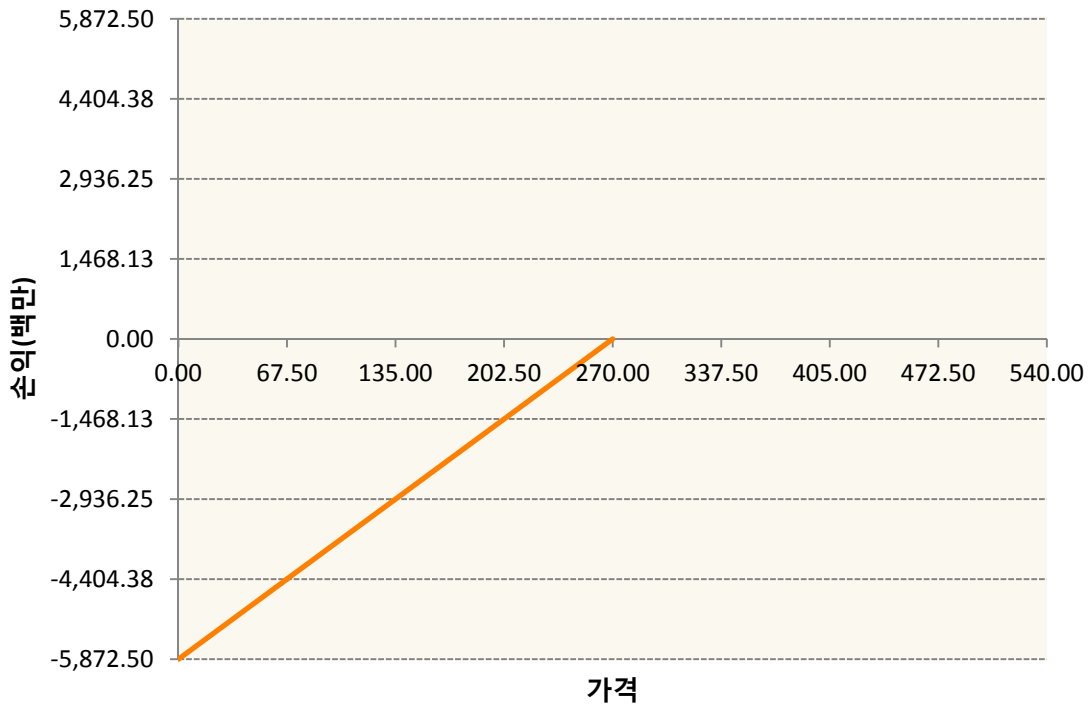


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

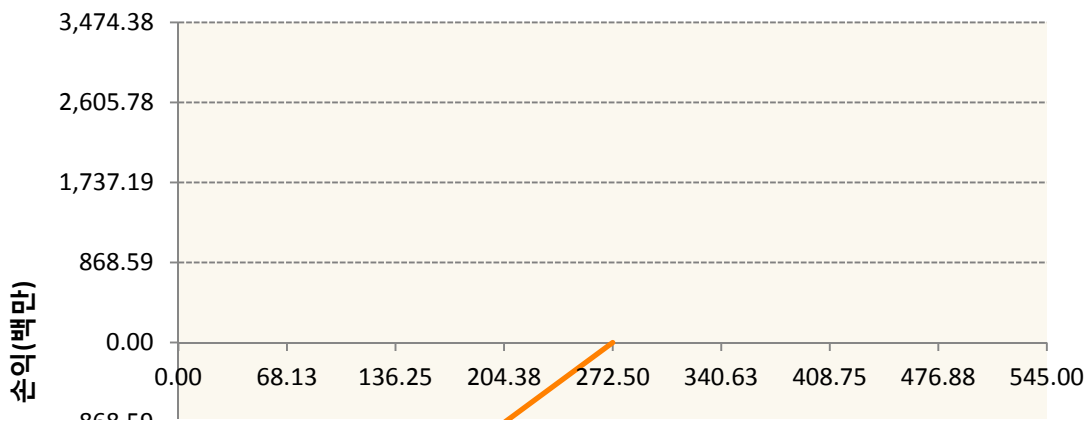




KR4301P82707-2019-08 풋270



KR4301P82723-2019-08 풋272.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,023
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,023	-1,023	-1,023	-1,023	-1,023	-1,023	-1,023	
-5.33%	-682	-682	-682	-682	-682	-682	-682	
-2.67%	-341	-341	-341	-341	-341	-341	-341	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	341	341	341	341	341	341	341	
5.33%	682	682	682	682	682	682	682	
8.00%	1,023	1,023	1,023	1,023	1,023	1,023	1,023	
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						247
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-247	-247	-247	-247	-247	-247	-247	
-5.33%	-165	-165	-165	-165	-165	-165	-165	
-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%	165	165	165	165	165	165	165	
8.00%	247	247	247	247	247	247	247	
KR4201P82725		2019-08 콜272.5						575
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	96	95	95	95	94	93	92
-5.33%	95	94	92	90	87	83	79
-2.67%	85	80	73	66	59	51	42
0%	35	24	12	0	-12	-24	-36
2.67%	-96	-108	-119	-132	-144	-156	-168
5.33%	-306	-312	-319	-326	-335	-343	-353
8.00%	-555	-556	-558	-562	-565	-570	-575
KR4301P82707 2019-08 풋270							421
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-421	-421	-421	-421	-421	-421	-421
-5.33%	-265	-265	-265	-265	-266	-266	-267
-2.67%	-111	-113	-114	-116	-119	-121	-124
0%	14	10	5	0	-5	-10	-14
2.67%	65	62	59	56	53	49	45
5.33%	71	71	70	69	69	67	66
8.00%	71	71	71	71	71	71	70
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							258
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-258	-258	-258	-258	-258	-258	-258
-5.33%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
-2.67%	-76	-76	-77	-77	-78	-79	-80
0%	7	5	2	0	-2	-5	-8
2.67%	53	50	48	45	43	40	38
5.33%	62	61	61	60	59	58	56
8.00%	62	62	62	62	62	62	61

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

(단위:백만원)

3,272

공시일	2019-07-31
기준일	2019-07-30

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

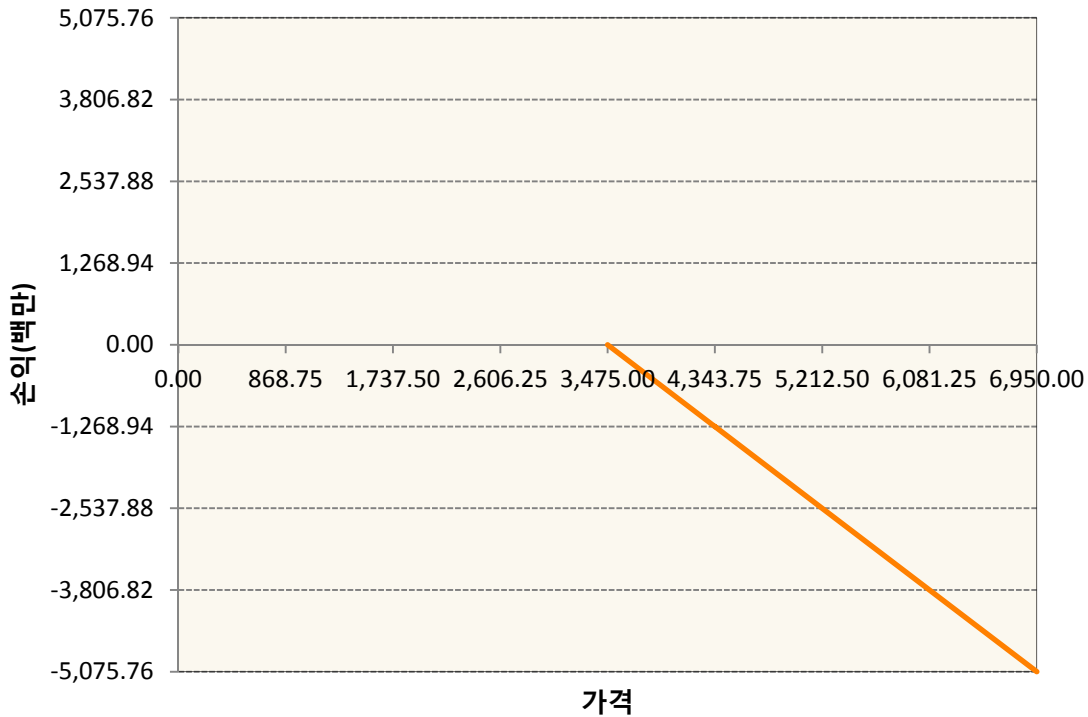
1. 계약금액

(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	3,494	0	3,494	
누계	유가증권	스왑	37,575	0	37,575	장외
누계	유가증권	옵션	0	12,731	-12,731	장내
누계	통화	선도	12,106	22,370	-10,264	장외

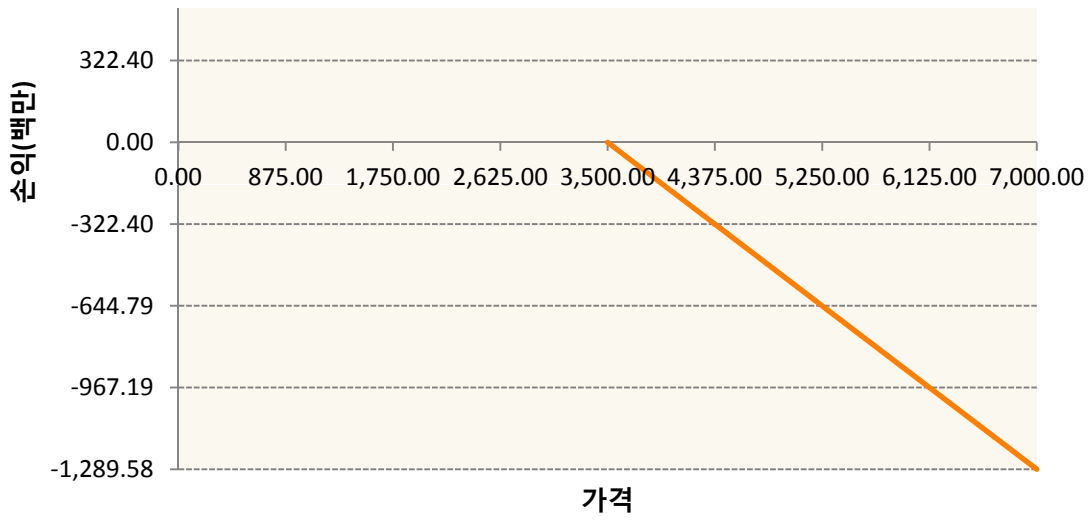
2. 만기시점의 손익구조

OESXQ9-C3475-EURO STOXX 50

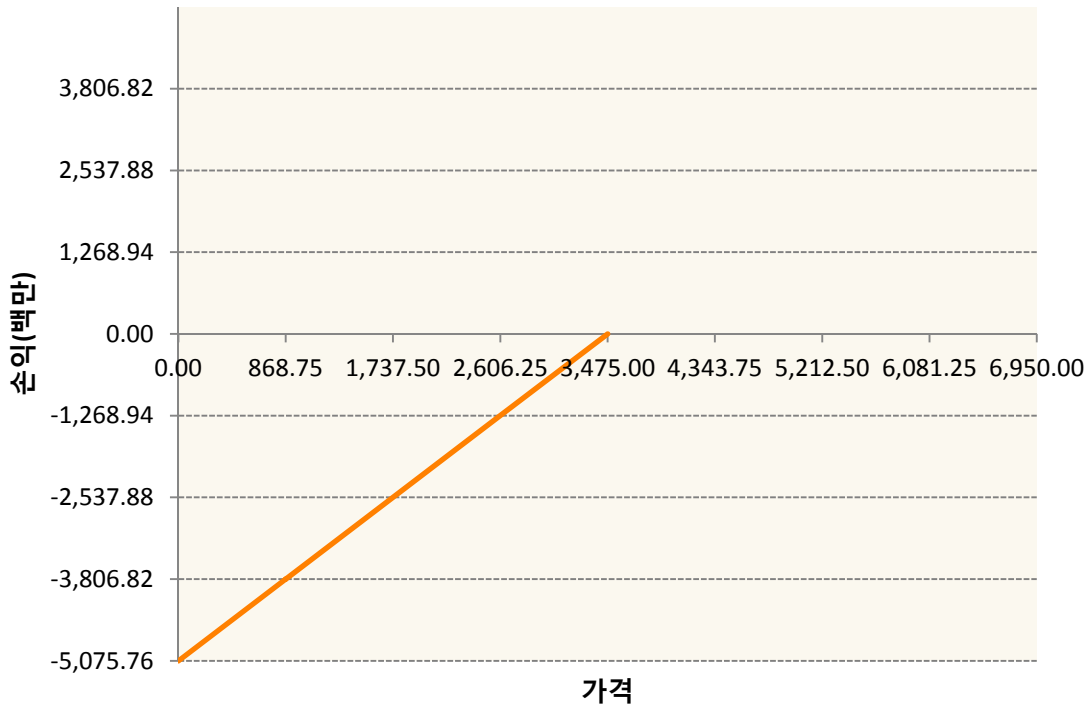


OESXQ9-C3500-EURO STOXX 50

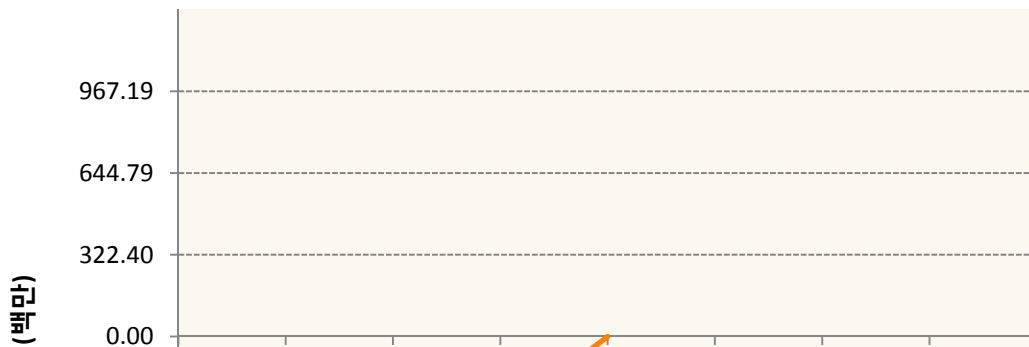


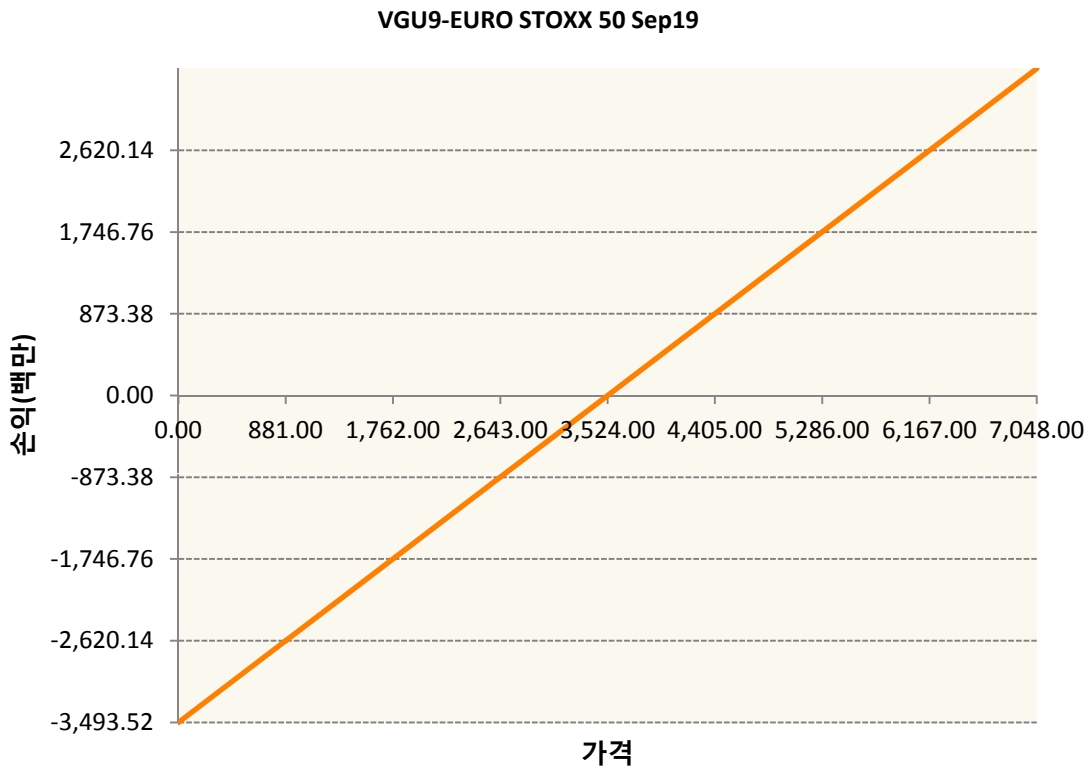
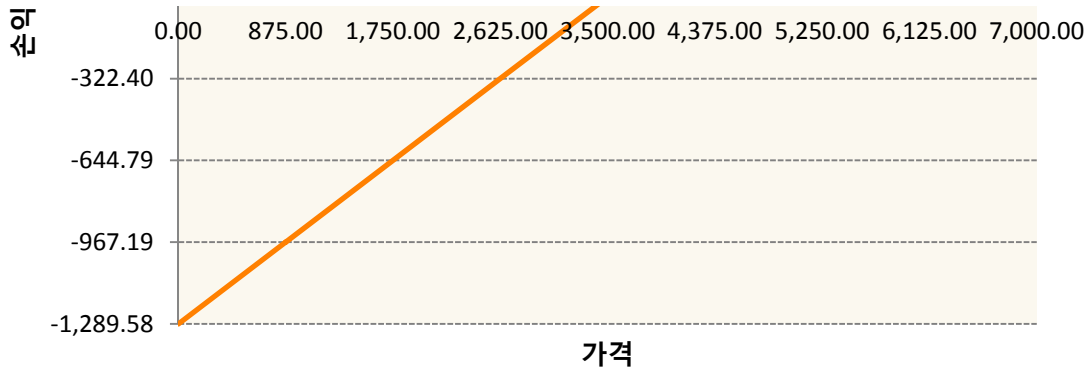


OESXQ9-P3475-EURO STOXX 50



OESXQ9-P3500-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	22
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
FX21019N04 EUR/KRW 27-09-19E	232
OESXQ9-C34 EURO STOXX 50	406
OESXQ9-C35 EURO STOXX 50	103
OESXQ9-P34 EURO STOXX 50	406
OESXQ9-P35 EURO STOXX 50	103

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

(단위:백만원)

2,170

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

(단위:백만원)

1,011

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

(단위:백만원)

86

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

(단위:백만원)

131

공시일	2019-07-31
기준일	2019-07-30

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

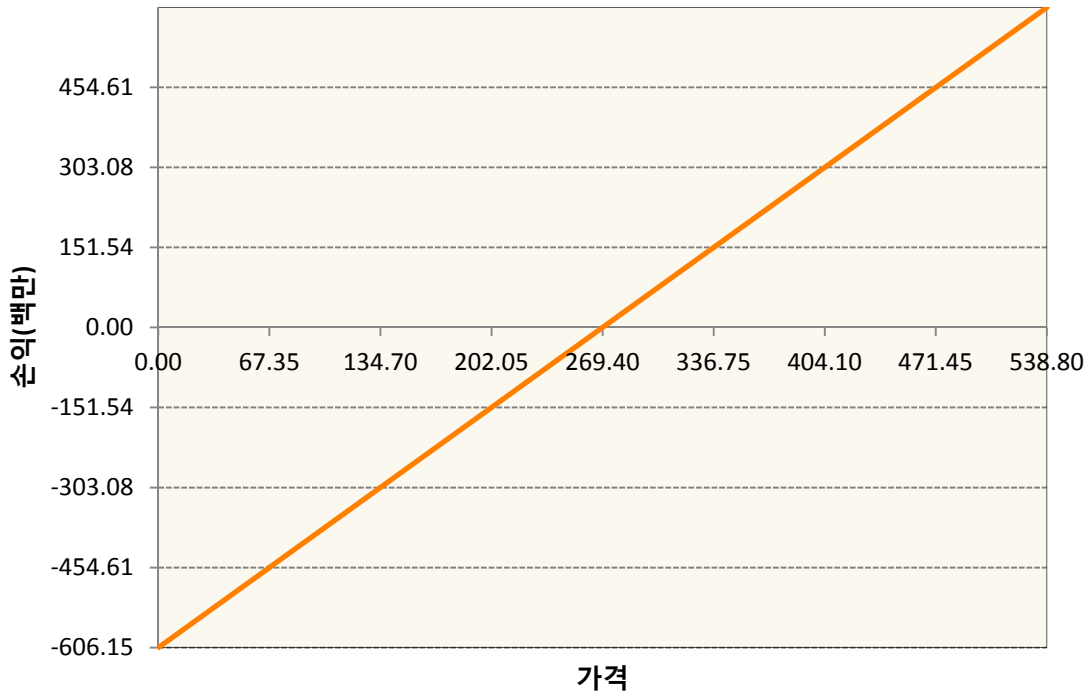
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	606	0	606	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)

41

공시일	2019-07-31
기준일	2019-07-30

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

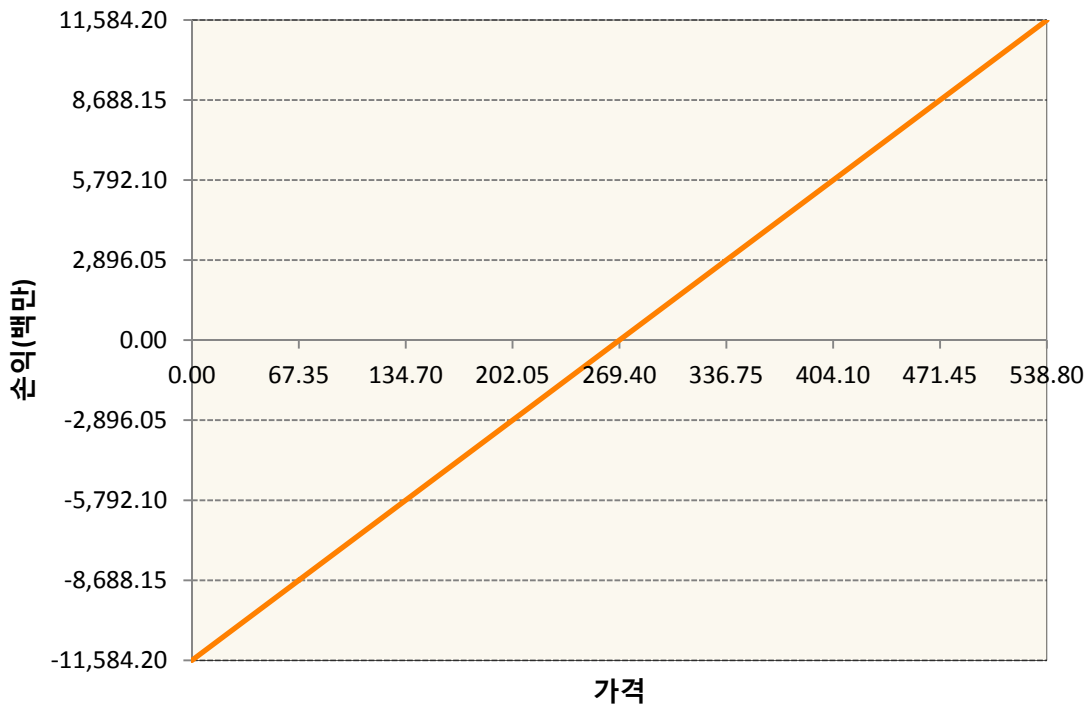
1. 계약금액

(단위:백만원)

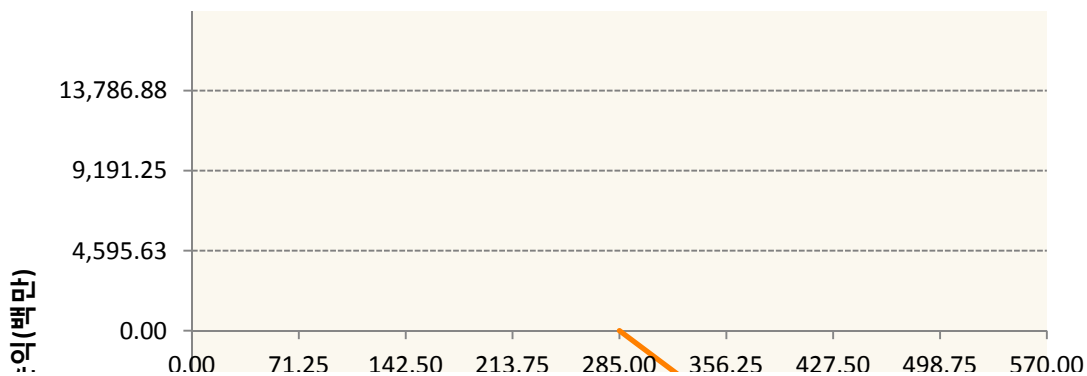
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,584	0	11,584	장내
누계	유가증권	옵션	1,698	21,617	-19,919	장내

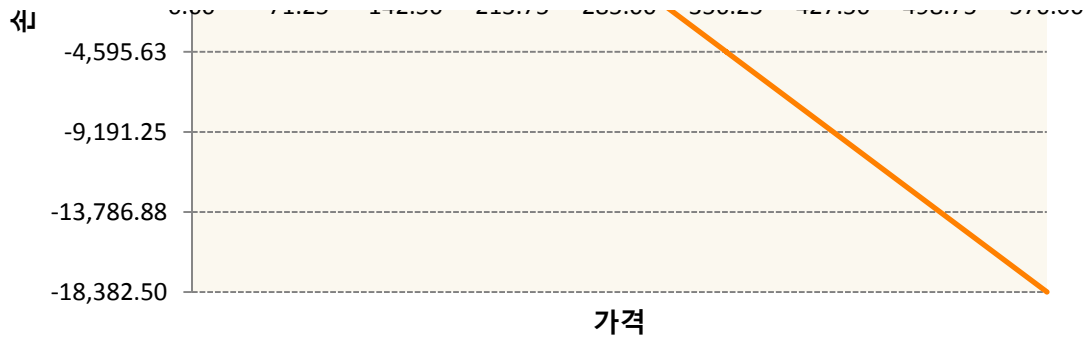
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

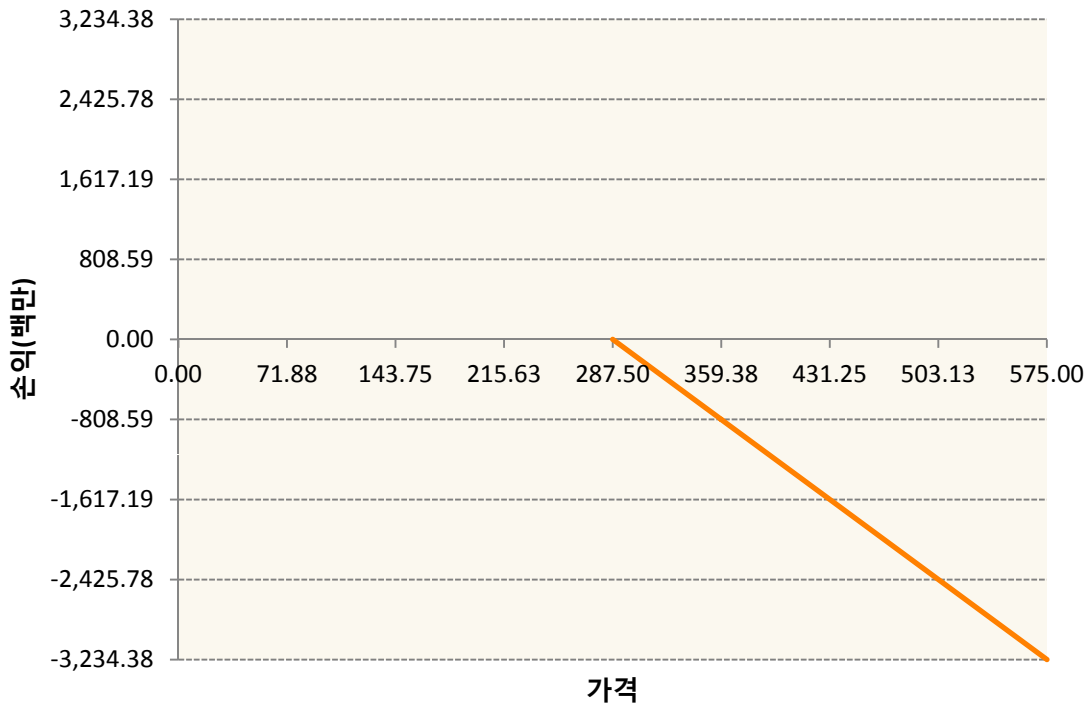


KR4201P82857-2019-08 콜285

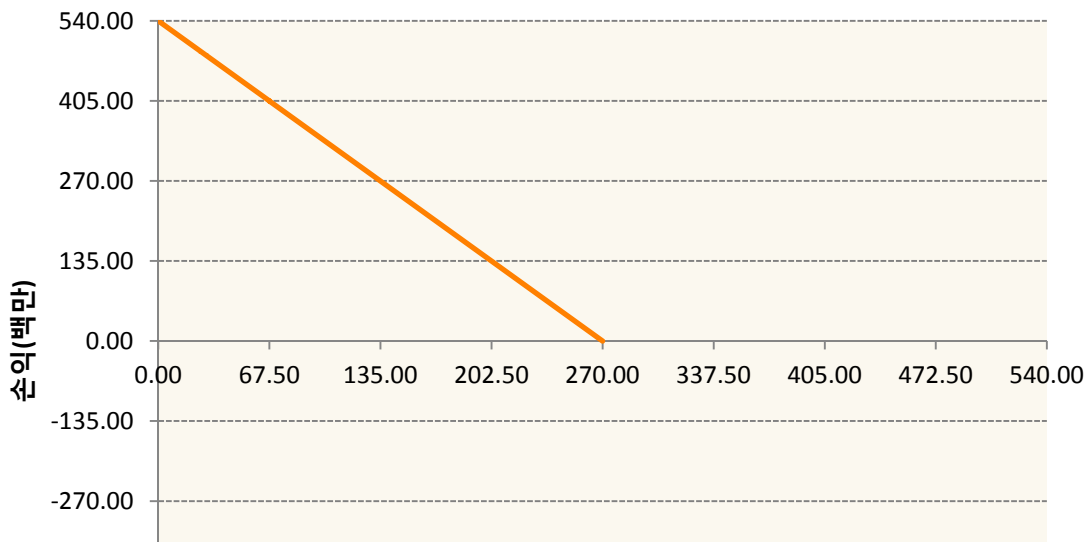


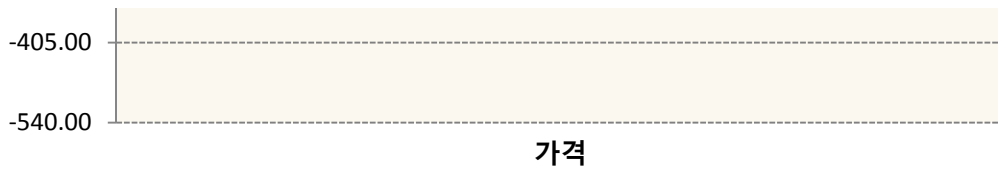


KR4201P82873-2019-08 콜287.5

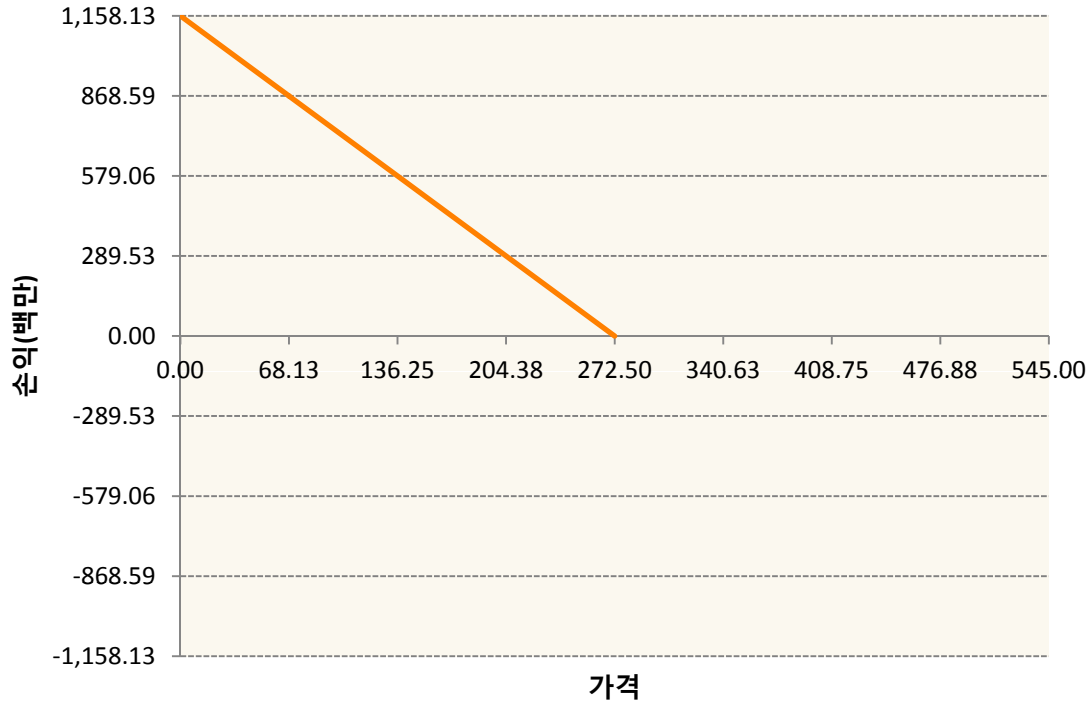


KR4301P82707-2019-08 풋270





KR4301P82723-2019-08 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						925
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-925	-925	-925	-925	-925	-925	-925	
-5.33%	-617	-617	-617	-617	-617	-617	-617	
-2.67%	-308	-308	-308	-308	-308	-308	-308	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	308	308	308	308	308	308	308	
5.33%	617	617	617	617	617	617	617	
8.00%	925	925	925	925	925	925	925	
KR4201P82857		2019-08 콜285						540
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	21	21	21	20	20	20	20	
-5.33%	21	20	20	20	20	19	18	
-2.67%	20	20	19	17	15	11	7	

0%	16	12	7	0	-8	-18	-28
2.67%	-16	-30	-45	-61	-78	-96	-115
5.33%	-140	-164	-187	-210	-234	-257	-281
8.00%	-413	-433	-453	-474	-496	-518	-540
KR4201P82873 2019-08 콜287.5							79
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	2	1	1
0%	2	1	1	0	-1	-2	-4
2.67%	-1	-3	-5	-7	-10	-12	-15
5.33%	-16	-20	-23	-27	-31	-35	-39
8.00%	-54	-58	-62	-66	-70	-74	-79
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%	24	24	24	24	24	24	25
-2.67%	10	10	11	11	11	11	11
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-6	-6	-5	-5	-5	-5	-4
5.33%	-7	-6	-6	-6	-6	-6	-6
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-6	-6
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							86
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	86	86	86	86	86	86	86
-5.33%	56	56	56	56	56	56	56
-2.67%	25	25	26	26	26	26	27
0%	-2	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-18	-17	-16	-15	-14	-13	-13
5.33%	-21	-20	-20	-20	-20	-19	-19
8.00%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-20

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

(단위:백만원)

1,223

공시일	2019-07-31
기준일	2019-07-30

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	709	0	709	
누계	유가증권	수익증권	48,387	0	48,387	

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	2019-07-31
기준일	2019-07-30

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	945	0	945	
누계	유가증권	수익증권	58,221	0	58,221	

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	2019-07-31
기준일	2019-07-30

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	5,908	0	5,908	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	425,739	0	425,739	
누계	통화	선도	0	473,845	-473,845	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E	1,304
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E	2,564
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E	3,119
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E	2,117
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E	1,702
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E	2,080
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E	132
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	567
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	3,025
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	3,308
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	473
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E	945
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E	2,940
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E	1,645
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E	756
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E	1,891
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E	1,891
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	284
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	95
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	700
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	700
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	284
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	662
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E	2,647
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E	1,323
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E	756

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

(단위:백만원)

12,269

공시일	2019-07-31
기준일	2019-07-30

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

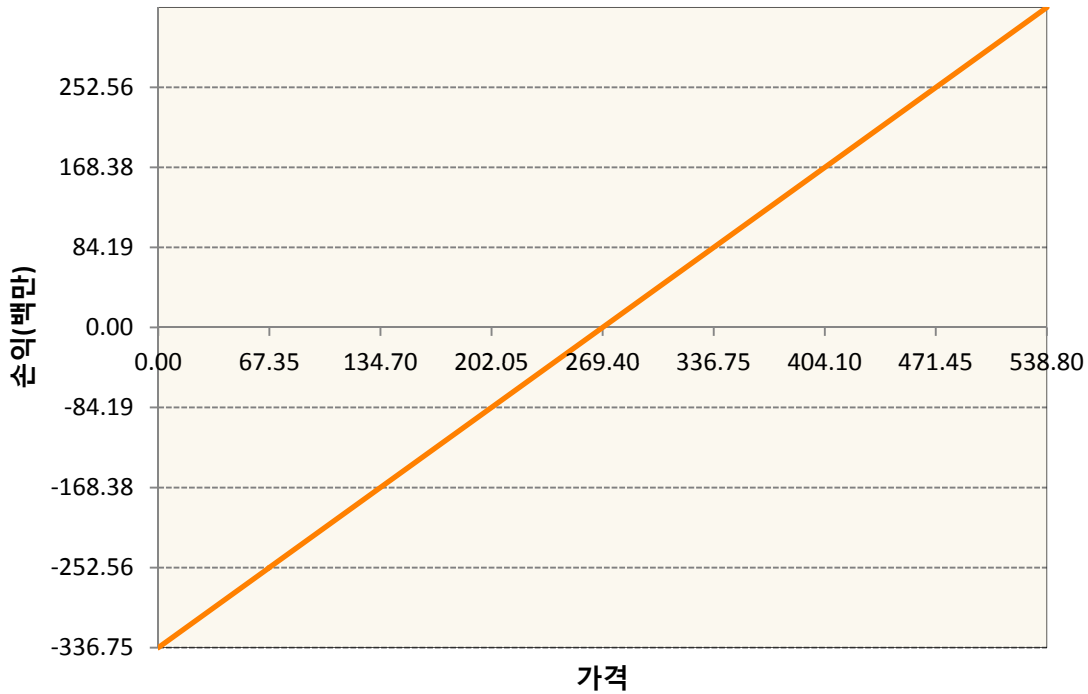
1. 계약금액

(단위:백만원)

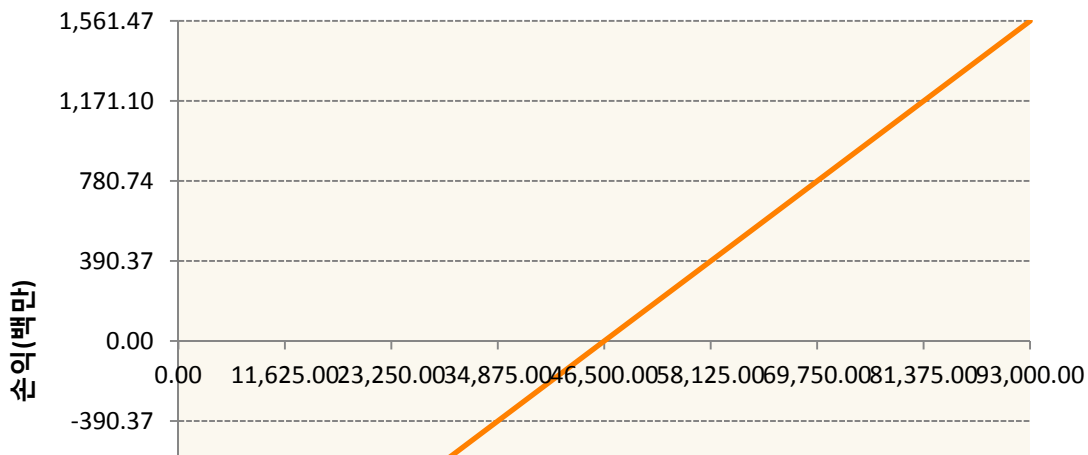
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,898	0	1,898	장내

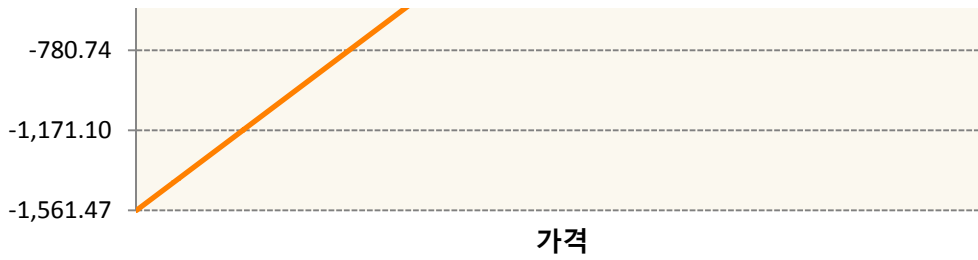
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P80001-2019-08 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						27
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27	
-5.33%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
-2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	9	9	9	9	9	9	9	
5.33%	18	18	18	18	18	18	18	
8.00%	27	27	27	27	27	27	27	
KR4111P80001		2019-08 삼성전자개별선물						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)

180

공시일	2019-07-31
기준일	2019-07-30

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

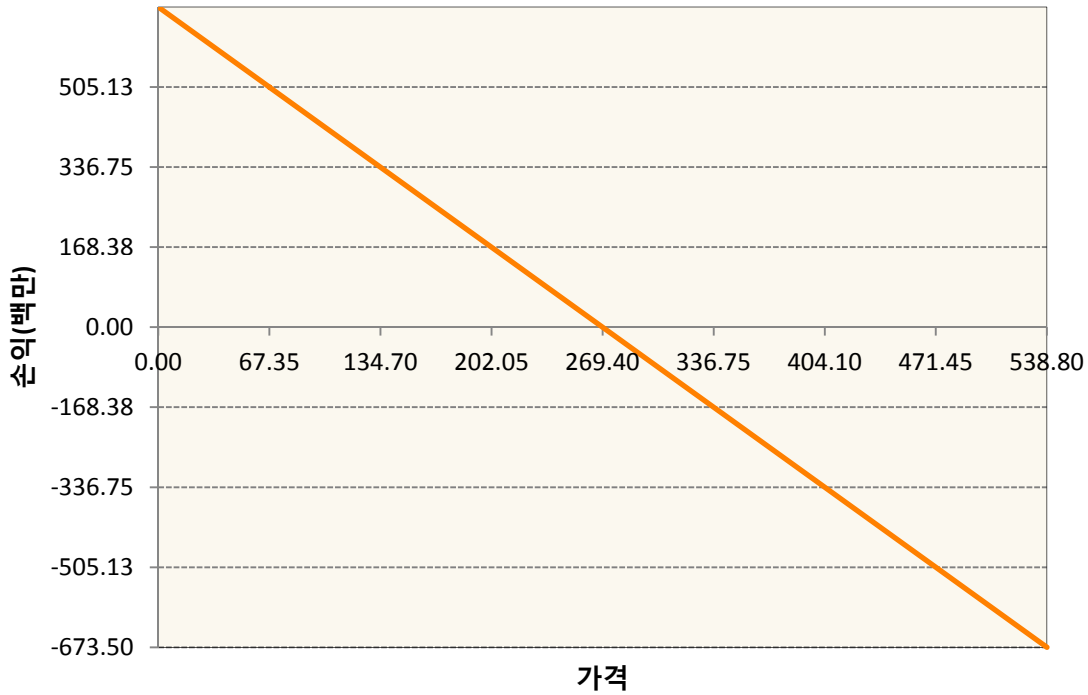
1. 계약금액

(단위:백만원)

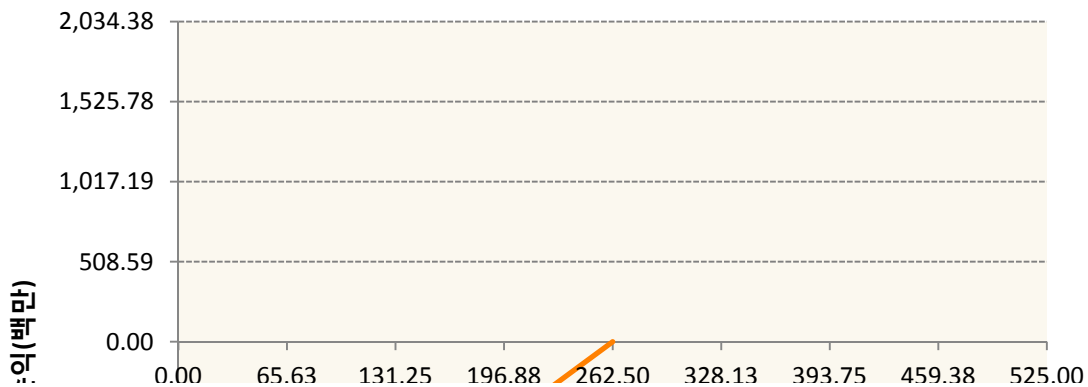
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	132	-132	장내
누계	유가증권	선물	0	674	-674	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,757	-3,757	장내

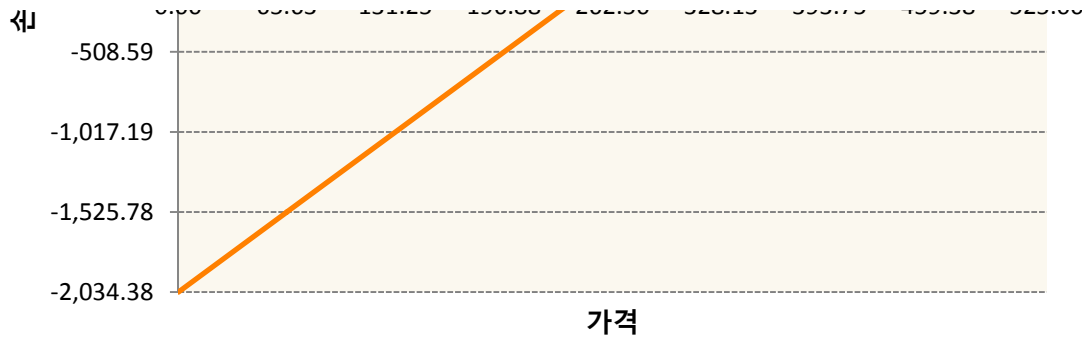
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

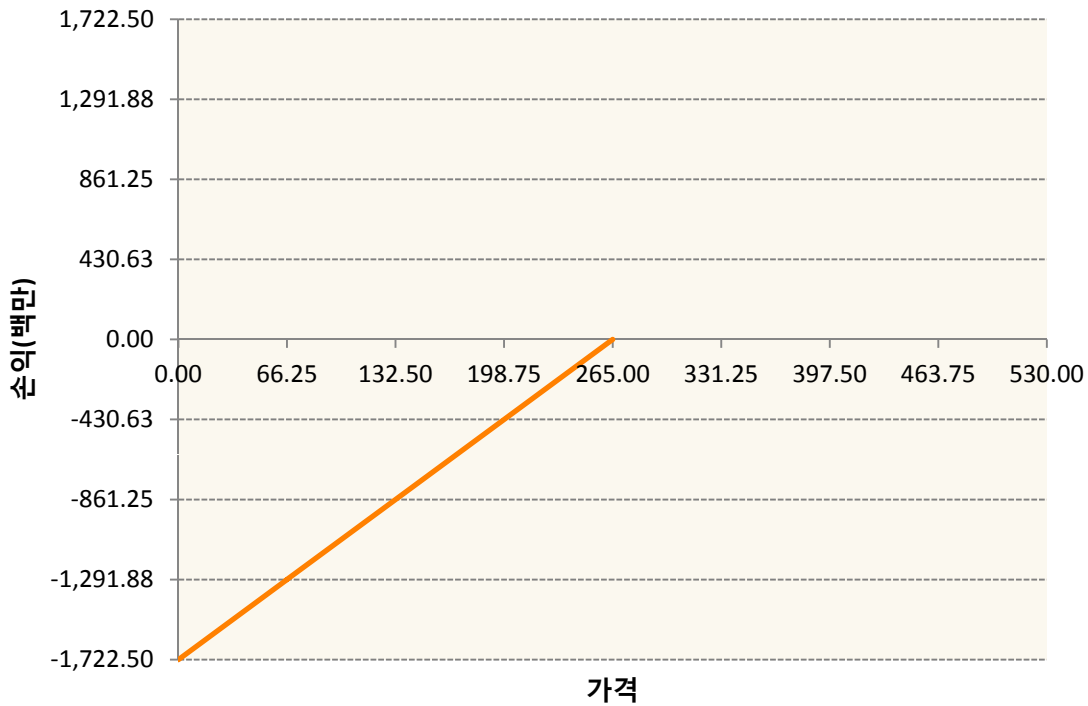


KR4301P82624-2019-08 풋262.5





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						113
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-113	-113	-113	-113	-113	-113	-113
-5.33%	-58	-58	-59	-60	-60	-61	-62
-2.67%	-14	-15	-17	-19	-20	-22	-24
0%	3	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	4	4	4	4	4	4	3
5.33%	5	5	5	5	4	4	4
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

KR4301P82657

2019-08 풋265

107

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107
-5.33%	-61	-61	-61	-61	-62	-62	-63
-2.67%	-19	-20	-21	-22	-24	-25	-26
0%	3	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	7	7	7	7	6	6	5
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)

261

공시일	2019-07-31
기준일	2019-07-30

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	18,682	0	18,682	
누계	통화	선도	0	18,315	-18,315	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		983
FX21019N01 KRW/USD 12-08-19E		161
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		321

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

(단위:백만원)

474

공시일	2019-07-31
기준일	2019-07-30

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	2019-07-31
기준일	2019-07-30

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

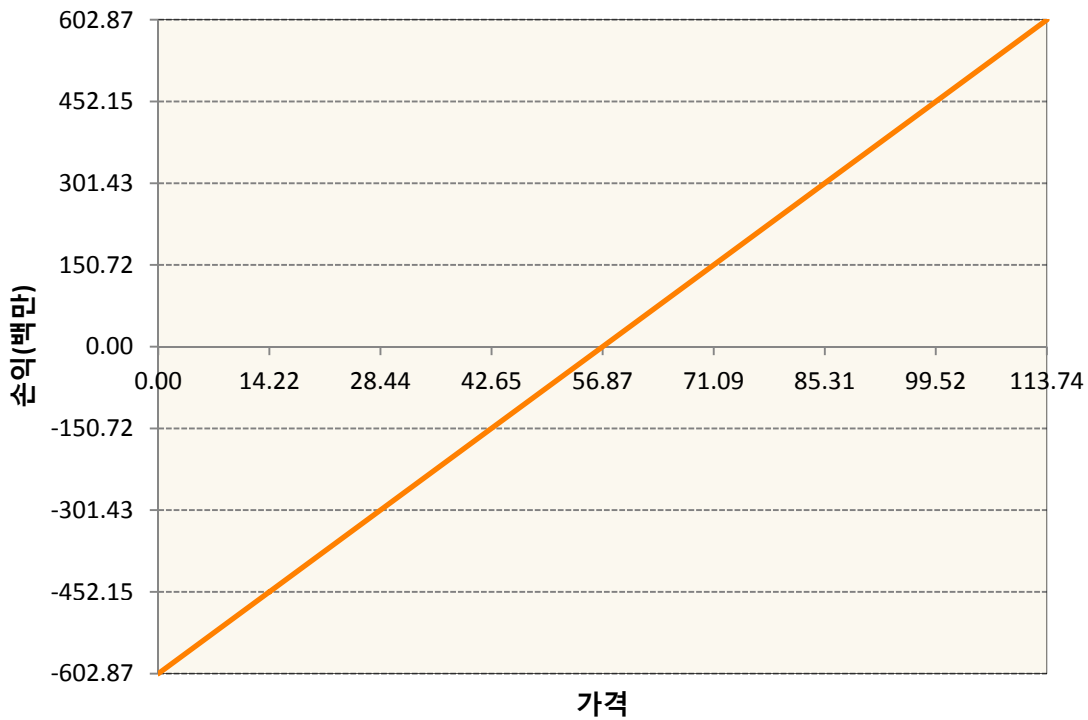
1. 계약금액

(단위:백만원)

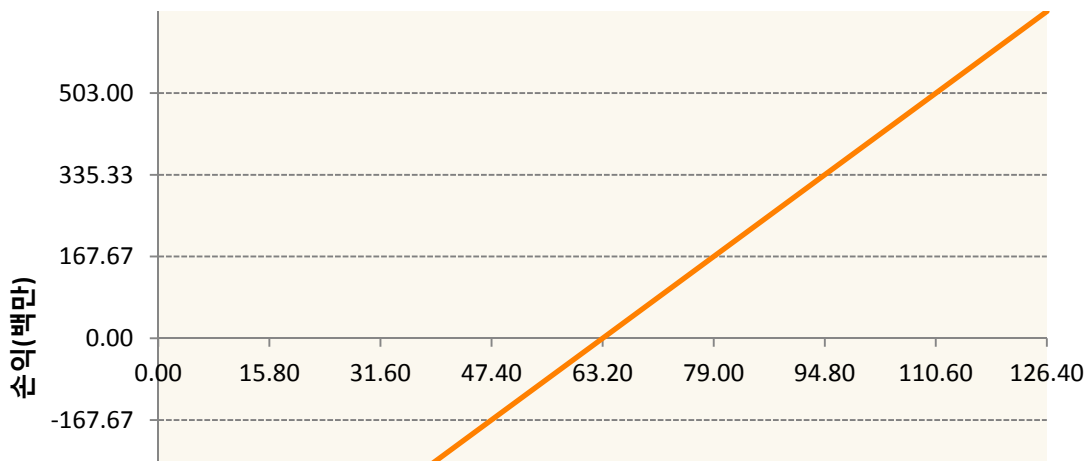
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,511	118	2,393	

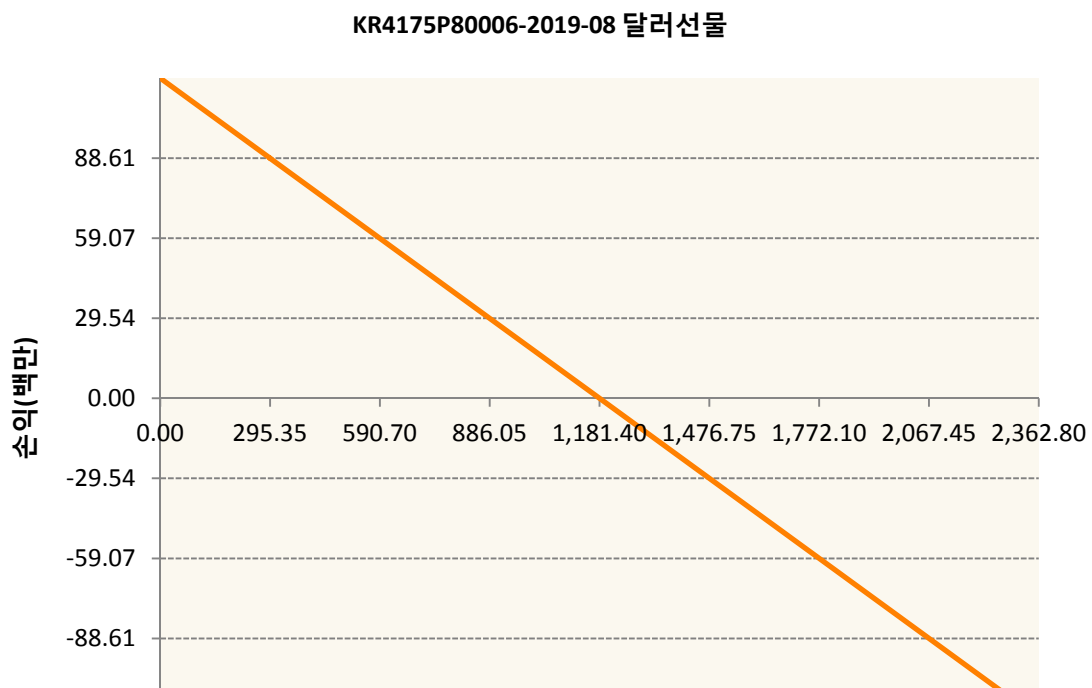
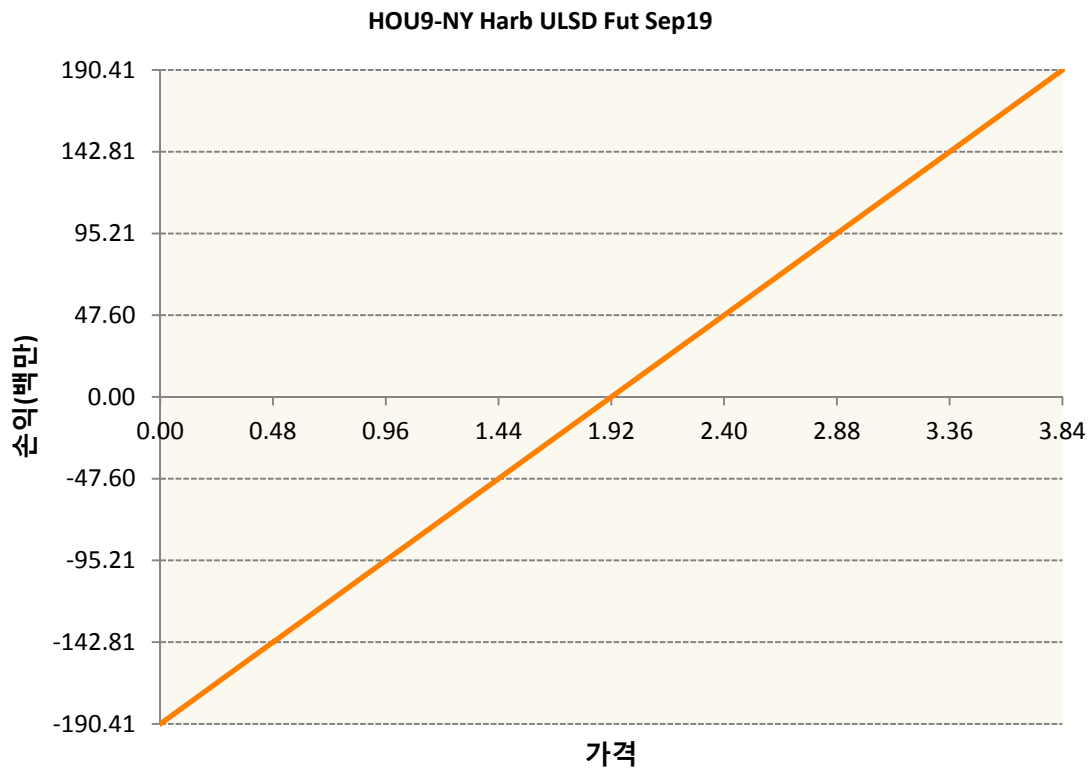
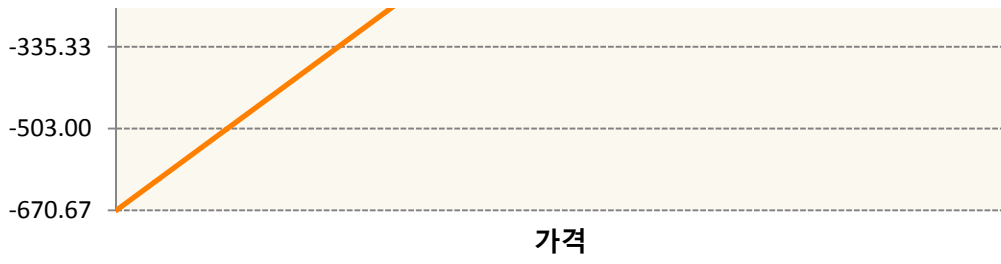
2. 만기시점의 손익구조

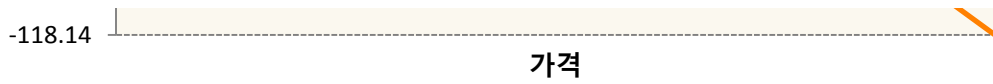
CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19



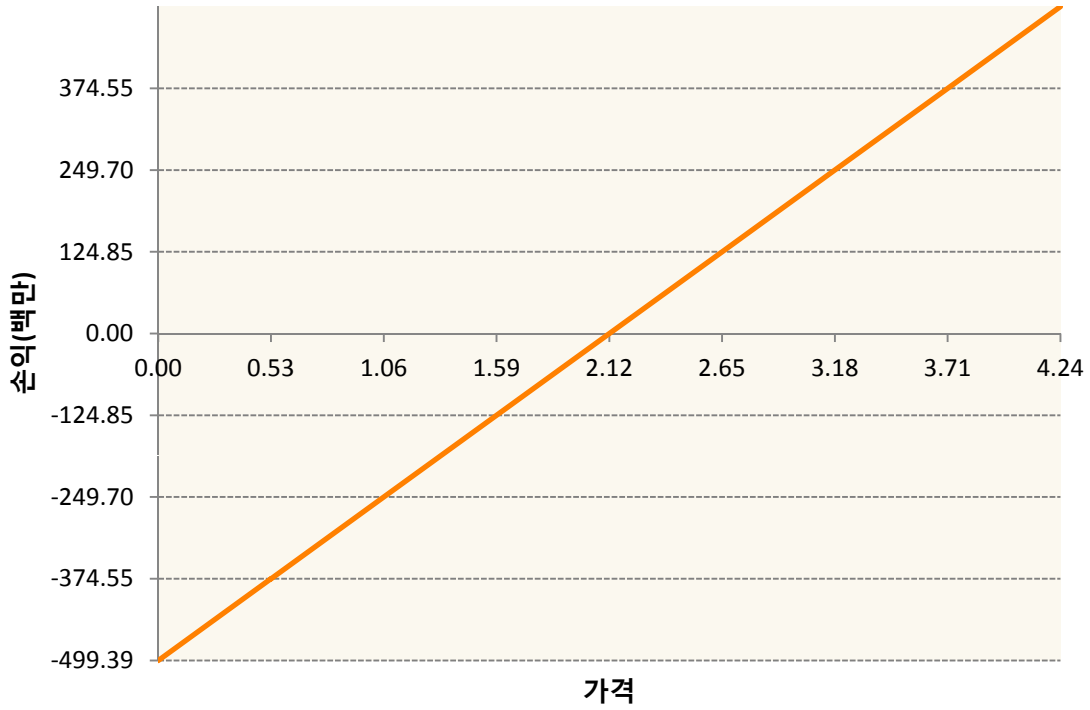
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19



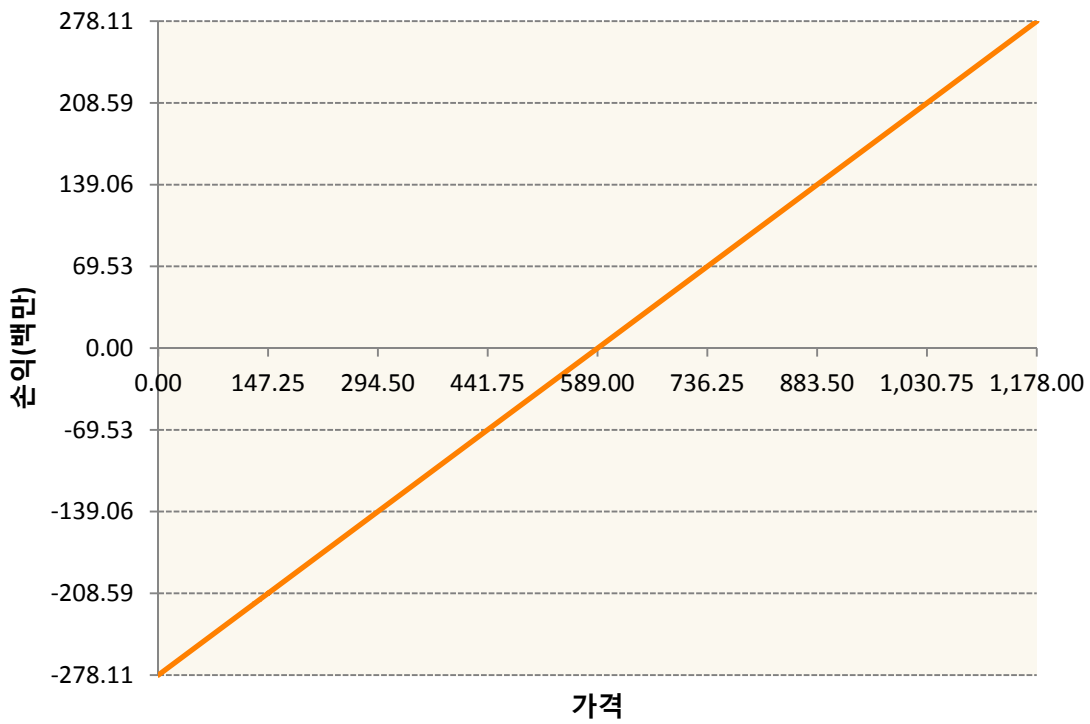




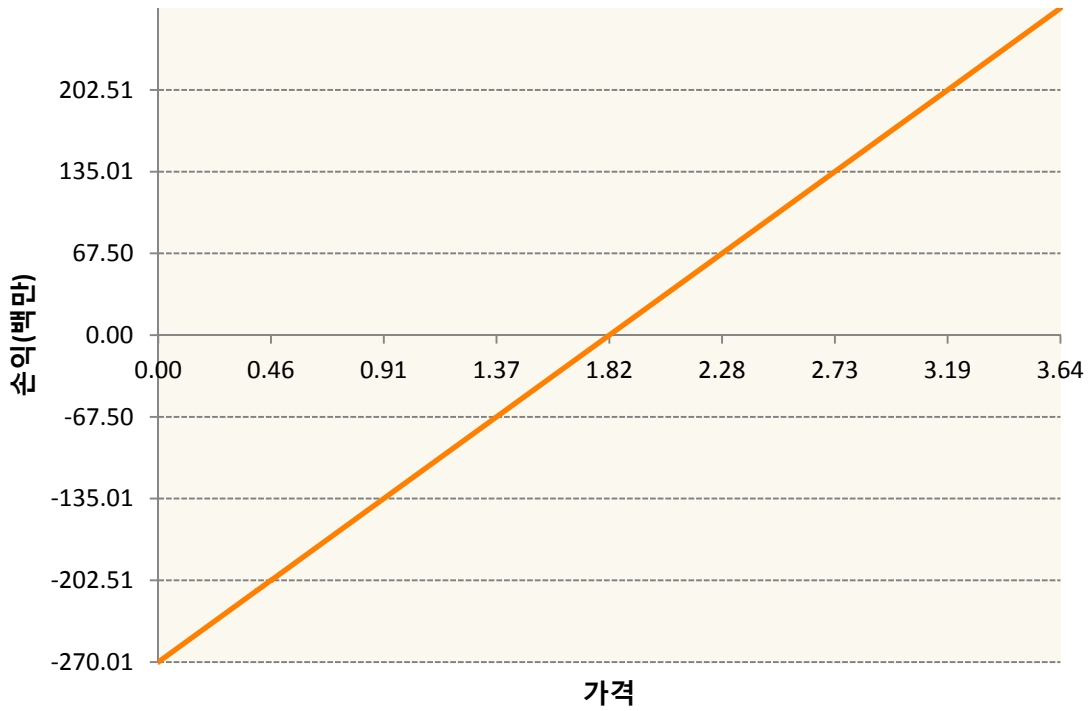
NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



QSU9-Low Su Gasoil G Sep19



XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	48
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	54
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	15
KR4175P800	2019-08 달러선물	9
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	40
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	22
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	22

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

(단위:백만원)

364

공시일	2019-07-31
기준일	2019-07-30

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

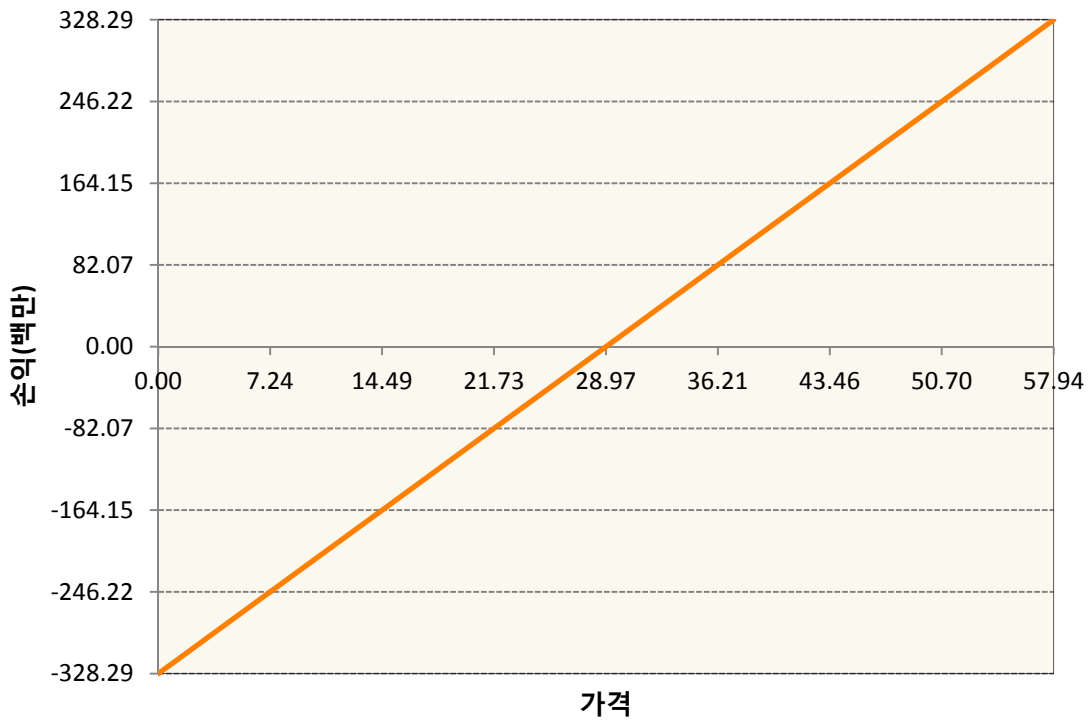
1. 계약금액

(단위:백만원)

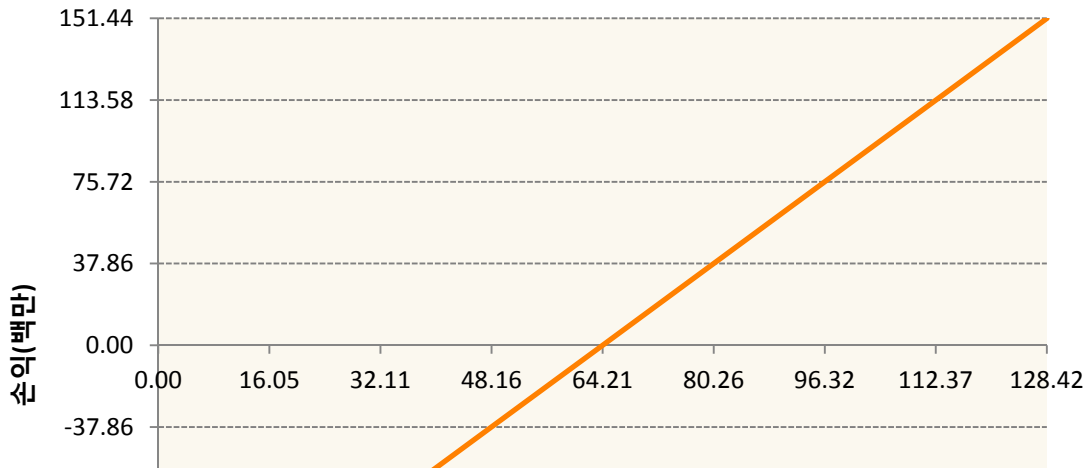
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,988	201	2,787	

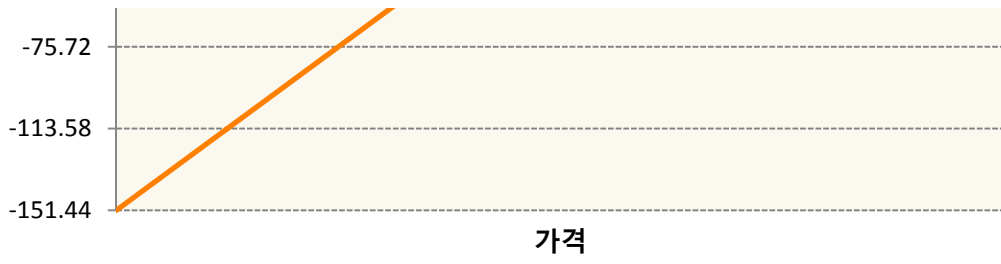
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

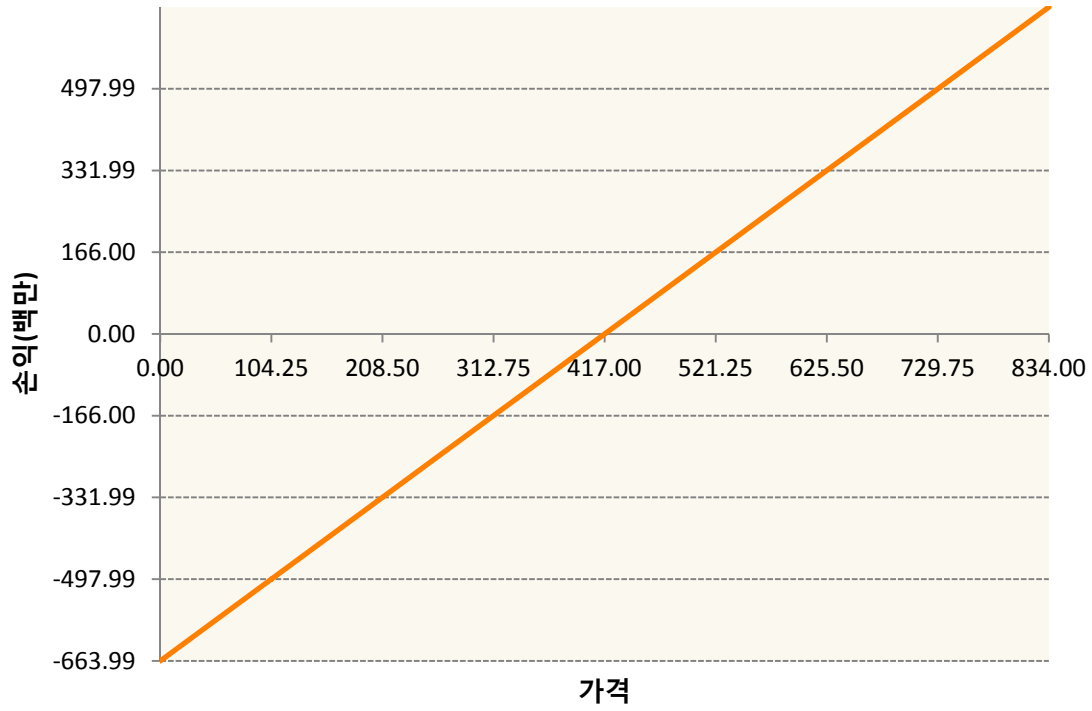


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

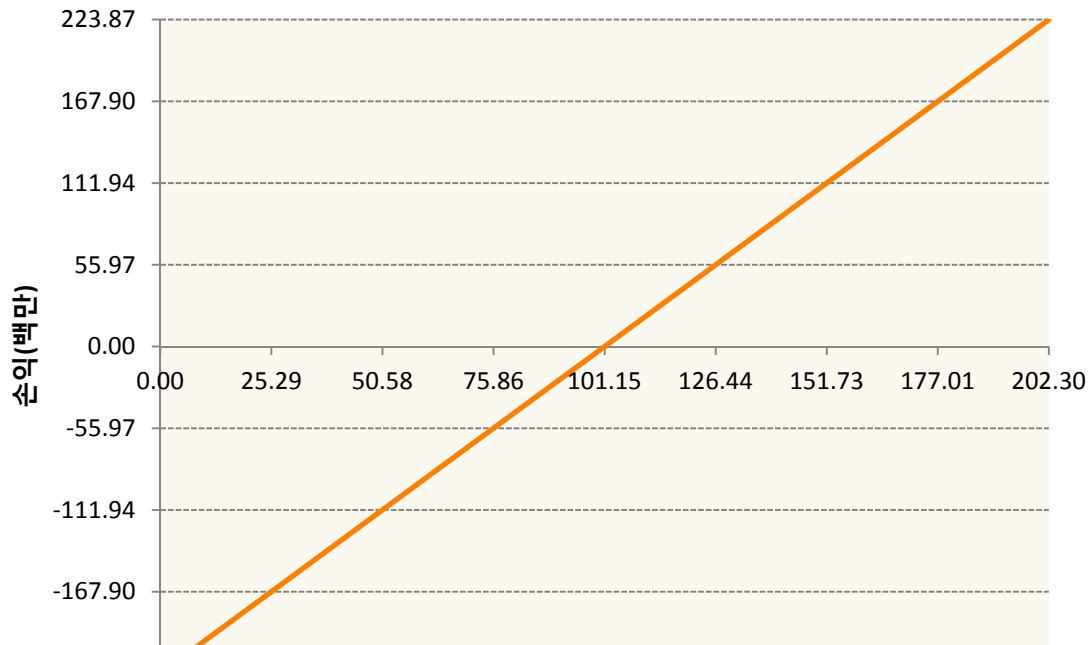


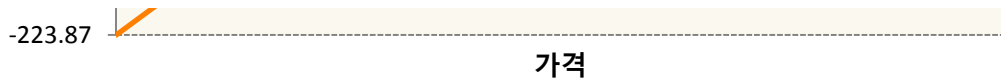


CU9-CORN FUTURE Sep19

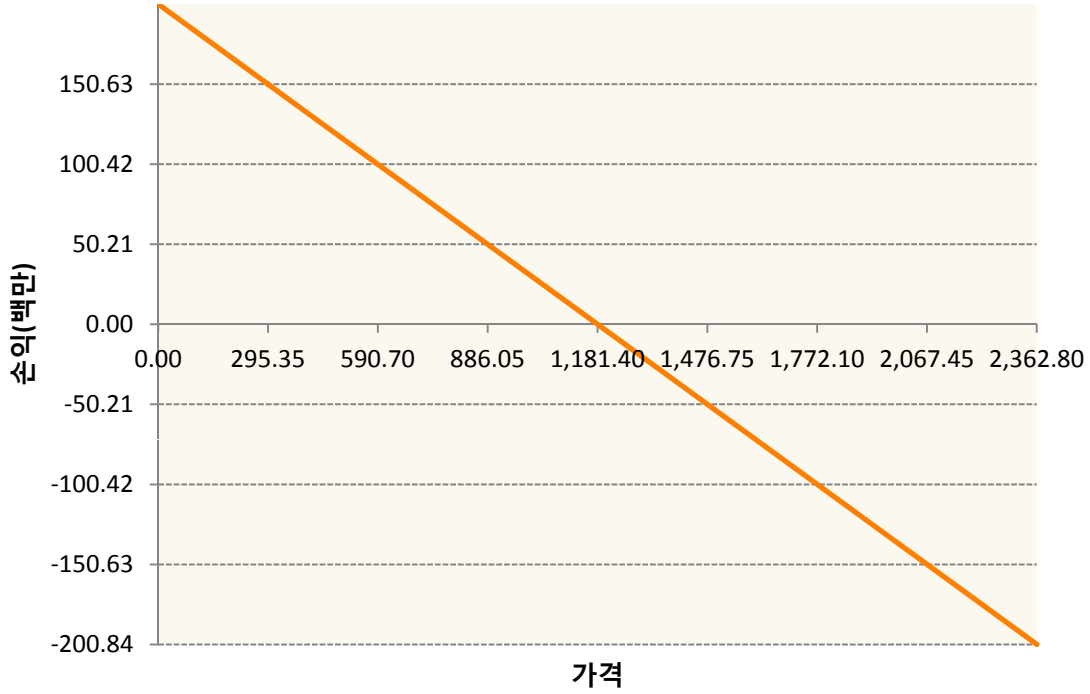


KCU9-COFFEE 'C' FUTURE Sep19

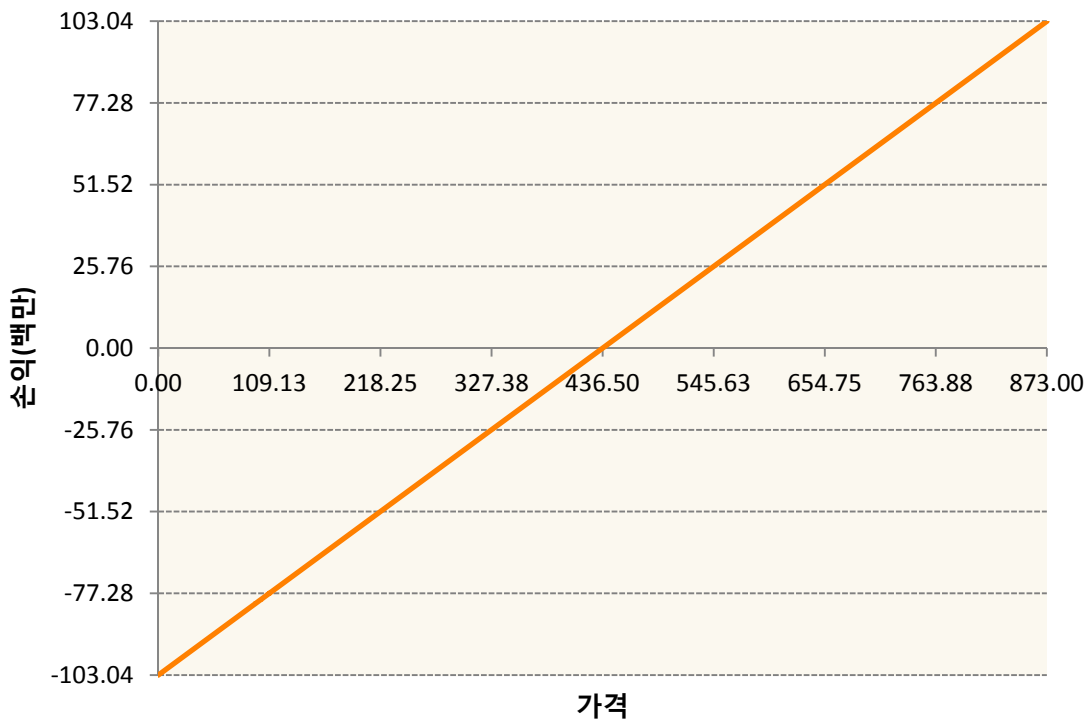




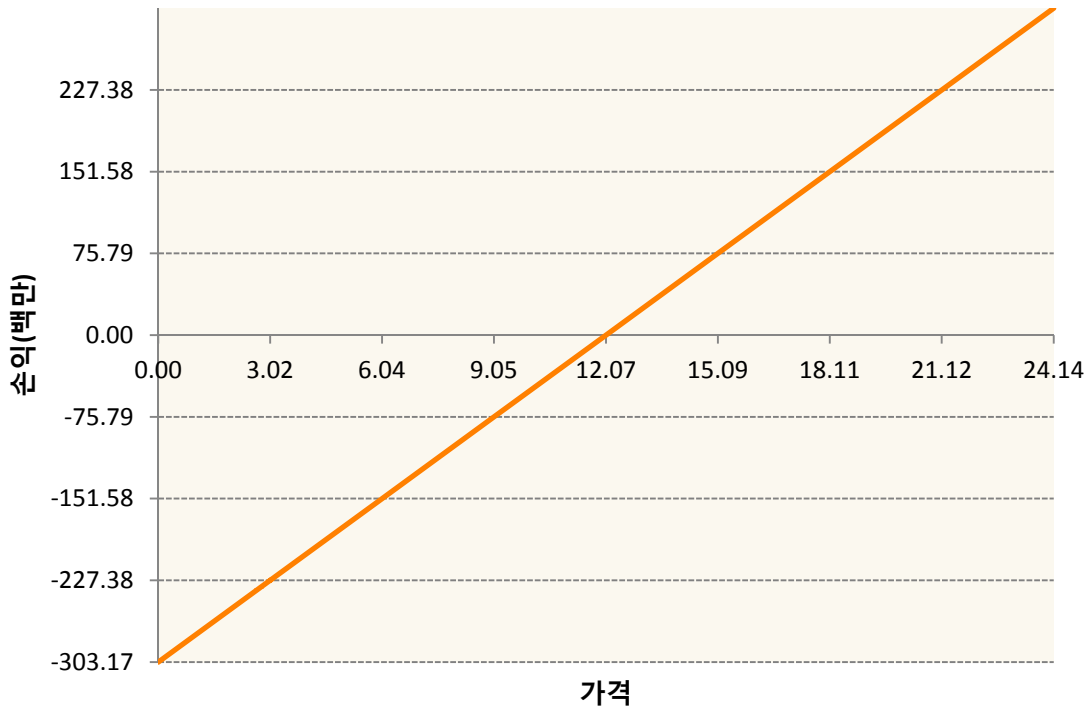
KR4175P80006-2019-08 달러선물



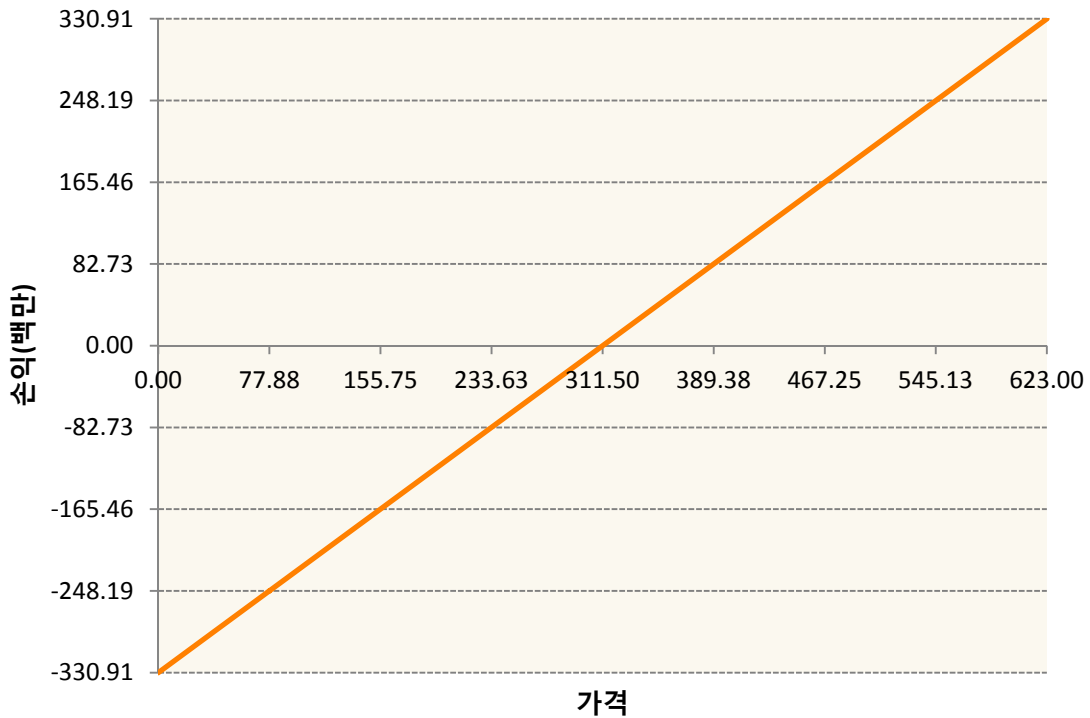
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

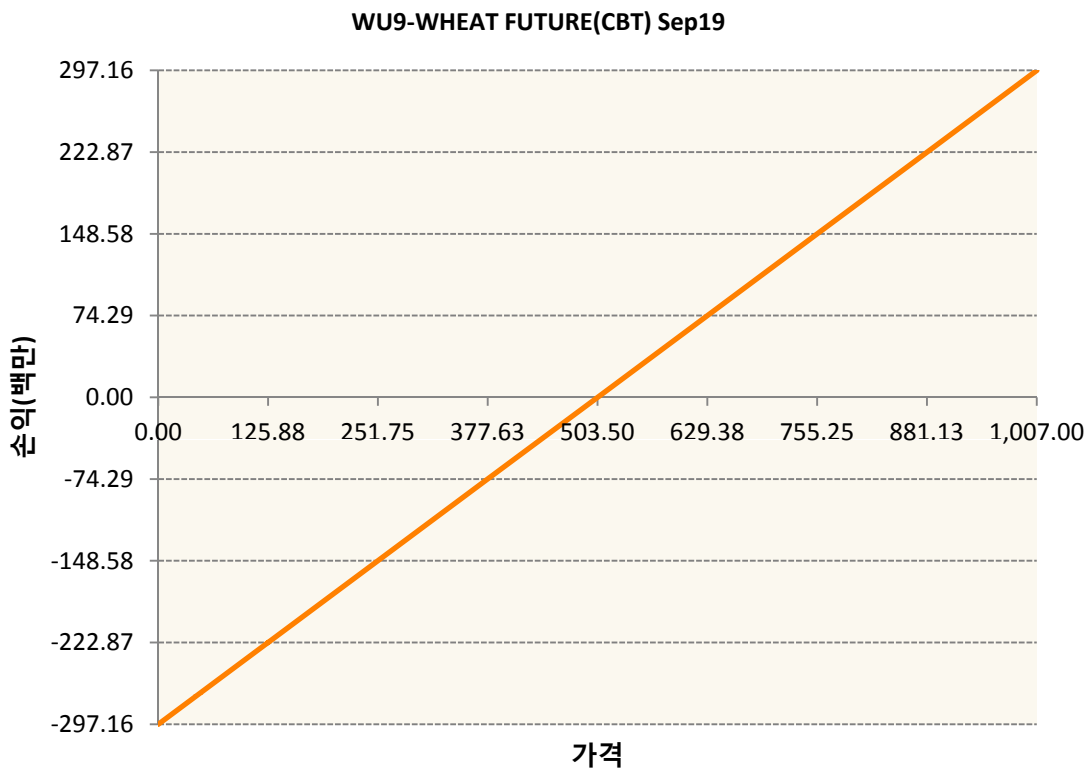
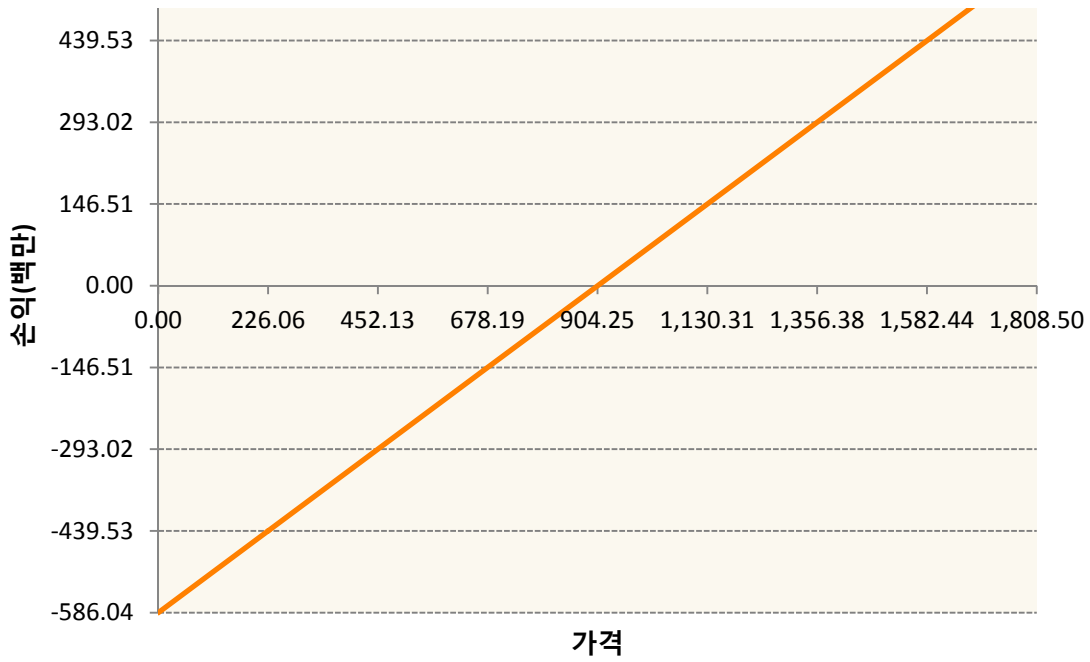


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



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	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	24

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

(단위:백만원)

263