

공시일	2019-08-01
기준일	2019-07-31

## 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	2019-08-01
기준일	2019-07-31

## 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

1,179

\* 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	2019-08-01
기준일	2019-07-31

## 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)	384
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	140

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

<b>843</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-01
기준일	2019-07-31

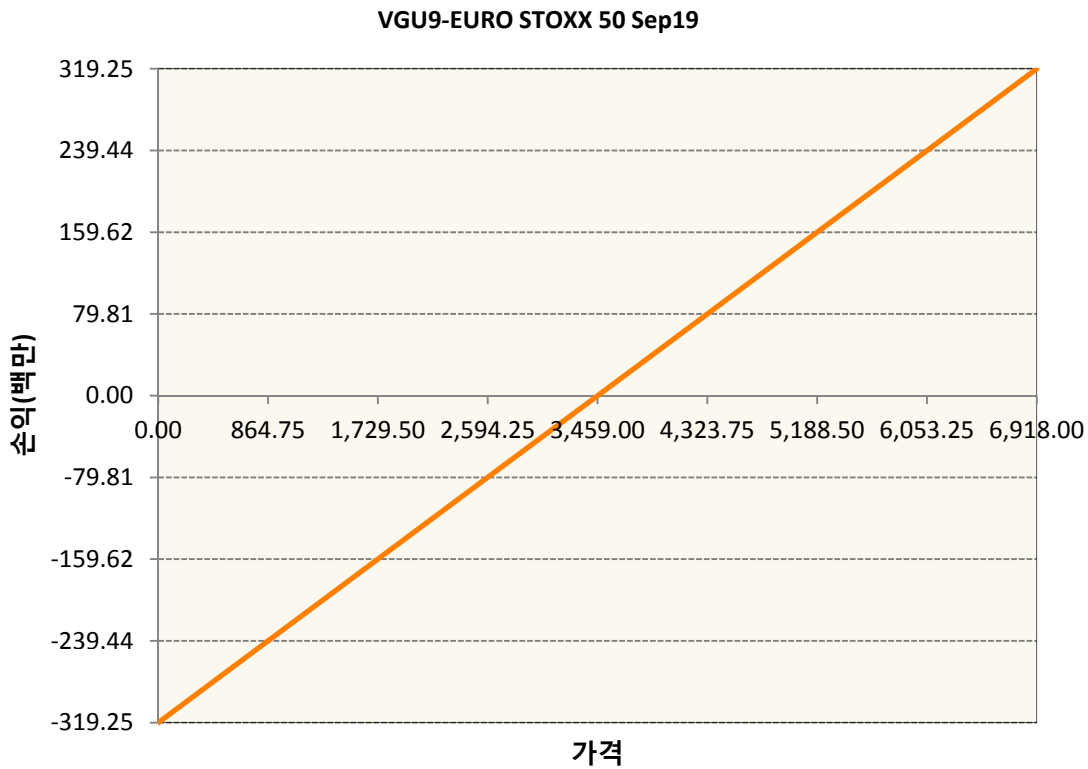
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	319	0	319	

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU9	EURO STOXX 50 Sep19	26
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

<b>18</b>
-----------

공시일	2019-08-01
기준일	2019-07-31

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

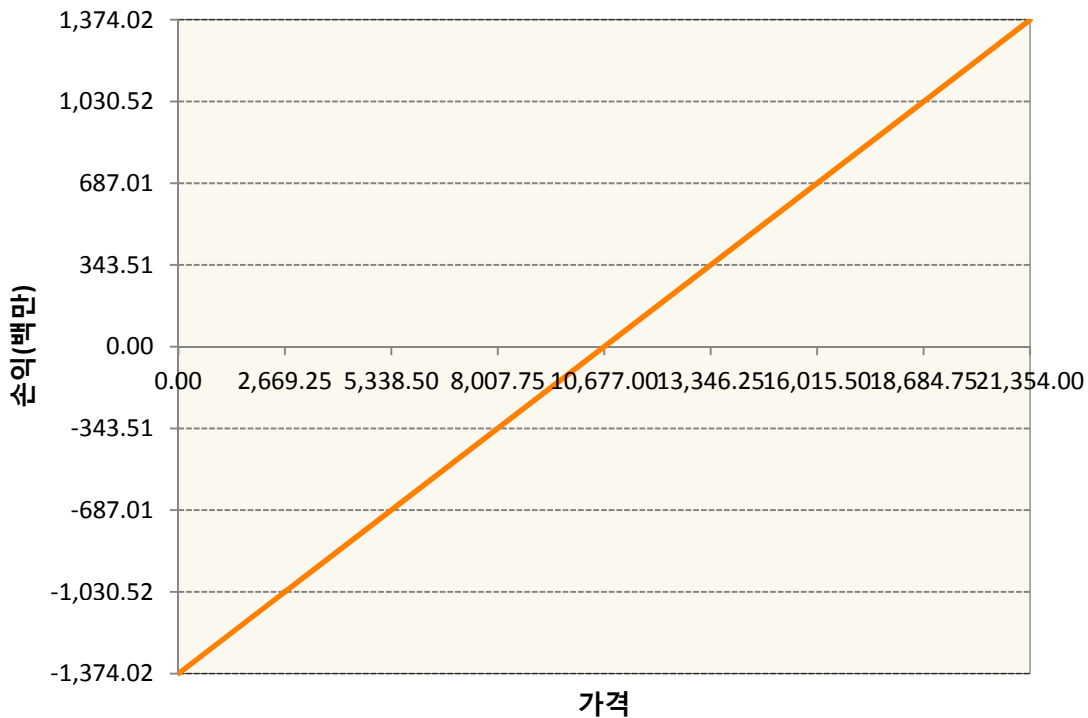
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,374	0	1,374	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCQ9	HSCEI Futures Aug19	110
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

107
-----

공시일	2019-08-01
기준일	2019-07-31

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

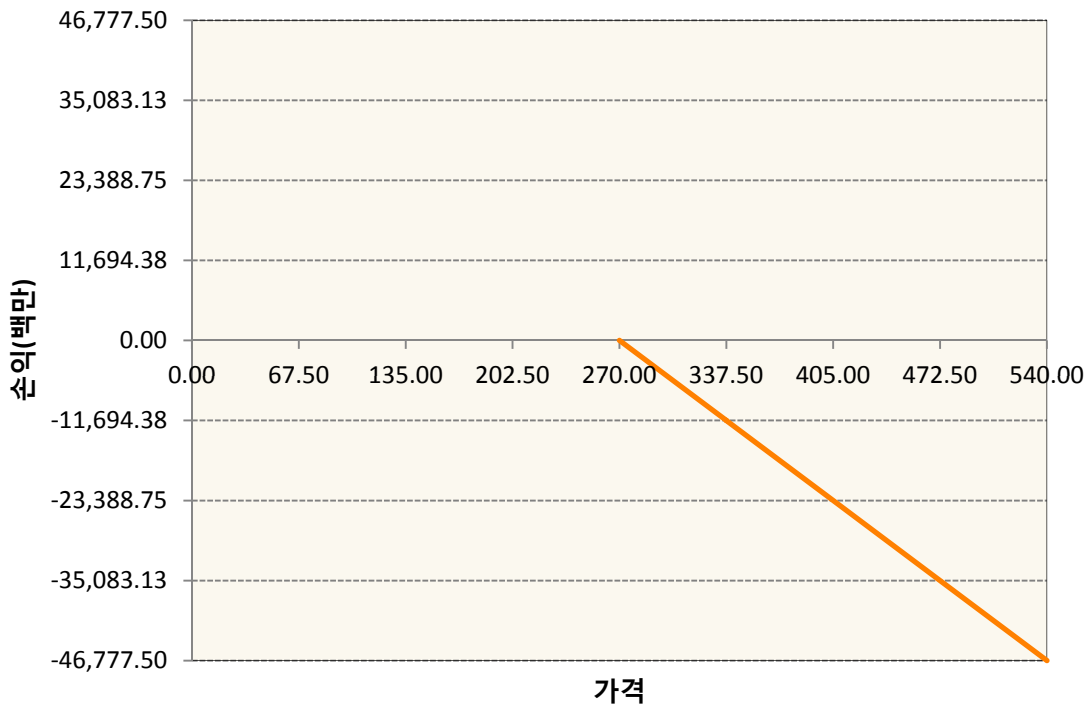
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

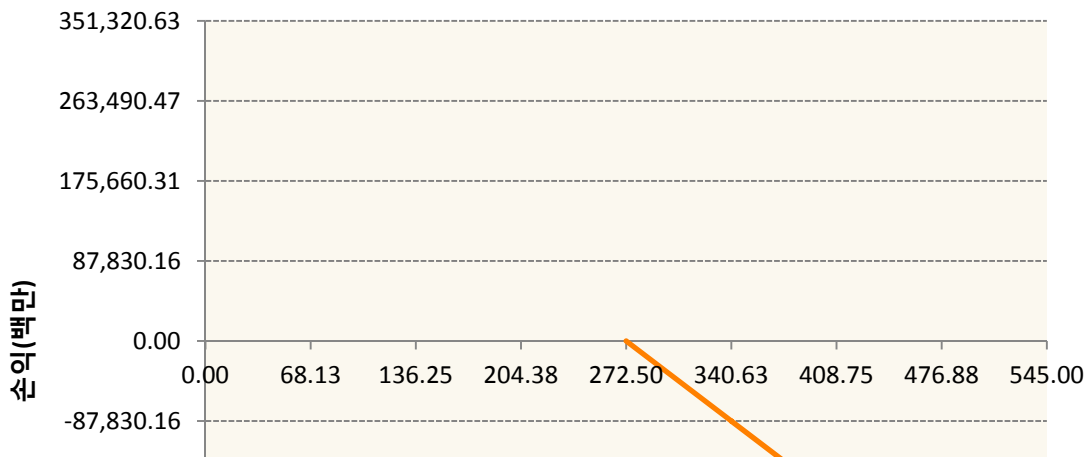
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	679	0	679	장내
누계	유가증권	옵션	0	582,986	-582,986	장내

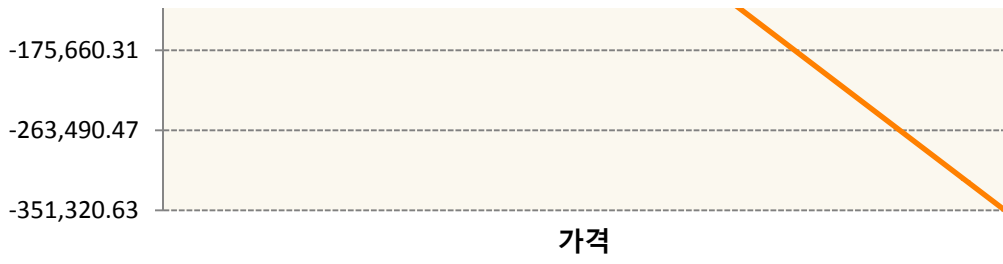
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P82709-2019-08 콜270

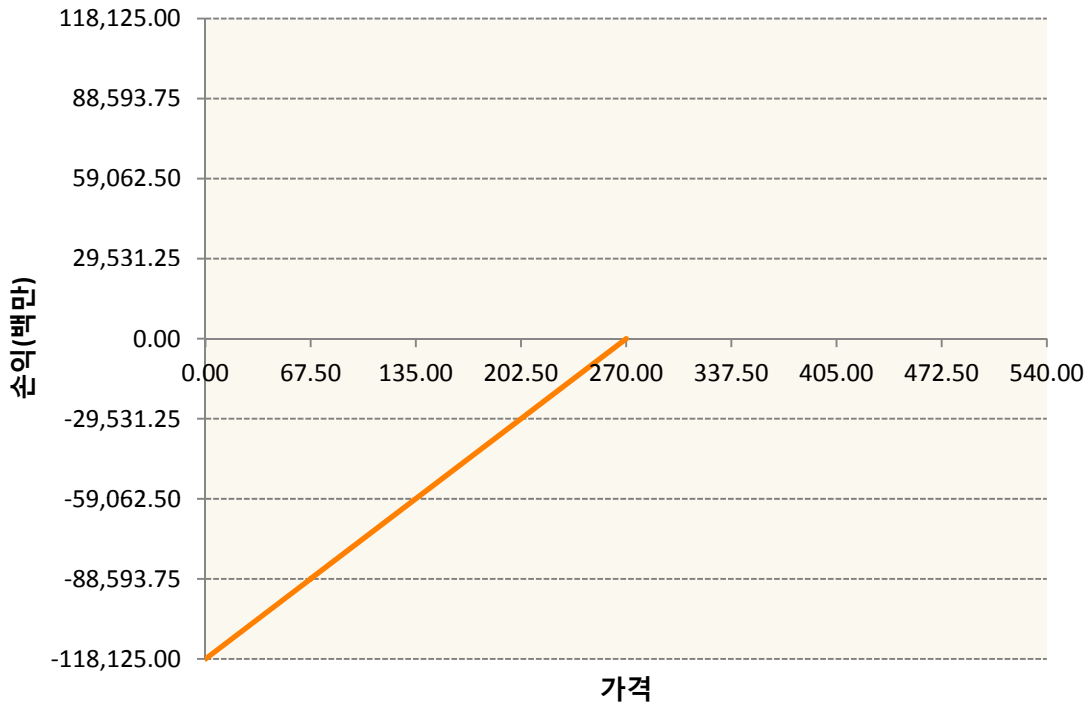


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

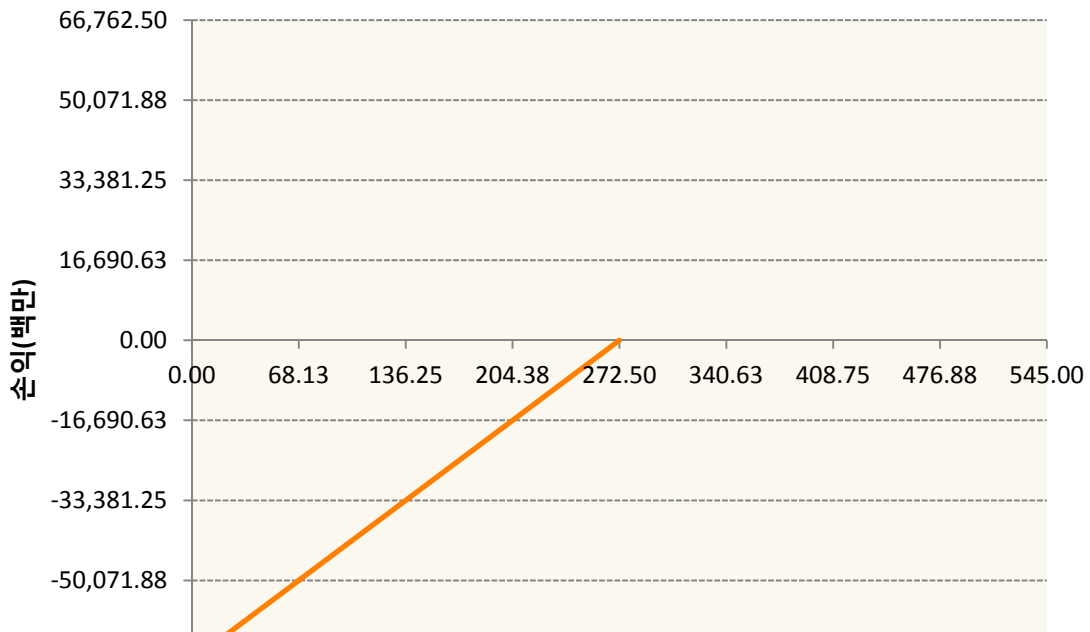




**KR4301P82707-2019-08 풋270**



**KR4301P82723-2019-08 풋272.5**



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P82709 2019-08 콜270							2,725
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	407	406	406	405	402	399	394
-5.33%	404	401	395	387	376	362	345
-2.67%	368	347	323	294	263	228	192
0%	155	104	52	0	-53	-107	-161
2.67%	-456	-508	-561	-615	-670	-725	-780
5.33%	-1,460	-1,484	-1,513	-1,545	-1,581	-1,619	-1,659
8.00%	-2,645	-2,650	-2,659	-2,671	-2,686	-2,704	-2,725
KR4201P82725 2019-08 콜272.5							18,372
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,054	2,054	2,052	2,048	2,039	2,024	2,001
-5.33%	2,048	2,036	2,014	1,978	1,926	1,857	1,768
-2.67%	1,926	1,831	1,707	1,555	1,378	1,177	956
0%	979	669	342	0	-353	-716	-1,086
2.67%	-2,410	-2,836	-3,264	-3,692	-4,120	-4,548	-4,976
5.33%	-8,984	-9,250	-9,540	-9,851	-10,178	-10,518	-10,870
8.00%	-17,487	-17,566	-17,674	-17,810	-17,974	-18,162	-18,372
KR4301P82707 2019-08 풋270							8,845
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,845	-8,845	-8,845	-8,845	-8,845	-8,845	-8,845
-5.33%	-5,739	-5,739	-5,739	-5,740	-5,742	-5,745	-5,750
-2.67%	-2,640	-2,648	-2,661	-2,678	-2,701	-2,728	-2,760
0%	218	149	76	0	-78	-158	-239
2.67%	1,802	1,728	1,651	1,571	1,489	1,406	1,322
5.33%	2,086	2,075	2,058	2,035	2,007	1,974	1,936
8.00%	2,098	2,097	2,096	2,094	2,091	2,086	2,077
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							5,084
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,084	-5,084	-5,084	-5,084	-5,084	-5,084	-5,084
-5.33%	-3,345	-3,345	-3,345	-3,345	-3,345	-3,346	-3,347
-2.67%	-1,606	-1,608	-1,610	-1,615	-1,621	-1,629	-1,640
0%	82	58	30	0	-33	-68	-105
2.67%	1,286	1,235	1,183	1,132	1,080	1,028	976

5.33%	1,631	1,615	1,595	1,572	1,546	1,517	1,485
8.00%	1,656	1,655	1,653	1,650	1,645	1,639	1,630

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

(단위:백만원)

**37,760**

공시일	2019-08-01
기준일	2019-07-31

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

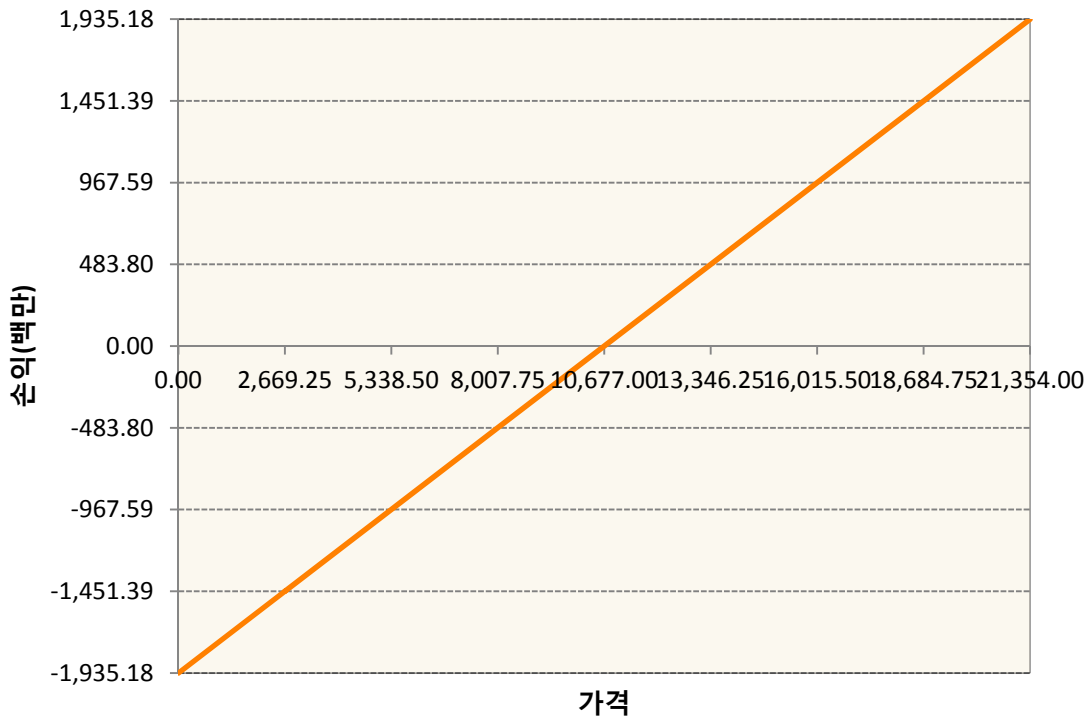
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

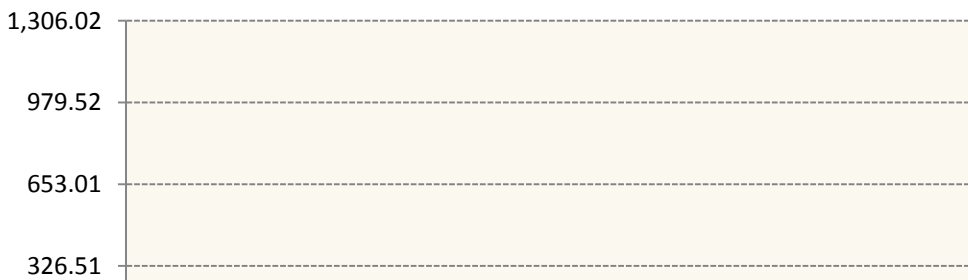
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,935	0	1,935	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,601	-3,601	장내
누계	통화	선도	151	3,174	-3,023	장외

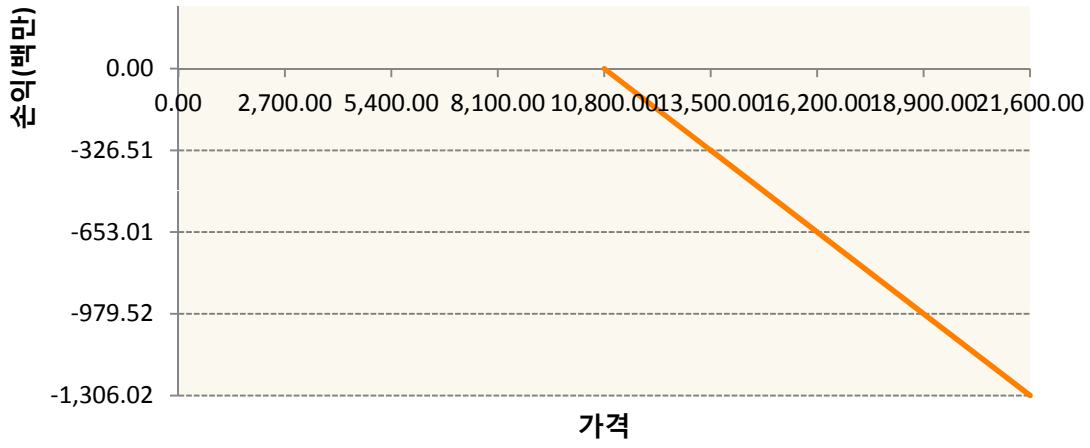
### 2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19

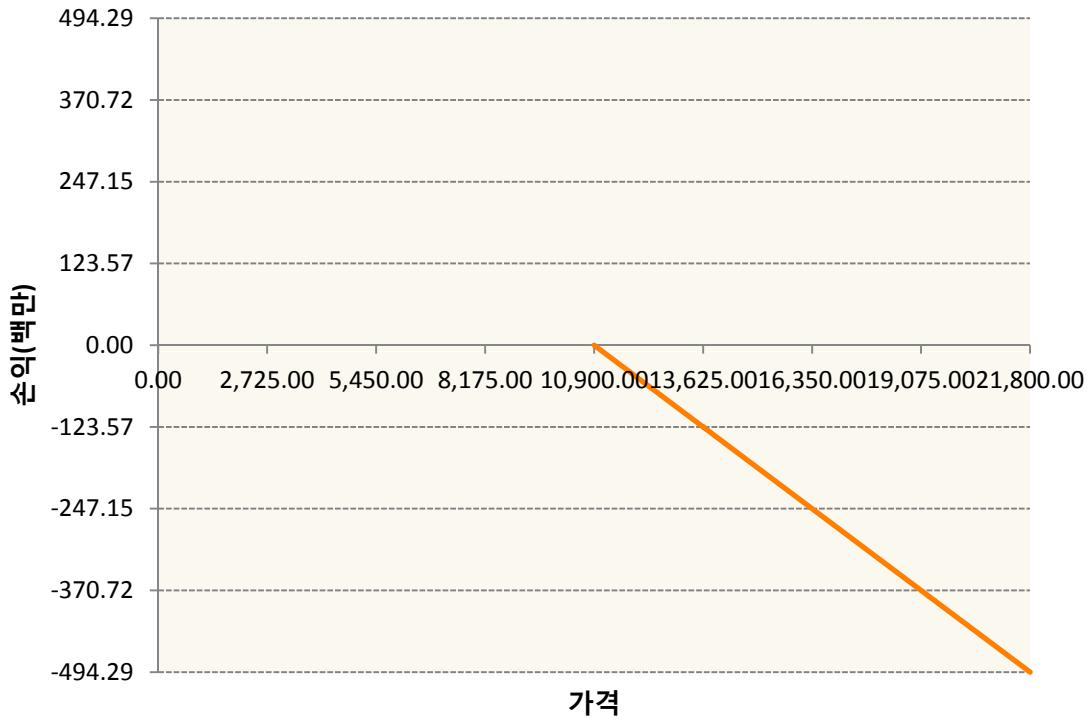


OHHIQ9-C108-HSCEI

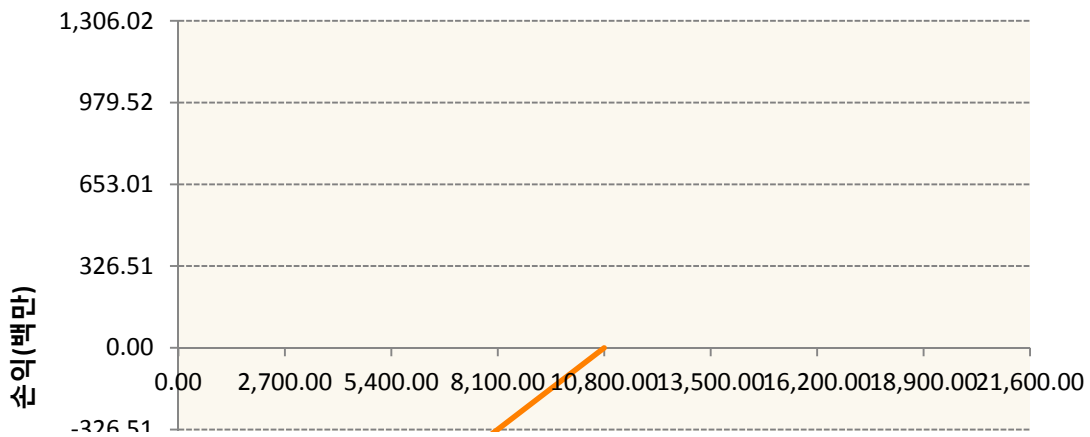


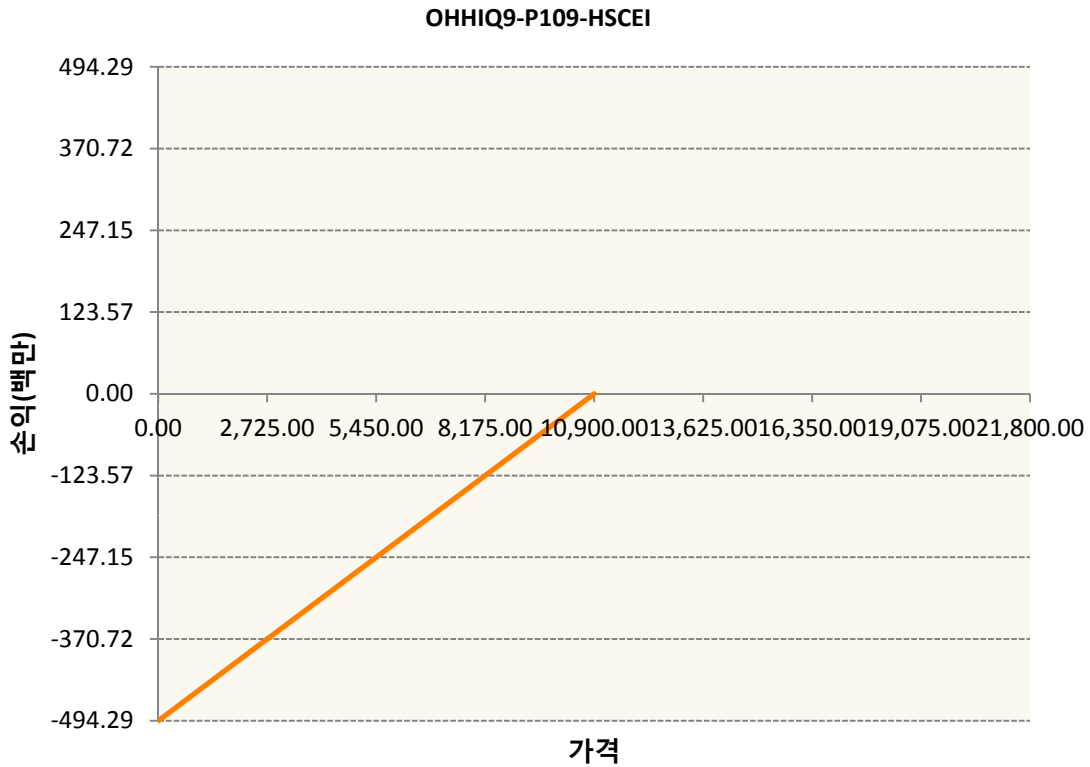
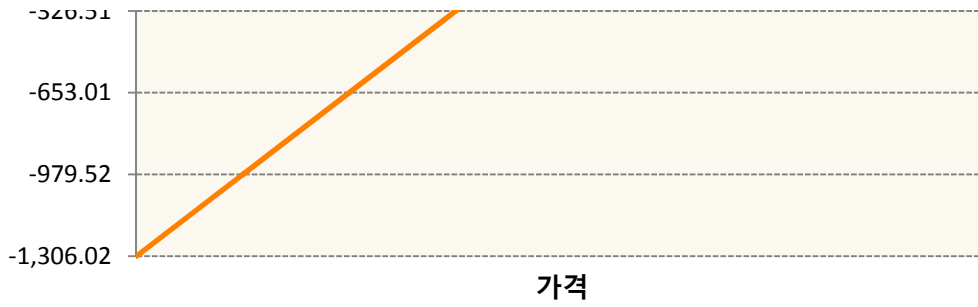


OHHIQ9-C109-HSCEI



OHHIQ9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	254
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E	12
HCQ9 HSCEI Futures Aug19	155
OHHIQ9-C1(HSCEI	104
OHHIQ9-C1(HSCEI	40
OHHIQ9-P1(HSCEI	104
OHHIQ9-P1(HSCEI	40

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	516

공시일	2019-08-01
기준일	2019-07-31

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

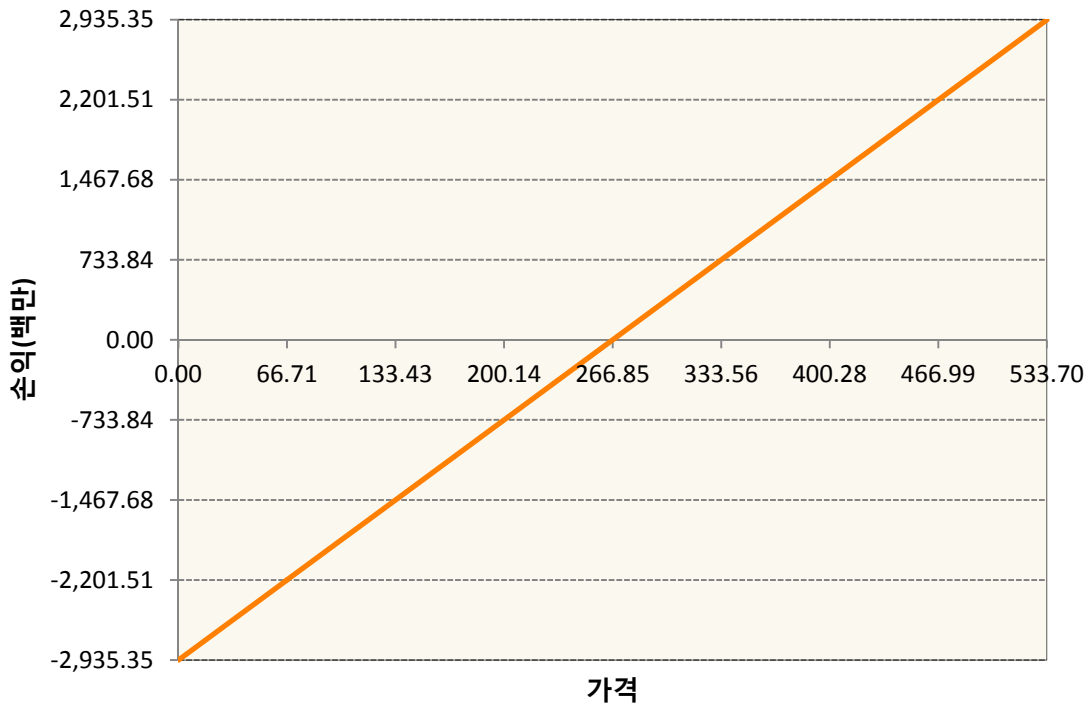
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

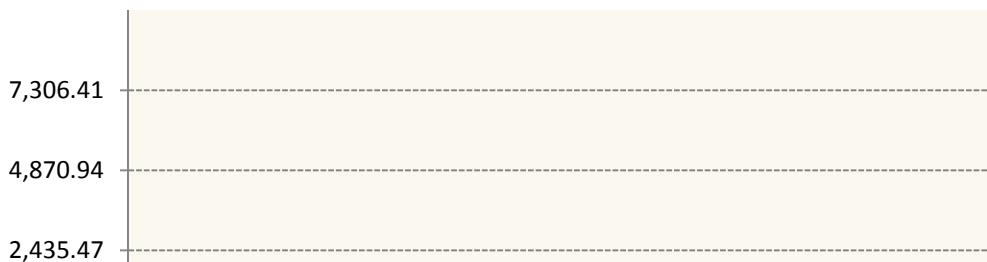
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	133	-133	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	136	0	136	장내
누계	유가증권	선물	2,935	0	2,935	장내
누계	유가증권	스왑	18,836	0	18,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	19,089	-19,089	장내

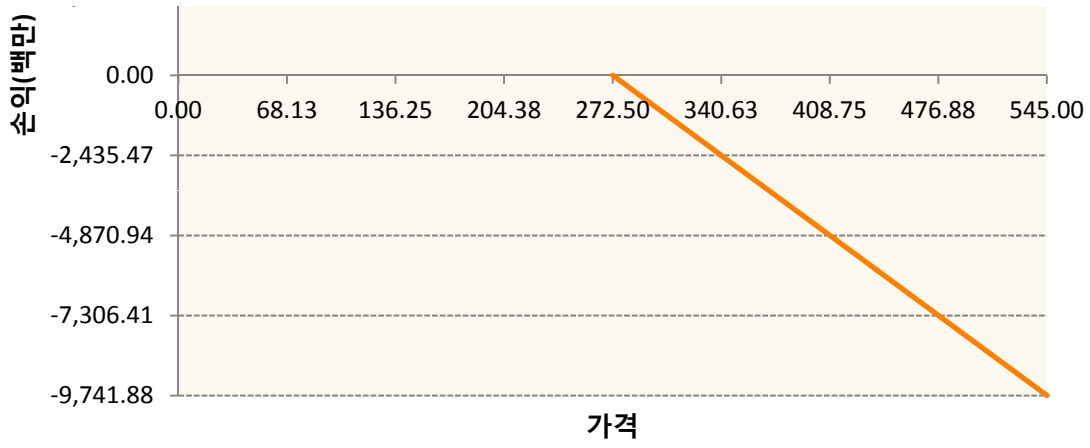
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

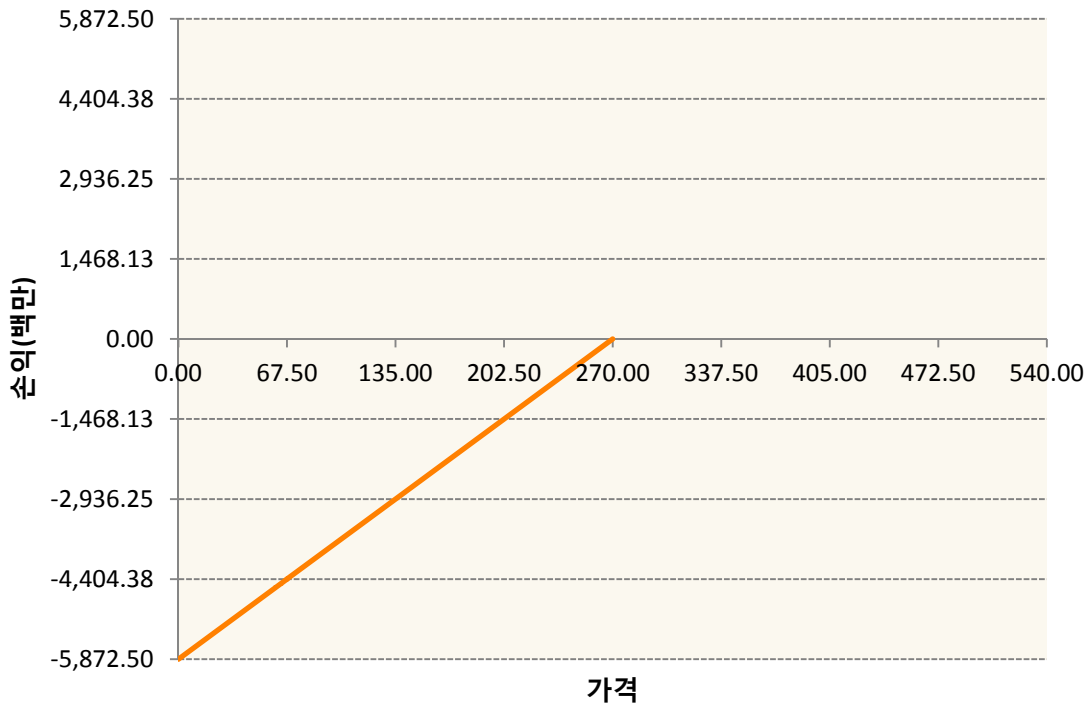


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

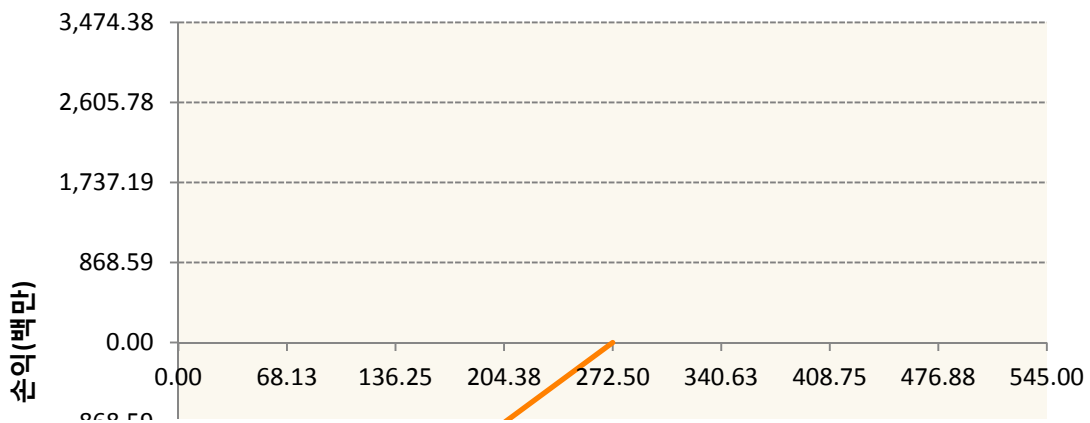




KR4301P82707-2019-08 풋270



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						234
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-234	-234	-234	-234	-234	-234	-234	
-5.33%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156	
-2.67%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	78	78	78	78	78	78	78	
5.33%	156	156	156	156	156	156	156	
8.00%	234	234	234	234	234	234	234	
KR4201P82725		2019-08 콜272.5						509
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	57	57	57	57	57	56	55
-5.33%	57	56	56	55	53	51	49
-2.67%	53	51	47	43	38	33	27
0%	27	19	9	0	-10	-20	-30
2.67%	-67	-79	-91	-102	-114	-126	-138
5.33%	-249	-256	-265	-273	-282	-292	-301
8.00%	-485	-487	-490	-494	-498	-504	-509
KR4301P82707                      2019-08 풋270							440
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-440	-440	-440	-440	-440	-440	-440
-5.33%	-285	-285	-285	-285	-285	-286	-286
-2.67%	-131	-132	-132	-133	-134	-136	-137
0%	11	7	4	0	-4	-8	-12
2.67%	90	86	82	78	74	70	66
5.33%	104	103	102	101	100	98	96
8.00%	104	104	104	104	104	104	103
KR4301P82723                      2019-08 풋272.5							265
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-265	-265	-265	-265	-265	-265	-265
-5.33%	-174	-174	-174	-174	-174	-174	-174
-2.67%	-84	-84	-84	-84	-84	-85	-85
0%	4	3	2	0	-2	-4	-5
2.67%	67	64	62	59	56	54	51
5.33%	85	84	83	82	80	79	77
8.00%	86	86	86	86	86	85	85

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

(단위:백만원)

**3,192**

공시일	2019-08-01
기준일	2019-07-31

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

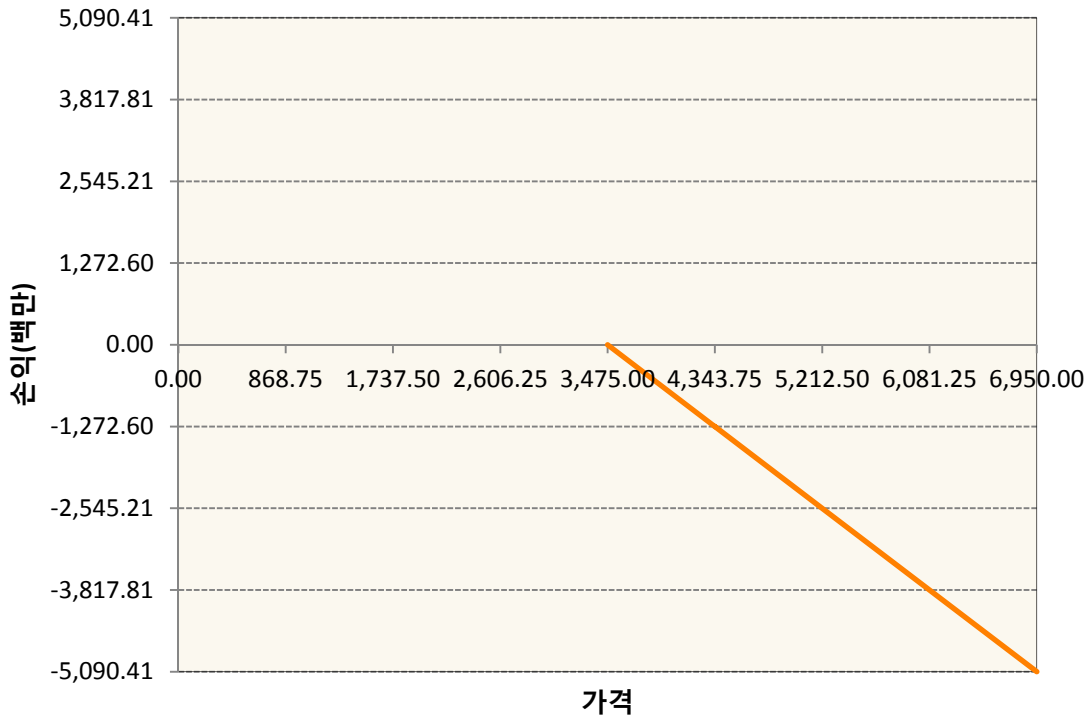
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

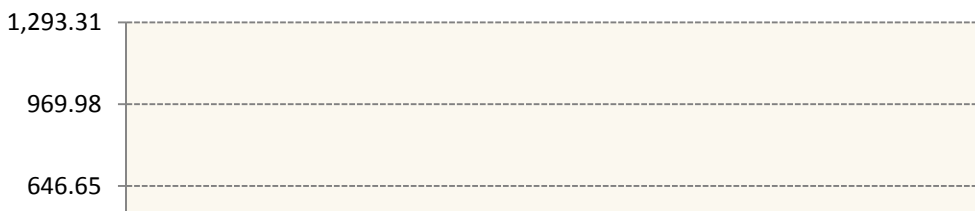
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,429	0	3,429	
누계	유가증권	스왑	37,684	0	37,684	장외
누계	유가증권	옵션	0	12,767	-12,767	장내
누계	통화	선도	12,141	22,435	-10,294	장외

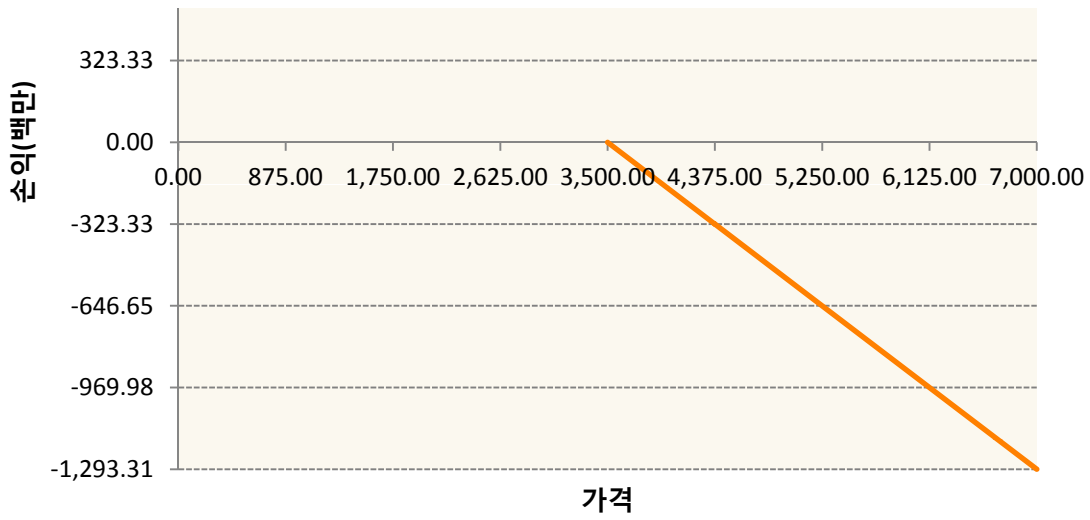
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXQ9-C3475-EURO STOXX 50**

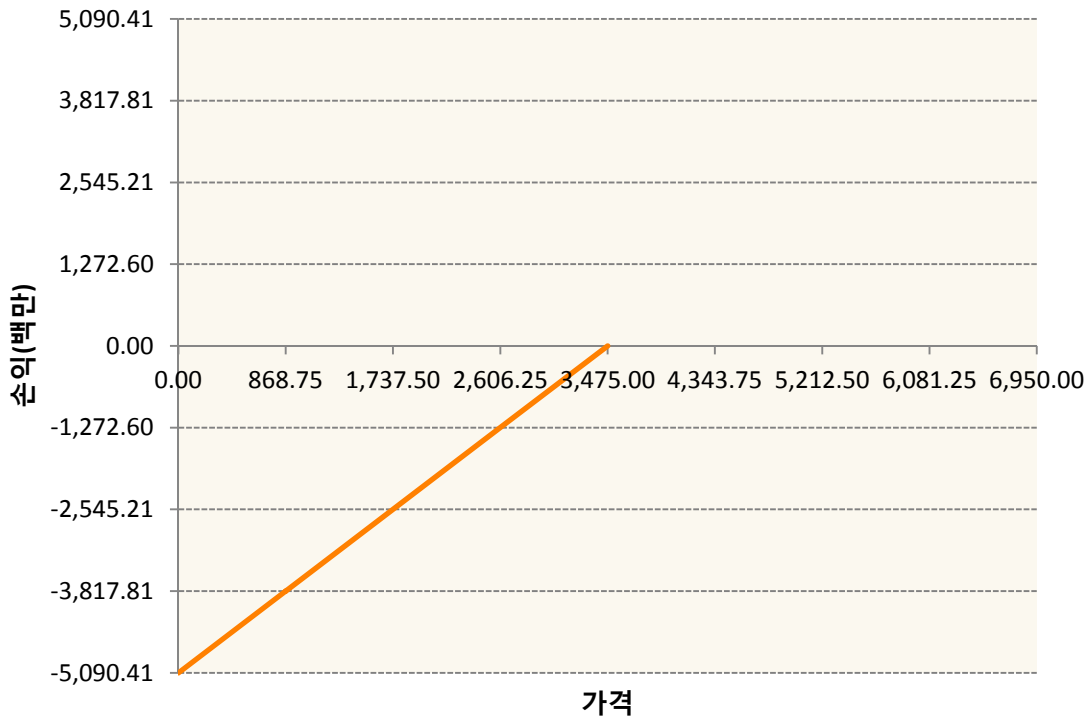


**OESXQ9-C3500-EURO STOXX 50**

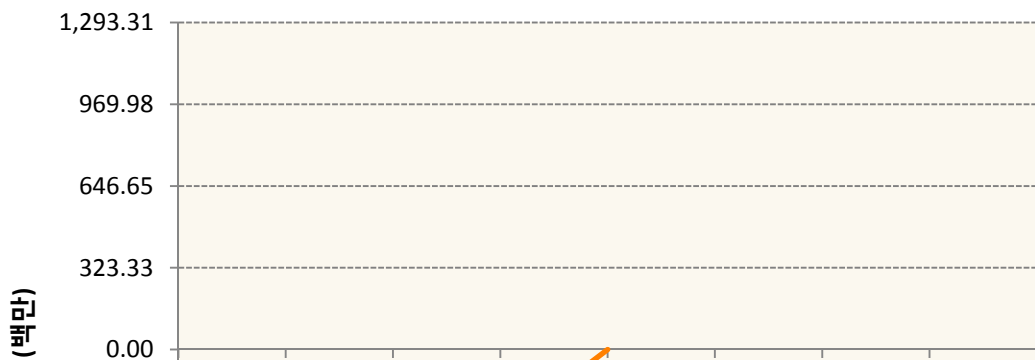


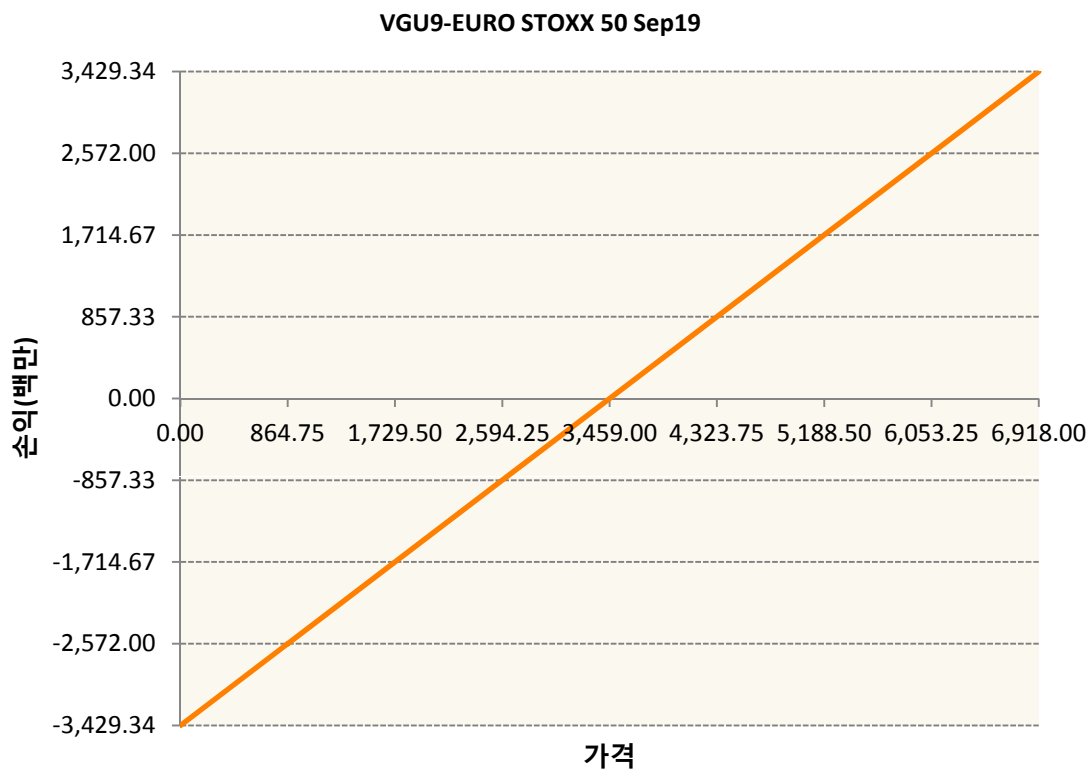
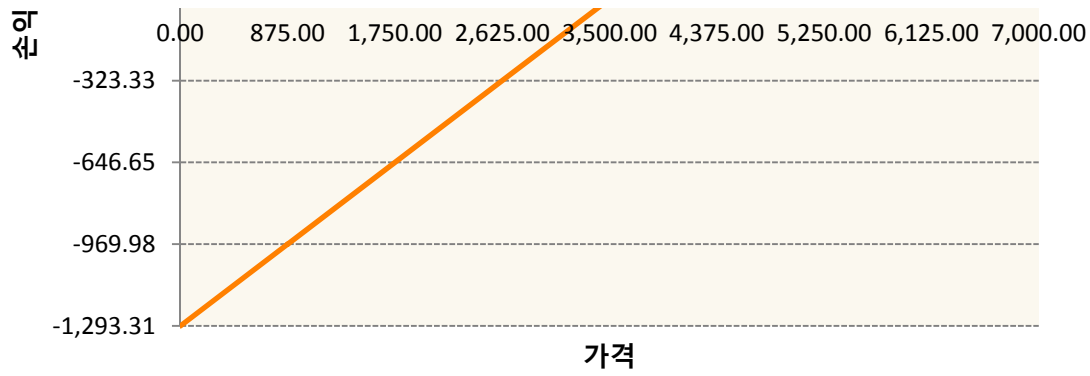


**OESXQ9-P3475-EURO STOXX 50**



**OESXQ9-P3500-EURO STOXX 50**





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	1
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	422
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E	1,056
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	317
FX21019N01 EUR/KRW 23-08-19E	422
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E	317
FX21019N04 EUR/KRW 27-09-19E	232
OESXQ9-C34 EURO STOXX 50	407
OESXQ9-C35 EURO STOXX 50	103
OESXQ9-P34 EURO STOXX 50	407
OESXQ9-P35 EURO STOXX 50	103

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

(단위:백만원)

**2,149**



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

(단위:백만원)

1,003



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

(단위:백만원)

85



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

(단위:백만원)

130

공시일	2019-08-01
기준일	2019-07-31

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

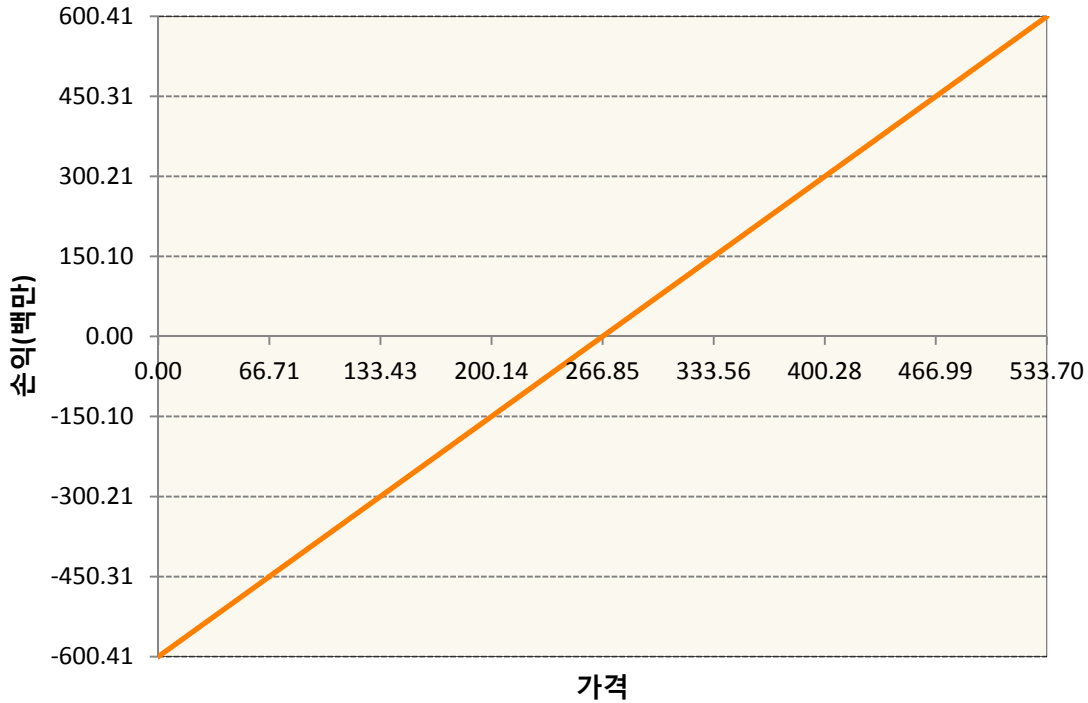
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	600	0	600	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	2019-08-01
기준일	2019-07-31

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

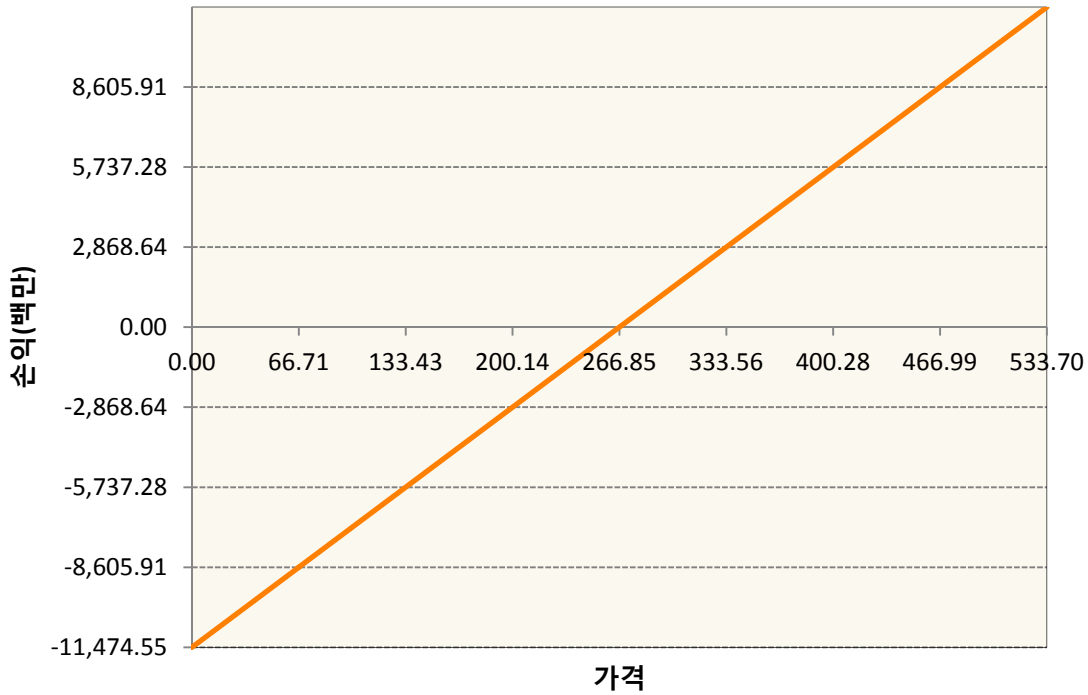
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

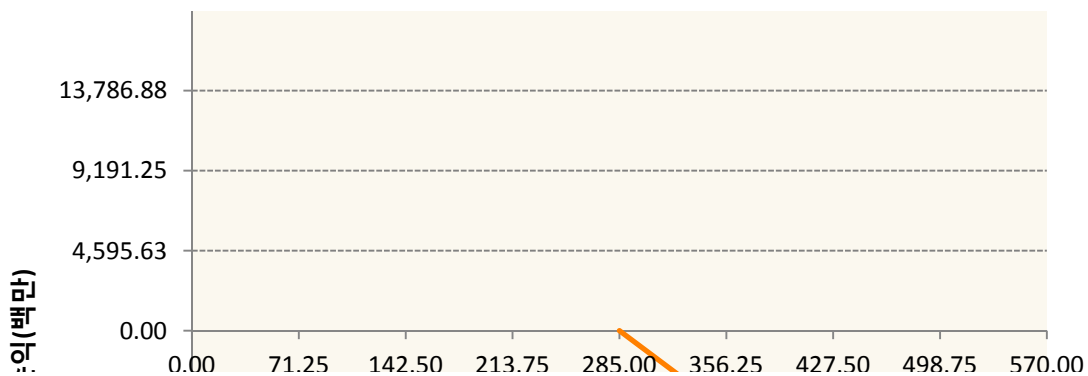
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,475	0	11,475	장내
누계	유가증권	옵션	1,698	21,617	-19,919	장내

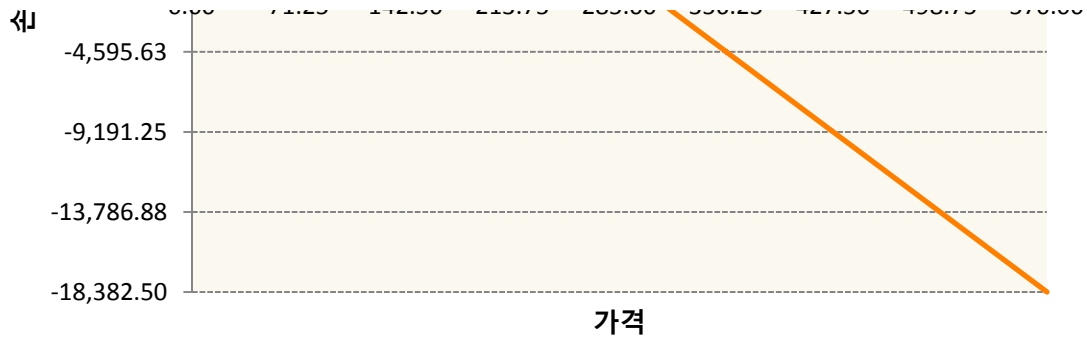
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

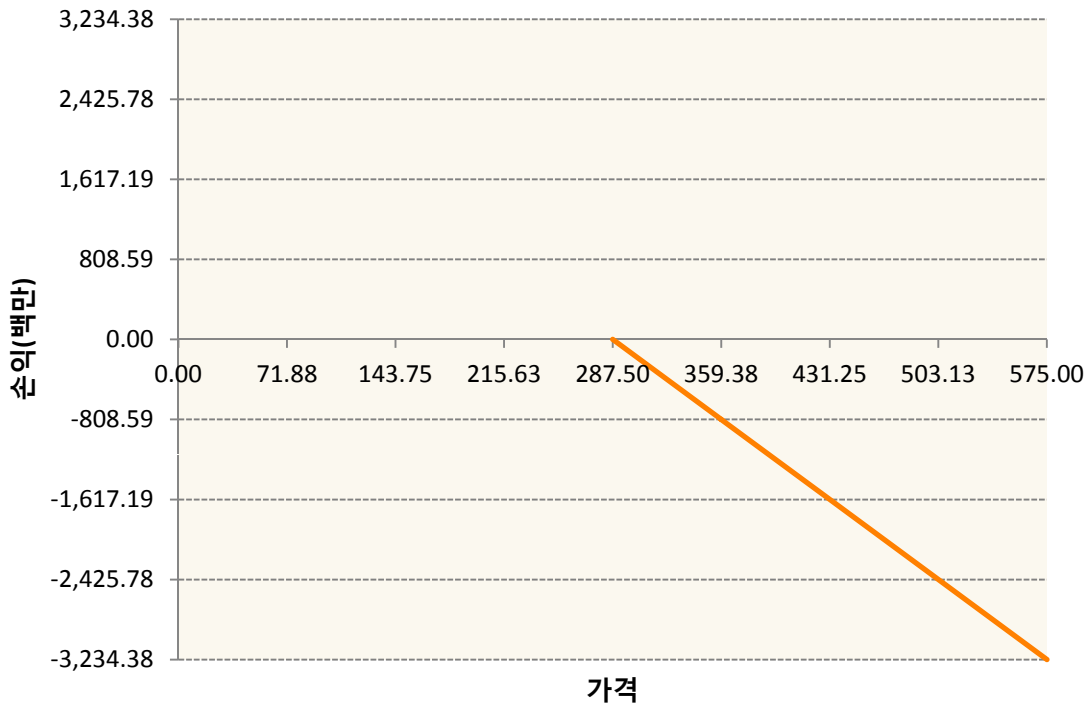


KR4201P82857-2019-08 콜285

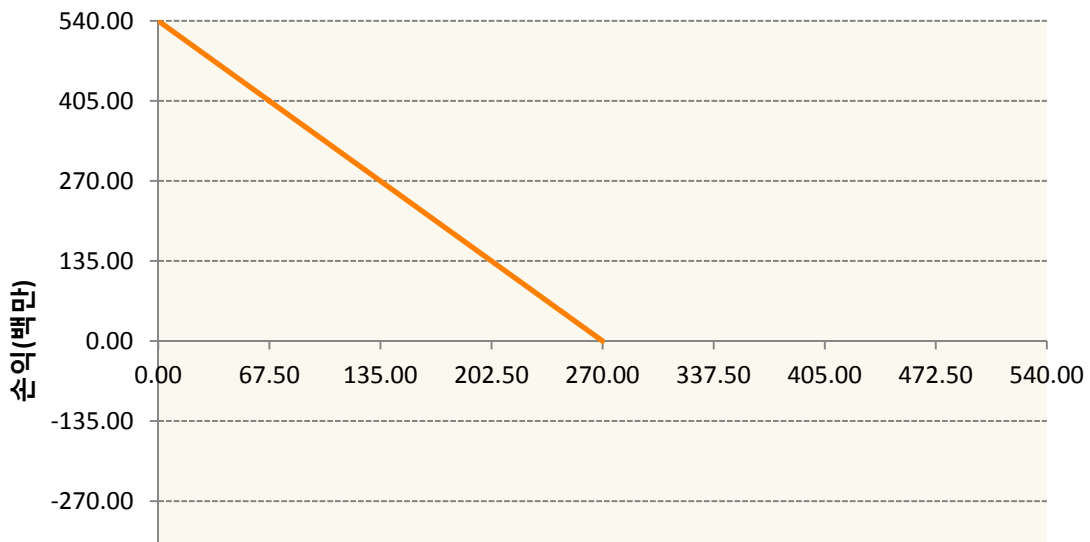


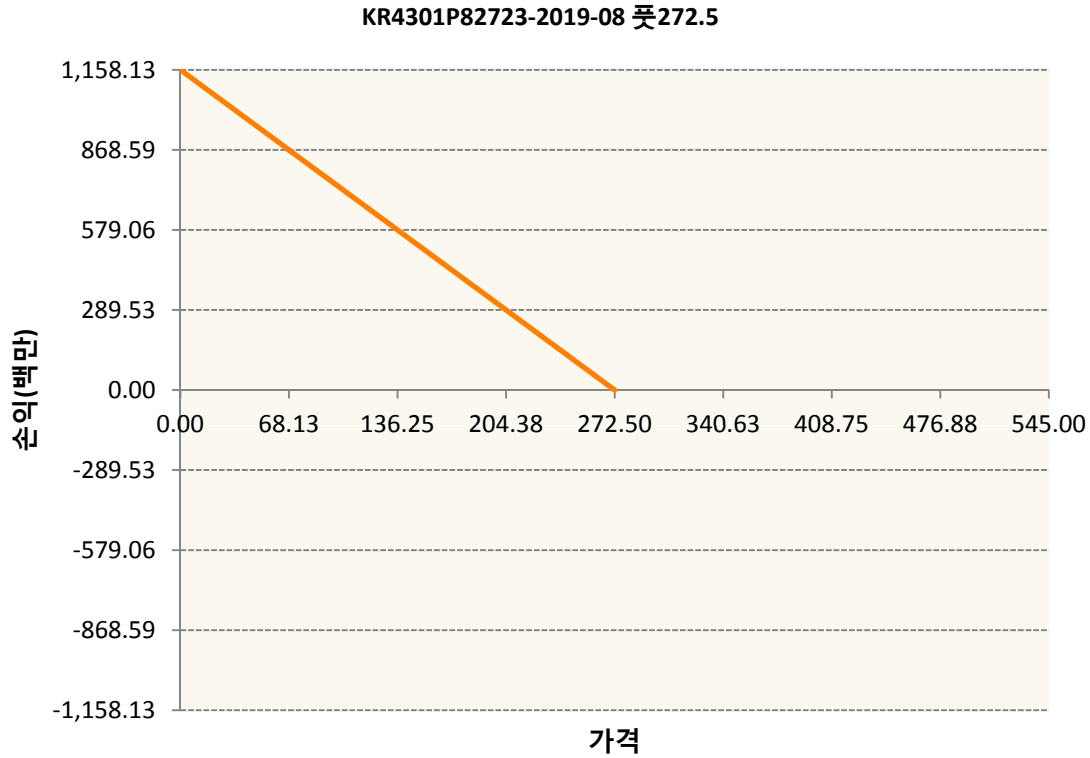
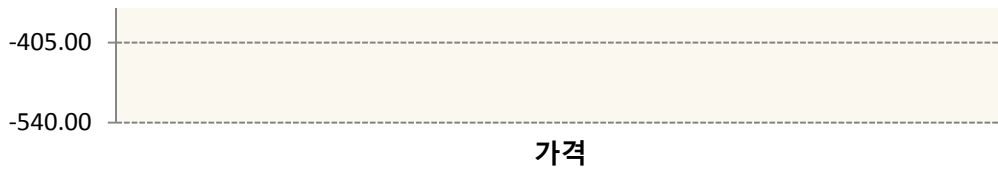


KR4201P82873-2019-08 콜287.5



KR4301P82707-2019-08 풋270





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

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						916
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-916	-916	-916	-916	-916	-916	-916	
-5.33%	-611	-611	-611	-611	-611	-611	-611	
-2.67%	-305	-305	-305	-305	-305	-305	-305	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	305	305	305	305	305	305	305	
5.33%	611	611	611	611	611	611	611	
8.00%	916	916	916	916	916	916	916	
KR4201P82857		2019-08 콜285						420
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	8	8	8	8	8	8	8	
-5.33%	8	8	8	8	8	8	7	
-2.67%	8	8	8	7	6	5	3	

0%	7	6	3	0	-4	-10	-17
2.67%	-6	-14	-23	-34	-46	-60	-74
5.33%	-79	-99	-118	-138	-159	-179	-200
8.00%	-289	-310	-332	-354	-376	-398	-420
KR4201P82873                      2019-08 콜287.5							59
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1
-2.67%	1	1	1	1	1	0	0
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	0	-1	-2	-4	-5	-7	-9
5.33%	-8	-11	-14	-17	-20	-23	-27
8.00%	-35	-39	-43	-47	-51	-55	-59
KR4301P82707                      2019-08 풋270							40
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	40	40	40	40	40	40	40
-5.33%	26	26	26	26	26	26	26
-2.67%	12	12	12	12	12	12	13
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-8	-8	-8	-7	-7	-6	-6
5.33%	-10	-9	-9	-9	-9	-9	-9
8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-9
KR4301P82723                      2019-08 풋272.5							88
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	88	88	88	88	88	88	88
-5.33%	58	58	58	58	58	58	58
-2.67%	28	28	28	28	28	28	28
0%	-1	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-22	-21	-21	-20	-19	-18	-17
5.33%	-28	-28	-28	-27	-27	-26	-26
8.00%	-29	-29	-29	-29	-29	-28	-28

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

(단위:백만원)

**1,082**

공시일	2019-08-01
기준일	2019-07-31

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	710	0	710	
누계	유가증권	수익증권	49,158	0	49,158	

### 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	2019-08-01
기준일	2019-07-31

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,775	0	1,775	
누계	유가증권	수익증권	60,070	0	60,070	

### 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	2019-08-01
기준일	2019-07-31

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	9,465	0	9,465	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	435,744	0	435,744	
누계	통화	선도	0	429,584	-429,584	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E	3,123
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E	2,120
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E	1,704
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E	2,082
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E	133
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	568
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	3,029
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	3,313
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	473
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E	946
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E	2,944
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E	1,647
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E	757
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E	1,893
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E	1,893
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	663
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E	2,650
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E	1,325
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E	757
FX21019N04 KRW/USD 03-09-19E	284

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

(단위:백만원)

11,066

공시일	2019-08-01
기준일	2019-07-31

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

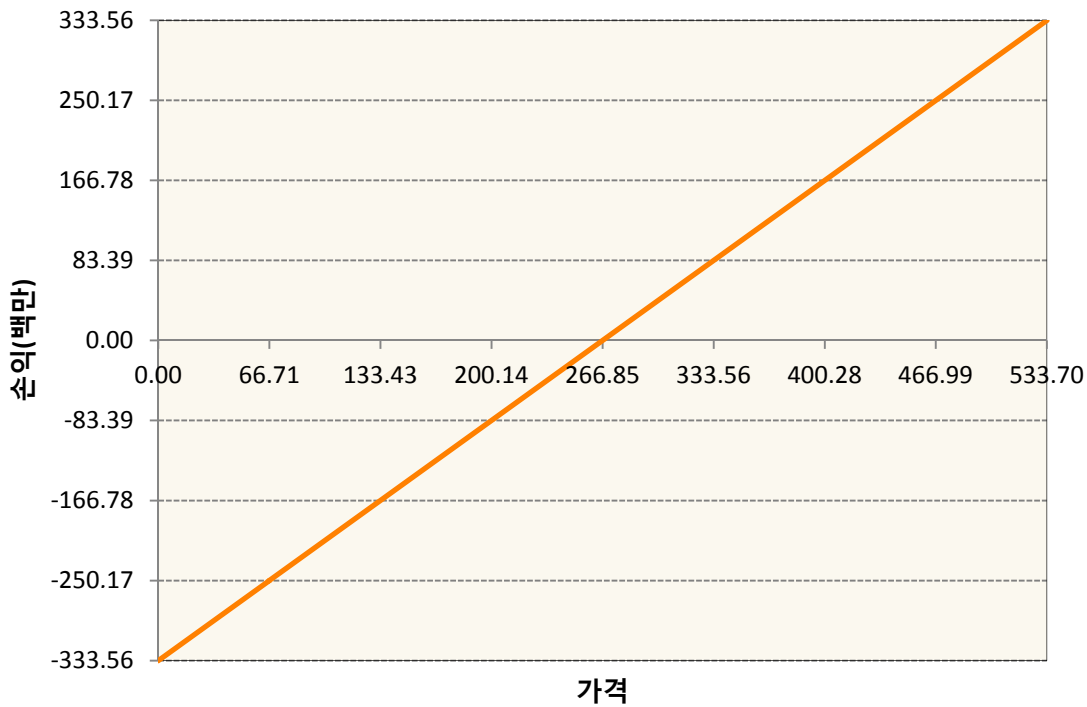
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

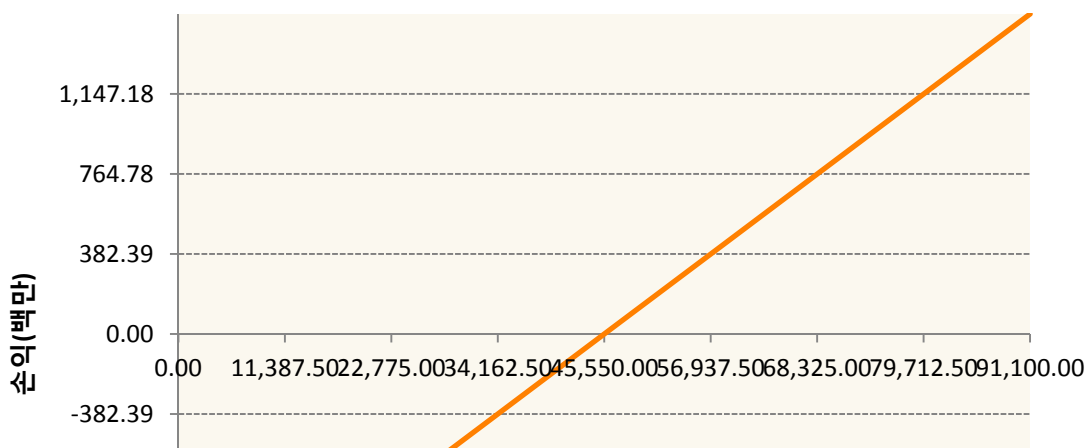
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,863	0	1,863	장내

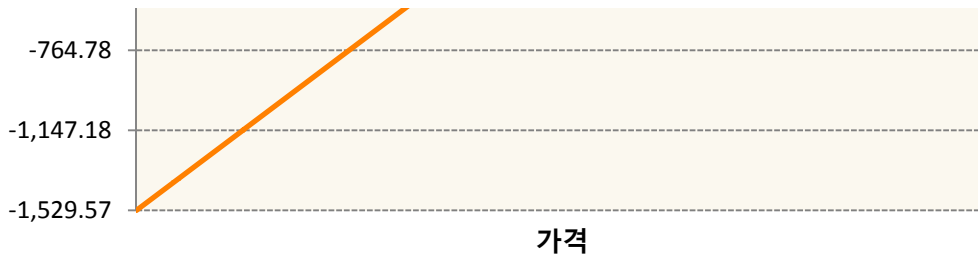
### 2. 만기시점의 손익구조

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						122
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-122	-122	-122	-122	-122	-122	-122	
-5.33%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81	
-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%	81	81	81	81	81	81	81	
8.00%	122	122	122	122	122	122	122	

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

177

공시일	2019-08-01
기준일	2019-07-31

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

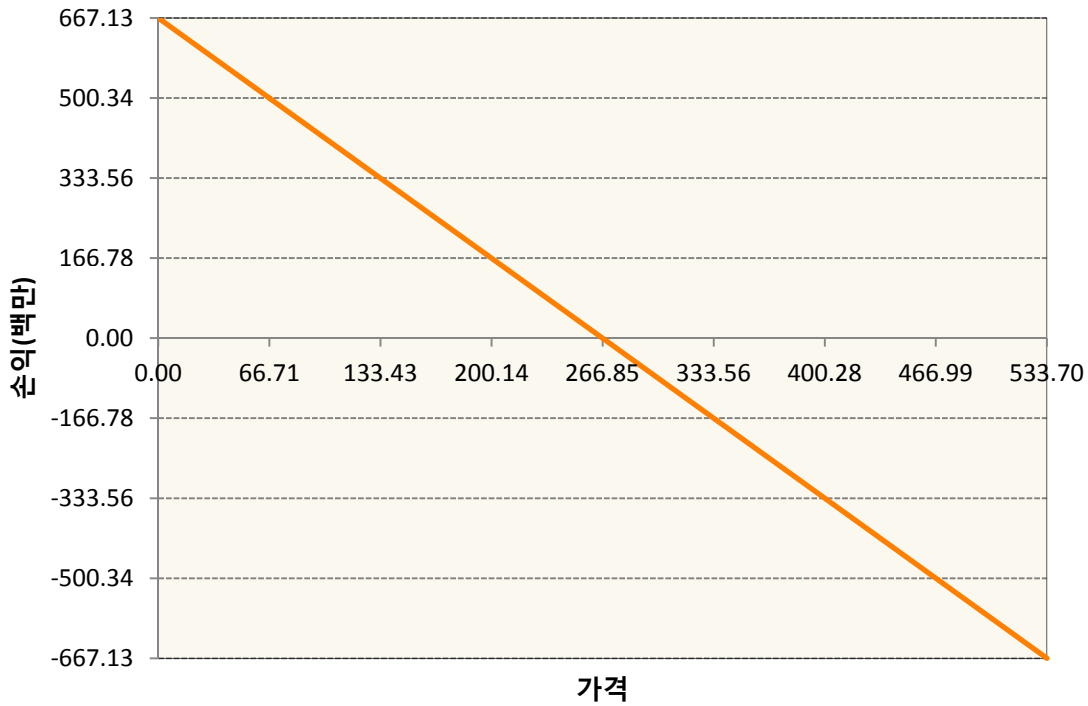
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

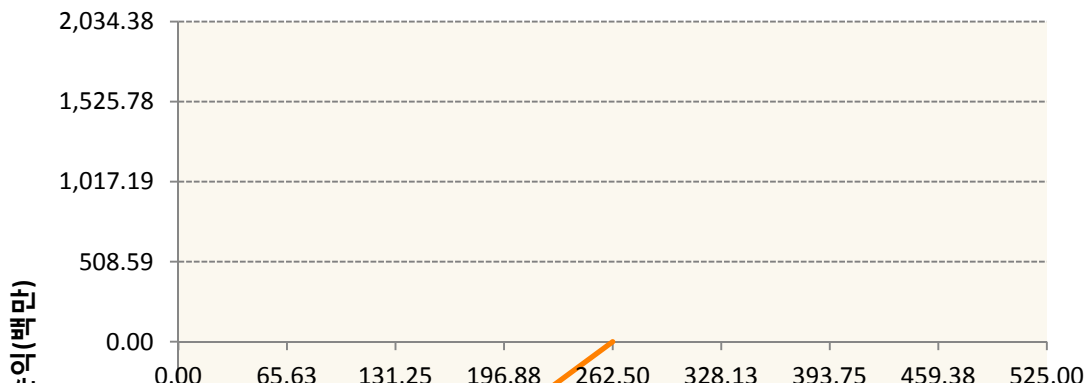
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	667	-667	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,757	-3,757	장내

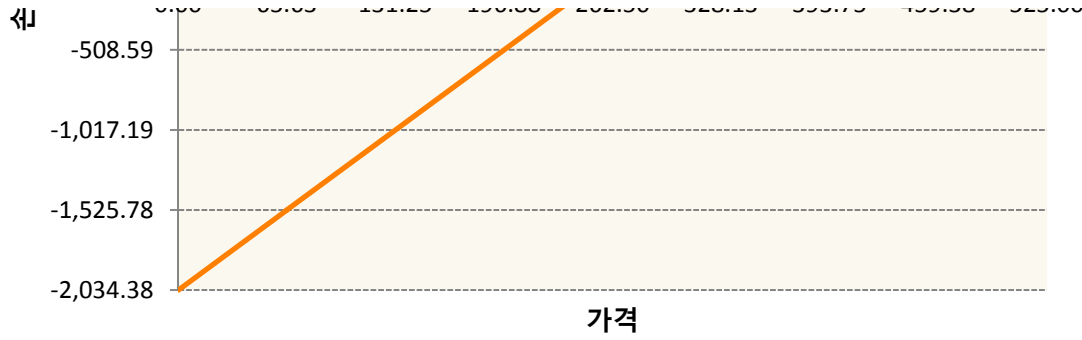
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

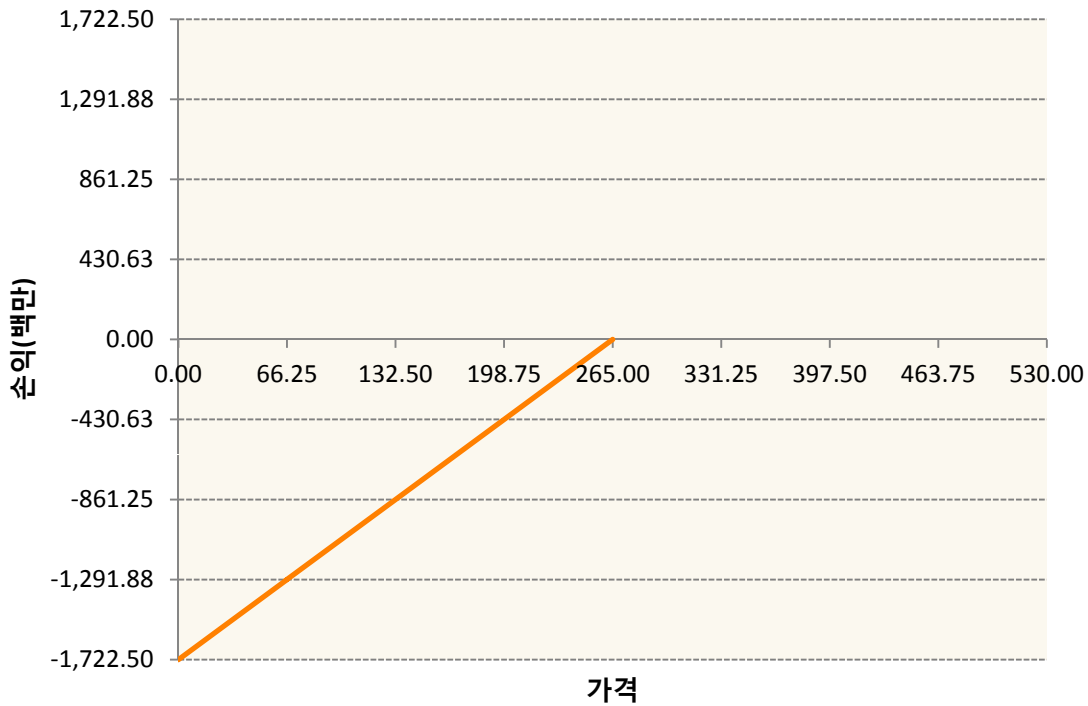


KR4301P82624-2019-08 풋262.5





KR4301P82657-2019-08 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						53
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	53	53	53	53	53	53	53	
-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%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53	
KR4301P82624		2019-08 풋262.5						128
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
-5.33%	-73	-73	-73	-74	-74	-74	-75
-2.67%	-23	-24	-25	-27	-28	-29	-31
0%	4	3	1	0	-1	-3	-4
2.67%	8	8	7	7	7	6	6
5.33%	8	8	8	8	8	8	8
8.00%	8	8	8	8	8	8	8

KR4301P82657

2019-08 풋265

118

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118
-5.33%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72
-2.67%	-27	-28	-28	-29	-30	-31	-32
0%	4	3	1	0	-1	-3	-4
2.67%	12	12	11	11	10	9	9
5.33%	12	12	12	12	12	12	12
8.00%	12	12	12	12	12	12	12

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

(단위:백만원)

**324**

공시일	2019-08-01
기준일	2019-07-31

## 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	18,705	0	18,705	
누계	통화	선도	0	18,338	-18,338	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		984
FX21019N01 KRW/USD 12-08-19E		161
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		322

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

(단위:백만원)

472
-----

공시일	2019-08-01
기준일	2019-07-31

## 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	376	0	376	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)

<b>30</b>
-----------

공시일	2019-08-01
기준일	2019-07-31

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

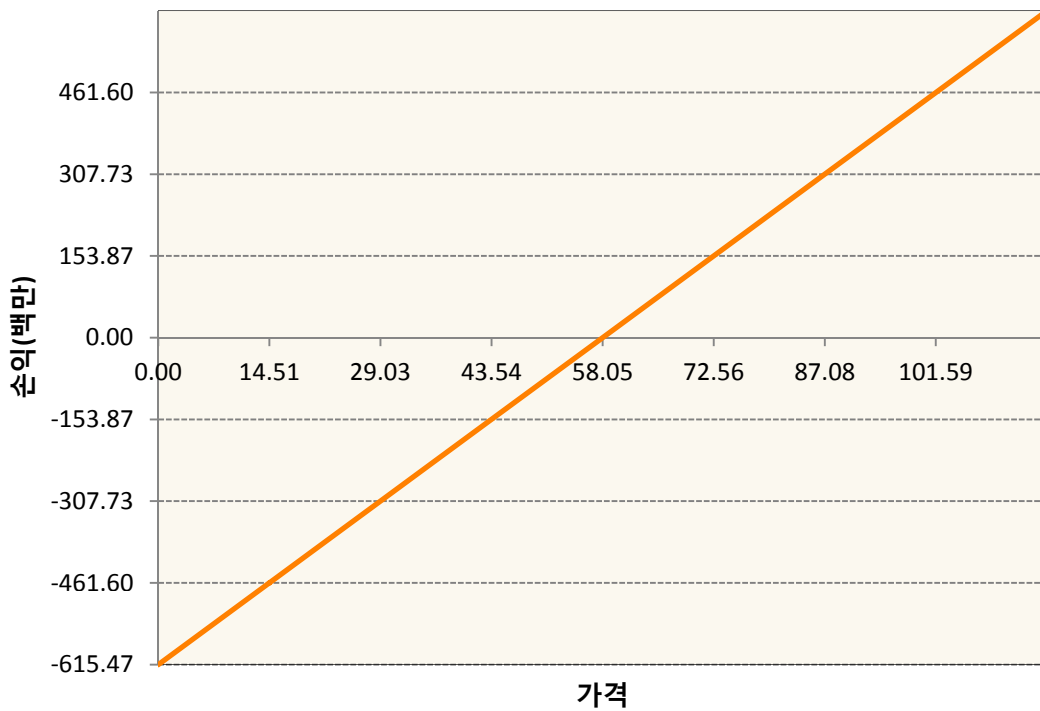
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

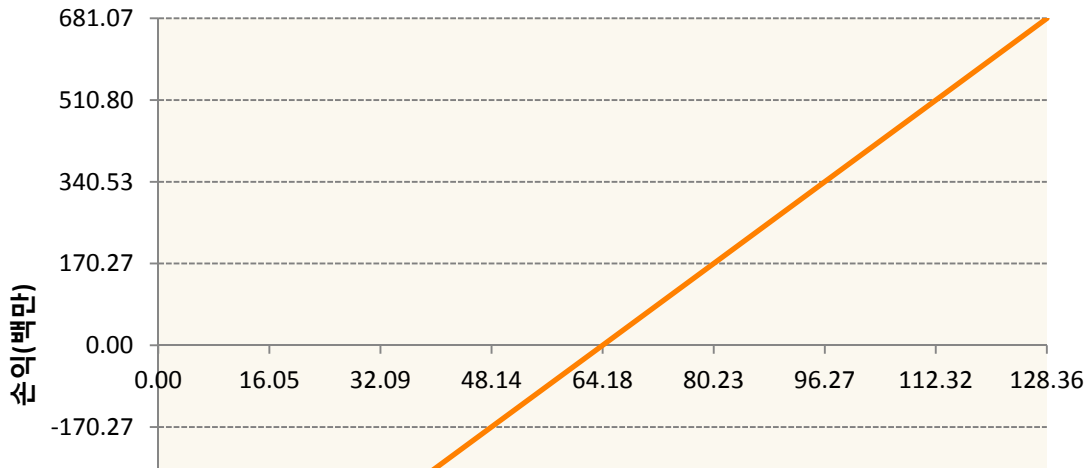
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,550	118	2,431	

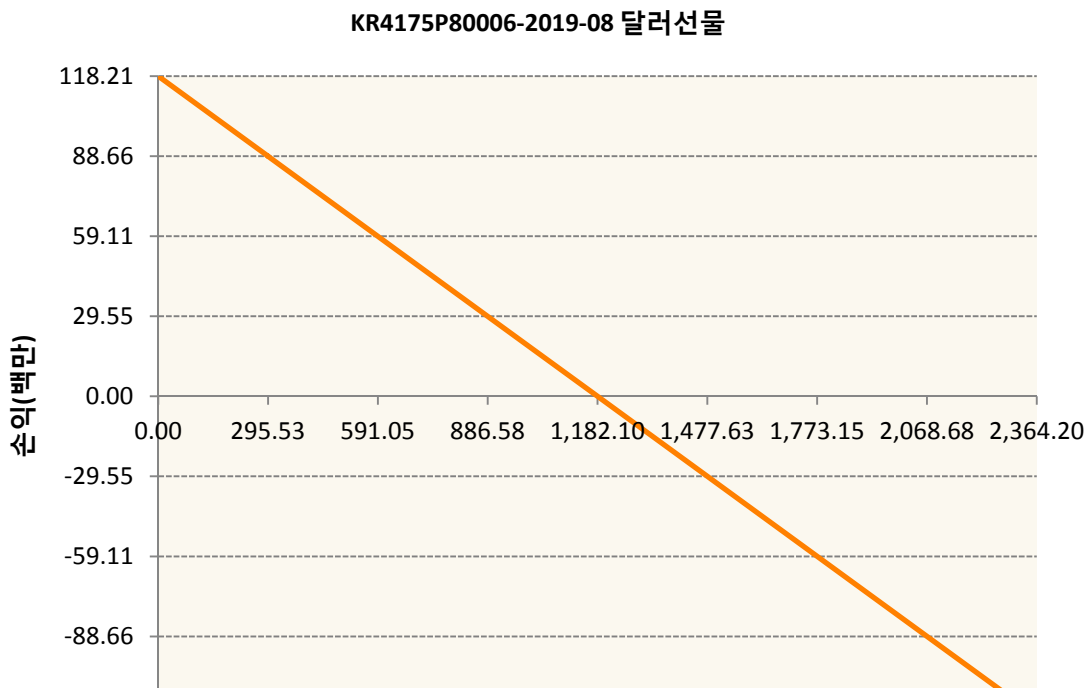
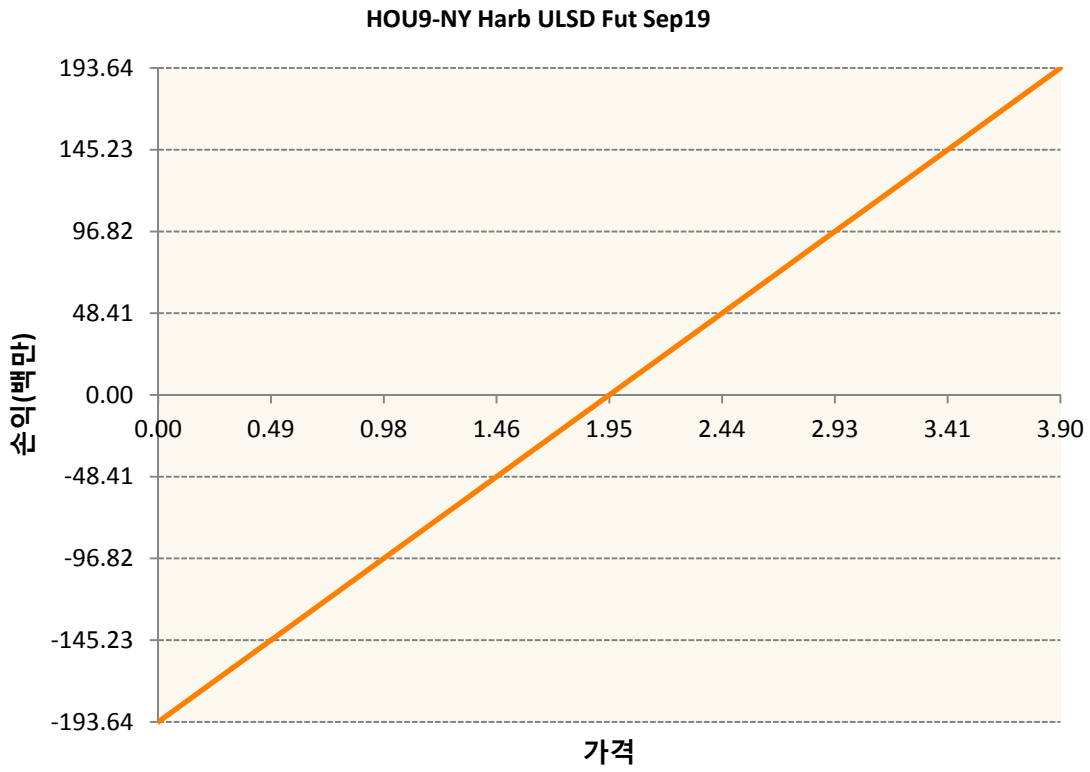
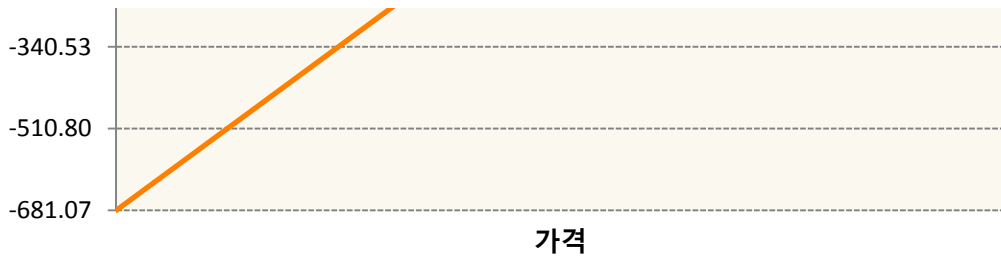
### 2. 만기시점의 손익구조

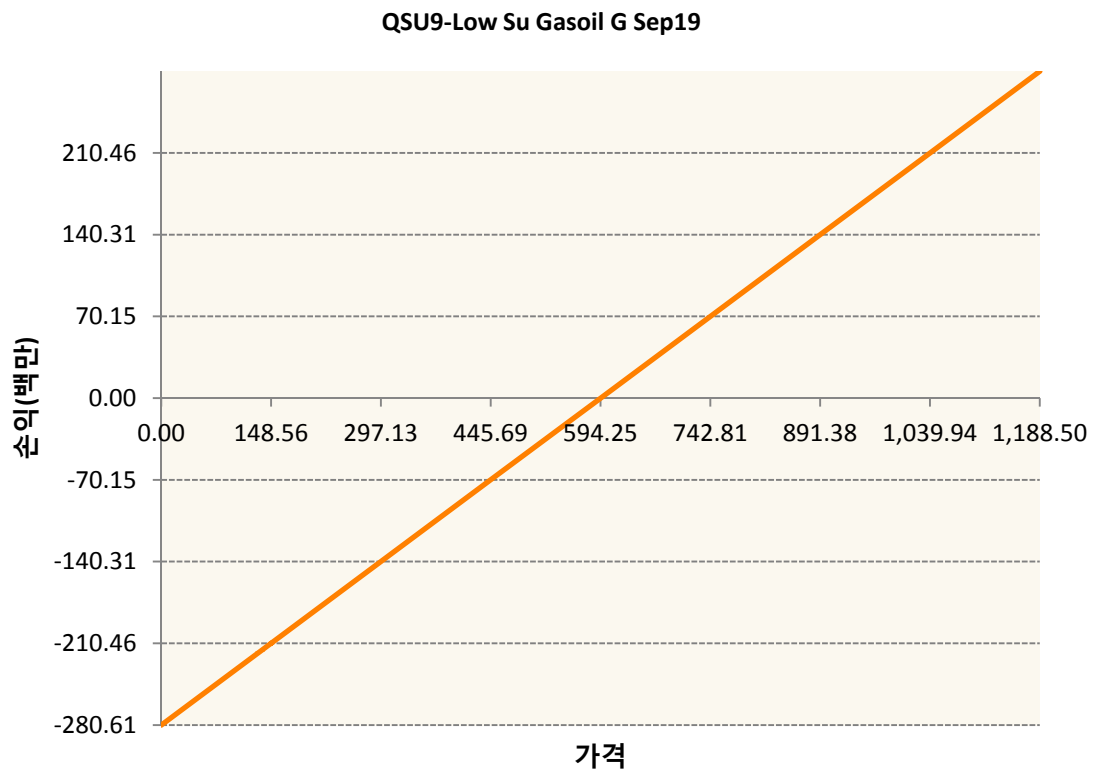
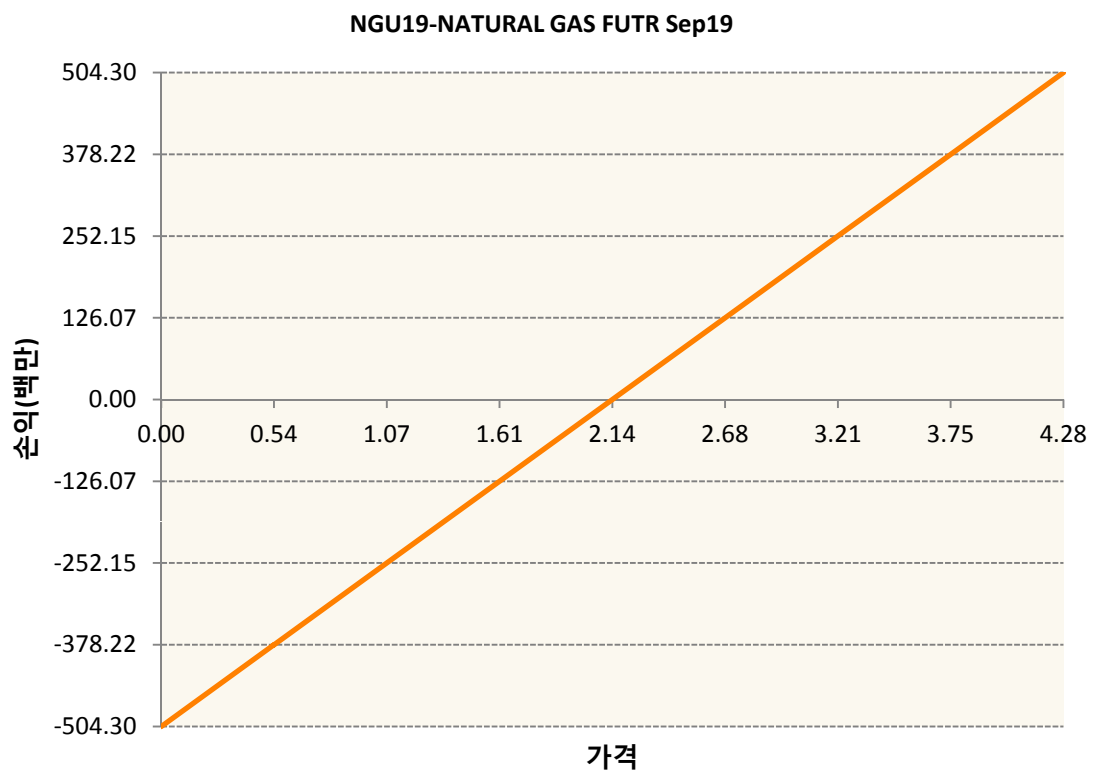
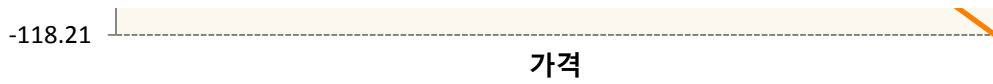
CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19



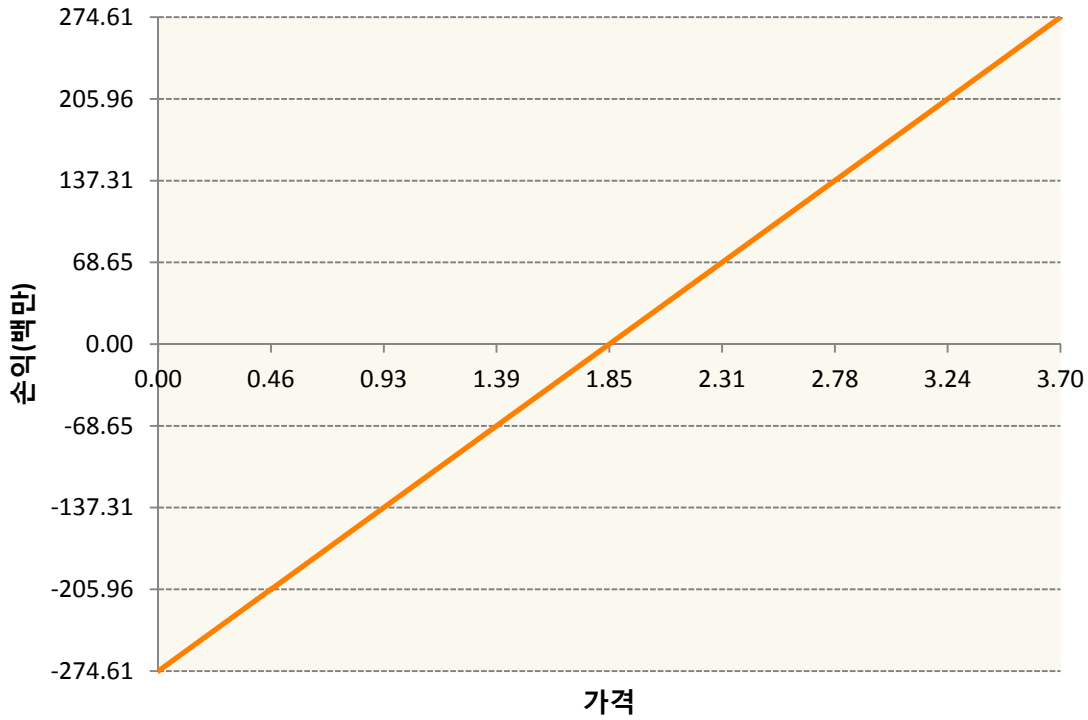
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19







XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	49
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)

370

공시일	2019-08-01
기준일	2019-07-31

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

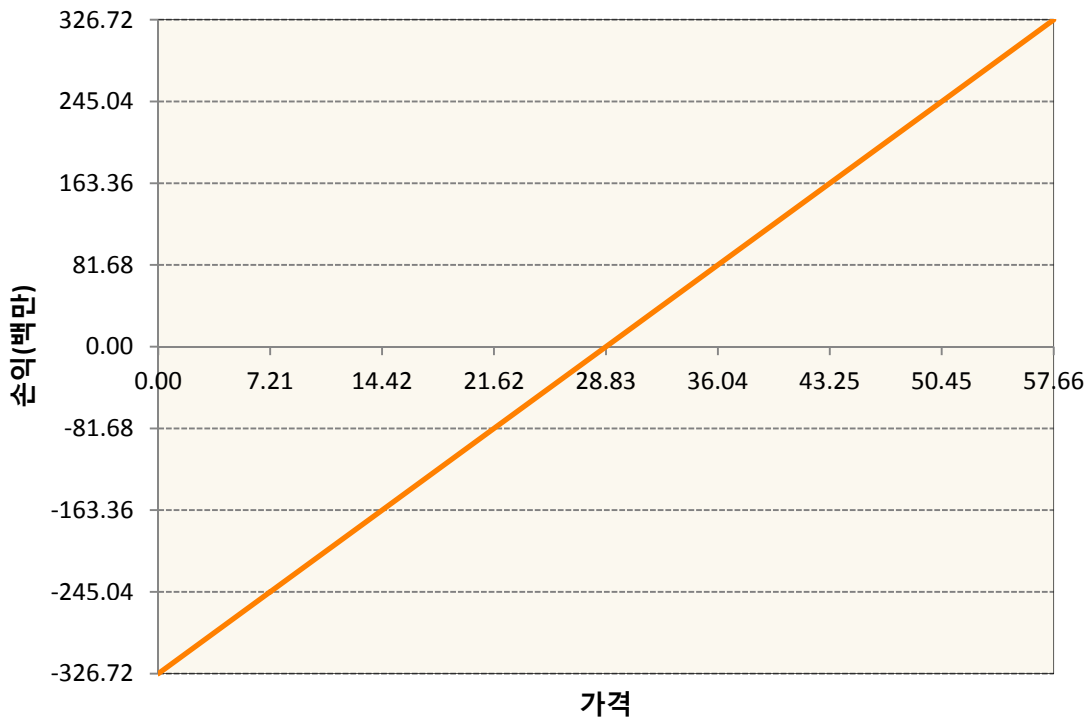
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

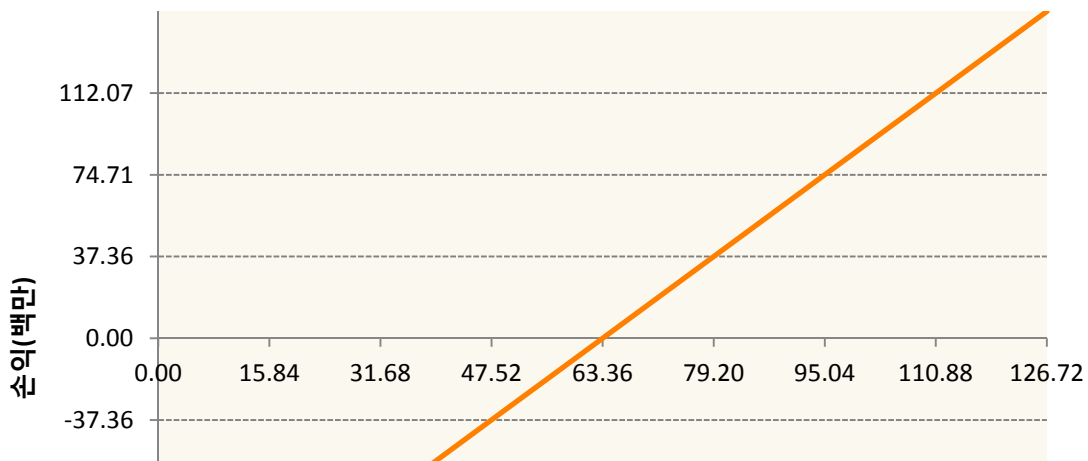
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,960	201	2,759	

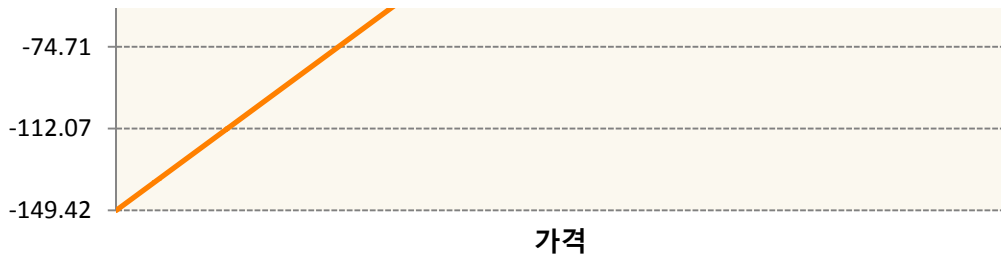
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19**

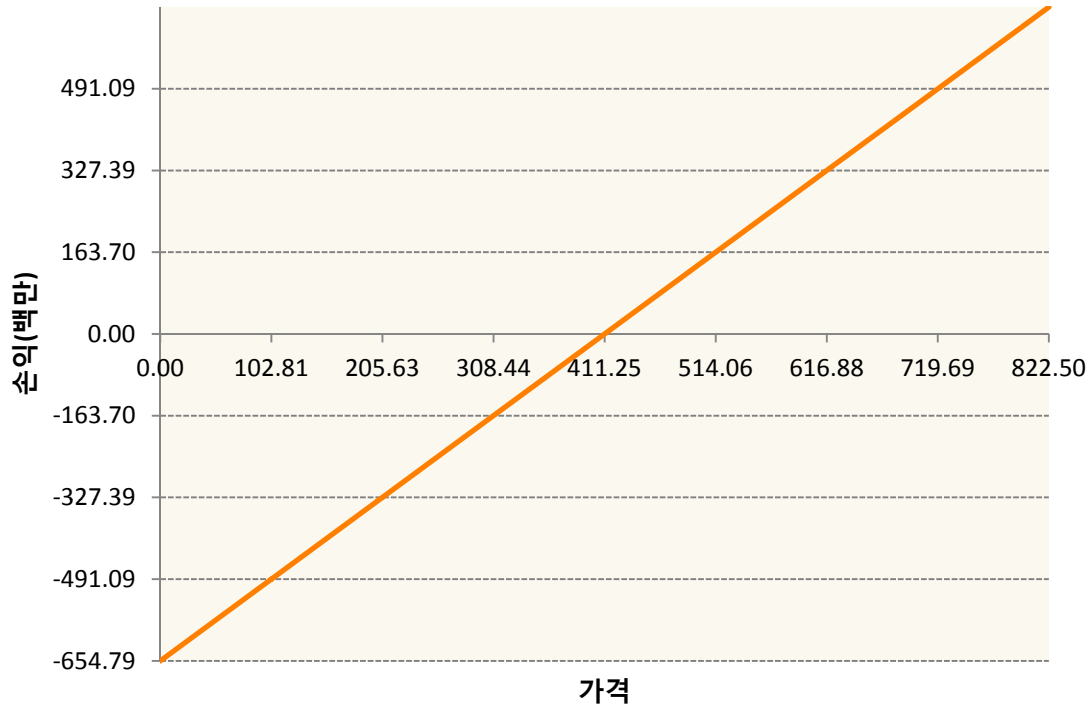


**CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19**

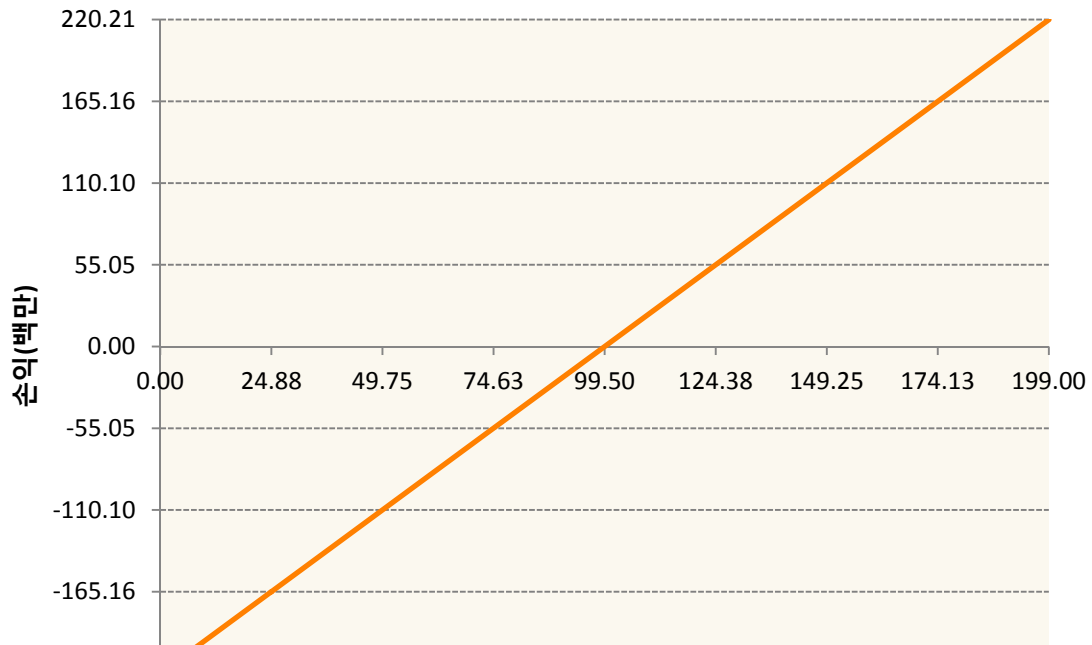


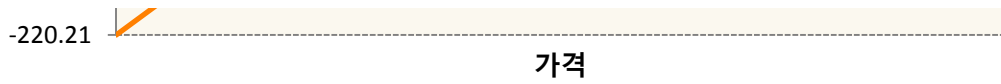


CU9-CORN FUTURE Sep19

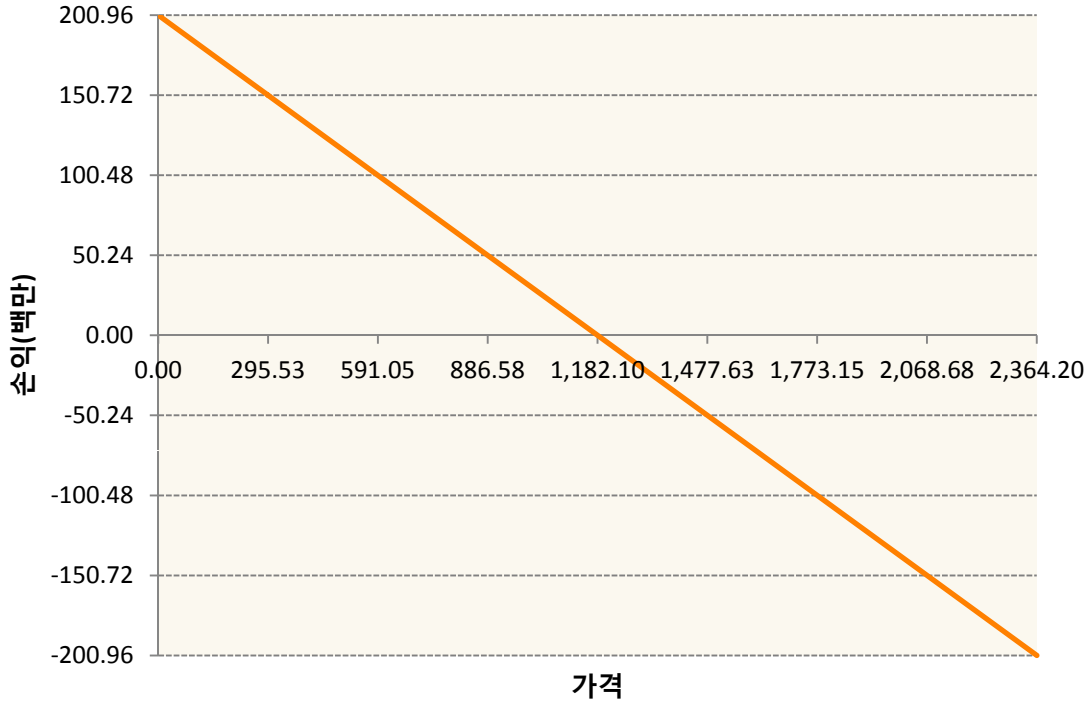


KCU9-COFFEE 'C' FUTURE Sep19

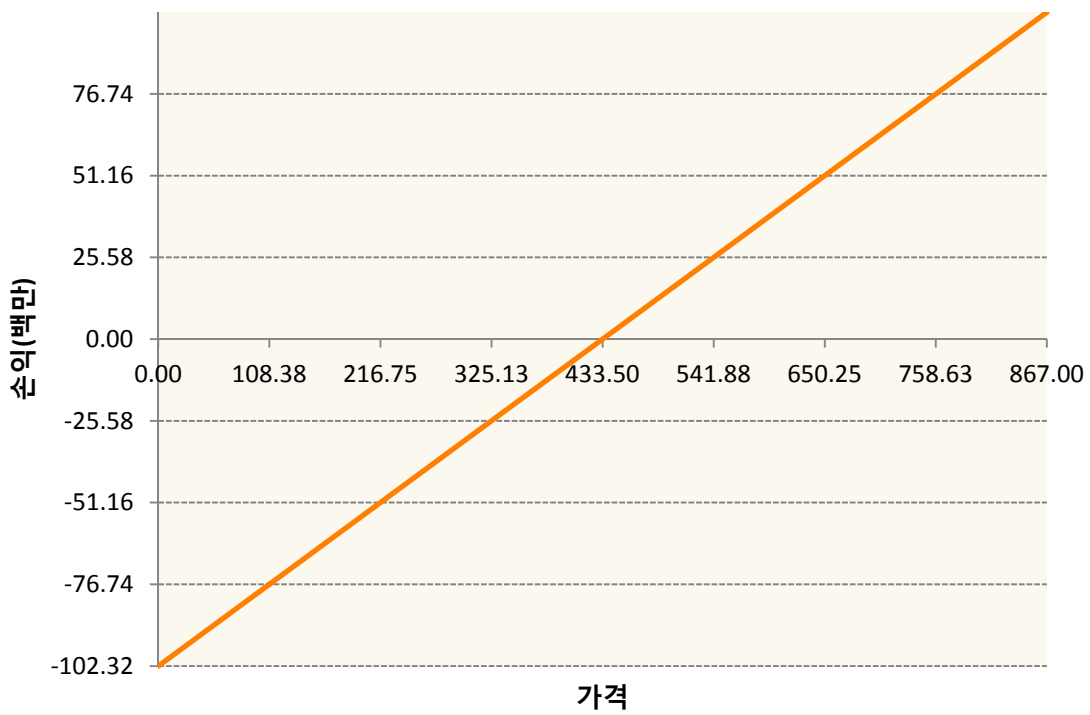




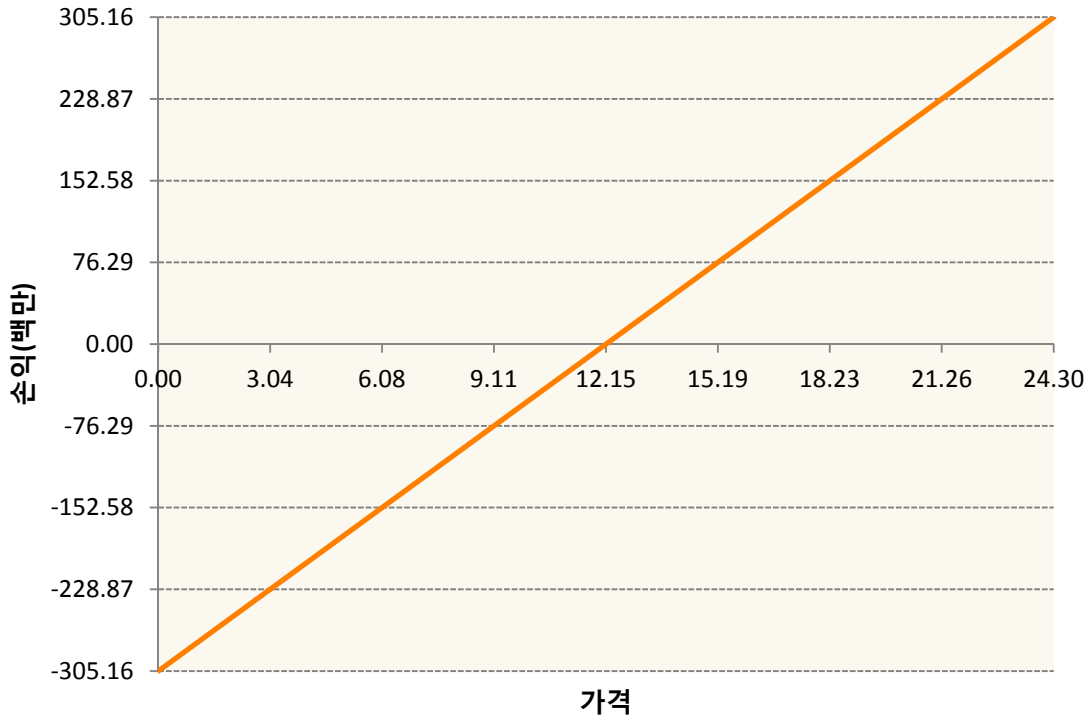
KR4175P80006-2019-08 달러선물



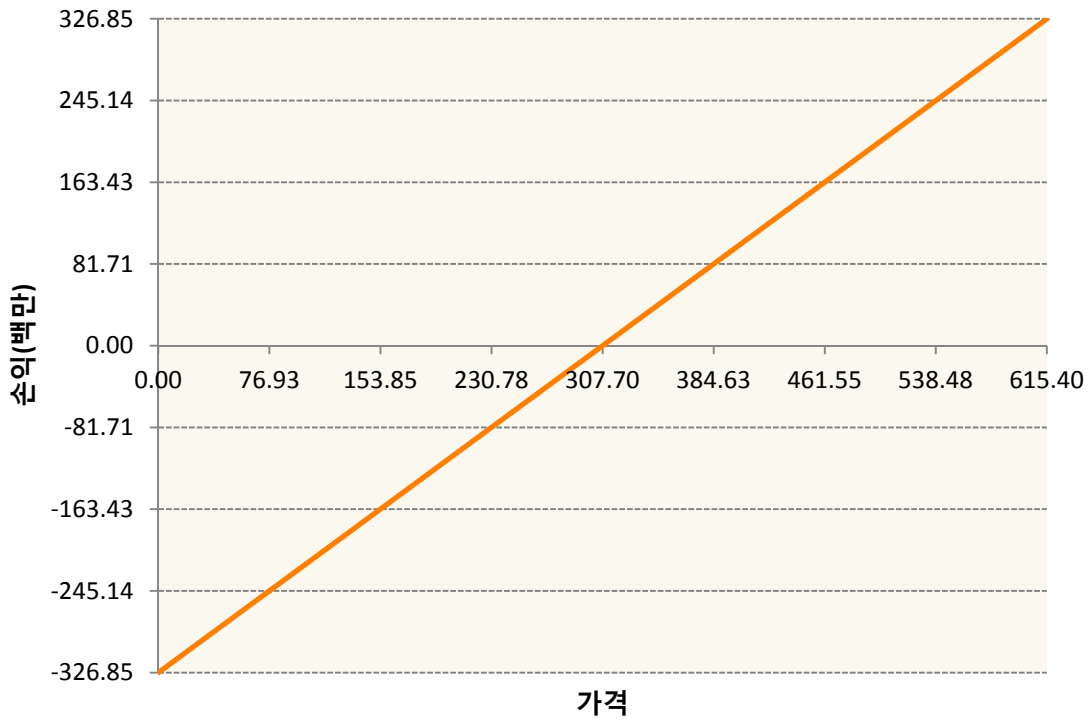
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



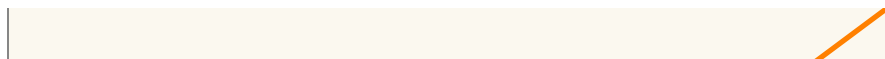
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

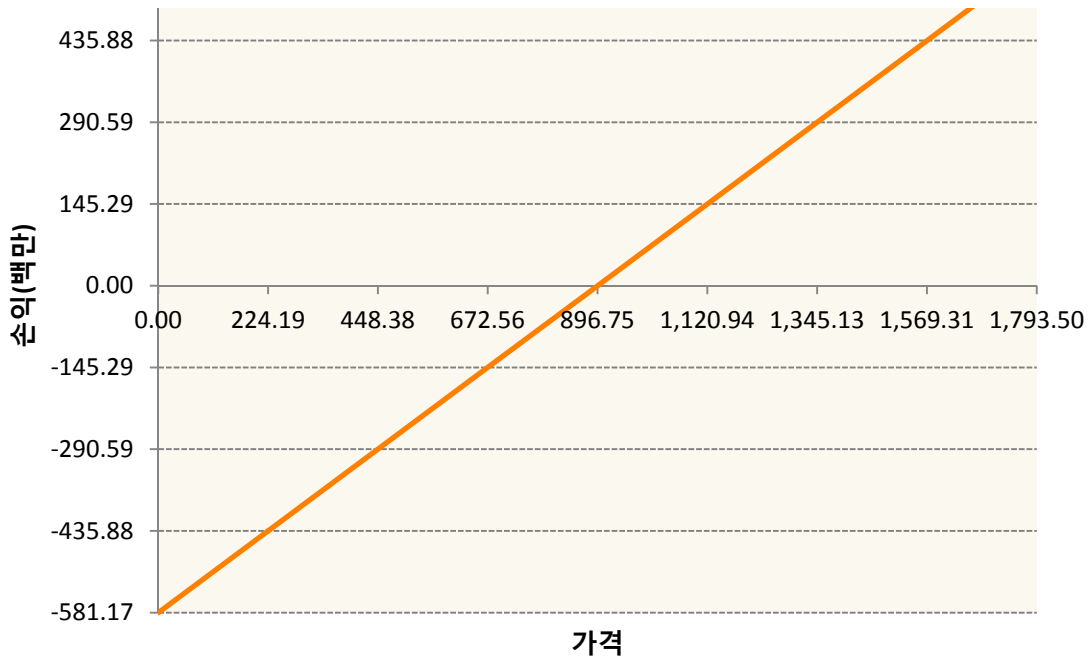


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

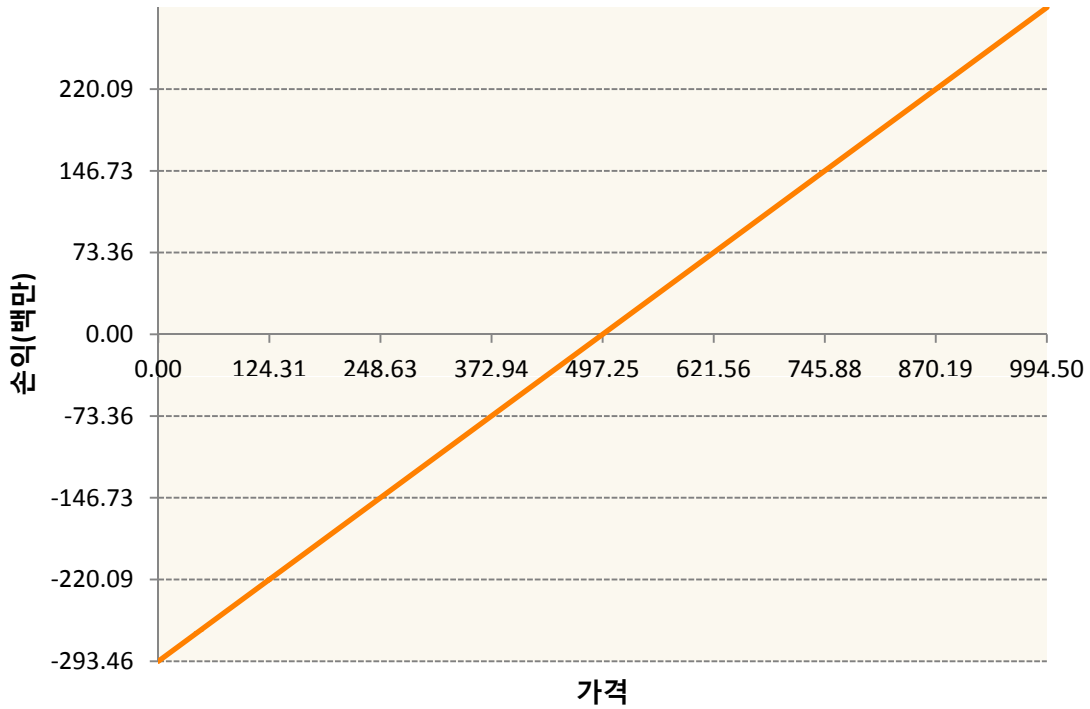


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





WU9-WHEAT FUTURE(CBT) Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	26
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	12
CU9	CORN FUTURE Sep19	52
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	46
WU9	WHEAT FUTURE(CBT) Sep19	23

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

(단위:백만원)

**261**