

공시일	2019-08-08
기준일	2019-08-07

## 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)

86

공시일	2019-08-08
기준일	2019-08-07

## 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

1,129

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

646

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-08
기준일	2019-08-07

## 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)	353
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	129

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

781

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-08
기준일	2019-08-07

## 유로인덱스모(주식-파생형)

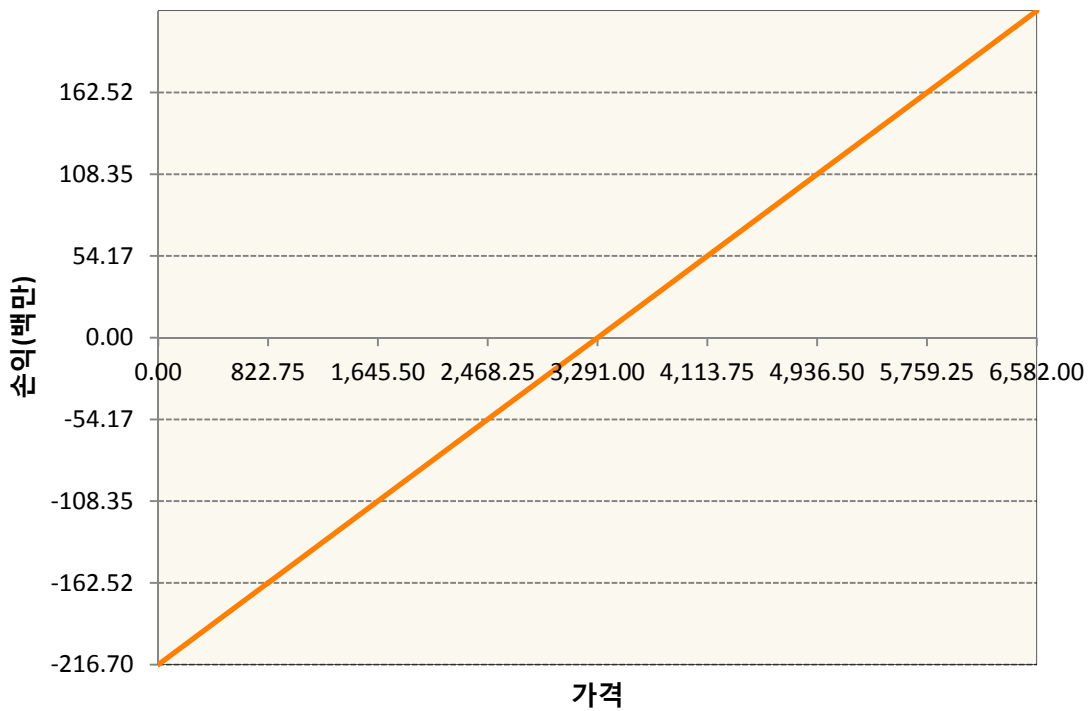
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	217	0	217	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGU9-EURO STOXX 50 Sep19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU9	EURO STOXX 50 Sep19	17
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

12
----

공시일	2019-08-08
기준일	2019-08-07

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

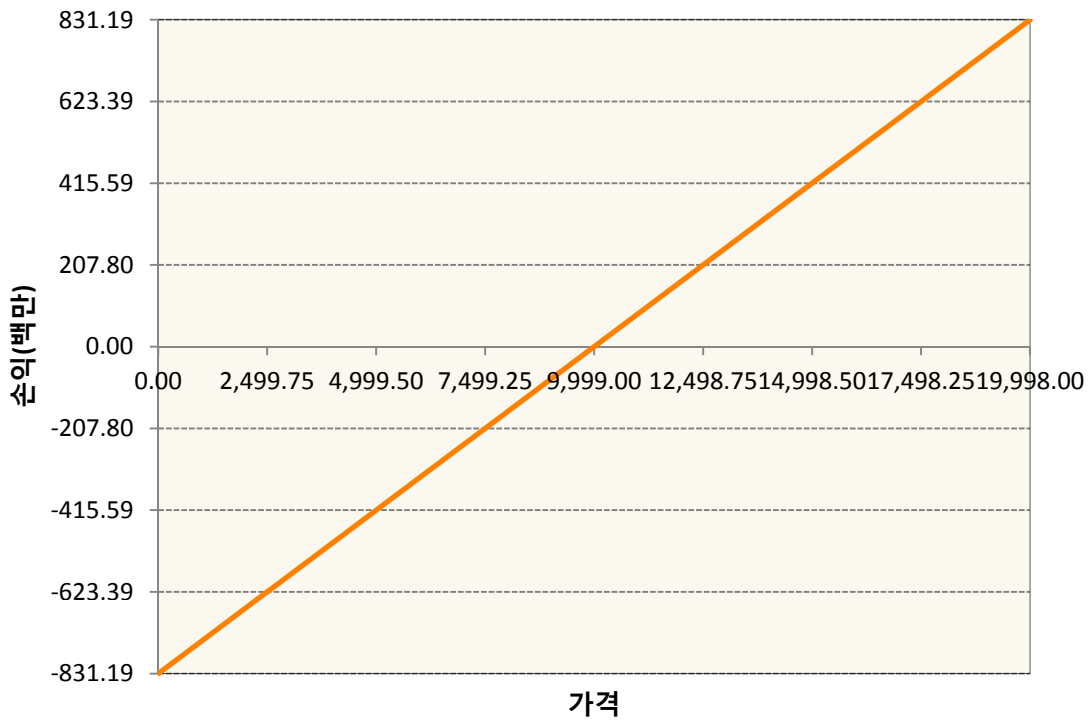
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	831	0	831	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCQ9	HSCEI Futures Aug19	66
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

64
----

공시일	2019-08-08
기준일	2019-08-07

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

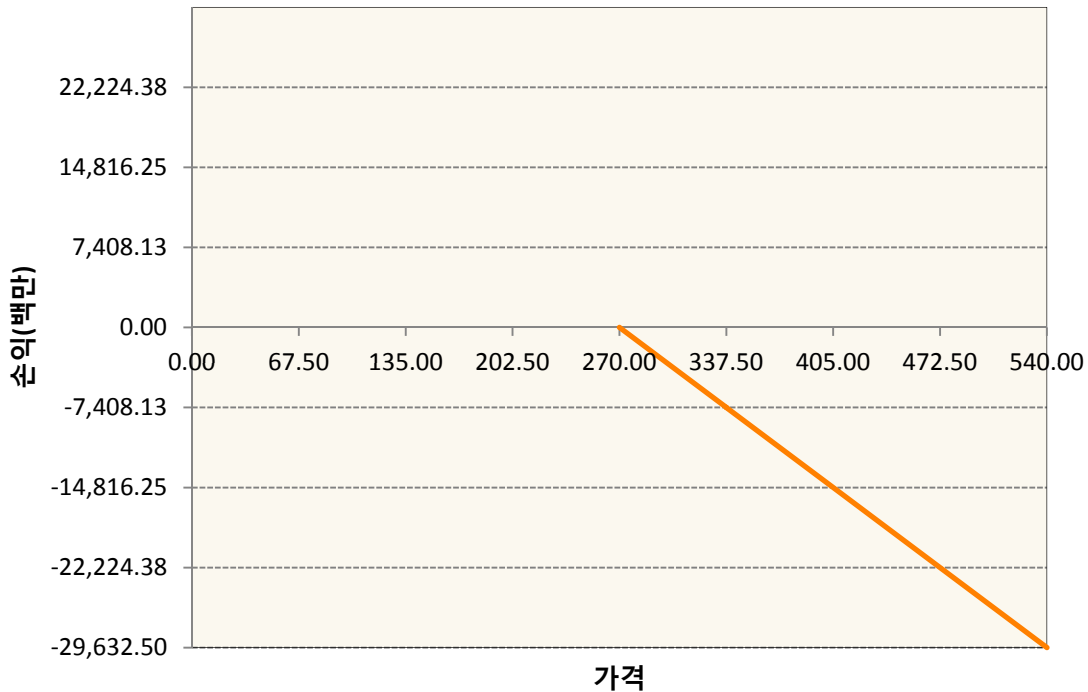
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

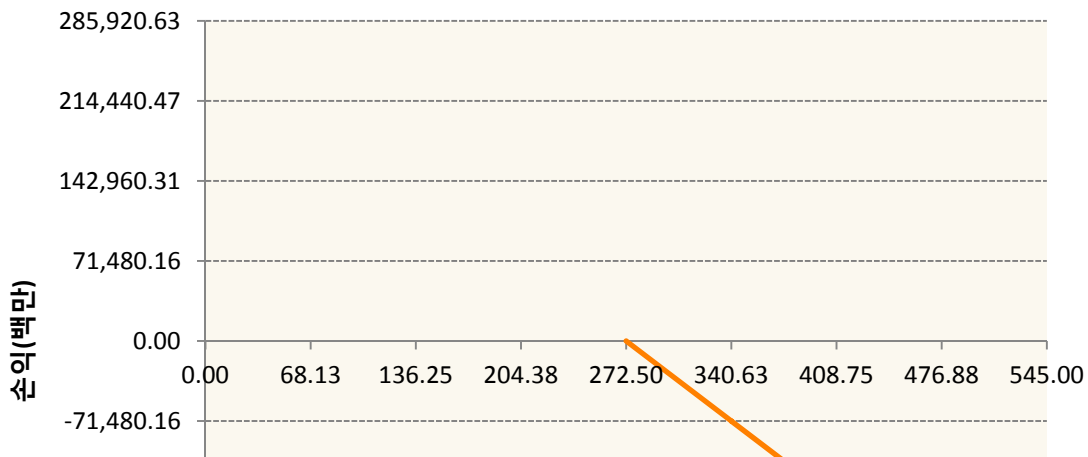
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	77,786	69,621	8,165	장내
누계	유가증권	옵션	0	568,762	-568,762	장내

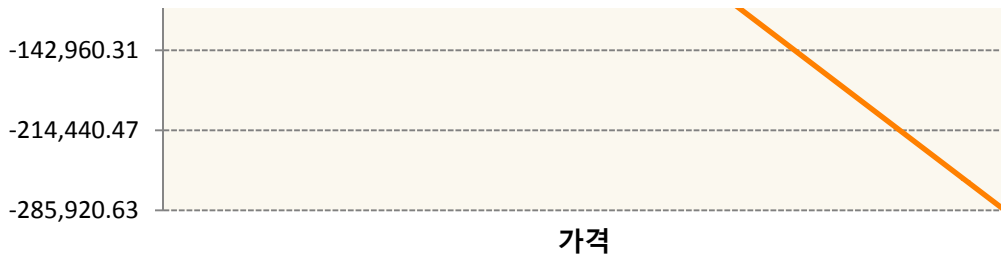
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P82709-2019-08 콜270

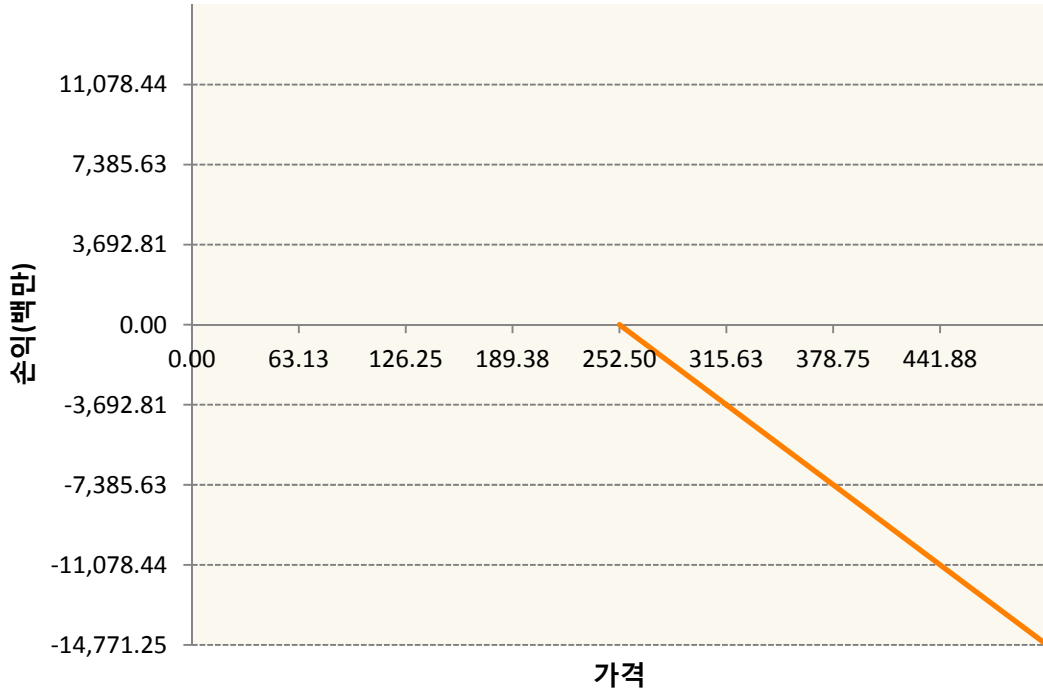


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

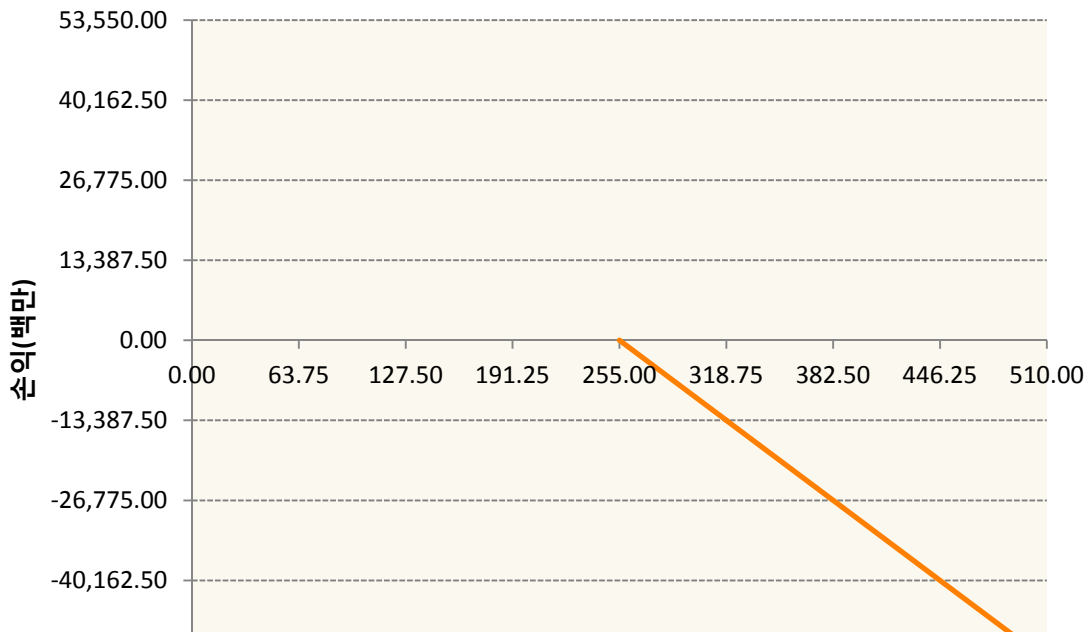


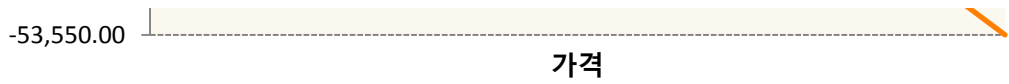


**KR4201P92526-2019-09 콜252.5**

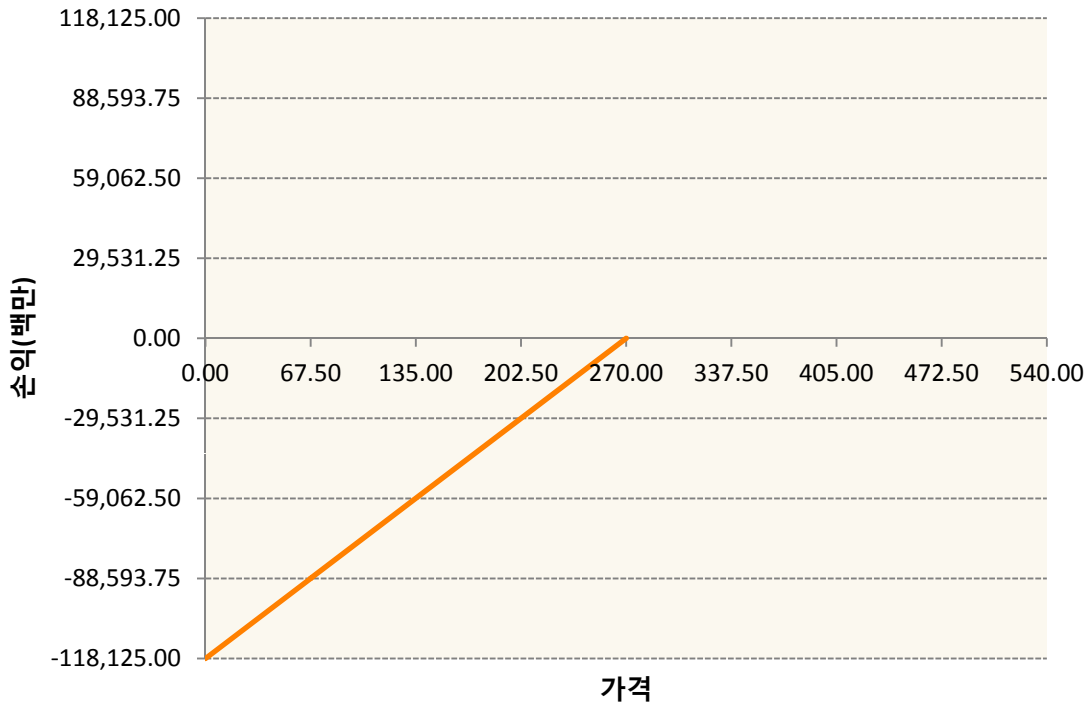


**KR4201P92559-2019-09 콜255**

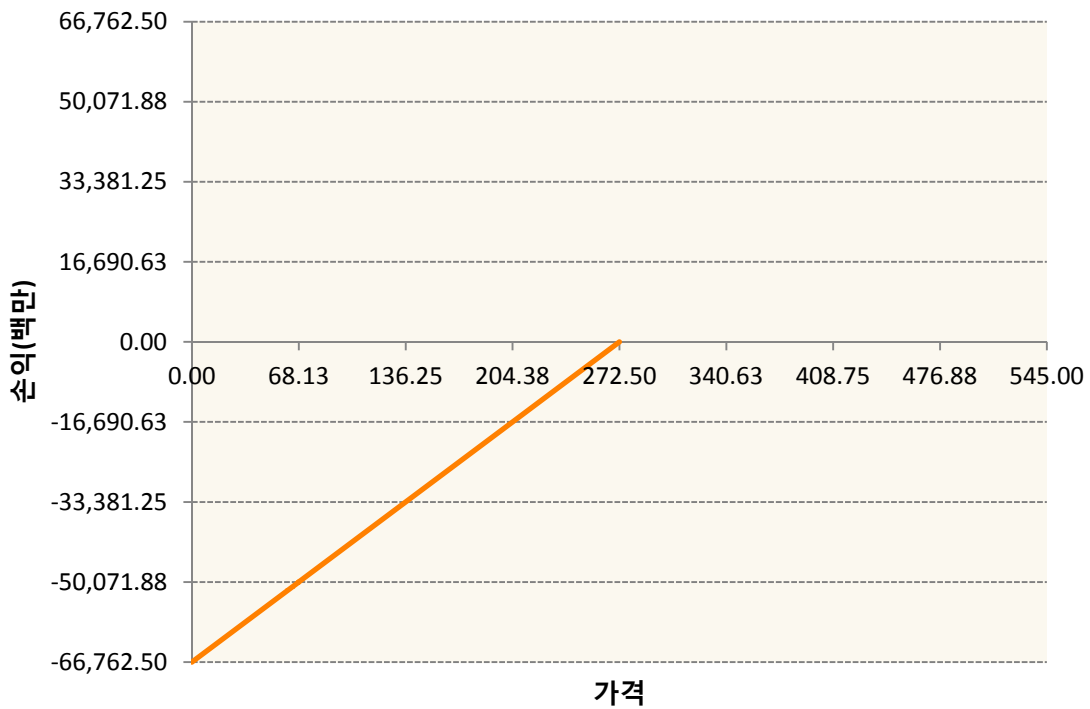




KR4301P82707-2019-08 풋270



KR4301P82723-2019-08 풋272.5



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

KR4201P82709		2019-08 콜270						339
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0	
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0	
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	0	0	0	0	0	0	-1	
5.33%	-5	-9	-14	-19	-25	-32	-40	
8.00%	-273	-283	-293	-304	-315	-327	-339	
KR4201P82725		2019-08 콜272.5						1,732
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0	
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0	
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	0	0	0	0	0	-1	-1	
5.33%	-4	-10	-20	-36	-57	-84	-118	
8.00%	-971	-1,098	-1,224	-1,351	-1,478	-1,605	-1,732	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5						887
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	415	400	383	364	342	319	295	
-5.33%	368	343	317	288	259	228	197	
-2.67%	274	240	205	169	134	98	61	
0%	116	78	39	0	-39	-78	-116	
2.67%	-110	-147	-184	-222	-259	-297	-336	
5.33%	-398	-428	-459	-491	-525	-559	-594	
8.00%	-733	-753	-776	-801	-828	-857	-887	
KR4201P92559		2019-09 콜255						3,028
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,287	1,246	1,195	1,135	1,067	993	912	
-5.33%	1,160	1,084	1,000	909	812	710	604	
-2.67%	890	777	661	541	418	293	167	
0%	412	275	138	0	-138	-277	-415	
2.67%	-309	-447	-587	-726	-866	-1,007	-1,147	
5.33%	-1,264	-1,382	-1,505	-1,631	-1,760	-1,891	-2,023	
8.00%	-2,407	-2,494	-2,589	-2,692	-2,799	-2,912	-3,028	
KR4301P82707		2019-08 풋270						8,819
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,819	-8,819	-8,819	-8,819	-8,819	-8,819	-8,819
-5.33%	-5,880	-5,880	-5,880	-5,880	-5,880	-5,880	-5,880
-2.67%	-2,940	-2,940	-2,940	-2,940	-2,940	-2,940	-2,940
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	2,940	2,940	2,940	2,940	2,940	2,940	2,940
5.33%	5,877	5,874	5,869	5,862	5,852	5,841	5,828
8.00%	7,818	7,796	7,771	7,745	7,716	7,687	7,657
KR4301P82723                      2019-08 풋272.5							4,939
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,939	-4,939	-4,939	-4,939	-4,939	-4,939	-4,939
-5.33%	-3,293	-3,293	-3,293	-3,293	-3,293	-3,293	-3,293
-2.67%	-1,646	-1,646	-1,646	-1,646	-1,646	-1,646	-1,646
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,646	1,646	1,646	1,646	1,646	1,646	1,646
5.33%	3,293	3,292	3,292	3,292	3,291	3,290	3,288
8.00%	4,785	4,764	4,742	4,721	4,700	4,678	4,657

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

(단위:백만원)

**17,320**

공시일	2019-08-08
기준일	2019-08-07

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

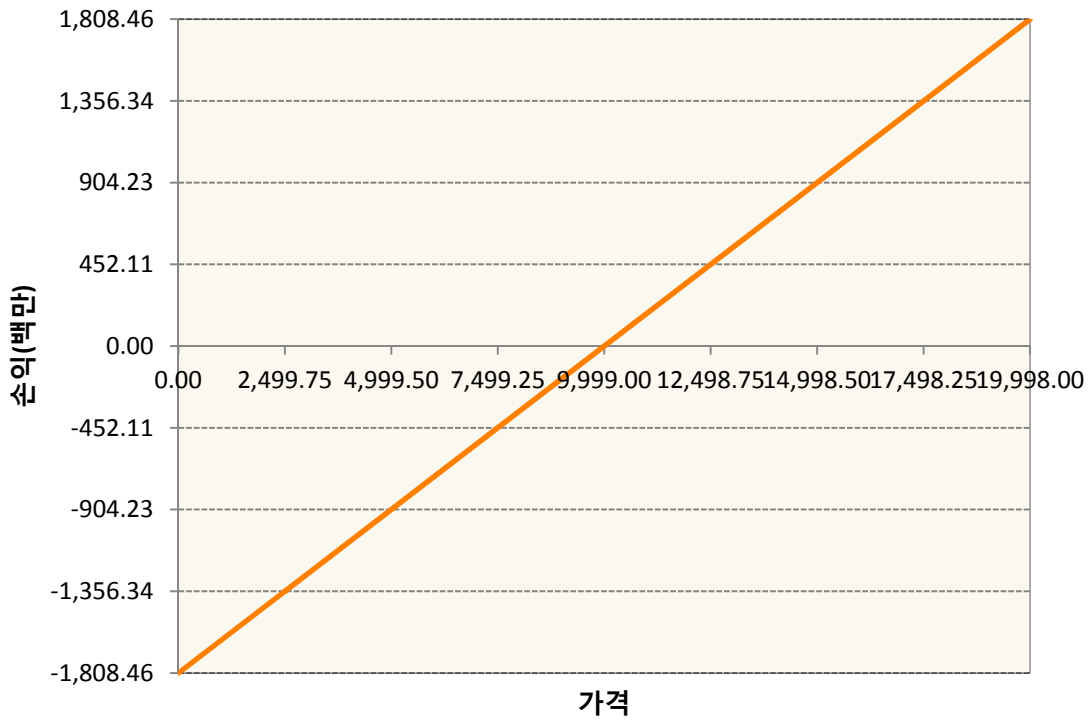
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

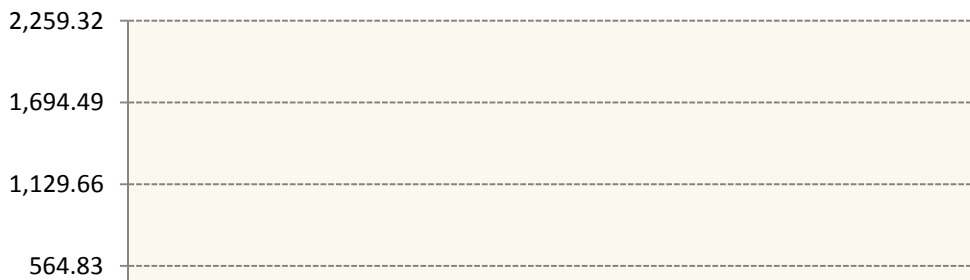
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,808	0	1,808	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,532	-5,532	장내
누계	통화	선도	460	3,254	-2,794	장외

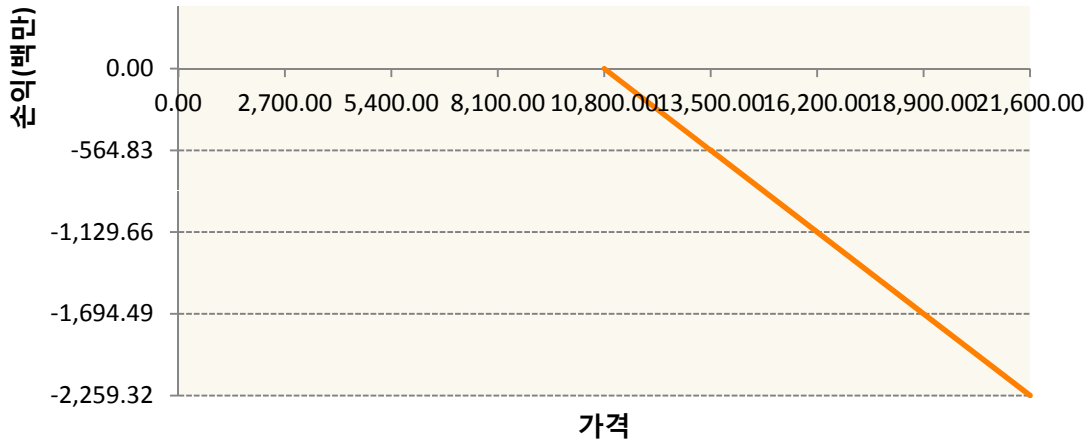
### 2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19

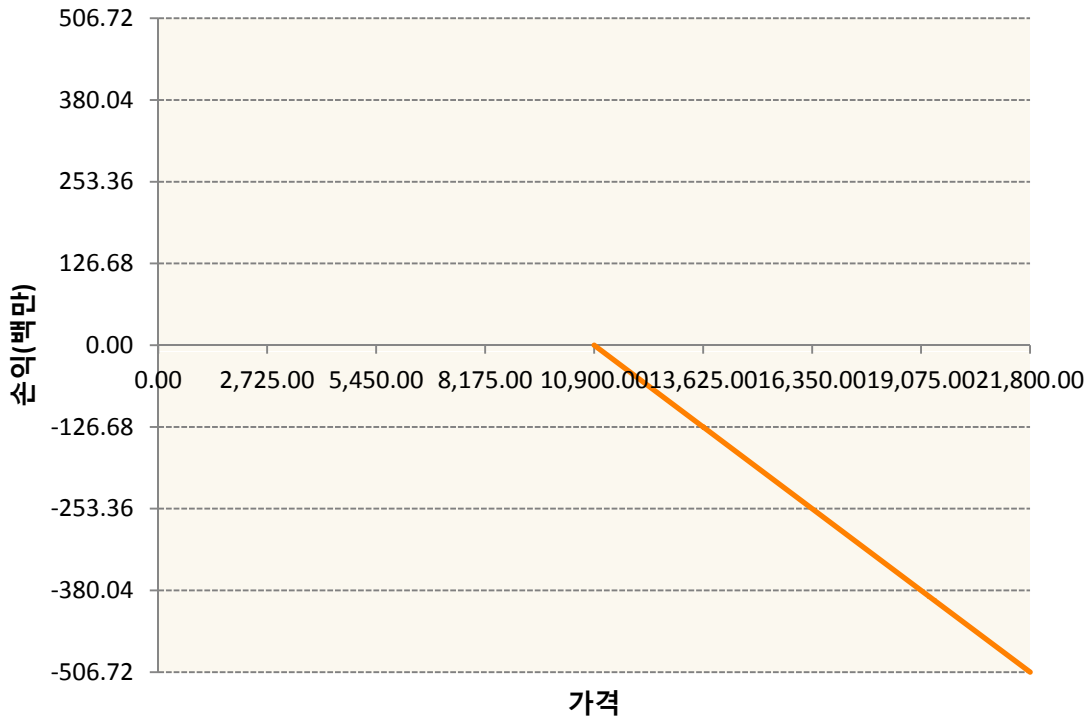


OHHIQ9-C108-HSCEI

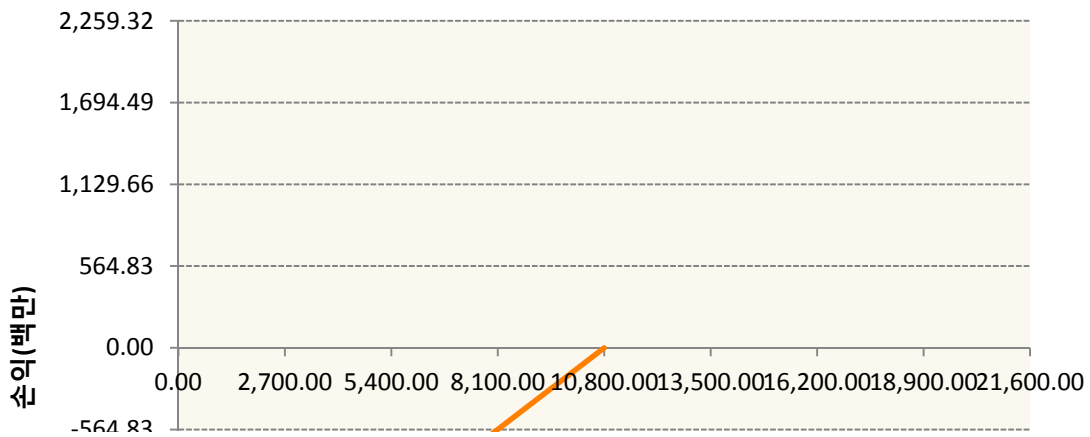


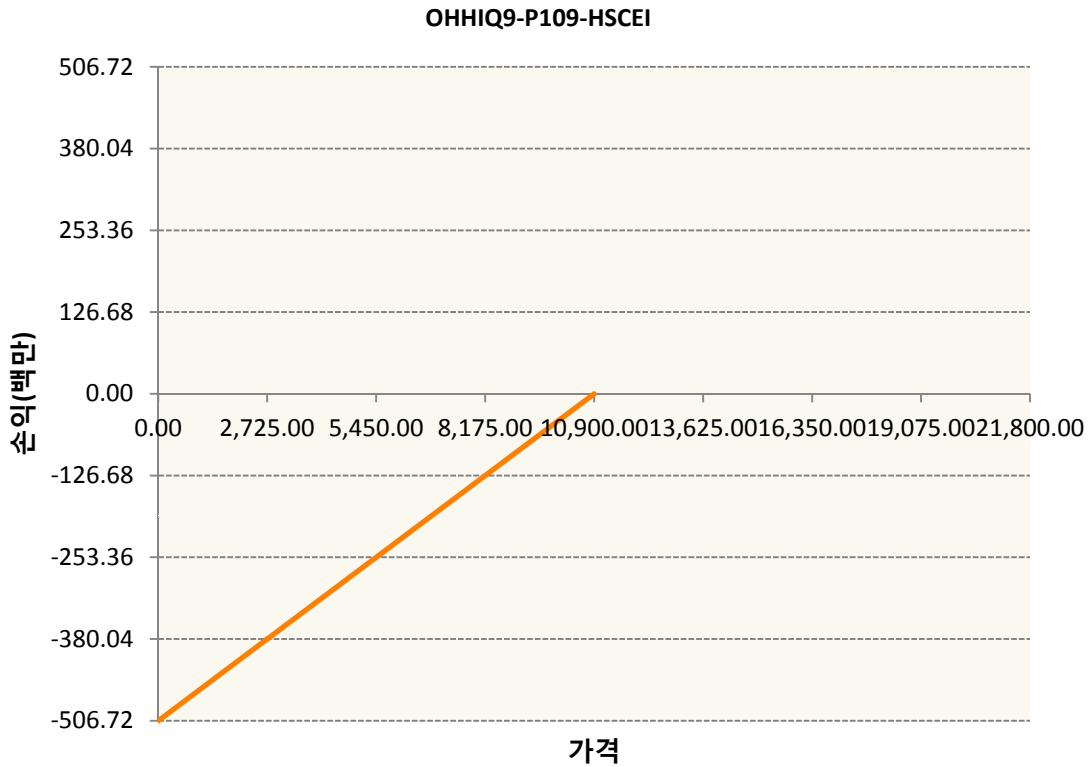


OHHIQ9-C109-HSCEI



OHHIQ9-P108-HSCEI





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

FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	260
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E	12
FX21019Q00 HKD/KRW 23-08-19E	24
HCQ9 HSCEI Futures Aug19	145
OHHIQ9-C1(HSCEI	181
OHHIQ9-C1(HSCEI	41
OHHIQ9-P1(HSCEI	181
OHHIQ9-P1(HSCEI	41

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

**663**

공시일	2019-08-08
기준일	2019-08-07

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

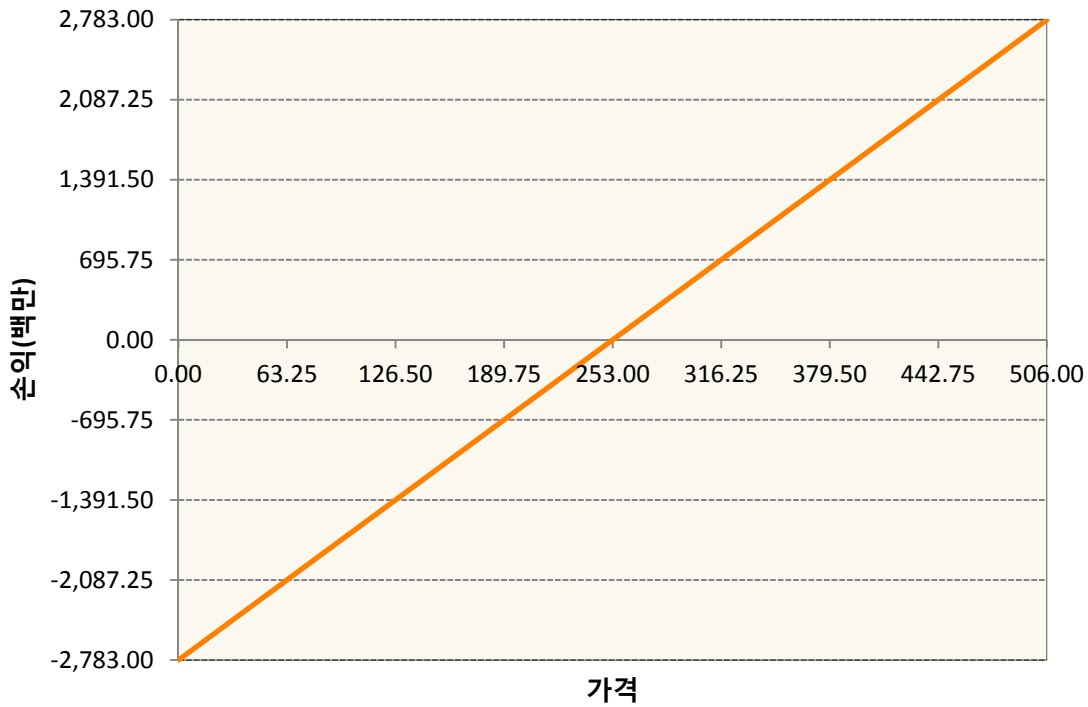
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

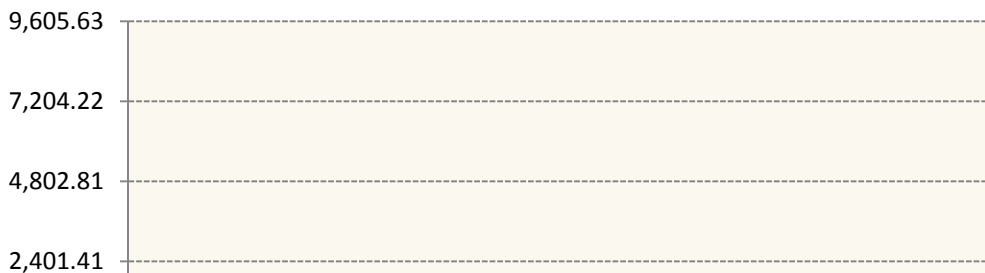
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	63	0	63	장내
누계	유가증권	선물	2,783	0	2,783	장내
누계	유가증권	스왑	18,836	0	18,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	18,749	-18,749	장내

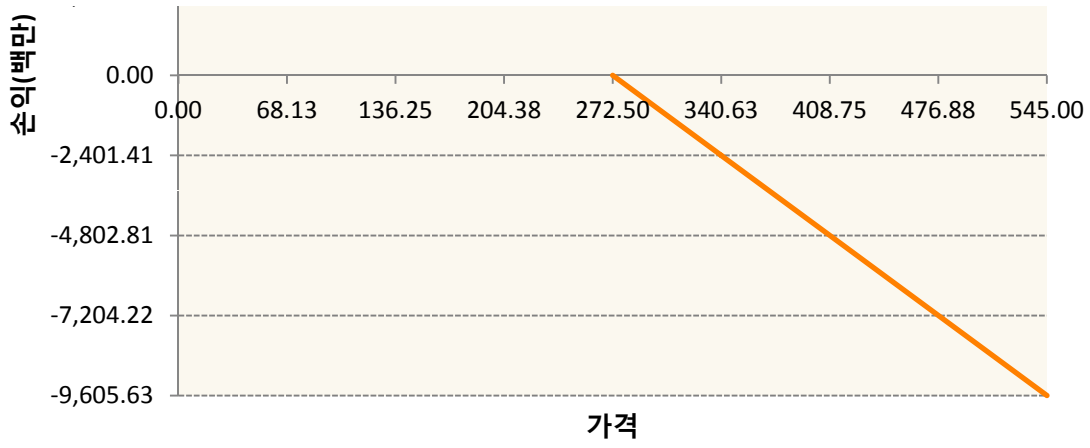
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

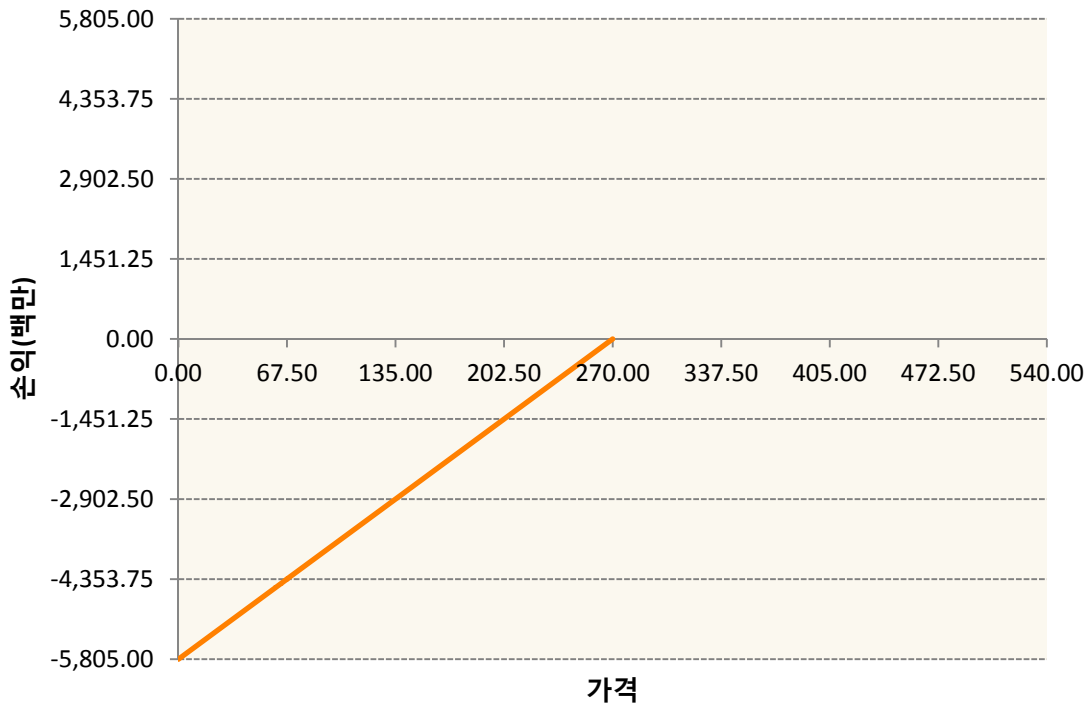


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

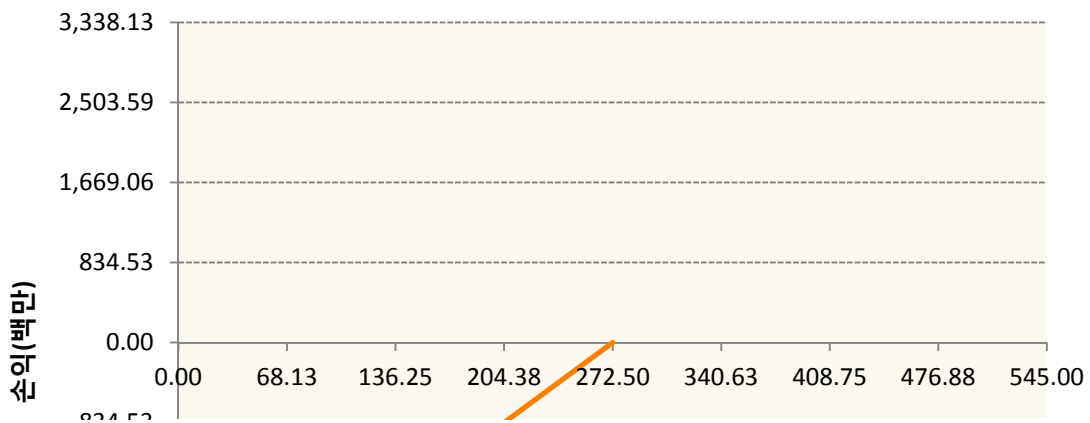




KR4301P82707-2019-08 풋270



KR4301P82723-2019-08 풋272.5





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,025
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,025	-1,025	-1,025	-1,025	-1,025	-1,025	-1,025	
-5.33%	-683	-683	-683	-683	-683	-683	-683	
-2.67%	-342	-342	-342	-342	-342	-342	-342	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	342	342	342	342	342	342	342	
5.33%	683	683	683	683	683	683	683	
8.00%	1,025	1,025	1,025	1,025	1,025	1,025	1,025	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						606
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-606	-606	-606	-606	-606	-606	-606	
-5.33%	-404	-404	-404	-404	-404	-404	-404	
-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%	404	404	404	404	404	404	404	
8.00%	606	606	606	606	606	606	606	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						222
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-222	-222	-222	-222	-222	-222	-222	
-5.33%	-148	-148	-148	-148	-148	-148	-148	
-2.67%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	74	74	74	74	74	74	74	
5.33%	148	148	148	148	148	148	148	
8.00%	222	222	222	222	222	222	222	
KR4201P82725		2019-08 콜272.5						58
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	-1	-1	-2	-3	-4
8.00%	-33	-37	-41	-45	-50	-54	-58

KR4301P82707                      2019-08 풋270                      433

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-433	-433	-433	-433	-433	-433	-433
-5.33%	-289	-289	-289	-289	-289	-289	-289
-2.67%	-144	-144	-144	-144	-144	-144	-144
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	144	144	144	144	144	144	144
5.33%	289	289	288	288	288	287	286
8.00%	384	383	382	381	379	378	376

KR4301P82723                      2019-08 풋272.5                      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	164	164
8.00%	239	238	237	236	235	234	233

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

(단위:백만원)

**2,501**

공시일	2019-08-08
기준일	2019-08-07

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

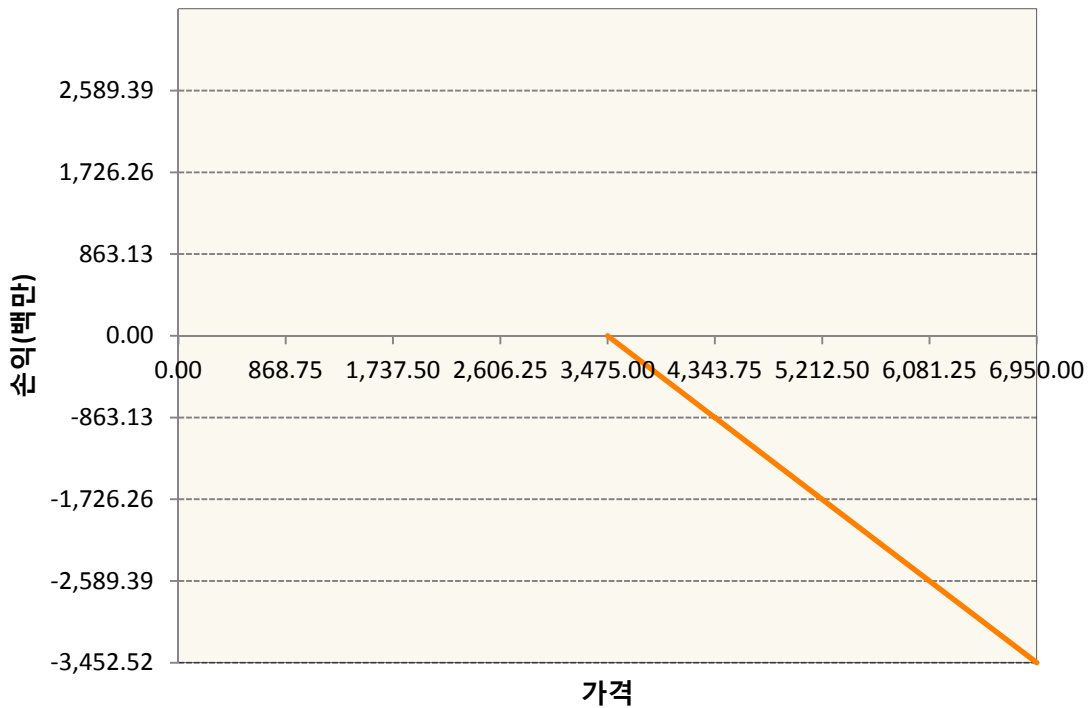
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

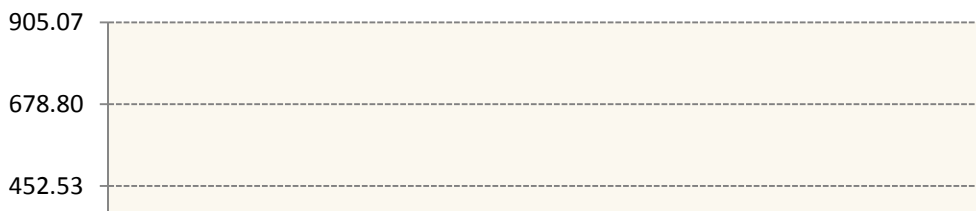
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,216	0	1,216	
누계	유가증권	스왑	38,863	0	38,863	장외
누계	유가증권	옵션	0	8,715	-8,715	장내
누계	통화	선도	14,699	23,137	-8,438	장외

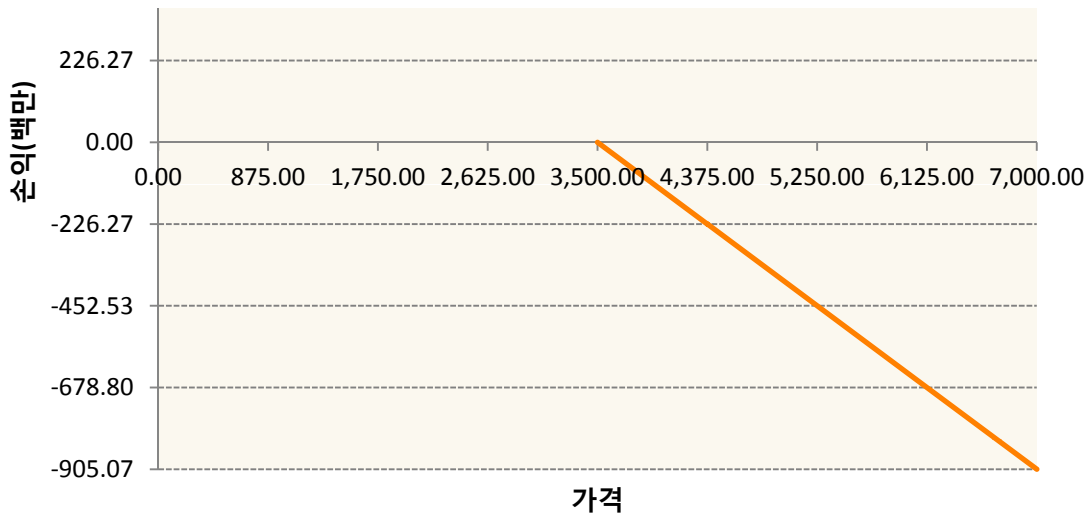
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXQ9-C3475-EURO STOXX 50**

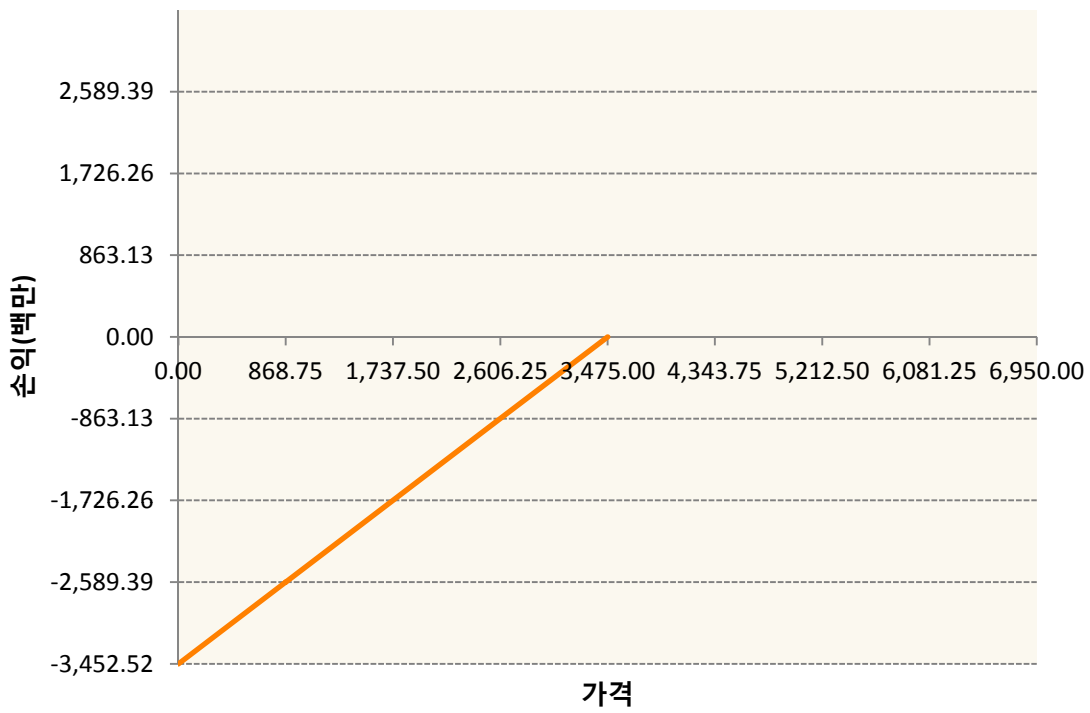


**OESXQ9-C3500-EURO STOXX 50**

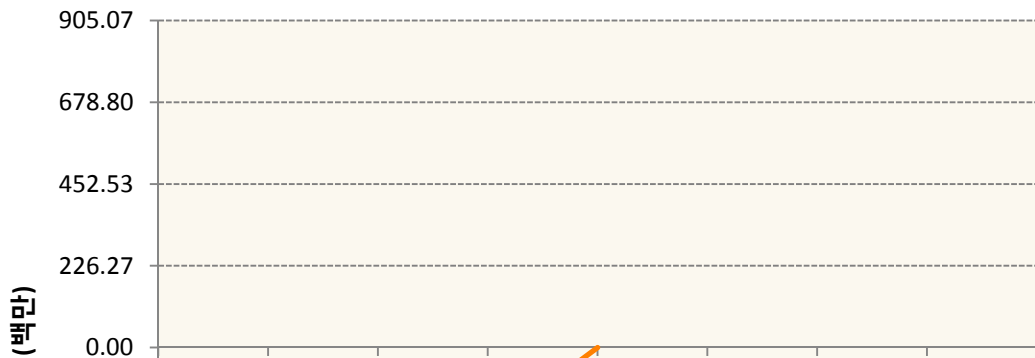


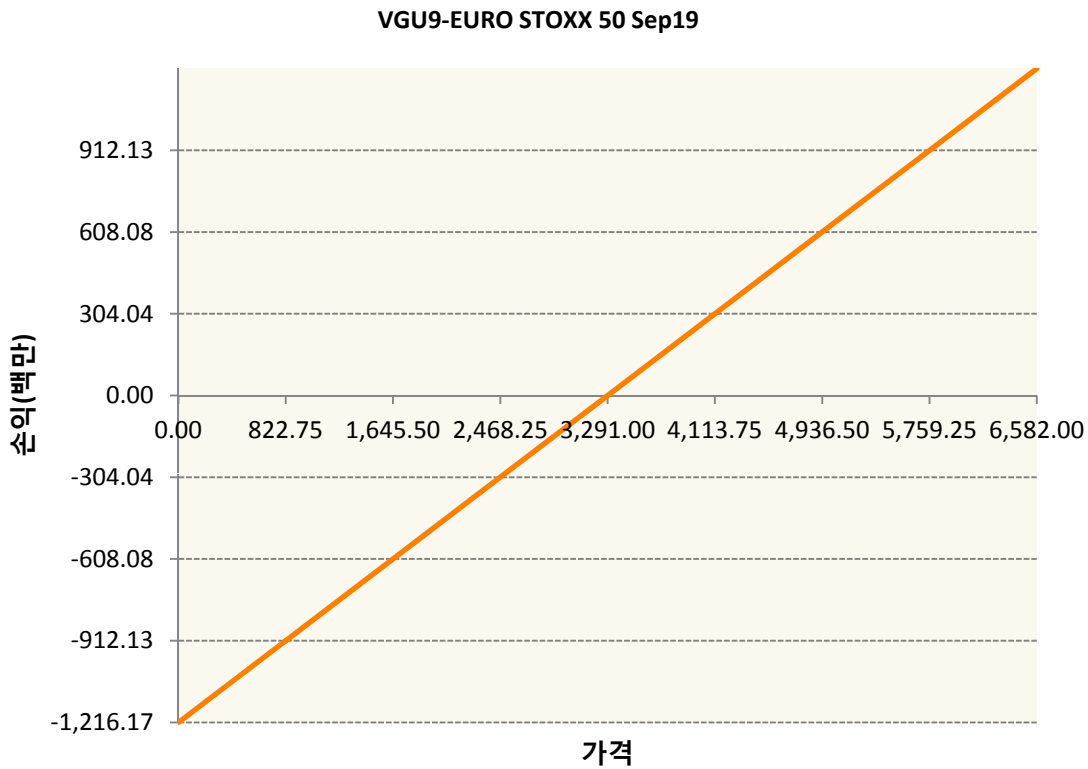
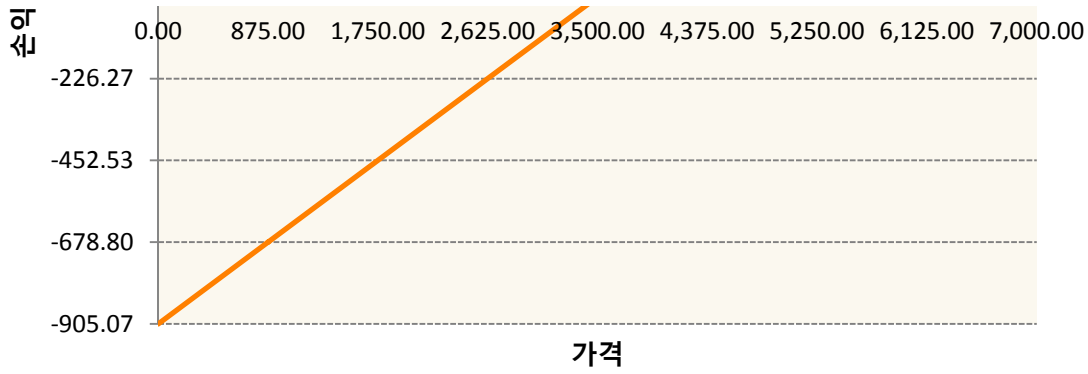


OESXQ9-P3475-EURO STOXX 50



OESXQ9-P3500-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		130
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E		436
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E		1,089
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E		327
FX21019N01 EUR/KRW 23-08-19E		436
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E		327
FX21019N04 EUR/KRW 27-09-19E		240
FX21019Q00 EUR/KRW 27-09-19E		174
OESXQ9-C34 EURO STOXX 50		276
OESXQ9-C35 EURO STOXX 50		72
OESXQ9-P34 EURO STOXX 50		276

OESXQ9-P3: EURO STOXX 50  
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19

72
97

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

(단위:백만원)

**2,128**



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

(단위:백만원)

922

공시일	2019-08-08
기준일	2019-08-07

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

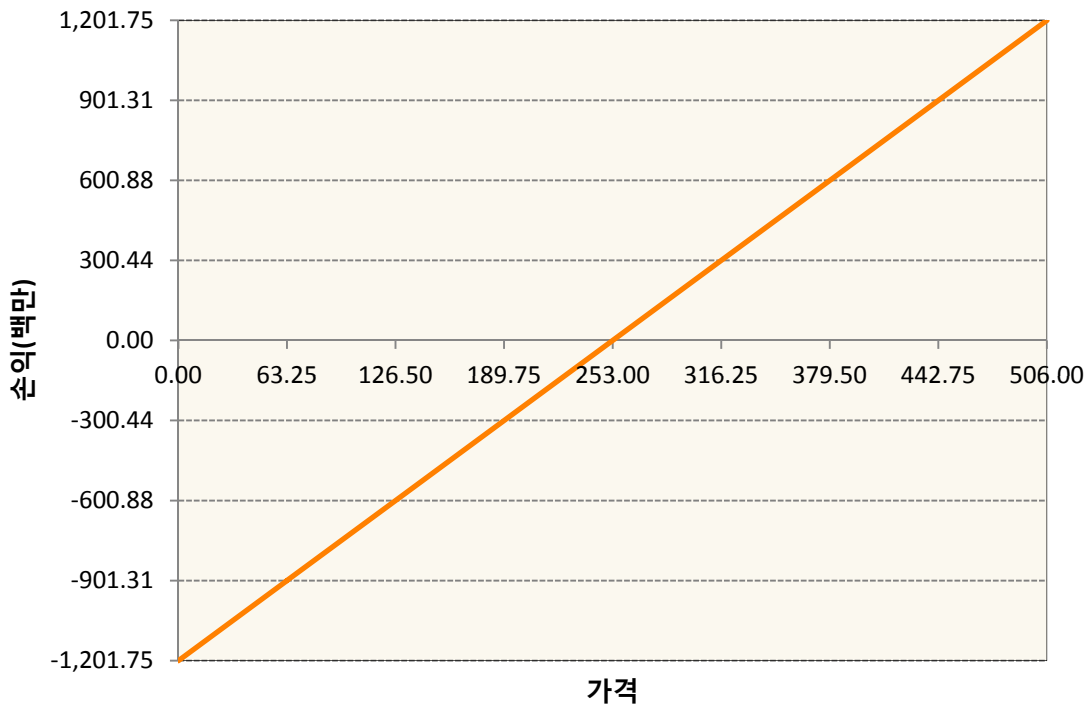
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,202	0	1,202	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						96
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96	
-5.33%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64	
-2.67%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	32	32	32	32	32	32	32	
5.33%	64	64	64	64	64	64	64	
8.00%	96	96	96	96	96	96	96	

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

(단위:백만원)

82



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

(단위:백만원)

125

공시일	2019-08-08
기준일	2019-08-07

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

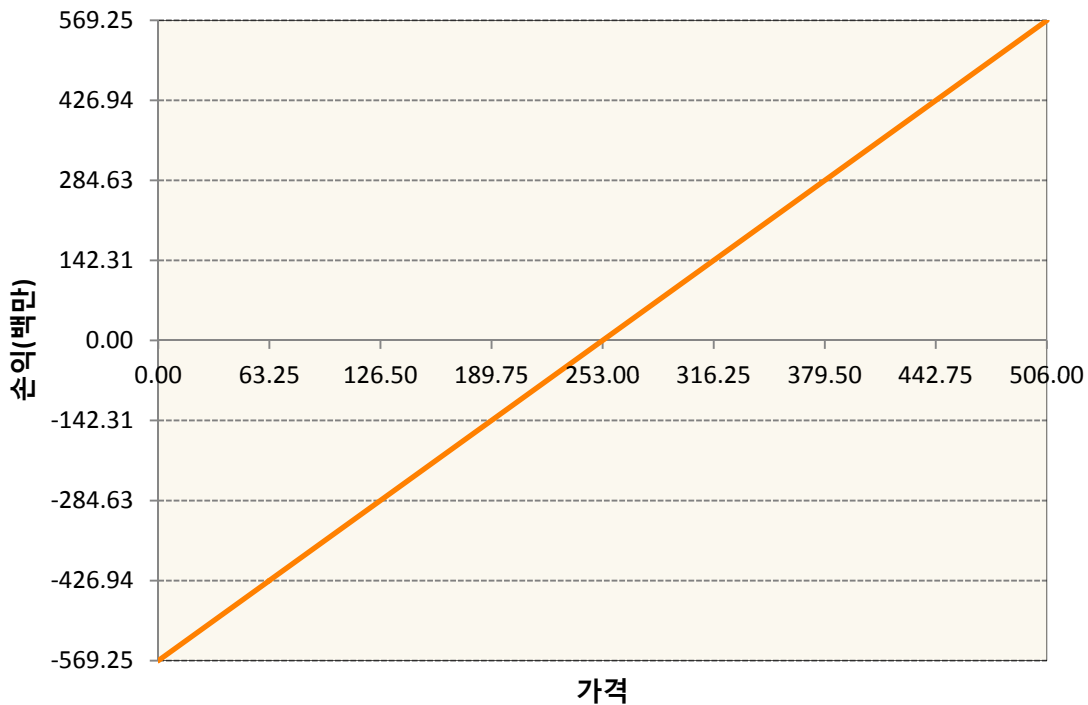
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	569	0	569	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						45
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45	
-5.33%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30	
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	15	15	15	15	15	15	15	
5.33%	30	30	30	30	30	30	30	
8.00%	45	45	45	45	45	45	45	

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

(단위:백만원)

39

공시일	2019-08-08
기준일	2019-08-07

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

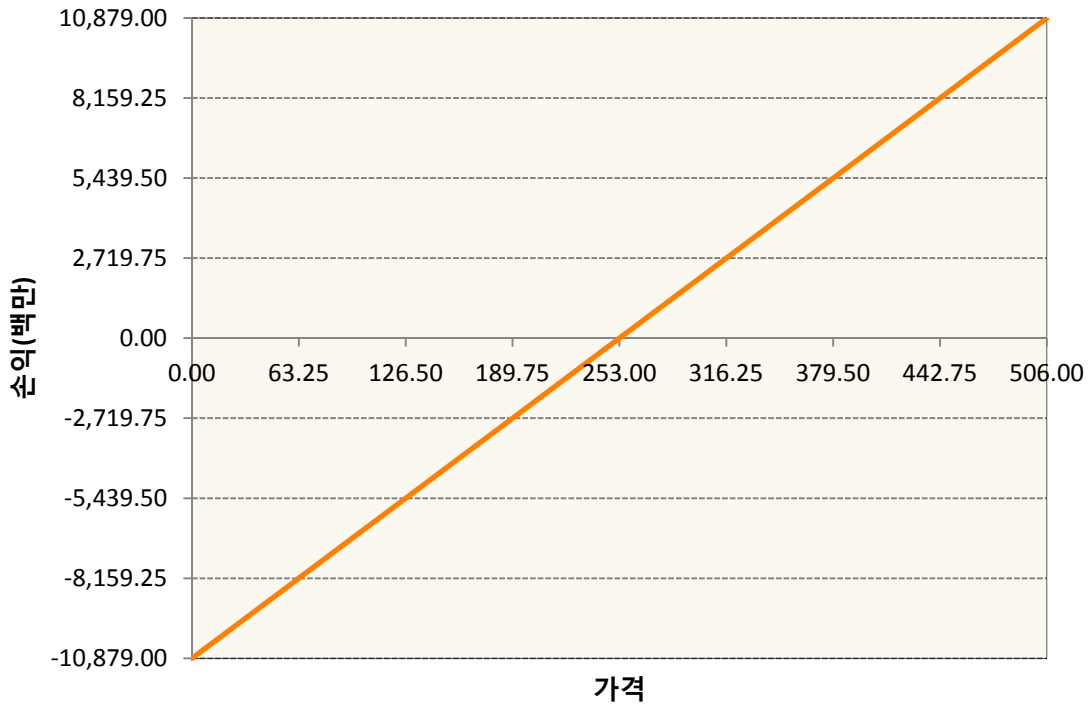
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

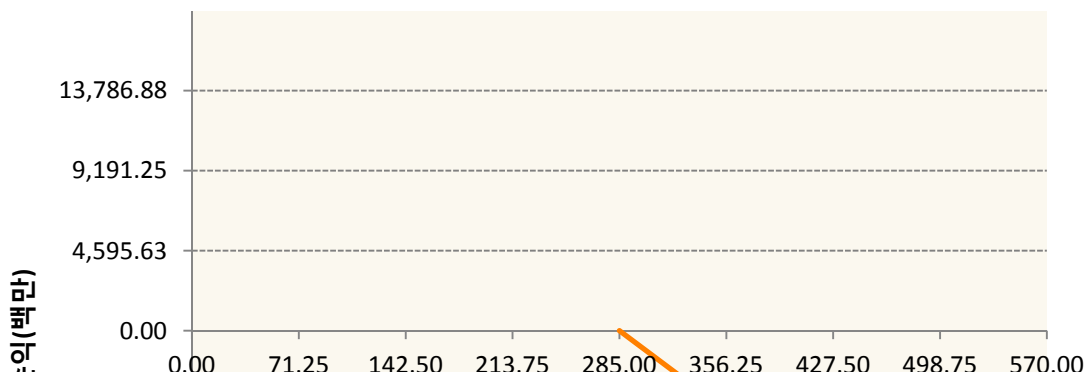
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,879	0	10,879	장내
누계	유가증권	옵션	1,698	21,617	-19,919	장내

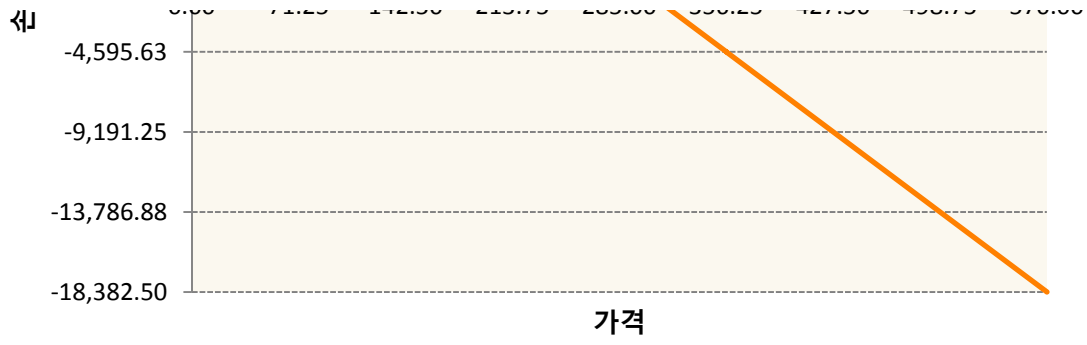
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

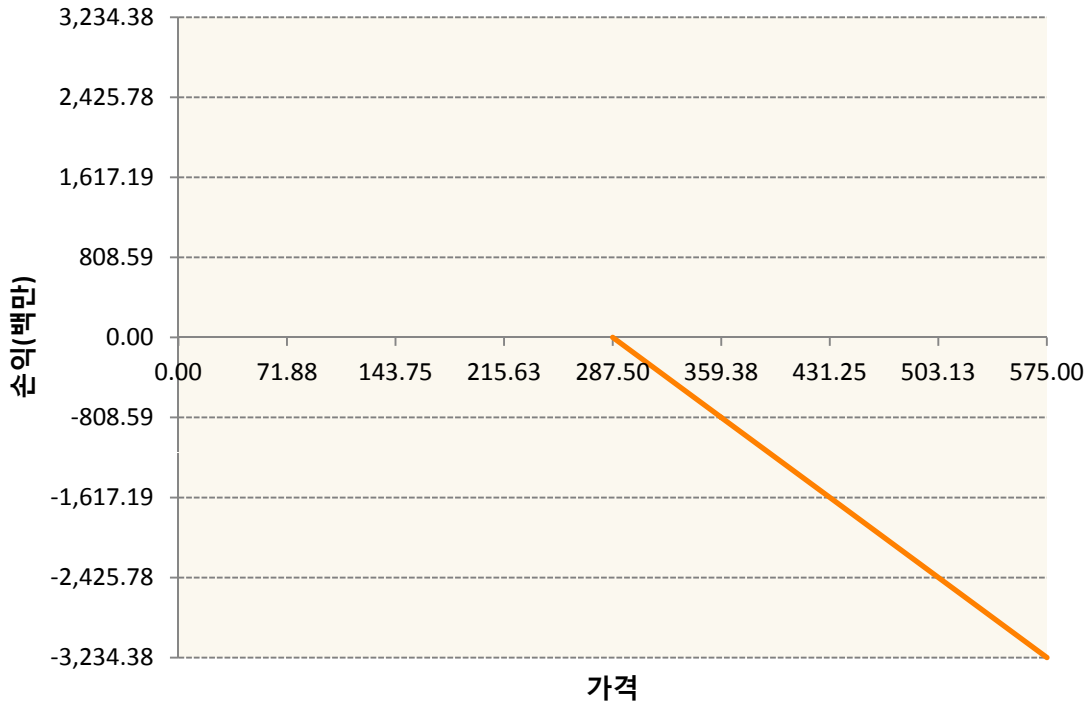


KR4201P82857-2019-08 콜285

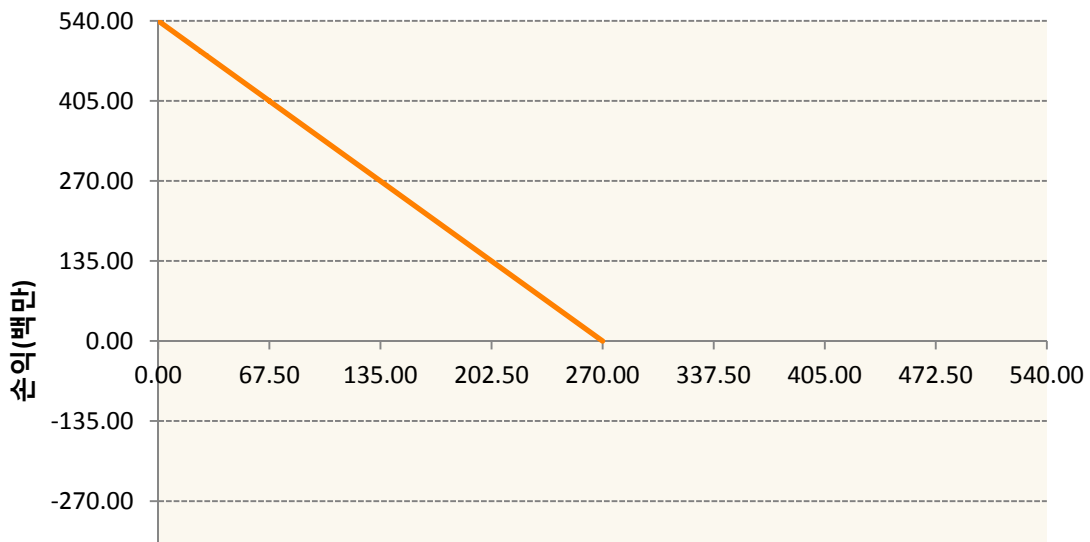


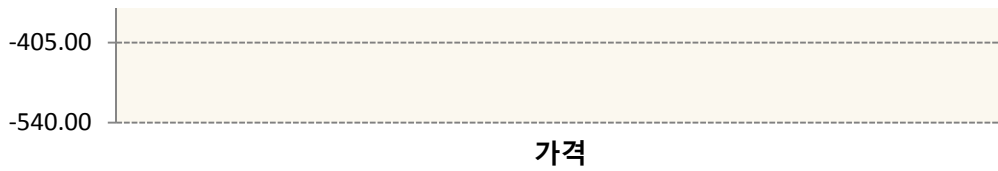


KR4201P82873-2019-08 콜287.5

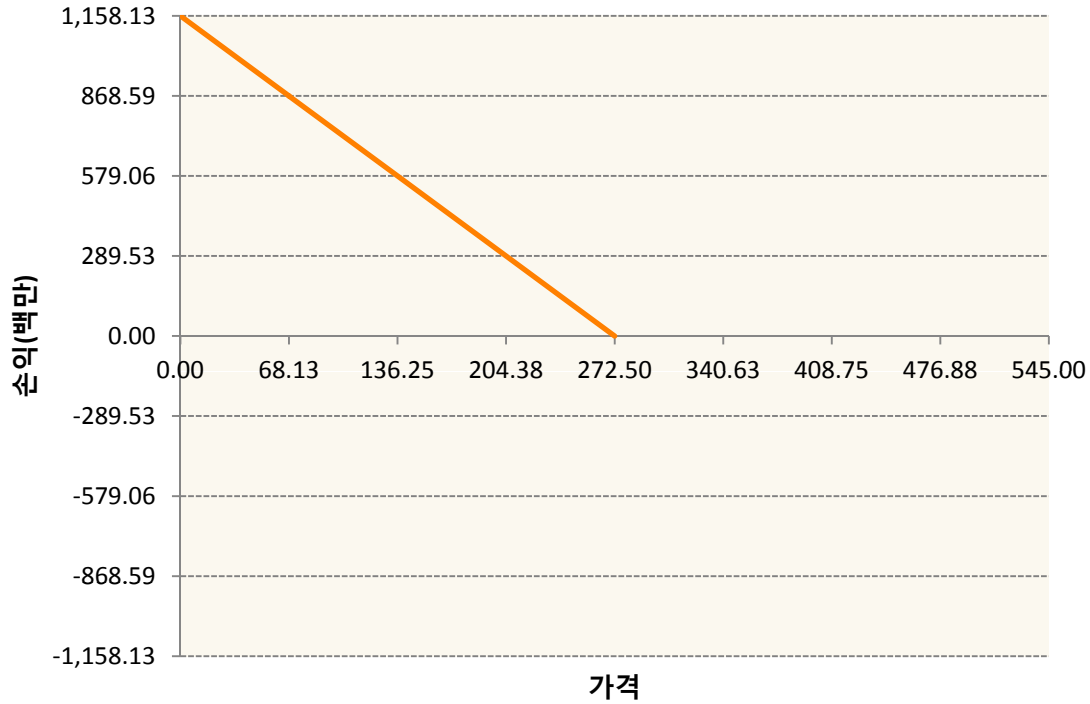


KR4301P82707-2019-08 풋270





KR4301P82723-2019-08 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						867
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-867	-867	-867	-867	-867	-867	-867	
-5.33%	-578	-578	-578	-578	-578	-578	-578	
-2.67%	-289	-289	-289	-289	-289	-289	-289	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	289	289	289	289	289	289	289	
5.33%	578	578	578	578	578	578	578	
8.00%	867	867	867	867	867	867	867	
KR4201P82857		2019-08 콜285						0
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0	
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0	
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	

0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0
KR4201P82873                      2019-08 콜287.5							0
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0
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%	27	27	27	27	27	27	27
-2.67%	13	13	13	13	13	13	13
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
5.33%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
8.00%	-36	-36	-36	-35	-35	-35	-35
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%	57	57	57	57	57	57	57
-2.67%	29	29	29	29	29	29	29
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
5.33%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
8.00%	-83	-83	-82	-82	-82	-81	-81

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

(단위:백만원)

**867**

공시일	2019-08-08
기준일	2019-08-07

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,037	0	3,037	
누계	유가증권	수익증권	58,667	0	58,667	

### 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	2019-08-08
기준일	2019-08-07

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,037	0	3,037	
누계	유가증권	수익증권	73,750	0	73,750	

### 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	2019-08-08
기준일	2019-08-07

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	6,075	0	6,075	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	460,247	0	460,247	
누계	통화	선도	0	453,279	-453,279	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		3,207
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		2,177
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		1,749
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,138
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		136
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		583
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		3,110
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		3,402
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		486
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		972
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		3,023
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		1,691
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		778
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,944
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,944
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		292
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		97
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		719
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		719
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		292
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		680
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		2,721
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		1,361
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		778
FX21019N04 KRW/USD 03-09-19E		292
FX21019Q00 KRW/USD 03-09-19E		292

FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E

486

FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E

194

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

(단위:백만원)

**11,934**

공시일	2019-08-08
기준일	2019-08-07

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

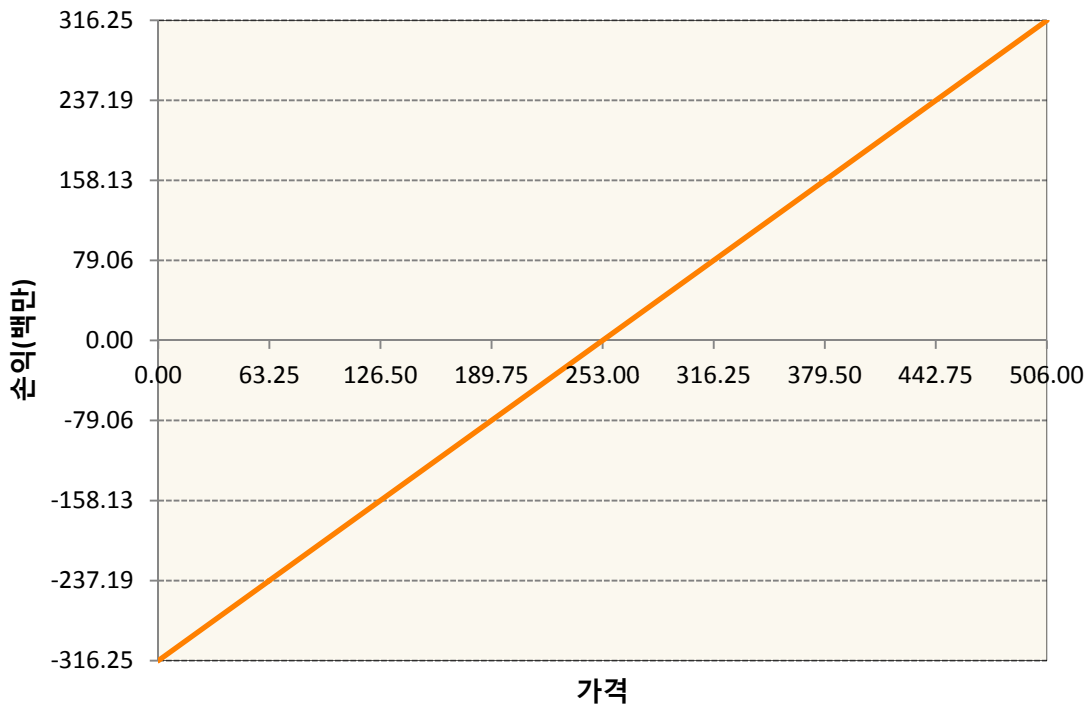
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

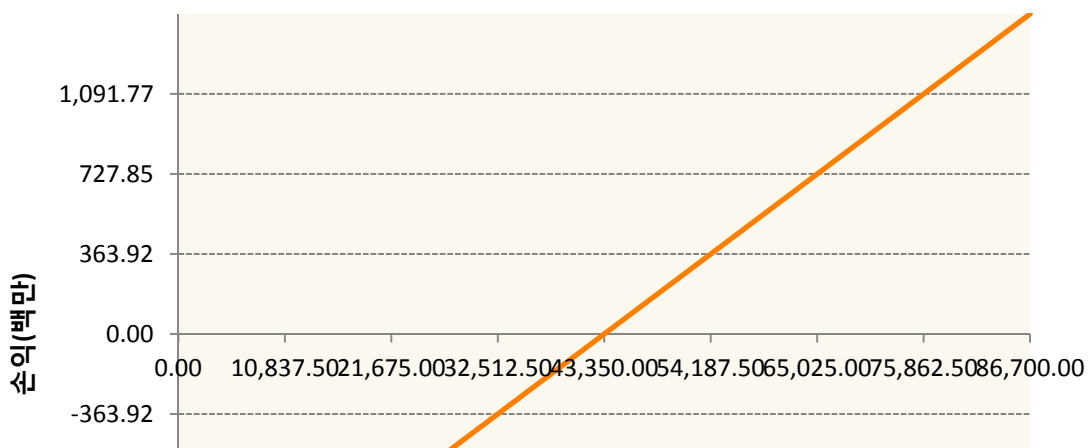
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,462	0	1,462	장내
누계	유가증권	선물	1,772	0	1,772	장내

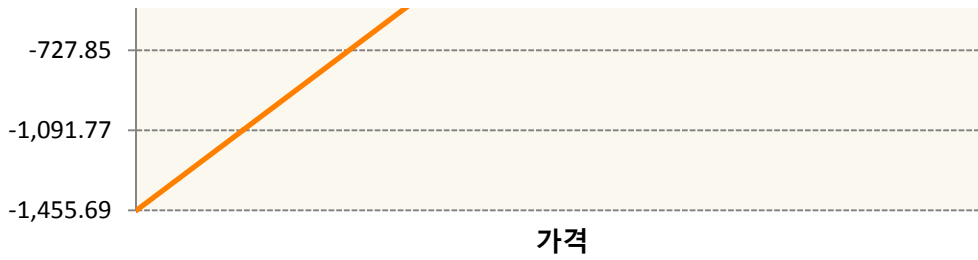
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P90000-2019-09 삼성전자개별선물





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

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						25
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25	
-5.33%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
-2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	8	8	8	8	8	8	8	
5.33%	17	17	17	17	17	17	17	
8.00%	25	25	25	25	25	25	25	
KR4111P90000		2019-09 삼성전자개별선물						116
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116	
-5.33%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77	
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	39	39	39	39	39	39	39	
5.33%	77	77	77	77	77	77	77	
8.00%	116	116	116	116	116	116	116	

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

**168**

공시일	2019-08-08
기준일	2019-08-07

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

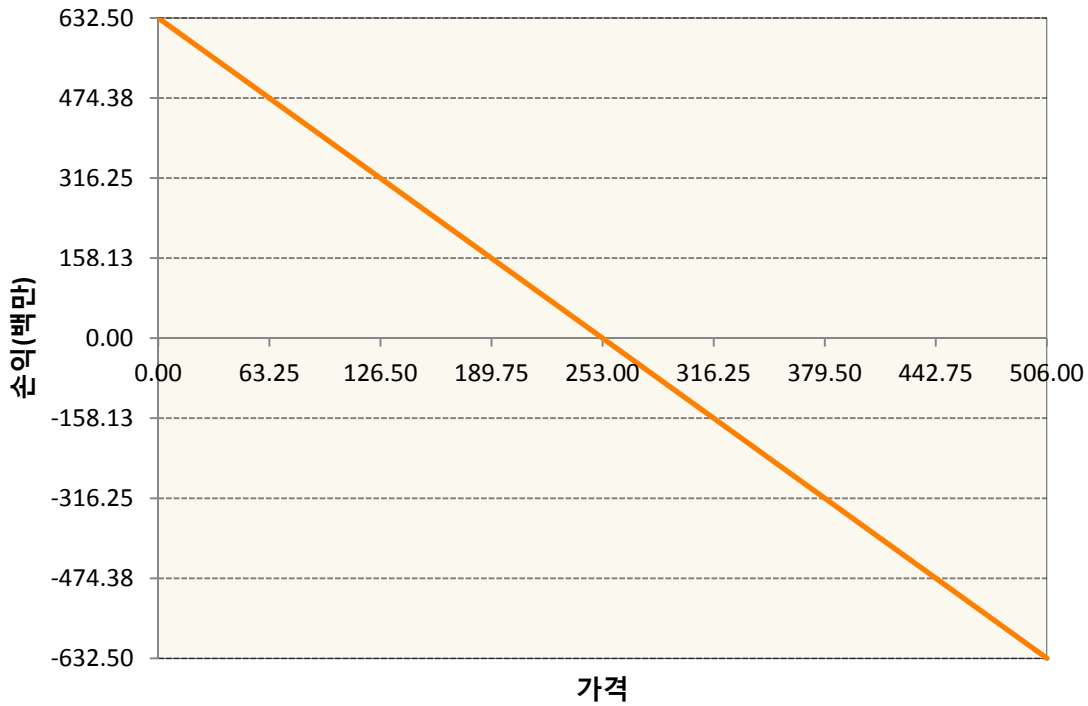
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

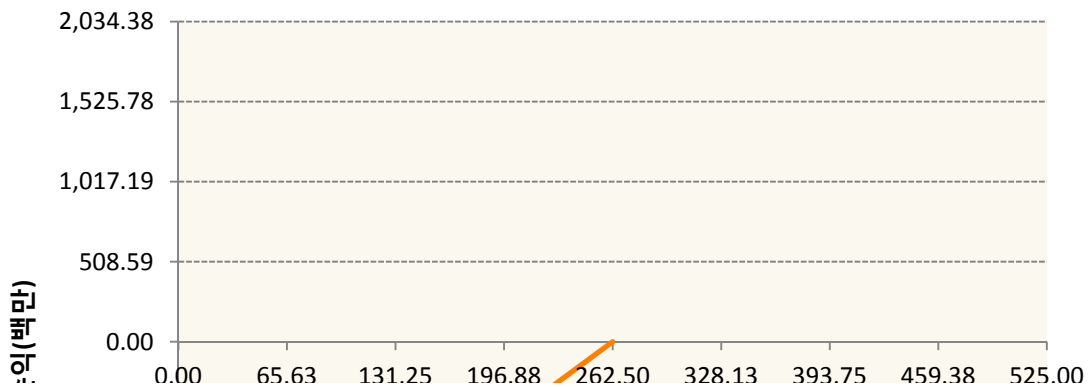
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	633	-633	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,691	-3,691	장내

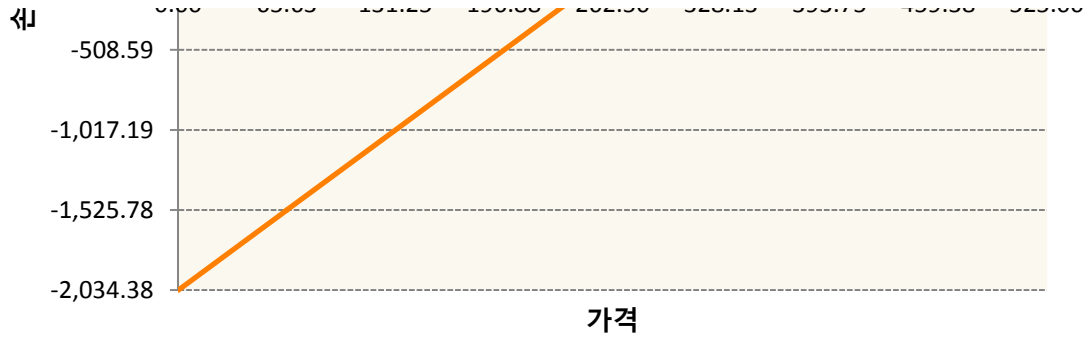
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

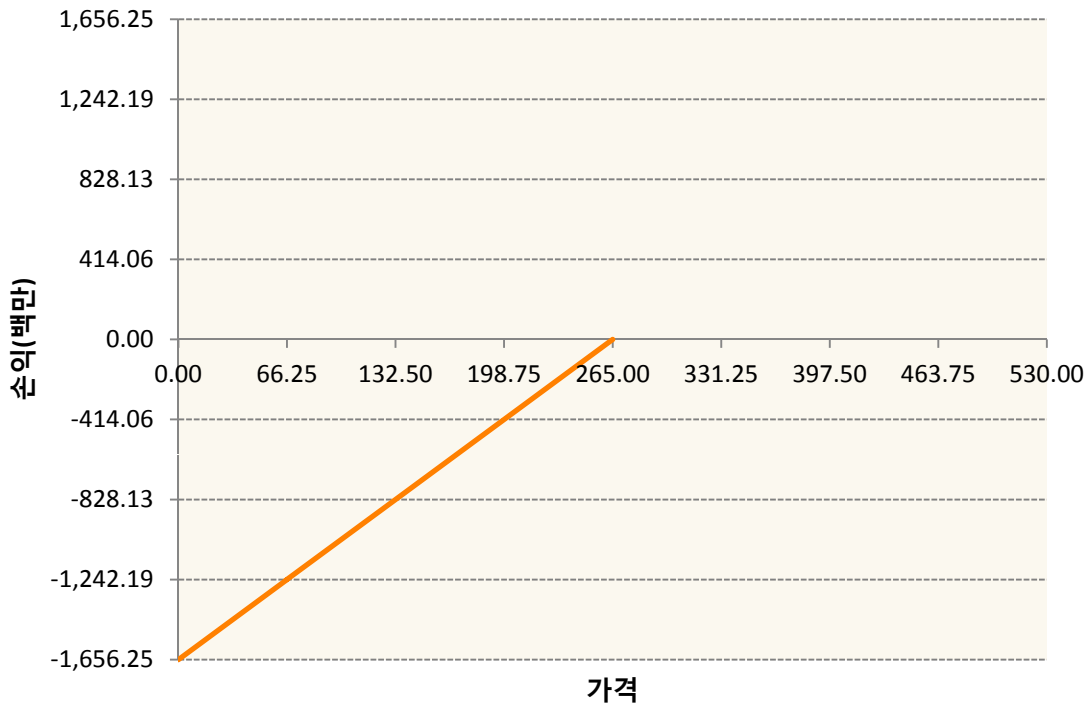


KR4301P82624-2019-08 풋262.5





KR4301P82657-2019-08 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						50
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	50	50	50	50	50	50	50	
-5.33%	34	34	34	34	34	34	34	
-2.67%	17	17	17	17	17	17	17	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
5.33%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34	
8.00%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	
KR4301P82624		2019-08 풋262.5						156
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
-5.33%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104
-2.67%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	52	52	52	51	51	51	51
5.33%	81	81	81	80	80	79	79
8.00%	81	81	81	81	81	81	81
KR4301P82657                      2019-08 풋265							126
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
-5.33%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
-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%	78	77	77	76	76	75	75
8.00%	81	81	81	81	81	81	81

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

(단위:백만원)

**328**

공시일	2019-08-08
기준일	2019-08-07

## 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	19,184	0	19,184	
누계	통화	선도	0	18,831	-18,831	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		1,011
FX21019N01 KRW/USD 12-08-19E		165
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		330

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

(단위:백만원)

<b>496</b>
------------

공시일	2019-08-08
기준일	2019-08-07

## 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	388	0	388	장외
누계	통화	선도	0	95	-95	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	31
FX21019N01 KRW/EUR 25-10-19E	4
FX21019Q00 KRW/EUR 25-10-19E	4

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

(단위:백만원)

<b>33</b>
-----------

공시일	2019-08-08
기준일	2019-08-07

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

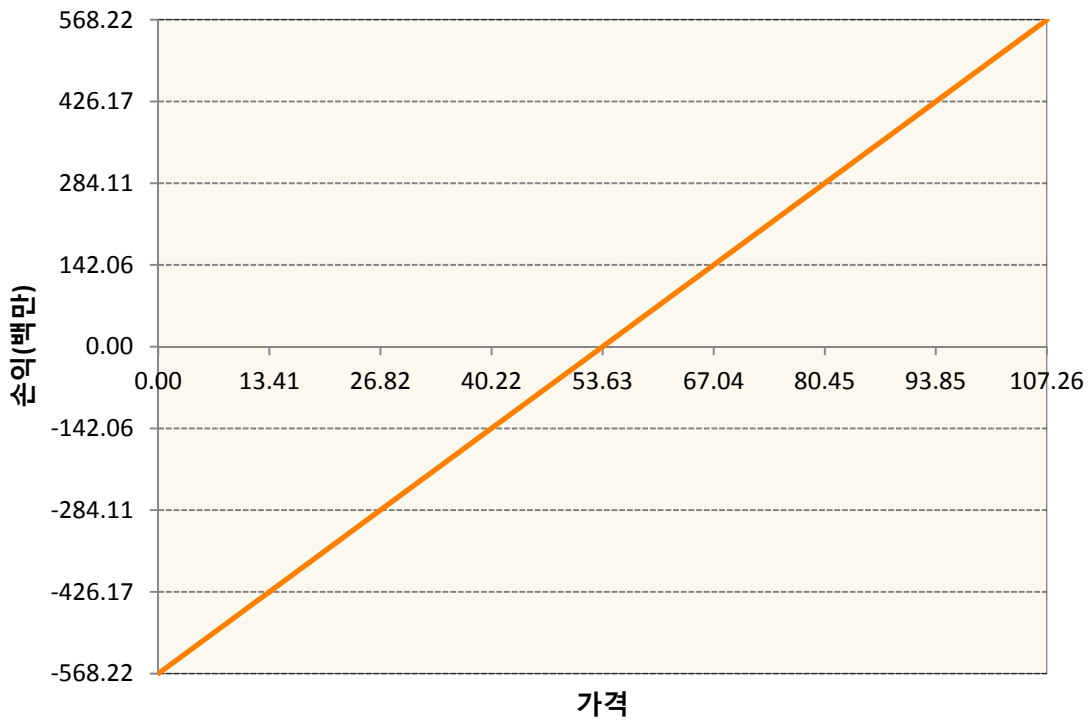
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

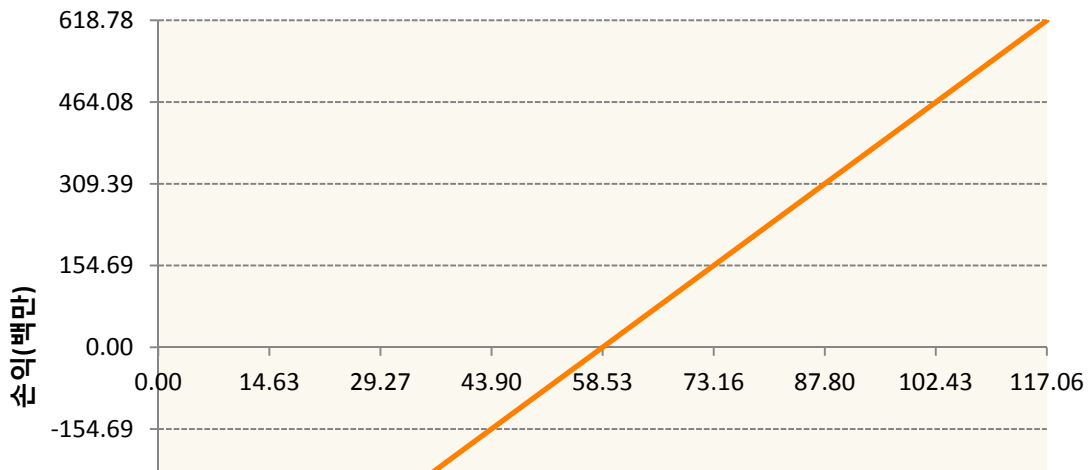
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,381	121	2,259	

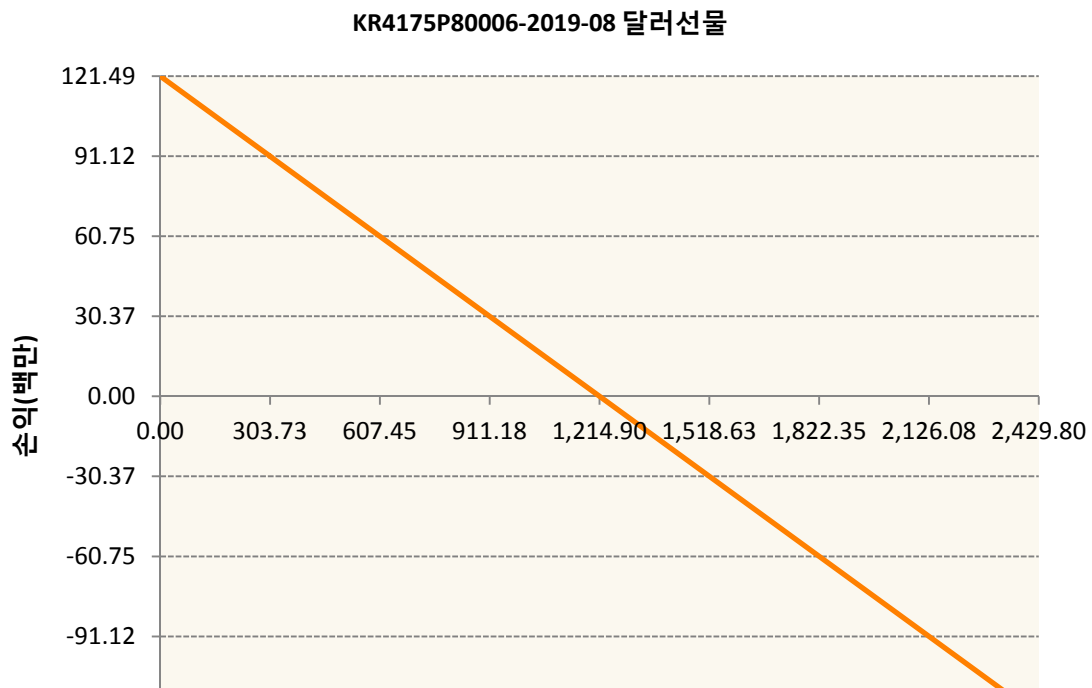
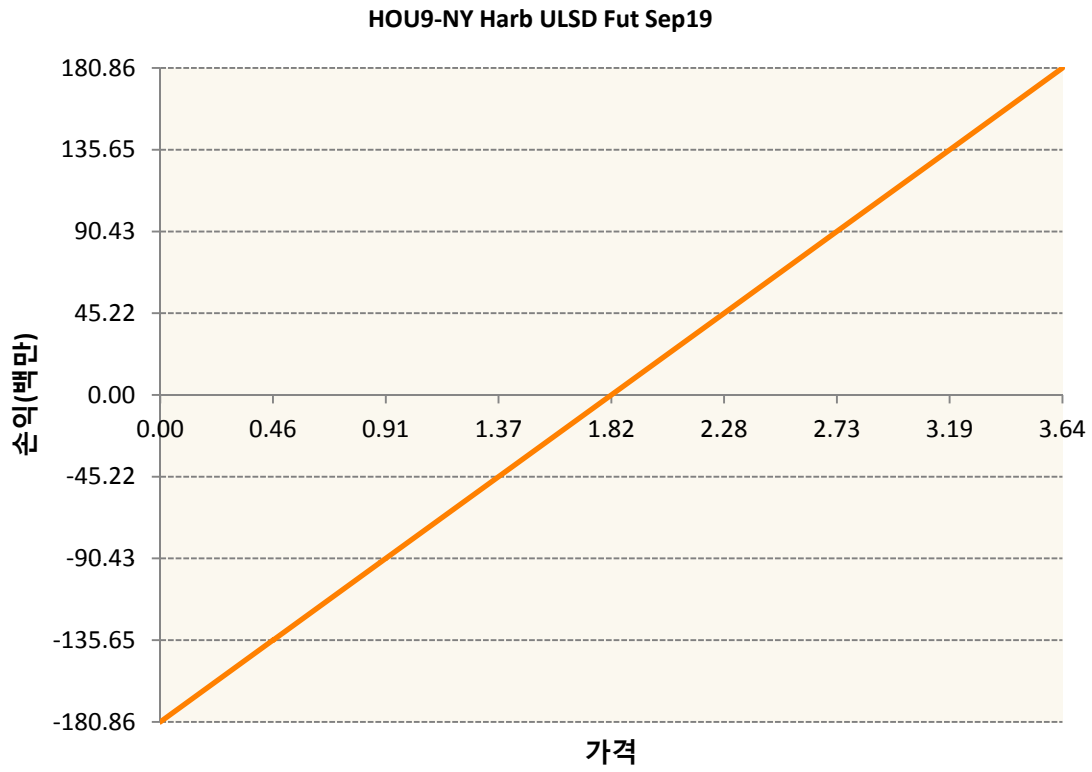
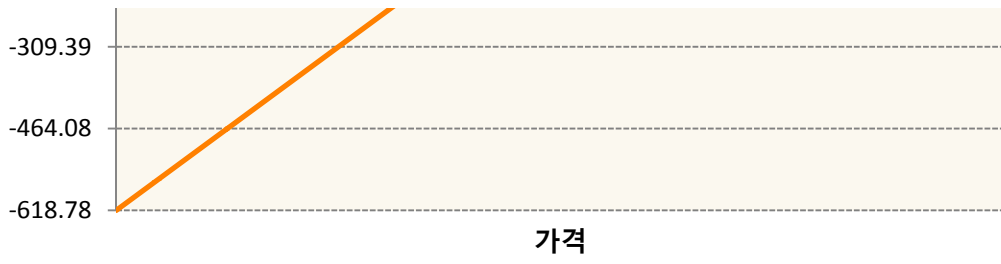
### 2. 만기시점의 손익구조

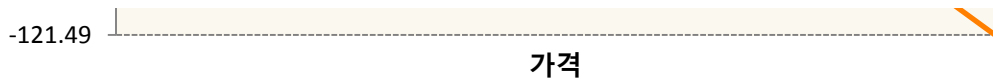
CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19



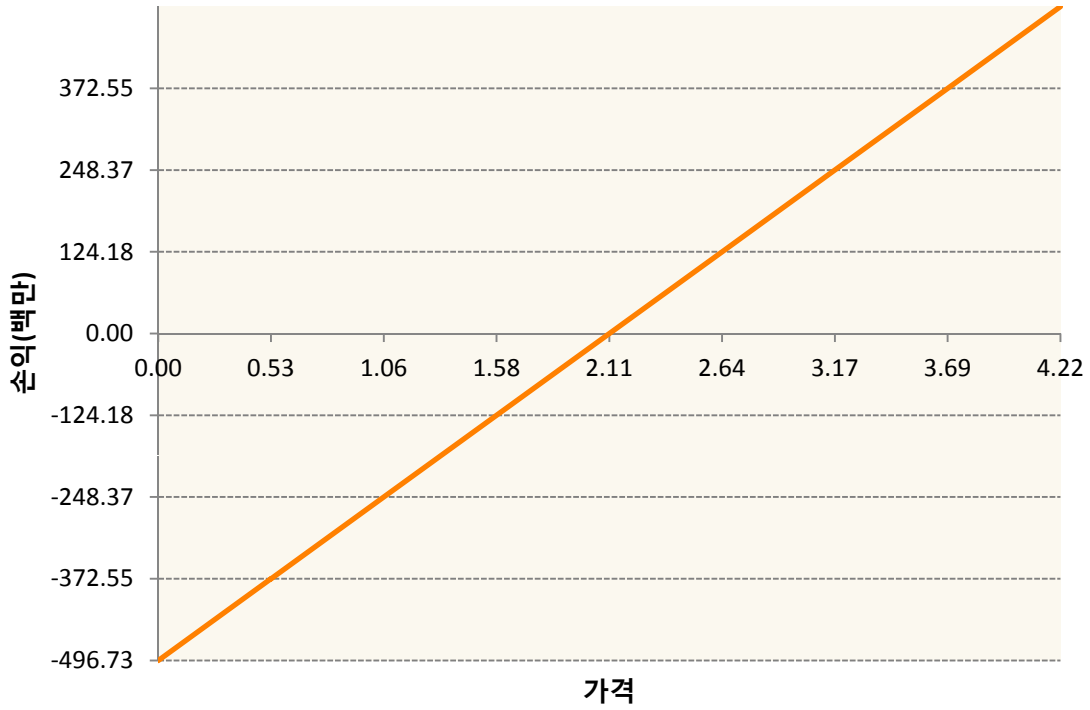
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19



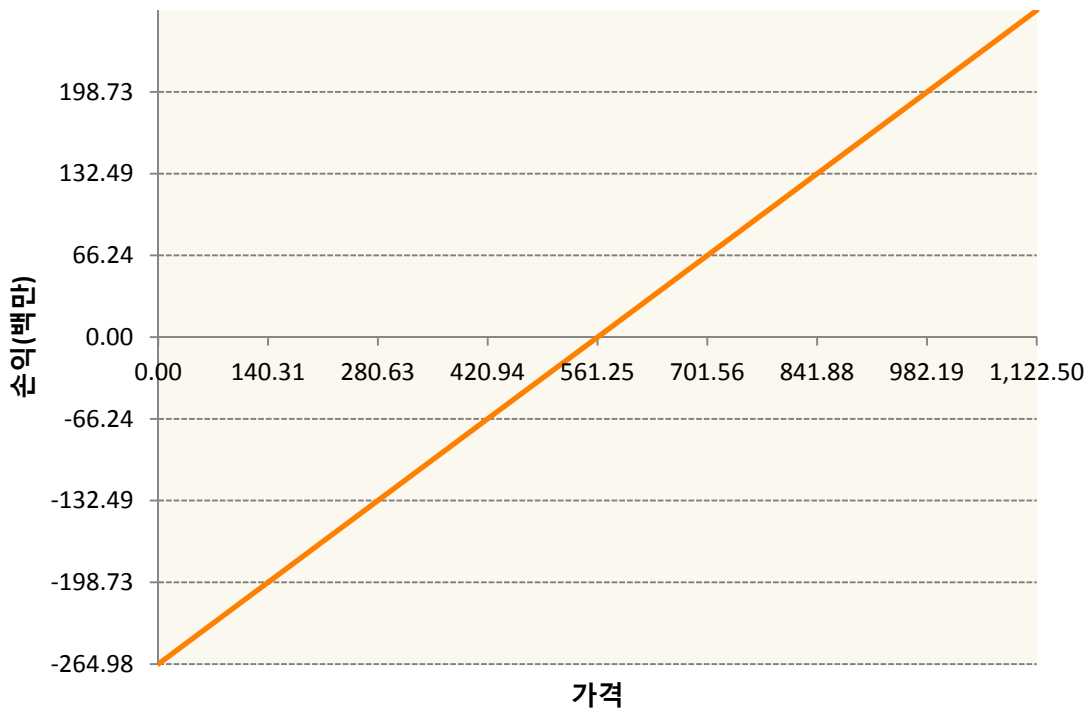




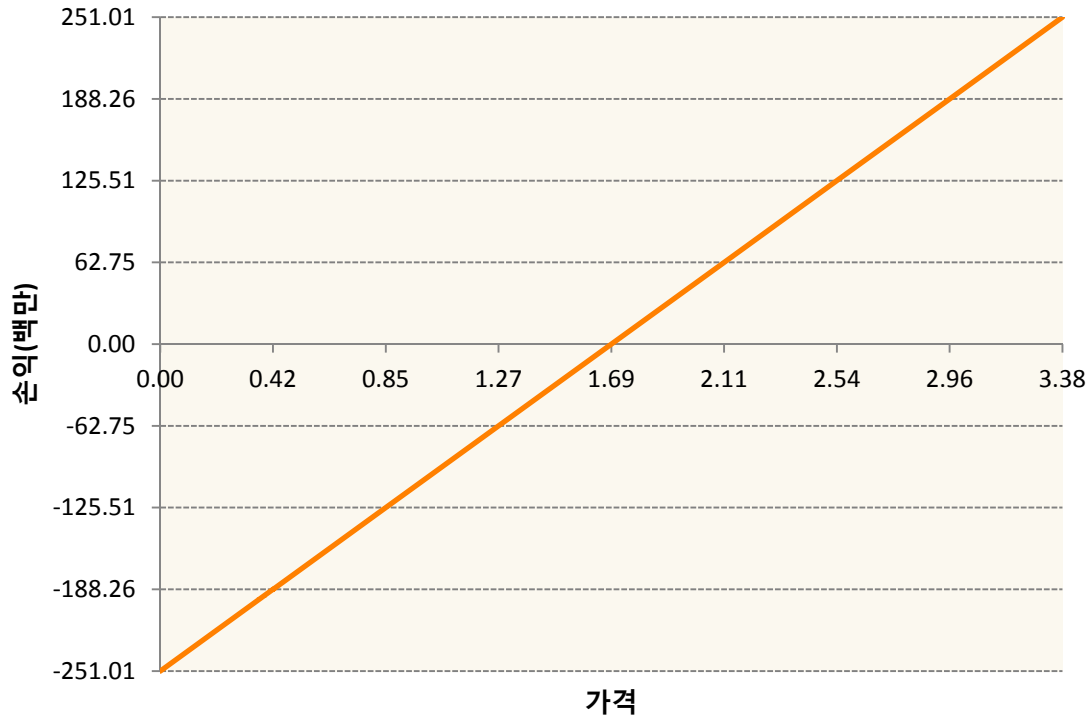
NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



QSU9-Low Su Gasoil G Sep19



XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	45
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	50
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	14
KR4175P800	2019-08 달러선물	10
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	40
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	21
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	20

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

354

공시일	2019-08-08
기준일	2019-08-07

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

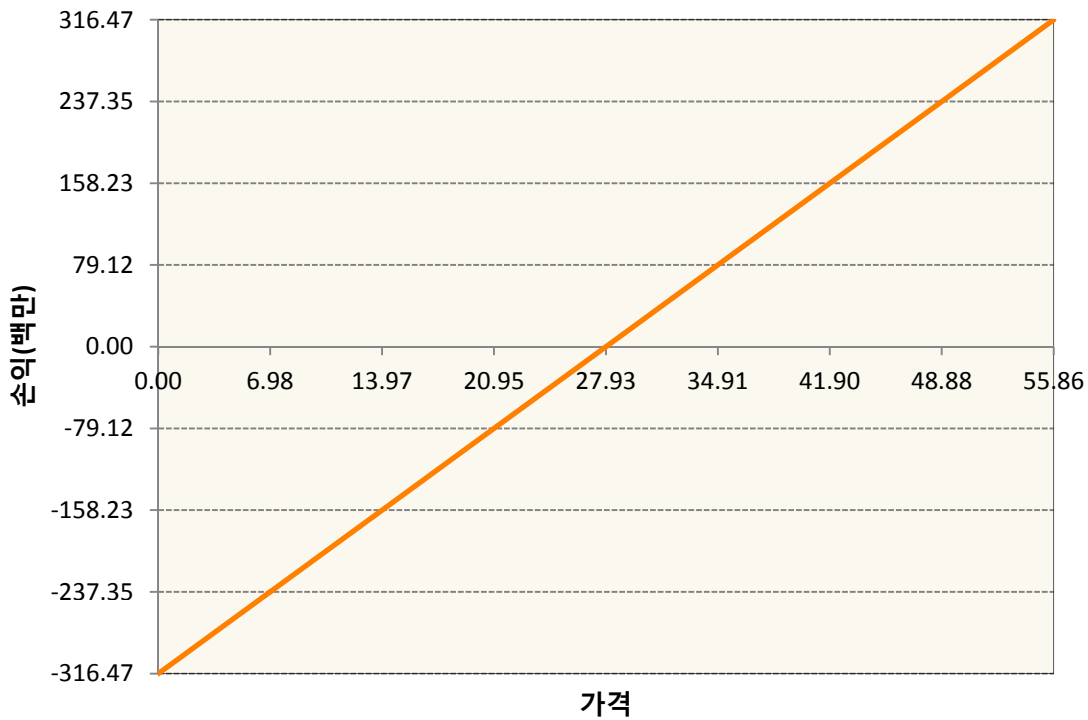
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

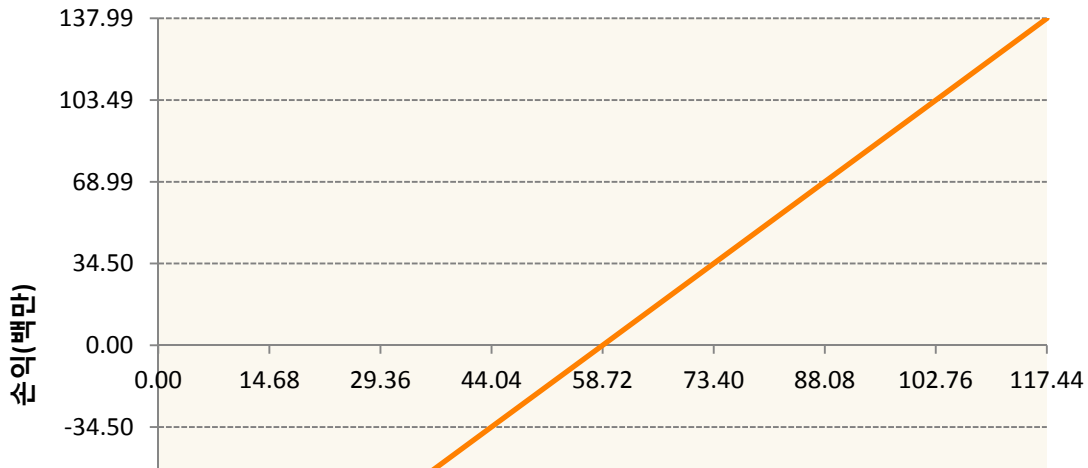
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,870	207	2,664	

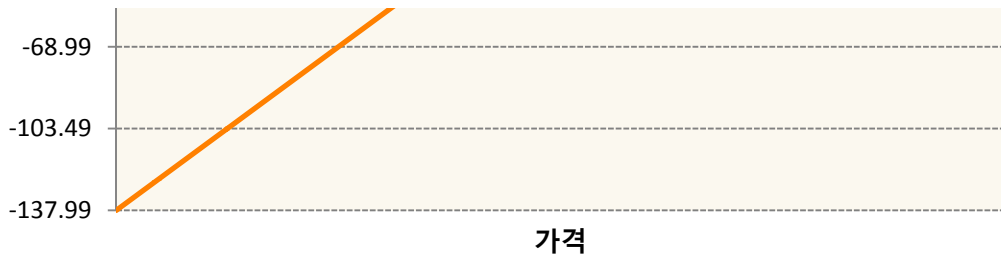
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19**

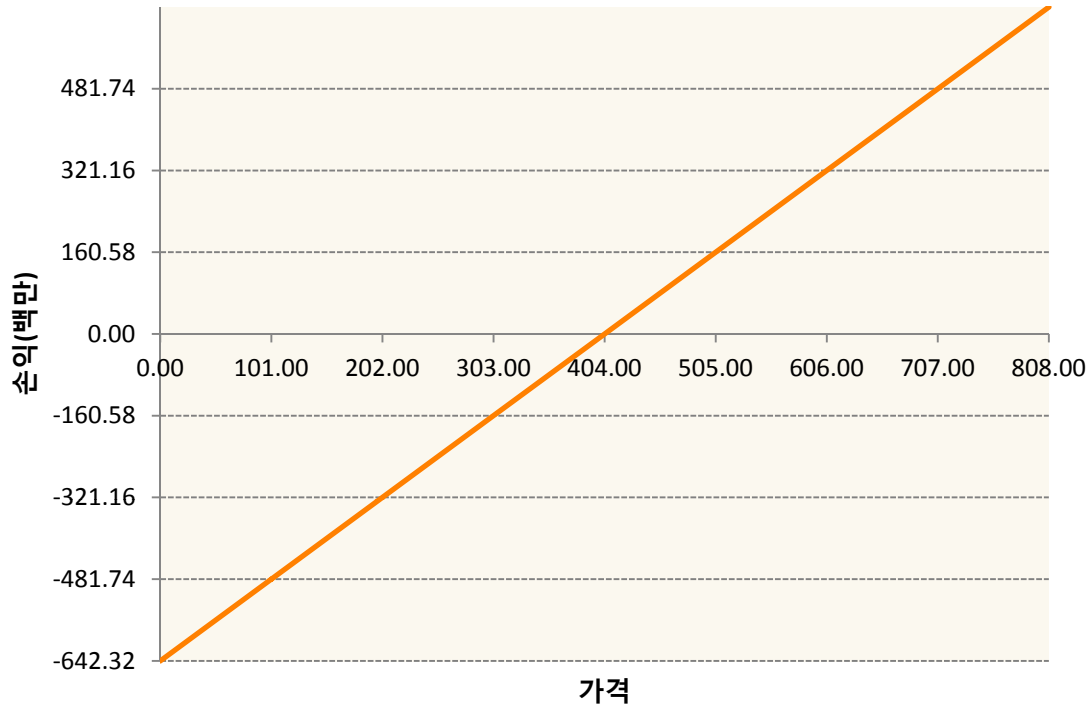


**CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19**

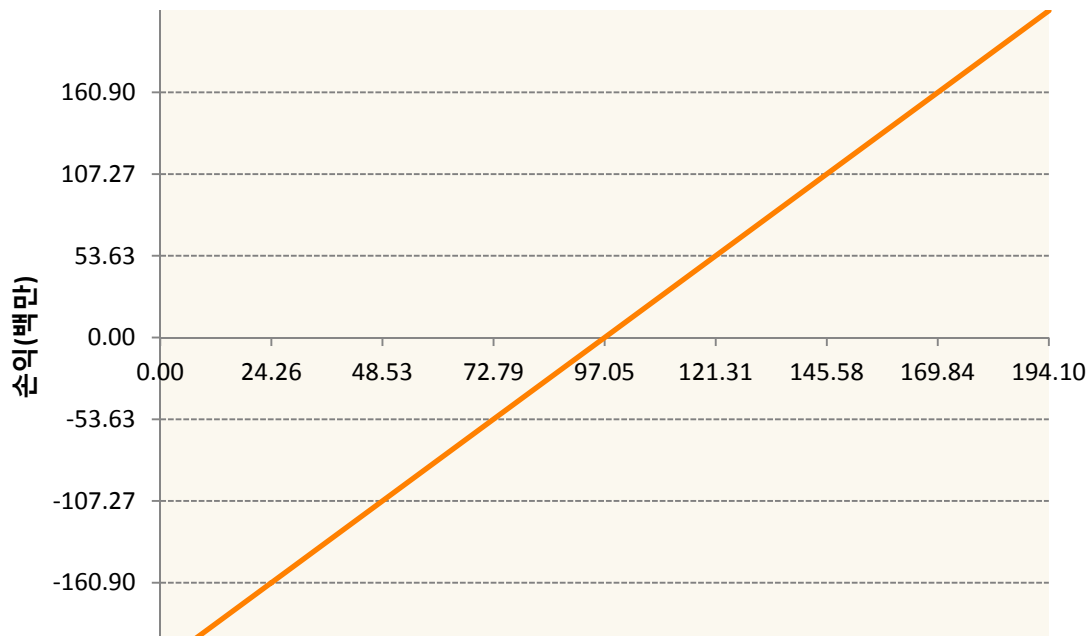


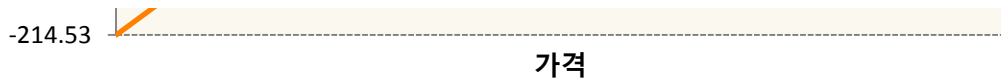


CU9-CORN FUTURE Sep19

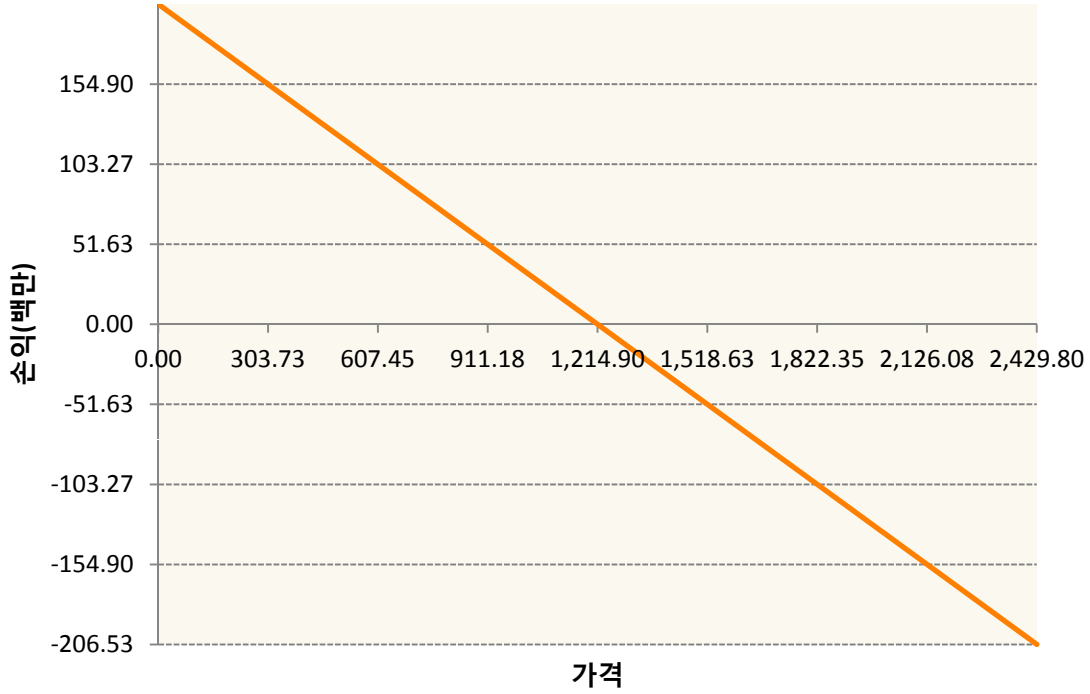


KCU9-COFFEE 'C' FUTURE Sep19

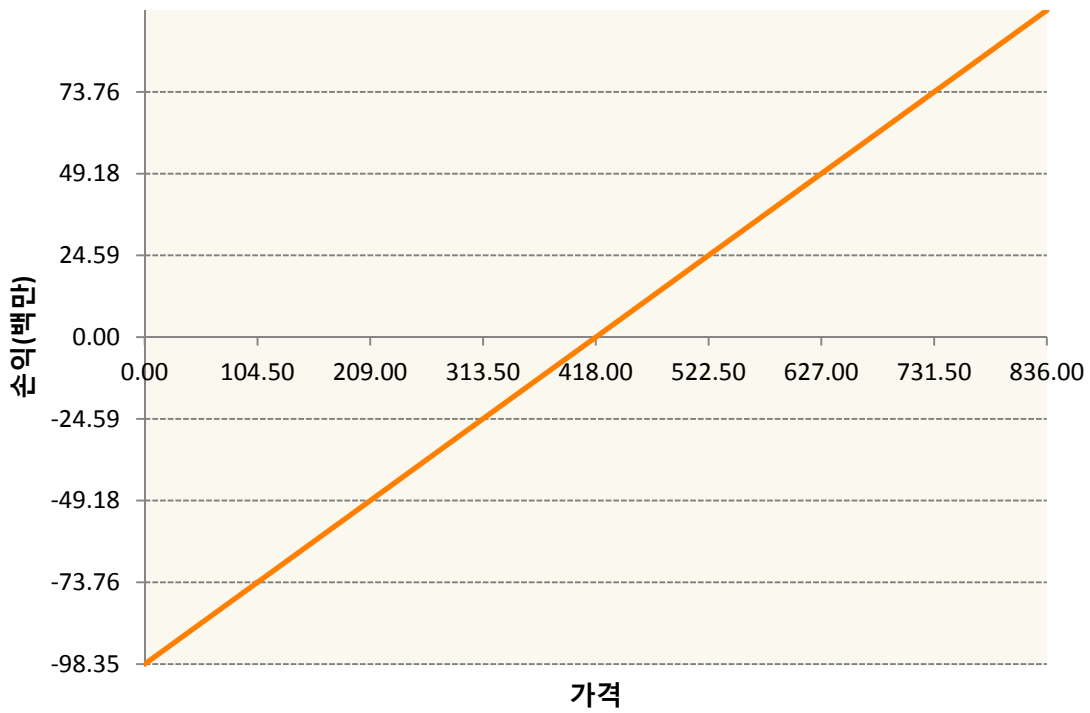




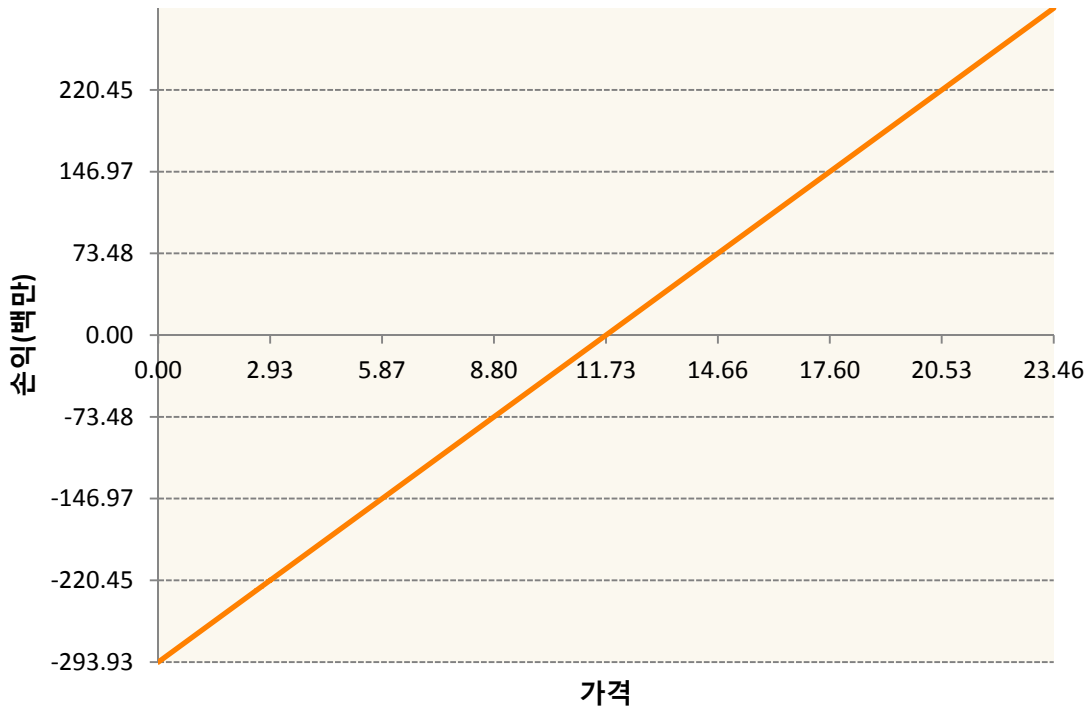
KR4175P80006-2019-08 달러선물



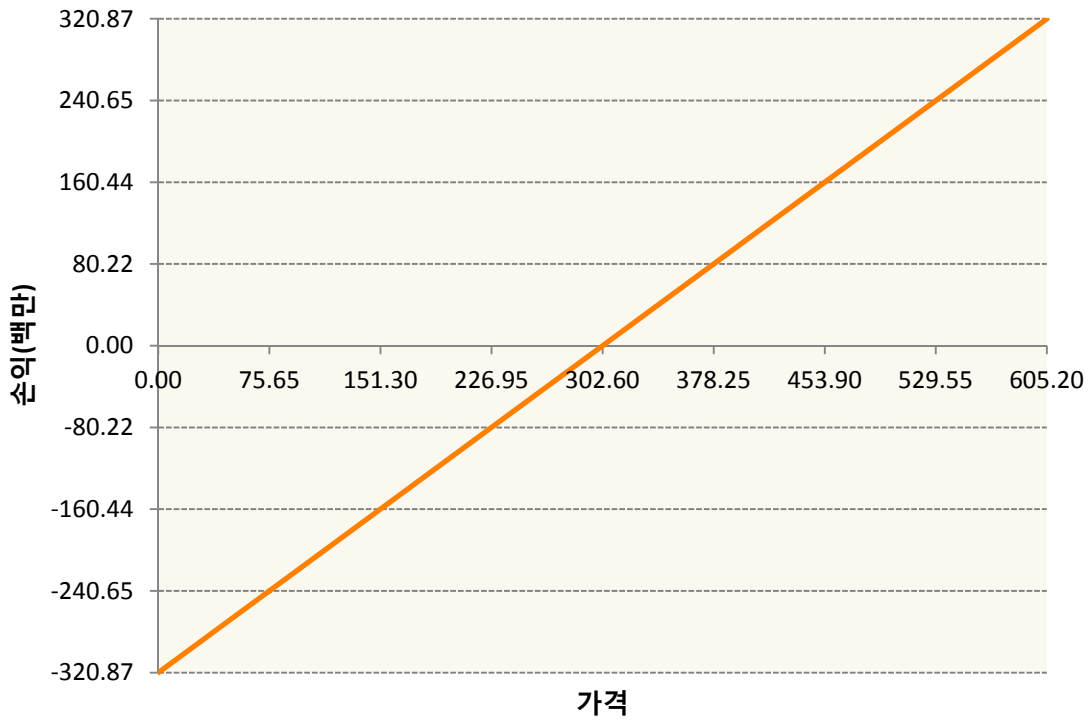
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



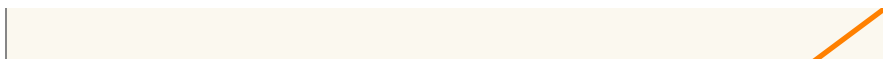
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

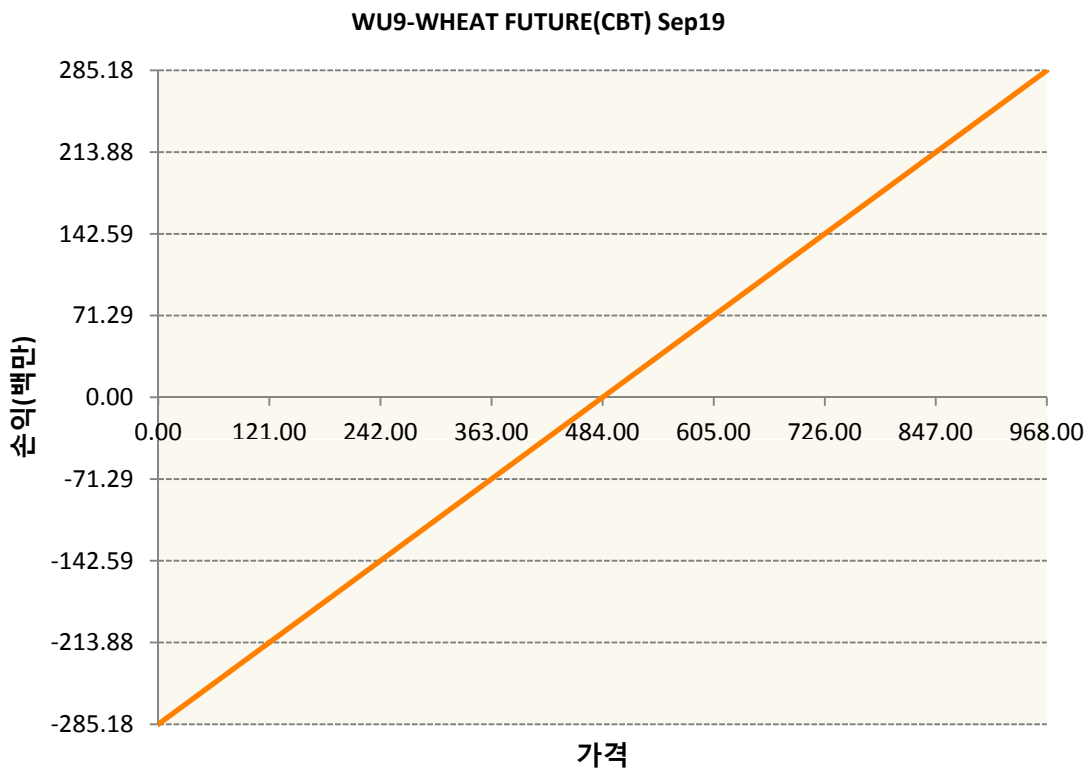
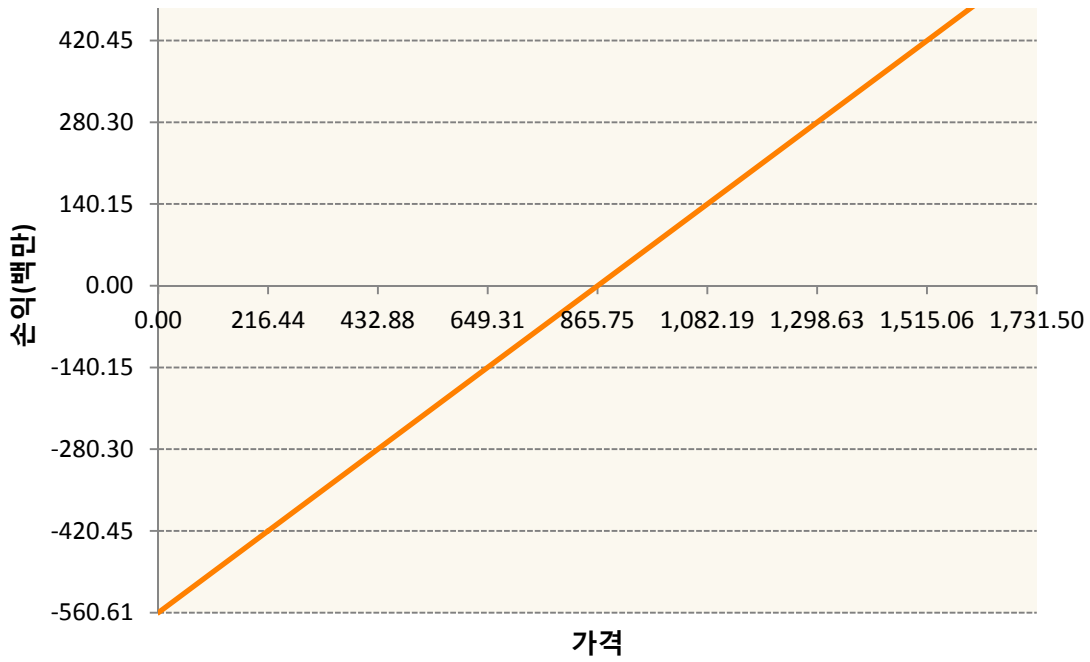


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	25
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	11
CU9	CORN FUTURE Sep19	51
KCU9	COFFEE 'C' FUTURE Sep19	17
KR4175P800	2019-08 달러선물	17

KWU9	KC HRW WHEAT FUT Sep19	8
SBV9	SUGAR #11 (WORLD) Oct19	24
SMZ9	SOYBEAN MEAL FUTR Dec19	26
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	45
WU9	WHEAT FUTURE(CBT) Sep19	23

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

(단위:백만원)

**253**