

공시일	2019-07-16
기준일	2019-07-15

포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6	0	6	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

91

공시일	2019-07-16
기준일	2019-07-15

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

1,184

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

674

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-16
기준일	2019-07-15

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)

852

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-16
기준일	2019-07-15

유로인덱스모(주식-파생형)

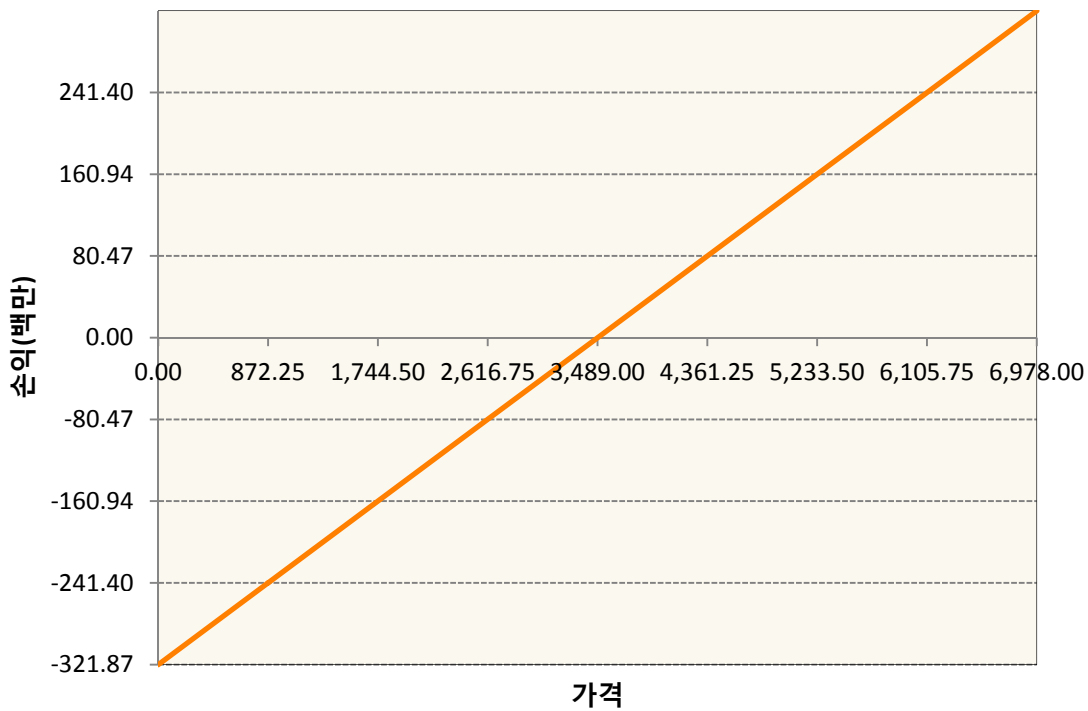
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	322	0	322	

2. 만기시점의 손익구조

VGU9-EURO STOXX 50 Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

18

공시일	2019-07-16
기준일	2019-07-15

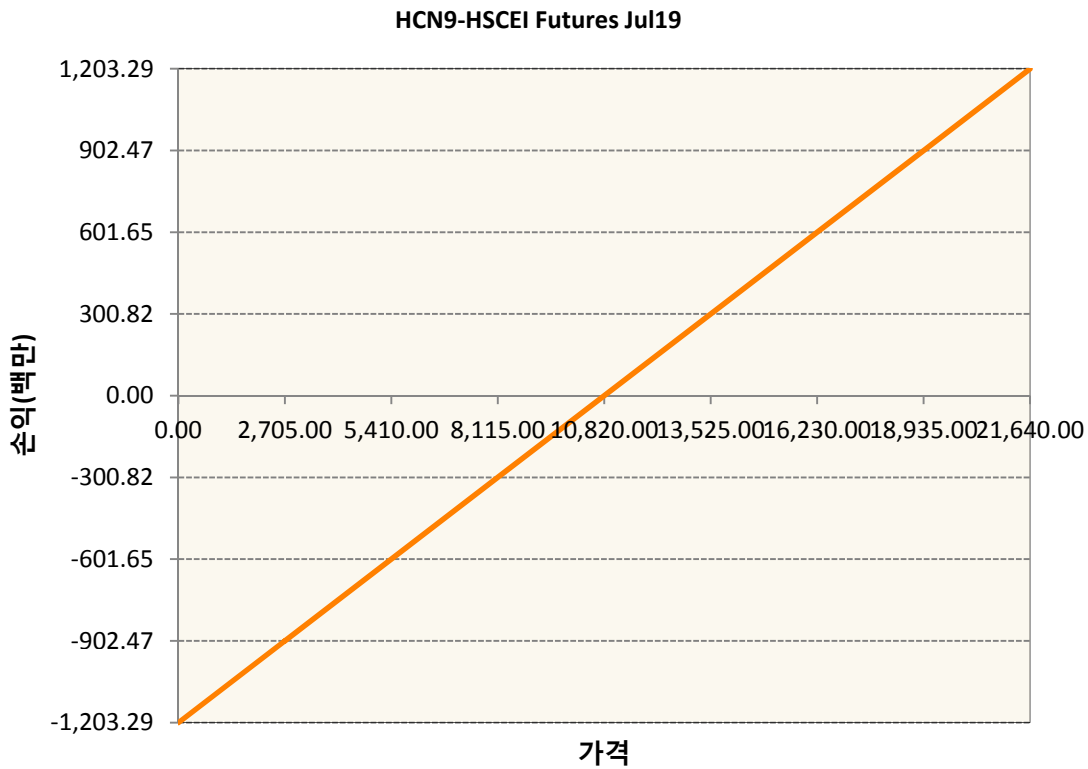
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,203	0	1,203	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN9	HSCEI Futures Jul19	96
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

97

공시일	2019-07-16
기준일	2019-07-15

커버드콜모(주식혼합-파생형)

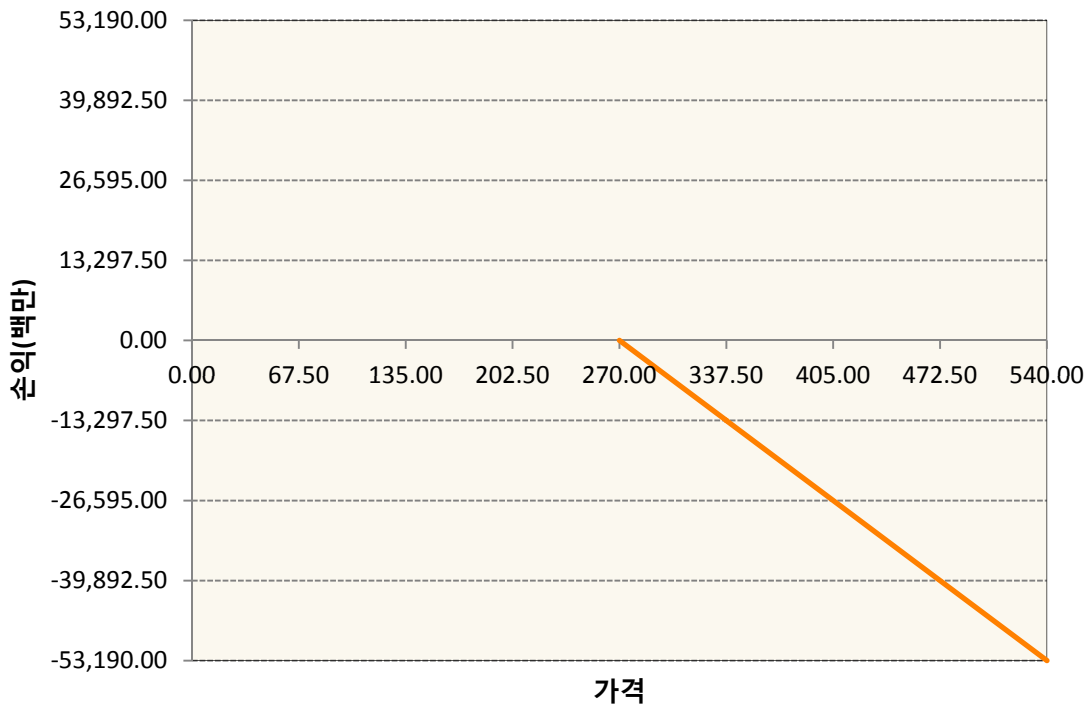
1. 계약금액

(단위:백만원)

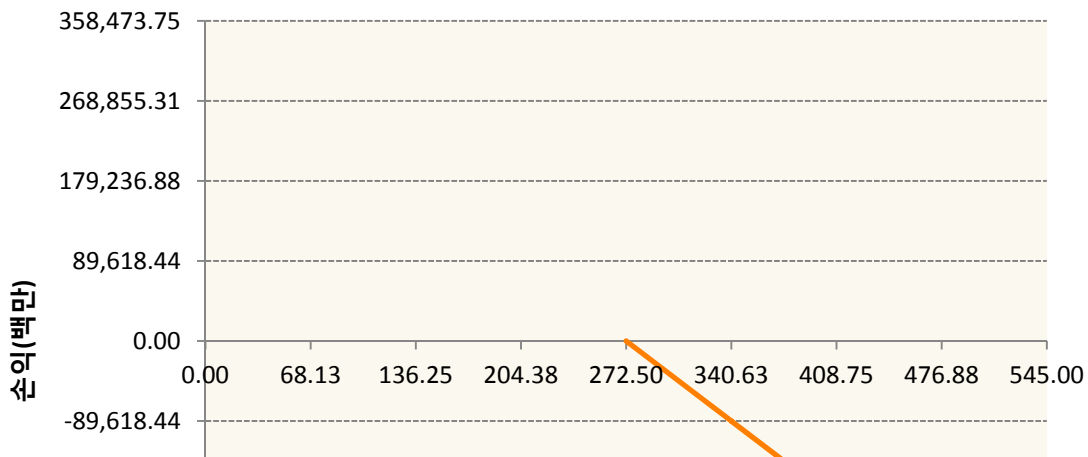
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	601,289	-601,289	장내

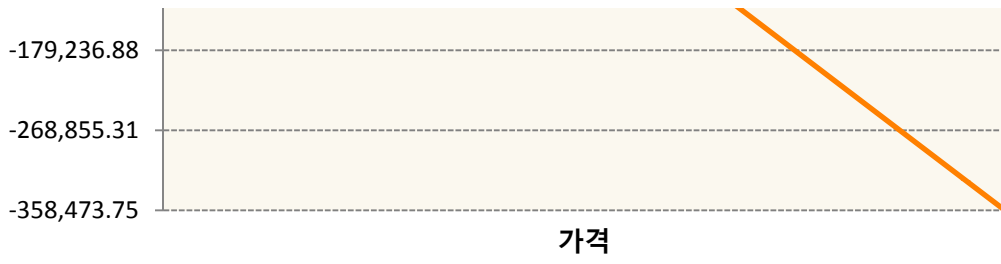
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P82709-2019-08 콜270

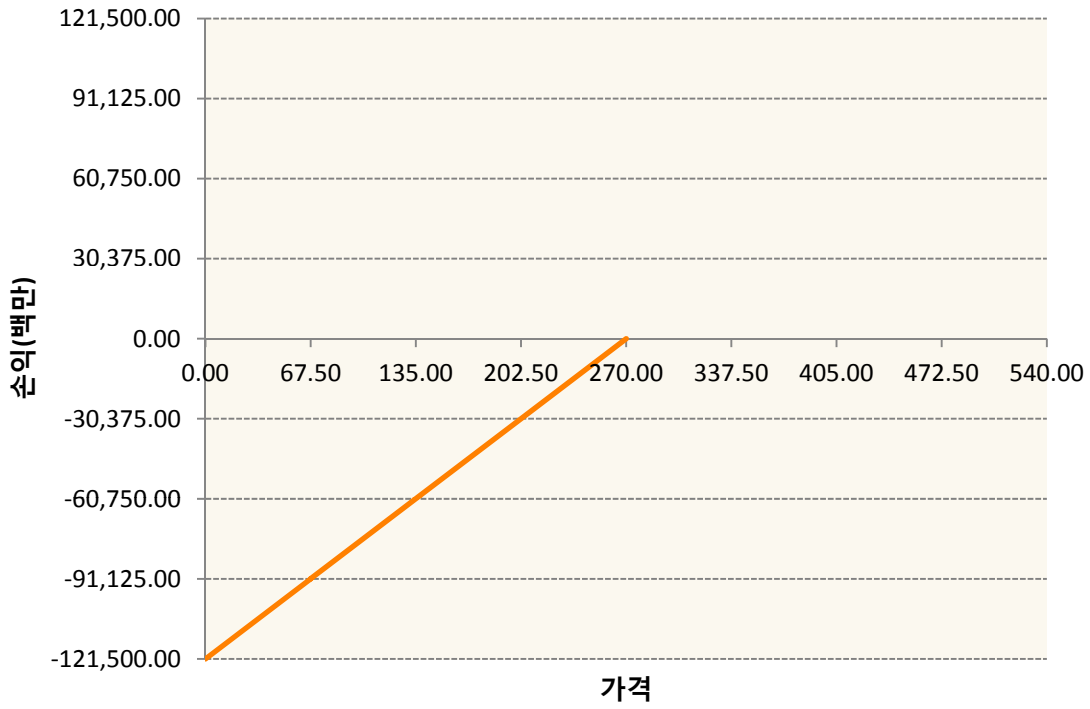


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

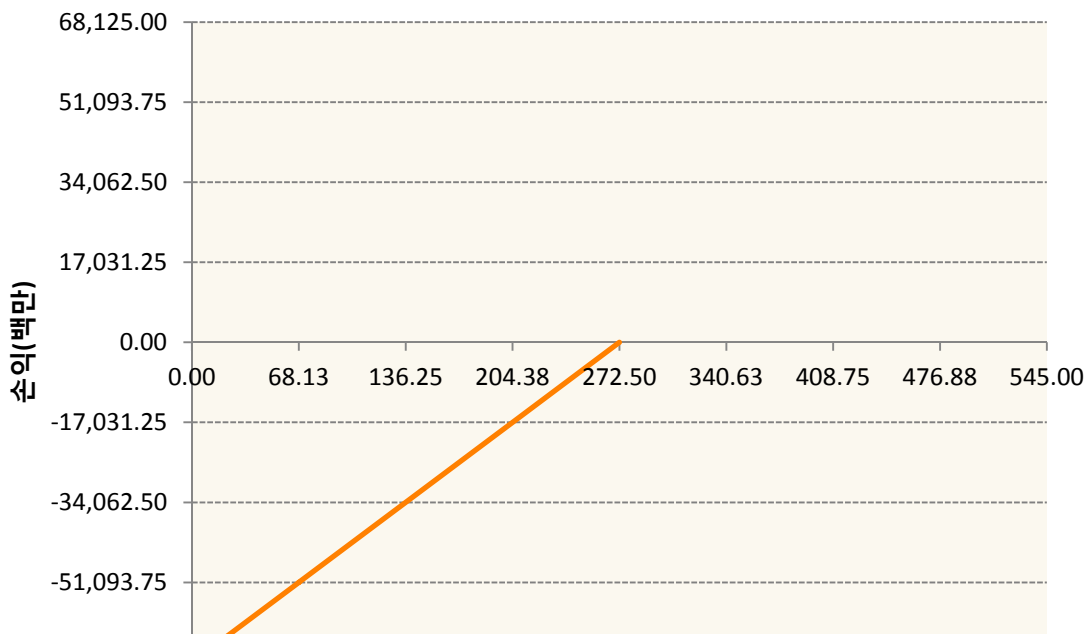




KR4301P82707-2019-08 풋270



KR4301P82723-2019-08 풋272.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P82709 2019-08 콜270							3,481
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,557	1,520	1,475	1,423	1,365	1,301	1,233
-5.33%	1,394	1,321	1,242	1,159	1,071	981	889
-2.67%	1,015	910	803	696	589	480	372
0%	335	224	112	0	-112	-224	-337
2.67%	-648	-738	-831	-928	-1,027	-1,129	-1,232
5.33%	-1,860	-1,916	-1,979	-2,050	-2,126	-2,206	-2,291
8.00%	-3,204	-3,231	-3,267	-3,310	-3,361	-3,418	-3,481
KR4201P82725 2019-08 콜272.5							22,190
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,859	8,672	8,433	8,145	7,813	7,442	7,036
-5.33%	8,082	7,672	7,215	6,720	6,194	5,641	5,067
-2.67%	6,104	5,454	4,787	4,107	3,417	2,719	2,015
0%	2,278	1,519	759	0	-759	-1,519	-2,278
2.67%	-3,617	-4,288	-4,976	-5,676	-6,387	-7,106	-7,832
5.33%	-11,239	-11,697	-12,201	-12,744	-13,317	-13,916	-14,536
8.00%	-19,957	-20,204	-20,508	-20,865	-21,268	-21,711	-22,190
KR4301P82707 2019-08 풋270							7,614
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,539	-7,542	-7,547	-7,557	-7,571	-7,590	-7,614
-5.33%	-4,313	-4,343	-4,383	-4,432	-4,489	-4,553	-4,624
-2.67%	-1,434	-1,541	-1,653	-1,769	-1,887	-2,007	-2,129
0%	388	260	131	0	-131	-264	-396
2.67%	1,018	962	896	821	739	651	557
5.33%	1,121	1,111	1,096	1,073	1,042	1,005	960
8.00%	1,129	1,128	1,126	1,122	1,115	1,105	1,090
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							4,555
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,530	-4,531	-4,532	-4,535	-4,539	-4,546	-4,555
-5.33%	-2,724	-2,733	-2,746	-2,763	-2,785	-2,811	-2,841
-2.67%	-1,023	-1,068	-1,117	-1,170	-1,226	-1,284	-1,344
0%	228	152	76	0	-76	-152	-228
2.67%	777	730	679	624	566	506	443

5.33%	897	885	869	848	822	792	757
8.00%	909	907	905	900	893	883	870

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

(단위:백만원)

38,455

공시일	2019-07-16
기준일	2019-07-15

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

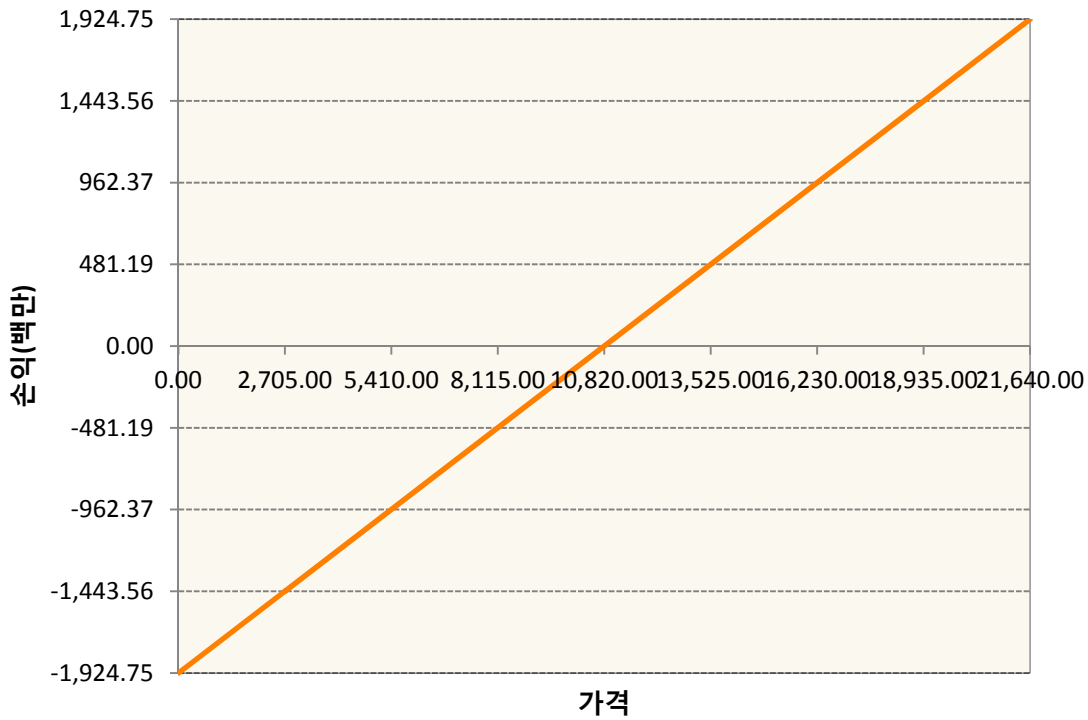
1. 계약금액

(단위:백만원)

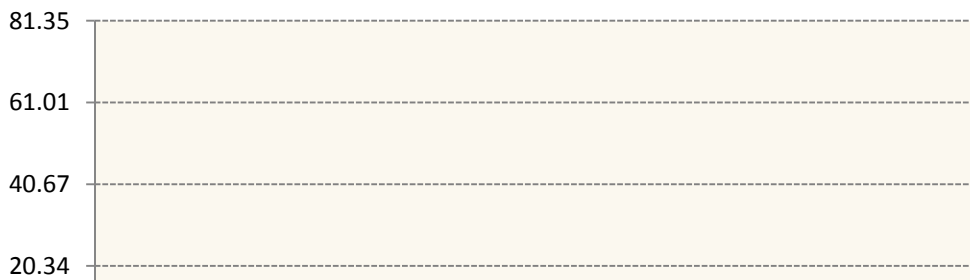
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,925	0	1,925	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,253	-5,253	장내
누계	통화	선도	151	3,163	-3,013	장외

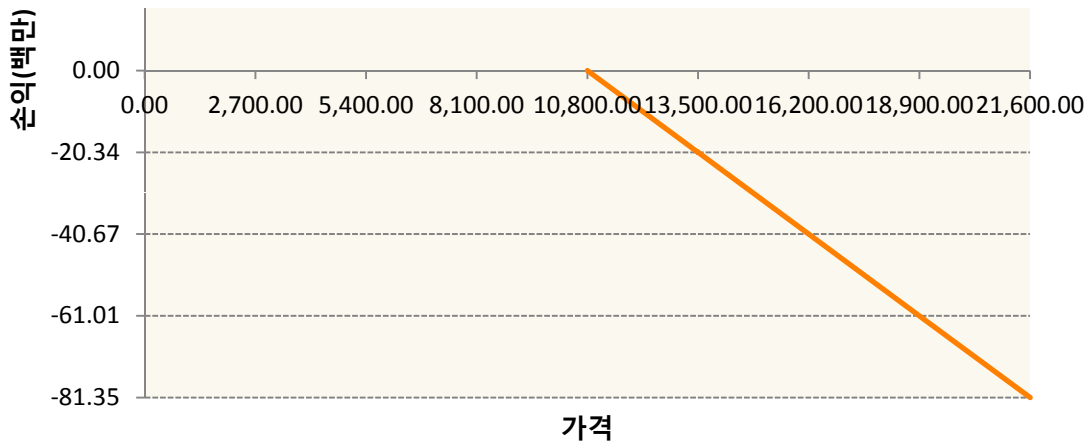
2. 만기시점의 손익구조

HCN9-HSCEI Futures Jul19

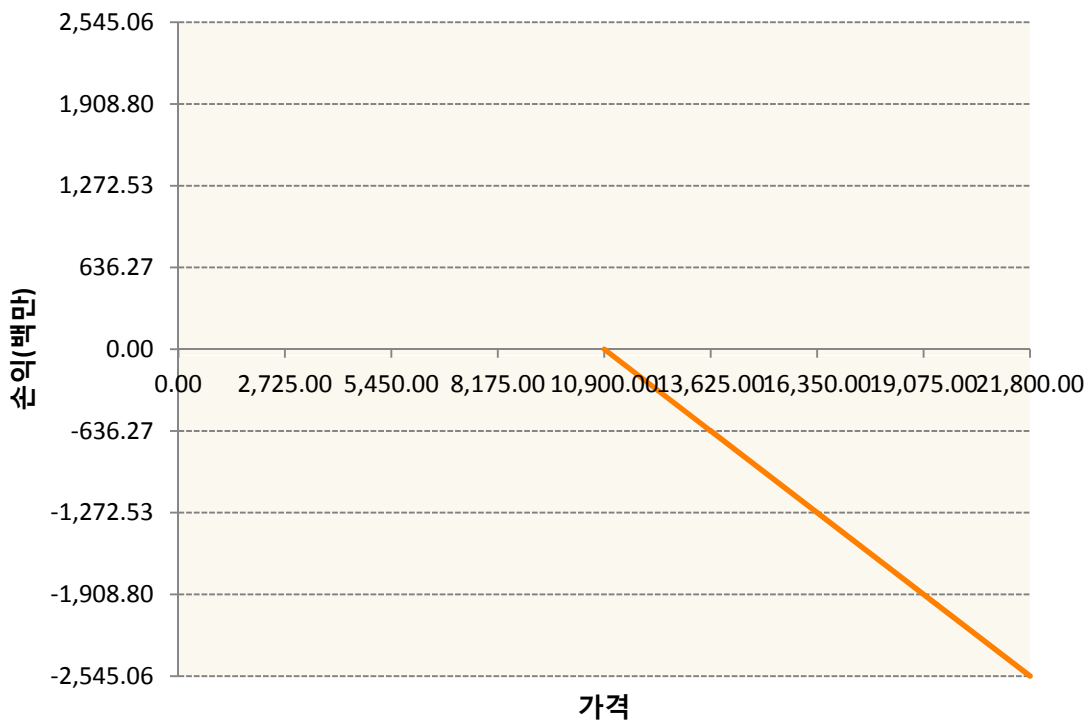


OHHIN9-C108-HSCEI

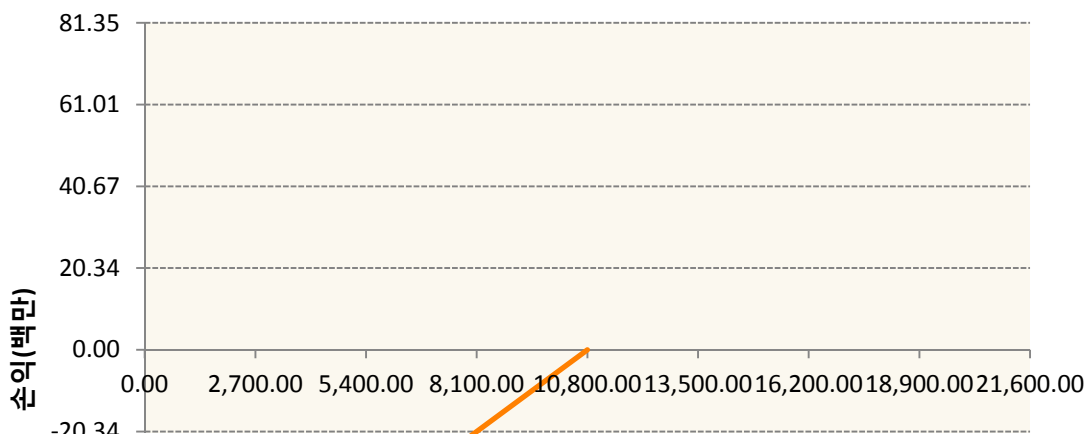


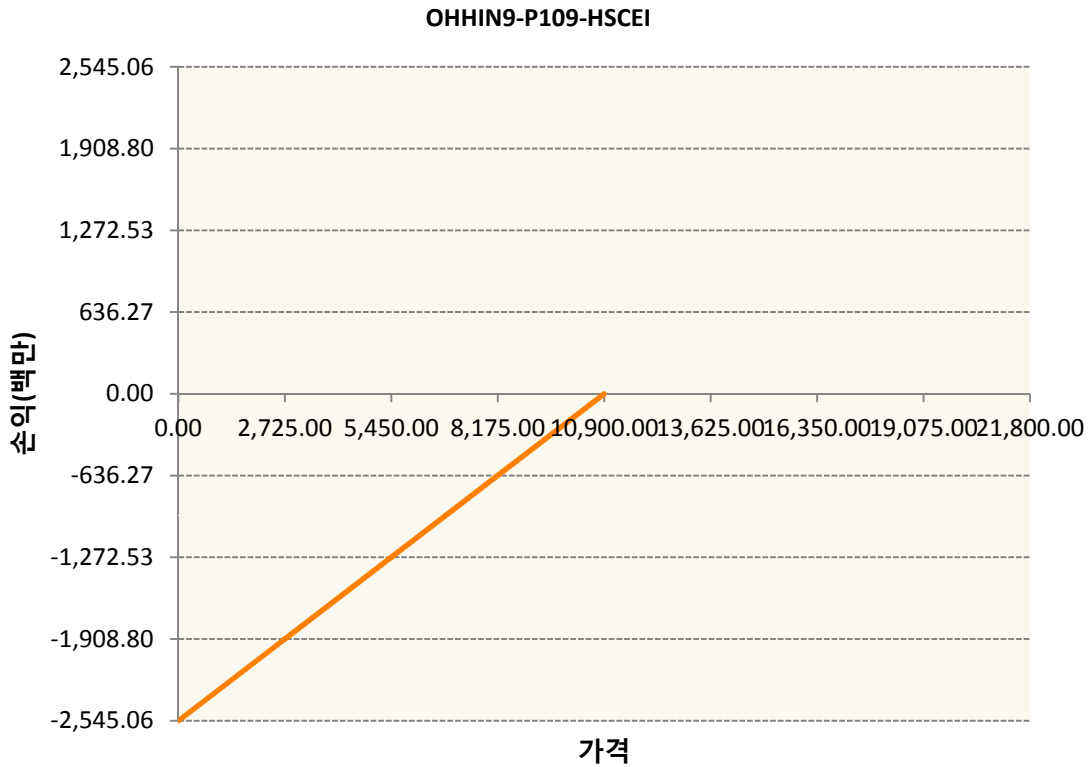
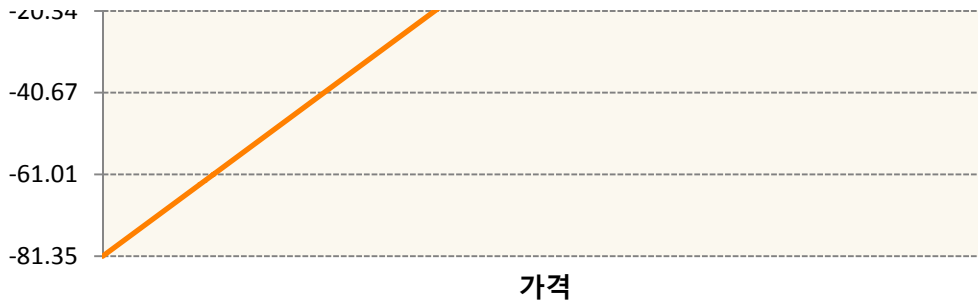


OHHIN9-C109-HSCEI



OHHIN9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	253
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E	12
HCN9 HSCEI Futures Jul19	154
OHHIN9-C1(HSCEI	7
OHHIN9-C1(HSCEI	204
OHHIN9-P1(HSCEI	7
OHHIN9-P1(HSCEI	204

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	668

공시일	2019-07-16
기준일	2019-07-15

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

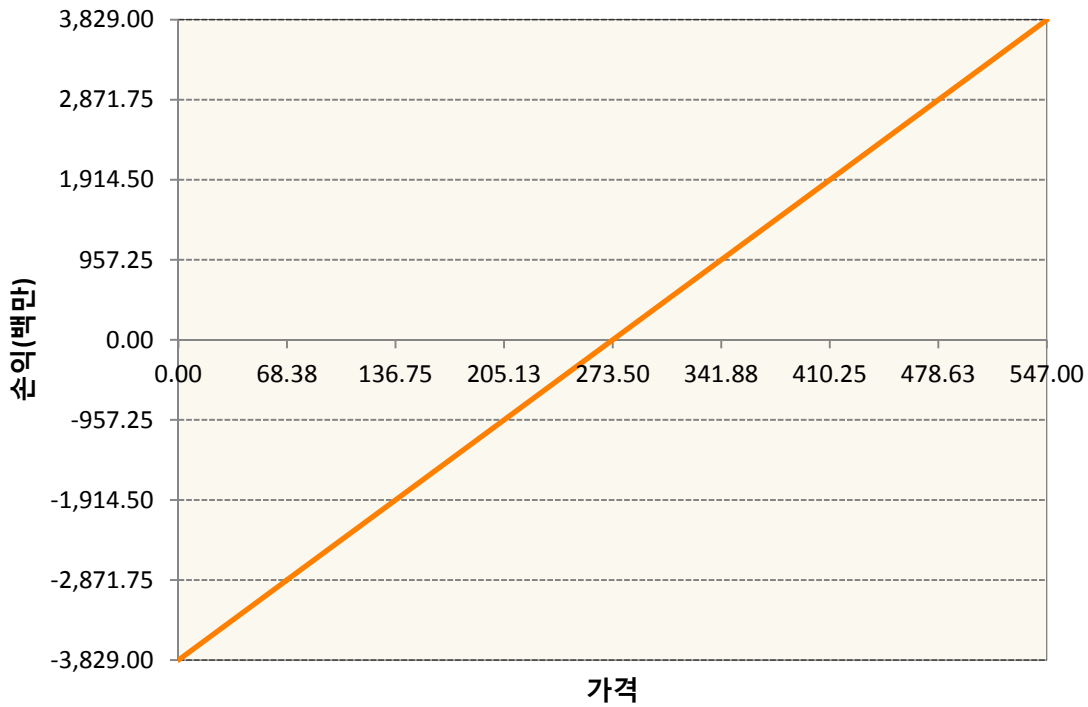
1. 계약금액

(단위:백만원)

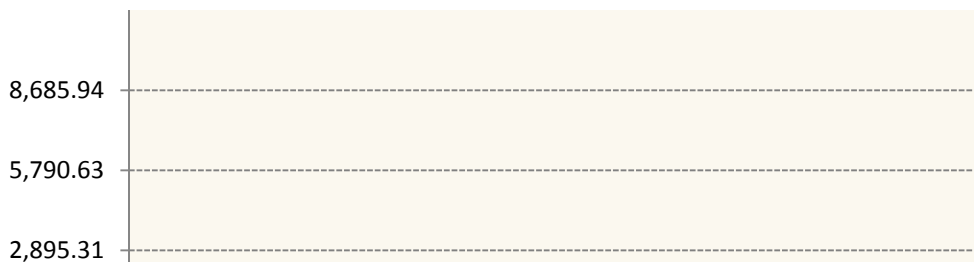
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	201	0	201	장내
누계	유가증권	선물	3,829	0	3,829	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,996	-20,996	장내

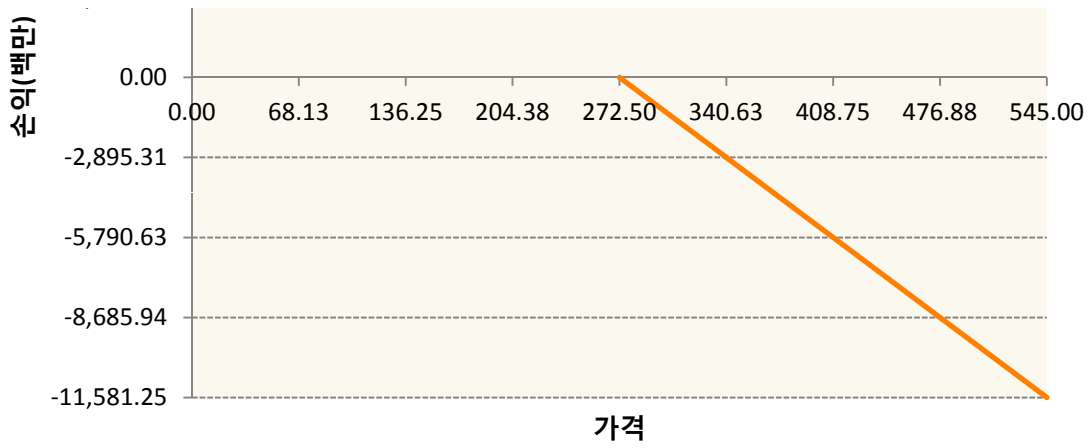
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

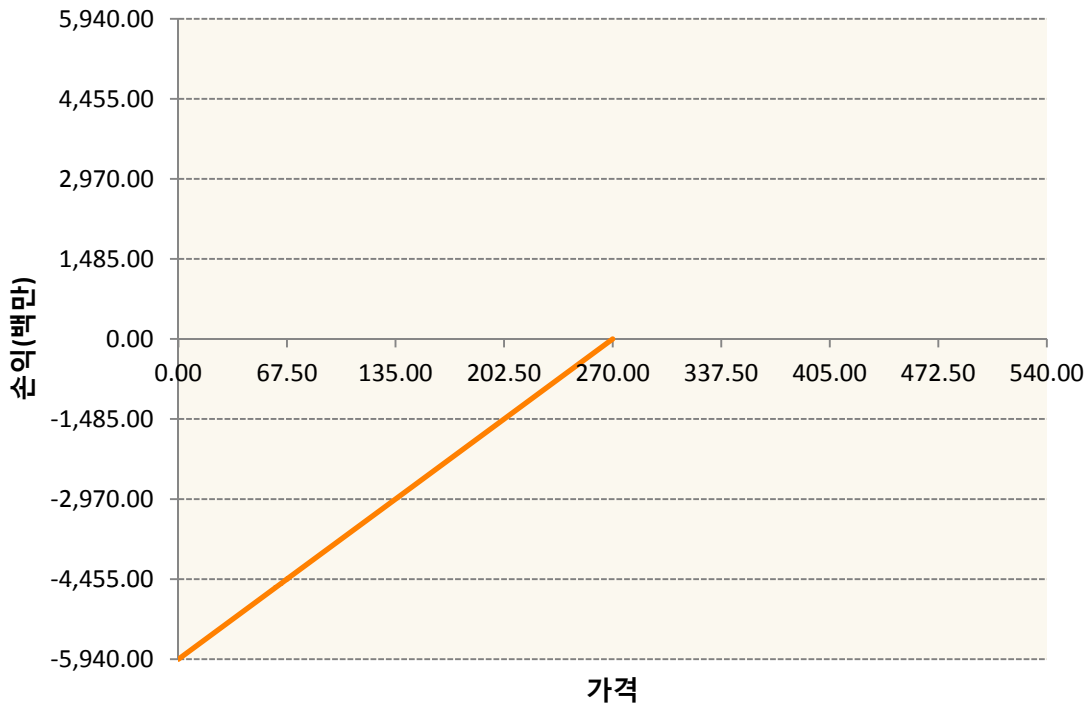


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

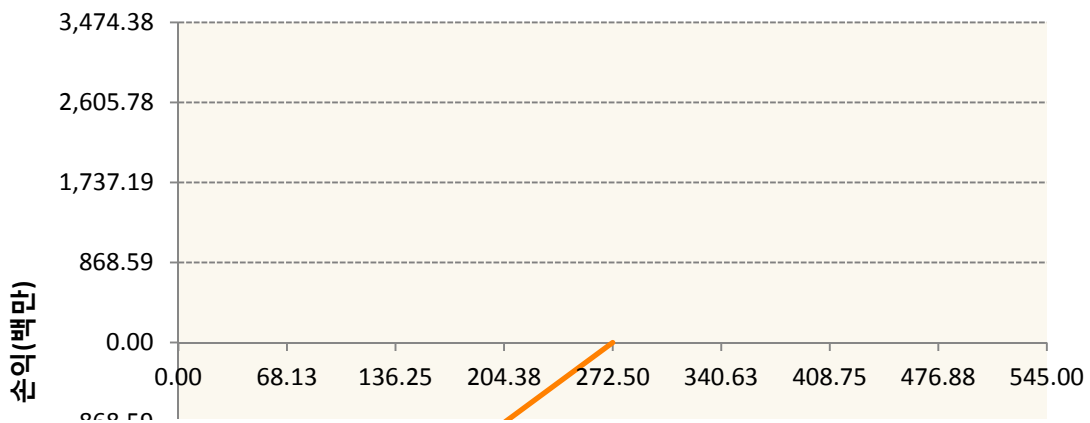




KR4301P82707-2019-08 풋270



KR4301P82723-2019-08 풋272.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,193
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	
-5.33%	-796	-796	-796	-796	-796	-796	-796	
-2.67%	-398	-398	-398	-398	-398	-398	-398	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	398	398	398	398	398	398	398	
5.33%	796	796	796	796	796	796	796	
8.00%	1,193	1,193	1,193	1,193	1,193	1,193	1,193	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						604
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-604	-604	-604	-604	-604	-604	-604	
-5.33%	-403	-403	-403	-403	-403	-403	-403	
-2.67%	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-201	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	201	201	201	201	201	201	201	
5.33%	403	403	403	403	403	403	403	
8.00%	604	604	604	604	604	604	604	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						305
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-305	-305	-305	-305	-305	-305	-305	
-5.33%	-204	-204	-204	-204	-204	-204	-204	
-2.67%	-102	-102	-102	-102	-102	-102	-102	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	102	102	102	102	102	102	102	
5.33%	204	204	204	204	204	204	204	
8.00%	305	305	305	305	305	305	305	
KR4201P82725		2019-08 콜272.5						717
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	286	280	272	263	252	240	227
-5.33%	261	248	233	217	200	182	164
-2.67%	197	176	155	133	110	88	65
0%	74	49	25	0	-25	-49	-74
2.67%	-117	-139	-161	-183	-206	-230	-253
5.33%	-363	-378	-394	-412	-430	-450	-470
8.00%	-645	-653	-663	-674	-687	-701	-717
KR4301P82707 2019-08 풋270							372
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-369	-369	-369	-369	-370	-371	-372
-5.33%	-211	-212	-214	-217	-219	-223	-226
-2.67%	-70	-75	-81	-86	-92	-98	-104
0%	19	13	6	0	-6	-13	-19
2.67%	50	47	44	40	36	32	27
5.33%	55	54	54	52	51	49	47
8.00%	55	55	55	55	55	54	53
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							232
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-231	-231	-231	-231	-232	-232	-232
-5.33%	-139	-139	-140	-141	-142	-143	-145
-2.67%	-52	-54	-57	-60	-63	-65	-69
0%	12	8	4	0	-4	-8	-12
2.67%	40	37	35	32	29	26	23
5.33%	46	45	44	43	42	40	39
8.00%	46	46	46	46	46	45	44

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

(단위:백만원)

3,412

공시일	2019-07-16
기준일	2019-07-15

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

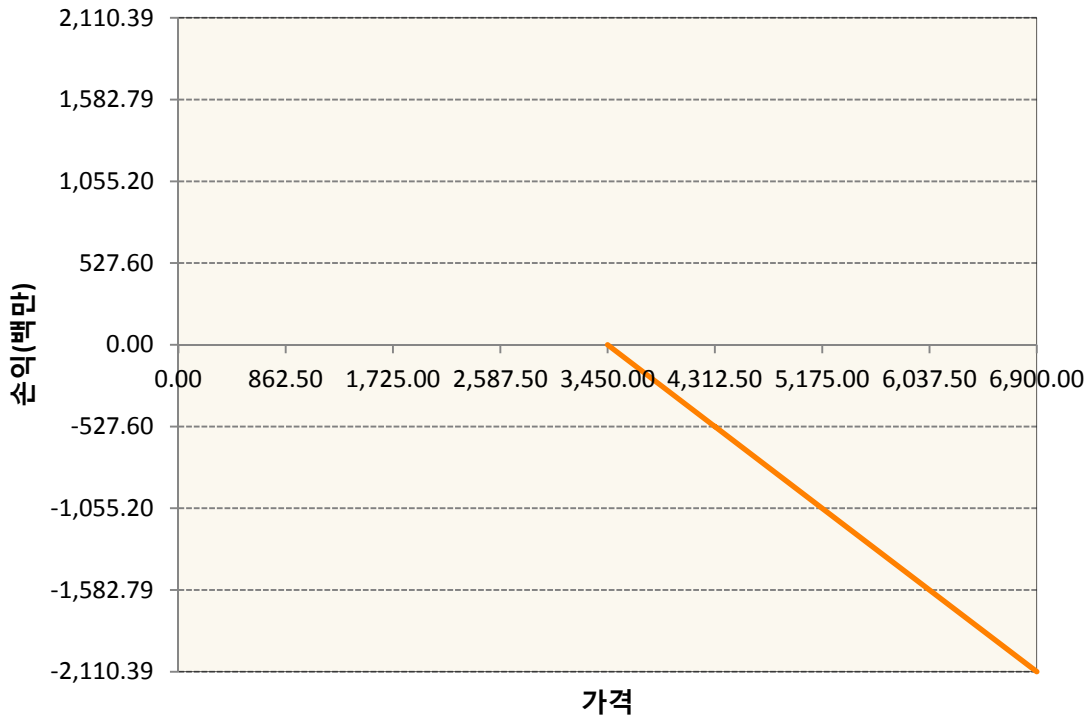
1. 계약금액

(단위:백만원)

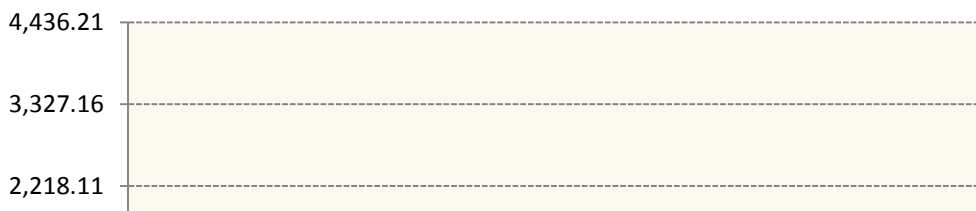
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,552	0	3,552	
누계	유가증권	스왑	47,065	0	47,065	장외
누계	유가증권	옵션	0	13,093	-13,093	장내
누계	통화	선도	5,319	22,606	-17,287	장외

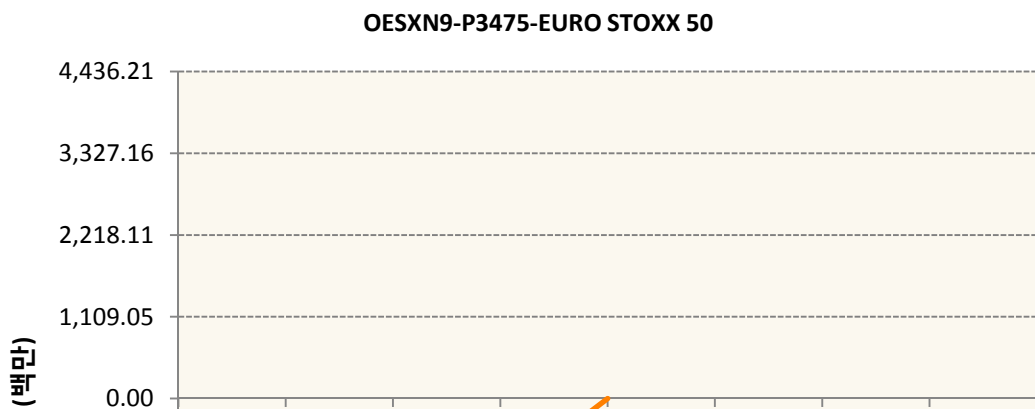
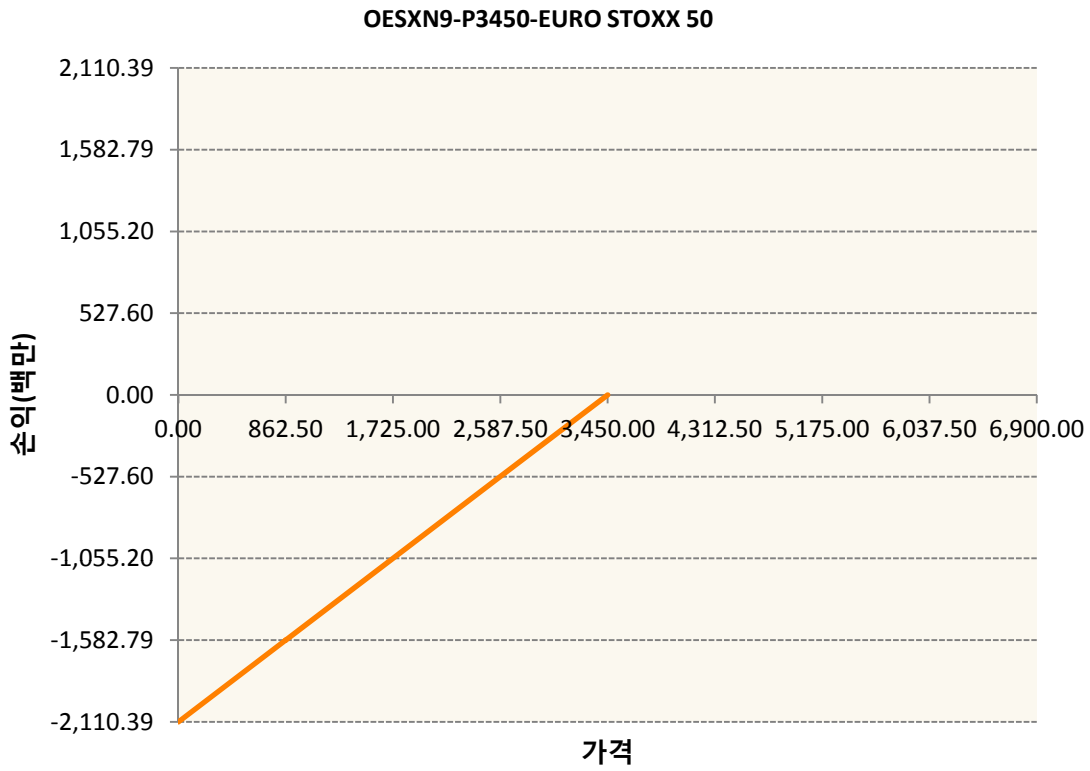
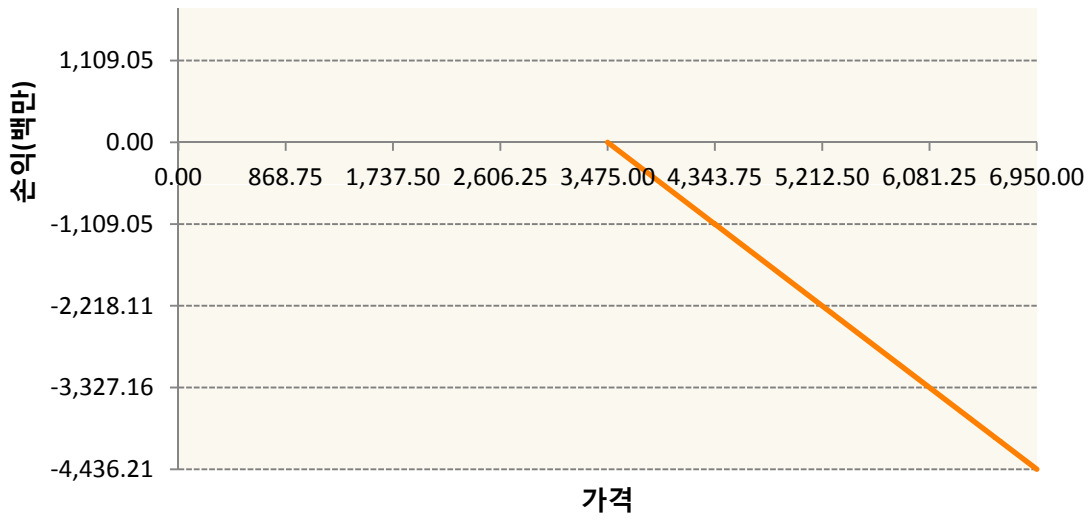
2. 만기시점의 손익구조

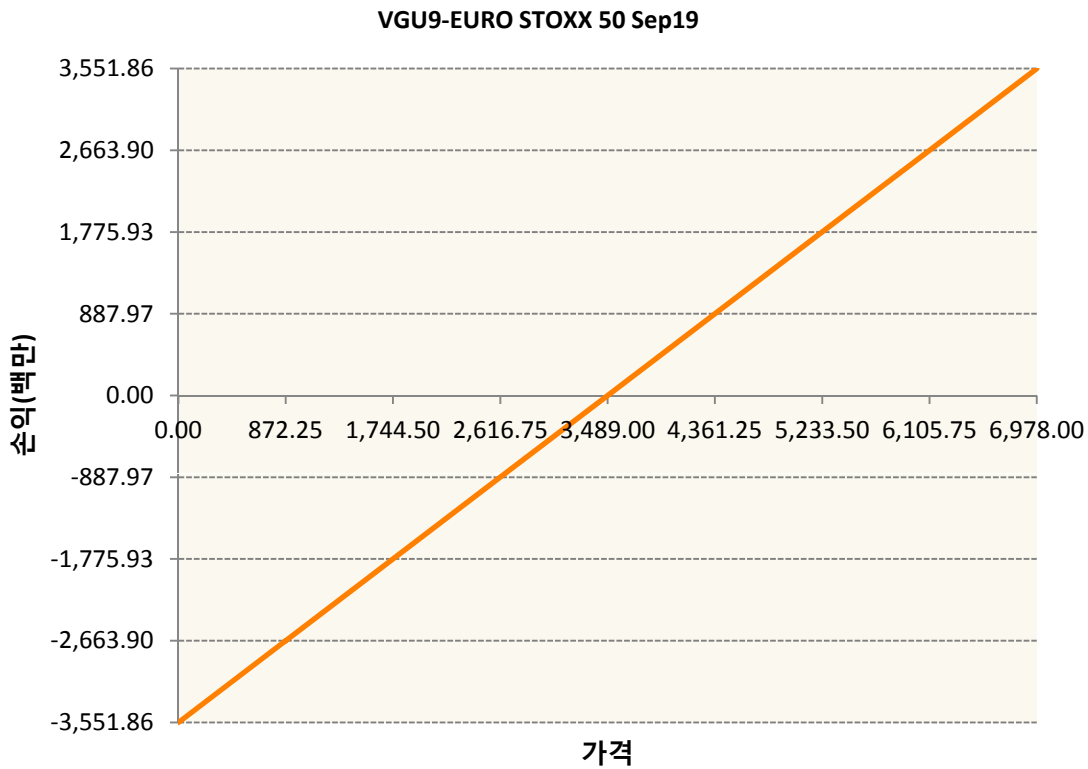
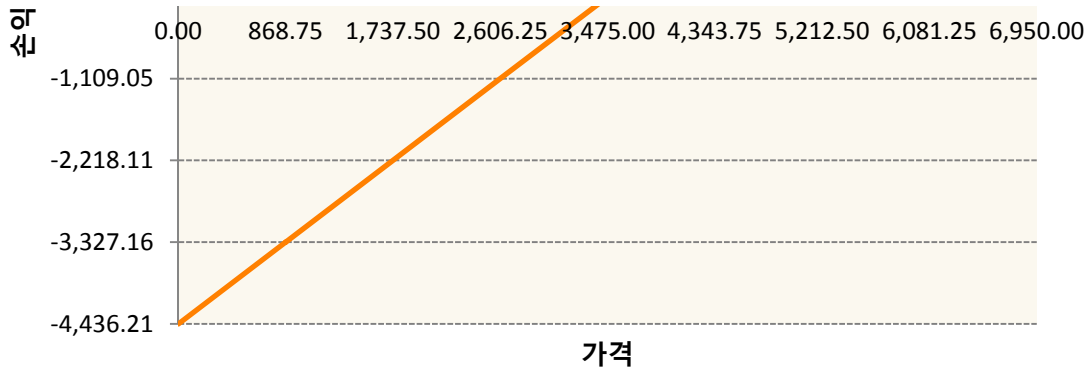
OESXN9-C3450-EURO STOXX 50



OESXN9-C3475-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	84
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	426
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E	1,064
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	319
FX21019N01 EUR/KRW 23-08-19E	426
OESXN9-C34 EURO STOXX 50	169
OESXN9-C34 EURO STOXX 50	355
OESXN9-P34 EURO STOXX 50	169
OESXN9-P34 EURO STOXX 50	355
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	284

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

(단위:백만원)

2,051

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

(단위:백만원)

1,024

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

(단위:백만원)

86

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

(단위:백만원)

131

공시일	2019-07-16
기준일	2019-07-15

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

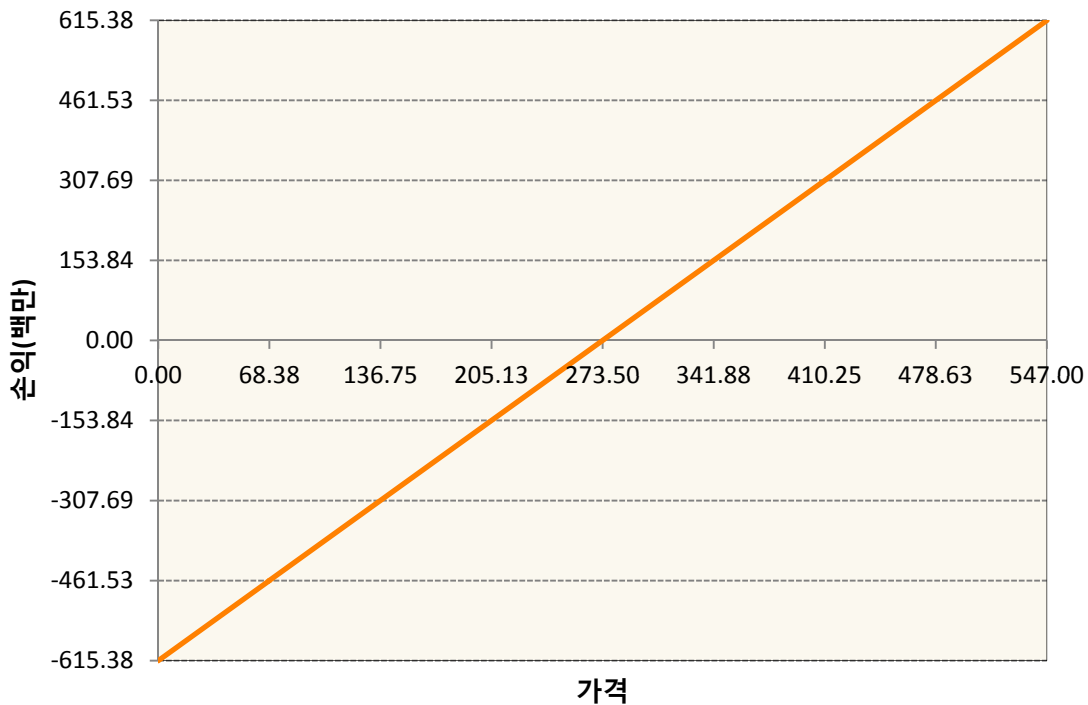
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	615	0	615	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001 2019-09 코스피200지수선물 49

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	16	16	16	16	16	16	16
5.33%	33	33	33	33	33	33	33
8.00%	49	49	49	49	49	49	49

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-07-16
기준일	2019-07-15

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

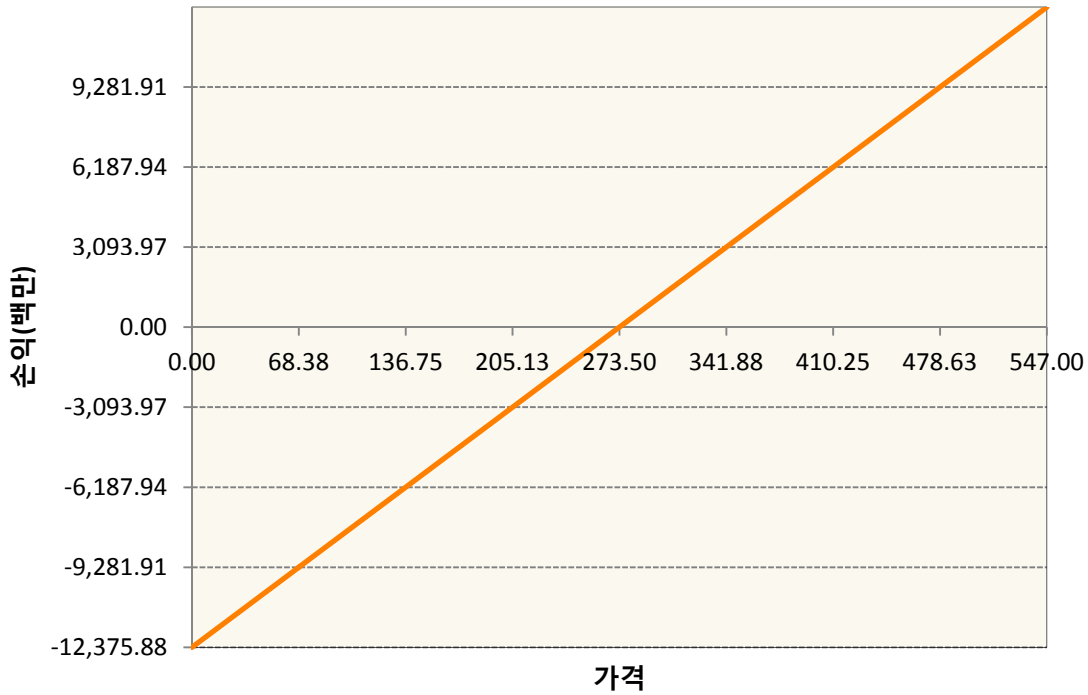
1. 계약금액

(단위:백만원)

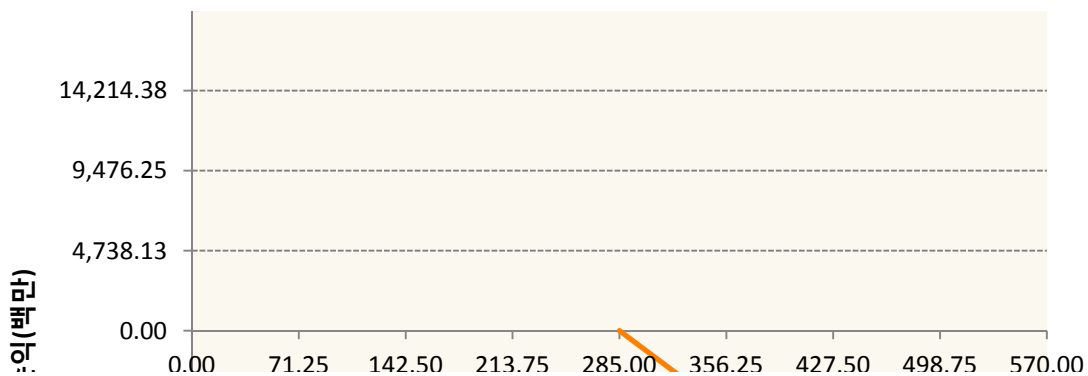
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,376	0	12,376	장내
누계	유가증권	옵션	1,698	22,259	-20,561	장내

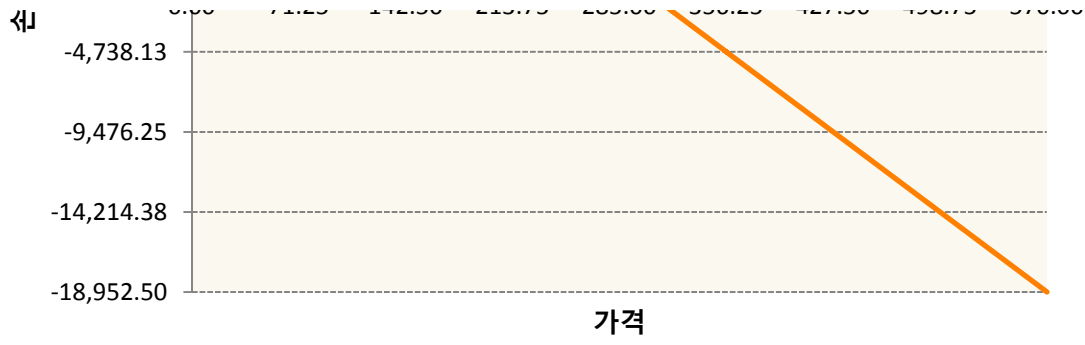
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

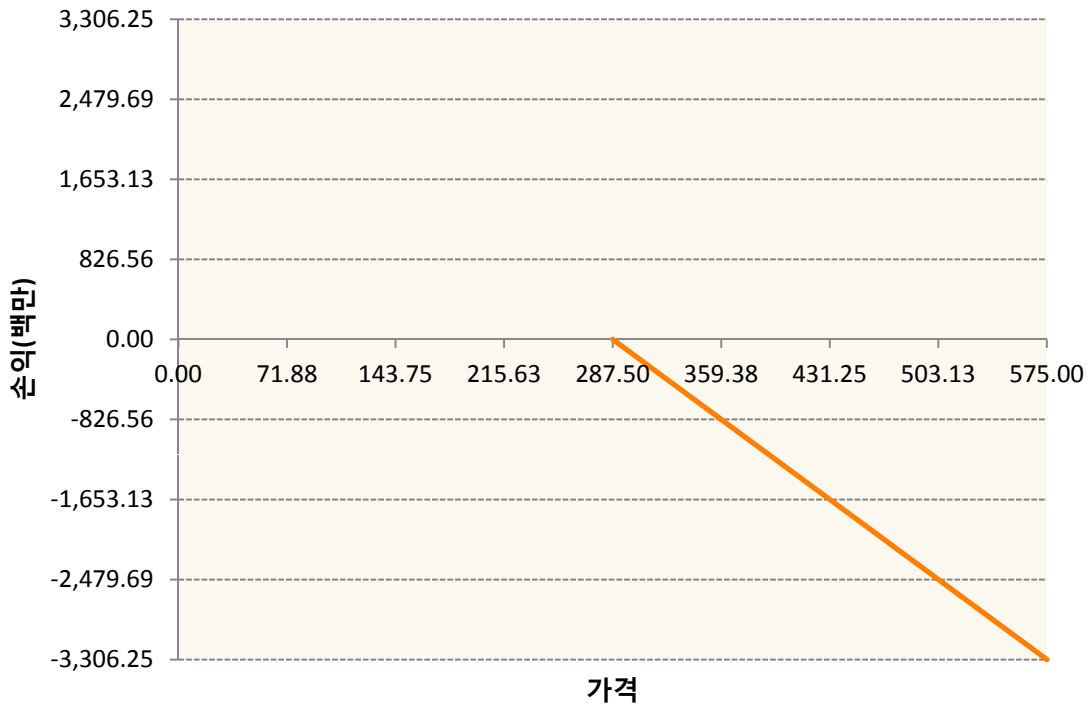


KR4201P82857-2019-08 콜285

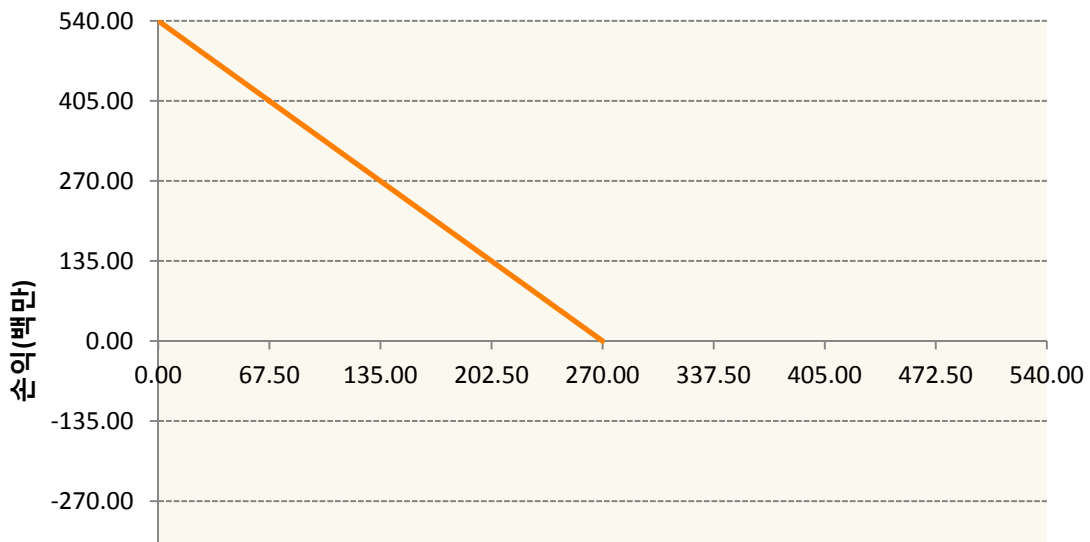


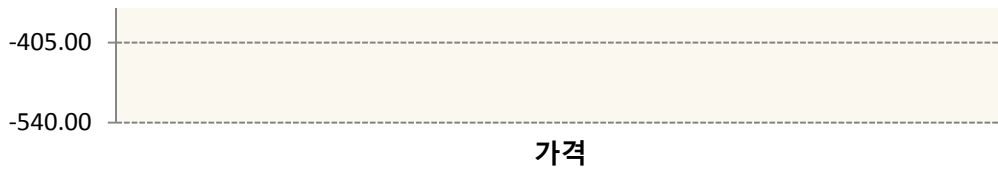


KR4201P82873-2019-08 콜287.5

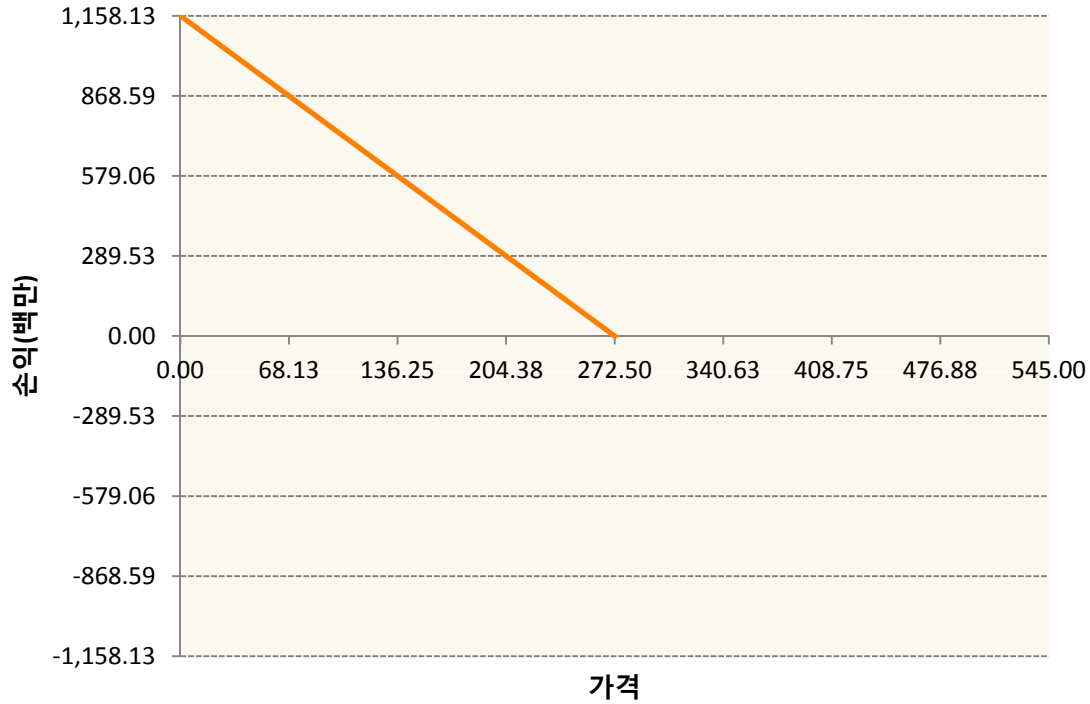


KR4301P82707-2019-08 풋270





KR4301P82723-2019-08 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						987
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-987	-987	-987	-987	-987	-987	-987	
-5.33%	-658	-658	-658	-658	-658	-658	-658	
-2.67%	-329	-329	-329	-329	-329	-329	-329	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	329	329	329	329	329	329	329	
5.33%	658	658	658	658	658	658	658	
8.00%	987	987	987	987	987	987	987	
KR4201P82857		2019-08 콜285						803
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	167	166	163	159	153	145	136	
-5.33%	162	157	149	139	127	112	95	
-2.67%	143	129	112	92	71	47	22	

0%	85	58	30	0	-31	-64	-97
2.67%	-43	-80	-118	-156	-194	-233	-271
5.33%	-267	-307	-347	-387	-427	-467	-507
8.00%	-589	-622	-657	-692	-729	-765	-803
KR4201P82873 2019-08 콜287.5							127
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	23	23	22	22	21	20	19
-5.33%	22	22	21	19	18	15	13
-2.67%	20	18	16	13	10	6	2
0%	13	9	5	0	-5	-10	-15
2.67%	-5	-11	-17	-23	-29	-36	-42
5.33%	-37	-44	-51	-58	-65	-72	-79
8.00%	-87	-94	-100	-107	-114	-120	-127
KR4301P82707 2019-08 풋270							34
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	34	34	34	34	34	34	34
-5.33%	19	19	19	20	20	20	21
-2.67%	6	7	7	8	8	9	9
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-5	-4	-4	-4	-3	-3	-2
5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-4	-4
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							77
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	77	77	77	77	77	77	77
-5.33%	46	46	47	47	47	48	48
-2.67%	17	18	19	20	21	22	23
0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-13	-12	-12	-11	-10	-9	-8
5.33%	-15	-15	-15	-14	-14	-13	-13
8.00%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15

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

(단위:백만원)

1,644

공시일	2019-07-16
기준일	2019-07-15

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,477	0	2,477	
누계	유가증권	수익증권	31,583	0	31,583	

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	2019-07-16
기준일	2019-07-15

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	1,324	-1,324	
누계	유가증권	수익증권	54,307	0	54,307	

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	2019-07-16
기준일	2019-07-15

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

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	349,950	0	349,950	
누계	통화	선도	0	364,427	-364,427	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E		472
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		472
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		377
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		792
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		566
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		3,019
FX21019M02 KRW/USD 18-07-19E		2,264
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E		283
FX21019M02 KRW/USD 22-07-19E		283
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E		792
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E		632
FX21019M03 KRW/USD 22-07-19E		472
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		1,887
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		1,887
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E		698
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E		698
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E		1,302
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E		2,559
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		3,113
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		2,113
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		1,698
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,076
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		132
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		566

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

(단위:백만원)

9,652

공시일	2019-07-16
기준일	2019-07-15

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

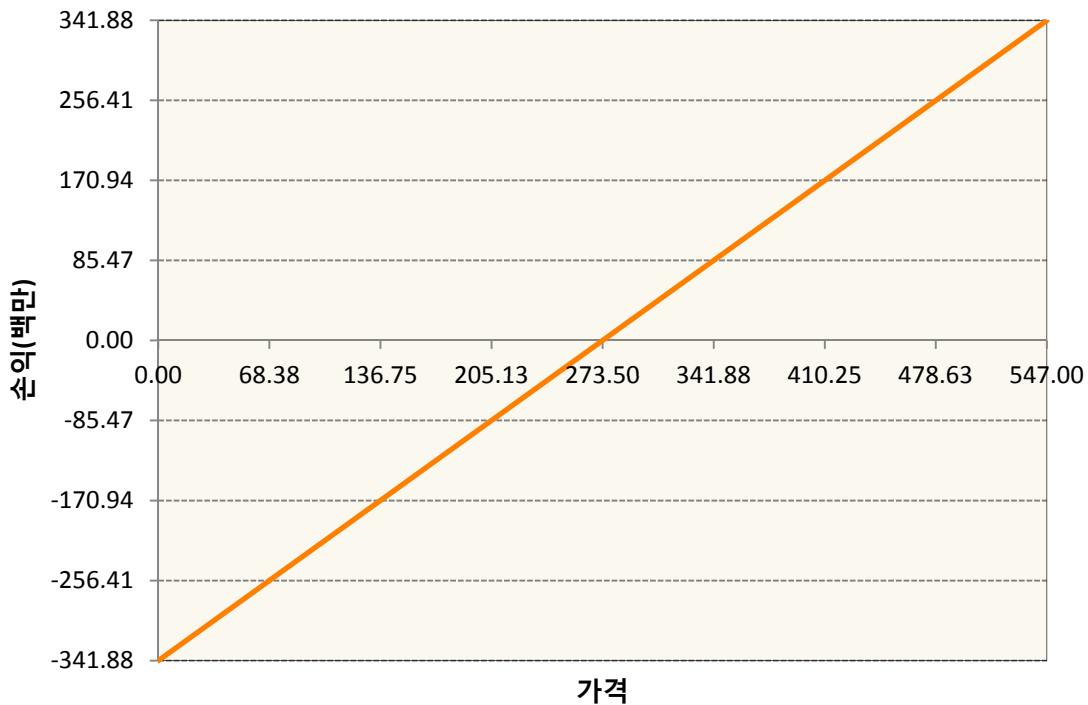
1. 계약금액

(단위:백만원)

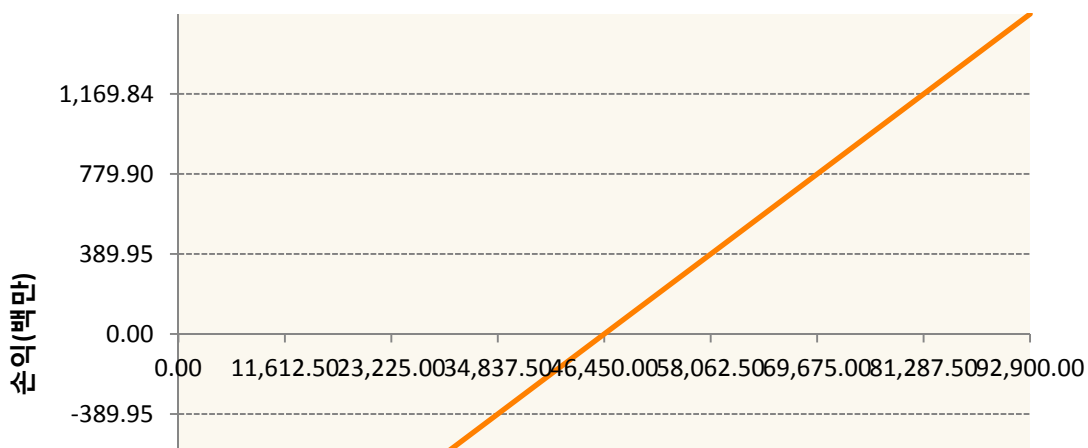
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,902	0	1,902	장내

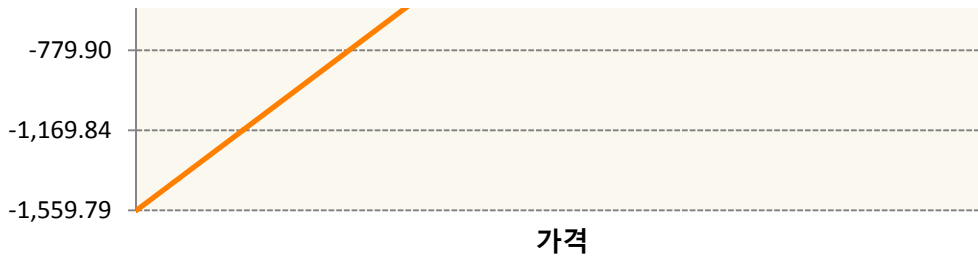
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P80001-2019-08 삼성전자개별선물





3. 시나리오 별 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)

173

공시일	2019-07-16
기준일	2019-07-15

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

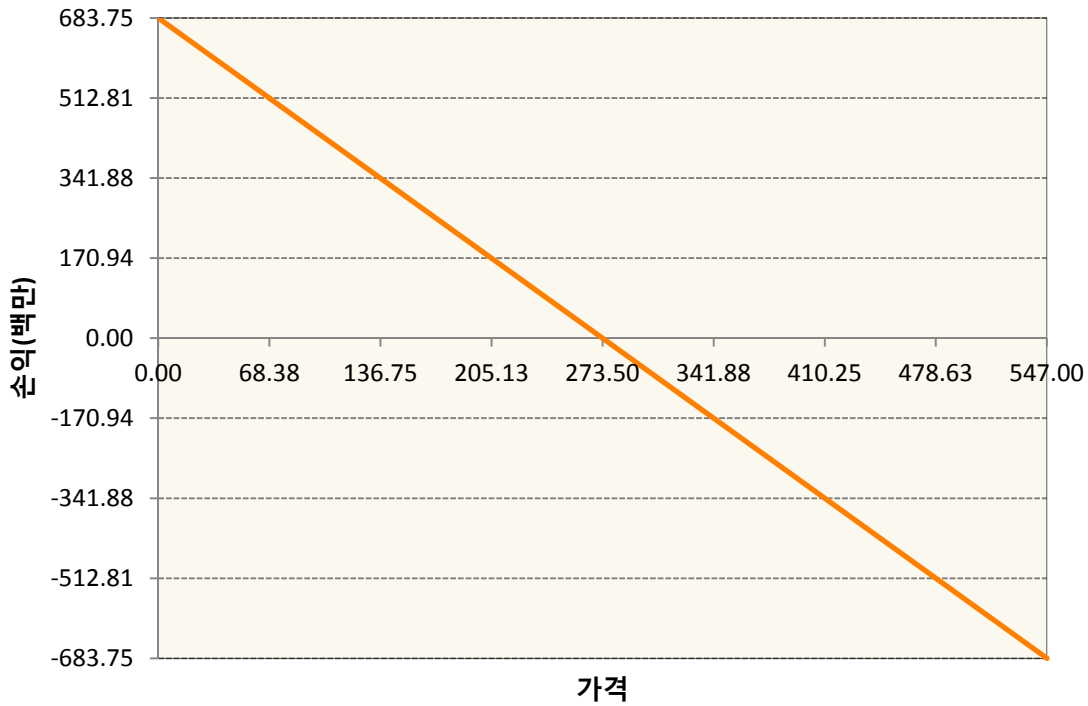
1. 계약금액

(단위:백만원)

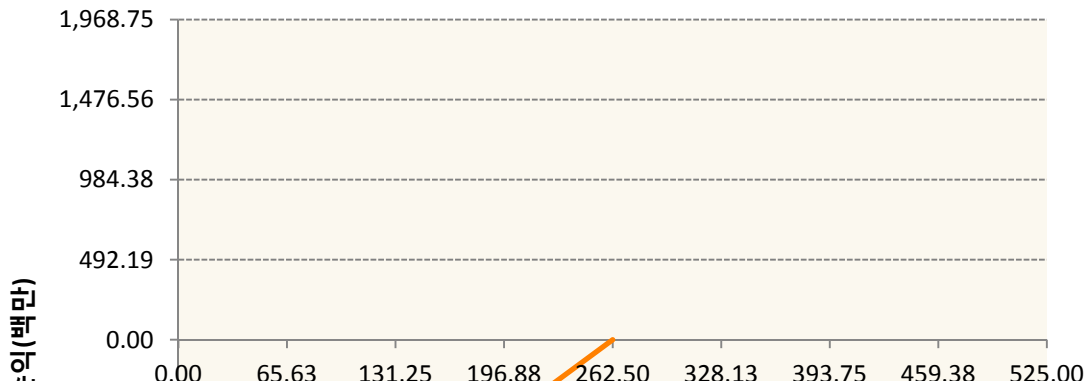
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	684	-684	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,625	-3,625	장내

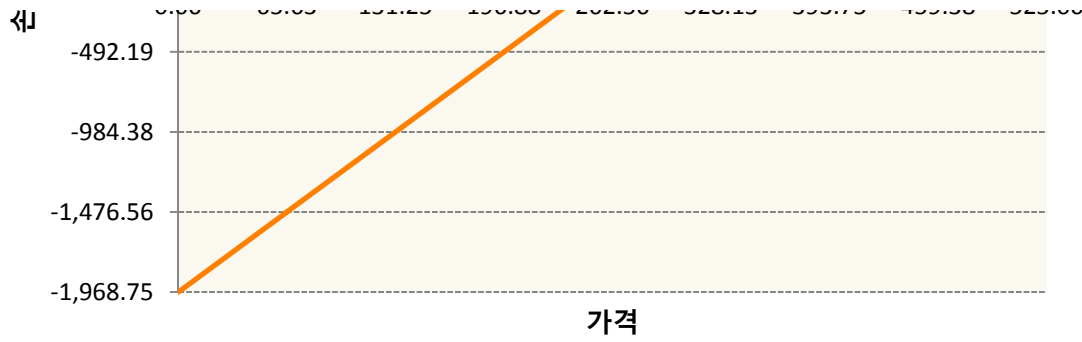
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

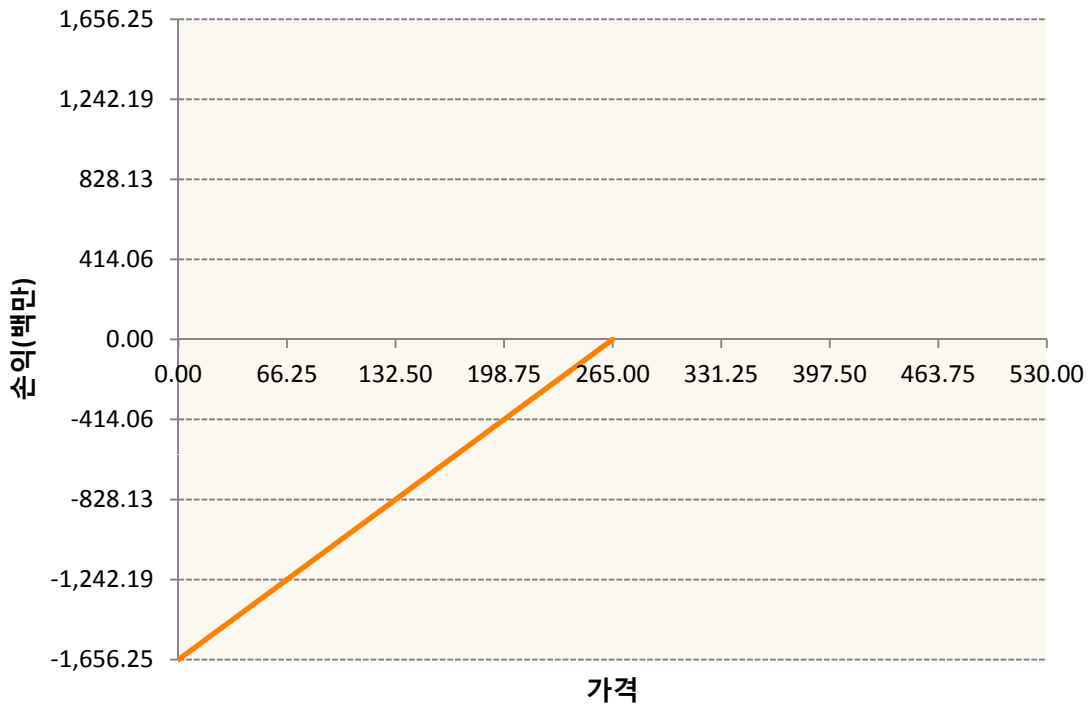


KR4301P82624-2019-08 풋262.5





KR4301P82657-2019-08 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						55
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	55	55	55	55	55	55	55	
-5.33%	36	36	36	36	36	36	36	
-2.67%	18	18	18	18	18	18	18	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	
8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55	
KR4301P82624		2019-08 풋262.5						89
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-84	-85	-86	-86	-87	-88	-89
-5.33%	-36	-38	-40	-42	-44	-46	-48
-2.67%	-7	-9	-11	-13	-15	-17	-19
0%	3	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	4	4	4	4	3	3	2
5.33%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

KR4301P82657

2019-08 풋265

86

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-83	-83	-83	-84	-84	-85	-86
-5.33%	-40	-42	-43	-44	-45	-47	-48
-2.67%	-9	-11	-13	-15	-17	-19	-21
0%	4	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	6	6	6	5	5	4	3
5.33%	6	6	6	6	6	6	6
8.00%	6	6	6	6	6	6	6

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

(단위:백만원)

188

공시일	2019-07-16
기준일	2019-07-15

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	18,341	0	18,341	
누계	통화	선도	0	18,279	-18,279	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		142
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		179
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		981
FX21019N01 KRW/USD 12-08-19E		160

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

(단위:백만원)

484

공시일	2019-07-16
기준일	2019-07-15

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	0	50	-50	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019N01 KRW/EUR 25-10-19E

4

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

(단위:백만원)

2

공시일	2019-07-16
기준일	2019-07-15

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

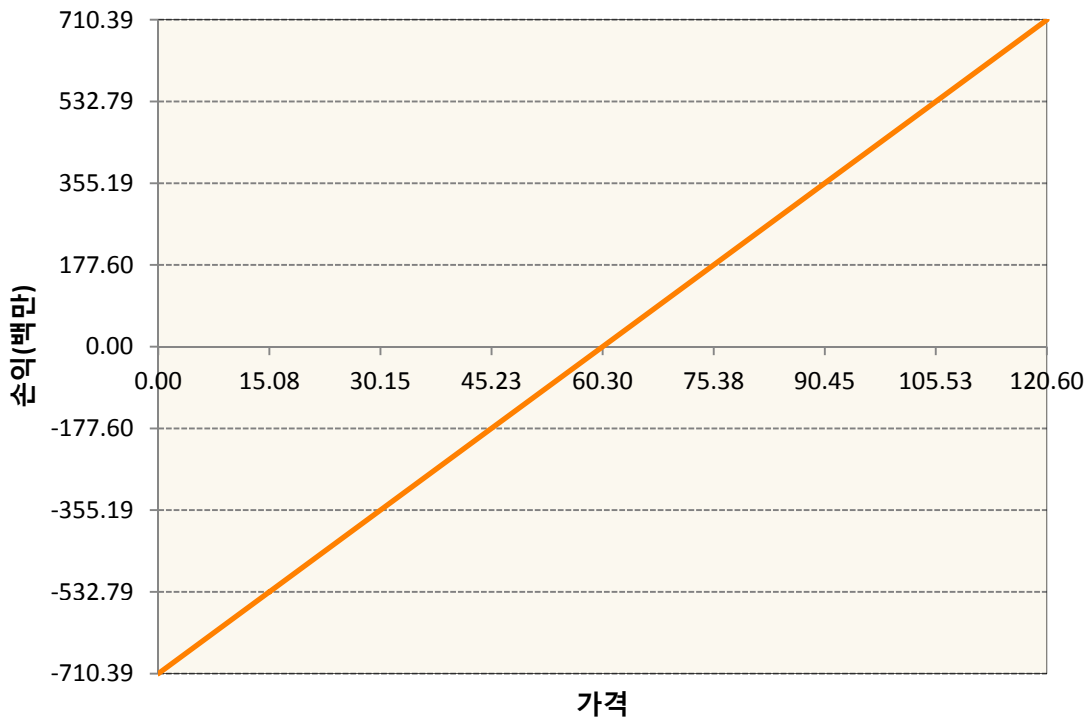
1. 계약금액

(단위:백만원)

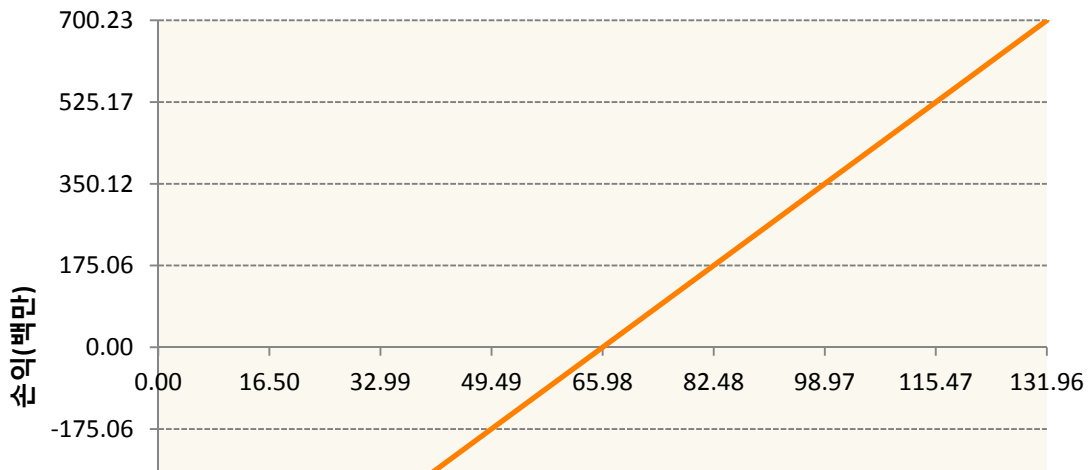
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,784	118	2,666	

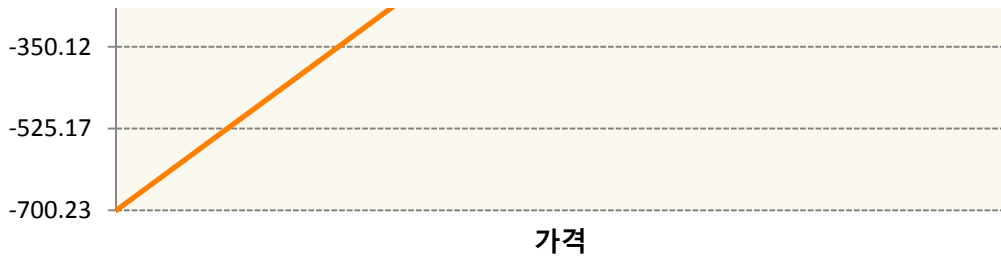
2. 만기시점의 손익구조

CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19

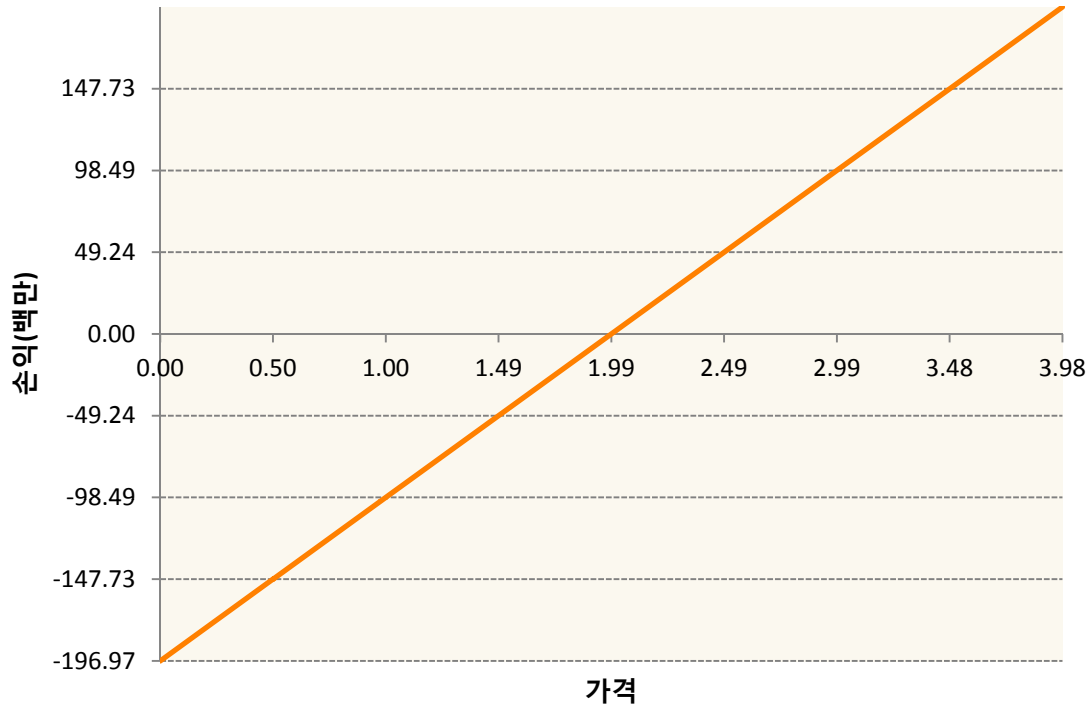


COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19

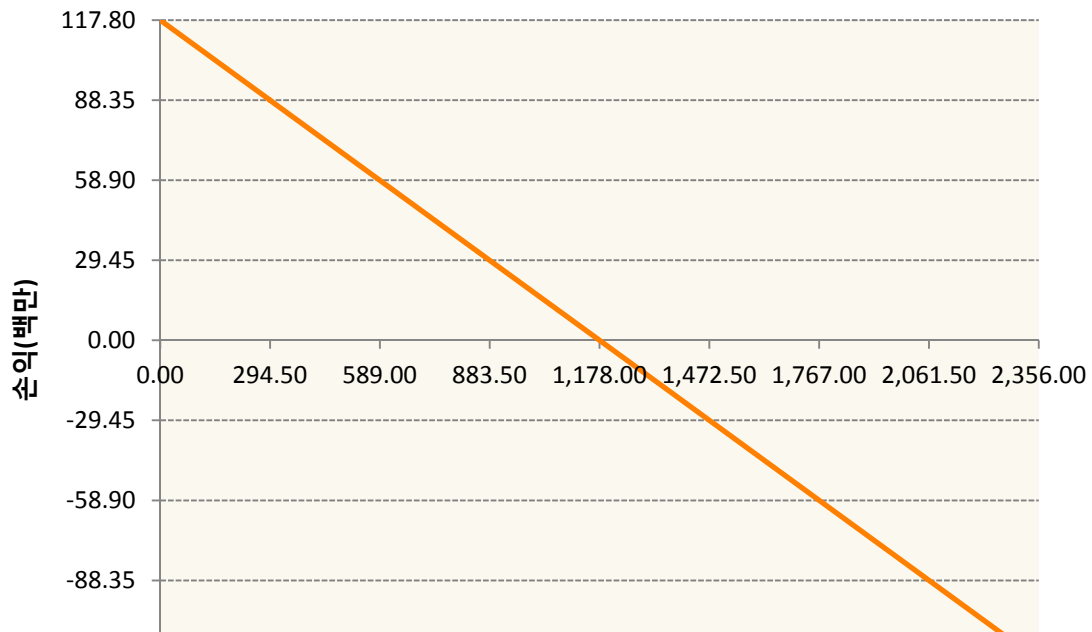


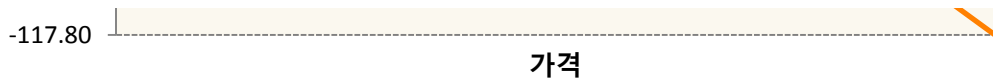


HOU9-NY Harb ULSD Fut Sep19

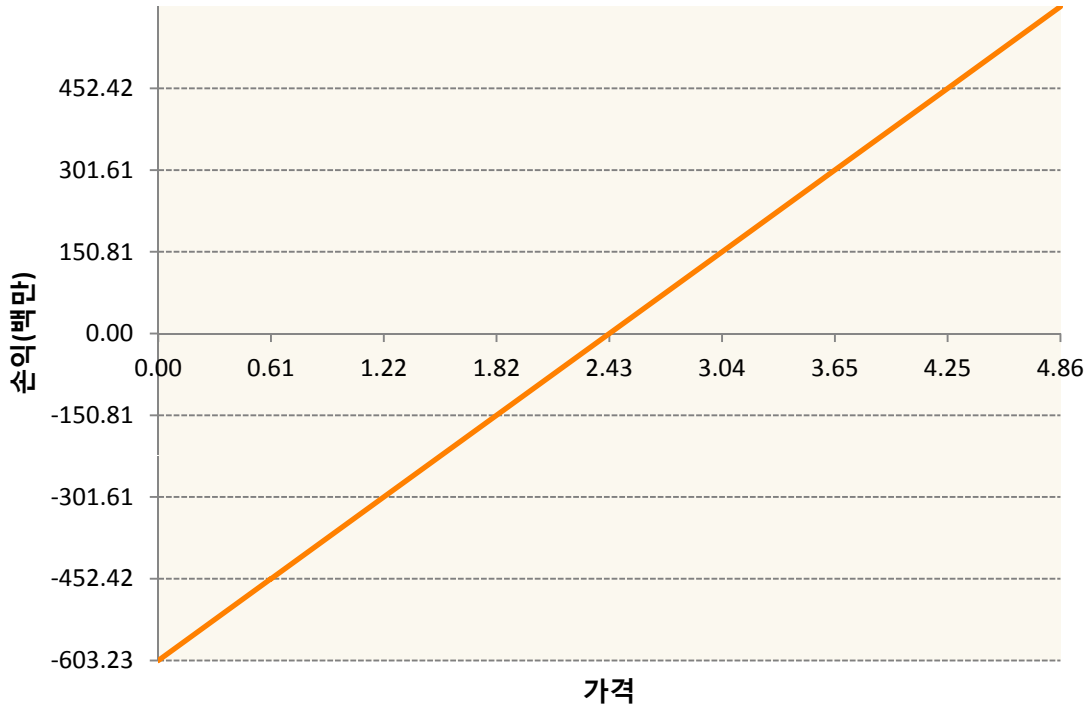


KR4175P80006-2019-08 달러선물

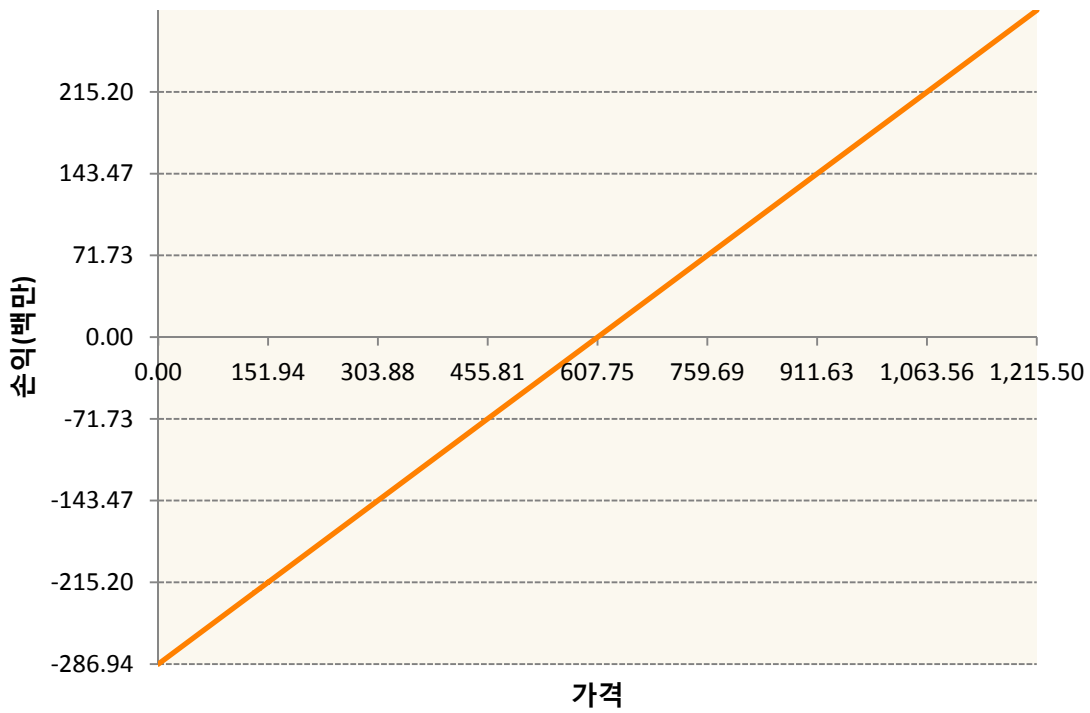




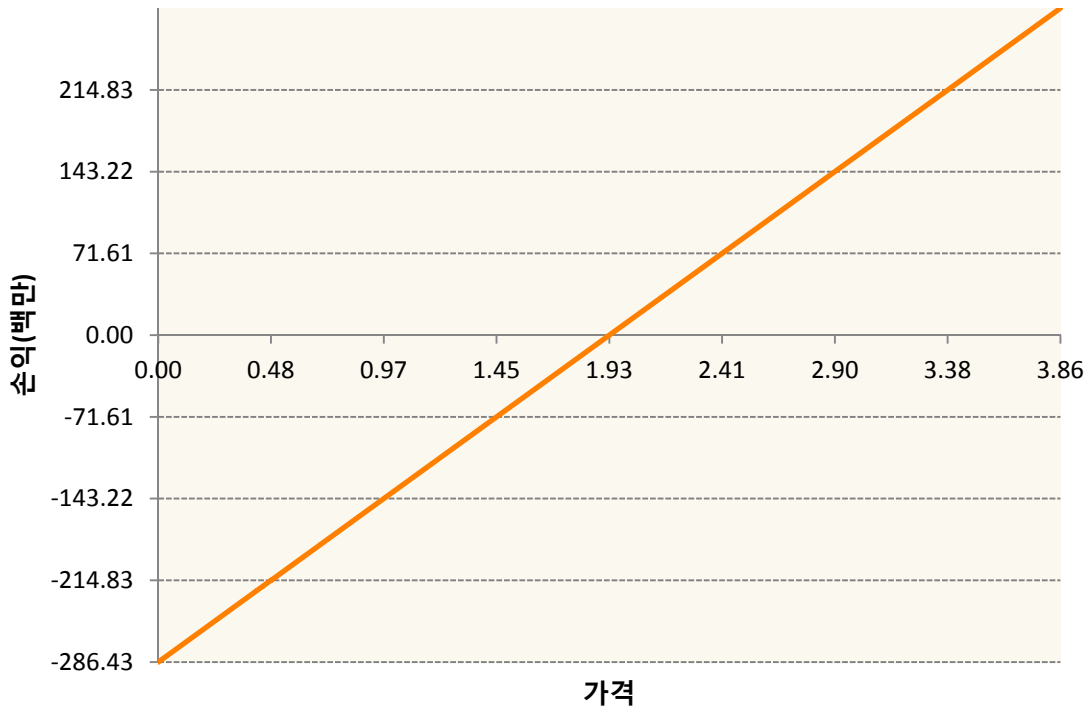
NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



QSU9-Low Su Gasoil G Sep19



XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	57
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	56
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	16
KR4175P800	2019-08 달러선물	9
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	48
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	23
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	23

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

412

공시일	2019-07-16
기준일	2019-07-15

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

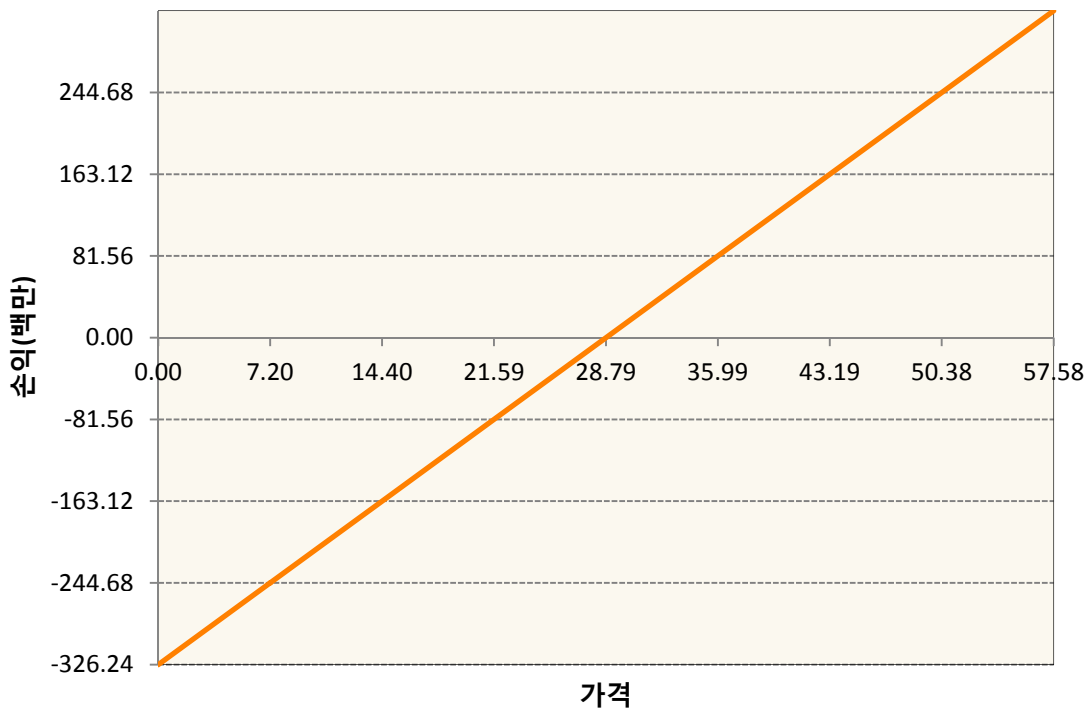
1. 계약금액

(단위:백만원)

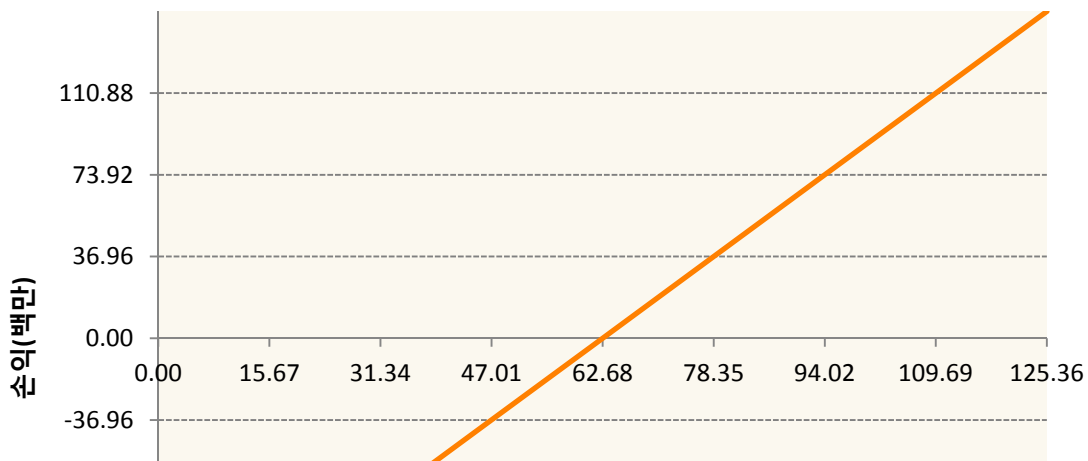
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,209	200	3,008	

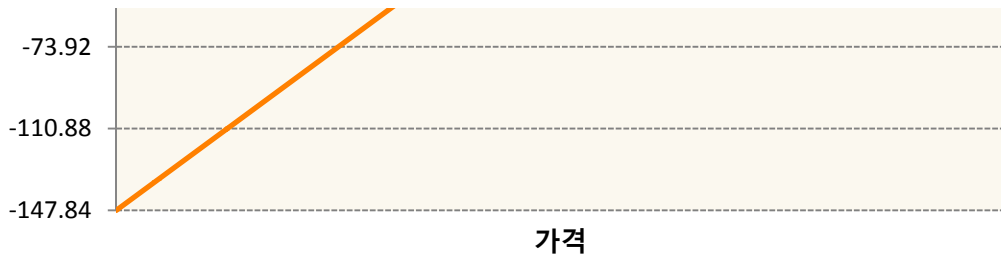
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

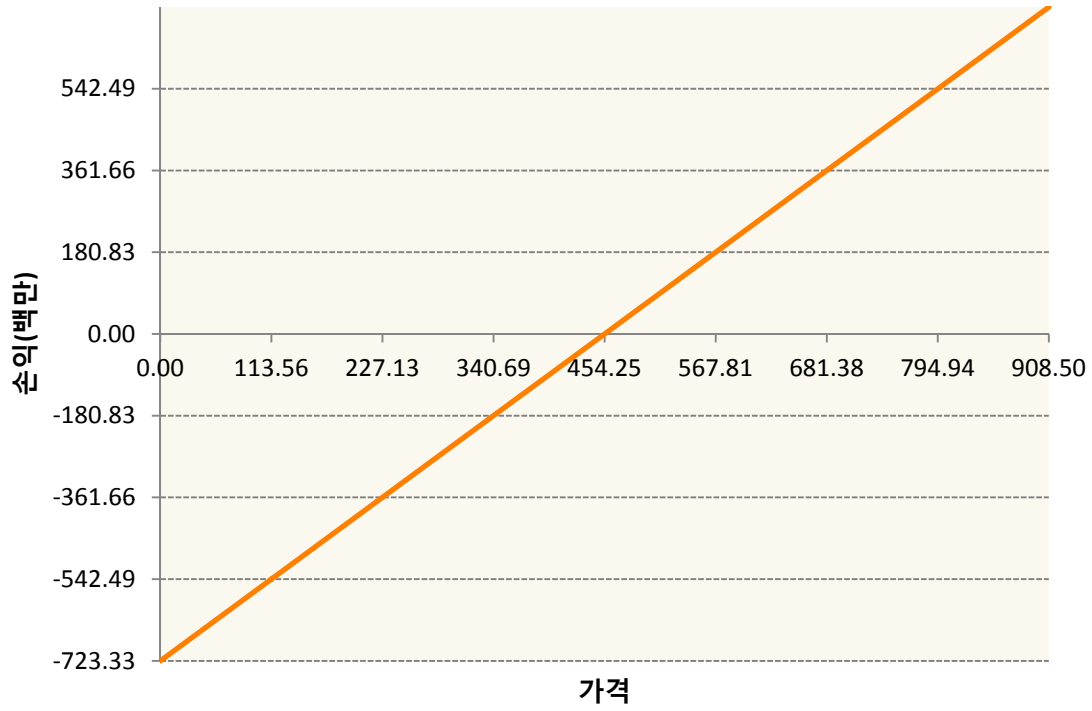


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

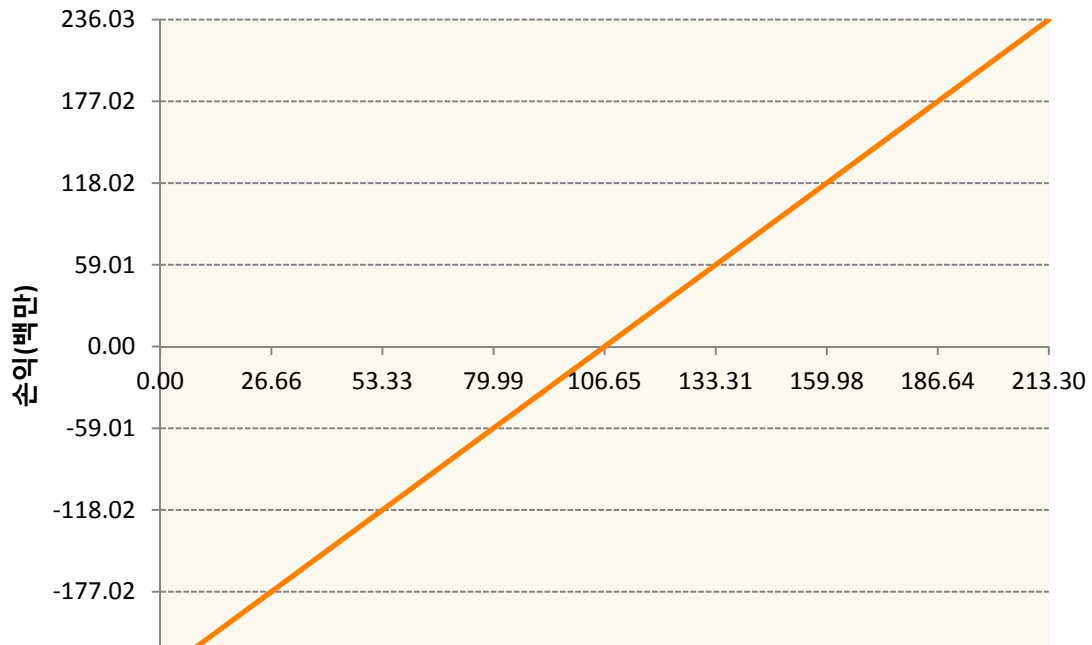


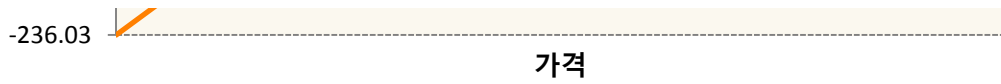


CU9-CORN FUTURE Sep19

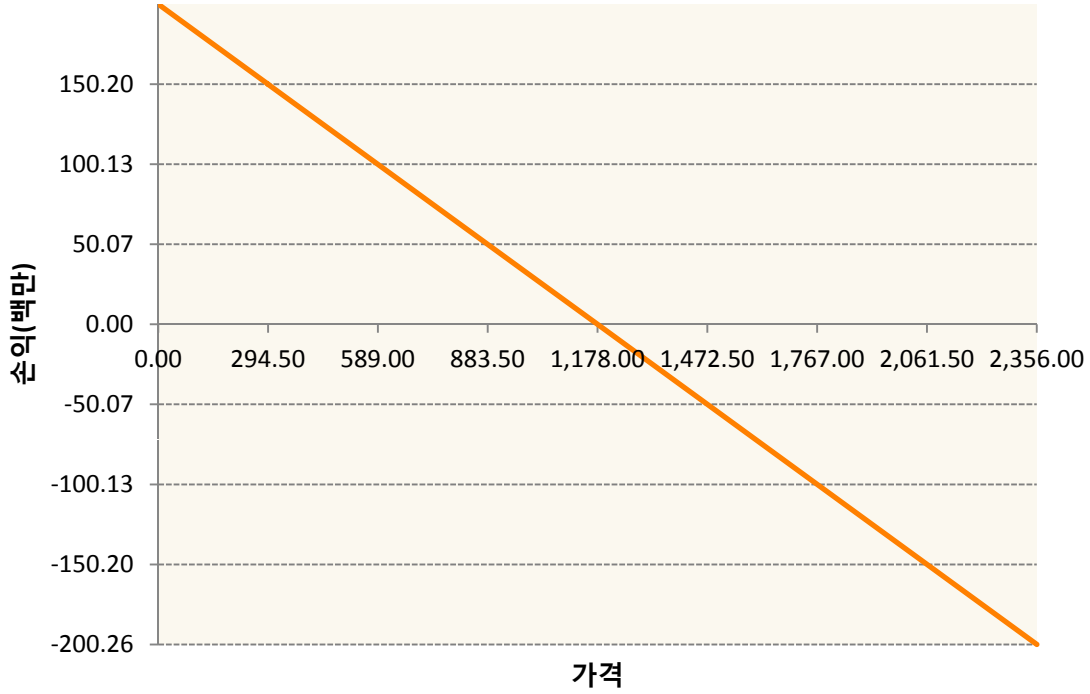


KCU9-COFFEE 'C' FUTURE Sep19

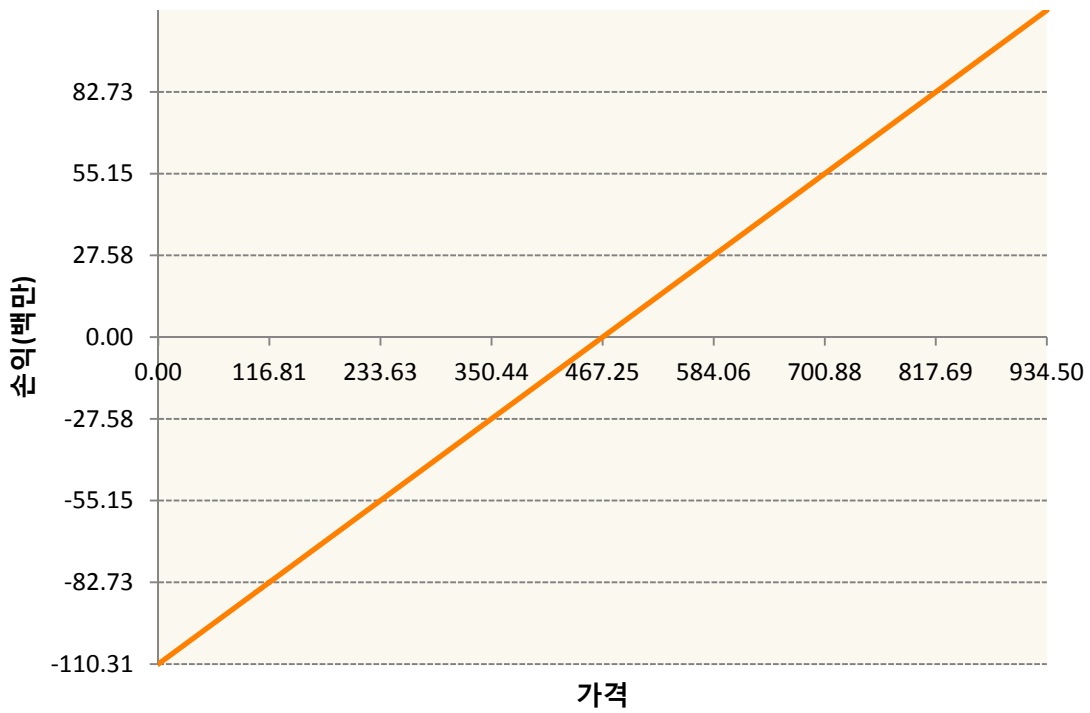




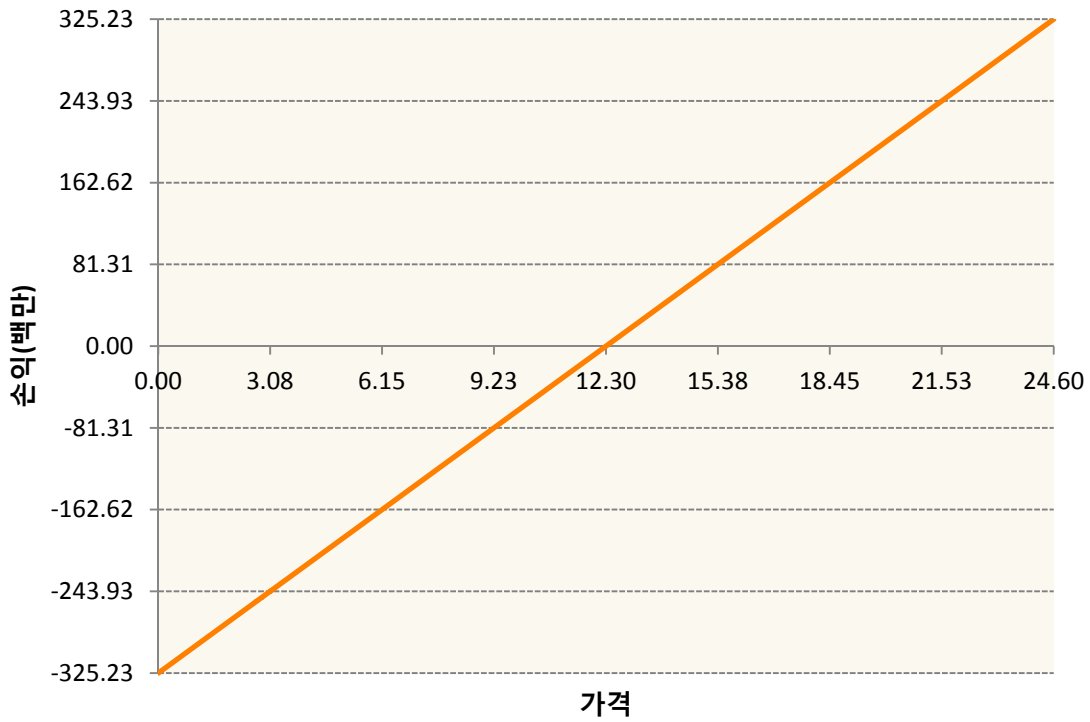
KR4175P80006-2019-08 달러선물



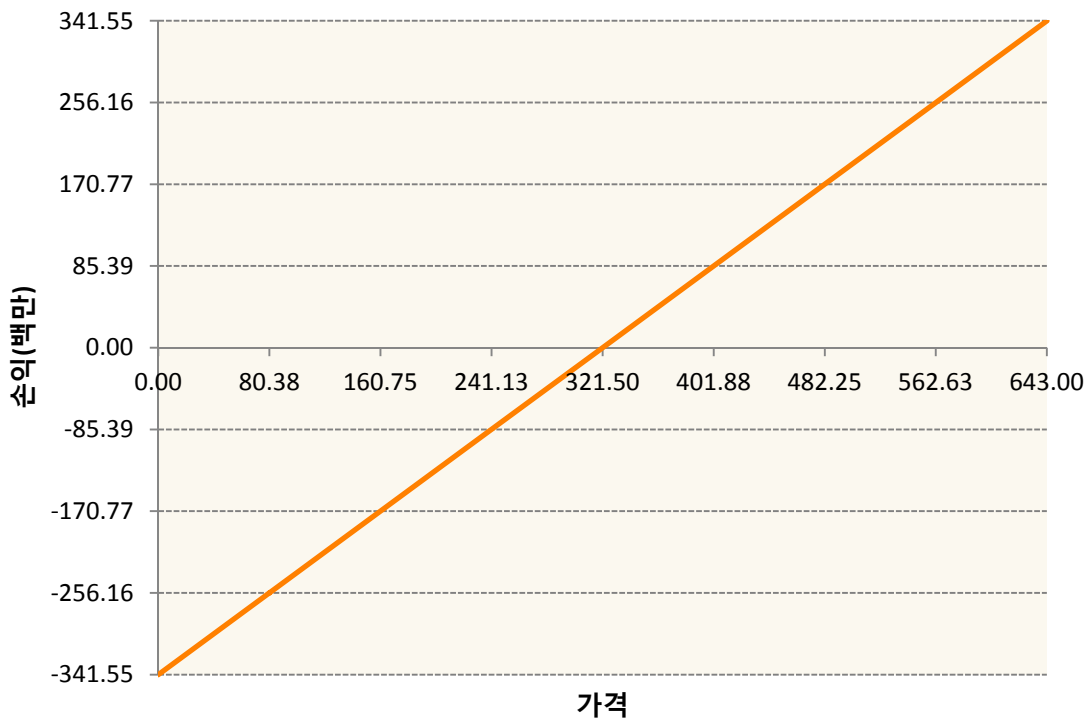
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



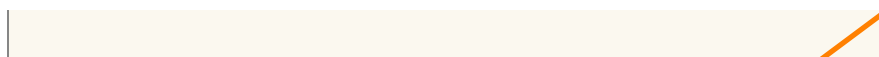
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

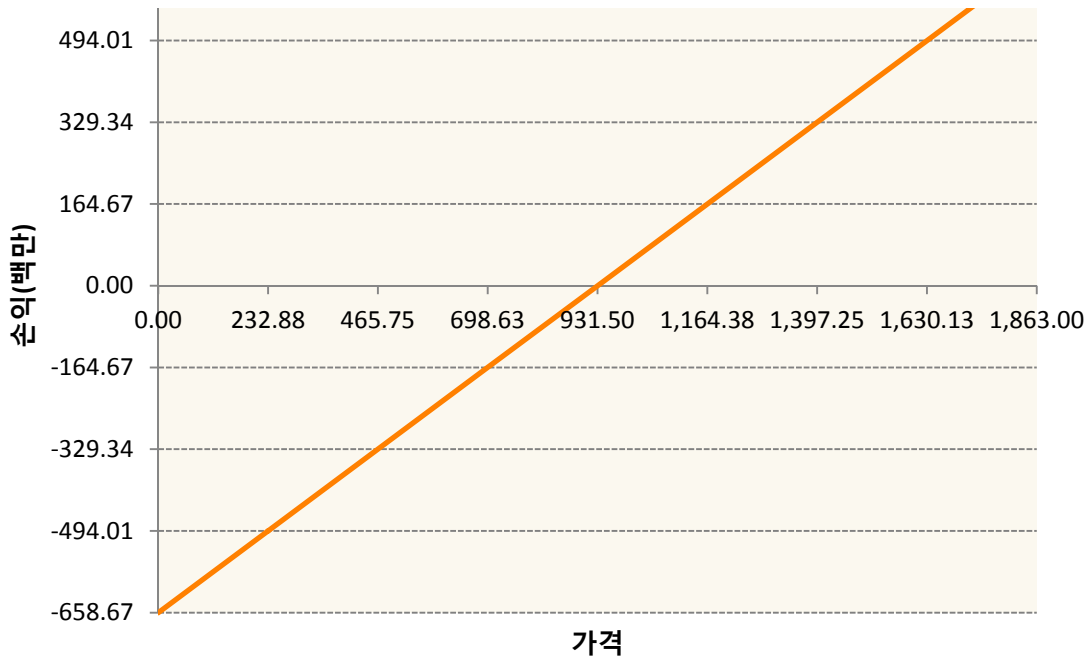


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

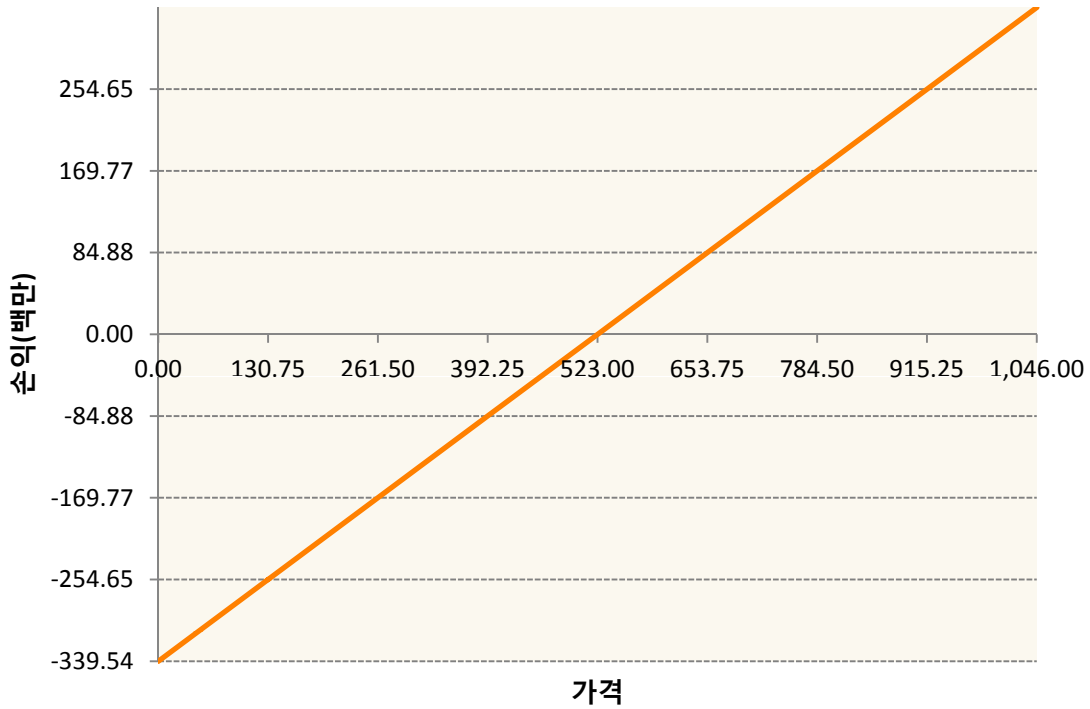


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





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	58
KCU9	COFFEE 'C' FUTURE Sep19	19
KR4175P800	2019-08 달러선물	16

KWU9	KC HRW WHEAT FUT Sep19	9
SBV9	SUGAR #11 (WORLD) Oct19	26
SMZ9	SOYBEAN MEAL FUTR Dec19	27
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	53
WU9	WHEAT FUTURE(CBT) Sep19	27

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

(단위:백만원)

281