

공시일	2019-07-19
기준일	2019-07-18

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	2019-07-19
기준일	2019-07-18

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

1,176

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

664

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-19
기준일	2019-07-18

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)	379
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	138

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

831

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-07-19
기준일	2019-07-18

유로인덱스모(주식-파생형)

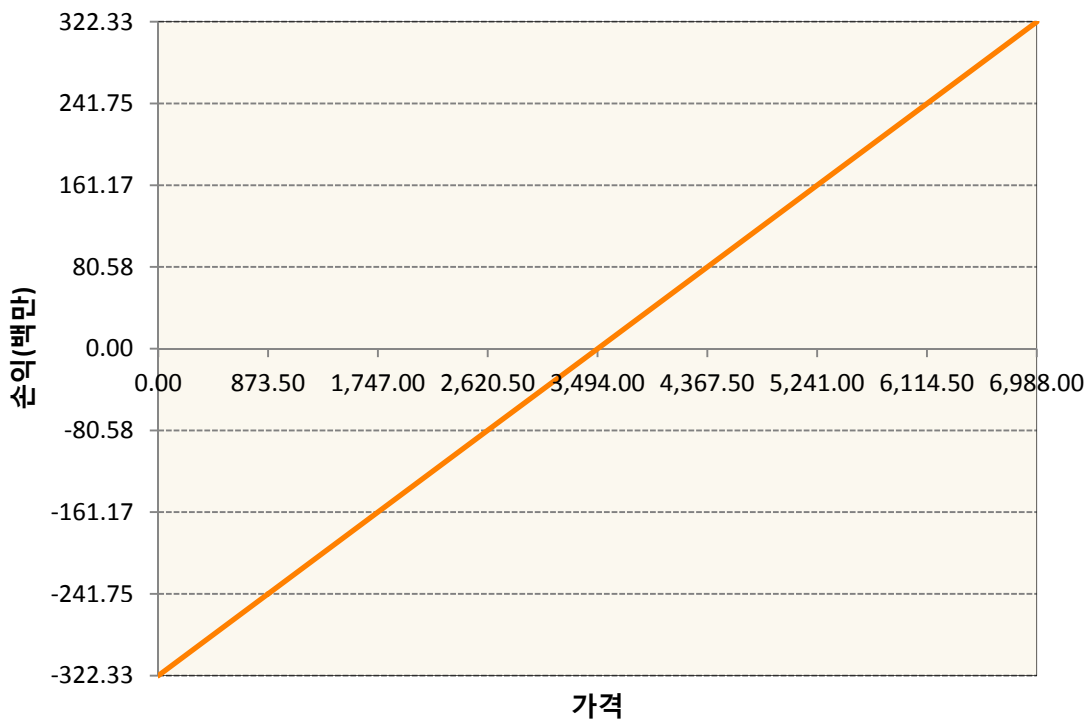
1. 계약금액

(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	2019-07-19
기준일	2019-07-18

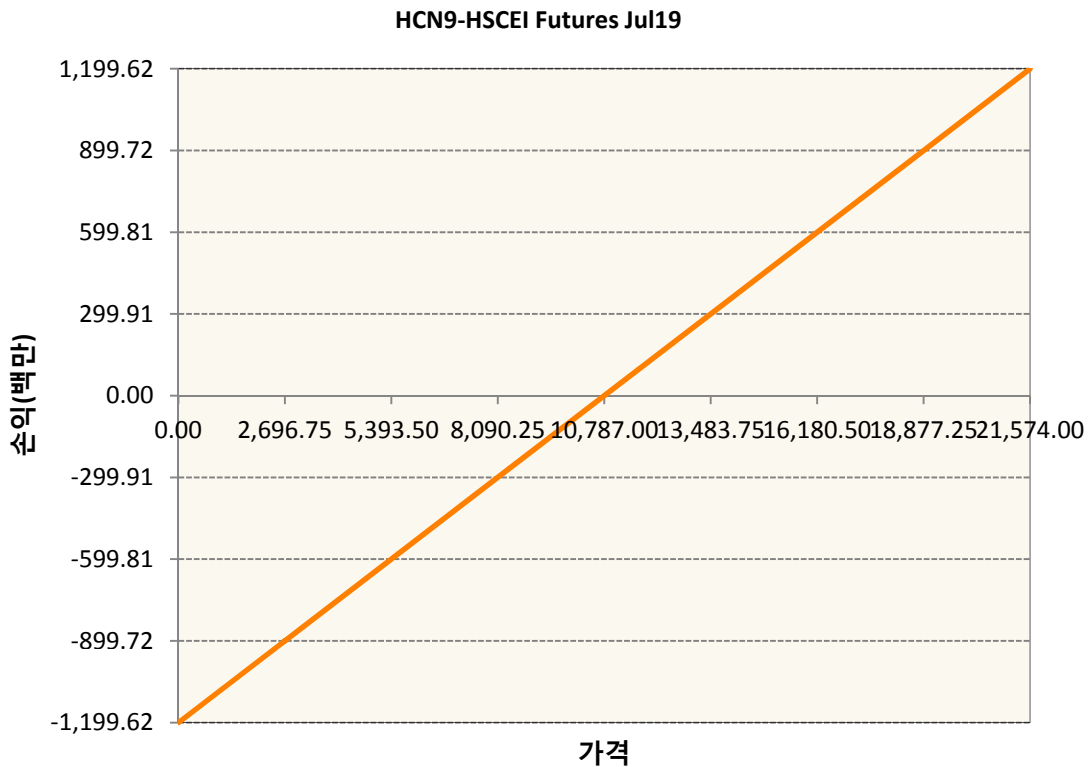
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,200	0	1,200	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

96

공시일	2019-07-19
기준일	2019-07-18

커버드콜모(주식혼합-파생형)

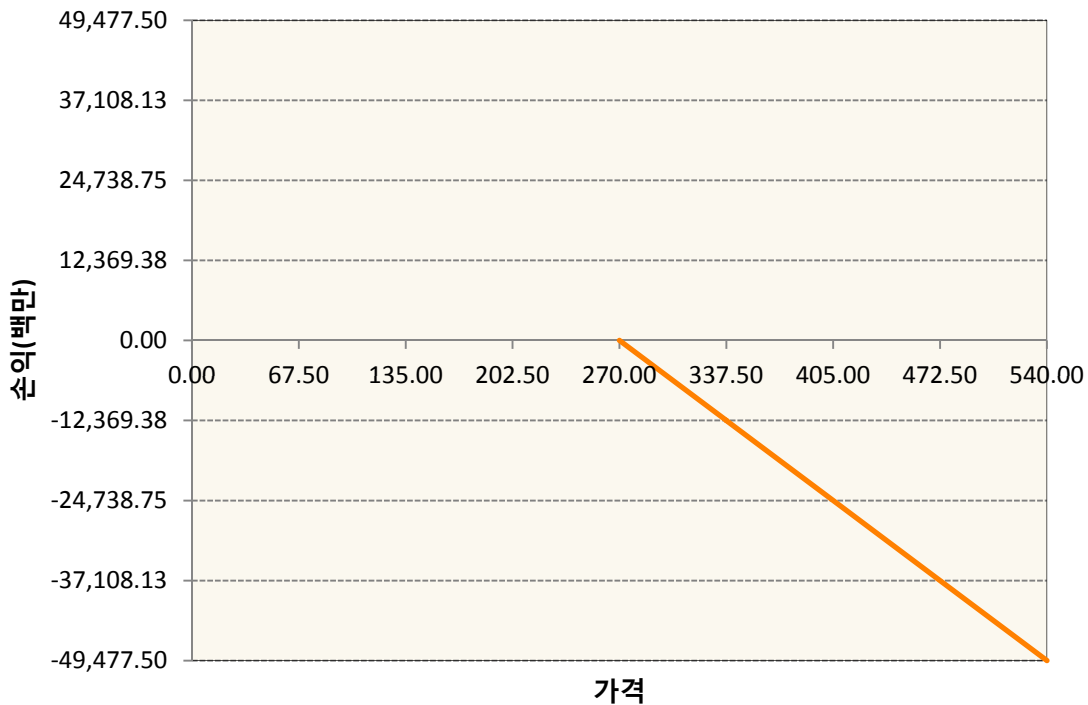
1. 계약금액

(단위:백만원)

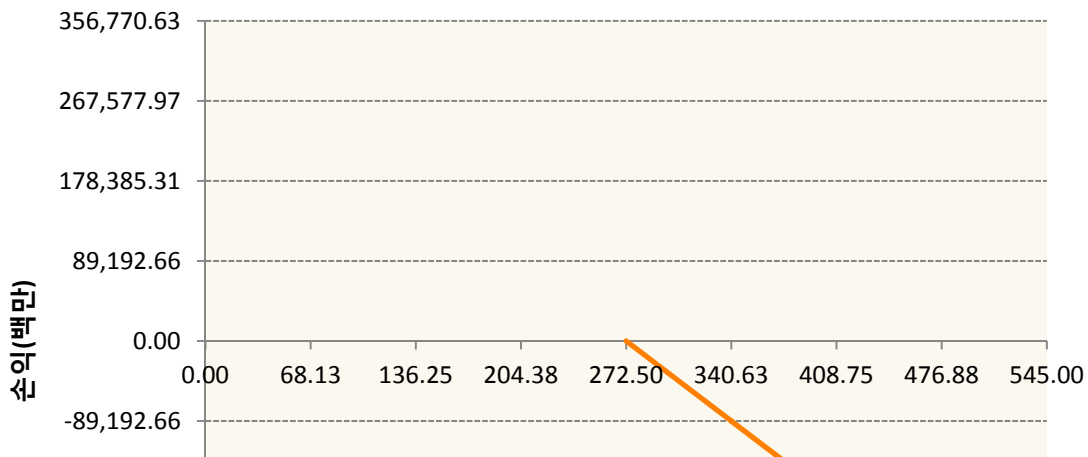
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	2,021	0	2,021	장내
누계	유가증권	옵션	0	595,873	-595,873	장내

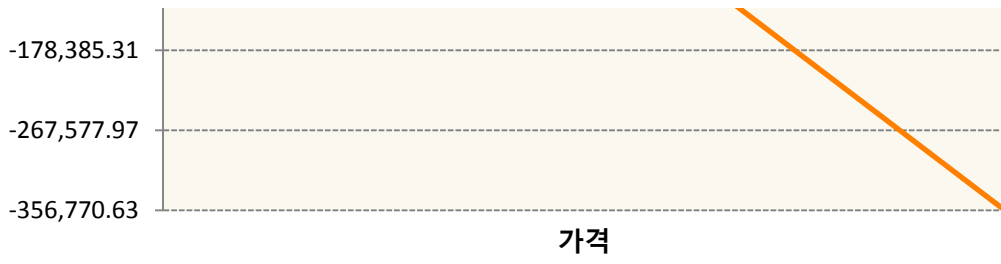
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P82709-2019-08 콜270

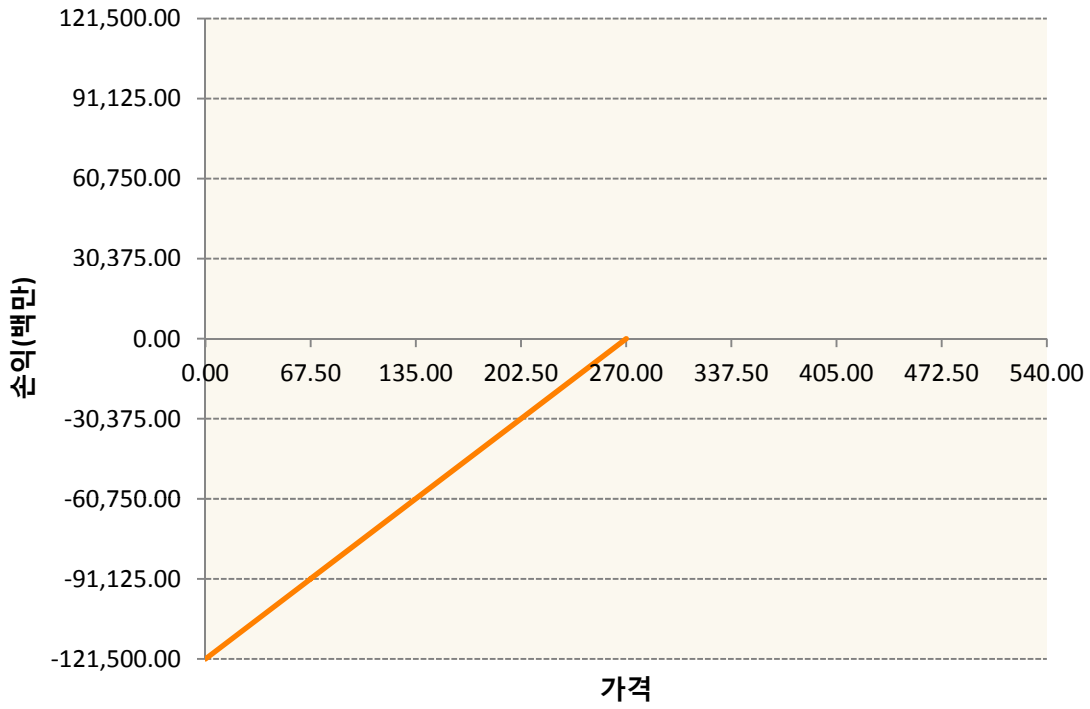


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

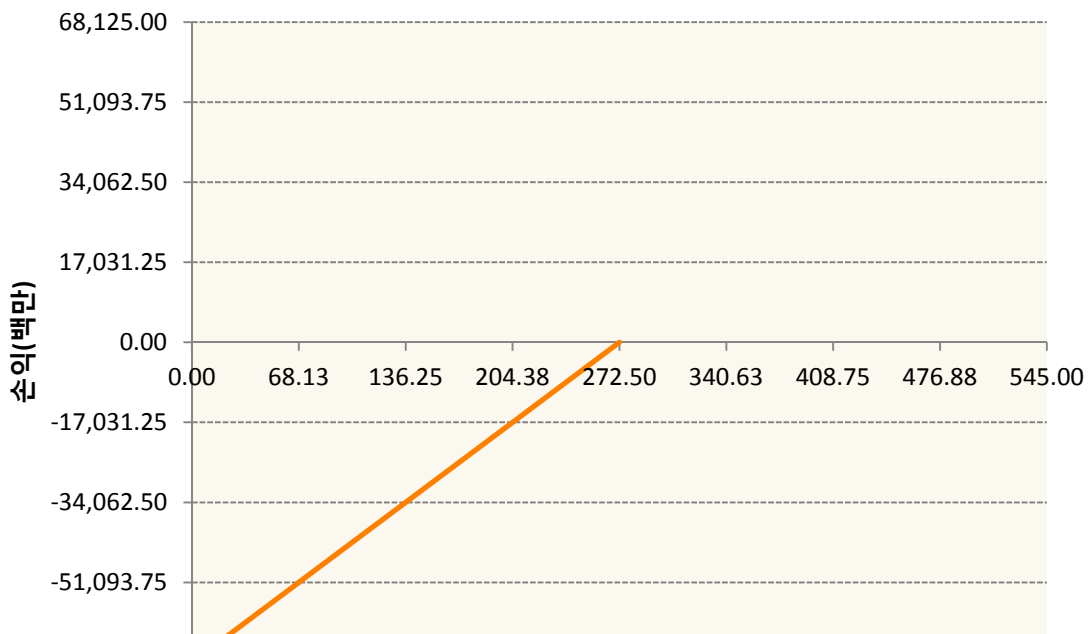




KR4301P82707-2019-08 풋270



KR4301P82723-2019-08 풋272.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P82709 2019-08 콜270							3,121
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,199	1,178	1,150	1,116	1,076	1,031	981
-5.33%	1,102	1,051	994	932	866	796	723
-2.67%	835	751	664	577	487	397	306
0%	294	196	98	0	-98	-196	-294
2.67%	-552	-635	-720	-808	-898	-988	-1,080
5.33%	-1,641	-1,693	-1,752	-1,816	-1,885	-1,958	-2,034
8.00%	-2,873	-2,898	-2,930	-2,969	-3,014	-3,065	-3,121
KR4201P82725 2019-08 콜272.5							21,117
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,112	7,005	6,856	6,664	6,431	6,160	5,854
-5.33%	6,650	6,361	6,023	5,644	5,228	4,782	4,310
-2.67%	5,231	4,698	4,138	3,558	2,962	2,353	1,733
0%	2,090	1,395	698	0	-699	-1,398	-2,098
2.67%	-3,213	-3,869	-4,535	-5,209	-5,888	-6,572	-7,260
5.33%	-10,452	-10,912	-11,411	-11,941	-12,497	-13,075	-13,669
8.00%	-18,959	-19,203	-19,501	-19,848	-20,236	-20,661	-21,117
KR4301P82707 2019-08 풋270							8,026
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,978	-7,979	-7,982	-7,988	-7,996	-8,009	-8,026
-5.33%	-4,753	-4,771	-4,798	-4,832	-4,874	-4,924	-4,980
-2.67%	-1,744	-1,830	-1,923	-2,022	-2,126	-2,233	-2,344
0%	406	270	135	0	-135	-271	-406
2.67%	1,303	1,226	1,140	1,047	948	845	737
5.33%	1,487	1,469	1,444	1,410	1,368	1,318	1,260
8.00%	1,504	1,502	1,498	1,492	1,481	1,465	1,444
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							4,736
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,721	-4,721	-4,722	-4,724	-4,726	-4,730	-4,736
-5.33%	-2,923	-2,928	-2,935	-2,947	-2,962	-2,981	-3,004
-2.67%	-1,184	-1,217	-1,255	-1,297	-1,343	-1,393	-1,445
0%	220	147	74	0	-74	-148	-223
2.67%	949	890	828	764	698	630	562

5.33%	1,145	1,126	1,102	1,073	1,039	1,000	958
8.00%	1,170	1,167	1,163	1,155	1,144	1,130	1,112

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

(단위:백만원)

38,093

공시일	2019-07-19
기준일	2019-07-18

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

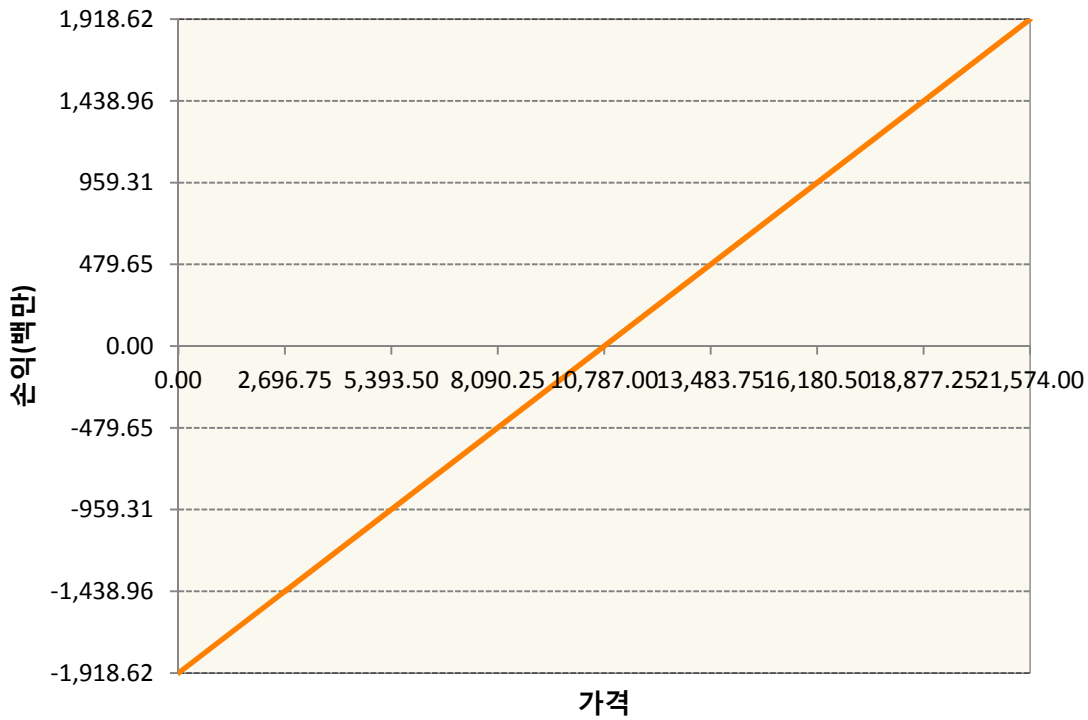
1. 계약금액

(단위:백만원)

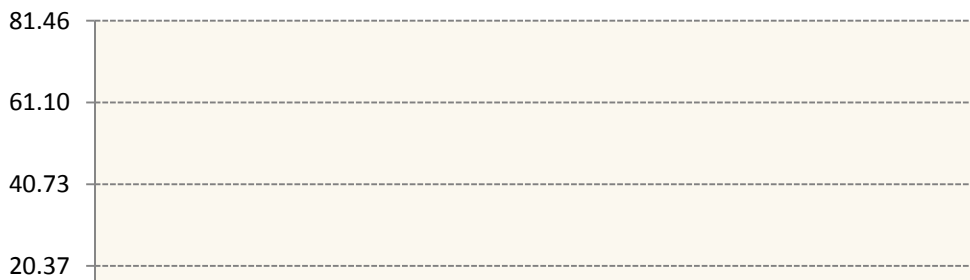
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,919	0	1,919	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,260	-5,260	장내
누계	통화	선도	151	3,168	-3,017	장외

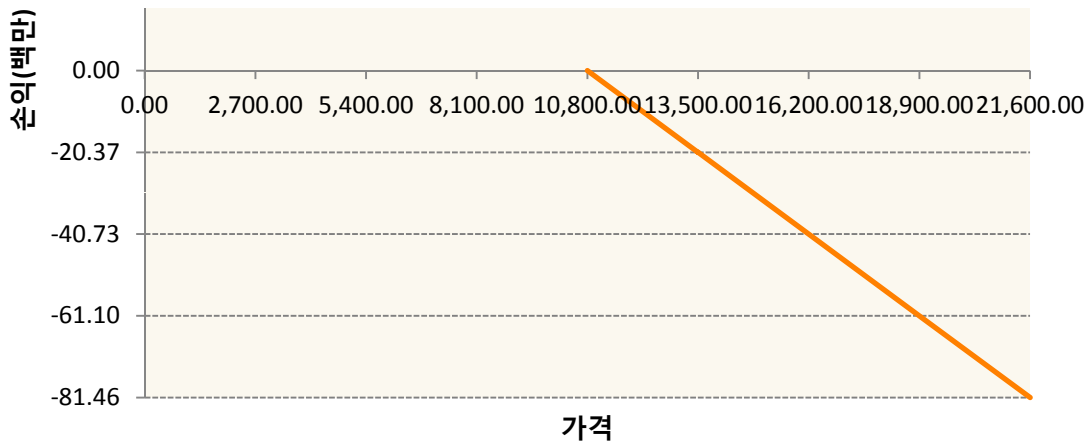
2. 만기시점의 손익구조

HCN9-HSCEI Futures Jul19

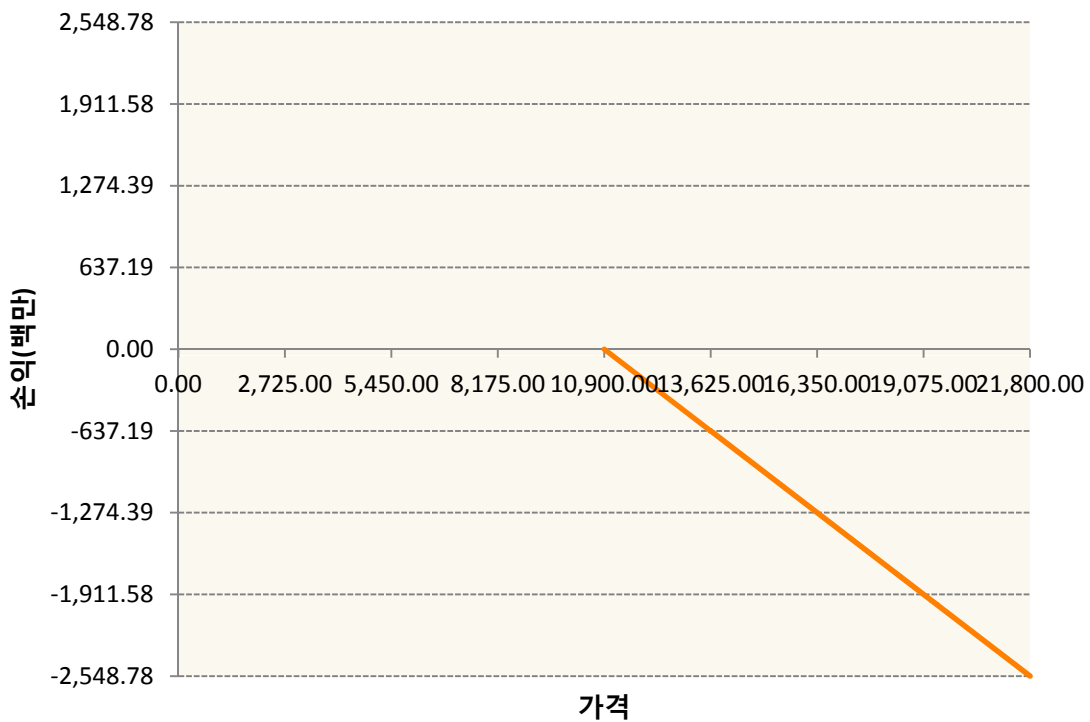


OHHIN9-C108-HSCEI

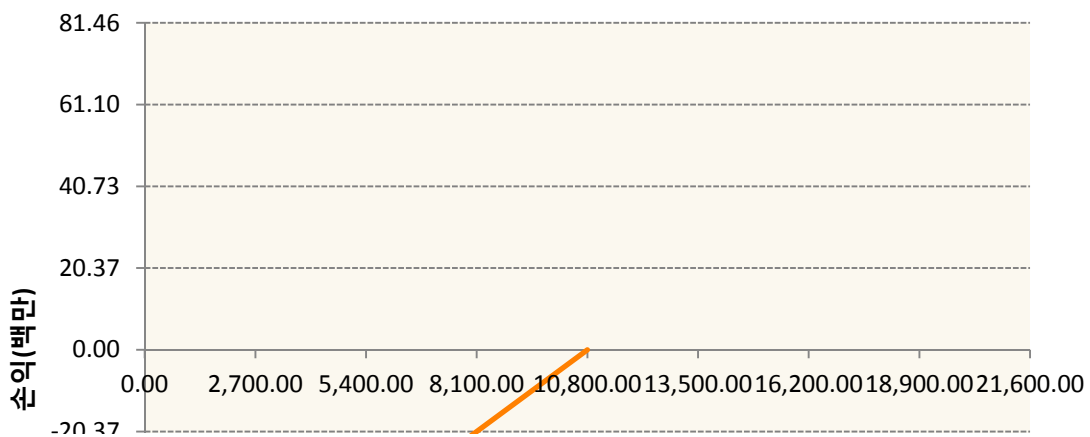


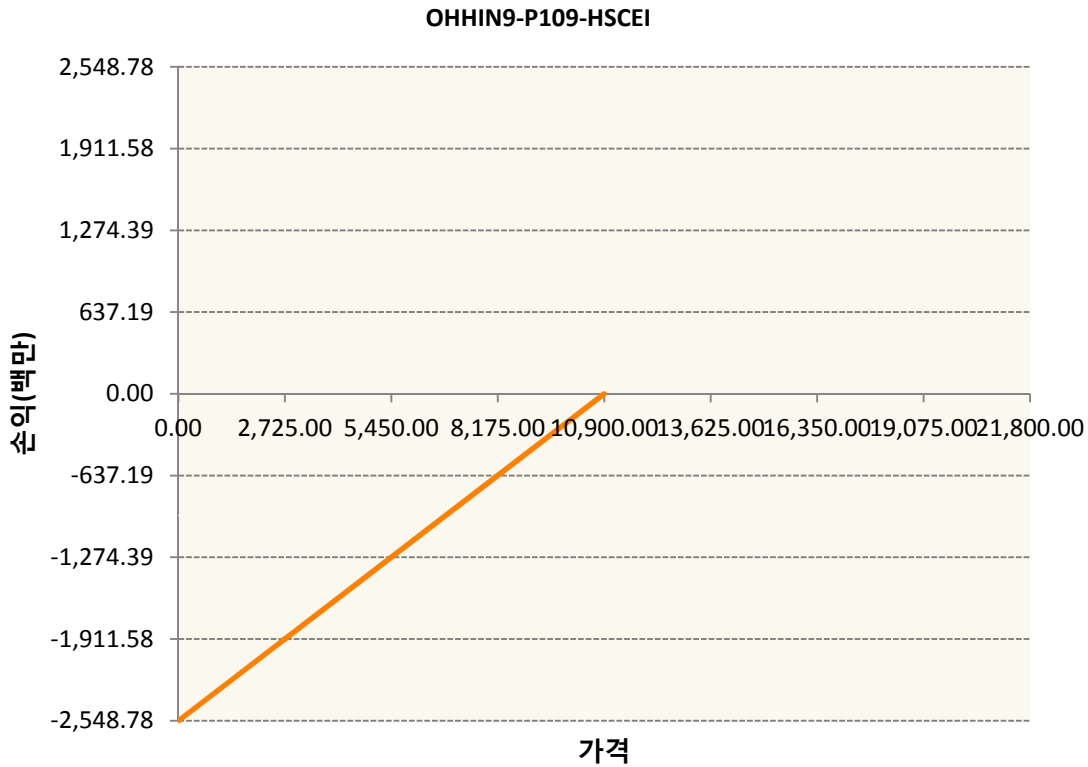


OHHIN9-C109-HSCEI



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	153
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)

664

공시일	2019-07-19
기준일	2019-07-18

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

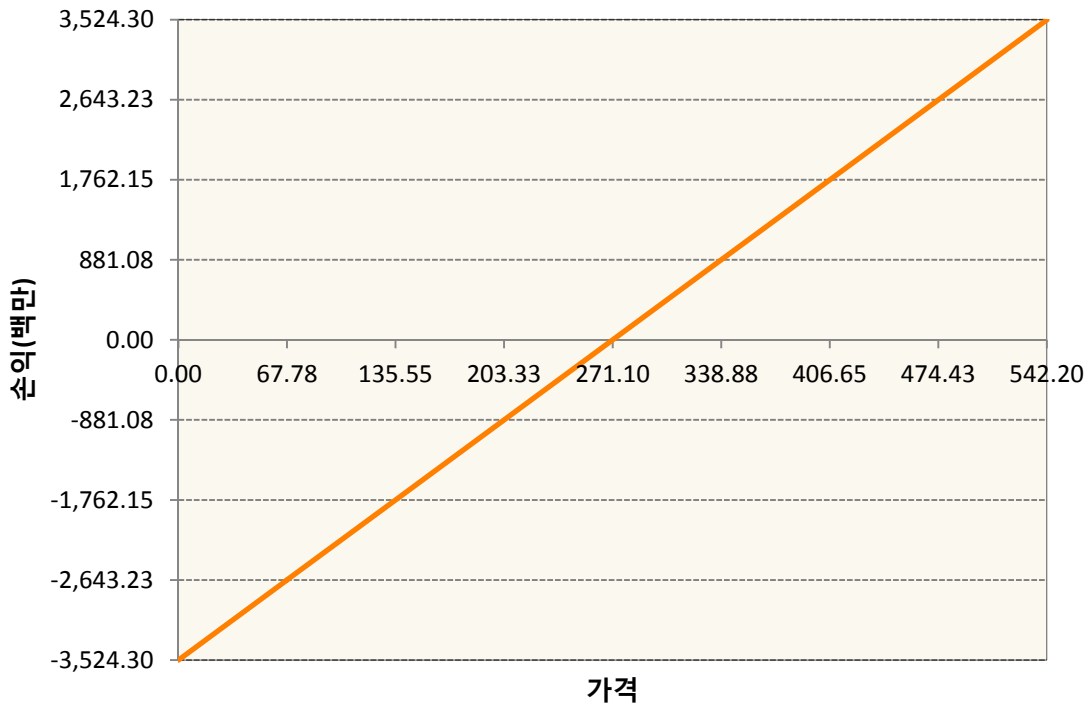
1. 계약금액

(단위:백만원)

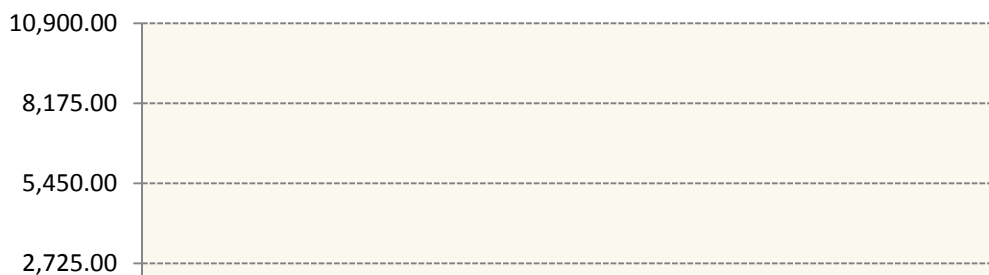
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	203	0	203	장내
누계	유가증권	선물	3,524	0	3,524	장내
누계	유가증권	스왑	20,836	0	20,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,314	-20,314	장내

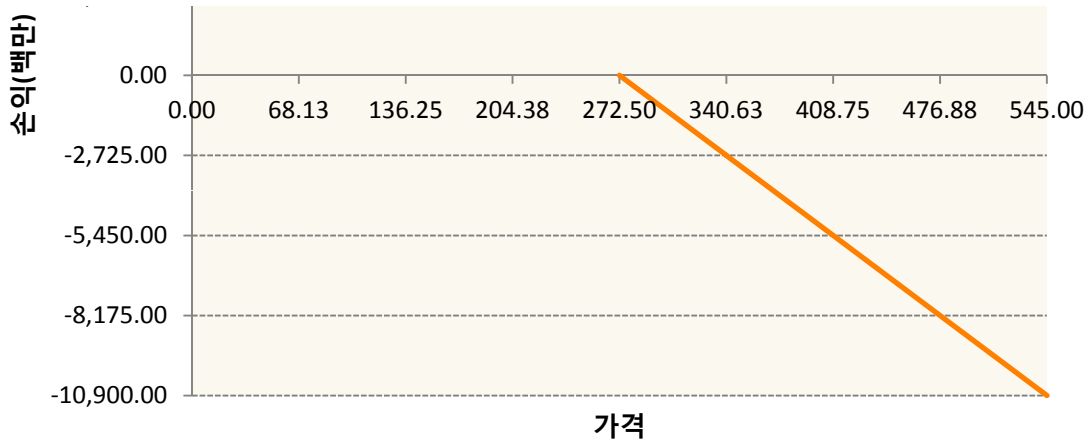
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

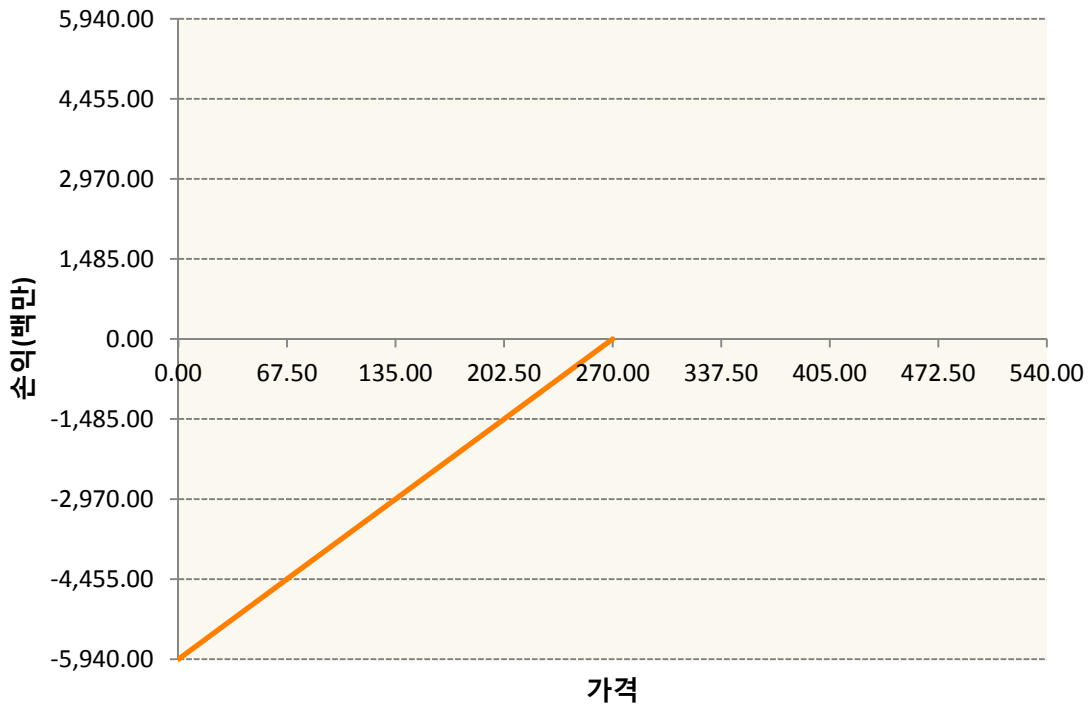


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

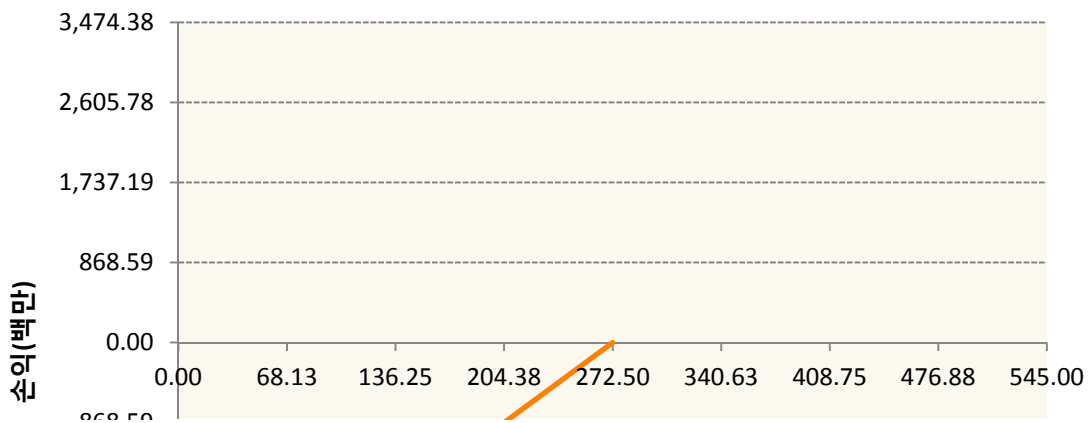




KR4301P82707-2019-08 풋270



KR4301P82723-2019-08 풋272.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,194
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	
-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%	1,194	1,194	1,194	1,194	1,194	1,194	1,194	
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						281
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-281	-281	-281	-281	-281	-281	-281	
-5.33%	-188	-188	-188	-188	-188	-188	-188	
-2.67%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	94	94	94	94	94	94	94	
5.33%	188	188	188	188	188	188	188	
8.00%	281	281	281	281	281	281	281	
KR4201P82725		2019-08 콜272.5						645
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	217	214	209	204	196	188	179
-5.33%	203	194	184	172	160	146	132
-2.67%	160	144	126	109	90	72	53
0%	64	43	21	0	-21	-43	-64
2.67%	-98	-118	-139	-159	-180	-201	-222
5.33%	-319	-333	-349	-365	-382	-399	-418
8.00%	-579	-587	-596	-606	-618	-631	-645
KR4301P82707 2019-08 풋270							392
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-390	-390	-390	-391	-391	-392	-392
-5.33%	-232	-233	-235	-236	-238	-241	-243
-2.67%	-85	-89	-94	-99	-104	-109	-115
0%	20	13	7	0	-7	-13	-20
2.67%	64	60	56	51	46	41	36
5.33%	73	72	71	69	67	64	62
8.00%	74	73	73	73	72	72	71
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							242
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-241	-241	-241	-241	-241	-241	-242
-5.33%	-149	-149	-150	-150	-151	-152	-153
-2.67%	-60	-62	-64	-66	-69	-71	-74
0%	11	8	4	0	-4	-8	-11
2.67%	48	45	42	39	36	32	29
5.33%	58	57	56	55	53	51	49
8.00%	60	60	59	59	58	58	57

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

(단위:백만원)

3,377

공시일	2019-07-19
기준일	2019-07-18

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

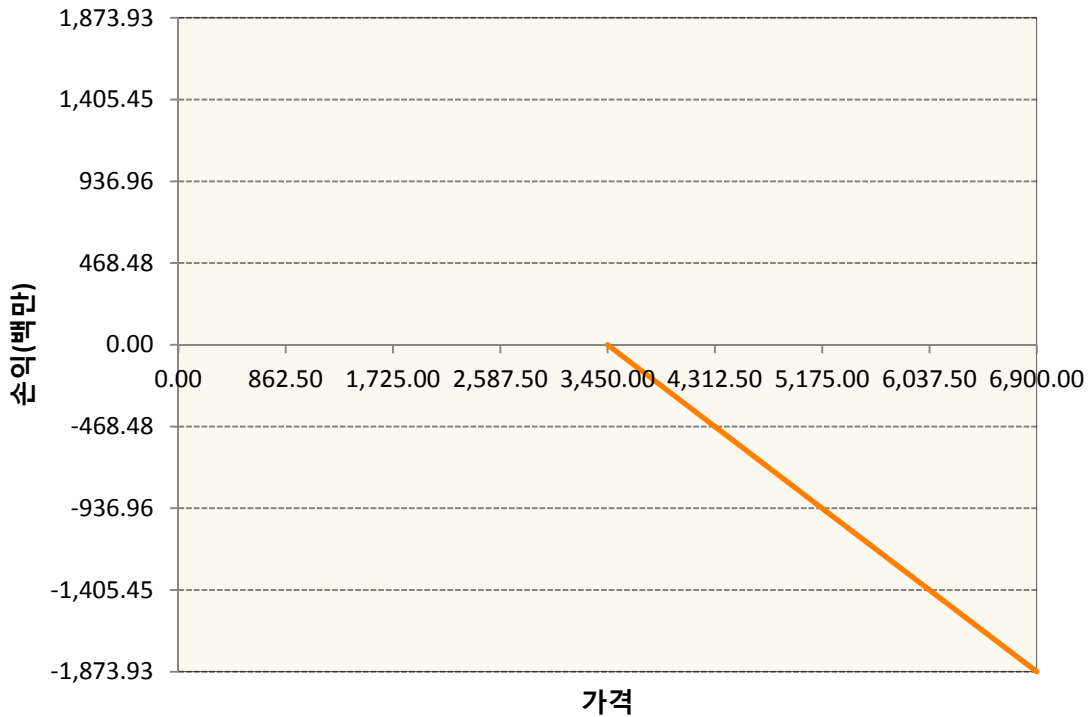
1. 계약금액

(단위:백만원)

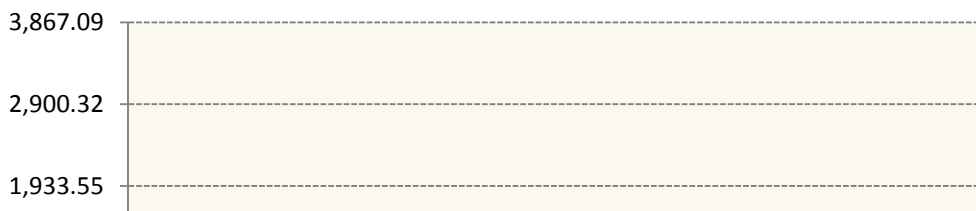
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,772	0	2,772	
누계	유가증권	스왑	46,888	0	46,888	장외
누계	유가증권	옵션	0	11,482	-11,482	장내
누계	통화	선도	5,299	22,521	-17,222	장외

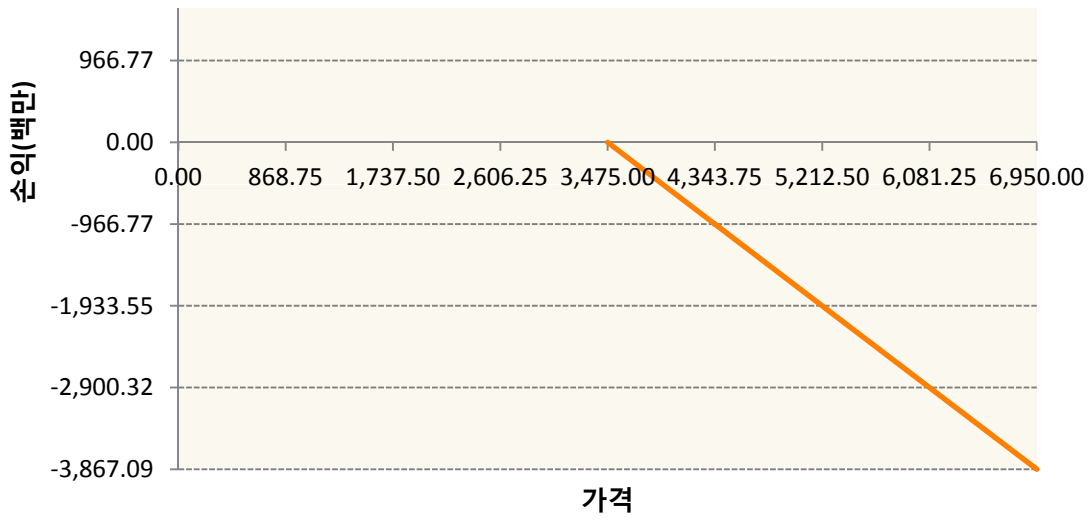
2. 만기시점의 손익구조

OESXN9-C3450-EURO STOXX 50

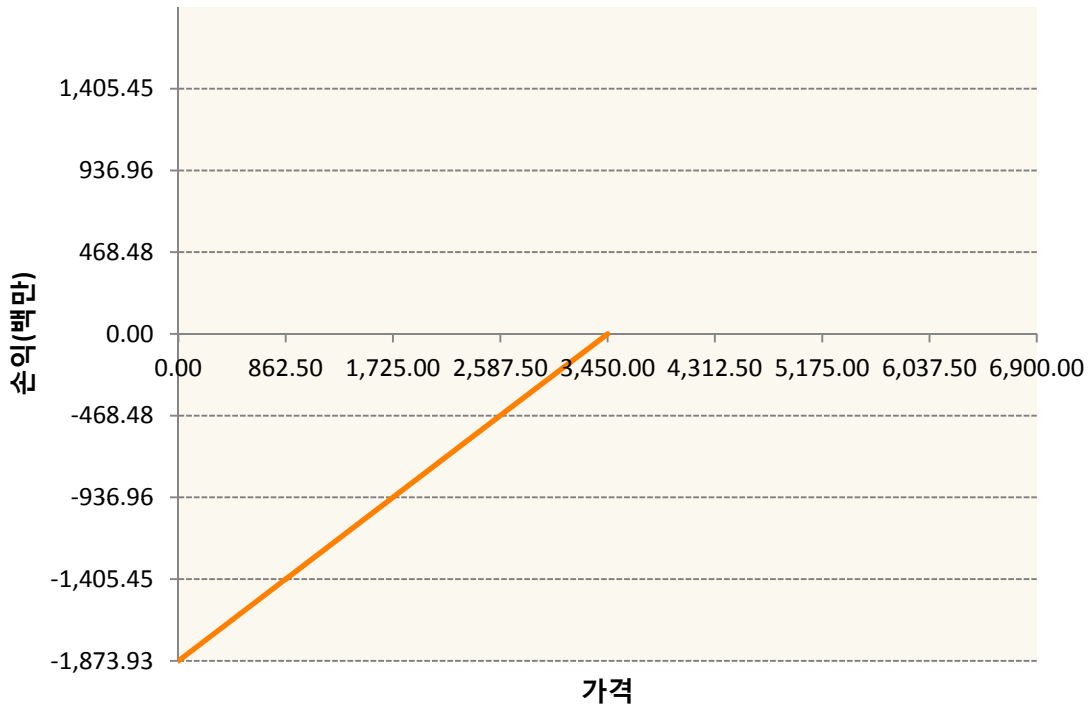


OESXN9-C3475-EURO STOXX 50

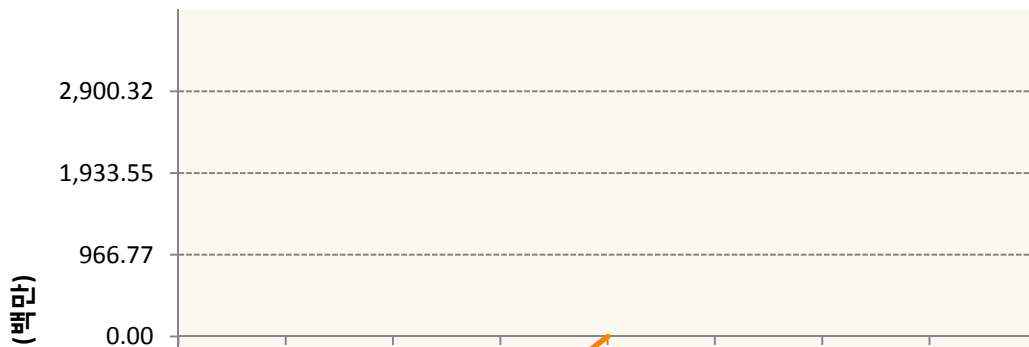


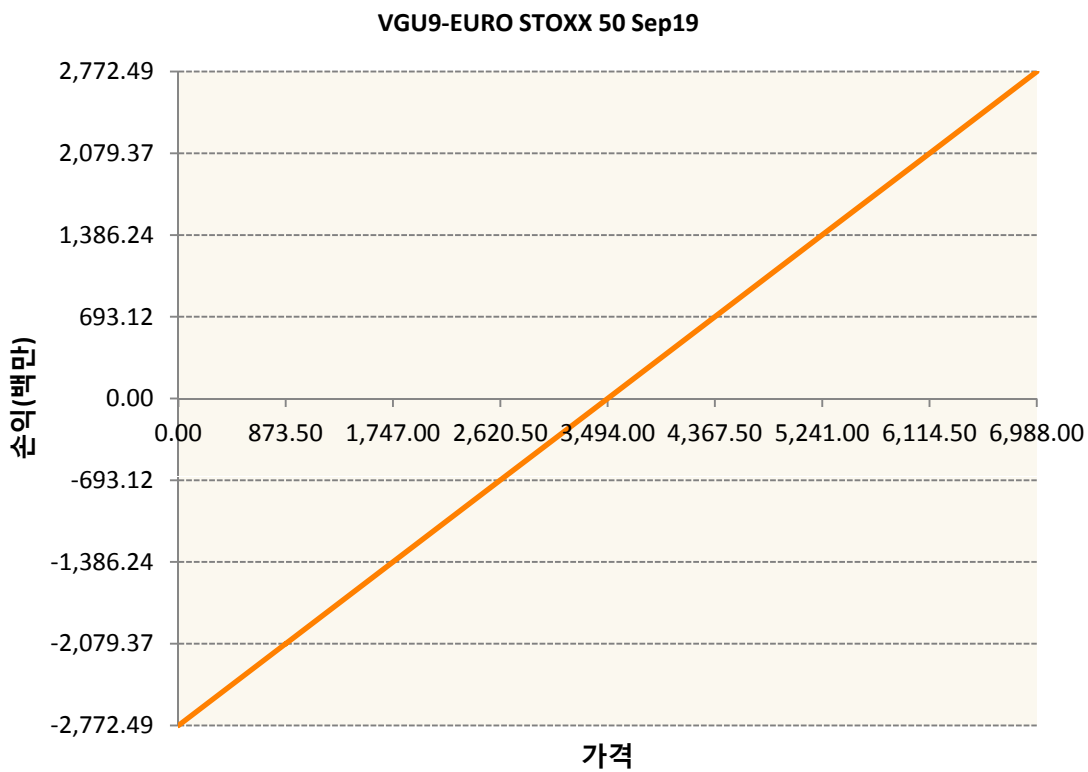
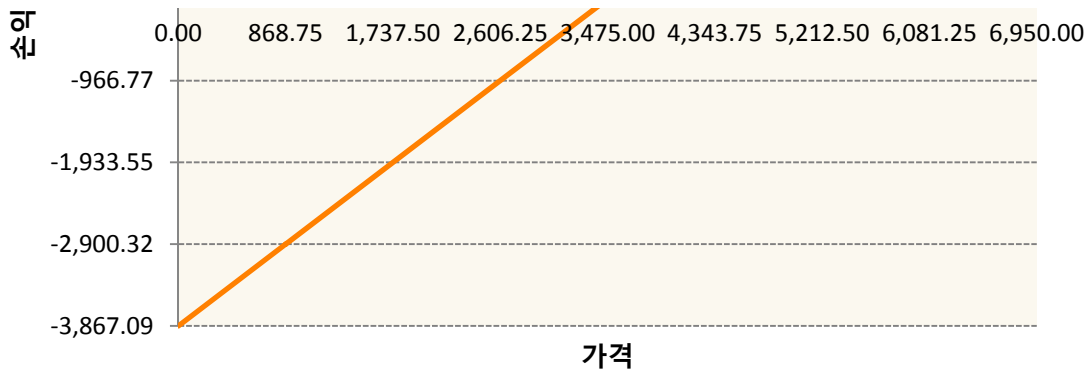


OESXN9-P3450-EURO STOXX 50



OESXN9-P3475-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	90
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	424
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E	1,060
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	318
FX21019N01 EUR/KRW 23-08-19E	424
OESXN9-C34 EURO STOXX 50	150
OESXN9-C34 EURO STOXX 50	309
OESXN9-P34 EURO STOXX 50	150
OESXN9-P34 EURO STOXX 50	309
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	222

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

(단위:백만원)

1,916

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

(단위:백만원)

1,010

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

(단위:백만원)

86

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

(단위:백만원)

131

공시일	2019-07-19
기준일	2019-07-18

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

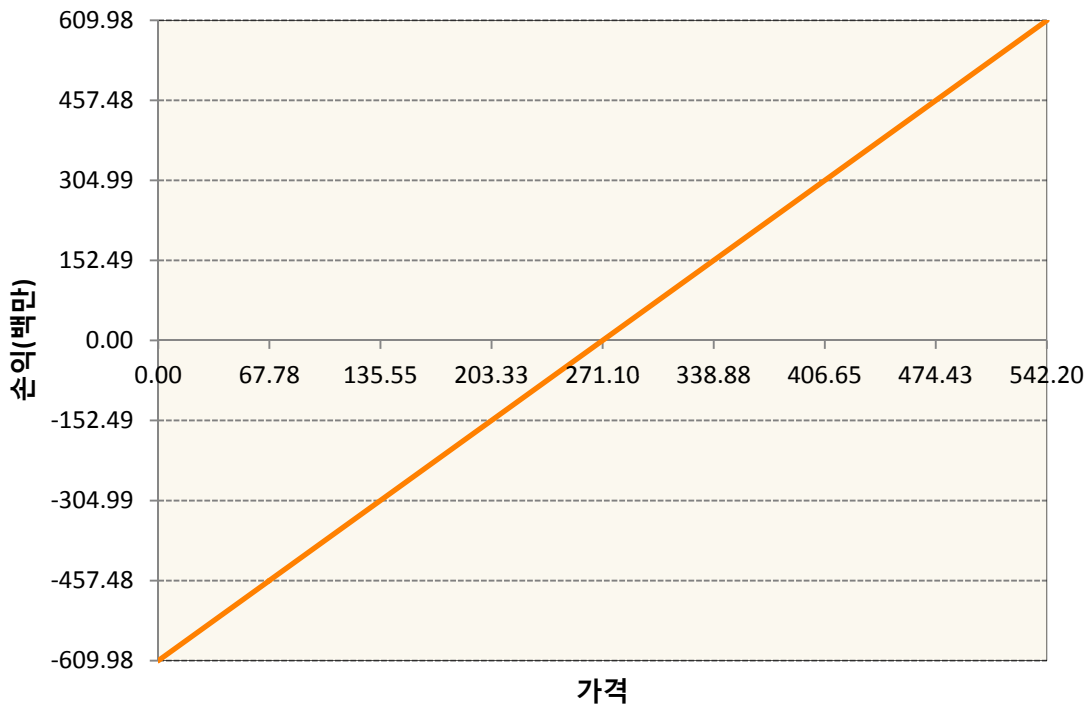
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	610	0	610	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						49
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
-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%	49	49	49	49	49	49	49	

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-07-19
기준일	2019-07-18

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

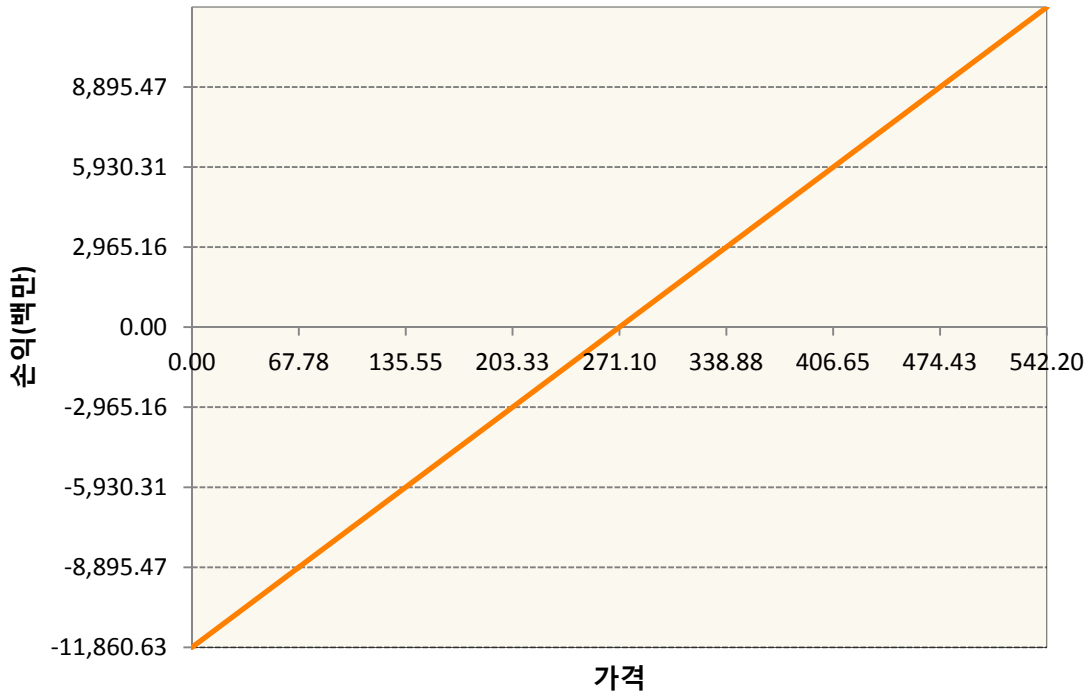
1. 계약금액

(단위:백만원)

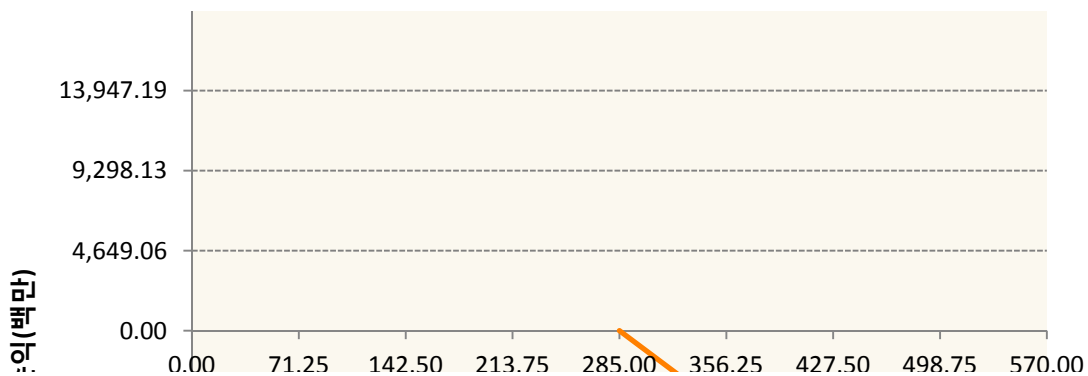
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	271	-271	장내
신규	유가증권	옵션	285	0	285	장내
누계	유가증권	선물	11,861	0	11,861	장내
누계	유가증권	옵션	1,698	21,831	-20,133	장내

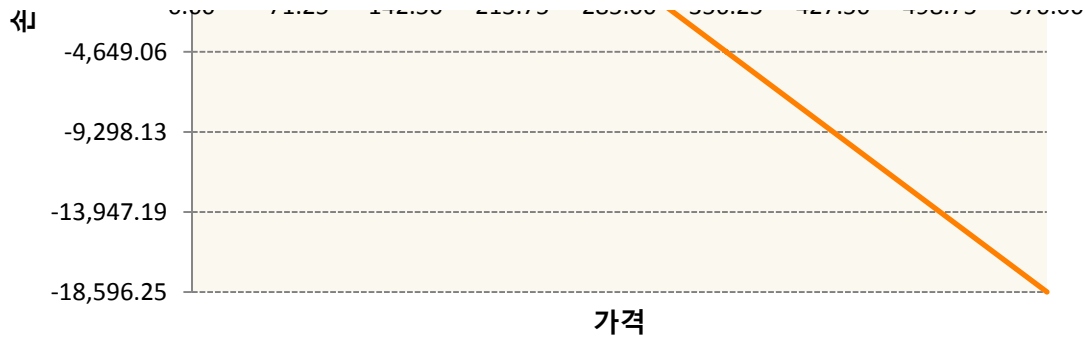
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

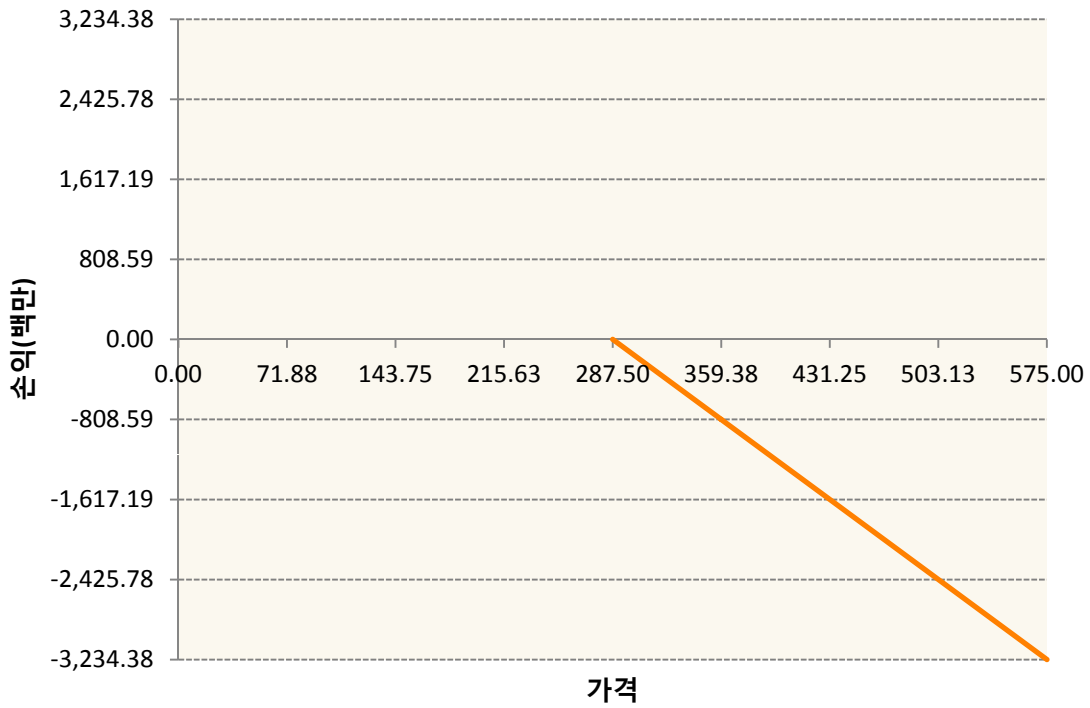


KR4201P82857-2019-08 콜285

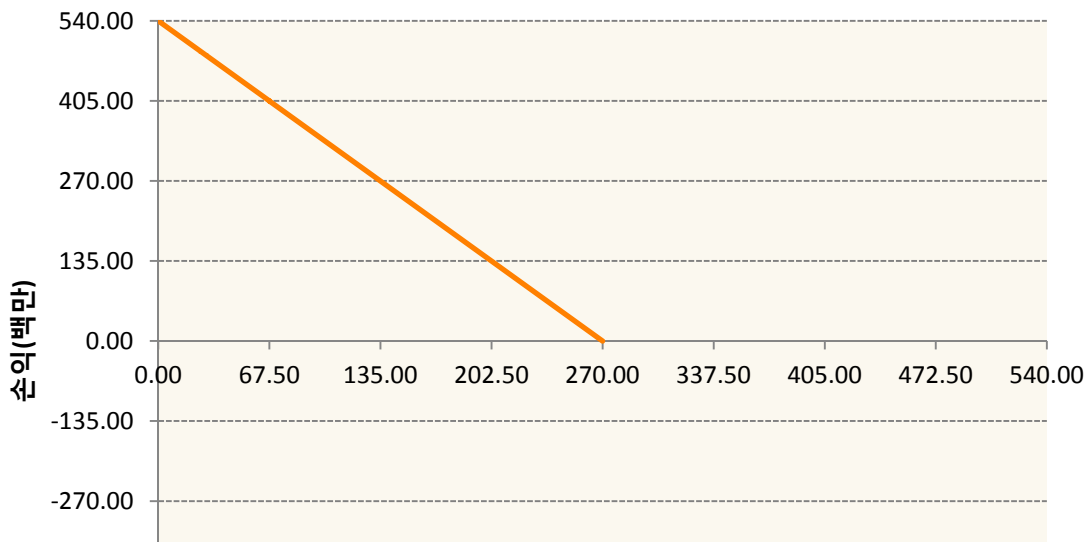


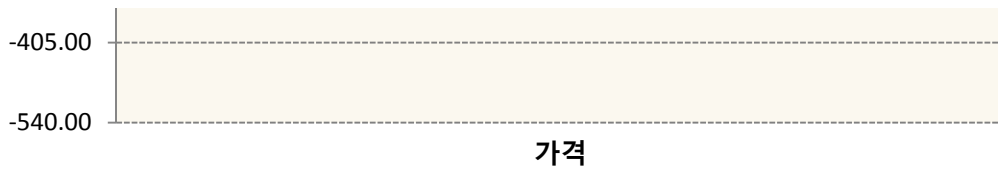


KR4201P82873-2019-08 콜287.5

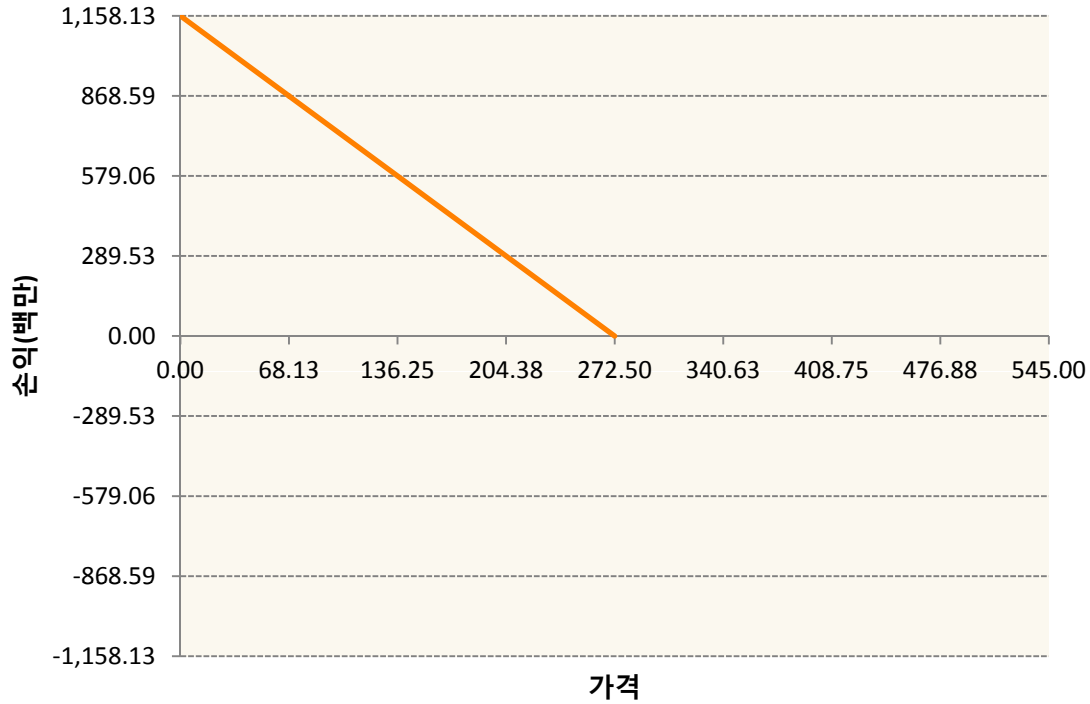


KR4301P82707-2019-08 풋270





KR4301P82723-2019-08 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						947
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-947	-947	-947	-947	-947	-947	-947	
-5.33%	-632	-632	-632	-632	-632	-632	-632	
-2.67%	-316	-316	-316	-316	-316	-316	-316	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	316	316	316	316	316	316	316	
5.33%	632	632	632	632	632	632	632	
8.00%	947	947	947	947	947	947	947	
KR4201P82857		2019-08 콜285						711
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	114	113	112	110	107	102	96	
-5.33%	112	109	105	99	91	81	69	
-2.67%	102	93	82	68	52	35	15	

0%	65	45	24	0	-25	-52	-79
2.67%	-30	-61	-94	-126	-160	-194	-228
5.33%	-217	-254	-291	-327	-364	-401	-438
8.00%	-507	-540	-573	-607	-641	-676	-711
KR4201P82873 2019-08 콜287.5							111
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15	15	15	15	14	14	13
-5.33%	15	14	14	13	12	11	9
-2.67%	14	13	11	9	7	4	1
0%	9	7	4	0	-4	-8	-12
2.67%	-3	-8	-13	-18	-23	-29	-35
5.33%	-29	-36	-42	-48	-54	-61	-67
8.00%	-73	-79	-86	-92	-98	-104	-111
KR4301P82707 2019-08 풋270							36
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	35	35	35	36	36	36	36
-5.33%	21	21	21	21	22	22	22
-2.67%	8	8	9	9	9	10	10
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-6	-5	-5	-5	-4	-4	-3
5.33%	-7	-7	-6	-6	-6	-6	-6
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-6
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							81
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	80	80	80	80	80	80	81
-5.33%	50	50	50	50	50	51	51
-2.67%	20	21	21	22	23	24	25
0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-16	-15	-14	-13	-12	-11	-10
5.33%	-19	-19	-19	-18	-18	-17	-16
8.00%	-20	-20	-20	-20	-19	-19	-19

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

(단위:백만원)

1,501

공시일	2019-07-19
기준일	2019-07-18

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	32,551	0	32,551	

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	2019-07-19
기준일	2019-07-18

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	52,801	0	52,801	

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	2019-07-19
기준일	2019-07-18

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	6,081	187	5,894	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	378,683	0	378,683	
누계	통화	선도	0	445,021	-445,021	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 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		1,886
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		1,886
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E		698
FX21019M04 KRW/USD 26-07-19E		698
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E		1,301
FX21019M04 KRW/USD 31-07-19E		2,558
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		3,112
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		2,112
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		1,697
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,075
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		132
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		566
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		3,018
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		3,301
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		472
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		943
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		2,933

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

(단위:백만원)

11,677

공시일	2019-07-19
기준일	2019-07-18

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

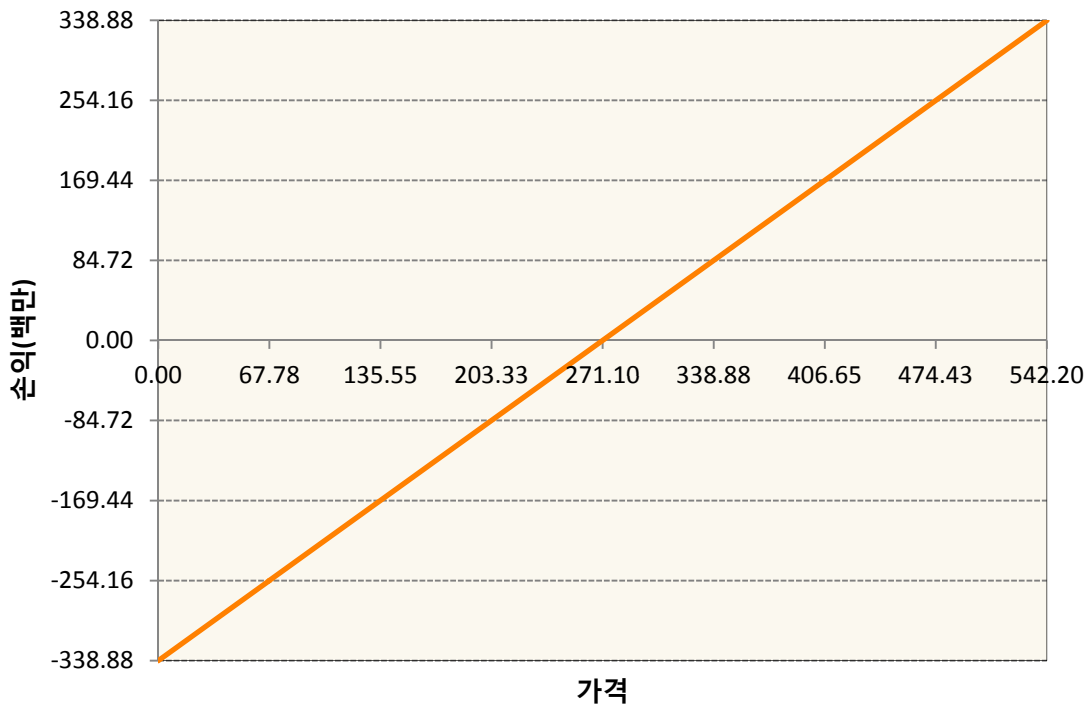
1. 계약금액

(단위:백만원)

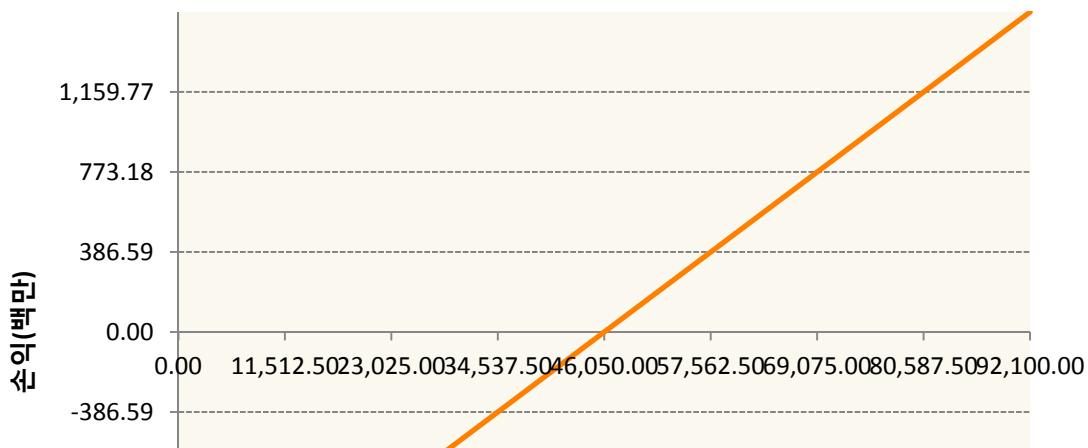
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,885	0	1,885	장내

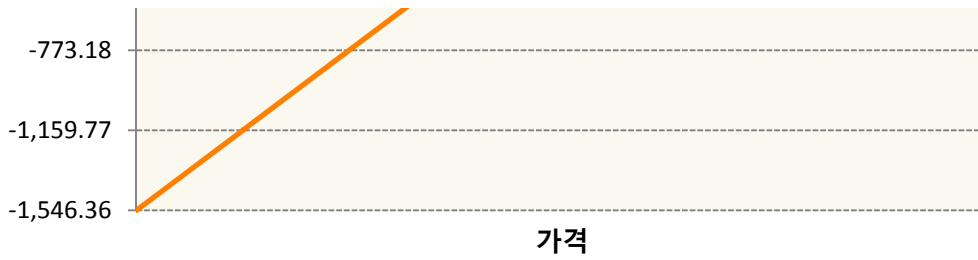
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P80001-2019-08 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						27
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27	
-5.33%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
-2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	9	9	9	9	9	9	9	
5.33%	18	18	18	18	18	18	18	
8.00%	27	27	27	27	27	27	27	
KR4111P80001		2019-08 삼성전자개별선물						124
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124	
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83	
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	41	41	41	41	41	41	41	
5.33%	83	83	83	83	83	83	83	
8.00%	124	124	124	124	124	124	124	

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

173

공시일	2019-07-19
기준일	2019-07-18

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

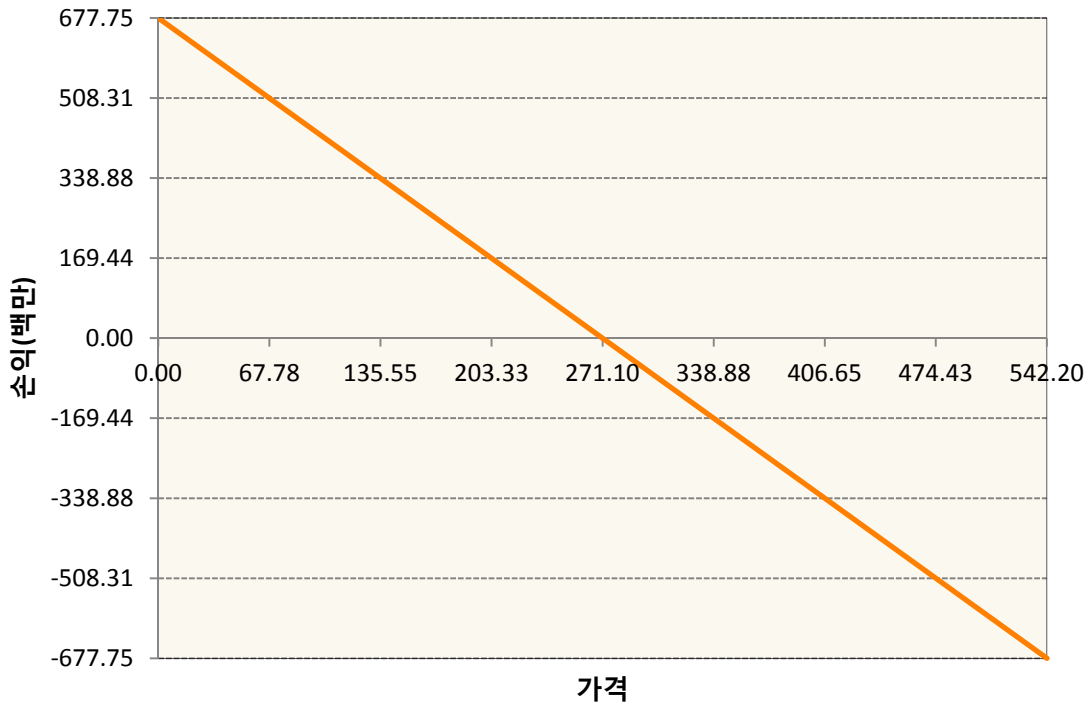
1. 계약금액

(단위:백만원)

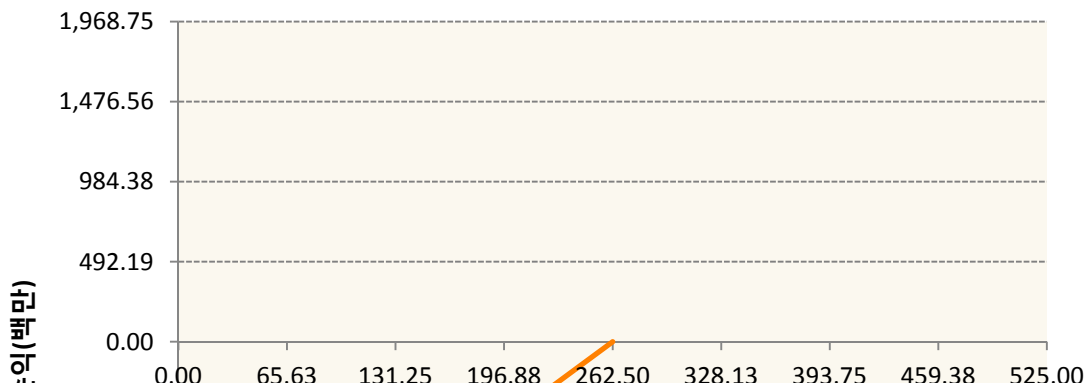
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	678	-678	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,625	-3,625	장내

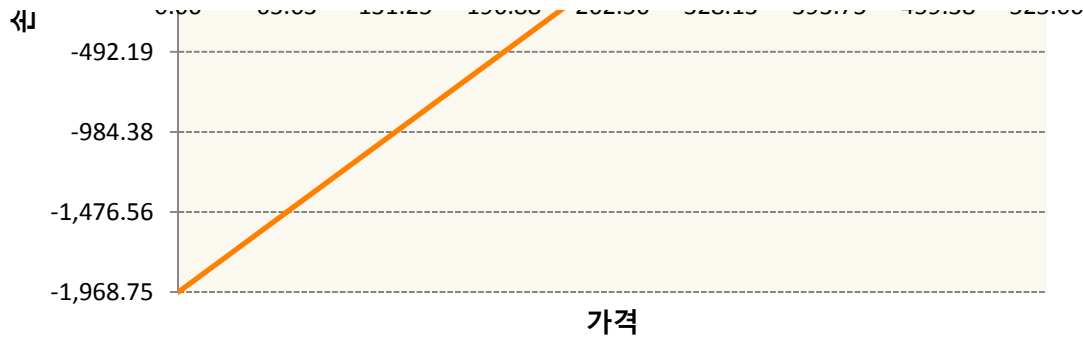
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

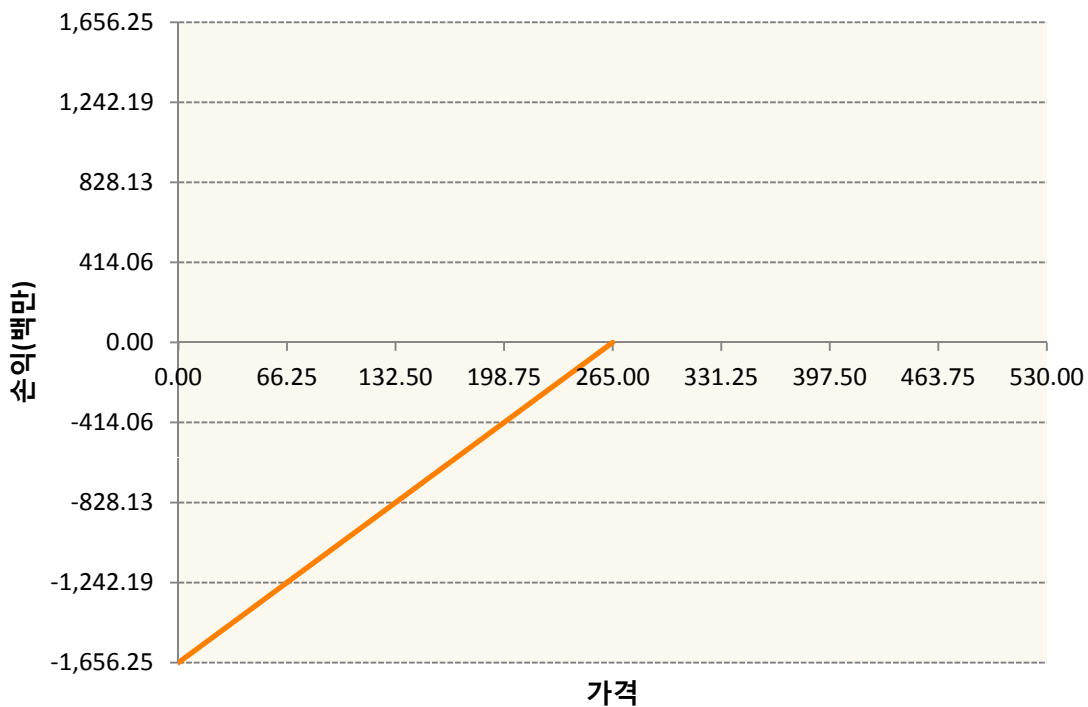


KR4301P82624-2019-08 풋262.5





KR4301P82657-2019-08 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						54
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	54	54	54	54	54	54	54	54
-5.33%	36	36	36	36	36	36	36	36
-2.67%	18	18	18	18	18	18	18	18
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
KR4301P82624		2019-08 풋262.5						99
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-95	-96	-96	-97	-97	-98	-99
-5.33%	-45	-47	-48	-50	-52	-53	-55
-2.67%	-10	-12	-14	-17	-19	-21	-23
0%	4	3	1	0	-2	-3	-5
2.67%	7	6	6	5	5	4	3
5.33%	7	7	7	7	6	6	6
8.00%	7	7	7	7	7	7	7

KR4301P82657

2019-08 풋265

93

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-91	-91	-92	-92	-92	-93	-93
-5.33%	-48	-49	-50	-51	-52	-53	-54
-2.67%	-13	-15	-17	-18	-20	-22	-24
0%	4	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	9	8	8	7	6	5	5
5.33%	9	9	9	9	9	8	8
8.00%	9	9	9	9	9	9	9

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

(단위:백만원)

219

공시일	2019-07-19
기준일	2019-07-18

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	18,422	0	18,422	
누계	통화	선도	0	18,271	-18,271	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019M03 KRW/USD 24-07-19E		141
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)

479

공시일	2019-07-19
기준일	2019-07-18

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	2019-07-19
기준일	2019-07-18

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

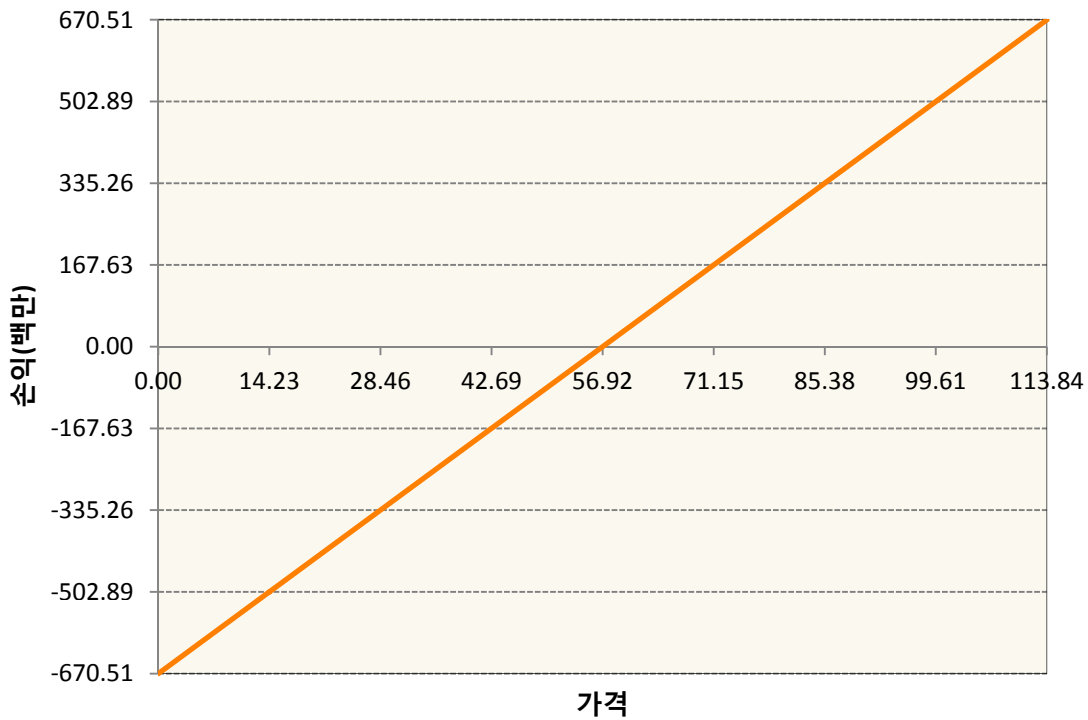
1. 계약금액

(단위:백만원)

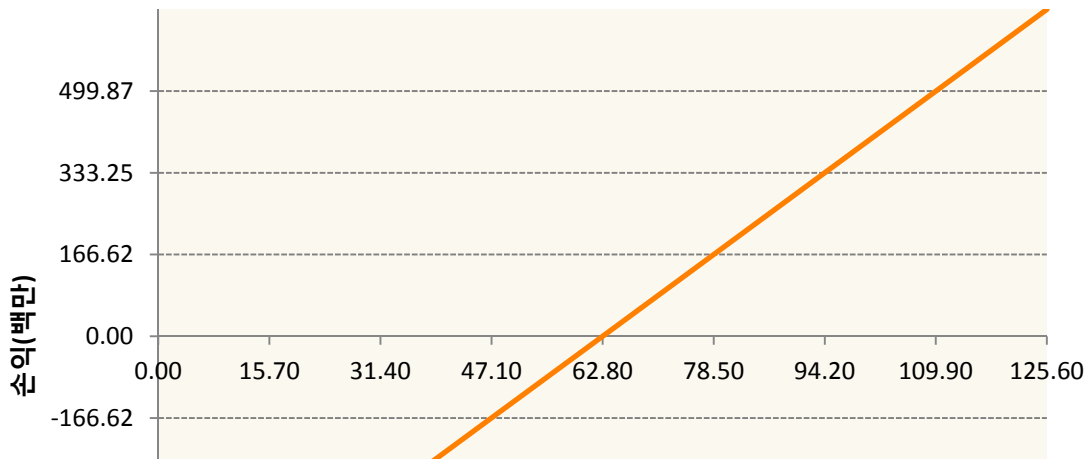
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,639	118	2,521	

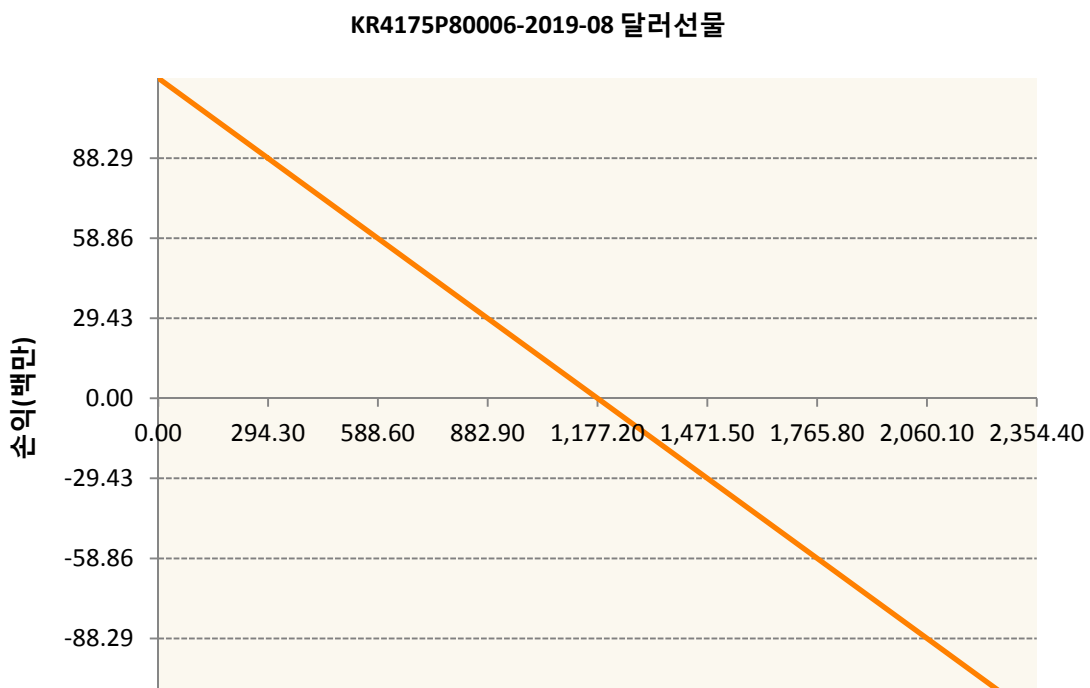
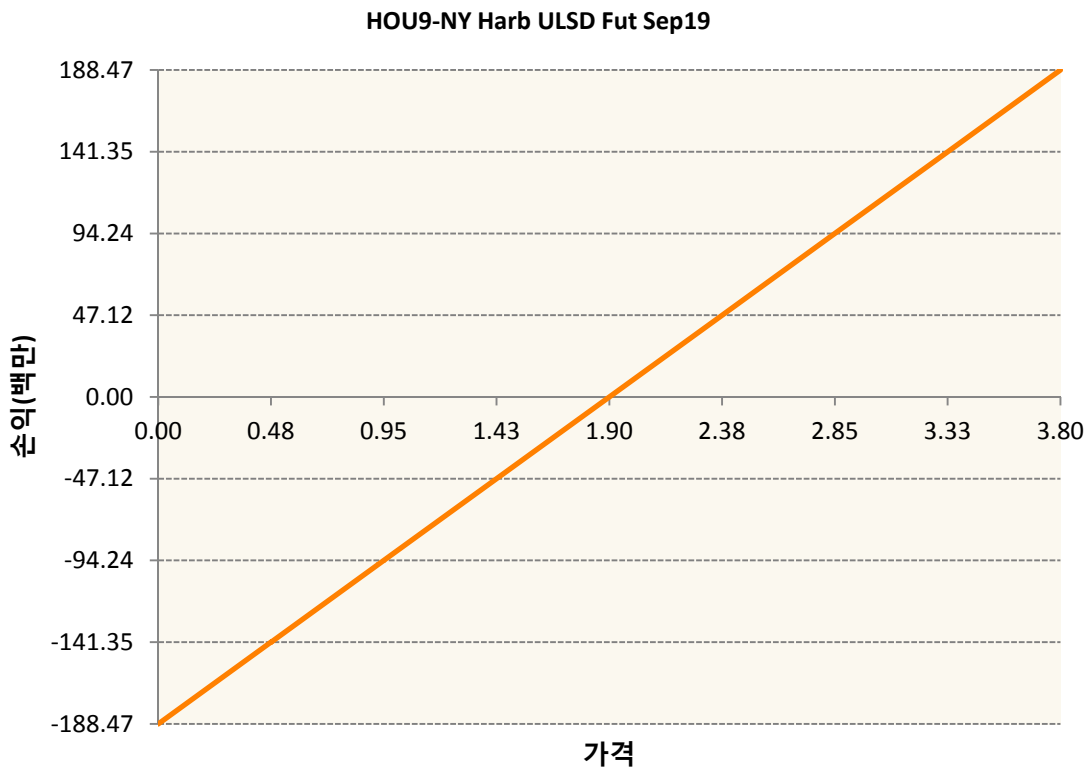
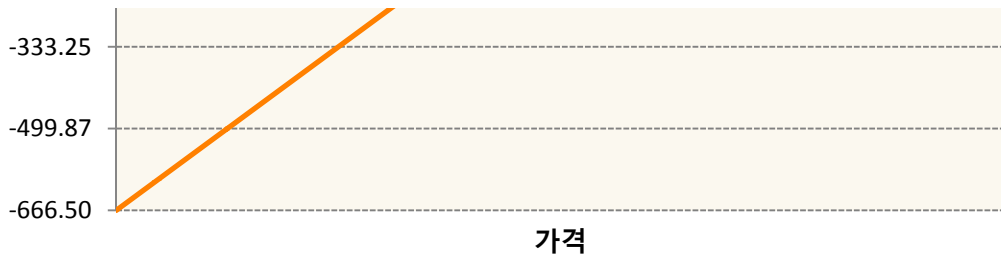
2. 만기시점의 손익구조

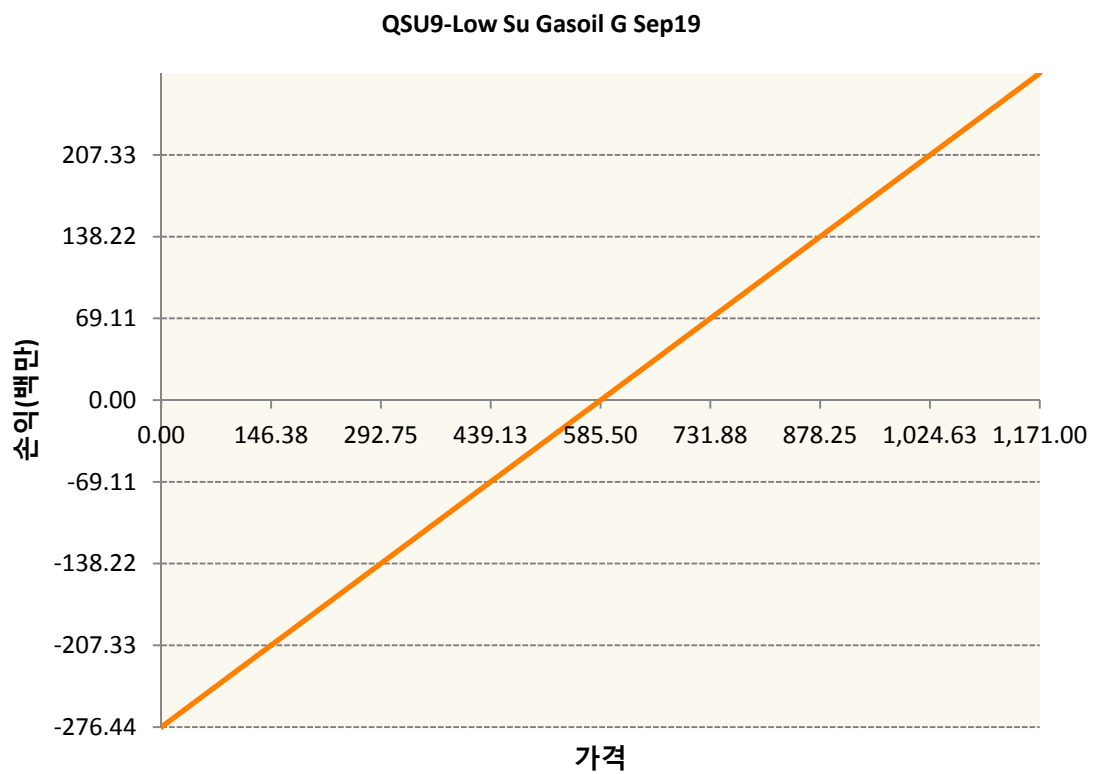
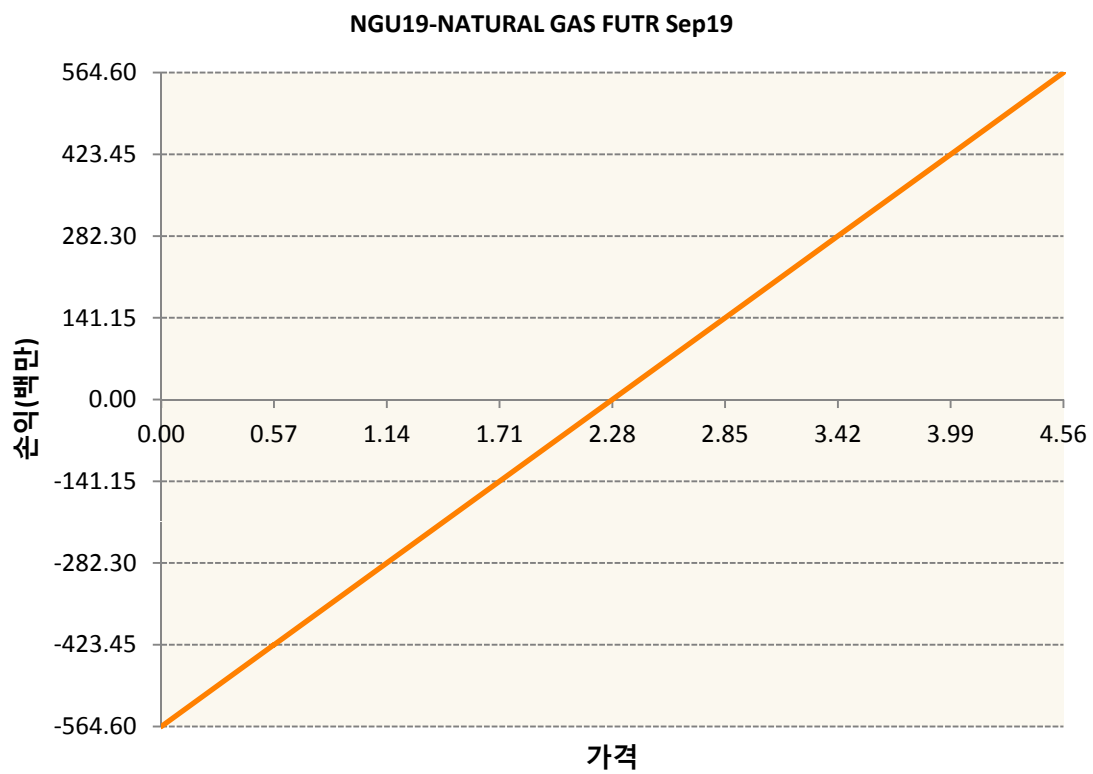
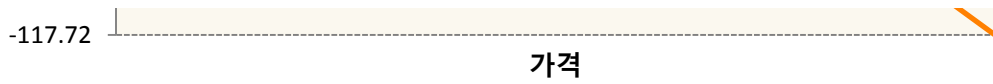
CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19



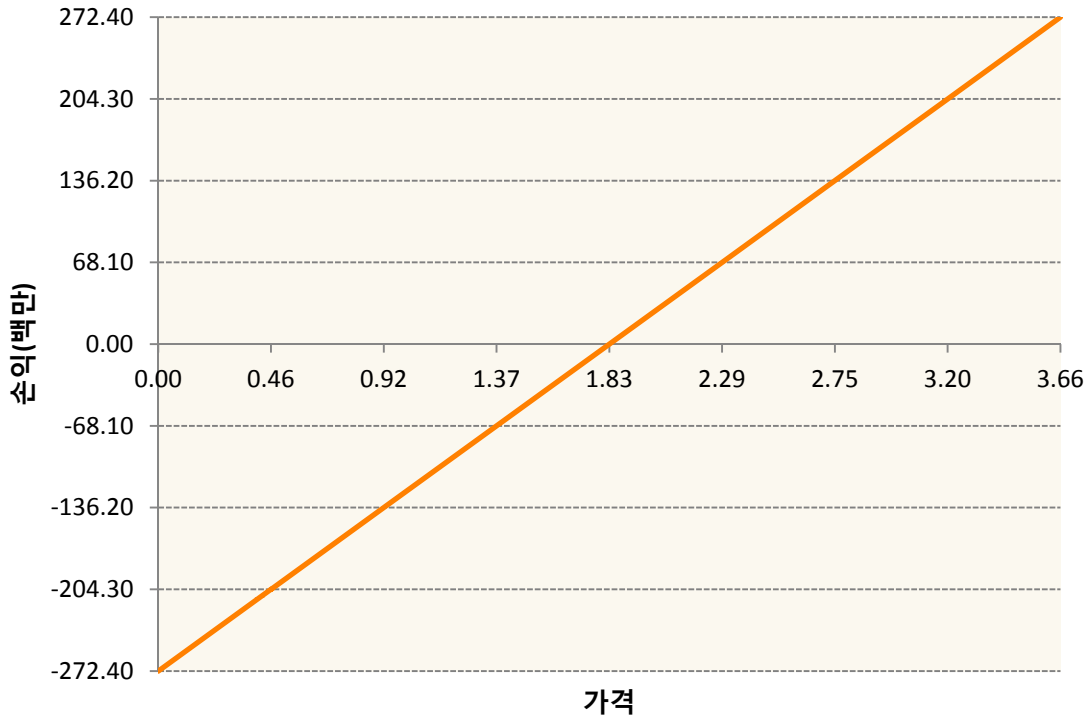
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19







XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	54
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	53
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	15
KR4175P800	2019-08 달러선물	9
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	45
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	22
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	22

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

(단위:백만원)

388

공시일	2019-07-19
기준일	2019-07-18

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

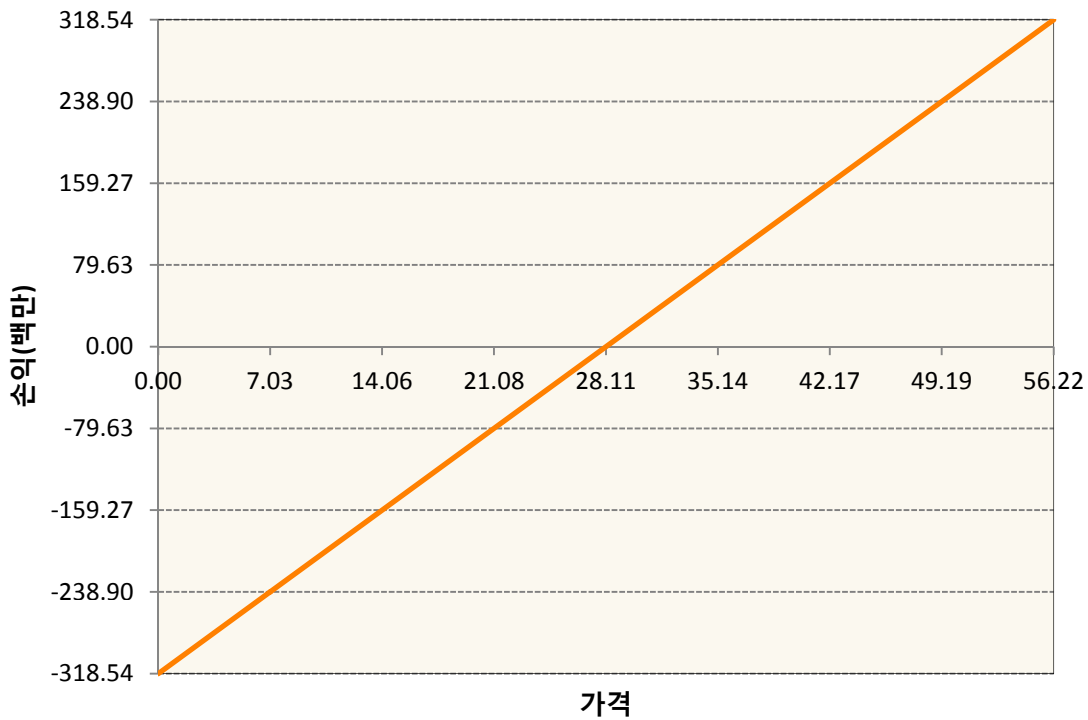
1. 계약금액

(단위:백만원)

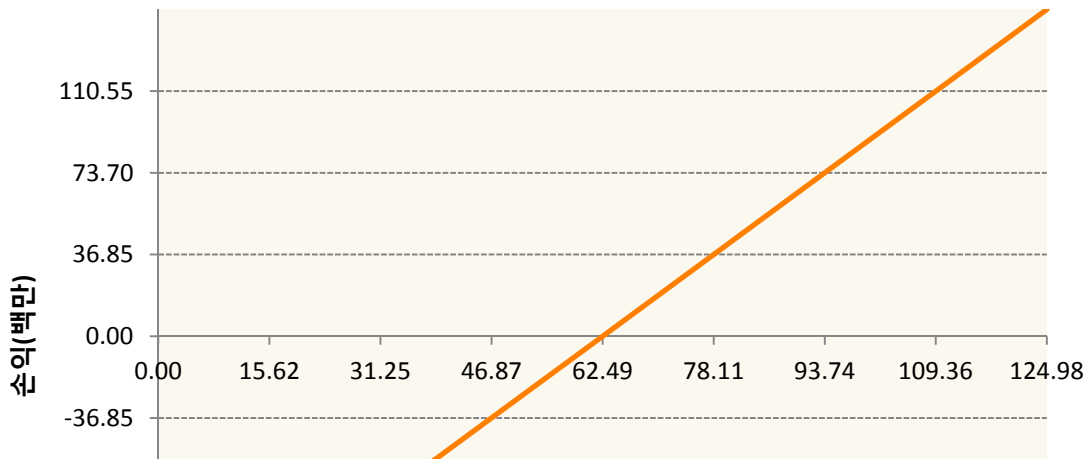
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,112	200	2,912	

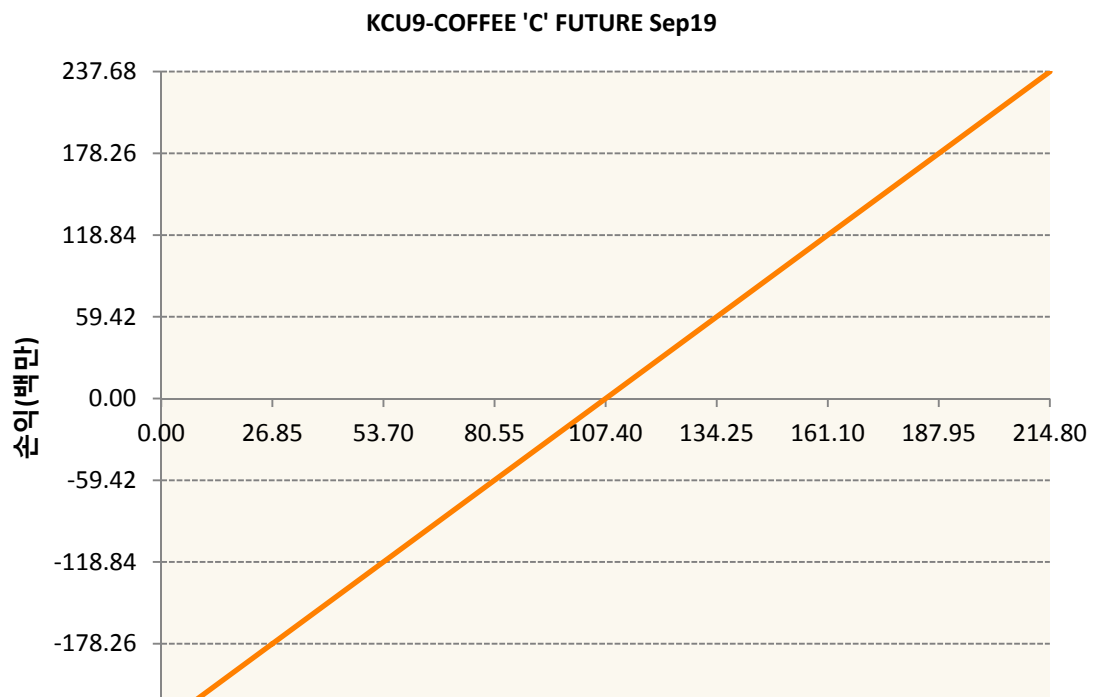
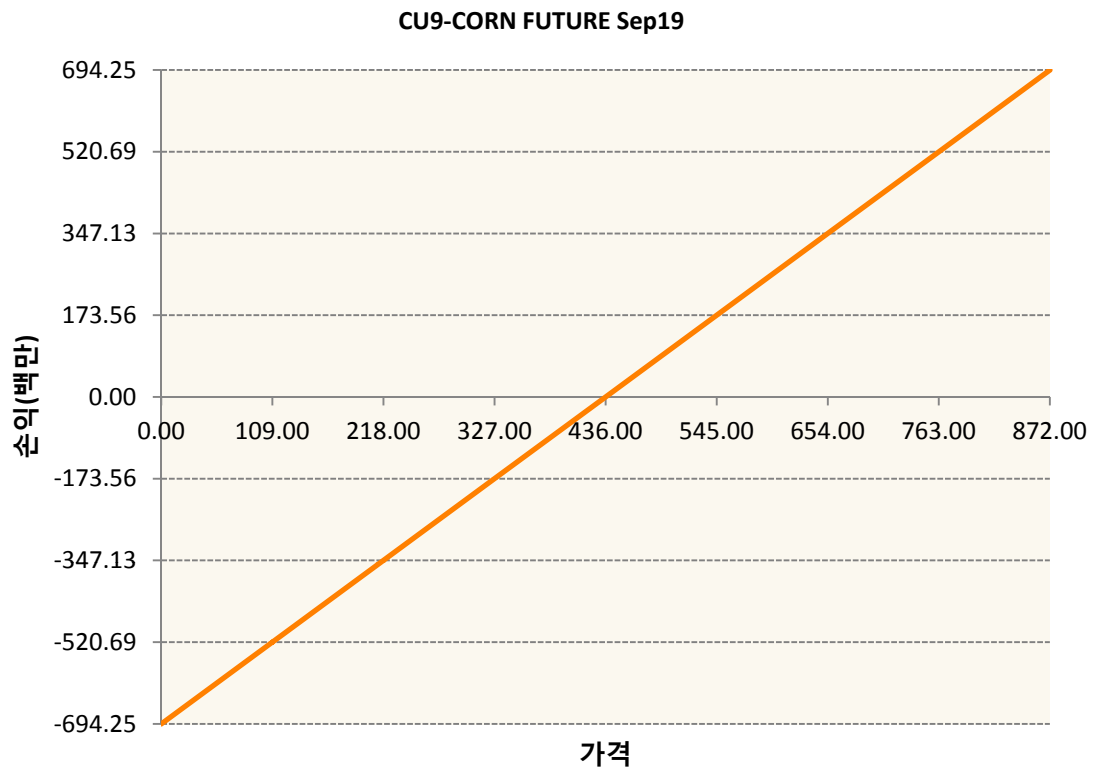
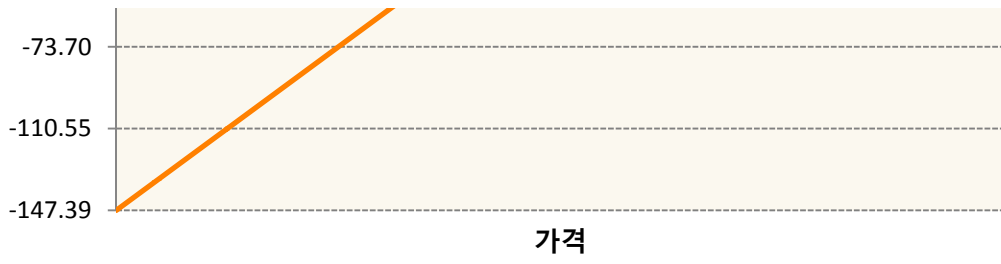
2. 만기시점의 손익구조

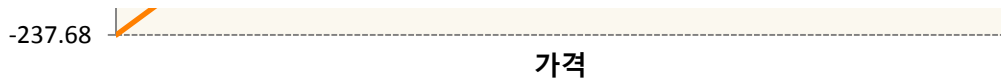
BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19



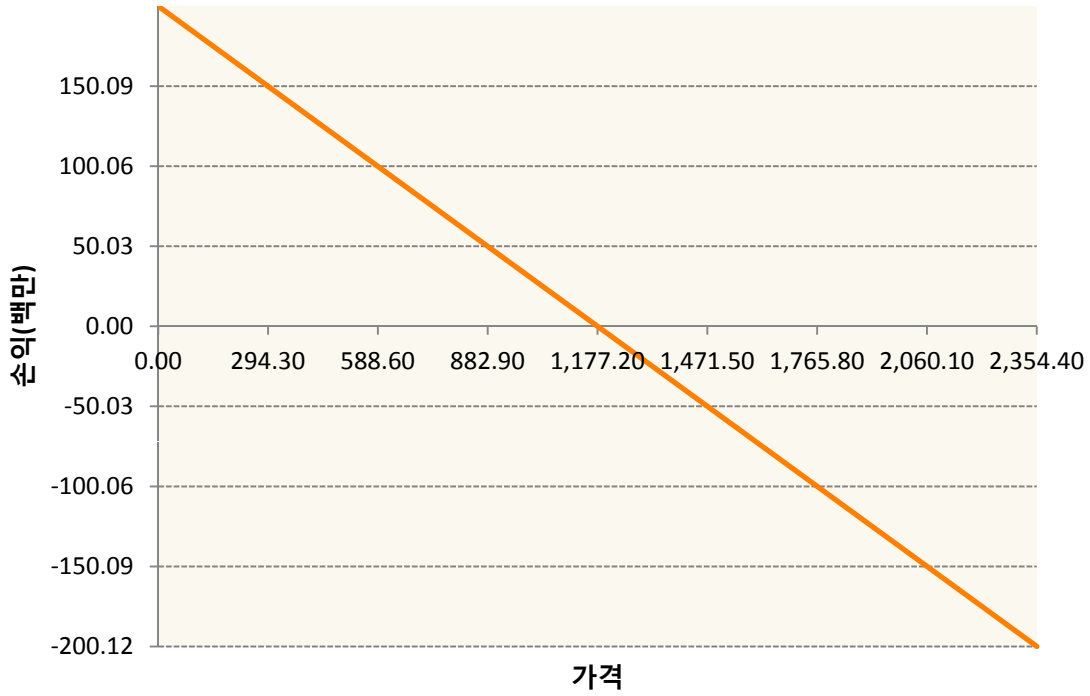
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



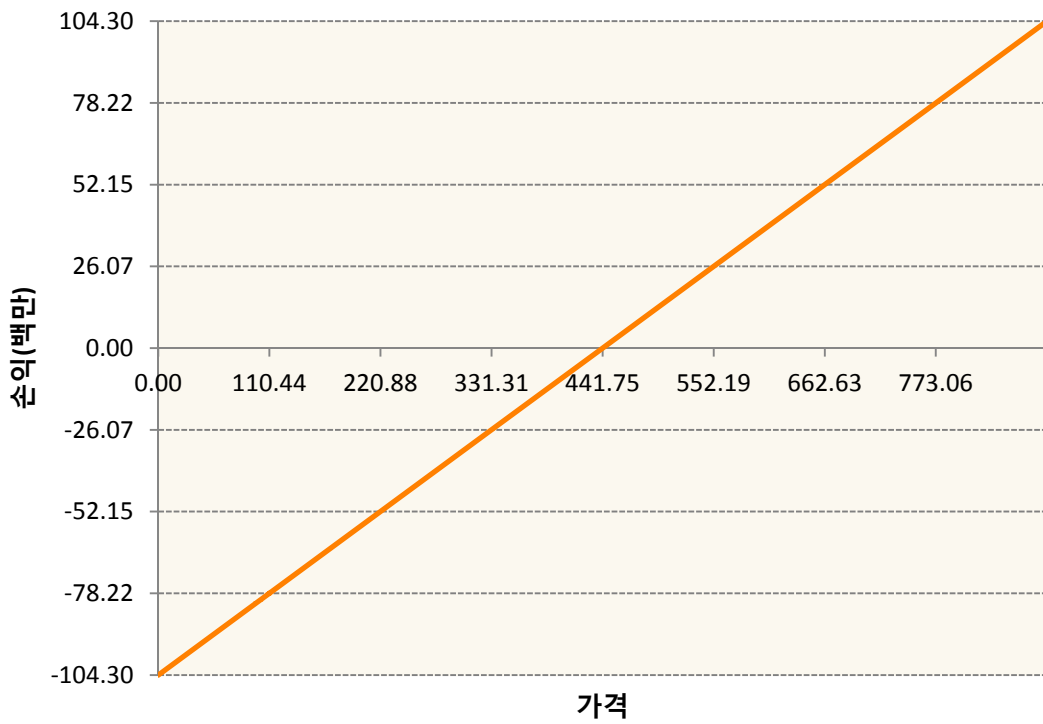




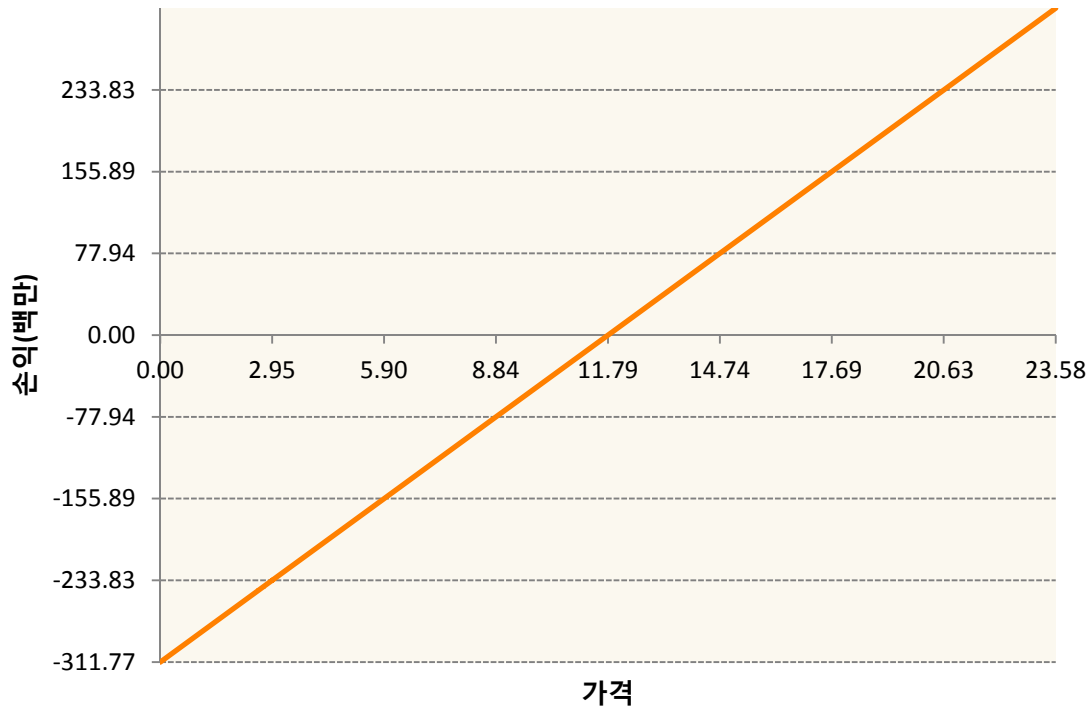
KR4175P80006-2019-08 달러선물



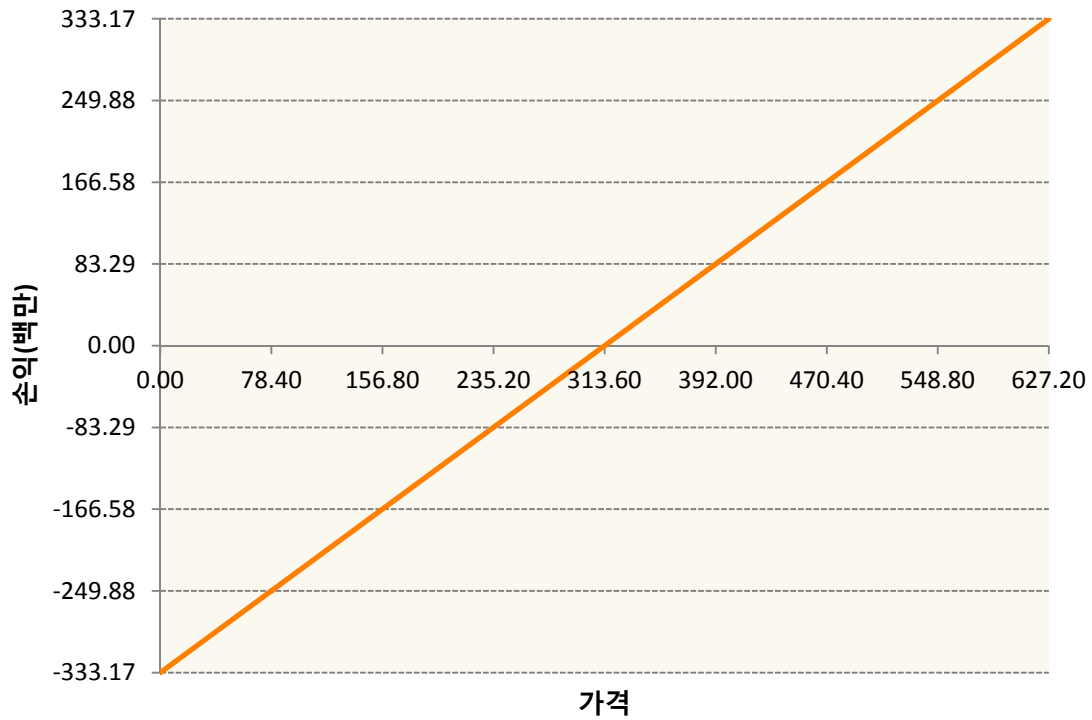
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



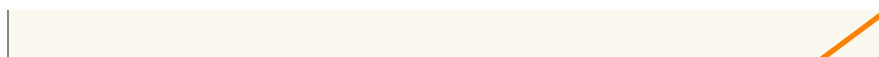
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

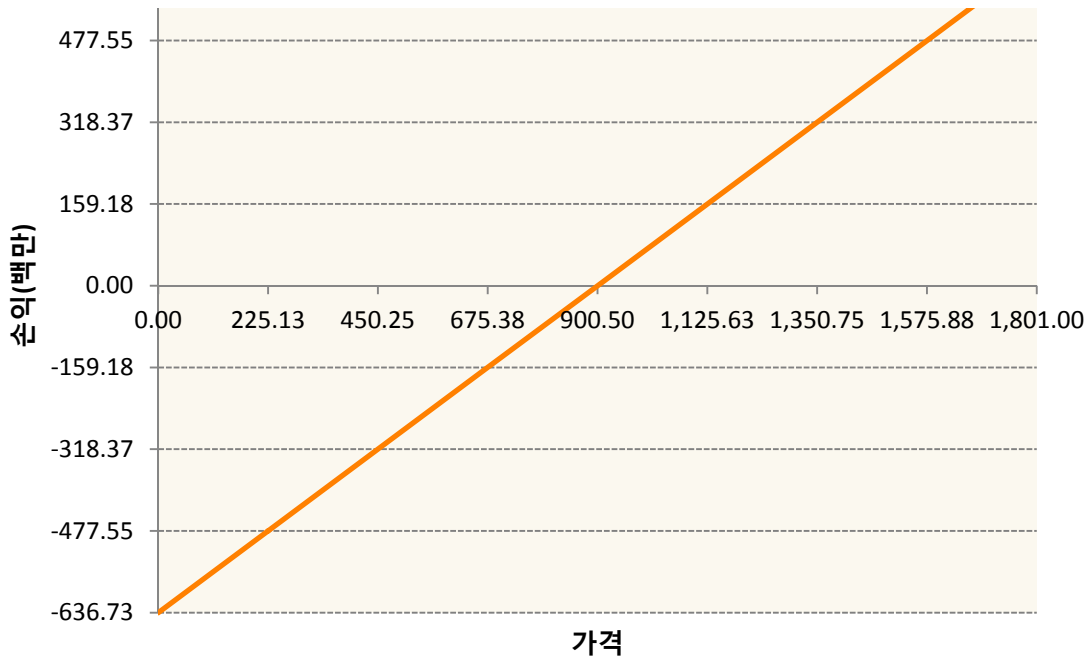


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

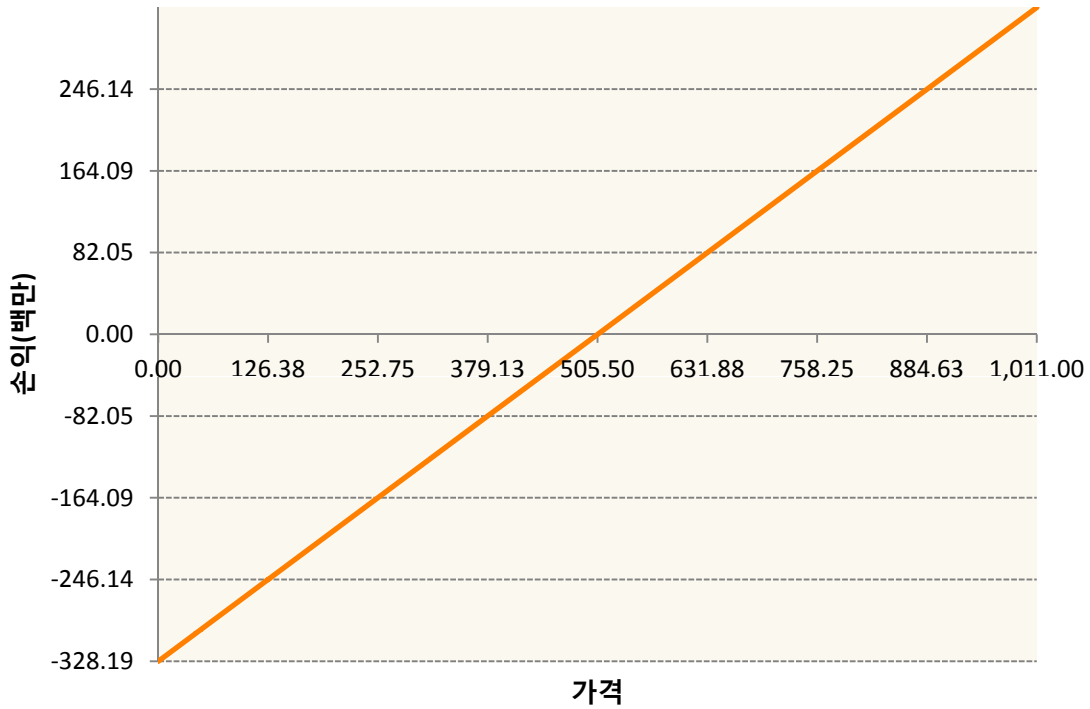


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





WU9-WHEAT FUTURE(CBT) Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	25
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	12
CU9	CORN FUTURE Sep19	56
KCU9	COFFEE 'C' FUTURE Sep19	19
KR4175P800	2019-08 달러선물	16

KWU9	KC HRW WHEAT FUT Sep19	8
SBV9	SUGAR #11 (WORLD) Oct19	25
SMZ9	SOYBEAN MEAL FUTR Dec19	27
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	51
WU9	WHEAT FUTURE(CBT) Sep19	26

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

(단위:백만원)

274