

공시일	2019-08-02
기준일	2019-08-01

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)

89

공시일	2019-08-02
기준일	2019-08-01

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

1,170

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

659

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-02
기준일	2019-08-01

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)	380
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	139

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

836

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-02
기준일	2019-08-01

유로인덱스모(주식-파생형)

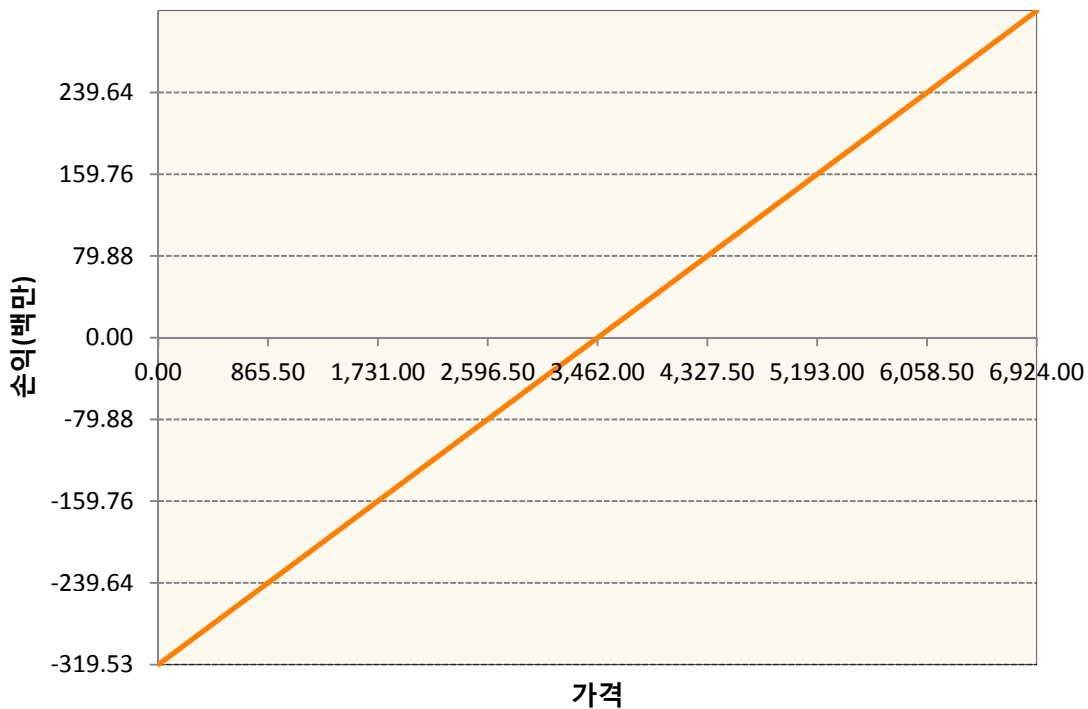
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	320	0	320	

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	2019-08-02
기준일	2019-08-01

차이나인덱스모(주식-파생형)

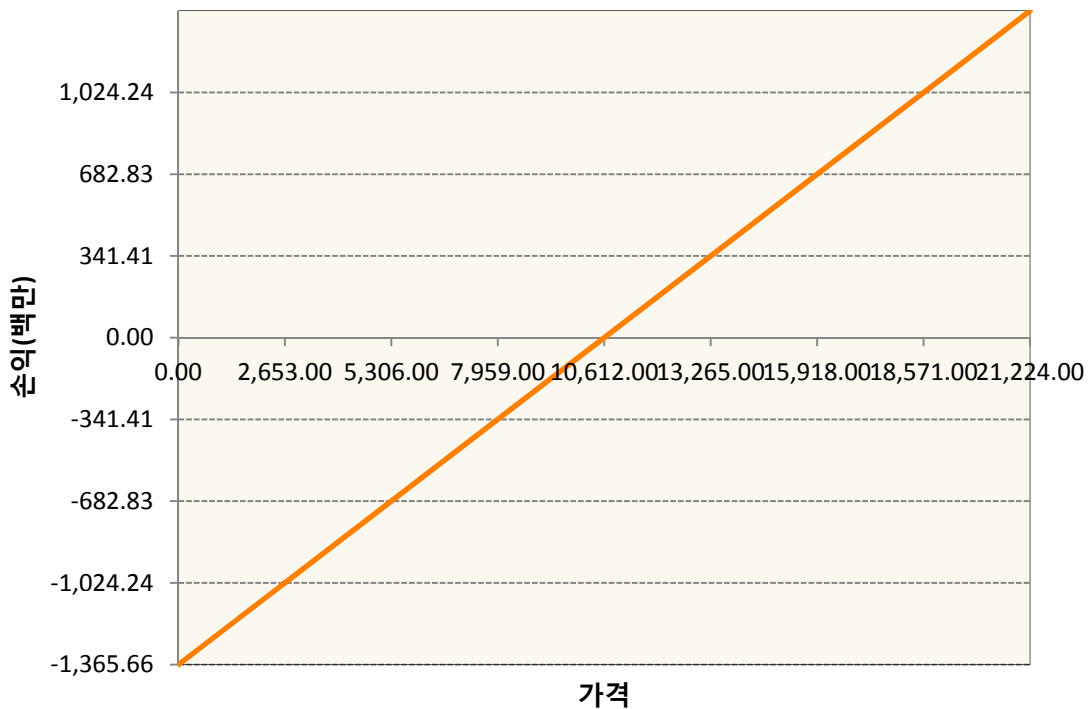
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,366	0	1,366	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCQ9	HSCEI Futures Aug19	109
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

106

공시일	2019-08-02
기준일	2019-08-01

커버드콜모(주식혼합-파생형)

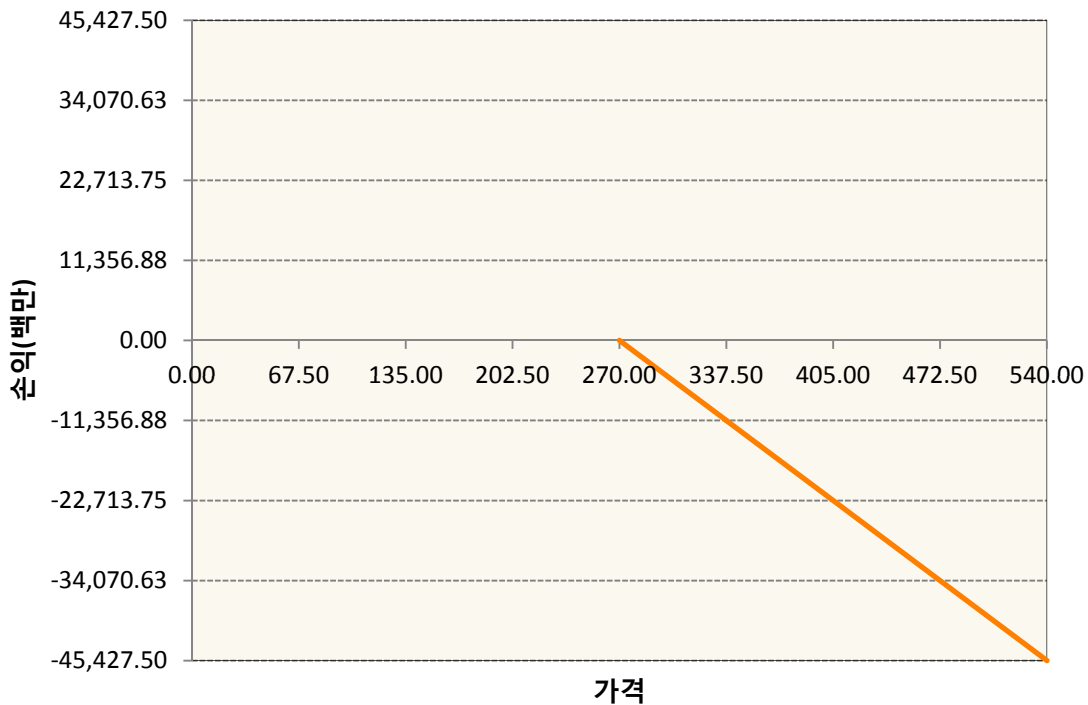
1. 계약금액

(단위:백만원)

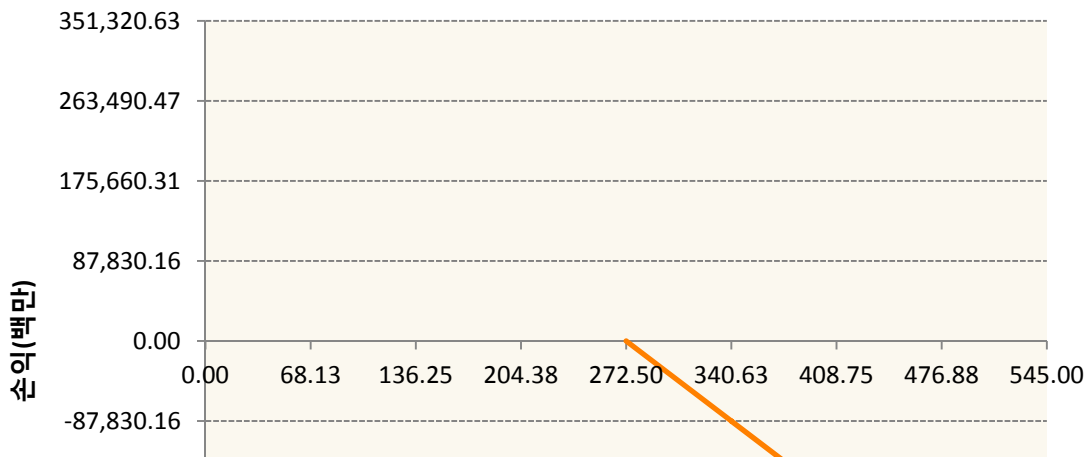
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	1,345	0	1,345	장내
누계	유가증권	옵션	0	581,636	-581,636	장내

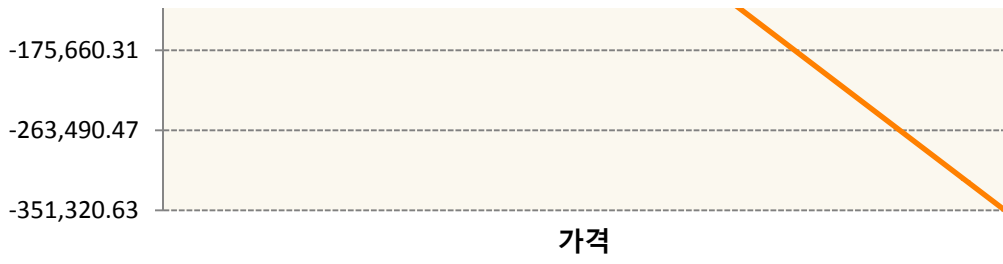
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P82709-2019-08 콜270

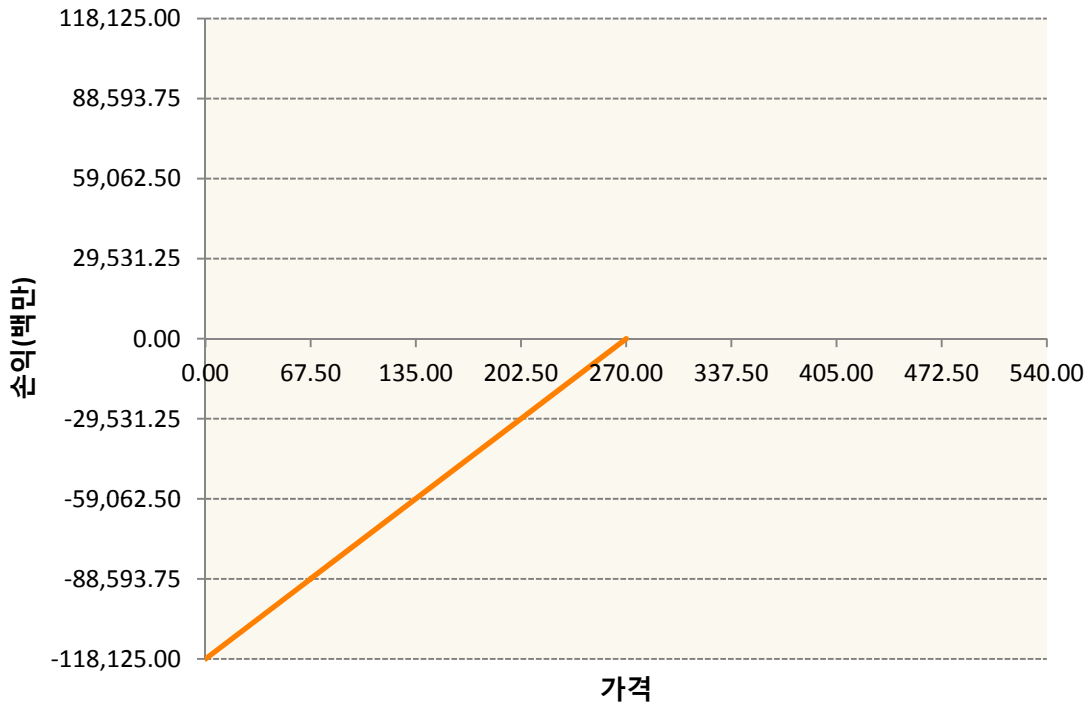


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

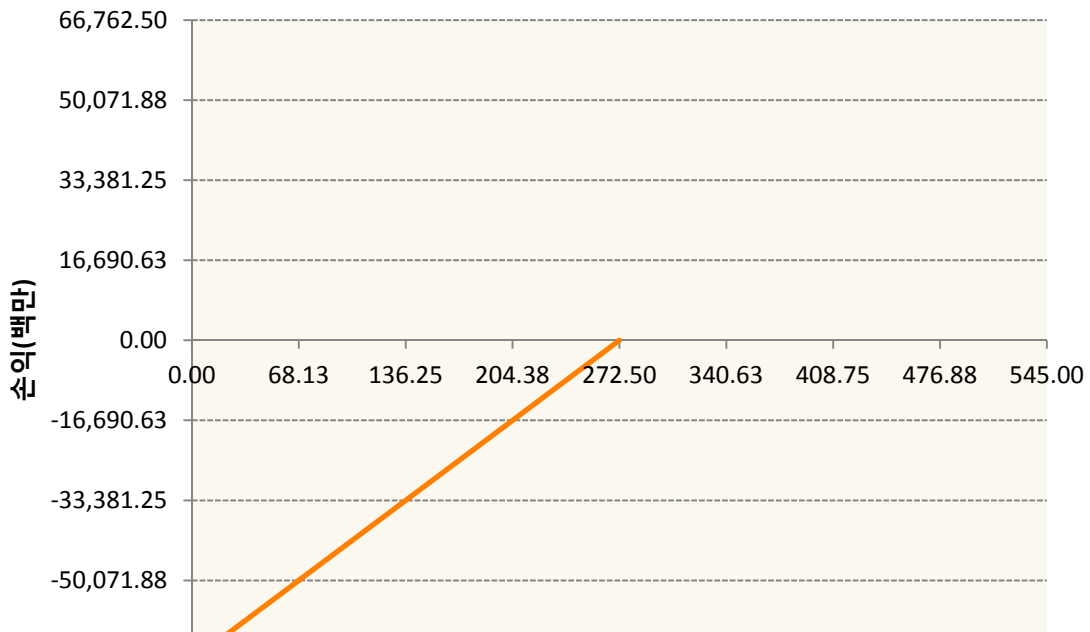




KR4301P82707-2019-08 풋270



KR4301P82723-2019-08 풋272.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P82709 2019-08 콜270							2,598
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	320	320	320	319	318	317	314
-5.33%	319	317	314	309	303	293	282
-2.67%	298	284	266	244	220	193	163
0%	133	90	46	0	-46	-94	-141
2.67%	-417	-465	-514	-564	-614	-664	-715
5.33%	-1,380	-1,402	-1,428	-1,457	-1,489	-1,523	-1,560
8.00%	-2,530	-2,535	-2,542	-2,551	-2,564	-2,579	-2,598
KR4201P82725 2019-08 콜272.5							17,865
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,591	1,591	1,591	1,589	1,585	1,578	1,566
-5.33%	1,589	1,584	1,573	1,553	1,522	1,477	1,418
-2.67%	1,523	1,462	1,377	1,267	1,134	978	802
0%	827	571	294	0	-308	-627	-955
2.67%	-2,186	-2,587	-2,988	-3,388	-3,789	-4,190	-4,591
5.33%	-8,587	-8,839	-9,114	-9,407	-9,715	-10,035	-10,366
8.00%	-17,079	-17,147	-17,241	-17,361	-17,507	-17,675	-17,865
KR4301P82707 2019-08 풋270							8,985
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,985	-8,985	-8,985	-8,985	-8,985	-8,985	-8,985
-5.33%	-5,886	-5,887	-5,887	-5,887	-5,887	-5,888	-5,890
-2.67%	-2,789	-2,792	-2,797	-2,805	-2,817	-2,832	-2,851
0%	165	114	59	0	-62	-127	-193
2.67%	1,912	1,844	1,773	1,700	1,625	1,550	1,474
5.33%	2,197	2,189	2,176	2,159	2,137	2,111	2,080
8.00%	2,205	2,204	2,204	2,203	2,201	2,198	2,193
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							5,130
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,130	-5,130	-5,130	-5,130	-5,130	-5,130	-5,130
-5.33%	-3,395	-3,395	-3,395	-3,395	-3,395	-3,395	-3,395
-2.67%	-1,659	-1,660	-1,661	-1,662	-1,665	-1,668	-1,674
0%	53	38	21	0	-23	-49	-77
2.67%	1,360	1,314	1,267	1,221	1,174	1,128	1,081

5.33%	1,729	1,716	1,699	1,679	1,657	1,632	1,605
8.00%	1,749	1,748	1,747	1,745	1,743	1,738	1,732

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

(단위:백만원)

37,062

공시일	2019-08-02
기준일	2019-08-01

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

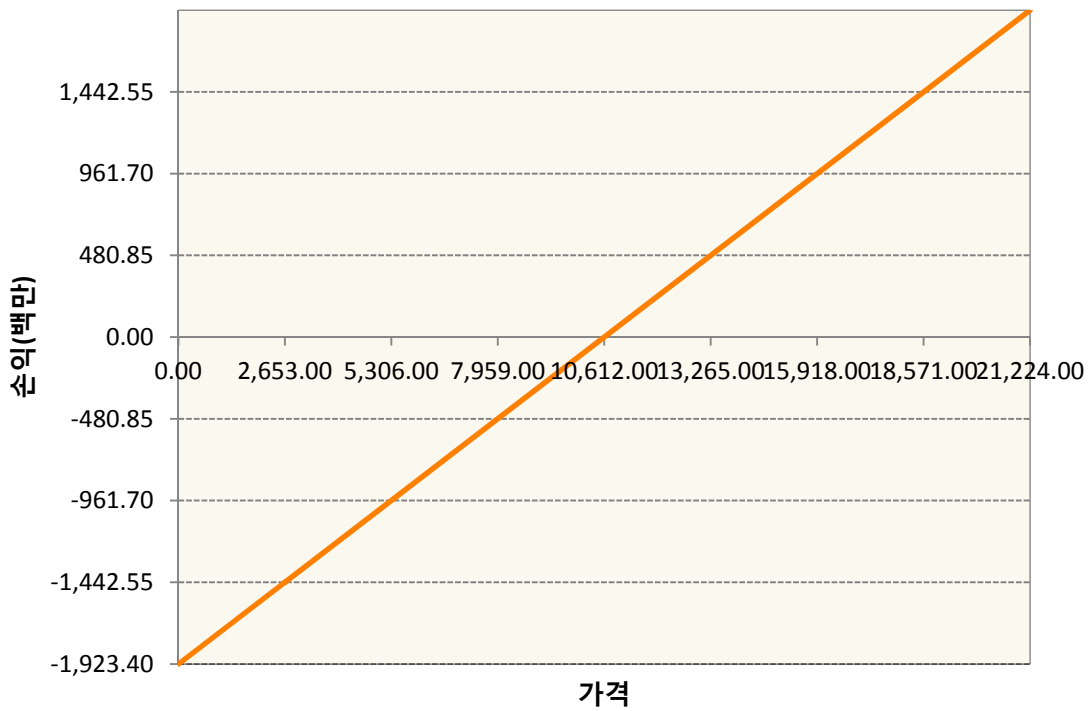
1. 계약금액

(단위:백만원)

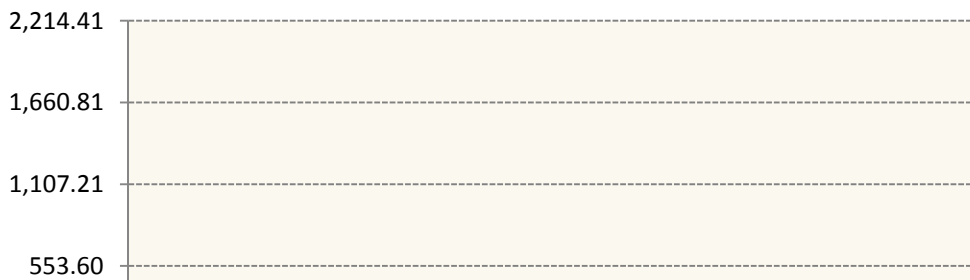
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,923	0	1,923	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,422	-5,422	장내
누계	통화	선도	152	3,189	-3,038	장외

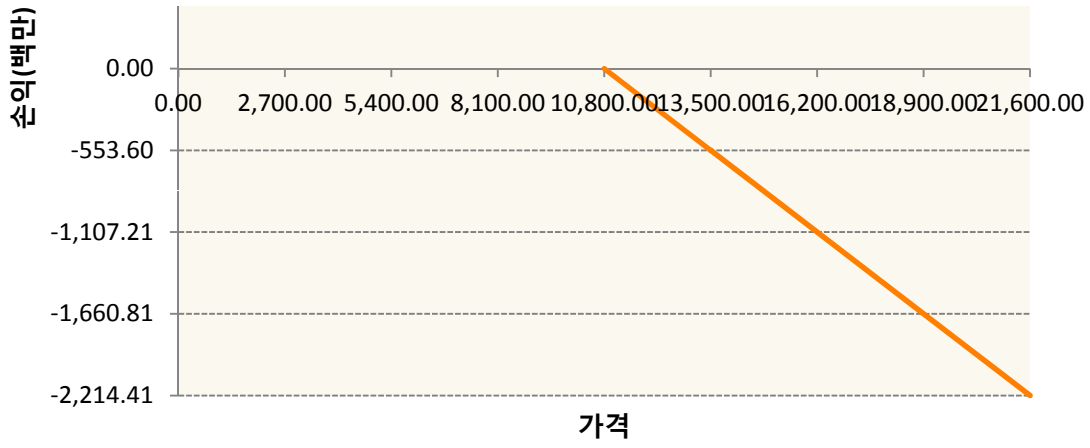
2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19

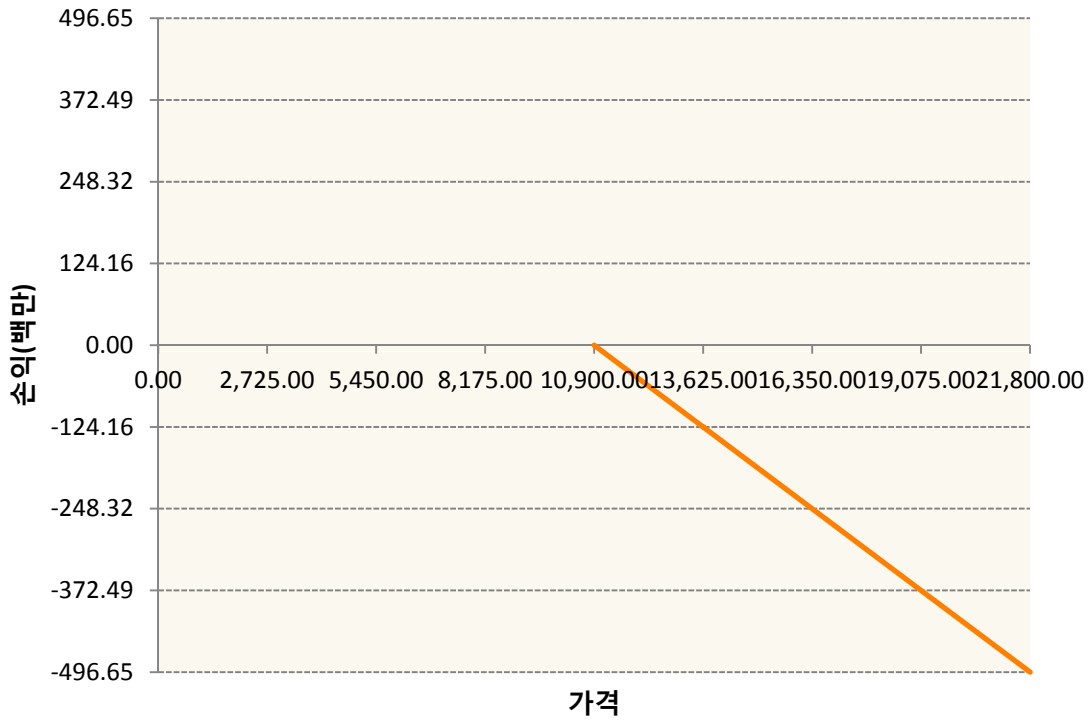


OHHIQ9-C108-HSCEI

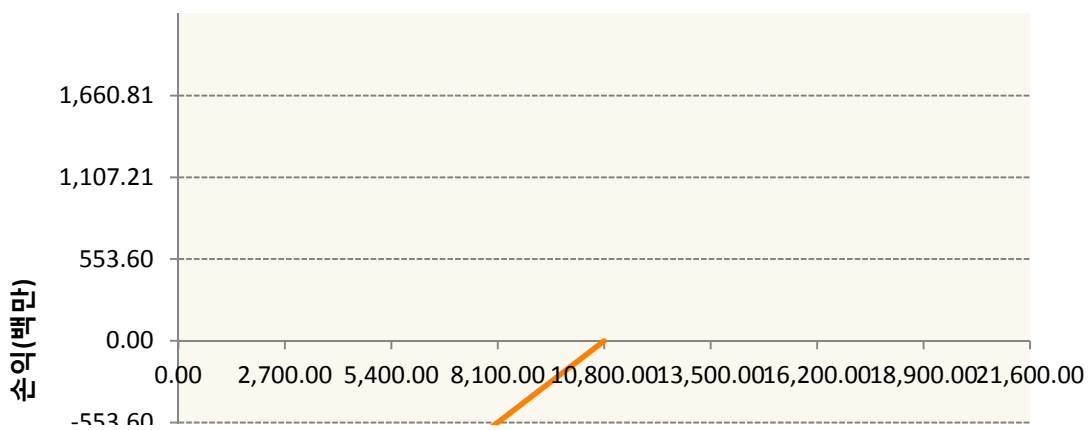


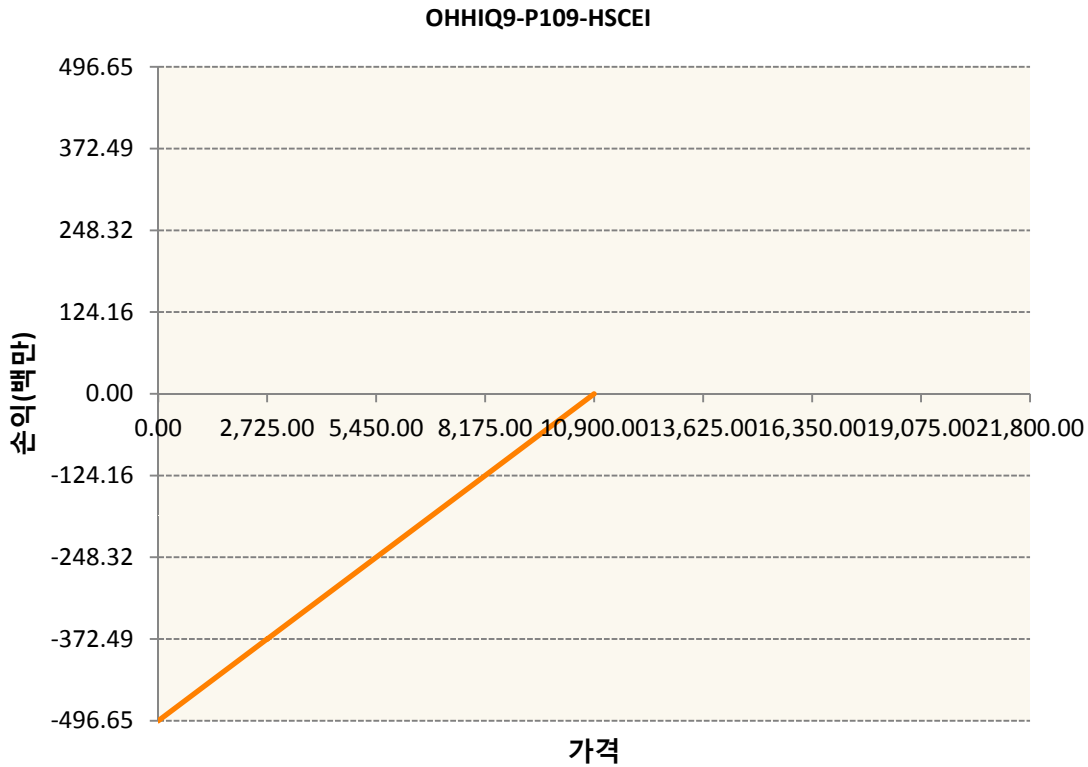


OHHIQ9-C109-HSCEI



OHHIQ9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	255
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E	12
HCQ9 HSCEI Futures Aug19	154
OHHIQ9-C1(HSCEI	177
OHHIQ9-C1(HSCEI	40
OHHIQ9-P1(HSCEI	177
OHHIQ9-P1(HSCEI	40

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	657

공시일	2019-08-02
기준일	2019-08-01

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

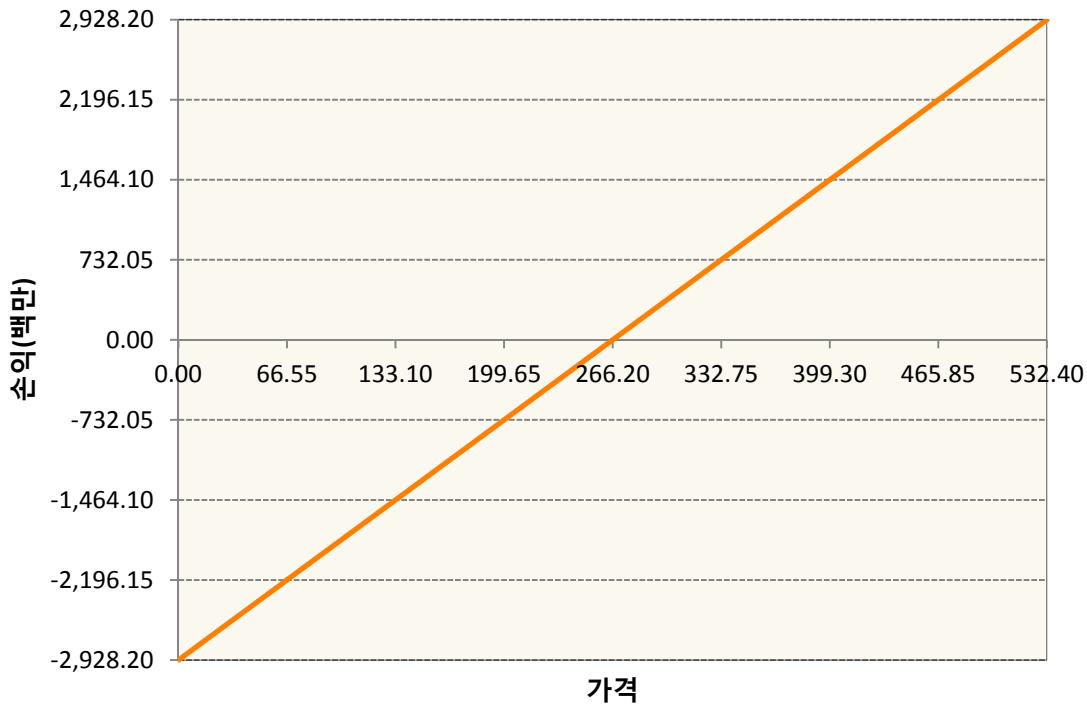
1. 계약금액

(단위:백만원)

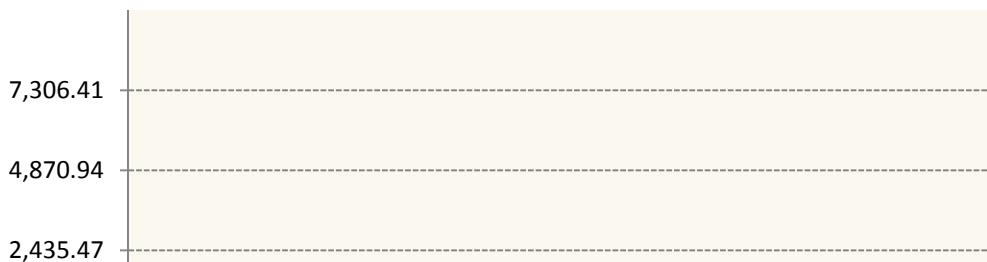
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,928	0	2,928	장내
누계	유가증권	스왑	18,836	0	18,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	19,089	-19,089	장내

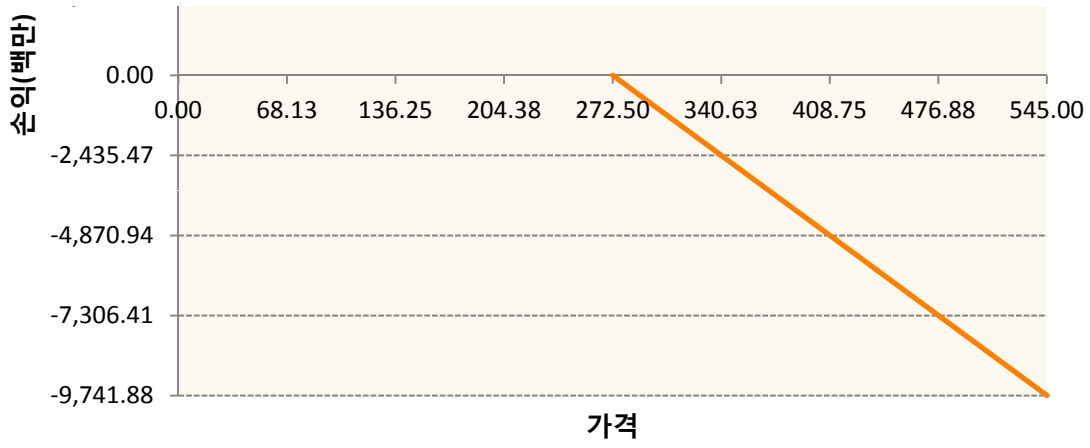
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

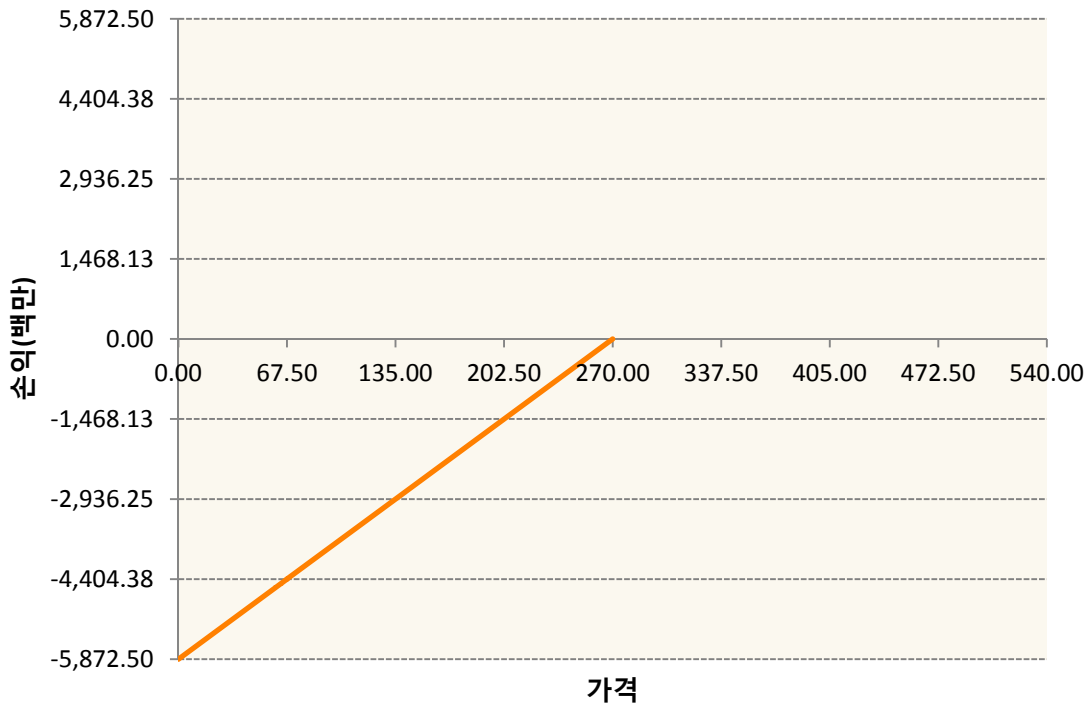


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

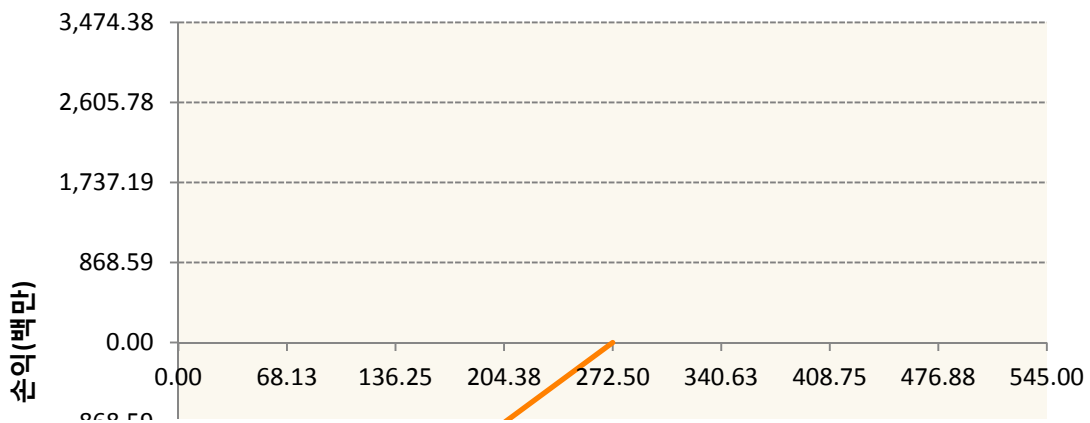




KR4301P82707-2019-08 풋270



KR4301P82723-2019-08 풋272.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,025
	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						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						495
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	44	44	44	44	44	44	43
-5.33%	44	44	44	43	42	41	39
-2.67%	42	41	38	35	31	27	22
0%	23	16	8	0	-9	-17	-26
2.67%	-61	-72	-83	-94	-105	-116	-127
5.33%	-238	-245	-253	-261	-269	-278	-287
8.00%	-474	-475	-478	-481	-485	-490	-495
KR4301P82707 2019-08 풋270							447
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-447	-447	-447	-447	-447	-447	-447
-5.33%	-293	-293	-293	-293	-293	-293	-293
-2.67%	-139	-139	-139	-139	-140	-141	-142
0%	8	6	3	0	-3	-6	-10
2.67%	95	92	88	85	81	77	73
5.33%	109	109	108	107	106	105	103
8.00%	110	110	110	110	109	109	109
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							267
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-267	-267	-267	-267	-267	-267	-267
-5.33%	-177	-177	-177	-177	-177	-177	-177
-2.67%	-86	-86	-86	-86	-87	-87	-87
0%	3	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	71	68	66	64	61	59	56
5.33%	90	89	88	87	86	85	84
8.00%	91	91	91	91	91	90	90

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

(단위:백만원)

3,188

공시일	2019-08-02
기준일	2019-08-01

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

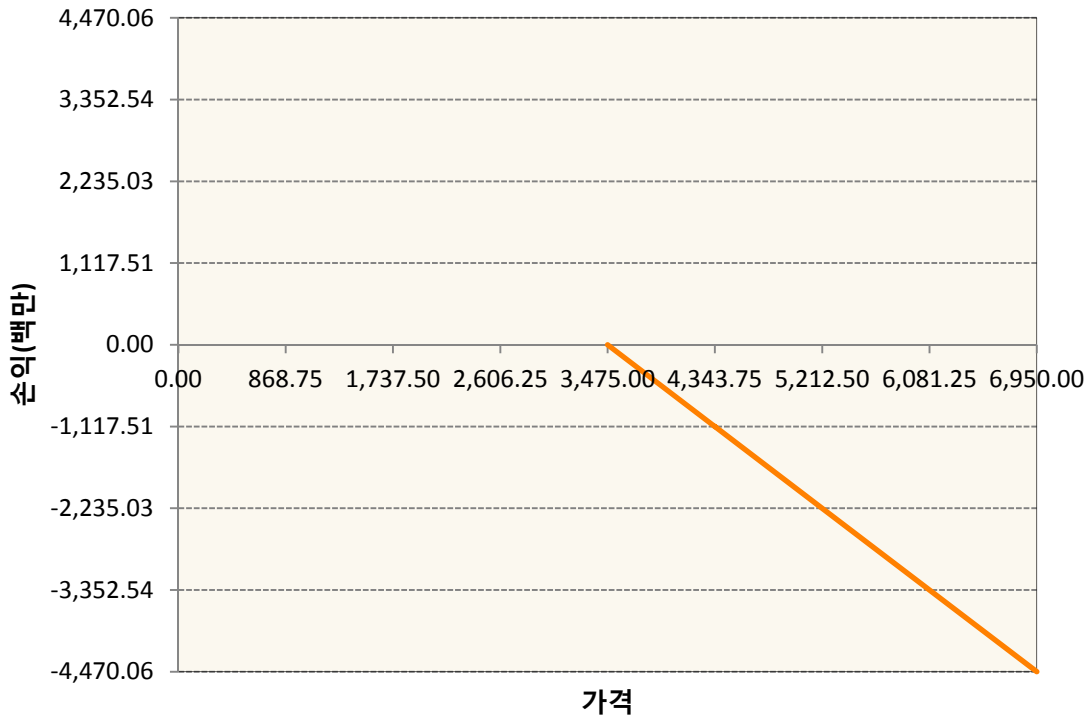
1. 계약금액

(단위:백만원)

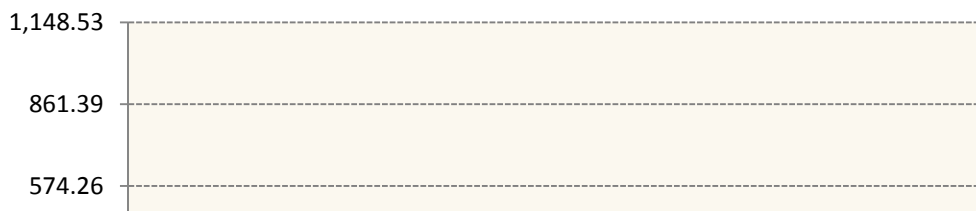
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,700	0	2,700	
누계	유가증권	스왑	37,481	0	37,481	장외
누계	유가증권	옵션	0	11,237	-11,237	장내
누계	통화	선도	12,076	22,314	-10,238	장외

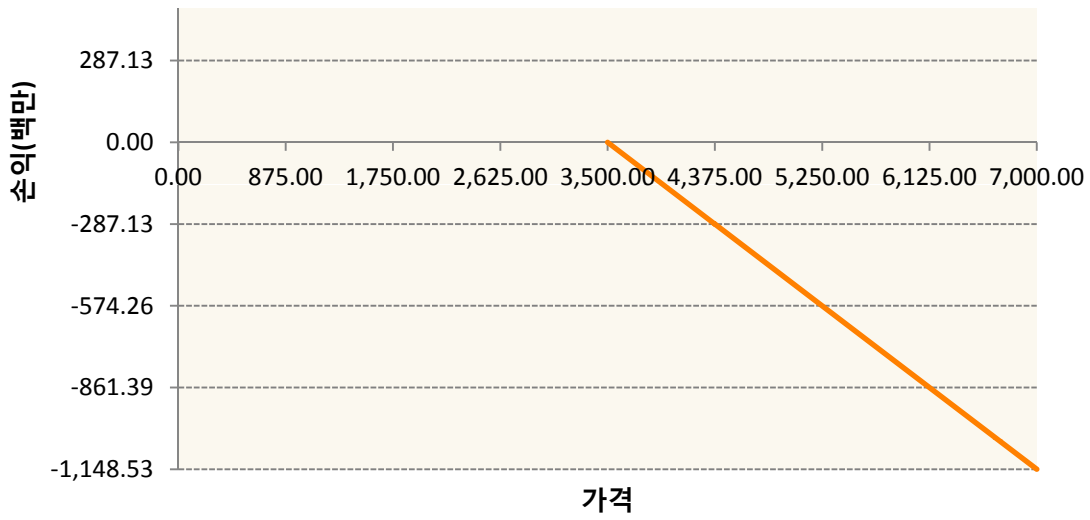
2. 만기시점의 손익구조

OESXQ9-C3475-EURO STOXX 50

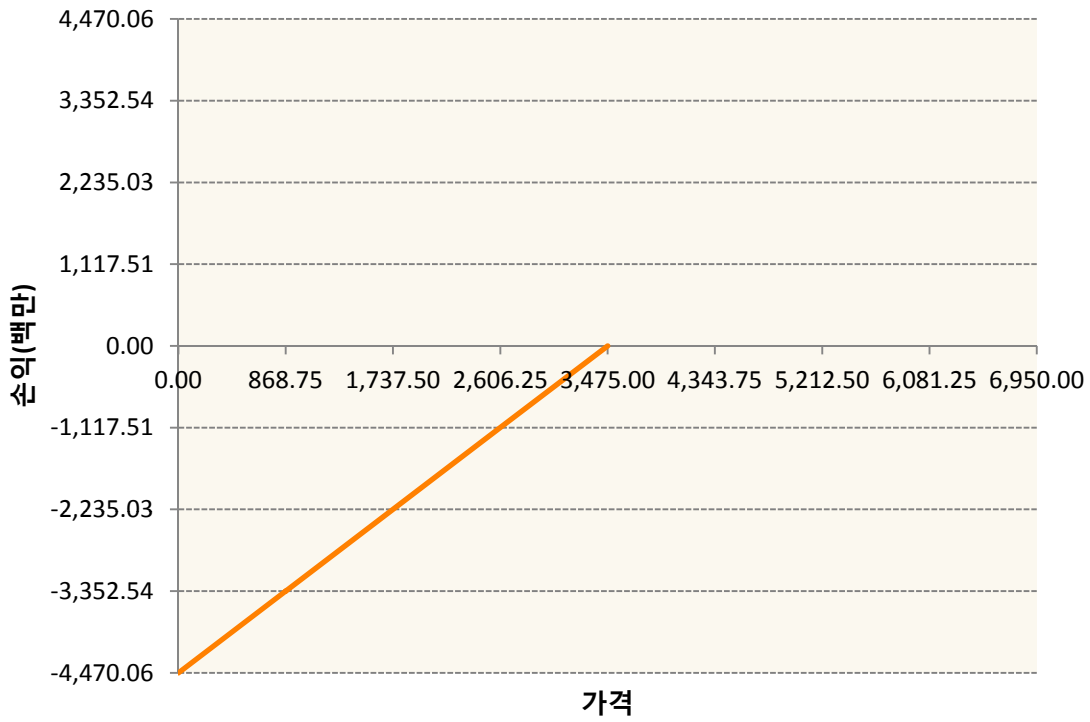


OESXQ9-C3500-EURO STOXX 50

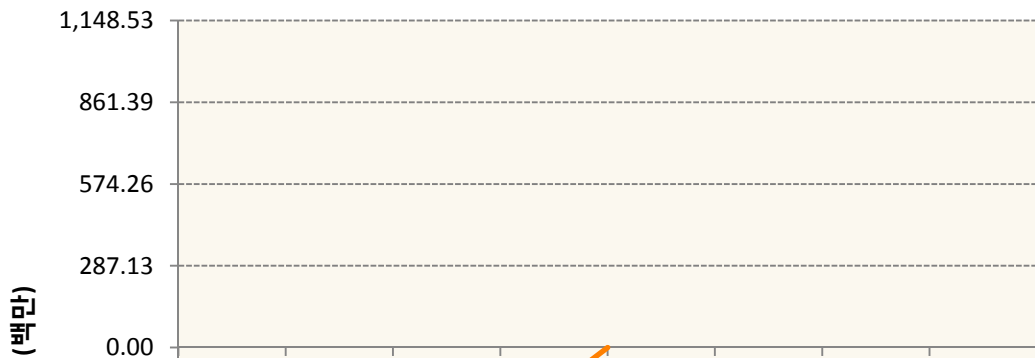


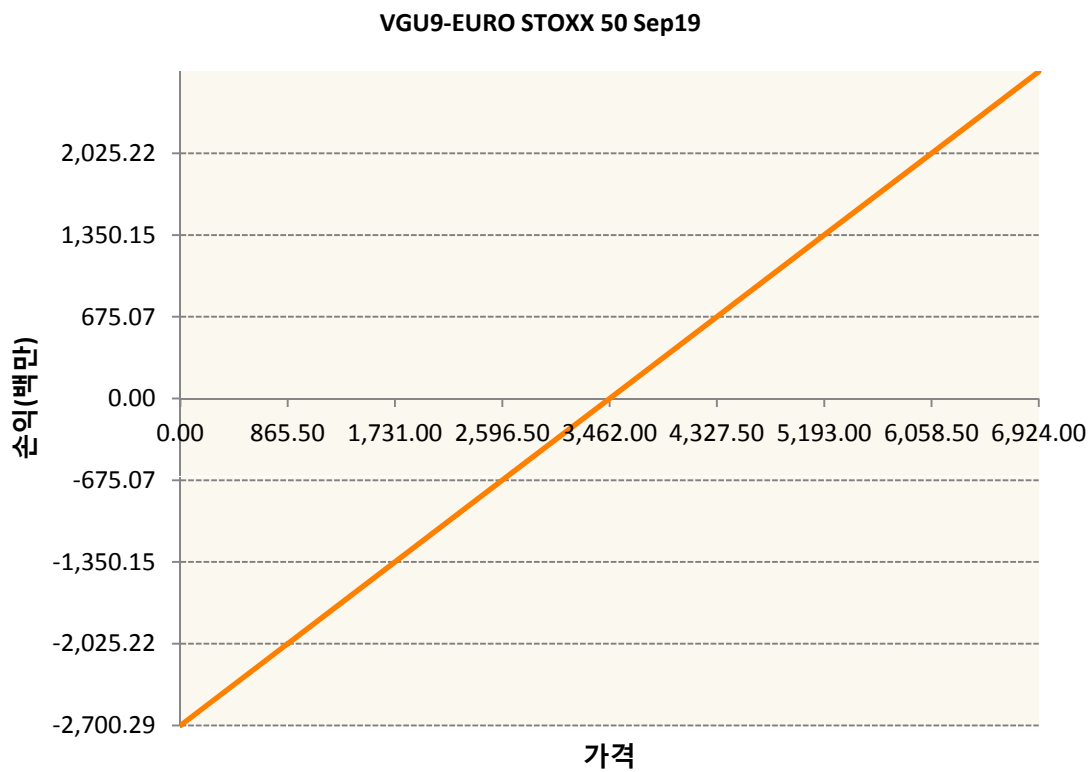
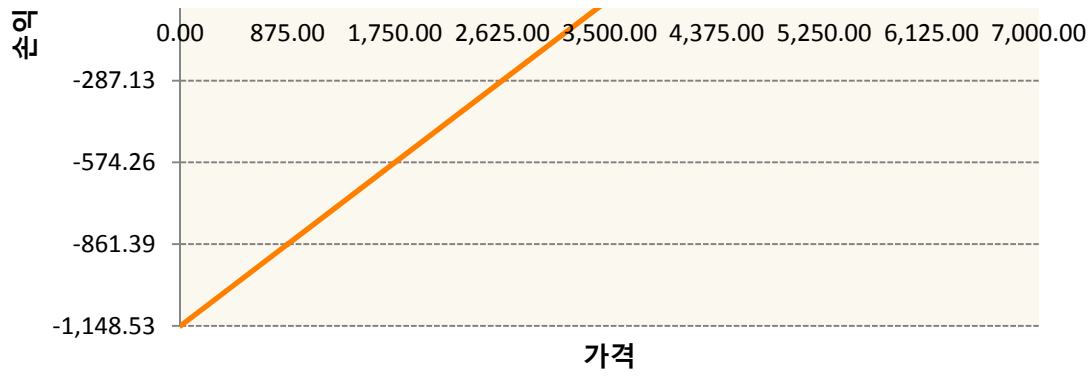


OESXQ9-P3475-EURO STOXX 50



OESXQ9-P3500-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	2
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	420
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E	1,050
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	315
FX21019N01 EUR/KRW 23-08-19E	420
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E	315
FX21019N04 EUR/KRW 27-09-19E	231
OESXQ9-C34 EURO STOXX 50	358
OESXQ9-C35 EURO STOXX 50	92
OESXQ9-P34 EURO STOXX 50	358
OESXQ9-P35 EURO STOXX 50	92

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

(단위:백만원)

2,015

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

(단위:백만원)

991

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

(단위:백만원)

85

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

(단위:백만원)

129

공시일	2019-08-02
기준일	2019-08-01

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

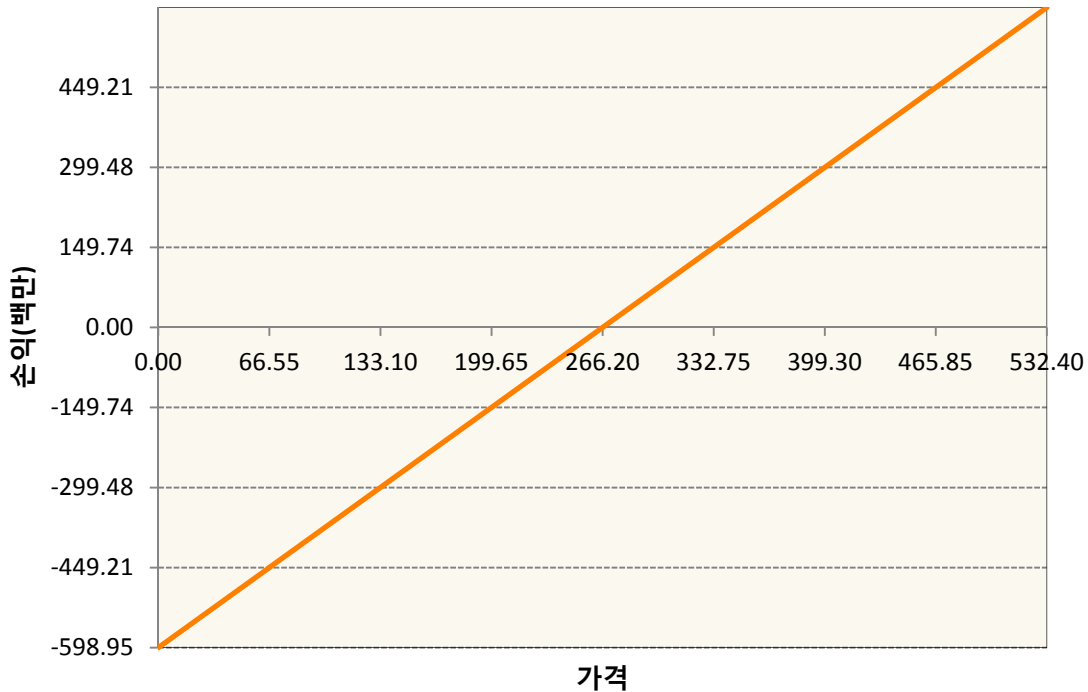
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	599	0	599	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	2019-08-02
기준일	2019-08-01

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

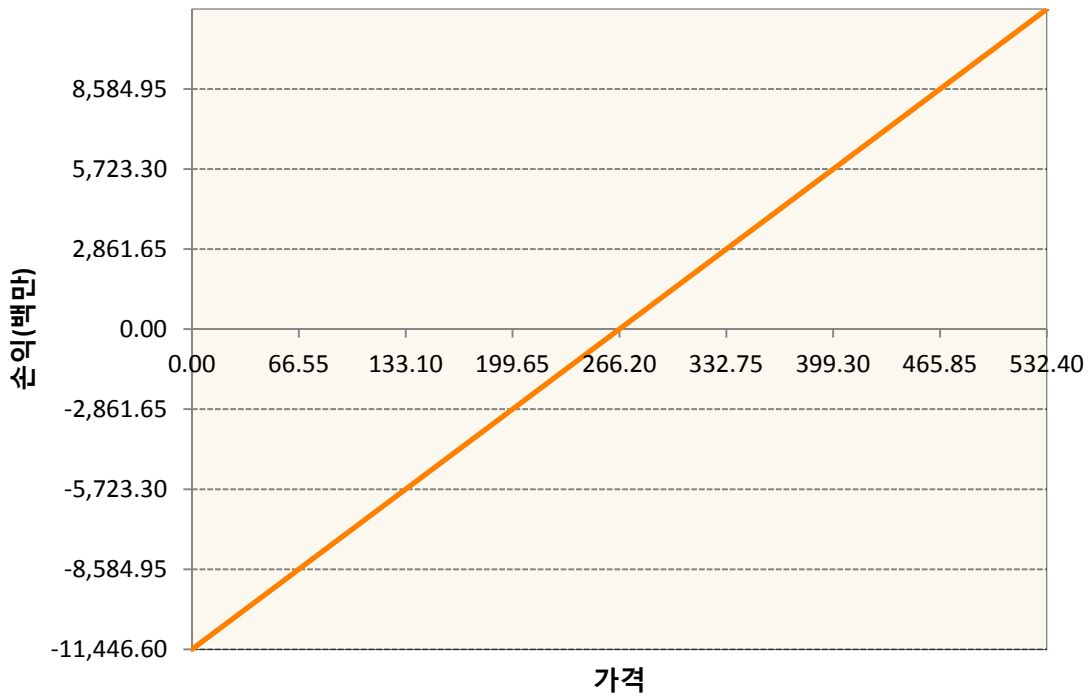
1. 계약금액

(단위:백만원)

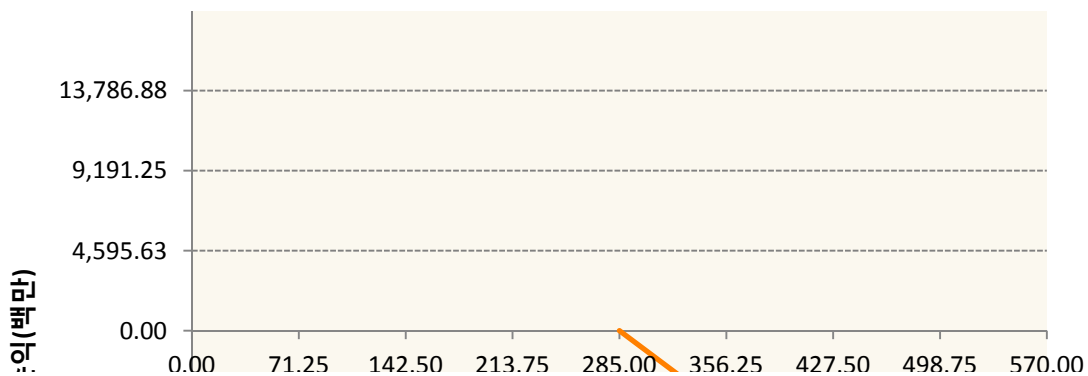
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,447	0	11,447	장내
누계	유가증권	옵션	1,698	21,617	-19,919	장내

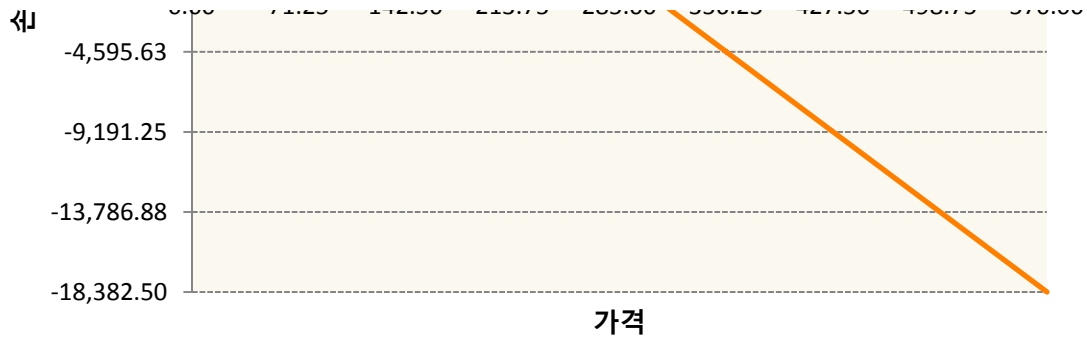
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

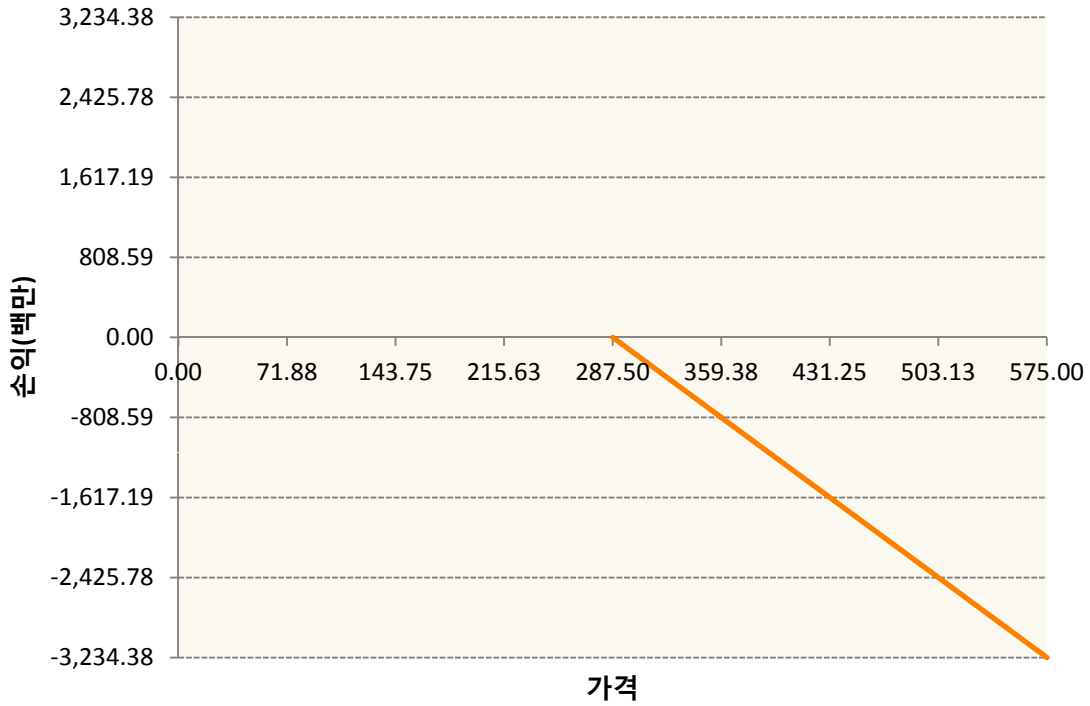


KR4201P82857-2019-08 콜285

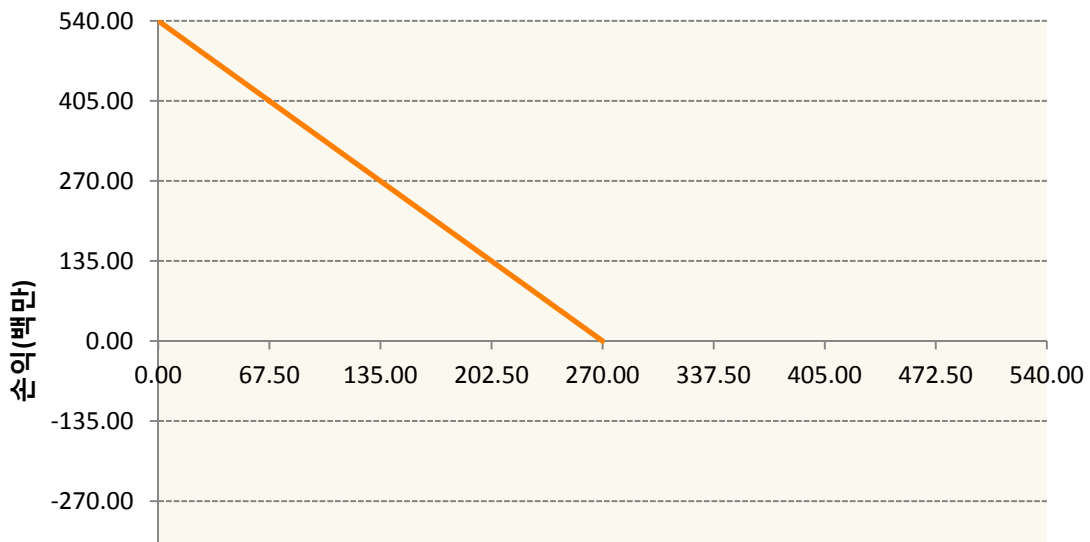


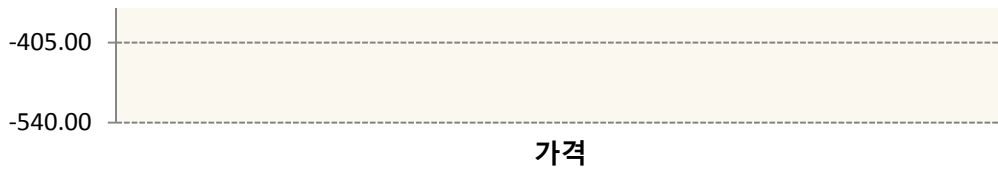


KR4201P82873-2019-08 콜287.5

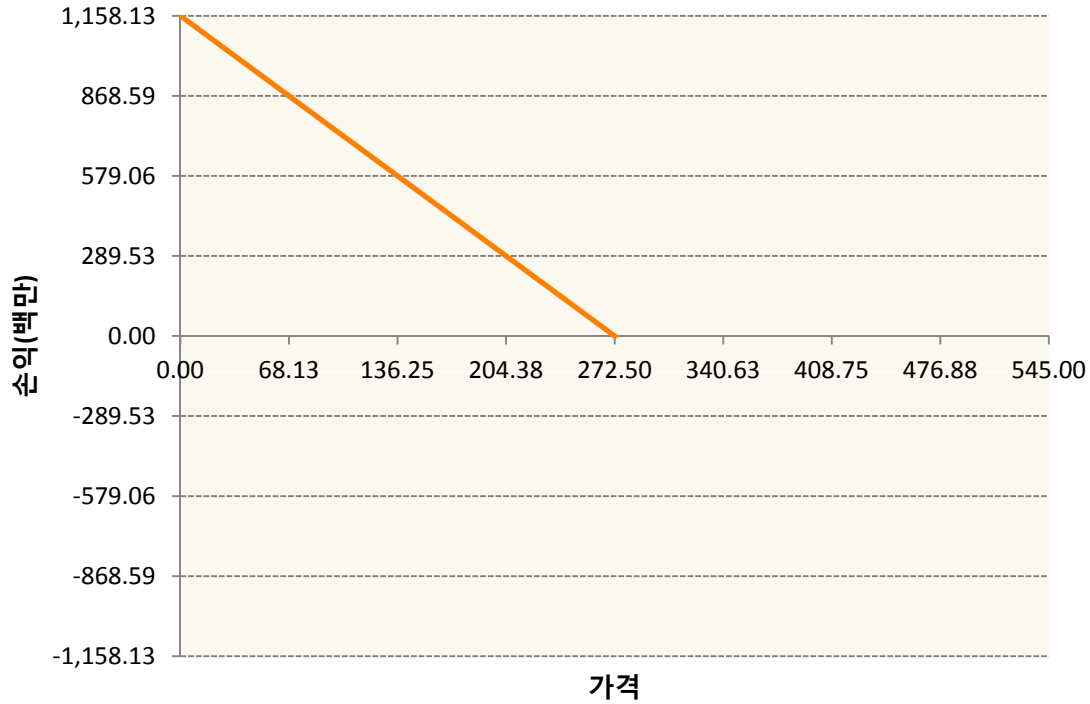


KR4301P82707-2019-08 풋270





KR4301P82723-2019-08 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						914
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-914	-914	-914	-914	-914	-914	-914	
-5.33%	-609	-609	-609	-609	-609	-609	-609	
-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%	609	609	609	609	609	609	609	
8.00%	914	914	914	914	914	914	914	
KR4201P82857		2019-08 콜285						377
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5	5	5	5	5	5	5	
-5.33%	5	5	5	5	5	4	4	
-2.67%	5	5	4	4	4	3	2	

0%	4	3	2	0	-3	-7	-12
2.67%	-4	-9	-16	-25	-34	-45	-57
5.33%	-61	-78	-95	-113	-131	-150	-169
8.00%	-253	-274	-294	-315	-336	-356	-377
KR4201P82873 2019-08 콜287.5							52
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	-1	-1
2.67%	0	-1	-2	-3	-4	-5	-7
5.33%	-6	-8	-10	-13	-16	-19	-22
8.00%	-30	-33	-37	-41	-44	-48	-52
KR4301P82707 2019-08 풋270							41
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	41	41	41	41	41	41	41
-5.33%	27	27	27	27	27	27	27
-2.67%	13	13	13	13	13	13	13
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-9	-8	-8	-8	-7	-7	-7
5.33%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							89
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	89	89	89	89	89	89	89
-5.33%	59	59	59	59	59	59	59
-2.67%	29	29	29	29	29	29	29
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-24	-23	-22	-21	-20	-20	-19
5.33%	-30	-30	-29	-29	-29	-28	-28
8.00%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30

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

(단위:백만원)

1,030

공시일	2019-08-02
기준일	2019-08-01

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	49,317	0	49,317	

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	2019-08-02
기준일	2019-08-01

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	60,264	0	60,264	

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	2019-08-02
기준일	2019-08-01

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	437,150	0	437,150	
누계	통화	선도	0	435,110	-435,110	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E	3,138
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E	2,130
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E	1,711
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E	2,092
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E	133
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	570
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	3,043
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	3,328
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	475
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E	951
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E	2,957
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E	1,654
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E	761
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E	1,902
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E	1,902
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	285
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	95
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	704
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	704
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	285
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	666
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E	2,662
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E	1,331
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E	761
FX21019N04 KRW/USD 03-09-19E	285
FX21019Q00 KRW/USD 03-09-19E	285

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

(단위:백만원)

11,119

공시일	2019-08-02
기준일	2019-08-01

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

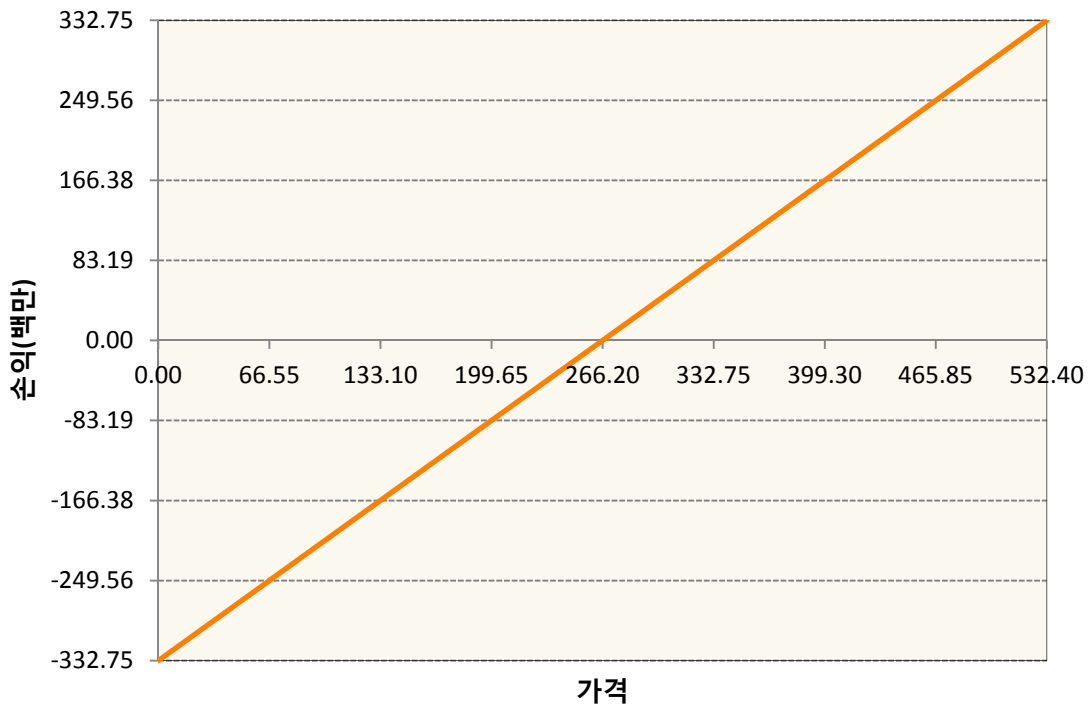
1. 계약금액

(단위:백만원)

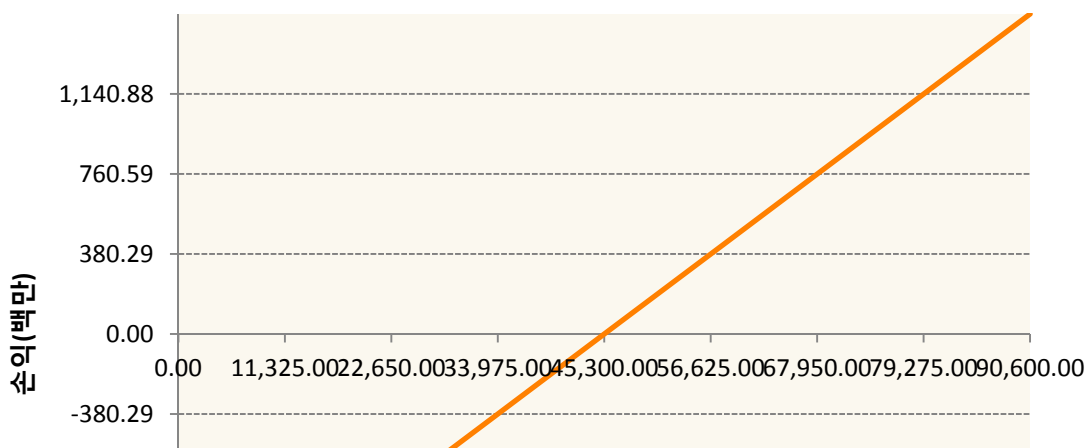
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,854	0	1,854	장내

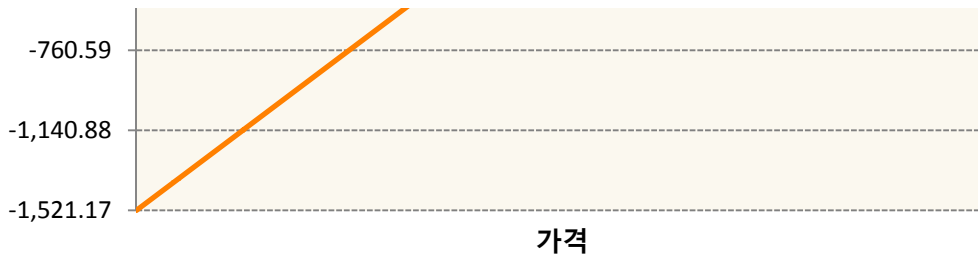
2. 만기시점의 손익구조

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						121
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-121	-121	-121	-121	-121	-121	-121	
-5.33%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81	
-2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	40	40	40	40	40	40	40	
5.33%	81	81	81	81	81	81	81	
8.00%	121	121	121	121	121	121	121	

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

176

공시일	2019-08-02
기준일	2019-08-01

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

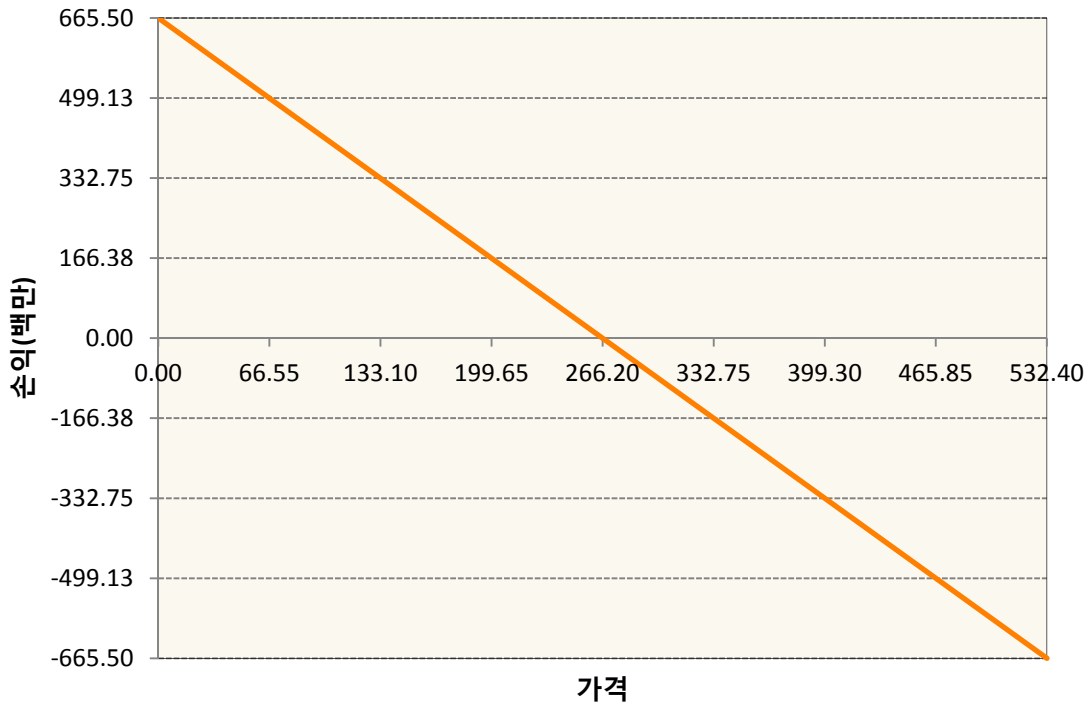
1. 계약금액

(단위:백만원)

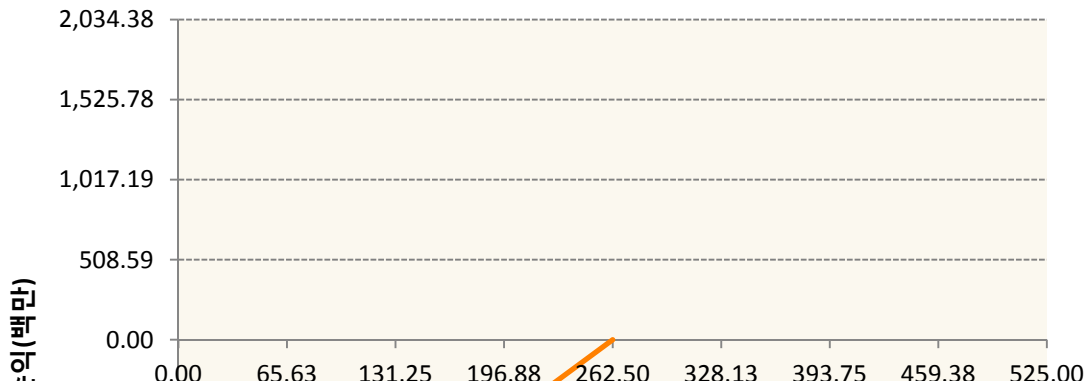
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	66	0	66	장내
누계	유가증권	선물	0	666	-666	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,691	-3,691	장내

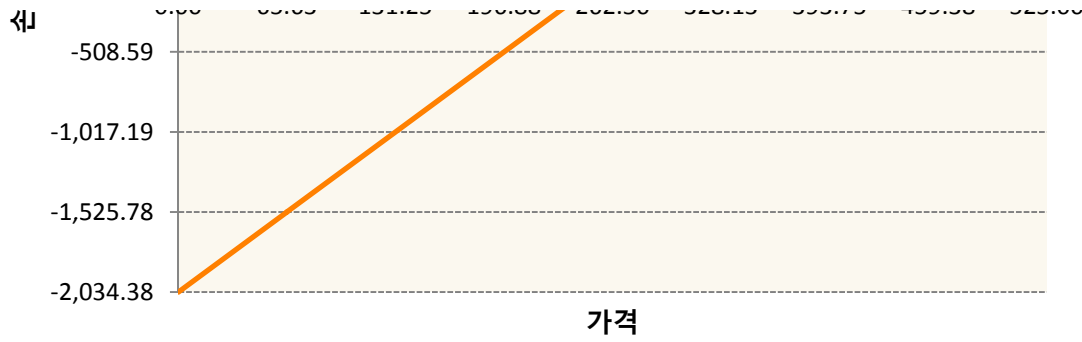
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

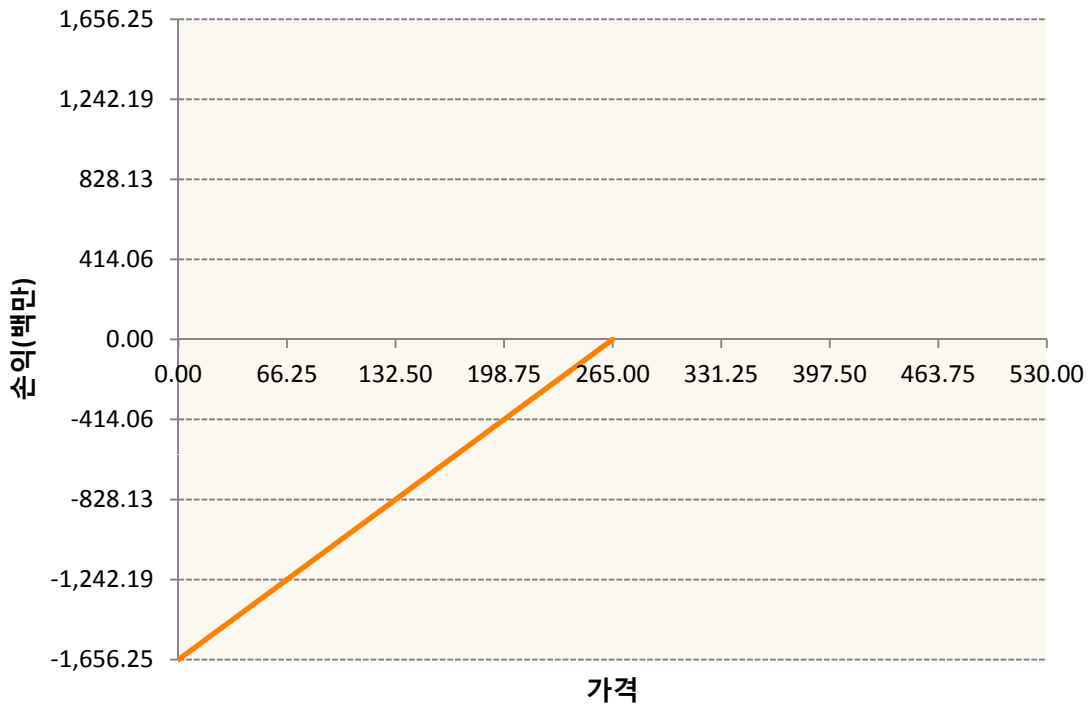


KR4301P82624-2019-08 풋262.5





KR4301P82657-2019-08 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						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%	35	35	35	35	35	35	35	
-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%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	
8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53	
KR4301P82624		2019-08 풋262.5						133
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133
-5.33%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-79
-2.67%	-26	-27	-28	-29	-30	-31	-32
0%	3	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	7	7	7	7	7	6	6
5.33%	8	8	8	8	8	7	7
8.00%	8	8	8	8	8	8	8

KR4301P82657

2019-08 풋265

117

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117
-5.33%	-72	-72	-72	-73	-73	-73	-73
-2.67%	-29	-29	-30	-30	-31	-32	-32
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	12	11	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)

343

공시일	2019-08-02
기준일	2019-08-01

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	18,766	0	18,766	
누계	통화	선도	0	18,422	-18,422	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		989
FX21019N01 KRW/USD 12-08-19E		162
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		323

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

(단위:백만원)

471

공시일	2019-08-02
기준일	2019-08-01

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	374	0	374	장외
누계	통화	선도	0	49	-49	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	30
FX21019N01 KRW/EUR 25-10-19E	4

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

(단위:백만원)

30

공시일	2019-08-02
기준일	2019-08-01

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

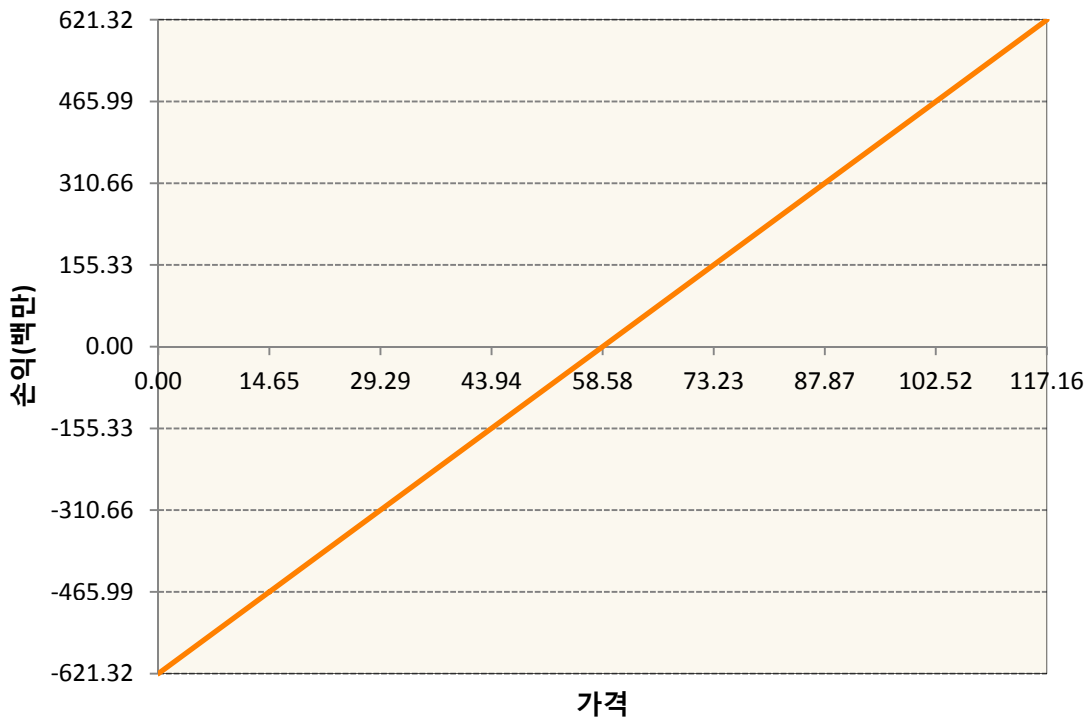
1. 계약금액

(단위:백만원)

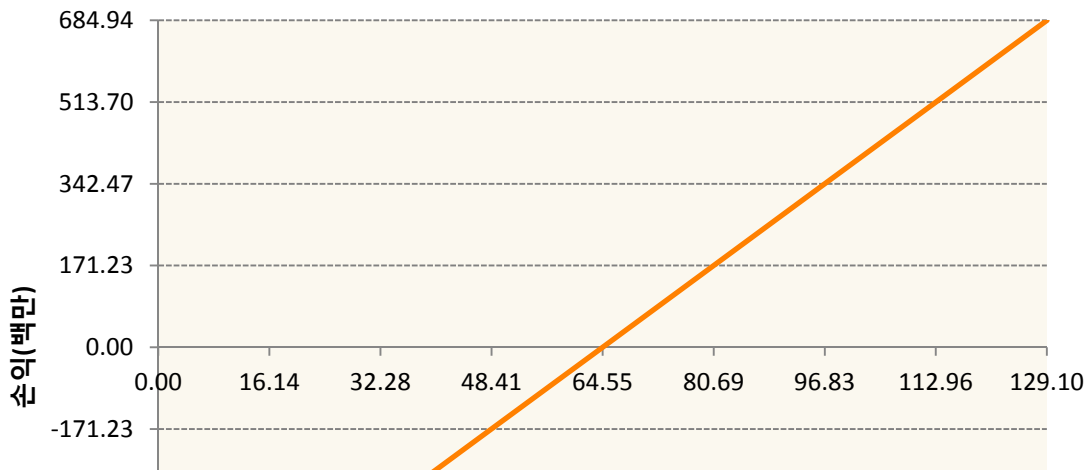
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,591	119	2,472	

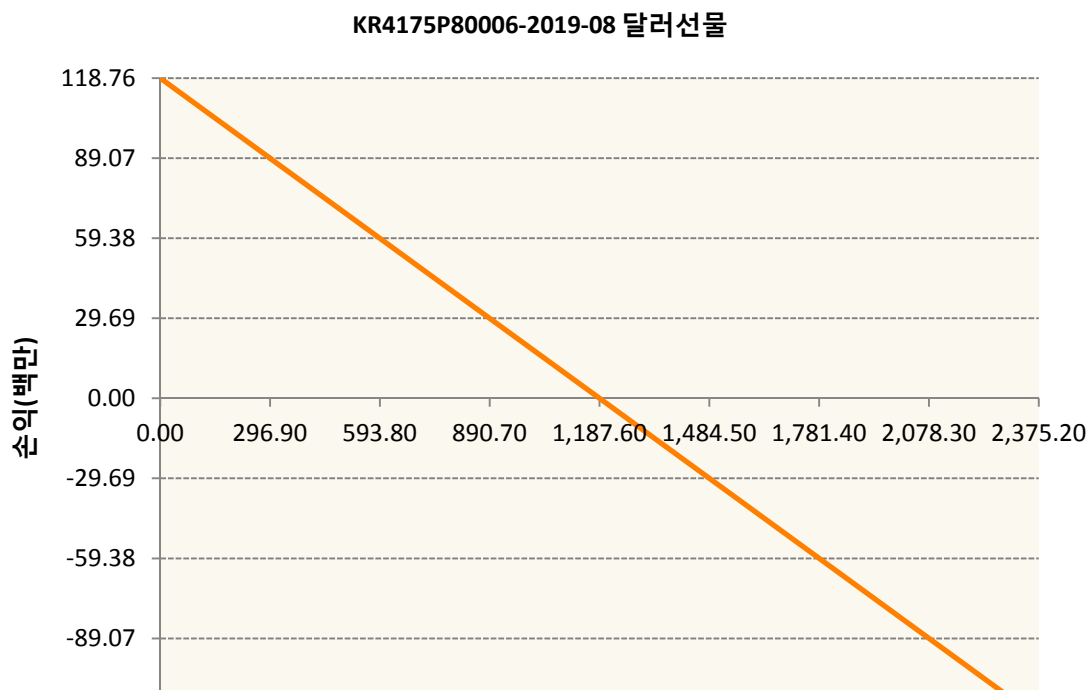
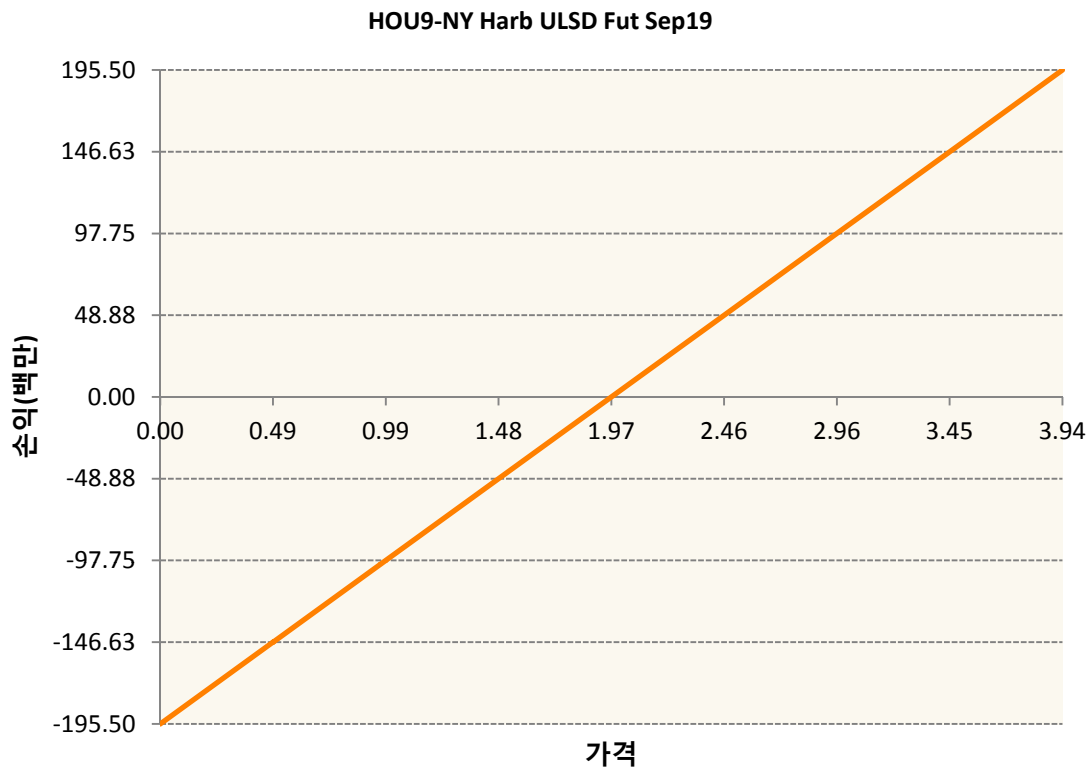
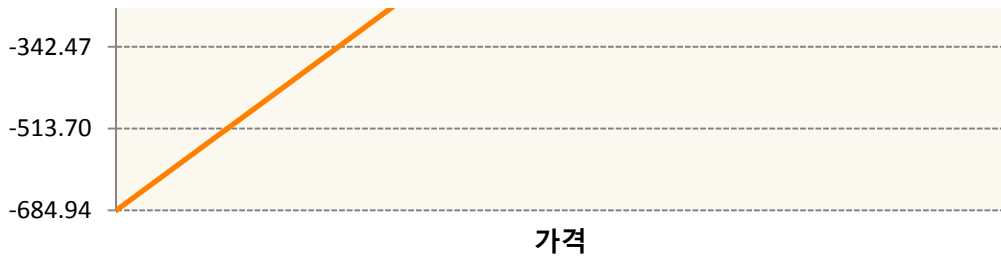
2. 만기시점의 손익구조

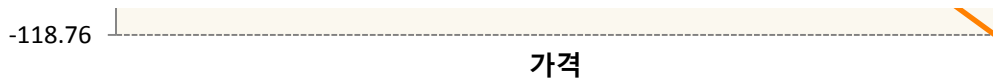
CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19



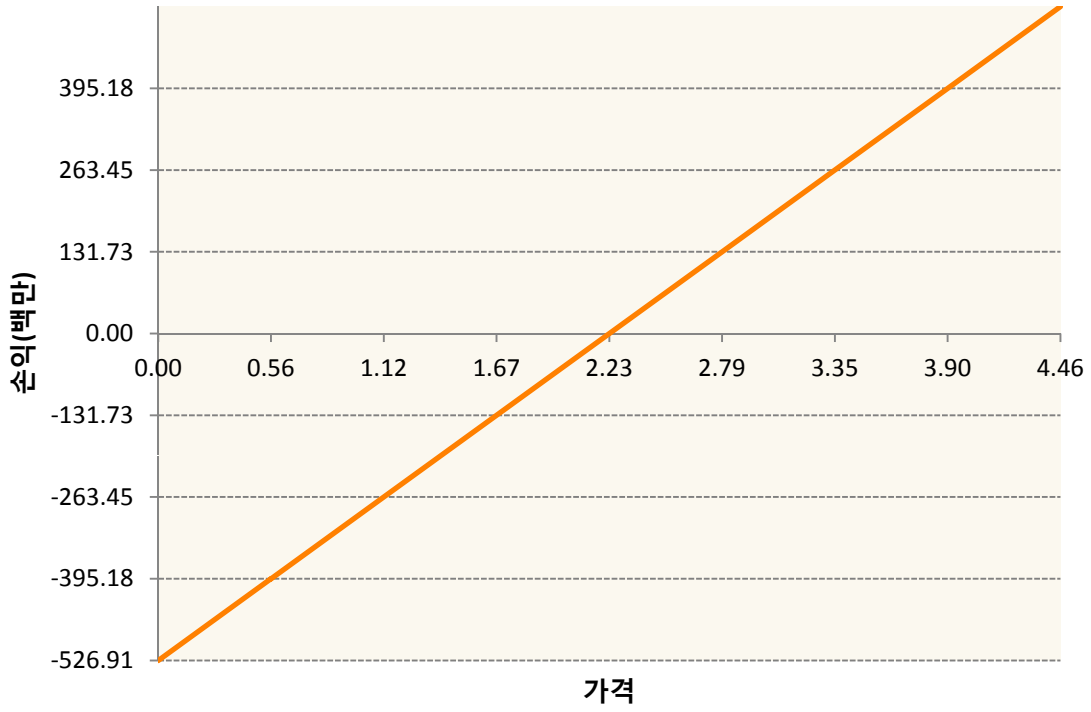
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19



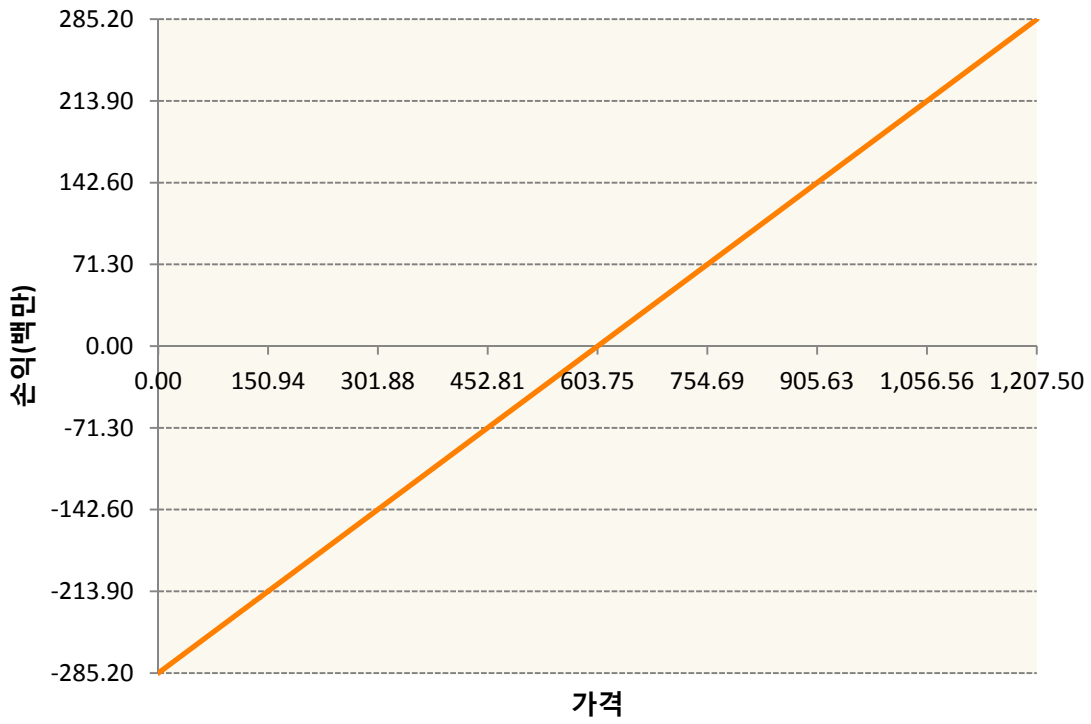




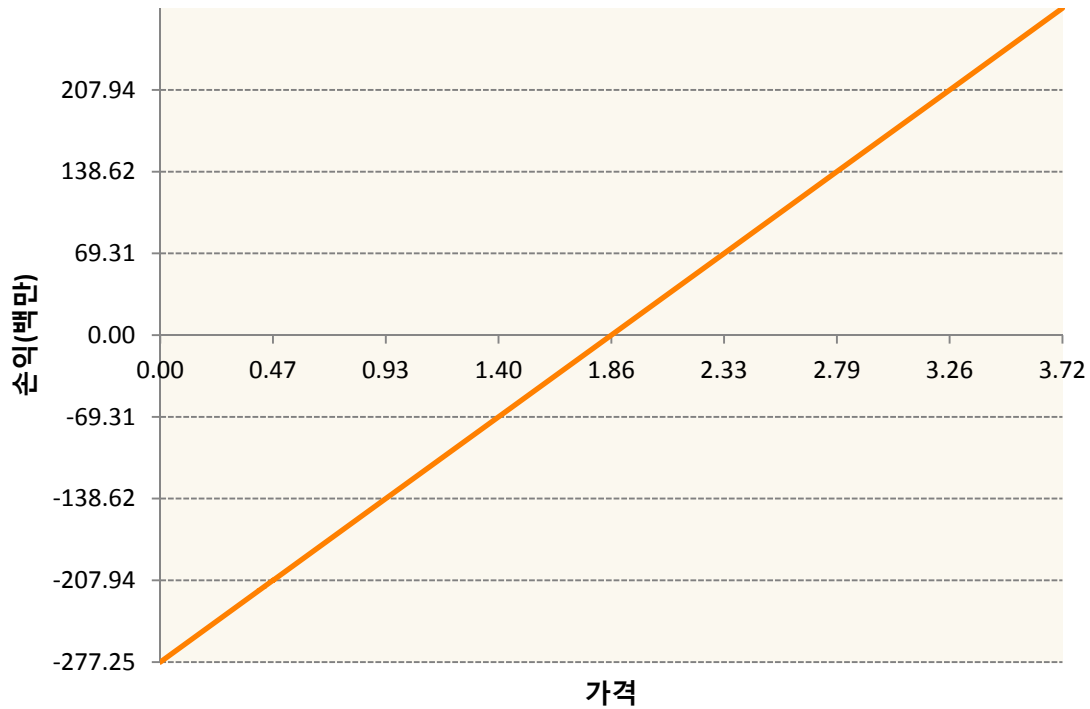
NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



QSU9-Low Su Gasoil G Sep19



XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	50
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	55
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	16
KR4175P800	2019-08 달러선물	10
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	42
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	23
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	22

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

377

공시일	2019-08-02
기준일	2019-08-01

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

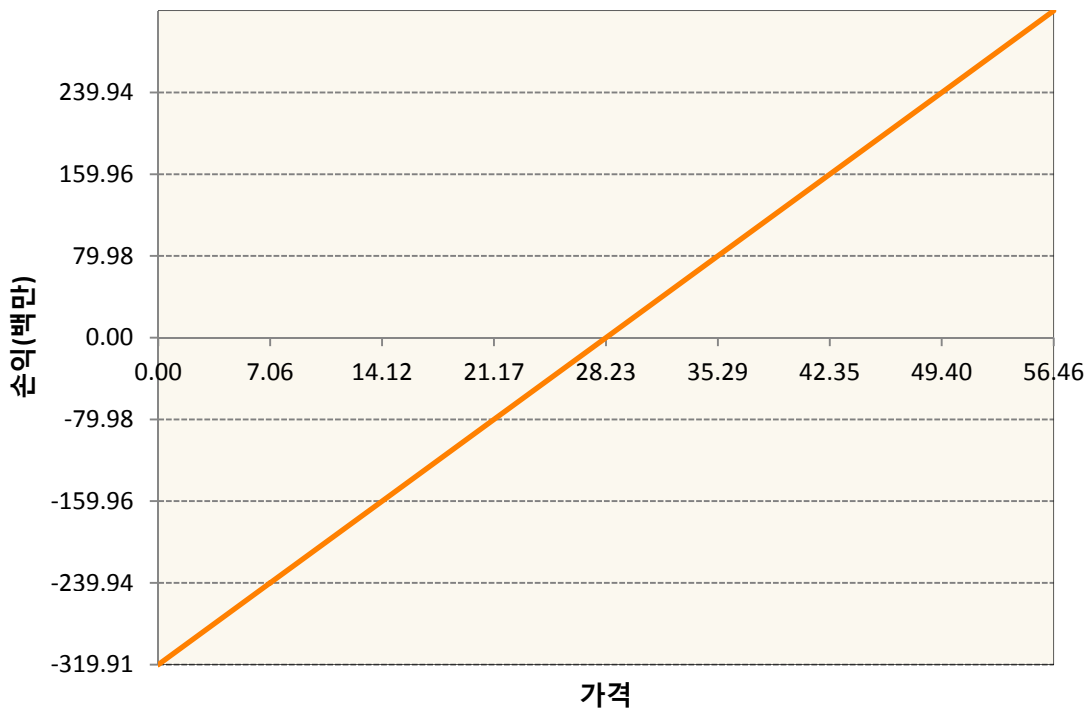
1. 계약금액

(단위:백만원)

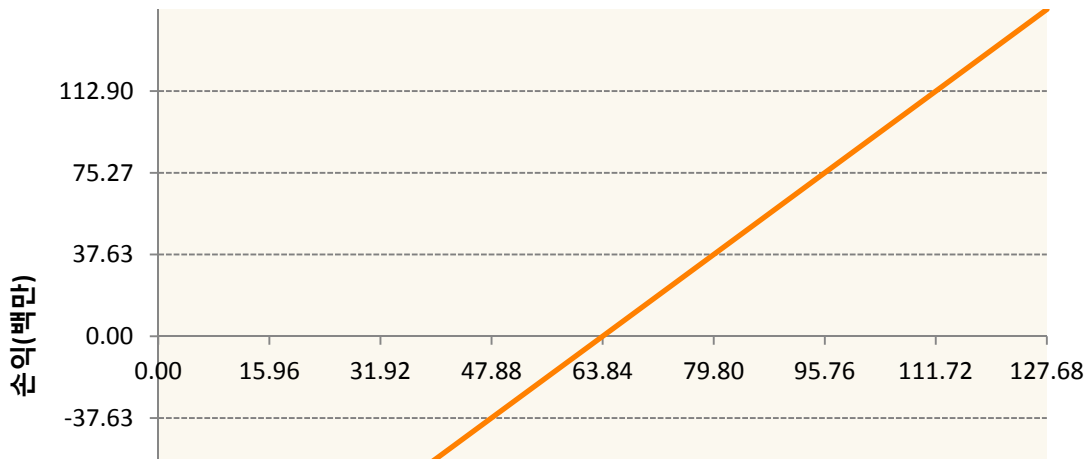
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,917	202	2,716	

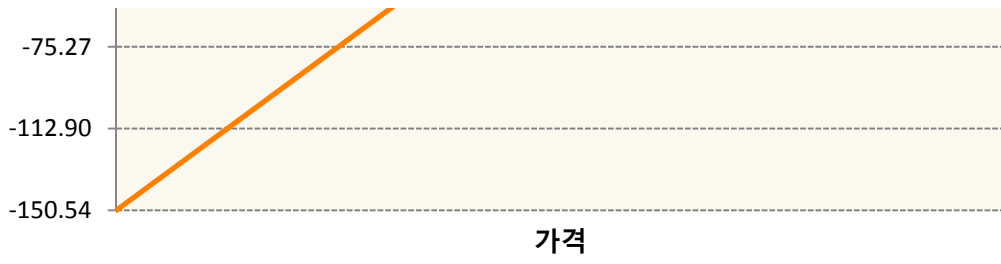
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

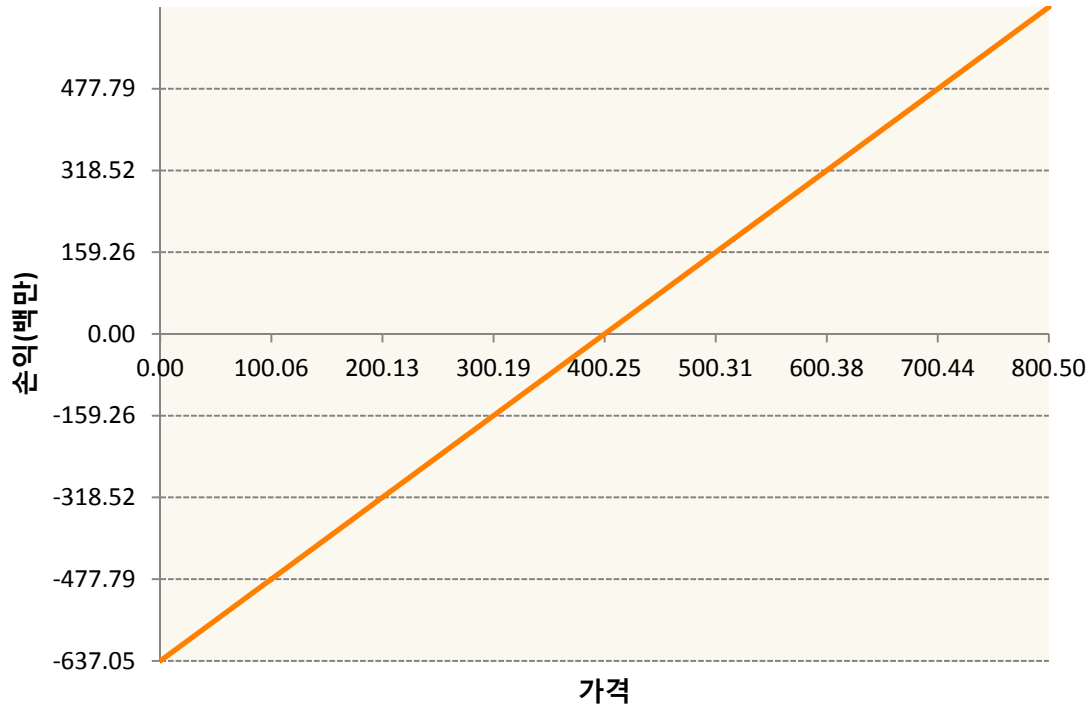


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

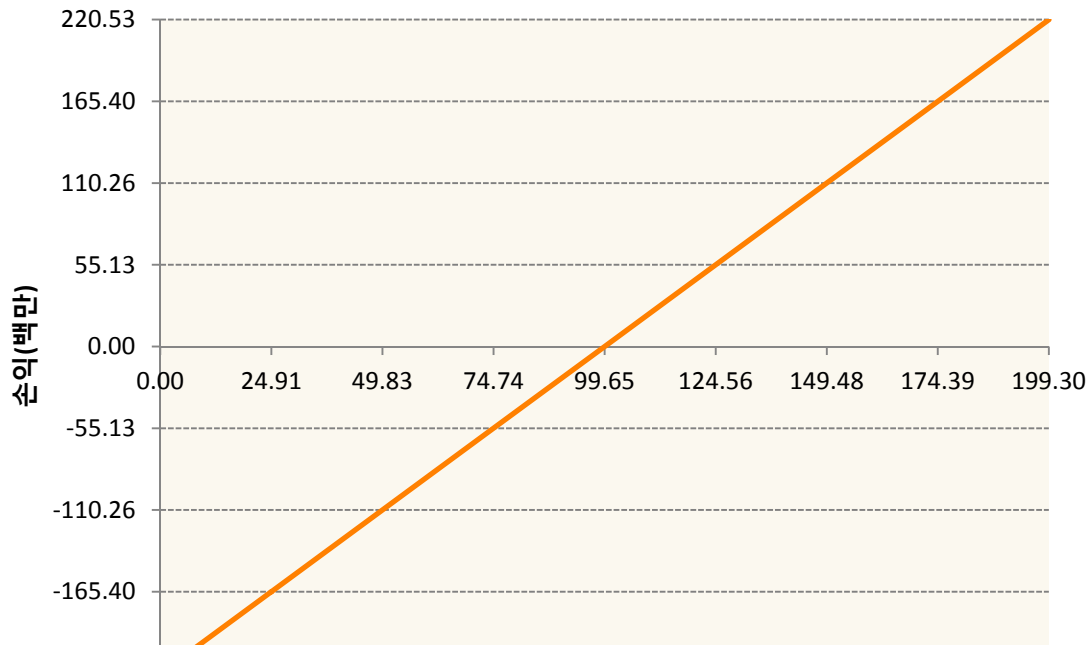


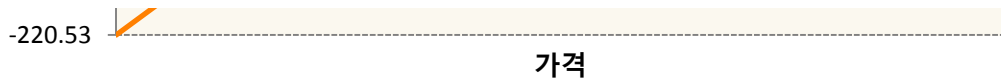


CU9-CORN FUTURE Sep19

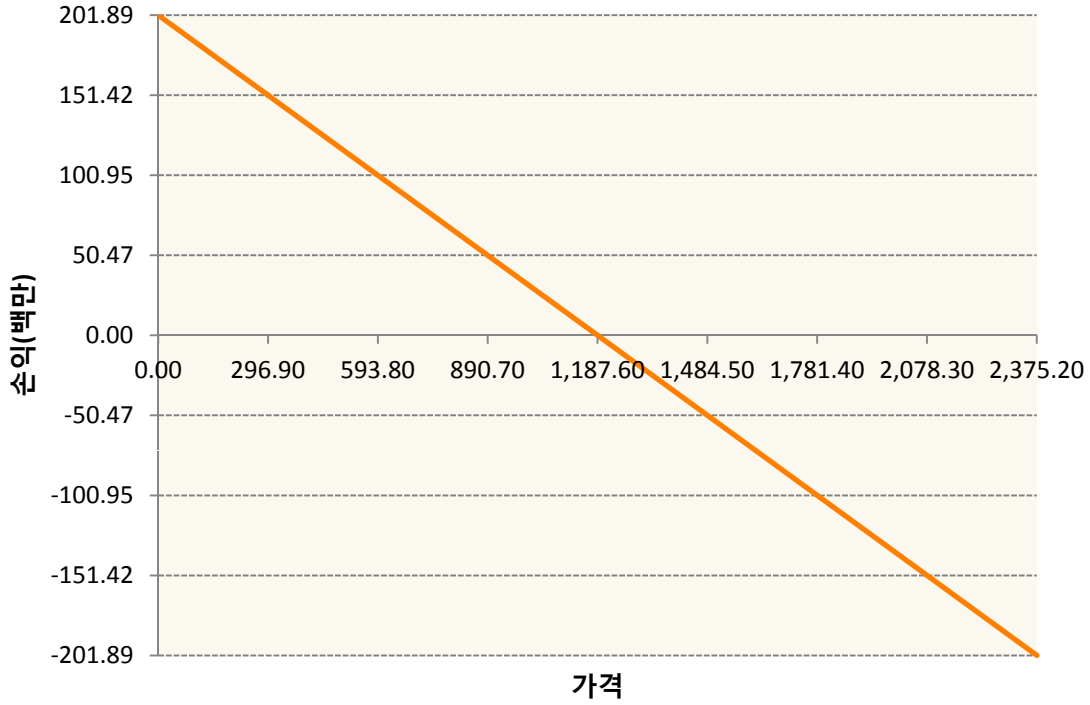


KCU9-COFFEE 'C' FUTURE Sep19

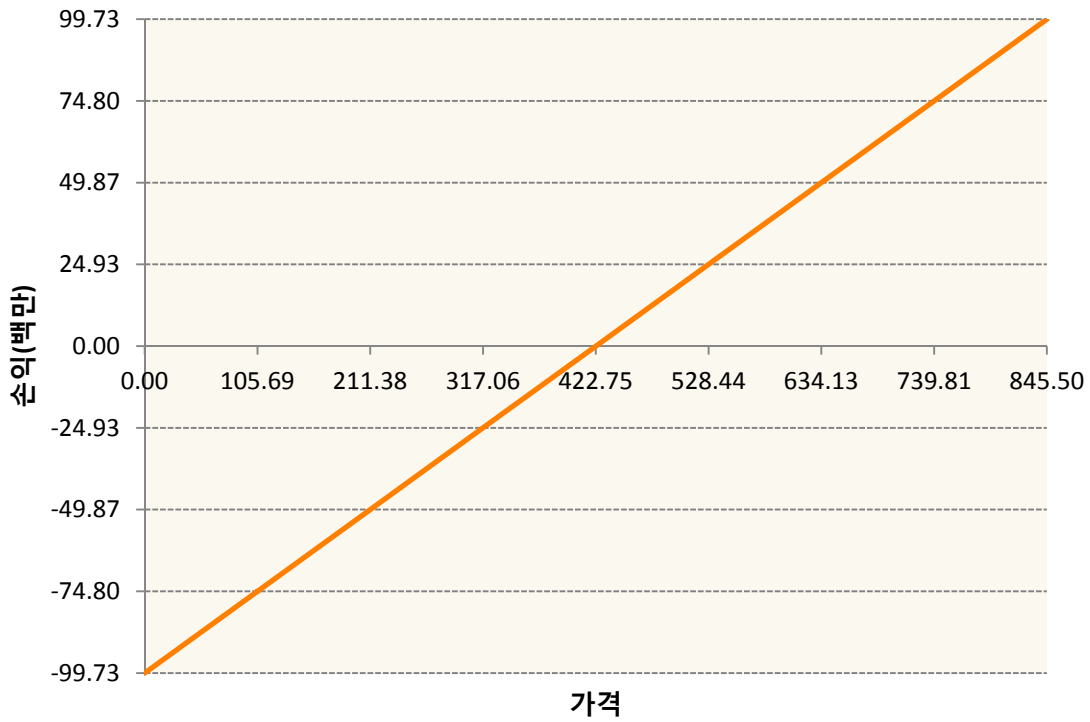




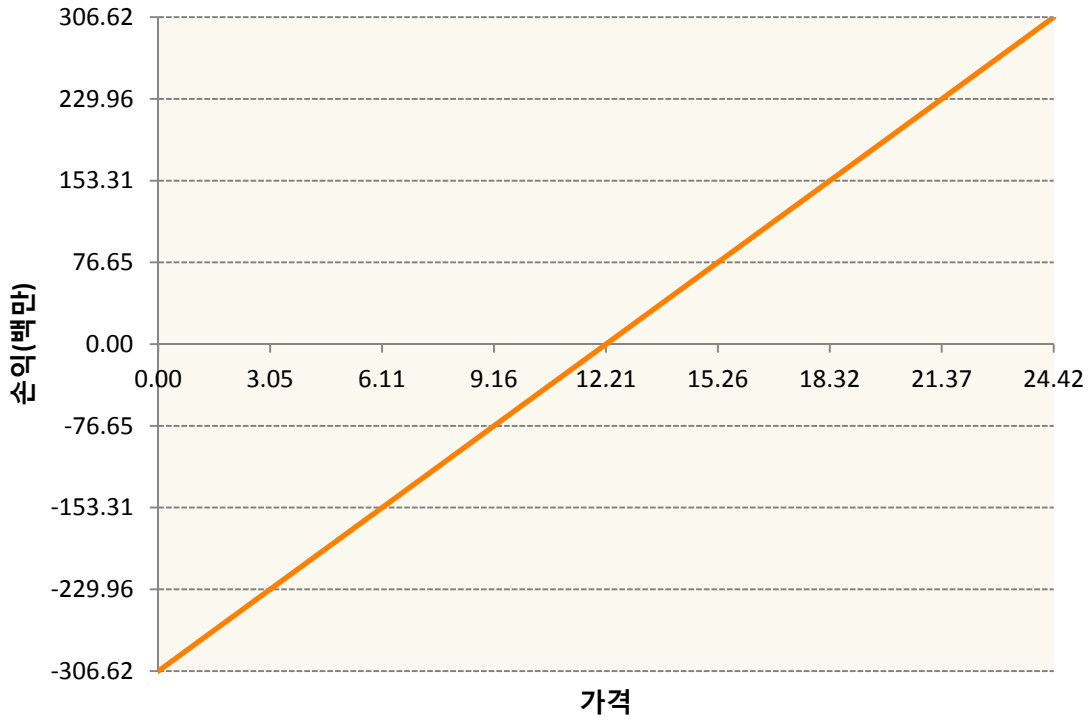
KR4175P80006-2019-08 달러선물



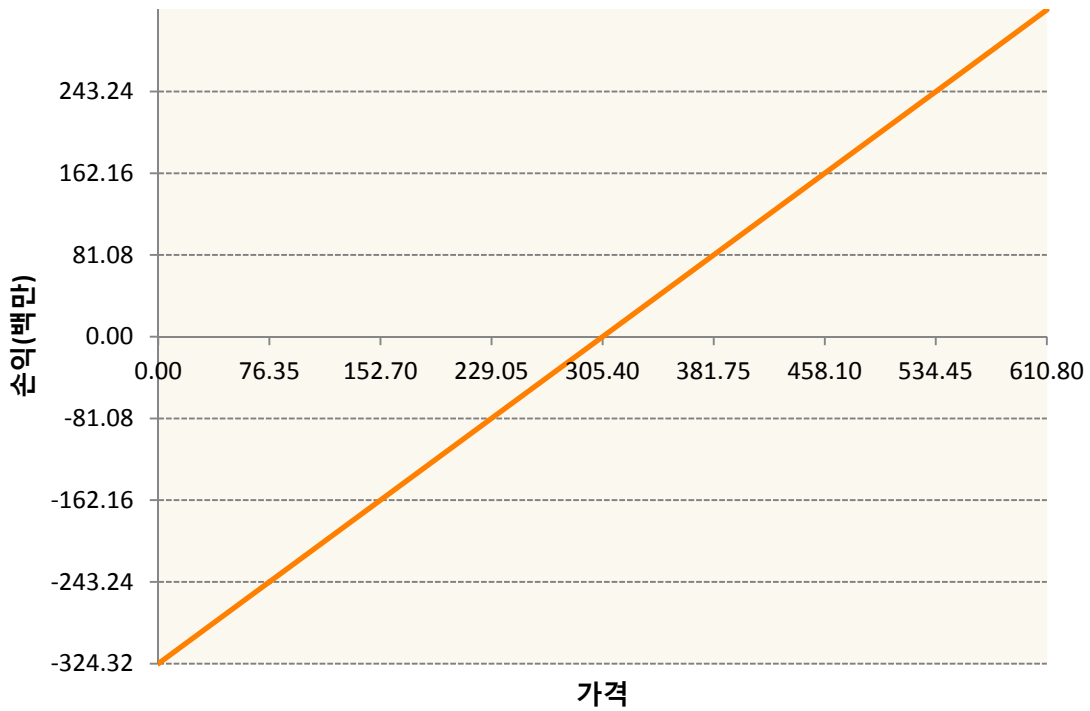
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



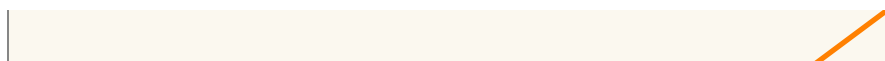
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

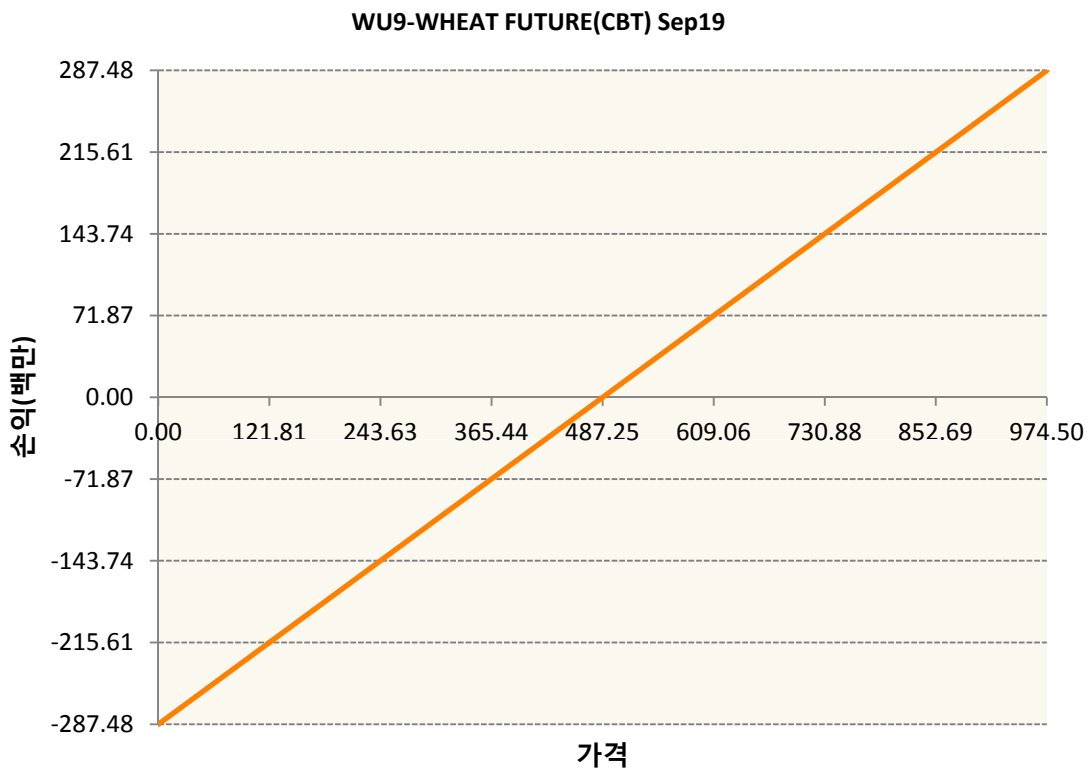
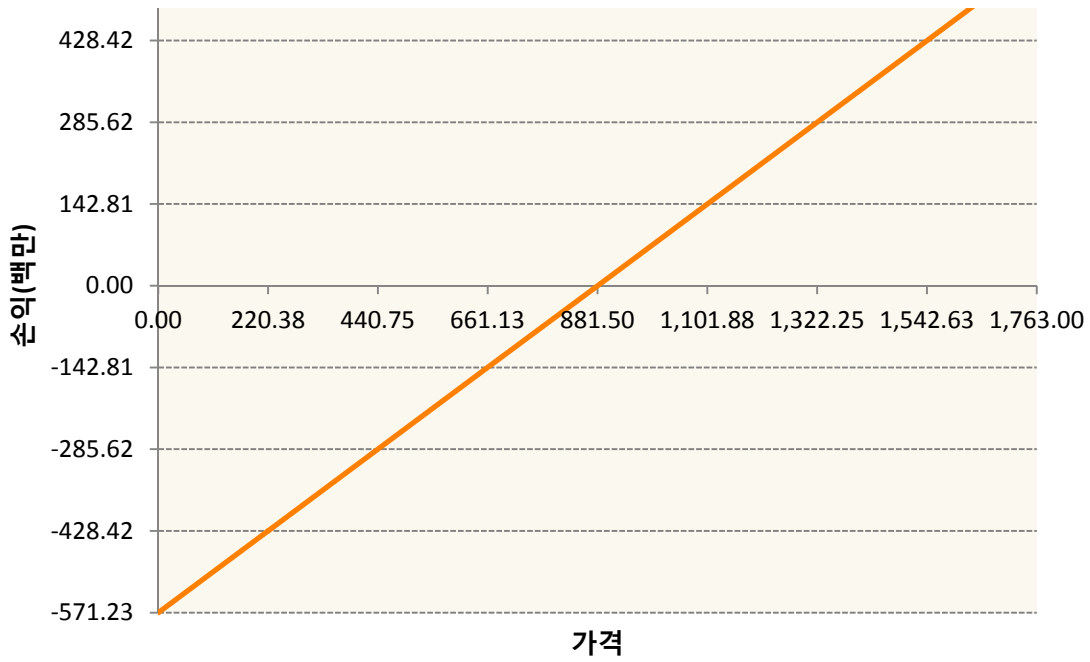


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	26
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	12
CU9	CORN FUTURE Sep19	51
KCU9	COFFEE 'C' FUTURE Sep19	18
KR4175P800	2019-08 달러선물	16

KWU9	KC HRW WHEAT FUT Sep19	8
SBV9	SUGAR #11 (WORLD) Oct19	25
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)

257