

공시일	2019-08-05
기준일	2019-08-02

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	2019-08-05
기준일	2019-08-02

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

1,163

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

655

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-05
기준일	2019-08-02

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)	374
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	137

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

822

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-05
기준일	2019-08-02

유로인덱스모(주식-파생형)

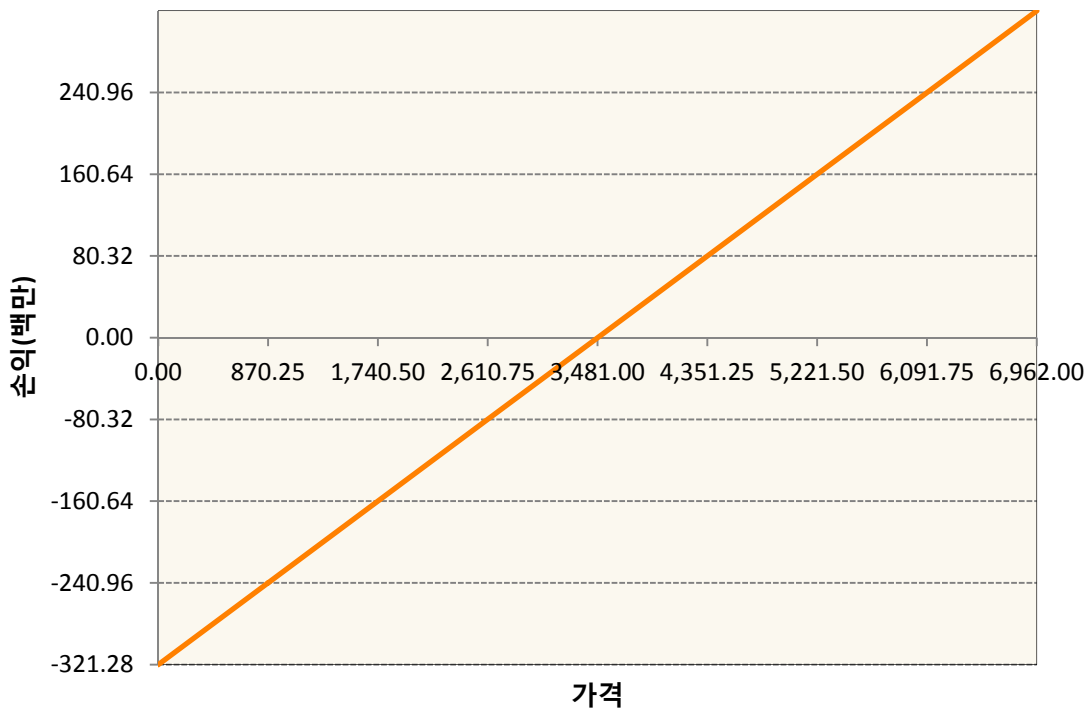
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	321	0	321	

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	2019-08-05
기준일	2019-08-02

차이나인덱스모(주식-파생형)

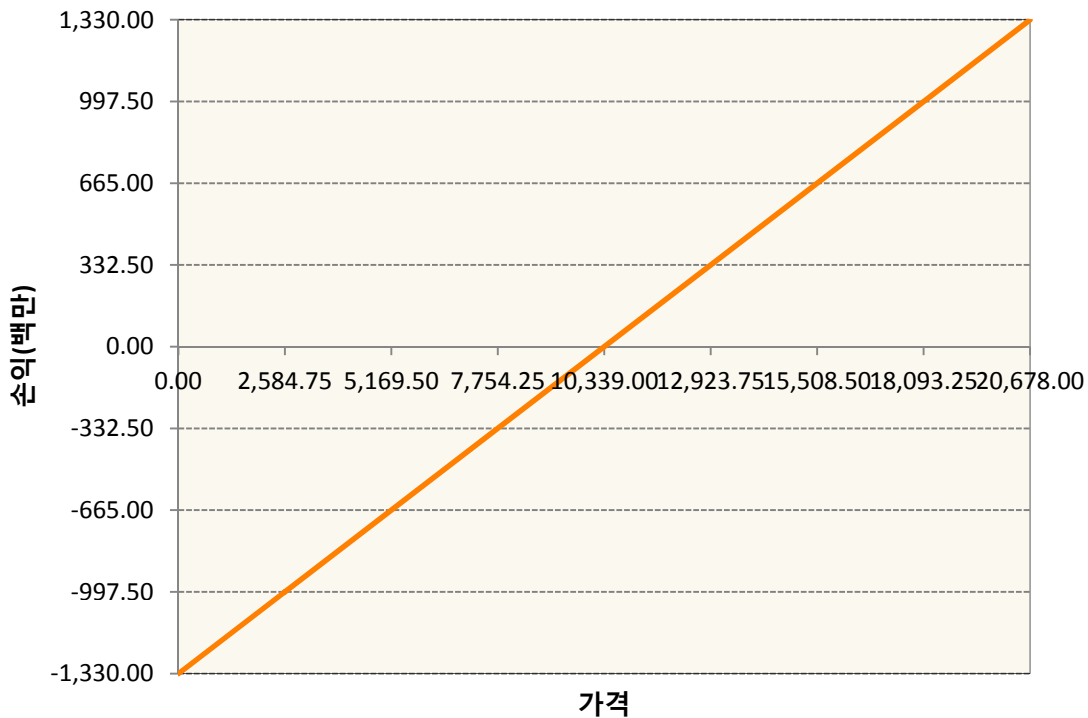
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,330	0	1,330	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCQ9	HSCEI Futures Aug19	106
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

102

공시일	2019-08-05
기준일	2019-08-02

커버드콜모(주식혼합-파생형)

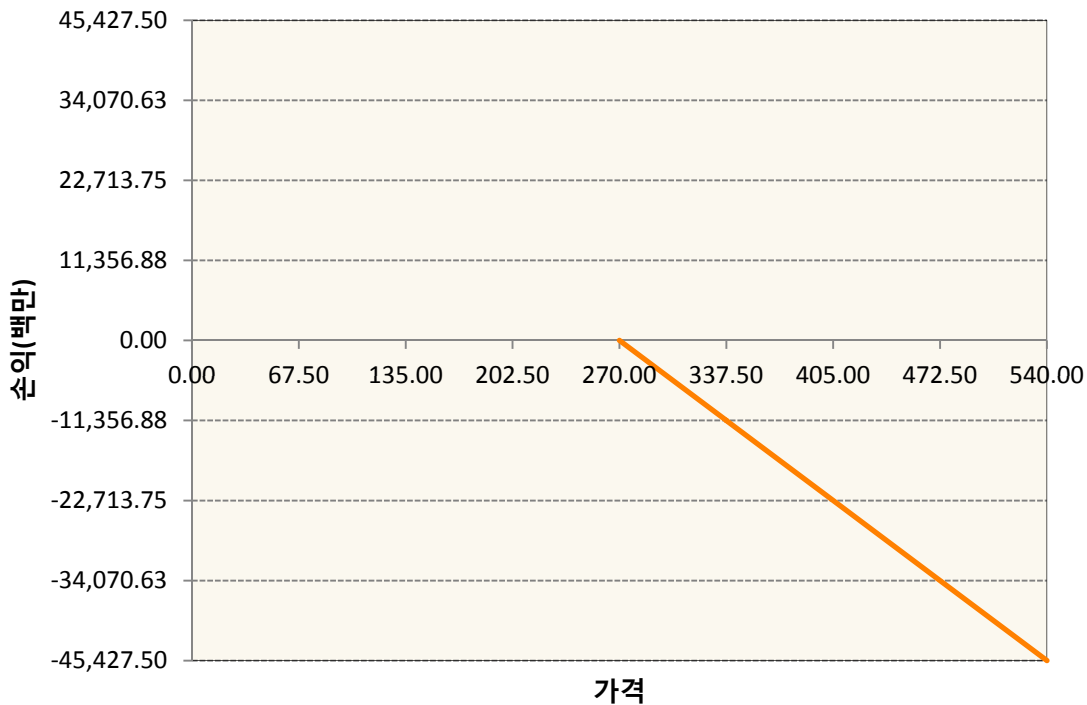
1. 계약금액

(단위:백만원)

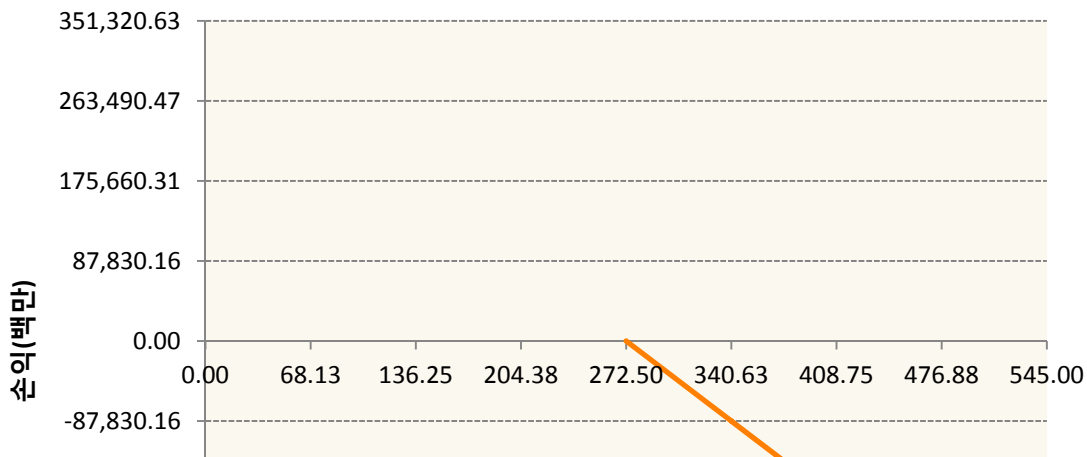
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	581,636	-581,636	장내

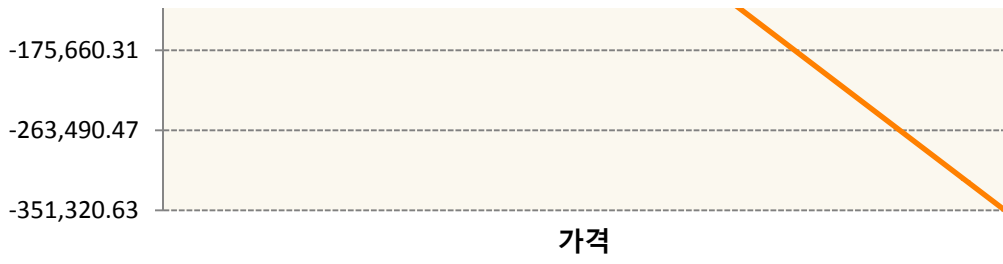
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P82709-2019-08 콜270

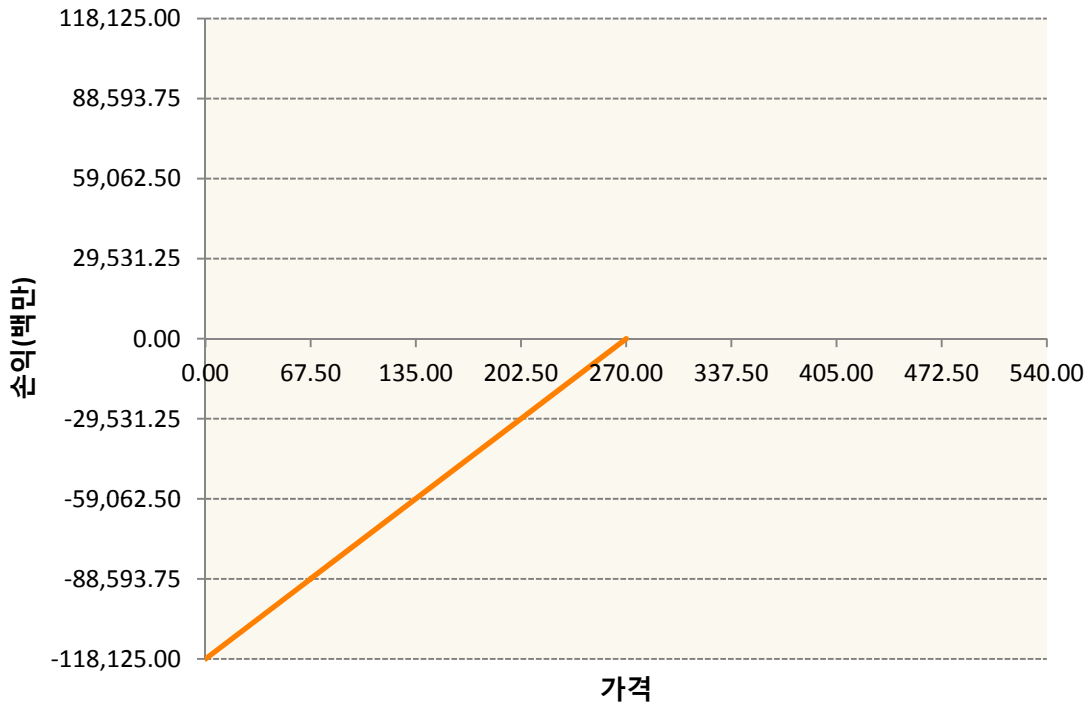


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

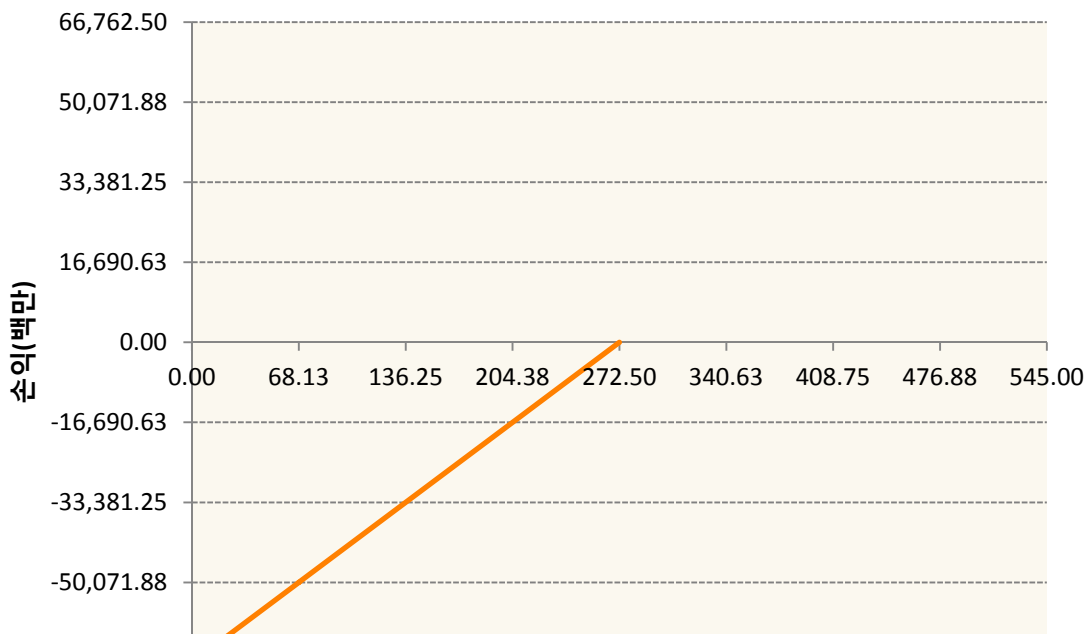




KR4301P82707-2019-08 풋270



KR4301P82723-2019-08 풋272.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P82709 2019-08 콜270							2,278
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	169	169	169	168	168	168	167
-5.33%	168	168	167	166	163	159	154
-2.67%	163	158	150	139	126	110	91
0%	93	65	33	0	-35	-72	-111
2.67%	-267	-316	-365	-413	-462	-511	-560
5.33%	-1,087	-1,117	-1,150	-1,185	-1,223	-1,261	-1,301
8.00%	-2,189	-2,197	-2,207	-2,220	-2,237	-2,256	-2,278
KR4201P82725 2019-08 콜272.5							15,191
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	760	760	760	760	759	757	754
-5.33%	760	759	757	752	742	725	701
-2.67%	748	729	698	650	585	503	402
0%	499	358	191	0	-212	-441	-685
2.67%	-1,232	-1,583	-1,939	-2,298	-2,660	-3,023	-3,389
5.33%	-6,283	-6,594	-6,917	-7,249	-7,589	-7,933	-8,283
8.00%	-14,186	-14,292	-14,425	-14,585	-14,767	-14,970	-15,191
KR4301P82707 2019-08 풋270							9,094
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,094	-9,094	-9,094	-9,094	-9,094	-9,094	-9,094
-5.33%	-6,027	-6,027	-6,027	-6,027	-6,027	-6,027	-6,028
-2.67%	-2,960	-2,961	-2,961	-2,963	-2,966	-2,971	-2,979
0%	77	57	31	0	-36	-76	-120
2.67%	2,467	2,387	2,308	2,228	2,148	2,068	1,988
5.33%	3,160	3,137	3,108	3,074	3,035	2,991	2,944
8.00%	3,196	3,195	3,194	3,191	3,186	3,179	3,169
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							5,131
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,131	-5,131	-5,131	-5,131	-5,131	-5,131	-5,131
-5.33%	-3,414	-3,414	-3,414	-3,414	-3,414	-3,414	-3,414
-2.67%	-1,696	-1,696	-1,697	-1,697	-1,697	-1,698	-1,700
0%	18	14	8	0	-11	-24	-39
2.67%	1,573	1,535	1,496	1,456	1,415	1,374	1,332

5.33%	2,288	2,261	2,231	2,199	2,165	2,130	2,093
8.00%	2,363	2,361	2,358	2,353	2,346	2,337	2,326

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

(단위:백만원)

30,890

공시일	2019-08-05
기준일	2019-08-02

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

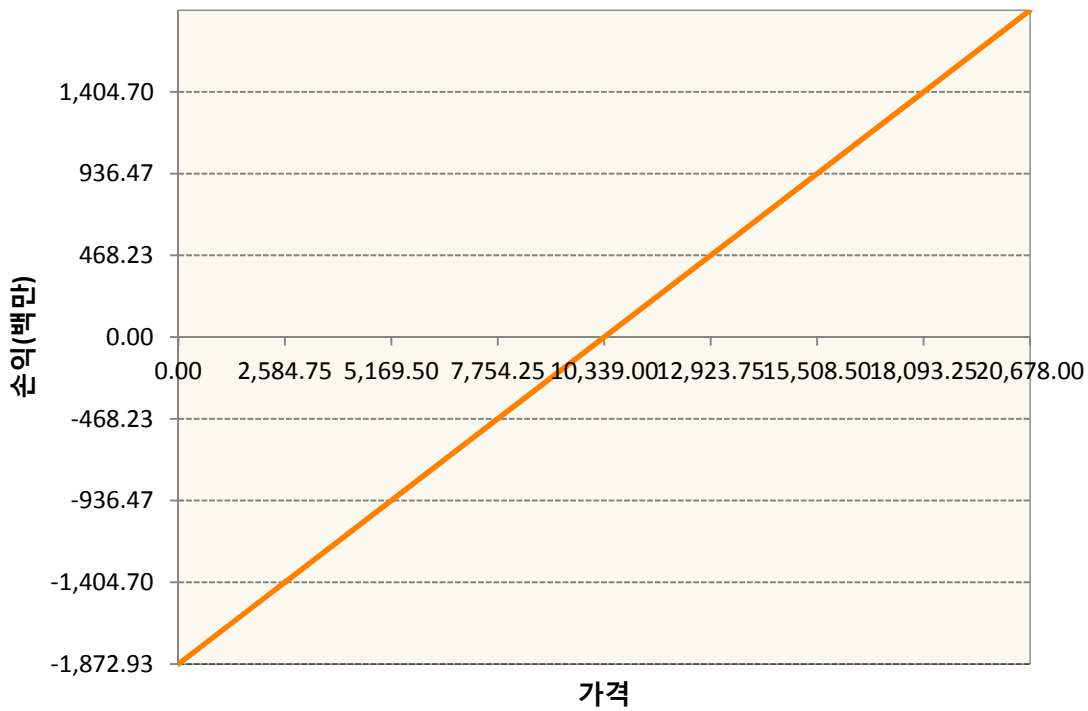
1. 계약금액

(단위:백만원)

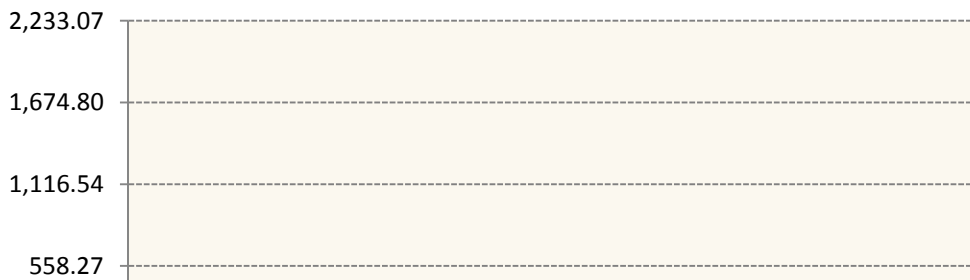
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,873	0	1,873	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,468	-5,468	장내
누계	통화	선도	153	3,216	-3,063	장외

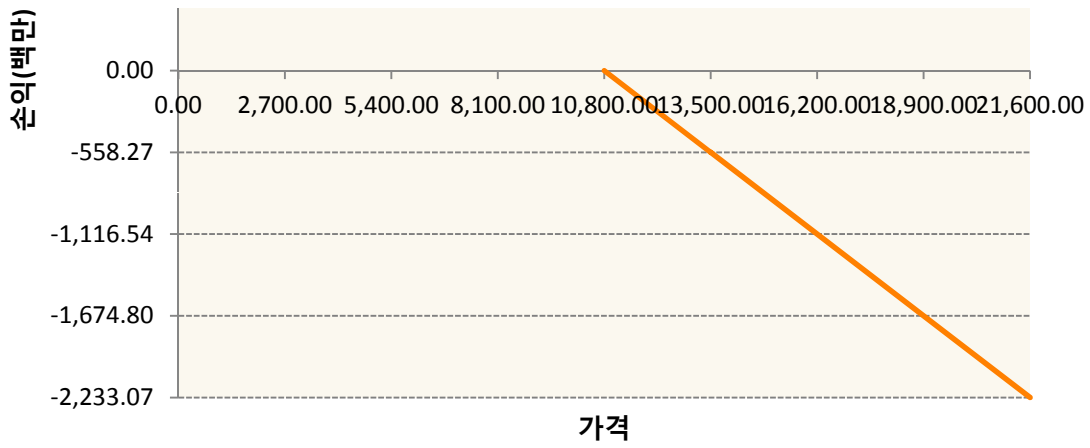
2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19

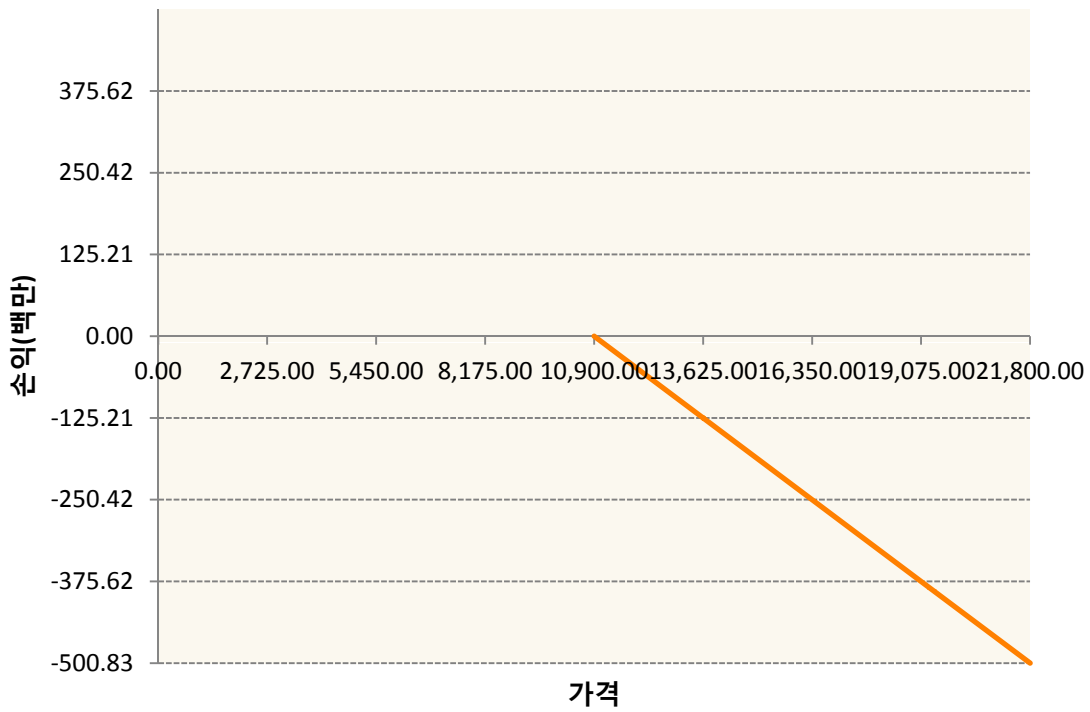


OHHIQ9-C108-HSCEI

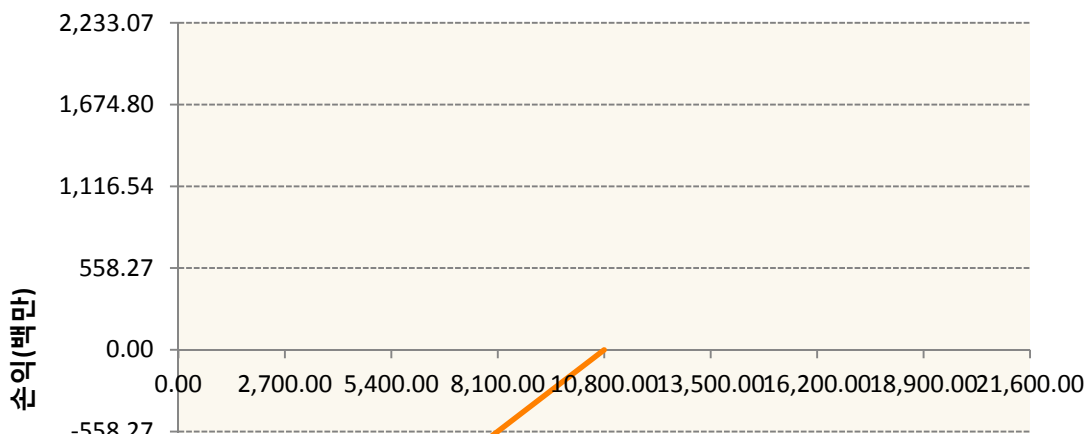


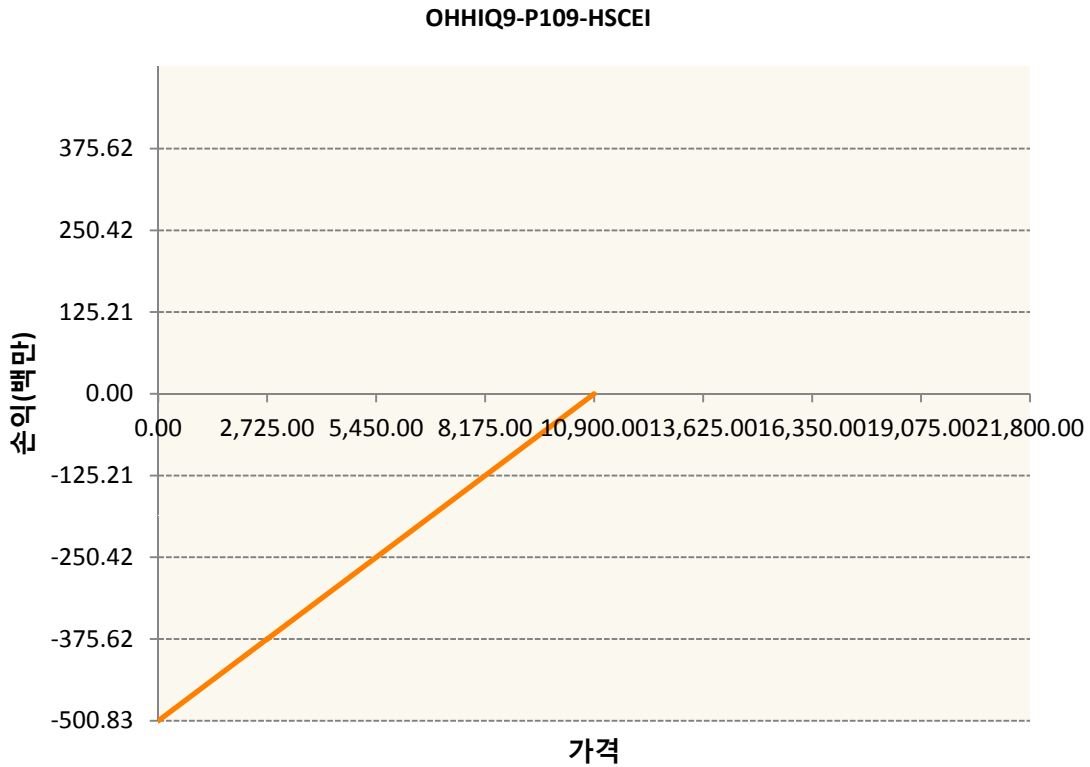


OHHIQ9-C109-HSCEI



OHHIQ9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	257
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E	12
HCQ9 HSCEI Futures Aug19	150
OHHIQ9-C1(HSCEI	179
OHHIQ9-C1(HSCEI	40
OHHIQ9-P1(HSCEI	179
OHHIQ9-P1(HSCEI	40

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	647

공시일	2019-08-05
기준일	2019-08-02

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

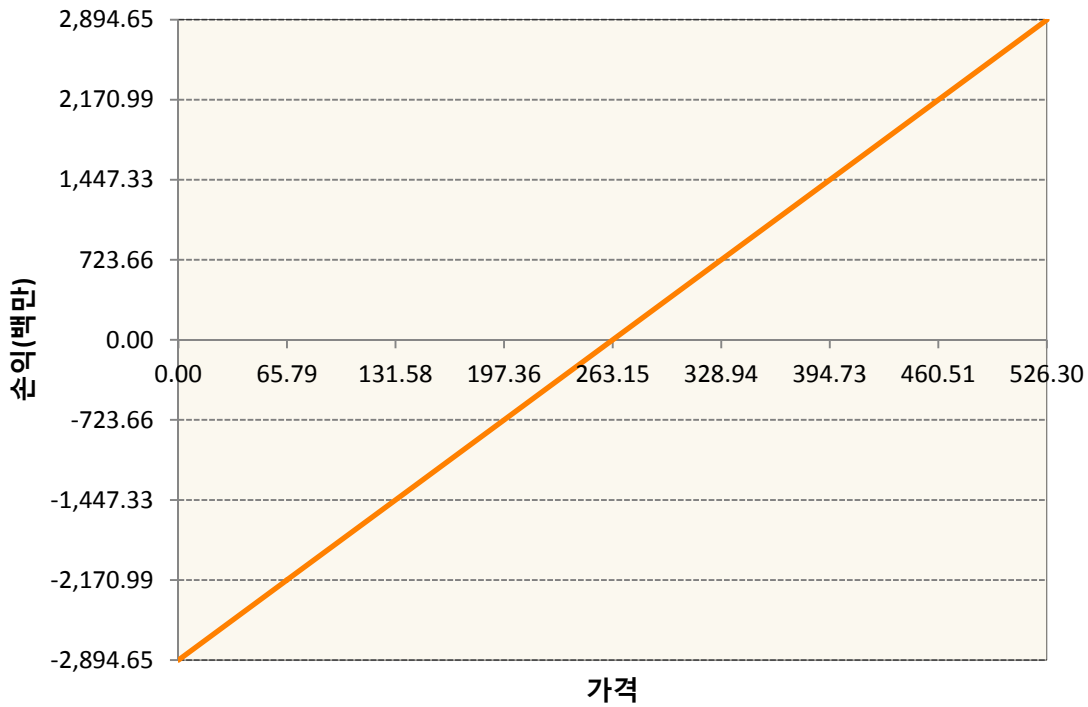
1. 계약금액

(단위:백만원)

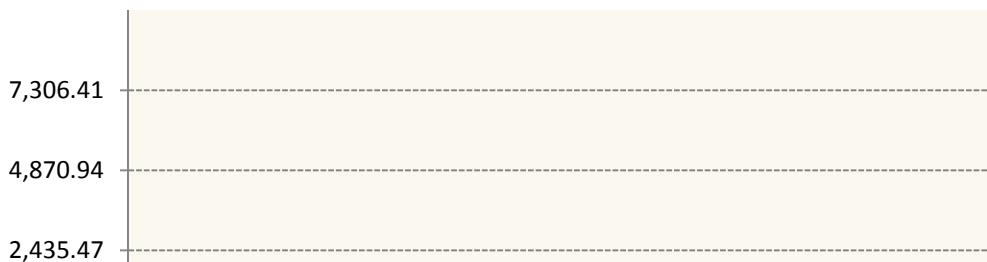
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	131	0	131	장내
누계	유가증권	선물	2,895	0	2,895	장내
누계	유가증권	스왑	18,836	0	18,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	18,953	-18,953	장내

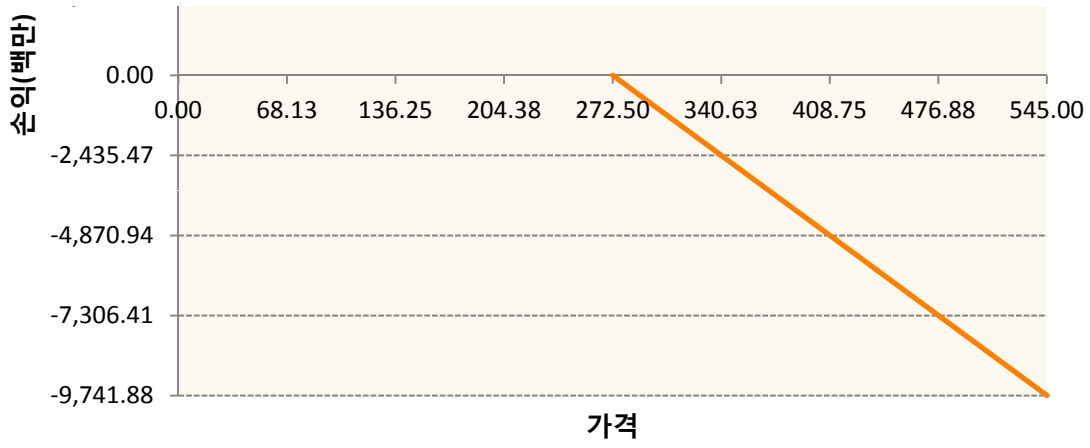
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

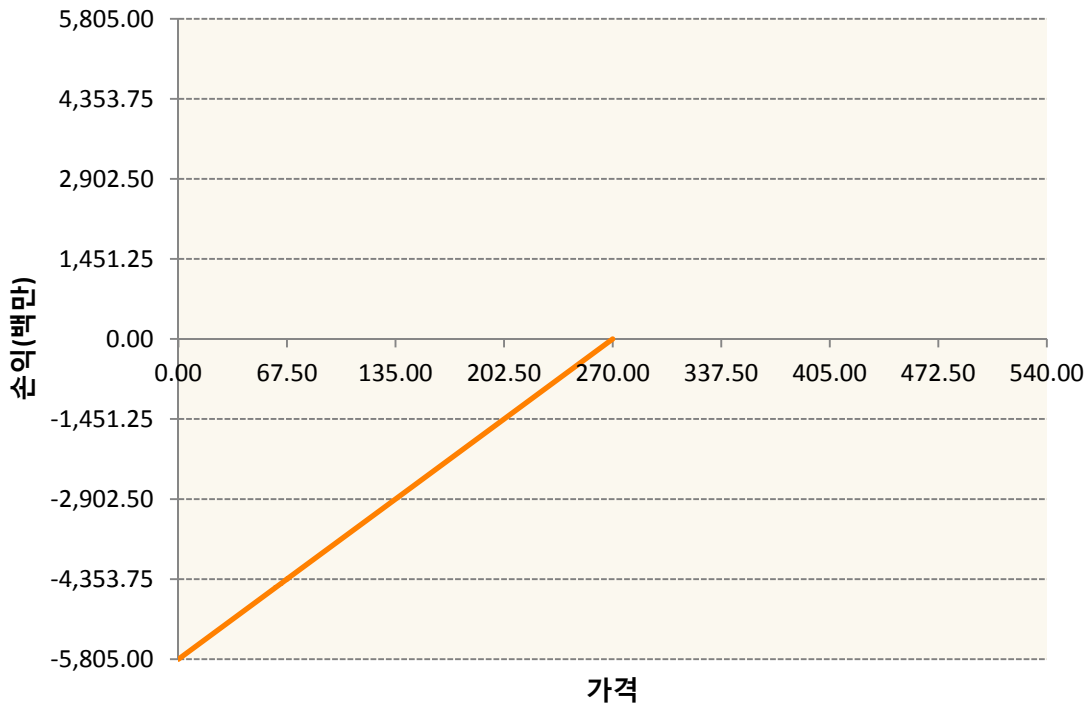


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

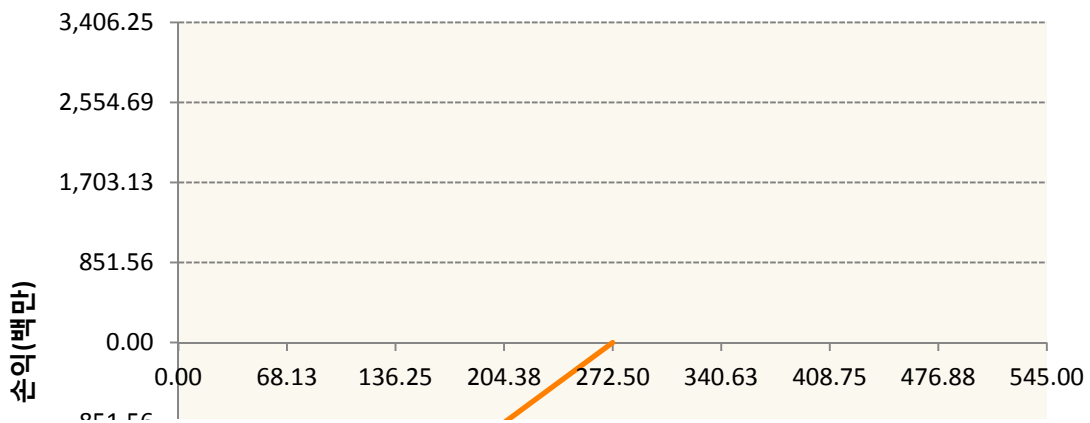




KR4301P82707-2019-08 풋270



KR4301P82723-2019-08 풋272.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						1,024
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,024	-1,024	-1,024	-1,024	-1,024	-1,024	-1,024	
-5.33%	-683	-683	-683	-683	-683	-683	-683	
-2.67%	-341	-341	-341	-341	-341	-341	-341	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	341	341	341	341	341	341	341	
5.33%	683	683	683	683	683	683	683	
8.00%	1,024	1,024	1,024	1,024	1,024	1,024	1,024	
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						231
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-231	-231	-231	-231	-231	-231	-231	
-5.33%	-154	-154	-154	-154	-154	-154	-154	
-2.67%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	77	77	77	77	77	77	77	
5.33%	154	154	154	154	154	154	154	
8.00%	231	231	231	231	231	231	231	
KR4201P82725		2019-08 콜272.5						421
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	21	21	21	21	21	21	21
-5.33%	21	21	21	21	21	20	19
-2.67%	21	20	19	18	16	14	11
0%	14	10	5	0	-6	-12	-19
2.67%	-34	-44	-54	-64	-74	-84	-94
5.33%	-174	-183	-192	-201	-210	-220	-230
8.00%	-393	-396	-400	-404	-409	-415	-421

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%	-296	-296	-296	-296	-296	-296	-296
-2.67%	-145	-145	-146	-146	-146	-146	-146
0%	4	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	121	117	113	109	106	102	98
5.33%	155	154	153	151	149	147	145
8.00%	157	157	157	157	157	156	156

KR4301P82723 2019-08 풋272.5 262

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-262	-262	-262	-262	-262	-262	-262
-5.33%	-174	-174	-174	-174	-174	-174	-174
-2.67%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	80	78	76	74	72	70	68
5.33%	117	115	114	112	110	109	107
8.00%	121	120	120	120	120	119	119

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

(단위:백만원)

2,995

공시일	2019-08-05
기준일	2019-08-02

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

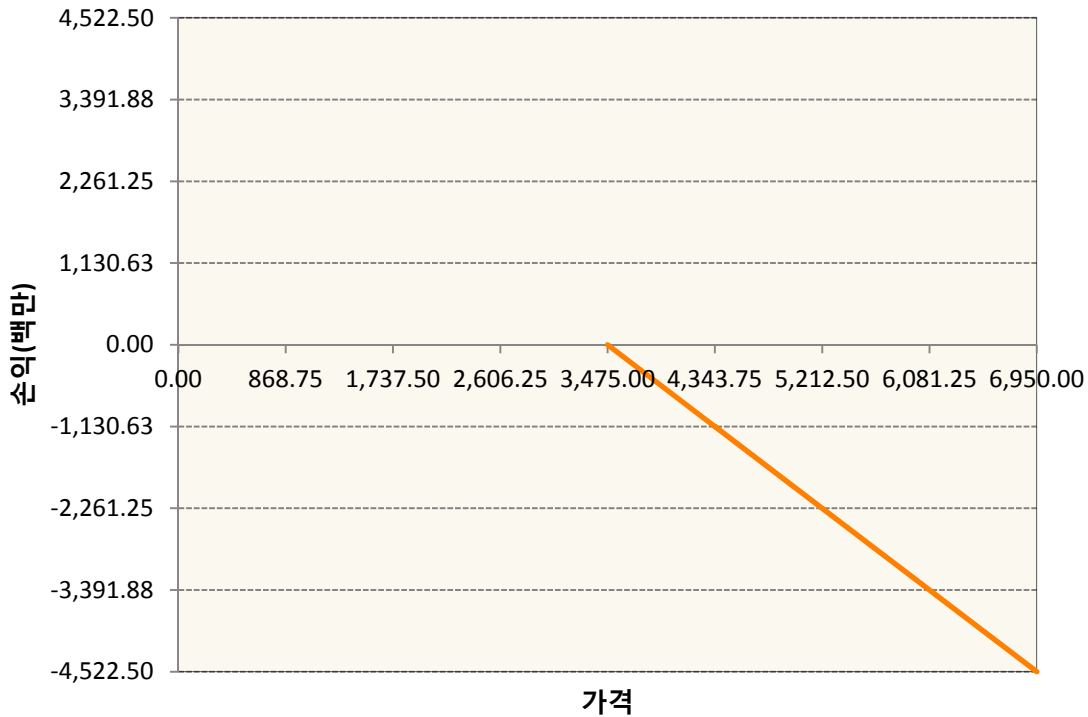
1. 계약금액

(단위:백만원)

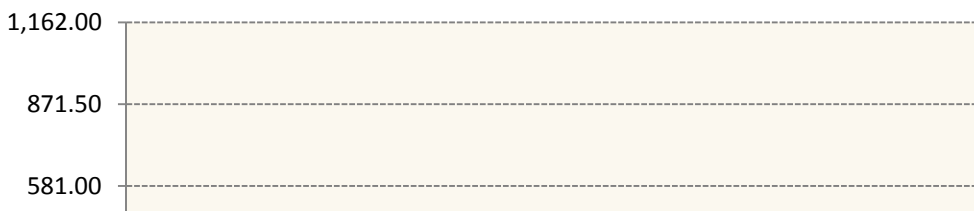
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,715	0	2,715	
누계	유가증권	스왑	37,920	0	37,920	장외
누계	유가증권	옵션	0	11,369	-11,369	장내
누계	통화	선도	14,342	22,576	-8,233	장외

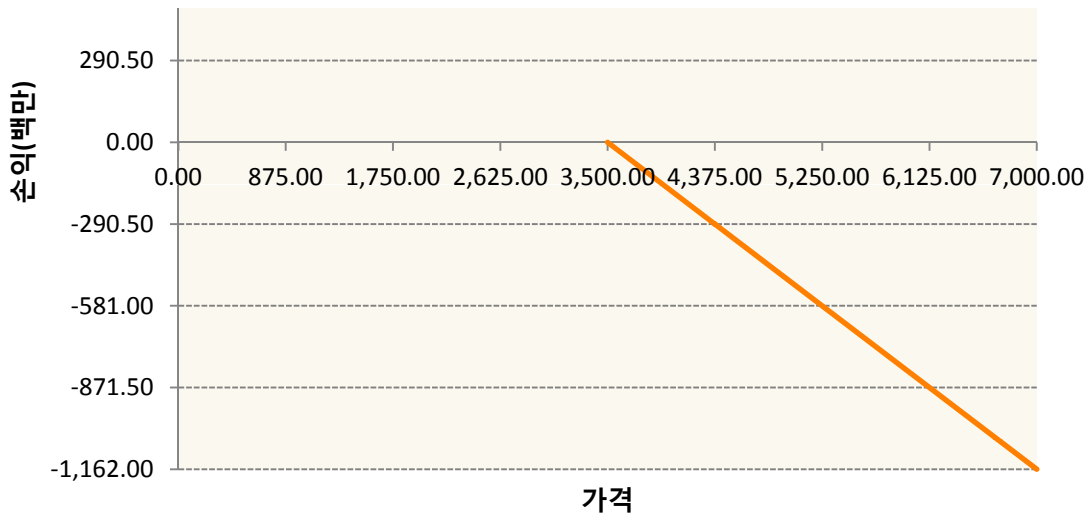
2. 만기시점의 손익구조

OESXQ9-C3475-EURO STOXX 50

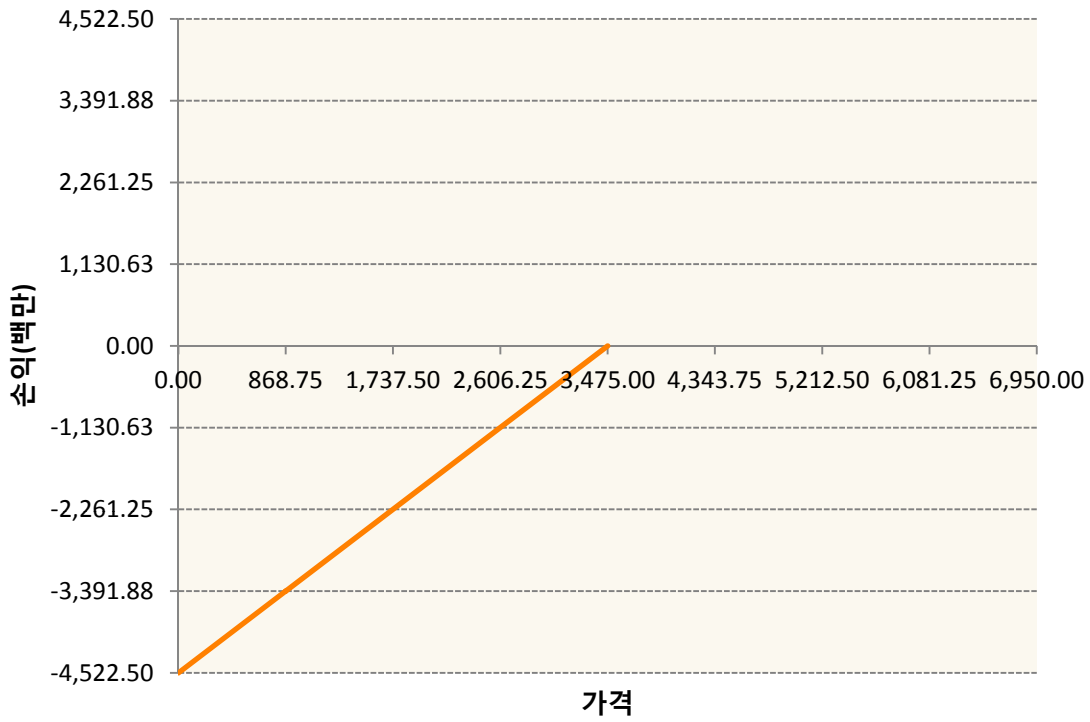


OESXQ9-C3500-EURO STOXX 50

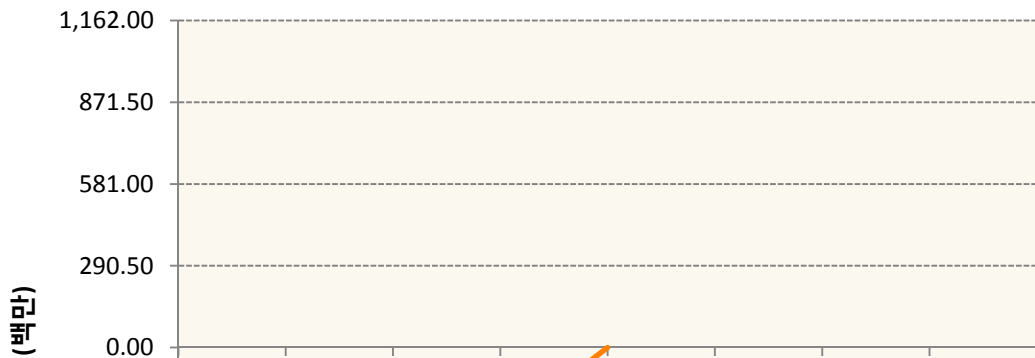


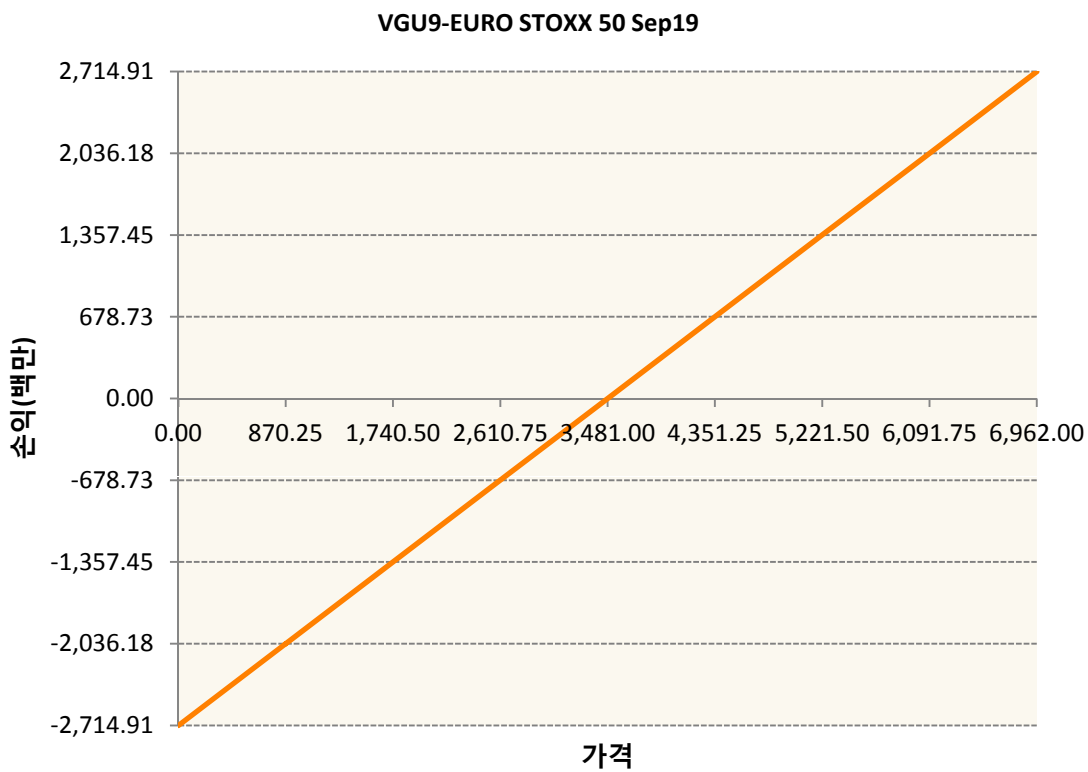
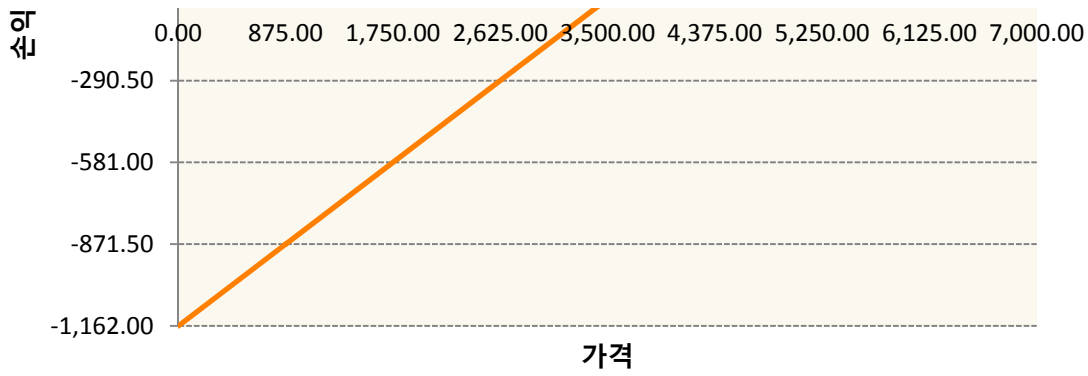


OESXQ9-P3475-EURO STOXX 50



OESXQ9-P3500-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	15
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	425
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E	1,062
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	319
FX21019N01 EUR/KRW 23-08-19E	425
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E	319
FX21019N04 EUR/KRW 27-09-19E	234
FX21019Q00 EUR/KRW 27-09-19E	170
OESXQ9-C34 EURO STOXX 50	362
OESXQ9-C35 EURO STOXX 50	93
OESXQ9-P34 EURO STOXX 50	362

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

93
217

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

(단위:백만원)

2,105

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

(단위:백만원)

982

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

(단위:백만원)

84

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

(단위:백만원)

128

공시일	2019-08-05
기준일	2019-08-02

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

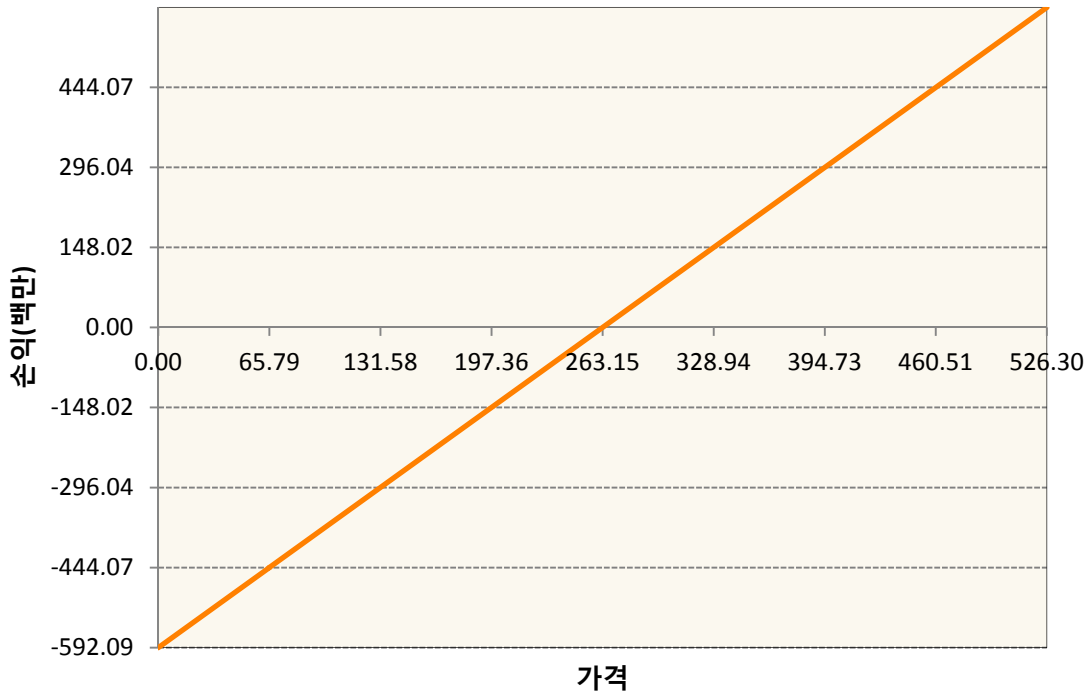
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	592	0	592	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						47
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47	
-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%	47	47	47	47	47	47	47	

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

(단위:백만원)

40

공시일	2019-08-05
기준일	2019-08-02

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

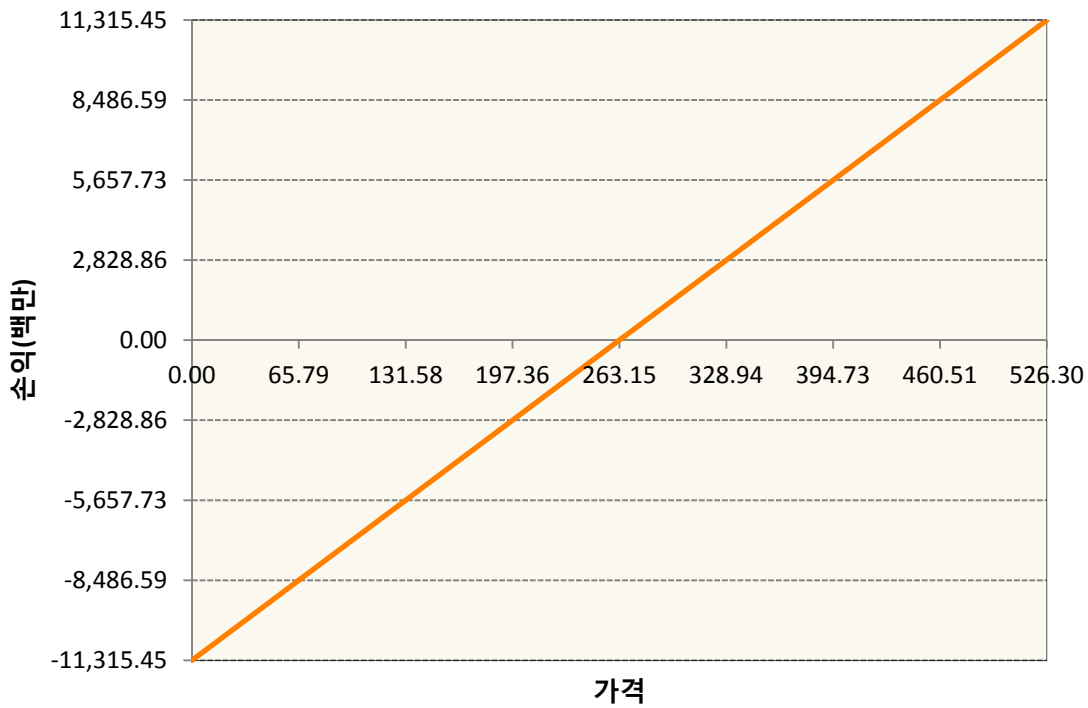
1. 계약금액

(단위:백만원)

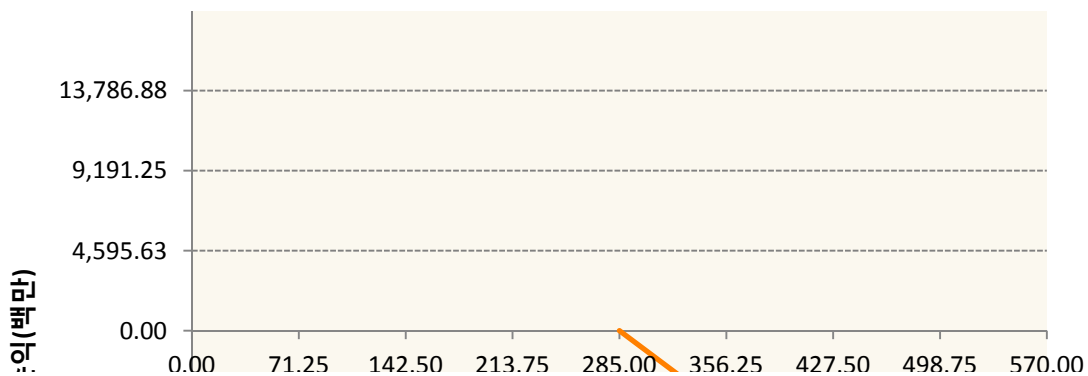
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,315	0	11,315	장내
누계	유가증권	옵션	1,698	21,617	-19,919	장내

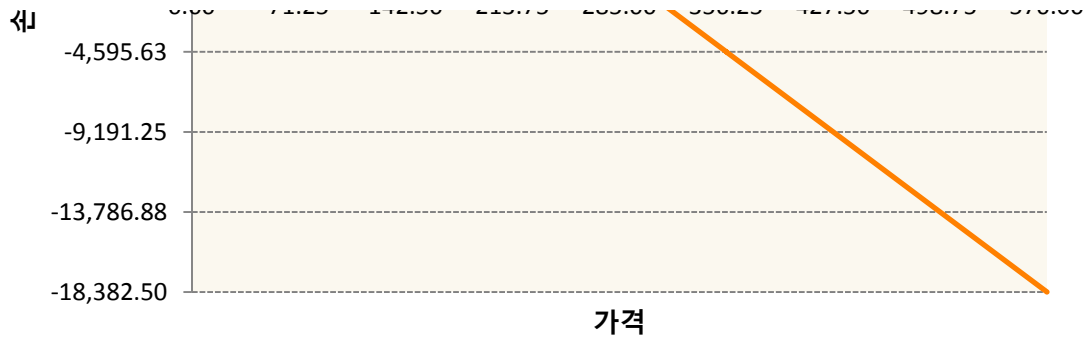
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

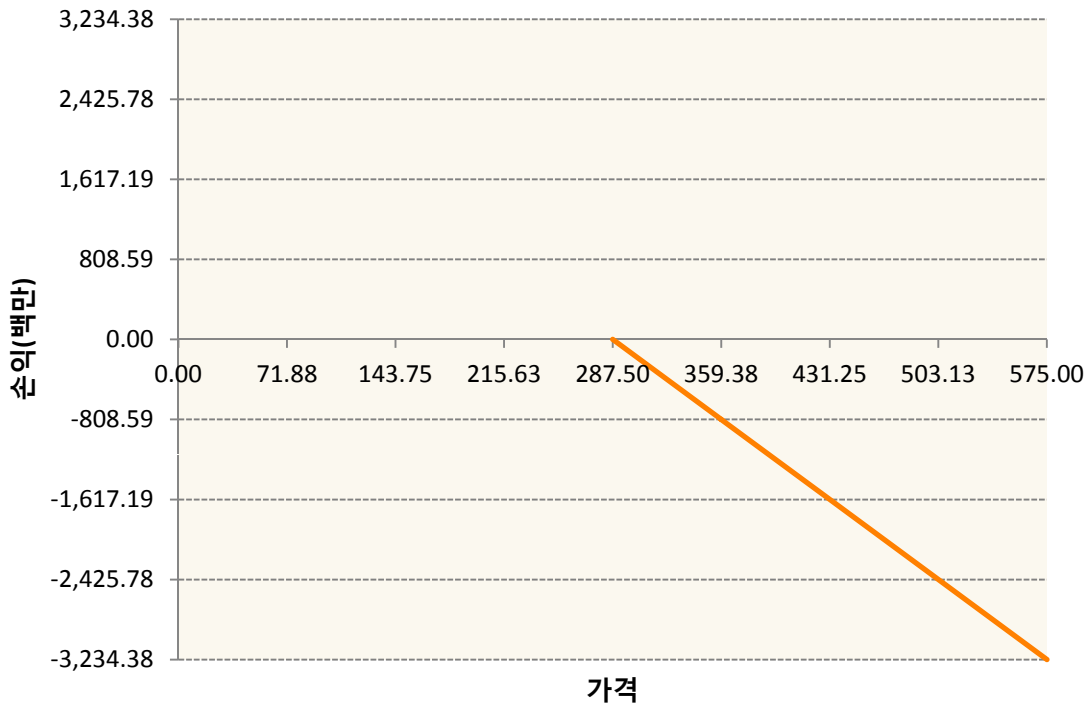


KR4201P82857-2019-08 콜285

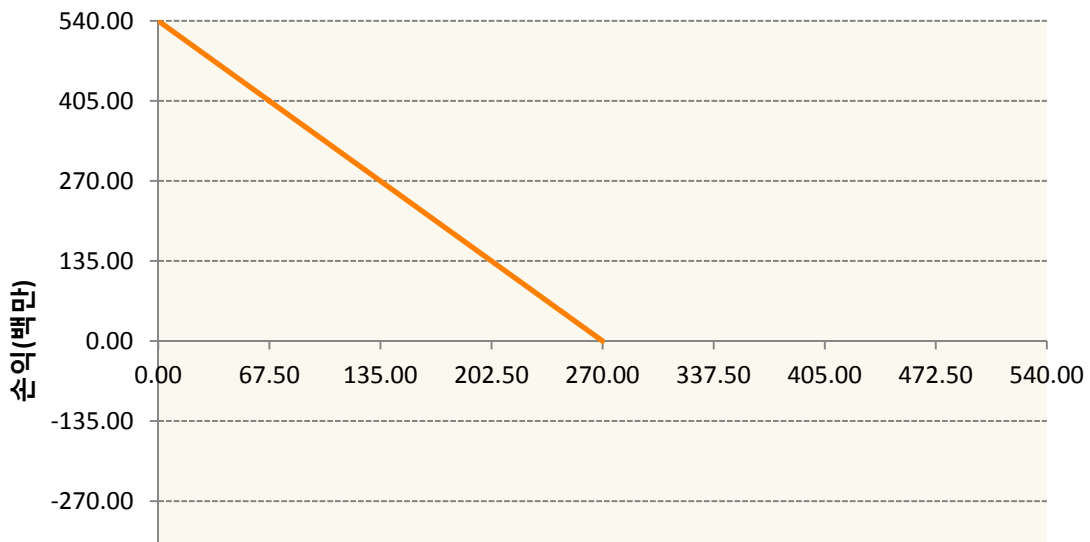


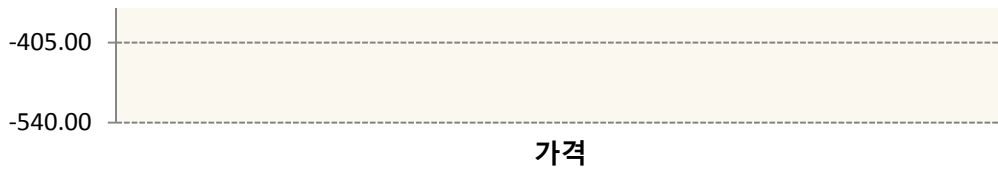


KR4201P82873-2019-08 콜287.5

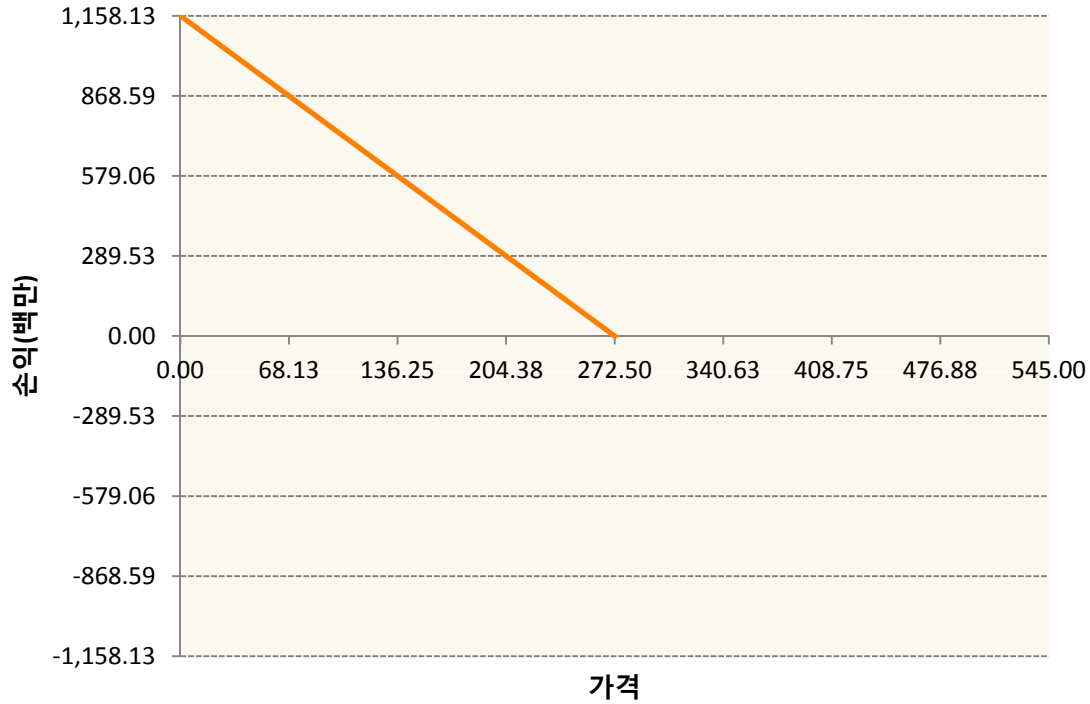


KR4301P82707-2019-08 풋270





KR4301P82723-2019-08 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						905
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-905	-905	-905	-905	-905	-905	-905	
-5.33%	-603	-603	-603	-603	-603	-603	-603	
-2.67%	-302	-302	-302	-302	-302	-302	-302	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	302	302	302	302	302	302	302	
5.33%	603	603	603	603	603	603	603	
8.00%	905	905	905	905	905	905	905	
KR4201P82857		2019-08 콜285						263
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1	
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1	
-2.67%	1	1	1	1	1	1	0	

0%	1	1	1	0	-1	-3	-5
2.67%	-1	-3	-6	-10	-15	-22	-29
5.33%	-25	-35	-47	-59	-73	-87	-102
8.00%	-145	-165	-184	-204	-224	-243	-263
KR4201P82873 2019-08 콜287.5							34
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	-1
2.67%	0	0	0	-1	-1	-2	-3
5.33%	-2	-3	-5	-6	-8	-10	-12
8.00%	-15	-18	-21	-25	-28	-31	-34
KR4301P82707 2019-08 풋270							42
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	42	42	42	42	42	42	42
-5.33%	28	28	28	28	28	28	28
-2.67%	14	14	14	14	14	14	14
0%	0	0	0	0	0	0	1
2.67%	-11	-11	-11	-10	-10	-9	-9
5.33%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-13
8.00%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-14
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%	0	0	0	0	0	0	1
2.67%	-27	-27	-26	-25	-25	-24	-23
5.33%	-40	-39	-39	-38	-38	-37	-36
8.00%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-40

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

(단위:백만원)

944

공시일	2019-08-05
기준일	2019-08-02

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,953	0	3,953	
누계	유가증권	수익증권	53,805	0	53,805	

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	2019-08-05
기준일	2019-08-02

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	4,792	0	4,792	
누계	유가증권	수익증권	65,715	0	65,715	

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	2019-08-05
기준일	2019-08-02

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,594	0	3,594	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	445,476	0	445,476	
누계	통화	선도	0	444,578	-444,578	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E	3,163
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E	2,147
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E	1,725
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E	2,108
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E	134
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	575
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	3,067
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	3,354
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E	479
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E	958
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E	2,981
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E	1,668
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E	767
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E	1,917
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E	1,917
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	288
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	96
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	709
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	709
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	288
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E	671
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E	2,684
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E	1,342
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E	767
FX21019N04 KRW/USD 03-09-19E	288
FX21019Q00 KRW/USD 03-09-19E	288
FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E	479

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

(단위:백만원)

11,316

공시일	2019-08-05
기준일	2019-08-02

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

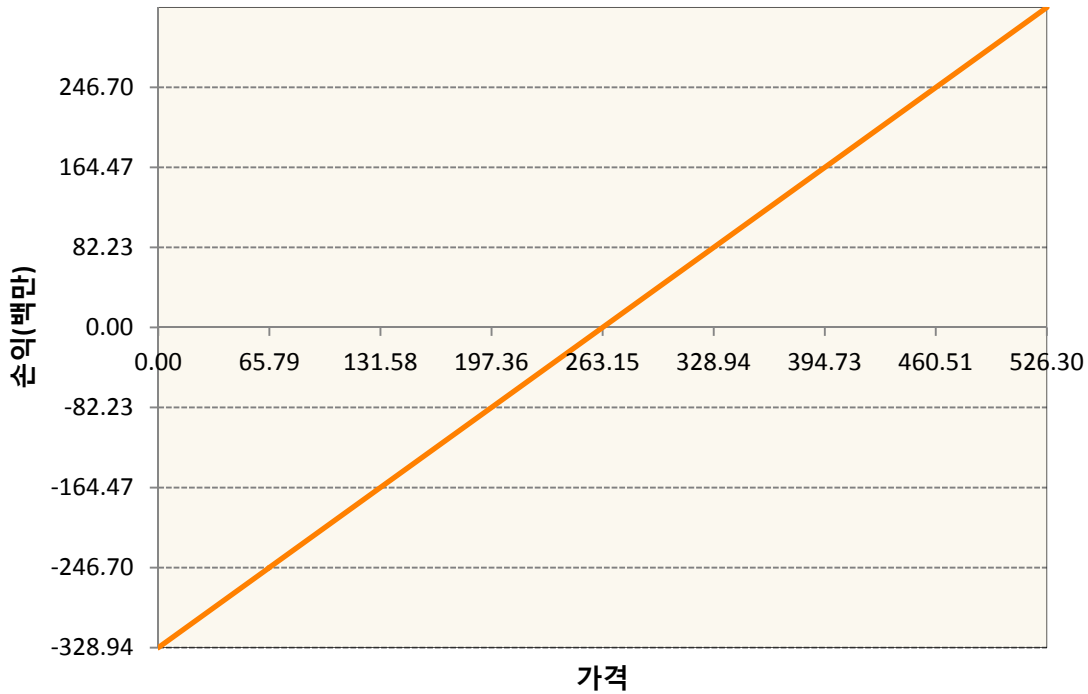
1. 계약금액

(단위:백만원)

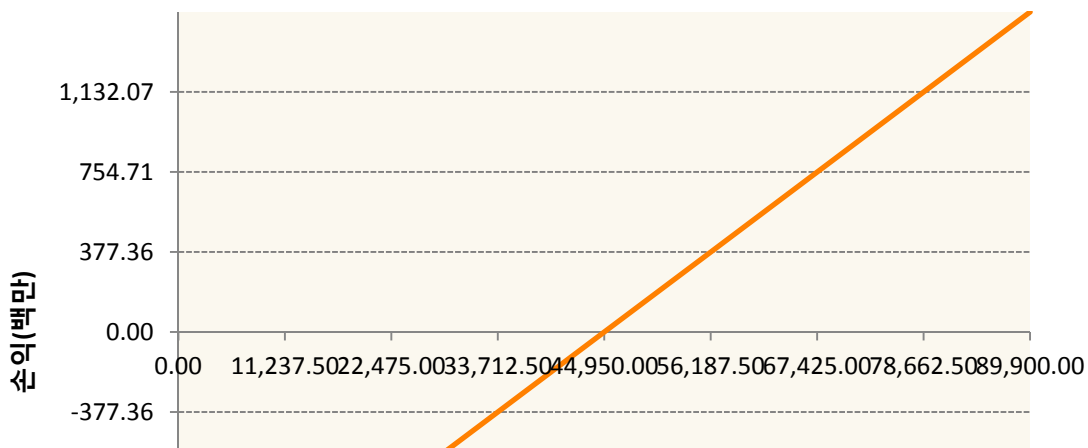
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,838	0	1,838	장내

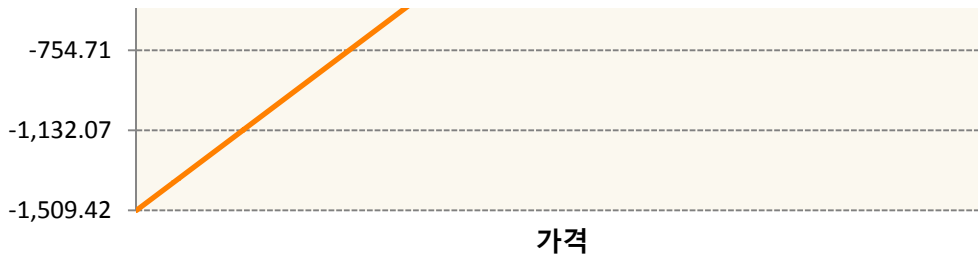
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P80001-2019-08 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						26
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26	
-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%	26	26	26	26	26	26	26	
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)

175

공시일	2019-08-05
기준일	2019-08-02

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

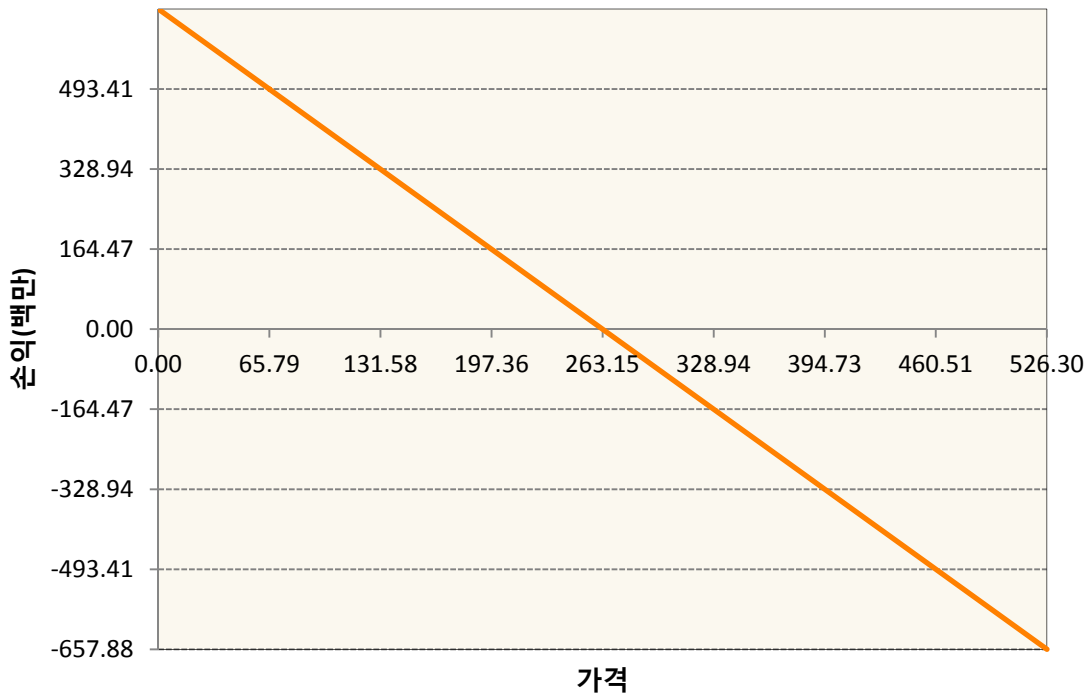
1. 계약금액

(단위:백만원)

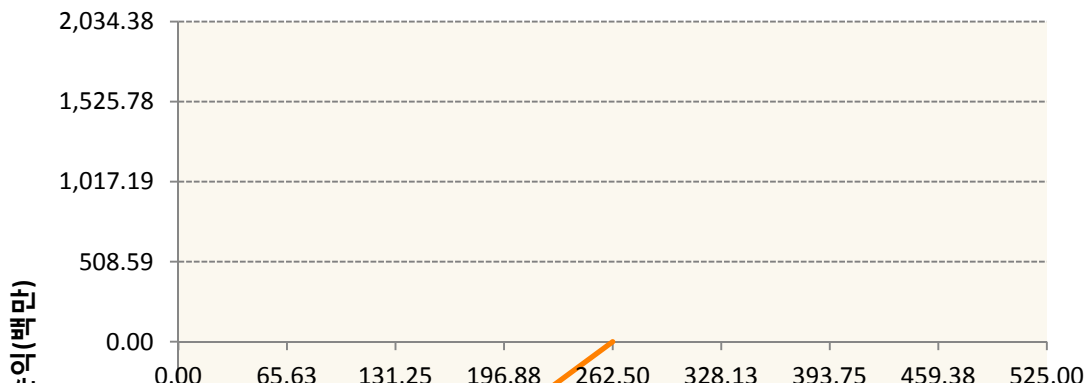
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	658	-658	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,691	-3,691	장내

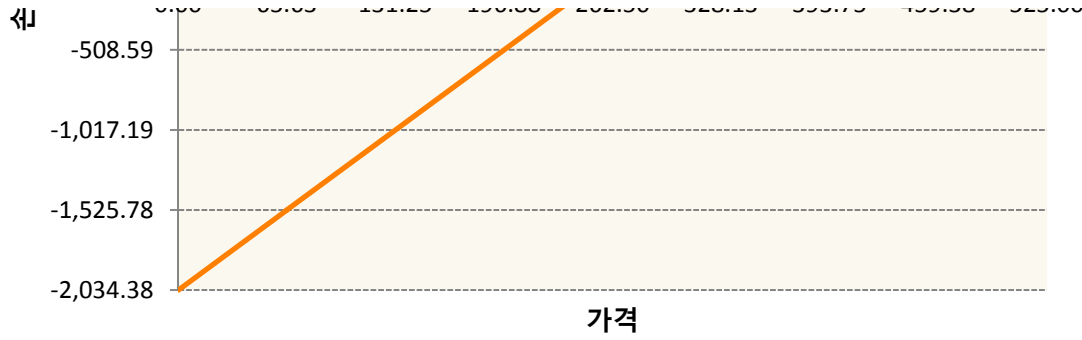
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

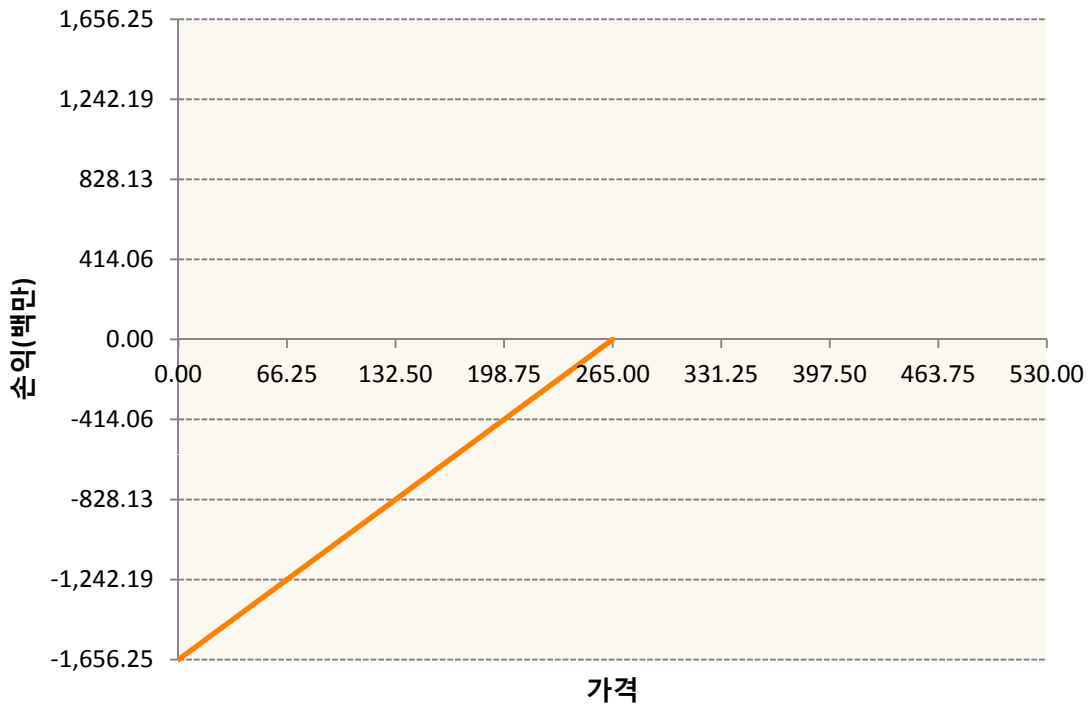


KR4301P82624-2019-08 풋262.5





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						145
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-145	-145	-145	-145	-145	-145	-145
-5.33%	-90	-90	-90	-90	-91	-91	-91
-2.67%	-37	-37	-38	-38	-39	-40	-40
0%	4	3	1	0	-1	-3	-4
2.67%	14	14	14	13	13	12	11
5.33%	15	15	15	15	15	15	15
8.00%	15	15	15	15	15	15	15
KR4301P82657 2019-08 풋265							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%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
-2.67%	-36	-36	-36	-36	-37	-37	-38
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	19	19	18	17	17	16	15
5.33%	21	21	21	21	20	20	20
8.00%	21	21	21	21	21	21	21

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

(단위:백만원)

394

공시일	2019-08-05
기준일	2019-08-02

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	18,969	0	18,969	
누계	통화	선도	0	18,569	-18,569	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		997
FX21019N01 KRW/USD 12-08-19E		163
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		326

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

(단위:백만원)

473

공시일	2019-08-05
기준일	2019-08-02

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	379	0	379	장외
누계	통화	선도	0	50	-50	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	2019-08-05
기준일	2019-08-02

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

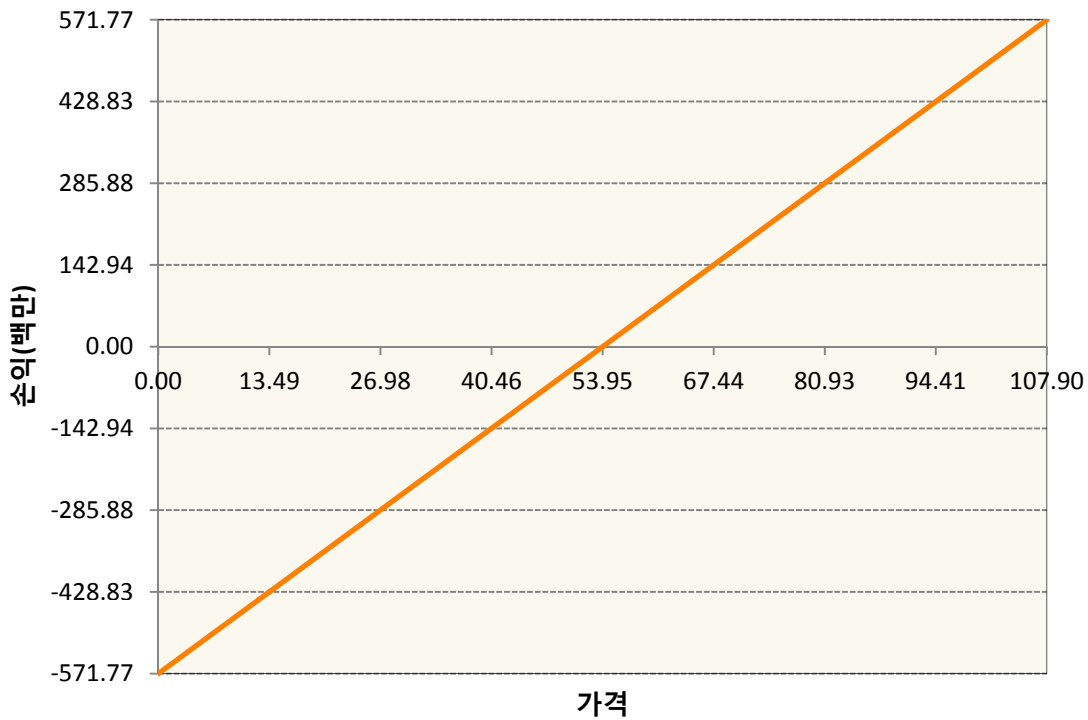
1. 계약금액

(단위:백만원)

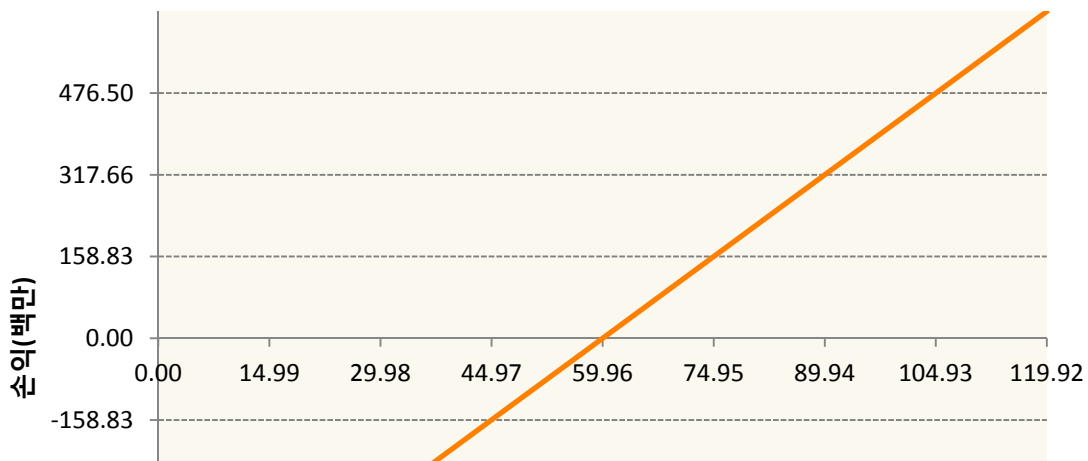
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,448	120	2,329	

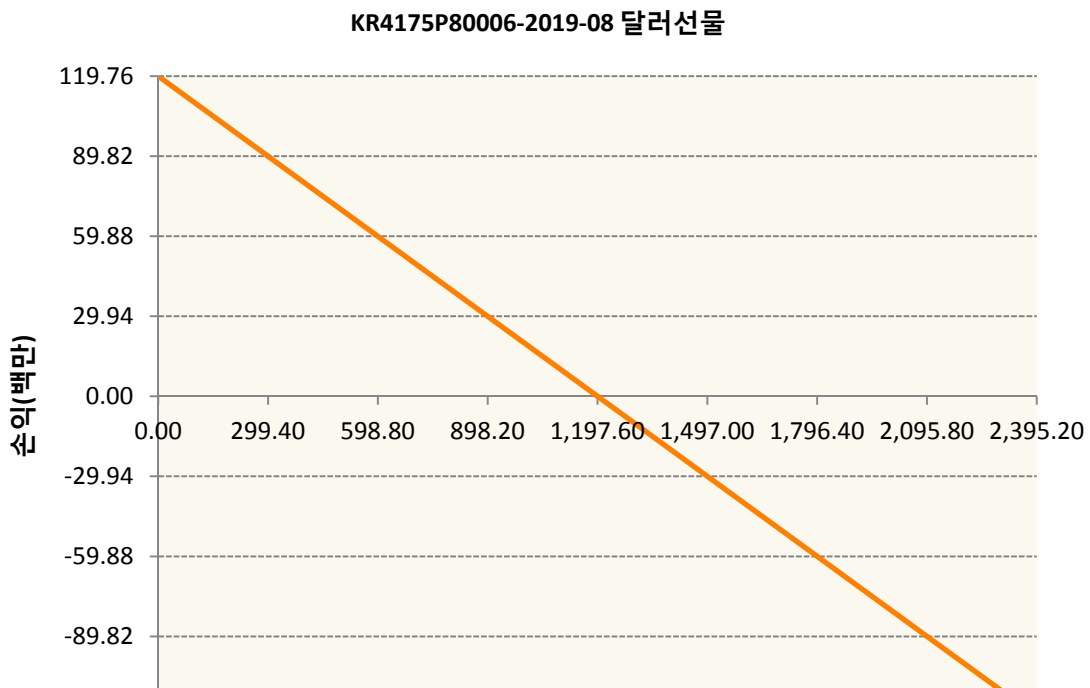
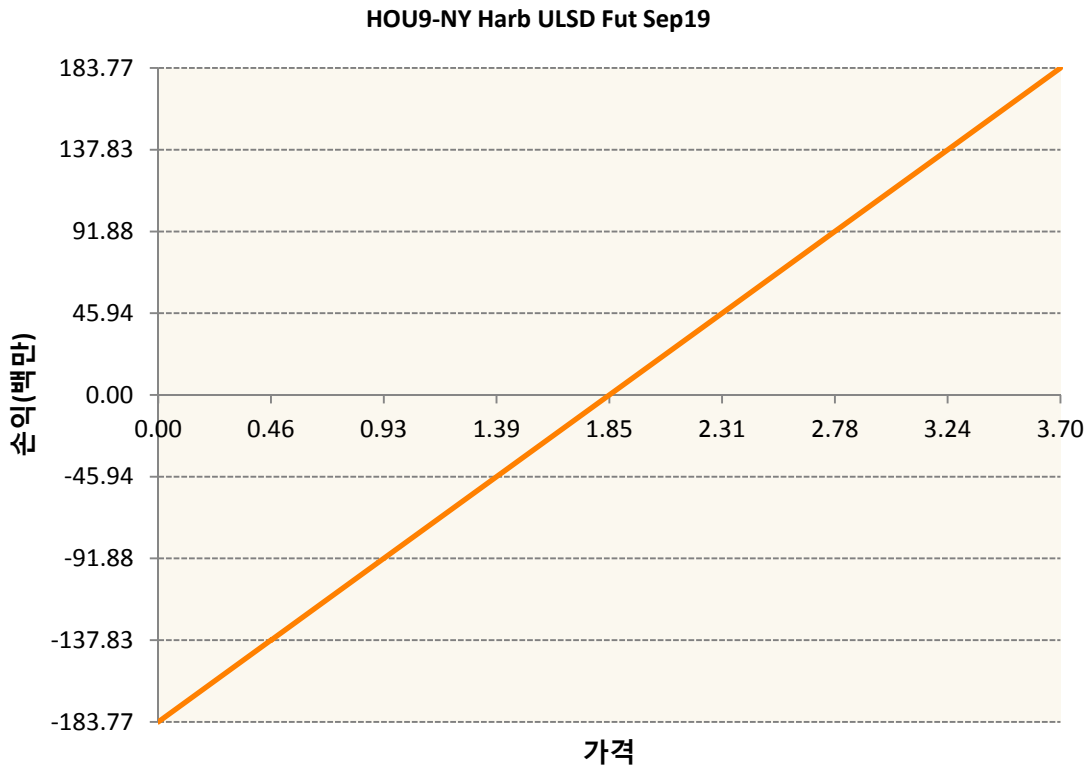
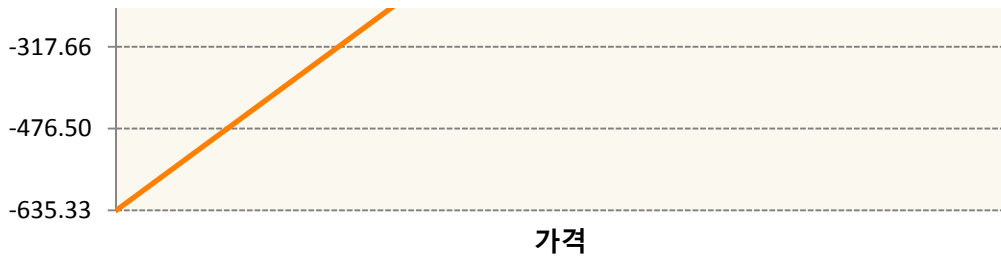
2. 만기시점의 손익구조

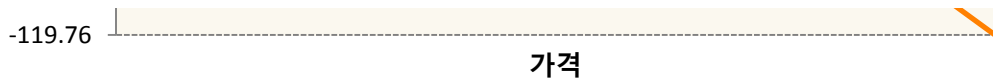
CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19



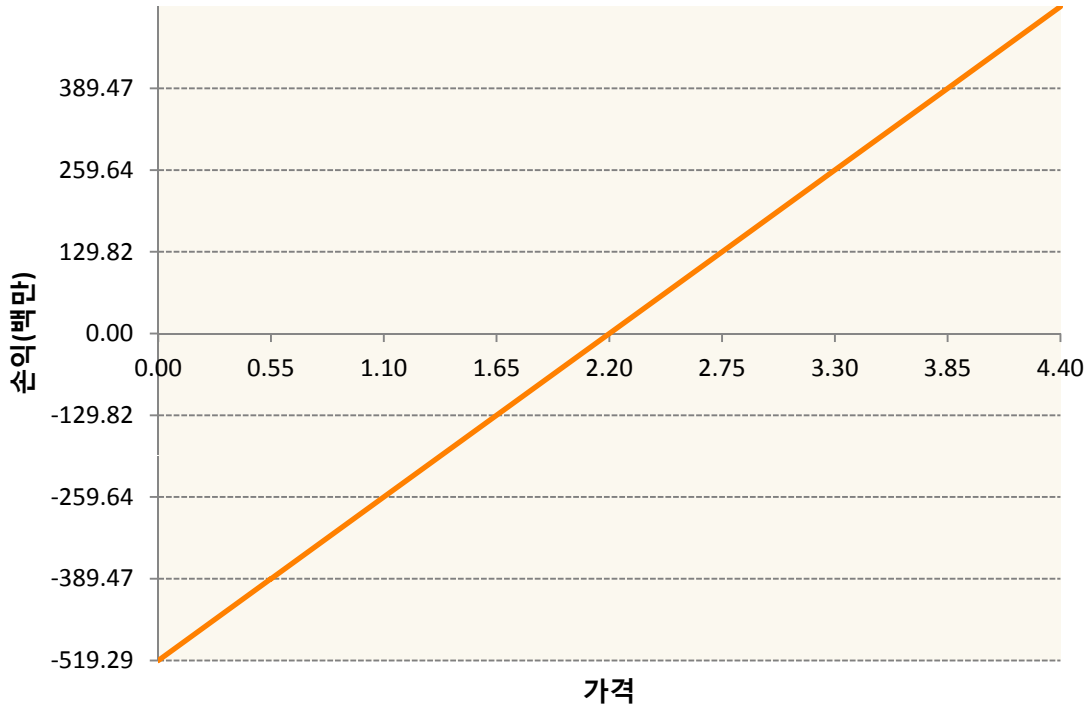
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19



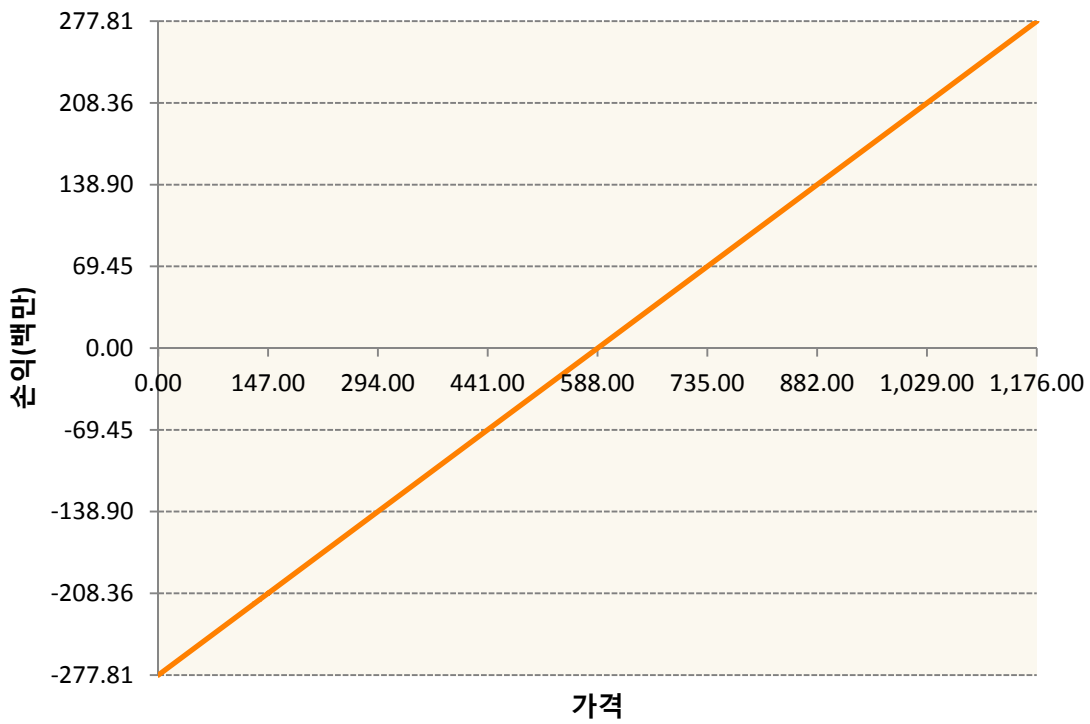




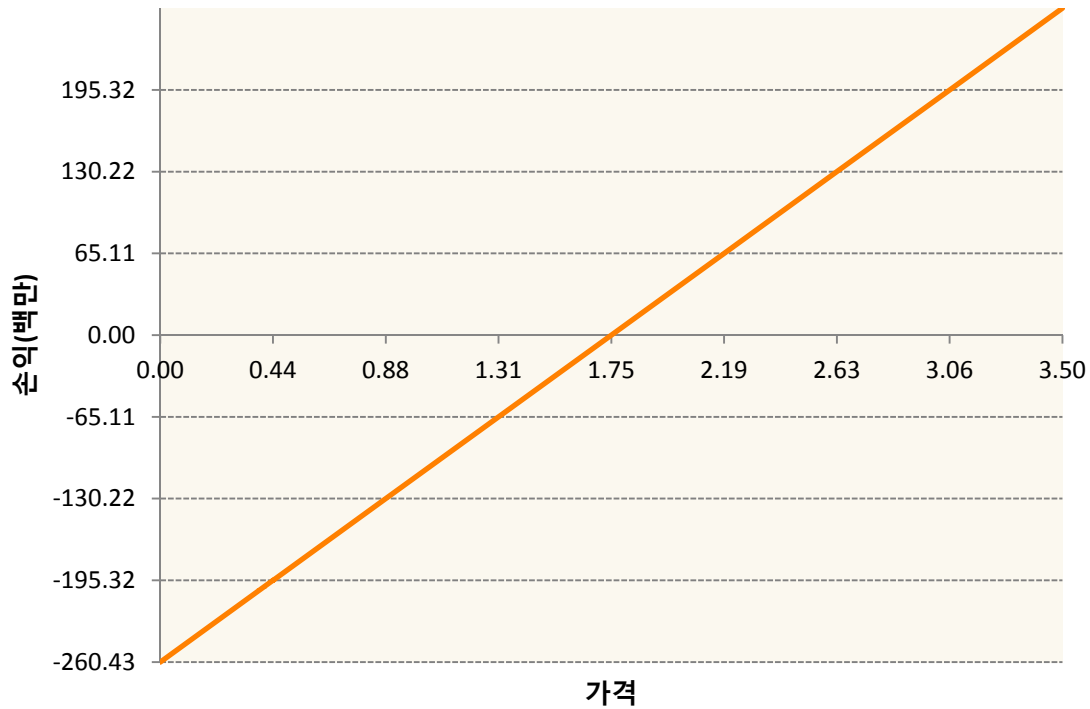
NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



QSU9-Low Su Gasoil G Sep19



XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	46
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	51
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	15
KR4175P800	2019-08 달러선물	10
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	42
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	22
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	21

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

(단위:백만원)

363

공시일	2019-08-05
기준일	2019-08-02

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

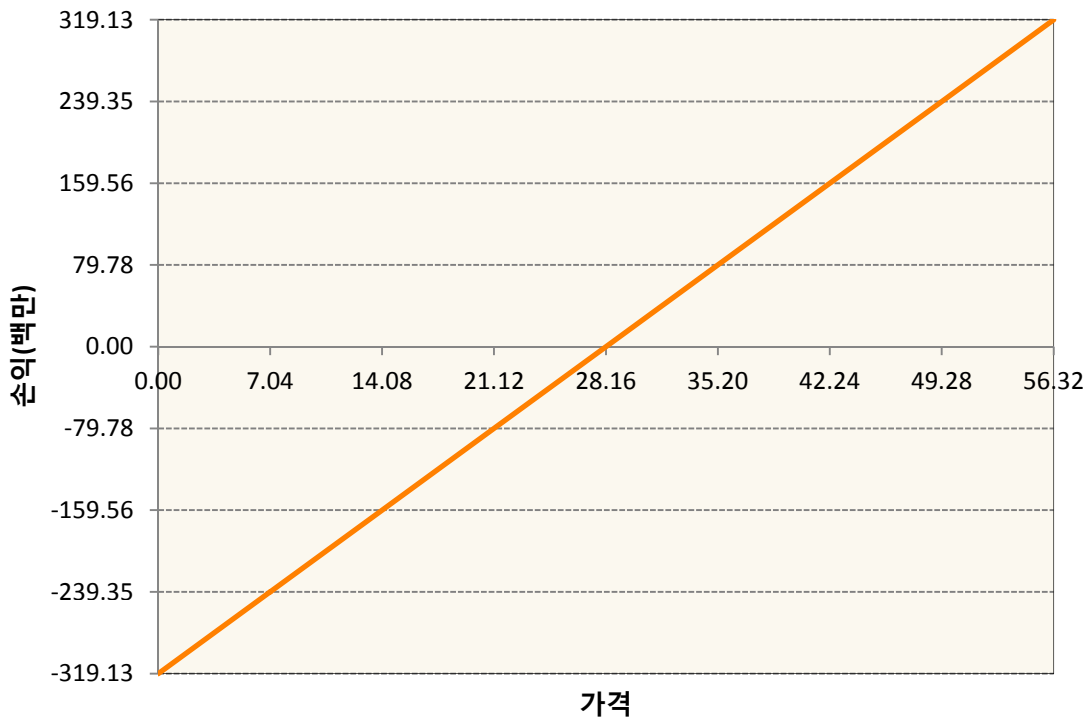
1. 계약금액

(단위:백만원)

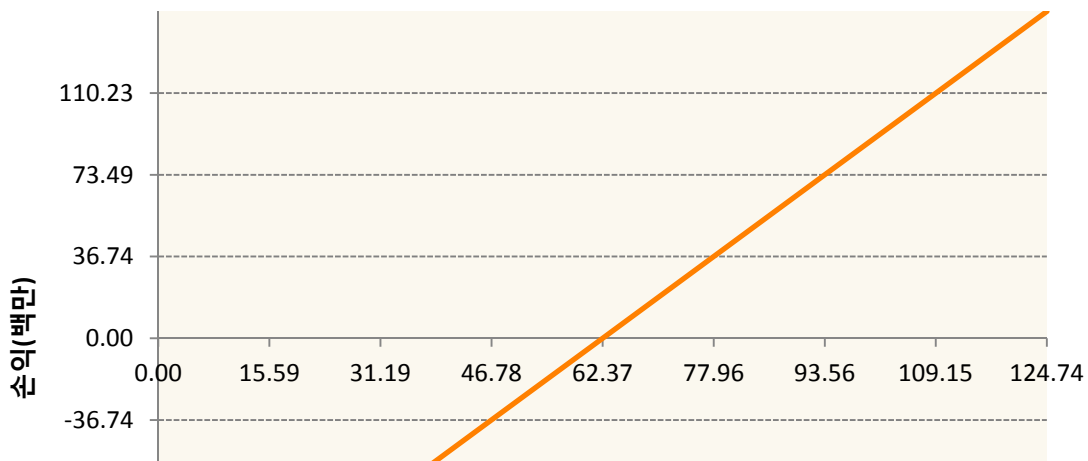
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,867	204	2,663	

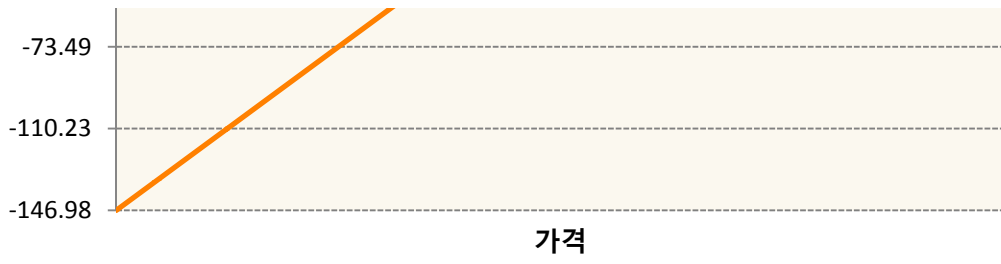
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

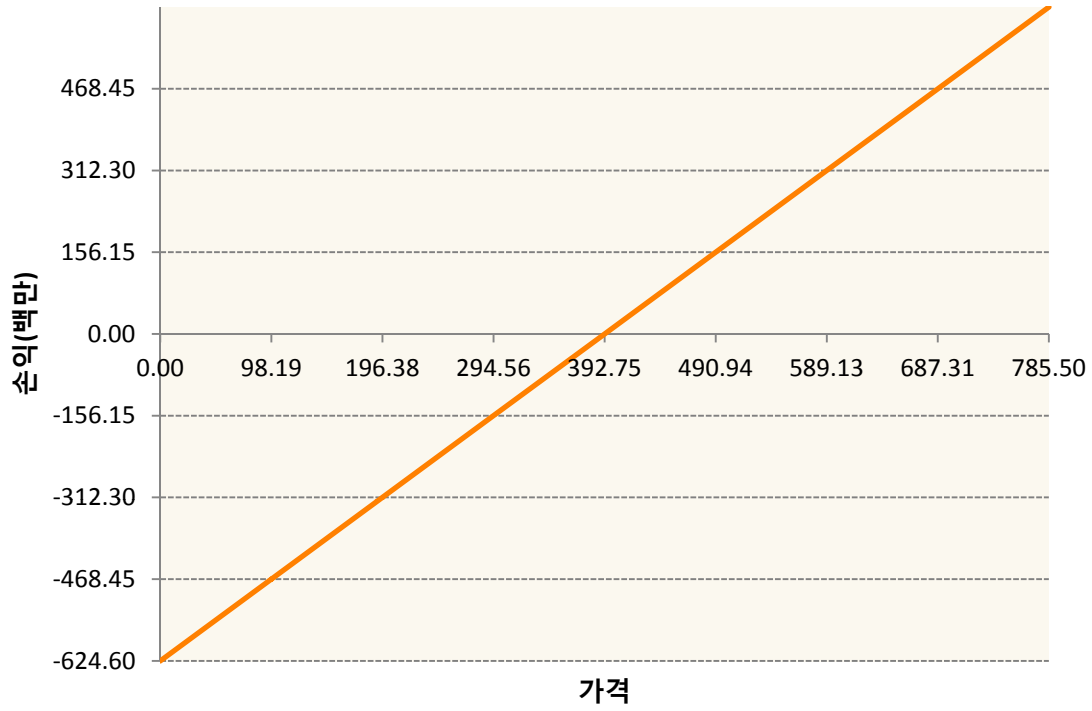


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

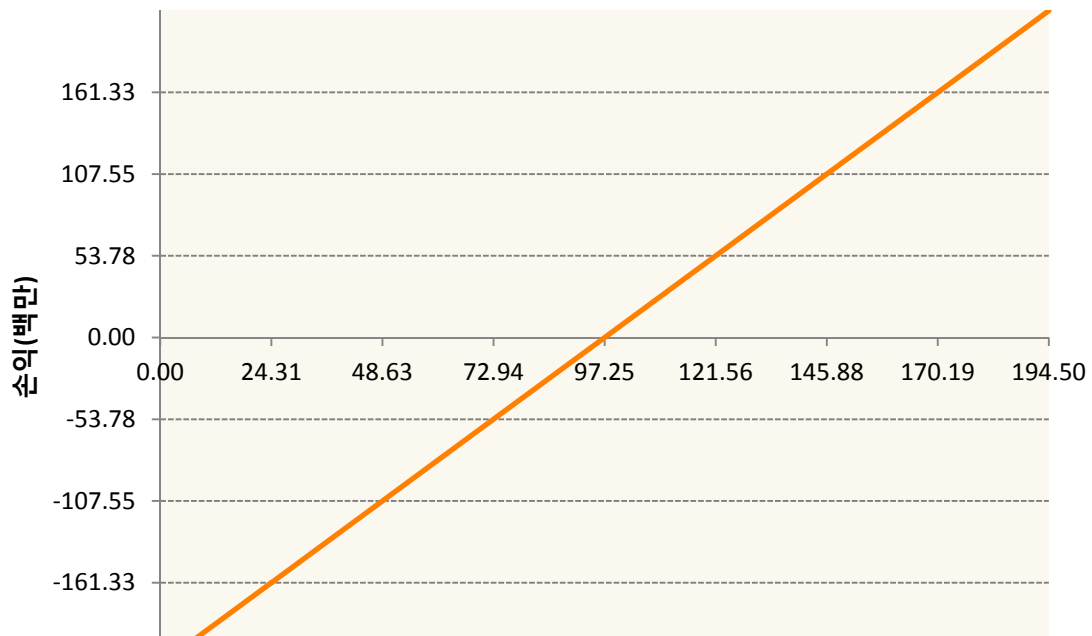


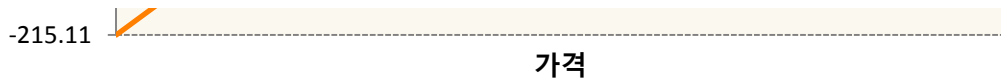


CU9-CORN FUTURE Sep19

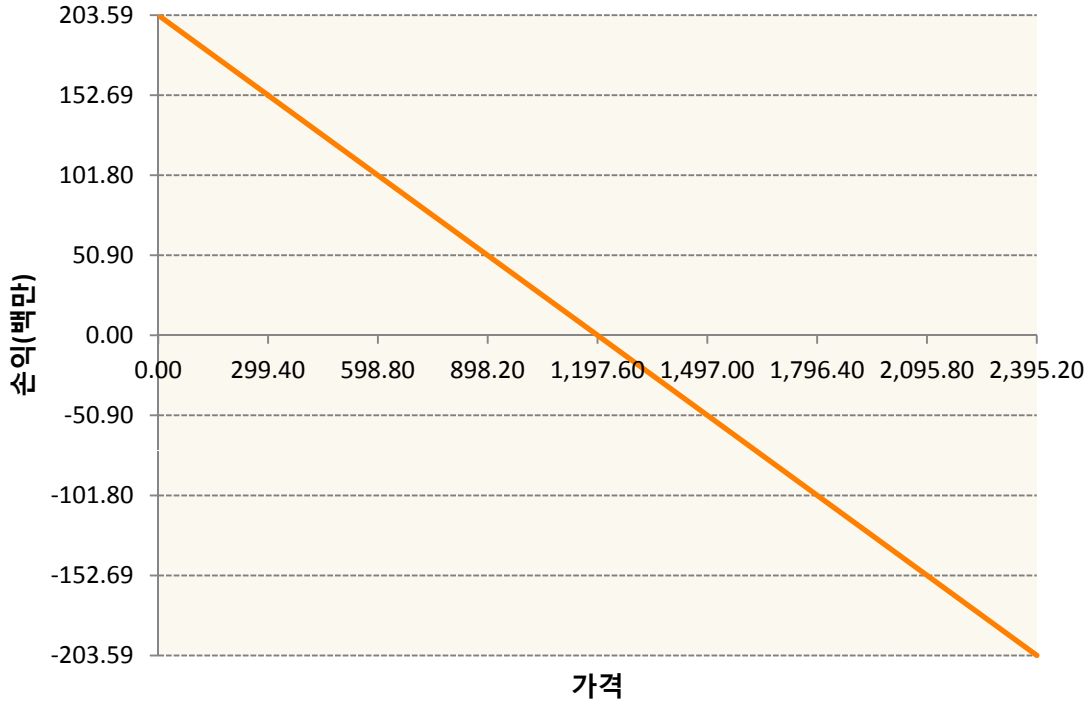


KCU9-COFFEE 'C' FUTURE Sep19

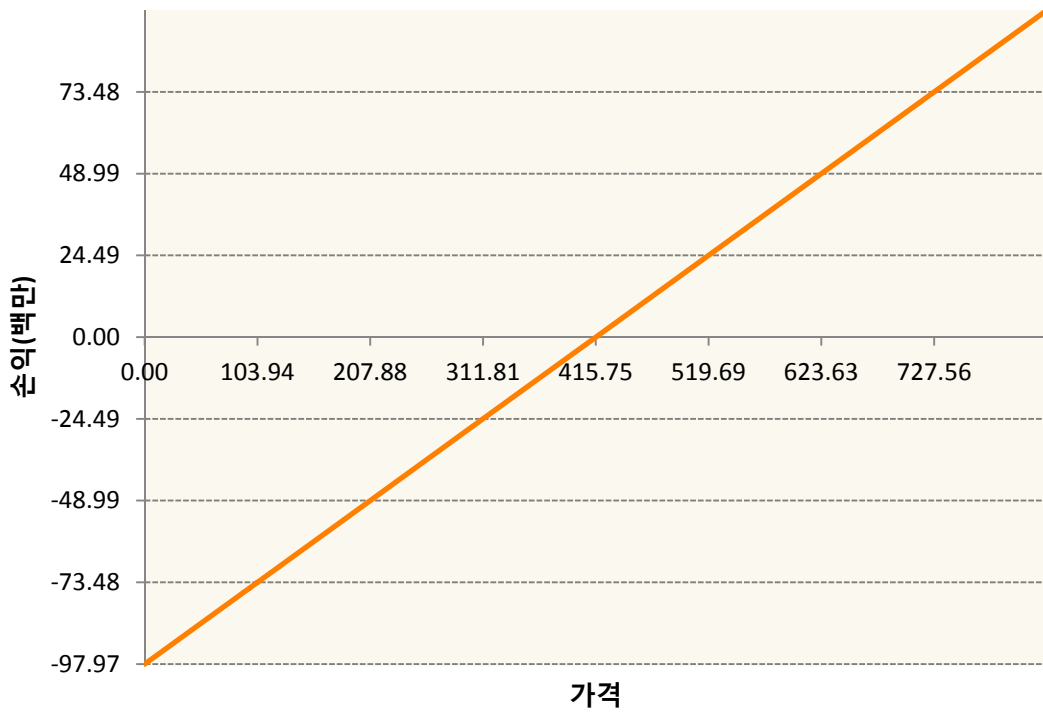




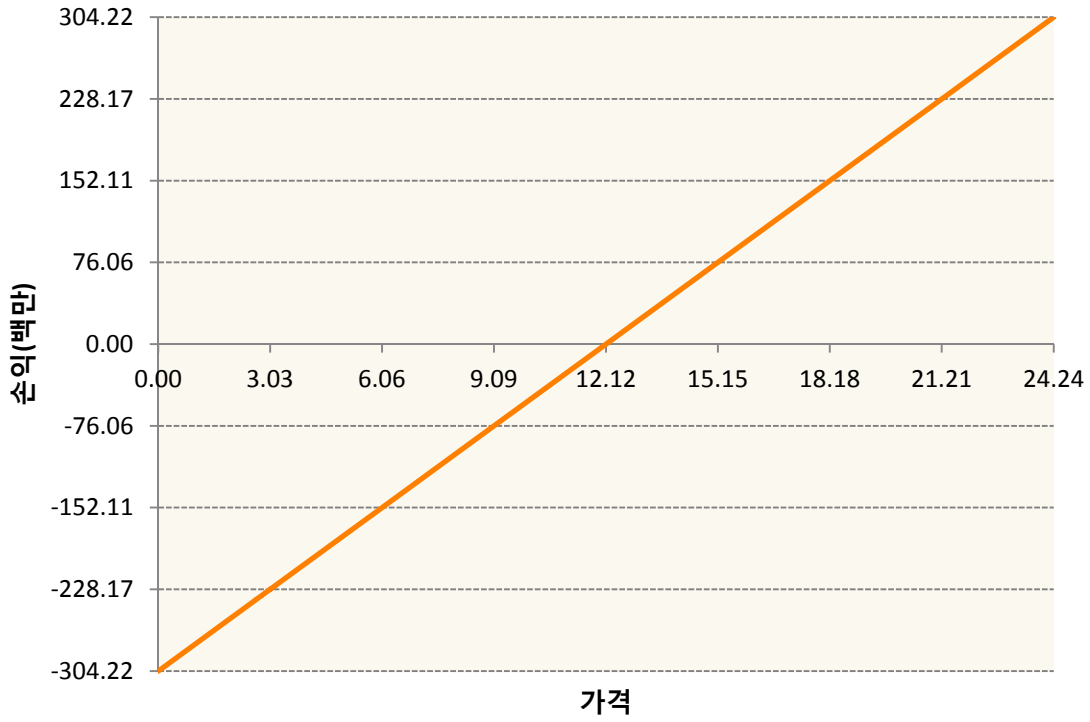
KR4175P80006-2019-08 달러선물



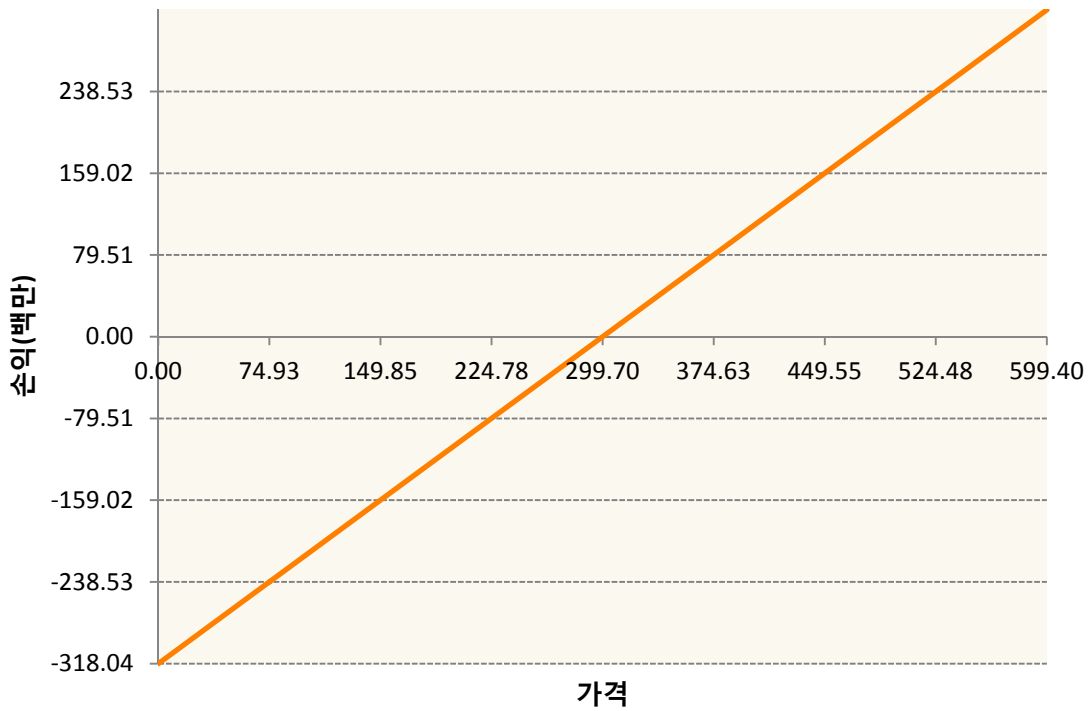
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

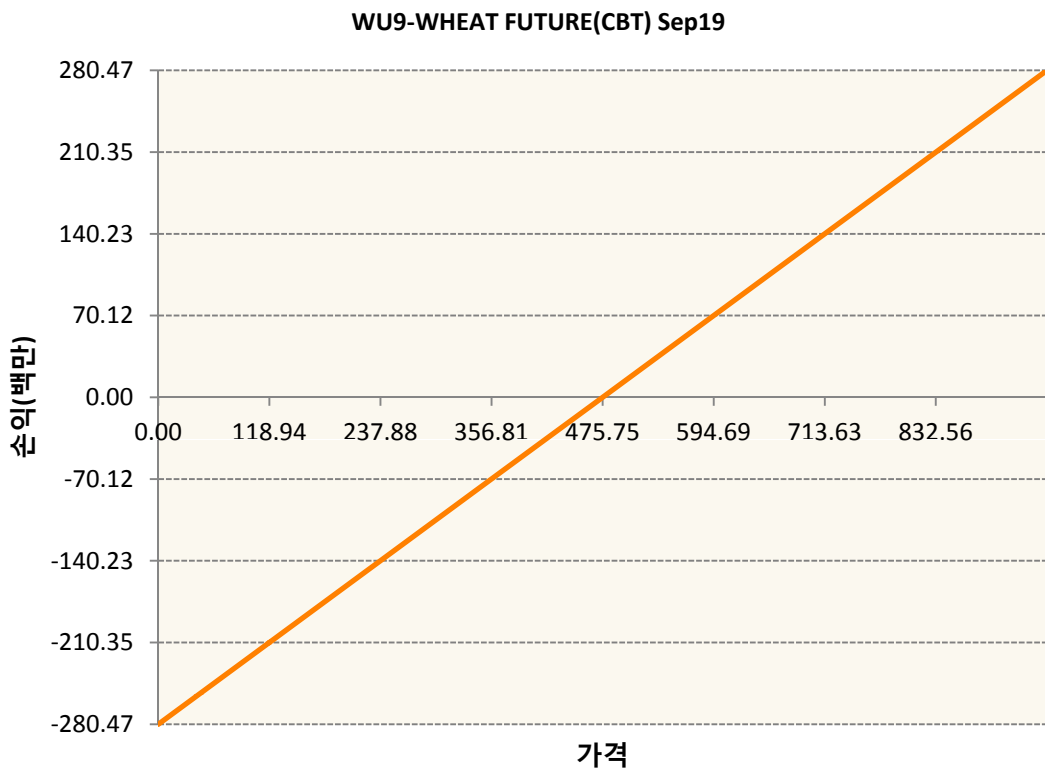
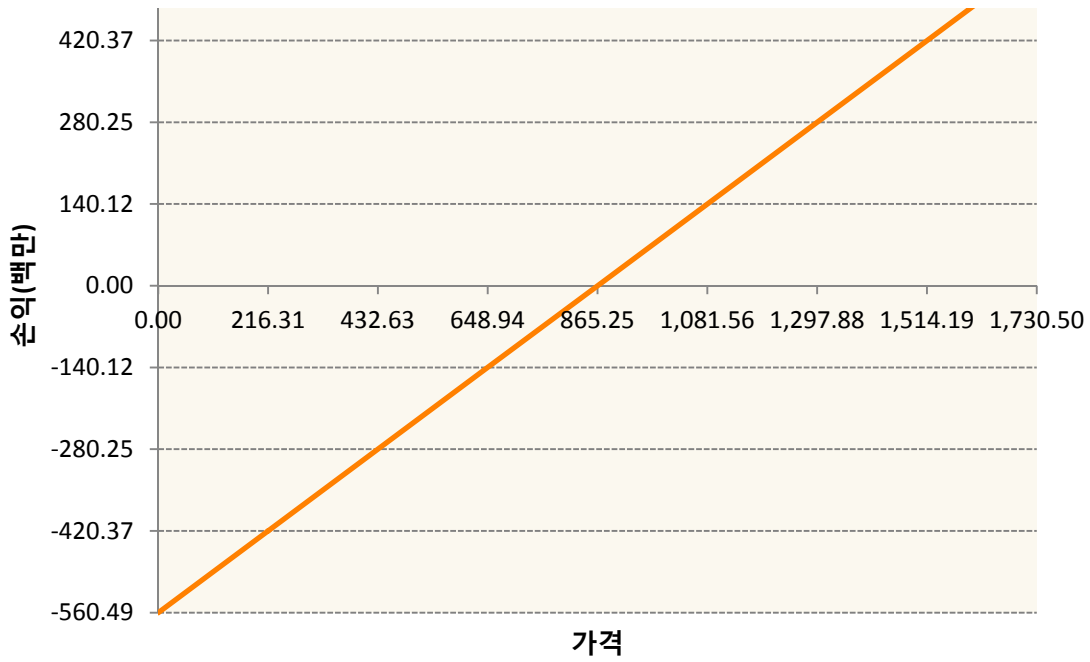


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



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	50
KCU9	COFFEE 'C' FUTURE Sep19	17
KR4175P800	2019-08 달러선물	16

KWU9	KC HRW WHEAT FUT Sep19	8
SBV9	SUGAR #11 (WORLD) Oct19	24
SMZ9	SOYBEAN MEAL FUTR Dec19	25
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	45
WU9	WHEAT FUTURE(CBT) Sep19	22

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

(단위:백만원)

253