

공시일	2019-08-06
기준일	2019-08-05

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)

88

공시일	2019-08-06
기준일	2019-08-05

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

1,151

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

648

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-06
기준일	2019-08-05

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)	365
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	133

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

802

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-06
기준일	2019-08-05

유로인덱스모(주식-파생형)

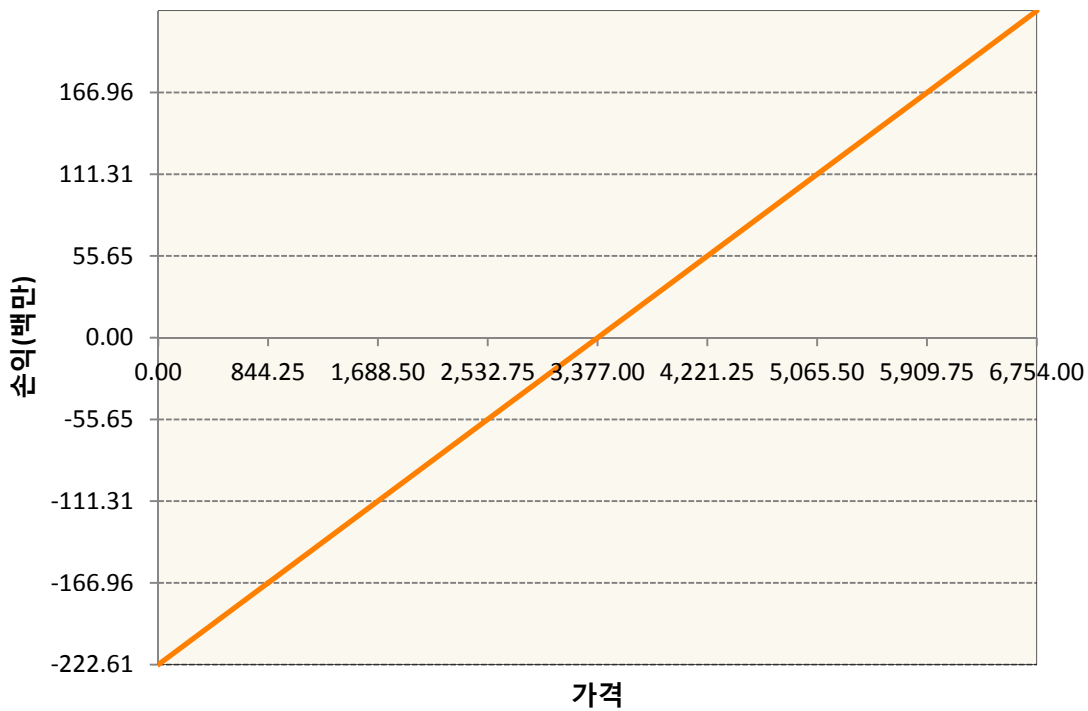
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	223	0	223	

2. 만기시점의 손익구조

VGU9-EURO STOXX 50 Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU9	EURO STOXX 50 Sep19	18
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

13

공시일	2019-08-06
기준일	2019-08-05

차이나인덱스모(주식-파생형)

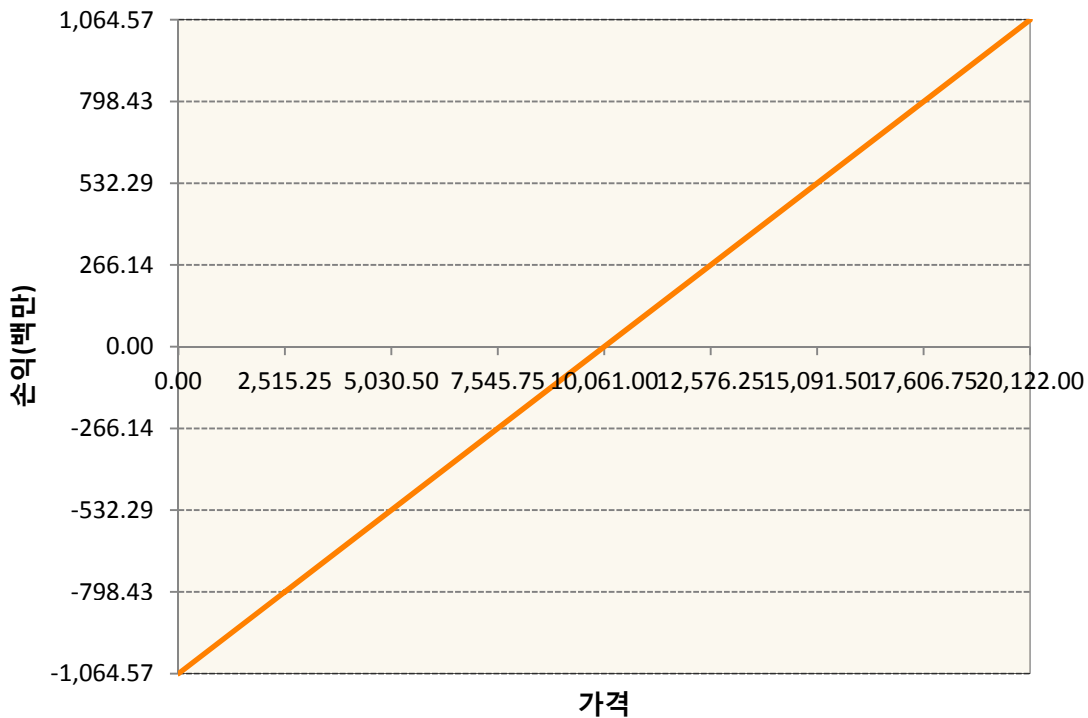
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,065	0	1,065	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCQ9	HSCEI Futures Aug19	85
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

82

공시일	2019-08-06
기준일	2019-08-05

커버드콜모(주식혼합-파생형)

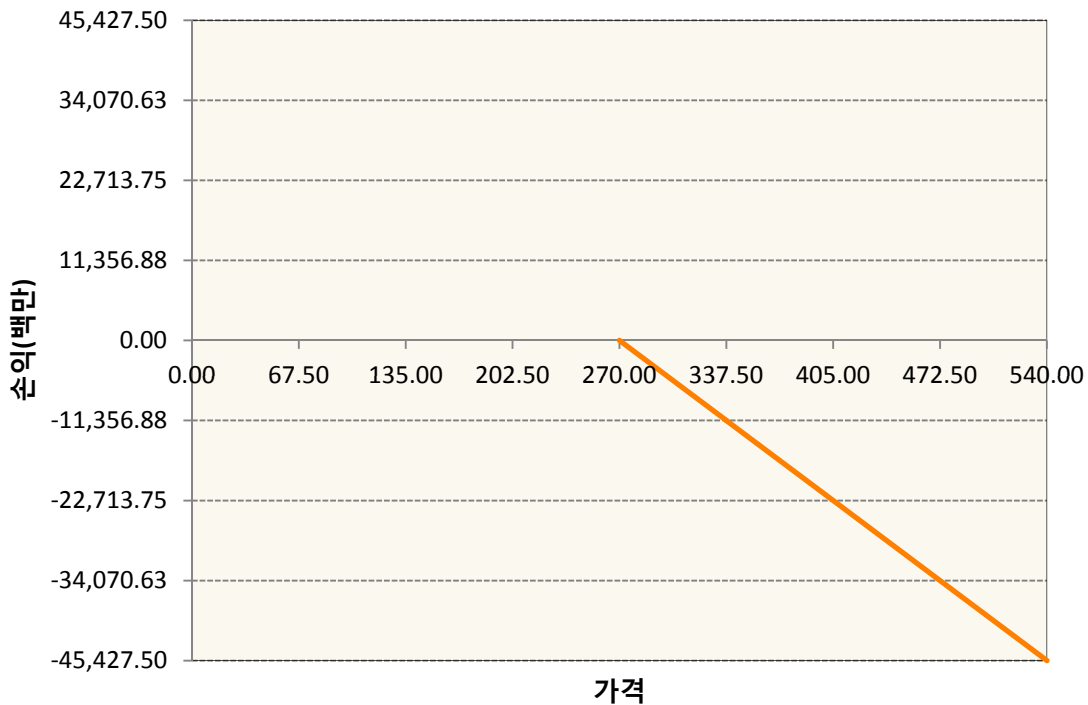
1. 계약금액

(단위:백만원)

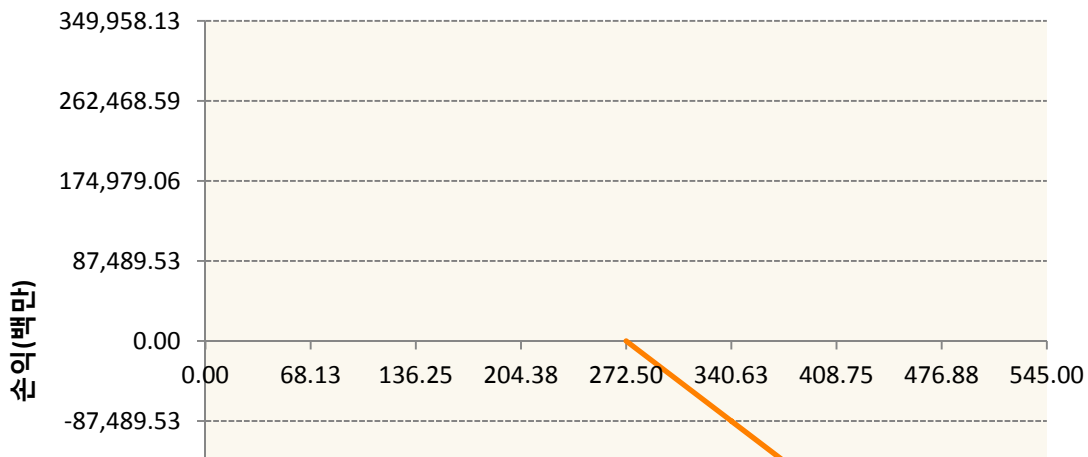
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	1,362	0	1,362	장내
누계	유가증권	옵션	0	580,273	-580,273	장내

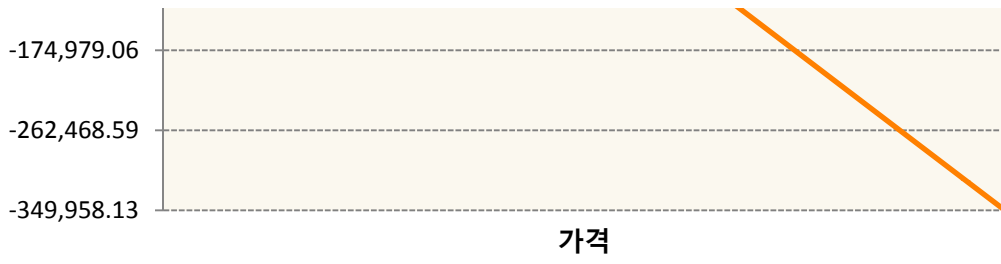
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P82709-2019-08 콜270

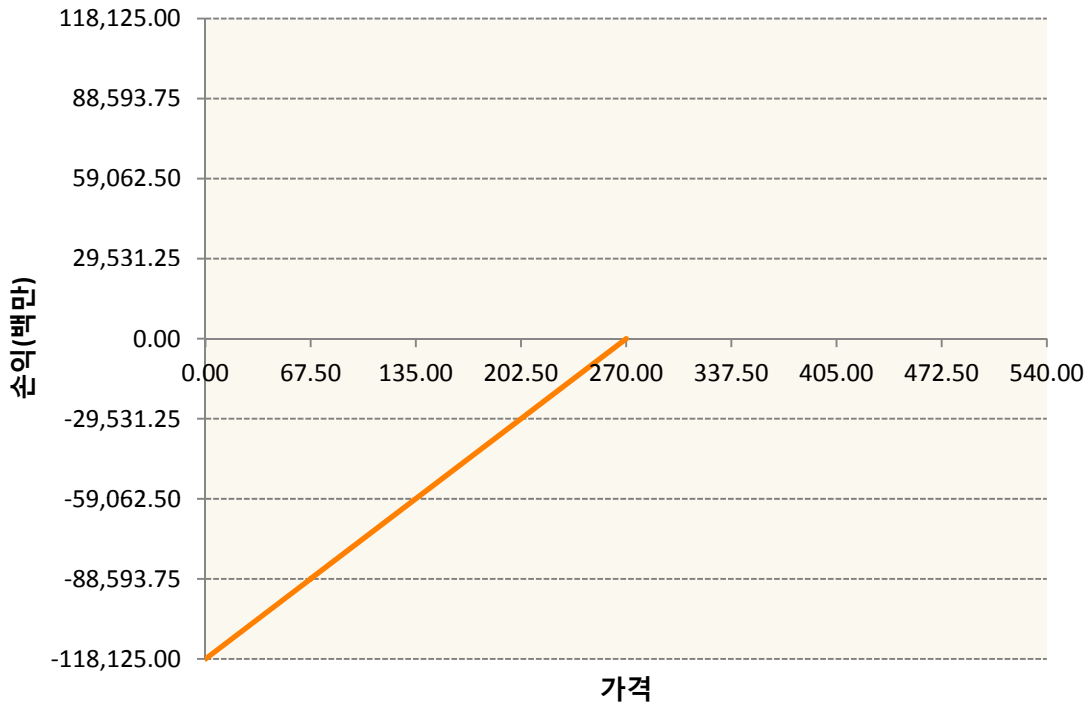


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

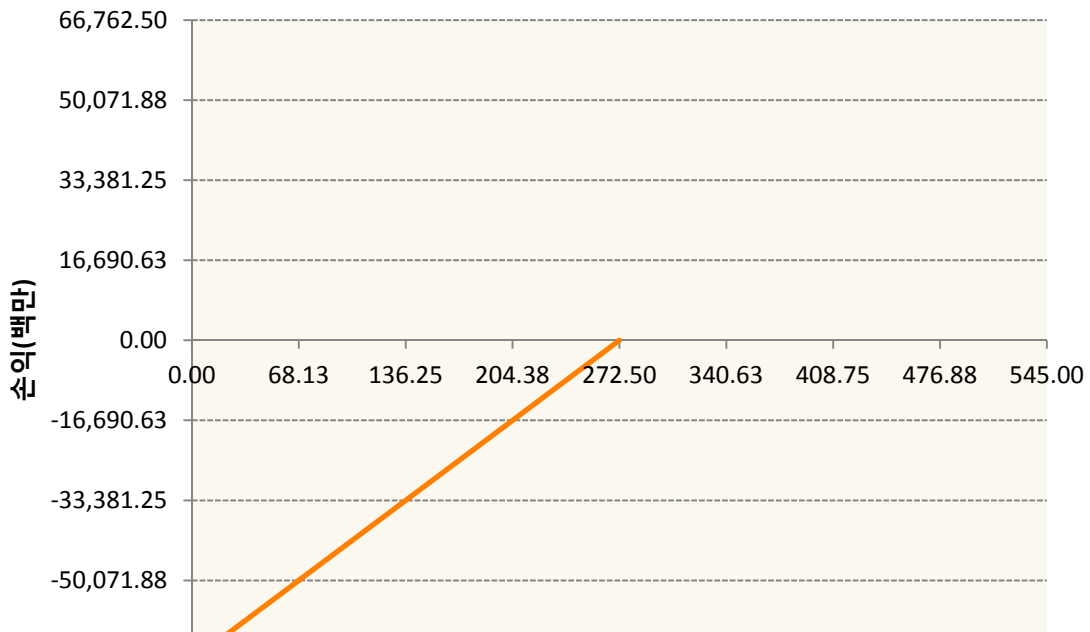




KR4301P82707-2019-08 풋270



KR4301P82723-2019-08 풋272.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P82709		2019-08 콜270						1,412
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	7	7	7	7	7	7	7	
-5.33%	7	7	7	7	7	7	7	
-2.67%	7	7	7	7	6	6	5	
0%	6	5	3	0	-4	-10	-18	
2.67%	-30	-46	-65	-86	-109	-133	-158	
5.33%	-388	-423	-458	-492	-527	-562	-597	
8.00%	-1,312	-1,323	-1,337	-1,352	-1,370	-1,390	-1,412	
KR4201P82725		2019-08 콜272.5						8,282
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	16	16	16	16	16	16	16	
-5.33%	16	16	16	16	16	16	16	
-2.67%	16	16	16	16	15	14	11	
0%	15	13	9	0	-15	-37	-68	
2.67%	-66	-126	-205	-302	-415	-542	-683	
5.33%	-1,505	-1,761	-2,018	-2,278	-2,539	-2,801	-3,064	
8.00%	-7,133	-7,293	-7,468	-7,657	-7,857	-8,066	-8,282	
KR4301P82707		2019-08 풋270						8,999
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-8,999	-8,999	-8,999	-8,999	-8,999	-8,999	-8,999	
-5.33%	-5,999	-5,999	-5,999	-5,999	-5,999	-5,999	-5,999	
-2.67%	-2,999	-2,999	-2,999	-2,999	-2,999	-2,999	-2,999	
0%	1	1	1	0	-1	-3	-7	
2.67%	2,980	2,965	2,945	2,921	2,893	2,861	2,827	
5.33%	5,200	5,137	5,073	5,009	4,945	4,880	4,816	
8.00%	5,611	5,604	5,594	5,581	5,563	5,542	5,517	
KR4301P82723		2019-08 풋272.5						5,040
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-5,040	-5,040	-5,040	-5,040	-5,040	-5,040	-5,040	
-5.33%	-3,360	-3,360	-3,360	-3,360	-3,360	-3,360	-3,360	
-2.67%	-1,680	-1,680	-1,680	-1,680	-1,680	-1,680	-1,680	
0%	0	0	0	0	0	0	-1	
2.67%	1,679	1,677	1,673	1,668	1,661	1,652	1,642	

5.33%	3,190	3,157	3,123	3,089	3,054	3,019	2,984
8.00%	3,734	3,721	3,705	3,687	3,667	3,645	3,621

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

(단위:백만원)

16,864

공시일	2019-08-06
기준일	2019-08-05

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

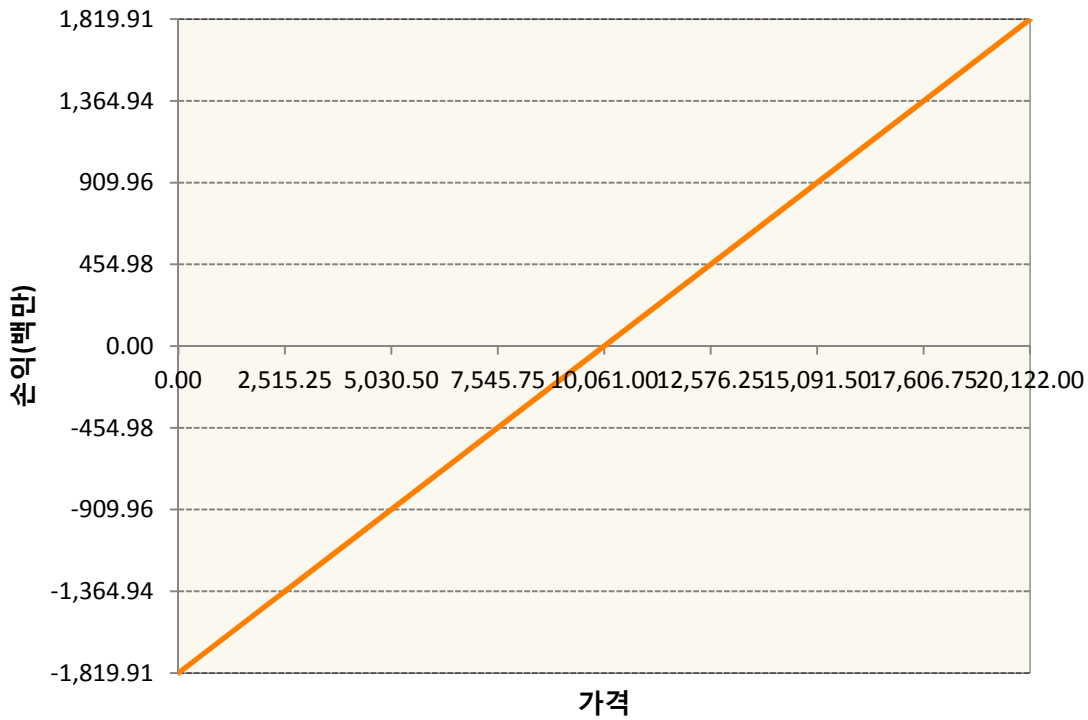
1. 계약금액

(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	1,820	0	1,820	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,540	-5,540	장내
누계	통화	선도	155	3,259	-3,104	장외

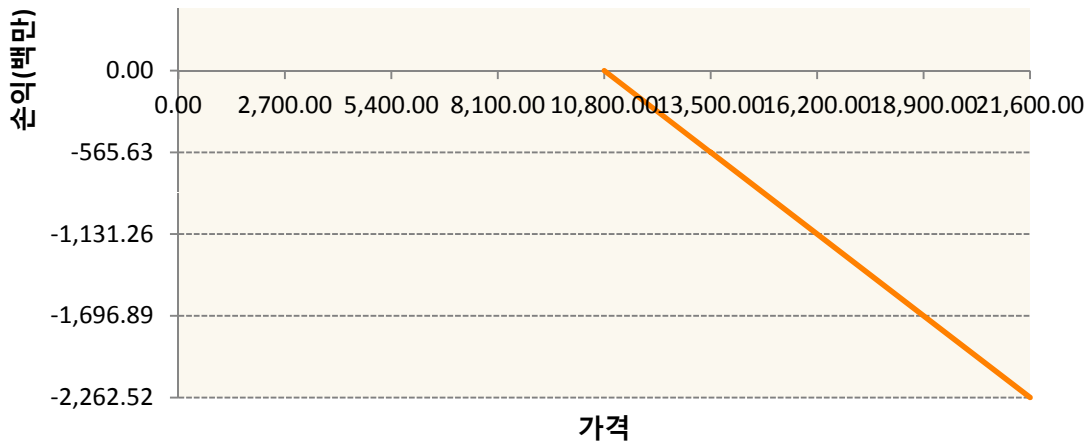
2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19

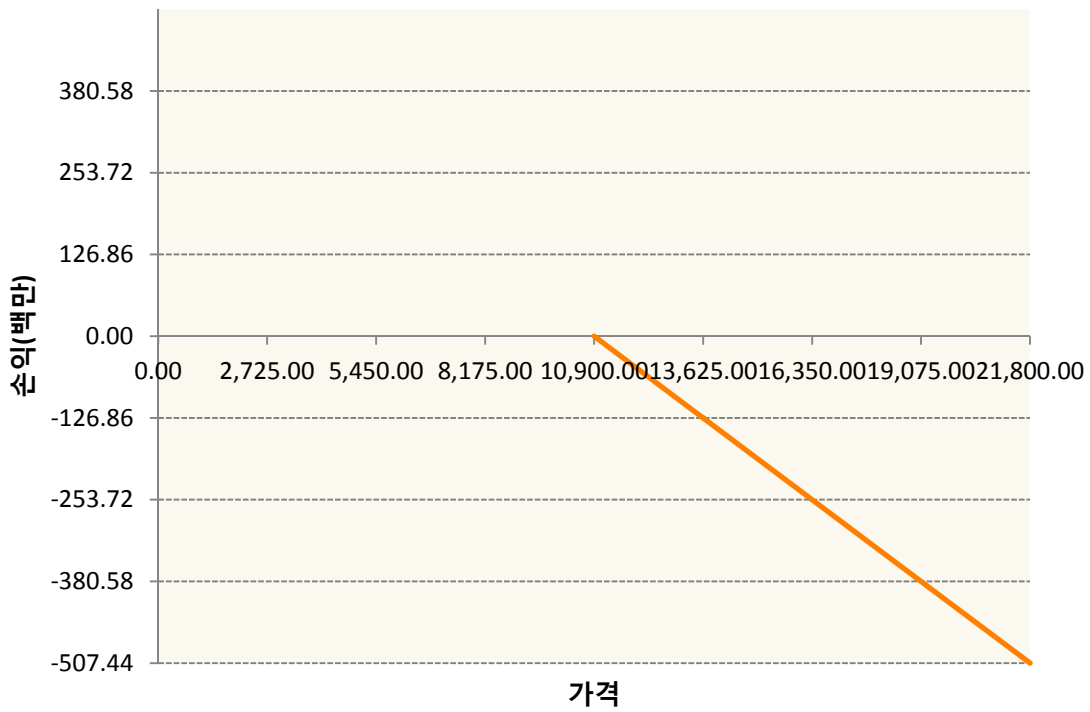


OHHIQ9-C108-HSCEI

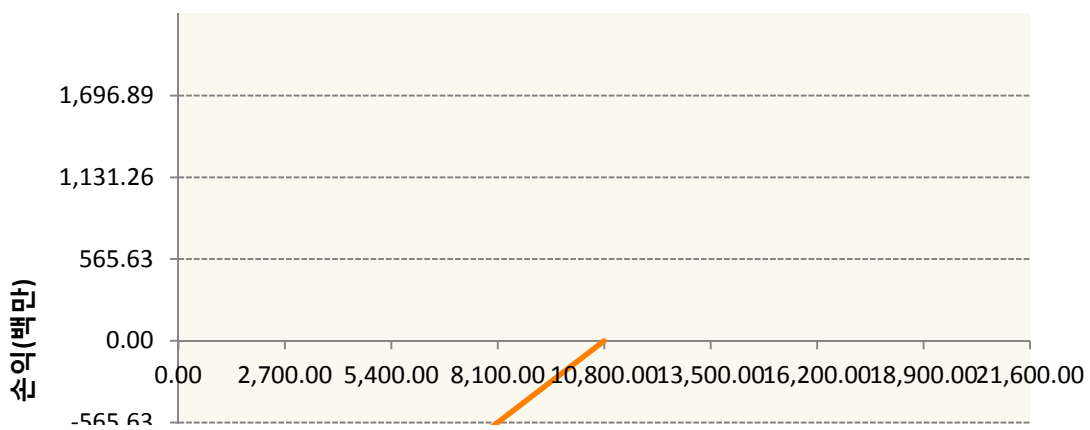


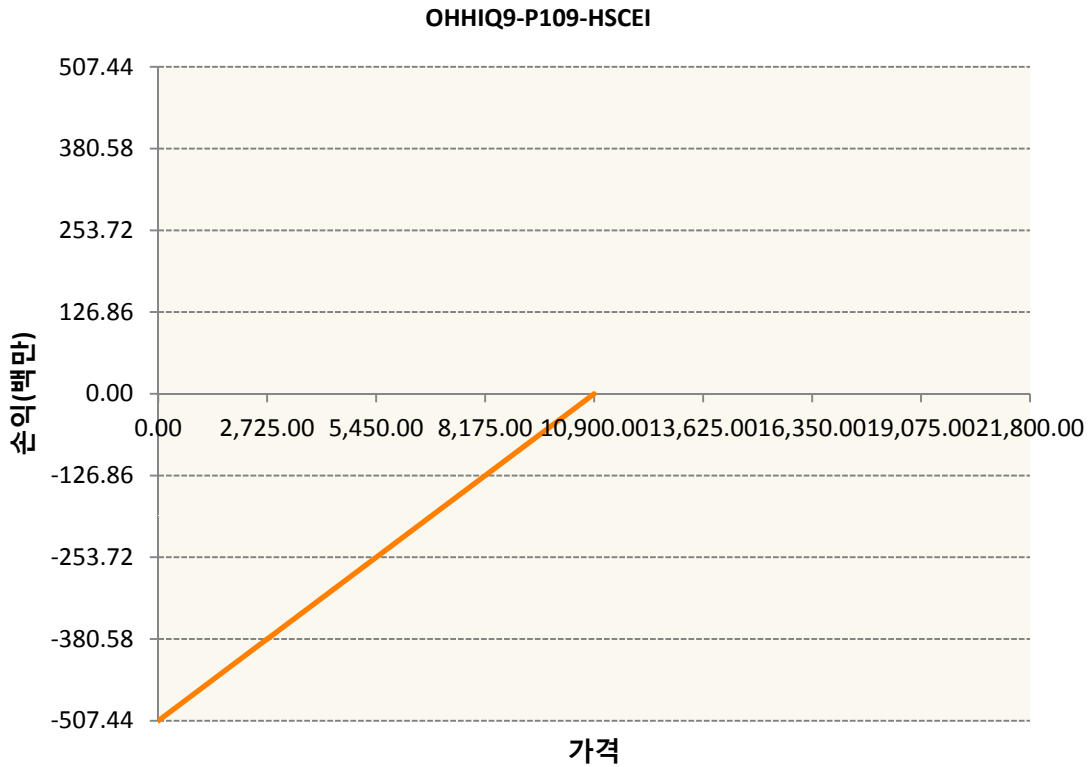


OHHIQ9-C109-HSCEI



OHHIQ9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	261
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E	12
HCQ9 HSCEI Futures Aug19	146
OHHIQ9-C1(HSCEI	181
OHHIQ9-C1(HSCEI	41
OHHIQ9-P1(HSCEI	181
OHHIQ9-P1(HSCEI	41

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	654

공시일	2019-08-06
기준일	2019-08-05

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

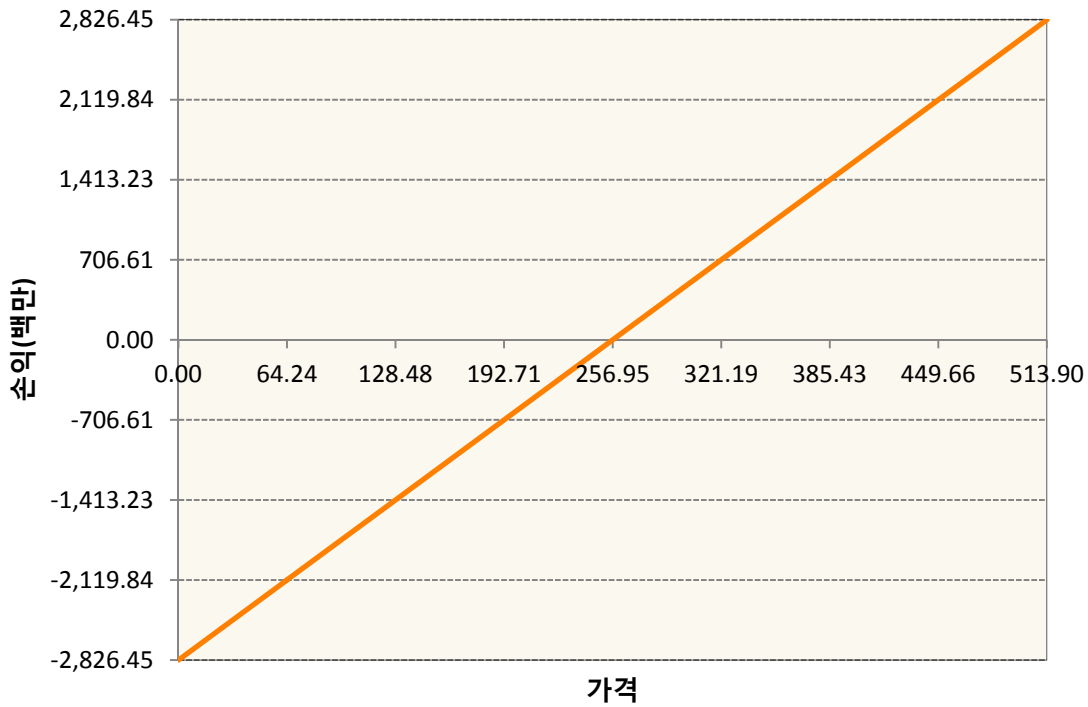
1. 계약금액

(단위:백만원)

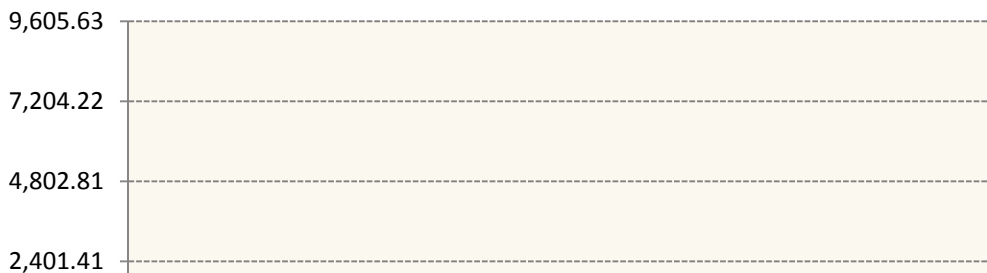
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	136	0	136	장내
누계	유가증권	선물	2,826	0	2,826	장내
누계	유가증권	스왑	18,836	0	18,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	18,817	-18,817	장내

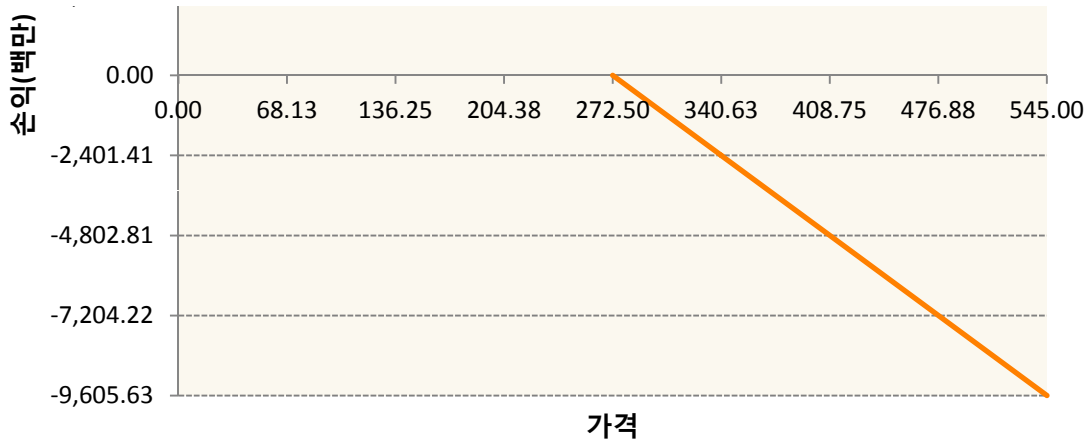
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

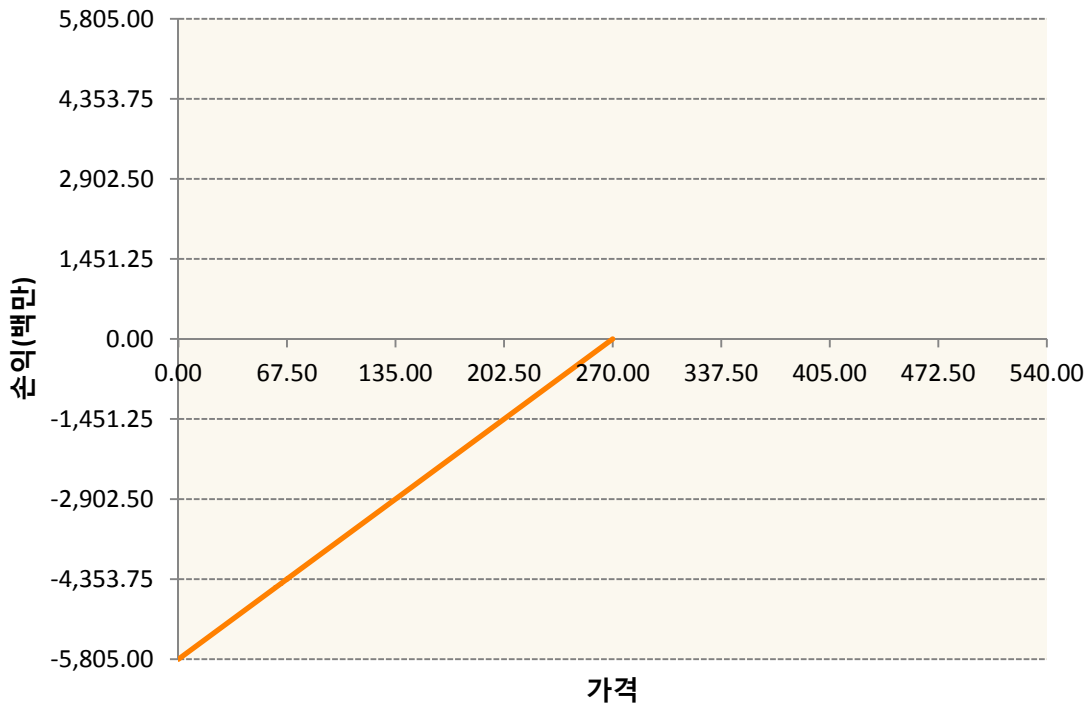


KR4201P82725-2019-08 콜272.5

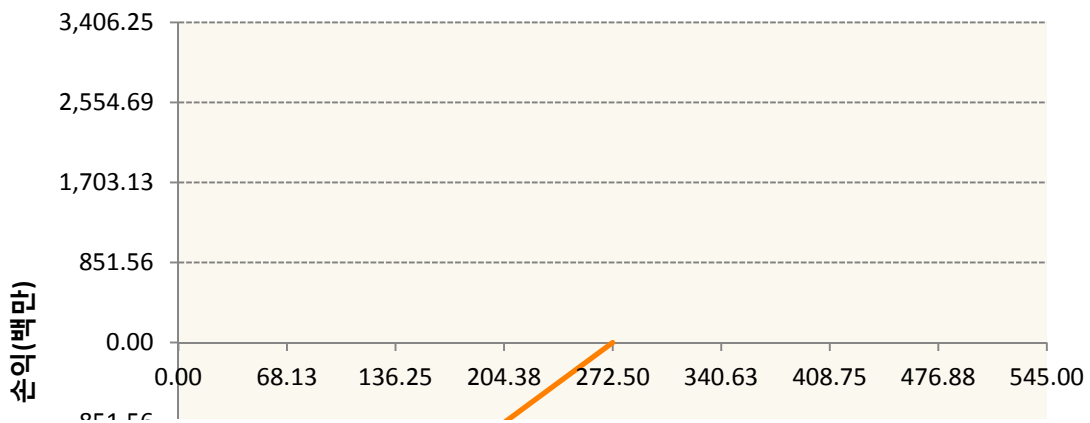




KR4301P82707-2019-08 풋270



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						226
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-226	-226	-226	-226	-226	-226	-226	
-5.33%	-151	-151	-151	-151	-151	-151	-151	
-2.67%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	75	75	75	75	75	75	75	
5.33%	151	151	151	151	151	151	151	
8.00%	226	226	226	226	226	226	226	
KR4201P82725		2019-08 콜272.5						227
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	-2	
2.67%	-2	-3	-6	-8	-11	-15	-19	
5.33%	-41	-48	-55	-63	-70	-77	-84	
8.00%	-196	-200	-205	-210	-216	-221	-227	
KR4301P82707 2019-08 풋270							442	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-442	-442	-442	-442	-442	-442	-442	
-5.33%	-295	-295	-295	-295	-295	-295	-295	
-2.67%	-147	-147	-147	-147	-147	-147	-147	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	146	146	145	144	142	141	139	
5.33%	256	252	249	246	243	240	237	
8.00%	276	275	275	274	273	272	271	
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							257	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-257	-257	-257	-257	-257	-257	-257	
-5.33%	-171	-171	-171	-171	-171	-171	-171	
-2.67%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	86	86	85	85	85	84	84	
5.33%	163	161	159	158	156	154	152	
8.00%	191	190	189	188	187	186	185	

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

(단위:백만원)

2,593

공시일	2019-08-06
기준일	2019-08-05

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

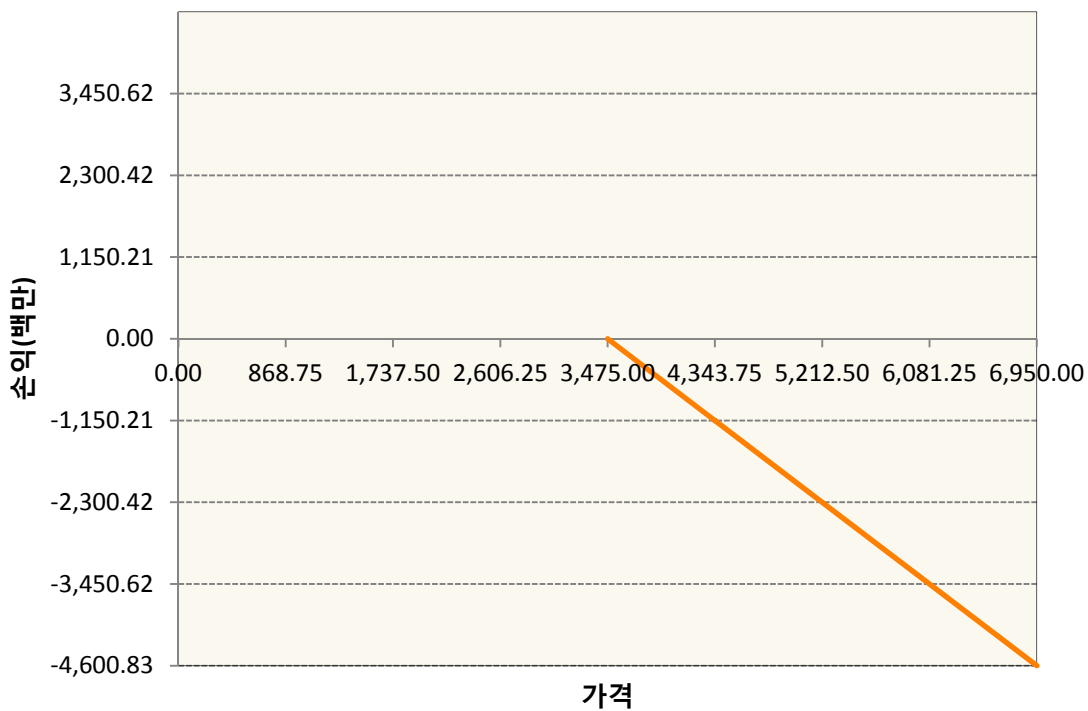
1. 계약금액

(단위:백만원)

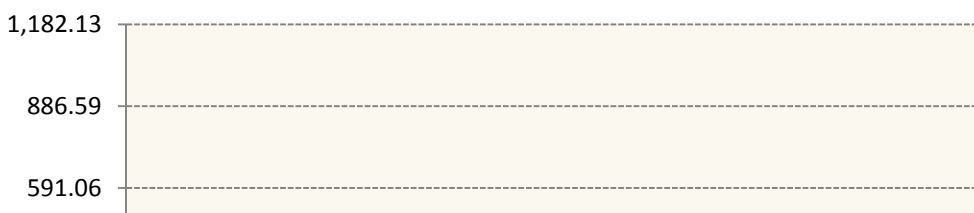
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,632	0	2,632	
누계	유가증권	스왑	38,579	0	38,579	장외
누계	유가증권	옵션	0	11,566	-11,566	장내
누계	통화	선도	14,591	22,968	-8,377	장외

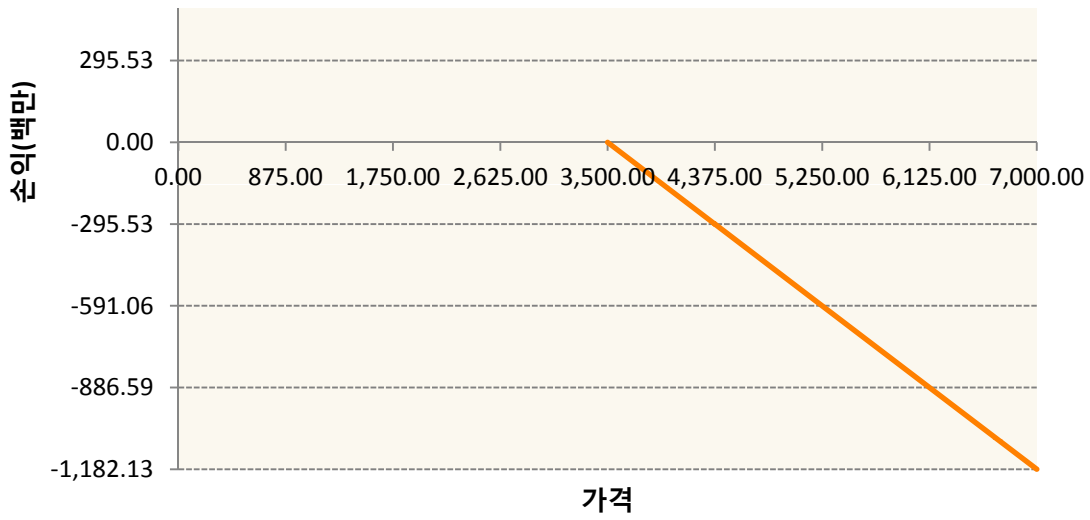
2. 만기시점의 손익구조

OESXQ9-C3475-EURO STOXX 50

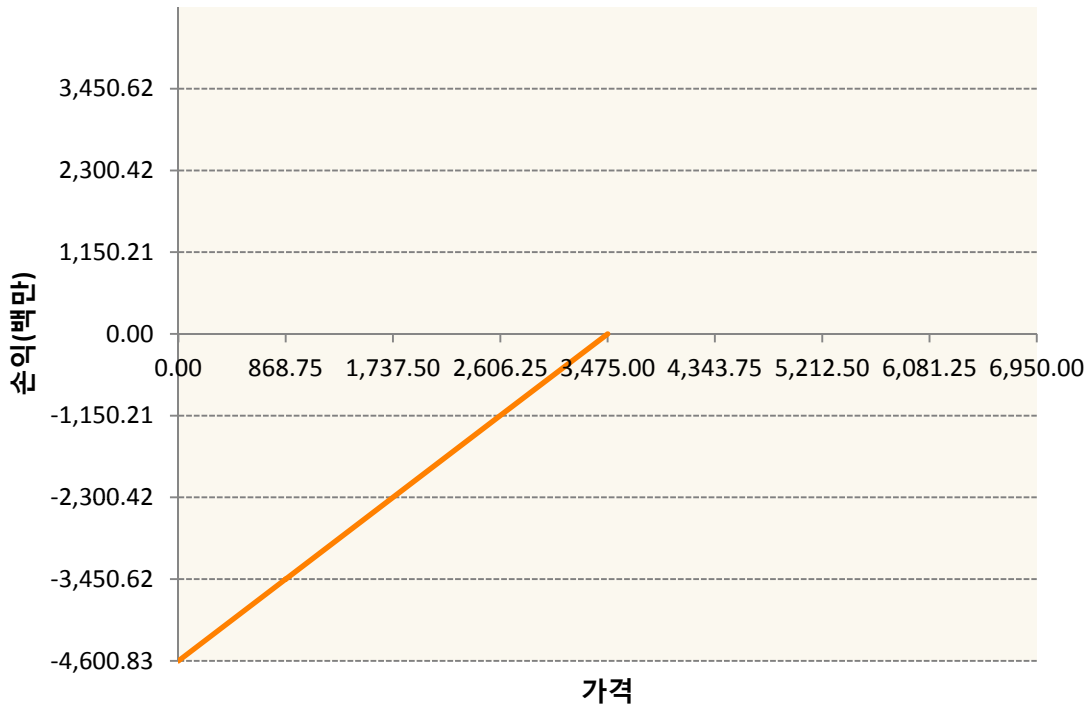


OESXQ9-C3500-EURO STOXX 50

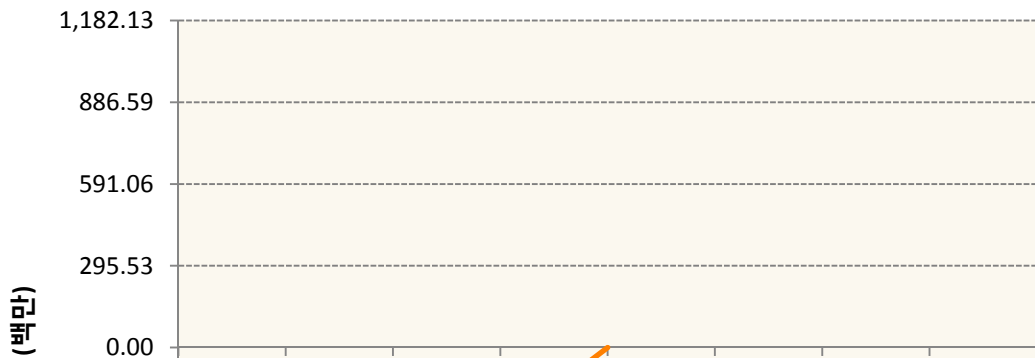


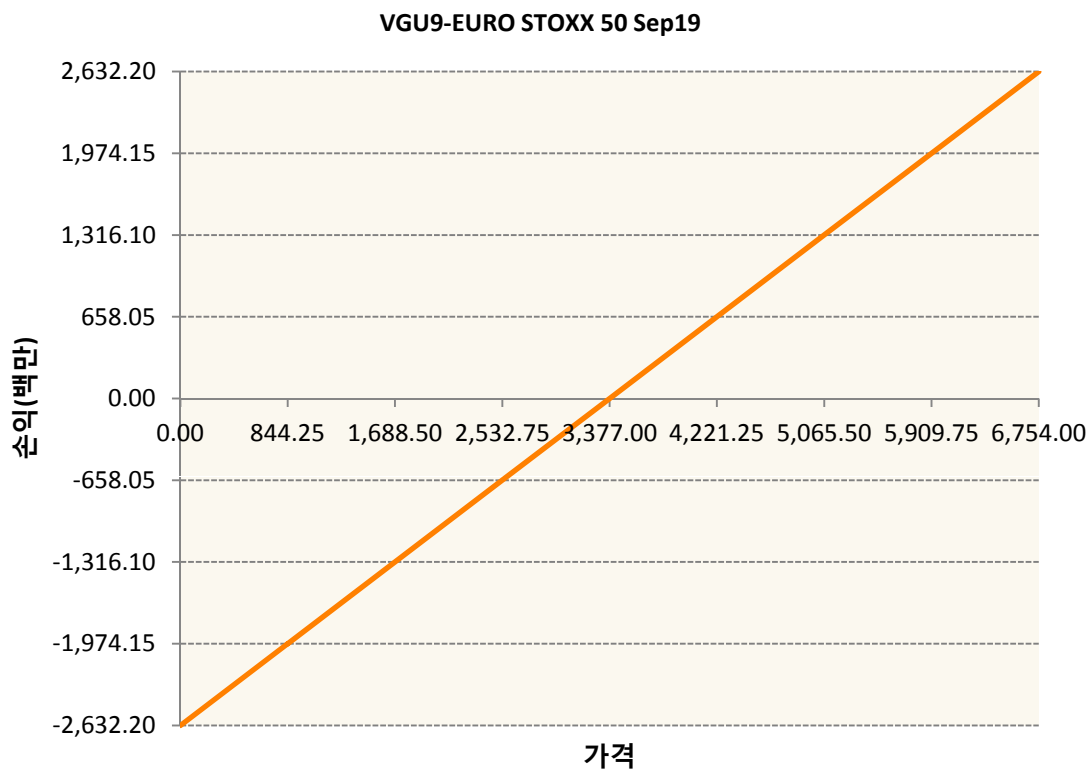
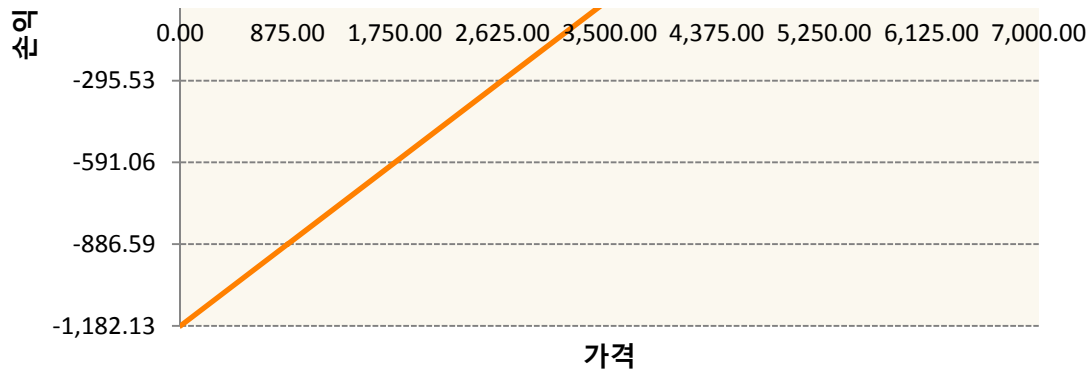


OESXQ9-P3475-EURO STOXX 50



OESXQ9-P3500-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	60
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	432
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E	1,081
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	324
FX21019N01 EUR/KRW 23-08-19E	432
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E	324
FX21019N04 EUR/KRW 27-09-19E	238
FX21019Q00 EUR/KRW 27-09-19E	173
OESXQ9-C34 EURO STOXX 50	368
OESXQ9-C35 EURO STOXX 50	95
OESXQ9-P34 EURO STOXX 50	368

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

95
211

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

(단위:백만원)

2,205

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

(단위:백만원)

954

공시일	2019-08-06
기준일	2019-08-05

ETF스마트레버리지목표전환형9호

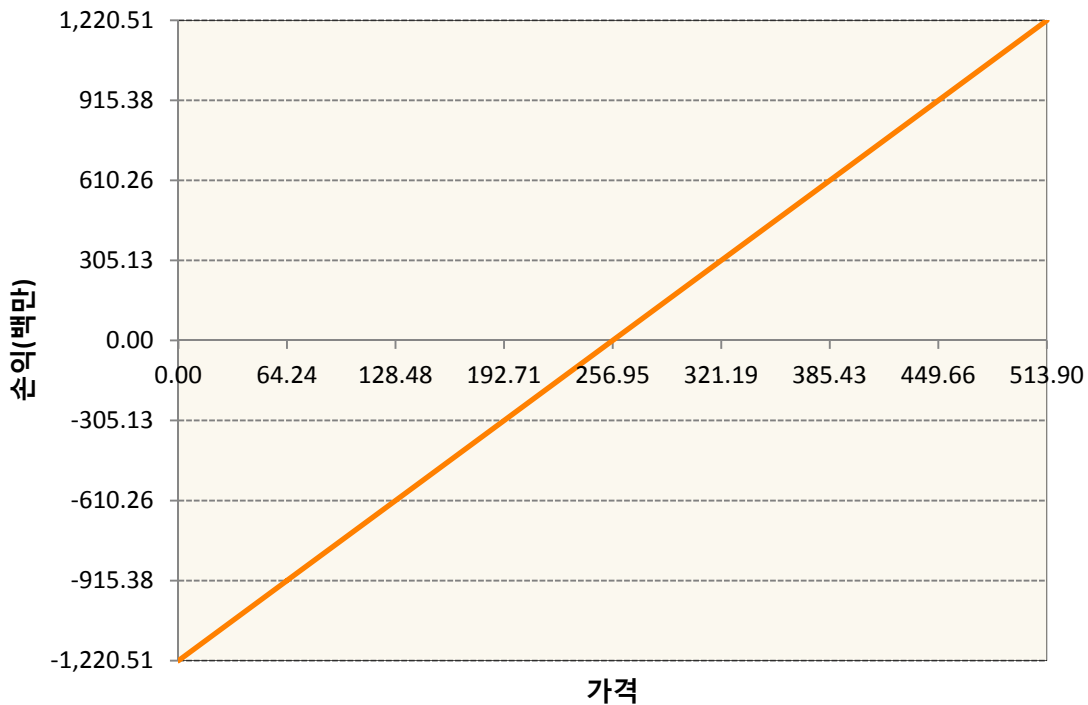
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,221	0	1,221	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						98
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98	
-5.33%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65	
-2.67%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	33	33	33	33	33	33	33	
5.33%	65	65	65	65	65	65	65	
8.00%	98	98	98	98	98	98	98	

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

(단위:백만원)

83

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

(단위:백만원)

127

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

(단위:백만원)

39

공시일	2019-08-06
기준일	2019-08-05

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

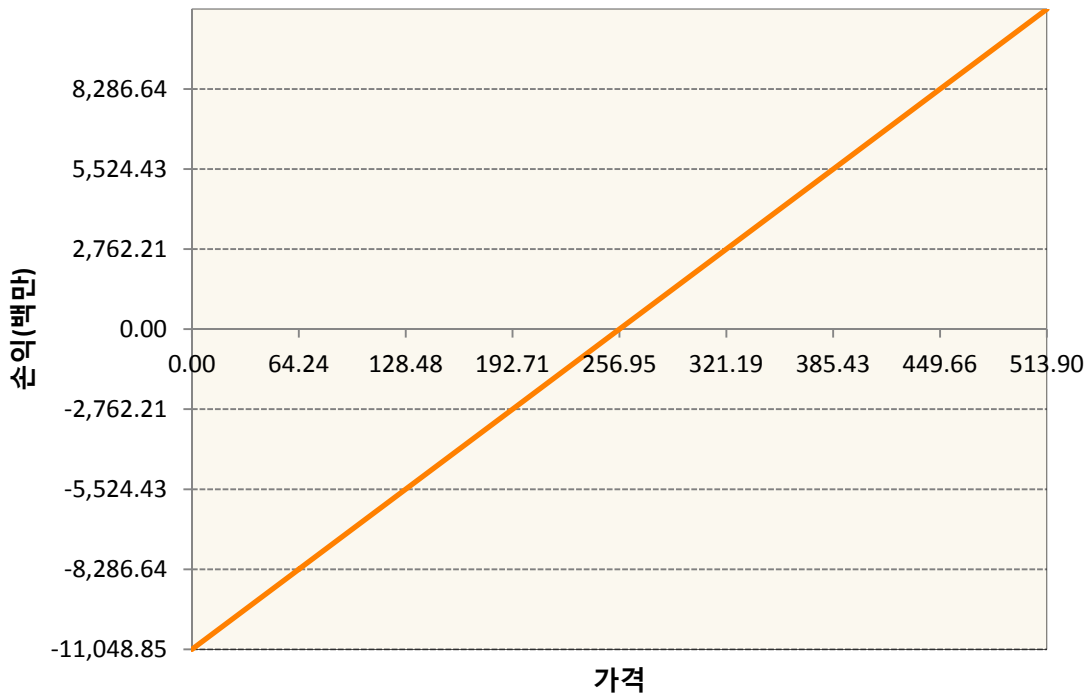
1. 계약금액

(단위:백만원)

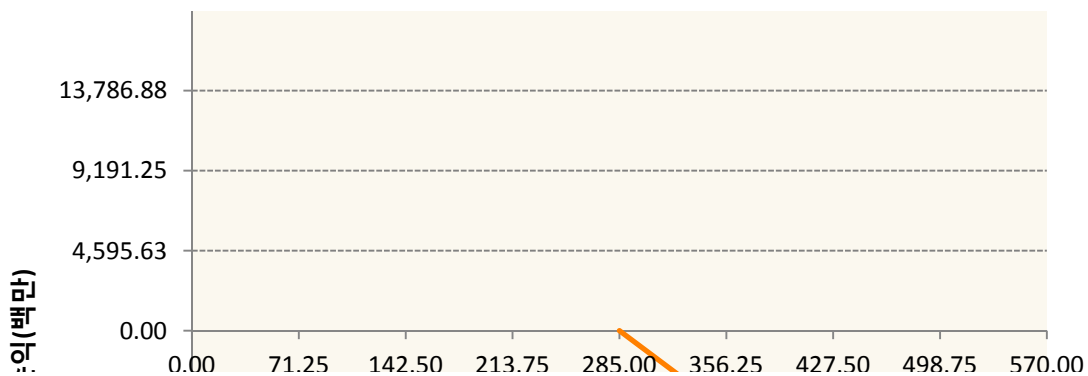
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,049	0	11,049	장내
누계	유가증권	옵션	1,698	21,617	-19,919	장내

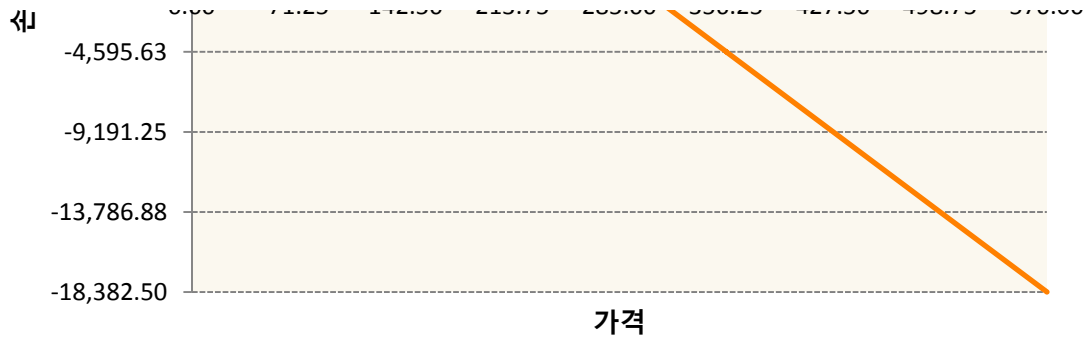
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

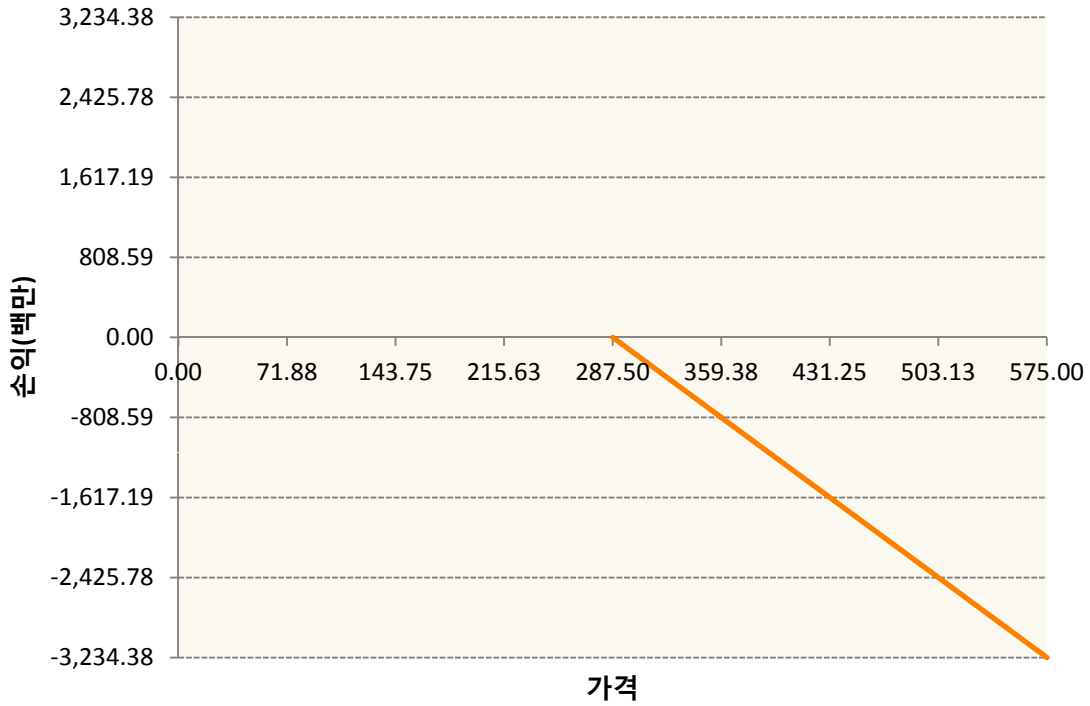


KR4201P82857-2019-08 콜285

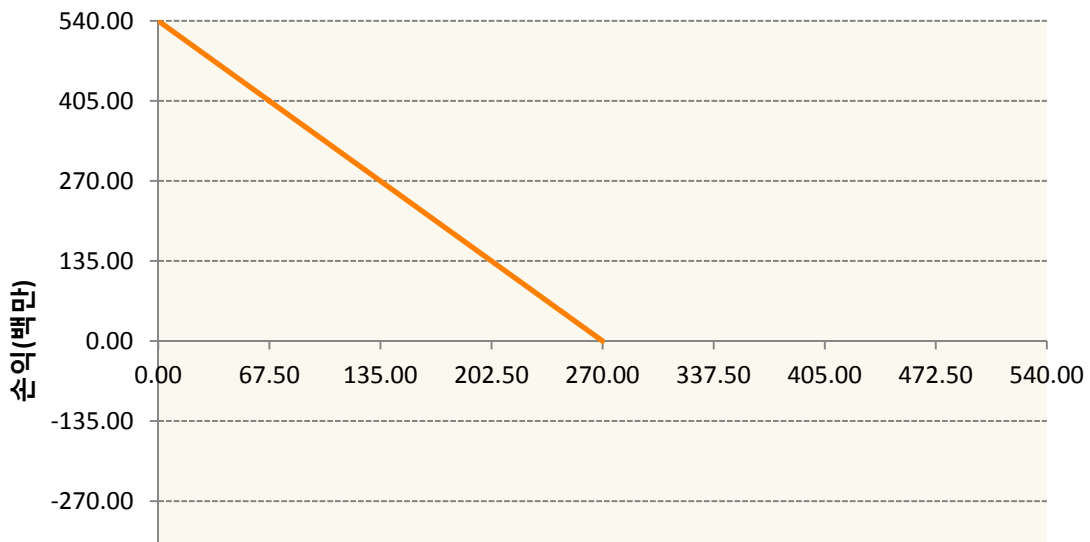


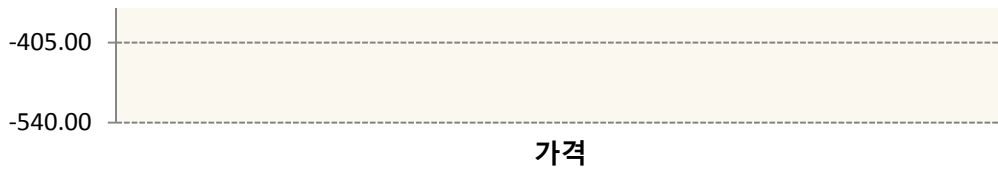


KR4201P82873-2019-08 콜287.5

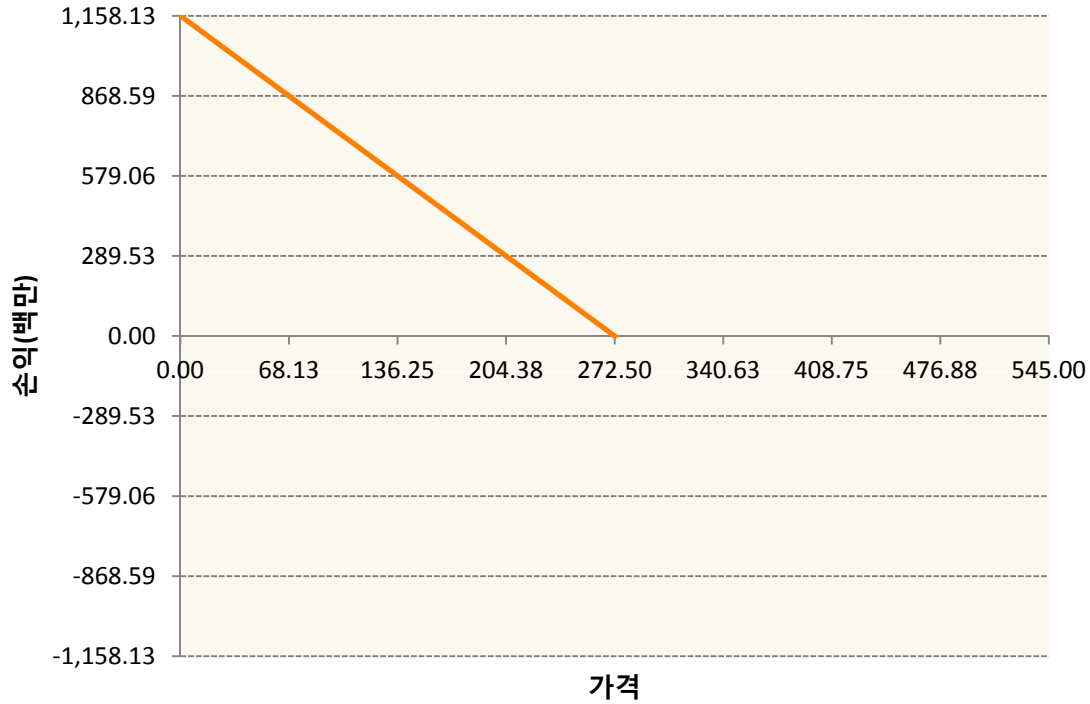


KR4301P82707-2019-08 풋270





KR4301P82723-2019-08 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						885
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-885	-885	-885	-885	-885	-885	-885	
-5.33%	-590	-590	-590	-590	-590	-590	-590	
-2.67%	-295	-295	-295	-295	-295	-295	-295	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	295	295	295	295	295	295	295	
5.33%	590	590	590	590	590	590	590	
8.00%	885	885	885	885	885	885	885	
KR4201P82857		2019-08 콜285						54
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0	
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0	
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	

0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	-1
5.33%	0	0	-1	-2	-4	-6	-8
8.00%	-10	-15	-21	-28	-36	-45	-54
KR4201P82873 2019-08 콜287.5							5
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	-1
8.00%	0	-1	-1	-2	-3	-4	-5
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%	14	14	14	14	14	14	14
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-14	-14	-13	-13	-13	-13	-13
5.33%	-24	-23	-23	-23	-23	-22	-22
8.00%	-26	-26	-26	-26	-25	-25	-25
KR4301P82723 2019-08 풋272.5							87
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	87	87	87	87	87	87	87
-5.33%	58	58	58	58	58	58	58
-2.67%	29	29	29	29	29	29	29
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-28
5.33%	-55	-55	-54	-54	-53	-52	-52
8.00%	-65	-65	-64	-64	-64	-63	-63

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

(단위:백만원)

881

공시일	2019-08-06
기준일	2019-08-05

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,215	0	1,215	
누계	유가증권	수익증권	55,633	0	55,633	

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	2019-08-06
기준일	2019-08-05

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	4,254	0	4,254	
누계	유가증권	수익증권	70,717	0	70,717	

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	2019-08-06
기준일	2019-08-05

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,646	0	3,646	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	454,195	0	454,195	
누계	통화	선도	0	453,428	-453,428	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		3,208
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		2,178
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		1,750
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,139
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		136
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		583
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		3,111
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		3,403
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		486
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		972
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		3,024
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		1,692
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		778
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,944
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,944
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		292
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		97
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		719
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		719
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		292
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		681
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		2,722
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		1,361
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		778
FX21019N04 KRW/USD 03-09-19E		292
FX21019Q00 KRW/USD 03-09-19E		292

FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E

486

FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E

194

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

(단위:백만원)

11,590

공시일	2019-08-06
기준일	2019-08-05

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

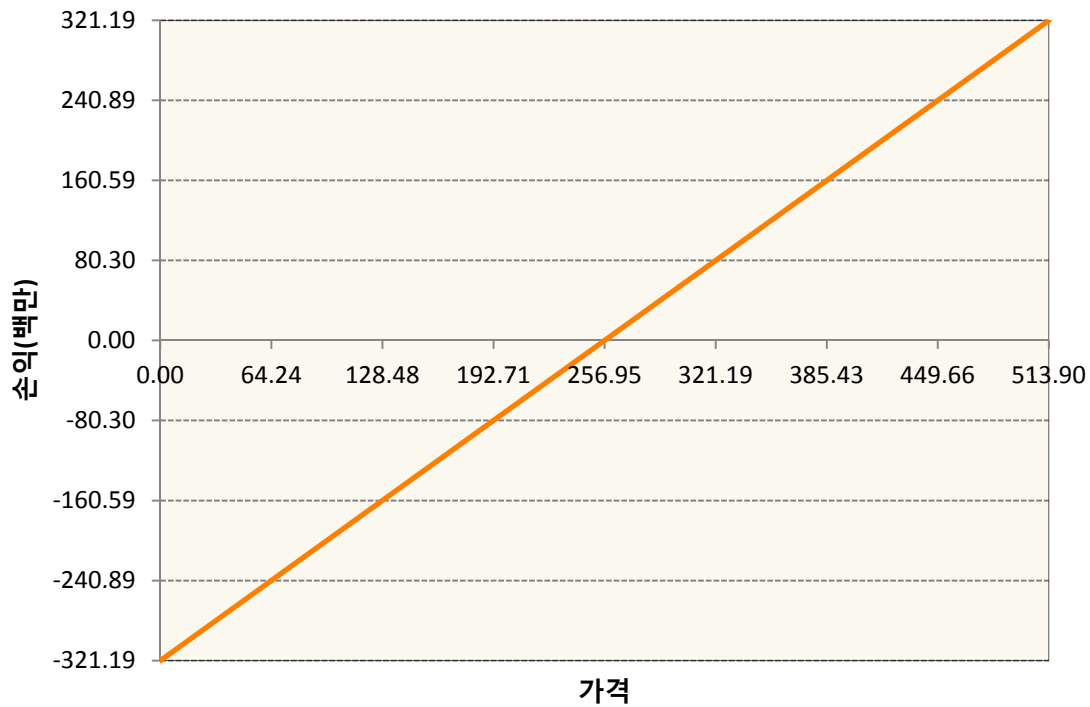
1. 계약금액

(단위:백만원)

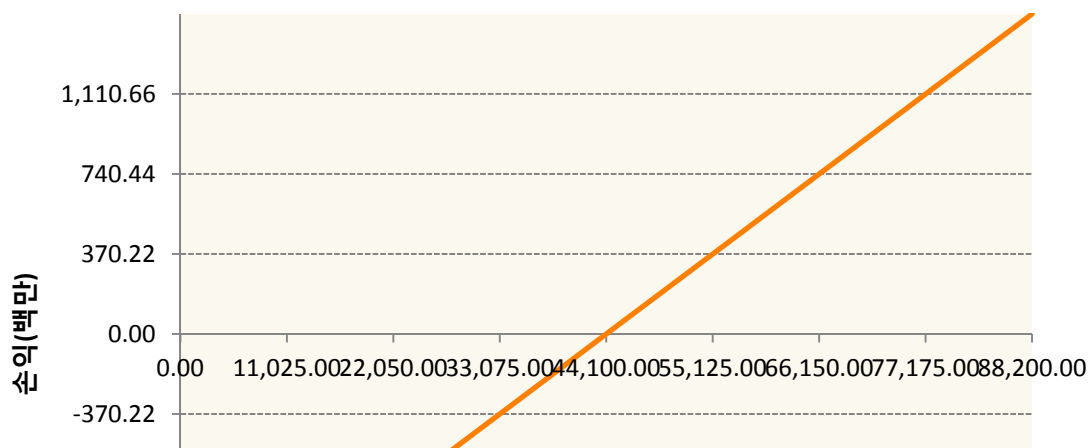
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,802	0	1,802	장내

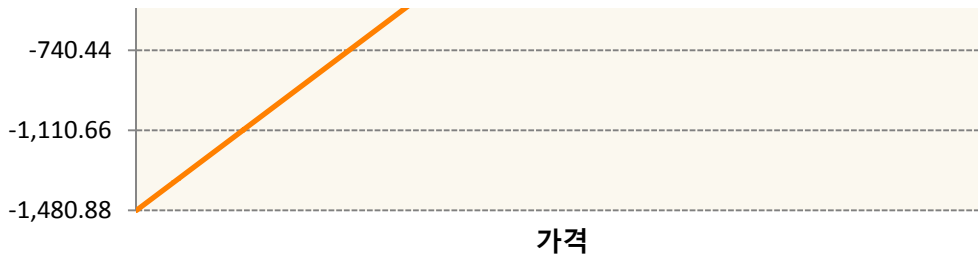
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P80001-2019-08 삼성전자개별선물





3. 시나리오 별 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%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
-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%	17	17	17	17	17	17	17	
8.00%	26	26	26	26	26	26	26	
KR4111P80001		2019-08 삼성전자개별선물						118
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118	
-5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79	
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	39	39	39	39	39	39	39	
5.33%	79	79	79	79	79	79	79	
8.00%	118	118	118	118	118	118	118	

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

171

공시일	2019-08-06
기준일	2019-08-05

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

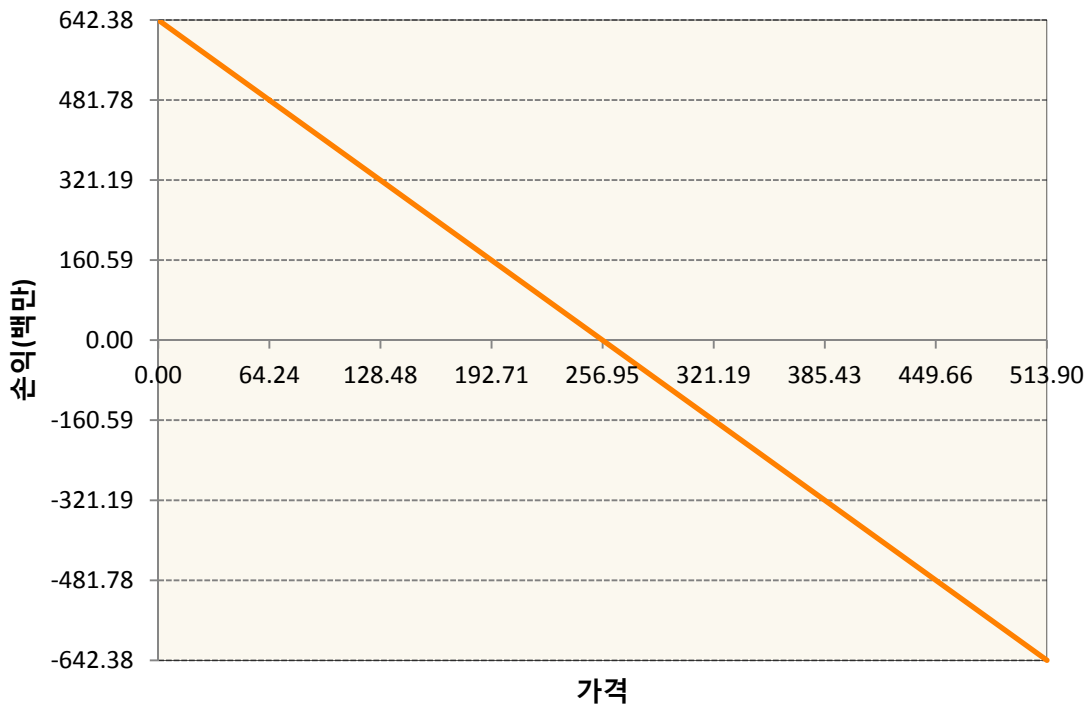
1. 계약금액

(단위:백만원)

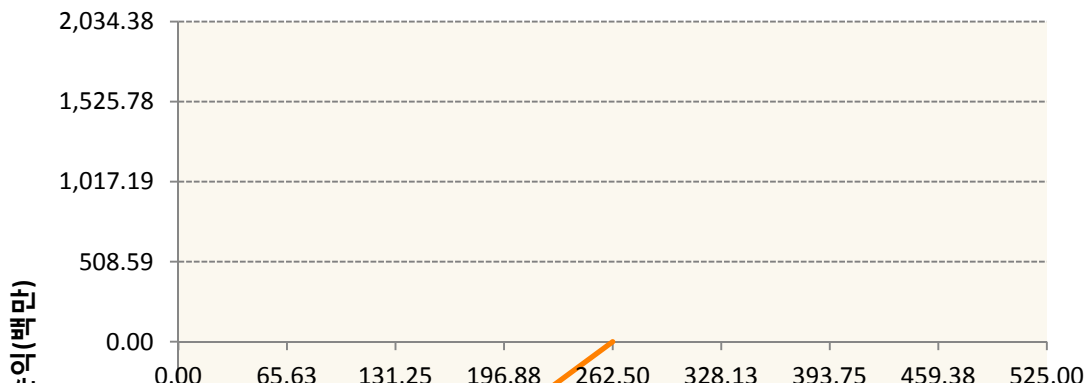
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	642	-642	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,691	-3,691	장내

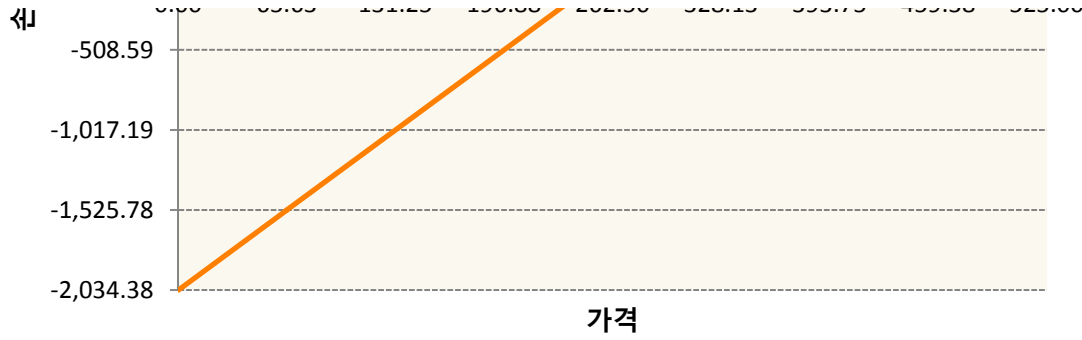
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

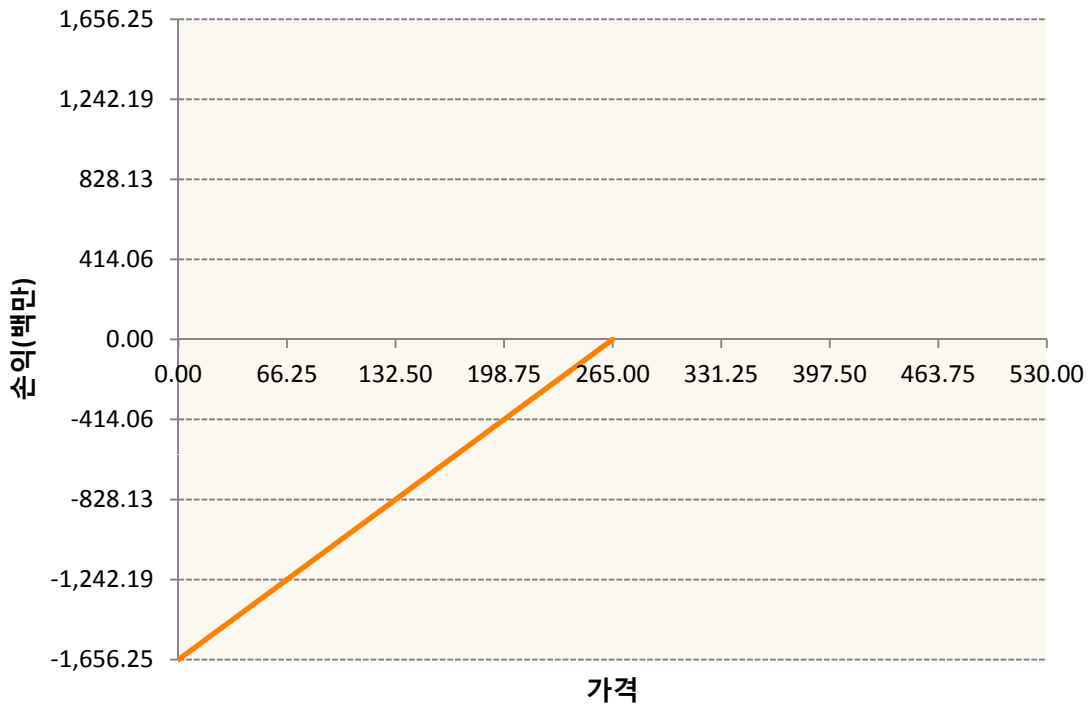


KR4301P82624-2019-08 풋262.5





KR4301P82657-2019-08 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						51
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	51	51	51	51	51	51	51	
-5.33%	34	34	34	34	34	34	34	
-2.67%	17	17	17	17	17	17	17	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
5.33%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34	
8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51	
KR4301P82624		2019-08 풋262.5						158
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
-5.33%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-2.67%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-52
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	38	37	36	35	34	33	31
5.33%	43	43	43	43	43	42	42
8.00%	43	43	43	43	43	43	43
KR4301P82657 2019-08 풋265							128

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-43
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	38	37	36	35	34	33	32
5.33%	49	49	49	48	48	47	47
8.00%	49	49	49	49	49	49	49

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

(단위:백만원)

395

공시일	2019-08-06
기준일	2019-08-05

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	19,185	0	19,185	
누계	통화	선도	0	18,837	-18,837	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		1,011
FX21019N01 KRW/USD 12-08-19E		165
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		331

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

(단위:백만원)

482

공시일	2019-08-06
기준일	2019-08-05

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	385	0	385	장외
누계	통화	선도	0	51	-51	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

31

공시일	2019-08-06
기준일	2019-08-05

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

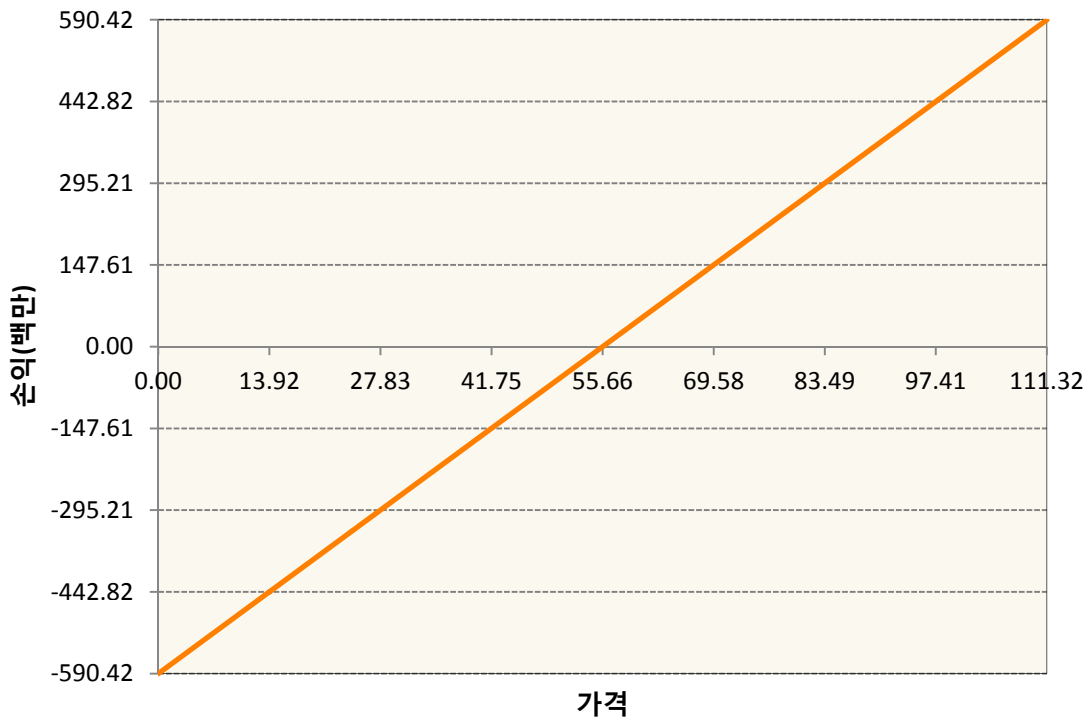
1. 계약금액

(단위:백만원)

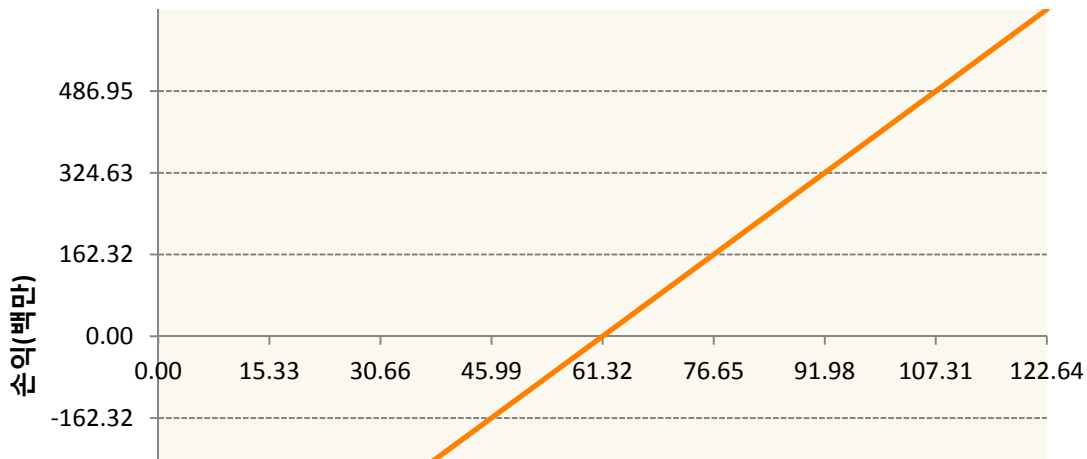
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,466	122	2,344	

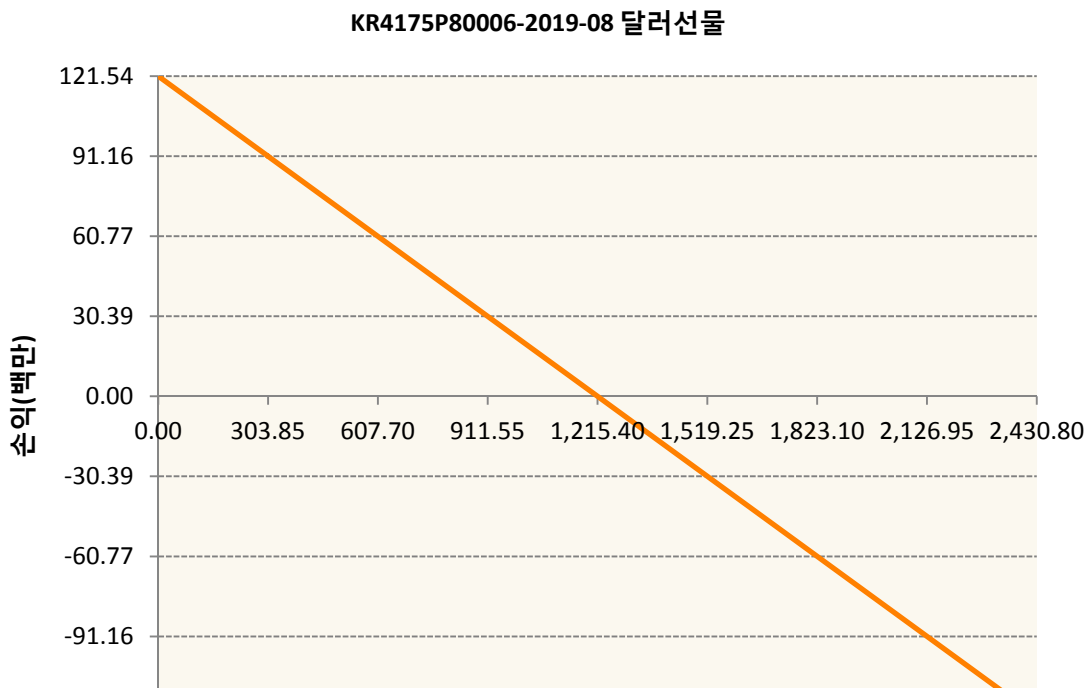
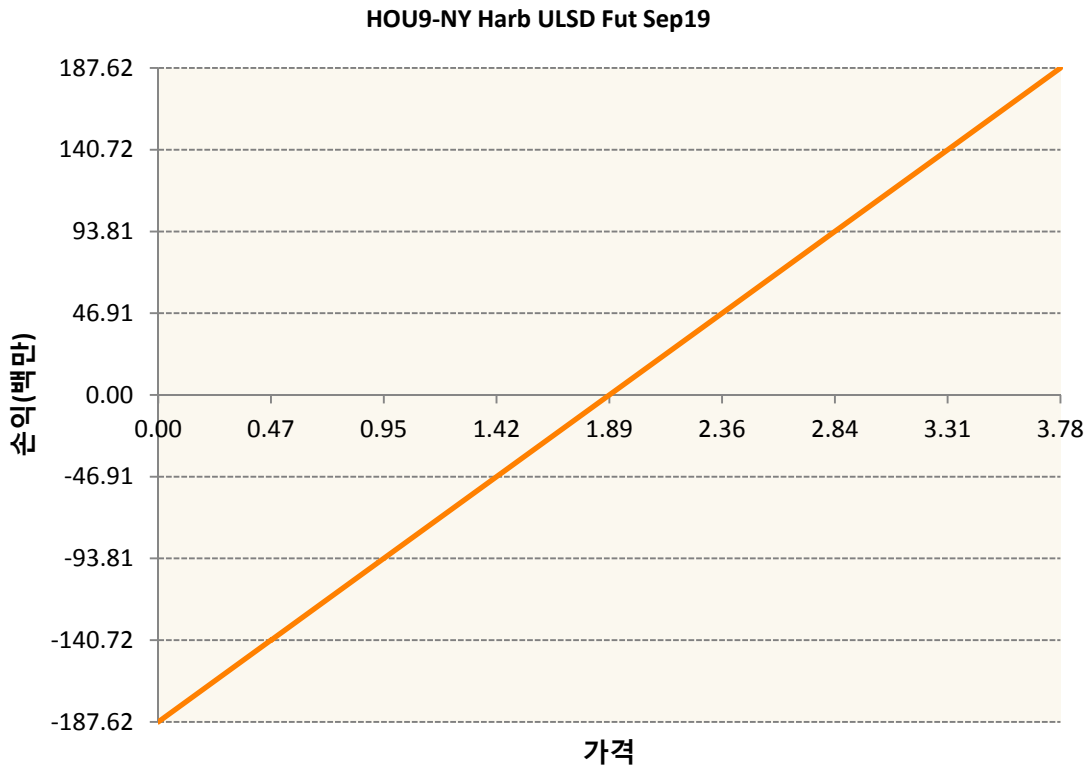
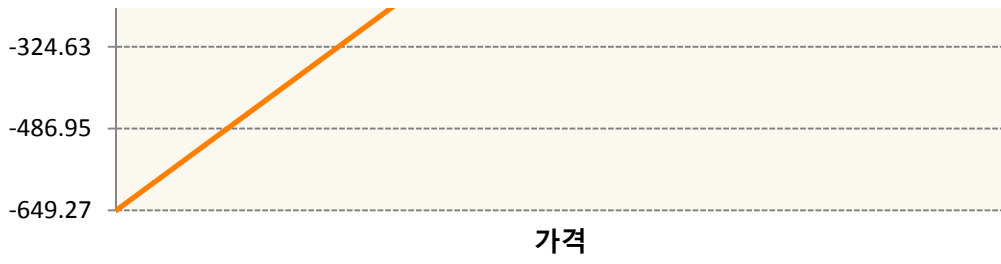
2. 만기시점의 손익구조

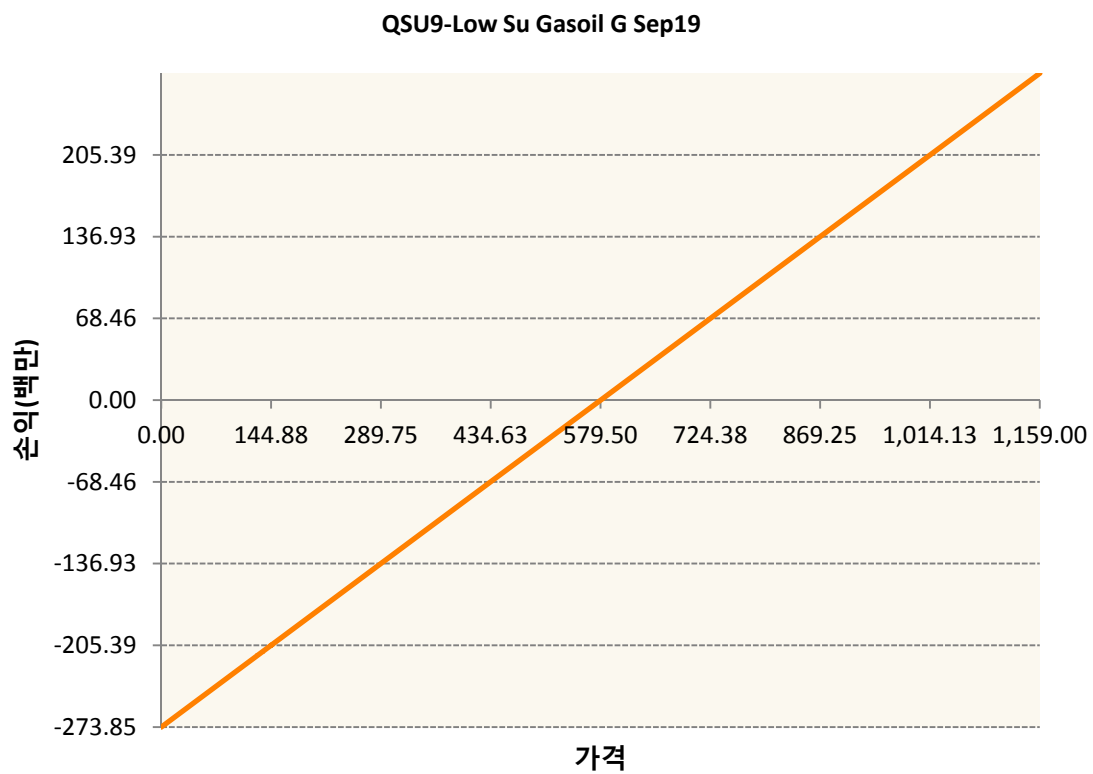
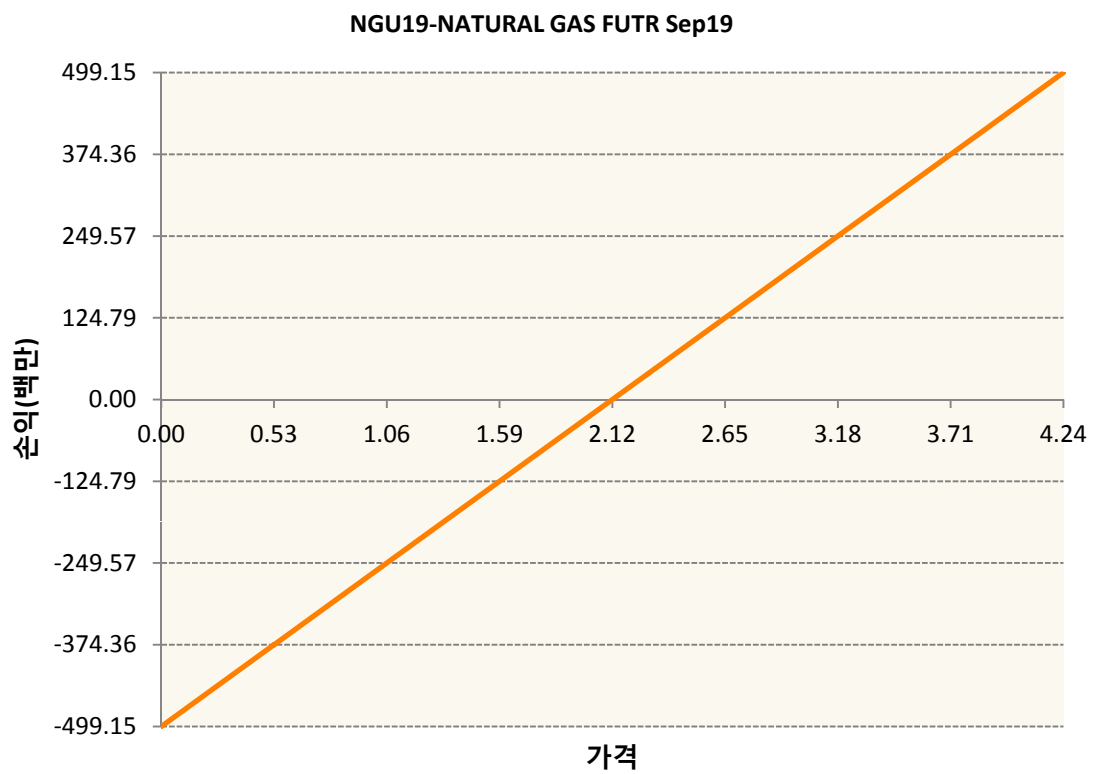
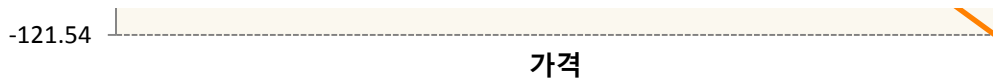
CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19



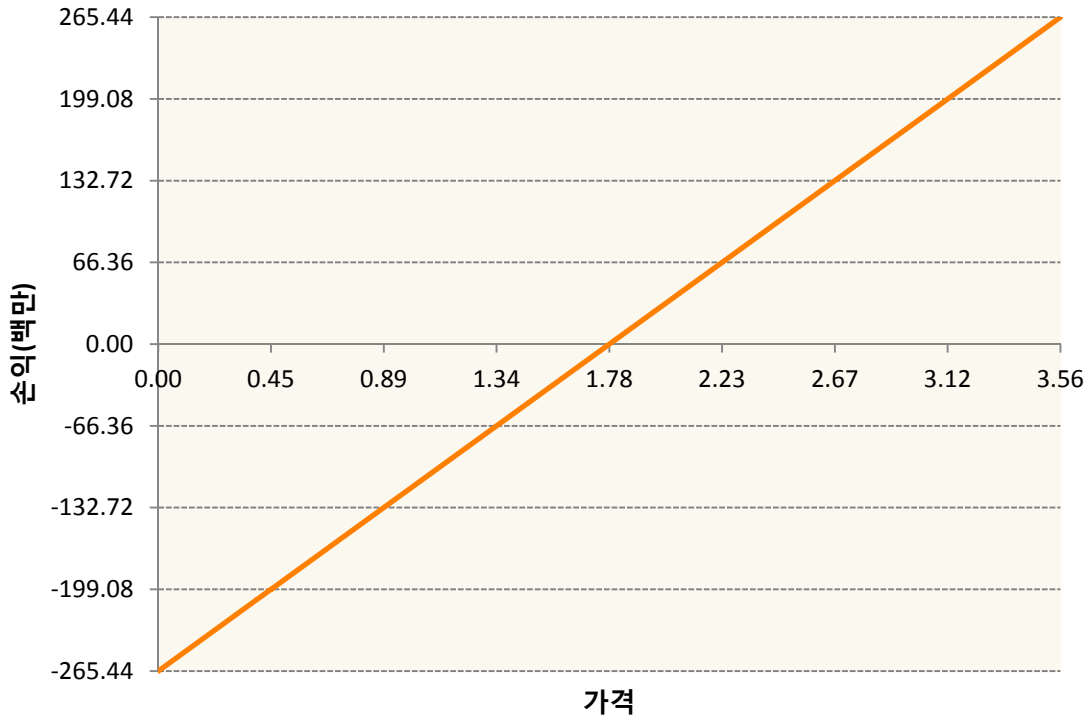
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19







XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	47
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	52
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	15
KR4175P800	2019-08 달러선물	10
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	40
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	22
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	21

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

365

공시일	2019-08-06
기준일	2019-08-05

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

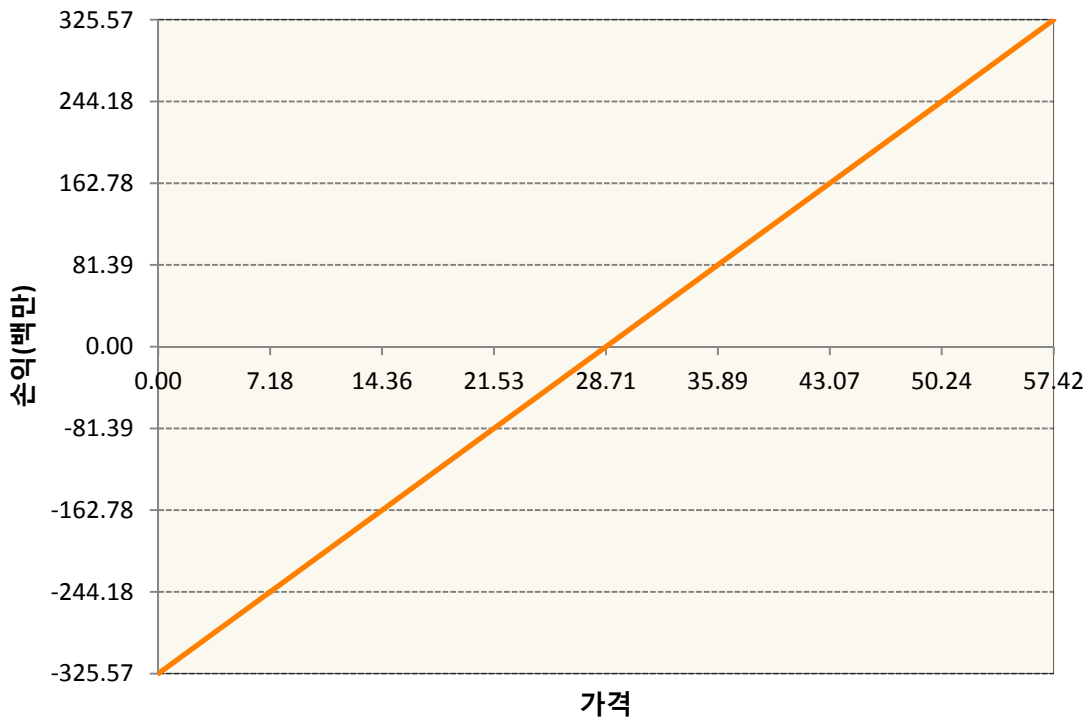
1. 계약금액

(단위:백만원)

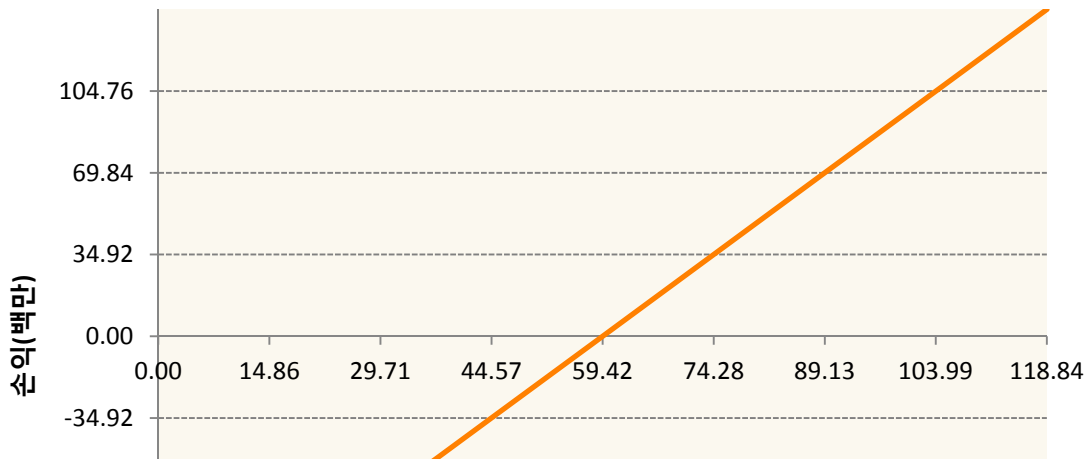
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,887	207	2,680	

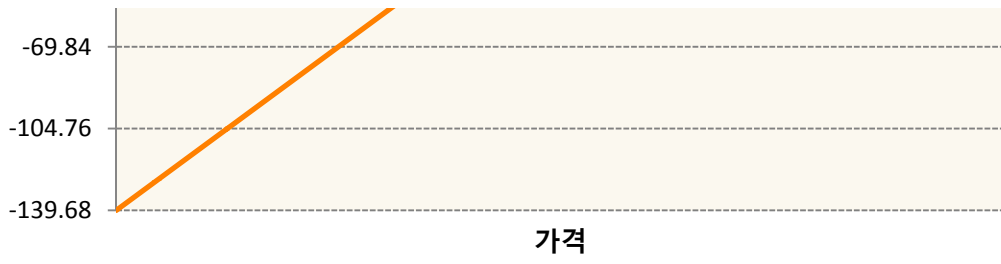
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

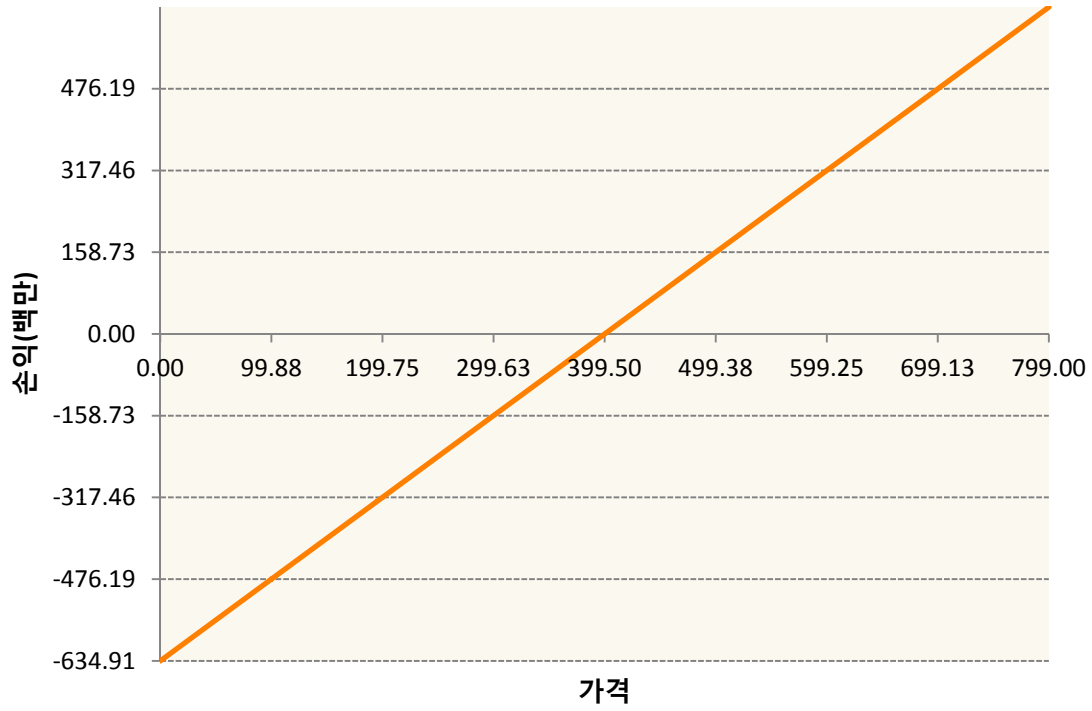


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

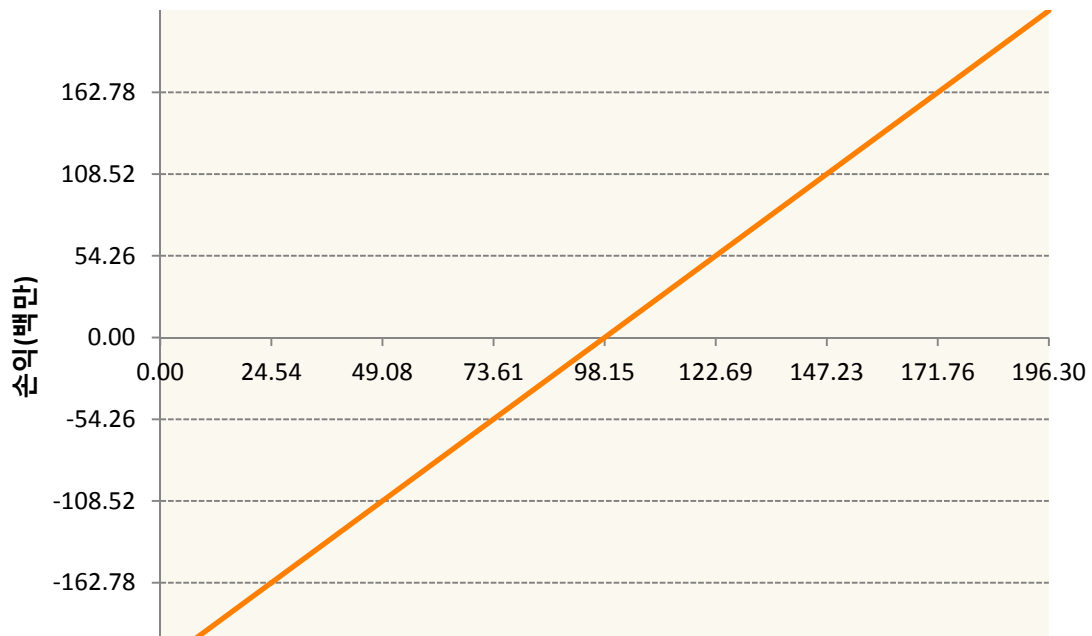


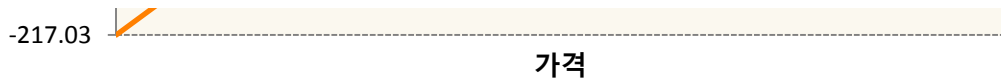


CU9-CORN FUTURE Sep19

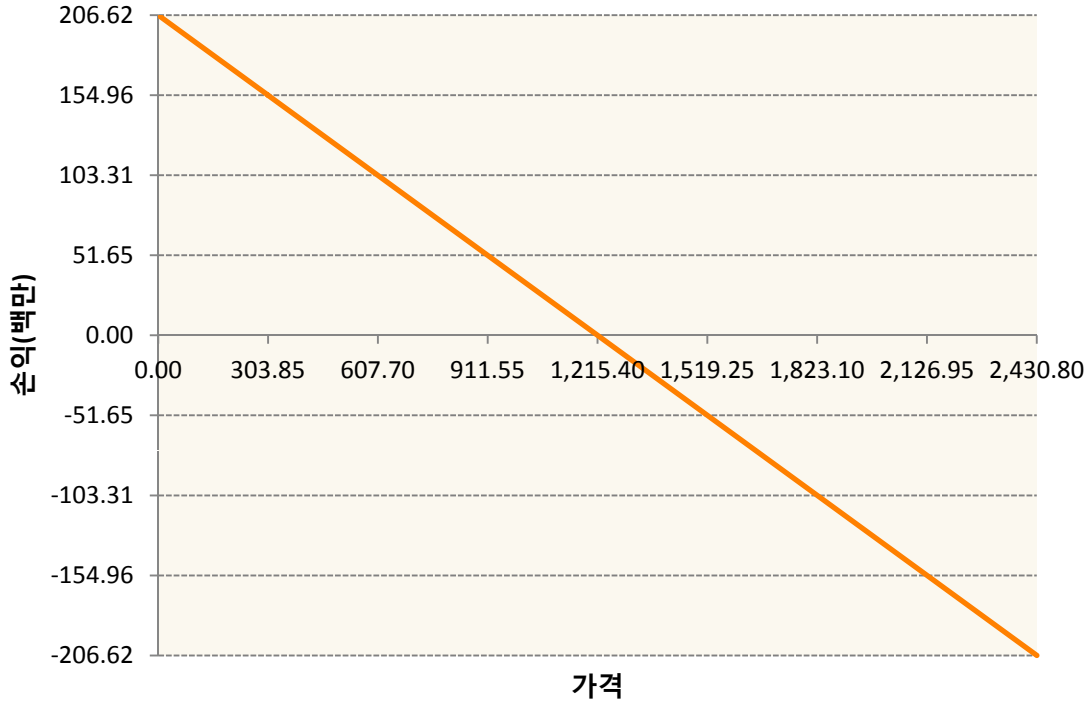


KCU9-COFFEE 'C' FUTURE Sep19

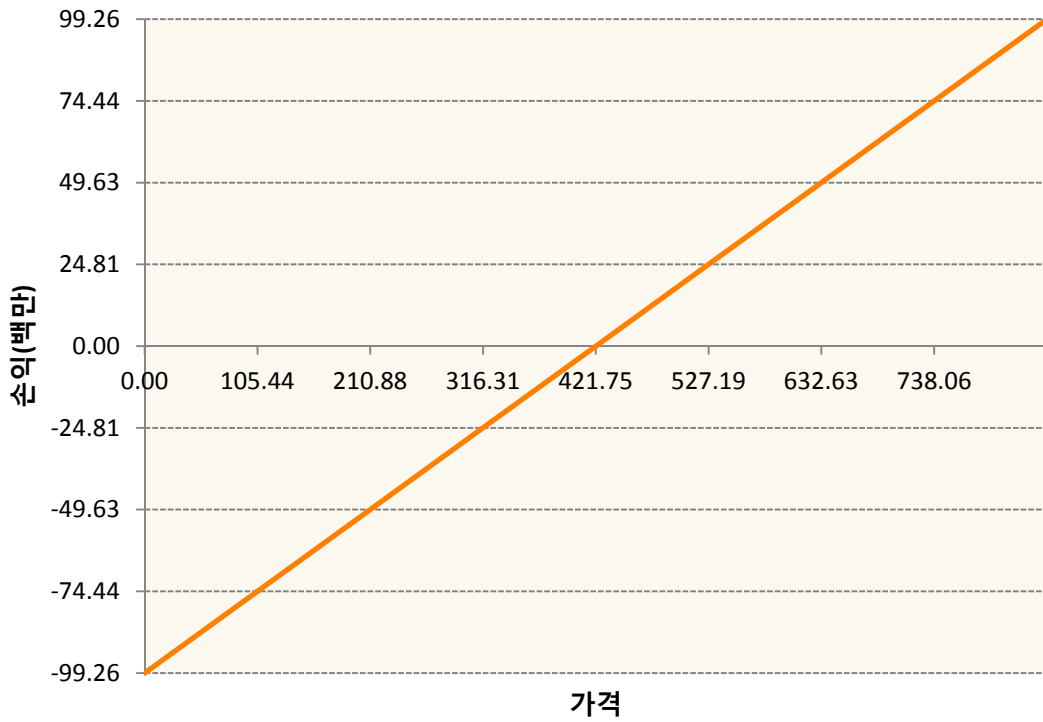




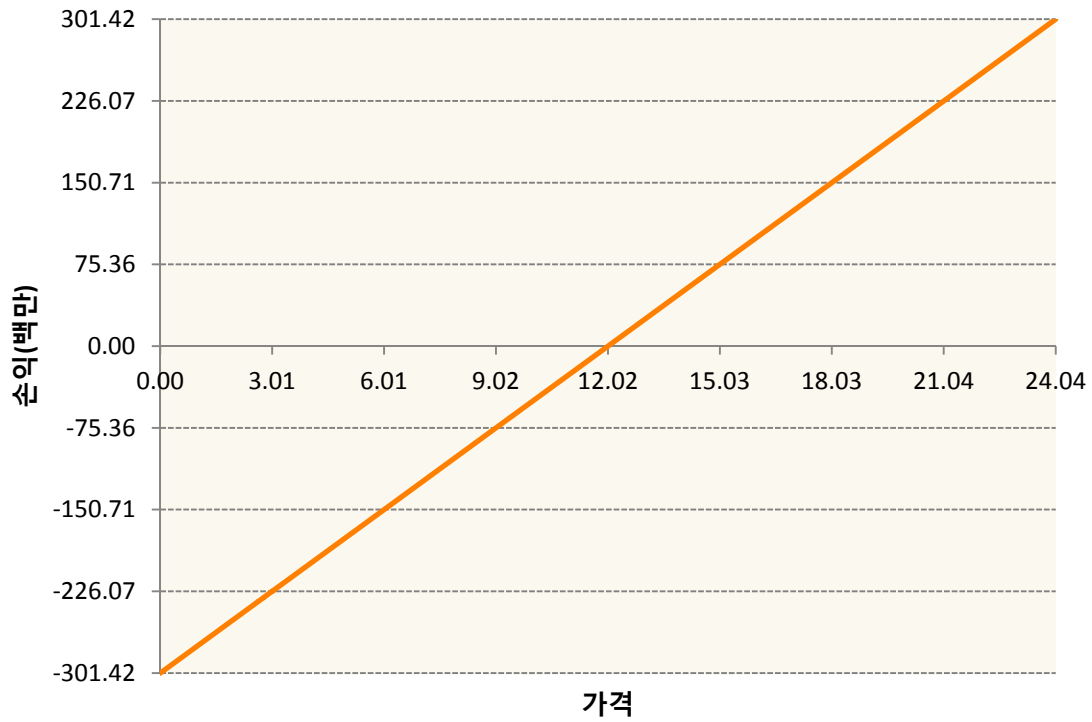
KR4175P80006-2019-08 달러선물



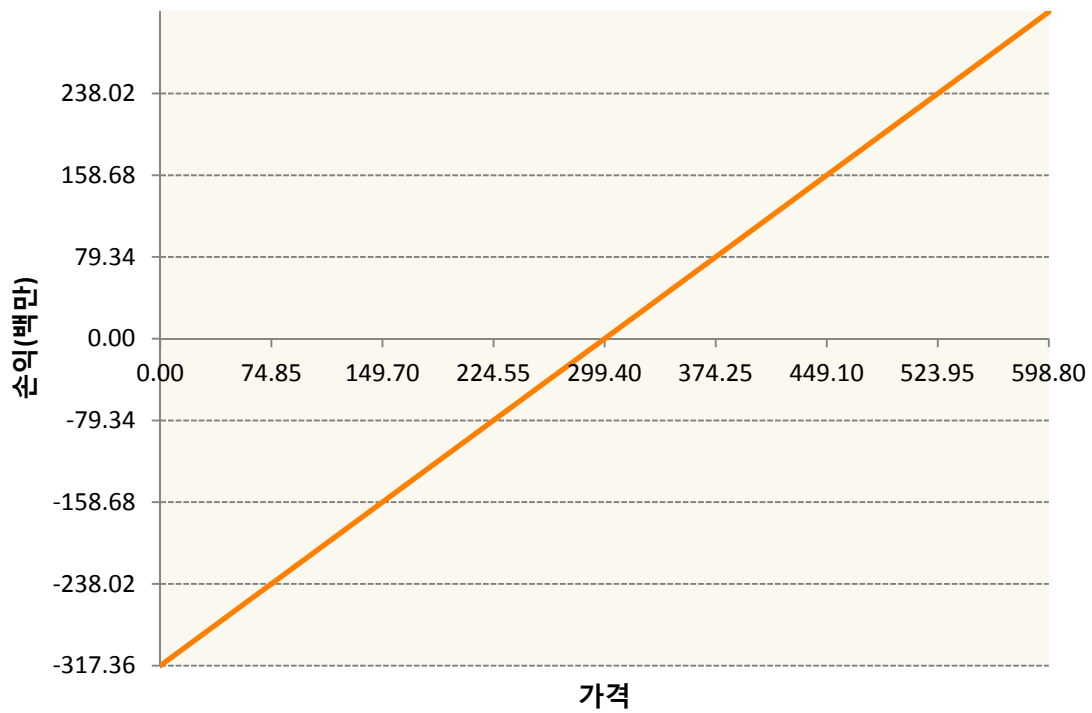
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



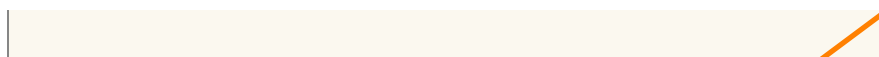
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

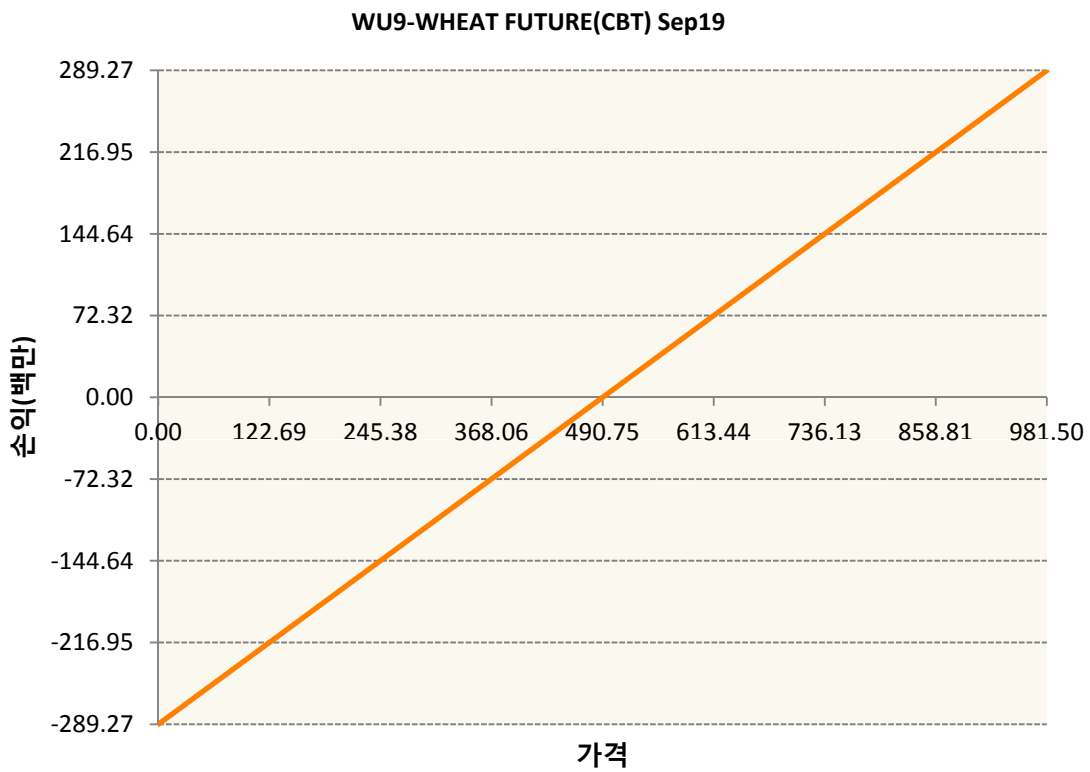
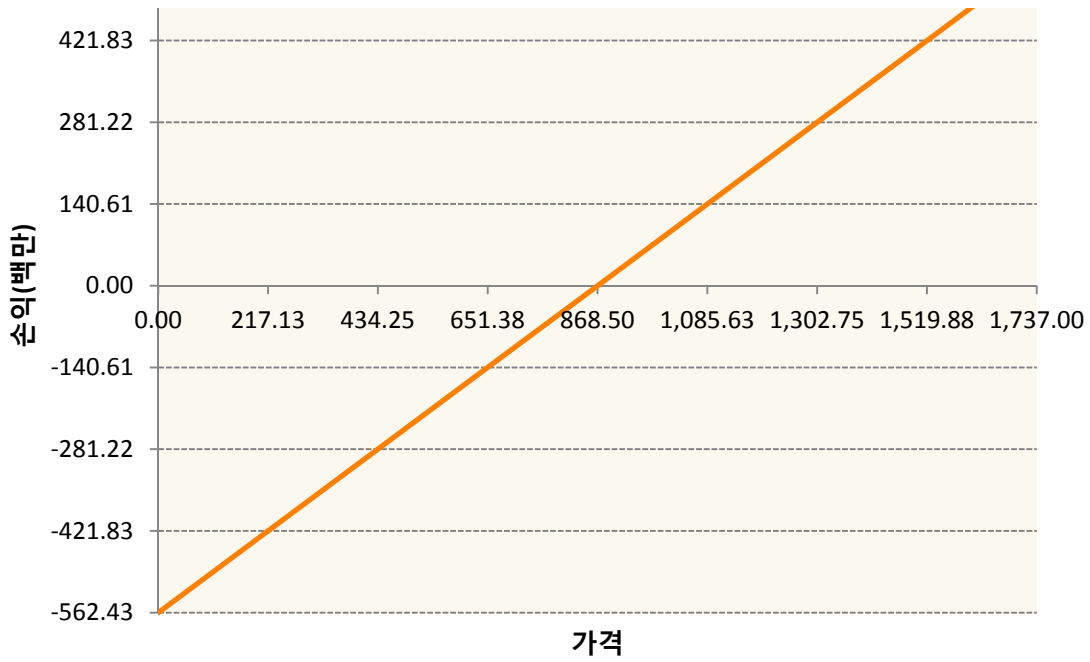


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	26
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	11
CU9	CORN FUTURE Sep19	51
KCU9	COFFEE 'C' FUTURE Sep19	17
KR4175P800	2019-08 달러선물	17

KWU9	KC HRW WHEAT FUT Sep19	8
SBV9	SUGAR #11 (WORLD) Oct19	24
SMZ9	SOYBEAN MEAL FUTR Dec19	25
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	45
WU9	WHEAT FUTURE(CBT) Sep19	23

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

(단위:백만원)

255