

공시일	2019-08-09
기준일	2019-08-08

포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	1	-1	장외
누계	지수	스왑	5	0	5	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)

86

공시일	2019-08-09
기준일	2019-08-08

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

1,131

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

643

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-09
기준일	2019-08-08

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)	357
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	130

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

788

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-09
기준일	2019-08-08

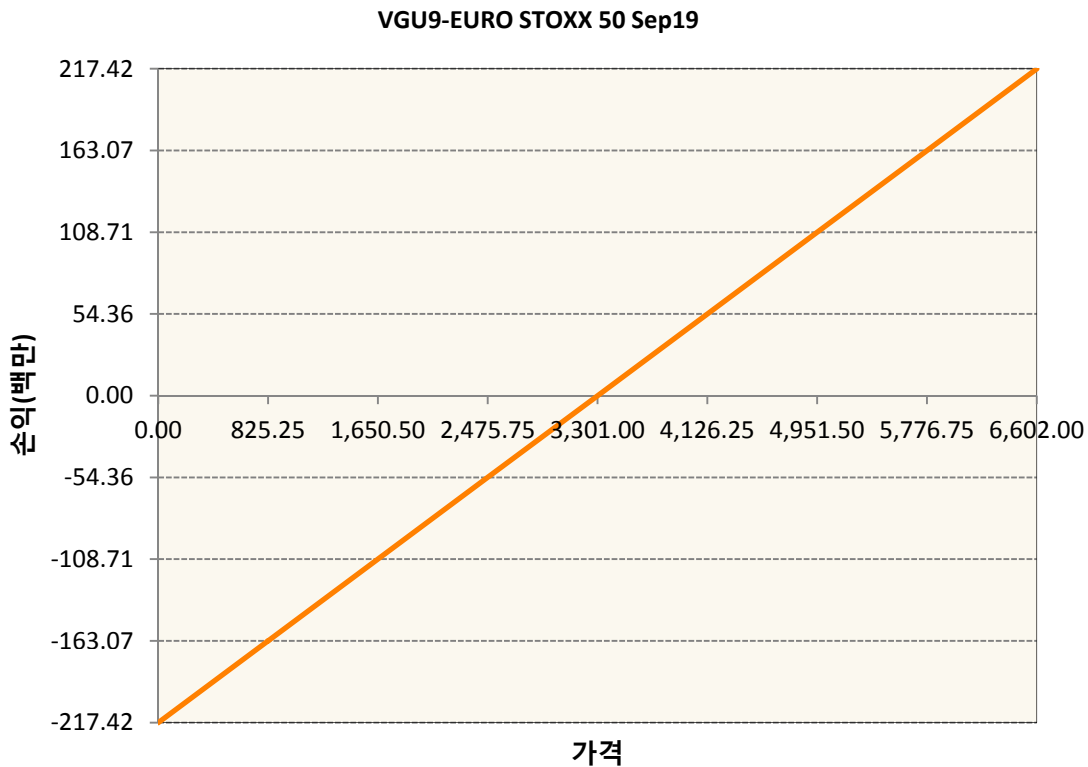
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	217	0	217	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU9	EURO STOXX 50 Sep19	17
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

12

공시일	2019-08-09
기준일	2019-08-08

차이나인덱스모(주식-파생형)

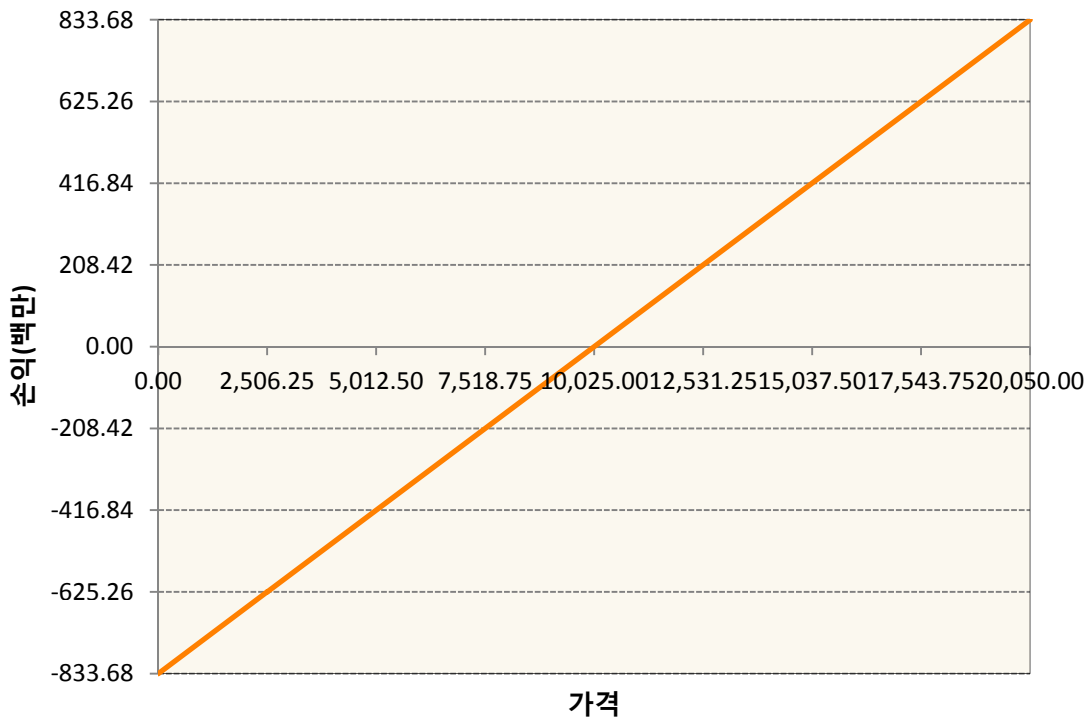
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	834	0	834	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCQ9	HSCEI Futures Aug19	67
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

64

공시일	2019-08-09
기준일	2019-08-08

커버드콜모(주식혼합-파생형)

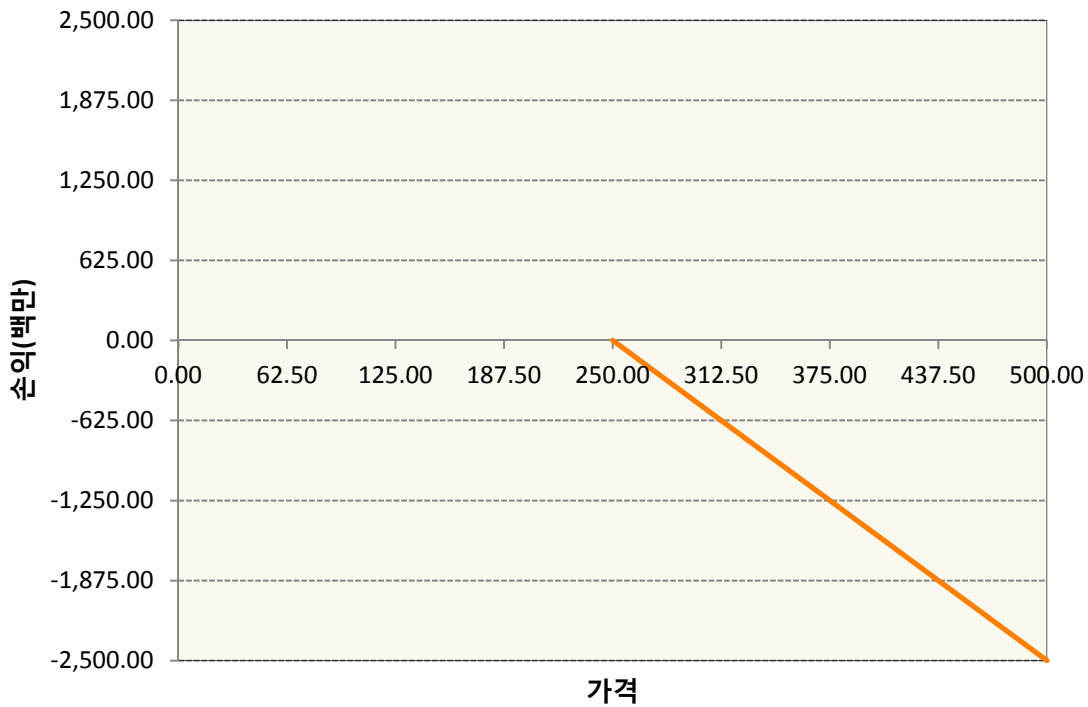
1. 계약금액

(단위:백만원)

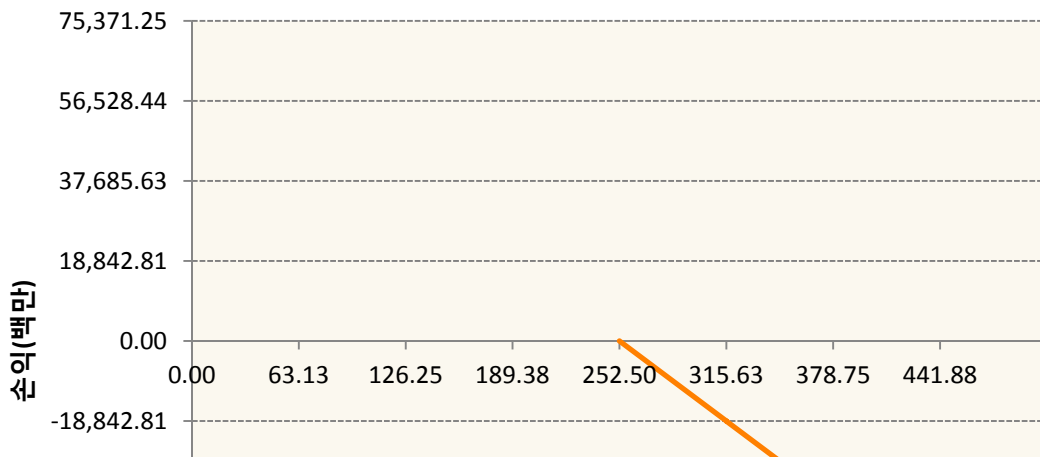
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	121,197	-121,197	장내
누계	유가증권	옵션	0	187,266	-187,266	장내

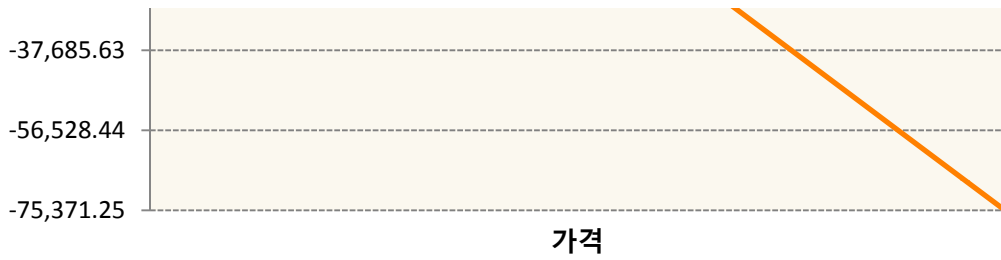
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P92500-2019-09 콜250

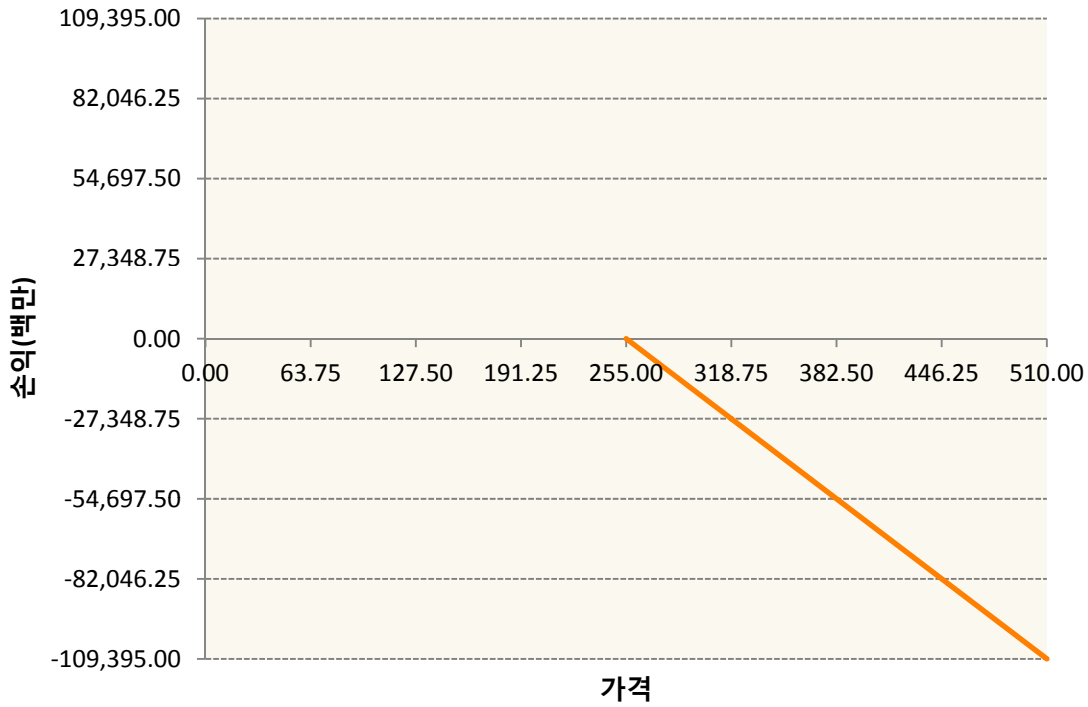


KR4201P92526-2019-09 콜252.5





KR4201P92559-2019-09 콜255



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P92500		2019-09 콜250					160	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	80	77	74	71	67	63	59	
-5.33%	70	66	61	56	51	46	40	
-2.67%	50	45	39	33	27	21	15	
0%	19	12	6	0	-6	-12	-19	
2.67%	-26	-31	-36	-42	-48	-54	-59	
5.33%	-80	-84	-88	-92	-97	-102	-107	
8.00%	-141	-143	-146	-149	-152	-156	-160	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5					4,575	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,064	2,000	1,923	1,835	1,737	1,630	1,515	

-5.33%	1,841	1,726	1,602	1,469	1,329	1,185	1,036
-2.67%	1,372	1,208	1,041	871	699	526	351
0%	560	373	187	0	-187	-373	-559
2.67%	-626	-799	-976	-1,154	-1,333	-1,514	-1,697
5.33%	-2,140	-2,273	-2,416	-2,565	-2,721	-2,881	-3,045
8.00%	-3,890	-3,976	-4,076	-4,187	-4,308	-4,438	-4,575
KR4201P92559 2019-09 콜255							6,243
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,539	2,467	2,378	2,270	2,148	2,011	1,863
-5.33%	2,304	2,165	2,008	1,838	1,656	1,464	1,264
-2.67%	1,773	1,558	1,335	1,105	870	631	388
0%	796	531	266	0	-266	-533	-801
2.67%	-710	-975	-1,241	-1,508	-1,777	-2,045	-2,315
5.33%	-2,720	-2,938	-3,167	-3,402	-3,644	-3,890	-4,140
8.00%	-5,119	-5,271	-5,440	-5,624	-5,821	-6,027	-6,243

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

(단위:백만원)

10,204

공시일	2019-08-09
기준일	2019-08-08

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

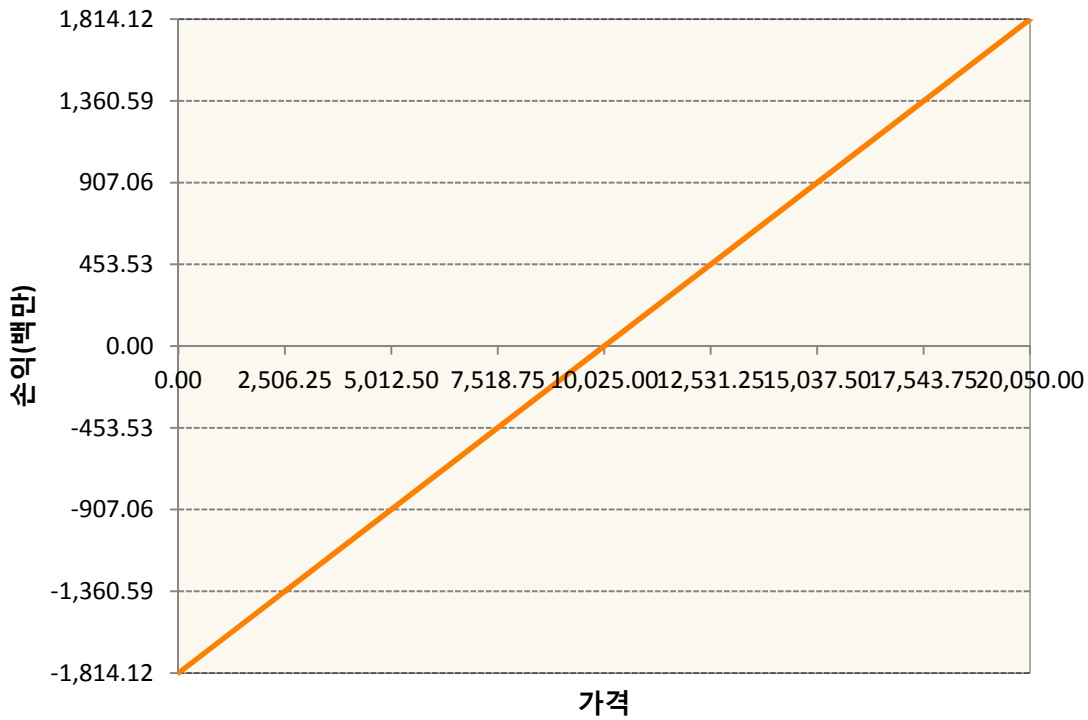
1. 계약금액

(단위:백만원)

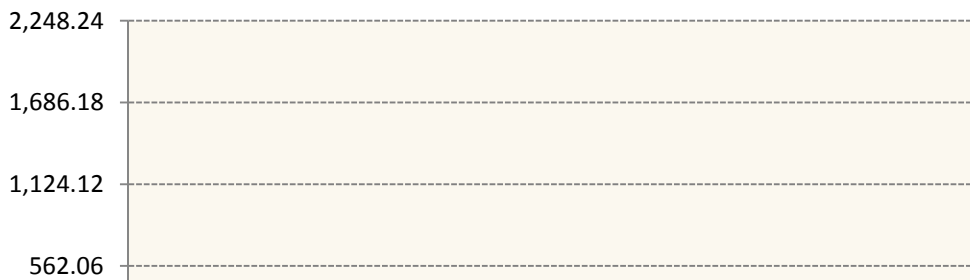
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,814	0	1,814	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,505	-5,505	장내
누계	통화	선도	458	3,238	-2,780	장외

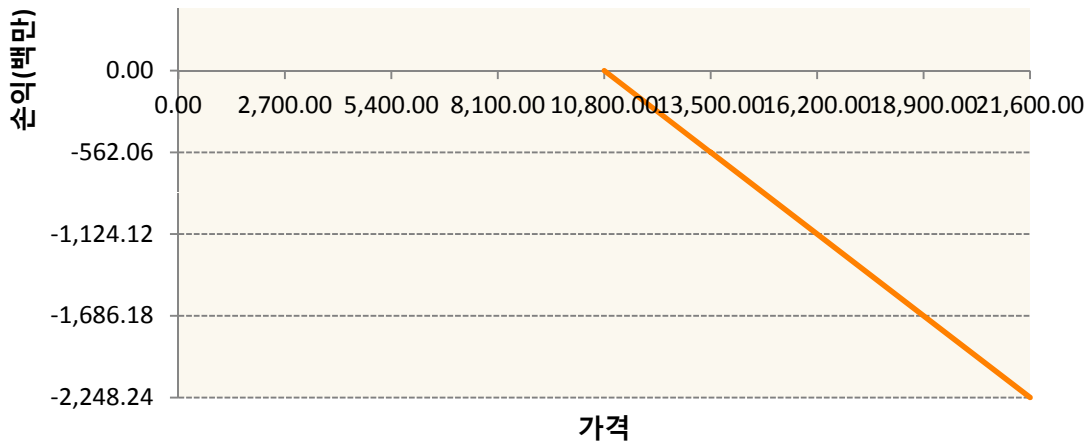
2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19

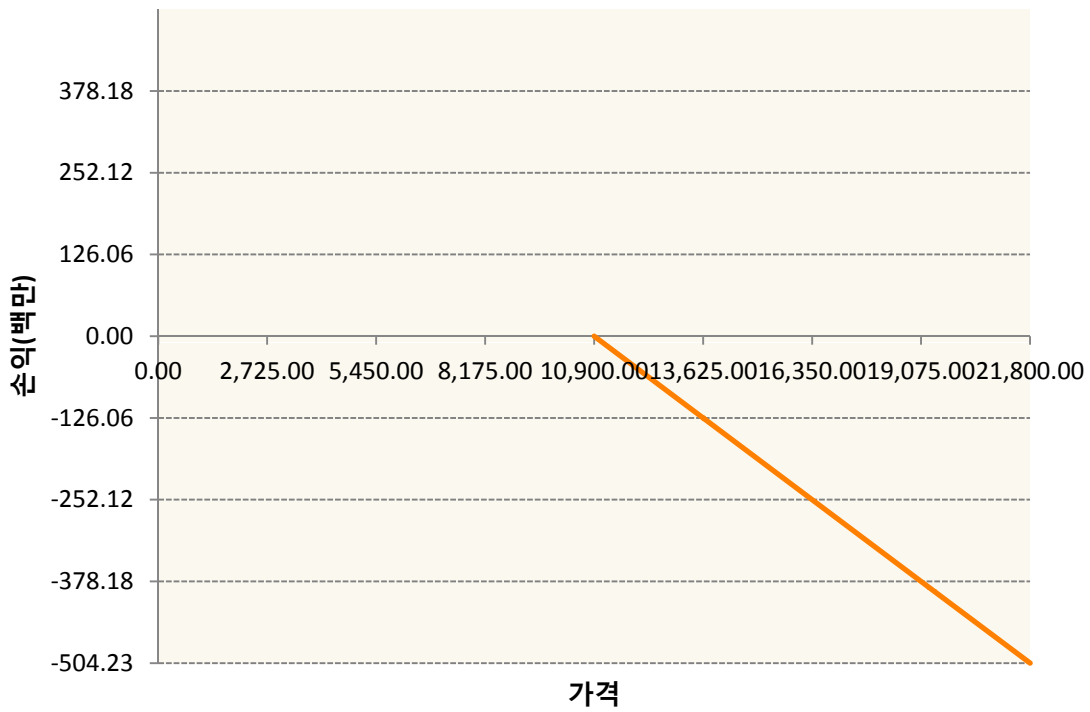


OHHIQ9-C108-HSCEI

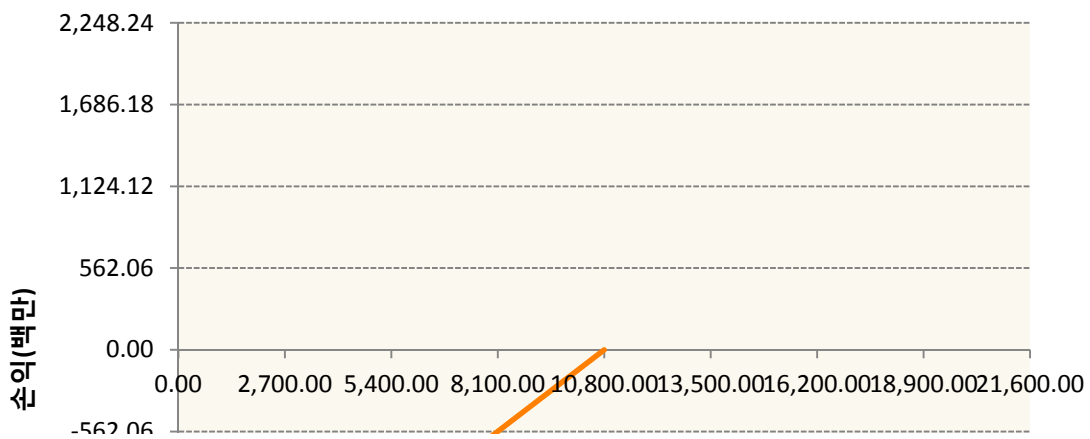


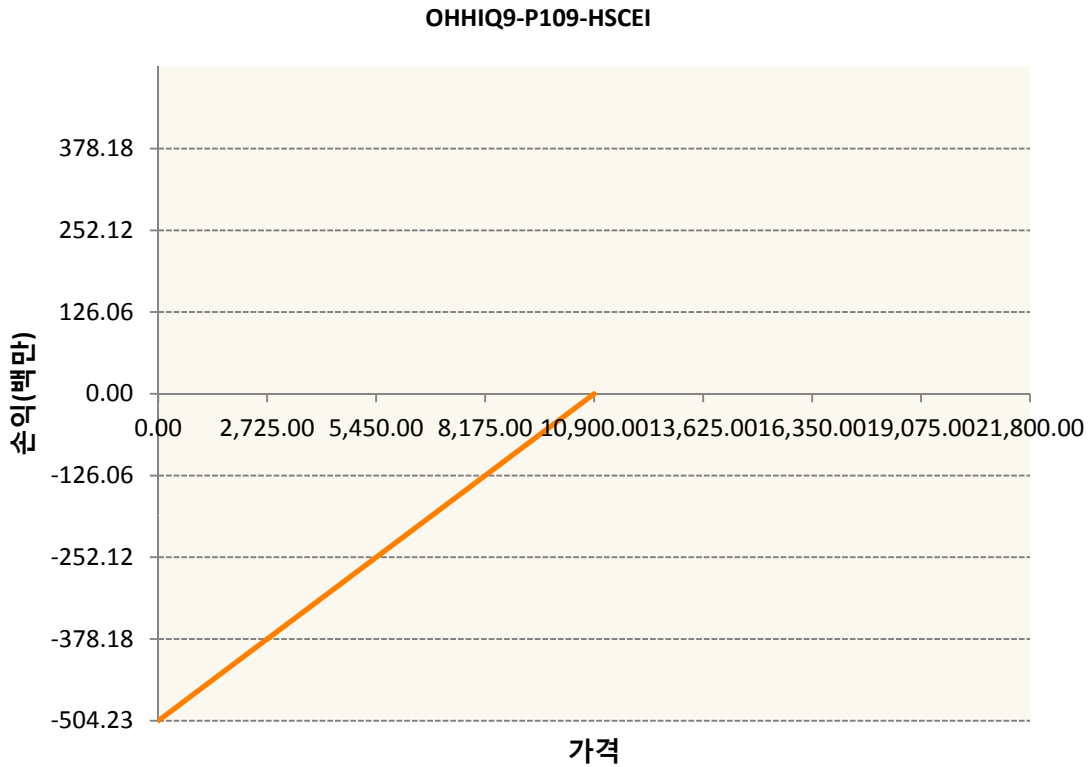


OHHIQ9-C109-HSCEI



OHHIQ9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	259
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E	12
FX21019Q00 HKD/KRW 23-08-19E	24
HCQ9 HSCEI Futures Aug19	145
OHHIQ9-C1(HSCEI	180
OHHIQ9-C1(HSCEI	40
OHHIQ9-P1(HSCEI	180
OHHIQ9-P1(HSCEI	40

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	658

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							222
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-222	-222	-222	-222	-222	-222	-222
-5.33%	-148	-148	-148	-148	-148	-148	-148
-2.67%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	74	74	74	74	74	74	74
5.33%	148	148	148	148	148	148	148
8.00%	222	222	222	222	222	222	222

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

(단위:백만원)

1,820

공시일	2019-08-09
기준일	2019-08-08

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

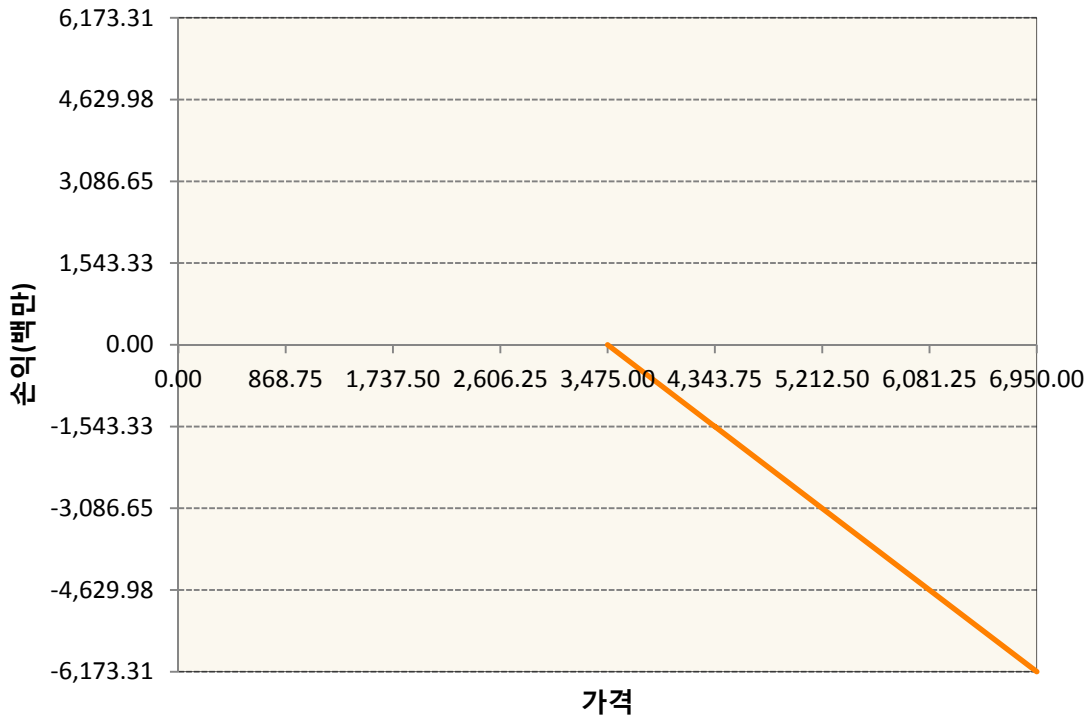
1. 계약금액

(단위:백만원)

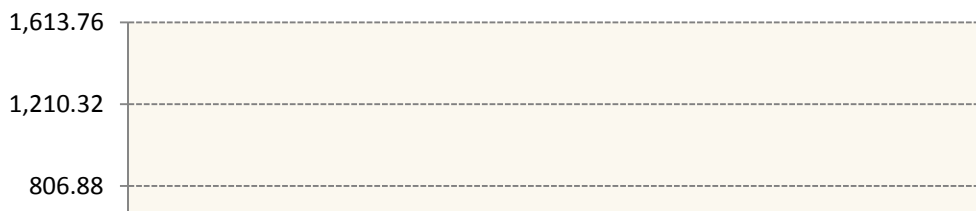
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	7	-7	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,488	0	4,488	
누계	유가증권	스왑	28,671	0	28,671	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,574	-15,574	장내
누계	통화	선도	14,646	23,054	-8,408	장외

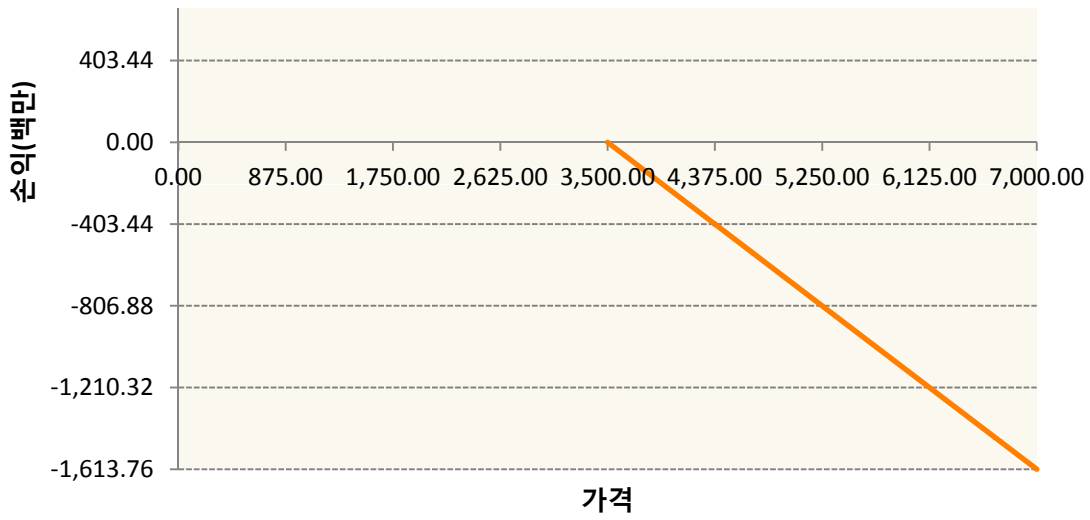
2. 만기시점의 손익구조

OESXQ9-C3475-EURO STOXX 50

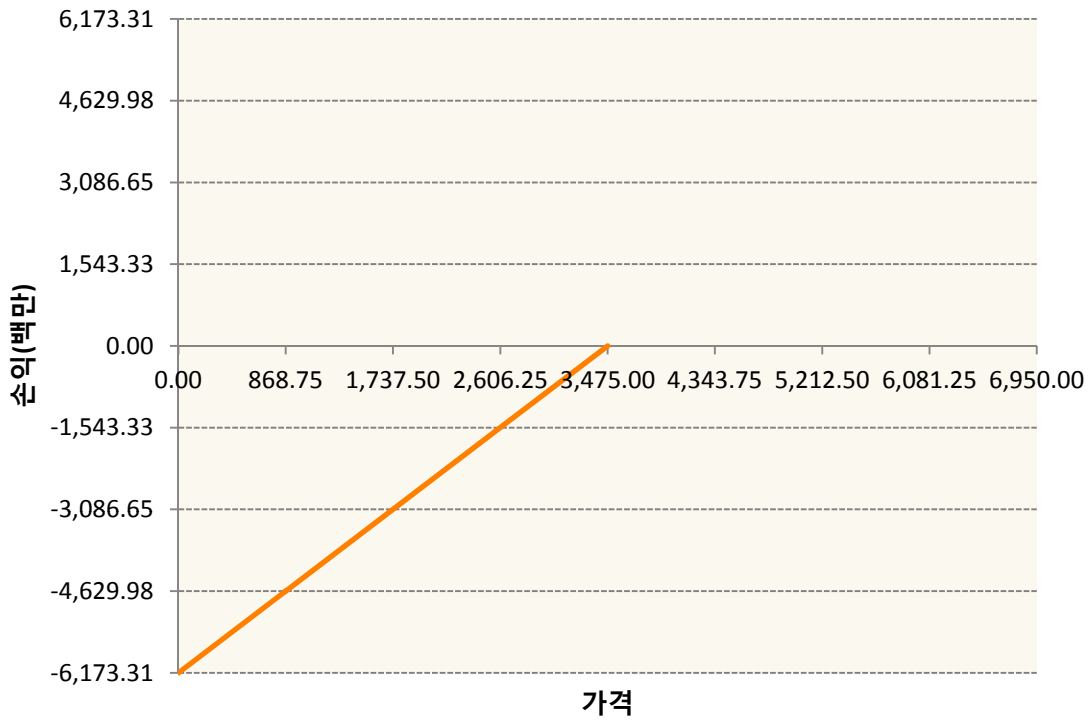


OESXQ9-C3500-EURO STOXX 50

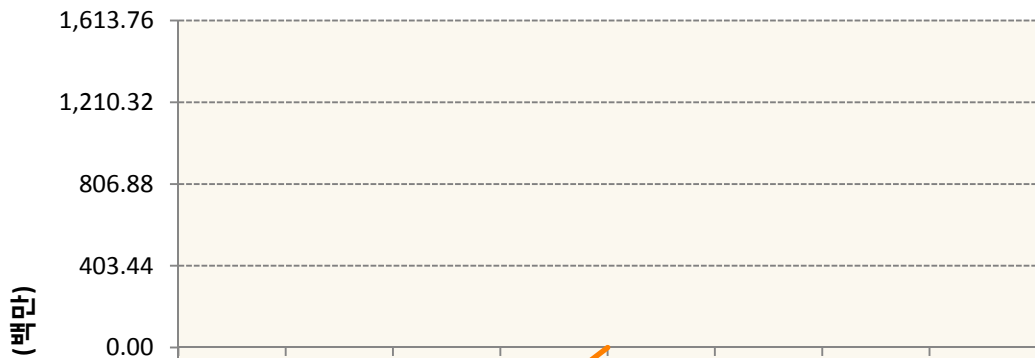


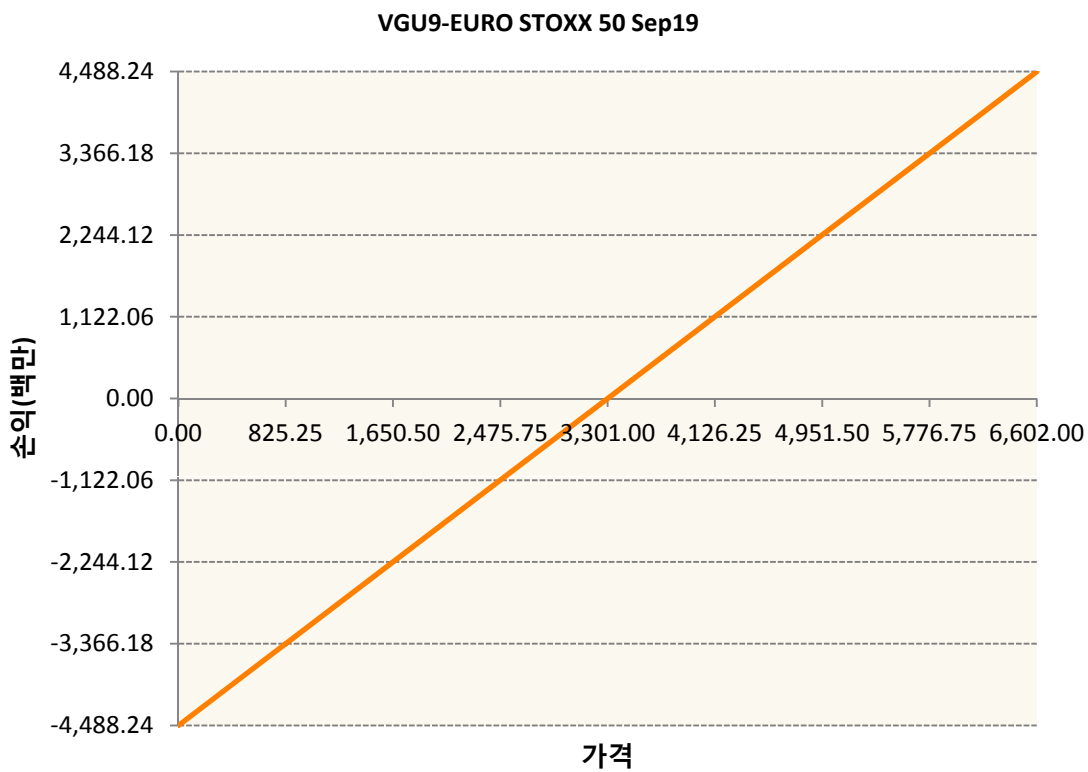
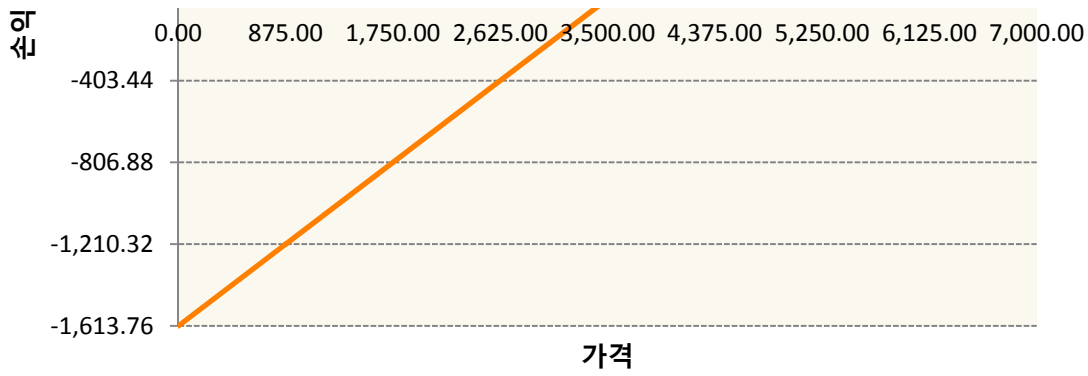


OESXQ9-P3475-EURO STOXX 50



OESXQ9-P3500-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	84
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	434
FX21019M0< KRW/EUR 27-09-19E	1,085
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	325
FX21019N01 EUR/KRW 23-08-19E	434
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E	325
FX21019N04 EUR/KRW 27-09-19E	239
FX21019Q00 EUR/KRW 27-09-19E	174
OESXQ9-C3< EURO STOXX 50	494
OESXQ9-C3! EURO STOXX 50	129
OESXQ9-P3< EURO STOXX 50	494

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

129
359

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

(단위:백만원)

2,647

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

(단위:백만원)

918

공시일	2019-08-09
기준일	2019-08-08

ETF스마트레버리지목표전환형9호

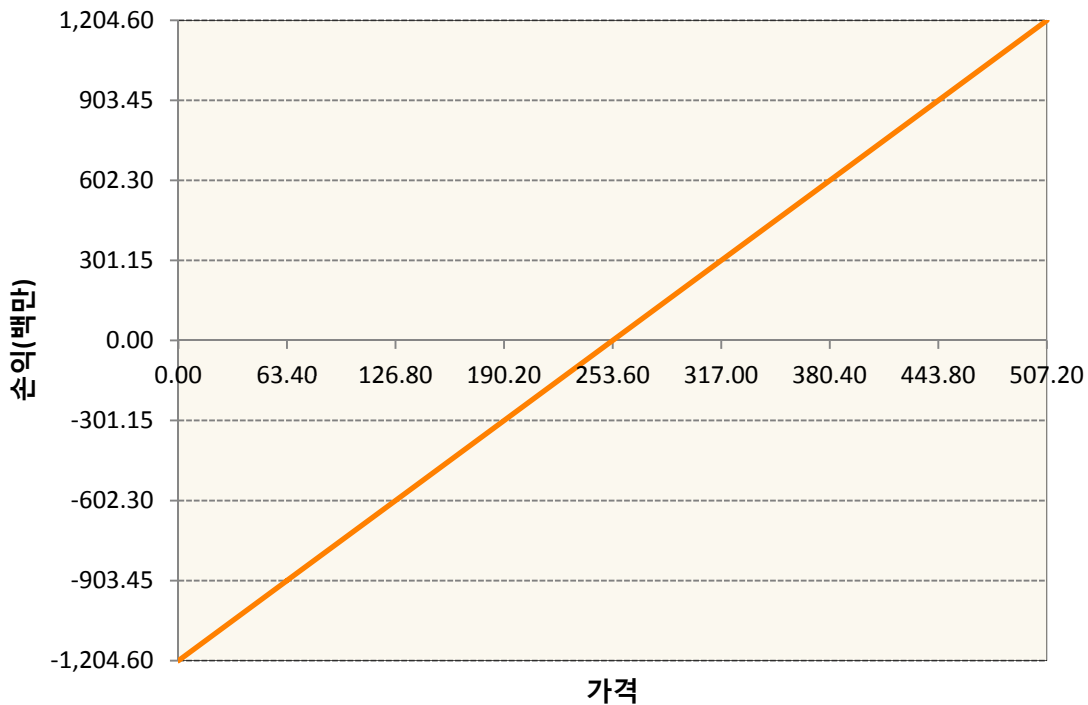
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,205	0	1,205	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						96
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96	
-5.33%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64	
-2.67%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	32	32	32	32	32	32	32	
5.33%	64	64	64	64	64	64	64	
8.00%	96	96	96	96	96	96	96	

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

(단위:백만원)

81

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

(단위:백만원)

120

공시일	2019-08-09
기준일	2019-08-08

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

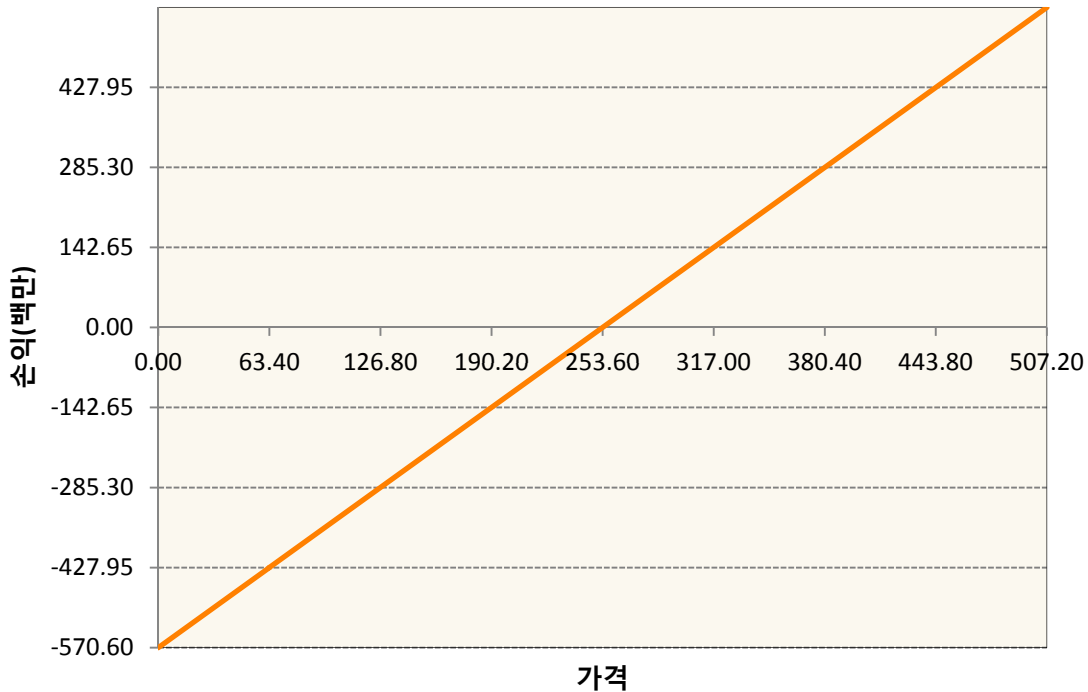
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	571	0	571	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						45
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45	
-5.33%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30	
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	15	15	15	15	15	15	15	
5.33%	30	30	30	30	30	30	30	
8.00%	45	45	45	45	45	45	45	

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

(단위:백만원)

39

공시일	2019-08-09
기준일	2019-08-08

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

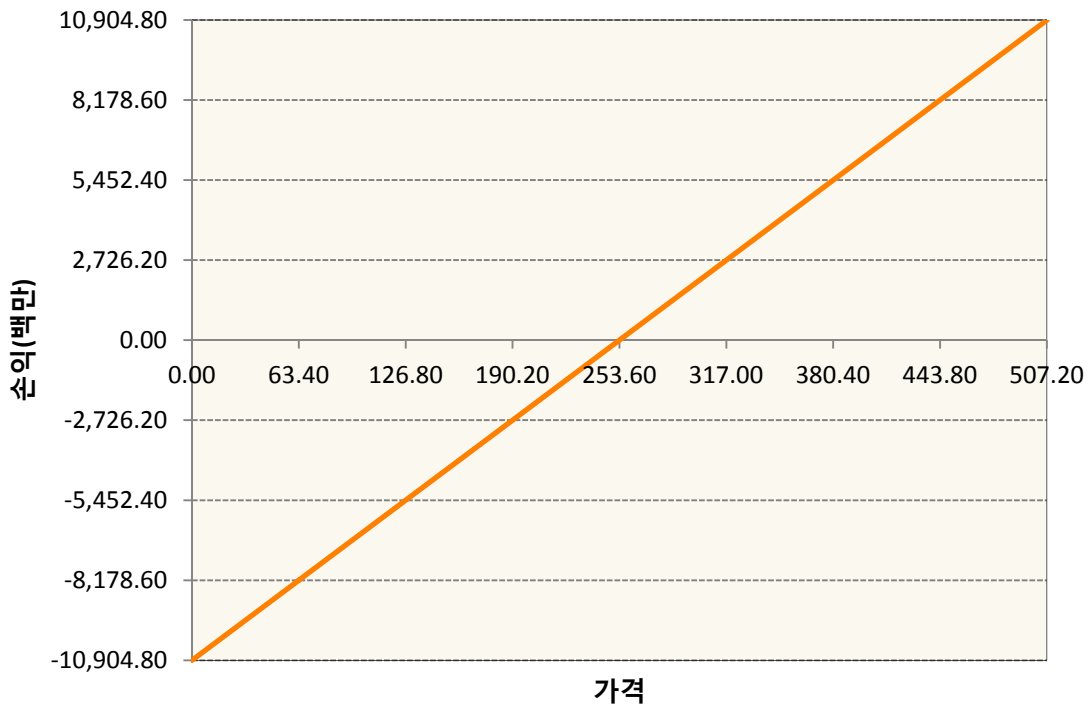
1. 계약금액

(단위:백만원)

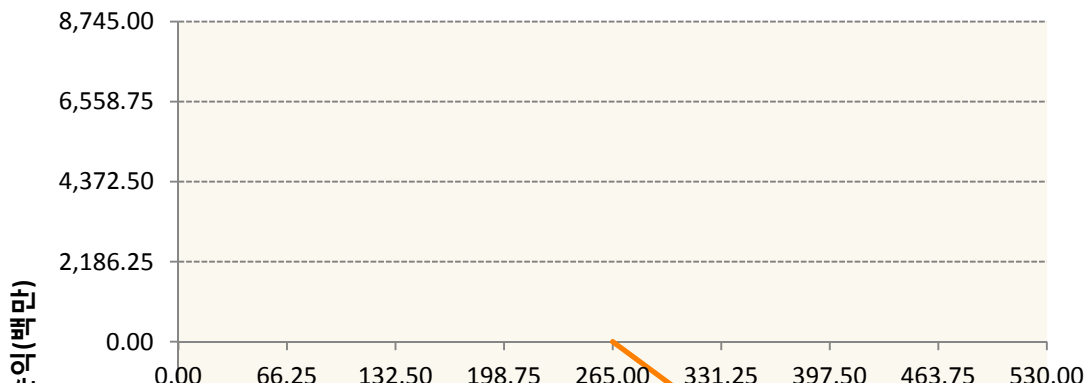
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	2,987	20,237	-17,250	장내
누계	유가증권	선물	10,905	0	10,905	장내
누계	유가증권	옵션	3,044	20,181	-17,136	장내

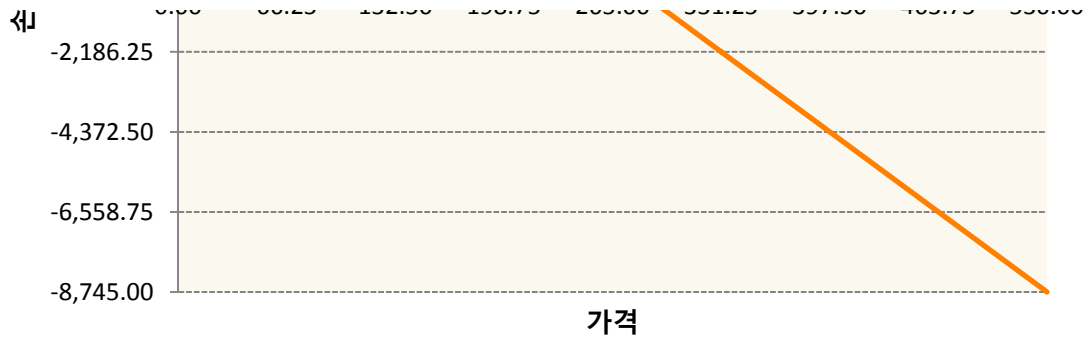
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

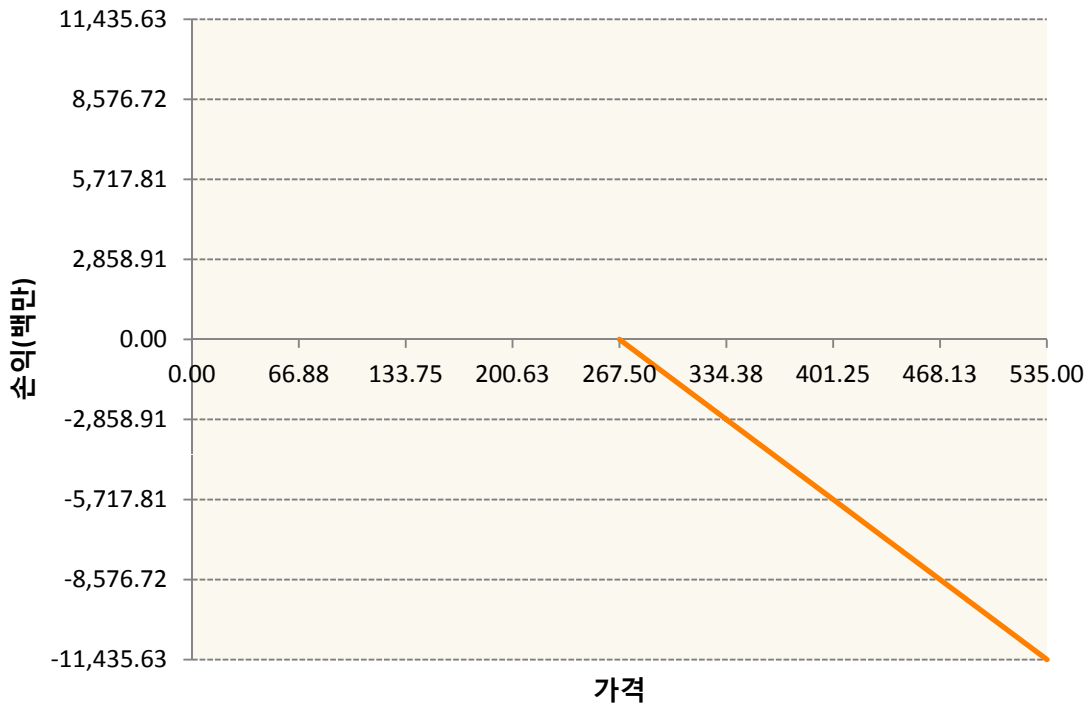


KR4201P92658-2019-09 콜265

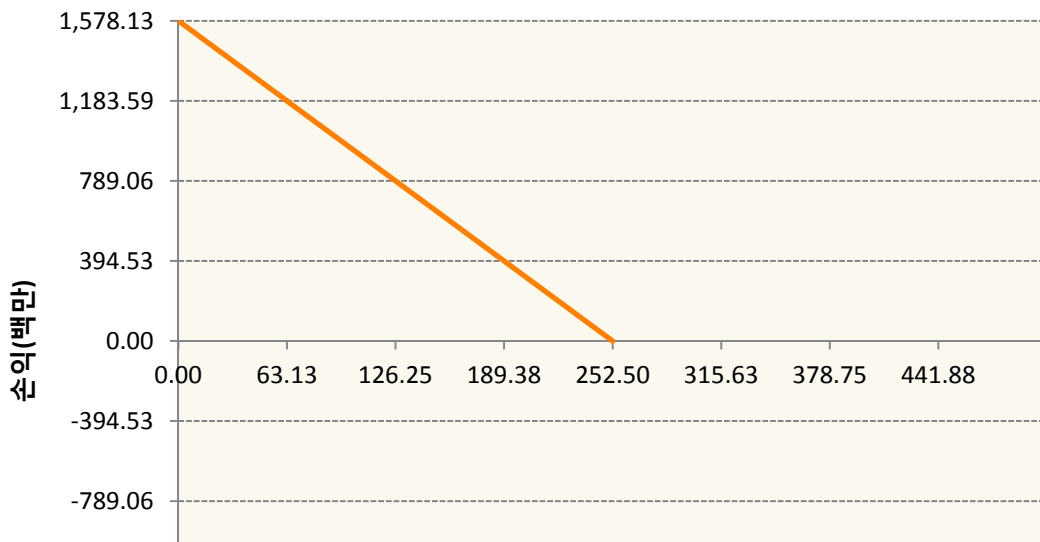


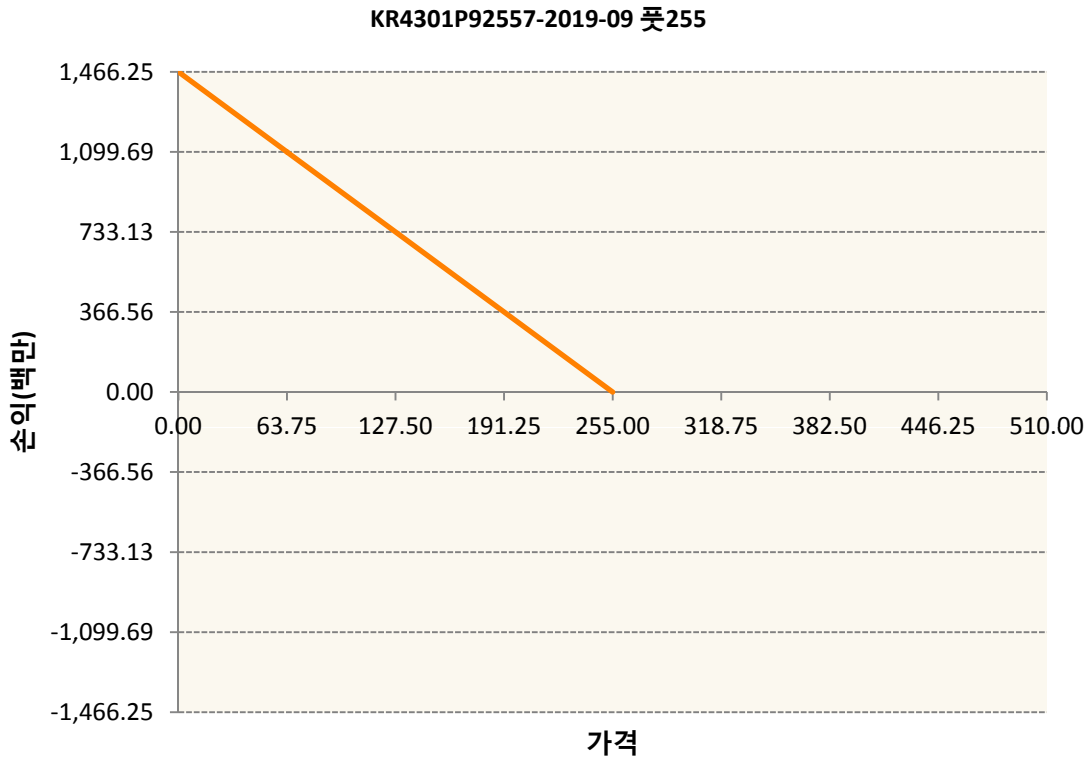
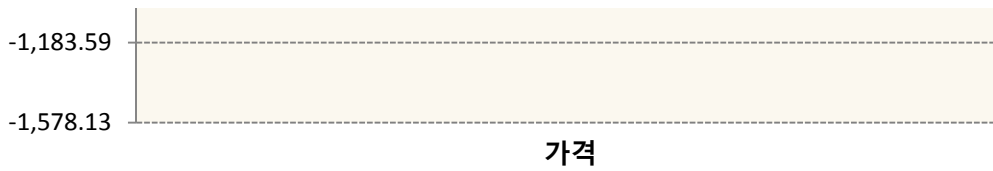


KR4201P92674-2019-09 콜267.5



KR4301P92524-2019-09 풋252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						868
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-868	-868	-868	-868	-868	-868	-868	
-5.33%	-579	-579	-579	-579	-579	-579	-579	
-2.67%	-289	-289	-289	-289	-289	-289	-289	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	289	289	289	289	289	289	289	
5.33%	579	579	579	579	579	579	579	
8.00%	868	868	868	868	868	868	868	
KR4201P92658		2019-09 콜265						367
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	94	93	90	87	82	76	69	
-5.33%	90	86	80	73	65	55	45	
-2.67%	77	68	58	46	34	20	6	

0%	47	32	17	0	-17	-35	-53
2.67%	-12	-32	-52	-72	-92	-113	-134
5.33%	-108	-130	-152	-173	-195	-217	-238
8.00%	-244	-264	-284	-304	-325	-346	-367
KR4201P92674 2019-09 콜267.5							437
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	99	98	95	92	87	81	73
-5.33%	96	91	86	78	69	58	46
-2.67%	84	75	63	50	36	20	3
0%	54	38	19	0	-21	-42	-64
2.67%	-7	-31	-56	-81	-106	-132	-158
5.33%	-114	-142	-170	-198	-226	-254	-282
8.00%	-271	-298	-326	-354	-381	-409	-437
KR4301P92524 2019-09 풋252.5							98
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	94	94	95	95	96	97	98
-5.33%	54	55	56	58	59	61	63
-2.67%	18	21	23	25	28	30	33
0%	-8	-6	-3	0	3	6	8
2.67%	-24	-22	-20	-17	-14	-12	-9
5.33%	-32	-30	-29	-27	-25	-23	-21
8.00%	-34	-34	-33	-32	-31	-29	-28
KR4301P92557 2019-09 풋255							96
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	93	93	93	94	94	95	96
-5.33%	55	56	57	58	59	60	62
-2.67%	20	22	24	26	28	30	32
0%	-8	-5	-3	0	3	5	8
2.67%	-26	-23	-21	-18	-16	-13	-11
5.33%	-35	-34	-32	-30	-28	-26	-23
8.00%	-39	-38	-37	-36	-35	-33	-31

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

(단위:백만원)

1,496

공시일	2019-08-09
기준일	2019-08-08

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,209	0	1,209	
누계	유가증권	수익증권	59,343	0	59,343	

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	2019-08-09
기준일	2019-08-08

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	1,284	-1,284	
누계	유가증권	수익증권	71,796	0	71,796	

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	2019-08-09
기준일	2019-08-08

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,418	0	2,418	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	458,481	0	458,481	
누계	통화	선도	0	521,770	-521,770	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		3,192
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		2,167
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		1,741
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,128
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		135
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		580
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		3,096
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		3,386
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		484
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		967
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		3,008
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		1,683
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		774
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,935
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,935
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		290
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		97
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		716
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		716
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		290
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		677
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		2,709
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		1,354
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		774
FX21019N04 KRW/USD 03-09-19E		290
FX21019Q00 KRW/USD 03-09-19E		290

FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E	484
FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E	193
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E	290
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E	3,192
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E	2,167

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

(단위:백만원)

13,736

공시일	2019-08-09
기준일	2019-08-08

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

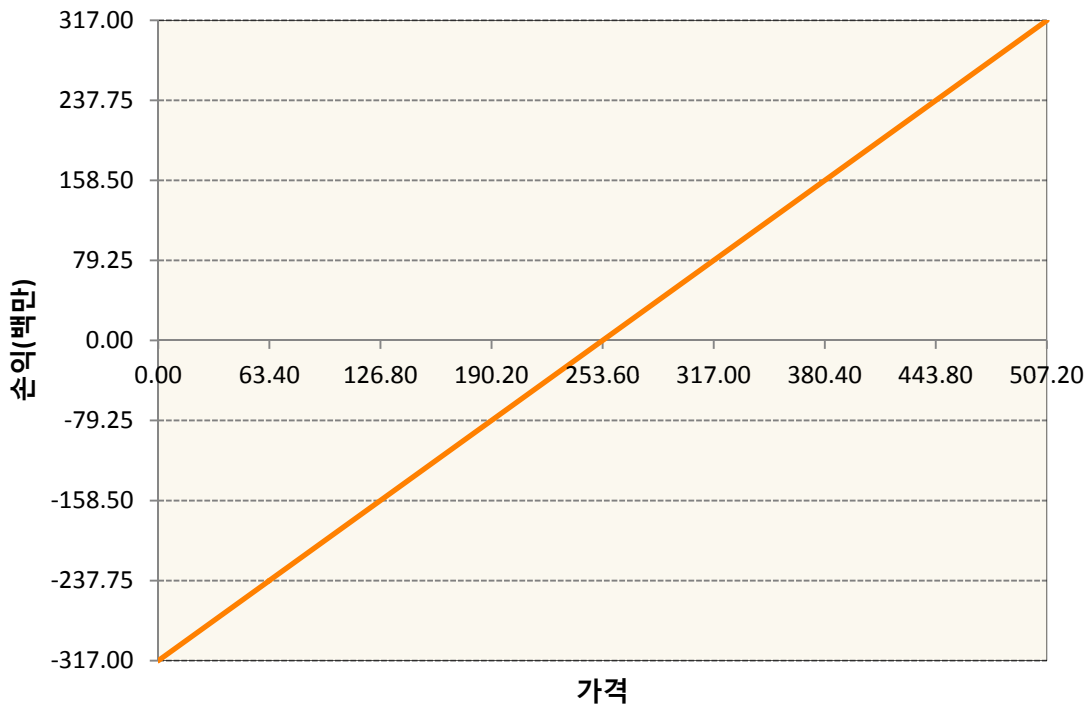
1. 계약금액

(단위:백만원)

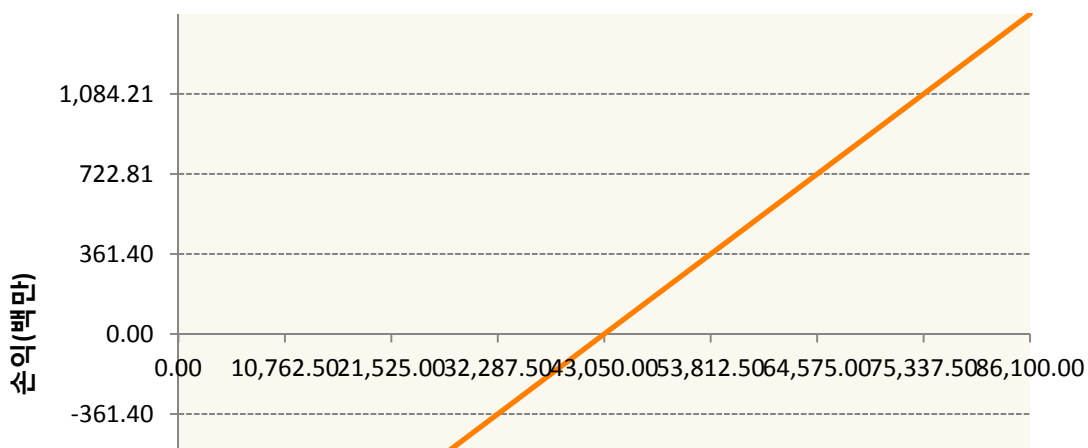
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,763	0	1,763	장내

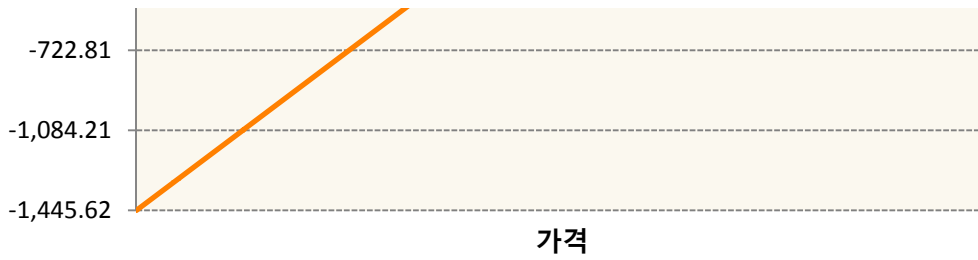
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P90000-2019-09 삼성전자개별선물





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						25
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25	
-5.33%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
-2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	8	8	8	8	8	8	8	
5.33%	17	17	17	17	17	17	17	
8.00%	25	25	25	25	25	25	25	
KR4111P90000		2019-09 삼성전자개별선물						115
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-115	-115	-115	-115	-115	-115	-115	
-5.33%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76	
-2.67%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	38	38	38	38	38	38	38	
5.33%	76	76	76	76	76	76	76	
8.00%	115	115	115	115	115	115	115	

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

165

공시일	2019-08-09
기준일	2019-08-08

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

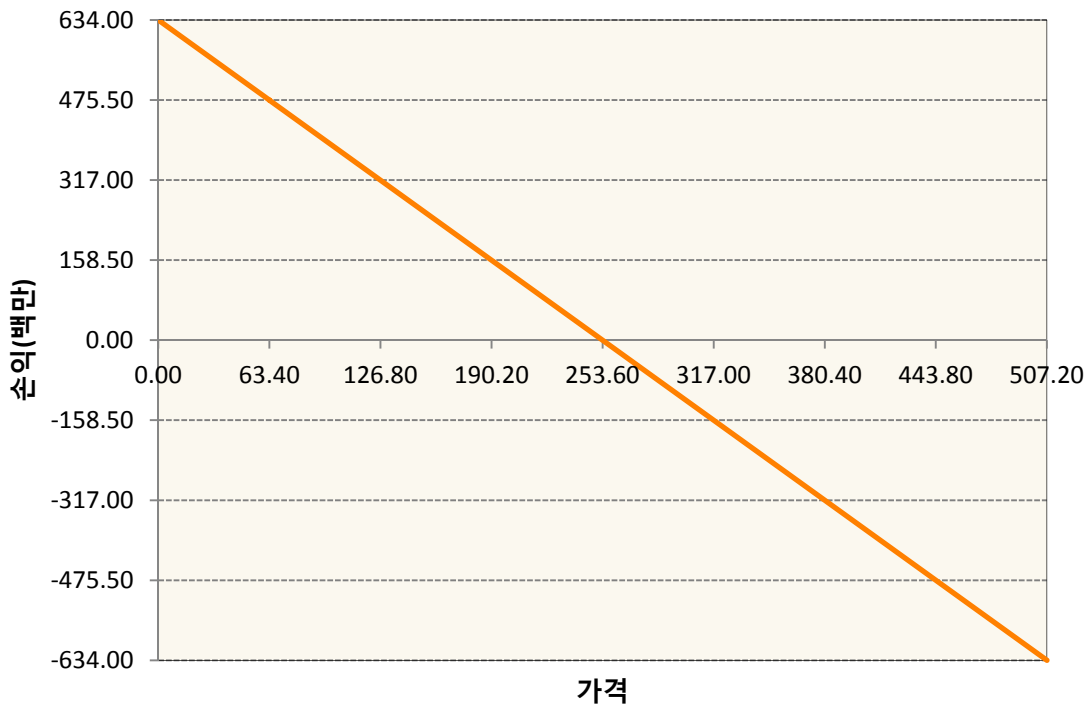
1. 계약금액

(단위:백만원)

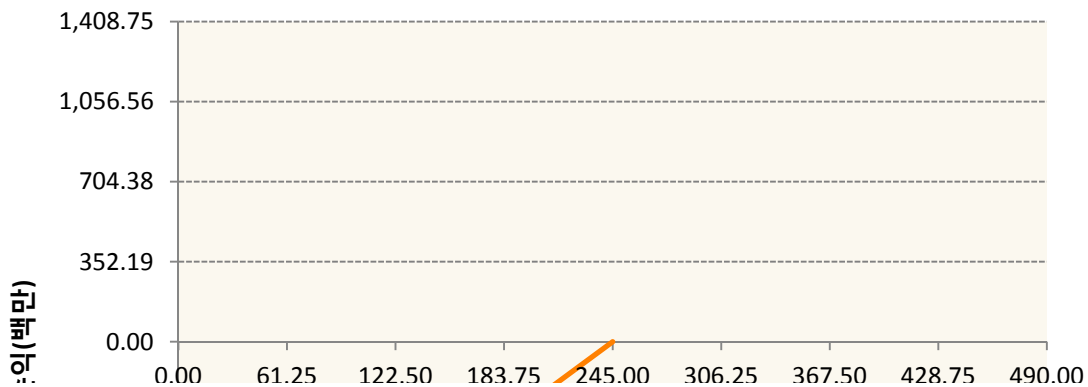
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	3,610	-3,610	장내
누계	유가증권	선물	0	634	-634	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,574	-3,574	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

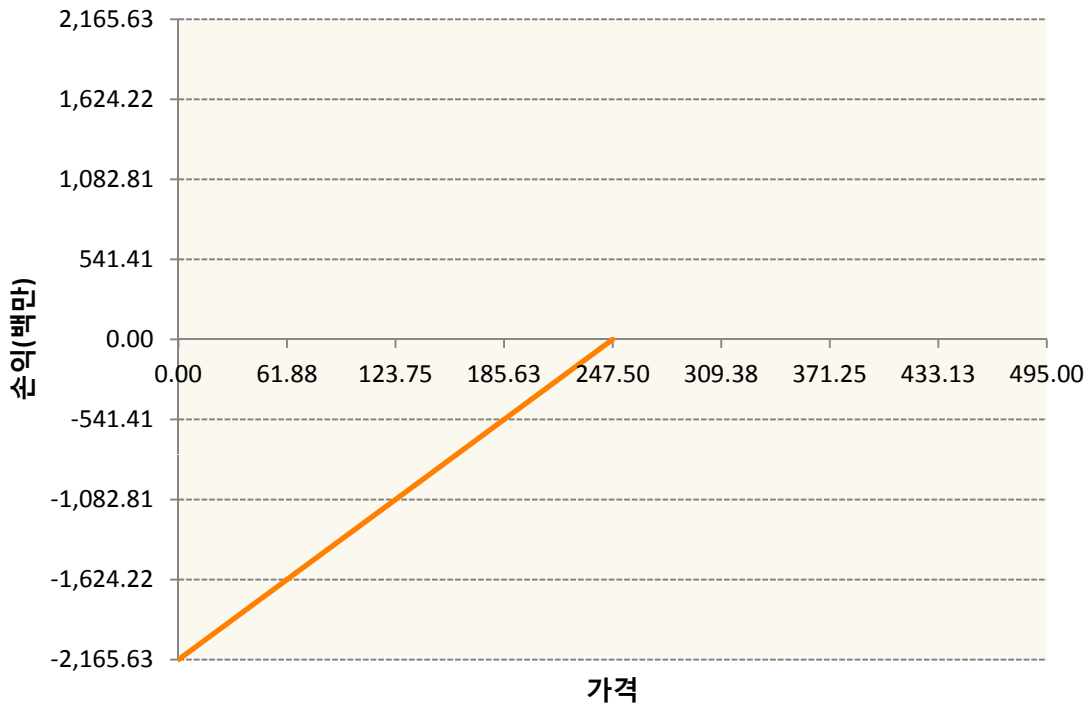


KR4301P92458-2019-09 풋245





KR4301P92474-2019-09 풋247.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						50
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	50	50	50	50	50	50	50	
-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%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	
KR4301P92458		2019-09 풋245						71
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-63	-64	-65	-67	-68	-70	-71
-5.33%	-31	-33	-35	-37	-39	-42	-44
-2.67%	-7	-10	-12	-15	-17	-20	-22
0%	6	4	2	0	-2	-5	-7
2.67%	12	11	10	8	7	5	3
5.33%	14	13	13	12	11	10	9
8.00%	14	14	14	14	13	13	12
KR4301P92474 2019-09 풋247.5							119
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-109	-110	-111	-113	-115	-117	-119
-5.33%	-57	-59	-62	-65	-68	-71	-74
-2.67%	-15	-19	-23	-27	-30	-34	-38
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	23	21	19	16	13	10	7
5.33%	28	27	26	24	22	20	18
8.00%	29	29	28	28	27	25	24

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

(단위:백만원)

219

공시일	2019-08-09
기준일	2019-08-08

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	19,009	0	19,009	
누계	통화	선도	0	33,858	-33,858	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		1,006
FX21019N01 KRW/USD 12-08-19E		164
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		329
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		164
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		484
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		522
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		39

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

(단위:백만원)

891

공시일	2019-08-09
기준일	2019-08-08

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	387	0	387	장외
누계	통화	선도	0	95	-95	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
FX21019Q00 KRW/EUR 25-10-19E	4

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

(단위:백만원)

32

공시일	2019-08-09
기준일	2019-08-08

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

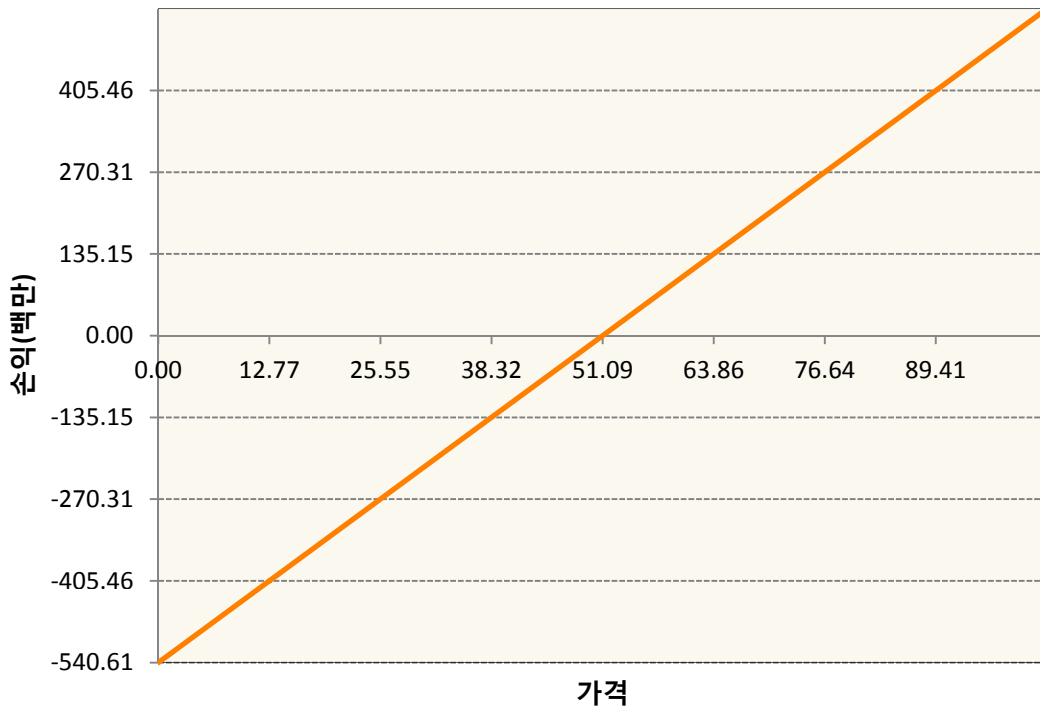
1. 계약금액

(단위:백만원)

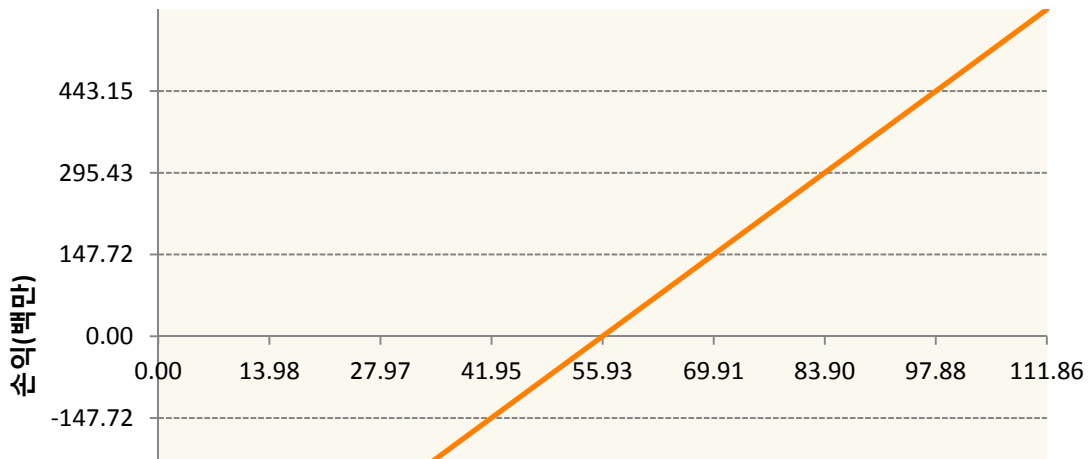
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,226	121	2,105	

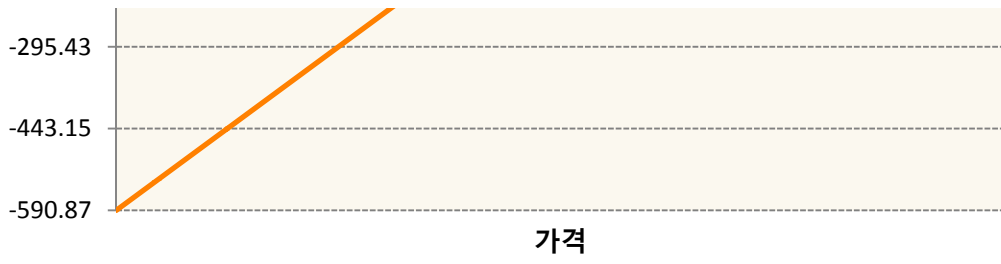
2. 만기시점의 손익구조

CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19

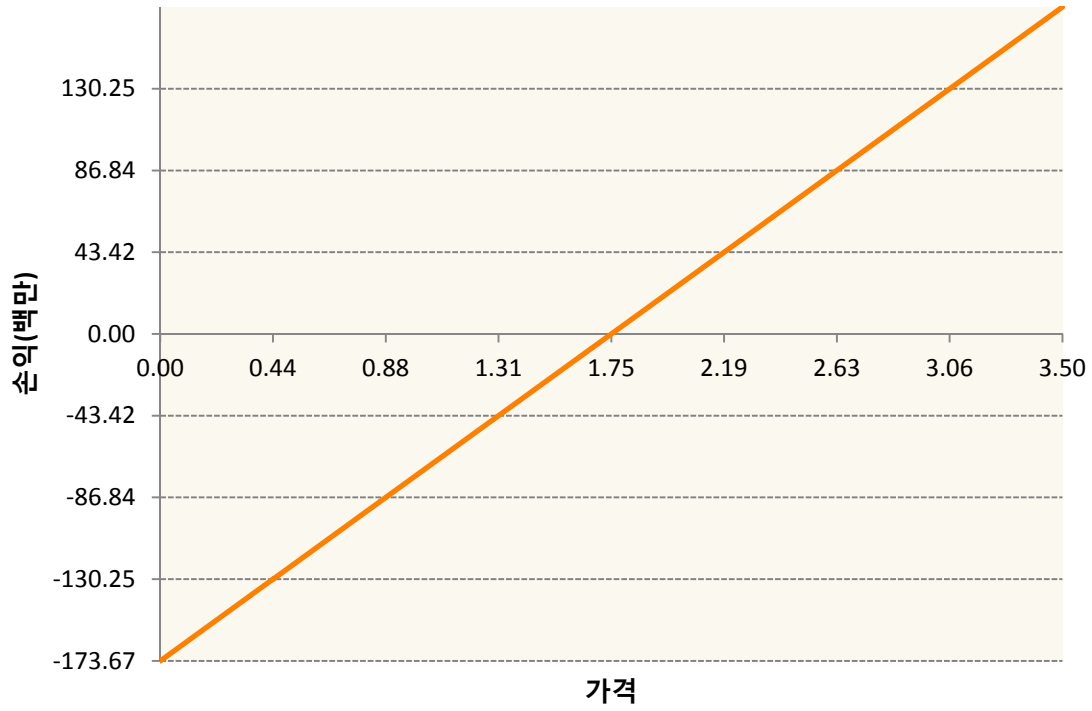


COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19

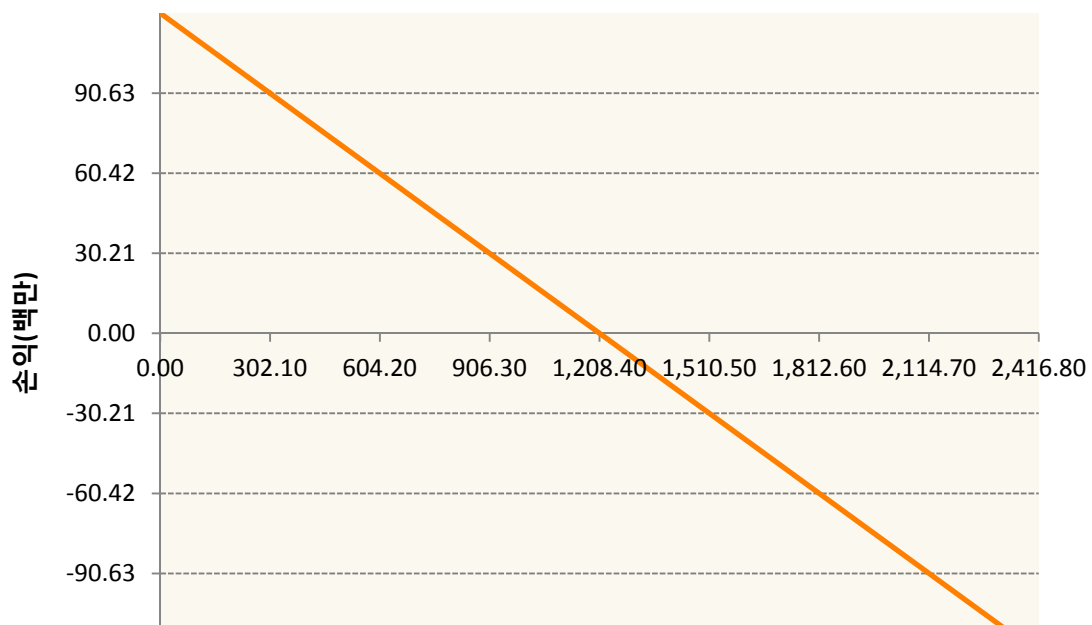


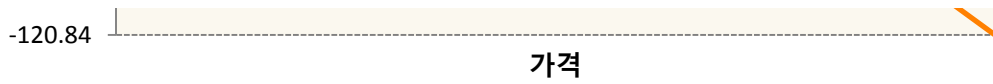


HOU9-NY Harb ULSD Fut Sep19

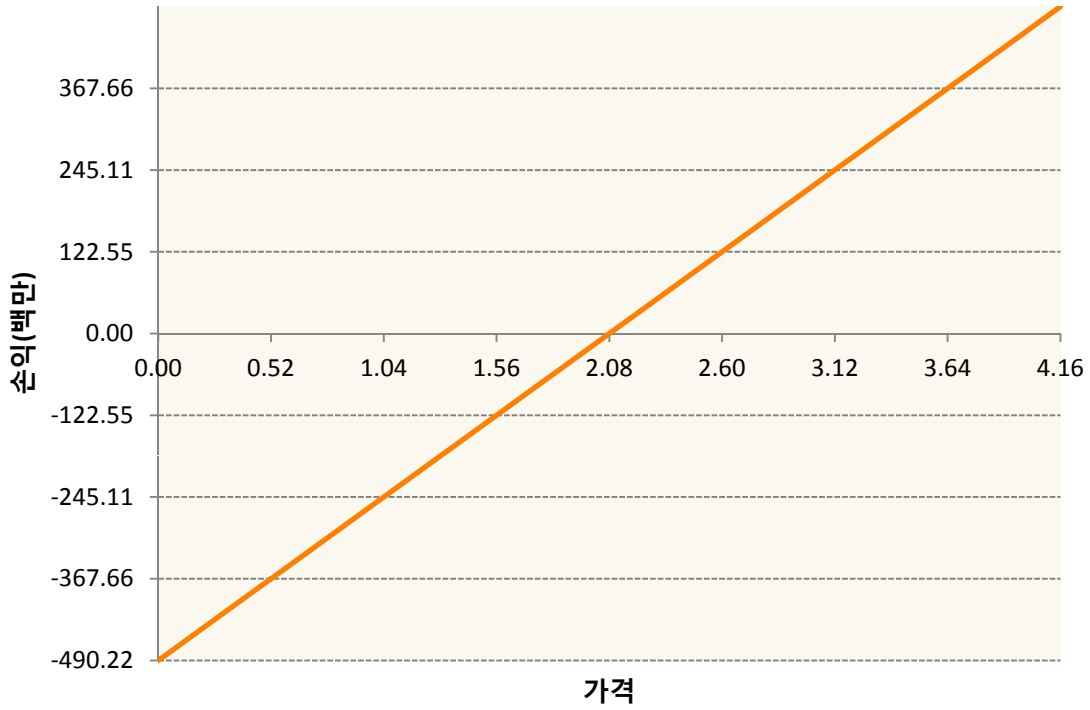


KR4175P80006-2019-08 달러선물

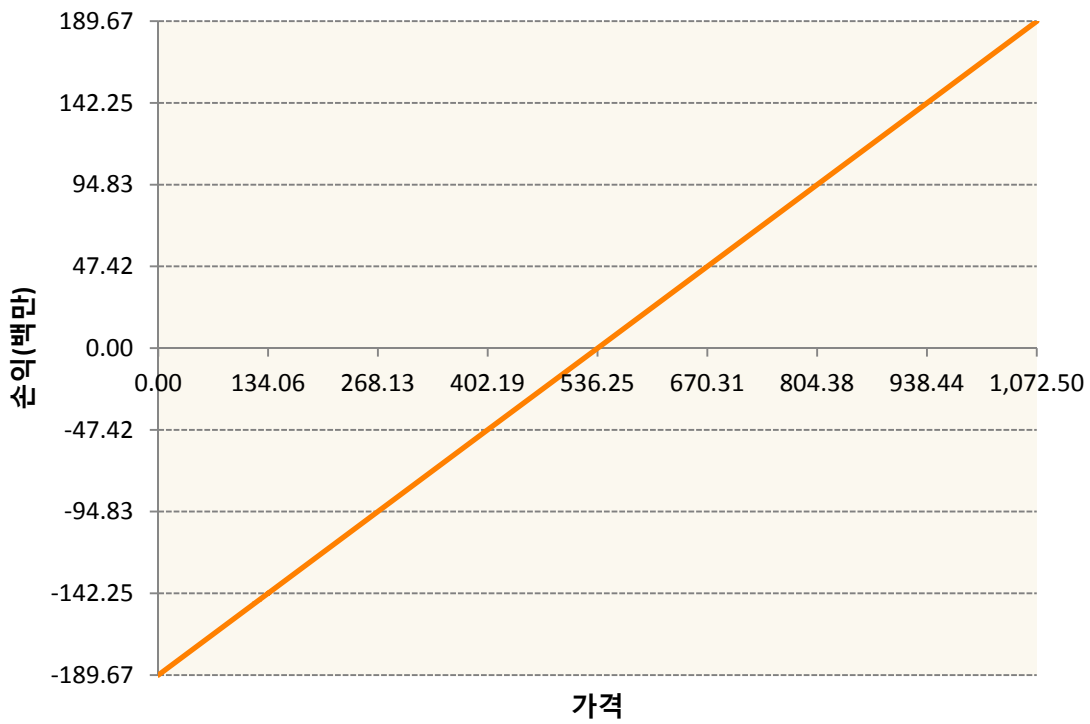




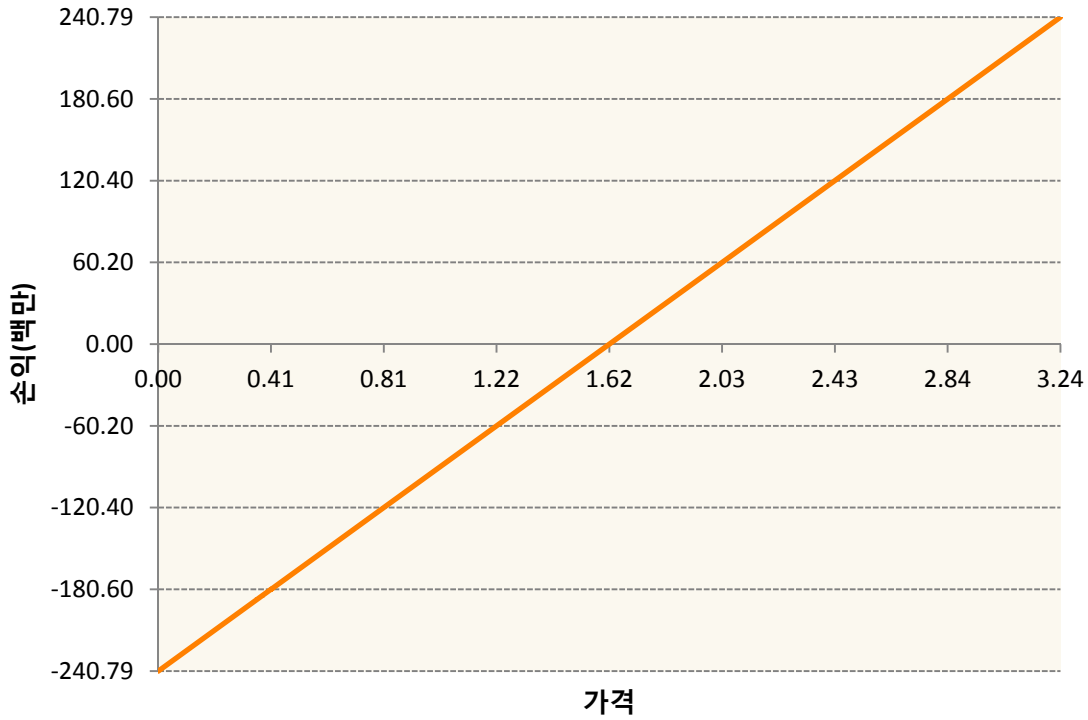
NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



QSU9-Low Su Gasoil G Sep19



XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	43
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	47
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	14
KR4175P800	2019-08 달러선물	10
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	39
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	15
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	19

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

337

공시일	2019-08-09
기준일	2019-08-08

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

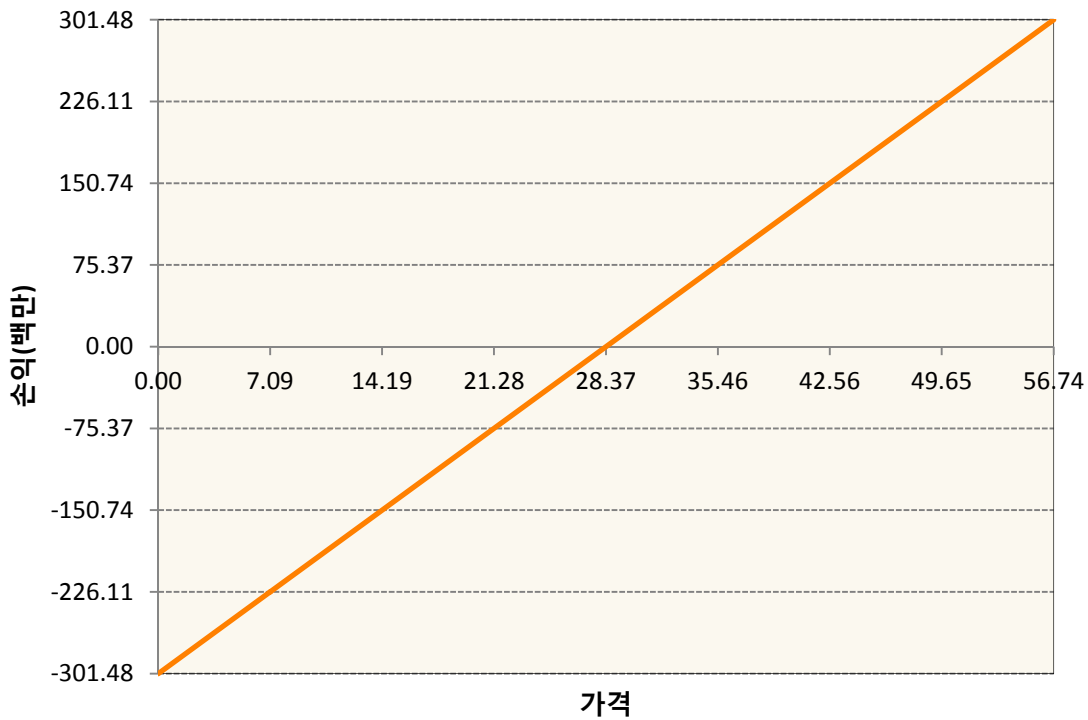
1. 계약금액

(단위:백만원)

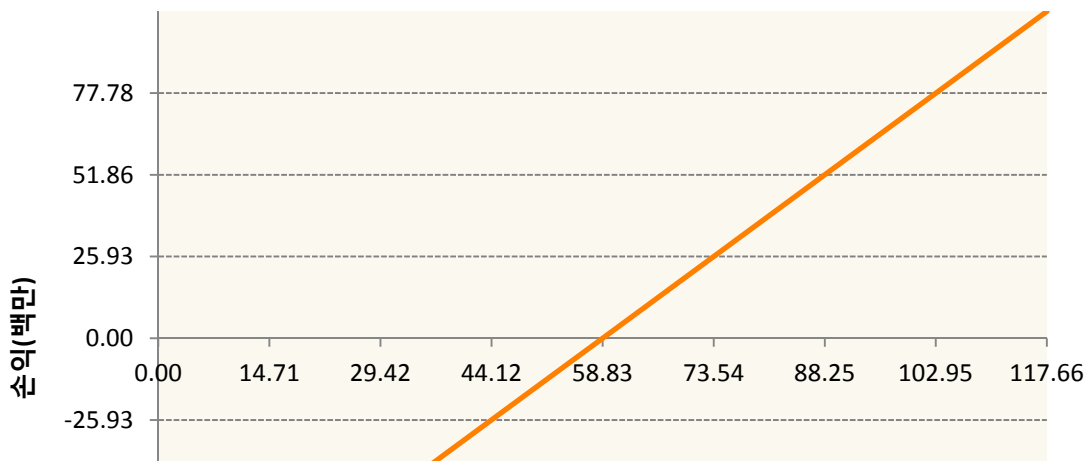
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,753	205	2,547	

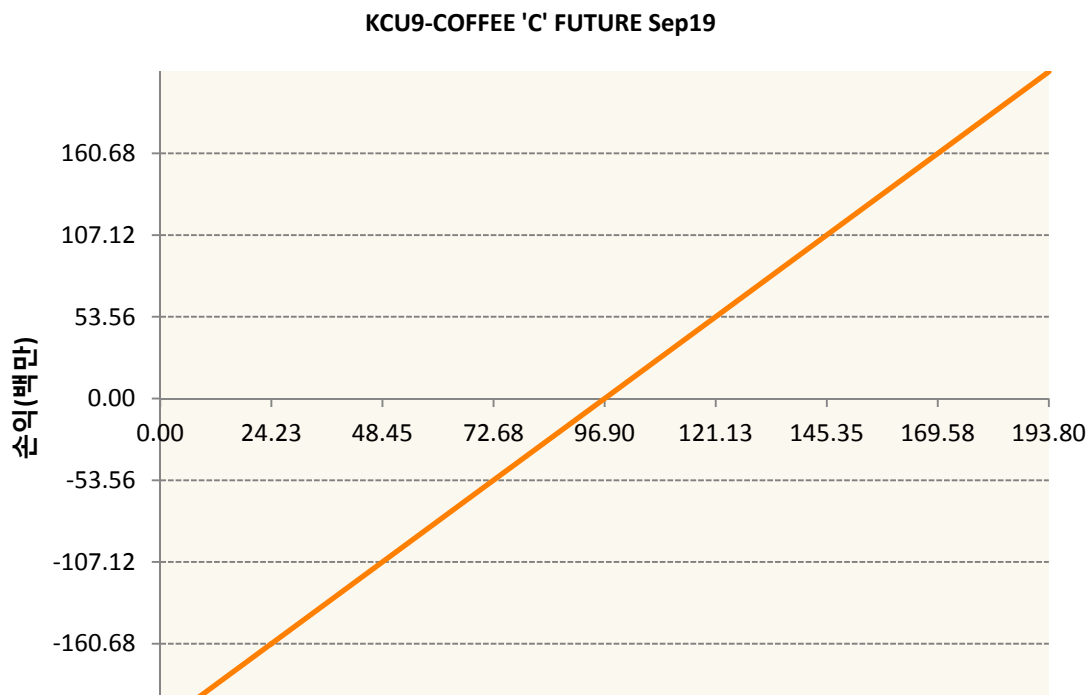
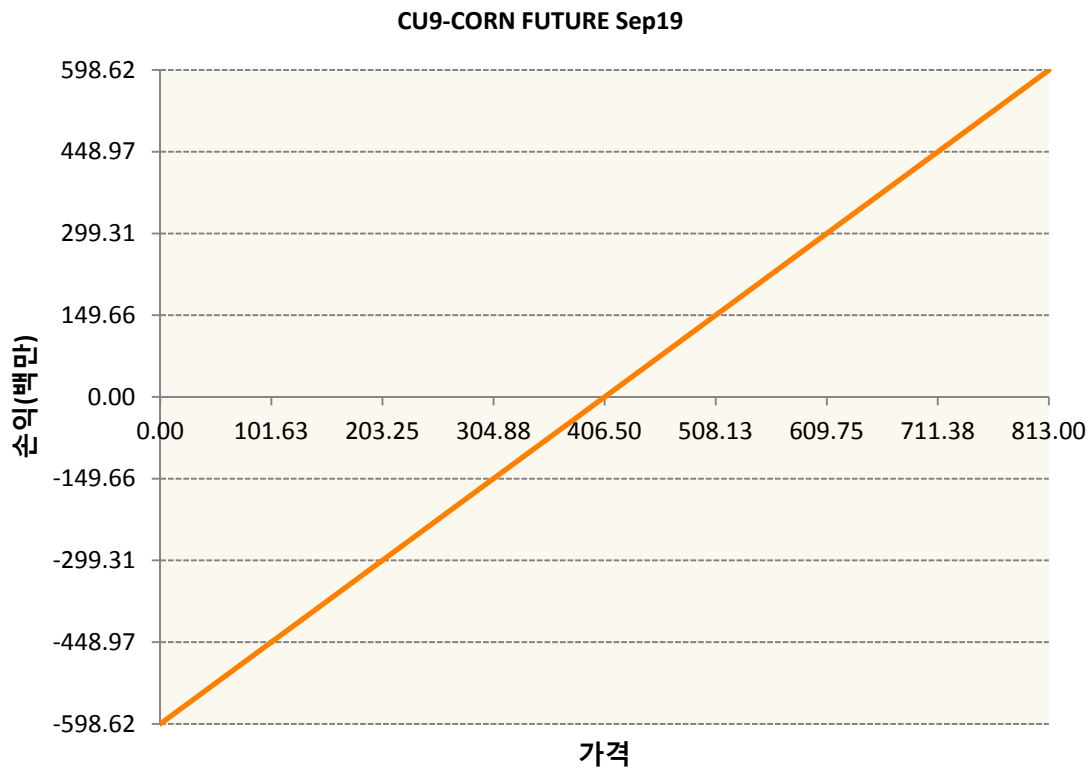
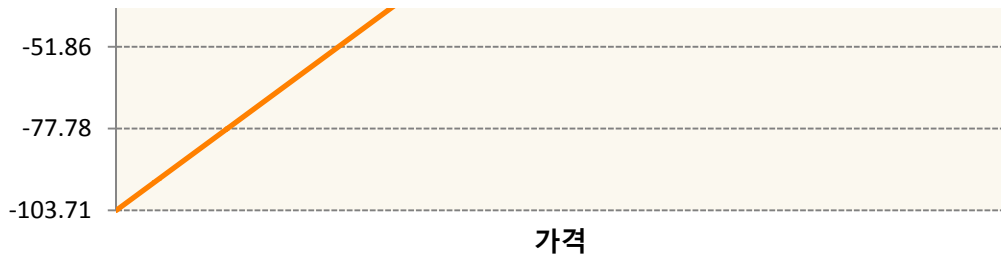
2. 만기시점의 손익구조

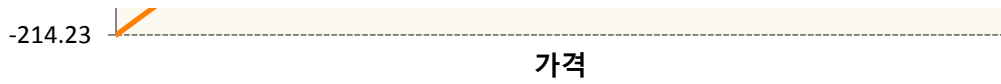
BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19



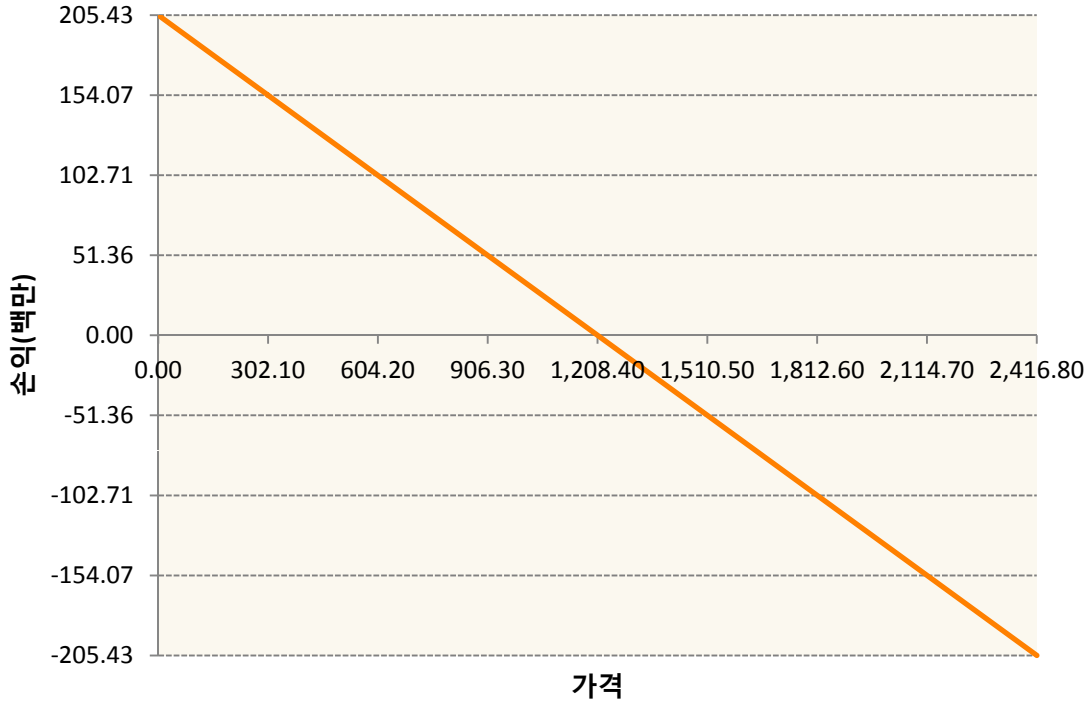
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



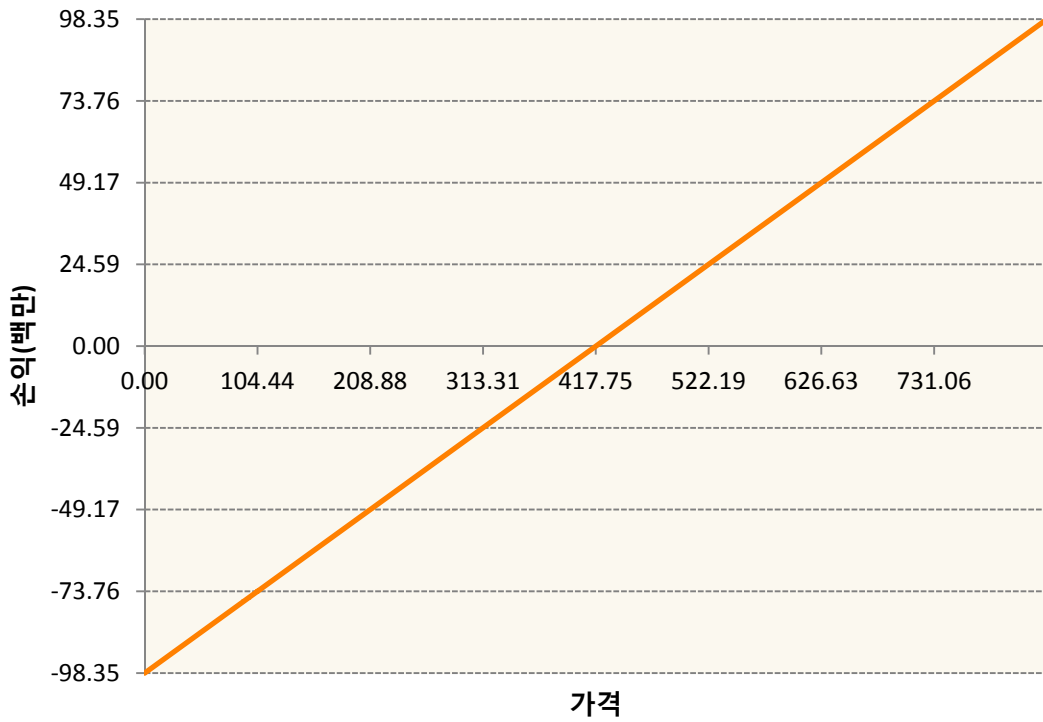




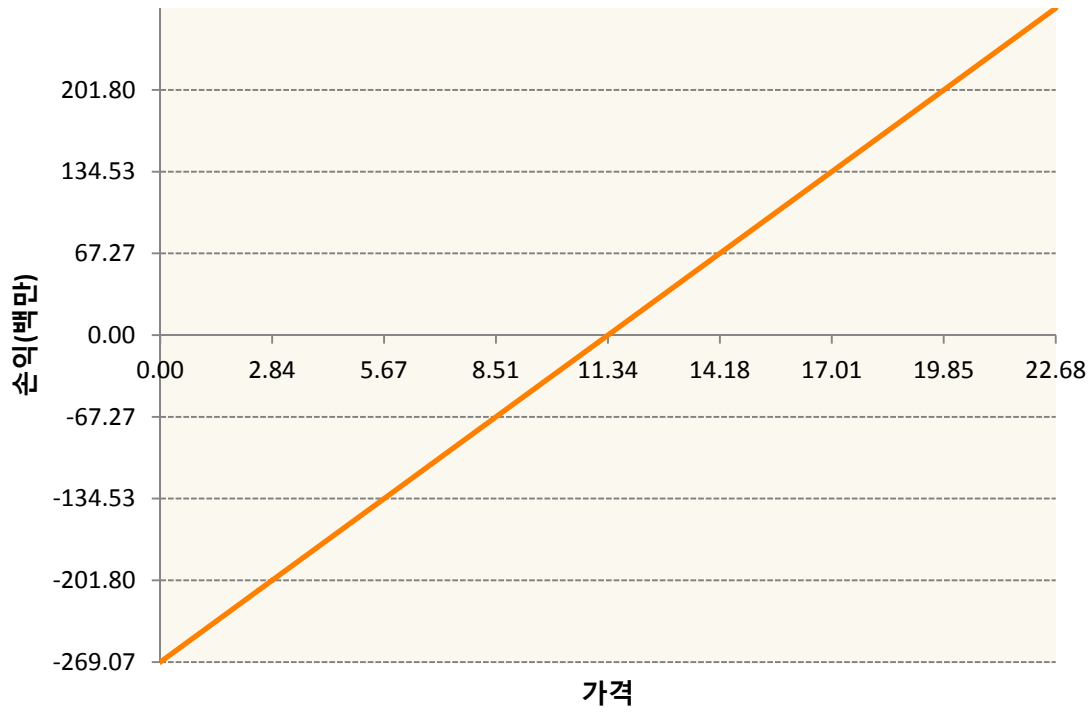
KR4175P80006-2019-08 달러선물



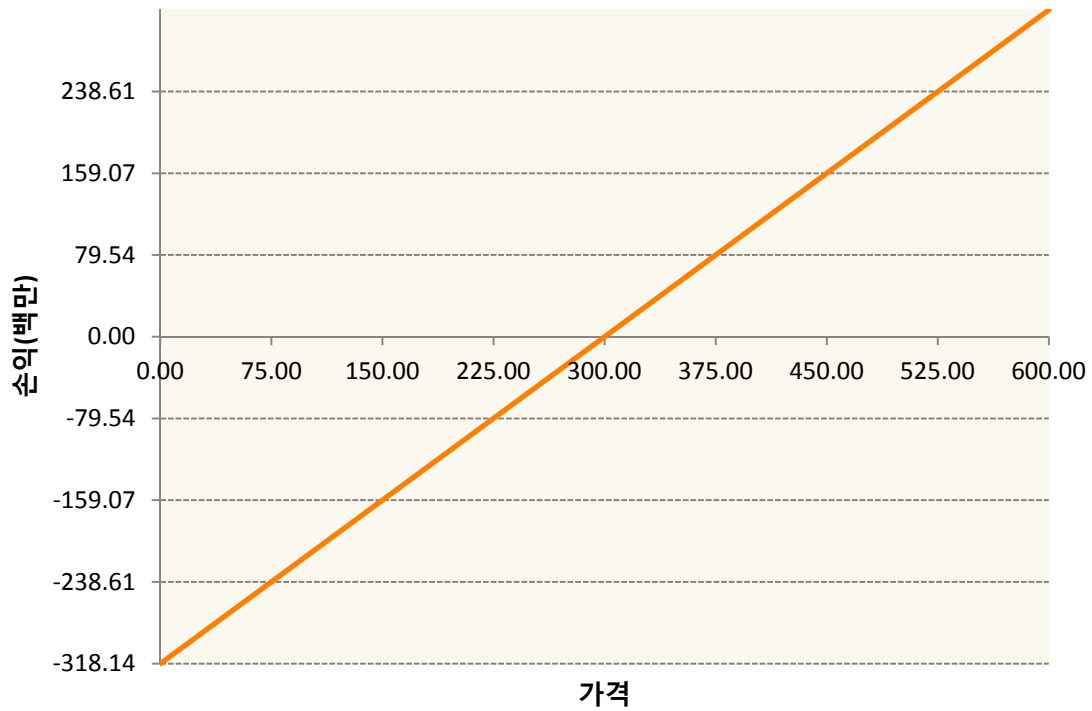
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



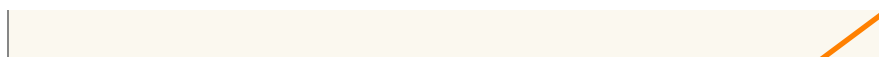
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

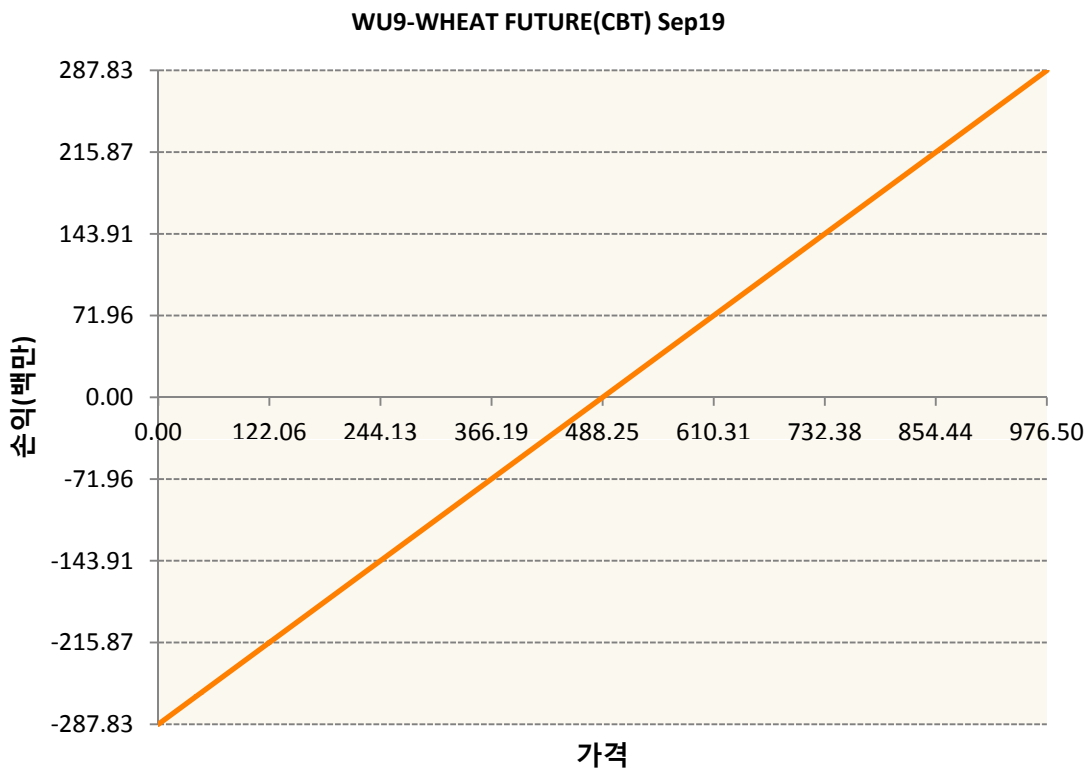
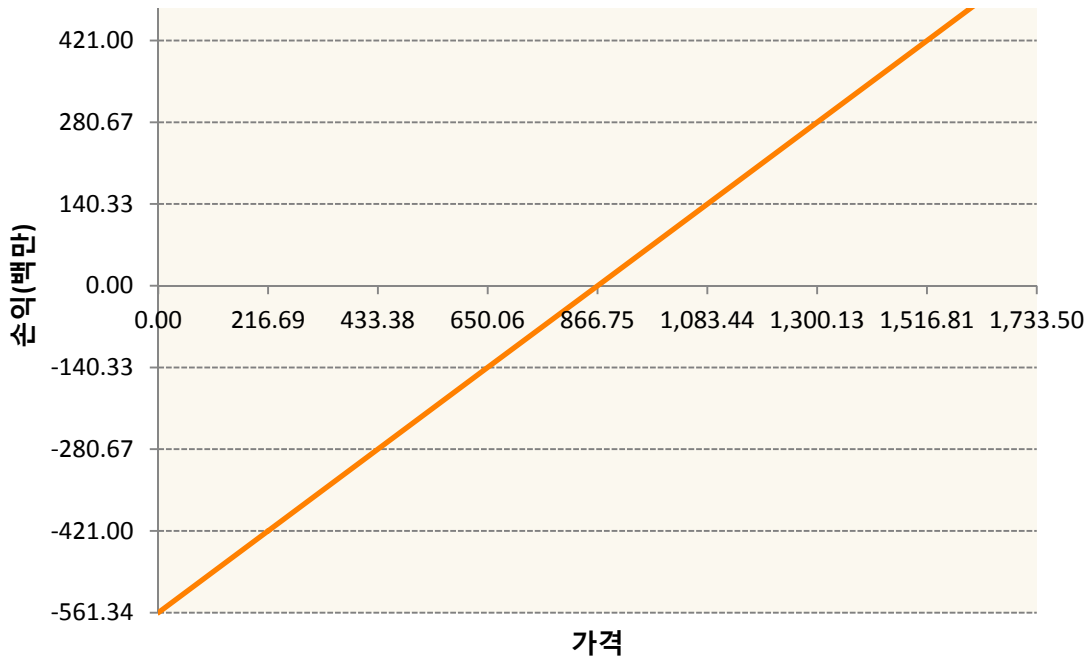


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	24
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	8
CU9	CORN FUTURE Sep19	48
KCU9	COFFEE 'C' FUTURE Sep19	17
KR4175P800	2019-08 달러선물	16

KWU9	KC HRW WHEAT FUT Sep19	8
SBV9	SUGAR #11 (WORLD) Oct19	22
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)

243