

공시일	2019-08-12
기준일	2019-08-09

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	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)

87

공시일	2019-08-12
기준일	2019-08-09

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

1,149

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

652

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-12
기준일	2019-08-09

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)	352
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	128

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

774

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-12
기준일	2019-08-09

유로인덱스모(주식-파생형)

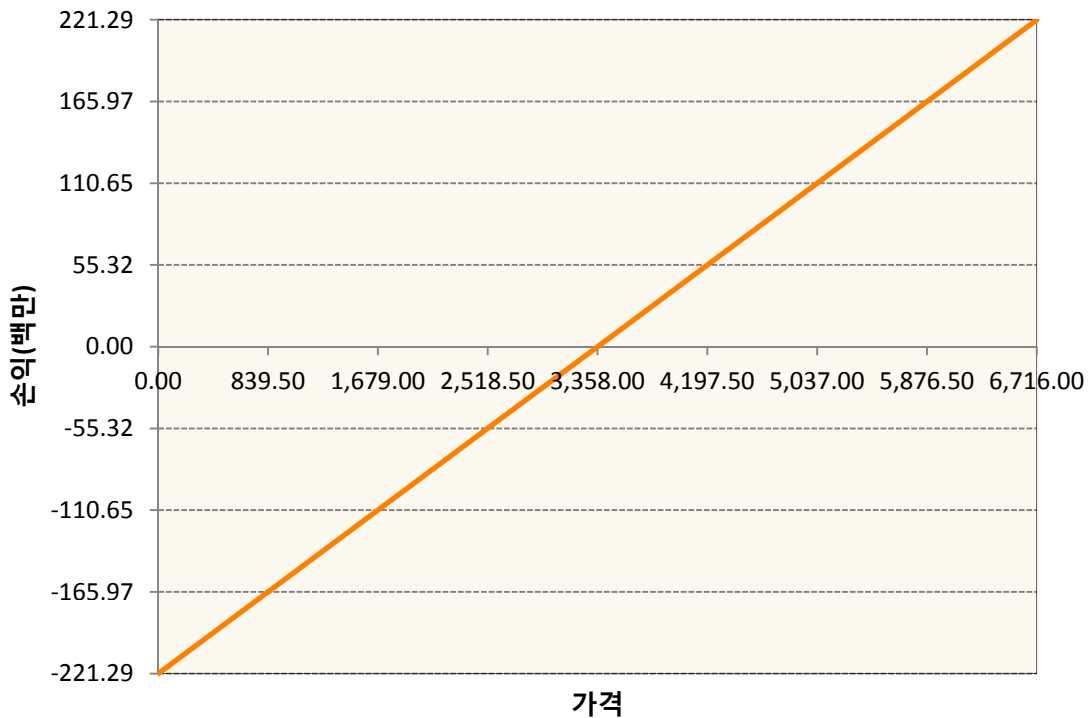
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

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	2019-08-12
기준일	2019-08-09

차이나인덱스모(주식-파생형)

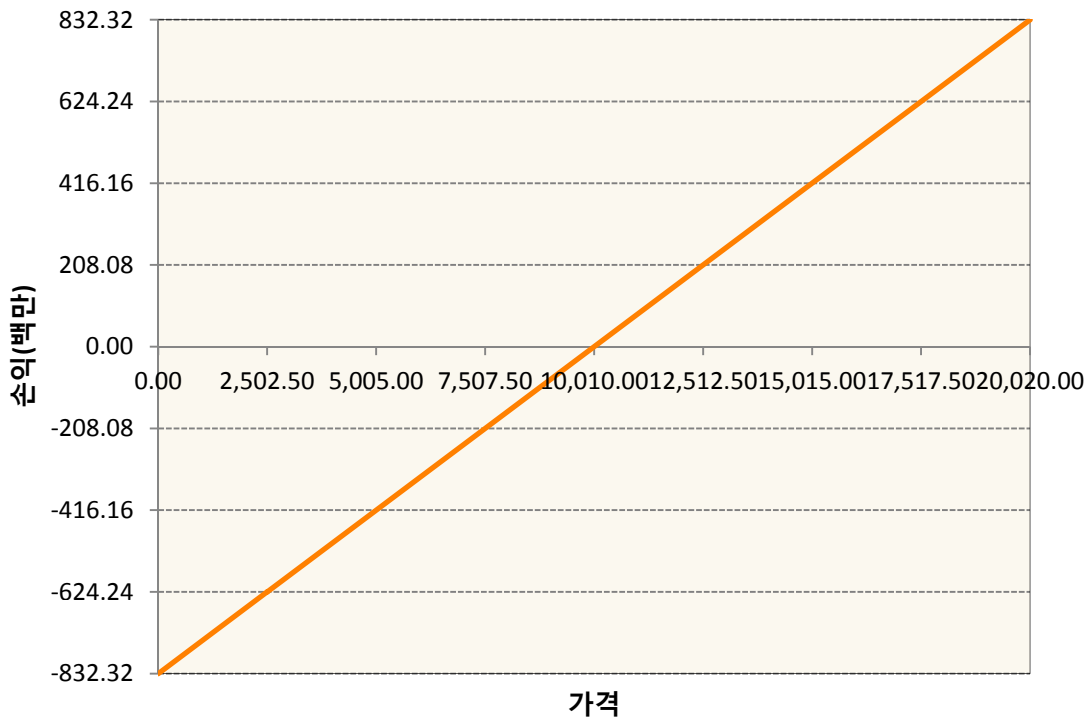
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	832	0	832	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	2019-08-12
기준일	2019-08-09

커버드콜모(주식혼합-파생형)

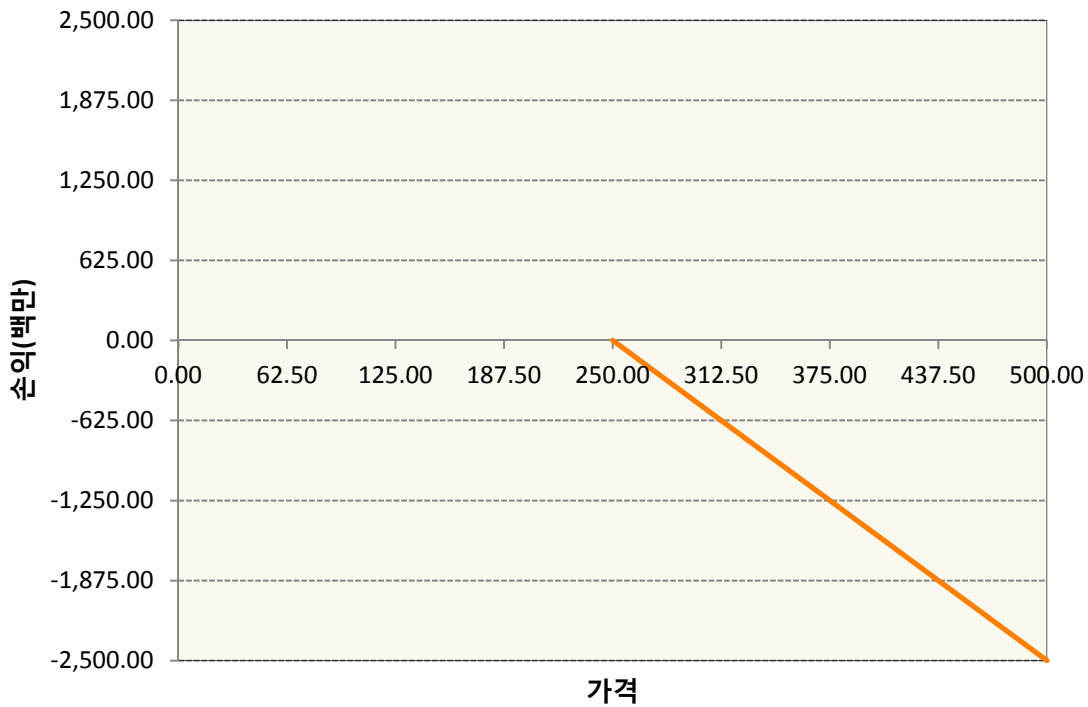
1. 계약금액

(단위:백만원)

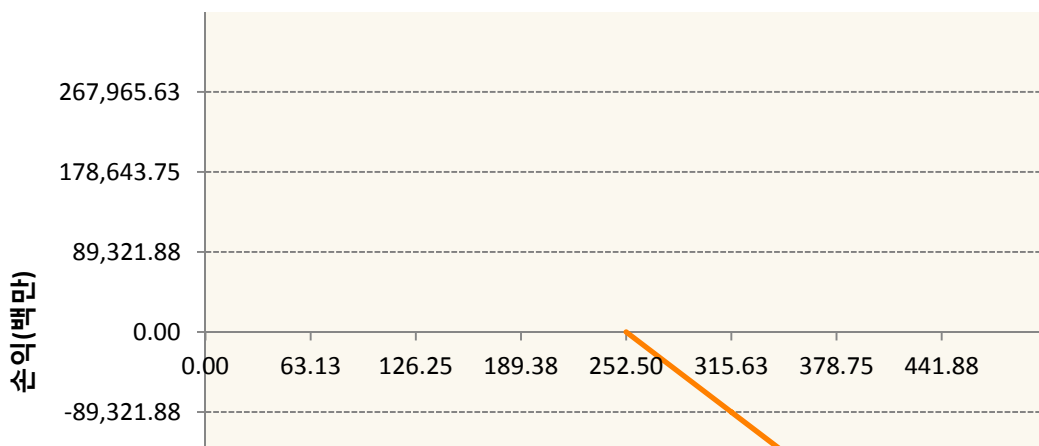
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	458,204	-458,204	장내
누계	유가증권	옵션	0	526,881	-526,881	장내

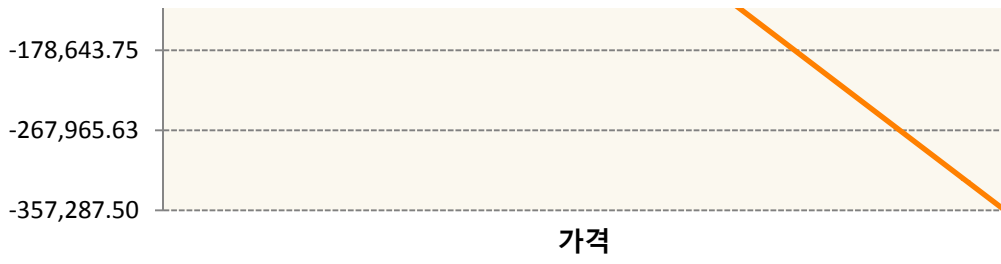
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P92500-2019-09 콜250

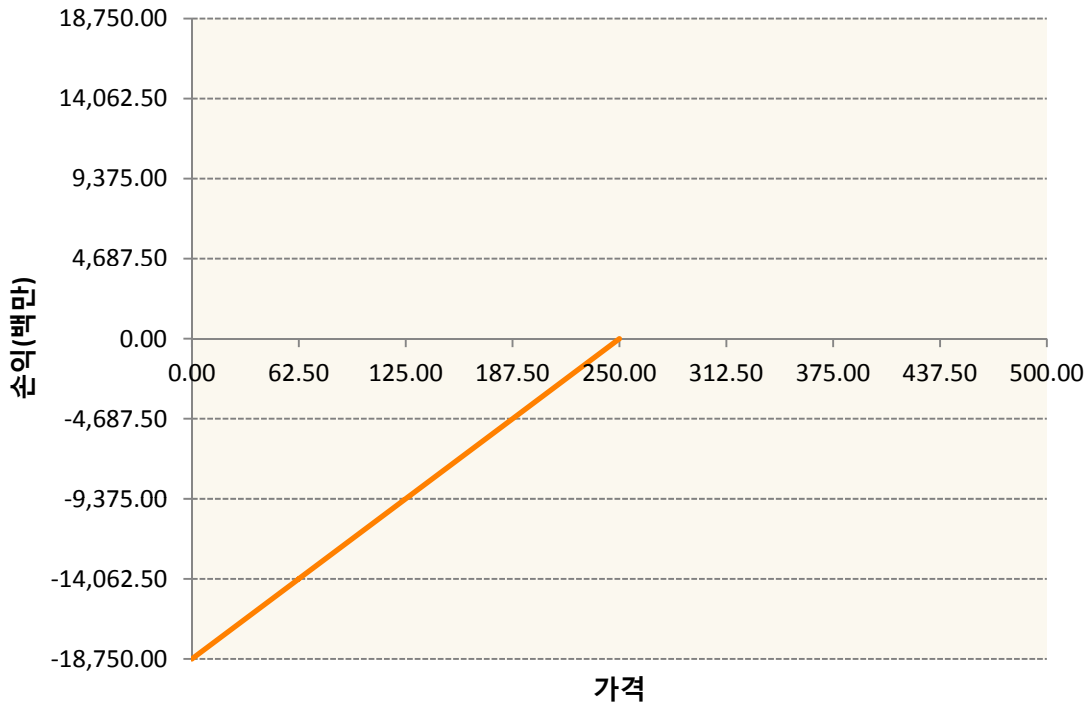


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

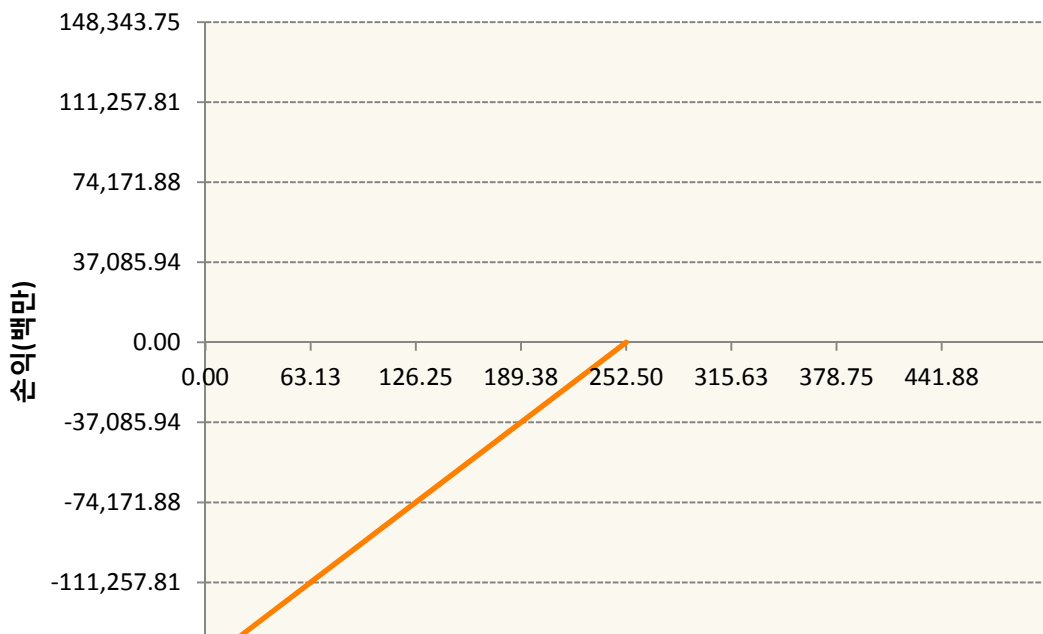




KR4301P92508-2019-09 풋250



KR4301P92524-2019-09 풋252.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P92500		2019-09 콜250						169
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	91	88	84	80	76	72	68	
-5.33%	78	73	68	63	58	52	47	
-2.67%	54	48	43	37	31	25	19	
0%	18	12	6	0	-6	-12	-18	
2.67%	-32	-36	-41	-46	-51	-57	-62	
5.33%	-90	-93	-96	-100	-104	-108	-113	
8.00%	-153	-155	-157	-159	-162	-165	-169	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5						22,948
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	11,181	10,829	10,417	9,954	9,448	8,905	8,330	
-5.33%	9,834	9,229	8,586	7,914	7,217	6,502	5,771	
-2.67%	7,101	6,292	5,475	4,652	3,824	2,992	2,158	
0%	2,577	1,720	860	0	-861	-1,723	-2,585	
2.67%	-3,756	-4,490	-5,248	-6,025	-6,817	-7,620	-8,433	
5.33%	-11,544	-12,061	-12,630	-13,244	-13,893	-14,572	-15,276	
8.00%	-20,282	-20,584	-20,953	-21,381	-21,860	-22,385	-22,948	
KR4301P92508		2019-09 풋250						1,045
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-980	-986	-994	-1,005	-1,017	-1,030	-1,045	
-5.33%	-514	-532	-552	-573	-595	-618	-642	
-2.67%	-144	-173	-202	-231	-260	-289	-318	
0%	82	55	28	0	-28	-56	-85	
2.67%	179	164	147	128	108	86	63	
5.33%	208	203	195	186	174	161	146	
8.00%	214	213	210	207	202	195	187	
KR4301P92524		2019-09 풋252.5						8,901
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-8,516	-8,547	-8,591	-8,649	-8,720	-8,805	-8,901	
-5.33%	-4,732	-4,838	-4,960	-5,096	-5,243	-5,400	-5,565	
-2.67%	-1,505	-1,710	-1,919	-2,133	-2,349	-2,567	-2,787	
0%	694	464	232	0	-233	-466	-699	
2.67%	1,789	1,631	1,461	1,281	1,093	898	698	

5.33%	2,167	2,099	2,013	1,911	1,794	1,665	1,524
8.00%	2,256	2,237	2,206	2,163	2,106	2,036	1,954

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

(단위:백만원)

32,310

공시일	2019-08-12
기준일	2019-08-09

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

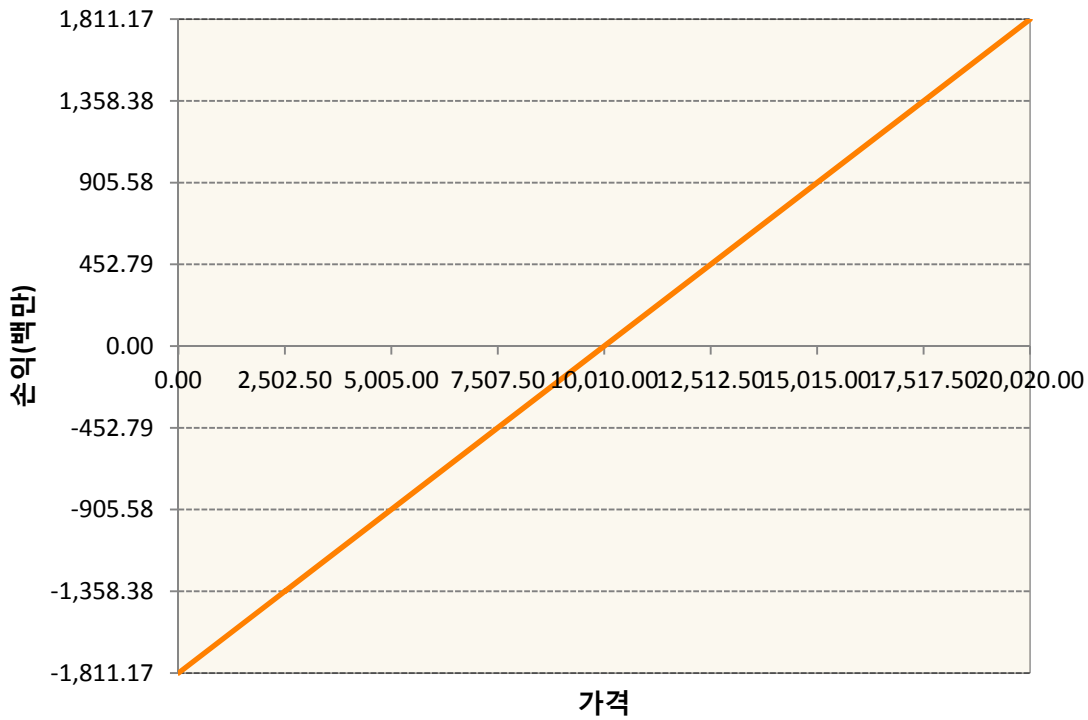
1. 계약금액

(단위:백만원)

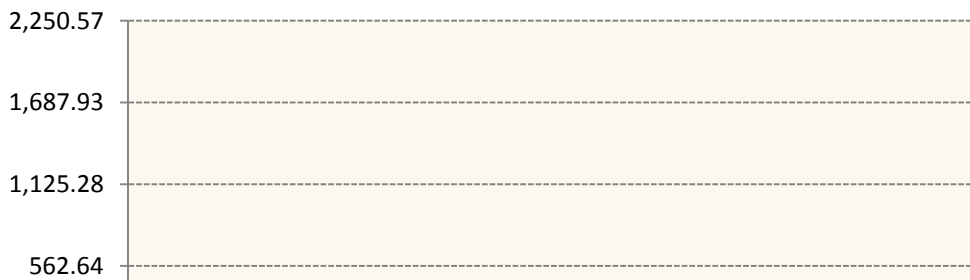
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,811	0	1,811	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,511	-5,511	장내
누계	통화	선도	458	3,242	-2,783	장외

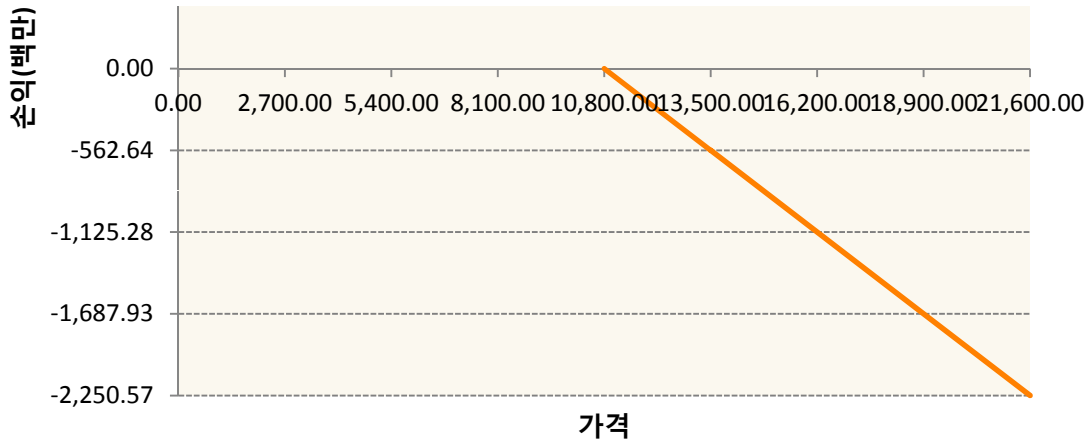
2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19

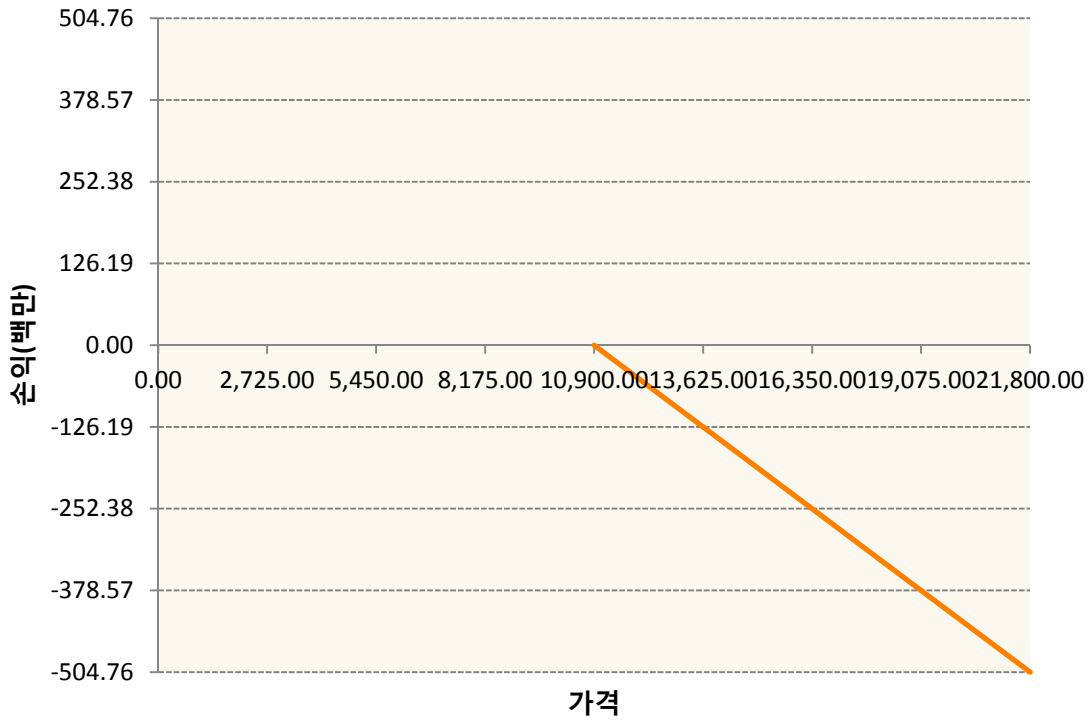


OHHIQ9-C108-HSCEI

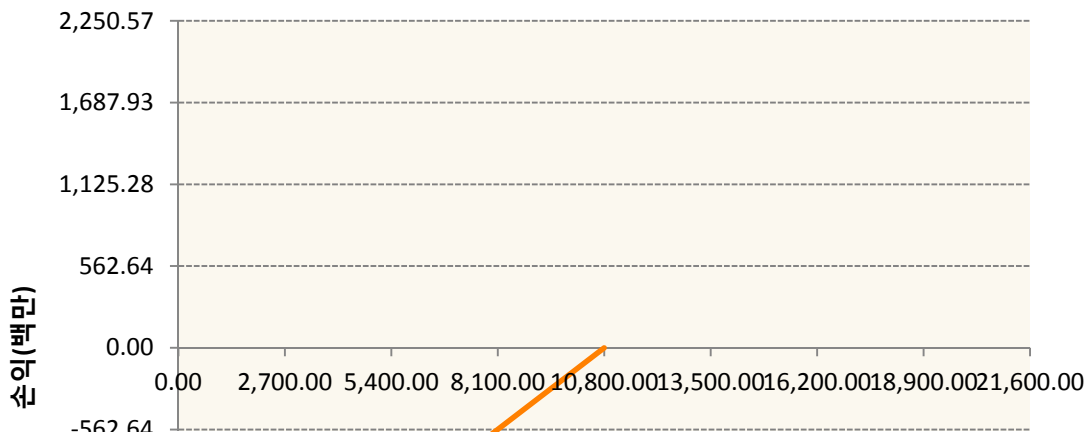


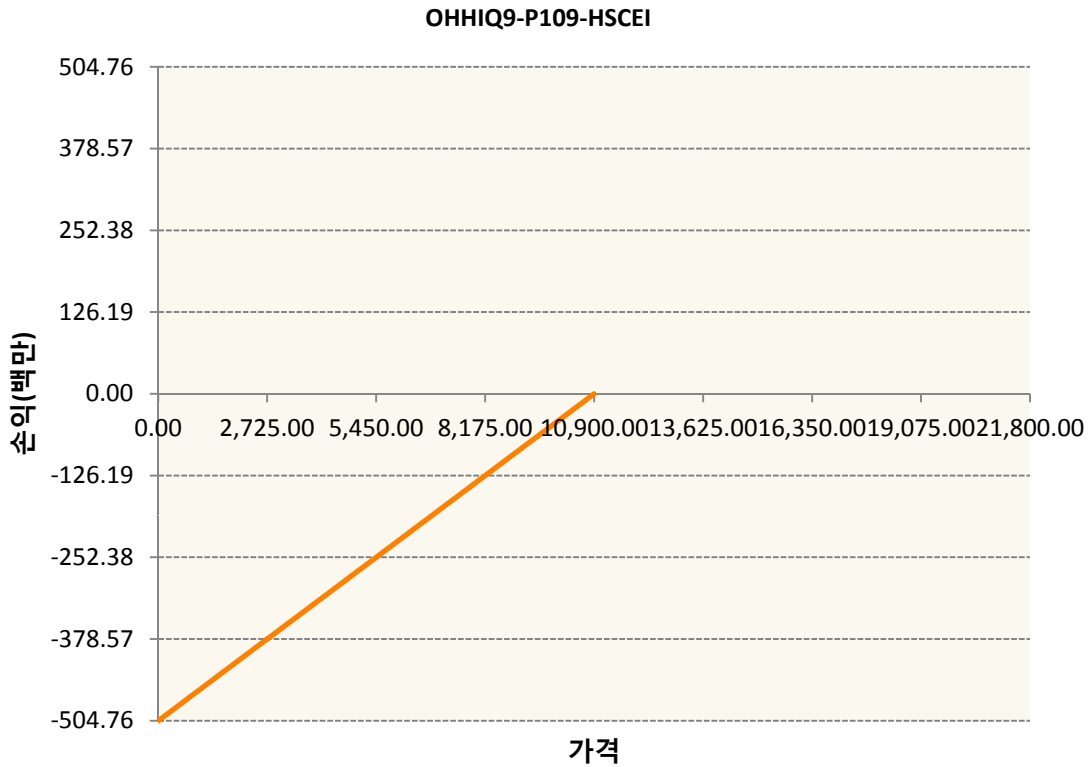


OHHIQ9-C109-HSCEI



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

공시일	2019-08-12
기준일	2019-08-09

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

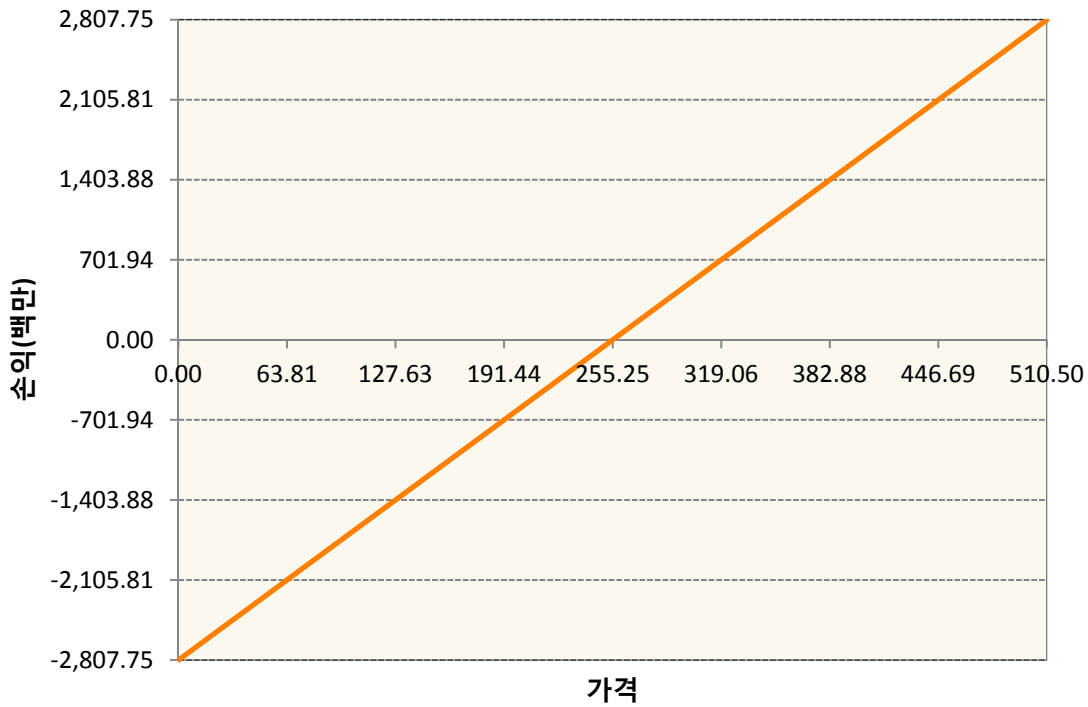
1. 계약금액

(단위:백만원)

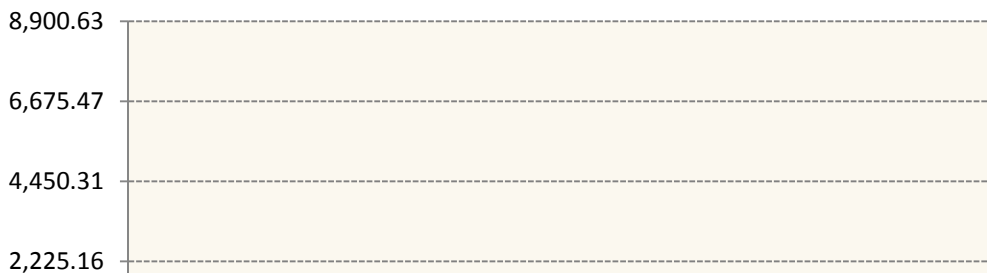
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	20,125	0	20,125	장외
신규	유가증권	옵션	0	17,749	-17,749	장내
누계	유가증권	선물	2,808	0	2,808	장내
누계	유가증권	스왑	20,125	0	20,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	17,416	-17,416	장내

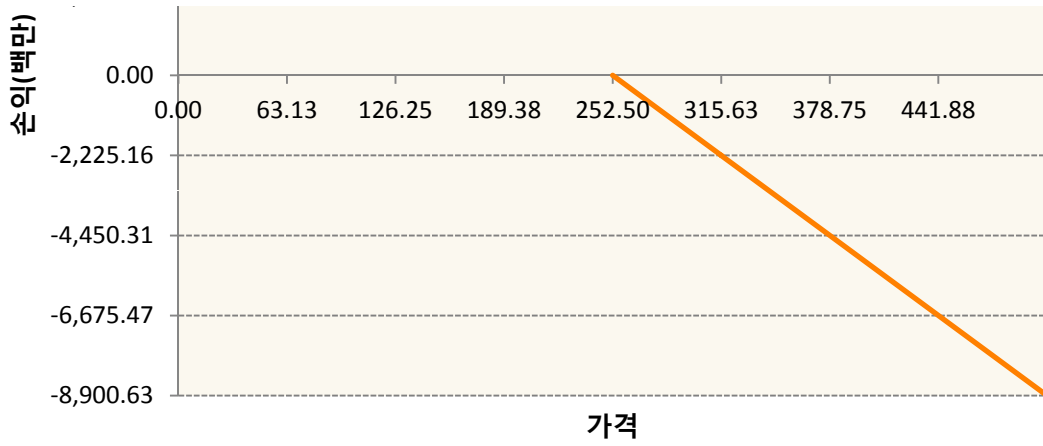
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

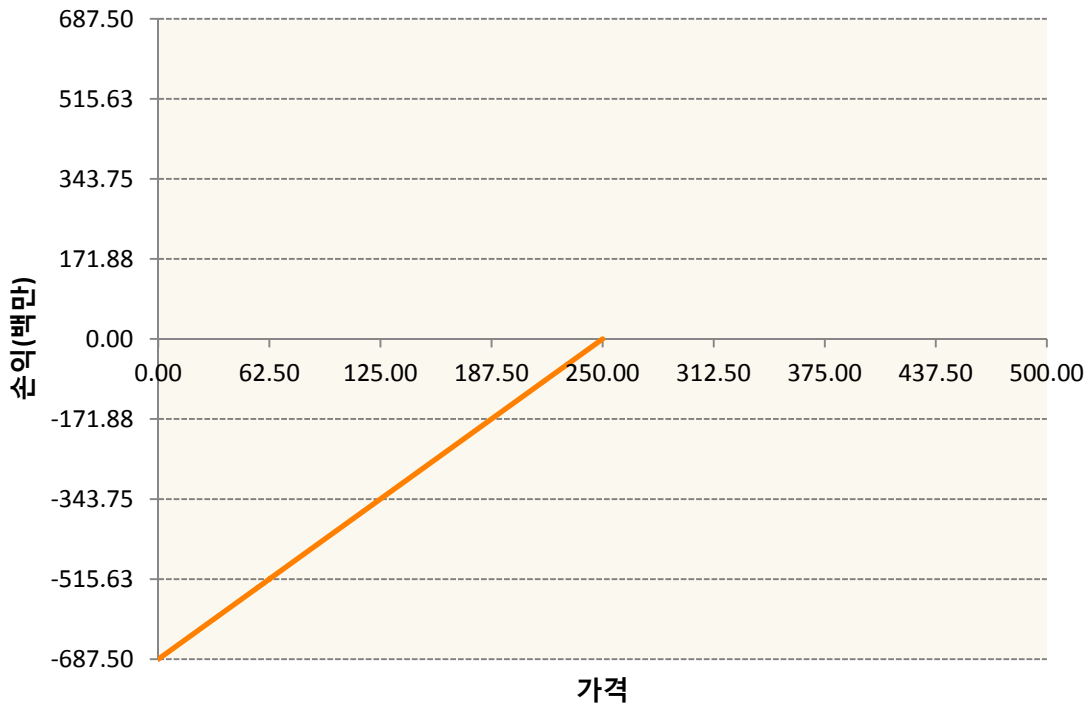


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

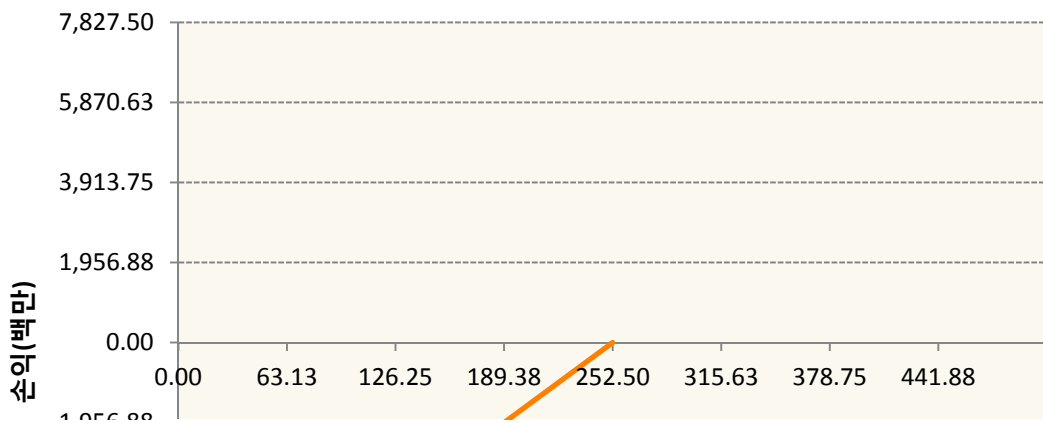




KR4301P92508-2019-09 풋250



KR4301P92524-2019-09 풋252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						1,743
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,743	-1,743	-1,743	-1,743	-1,743	-1,743	-1,743	
-5.33%	-1,162	-1,162	-1,162	-1,162	-1,162	-1,162	-1,162	
-2.67%	-581	-581	-581	-581	-581	-581	-581	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	581	581	581	581	581	581	581	
5.33%	1,162	1,162	1,162	1,162	1,162	1,162	1,162	
8.00%	1,743	1,743	1,743	1,743	1,743	1,743	1,743	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						224
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-224	-224	-224	-224	-224	-224	-224	
-5.33%	-150	-150	-150	-150	-150	-150	-150	
-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%	150	150	150	150	150	150	150	
8.00%	224	224	224	224	224	224	224	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5						572
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	279	270	260	248	235	222	208	
-5.33%	245	230	214	197	180	162	144	
-2.67%	177	157	136	116	95	75	54	
0%	64	43	21	0	-21	-43	-64	
2.67%	-94	-112	-131	-150	-170	-190	-210	
5.33%	-288	-300	-315	-330	-346	-363	-381	
8.00%	-505	-513	-522	-533	-545	-558	-572	
KR4301P92508		2019-09 풋250						38
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-36	-36	-36	-37	-37	-38	-38
-5.33%	-19	-20	-20	-21	-22	-23	-24
-2.67%	-5	-6	-7	-8	-10	-11	-12
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	7	6	5	5	4	3	2
5.33%	8	7	7	7	6	6	5
8.00%	8	8	8	8	7	7	7
KR4301P92524 2019-09 풋252.5							470
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-449	-451	-453	-456	-460	-465	-470
-5.33%	-250	-255	-262	-269	-277	-285	-294
-2.67%	-79	-90	-101	-113	-124	-135	-147
0%	37	24	12	0	-12	-25	-37
2.67%	94	86	77	68	58	47	37
5.33%	114	111	106	101	95	88	80
8.00%	119	118	116	114	111	107	103

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

(단위:백만원)

2,996

공시일	2019-08-12
기준일	2019-08-09

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

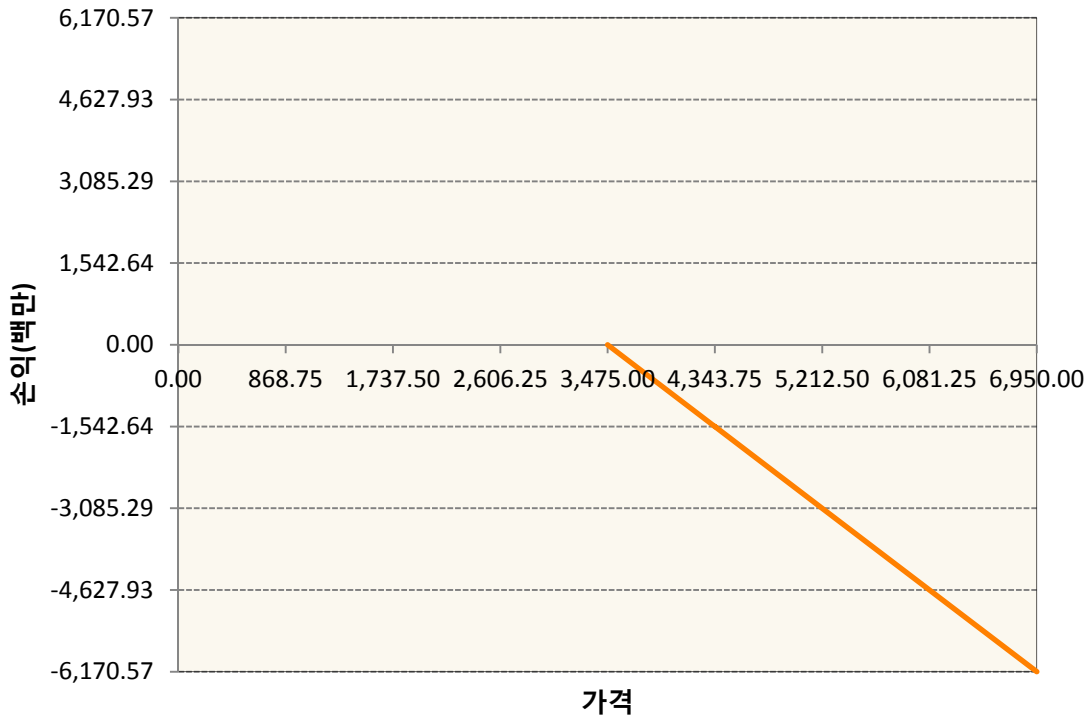
1. 계약금액

(단위:백만원)

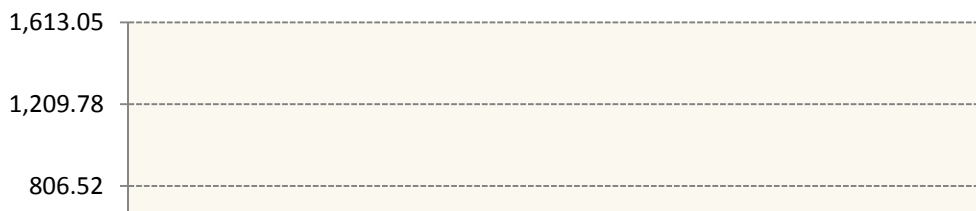
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,566	0	4,566	
누계	유가증권	스왑	28,657	0	28,657	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,567	-15,567	장내
누계	통화	선도	14,639	23,043	-8,404	장외

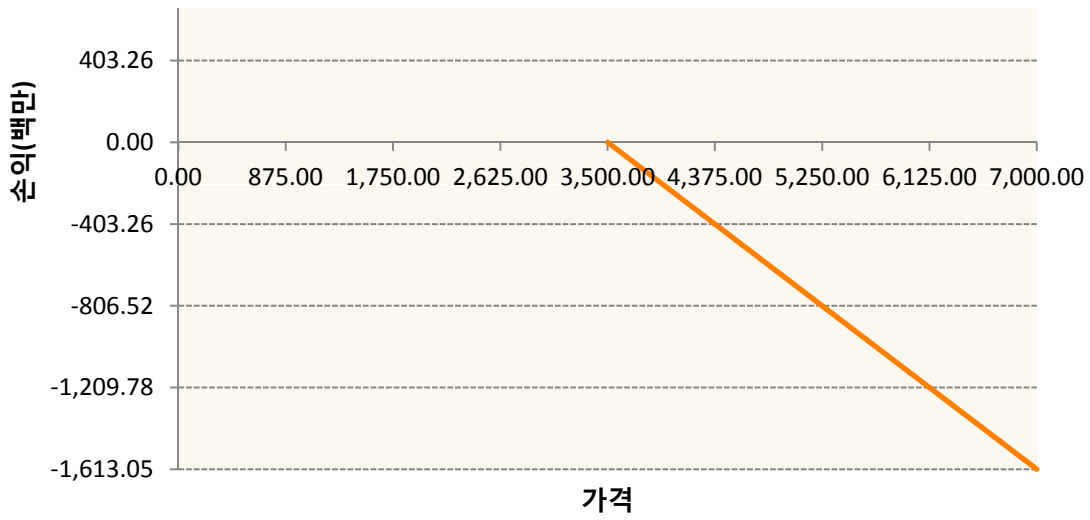
2. 만기시점의 손익구조

OESXQ9-C3475-EURO STOXX 50

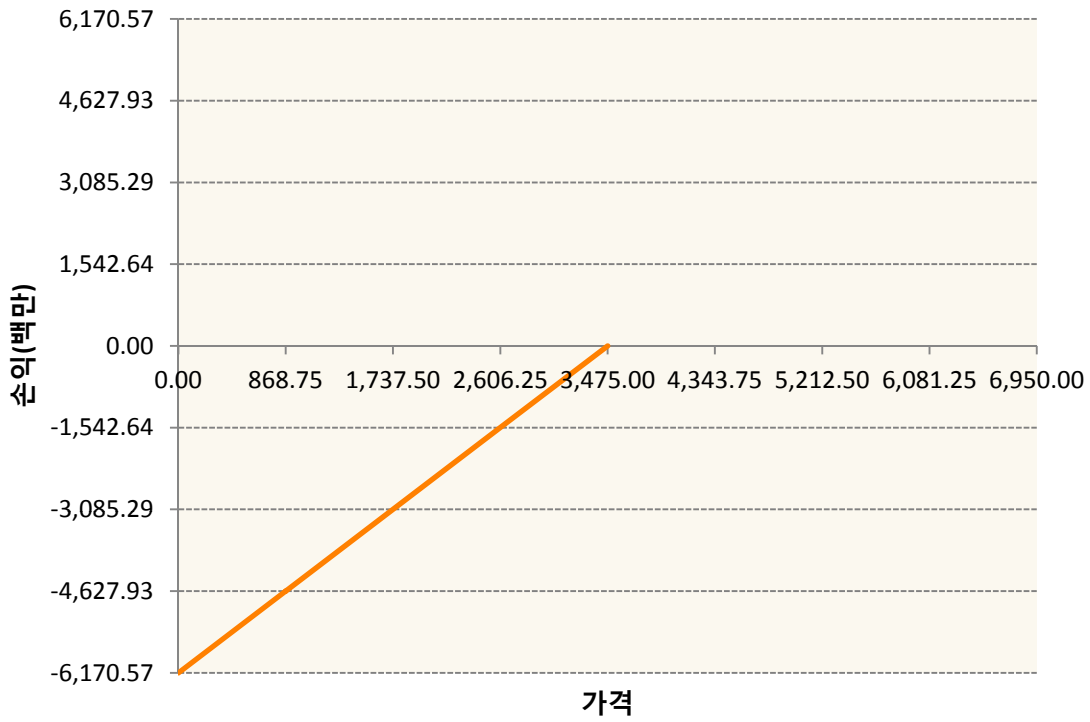


OESXQ9-C3500-EURO STOXX 50

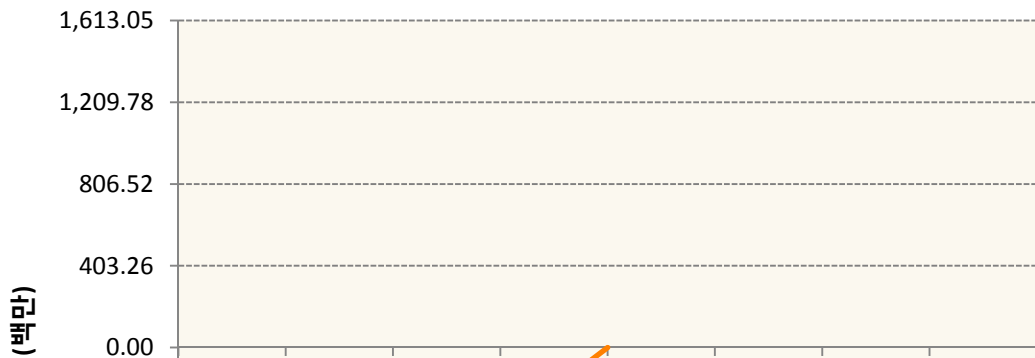


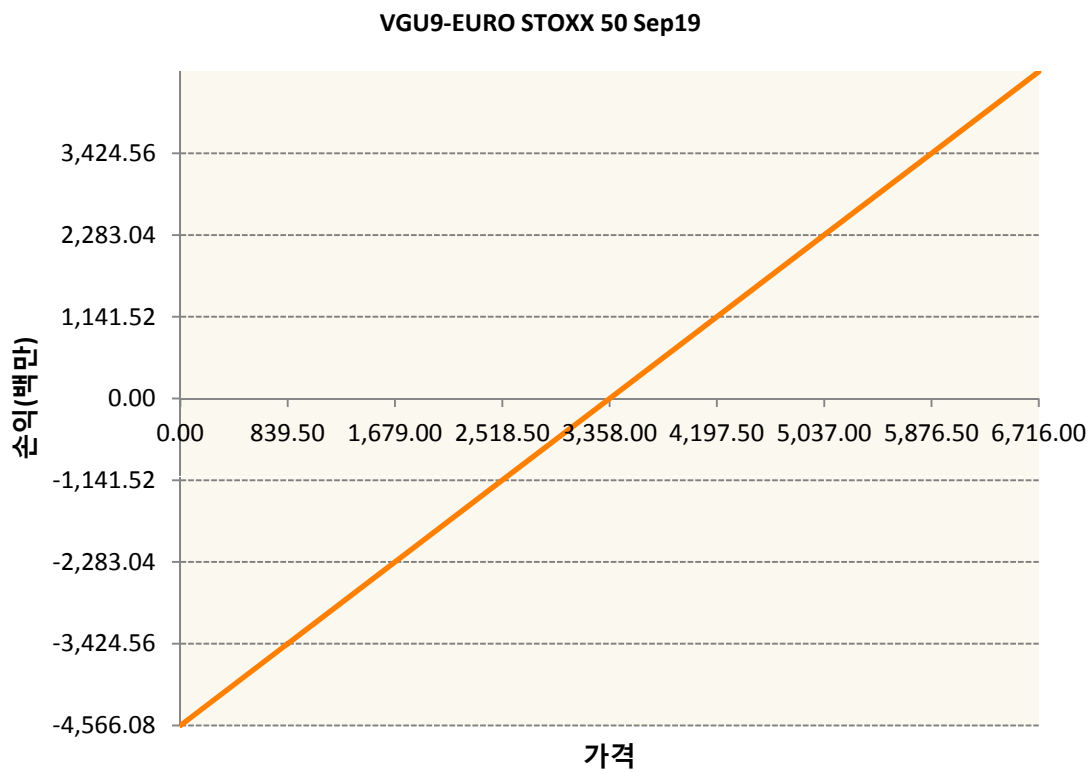
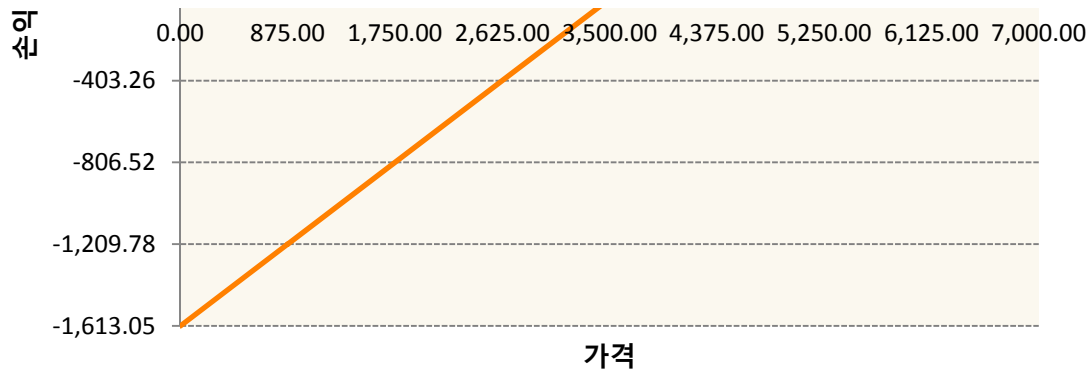


OESXQ9-P3475-EURO STOXX 50



OESXQ9-P3500-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	41
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	434
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E	1,084
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	173
OESXQ9-C34 EURO STOXX 50	494
OESXQ9-C35 EURO STOXX 50	129
OESXQ9-P34 EURO STOXX 50	494

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

129
365

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

(단위:백만원)

2,608

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

(단위:백만원)

927

공시일	2019-08-12
기준일	2019-08-09

ETF스마트레버리지목표전환형9호

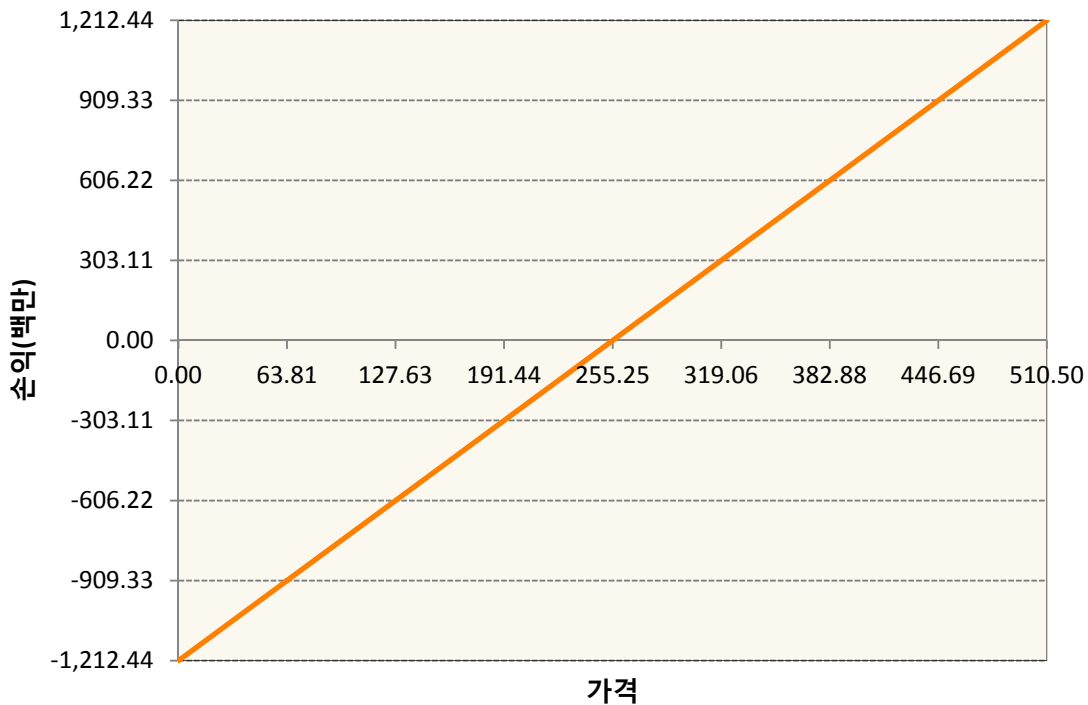
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,212	0	1,212	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						97
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97	
-5.33%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65	
-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%	65	65	65	65	65	65	65	
8.00%	97	97	97	97	97	97	97	

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

(단위:백만원)

82

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

(단위:백만원)

121

공시일	2019-08-12
기준일	2019-08-09

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

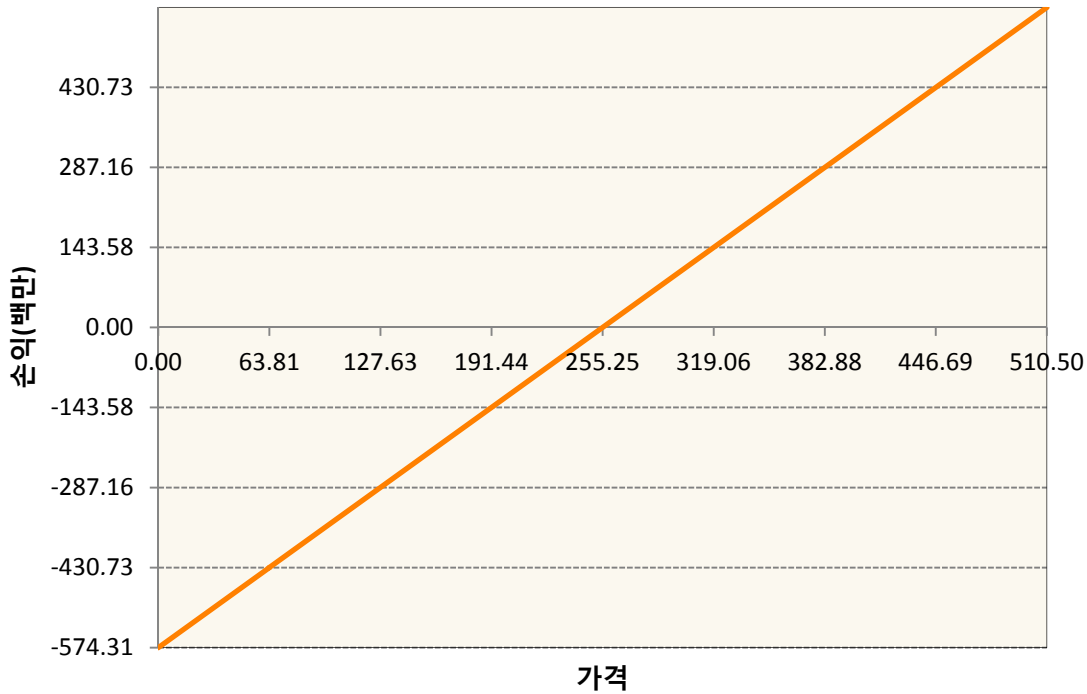
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	574	0	574	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						46
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46	
-5.33%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31	
-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%	31	31	31	31	31	31	31	
8.00%	46	46	46	46	46	46	46	

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

(단위:백만원)

39

공시일	2019-08-12
기준일	2019-08-09

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

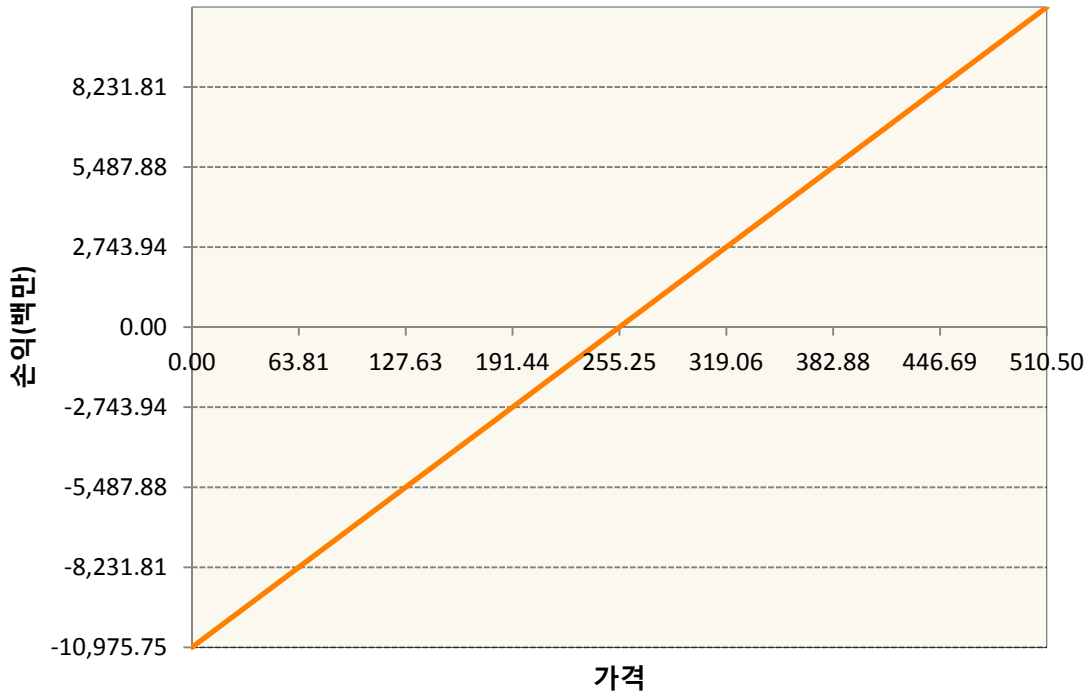
1. 계약금액

(단위:백만원)

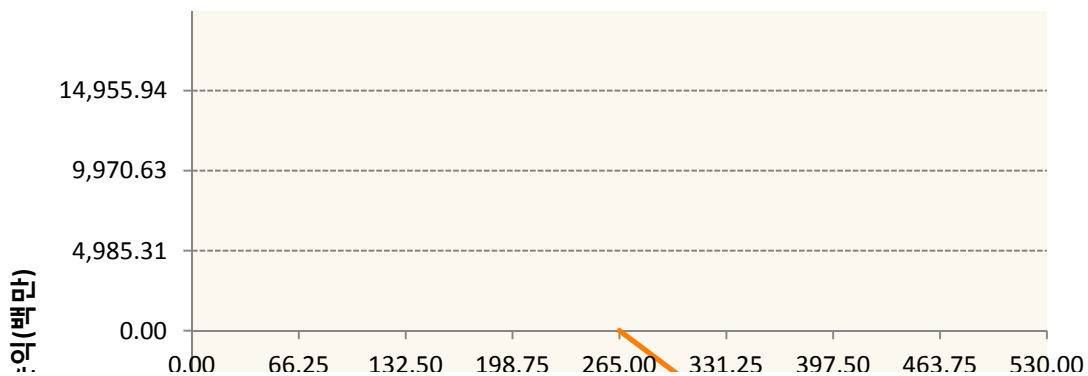
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	13,331	11,237	2,094	장내
누계	유가증권	선물	10,976	0	10,976	장내
누계	유가증권	옵션	3,659	20,075	-16,416	장내

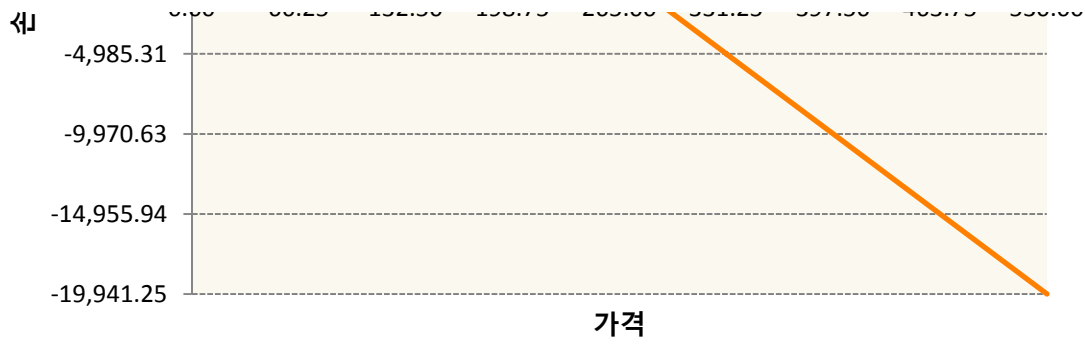
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

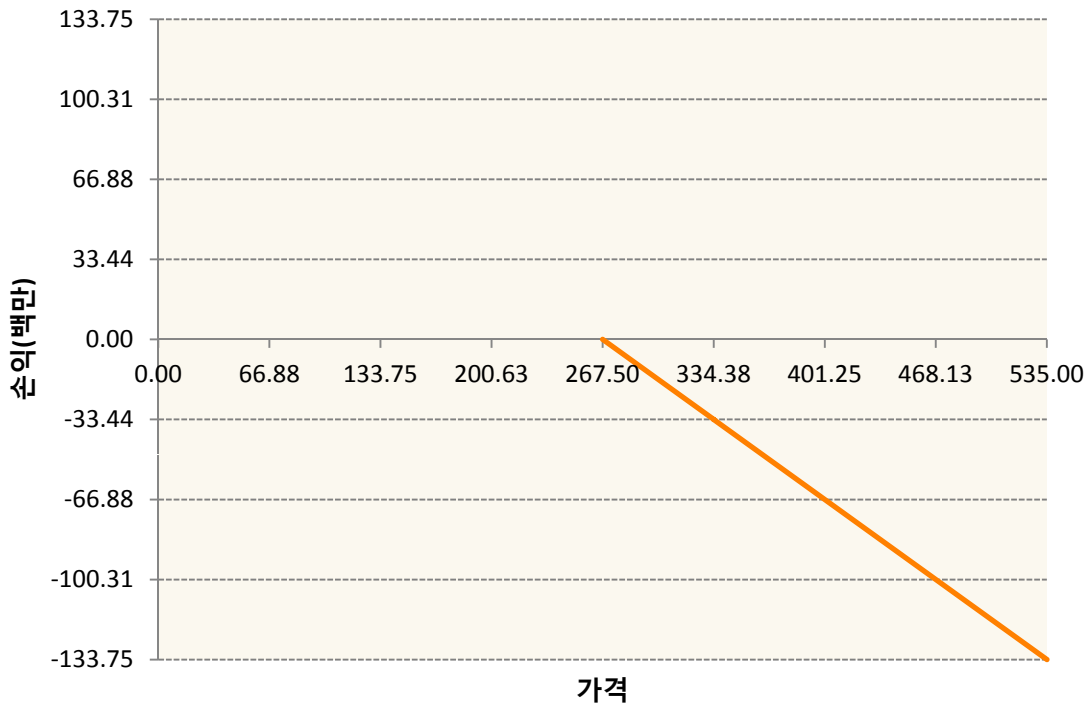


KR4201P92658-2019-09 콜265

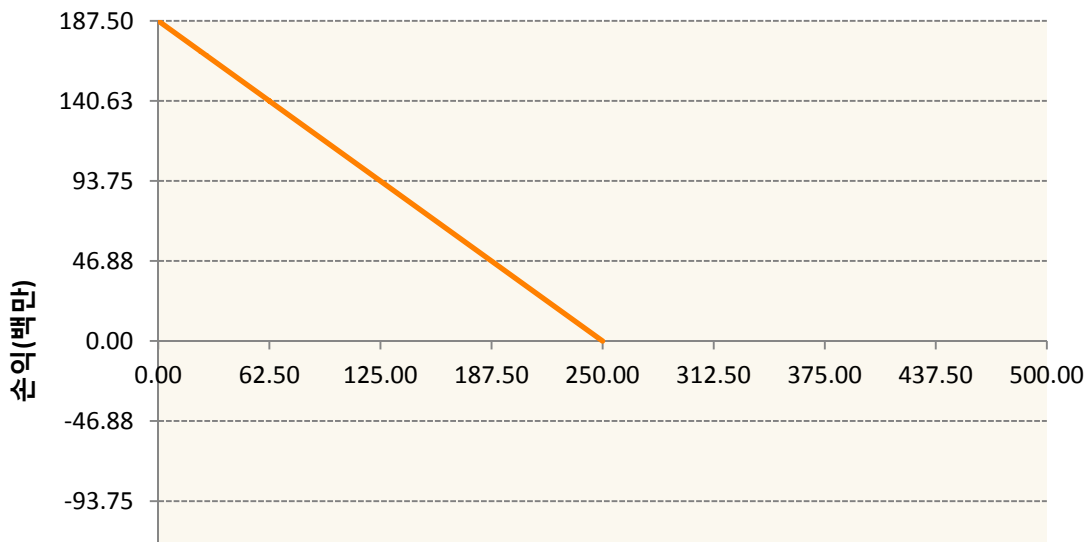


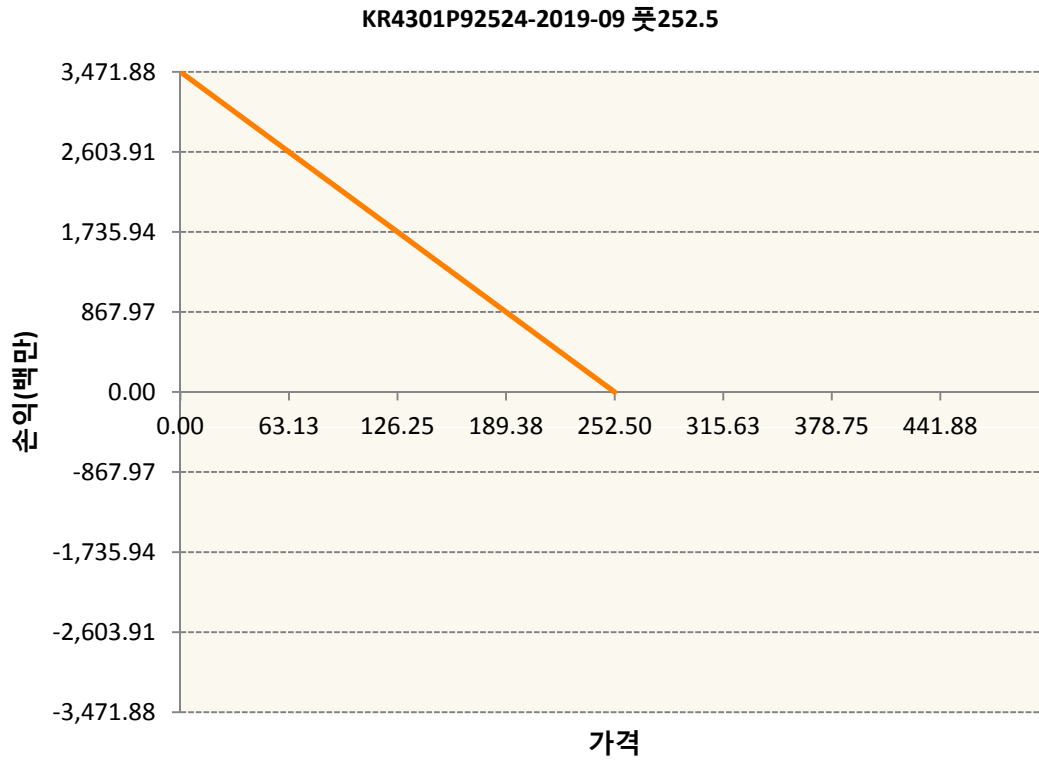
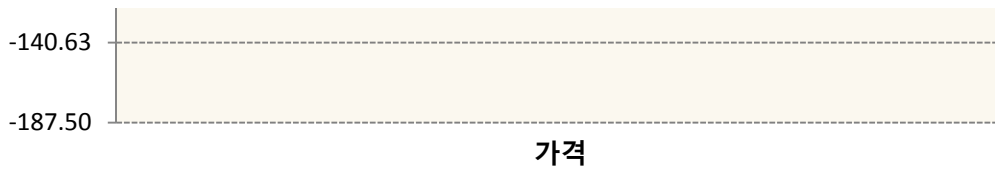


KR4201P92674-2019-09 콜267.5



KR4301P92508-2019-09 풋250





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						877
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-877	-877	-877	-877	-877	-877	-877	
-5.33%	-584	-584	-584	-584	-584	-584	-584	
-2.67%	-292	-292	-292	-292	-292	-292	-292	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	292	292	292	292	292	292	292	
5.33%	584	584	584	584	584	584	584	
8.00%	877	877	877	877	877	877	877	
KR4201P92658		2019-09 콜265						909
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	254	249	242	233	221	207	190	
-5.33%	241	229	214	196	175	152	126	
-2.67%	203	179	153	124	92	59	24	

0%	115	79	40	0	-41	-83	-125
2.67%	-48	-95	-142	-188	-235	-282	-330
5.33%	-305	-352	-400	-448	-496	-544	-592
8.00%	-652	-692	-733	-776	-820	-864	-909
KR4201P92674 2019-09 콜267.5							6
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	0	0
0%	1	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	0	0	-1	-1	-1	-2	-2
5.33%	-2	-2	-2	-3	-3	-3	-4
8.00%	-4	-4	-4	-5	-5	-5	-6
KR4301P92508 2019-09 풋250							10
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10	10	10	10	10	10	10
-5.33%	5	5	6	6	6	6	6
-2.67%	1	2	2	2	3	3	3
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-2	-2	-1	-1	-1	-1	-1
5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-1
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
KR4301P92524 2019-09 풋252.5							208
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	199	200	201	202	204	206	208
-5.33%	111	113	116	119	123	126	130
-2.67%	35	40	45	50	55	60	65
0%	-16	-11	-5	0	5	11	16
2.67%	-42	-38	-34	-30	-26	-21	-16
5.33%	-51	-49	-47	-45	-42	-39	-36
8.00%	-53	-52	-52	-51	-49	-48	-46

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

(단위:백만원)

1,637

공시일	2019-08-12
기준일	2019-08-09

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	59,725	0	59,725	

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	2019-08-12
기준일	2019-08-09

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	72,259	0	72,259	

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	2019-08-12
기준일	2019-08-09

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	461,433	0	461,433	
누계	통화	선도	0	522,331	-522,331	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		3,196
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		2,169
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		1,743
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,130
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		136
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		581
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		3,099
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		3,389
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		484
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		968
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		3,012
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		1,685
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		775
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,937
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,937
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		291
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		97
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		717
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		717
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		291
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		678
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		2,712
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		1,356
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		775
FX21019N04 KRW/USD 03-09-19E		291
FX21019Q00 KRW/USD 03-09-19E		291

FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E	484
FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E	194
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E	291
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E	3,196
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E	2,169

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

(단위:백만원)

13,754

공시일	2019-08-12
기준일	2019-08-09

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

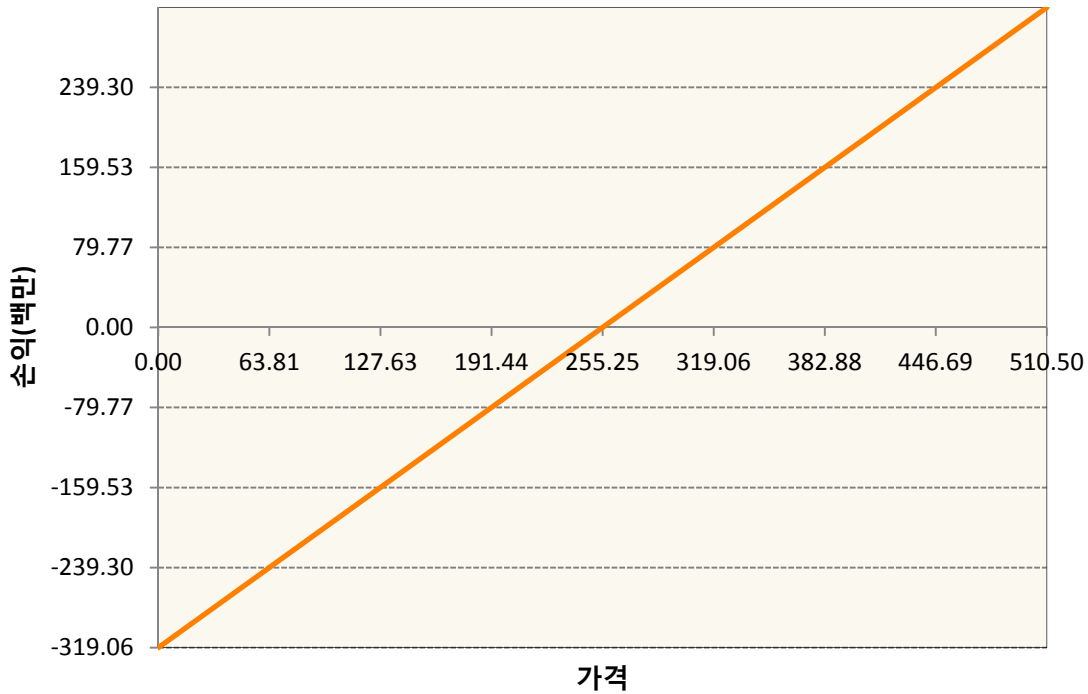
1. 계약금액

(단위:백만원)

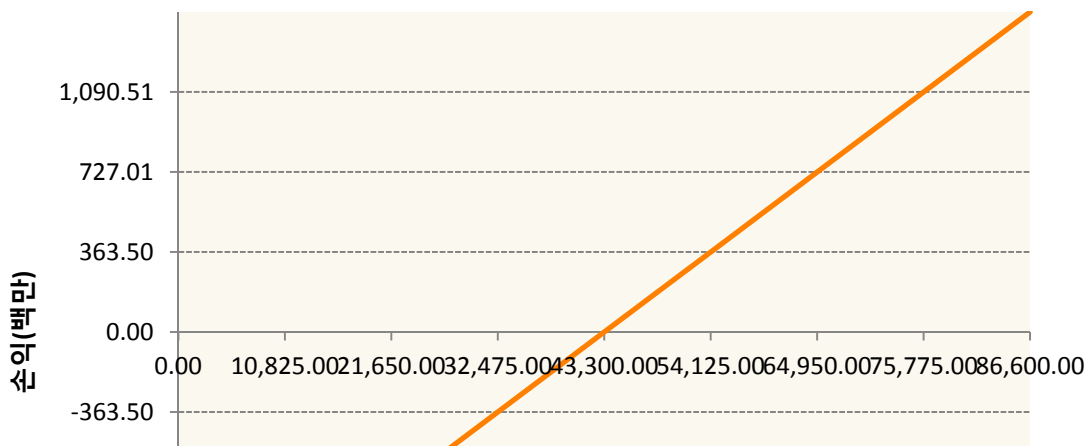
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,773	0	1,773	장내

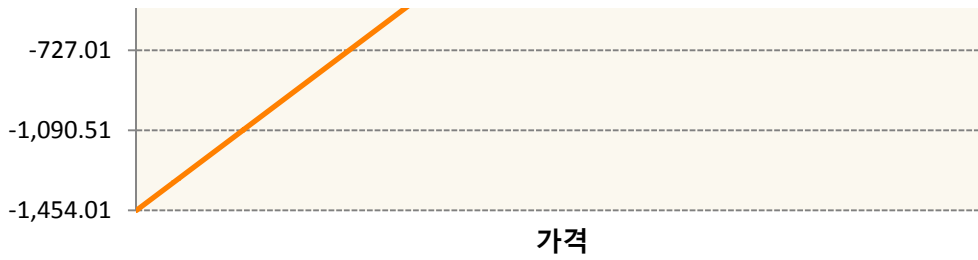
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P90000-2019-09 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 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						116
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116	
-5.33%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77	
-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%	77	77	77	77	77	77	77	
8.00%	116	116	116	116	116	116	116	

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

167

공시일	2019-08-12
기준일	2019-08-09

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

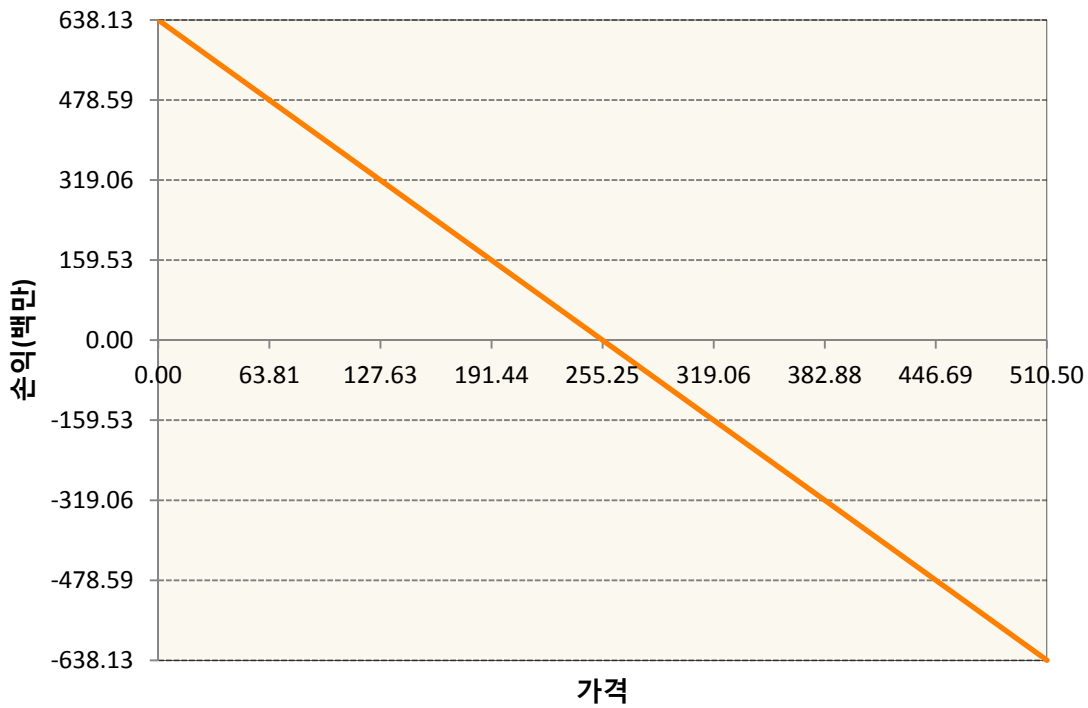
1. 계약금액

(단위:백만원)

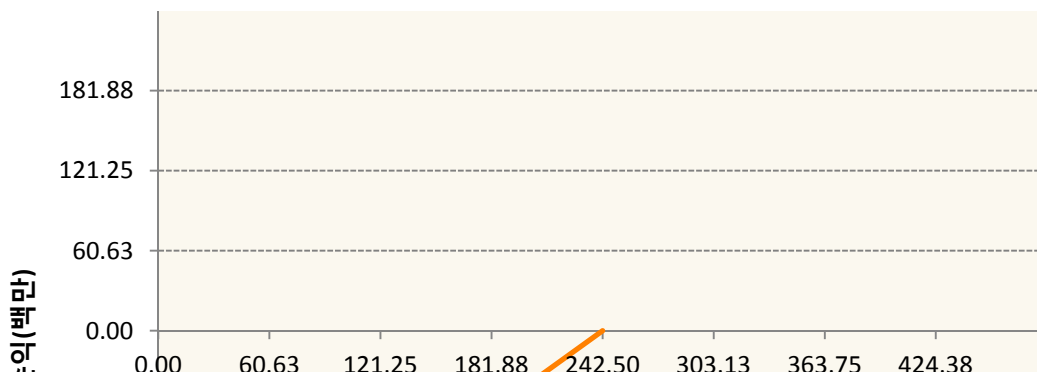
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	2,093	-2,093	장내
누계	유가증권	선물	0	638	-638	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,489	-3,489	장내

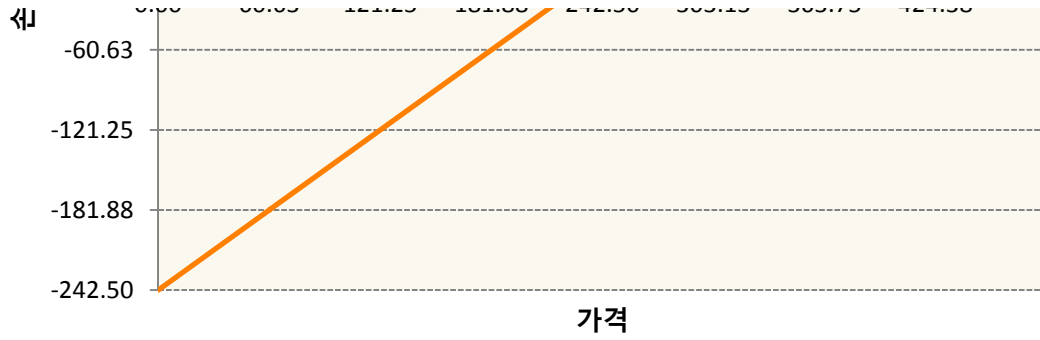
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

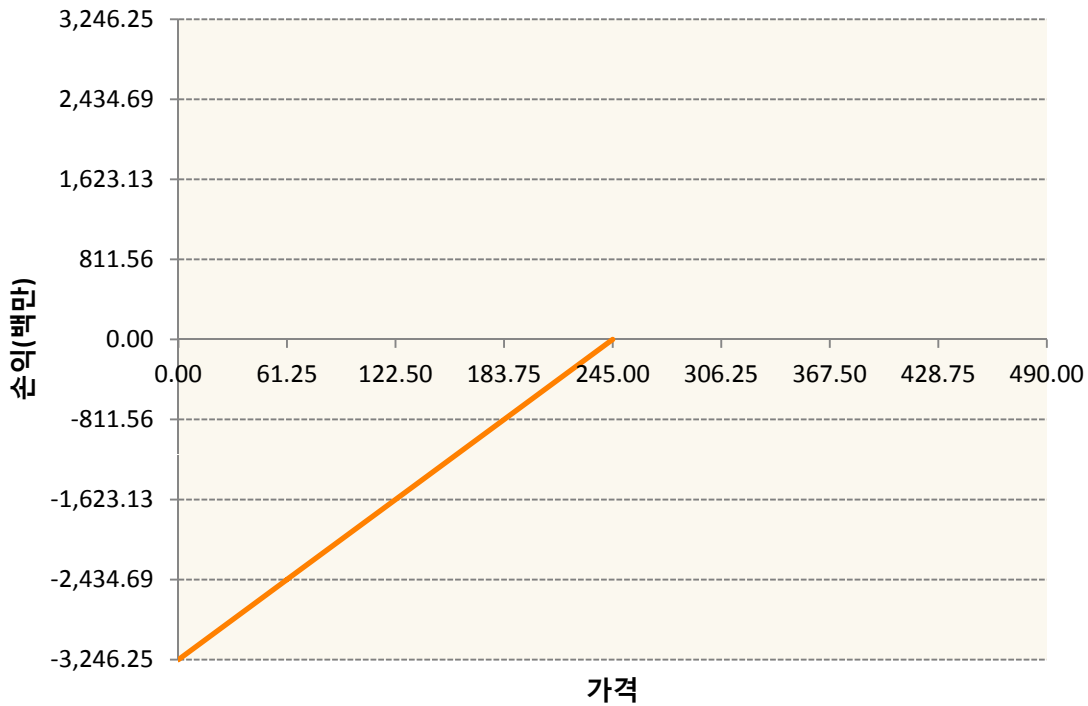


KR4301P92425-2019-09 풋242.5





KR4301P92458-2019-09 풋245



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	
KR4301P92425		2019-09 풋242.5						10
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8	-8	-9	-9	-9	-9	-10
-5.33%	-3	-4	-4	-4	-5	-5	-6
-2.67%	-1	-1	-1	-2	-2	-2	-3
0%	1	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	1	1	1	1	1	0	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

KR4301P92458

2019-09 풋245

149

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-130	-132	-135	-138	-142	-145	-149
-5.33%	-59	-63	-68	-73	-77	-82	-87
-2.67%	-12	-17	-22	-27	-32	-37	-42
0%	10	7	4	0	-4	-8	-12
2.67%	17	16	14	12	10	8	5
5.33%	19	18	18	17	16	15	13
8.00%	19	19	19	18	18	18	17

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

(단위:백만원)

174

공시일	2019-08-12
기준일	2019-08-09

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	19,132	0	19,132	
누계	통화	선도	0	33,894	-33,894	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019N00 KRW/USD 12-08-19E		1,007
FX21019N01 KRW/USD 12-08-19E		165
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		329
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		165
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		484
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		523
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		39

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

(단위:백만원)

893

공시일	2019-08-12
기준일	2019-08-09

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	94	-94	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	2019-08-12
기준일	2019-08-09

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

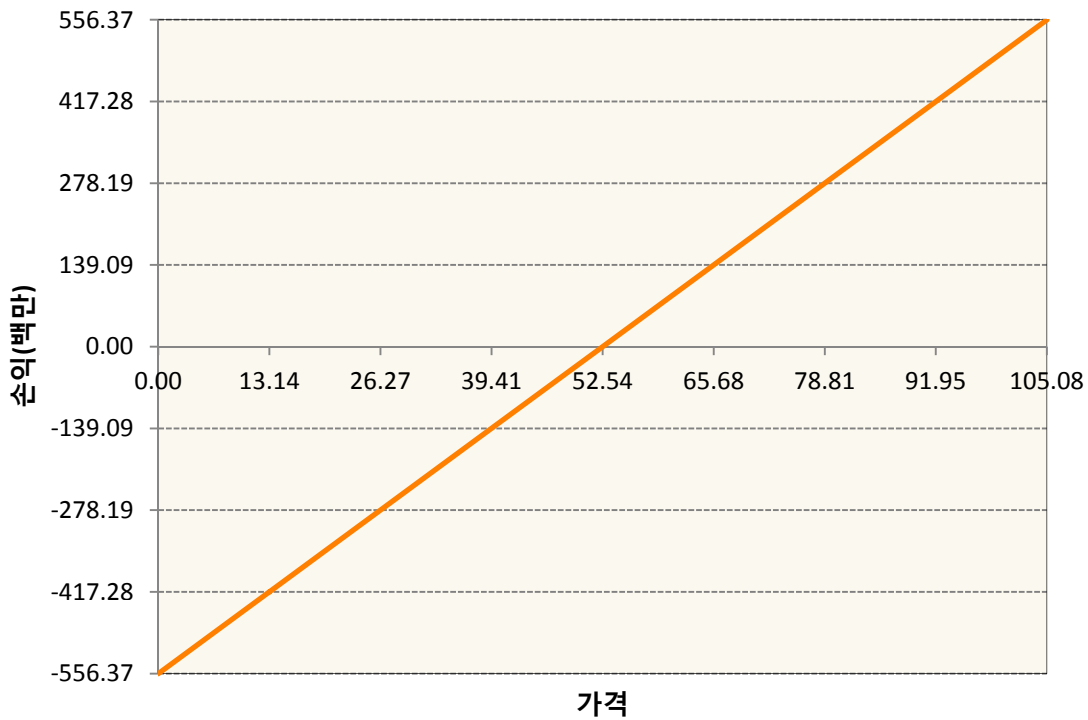
1. 계약금액

(단위:백만원)

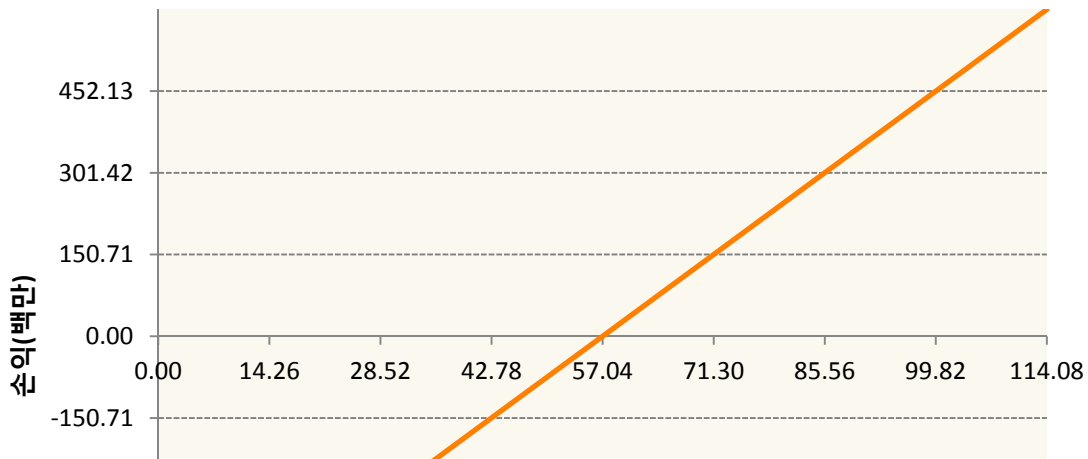
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,274	121	2,153	

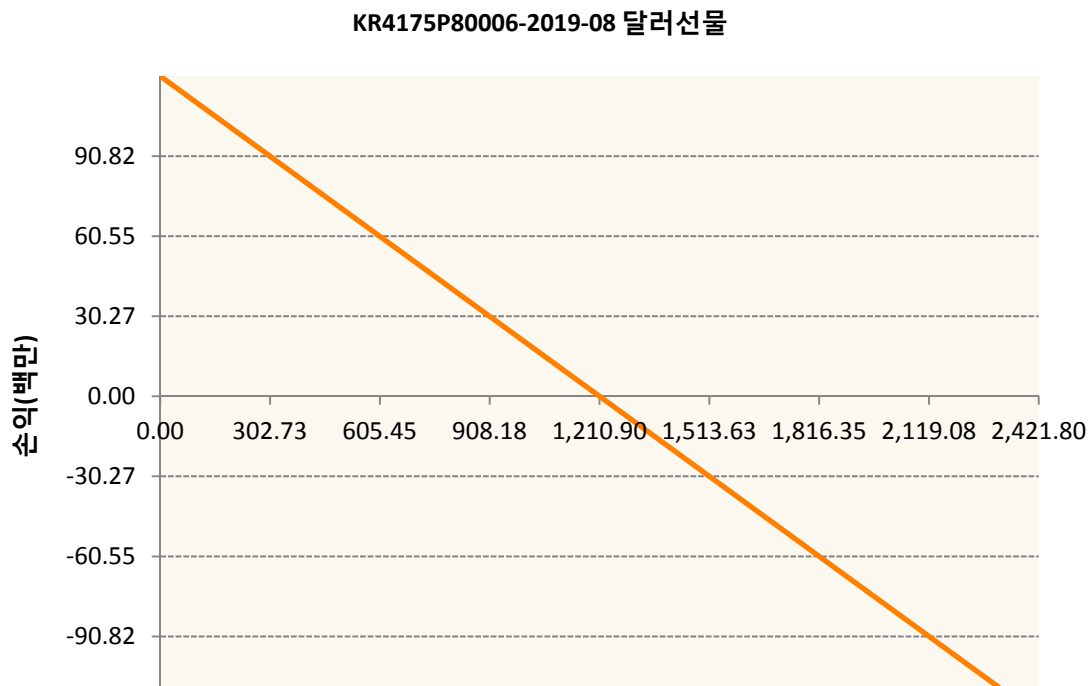
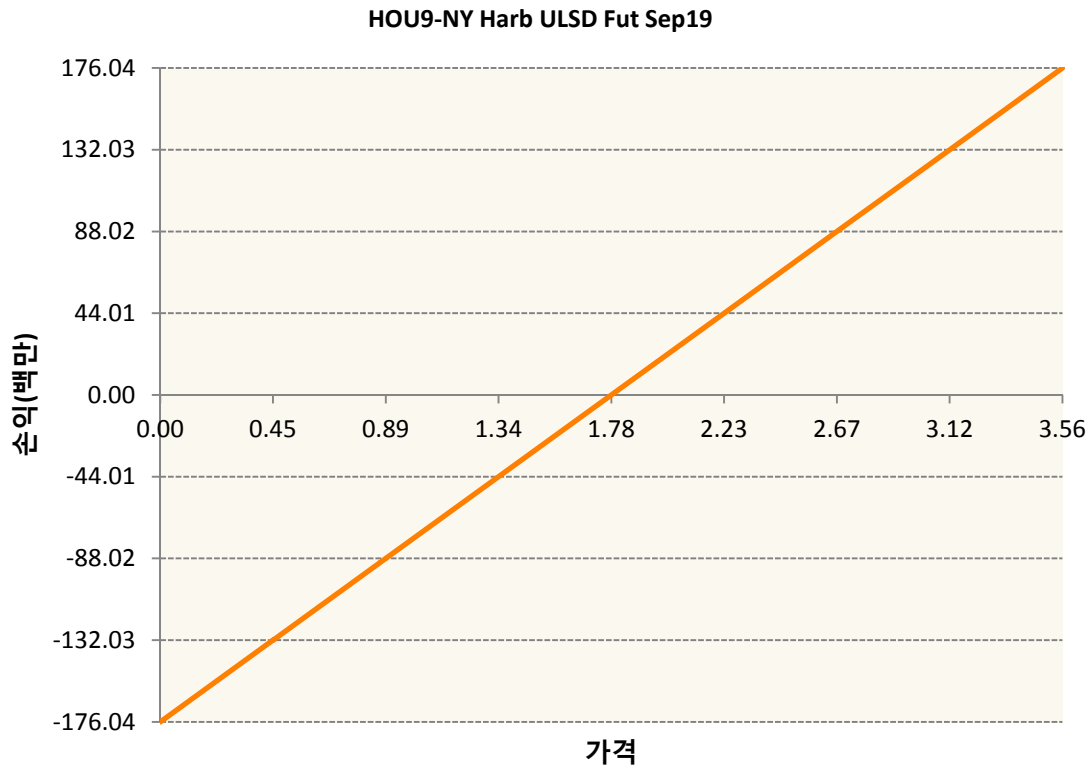
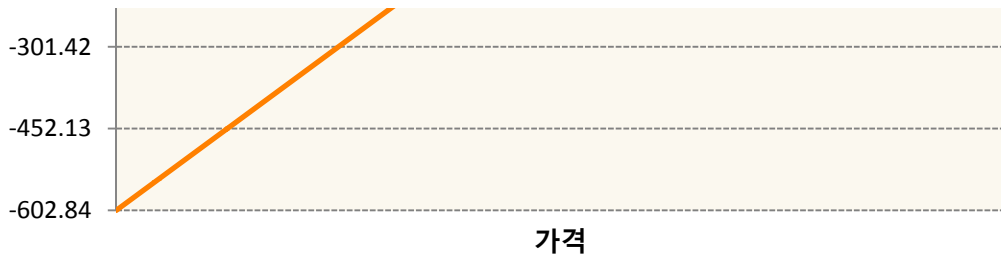
2. 만기시점의 손익구조

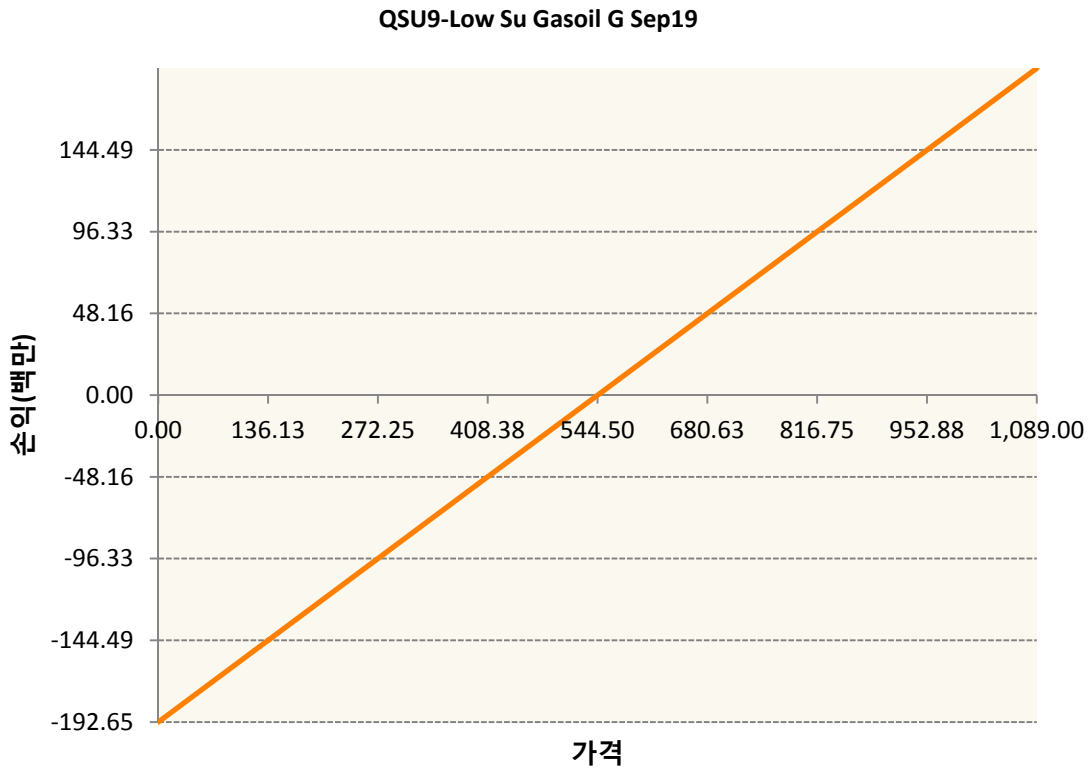
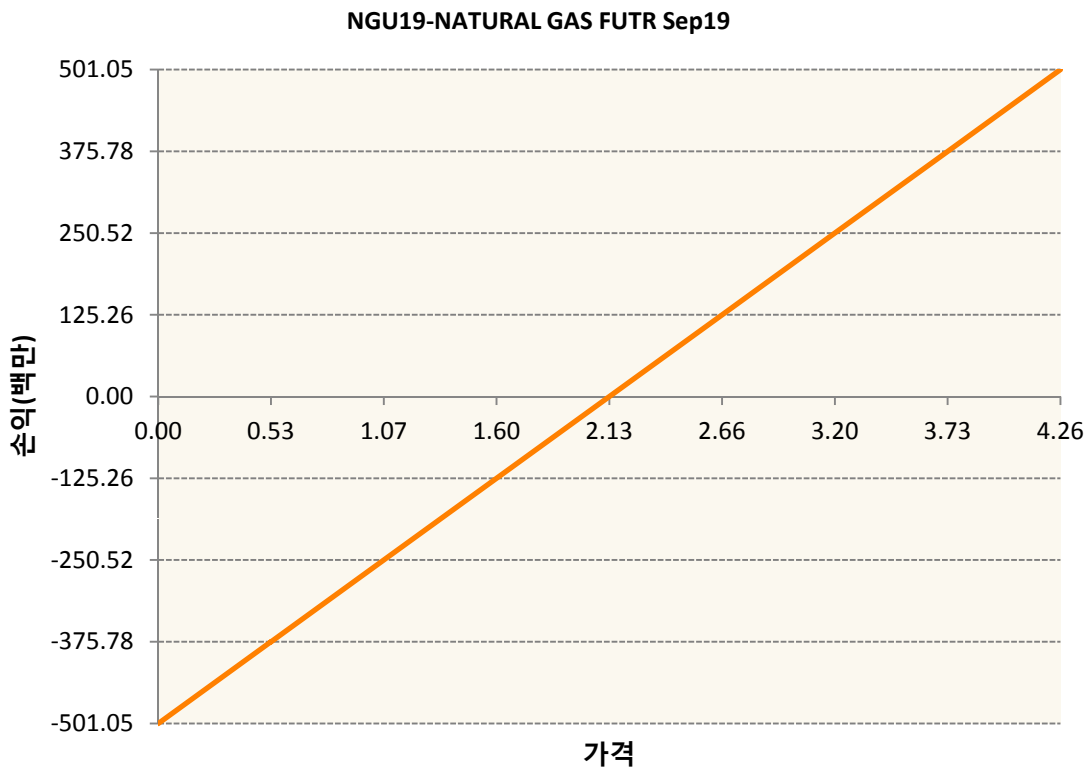
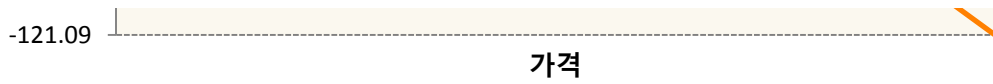
CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19



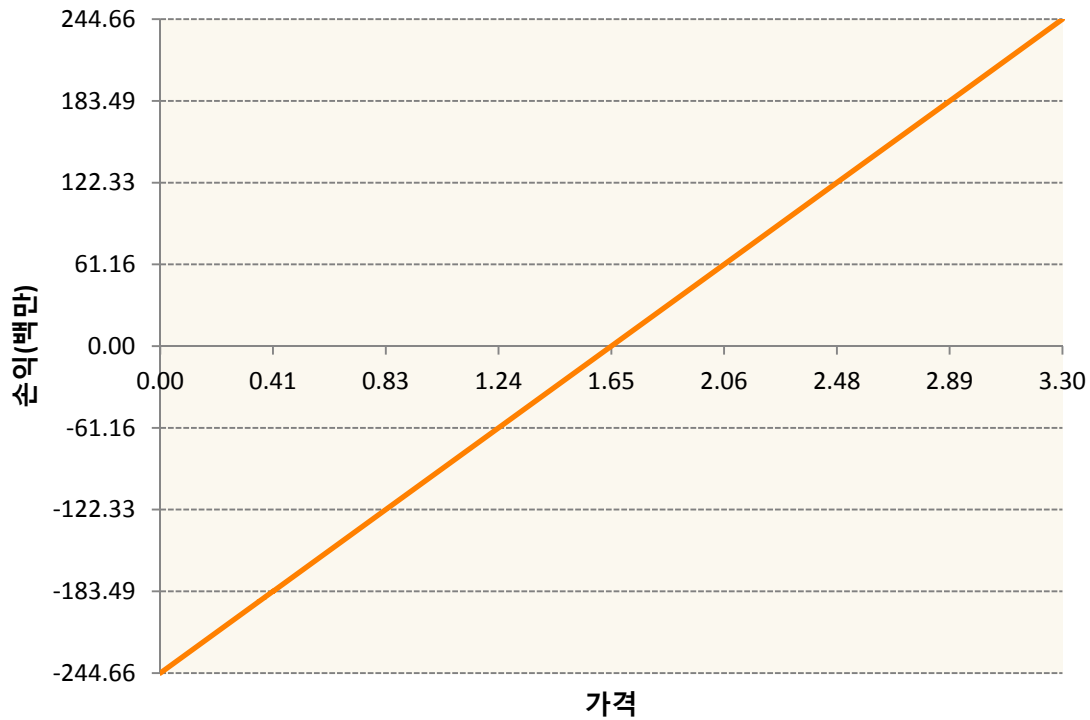
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19







XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	45
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	48
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	14
KR4175P800	2019-08 달러선물	10
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	40
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	15
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	20

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

345

공시일	2019-08-12
기준일	2019-08-09

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

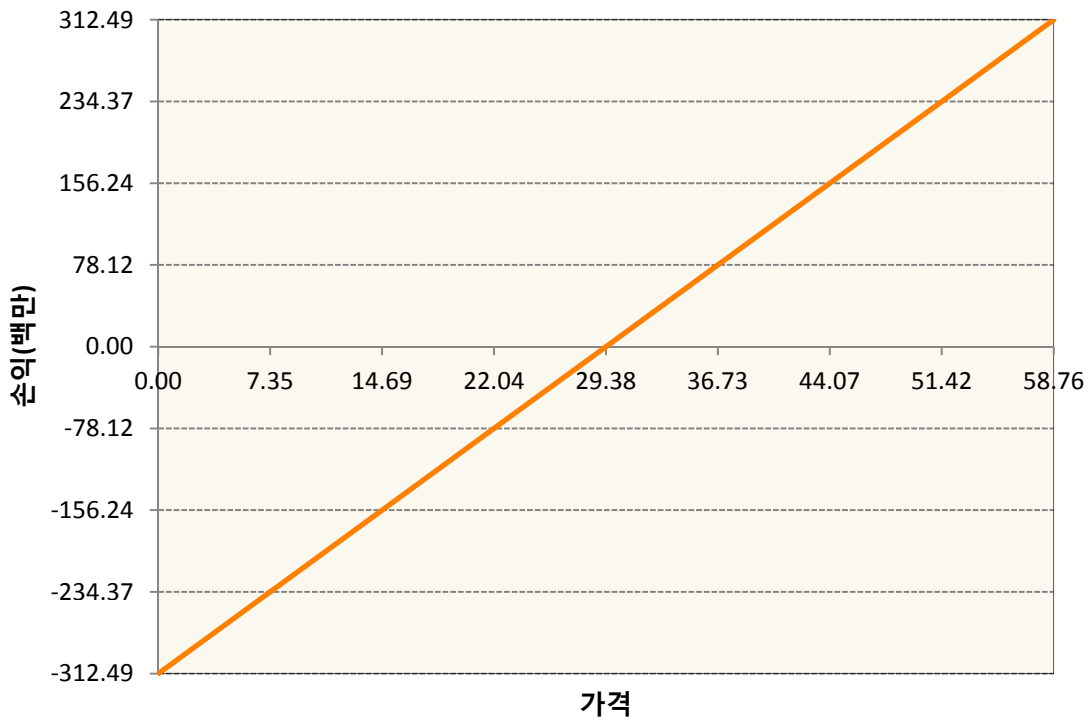
1. 계약금액

(단위:백만원)

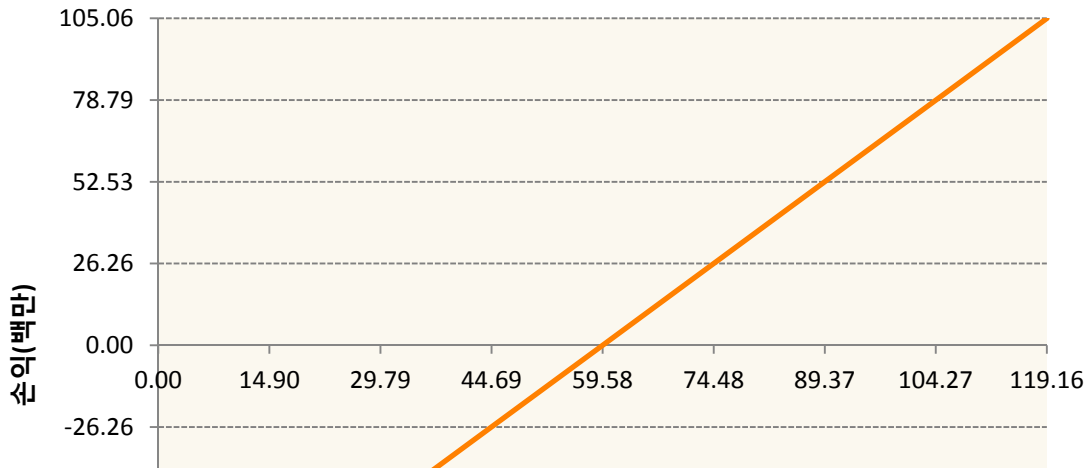
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,795	206	2,589	

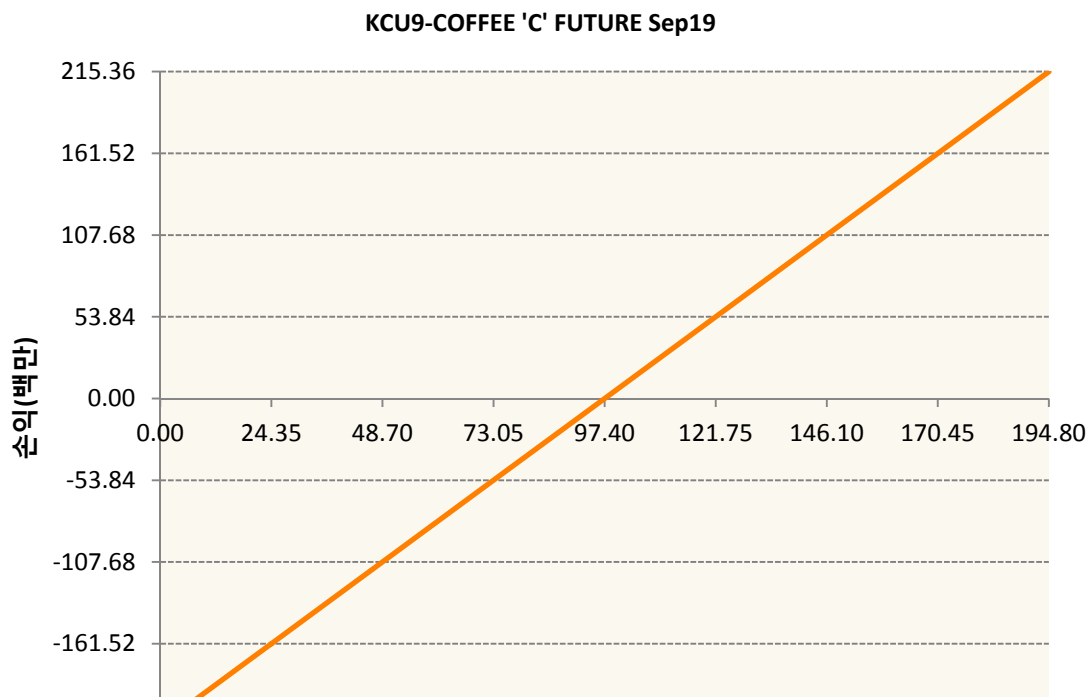
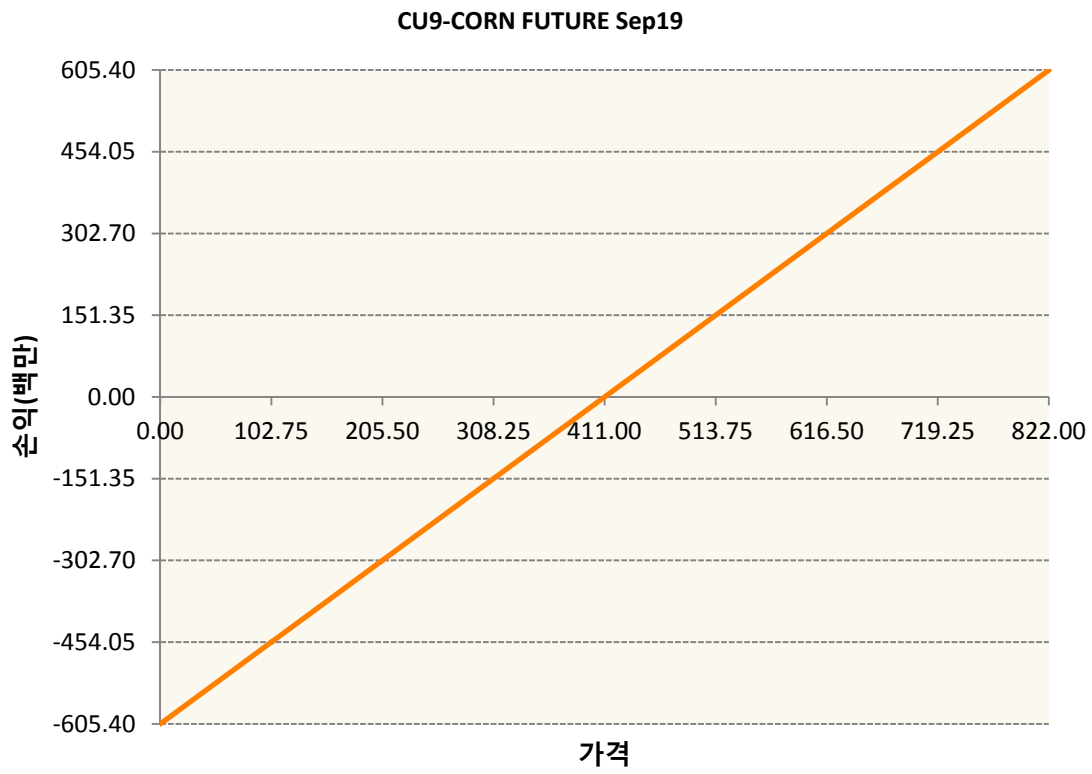
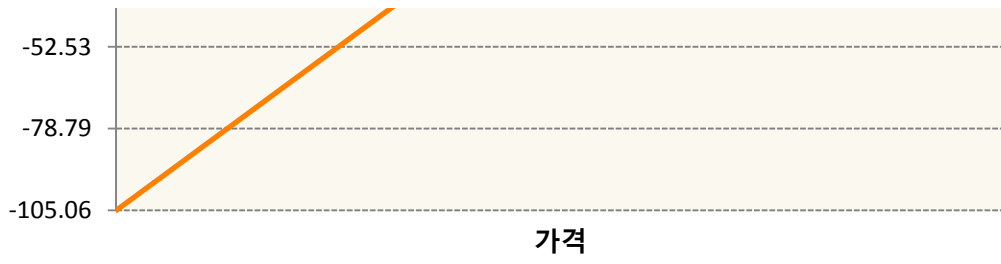
2. 만기시점의 손익구조

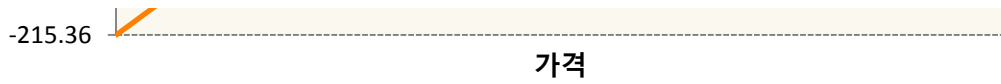
BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19



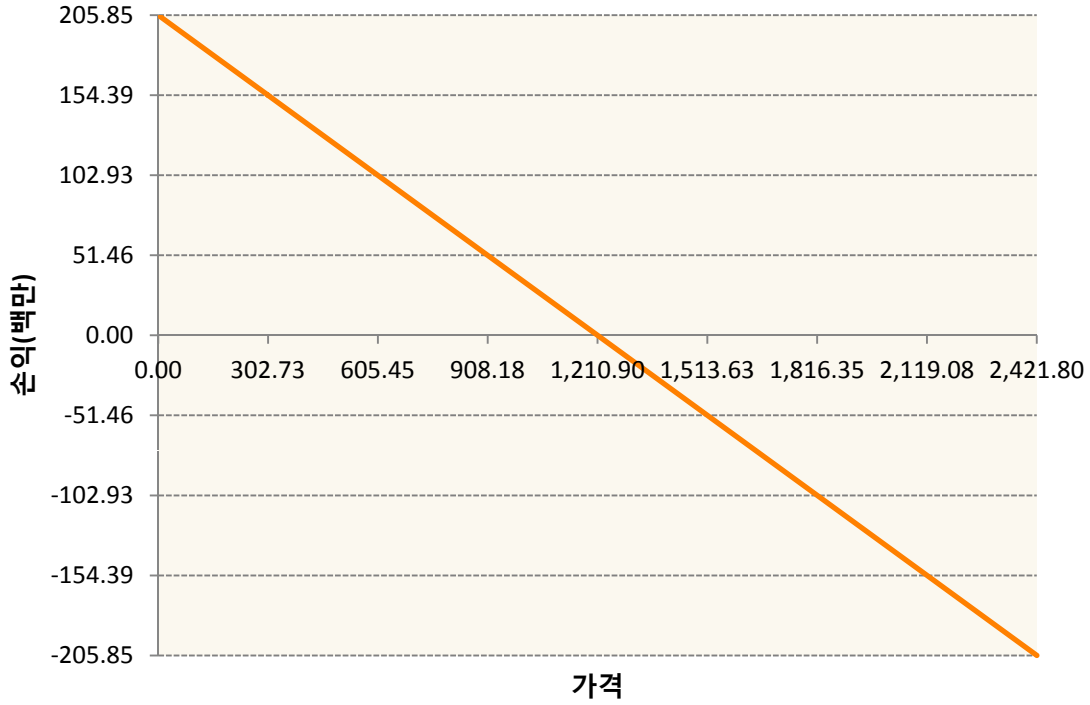
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



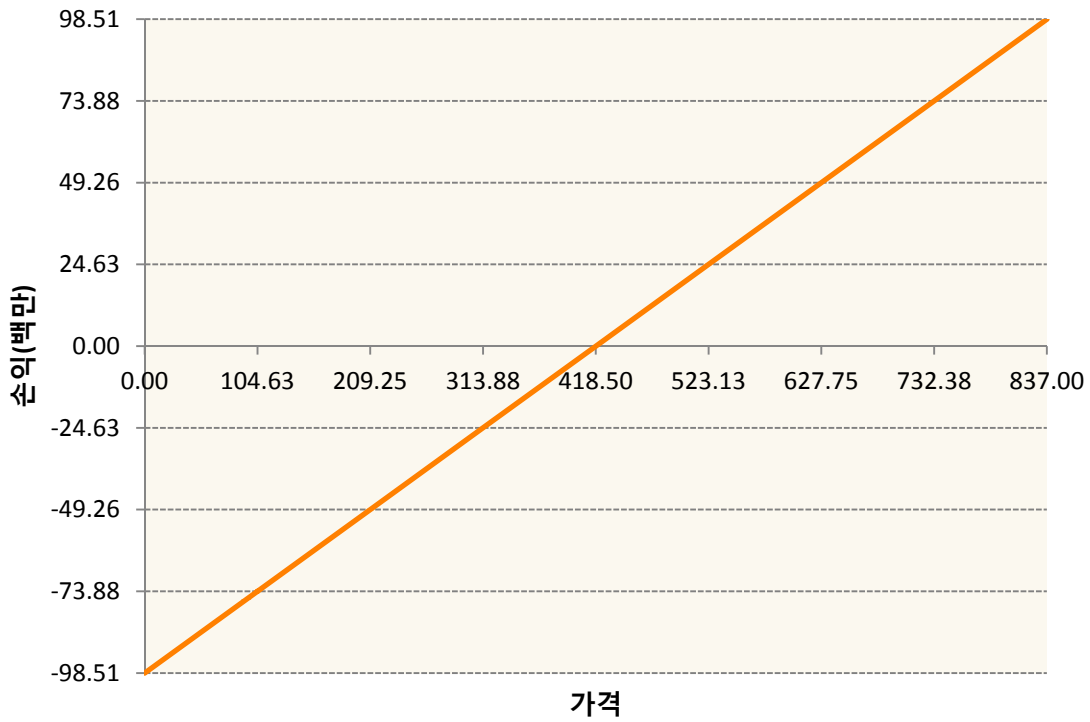




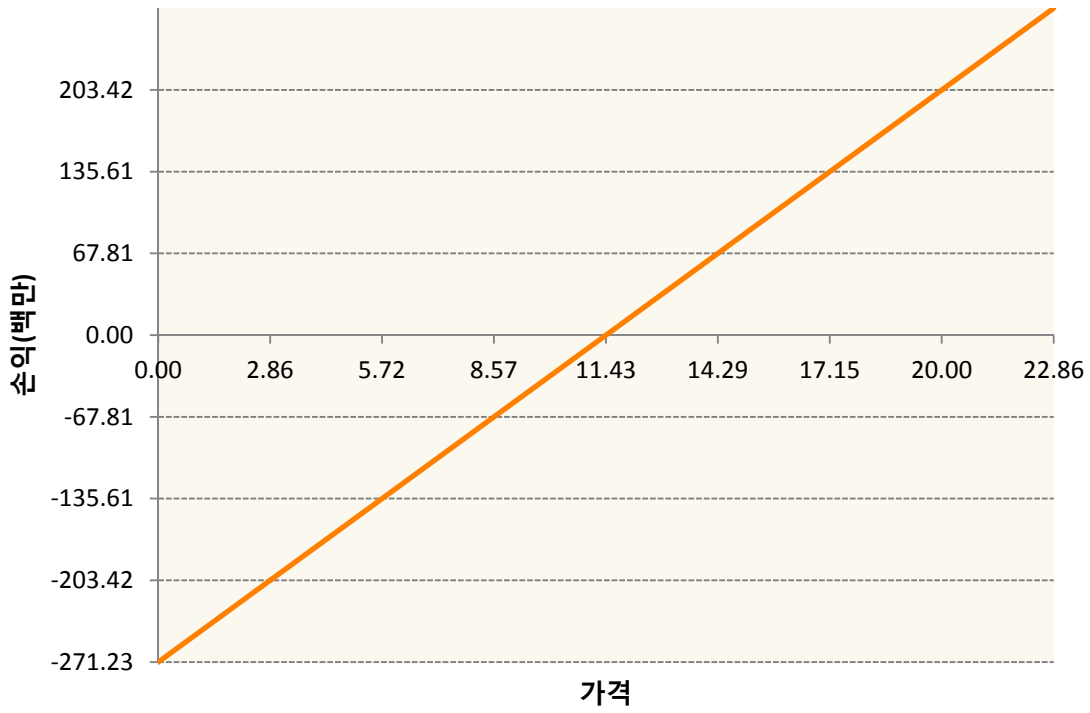
KR4175P80006-2019-08 달러선물



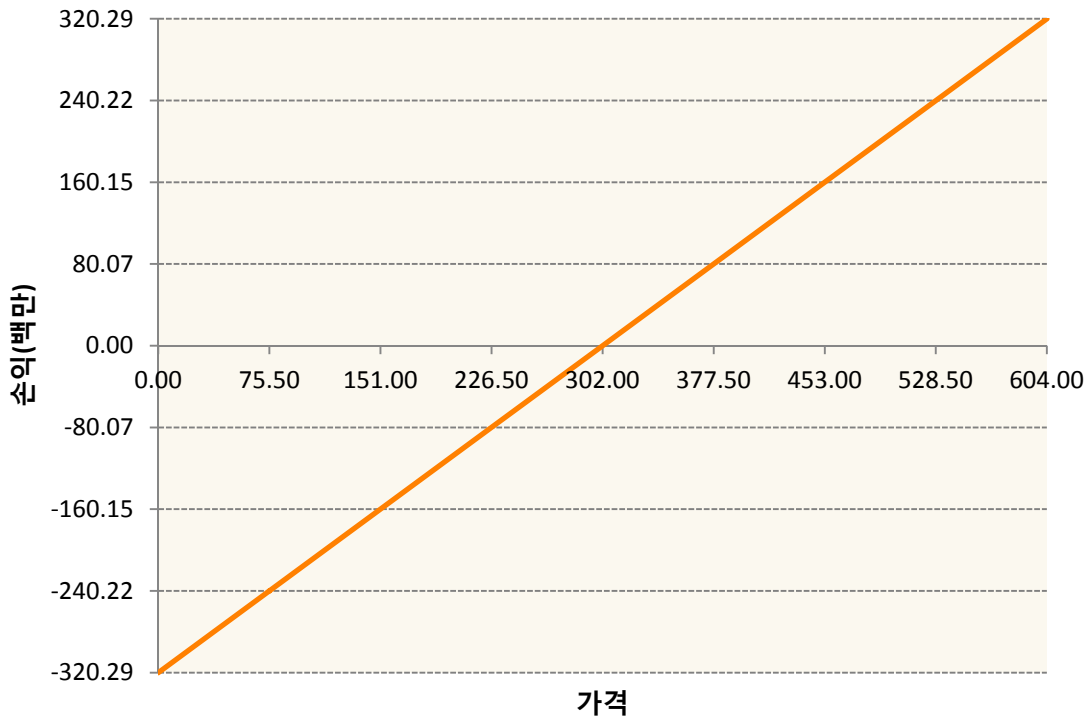
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



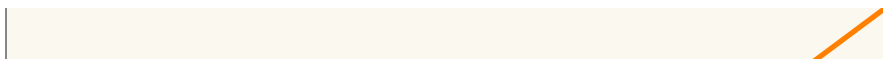
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

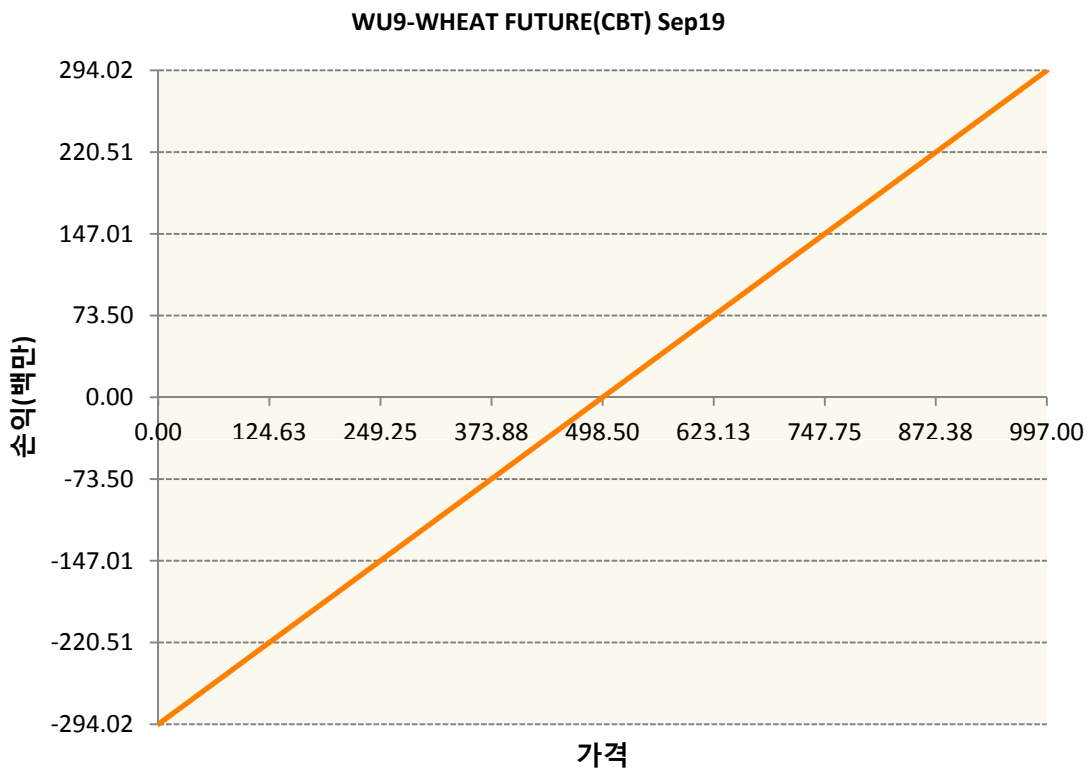
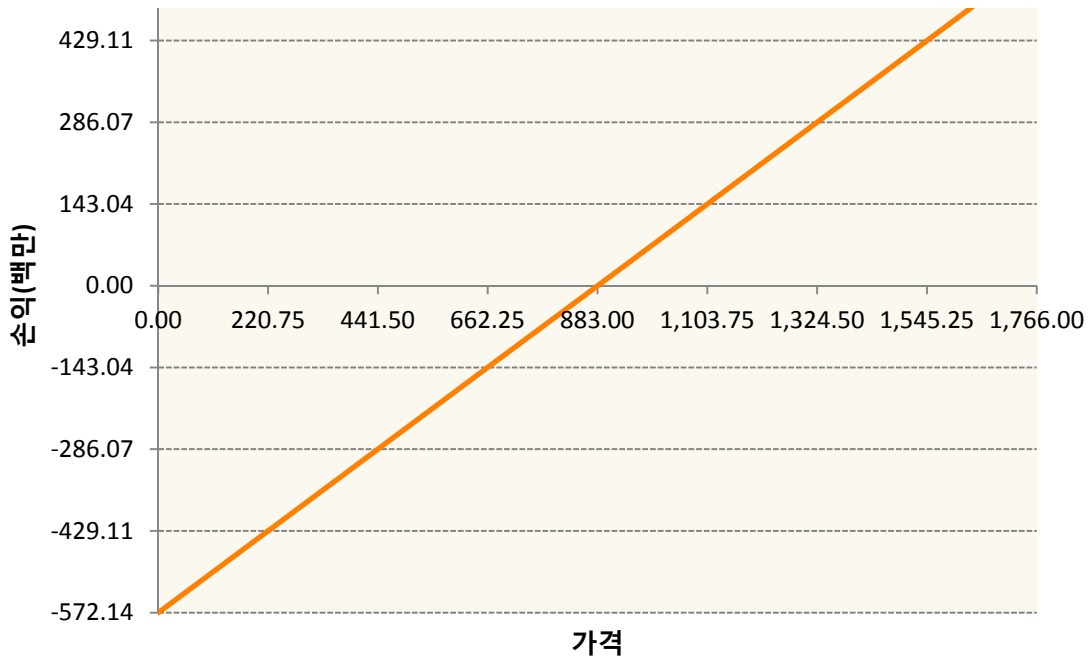


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	25
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	26
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	46
WU9	WHEAT FUTURE(CBT) Sep19	24

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

(단위:백만원)

247