

공시일	2019-08-13
기준일	2019-08-12

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	2019-08-13
기준일	2019-08-12

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

1,143

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

645

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-13
기준일	2019-08-12

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)	359
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	131

* 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	2019-08-13
기준일	2019-08-12

유로인덱스모(주식-파생형)

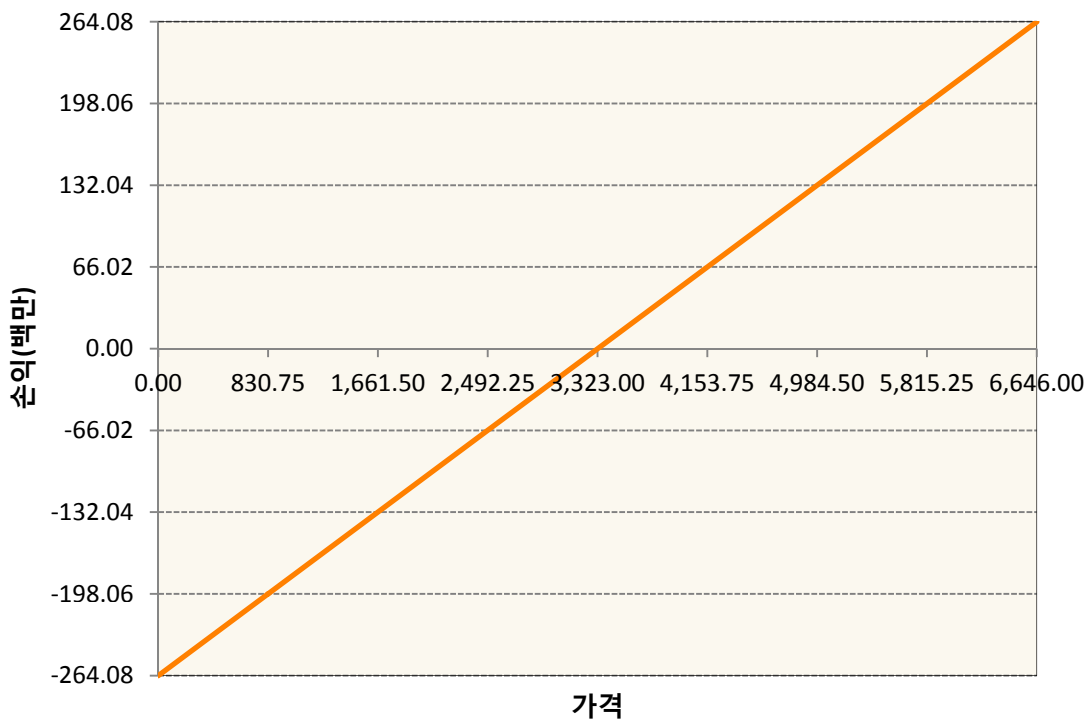
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	264	0	264	

2. 만기시점의 손익구조

VGU9-EURO STOXX 50 Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU9	EURO STOXX 50 Sep19	21
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

15

공시일	2019-08-13
기준일	2019-08-12

차이나인덱스모(주식-파생형)

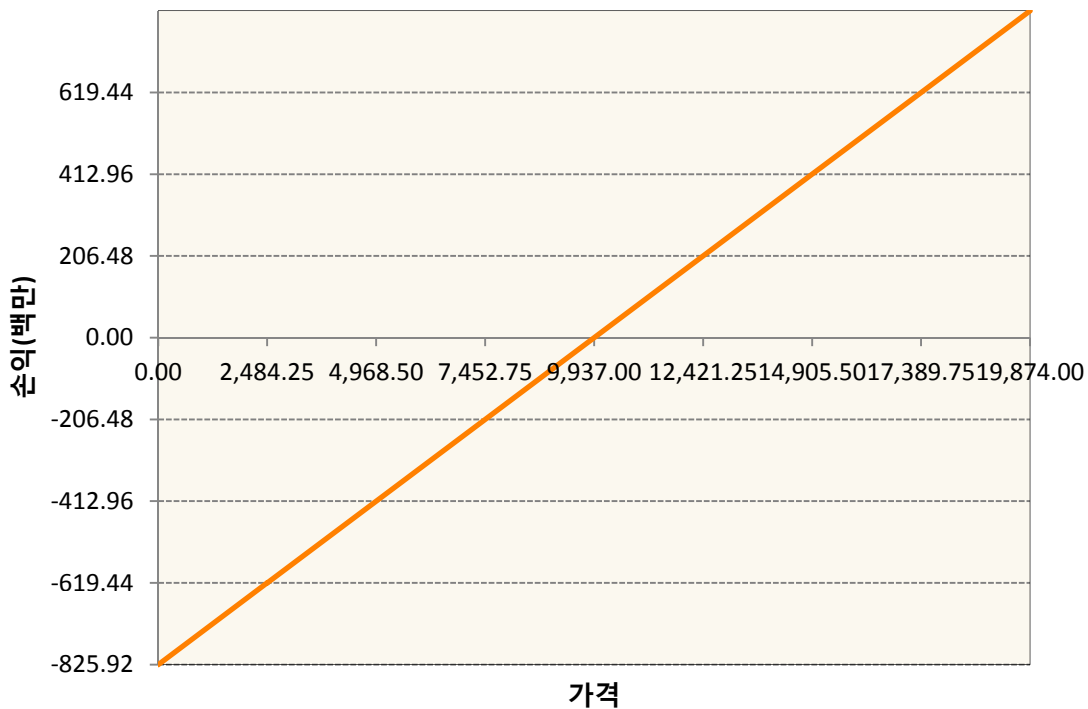
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	826	0	826	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCQ9	HSCEI Futures Aug19	66
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

63

공시일	2019-08-13
기준일	2019-08-12

커버드콜모(주식혼합-파생형)

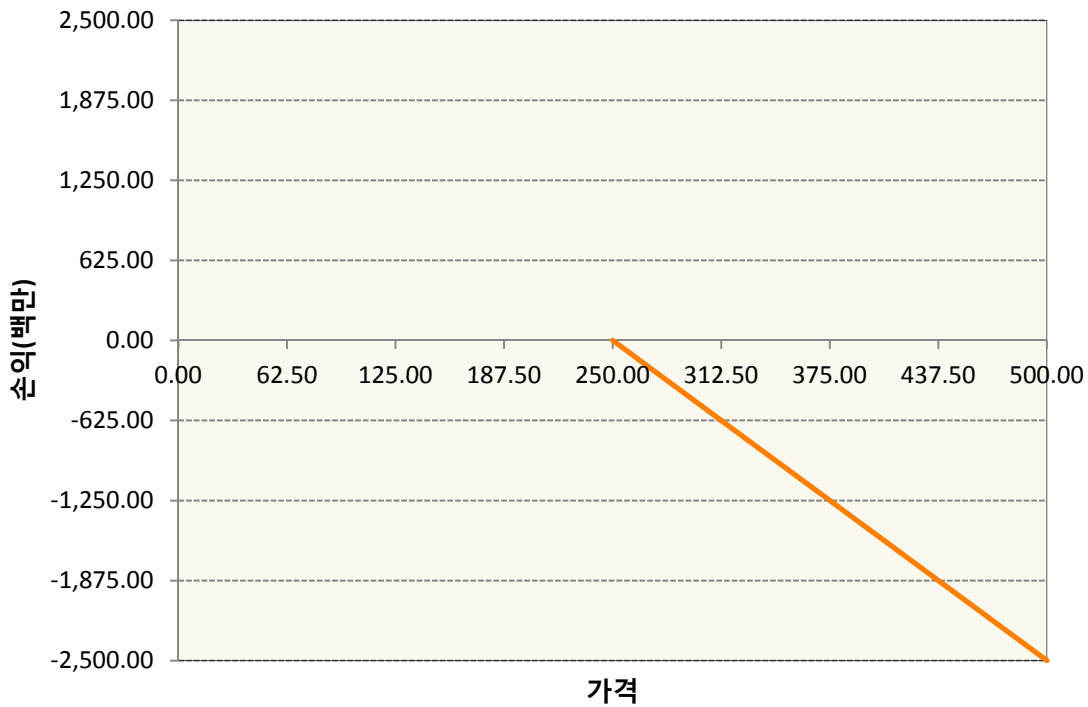
1. 계약금액

(단위:백만원)

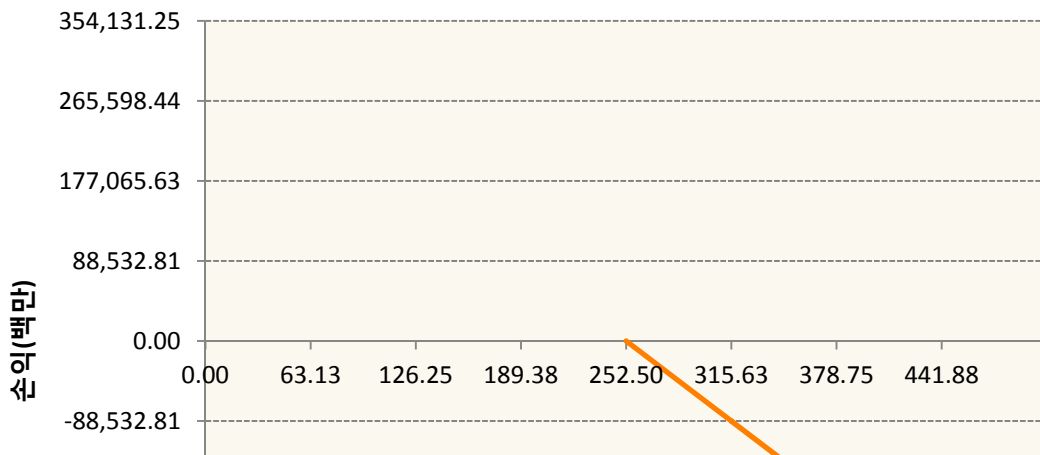
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	3,077	0	3,077	장내
누계	유가증권	옵션	0	523,725	-523,725	장내

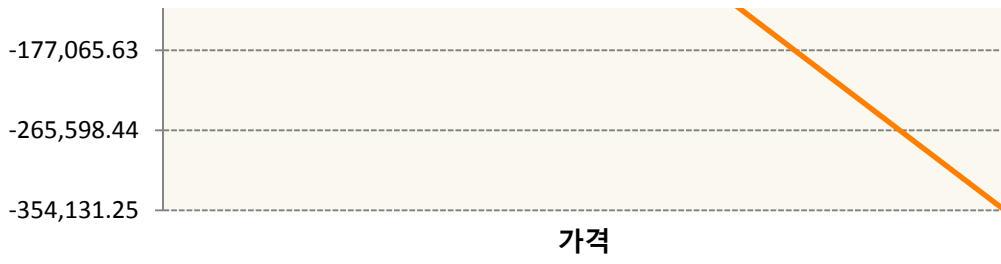
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P92500-2019-09 콜250

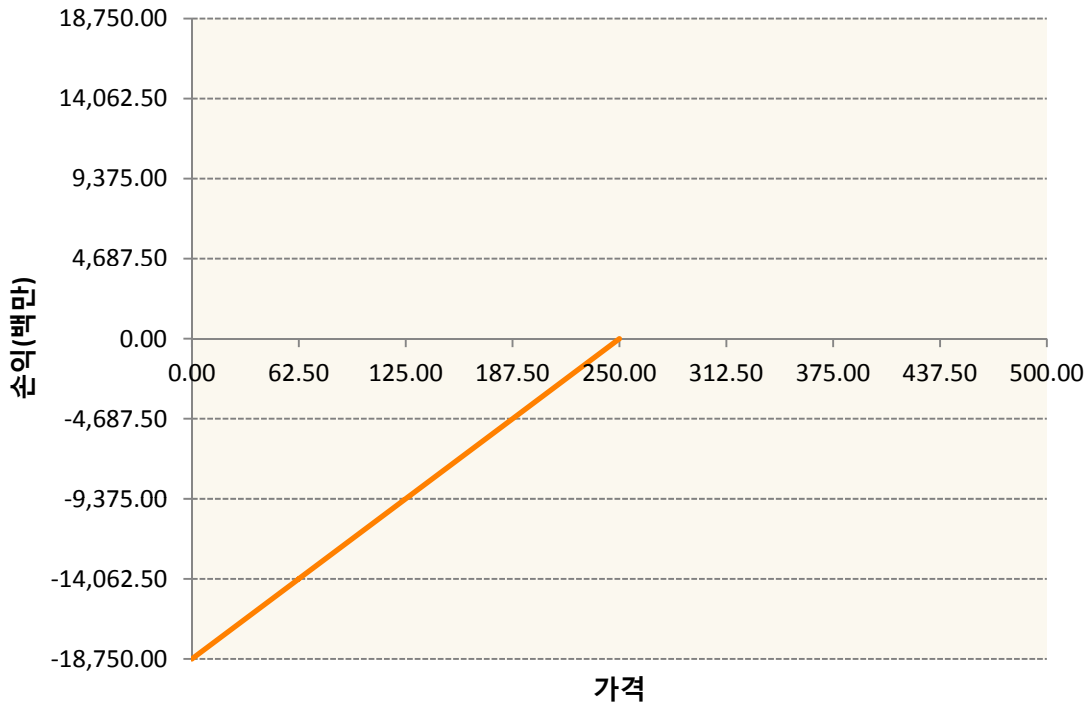


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

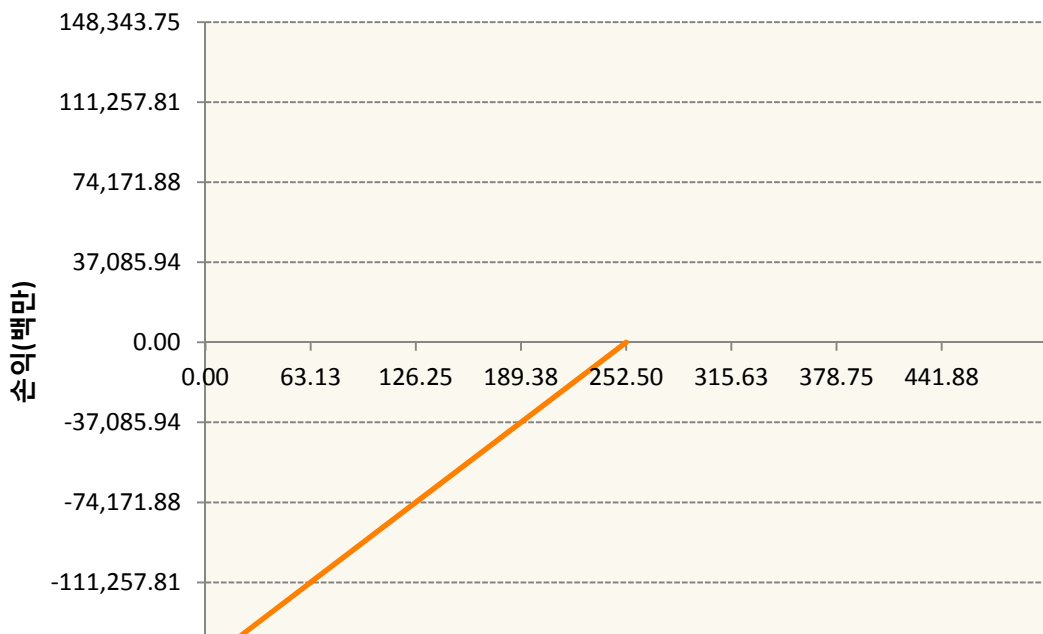




KR4301P92508-2019-09 풋250



KR4301P92524-2019-09 풋252.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P92500		2019-09 콜250						171
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	91	88	85	82	78	74	70	
-5.33%	79	74	69	64	59	54	49	
-2.67%	55	49	43	37	32	26	20	
0%	16	11	6	0	-6	-11	-17	
2.67%	-34	-38	-43	-47	-52	-57	-62	
5.33%	-94	-96	-99	-102	-106	-110	-114	
8.00%	-158	-159	-161	-163	-166	-168	-171	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5						23,092
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	11,096	10,774	10,396	9,968	9,499	8,994	8,458	
-5.33%	9,790	9,218	8,611	7,975	7,318	6,642	5,951	
-2.67%	7,043	6,273	5,496	4,713	3,927	3,138	2,347	
0%	2,423	1,618	810	0	-811	-1,623	-2,436	
2.67%	-4,063	-4,729	-5,422	-6,136	-6,867	-7,611	-8,365	
5.33%	-11,997	-12,441	-12,938	-13,481	-14,062	-14,675	-15,313	
8.00%	-20,823	-21,064	-21,368	-21,729	-22,140	-22,596	-23,092	
KR4301P92508		2019-09 풋250						1,035
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-980	-985	-992	-1,000	-1,010	-1,022	-1,035	
-5.33%	-509	-526	-544	-563	-583	-604	-626	
-2.67%	-140	-167	-194	-221	-247	-274	-301	
0%	72	49	25	0	-25	-51	-76	
2.67%	153	142	128	113	96	78	59	
5.33%	173	169	164	158	150	140	129	
8.00%	176	175	174	172	169	165	159	
KR4301P92524		2019-09 풋252.5						8,876
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-8,566	-8,588	-8,622	-8,668	-8,726	-8,796	-8,876	
-5.33%	-4,745	-4,837	-4,945	-5,065	-5,197	-5,337	-5,486	
-2.67%	-1,498	-1,688	-1,883	-2,081	-2,282	-2,484	-2,688	
0%	630	422	211	0	-212	-425	-639	
2.67%	1,590	1,462	1,322	1,170	1,009	841	667	

5.33%	1,869	1,824	1,763	1,688	1,599	1,497	1,385
8.00%	1,921	1,911	1,894	1,867	1,830	1,782	1,723

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

(단위:백만원)

32,795

공시일	2019-08-13
기준일	2019-08-12

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

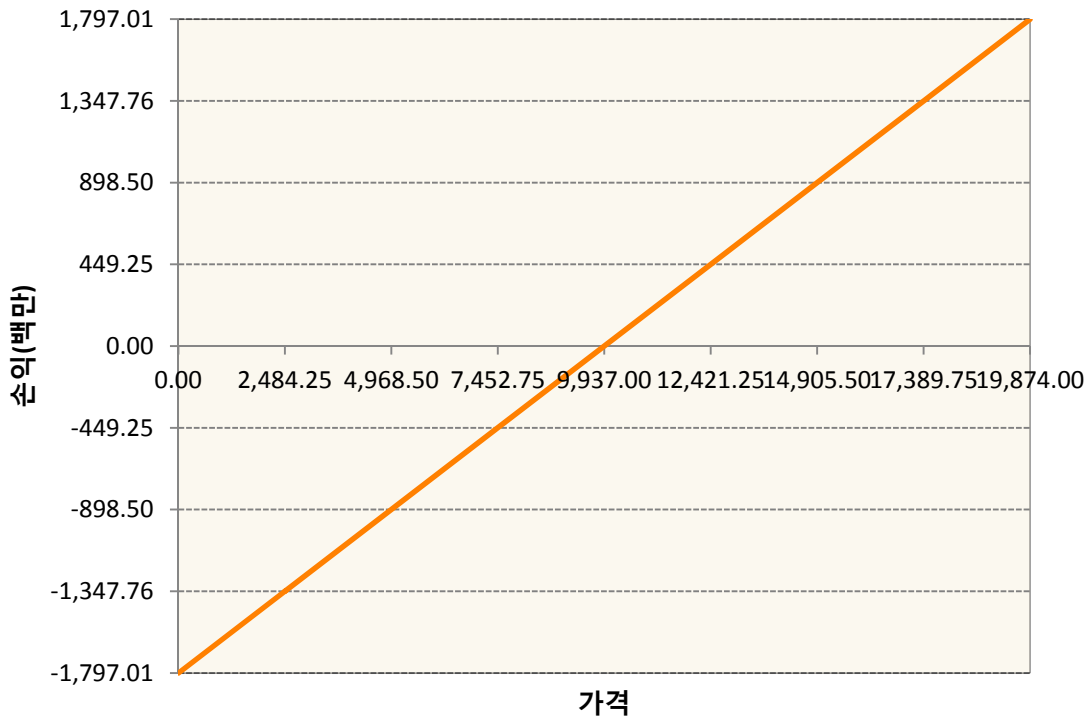
1. 계약금액

(단위:백만원)

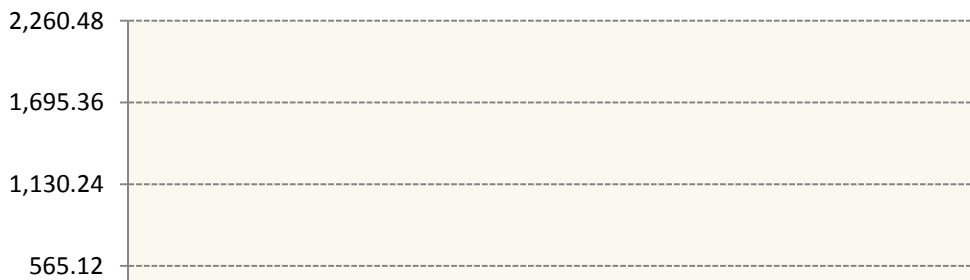
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,797	0	1,797	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,535	-5,535	장내
누계	통화	선도	460	3,256	-2,795	장외

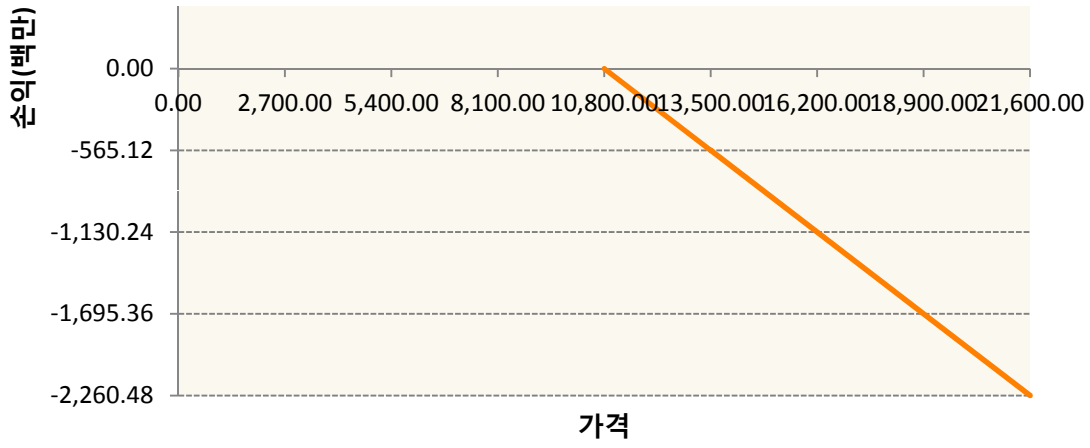
2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19

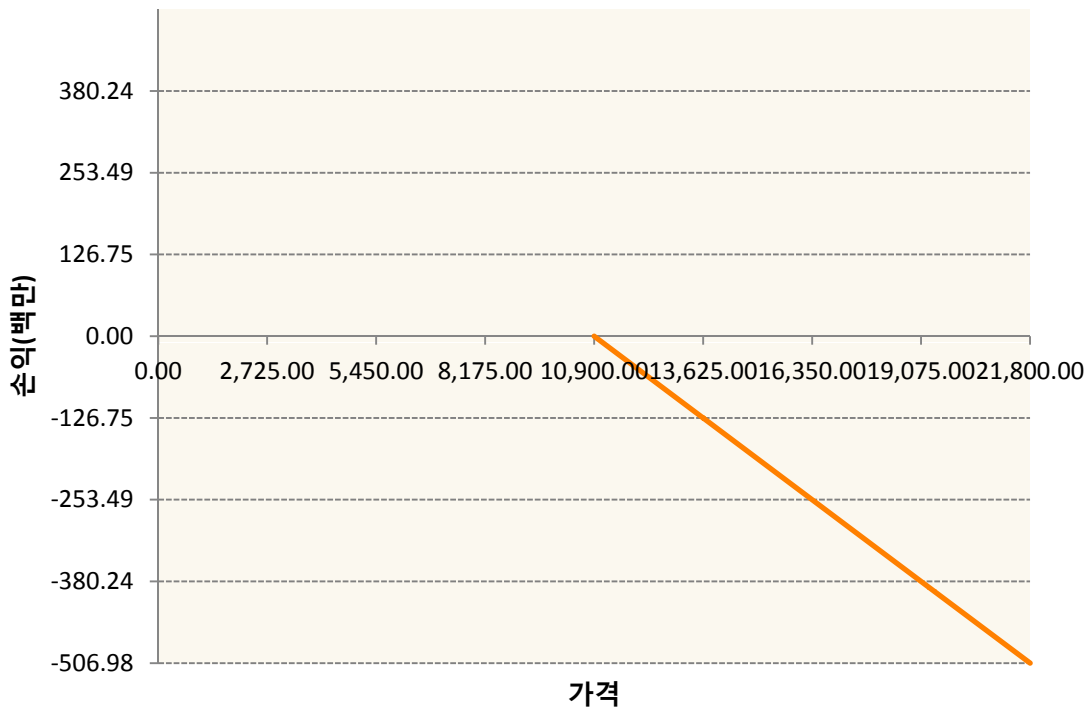


OHHIQ9-C108-HSCEI

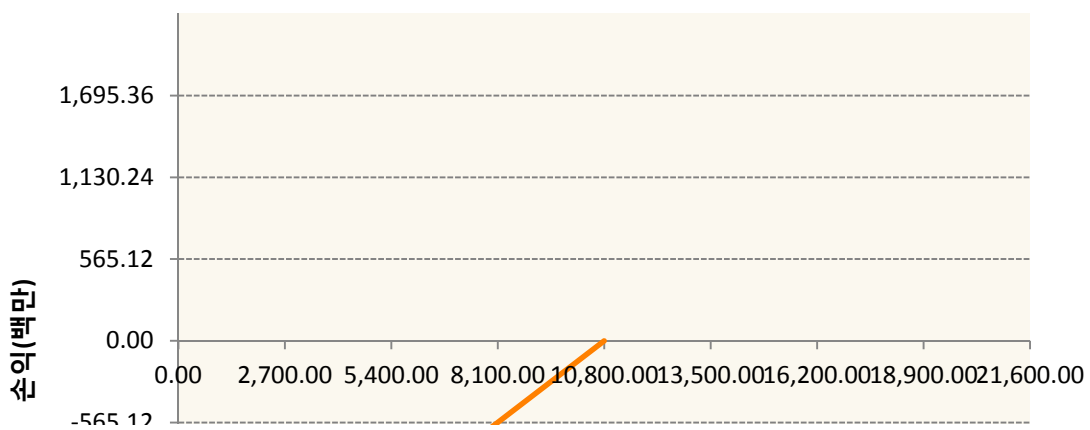


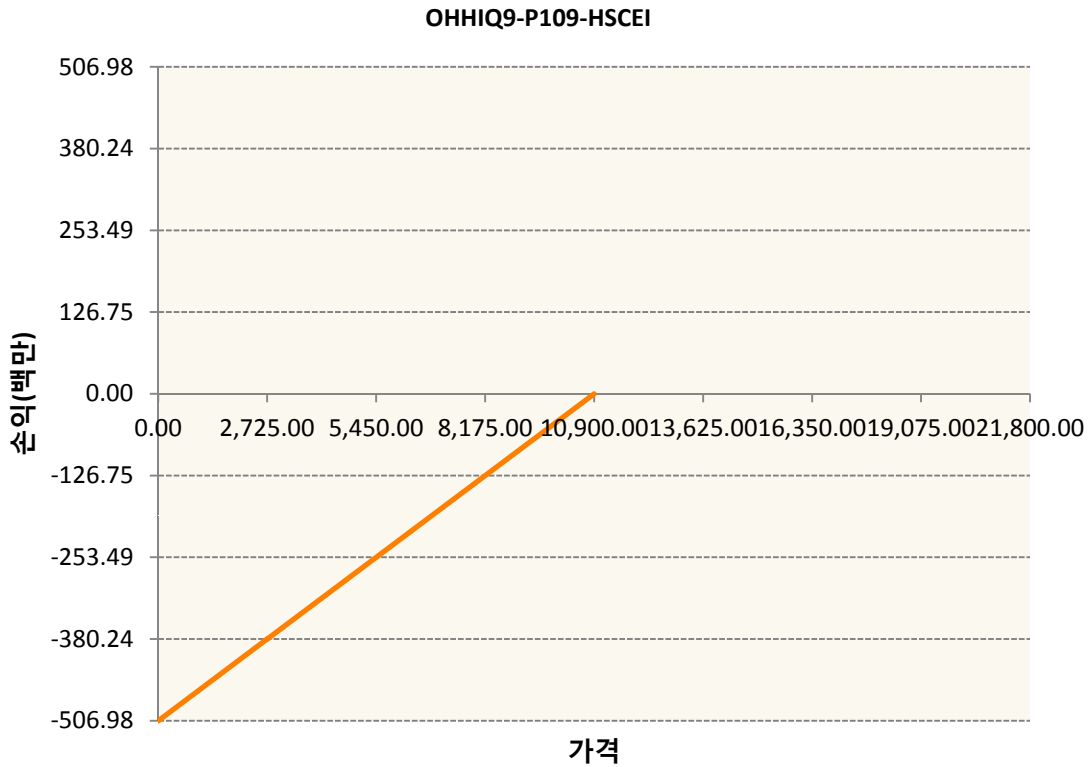


OHHIQ9-C109-HSCEI



OHHIQ9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	260
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E	12
FX21019Q00 HKD/KRW 23-08-19E	24
HCQ9 HSCEI Futures Aug19	144
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)
	656

공시일	2019-08-13
기준일	2019-08-12

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

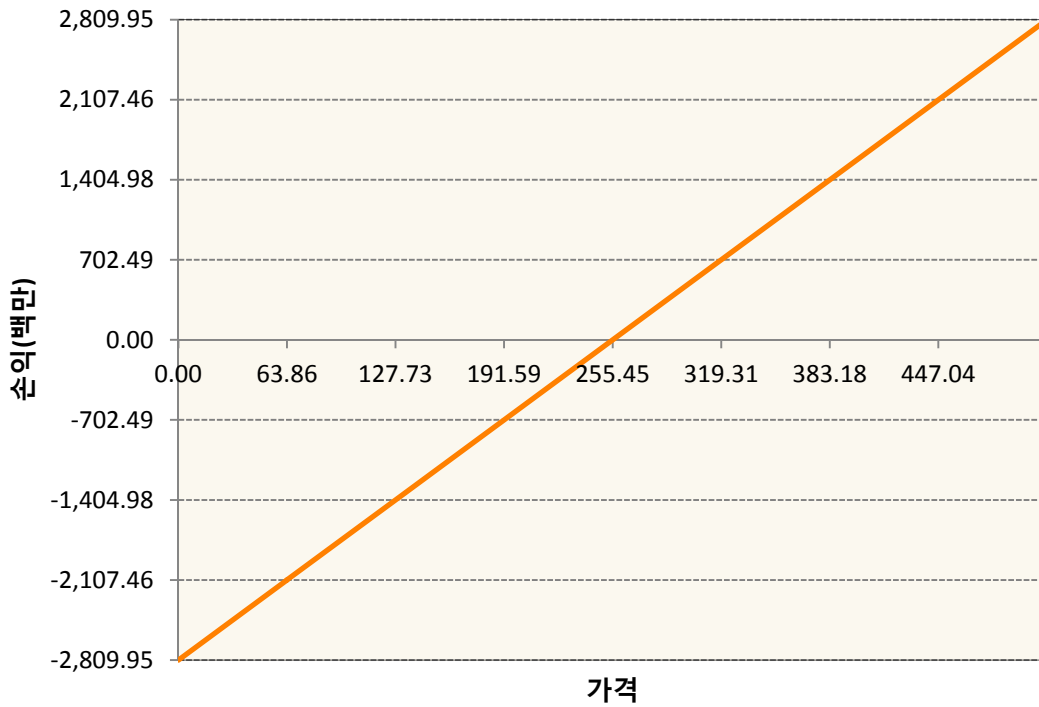
1. 계약금액

(단위:백만원)

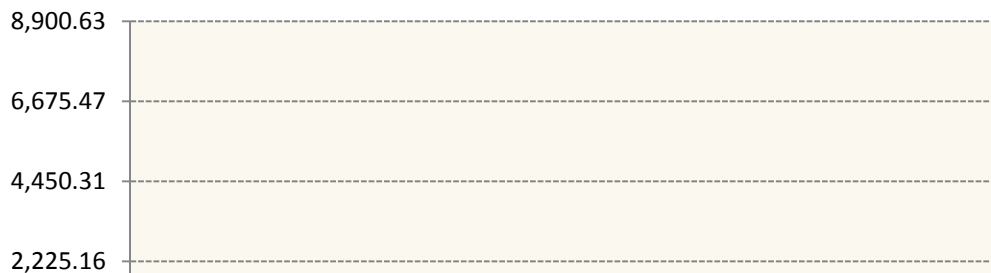
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,810	0	2,810	장내
누계	유가증권	스왑	20,125	0	20,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	17,416	-17,416	장내

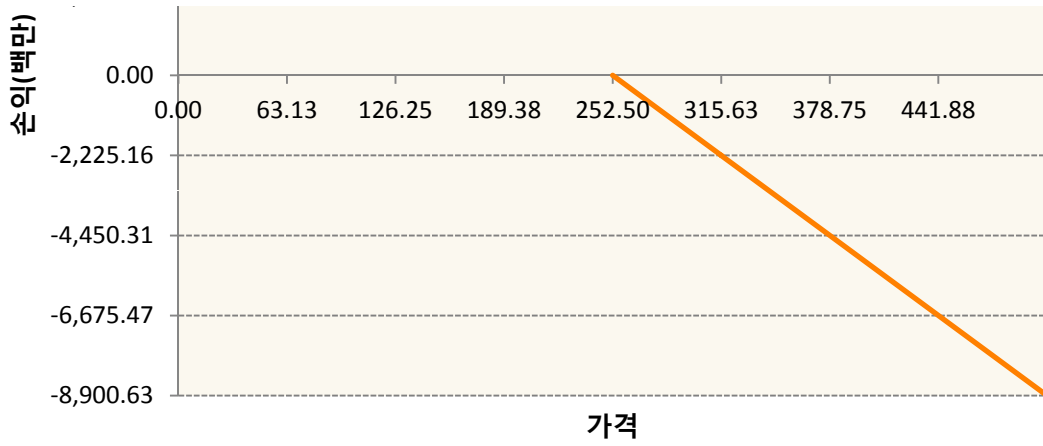
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

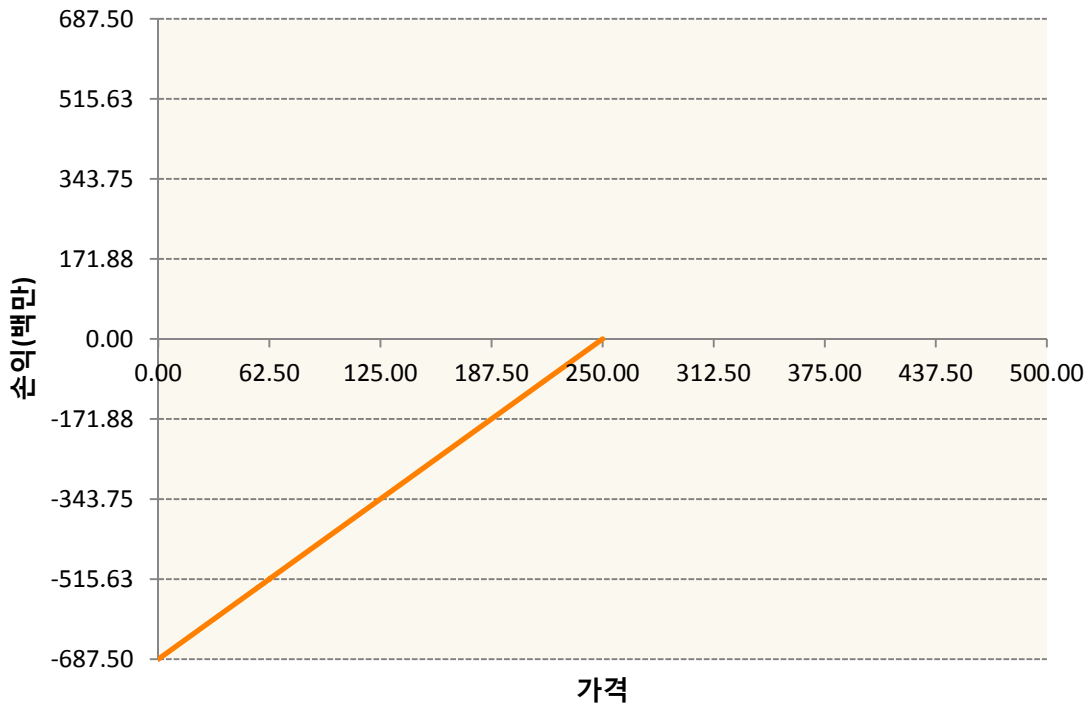


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

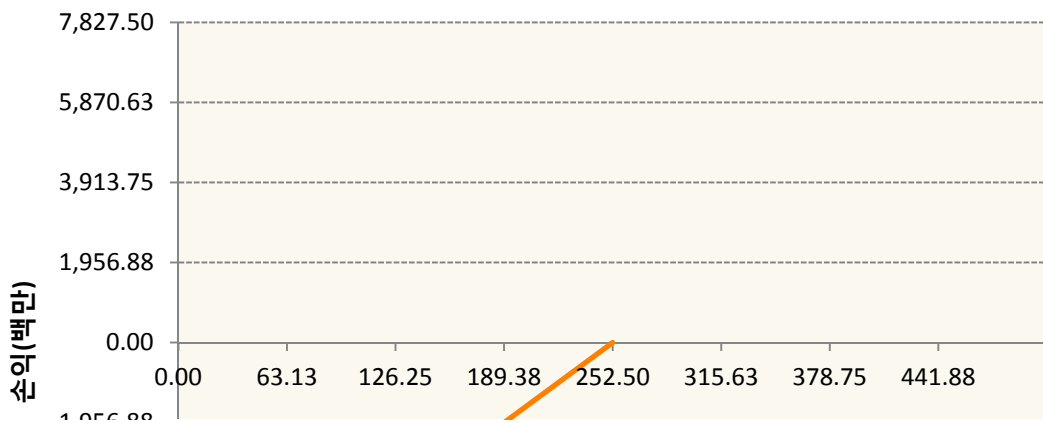




KR4301P92508-2019-09 풋250



KR4301P92524-2019-09 풋252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						1,746
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,746	-1,746	-1,746	-1,746	-1,746	-1,746	-1,746	
-5.33%	-1,164	-1,164	-1,164	-1,164	-1,164	-1,164	-1,164	
-2.67%	-582	-582	-582	-582	-582	-582	-582	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	582	582	582	582	582	582	582	
5.33%	1,164	1,164	1,164	1,164	1,164	1,164	1,164	
8.00%	1,746	1,746	1,746	1,746	1,746	1,746	1,746	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						225
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-225	-225	-225	-225	-225	-225	-225	
-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%	225	225	225	225	225	225	225	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5						580
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	279	271	261	251	239	226	213	
-5.33%	246	232	216	200	184	167	150	
-2.67%	177	158	138	118	99	79	59	
0%	61	41	20	0	-20	-41	-61	
2.67%	-102	-119	-136	-154	-173	-191	-210	
5.33%	-302	-313	-325	-339	-353	-369	-385	
8.00%	-523	-529	-537	-546	-556	-568	-580	
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	-37	-38
-5.33%	-19	-19	-20	-21	-21	-22	-23
-2.67%	-5	-6	-7	-8	-9	-10	-11
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	6	5	5	4	4	3	2
5.33%	6	6	6	6	5	5	5
8.00%	6	6	6	6	6	6	6
KR4301P92524 2019-09 풋252.5							468
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-452	-453	-455	-457	-460	-464	-468
-5.33%	-250	-255	-261	-267	-274	-282	-289
-2.67%	-79	-89	-99	-110	-120	-131	-142
0%	33	22	11	0	-11	-22	-34
2.67%	84	77	70	62	53	44	35
5.33%	99	96	93	89	84	79	73
8.00%	101	101	100	99	97	94	91

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

(단위:백만원)

3,016

공시일	2019-08-13
기준일	2019-08-12

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

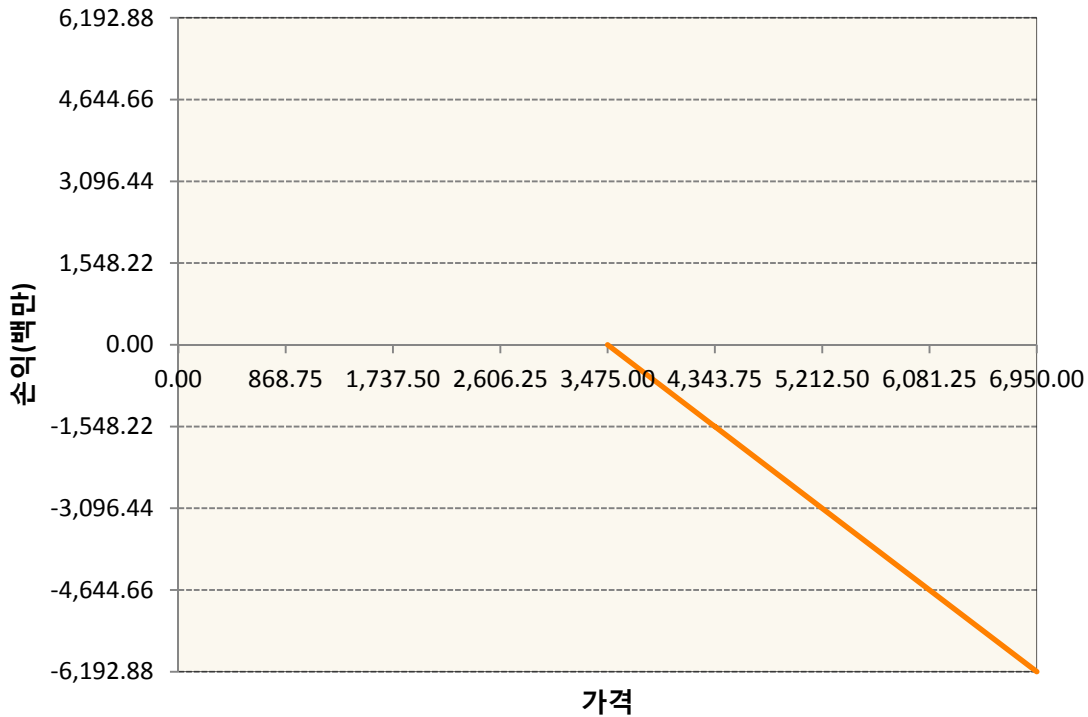
1. 계약금액

(단위:백만원)

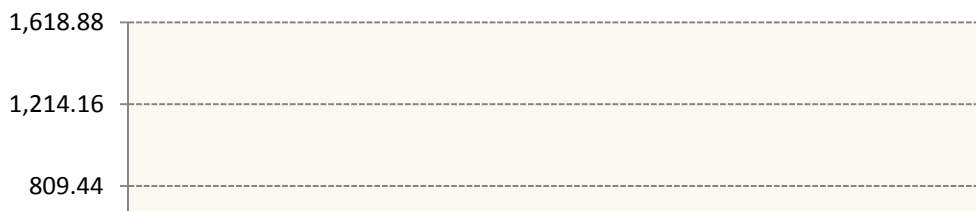
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,518	0	4,518	
누계	유가증권	옵션	0	15,624	-15,624	장내
누계	지수	스왑	28,762	0	28,762	장외
누계	통화	선도	14,693	23,127	-8,435	장외

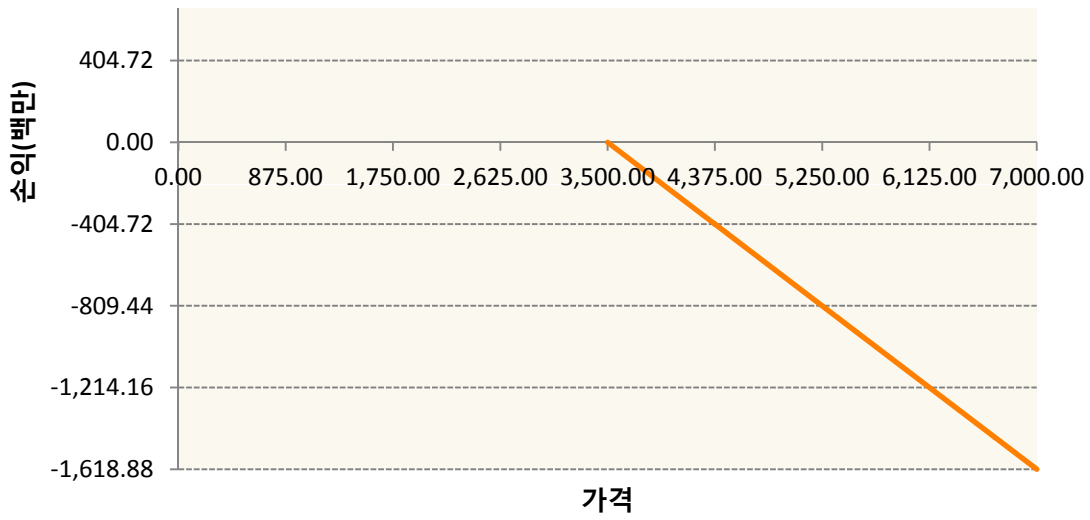
2. 만기시점의 손익구조

OESXQ9-C3475-EURO STOXX 50

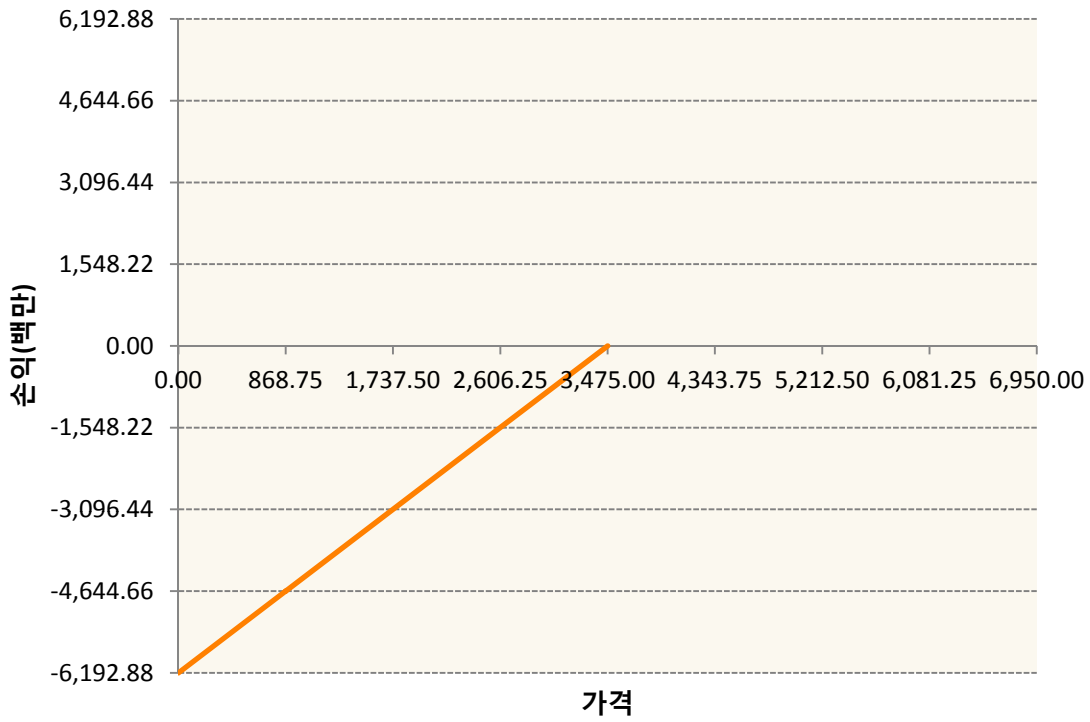


OESXQ9-C3500-EURO STOXX 50

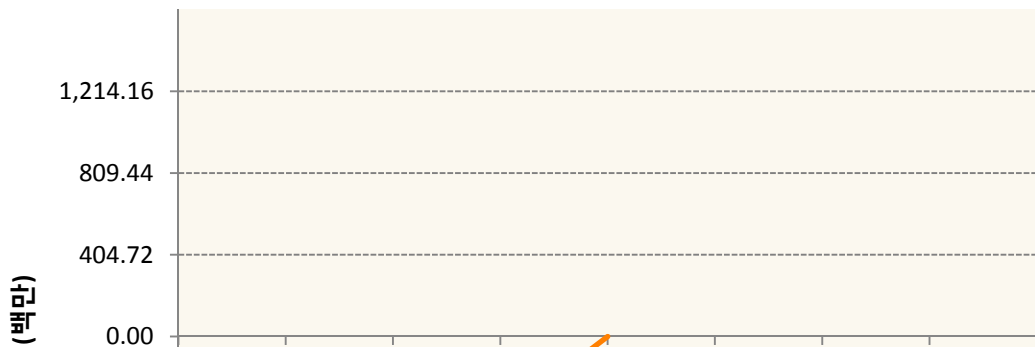


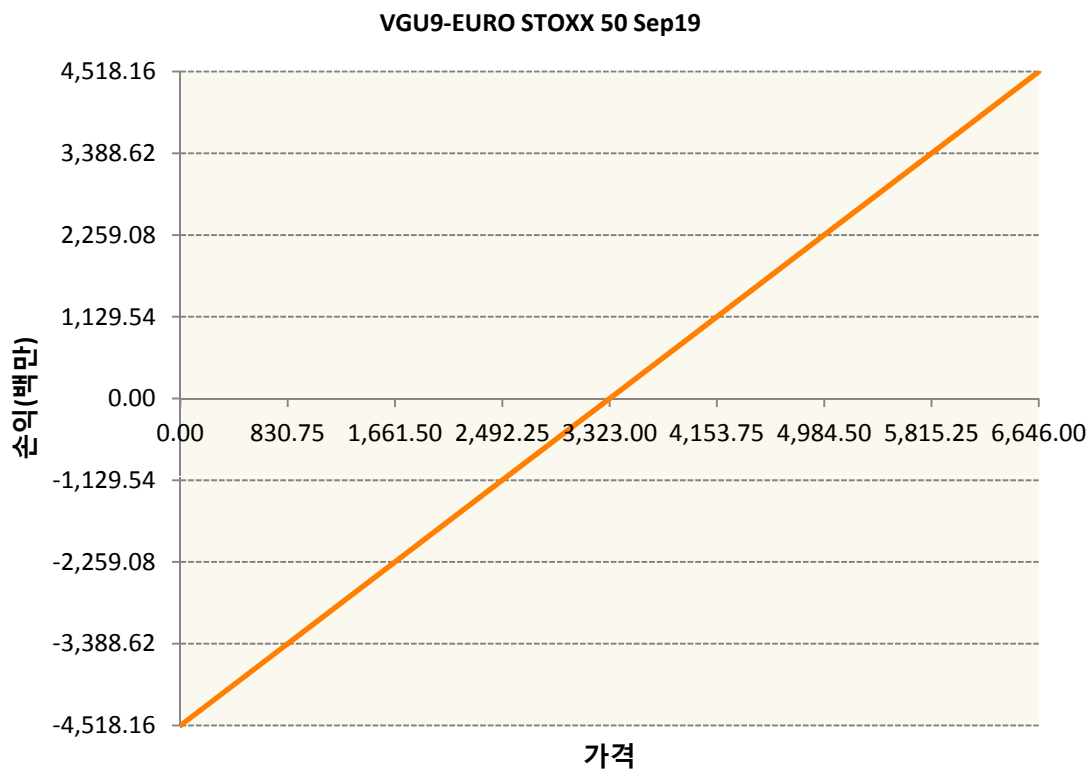
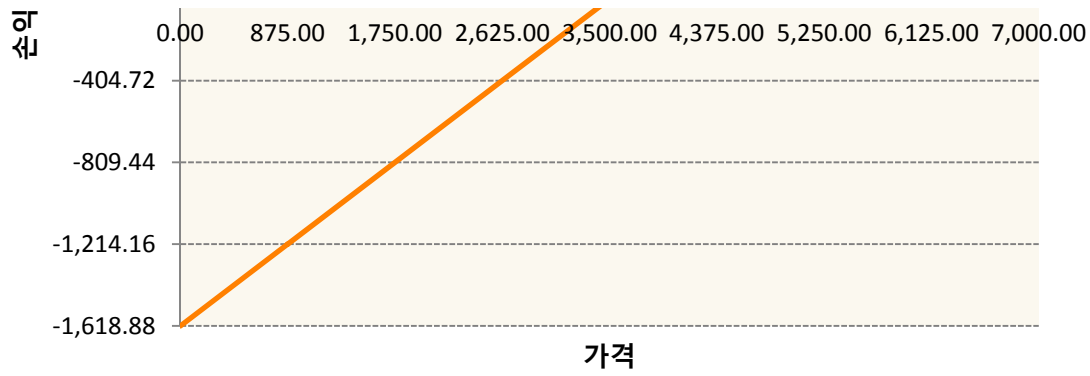


OESXQ9-P3475-EURO STOXX 50



OESXQ9-P3500-EURO STOXX 50





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

130
361

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

(단위:백만원)

2,643

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

(단위:백만원)

929

공시일	2019-08-13
기준일	2019-08-12

ETF스마트레버리지목표전환형9호

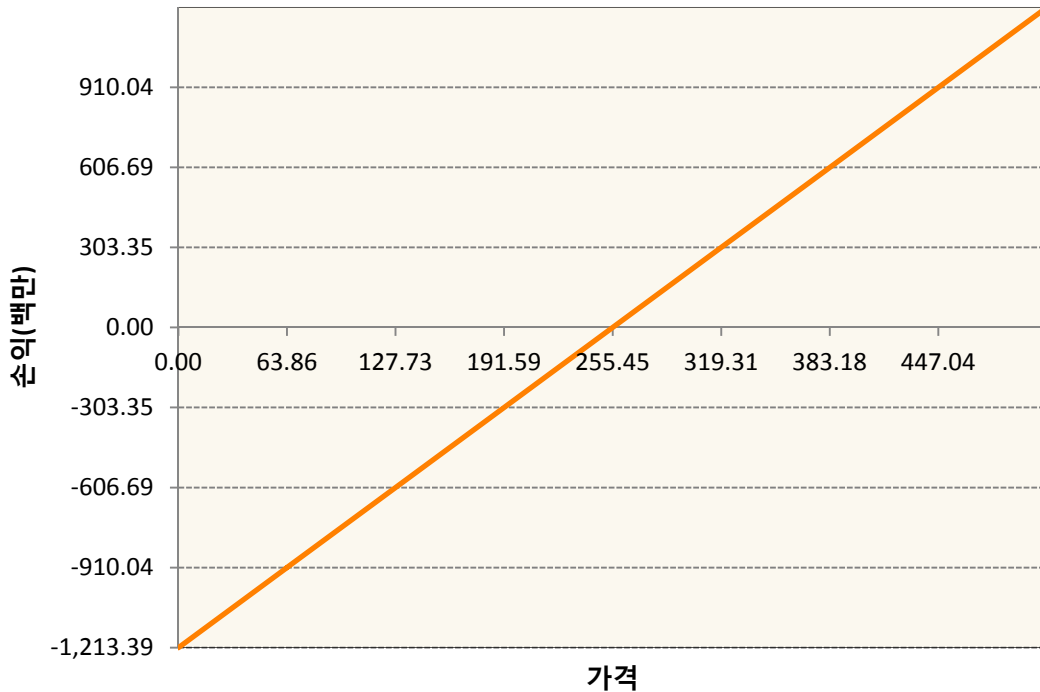
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,213	0	1,213	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)

83

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

(단위:백만원)

122

공시일	2019-08-13
기준일	2019-08-12

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

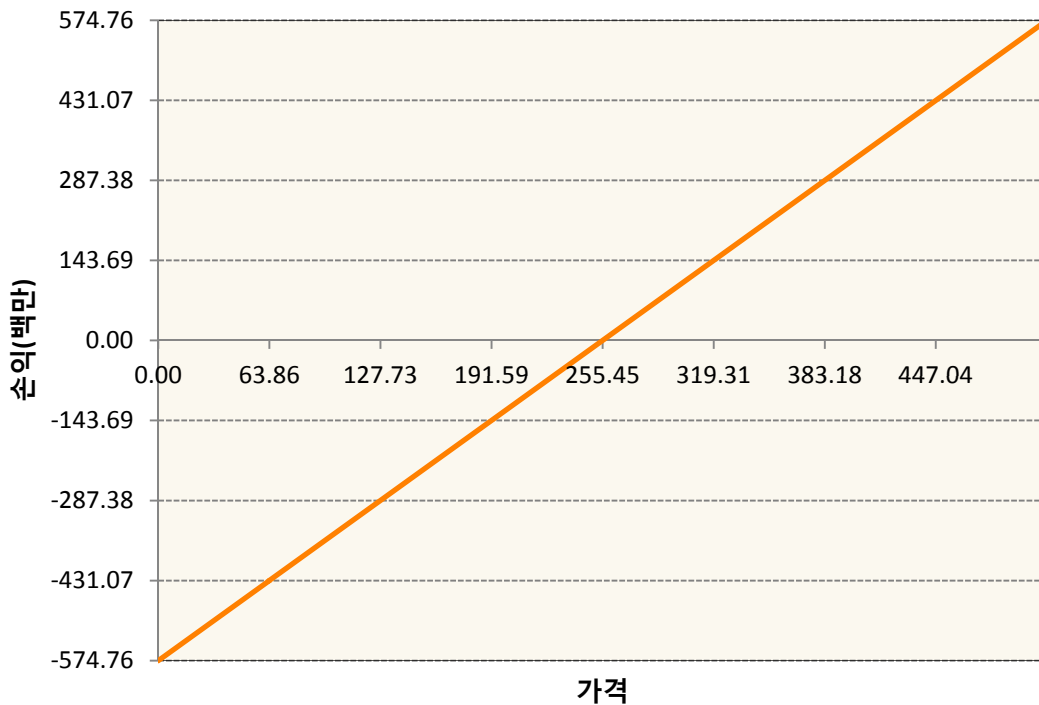
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	575	0	575	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	2019-08-13
기준일	2019-08-12

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

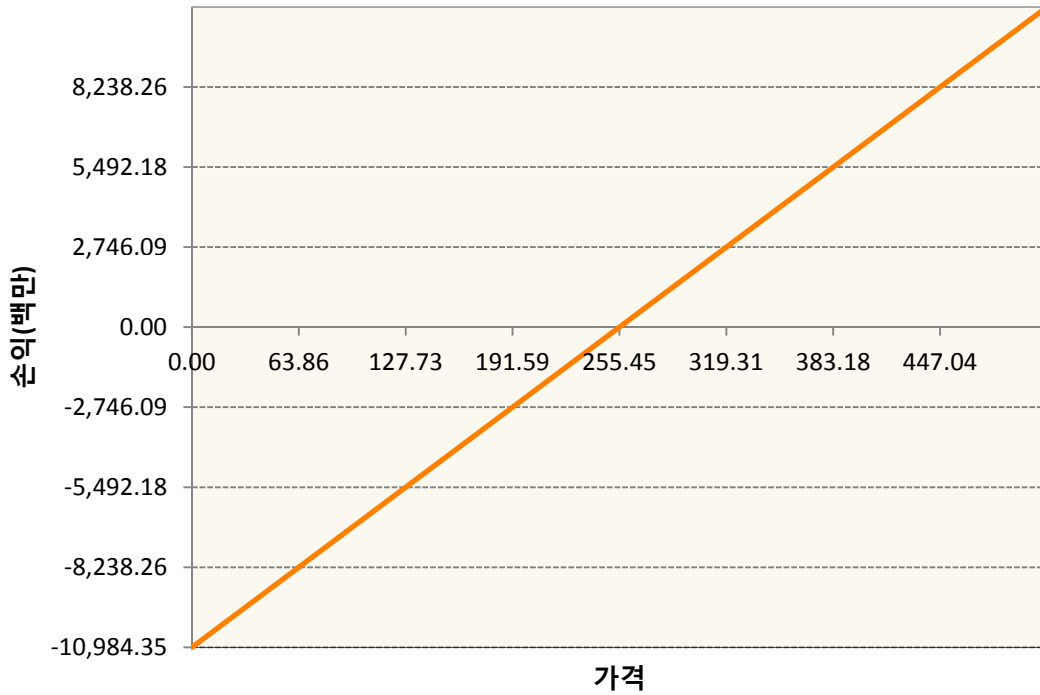
1. 계약금액

(단위:백만원)

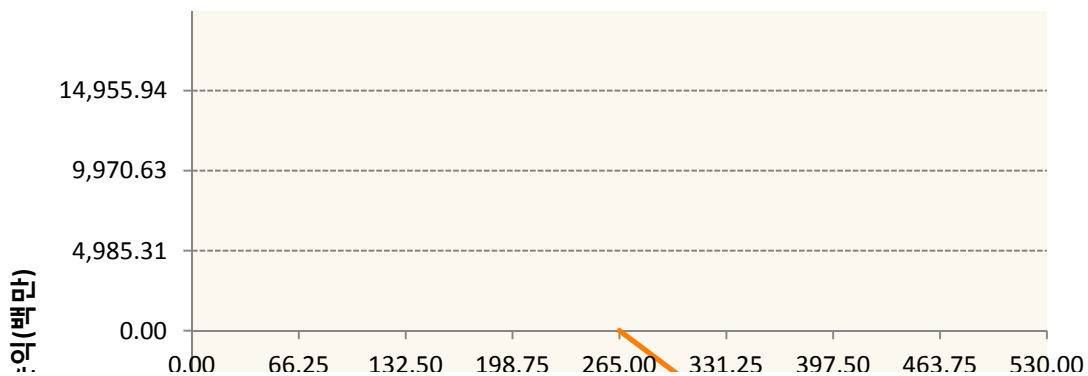
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,984	0	10,984	장내
누계	유가증권	옵션	3,659	20,075	-16,416	장내

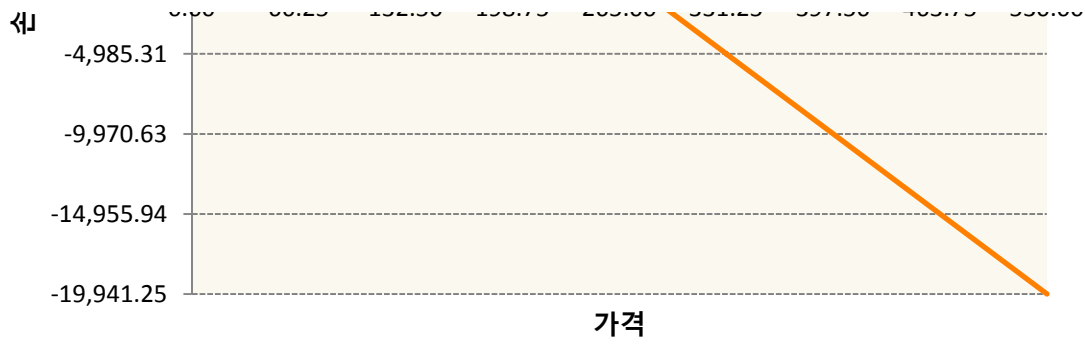
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

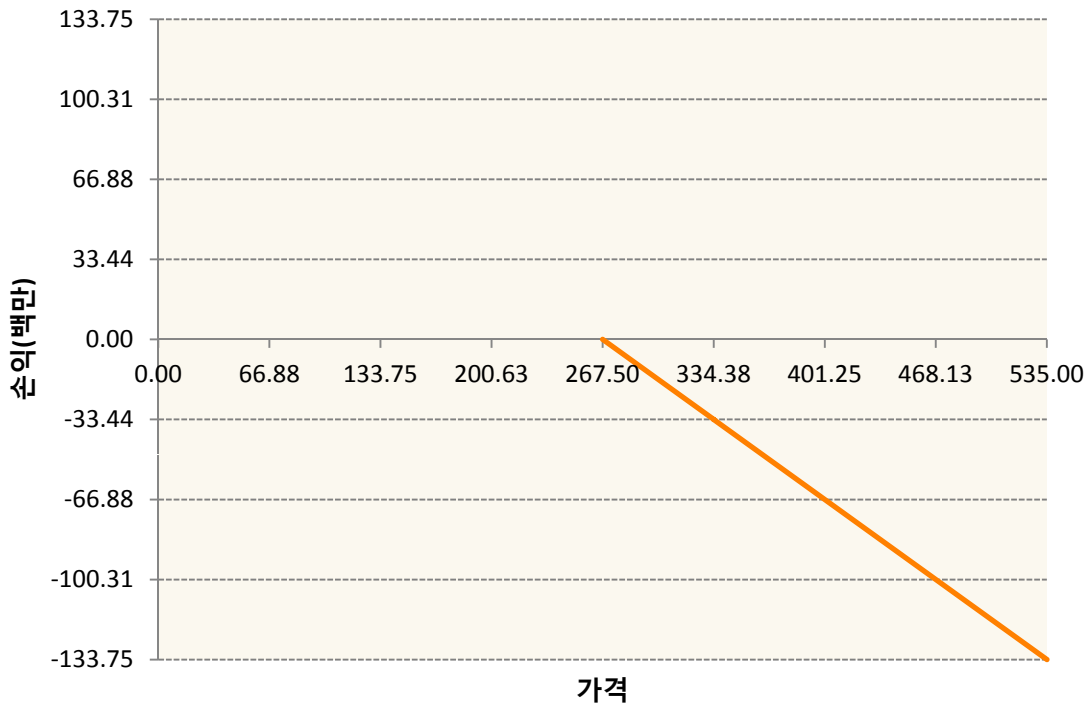


KR4201P92658-2019-09 콜265

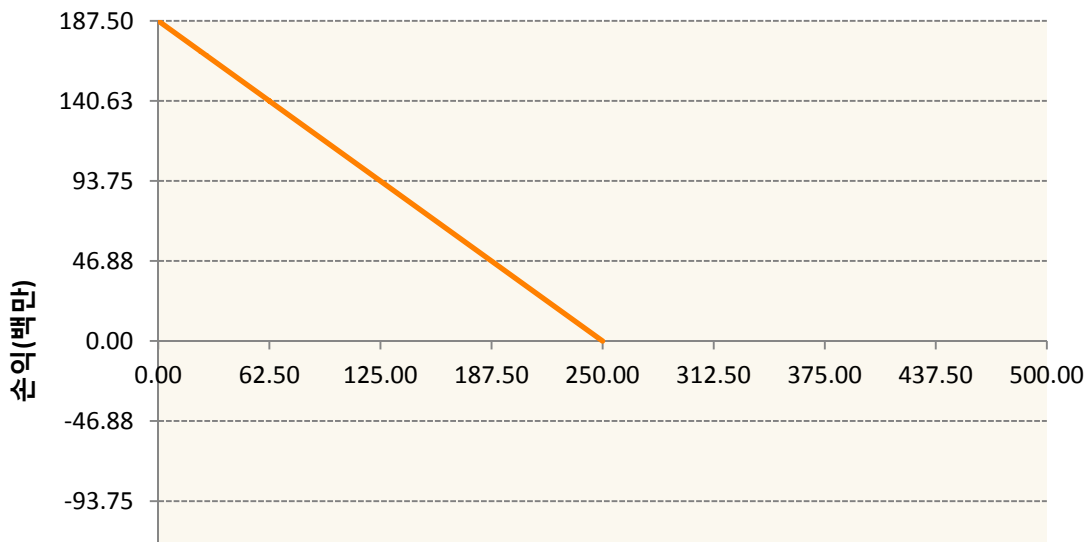


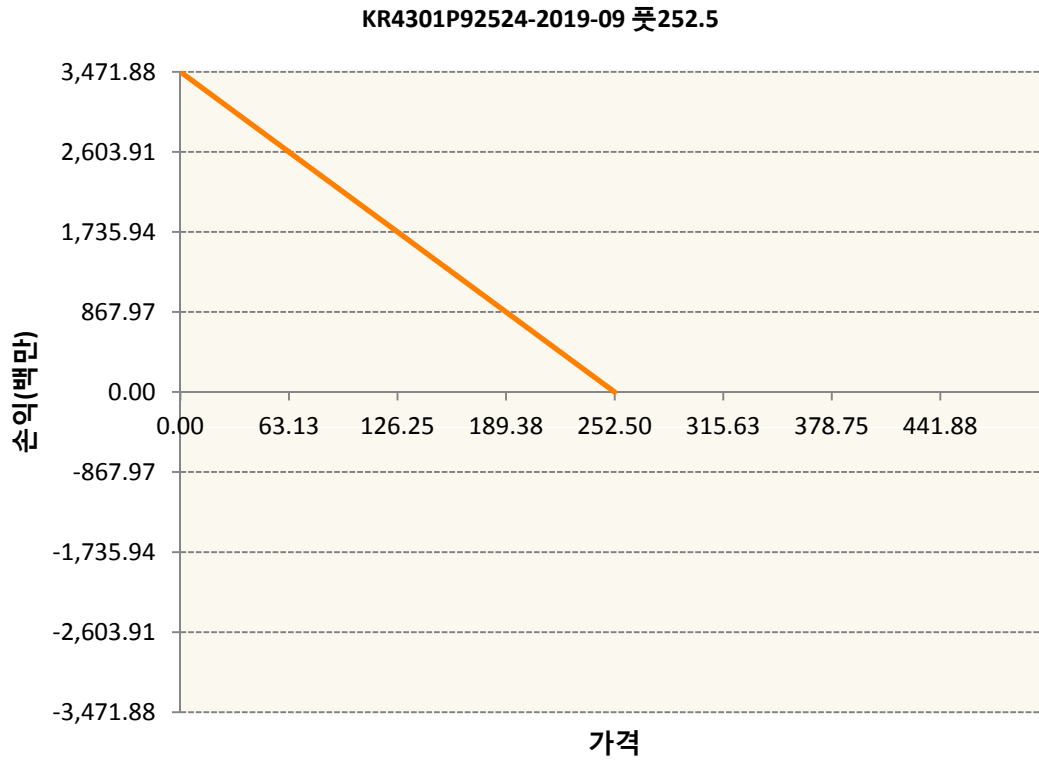
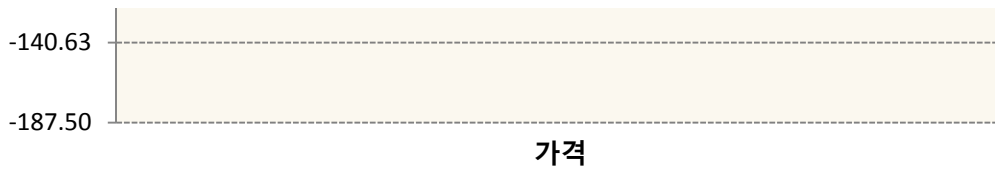


KR4201P92674-2019-09 콜267.5



KR4301P92508-2019-09 풋250





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						878
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-878	-878	-878	-878	-878	-878	-878	
-5.33%	-586	-586	-586	-586	-586	-586	-586	
-2.67%	-293	-293	-293	-293	-293	-293	-293	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	293	293	293	293	293	293	293	
5.33%	586	586	586	586	586	586	586	
8.00%	878	878	878	878	878	878	878	
KR4201P92658		2019-09 콜265						917
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	244	240	234	226	216	203	188	
-5.33%	233	222	209	192	173	152	128	
-2.67%	197	175	150	123	93	62	29	

0%	110	75	38	0	-39	-79	-120
2.67%	-56	-101	-146	-191	-236	-281	-326
5.33%	-321	-366	-411	-456	-502	-547	-593
8.00%	-680	-716	-754	-794	-834	-875	-917

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	0	-1
2.67%	0	-1	-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	5	6	6	6	6
-2.67%	1	2	2	2	2	3	3
0%	-1	0	0	0	0	1	1
2.67%	-2	-1	-1	-1	-1	-1	-1
5.33%	-2	-2	-2	-2	-1	-1	-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%	200	201	202	203	204	206	208
-5.33%	111	113	116	119	122	125	128
-2.67%	35	40	44	49	53	58	63
0%	-15	-10	-5	0	5	10	15
2.67%	-37	-34	-31	-27	-24	-20	-16
5.33%	-44	-43	-41	-40	-37	-35	-32
8.00%	-45	-45	-44	-44	-43	-42	-40

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

(단위:백만원)

1,649

공시일	2019-08-13
기준일	2019-08-12

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	59,977	0	59,977	

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	2019-08-13
기준일	2019-08-12

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	72,563	0	72,563	

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	2019-08-13
기준일	2019-08-12

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	463,378	0	463,378	
누계	통화	선도	0	457,413	-457,413	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		1,751
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,141
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		136
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		584
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		3,113
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		3,405
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		486
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		973
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		3,026
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		1,693
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		778
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,946
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,946
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		292
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		97
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		720
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		720
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		292
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		681
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		2,724
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		1,362
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		195

FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E

292
3,211
2,179

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

(단위:백만원)

12,010

공시일	2019-08-13
기준일	2019-08-12

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

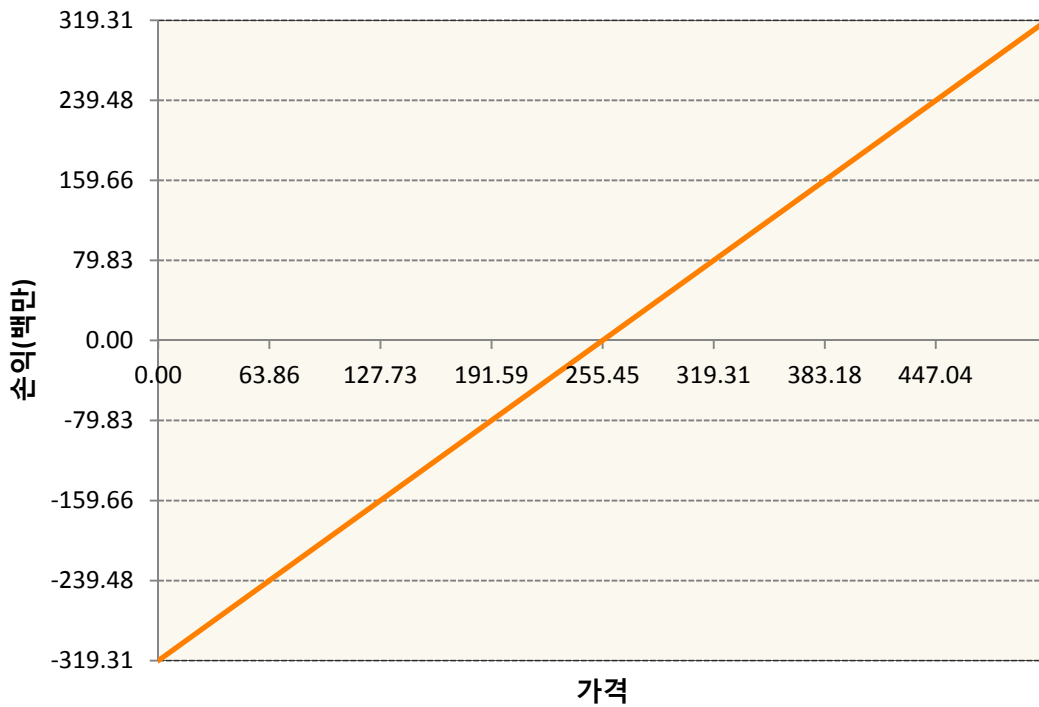
1. 계약금액

(단위:백만원)

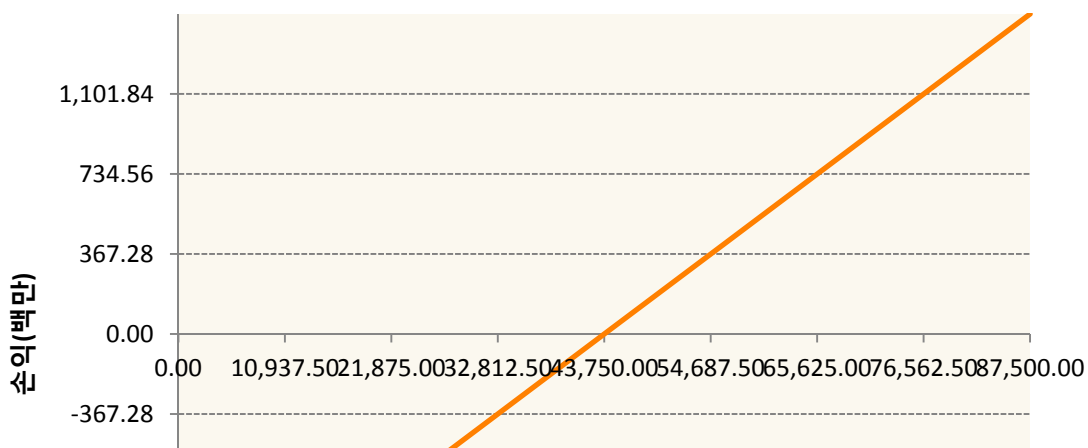
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,788	0	1,788	장내

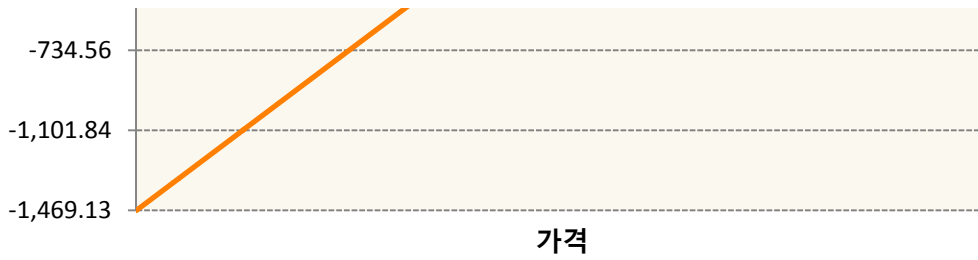
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P90000-2019-09 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%	-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	
KR4111P90000		2019-09 삼성전자개별선물						117
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117	
-5.33%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78	
-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%	78	78	78	78	78	78	78	
8.00%	117	117	117	117	117	117	117	

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

169

공시일	2019-08-13
기준일	2019-08-12

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

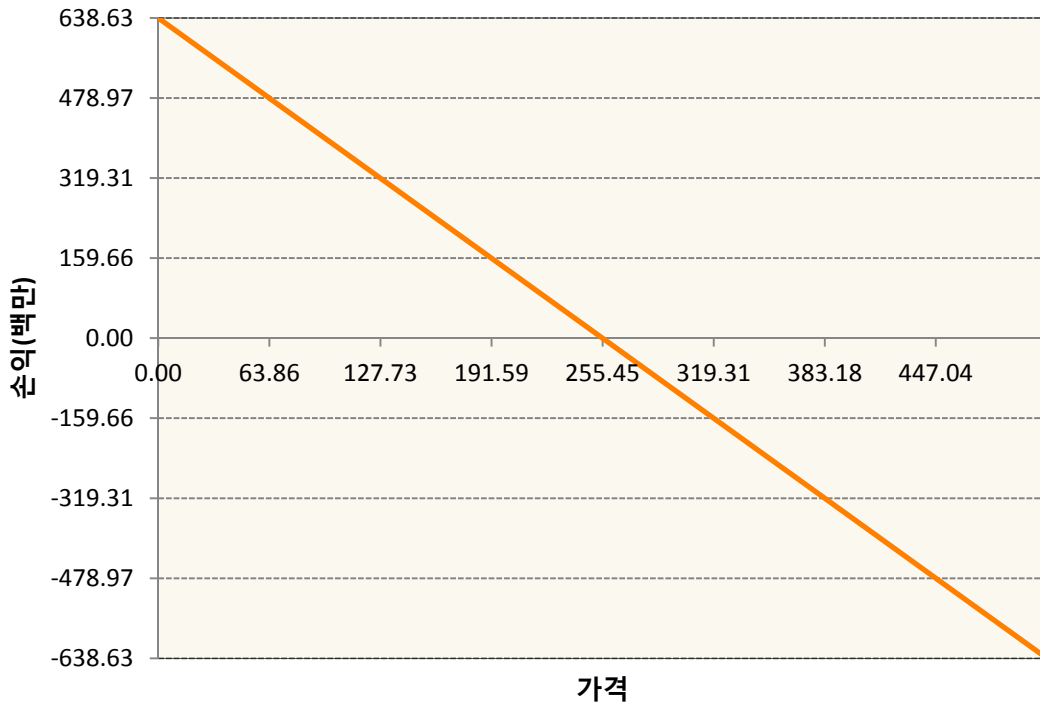
1. 계약금액

(단위:백만원)

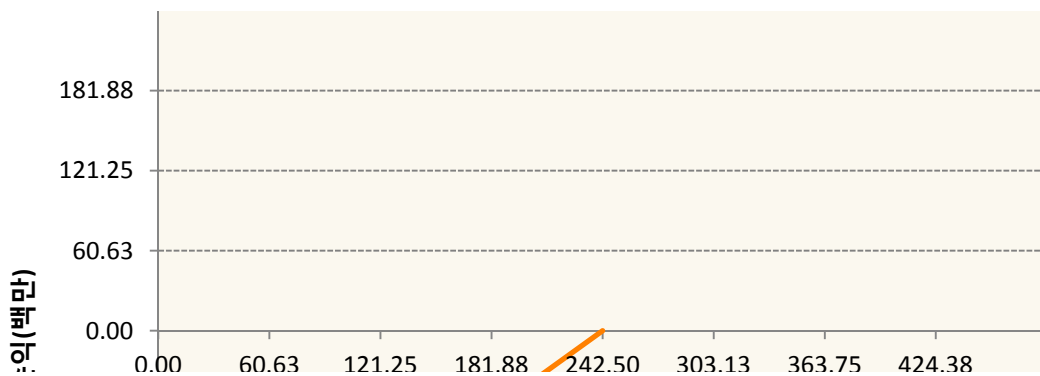
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	639	-639	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,489	-3,489	장내

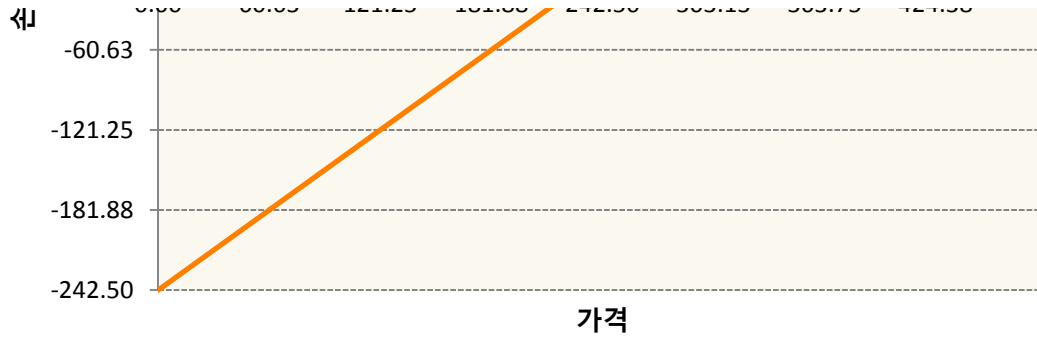
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

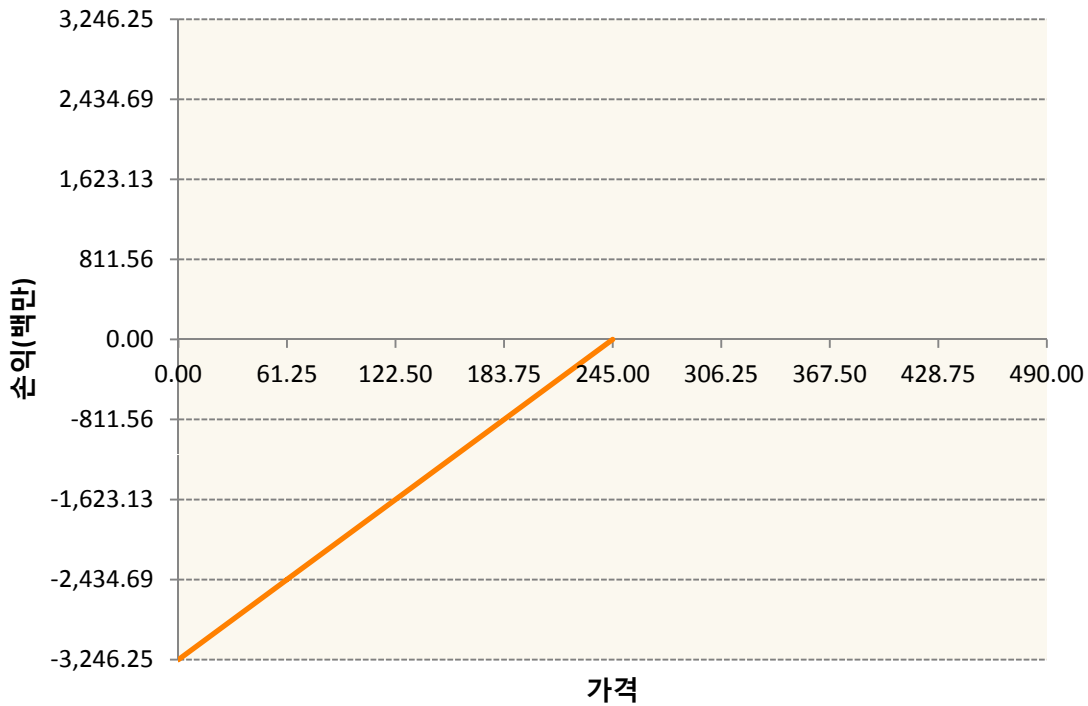


KR4301P92425-2019-09 풋242.5





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						9
기초자산의 변동성								

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

KR4301P92458

2019-09 풋245

144

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-127	-130	-132	-135	-138	-141	-144
-5.33%	-56	-60	-64	-69	-73	-78	-82
-2.67%	-11	-15	-19	-24	-29	-33	-38
0%	8	6	3	0	-3	-7	-10
2.67%	13	13	11	10	8	6	4
5.33%	14	14	14	13	13	12	11
8.00%	14	14	14	14	14	14	13

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

(단위:백만원)

165

공시일	2019-08-13
기준일	2019-08-12

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	19,212	0	19,212	
누계	통화	선도	0	19,338	-19,338	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		331
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		165
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		486
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		525
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		39

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

(단위:백만원)

508

공시일	2019-08-13
기준일	2019-08-12

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	388	0	388	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	2019-08-13
기준일	2019-08-12

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

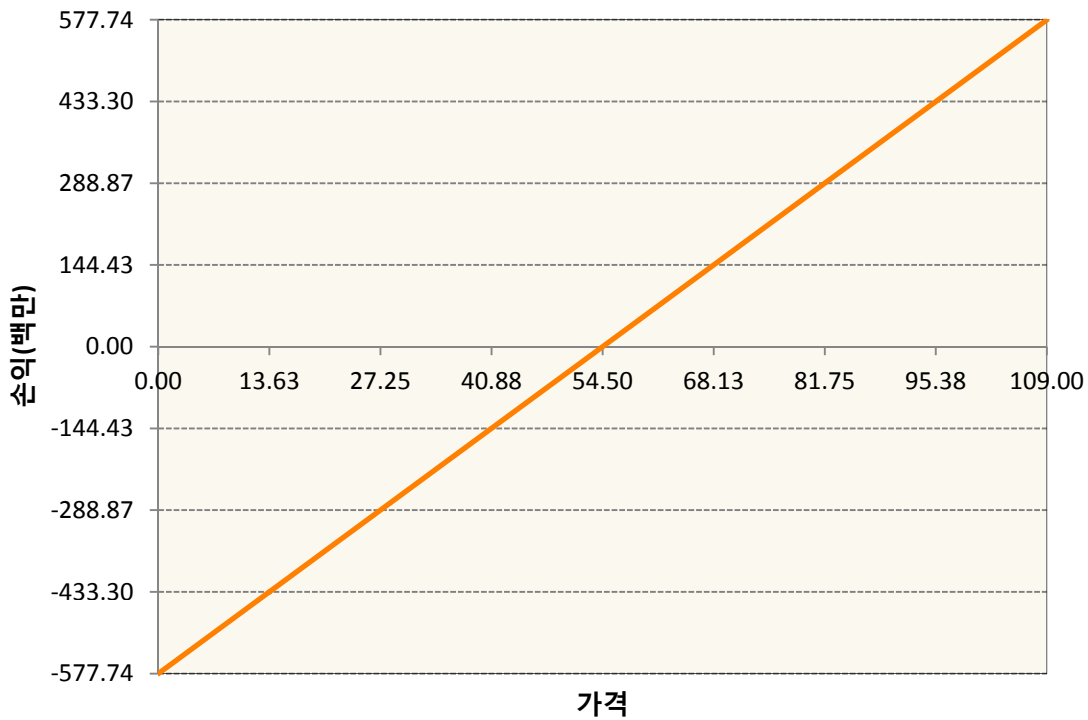
1. 계약금액

(단위:백만원)

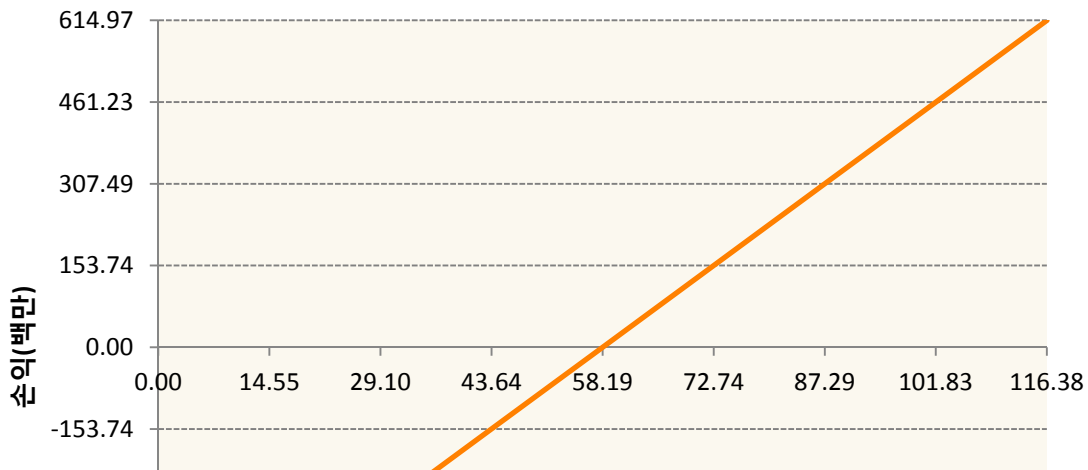
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,317	122	2,195	

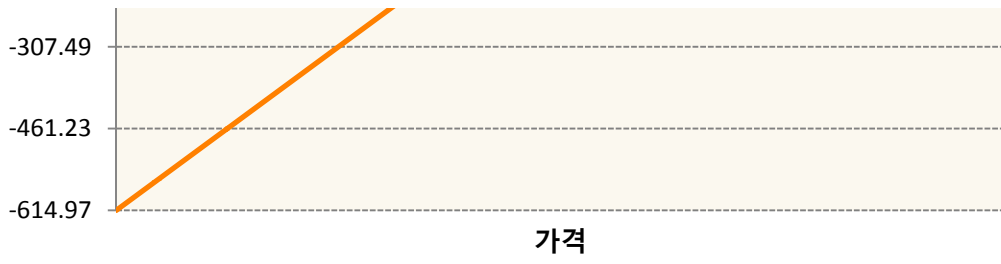
2. 만기시점의 손익구조

CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19

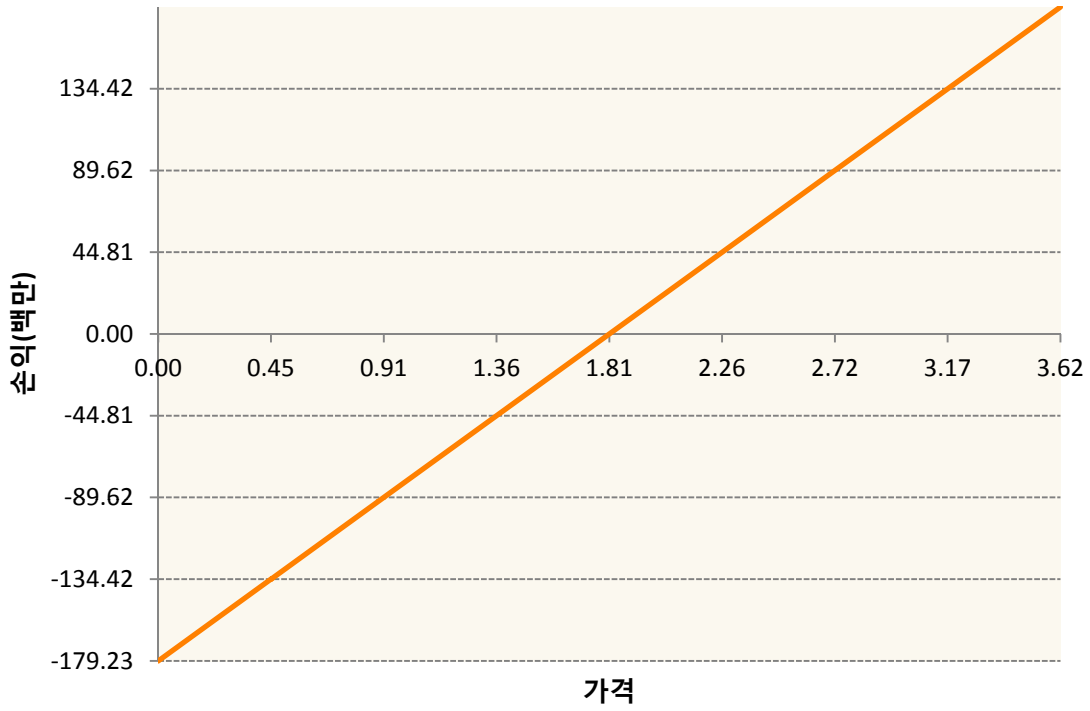


COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19

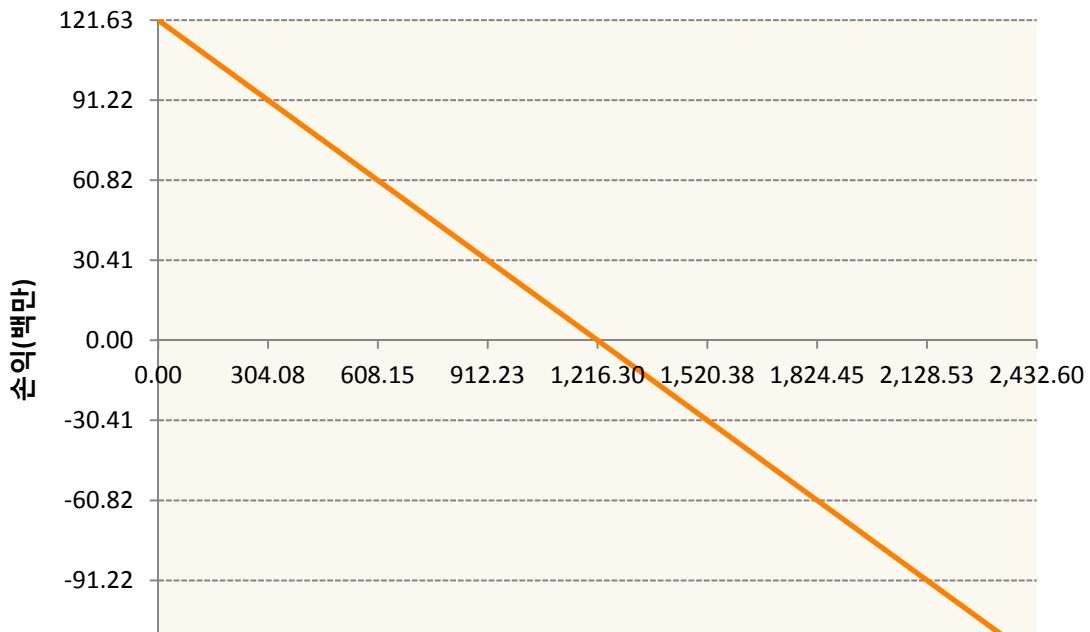


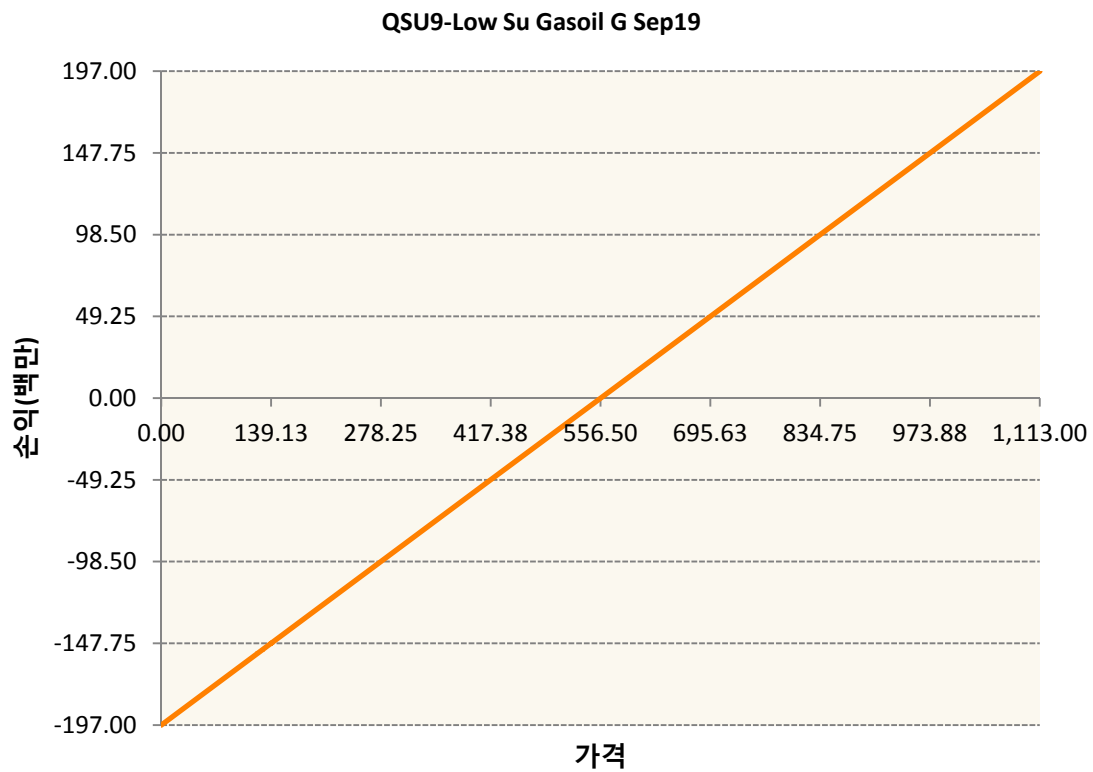
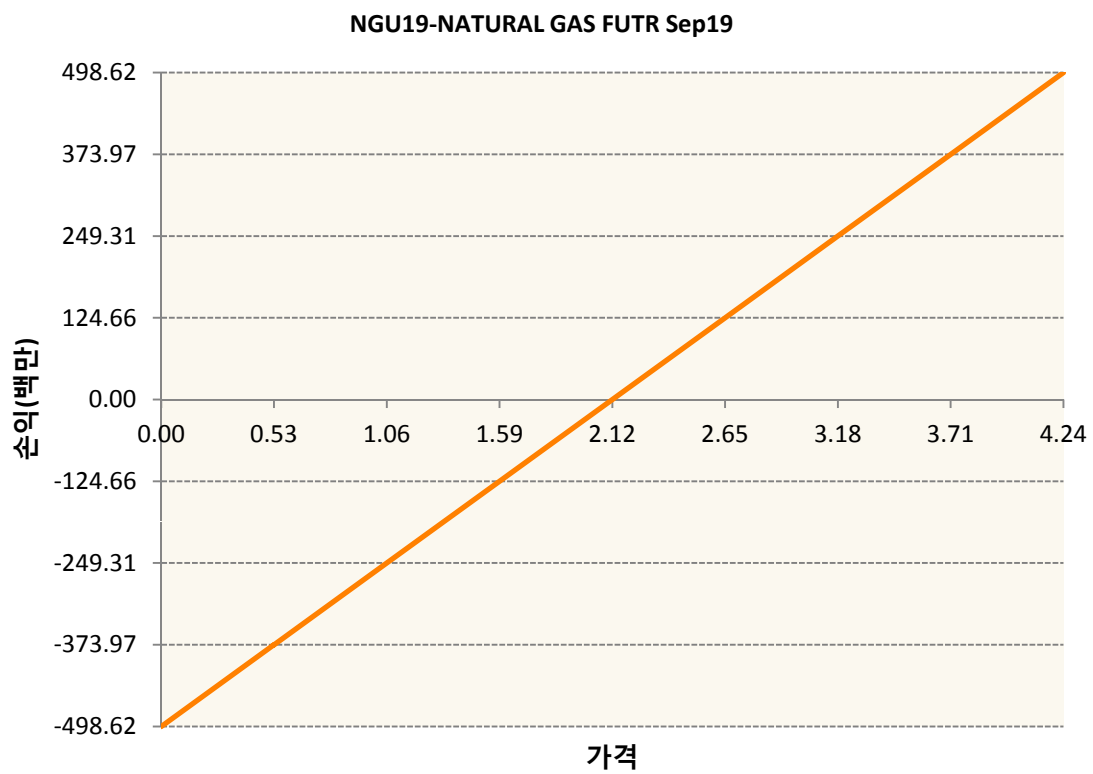
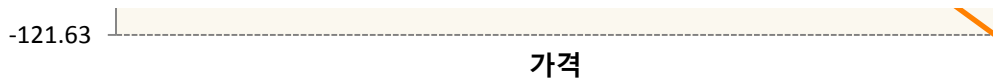


HOU9-NY Harb ULSD Fut Sep19

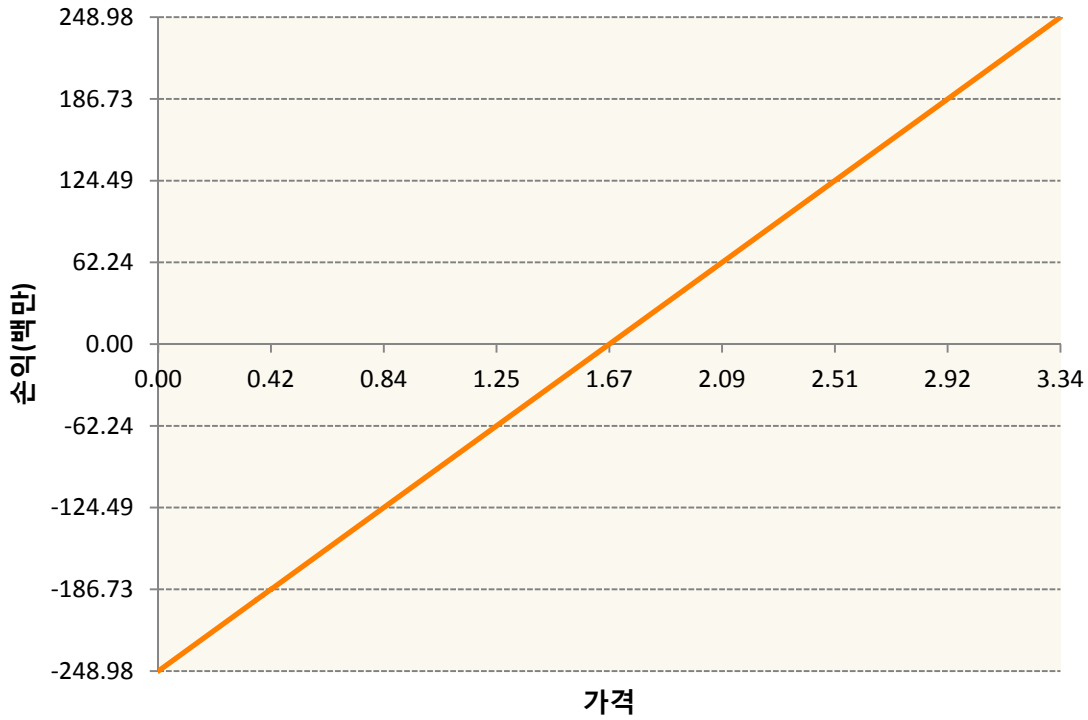


KR4175P80006-2019-08 달러선물





XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	46
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	49
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	14
KR4175P800	2019-08 달러선물	10
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	40
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	16
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	20

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

352

공시일	2019-08-13
기준일	2019-08-12

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

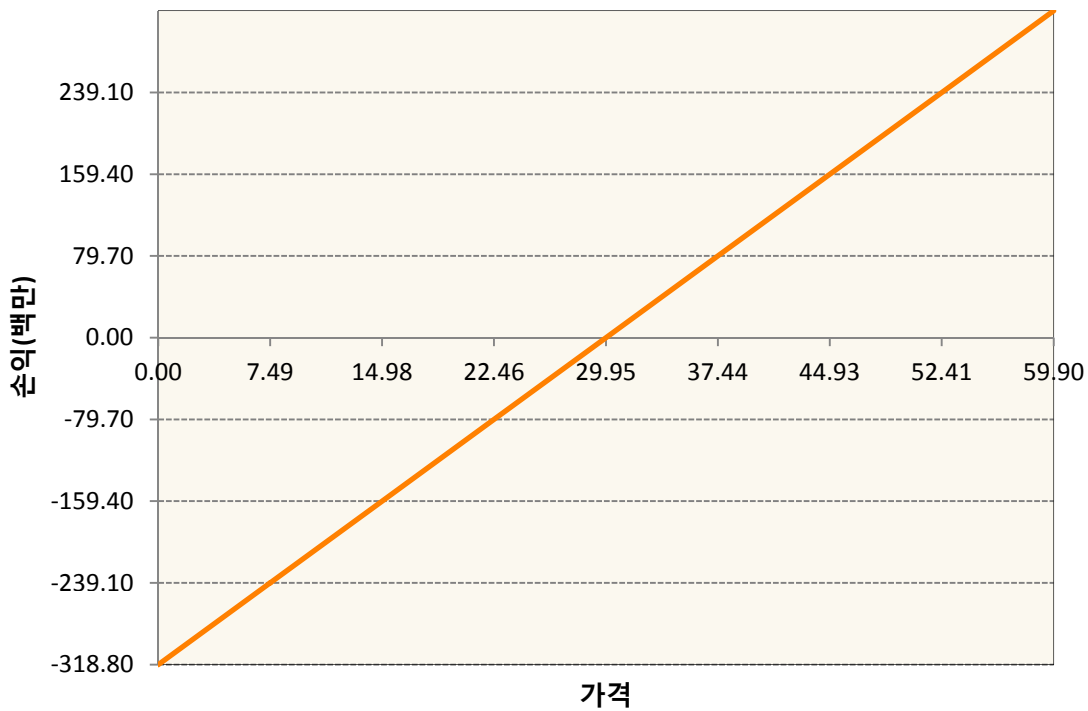
1. 계약금액

(단위:백만원)

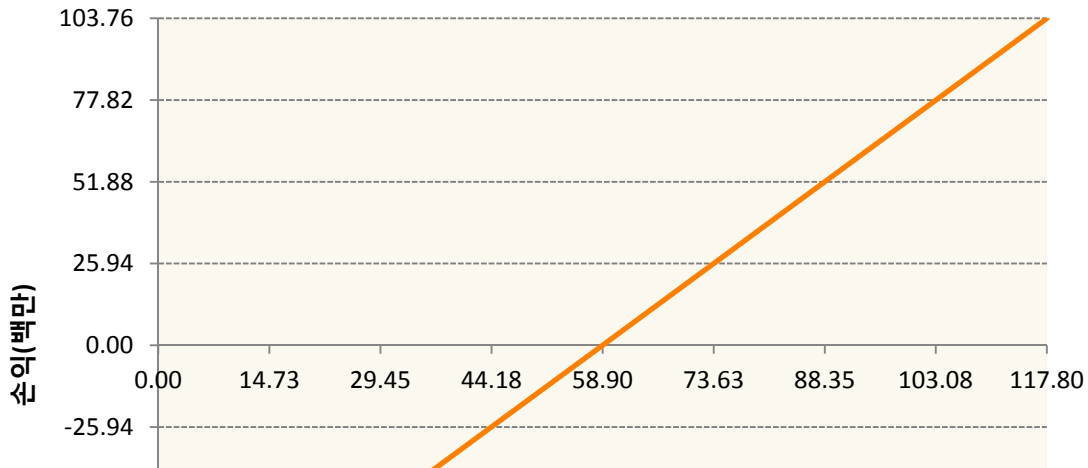
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,816	207	2,609	

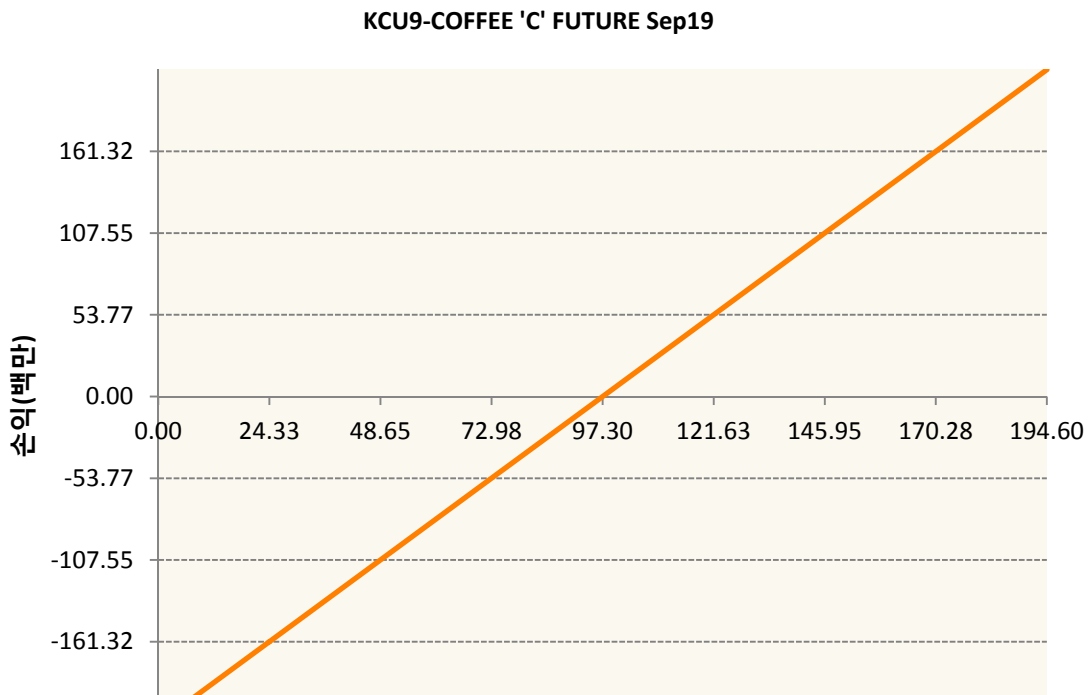
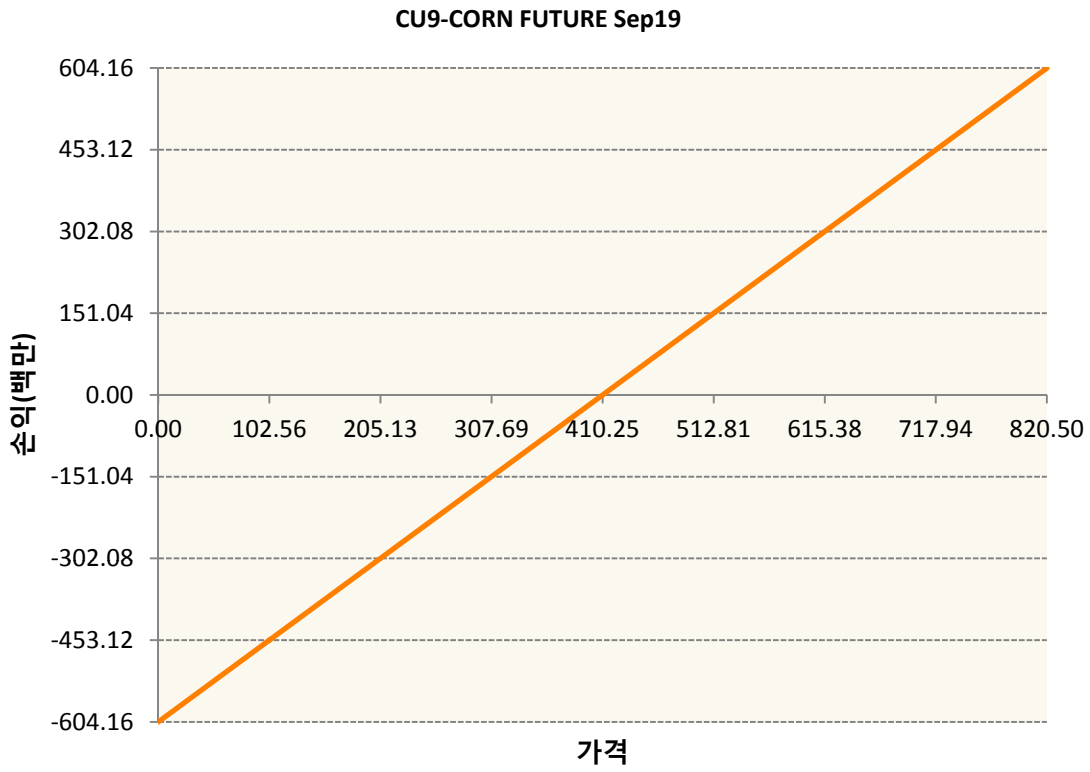
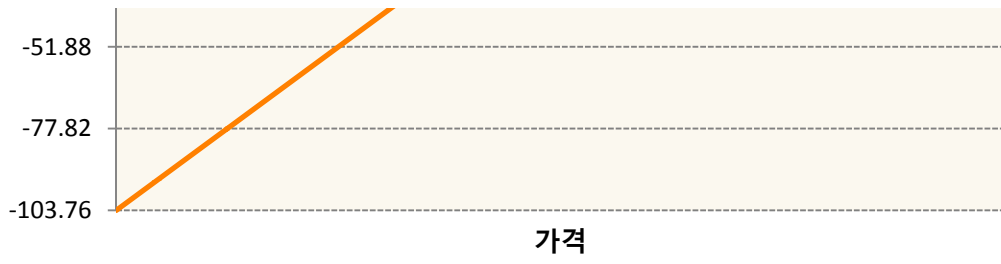
2. 만기시점의 손익구조

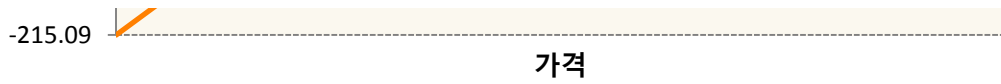
BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19



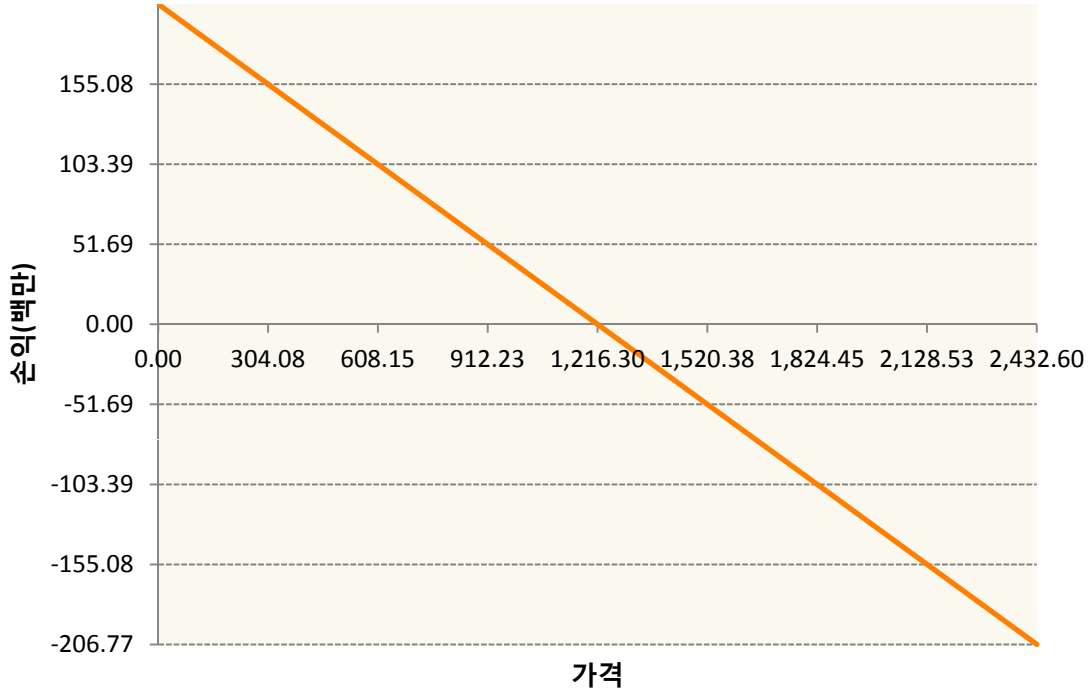
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



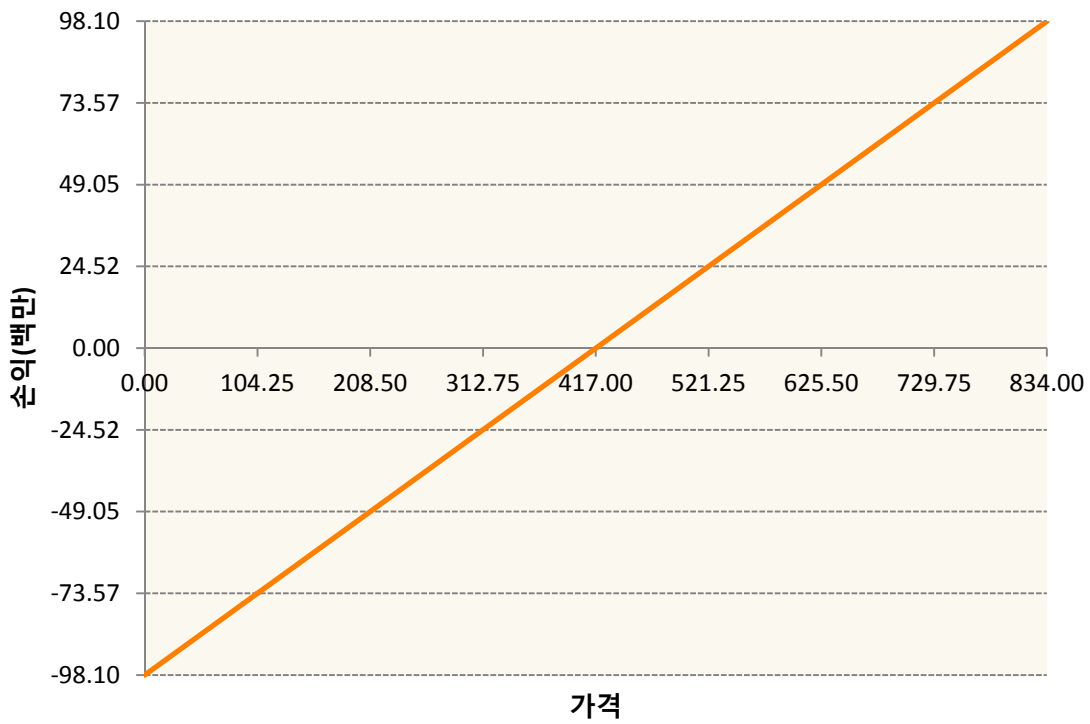




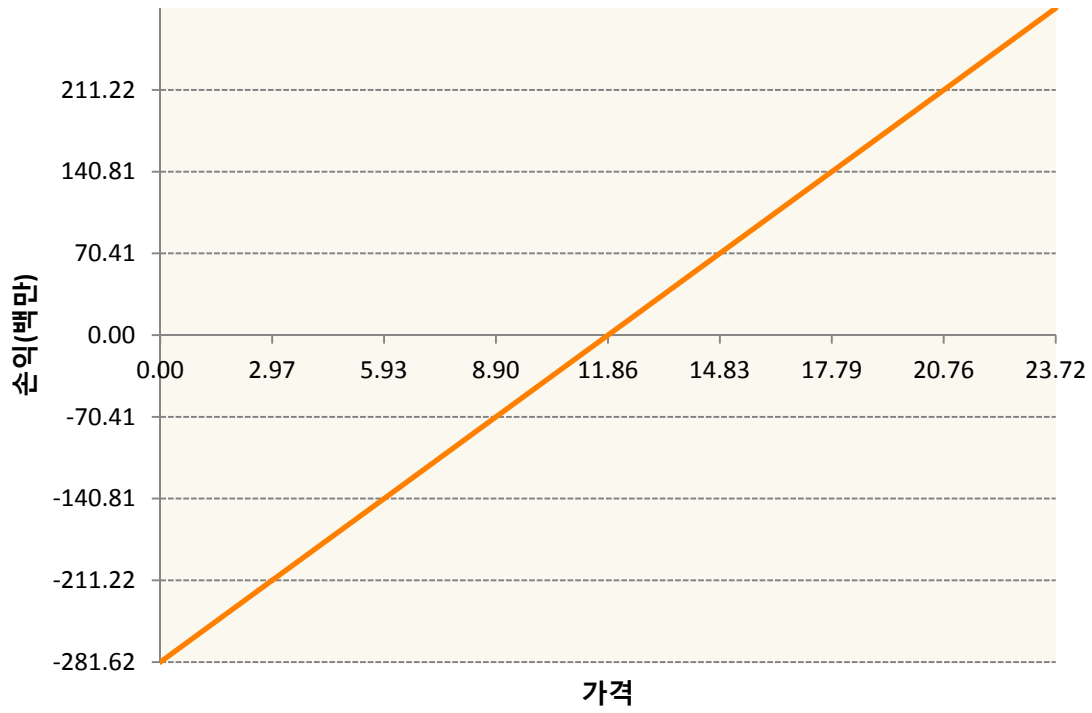
KR4175P80006-2019-08 달러선물



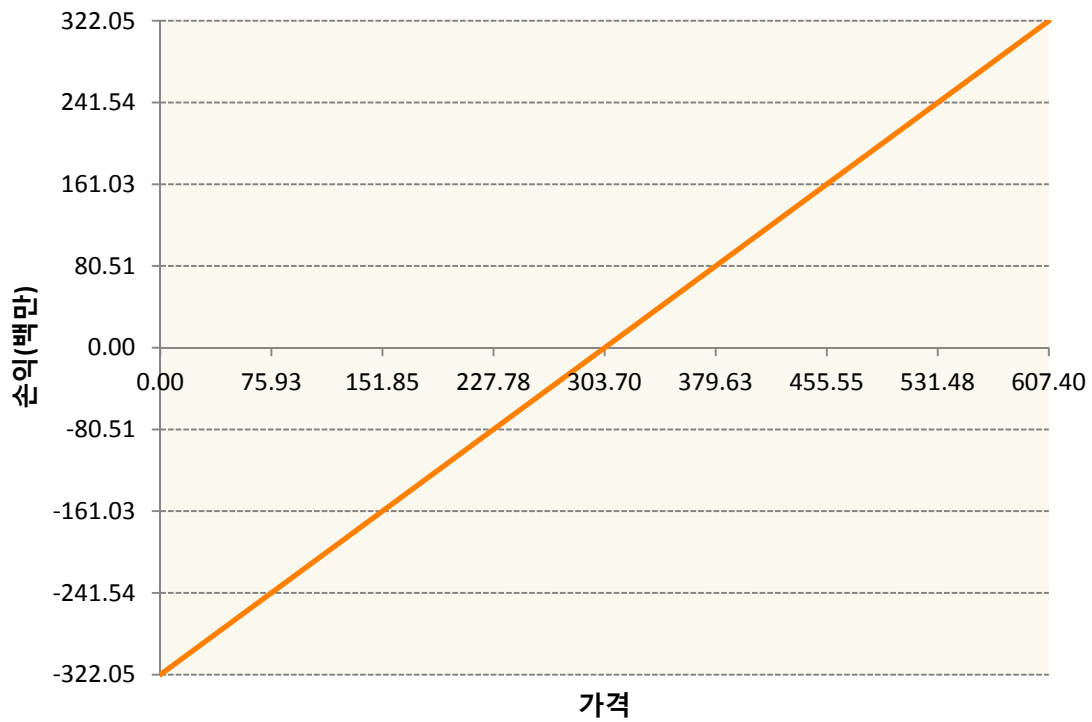
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

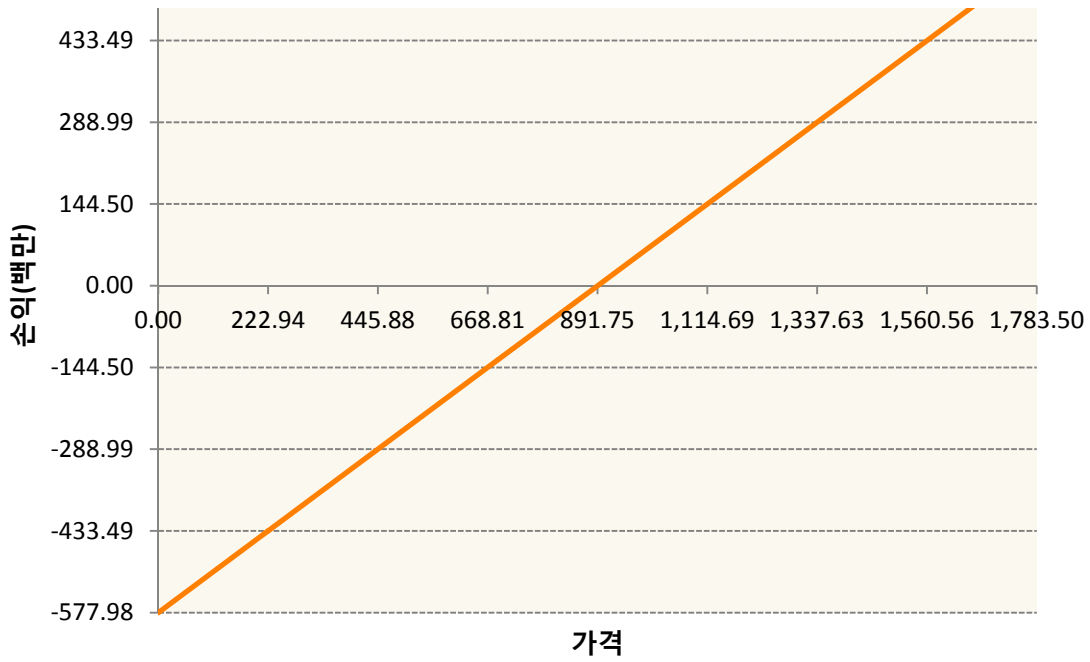


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

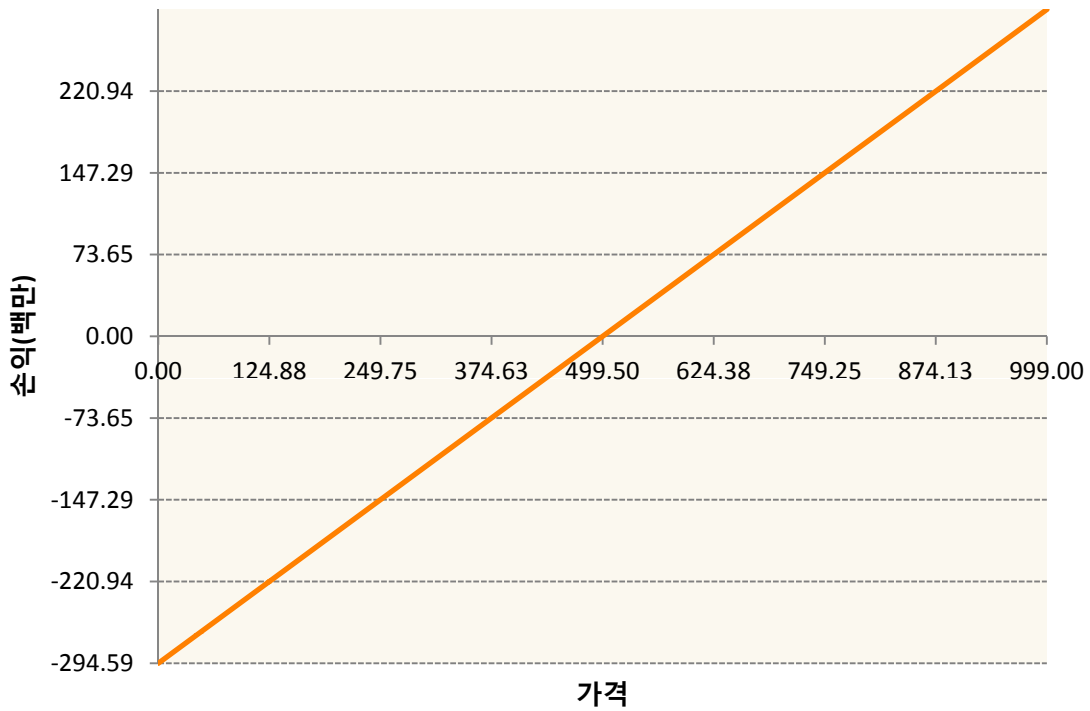


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





WU9-WHEAT FUTURE(CBT) Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	26
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	8
CU9	CORN FUTURE Sep19	48
KCU9	COFFEE 'C' FUTURE Sep19	17
KR4175P800	2019-08 달러선물	17

KWU9	KC HRW WHEAT FUT Sep19	8
SBV9	SUGAR #11 (WORLD) Oct19	23
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)

249