

공시일	2019-08-16
기준일	2019-08-14

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	2019-08-16
기준일	2019-08-14

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)

646

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-16
기준일	2019-08-14

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)	360
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	131

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

786

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-16
기준일	2019-08-14

유로인덱스모(주식-파생형)

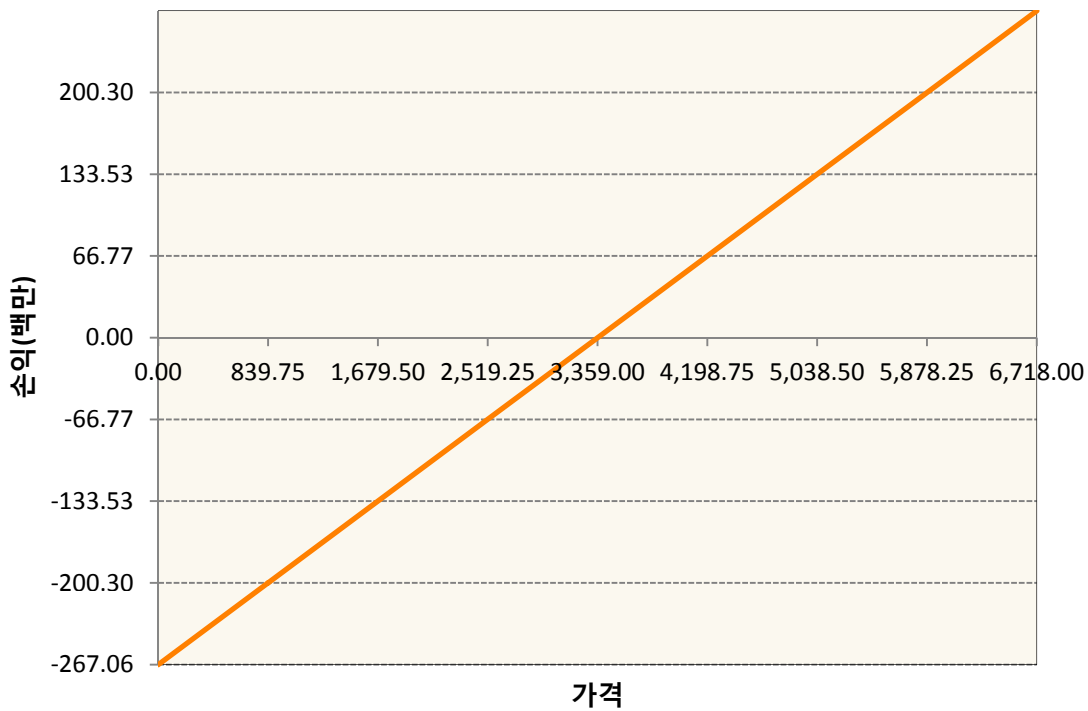
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	267	0	267	

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	2019-08-16
기준일	2019-08-14

차이나인덱스모(주식-파생형)

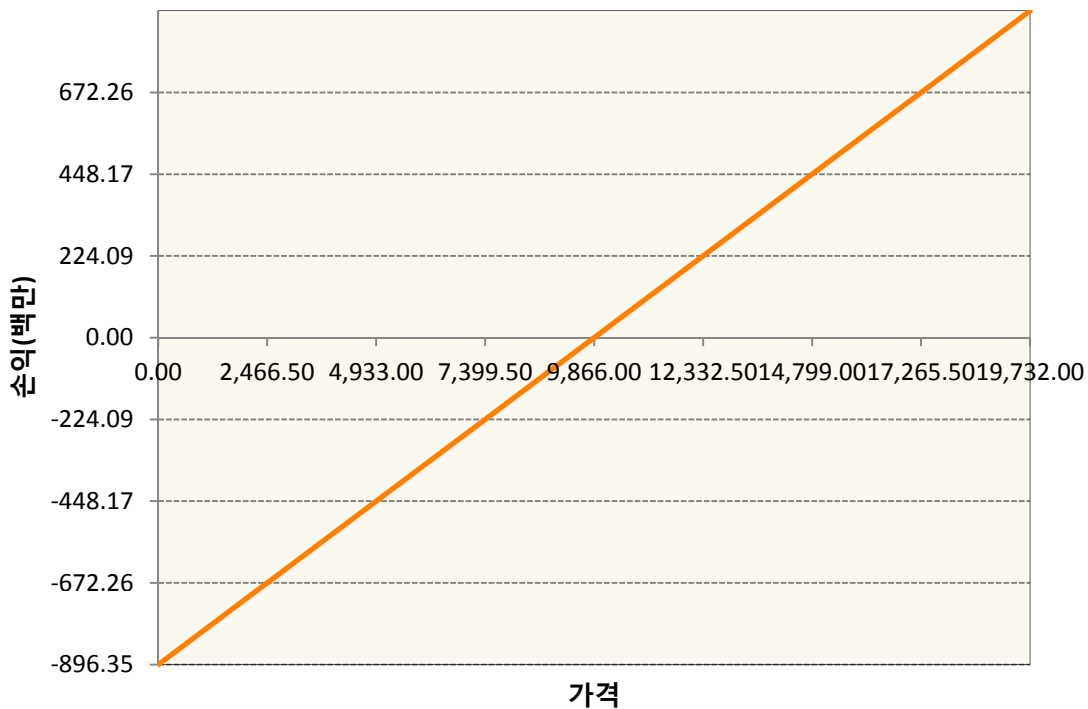
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	896	0	896	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCQ9	HSCEI Futures Aug19	72
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

68

공시일	2019-08-16
기준일	2019-08-14

커버드콜모(주식혼합-파생형)

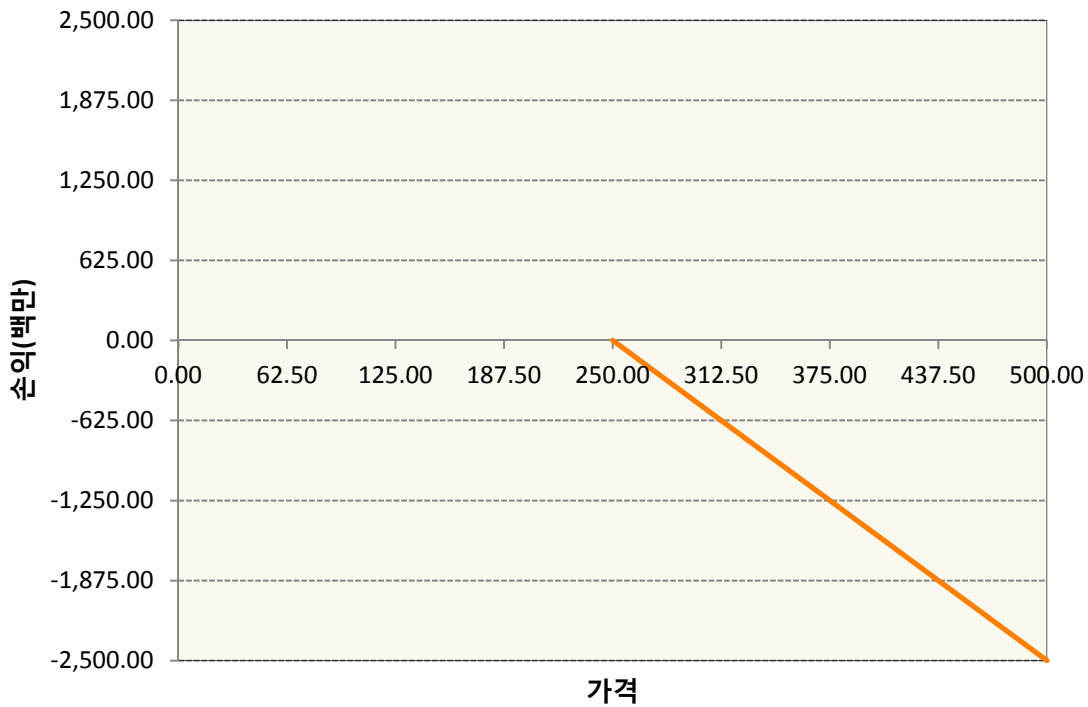
1. 계약금액

(단위:백만원)

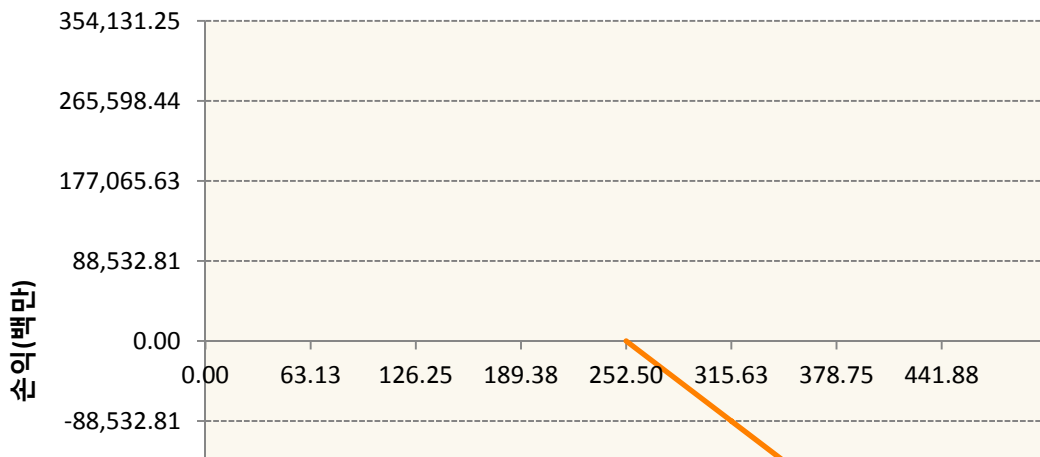
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	523,725	-523,725	장내

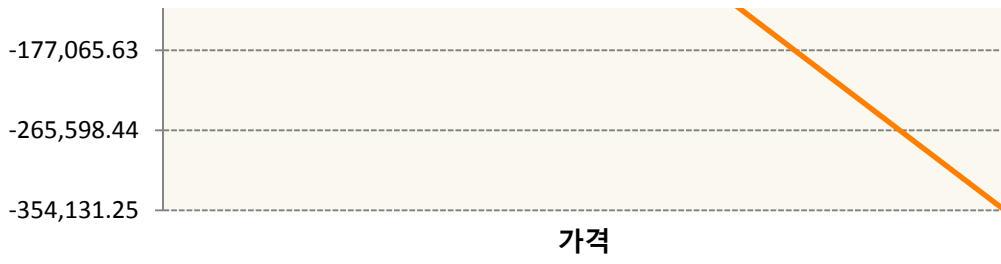
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P92500-2019-09 콜250

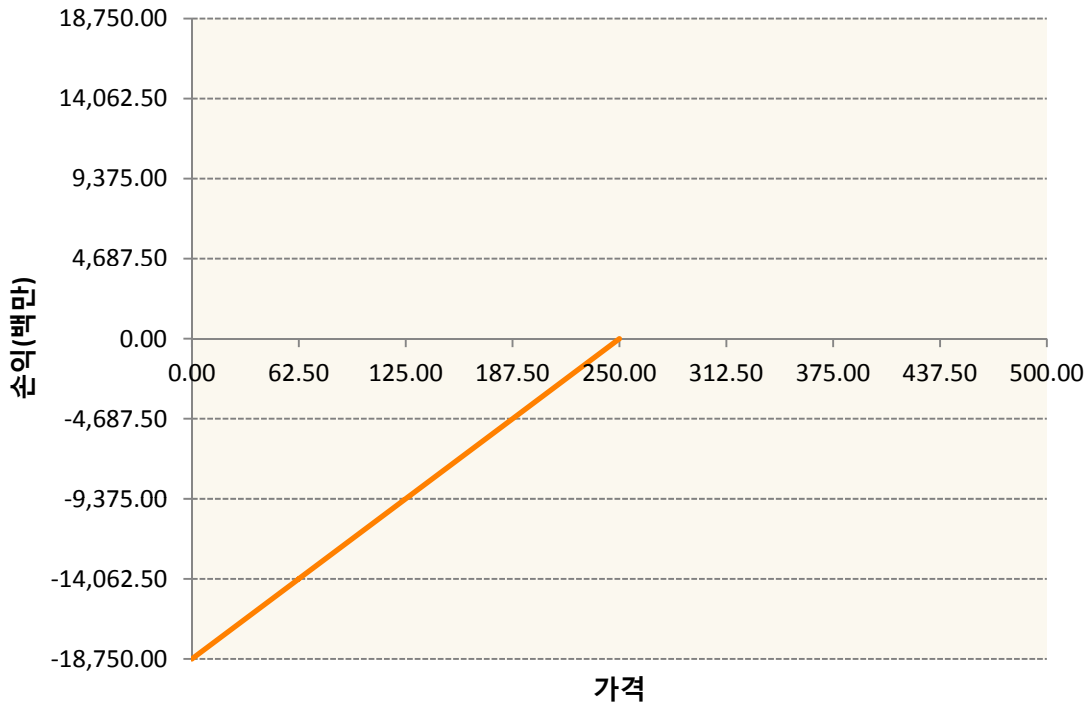


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

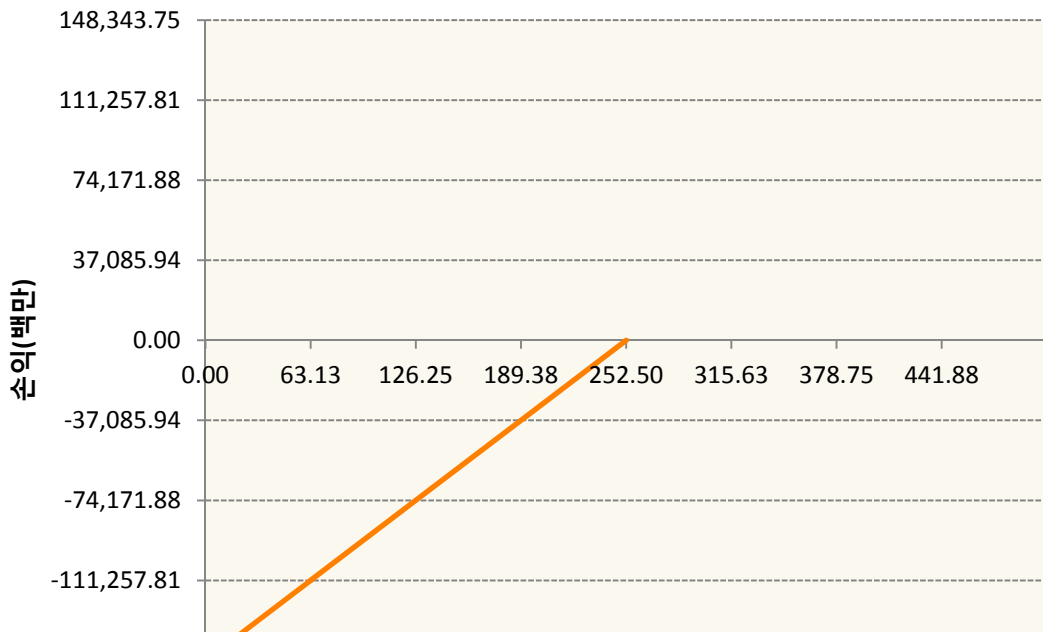




KR4301P92508-2019-09 풋250



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%	87	85	82	79	75	71	67	
-5.33%	76	72	67	63	58	53	48	
-2.67%	53	48	42	37	31	26	20	
0%	16	11	5	0	-5	-11	-16	
2.67%	-34	-38	-42	-47	-52	-56	-61	
5.33%	-93	-96	-99	-102	-105	-109	-113	
8.00%	-158	-159	-161	-163	-165	-168	-171	
KR4201P92526 2019-09 콜252.5								22,923
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	10,532	10,253	9,918	9,535	9,109	8,646	8,152	
-5.33%	9,376	8,851	8,289	7,696	7,079	6,442	5,789	
-2.67%	6,815	6,081	5,338	4,590	3,836	3,079	2,318	
0%	2,353	1,570	786	0	-787	-1,574	-2,362	
2.67%	-4,043	-4,692	-5,367	-6,061	-6,772	-7,494	-8,227	
5.33%	-11,946	-12,373	-12,853	-13,378	-13,939	-14,530	-15,147	
8.00%	-20,767	-20,994	-21,281	-21,623	-22,015	-22,450	-22,923	
KR4301P92508 2019-09 풋250								1,054
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,005	-1,009	-1,015	-1,022	-1,032	-1,042	-1,054	
-5.33%	-530	-545	-561	-579	-598	-618	-639	
-2.67%	-150	-176	-202	-228	-255	-281	-307	
0%	72	49	25	0	-25	-50	-76	
2.67%	158	147	133	117	100	82	63	
5.33%	179	176	171	164	156	146	135	
8.00%	182	182	180	178	175	171	166	
KR4301P92524 2019-09 풋252.5								9,018
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-8,746	-8,764	-8,793	-8,833	-8,883	-8,946	-9,018	
-5.33%	-4,904	-4,986	-5,083	-5,194	-5,316	-5,447	-5,587	
-2.67%	-1,589	-1,771	-1,957	-2,147	-2,341	-2,536	-2,734	
0%	626	418	210	0	-210	-421	-632	
2.67%	1,641	1,511	1,369	1,216	1,054	886	712	

5.33%	1,939	1,892	1,830	1,754	1,664	1,562	1,449
8.00%	1,993	1,983	1,966	1,939	1,902	1,854	1,795

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

(단위:백만원)

33,006

공시일	2019-08-16
기준일	2019-08-14

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

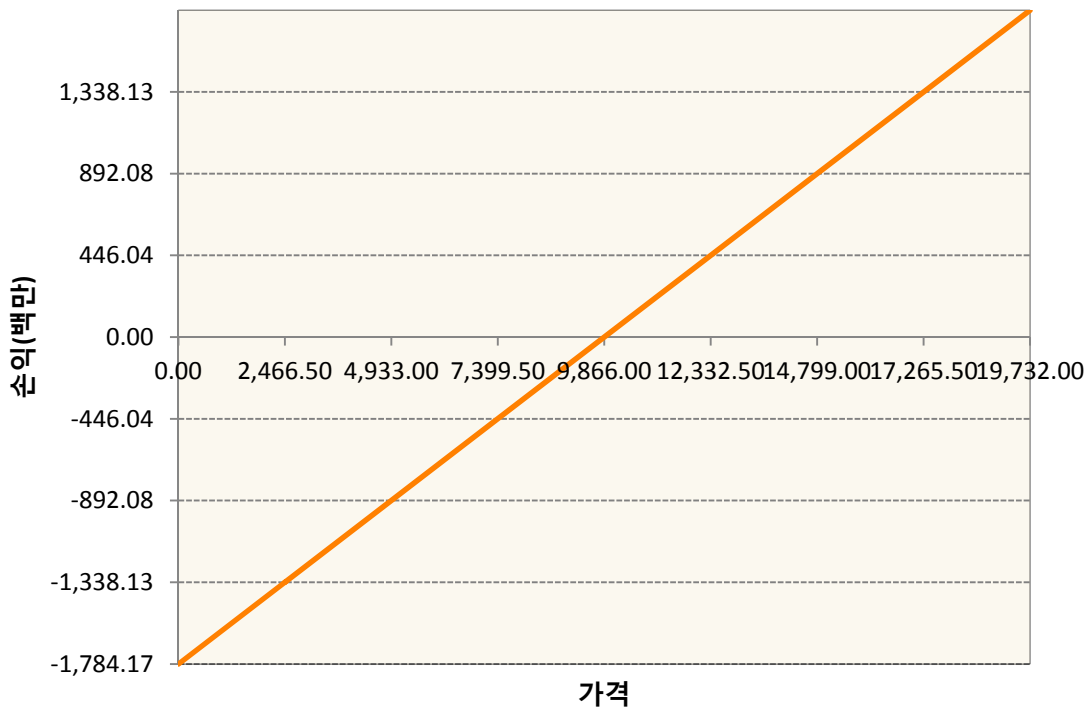
1. 계약금액

(단위:백만원)

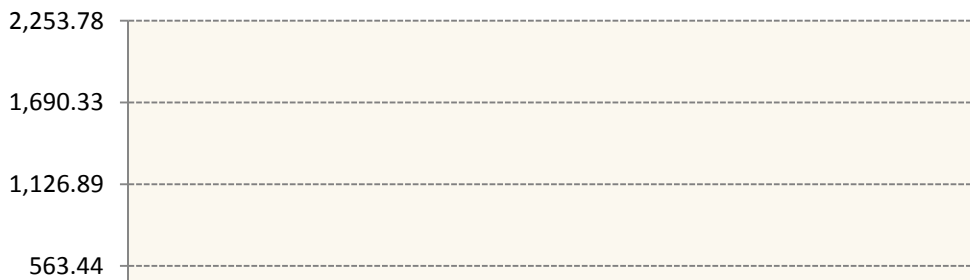
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,784	0	1,784	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,519	-5,519	장내
누계	통화	선도	459	3,246	-2,787	장외

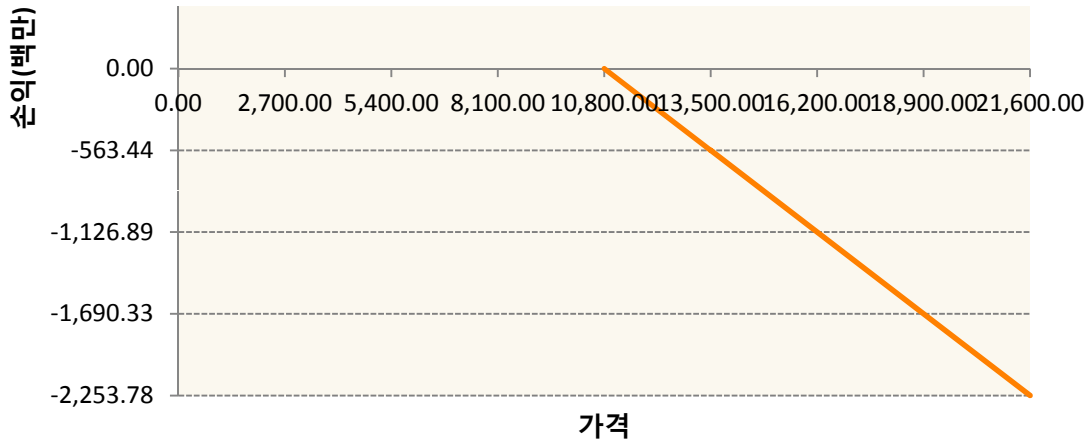
2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19

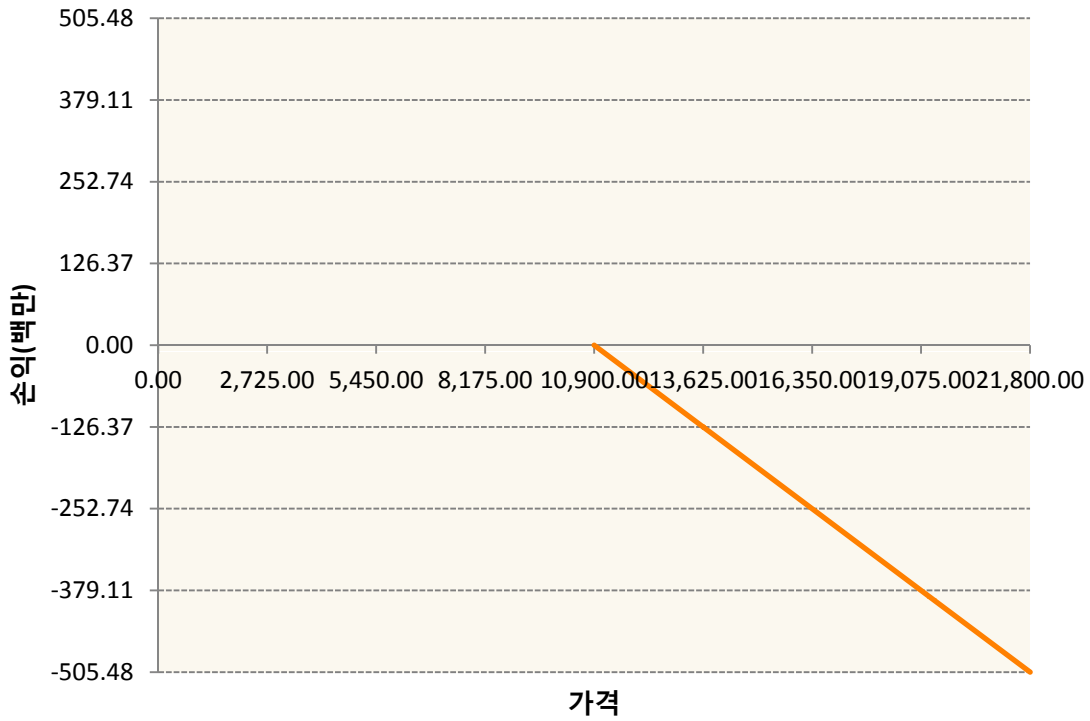


OHHIQ9-C108-HSCEI

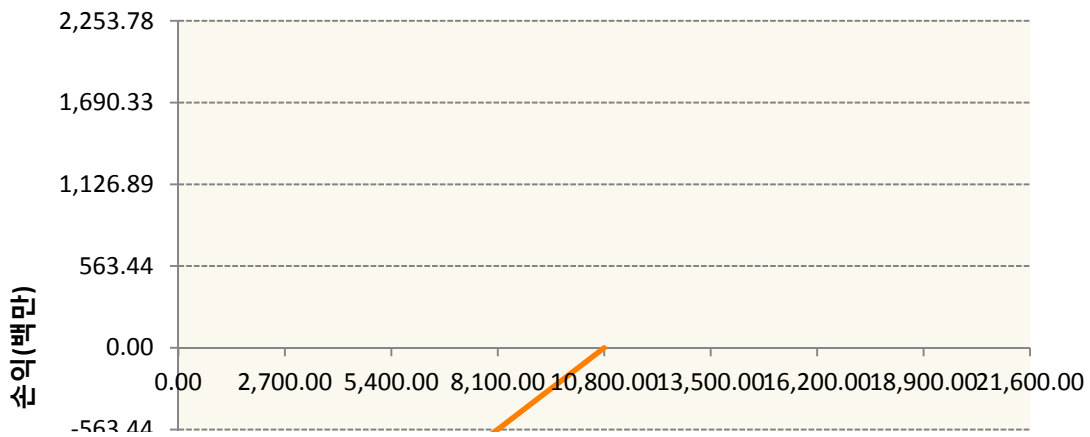


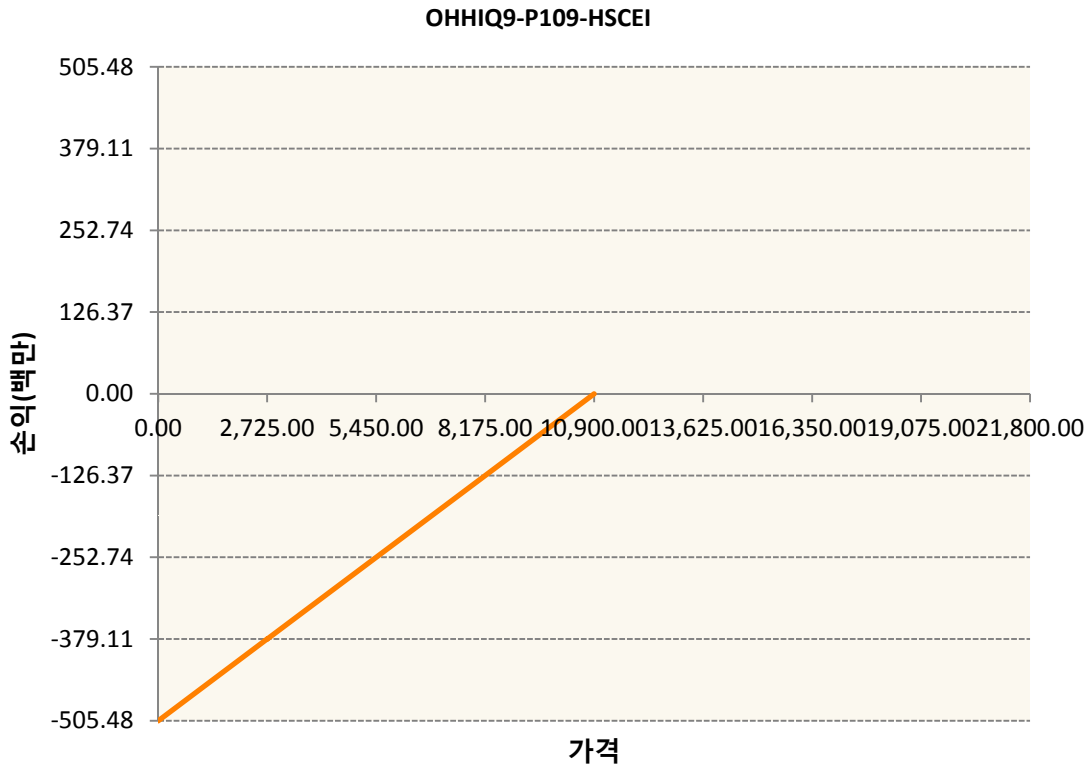


OHHIQ9-C109-HSCEI



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	143
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)
	651

공시일	2019-08-16
기준일	2019-08-14

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

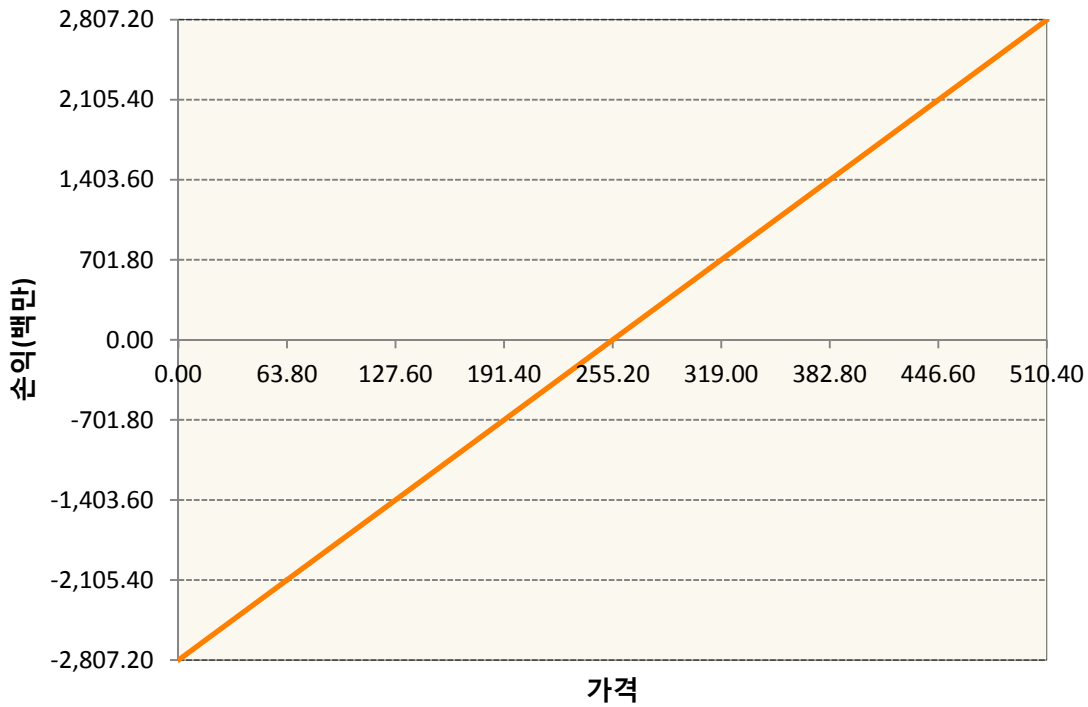
1. 계약금액

(단위:백만원)

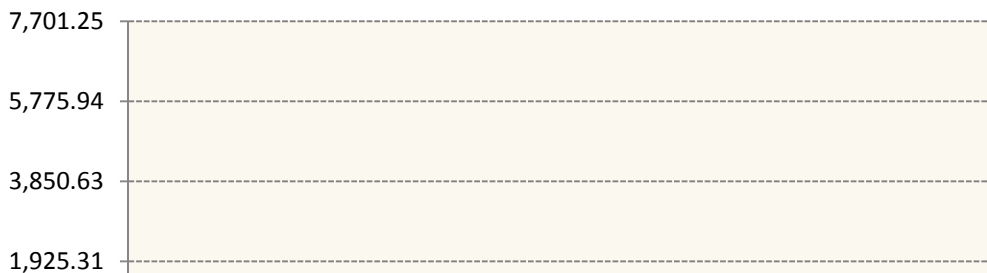
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	3,000	-3,000	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,807	0	2,807	장내
누계	유가증권	스왑	17,125	0	17,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,018	-15,018	장내

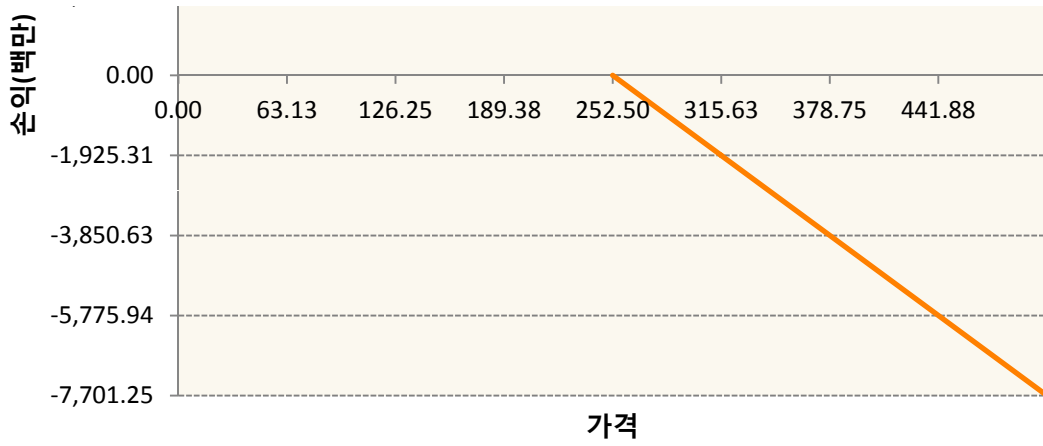
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

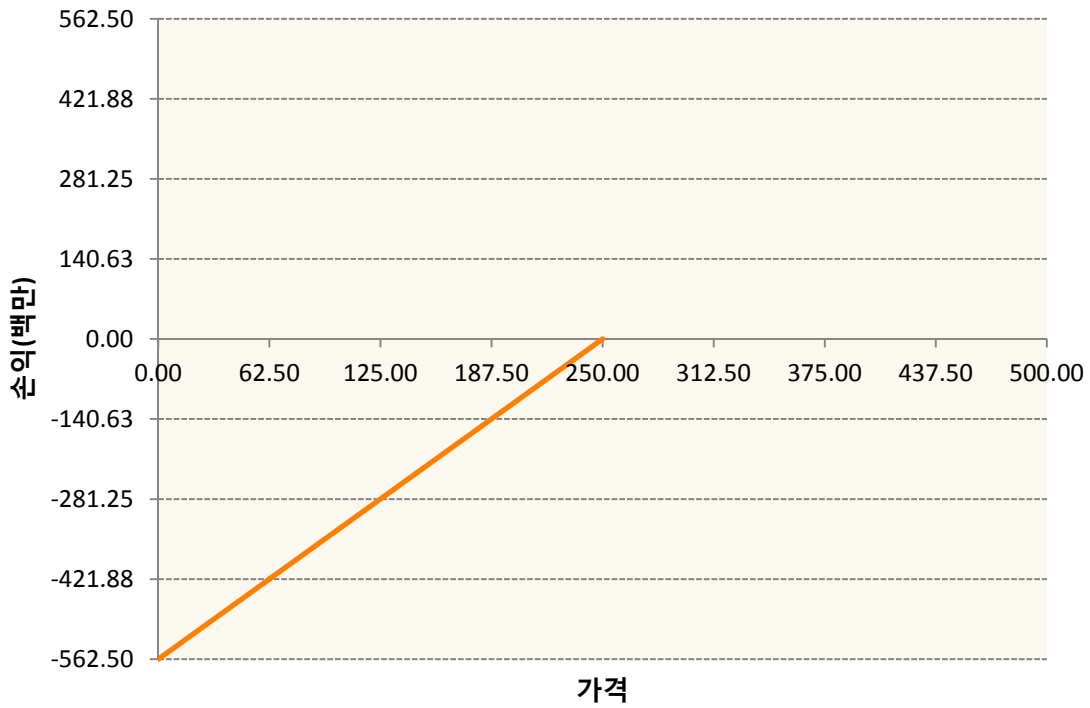


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

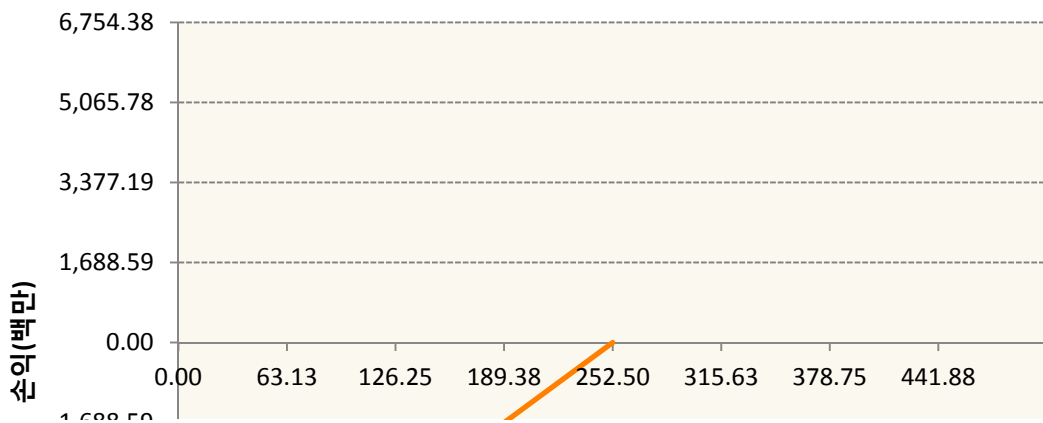




KR4301P92508-2019-09 풋250



KR4301P92524-2019-09 풋252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						1,484
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,484	-1,484	-1,484	-1,484	-1,484	-1,484	-1,484	
-5.33%	-990	-990	-990	-990	-990	-990	-990	
-2.67%	-495	-495	-495	-495	-495	-495	-495	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	495	495	495	495	495	495	495	
5.33%	990	990	990	990	990	990	990	
8.00%	1,484	1,484	1,484	1,484	1,484	1,484	1,484	
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						499
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	229	223	216	207	198	188	177	
-5.33%	204	192	180	167	154	140	126	
-2.67%	148	132	116	100	83	67	50	
0%	51	34	17	0	-17	-34	-51	
2.67%	-88	-102	-117	-132	-147	-163	-179	
5.33%	-260	-269	-280	-291	-303	-316	-329	
8.00%	-452	-457	-463	-470	-479	-488	-499	
KR4301P92508		2019-09 풋250						32
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-30	-30	-30	-31	-31	-31	-32
-5.33%	-16	-16	-17	-17	-18	-19	-19
-2.67%	-5	-5	-6	-7	-8	-8	-9
0%	2	1	1	0	-1	-2	-2
2.67%	5	4	4	4	3	2	2
5.33%	5	5	5	5	5	4	4
8.00%	5	5	5	5	5	5	5
KR4301P92524 2019-09 풋252.5							411
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-398	-399	-400	-402	-404	-407	-411
-5.33%	-223	-227	-231	-236	-242	-248	-254
-2.67%	-72	-81	-89	-98	-107	-115	-124
0%	29	19	10	0	-10	-19	-29
2.67%	75	69	62	55	48	40	32
5.33%	88	86	83	80	76	71	66
8.00%	91	90	89	88	87	84	82

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

(단위:백만원)

2,618

공시일	2019-08-16
기준일	2019-08-14

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

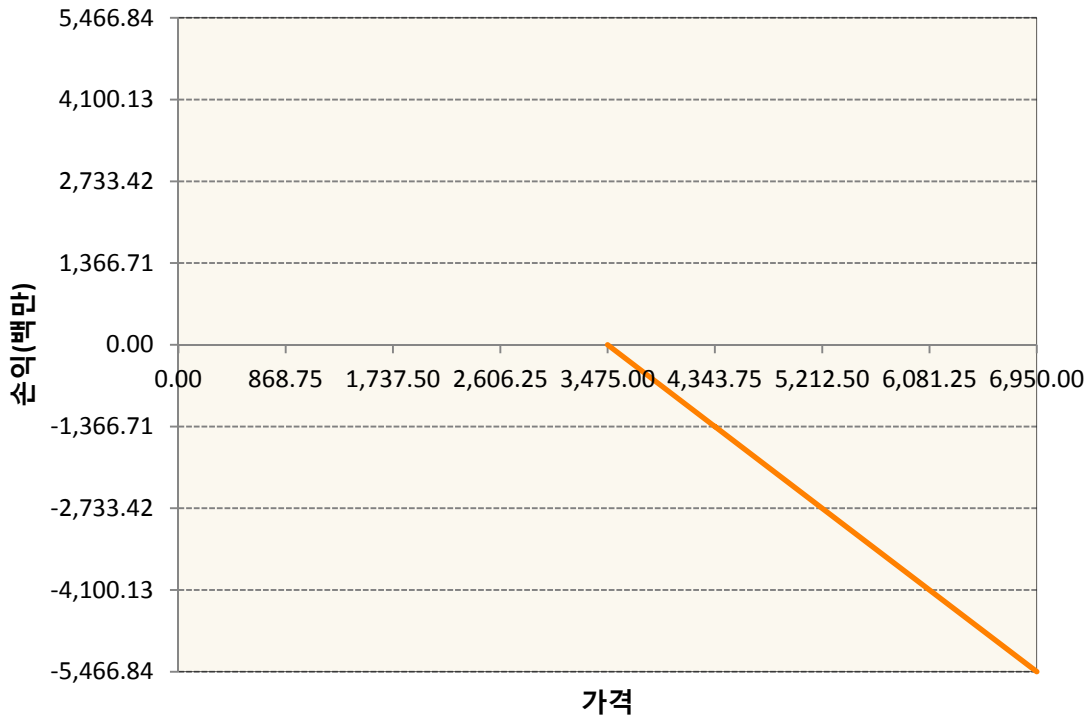
1. 계약금액

(단위:백만원)

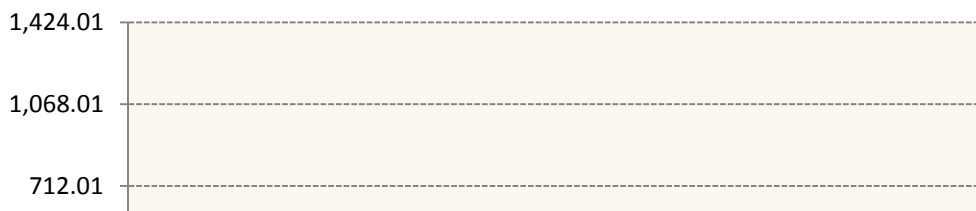
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,724	0	3,724	
누계	유가증권	옵션	0	13,782	-13,782	장내
누계	지수	스왑	28,673	0	28,673	장외
누계	통화	선도	14,647	23,056	-8,409	장외

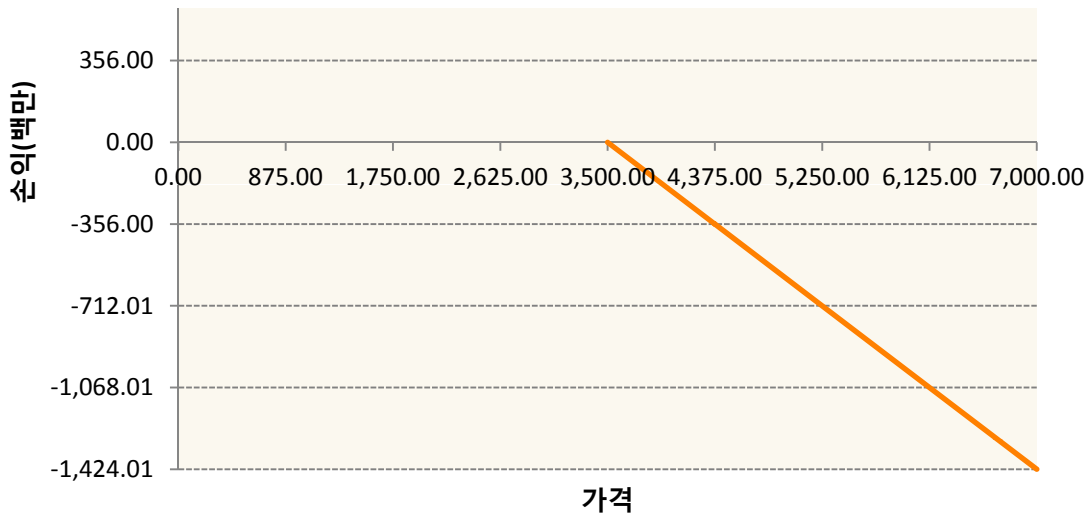
2. 만기시점의 손익구조

OESXQ9-C3475-EURO STOXX 50

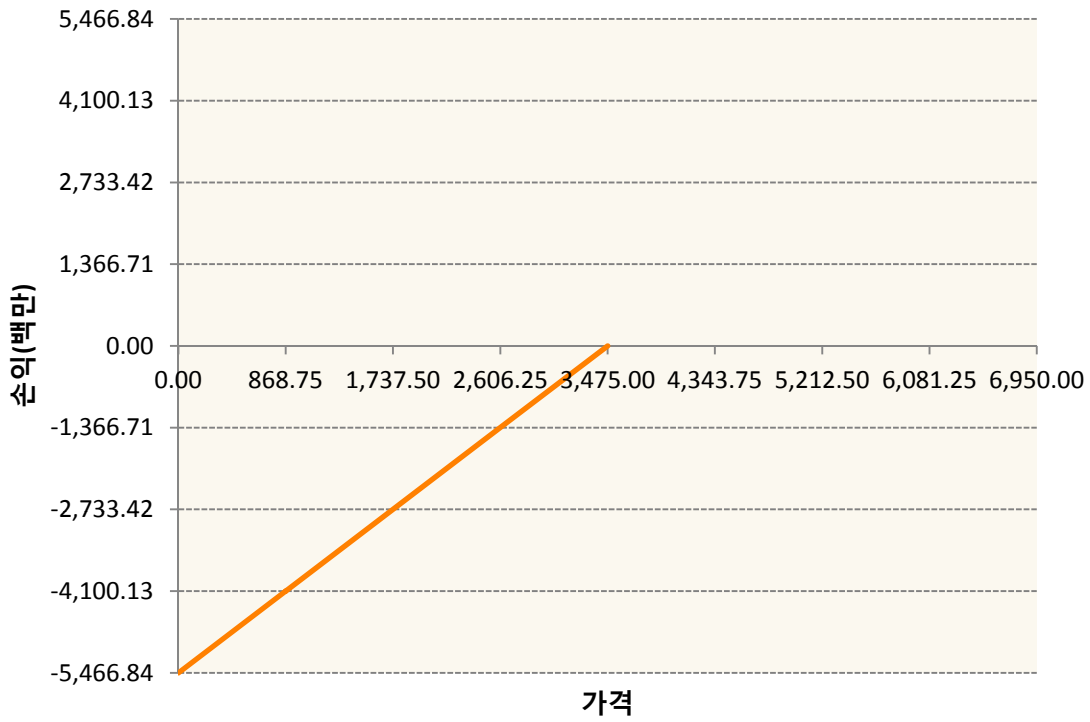


OESXQ9-C3500-EURO STOXX 50

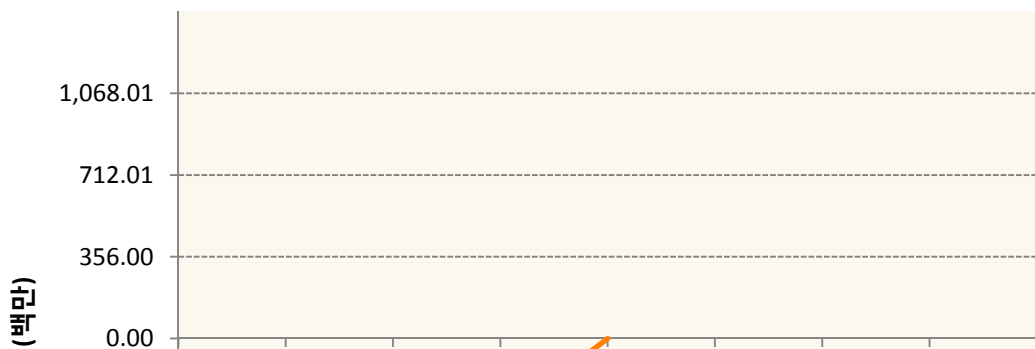


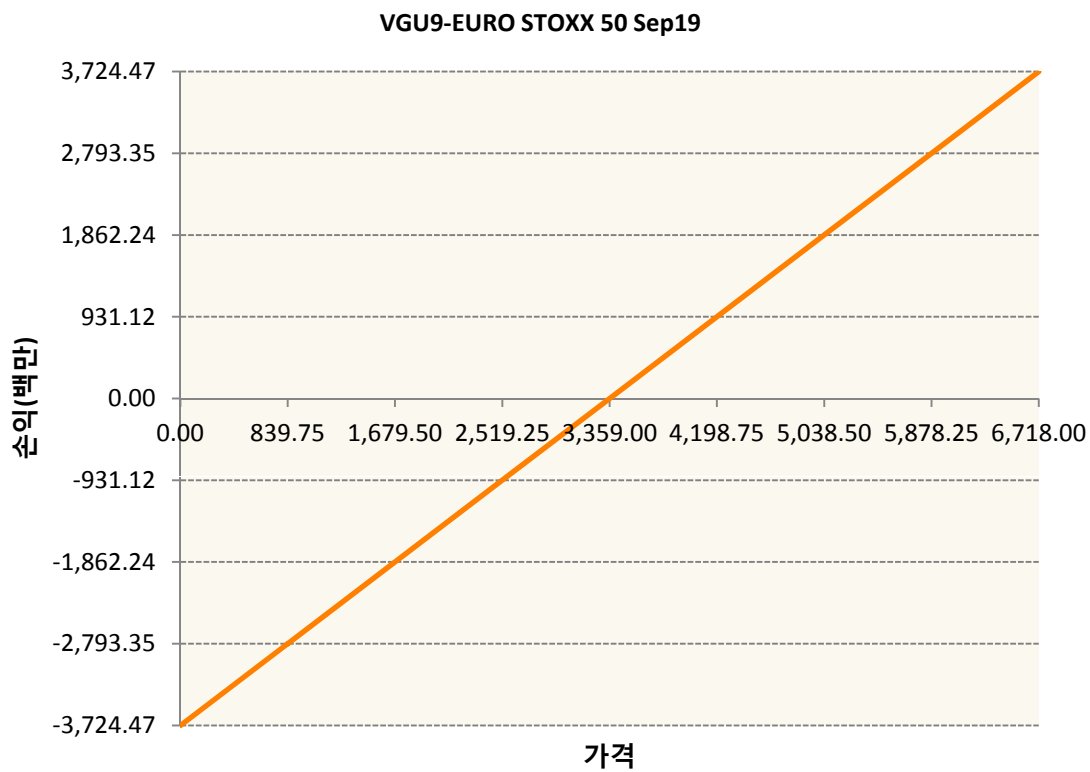
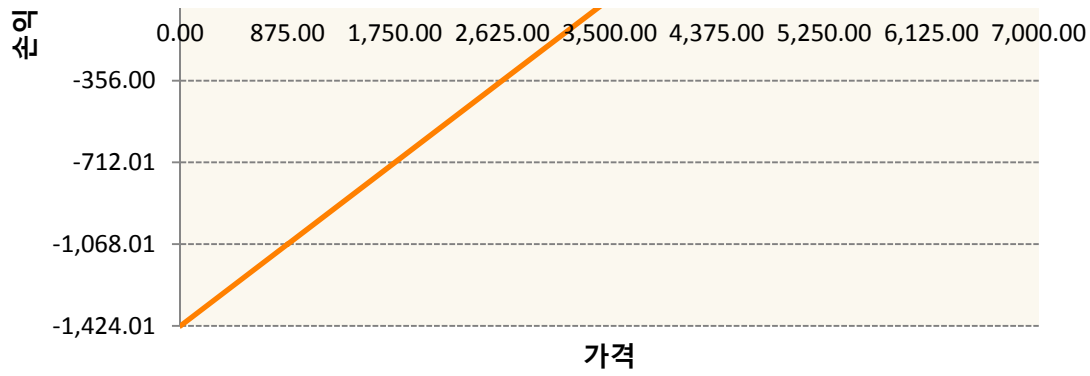


OESXQ9-P3475-EURO STOXX 50



OESXQ9-P3500-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	51
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	434
FX21019M04 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-C34 EURO STOXX 50	437
OESXQ9-C35 EURO STOXX 50	114
OESXQ9-P34 EURO STOXX 50	437

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

114
298

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

(단위:백만원)

2,469

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

(단위:백만원)

926

공시일	2019-08-16
기준일	2019-08-14

ETF스마트레버리지목표전환형9호

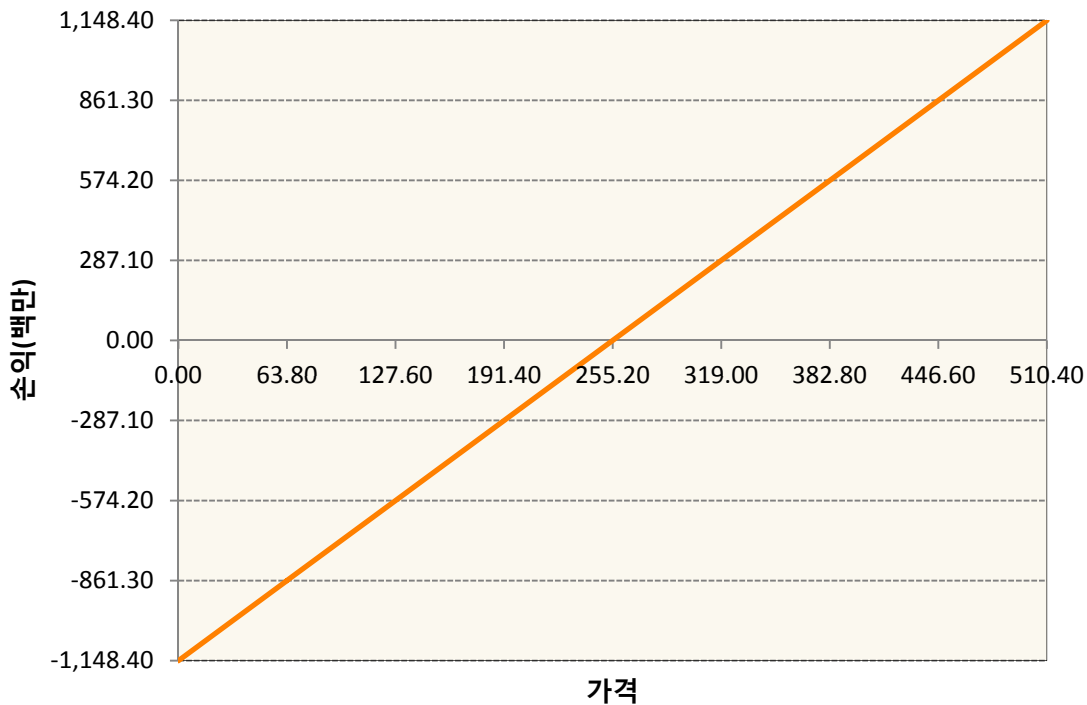
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,148	0	1,148	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						92
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92	
-5.33%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61	
-2.67%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	31	31	31	31	31	31	31	
5.33%	61	61	61	61	61	61	61	
8.00%	92	92	92	92	92	92	92	

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

(단위:백만원)

78

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

(단위:백만원)

122

공시일	2019-08-16
기준일	2019-08-14

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

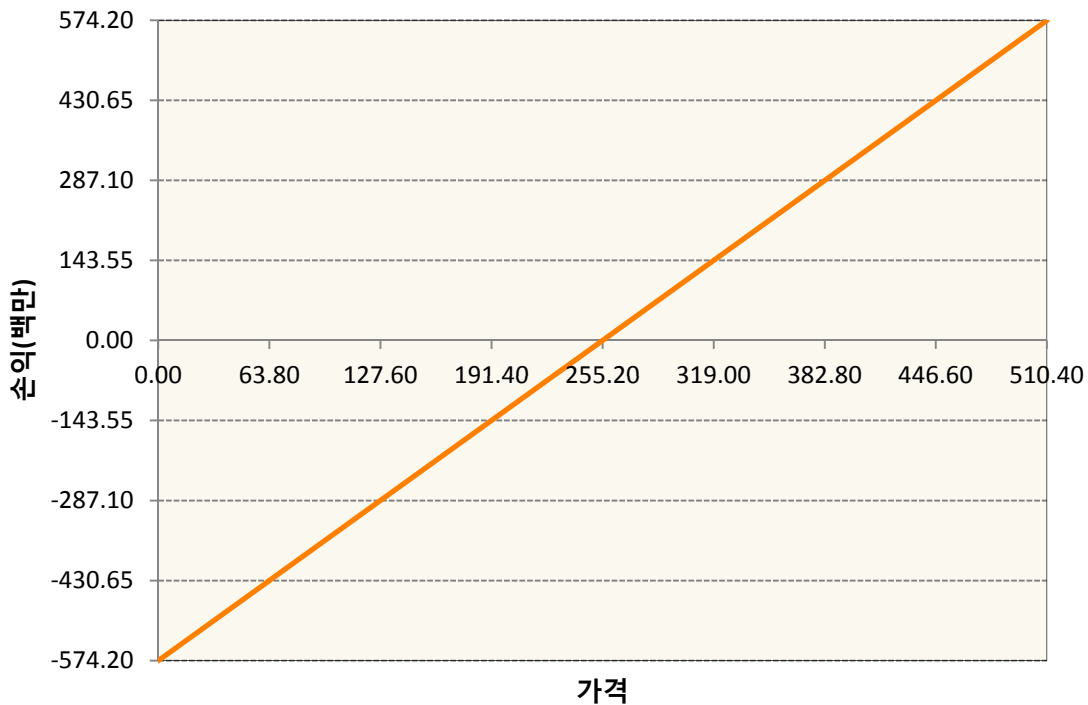
1. 계약금액

(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	2019-08-16
기준일	2019-08-14

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

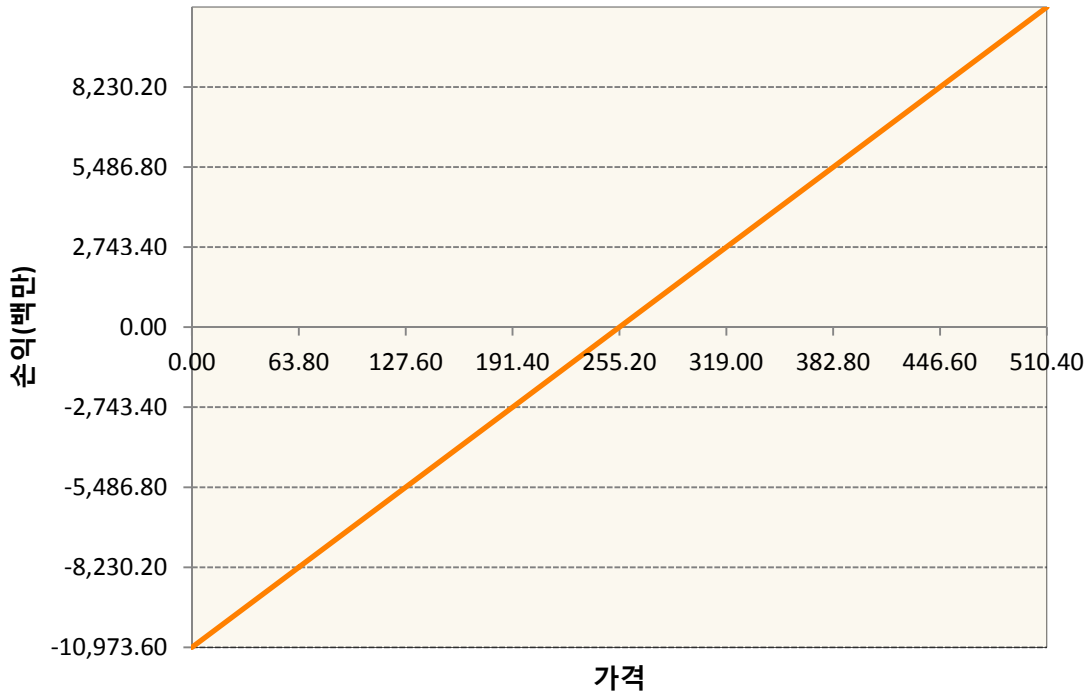
1. 계약금액

(단위:백만원)

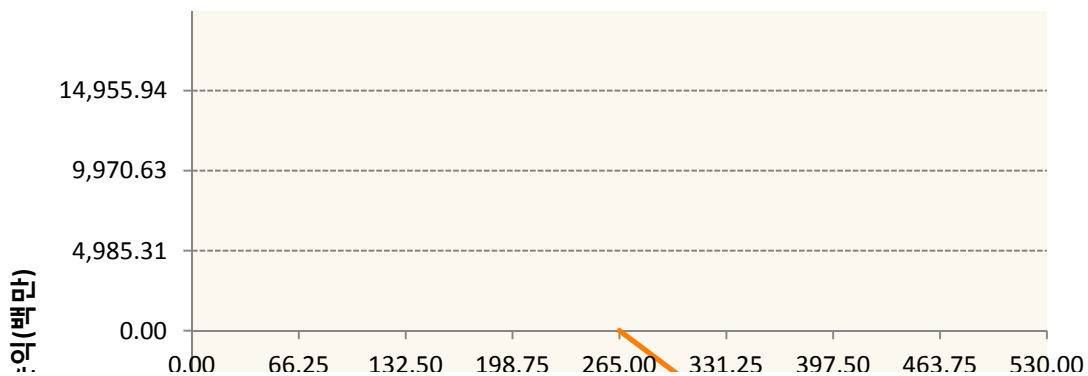
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,974	0	10,974	장내
누계	유가증권	옵션	3,659	20,075	-16,416	장내

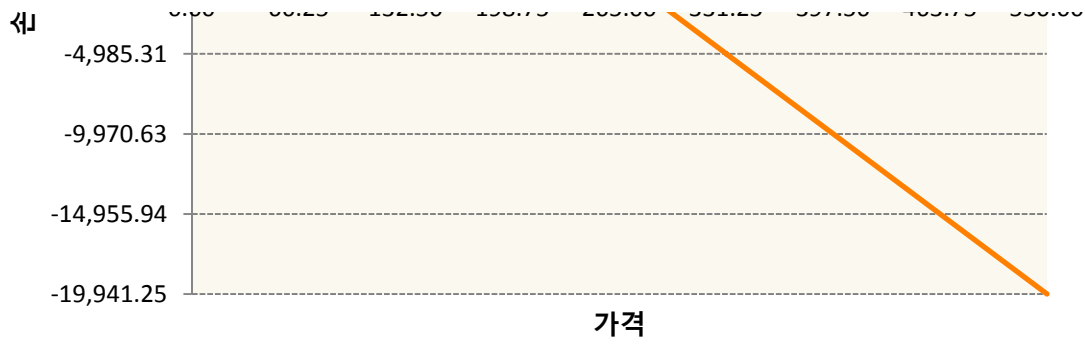
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

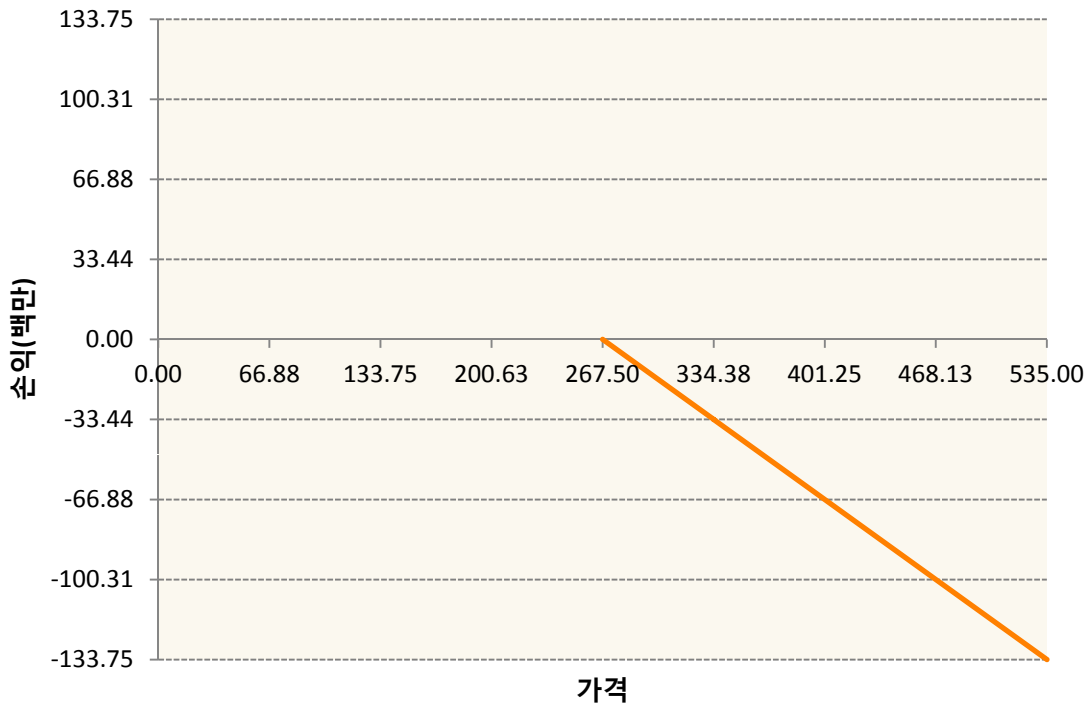


KR4201P92658-2019-09 콜265

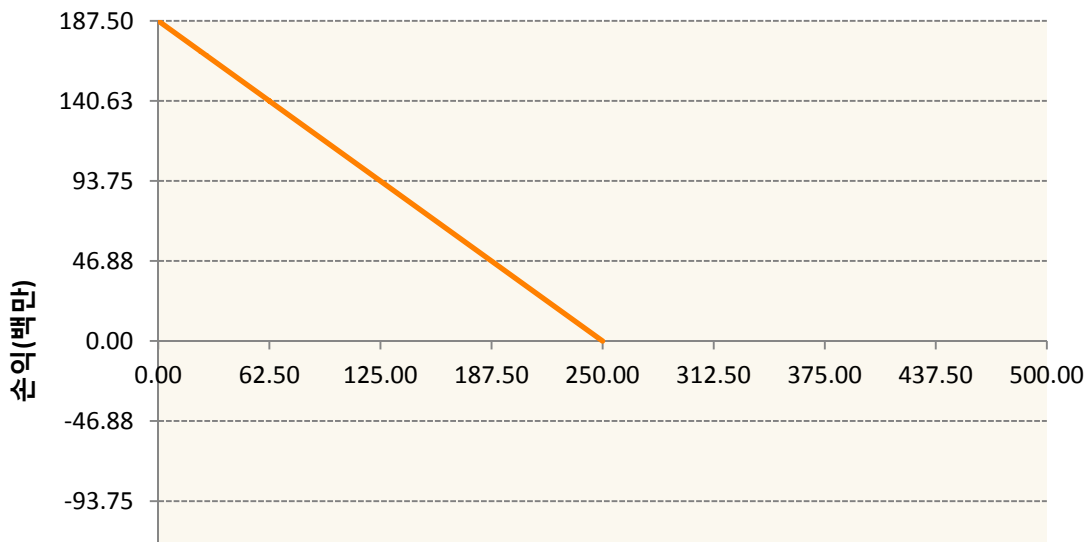


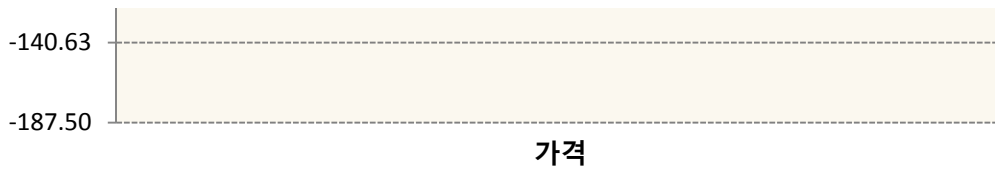


KR4201P92674-2019-09 콜267.5

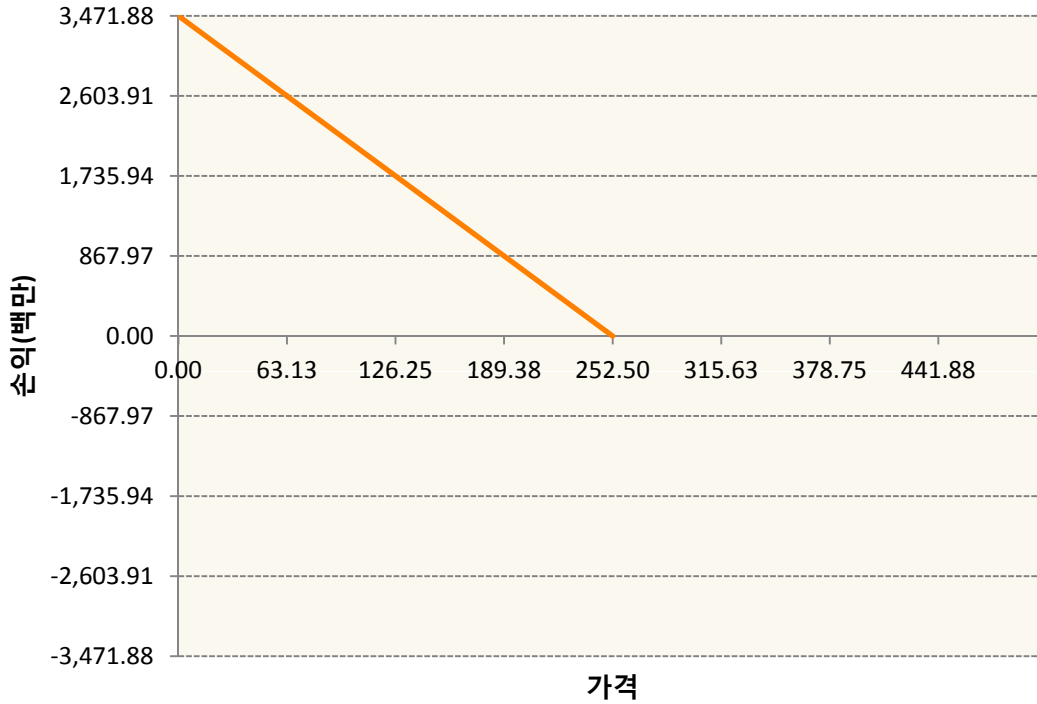


KR4301P92508-2019-09 풋250





KR4301P92524-2019-09 풋252.5



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						896
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	220	217	212	206	197	186	173	
-5.33%	211	202	191	177	160	141	119	
-2.67%	181	161	139	114	87	58	28	

0%	103	70	36	0	-37	-75	-113
2.67%	-54	-97	-139	-183	-226	-269	-313
5.33%	-311	-354	-398	-442	-486	-530	-574
8.00%	-664	-700	-737	-776	-815	-855	-896

KR4201P92674 2019-09 콜267.5 5

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	0	0	0
0%	1	0	0	0	0	0	-1
2.67%	0	0	-1	-1	-1	-2	-2
5.33%	-2	-2	-2	-3	-3	-3	-3
8.00%	-4	-4	-4	-5	-5	-5	-5

KR4301P92508 2019-09 풋250 11

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10	10	10	10	10	10	11
-5.33%	5	5	6	6	6	6	6
-2.67%	2	2	2	2	3	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	-2	-1	-1
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2

KR4301P92524 2019-09 풋252.5 211

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	205	205	206	207	208	209	211
-5.33%	115	117	119	122	124	127	131
-2.67%	37	41	46	50	55	59	64
0%	-15	-10	-5	0	5	10	15
2.67%	-38	-35	-32	-28	-25	-21	-17
5.33%	-45	-44	-43	-41	-39	-37	-34
8.00%	-47	-46	-46	-45	-45	-43	-42

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

(단위:백만원)

1,630

공시일	2019-08-16
기준일	2019-08-14

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	2,569	-2,569	
누계	유가증권	수익증권	56,816	0	56,816	

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	2019-08-16
기준일	2019-08-14

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,285	0	1,285	
누계	유가증권	수익증권	73,132	0	73,132	

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	2019-08-16
기준일	2019-08-14

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	462,416	0	462,416	
누계	통화	선도	0	551,900	-551,900	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		1,746
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,134
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		136
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		582
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		3,105
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		3,396
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		485
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		970
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		3,017
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		1,688
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		776
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,940
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,940
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		291
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		97
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		718
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		718
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		291
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		679
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		2,716
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		1,358
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		776
FX21019N04 KRW/USD 03-09-19E		291
FX21019Q00 KRW/USD 03-09-19E		291
FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E		485
FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E		194

FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E	291
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E	3,202
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E	2,173
FX21019Q01 KRW/USD 16-09-19E	97
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,978
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,590

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

(단위:백만원)

14,502

공시일	2019-08-16
기준일	2019-08-14

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

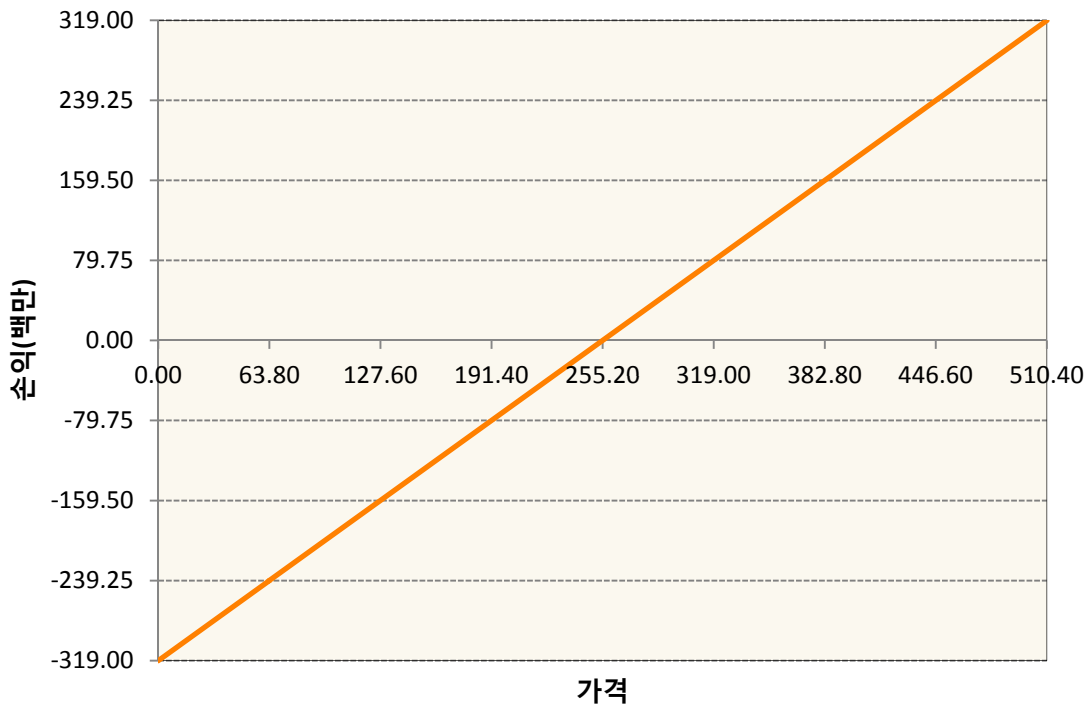
1. 계약금액

(단위:백만원)

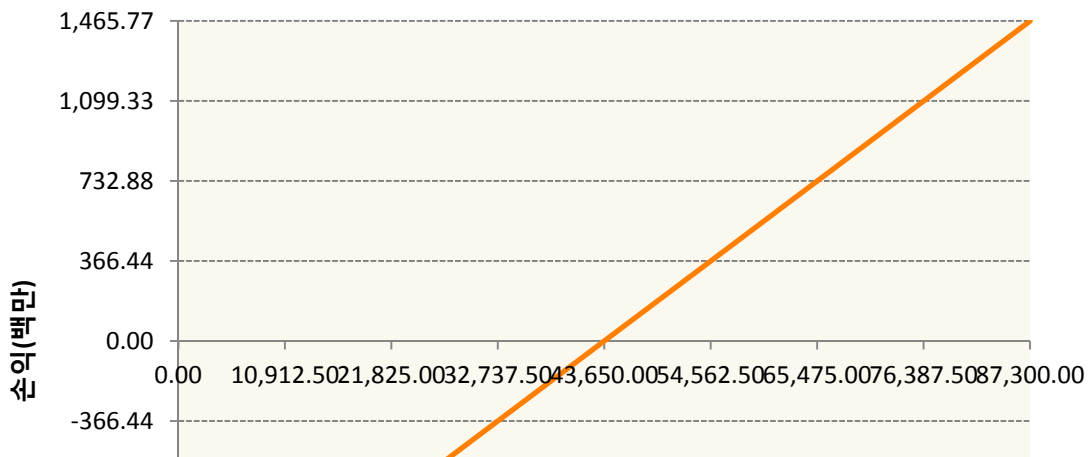
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,785	0	1,785	장내

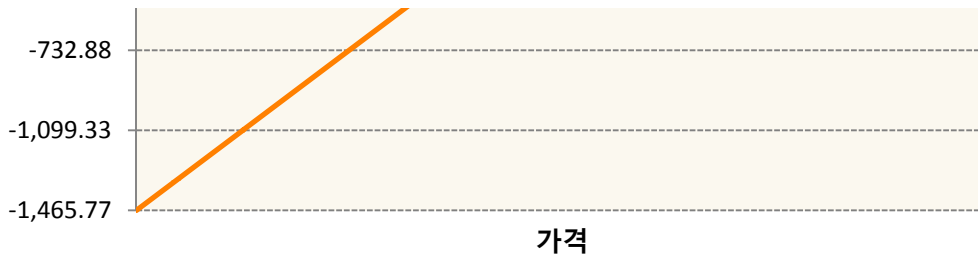
2. 만기시점의 손익구조

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						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	2019-08-16
기준일	2019-08-14

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

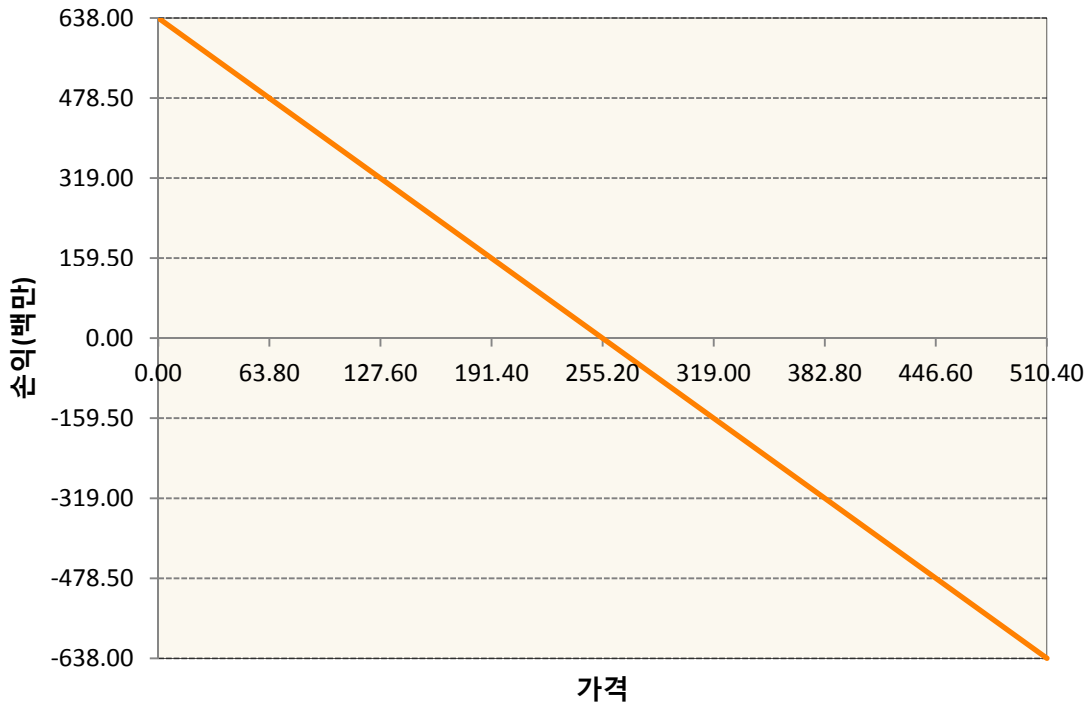
1. 계약금액

(단위:백만원)

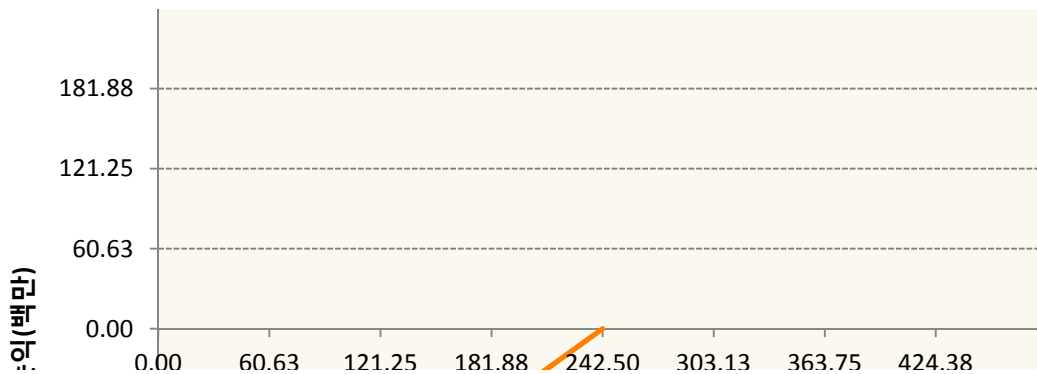
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	638	-638	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,550	-3,550	장내

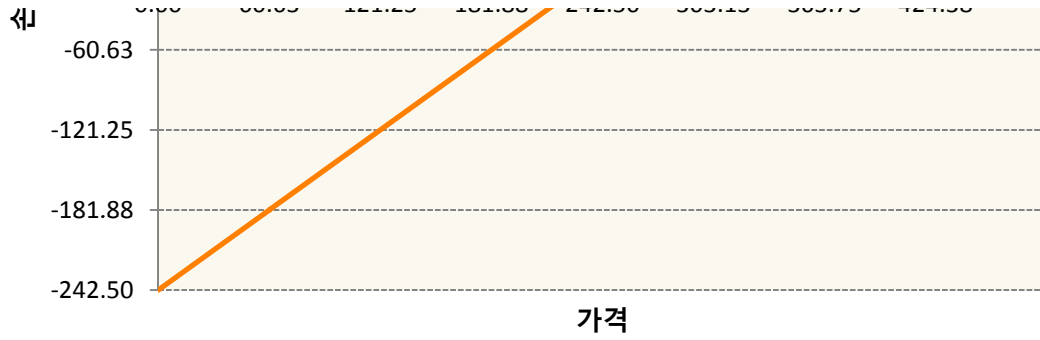
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

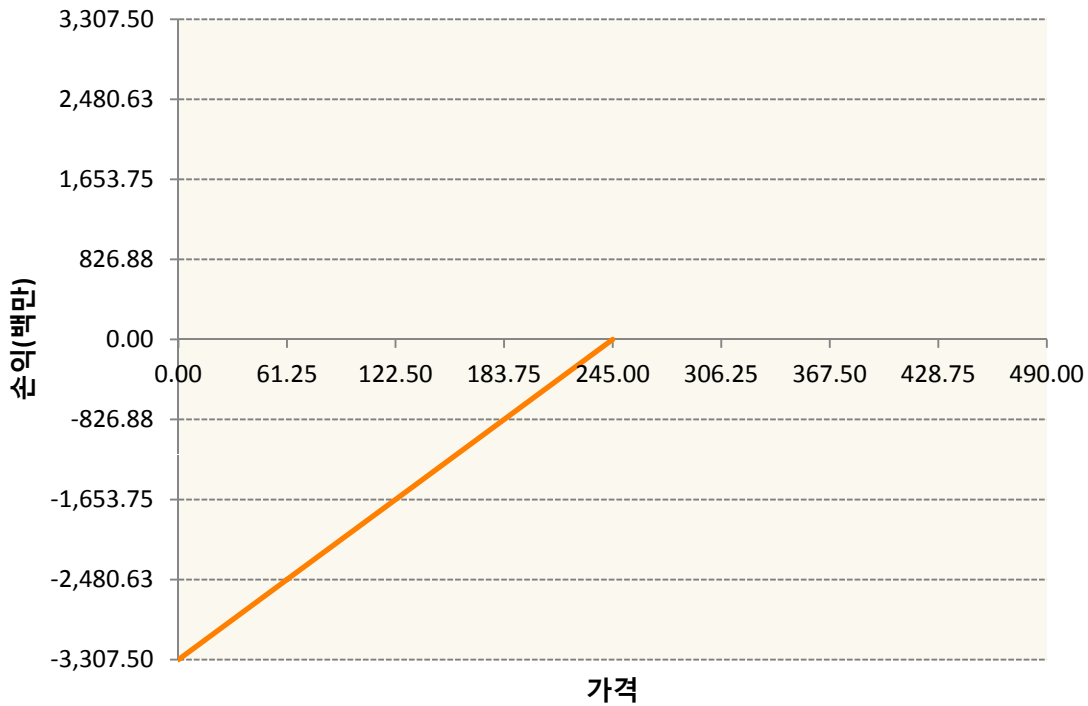


KR4301P92425-2019-09 풋242.5





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	-5
-2.67%	0	-1	-1	-1	-2	-2	-2
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	1	1	1	1	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

150

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-134	-136	-139	-141	-144	-147	-150
-5.33%	-60	-64	-68	-73	-77	-81	-86
-2.67%	-12	-16	-21	-25	-30	-35	-39
0%	9	6	3	0	-3	-7	-11
2.67%	14	13	12	11	9	7	5
5.33%	15	15	14	14	13	12	11
8.00%	15	15	15	15	15	14	14

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

(단위:백만원)

172

공시일	2019-08-16
기준일	2019-08-14

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	19,504	0	19,504	
누계	통화	선도	0	19,282	-19,282	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		330
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		165
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		485
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		524
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		39

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

(단위:백만원)

507

공시일	2019-08-16
기준일	2019-08-14

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	2019-08-16
기준일	2019-08-14

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

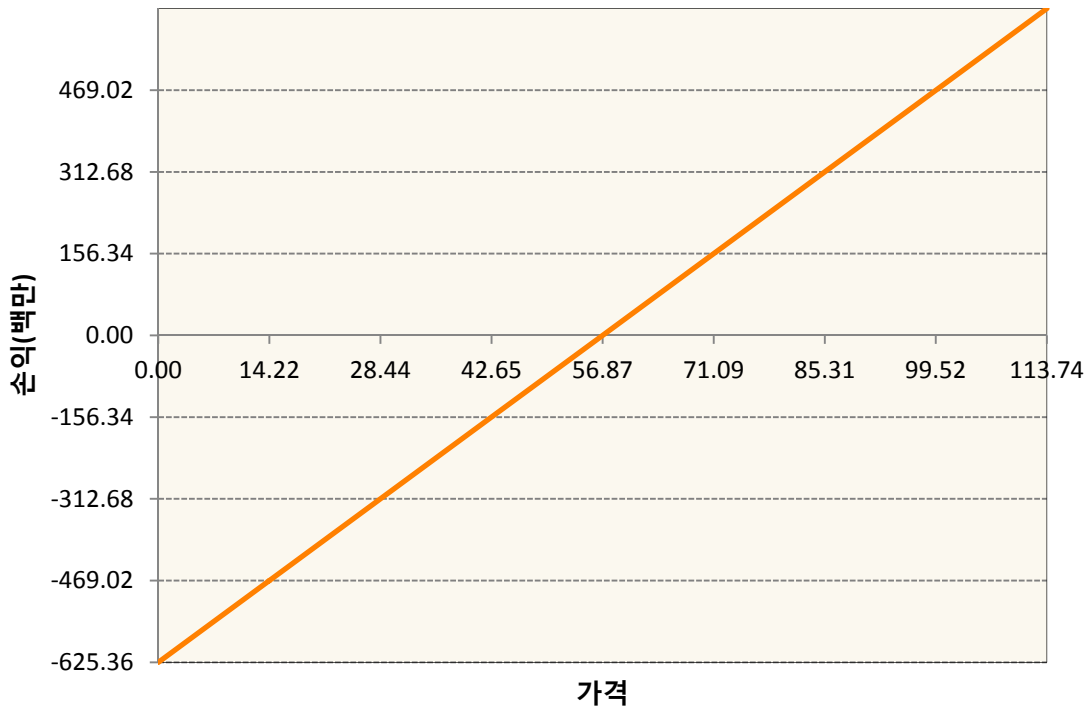
1. 계약금액

(단위:백만원)

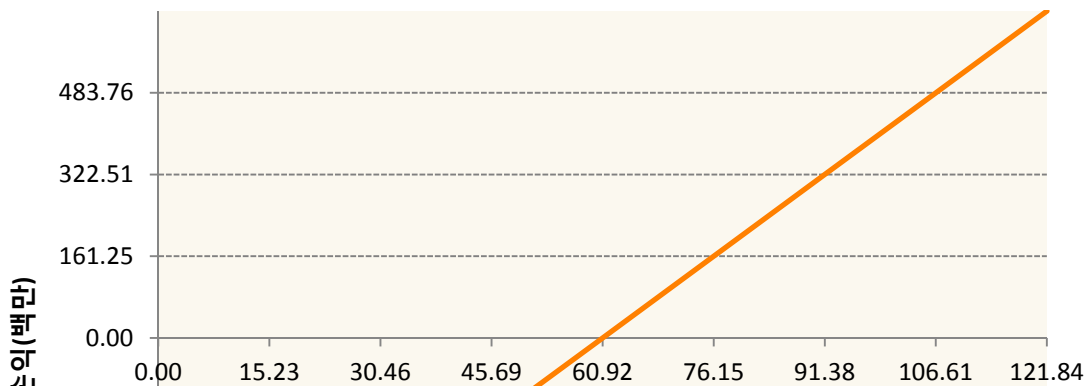
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,265	121	2,144	
누계	유가증권	선물	194	0	194	장내

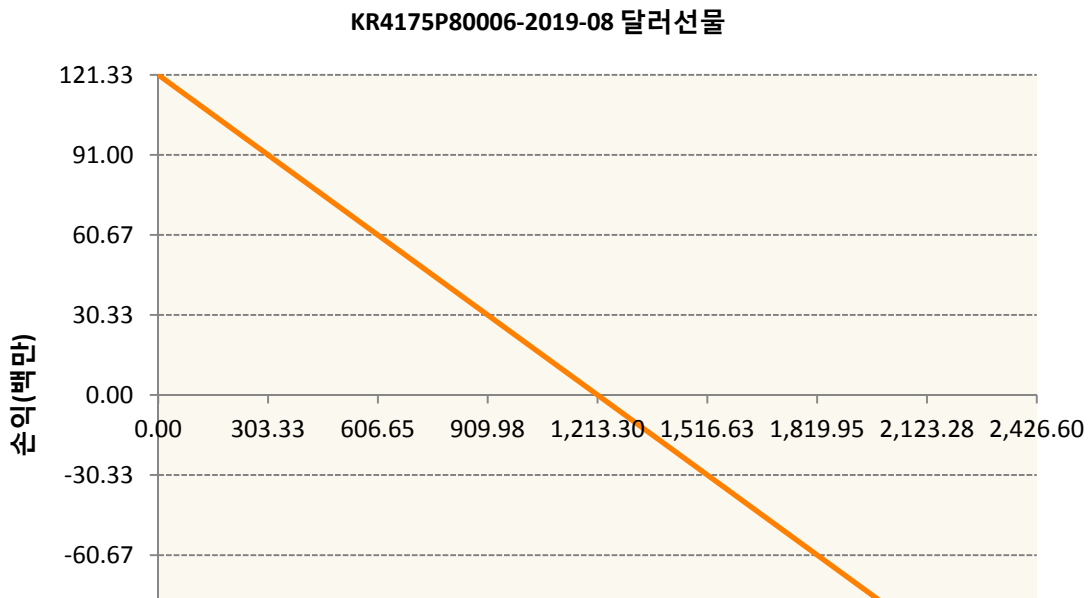
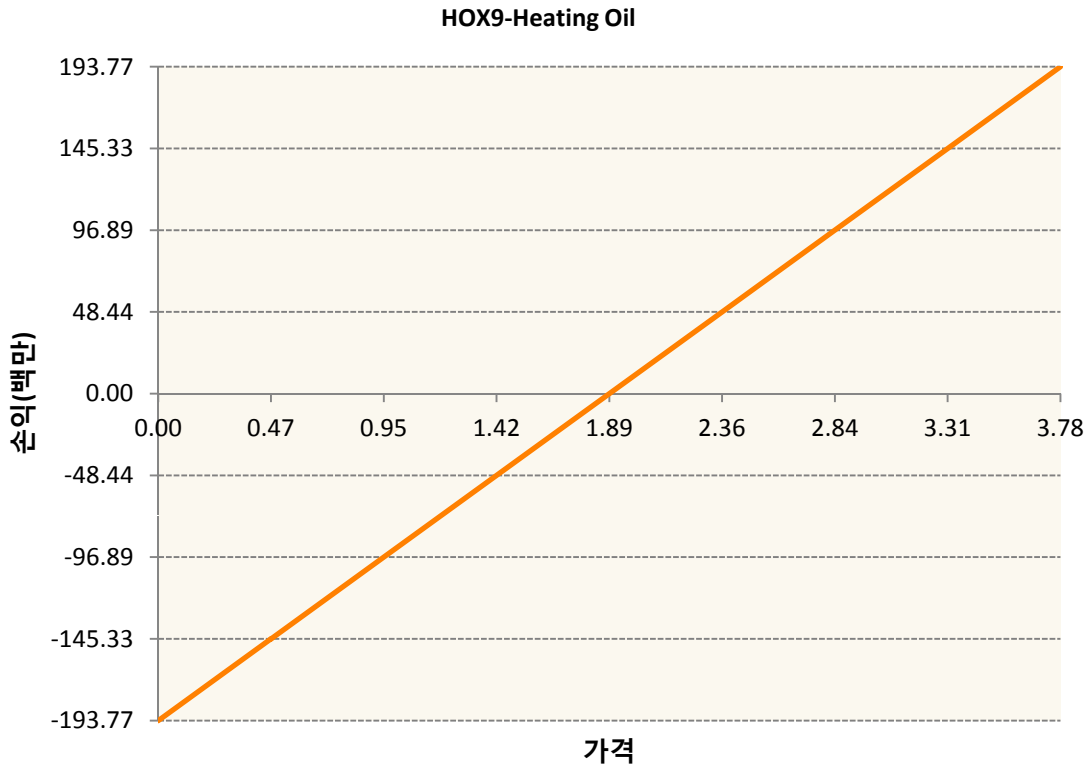
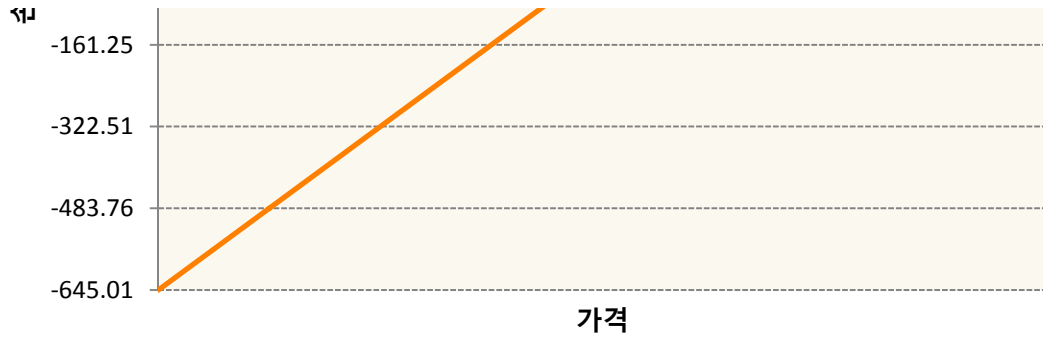
2. 만기시점의 손익구조

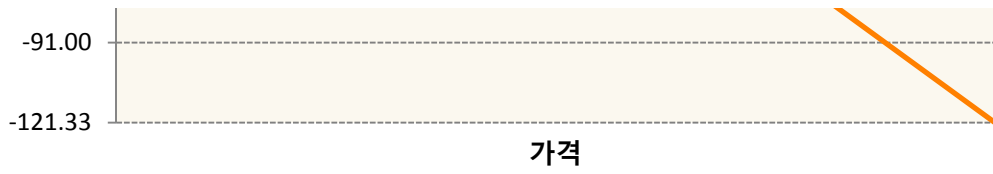
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19



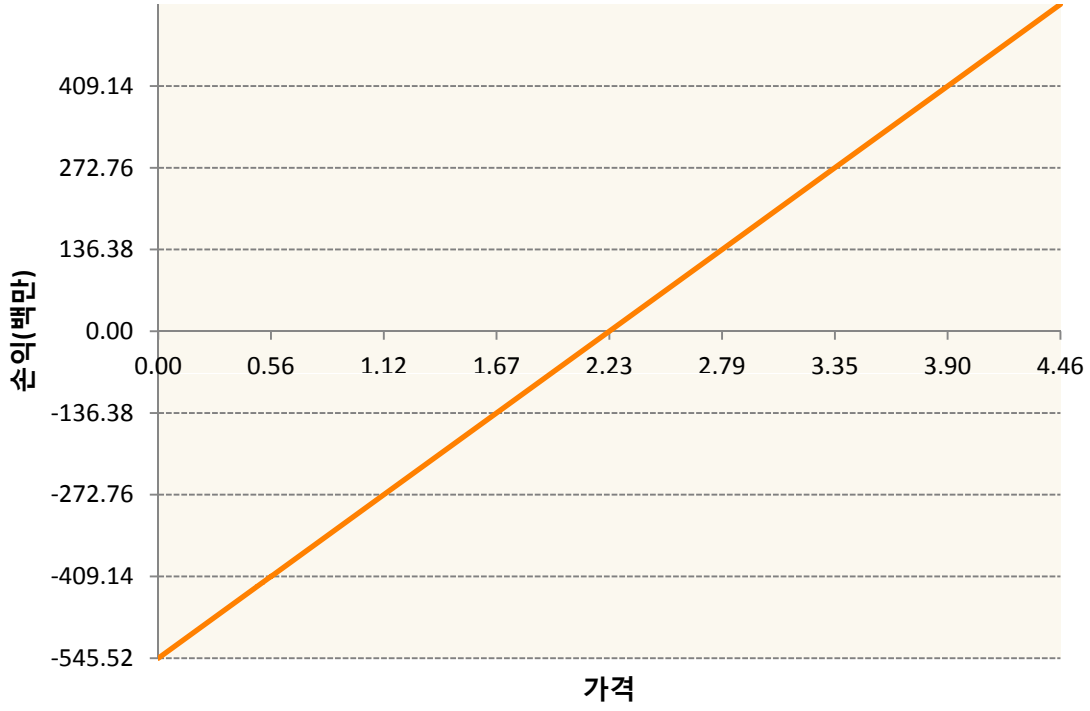
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19



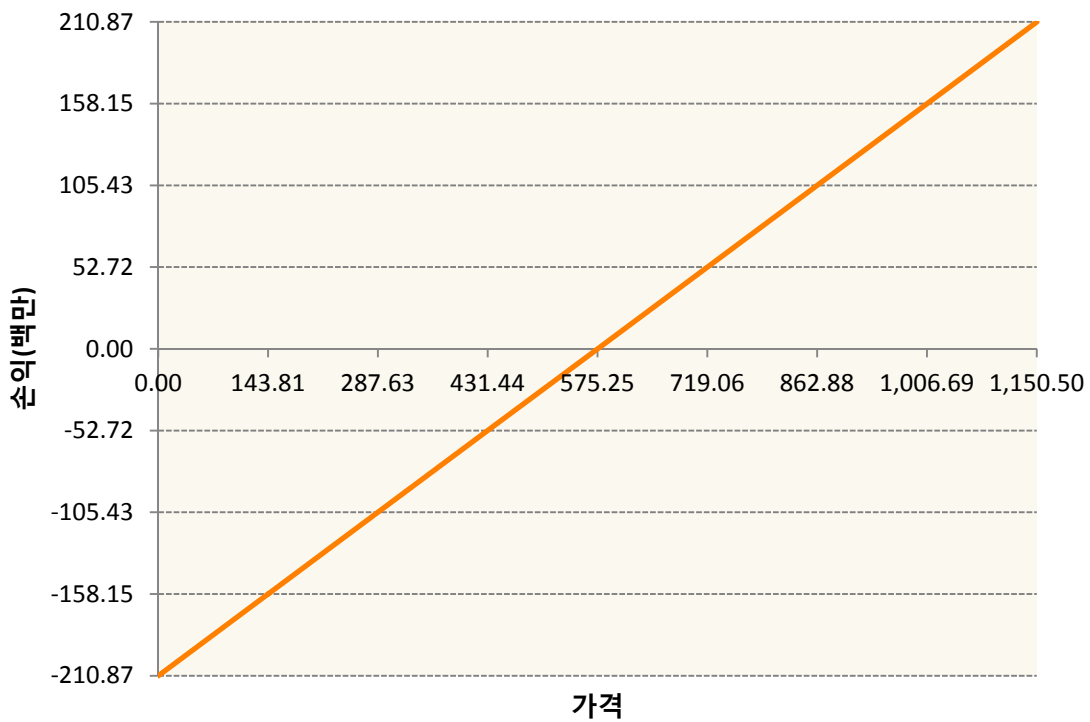




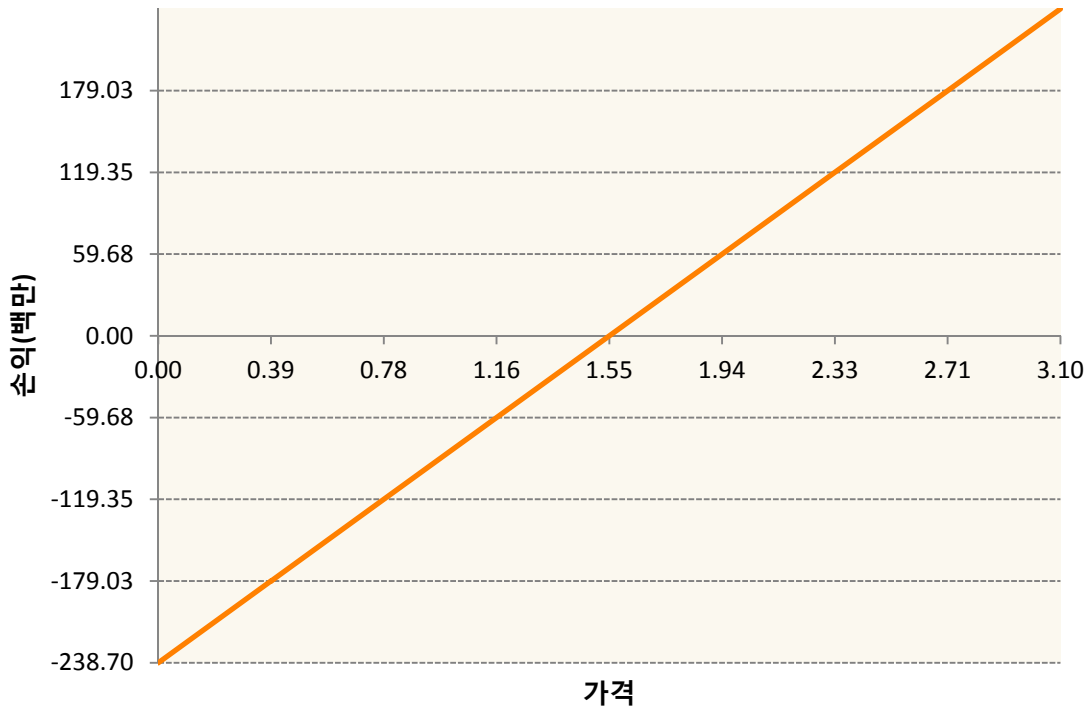
NGX19-NATURAL GAS FUTR Nov19



QSX9-Low Su Gasoil G Nov19



XBX9-GASOLINE RBOB FUT Nov19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLX9	WTI CRUDE FUTURE Nov19	50
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	52
HOX9	Heating Oil	16
KR4175P800	2019-08 달러선물	10
NGX19	NATURAL GAS FUTR Nov19	44
QSX9	Low Su Gasoil G Nov19	17
XBX9	GASOLINE RBOB FUT Nov19	19

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

(단위:백만원)

375

공시일	2019-08-16
기준일	2019-08-14

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

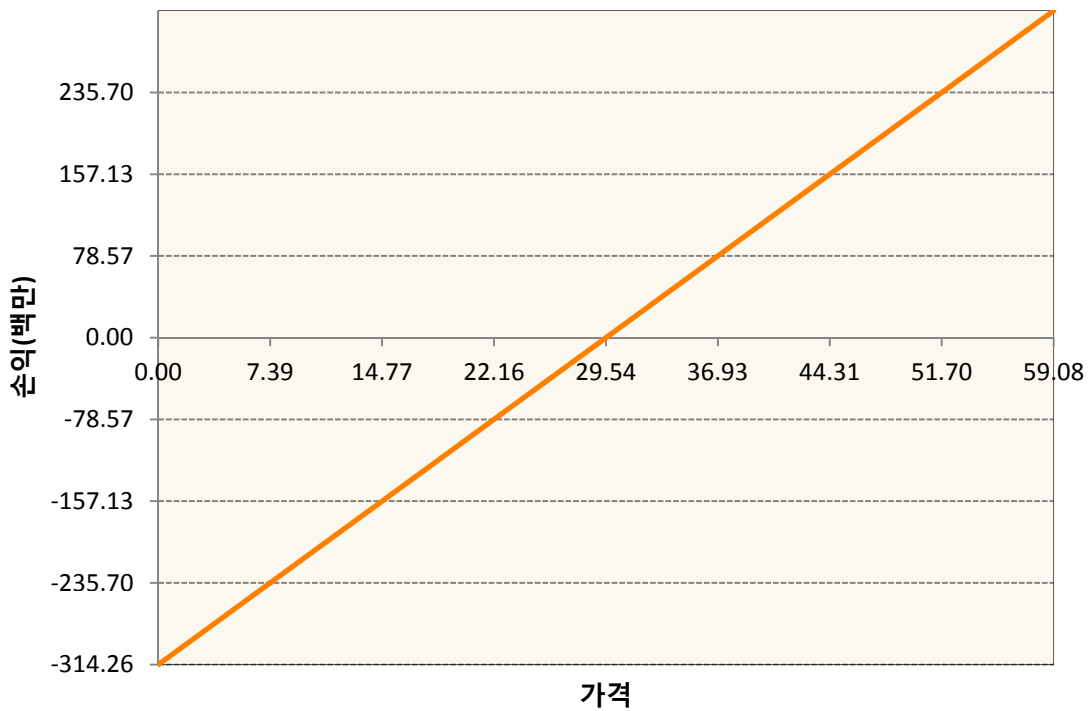
1. 계약금액

(단위:백만원)

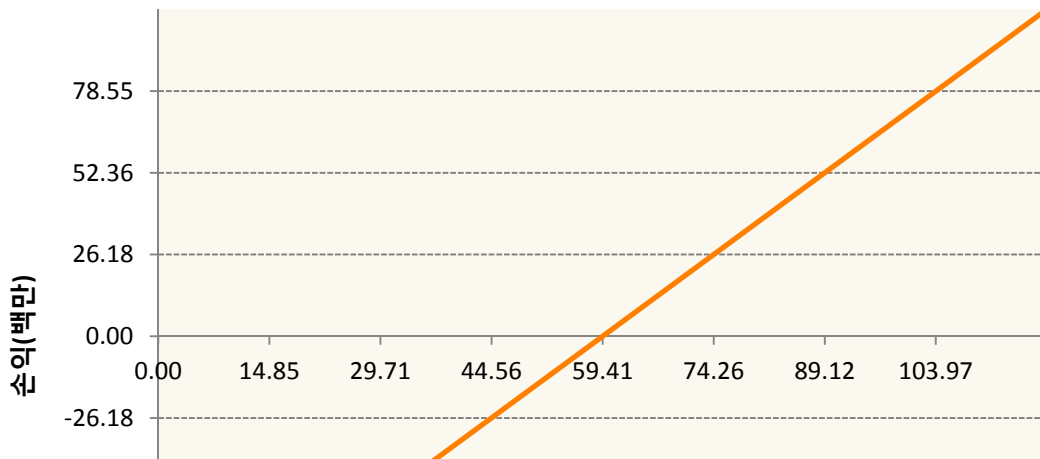
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,789	206	2,583	

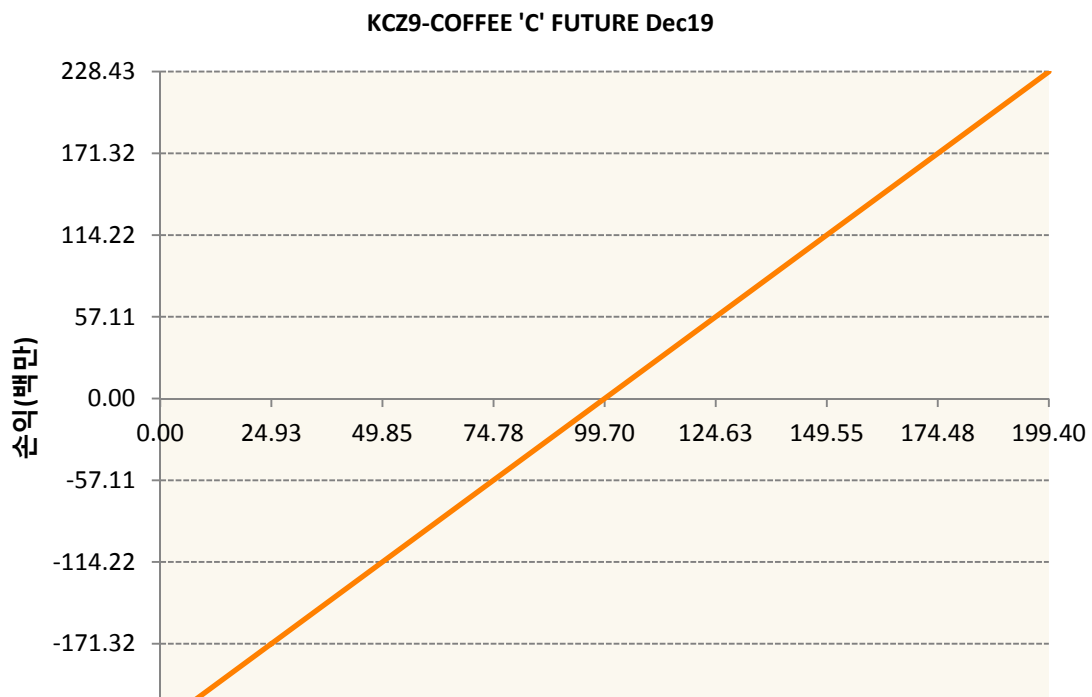
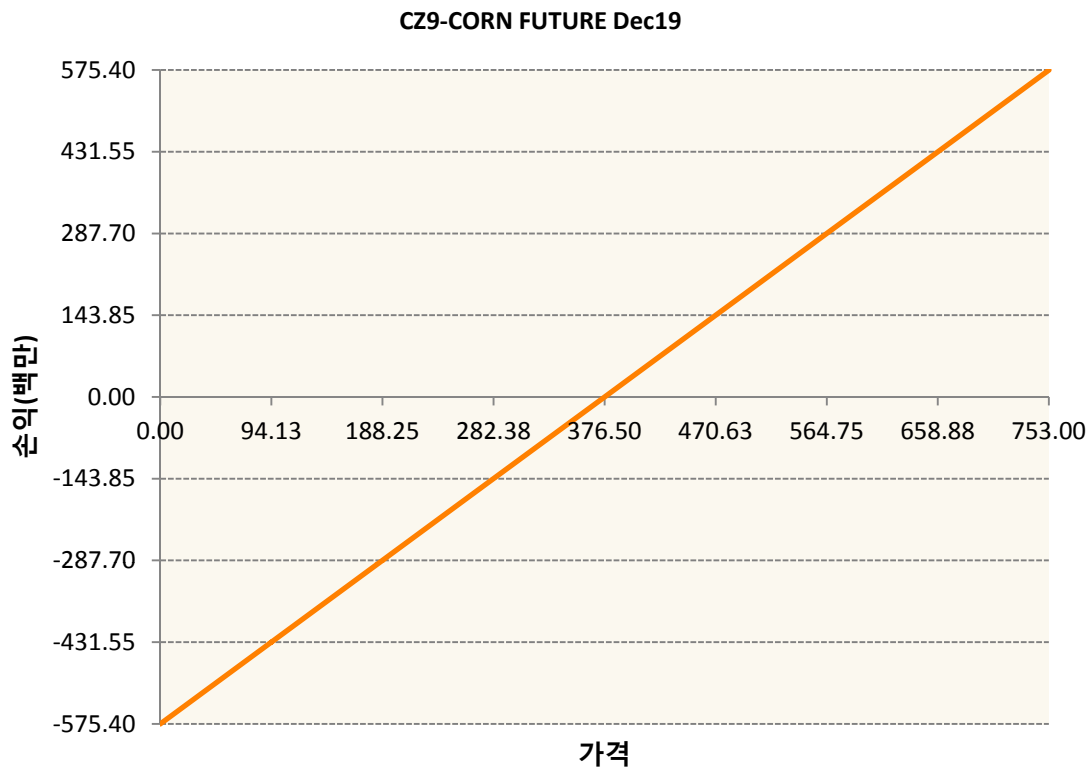
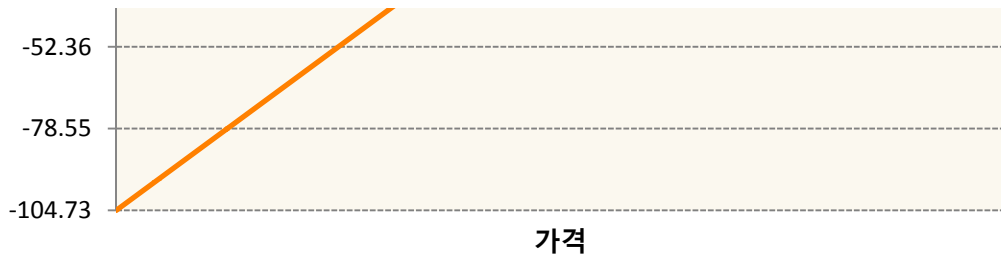
2. 만기시점의 손익구조

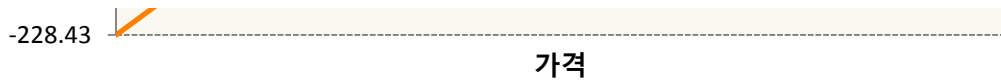
BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19



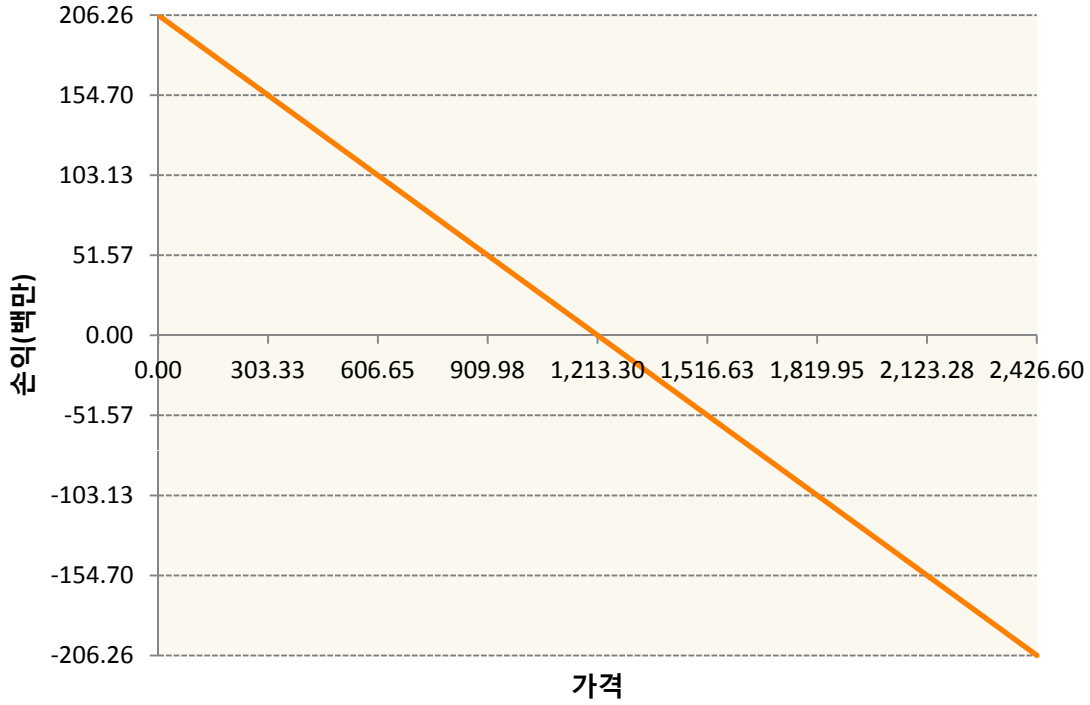
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



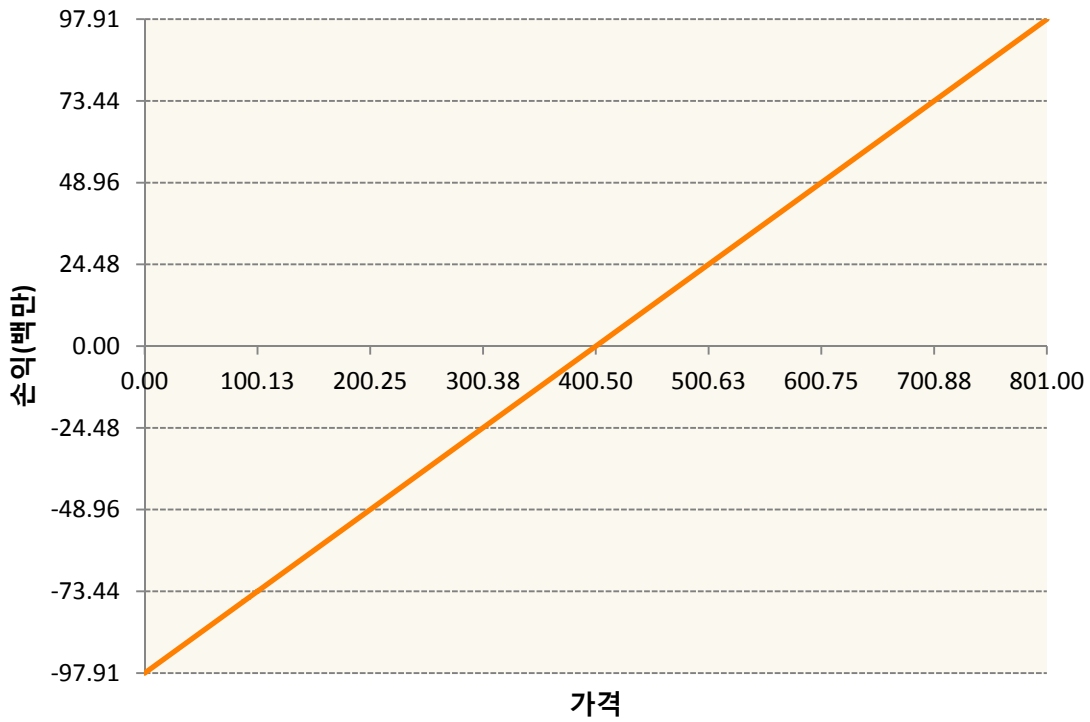




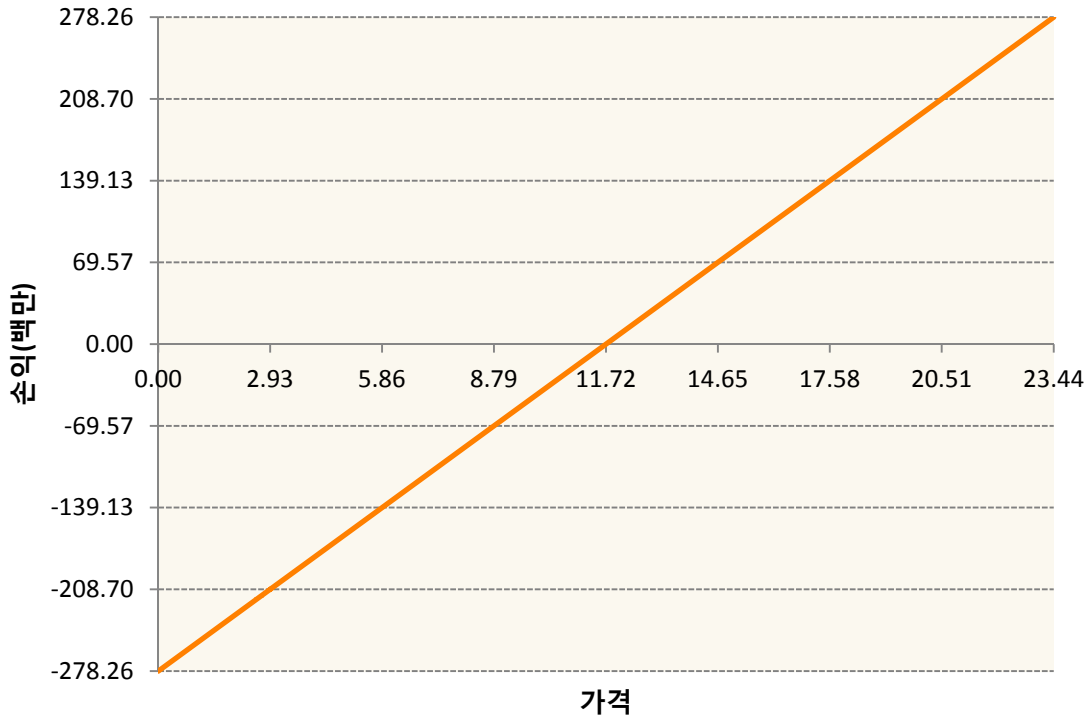
KR4175P80006-2019-08 달러선물



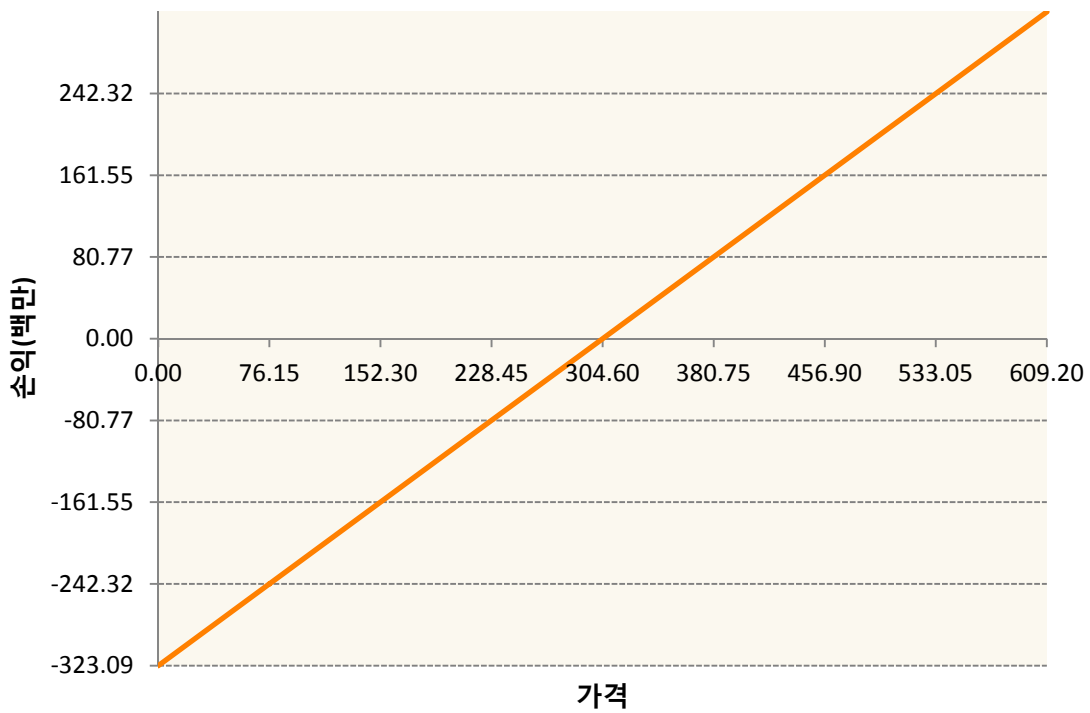
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



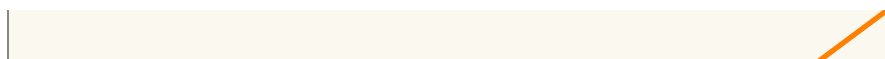
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

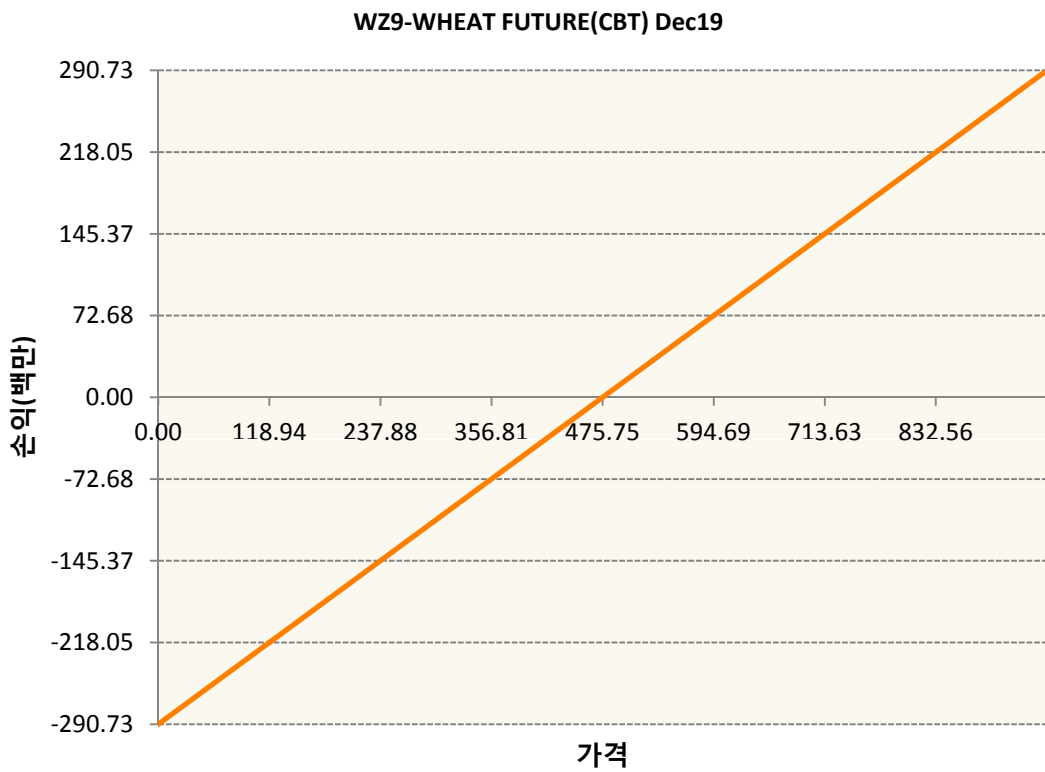
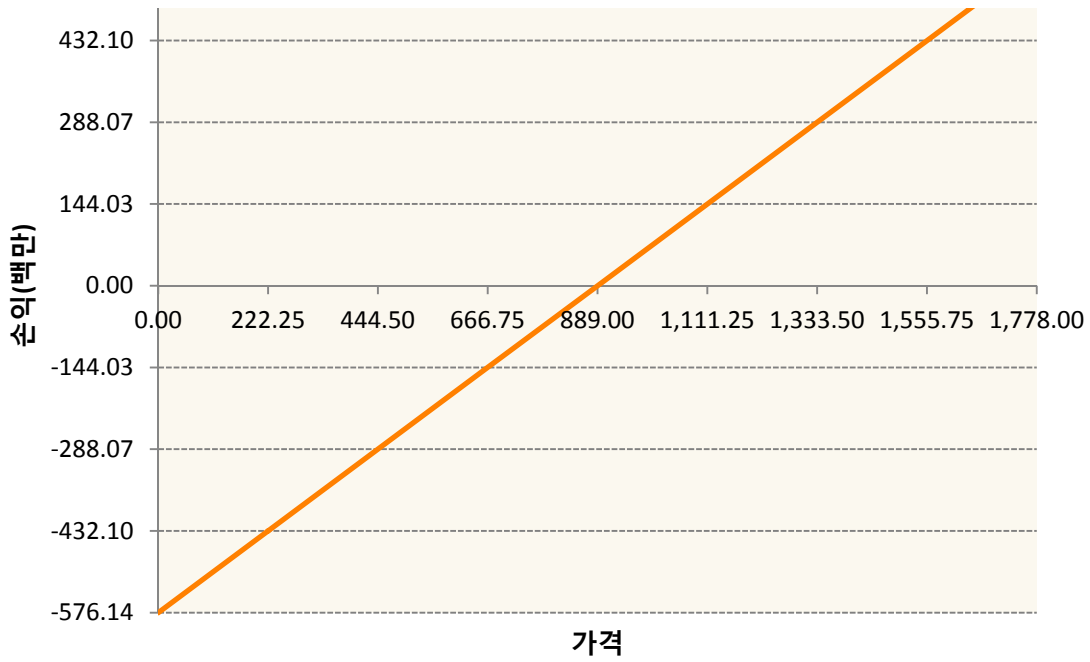


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	25
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	8
CZ9	CORN FUTURE Dec19	46
KCZ9	COFFEE 'C' FUTURE Dec19	18
KR4175P800	2019-08 달러선물	17

KWZ9	KC HRW WHEAT FUT Dec19	8
SBV9	SUGAR #11 (WORLD) Oct19	22
SMZ9	SOYBEAN MEAL FUTR Dec19	26
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	46
WZ9	WHEAT FUTURE(CBT) Dec19	23

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

(단위:백만원)

250