

공시일	2019-08-19
기준일	2019-08-16

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	2019-08-19
기준일	2019-08-16

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

1,115

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

631

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-19
기준일	2019-08-16

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)	363
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	132

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

791

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-19
기준일	2019-08-16

유로인덱스모(주식-파생형)

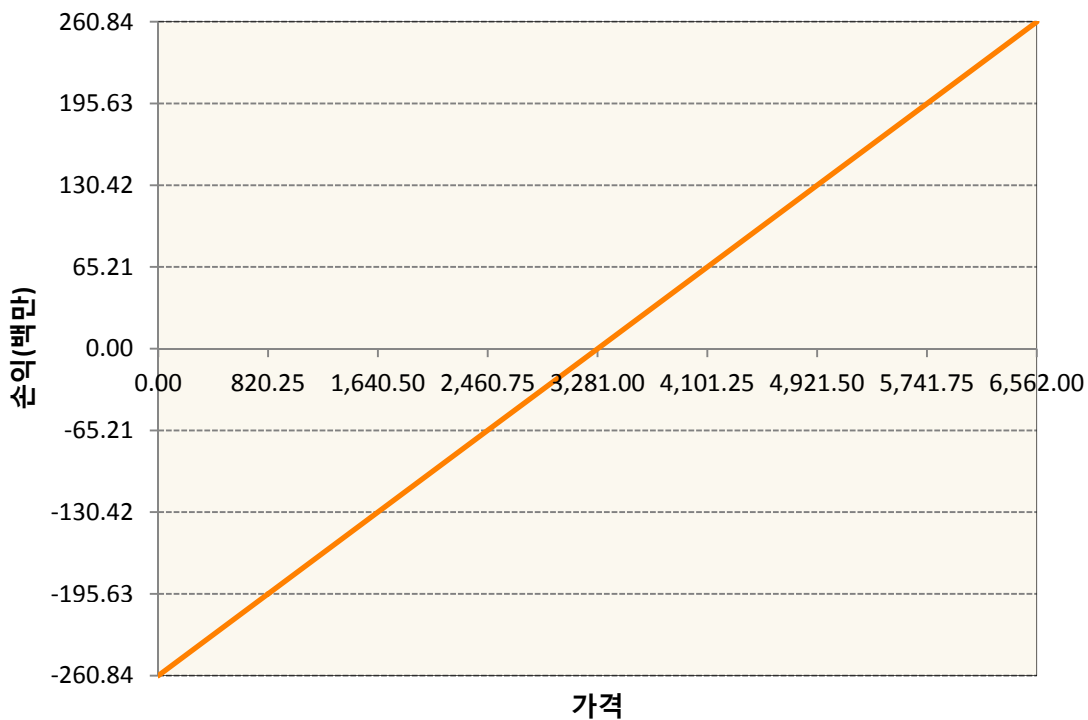
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	261	0	261	

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	2019-08-19
기준일	2019-08-16

차이나인덱스모(주식-파생형)

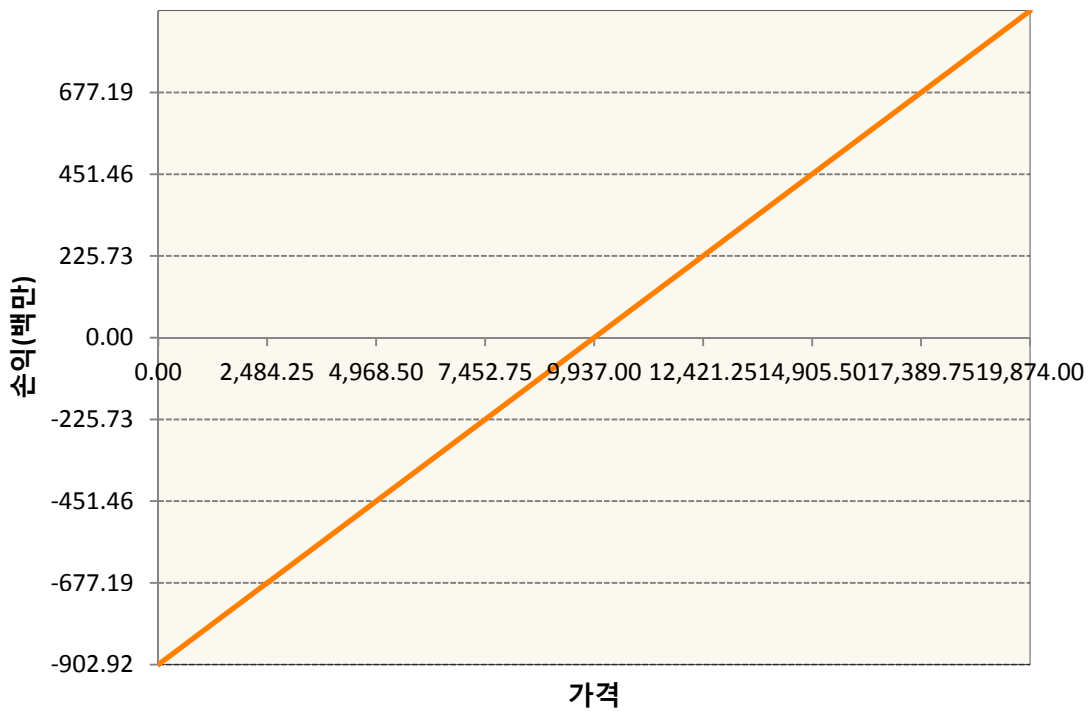
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	903	0	903	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)

69

공시일	2019-08-19
기준일	2019-08-16

커버드콜모(주식혼합-파생형)

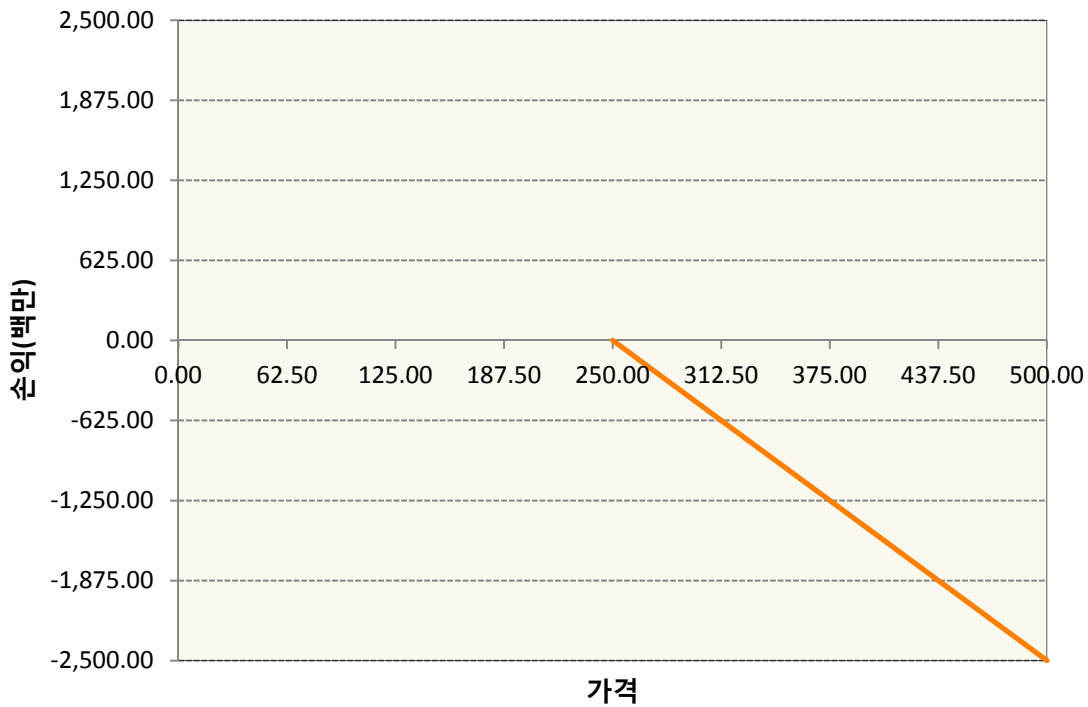
1. 계약금액

(단위:백만원)

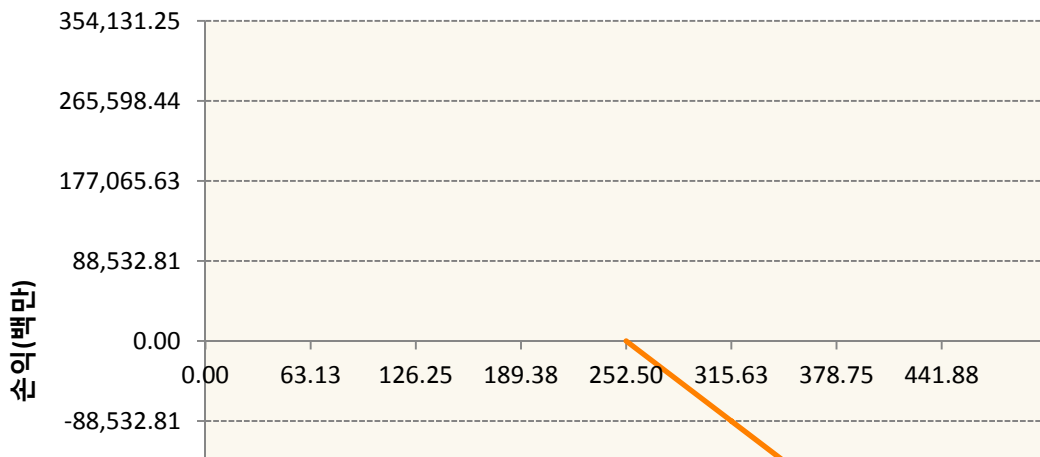
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	523,725	-523,725	장내

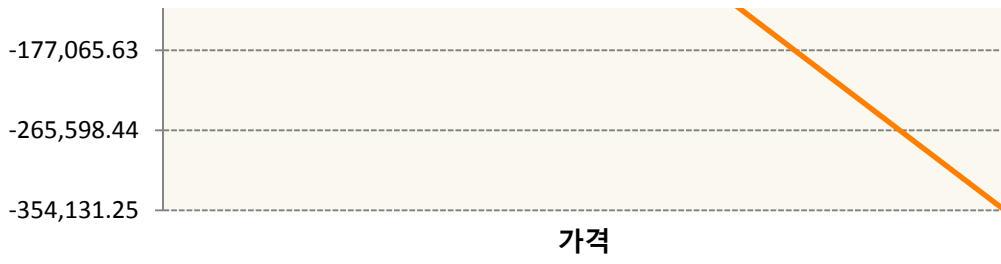
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P92500-2019-09 콜250

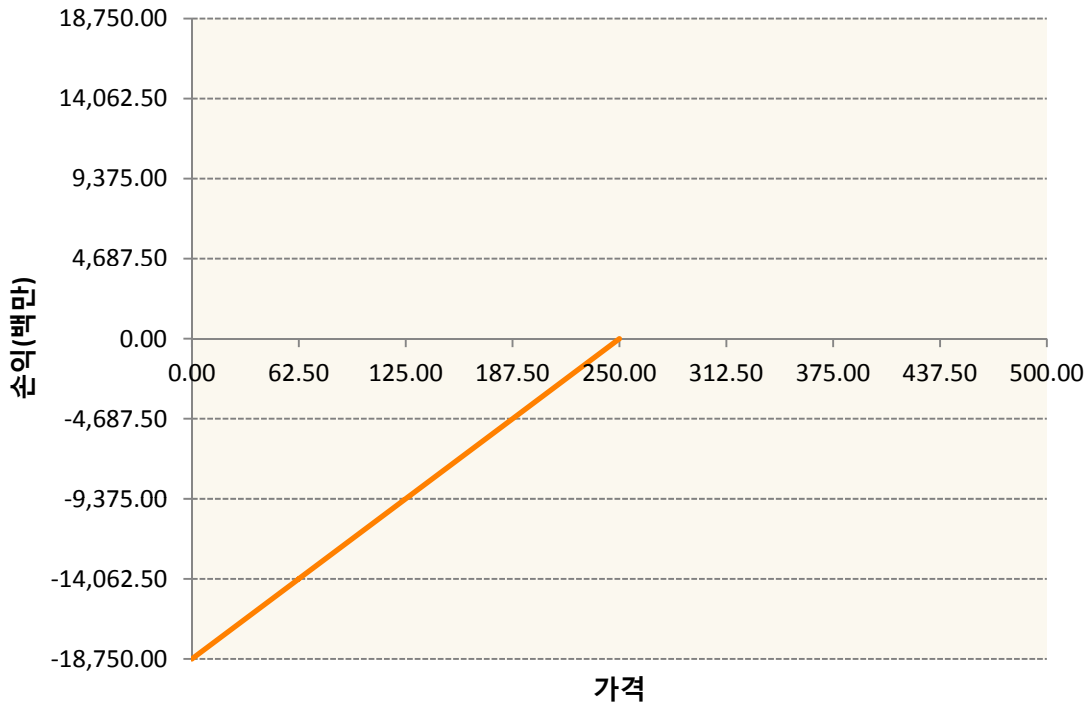


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

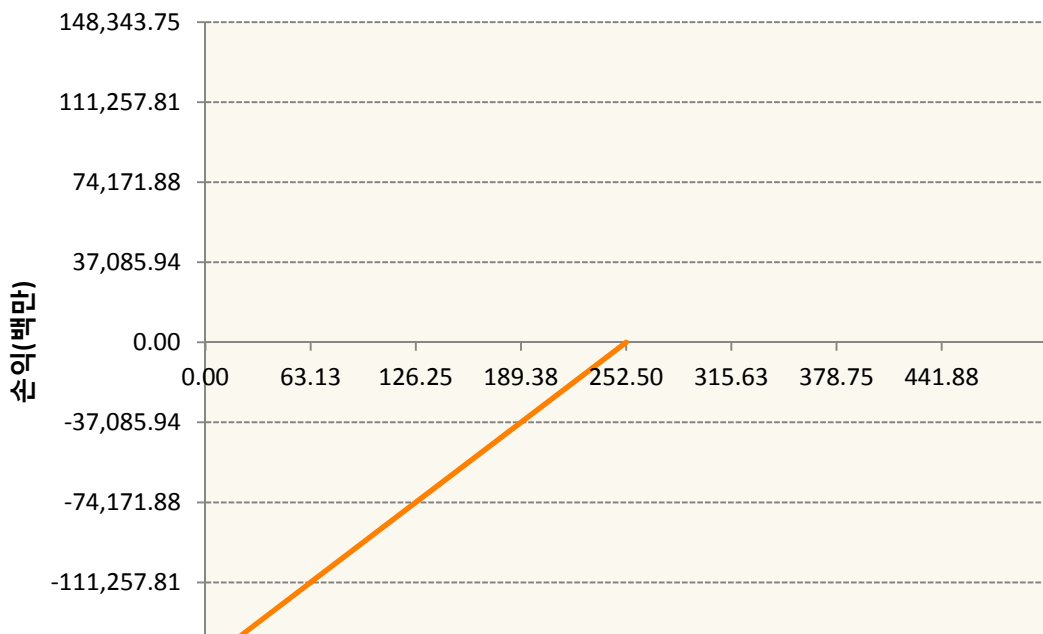




KR4301P92508-2019-09 풋250



KR4301P92524-2019-09 풋252.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P92500		2019-09 콜250						168
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	82	79	77	74	71	67	64	
-5.33%	72	68	64	59	55	50	45	
-2.67%	51	46	40	35	30	24	19	
0%	16	11	5	0	-5	-11	-16	
2.67%	-32	-37	-41	-45	-50	-55	-60	
5.33%	-91	-93	-96	-99	-103	-107	-111	
8.00%	-155	-156	-157	-160	-162	-165	-168	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5						22,462
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	9,783	9,542	9,246	8,901	8,512	8,085	7,624	
-5.33%	8,794	8,315	7,795	7,241	6,659	6,055	5,432	
-2.67%	6,495	5,793	5,079	4,356	3,627	2,891	2,152	
0%	2,334	1,556	778	0	-779	-1,557	-2,336	
2.67%	-3,798	-4,463	-5,149	-5,852	-6,567	-7,293	-8,027	
5.33%	-11,518	-11,966	-12,464	-13,003	-13,576	-14,177	-14,801	
8.00%	-20,231	-20,473	-20,775	-21,130	-21,534	-21,980	-22,462	
KR4301P92508		2019-09 풋250						1,088
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,045	-1,048	-1,053	-1,060	-1,068	-1,077	-1,088	
-5.33%	-565	-578	-593	-609	-627	-645	-665	
-2.67%	-169	-194	-219	-245	-270	-296	-322	
0%	75	51	25	0	-26	-52	-78	
2.67%	176	162	147	130	112	93	73	
5.33%	202	198	192	184	175	164	152	
8.00%	206	205	204	201	198	193	187	
KR4301P92524		2019-09 풋252.5						9,251
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-9,016	-9,030	-9,054	-9,087	-9,131	-9,185	-9,251	
-5.33%	-5,156	-5,226	-5,311	-5,410	-5,521	-5,642	-5,772	
-2.67%	-1,747	-1,916	-2,092	-2,273	-2,459	-2,647	-2,839	
0%	635	424	212	0	-212	-424	-637	
2.67%	1,793	1,650	1,495	1,331	1,160	984	803	

5.33%	2,157	2,101	2,029	1,943	1,844	1,733	1,611
8.00%	2,228	2,215	2,194	2,162	2,119	2,065	1,999

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

(단위:백만원)

32,906

공시일	2019-08-19
기준일	2019-08-16

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

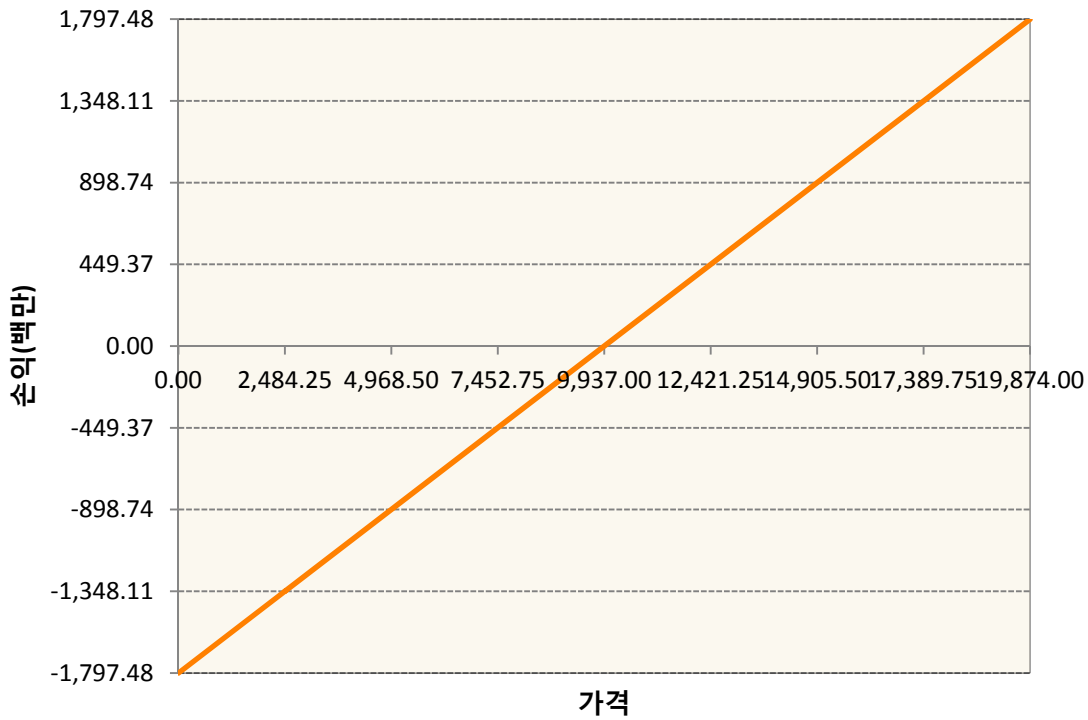
1. 계약금액

(단위:백만원)

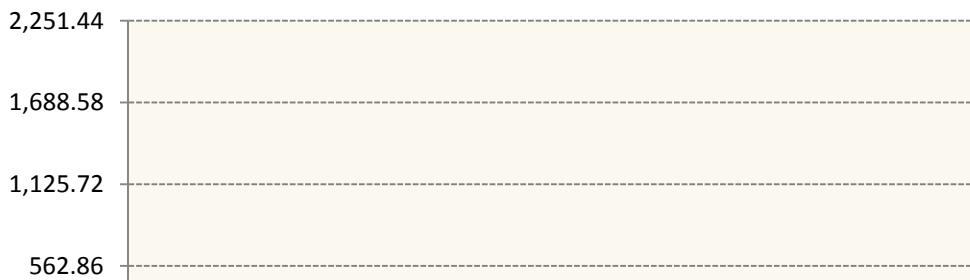
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,797	0	1,797	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,513	-5,513	장내
누계	통화	선도	459	3,243	-2,784	장외

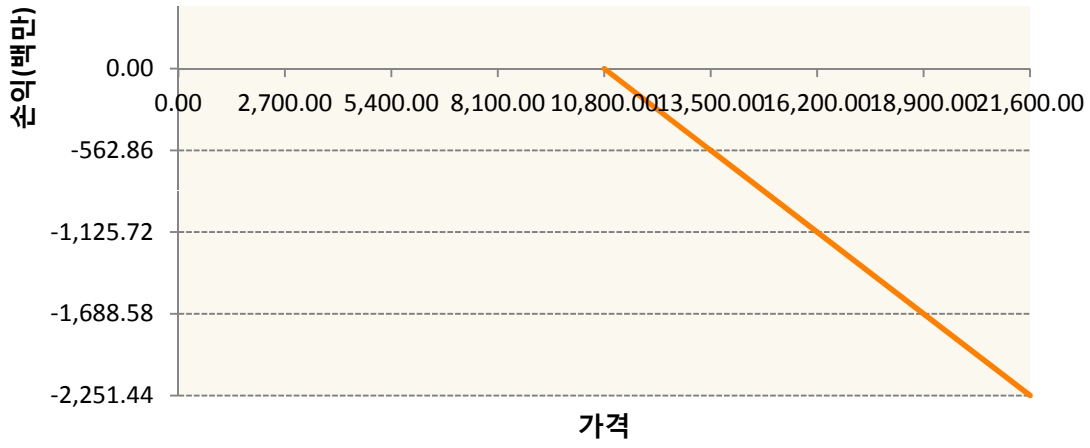
2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19

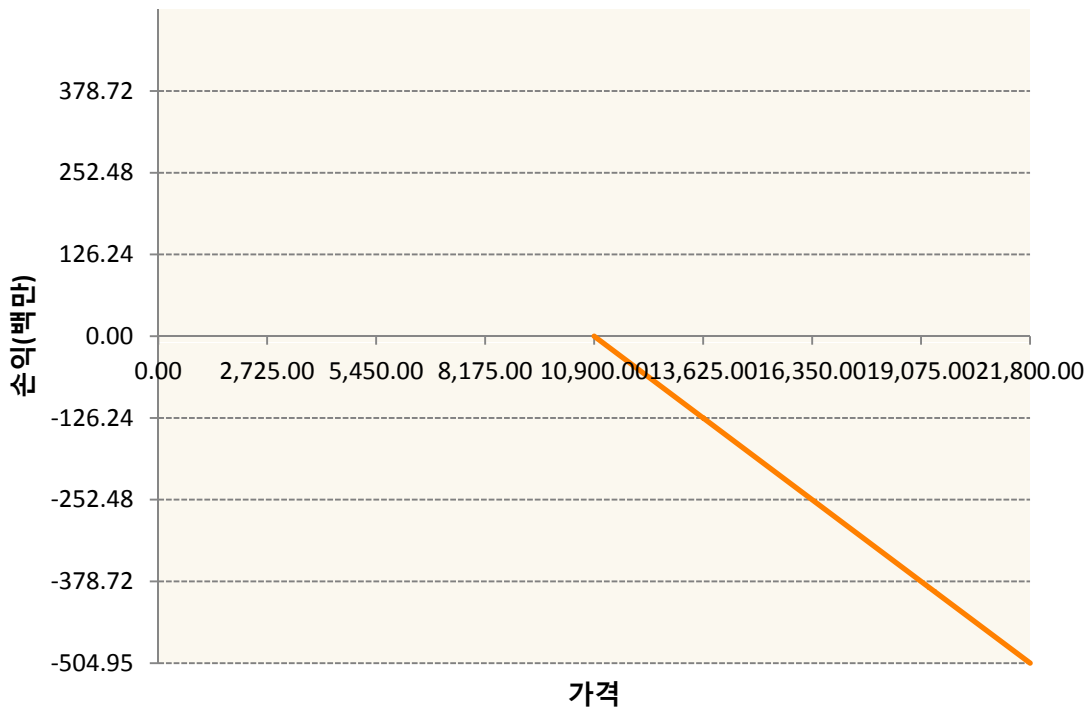


OHHIQ9-C108-HSCEI

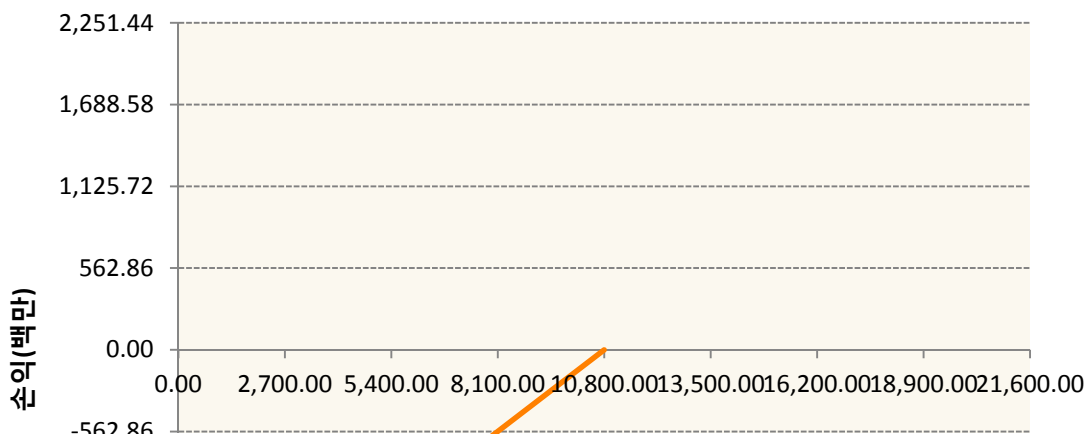


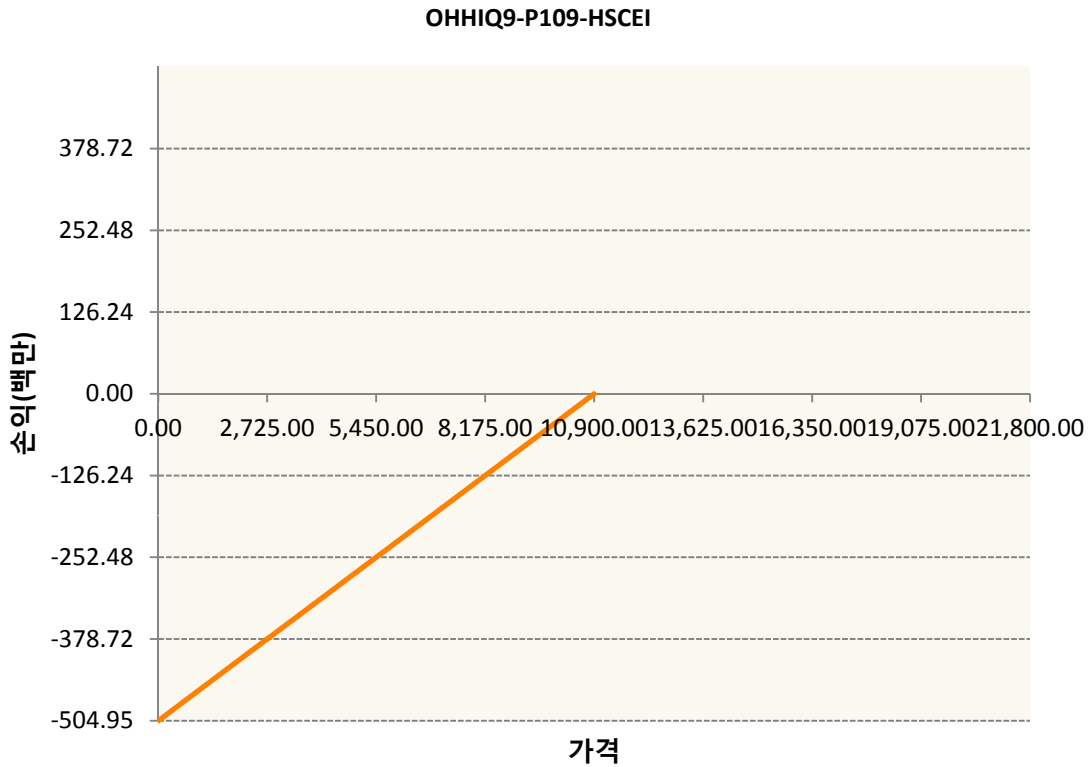


OHHIQ9-C109-HSCEI



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	144
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	2019-08-19
기준일	2019-08-16

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

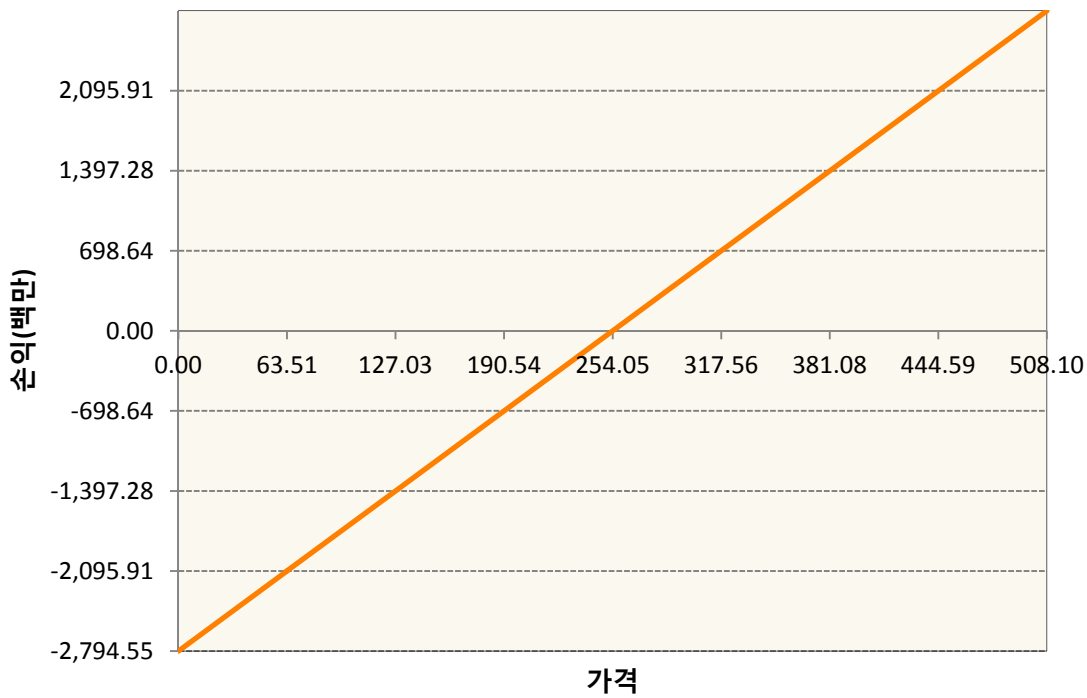
1. 계약금액

(단위:백만원)

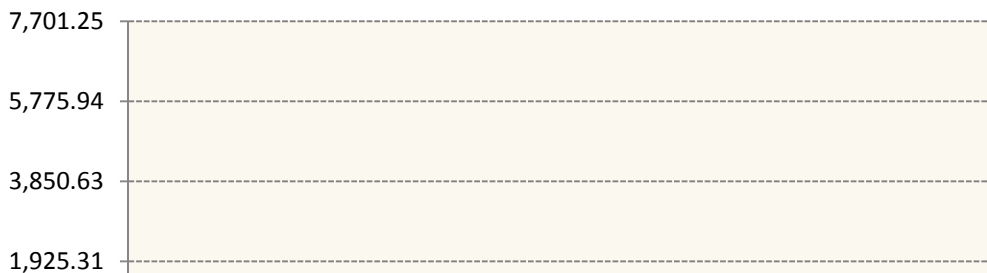
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,795	0	2,795	장내
누계	유가증권	스왑	17,125	0	17,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,018	-15,018	장내

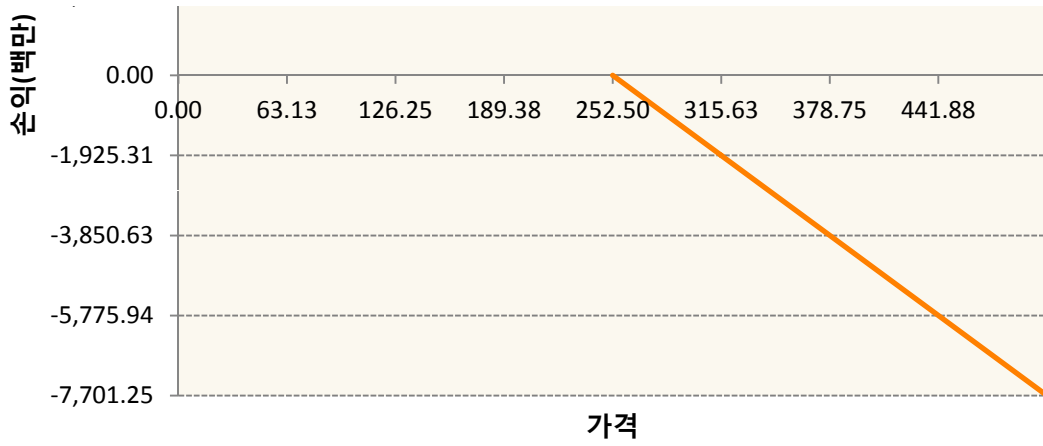
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

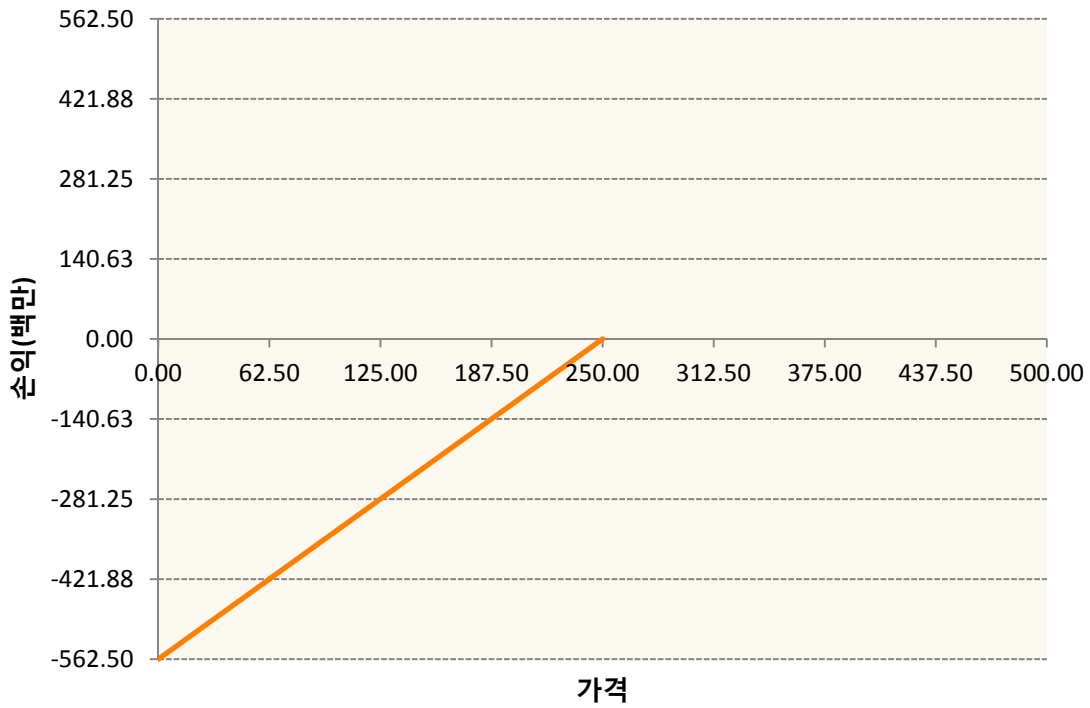


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

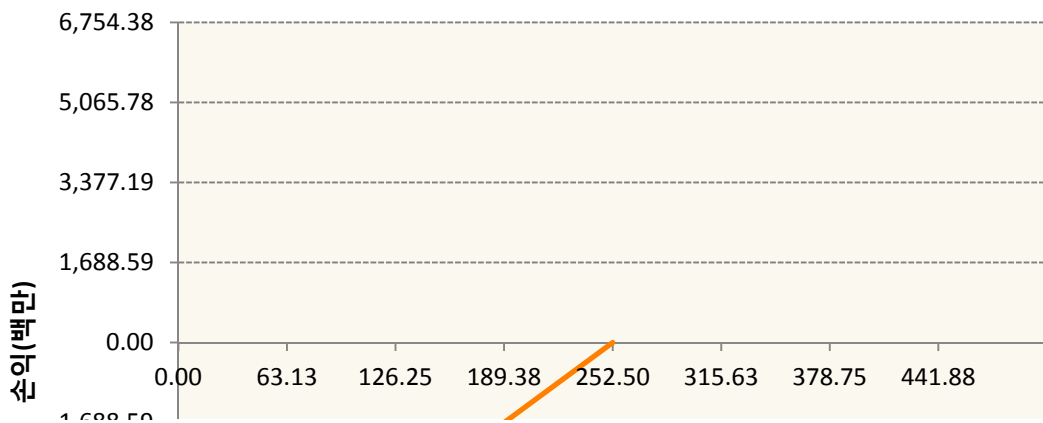




KR4301P92508-2019-09 풋250



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%	-989	-989	-989	-989	-989	-989	-989	
-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%	989	989	989	989	989	989	989	
8.00%	1,484	1,484	1,484	1,484	1,484	1,484	1,484	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						223
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-223	-223	-223	-223	-223	-223	-223	
-5.33%	-149	-149	-149	-149	-149	-149	-149	
-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%	149	149	149	149	149	149	149	
8.00%	223	223	223	223	223	223	223	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5						488
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	213	208	201	194	185	176	166	
-5.33%	191	181	170	157	145	132	118	
-2.67%	141	126	110	95	79	63	47	
0%	51	34	17	0	-17	-34	-51	
2.67%	-83	-97	-112	-127	-143	-159	-175	
5.33%	-250	-260	-271	-283	-295	-308	-322	
8.00%	-440	-445	-452	-460	-468	-478	-488	
KR4301P92508		2019-09 풋250						33
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-31	-31	-32	-32	-32	-32	-33
-5.33%	-17	-17	-18	-18	-19	-19	-20
-2.67%	-5	-6	-7	-7	-8	-9	-10
0%	2	2	1	0	-1	-2	-2
2.67%	5	5	4	4	3	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							421
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-411	-411	-412	-414	-416	-418	-421
-5.33%	-235	-238	-242	-246	-251	-257	-263
-2.67%	-80	-87	-95	-104	-112	-121	-129
0%	29	19	10	0	-10	-19	-29
2.67%	82	75	68	61	53	45	37
5.33%	98	96	92	88	84	79	73
8.00%	101	101	100	98	96	94	91

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

(단위:백만원)

2,624

공시일	2019-08-19
기준일	2019-08-16

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

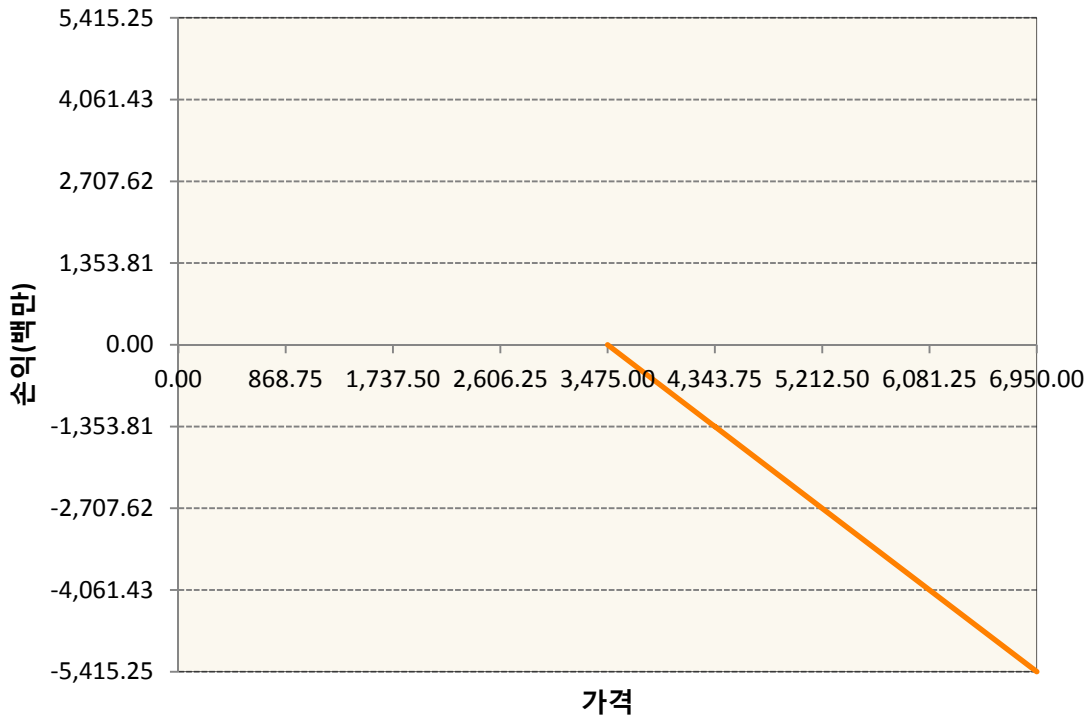
1. 계약금액

(단위:백만원)

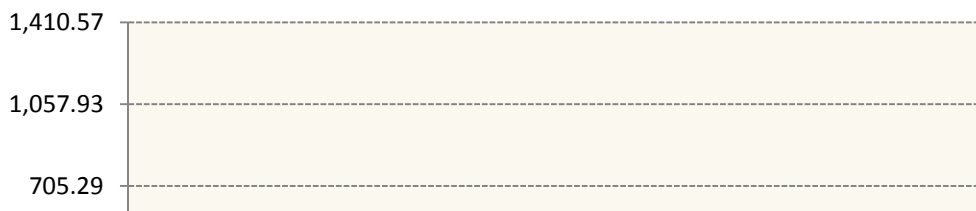
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,639	0	3,639	
누계	유가증권	옵션	0	13,652	-13,652	장내
누계	지수	스왑	28,403	0	28,403	장외
누계	통화	선도	14,509	22,838	-8,329	장외

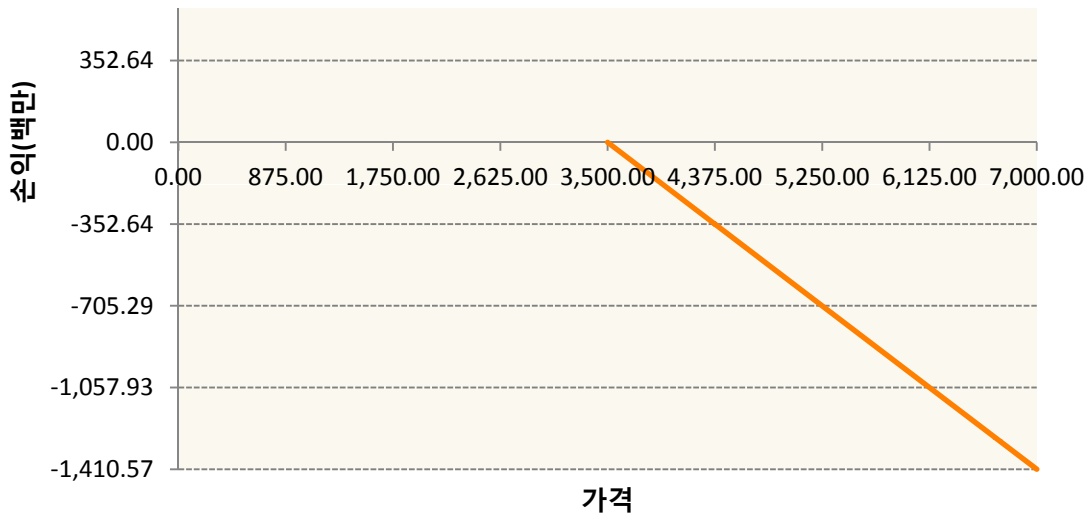
2. 만기시점의 손익구조

OESXQ9-C3475-EURO STOXX 50

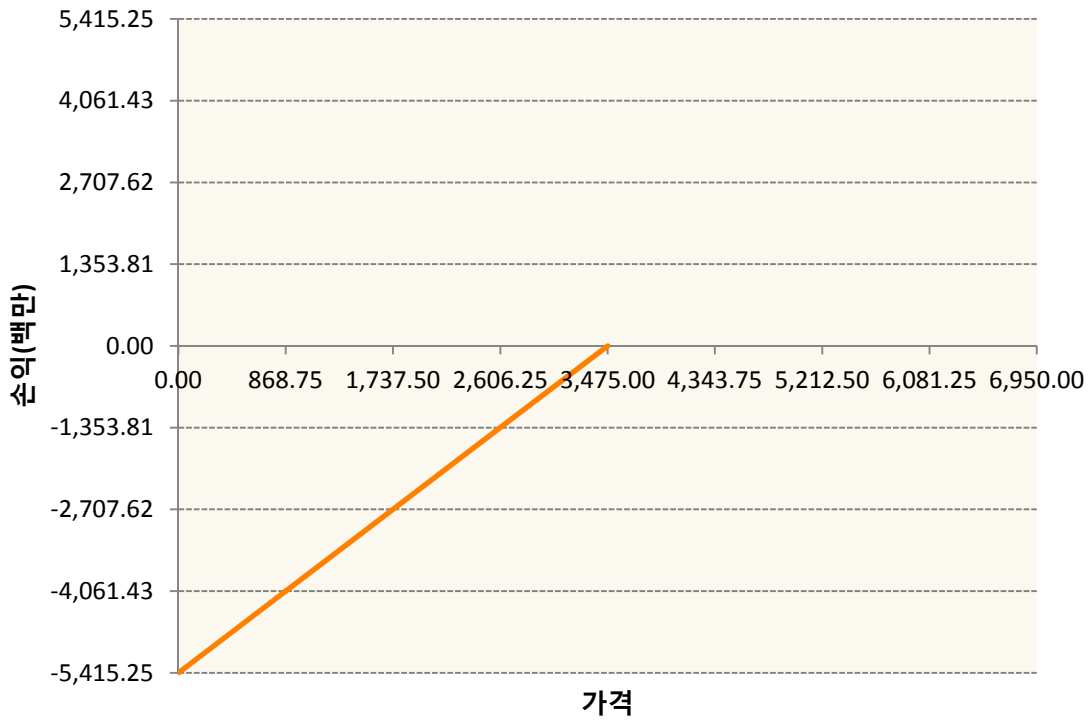


OESXQ9-C3500-EURO STOXX 50

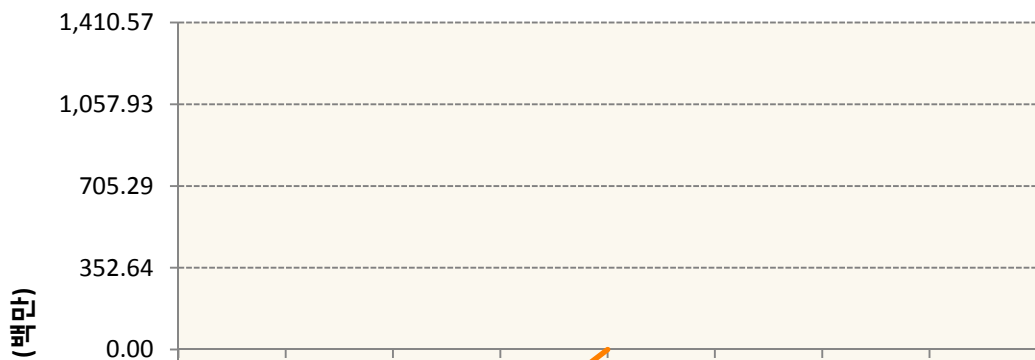


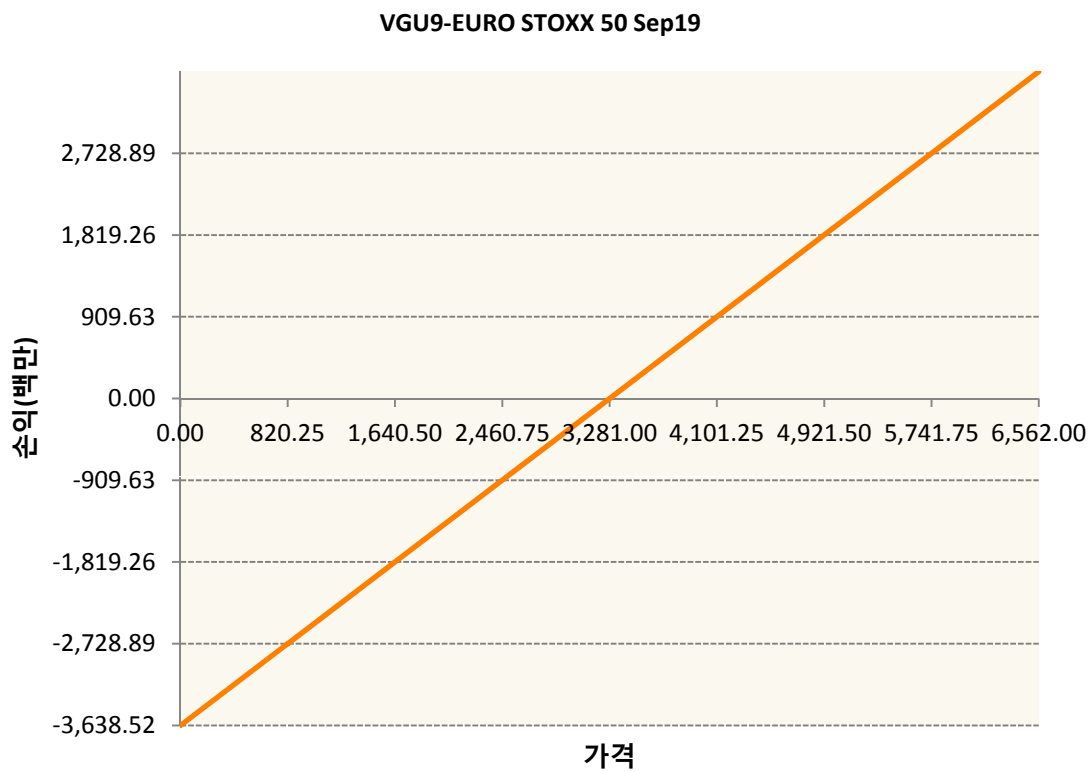
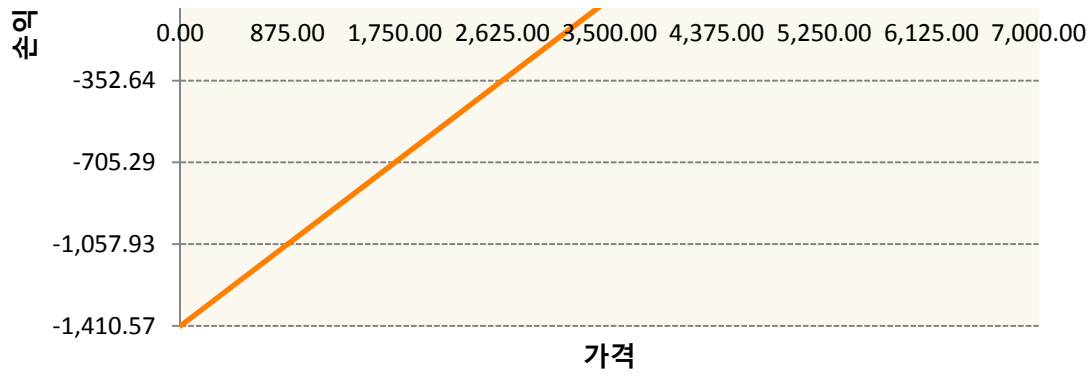


OESXQ9-P3475-EURO STOXX 50



OESXQ9-P3500-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	96
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	430
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E	1,075
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	322
FX21019N01 EUR/KRW 23-08-19E	430
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E	322
FX21019N04 EUR/KRW 27-09-19E	236
FX21019Q00 EUR/KRW 27-09-19E	172
OESXQ9-C34 EURO STOXX 50	433
OESXQ9-C35 EURO STOXX 50	113
OESXQ9-P34 EURO STOXX 50	433

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

113
291

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

(단위:백만원)

2,509

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

(단위:백만원)

922

공시일	2019-08-19
기준일	2019-08-16

ETF스마트레버리지목표전환형9호

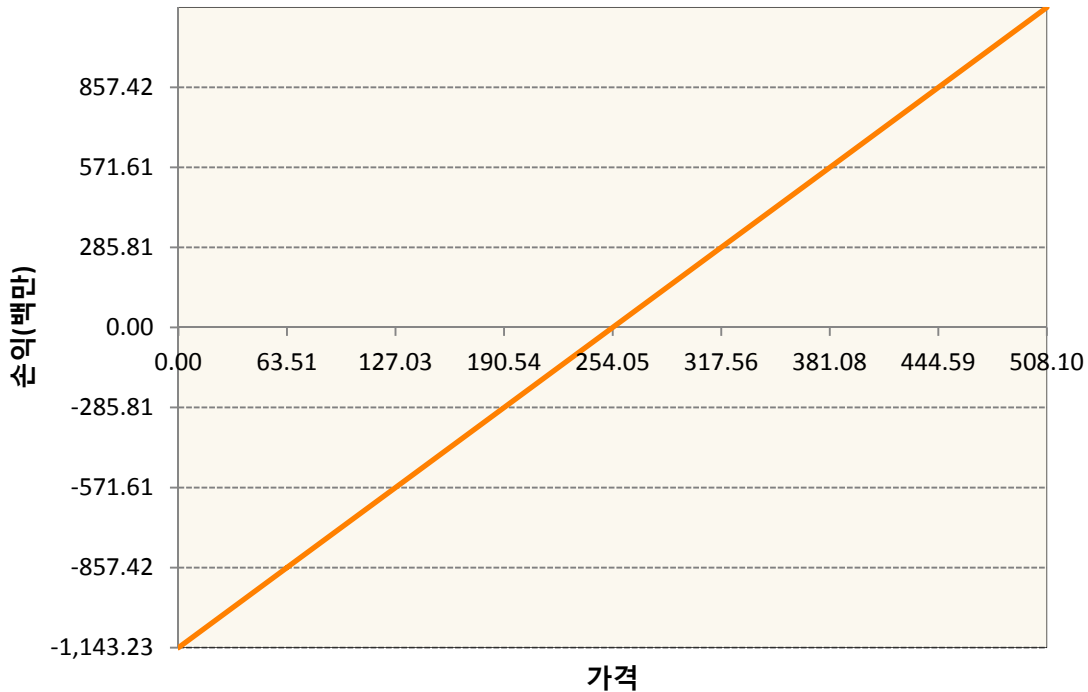
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,143	0	1,143	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						91
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91	
-5.33%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61	
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	30	30	30	30	30	30	30	
5.33%	61	61	61	61	61	61	61	
8.00%	91	91	91	91	91	91	91	

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

(단위:백만원)

78

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

(단위:백만원)

121

공시일	2019-08-19
기준일	2019-08-16

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

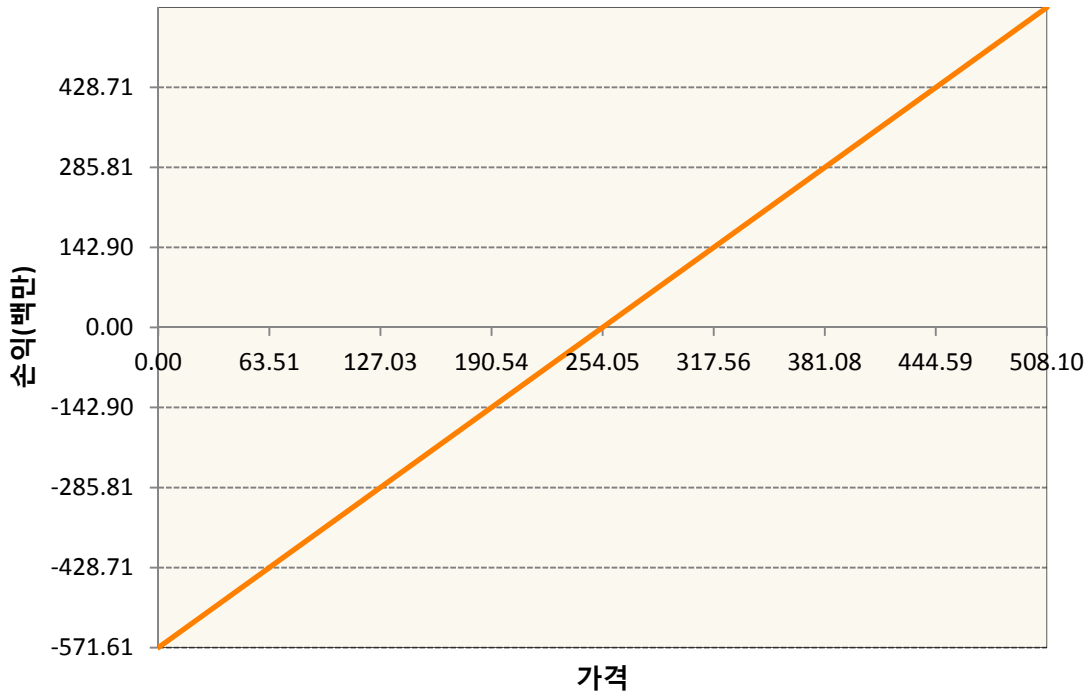
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	572	0	572	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%	-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%	46	46	46	46	46	46	46	

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

(단위:백만원)

39

공시일	2019-08-19
기준일	2019-08-16

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

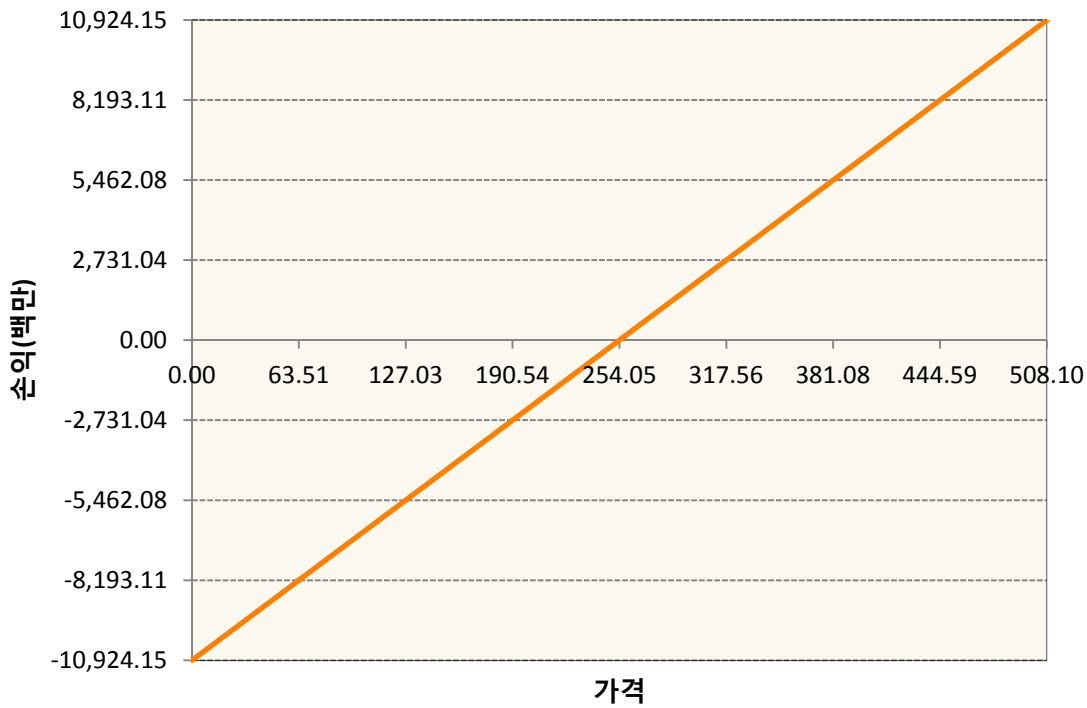
1. 계약금액

(단위:백만원)

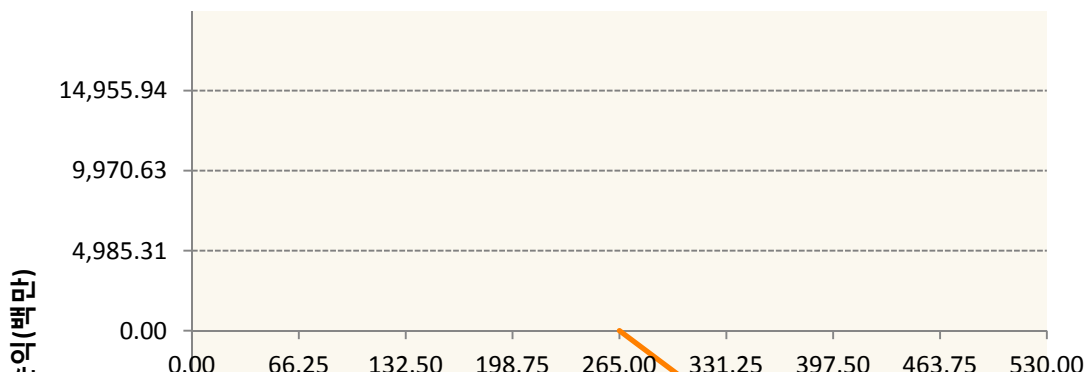
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,924	0	10,924	장내
누계	유가증권	옵션	3,659	20,075	-16,416	장내

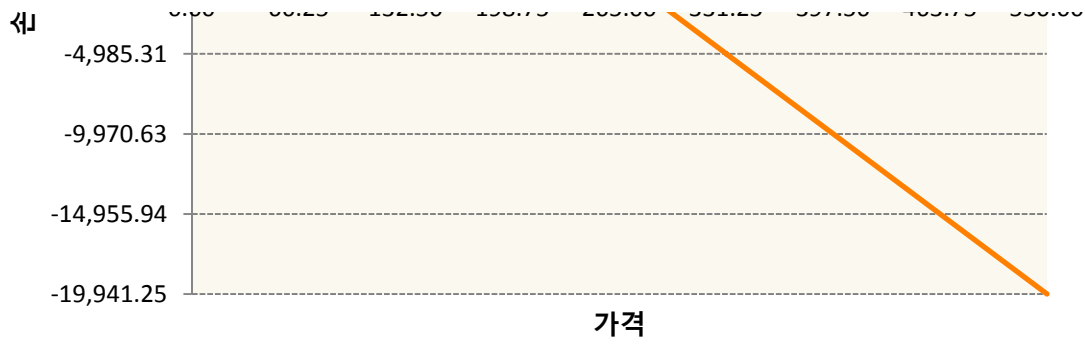
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

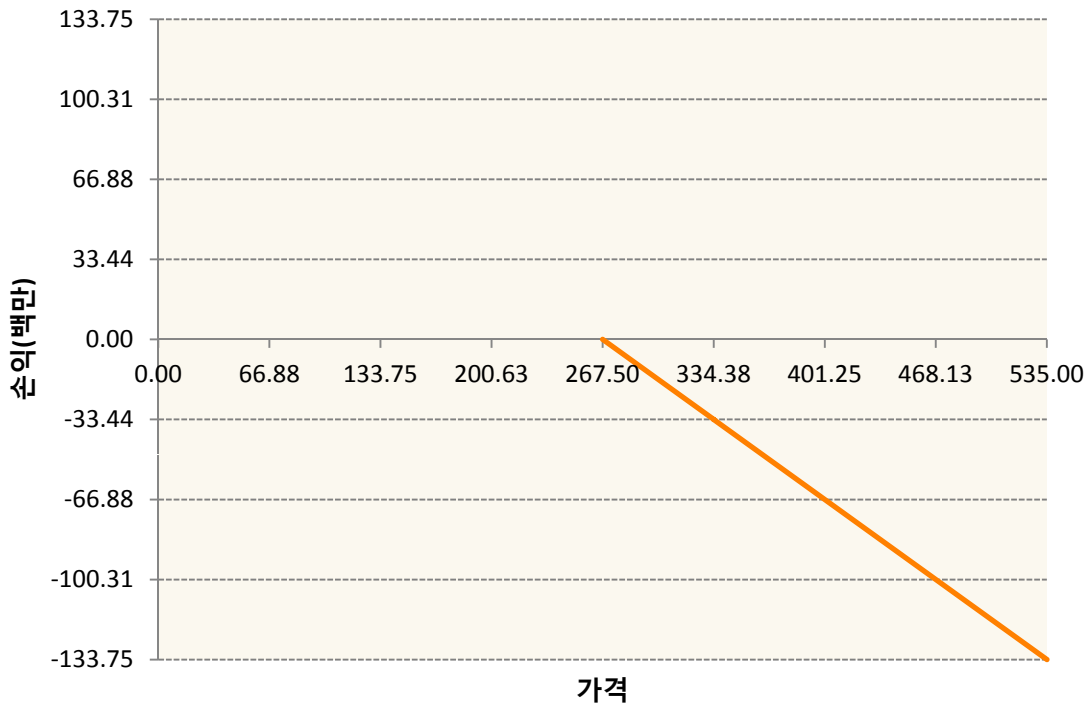


KR4201P92658-2019-09 콜265

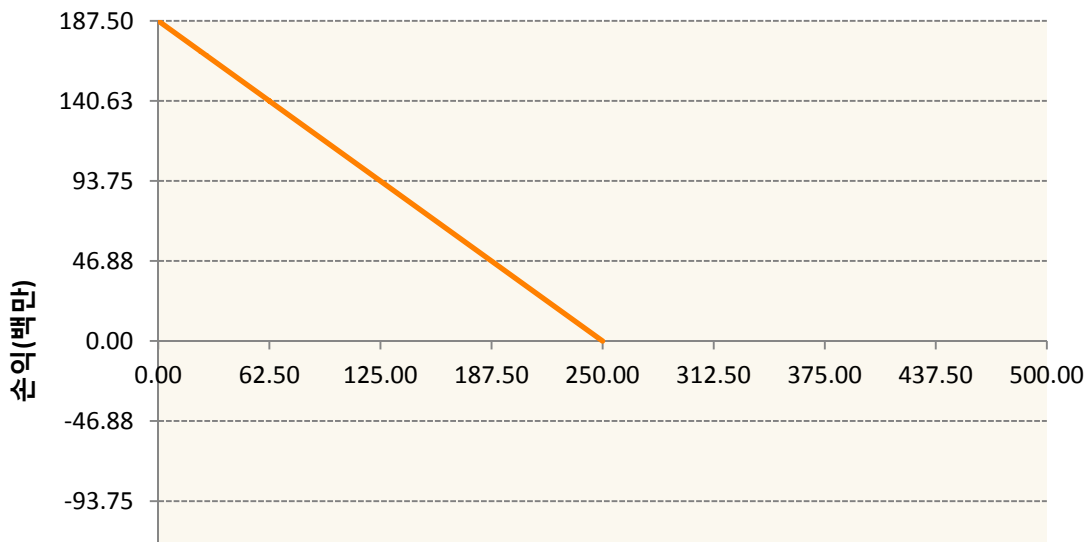


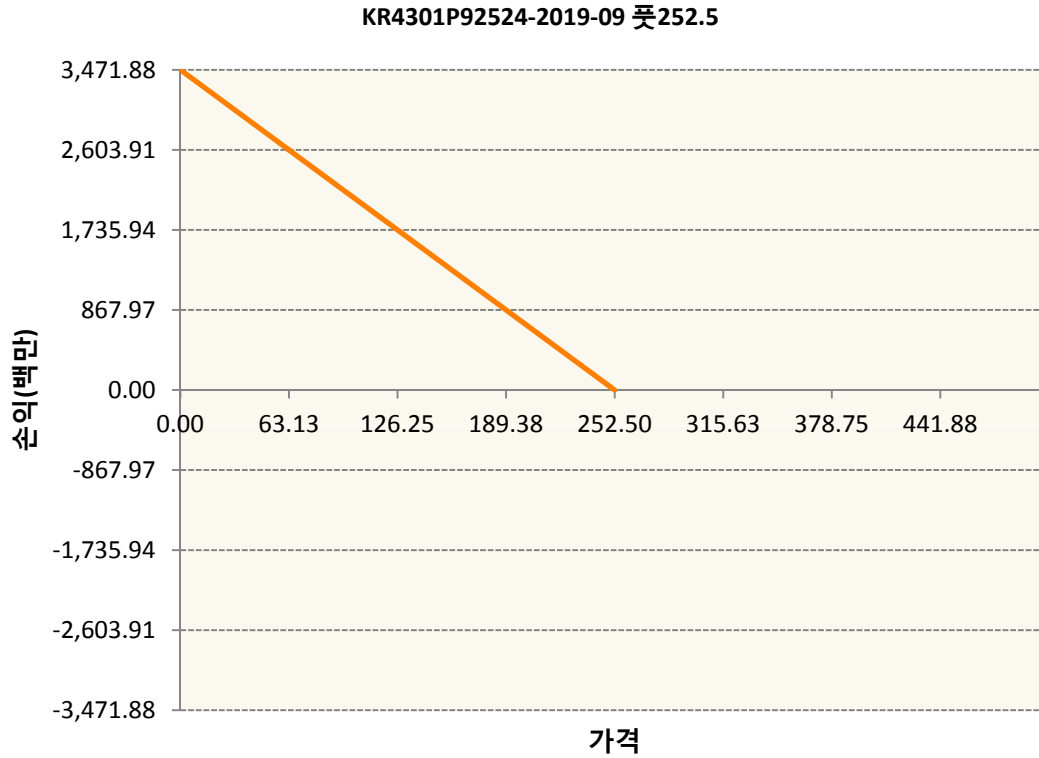
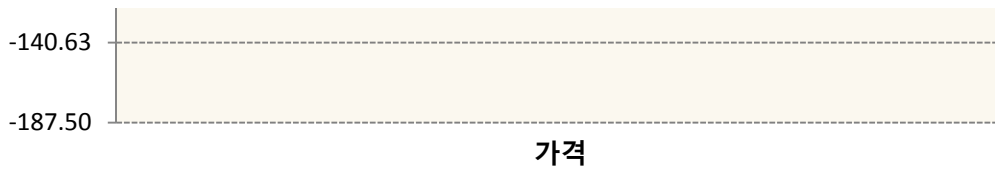


KR4201P92674-2019-09 콜267.5



KR4301P92508-2019-09 풋250





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						873
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-873	-873	-873	-873	-873	-873	-873	
-5.33%	-582	-582	-582	-582	-582	-582	-582	
-2.67%	-291	-291	-291	-291	-291	-291	-291	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	291	291	291	291	291	291	291	
5.33%	582	582	582	582	582	582	582	
8.00%	873	873	873	873	873	873	873	
KR4201P92658		2019-09 콜265						861
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	195	193	189	184	176	167	155	
-5.33%	188	181	171	159	144	127	107	
-2.67%	164	147	127	104	79	52	24	

0%	96	66	34	0	-35	-71	-108
2.67%	-46	-87	-129	-170	-212	-255	-297
5.33%	-286	-330	-374	-417	-461	-505	-548
8.00%	-627	-663	-701	-740	-780	-820	-861

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	-2	-3	-3	-3
8.00%	-4	-4	-4	-4	-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	11	11	11	11	11
-5.33%	6	6	6	6	6	6	7
-2.67%	2	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	-2
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2

KR4301P92524 2019-09 풋252.5 217

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	211	211	212	213	214	215	217
-5.33%	121	122	124	127	129	132	135
-2.67%	41	45	49	53	58	62	66
0%	-15	-10	-5	0	5	10	15
2.67%	-42	-39	-35	-31	-27	-23	-19
5.33%	-50	-49	-47	-45	-43	-41	-38
8.00%	-52	-52	-51	-51	-50	-48	-47

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

(단위:백만원)

1,594

공시일	2019-08-19
기준일	2019-08-16

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	515	-515	
누계	유가증권	수익증권	56,615	0	56,615	

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	2019-08-19
기준일	2019-08-16

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,058	0	2,058	
누계	유가증권	수익증권	75,601	0	75,601	

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	2019-08-19
기준일	2019-08-16

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,422	0	2,422	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	467,417	0	467,417	
누계	통화	선도	0	551,035	-551,035	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		1,744
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,131
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		136
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		581
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		3,100
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		3,390
FX21019N02 KRW/USD 19-08-19E		484
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		969
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	3,197
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E	2,170
FX21019Q01 KRW/USD 16-09-19E	97
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,971
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,584

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

(단위:백만원)

14,472

공시일	2019-08-19
기준일	2019-08-16

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

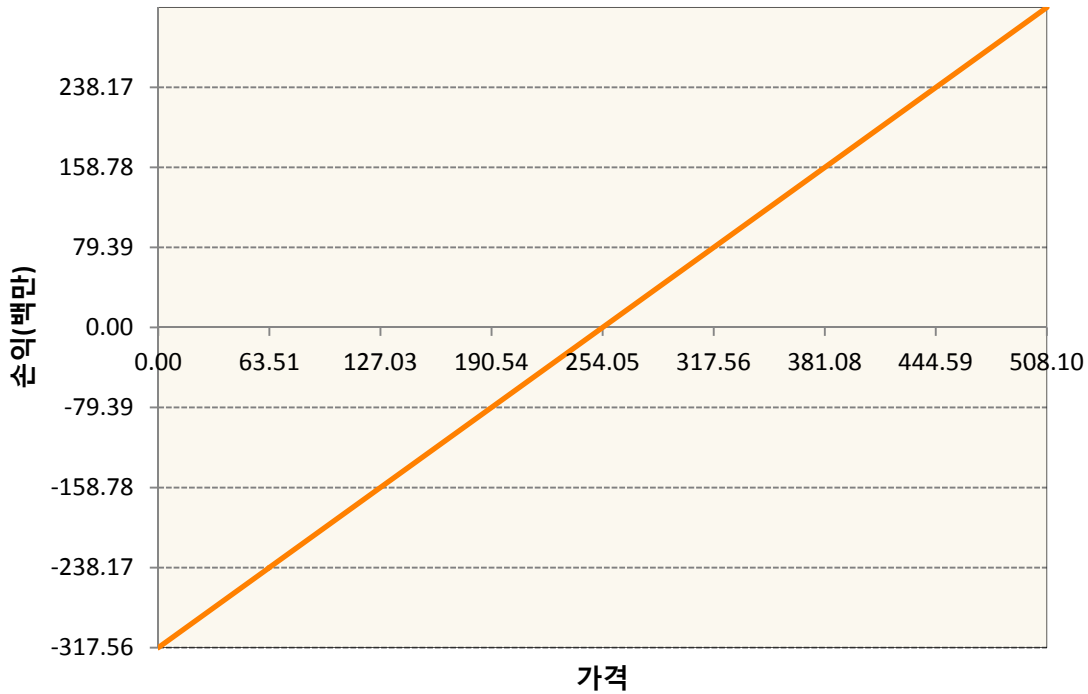
1. 계약금액

(단위:백만원)

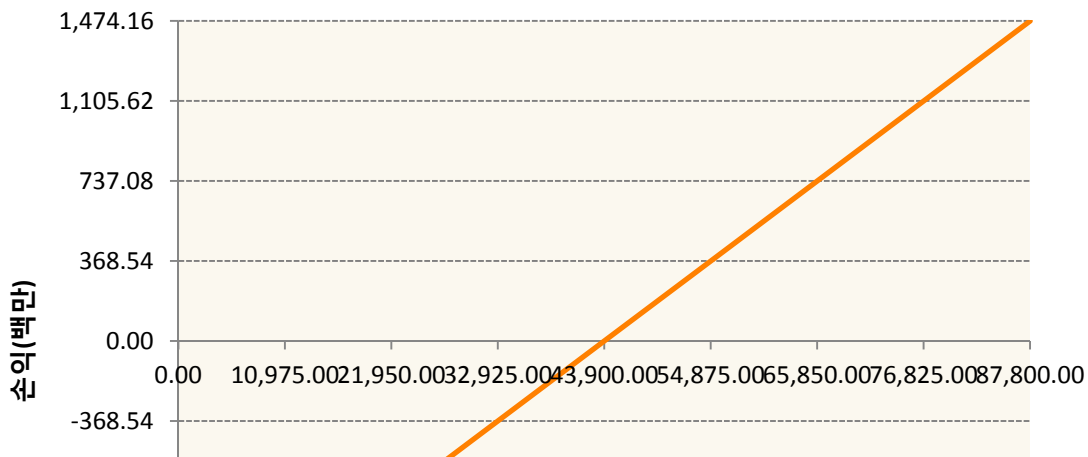
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,792	0	1,792	장내

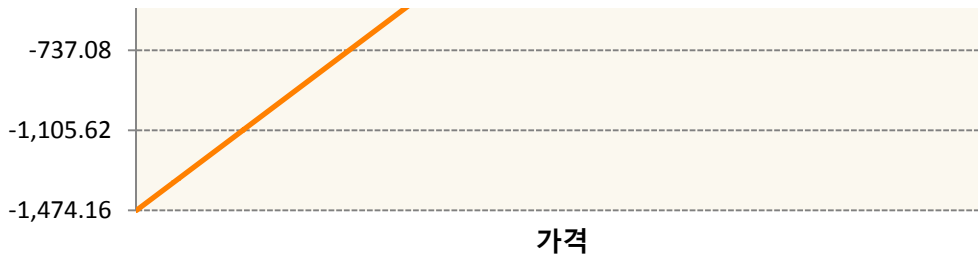
2. 만기시점의 손익구조

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						118
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118	
-5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79	
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	39	39	39	39	39	39	39	
5.33%	79	79	79	79	79	79	79	
8.00%	118	118	118	118	118	118	118	

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

170

공시일	2019-08-19
기준일	2019-08-16

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

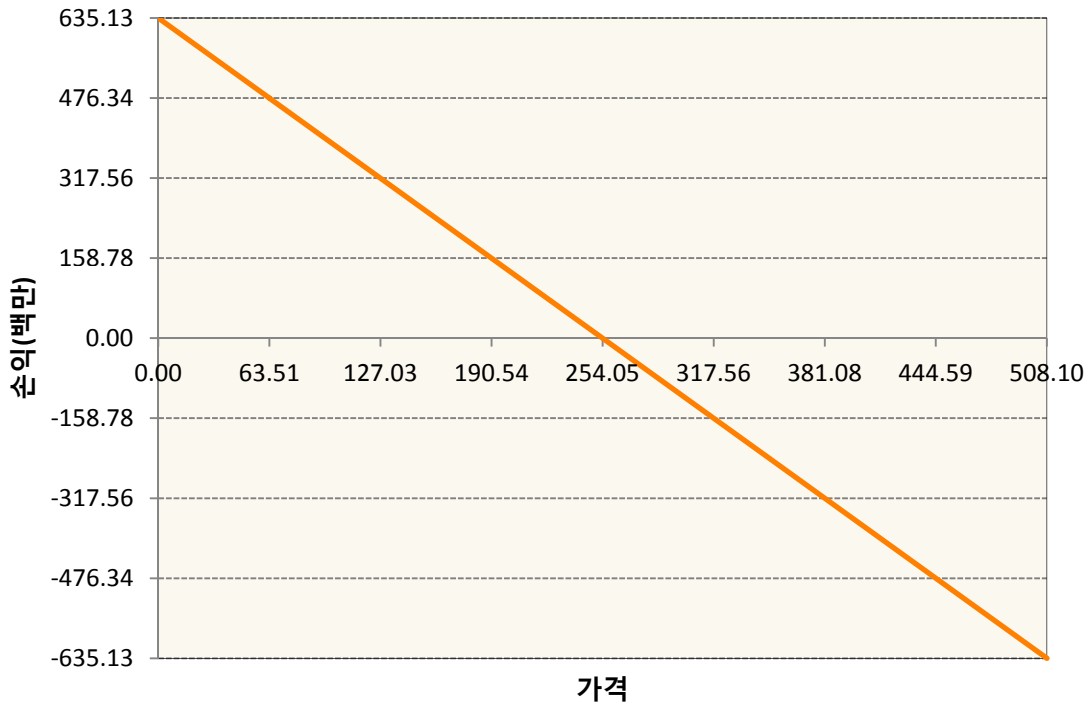
1. 계약금액

(단위:백만원)

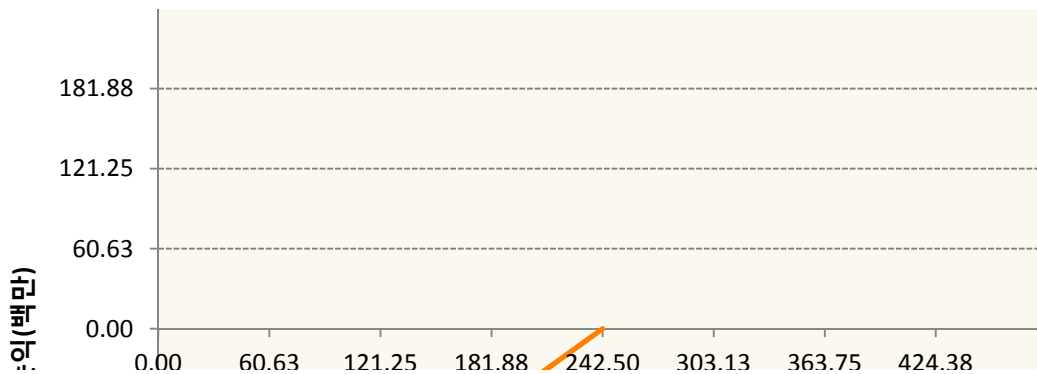
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	635	-635	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,550	-3,550	장내

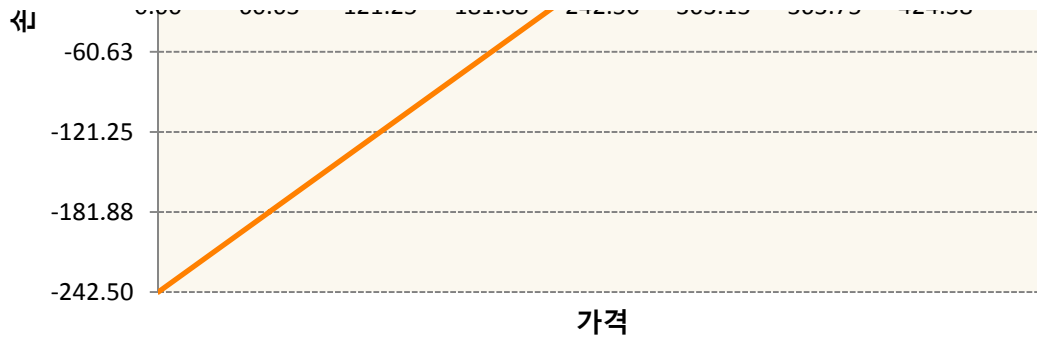
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

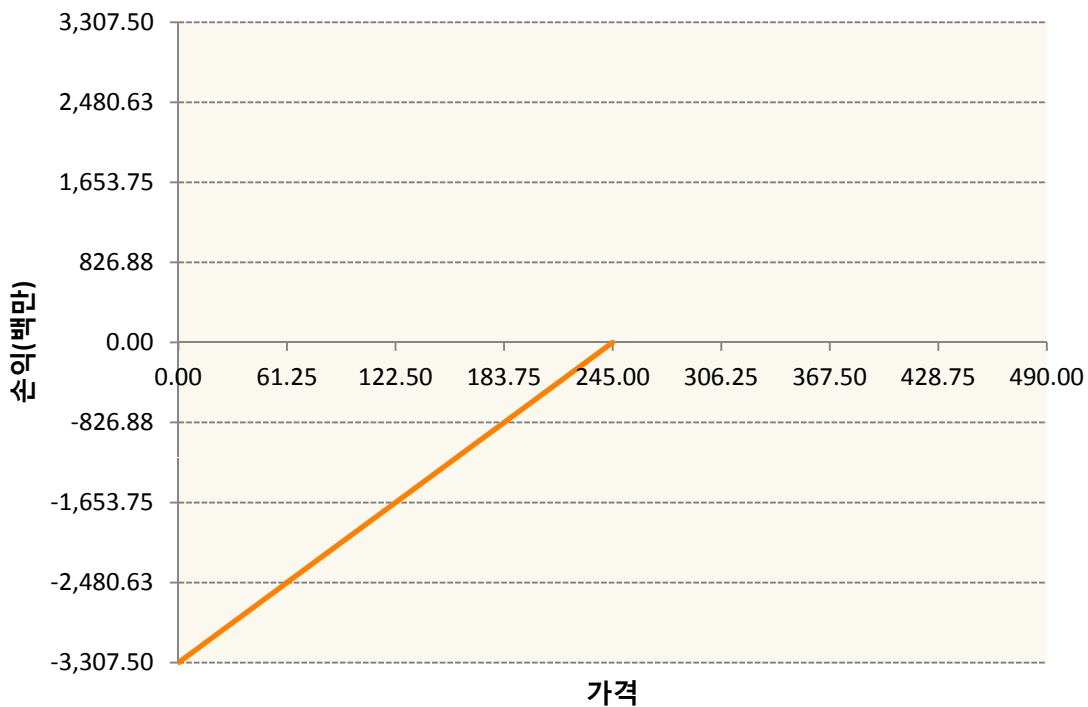


KR4301P92425-2019-09 풋242.5





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%	-9	-9	-9	-9	-10	-10	-10
-5.33%	-4	-4	-4	-5	-5	-5	-6
-2.67%	-1	-1	-1	-2	-2	-2	-3
0%	1	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

157

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-143	-145	-147	-149	-151	-154	-157
-5.33%	-66	-70	-74	-78	-82	-87	-91
-2.67%	-14	-19	-23	-28	-33	-37	-42
0%	9	7	3	0	-4	-7	-11
2.67%	16	15	14	12	10	8	5
5.33%	17	17	17	16	15	14	13
8.00%	17	17	17	17	17	17	16

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

(단위:백만원)

184

공시일	2019-08-19
기준일	2019-08-16

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	19,613	0	19,613	
누계	통화	선도	0	19,252	-19,252	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		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)

506

공시일	2019-08-19
기준일	2019-08-16

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	383	0	383	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	3

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

(단위:백만원)

32

공시일	2019-08-19
기준일	2019-08-16

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

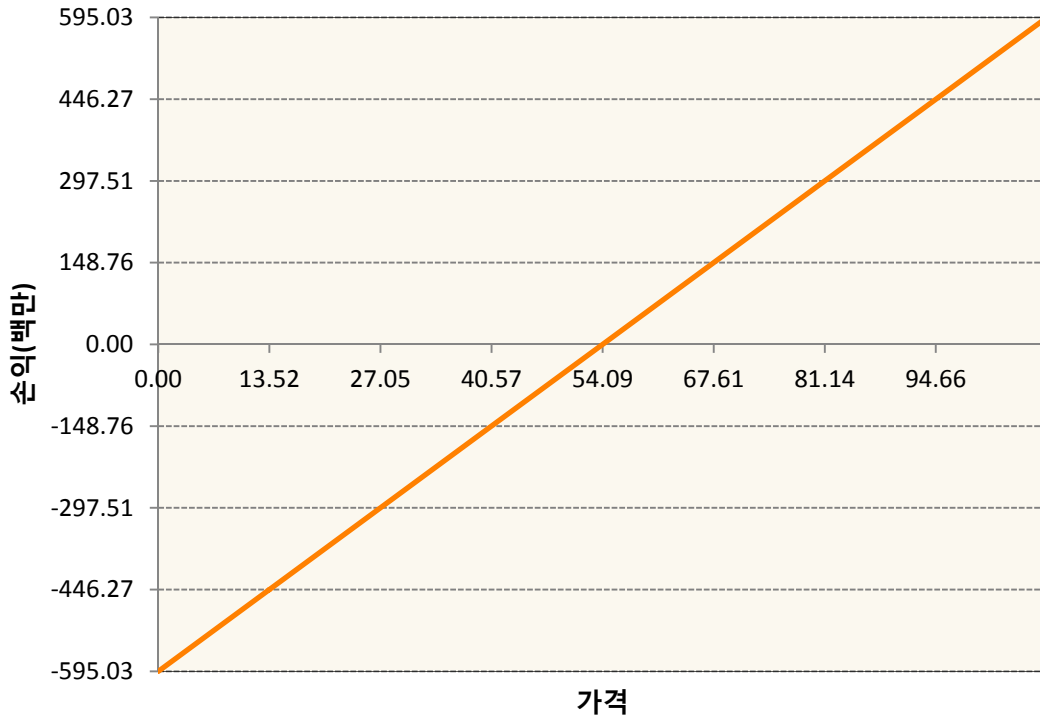
1. 계약금액

(단위:백만원)

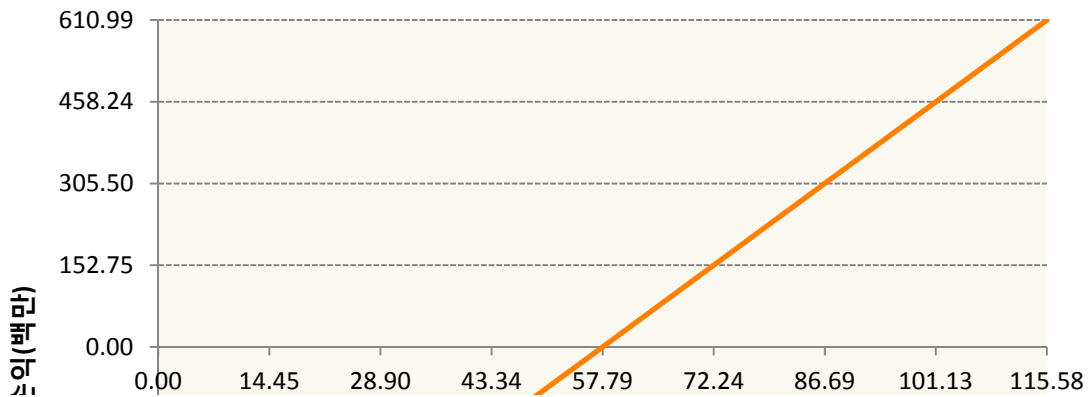
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,201	121	2,080	
누계	유가증권	선물	187	0	187	장내

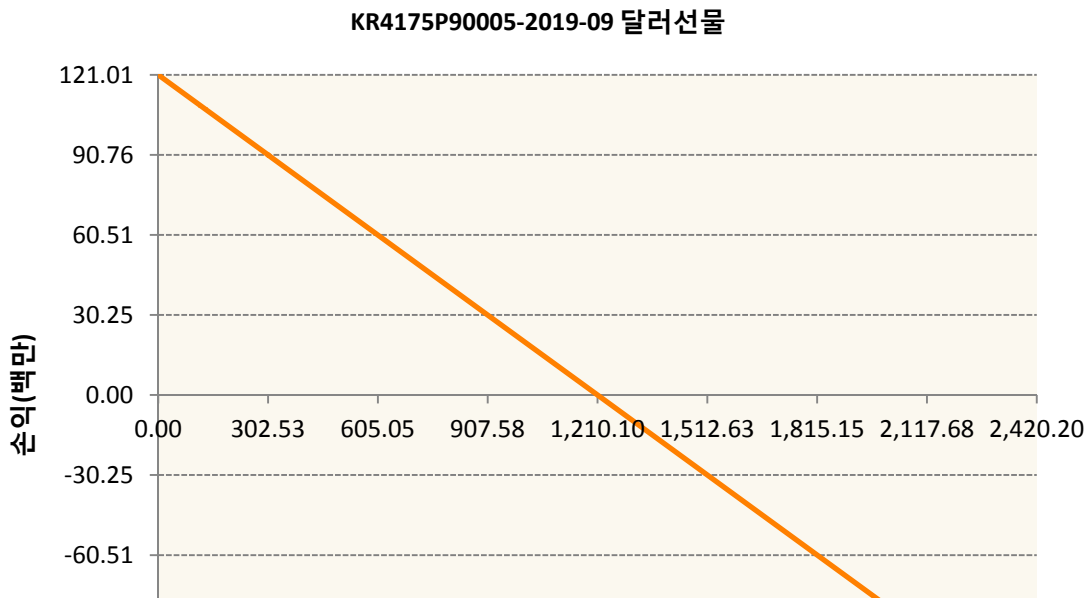
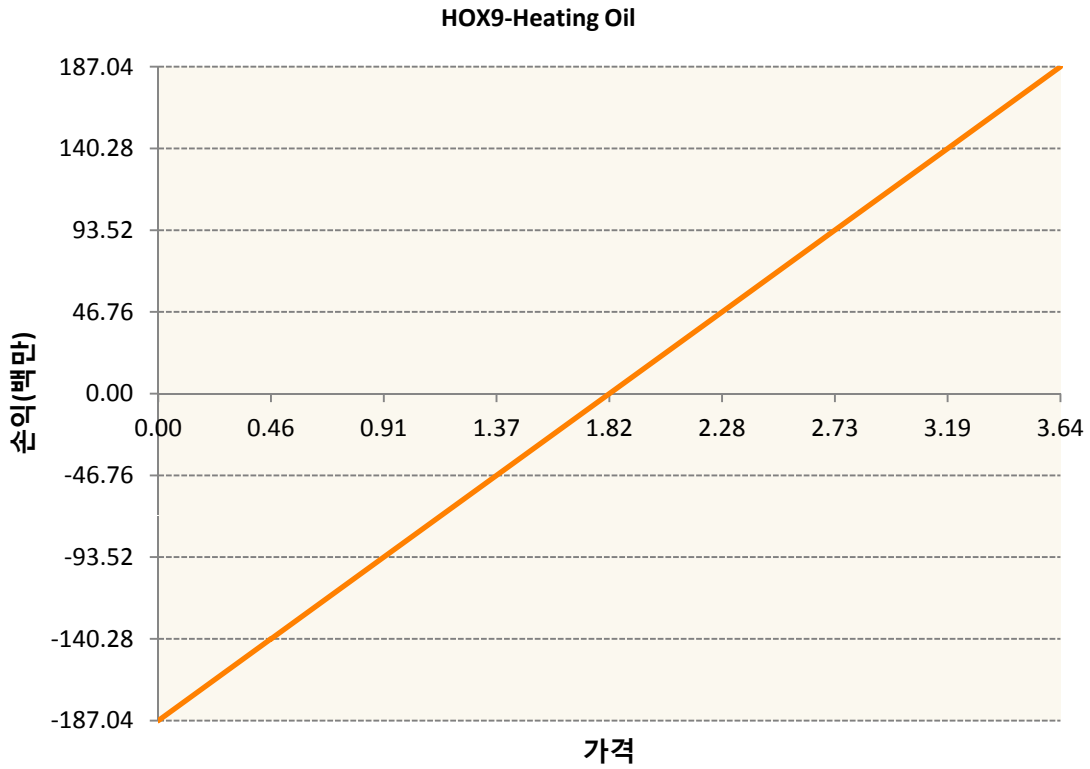
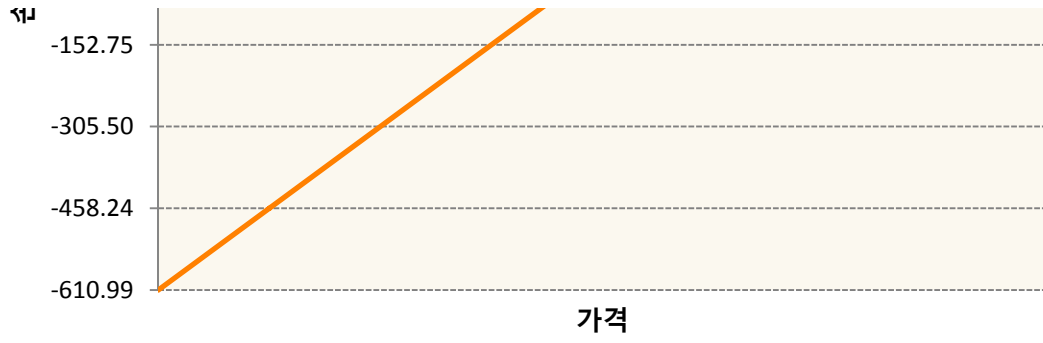
2. 만기시점의 손익구조

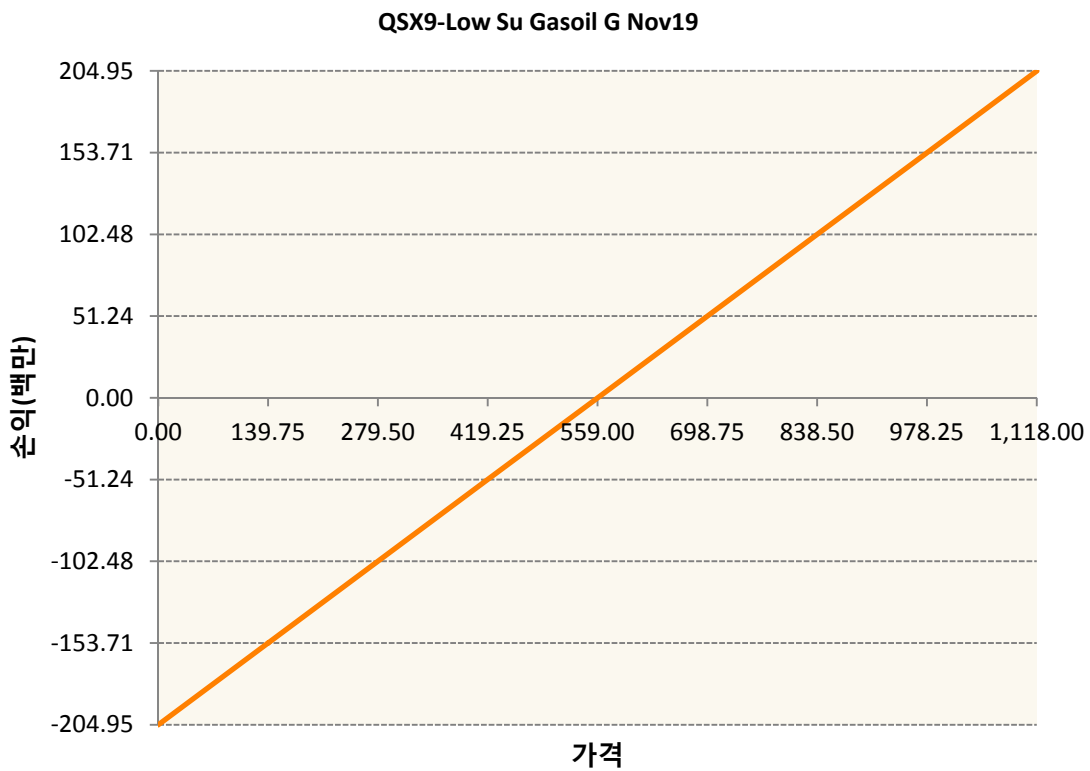
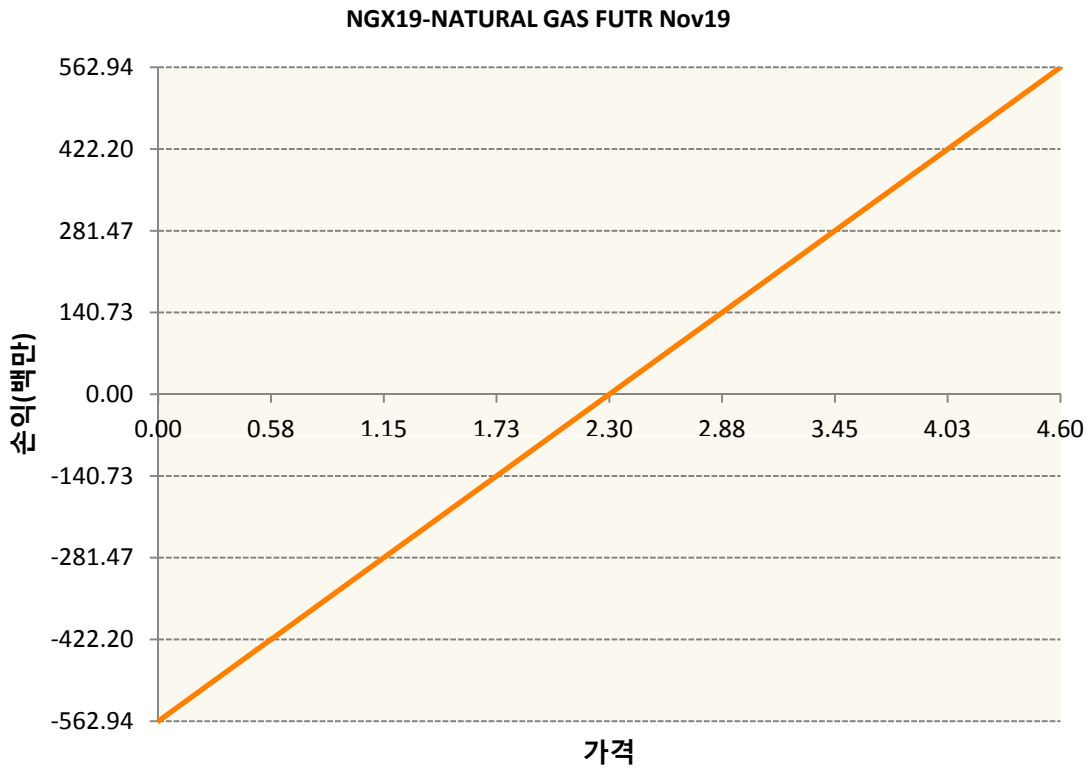
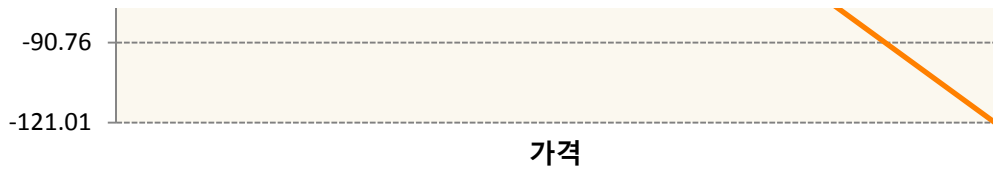
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19



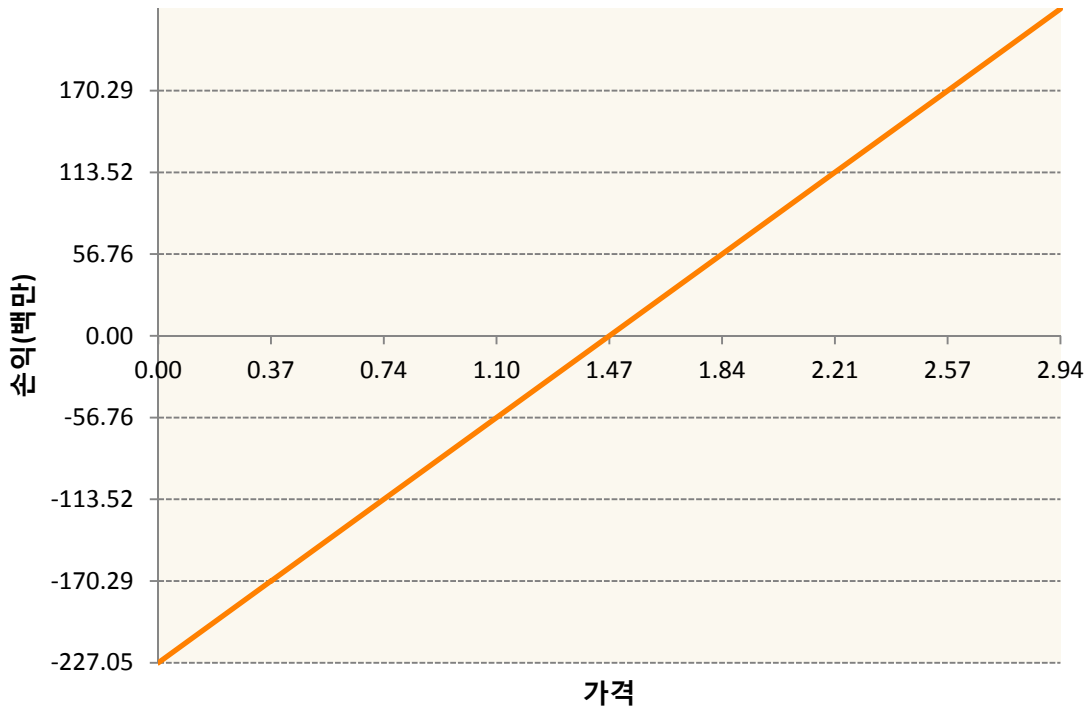
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19







XBX9-GASOLINE RBOB FUT Nov19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLX9	WTI CRUDE FUTURE Nov19	48
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	49
HOX9	Heating Oil	15
KR4175P900	2019-09 달러선물	10
NGX19	NATURAL GAS FUTR Nov19	45
QSX9	Low Su Gasoil G Nov19	16
XBX9	GASOLINE RBOB FUT Nov19	18

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

(단위:백만원)

366

공시일	2019-08-19
기준일	2019-08-16

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

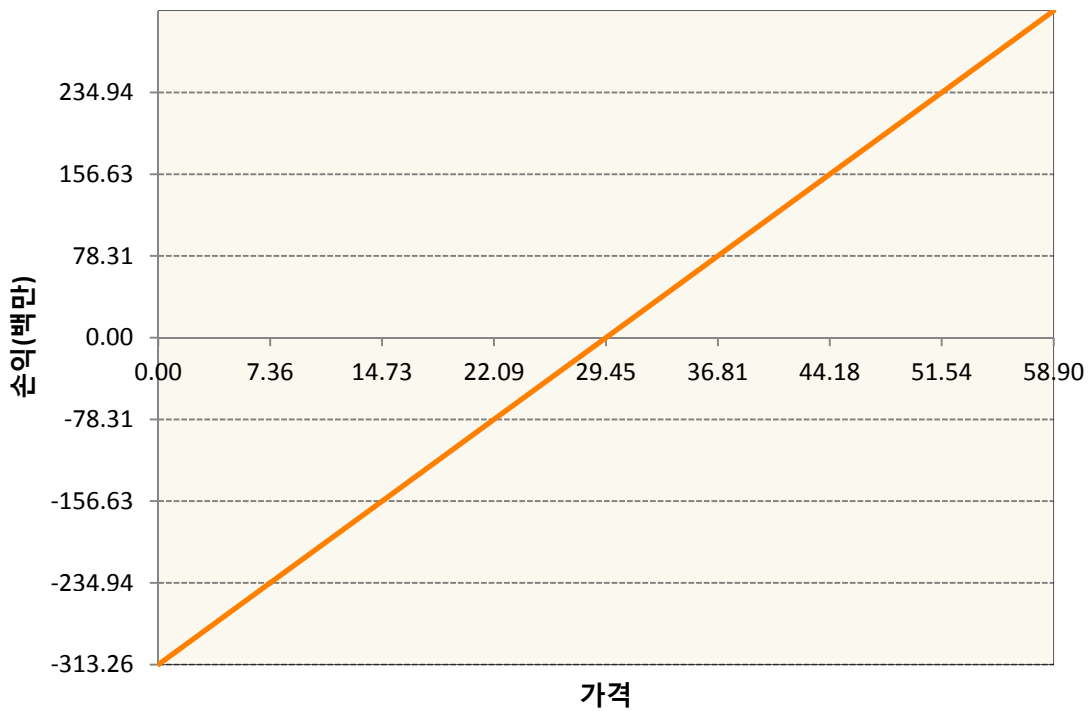
1. 계약금액

(단위:백만원)

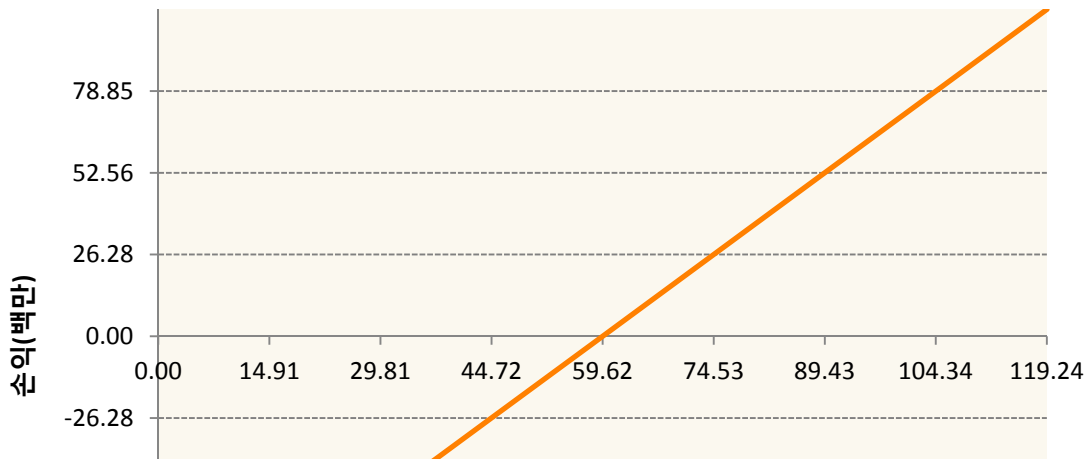
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,754	157	2,596	

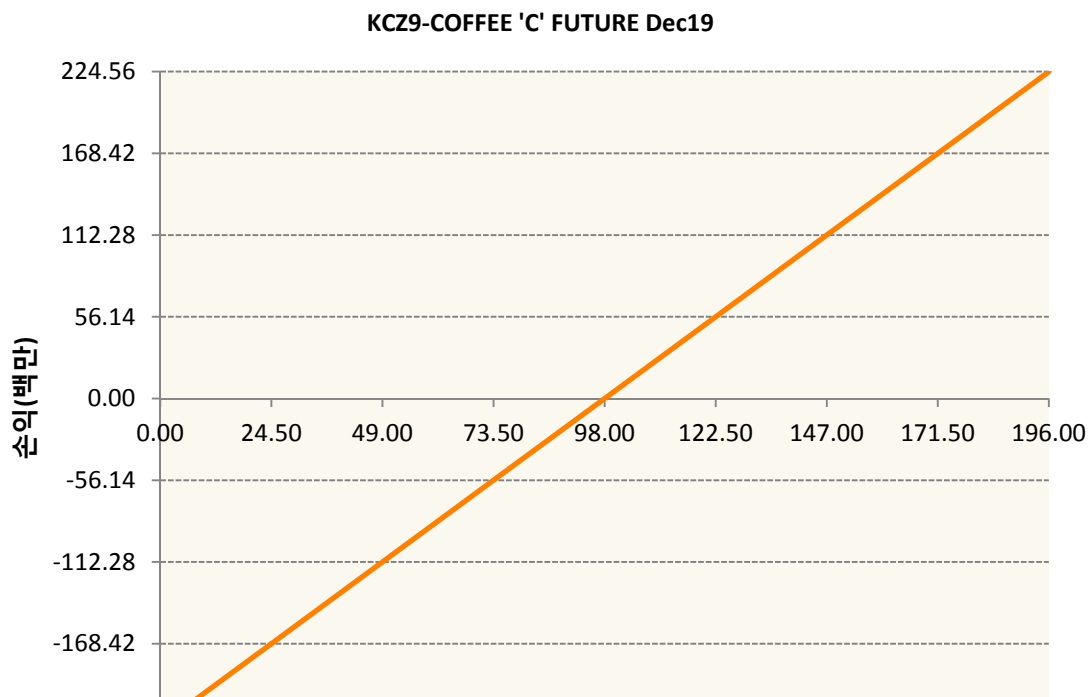
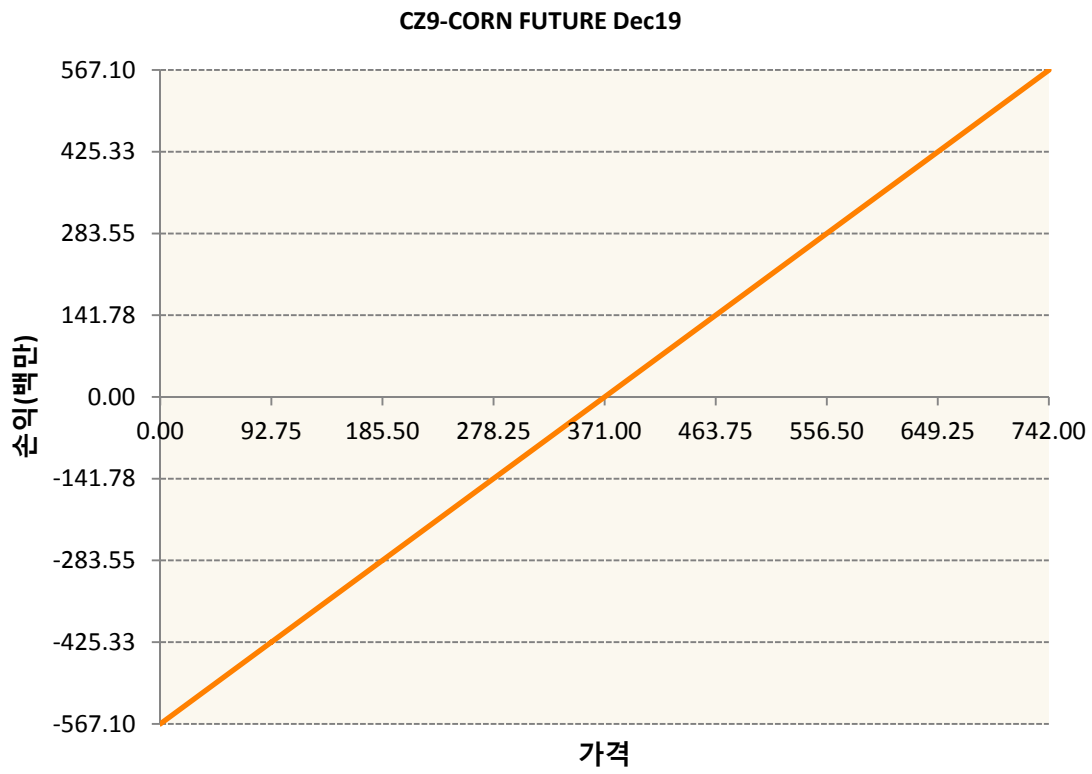
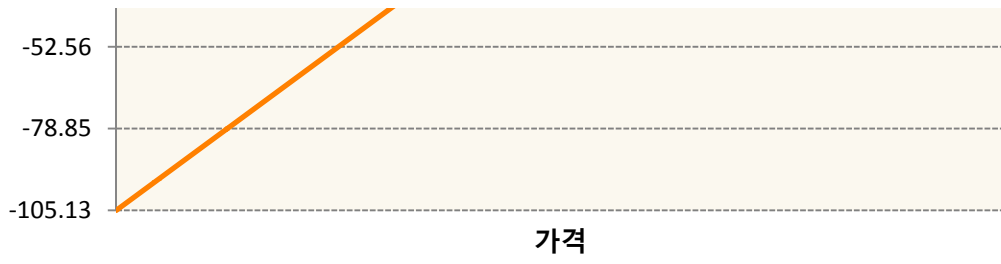
2. 만기시점의 손익구조

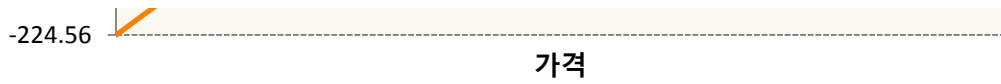
BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19



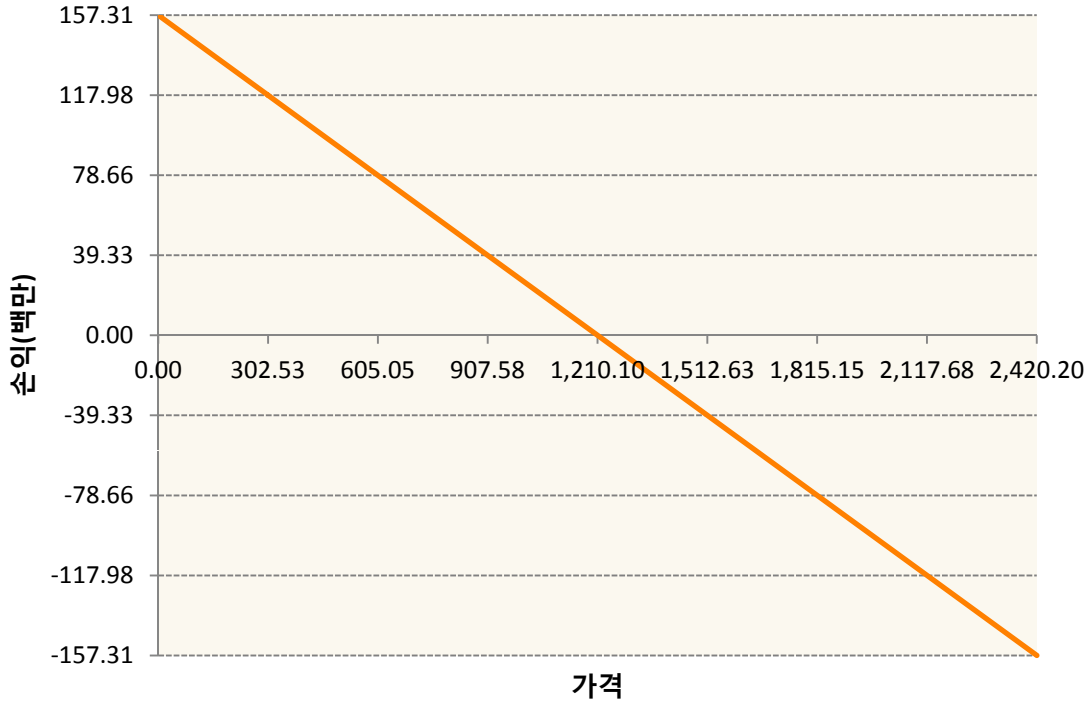
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



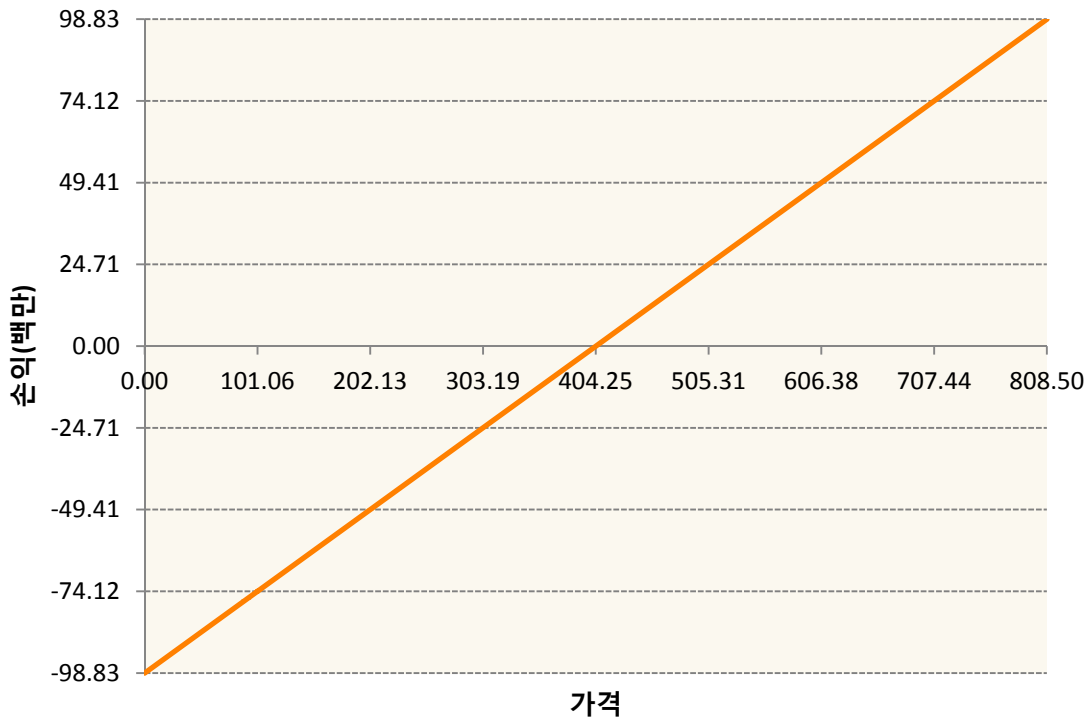




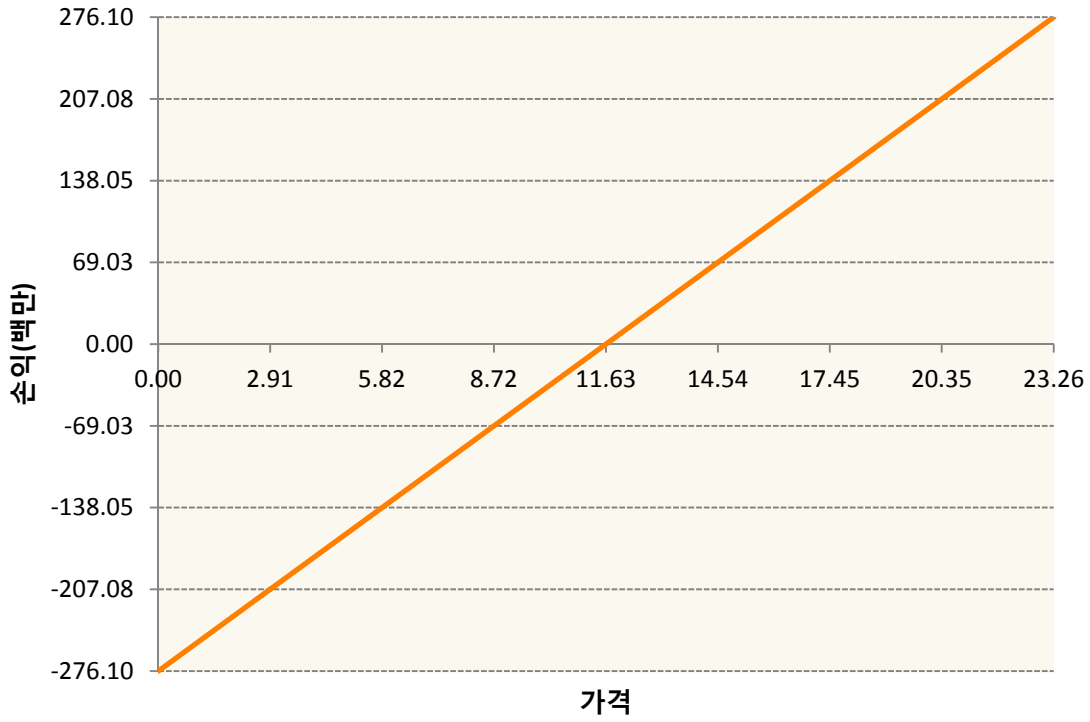
KR4175P90005-2019-09 달러선물



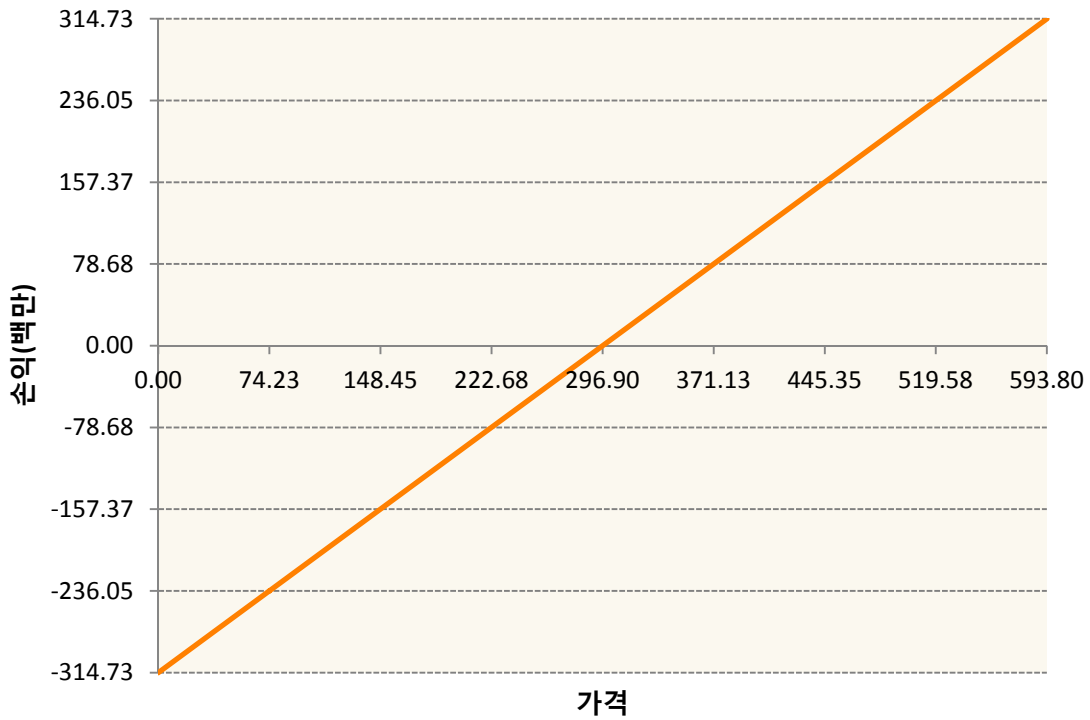
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



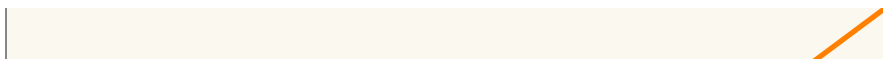
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

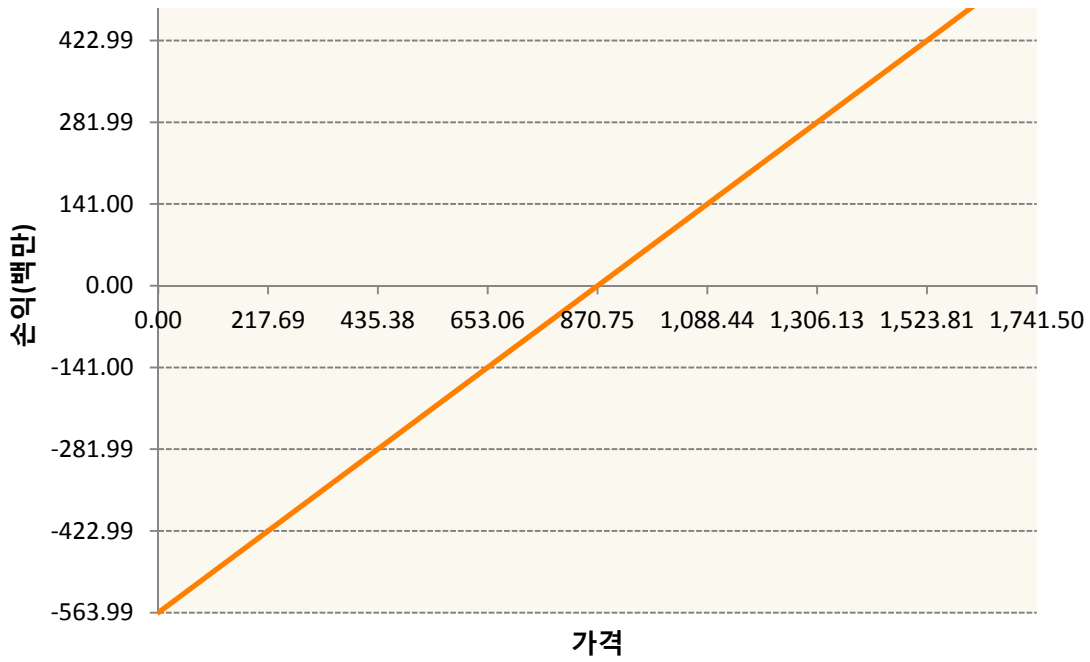


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

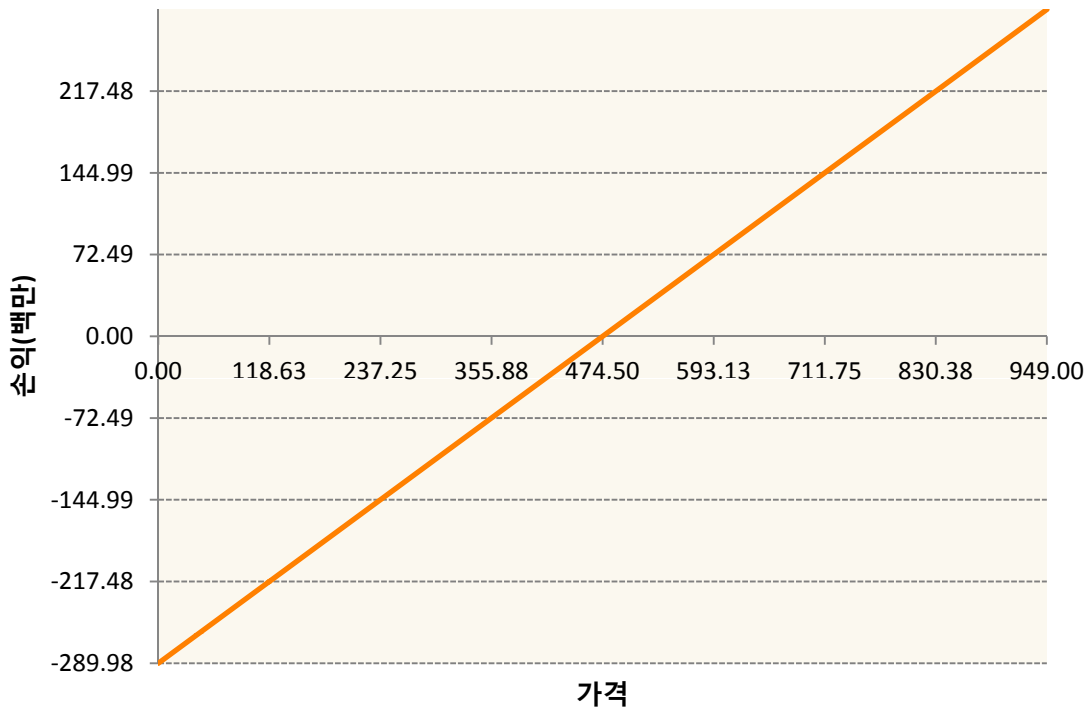


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





WZ9-WHEAT FUTURE(CBT) Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	25
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	8
CZ9	CORN FUTURE Dec19	45
KCZ9	COFFEE 'C' FUTURE Dec19	18
KR4175P900	2019-09 달러선물	13

KWZ9	KC HRW WHEAT FUT Dec19	8
SBV9	SUGAR #11 (WORLD) Oct19	22
SMZ9	SOYBEAN MEAL FUTR Dec19	25
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	45
WZ9	WHEAT FUTURE(CBT) Dec19	23

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

(단위:백만원)

246