

공시일	2019-08-20
기준일	2019-08-19

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	2019-08-20
기준일	2019-08-19

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

1,129

* 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	2019-08-20
기준일	2019-08-19

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)	375
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	137

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

817

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-20
기준일	2019-08-19

유로인덱스모(주식-파생형)

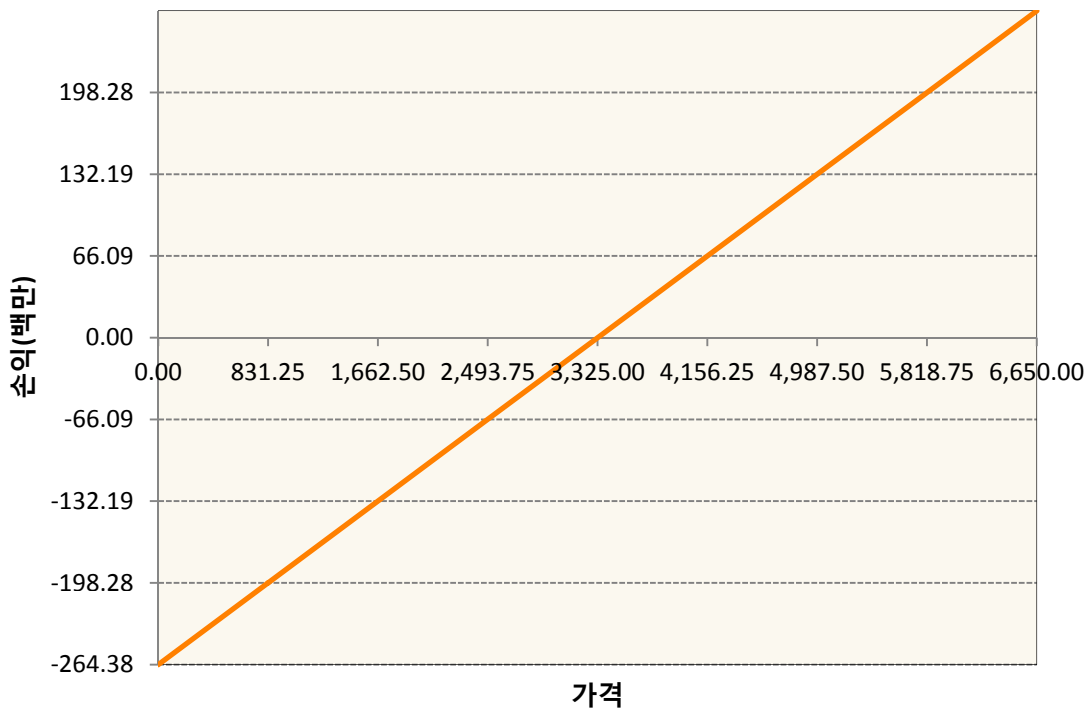
1. 계약금액

(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	2019-08-20
기준일	2019-08-19

차이나인덱스모(주식-파생형)

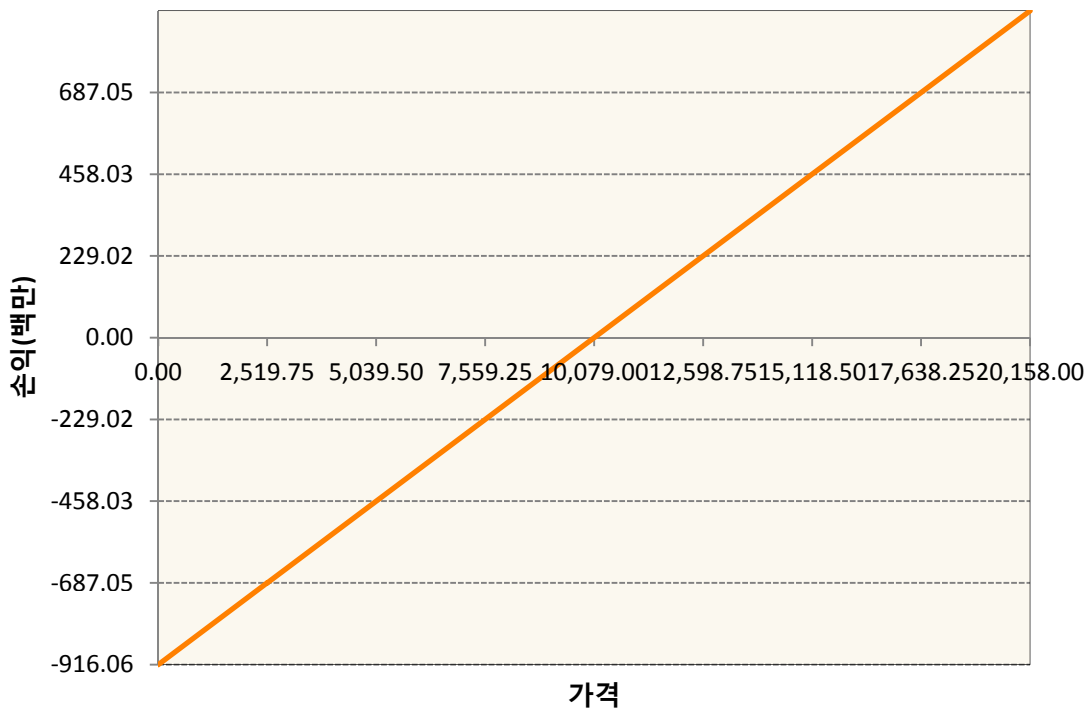
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	916	0	916	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCQ9	HSCEI Futures Aug19	73
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

69

공시일	2019-08-20
기준일	2019-08-19

커버드콜모(주식혼합-파생형)

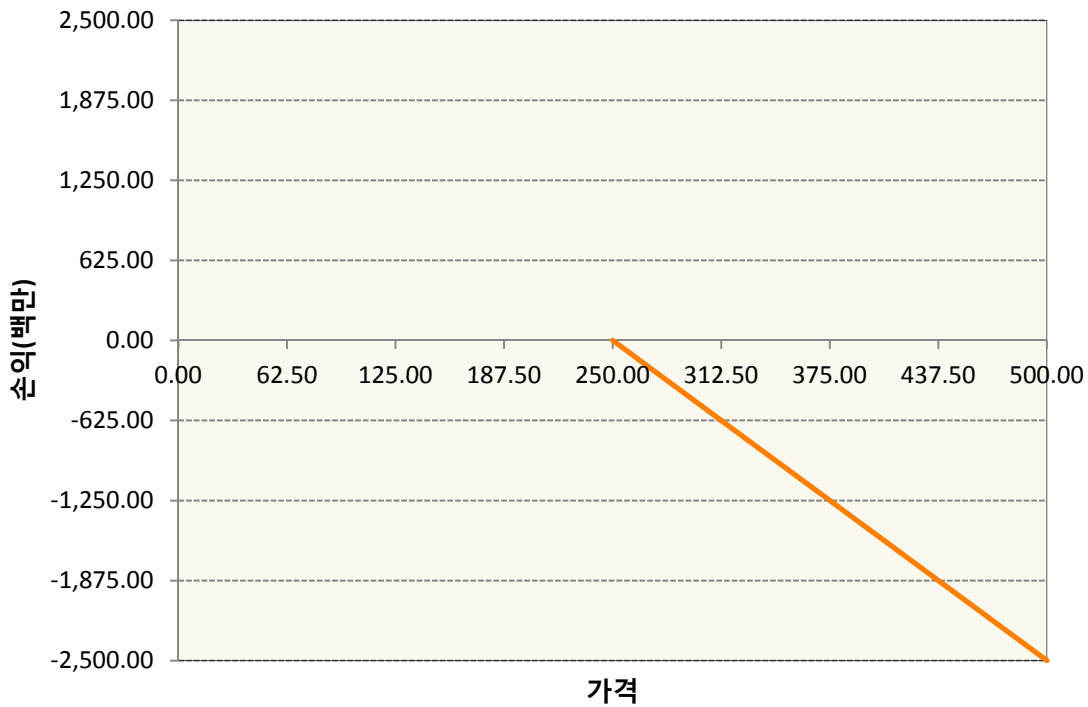
1. 계약금액

(단위:백만원)

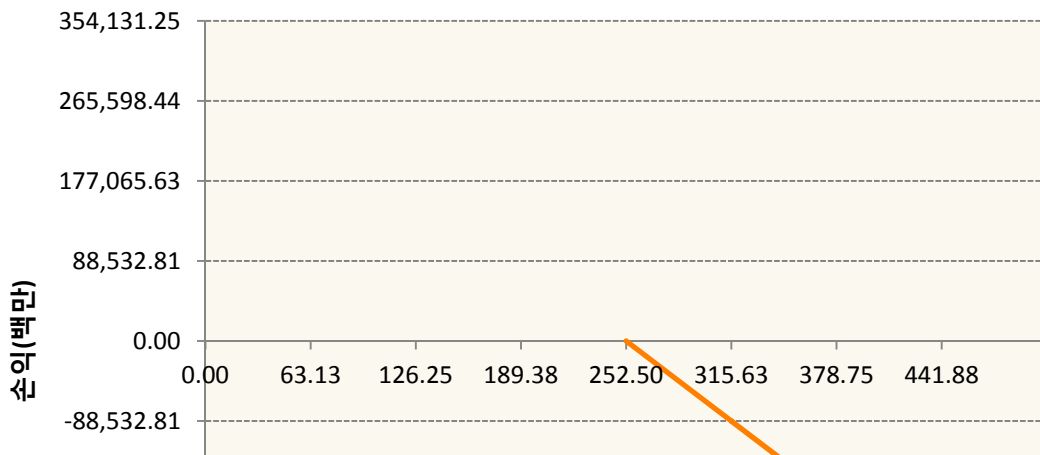
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	523,725	-523,725	장내

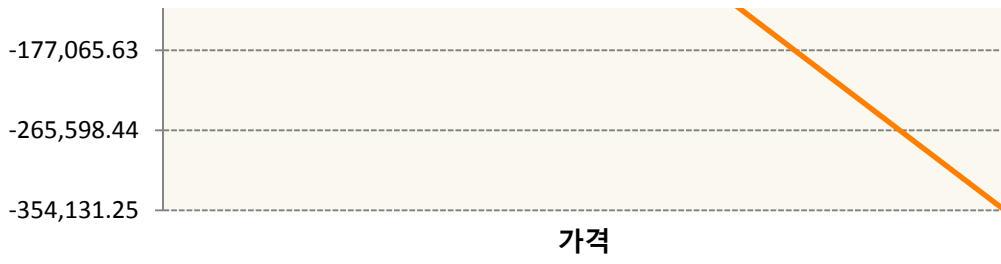
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P92500-2019-09 콜250

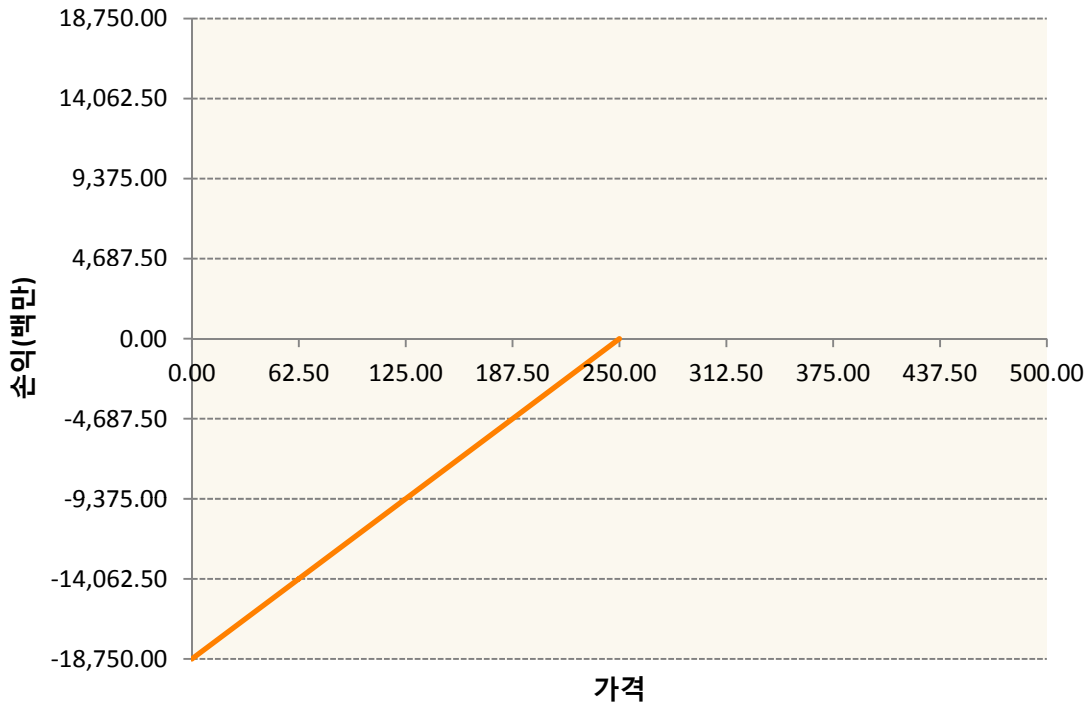


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

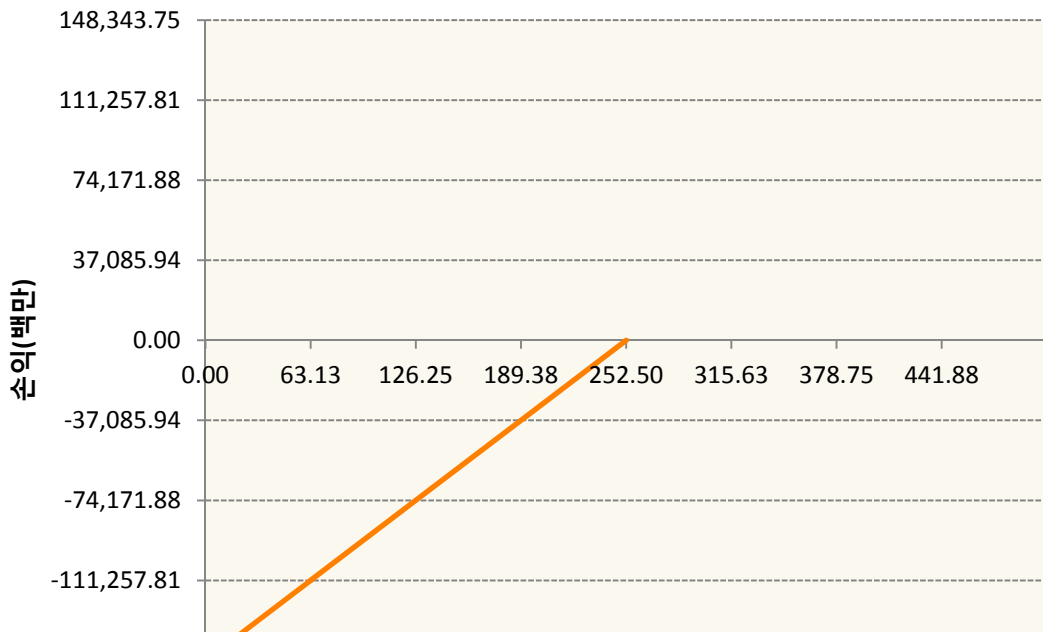




KR4301P92508-2019-09 풋250



KR4301P92524-2019-09 풋252.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P92500		2019-09 콜250						173
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	86	83	81	78	75	72	68	
-5.33%	75	71	67	63	59	54	50	
-2.67%	53	48	42	37	32	27	22	
0%	15	10	5	0	-5	-10	-15	
2.67%	-37	-40	-44	-48	-52	-57	-61	
5.33%	-98	-100	-102	-105	-108	-111	-114	
8.00%	-163	-164	-165	-167	-169	-171	-173	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5						23,249
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	10,217	9,988	9,707	9,380	9,012	8,608	8,173	
-5.33%	9,183	8,715	8,209	7,673	7,113	6,533	5,936	
-2.67%	6,699	6,018	5,329	4,634	3,934	3,231	2,524	
0%	2,175	1,452	727	0	-728	-1,458	-2,188	
2.67%	-4,413	-4,986	-5,588	-6,211	-6,852	-7,507	-8,173	
5.33%	-12,539	-12,887	-13,288	-13,733	-14,216	-14,731	-15,273	
8.00%	-21,528	-21,693	-21,911	-22,180	-22,495	-22,853	-23,249	
KR4301P92508		2019-09 풋250						1,051
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,009	-1,013	-1,017	-1,024	-1,031	-1,040	-1,051	
-5.33%	-530	-543	-558	-574	-592	-610	-629	
-2.67%	-148	-173	-197	-222	-247	-271	-296	
0%	66	44	22	0	-23	-46	-70	
2.67%	140	131	119	106	92	77	60	
5.33%	155	153	149	144	138	131	122	
8.00%	157	156	156	155	153	150	146	
KR4301P92524		2019-09 풋252.5						9,034
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-8,814	-8,828	-8,849	-8,880	-8,922	-8,973	-9,034	
-5.33%	-4,943	-5,015	-5,100	-5,198	-5,307	-5,426	-5,552	
-2.67%	-1,598	-1,768	-1,943	-2,121	-2,302	-2,485	-2,670	
0%	580	388	195	0	-195	-392	-588	
2.67%	1,501	1,392	1,270	1,137	995	846	690	

5.33%	1,733	1,700	1,654	1,596	1,524	1,441	1,348
8.00%	1,768	1,762	1,751	1,734	1,708	1,674	1,630

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

(단위:백만원)

33,840

공시일	2019-08-20
기준일	2019-08-19

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

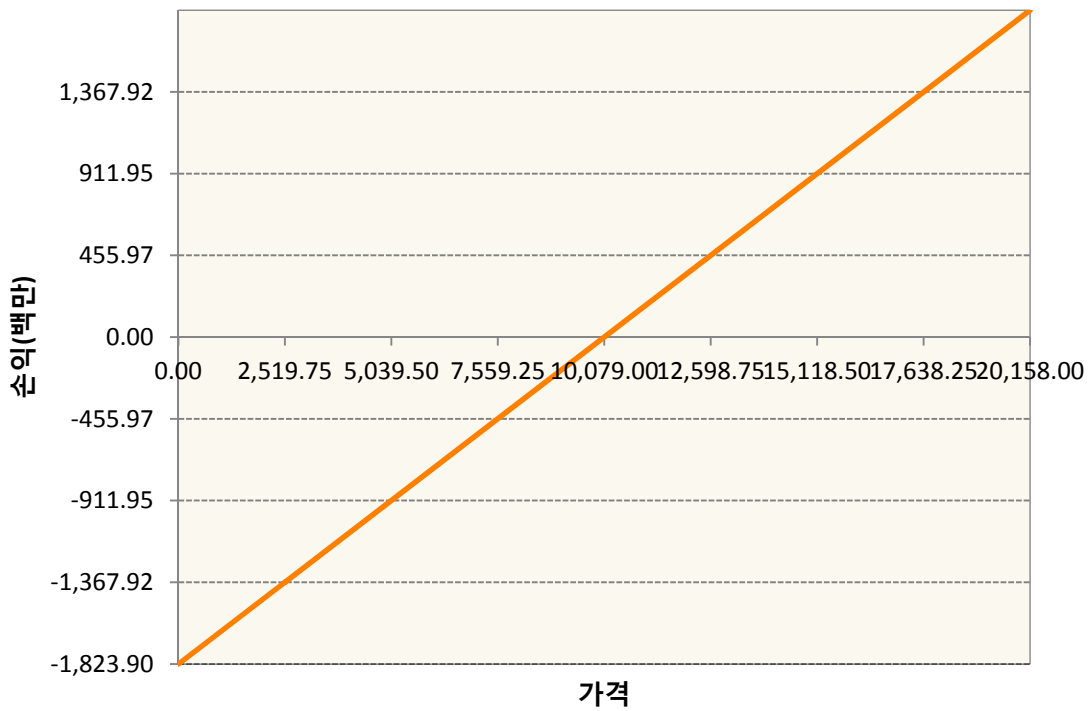
1. 계약금액

(단위:백만원)

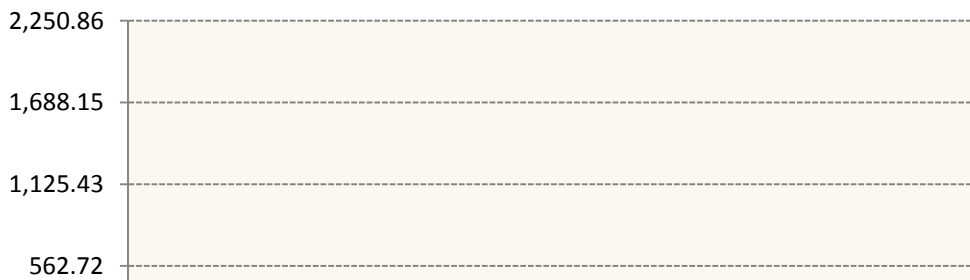
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,824	0	1,824	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,511	-5,511	장내
누계	통화	선도	459	3,242	-2,783	장외

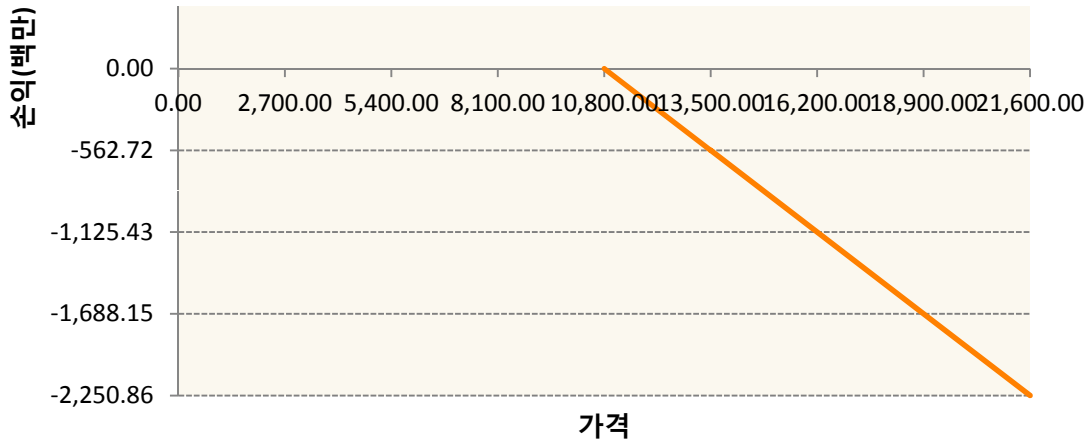
2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19

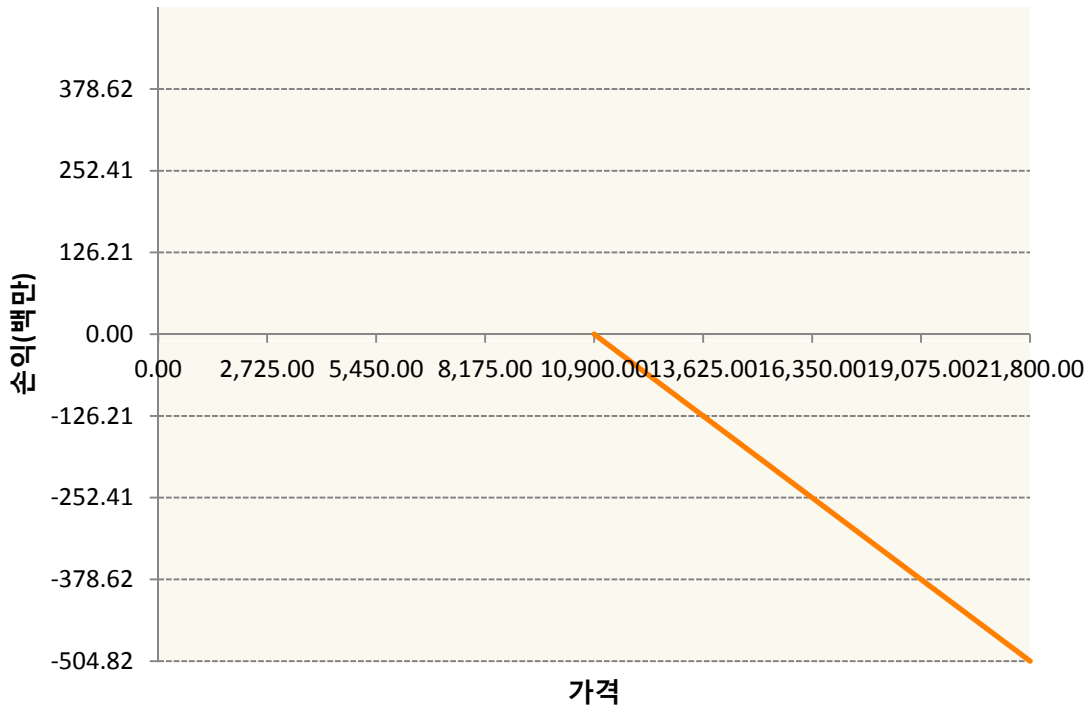


OHHIQ9-C108-HSCEI

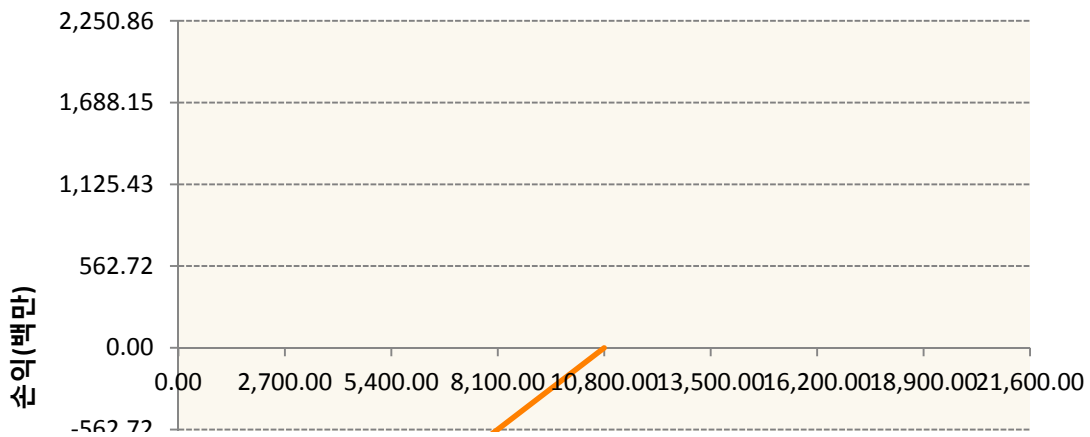


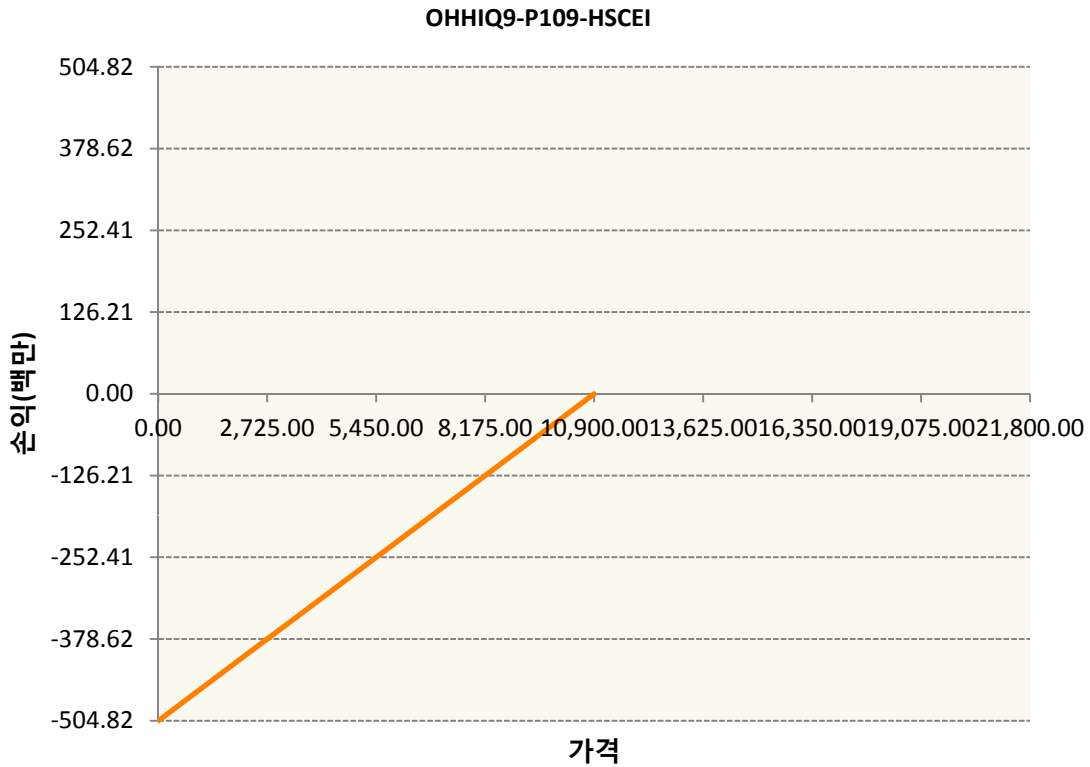


OHHIQ9-C109-HSCEI



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	146
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)
	648

공시일	2019-08-20
기준일	2019-08-19

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

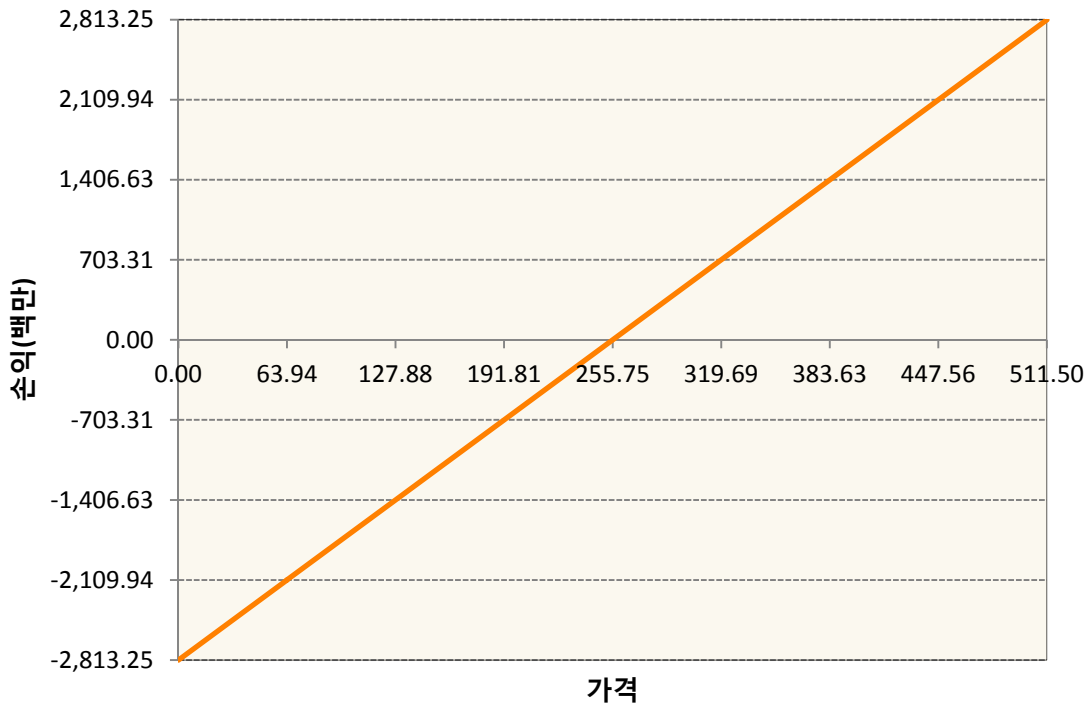
1. 계약금액

(단위:백만원)

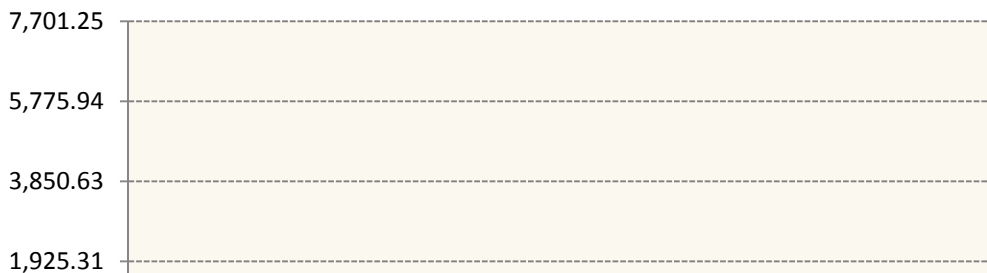
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	3,000	-3,000	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,813	0	2,813	장내
누계	유가증권	스왑	14,125	0	14,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,018	-15,018	장내

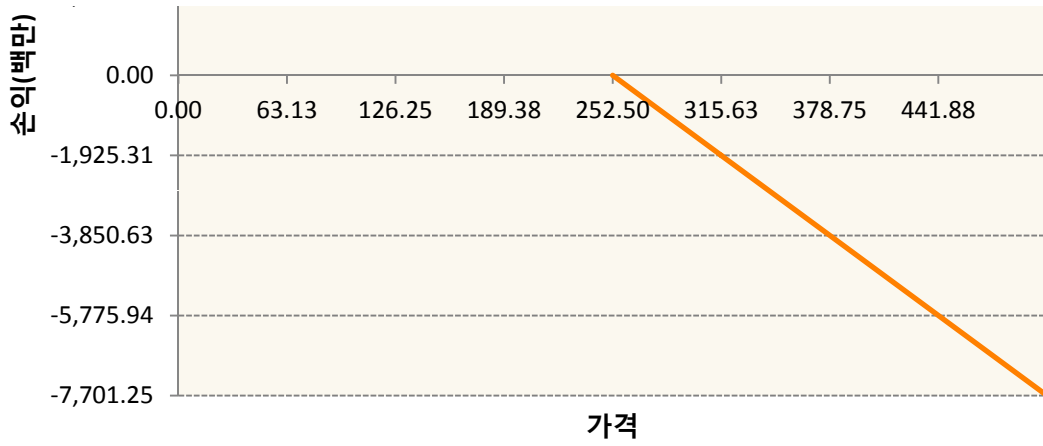
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

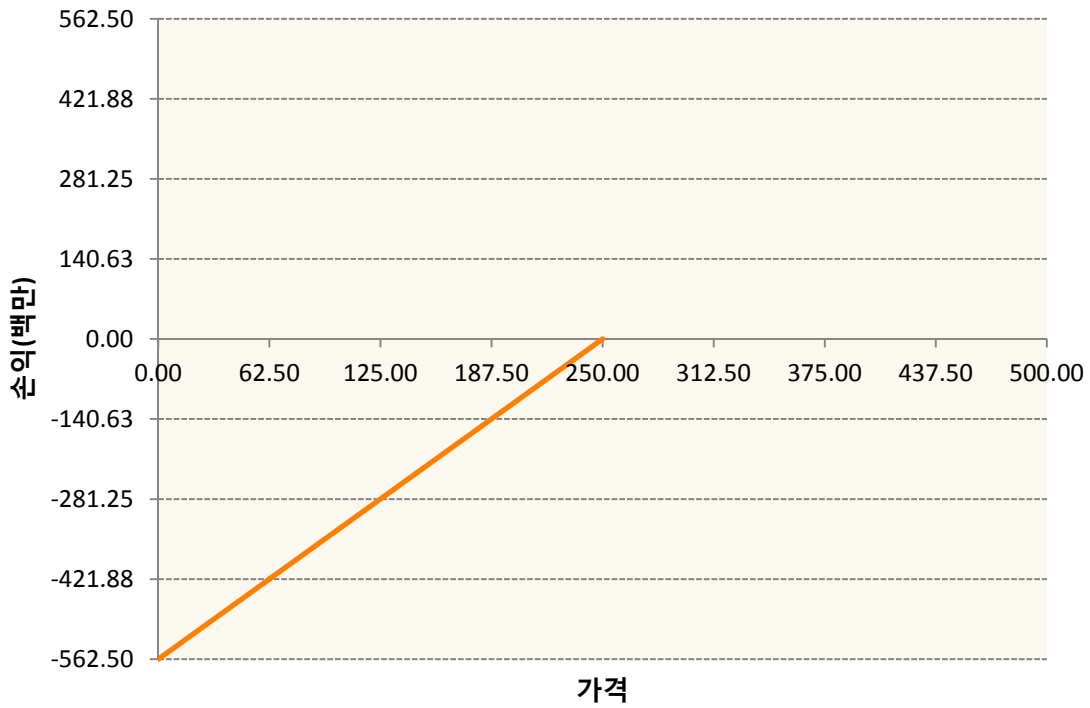


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

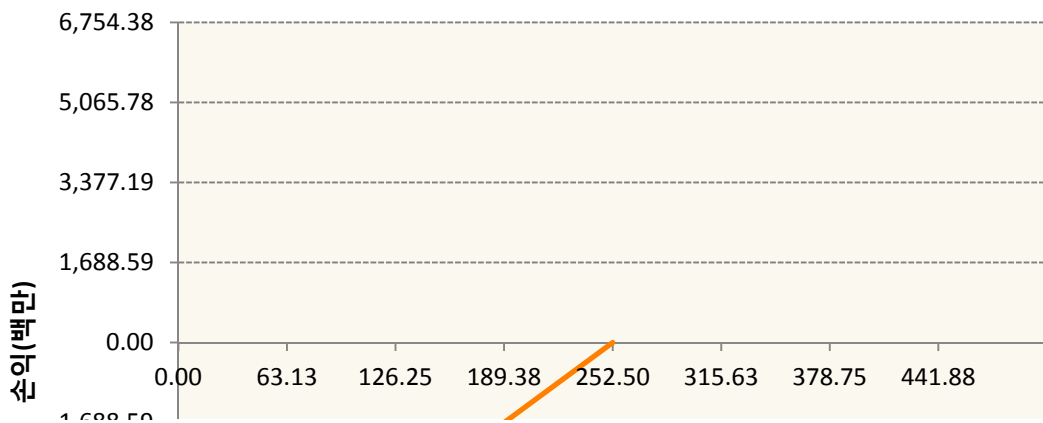




KR4301P92508-2019-09 풋250



KR4301P92524-2019-09 풋252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						1,224
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,224	-1,224	-1,224	-1,224	-1,224	-1,224	-1,224	
-5.33%	-816	-816	-816	-816	-816	-816	-816	
-2.67%	-408	-408	-408	-408	-408	-408	-408	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	408	408	408	408	408	408	408	
5.33%	816	816	816	816	816	816	816	
8.00%	1,224	1,224	1,224	1,224	1,224	1,224	1,224	
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						506
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	222	217	211	204	196	187	178	
-5.33%	200	190	179	167	155	142	129	
-2.67%	146	131	116	101	86	70	55	
0%	47	32	16	0	-16	-32	-48	
2.67%	-96	-108	-122	-135	-149	-163	-178	
5.33%	-273	-280	-289	-299	-309	-320	-332	
8.00%	-468	-472	-476	-482	-489	-497	-506	
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	-31	-31	-31	-31	-32
-5.33%	-16	-16	-17	-17	-18	-18	-19
-2.67%	-4	-5	-6	-7	-7	-8	-9
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	4	4	4	3	3	2	2
5.33%	5	5	4	4	4	4	4
8.00%	5	5	5	5	5	4	4
KR4301P92524 2019-09 풋252.5							411
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-401	-402	-403	-404	-406	-409	-411
-5.33%	-225	-228	-232	-237	-242	-247	-253
-2.67%	-73	-81	-88	-97	-105	-113	-122
0%	26	18	9	0	-9	-18	-27
2.67%	68	63	58	52	45	39	31
5.33%	79	77	75	73	69	66	61
8.00%	80	80	80	79	78	76	74

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

(단위:백만원)

2,376

공시일	2019-08-20
기준일	2019-08-19

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

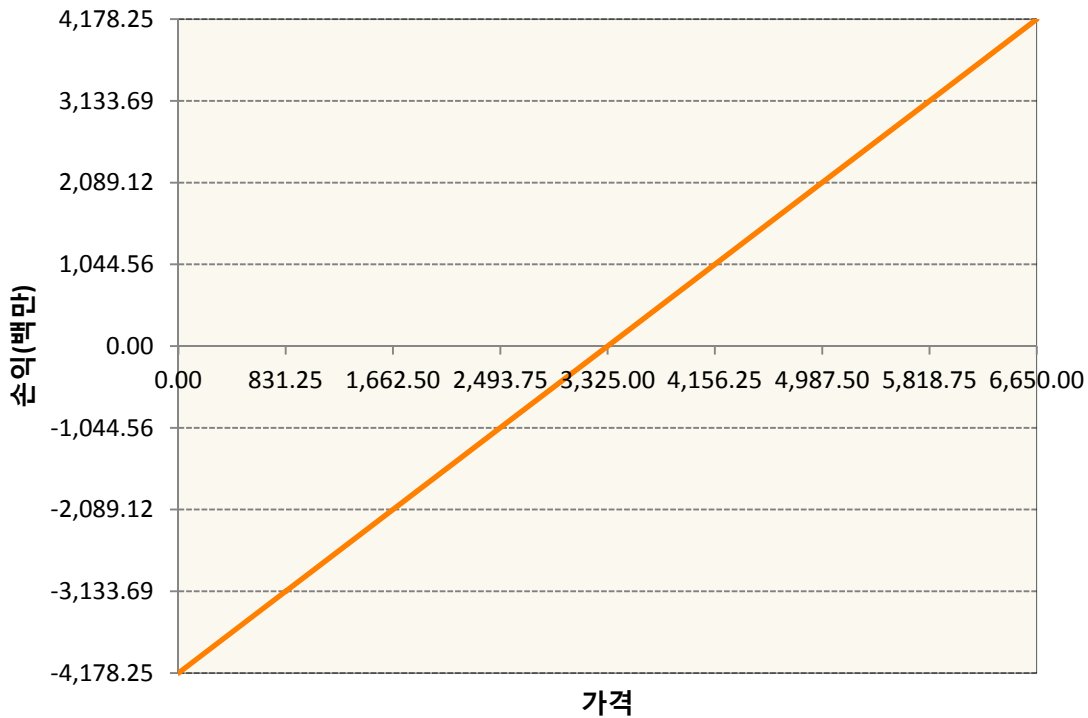
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,178	0	4,178	
누계	지수	스왑	28,411	0	28,411	장외
누계	통화	선도	14,514	22,845	-8,332	장외

2. 만기시점의 손익구조

VGU9-EURO STOXX 50 Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	69
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	430
FX21019M02 KRW/EUR 27-09-19E	1,075
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	323
FX21019N01 EUR/KRW 23-08-19E	430
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E	323

FX21019N04 EUR/KRW 27-09-19E
FX21019Q00 EUR/KRW 27-09-19E
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19

237
172
334

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

(단위:백만원)

1,716

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

(단위:백만원)

924

공시일	2019-08-20
기준일	2019-08-19

ETF스마트레버리지목표전환형9호

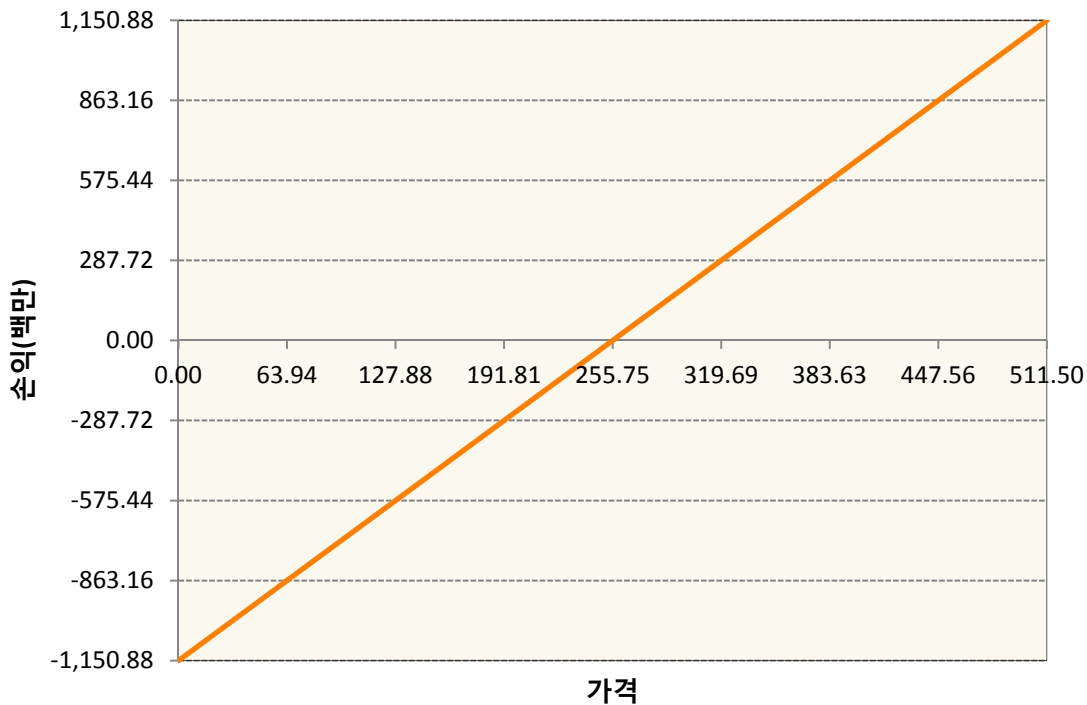
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,151	0	1,151	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)

121

공시일	2019-08-20
기준일	2019-08-19

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

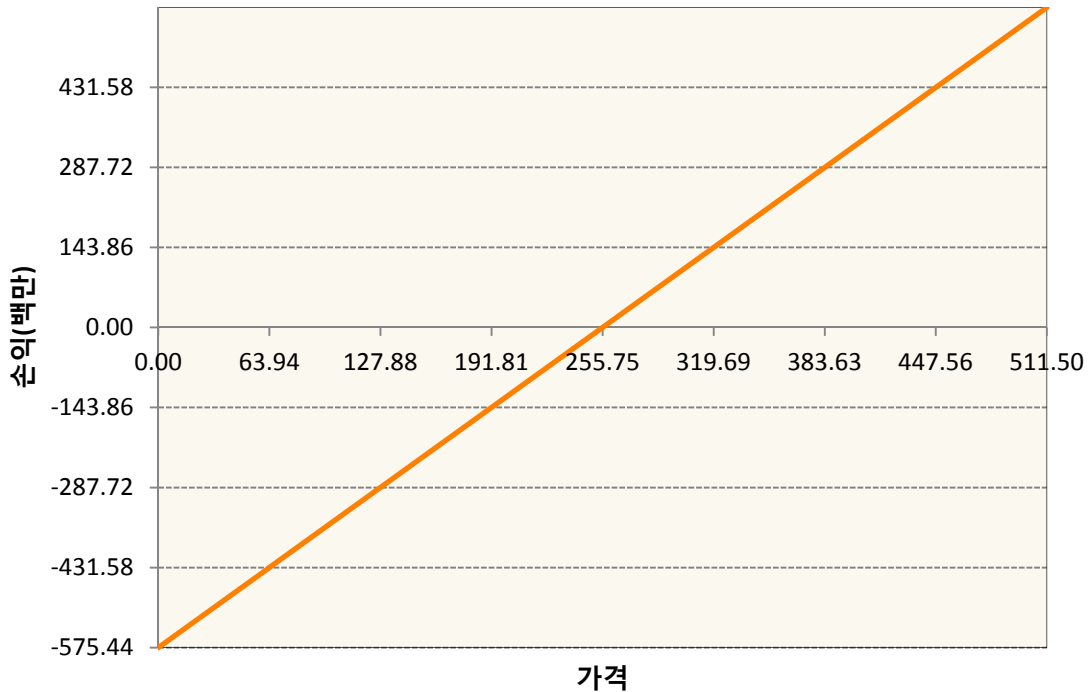
1. 계약금액

(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	2019-08-20
기준일	2019-08-19

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

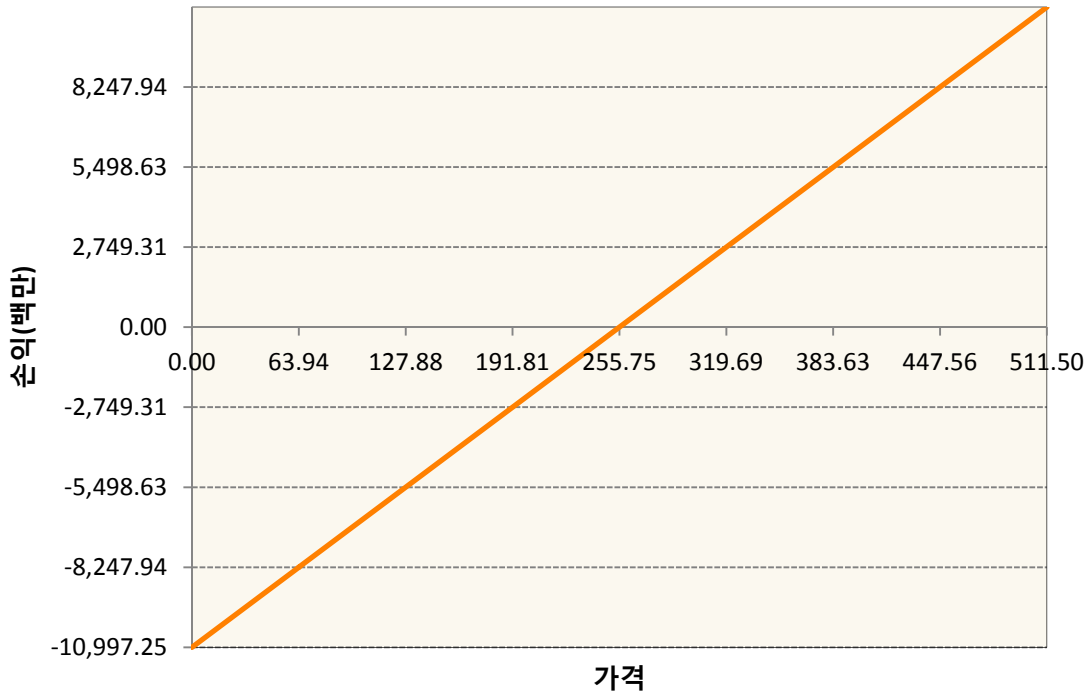
1. 계약금액

(단위:백만원)

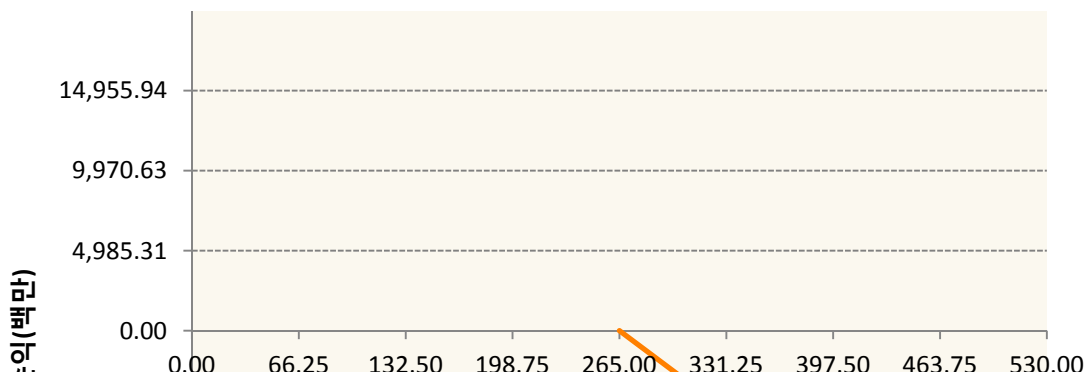
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,997	0	10,997	장내
누계	유가증권	옵션	3,659	20,075	-16,416	장내

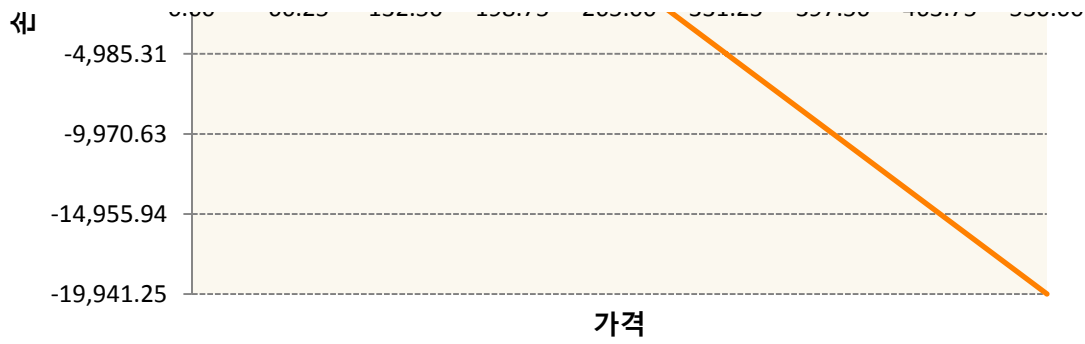
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

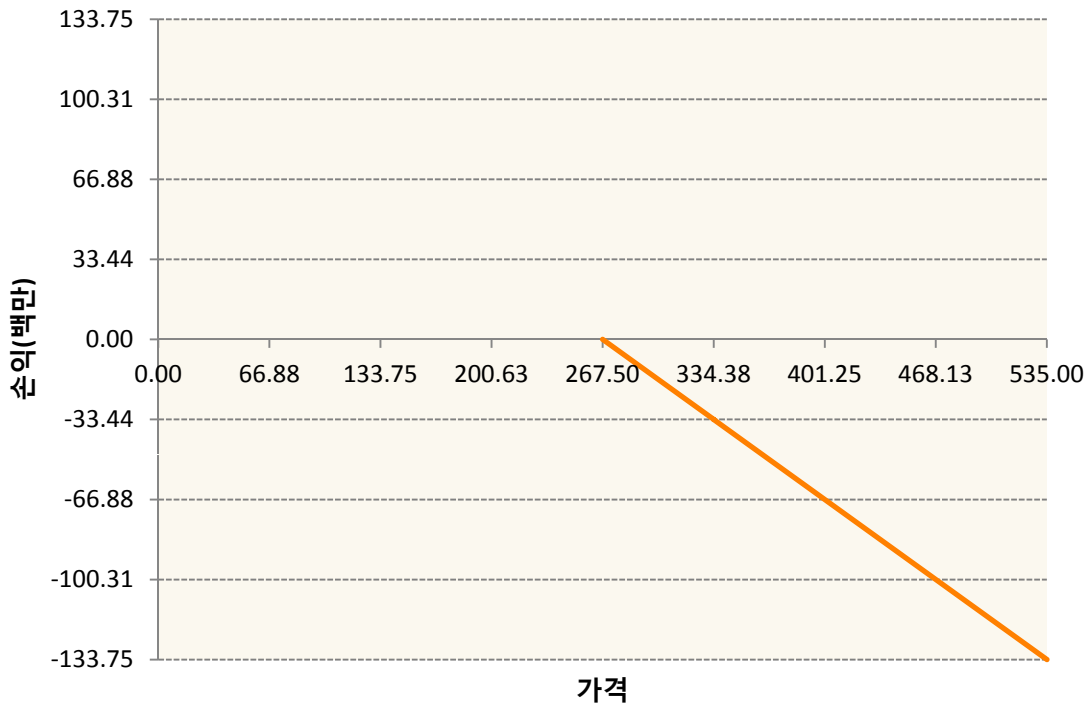


KR4201P92658-2019-09 콜265

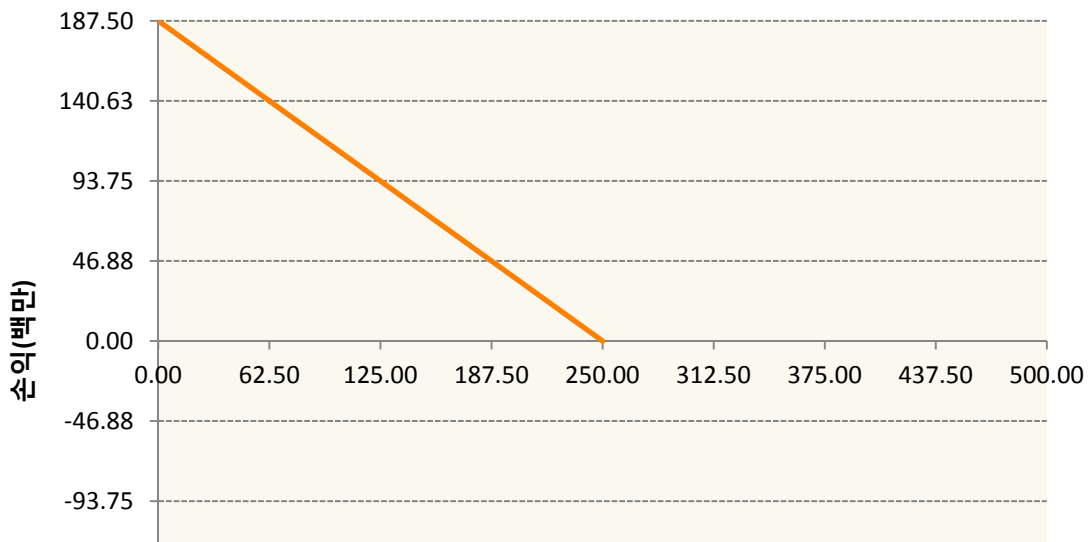


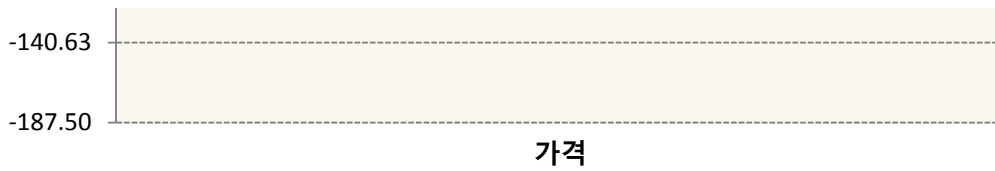


KR4201P92674-2019-09 콜267.5

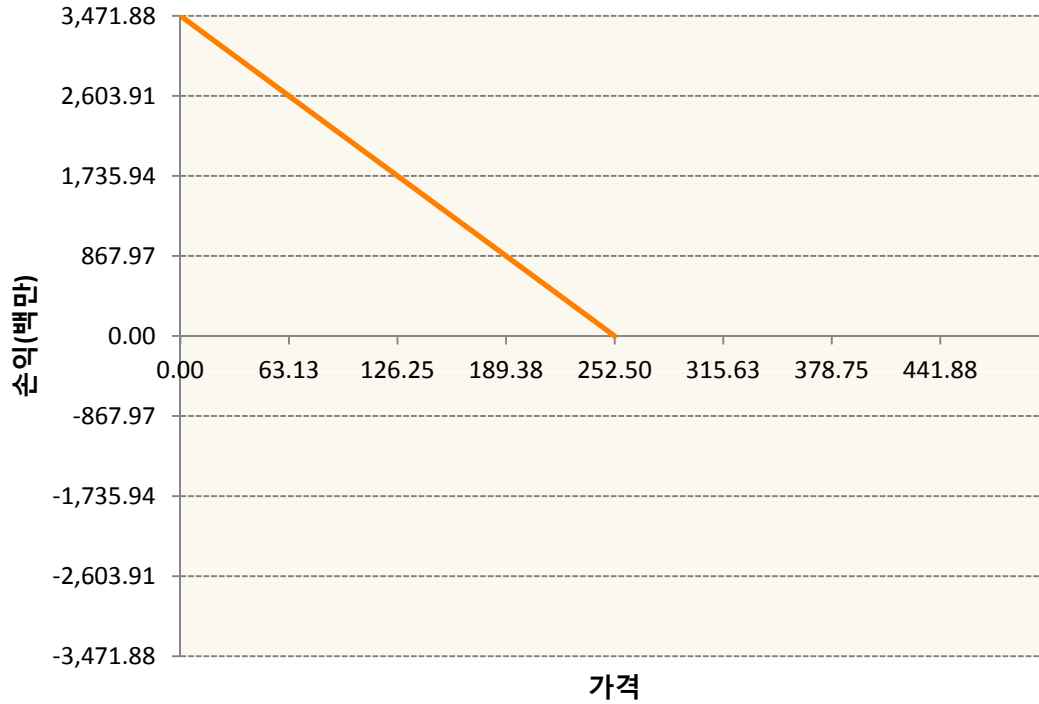


KR4301P92508-2019-09 풋250





KR4301P92524-2019-09 풋252.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						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%	-585	-585	-585	-585	-585	-585	-585	
-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%	585	585	585	585	585	585	585	
8.00%	878	878	878	878	878	878	878	
KR4201P92658		2019-09 콜265						894
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	196	194	191	186	180	171	161	
-5.33%	190	183	174	163	149	133	115	
-2.67%	165	149	129	108	84	58	31	

0%	94	64	33	0	-34	-68	-104
2.67%	-60	-100	-140	-180	-220	-261	-301
5.33%	-322	-362	-402	-443	-483	-524	-565
8.00%	-686	-718	-751	-785	-820	-857	-894

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

KR4301P92524 2019-09 풋252.5 211

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	206	207	207	208	209	210	211
-5.33%	116	117	119	122	124	127	130
-2.67%	37	41	45	50	54	58	62
0%	-14	-9	-5	0	5	9	14
2.67%	-35	-33	-30	-27	-23	-20	-16
5.33%	-41	-40	-39	-37	-36	-34	-32
8.00%	-41	-41	-41	-41	-40	-39	-38

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

(단위:백만원)

1,630

공시일	2019-08-20
기준일	2019-08-19

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	56,878	0	56,878	

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	2019-08-20
기준일	2019-08-19

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	75,953	0	75,953	

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	2019-08-20
기준일	2019-08-19

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	469,593	0	469,593	
누계	통화	선도	0	456,668	-456,668	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 22-08-19E		969
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		3,013
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		1,686
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		775
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,938
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,938
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		2,713
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

3,972

FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E

3,585

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

(단위:백만원)

11,993

공시일	2019-08-20
기준일	2019-08-19

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

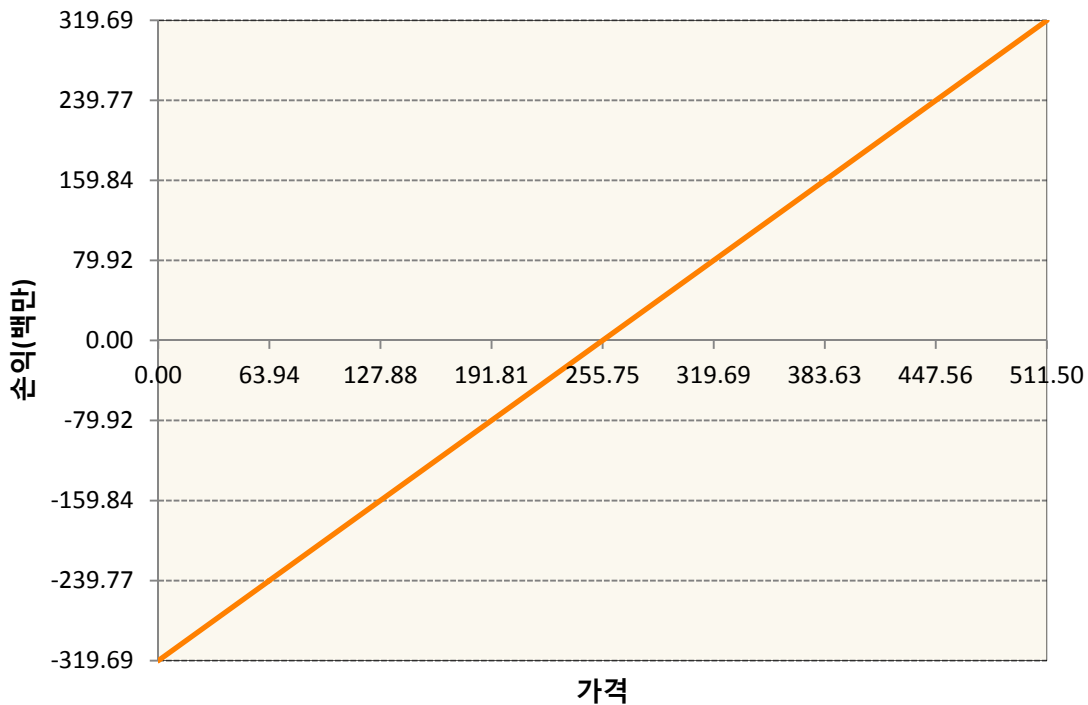
1. 계약금액

(단위:백만원)

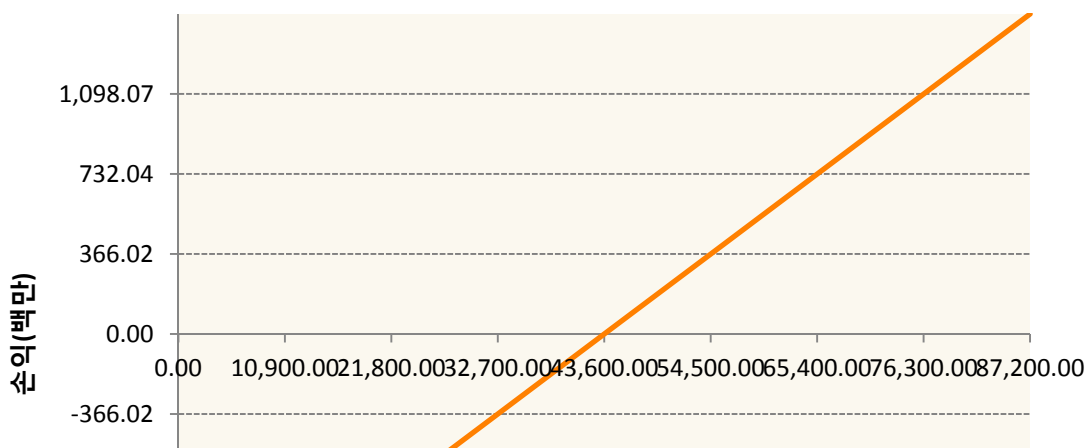
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,784	0	1,784	장내

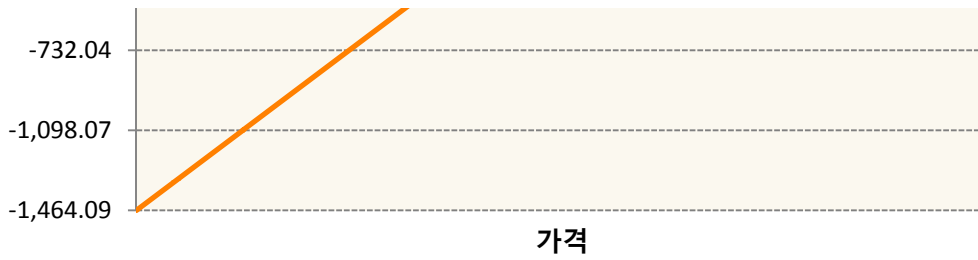
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P90000-2019-09 삼성전자개별선물





3. 시나리오 별 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)

170

공시일	2019-08-20
기준일	2019-08-19

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

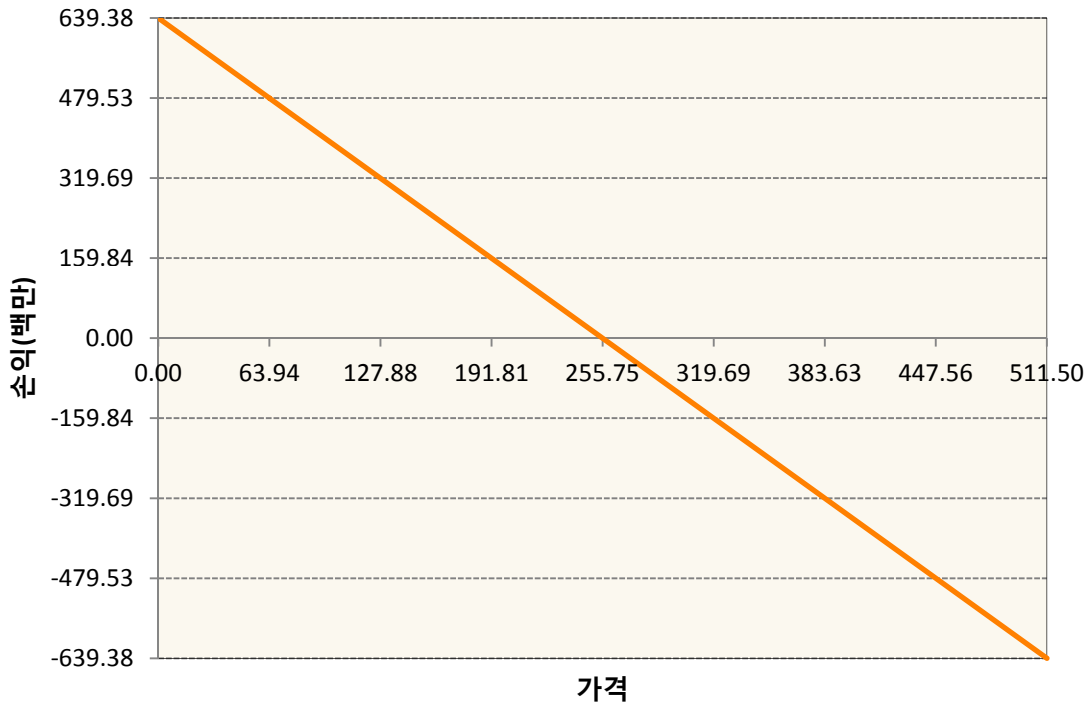
1. 계약금액

(단위:백만원)

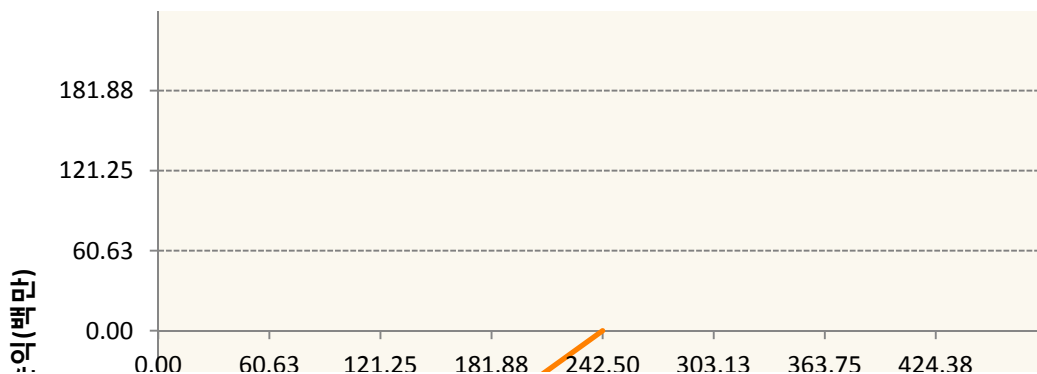
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	639	-639	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,550	-3,550	장내

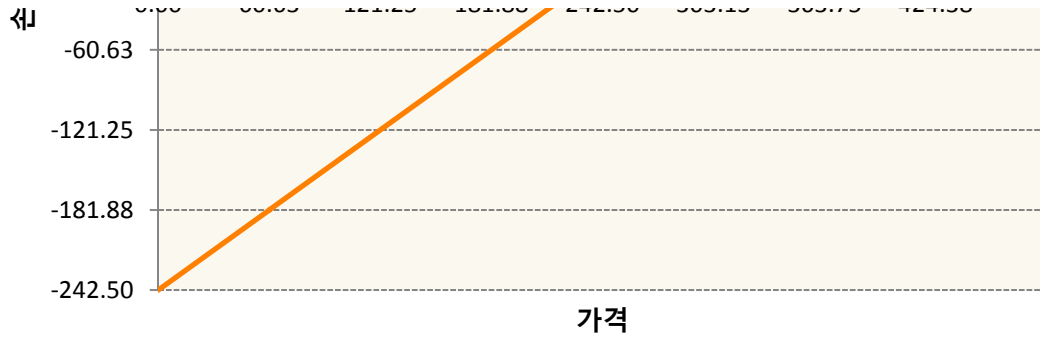
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

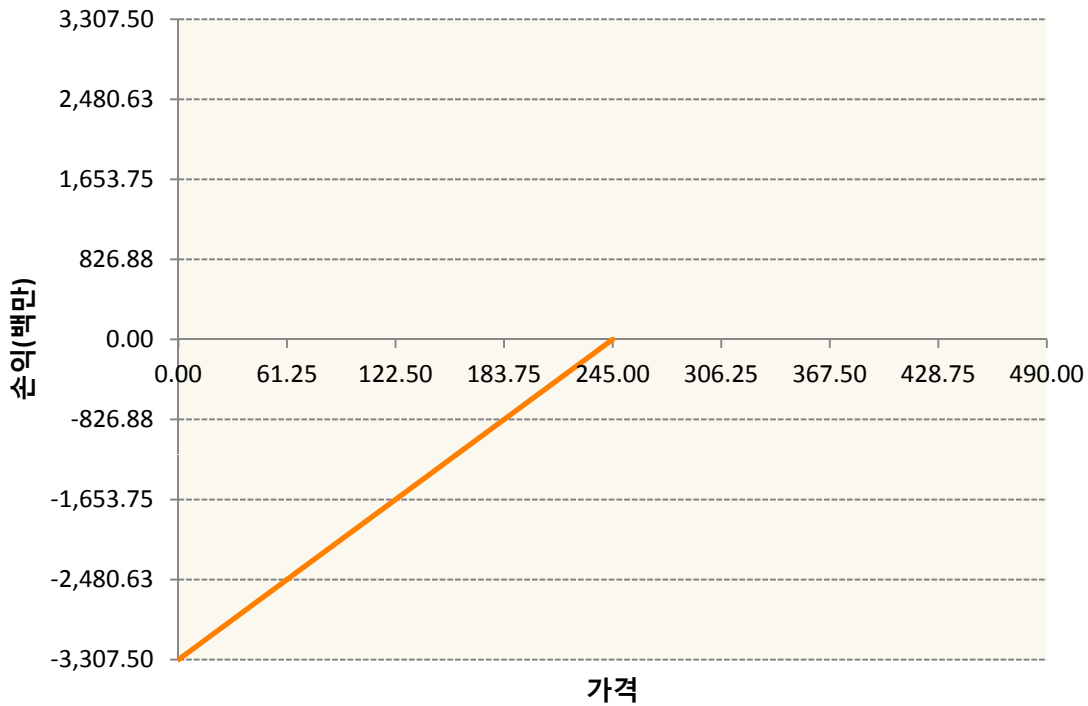


KR4301P92425-2019-09 풋242.5





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						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	0	0	0	0	0	0
5.33%	1	1	1	1	0	0	0
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

KR4301P92458

2019-09 풋245

147

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-133	-135	-137	-139	-142	-144	-147
-5.33%	-58	-62	-66	-70	-74	-78	-82
-2.67%	-11	-15	-19	-24	-28	-32	-36
0%	7	5	3	0	-3	-6	-9
2.67%	11	11	10	9	8	6	4
5.33%	12	12	12	11	11	10	9
8.00%	12	12	12	12	12	12	11

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

(단위:백만원)

166

공시일	2019-08-20
기준일	2019-08-19

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	19,704	0	19,704	
누계	통화	선도	0	19,255	-19,255	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	2019-08-20
기준일	2019-08-19

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	2019-08-20
기준일	2019-08-19

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

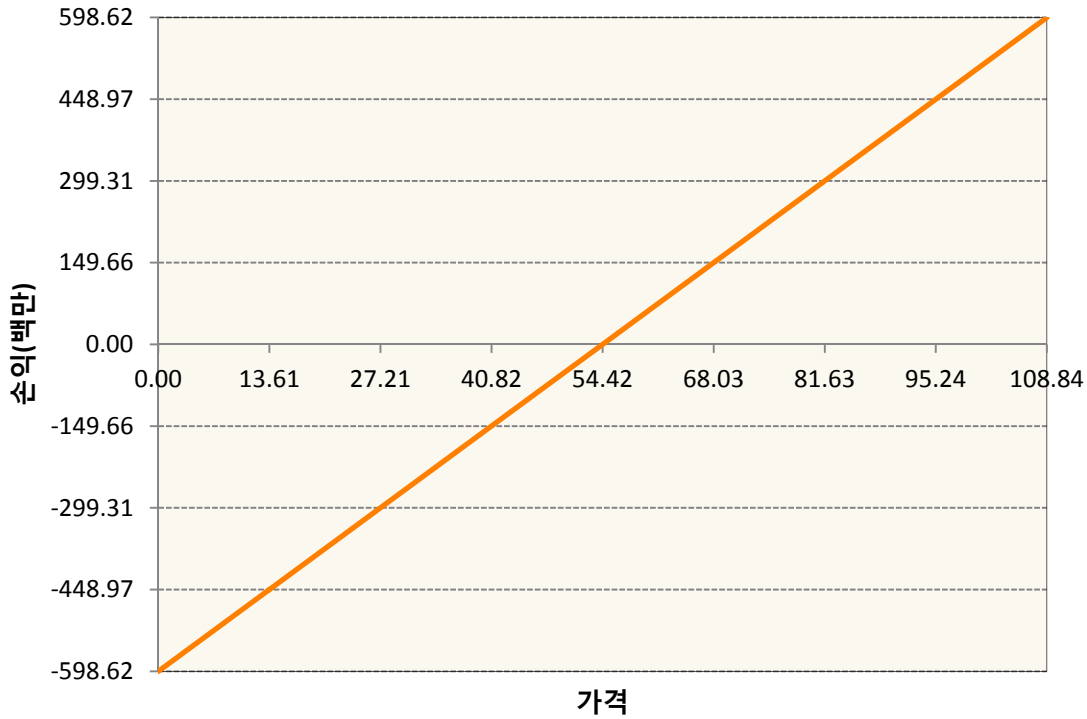
1. 계약금액

(단위:백만원)

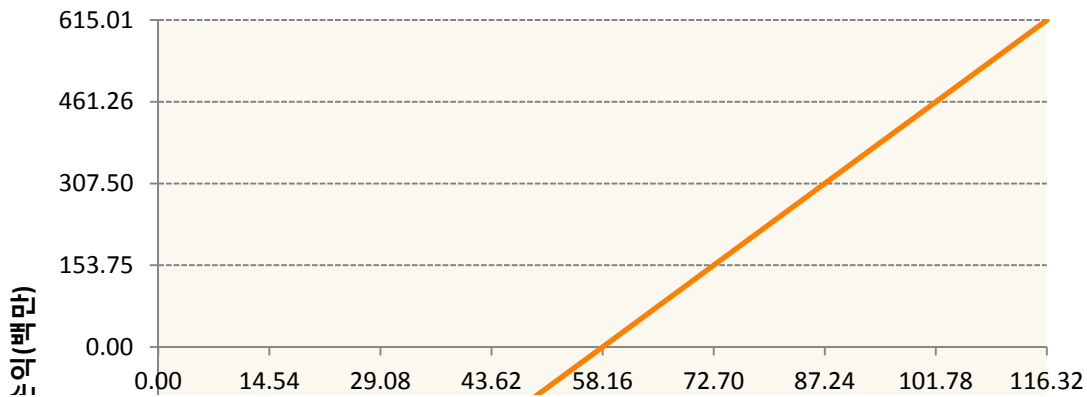
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,203	121	2,082	
누계	유가증권	선물	187	0	187	장내

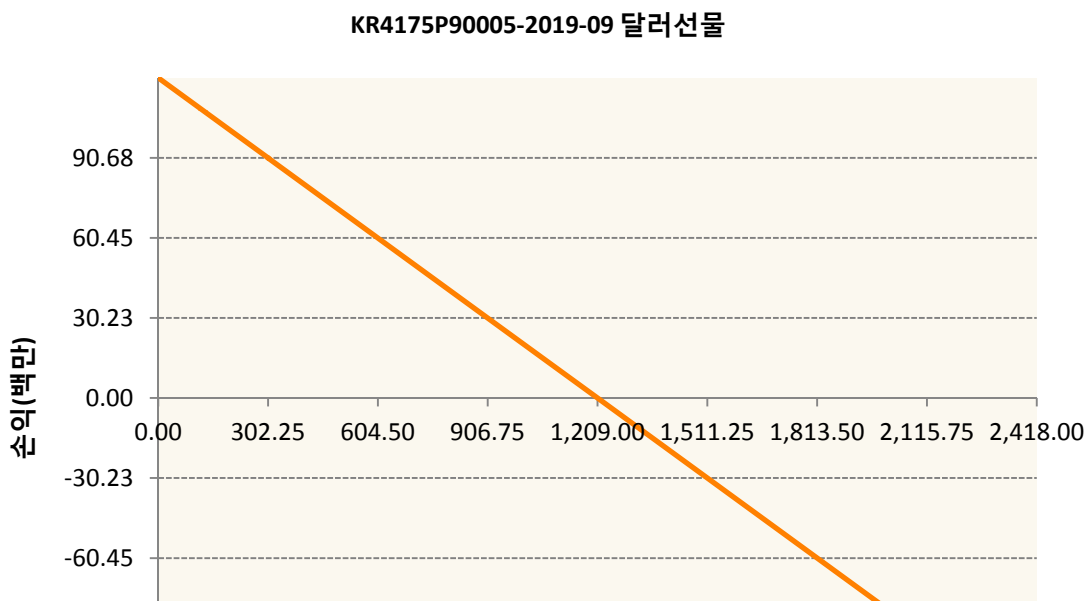
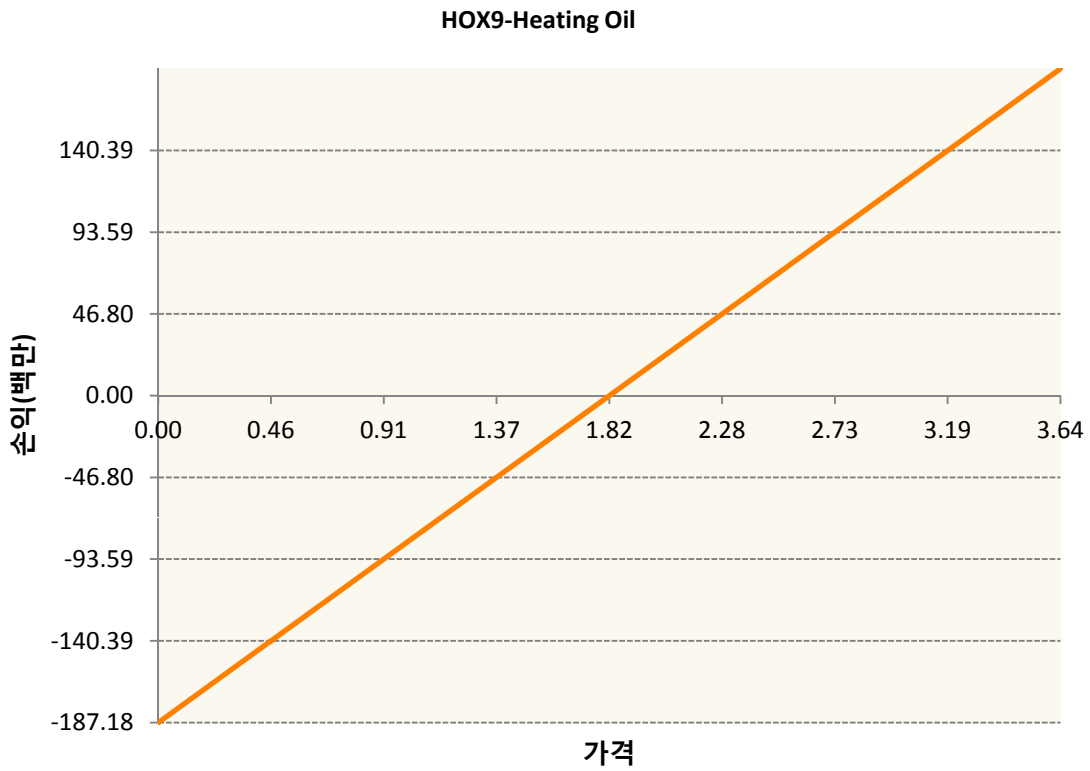
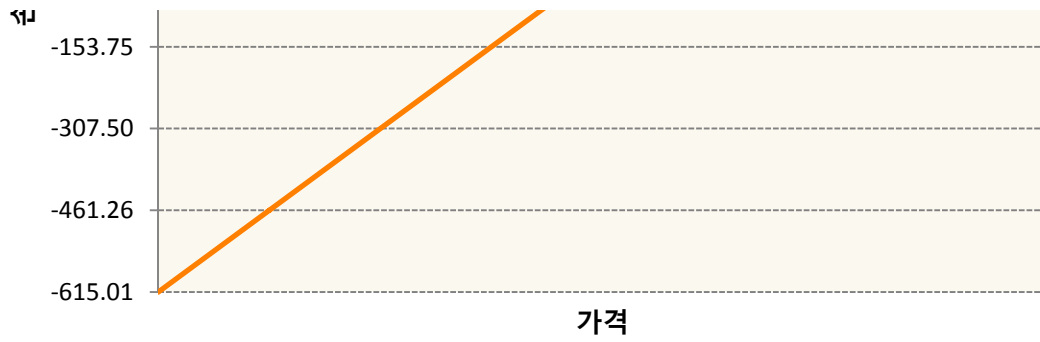
2. 만기시점의 손익구조

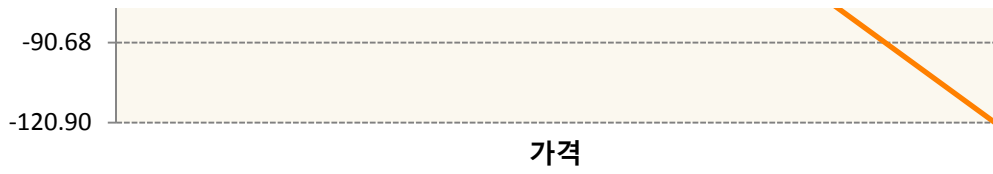
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19



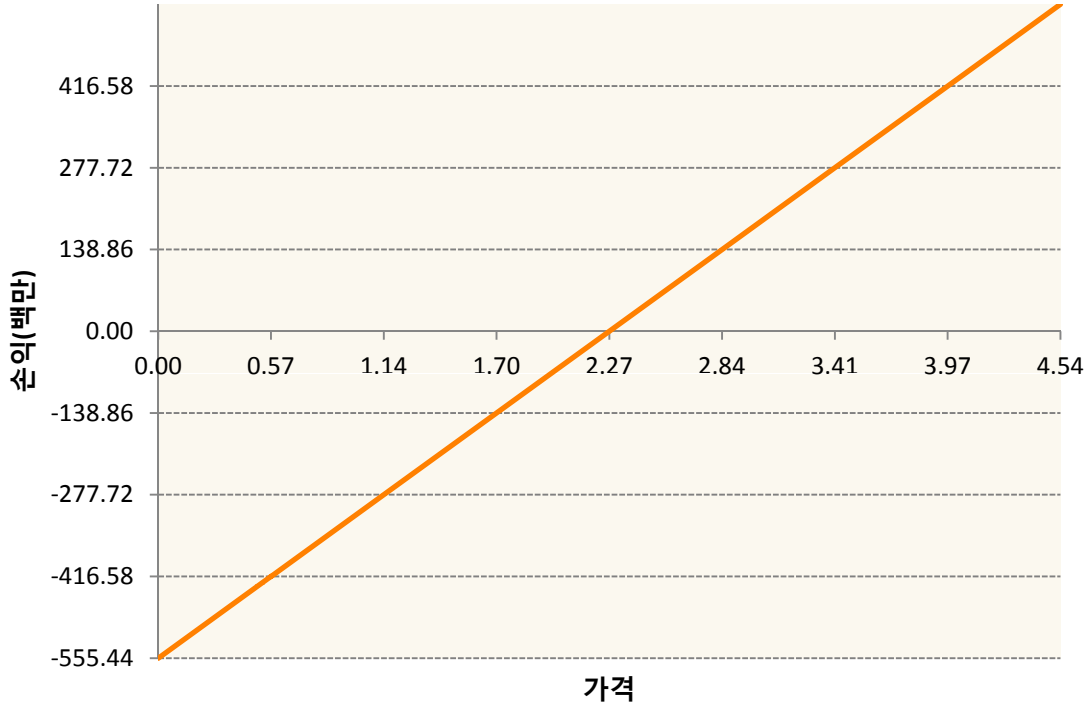
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19



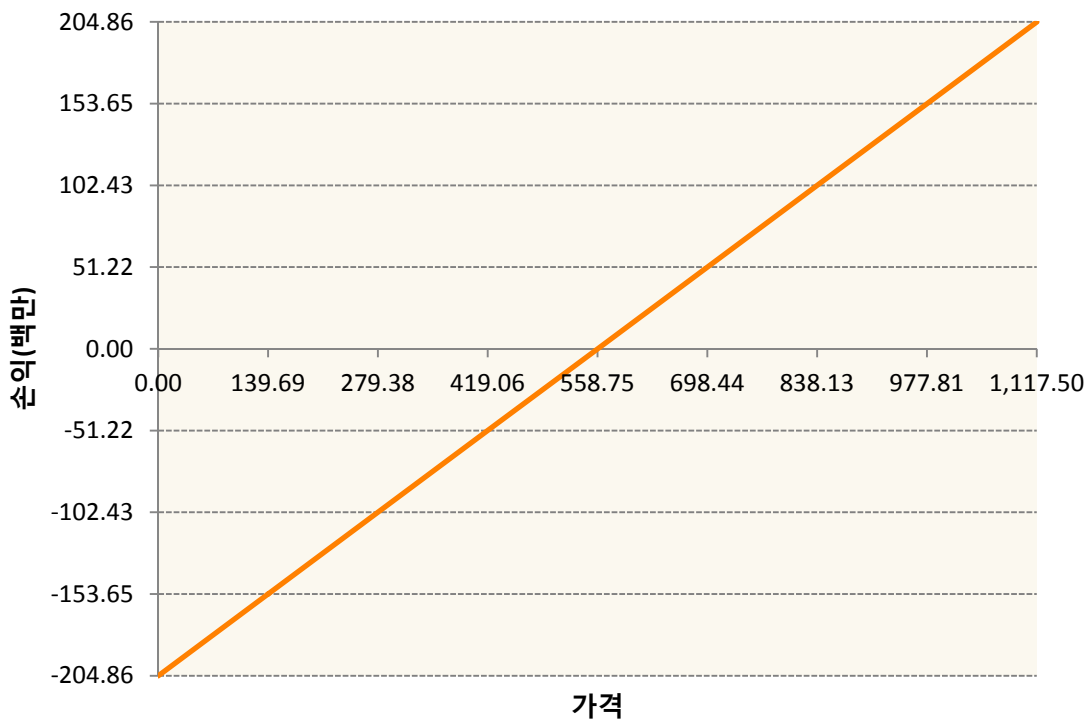


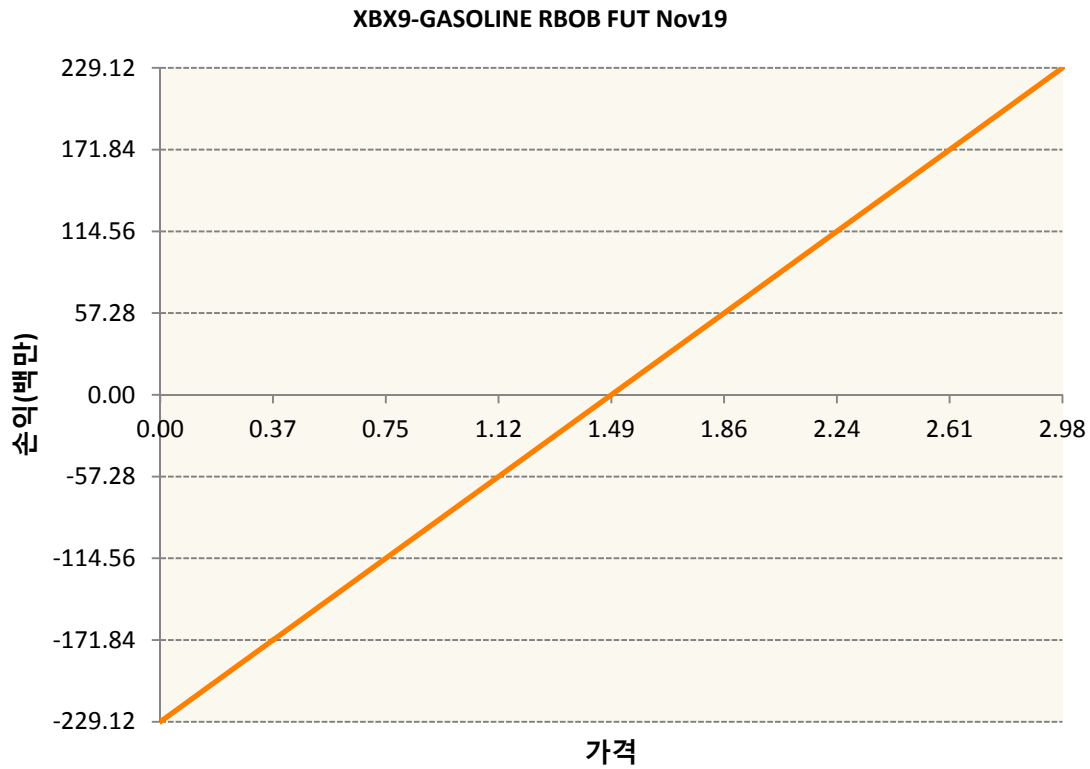


NGX19-NATURAL GAS FUTR Nov19



QSX9-Low Su Gasoil G Nov19





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	44
QSX9	Low Su Gasoil G Nov19	16
XBX9	GASOLINE RBOB FUT Nov19	18

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	367

공시일	2019-08-20
기준일	2019-08-19

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

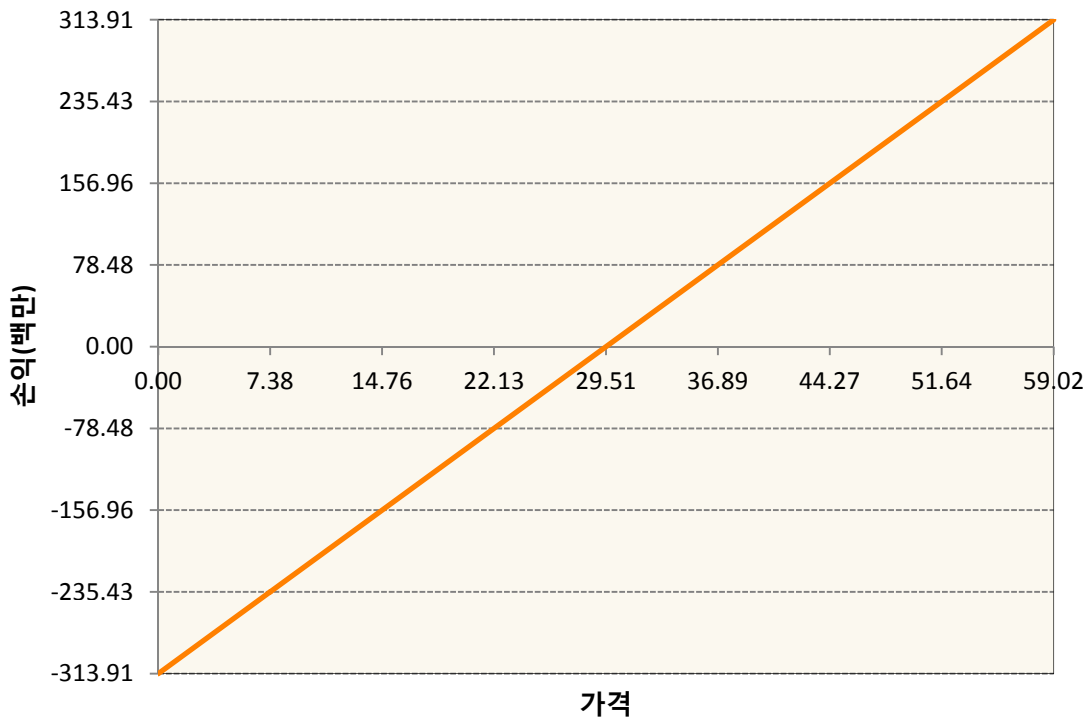
1. 계약금액

(단위:백만원)

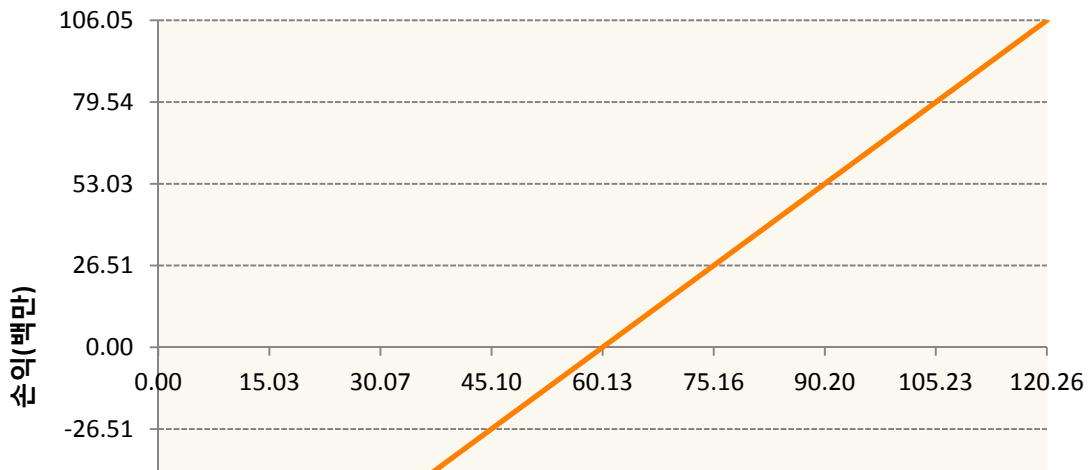
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,779	157	2,622	

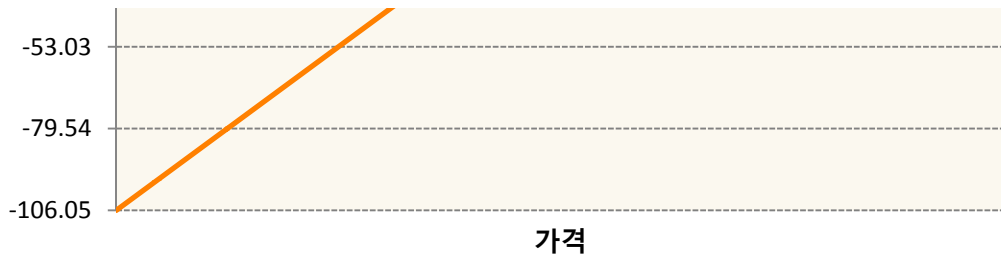
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

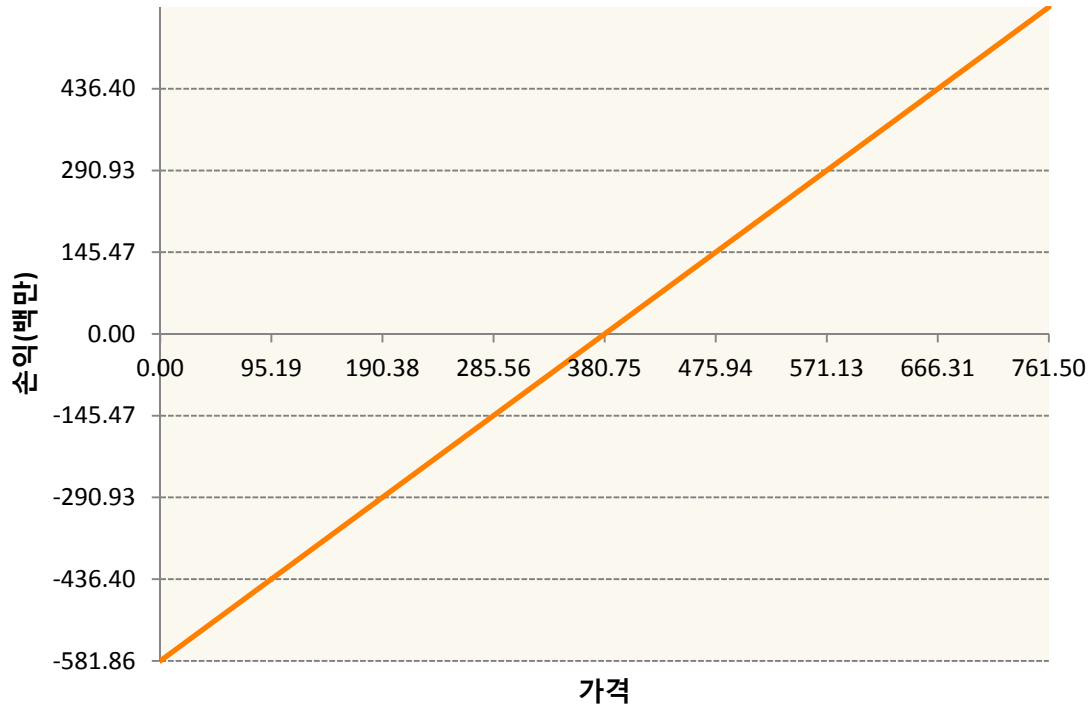


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

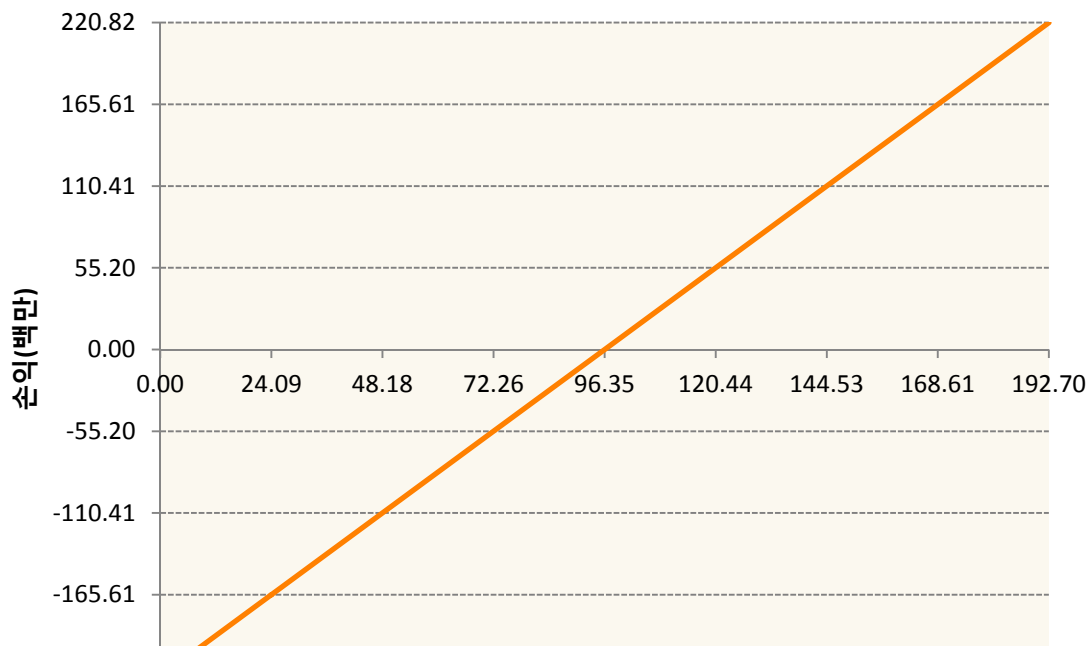


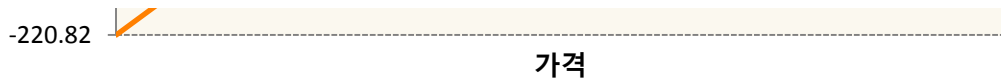


CZ9-CORN FUTURE Dec19

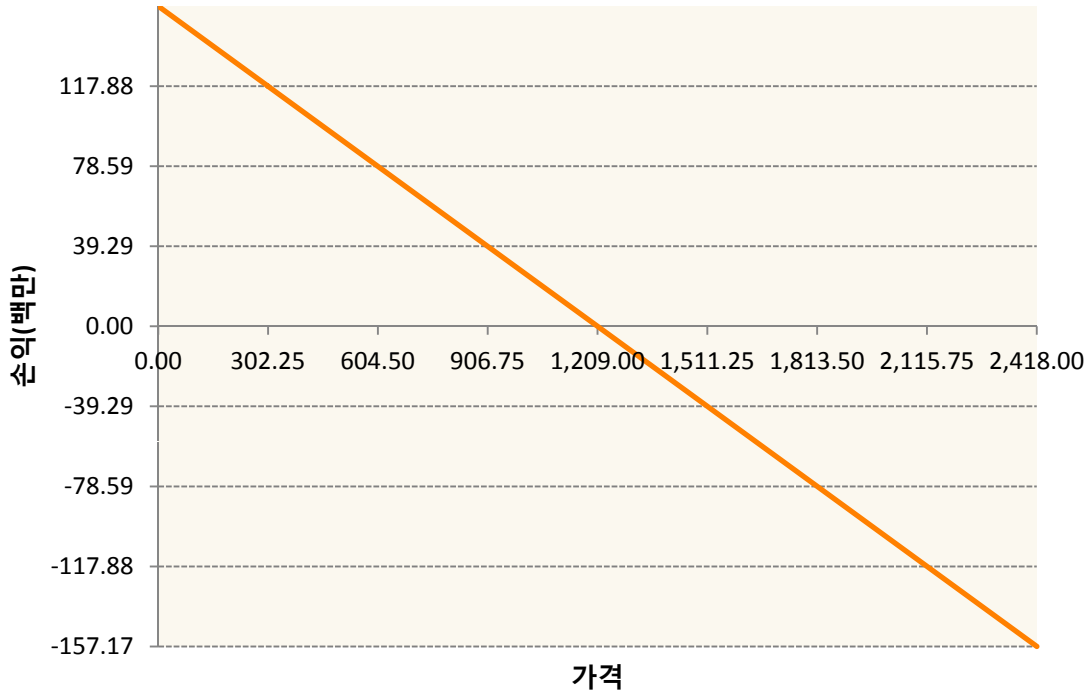


KCZ9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19

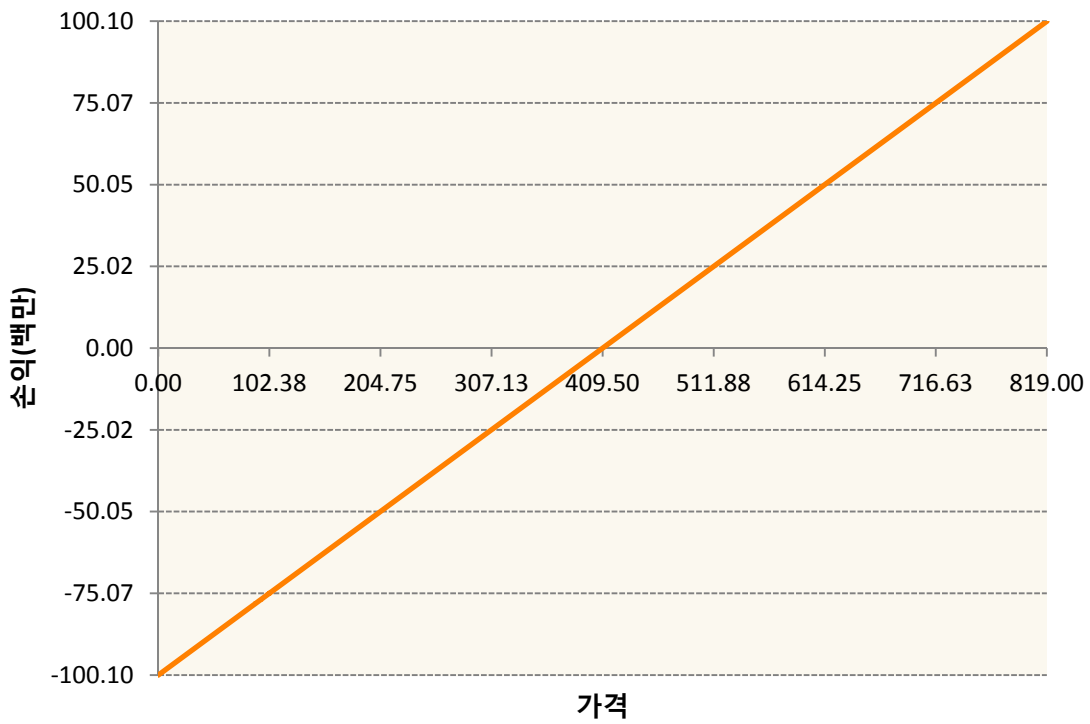




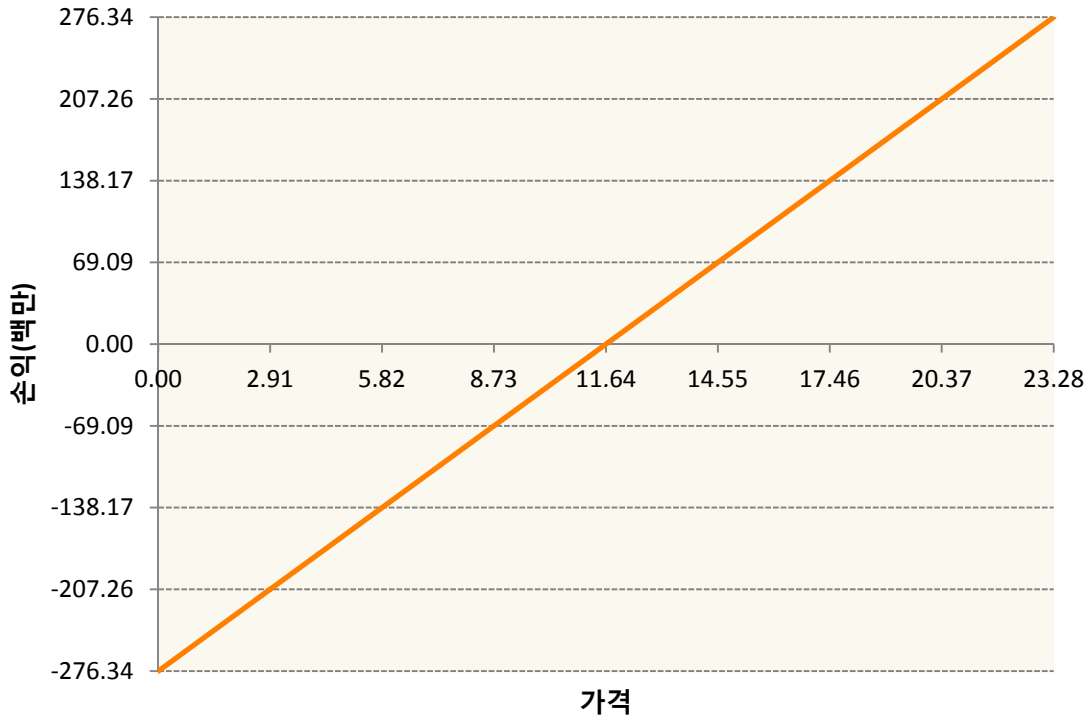
KR4175P90005-2019-09 달러선물



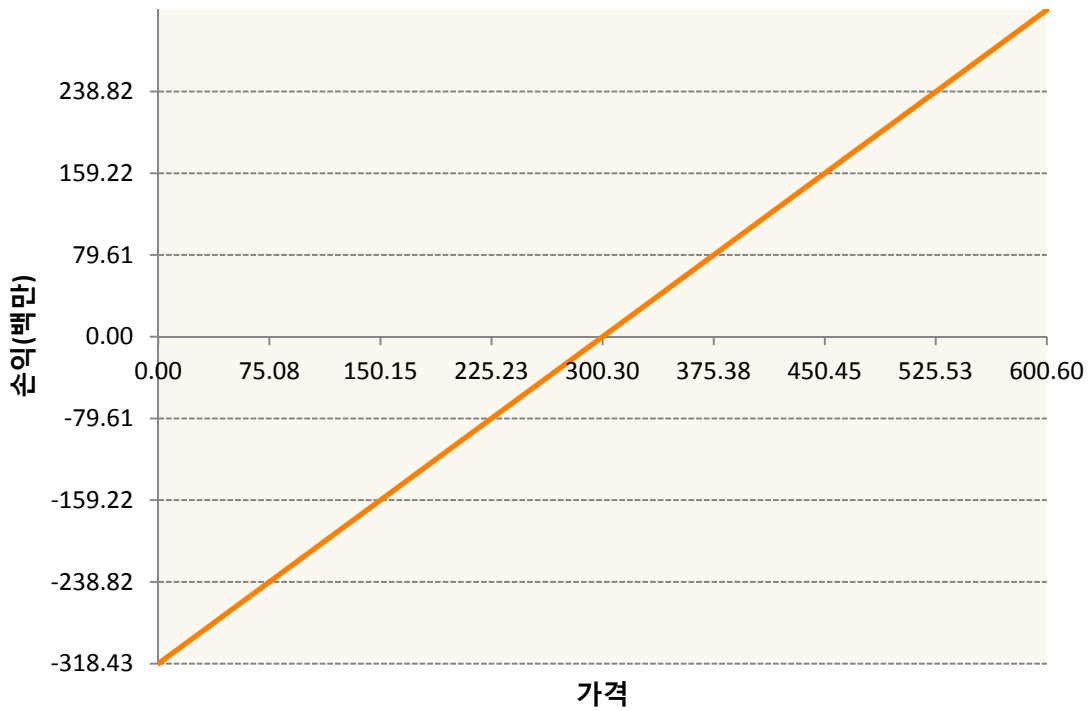
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



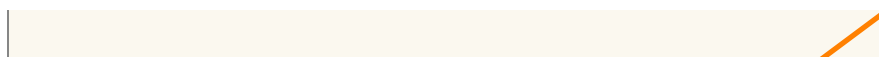
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

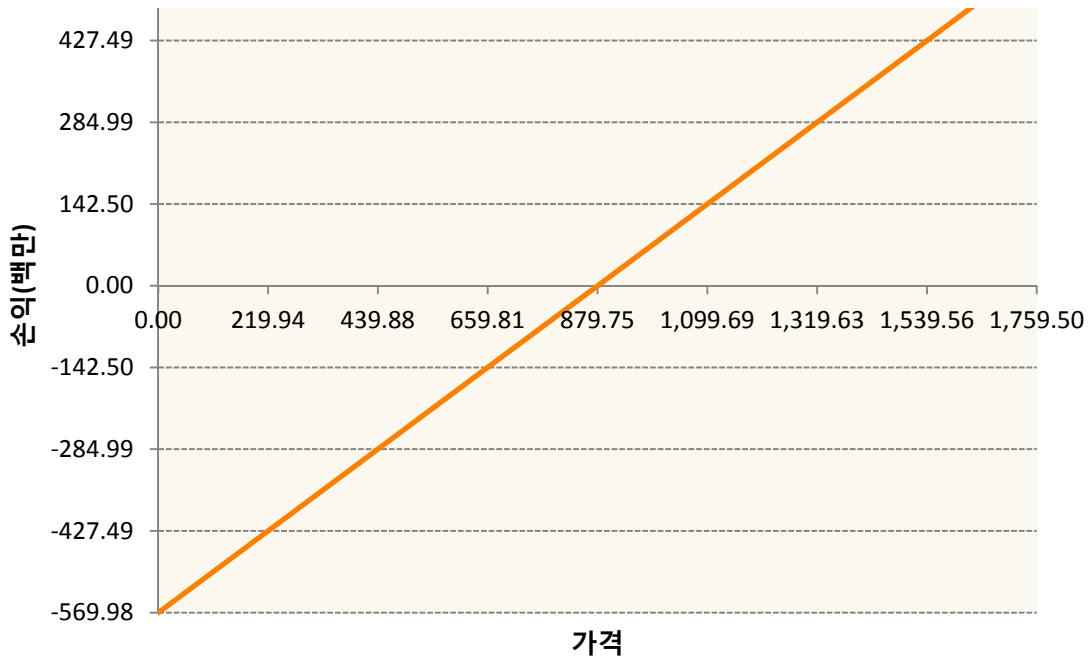


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

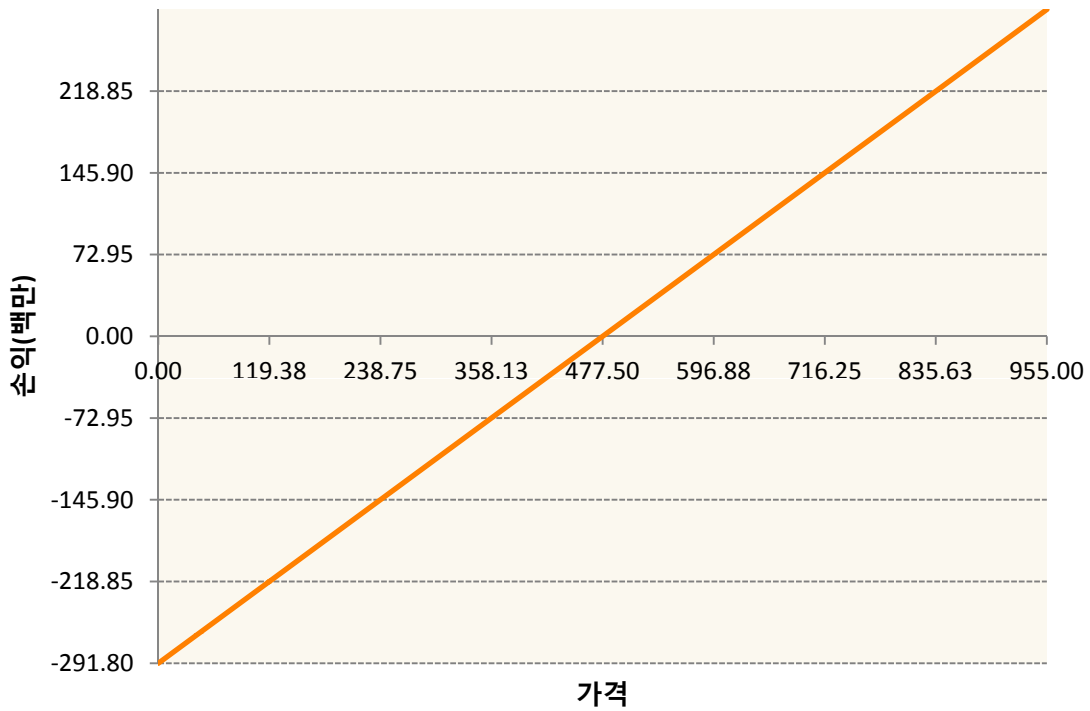


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





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	47
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	46
WZ9	WHEAT FUTURE(CBT) Dec19	23

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

(단위:백만원)

248