

공시일	2019-08-21
기준일	2019-08-20

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)

88

공시일	2019-08-21
기준일	2019-08-20

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

1,142

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

654

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-21
기준일	2019-08-20

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)	373
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	136

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

820

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-21
기준일	2019-08-20

유로인덱스모(주식-파생형)

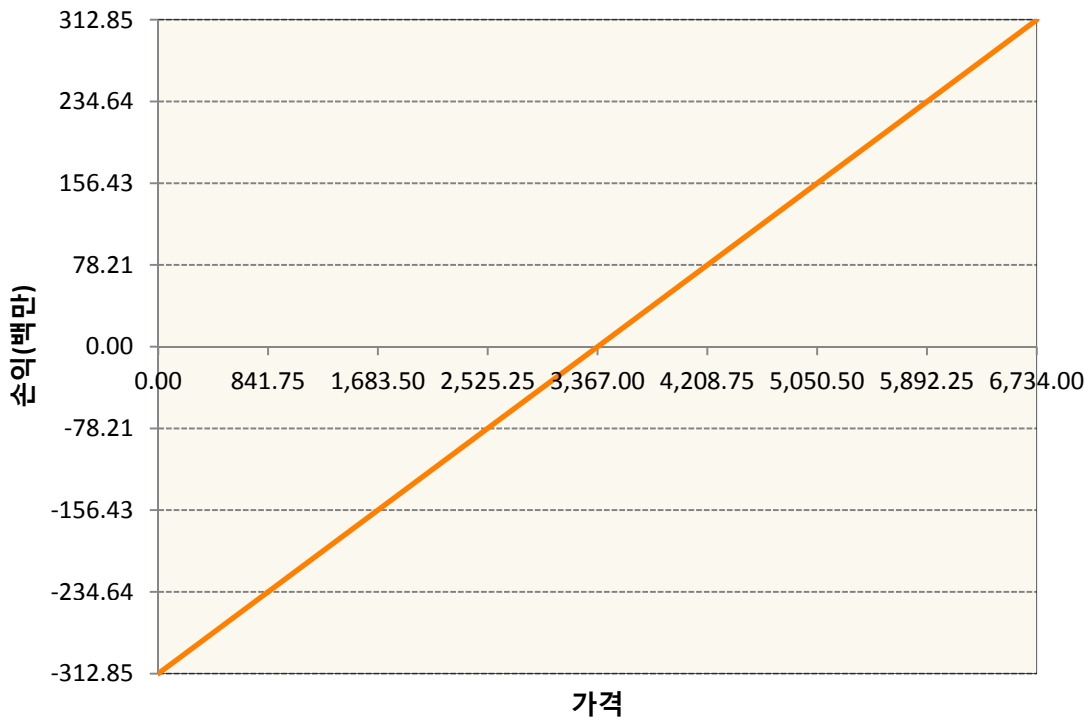
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	313	0	313	

2. 만기시점의 손익구조

VGU9-EURO STOXX 50 Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU9	EURO STOXX 50 Sep19	25
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

18

공시일	2019-08-21
기준일	2019-08-20

차이나인덱스모(주식-파생형)

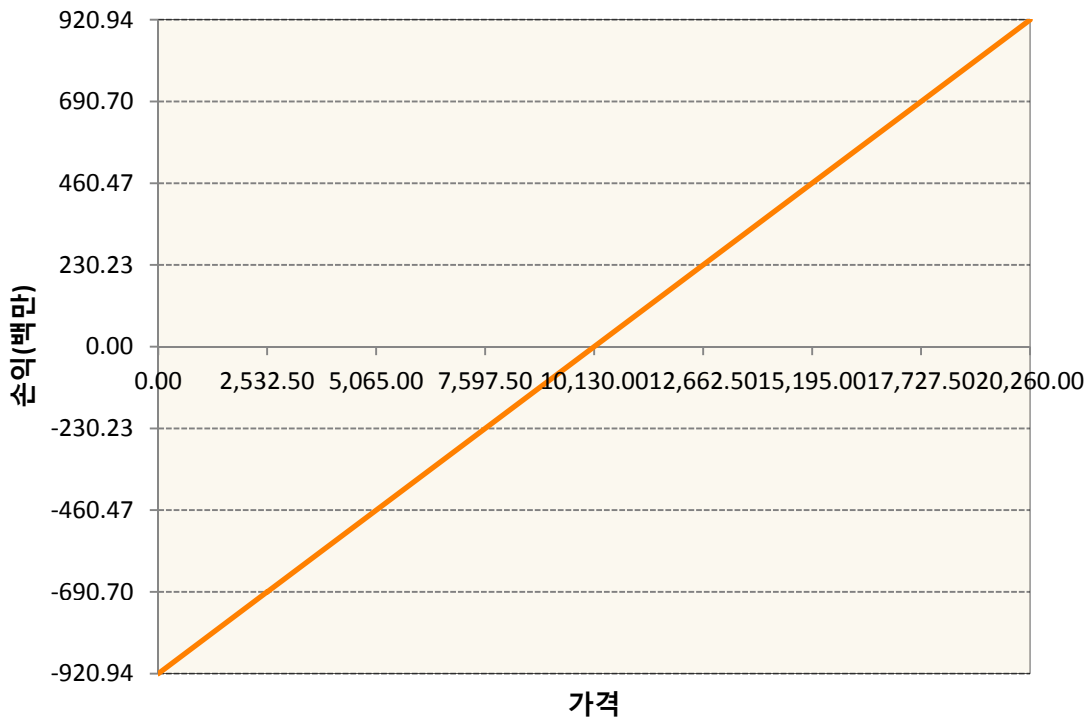
1. 계약금액

(단위:백만원)

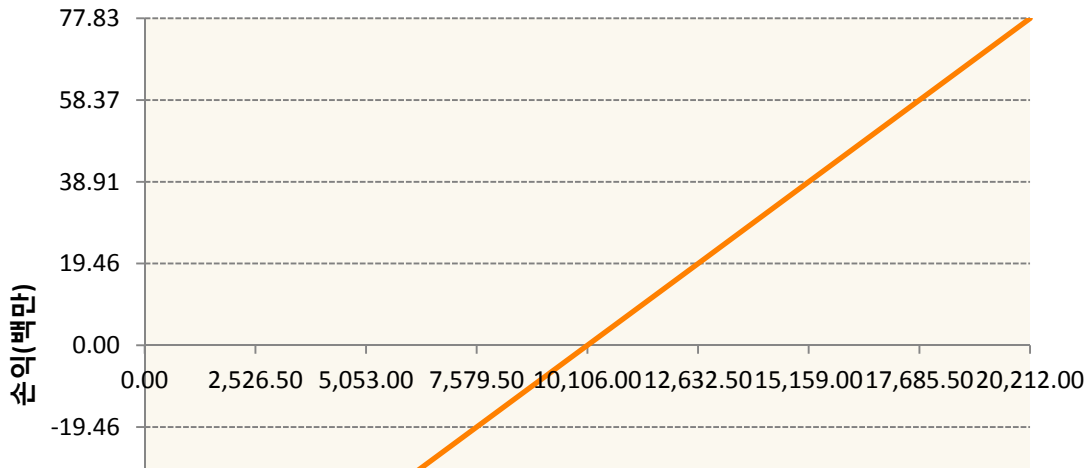
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	999	0	999	장내

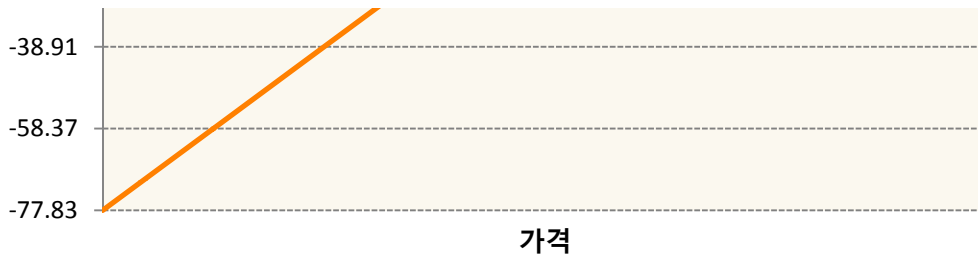
2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19



HCU9-HSCEI Futures Sep19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCQ9	HSCEI Futures Aug19	74
HCU9	HSCEI Futures Sep19	6

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

75

공시일	2019-08-21
기준일	2019-08-20

커버드콜모(주식혼합-파생형)

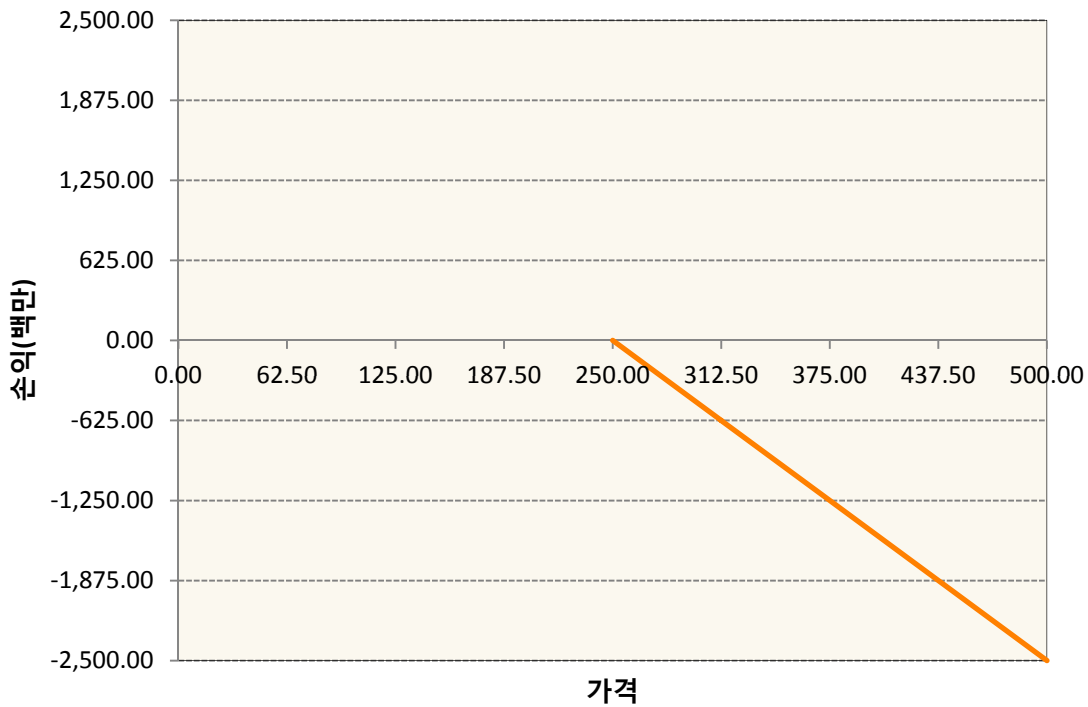
1. 계약금액

(단위:백만원)

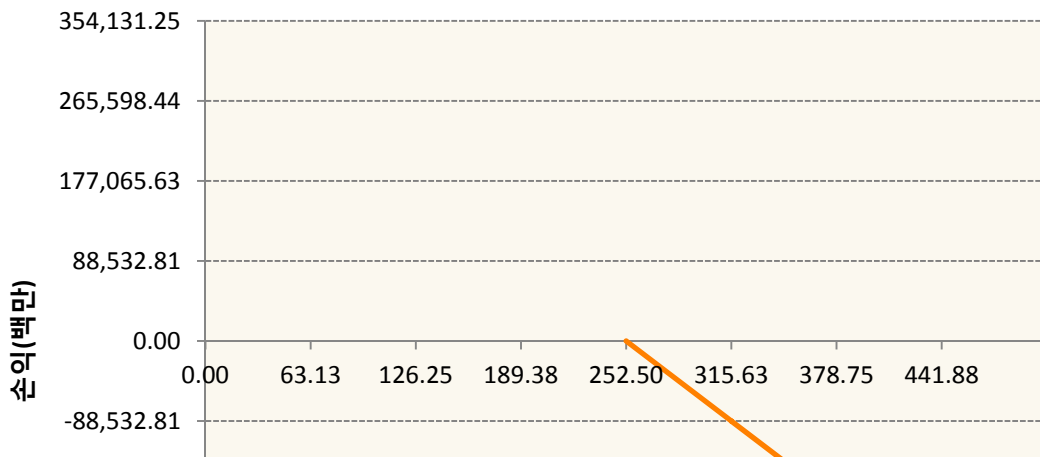
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	523,725	-523,725	장내

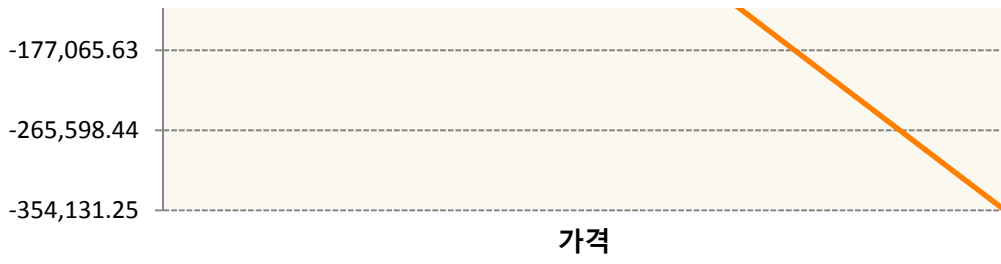
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P92500-2019-09 콜250

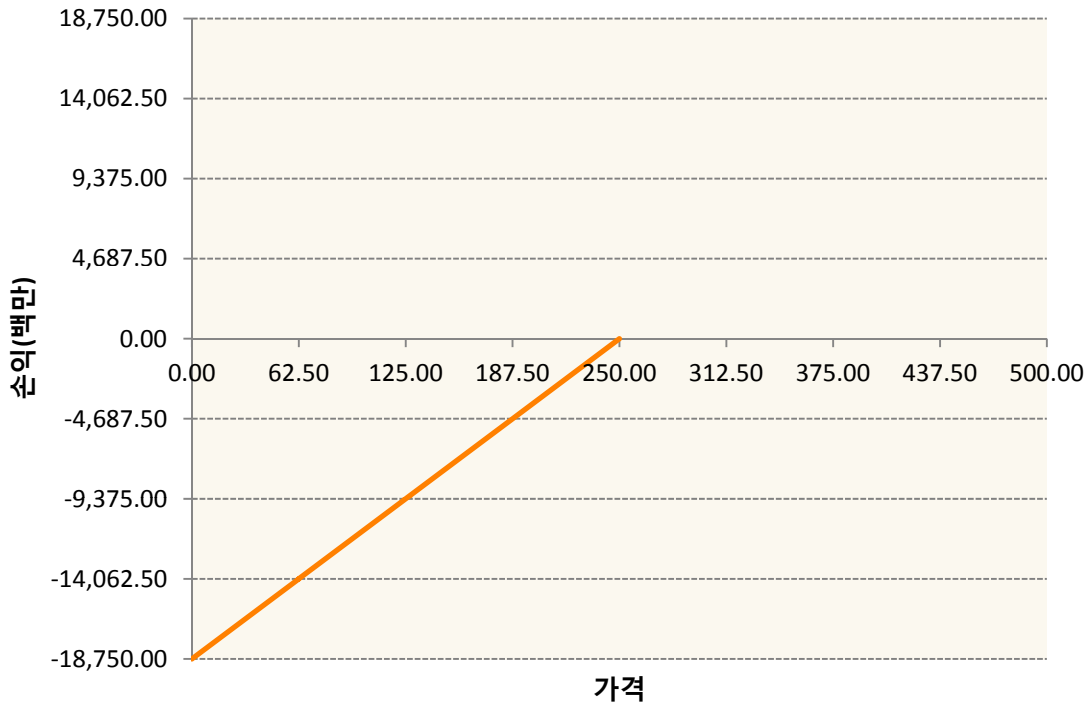


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

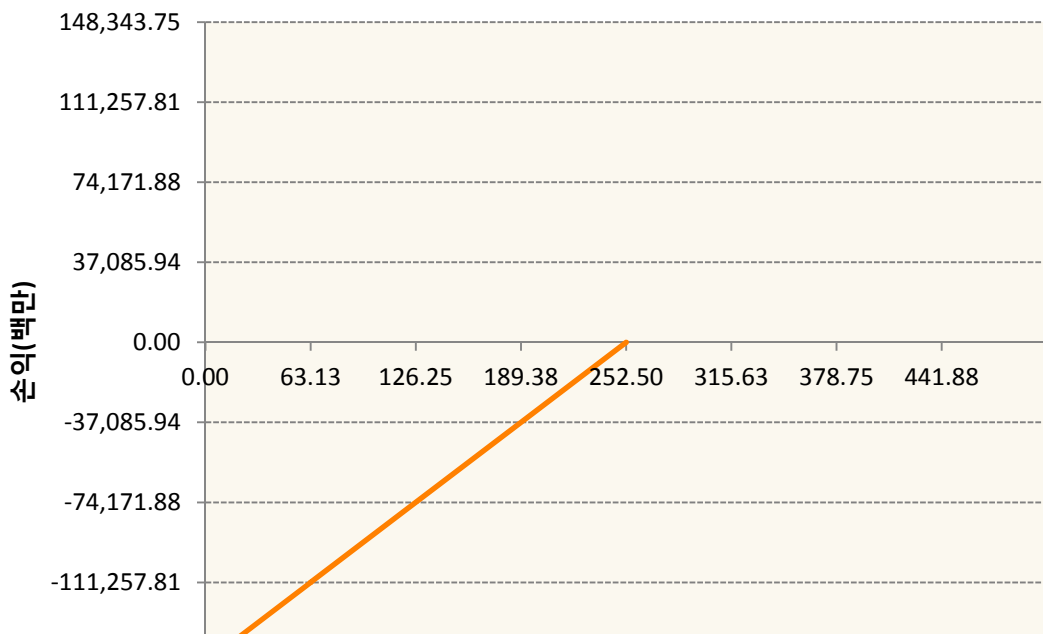




KR4301P92508-2019-09 풋250



KR4301P92524-2019-09 풋252.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P92500 2019-09 콜250								183
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	101	99	96	93	89	85	82	
-5.33%	87	83	78	74	69	64	60	
-2.67%	58	53	48	43	38	33	28	
0%	13	9	4	0	-5	-9	-14	
2.67%	-45	-47	-50	-53	-57	-60	-64	
5.33%	-109	-110	-112	-114	-116	-118	-121	
8.00%	-176	-177	-178	-179	-180	-181	-183	
KR4201P92526 2019-09 콜252.5								24,792
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	12,291	11,994	11,649	11,261	10,837	10,383	9,902	
-5.33%	10,805	10,258	9,687	9,095	8,488	7,868	7,238	
-2.67%	7,518	6,813	6,106	5,399	4,691	3,983	3,275	
0%	1,999	1,343	676	0	-682	-1,370	-2,062	
2.67%	-5,488	-5,938	-6,430	-6,955	-7,507	-8,082	-8,675	
5.33%	-14,234	-14,468	-14,756	-15,093	-15,473	-15,892	-16,343	
8.00%	-23,578	-23,672	-23,809	-23,991	-24,217	-24,484	-24,792	
KR4301P92508 2019-09 풋250								933
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-882	-887	-893	-901	-911	-921	-933	
-5.33%	-418	-435	-453	-471	-490	-510	-530	
-2.67%	-94	-118	-141	-164	-188	-211	-235	
0%	46	32	17	0	-17	-36	-55	
2.67%	79	75	70	63	55	45	34	
5.33%	83	82	81	80	77	73	69	
8.00%	83	83	83	83	82	81	80	
KR4301P92524 2019-09 풋252.5								8,247
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-7,976	-7,996	-8,026	-8,066	-8,117	-8,177	-8,247	
-5.33%	-4,151	-4,246	-4,354	-4,471	-4,596	-4,729	-4,867	
-2.67%	-1,134	-1,316	-1,497	-1,680	-1,862	-2,045	-2,229	
0%	458	312	159	0	-163	-329	-497	
2.67%	939	885	817	736	644	542	431	

5.33%	1,016	1,007	990	965	930	887	833
8.00%	1,023	1,022	1,020	1,015	1,006	992	973

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

(단위:백만원)

34,379

공시일	2019-08-21
기준일	2019-08-20

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

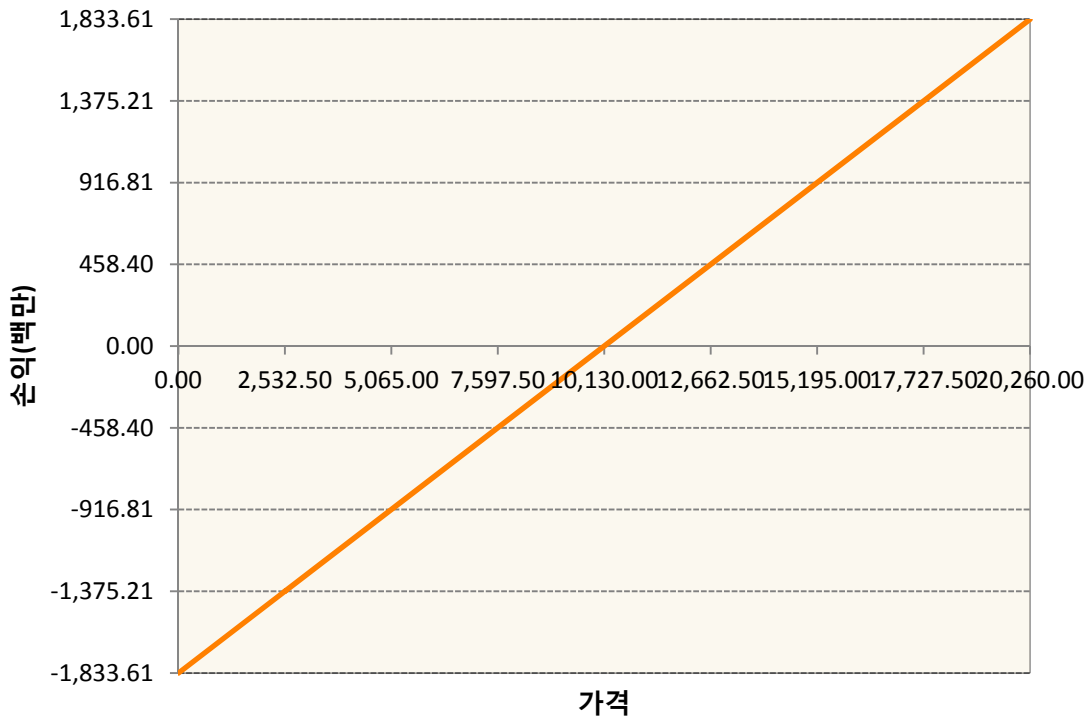
1. 계약금액

(단위:백만원)

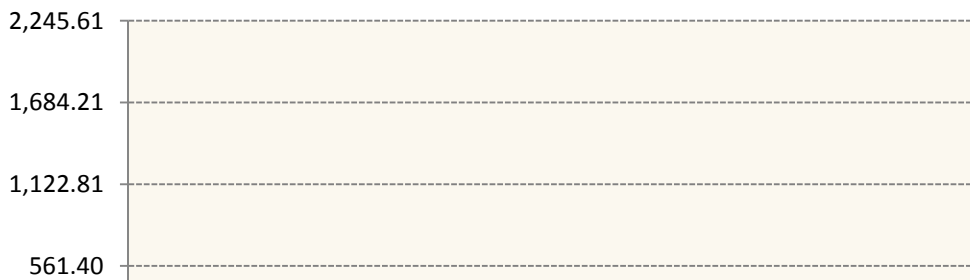
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,834	0	1,834	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,499	-5,499	장내
누계	통화	선도	457	3,235	-2,777	장외

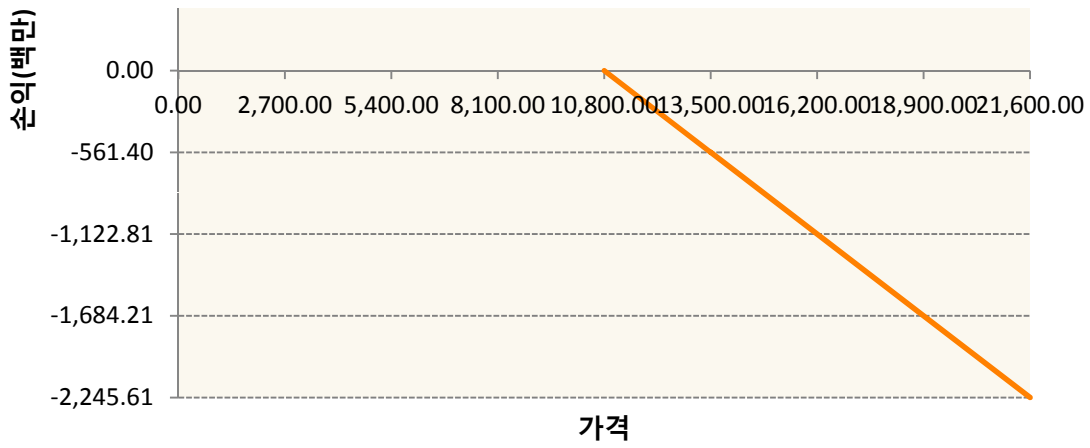
2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19

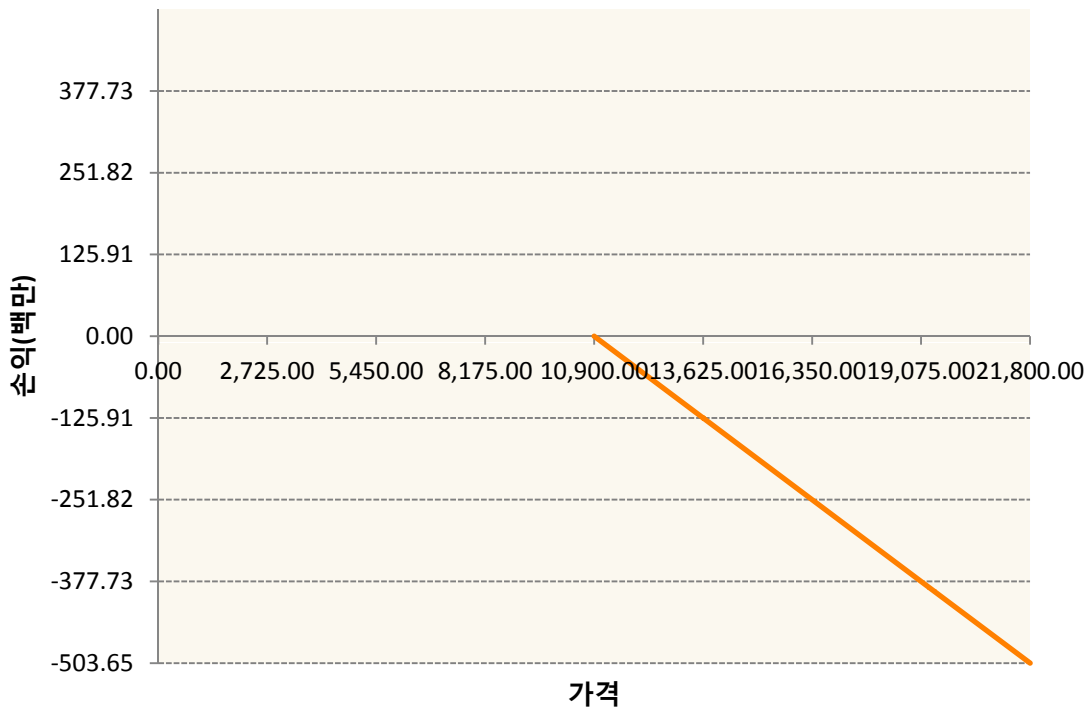


OHHIQ9-C108-HSCEI

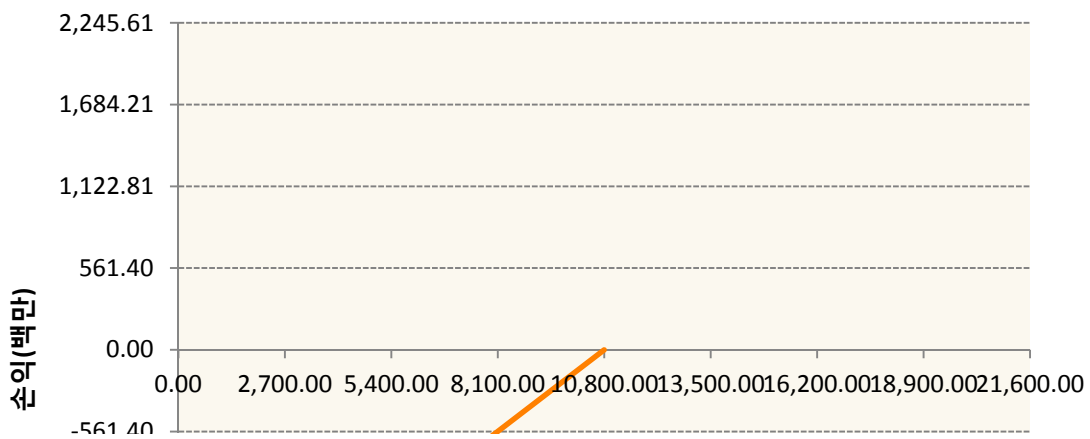


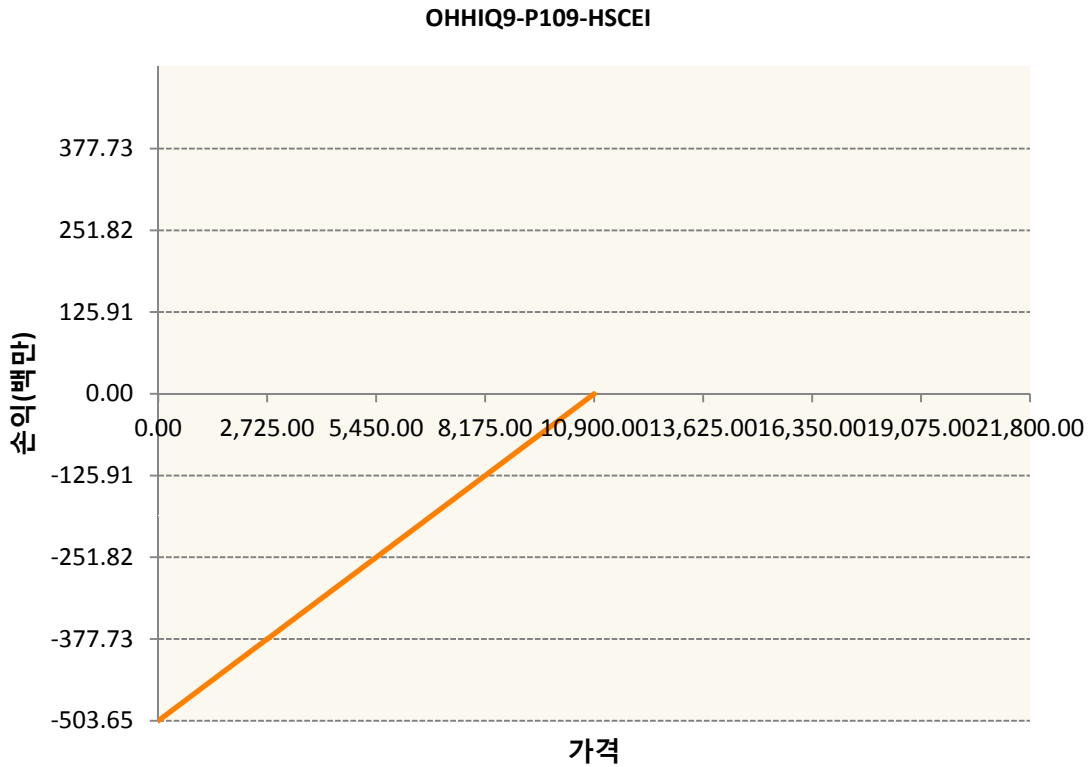


OHHIQ9-C109-HSCEI



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	147
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	2019-08-21
기준일	2019-08-20

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

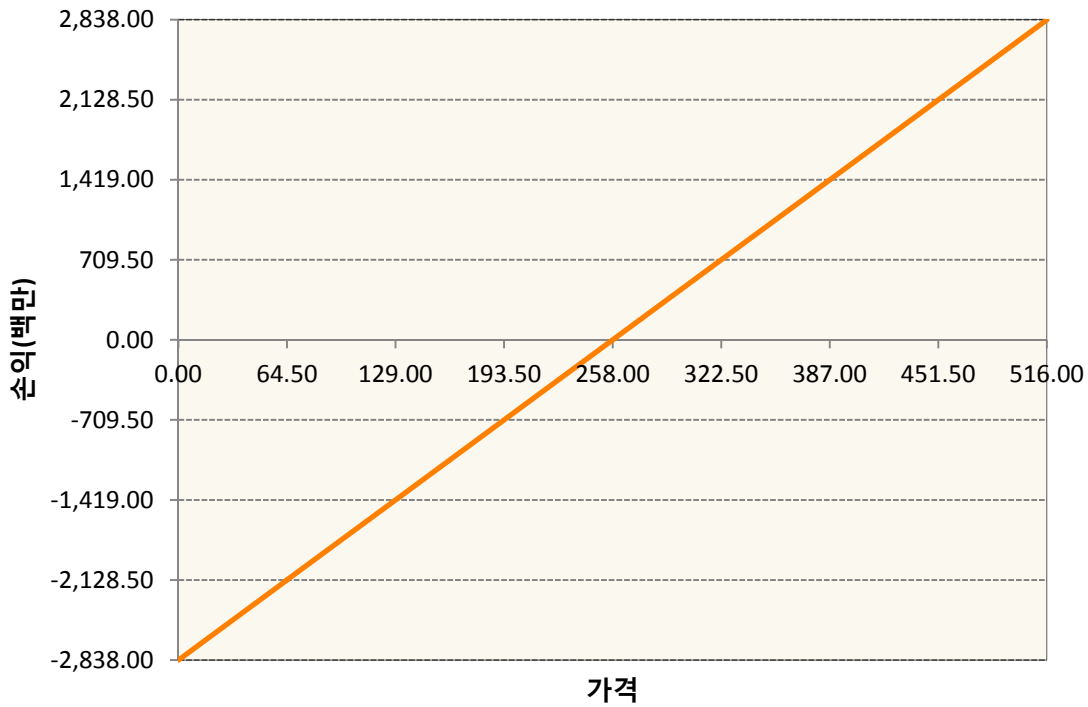
1. 계약금액

(단위:백만원)

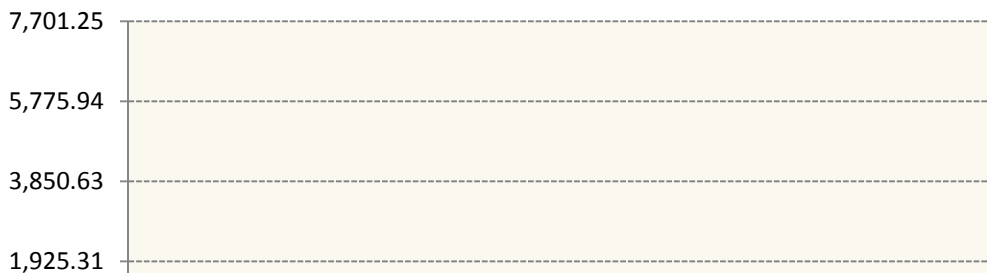
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,838	0	2,838	장내
누계	유가증권	스왑	14,125	0	14,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,018	-15,018	장내

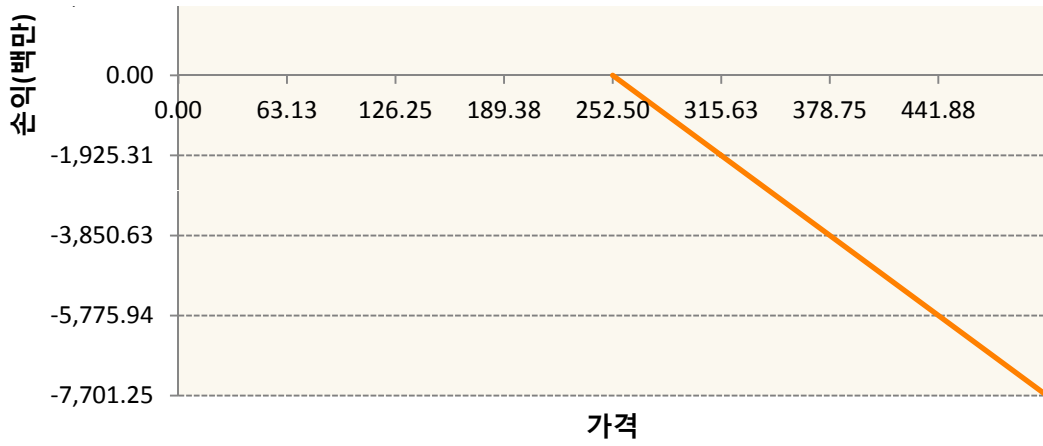
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

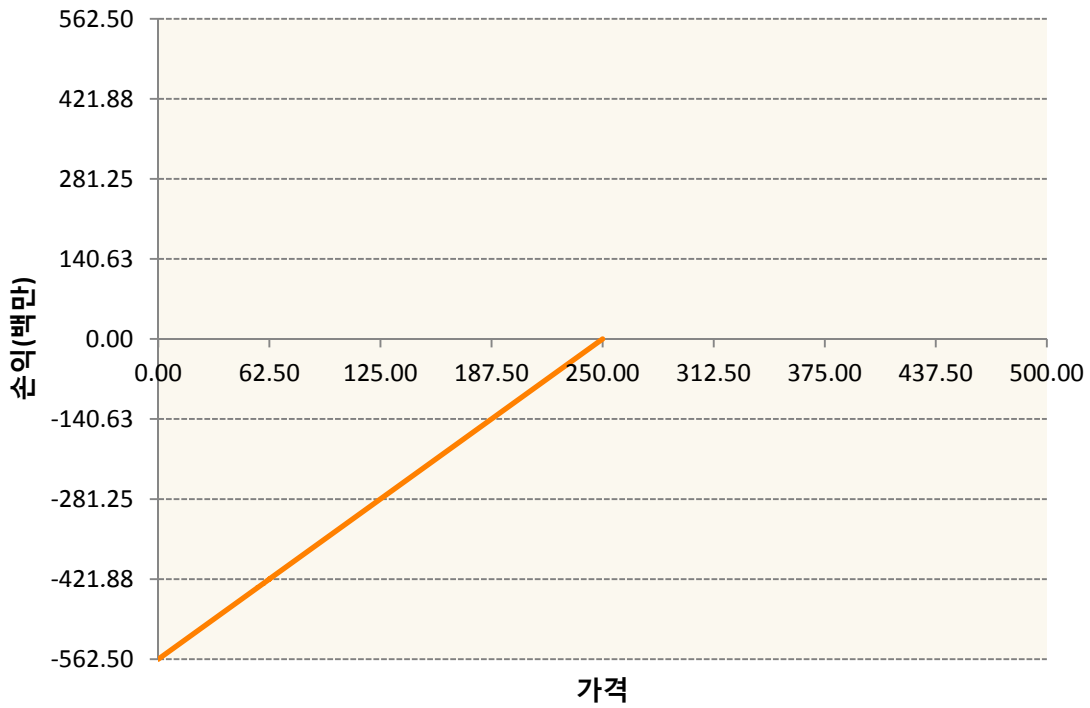


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

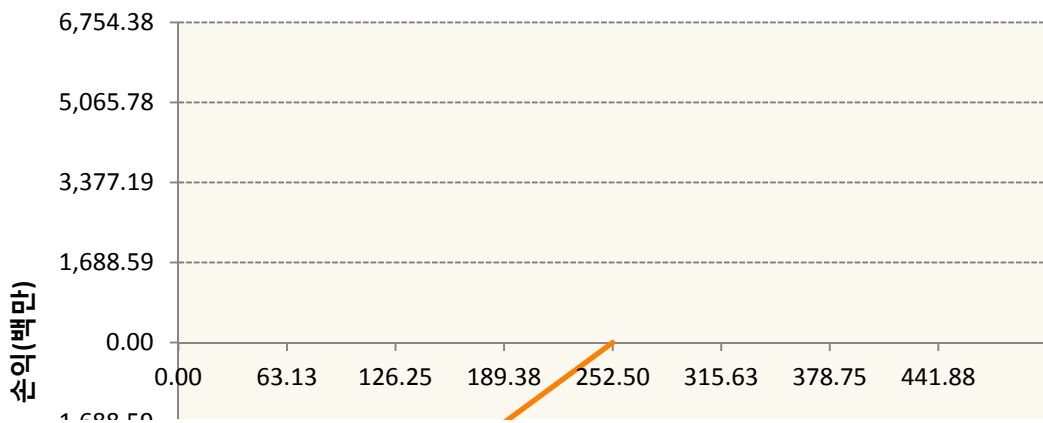




KR4301P92508-2019-09 풋250



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						227
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-227	-227	-227	-227	-227	-227	-227	
-5.33%	-151	-151	-151	-151	-151	-151	-151	
-2.67%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	76	76	76	76	76	76	76	
5.33%	151	151	151	151	151	151	151	
8.00%	227	227	227	227	227	227	227	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5						539
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	267	261	253	245	236	226	215	
-5.33%	235	223	211	198	185	171	157	
-2.67%	164	148	133	117	102	87	71	
0%	43	29	15	0	-15	-30	-45	
2.67%	-119	-129	-140	-151	-163	-176	-189	
5.33%	-310	-315	-321	-328	-336	-346	-355	
8.00%	-513	-515	-518	-522	-527	-532	-539	
KR4301P92508		2019-09 풋250						28
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-26	-27	-27	-27	-27	-28	-28
-5.33%	-13	-13	-14	-14	-15	-15	-16
-2.67%	-3	-4	-4	-5	-6	-6	-7
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	2	2	2	2	2	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							376
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-363	-364	-365	-367	-370	-372	-376
-5.33%	-189	-193	-198	-204	-209	-215	-222
-2.67%	-52	-60	-68	-76	-85	-93	-101
0%	21	14	7	0	-7	-15	-23
2.67%	43	40	37	34	29	25	20
5.33%	46	46	45	44	42	40	38
8.00%	47	47	46	46	46	45	44

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

(단위:백만원)

2,355

공시일	2019-08-21
기준일	2019-08-20

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

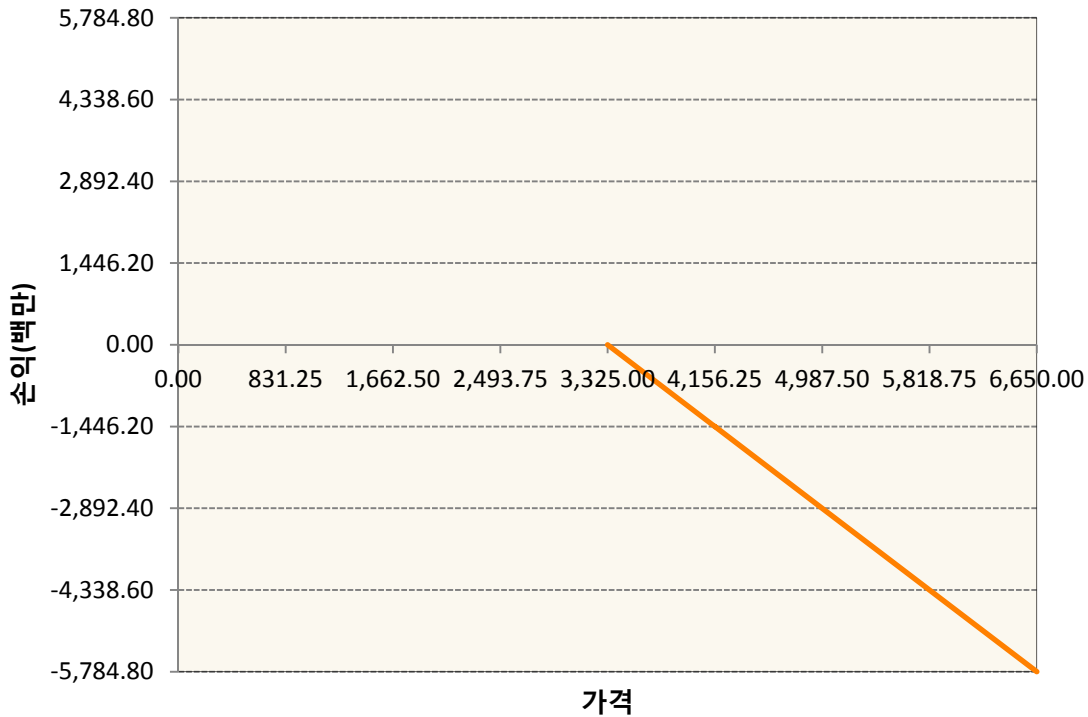
1. 계약금액

(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	4,231	0	4,231	
누계	유가증권	옵션	0	13,901	-13,901	장내
누계	지수	스왑	28,294	0	28,294	장외
누계	통화	선도	14,454	22,751	-8,298	장외

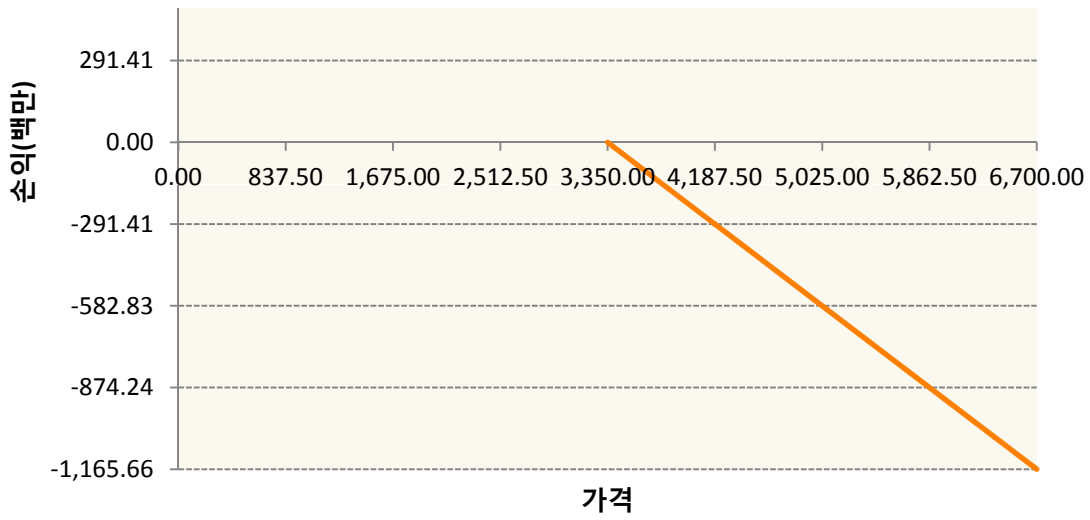
2. 만기시점의 손익구조

OESXU9-C3325-EURO STOXX 50

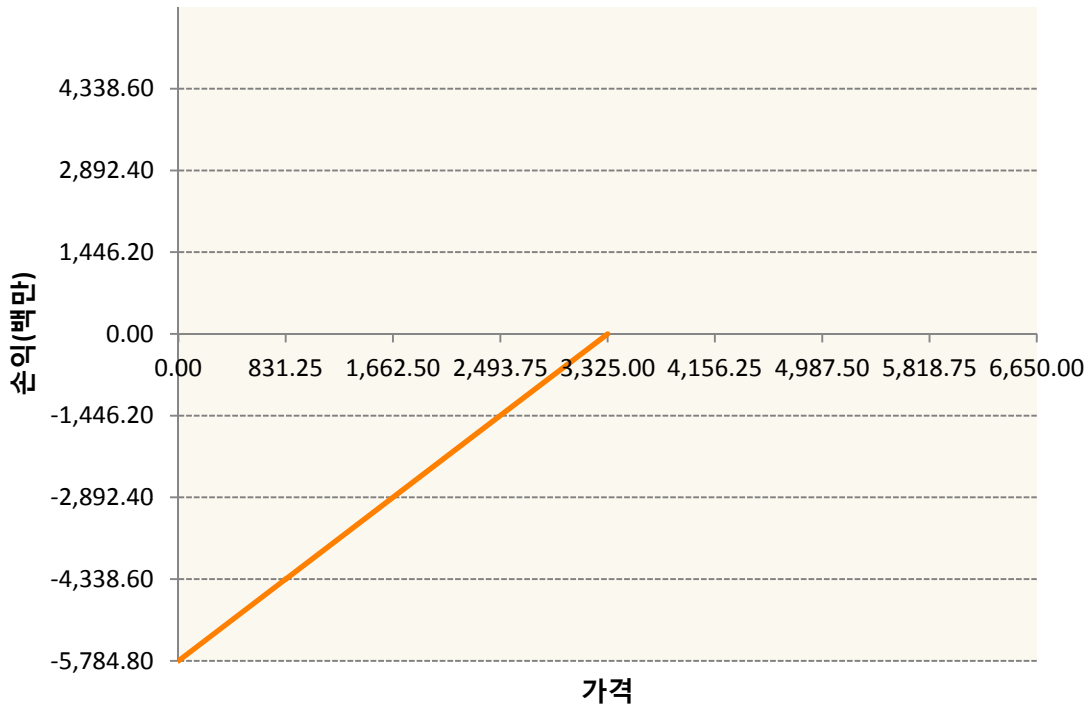


OESXU9-C3350-EURO STOXX 50

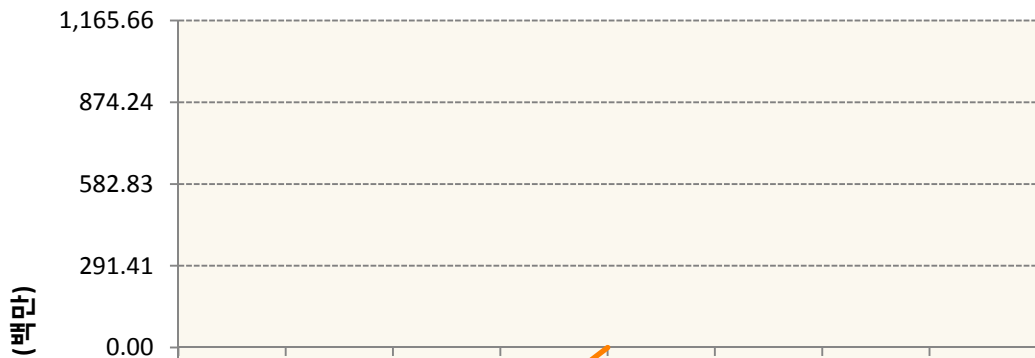


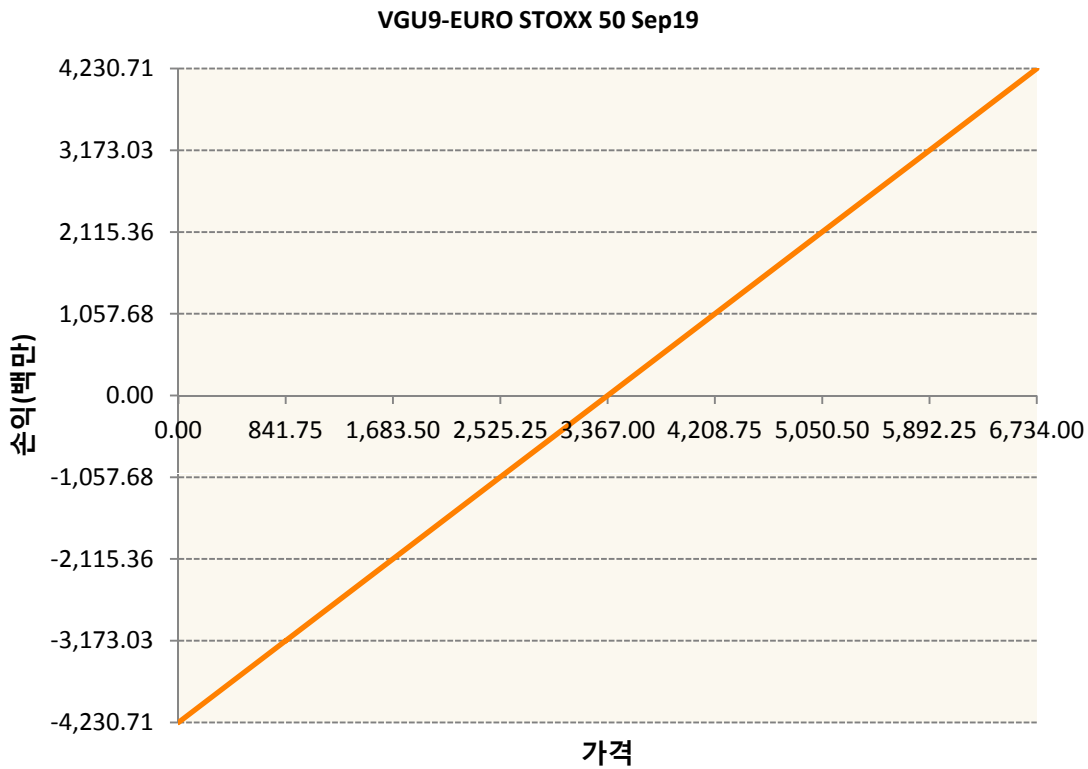
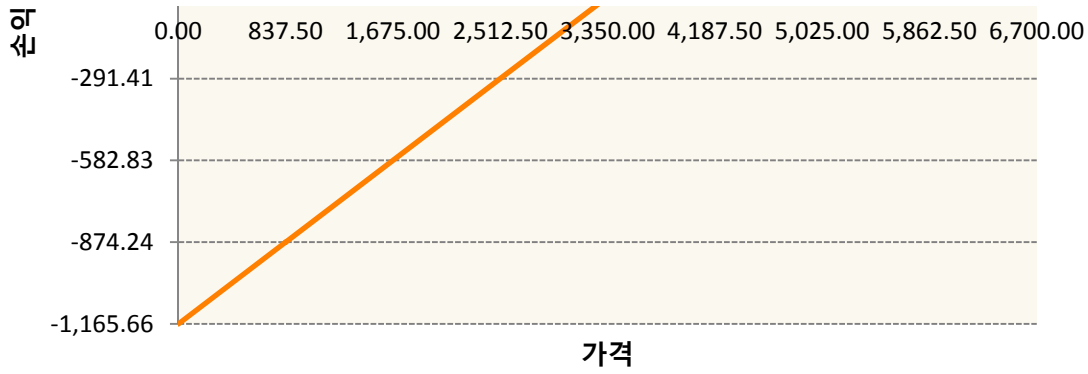


OESXU9-P3325-EURO STOXX 50



OESXU9-P3350-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		53
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E		428
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E		1,071
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E		321
FX21019N01 EUR/KRW 23-08-19E		428
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E		321
FX21019N04 EUR/KRW 27-09-19E		236
FX21019Q00 EUR/KRW 27-09-19E		171
OESXU9-C33 EURO STOXX 50		463
OESXU9-C33 EURO STOXX 50		93
OESXU9-P33 EURO STOXX 50		463

OESXU9-P33 EURO STOXX 50
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19

93
338

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

(단위:백만원)

2,482

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

(단위:백만원)

935

공시일	2019-08-21
기준일	2019-08-20

ETF스마트레버리지목표전환형9호

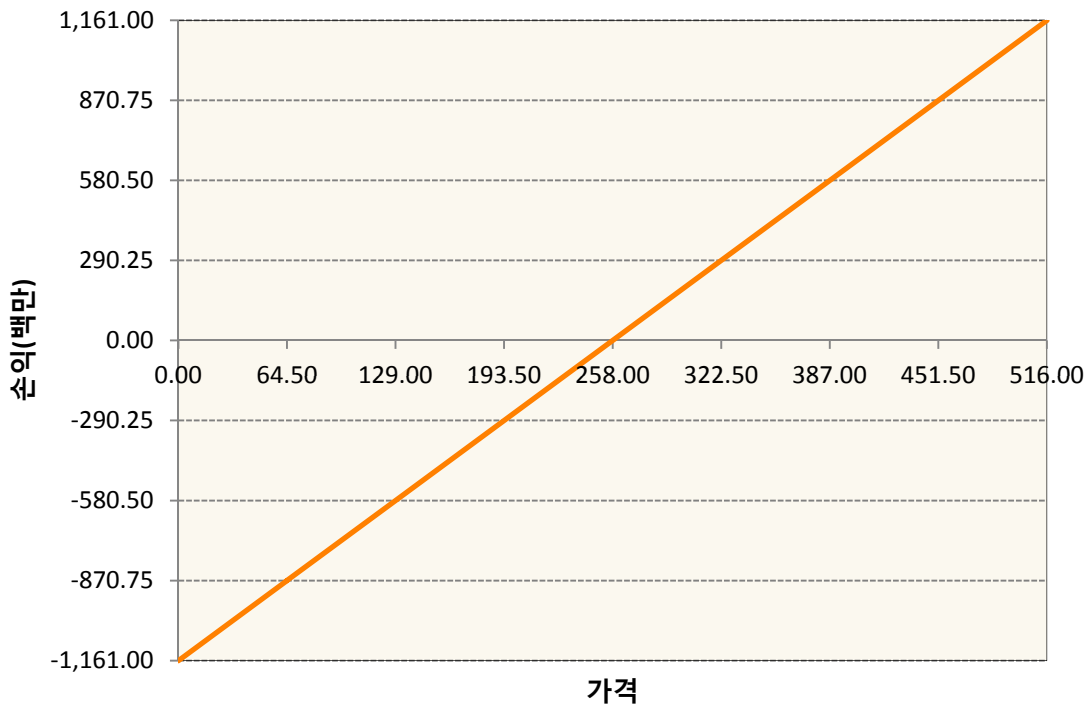
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,161	0	1,161	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						93
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93	
-5.33%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62	
-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%	62	62	62	62	62	62	62	
8.00%	93	93	93	93	93	93	93	

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

(단위:백만원)

79

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

(단위:백만원)

123

공시일	2019-08-21
기준일	2019-08-20

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

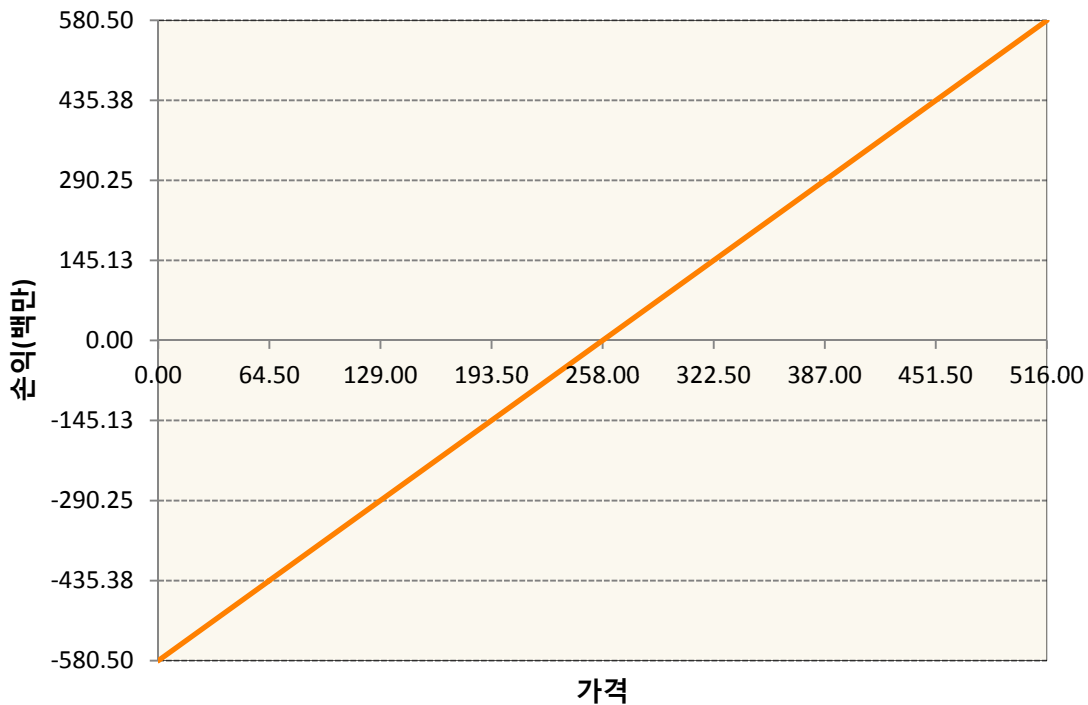
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	581	0	581	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	2019-08-21
기준일	2019-08-20

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

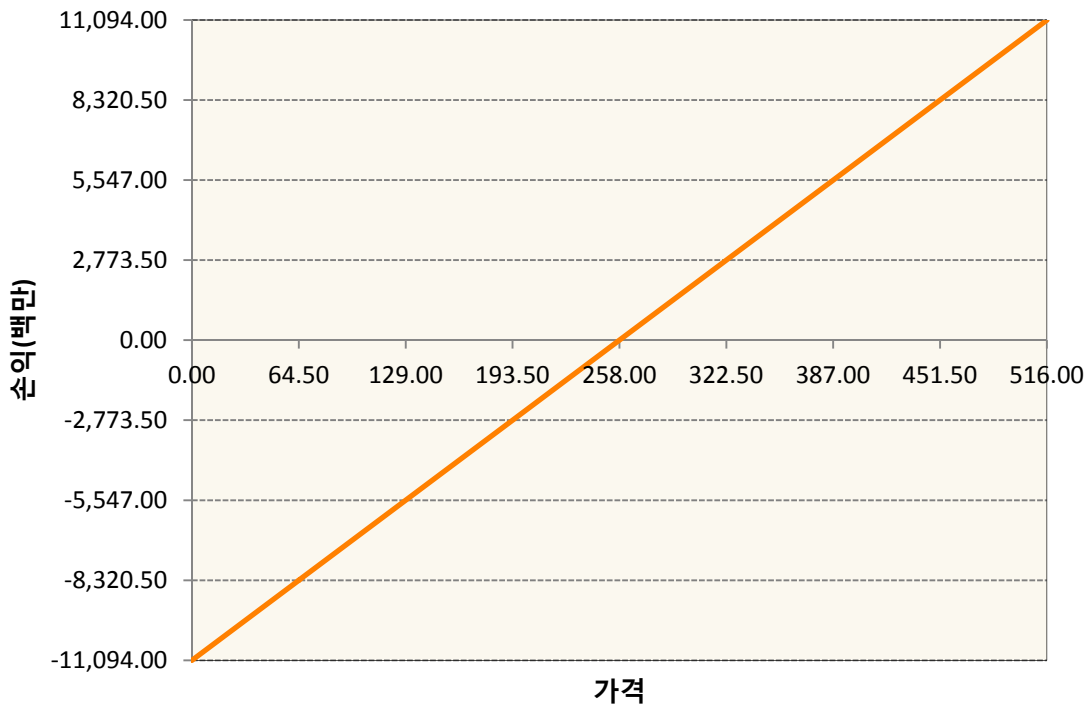
1. 계약금액

(단위:백만원)

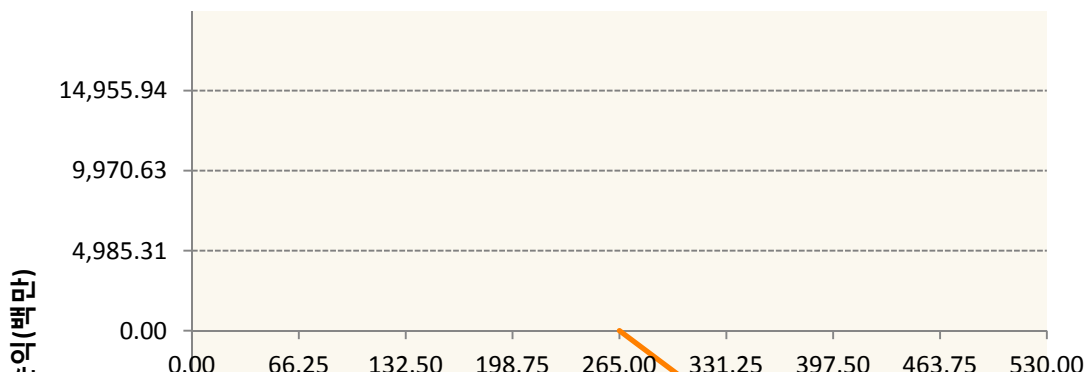
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,094	0	11,094	장내
누계	유가증권	옵션	3,659	20,075	-16,416	장내

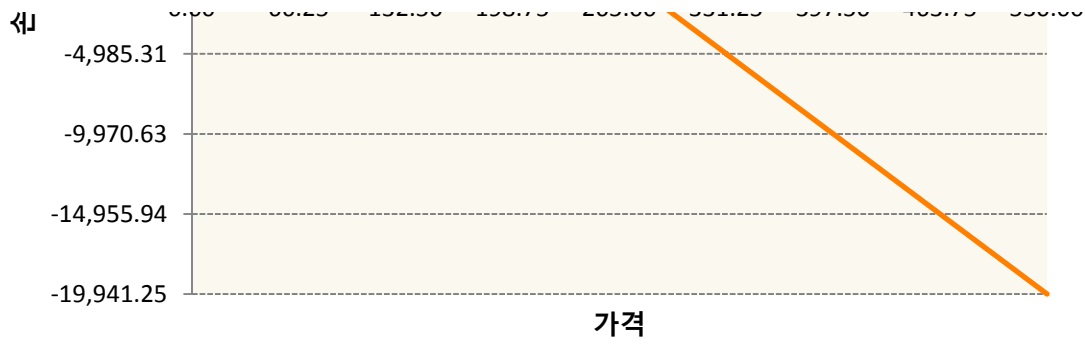
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

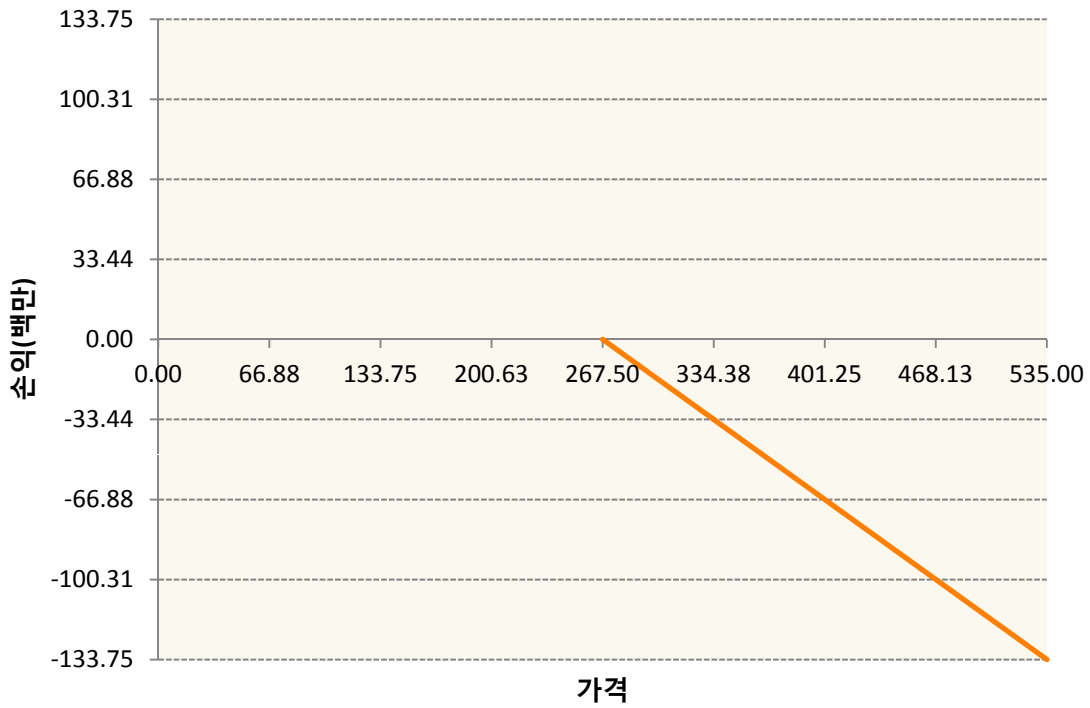


KR4201P92658-2019-09 콜265

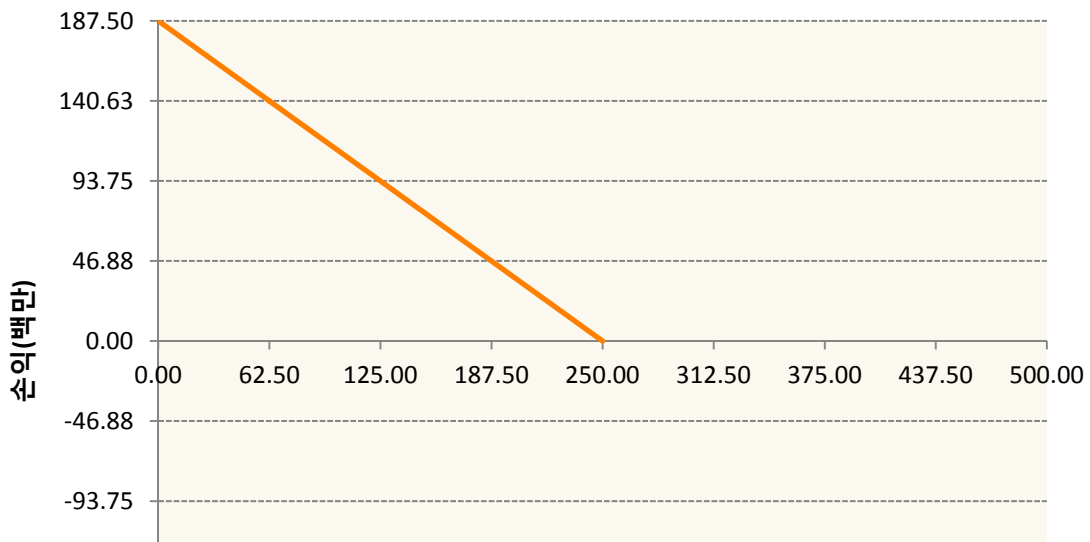


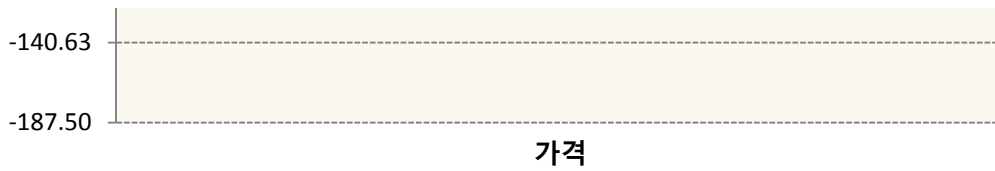


KR4201P92674-2019-09 콜267.5

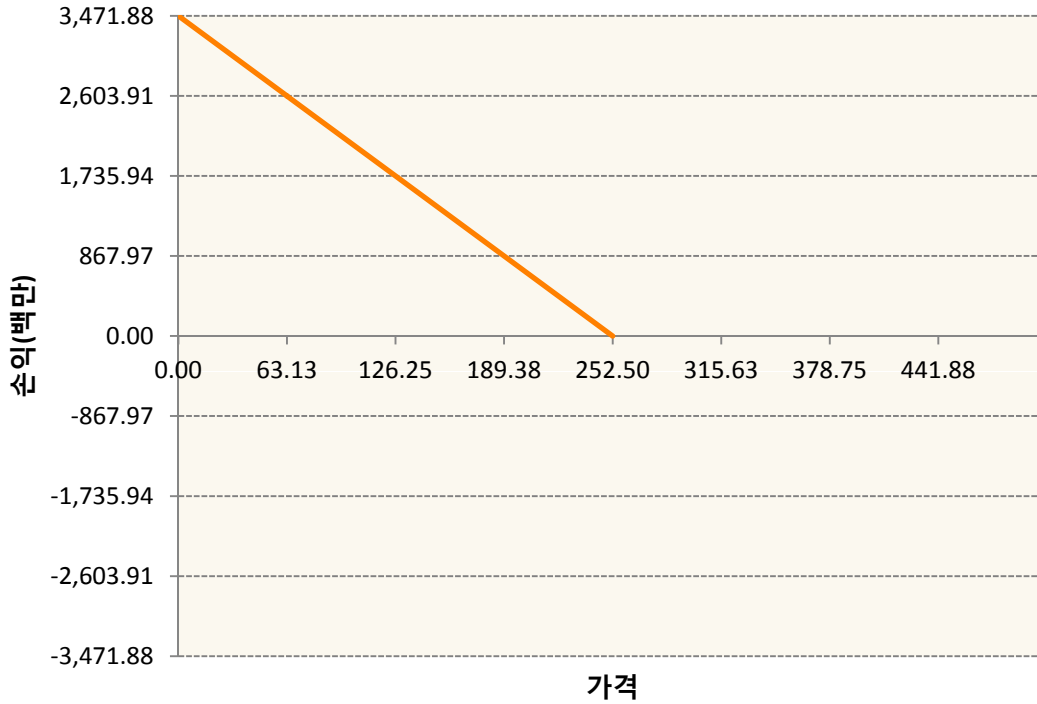


KR4301P92508-2019-09 풋250





KR4301P92524-2019-09 풋252.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						888
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-888	-888	-888	-888	-888	-888	-888	
-5.33%	-592	-592	-592	-592	-592	-592	-592	
-2.67%	-296	-296	-296	-296	-296	-296	-296	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	296	296	296	296	296	296	296	
5.33%	592	592	592	592	592	592	592	
8.00%	888	888	888	888	888	888	888	
KR4201P92658		2019-09 콜265						997
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	252	249	245	239	230	220	208	
-5.33%	242	233	221	207	191	172	151	
-2.67%	204	184	160	135	108	80	50	

0%	104	70	35	0	-36	-73	-110
2.67%	-97	-137	-177	-217	-257	-297	-337
5.33%	-412	-447	-484	-521	-559	-597	-635
8.00%	-823	-847	-874	-903	-933	-965	-997
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	-2	-2	-2
5.33%	-2	-3	-3	-3	-3	-4	-4
8.00%	-5	-5	-5	-5	-6	-6	-6
KR4301P92508 2019-09 풋250							9
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9	9	9	9	9	9	9
-5.33%	4	4	5	5	5	5	5
-2.67%	1	1	1	2	2	2	2
0%	0	0	0	0	0	0	1
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	0	0
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
KR4301P92524 2019-09 풋252.5							193
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	187	187	188	189	190	191	193
-5.33%	97	99	102	105	108	111	114
-2.67%	27	31	35	39	44	48	52
0%	-11	-7	-4	0	4	8	12
2.67%	-22	-21	-19	-17	-15	-13	-10
5.33%	-24	-24	-23	-23	-22	-21	-19
8.00%	-24	-24	-24	-24	-24	-23	-23

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

(단위:백만원)

1,747

공시일	2019-08-21
기준일	2019-08-20

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,021	0	3,021	
누계	유가증권	수익증권	59,824	0	59,824	

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	2019-08-21
기준일	2019-08-20

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,054	0	2,054	
누계	유가증권	수익증권	77,906	0	77,906	

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	2019-08-21
기준일	2019-08-20

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	468,972	0	468,972	
누계	통화	선도	0	526,335	-526,335	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		1,740
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,127
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		135
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		967
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		3,006
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		1,682
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		773
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,933
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,933
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		290
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		97
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		715
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		715
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		290
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		677
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		2,707
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		1,353
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		773
FX21019N04 KRW/USD 03-09-19E		290
FX21019Q00 KRW/USD 03-09-19E		290
FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E		483
FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E		193
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		290
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		3,190
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		2,165
FX21019Q01 KRW/USD 16-09-19E		97

FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,963
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,577
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E	2,649
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E	3,006

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

(단위:백만원)

13,724

공시일	2019-08-21
기준일	2019-08-20

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

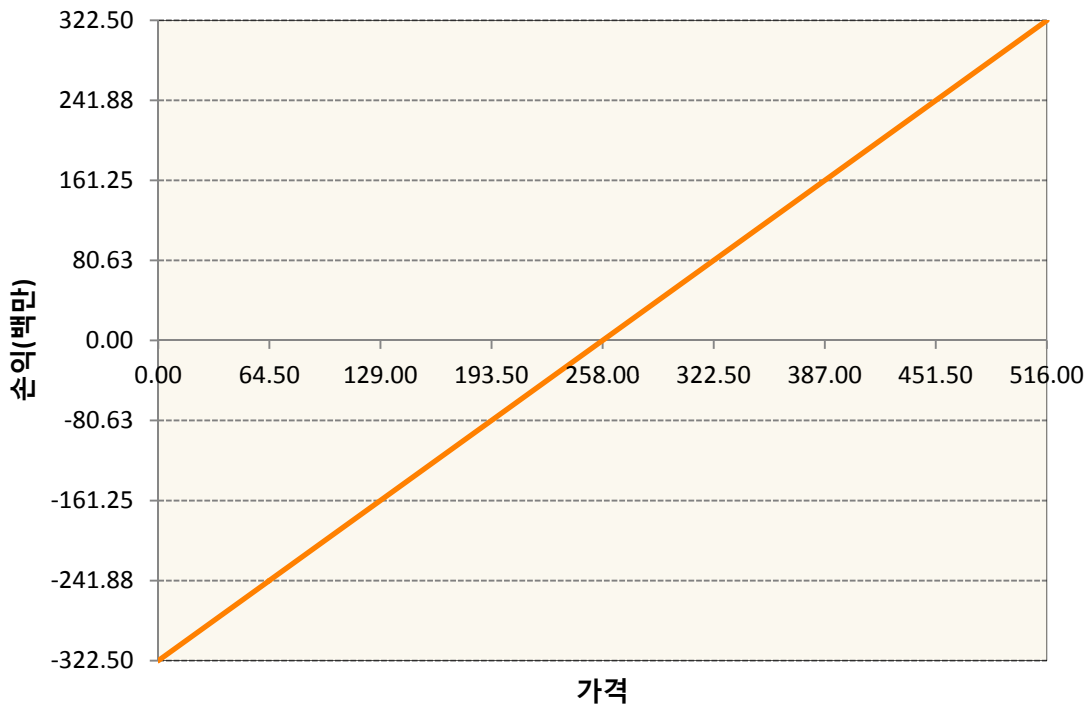
1. 계약금액

(단위:백만원)

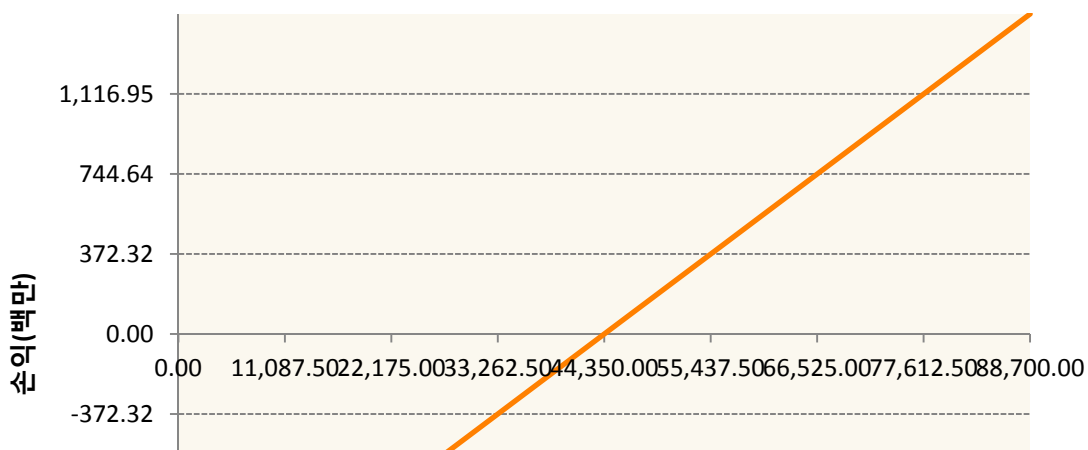
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,812	0	1,812	장내

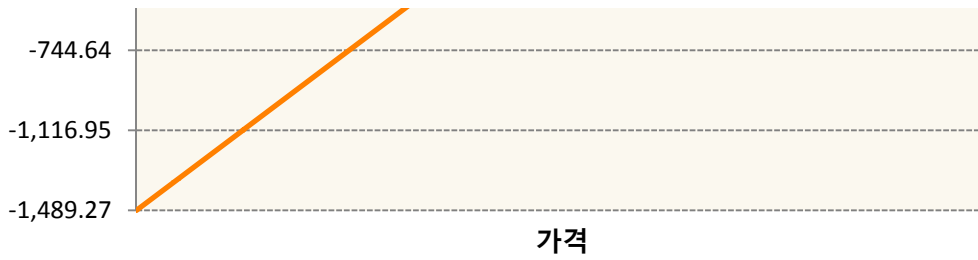
2. 만기시점의 손익구조

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						119
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119	
-5.33%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80	
-2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	40	40	40	40	40	40	40	
5.33%	80	80	80	80	80	80	80	
8.00%	119	119	119	119	119	119	119	

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

173

공시일	2019-08-21
기준일	2019-08-20

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

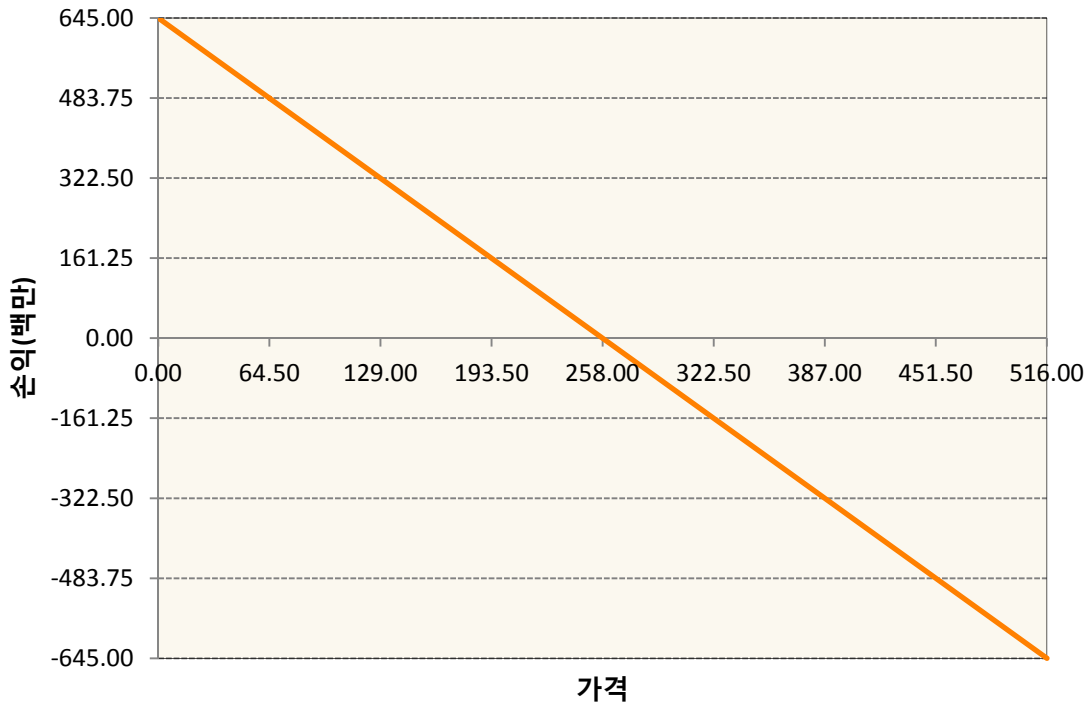
1. 계약금액

(단위:백만원)

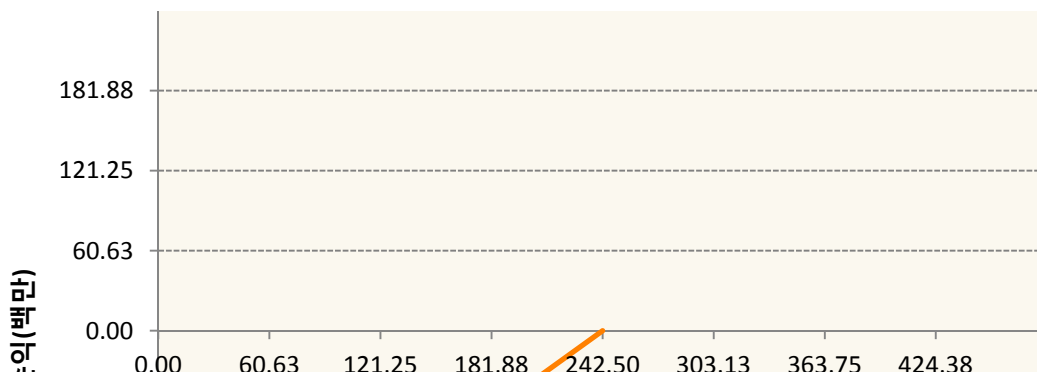
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	645	-645	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,550	-3,550	장내

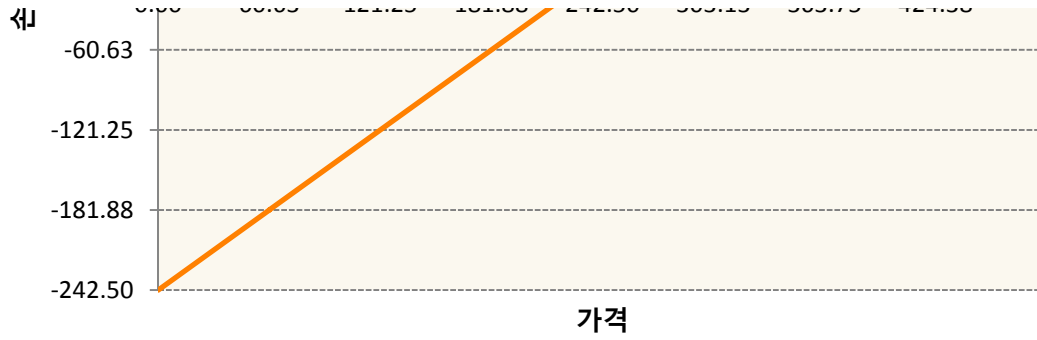
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

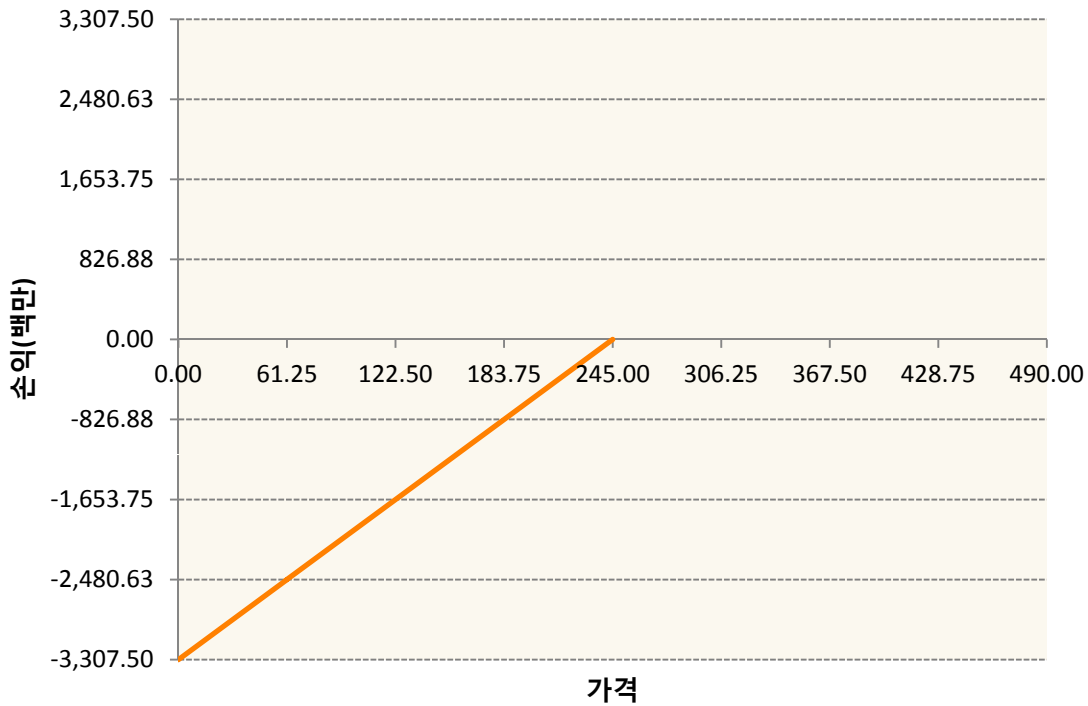


KR4301P92425-2019-09 풋242.5





KR4301P92458-2019-09 풋245



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						52
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	52	52	52	52	52	52	52	
-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%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52	
KR4301P92425		2019-09 풋242.5						7
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6	-6	-6	-7	-7	-7	-7
-5.33%	-2	-2	-2	-3	-3	-3	-4
-2.67%	0	0	-1	-1	-1	-1	-1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

KR4301P92458

2019-09 풋245

122

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-106	-108	-111	-113	-116	-119	-122
-5.33%	-39	-43	-47	-51	-55	-59	-63
-2.67%	-5	-8	-11	-15	-18	-22	-25
0%	4	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	5	5	5	4	4	3	2
5.33%	5	5	5	5	5	5	4
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

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

(단위:백만원)

126

공시일	2019-08-21
기준일	2019-08-20

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	19,678	0	19,678	
누계	통화	선도	0	19,212	-19,212	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		164
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		483
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		522
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		39

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

(단위:백만원)

501

공시일	2019-08-21
기준일	2019-08-20

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	382	0	382	장외
누계	통화	선도	0	93	-93	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	2019-08-21
기준일	2019-08-20

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

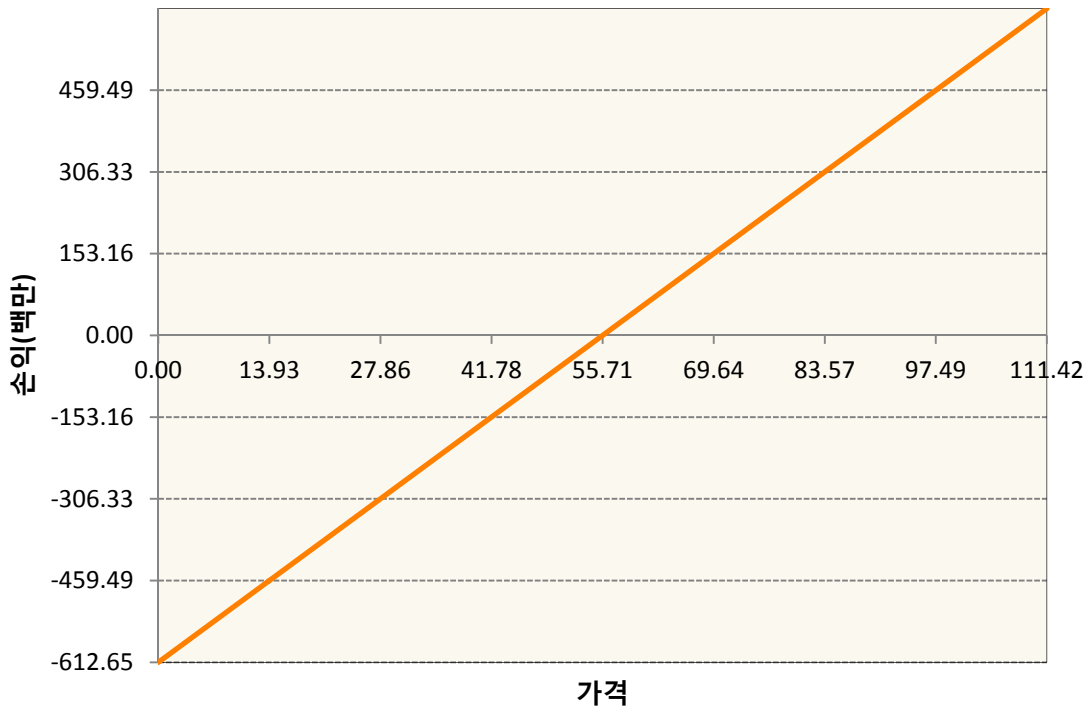
1. 계약금액

(단위:백만원)

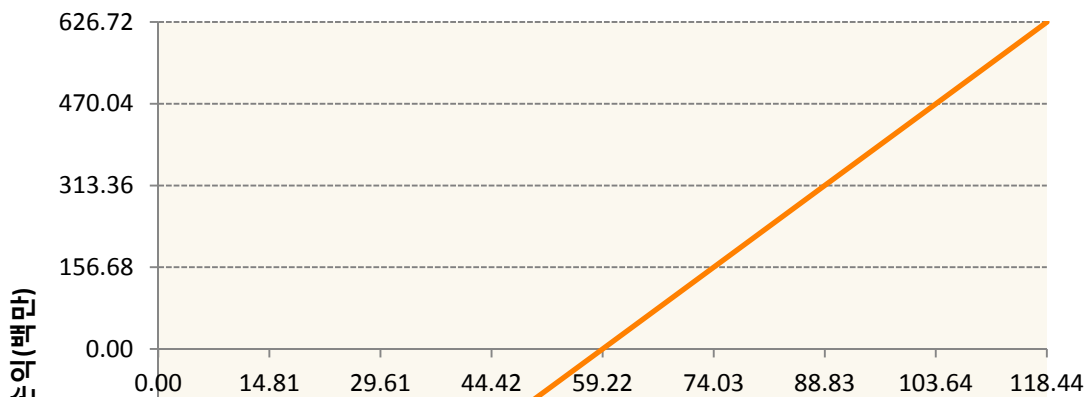
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,231	121	2,110	
누계	유가증권	선물	189	0	189	장내

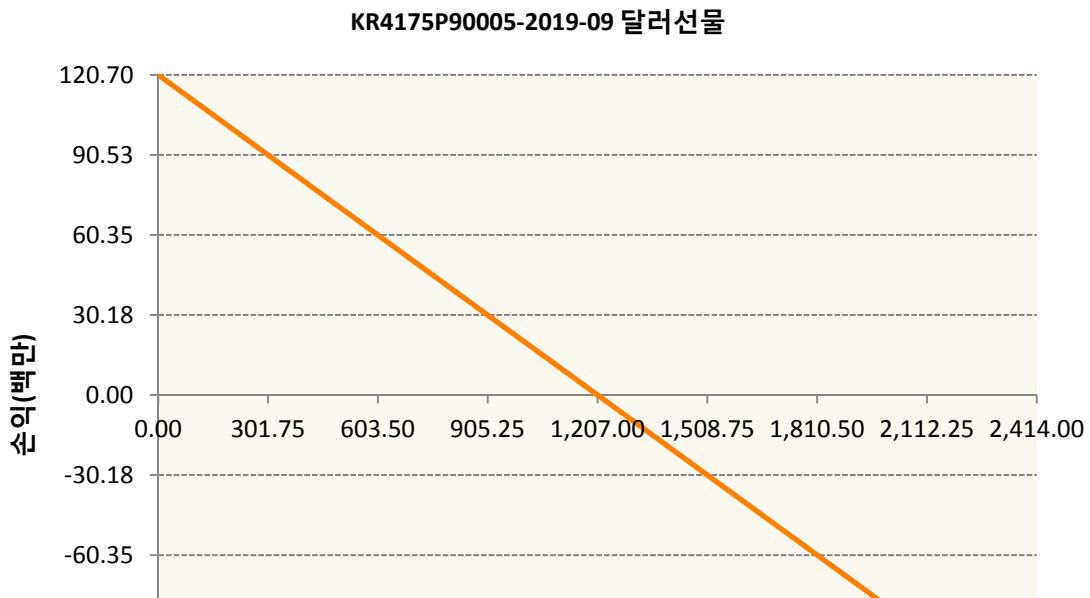
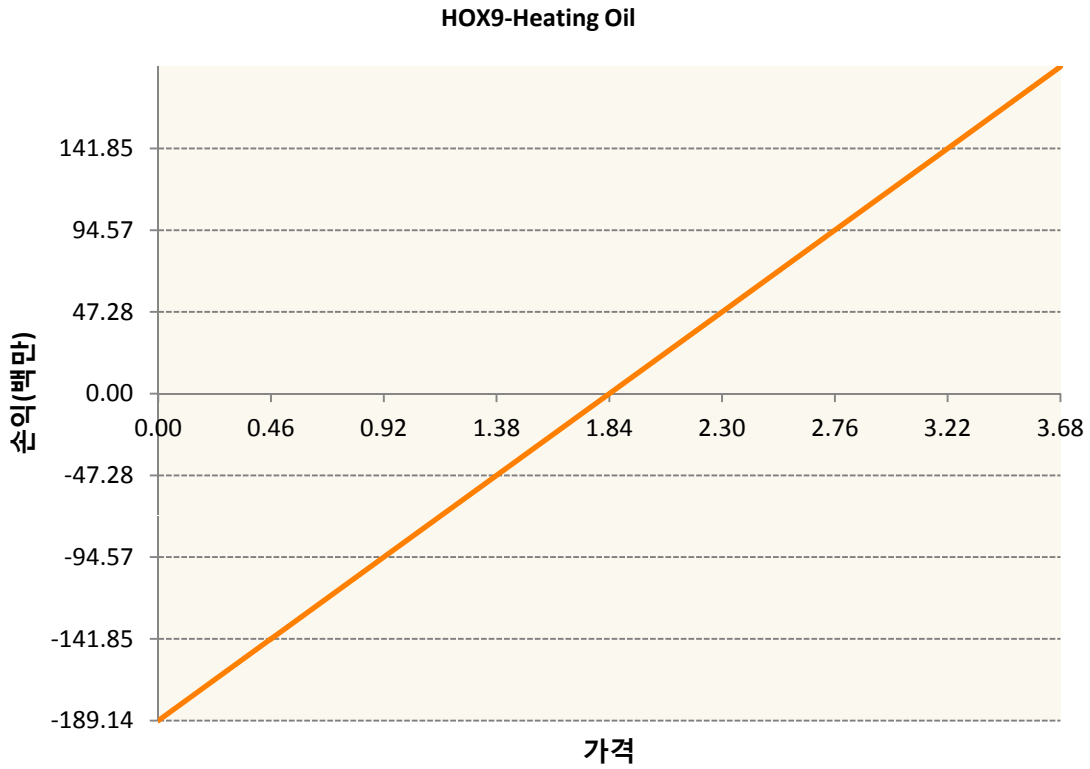
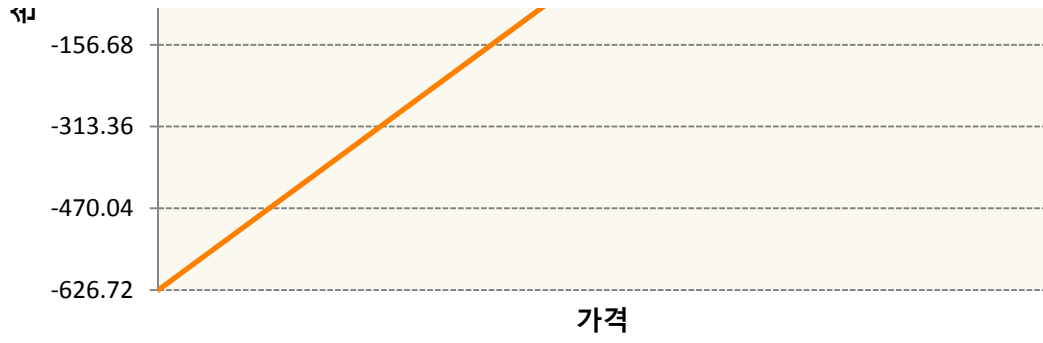
2. 만기시점의 손익구조

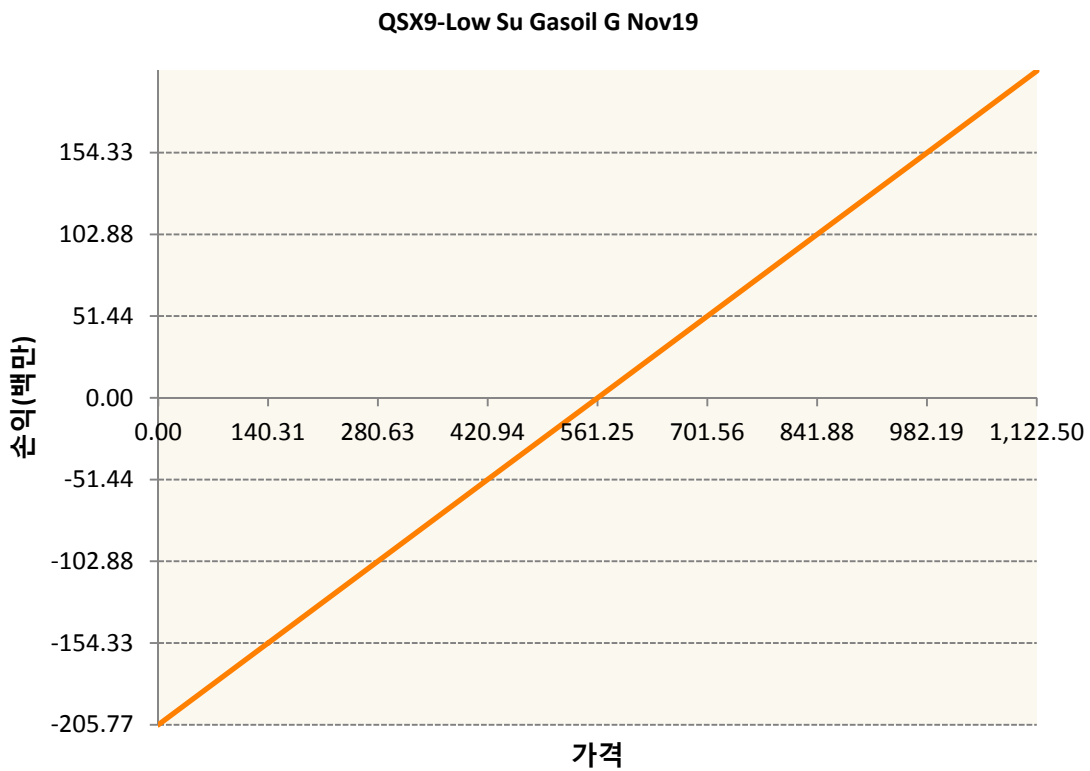
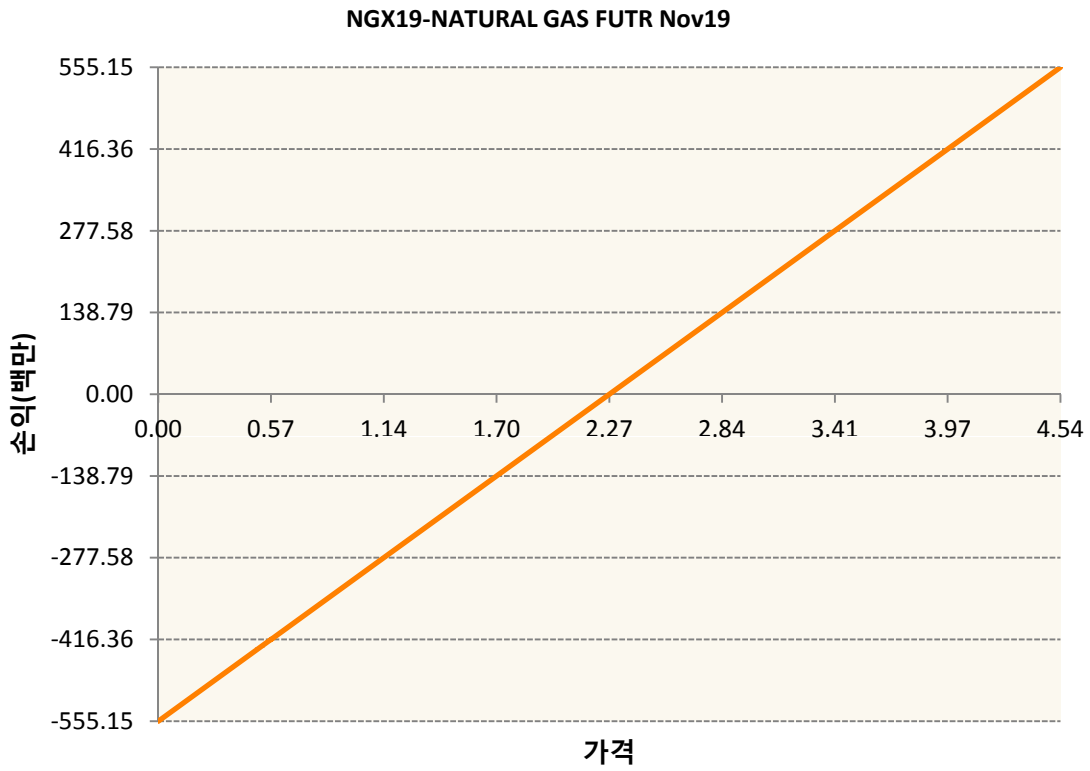
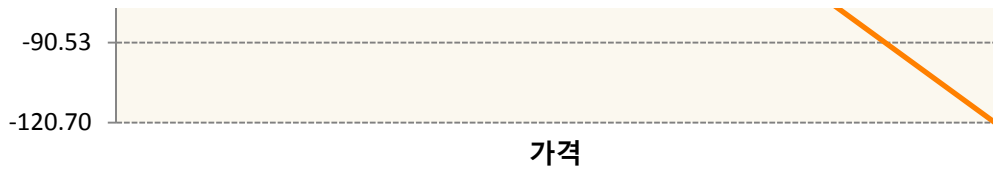
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19



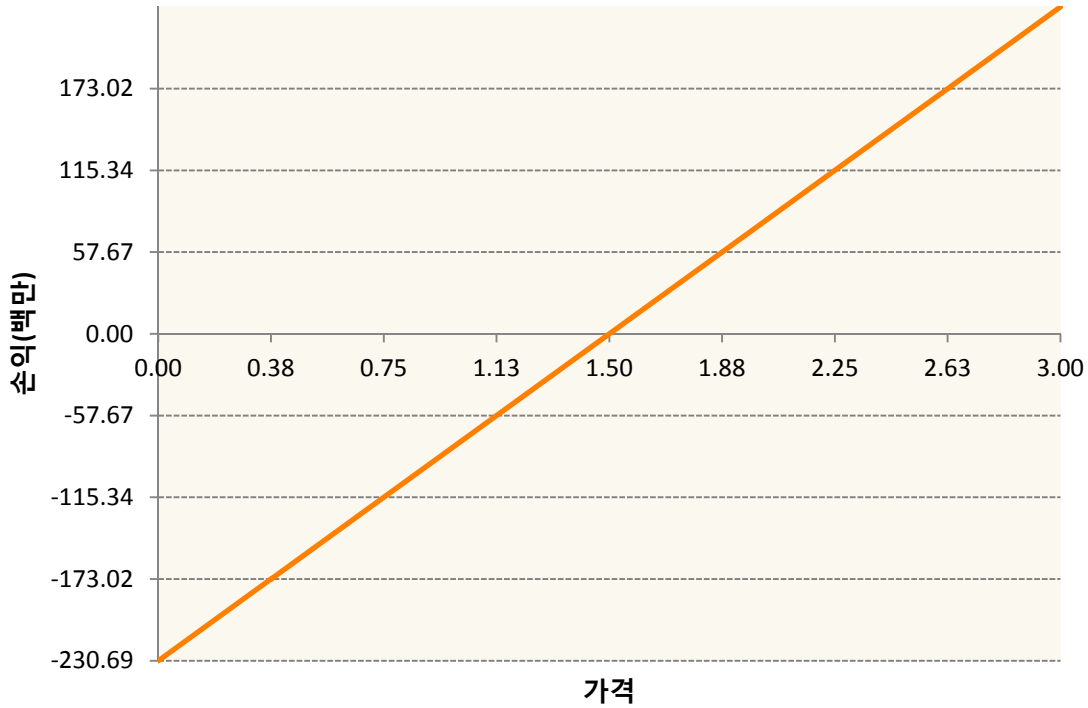
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19







XBX9-GASOLINE RBOB FUT Nov19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX9	WTI CRUDE FUTURE Nov19	49
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	50
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)
	372

공시일	2019-08-21
기준일	2019-08-20

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

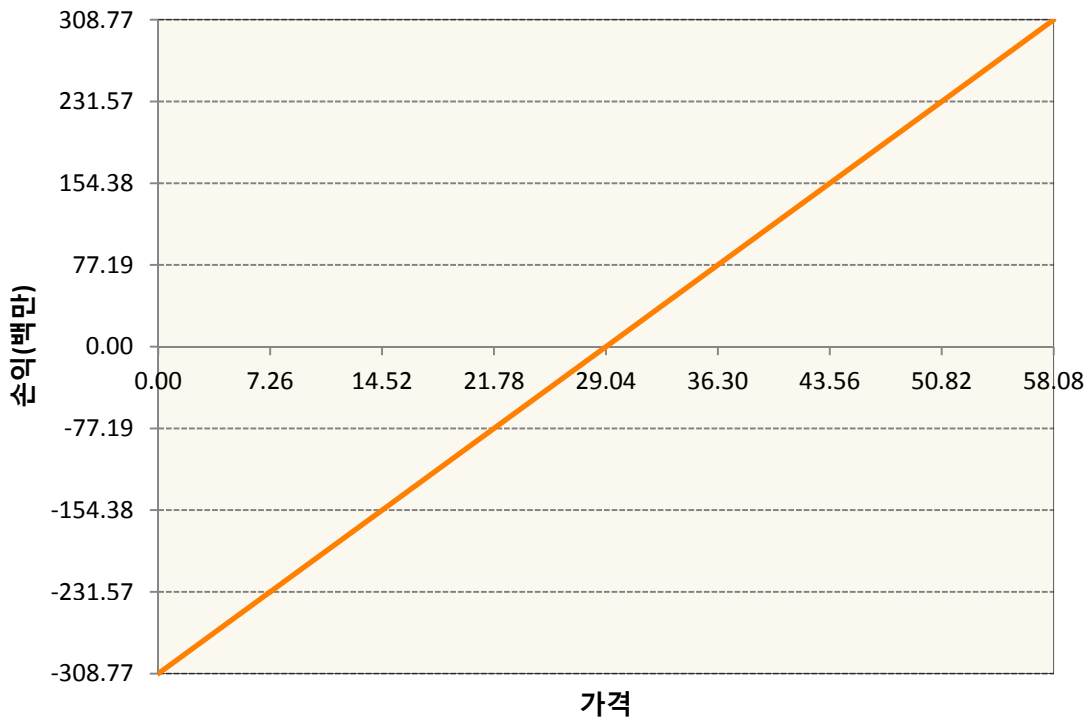
1. 계약금액

(단위:백만원)

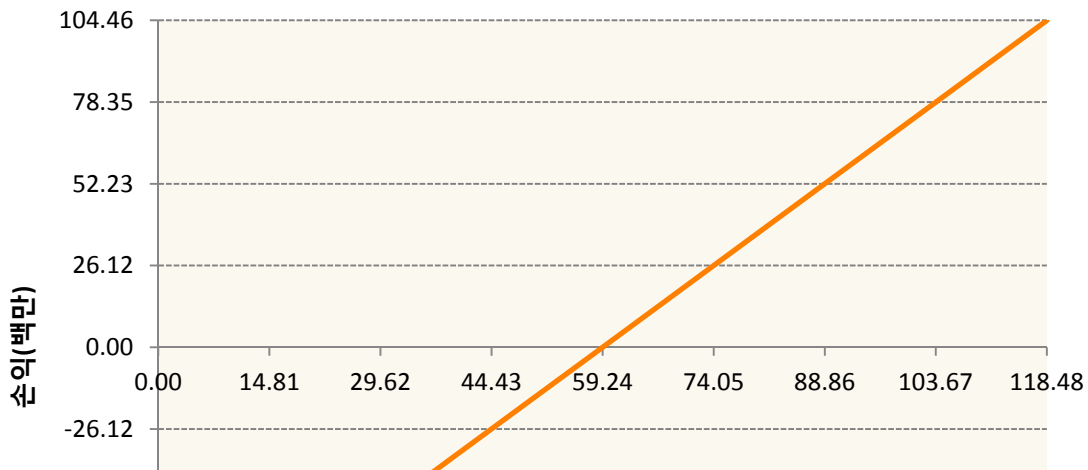
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,740	157	2,583	

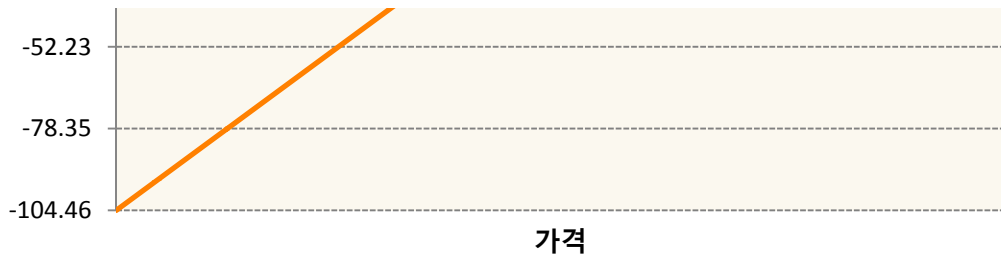
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

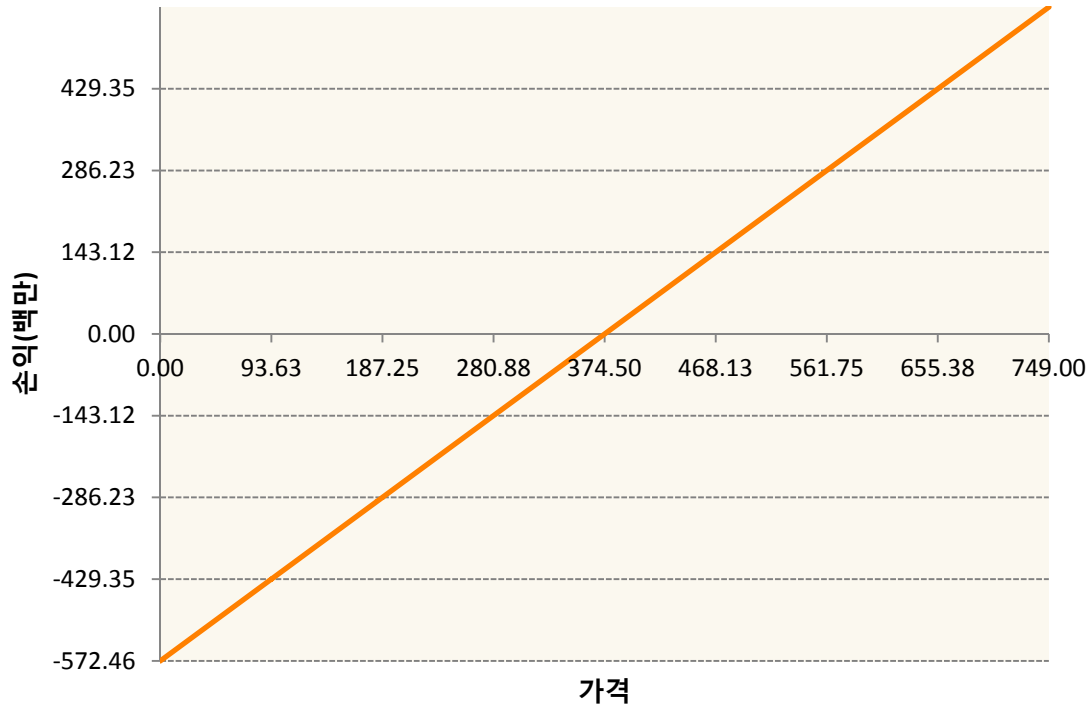


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

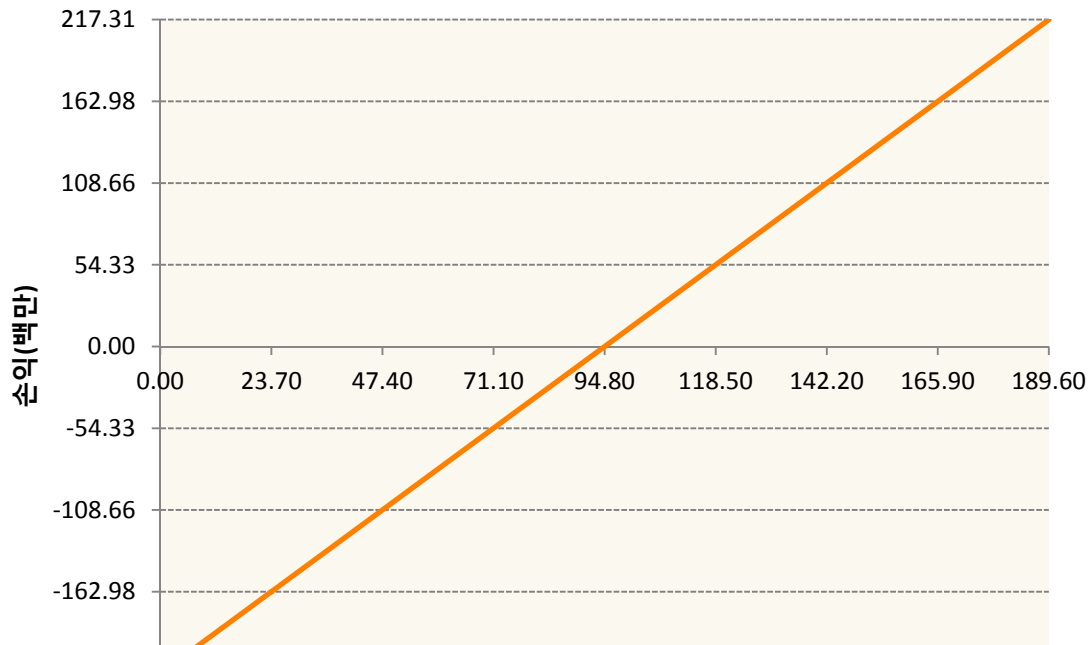


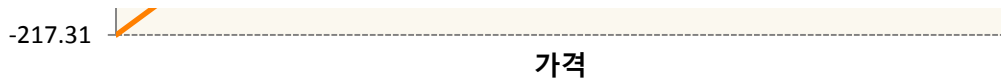


CZ9-CORN FUTURE Dec19

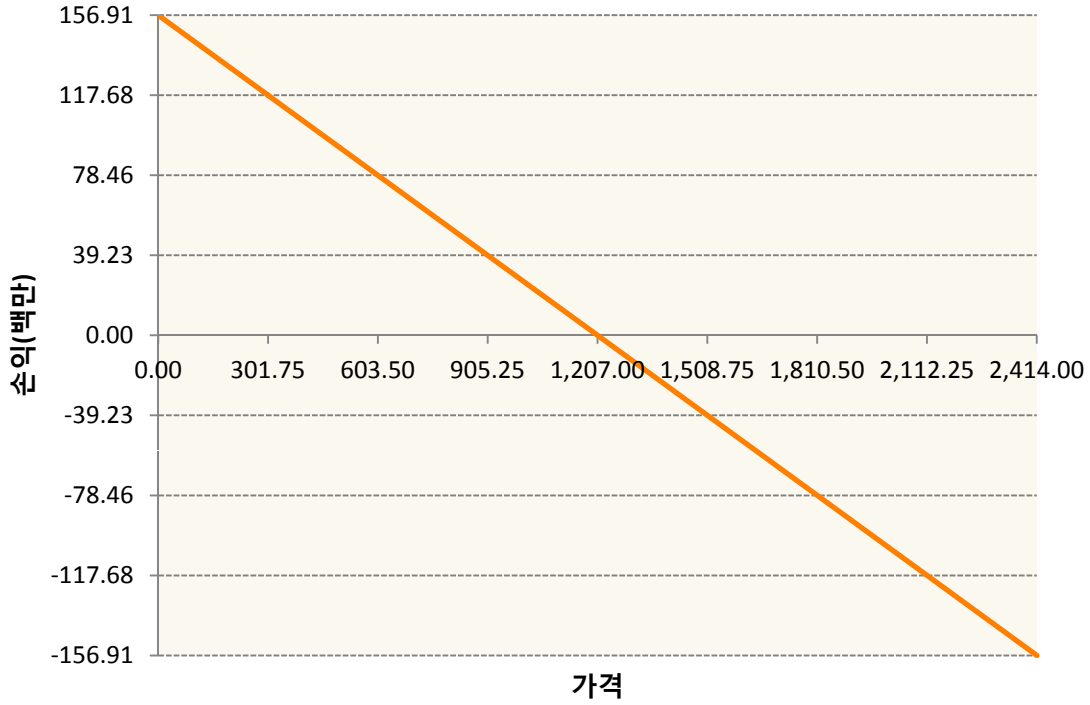


KCZ9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19

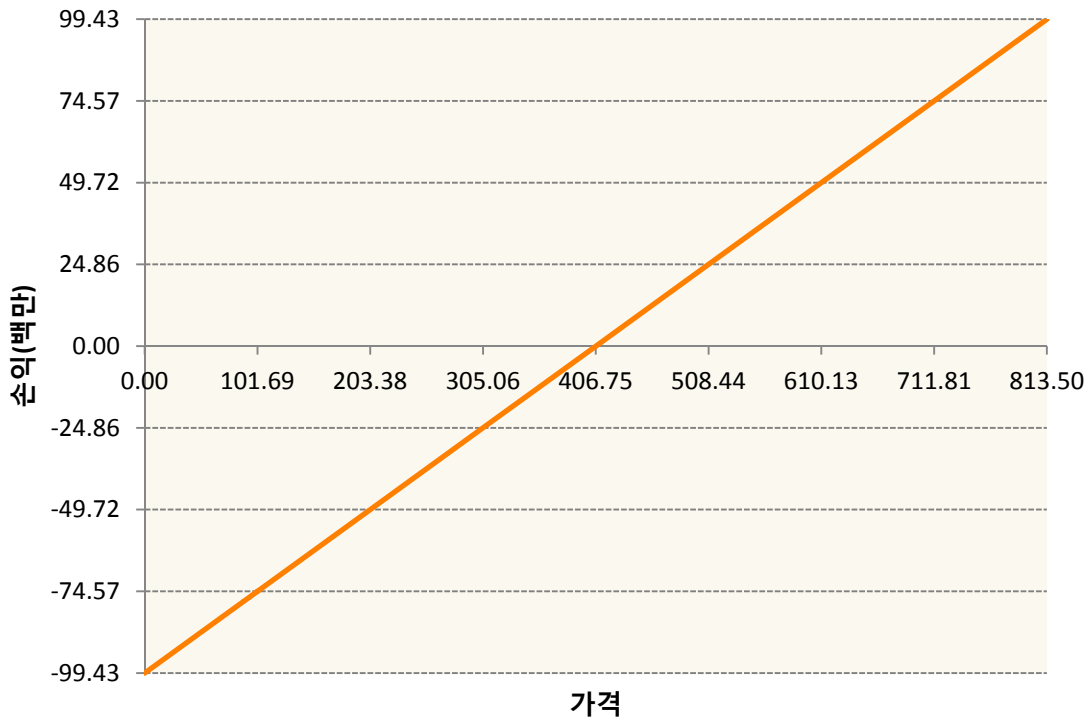




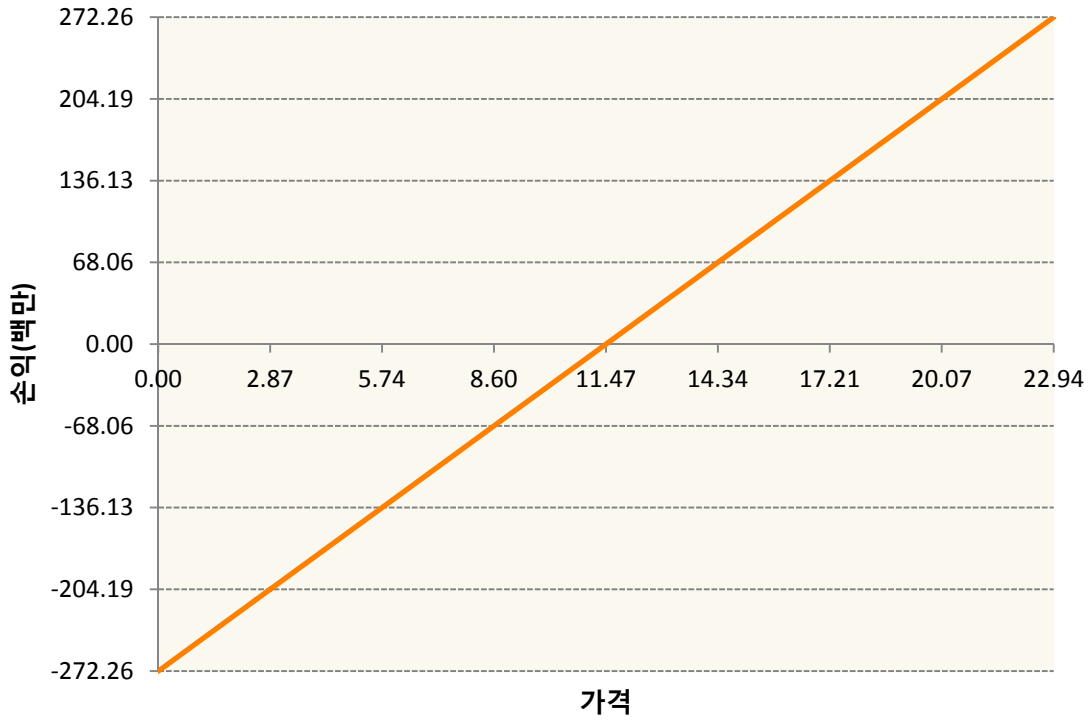
KR4175P90005-2019-09 달러선물



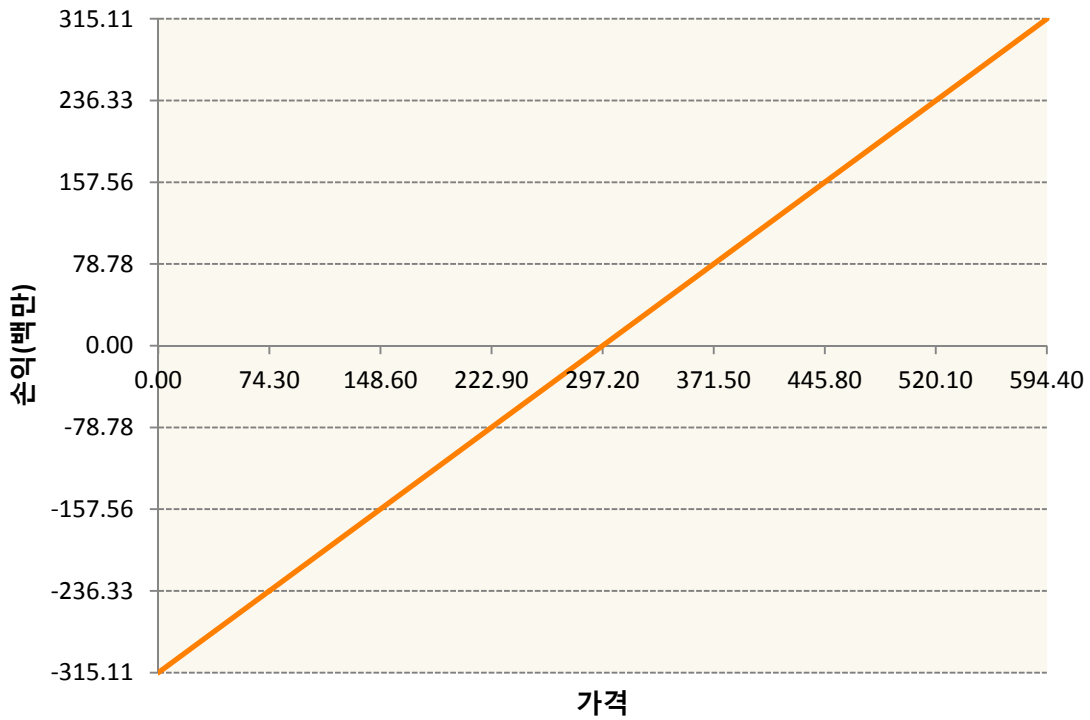
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



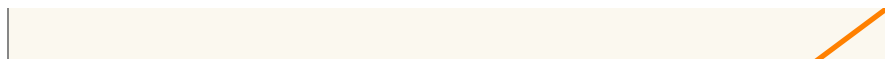
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

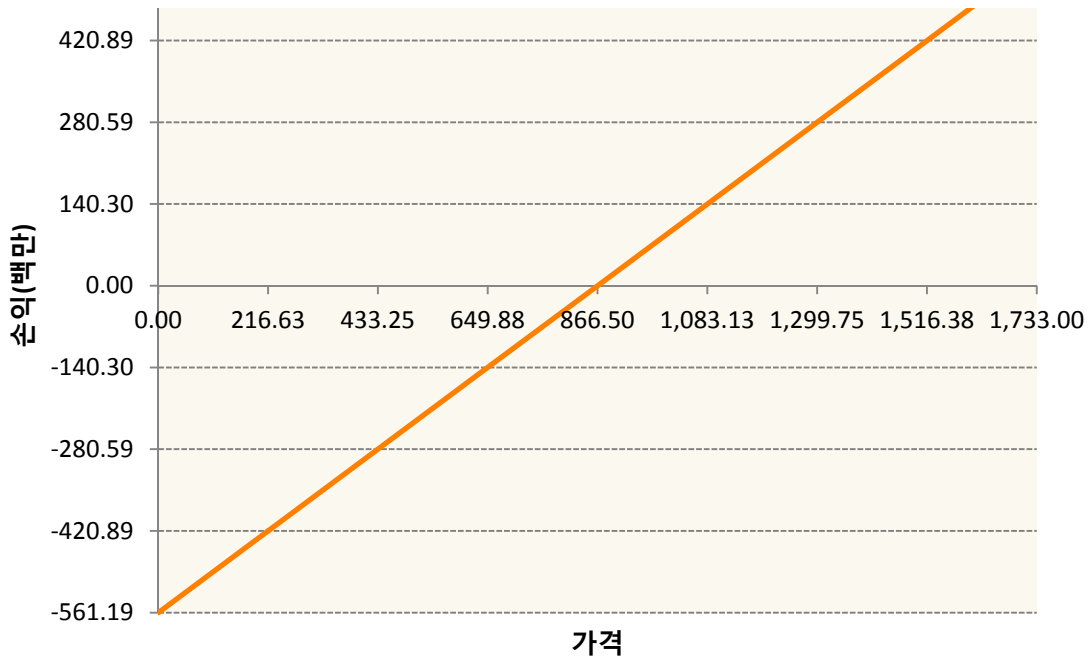


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

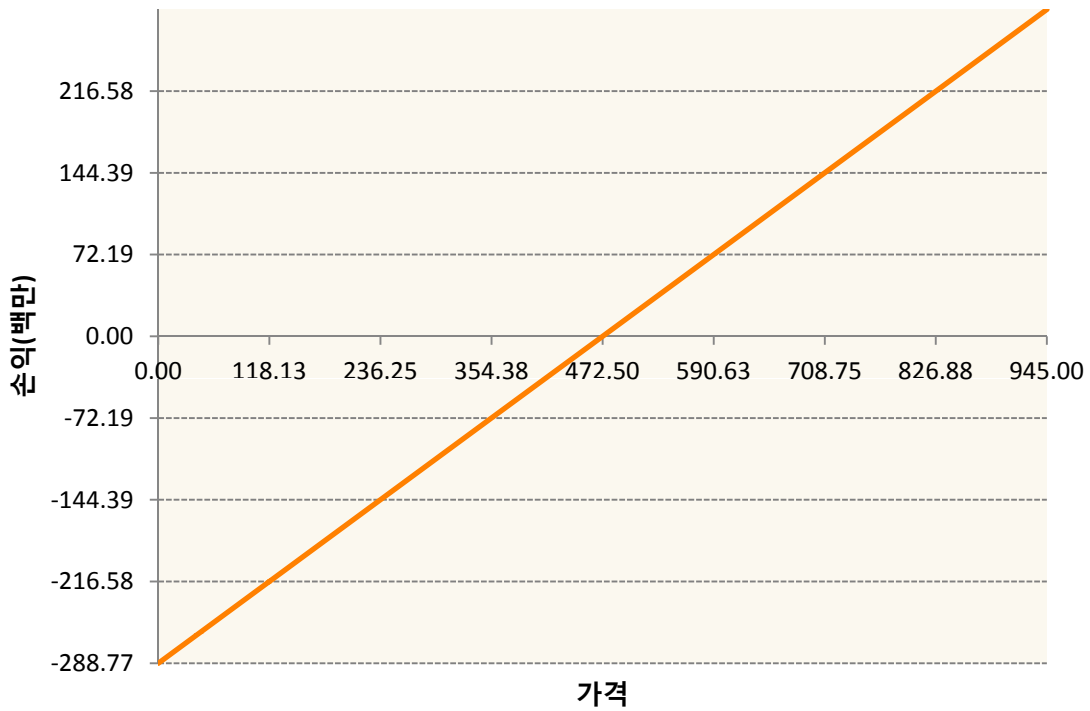


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





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	46
KCZ9	COFFEE 'C' FUTURE Dec19	17
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)

244