

공시일	2019-08-22
기준일	2019-08-21

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	2019-08-22
기준일	2019-08-21

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

1,135

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

650

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-22
기준일	2019-08-21

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)	374
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	136

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

821

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-22
기준일	2019-08-21

유로인덱스모(주식-파생형)

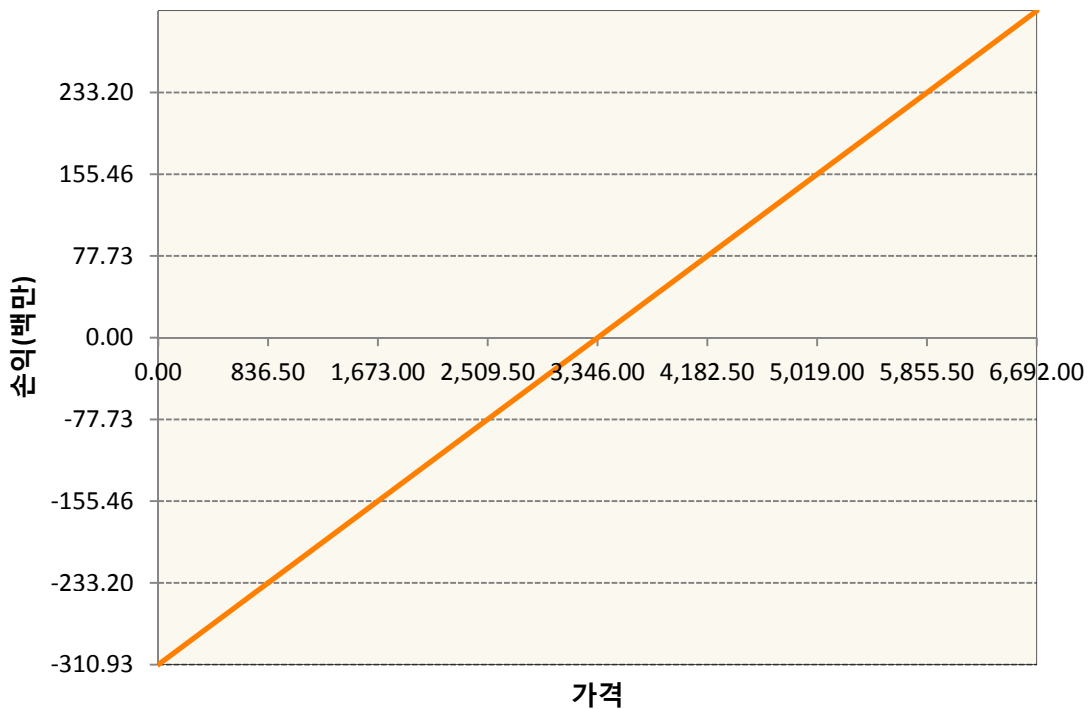
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	311	0	311	

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	2019-08-22
기준일	2019-08-21

차이나인덱스모(주식-파생형)

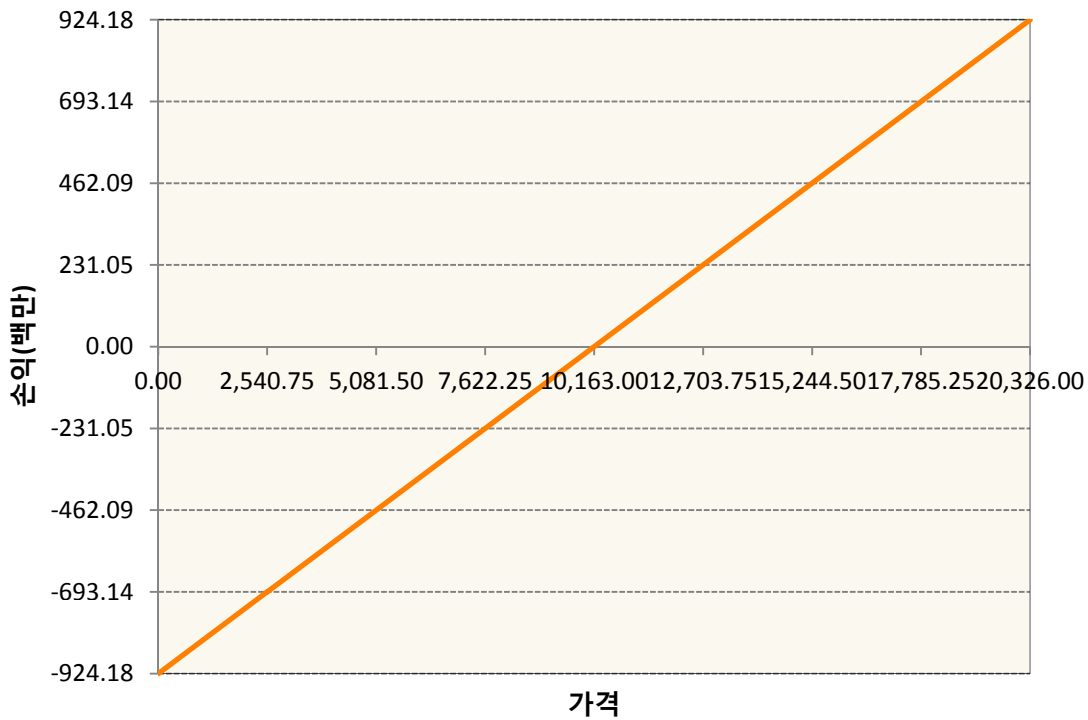
1. 계약금액

(단위:백만원)

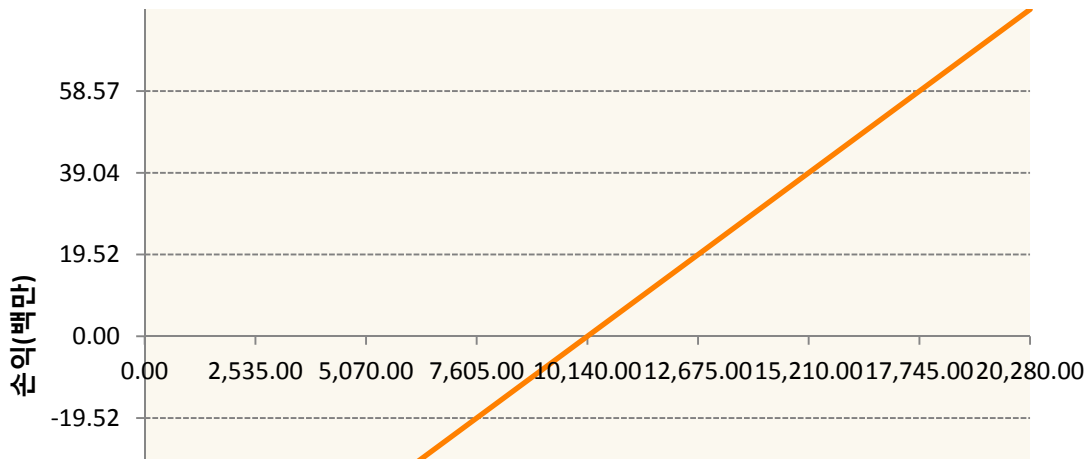
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,002	0	1,002	장내

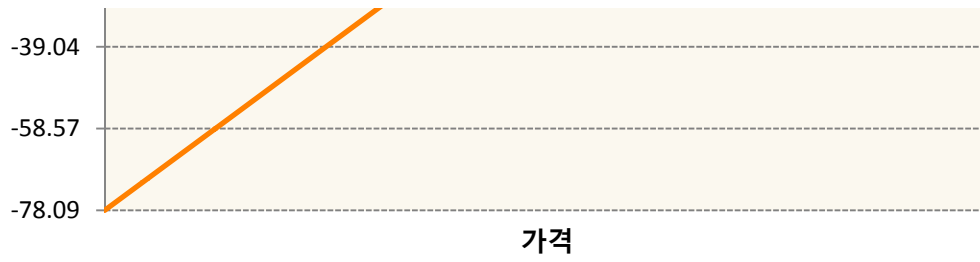
2. 만기시점의 손익구조

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	2019-08-22
기준일	2019-08-21

커버드콜모(주식혼합-파생형)

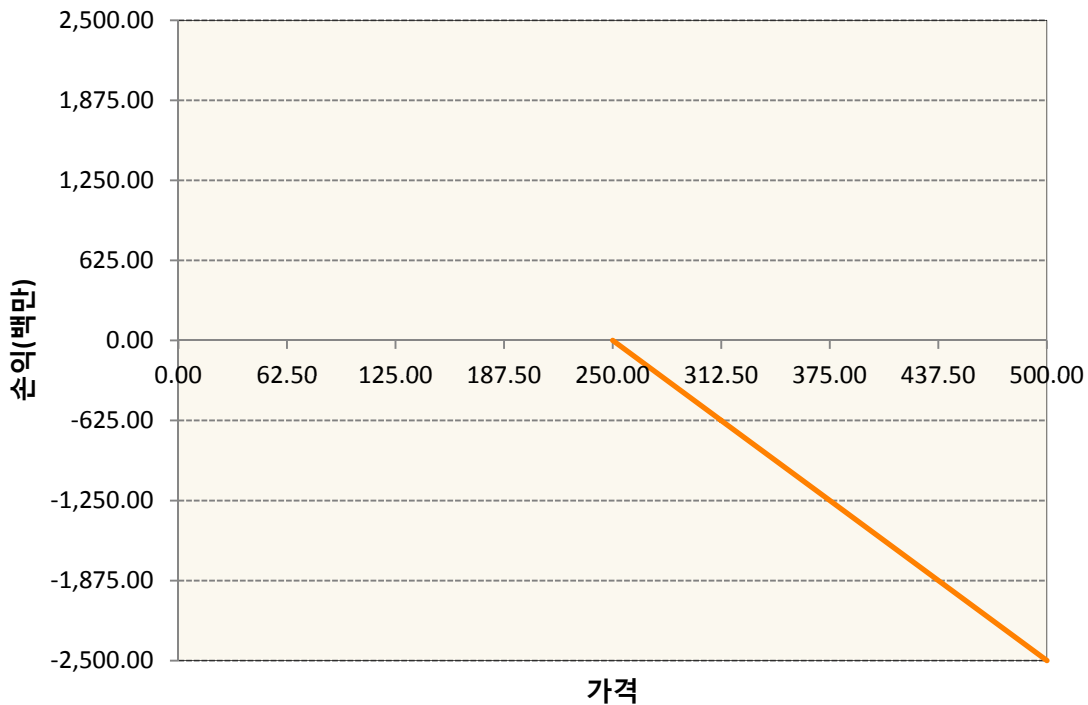
1. 계약금액

(단위:백만원)

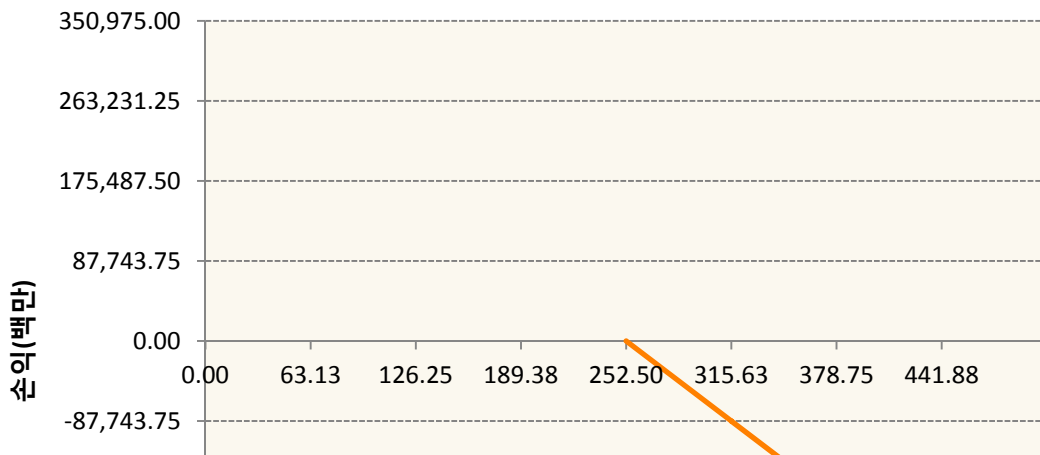
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	3,065	0	3,065	장내
누계	유가증권	옵션	0	520,569	-520,569	장내

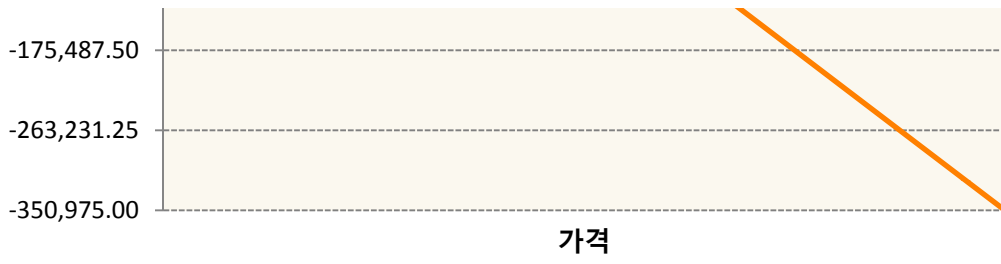
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P92500-2019-09 콜250

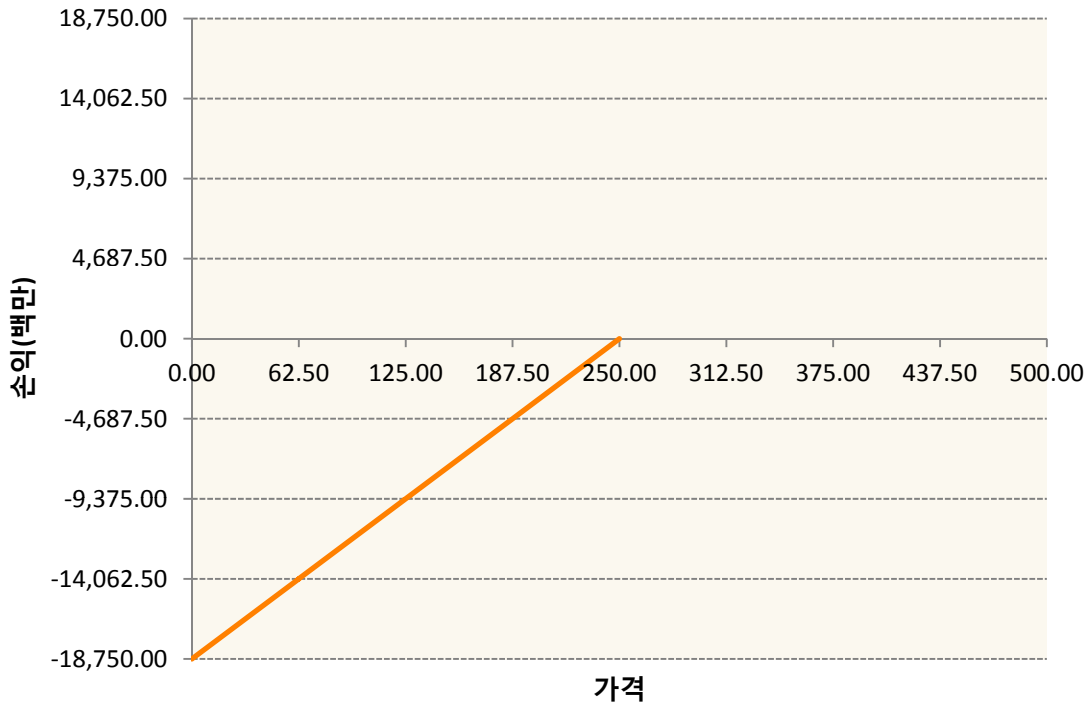


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

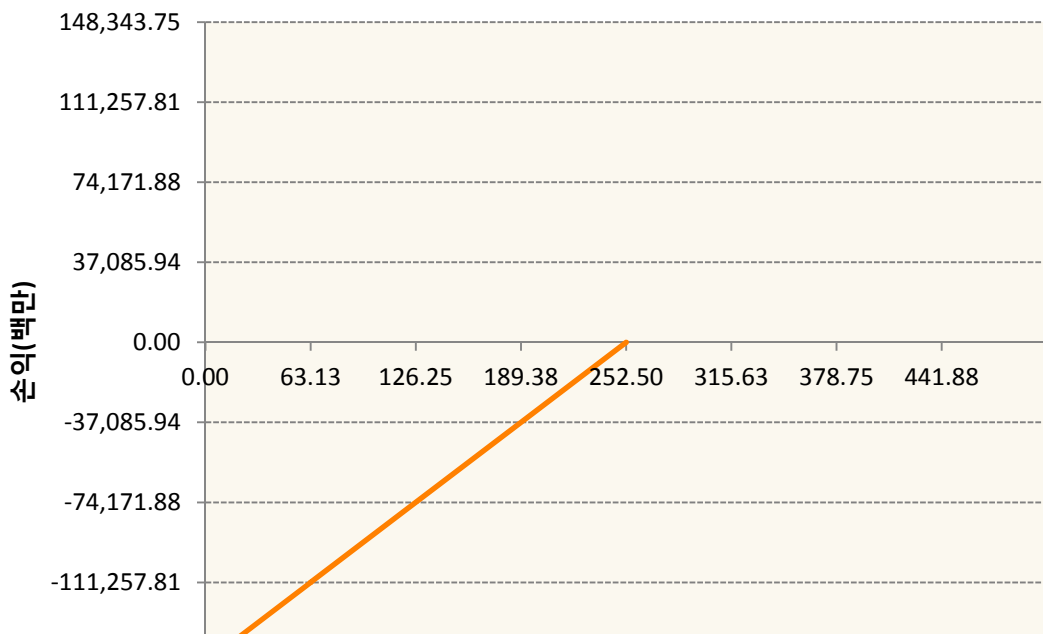




KR4301P92508-2019-09 풋250



KR4301P92524-2019-09 풋252.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P92500 2019-09 콜250								185
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	103	100	97	94	91	87	83	
-5.33%	88	84	79	75	70	66	61	
-2.67%	58	53	49	44	39	34	29	
0%	12	8	4	0	-4	-9	-13	
2.67%	-46	-48	-51	-54	-57	-61	-64	
5.33%	-111	-112	-114	-115	-117	-120	-122	
8.00%	-179	-179	-180	-181	-182	-183	-185	
KR4201P92526 2019-09 콜252.5								24,808
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	12,317	12,032	11,699	11,324	10,915	10,476	10,012	
-5.33%	10,833	10,300	9,743	9,167	8,577	7,974	7,362	
-2.67%	7,507	6,821	6,136	5,449	4,763	4,076	3,389	
0%	1,907	1,283	646	0	-654	-1,314	-1,979	
2.67%	-5,652	-6,066	-6,522	-7,012	-7,531	-8,073	-8,635	
5.33%	-14,422	-14,627	-14,884	-15,189	-15,536	-15,922	-16,340	
8.00%	-23,740	-23,818	-23,934	-24,092	-24,291	-24,531	-24,808	
KR4301P92508 2019-09 풋250								918
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-869	-874	-880	-888	-897	-907	-918	
-5.33%	-405	-422	-439	-458	-476	-496	-515	
-2.67%	-88	-111	-133	-156	-178	-201	-223	
0%	41	29	15	0	-16	-33	-51	
2.67%	69	66	62	56	49	40	31	
5.33%	72	72	71	70	67	65	61	
8.00%	72	72	72	72	71	71	70	
KR4301P92524 2019-09 풋252.5								8,161
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-7,906	-7,924	-7,952	-7,990	-8,037	-8,094	-8,161	
-5.33%	-4,074	-4,167	-4,272	-4,386	-4,509	-4,637	-4,772	
-2.67%	-1,086	-1,263	-1,440	-1,618	-1,796	-1,974	-2,152	
0%	426	291	148	0	-153	-310	-470	
2.67%	845	800	743	672	591	500	399	

5.33%	904	897	885	865	837	801	756
8.00%	908	908	906	903	897	886	871

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

(단위:백만원)

34,369

공시일	2019-08-22
기준일	2019-08-21

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

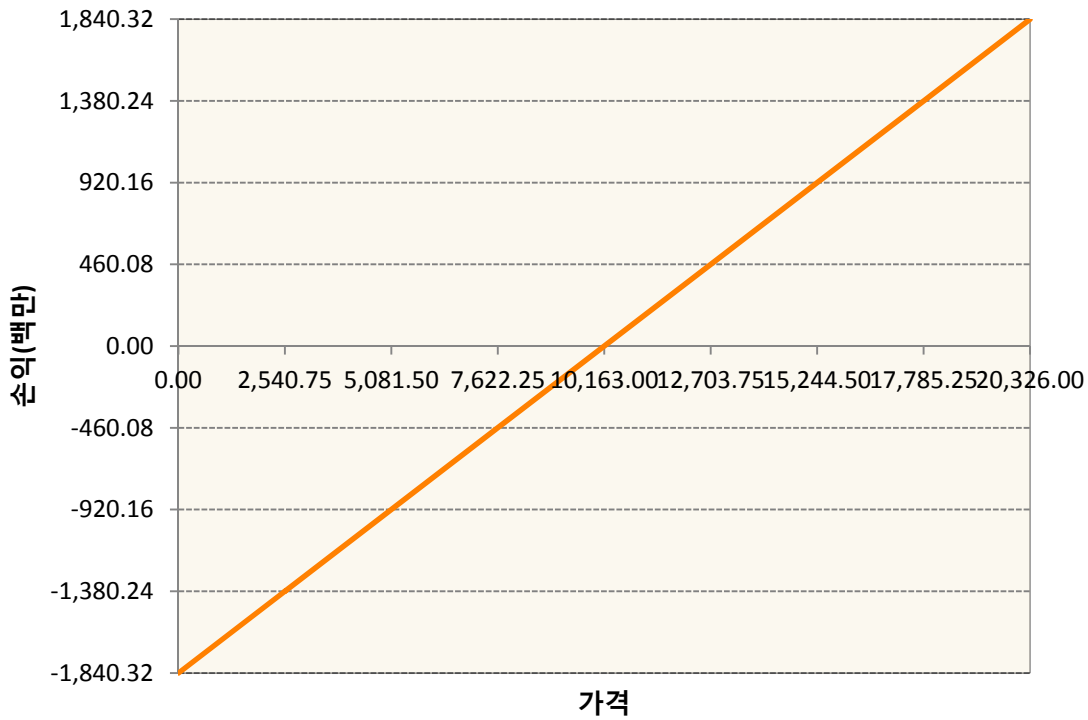
1. 계약금액

(단위:백만원)

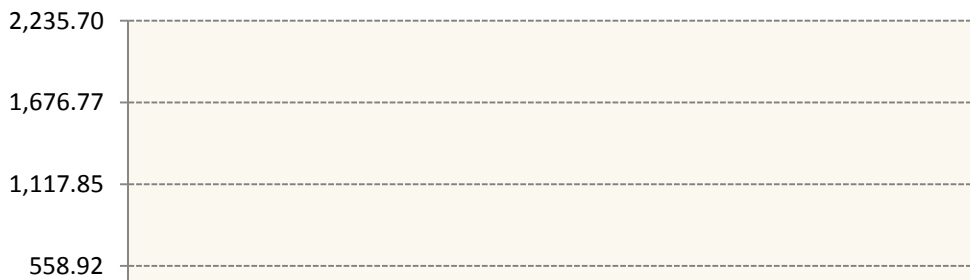
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,840	0	1,840	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,474	-5,474	장내
누계	통화	선도	455	6,069	-5,613	장외

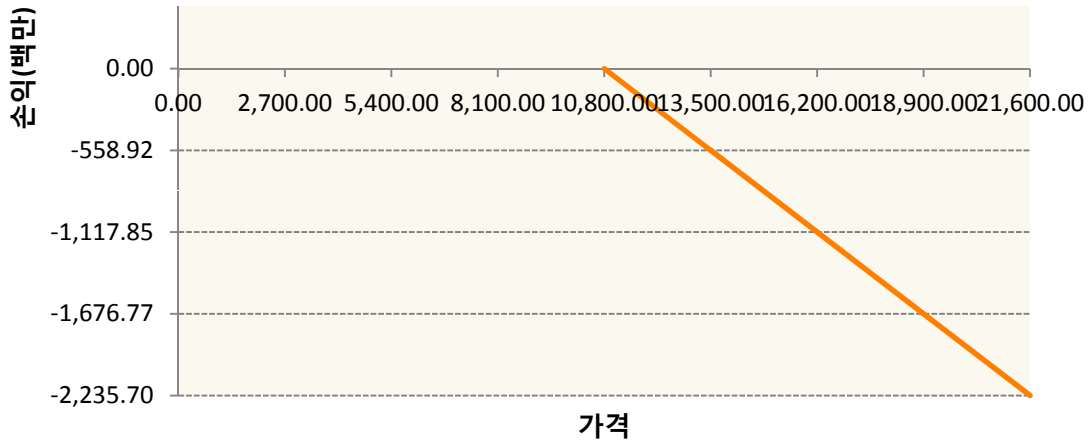
2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19

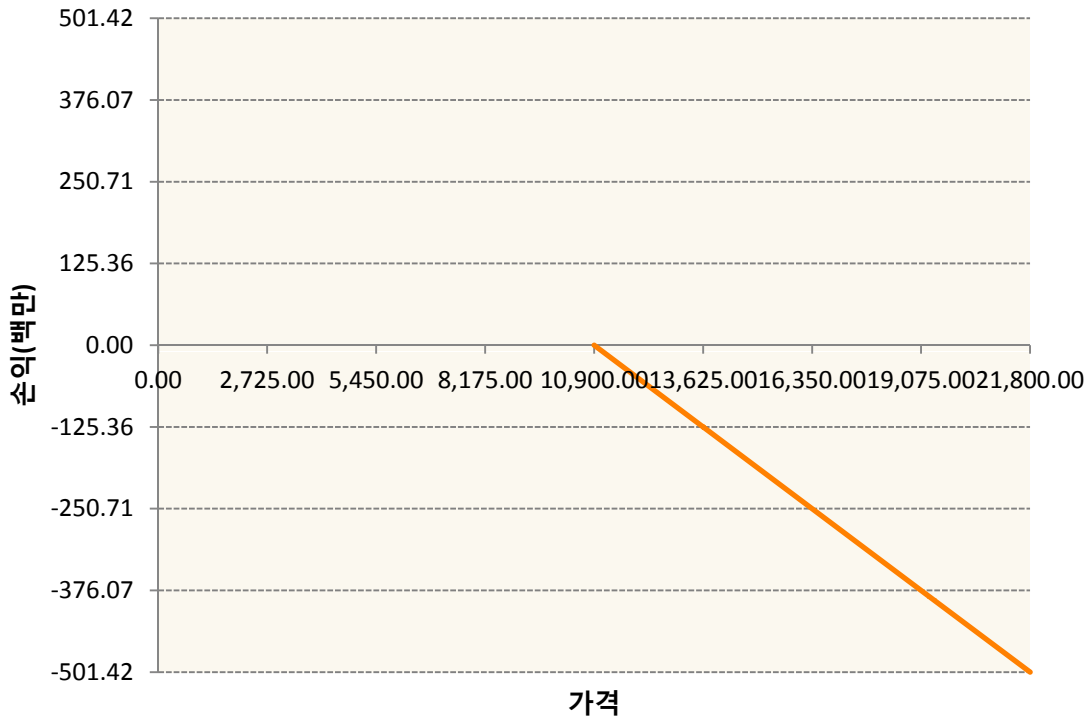


OHHIQ9-C108-HSCEI

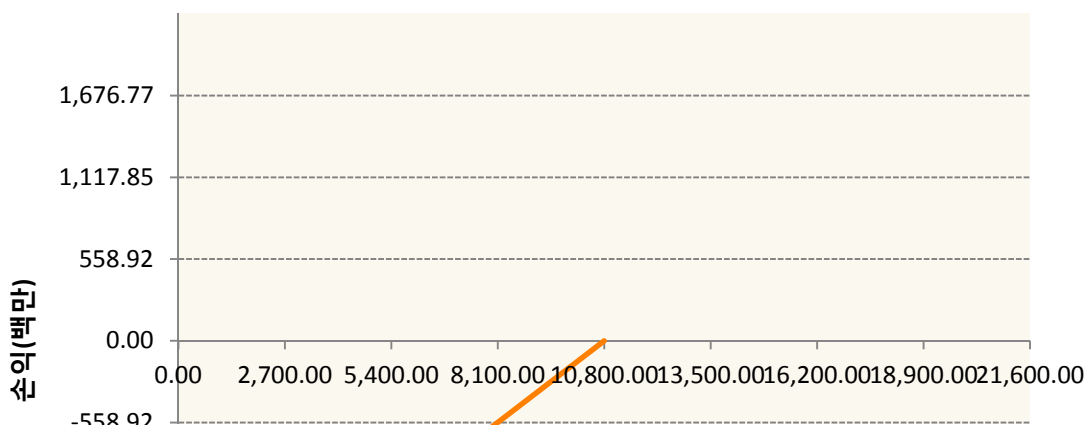


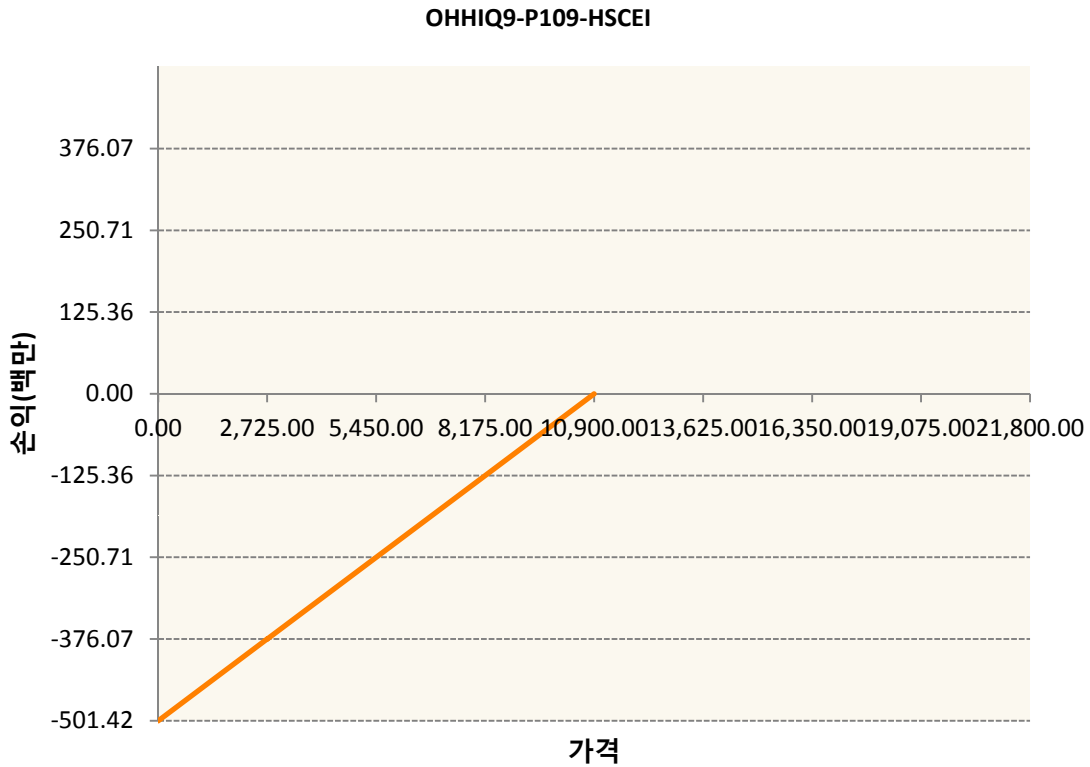


OHHIQ9-C109-HSCEI



OHHIQ9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	258
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E	12
FX21019Q00 HKD/KRW 23-08-19E	24
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	228
HCQ9 HSCEI Futures Aug19	147
OHHIQ9-C1(HSCEI	179
OHHIQ9-C1(HSCEI	40
OHHIQ9-P1(HSCEI	179
OHHIQ9-P1(HSCEI	40

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

공시일	2019-08-22
기준일	2019-08-21

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

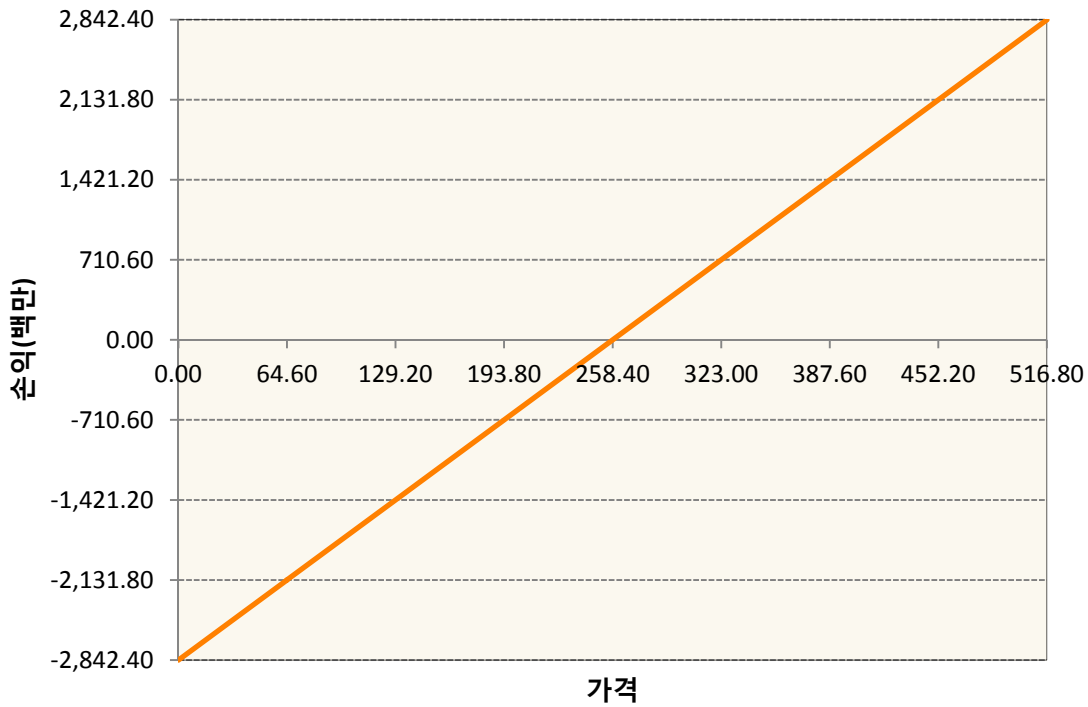
1. 계약금액

(단위:백만원)

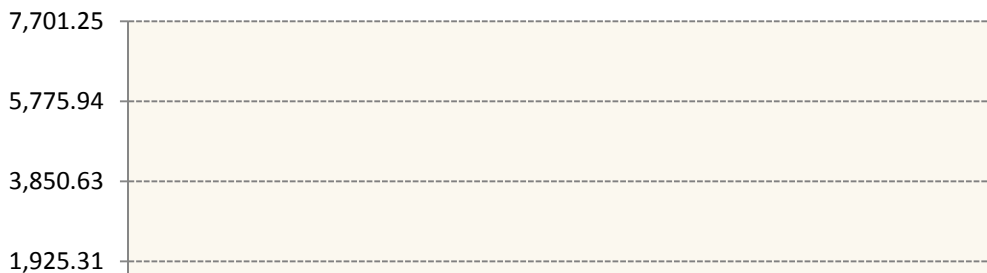
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	125	0	125	장내
누계	유가증권	선물	2,842	0	2,842	장내
누계	유가증권	스왑	14,125	0	14,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,892	-14,892	장내

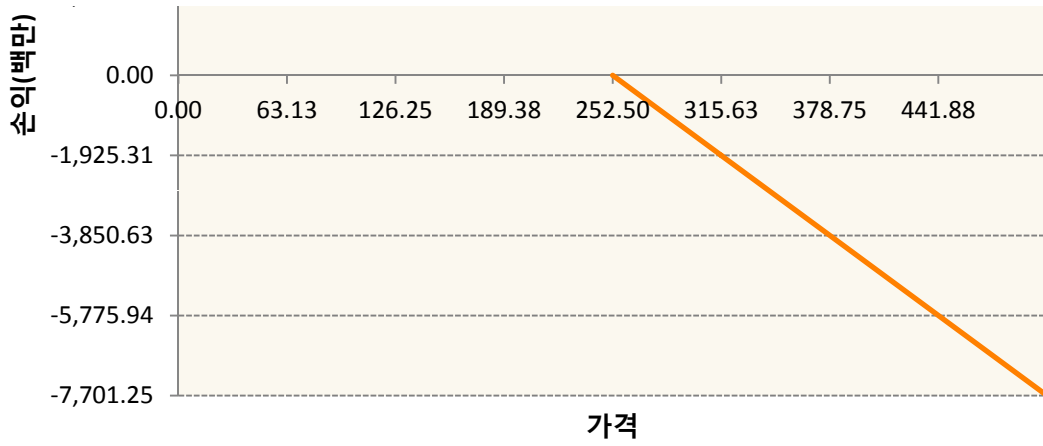
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

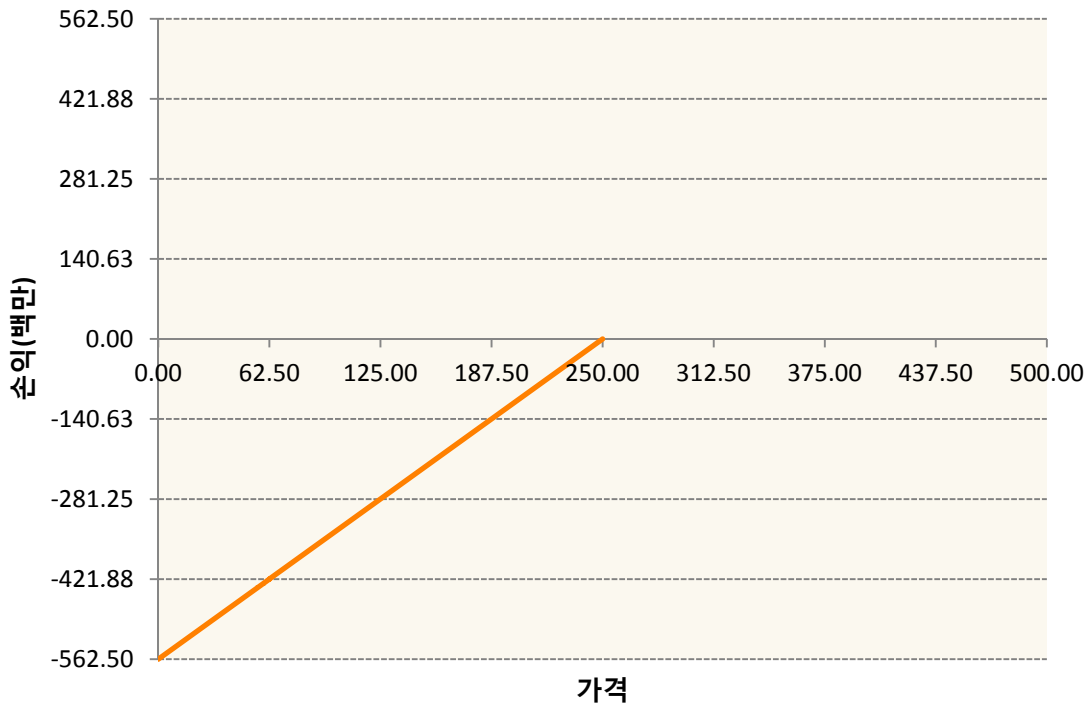


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

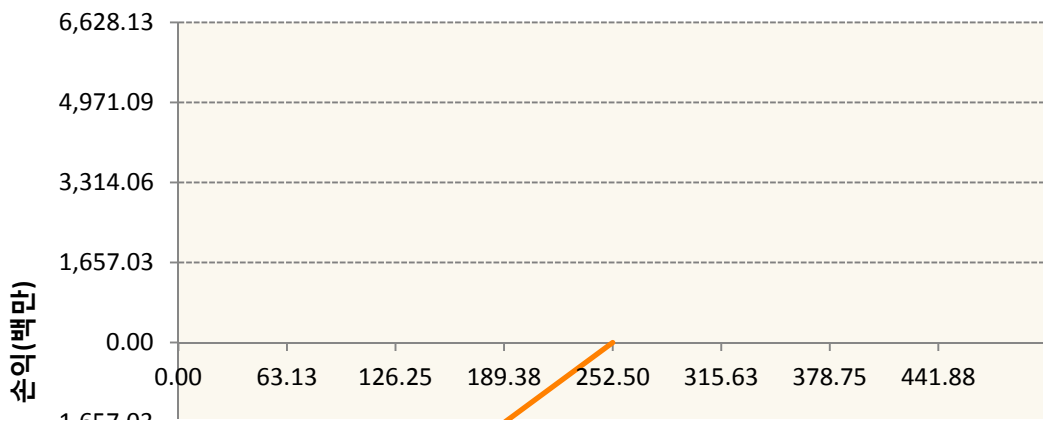




KR4301P92508-2019-09 풋250



KR4301P92524-2019-09 풋252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						1,220
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,220	-1,220	-1,220	-1,220	-1,220	-1,220	-1,220	
-5.33%	-813	-813	-813	-813	-813	-813	-813	
-2.67%	-407	-407	-407	-407	-407	-407	-407	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	407	407	407	407	407	407	407	
5.33%	813	813	813	813	813	813	813	
8.00%	1,220	1,220	1,220	1,220	1,220	1,220	1,220	
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%	-152	-152	-152	-152	-152	-152	-152	
-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%	152	152	152	152	152	152	152	
8.00%	227	227	227	227	227	227	227	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5						544
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	270	264	257	248	240	230	220	
-5.33%	238	226	214	201	188	175	162	
-2.67%	165	150	135	120	105	89	74	
0%	42	28	14	0	-14	-29	-43	
2.67%	-124	-133	-143	-154	-165	-177	-189	
5.33%	-316	-321	-327	-333	-341	-349	-359	
8.00%	-521	-523	-525	-529	-533	-538	-544	
KR4301P92508		2019-09 풋250						28
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-26	-26	-26	-27	-27	-27	-28
-5.33%	-12	-13	-13	-14	-14	-15	-15
-2.67%	-3	-3	-4	-5	-5	-6	-7
0%	1	1	0	0	0	-1	-2
2.67%	2	2	2	2	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							365
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-353	-354	-355	-357	-359	-362	-365
-5.33%	-182	-186	-191	-196	-201	-207	-213
-2.67%	-49	-56	-64	-72	-80	-88	-96
0%	19	13	7	0	-7	-14	-21
2.67%	38	36	33	30	26	22	18
5.33%	40	40	40	39	37	36	34
8.00%	41	41	40	40	40	40	39

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

(단위:백만원)

2,345

공시일	2019-08-22
기준일	2019-08-21

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

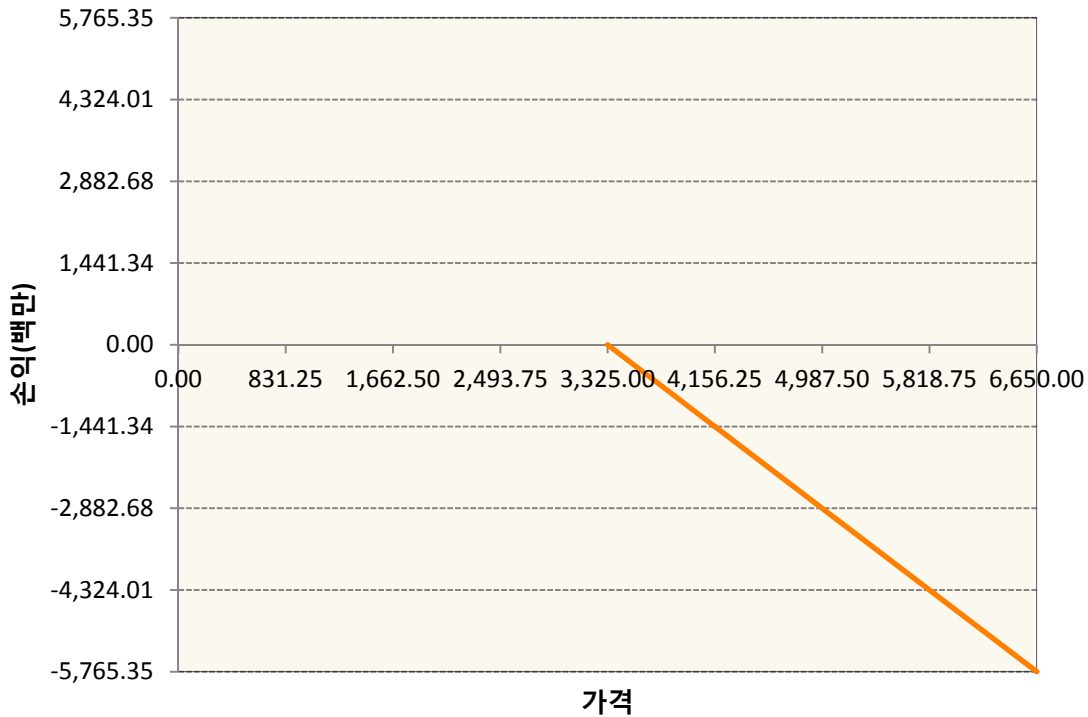
1. 계약금액

(단위:백만원)

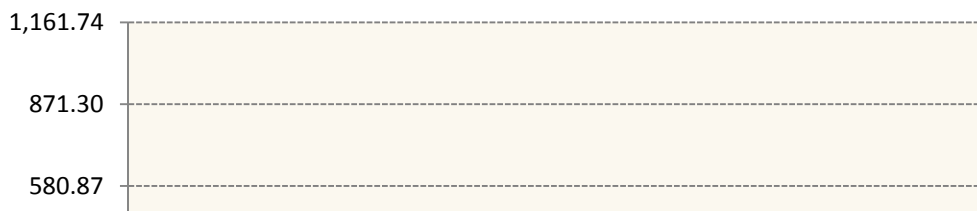
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,205	0	4,205	
누계	유가증권	옵션	0	13,854	-13,854	장내
누계	지수	스왑	28,199	0	28,199	장외
누계	통화	선도	14,405	22,675	-8,270	장외

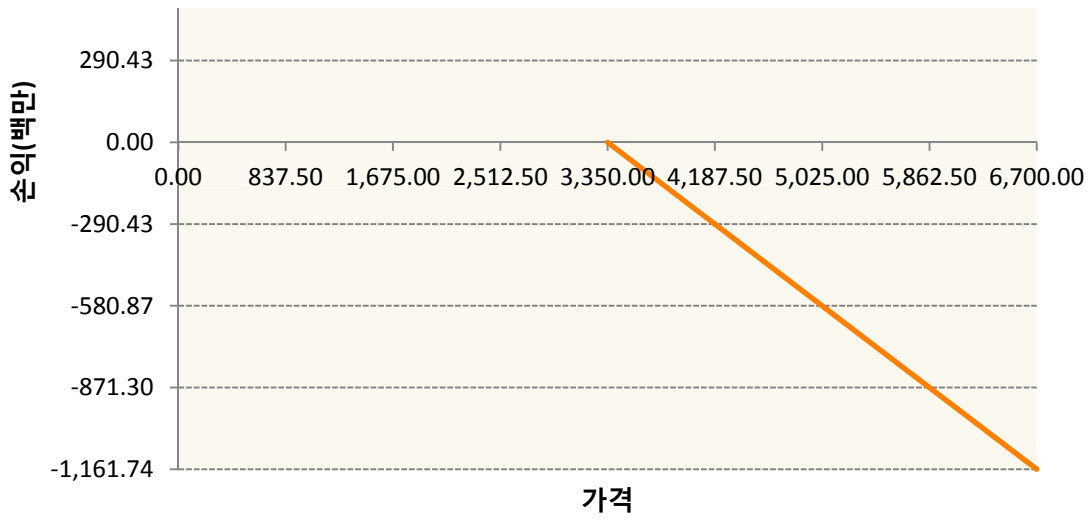
2. 만기시점의 손익구조

OESXU9-C3325-EURO STOXX 50

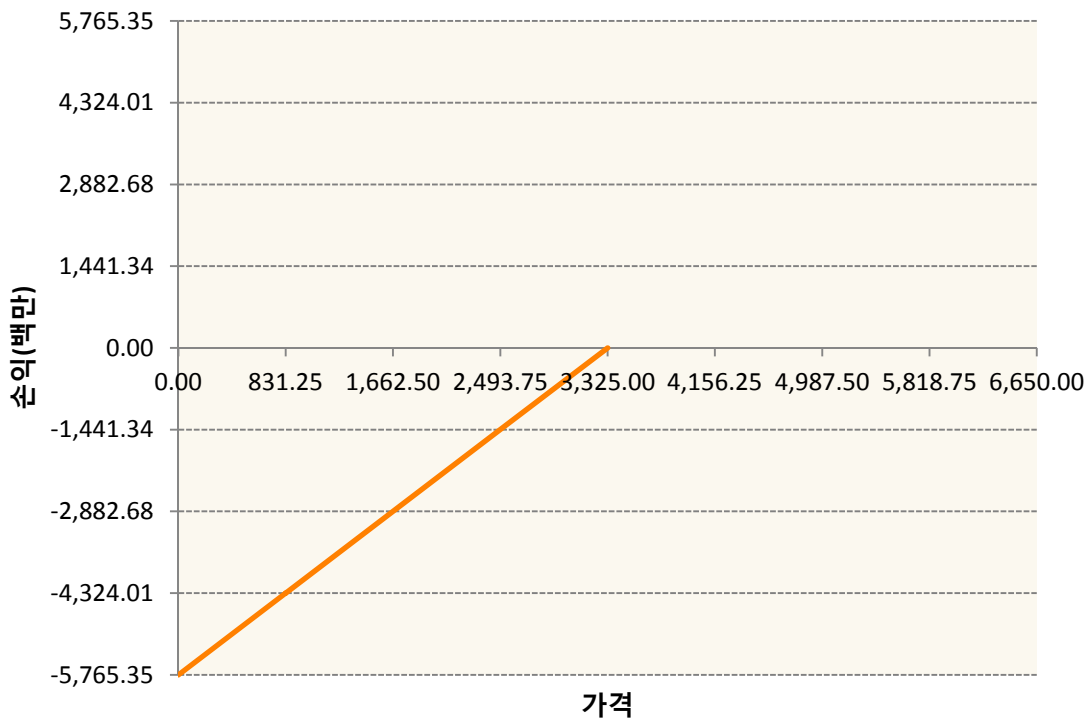


OESXU9-C3350-EURO STOXX 50

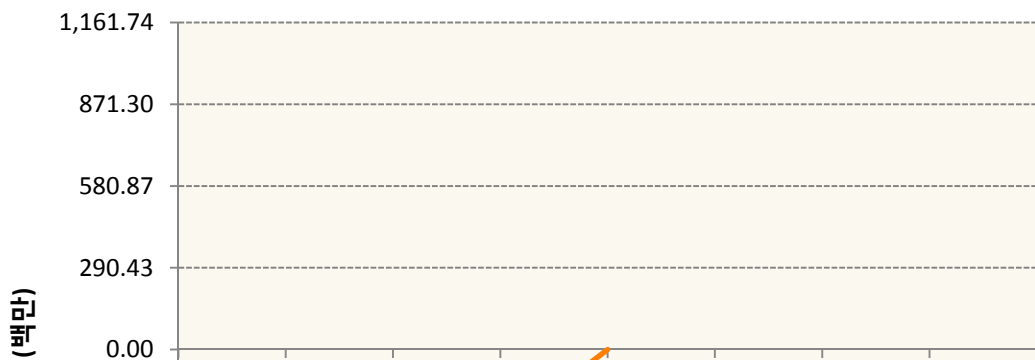


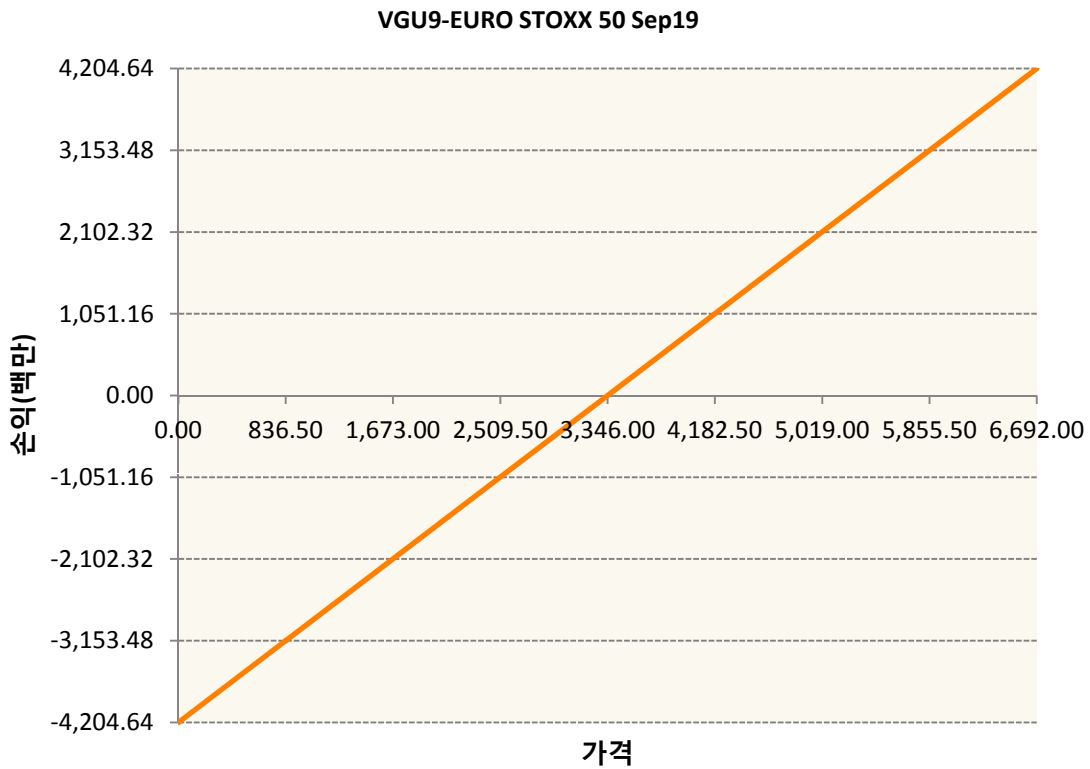
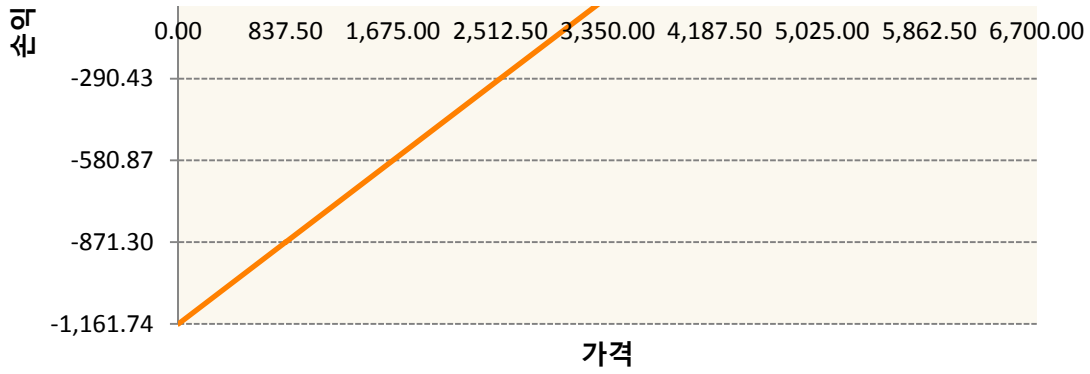


OESXU9-P3325-EURO STOXX 50



OESXU9-P3350-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	57
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	427
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E	1,067
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	320
FX21019N01 EUR/KRW 23-08-19E	427
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E	320
FX21019N04 EUR/KRW 27-09-19E	235
FX21019Q00 EUR/KRW 27-09-19E	171
OESXU9-C33 EURO STOXX 50	461
OESXU9-C33 EURO STOXX 50	93
OESXU9-P33 EURO STOXX 50	461

OESXU9-P33 EURO STOXX 50
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19

93
336

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

(단위:백만원)

2,468

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

(단위:백만원)

935

공시일	2019-08-22
기준일	2019-08-21

ETF스마트레버리지목표전환형9호

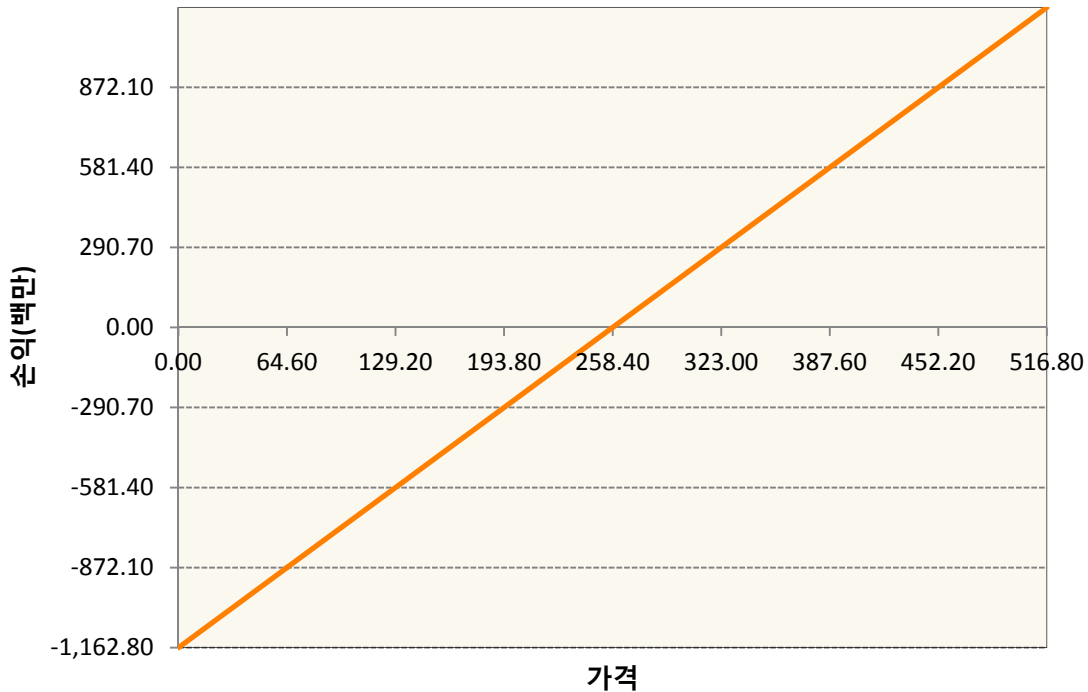
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,163	0	1,163	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	2019-08-22
기준일	2019-08-21

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

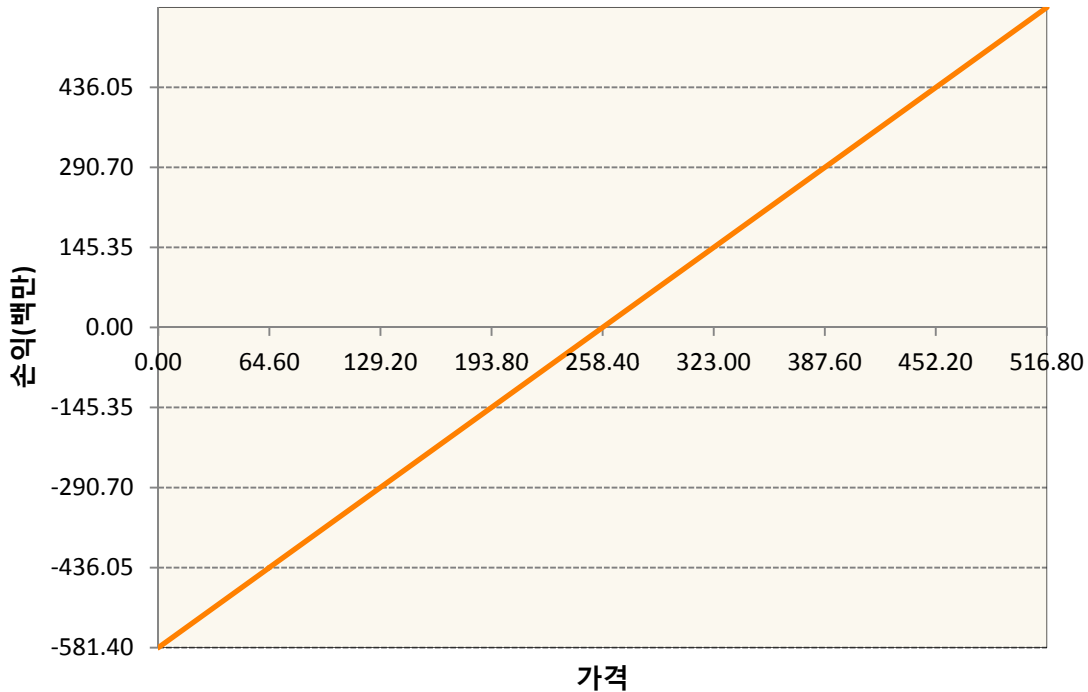
1. 계약금액

(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						47
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47	
-5.33%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31	
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	16	16	16	16	16	16	16	
5.33%	31	31	31	31	31	31	31	
8.00%	47	47	47	47	47	47	47	

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

(단위:백만원)

40

공시일	2019-08-22
기준일	2019-08-21

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

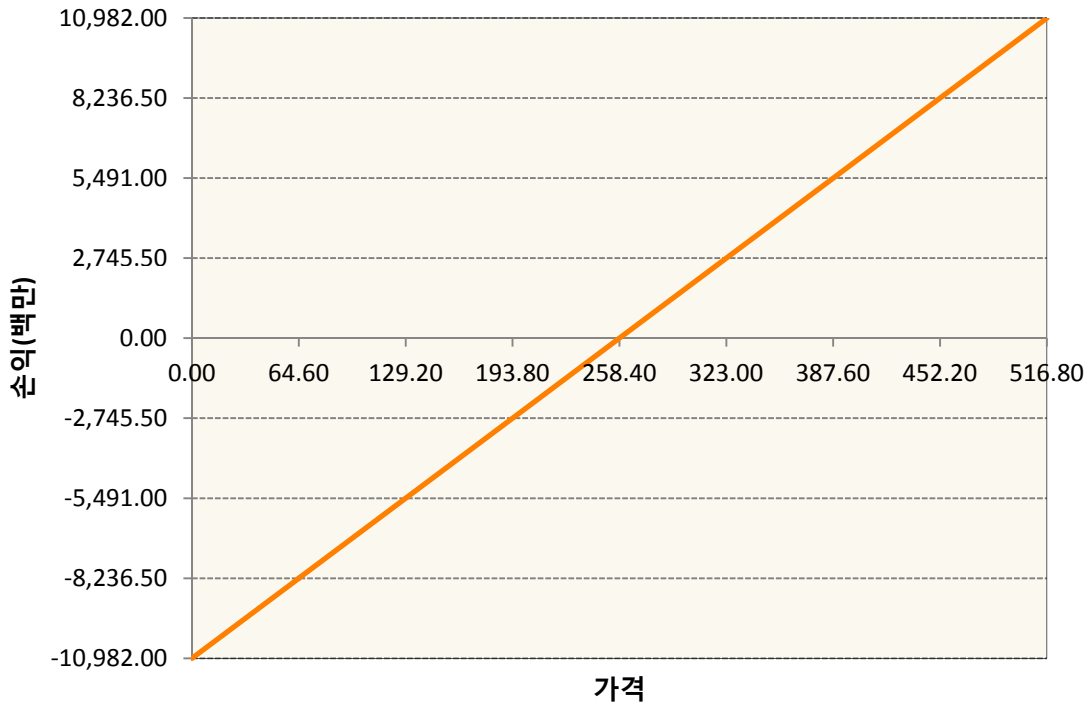
1. 계약금액

(단위:백만원)

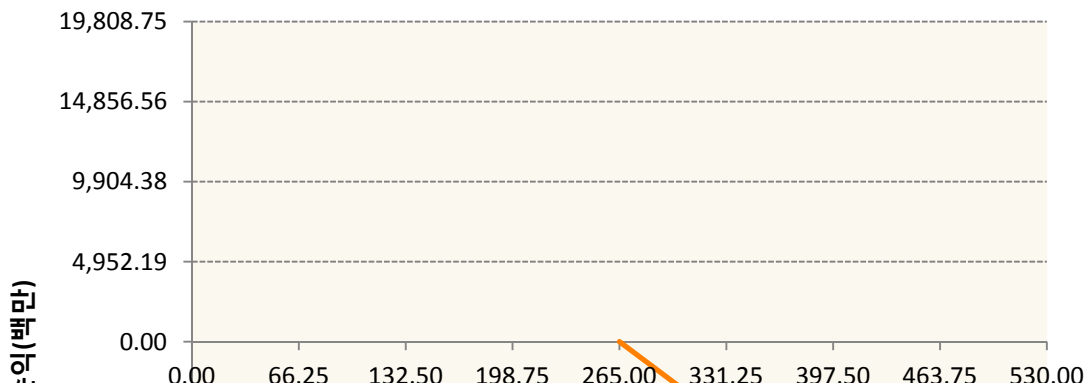
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	129	-129	장내
신규	유가증권	옵션	132	0	132	장내
누계	유가증권	선물	10,982	0	10,982	장내
누계	유가증권	옵션	3,659	19,943	-16,283	장내

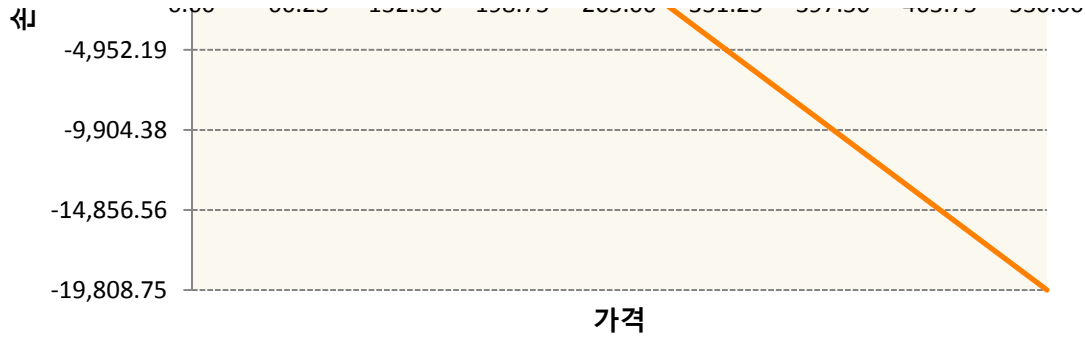
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

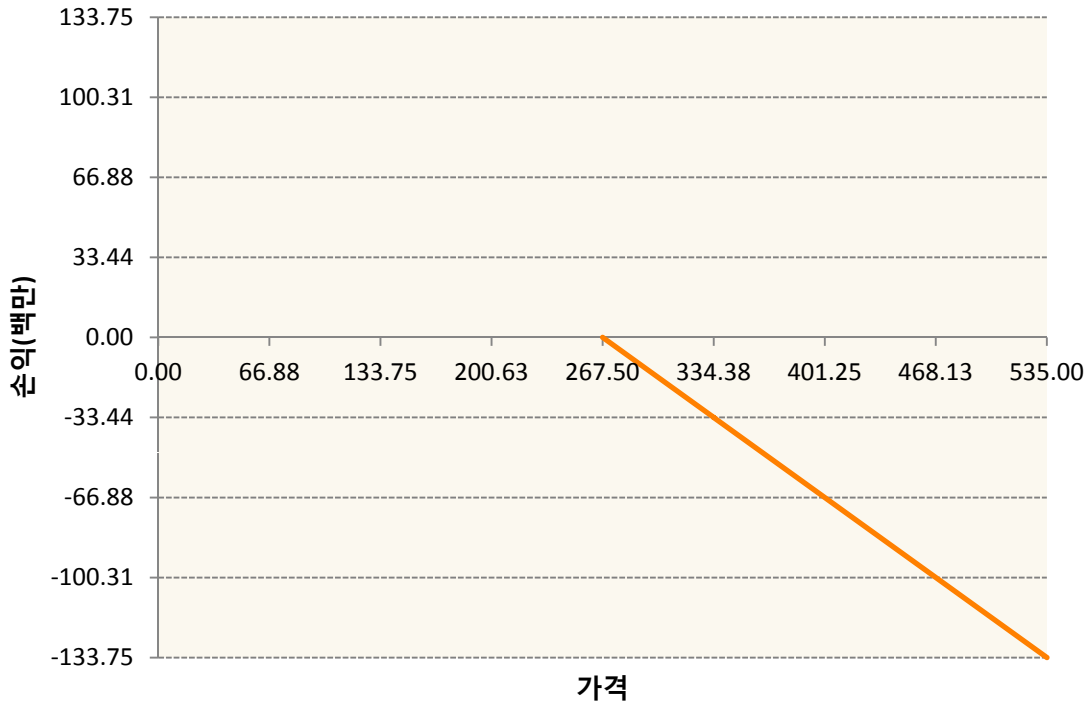


KR4201P92658-2019-09 콜265

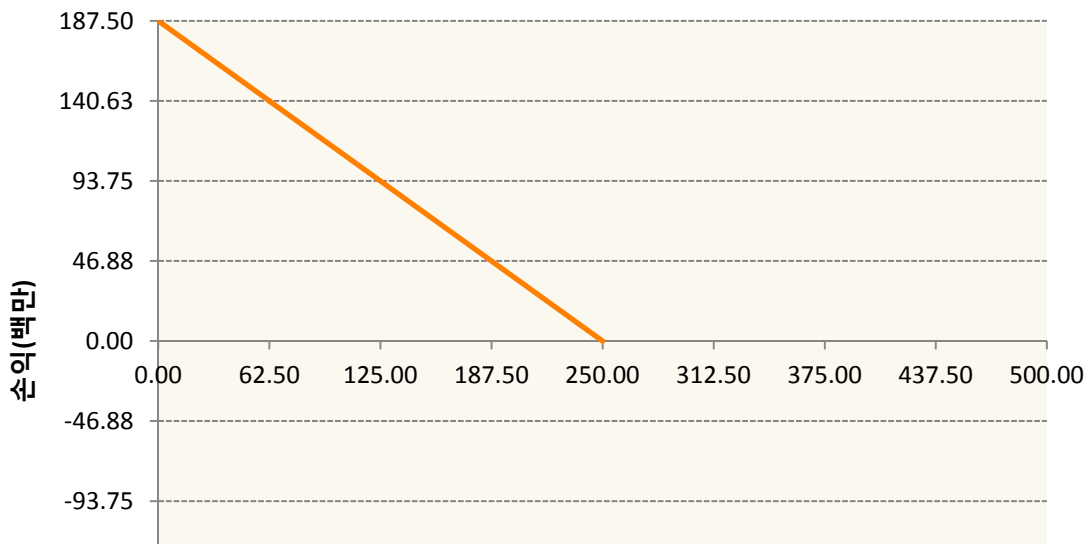


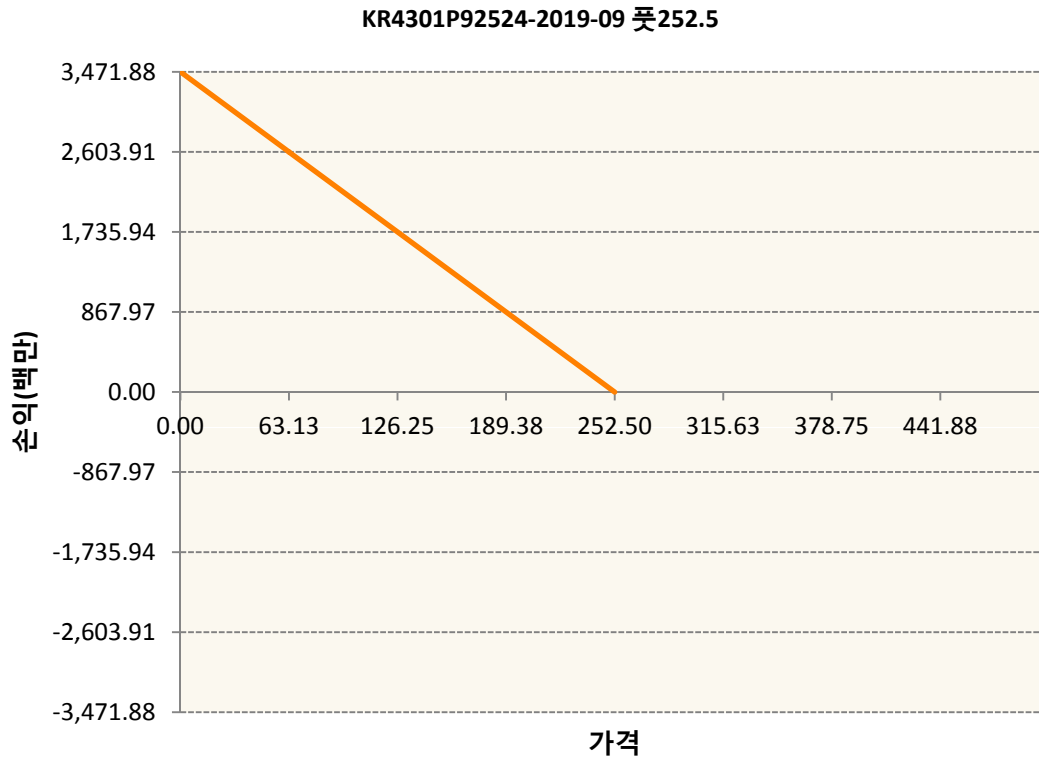
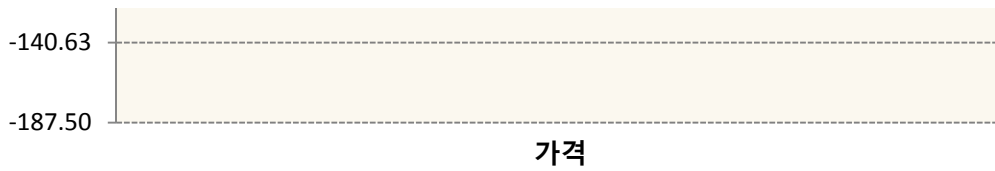


KR4201P92674-2019-09 콜267.5



KR4301P92508-2019-09 풋250





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						878
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-878	-878	-878	-878	-878	-878	-878	
-5.33%	-586	-586	-586	-586	-586	-586	-586	
-2.67%	-293	-293	-293	-293	-293	-293	-293	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	293	293	293	293	293	293	293	
5.33%	586	586	586	586	586	586	586	
8.00%	878	878	878	878	878	878	878	
KR4201P92658		2019-09 콜265						1,002
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	249	246	242	237	229	219	208	
-5.33%	239	231	220	206	190	173	153	
-2.67%	202	182	160	135	109	82	53	

0%	101	68	35	0	-35	-71	-107
2.67%	-102	-141	-180	-219	-258	-297	-336
5.33%	-422	-456	-491	-527	-563	-599	-636
8.00%	-839	-861	-885	-912	-941	-970	-1,002
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	-6	-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	4	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	0	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							191
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	185	185	186	187	188	189	191
-5.33%	95	98	100	103	106	109	112
-2.67%	25	30	34	38	42	46	50
0%	-10	-7	-3	0	4	7	11
2.67%	-20	-19	-17	-16	-14	-12	-9
5.33%	-21	-21	-21	-20	-20	-19	-18
8.00%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-20

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

(단위:백만원)

1,746

공시일	2019-08-22
기준일	2019-08-21

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	59,383	0	59,383	

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	2019-08-22
기준일	2019-08-21

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,006	0	3,006	
누계	유가증권	수익증권	80,338	0	80,338	

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	2019-08-22
기준일	2019-08-21

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	465,515	0	465,515	
누계	통화	선도	0	523,809	-523,809	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		1,732
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,116
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		135
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		962
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		2,992
FX21019N02 KRW/USD 22-08-19E		1,674
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		770
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,924
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,924
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		289
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		96
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		712
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		712
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		289
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		673
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		2,694
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		1,347
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		770
FX21019N04 KRW/USD 03-09-19E		289
FX21019Q00 KRW/USD 03-09-19E		289
FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E		481
FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E		192
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		289
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		3,175
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		2,155
FX21019Q01 KRW/USD 16-09-19E		96

FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,944
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,559
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E	2,636
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E	2,992

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

(단위:백만원)

13,573

공시일	2019-08-22
기준일	2019-08-21

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

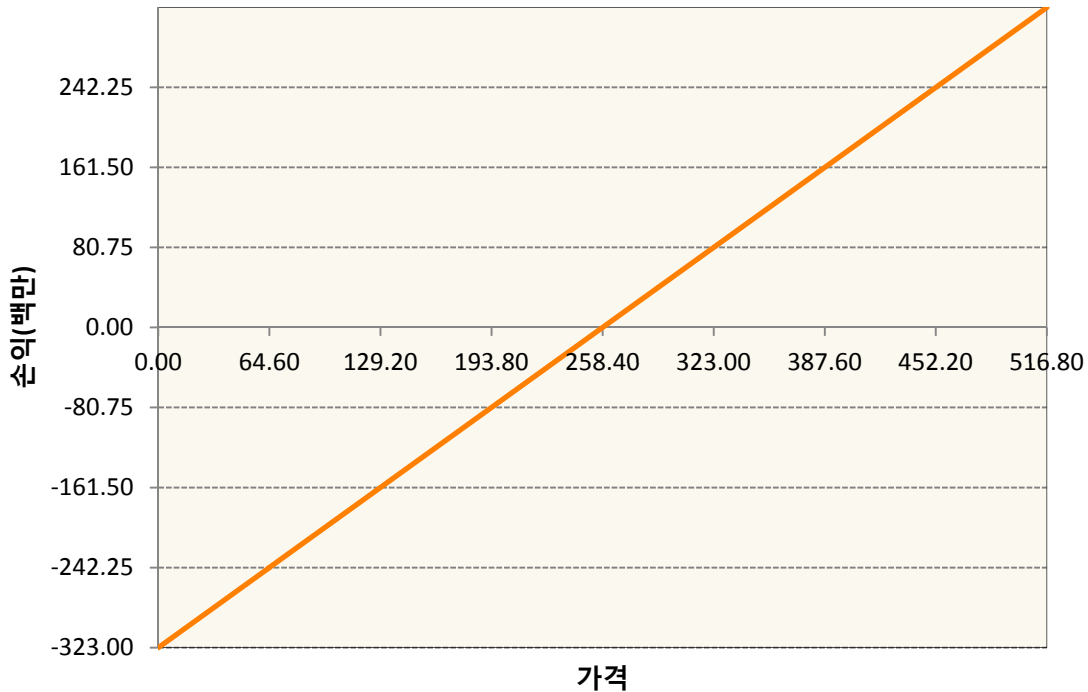
1. 계약금액

(단위:백만원)

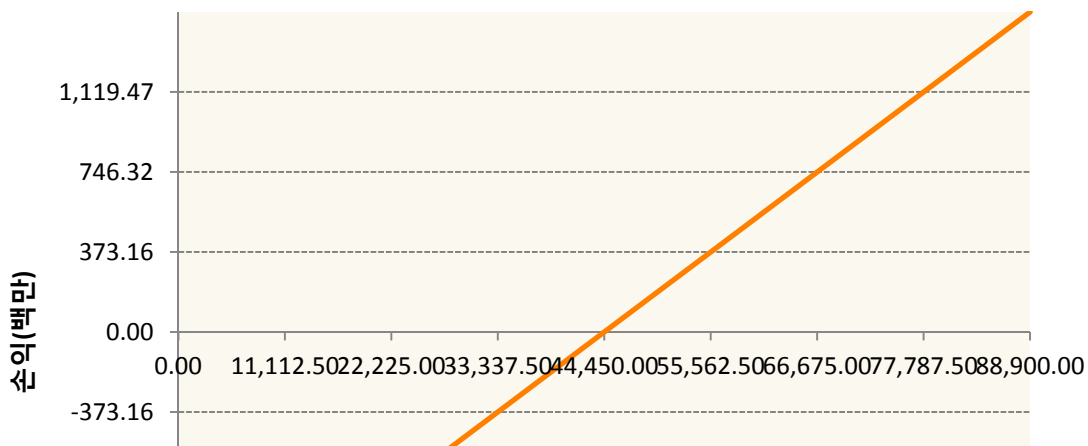
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,816	0	1,816	장내

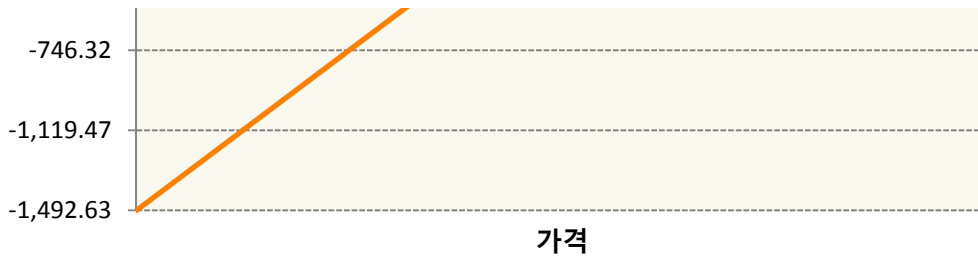
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P90000-2019-09 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						26
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26	
-5.33%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
-2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	9	9	9	9	9	9	9	
5.33%	17	17	17	17	17	17	17	
8.00%	26	26	26	26	26	26	26	
KR4111P90000		2019-09 삼성전자개별선물						120
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120	
-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%	120	120	120	120	120	120	120	

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

173

공시일	2019-08-22
기준일	2019-08-21

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

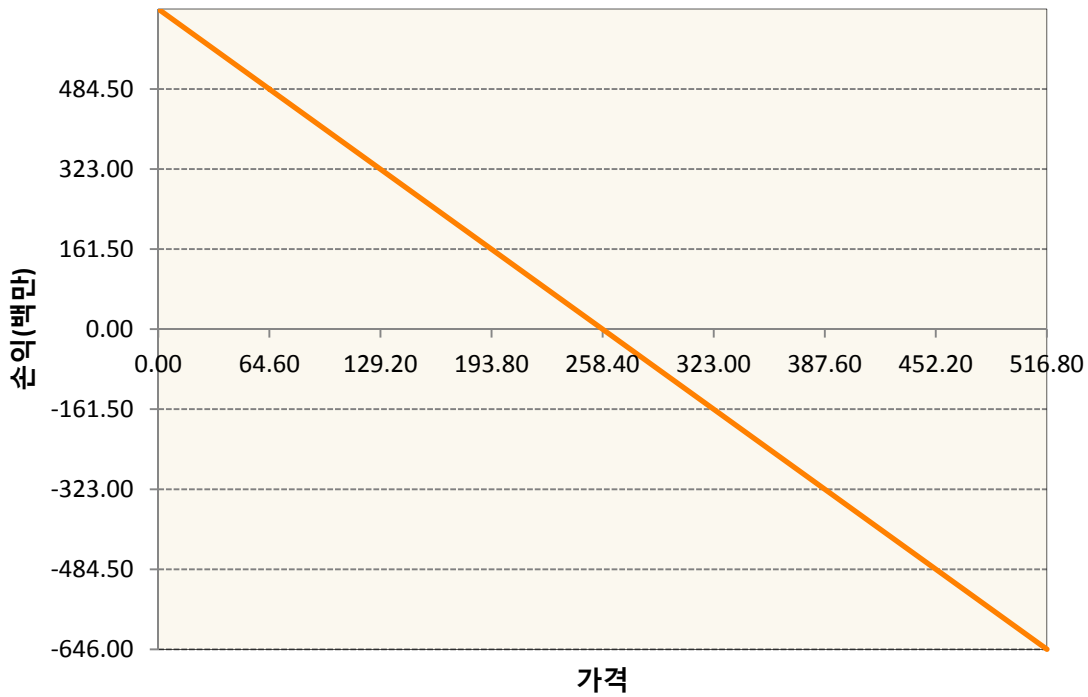
1. 계약금액

(단위:백만원)

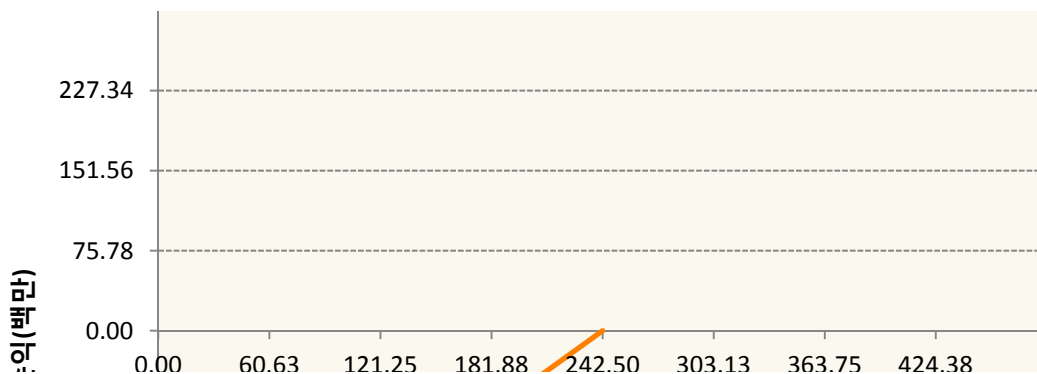
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	122	-122	장내
누계	유가증권	선물	0	646	-646	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,672	-3,672	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

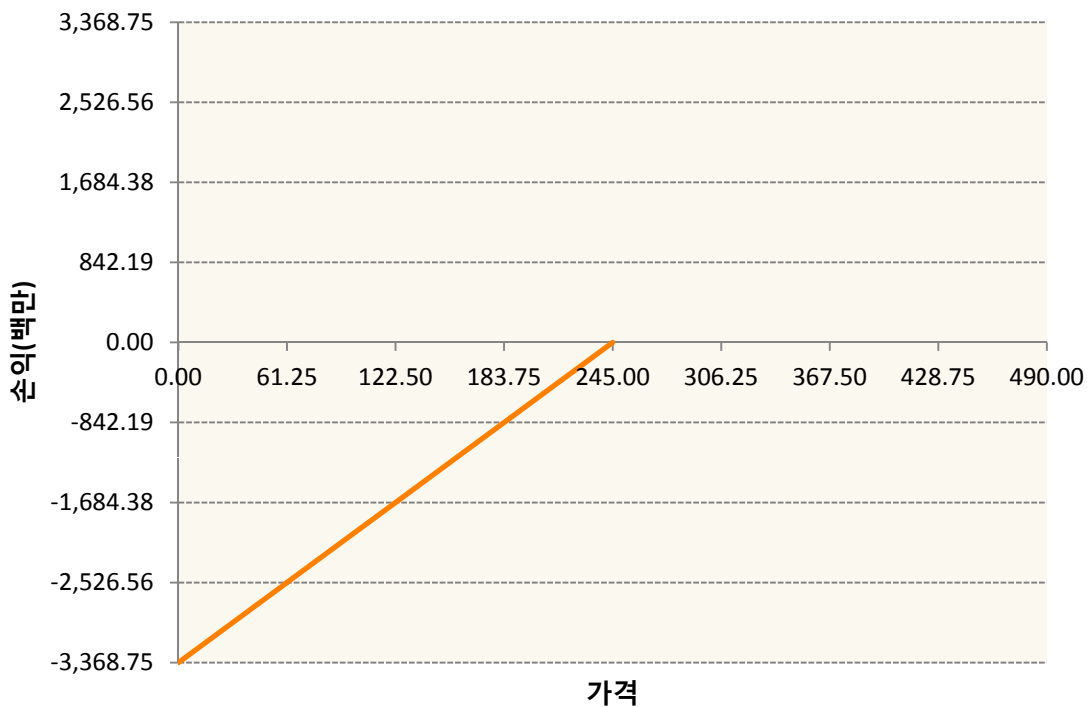


KR4301P92425-2019-09 풋242.5





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						9
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7	-7	-8	-8	-8	-9	-9
-5.33%	-2	-2	-3	-3	-3	-4	-4
-2.67%	0	0	-1	-1	-1	-1	-2
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

121

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-104	-107	-109	-112	-115	-118	-121
-5.33%	-37	-41	-45	-49	-53	-57	-61
-2.67%	-5	-7	-10	-14	-17	-20	-24
0%	3	2	1	0	-2	-3	-6
2.67%	4	4	4	4	3	2	2
5.33%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

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

(단위:백만원)

121

공시일	2019-08-22
기준일	2019-08-21

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	19,533	0	19,533	
누계	통화	선도	0	19,120	-19,120	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		327
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		164
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		481
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		519
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		38

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

(단위:백만원)

495

공시일	2019-08-22
기준일	2019-08-21

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	381	0	381	장외
누계	통화	선도	0	93	-93	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	30
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	2019-08-22
기준일	2019-08-21

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

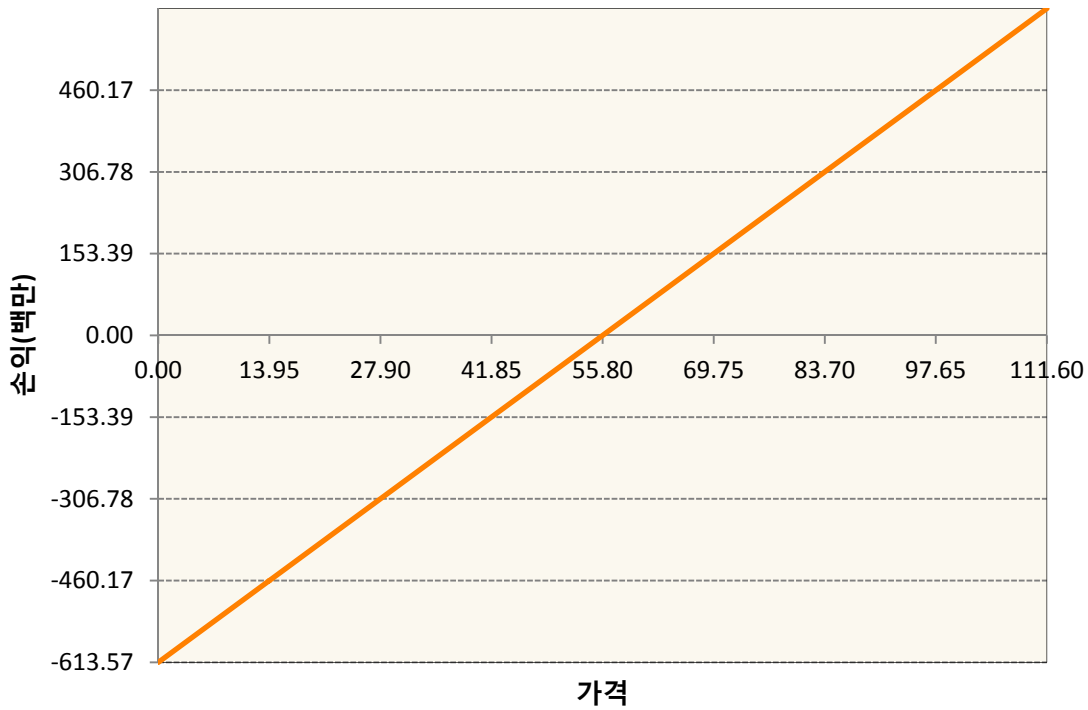
1. 계약금액

(단위:백만원)

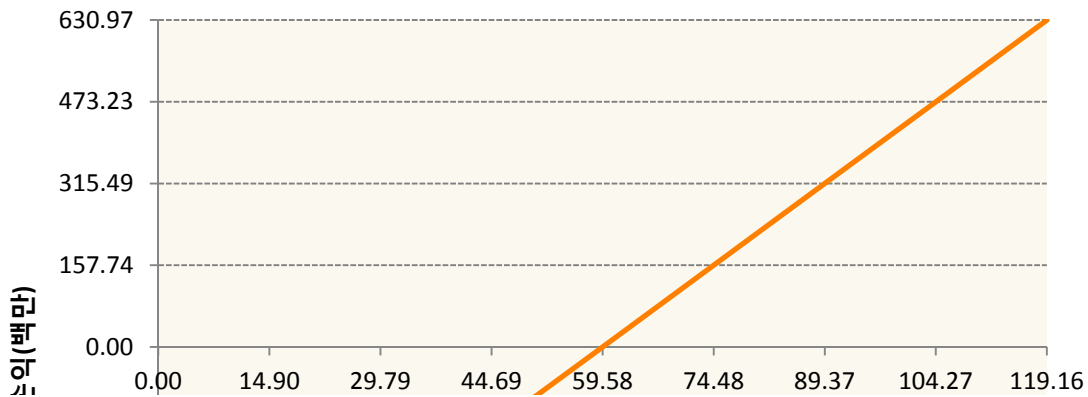
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,241	120	2,121	
누계	유가증권	선물	191	0	191	장내

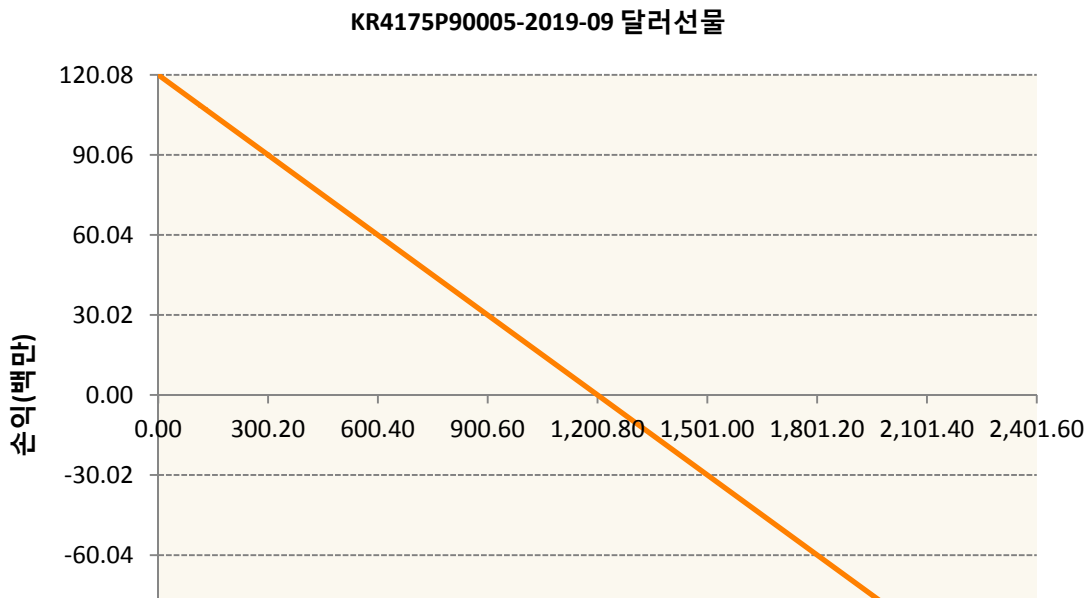
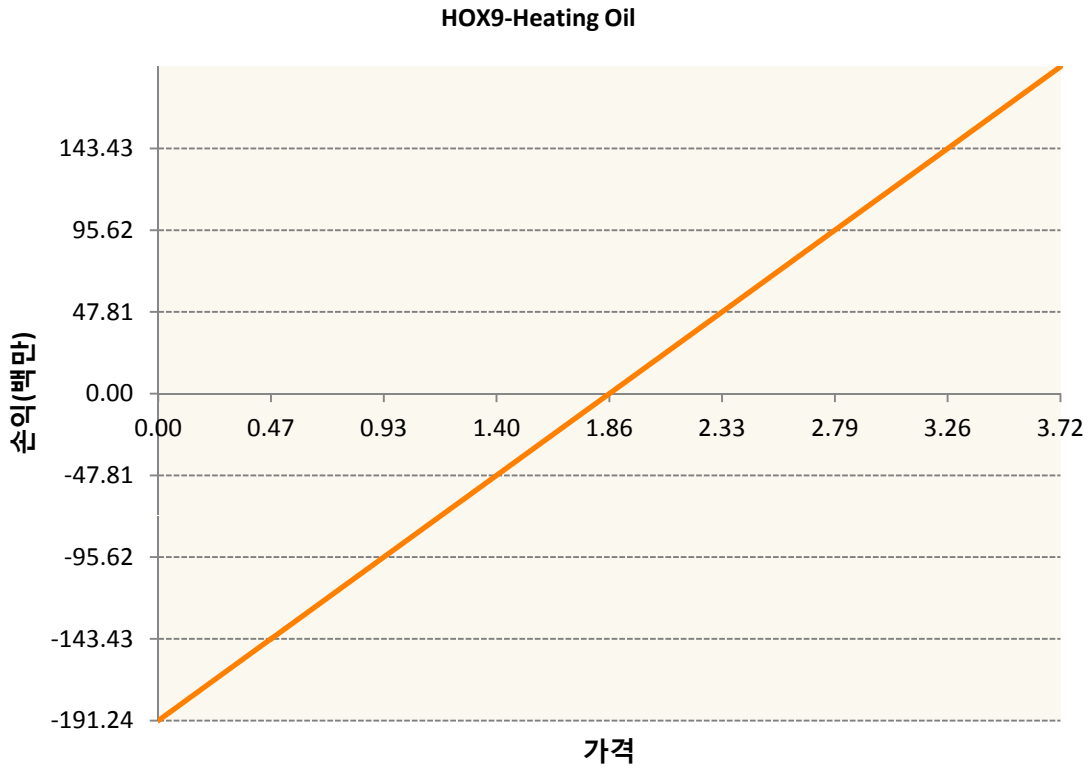
2. 만기시점의 손익구조

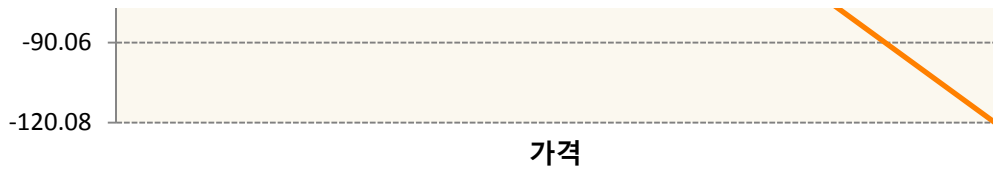
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19



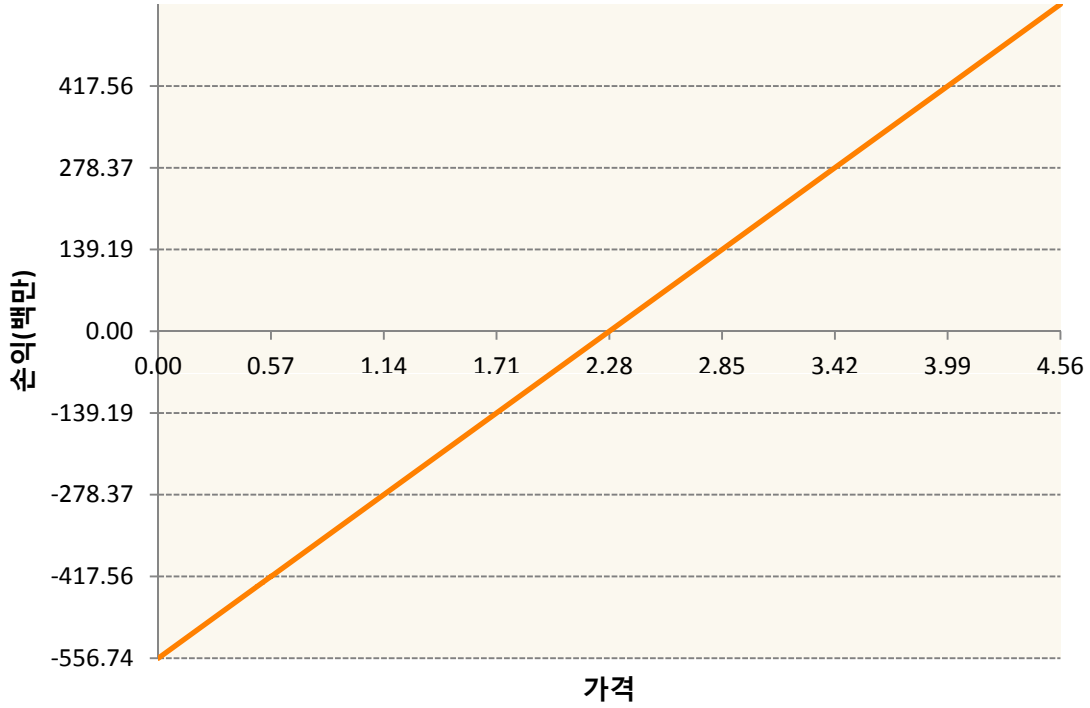
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19



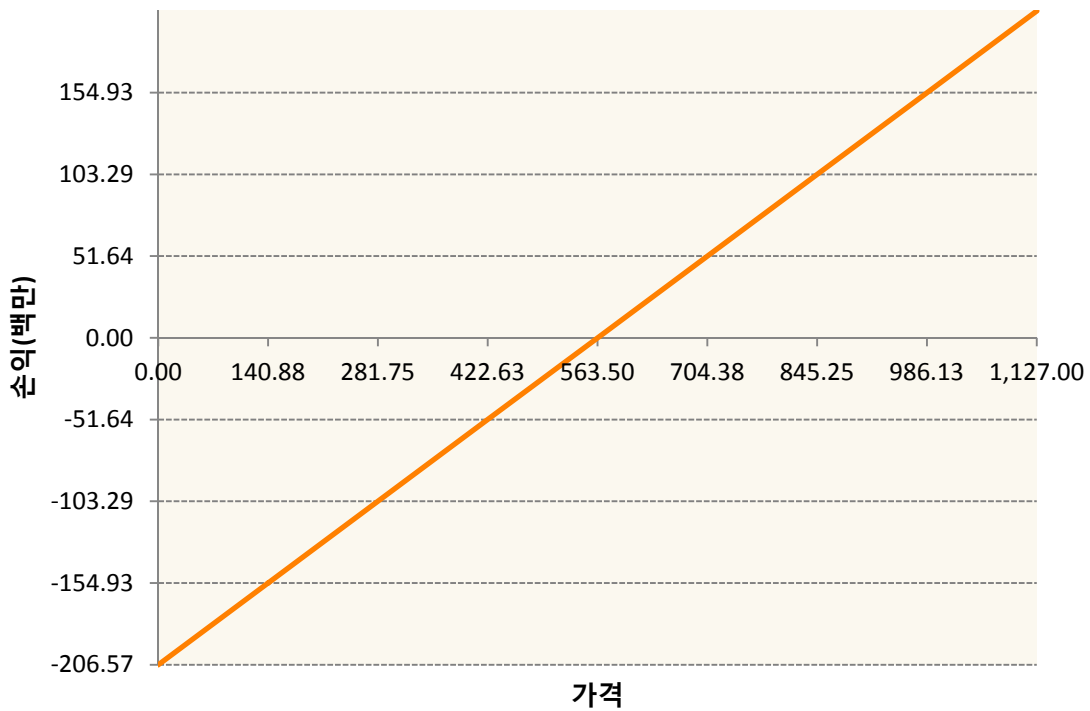


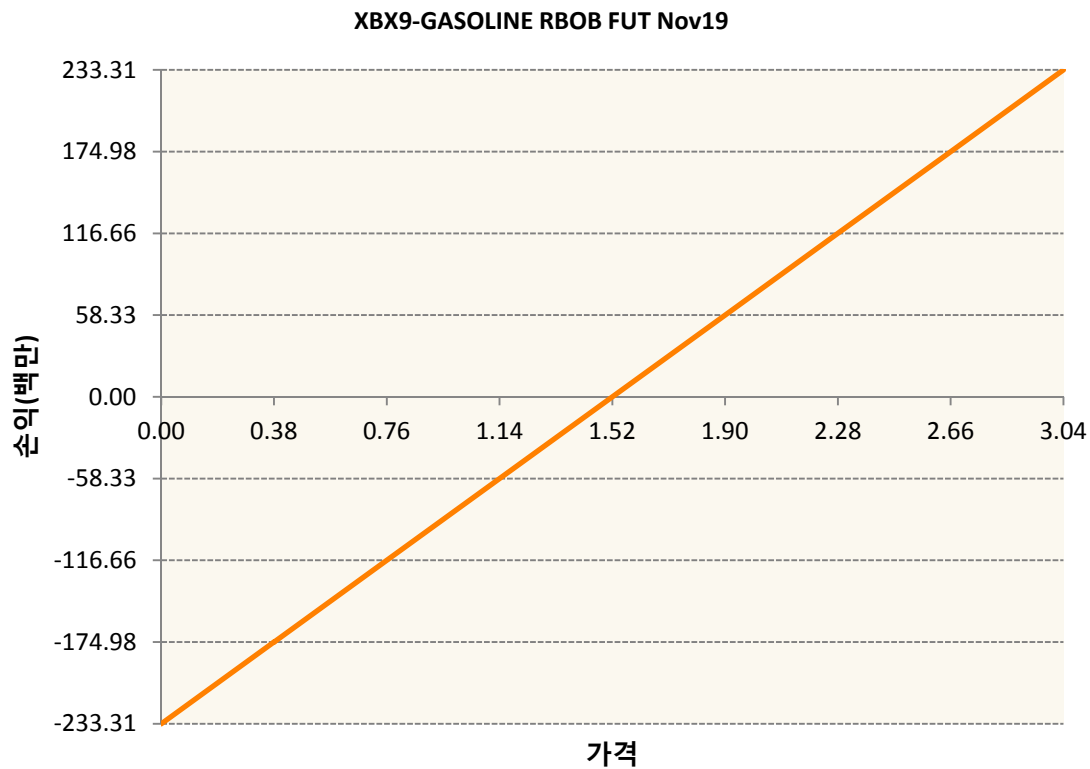


NGX19-NATURAL GAS FUTR Nov19



QSX9-Low Su Gasoil G Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLX9	WTI CRUDE FUTURE Nov19	49
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	50
HOX9	Heating Oil	15
KR4175P900	2019-09 달러선물	10
NGX19	NATURAL GAS FUTR Nov19	45
QSX9	Low Su Gasoil G Nov19	17
XBX9	GASOLINE RBOB FUT Nov19	19

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

373

공시일	2019-08-22
기준일	2019-08-21

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

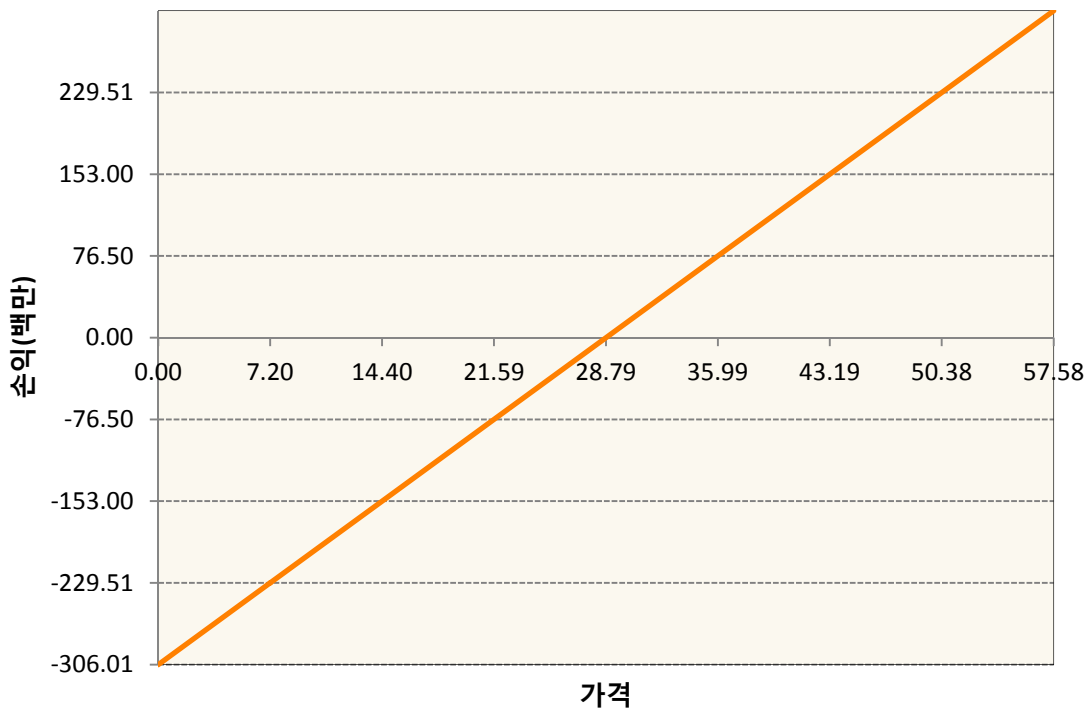
1. 계약금액

(단위:백만원)

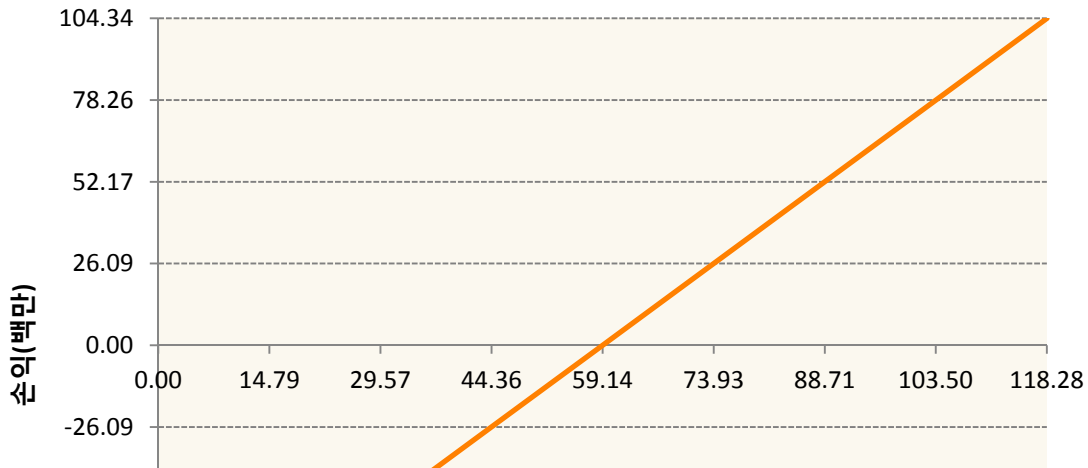
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,728	156	2,572	

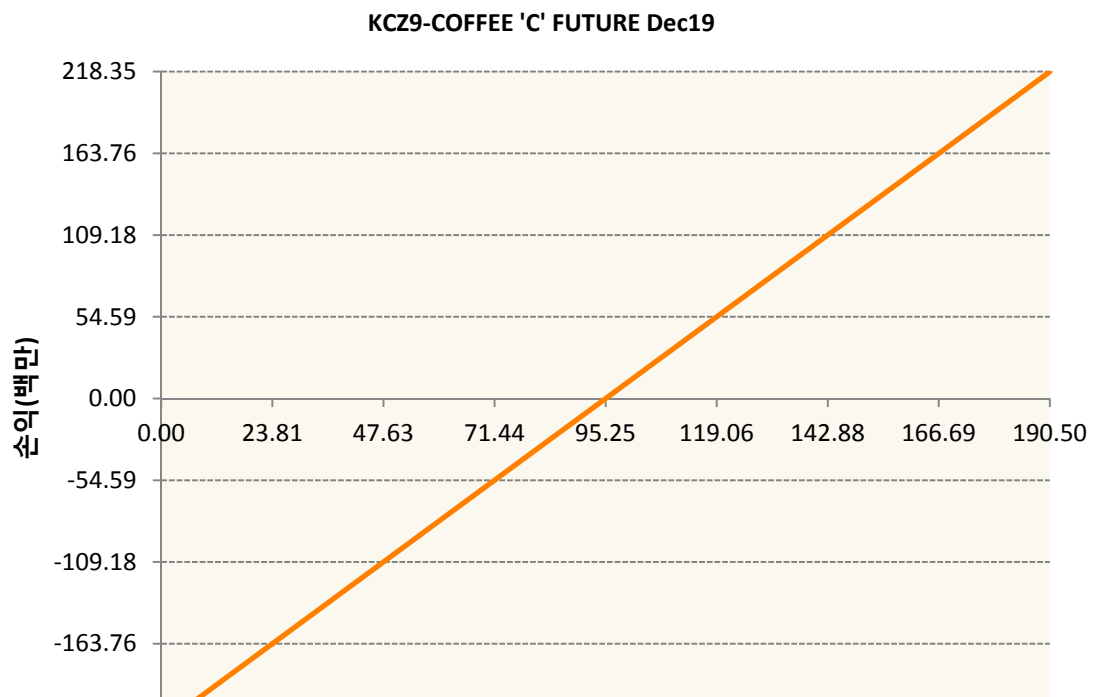
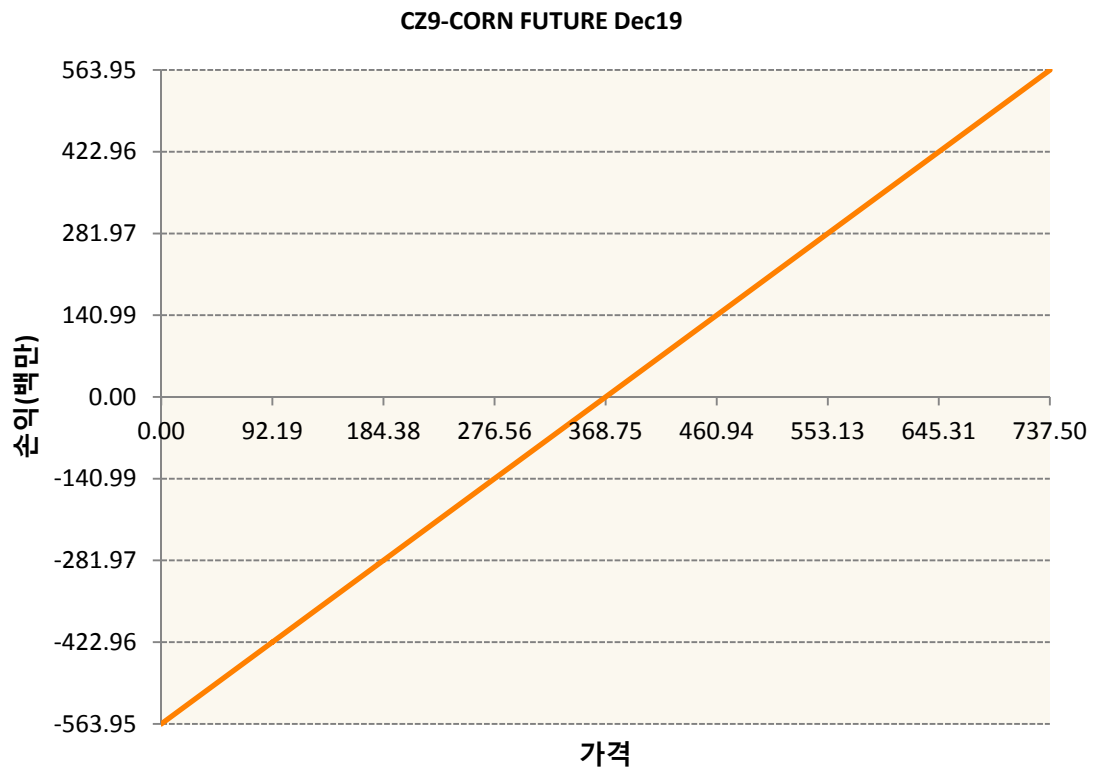
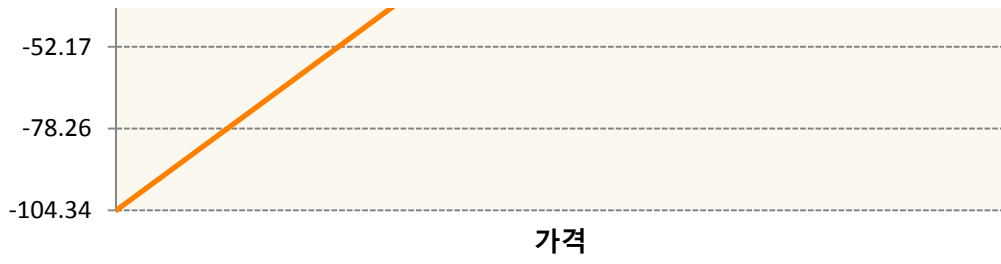
2. 만기시점의 손익구조

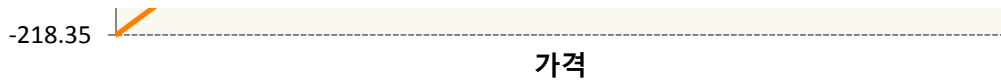
BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19



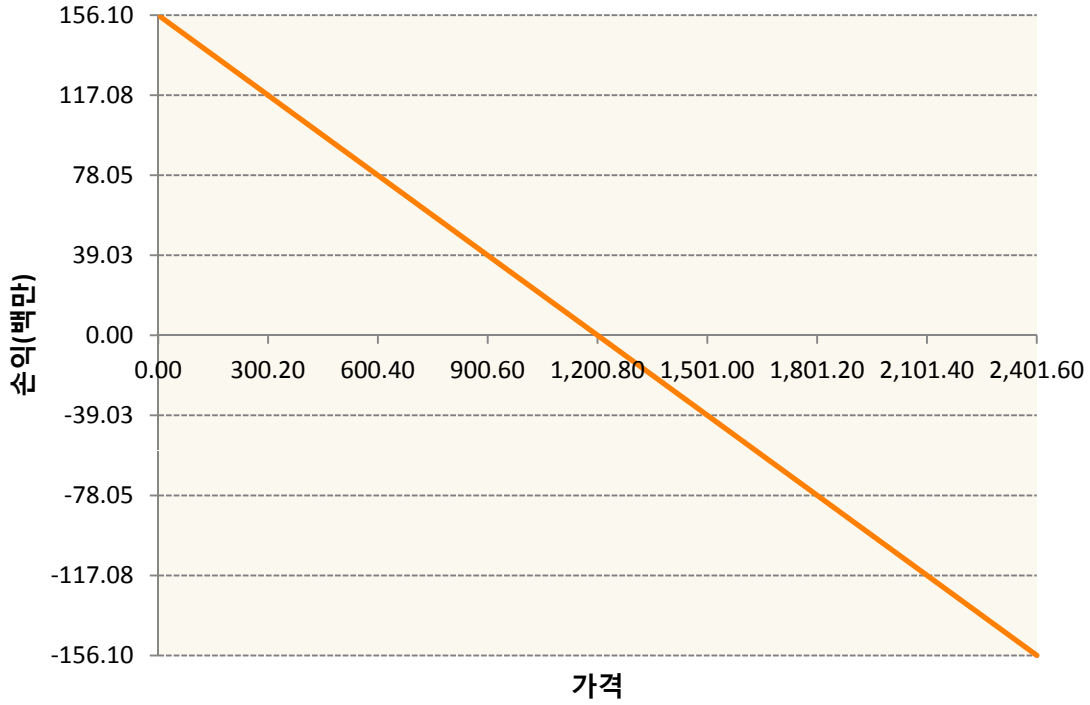
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



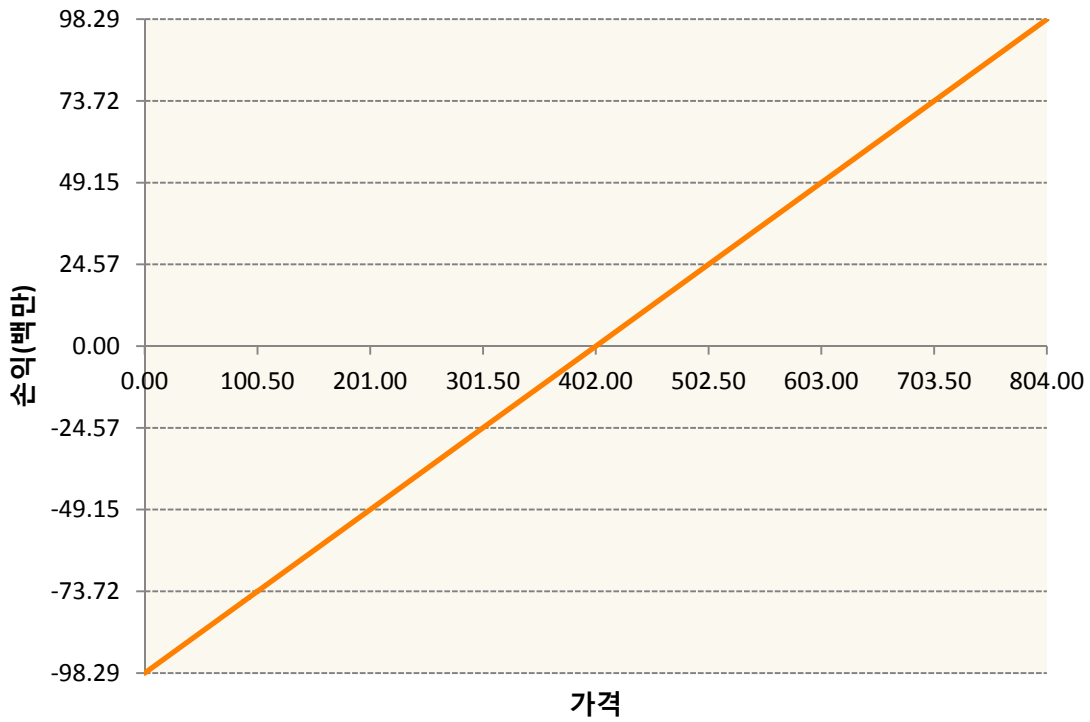




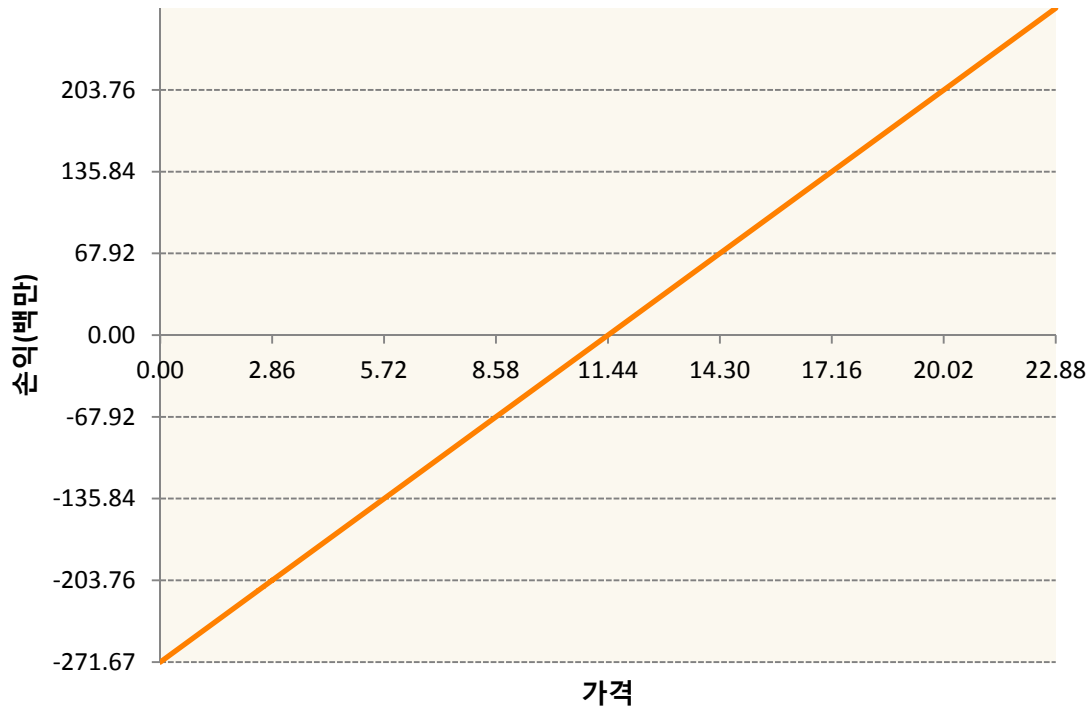
KR4175P90005-2019-09 달러선물



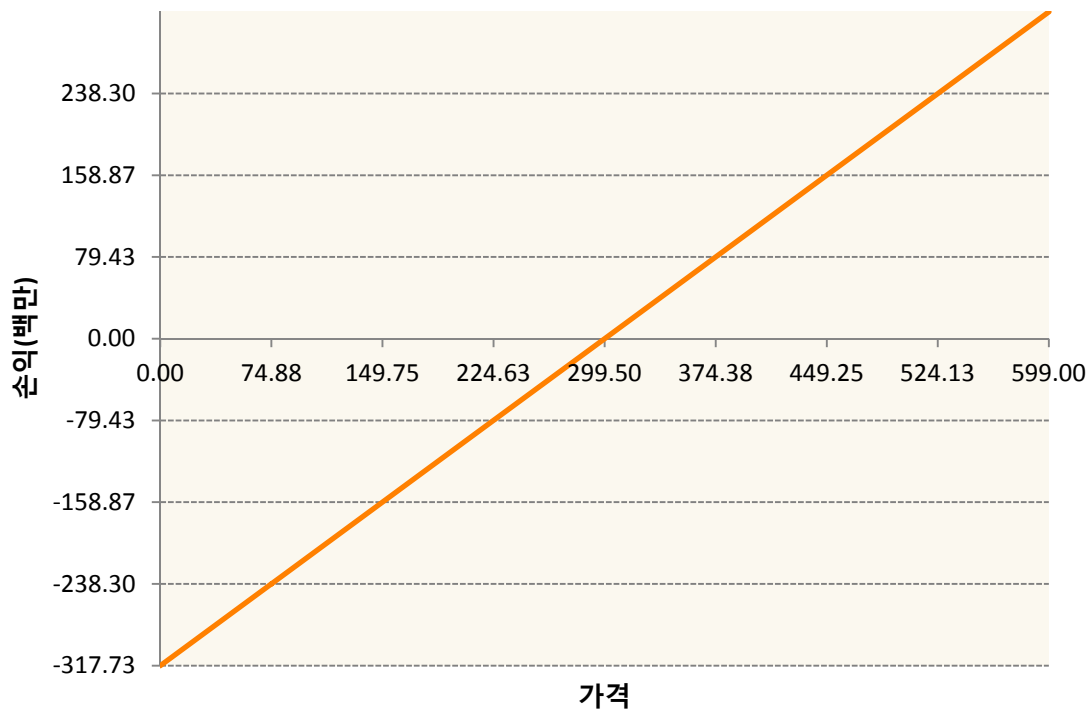
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

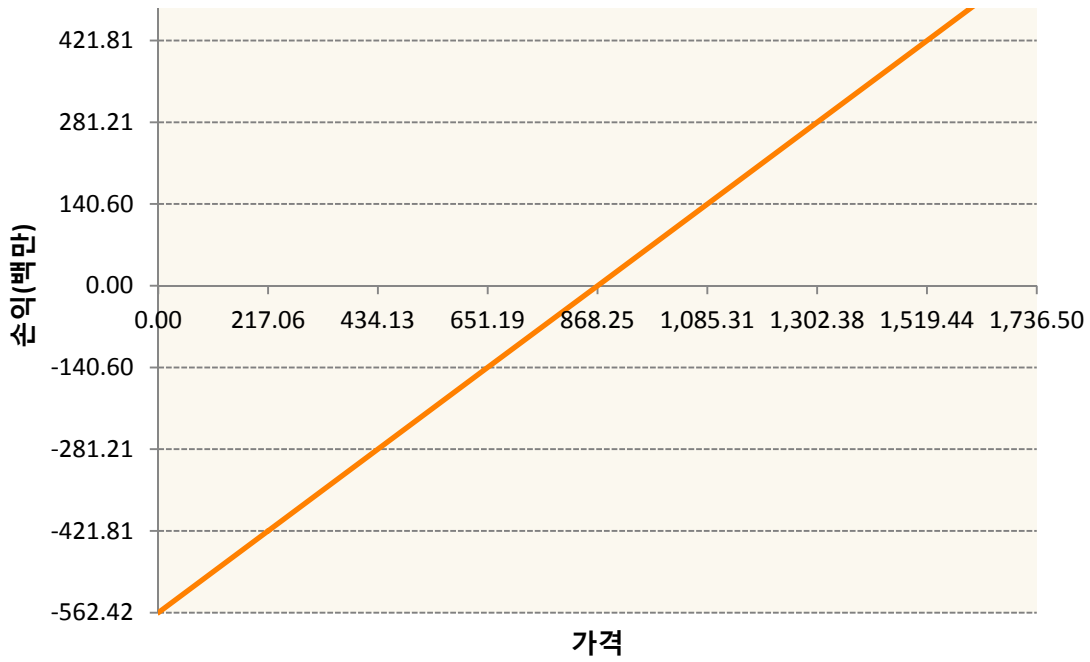


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

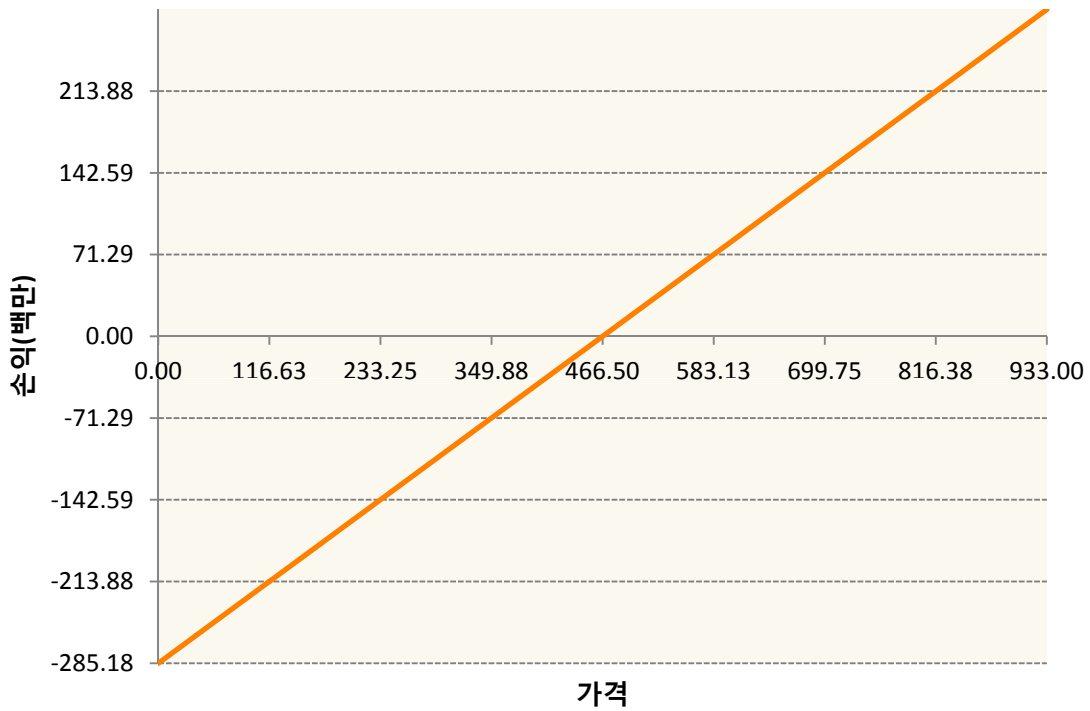


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





WZ9-WHEAT FUTURE(CBT) Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	24
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	8
CZ9	CORN FUTURE Dec19	45
KCZ9	COFFEE 'C' FUTURE Dec19	17
KR4175P900	2019-09 달러선물	12

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)

242