

공시일	2019-08-23
기준일	2019-08-22

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	2019-08-23
기준일	2019-08-22

SMART합성-MSCI선진국증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	14,341	0	14,341	장외
누계	지수	스왑	14,341	0	14,341	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S190822

1,147

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

657

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-23
기준일	2019-08-22

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)

814

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-23
기준일	2019-08-22

유로인덱스모(주식-파생형)

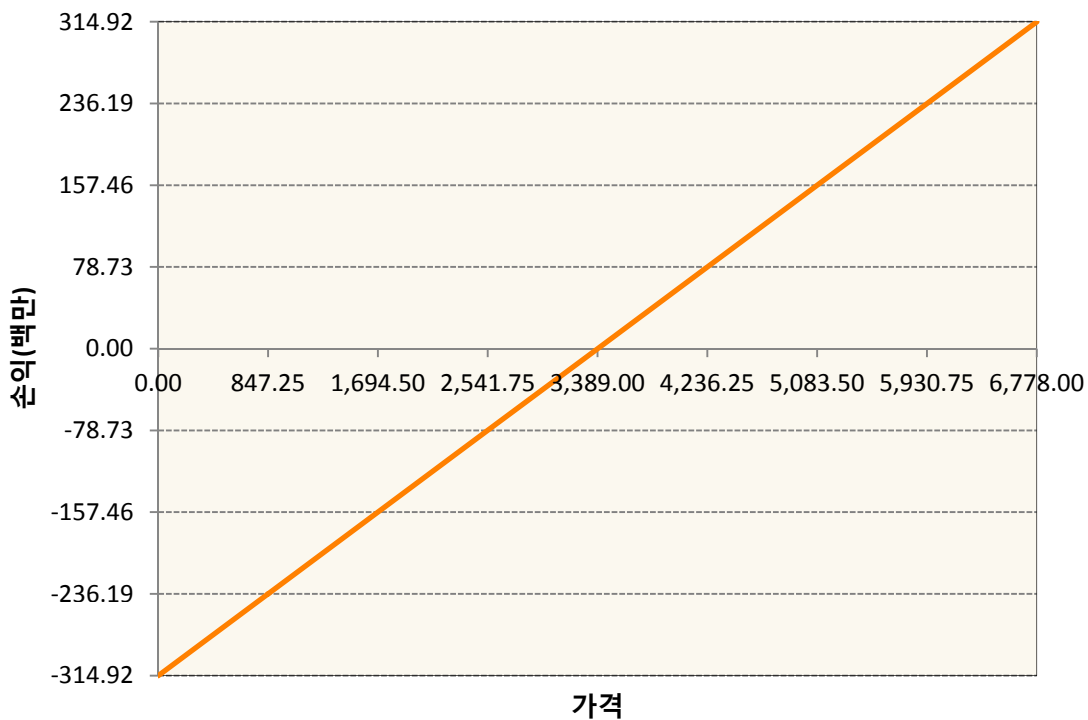
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	315	0	315	

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	2019-08-23
기준일	2019-08-22

차이나인덱스모(주식-파생형)

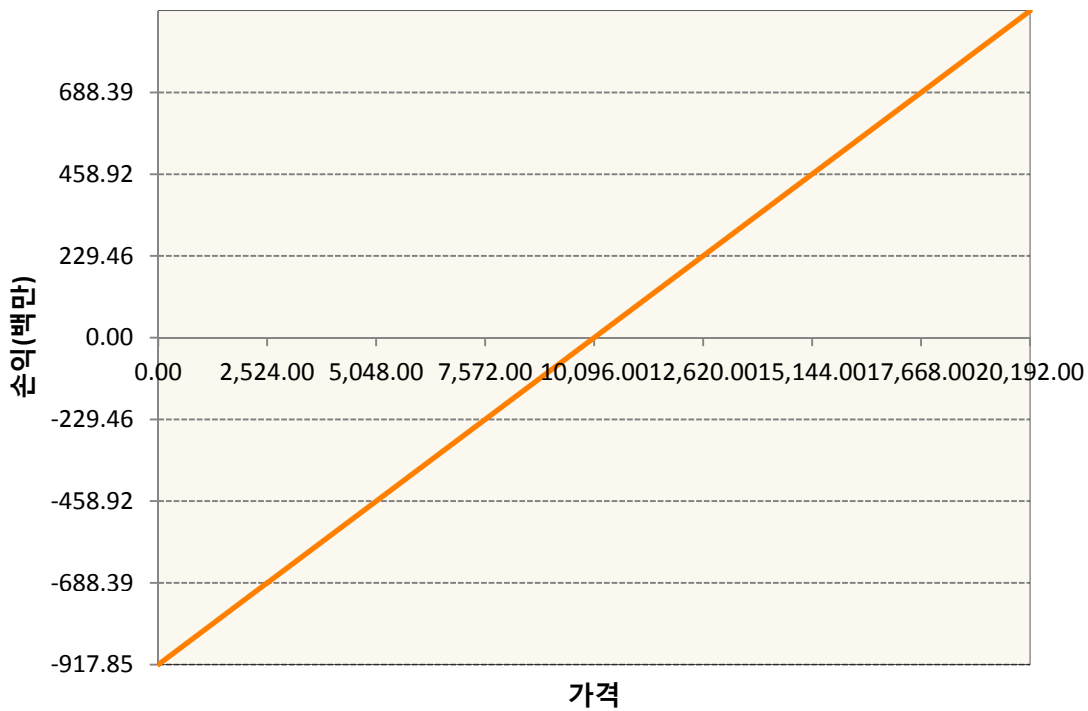
1. 계약금액

(단위:백만원)

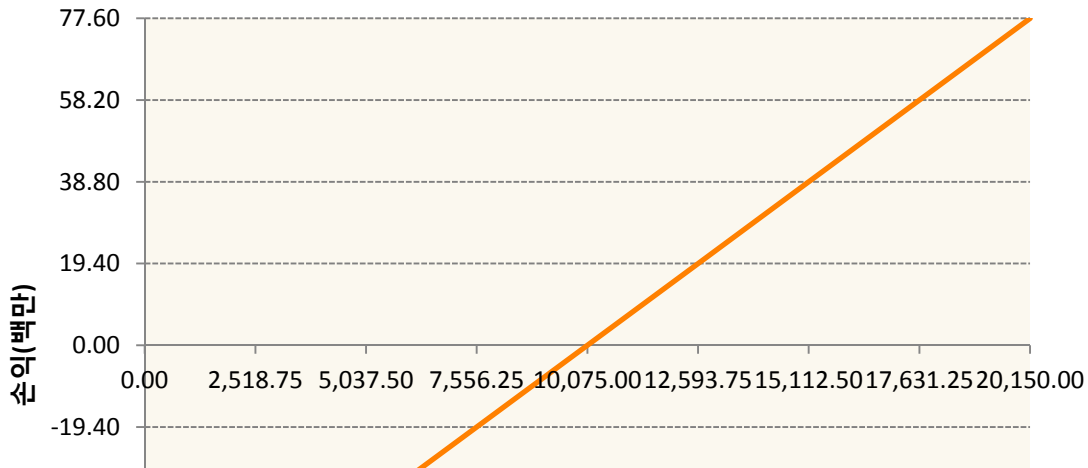
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	995	0	995	장내

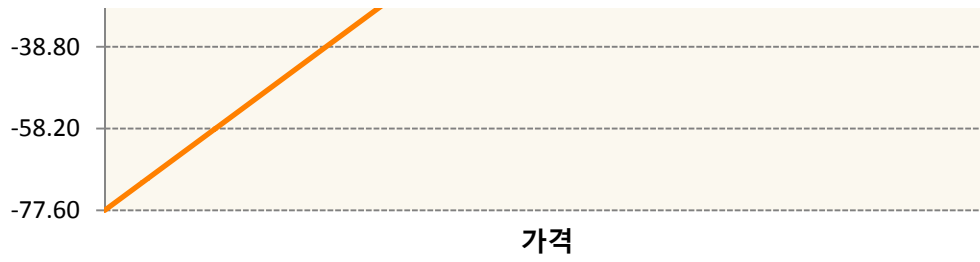
2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19



HCU9-HSCEI Futures Sep19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCQ9	HSCEI Futures Aug19	73
HCU9	HSCEI Futures Sep19	6

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

75

공시일	2019-08-23
기준일	2019-08-22

커버드콜모(주식혼합-파생형)

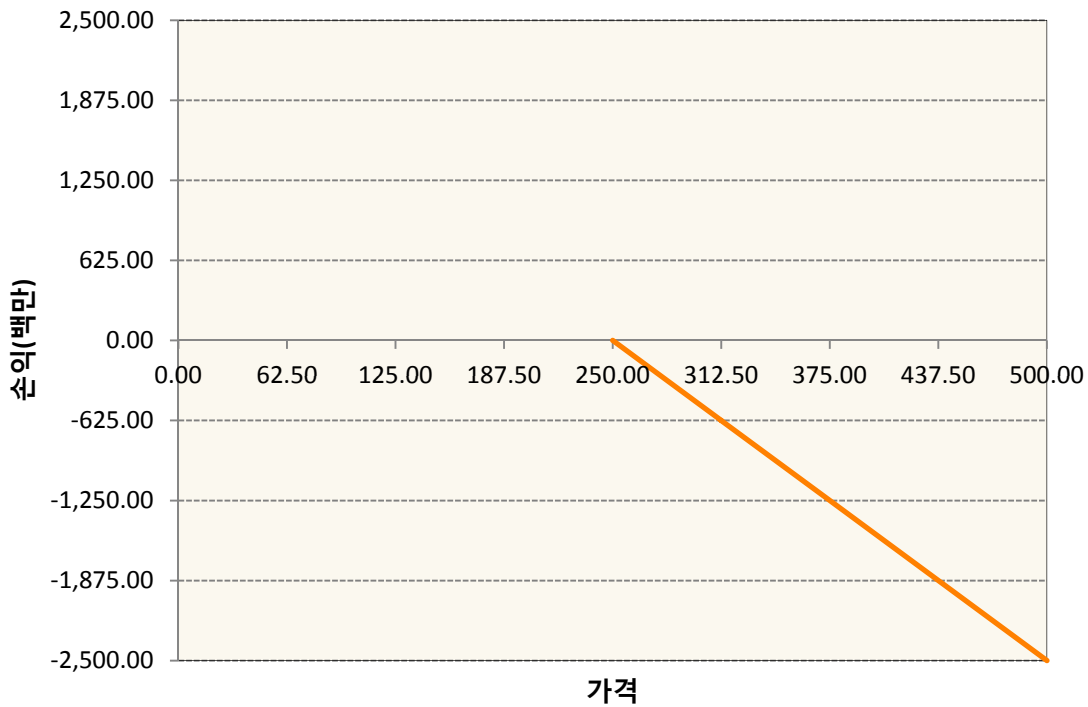
1. 계약금액

(단위:백만원)

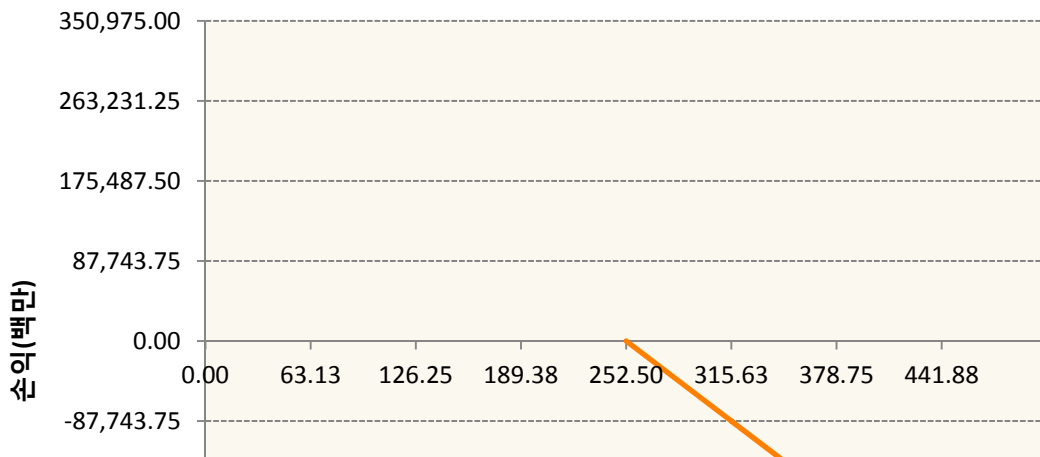
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	520,569	-520,569	장내

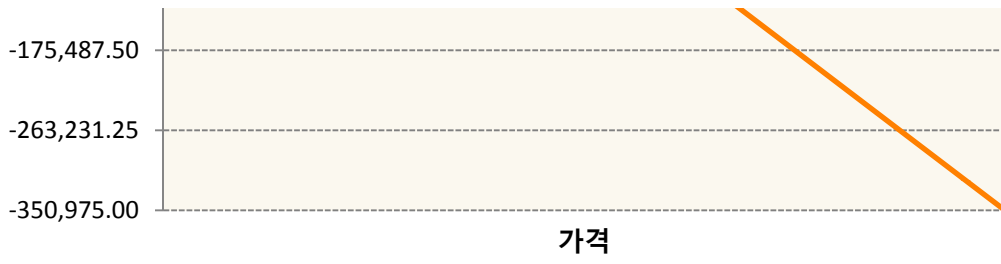
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P92500-2019-09 콜250

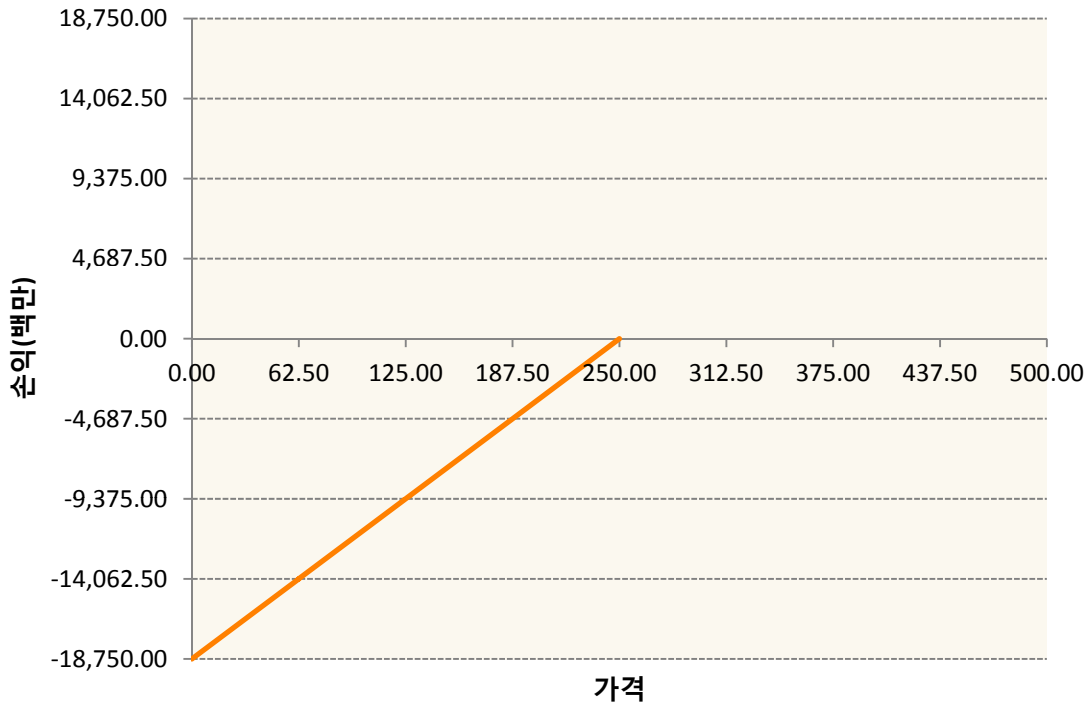


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

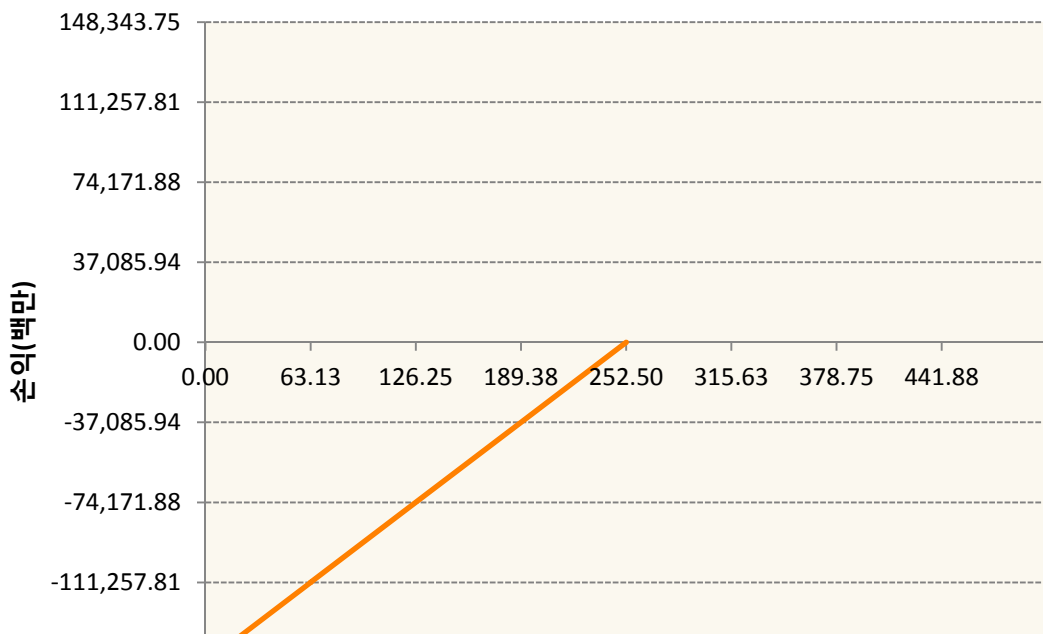




KR4301P92508-2019-09 풋250



KR4301P92524-2019-09 풋252.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P92500		2019-09 콜250						179
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	90	88	85	83	80	77	73	
-5.33%	79	75	71	67	63	59	54	
-2.67%	54	49	45	40	35	30	25	
0%	13	9	4	0	-4	-9	-14	
2.67%	-42	-45	-48	-51	-54	-58	-62	
5.33%	-105	-107	-108	-110	-112	-115	-118	
8.00%	-172	-173	-173	-174	-176	-177	-179	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5						23,869
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	10,533	10,326	10,071	9,773	9,437	9,068	8,669	
-5.33%	9,483	9,038	8,561	8,056	7,531	6,988	6,430	
-2.67%	6,836	6,192	5,543	4,891	4,237	3,580	2,922	
0%	1,959	1,311	658	0	-661	-1,324	-1,990	
2.67%	-5,053	-5,519	-6,019	-6,547	-7,096	-7,664	-8,246	
5.33%	-13,504	-13,750	-14,048	-14,391	-14,773	-15,189	-15,635	
8.00%	-22,655	-22,753	-22,893	-23,077	-23,302	-23,567	-23,869	
KR4301P92508		2019-09 풋250						1,013
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-979	-981	-985	-990	-996	-1,004	-1,013	
-5.33%	-496	-509	-522	-537	-553	-570	-587	
-2.67%	-128	-150	-172	-195	-217	-240	-262	
0%	51	35	18	0	-19	-38	-57	
2.67%	97	92	86	78	68	58	46	
5.33%	103	102	101	99	96	92	87	
8.00%	104	103	103	103	102	101	100	
KR4301P92524		2019-09 풋252.5						8,842
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-8,674	-8,683	-8,699	-8,722	-8,753	-8,793	-8,842	
-5.33%	-4,772	-4,835	-4,911	-4,998	-5,094	-5,200	-5,312	
-2.67%	-1,464	-1,623	-1,785	-1,950	-2,116	-2,284	-2,453	
0%	485	327	165	0	-167	-336	-505	
2.67%	1,138	1,071	991	900	798	687	569	

5.33%	1,250	1,237	1,217	1,187	1,148	1,099	1,040
8.00%	1,260	1,258	1,255	1,250	1,240	1,225	1,203

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

(단위:백만원)

34,694

공시일	2019-08-23
기준일	2019-08-22

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

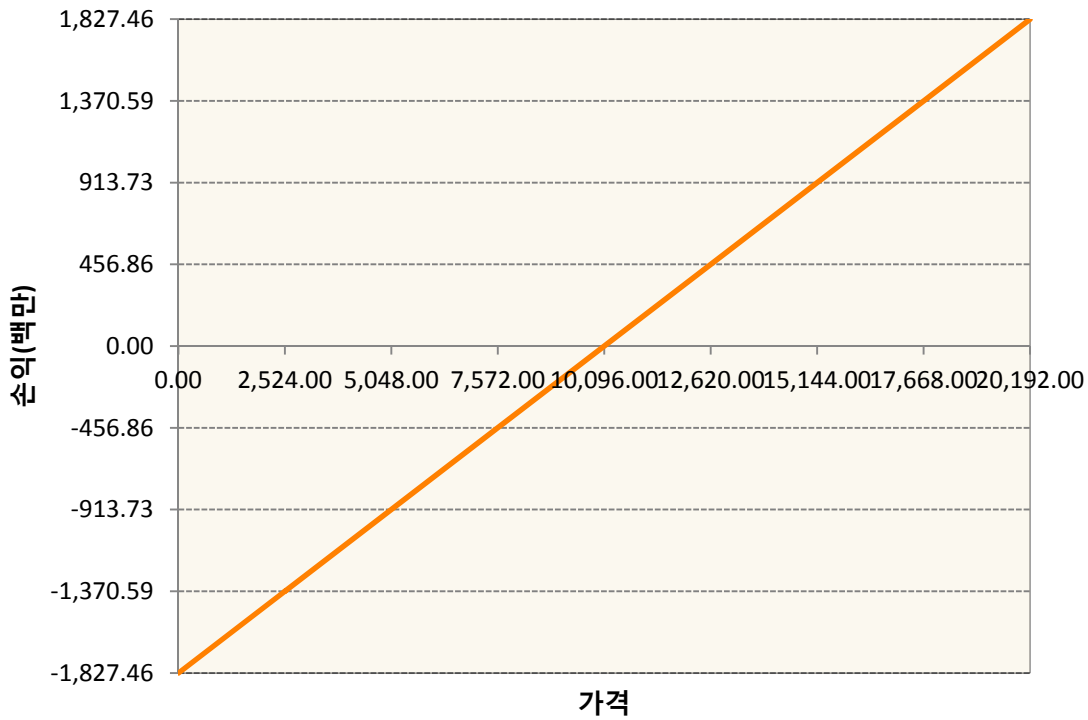
1. 계약금액

(단위:백만원)

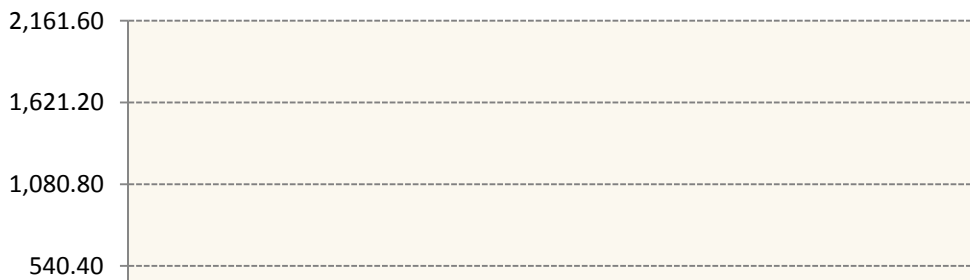
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,827	0	1,827	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,330	-5,330	장내
누계	통화	선도	457	6,094	-5,636	장외

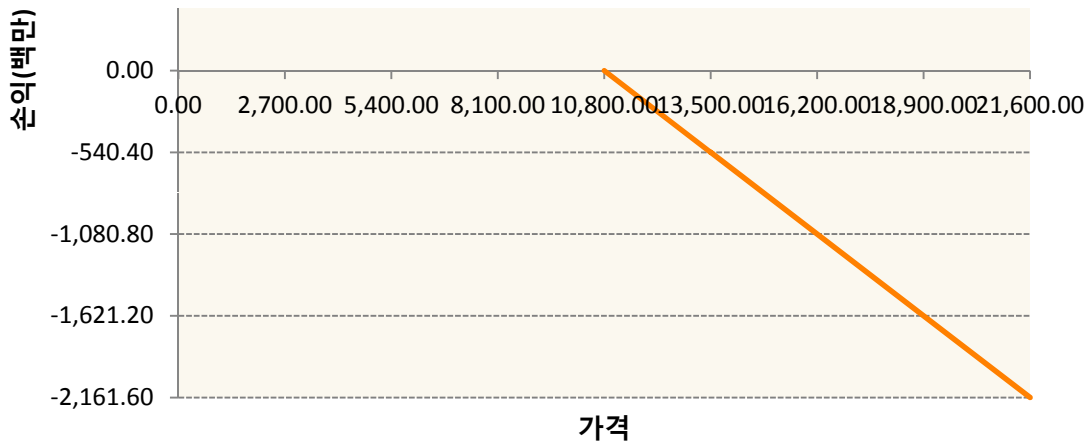
2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19

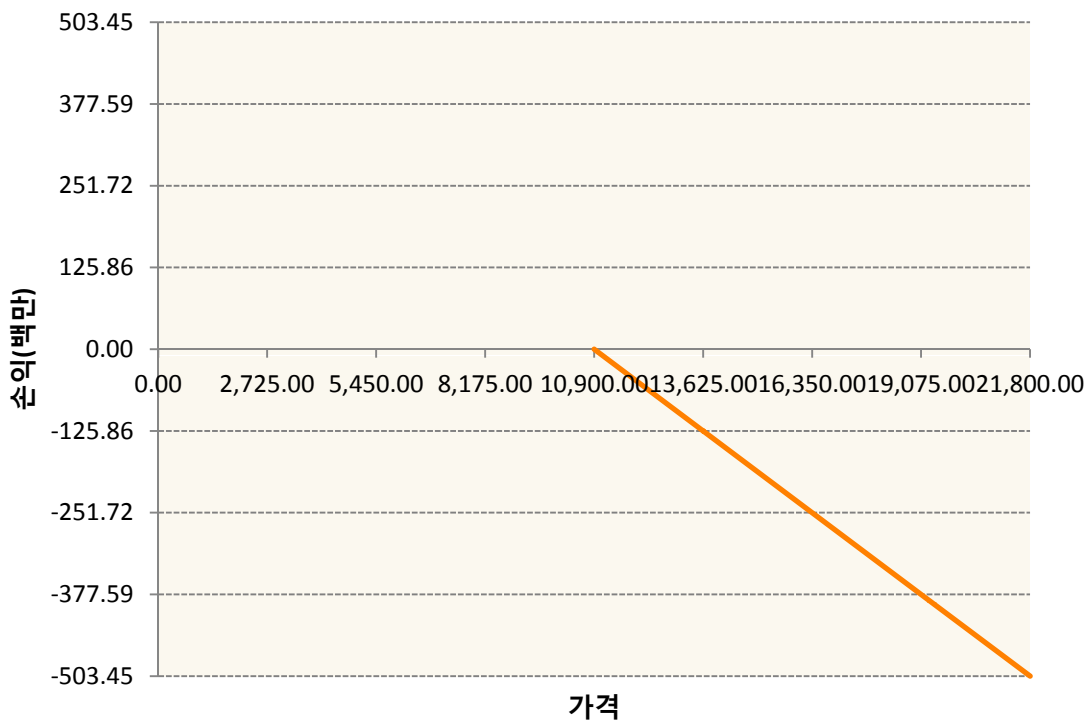


OHHIQ9-C108-HSCEI

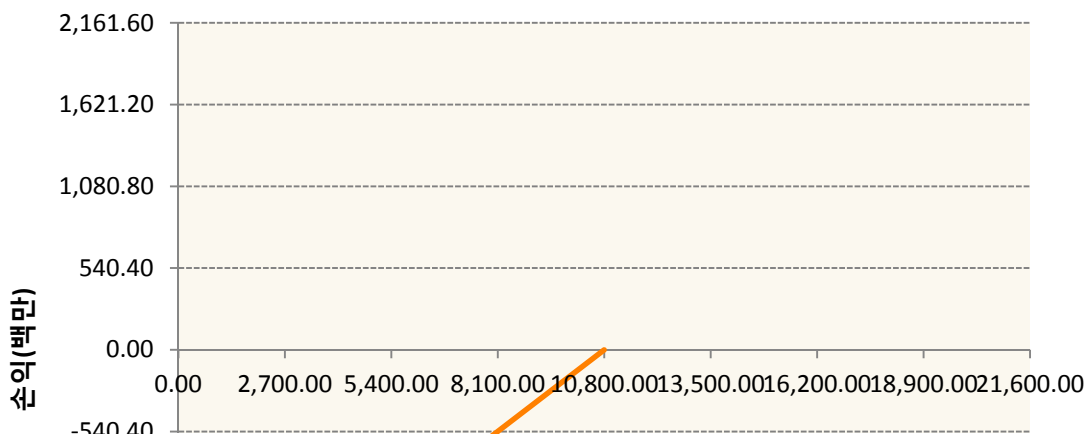


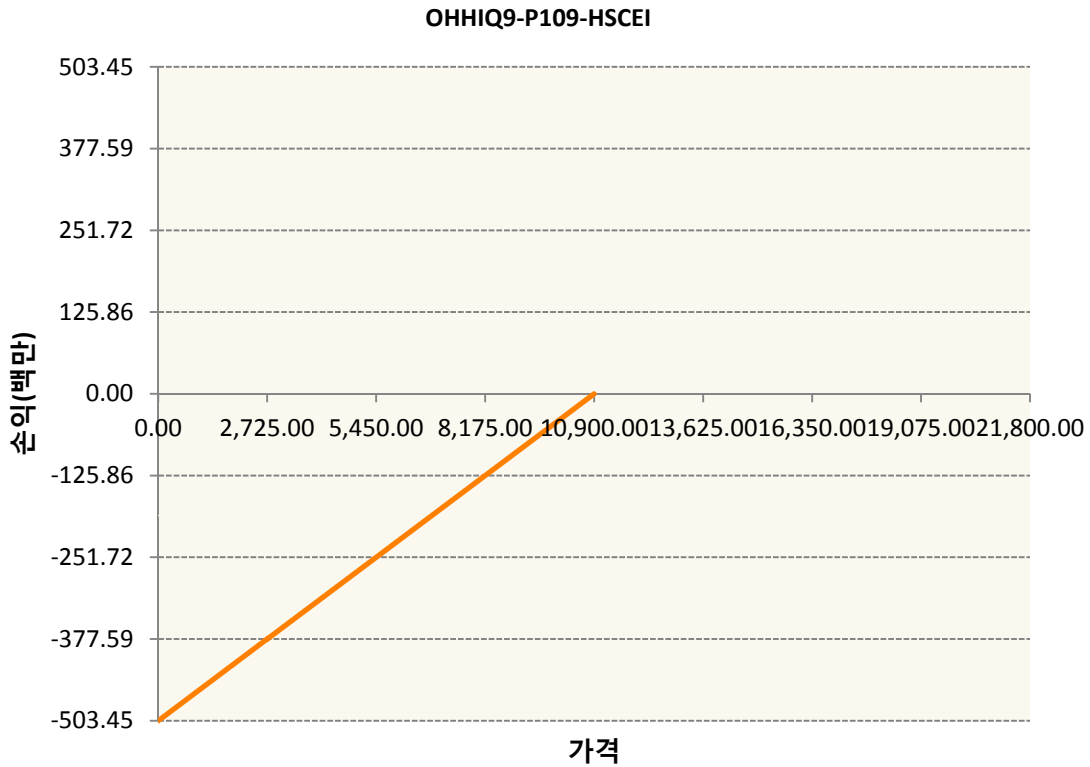


OHHIQ9-C109-HSCEI



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
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	229
HCQ9 HSCEI Futures Aug19	146
OHHIQ9-C1(HSCEI	173
OHHIQ9-C1(HSCEI	40
OHHIQ9-P1(HSCEI	173
OHHIQ9-P1(HSCEI	40

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

공시일	2019-08-23
기준일	2019-08-22

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

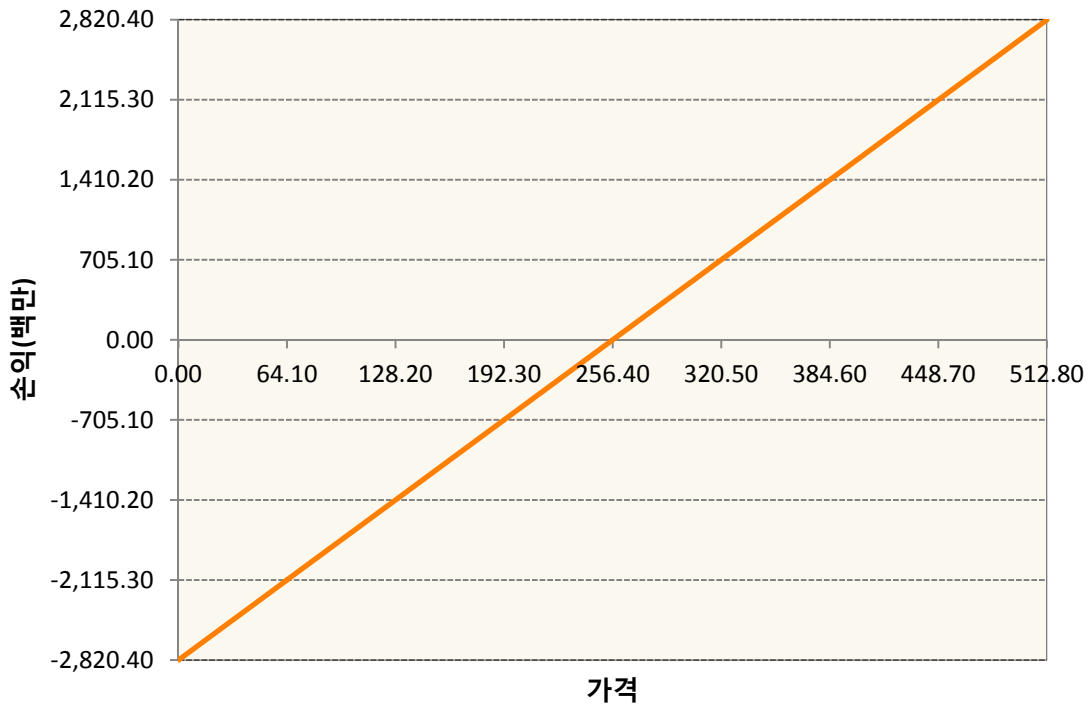
1. 계약금액

(단위:백만원)

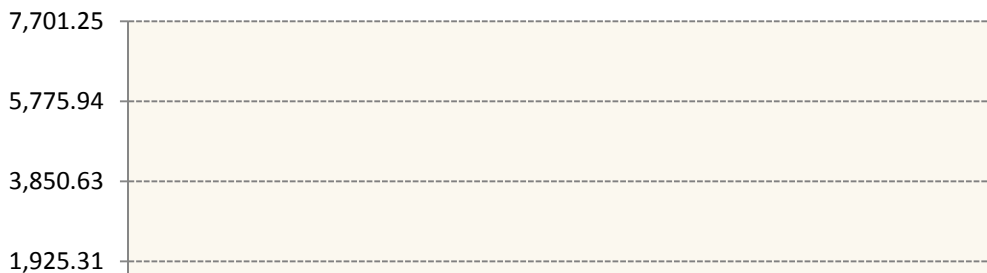
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	63	0	63	장내
누계	유가증권	선물	2,820	0	2,820	장내
누계	유가증권	스왑	14,125	0	14,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,829	-14,829	장내

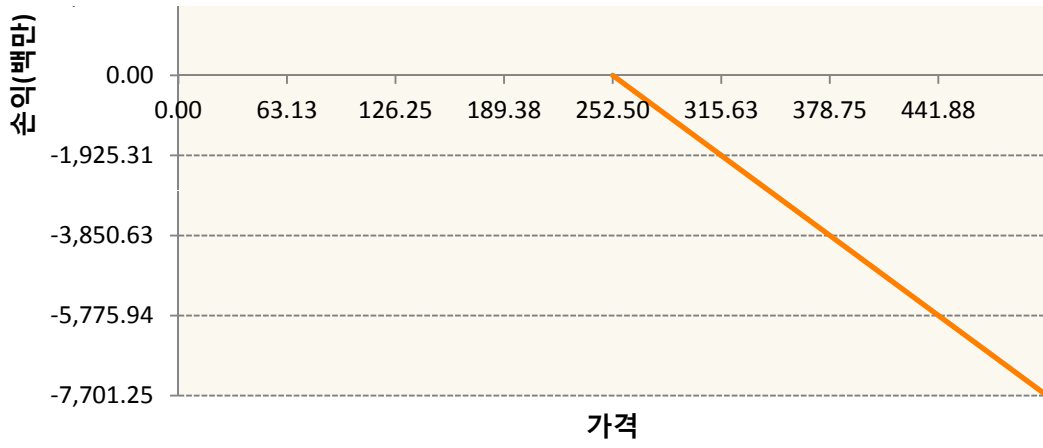
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

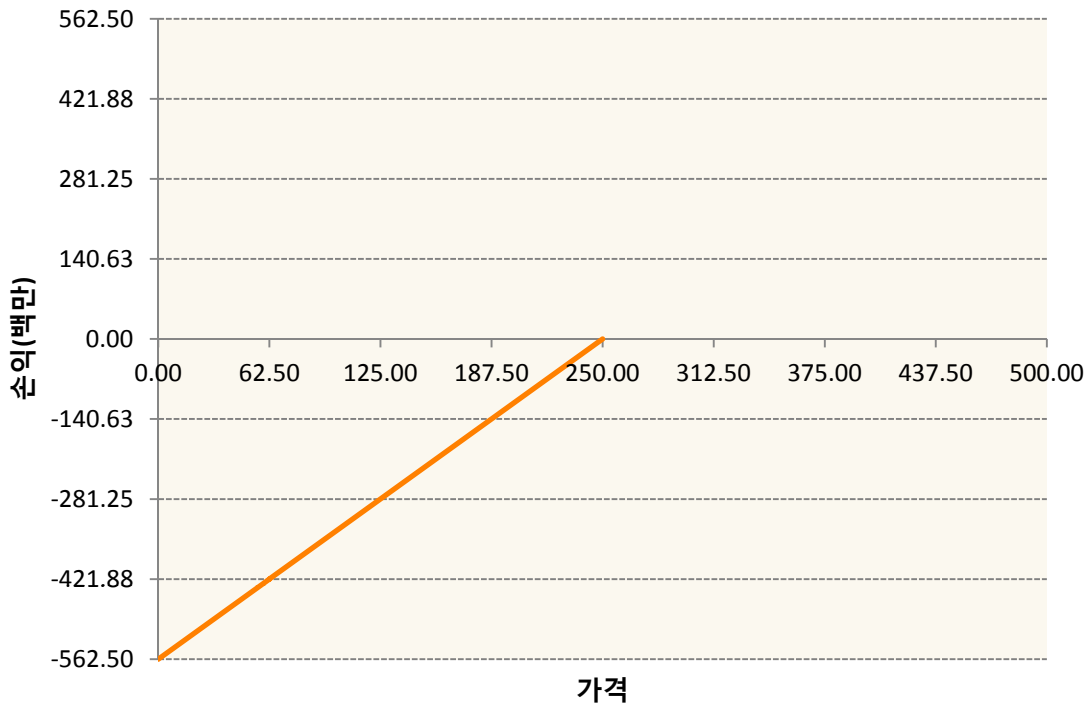


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

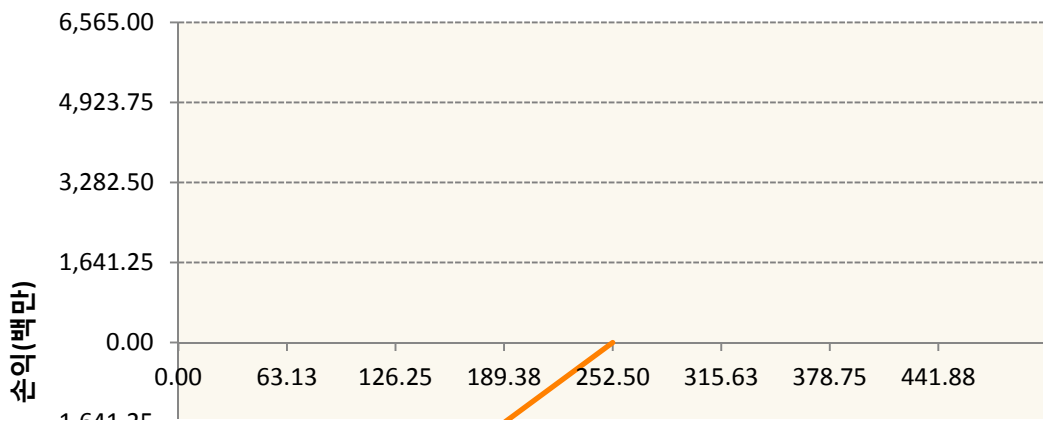




KR4301P92508-2019-09 풋250



KR4301P92524-2019-09 풋252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						1,221
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,221	-1,221	-1,221	-1,221	-1,221	-1,221	-1,221	
-5.33%	-814	-814	-814	-814	-814	-814	-814	
-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%	814	814	814	814	814	814	814	
8.00%	1,221	1,221	1,221	1,221	1,221	1,221	1,221	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						226
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-226	-226	-226	-226	-226	-226	-226	
-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%	226	226	226	226	226	226	226	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5						524
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	231	227	221	214	207	199	190	
-5.33%	208	198	188	177	165	153	141	
-2.67%	150	136	122	107	93	79	64	
0%	43	29	14	0	-15	-29	-44	
2.67%	-111	-121	-132	-144	-156	-168	-181	
5.33%	-296	-302	-308	-316	-324	-333	-343	
8.00%	-497	-499	-502	-506	-511	-517	-524	
KR4301P92508		2019-09 풋250						30
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-29	-29	-30	-30	-30	-30	-30
-5.33%	-15	-15	-16	-16	-17	-17	-18
-2.67%	-4	-5	-5	-6	-7	-7	-8
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	3	3	3	2	2	2	1
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3
KR4301P92524 2019-09 풋252.5							391
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-384	-384	-385	-386	-387	-389	-391
-5.33%	-211	-214	-217	-221	-225	-230	-235
-2.67%	-65	-72	-79	-86	-94	-101	-109
0%	21	14	7	0	-7	-15	-22
2.67%	50	47	44	40	35	30	25
5.33%	55	55	54	53	51	49	46
8.00%	56	56	56	55	55	54	53

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

(단위:백만원)

2,378

공시일	2019-08-23
기준일	2019-08-22

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

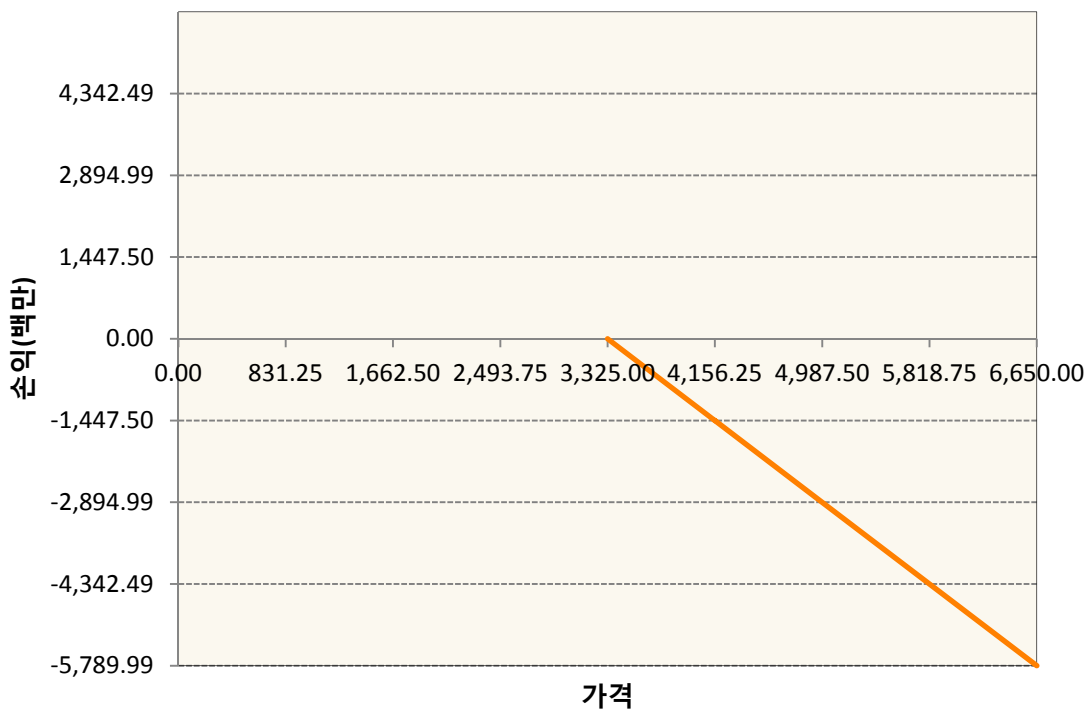
1. 계약금액

(단위:백만원)

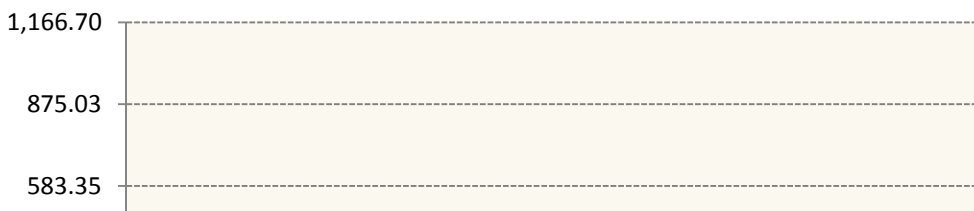
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,258	0	4,258	
누계	유가증권	옵션	0	13,913	-13,913	장내
누계	지수	스왑	28,319	0	28,319	장외
누계	통화	선도	14,466	22,771	-8,305	장외

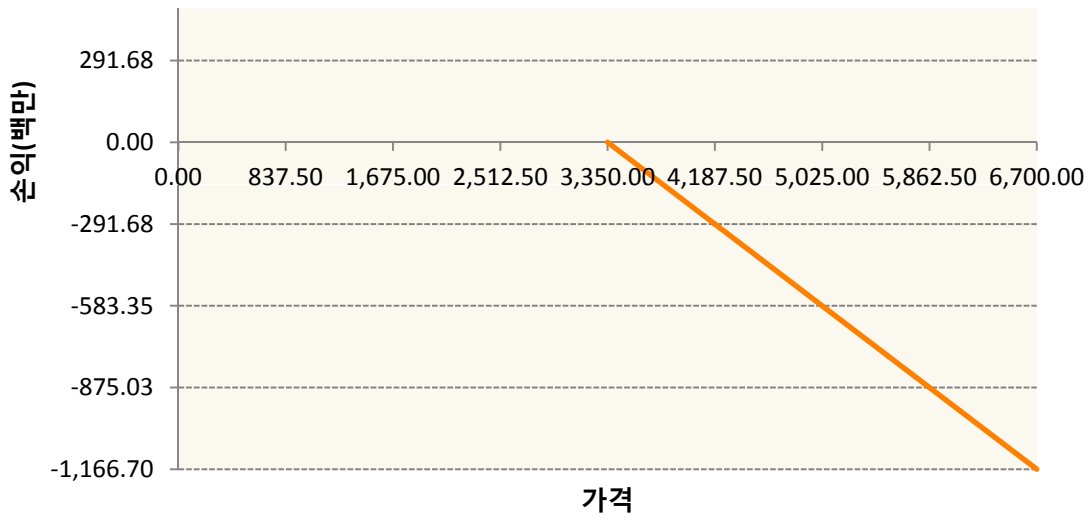
2. 만기시점의 손익구조

OESXU9-C3325-EURO STOXX 50

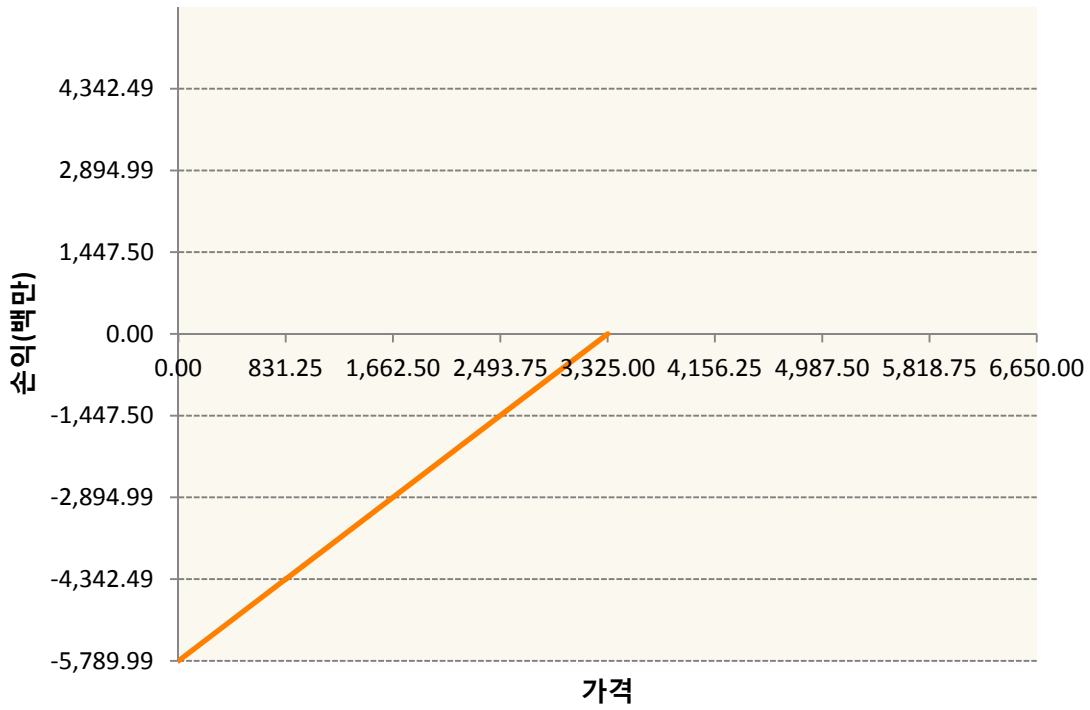


OESXU9-C3350-EURO STOXX 50

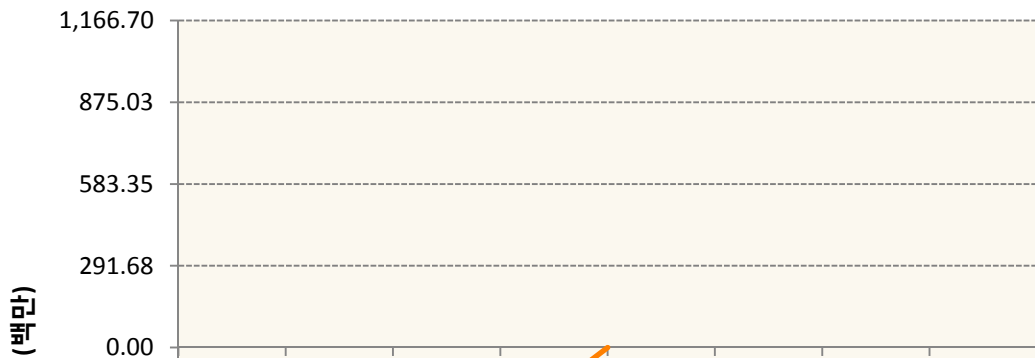


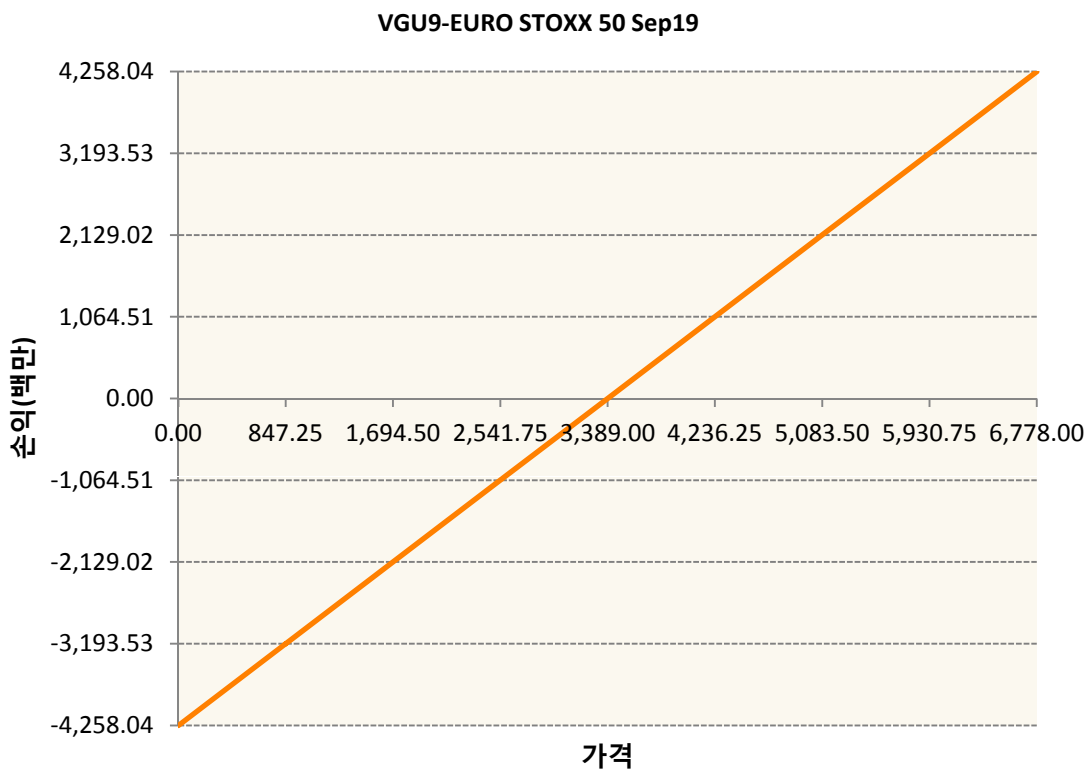
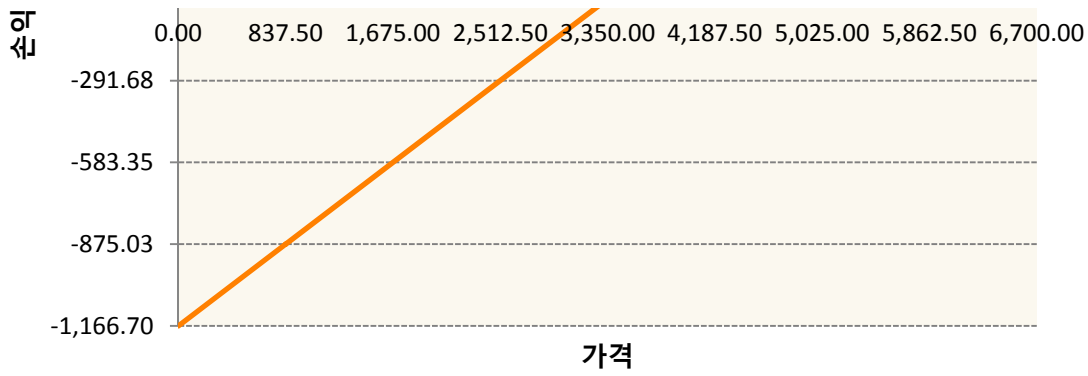


OESXU9-P3325-EURO STOXX 50



OESXU9-P3350-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	44
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	429
FX21019M04 KRW/EUR 27-09-19E	1,072
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	321
FX21019N01 EUR/KRW 23-08-19E	429
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
341

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

(단위:백만원)

2,463

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

(단위:백만원)

927

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

(단위:백만원)

78

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

(단위:백만원)

122

공시일	2019-08-23
기준일	2019-08-22

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

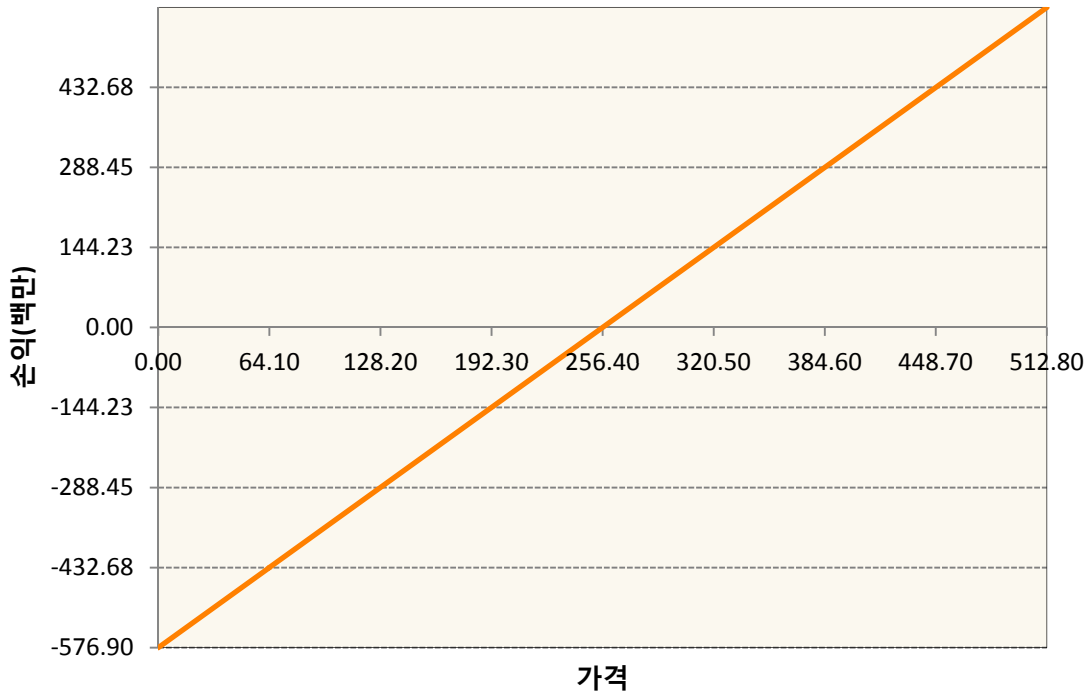
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	577	0	577	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	2019-08-23
기준일	2019-08-22

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

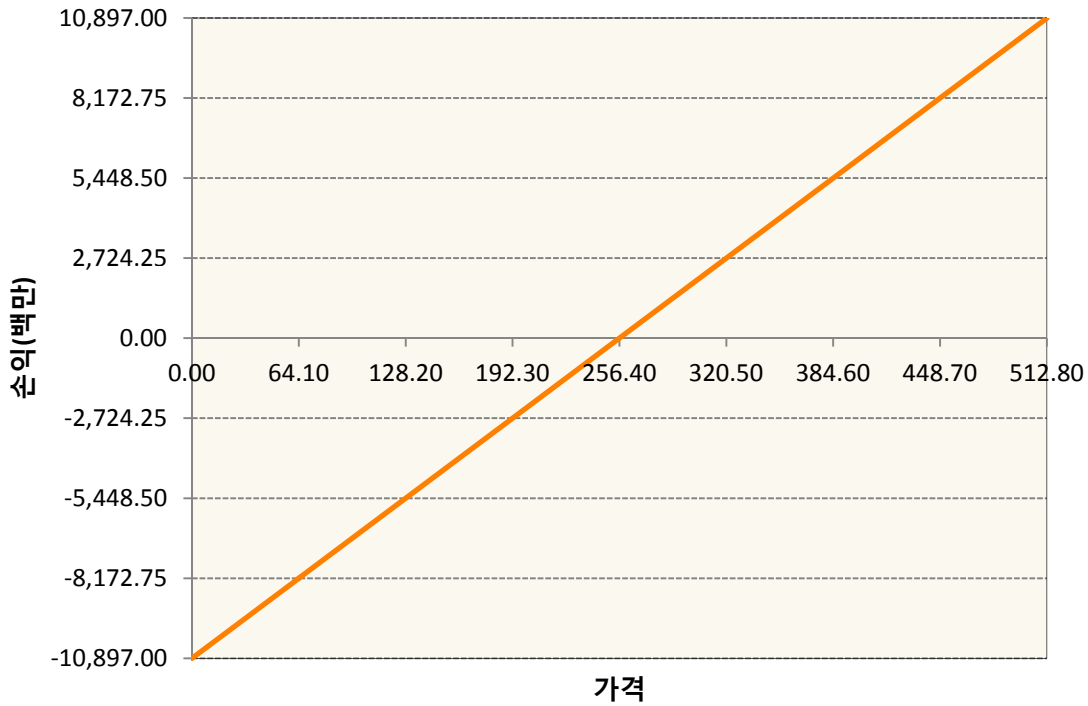
1. 계약금액

(단위:백만원)

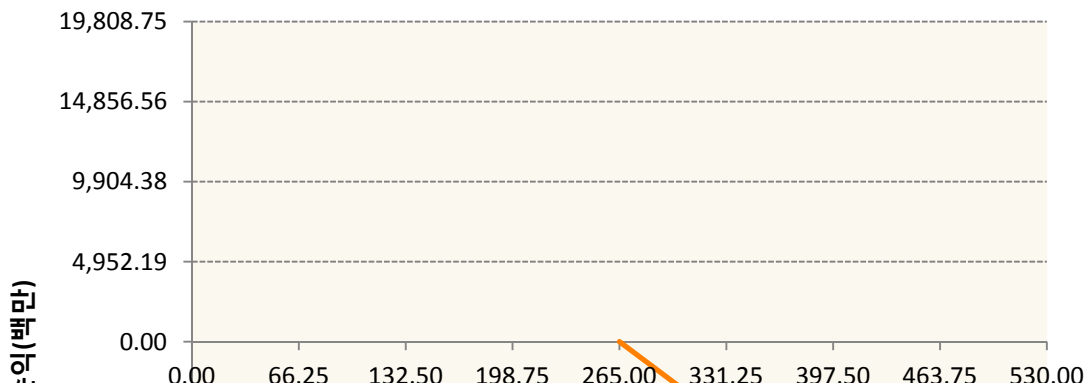
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,897	0	10,897	장내
누계	유가증권	옵션	3,659	19,943	-16,283	장내

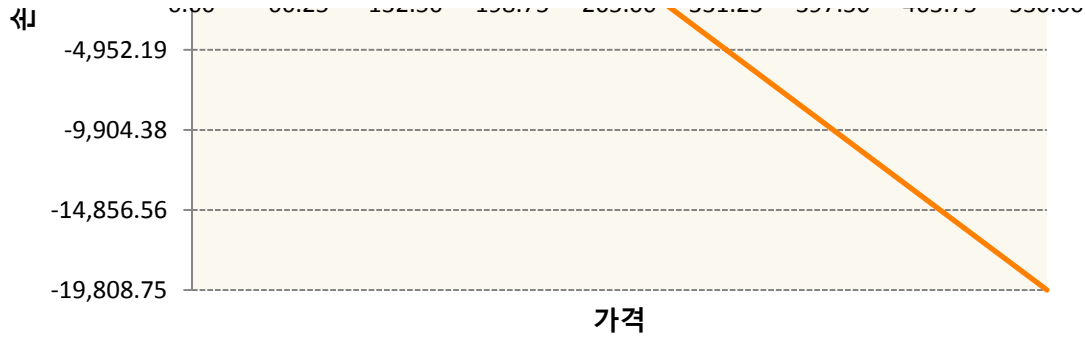
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

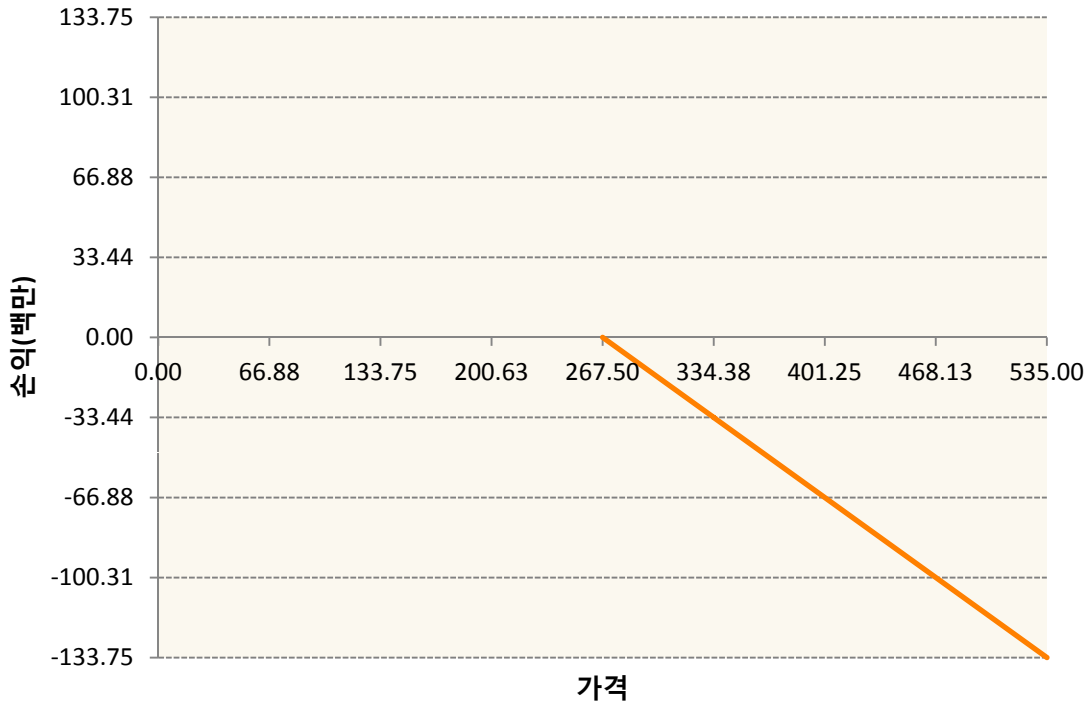


KR4201P92658-2019-09 콜265

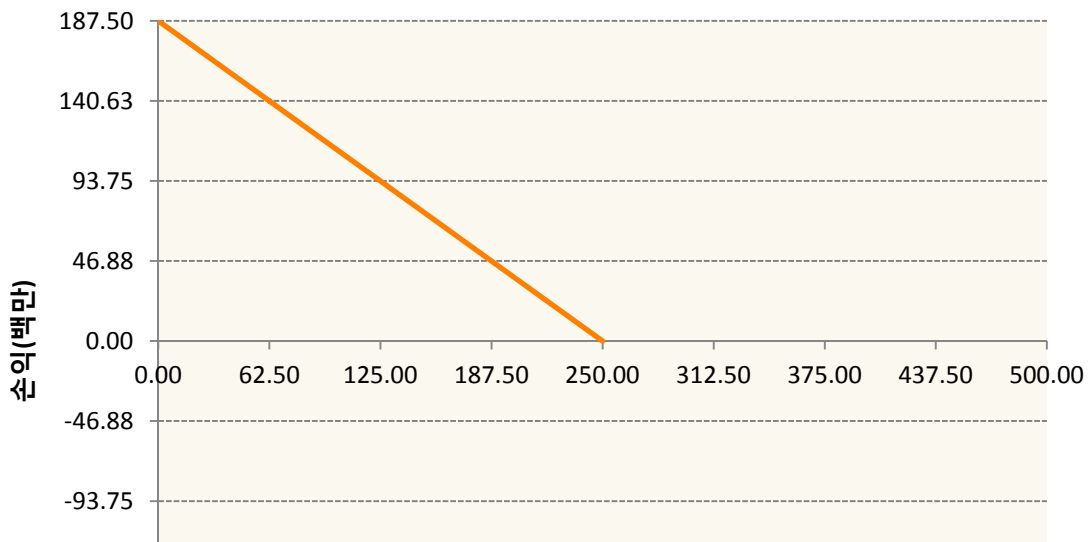


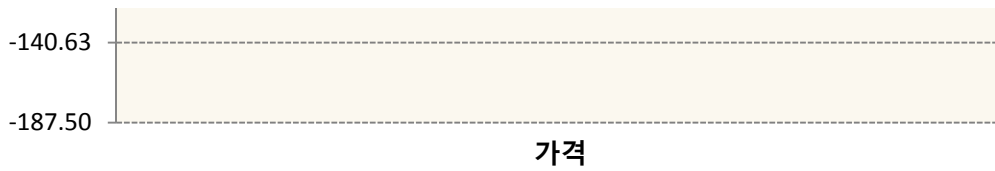


KR4201P92674-2019-09 콜267.5

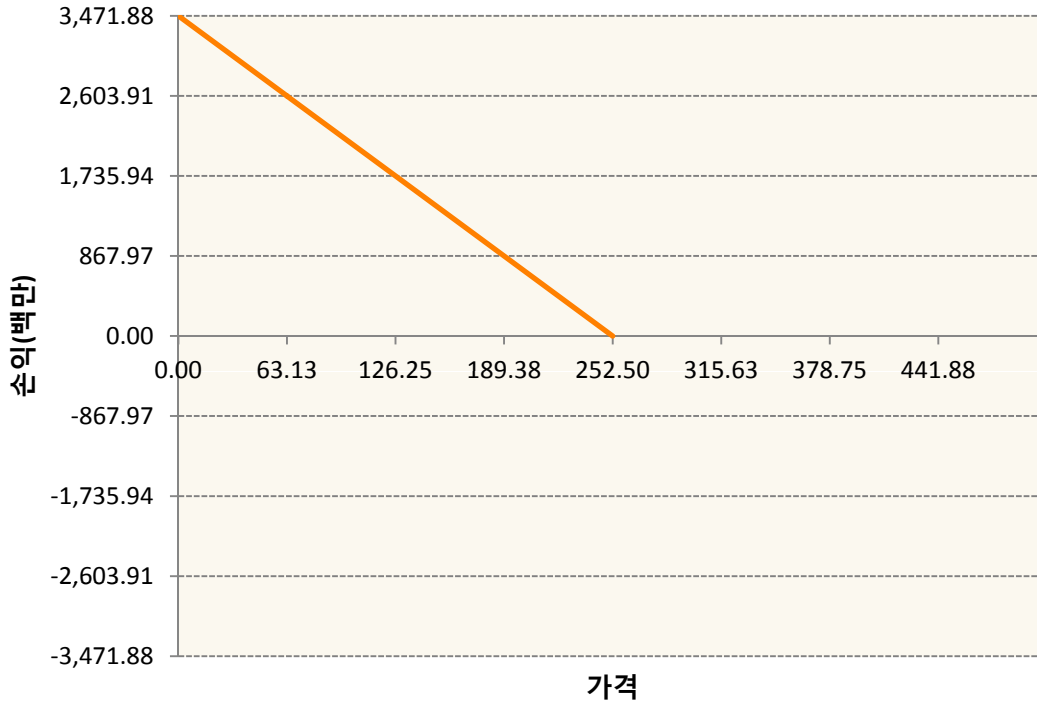


KR4301P92508-2019-09 풋250





KR4301P92524-2019-09 풋252.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						871
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-871	-871	-871	-871	-871	-871	-871	
-5.33%	-581	-581	-581	-581	-581	-581	-581	
-2.67%	-290	-290	-290	-290	-290	-290	-290	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	290	290	290	290	290	290	290	
5.33%	581	581	581	581	581	581	581	
8.00%	871	871	871	871	871	871	871	
KR4201P92658		2019-09 콜265						922
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	192	190	188	184	179	172	163	
-5.33%	186	181	173	163	151	137	120	
-2.67%	163	148	130	110	88	64	39	

0%	89	61	31	0	-32	-64	-98
2.67%	-76	-114	-151	-189	-226	-264	-302
5.33%	-359	-394	-430	-467	-504	-541	-578
8.00%	-747	-772	-799	-828	-858	-890	-922
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	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	-5	-5	-5	-5	-6
KR4301P92508 2019-09 풋250							10
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10	10	10	10	10	10	10
-5.33%	5	5	5	5	6	6	6
-2.67%	1	2	2	2	2	2	3
0%	-1	0	0	0	0	0	1
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	0
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
KR4301P92524 2019-09 풋252.5							207
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	203	203	204	204	205	206	207
-5.33%	112	113	115	117	119	122	124
-2.67%	34	38	42	46	50	53	57
0%	-11	-8	-4	0	4	8	12
2.67%	-27	-25	-23	-21	-19	-16	-13
5.33%	-29	-29	-28	-28	-27	-26	-24
8.00%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-28

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

(단위:백만원)

1,655

공시일	2019-08-23
기준일	2019-08-22

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,019	0	3,019	
누계	유가증권	수익증권	62,744	0	62,744	

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	2019-08-23
기준일	2019-08-22

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,415	0	2,415	
누계	유가증권	수익증권	83,216	0	83,216	

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	2019-08-23
기준일	2019-08-22

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	468,197	0	468,197	
누계	통화	선도	0	513,266	-513,266	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		1,739
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,125
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		135
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		773
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,932
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,932
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		676
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		2,705
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		1,352
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		3,188
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		2,164
FX21019Q01 KRW/USD 16-09-19E		97
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,960
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,574
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,647

FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E	3,004
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E	966
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E	966
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E	966
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E	1,739

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

(단위:백만원)

13,356

공시일	2019-08-23
기준일	2019-08-22

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

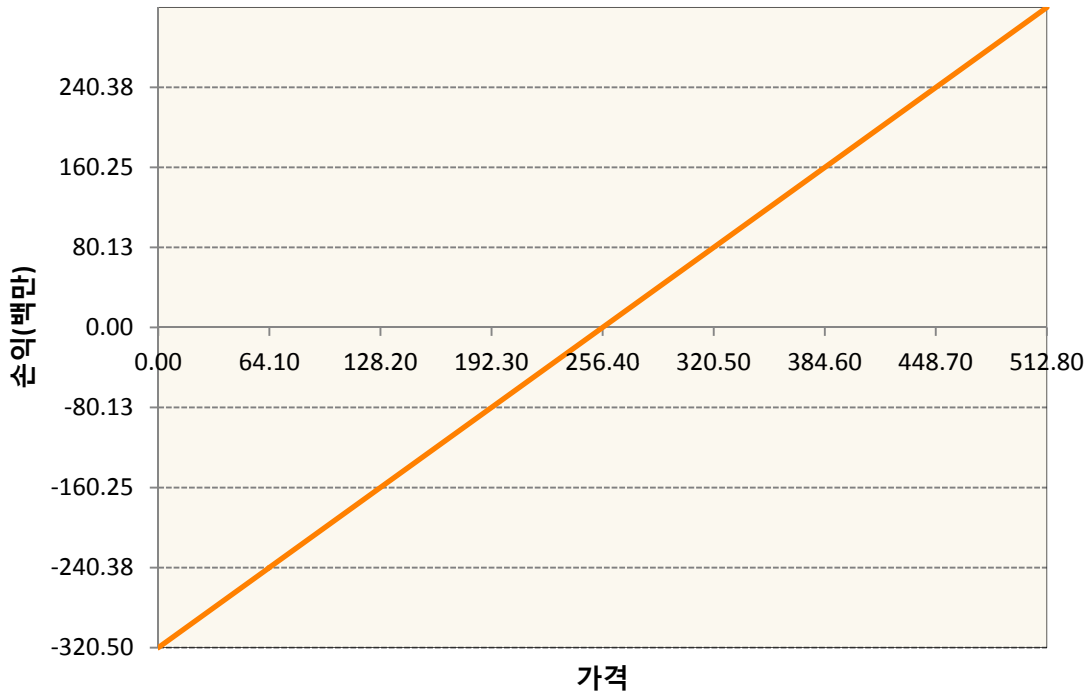
1. 계약금액

(단위:백만원)

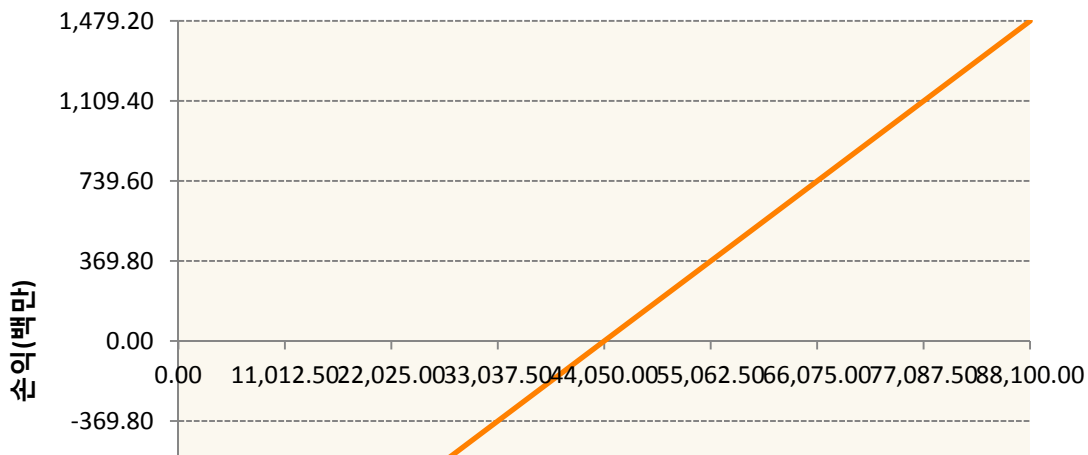
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,800	0	1,800	장내

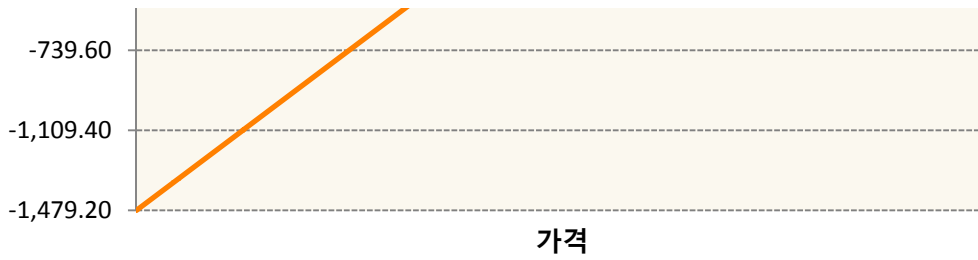
2. 만기시점의 손익구조

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						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)

172

공시일	2019-08-23
기준일	2019-08-22

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

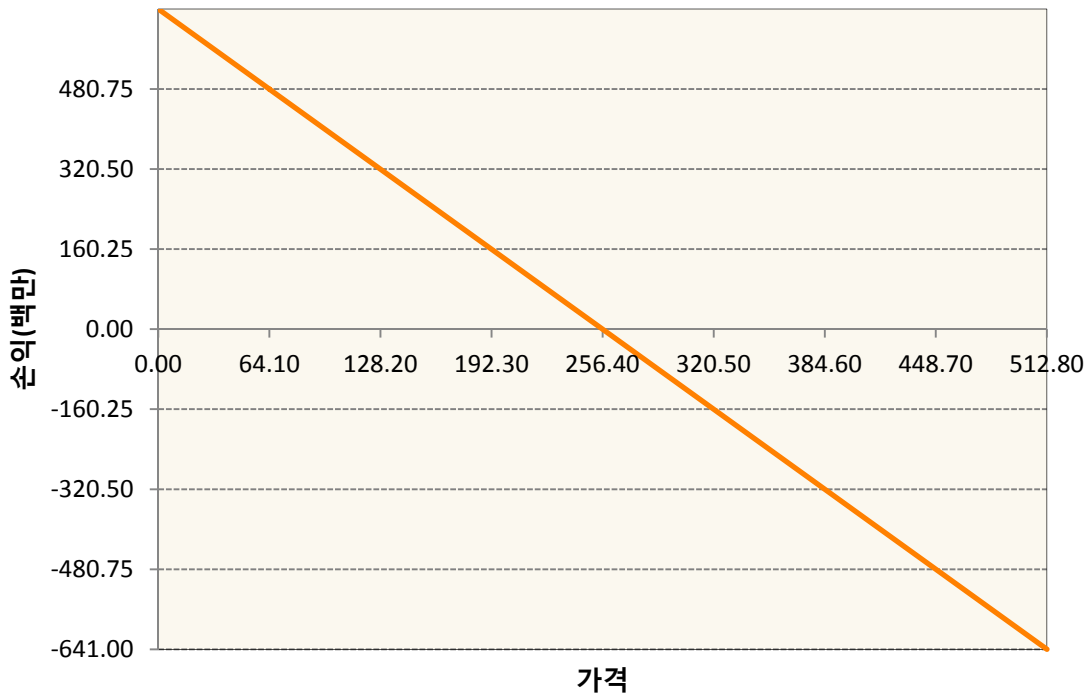
1. 계약금액

(단위:백만원)

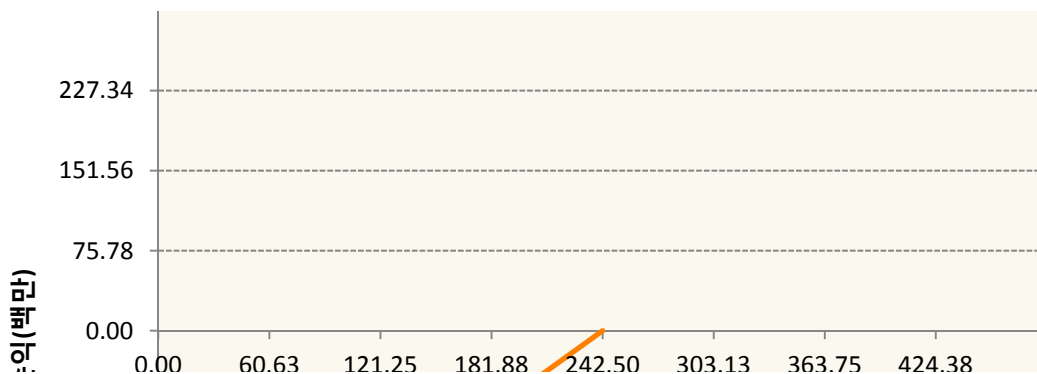
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	641	-641	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,672	-3,672	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

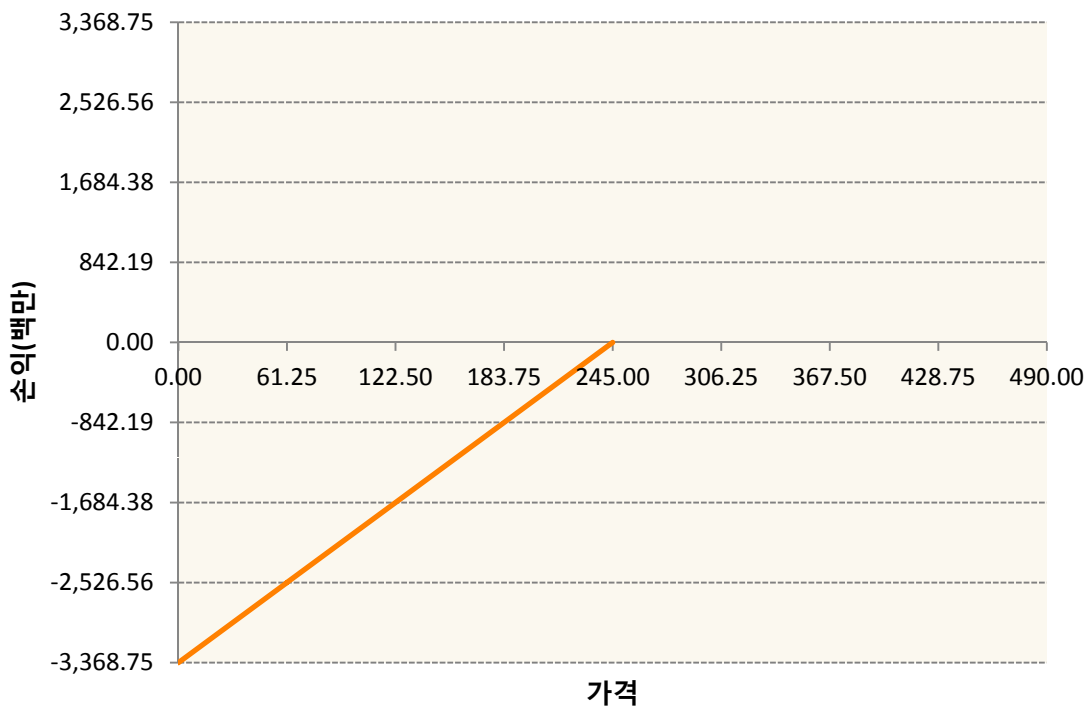


KR4301P92425-2019-09 풋242.5





KR4301P92458-2019-09 풋245



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						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	-10	-10	-10	-10
-5.33%	-3	-3	-4	-4	-4	-5	-5
-2.67%	0	-1	-1	-1	-1	-2	-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

139

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-126	-127	-129	-131	-133	-136	-139
-5.33%	-50	-54	-58	-61	-65	-69	-73
-2.67%	-8	-11	-15	-19	-22	-26	-30
0%	5	3	2	0	-2	-4	-7
2.67%	6	6	6	5	5	4	3
5.33%	7	7	7	6	6	6	6
8.00%	7	7	7	7	7	7	6

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

(단위:백만원)

146

공시일	2019-08-23
기준일	2019-08-22

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	19,646	0	19,646	
누계	통화	선도	0	23,303	-23,303	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		328
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
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		328

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

(단위:백만원)

606

공시일	2019-08-23
기준일	2019-08-22

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	2019-08-23
기준일	2019-08-22

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

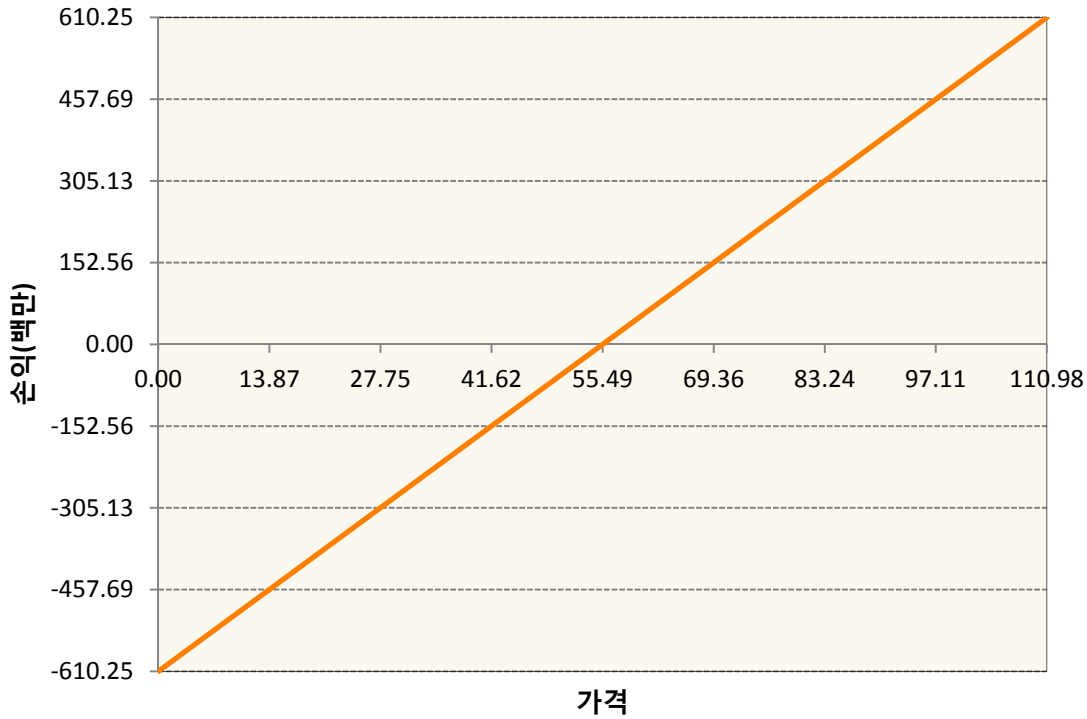
1. 계약금액

(단위:백만원)

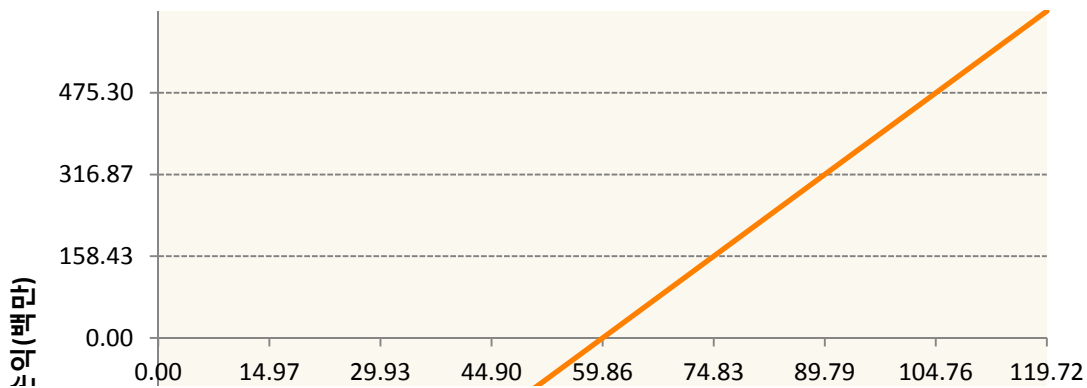
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,237	121	2,116	
누계	유가증권	선물	192	0	192	장내

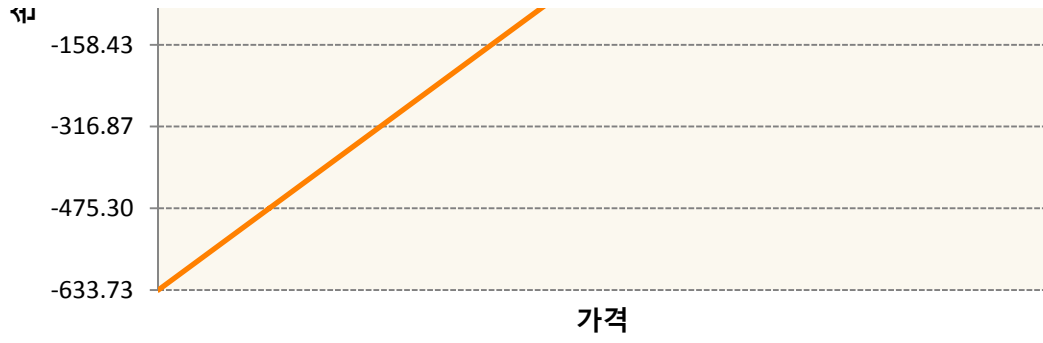
2. 만기시점의 손익구조

CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19

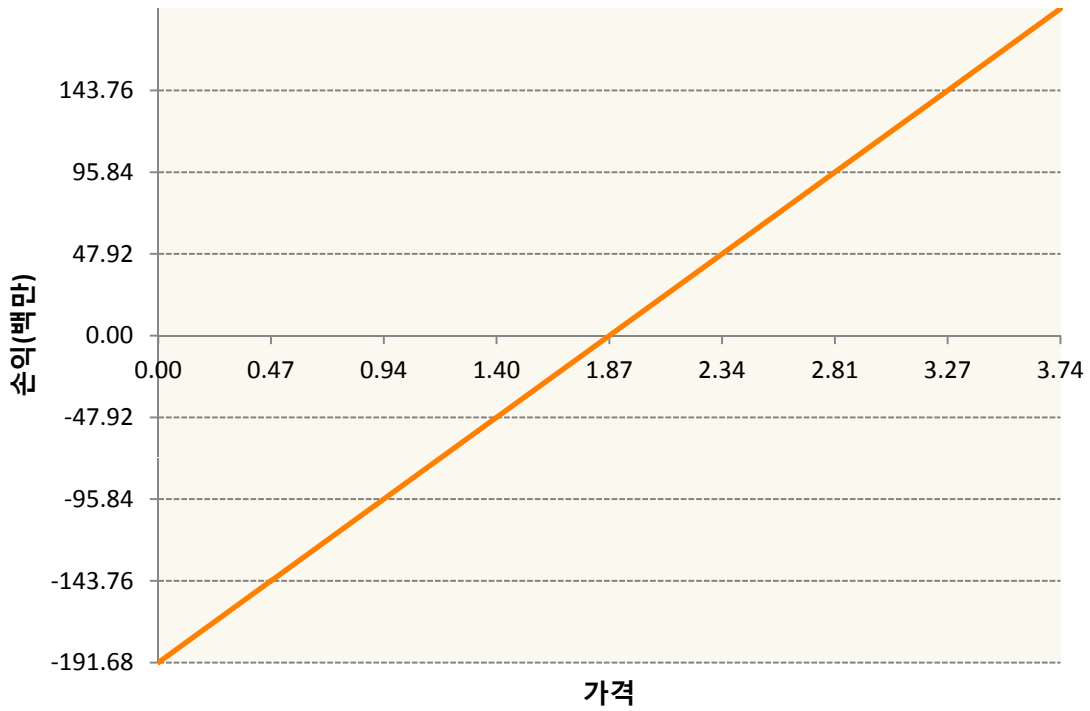


COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19

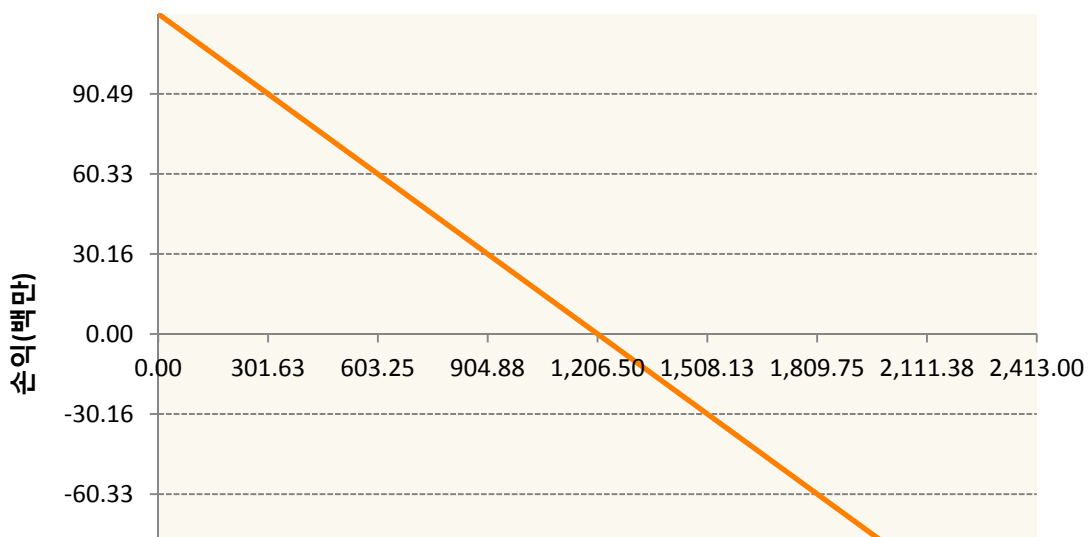


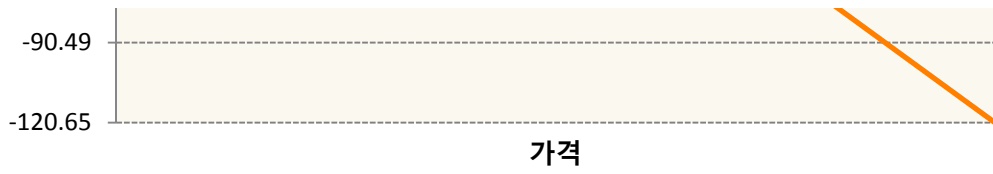


HOX9-Heating Oil

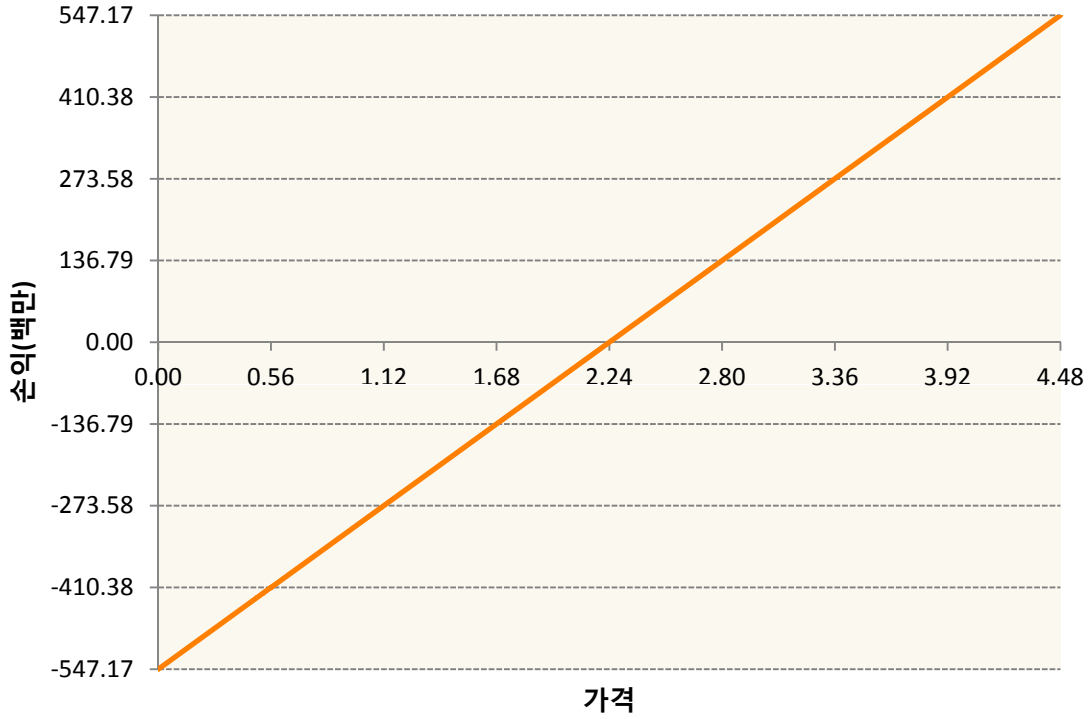


KR4175P90005-2019-09 달러선물

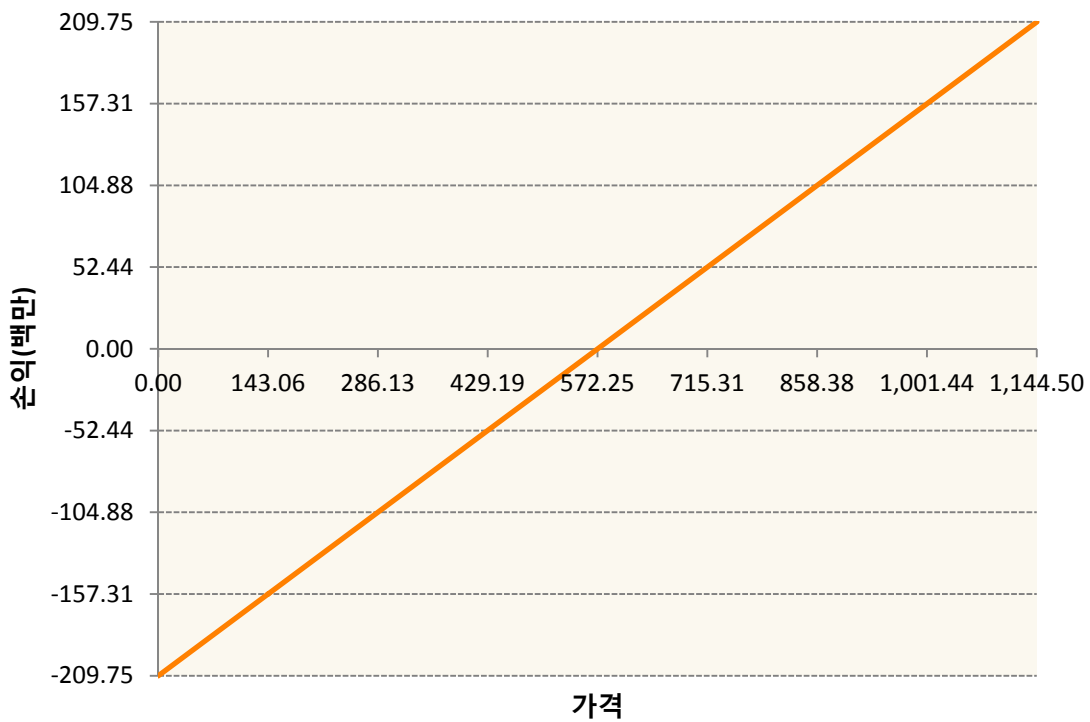




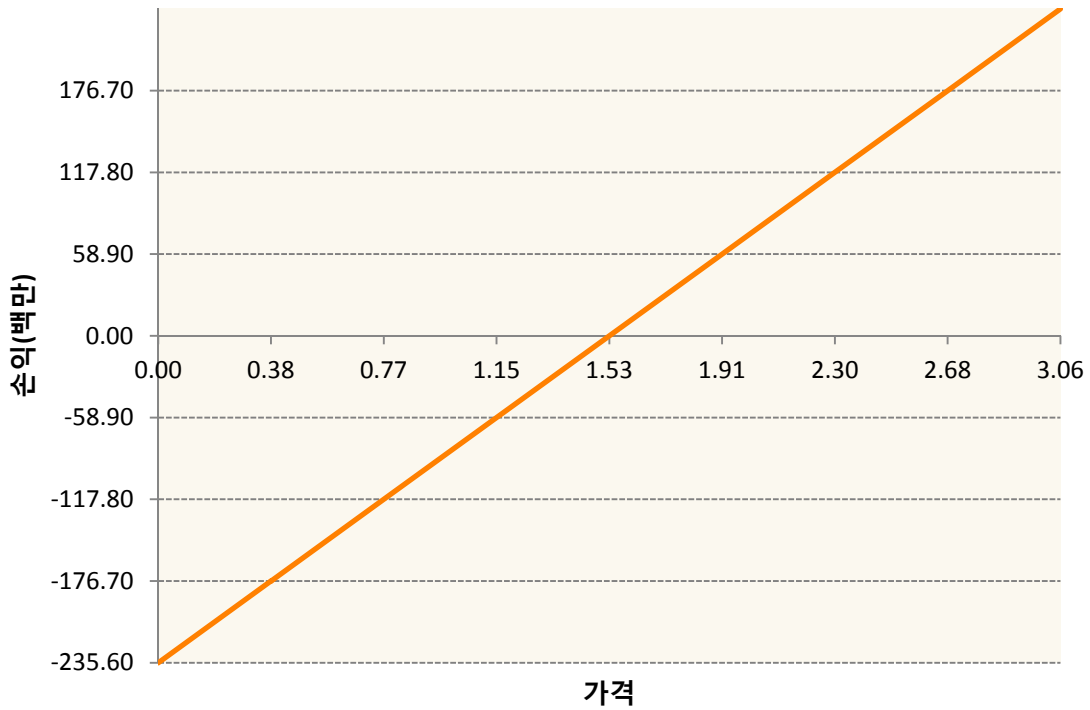
NGX19-NATURAL GAS FUTR Nov19



QSX9-Low Su Gasoil G Nov19



XBX9-GASOLINE RBOB FUT Nov19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLX9	WTI CRUDE FUTURE Nov19	49
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	51
HOX9	Heating Oil	15
KR4175P900	2019-09 달러선물	10
NGX19	NATURAL GAS FUTR Nov19	44
QSX9	Low Su Gasoil G Nov19	17
XBX9	GASOLINE RBOB FUT Nov19	19

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

372

공시일	2019-08-23
기준일	2019-08-22

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

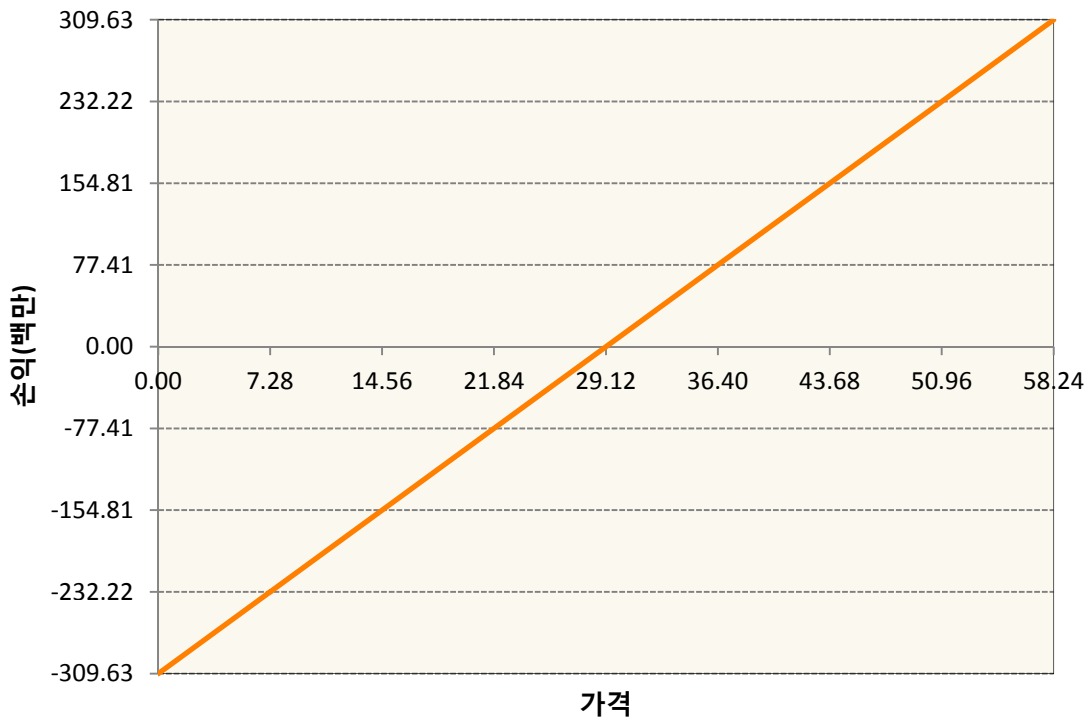
1. 계약금액

(단위:백만원)

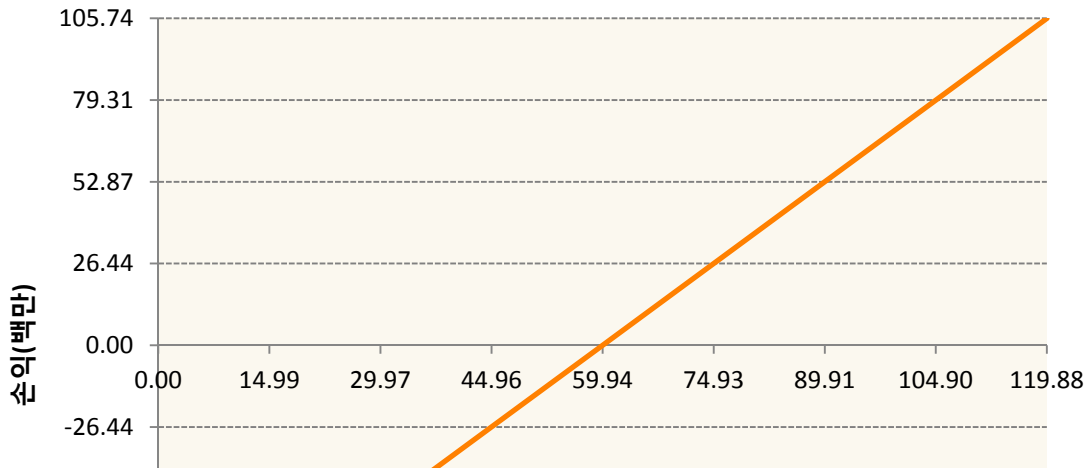
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,741	157	2,584	

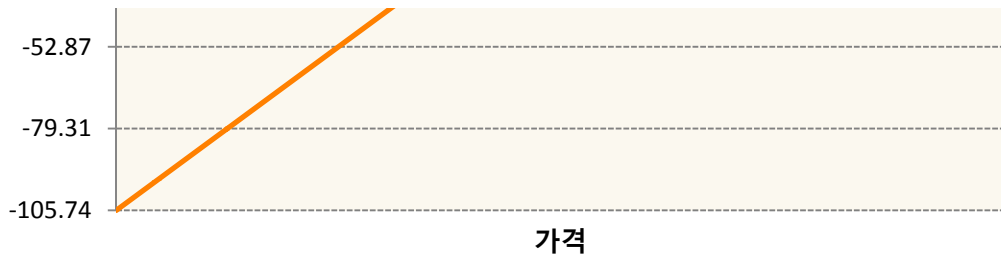
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

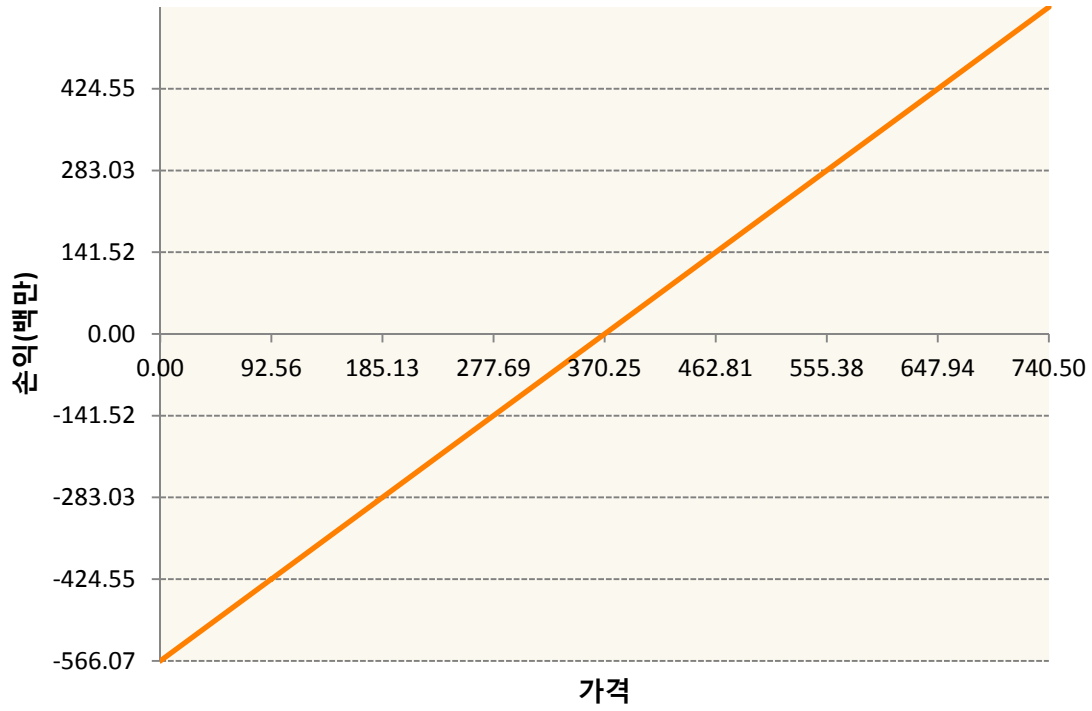


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

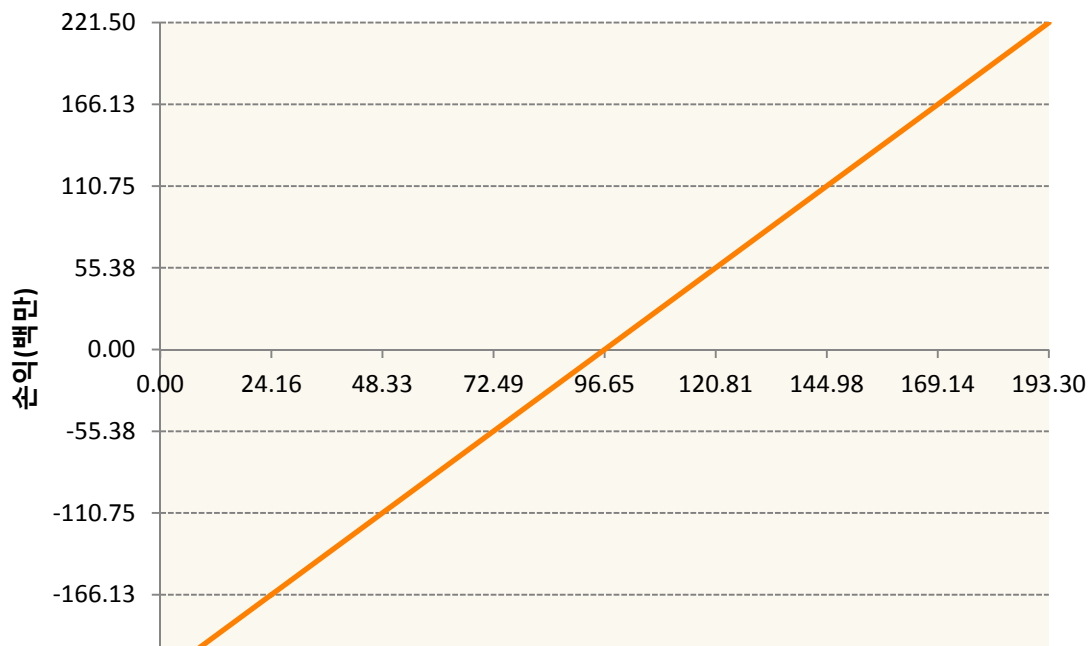


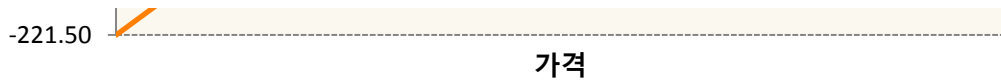


CZ9-CORN FUTURE Dec19

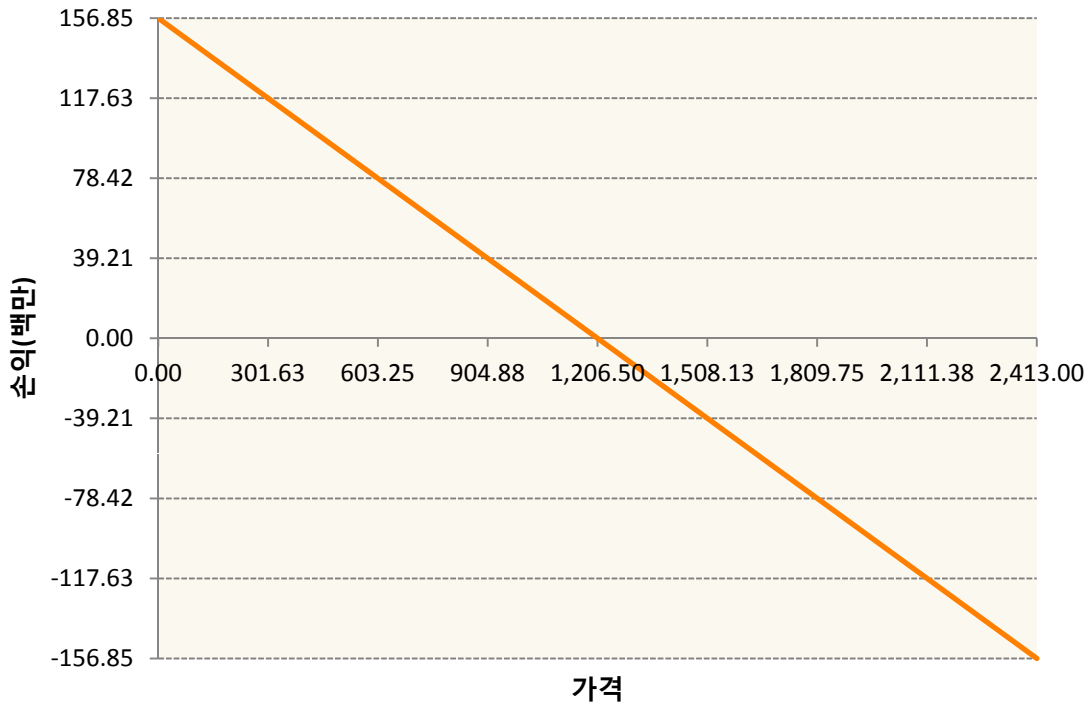


KCZ9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19

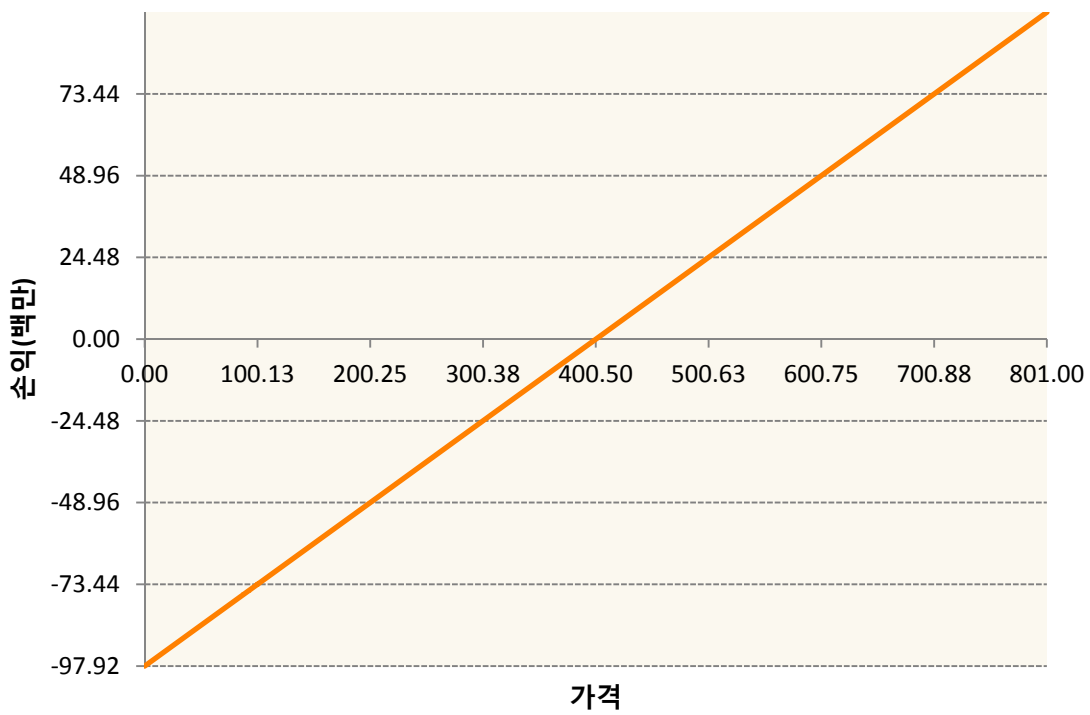




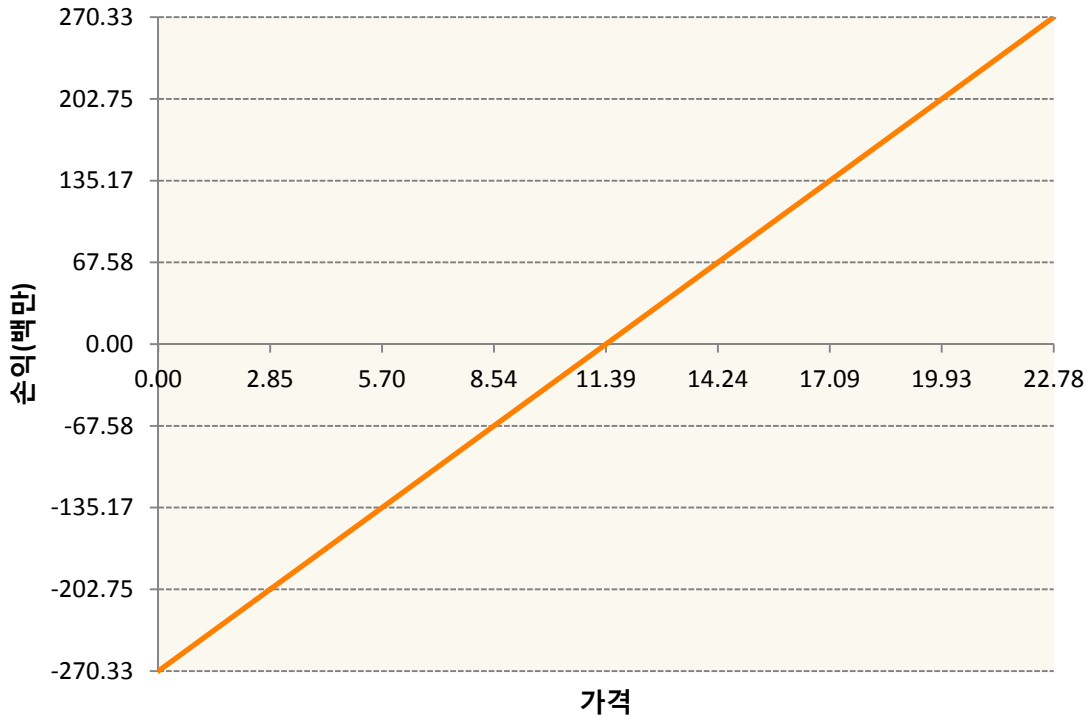
KR4175P90005-2019-09 달러선물



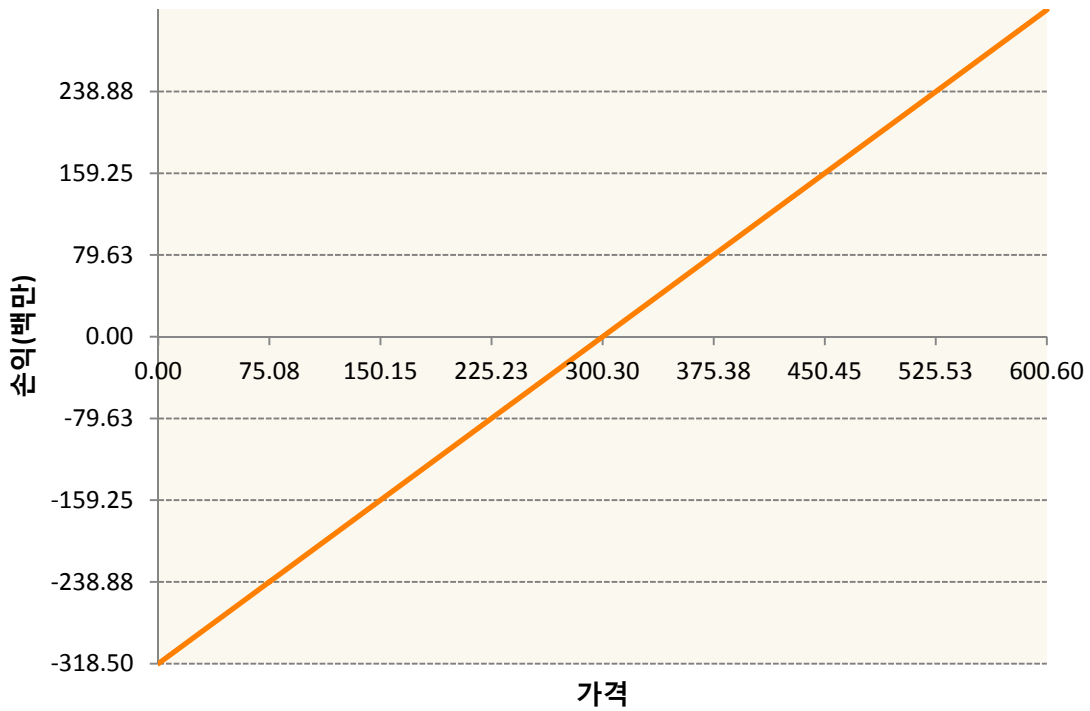
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



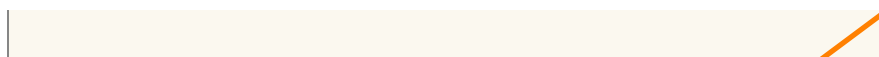
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

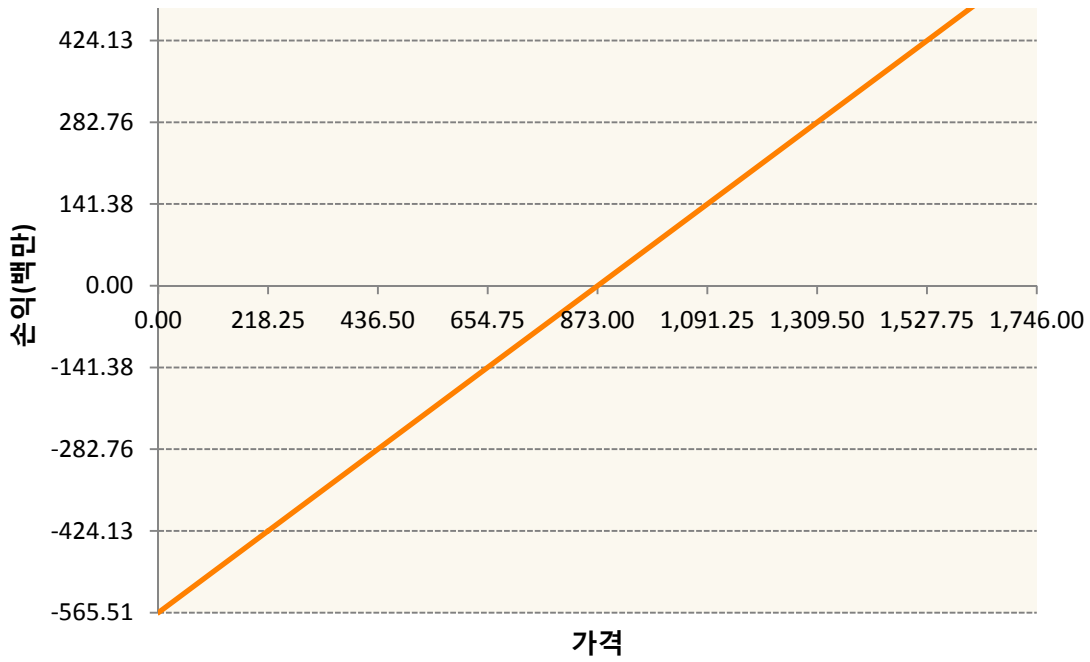


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

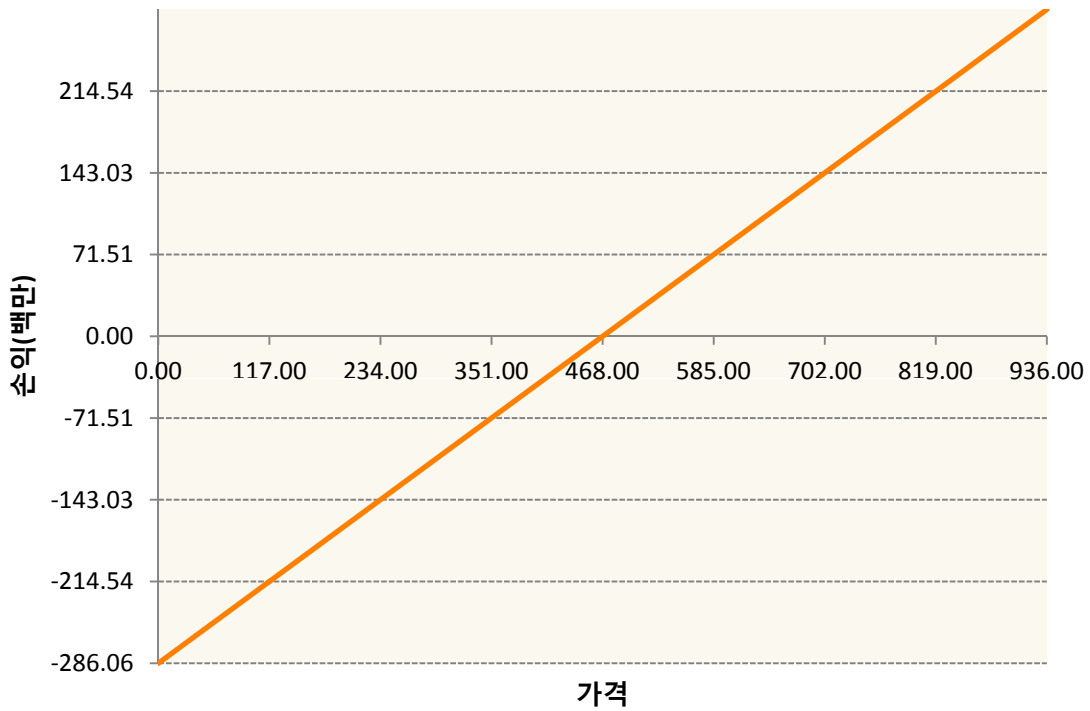


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





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	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)

243