

공시일	2019-08-26
기준일	2019-08-23

## 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	2019-08-26
기준일	2019-08-23

## 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	14,341	0	14,341	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0( 신한MXWO 미래S190822

1,145

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

652

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-26
기준일	2019-08-23

## 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)

<b>814</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-26
기준일	2019-08-23

## 유로인덱스모(주식-파생형)

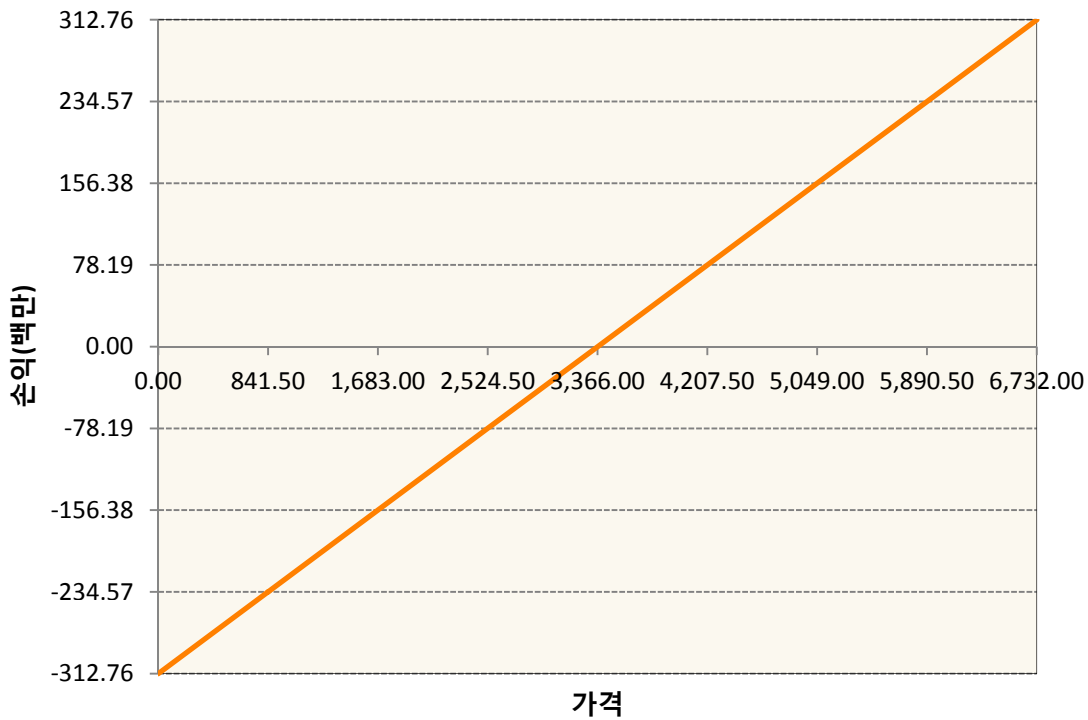
### 1. 계약금액

(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	2019-08-26
기준일	2019-08-23

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

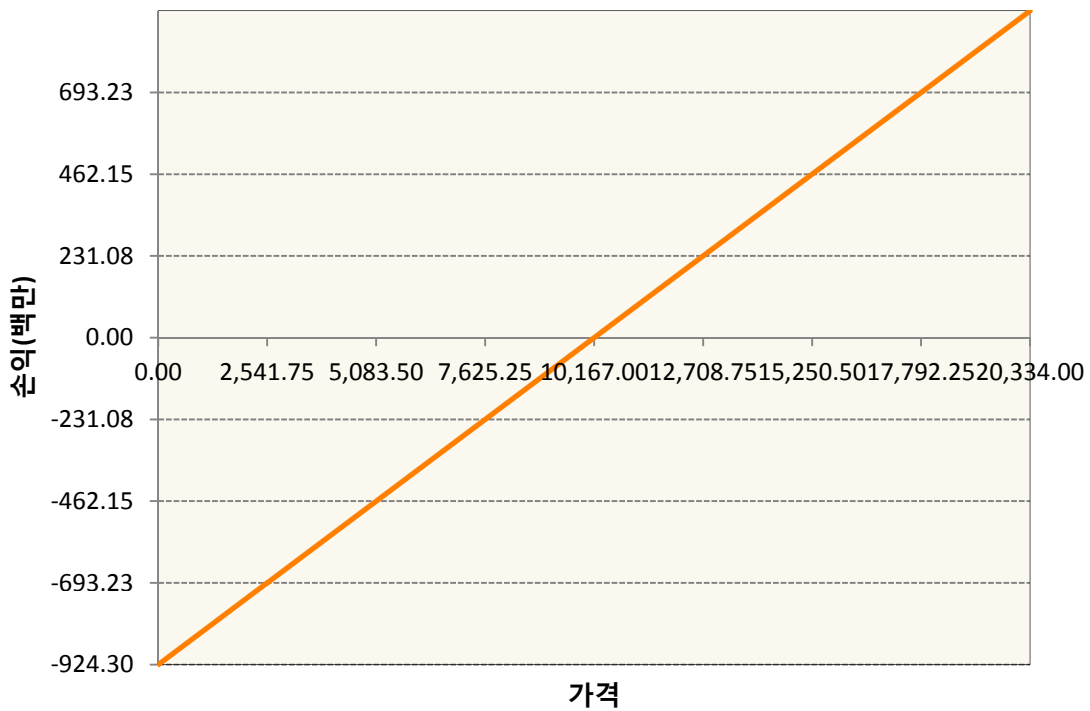
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

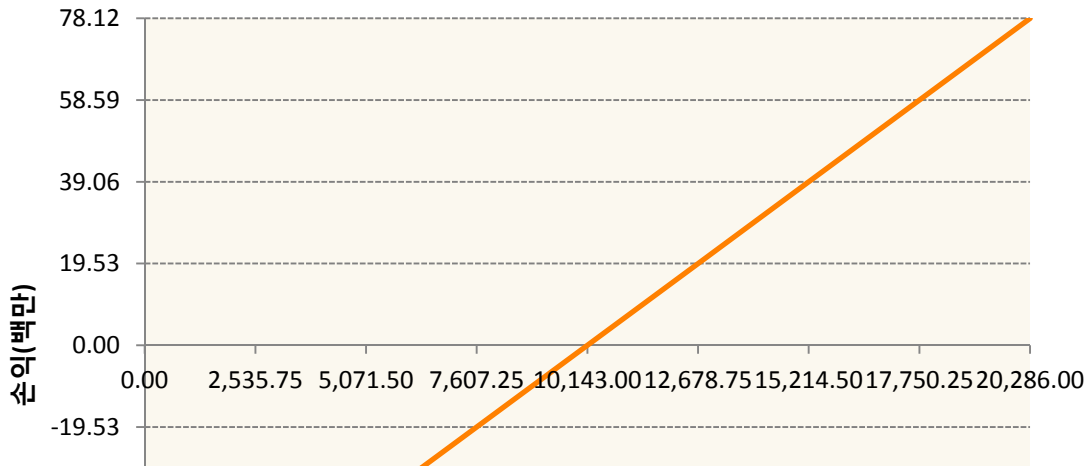
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,002	0	1,002	장내

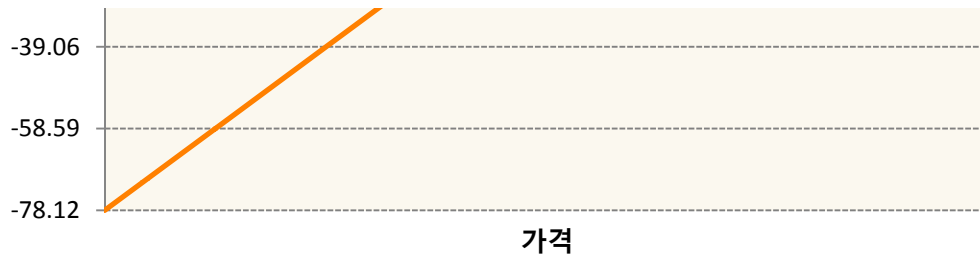
### 2. 만기시점의 손익구조

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	2019-08-26
기준일	2019-08-23

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

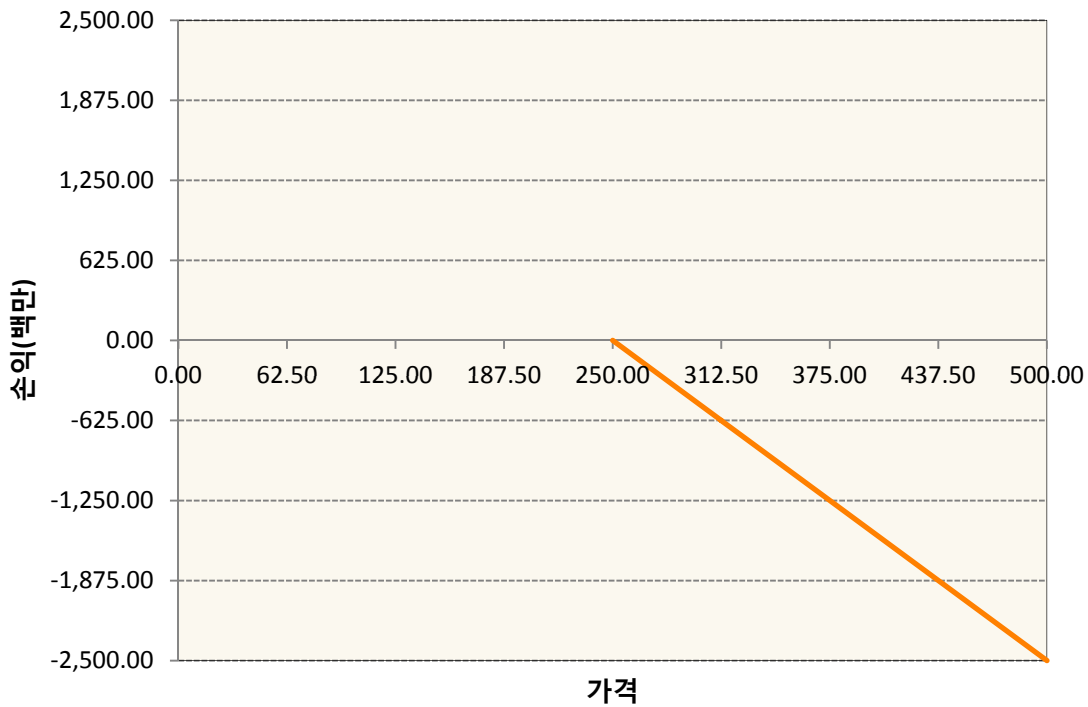
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

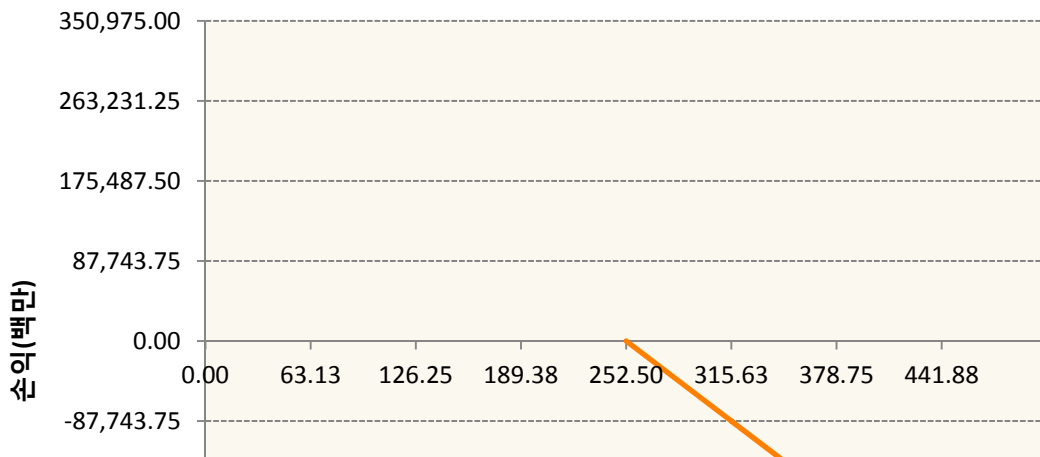
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	520,569	-520,569	장내

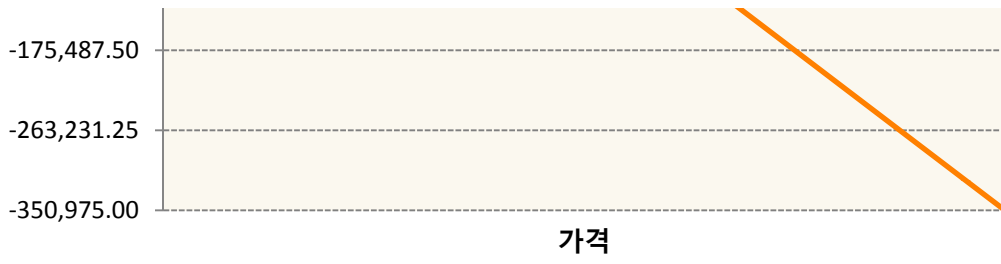
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P92500-2019-09 콜250

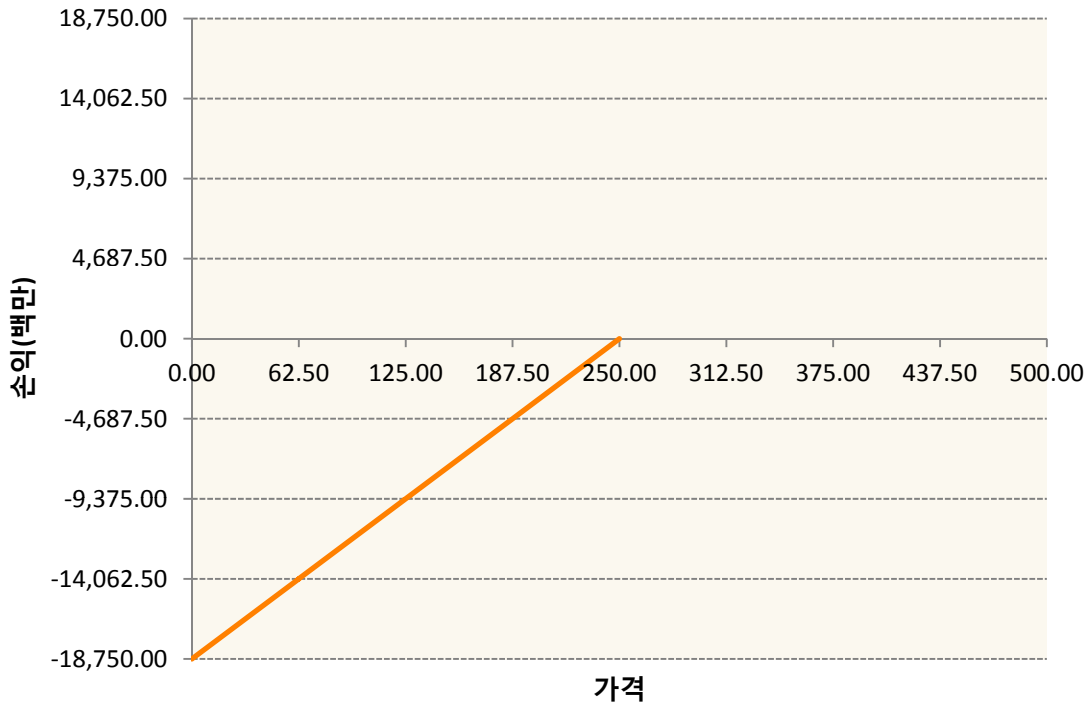


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

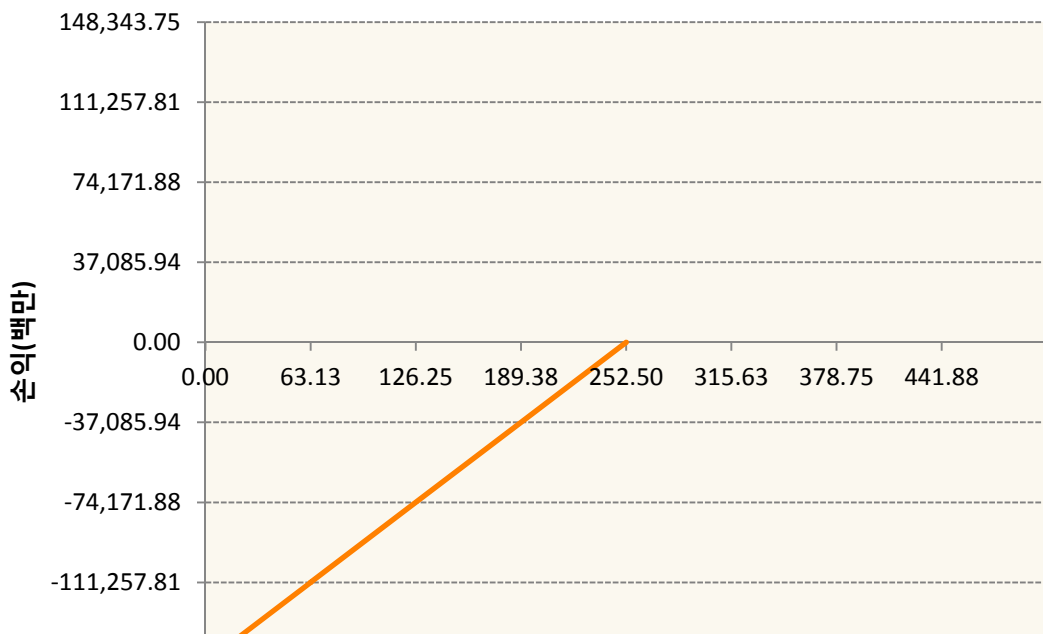




**KR4301P92508-2019-09 풋250**



**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%	88	86	84	81	79	76	73	
-5.33%	77	74	70	66	62	58	54	
-2.67%	54	49	44	40	35	30	26	
0%	13	9	4	0	-4	-9	-13	
2.67%	-42	-45	-48	-51	-54	-58	-62	
5.33%	-106	-107	-109	-110	-113	-115	-118	
8.00%	-173	-173	-174	-175	-176	-177	-179	
KR4201P92526 2019-09 콜252.5								23,862
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	10,263	10,076	9,842	9,566	9,252	8,905	8,528	
-5.33%	9,289	8,869	8,414	7,932	7,428	6,906	6,369	
-2.67%	6,735	6,110	5,480	4,846	4,209	3,569	2,928	
0%	1,916	1,282	643	0	-646	-1,295	-1,945	
2.67%	-5,089	-5,542	-6,028	-6,541	-7,075	-7,628	-8,195	
5.33%	-13,558	-13,792	-14,075	-14,403	-14,770	-15,171	-15,601	
8.00%	-22,723	-22,812	-22,942	-23,113	-23,325	-23,575	-23,862	
KR4301P92508 2019-09 풋250								1,020
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-987	-990	-993	-998	-1,004	-1,011	-1,020	
-5.33%	-504	-516	-529	-544	-559	-575	-592	
-2.67%	-131	-153	-176	-198	-220	-242	-265	
0%	51	35	18	0	-19	-38	-57	
2.67%	99	94	88	79	70	59	47	
5.33%	105	105	103	101	98	94	89	
8.00%	106	106	106	105	105	104	102	
KR4301P92524 2019-09 풋252.5								8,894
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-8,734	-8,743	-8,757	-8,779	-8,809	-8,847	-8,894	
-5.33%	-4,828	-4,888	-4,961	-5,046	-5,140	-5,243	-5,353	
-2.67%	-1,495	-1,653	-1,813	-1,976	-2,140	-2,307	-2,474	
0%	488	328	165	0	-167	-336	-506	
2.67%	1,159	1,091	1,010	917	814	702	584	

5.33%	1,275	1,262	1,241	1,211	1,171	1,121	1,062
8.00%	1,285	1,284	1,281	1,275	1,265	1,249	1,228

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

(단위:백만원)

**34,906**

공시일	2019-08-26
기준일	2019-08-23

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

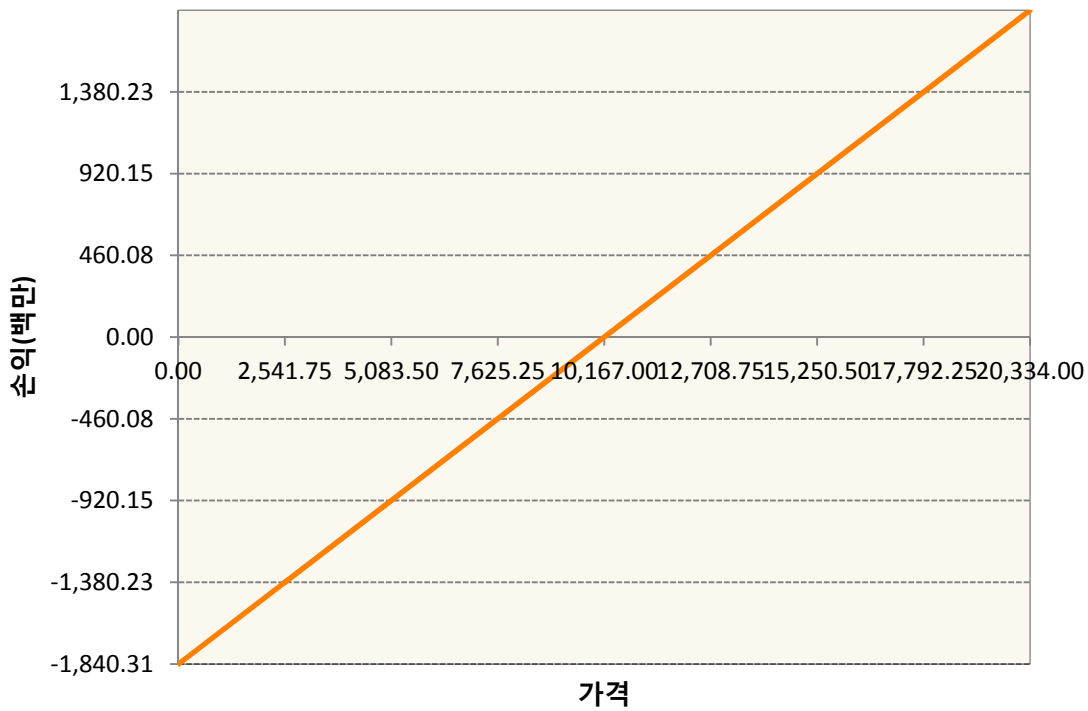
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

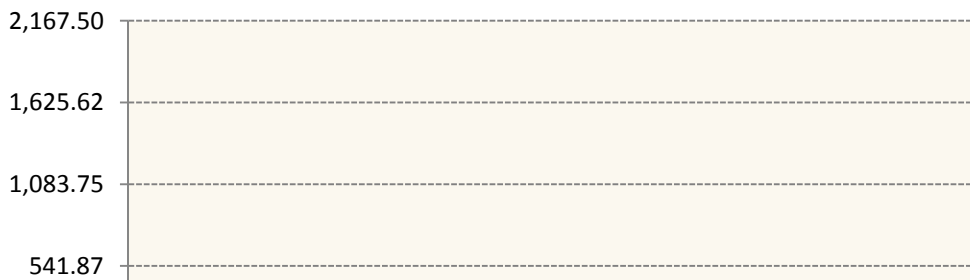
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,840	0	1,840	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,345	-5,345	장내
누계	통화	선도	0	2,869	-2,869	장외

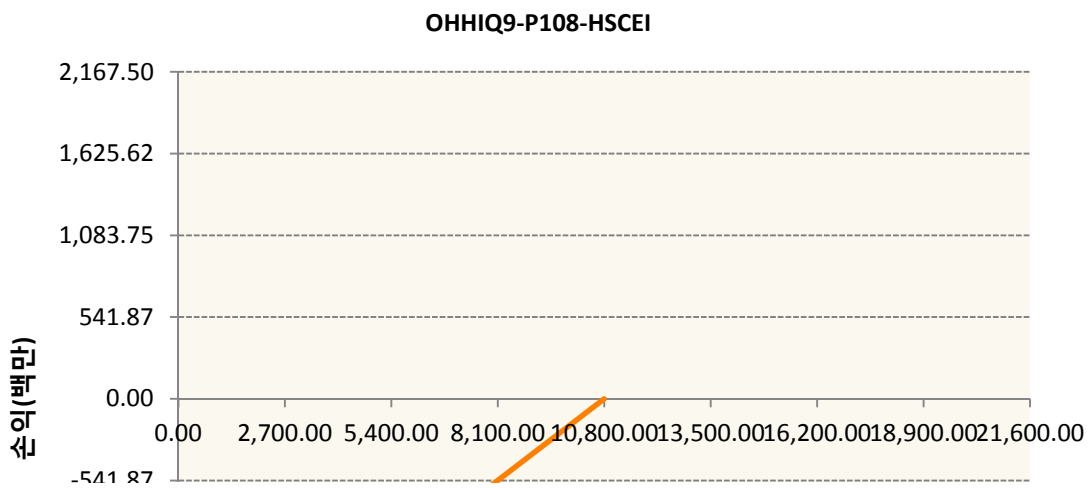
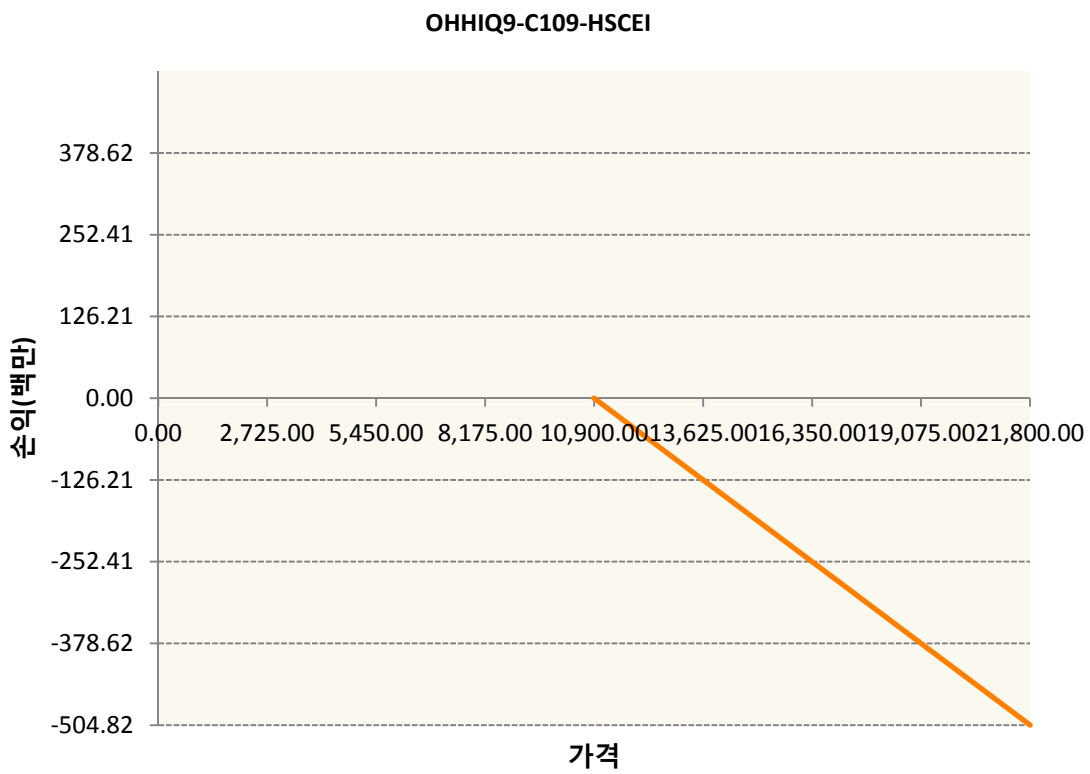
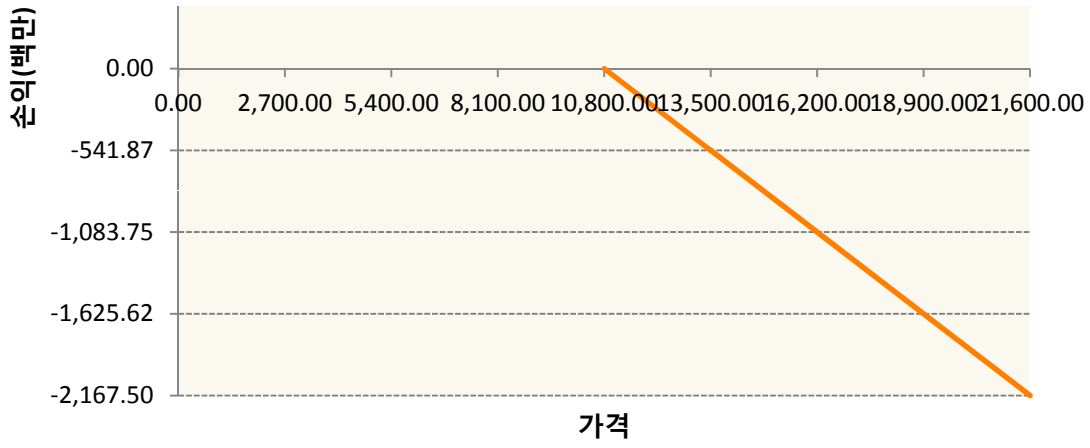
### 2. 만기시점의 손익구조

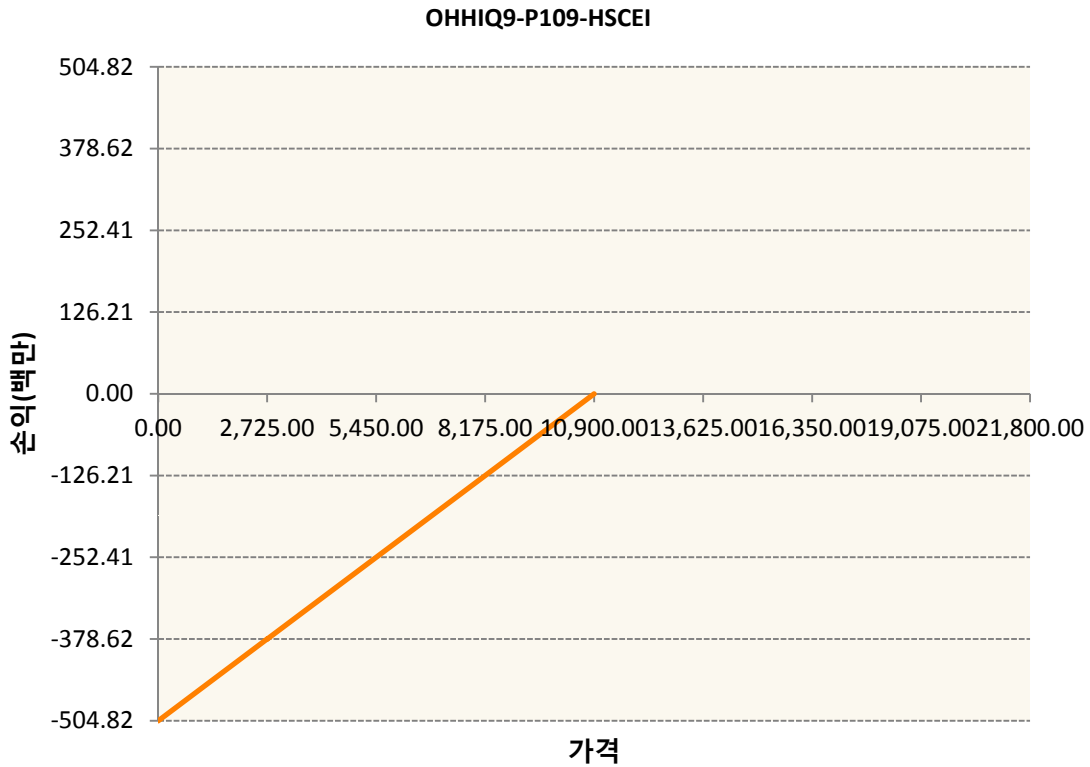
HCQ9-HSCEI Futures Aug19



OHHIQ9-C108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	229
HCQ9 HSCEI Futures Aug19	147
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)
	610

공시일	2019-08-26
기준일	2019-08-23

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

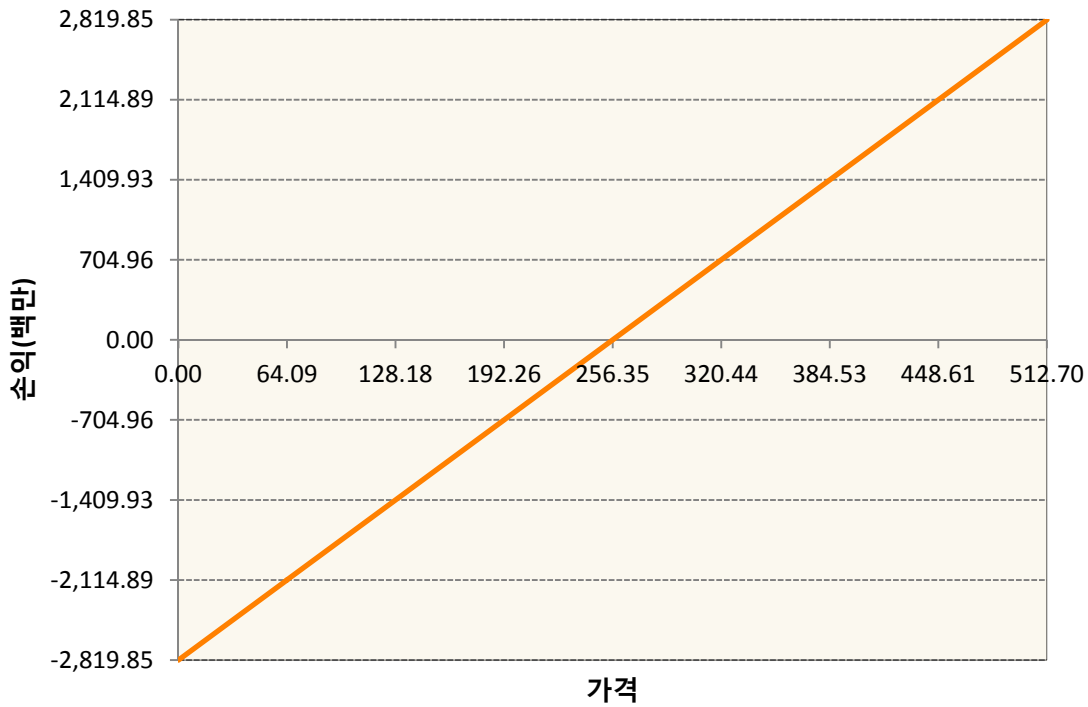
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

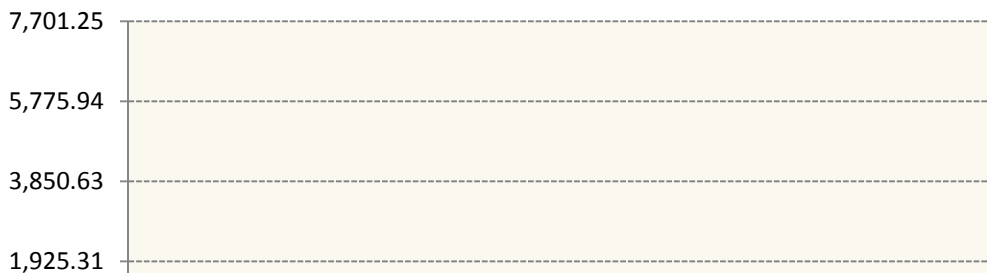
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,820	0	2,820	장내
누계	유가증권	스왑	14,125	0	14,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,829	-14,829	장내

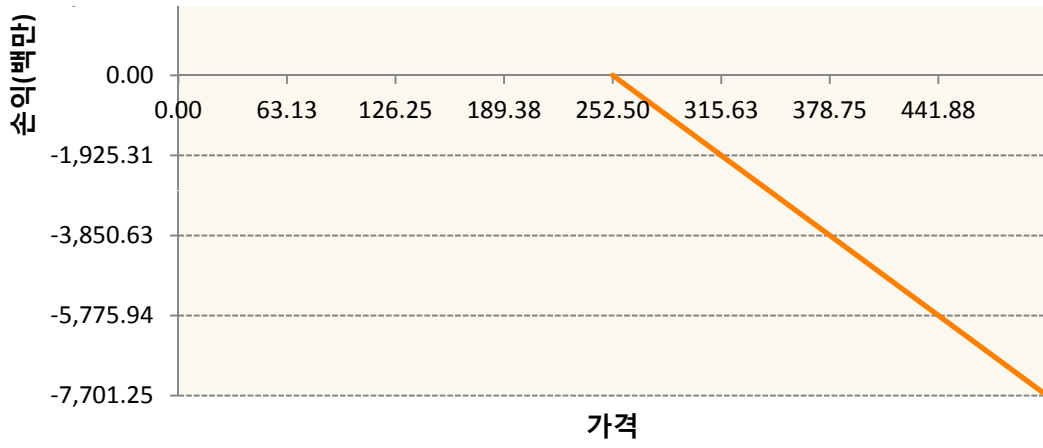
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

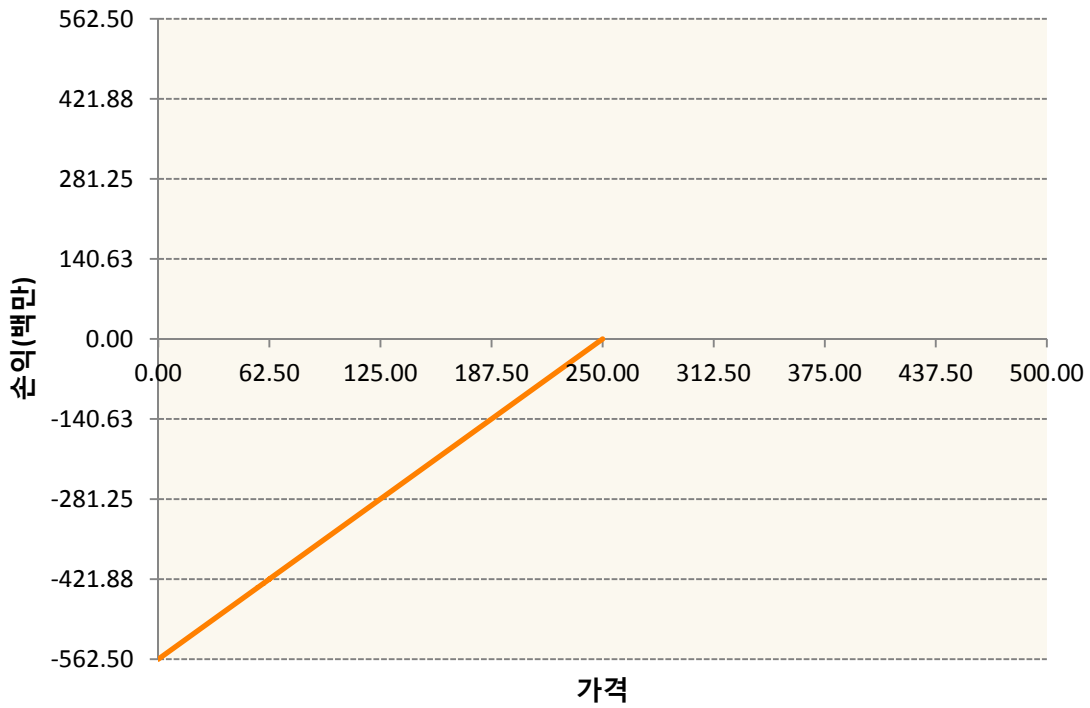


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

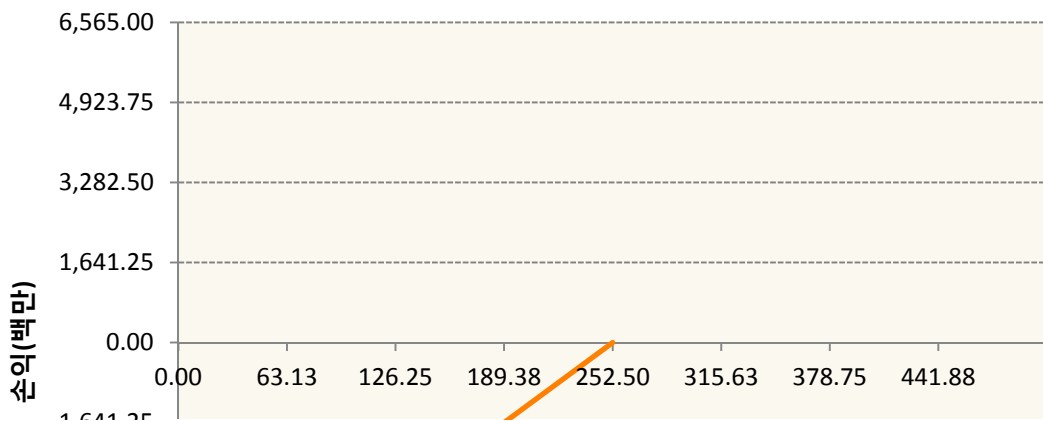




KR4301P92508-2019-09 풋250



KR4301P92524-2019-09 풋252.5





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						1,226
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,226	-1,226	-1,226	-1,226	-1,226	-1,226	-1,226	
-5.33%	-817	-817	-817	-817	-817	-817	-817	
-2.67%	-409	-409	-409	-409	-409	-409	-409	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	409	409	409	409	409	409	409	
5.33%	817	817	817	817	817	817	817	
8.00%	1,226	1,226	1,226	1,226	1,226	1,226	1,226	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						225
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-225	-225	-225	-225	-225	-225	-225	
-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%	225	225	225	225	225	225	225	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5						524
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	225	221	216	210	203	195	187	
-5.33%	204	195	185	174	163	152	140	
-2.67%	148	134	120	106	92	78	64	
0%	42	28	14	0	-14	-28	-43	
2.67%	-112	-122	-132	-144	-155	-167	-180	
5.33%	-297	-303	-309	-316	-324	-333	-342	
8.00%	-499	-501	-503	-507	-512	-517	-524	
KR4301P92508		2019-09 풋250						31
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-31
-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							394
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-387	-387	-388	-389	-390	-392	-394
-5.33%	-214	-216	-220	-223	-227	-232	-237
-2.67%	-66	-73	-80	-87	-95	-102	-110
0%	22	15	7	0	-7	-15	-22
2.67%	51	48	45	41	36	31	26
5.33%	56	56	55	54	52	50	47
8.00%	57	57	57	56	56	55	54

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

(단위:백만원)

**2,390**

공시일	2019-08-26
기준일	2019-08-23

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

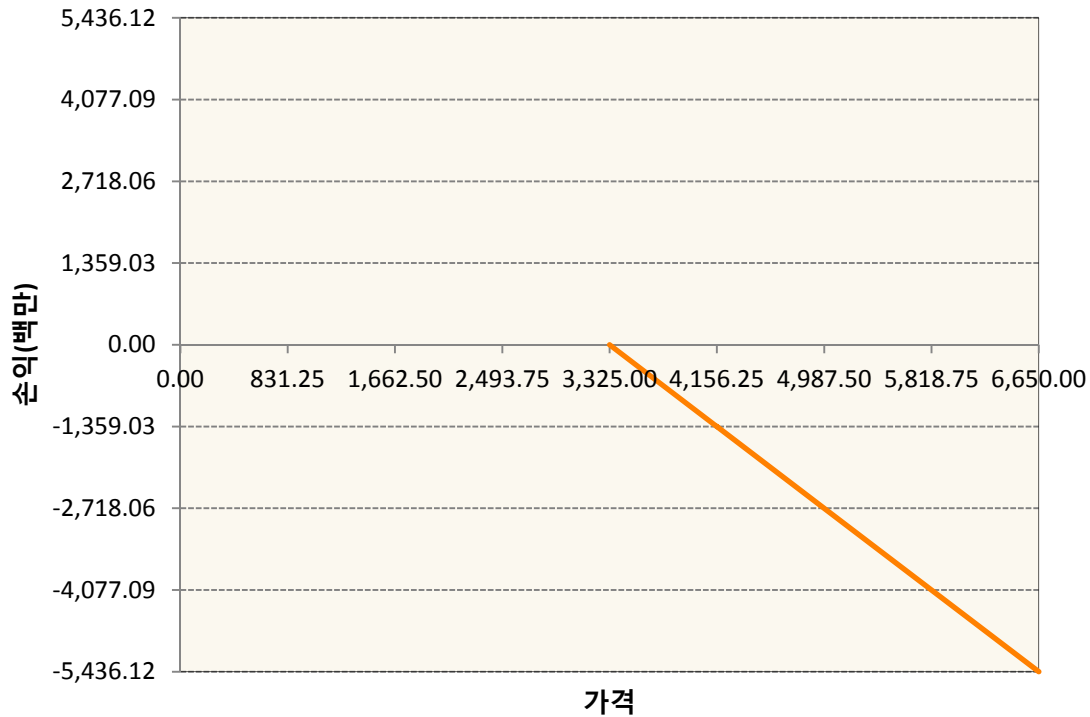
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

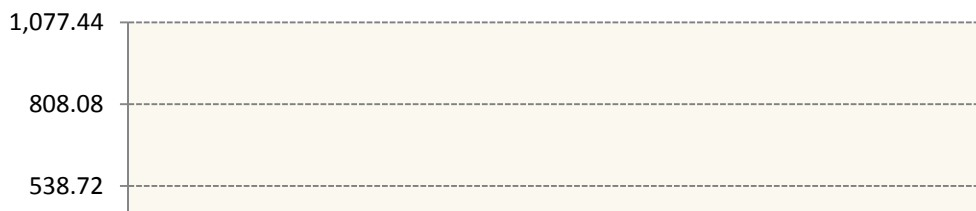
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,784	0	3,784	
누계	유가증권	옵션	0	13,027	-13,027	장내
누계	지수	스왑	28,333	0	28,333	장외
누계	통화	선도	9,113	17,422	-8,309	장외

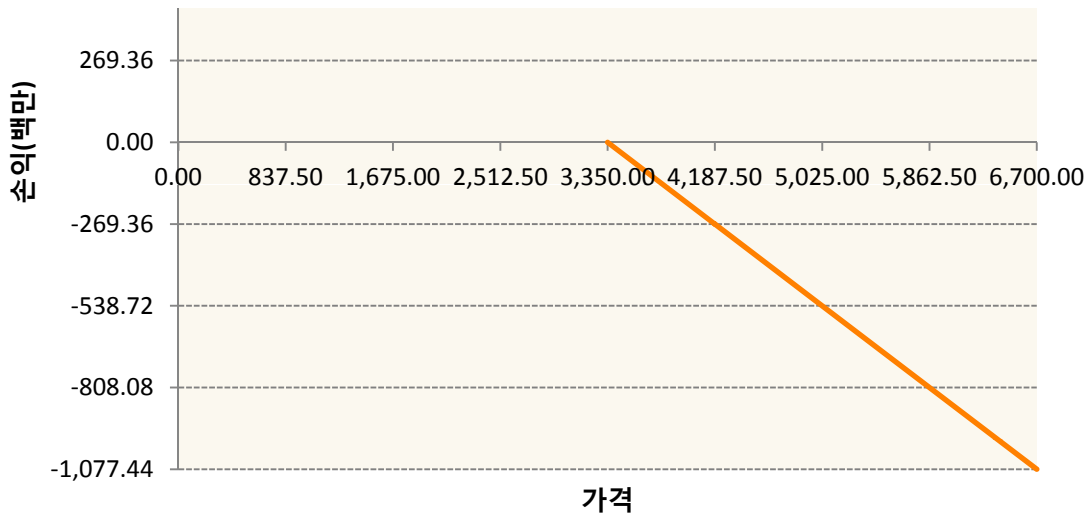
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXU9-C3325-EURO STOXX 50**

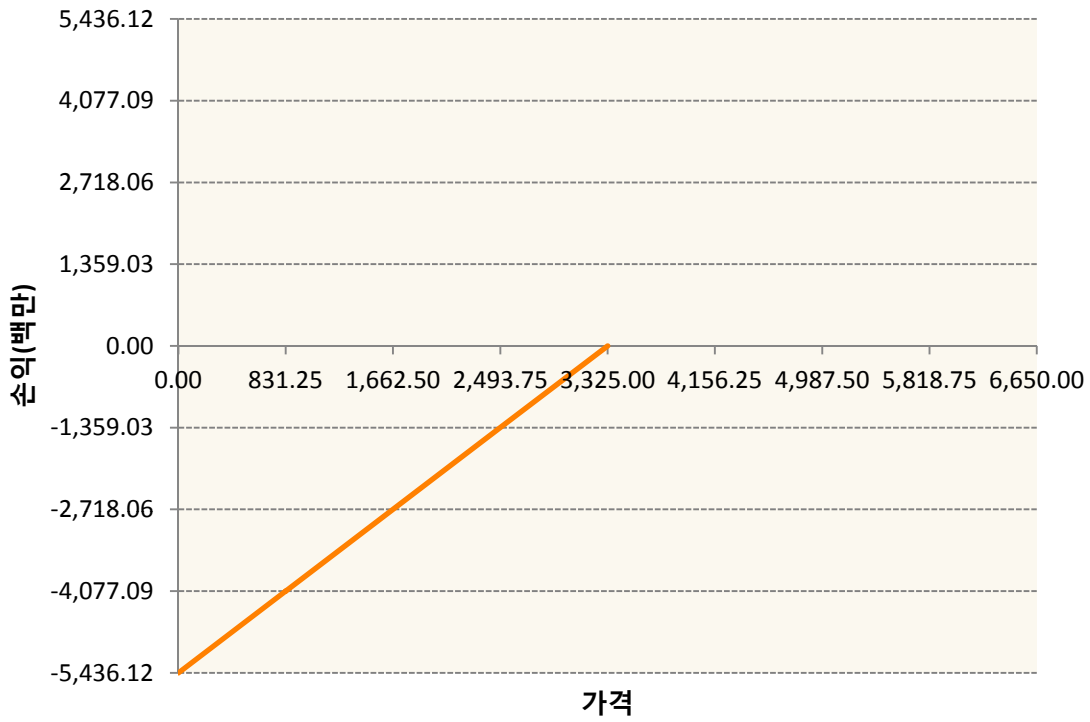


**OESXU9-C3350-EURO STOXX 50**

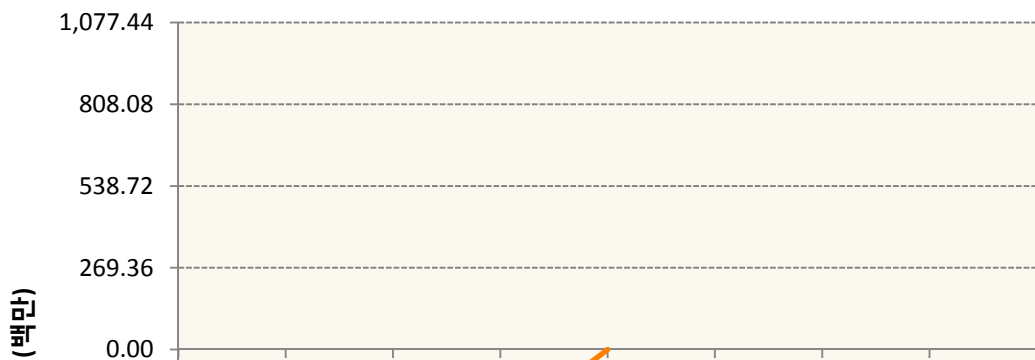


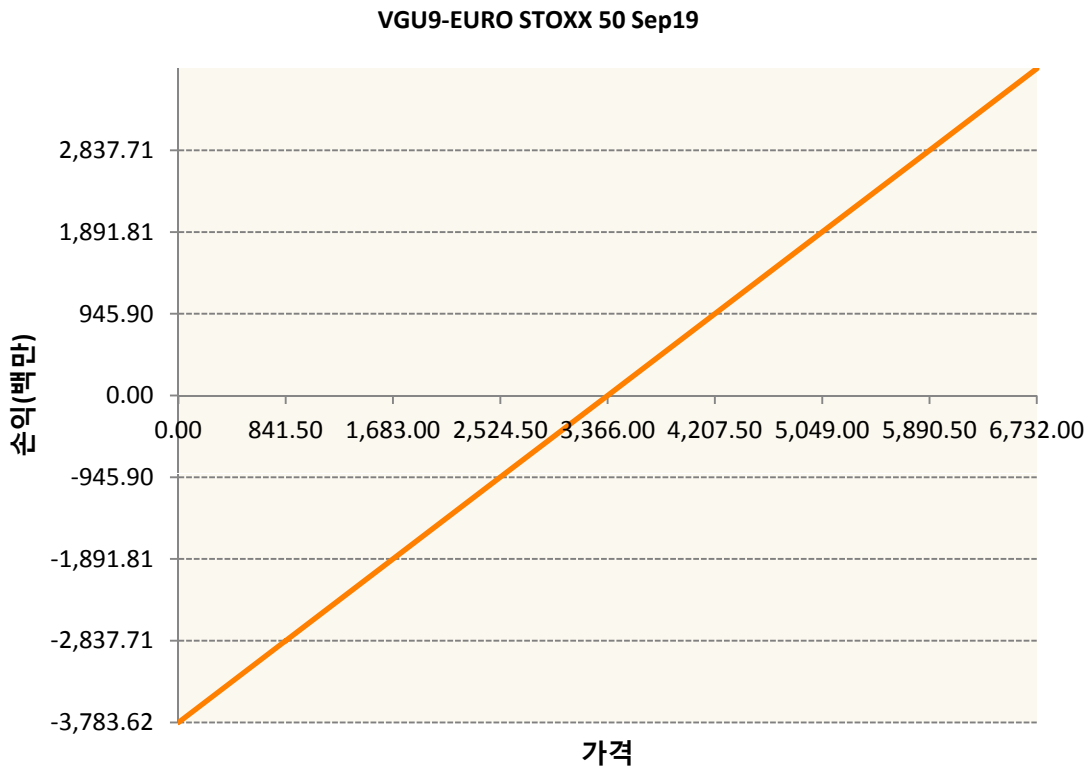
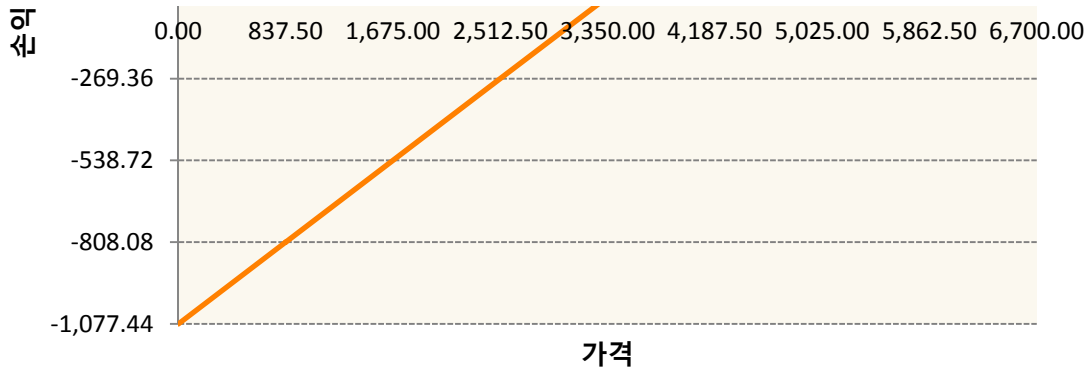


OESXU9-P3325-EURO STOXX 50



OESXU9-P3350-EURO STOXX 50





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	50
FX21019M0< KRW/EUR 27-09-19E	1,072
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	322
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E	322
FX21019N04 EUR/KRW 27-09-19E	236
FX21019Q00 EUR/KRW 27-09-19E	172
OESXU9-C3€ EURO STOXX 50	435
OESXU9-C3€ EURO STOXX 50	86
OESXU9-P3€ EURO STOXX 50	435
OESXU9-P3€ EURO STOXX 50	86
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	303

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

(단위:백만원)

1,995



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

(단위:백만원)

926

공시일	2019-08-26
기준일	2019-08-23

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

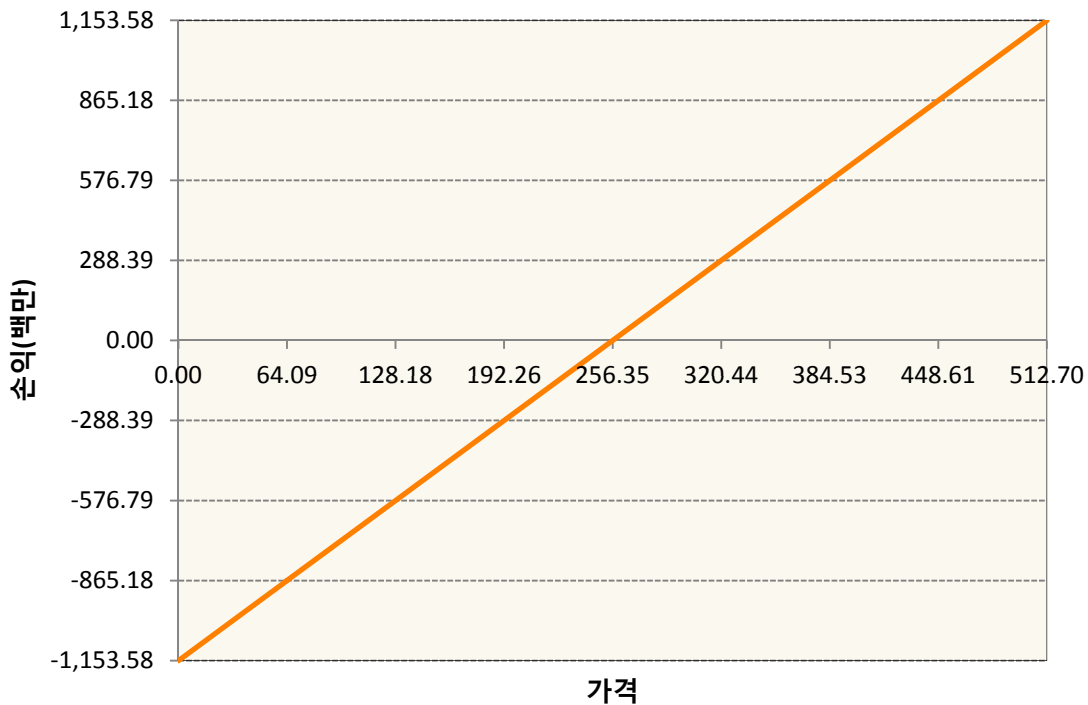
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,154	0	1,154	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)

122

공시일	2019-08-26
기준일	2019-08-23

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

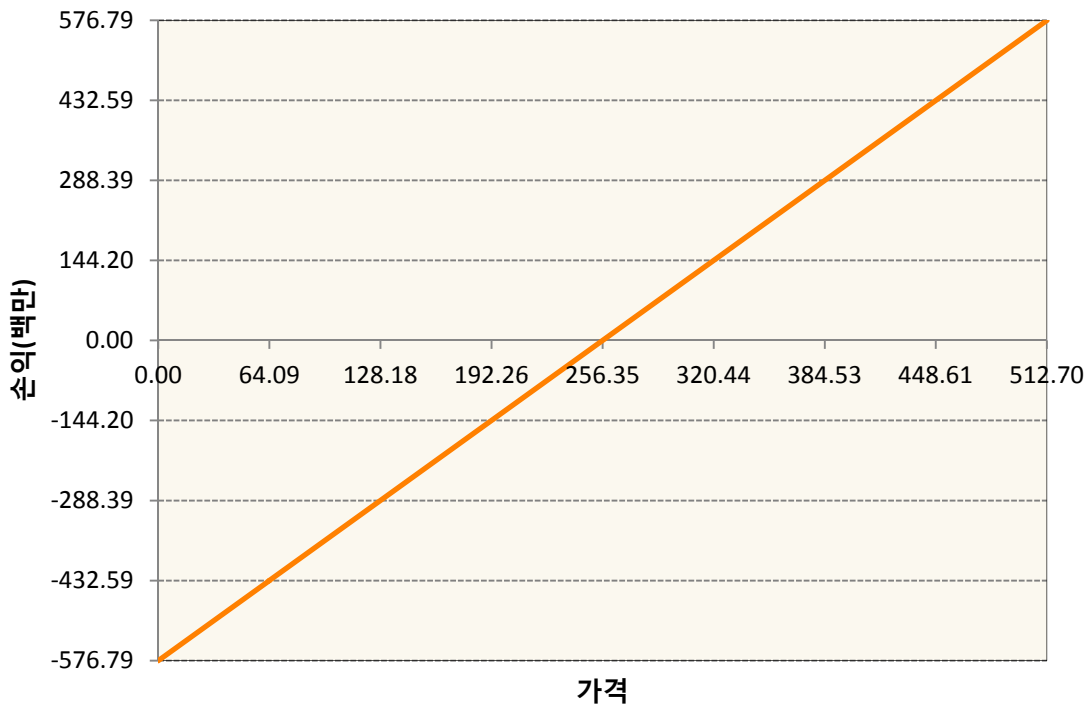
### 1. 계약금액

(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	2019-08-26
기준일	2019-08-23

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

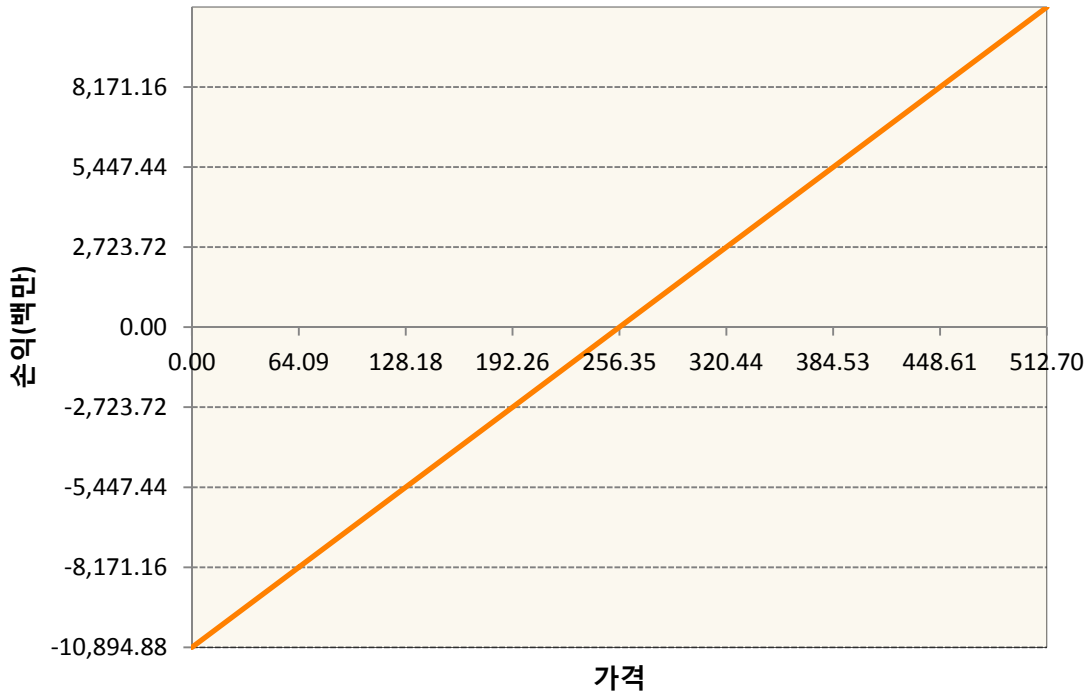
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

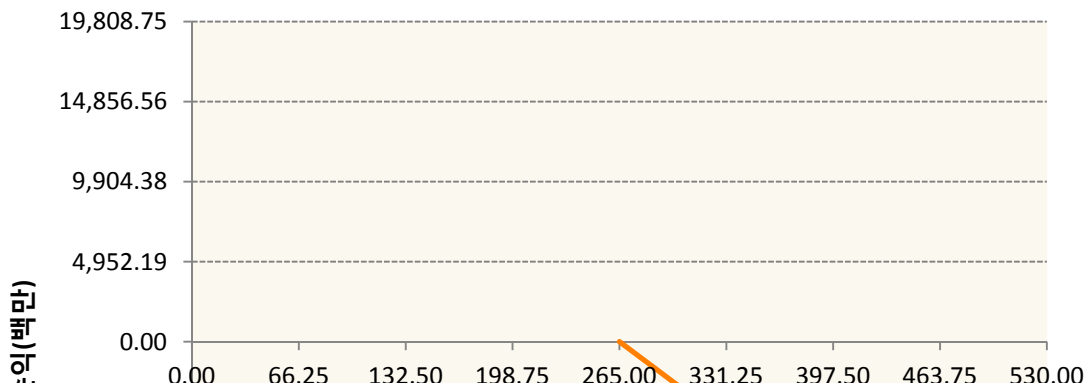
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,895	0	10,895	장내
누계	유가증권	옵션	3,659	19,943	-16,283	장내

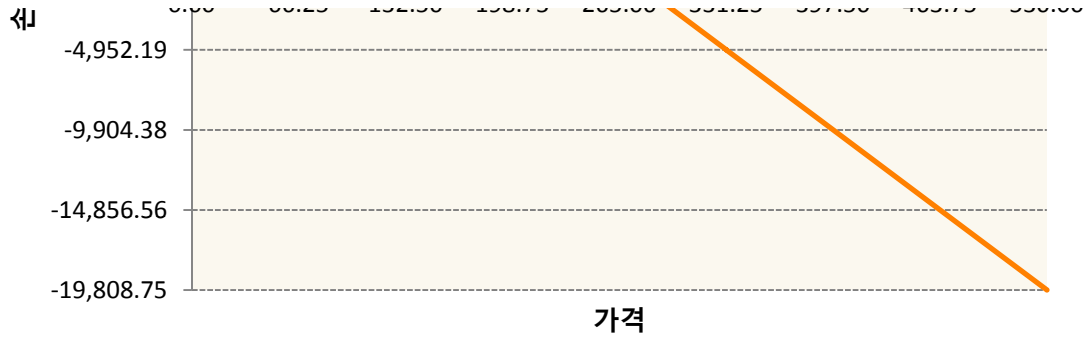
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

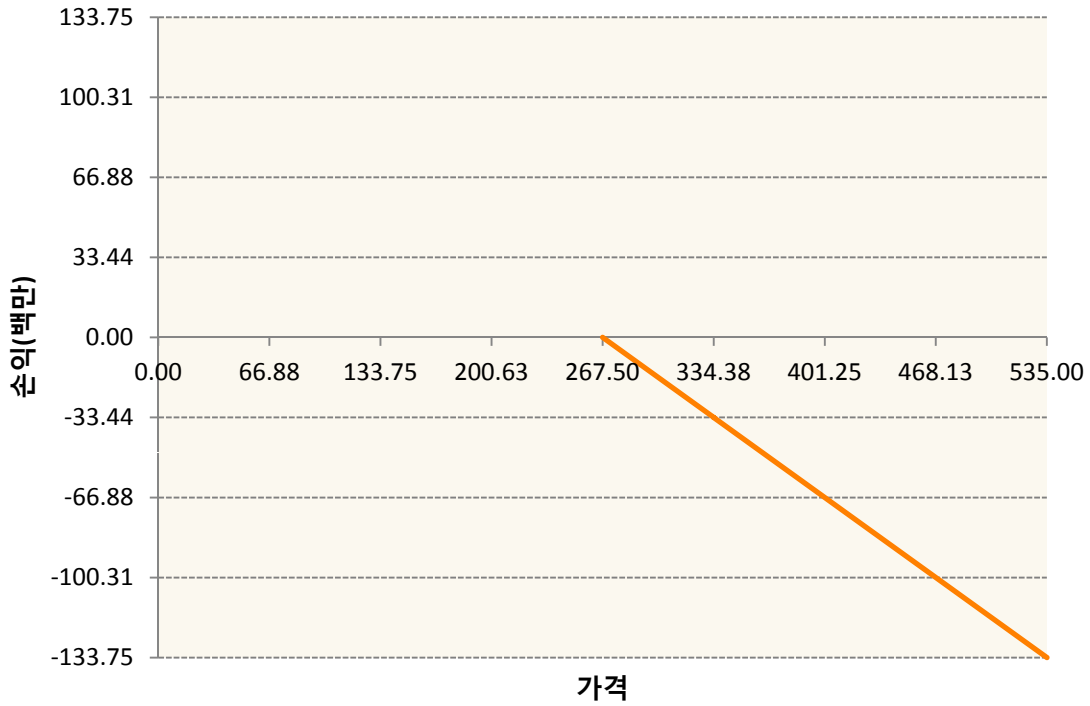


KR4201P92658-2019-09 콜265

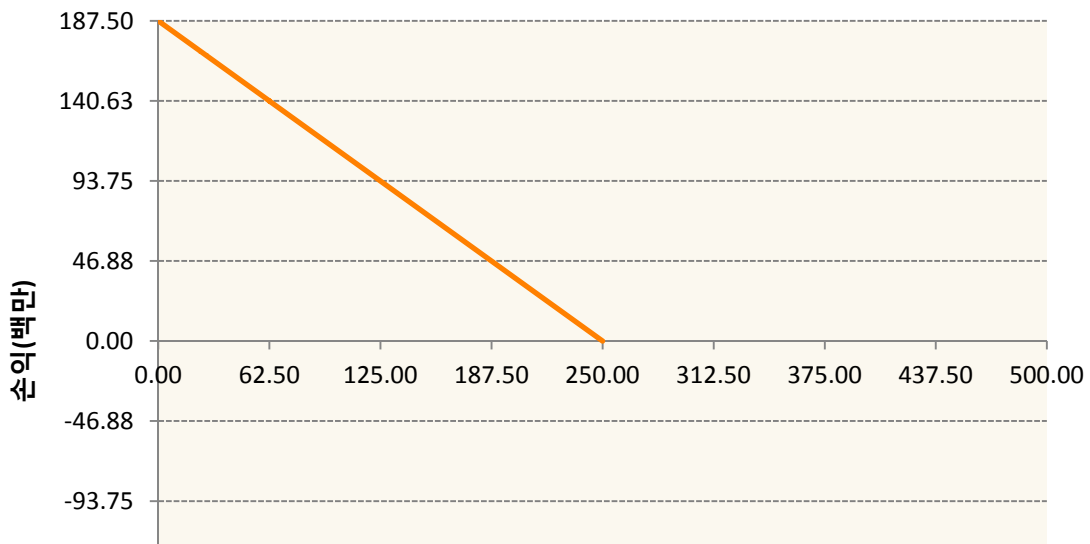


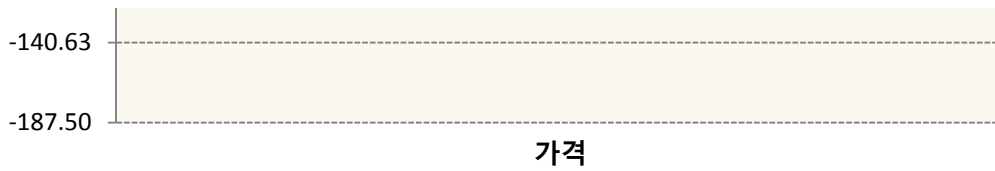


KR4201P92674-2019-09 콜267.5

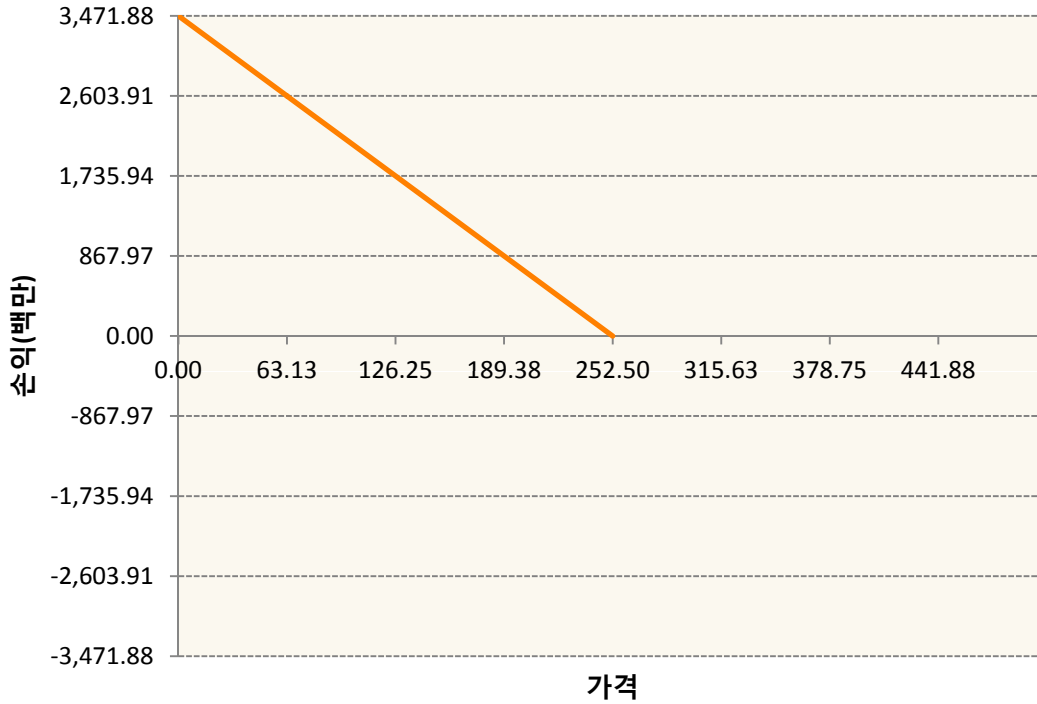


KR4301P92508-2019-09 풋250





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						913
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	180	179	177	173	169	162	155	
-5.33%	175	171	164	155	144	130	115	
-2.67%	154	140	124	105	84	62	38	

0%	85	58	30	0	-31	-62	-94
2.67%	-75	-112	-148	-185	-221	-258	-295
5.33%	-355	-390	-425	-461	-497	-533	-569
8.00%	-743	-767	-794	-822	-851	-882	-913
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%	0	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							208
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	204	205	205	205	206	207	208
-5.33%	113	114	116	118	120	123	125
-2.67%	35	39	42	46	50	54	58
0%	-11	-8	-4	0	4	8	12
2.67%	-27	-26	-24	-21	-19	-16	-14
5.33%	-30	-30	-29	-28	-27	-26	-25
8.00%	-30	-30	-30	-30	-30	-29	-29

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

(단위:백만원)

1,646

공시일	2019-08-26
기준일	2019-08-23

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,816	0	1,816	
누계	유가증권	수익증권	64,927	0	64,927	

### 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	2019-08-26
기준일	2019-08-23

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,816	0	1,816	
누계	유가증권	수익증권	85,520	0	85,520	

### 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	2019-08-26
기준일	2019-08-23

## 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	470,945	0	470,945	
누계	통화	선도	0	514,626	-514,626	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		1,743
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,131
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		136
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		775
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,937
FX21019N03 KRW/USD 26-08-19E		1,937
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		291
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		97
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		717
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		717
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		291
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		678
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		2,712
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		1,356
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		775
FX21019N04 KRW/USD 03-09-19E		291
FX21019Q00 KRW/USD 03-09-19E		291
FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E		484
FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E		194
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		291
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		3,196
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		2,169
FX21019Q01 KRW/USD 16-09-19E		97
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,971
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,583
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,654

FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E	3,012
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E	968
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E	968
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E	968
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E	1,743

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

(단위:백만원)

**13,388**

공시일	2019-08-26
기준일	2019-08-23

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

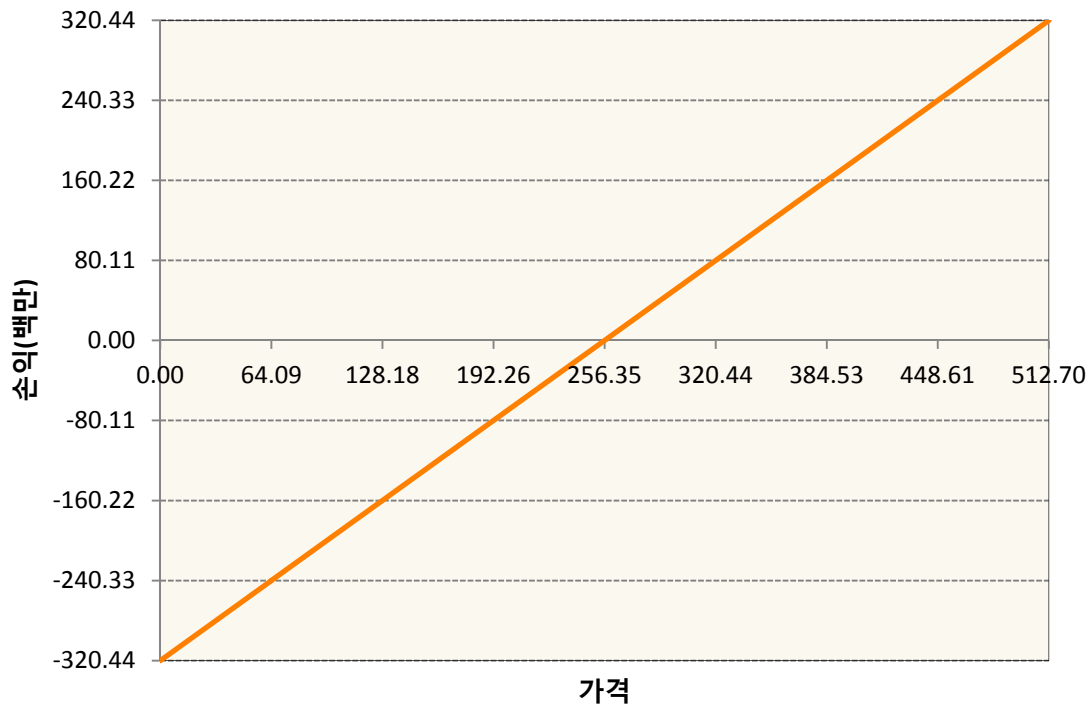
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

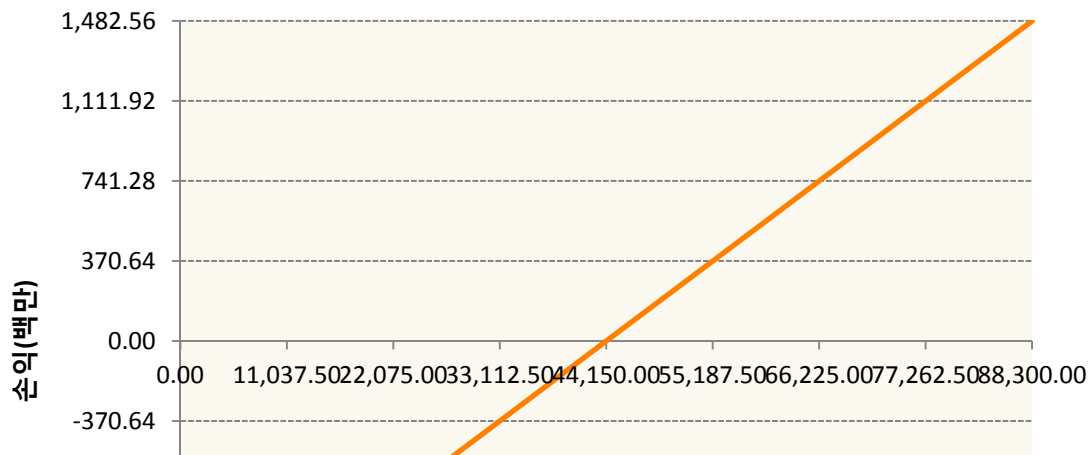
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,803	0	1,803	장내

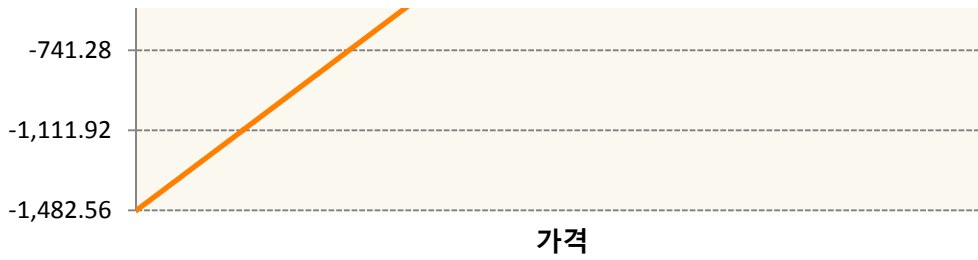
### 2. 만기시점의 손익구조

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)

**170**

공시일	2019-08-26
기준일	2019-08-23

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

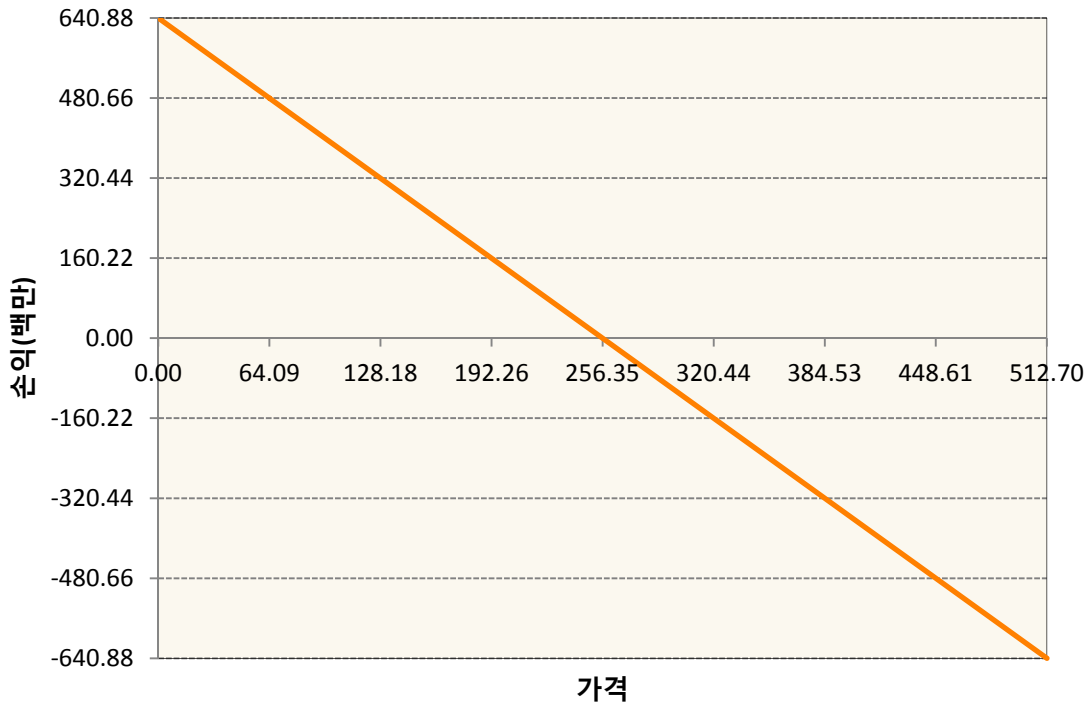
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

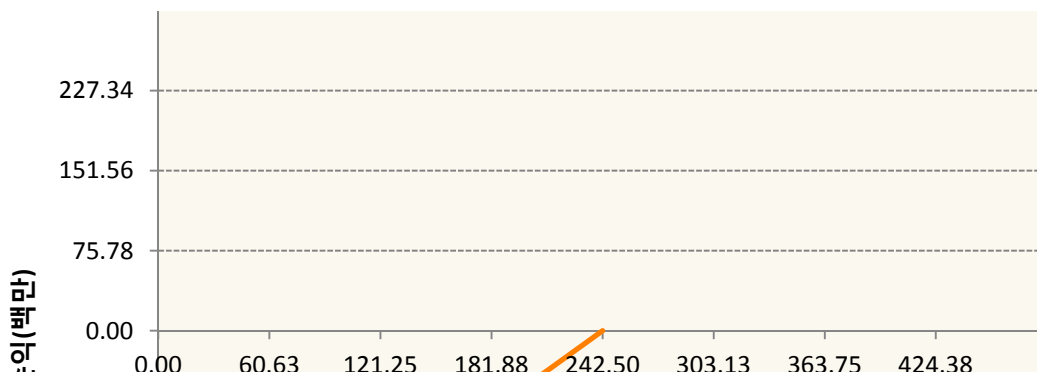
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	641	-641	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,672	-3,672	장내

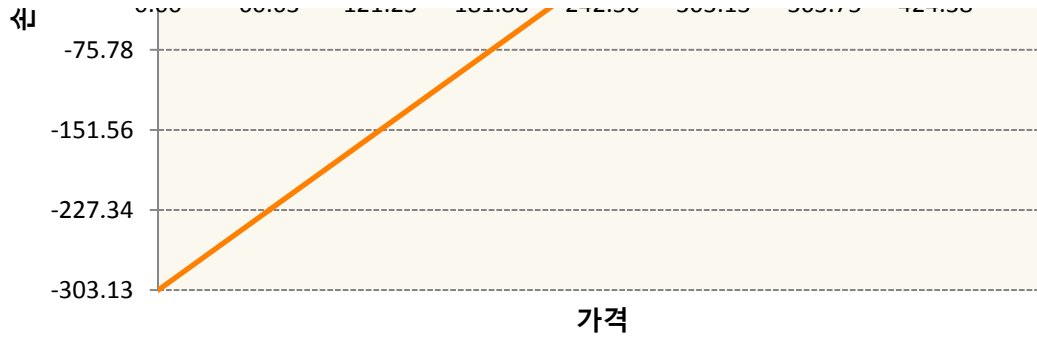
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

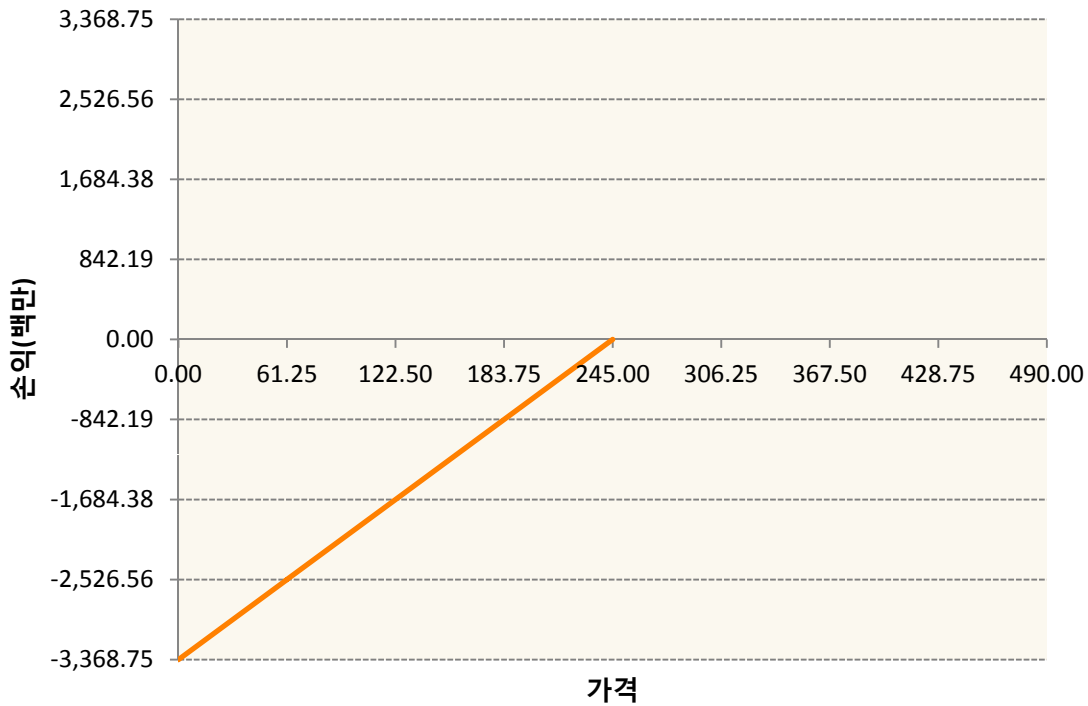


KR4301P92425-2019-09 풋242.5





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						11
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9	-9	-9	-10	-10	-10	-11
-5.33%	-3	-3	-4	-4	-5	-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

140

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-127	-129	-131	-133	-135	-137	-140
-5.33%	-51	-55	-59	-62	-66	-70	-74
-2.67%	-8	-12	-15	-19	-23	-26	-30
0%	5	3	2	0	-2	-4	-7
2.67%	7	6	6	6	5	4	3
5.33%	7	7	7	7	6	6	6
8.00%	7	7	7	7	7	7	7

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

(단위:백만원)

148

공시일	2019-08-26
기준일	2019-08-23

## 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	19,761	0	19,761	
누계	통화	선도	0	23,365	-23,365	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
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		329

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

(단위:백만원)

<b>608</b>
------------

공시일	2019-08-26
기준일	2019-08-23

## 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	539	0	539	장외
누계	통화	선도	93	93	0	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	31
2.55E+11 E1VFN30 VN ETF	12
FX21019N01 KRW/EUR 25-10-19E	4
FX21019Q00 KRW/EUR 25-10-19E	3
FX21019Q03 EUR/KRW 25-10-19E	7

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

(단위:백만원)

47
----

공시일	2019-08-26
기준일	2019-08-23

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

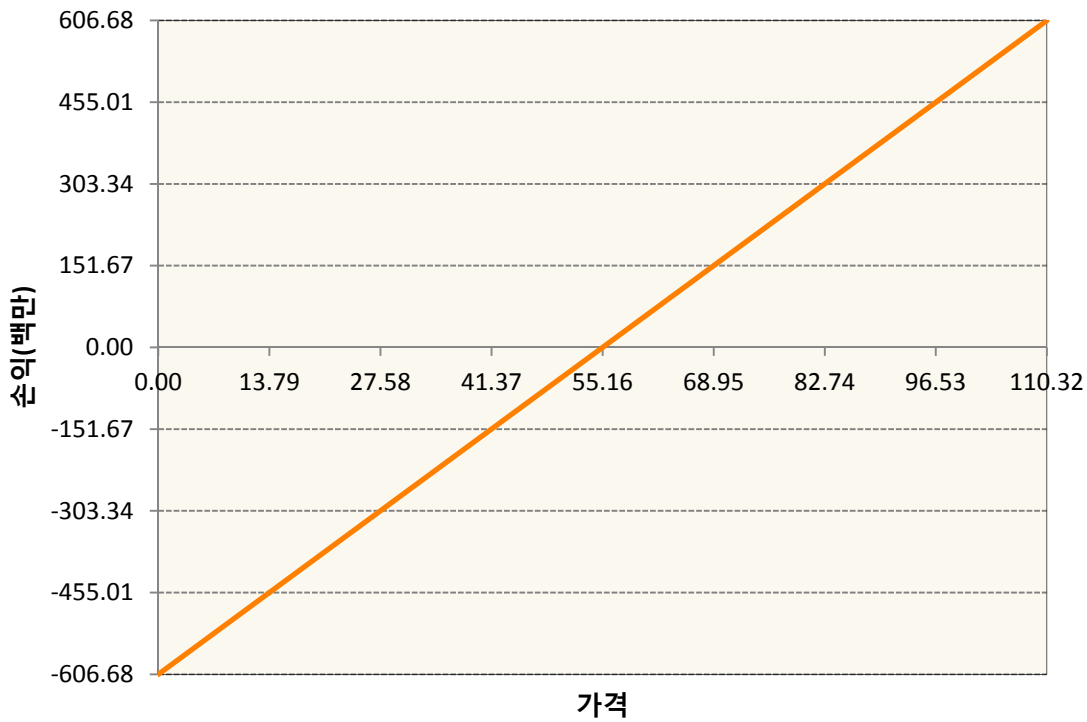
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

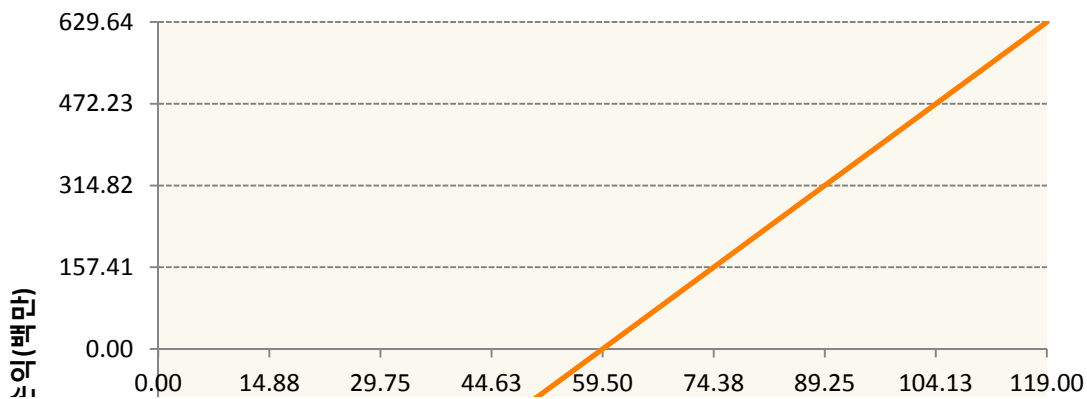
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,220	121	2,099	
누계	유가증권	선물	190	0	190	장내

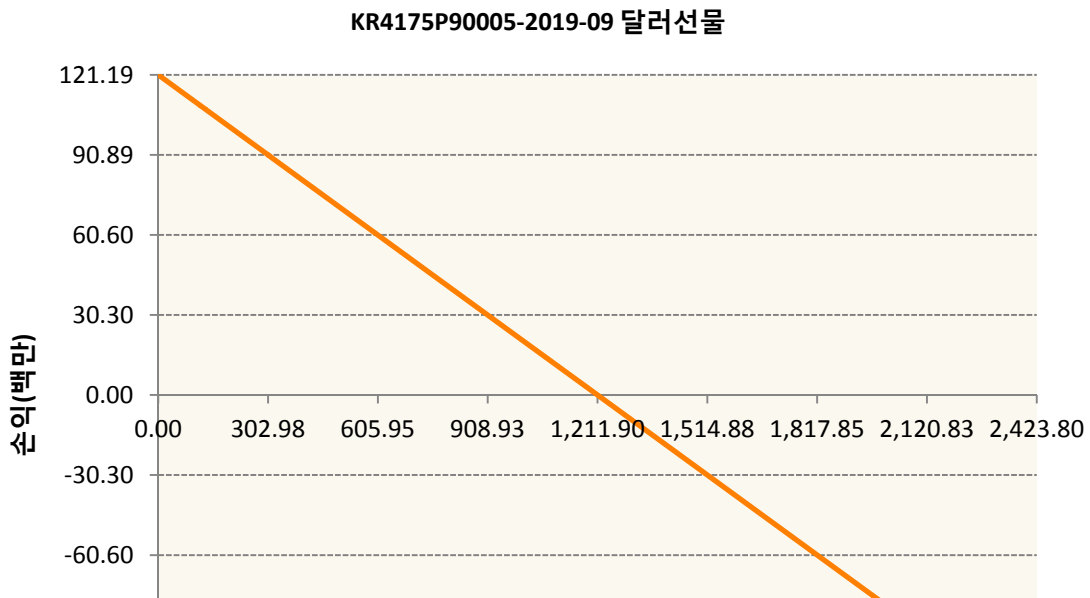
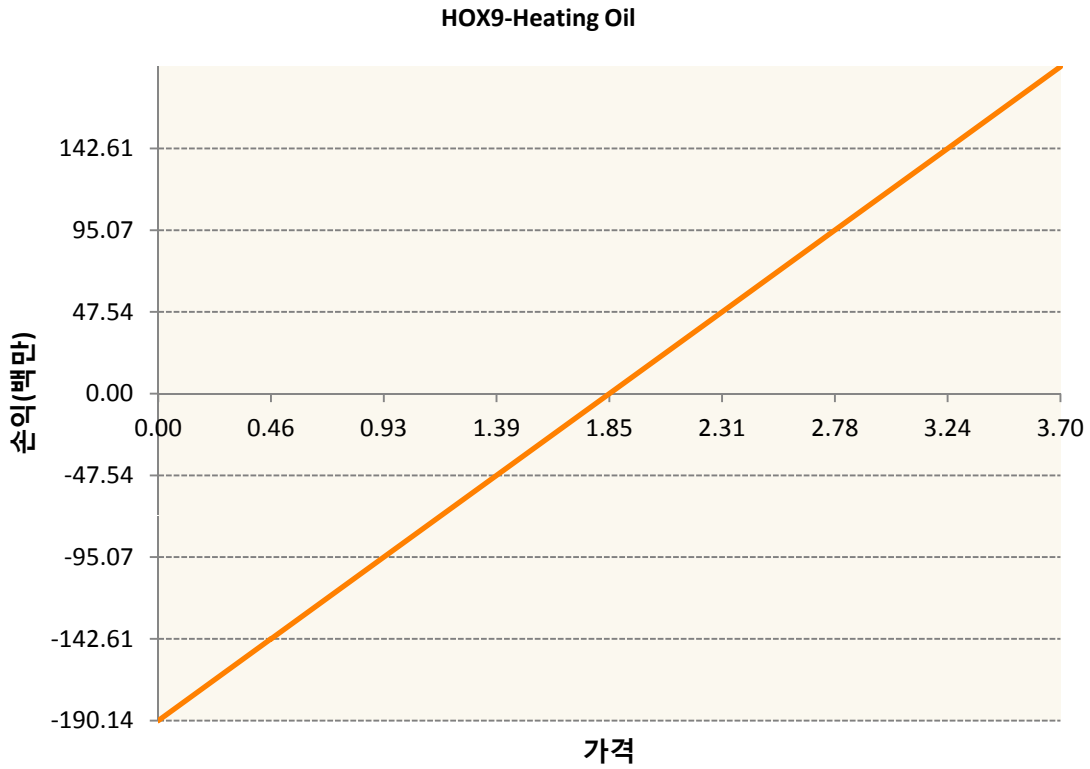
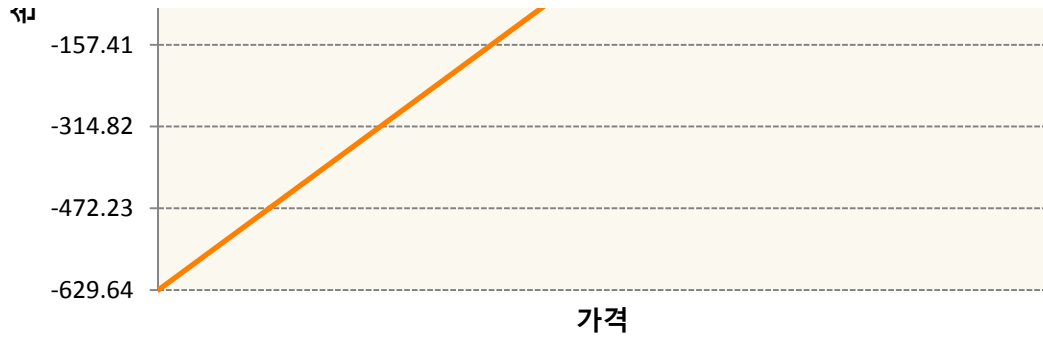
### 2. 만기시점의 손익구조

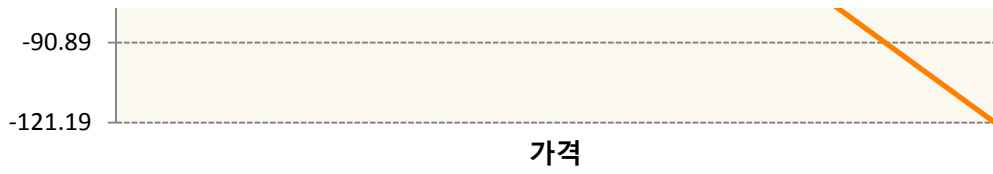
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19



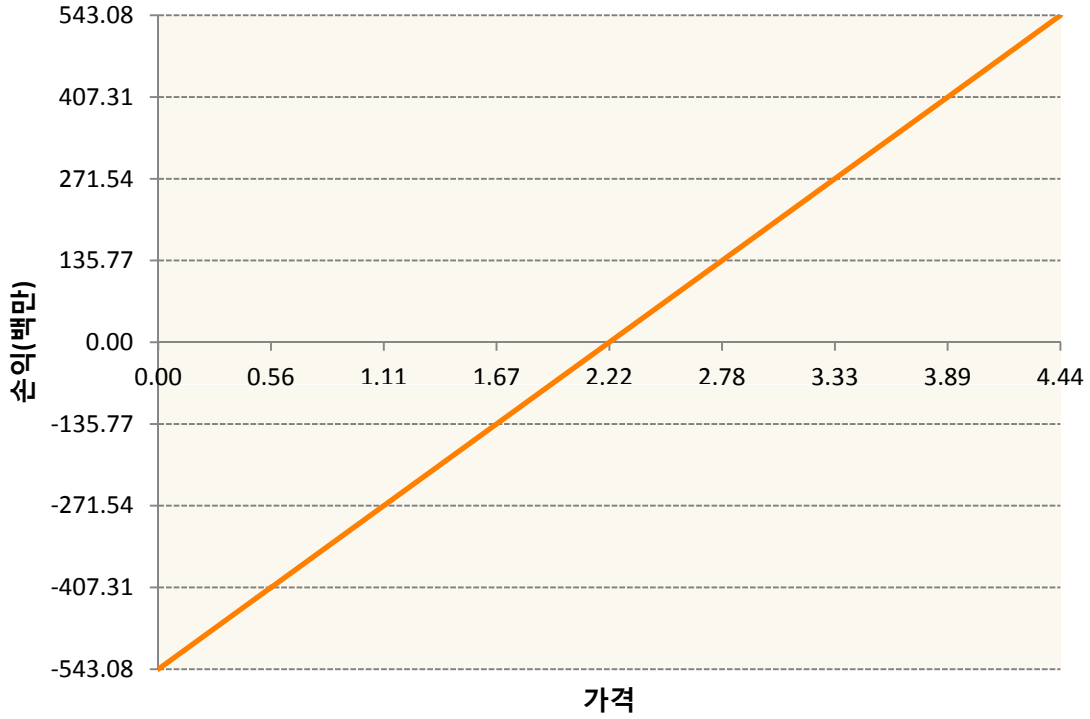
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19



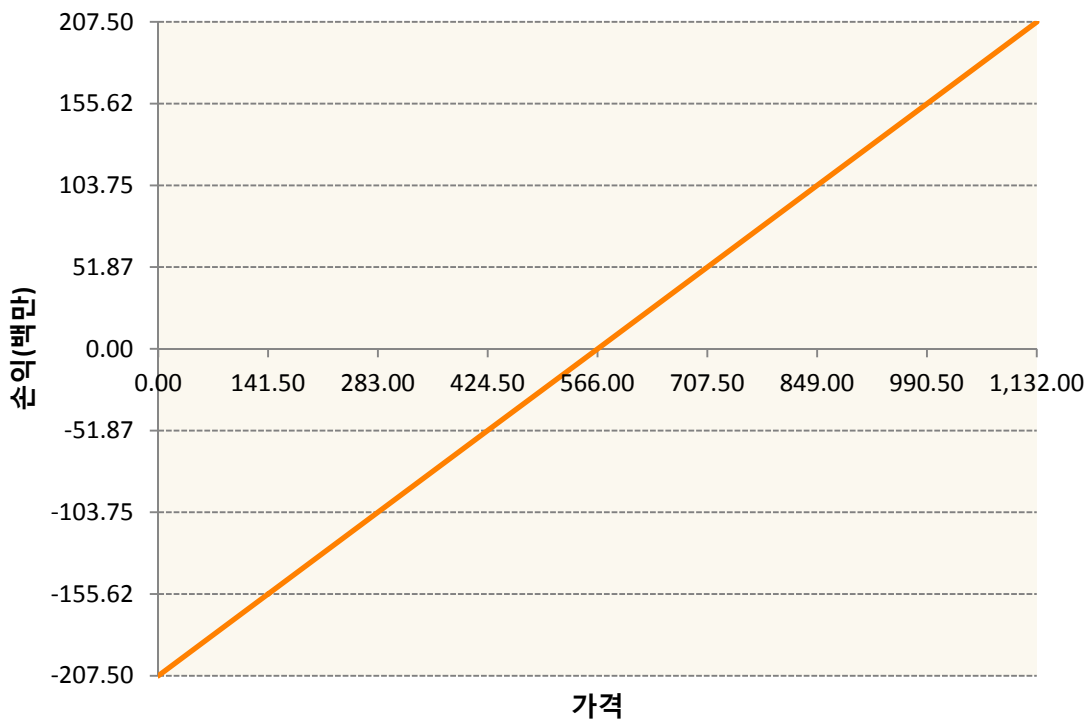


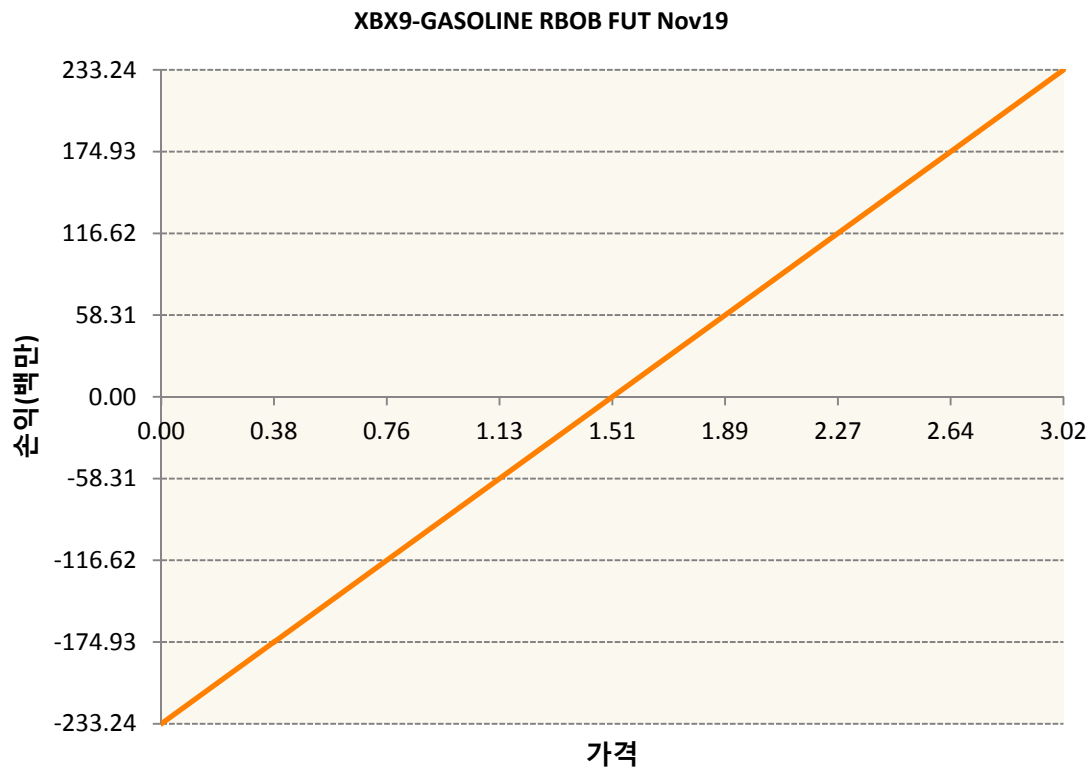


NGX19-NATURAL GAS FUTR Nov19



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	43
QSX9	Low Su Gasoil G Nov19	17
XBX9	GASOLINE RBOB FUT Nov19	19

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	369

공시일	2019-08-26
기준일	2019-08-23

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

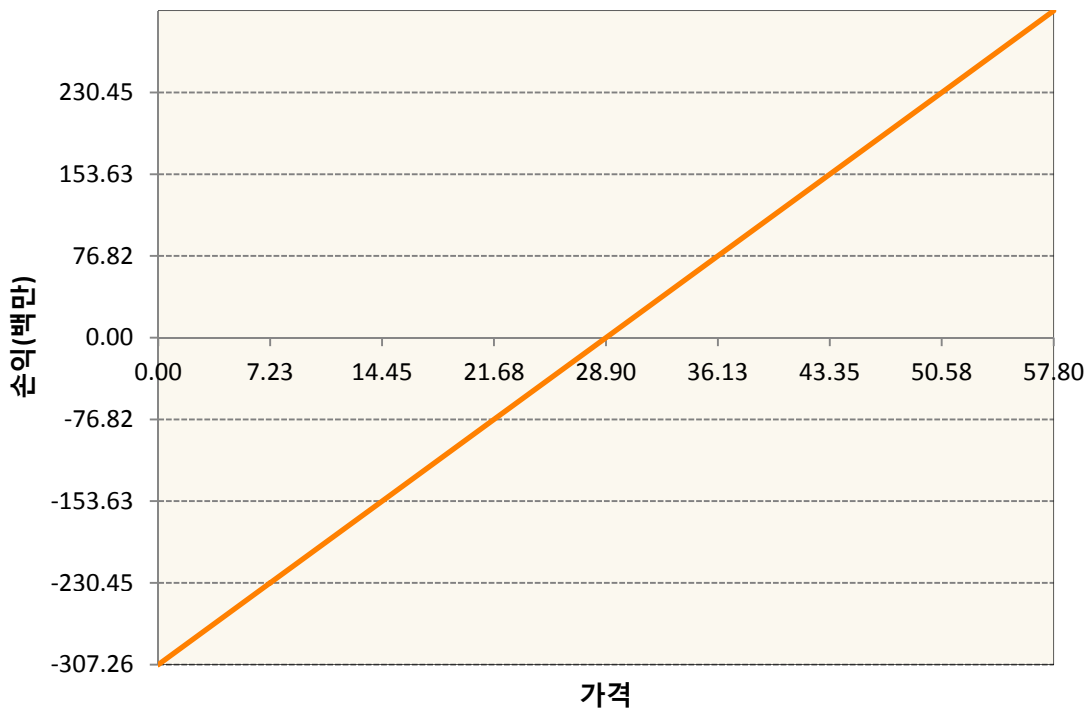
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

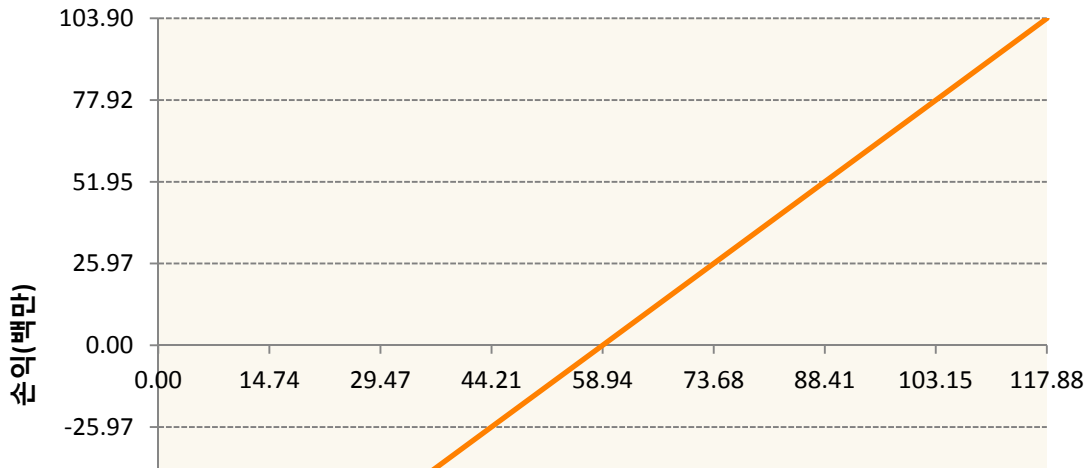
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,743	158	2,586	

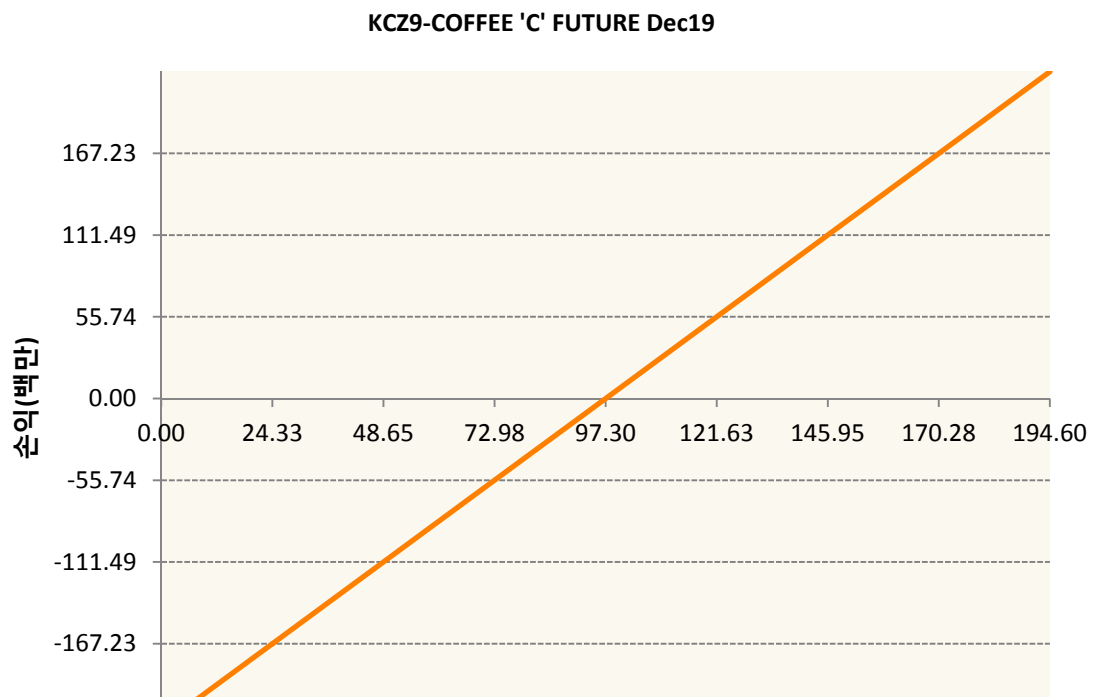
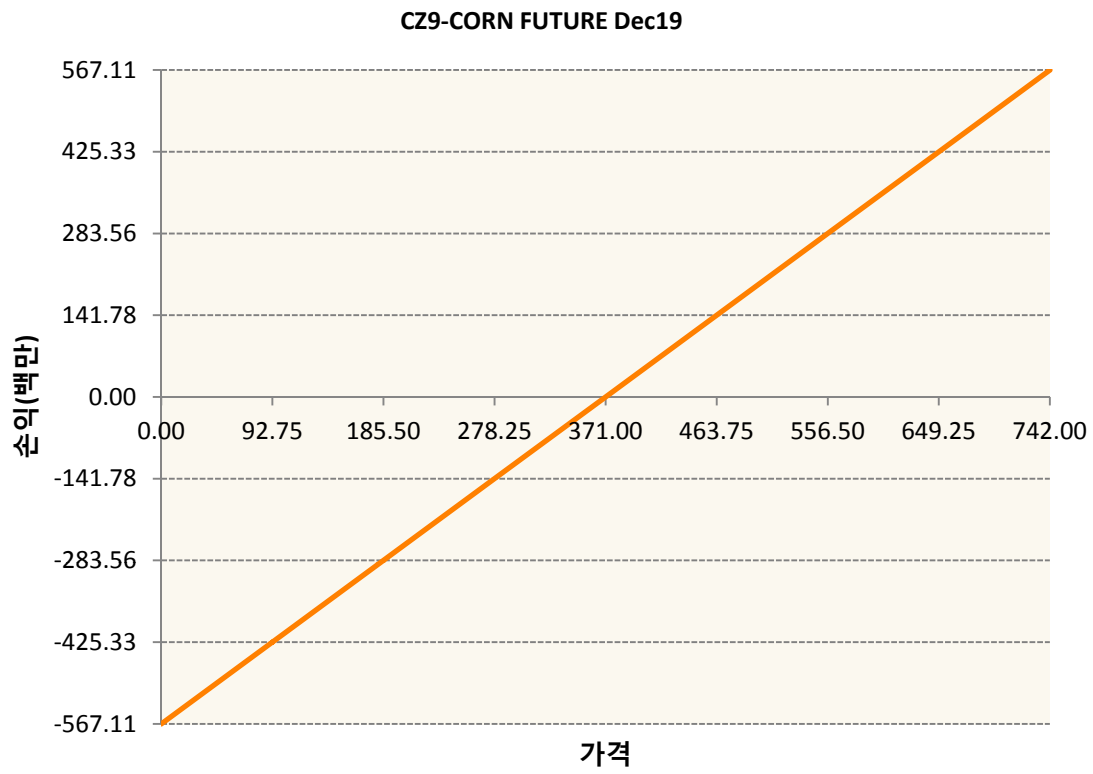
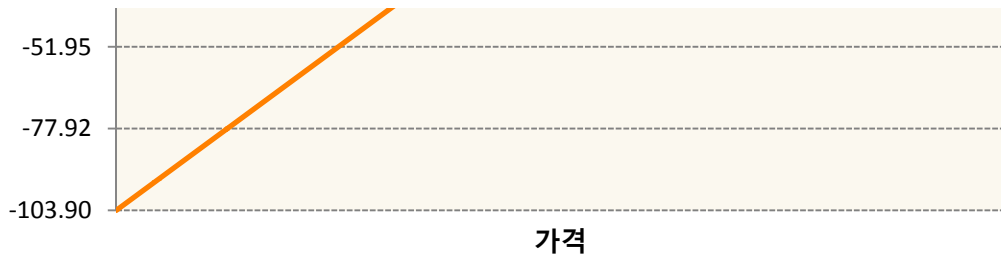
### 2. 만기시점의 손익구조

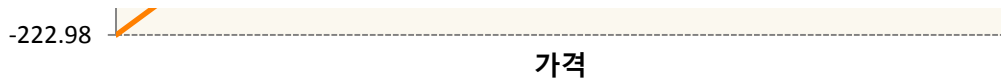
**BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19**



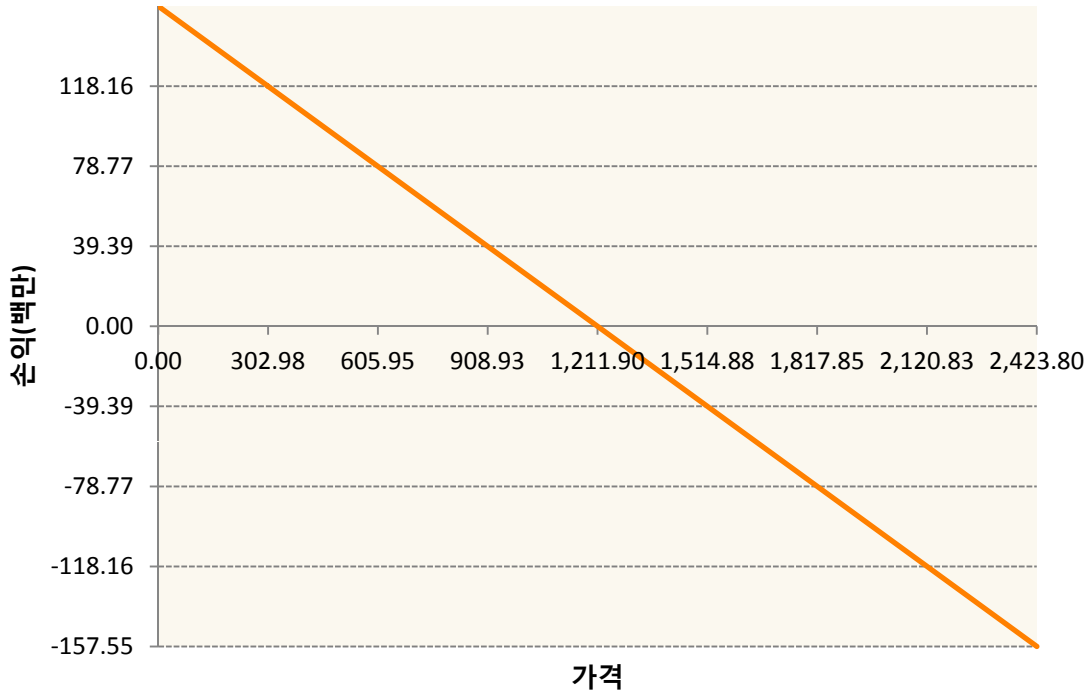
**CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19**



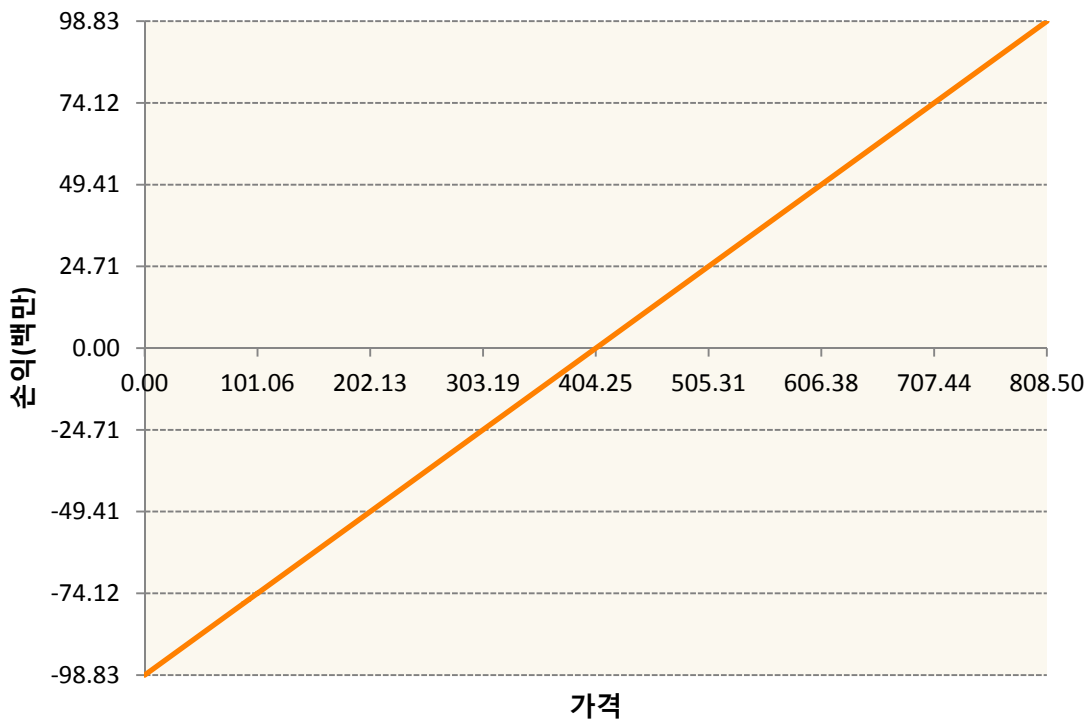




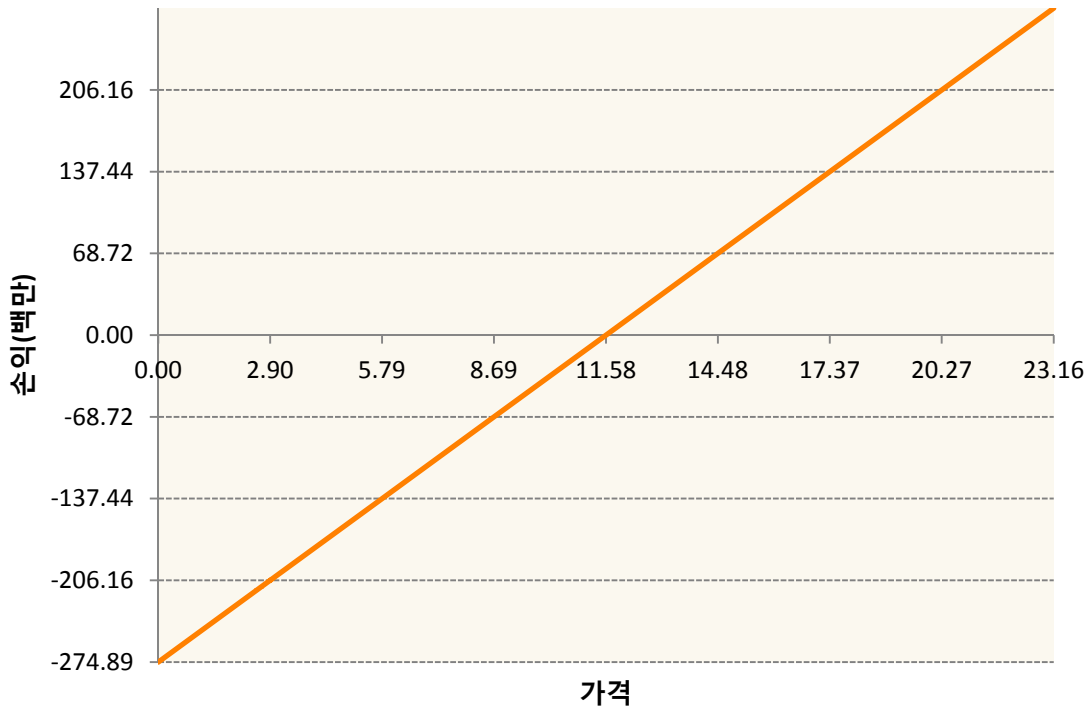
KR4175P90005-2019-09 달러선물



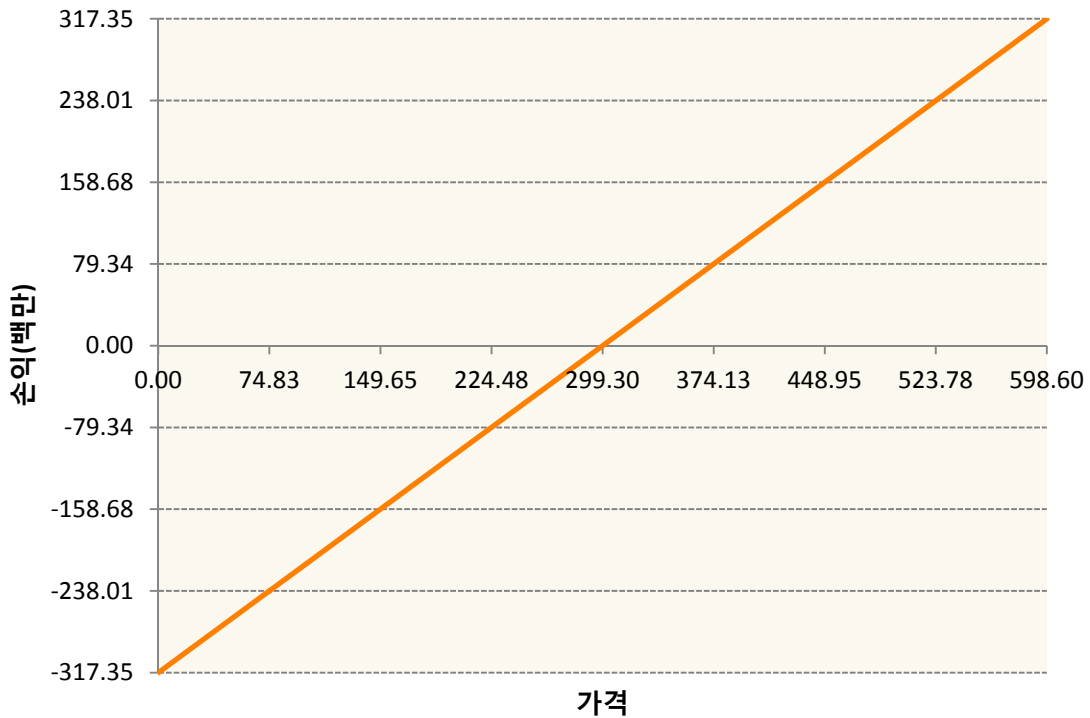
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



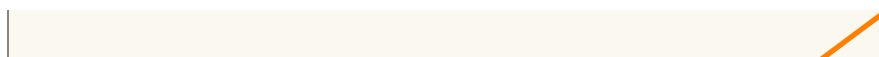
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

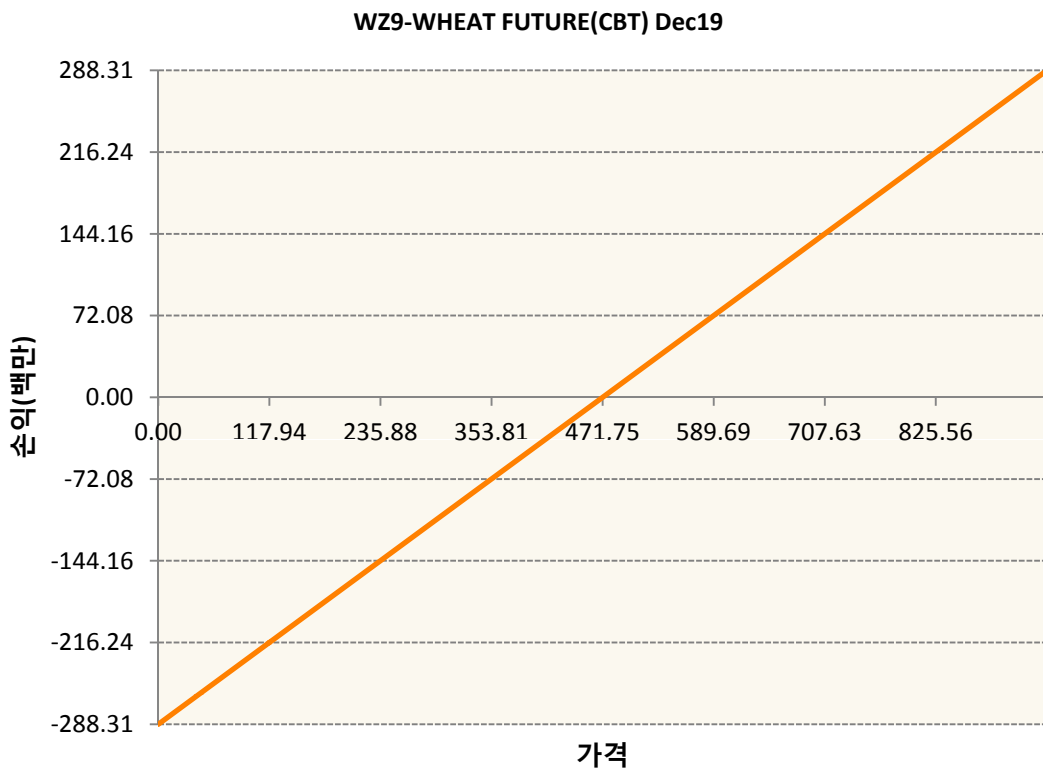
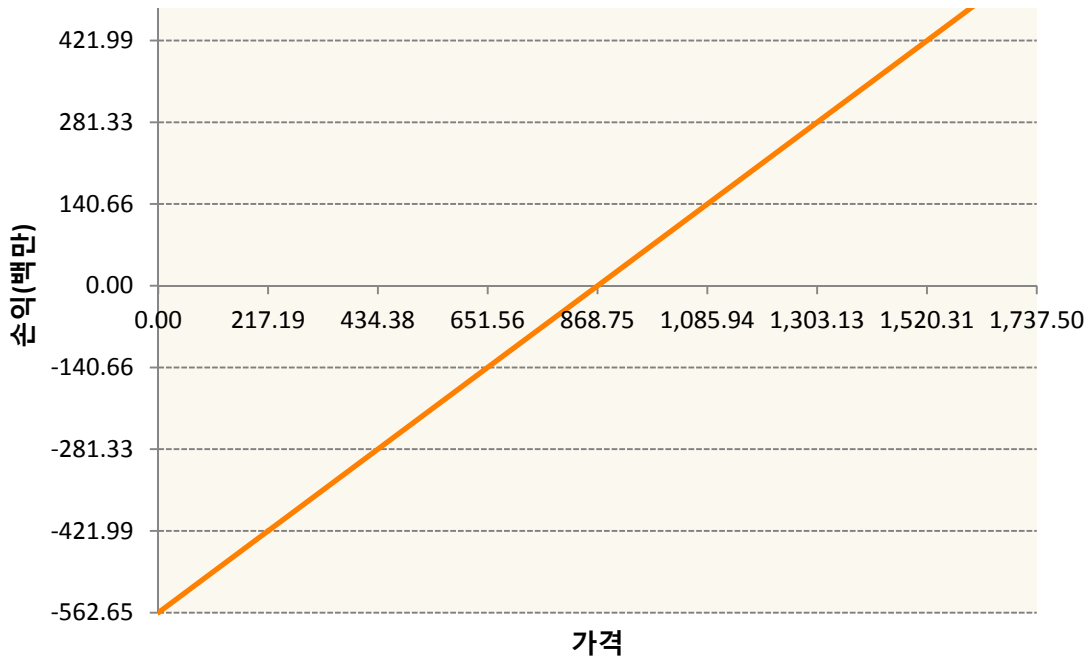


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





**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)

**244**