

공시일	2019-08-27
기준일	2019-08-26

## 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)

86

공시일	2019-08-27
기준일	2019-08-26

## 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

1,125

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

682

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-27
기준일	2019-08-26

## 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)	368
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	134

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

800

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-27
기준일	2019-08-26

## 유로인덱스모(주식-파생형)

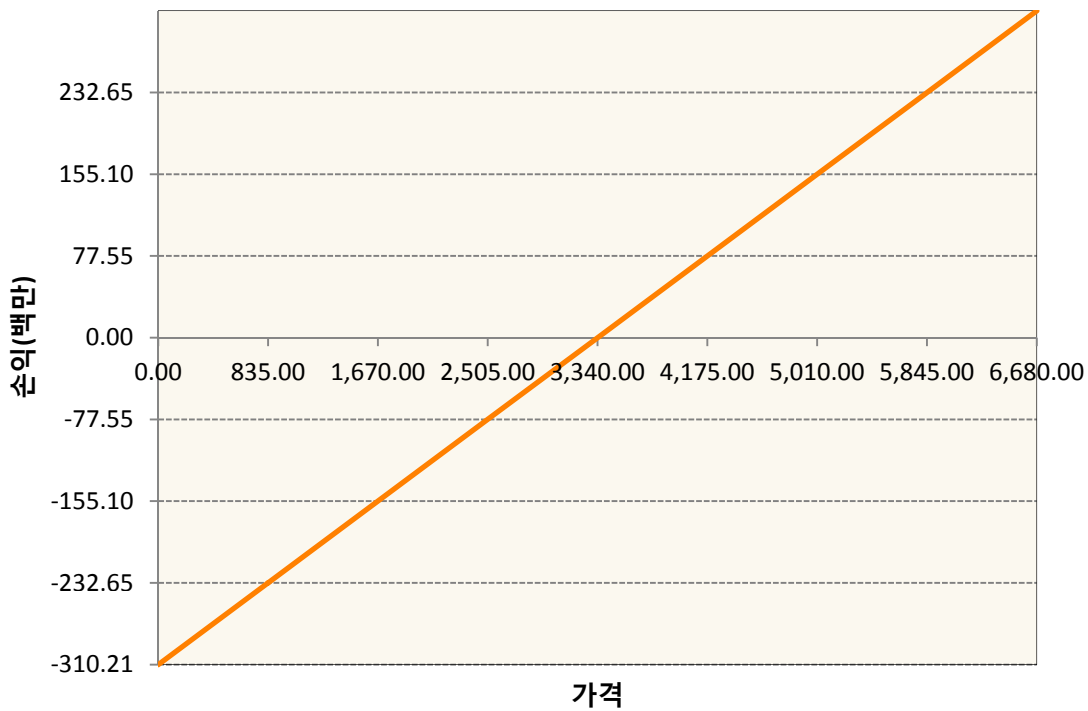
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	310	0	310	

### 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)

17
----

공시일	2019-08-27
기준일	2019-08-26

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

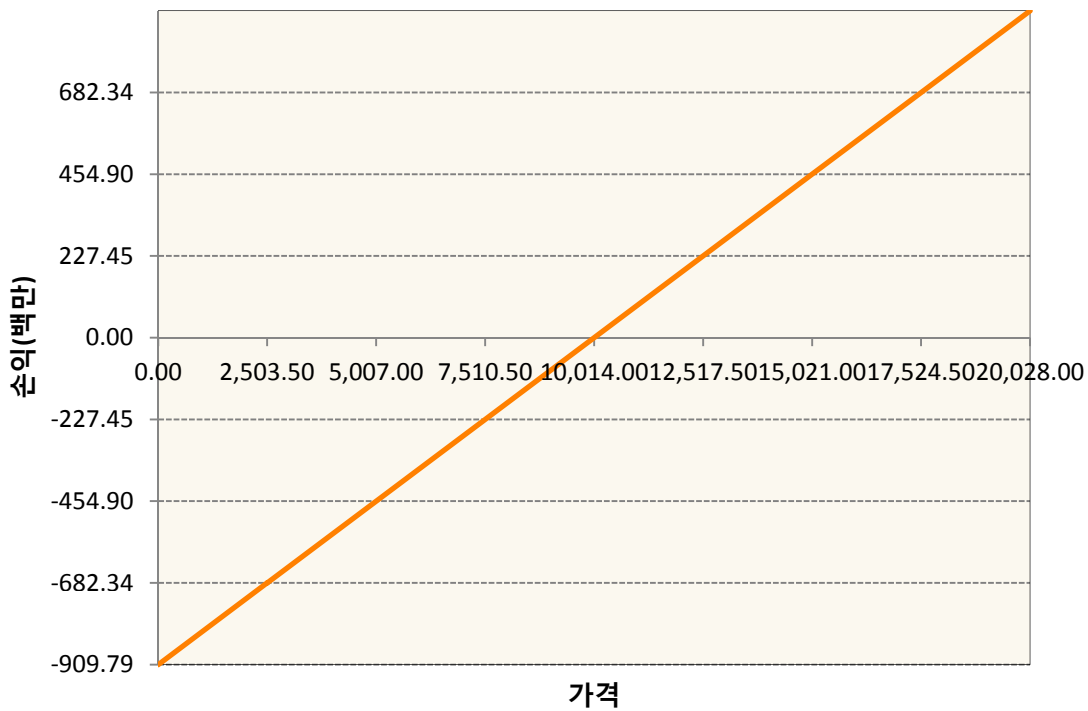
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

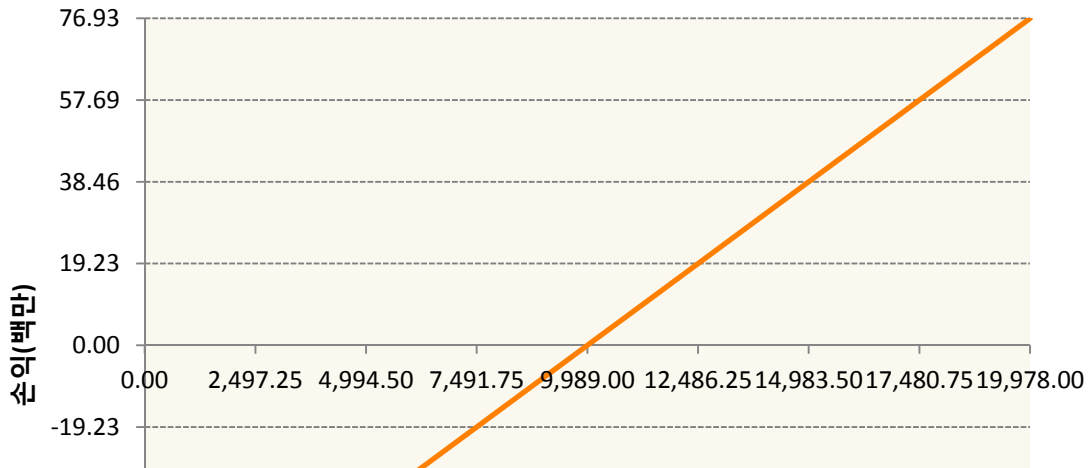
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	987	0	987	장내

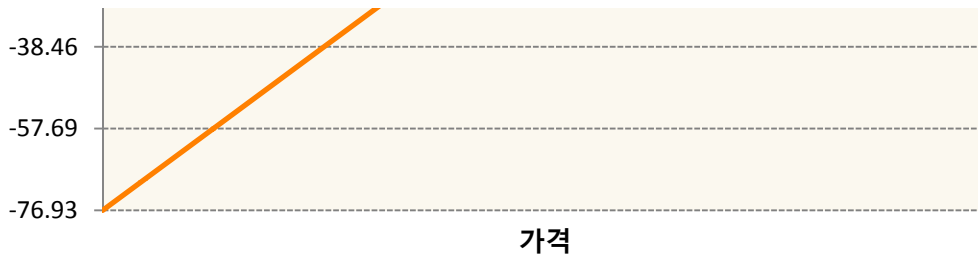
### 2. 만기시점의 손익구조

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)

<b>70</b>
-----------

공시일	2019-08-27
기준일	2019-08-26

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

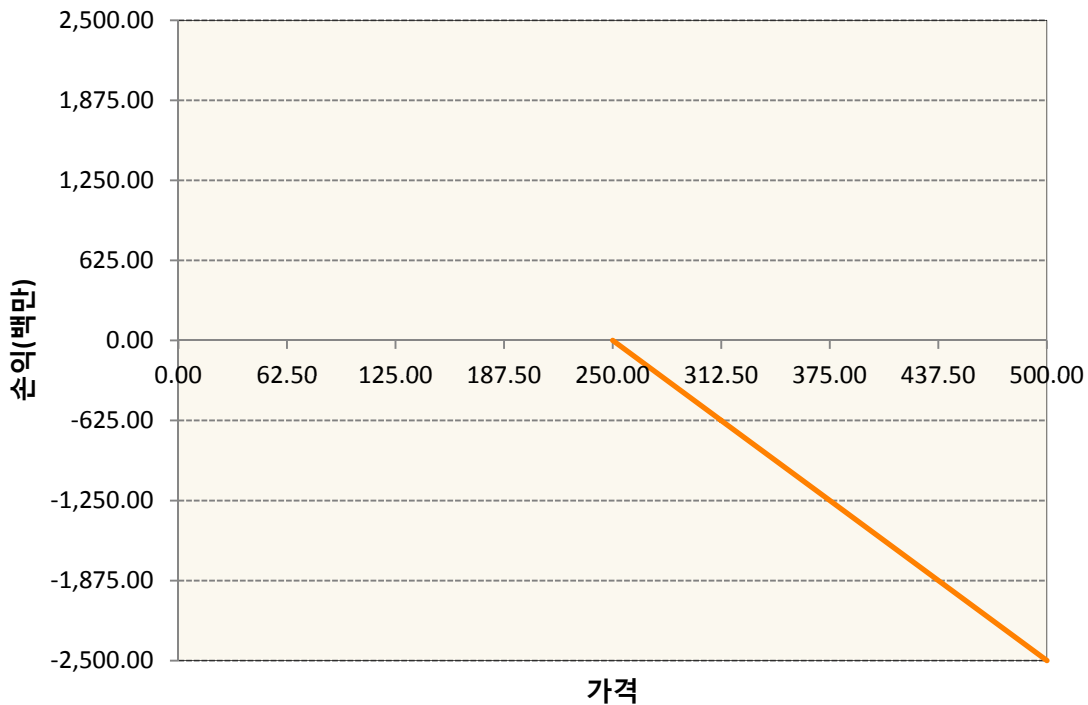
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

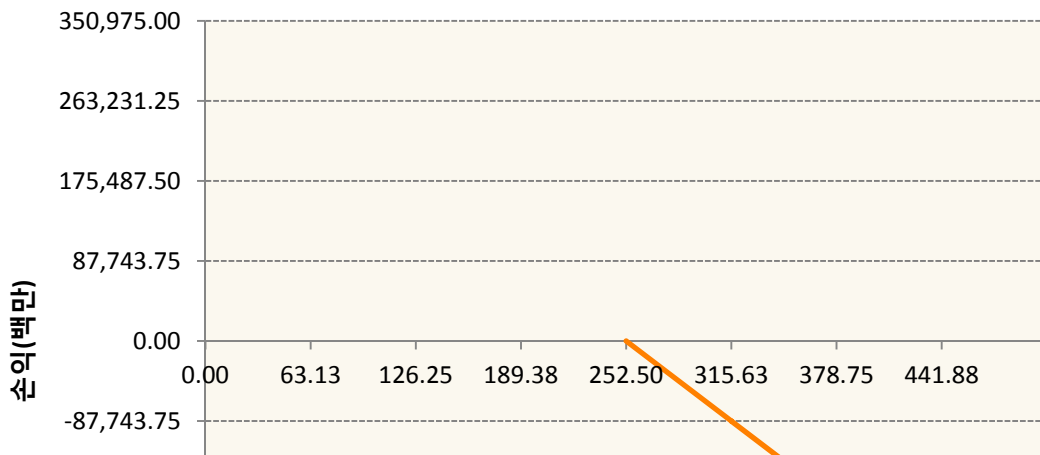
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	520,569	-520,569	장내

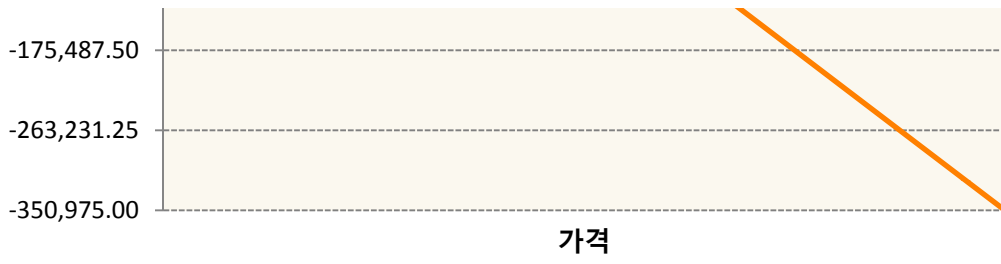
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P92500-2019-09 콜250

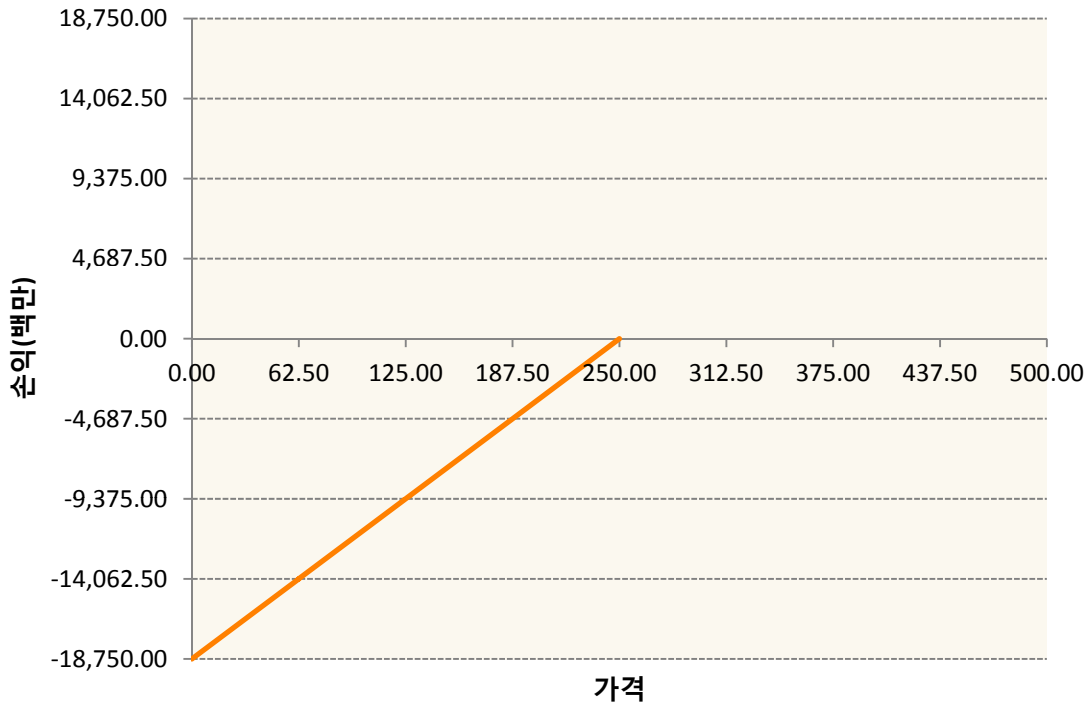


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

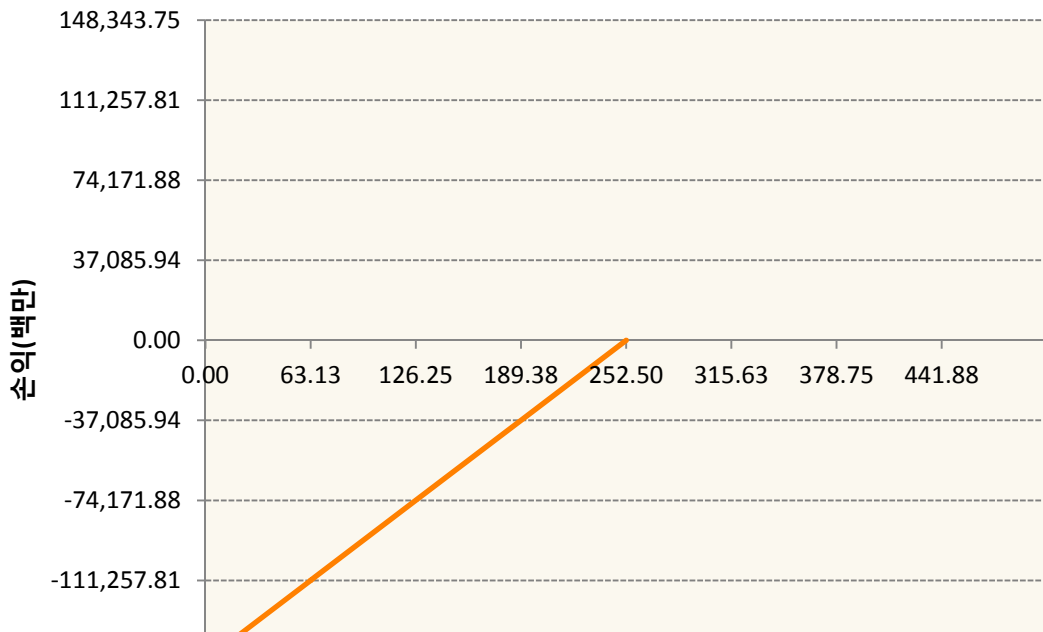




**KR4301P92508-2019-09 풋250**



**KR4301P92524-2019-09 풋252.5**



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P92500		2019-09 콜250						166
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	62	61	60	59	57	55	53	
-5.33%	58	55	53	50	47	44	41	
-2.67%	43	39	36	32	28	23	19	
0%	13	9	4	0	-4	-9	-13	
2.67%	-35	-38	-41	-45	-48	-52	-56	
5.33%	-94	-96	-98	-100	-102	-105	-108	
8.00%	-159	-160	-161	-162	-163	-165	-166	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5						21,855
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	6,897	6,828	6,726	6,590	6,420	6,218	5,985	
-5.33%	6,527	6,297	6,024	5,714	5,371	5,001	4,607	
-2.67%	5,158	4,690	4,199	3,693	3,173	2,642	2,103	
0%	1,821	1,214	607	0	-607	-1,214	-1,821	
2.67%	-3,962	-4,478	-5,011	-5,557	-6,113	-6,677	-7,248	
5.33%	-11,717	-12,015	-12,357	-12,734	-13,141	-13,574	-14,028	
8.00%	-20,536	-20,657	-20,820	-21,024	-21,267	-21,545	-21,855	
KR4301P92508		2019-09 풋250						1,179
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,166	-1,166	-1,167	-1,169	-1,171	-1,175	-1,179	
-5.33%	-669	-674	-681	-689	-698	-709	-720	
-2.67%	-225	-242	-260	-278	-297	-317	-336	
0%	64	43	21	0	-21	-43	-64	
2.67%	172	162	150	136	122	107	91	
5.33%	192	190	187	182	176	169	161	
8.00%	194	194	194	193	191	189	186	
KR4301P92524		2019-09 풋252.5						9,964
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-9,904	-9,905	-9,909	-9,916	-9,926	-9,943	-9,964	
-5.33%	-5,978	-5,999	-6,029	-6,070	-6,120	-6,180	-6,249	
-2.67%	-2,275	-2,374	-2,483	-2,600	-2,725	-2,855	-2,990	
0%	517	345	172	0	-172	-345	-517	
2.67%	1,839	1,720	1,593	1,459	1,319	1,174	1,026	

5.33%	2,171	2,136	2,090	2,031	1,962	1,883	1,795
8.00%	2,213	2,208	2,199	2,184	2,162	2,133	2,095

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

(단위:백만원)

**34,835**

공시일	2019-08-27
기준일	2019-08-26

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

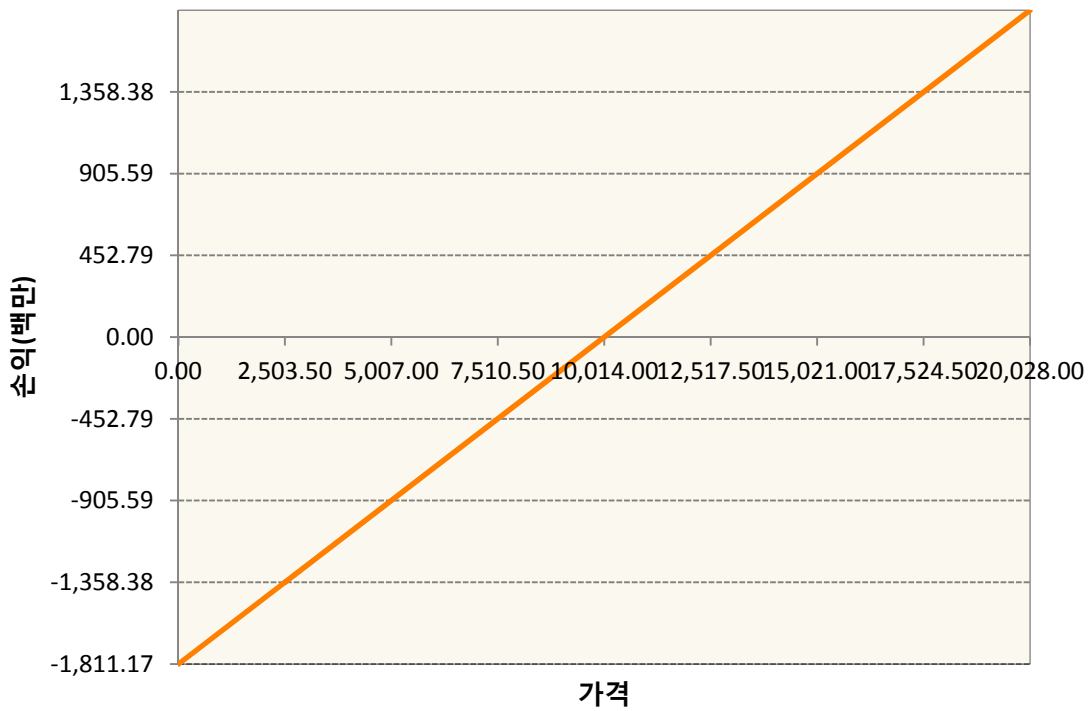
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

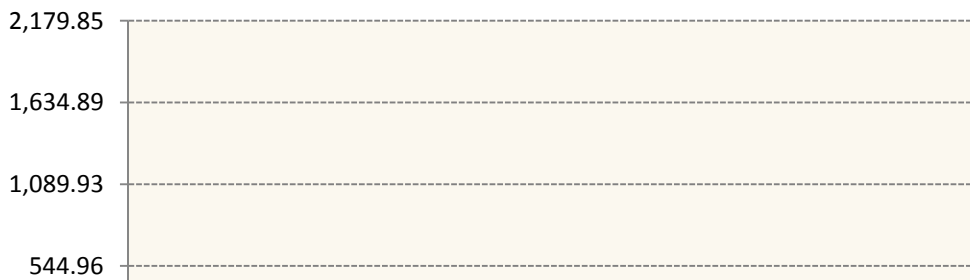
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,811	0	1,811	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,375	-5,375	장내
누계	통화	선도	0	2,885	-2,885	장외

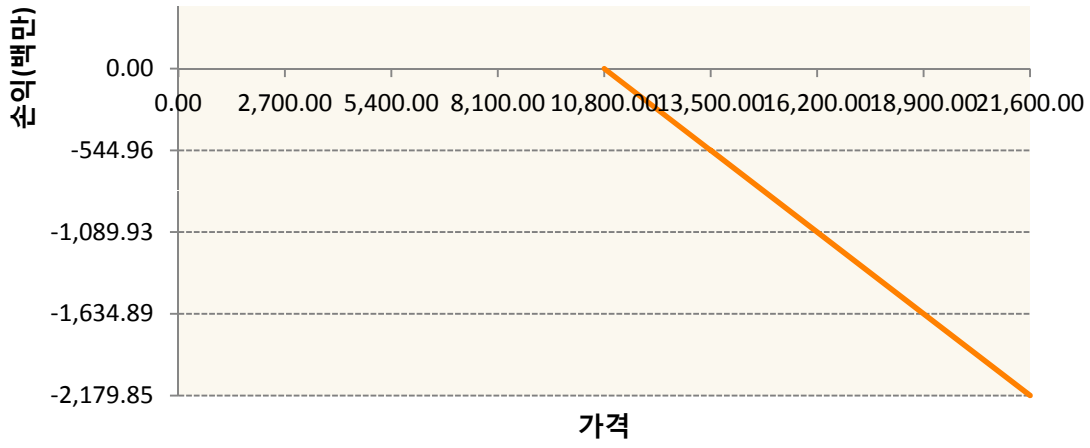
### 2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19

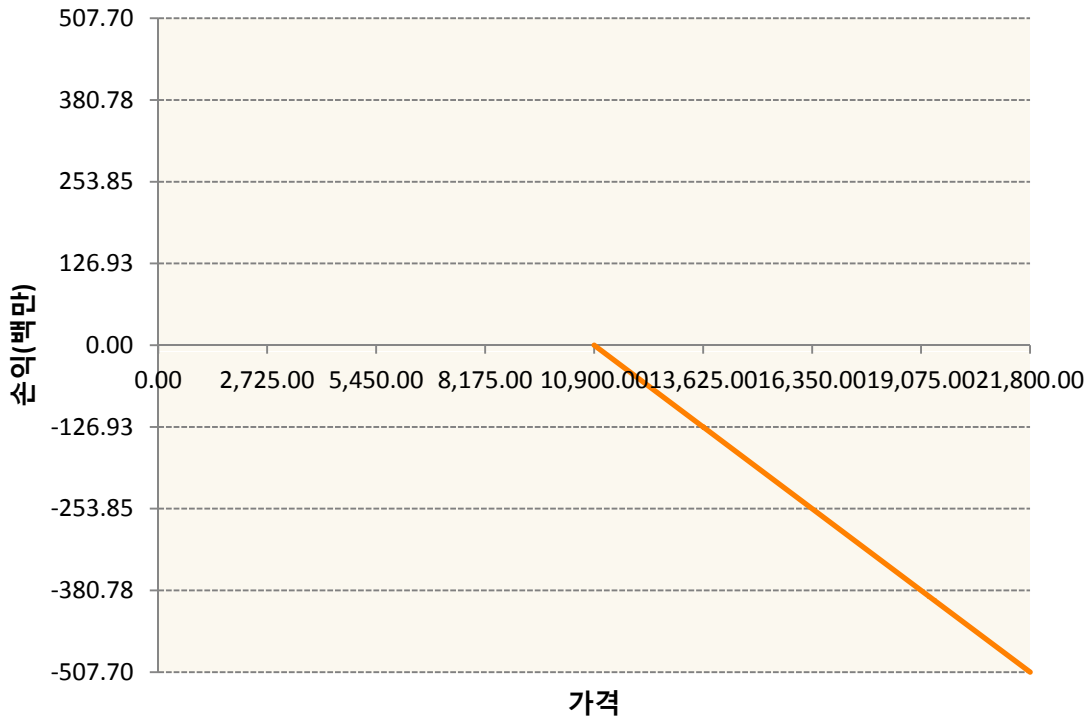


OHHIQ9-C108-HSCEI

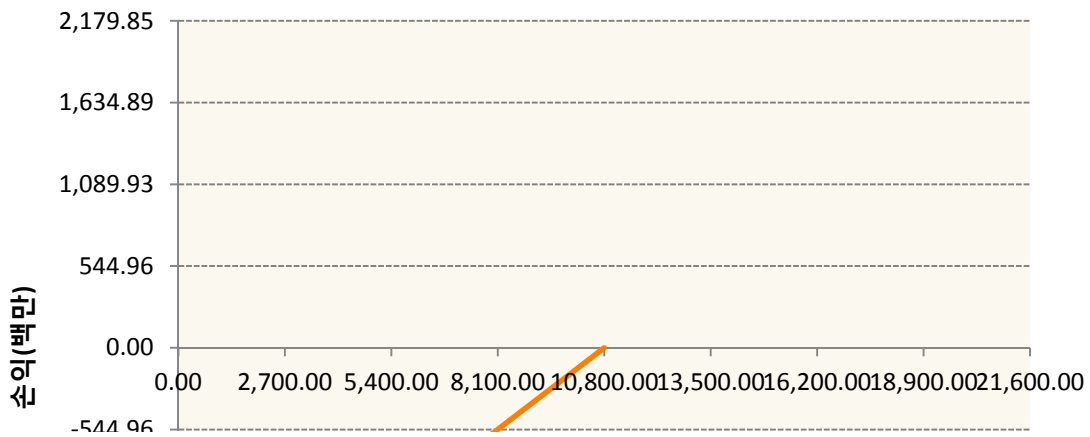


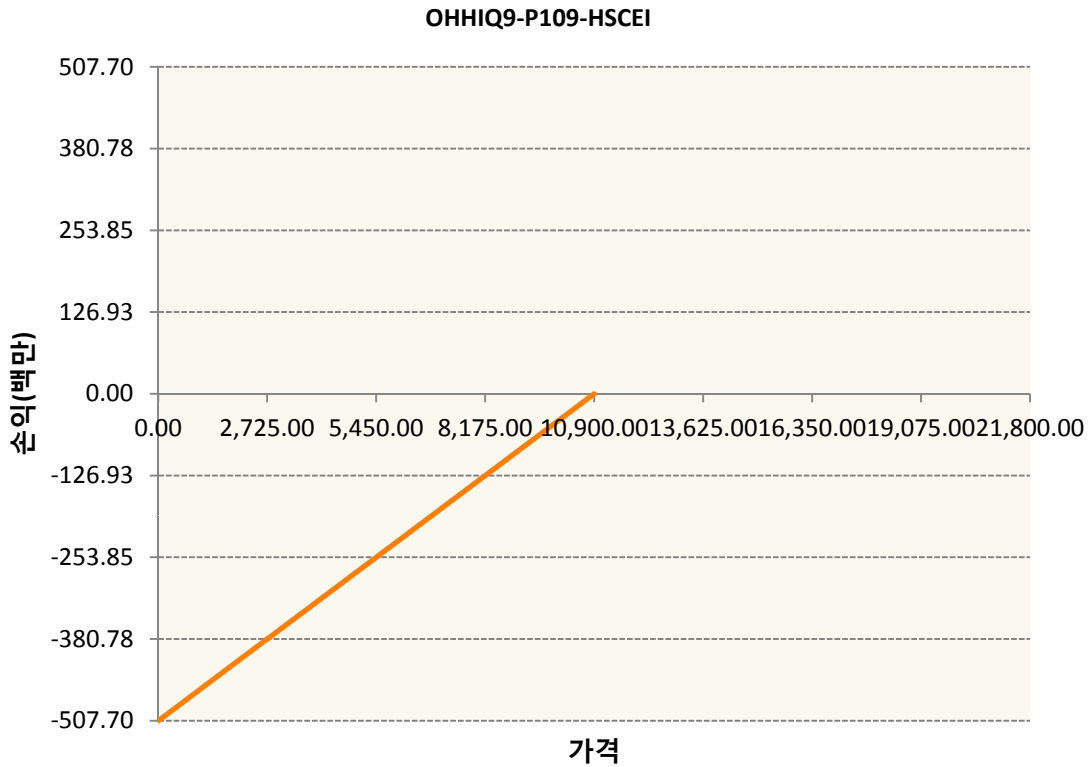


OHHIQ9-C109-HSCEI



OHHIQ9-P108-HSCEI





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

FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	231
HCQ9 HSCEI Futures Aug19	145
OHHIQ9-C1(HSCEI	174
OHHIQ9-C1(HSCEI	41
OHHIQ9-P1(HSCEI	174
OHHIQ9-P1(HSCEI	41

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

**580**

공시일	2019-08-27
기준일	2019-08-26

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

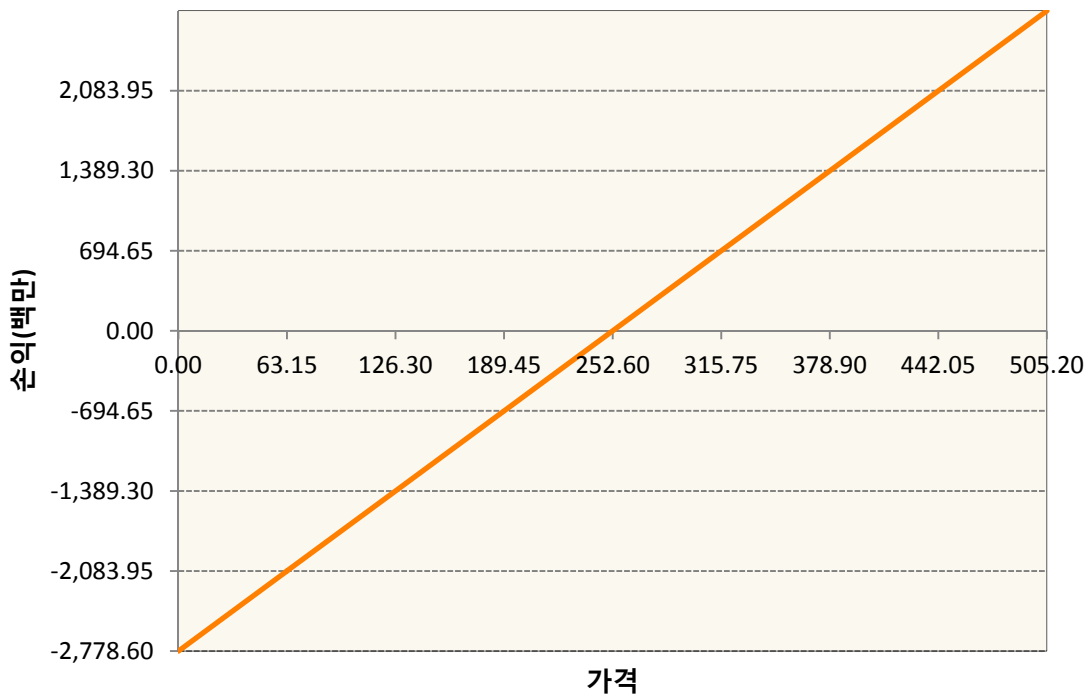
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

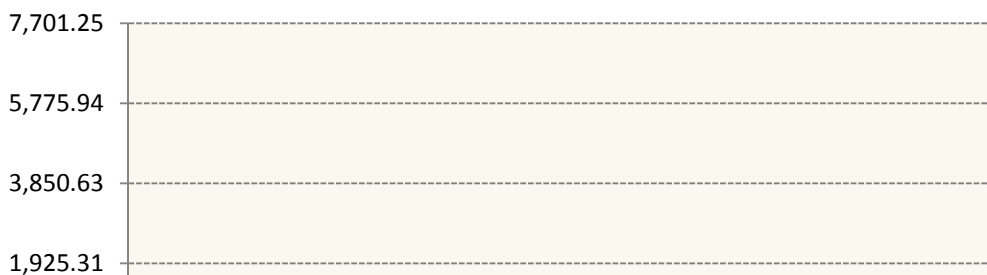
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,779	0	2,779	장내
누계	유가증권	스왑	14,125	0	14,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,829	-14,829	장내

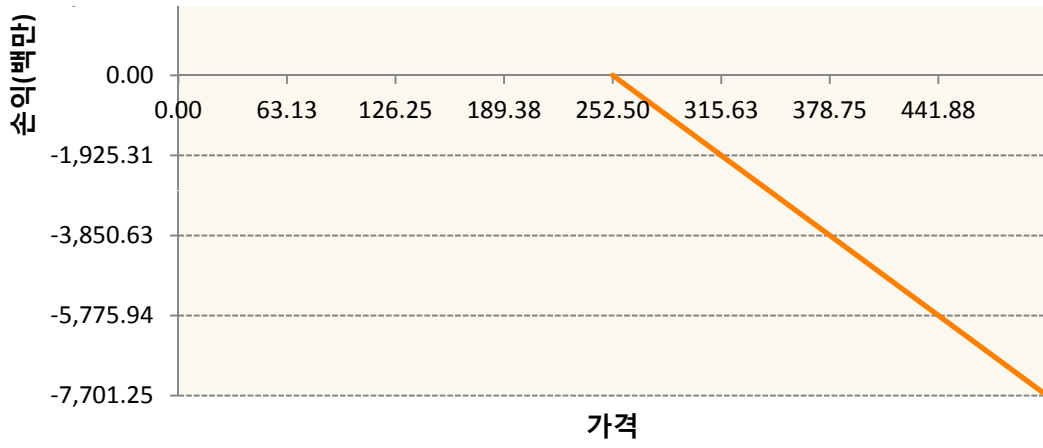
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

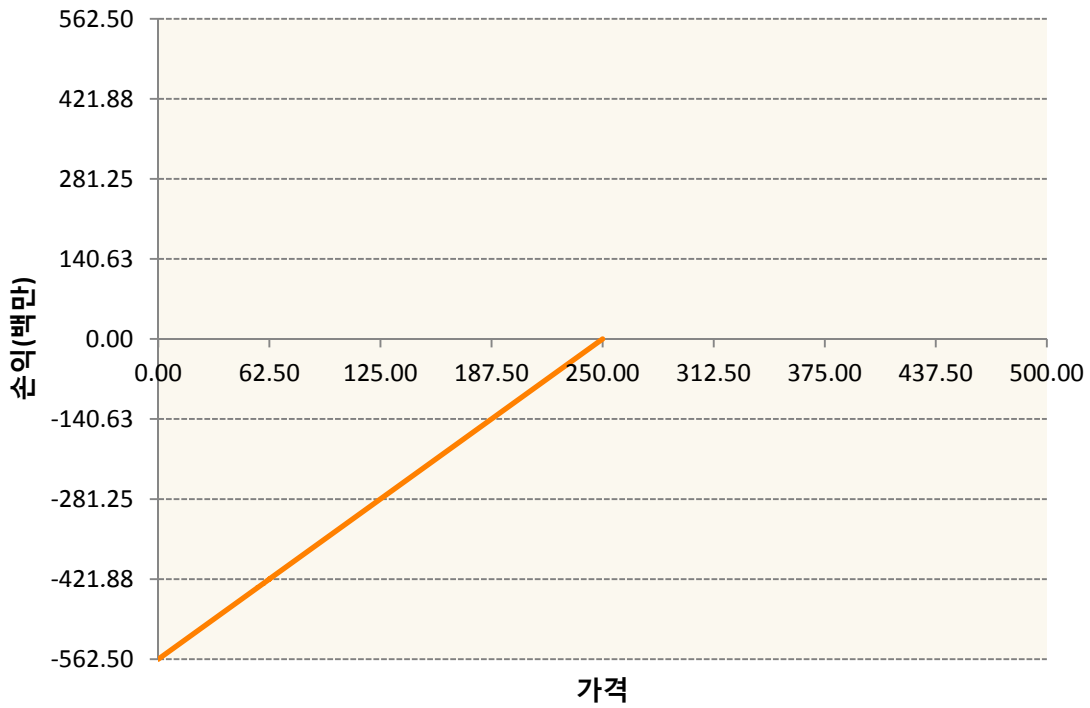


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

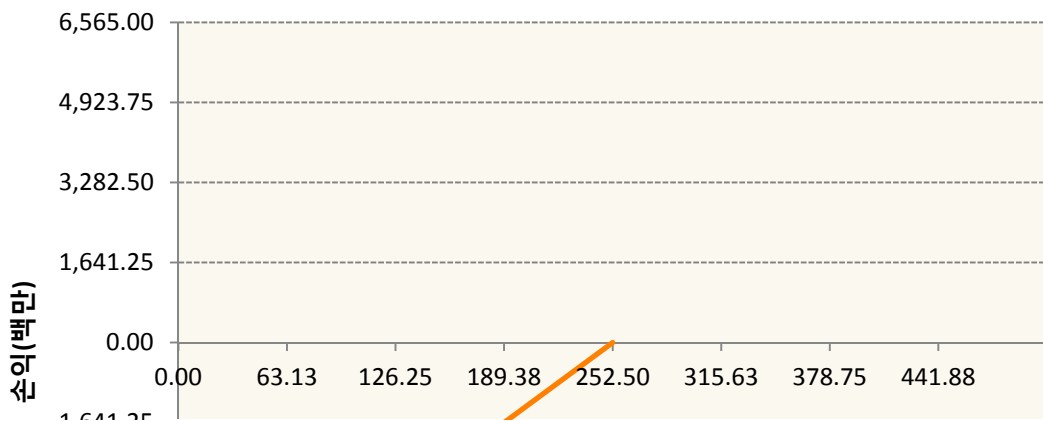




**KR4301P92508-2019-09 풋250**



**KR4301P92524-2019-09 풋252.5**





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						1,225
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,225	-1,225	-1,225	-1,225	-1,225	-1,225	-1,225	
-5.33%	-817	-817	-817	-817	-817	-817	-817	
-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%	817	817	817	817	817	817	817	
8.00%	1,225	1,225	1,225	1,225	1,225	1,225	1,225	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						222
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-222	-222	-222	-222	-222	-222	-222	
-5.33%	-148	-148	-148	-148	-148	-148	-148	
-2.67%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	74	74	74	74	74	74	74	
5.33%	148	148	148	148	148	148	148	
8.00%	222	222	222	222	222	222	222	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5						480
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	151	150	148	145	141	136	131	
-5.33%	143	138	132	125	118	110	101	
-2.67%	113	103	92	81	70	58	46	
0%	40	27	13	0	-13	-27	-40	
2.67%	-87	-98	-110	-122	-134	-147	-159	
5.33%	-257	-264	-271	-279	-288	-298	-308	
8.00%	-451	-453	-457	-461	-467	-473	-480	
KR4301P92508		2019-09 풋250						35
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-5.33%	-20	-20	-20	-21	-21	-21	-22
-2.67%	-7	-7	-8	-8	-9	-10	-10
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	5	5	4	4	4	3	3
5.33%	6	6	6	5	5	5	5
8.00%	6	6	6	6	6	6	6
KR4301P92524      2019-09 풋252.5							441
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-438	-438	-439	-439	-439	-440	-441
-5.33%	-265	-265	-267	-269	-271	-273	-277
-2.67%	-101	-105	-110	-115	-121	-126	-132
0%	23	15	8	0	-8	-15	-23
2.67%	81	76	70	65	58	52	45
5.33%	96	95	92	90	87	83	79
8.00%	98	98	97	97	96	94	93

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

(단위:백만원)

**2,434**

공시일	2019-08-27
기준일	2019-08-26

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

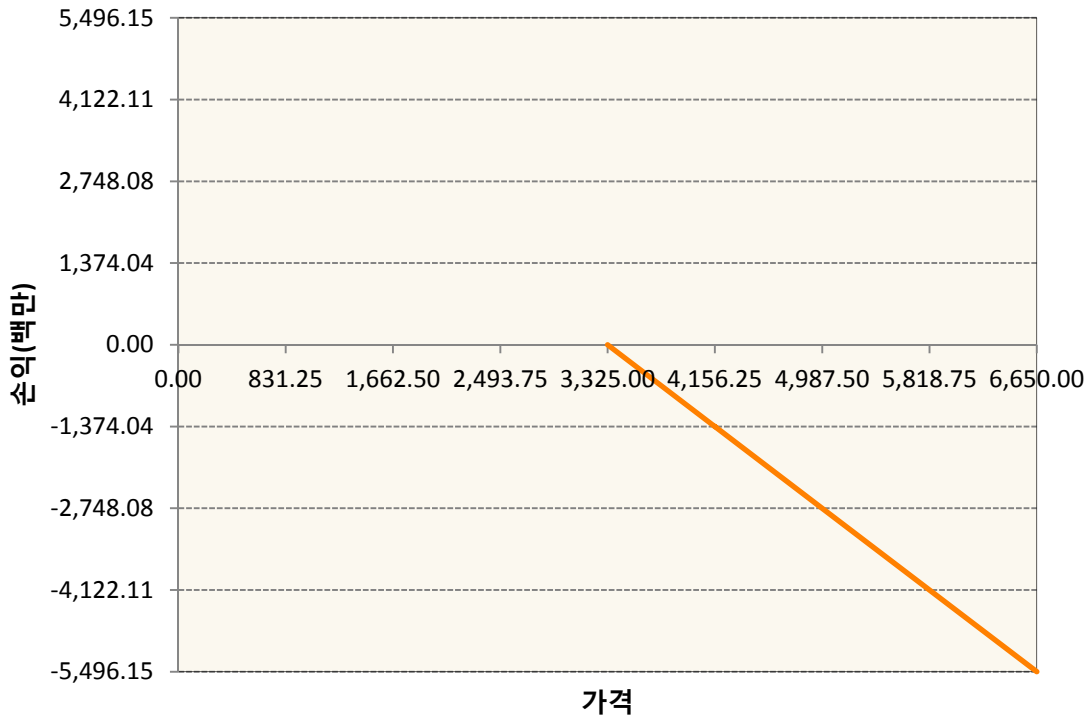
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

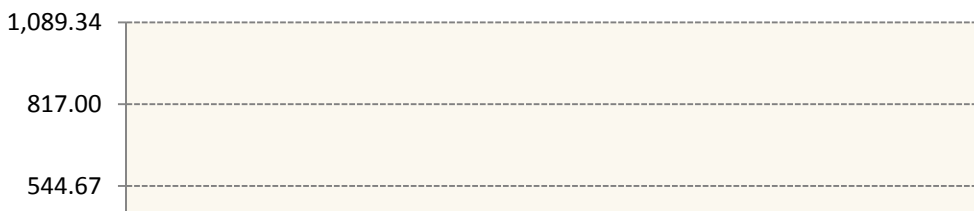
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,755	0	3,755	
누계	유가증권	옵션	0	13,171	-13,171	장내
누계	지수	스왑	28,645	0	28,645	장외
누계	통화	선도	9,213	17,614	-8,401	장외

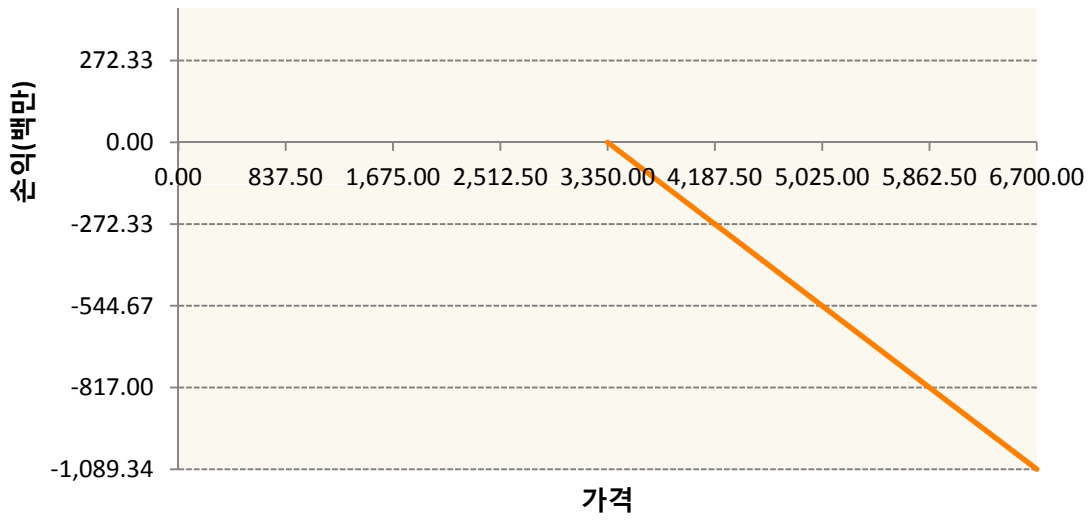
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXU9-C3325-EURO STOXX 50**

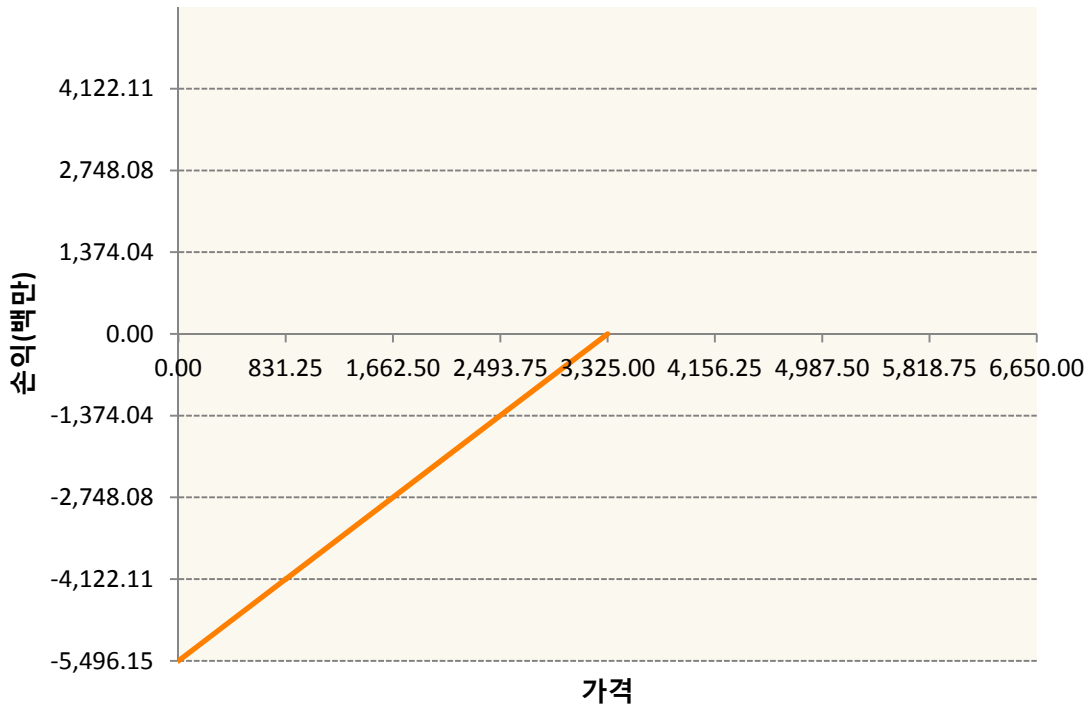


**OESXU9-C3350-EURO STOXX 50**

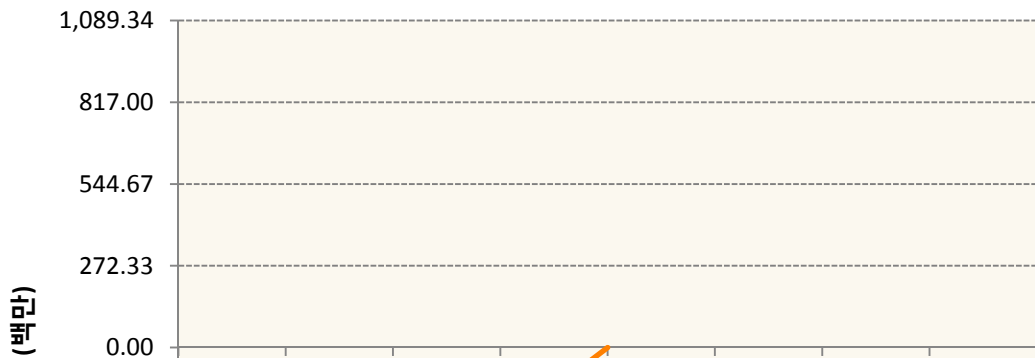


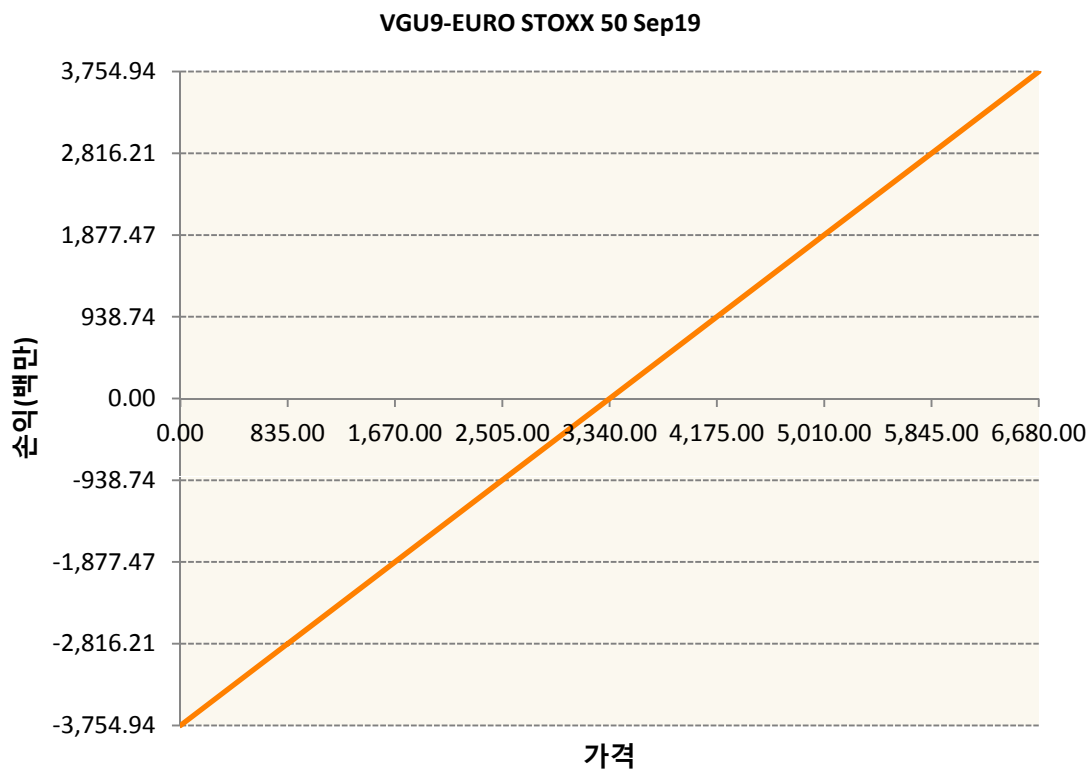
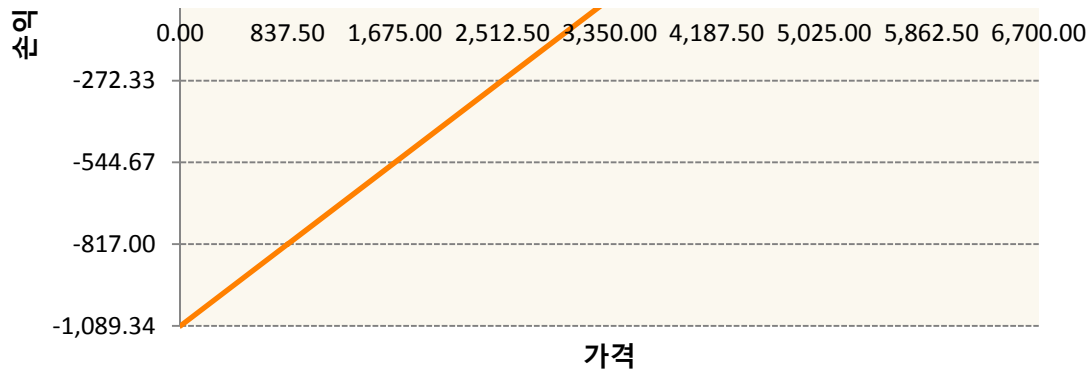


OESXU9-P3325-EURO STOXX 50



OESXU9-P3350-EURO STOXX 50





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	64
FX21019M0< KRW/EUR 27-09-19E	1,084
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	325
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E	325
FX21019N04 EUR/KRW 27-09-19E	238
FX21019Q00 EUR/KRW 27-09-19E	173
OESXU9-C3< EURO STOXX 50	440
OESXU9-C3< EURO STOXX 50	87
OESXU9-P3< EURO STOXX 50	440
OESXU9-P3< EURO STOXX 50	87
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	300

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

(단위:백만원)

2,038



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

(단위:백만원)

908

공시일	2019-08-27
기준일	2019-08-26

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

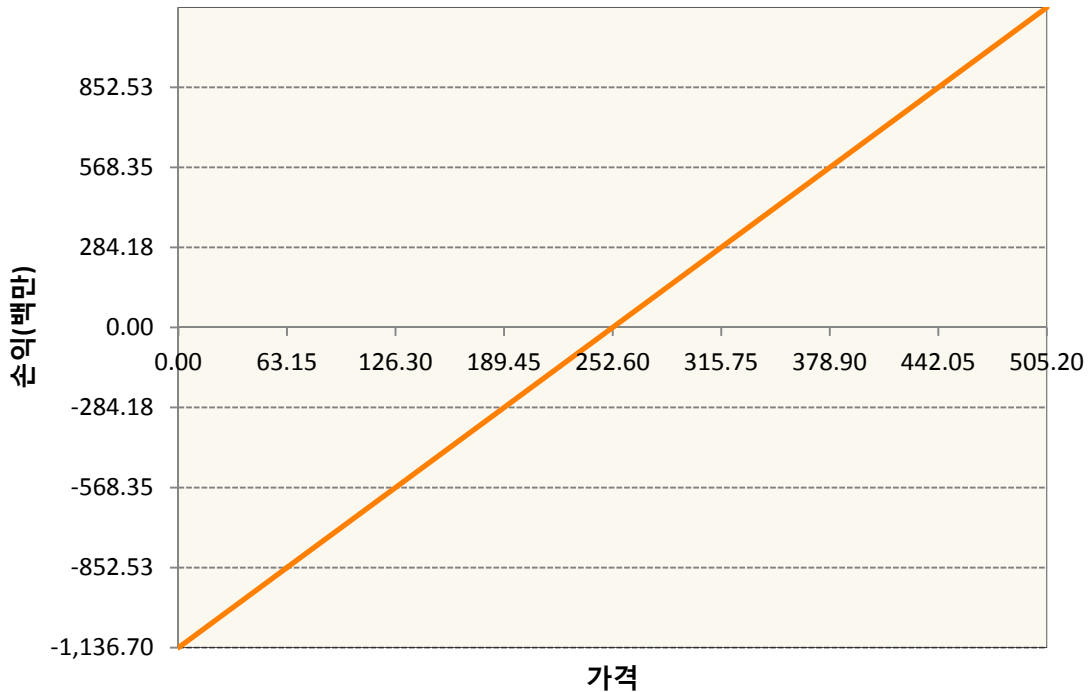
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,137	0	1,137	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						91
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91	
-5.33%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61	
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	30	30	30	30	30	30	30	
5.33%	61	61	61	61	61	61	61	
8.00%	91	91	91	91	91	91	91	

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

(단위:백만원)

77



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

(단위:백만원)

121

공시일	2019-08-27
기준일	2019-08-26

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

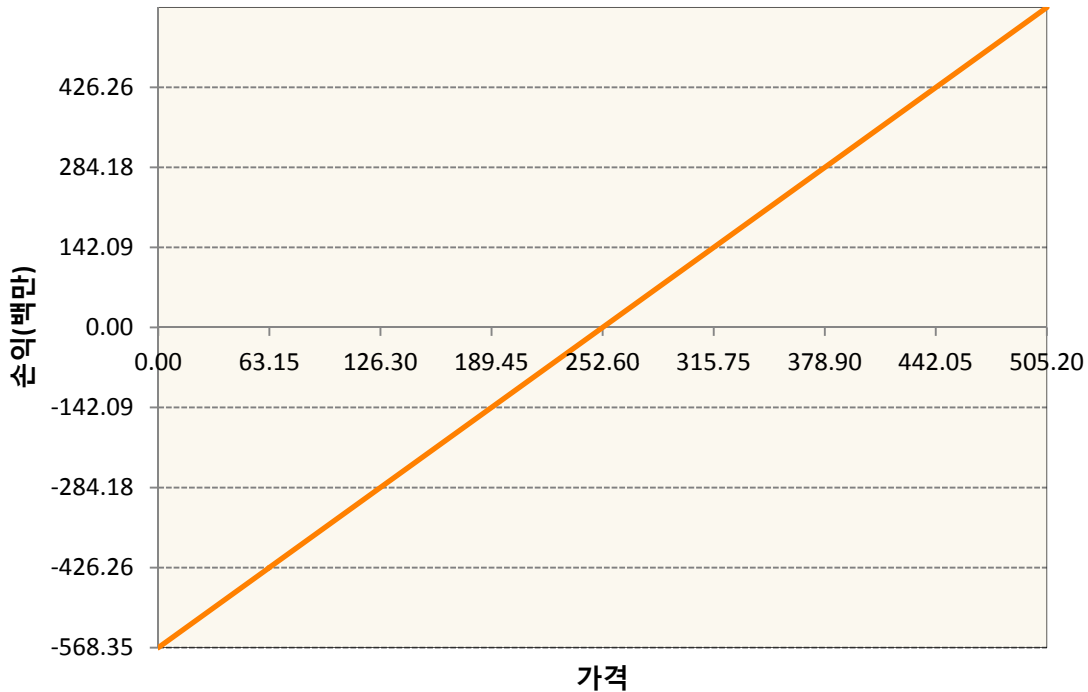
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	568	0	568	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						45
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45	
-5.33%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30	
-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%	30	30	30	30	30	30	30	
8.00%	45	45	45	45	45	45	45	

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

(단위:백만원)

39

공시일	2019-08-27
기준일	2019-08-26

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

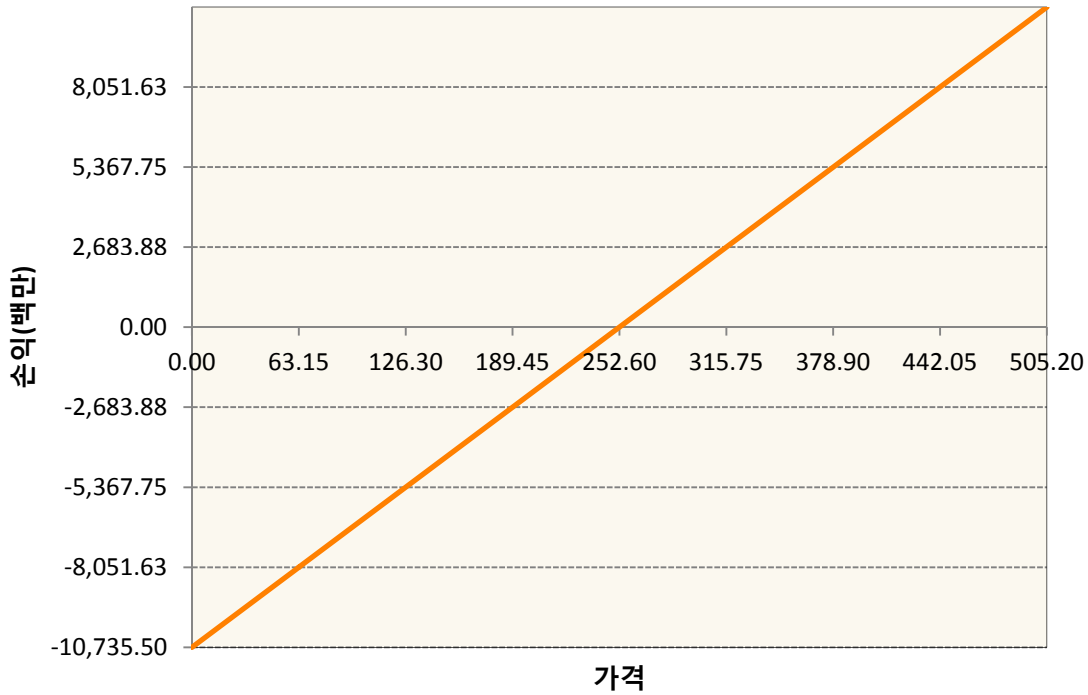
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

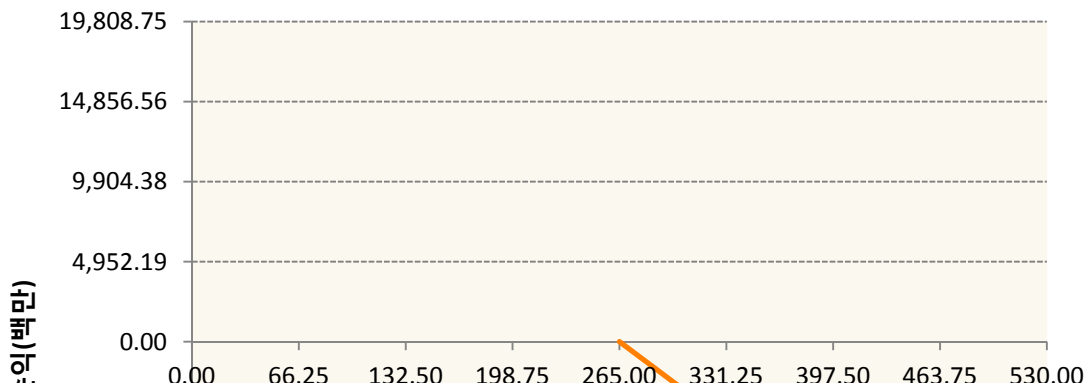
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,736	0	10,736	장내
누계	유가증권	옵션	3,659	19,943	-16,283	장내

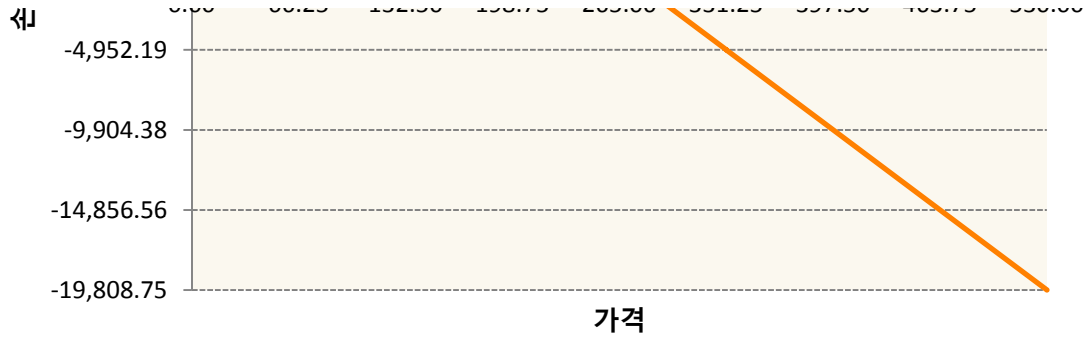
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

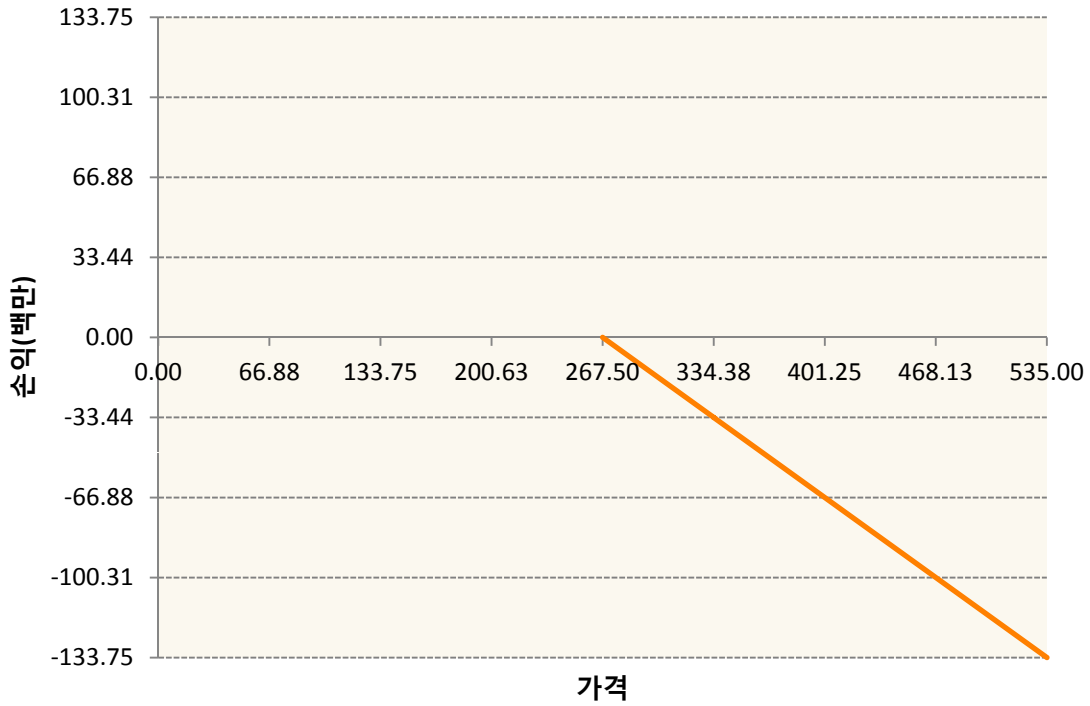


KR4201P92658-2019-09 콜265

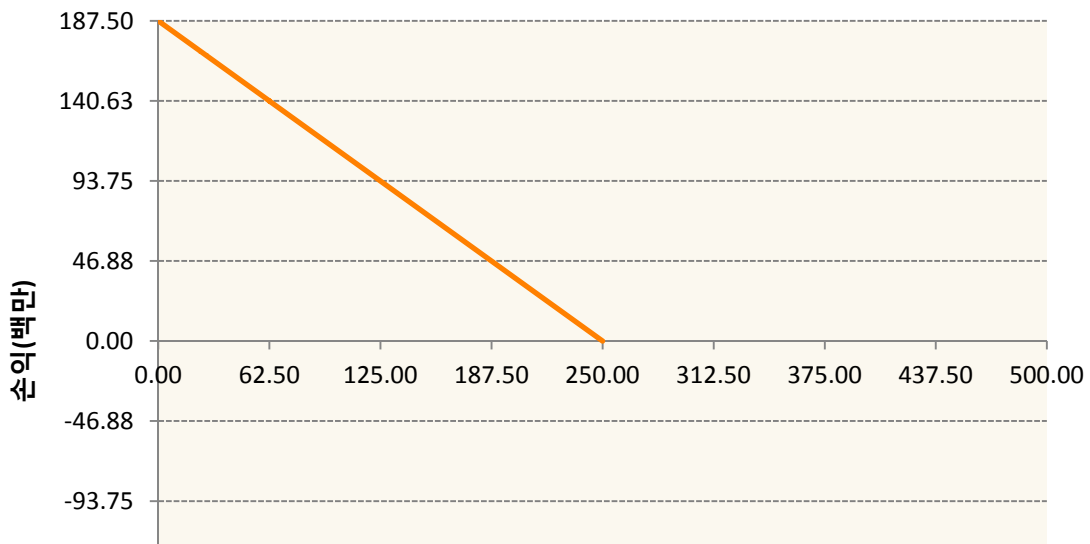


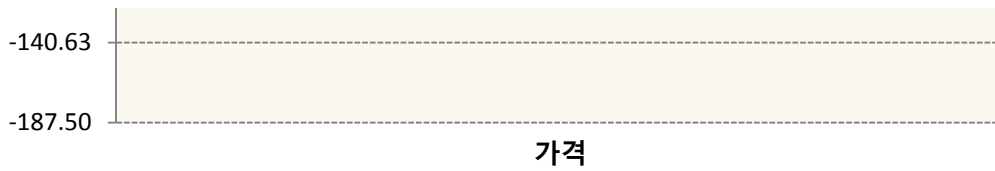


KR4201P92674-2019-09 콜267.5

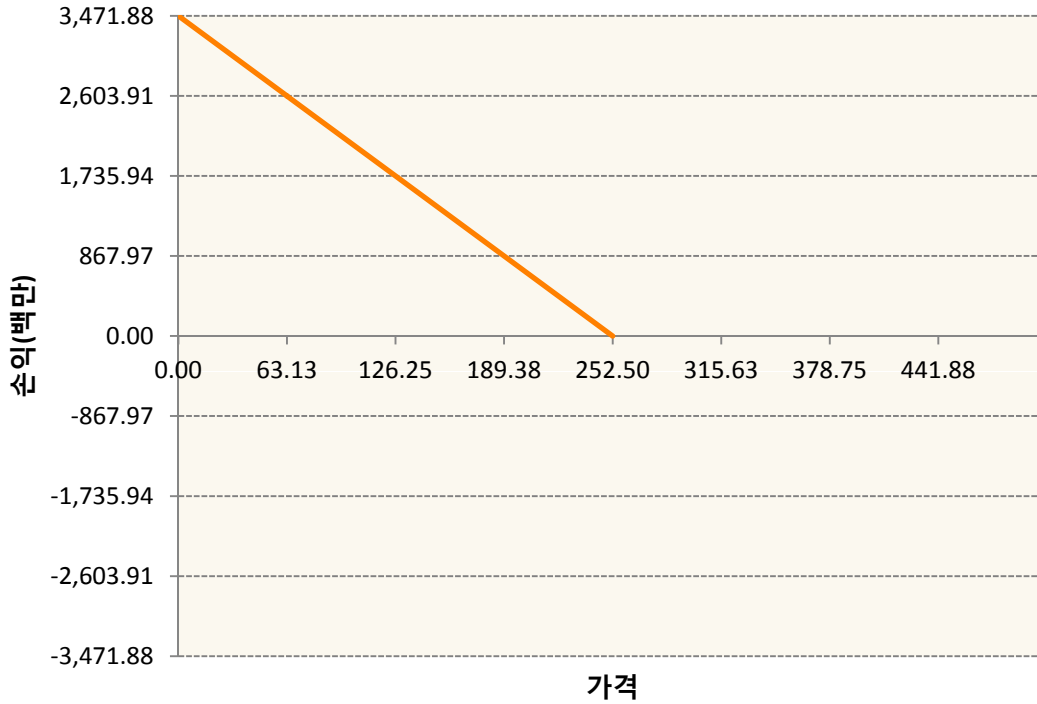


KR4301P92508-2019-09 풋250





KR4301P92524-2019-09 풋252.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물					857	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-857	-857	-857	-857	-857	-857	-857	-857
-5.33%	-572	-572	-572	-572	-572	-572	-572	-572
-2.67%	-286	-286	-286	-286	-286	-286	-286	-286
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	286	286	286	286	286	286	286	286
5.33%	572	572	572	572	572	572	572	572
8.00%	857	857	857	857	857	857	857	857
KR4201P92658		2019-09 콜265					744	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	90	90	89	88	87	84	81	
-5.33%	89	88	86	82	77	70	62	
-2.67%	83	77	70	60	48	34	18	

0%	54	38	20	0	-22	-45	-69
2.67%	-37	-65	-95	-125	-156	-187	-219
5.33%	-237	-271	-306	-340	-374	-409	-443
8.00%	-562	-590	-620	-650	-680	-712	-744
KR4201P92674                      2019-09 콜267.5							4
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	-1	-1	-1	-1
5.33%	-1	-1	-2	-2	-2	-2	-3
8.00%	-3	-3	-3	-4	-4	-4	-4
KR4301P92508                      2019-09 풋250							12
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12	12	12	12	12	12	12
-5.33%	7	7	7	7	7	7	7
-2.67%	2	2	3	3	3	3	3
0%	-1	0	0	0	0	0	1
2.67%	-2	-2	-1	-1	-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							233
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	232	232	232	232	232	233	233
-5.33%	140	140	141	142	143	145	146
-2.67%	53	56	58	61	64	67	70
0%	-12	-8	-4	0	4	8	12
2.67%	-43	-40	-37	-34	-31	-27	-24
5.33%	-51	-50	-49	-48	-46	-44	-42
8.00%	-52	-52	-51	-51	-51	-50	-49

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

(단위:백만원)

1,461

공시일	2019-08-27
기준일	2019-08-26

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	4,262	0	4,262	
누계	유가증권	수익증권	69,585	0	69,585	

### 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	2019-08-27
기준일	2019-08-26

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,827	0	1,827	
누계	유가증권	수익증권	87,868	0	87,868	

### 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	2019-08-27
기준일	2019-08-26

## 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	473,813	0	473,813	
누계	통화	선도	0	461,668	-461,668	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		1,754
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,143
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		136
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		292
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		97
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		721
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		721
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		292
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		682
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		2,728
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		1,364
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		779
FX21019N04 KRW/USD 03-09-19E		292
FX21019Q00 KRW/USD 03-09-19E		292
FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E		487
FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E		195
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		292
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		3,215
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		2,182
FX21019Q01 KRW/USD 16-09-19E		97
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,994
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,605
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,669
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		3,030
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		974
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		974

FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E  
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E  
FX21019Q04 KRW/USD 30-09-19E

974
1,754
195

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

(단위:백만원)

**12,026**

공시일	2019-08-27
기준일	2019-08-26

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

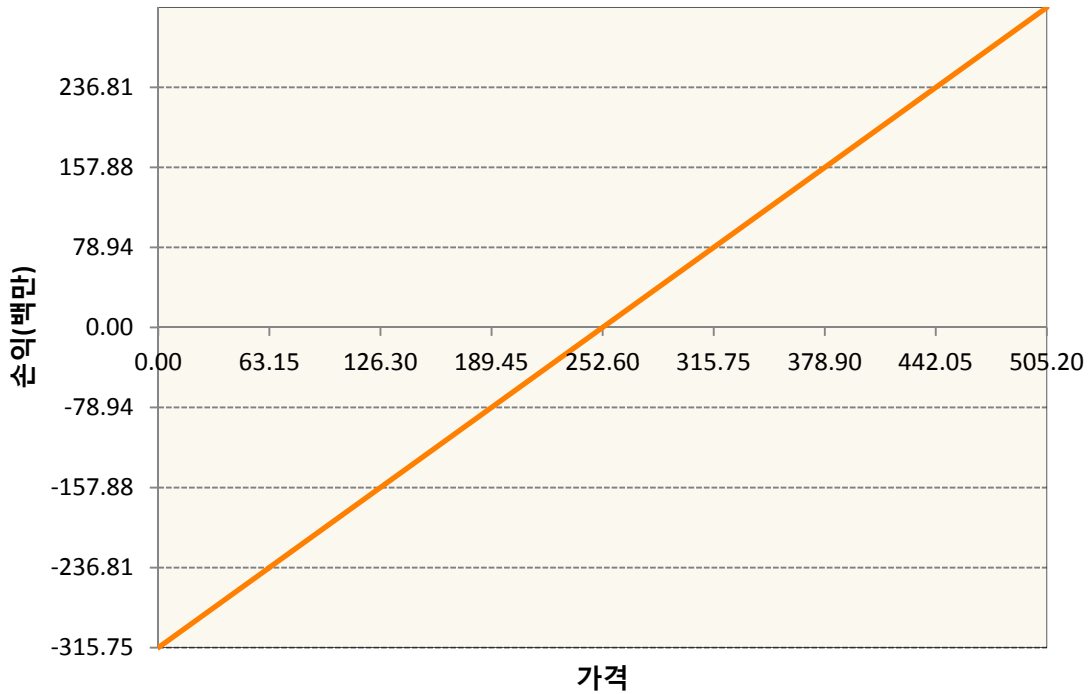
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

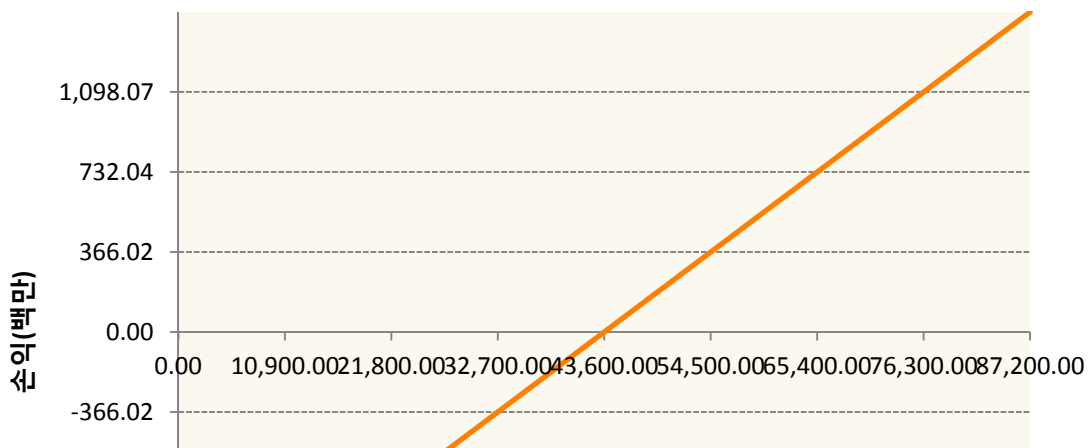
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,780	0	1,780	장내

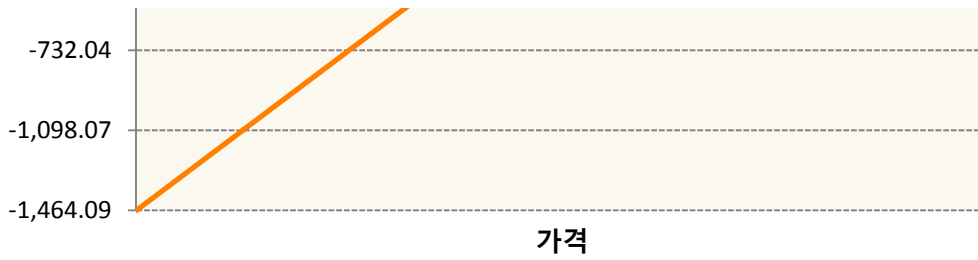
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P90000-2019-09 삼성전자개별선물





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

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						25
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25	
-5.33%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
-2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	8	8	8	8	8	8	8	
5.33%	17	17	17	17	17	17	17	
8.00%	25	25	25	25	25	25	25	
KR4111P90000		2019-09 삼성전자개별선물						117
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117	
-5.33%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78	
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	39	39	39	39	39	39	39	
5.33%	78	78	78	78	78	78	78	
8.00%	117	117	117	117	117	117	117	

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

**167**

공시일	2019-08-27
기준일	2019-08-26

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

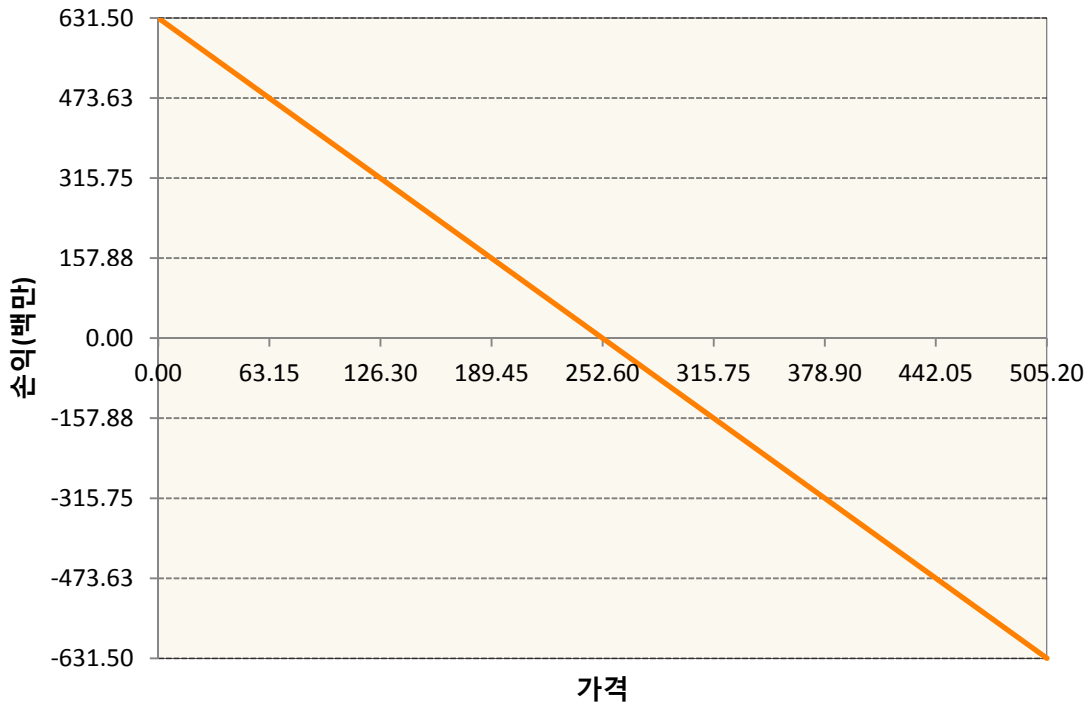
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

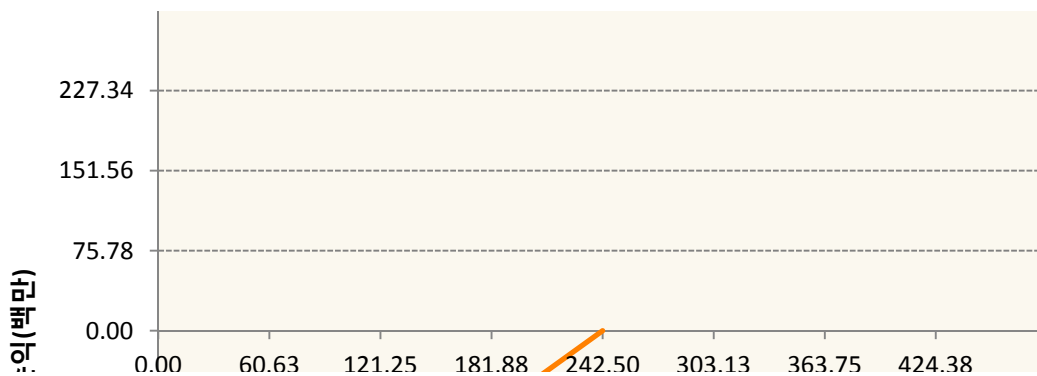
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	632	-632	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,672	-3,672	장내

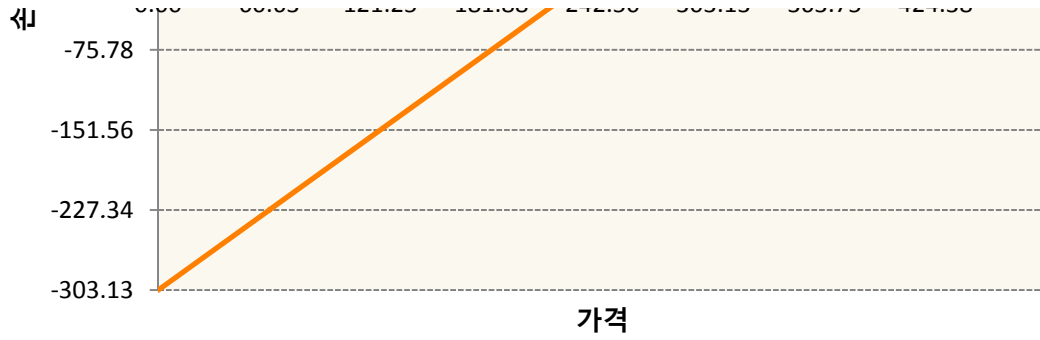
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

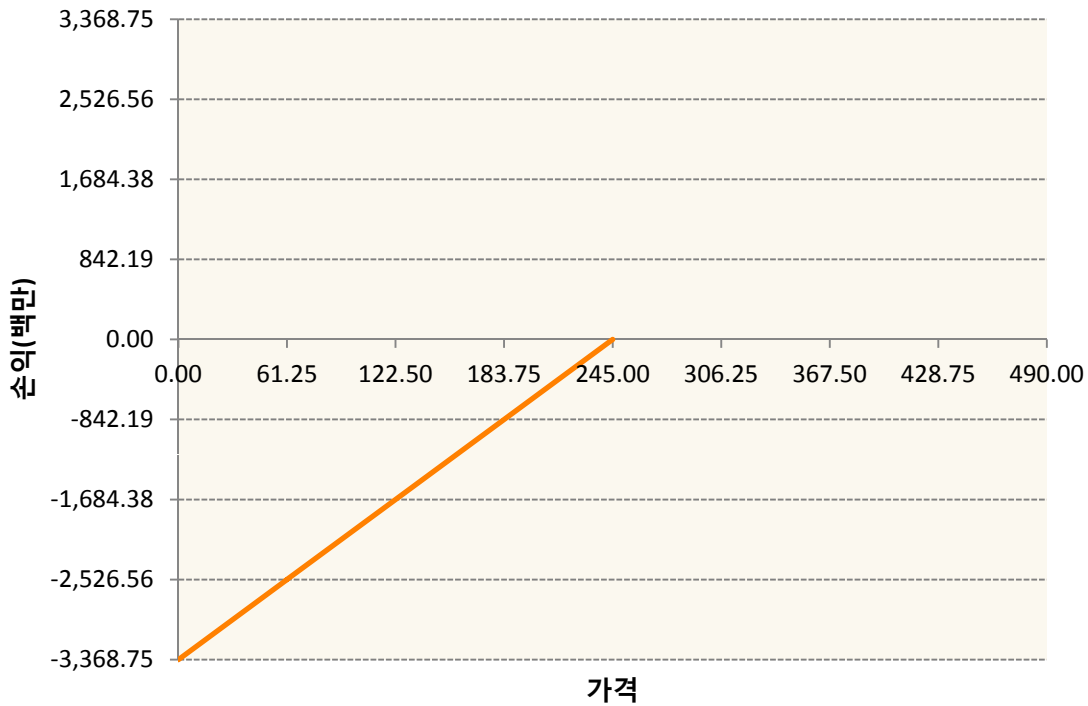


KR4301P92425-2019-09 풋242.5





KR4301P92458-2019-09 풋245



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						50
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	50	50	50	50	50	50	50	
-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%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	
KR4301P92425		2019-09 풋242.5						14
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-14
-5.33%	-5	-6	-6	-6	-7	-7	-7
-2.67%	-1	-1	-2	-2	-2	-3	-3
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

KR4301P92458

2019-09 풋245

173

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-167	-167	-168	-169	-170	-172	-173
-5.33%	-81	-84	-86	-89	-92	-95	-98
-2.67%	-19	-23	-27	-31	-35	-39	-43
0%	8	5	3	0	-3	-6	-9
2.67%	14	13	12	11	10	8	6
5.33%	14	14	14	14	13	13	12
8.00%	14	14	14	14	14	14	14

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

(단위:백만원)

206

공시일	2019-08-27
기준일	2019-08-26

## 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	19,881	0	19,881	
누계	통화	선도	0	19,363	-19,363	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		166
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		487
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		526
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		39
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		331

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

(단위:백만원)

<b>504</b>
------------

공시일	2019-08-27
기준일	2019-08-26

## 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	390	0	390	장외
누계	통화	선도	94	94	0	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	19
2.55E+11 E1VFN30 VN ETF	13
FX21019N01 KRW/EUR 25-10-19E	4
FX21019Q00 KRW/EUR 25-10-19E	4
FX21019Q03 EUR/KRW 25-10-19E	8

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

(단위:백만원)

36
----

공시일	2019-08-27
기준일	2019-08-26

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

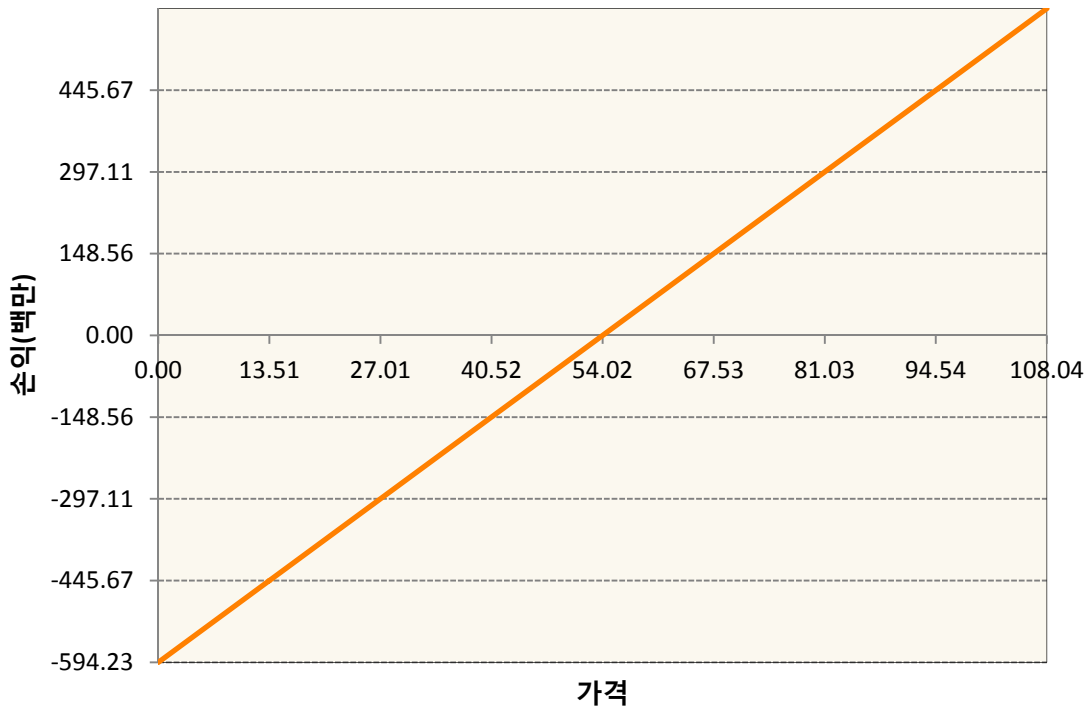
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

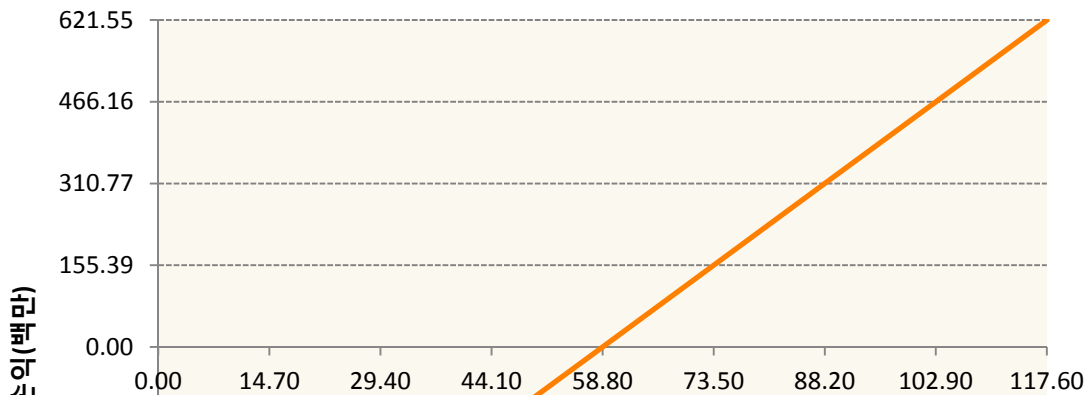
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,191	122	2,069	
누계	유가증권	선물	188	0	188	장내

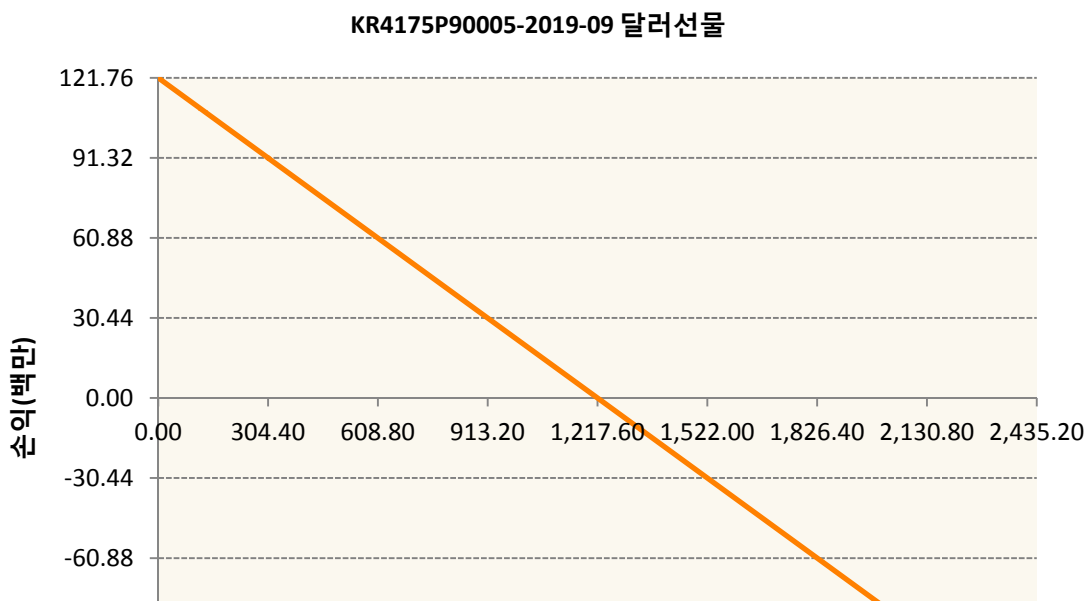
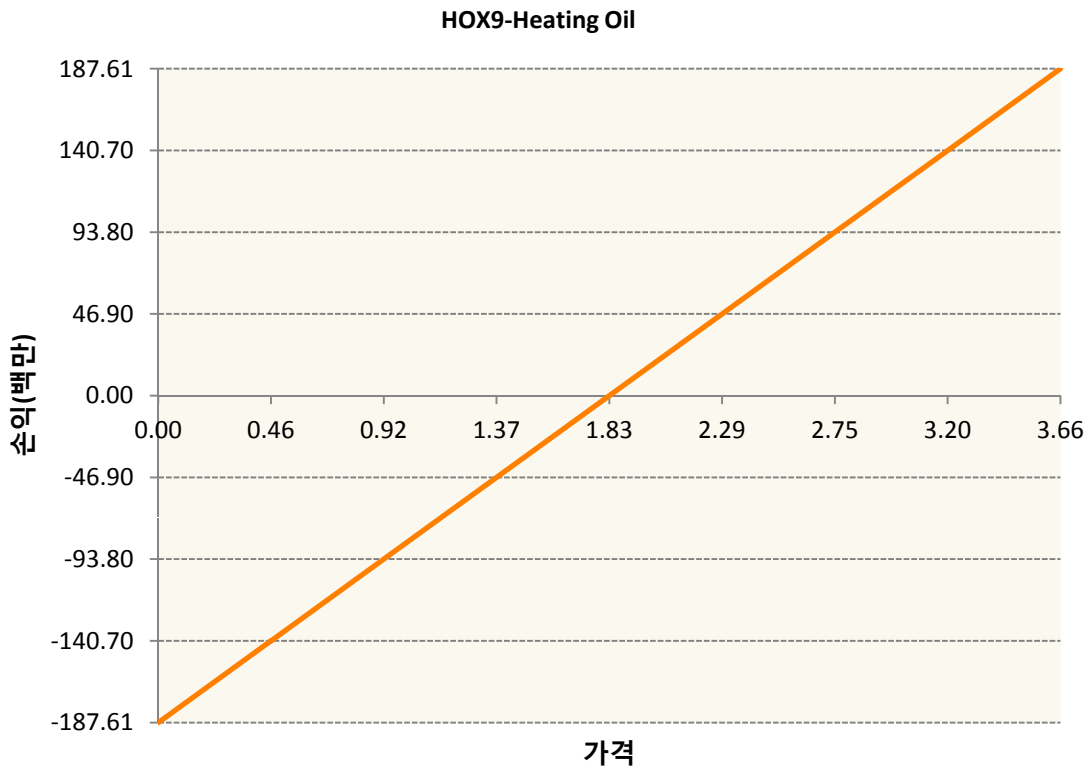
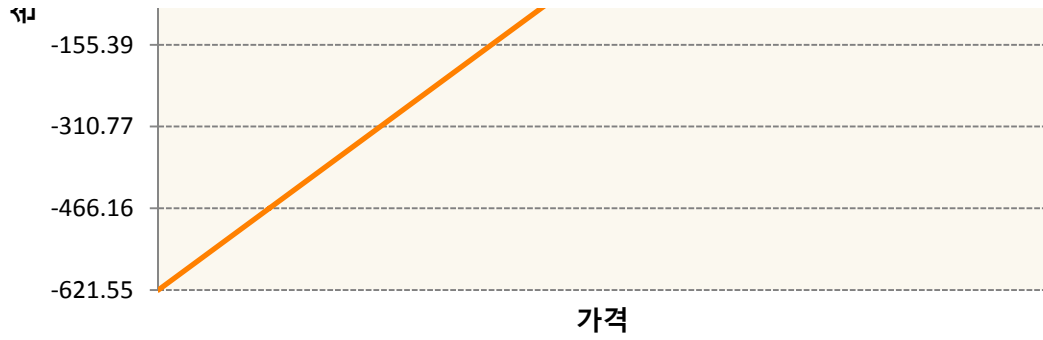
### 2. 만기시점의 손익구조

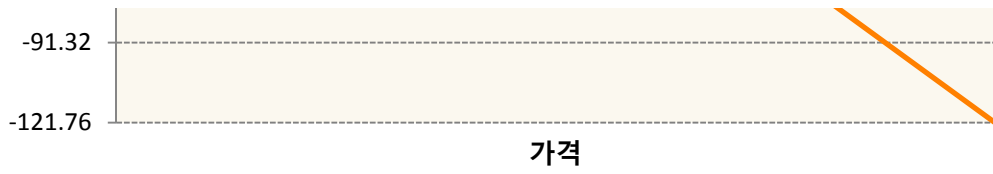
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19



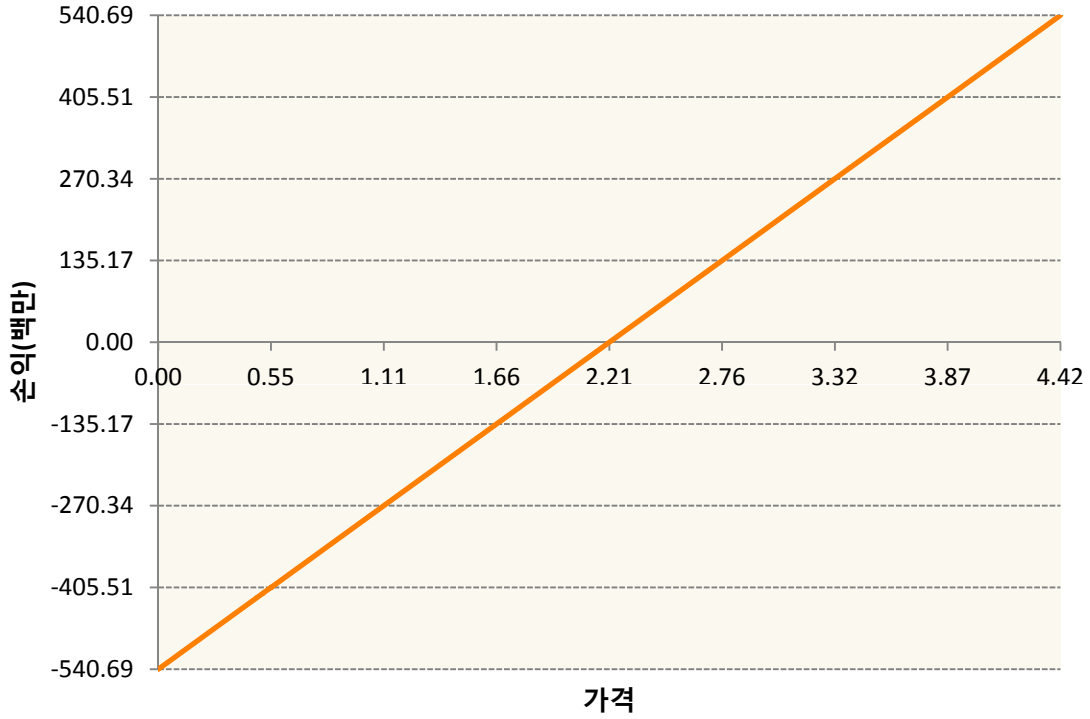
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19



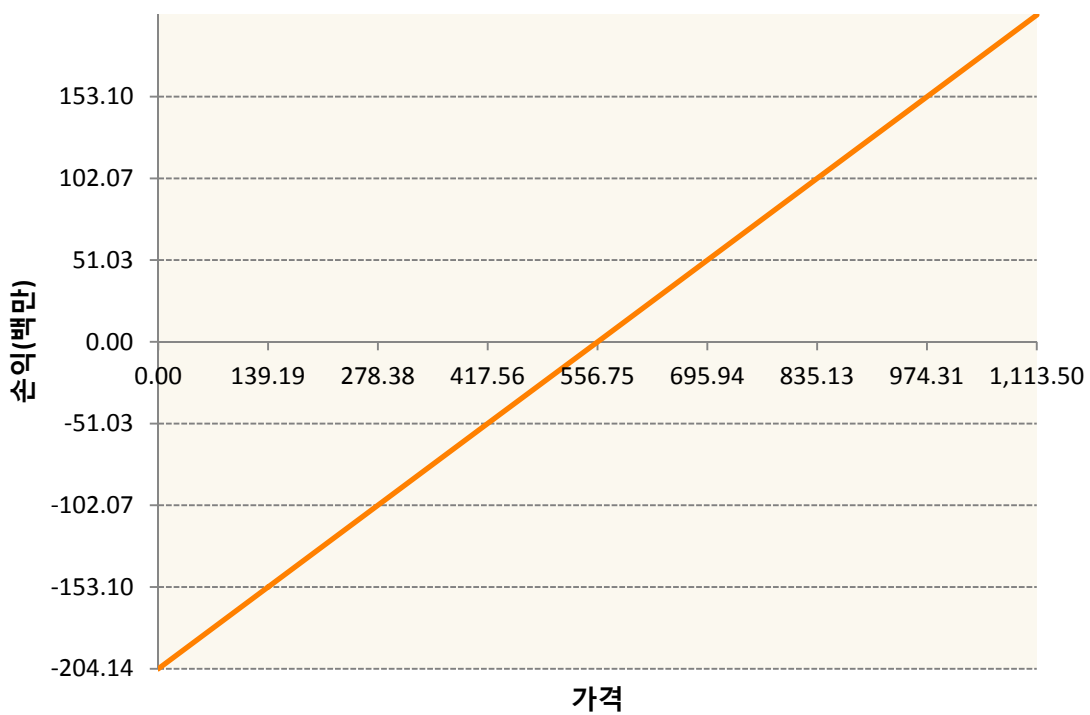




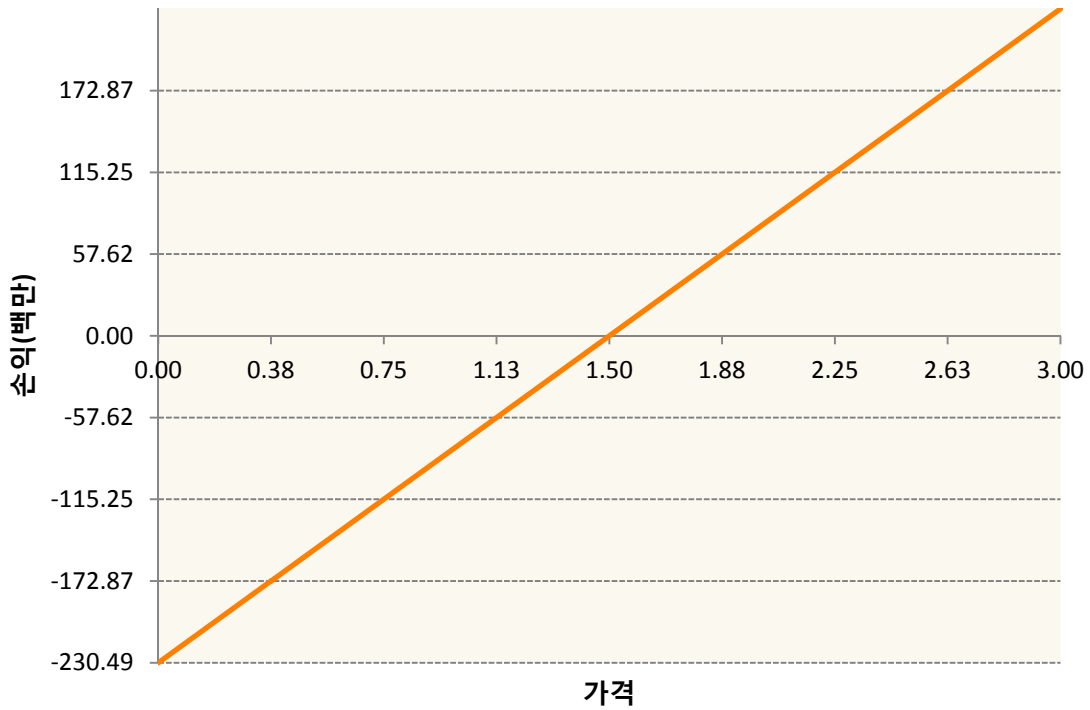
**NGX19-NATURAL GAS FUTR Nov19**



**QSX9-Low Su Gasoil G Nov19**



**XBX9-GASOLINE RBOB FUT Nov19**



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

CLX9	WTI CRUDE FUTURE Nov19	48
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	16
XBX9	GASOLINE RBOB FUT Nov19	18

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

(단위:백만원)

**365**

공시일	2019-08-27
기준일	2019-08-26

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

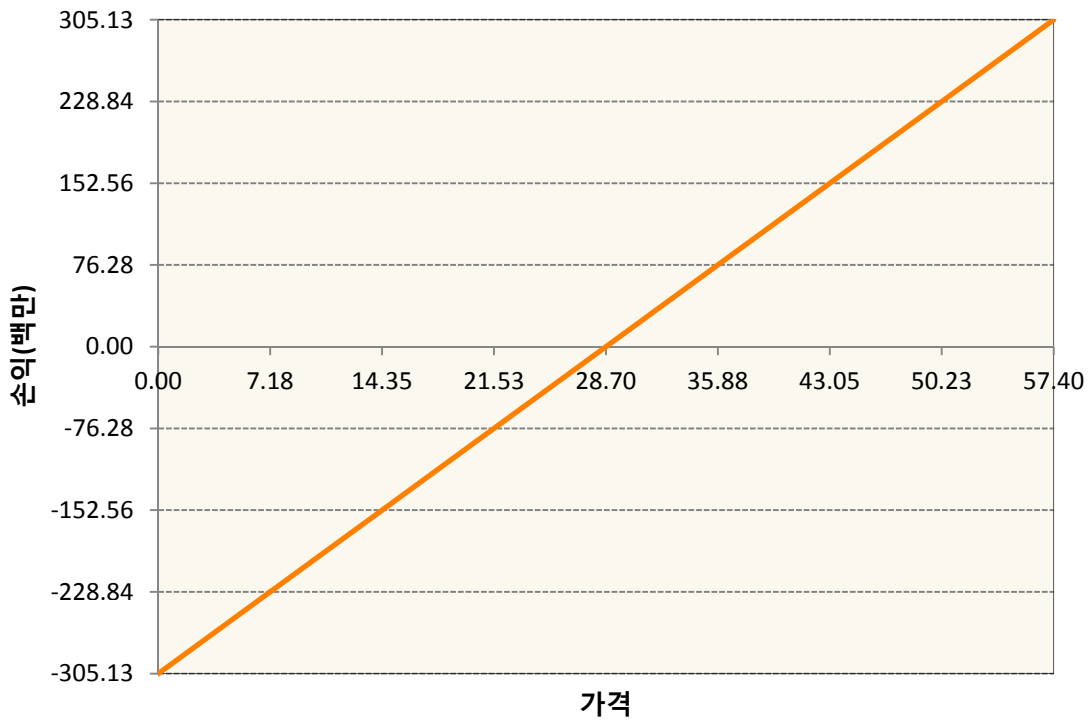
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

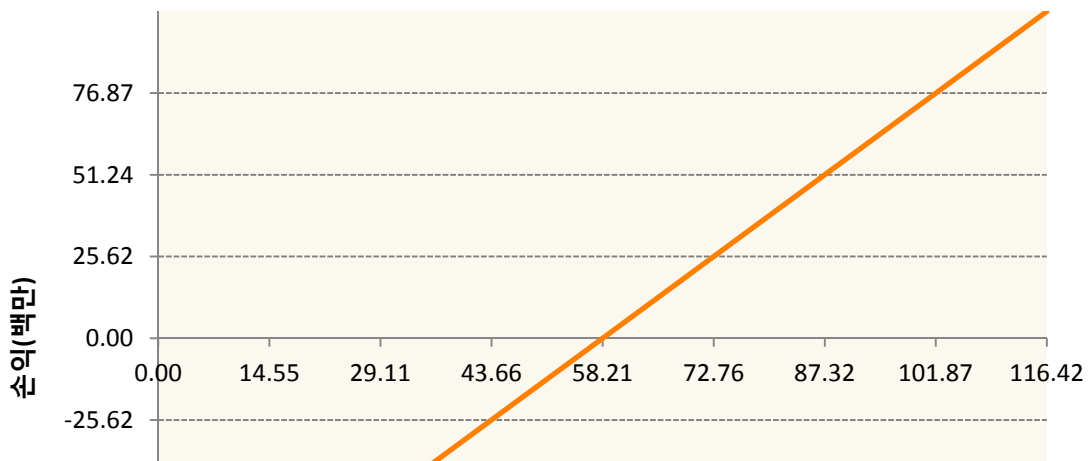
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,720	158	2,562	

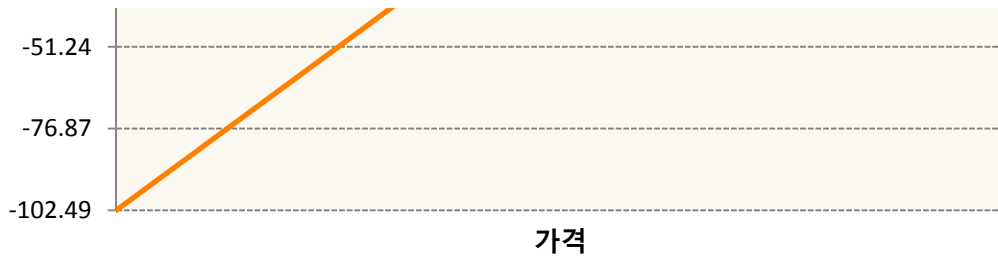
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19**

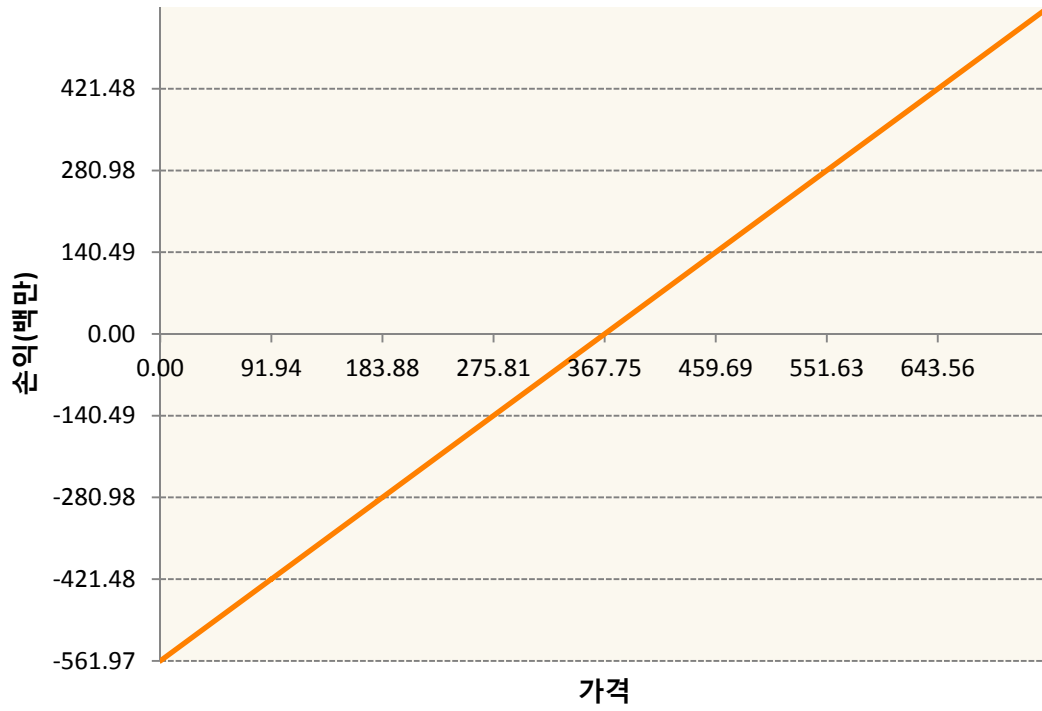


**CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19**

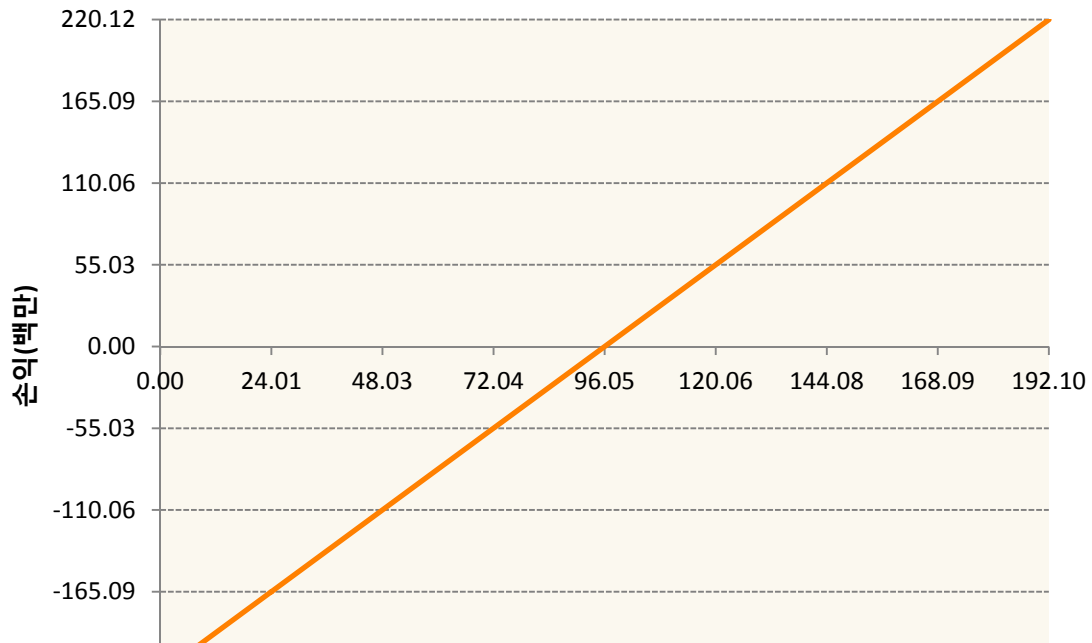


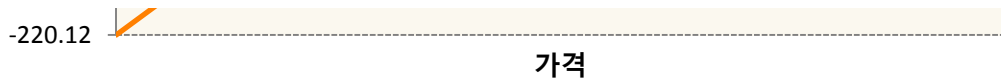


**CZ9-CORN FUTURE Dec19**

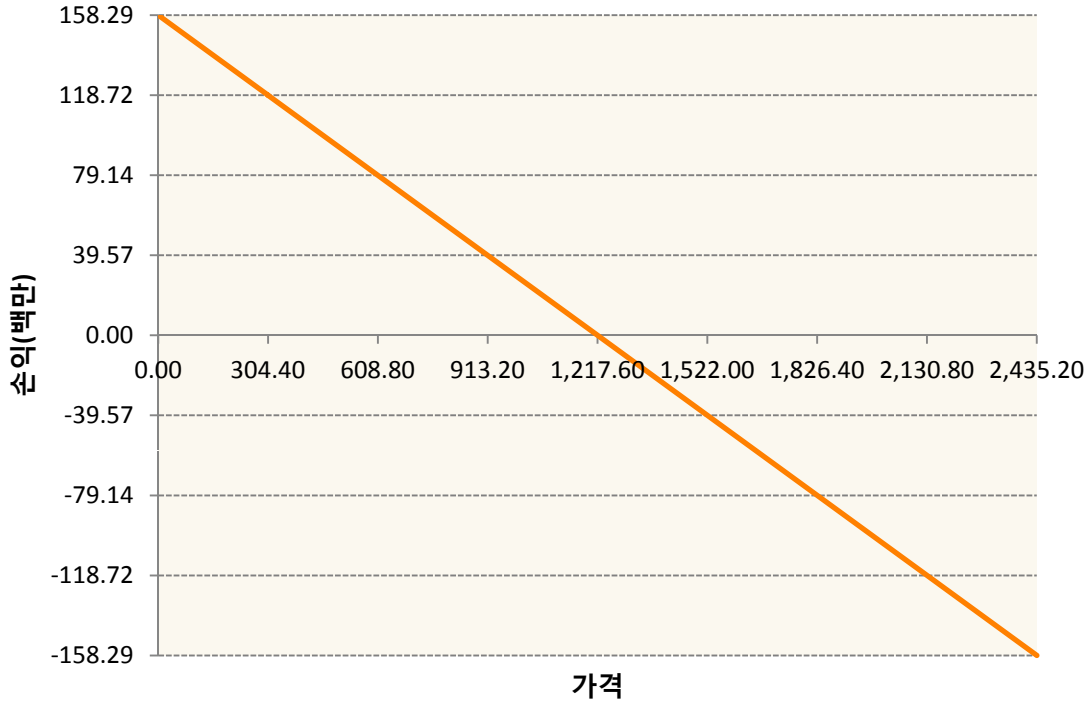


**KCZ9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19**

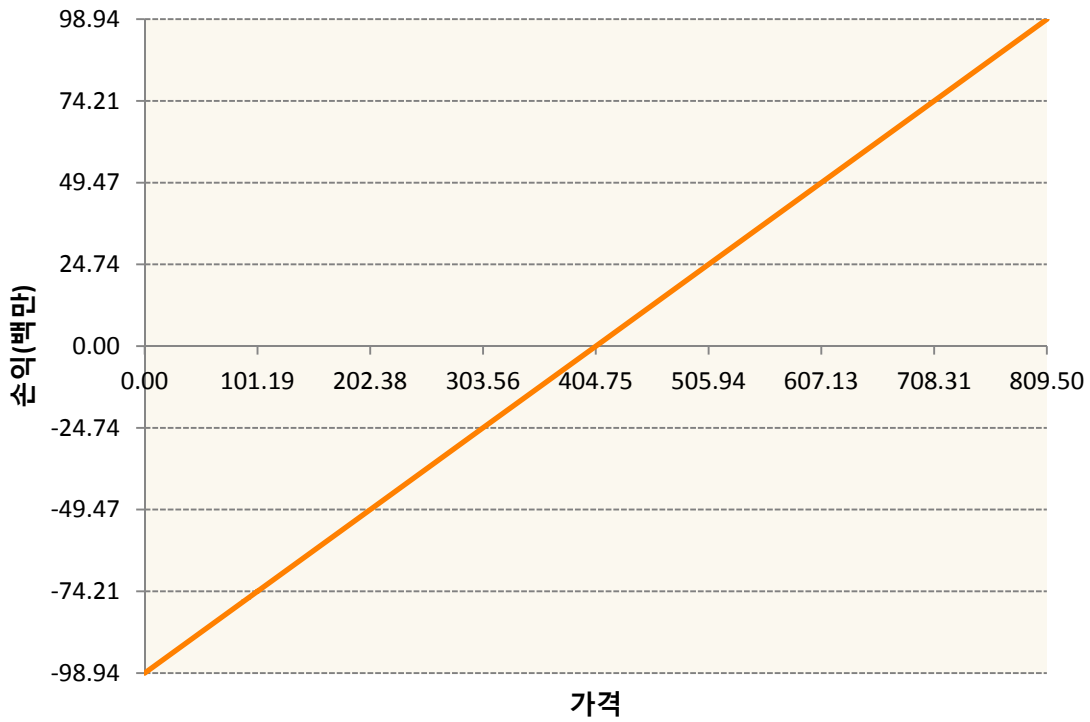




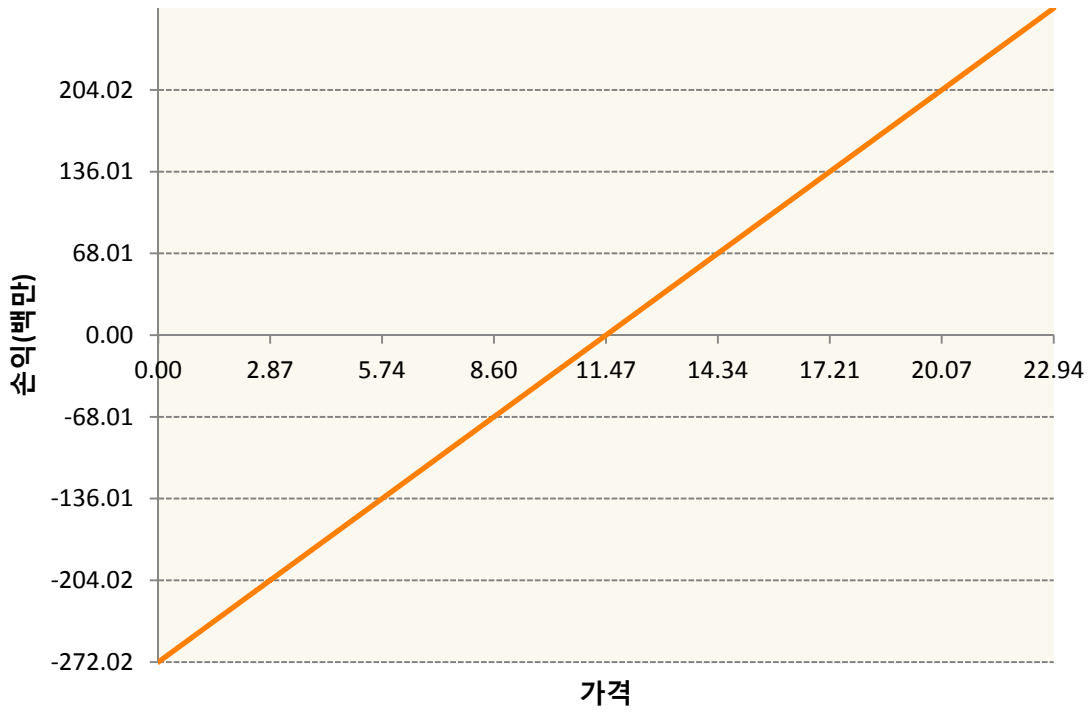
KR4175P90005-2019-09 달러선물



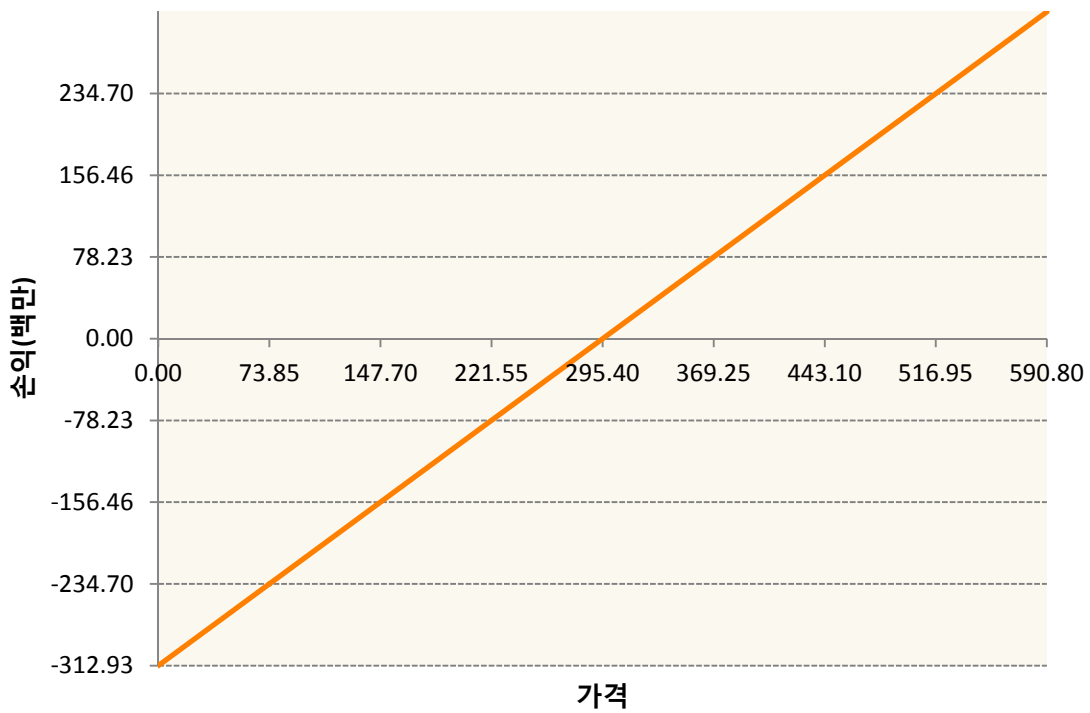
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



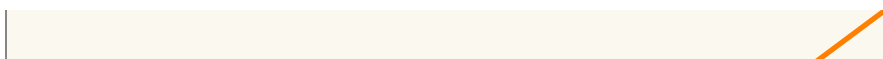
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

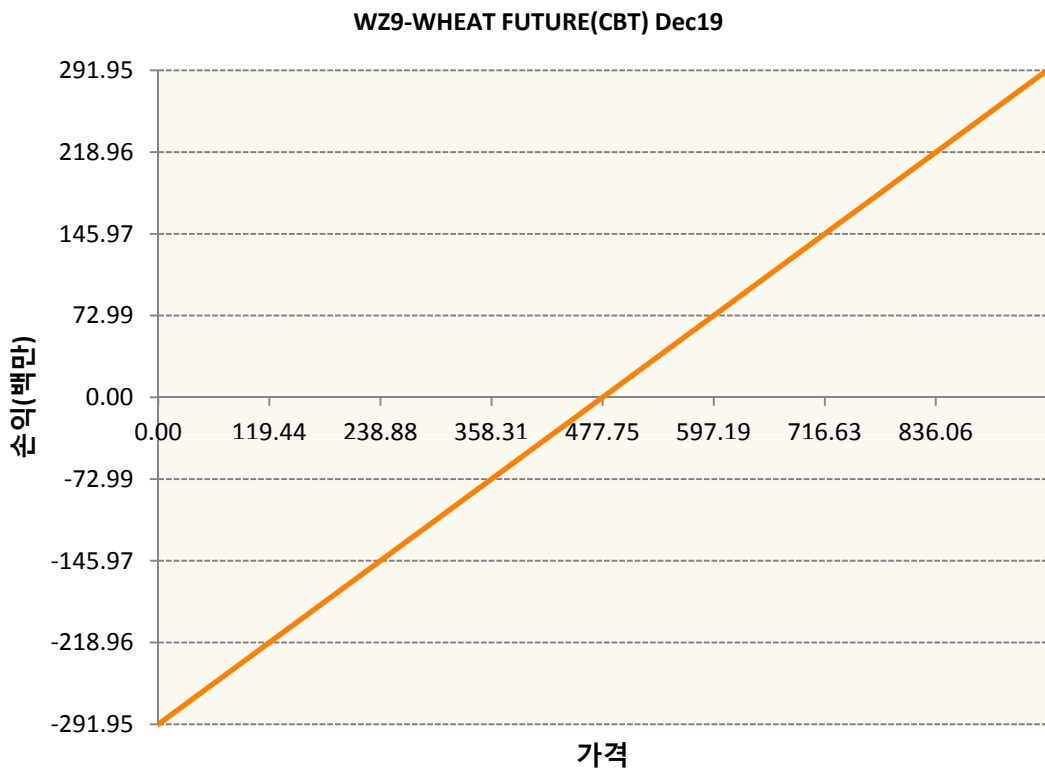
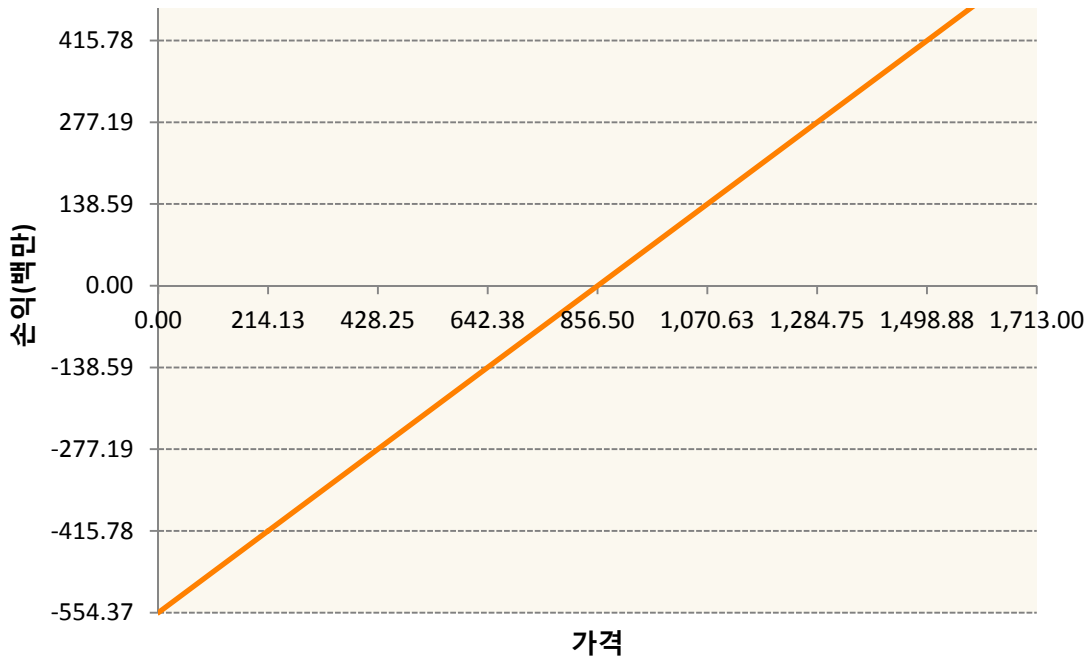


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





**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	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	44
WZ9	WHEAT FUTURE(CBT) Dec19	23

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

(단위:백만원)

**243**