

공시일	2019-08-28
기준일	2019-08-27

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	2019-08-28
기준일	2019-08-27

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

1,131

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

646

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-28
기준일	2019-08-27

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6,210	0	6,210	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(1)	373
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	136

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

811

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-28
기준일	2019-08-27

유로인덱스모(주식-파생형)

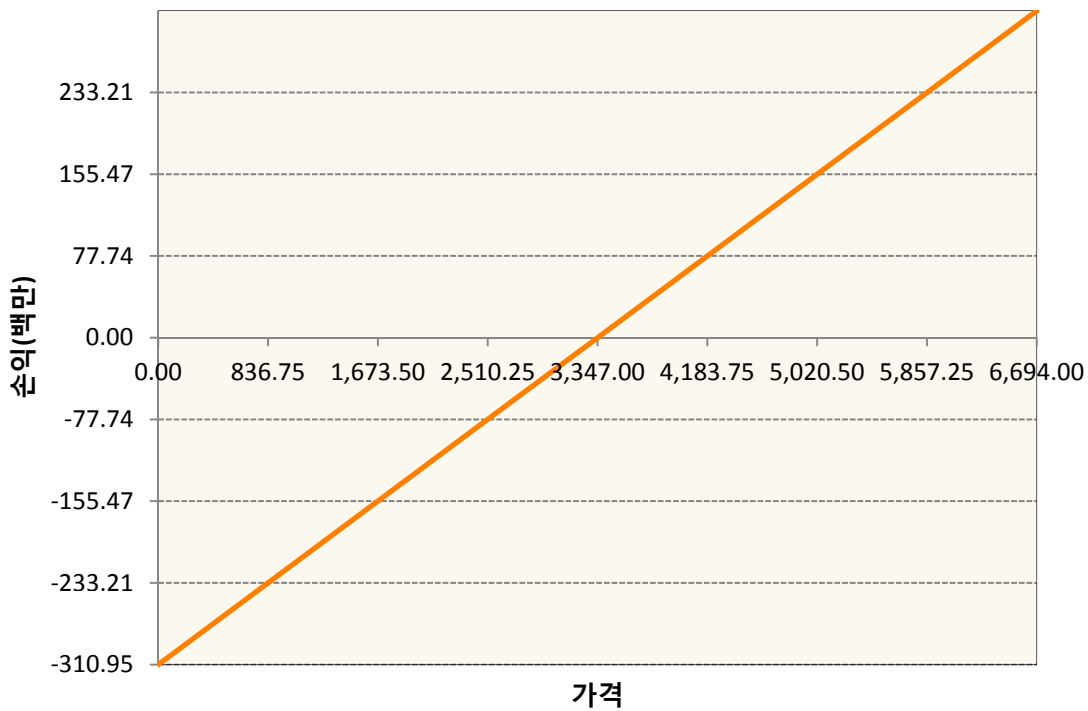
1. 계약금액

(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)

17

공시일	2019-08-28
기준일	2019-08-27

차이나인덱스모(주식-파생형)

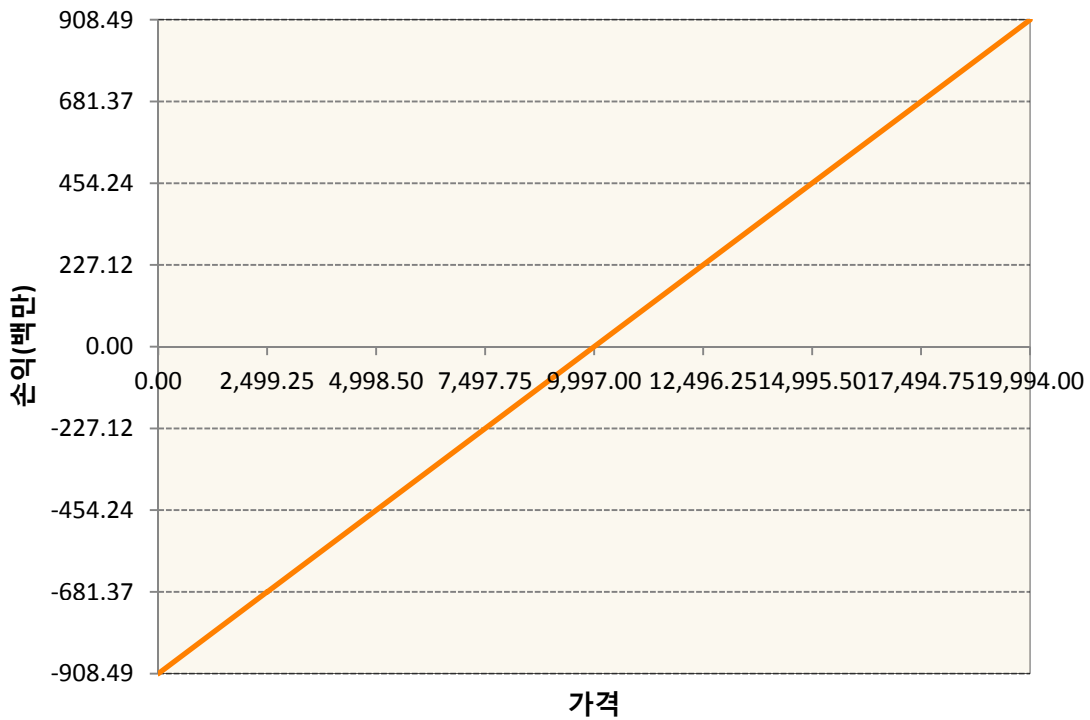
1. 계약금액

(단위:백만원)

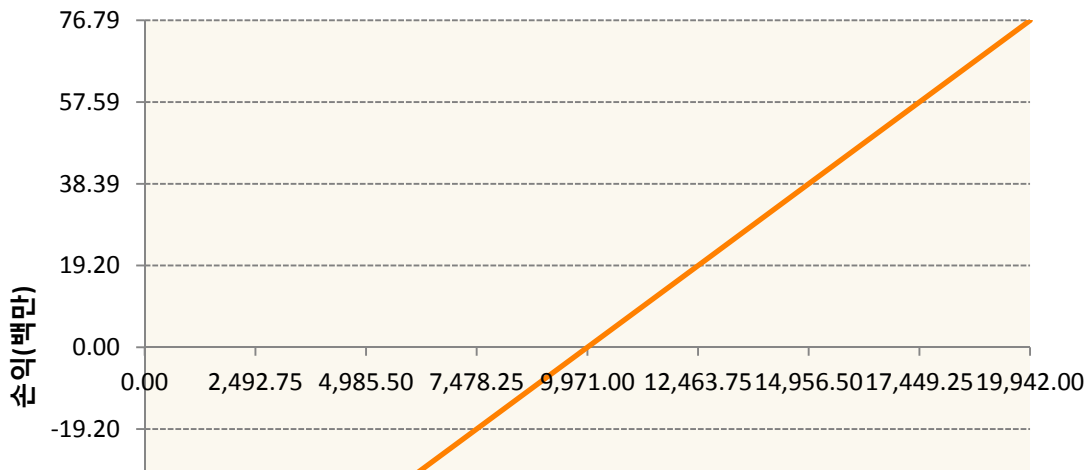
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	985	0	985	장내

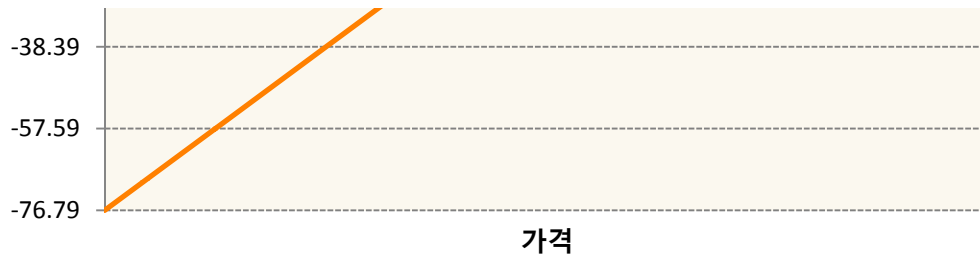
2. 만기시점의 손익구조

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)

74

공시일	2019-08-28
기준일	2019-08-27

커버드콜모(주식혼합-파생형)

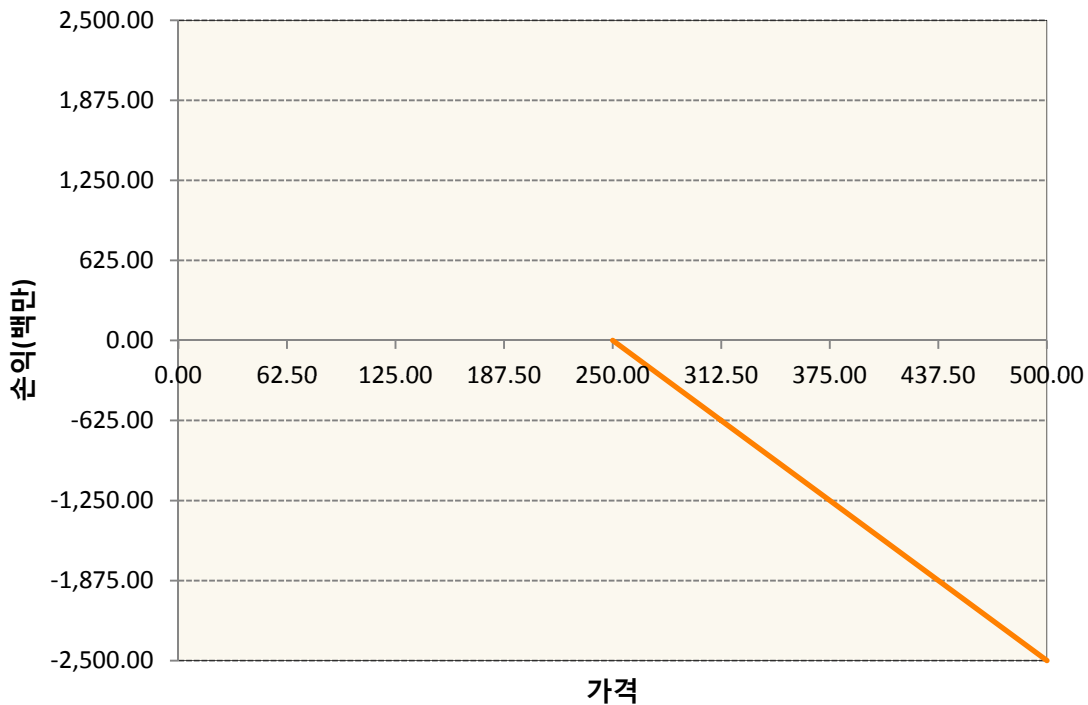
1. 계약금액

(단위:백만원)

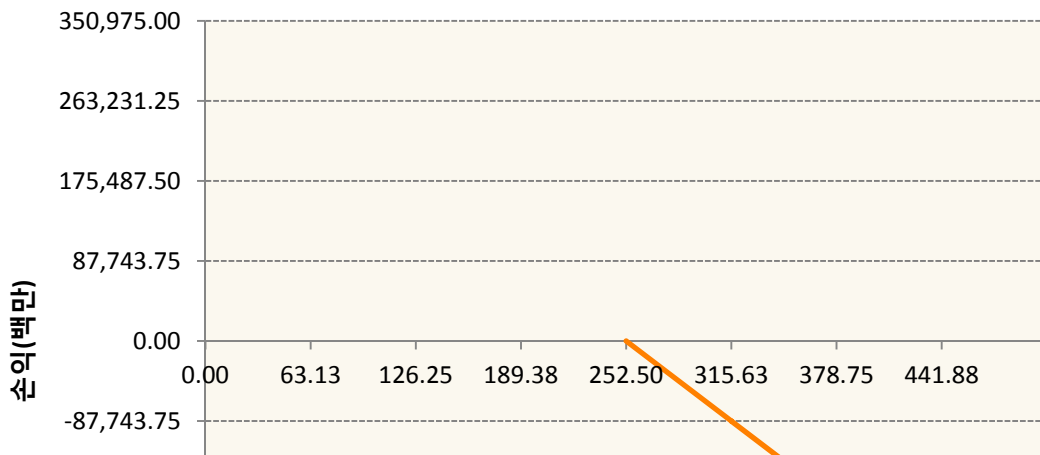
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	520,569	-520,569	장내

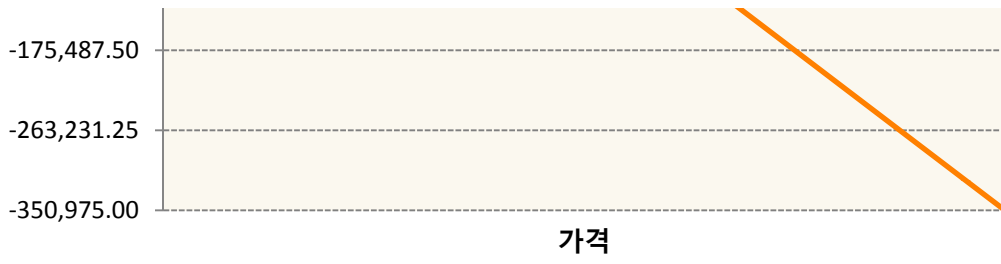
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P92500-2019-09 콜250

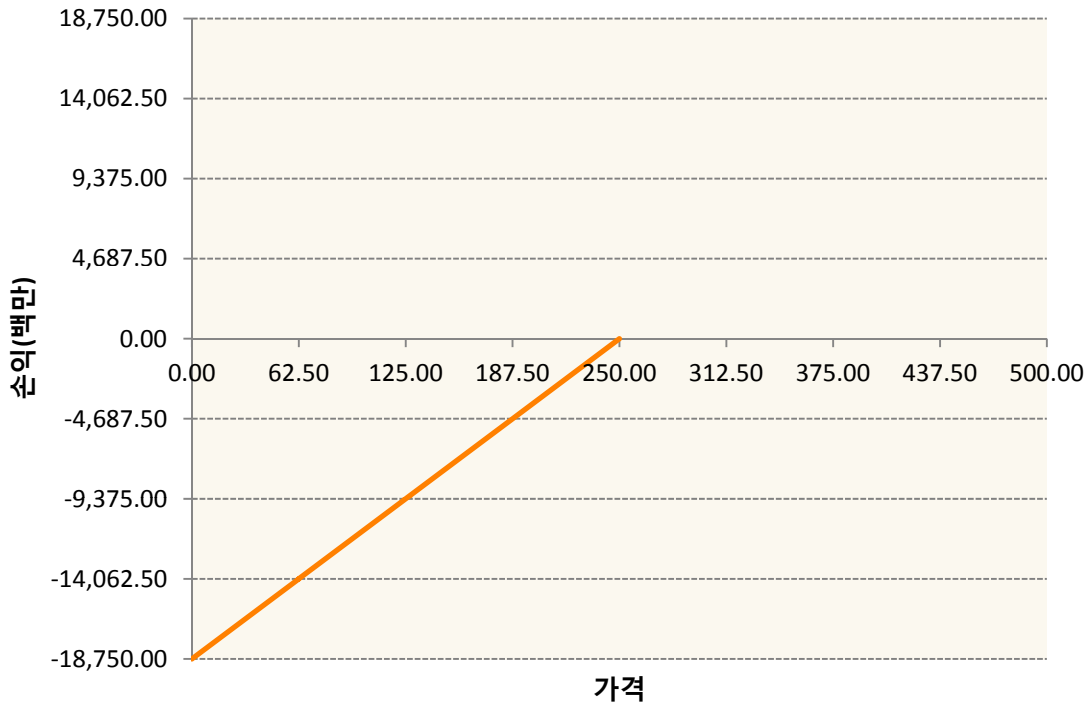


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

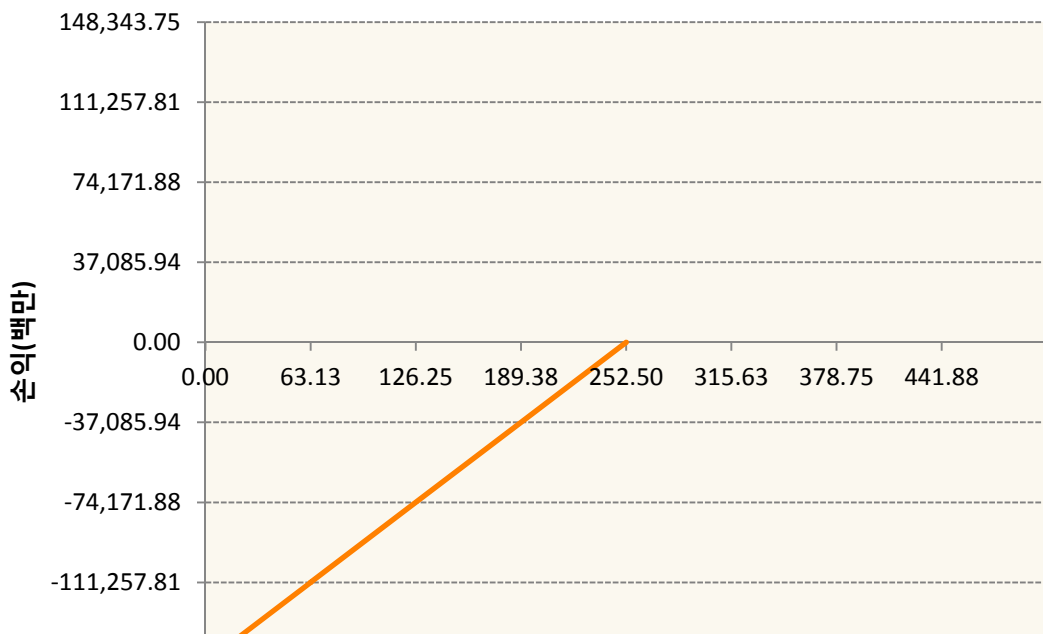




KR4301P92508-2019-09 풋250



KR4301P92524-2019-09 풋252.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P92500		2019-09 콜250						173
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	68	67	66	65	63	61	59	
-5.33%	63	60	58	55	52	49	45	
-2.67%	46	42	38	34	30	26	22	
0%	12	8	4	0	-4	-8	-12	
2.67%	-39	-42	-45	-48	-51	-54	-58	
5.33%	-101	-102	-104	-105	-107	-110	-112	
8.00%	-167	-167	-168	-169	-170	-171	-173	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5						22,764
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	7,611	7,535	7,424	7,280	7,101	6,891	6,651	
-5.33%	7,170	6,918	6,627	6,300	5,944	5,562	5,160	
-2.67%	5,561	5,072	4,568	4,051	3,525	2,990	2,450	
0%	1,766	1,178	589	0	-589	-1,178	-1,768	
2.67%	-4,547	-5,001	-5,479	-5,975	-6,485	-7,007	-7,538	
5.33%	-12,701	-12,934	-13,211	-13,526	-13,875	-14,252	-14,654	
8.00%	-21,733	-21,815	-21,933	-22,088	-22,280	-22,506	-22,764	
KR4301P92508		2019-09 풋250						1,138
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,125	-1,125	-1,126	-1,128	-1,131	-1,134	-1,138	
-5.33%	-627	-633	-640	-649	-658	-669	-681	
-2.67%	-196	-214	-232	-251	-270	-289	-308	
0%	56	38	19	0	-19	-39	-59	
2.67%	133	126	118	108	97	85	72	
5.33%	143	142	141	138	135	130	124	
8.00%	144	144	144	143	143	142	140	
KR4301P92524		2019-09 풋252.5						9,736
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-9,676	-9,678	-9,681	-9,688	-9,699	-9,715	-9,736	
-5.33%	-5,734	-5,757	-5,790	-5,834	-5,886	-5,948	-6,018	
-2.67%	-2,074	-2,182	-2,298	-2,421	-2,549	-2,681	-2,817	
0%	488	326	163	0	-163	-326	-490	
2.67%	1,514	1,426	1,328	1,220	1,105	984	858	

5.33%	1,710	1,692	1,664	1,627	1,580	1,524	1,459
8.00%	1,727	1,725	1,722	1,715	1,703	1,686	1,663

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

(단위:백만원)

35,824

공시일	2019-08-28
기준일	2019-08-27

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

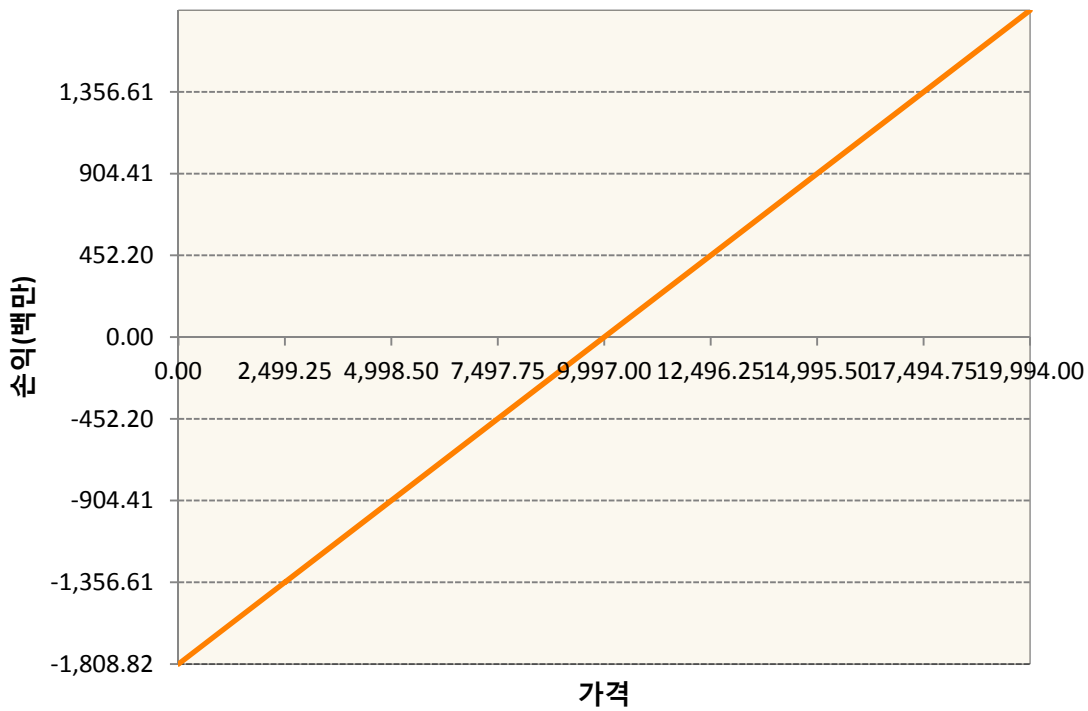
1. 계약금액

(단위:백만원)

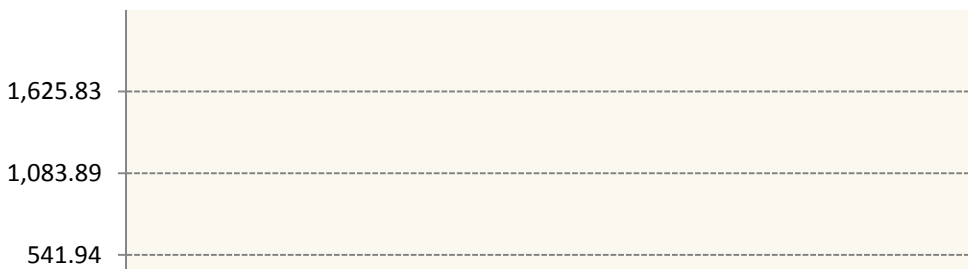
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,809	0	1,809	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,345	-5,345	장내
누계	통화	선도	0	2,869	-2,869	장외

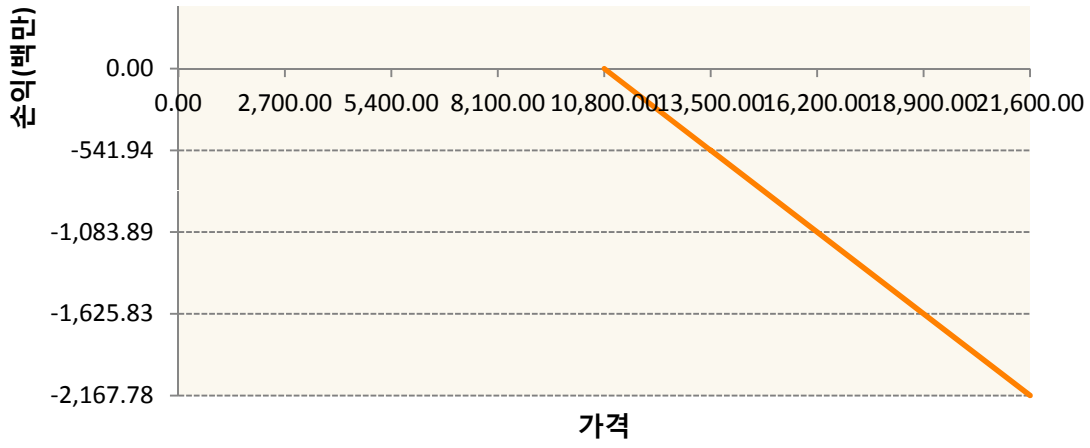
2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19

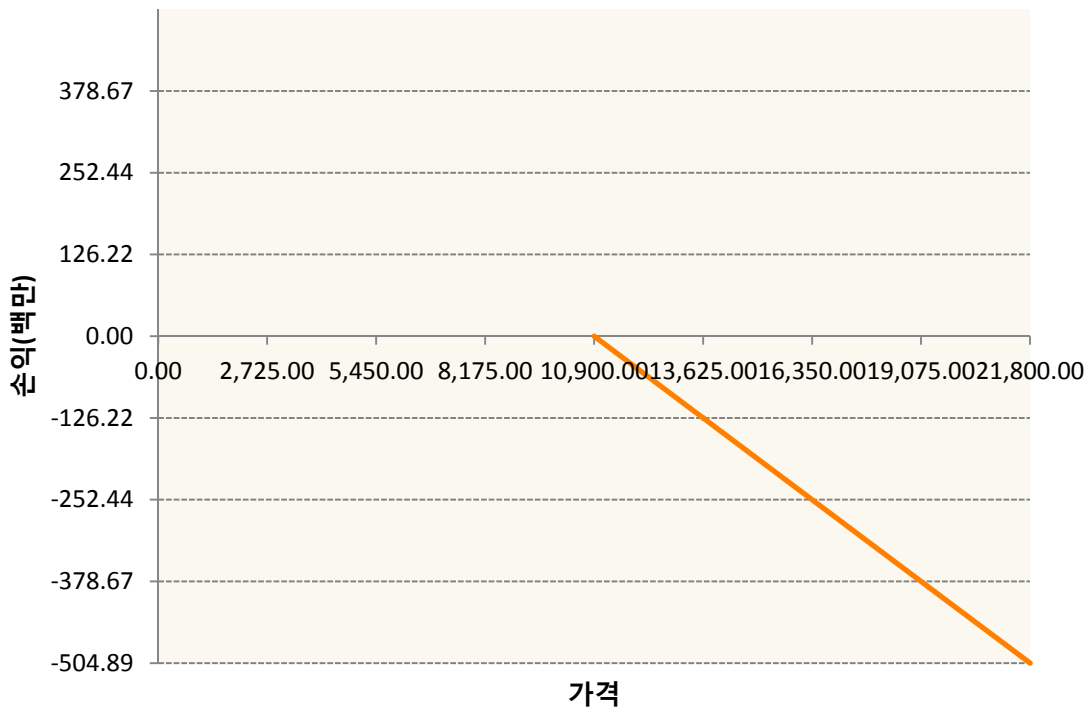


OHHIQ9-C108-HSCEI

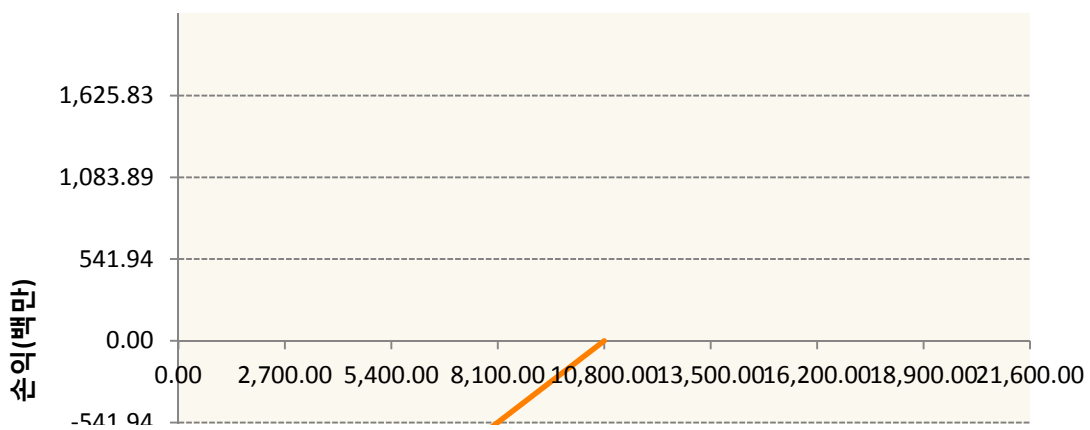


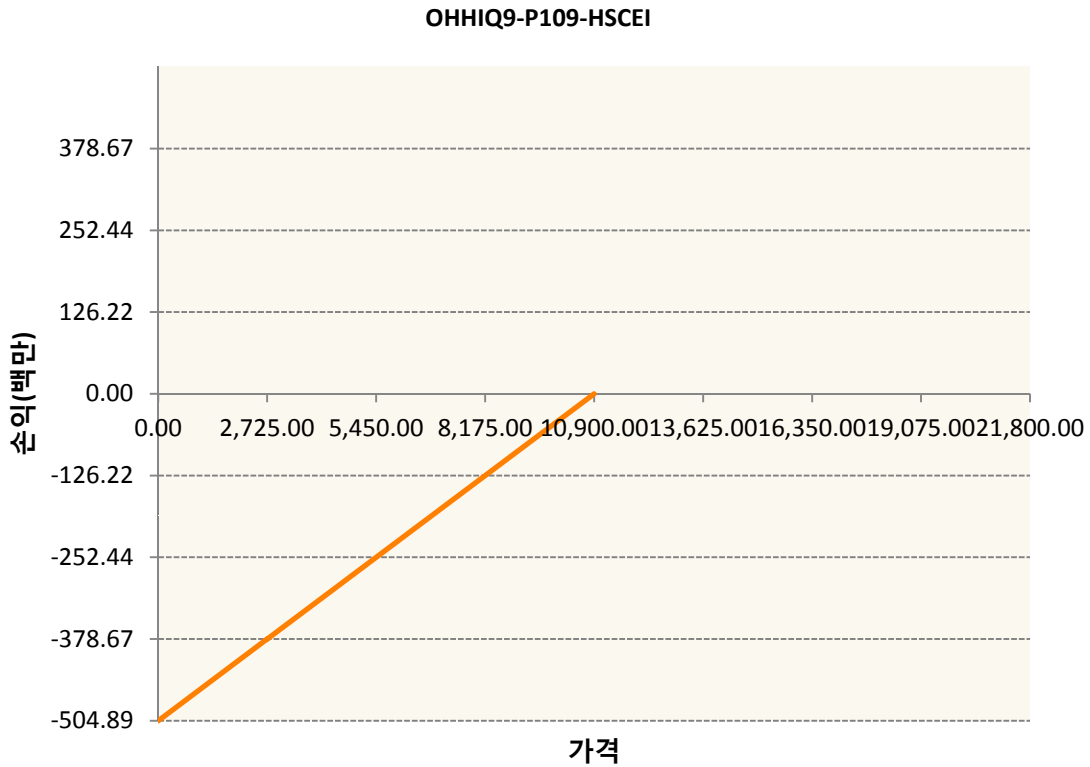


OHHIQ9-C109-HSCEI



OHHIQ9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	230
HCQ9 HSCEI Futures Aug19	145
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)
	608

공시일	2019-08-28
기준일	2019-08-27

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

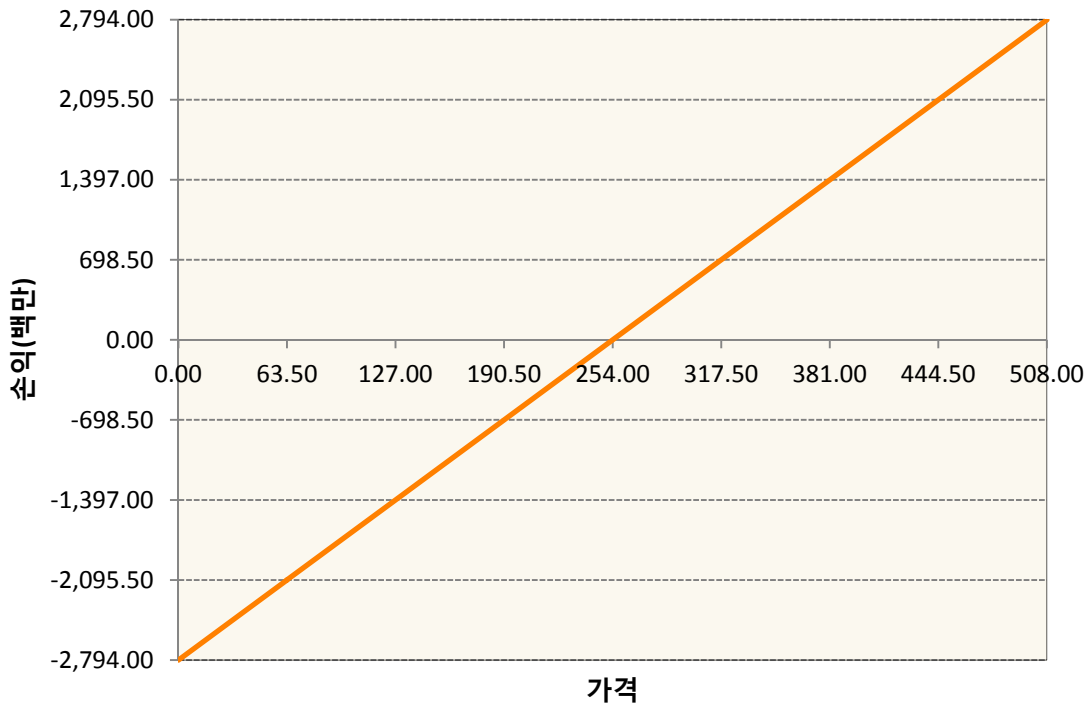
1. 계약금액

(단위:백만원)

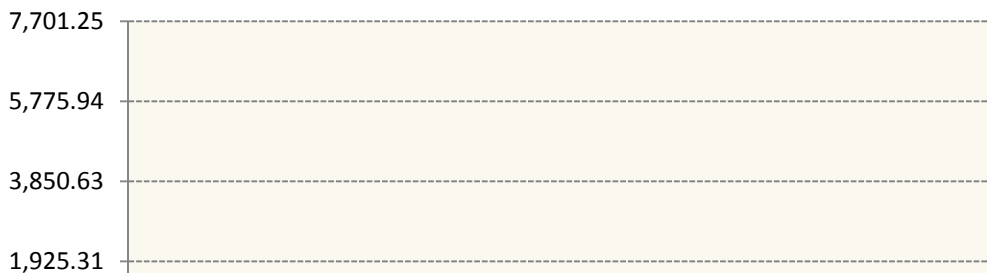
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,794	0	2,794	장내
누계	유가증권	스왑	14,125	0	14,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,829	-14,829	장내

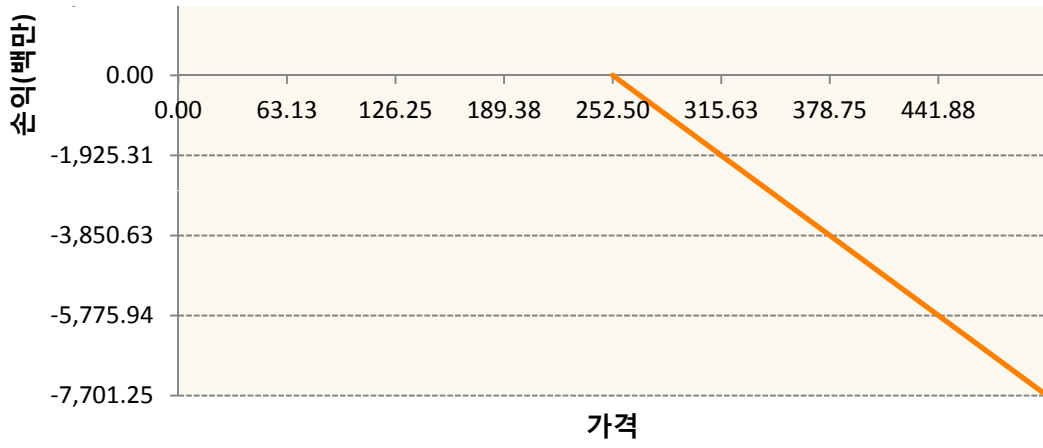
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

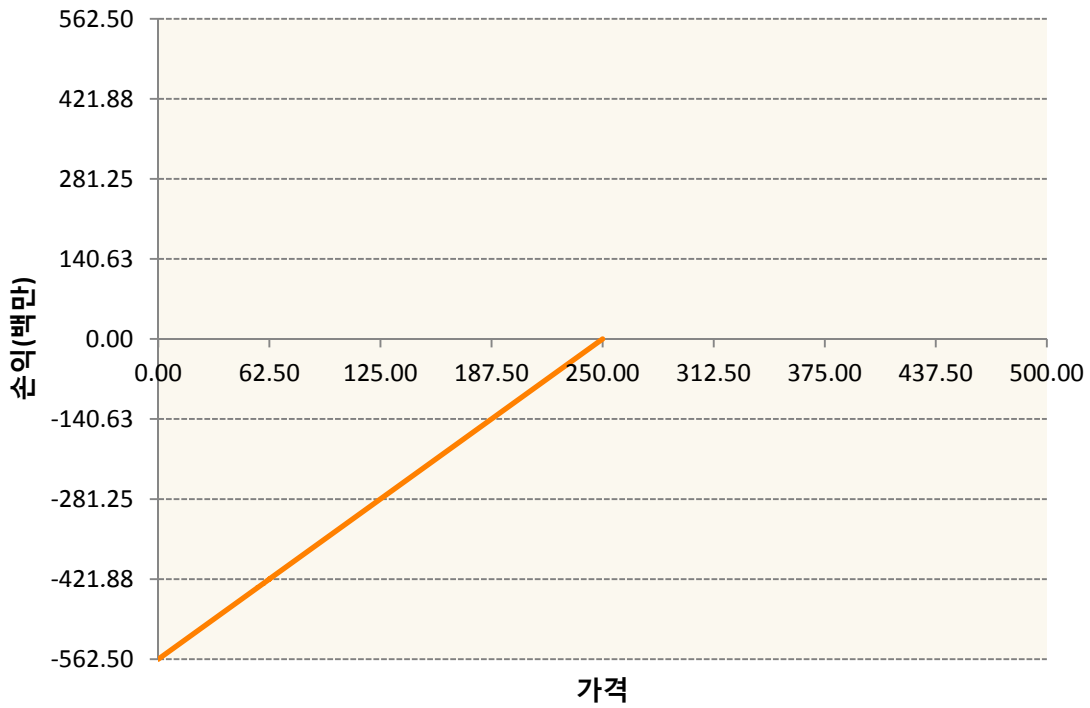


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

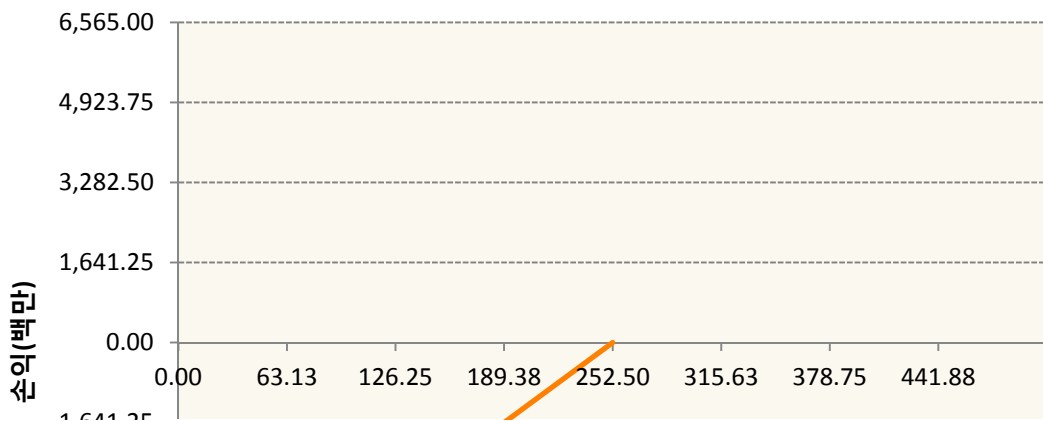




KR4301P92508-2019-09 풋250



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%	-818	-818	-818	-818	-818	-818	-818	
-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%	818	818	818	818	818	818	818	
8.00%	1,226	1,226	1,226	1,226	1,226	1,226	1,226	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						223
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-223	-223	-223	-223	-223	-223	-223	
-5.33%	-149	-149	-149	-149	-149	-149	-149	
-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%	149	149	149	149	149	149	149	
8.00%	223	223	223	223	223	223	223	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5						499
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	167	165	163	160	156	151	146	
-5.33%	157	152	145	138	130	122	113	
-2.67%	122	111	100	89	77	66	54	
0%	39	26	13	0	-13	-26	-39	
2.67%	-100	-110	-120	-131	-142	-154	-165	
5.33%	-279	-284	-290	-297	-304	-313	-322	
8.00%	-477	-479	-481	-485	-489	-494	-499	
KR4301P92508		2019-09 풋250						34
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
-5.33%	-19	-19	-19	-19	-20	-20	-20
-2.67%	-6	-6	-7	-8	-8	-9	-9
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	4	4	4	3	3	3	2
5.33%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	4	4	4	4	4	4	4
KR4301P92524 2019-09 풋252.5							431
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-428	-428	-428	-429	-429	-430	-431
-5.33%	-254	-255	-256	-258	-260	-263	-266
-2.67%	-92	-97	-102	-107	-113	-119	-125
0%	22	14	7	0	-7	-14	-22
2.67%	67	63	59	54	49	44	38
5.33%	76	75	74	72	70	67	65
8.00%	76	76	76	76	75	75	74

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

(단위:백만원)

2,449

공시일	2019-08-28
기준일	2019-08-27

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

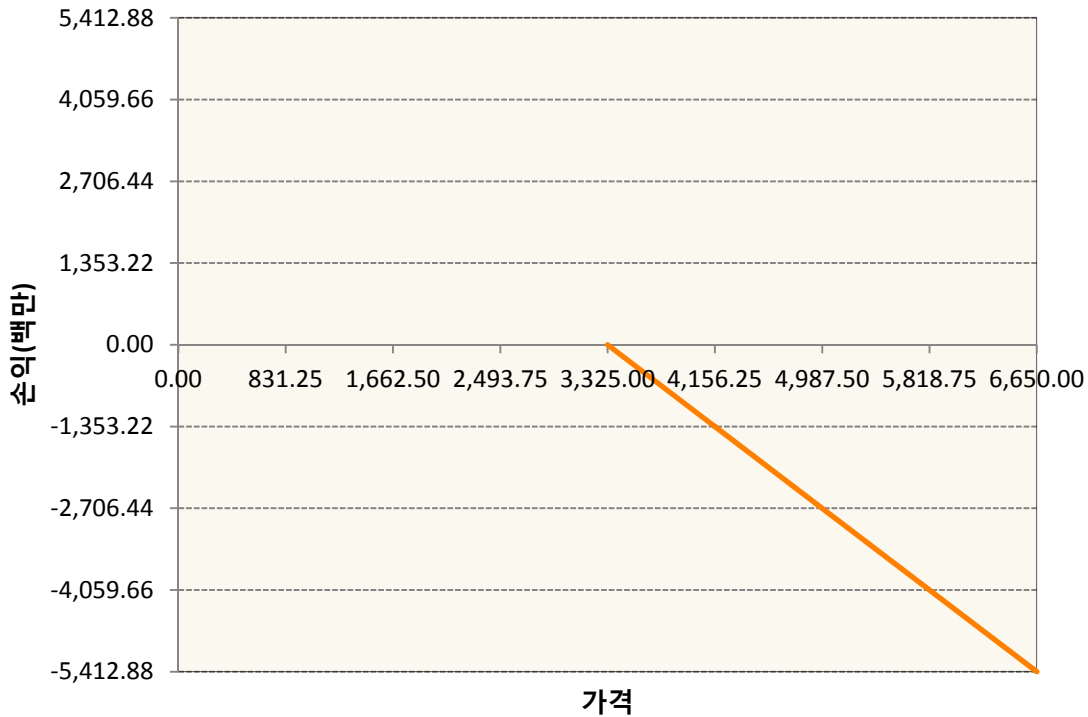
1. 계약금액

(단위:백만원)

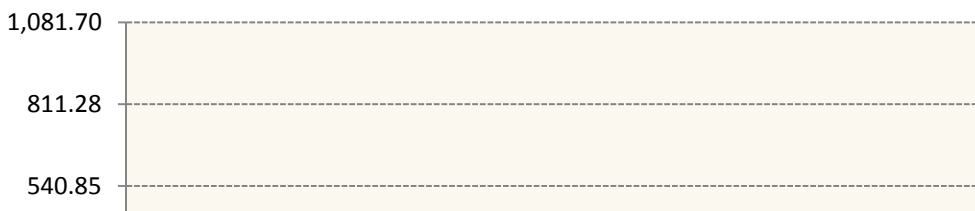
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,717	0	3,717	
누계	유가증권	옵션	0	12,989	-12,989	장내
누계	지수	스왑	28,444	0	28,444	장외
누계	통화	선도	9,149	17,490	-8,341	장외

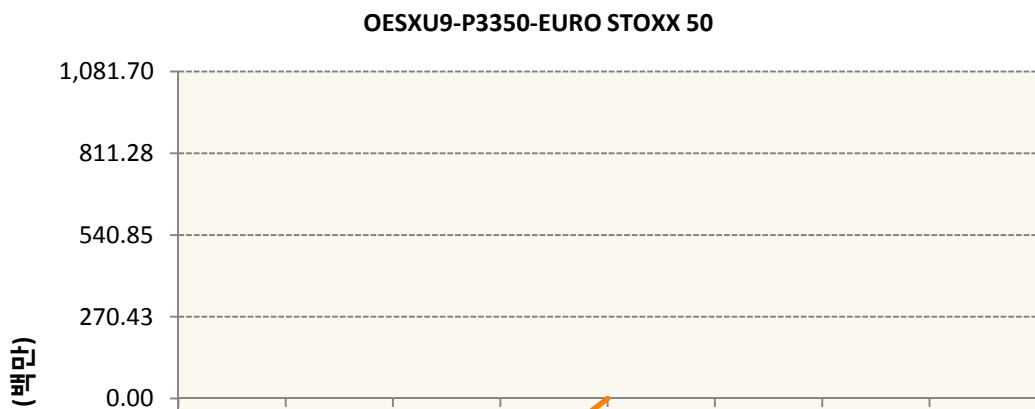
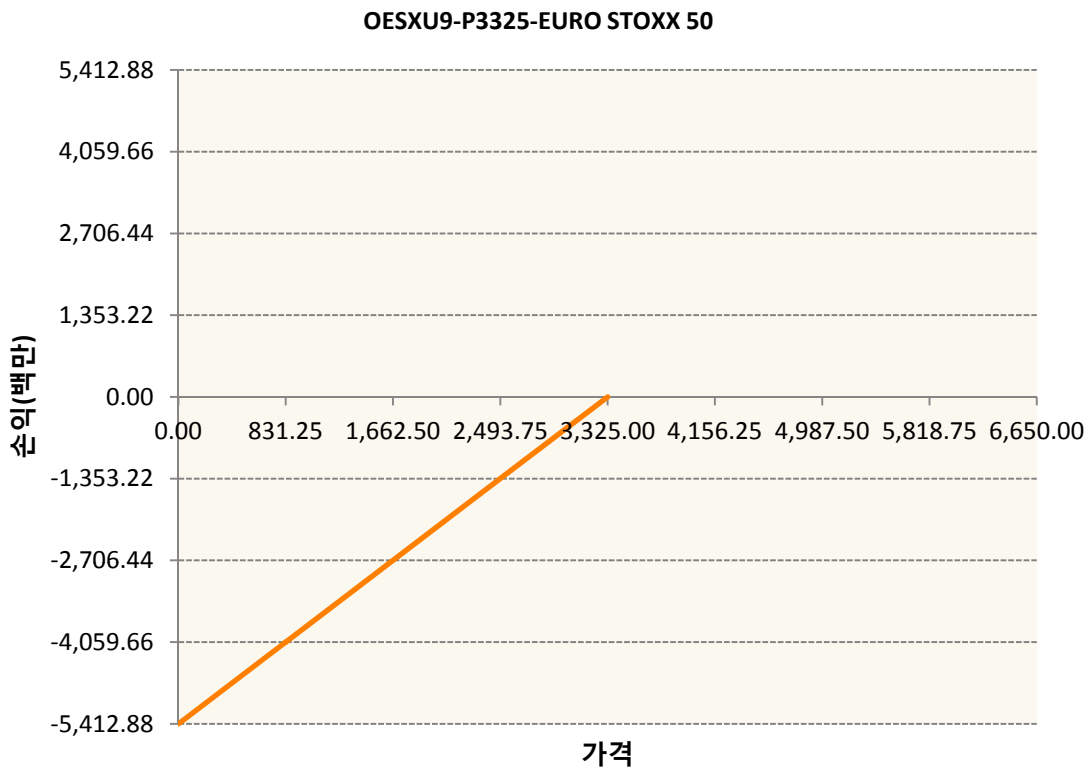
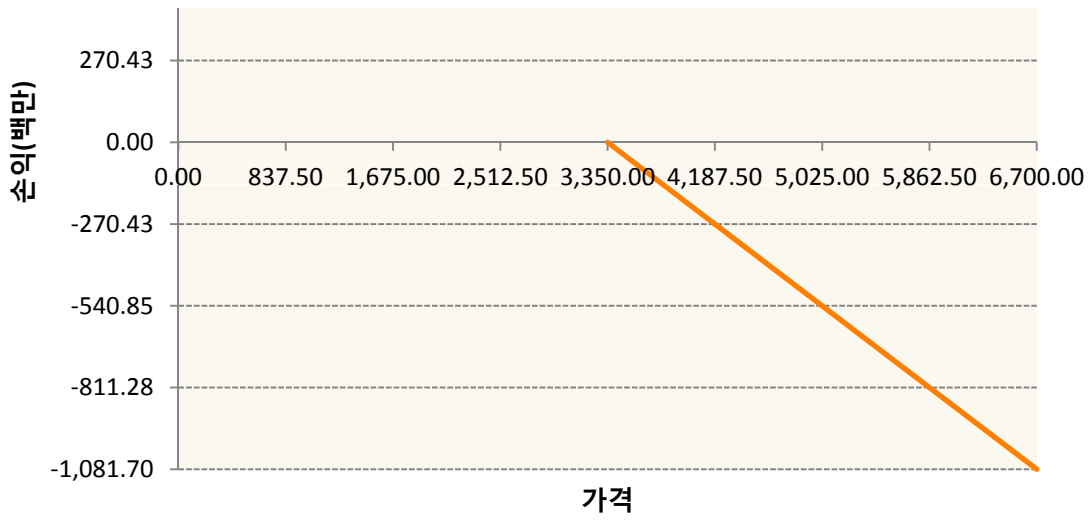
2. 만기시점의 손익구조

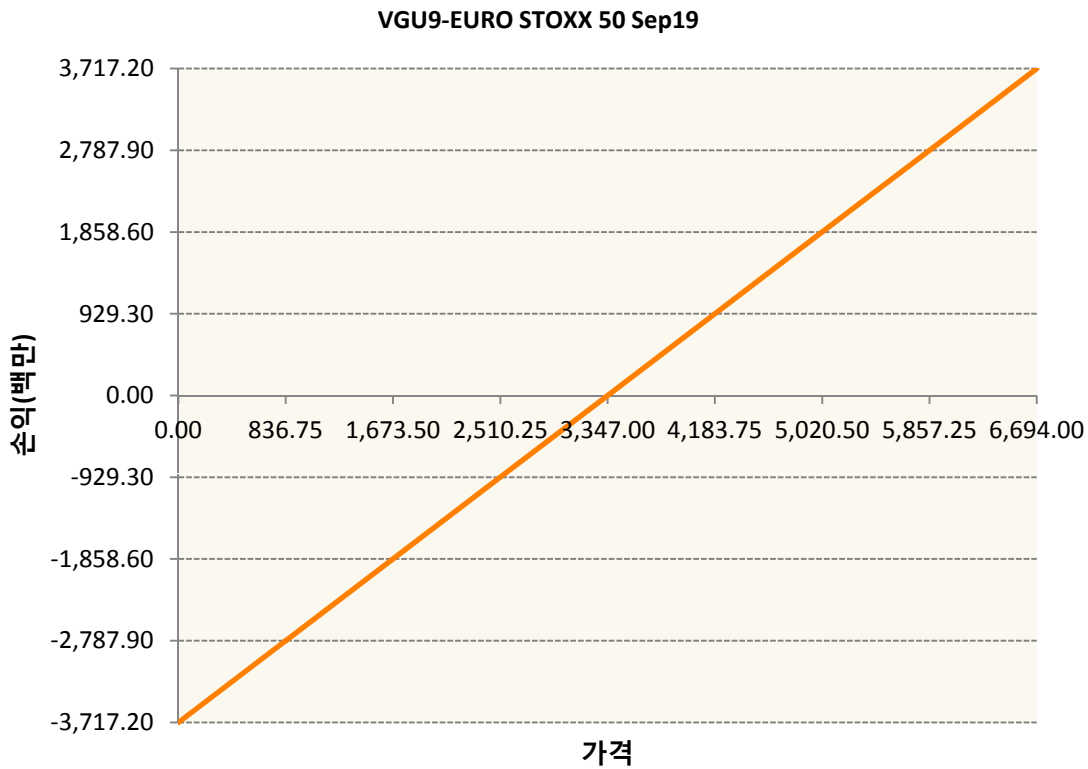
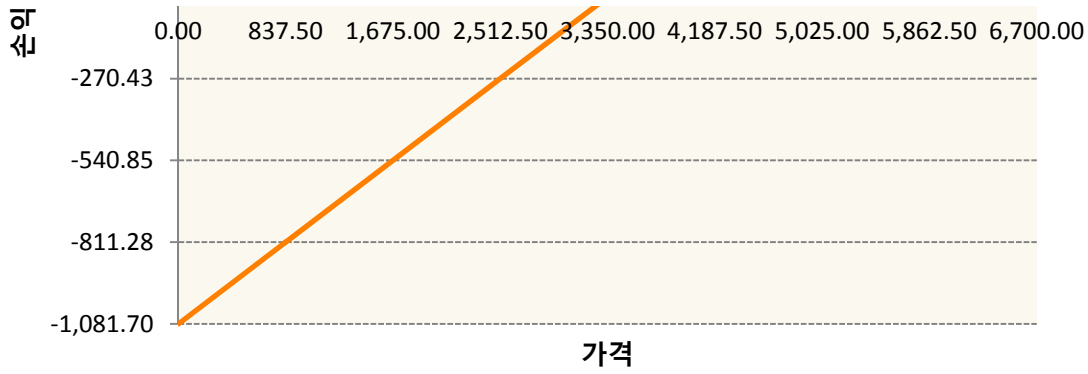
OESXU9-C3325-EURO STOXX 50



OESXU9-C3350-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	58
FX21019M0< KRW/EUR 27-09-19E	1,076
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	323
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E	323
FX21019N04 EUR/KRW 27-09-19E	237
FX21019Q00 EUR/KRW 27-09-19E	172
OESXU9-C3< EURO STOXX 50	433
OESXU9-C3< EURO STOXX 50	87
OESXU9-P3< EURO STOXX 50	433
OESXU9-P3< EURO STOXX 50	87
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	297

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

(단위:백만원)

2,011

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

(단위:백만원)

906

공시일	2019-08-28
기준일	2019-08-27

ETF스마트레버리지목표전환형9호

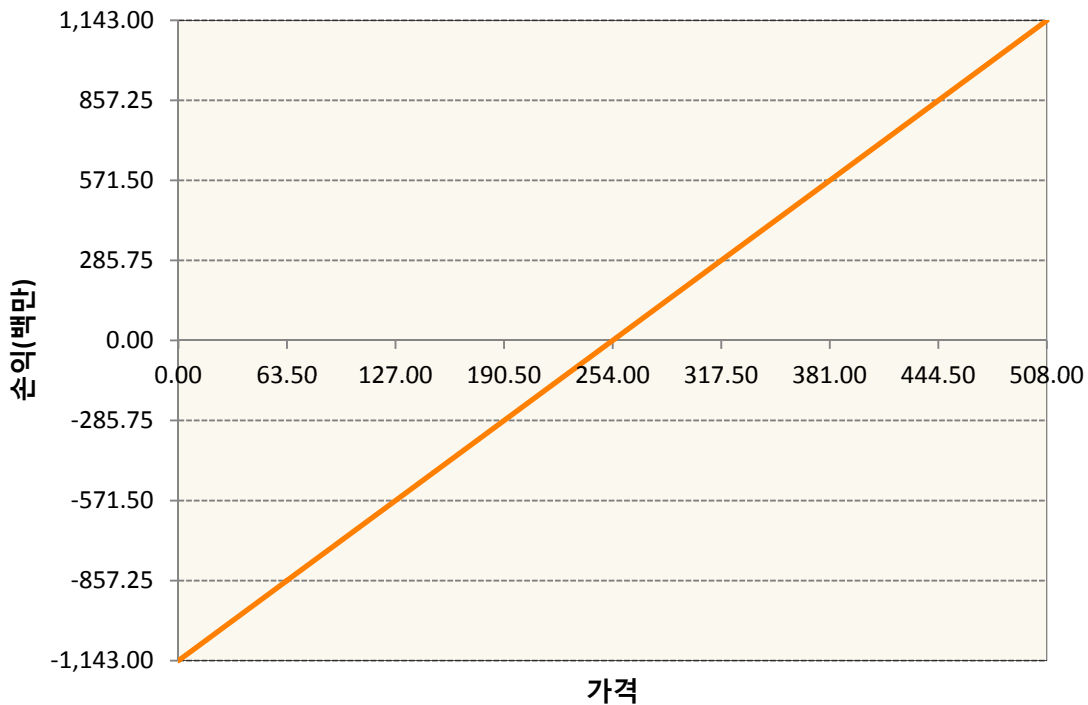
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,143	0	1,143	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)

78

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

(단위:백만원)

121

공시일	2019-08-28
기준일	2019-08-27

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

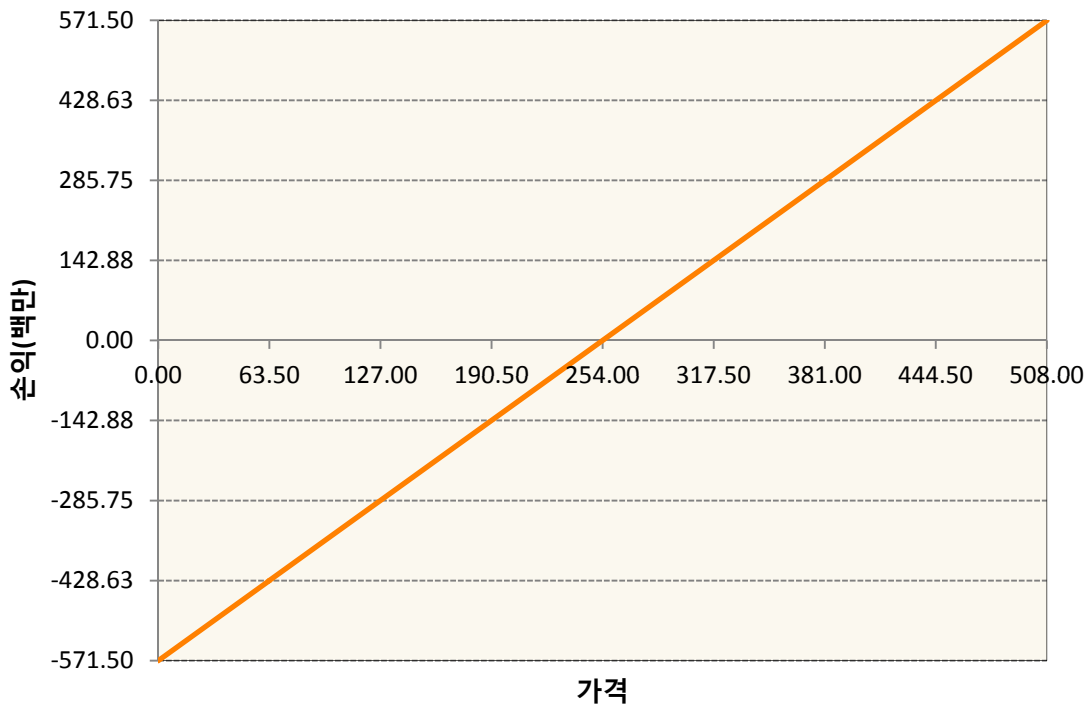
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	572	0	572	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%	-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%	46	46	46	46	46	46	46	

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

(단위:백만원)

39

공시일	2019-08-28
기준일	2019-08-27

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

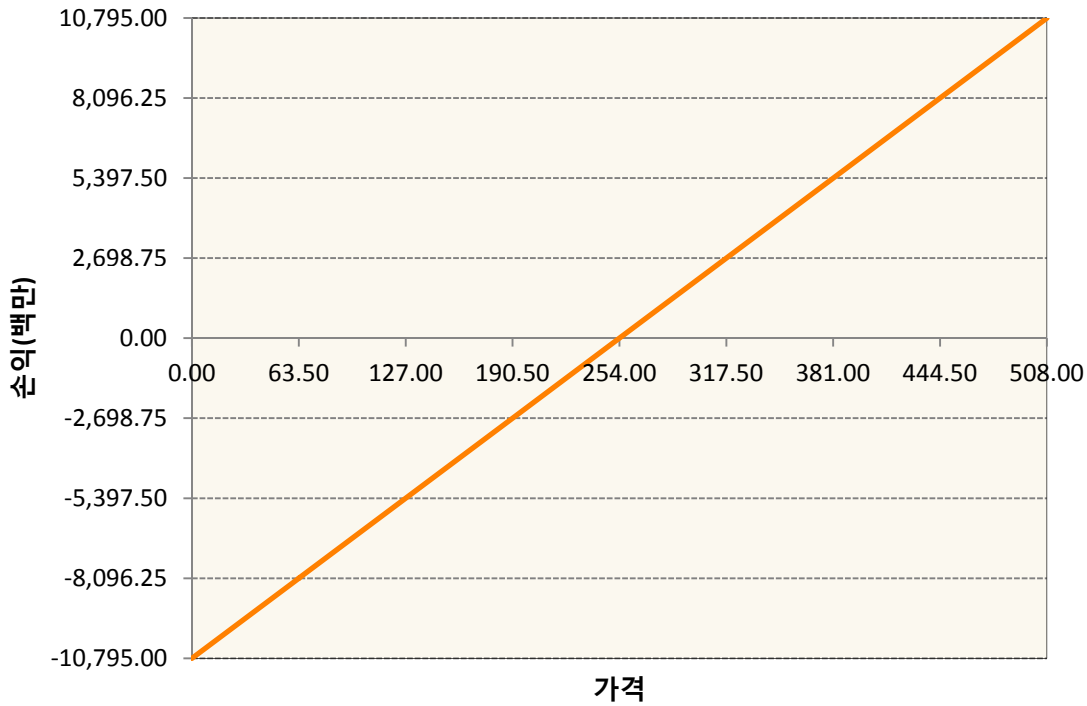
1. 계약금액

(단위:백만원)

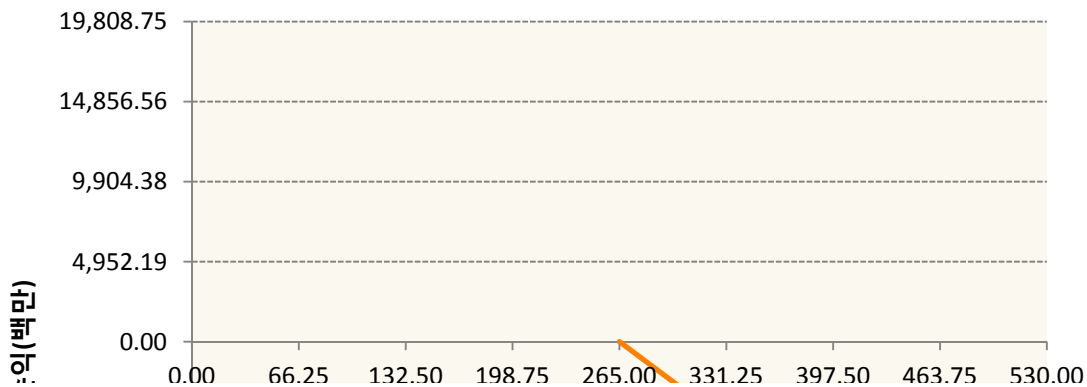
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,795	0	10,795	장내
누계	유가증권	옵션	3,659	19,943	-16,283	장내

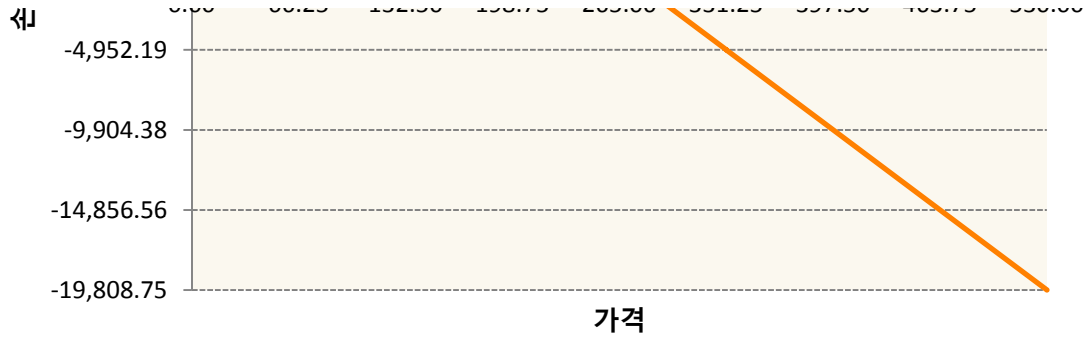
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

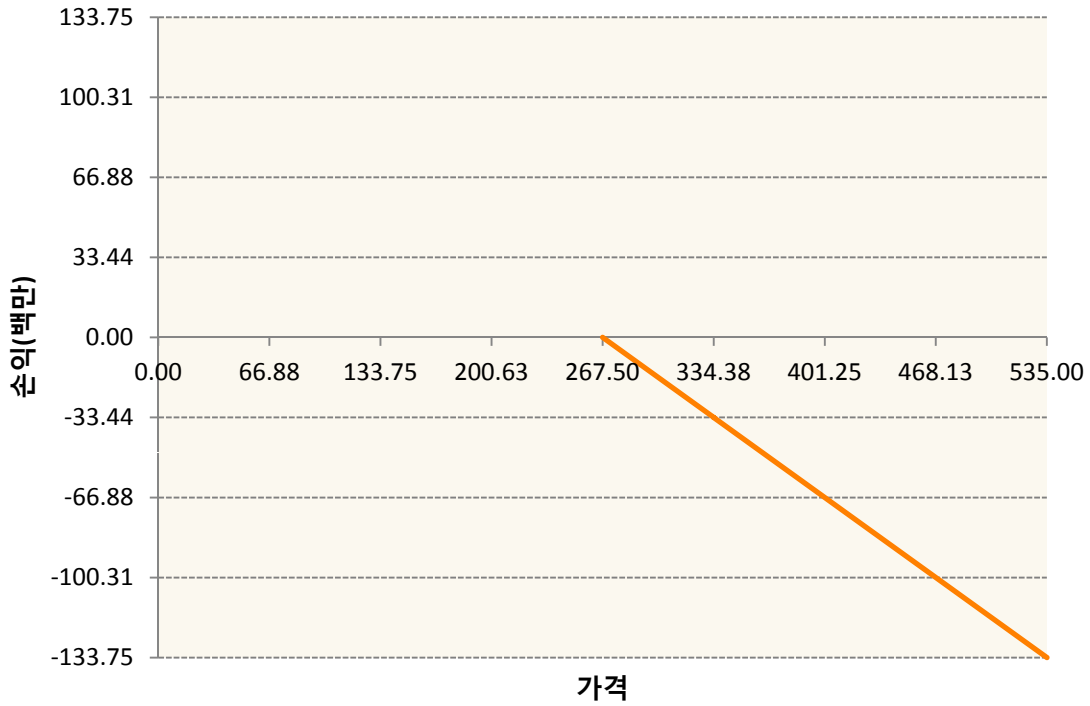


KR4201P92658-2019-09 콜265

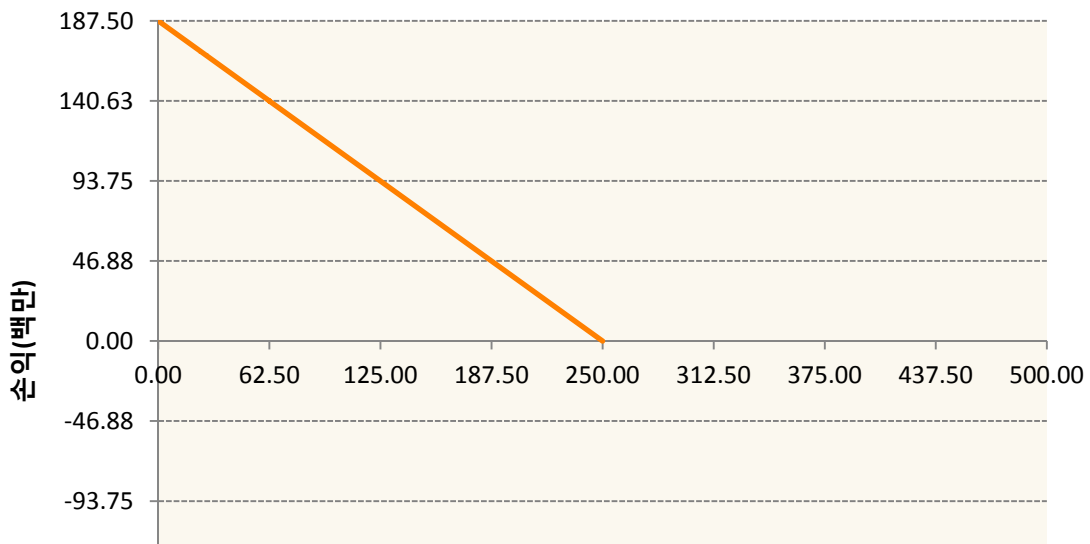


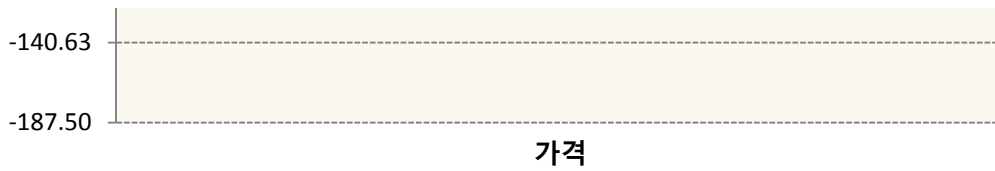


KR4201P92674-2019-09 콜267.5

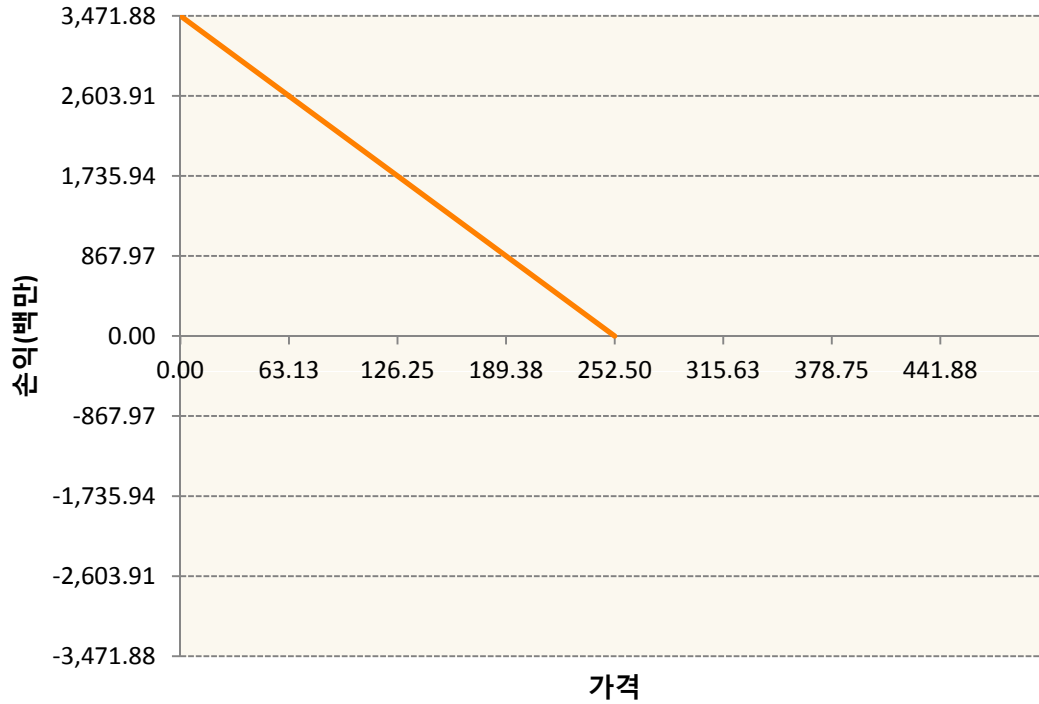


KR4301P92508-2019-09 풋250





KR4301P92524-2019-09 풋252.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						862
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-862	-862	-862	-862	-862	-862	-862	
-5.33%	-575	-575	-575	-575	-575	-575	-575	
-2.67%	-287	-287	-287	-287	-287	-287	-287	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	287	287	287	287	287	287	287	
5.33%	575	575	575	575	575	575	575	
8.00%	862	862	862	862	862	862	862	
KR4201P92658		2019-09 콜265						793
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	100	100	99	99	97	94	91	
-5.33%	99	98	95	92	86	79	71	
-2.67%	92	86	77	67	54	40	24	

0%	58	41	21	0	-23	-46	-71
2.67%	-49	-78	-109	-139	-170	-201	-233
5.33%	-275	-308	-341	-374	-407	-440	-473
8.00%	-628	-653	-679	-706	-734	-763	-793
KR4201P92674 2019-09 콜267.5							5
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	-1	-1	-1	-1	-1
5.33%	-1	-2	-2	-2	-2	-3	-3
8.00%	-3	-4	-4	-4	-4	-4	-5
KR4301P92508 2019-09 풋250							11
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11	11	11	11	11	11	11
-5.33%	6	6	6	6	7	7	7
-2.67%	2	2	2	3	3	3	3
0%	-1	0	0	0	0	0	1
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
KR4301P92524 2019-09 풋252.5							228
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	226	226	227	227	227	227	228
-5.33%	134	135	136	137	138	139	141
-2.67%	49	51	54	57	60	63	66
0%	-11	-8	-4	0	4	8	11
2.67%	-35	-33	-31	-29	-26	-23	-20
5.33%	-40	-40	-39	-38	-37	-36	-34
8.00%	-40	-40	-40	-40	-40	-39	-39

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

(단위:백만원)

1,510

공시일	2019-08-28
기준일	2019-08-27

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	69,237	0	69,237	

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	2019-08-28
기준일	2019-08-27

H2O글로벌본드(UH)(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	87,427	0	87,427	

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	2019-08-28
기준일	2019-08-27

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	471,441	0	471,441	
누계	통화	선도	0	459,166	-459,166	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		1,744
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,132
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		136
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		2,713
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		1,357
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		3,198
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		2,170
FX21019Q01 KRW/USD 16-09-19E		97
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,973
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,585
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,655
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		3,013
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		969
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		969

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

969
1,744
194

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

(단위:백만원)

11,974

공시일	2019-08-28
기준일	2019-08-27

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

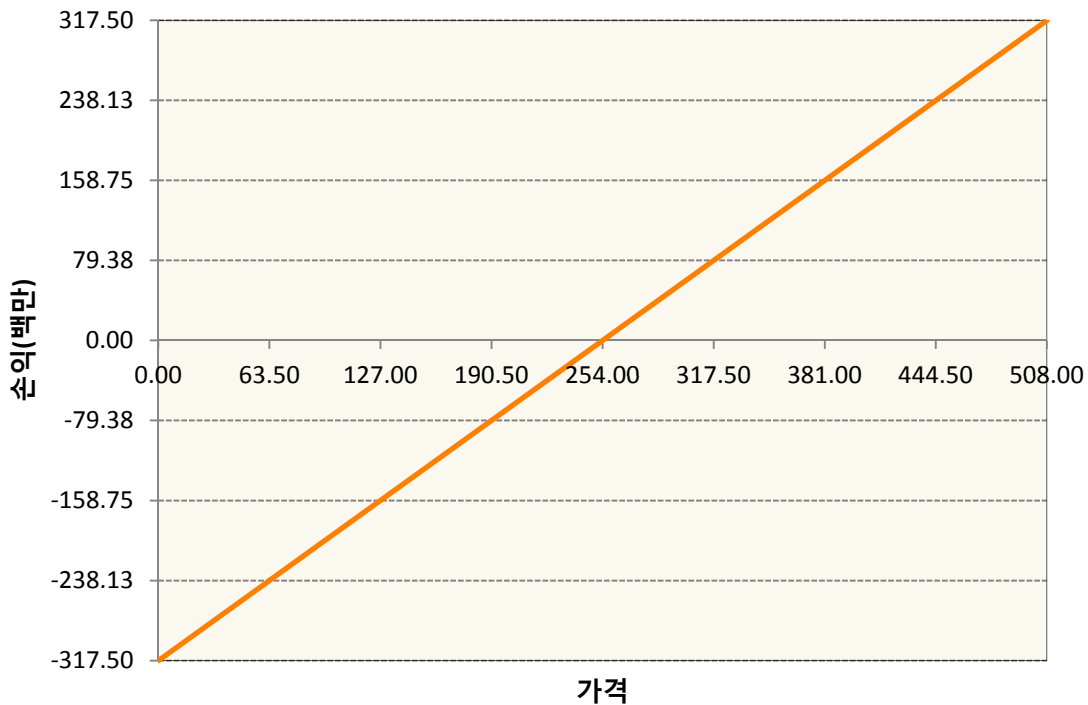
1. 계약금액

(단위:백만원)

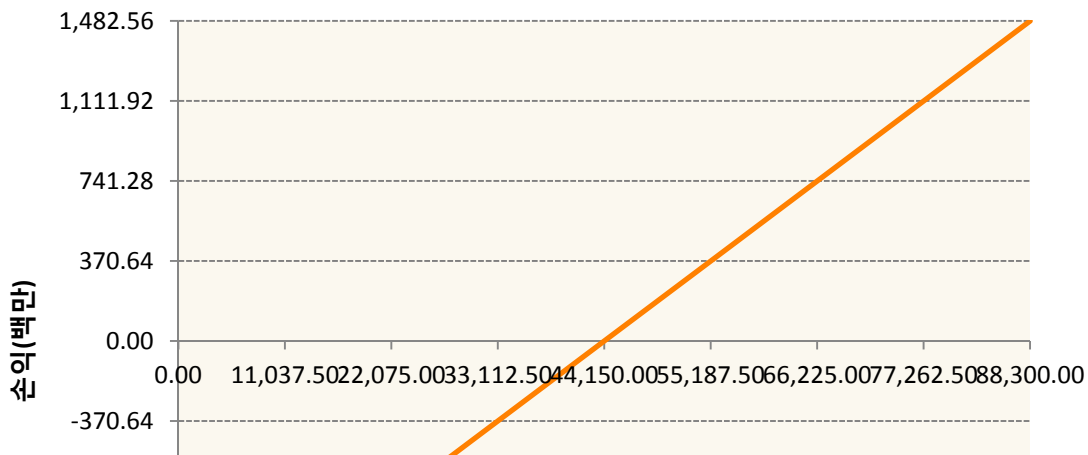
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,800	0	1,800	장내

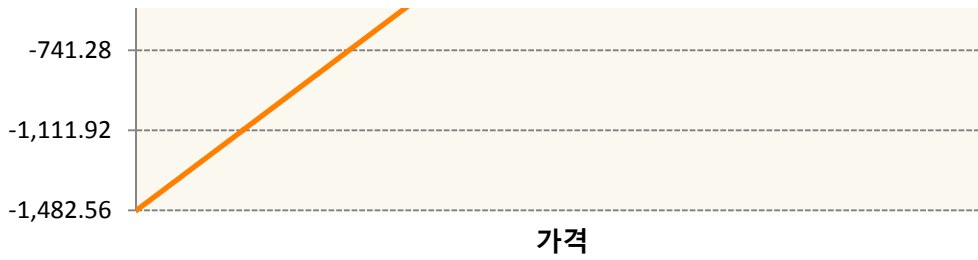
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P90000-2019-09 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						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						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)

167

공시일	2019-08-28
기준일	2019-08-27

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

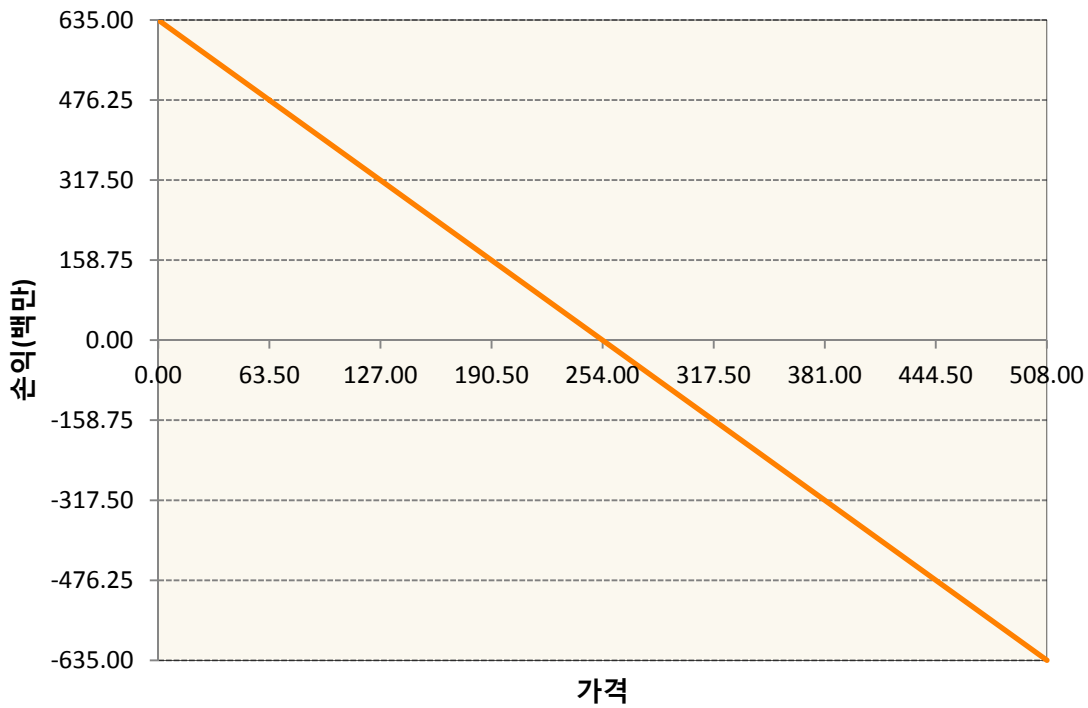
1. 계약금액

(단위:백만원)

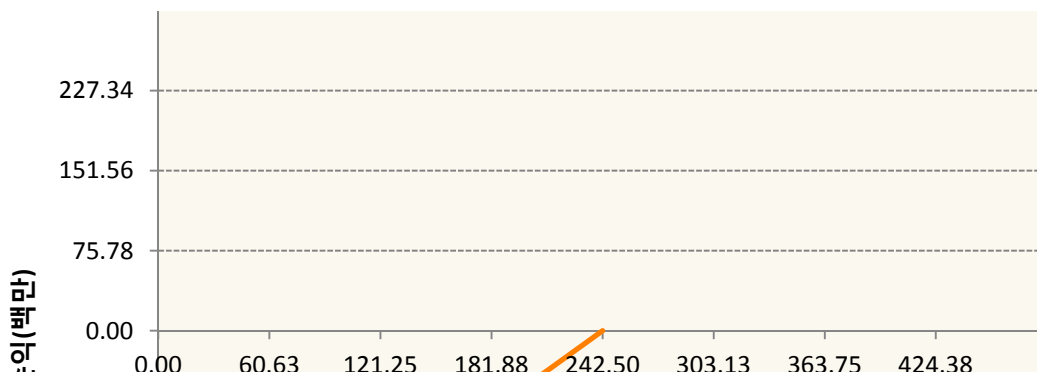
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	635	-635	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,672	-3,672	장내

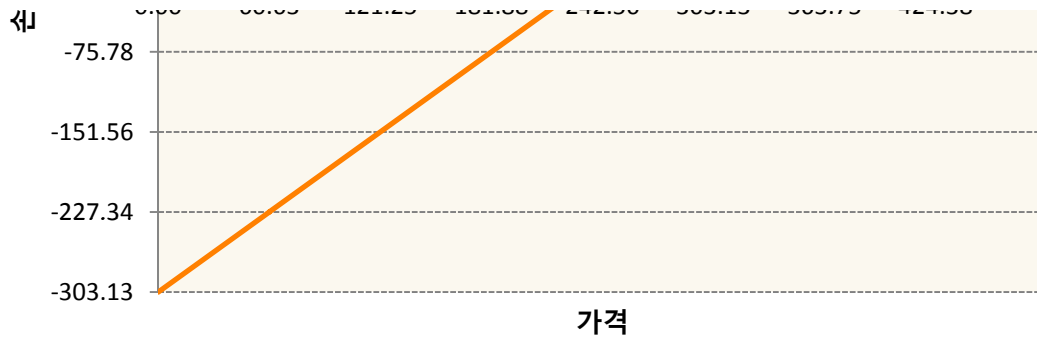
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

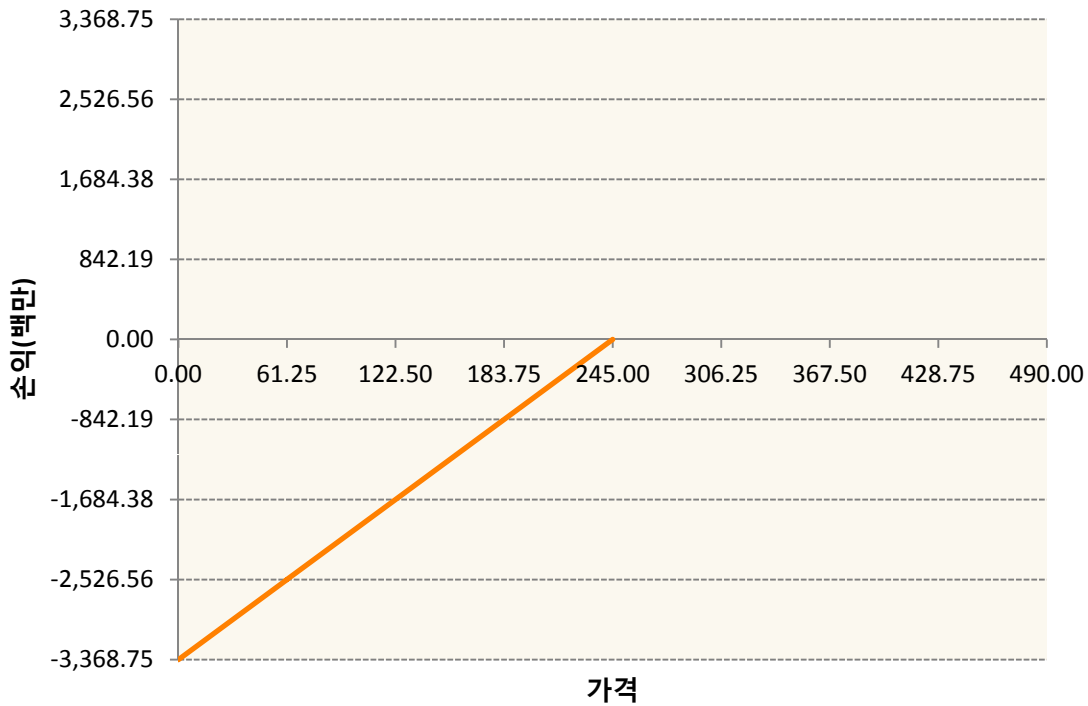


KR4301P92425-2019-09 풋242.5





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	51
-5.33%	34	34	34	34	34	34	34	34
-2.67%	17	17	17	17	17	17	17	17
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
5.33%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
KR4301P92425		2019-09 풋242.5						12
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11	-12	-12	-12	-12	-12	-12
-5.33%	-4	-5	-5	-5	-6	-6	-6
-2.67%	-1	-1	-1	-2	-2	-2	-2
0%	0	0	0	0	0	0	-1
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

162

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-155	-156	-157	-158	-159	-160	-162
-5.33%	-71	-73	-76	-79	-82	-85	-88
-2.67%	-14	-18	-22	-25	-29	-33	-36
0%	6	4	2	0	-2	-5	-8
2.67%	9	9	8	8	7	6	4
5.33%	9	9	9	9	9	9	8
8.00%	9	9	9	9	9	9	9

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

(단위:백만원)

182

공시일	2019-08-28
기준일	2019-08-27

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	19,782	0	19,782	
누계	통화	선도	0	19,258	-19,258	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		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)

502

공시일	2019-08-28
기준일	2019-08-27

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	387	0	387	장외
누계	통화	선도	94	94	0	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	18
2.55E+11 E1VFN30 VN ETF	13
FX21019N01 KRW/EUR 25-10-19E	4
FX21019Q00 KRW/EUR 25-10-19E	3
FX21019Q03 EUR/KRW 25-10-19E	8

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

(단위:백만원)

36

공시일	2019-08-28
기준일	2019-08-27

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

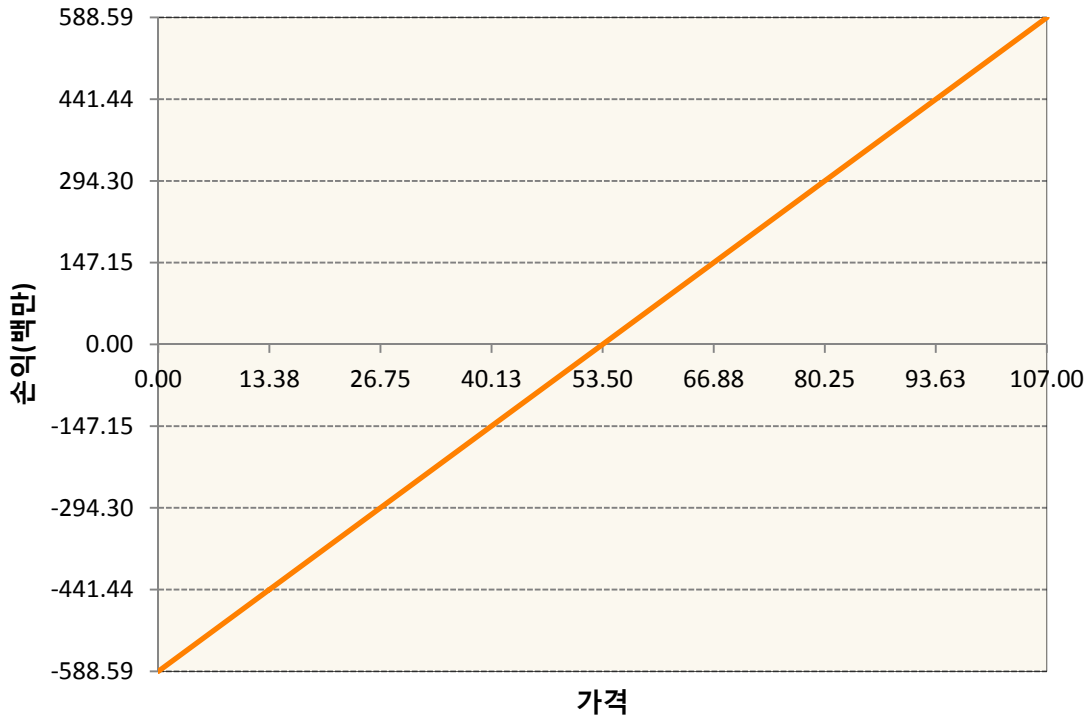
1. 계약금액

(단위:백만원)

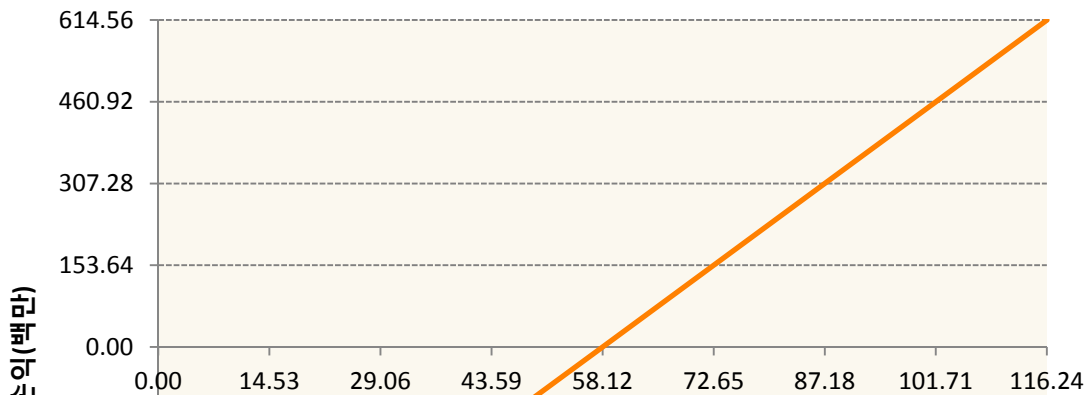
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,194	121	2,073	
누계	유가증권	선물	185	0	185	장내

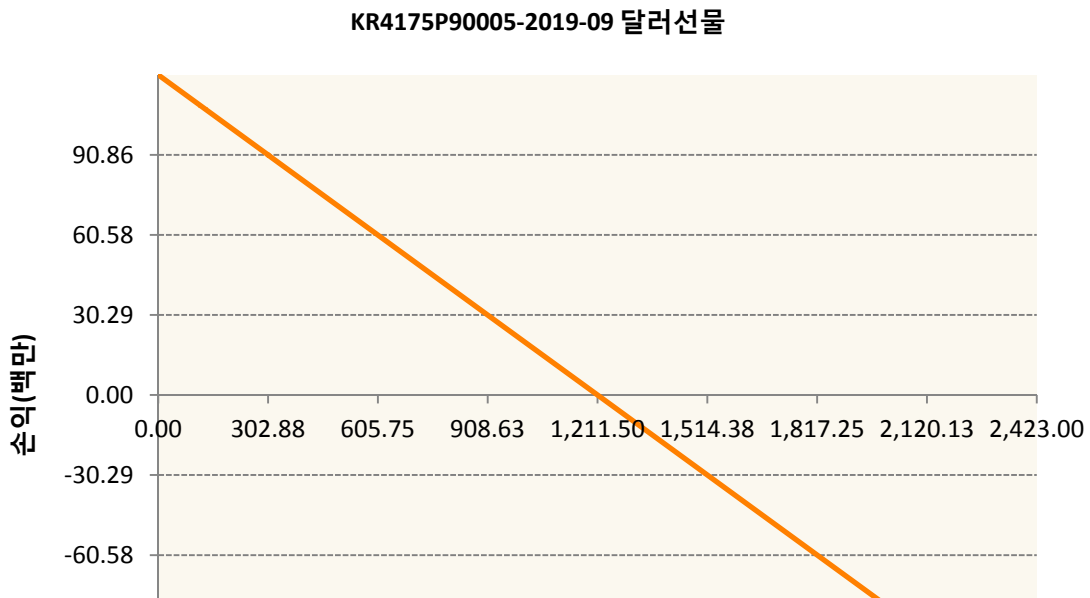
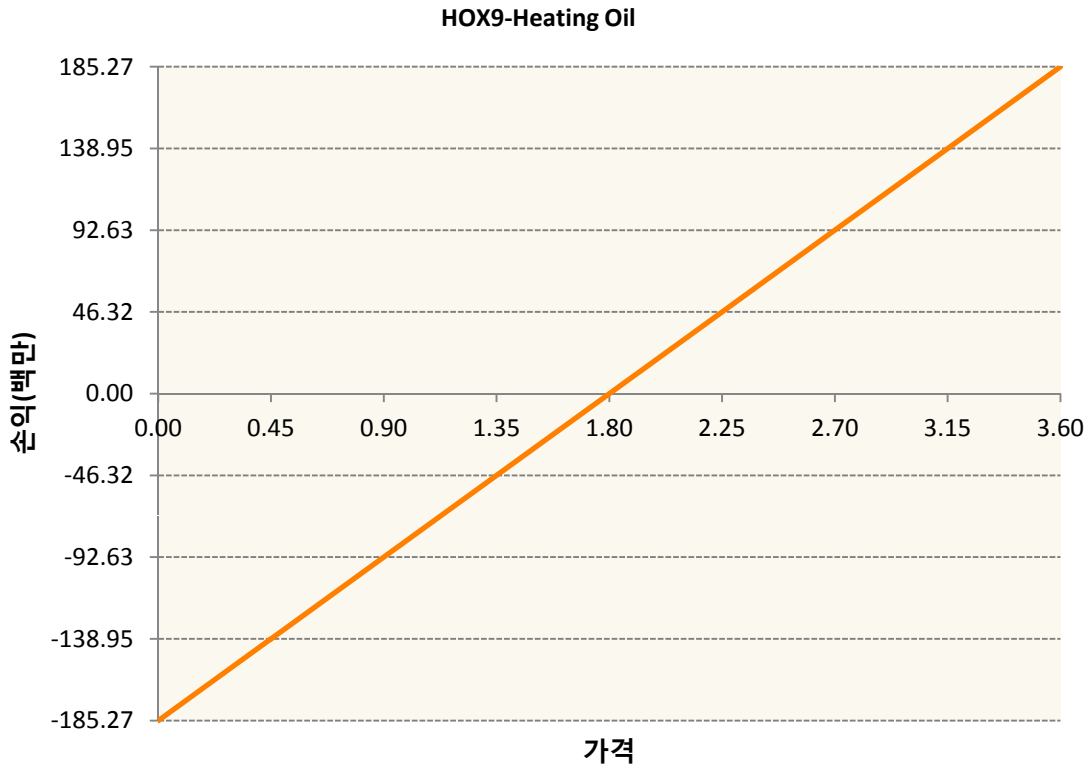
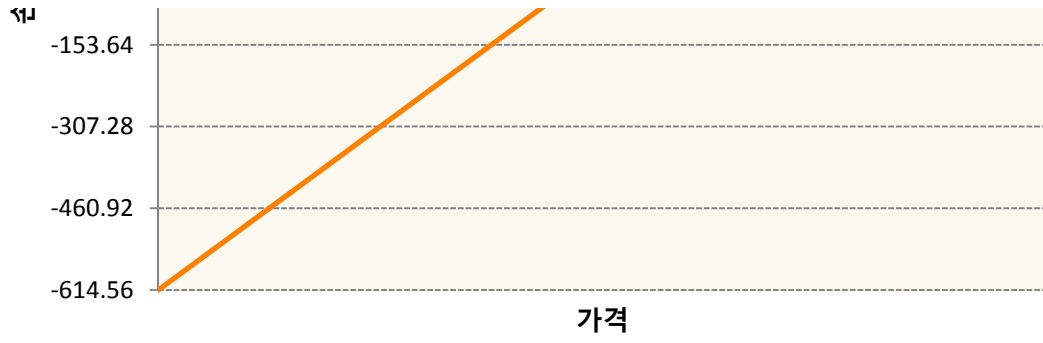
2. 만기시점의 손익구조

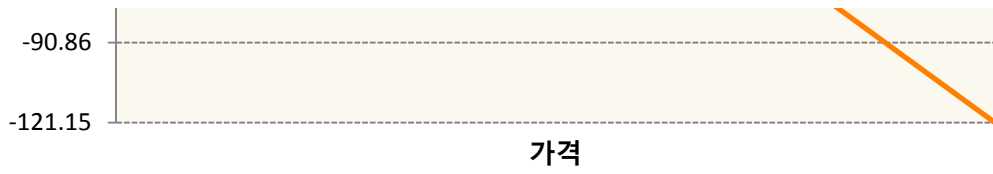
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19



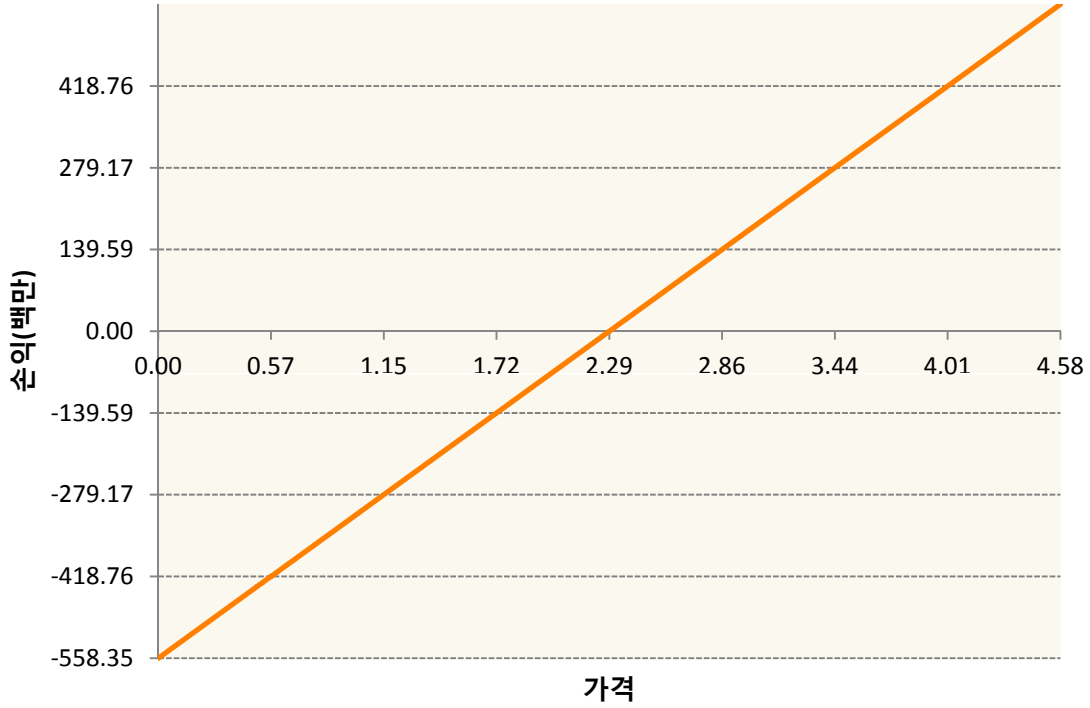
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19



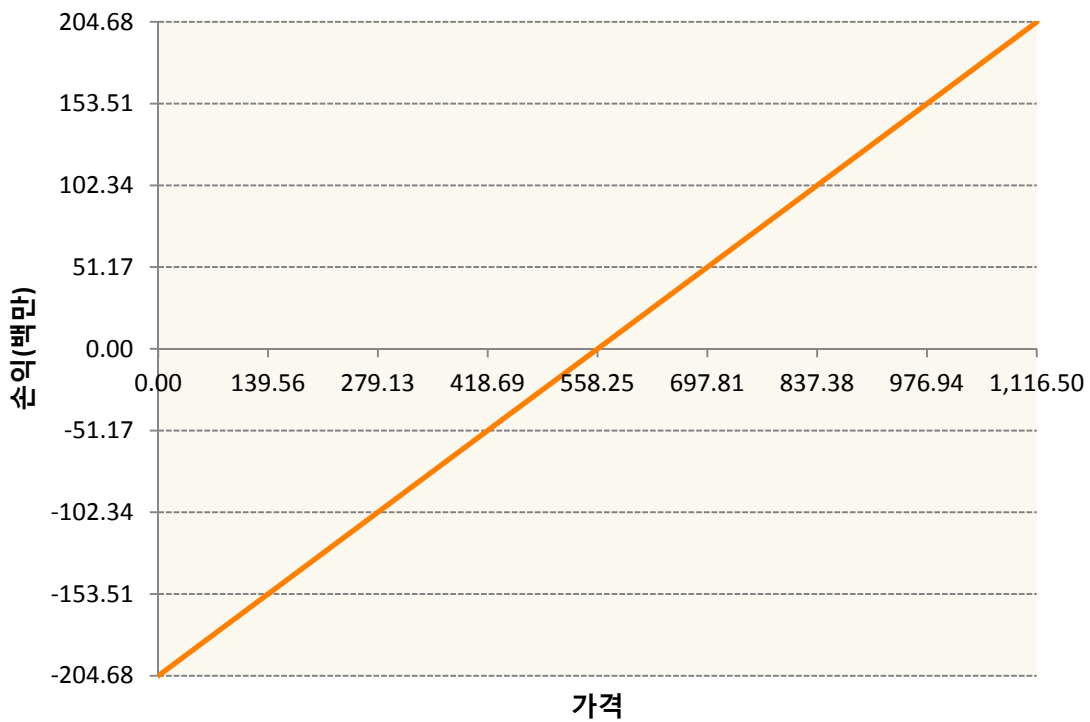


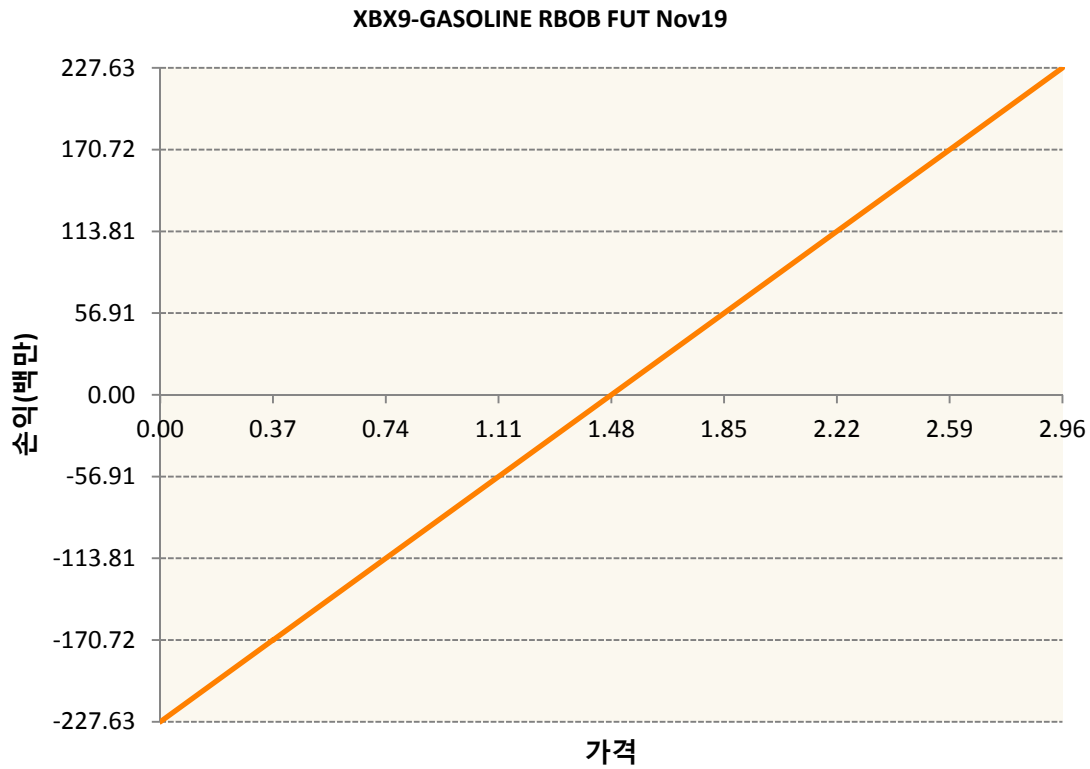


NGX19-NATURAL GAS FUTR Nov19



QSX9-Low Su Gasoil G Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX9	WTI CRUDE FUTURE Nov19	47
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	49
HOX9	Heating Oil	15
KR4175P900	2019-09 달러선물	10
NGX19	NATURAL GAS FUTR Nov19	45
QSX9	Low Su Gasoil G Nov19	16
XBX9	GASOLINE RBOB FUT Nov19	18

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	366

공시일	2019-08-28
기준일	2019-08-27

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

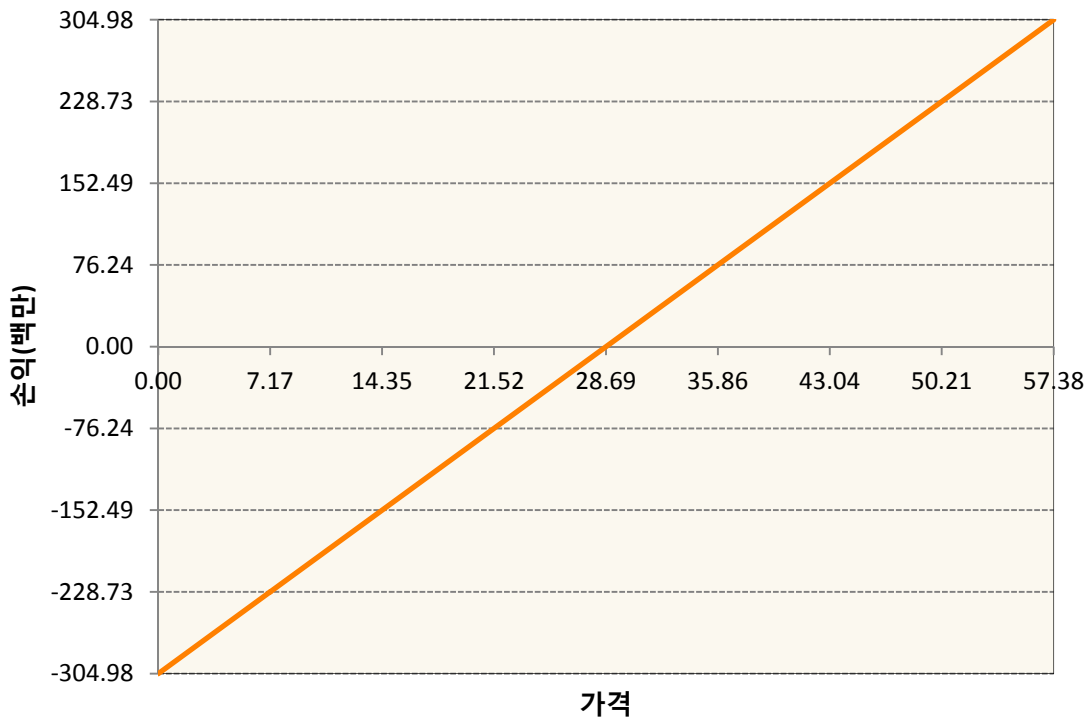
1. 계약금액

(단위:백만원)

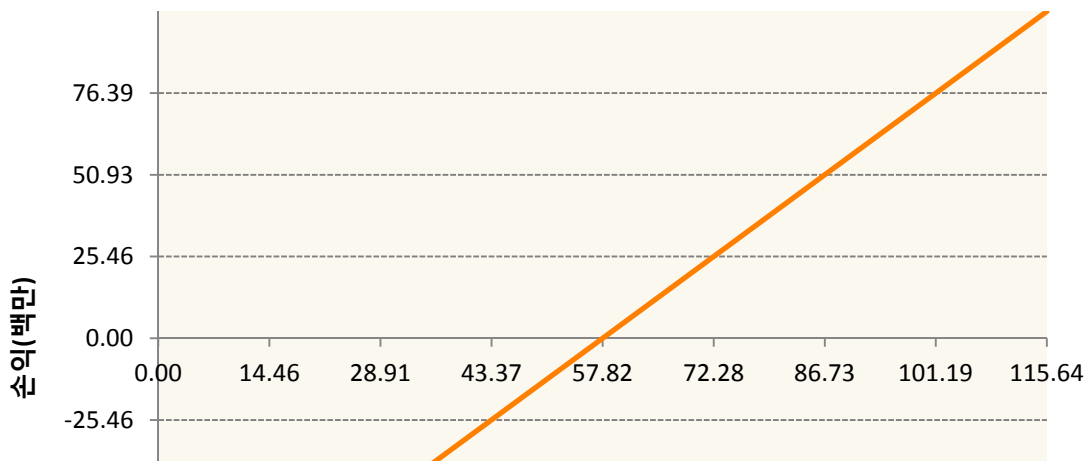
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,731	157	2,574	

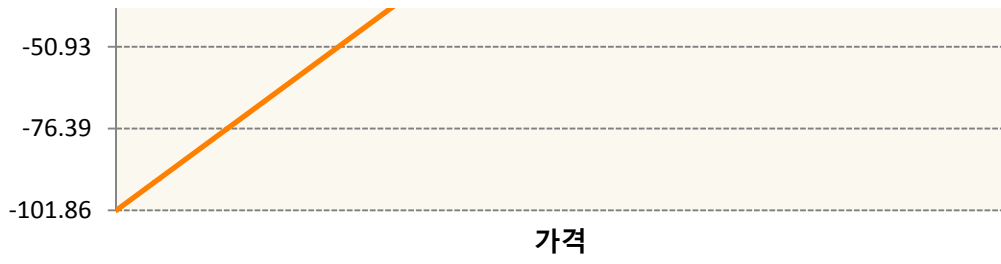
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

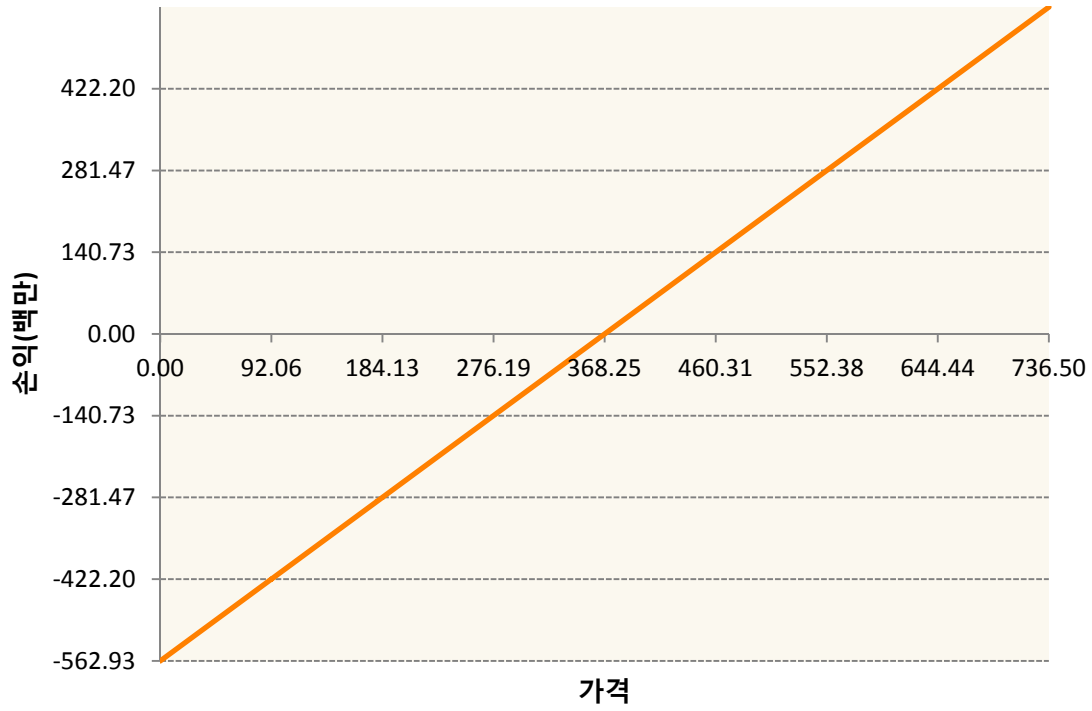


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

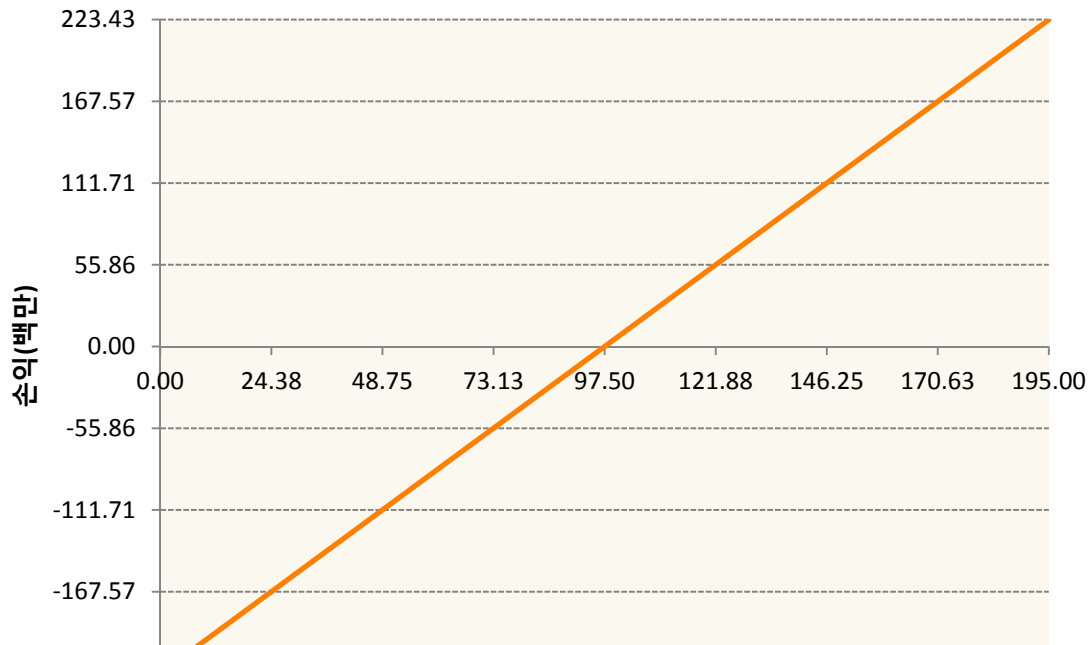


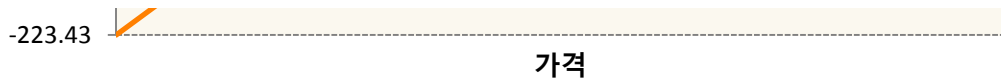


CZ9-CORN FUTURE Dec19

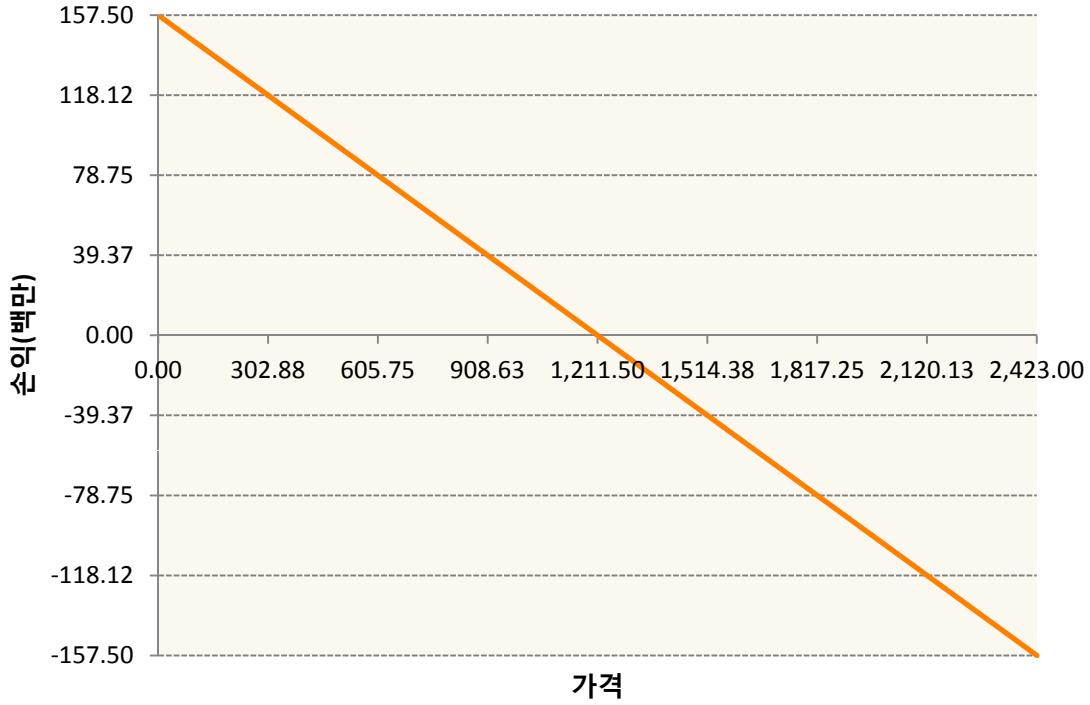


KCZ9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19

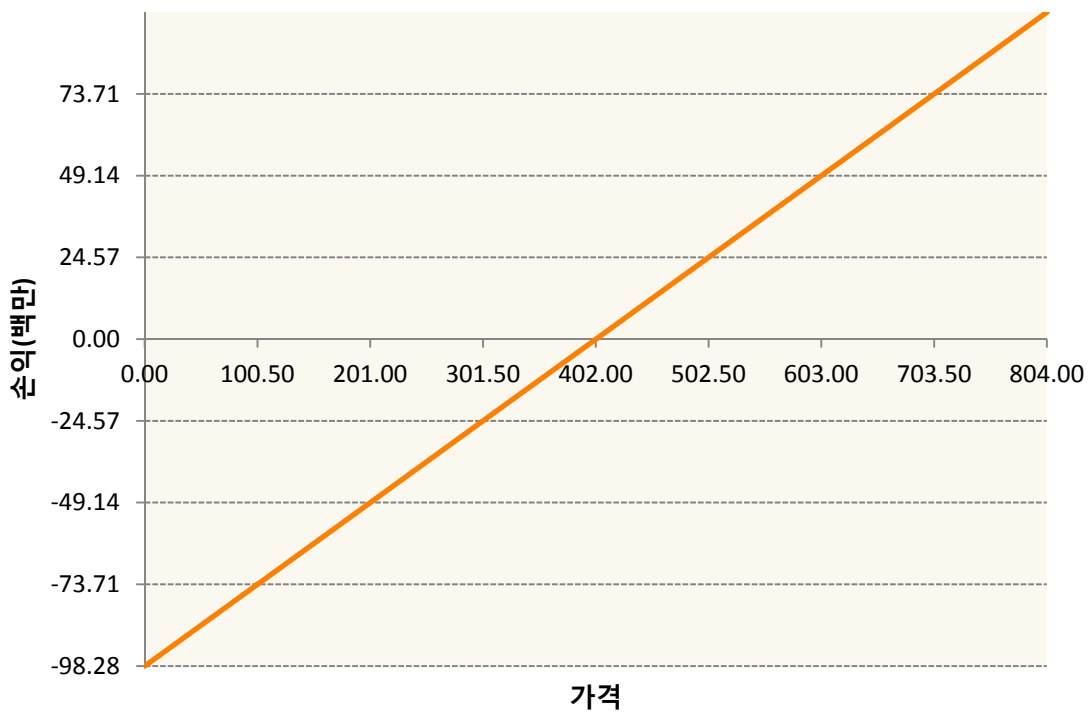




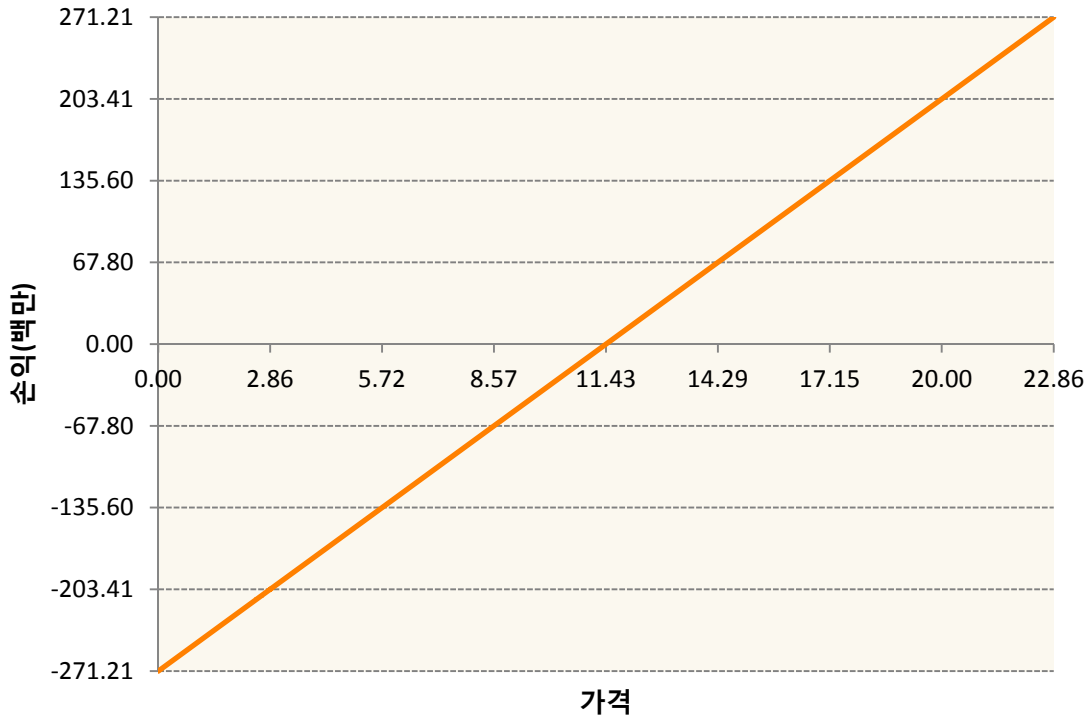
KR4175P90005-2019-09 달러선물



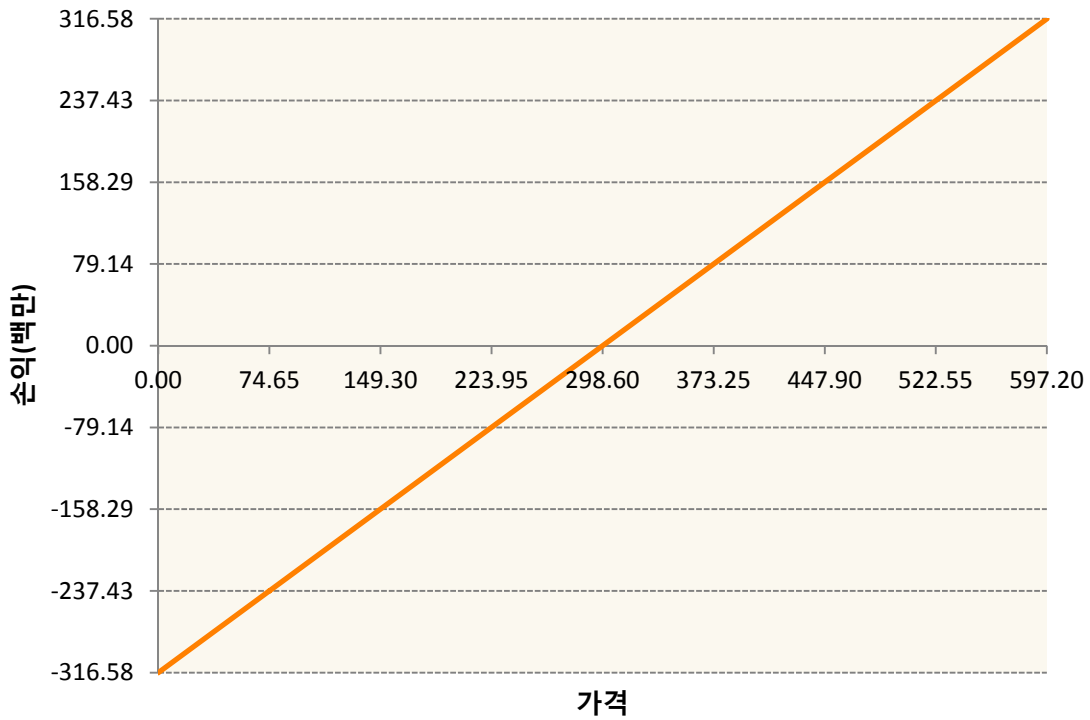
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

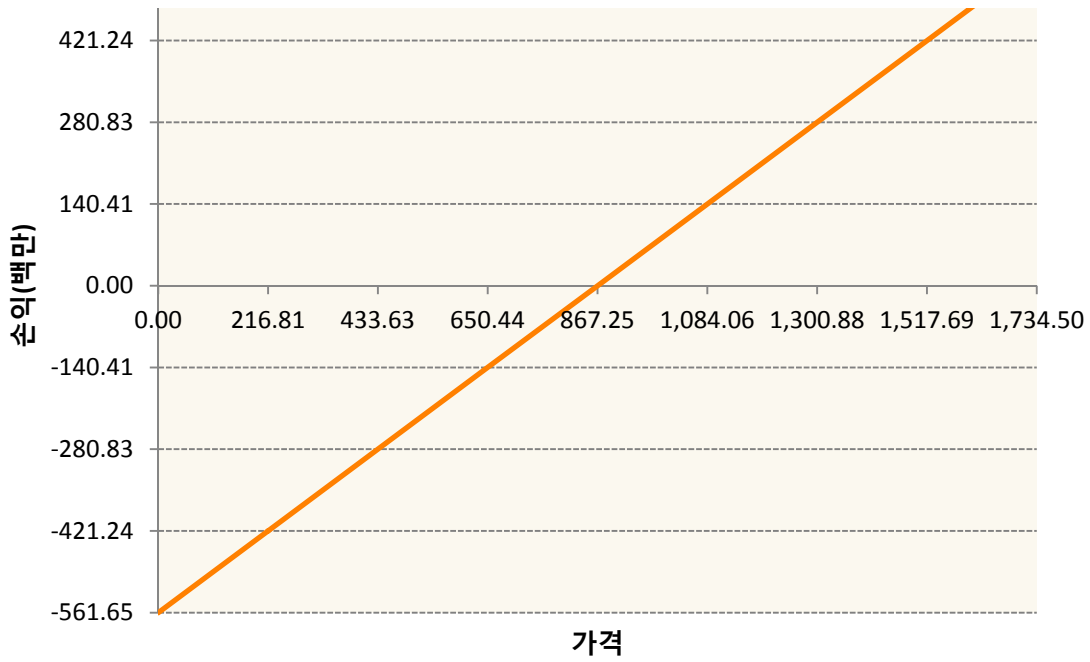


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

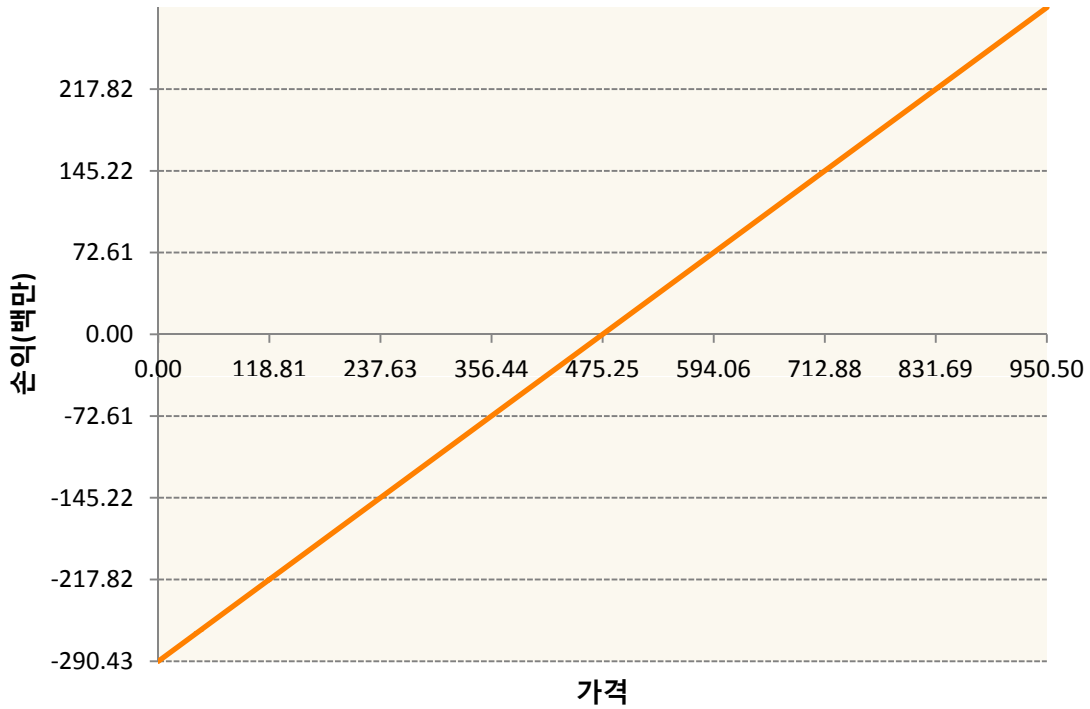


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





WZ9-WHEAT FUTURE(CBT) Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	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	45
WZ9	WHEAT FUTURE(CBT) Dec19	23

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

(단위:백만원)

243