

공시일	2019-08-29
기준일	2019-08-28

## 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	2019-08-29
기준일	2019-08-28

## 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	2019-08-29
기준일	2019-08-28

## 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)

**810**

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-29
기준일	2019-08-28

## 유로인덱스모(주식-파생형)

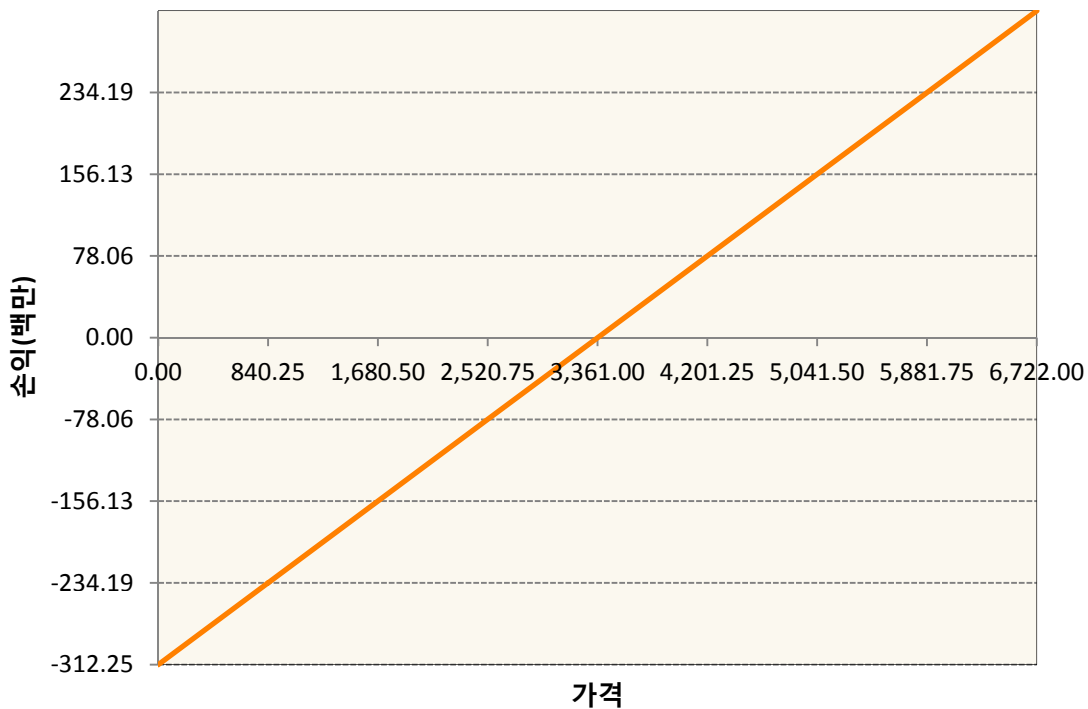
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	312	0	312	

### 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	2019-08-29
기준일	2019-08-28

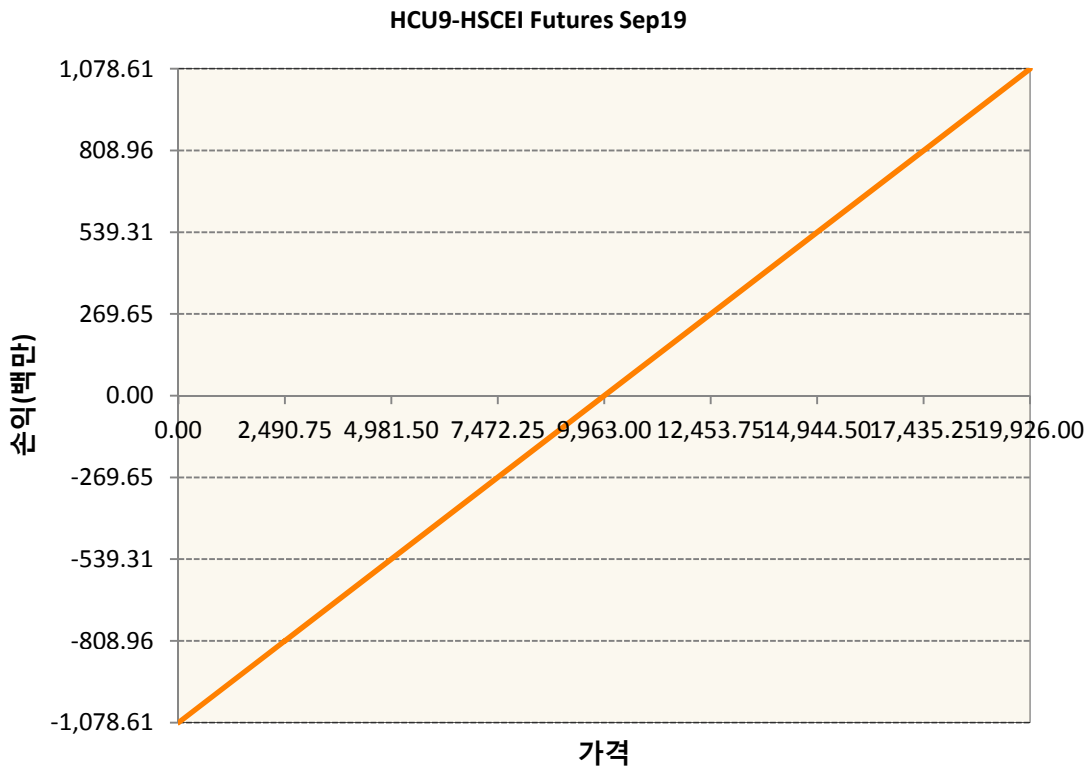
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,079	0	1,079	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU9	HSCEI Futures Sep19	86
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

<b>81</b>
-----------

공시일	2019-08-29
기준일	2019-08-28

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

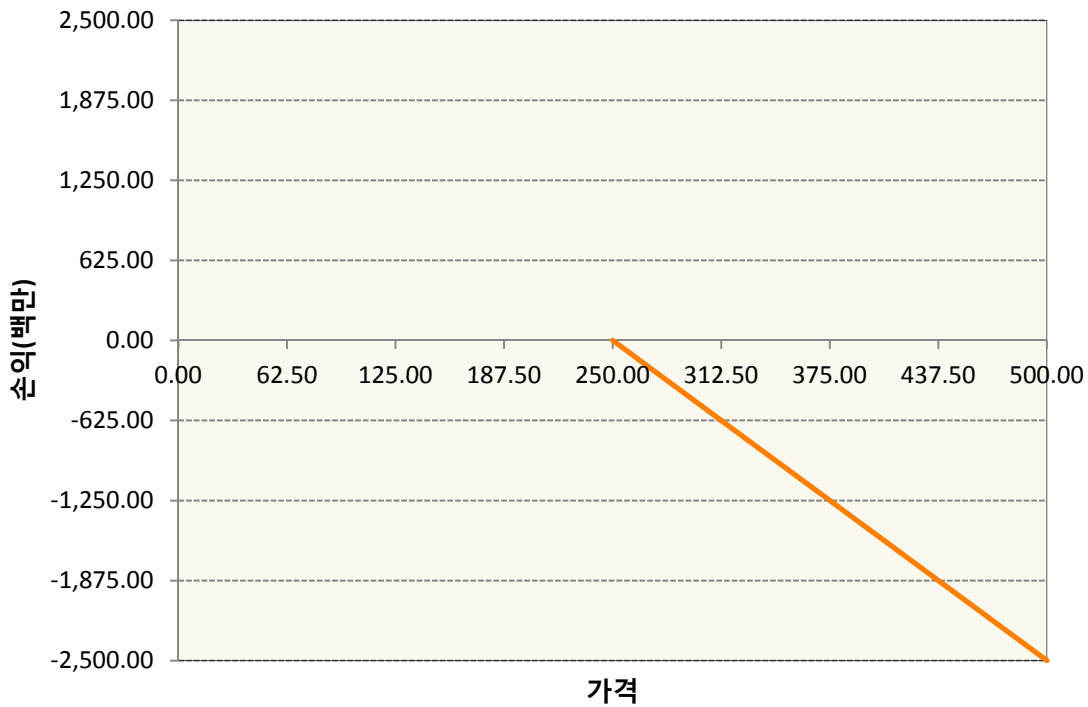
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

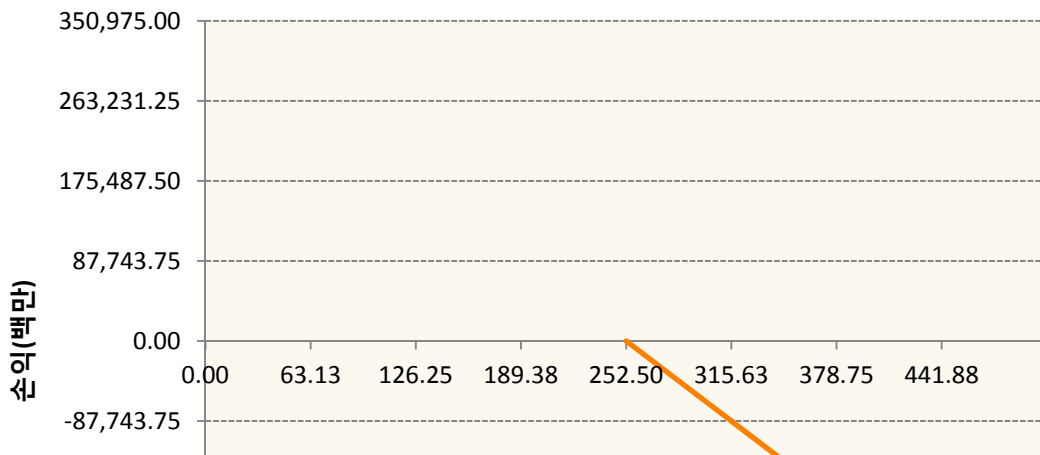
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	520,569	-520,569	장내

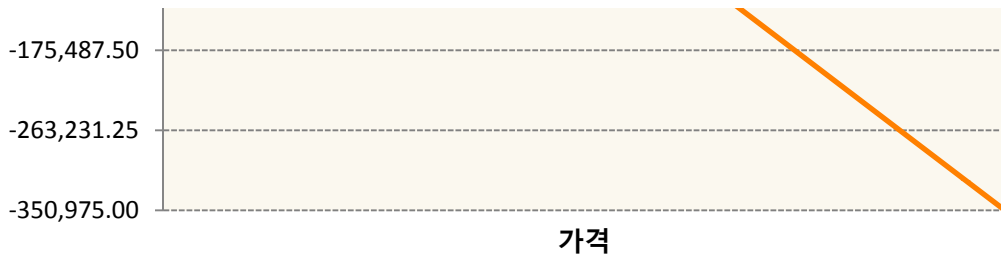
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P92500-2019-09 콜250

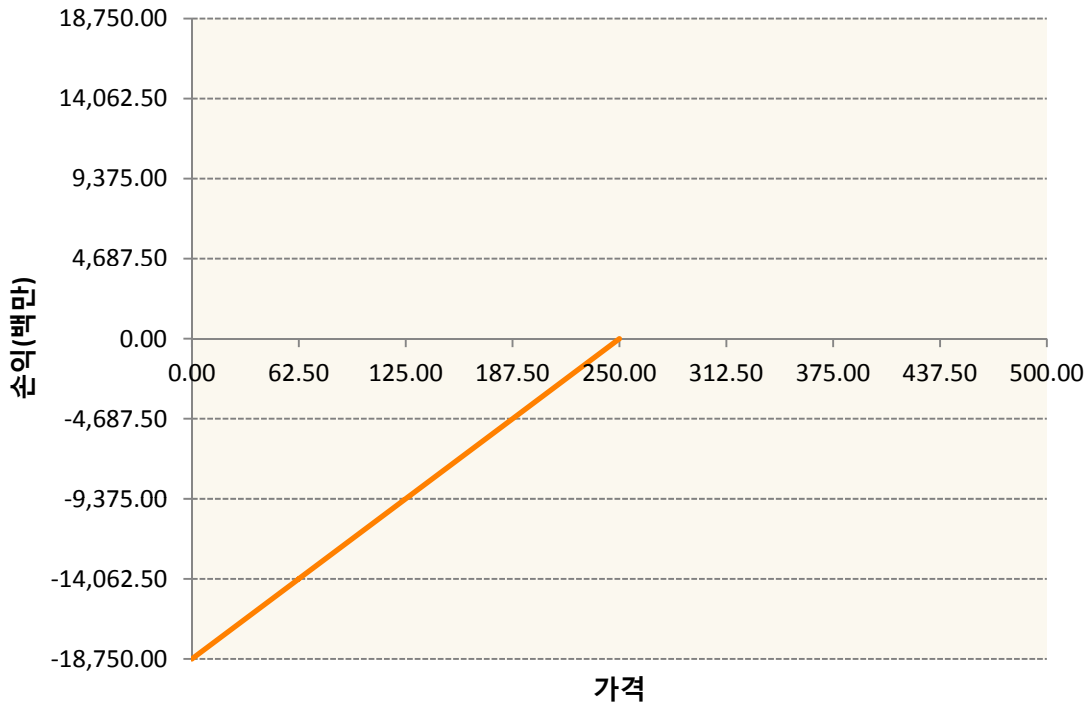


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

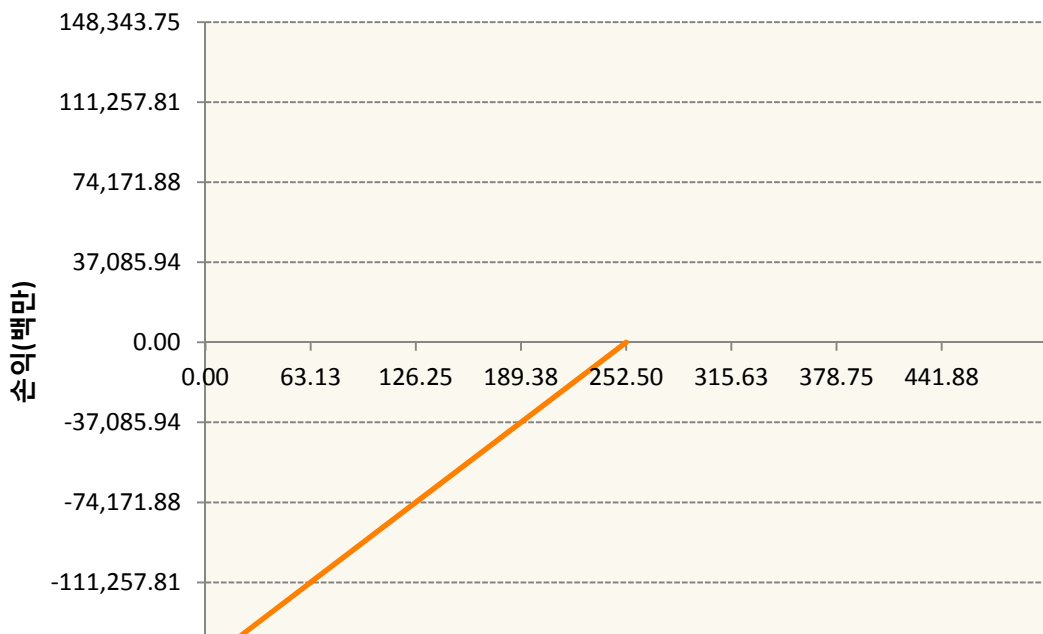




**KR4301P92508-2019-09 풋250**



**KR4301P92524-2019-09 풋252.5**



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P92500		2019-09 콜250						181
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	79	78	77	75	73	71	69	
-5.33%	72	69	66	63	60	57	53	
-2.67%	51	47	43	39	35	31	27	
0%	11	7	4	0	-4	-8	-11	
2.67%	-45	-47	-50	-52	-55	-58	-61	
5.33%	-110	-111	-112	-113	-114	-116	-118	
8.00%	-177	-178	-178	-178	-179	-180	-181	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5						24,078
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	8,946	8,850	8,717	8,550	8,349	8,117	7,857	
-5.33%	8,337	8,041	7,710	7,348	6,962	6,555	6,131	
-2.67%	6,245	5,725	5,198	4,664	4,126	3,584	3,039	
0%	1,655	1,108	555	0	-558	-1,118	-1,679	
2.67%	-5,446	-5,806	-6,198	-6,617	-7,057	-7,514	-7,987	
5.33%	-14,104	-14,257	-14,453	-14,687	-14,957	-15,258	-15,588	
8.00%	-23,377	-23,421	-23,491	-23,591	-23,722	-23,885	-24,078	
KR4301P92508		2019-09 풋250						1,055
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,038	-1,039	-1,040	-1,043	-1,046	-1,050	-1,055	
-5.33%	-542	-551	-560	-571	-582	-595	-608	
-2.67%	-146	-165	-184	-204	-223	-243	-262	
0%	45	31	16	0	-16	-33	-50	
2.67%	87	83	79	73	65	57	48	
5.33%	90	90	89	88	87	84	81	
8.00%	91	91	91	90	90	90	89	
KR4301P92524		2019-09 풋252.5						9,215
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-9,137	-9,140	-9,145	-9,154	-9,169	-9,189	-9,215	
-5.33%	-5,183	-5,218	-5,264	-5,320	-5,385	-5,458	-5,539	
-2.67%	-1,678	-1,806	-1,939	-2,076	-2,215	-2,356	-2,500	
0%	435	292	147	0	-149	-299	-450	
2.67%	1,077	1,025	961	886	802	711	612	

5.33%	1,160	1,153	1,141	1,122	1,096	1,062	1,021
8.00%	1,165	1,164	1,163	1,161	1,156	1,148	1,136

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

(단위:백만원)

**36,620**

공시일	2019-08-29
기준일	2019-08-28

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

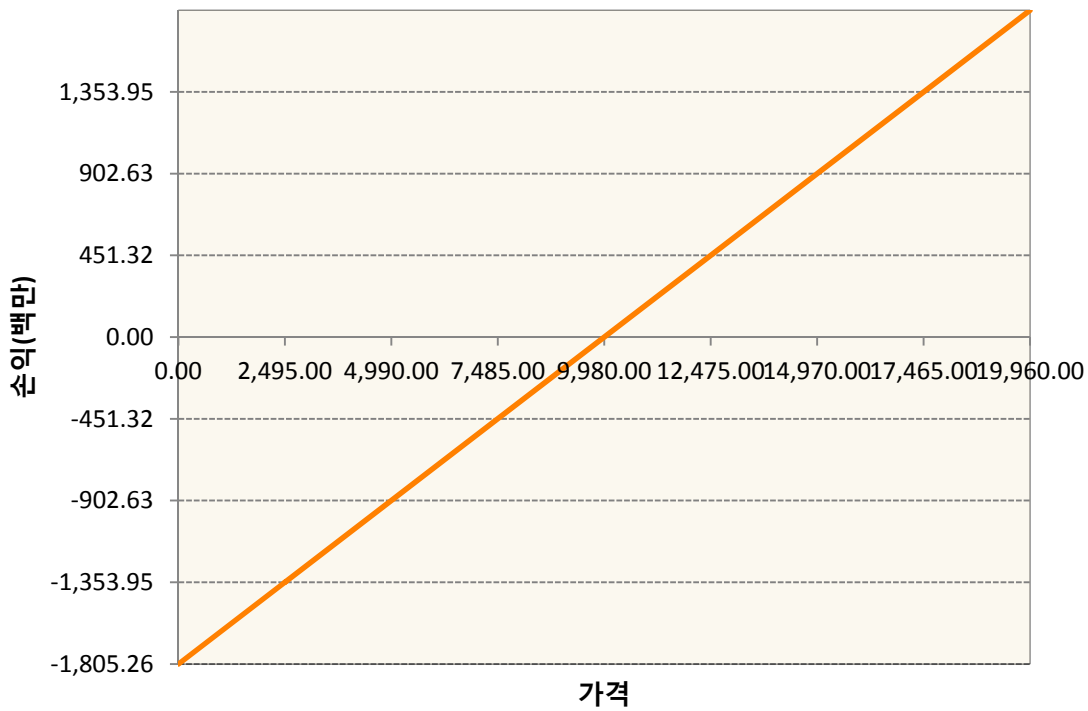
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

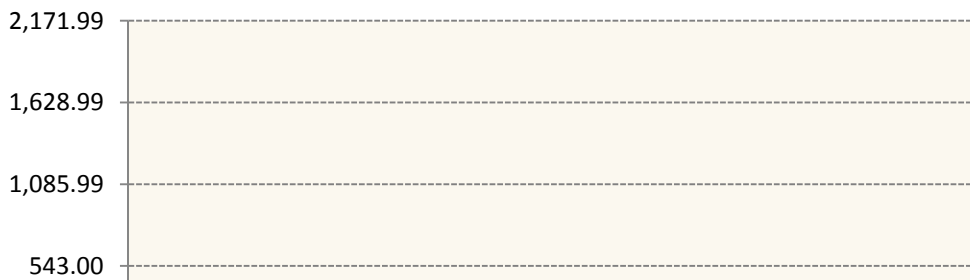
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,805	0	1,805	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,356	-5,356	장내
누계	통화	선도	0	2,874	-2,874	장외

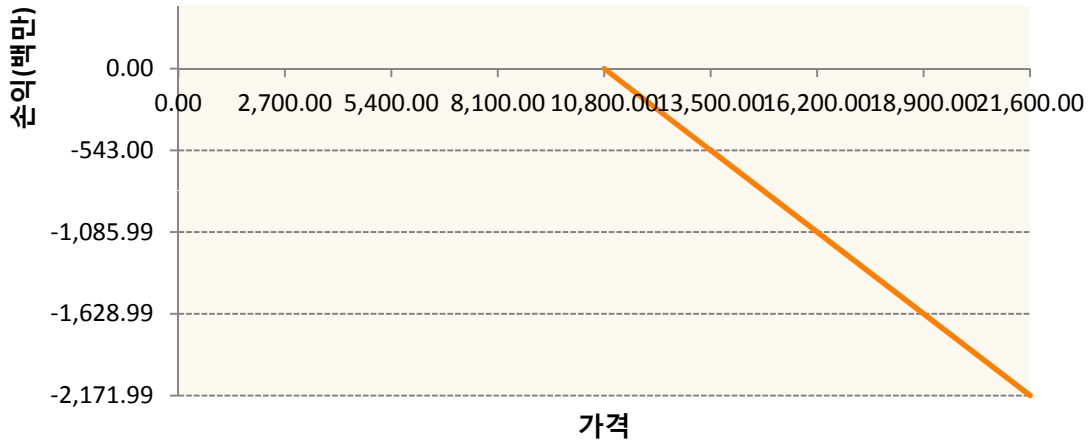
### 2. 만기시점의 손익구조

HCQ9-HSCEI Futures Aug19

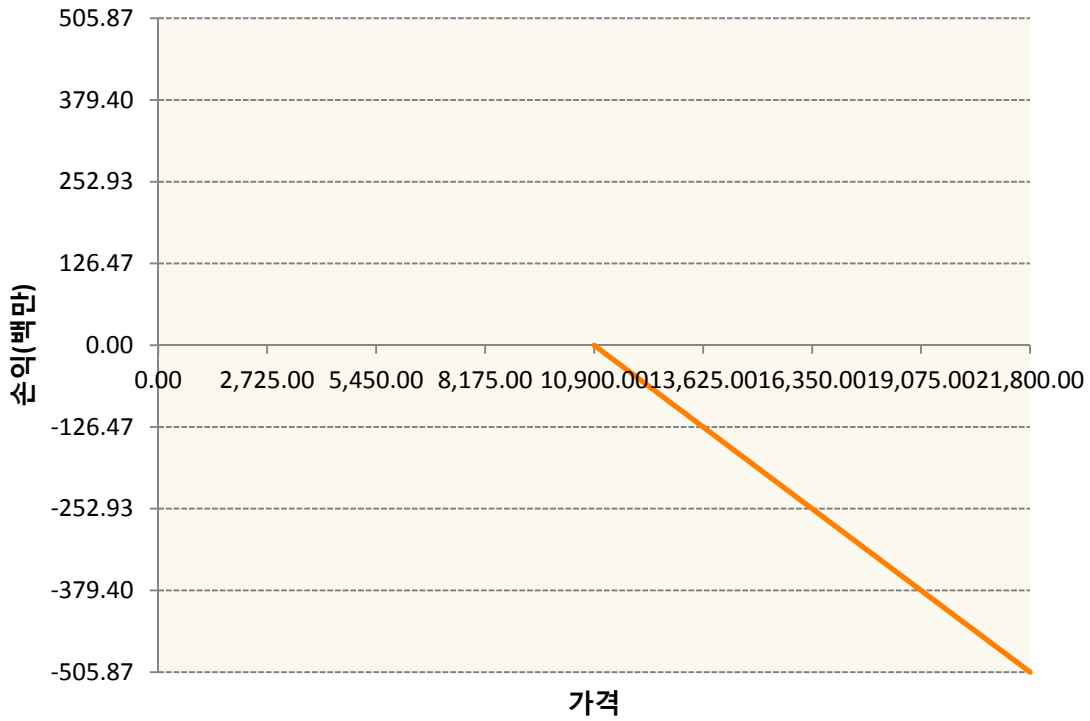


OHHIQ9-C108-HSCEI

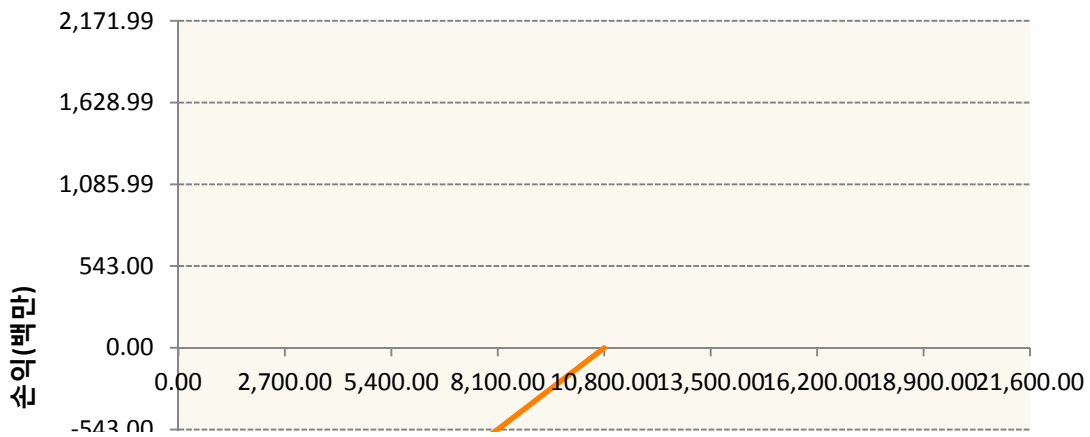


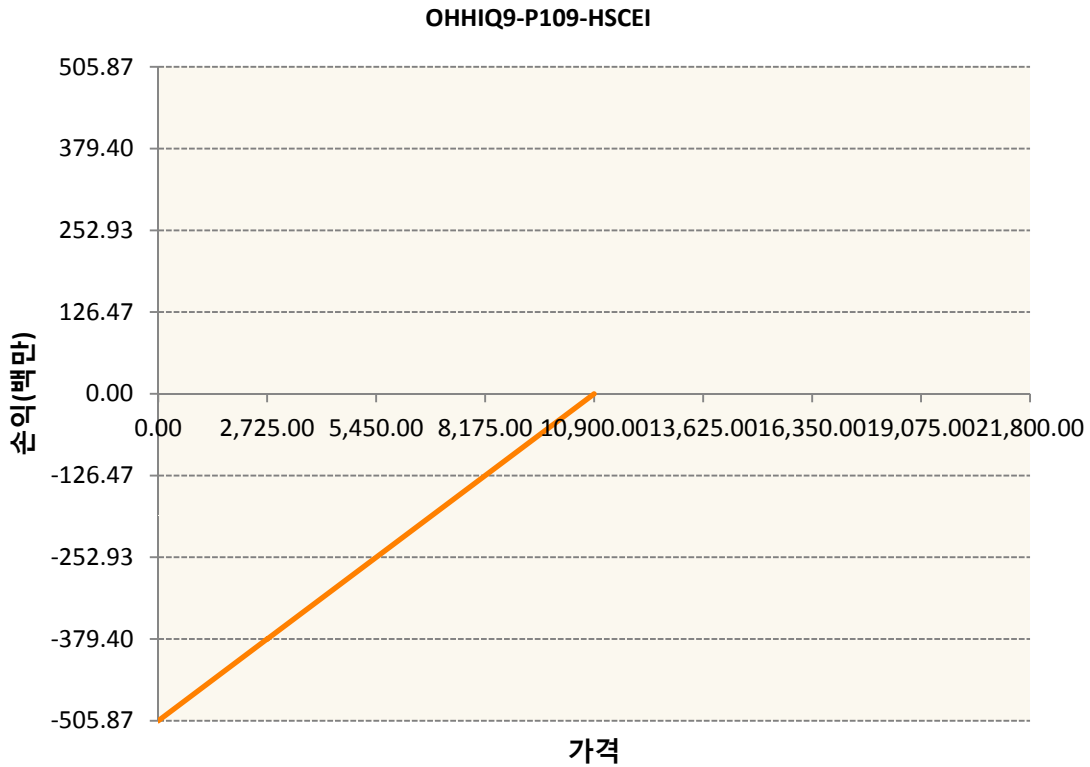


**OHHIQ9-C109-HSCEI**



**OHHIQ9-P108-HSCEI**





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	230
HCQ9 HSCEI Futures Aug19	144
OHHIQ9-C1(HSCEI	174
OHHIQ9-C1(HSCEI	40
OHHIQ9-P1(HSCEI	174
OHHIQ9-P1(HSCEI	40

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	609

공시일	2019-08-29
기준일	2019-08-28

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

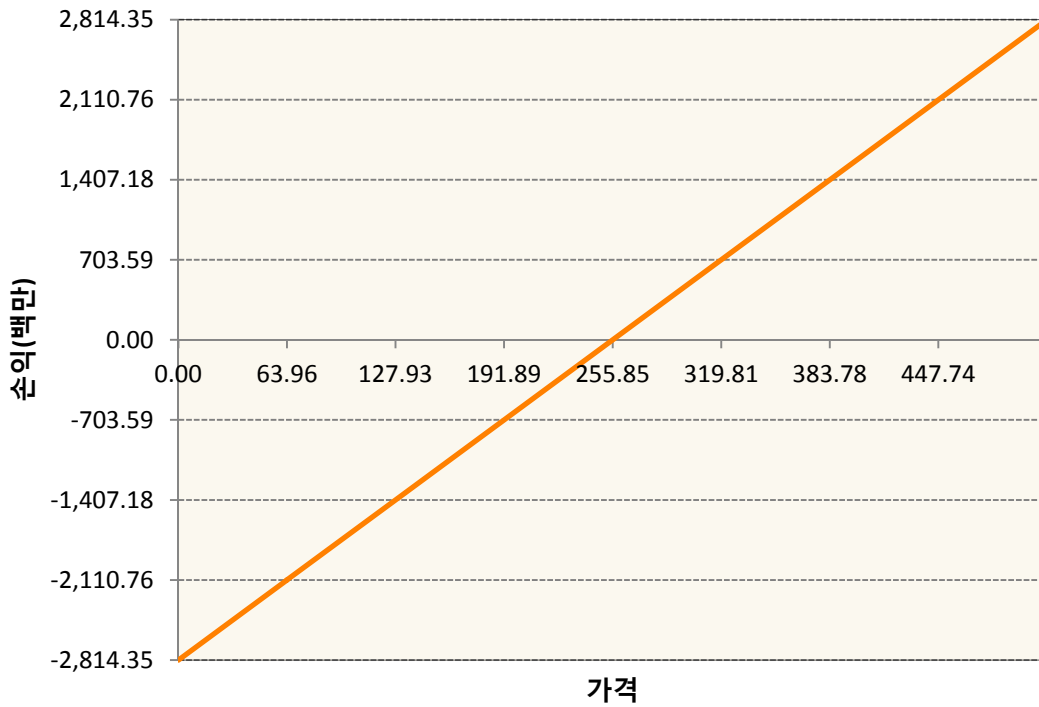
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

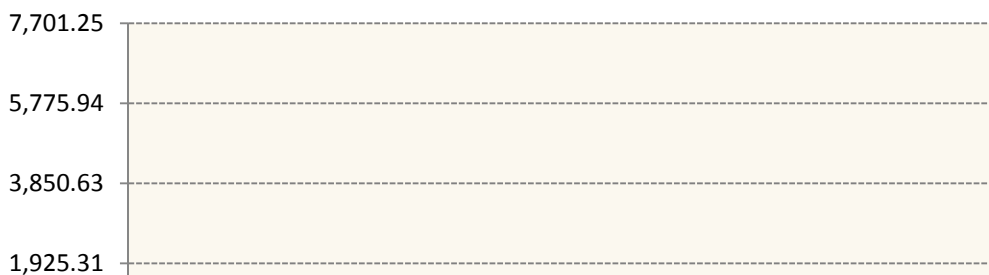
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,814	0	2,814	장내
누계	유가증권	스왑	14,125	0	14,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,829	-14,829	장내

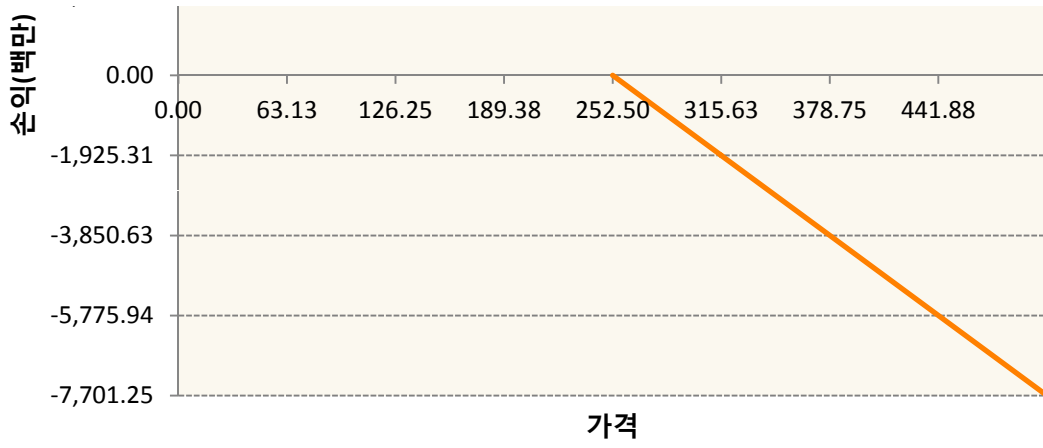
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

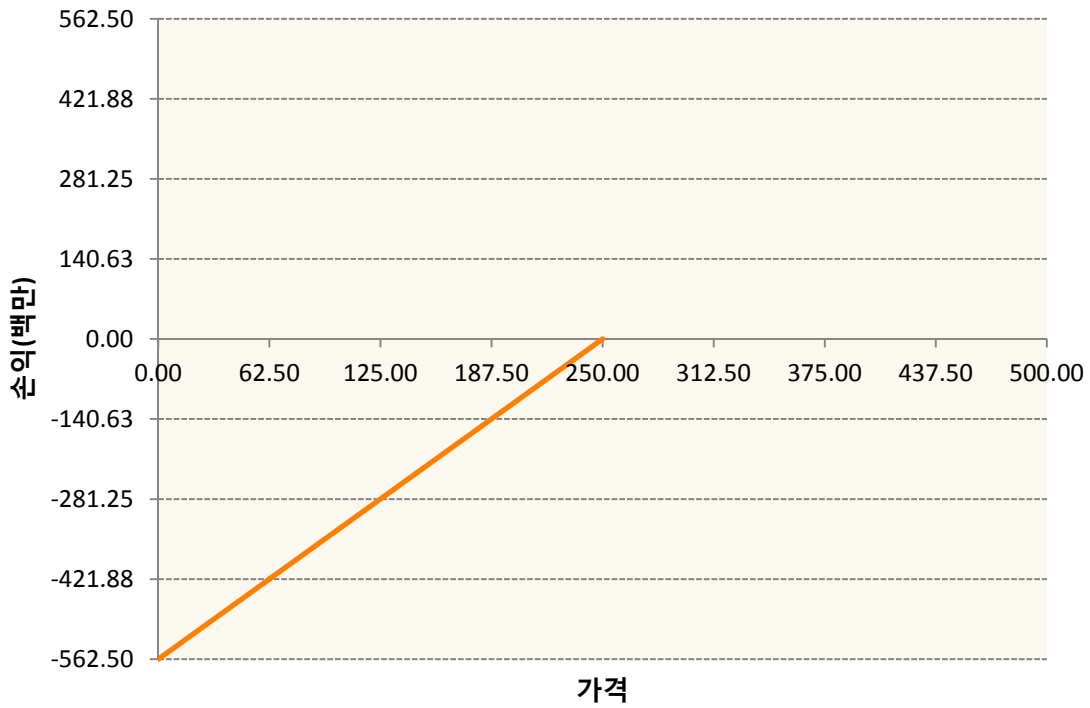


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

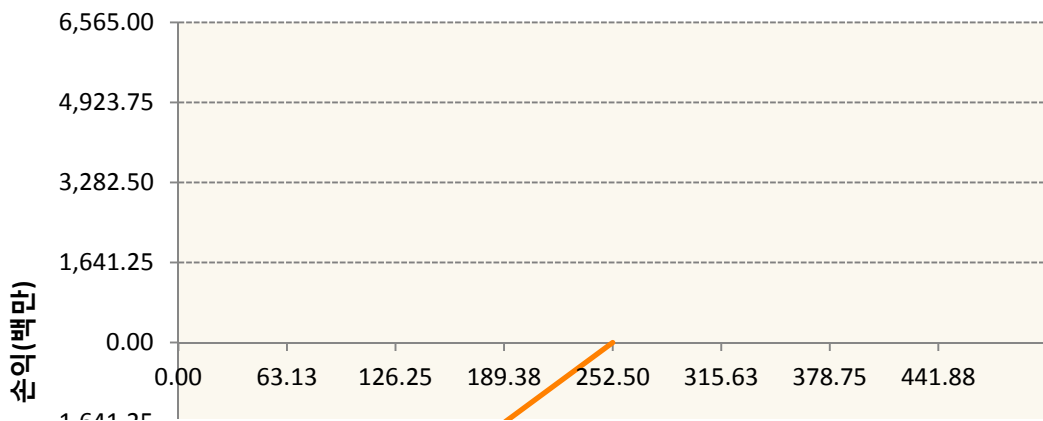




**KR4301P92508-2019-09 풋250**



**KR4301P92524-2019-09 풋252.5**





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						1,227
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,227	-1,227	-1,227	-1,227	-1,227	-1,227	-1,227	
-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%	1,227	1,227	1,227	1,227	1,227	1,227	1,227	
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						528
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	196	194	191	188	183	178	172	
-5.33%	183	176	169	161	153	144	135	
-2.67%	137	126	114	102	91	79	67	
0%	36	24	12	0	-12	-25	-37	
2.67%	-119	-127	-136	-145	-155	-165	-175	
5.33%	-309	-313	-317	-322	-328	-335	-342	
8.00%	-513	-514	-515	-518	-521	-524	-528	
KR4301P92508		2019-09 풋250						32
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-31	-31	-31	-31	-31	-32	-32
-5.33%	-16	-17	-17	-17	-17	-18	-18
-2.67%	-4	-5	-6	-6	-7	-7	-8
0%	1	1	0	0	0	-1	-2
2.67%	3	2	2	2	2	2	1
5.33%	3	3	3	3	3	3	2
8.00%	3	3	3	3	3	3	3
KR4301P92524                      2019-09 풋252.5							408
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-404	-404	-405	-405	-406	-407	-408
-5.33%	-229	-231	-233	-235	-238	-242	-245
-2.67%	-74	-80	-86	-92	-98	-104	-111
0%	19	13	7	0	-7	-13	-20
2.67%	48	45	43	39	36	31	27
5.33%	51	51	51	50	49	47	45
8.00%	52	52	51	51	51	51	50

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

(단위:백만원)

**2,444**

공시일	2019-08-29
기준일	2019-08-28

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

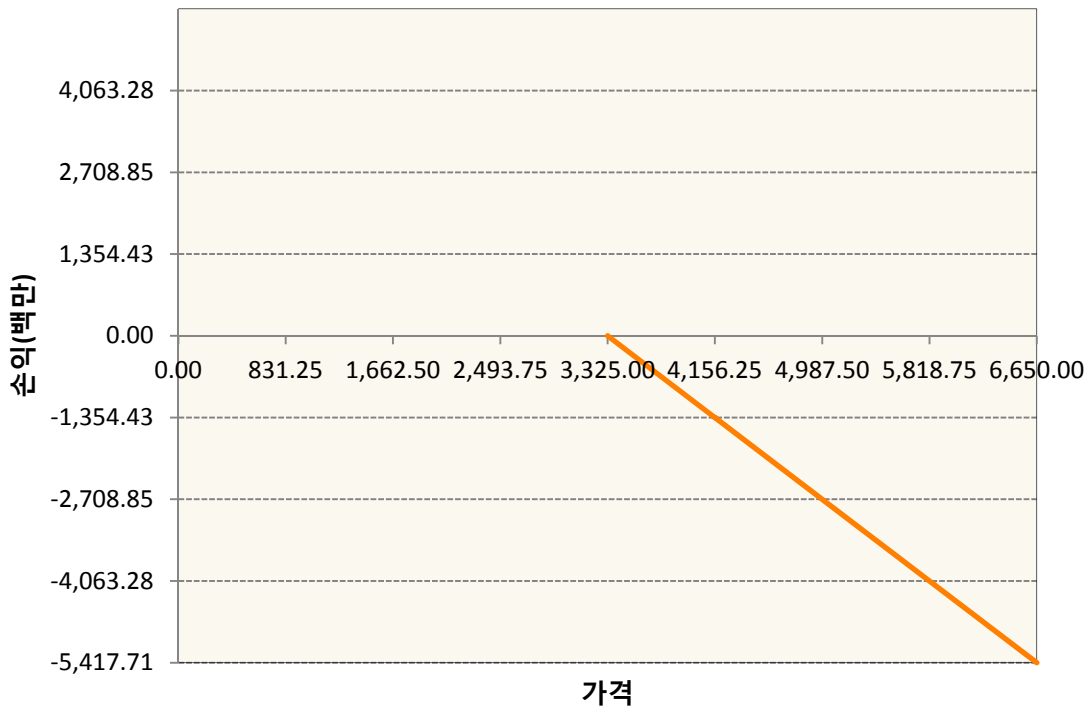
### 1. 계약금액

(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	3,733	0	3,733	
누계	유가증권	옵션	0	13,001	-13,001	장내
누계	지수	스왑	28,469	0	28,469	장외
누계	통화	선도	9,157	17,506	-8,349	장외

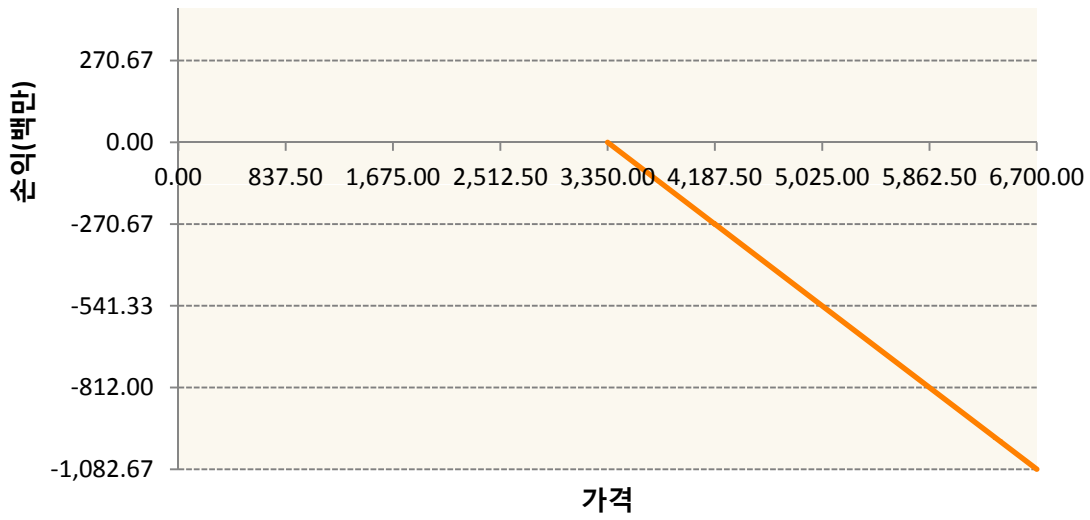
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXU9-C3325-EURO STOXX 50

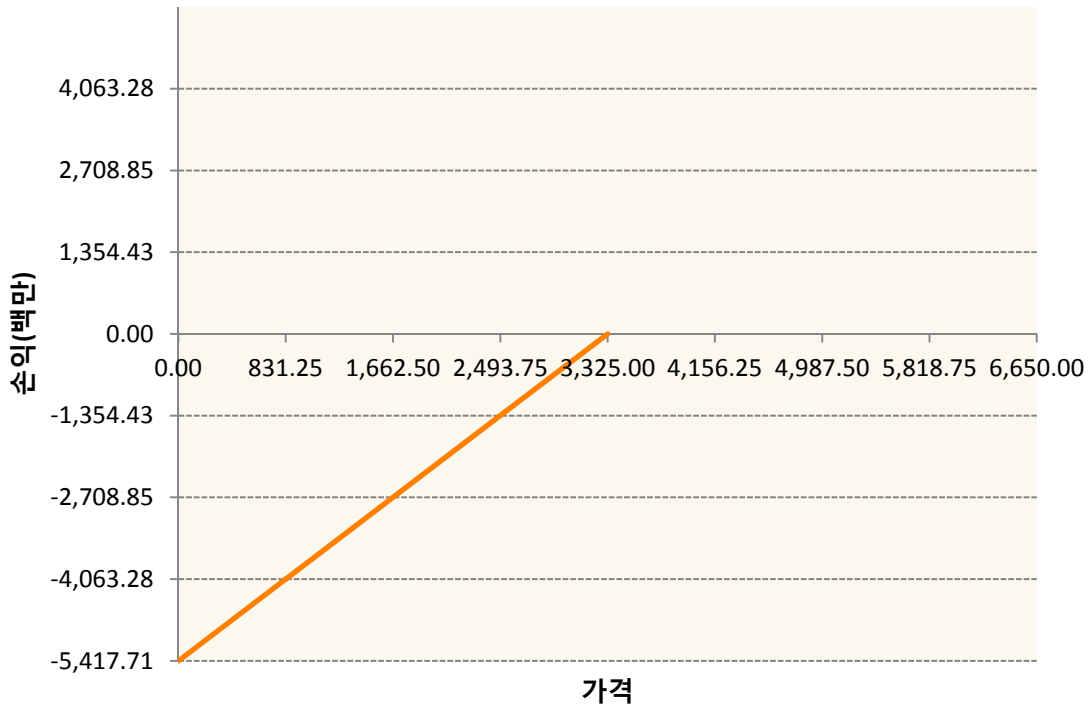


OESXU9-C3350-EURO STOXX 50

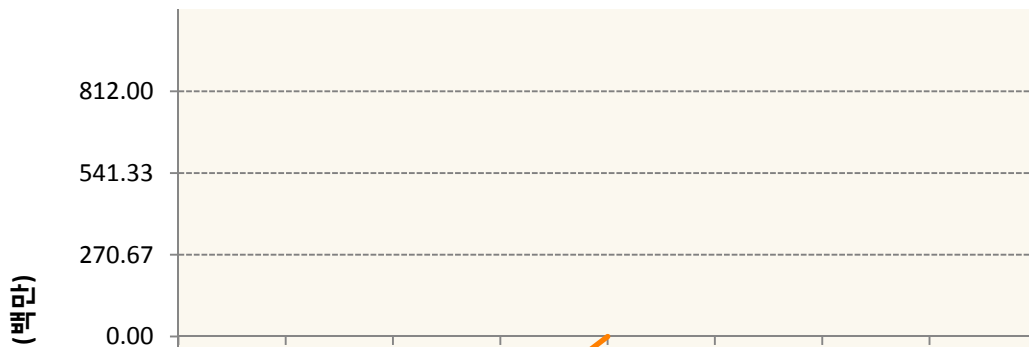


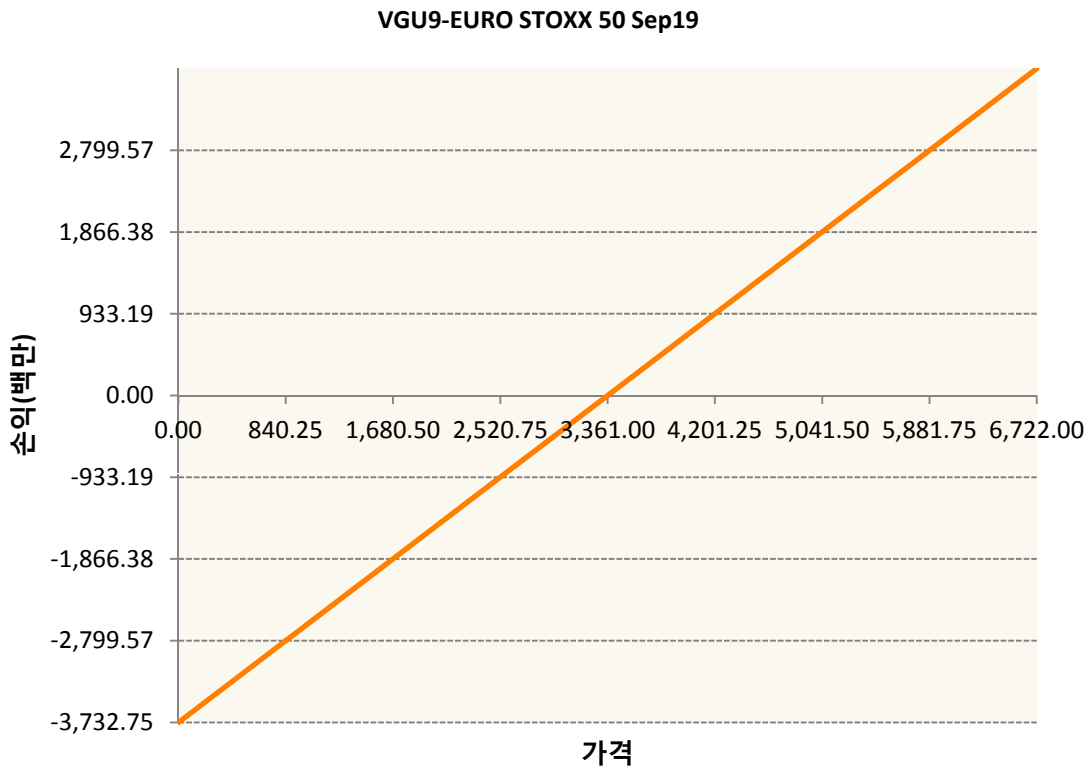
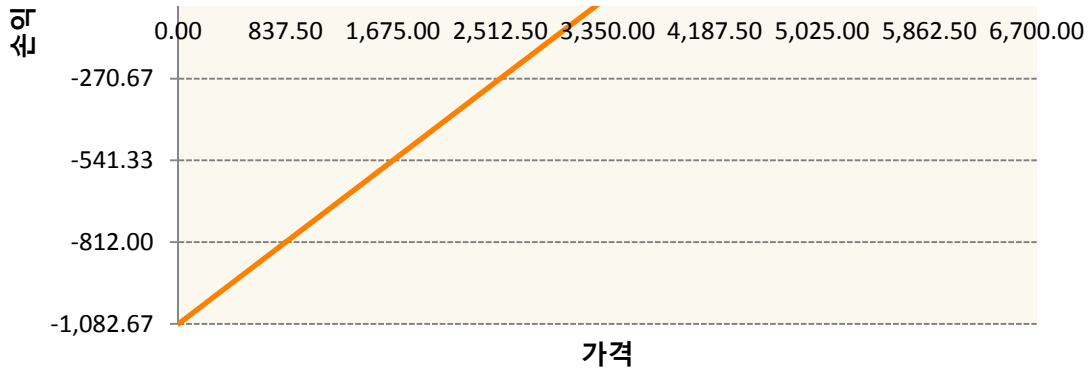


OESXU9-P3325-EURO STOXX 50



OESXU9-P3350-EURO STOXX 50





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	51
FX21019M0< KRW/EUR 27-09-19E	1,077
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	299

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

(단위:백만원)

2,002



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

(단위:백만원)

915



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

(단위:백만원)

78



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

(단위:백만원)

122

공시일	2019-08-29
기준일	2019-08-28

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

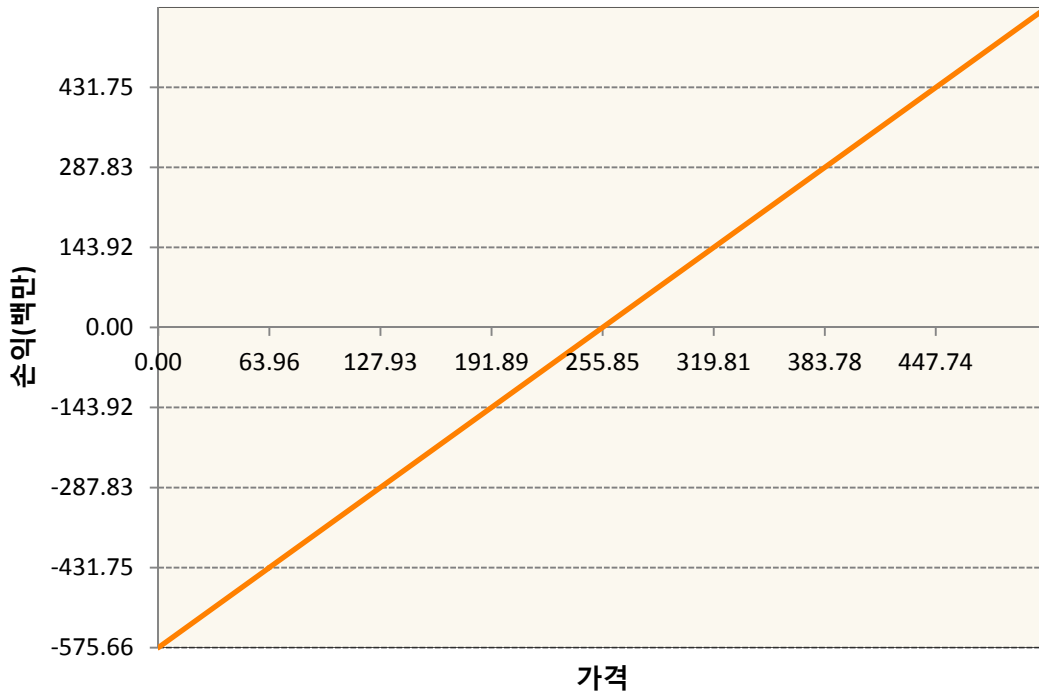
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	576	0	576	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	2019-08-29
기준일	2019-08-28

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

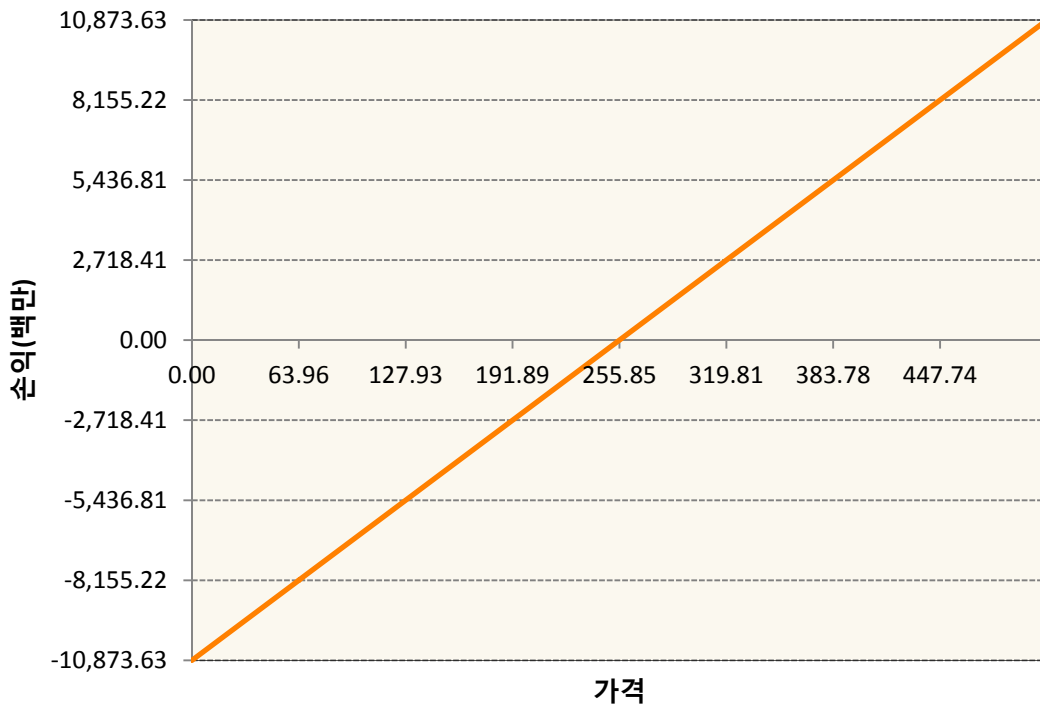
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

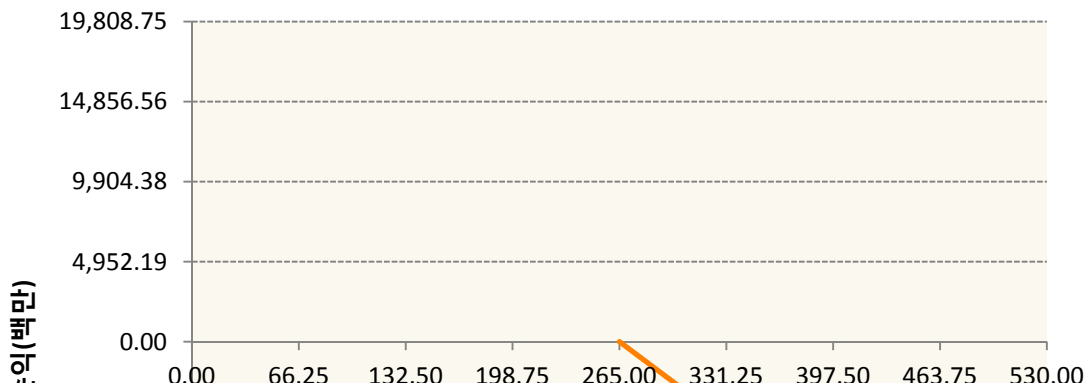
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,874	0	10,874	장내
누계	유가증권	옵션	3,659	19,943	-16,283	장내

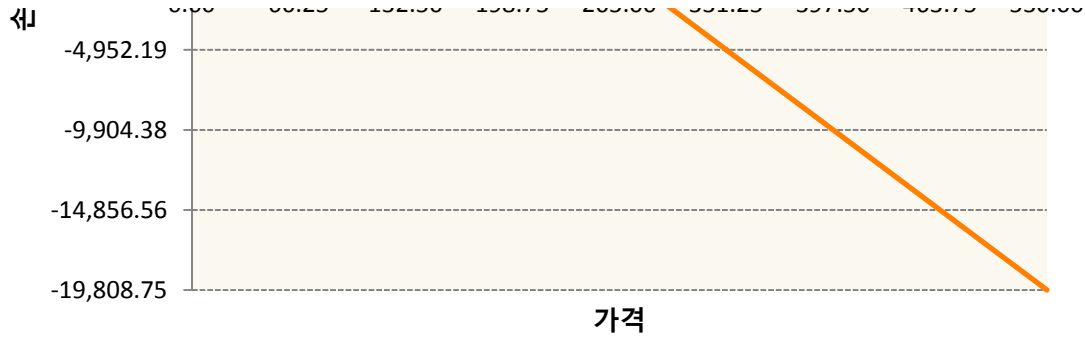
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

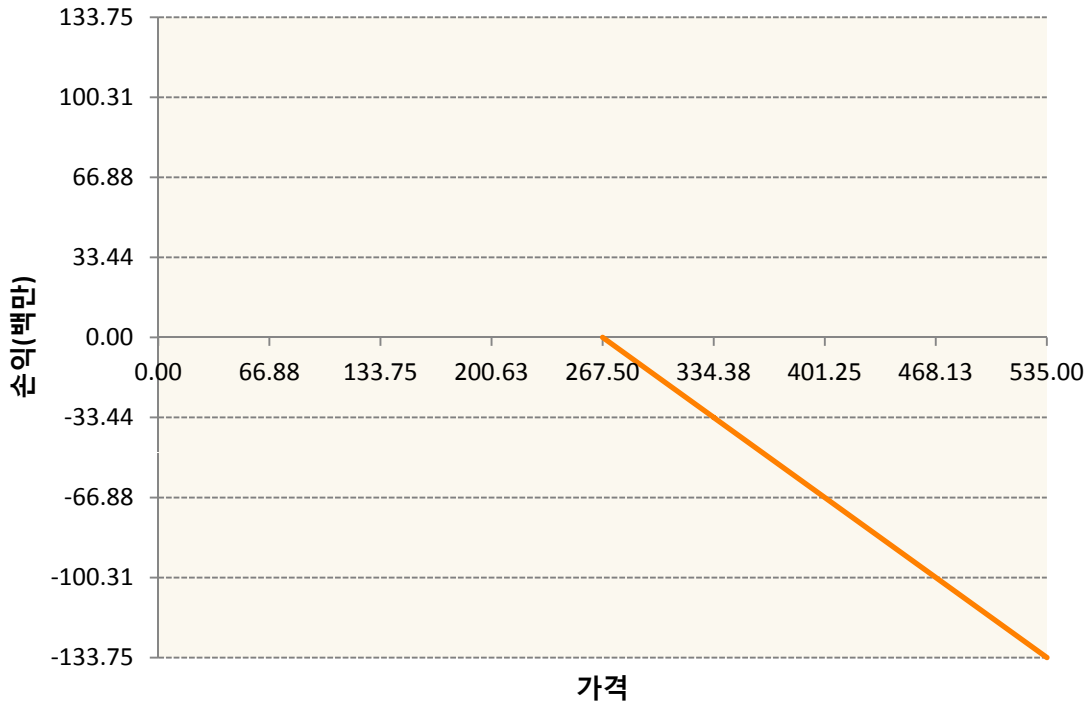


KR4201P92658-2019-09 콜265

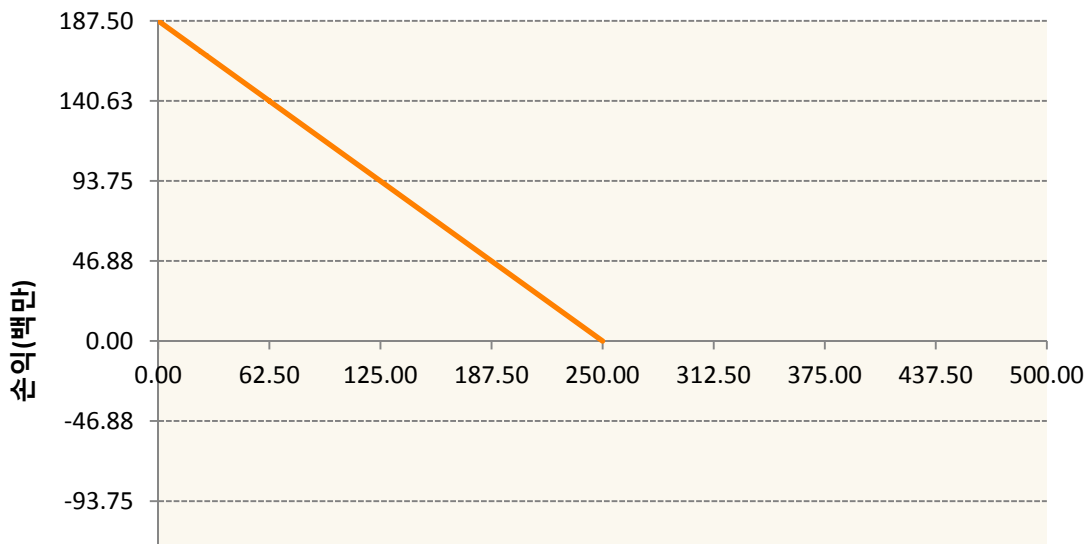


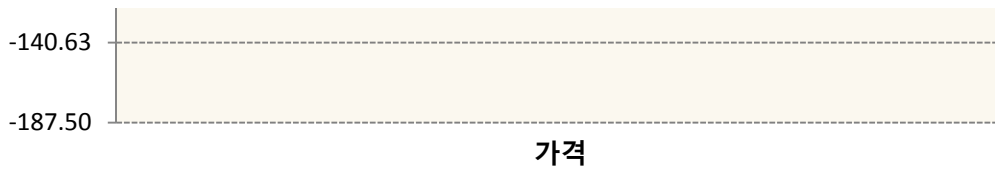


KR4201P92674-2019-09 콜267.5

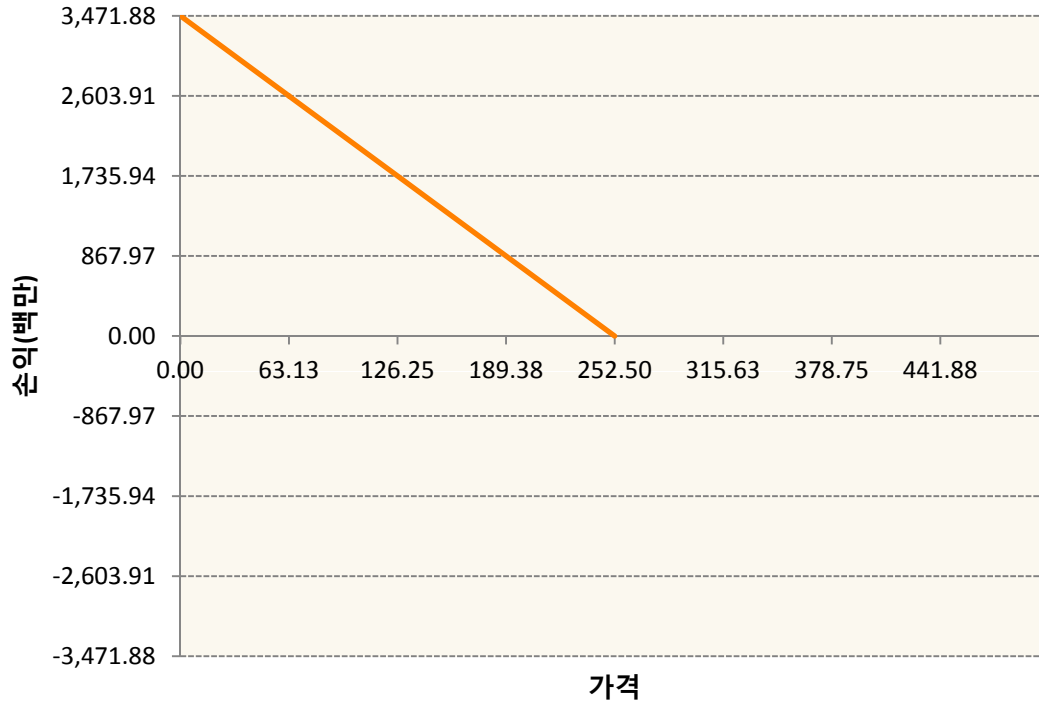


KR4301P92508-2019-09 풋250





KR4301P92524-2019-09 풋252.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						869
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-869	-869	-869	-869	-869	-869	-869	
-5.33%	-579	-579	-579	-579	-579	-579	-579	
-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%	579	579	579	579	579	579	579	
8.00%	869	869	869	869	869	869	869	
KR4201P92658		2019-09 콜265						875
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	123	123	122	121	119	116	112	
-5.33%	122	120	117	112	106	99	89	
-2.67%	111	104	93	81	67	51	34	

0%	65	45	23	0	-24	-49	-75
2.67%	-72	-103	-134	-165	-196	-228	-259
5.33%	-342	-372	-403	-434	-464	-496	-527
8.00%	-737	-756	-777	-800	-824	-849	-875
KR4201P92674                      2019-09 콜267.5							5
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	0	0
-2.67%	1	1	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	-1	-1	-1	-1	-1
5.33%	-2	-2	-2	-2	-3	-3	-3
8.00%	-4	-4	-4	-5	-5	-5	-5
KR4301P92508                      2019-09 풋250							11
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10	10	10	10	10	11	11
-5.33%	5	6	6	6	6	6	6
-2.67%	1	2	2	2	2	2	3
0%	0	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							216
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	214	214	214	214	215	215	216
-5.33%	121	122	123	124	126	128	130
-2.67%	39	42	45	49	52	55	59
0%	-10	-7	-3	0	3	7	11
2.67%	-25	-24	-22	-21	-19	-17	-14
5.33%	-27	-27	-27	-26	-26	-25	-24
8.00%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27

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

(단위:백만원)

1,603

공시일	2019-08-29
기준일	2019-08-28

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,214	0	1,214	
누계	유가증권	수익증권	70,605	0	70,605	

### 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	2019-08-29
기준일	2019-08-28

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,214	0	1,214	
누계	유가증권	수익증권	88,836	0	88,836	

### 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	2019-08-29
기준일	2019-08-28

## 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	472,492	0	472,492	
누계	통화	선도	0	520,884	-520,884	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		1,748
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,136
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		719
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		719
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		291
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		680
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		2,719
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		1,360
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		777
FX21019N04 KRW/USD 03-09-19E		291
FX21019Q00 KRW/USD 03-09-19E		291
FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E		486
FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E		194
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		291
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		3,205
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		2,175
FX21019Q01 KRW/USD 16-09-19E		97
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,982
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,593
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,661
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		3,020
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		971
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		971

FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E	971
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E	1,748
FX21019Q04 KRW/USD 30-09-19E	194
FX21019Q04 KRW/USD 24-09-19E	2,136
FX21019Q04 KRW/USD 24-09-19E	2,719

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

(단위:백만원)

**13,602**

공시일	2019-08-29
기준일	2019-08-28

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

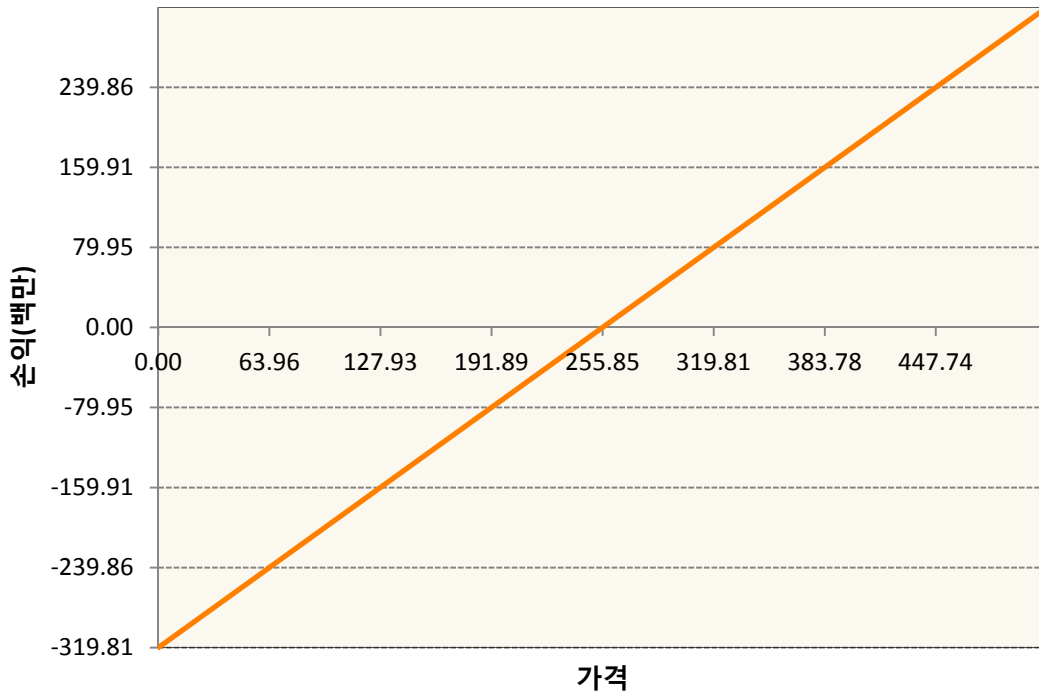
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

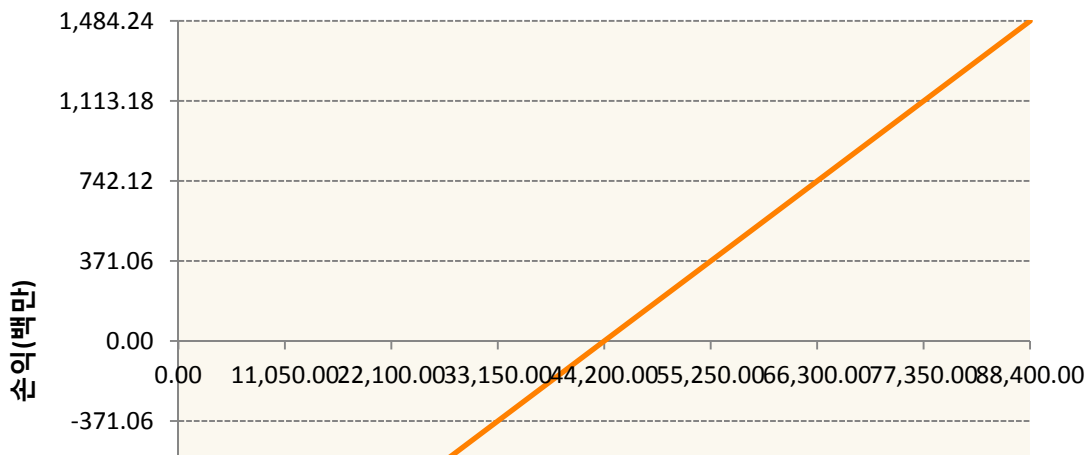
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,804	0	1,804	장내

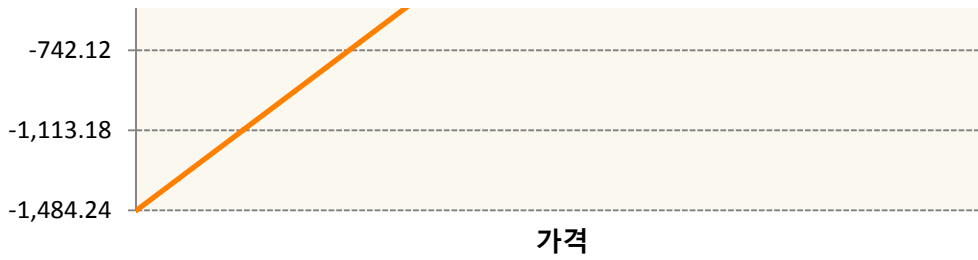
### 2. 만기시점의 손익구조

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						119
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119	
-5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79	
-2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	40	40	40	40	40	40	40	
5.33%	79	79	79	79	79	79	79	
8.00%	119	119	119	119	119	119	119	

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

**167**

공시일	2019-08-29
기준일	2019-08-28

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

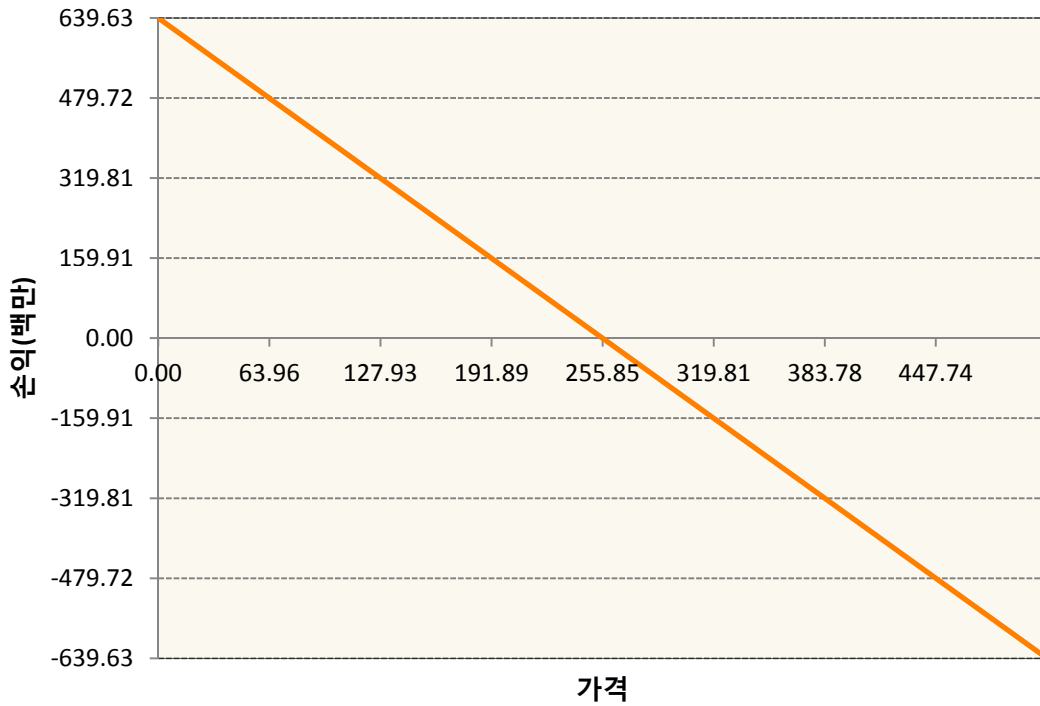
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

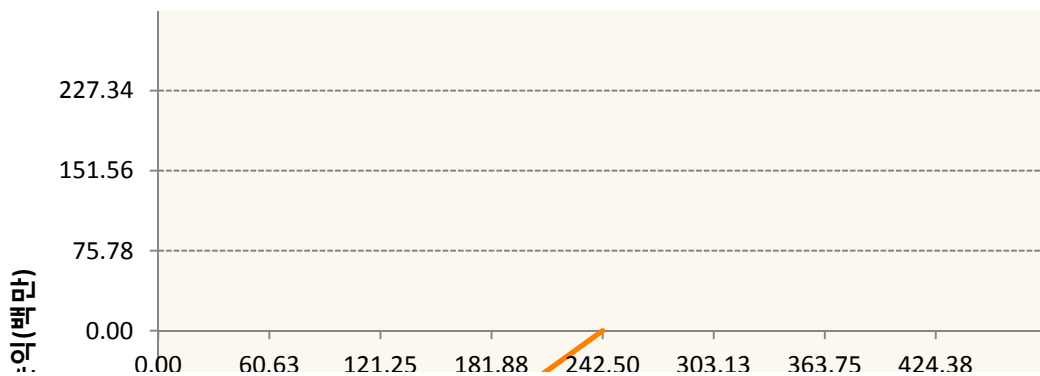
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	640	-640	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,672	-3,672	장내

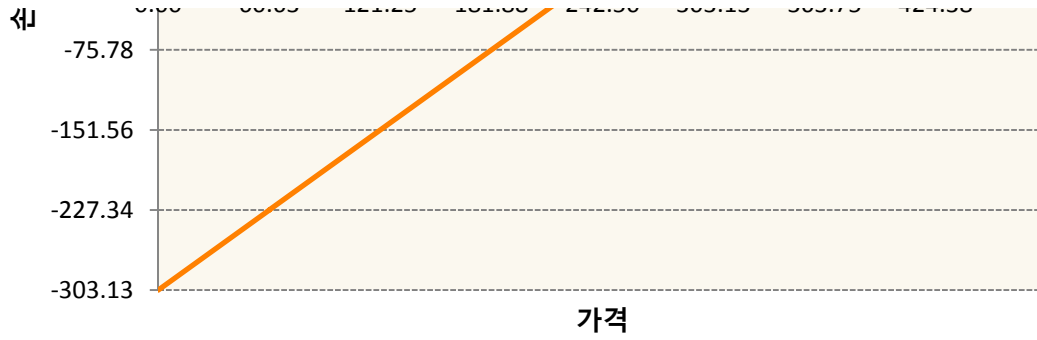
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

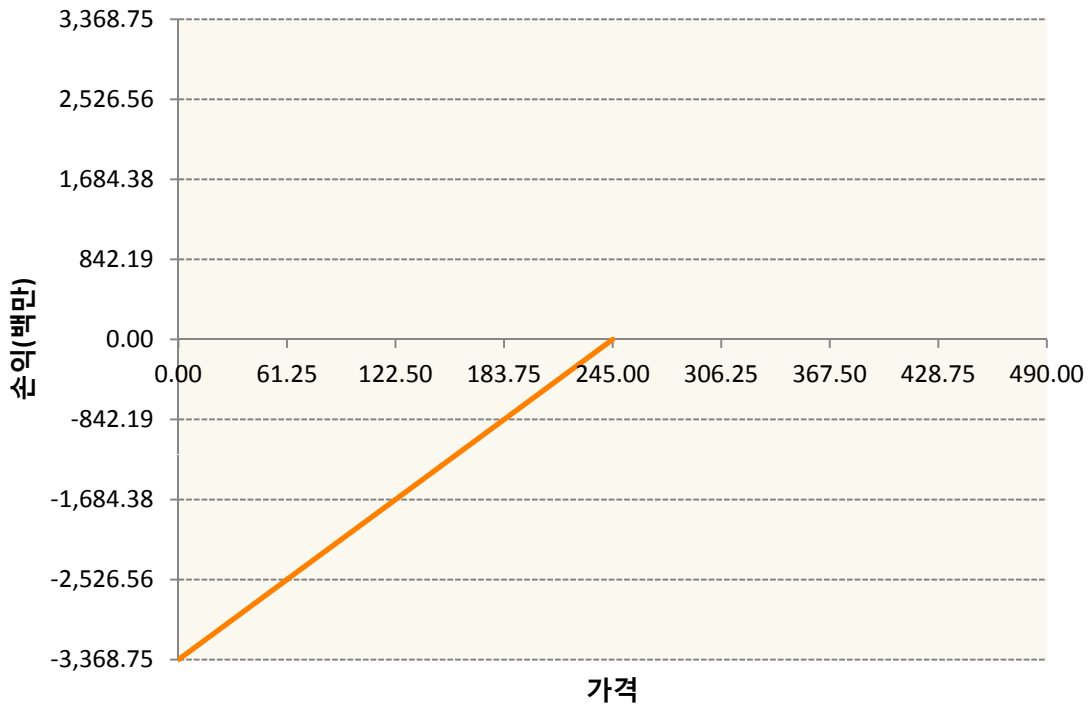


KR4301P92425-2019-09 풋242.5





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%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-11
-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

143

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-134	-135	-136	-138	-139	-141	-143
-5.33%	-54	-57	-60	-63	-67	-70	-73
-2.67%	-9	-12	-15	-18	-21	-25	-28
0%	4	3	1	0	-2	-4	-6
2.67%	5	5	5	4	4	3	2
5.33%	5	5	5	5	5	5	4
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

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

(단위:백만원)

146

공시일	2019-08-29
기준일	2019-08-28

## 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	19,826	0	19,826	
누계	통화	선도	0	19,301	-19,301	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		486
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		524
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		39
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		330

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

(단위:백만원)

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

공시일	2019-08-29
기준일	2019-08-28

## 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	2019-08-29
기준일	2019-08-28

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

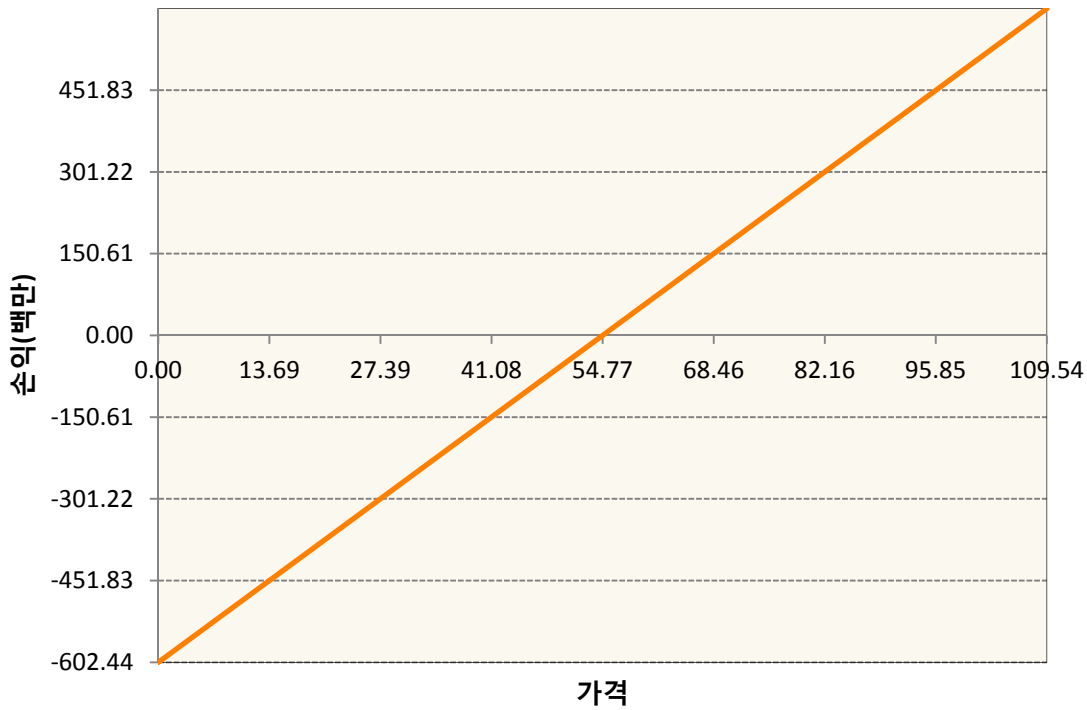
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

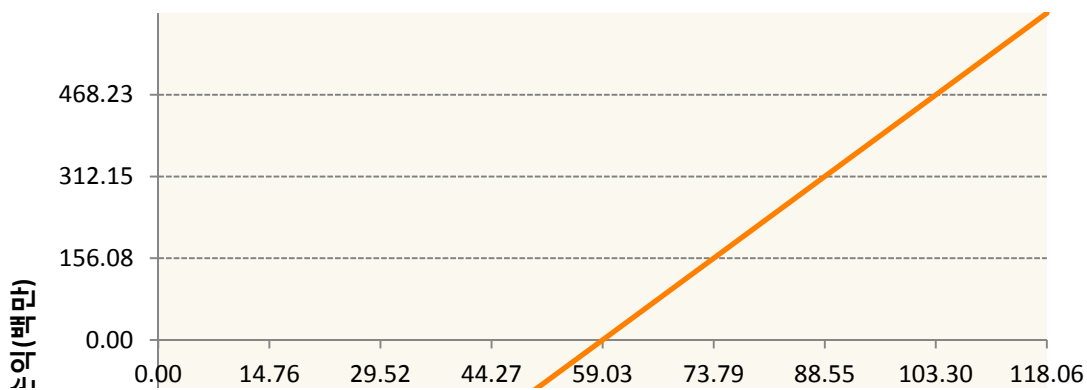
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,210	121	2,089	
누계	유가증권	선물	187	0	187	장내

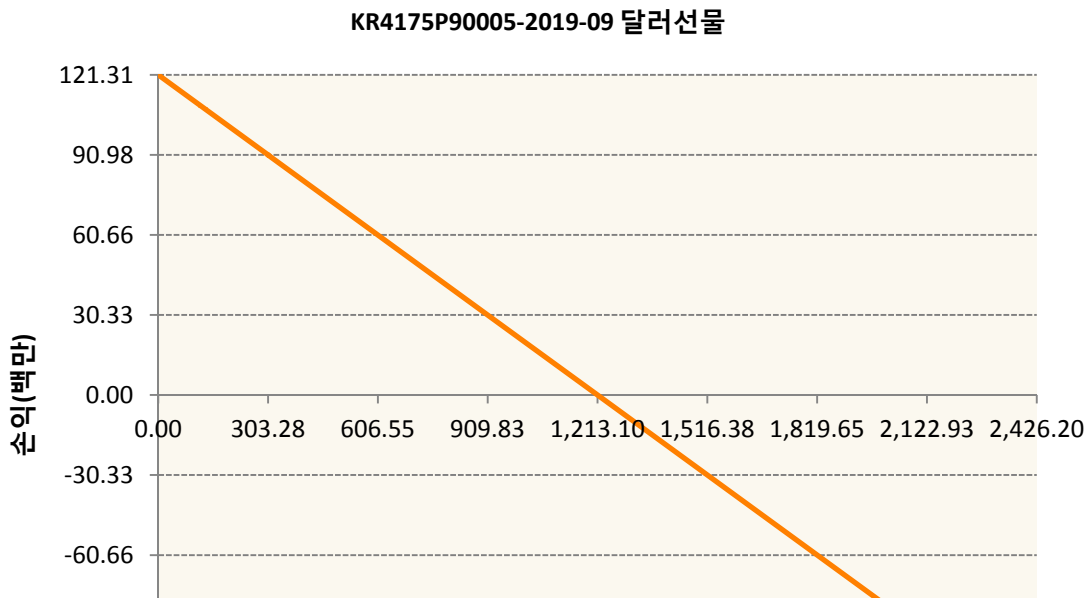
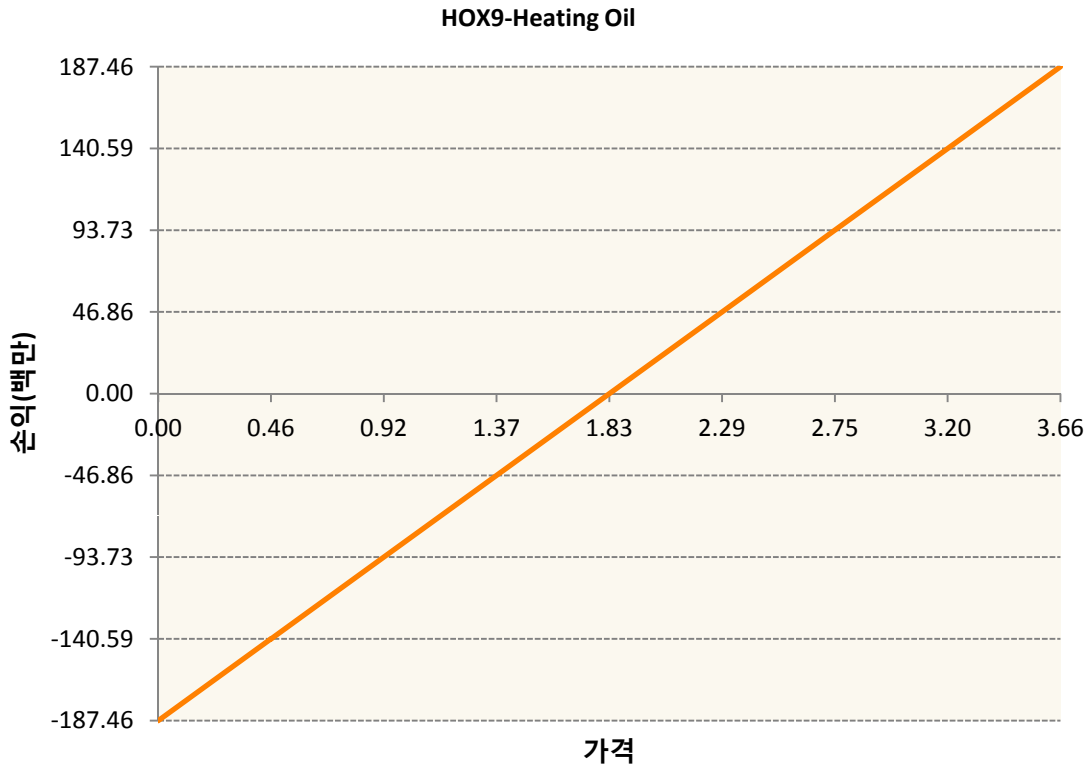
### 2. 만기시점의 손익구조

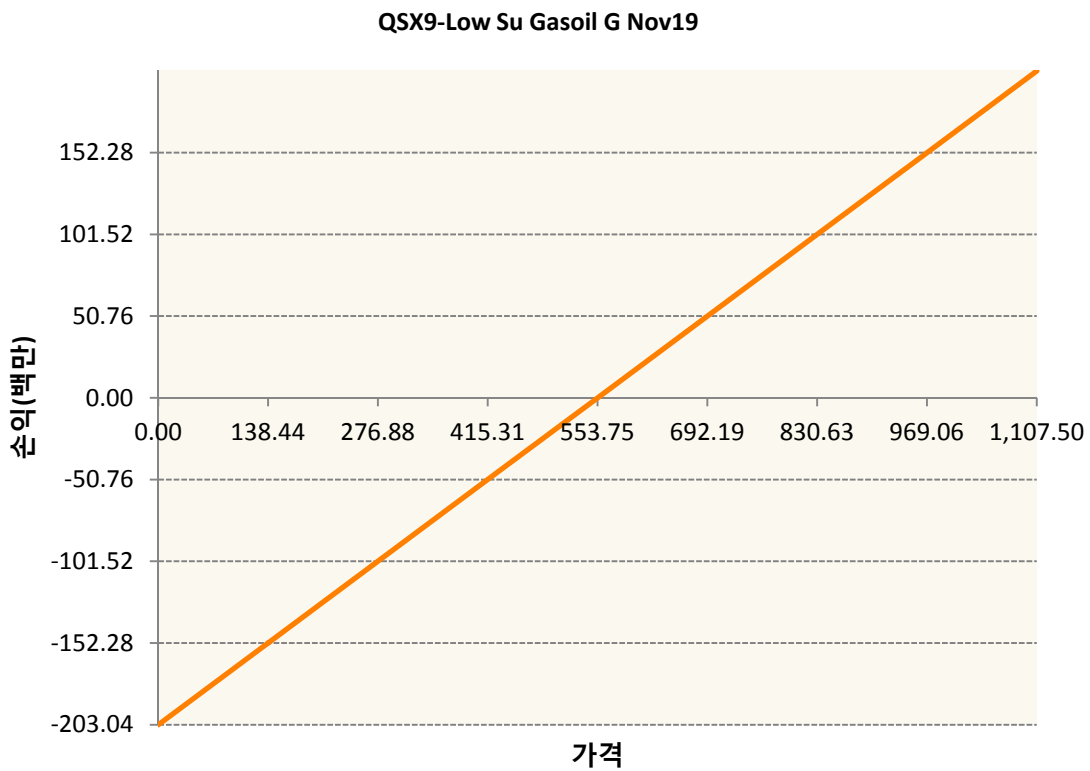
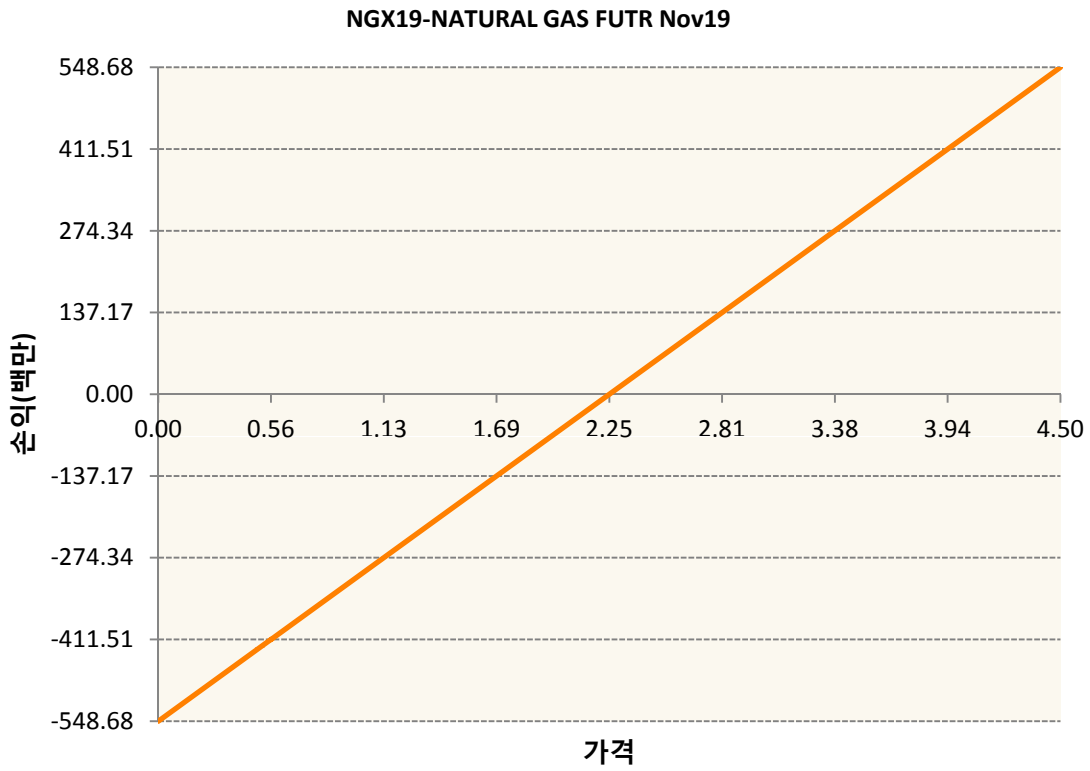
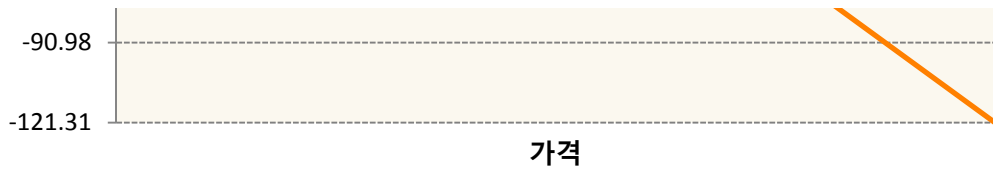
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19

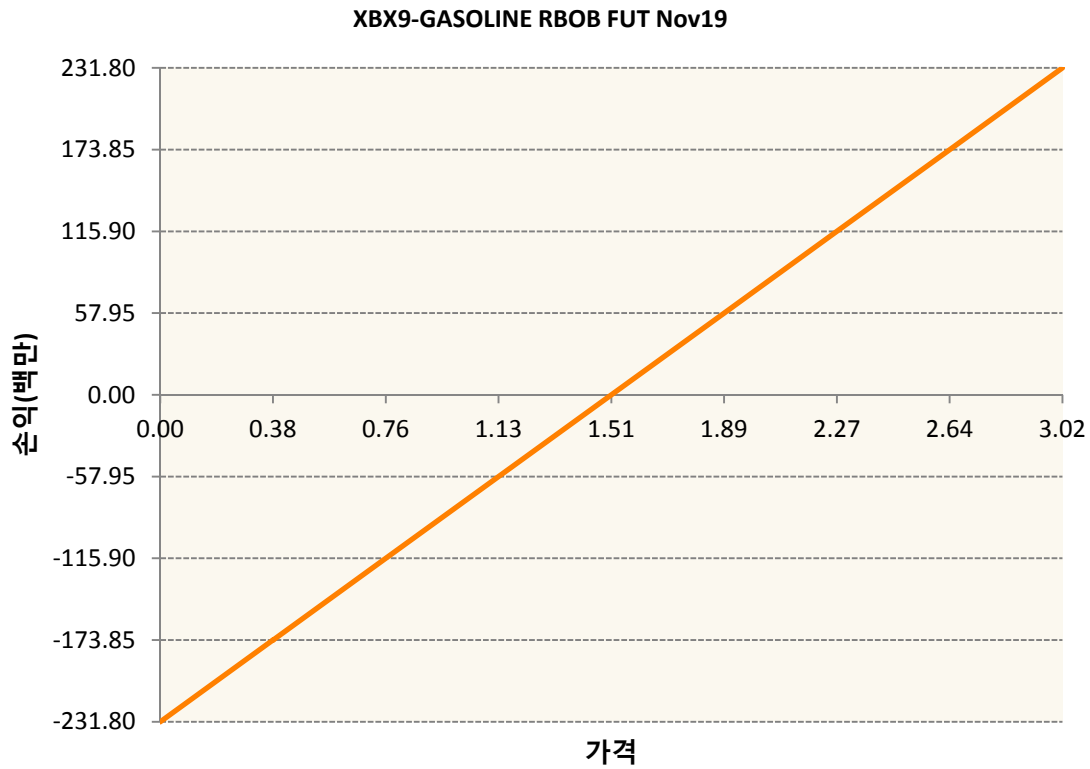


COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19









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	44
QSX9	Low Su Gasoil G Nov19	16
XBX9	GASOLINE RBOB FUT Nov19	19

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	368

공시일	2019-08-29
기준일	2019-08-28

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

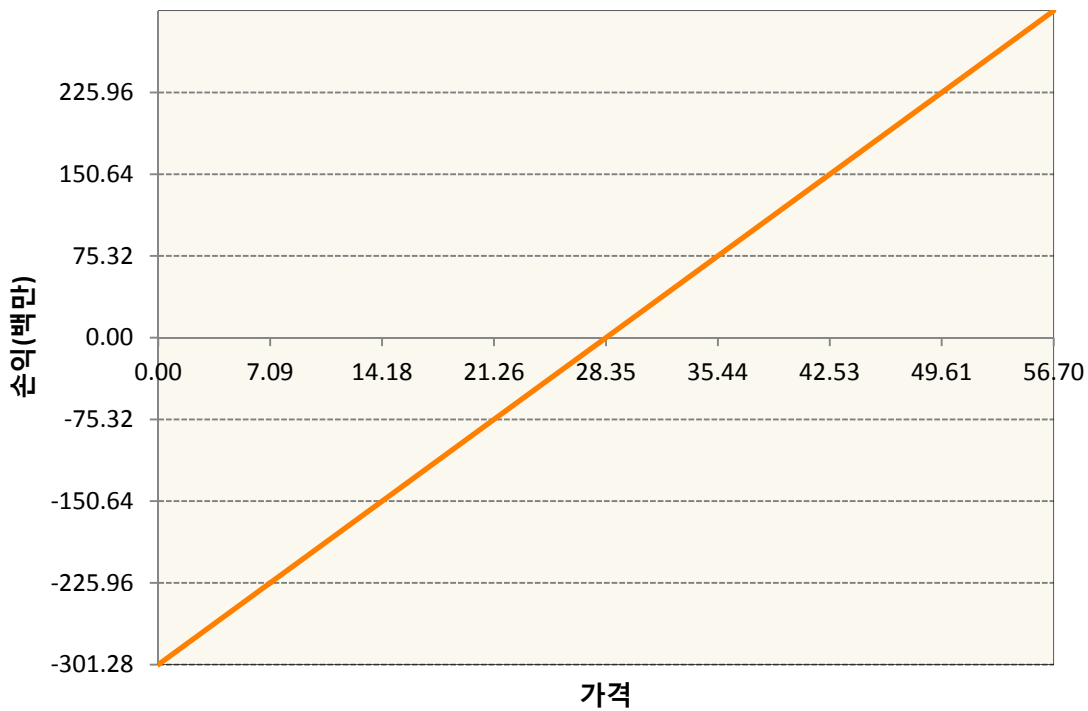
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

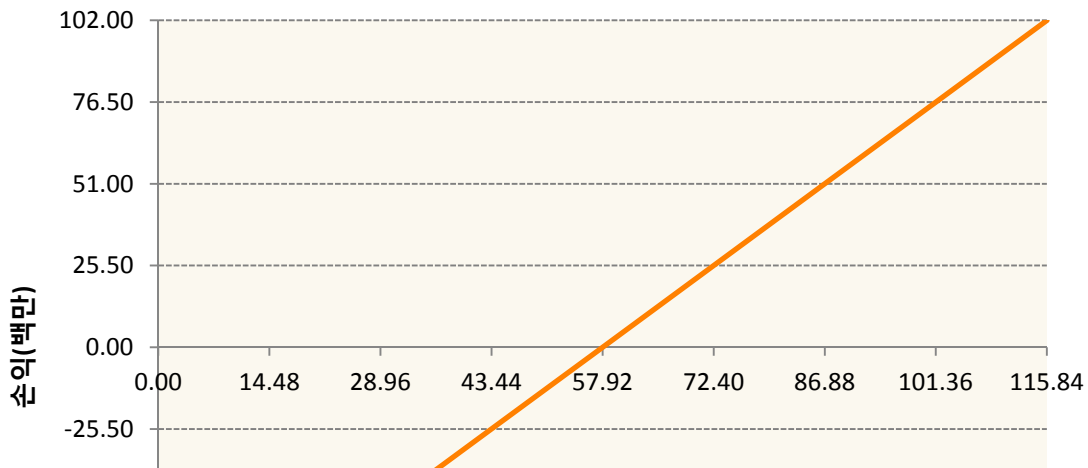
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,714	158	2,556	

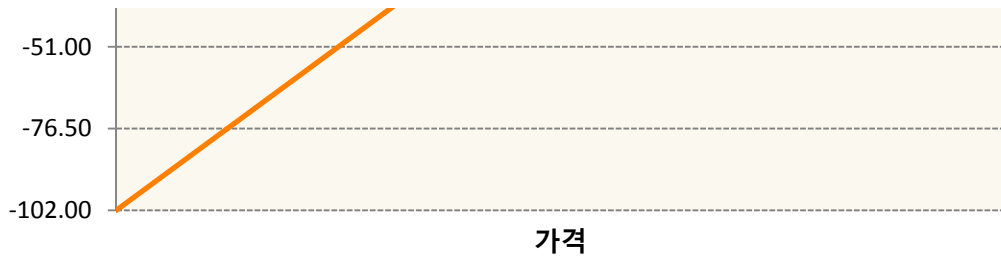
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19**

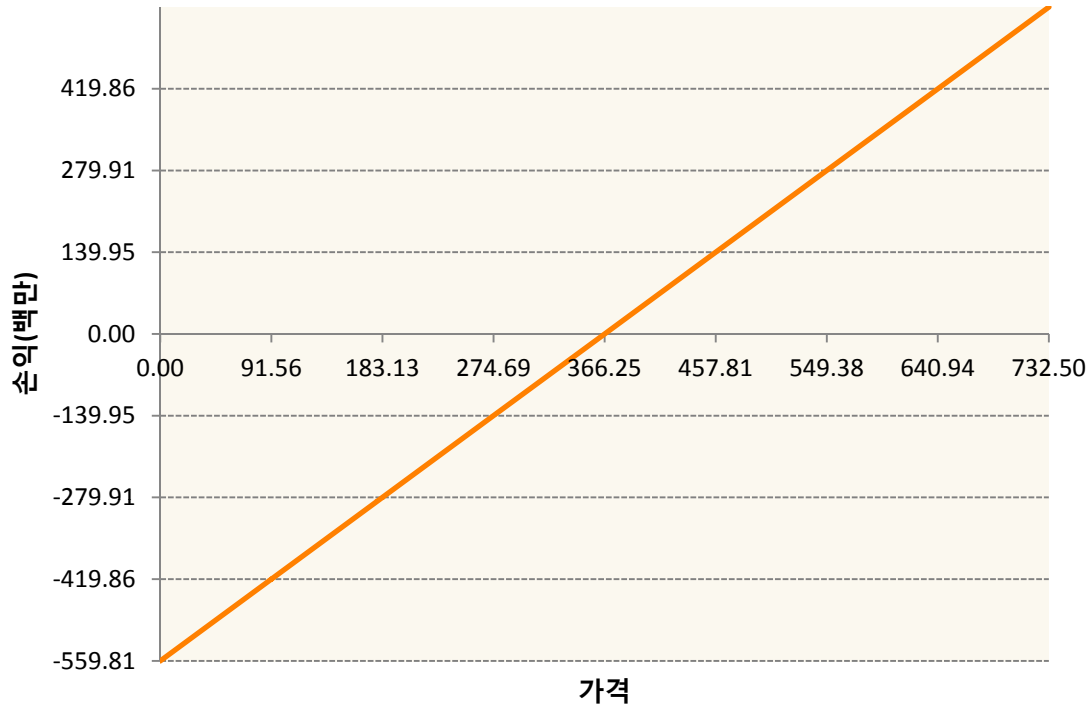


**CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19**

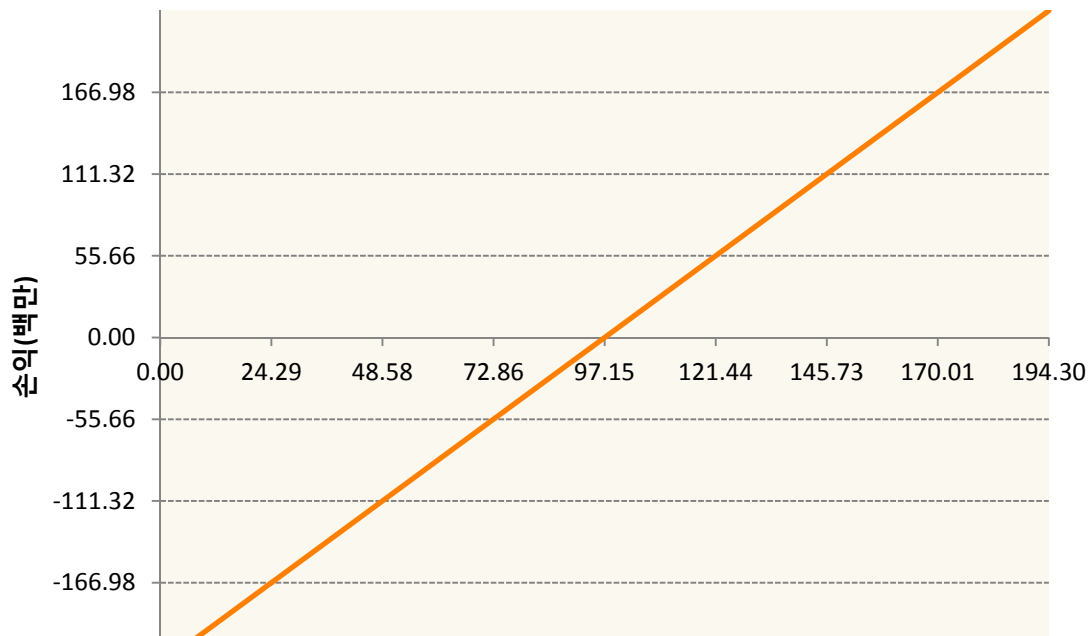


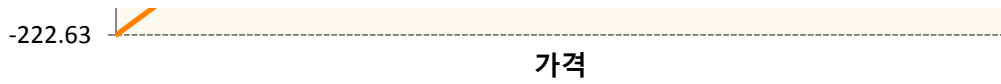


**CZ9-CORN FUTURE Dec19**

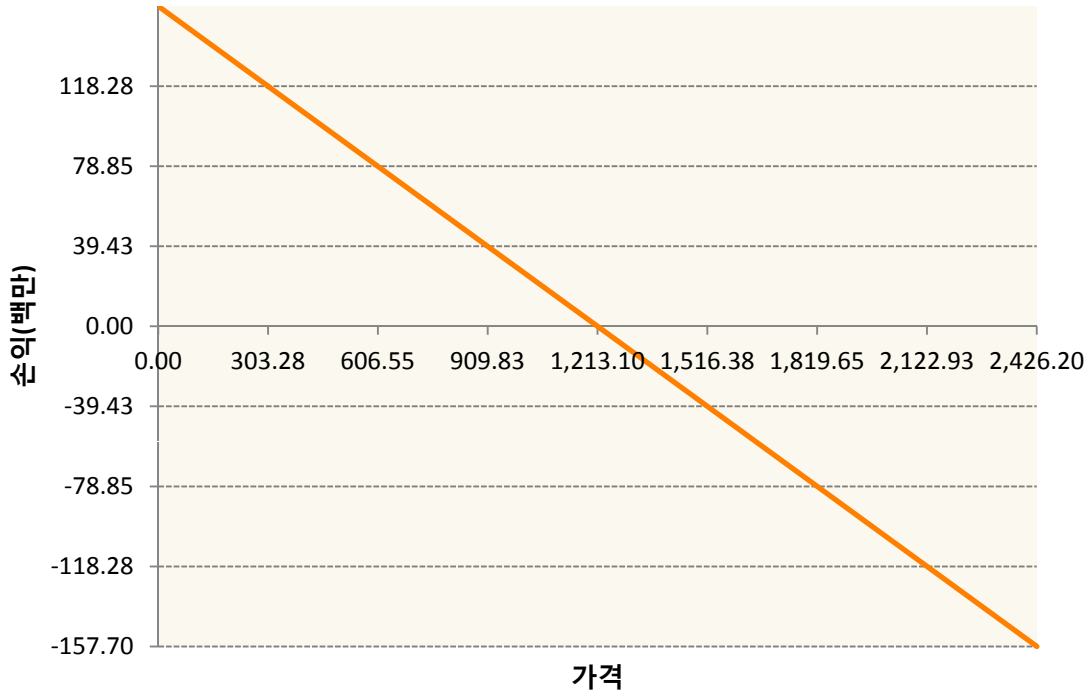


**KC9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19**

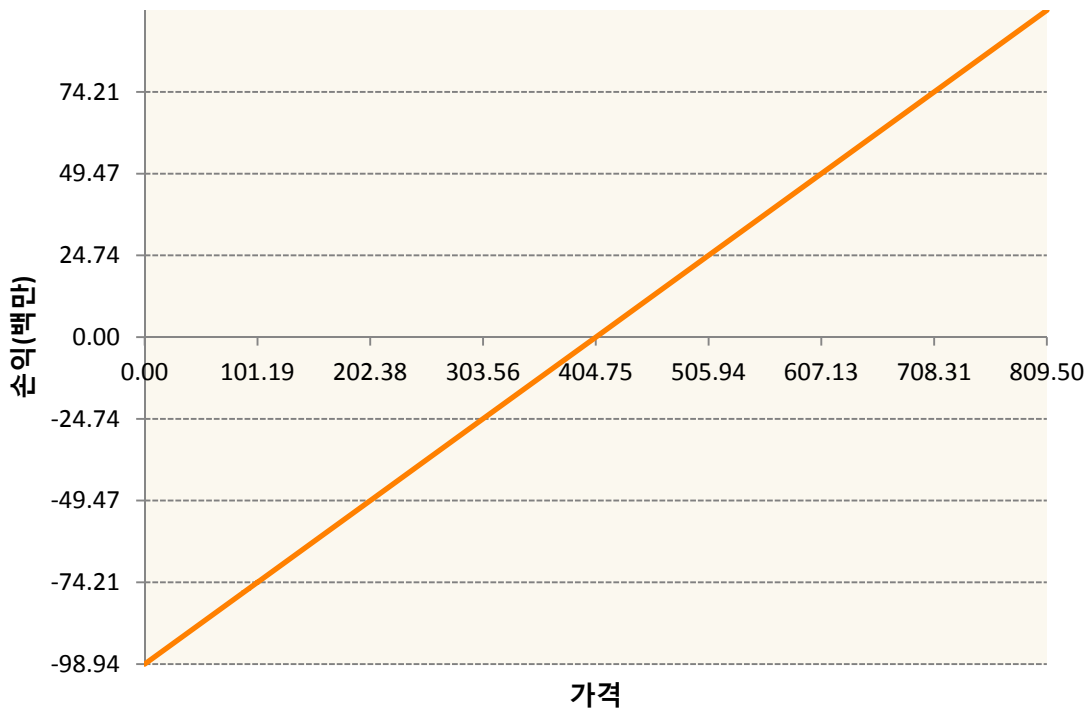




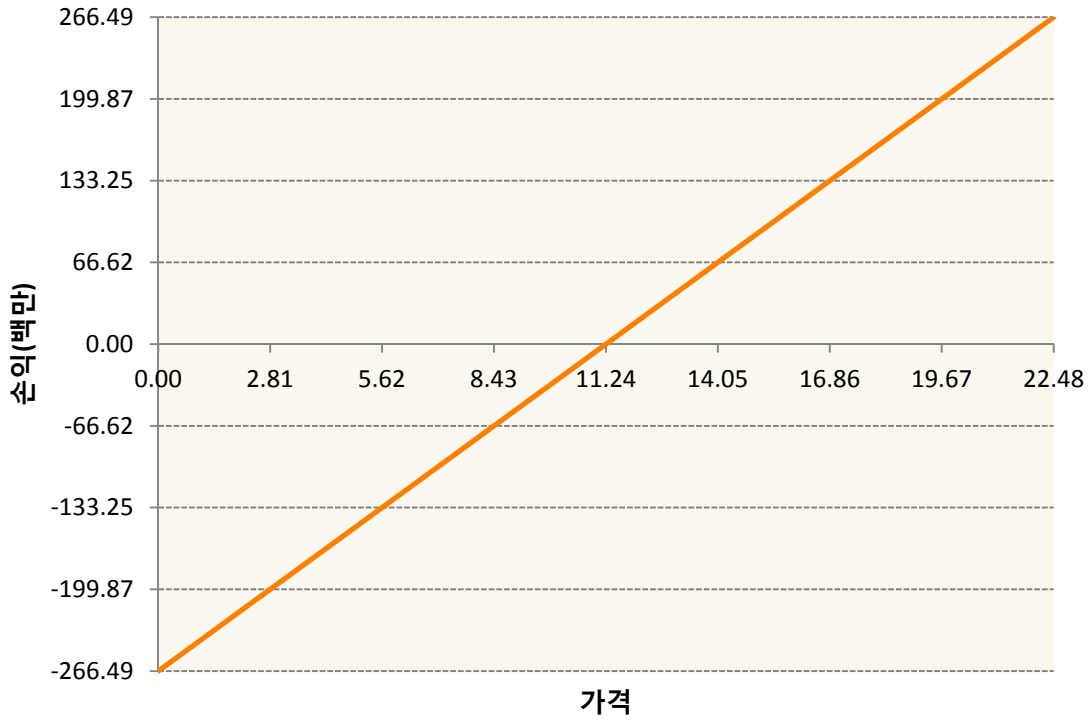
KR4175P90005-2019-09 달러선물



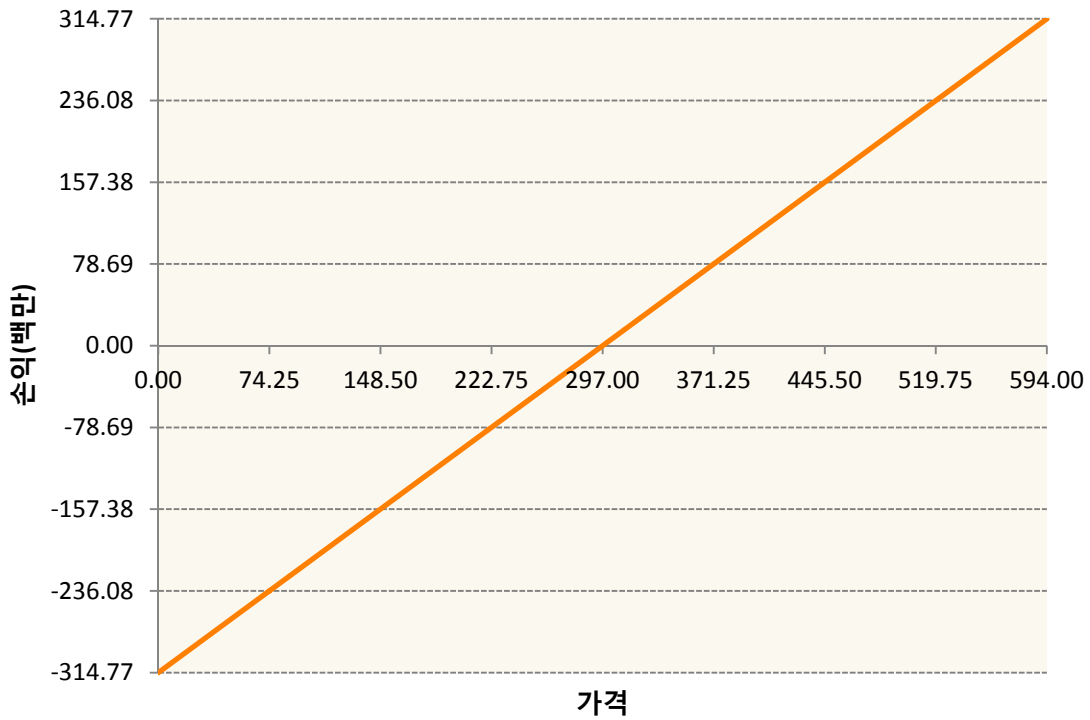
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



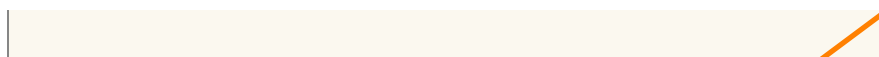
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

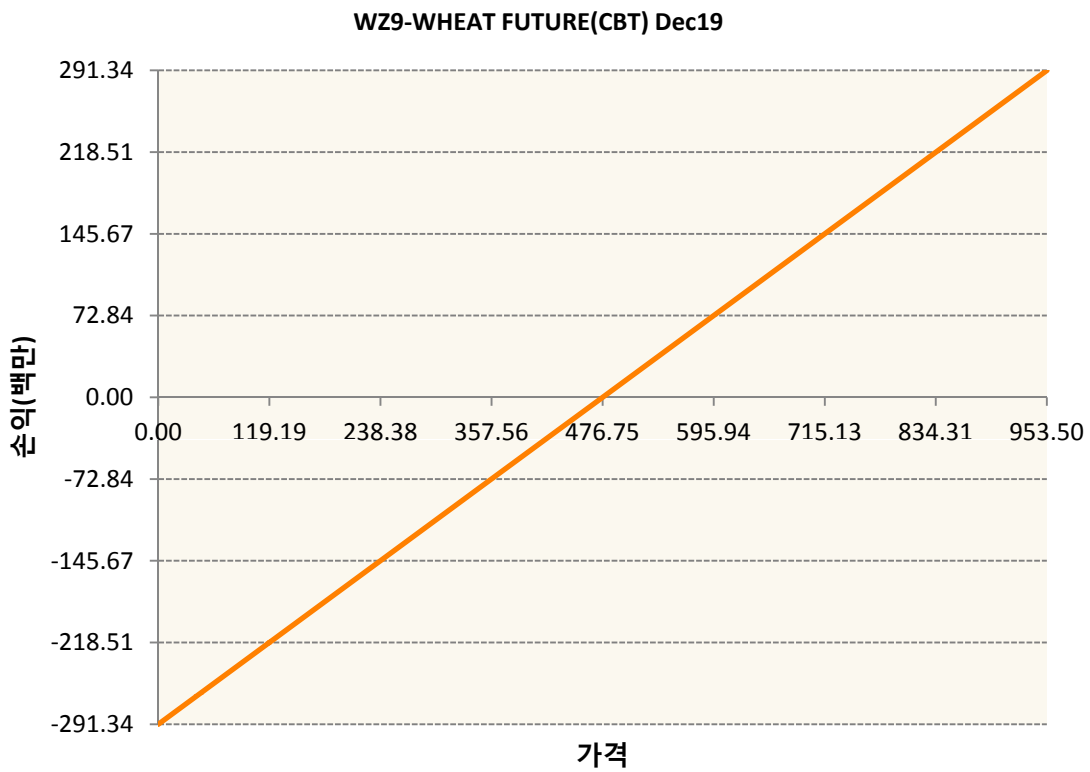
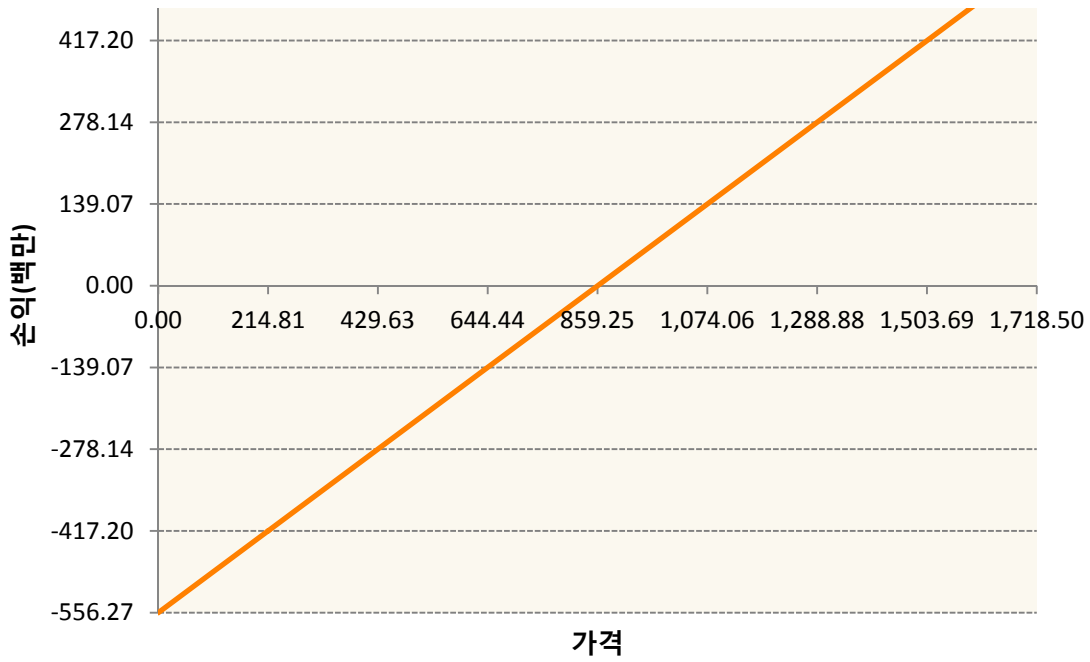


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



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	21
SMZ9	SOYBEAN MEAL FUTR Dec19	25
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	45
WZ9	WHEAT FUTURE(CBT) Dec19	23

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

(단위:백만원)

242