

공시일	2019-08-30
기준일	2019-08-29

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	2019-08-30
기준일	2019-08-29

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

1,134

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

648

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-30
기준일	2019-08-29

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)

813

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-08-30
기준일	2019-08-29

유로인덱스모(주식-파생형)

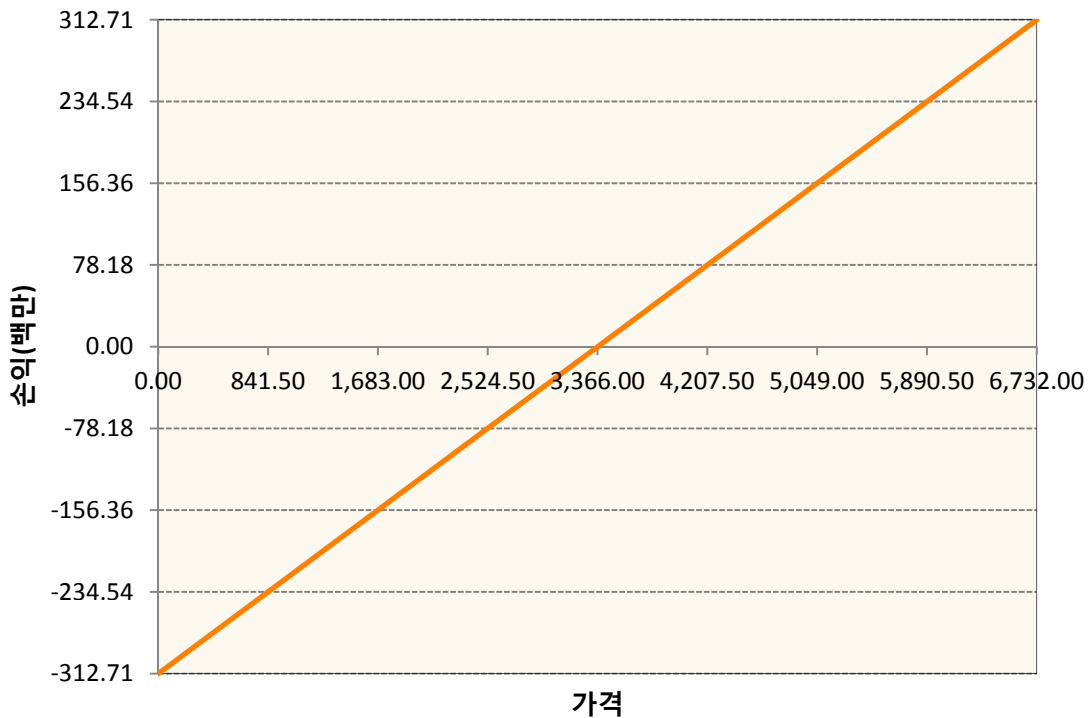
1. 계약금액

(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	2019-08-30
기준일	2019-08-29

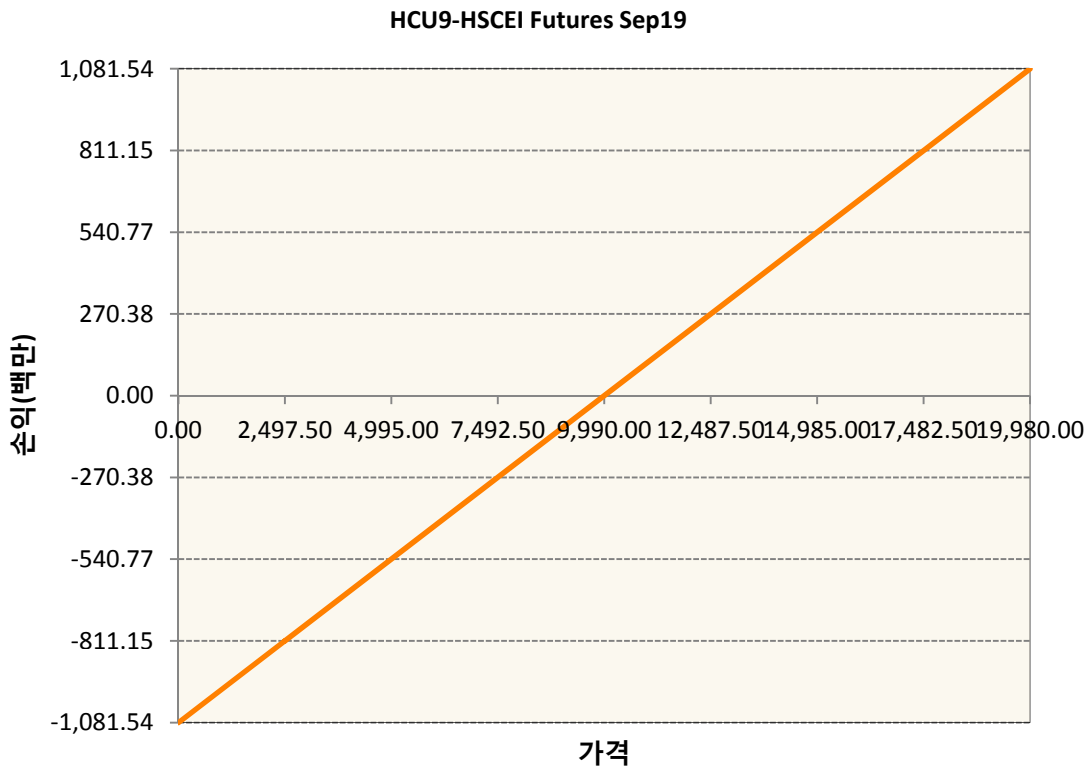
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,082	0	1,082	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU9	HSCEI Futures Sep19	87
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

80

공시일	2019-08-30
기준일	2019-08-29

커버드콜모(주식혼합-파생형)

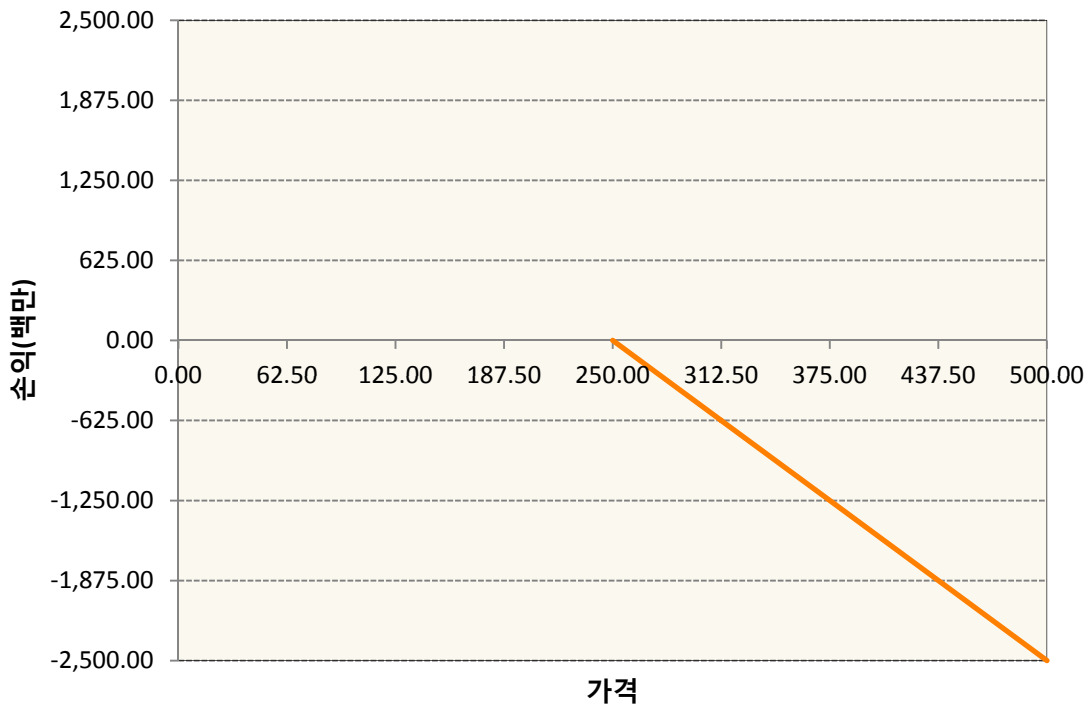
1. 계약금액

(단위:백만원)

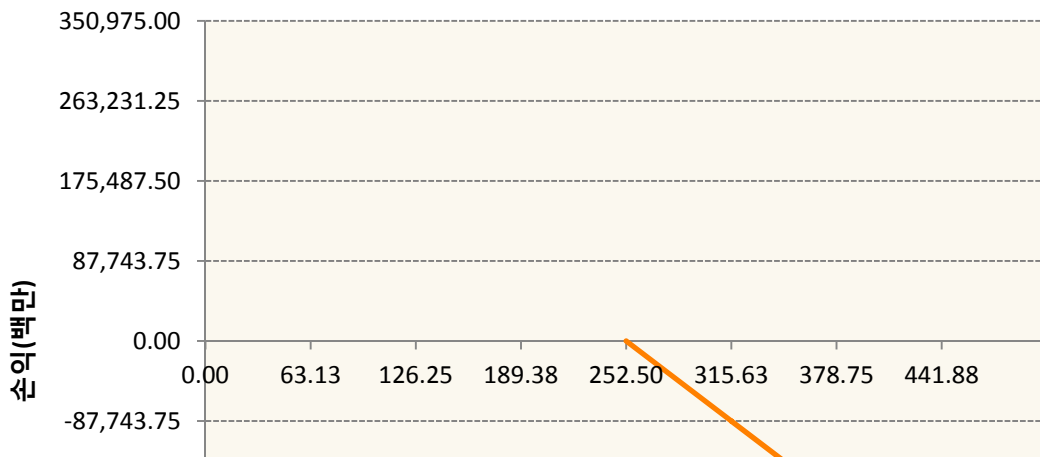
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	520,569	-520,569	장내

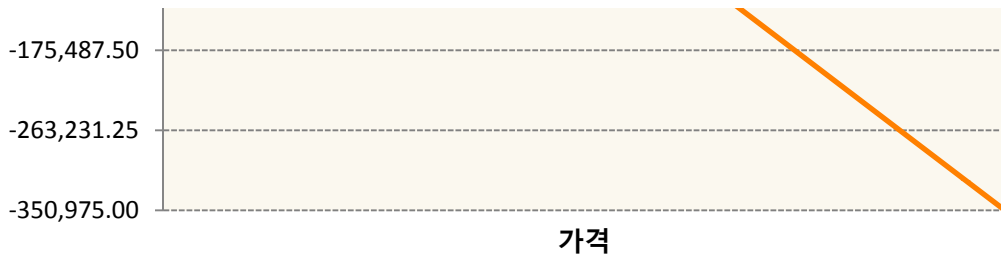
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P92500-2019-09 콜250

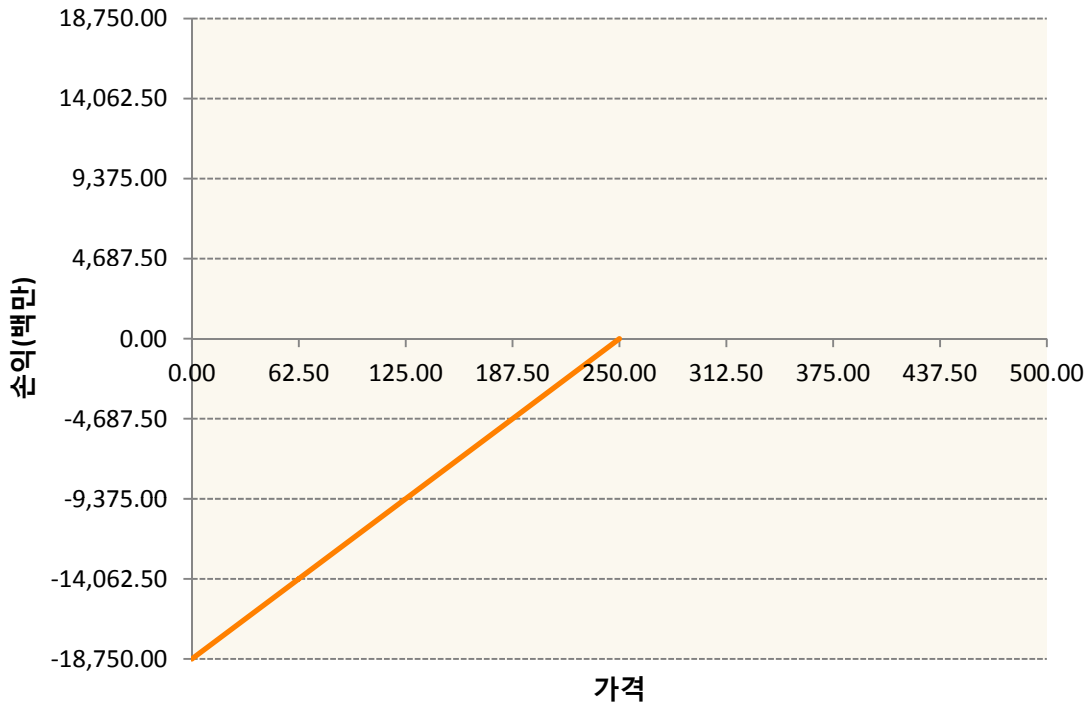


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

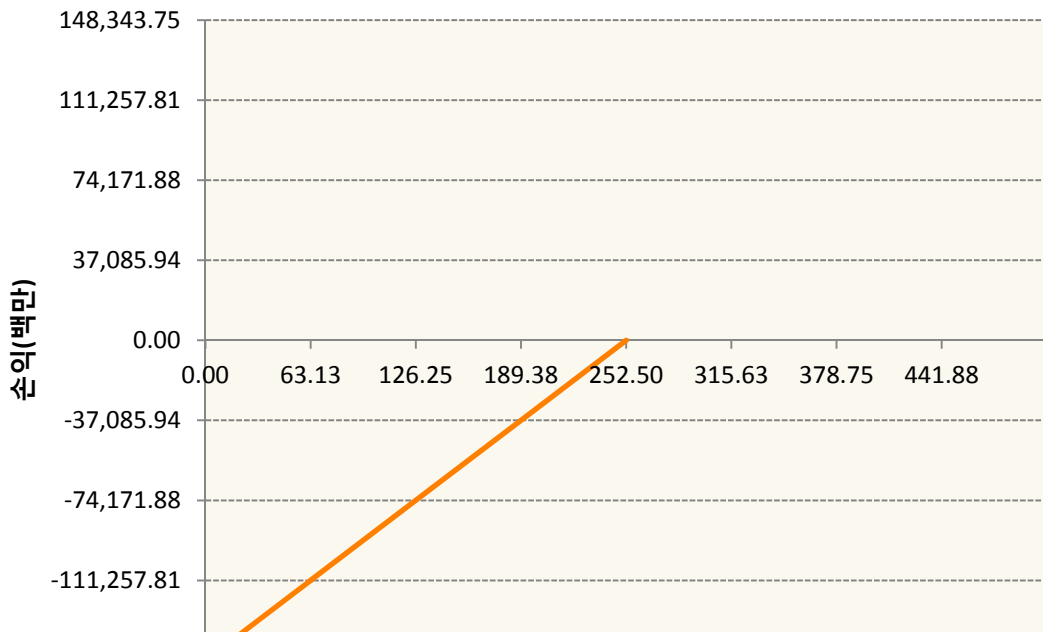




KR4301P92508-2019-09 풋250



KR4301P92524-2019-09 풋252.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P92500		2019-09 콜250						178
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	70	69	68	67	65	64	62	
-5.33%	65	63	60	57	55	52	49	
-2.67%	47	44	40	36	33	29	25	
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11	
2.67%	-44	-46	-48	-50	-53	-56	-59	
5.33%	-107	-108	-109	-110	-112	-114	-115	
8.00%	-174	-175	-175	-175	-176	-177	-178	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5						23,525
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	7,735	7,674	7,584	7,463	7,312	7,132	6,924	
-5.33%	7,329	7,102	6,836	6,538	6,213	5,863	5,494	
-2.67%	5,681	5,218	4,742	4,256	3,762	3,262	2,757	
0%	1,618	1,080	541	0	-542	-1,084	-1,627	
2.67%	-5,124	-5,496	-5,896	-6,318	-6,759	-7,214	-7,681	
5.33%	-13,624	-13,784	-13,985	-14,223	-14,495	-14,796	-15,123	
8.00%	-22,831	-22,875	-22,945	-23,045	-23,175	-23,335	-23,525	
KR4301P92508		2019-09 풋250						1,109
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,095	-1,096	-1,097	-1,099	-1,101	-1,105	-1,109	
-5.33%	-597	-603	-611	-620	-630	-641	-653	
-2.67%	-176	-195	-213	-232	-251	-270	-289	
0%	50	34	17	0	-18	-36	-54	
2.67%	109	105	98	91	82	72	61	
5.33%	116	115	114	113	110	107	102	
8.00%	116	116	116	116	115	115	114	
KR4301P92524		2019-09 풋252.5						9,569
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-9,510	-9,511	-9,515	-9,521	-9,532	-9,548	-9,569	
-5.33%	-5,557	-5,582	-5,617	-5,662	-5,716	-5,779	-5,850	
-2.67%	-1,935	-2,048	-2,167	-2,292	-2,422	-2,555	-2,690	
0%	461	308	155	0	-155	-311	-466	
2.67%	1,305	1,236	1,156	1,066	968	863	751	

5.33%	1,437	1,426	1,407	1,381	1,347	1,303	1,252
8.00%	1,445	1,445	1,443	1,439	1,431	1,420	1,404

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

(단위:백만원)

36,897

공시일	2019-08-30
기준일	2019-08-29

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

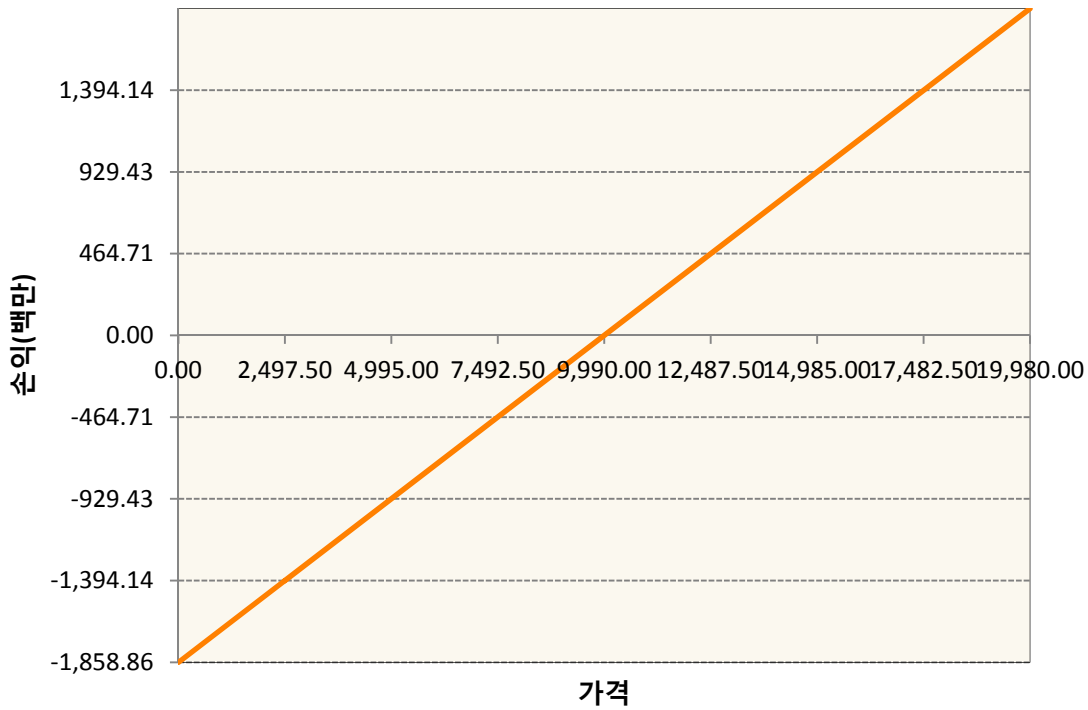
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,859	0	1,859	장내
누계	통화	선도	0	2,881	-2,881	장외

2. 만기시점의 손익구조

HCU9-HSCEI Futures Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	230
HCU9 HSCEI Futures Sep19	149

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

(단위:백만원)

212

공시일	2019-08-30
기준일	2019-08-29

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

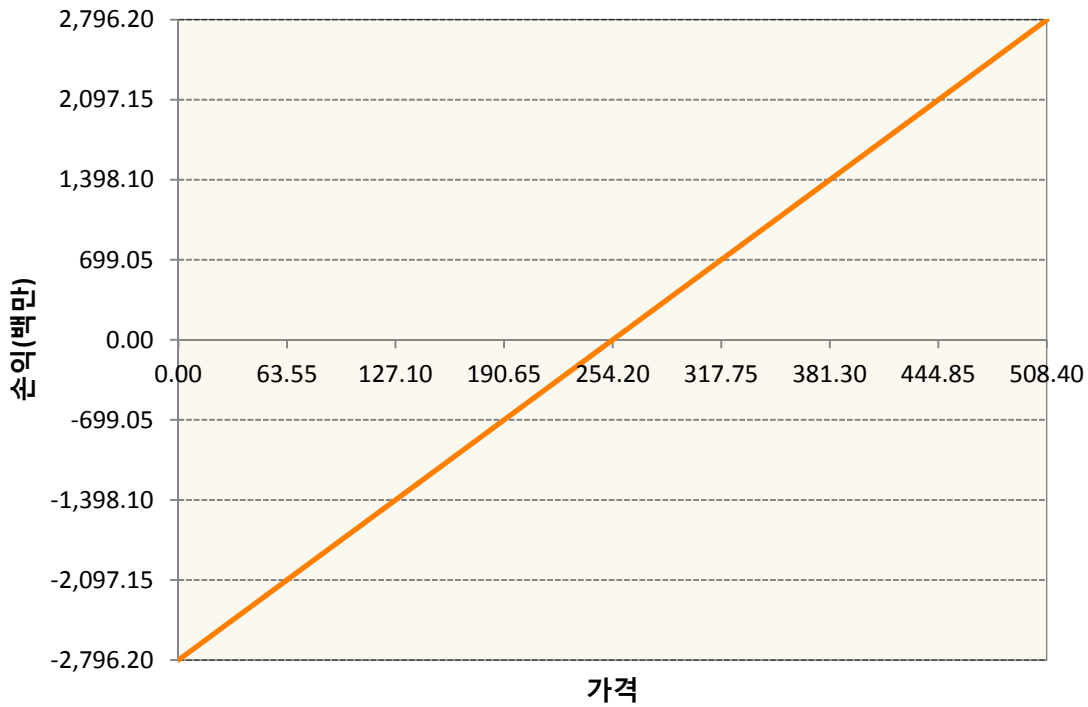
1. 계약금액

(단위:백만원)

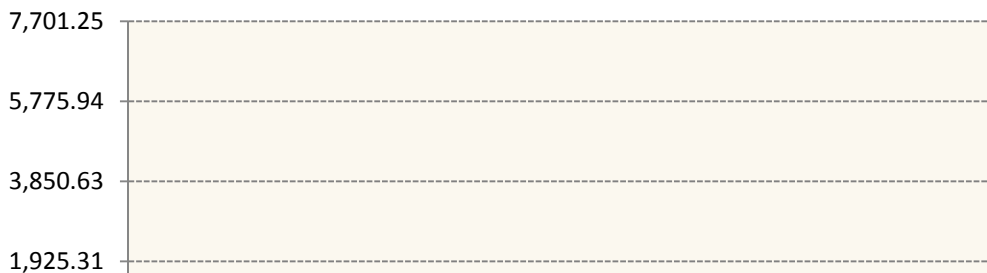
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,796	0	2,796	장내
누계	유가증권	스왑	14,125	0	14,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,829	-14,829	장내

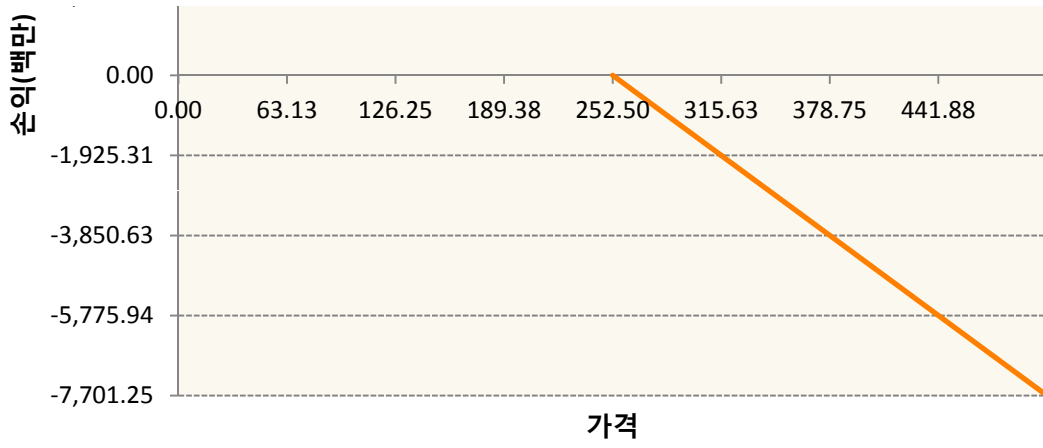
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

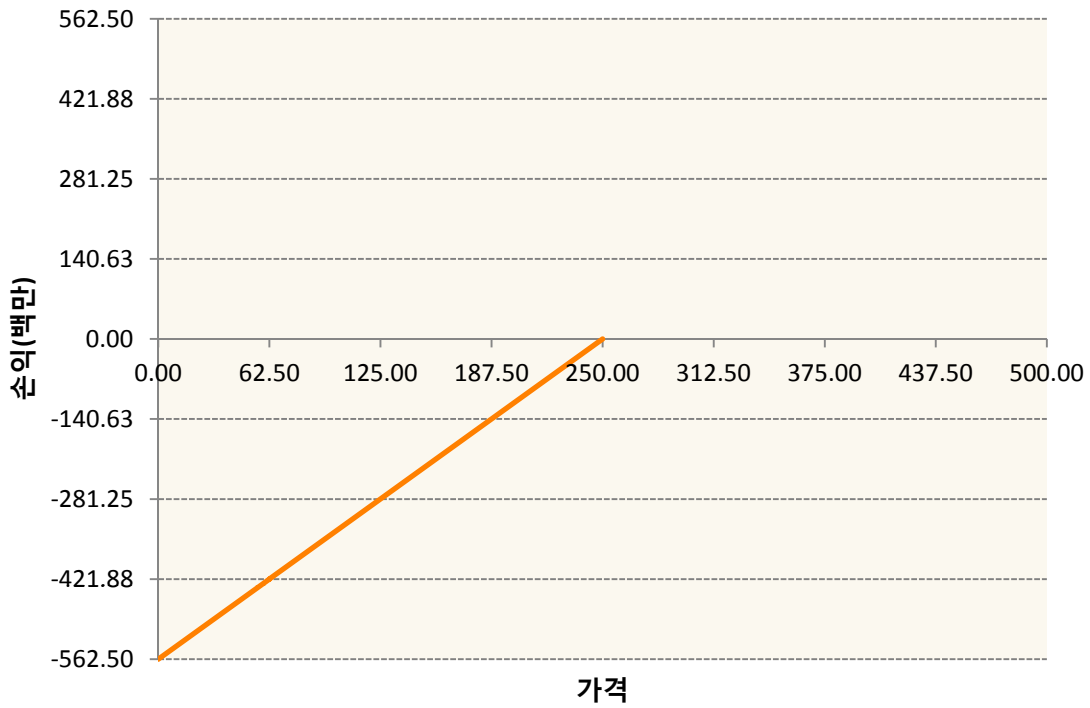


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

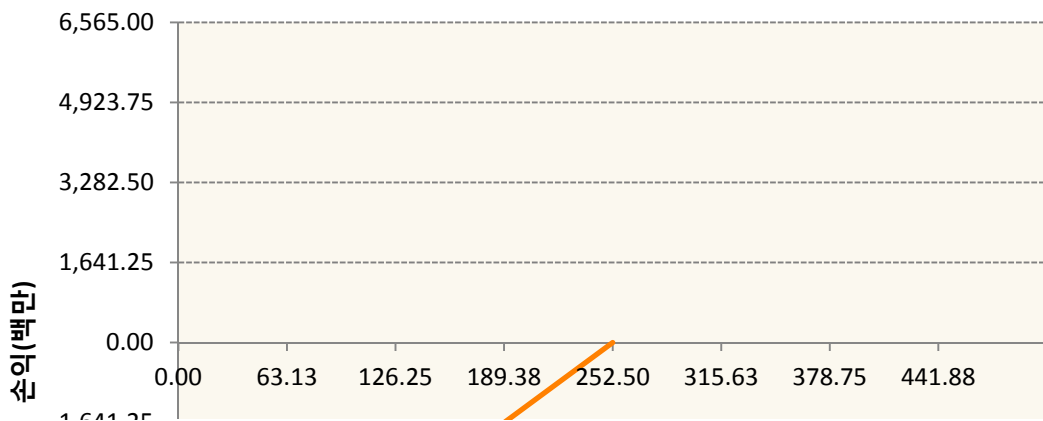


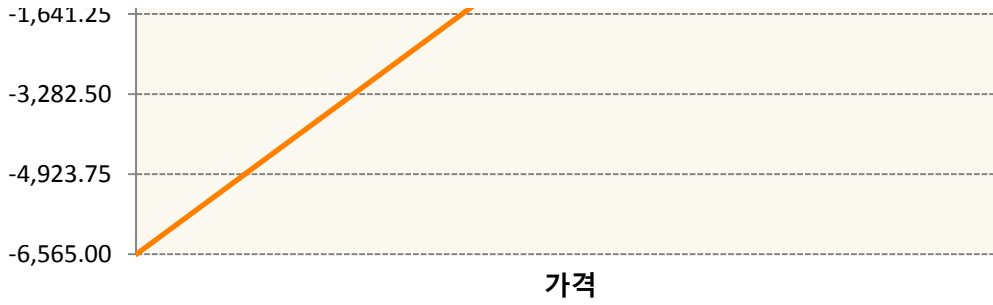


KR4301P92508-2019-09 풋250



KR4301P92524-2019-09 풋252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16					1,228	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,228	-1,228	-1,228	-1,228	-1,228	-1,228	-1,228	
-5.33%	-819	-819	-819	-819	-819	-819	-819	
-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%	819	819	819	819	819	819	819	
8.00%	1,228	1,228	1,228	1,228	1,228	1,228	1,228	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물					224	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-224	-224	-224	-224	-224	-224	-224	
-5.33%	-149	-149	-149	-149	-149	-149	-149	
-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%	149	149	149	149	149	149	149	
8.00%	224	224	224	224	224	224	224	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5					516	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	170	168	166	164	160	156	152	
-5.33%	161	156	150	143	136	129	121	
-2.67%	125	114	104	93	83	72	60	
0%	36	24	12	0	-12	-24	-36	
2.67%	-112	-121	-129	-139	-148	-158	-169	
5.33%	-299	-302	-307	-312	-318	-325	-332	
8.00%	-501	-502	-503	-506	-509	-512	-516	
KR4301P92508		2019-09 풋250					33	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-5.33%	-18	-18	-18	-19	-19	-19	-20
-2.67%	-5	-6	-6	-7	-8	-8	-9
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	3	3	3	3	2	2	2
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3
KR4301P92524 2019-09 풋252.5							423
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-421	-421	-421	-421	-422	-423	-423
-5.33%	-246	-247	-249	-251	-253	-256	-259
-2.67%	-86	-91	-96	-101	-107	-113	-119
0%	20	14	7	0	-7	-14	-21
2.67%	58	55	51	47	43	38	33
5.33%	64	63	62	61	60	58	55
8.00%	64	64	64	64	63	63	62

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

(단위:백만원)

2,468

공시일	2019-08-30
기준일	2019-08-29

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

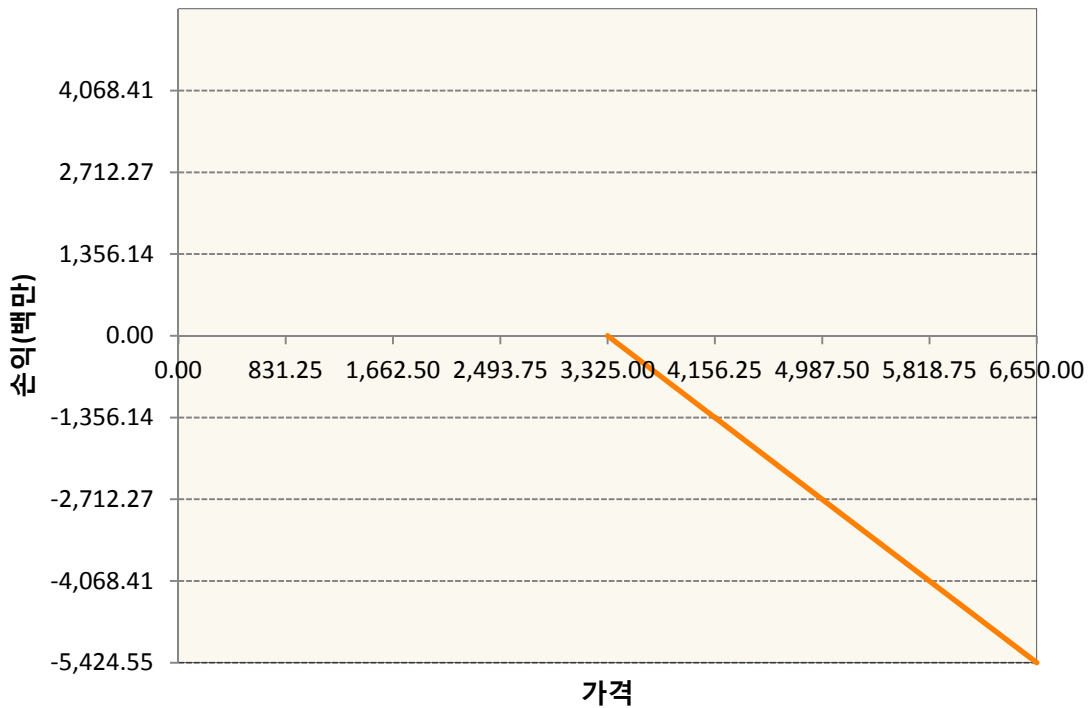
1. 계약금액

(단위:백만원)

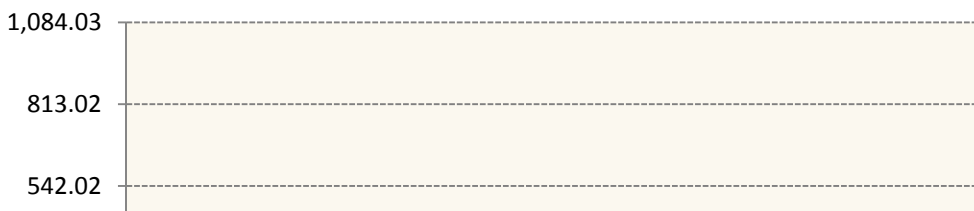
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,738	0	3,738	
누계	유가증권	옵션	0	13,017	-13,017	장내
누계	지수	스왑	28,504	0	28,504	장외
누계	통화	선도	9,168	17,527	-8,359	장외

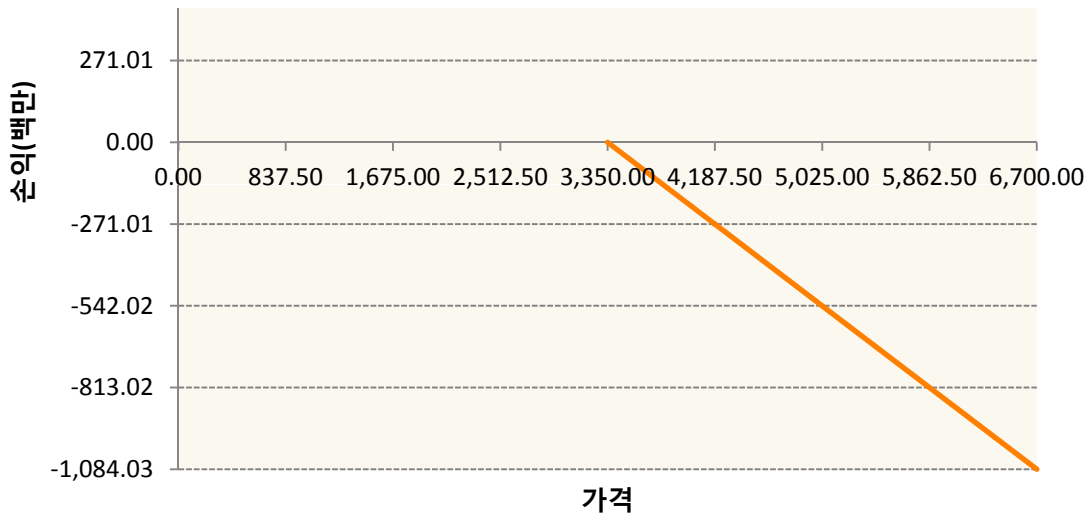
2. 만기시점의 손익구조

OESXU9-C3325-EURO STOXX 50

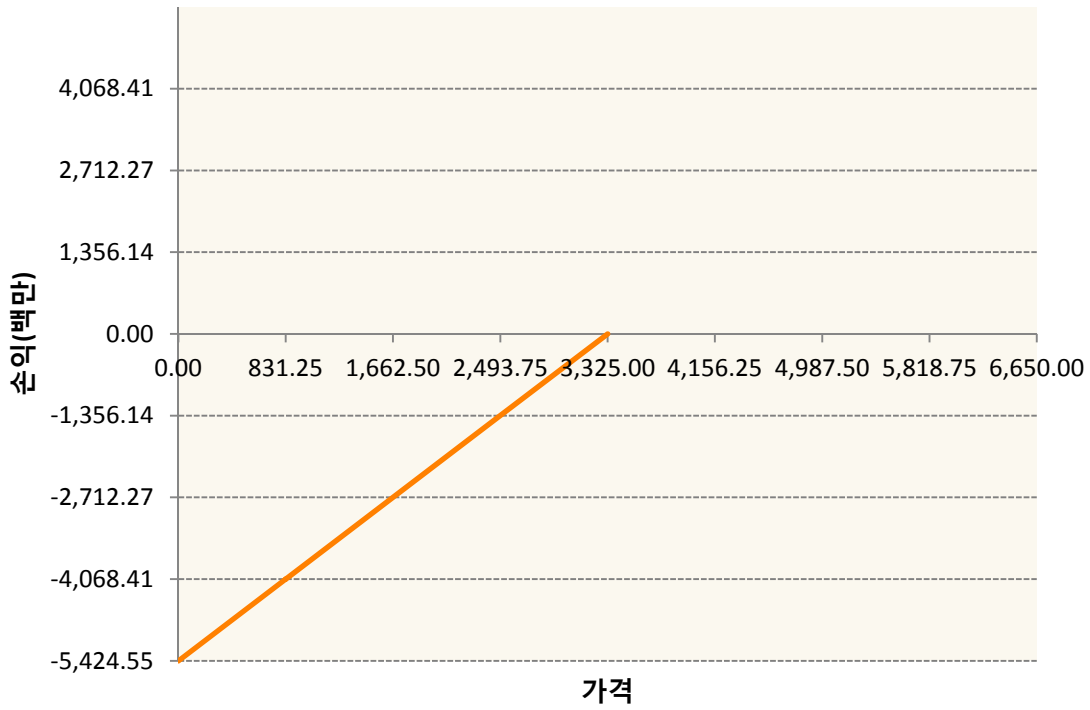


OESXU9-C3350-EURO STOXX 50

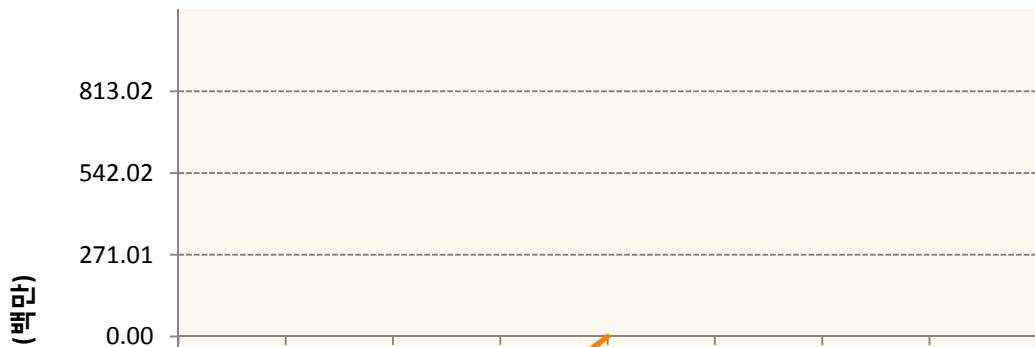


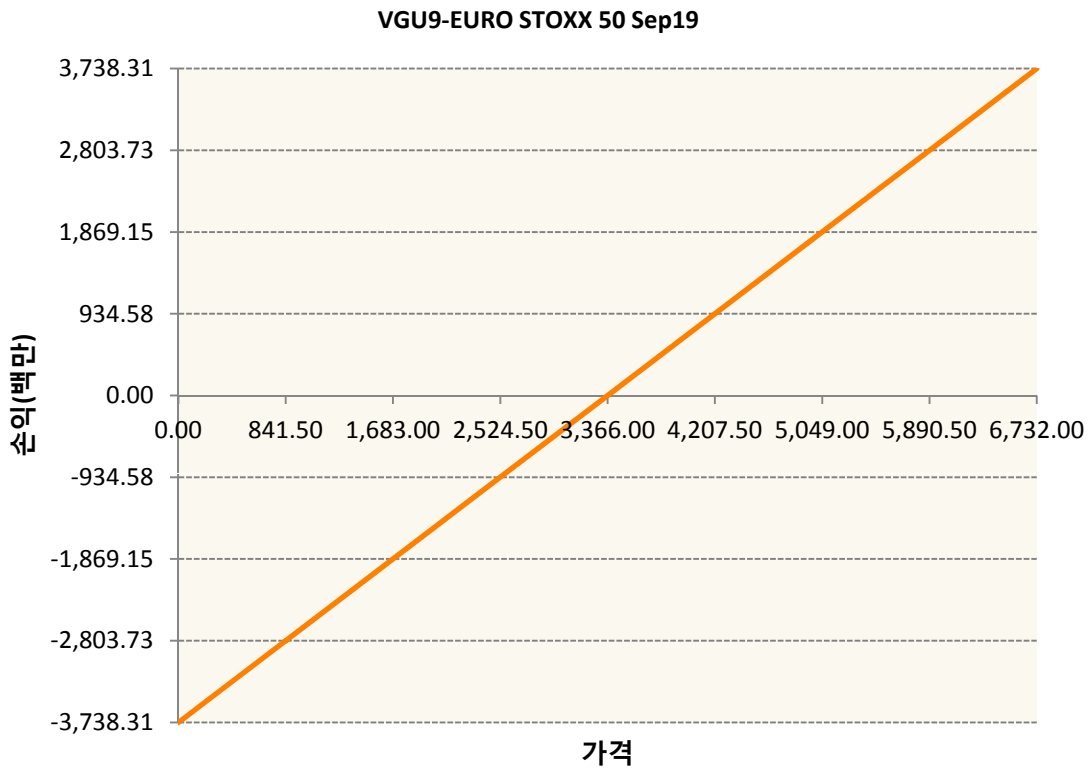
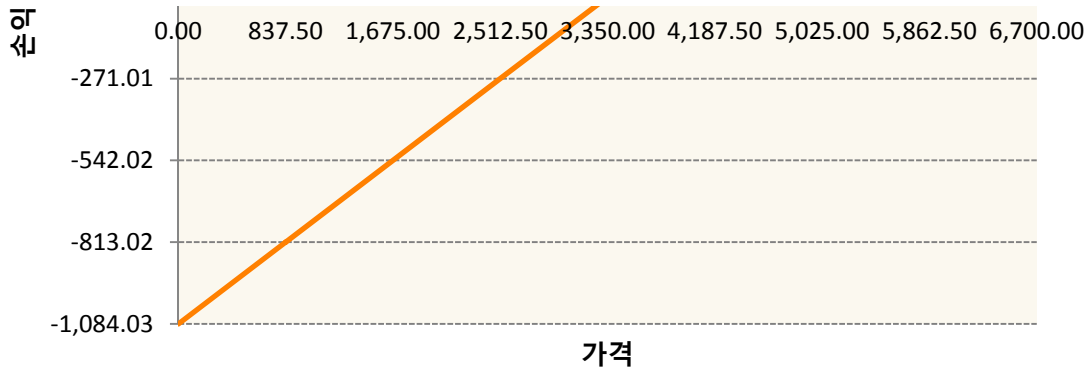


OESXU9-P3325-EURO STOXX 50



OESXU9-P3350-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	51
FX21019M0< KRW/EUR 27-09-19E	1,079
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	324
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E	324
FX21019N04 EUR/KRW 27-09-19E	237
FX21019Q00 EUR/KRW 27-09-19E	173
OESXU9-C3€ EURO STOXX 50	434
OESXU9-C3€ EURO STOXX 50	87
OESXU9-P3€ EURO STOXX 50	434
OESXU9-P3€ EURO STOXX 50	87
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	299

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

(단위:백만원)

2,004

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

(단위:백만원)

910

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

(단위:백만원)

78

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

(단위:백만원)

121

공시일	2019-08-30
기준일	2019-08-29

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

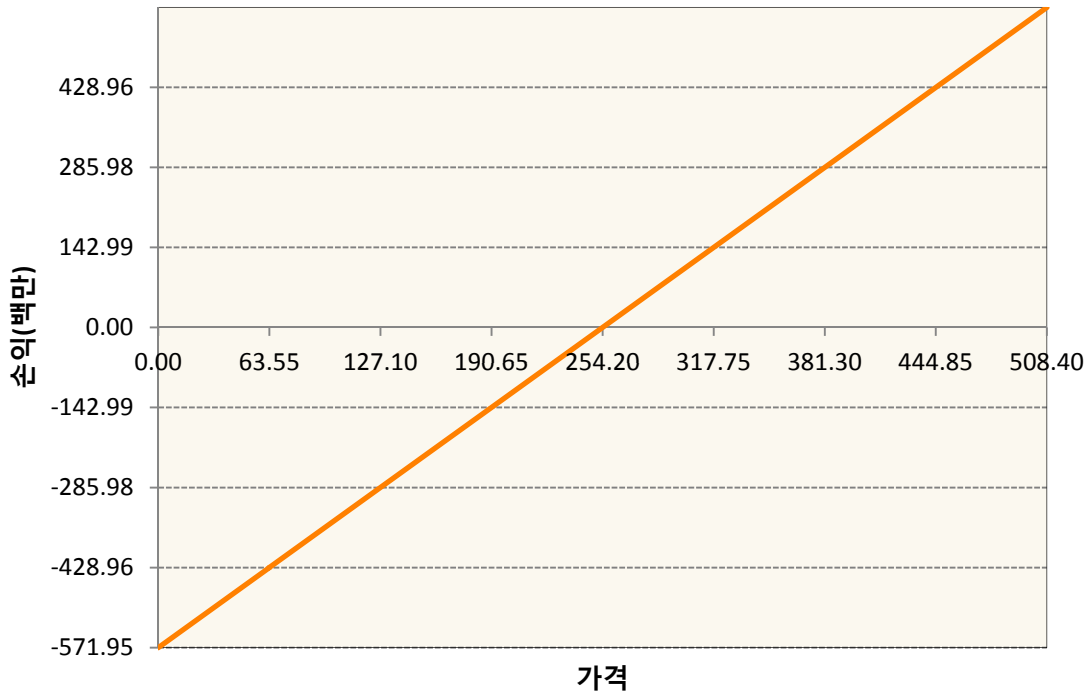
1. 계약금액

(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%	-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	2019-08-30
기준일	2019-08-29

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

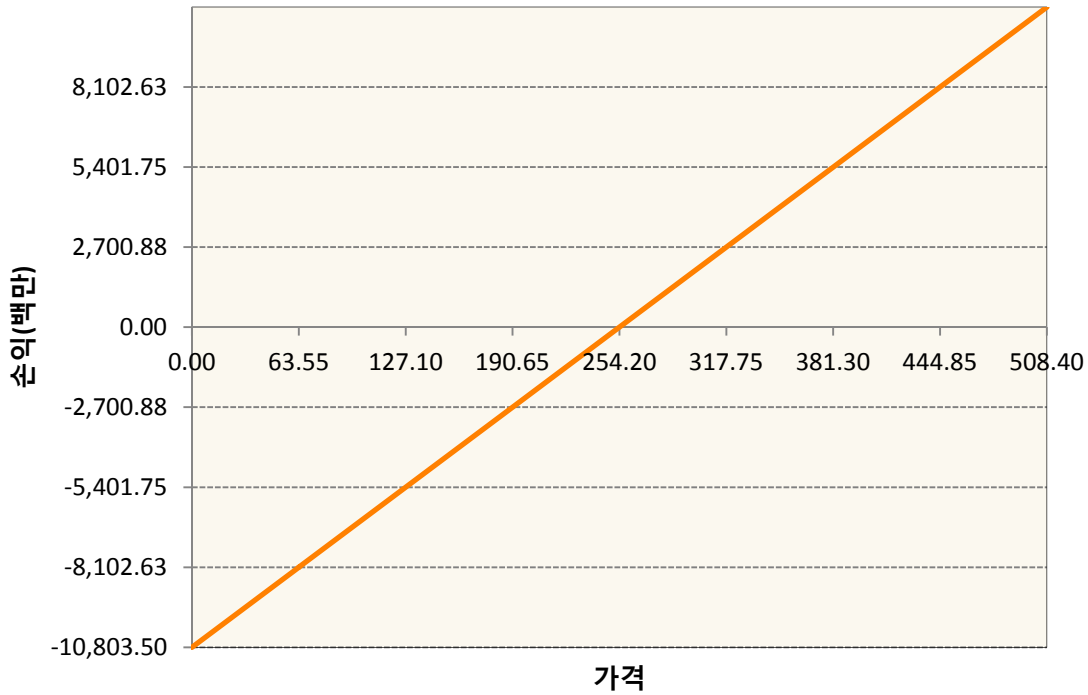
1. 계약금액

(단위:백만원)

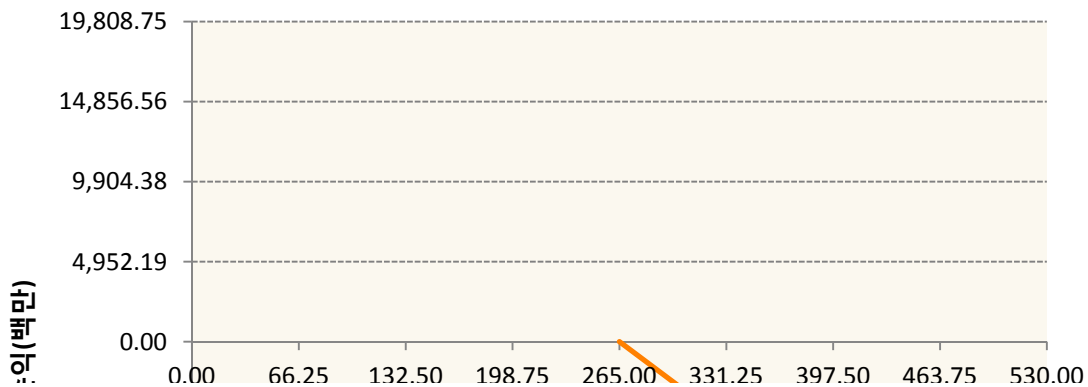
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,804	0	10,804	장내
누계	유가증권	옵션	3,659	19,943	-16,283	장내

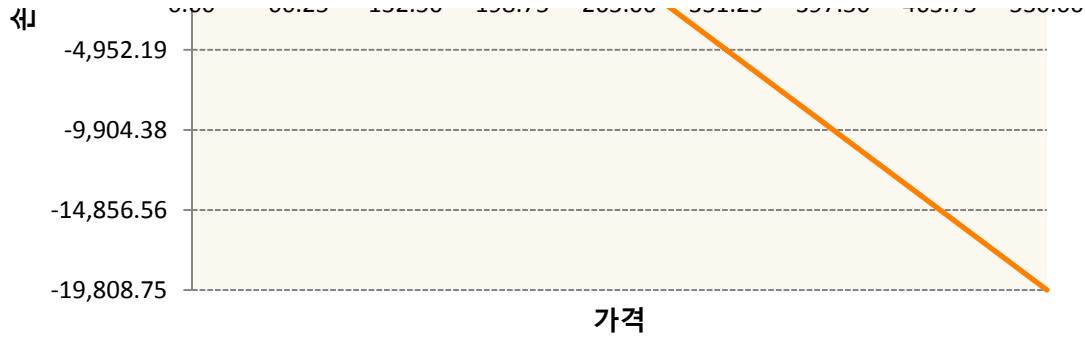
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

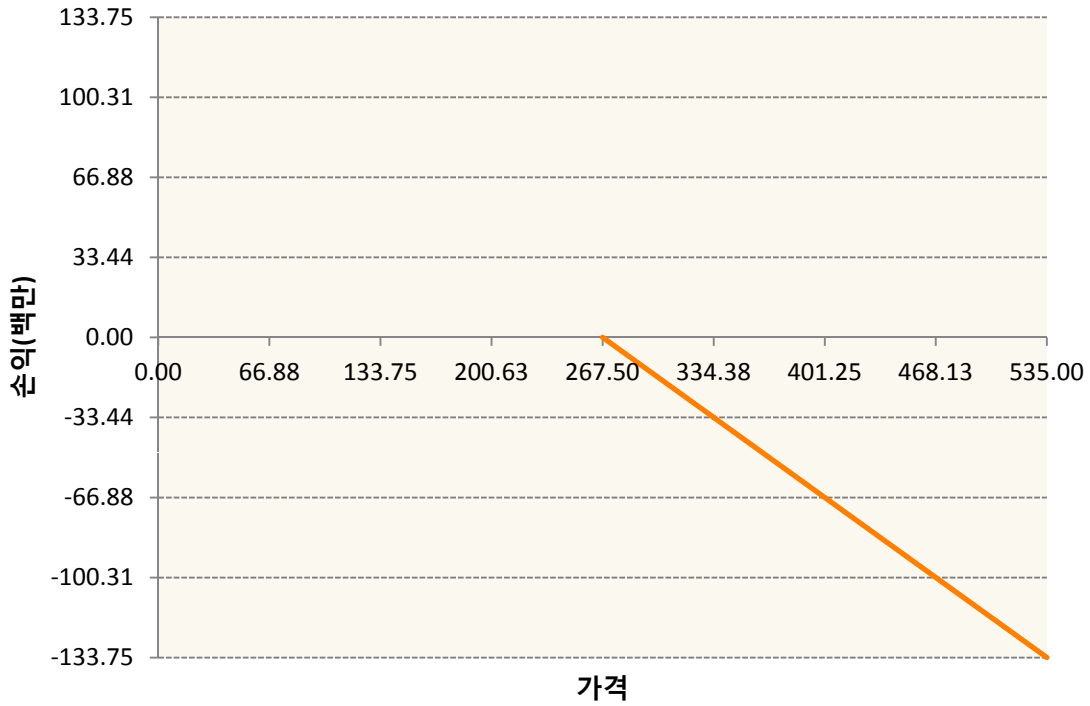


KR4201P92658-2019-09 콜265

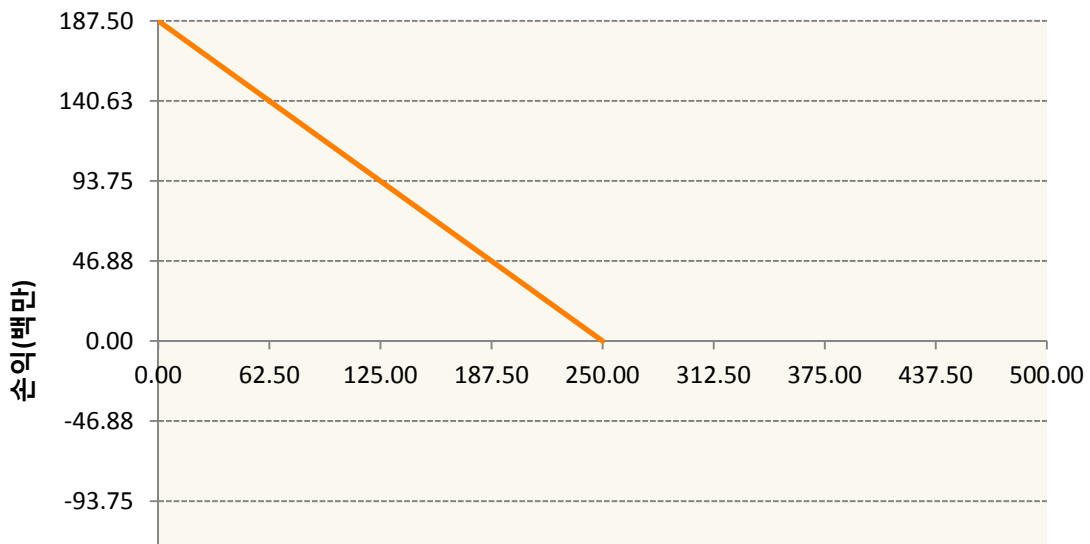


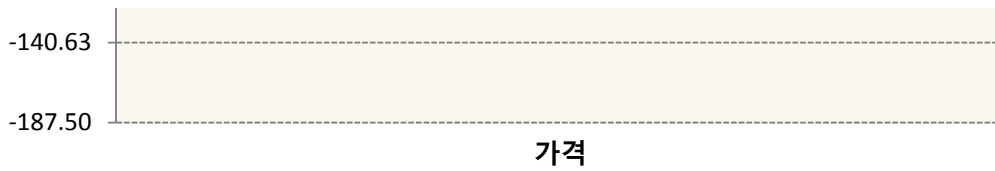


KR4201P92674-2019-09 콜267.5

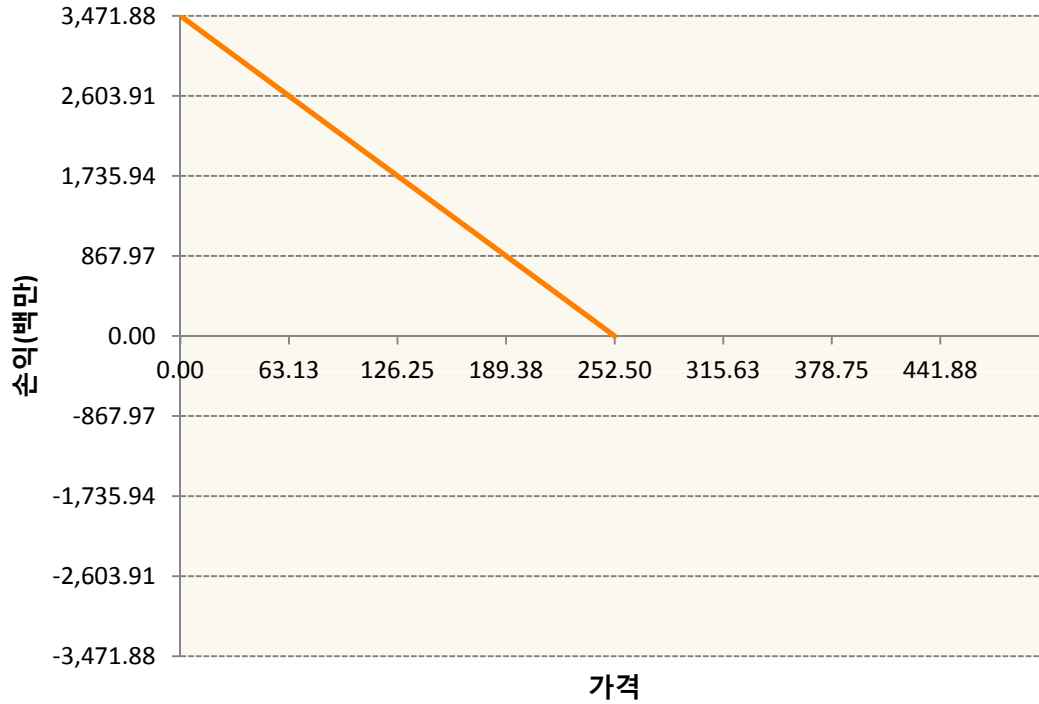


KR4301P92508-2019-09 풋250





KR4301P92524-2019-09 풋252.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						865
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-865	-865	-865	-865	-865	-865	-865	
-5.33%	-576	-576	-576	-576	-576	-576	-576	
-2.67%	-288	-288	-288	-288	-288	-288	-288	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	288	288	288	288	288	288	288	
5.33%	576	576	576	576	576	576	576	
8.00%	865	865	865	865	865	865	865	
KR4201P92658		2019-09 콜265						816
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	92	92	92	91	90	89	86	
-5.33%	92	91	89	86	82	76	70	
-2.67%	86	81	73	64	53	41	27	

0%	53	37	20	0	-21	-43	-66
2.67%	-57	-85	-114	-143	-172	-201	-230
5.33%	-300	-330	-360	-390	-420	-450	-481
8.00%	-677	-697	-718	-741	-765	-790	-816

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%	-2	-2	-2	-2	-2	-3	-3
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-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%	11	11	11	11	11	11	11
-5.33%	6	6	6	6	6	6	7
-2.67%	2	2	2	2	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 풋252.5 224

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	223	223	223	223	223	223	224
-5.33%	130	131	131	133	134	135	137
-2.67%	45	48	51	54	57	60	63
0%	-11	-7	-4	0	4	7	11
2.67%	-31	-29	-27	-25	-23	-20	-18
5.33%	-34	-33	-33	-32	-32	-31	-29
8.00%	-34	-34	-34	-34	-34	-33	-33

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

(단위:백만원)

1,531

공시일	2019-08-30
기준일	2019-08-29

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	71,144	0	71,144	

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	2019-08-30
기준일	2019-08-29

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,825	0	1,825	
누계	유가증권	수익증권	91,339	0	91,339	

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	2019-08-30
기준일	2019-08-29

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	476,100	0	476,100	
누계	통화	선도	0	524,390	-524,390	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		1,752
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,141
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		720
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		720
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		292
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		681
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		2,725
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		1,362
FX21019N04 KRW/USD 30-08-19E		778
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		3,211
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		2,180
FX21019Q01 KRW/USD 16-09-19E		97
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,990
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,601
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,666
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		3,026
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		973
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		973

FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E	973
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E	1,752
FX21019Q04 KRW/USD 30-09-19E	195
FX21019Q04 KRW/USD 24-09-19E	2,141
FX21019Q04 KRW/USD 24-09-19E	2,725
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E	195

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

(단위:백만원)

13,694

공시일	2019-08-30
기준일	2019-08-29

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

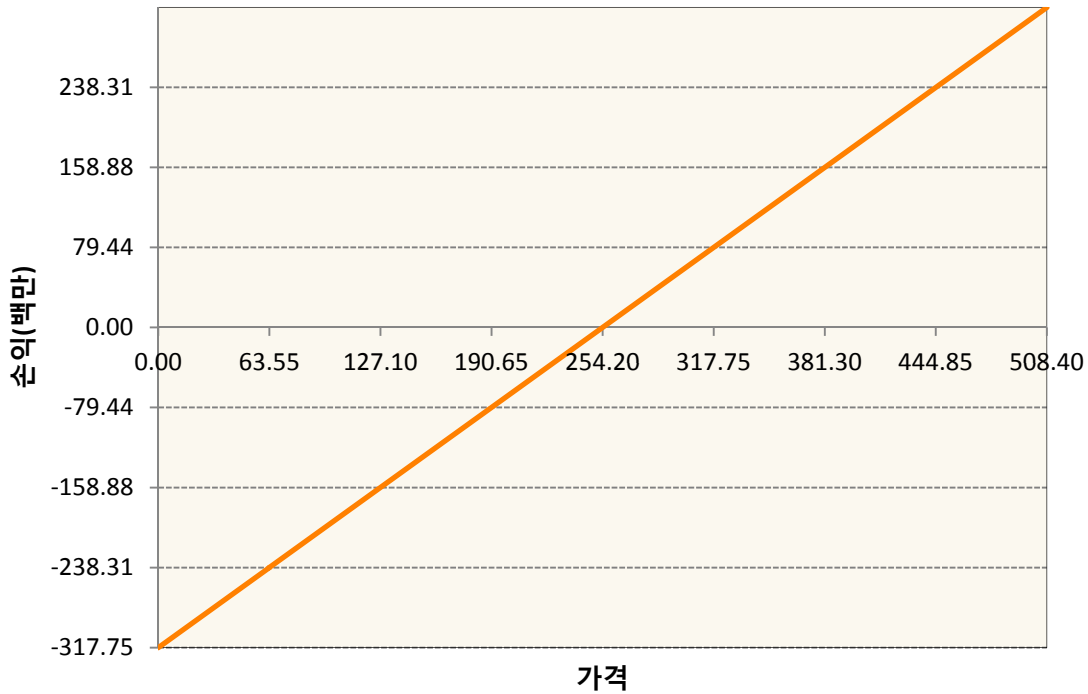
1. 계약금액

(단위:백만원)

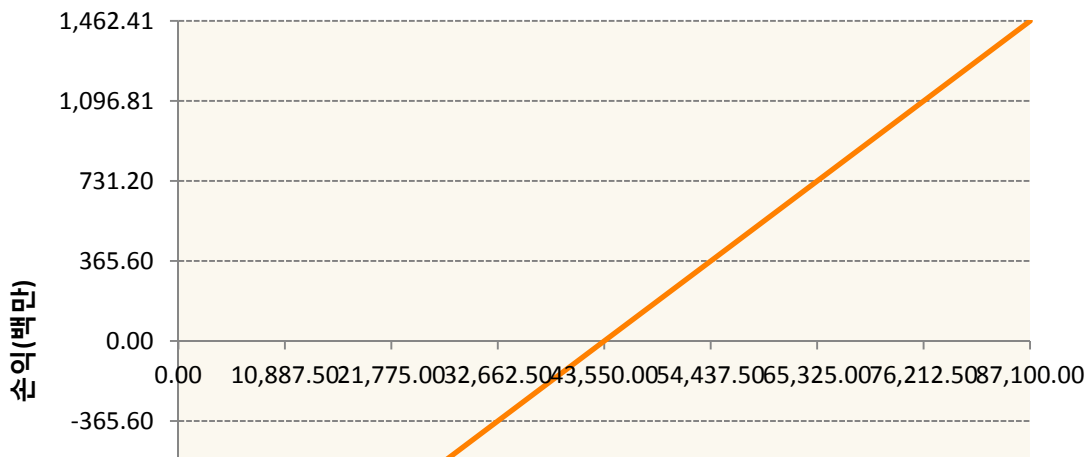
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,780	0	1,780	장내

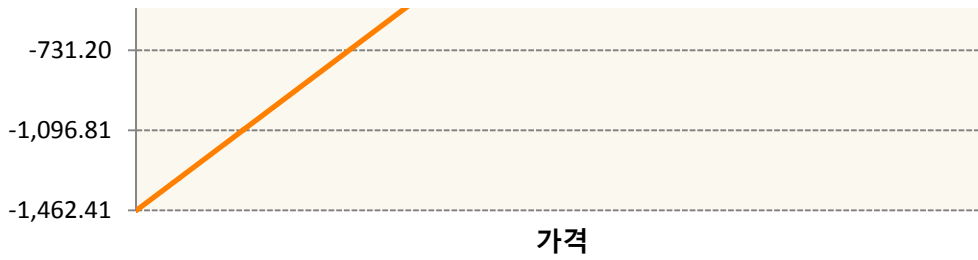
2. 만기시점의 손익구조

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)

165

공시일	2019-08-30
기준일	2019-08-29

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

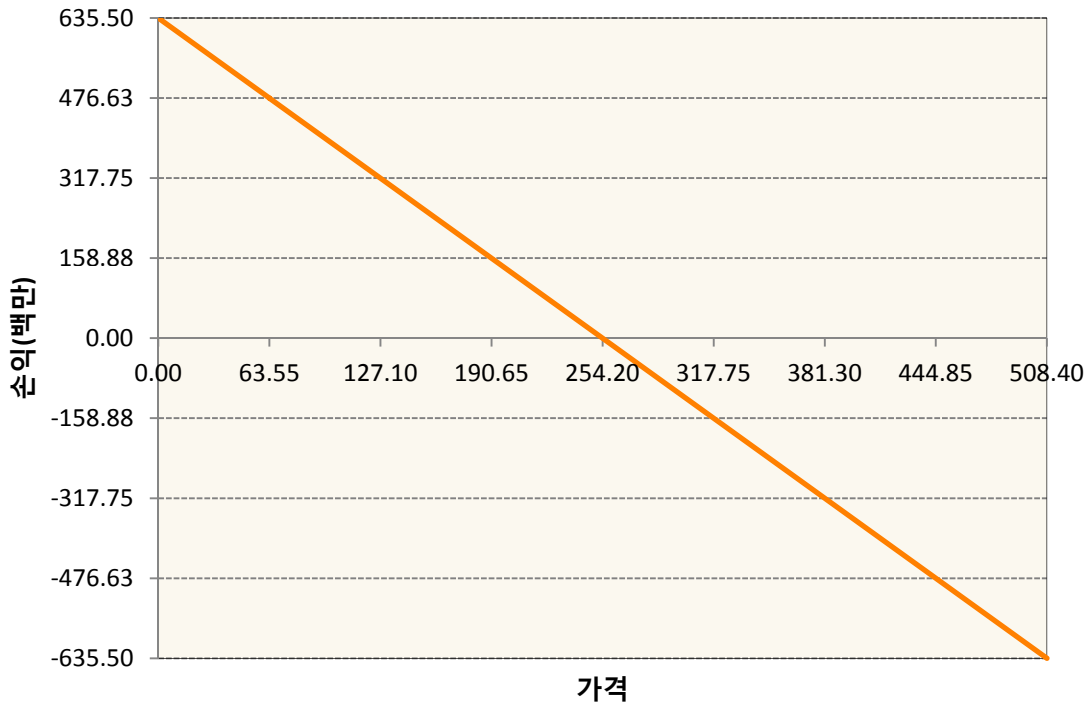
1. 계약금액

(단위:백만원)

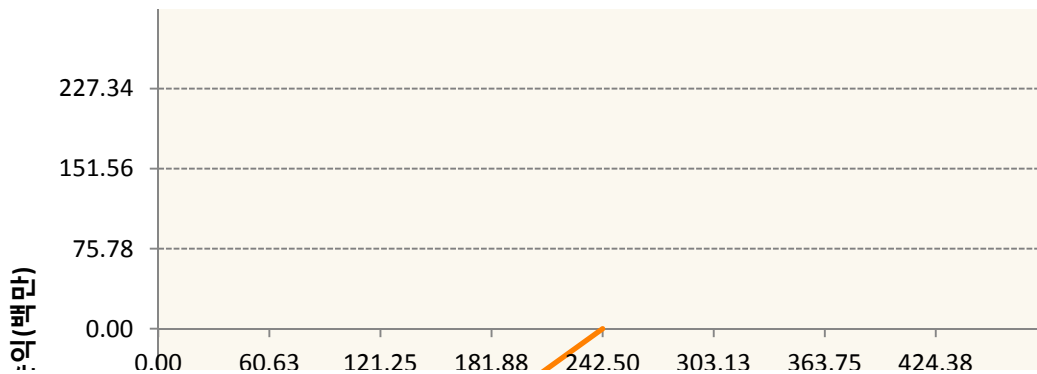
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	636	-636	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,672	-3,672	장내

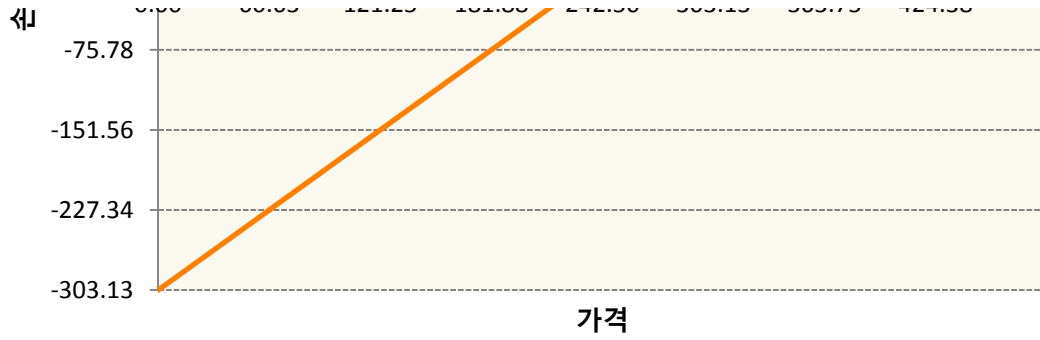
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

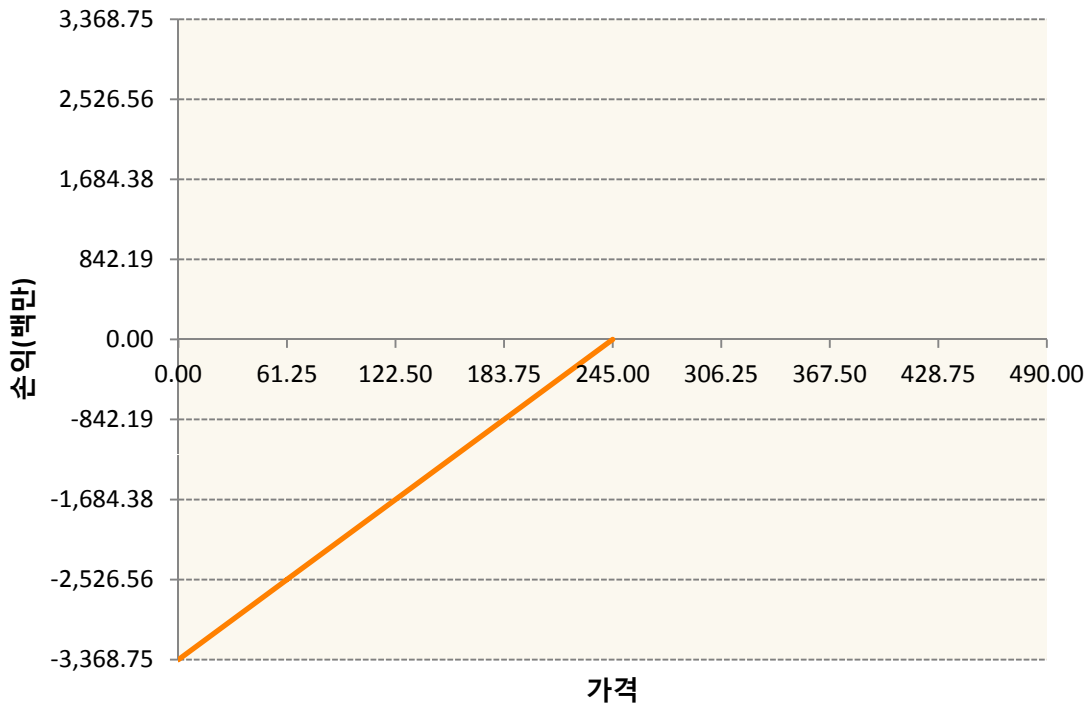


KR4301P92425-2019-09 풋242.5





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						12
기초자산의 변동성								

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

154

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-147	-148	-149	-150	-151	-153	-154
-5.33%	-64	-67	-69	-72	-75	-79	-82
-2.67%	-12	-15	-18	-22	-25	-29	-32
0%	5	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	7	7	6	6	5	4	3
5.33%	7	7	7	7	7	6	6
8.00%	7	7	7	7	7	7	7

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

(단위:백만원)

166

공시일	2019-08-30
기준일	2019-08-29

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	19,977	0	19,977	
누계	통화	선도	0	19,341	-19,341	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		487
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		525
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		39
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		331

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

(단위:백만원)

505

공시일	2019-08-30
기준일	2019-08-29

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	388	0	388	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	2019-08-30
기준일	2019-08-29

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

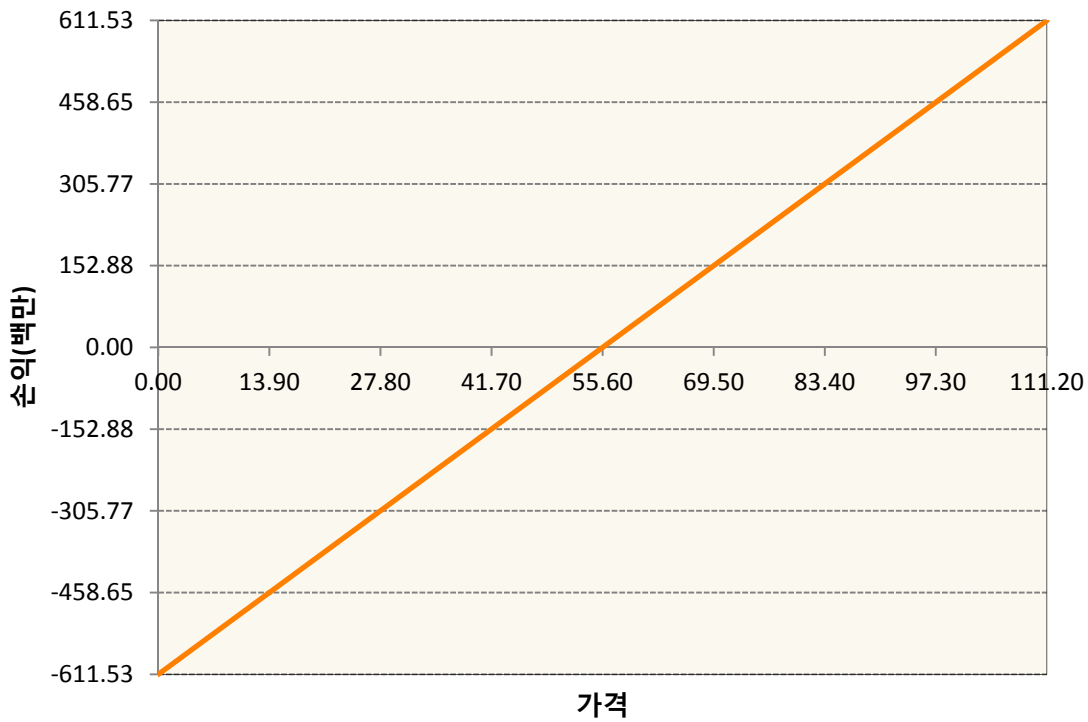
1. 계약금액

(단위:백만원)

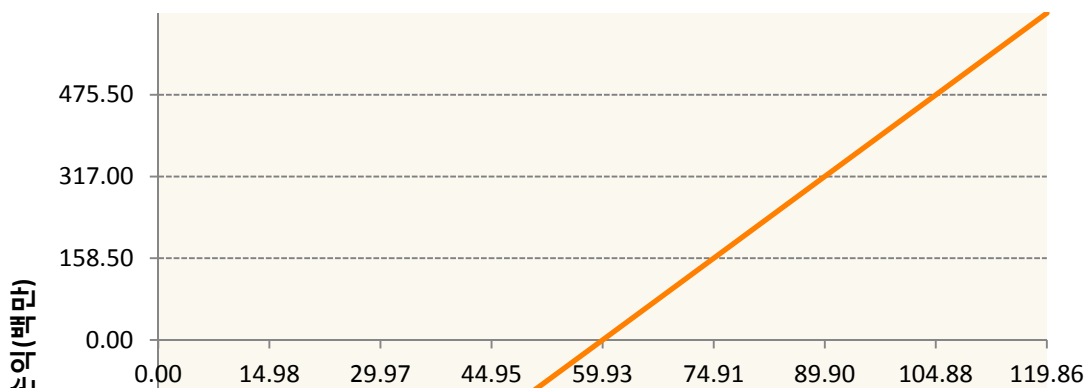
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,246	122	2,124	
누계	유가증권	선물	191	0	191	장내

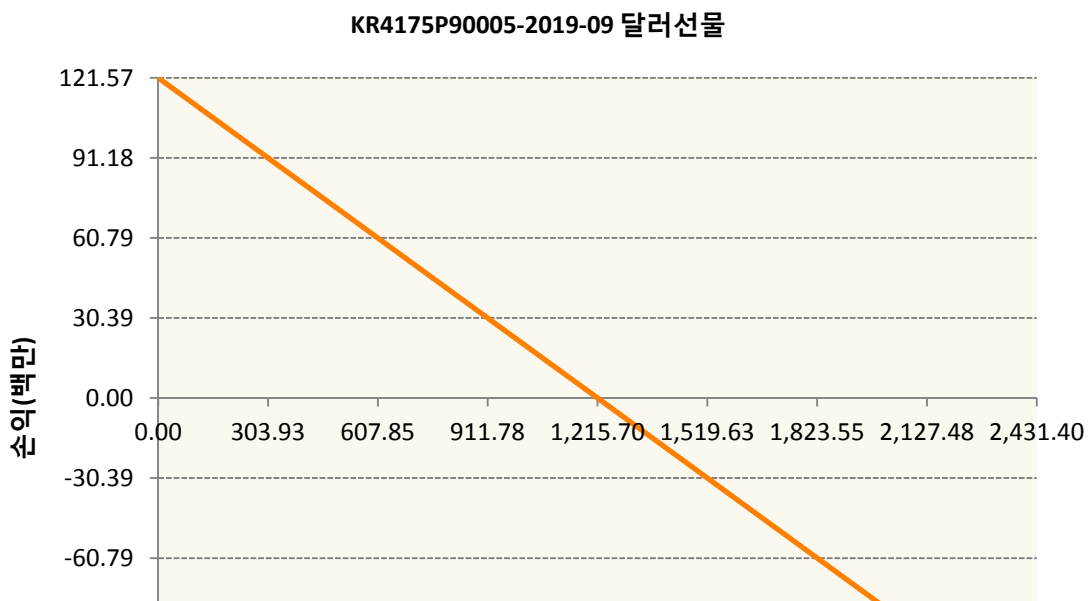
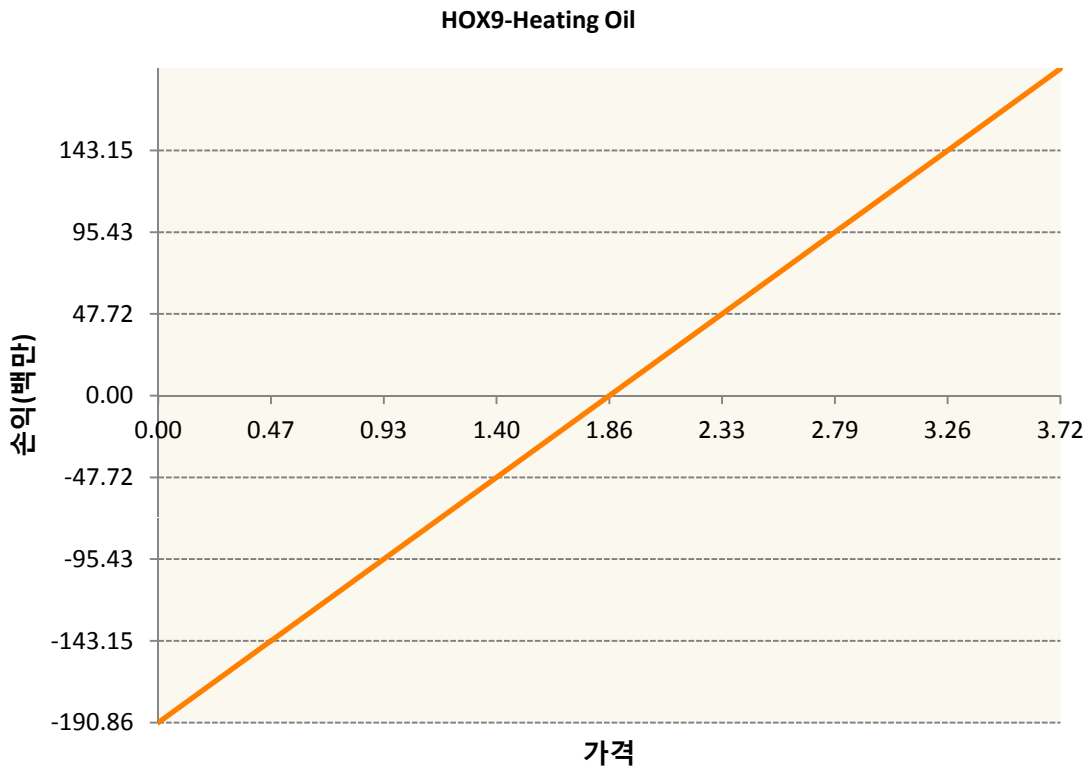
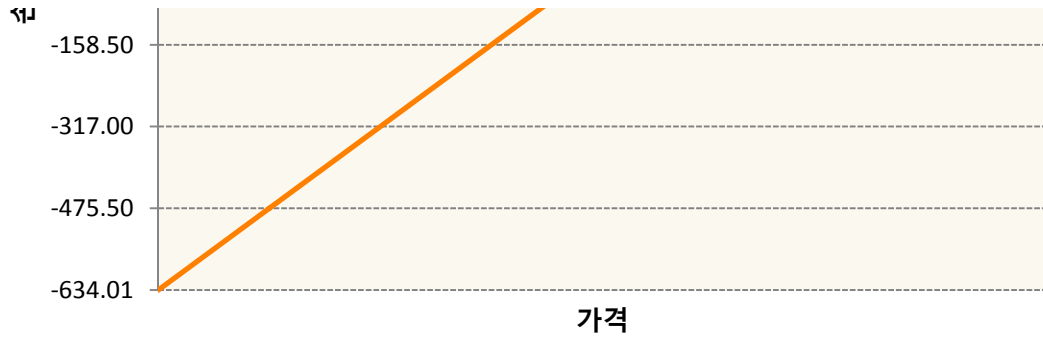
2. 만기시점의 손익구조

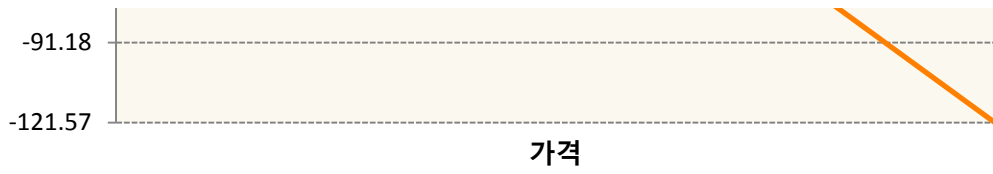
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19



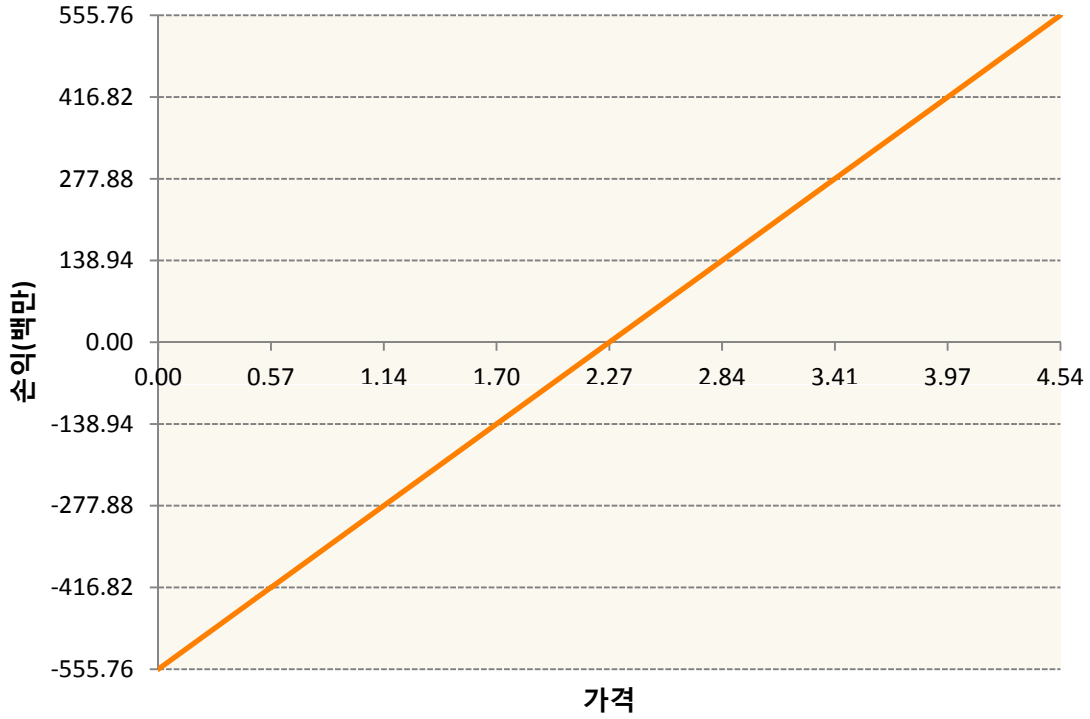
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19



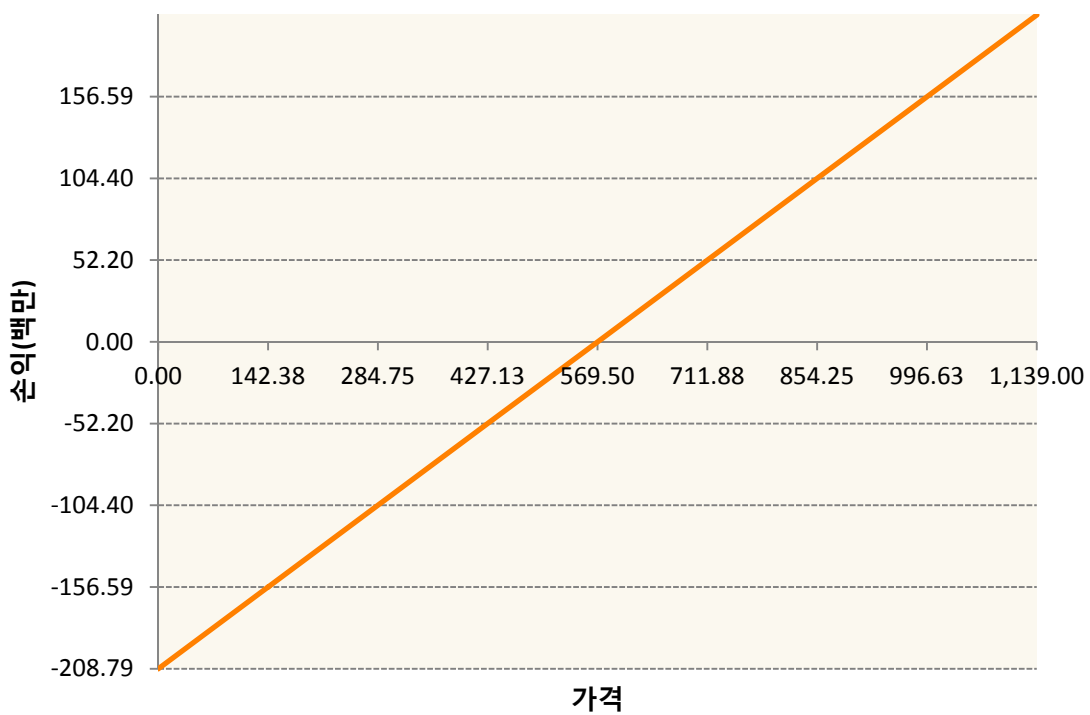




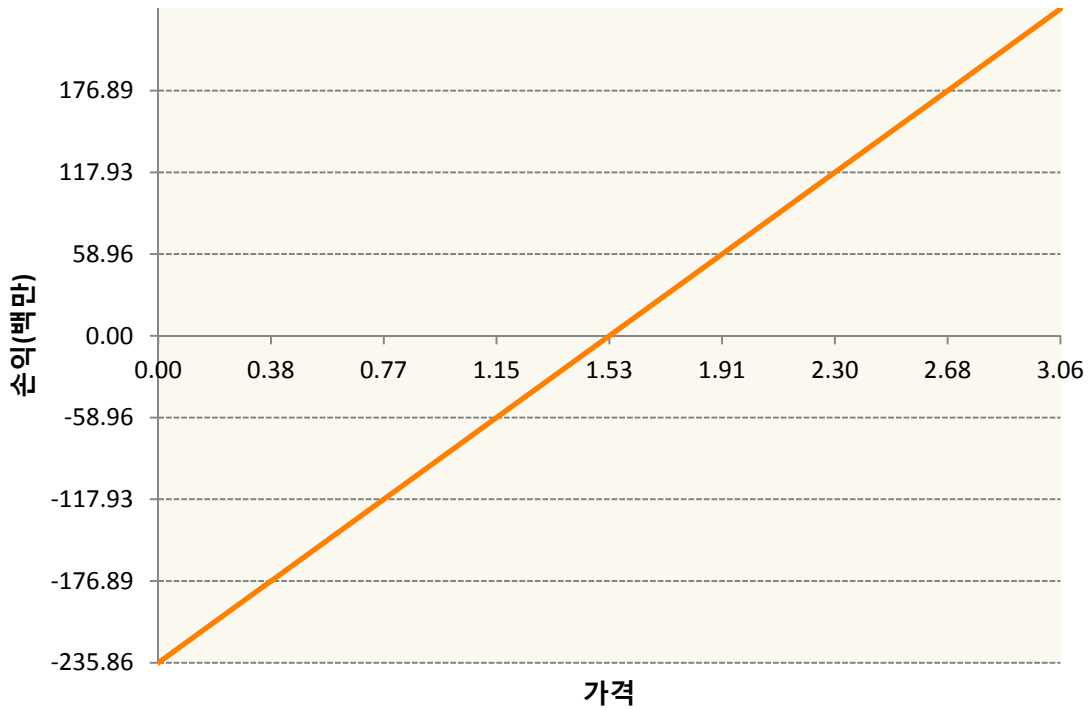
NGX19-NATURAL GAS FUTR Nov19



QSX9-Low Su Gasoil G Nov19



XBX9-GASOLINE RBOB FUT Nov19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX9	WTI CRUDE FUTURE Nov19	49
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	51
HOX9	Heating Oil	15
KR4175P900	2019-09 달러선물	10
NGX19	NATURAL GAS FUTR Nov19	44
QSX9	Low Su Gasoil G Nov19	17
XBX9	GASOLINE RBOB FUT Nov19	19

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	374

공시일	2019-08-30
기준일	2019-08-29

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

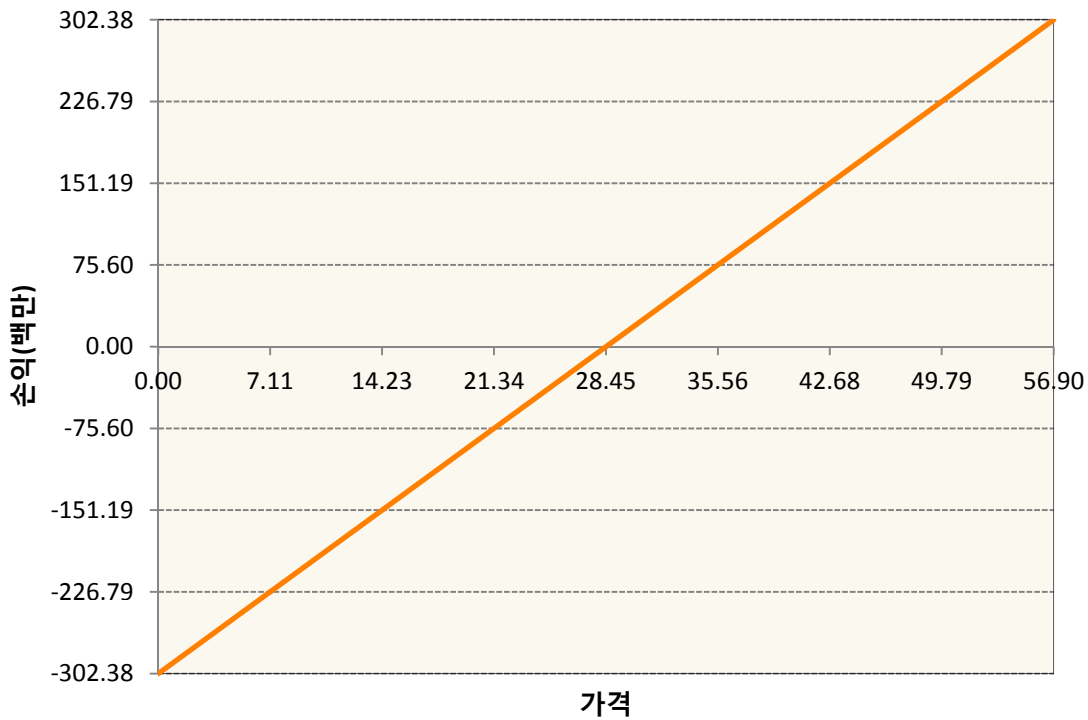
1. 계약금액

(단위:백만원)

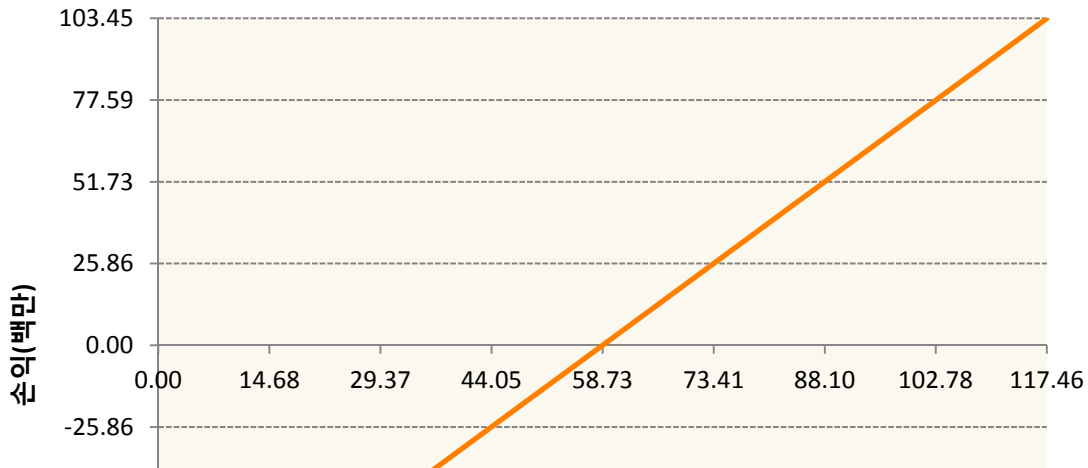
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,733	158	2,575	

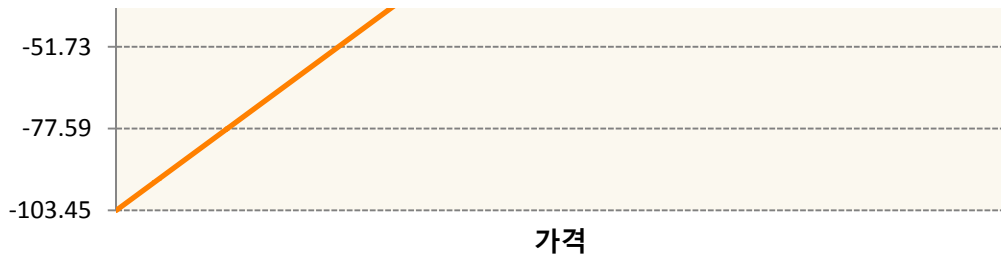
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

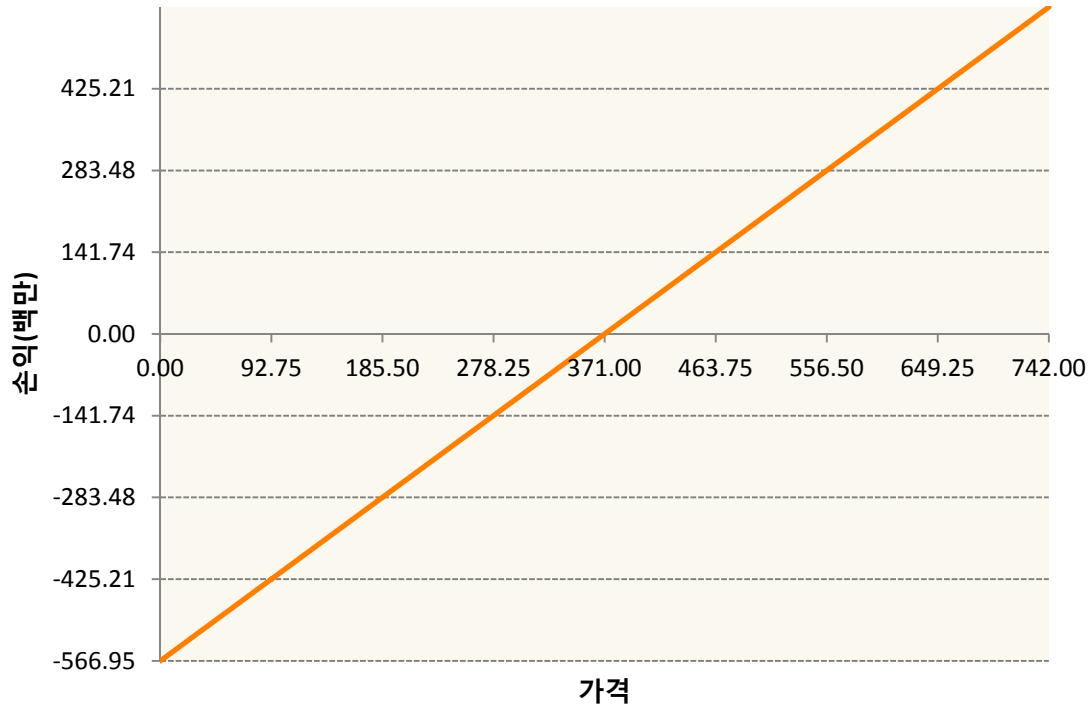


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

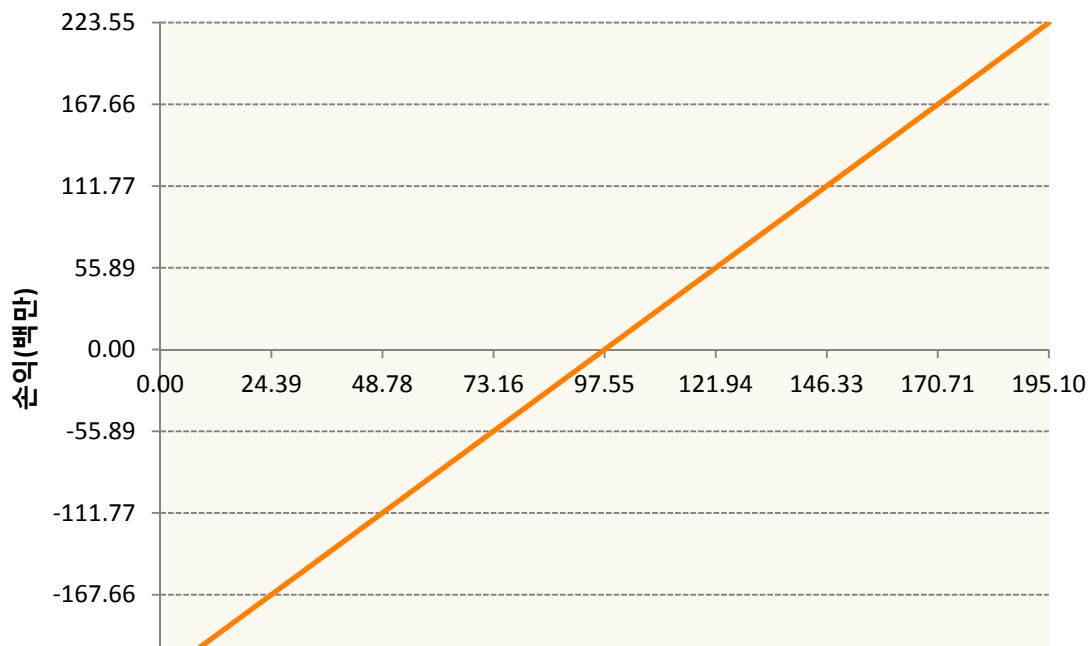


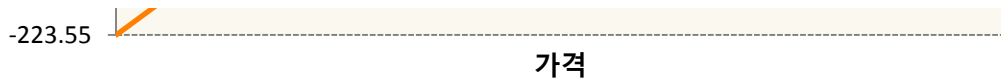


CZ9-CORN FUTURE Dec19

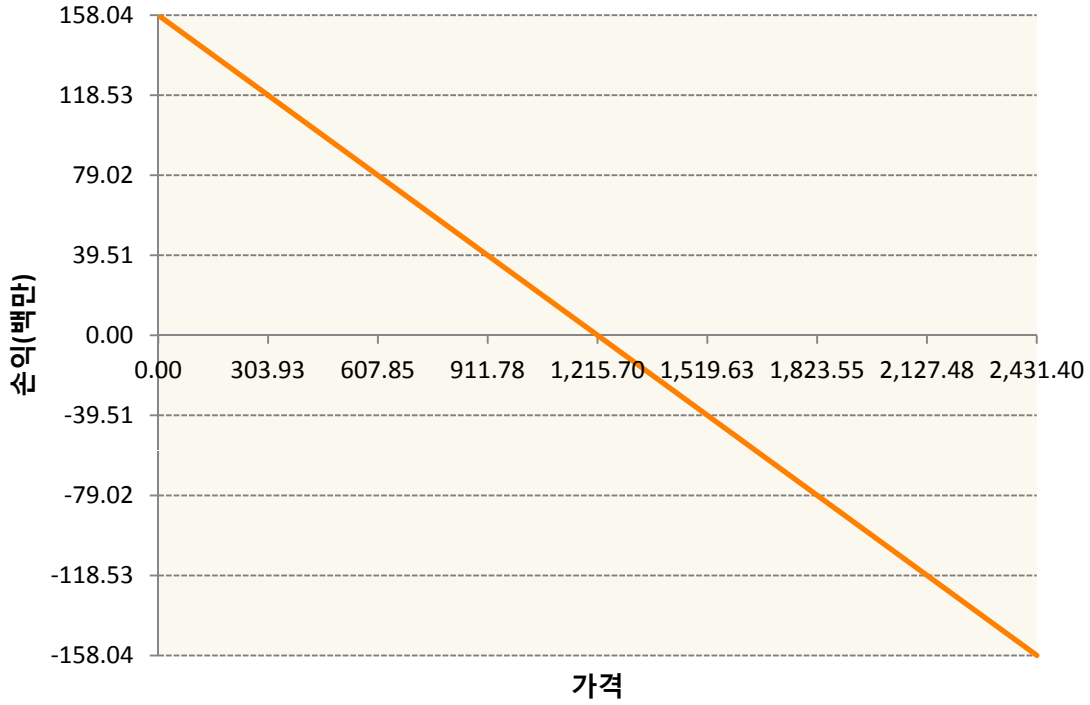


KCZ9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19

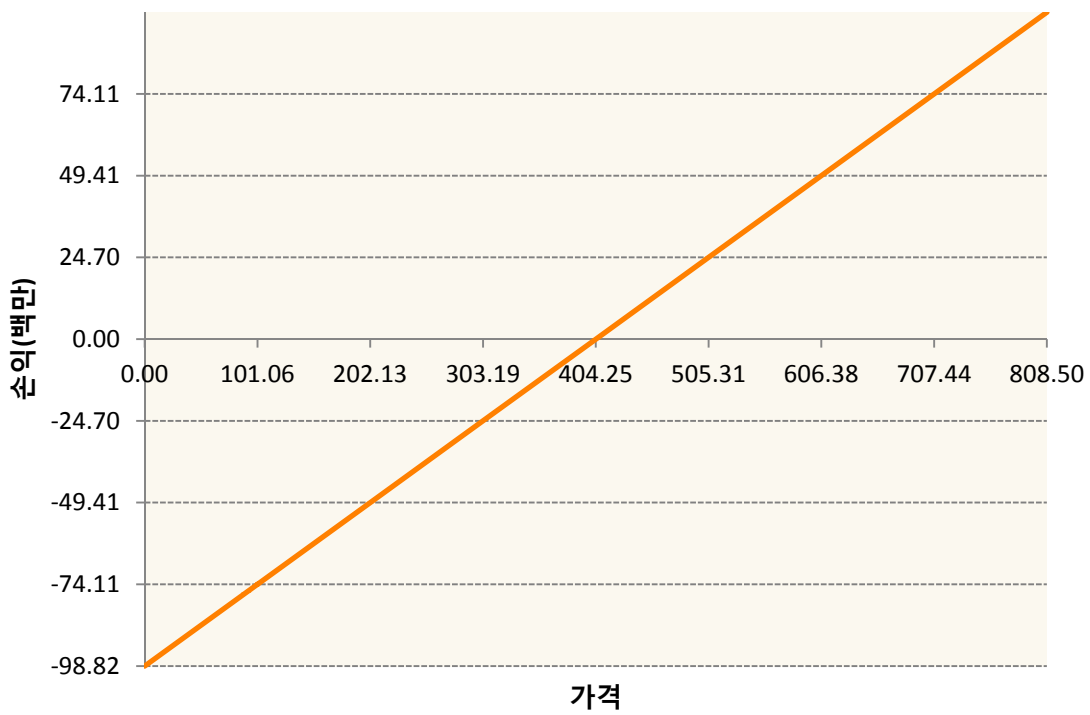




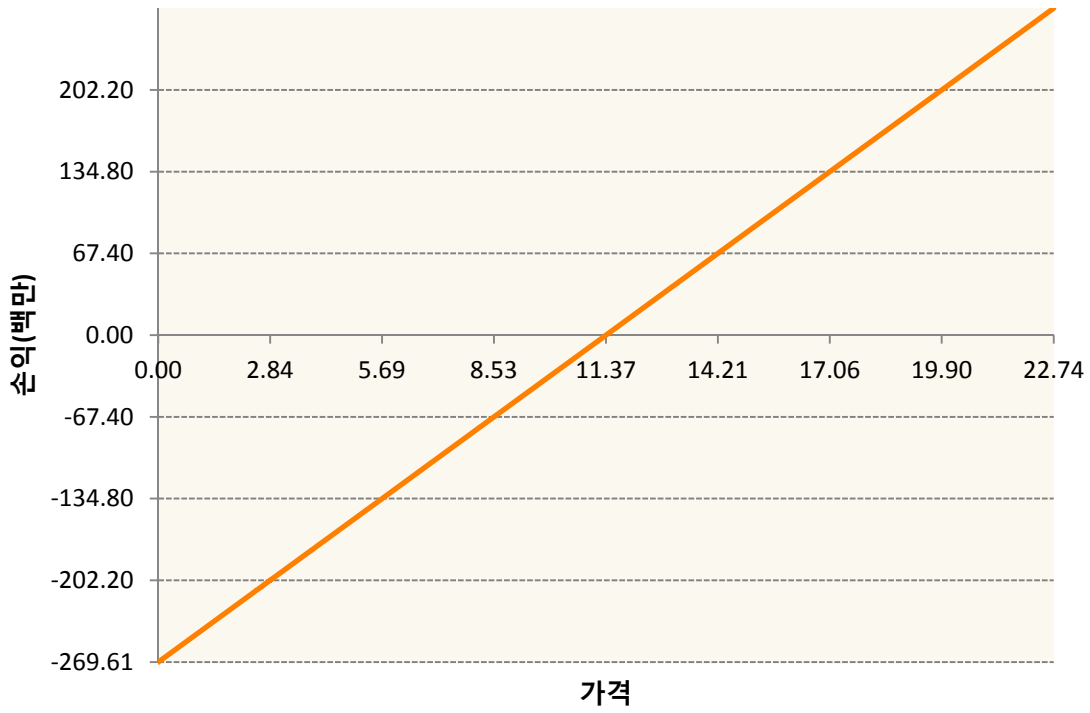
KR4175P90005-2019-09 달러선물



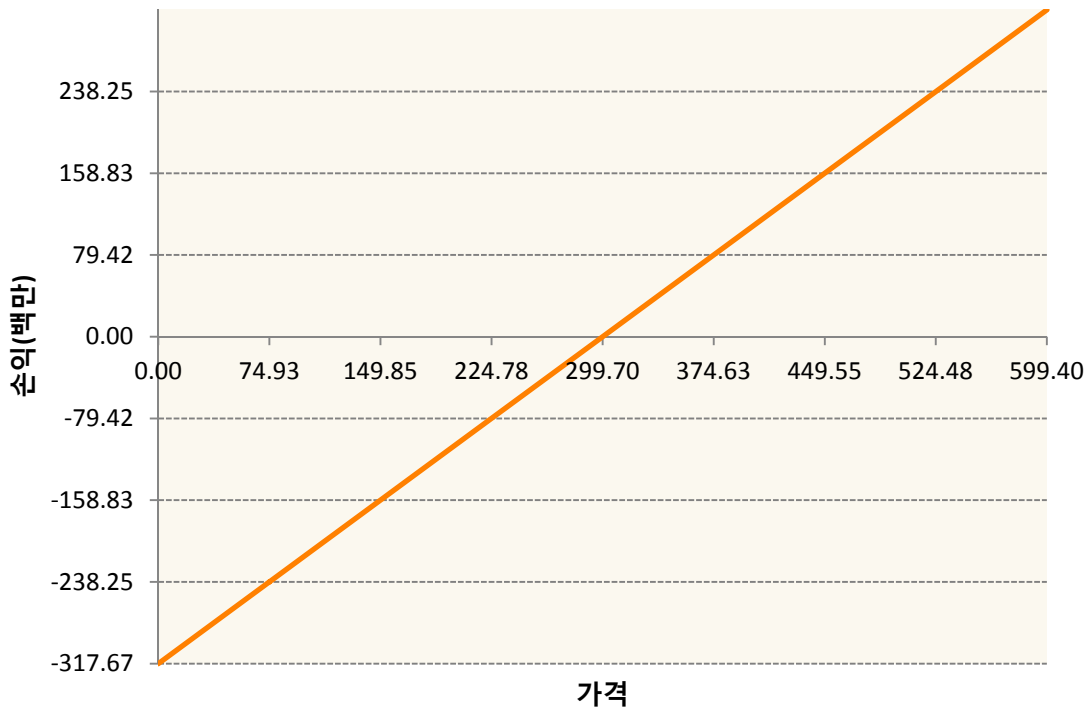
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



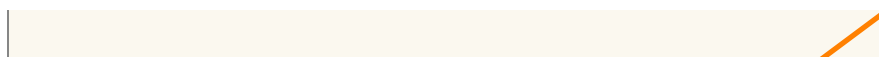
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

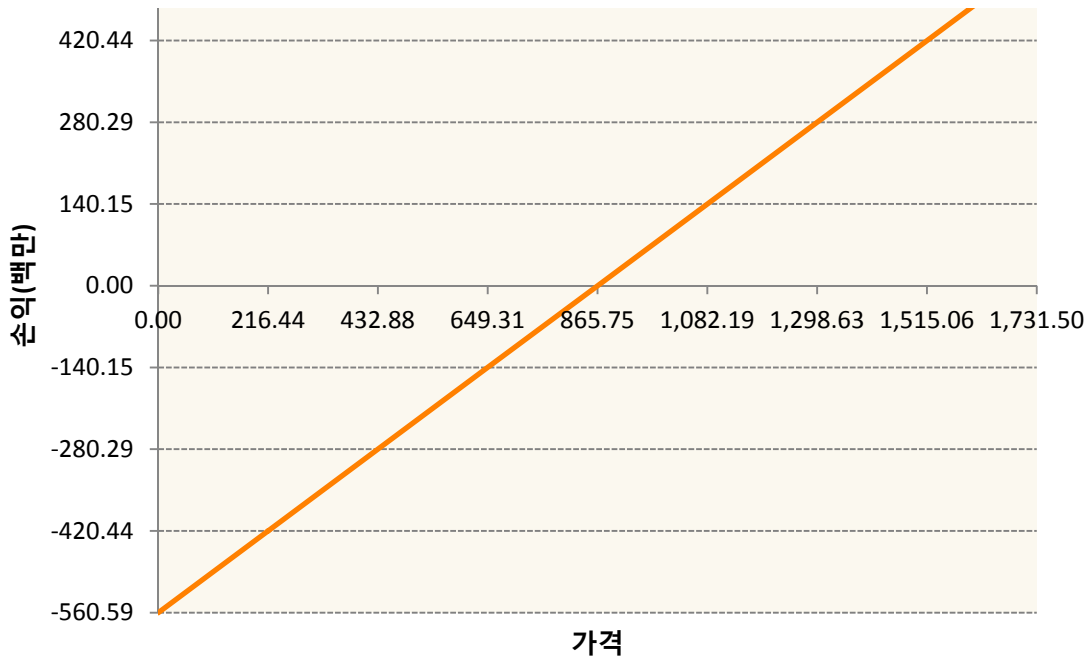


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

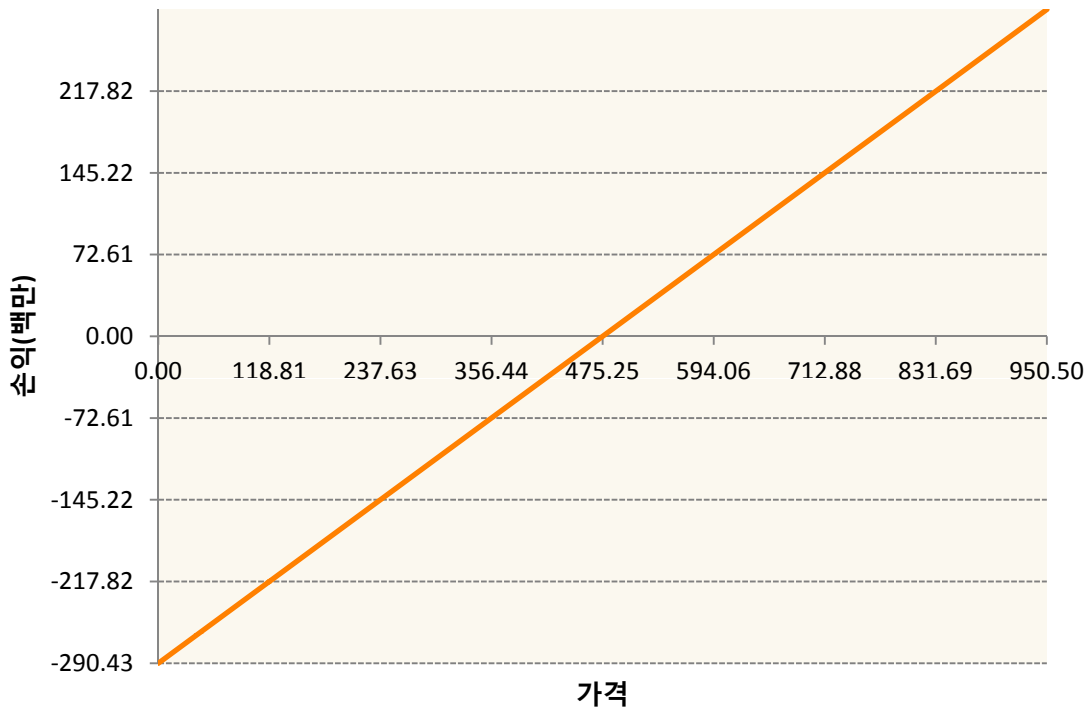


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





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