

공시일	2019-09-02
기준일	2019-08-30

## 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)

89

공시일	2019-09-02
기준일	2019-08-30

## 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

1,146

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

655

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-02
기준일	2019-08-30

## 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)	370
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	135

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

**804**

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-02
기준일	2019-08-30

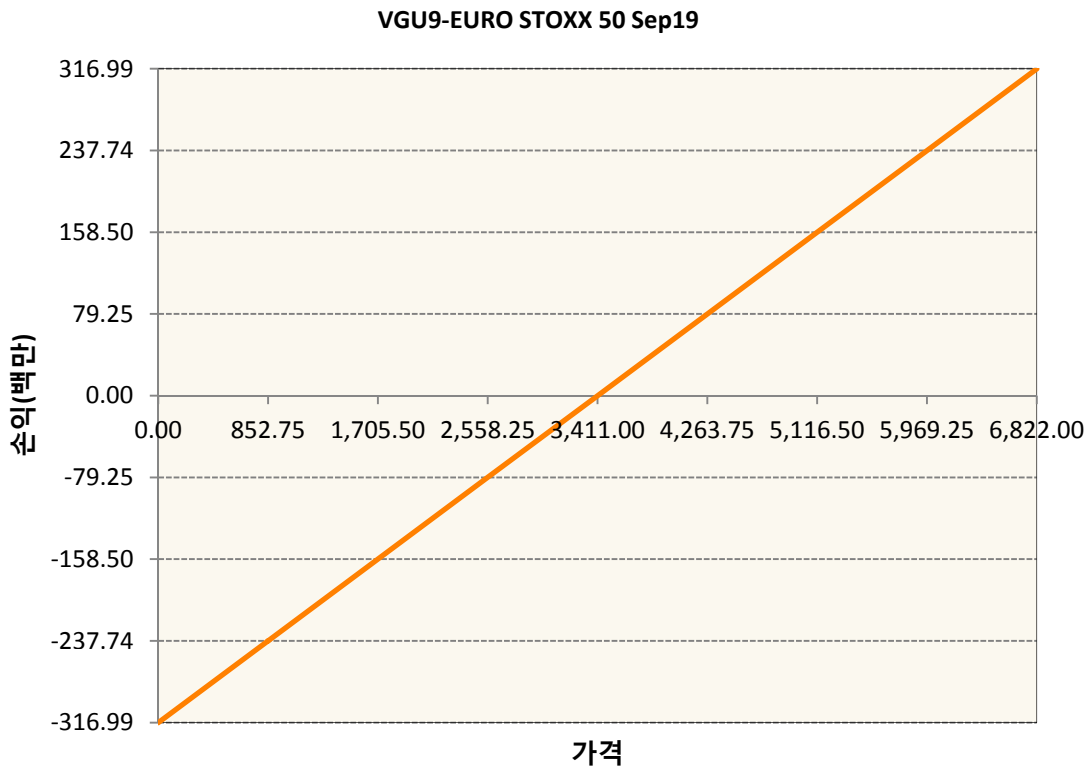
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	317	0	317	

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU9	EURO STOXX 50 Sep19	25
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

<b>18</b>
-----------

공시일	2019-09-02
기준일	2019-08-30

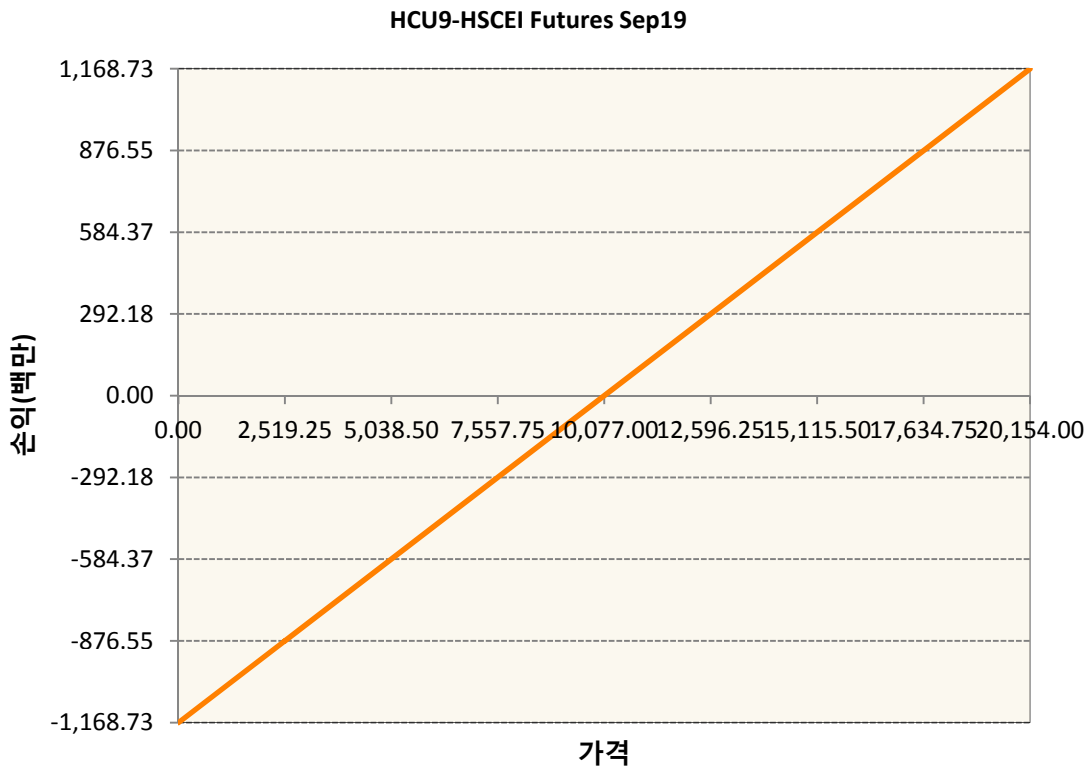
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,169	0	1,169	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU9	HSCEI Futures Sep19	93
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

87
----

공시일	2019-09-02
기준일	2019-08-30

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

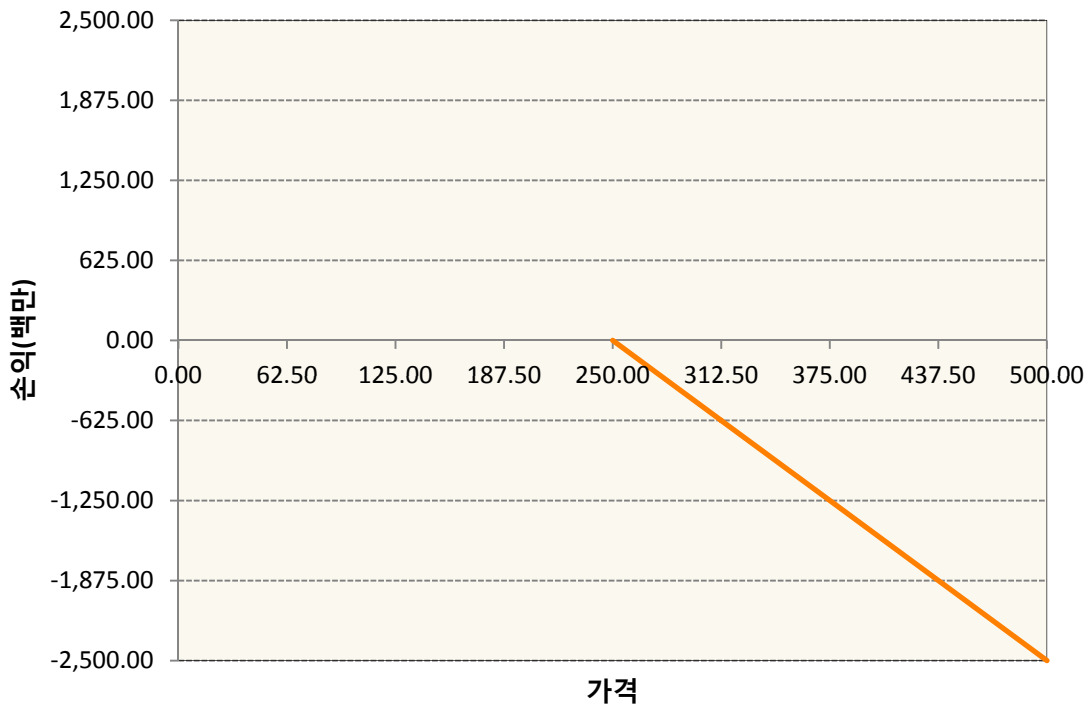
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

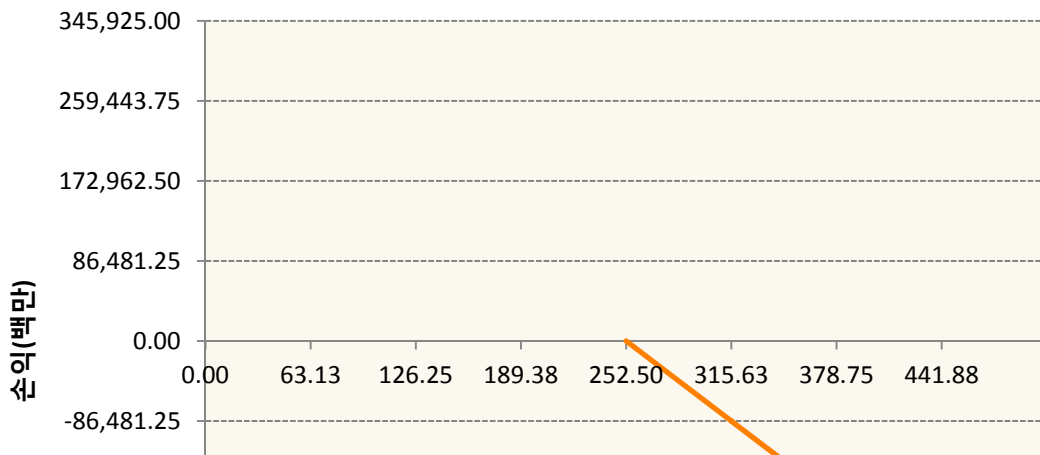
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	4,899	0	4,899	장내
누계	유가증권	옵션	0	515,519	-515,519	장내

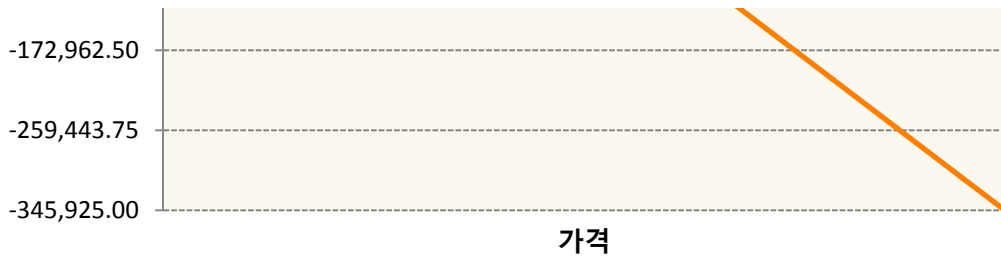
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P92500-2019-09 콜250

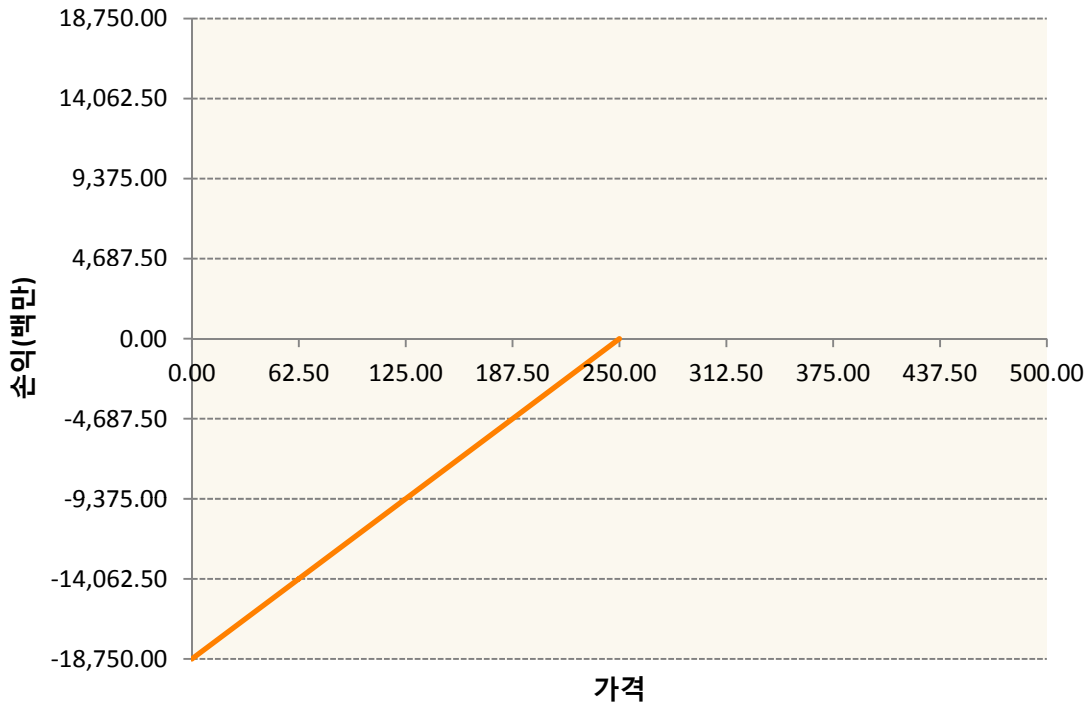


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

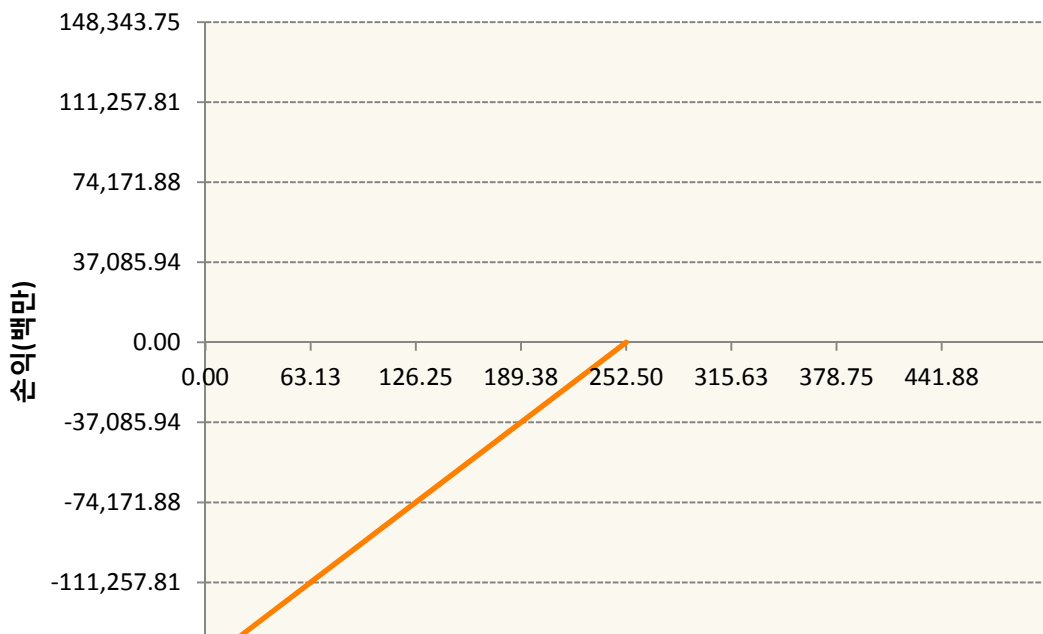




**KR4301P92508-2019-09 풋250**



**KR4301P92524-2019-09 풋252.5**



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P92500		2019-09 콜250						194
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	100	99	97	95	93	91	88	
-5.33%	89	86	82	79	76	72	69	
-2.67%	59	55	51	48	44	40	37	
0%	8	5	3	0	-3	-6	-9	
2.67%	-56	-57	-58	-59	-61	-63	-65	
5.33%	-124	-124	-125	-125	-126	-127	-128	
8.00%	-193	-193	-193	-193	-193	-194	-194	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5						25,816
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	11,376	11,249	11,086	10,889	10,663	10,409	10,131	
-5.33%	10,395	10,041	9,663	9,267	8,855	8,431	7,997	
-2.67%	7,291	6,779	6,267	5,755	5,242	4,730	4,217	
0%	1,267	862	438	0	-450	-910	-1,377	
2.67%	-6,960	-7,144	-7,367	-7,624	-7,910	-8,223	-8,559	
5.33%	-16,134	-16,185	-16,262	-16,368	-16,504	-16,669	-16,862	
8.00%	-25,548	-25,557	-25,575	-25,607	-25,656	-25,725	-25,816	
KR4301P92508		2019-09 풋250						884
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-854	-857	-860	-864	-870	-876	-884	
-5.33%	-378	-391	-405	-419	-434	-450	-466	
-2.67%	-70	-88	-106	-124	-143	-161	-179	
0%	23	17	9	0	-10	-21	-33	
2.67%	34	34	32	30	27	24	19	
5.33%	35	35	35	34	34	33	32	
8.00%	35	35	35	35	35	35	34	
KR4301P92524		2019-09 풋252.5						8,040
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-7,905	-7,912	-7,925	-7,943	-7,968	-8,001	-8,040	
-5.33%	-3,989	-4,055	-4,131	-4,217	-4,309	-4,408	-4,512	
-2.67%	-977	-1,124	-1,272	-1,419	-1,567	-1,714	-1,862	
0%	285	198	103	0	-109	-223	-342	
2.67%	500	485	462	431	391	343	287	

5.33%	513	512	510	506	498	486	470
8.00%	513	513	513	513	512	510	507

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

(단위:백만원)

**36,538**

공시일	2019-09-02
기준일	2019-08-30

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

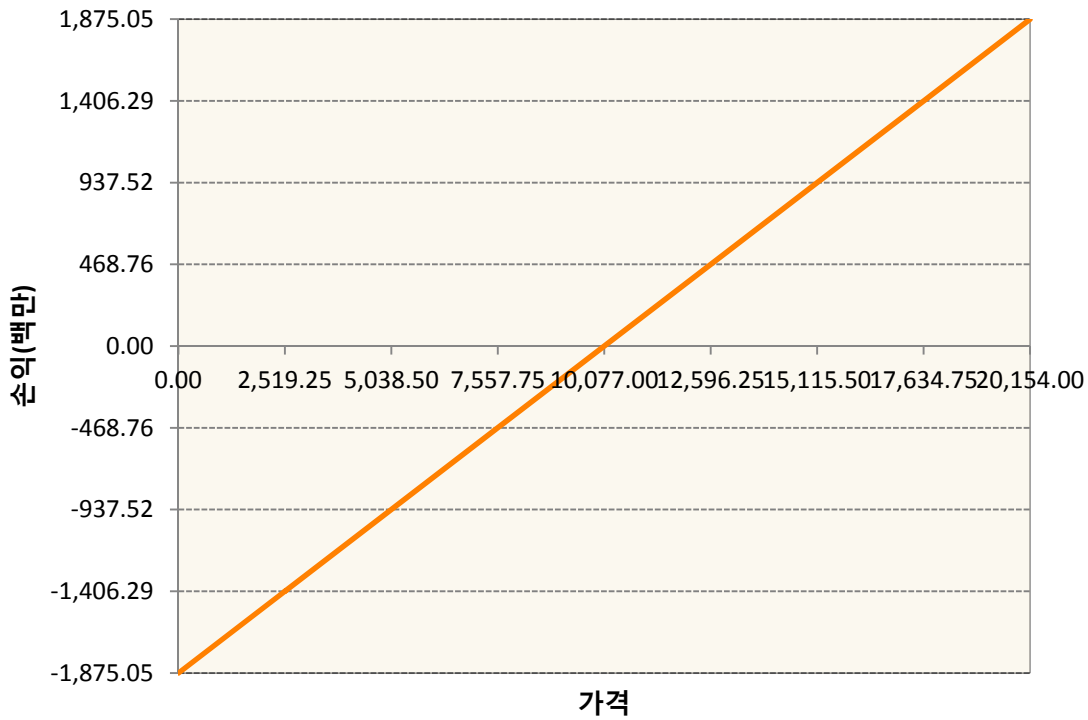
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

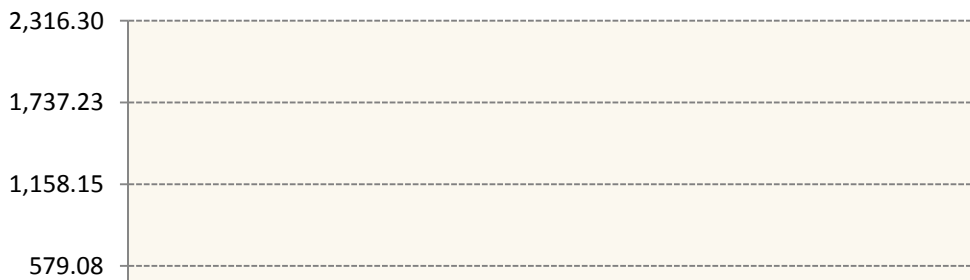
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,875	0	1,875	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,938	-4,938	장내
누계	통화	선도	0	2,869	-2,869	장외

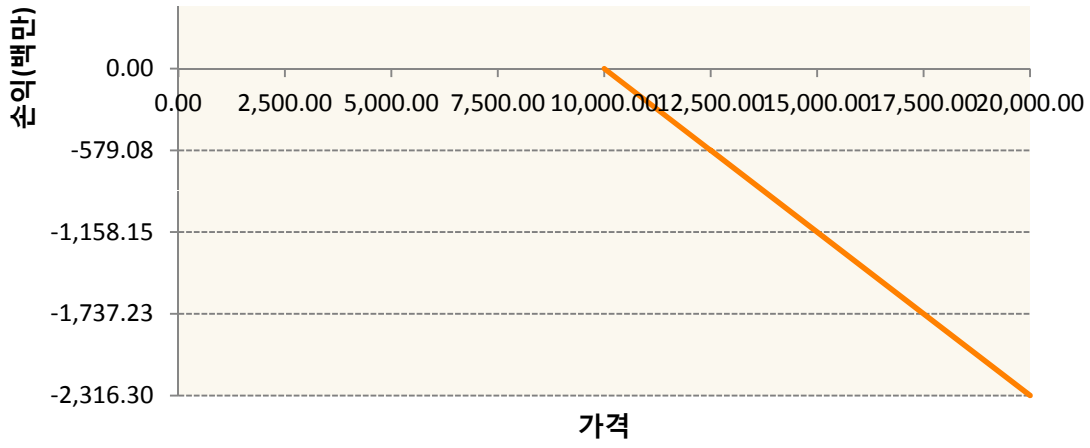
### 2. 만기시점의 손익구조

HCU9-HSCEI Futures Sep19

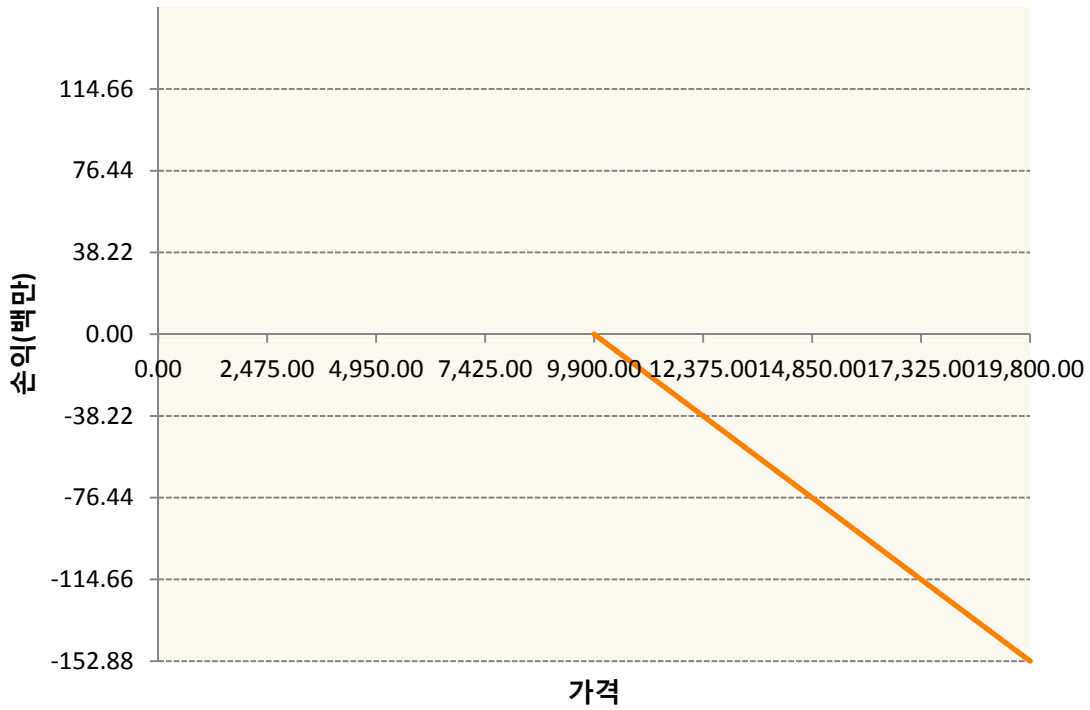


OHHIU9-C100-HSCEI

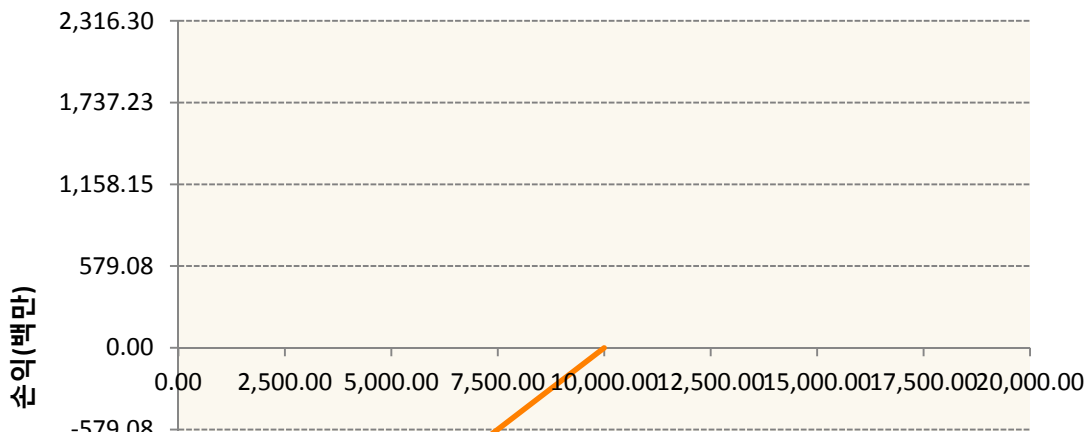


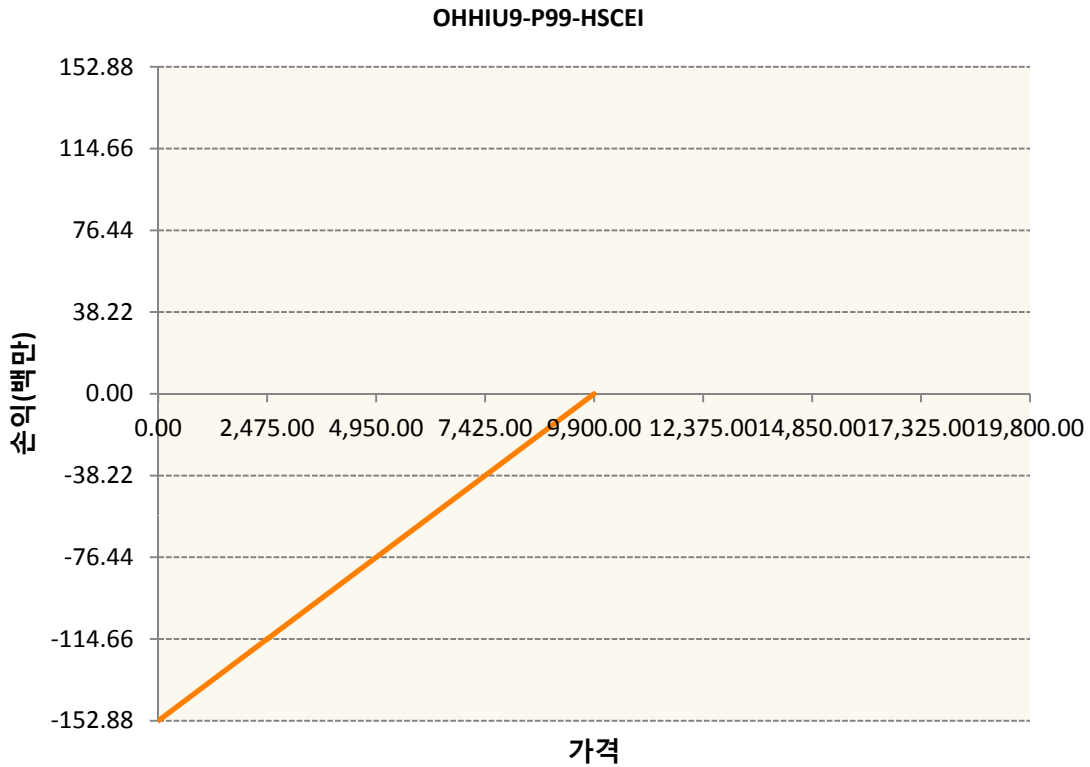


OHHIU9-C99-HSCEI



OHHIU9-P100-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	230
HCU9 HSCEI Futures Sep19	150
OHHIU9-C1( HSCEI	185
OHHIU9-C9( HSCEI	12
OHHIU9-P1( HSCEI	185
OHHIU9-P9( HSCEI	12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	<b>580</b>

공시일	2019-09-02
기준일	2019-08-30

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

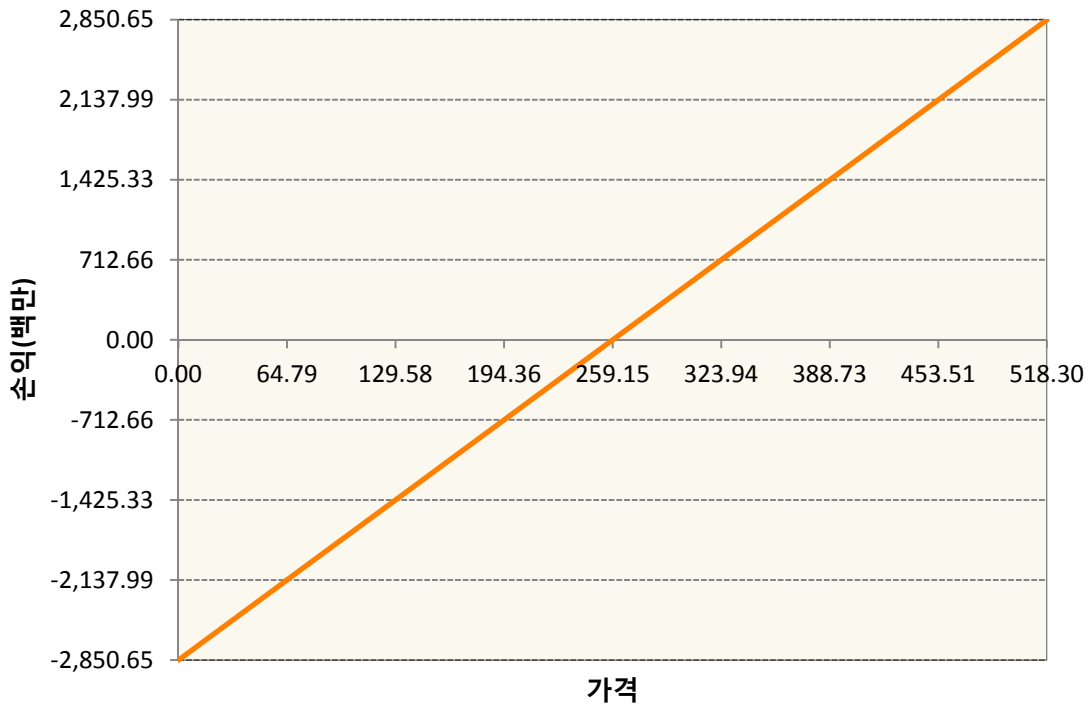
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

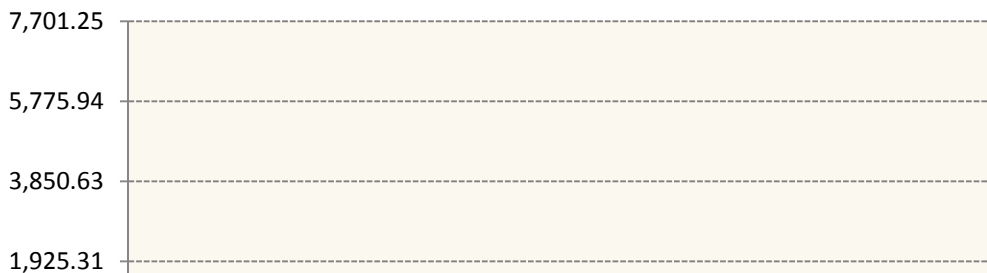
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,851	0	2,851	장내
누계	유가증권	스왑	14,125	0	14,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,829	-14,829	장내

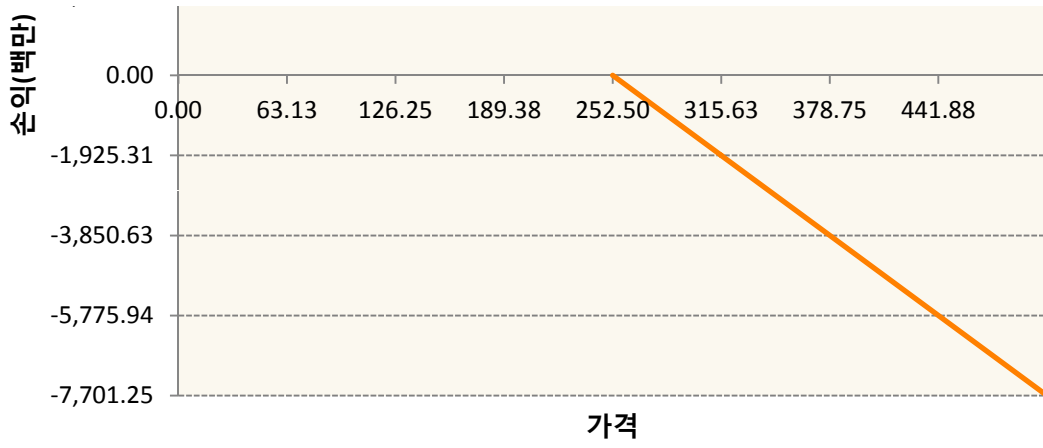
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

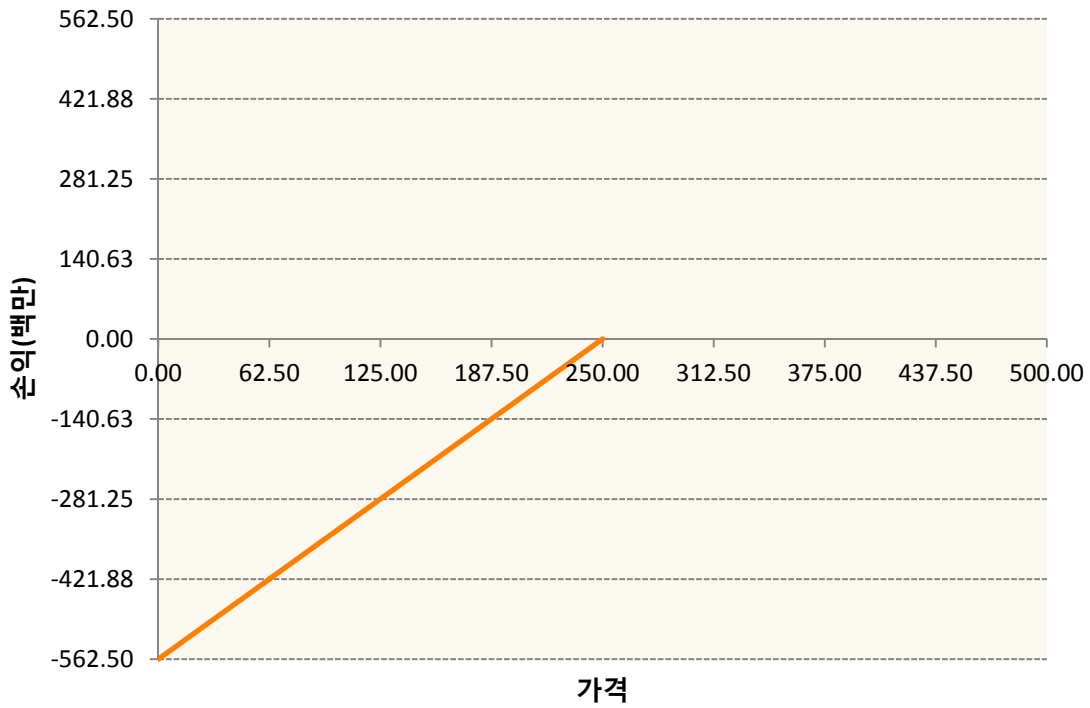


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

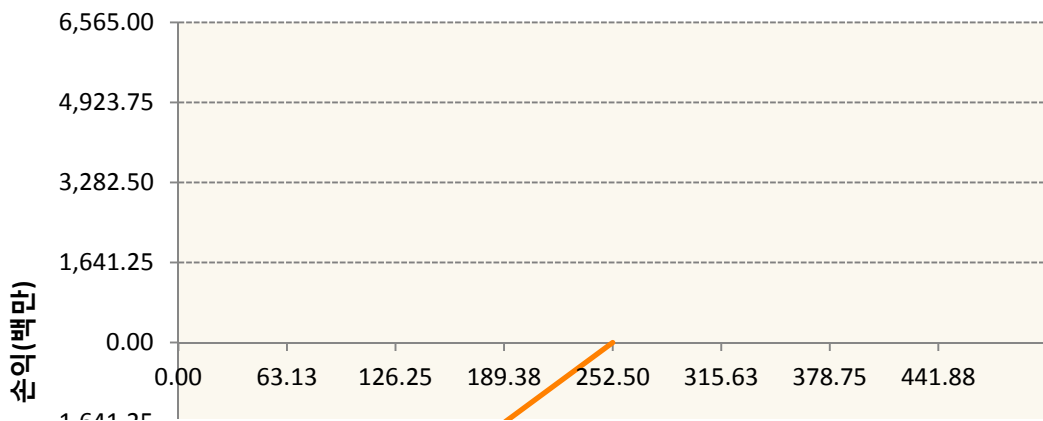




**KR4301P92508-2019-09 풋250**



**KR4301P92524-2019-09 풋252.5**





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						1,226
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,226	-1,226	-1,226	-1,226	-1,226	-1,226	-1,226	
-5.33%	-817	-817	-817	-817	-817	-817	-817	
-2.67%	-409	-409	-409	-409	-409	-409	-409	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	409	409	409	409	409	409	409	
5.33%	817	817	817	817	817	817	817	
8.00%	1,226	1,226	1,226	1,226	1,226	1,226	1,226	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						228
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-228	-228	-228	-228	-228	-228	-228	
-5.33%	-152	-152	-152	-152	-152	-152	-152	
-2.67%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	76	76	76	76	76	76	76	
5.33%	152	152	152	152	152	152	152	
8.00%	228	228	228	228	228	228	228	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5						575
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	253	250	247	242	237	232	226	
-5.33%	231	224	215	206	197	188	178	
-2.67%	162	151	140	128	117	105	94	
0%	28	19	10	0	-10	-20	-31	
2.67%	-155	-159	-164	-170	-176	-183	-191	
5.33%	-359	-360	-362	-364	-367	-371	-375	
8.00%	-569	-569	-569	-570	-571	-573	-575	
KR4301P92508		2019-09 풋250						27
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-27
-5.33%	-11	-12	-12	-13	-13	-14	-14
-2.67%	-2	-3	-3	-4	-4	-5	-5
0%	1	1	0	0	0	-1	-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							356
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-350	-350	-351	-352	-353	-354	-356
-5.33%	-177	-179	-183	-187	-191	-195	-200
-2.67%	-43	-50	-56	-63	-69	-76	-82
0%	13	9	5	0	-5	-10	-15
2.67%	22	21	20	19	17	15	13
5.33%	23	23	23	22	22	22	21
8.00%	23	23	23	23	23	23	22

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

(단위:백만원)

**2,396**

공시일	2019-09-02
기준일	2019-08-30

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

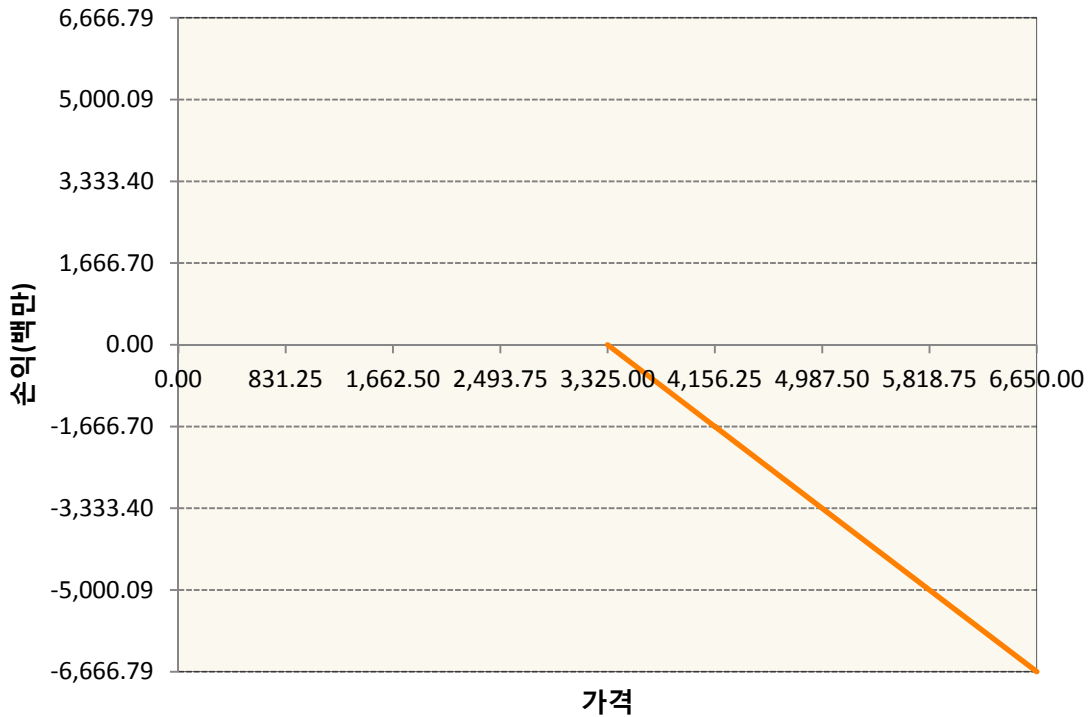
### 1. 계약금액

(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	3	-3	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,383	0	5,383	
누계	유가증권	옵션	0	16,020	-16,020	장내
누계	지수	스왑	24,323	0	24,323	장외
누계	통화	선도	9,089	17,377	-8,287	장외

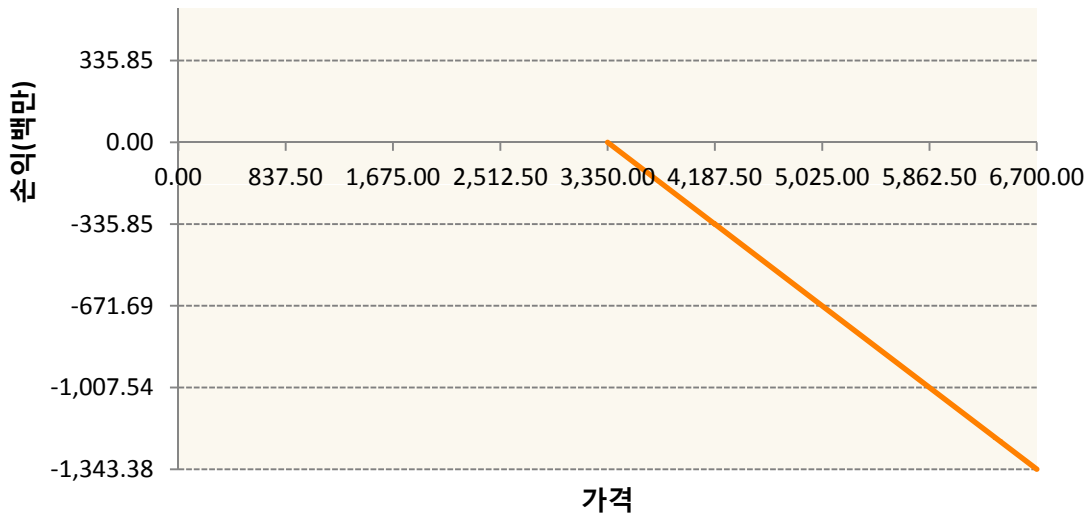
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXU9-C3325-EURO STOXX 50

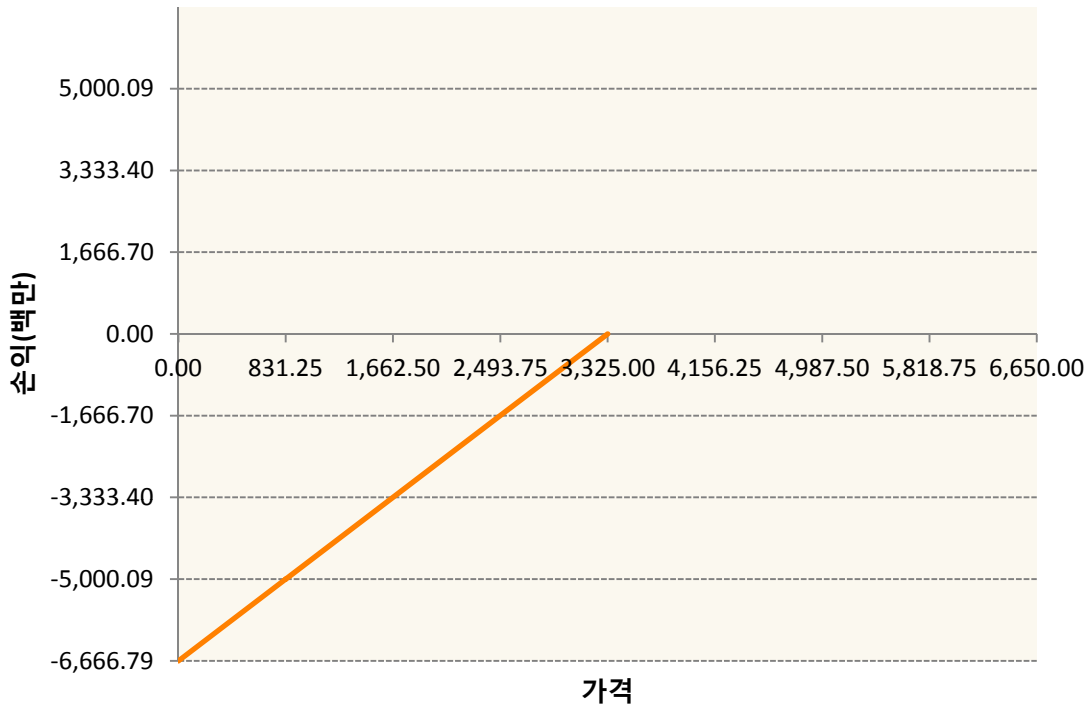


OESXU9-C3350-EURO STOXX 50

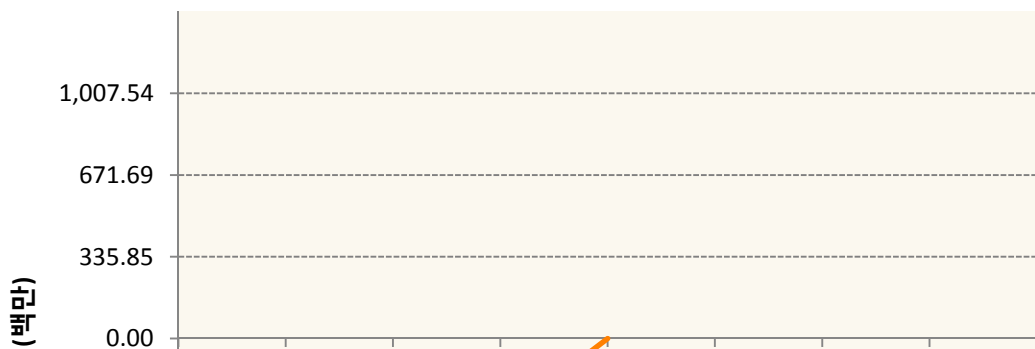


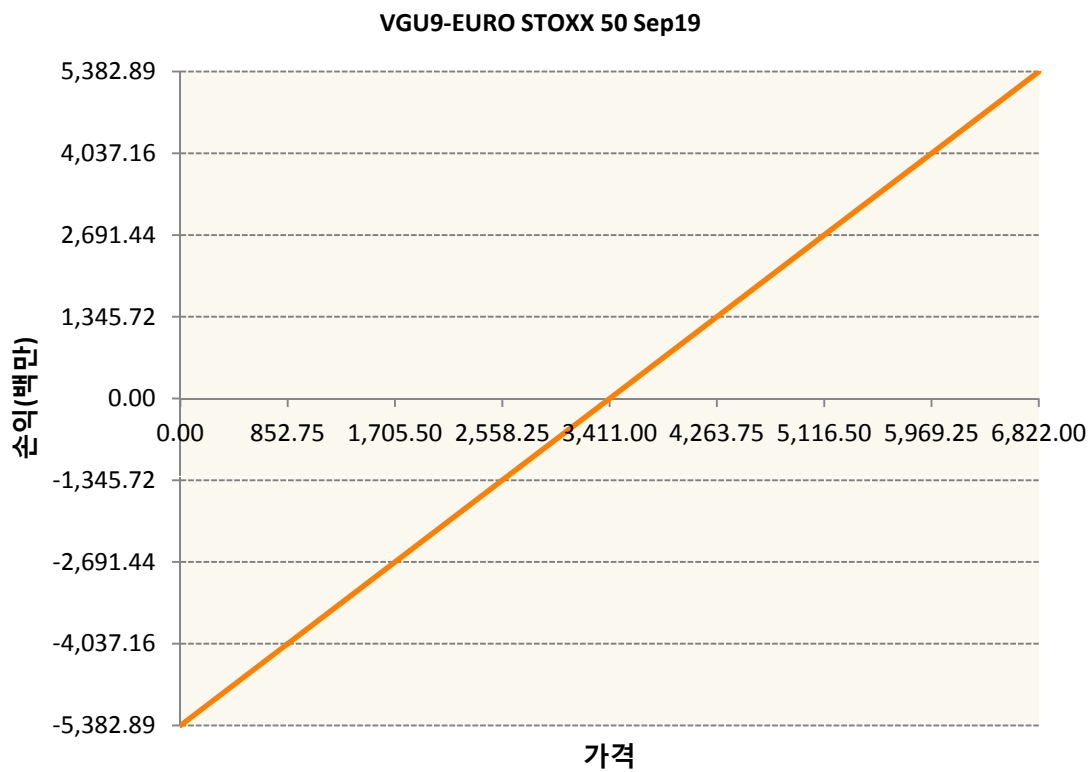
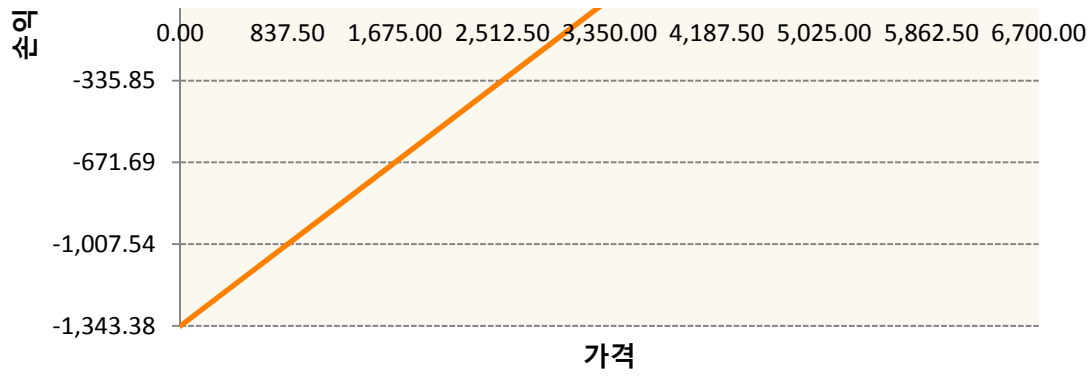


OESXU9-P3325-EURO STOXX 50



OESXU9-P3350-EURO STOXX 50





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	35
FX21019M0< KRW/EUR 27-09-19E	1,069
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	321
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E	321
FX21019N04 EUR/KRW 27-09-19E	235
FX21019Q00 EUR/KRW 27-09-19E	171
OESXU9-C3< EURO STOXX 50	533
OESXU9-C3< EURO STOXX 50	107
OESXU9-P3< EURO STOXX 50	533
OESXU9-P3< EURO STOXX 50	107
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	431

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

(단위:백만원)

2,235



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

(단위:백만원)

934



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

(단위:백만원)

80



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

(단위:백만원)

125

공시일	2019-09-02
기준일	2019-08-30

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

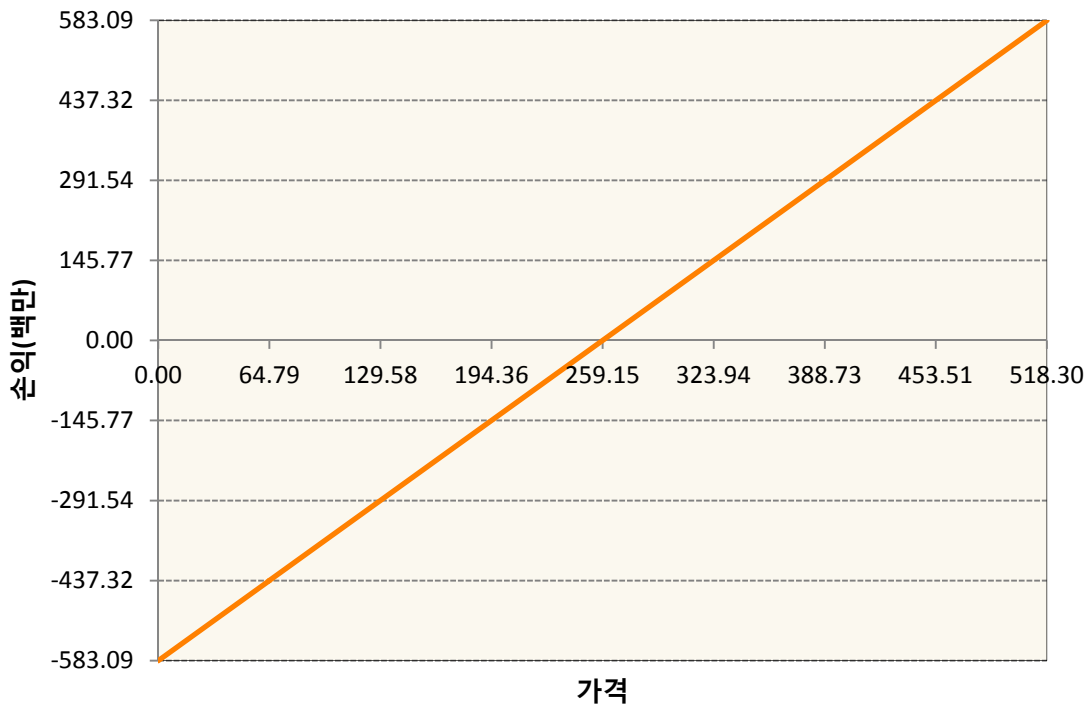
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	583	0	583	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						47
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47	
-5.33%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31	
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	16	16	16	16	16	16	16	
5.33%	31	31	31	31	31	31	31	
8.00%	47	47	47	47	47	47	47	

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

(단위:백만원)

40

공시일	2019-09-02
기준일	2019-08-30

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

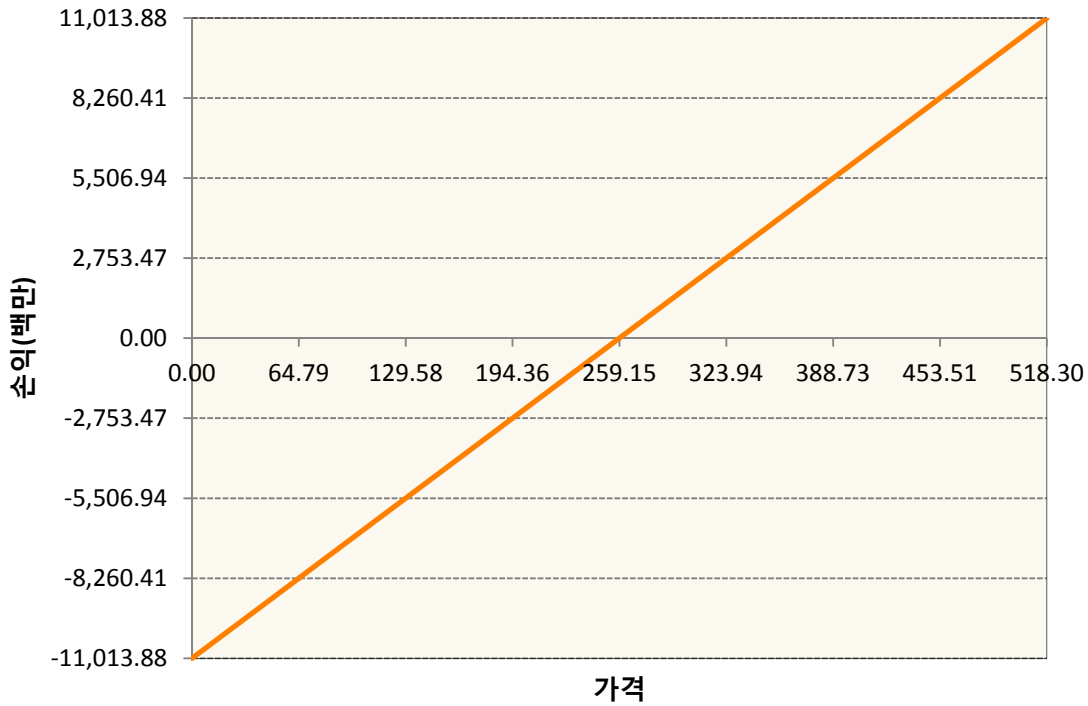
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

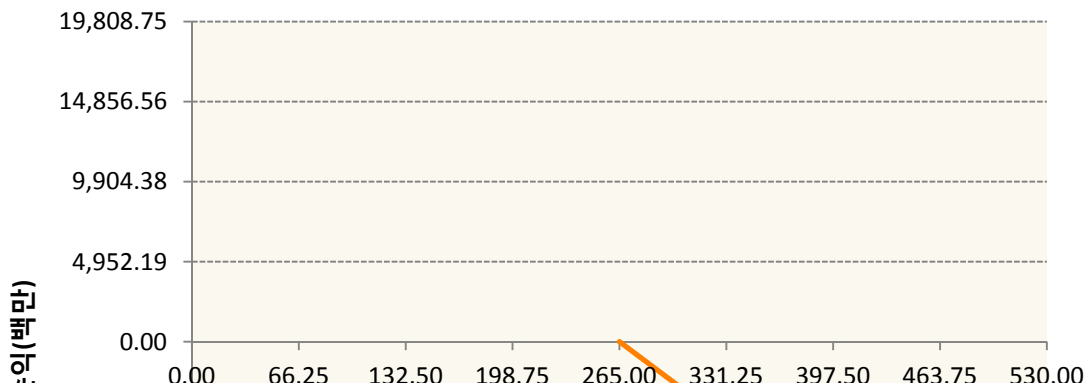
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,014	0	11,014	장내
누계	유가증권	옵션	3,659	19,943	-16,283	장내

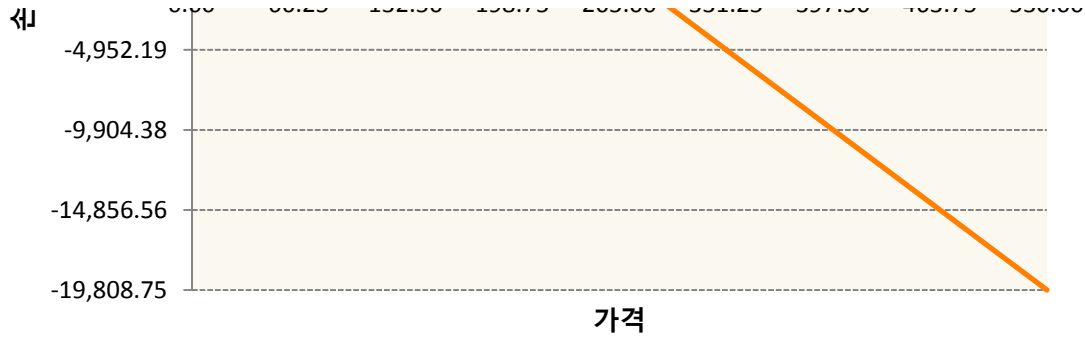
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

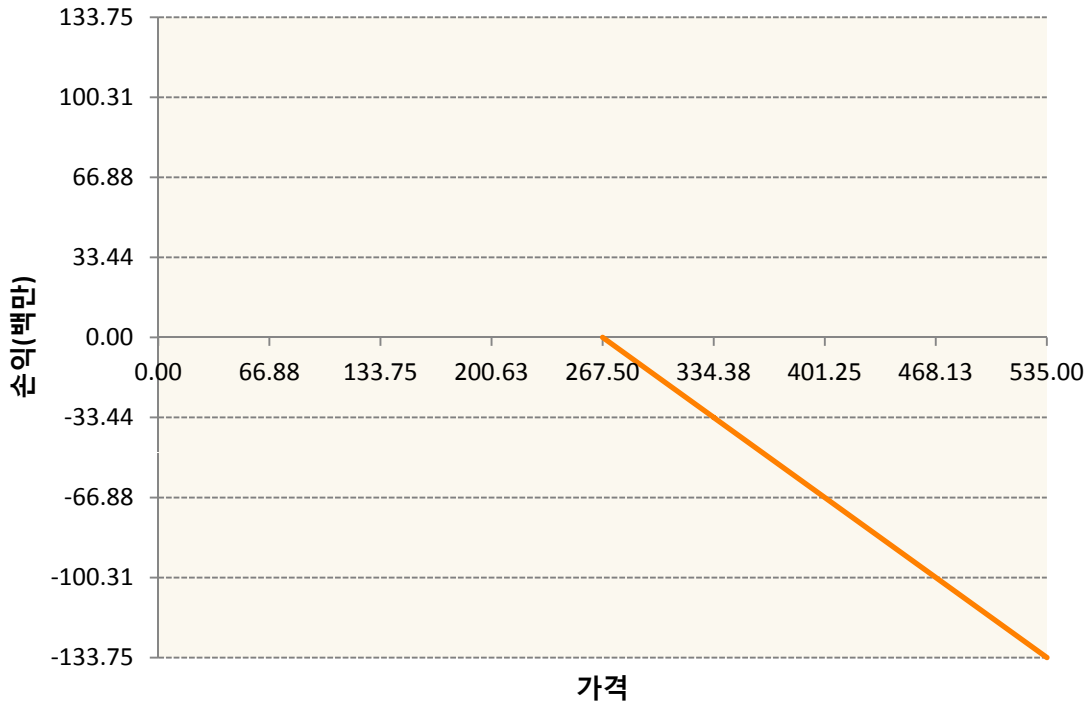


KR4201P92658-2019-09 콜265

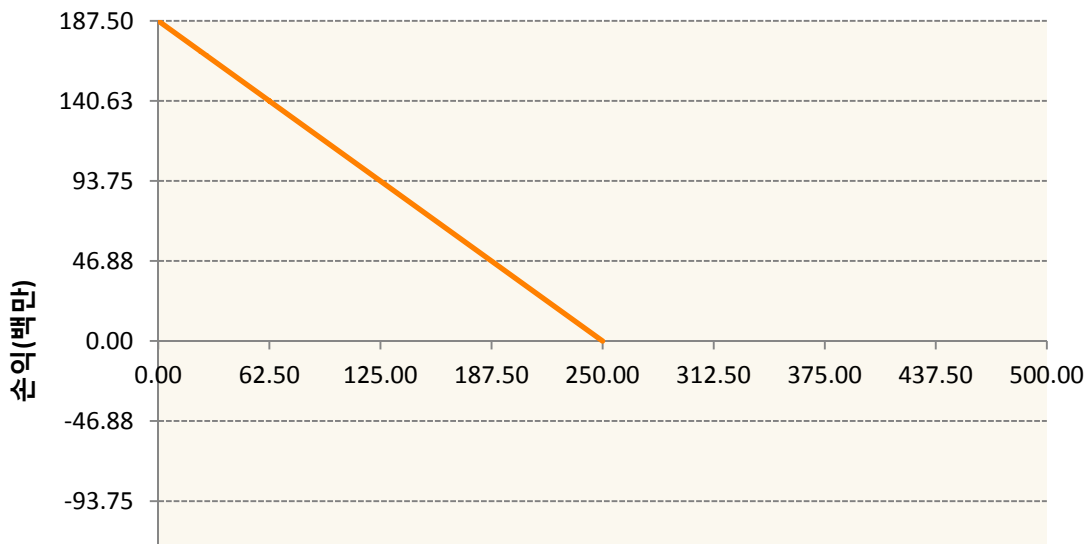


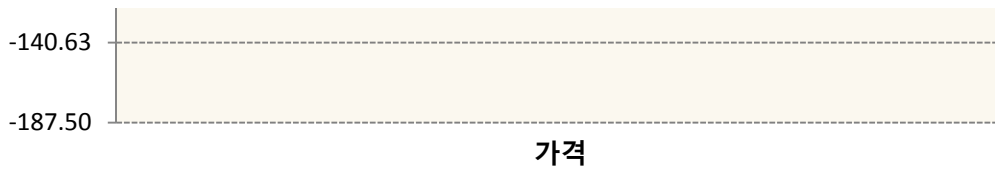


KR4201P92674-2019-09 콜267.5

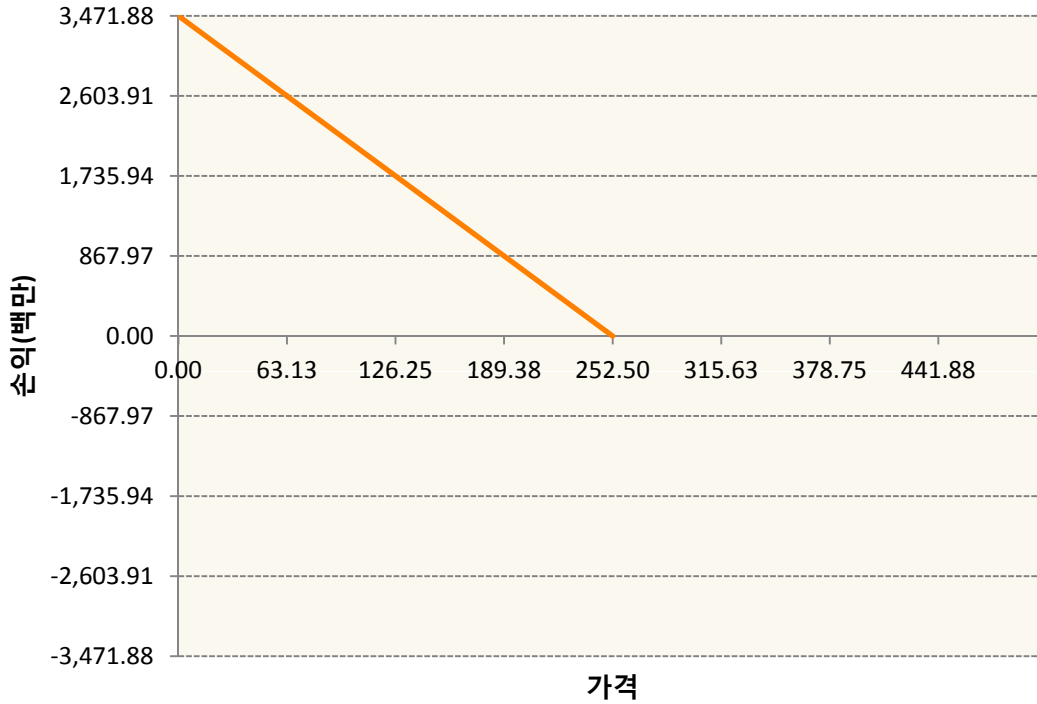


KR4301P92508-2019-09 풋250





KR4301P92524-2019-09 풋252.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						881
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-881	-881	-881	-881	-881	-881	-881	
-5.33%	-587	-587	-587	-587	-587	-587	-587	
-2.67%	-294	-294	-294	-294	-294	-294	-294	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	294	294	294	294	294	294	294	
5.33%	587	587	587	587	587	587	587	
8.00%	881	881	881	881	881	881	881	
KR4201P92658		2019-09 콜265						1,026
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	167	166	166	165	163	160	156	
-5.33%	165	162	158	153	146	138	128	
-2.67%	148	138	125	111	95	78	59	

0%	73	49	25	0	-26	-52	-78
2.67%	-129	-158	-187	-217	-246	-275	-305
5.33%	-481	-503	-526	-549	-574	-599	-625
8.00%	-939	-949	-961	-975	-990	-1,007	-1,026
KR4201P92674                      2019-09 콜267.5							6
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1
-2.67%	1	1	1	1	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-2	-2
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-4
8.00%	-5	-6	-6	-6	-6	-6	-6
KR4301P92508                      2019-09 풋250							9
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9	9	9	9	9	9	9
-5.33%	4	4	4	4	4	5	5
-2.67%	1	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
KR4301P92524                      2019-09 풋252.5							188
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	185	185	185	186	186	187	188
-5.33%	93	95	97	99	101	103	106
-2.67%	23	26	30	33	37	40	44
0%	-7	-5	-2	0	3	5	8
2.67%	-12	-11	-11	-10	-9	-8	-7
5.33%	-12	-12	-12	-12	-12	-11	-11
8.00%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12

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

(단위:백만원)

**1,800**

공시일	2019-09-02
기준일	2019-08-30

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,817	0	1,817	
누계	유가증권	수익증권	72,741	0	72,741	

### 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	2019-09-02
기준일	2019-08-30

## 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	91,056	0	91,056	

### 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	2019-09-02
기준일	2019-08-30

## 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	474,623	0	474,623	
누계	통화	선도	0	468,856	-468,856	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 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		969
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E		1,744
FX21019Q04 KRW/USD 30-09-19E		194

FX21019Q04 KRW/USD 24-09-19E	2,132
FX21019Q04 KRW/USD 24-09-19E	2,713
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E	194
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E	291
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E	291

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

(단위:백만원)

**12,241**

공시일	2019-09-02
기준일	2019-08-30

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

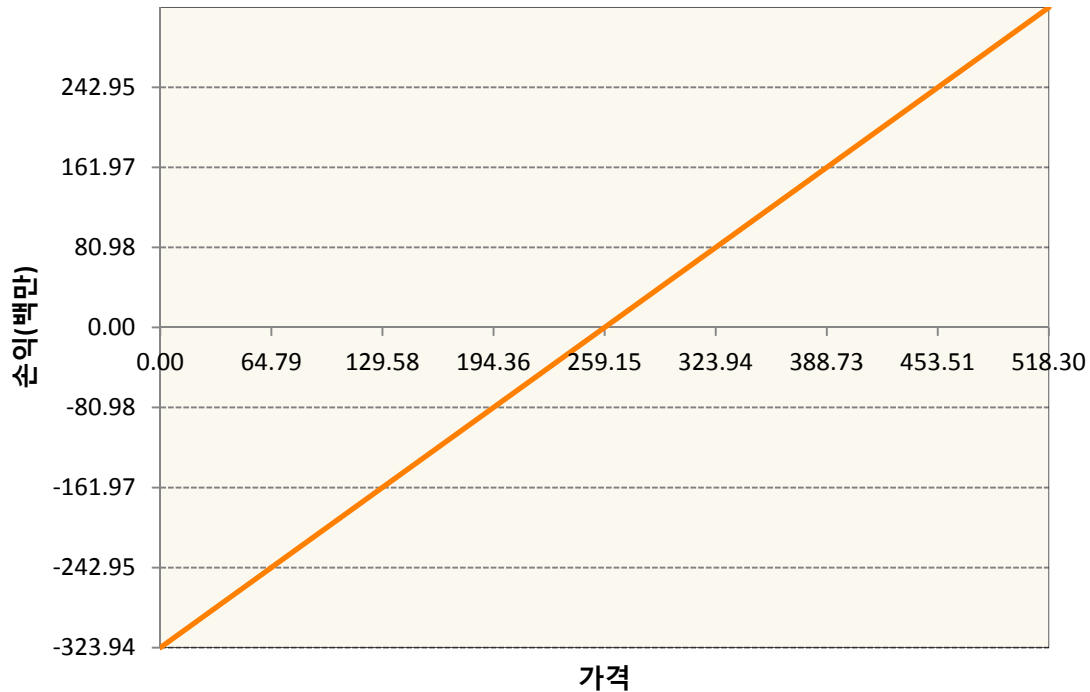
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

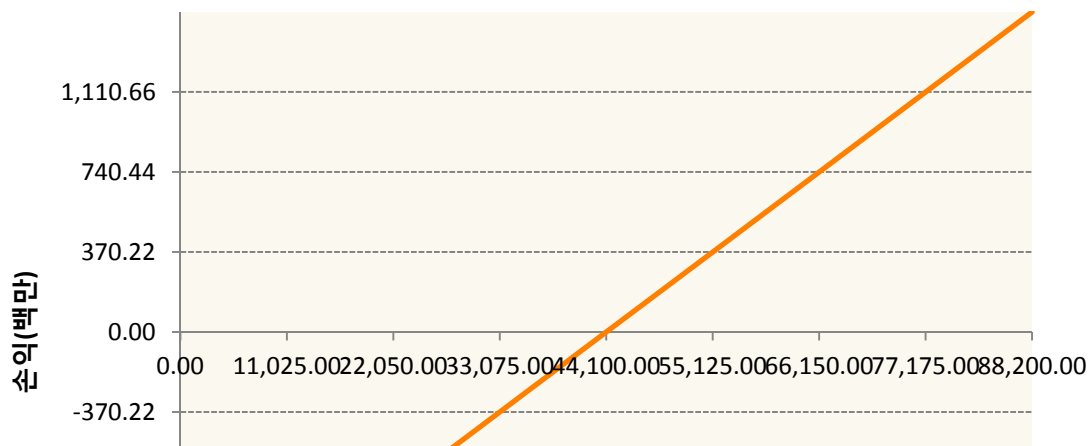
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,805	0	1,805	장내

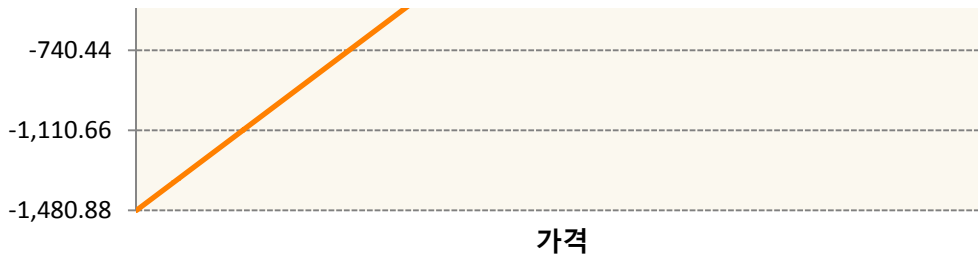
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P90000-2019-09 삼성전자개별선물





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

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						26
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26	
-5.33%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
-2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	9	9	9	9	9	9	9	
5.33%	17	17	17	17	17	17	17	
8.00%	26	26	26	26	26	26	26	
KR4111P90000		2019-09 삼성전자개별선물						118
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118	
-5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79	
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	39	39	39	39	39	39	39	
5.33%	79	79	79	79	79	79	79	
8.00%	118	118	118	118	118	118	118	

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

**166**

공시일	2019-09-02
기준일	2019-08-30

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

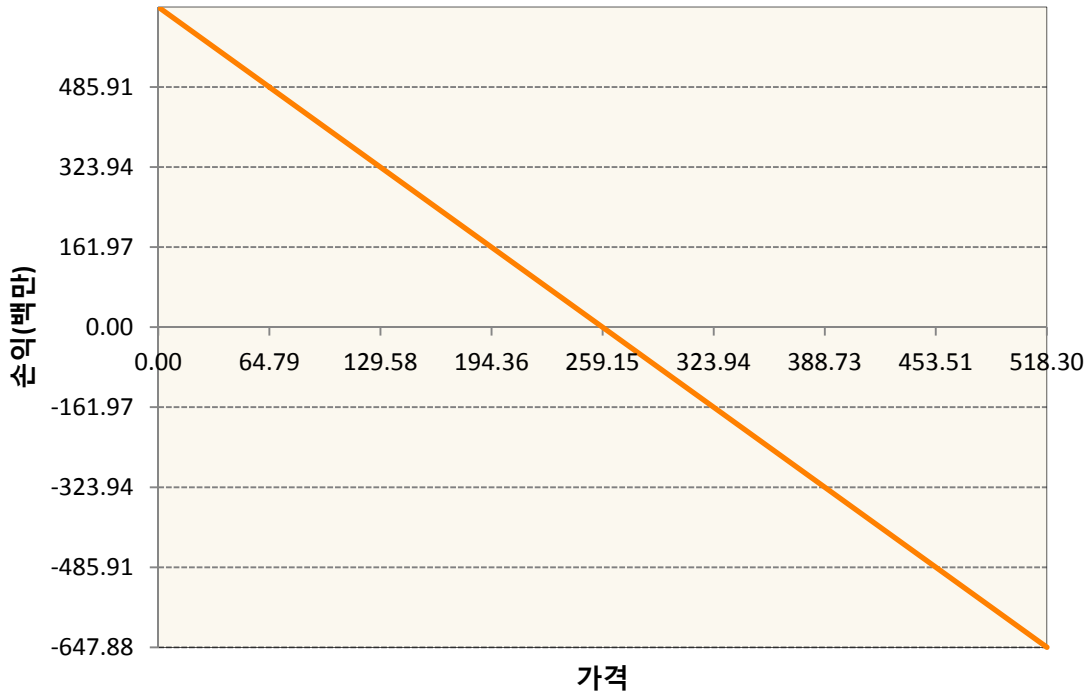
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

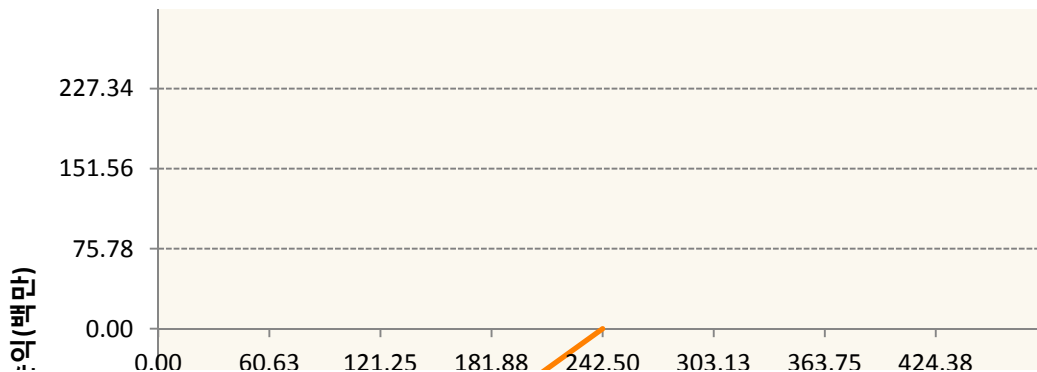
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	648	-648	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,672	-3,672	장내

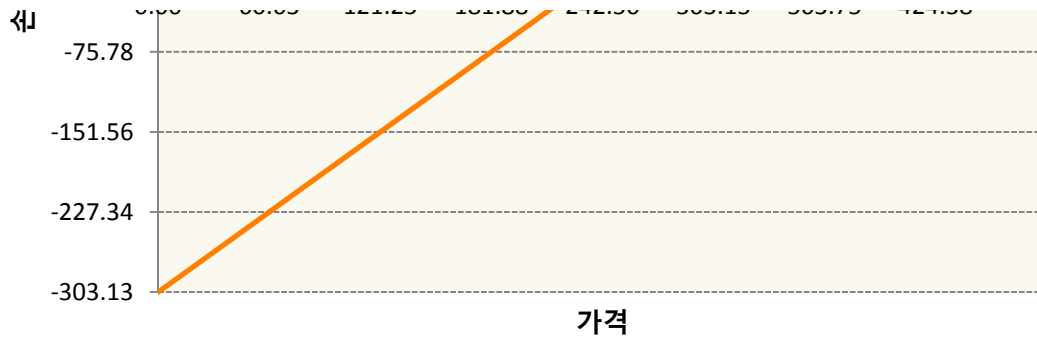
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

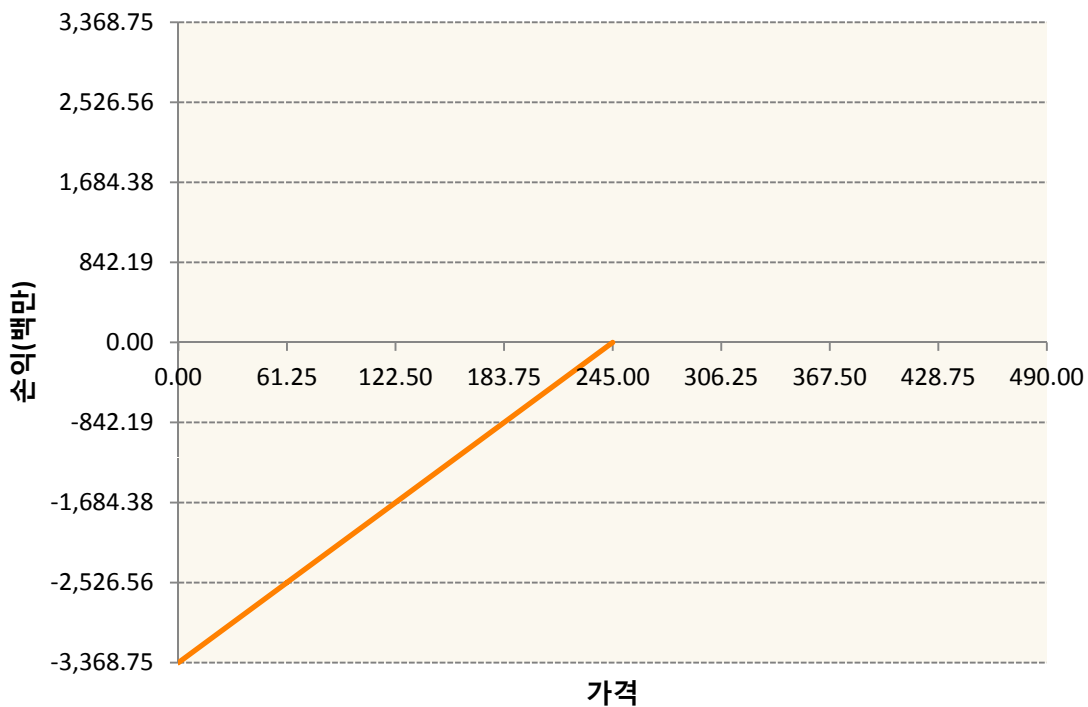


KR4301P92425-2019-09 풋242.5





KR4301P92458-2019-09 풋245



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						52
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	52	52	52	52	52	52	52	
-5.33%	35	35	35	35	35	35	35	
-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%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	
8.00%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52	
KR4301P92425		2019-09 풋242.5						8
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6	-6	-7	-7	-7	-7	-8
-5.33%	-1	-2	-2	-2	-3	-3	-3
-2.67%	0	0	0	0	-1	-1	-1
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

109

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-96	-98	-100	-102	-104	-106	-109
-5.33%	-28	-32	-35	-38	-42	-45	-49
-2.67%	-3	-4	-6	-8	-11	-13	-16
0%	1	1	1	0	-1	-2	-3
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

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

(단위:백만원)

95

공시일	2019-09-02
기준일	2019-08-30

## H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	262	-262	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	19,653	0	19,653	
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)

503
-----

공시일	2019-09-02
기준일	2019-08-30

## 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	385	0	385	장외
누계	통화	선도	93	93	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	12
FX21019N01 KRW/EUR 25-10-19E	4
FX21019Q00 KRW/EUR 25-10-19E	3
FX21019Q03 EUR/KRW 25-10-19E	7

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

(단위:백만원)

35
----

공시일	2019-09-02
기준일	2019-08-30

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

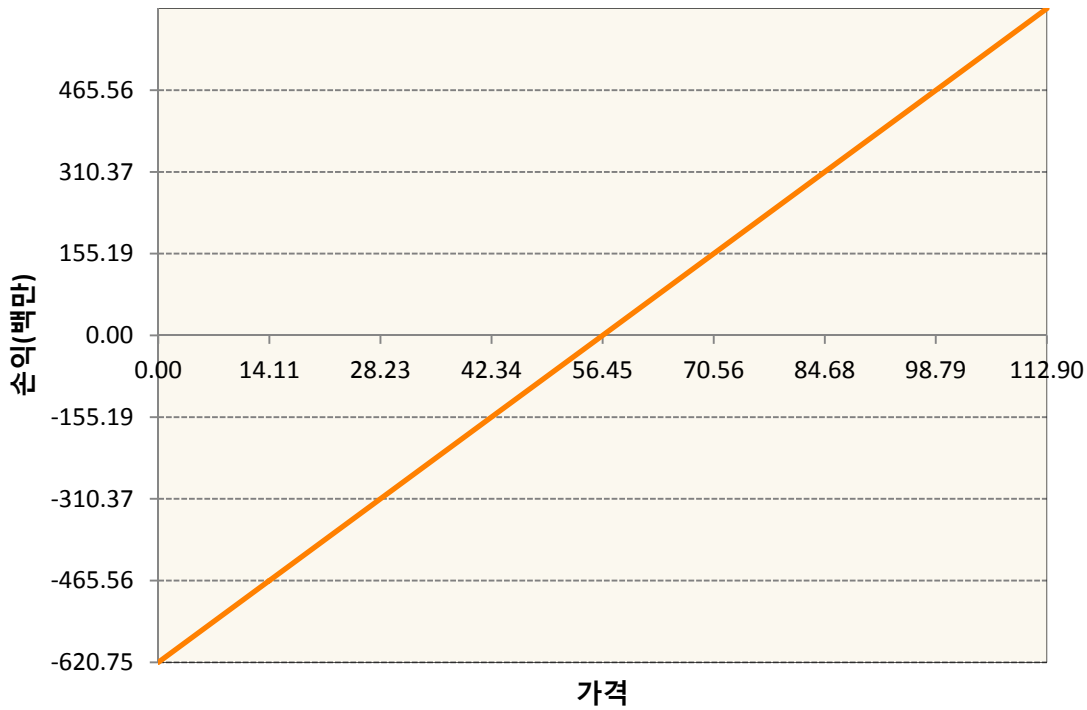
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

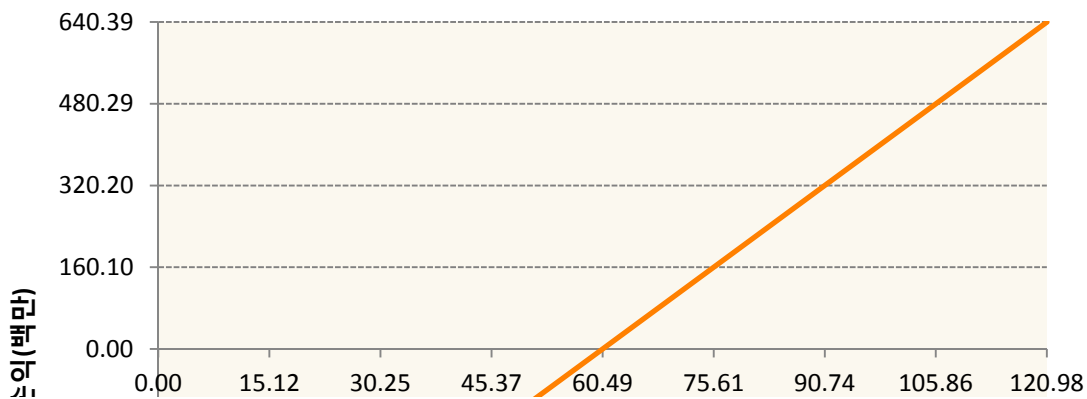
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,280	121	2,159	
누계	유가증권	선물	192	0	192	장내

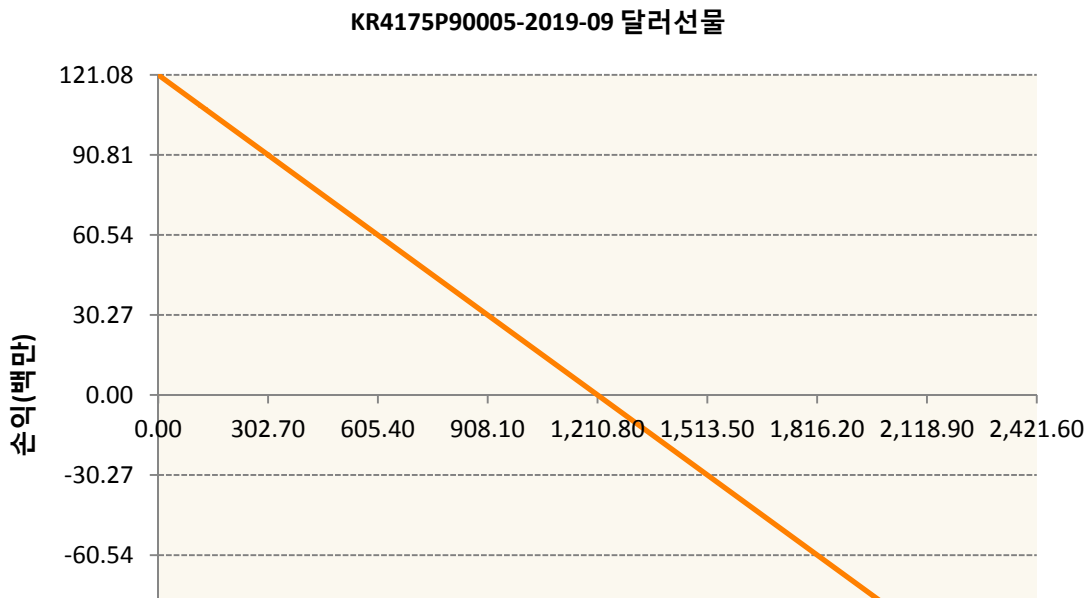
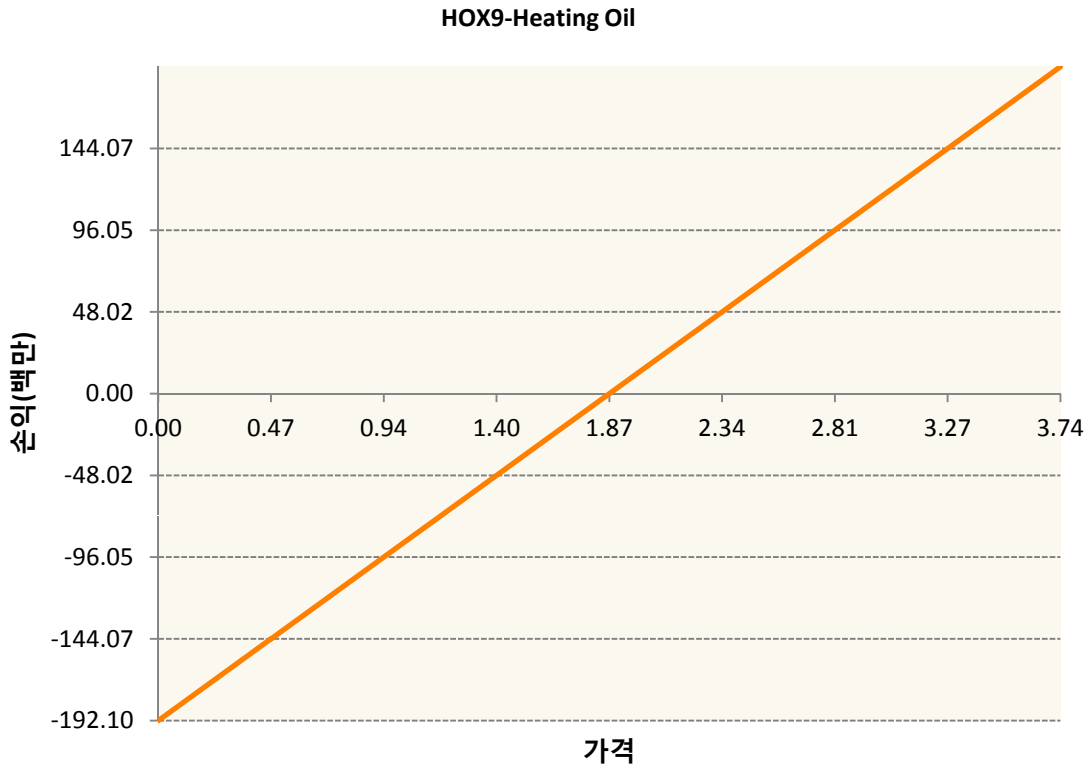
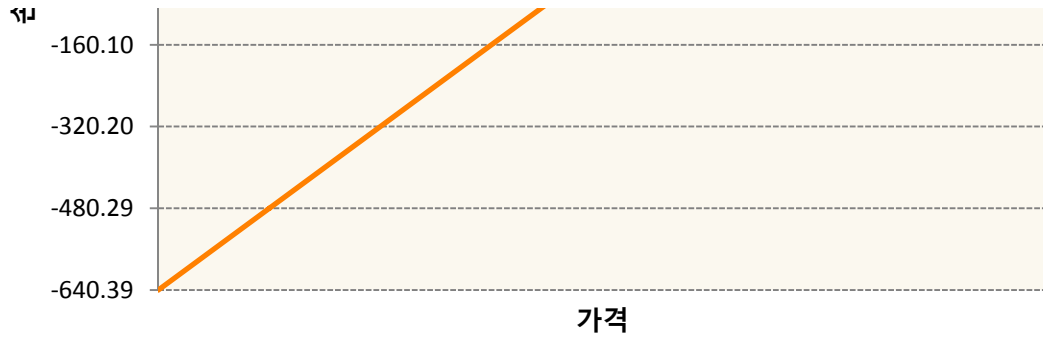
### 2. 만기시점의 손익구조

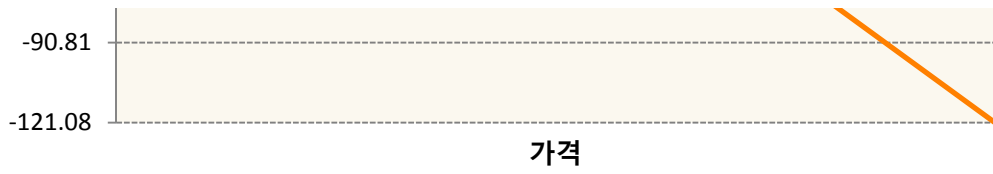
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19



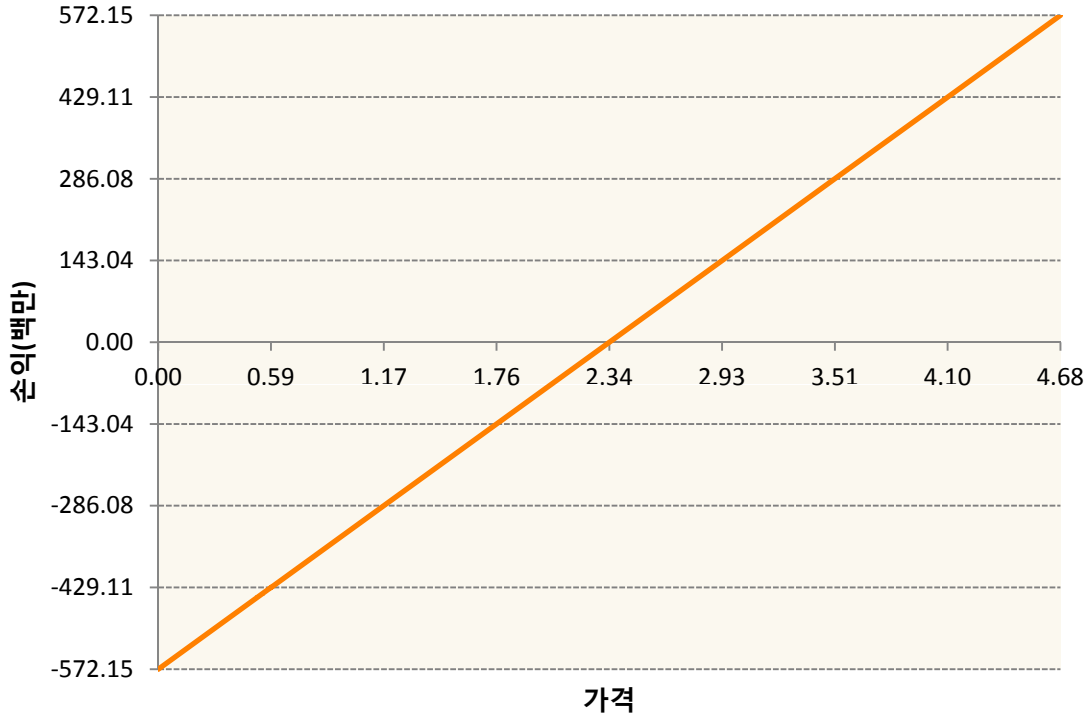
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19



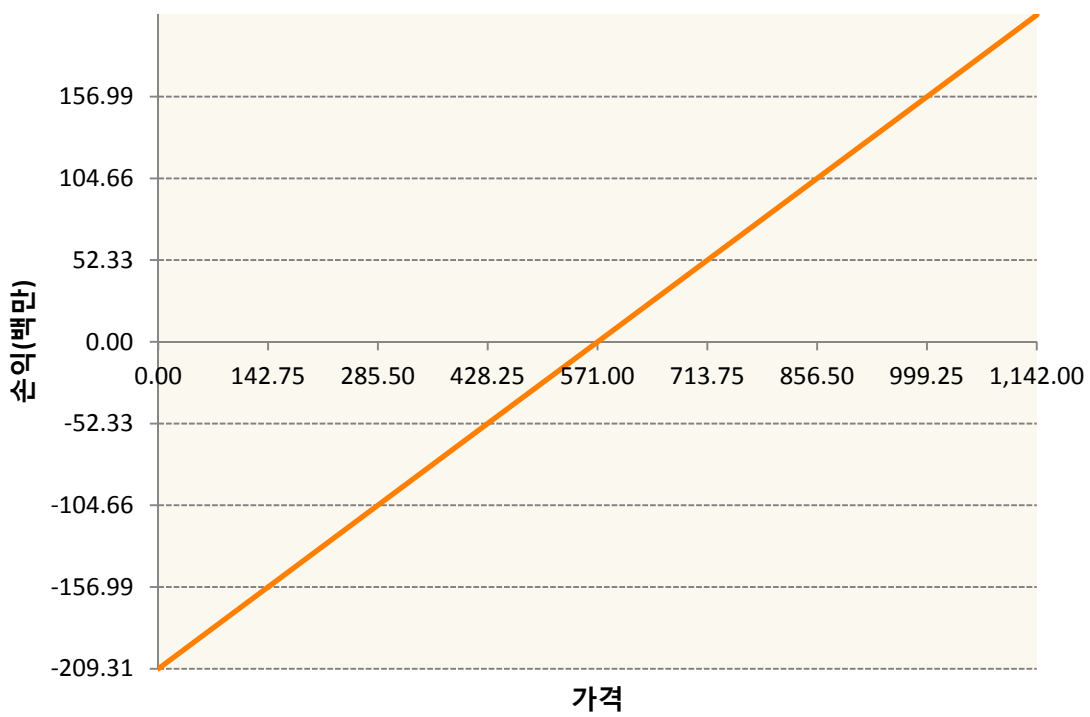


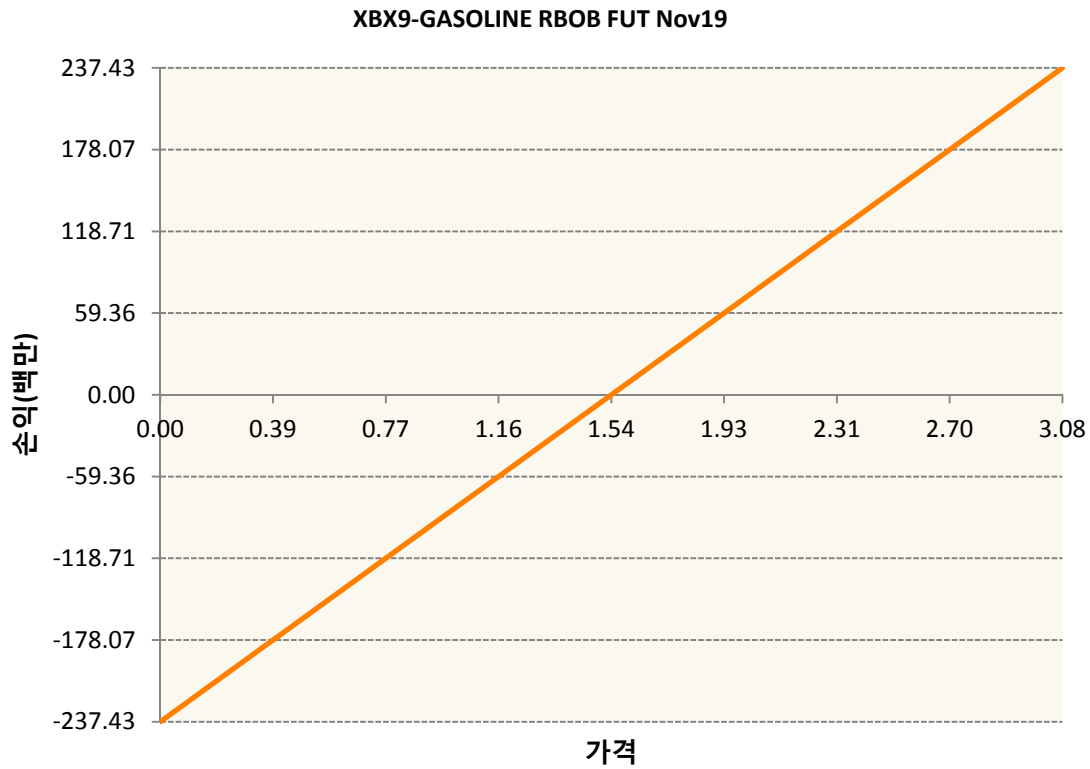


NGX19-NATURAL GAS FUTR Nov19



QSX9-Low Su Gasoil G Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX9	WTI CRUDE FUTURE Nov19	50
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	51
HOX9	Heating Oil	15
KR4175P900	2019-09 달러선물	10
NGX19	NATURAL GAS FUTR Nov19	46
QSX9	Low Su Gasoil G Nov19	17
XBX9	GASOLINE RBOB FUT Nov19	19

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	380

공시일	2019-09-02
기준일	2019-08-30

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

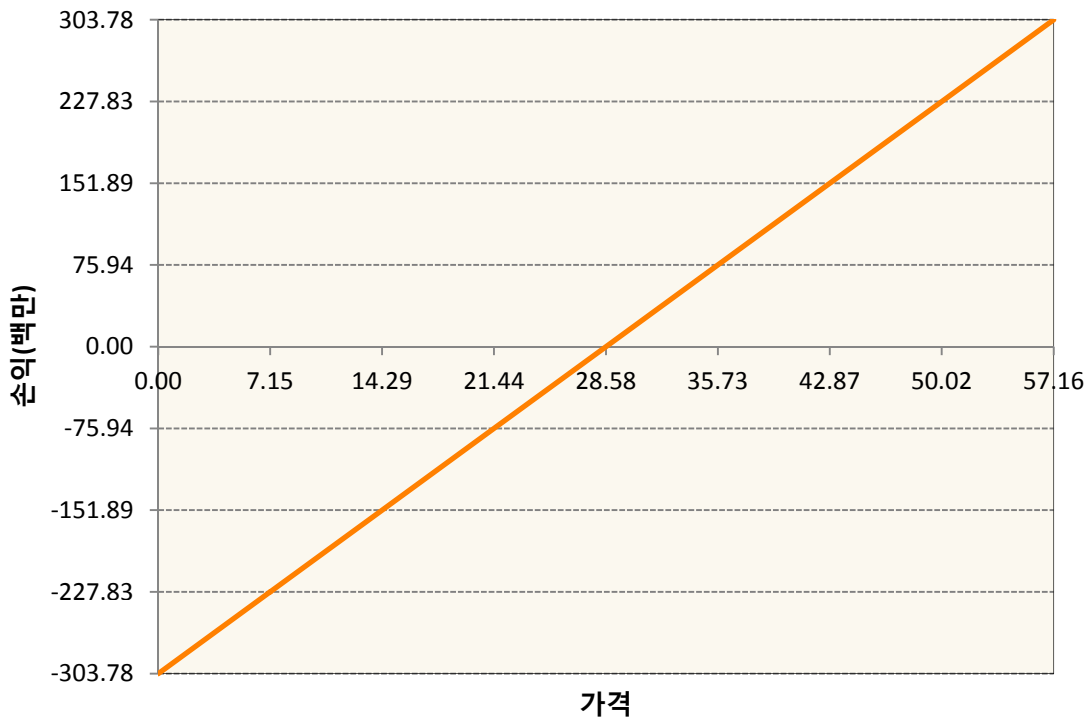
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

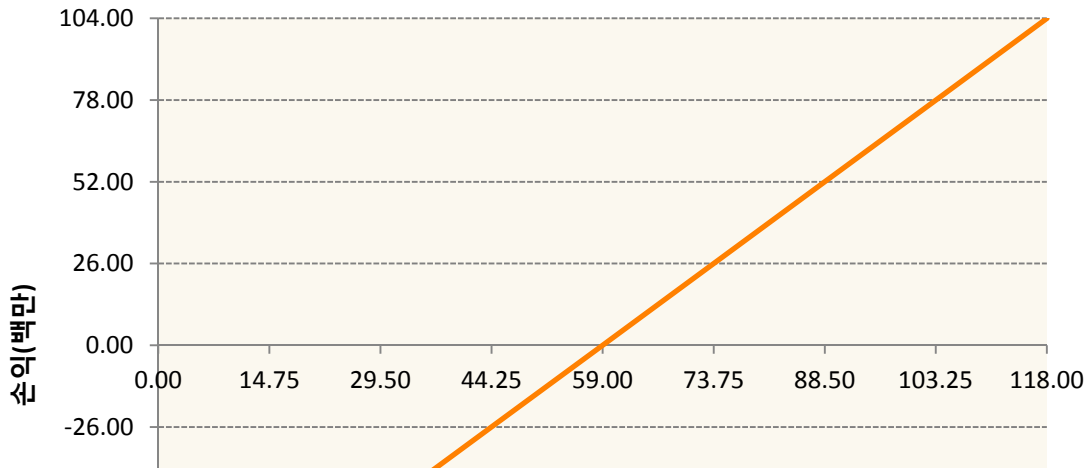
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,725	157	2,567	

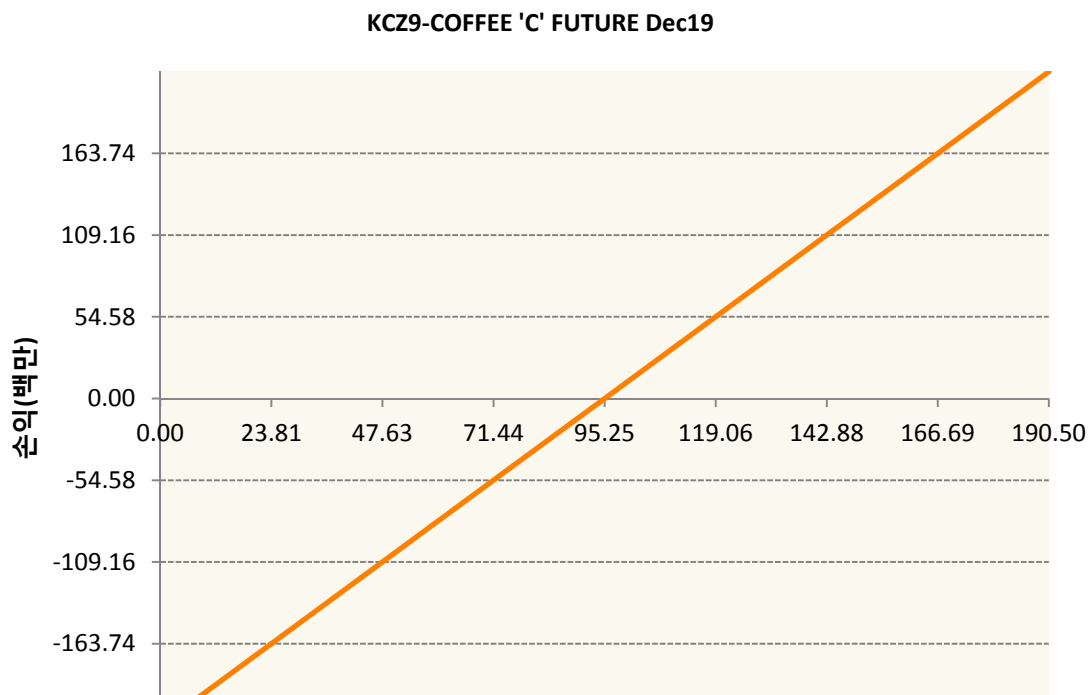
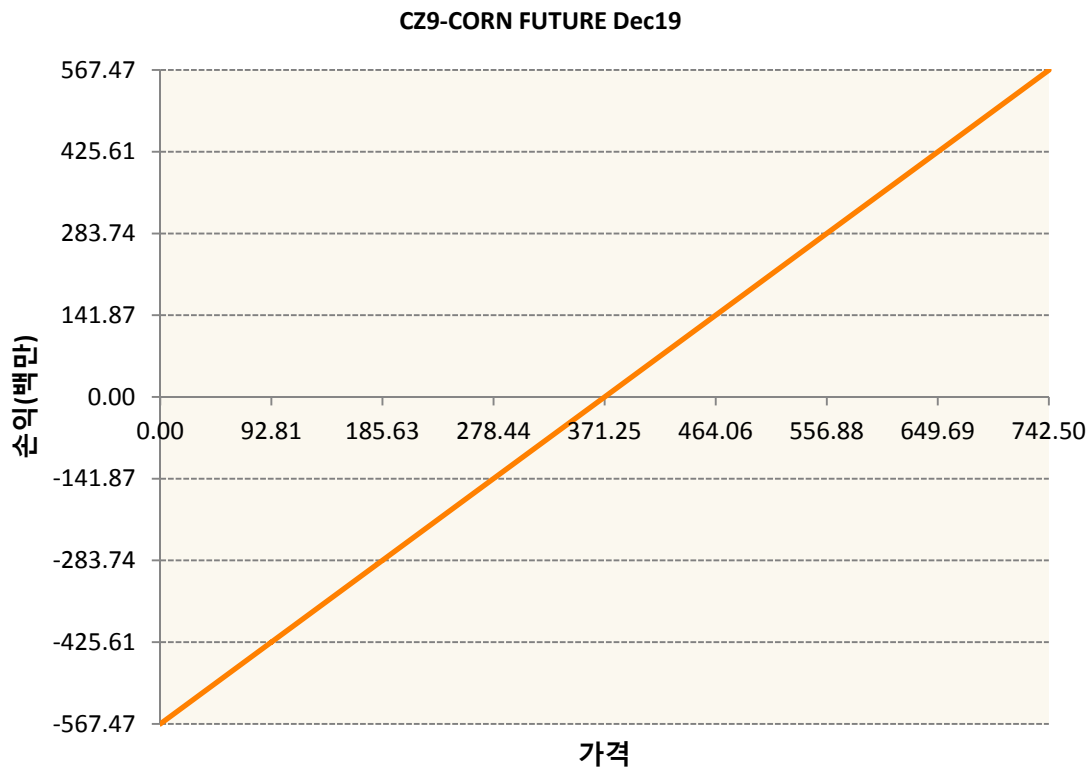
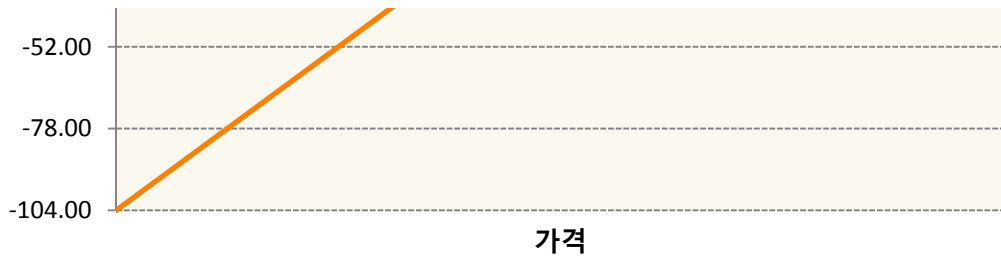
### 2. 만기시점의 손익구조

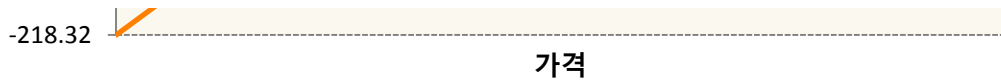
**BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19**



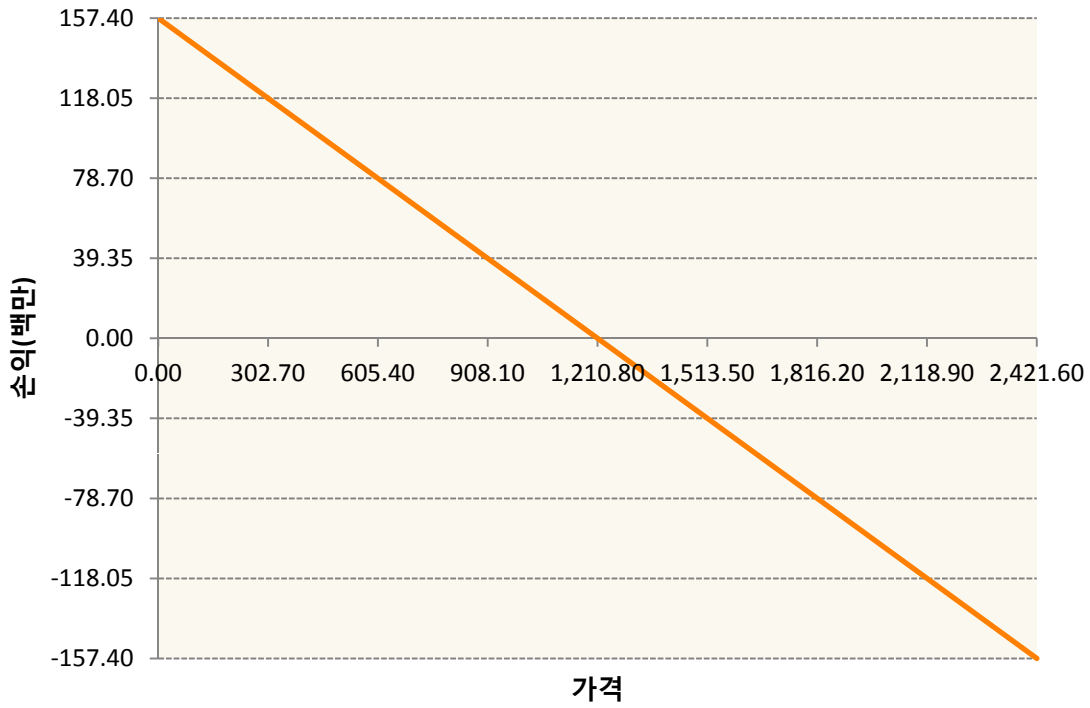
**CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19**



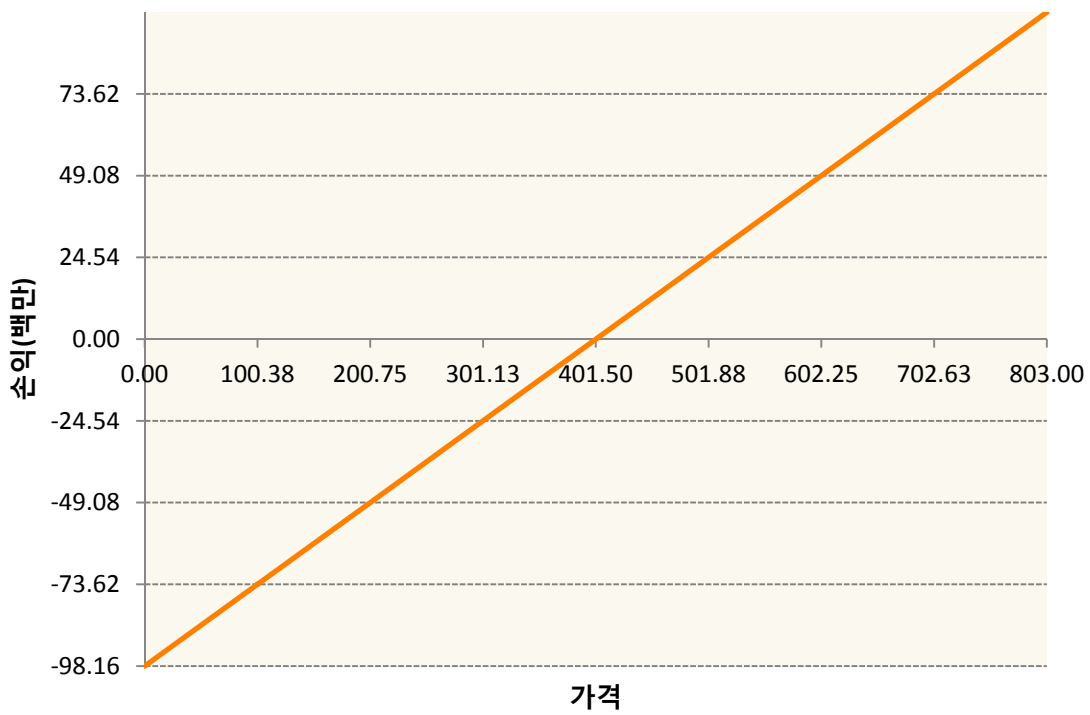




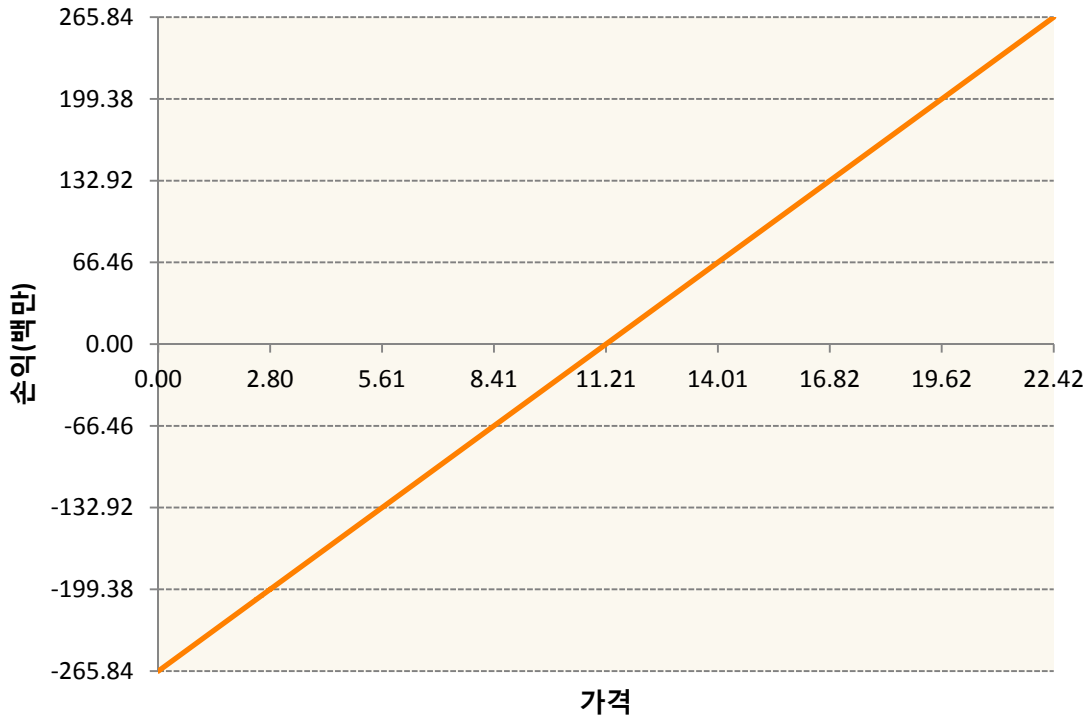
KR4175P90005-2019-09 달러선물



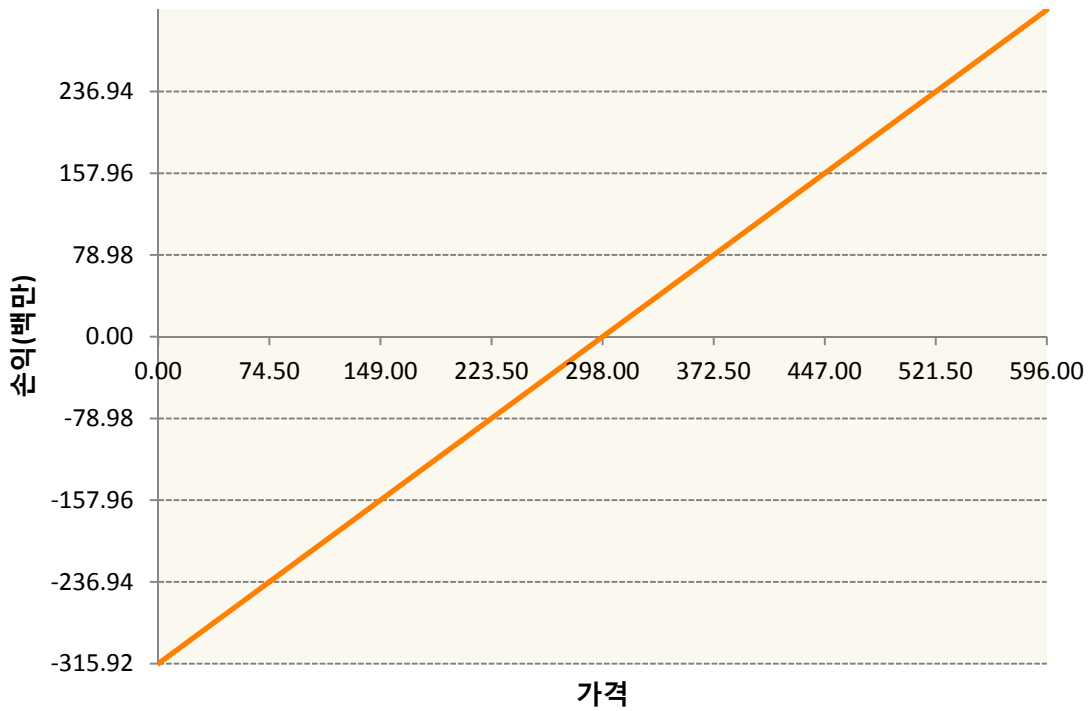
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



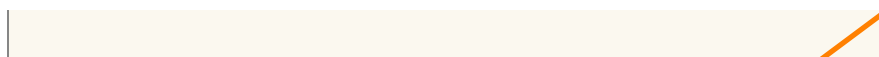
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

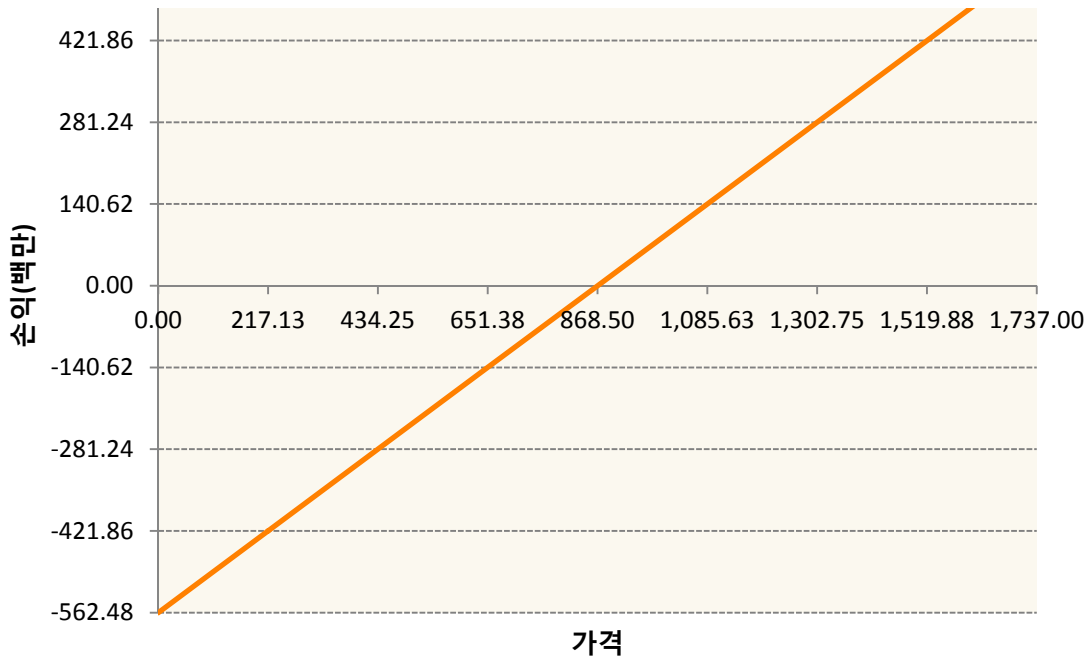


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

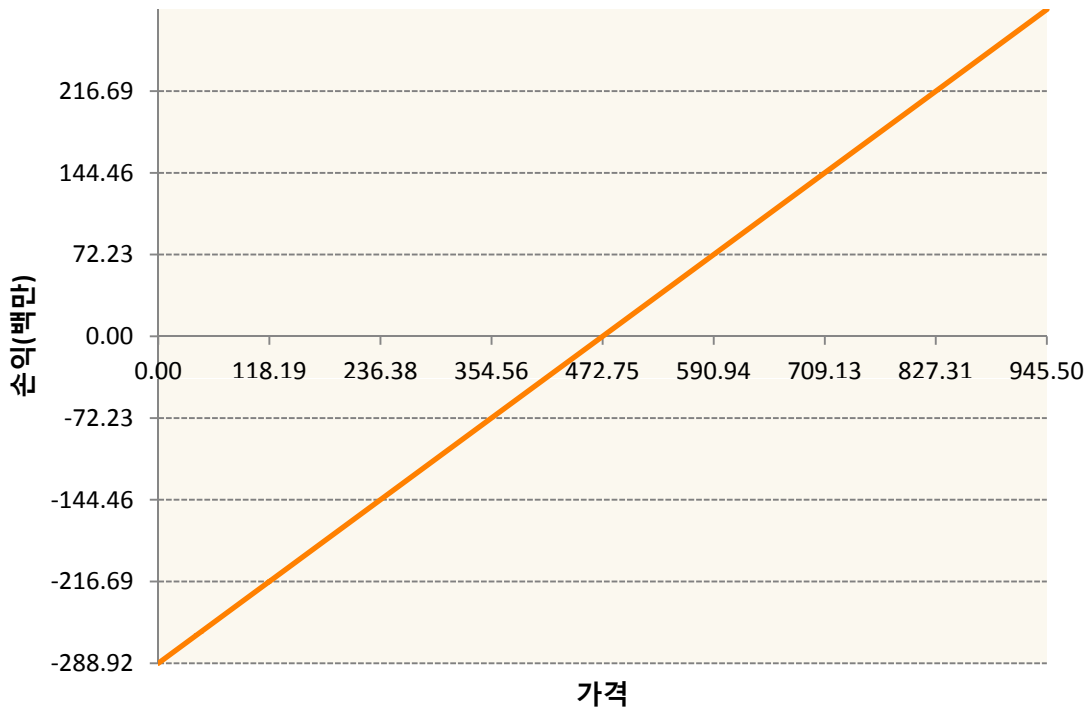


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





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	17
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**