

공시일	2019-09-04
기준일	2019-09-03

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	2019-09-04
기준일	2019-09-03

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

1,148

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

656

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-04
기준일	2019-09-03

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)	382
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	139

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

828

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-04
기준일	2019-09-03

유로인덱스모(주식-파생형)

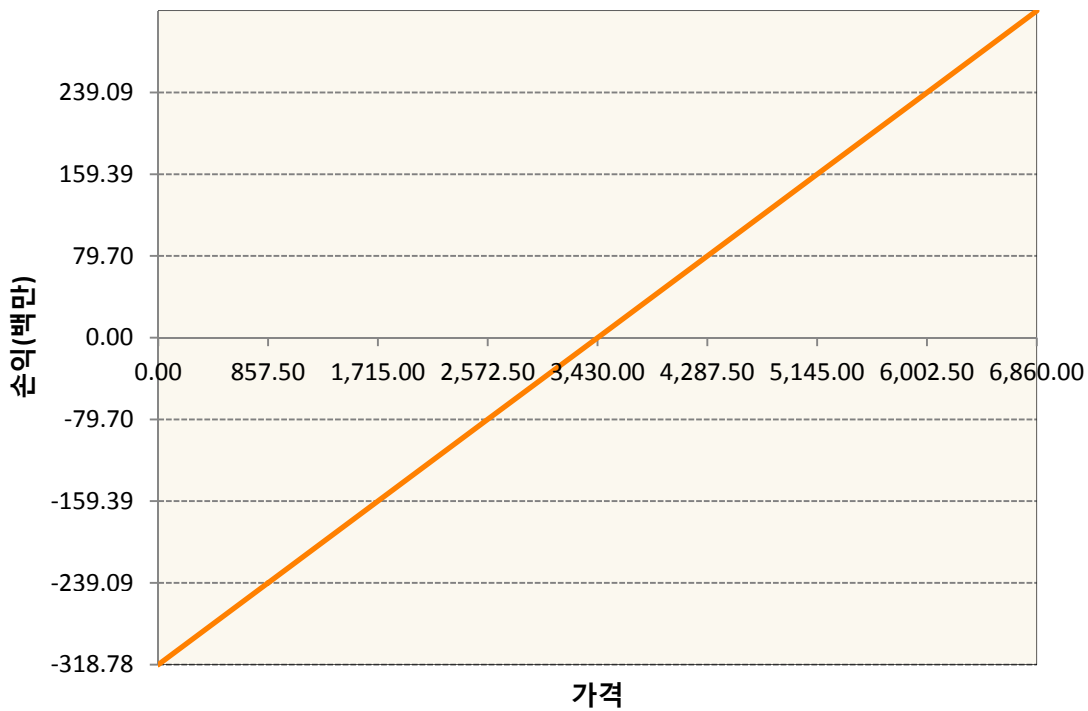
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	319	0	319	

2. 만기시점의 손익구조

VGU9-EURO STOXX 50 Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU9	EURO STOXX 50 Sep19	26
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

18

공시일	2019-09-04
기준일	2019-09-03

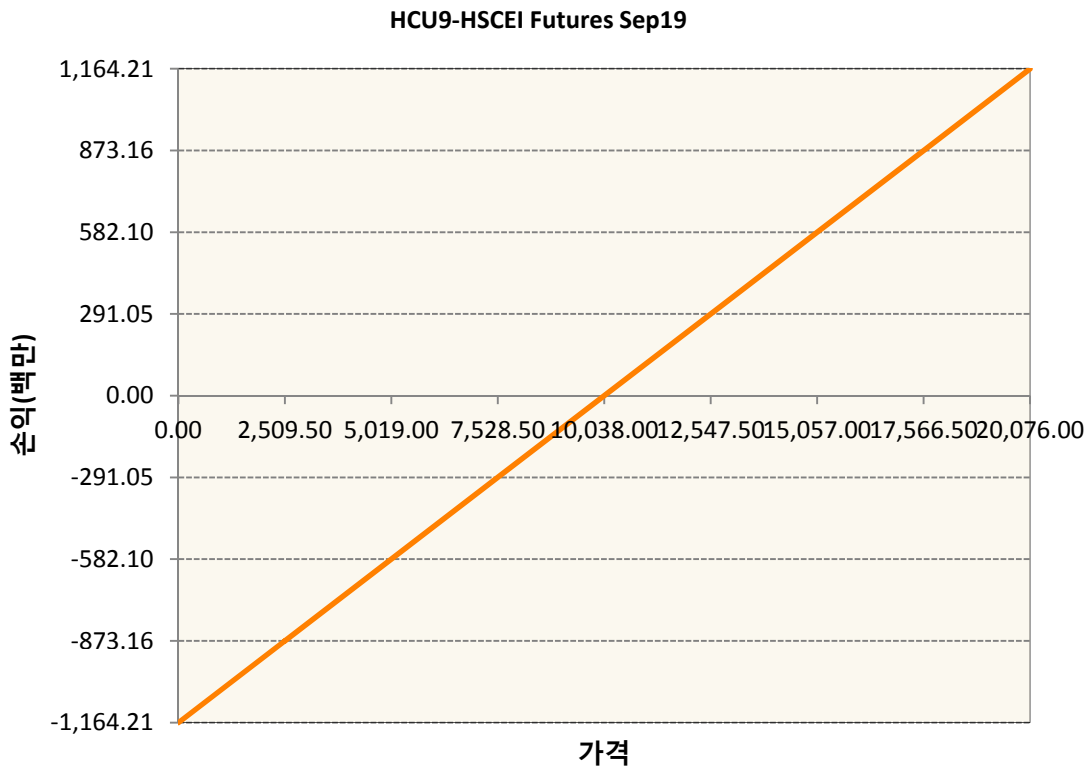
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,164	0	1,164	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	2019-09-04
기준일	2019-09-03

커버드콜모(주식혼합-파생형)

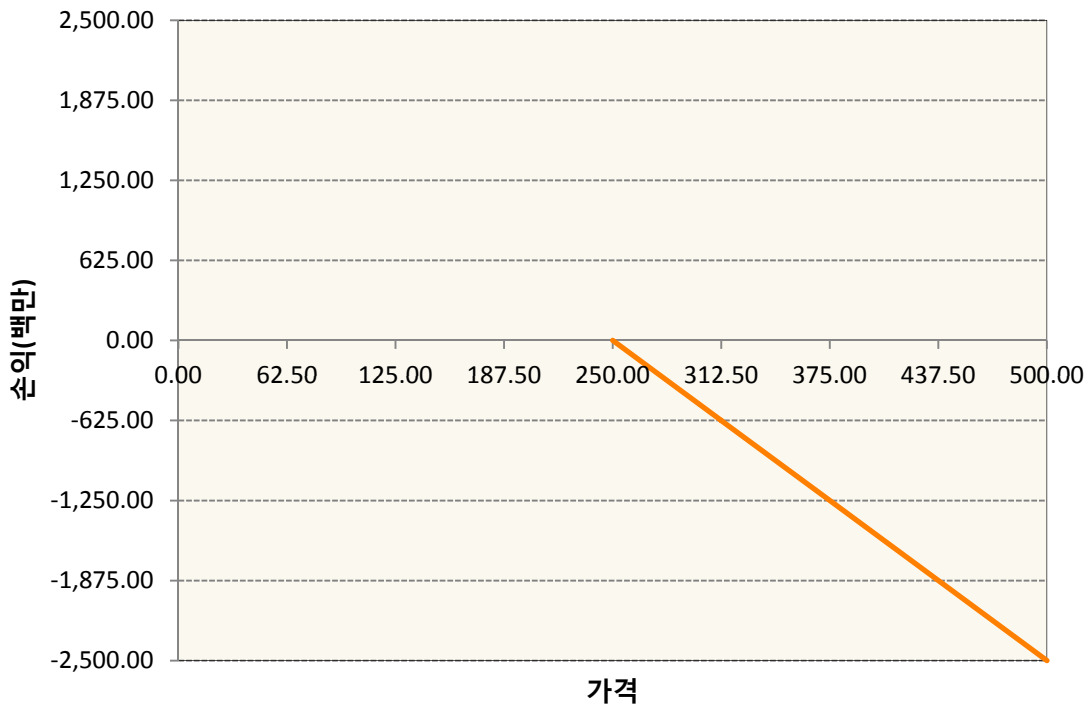
1. 계약금액

(단위:백만원)

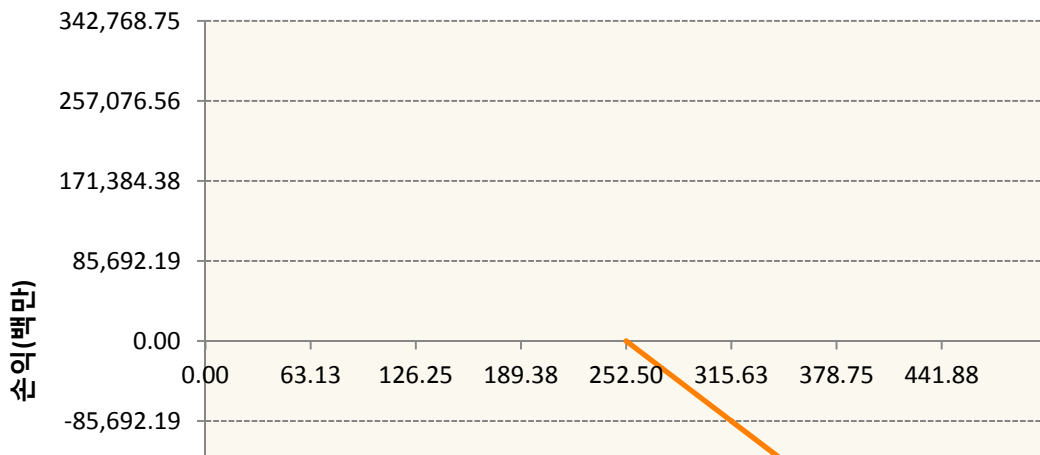
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	512,363	-512,363	장내

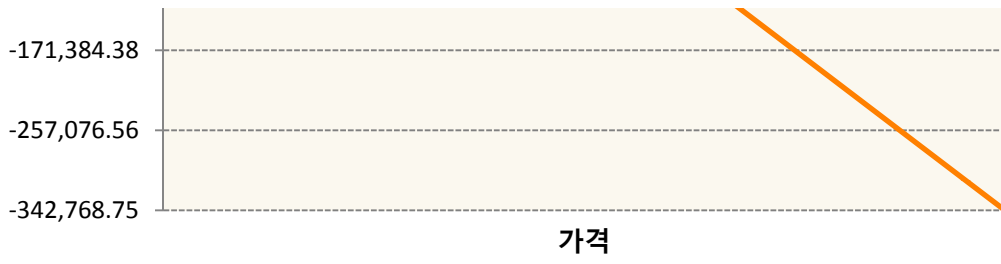
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P92500-2019-09 콜250

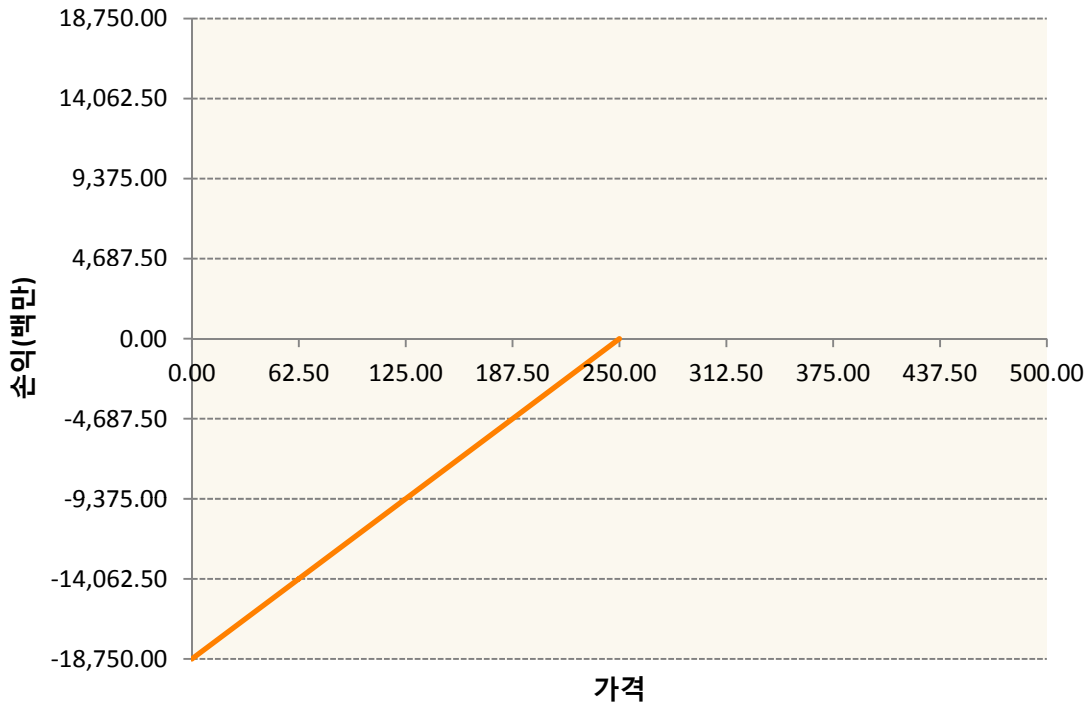


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

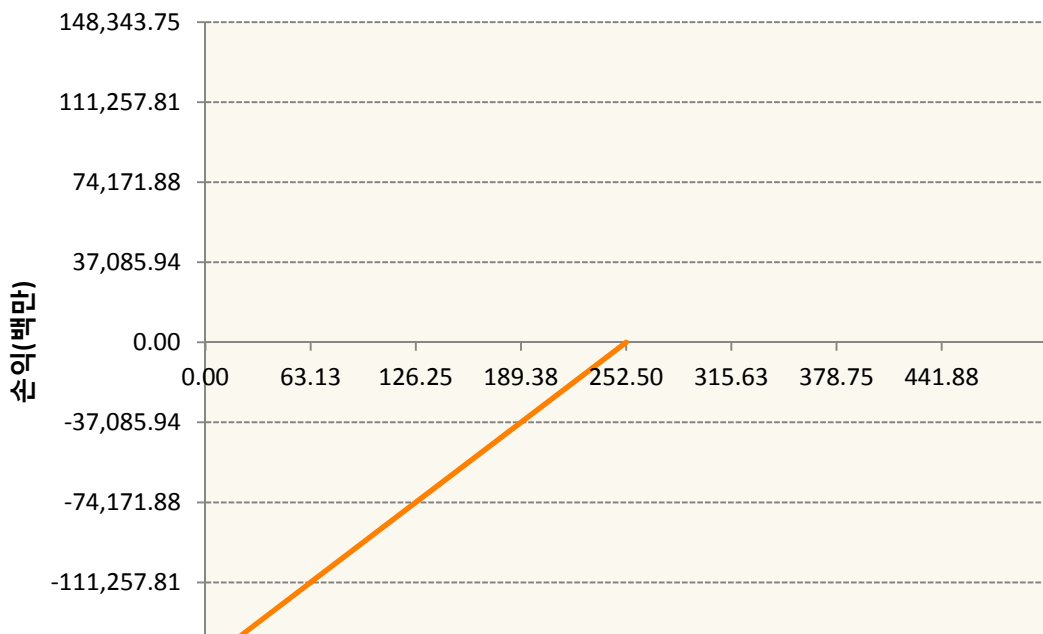




KR4301P92508-2019-09 풋250



KR4301P92524-2019-09 풋252.5



가격

3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P92500		2019-09 콜250						196
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	92	91	90	89	87	86	84	
-5.33%	84	82	79	76	74	71	68	
-2.67%	57	54	51	47	44	41	38	
0%	6	4	2	0	-2	-5	-8	
2.67%	-58	-59	-59	-60	-62	-63	-64	
5.33%	-126	-126	-127	-127	-127	-128	-128	
8.00%	-195	-195	-195	-195	-195	-195	-196	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5						25,770
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	10,032	9,971	9,885	9,771	9,632	9,469	9,283	
-5.33%	9,437	9,187	8,909	8,610	8,293	7,961	7,617	
-2.67%	6,873	6,434	5,995	5,555	5,115	4,674	4,233	
0%	1,087	740	377	0	-387	-783	-1,185	
2.67%	-7,154	-7,287	-7,453	-7,649	-7,872	-8,119	-8,387	
5.33%	-16,308	-16,334	-16,378	-16,443	-16,530	-16,641	-16,775	
8.00%	-25,634	-25,637	-25,644	-25,658	-25,682	-25,718	-25,770	
KR4301P92508		2019-09 풋250						924
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-908	-909	-911	-913	-916	-920	-924	
-5.33%	-415	-425	-435	-446	-458	-470	-483	
-2.67%	-78	-95	-111	-127	-144	-160	-176	
0%	19	14	8	0	-9	-18	-28	
2.67%	28	28	27	26	24	21	18	
5.33%	28	28	28	28	28	27	27	
8.00%	28	28	28	28	28	28	28	
KR4301P92524		2019-09 풋252.5						8,408
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-8,347	-8,349	-8,353	-8,360	-8,372	-8,387	-8,408	
-5.33%	-4,365	-4,405	-4,453	-4,511	-4,576	-4,647	-4,725	
-2.67%	-1,117	-1,245	-1,373	-1,502	-1,631	-1,760	-1,890	
0%	252	175	91	0	-96	-197	-302	
2.67%	445	436	420	398	369	332	289	

5.33%	453	452	451	449	446	439	430
8.00%	453	453	453	453	452	452	451

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

(단위:백만원)

37,888

공시일	2019-09-04
기준일	2019-09-03

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

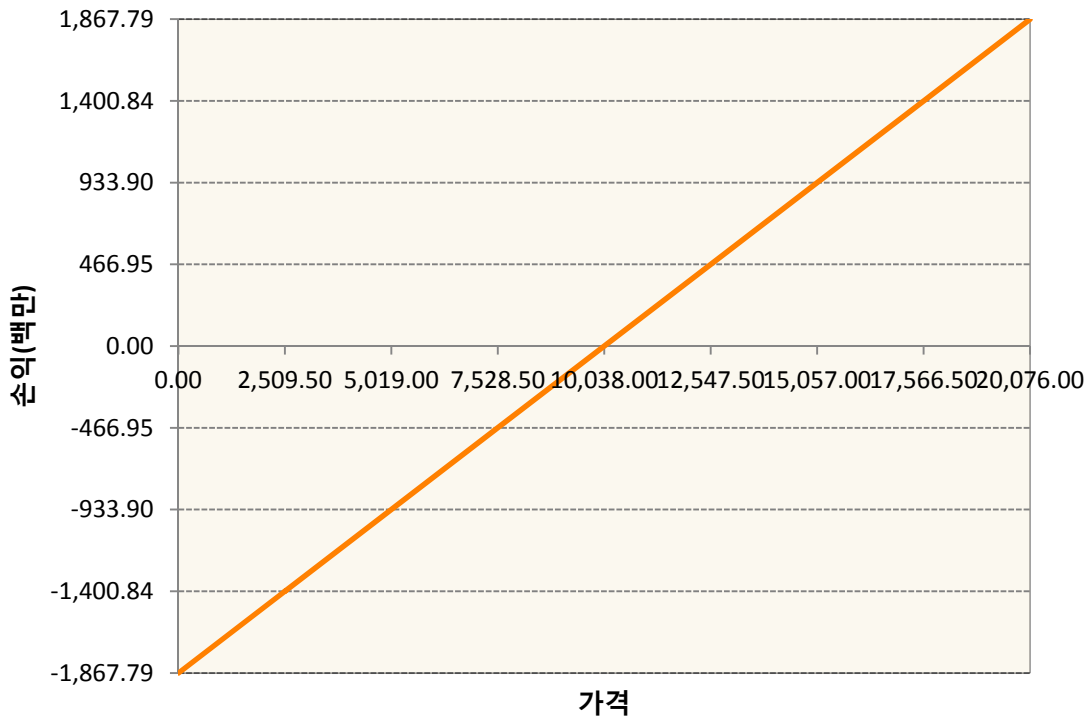
1. 계약금액

(단위:백만원)

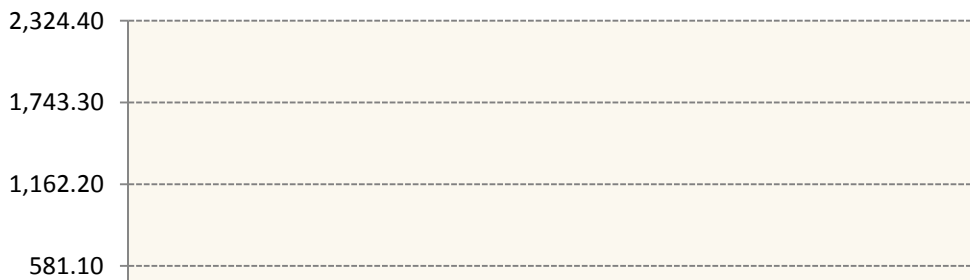
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,868	0	1,868	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,956	-4,956	장내
누계	통화	선도	77	2,879	-2,802	장외

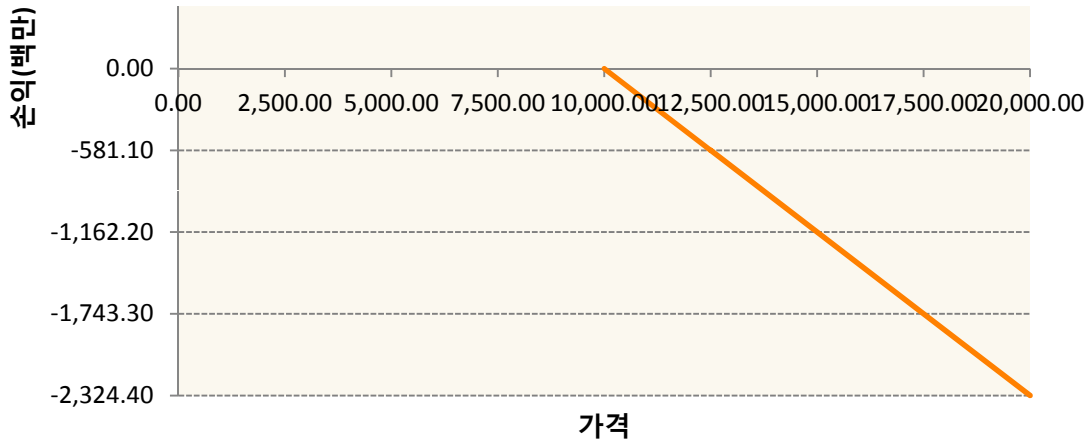
2. 만기시점의 손익구조

HCU9-HSCEI Futures Sep19

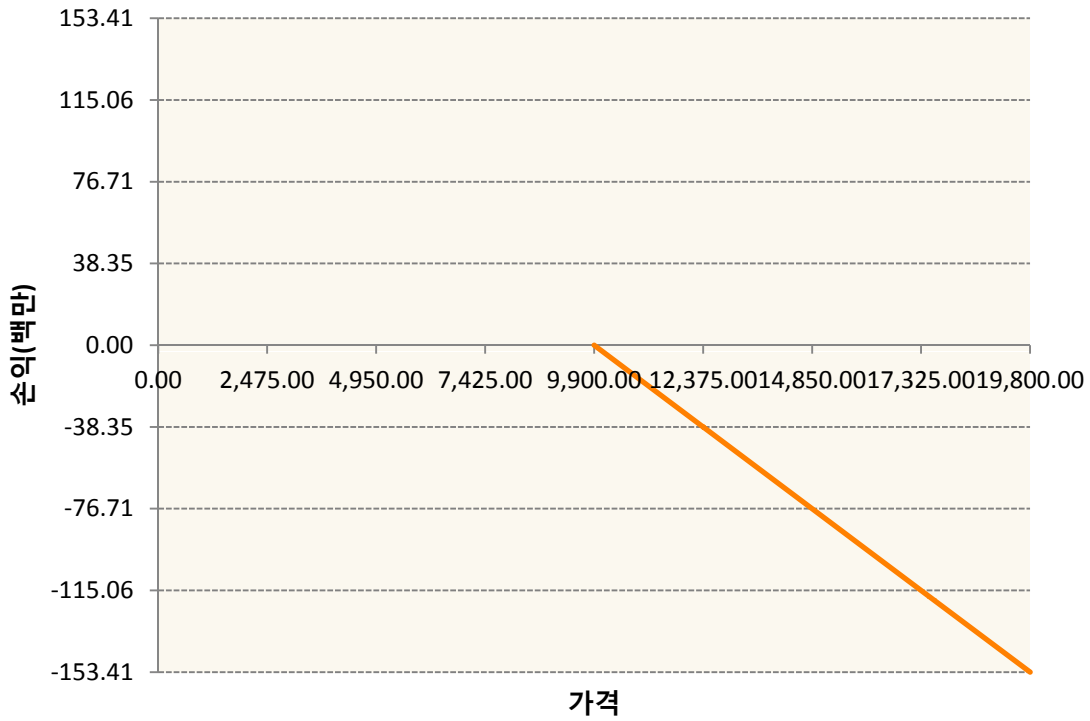


OHHIU9-C100-HSCEI

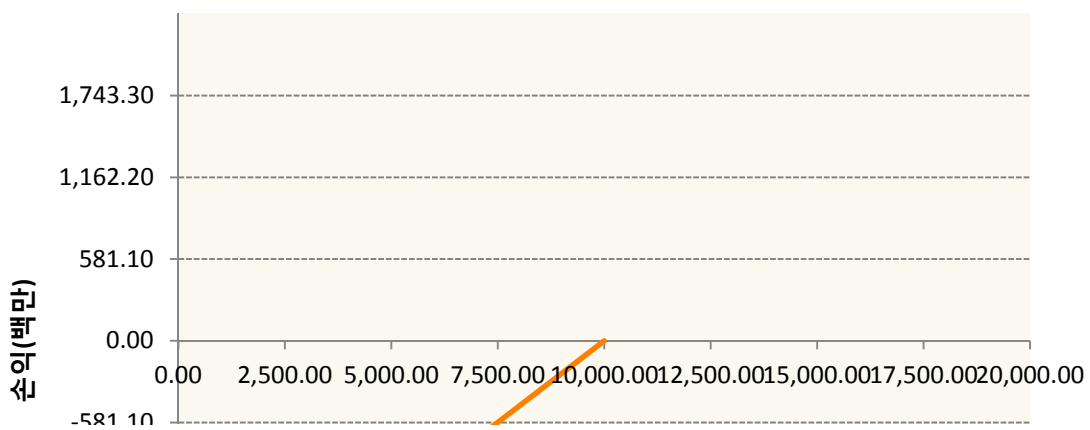


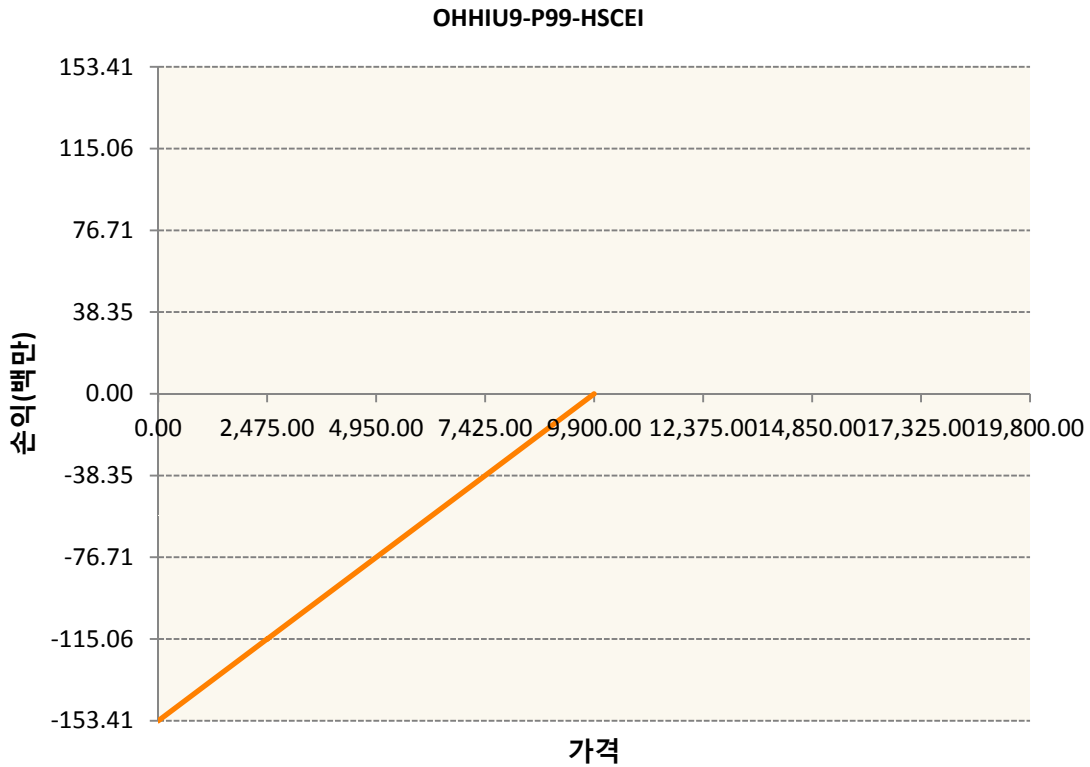


OHHIU9-C99-HSCEI



OHHIU9-P100-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	230
FX21019U00 HKD/KRW 22-11-19E	6
HCU9 HSCEI Futures Sep19	149
OHHIU9-C1(HSCEI	186
OHHIU9-C9(HSCEI	12
OHHIU9-P1(HSCEI	186
OHHIU9-P9(HSCEI	12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	584

공시일	2019-09-04
기준일	2019-09-03

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

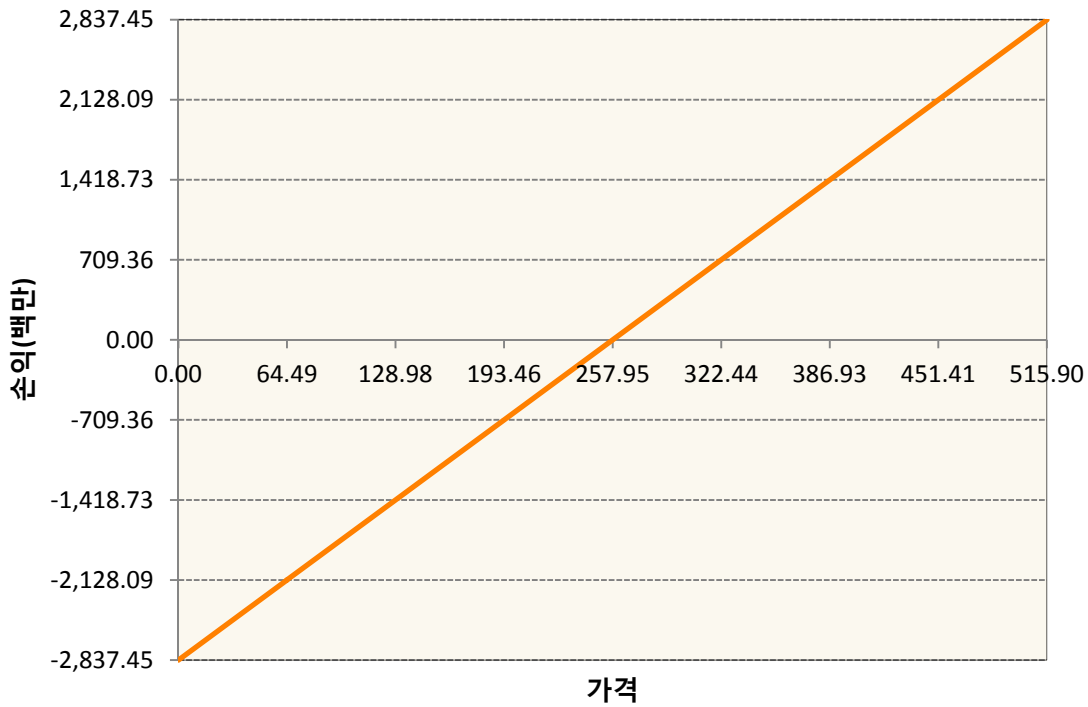
1. 계약금액

(단위:백만원)

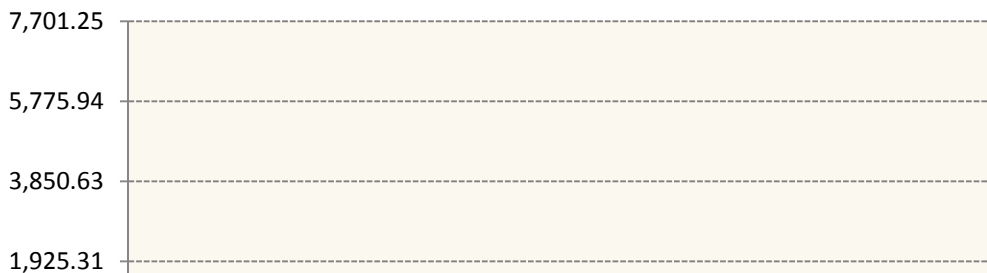
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,837	0	2,837	장내
누계	유가증권	스왑	14,125	0	14,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,829	-14,829	장내

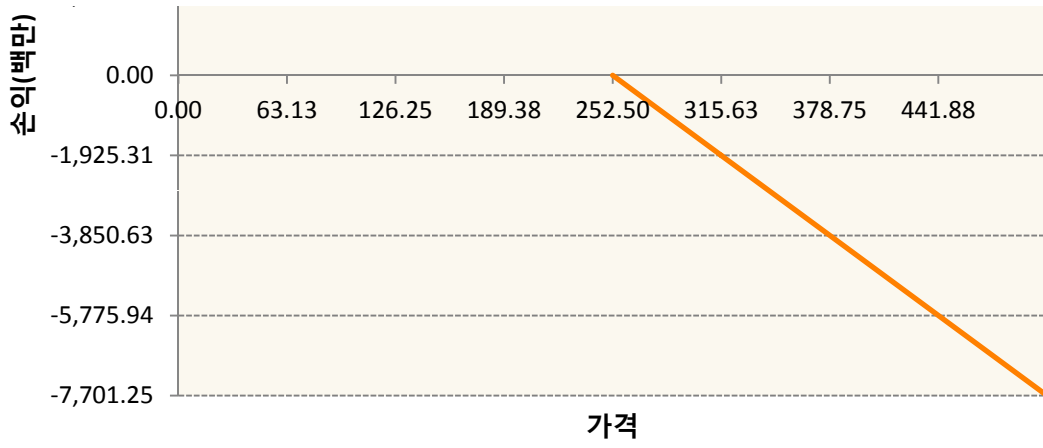
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

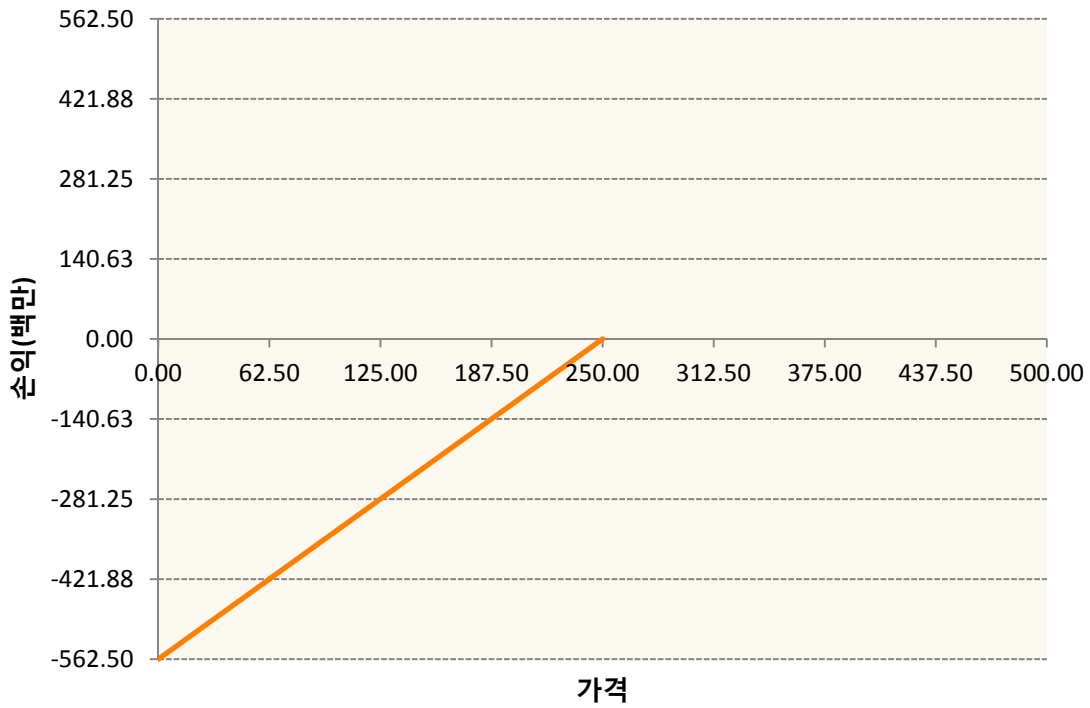


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

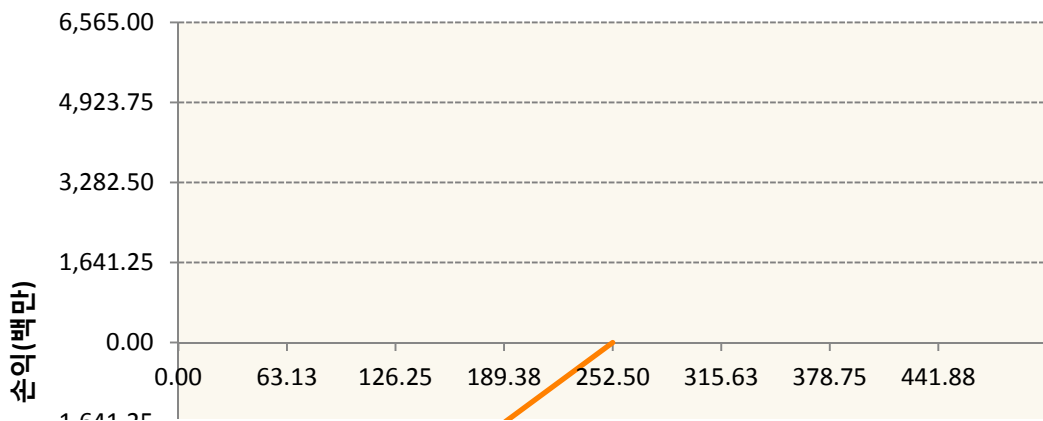




KR4301P92508-2019-09 풋250



KR4301P92524-2019-09 풋252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						1,229
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,229	-1,229	-1,229	-1,229	-1,229	-1,229	-1,229	
-5.33%	-820	-820	-820	-820	-820	-820	-820	
-2.67%	-410	-410	-410	-410	-410	-410	-410	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	410	410	410	410	410	410	410	
5.33%	820	820	820	820	820	820	820	
8.00%	1,229	1,229	1,229	1,229	1,229	1,229	1,229	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						227
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-227	-227	-227	-227	-227	-227	-227	
-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%	227	227	227	227	227	227	227	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5						579
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	225	224	222	220	216	213	209	
-5.33%	212	206	200	193	186	179	171	
-2.67%	154	145	135	125	115	105	95	
0%	24	17	8	0	-9	-18	-27	
2.67%	-161	-164	-167	-172	-177	-182	-188	
5.33%	-366	-367	-368	-369	-371	-374	-377	
8.00%	-576	-576	-576	-576	-577	-578	-579	
KR4301P92508		2019-09 풋250						28
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-27	-27	-27	-27	-27	-28	-28
-5.33%	-12	-13	-13	-13	-14	-14	-14
-2.67%	-2	-3	-3	-4	-4	-5	-5
0%	1	0	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							372
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-369	-369	-370	-370	-370	-371	-372
-5.33%	-193	-195	-197	-200	-202	-206	-209
-2.67%	-49	-55	-61	-66	-72	-78	-84
0%	11	8	4	0	-4	-9	-13
2.67%	20	19	19	18	16	15	13
5.33%	20	20	20	20	20	19	19
8.00%	20	20	20	20	20	20	20

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

(단위:백만원)

2,448

공시일	2019-09-04
기준일	2019-09-03

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

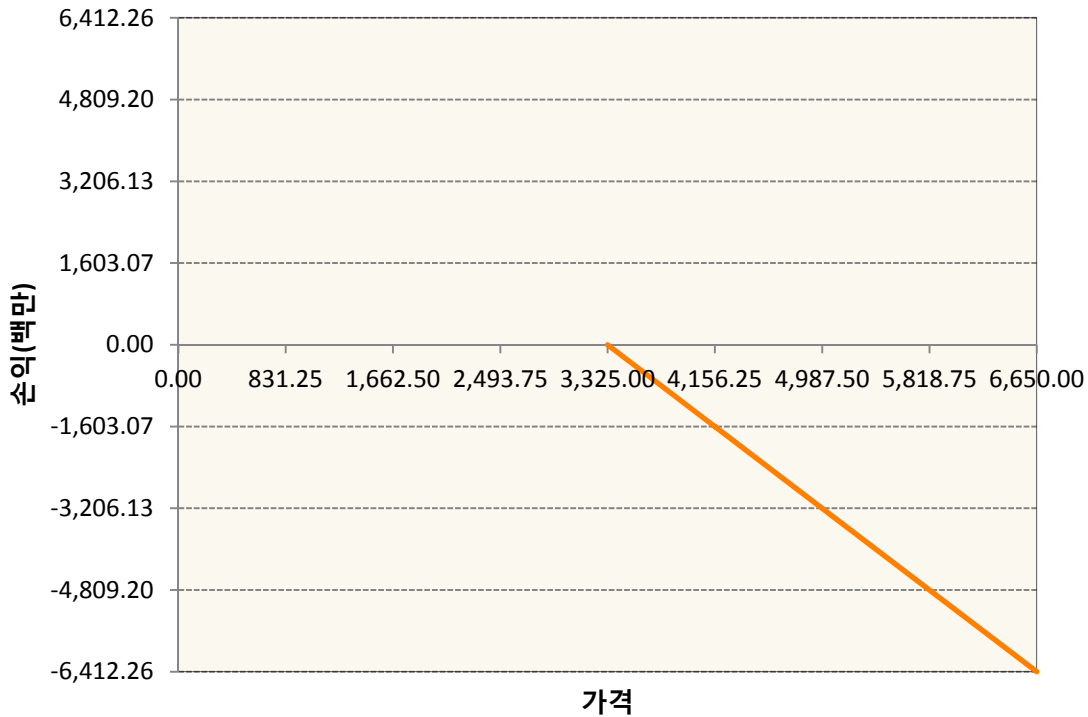
1. 계약금액

(단위:백만원)

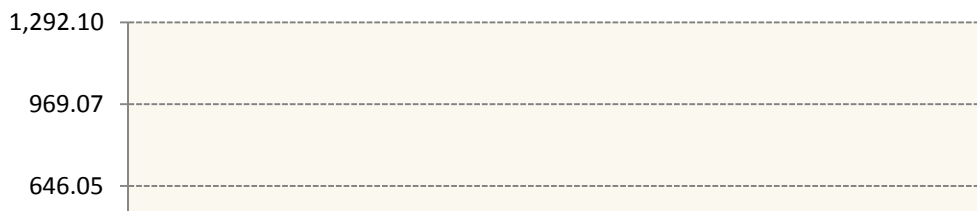
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,133	0	5,133	
누계	유가증권	옵션	0	15,409	-15,409	장내
누계	지수	스왑	24,203	0	24,203	장외
누계	통화	선도	9,044	17,291	-8,246	장외

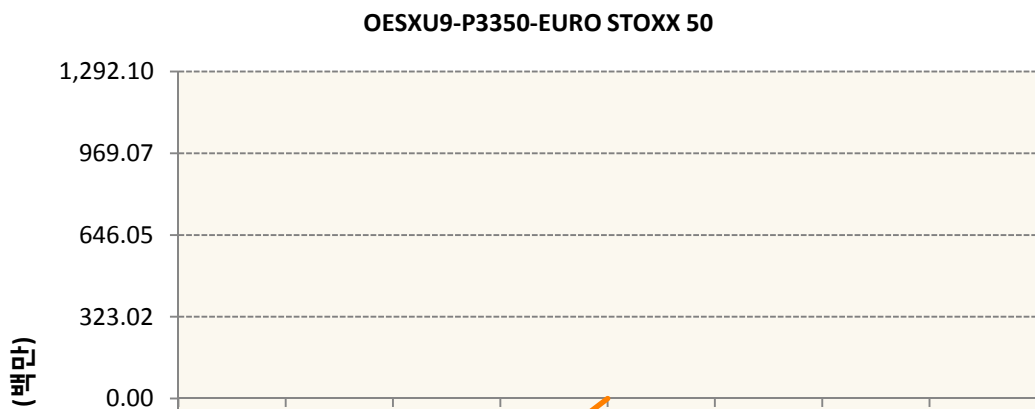
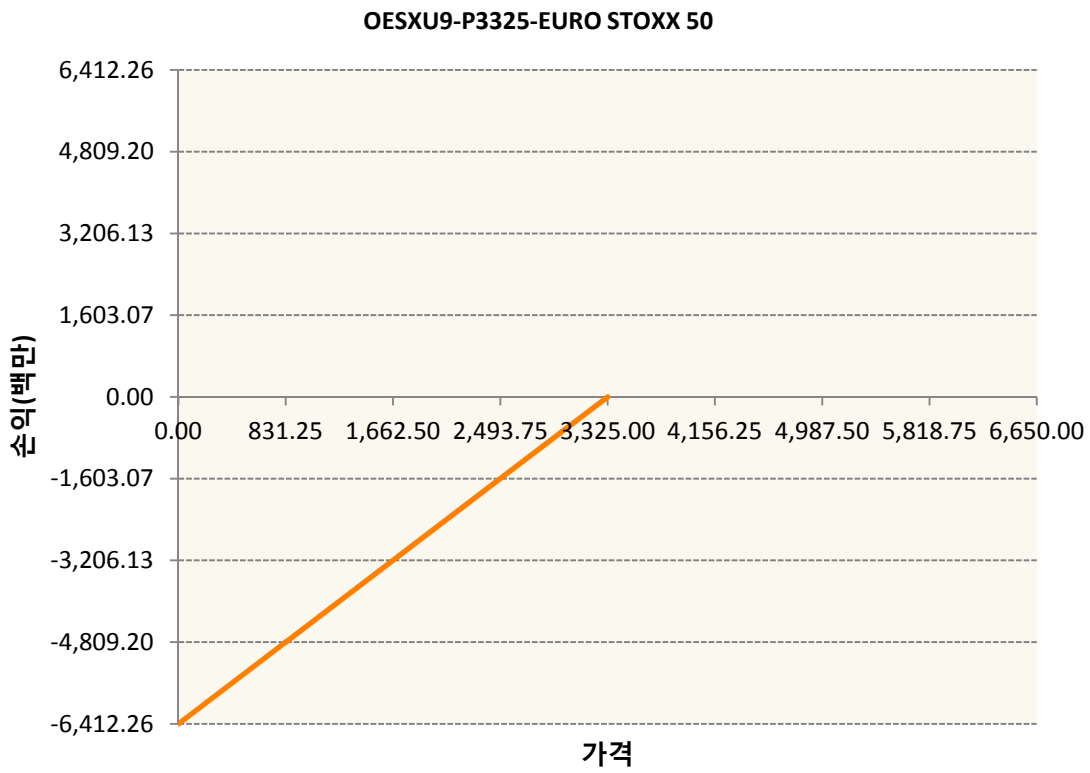
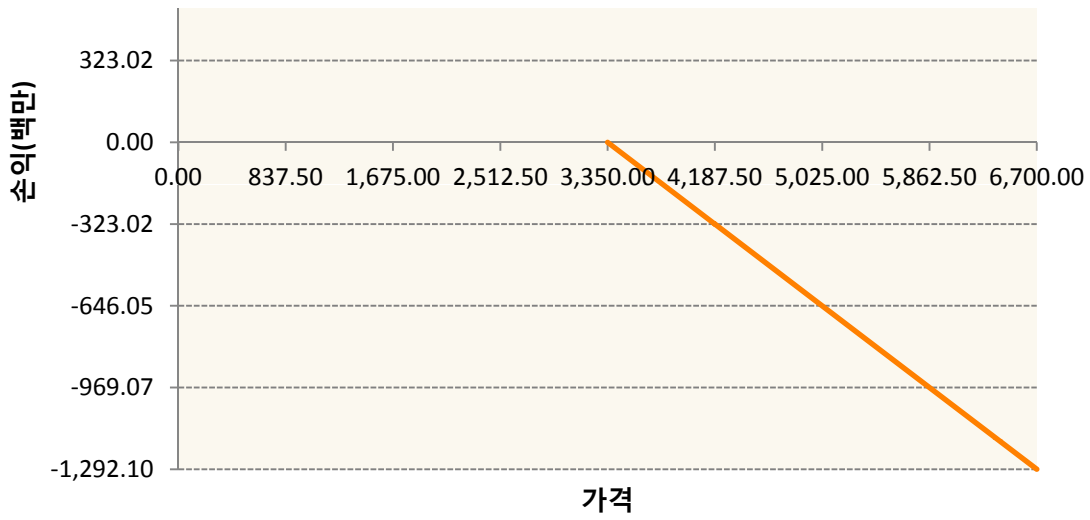
2. 만기시점의 손익구조

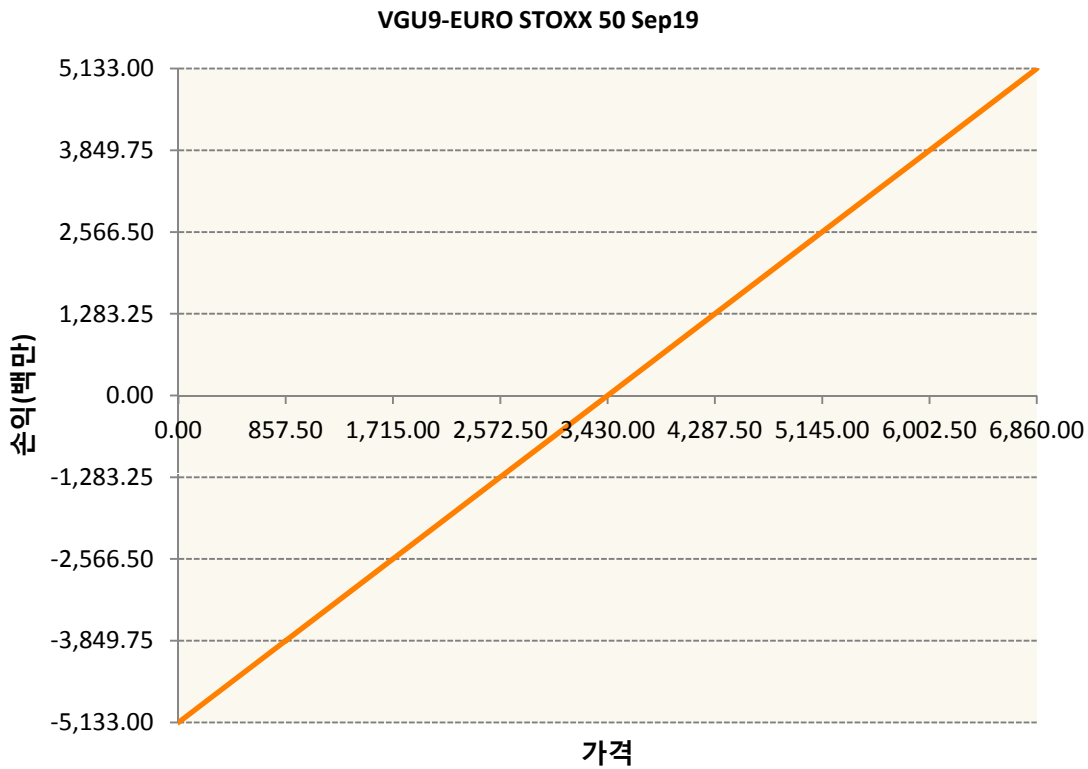
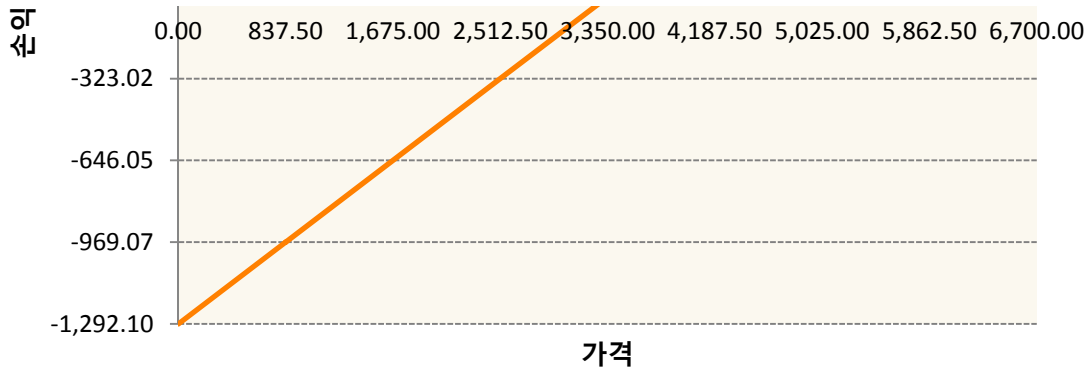
OESXU9-C3325-EURO STOXX 50



OESXU9-C3350-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		28
FX21019M0< KRW/EUR 27-09-19E		1,064
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E		319
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E		319
FX21019N04 EUR/KRW 27-09-19E		234
FX21019Q00 EUR/KRW 27-09-19E		170
OESXU9-C3< EURO STOXX 50		513
OESXU9-C3< EURO STOXX 50		103
OESXU9-P3< EURO STOXX 50		513
OESXU9-P3< EURO STOXX 50		103
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19		411

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

(단위:백만원)

2,163

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

(단위:백만원)

931

공시일	2019-09-04
기준일	2019-09-03

ETF스마트레버리지목표전환형9호

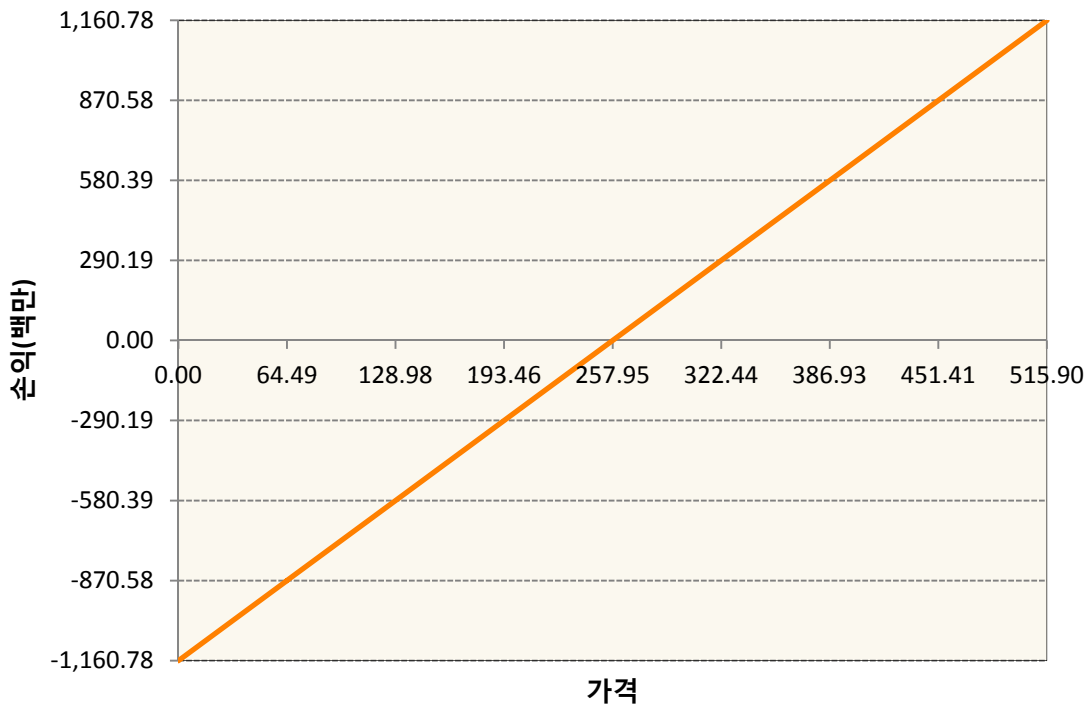
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,161	0	1,161	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						93
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93	
-5.33%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62	
-2.67%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	31	31	31	31	31	31	31	
5.33%	62	62	62	62	62	62	62	
8.00%	93	93	93	93	93	93	93	

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

(단위:백만원)

80

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

(단위:백만원)

124

공시일	2019-09-04
기준일	2019-09-03

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

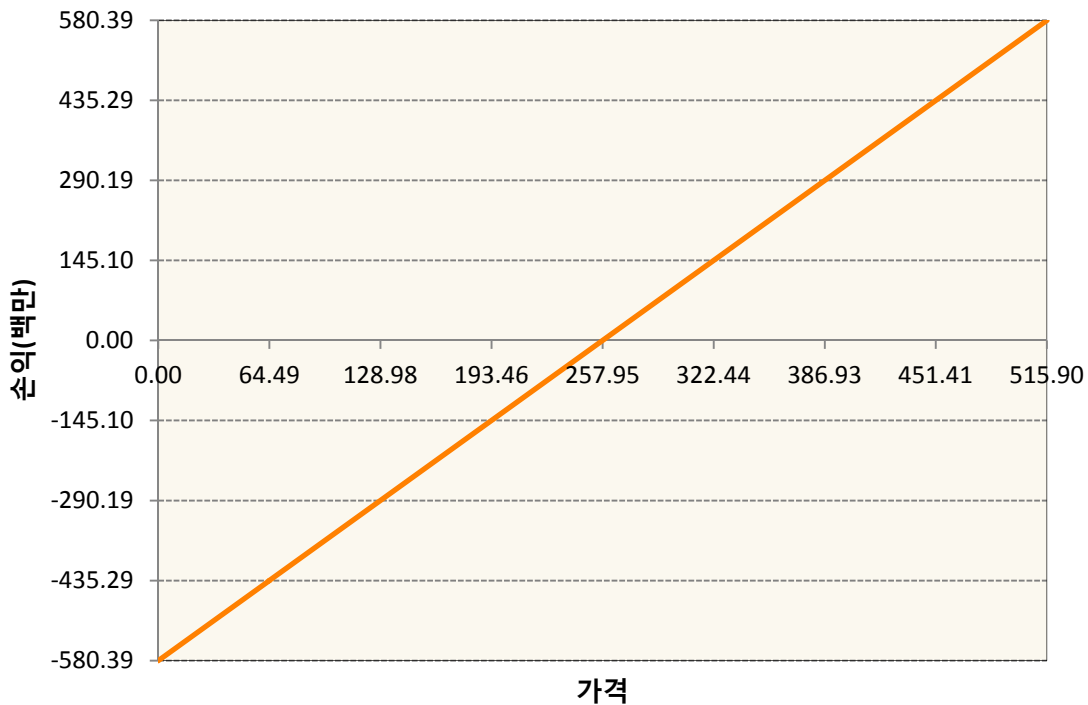
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	580	0	580	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)

40

공시일	2019-09-04
기준일	2019-09-03

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

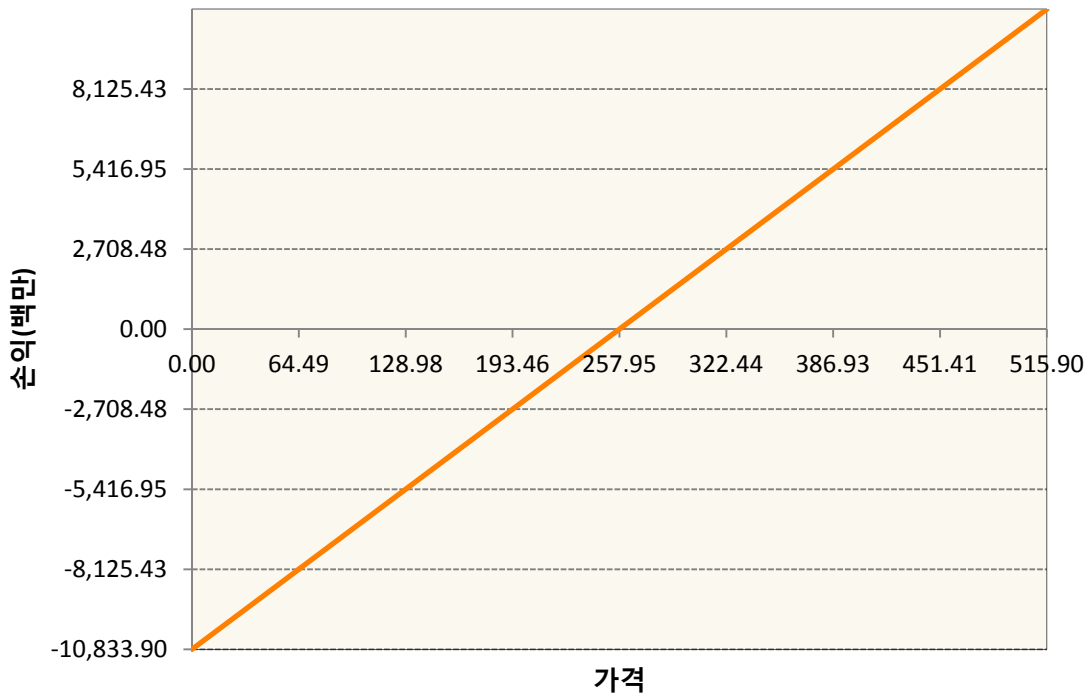
1. 계약금액

(단위:백만원)

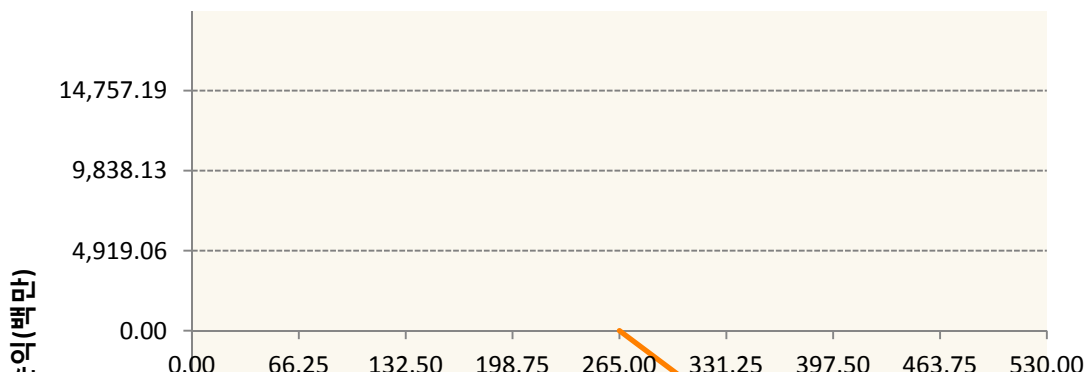
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	129	-129	장내
신규	유가증권	옵션	132	0	132	장내
누계	유가증권	선물	10,834	0	10,834	장내
누계	유가증권	옵션	3,659	19,810	-16,151	장내

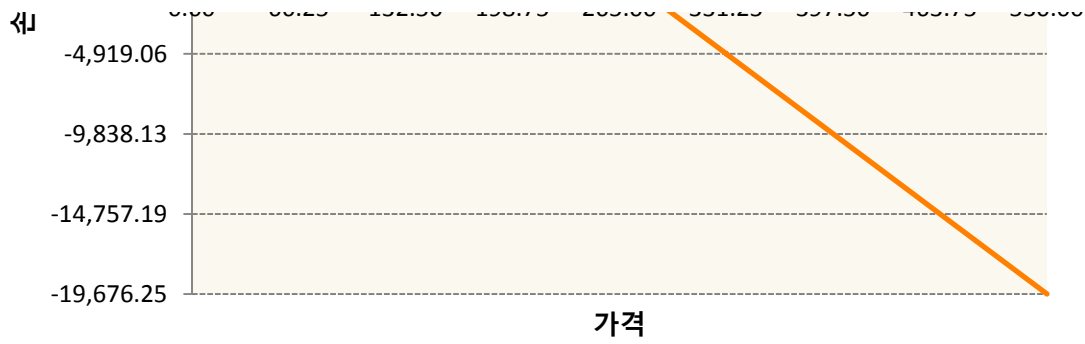
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

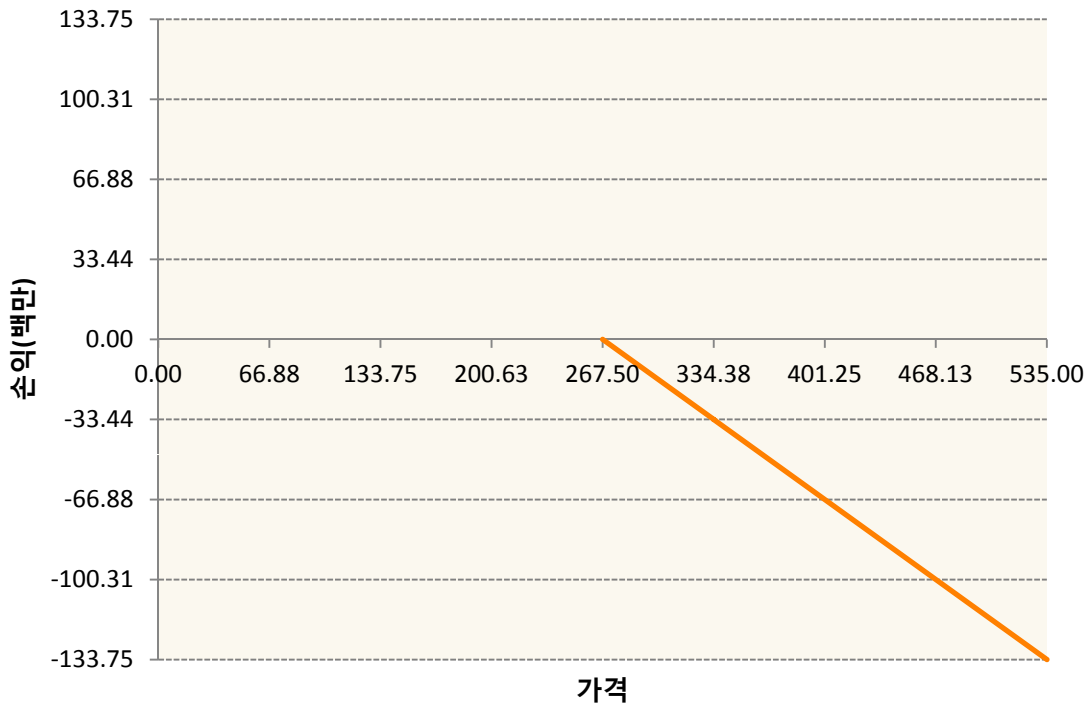


KR4201P92658-2019-09 콜265

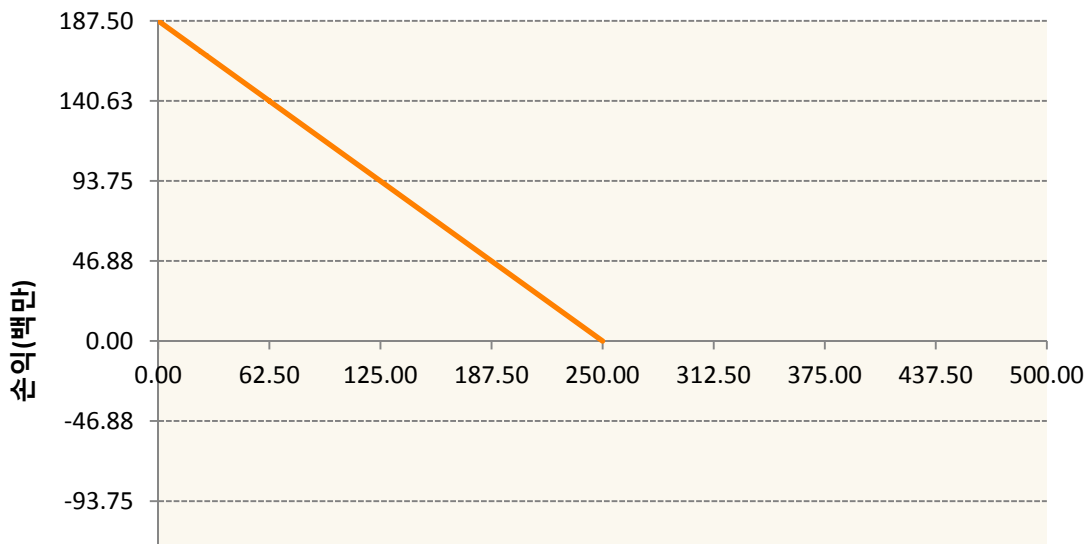


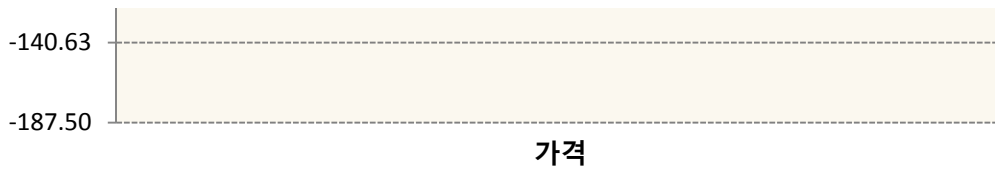


KR4201P92674-2019-09 콜267.5

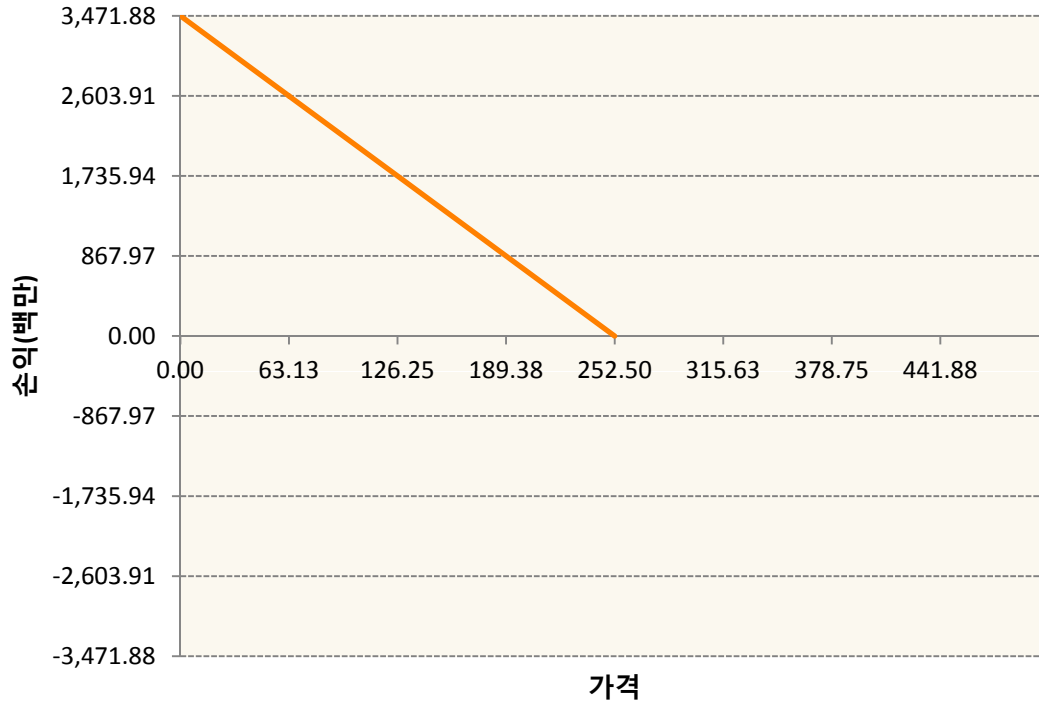


KR4301P92508-2019-09 풋250





KR4301P92524-2019-09 풋252.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						868
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-868	-868	-868	-868	-868	-868	-868	
-5.33%	-578	-578	-578	-578	-578	-578	-578	
-2.67%	-289	-289	-289	-289	-289	-289	-289	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	289	289	289	289	289	289	289	
5.33%	578	578	578	578	578	578	578	
8.00%	868	868	868	868	868	868	868	
KR4201P92658		2019-09 콜265						988
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	114	114	114	114	113	112	110	
-5.33%	114	113	111	109	106	101	96	
-2.67%	106	101	93	84	74	62	49	

0%	56	39	20	0	-20	-42	-63
2.67%	-118	-143	-169	-194	-220	-245	-271
5.33%	-462	-480	-499	-520	-541	-562	-585
8.00%	-922	-929	-938	-948	-960	-973	-988

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	0	0
-5.33%	1	1	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-2
5.33%	-2	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-5	-5	-5	-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	5	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 풋252.5 197

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	195	195	195	196	196	196	197
-5.33%	102	103	104	106	107	109	111
-2.67%	26	29	32	35	38	41	44
0%	-6	-4	-2	0	2	5	7
2.67%	-10	-10	-10	-9	-9	-8	-7
5.33%	-11	-11	-11	-11	-10	-10	-10
8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11

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

(단위:백만원)

1,738

공시일	2019-09-04
기준일	2019-09-03

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	75,017	0	75,017	

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	2019-09-04
기준일	2019-09-03

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,580	0	1,580	
누계	유가증권	수익증권	93,813	0	93,813	

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	2019-09-04
기준일	2019-09-03

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	477,597	0	477,597	
누계	통화	선도	0	463,265	-463,265	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		1,750
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,139
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
FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E		486
FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E		194
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		292
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		3,209
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		2,178
FX21019Q01 KRW/USD 16-09-19E		97
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,987
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,598
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,665
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		3,024
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		972
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		972
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E		972
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E		1,750
FX21019Q04 KRW/USD 30-09-19E		194
FX21019Q04 KRW/USD 24-09-19E		2,139
FX21019Q04 KRW/USD 24-09-19E		2,723

FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E

194
292
292

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

(단위:백만원)

12,051

공시일	2019-09-04
기준일	2019-09-03

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

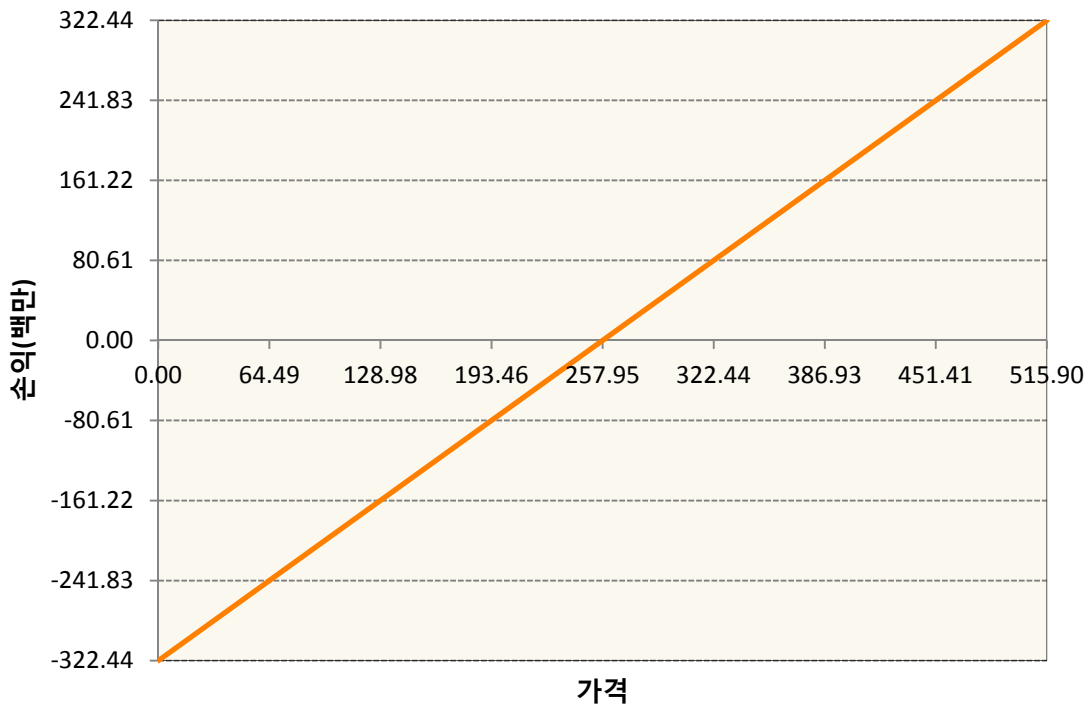
1. 계약금액

(단위:백만원)

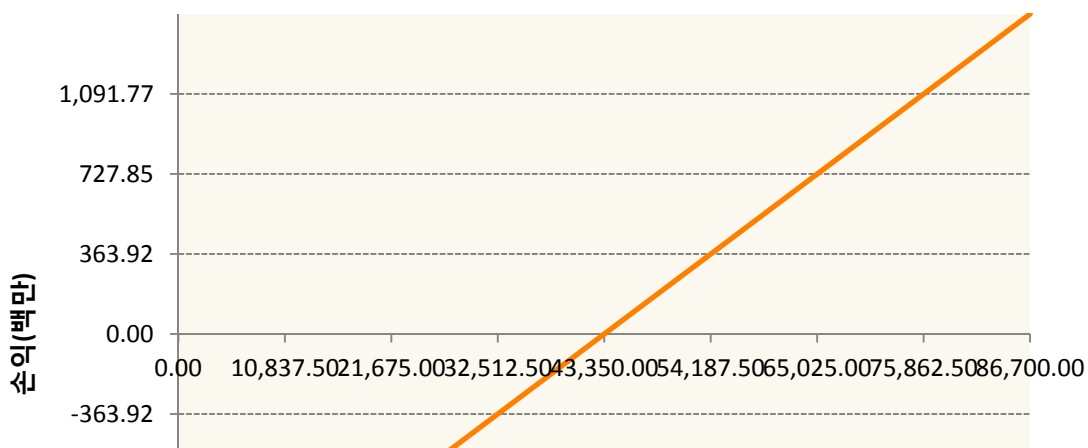
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,778	0	1,778	장내

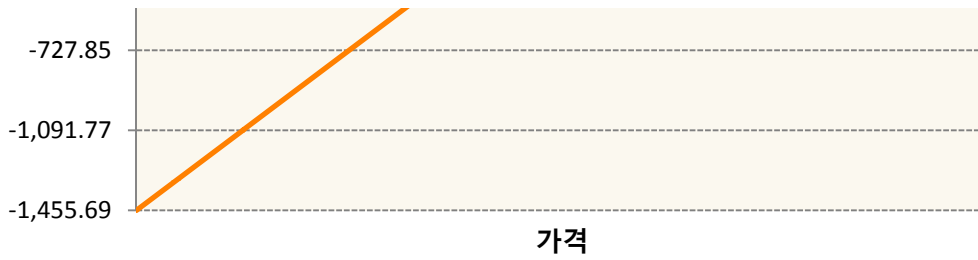
2. 만기시점의 손익구조

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						116
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116	
-5.33%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77	
-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%	77	77	77	77	77	77	77	
8.00%	116	116	116	116	116	116	116	

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

164

공시일	2019-09-04
기준일	2019-09-03

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

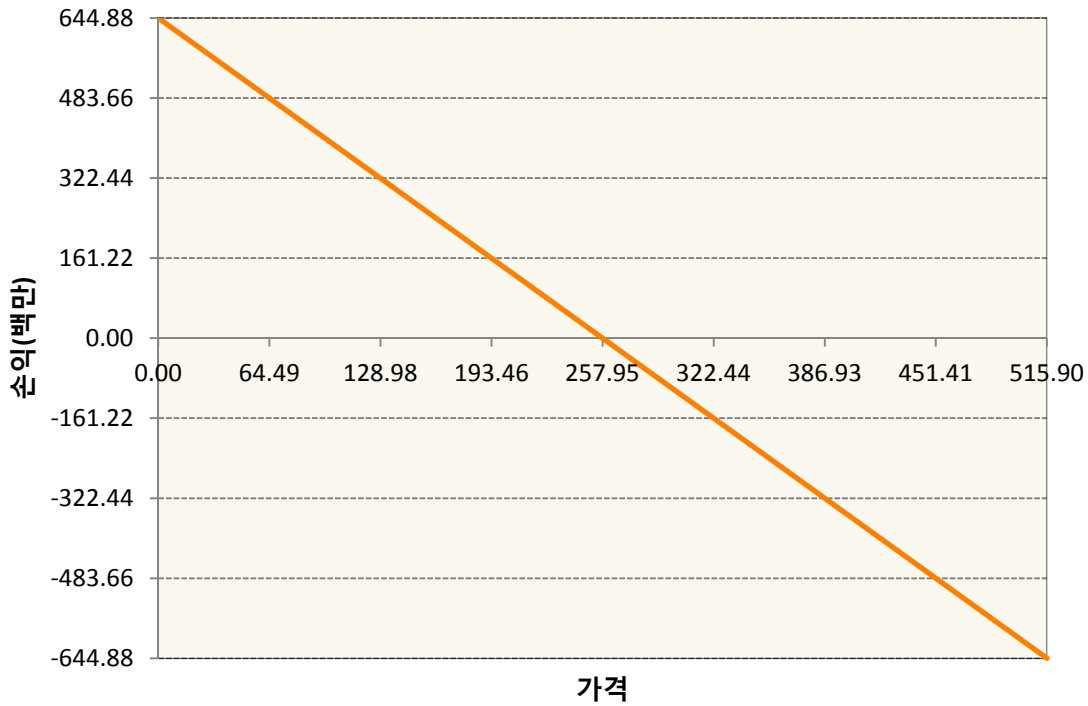
1. 계약금액

(단위:백만원)

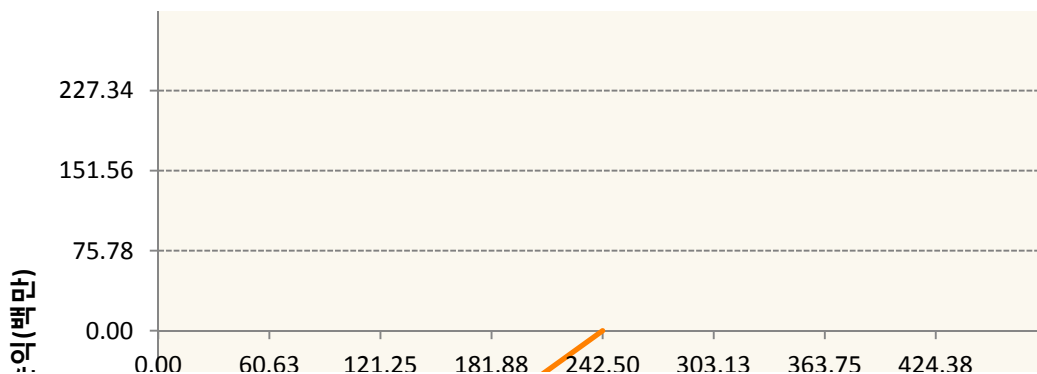
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	645	-645	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,672	-3,672	장내

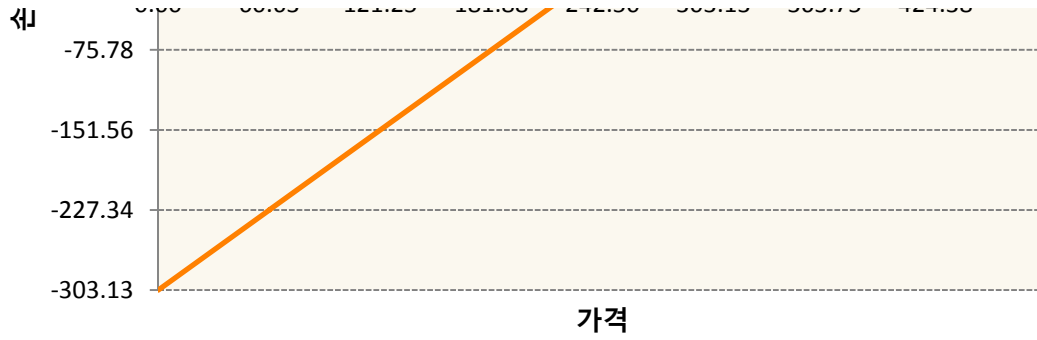
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

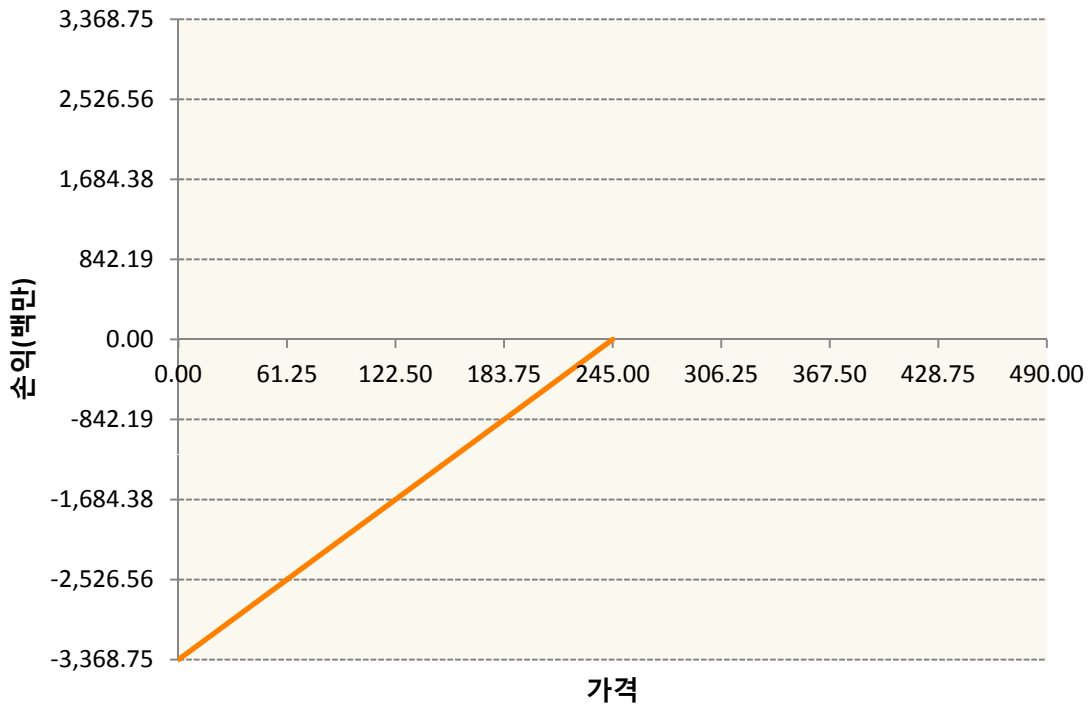


KR4301P92425-2019-09 풋242.5





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%	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%	-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%	-7	-7	-7	-7	-7	-8	-8
-5.33%	-1	-2	-2	-2	-2	-3	-3
-2.67%	0	0	0	0	0	-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

112

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-104	-105	-106	-107	-109	-111	-112
-5.33%	-30	-33	-36	-39	-42	-45	-48
-2.67%	-2	-4	-6	-7	-9	-12	-14
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
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)

92

공시일	2019-09-04
기준일	2019-09-03

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	19,776	0	19,776	
누계	통화	선도	0	19,328	-19,328	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		525
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		39
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		331

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

(단위:백만원)

503

공시일	2019-09-04
기준일	2019-09-03

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	383	0	383	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	2019-09-04
기준일	2019-09-03

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

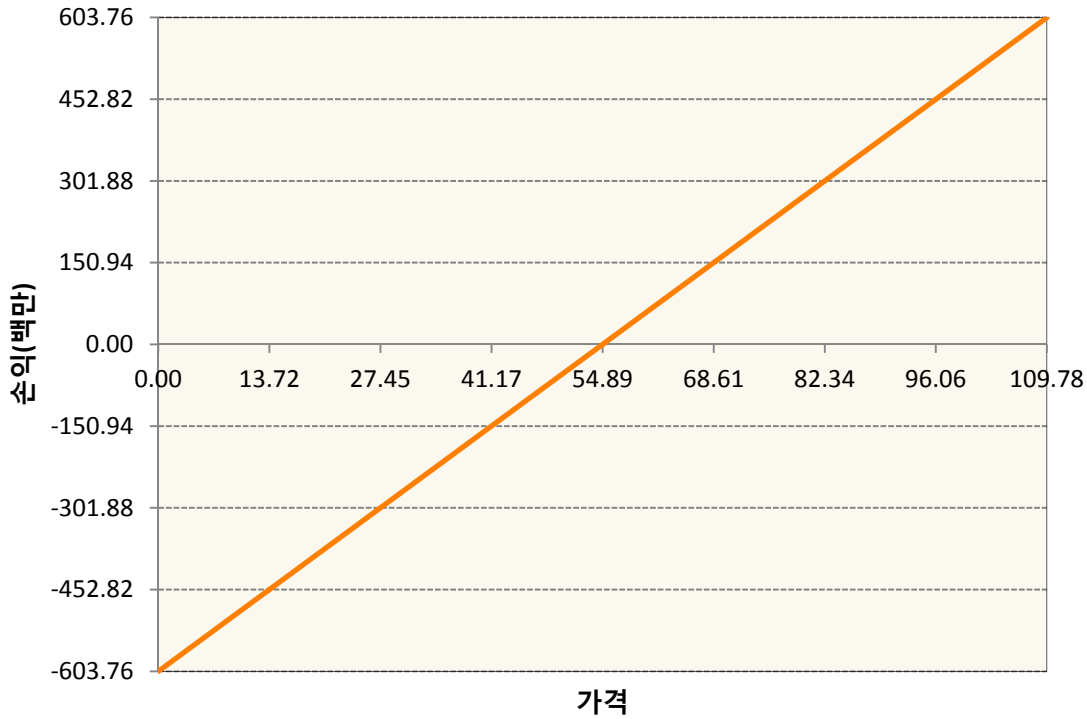
1. 계약금액

(단위:백만원)

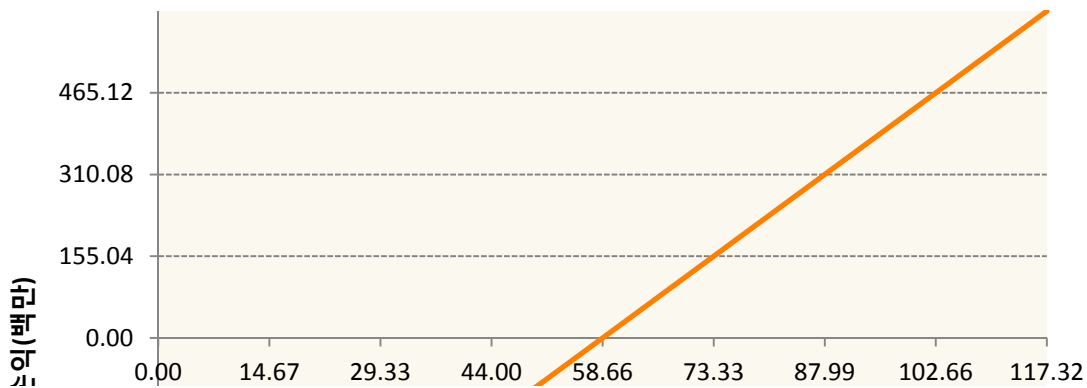
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,227	122	2,105	
누계	유가증권	선물	189	0	189	장내

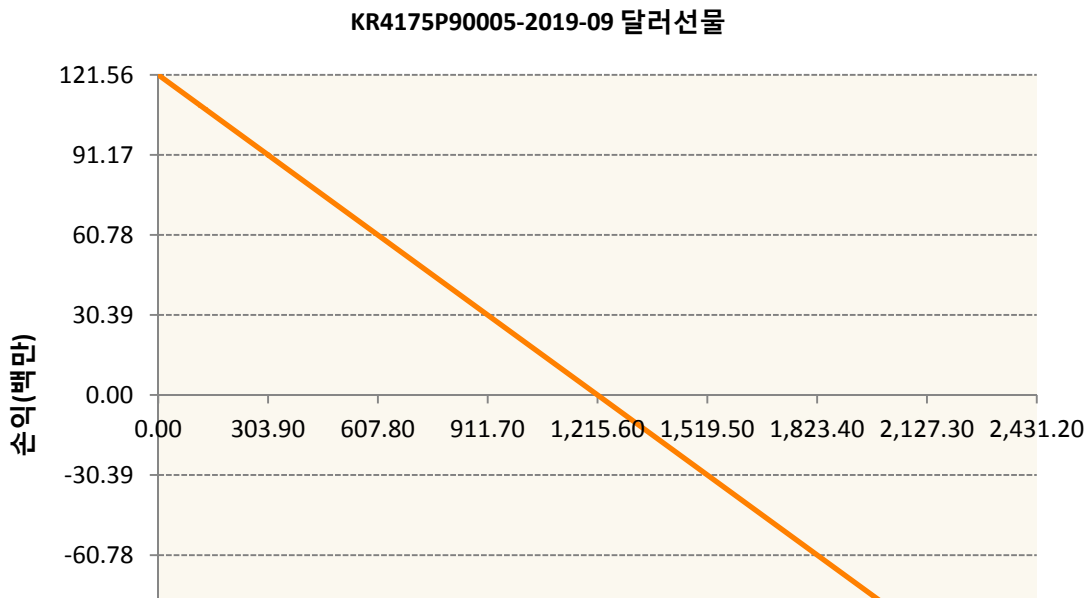
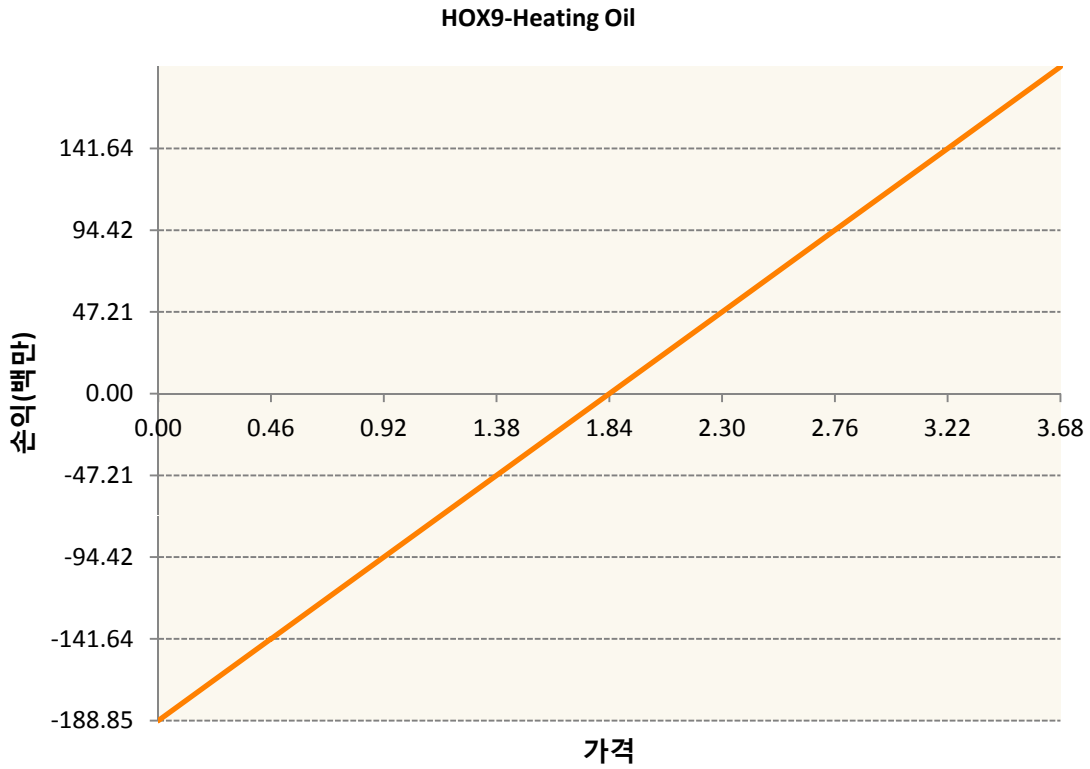
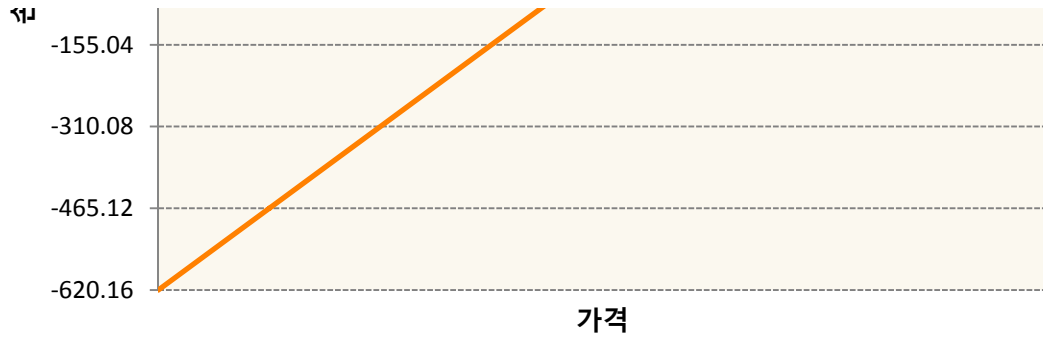
2. 만기시점의 손익구조

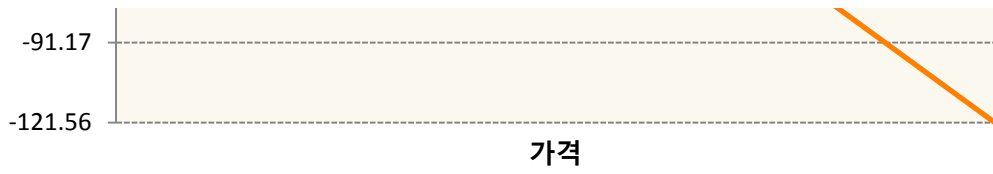
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19



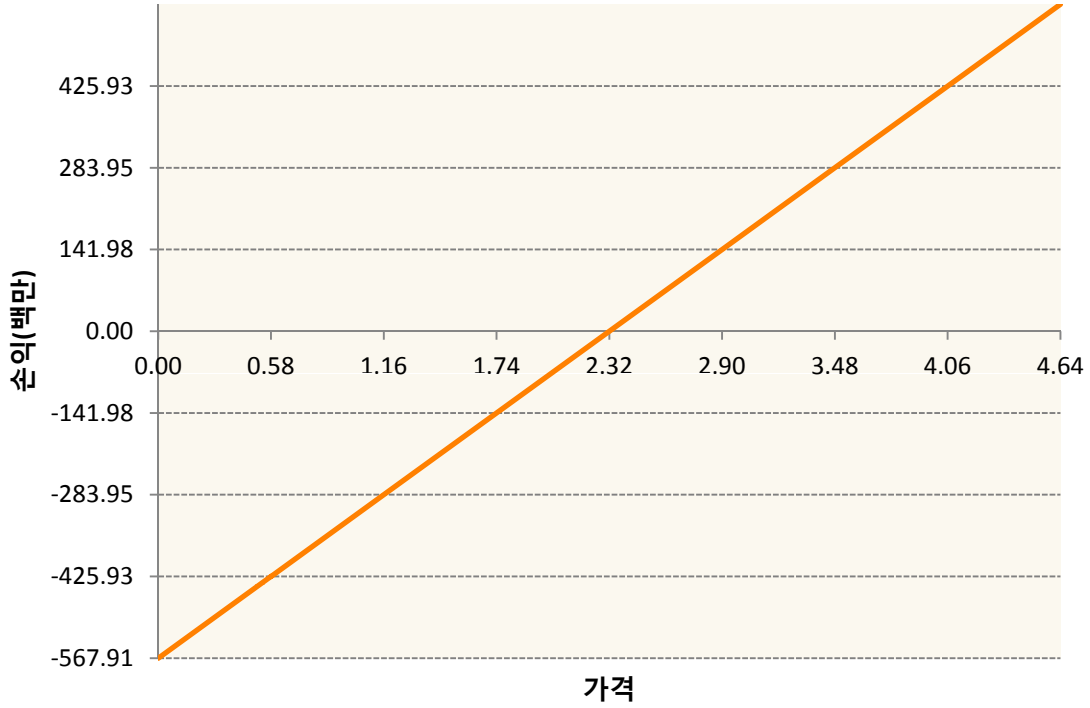
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19



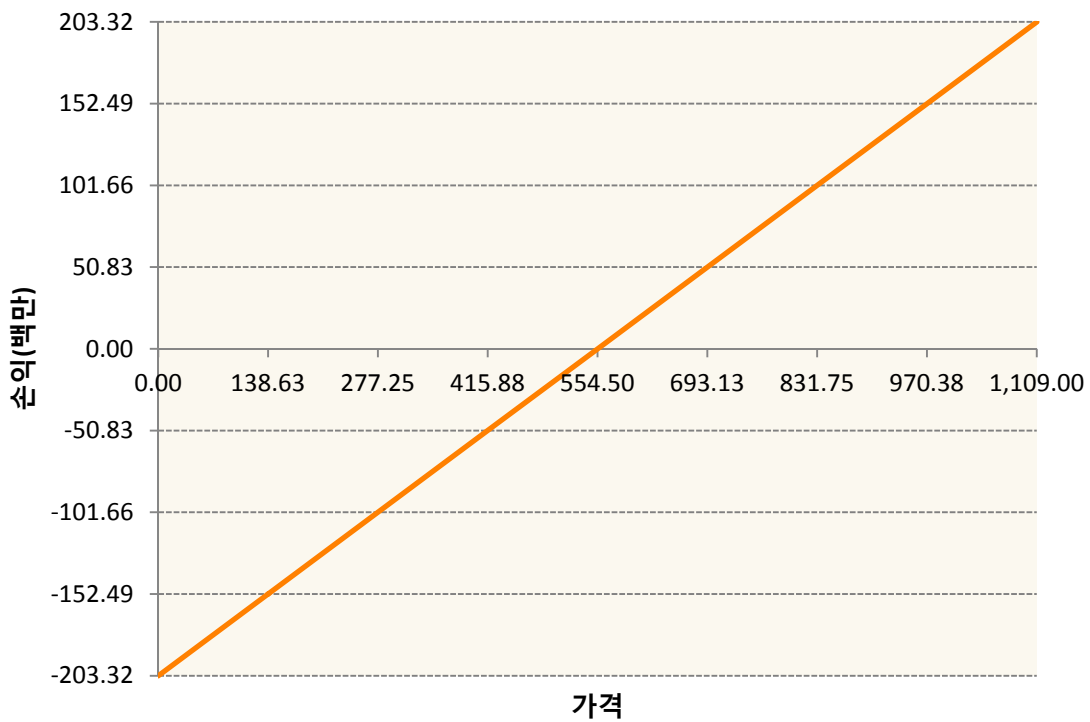


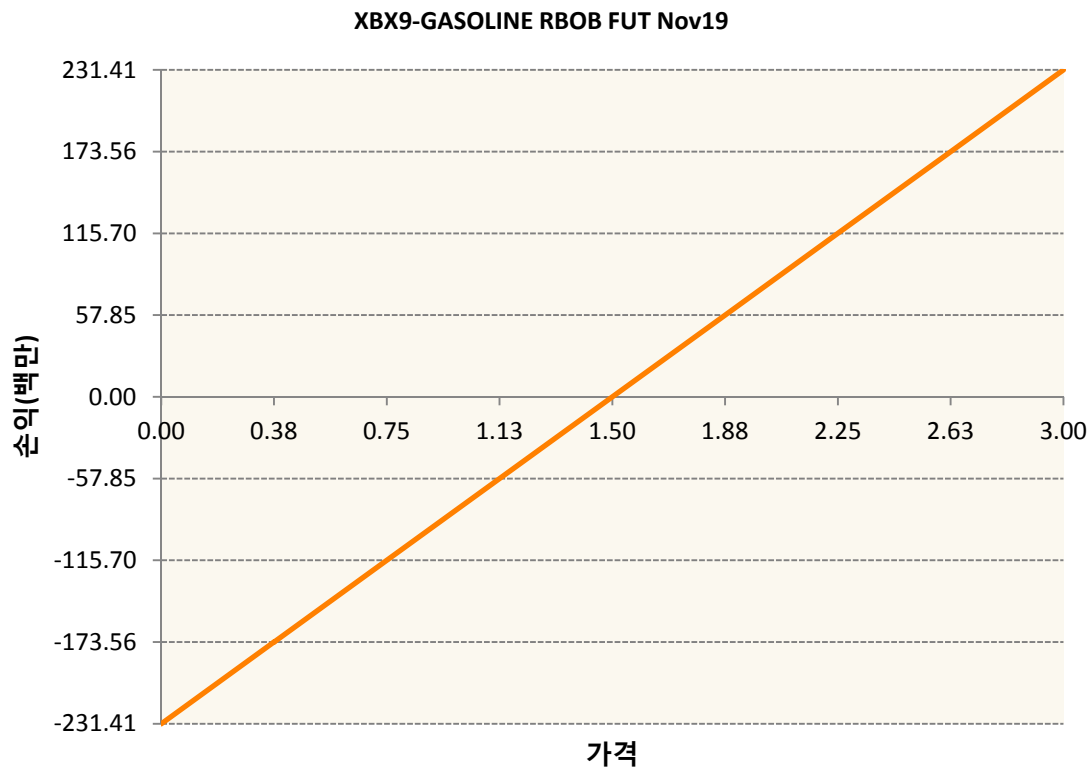


NGX19-NATURAL GAS FUTR Nov19



QSX9-Low Su Gasoil G Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLX9	WTI CRUDE FUTURE Nov19	48
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	50
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	19

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

373

공시일	2019-09-04
기준일	2019-09-03

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

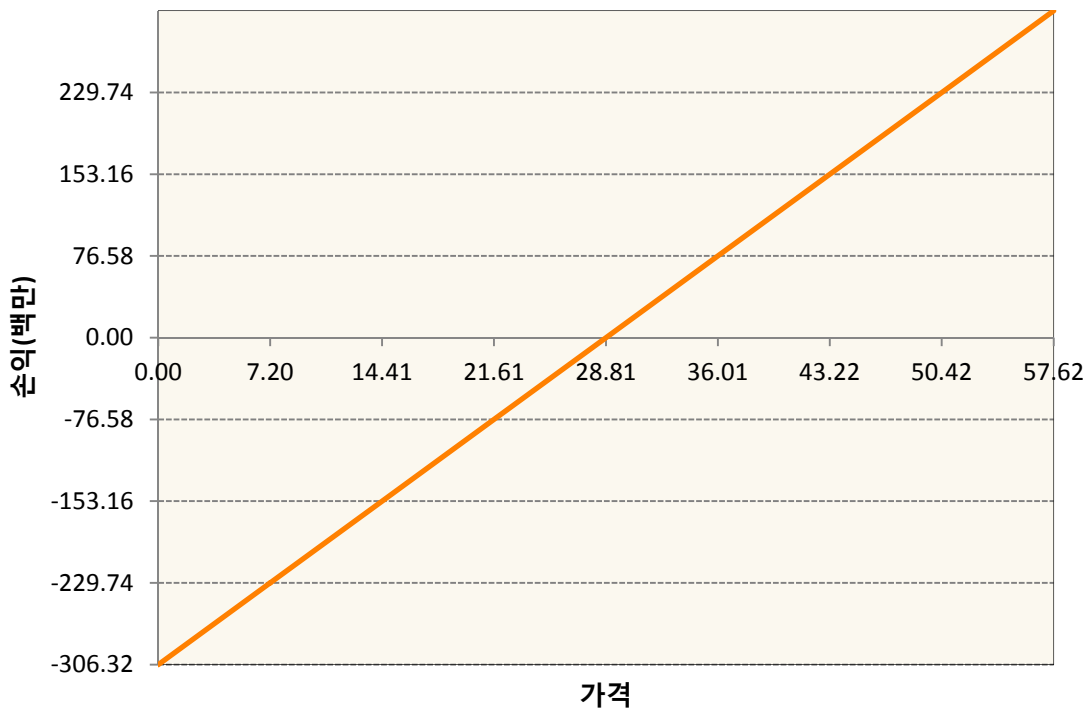
1. 계약금액

(단위:백만원)

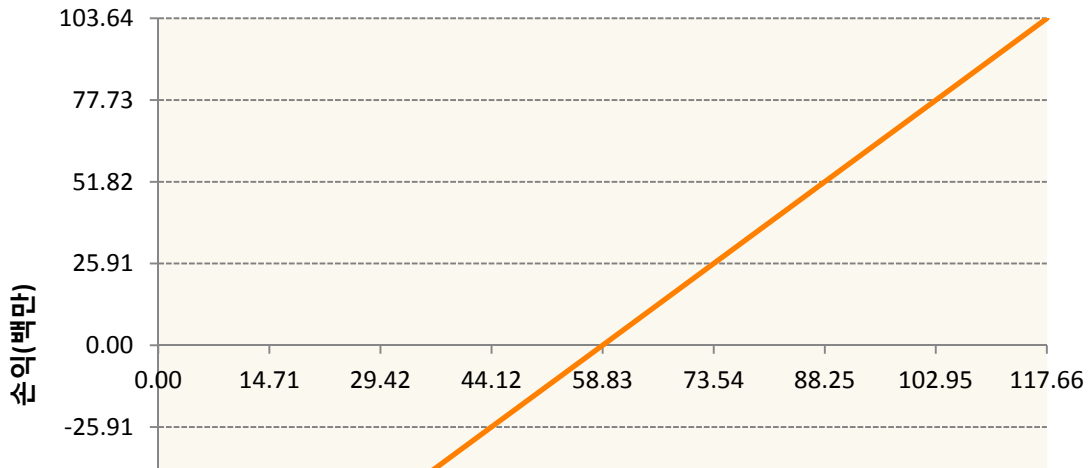
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,716	158	2,558	

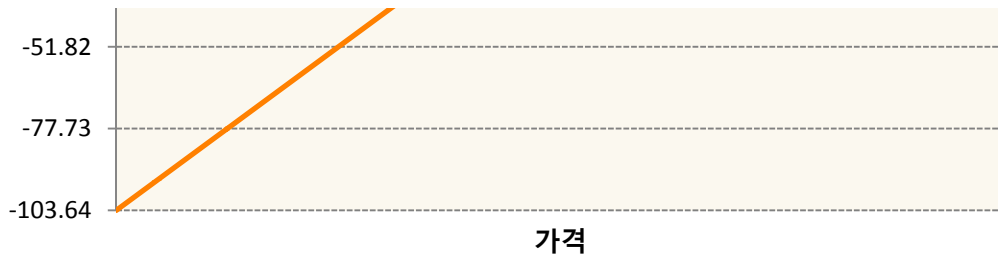
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

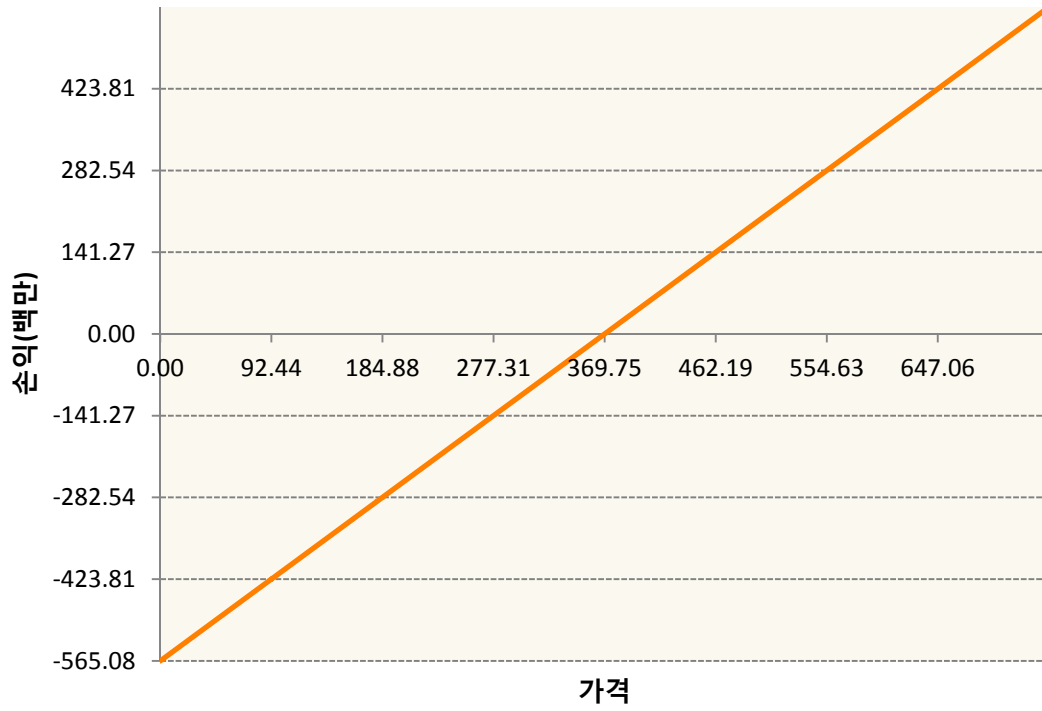


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

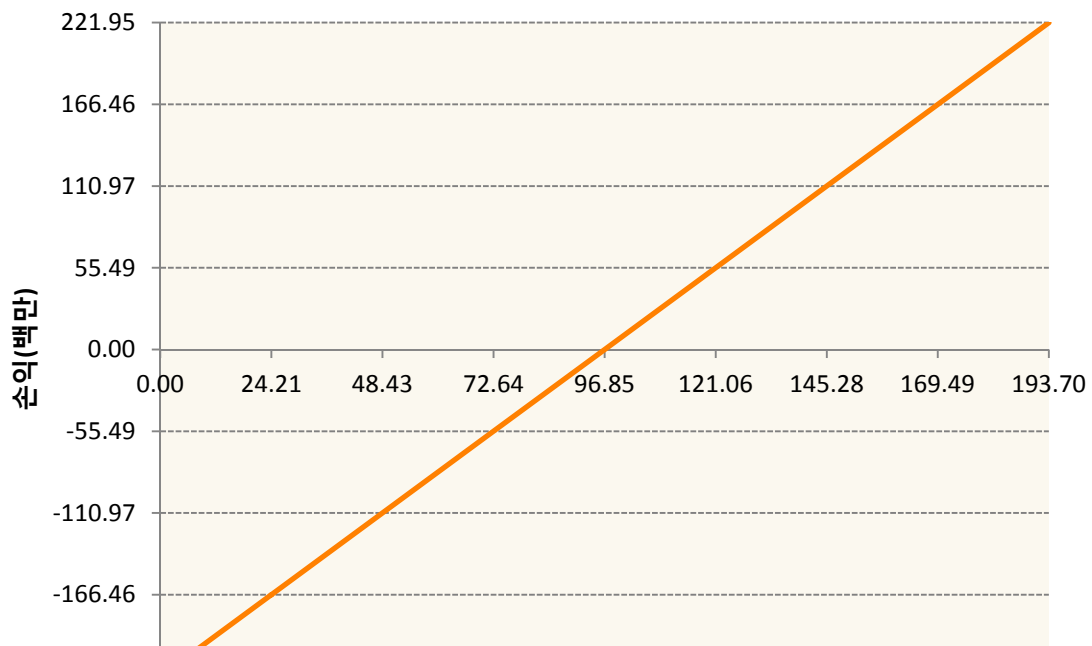


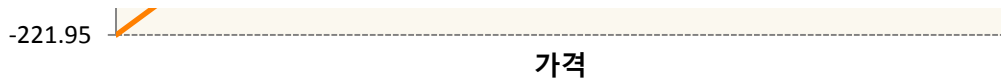


CZ9-CORN FUTURE Dec19

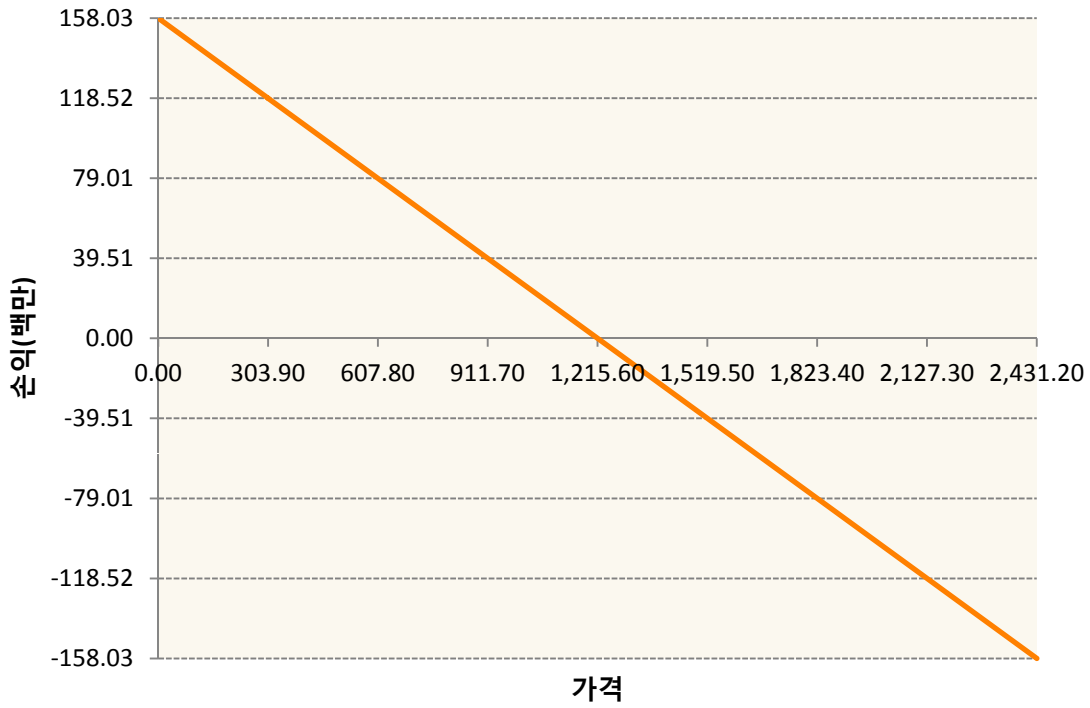


KCZ9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19

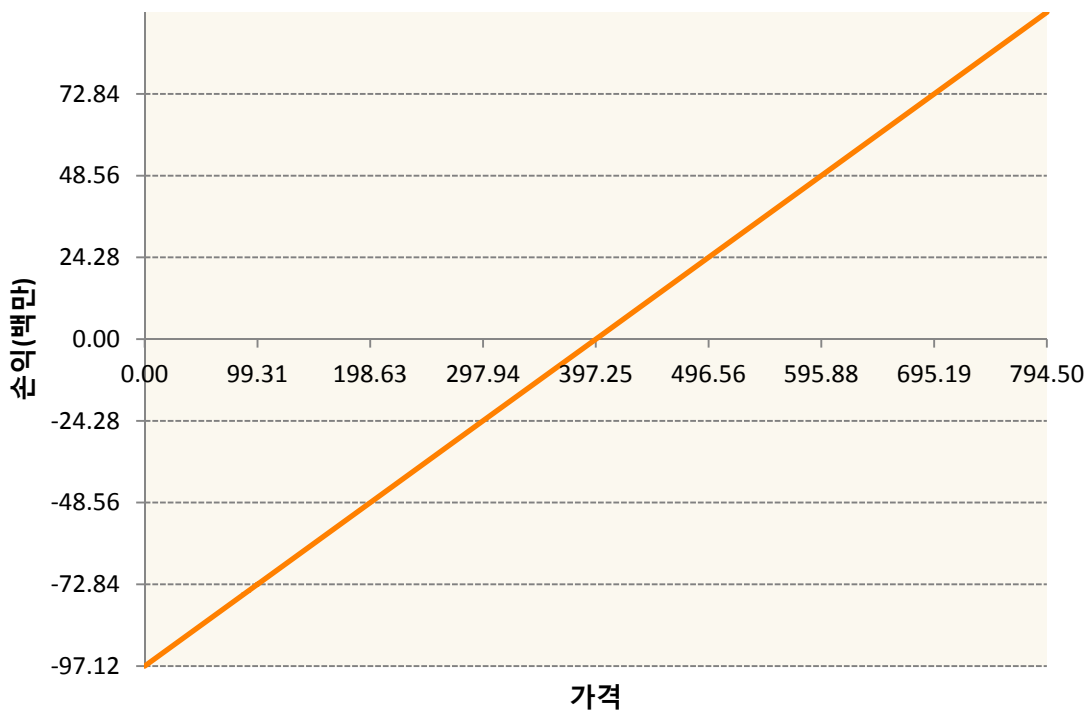




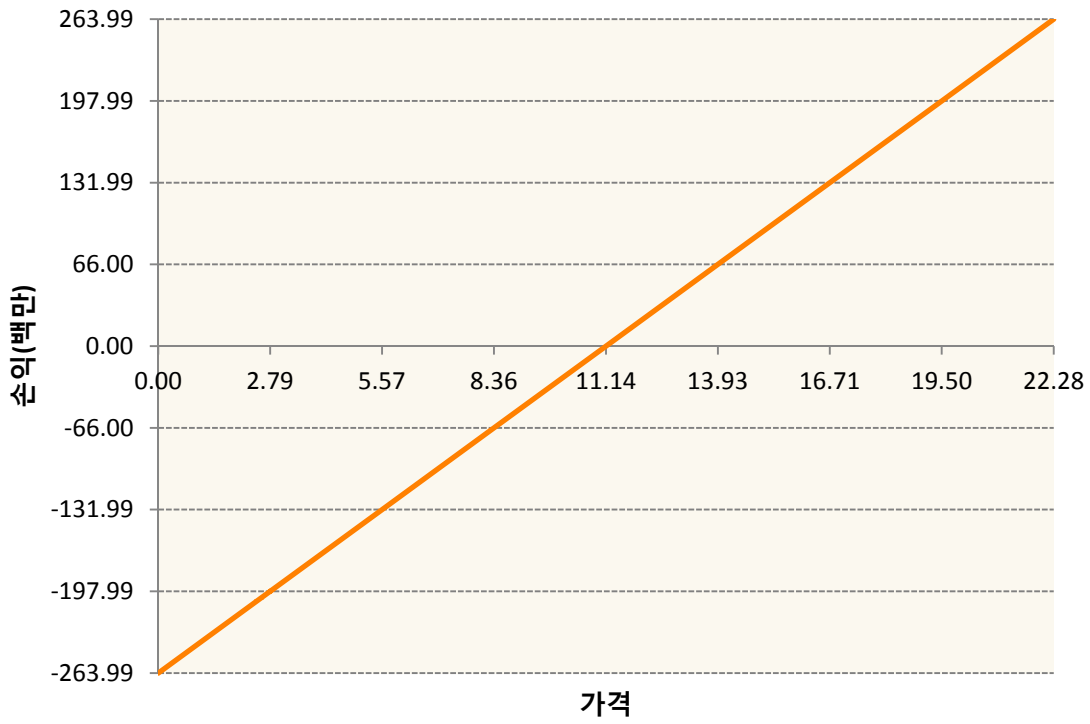
KR4175P90005-2019-09 달러선물



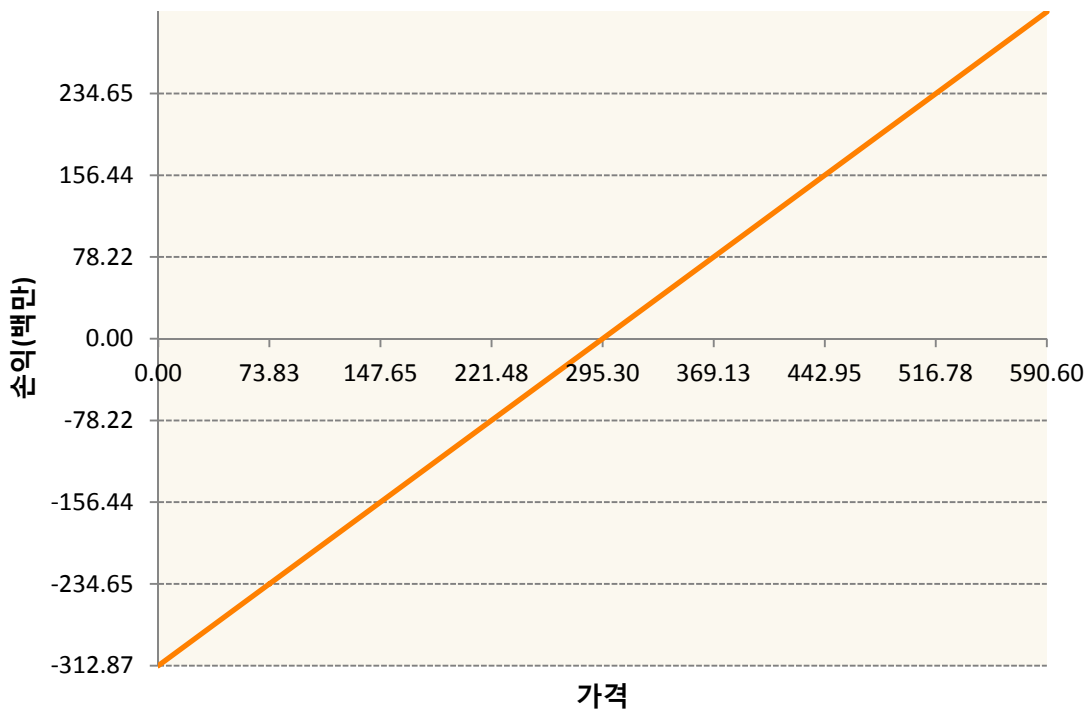
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



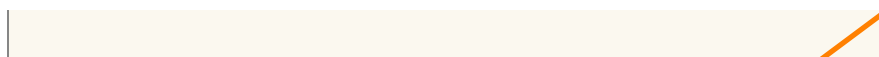
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

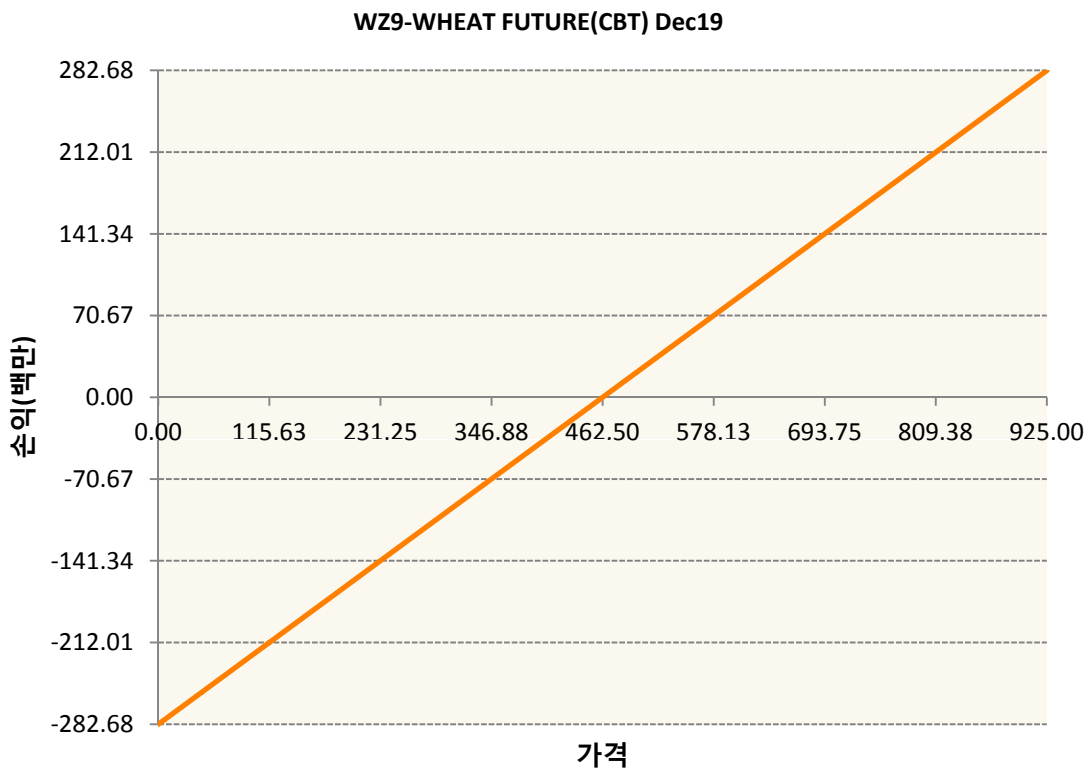
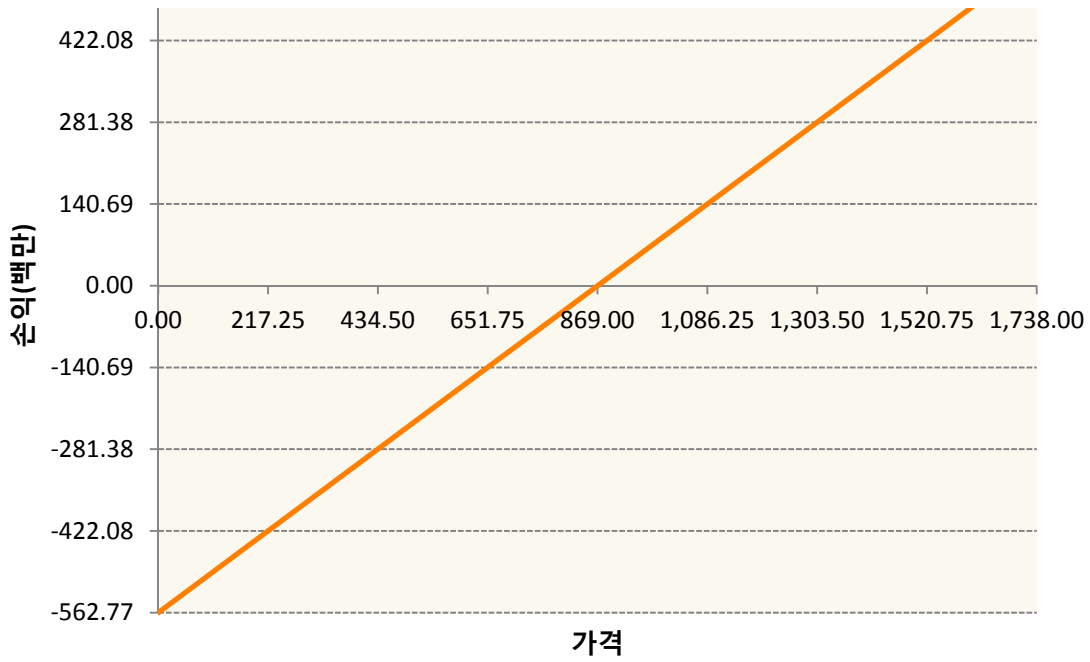


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	25
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)

241