

공시일	2019-09-06
기준일	2019-09-05

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)

91

공시일	2019-09-06
기준일	2019-09-05

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

1,155

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

662

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-06
기준일	2019-09-05

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)	389
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	142

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

843

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-06
기준일	2019-09-05

유로인덱스모(주식-파생형)

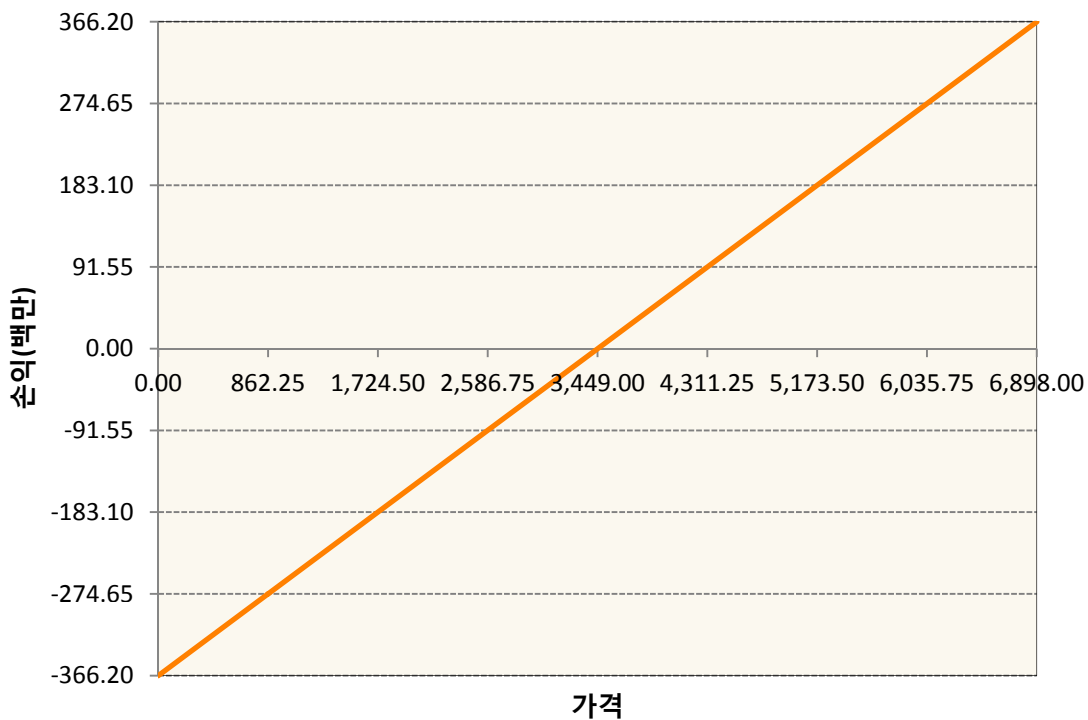
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	366	0	366	

2. 만기시점의 손익구조

VGU9-EURO STOXX 50 Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU9	EURO STOXX 50 Sep19	29
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

20

공시일	2019-09-06
기준일	2019-09-05

차이나인덱스모(주식-파생형)

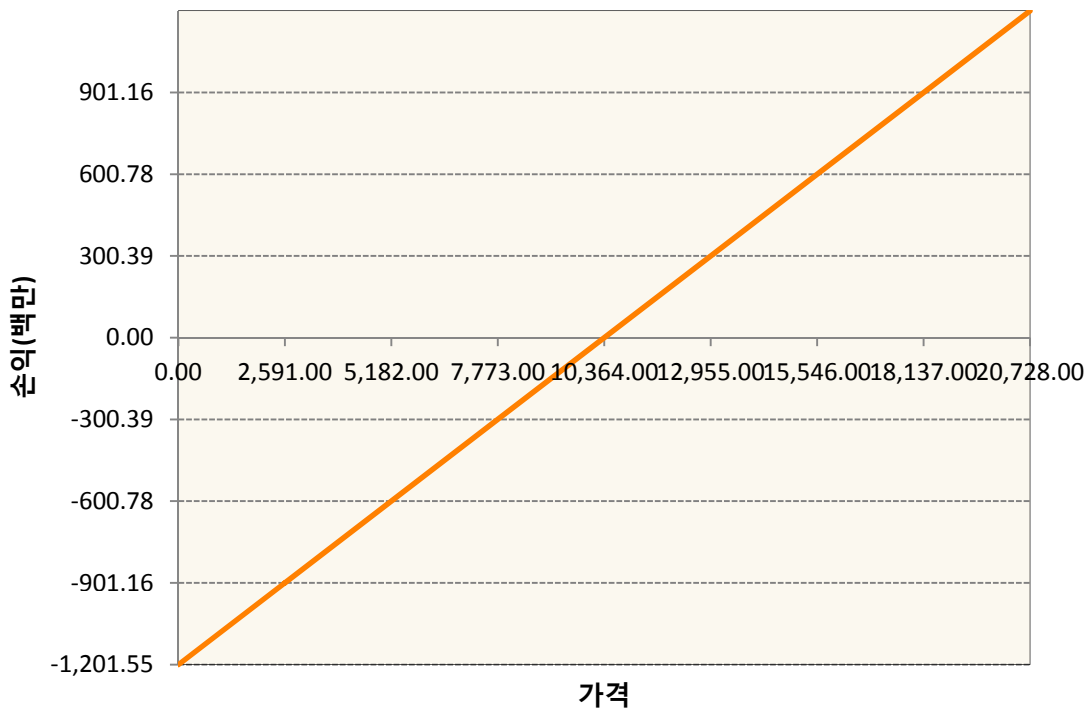
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,202	0	1,202	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCU9-HSCEI Futures Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU9	HSCEI Futures Sep19	96
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

90

공시일	2019-09-06
기준일	2019-09-05

커버드콜모(주식혼합-파생형)

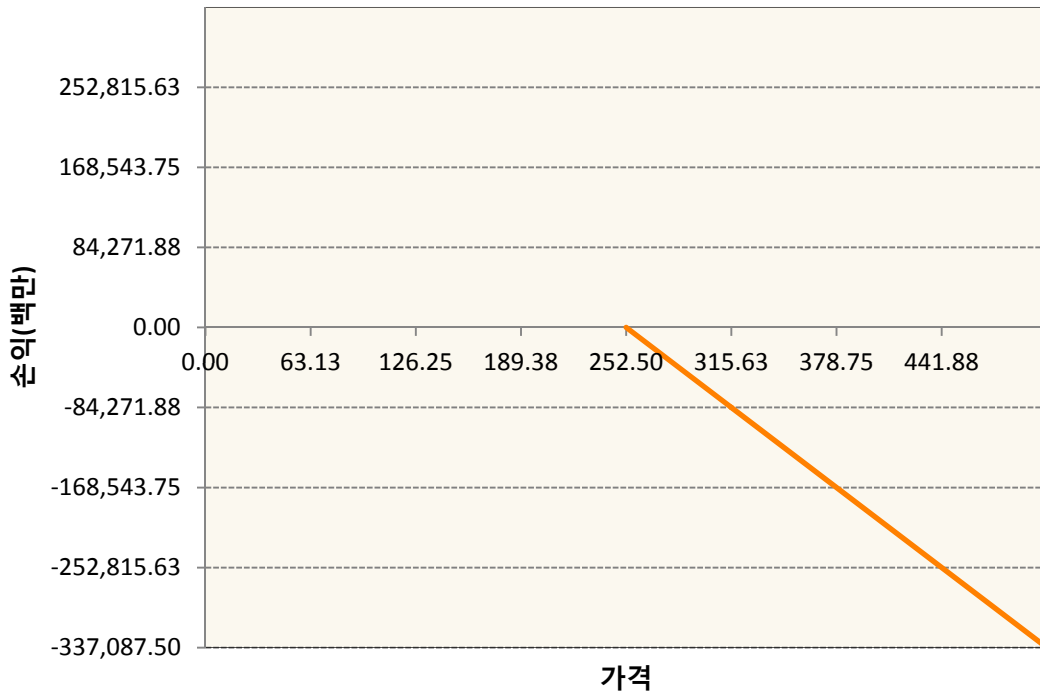
1. 계약금액

(단위:백만원)

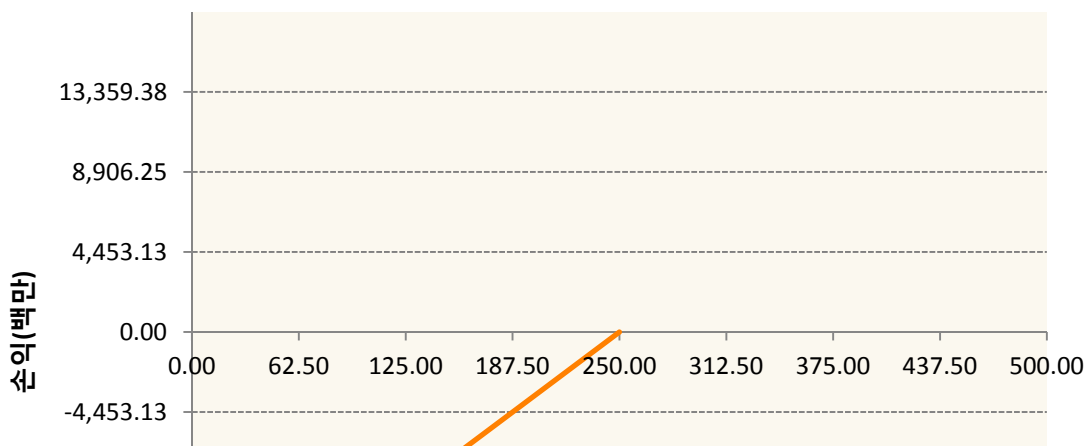
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	8,536	0	8,536	장내
누계	유가증권	옵션	0	501,034	-501,034	장내

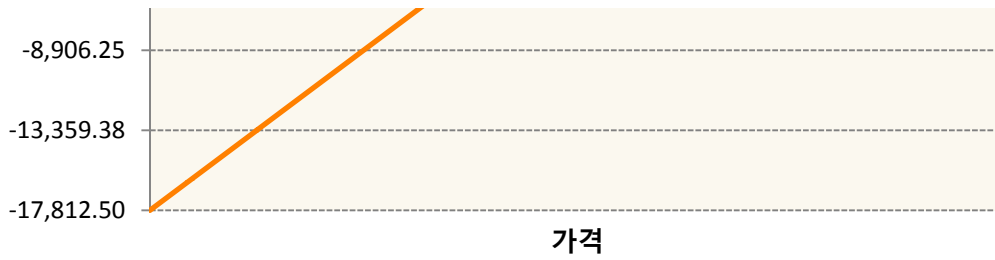
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P92526-2019-09 콜252.5

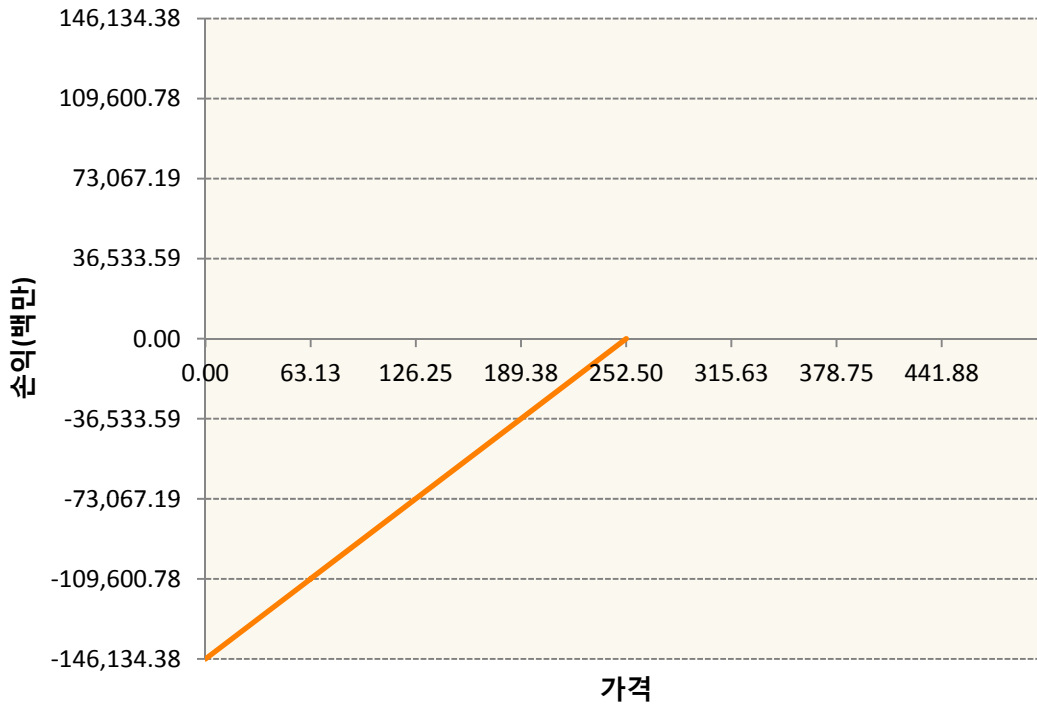


KR4301P92508-2019-09 풋250





KR4301P92524-2019-09 풋252.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P92526		2019-09 콜252.5					27,736	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	16,083	15,935	15,759	15,559	15,339	15,100	14,847	
-5.33%	14,184	13,819	13,450	13,079	12,706	12,331	11,955	
-2.67%	8,726	8,420	8,100	7,769	7,429	7,083	6,732	
0%	369	274	150	0	-174	-370	-585	
2.67%	-8,913	-8,925	-8,948	-8,985	-9,038	-9,108	-9,197	
5.33%	-18,317	-18,317	-18,319	-18,325	-18,334	-18,351	-18,377	
8.00%	-27,727	-27,727	-27,727	-27,727	-27,728	-27,731	-27,736	
KR4301P92508		2019-09 풋250					516	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-486	-489	-493	-497	-503	-509	-516	

-5.33%	-101	-113	-125	-137	-150	-162	-174
-2.67%	-3	-6	-9	-14	-19	-25	-31
0%	0	0	0	0	0	-1	-2
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							5,472
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,353	-5,361	-5,373	-5,390	-5,412	-5,440	-5,472
-5.33%	-1,672	-1,759	-1,848	-1,939	-2,032	-2,126	-2,220
-2.67%	-110	-162	-222	-286	-356	-429	-506
0%	14	11	7	0	-11	-26	-45
2.67%	15	15	15	14	14	13	11
5.33%	15	15	15	15	15	15	15
8.00%	15	15	15	15	15	15	15

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

(단위:백만원)

32,468

공시일	2019-09-06
기준일	2019-09-05

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

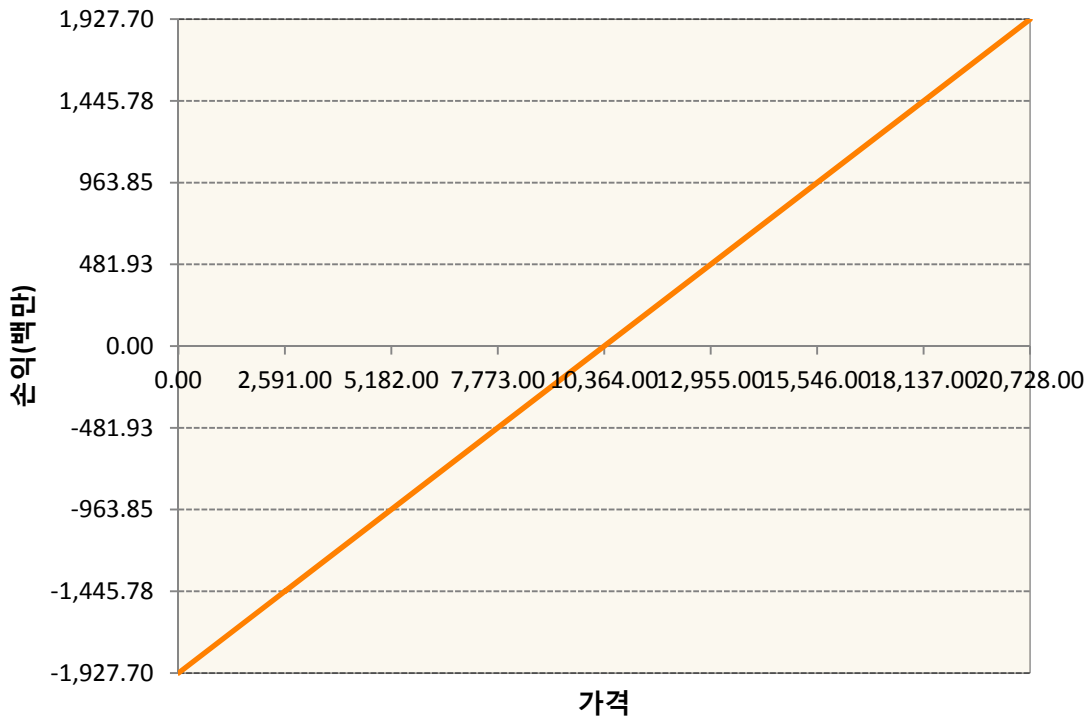
1. 계약금액

(단위:백만원)

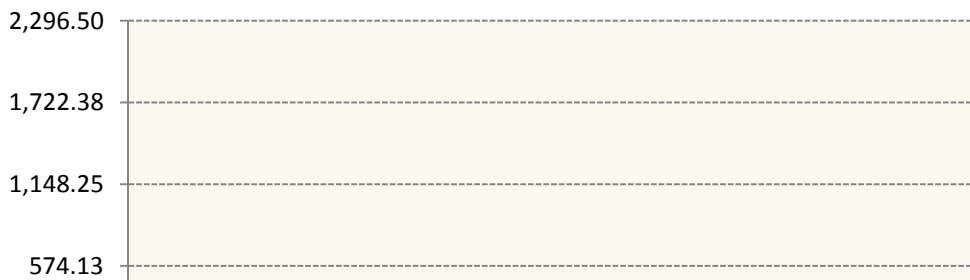
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,928	0	1,928	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,896	-4,896	장내
누계	통화	선도	77	2,845	-2,768	장외

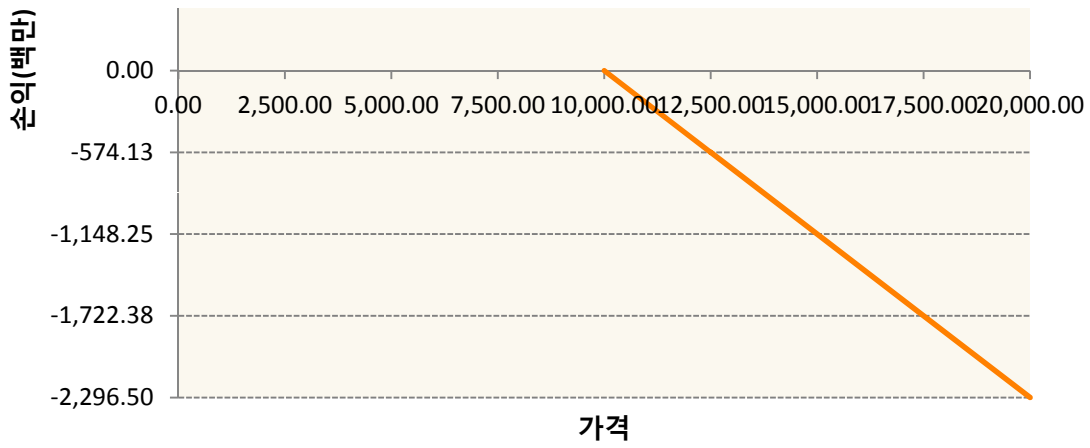
2. 만기시점의 손익구조

HCU9-HSCEI Futures Sep19

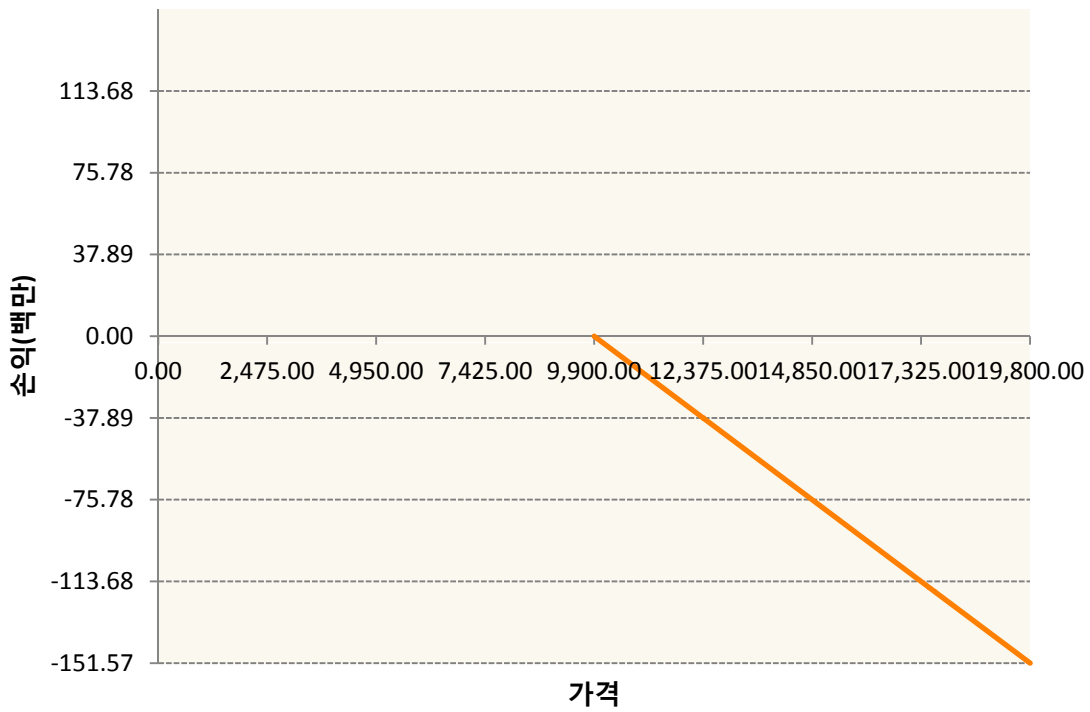


OHHIU9-C100-HSCEI

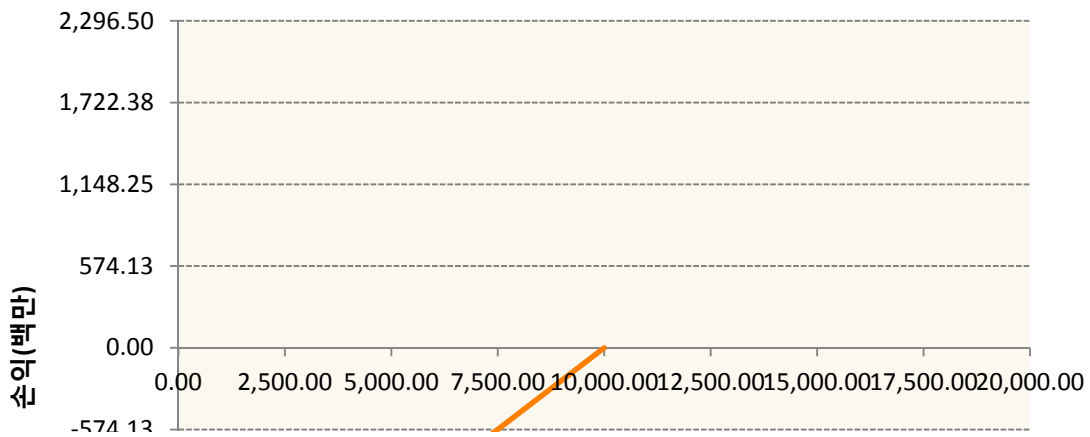


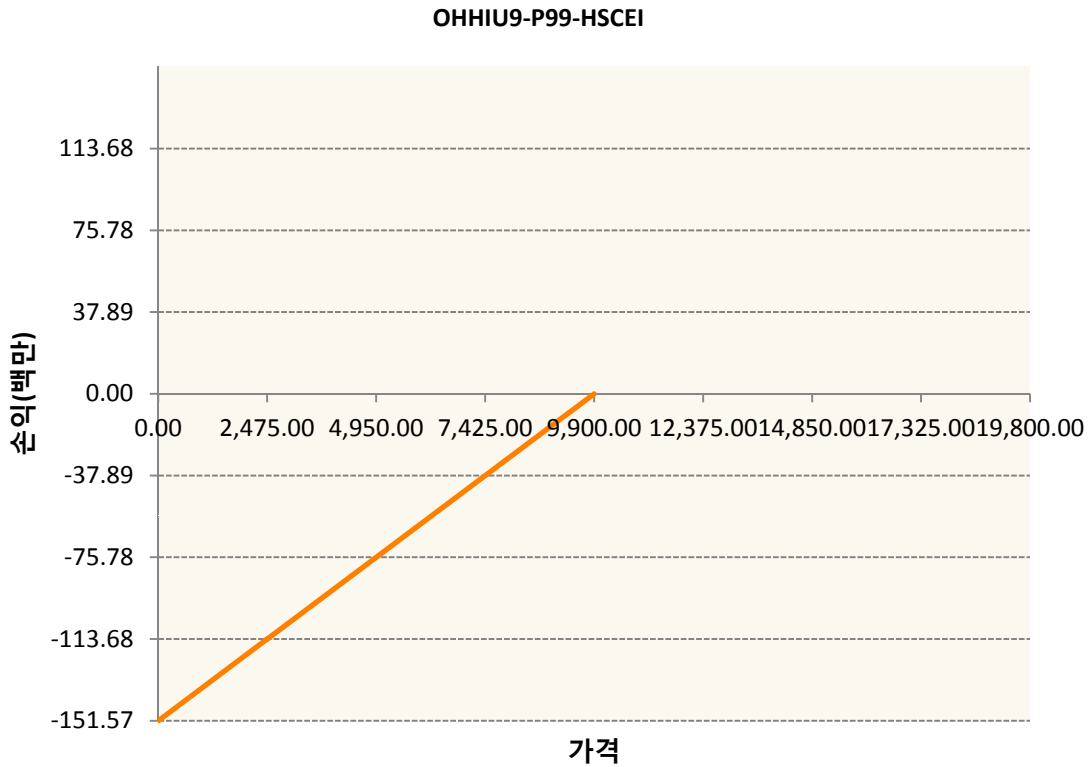


OHHIU9-C99-HSCEI



OHHIU9-P100-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	228
FX21019U00 HKD/KRW 22-11-19E	6
HCU9 HSCEI Futures Sep19	154
OHHIU9-C1(HSCEI	184
OHHIU9-C9(HSCEI	12
OHHIU9-P1(HSCEI	184
OHHIU9-P9(HSCEI	12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	586

공시일	2019-09-06
기준일	2019-09-05

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

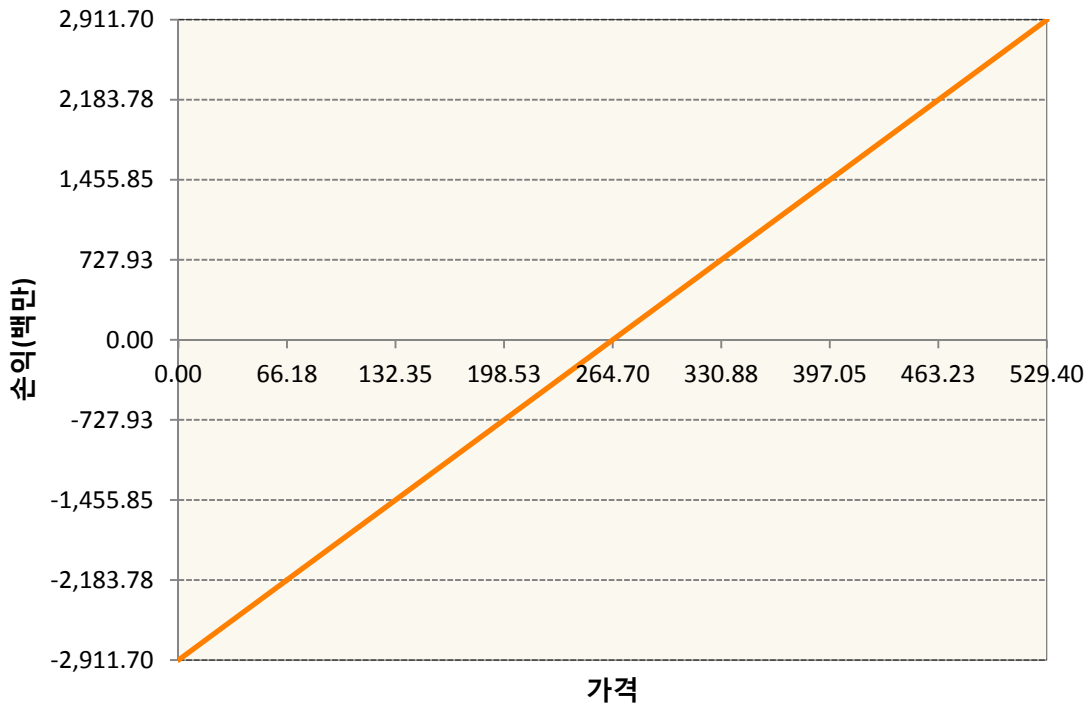
1. 계약금액

(단위:백만원)

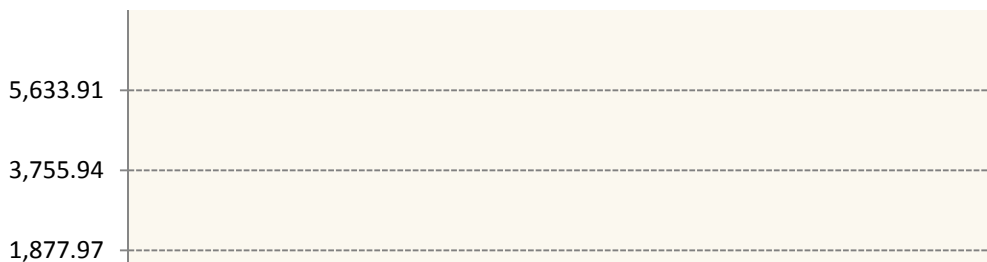
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	243	0	243	장내
누계	유가증권	선물	2,912	0	2,912	장내
누계	유가증권	스왑	14,125	0	14,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,576	-14,576	장내

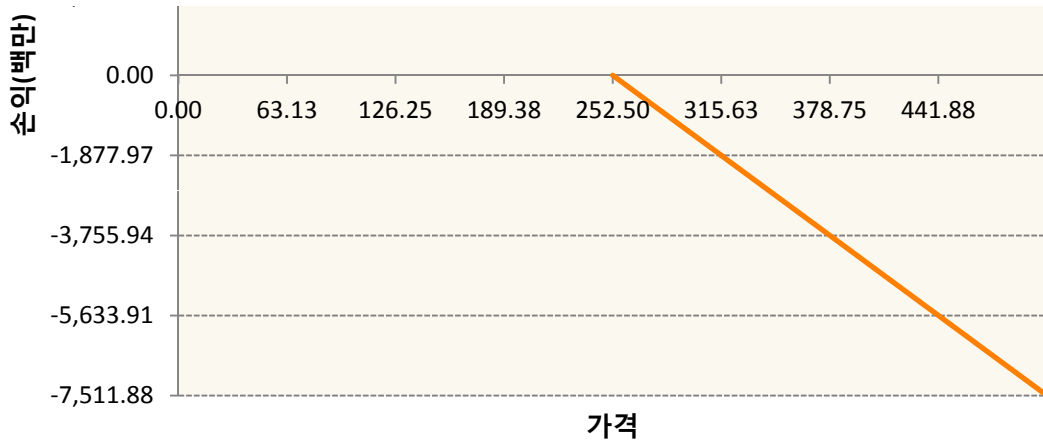
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

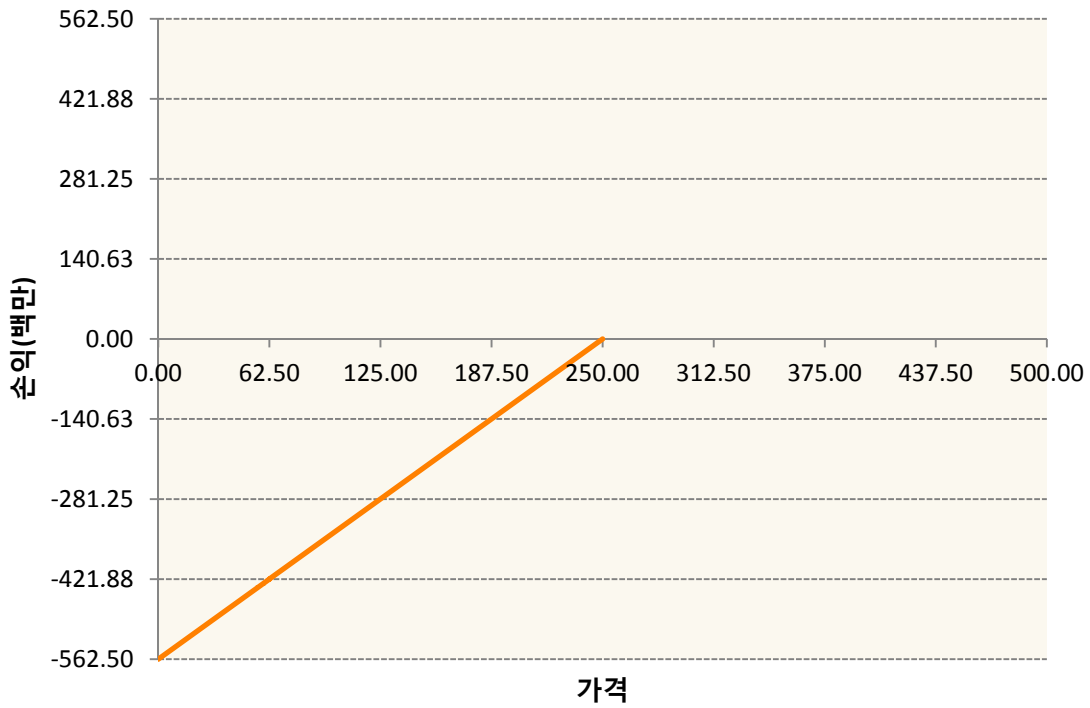


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

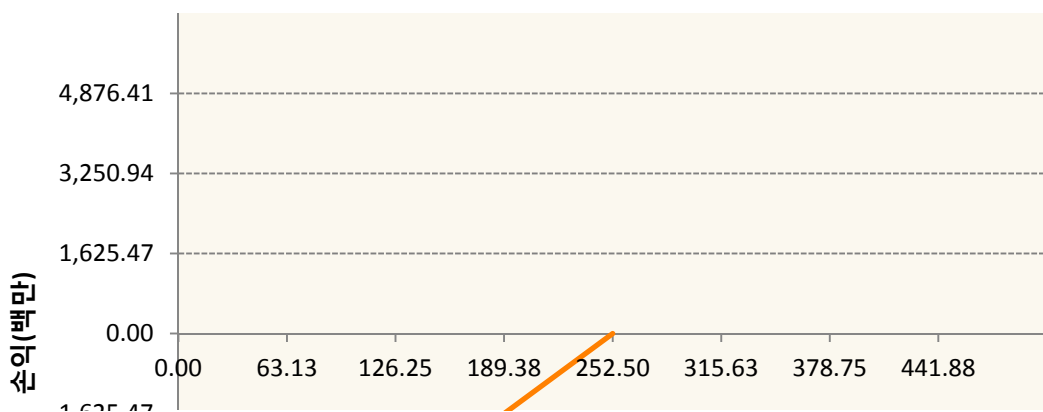




KR4301P92508-2019-09 풋250



KR4301P92524-2019-09 풋252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						1,221
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,221	-1,221	-1,221	-1,221	-1,221	-1,221	-1,221	
-5.33%	-814	-814	-814	-814	-814	-814	-814	
-2.67%	-407	-407	-407	-407	-407	-407	-407	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	407	407	407	407	407	407	407	
5.33%	814	814	814	814	814	814	814	
8.00%	1,221	1,221	1,221	1,221	1,221	1,221	1,221	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						233
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-233	-233	-233	-233	-233	-233	-233	
-5.33%	-155	-155	-155	-155	-155	-155	-155	
-2.67%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	78	78	78	78	78	78	78	
5.33%	155	155	155	155	155	155	155	
8.00%	233	233	233	233	233	233	233	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5						618
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	358	355	351	347	342	337	331	
-5.33%	316	308	300	291	283	275	266	
-2.67%	194	188	180	173	166	158	150	
0%	8	6	3	0	-4	-8	-13	
2.67%	-199	-199	-199	-200	-201	-203	-205	
5.33%	-408	-408	-408	-408	-409	-409	-410	
8.00%	-618	-618	-618	-618	-618	-618	-618	
KR4301P92508		2019-09 풋250						16
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-15	-15	-16	-16	-16	-16	-16
-5.33%	-3	-4	-4	-4	-5	-5	-6
-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
KR4301P92524 2019-09 풋252.5							243
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-238	-239	-239	-240	-241	-242	-243
-5.33%	-74	-78	-82	-86	-90	-95	-99
-2.67%	-5	-7	-10	-13	-16	-19	-22
0%	1	1	0	0	0	-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)

2,188

공시일	2019-09-06
기준일	2019-09-05

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

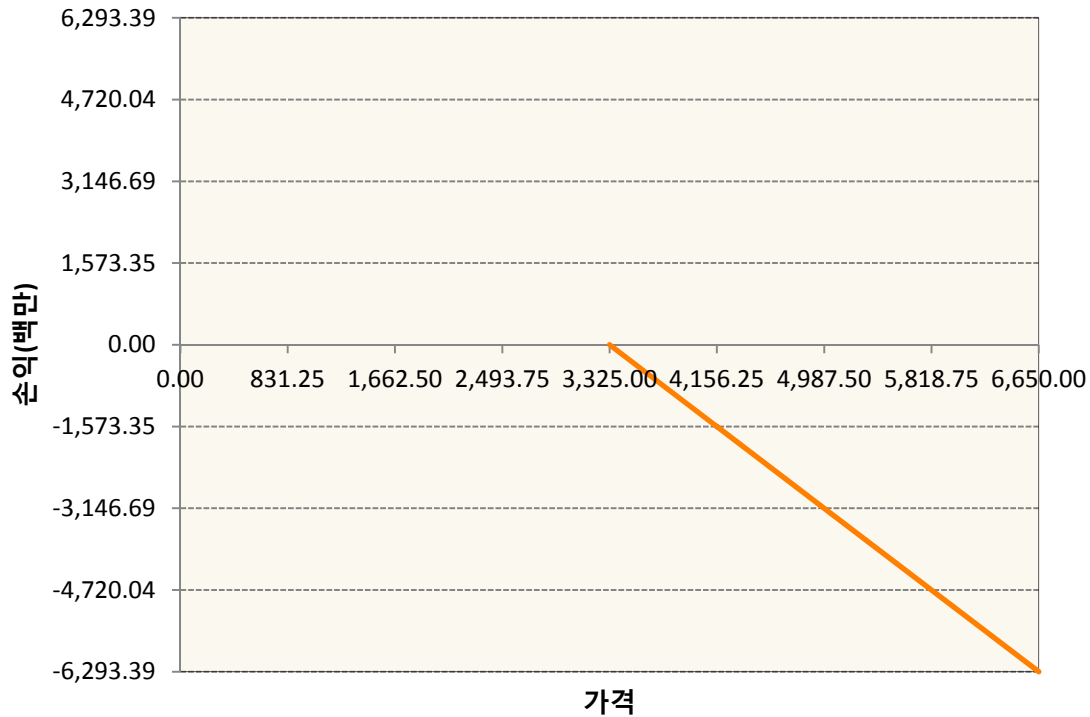
1. 계약금액

(단위:백만원)

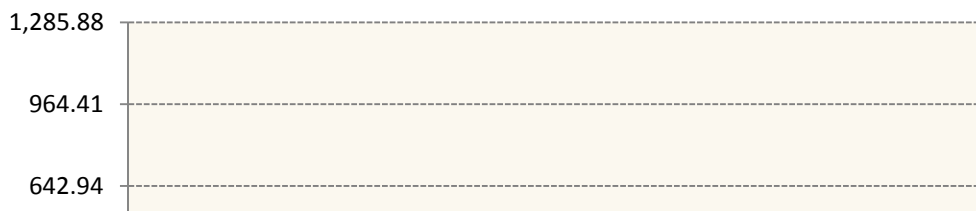
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,067	0	5,067	
누계	유가증권	옵션	0	15,159	-15,159	장내
누계	지수	스왑	24,085	0	24,085	장외
누계	통화	선도	9,000	17,207	-8,206	장외

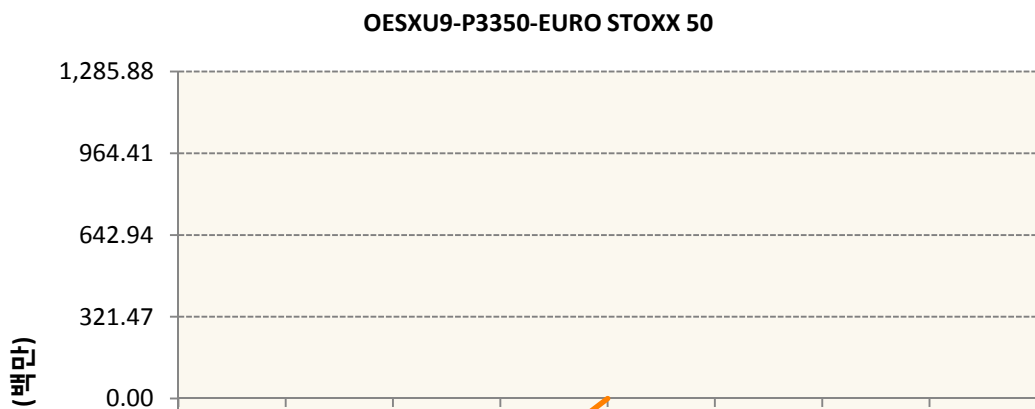
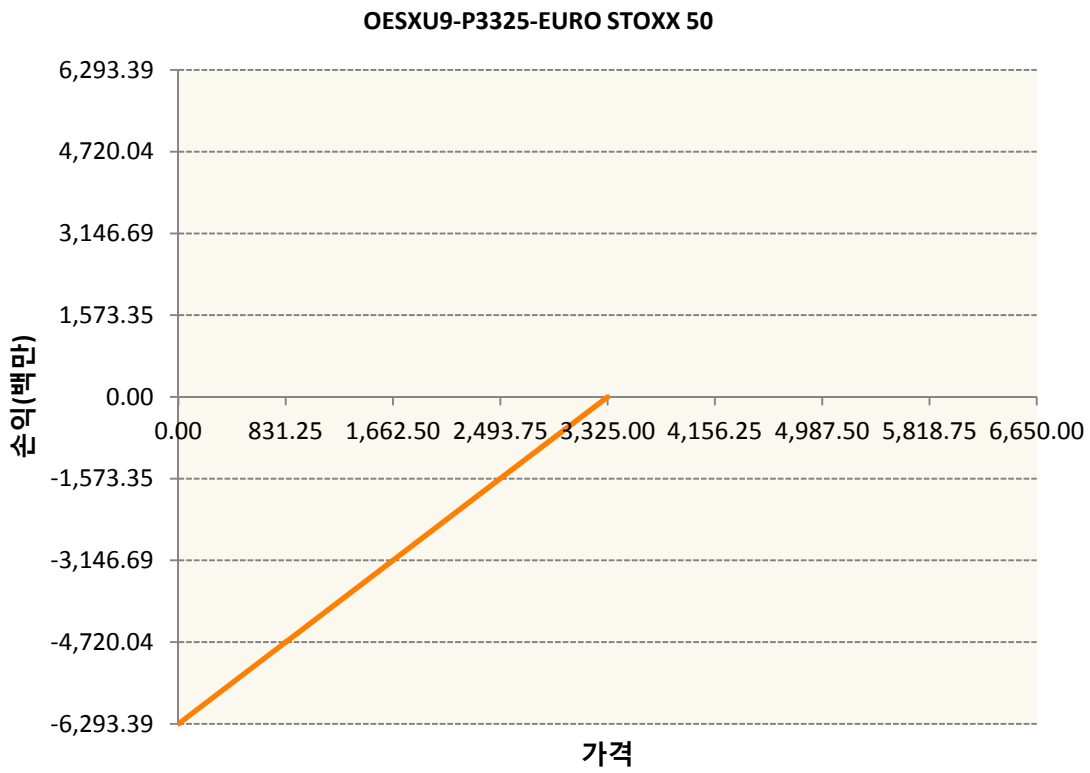
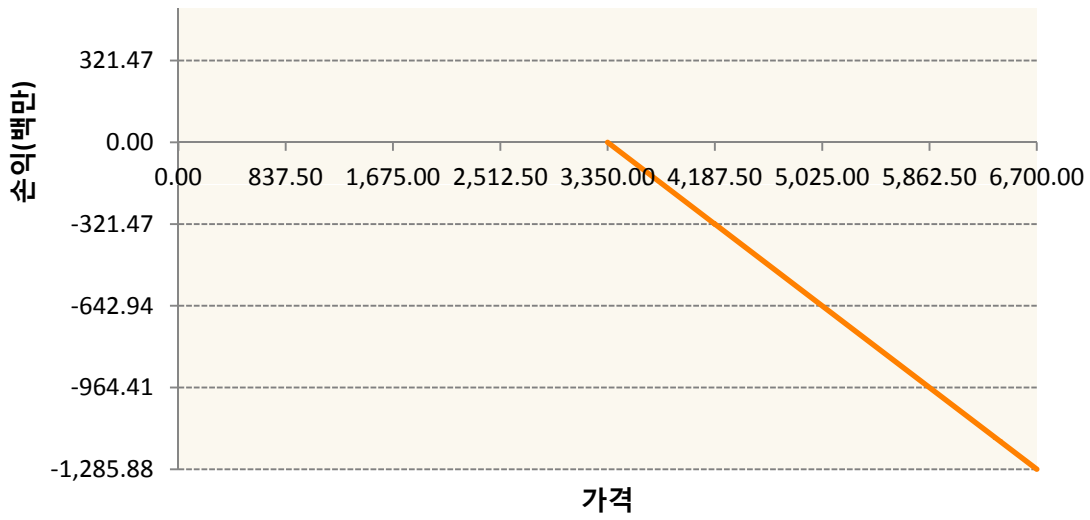
2. 만기시점의 손익구조

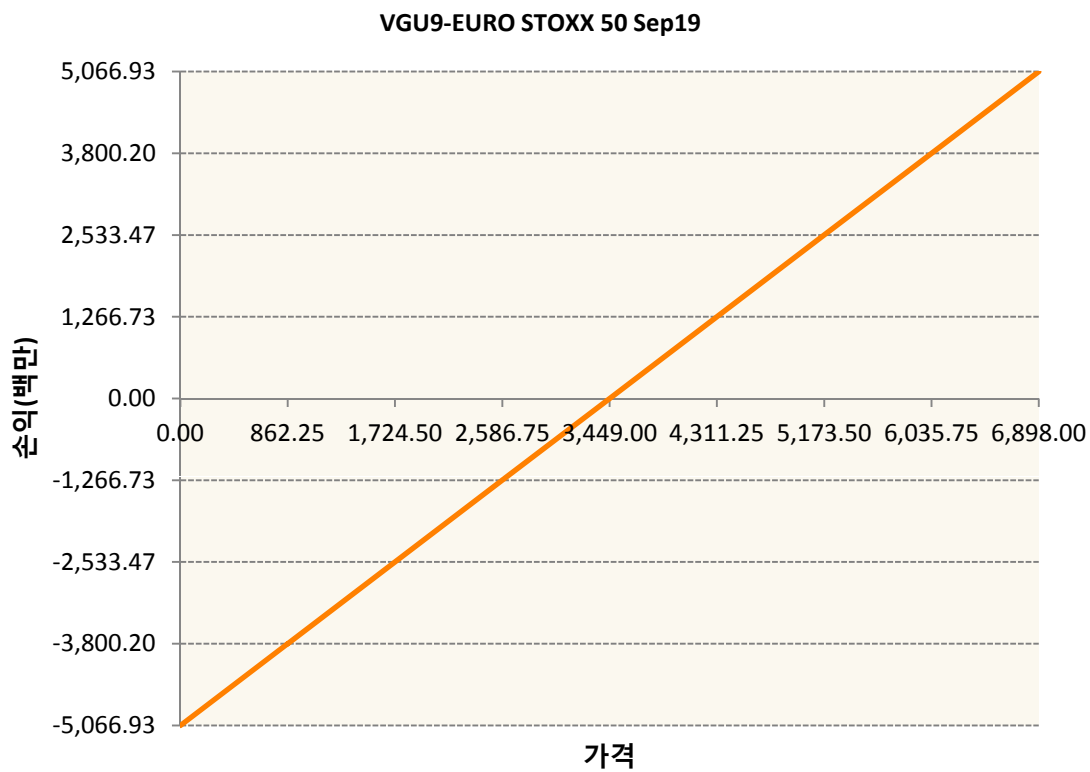
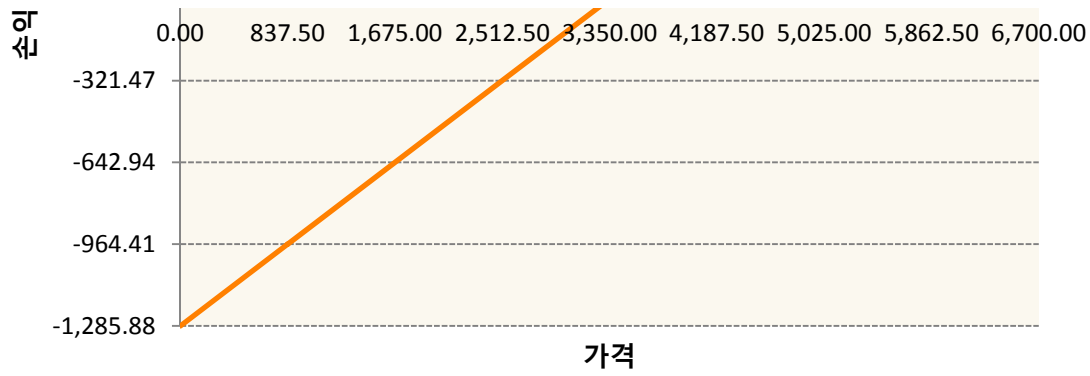
OESXU9-C3325-EURO STOXX 50



OESXU9-C3350-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	24
FX21019M0< KRW/EUR 27-09-19E	1,059
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	318
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E	318
FX21019N04 EUR/KRW 27-09-19E	233
FX21019Q00 EUR/KRW 27-09-19E	169
OESXU9-C3< EURO STOXX 50	503
OESXU9-C3< EURO STOXX 50	103
OESXU9-P3< EURO STOXX 50	503
OESXU9-P3< EURO STOXX 50	103
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	405

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

(단위:백만원)

2,137

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

(단위:백만원)

960

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

(단위:백만원)

82

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

(단위:백만원)

128

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-09-06
기준일	2019-09-05

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

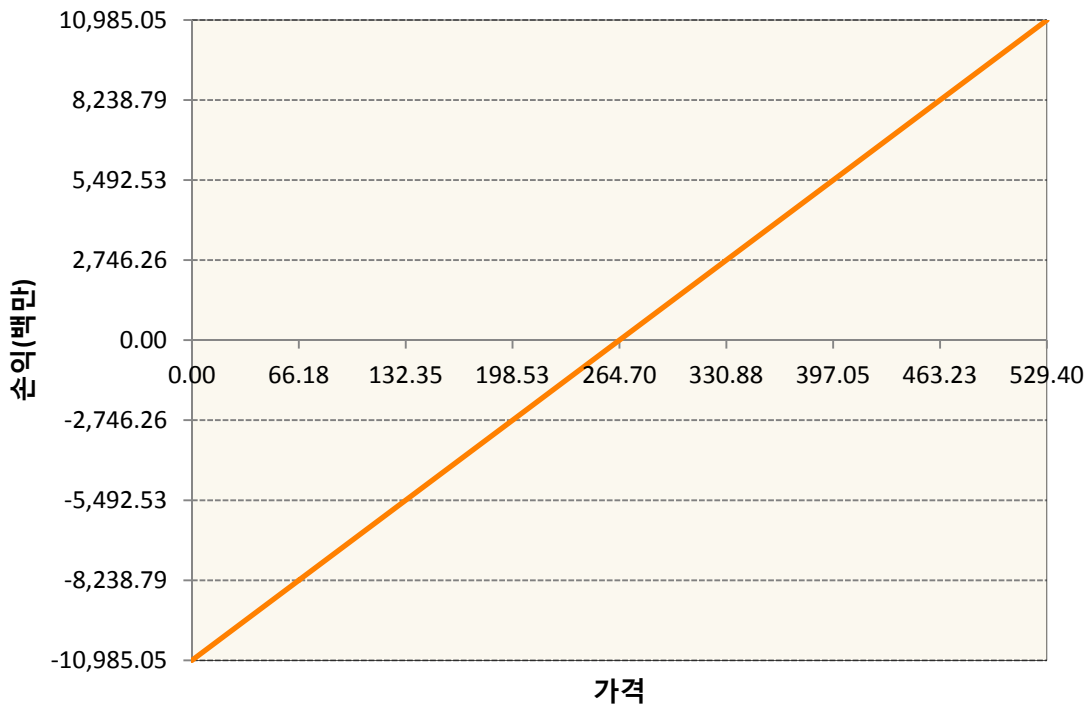
1. 계약금액

(단위:백만원)

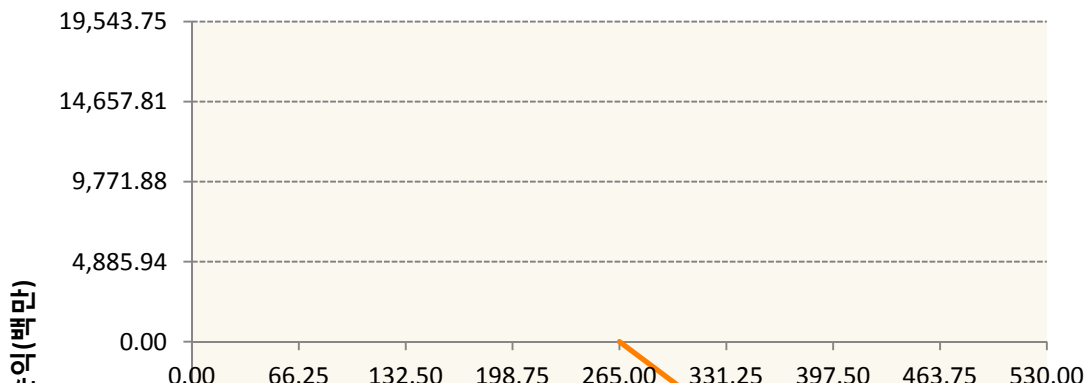
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	133	-133	장내
신규	유가증권	옵션	131	63	68	장내
누계	유가증권	선물	10,985	0	10,985	장내
누계	유가증권	옵션	3,596	19,678	-16,081	장내

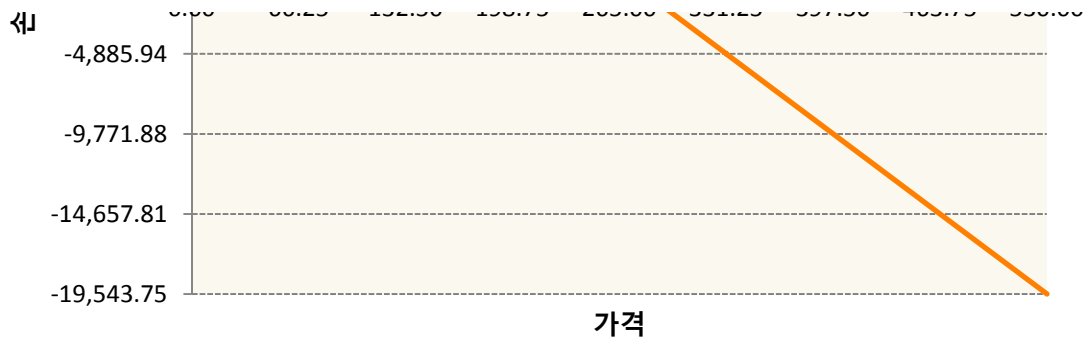
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

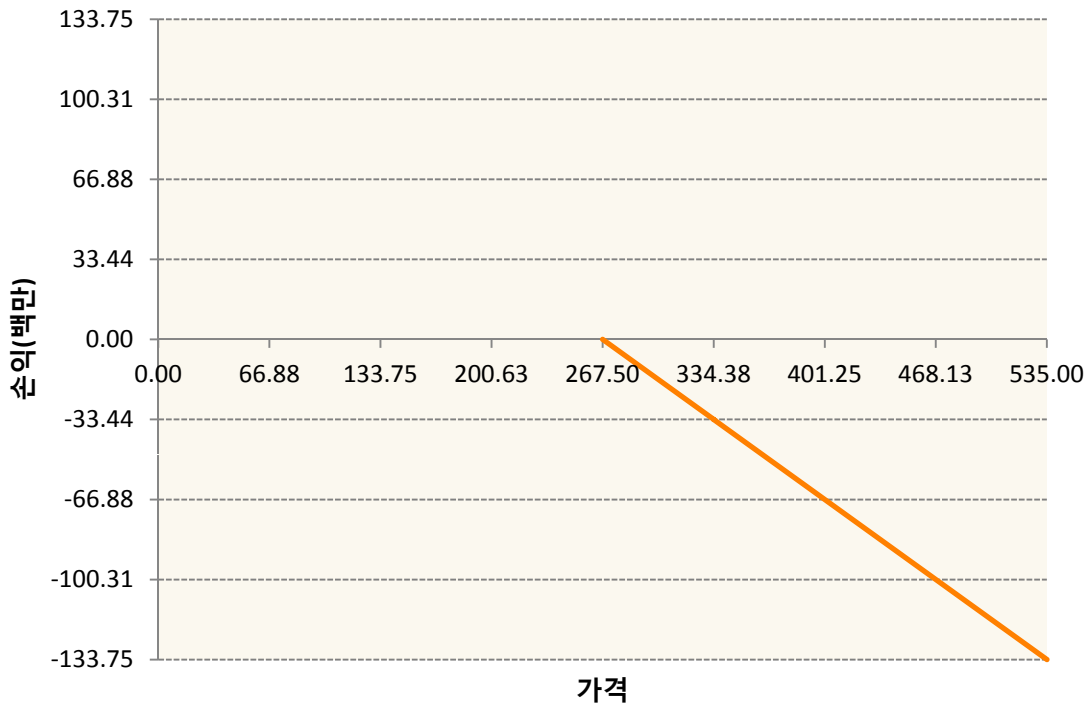


KR4201P92658-2019-09 콜265

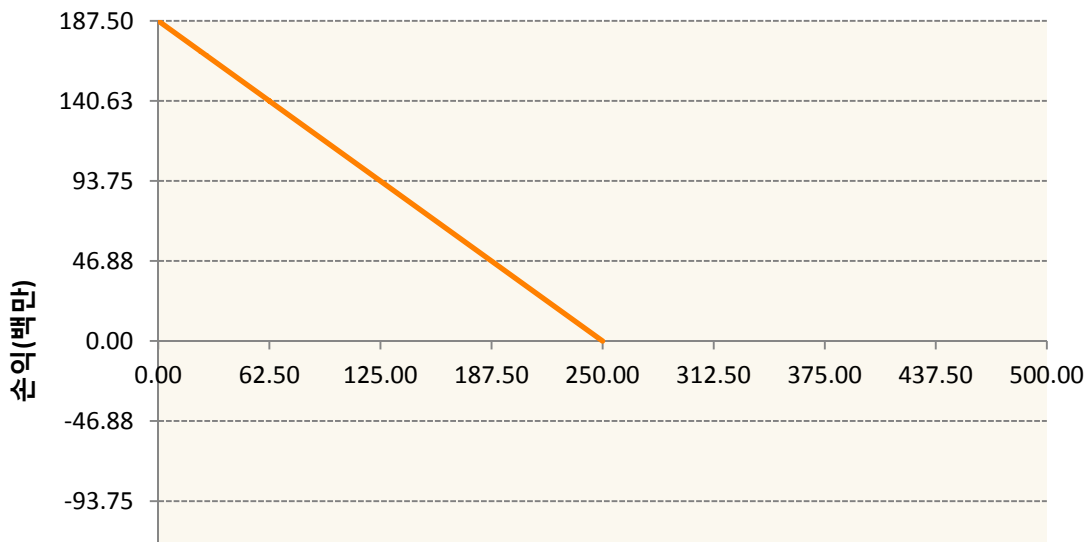


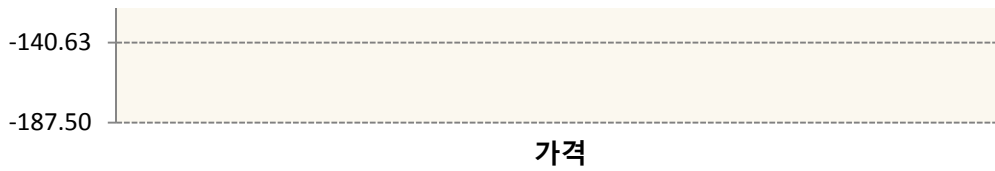


KR4201P92674-2019-09 콜267.5

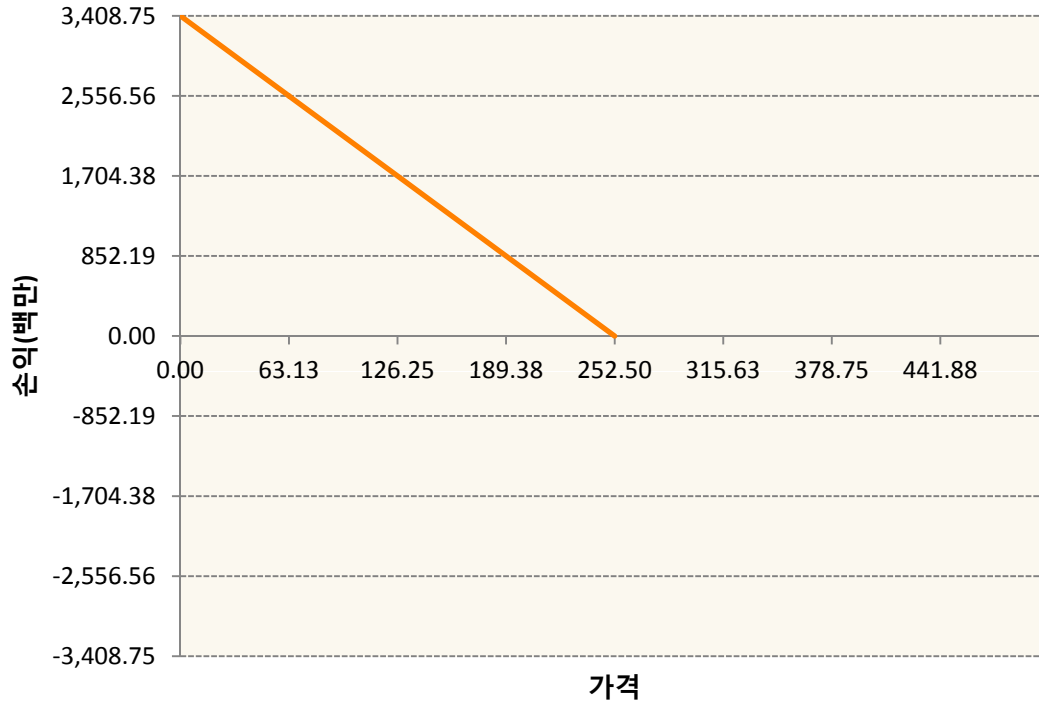


KR4301P92508-2019-09 풋250





KR4301P92524-2019-09 풋252.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						878
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-878	-878	-878	-878	-878	-878	-878	
-5.33%	-585	-585	-585	-585	-585	-585	-585	
-2.67%	-293	-293	-293	-293	-293	-293	-293	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	293	293	293	293	293	293	293	
5.33%	585	585	585	585	585	585	585	
8.00%	878	878	878	878	878	878	878	
KR4201P92658		2019-09 콜265						1,283
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	246	246	246	245	244	242	239	
-5.33%	244	242	238	233	227	220	211	
-2.67%	215	202	188	174	158	141	124	

0%	67	45	22	0	-22	-45	-67
2.67%	-277	-292	-309	-326	-344	-363	-382
5.33%	-753	-758	-764	-771	-780	-790	-801
8.00%	-1,268	-1,269	-1,270	-1,272	-1,274	-1,278	-1,283

KR4201P92674 2019-09 콜267.5 8

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	1	1	1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-1	-2	-2	-2	-2	-2	-2
5.33%	-4	-4	-5	-5	-5	-5	-5
8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8

KR4301P92508 2019-09 풋250 5

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	5	5	5	5	5	5
-5.33%	1	1	1	1	2	2	2
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
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 풋252.5 128

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	125	125	125	126	126	127	128
-5.33%	39	41	43	45	47	50	52
-2.67%	3	4	5	7	8	10	12
0%	0	0	0	0	0	1	1
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

2,209

공시일	2019-09-06
기준일	2019-09-05

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	79,155	0	79,155	

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	2019-09-06
기준일	2019-09-05

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,200	0	1,200	
누계	유가증권	수익증권	100,186	0	100,186	

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	2019-09-06
기준일	2019-09-05

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	473,302	0	473,302	
누계	통화	선도	0	502,764	-502,764	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		1,728
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,112
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		134
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		288
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		96
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		711
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		711
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		288
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		672
FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E		480
FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E		192
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		288
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		3,169
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		2,151
FX21019Q01 KRW/USD 16-09-19E		96
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,937
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,553
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,631
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,986
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		960
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		960
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E		960
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E		1,728
FX21019Q04 KRW/USD 30-09-19E		192
FX21019Q04 KRW/USD 24-09-19E		2,112
FX21019Q04 KRW/USD 24-09-19E		2,688

FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E	192
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E	288
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E	288
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E	192
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E	1,383
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E	2,055

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

(단위:백만원)

13,099

공시일	2019-09-06
기준일	2019-09-05

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

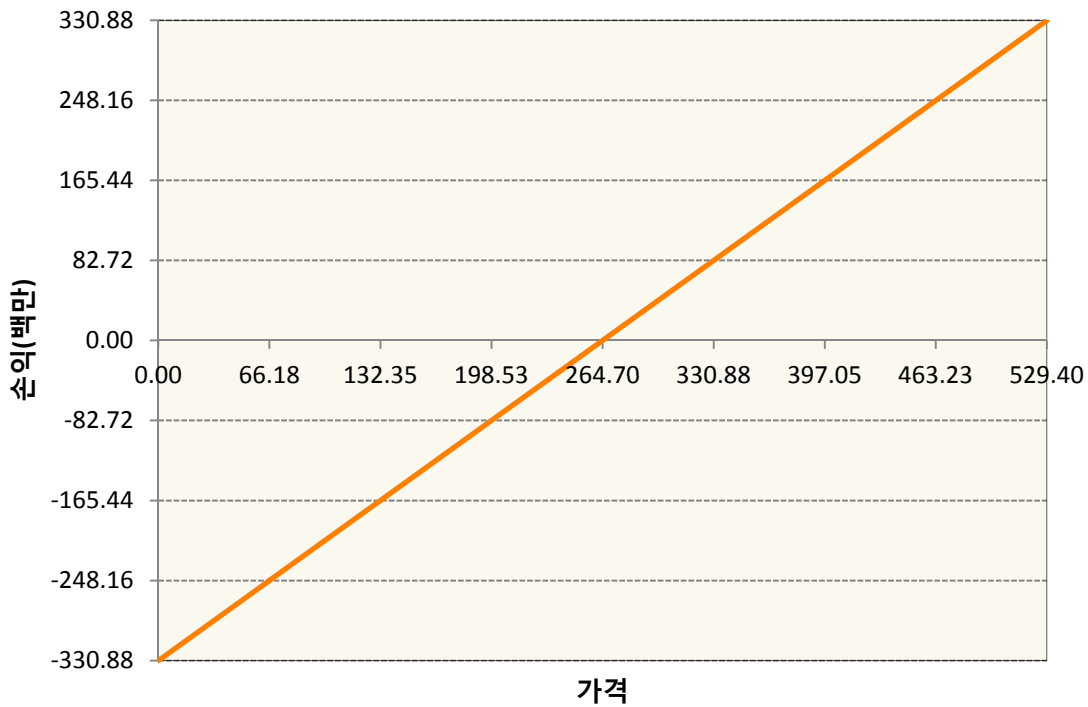
1. 계약금액

(단위:백만원)

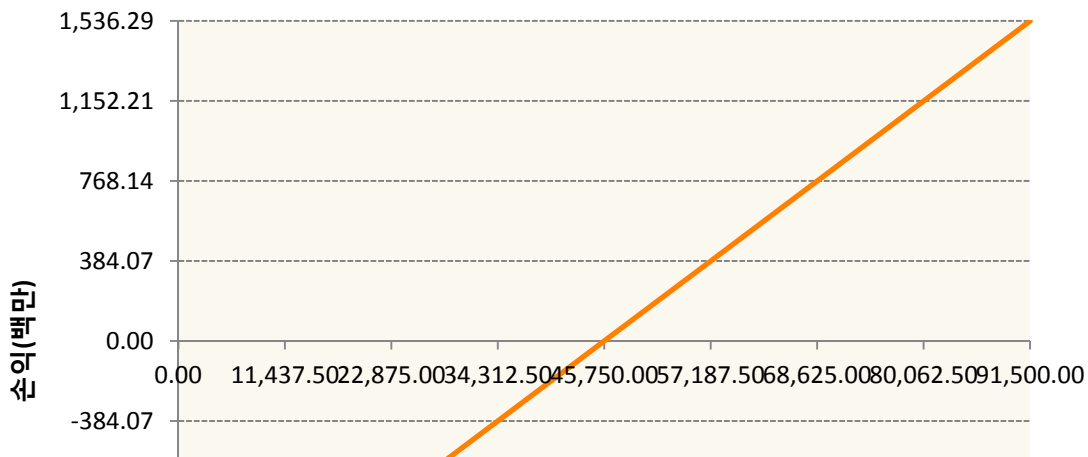
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,867	0	1,867	장내

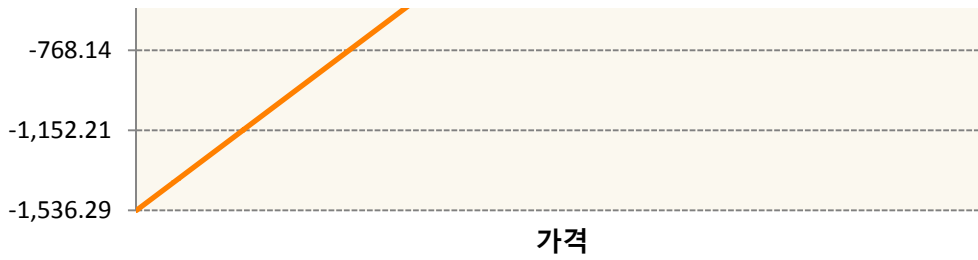
2. 만기시점의 손익구조

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%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
-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%	18	18	18	18	18	18	18	
8.00%	26	26	26	26	26	26	26	

KR4111P90000		2019-09 삼성전자개별선물						123
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123	
-5.33%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82	
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	41	41	41	41	41	41	41	
5.33%	82	82	82	82	82	82	82	
8.00%	123	123	123	123	123	123	123	

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

177

공시일	2019-09-06
기준일	2019-09-05

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

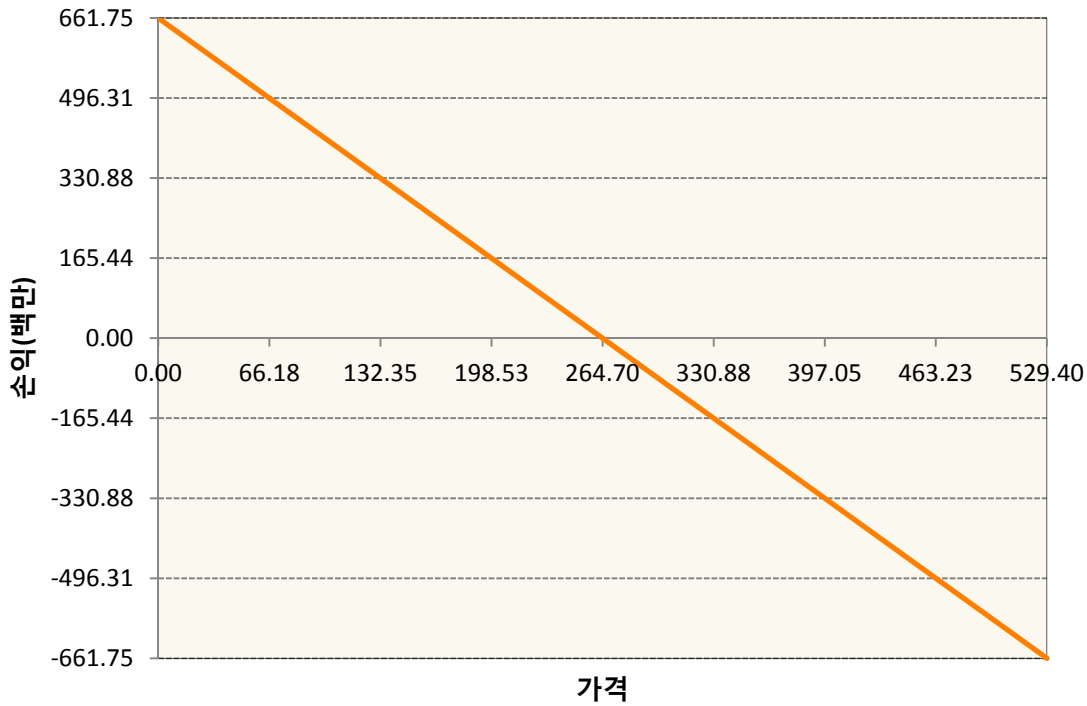
1. 계약금액

(단위:백만원)

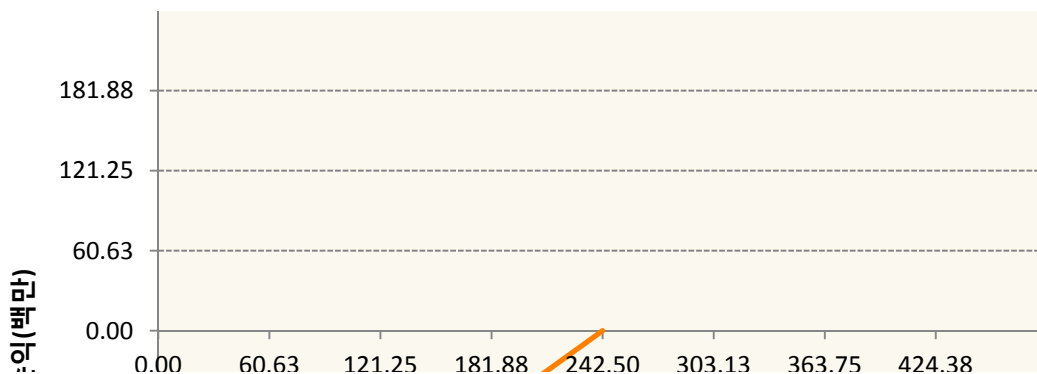
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	122	0	122	장내
누계	유가증권	선물	0	662	-662	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,611	-3,611	장내

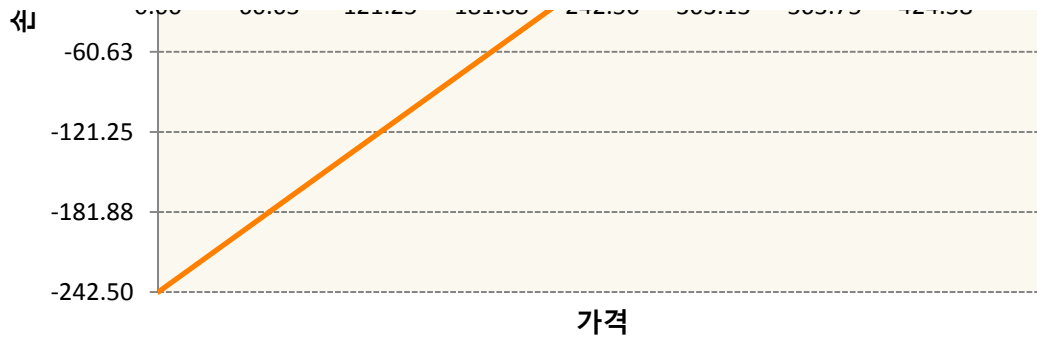
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

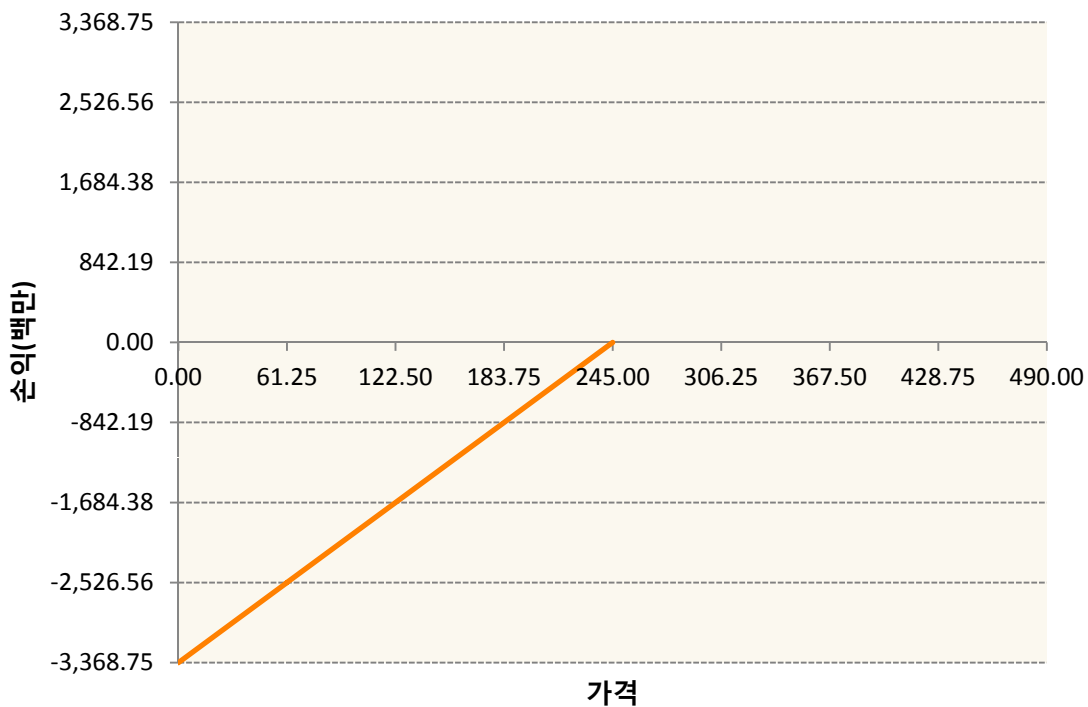


KR4301P92425-2019-09 풋242.5





KR4301P92458-2019-09 풋245



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						53
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	53	53	53	53	53	53	53	
-5.33%	35	35	35	35	35	35	35	
-2.67%	18	18	18	18	18	18	18	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	
8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53	
KR4301P92425		2019-09 풋242.5						2
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1	-1	-2	-2	-2	-2	-2
-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	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

48

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-35	-37	-39	-42	-44	-46	-48
-5.33%	-2	-3	-4	-6	-7	-9	-10
-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

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

(단위:백만원)

47

공시일	2019-09-06
기준일	2019-09-05

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	19,598	0	19,598	
누계	통화	선도	0	19,083	-19,083	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		163
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		480
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		518
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		38
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		326

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

(단위:백만원)

497

공시일	2019-09-06
기준일	2019-09-05

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	381	0	381	장외
누계	통화	선도	92	112	-20	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
FX21019U00 KRW/EUR 22-11-19E	2

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

(단위:백만원)

36

공시일	2019-09-06
기준일	2019-09-05

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

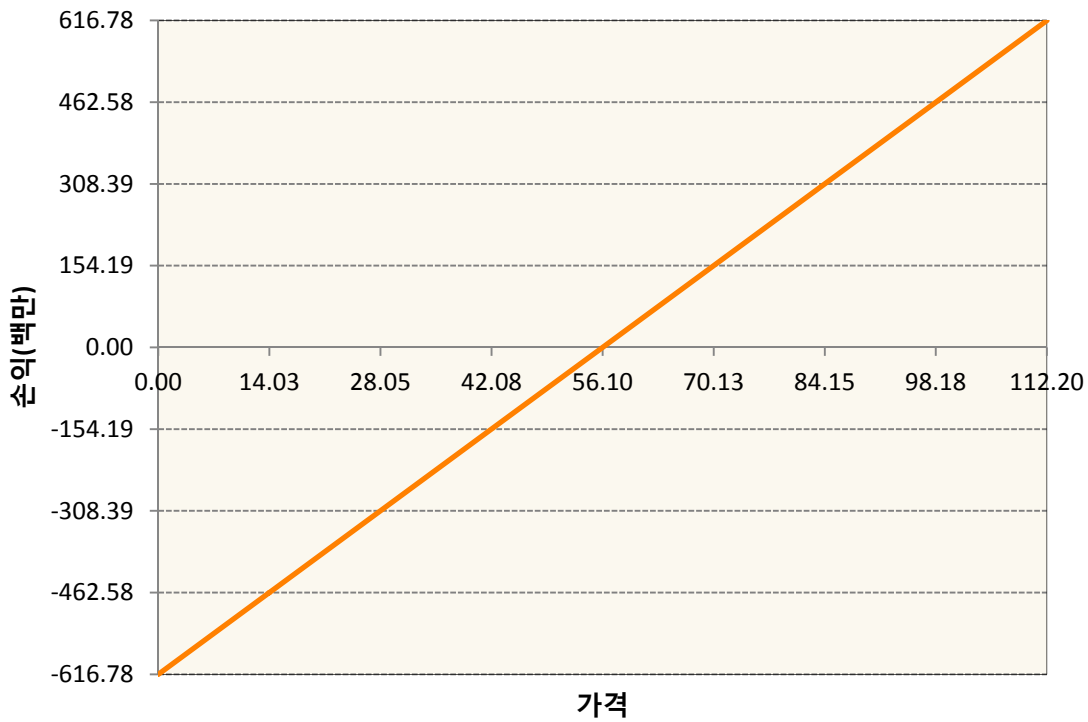
1. 계약금액

(단위:백만원)

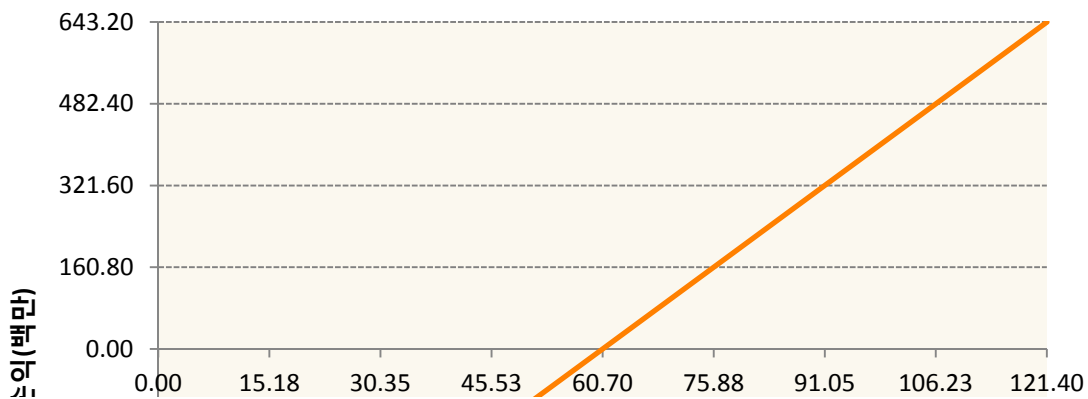
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,311	120	2,191	
누계	유가증권	선물	193	0	193	장내

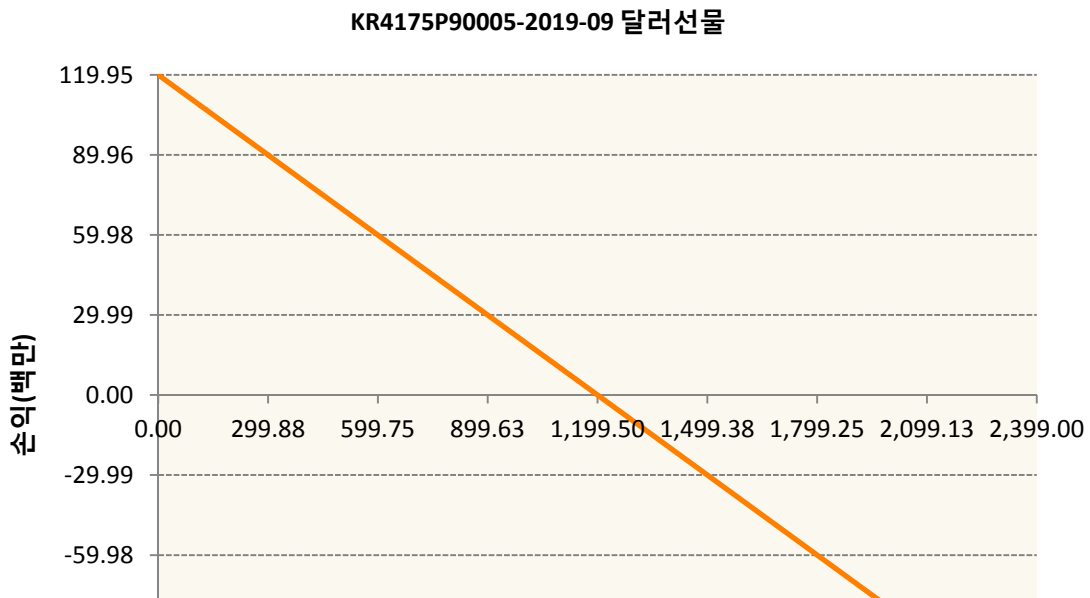
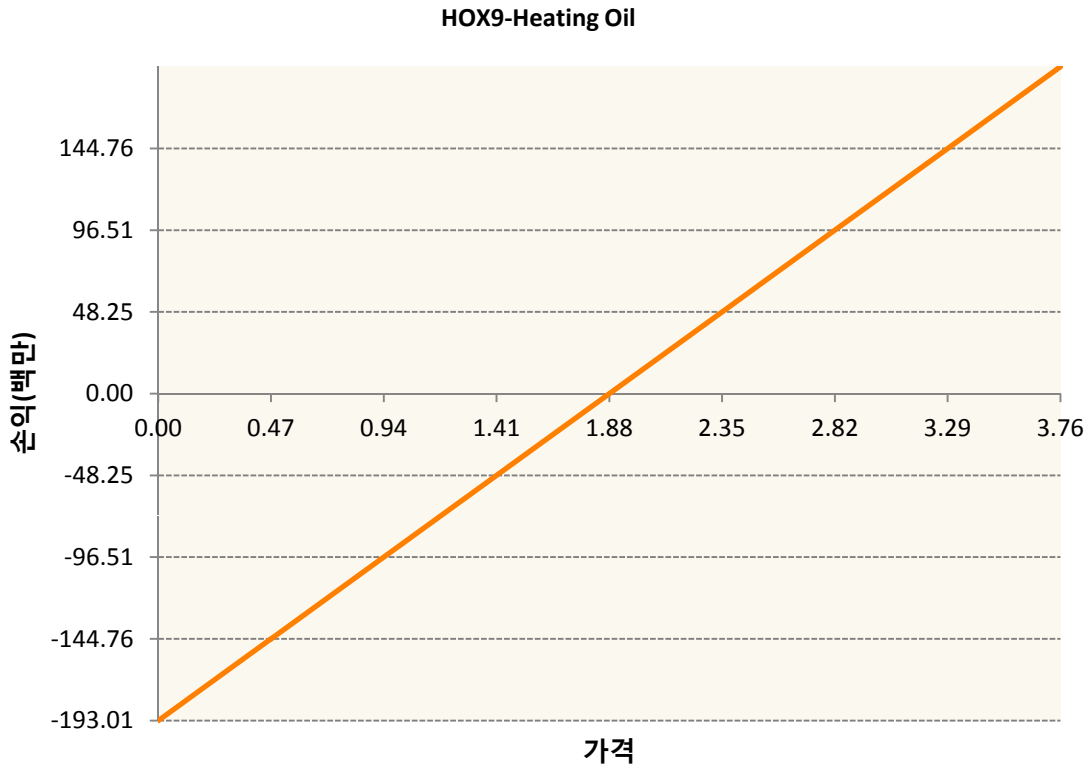
2. 만기시점의 손익구조

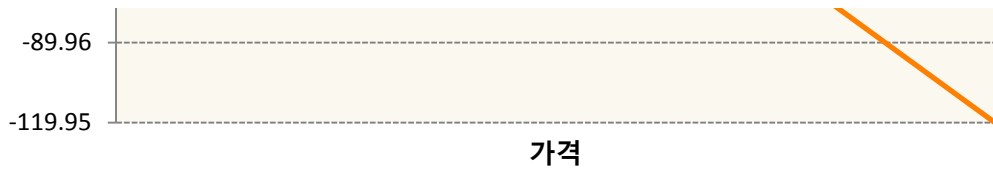
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19



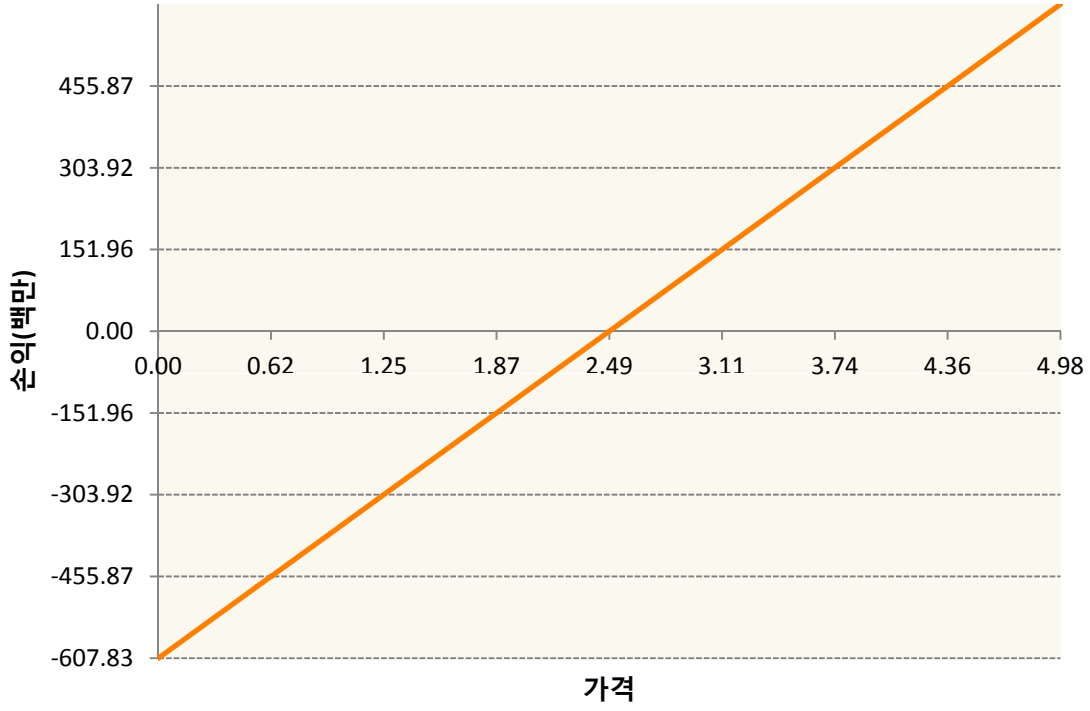
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19



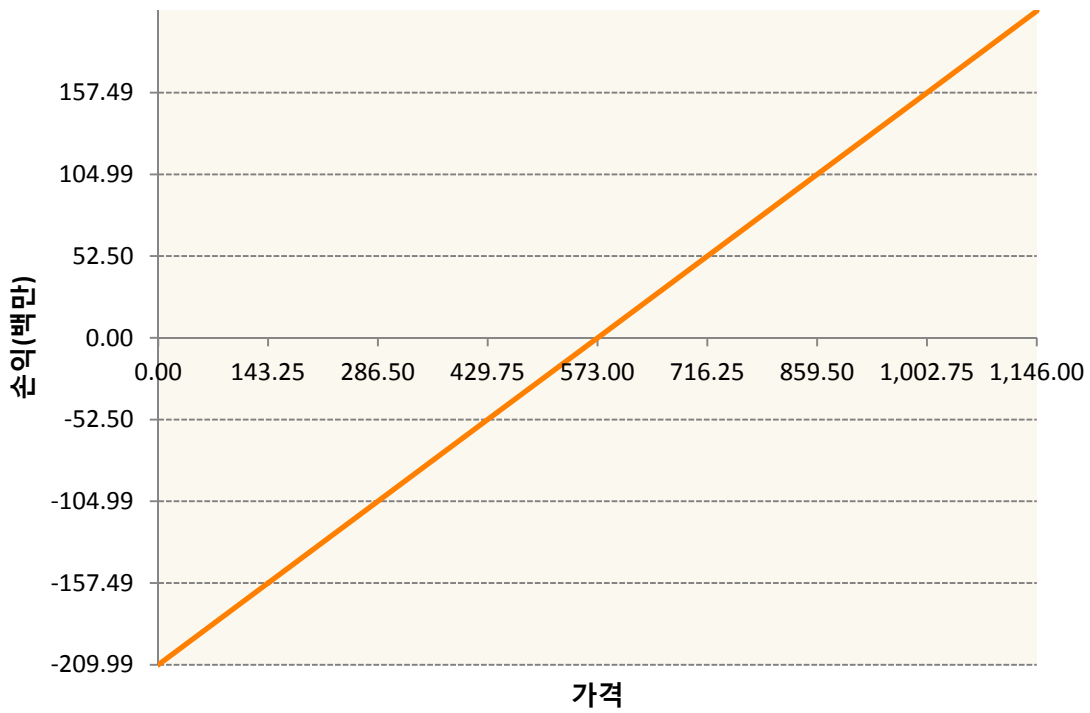


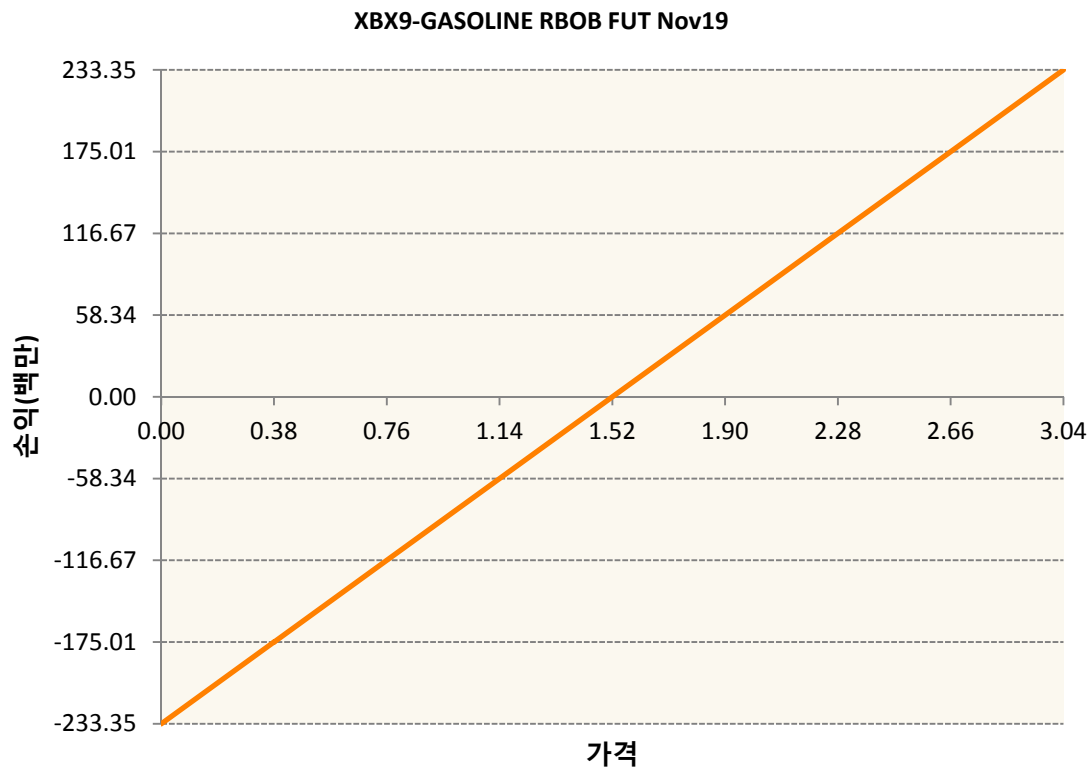


NGX19-NATURAL GAS FUTR Nov19



QSX9-Low Su Gasoil G Nov19





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

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	390

공시일	2019-09-06
기준일	2019-09-05

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

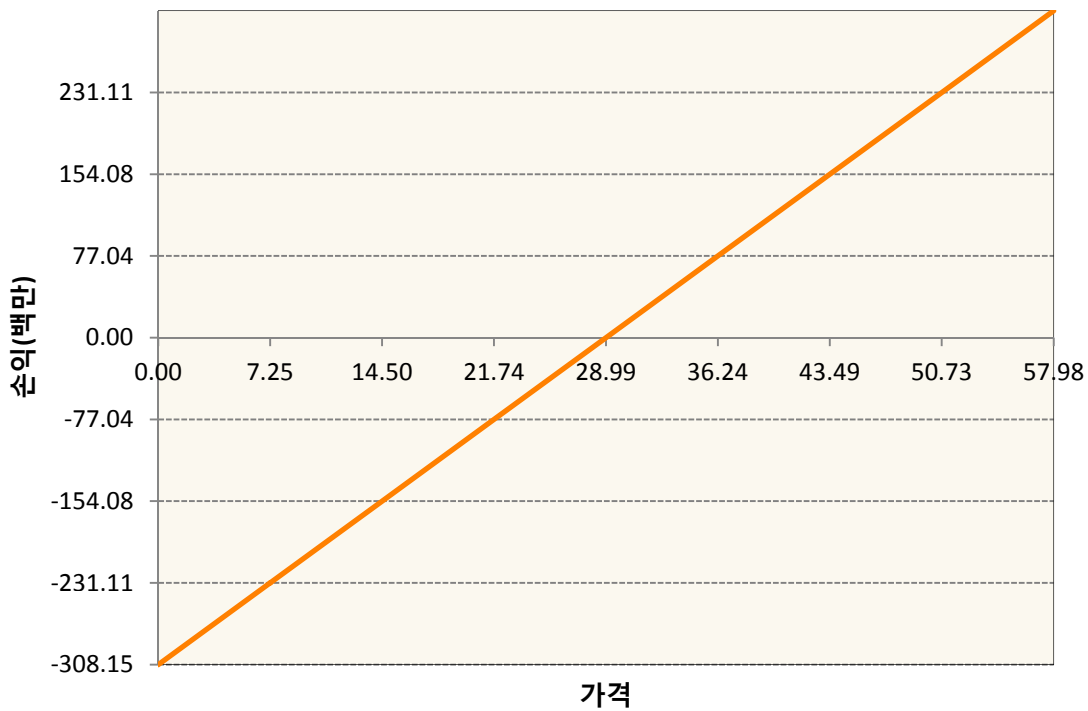
1. 계약금액

(단위:백만원)

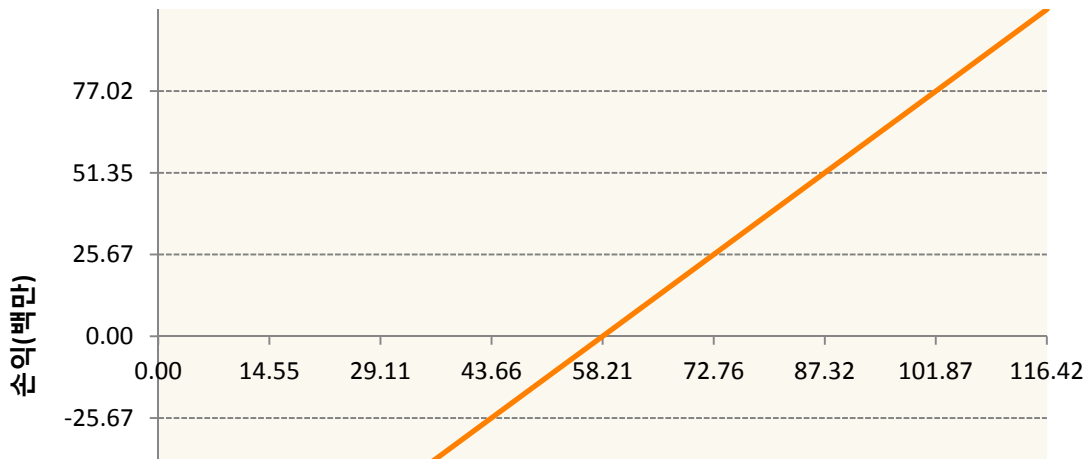
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,702	156	2,546	

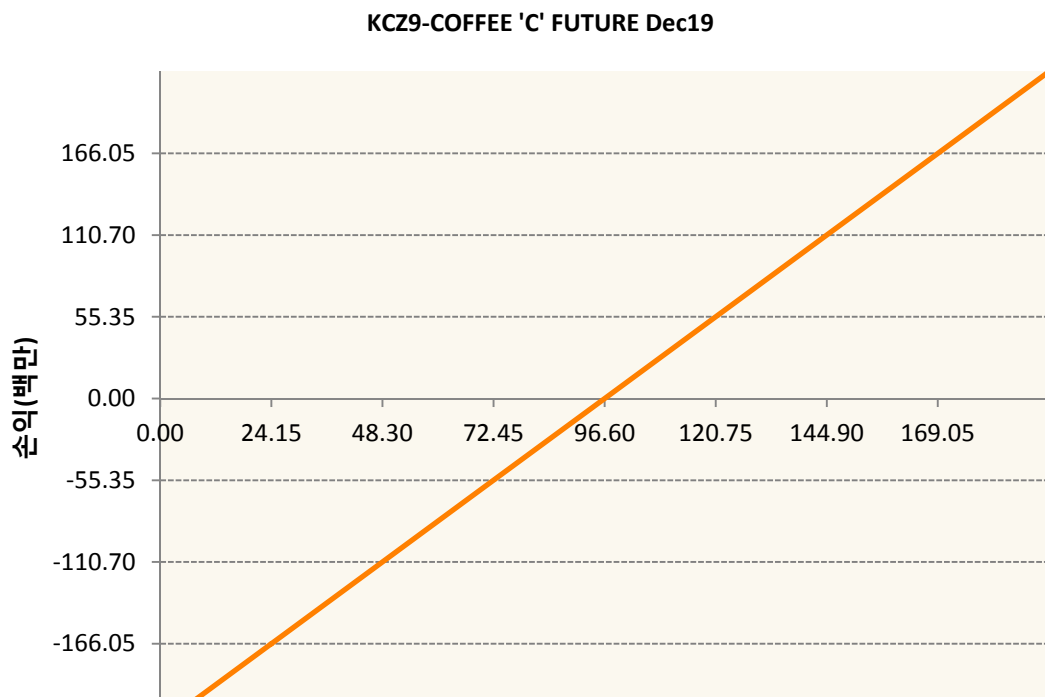
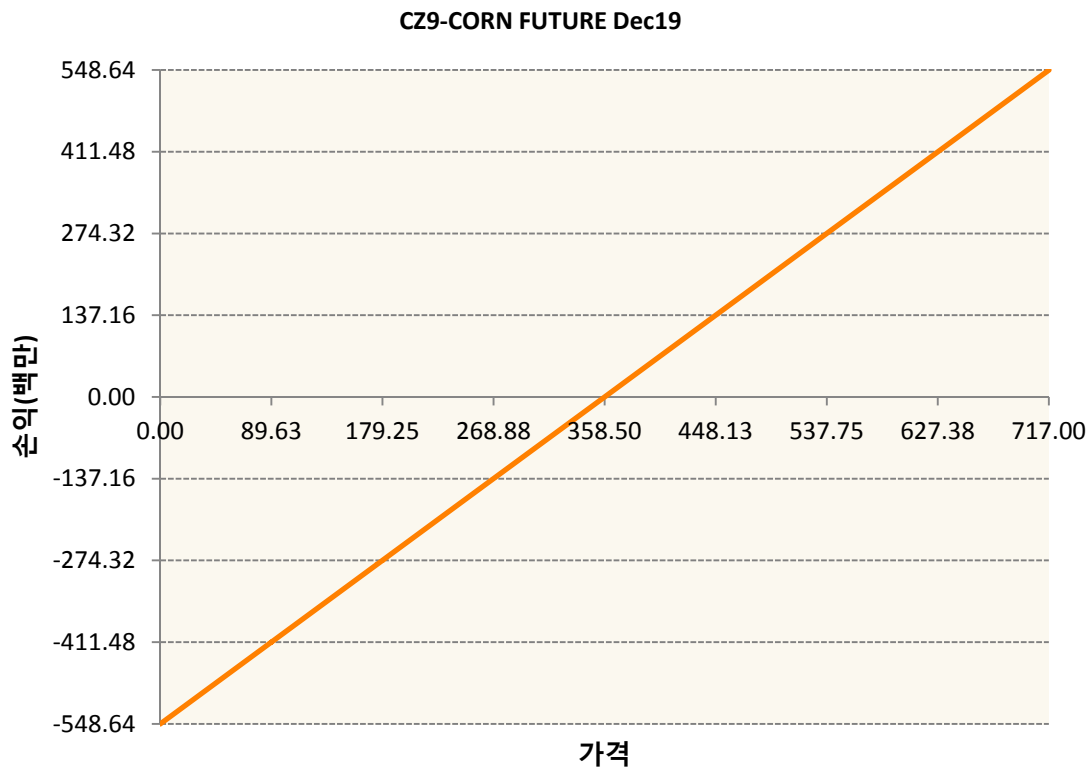
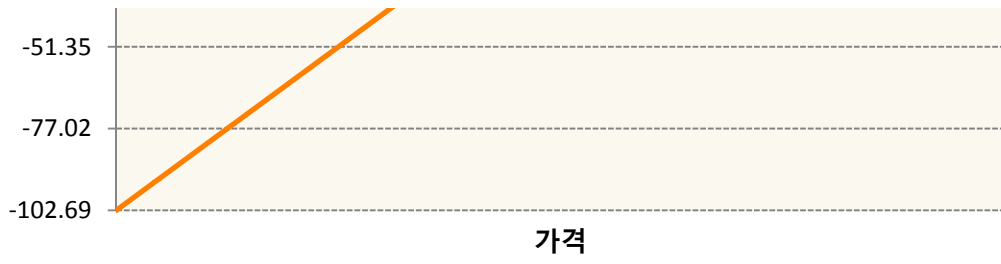
2. 만기시점의 손익구조

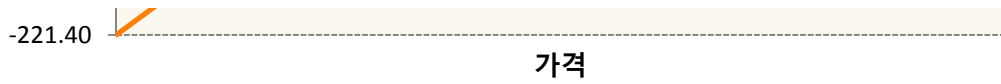
BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19



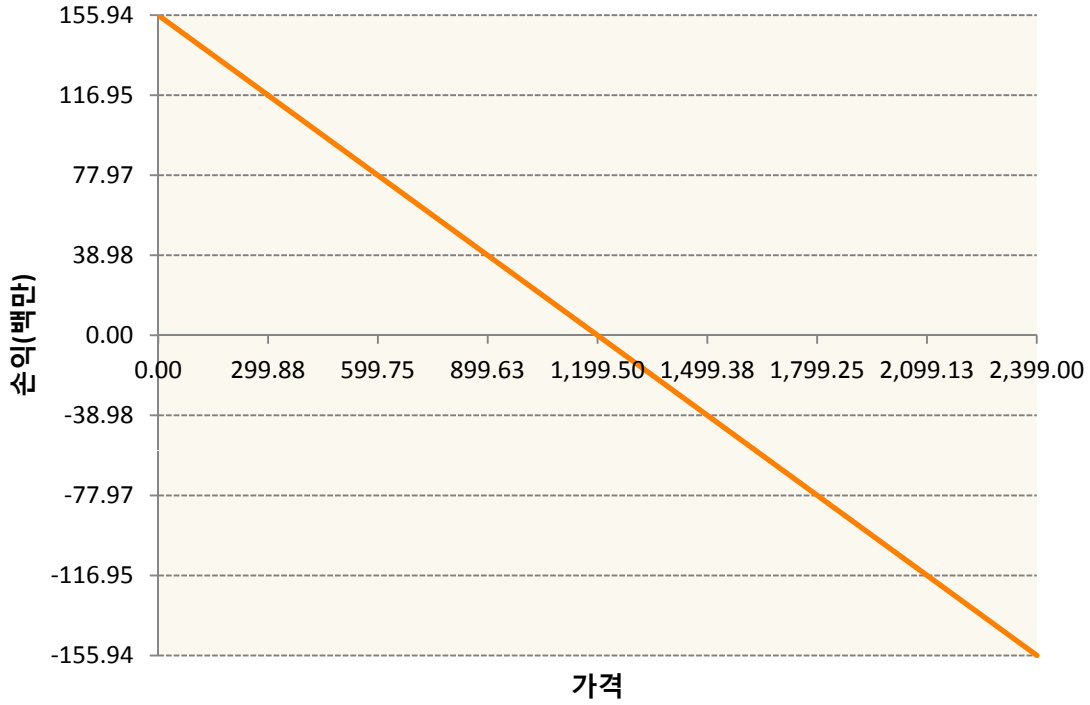
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



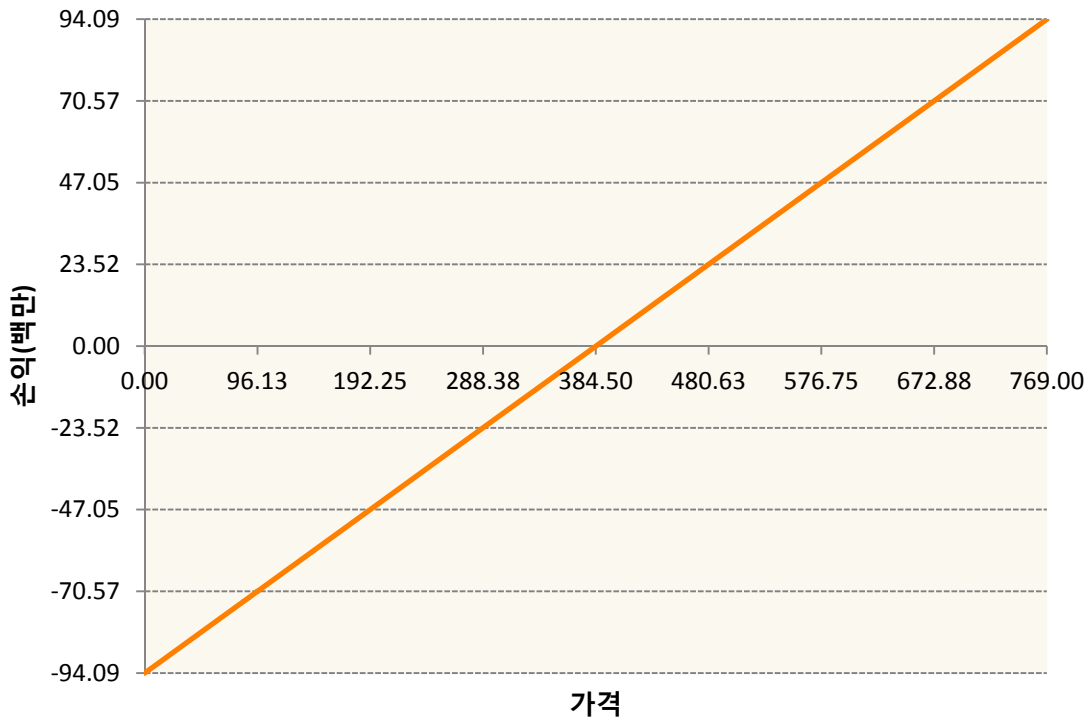




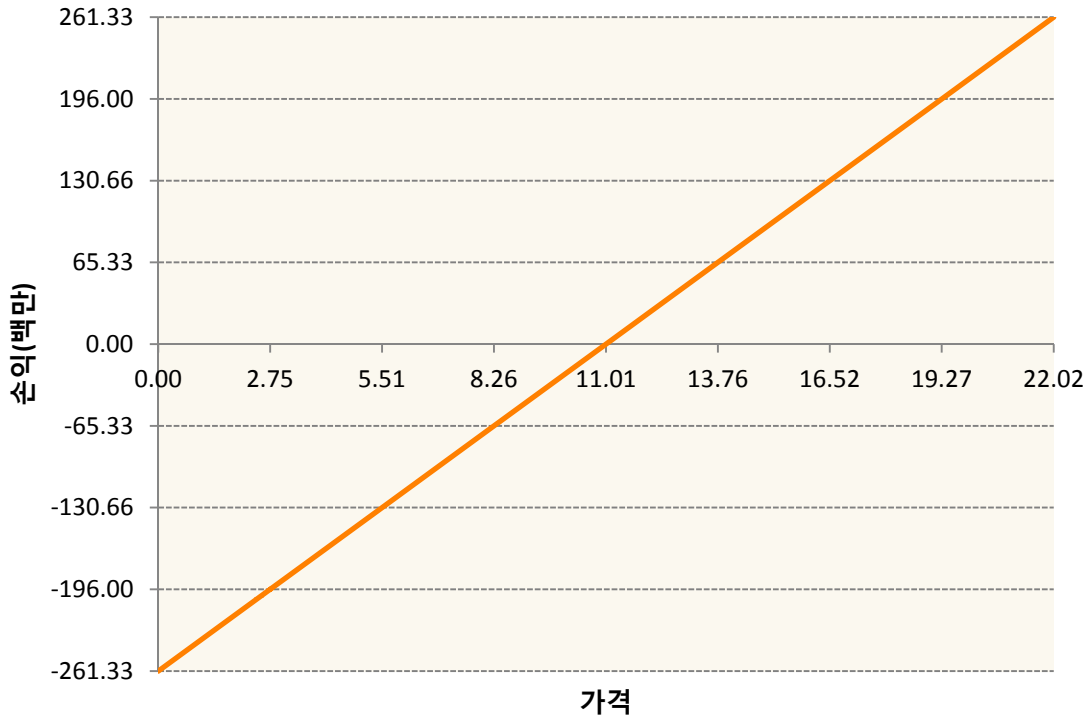
KR4175P90005-2019-09 달러선물



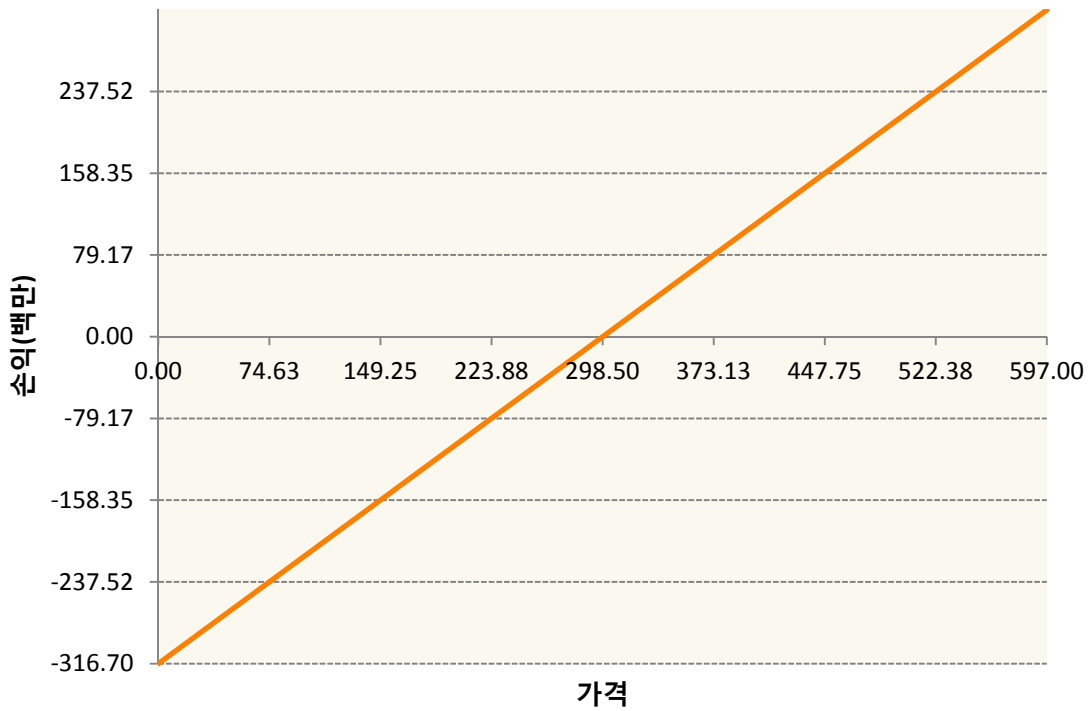
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



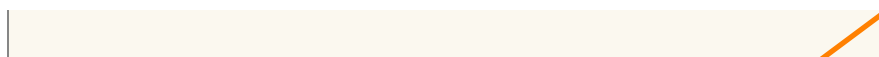
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

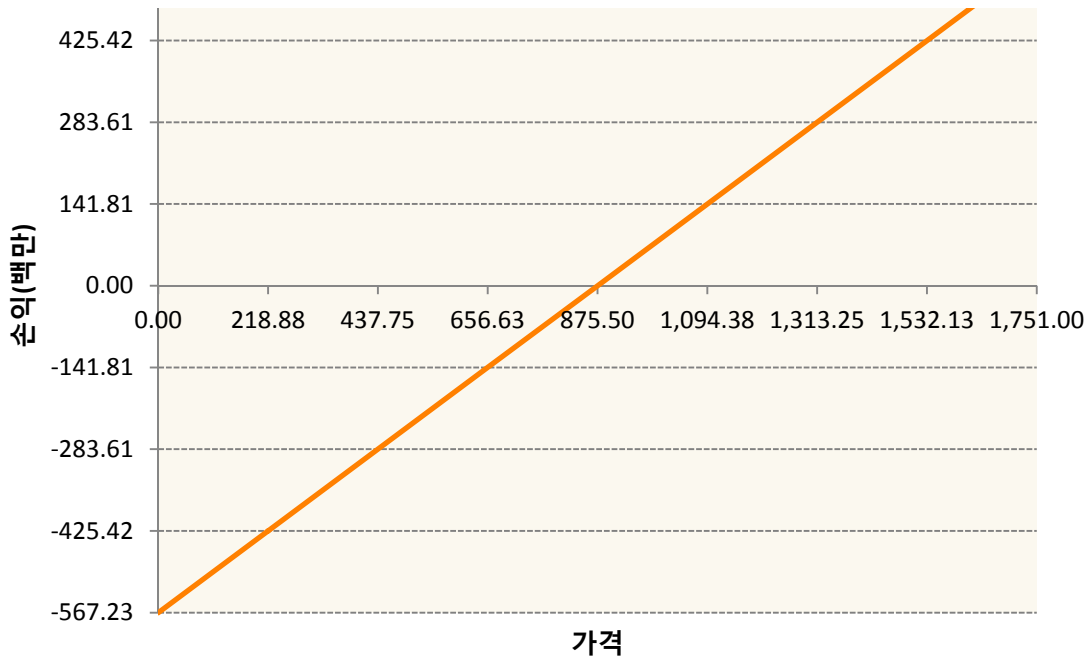


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

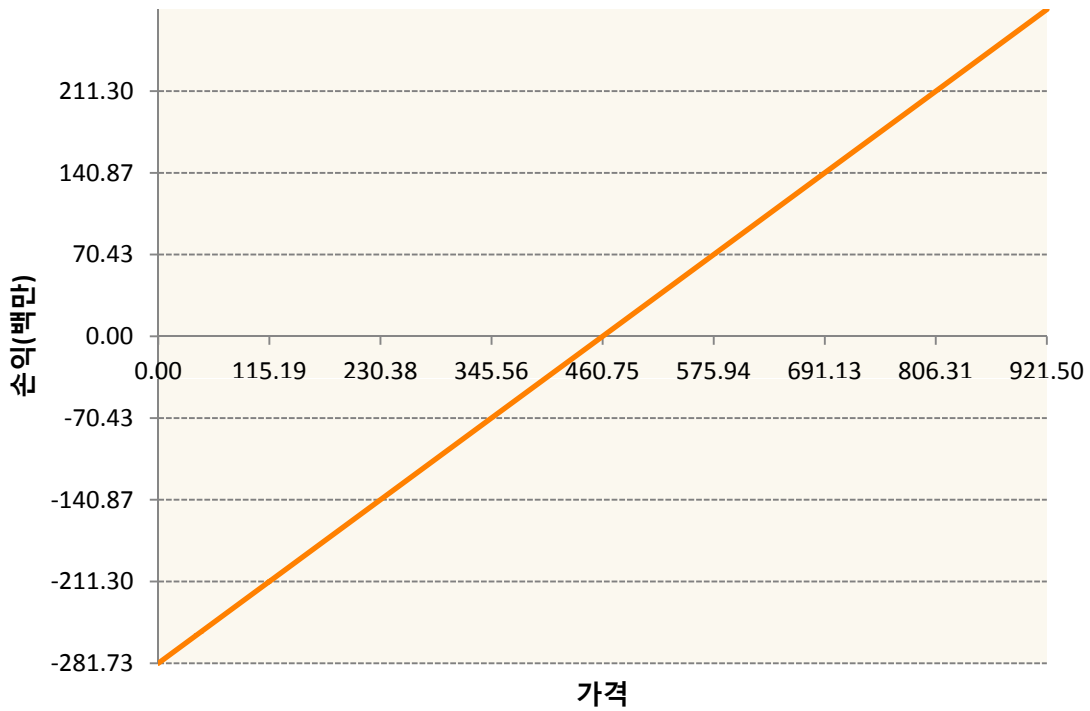


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





WZ9-WHEAT FUTURE(CBT) Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	25
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	8
CZ9	CORN FUTURE Dec19	44
KCZ9	COFFEE 'C' FUTURE Dec19	18
KR4175P900	2019-09 달러선물	12

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)

239