

공시일	2019-09-09
기준일	2019-09-06

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)

92

공시일	2019-09-09
기준일	2019-09-06

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

1,168

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

671

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-09
기준일	2019-09-06

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)	393
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	143

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

851

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-09
기준일	2019-09-06

유로인덱스모(주식-파생형)

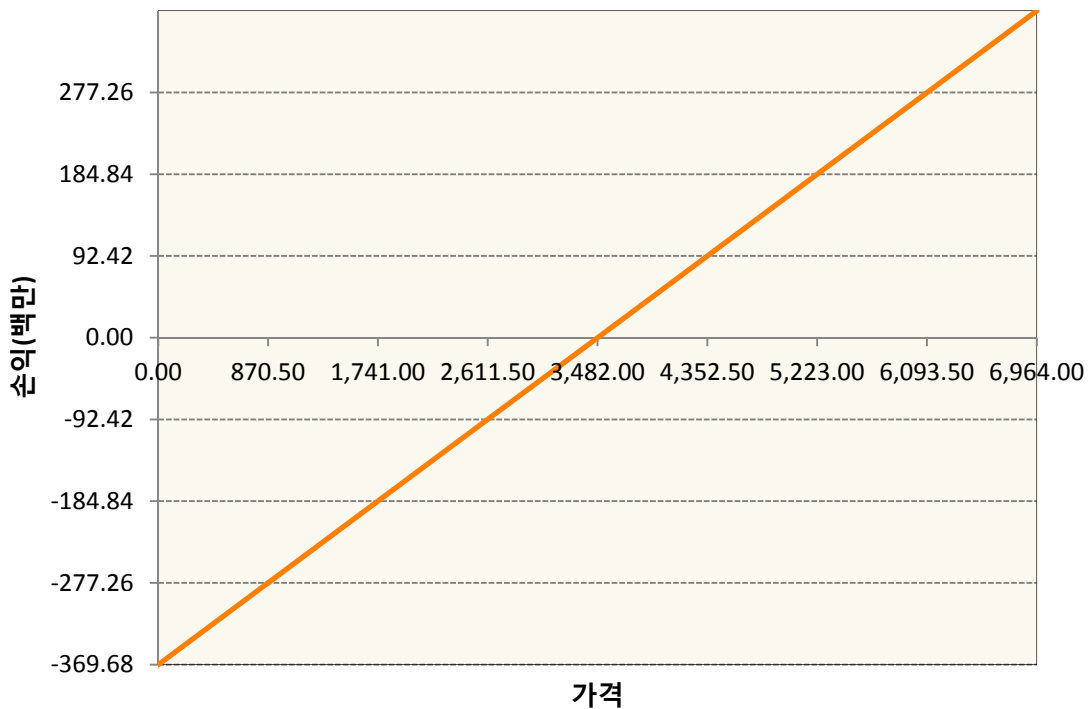
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	370	0	370	

2. 만기시점의 손익구조

VGU9-EURO STOXX 50 Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU9	EURO STOXX 50 Sep19	30
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

20

공시일	2019-09-09
기준일	2019-09-06

차이나인덱스모(주식-파생형)

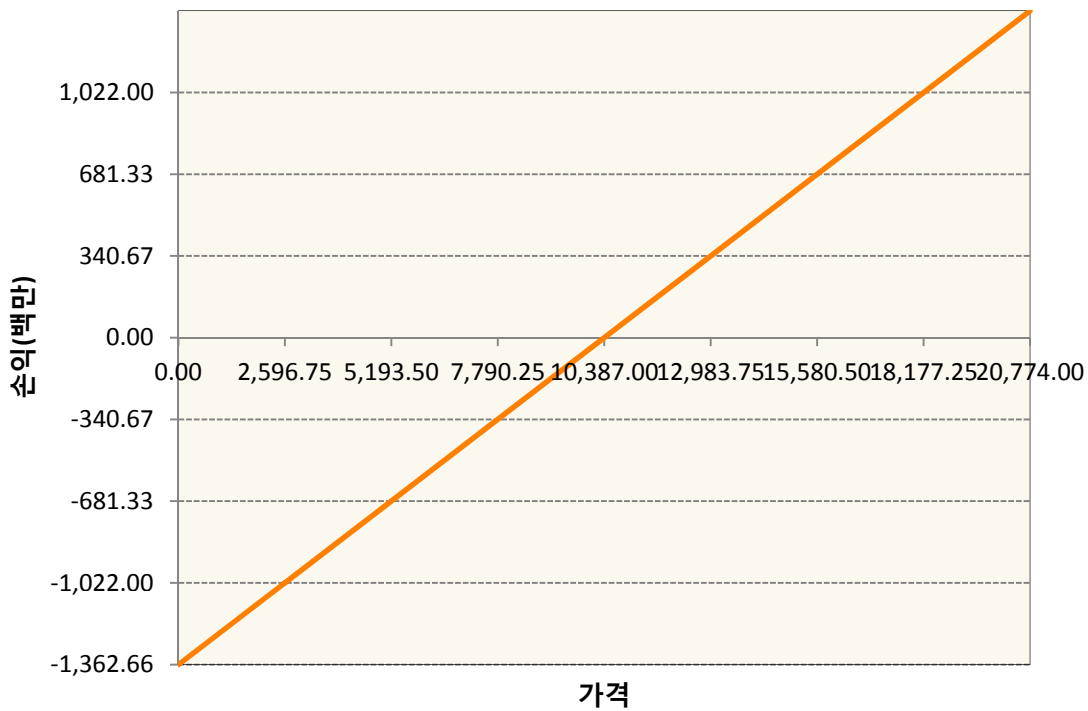
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

HCU9-HSCEI Futures Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU9	HSCEI Futures Sep19	109
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

102

공시일	2019-09-09
기준일	2019-09-06

커버드콜모(주식혼합-파생형)

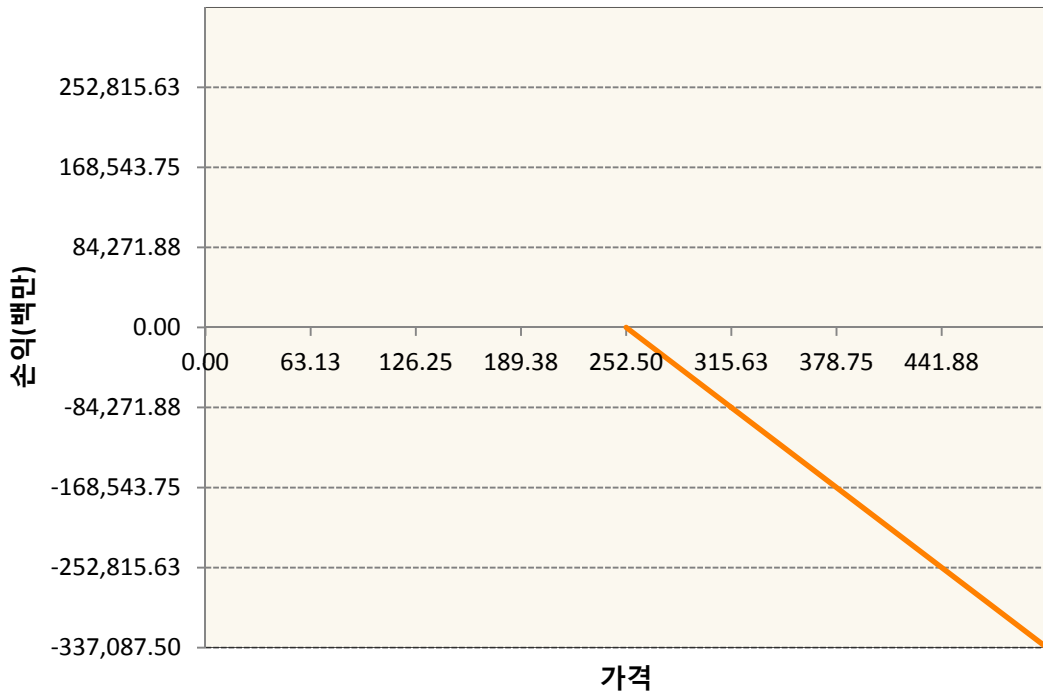
1. 계약금액

(단위:백만원)

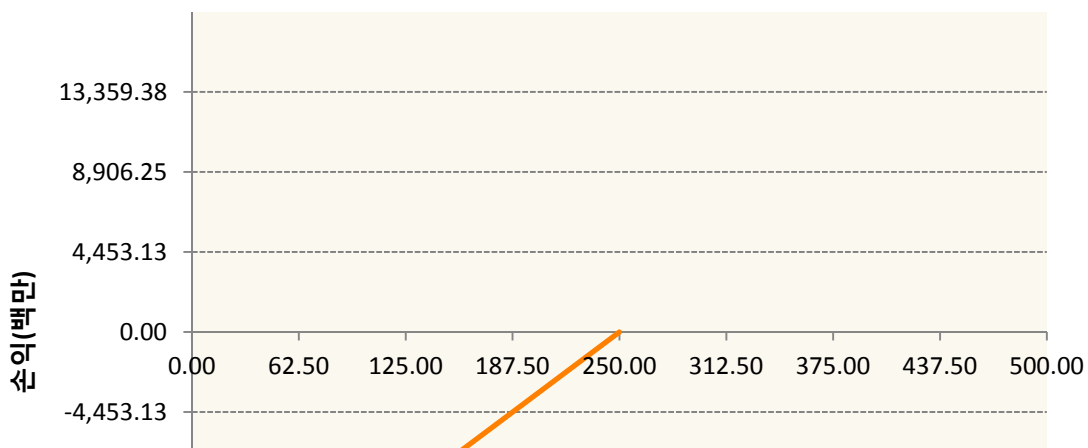
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	501,034	-501,034	장내

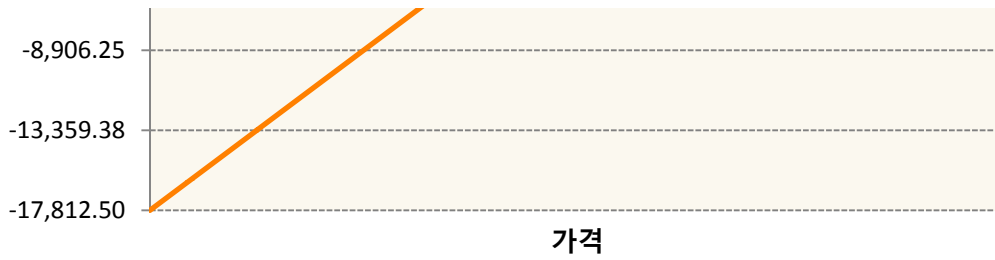
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P92526-2019-09 콜252.5

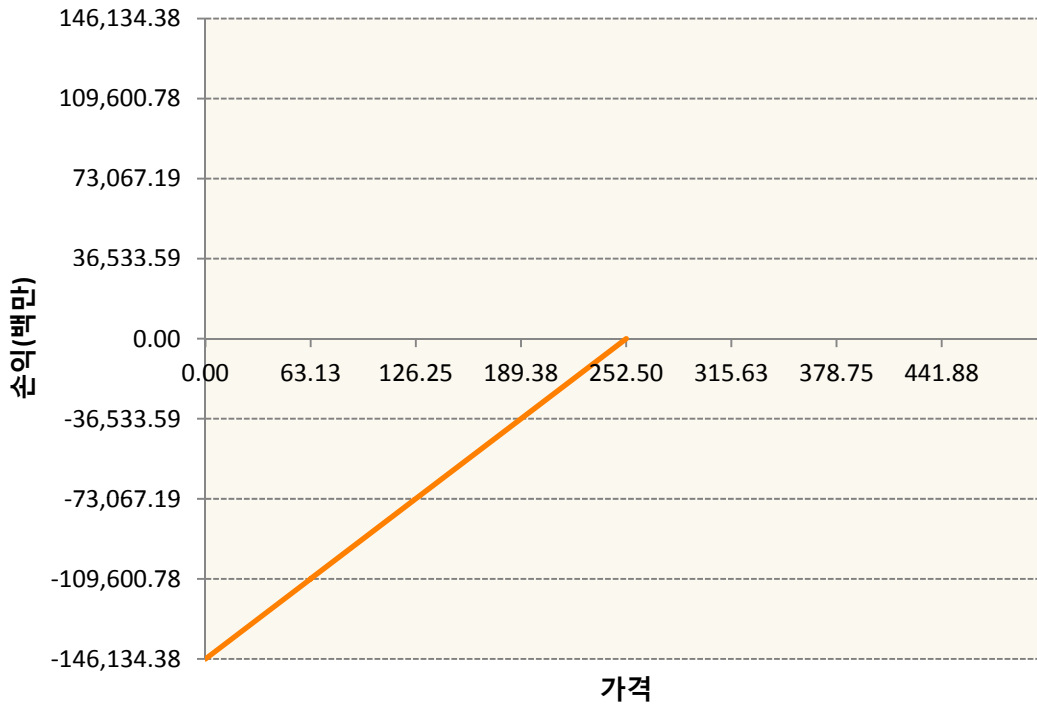


KR4301P92508-2019-09 풋250





KR4301P92524-2019-09 풋252.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P92526		2019-09 콜252.5					28,095
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17,306	17,164	16,997	16,808	16,601	16,378	16,142
-5.33%	15,145	14,799	14,453	14,105	13,757	13,408	13,059
-2.67%	9,009	8,778	8,527	8,262	7,984	7,696	7,399
0%	207	159	91	0	-112	-245	-396
2.67%	-9,195	-9,198	-9,206	-9,221	-9,245	-9,280	-9,329
5.33%	-18,643	-18,643	-18,643	-18,645	-18,648	-18,653	-18,664
8.00%	-28,093	-28,093	-28,093	-28,093	-28,093	-28,093	-28,095
KR4301P92508		2019-09 풋250					443
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-414	-417	-421	-426	-431	-437	-443

-5.33%	-58	-68	-79	-89	-100	-110	-121
-2.67%	-1	-1	-3	-5	-7	-10	-14
0%	0	0	0	0	0	0	-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
KR4301P92524 2019-09 풋252.5							4,883
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,779	-4,785	-4,796	-4,811	-4,830	-4,854	-4,883
-5.33%	-1,184	-1,269	-1,354	-1,441	-1,527	-1,614	-1,701
-2.67%	-37	-62	-95	-133	-176	-225	-277
0%	3	2	2	0	-3	-8	-15
2.67%	3	3	3	3	3	3	2
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

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

(단위:백만원)

31,456

공시일	2019-09-09
기준일	2019-09-06

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

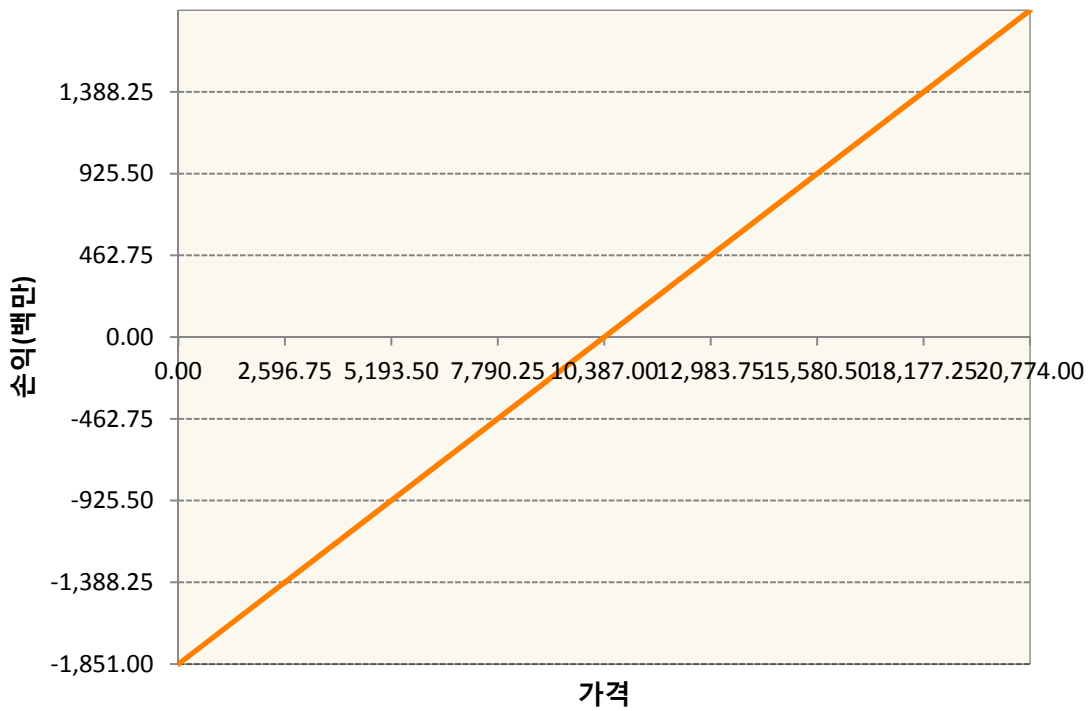
1. 계약금액

(단위:백만원)

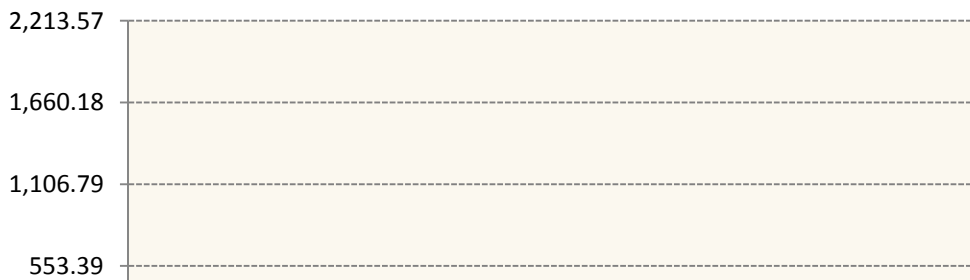
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,851	0	1,851	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,729	-4,729	장내
누계	통화	선도	76	2,837	-2,760	장외

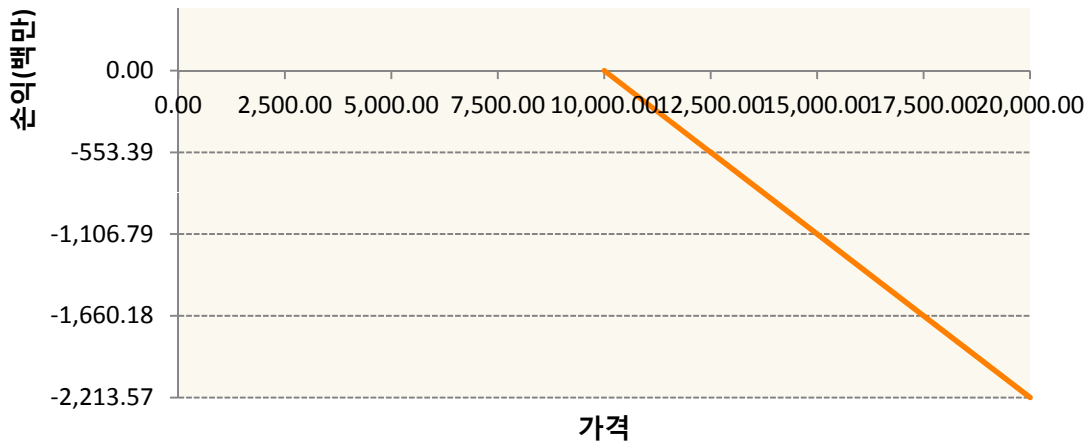
2. 만기시점의 손익구조

HCU9-HSCEI Futures Sep19

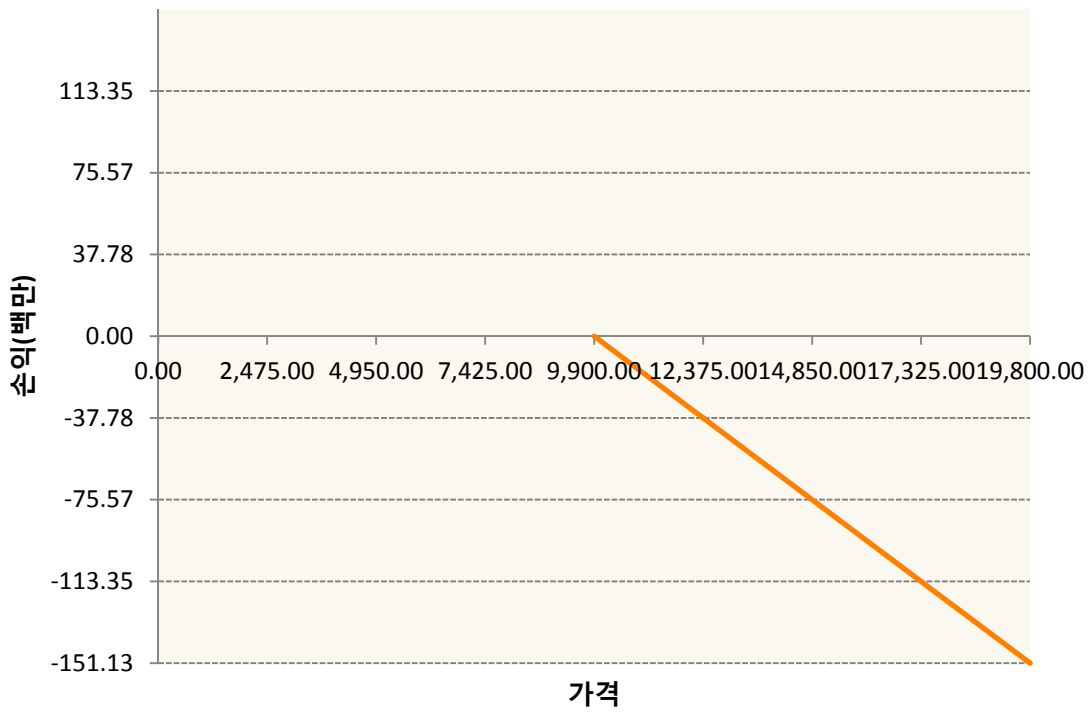


OHHIU9-C100-HSCEI

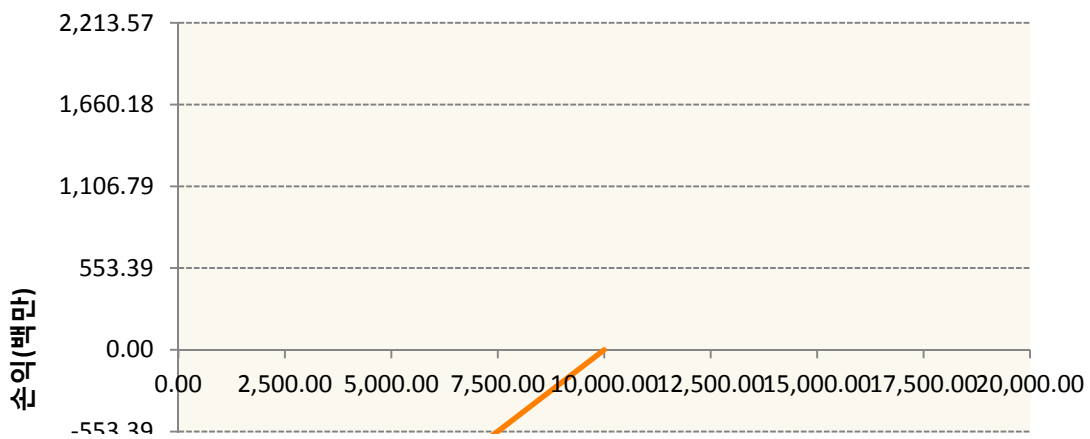


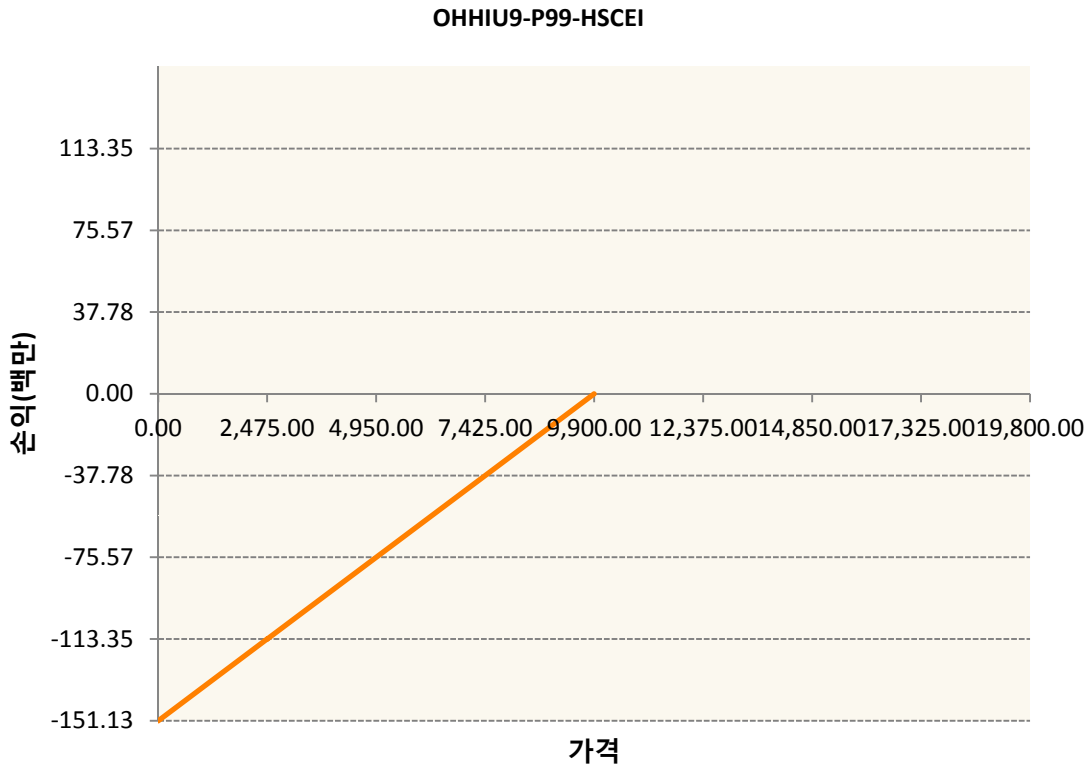


OHHIU9-C99-HSCEI



OHHIU9-P100-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	227
FX21019U00 HKD/KRW 22-11-19E	6
HCU9 HSCEI Futures Sep19	148
OHHIU9-C1(HSCEI	177
OHHIU9-C9(HSCEI	12
OHHIU9-P1(HSCEI	177
OHHIU9-P9(HSCEI	12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	569

공시일	2019-09-09
기준일	2019-09-06

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

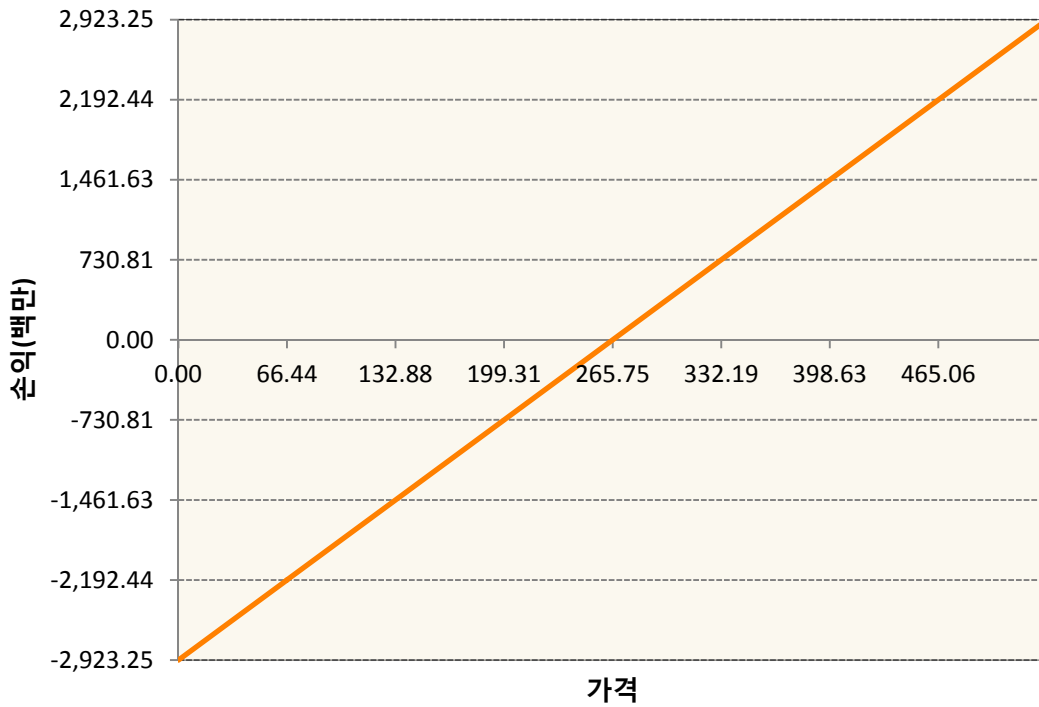
1. 계약금액

(단위:백만원)

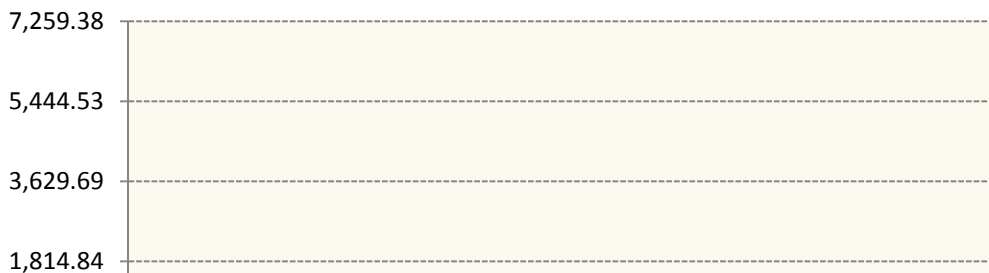
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	239	0	239	장내
누계	유가증권	선물	2,923	0	2,923	장내
누계	유가증권	스왑	14,125	0	14,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,324	-14,324	장내

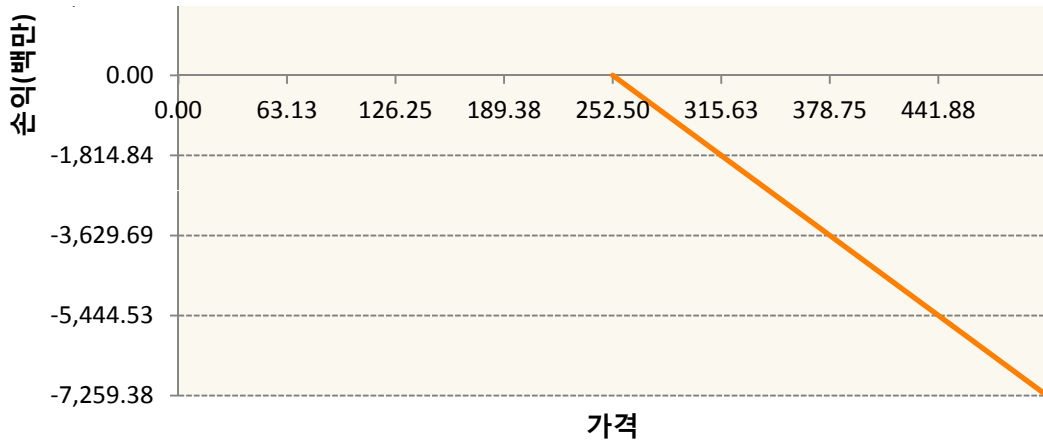
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

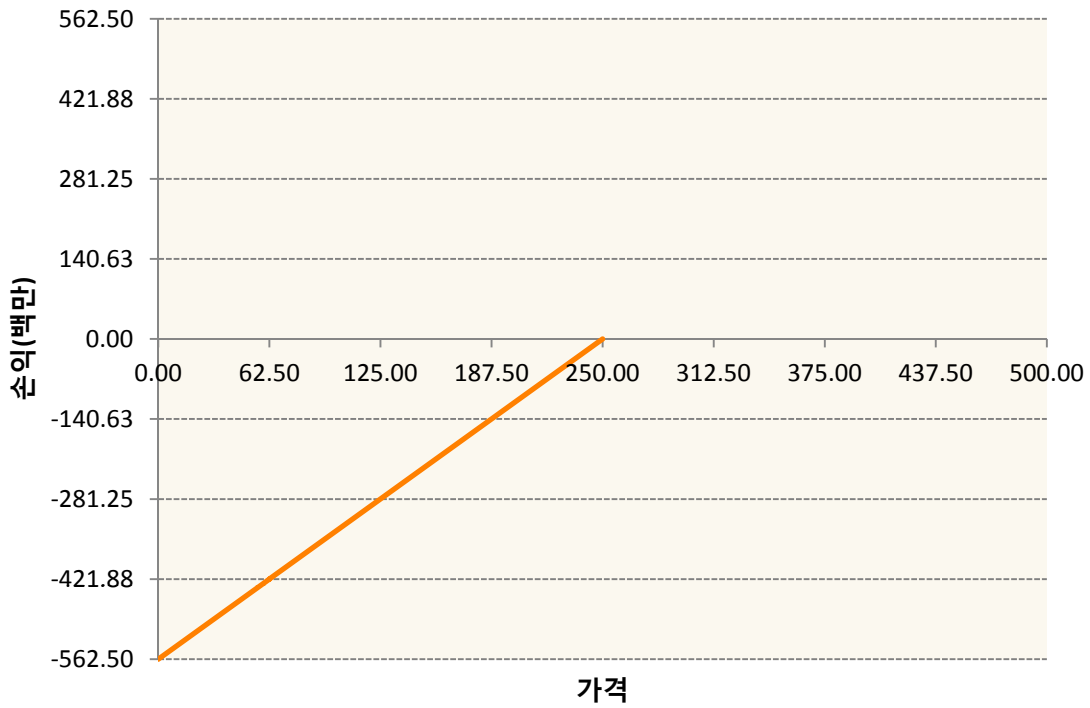


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

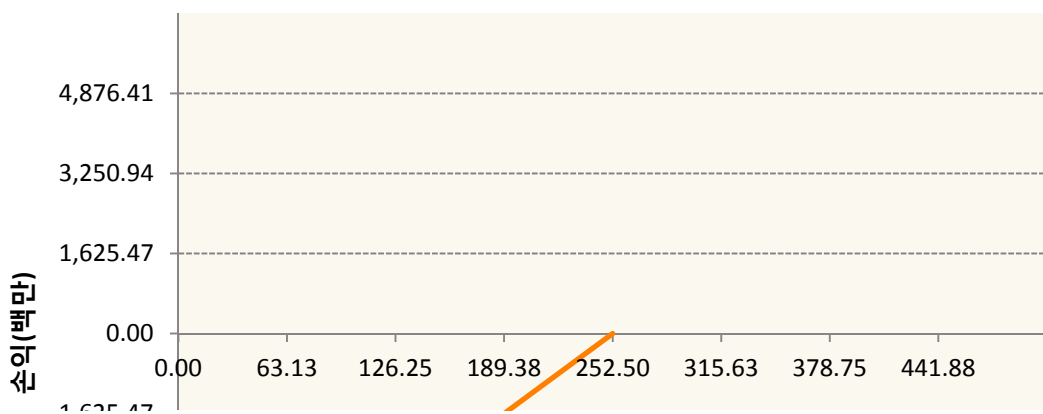




KR4301P92508-2019-09 풋250



KR4301P92524-2019-09 풋252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						1,219
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,219	-1,219	-1,219	-1,219	-1,219	-1,219	-1,219	
-5.33%	-813	-813	-813	-813	-813	-813	-813	
-2.67%	-406	-406	-406	-406	-406	-406	-406	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	406	406	406	406	406	406	406	
5.33%	813	813	813	813	813	813	813	
8.00%	1,219	1,219	1,219	1,219	1,219	1,219	1,219	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						234
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-234	-234	-234	-234	-234	-234	-234	
-5.33%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156	
-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%	156	156	156	156	156	156	156	
8.00%	234	234	234	234	234	234	234	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5						605
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	373	370	366	362	358	353	348	
-5.33%	326	319	311	304	296	289	281	
-2.67%	194	189	184	178	172	166	159	
0%	4	3	2	0	-2	-5	-9	
2.67%	-198	-198	-198	-199	-199	-200	-201	
5.33%	-401	-401	-401	-402	-402	-402	-402	
8.00%	-605	-605	-605	-605	-605	-605	-605	
KR4301P92508		2019-09 풋250						14
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-13	-13	-13	-13	-14	-14	-14
-5.33%	-2	-2	-2	-3	-3	-3	-4
-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							217
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-213	-213	-213	-214	-215	-216	-217
-5.33%	-53	-56	-60	-64	-68	-72	-76
-2.67%	-2	-3	-4	-6	-8	-10	-12
0%	0	0	0	0	0	0	-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)

2,120

공시일	2019-09-09
기준일	2019-09-06

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

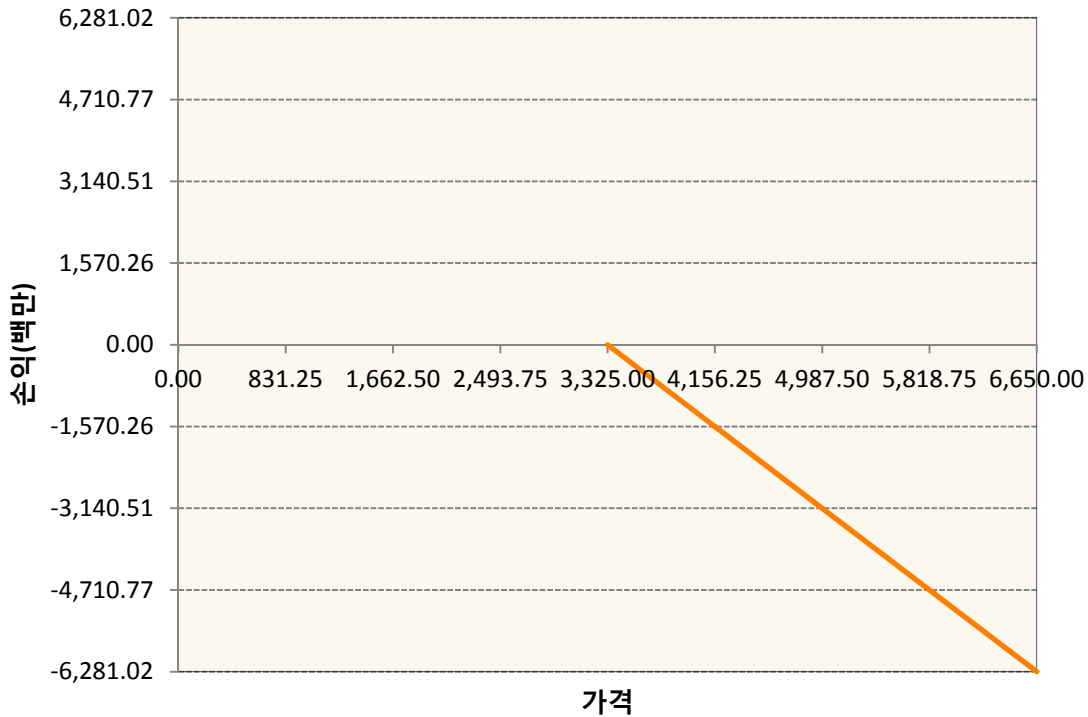
1. 계약금액

(단위:백만원)

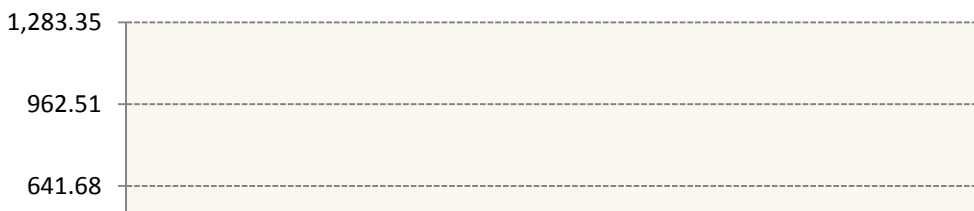
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,114	0	5,114	
누계	유가증권	옵션	0	15,129	-15,129	장내
누계	지수	스왑	24,038	0	24,038	장외
누계	통화	선도	8,983	17,173	-8,190	장외

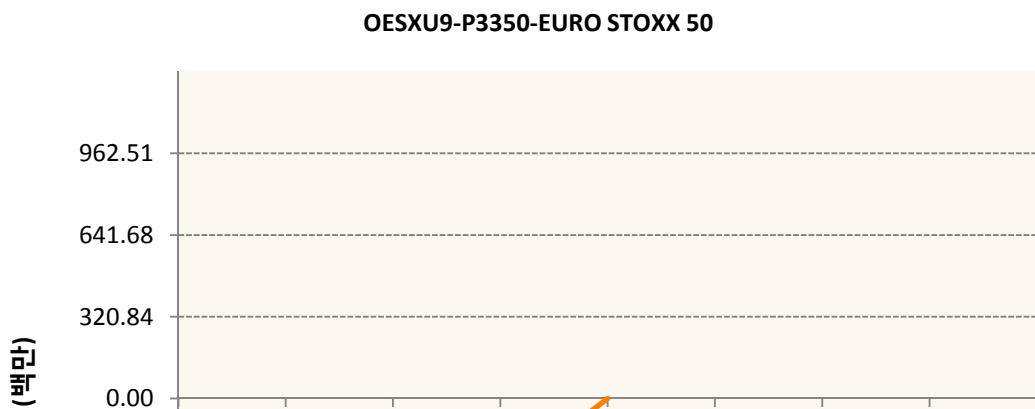
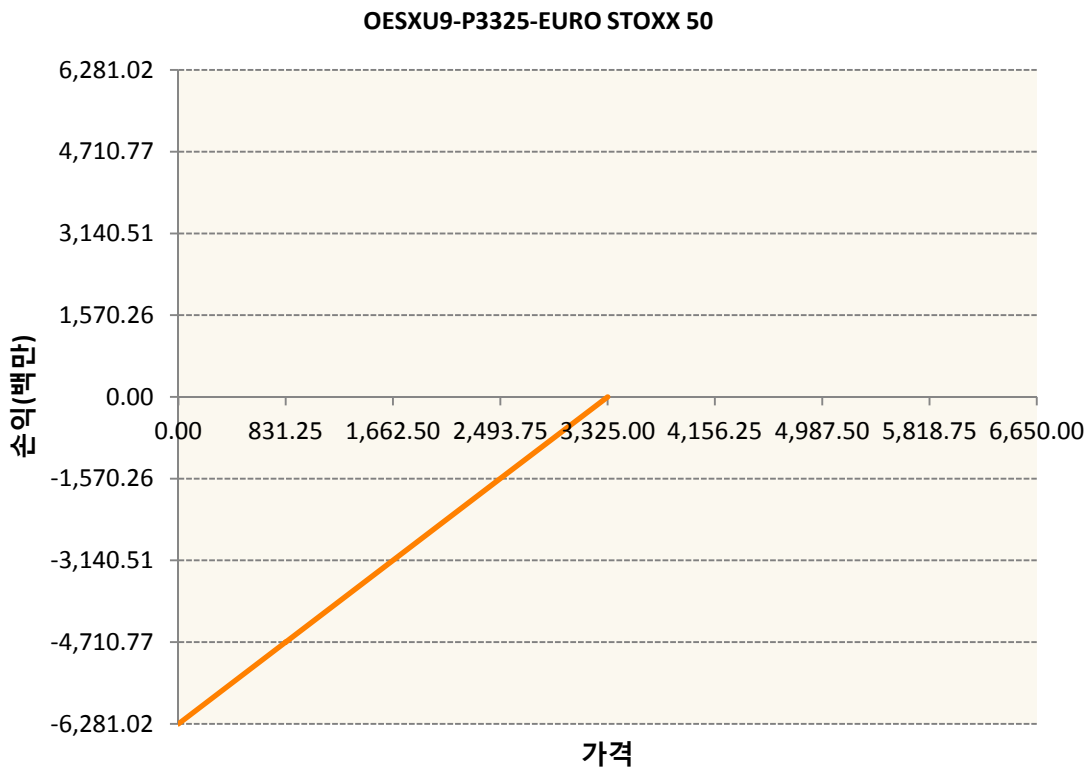
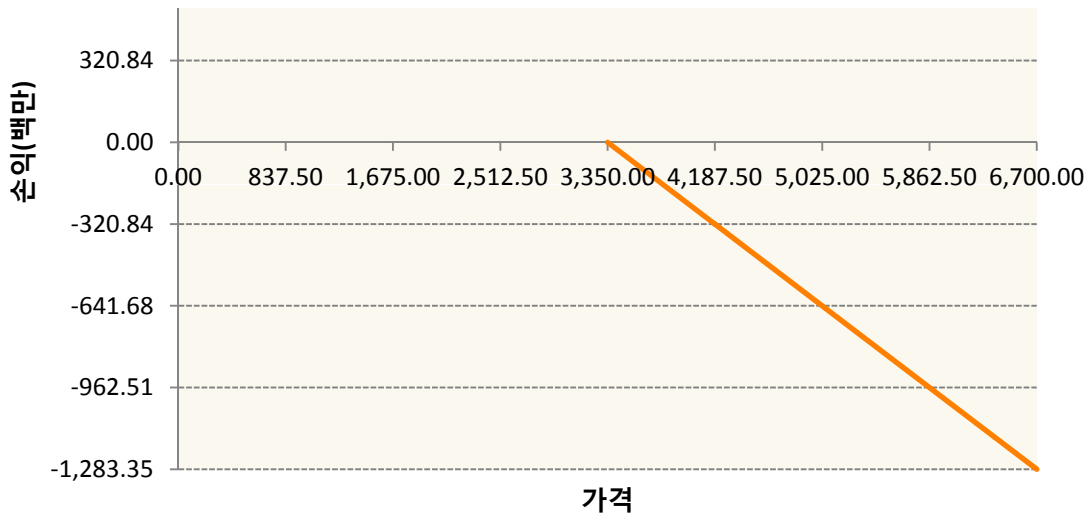
2. 만기시점의 손익구조

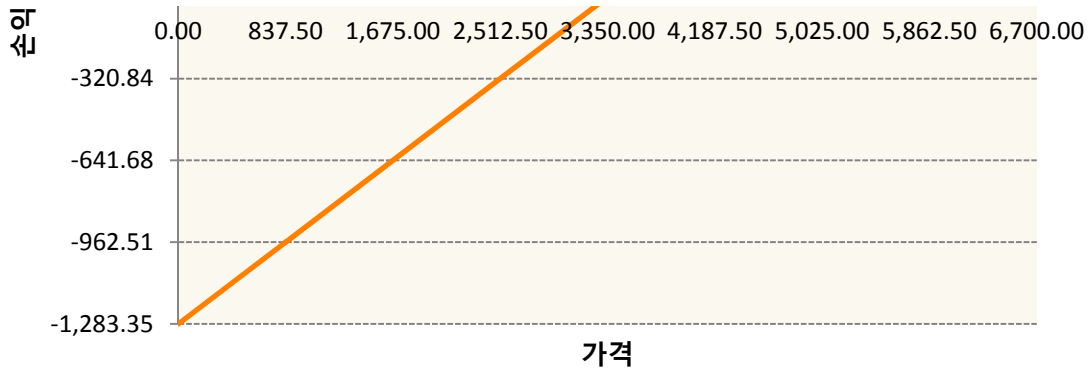
OESXU9-C3325-EURO STOXX 50



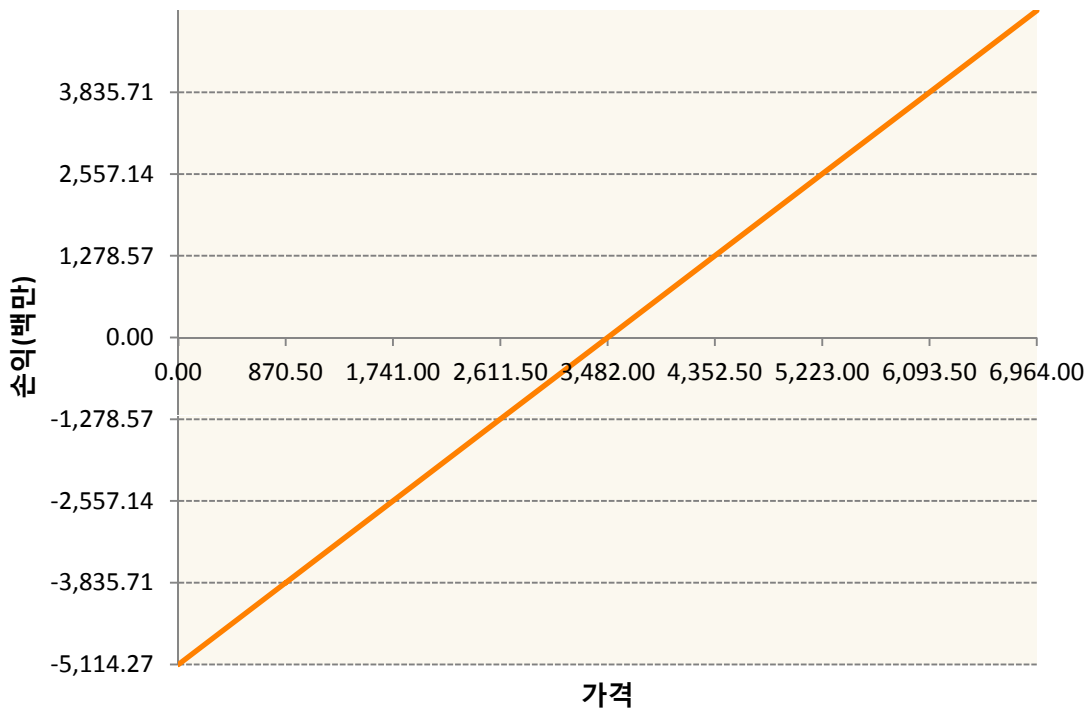
OESXU9-C3350-EURO STOXX 50







VGU9-EURO STOXX 50 Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	21
FX21019M0< KRW/EUR 27-09-19E	1,057
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	317
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E	317
FX21019N04 EUR/KRW 27-09-19E	232
FX21019Q00 EUR/KRW 27-09-19E	169
OESXU9-C3€ EURO STOXX 50	502
OESXU9-C3€ EURO STOXX 50	103
OESXU9-P3€ EURO STOXX 50	502
OESXU9-P3€ EURO STOXX 50	103
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	409

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

(단위:백만원)

2,137

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

(단위:백만원)

963

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

(단위:백만원)

83

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

(단위:백만원)

128

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-09-09
기준일	2019-09-06

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

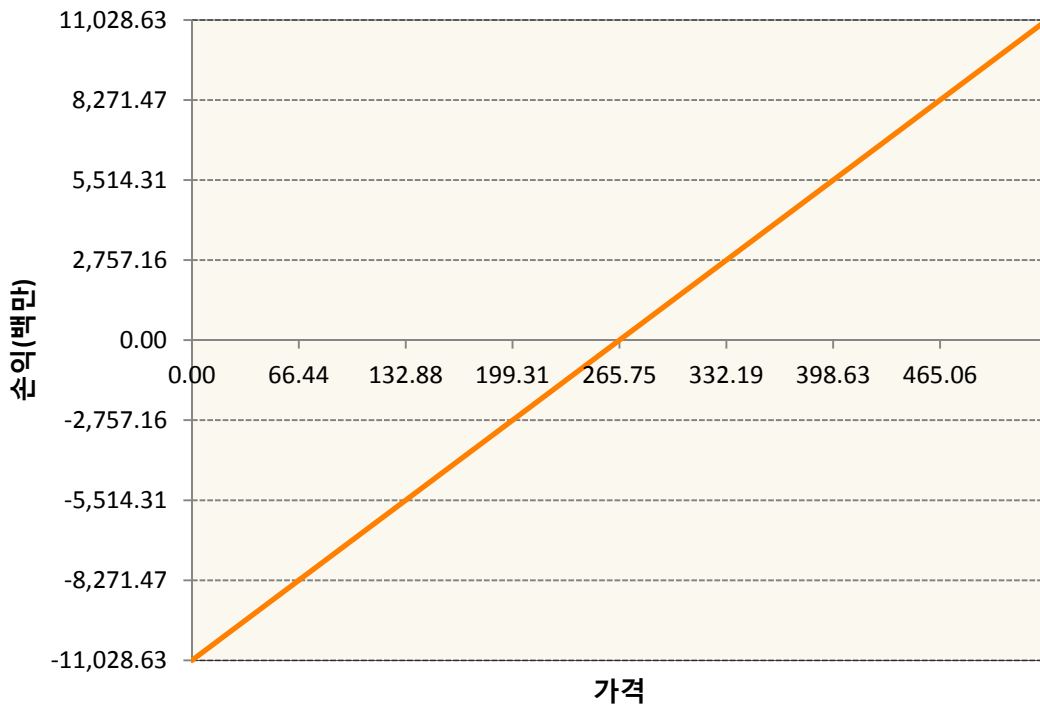
1. 계약금액

(단위:백만원)

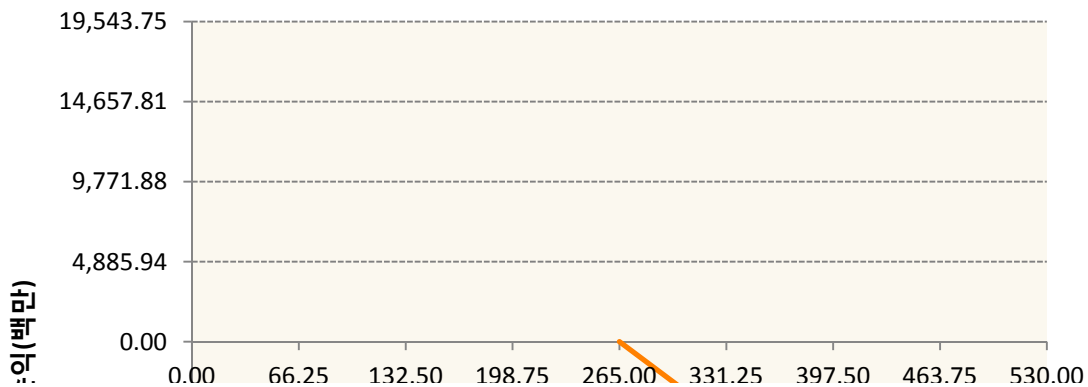
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,029	0	11,029	장내
누계	유가증권	옵션	3,596	19,678	-16,081	장내

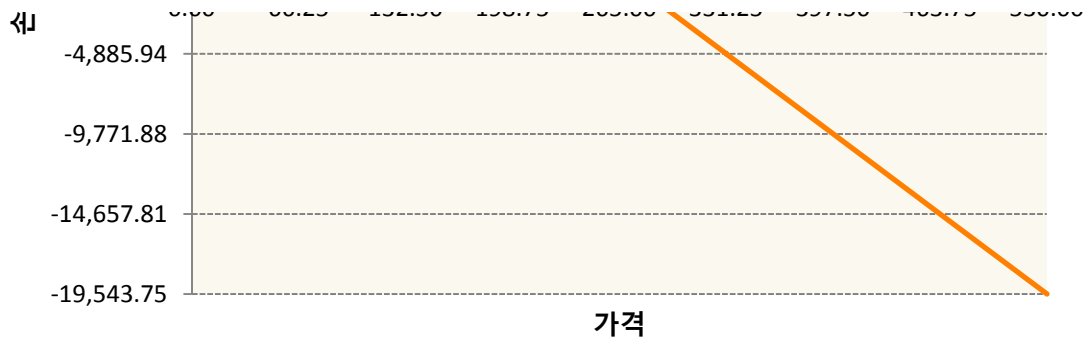
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

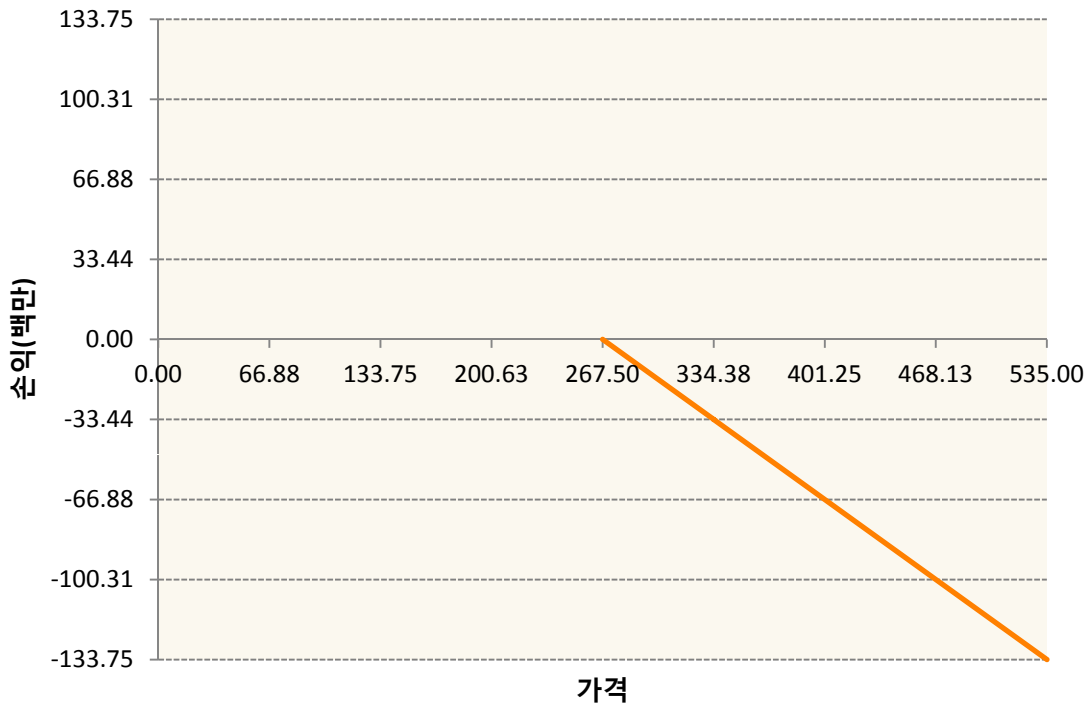


KR4201P92658-2019-09 콜265

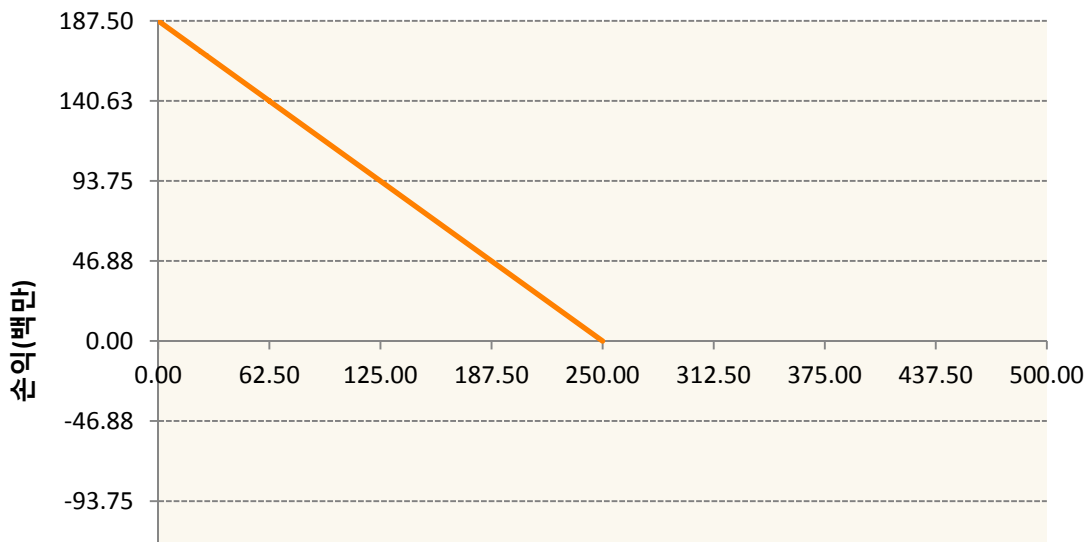


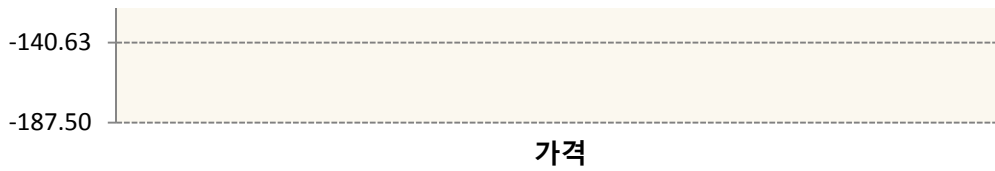


KR4201P92674-2019-09 콜267.5

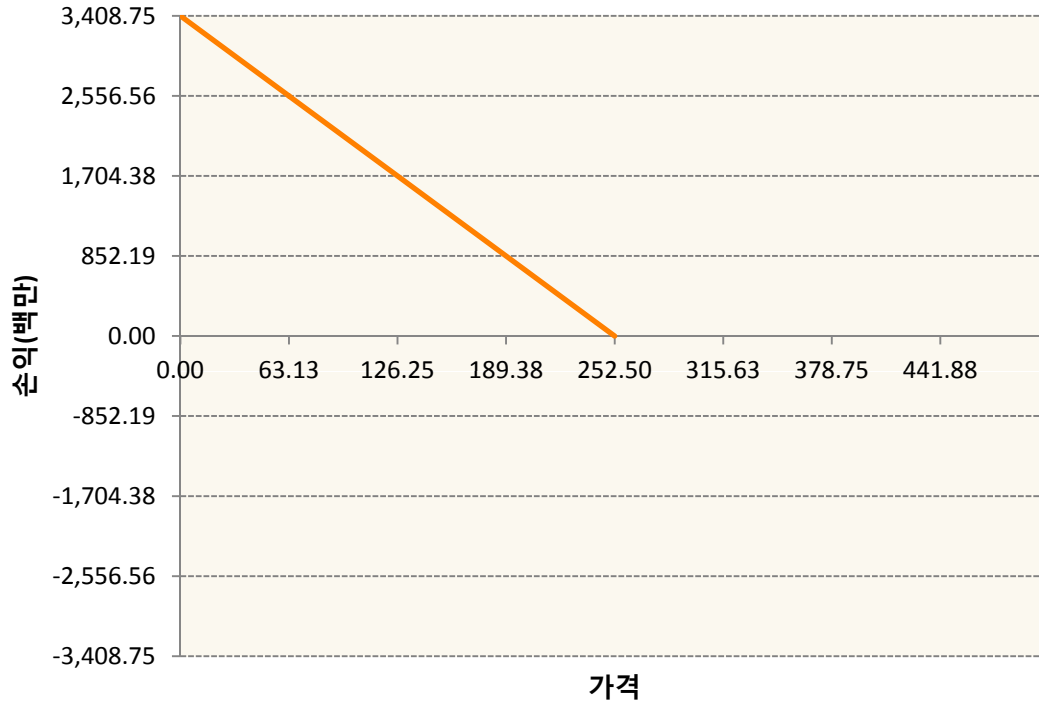


KR4301P92508-2019-09 풋250





KR4301P92524-2019-09 풋252.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						882
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-882	-882	-882	-882	-882	-882	-882	
-5.33%	-588	-588	-588	-588	-588	-588	-588	
-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%	588	588	588	588	588	588	588	
8.00%	882	882	882	882	882	882	882	
KR4201P92658		2019-09 콜265						1,345
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	264	264	263	263	262	261	259	
-5.33%	262	260	257	252	247	241	233	
-2.67%	230	218	205	191	176	160	144	

0%	61	41	20	0	-20	-41	-61
2.67%	-321	-332	-344	-357	-372	-387	-402
5.33%	-818	-820	-823	-827	-833	-839	-847
8.00%	-1,338	-1,338	-1,339	-1,339	-1,341	-1,342	-1,345

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%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
5.33%	-5	-5	-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%	4	4	4	4	5	5	5
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1
-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 풋252.5 114

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	111	112	112	112	113	113	114
-5.33%	28	30	32	34	36	38	40
-2.67%	1	1	2	3	4	5	6
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)

2,336

공시일	2019-09-09
기준일	2019-09-06

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,197	0	1,197	
누계	유가증권	수익증권	80,383	0	80,383	

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	2019-09-09
기준일	2019-09-06

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,394	0	2,394	
누계	유가증권	수익증권	102,619	0	102,619	

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	2019-09-09
기준일	2019-09-06

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	473,491	0	473,491	
누계	통화	선도	0	504,972	-504,972	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		1,724
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,107
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		134
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		287
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		96
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		709
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		709
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		287
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		670
FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E		479
FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E		192
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		287
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		3,160
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		2,145
FX21019Q01 KRW/USD 16-09-19E		96
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,926
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,543
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,624
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,978
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		958
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		958
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E		958
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E		1,724
FX21019Q04 KRW/USD 30-09-19E		192
FX21019Q04 KRW/USD 24-09-19E		2,107
FX21019Q04 KRW/USD 24-09-19E		2,681

FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E	192
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E	287
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E	287
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E	192
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E	1,379
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E	2,049
FX21019U01 KRW/USD 10-10-19E	287

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

(단위:백만원)

13,315

공시일	2019-09-09
기준일	2019-09-06

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

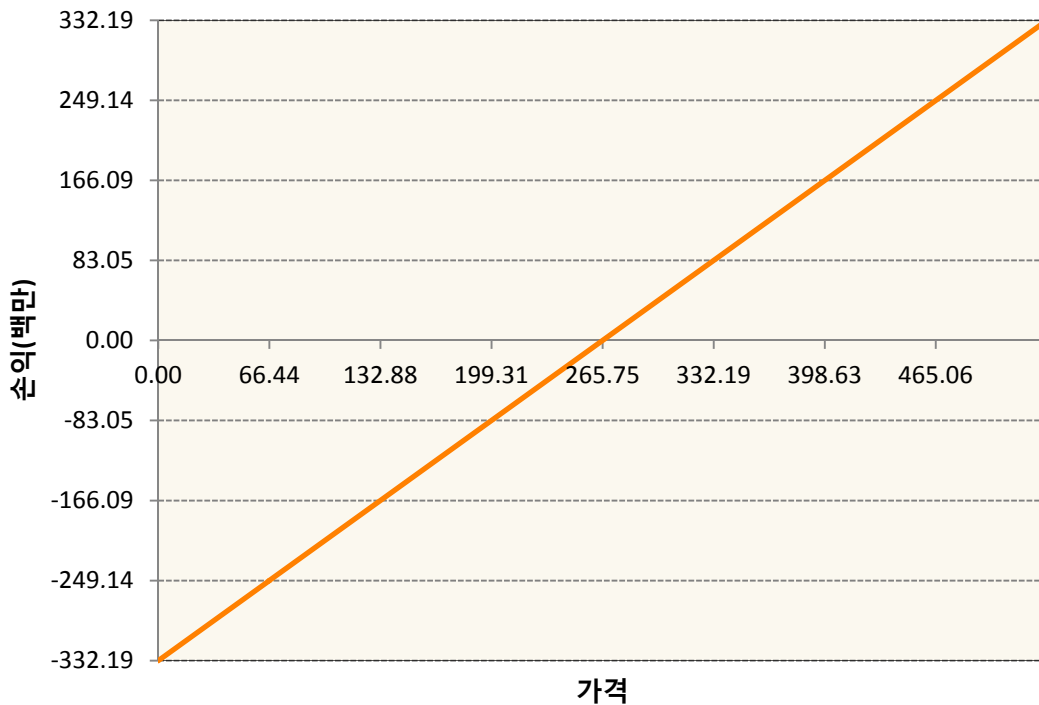
1. 계약금액

(단위:백만원)

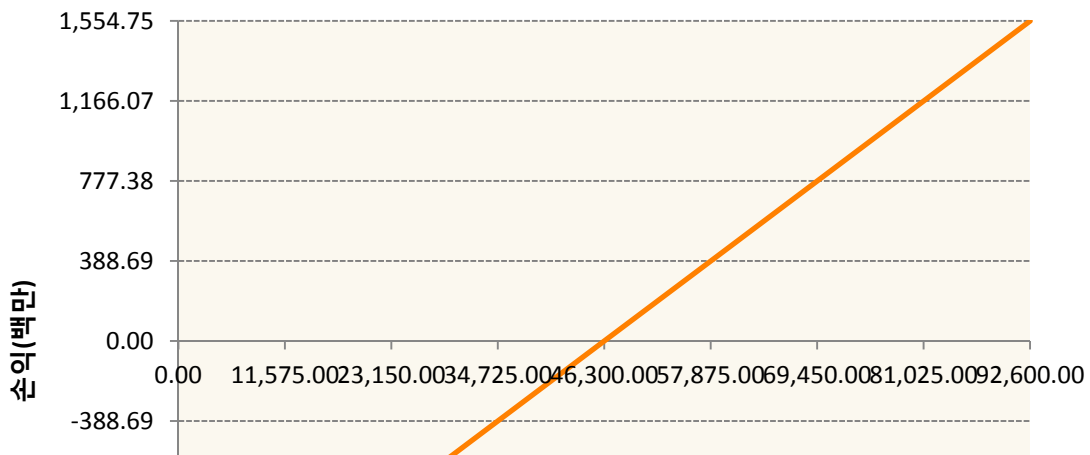
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,887	0	1,887	장내

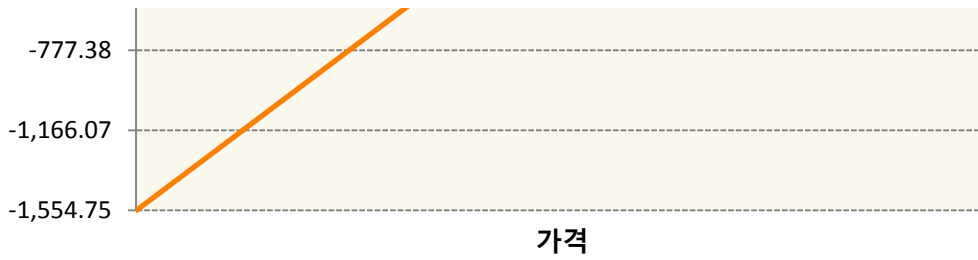
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P90000-2019-09 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						27
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27	
-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%	27	27	27	27	27	27	27	
KR4111P90000		2019-09 삼성전자개별선물						124
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124	
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83	
-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%	83	83	83	83	83	83	83	
8.00%	124	124	124	124	124	124	124	

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

179

공시일	2019-09-09
기준일	2019-09-06

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

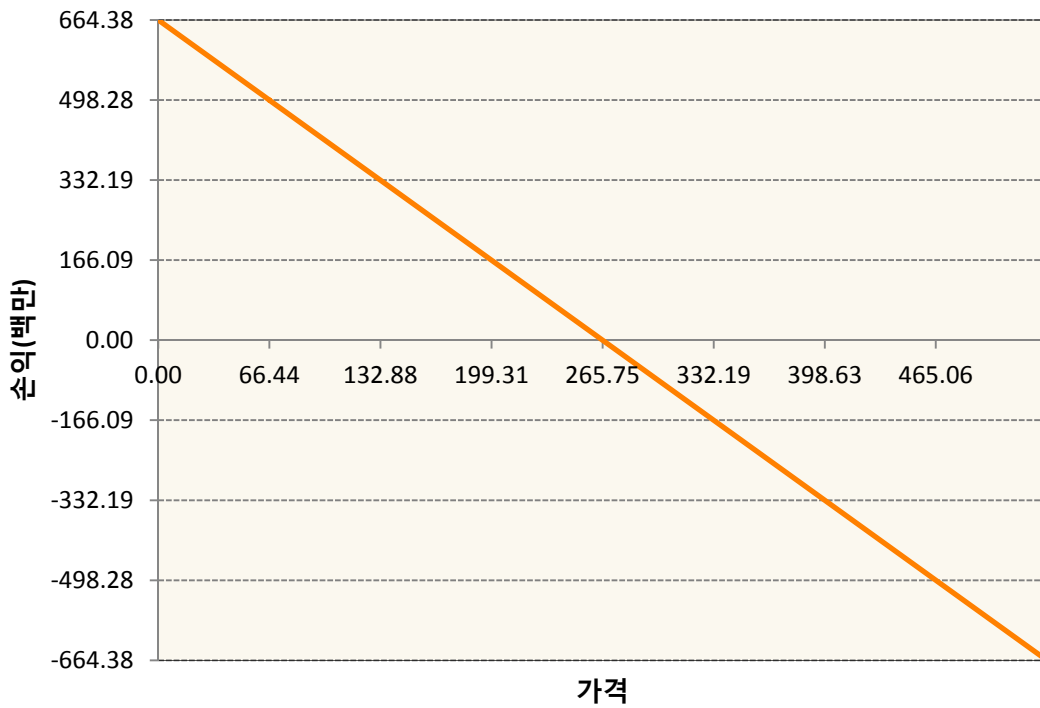
1. 계약금액

(단위:백만원)

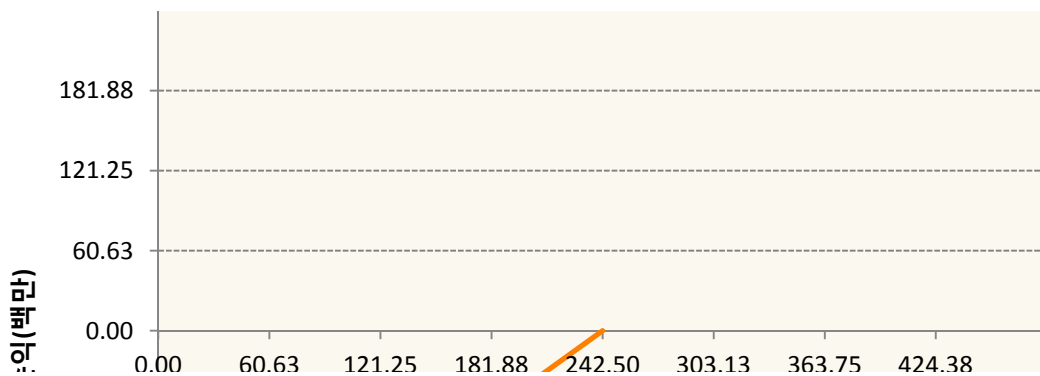
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	664	-664	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,611	-3,611	장내

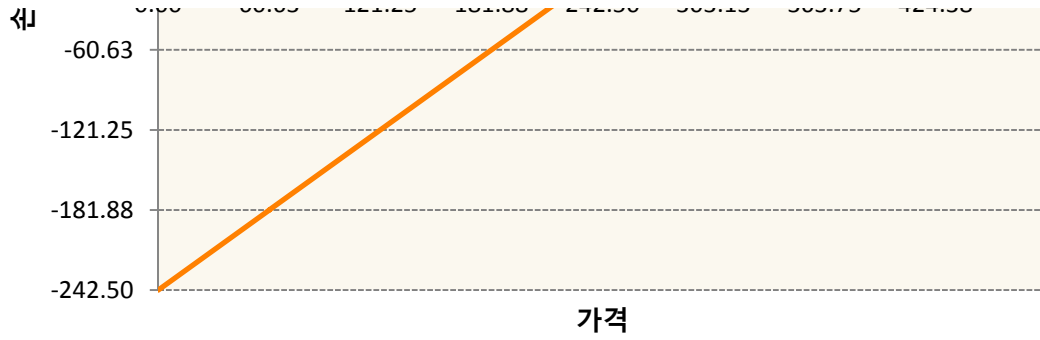
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

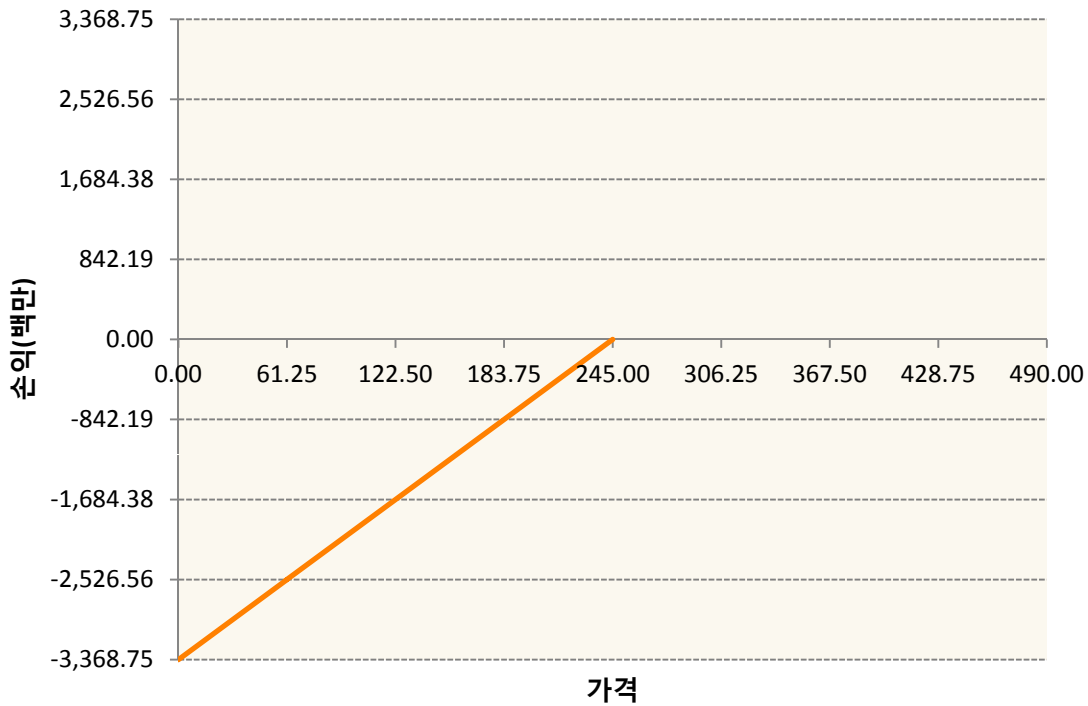


KR4301P92425-2019-09 풋242.5





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						1
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%	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

36

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-24	-26	-28	-30	-32	-34	-36
-5.33%	-1	-1	-2	-2	-3	-4	-5
-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

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

(단위:백만원)

46

공시일	2019-09-09
기준일	2019-09-06

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	19,606	0	19,606	
누계	통화	선도	0	19,031	-19,031	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		479
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		517
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		38
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		326

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

(단위:백만원)

502

공시일	2019-09-09
기준일	2019-09-06

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	380	0	380	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	2019-09-09
기준일	2019-09-06

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

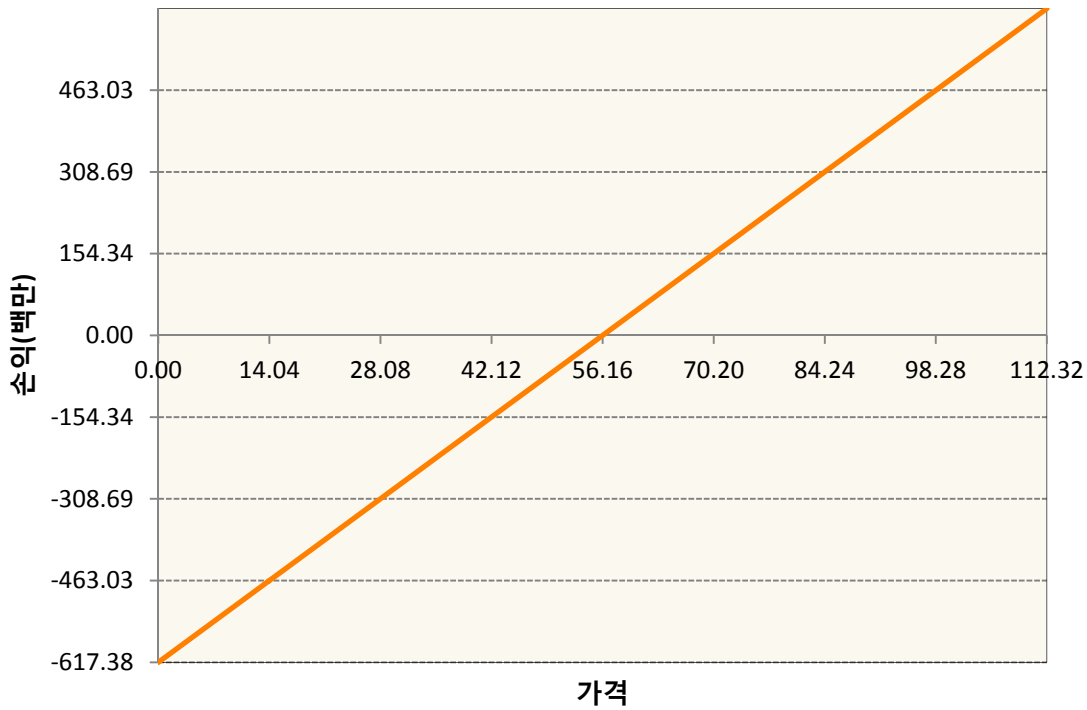
1. 계약금액

(단위:백만원)

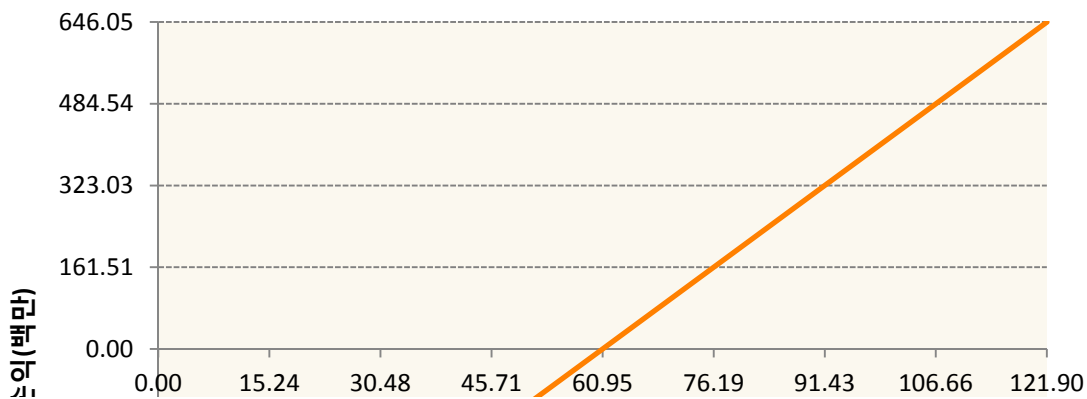
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,321	120	2,201	
누계	유가증권	선물	194	0	194	장내

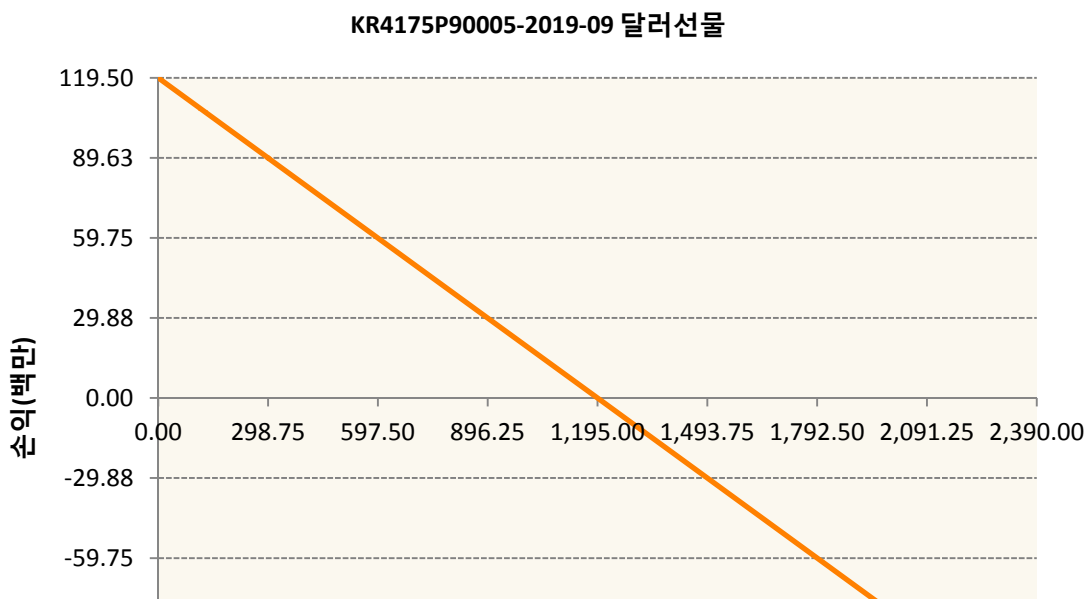
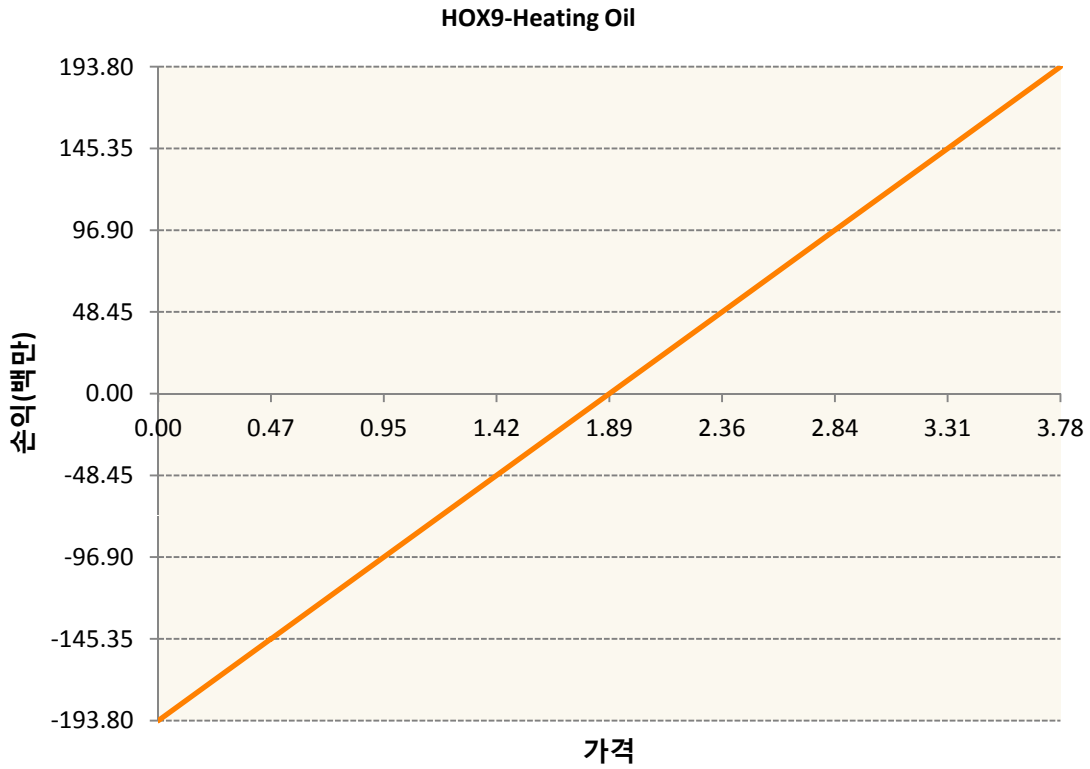
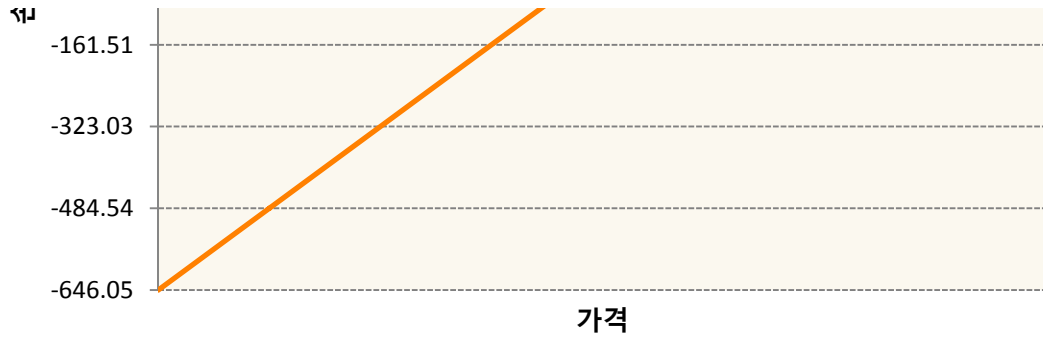
2. 만기시점의 손익구조

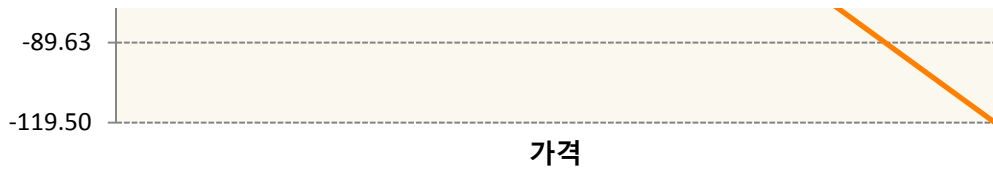
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19



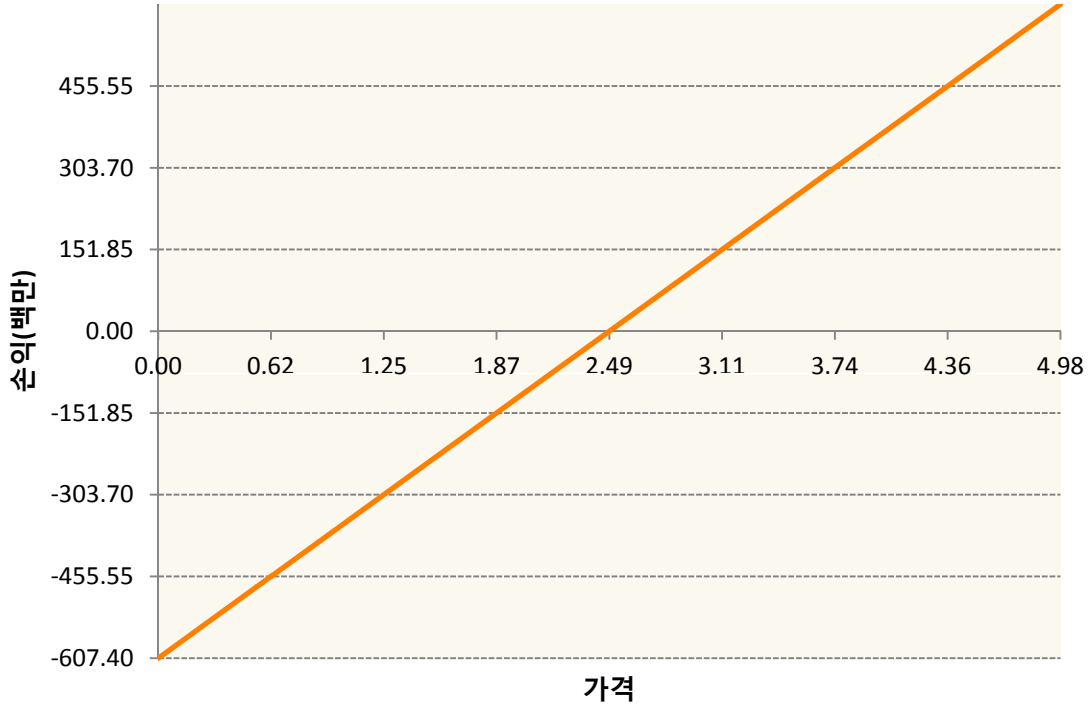
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19



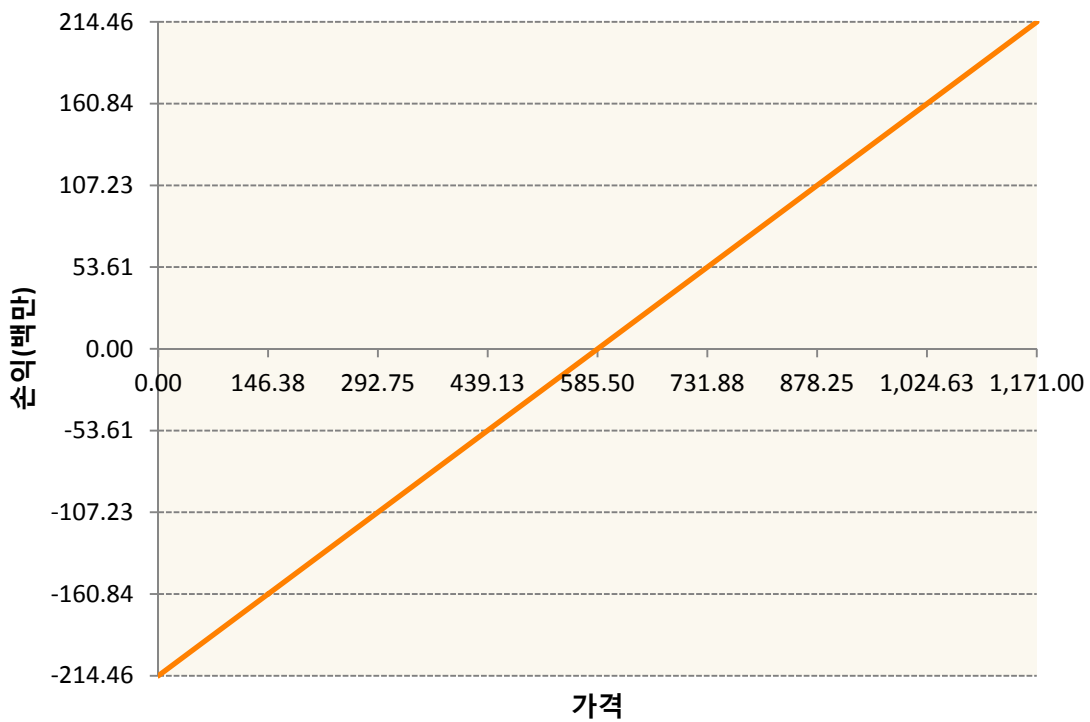




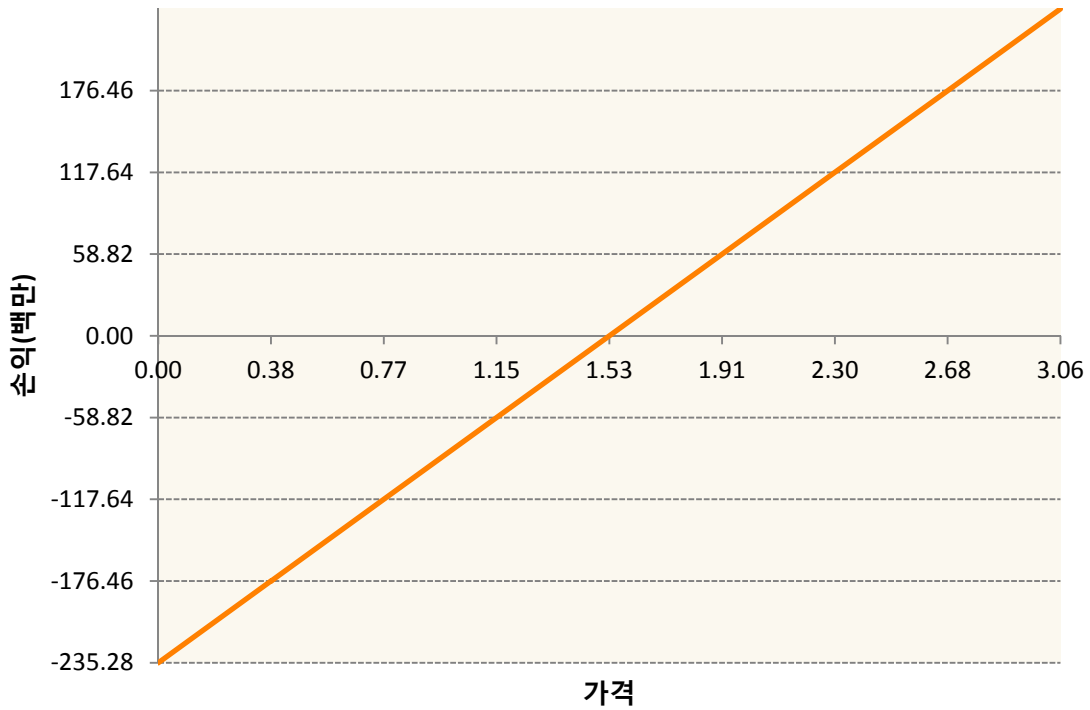
NGX19-NATURAL GAS FUTR Nov19



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	52
HOX9	Heating Oil	16
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)

391

공시일	2019-09-09
기준일	2019-09-06

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

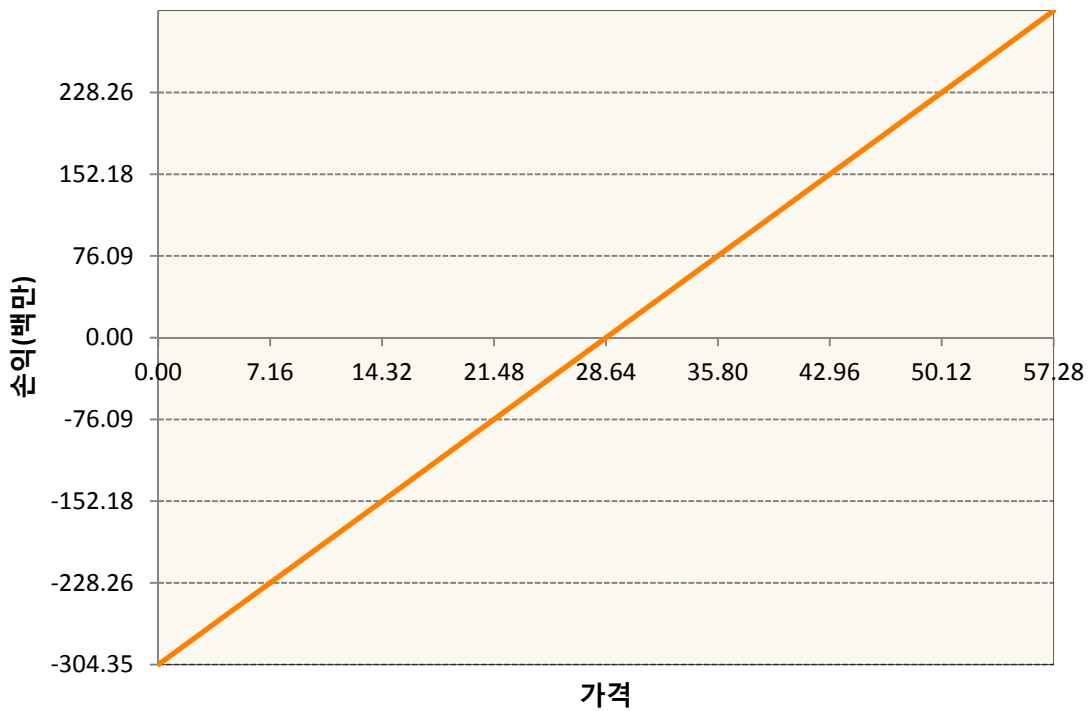
1. 계약금액

(단위:백만원)

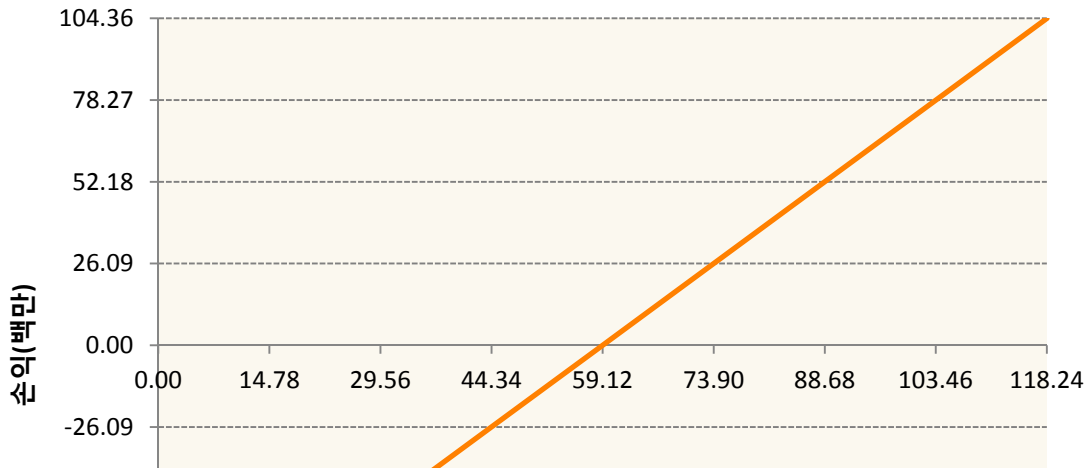
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,689	155	2,534	

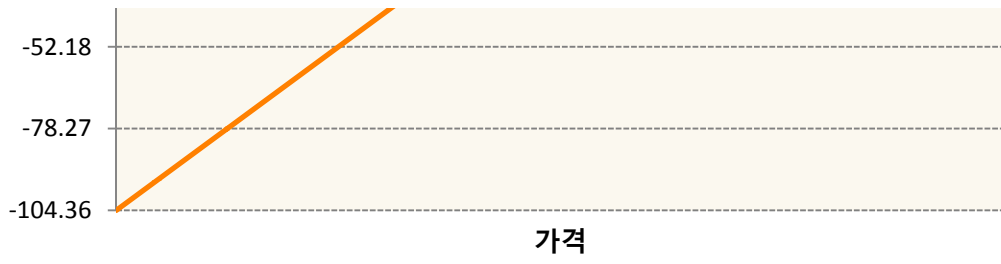
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

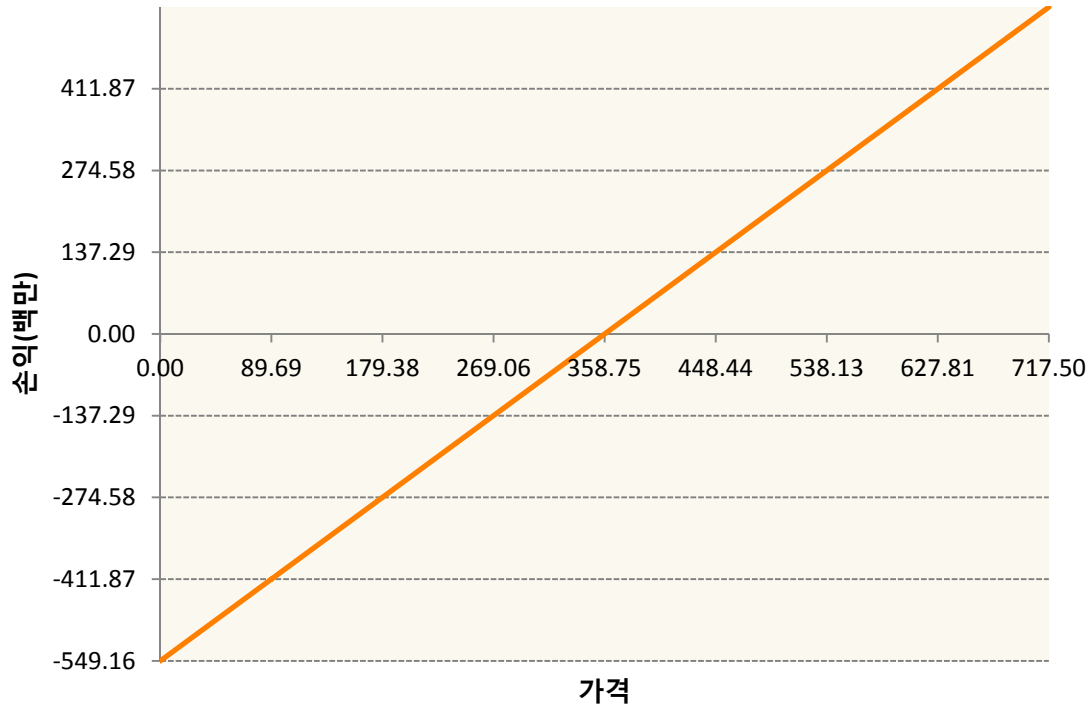


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

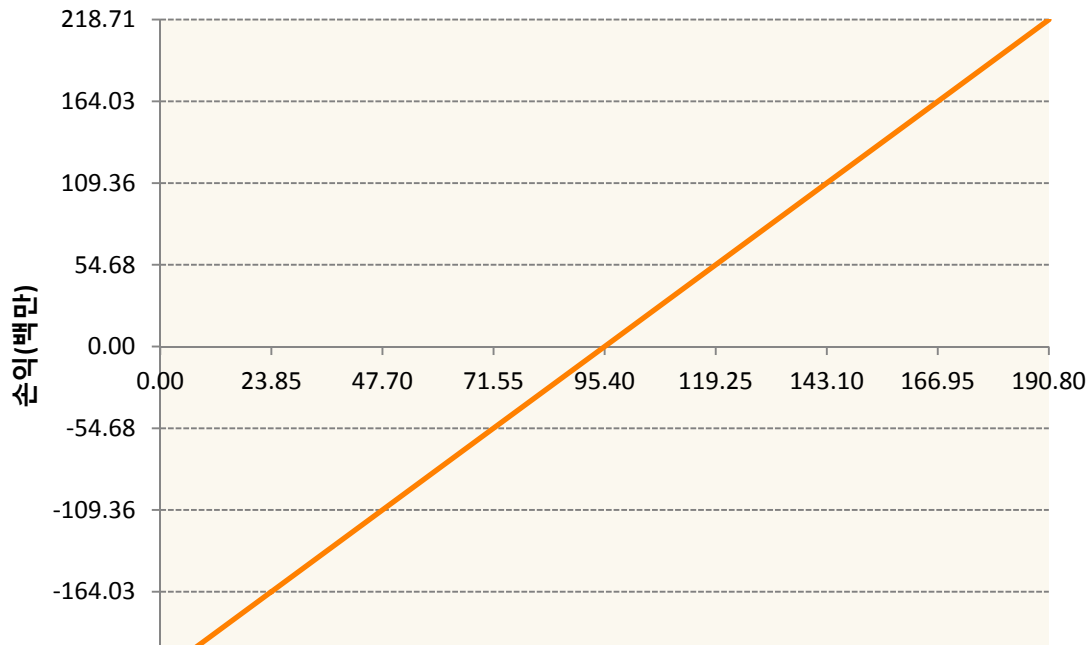


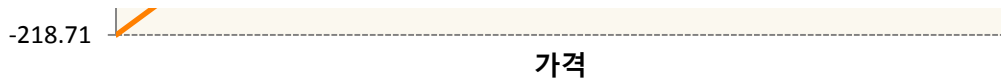


CZ9-CORN FUTURE Dec19

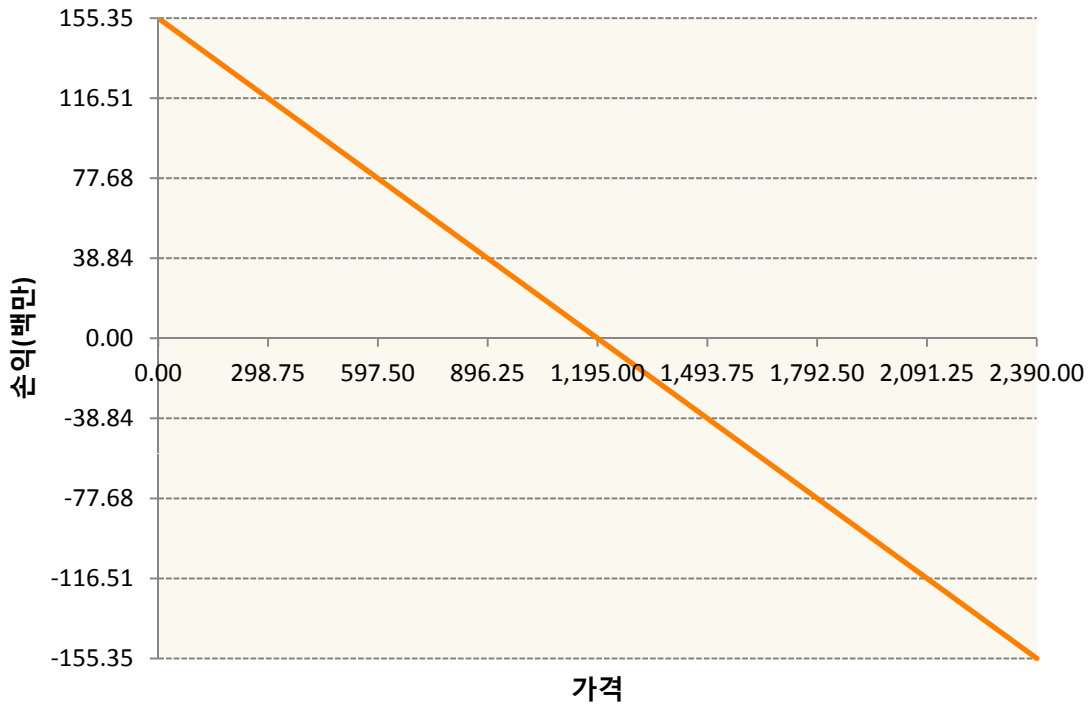


KC9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19

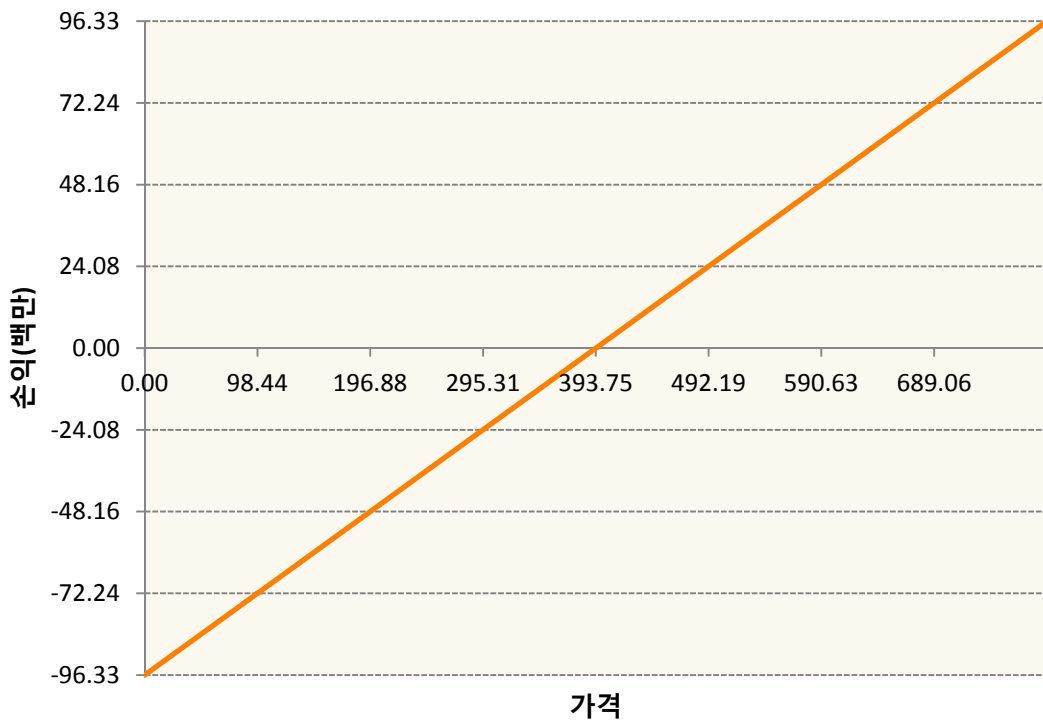




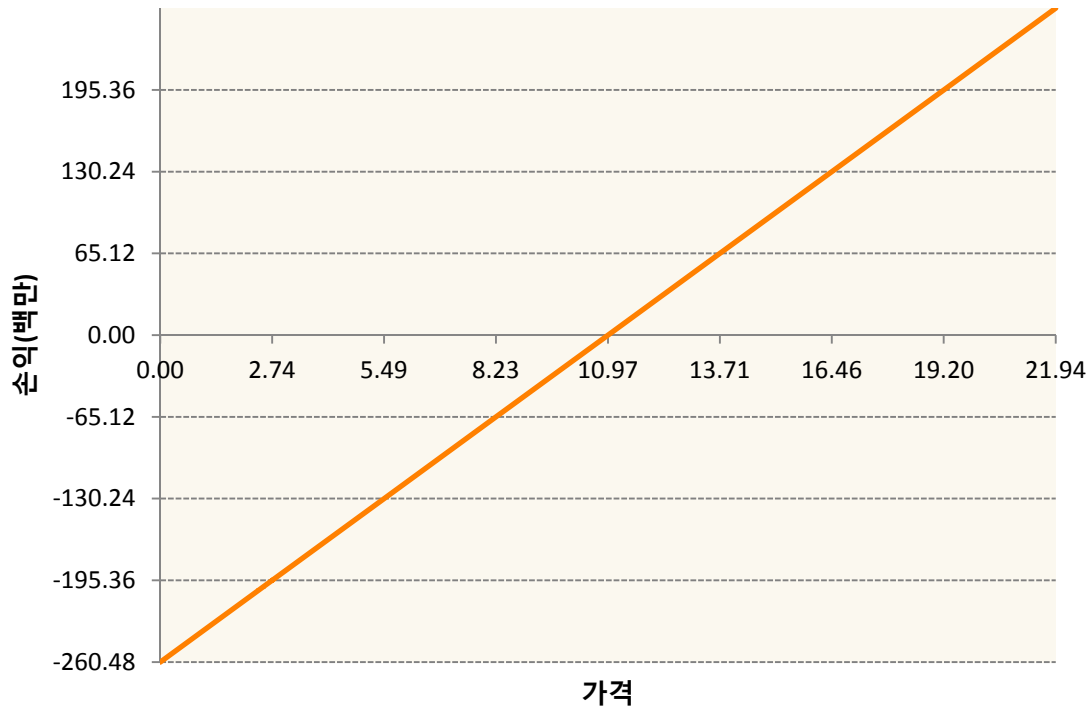
KR4175P90005-2019-09 달러선물



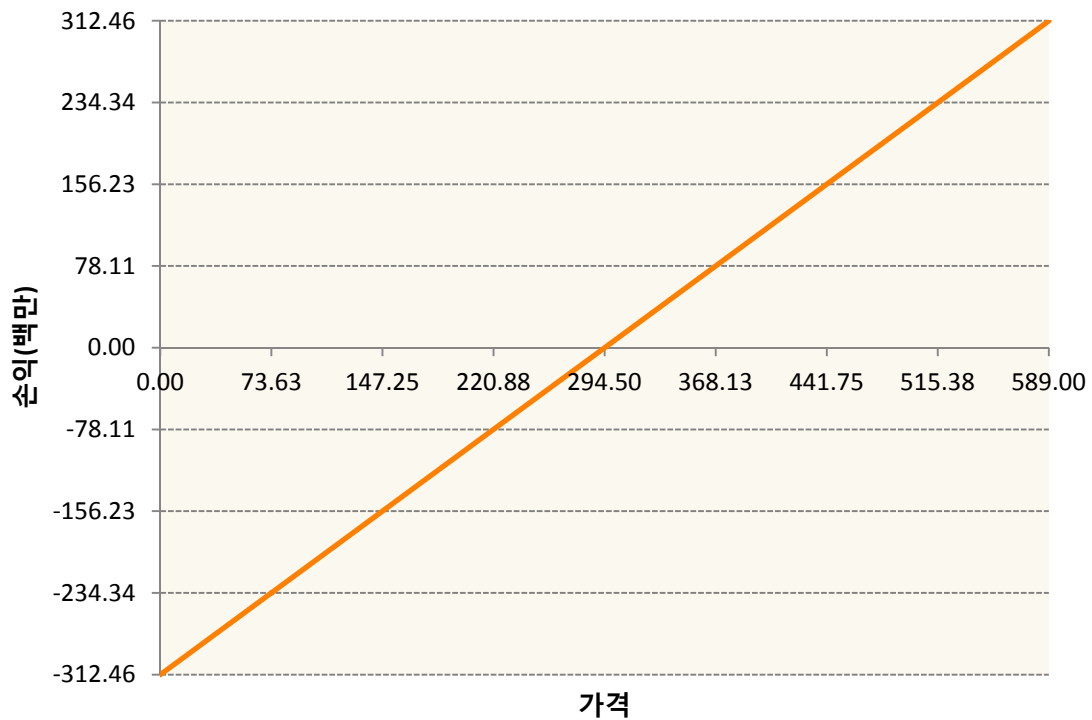
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

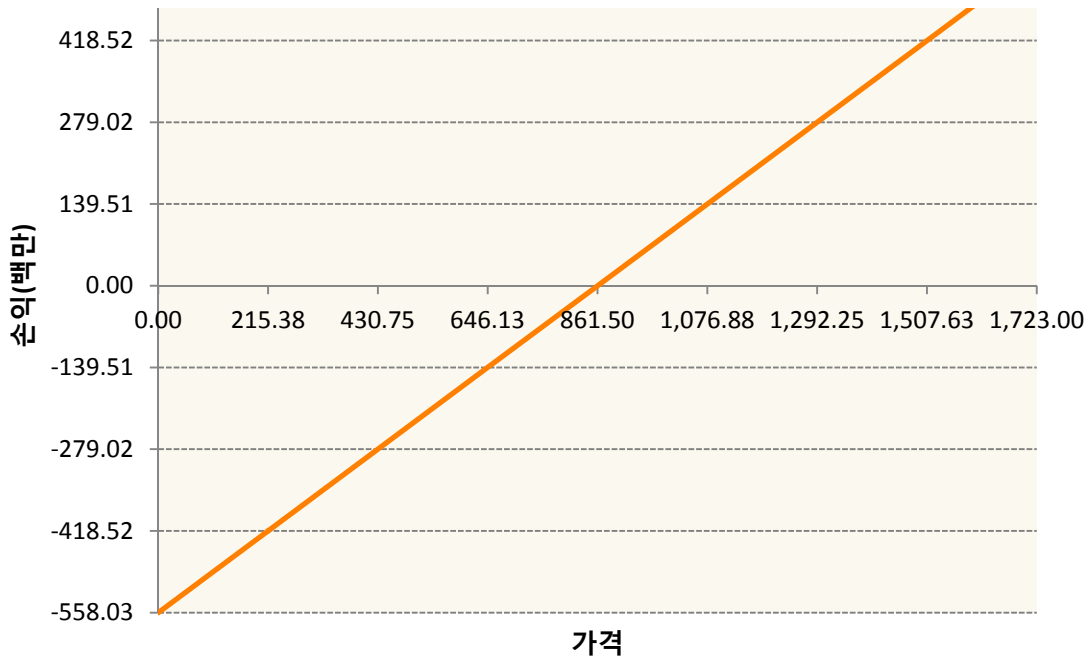


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

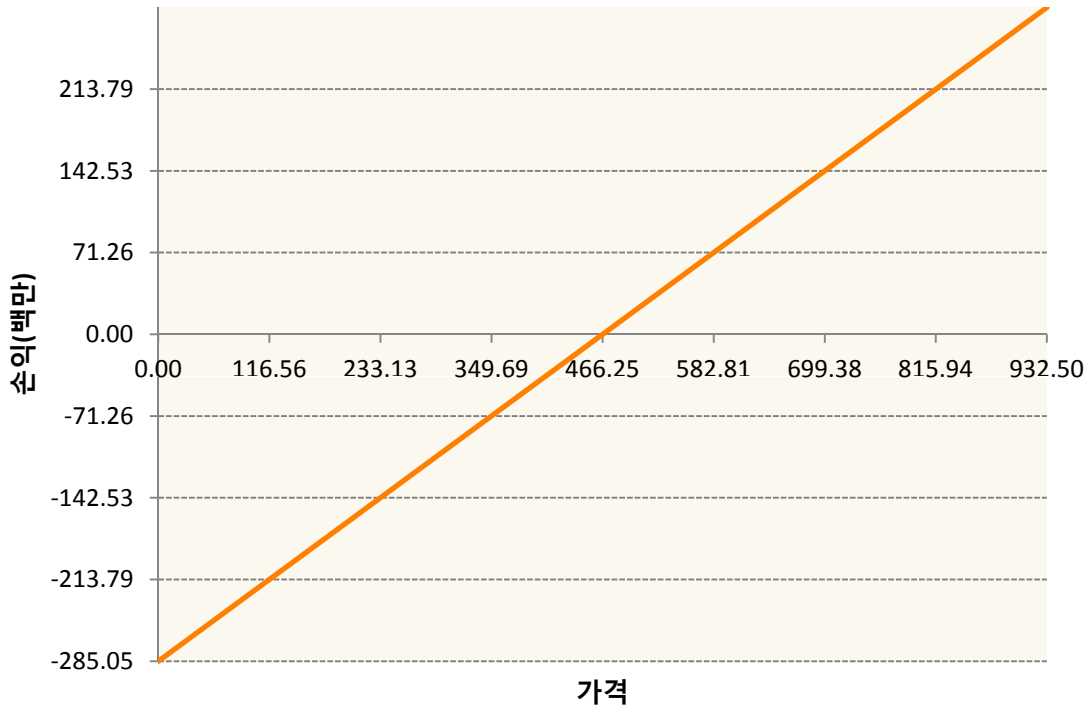


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





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	44
KCZ9	COFFEE 'C' FUTURE Dec19	17
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)

238