

공시일	2019-09-11
기준일	2019-09-10

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

공시일	2019-09-11
기준일	2019-09-10

스마트인덱스모

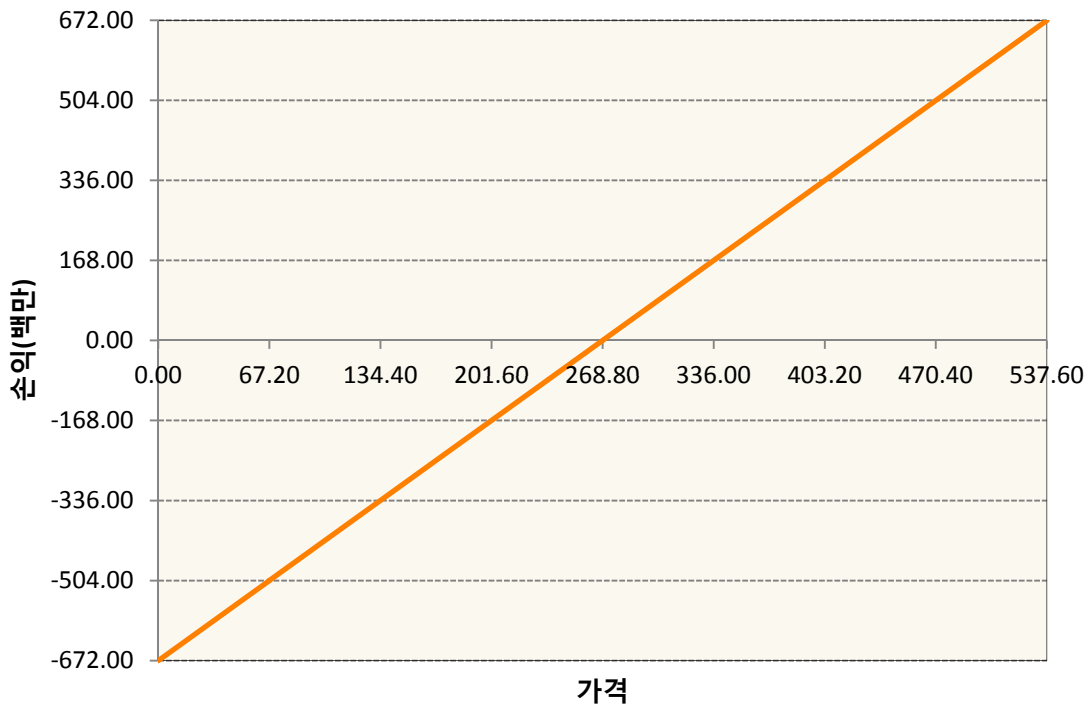
1. 계약금액

(단위:백만원)

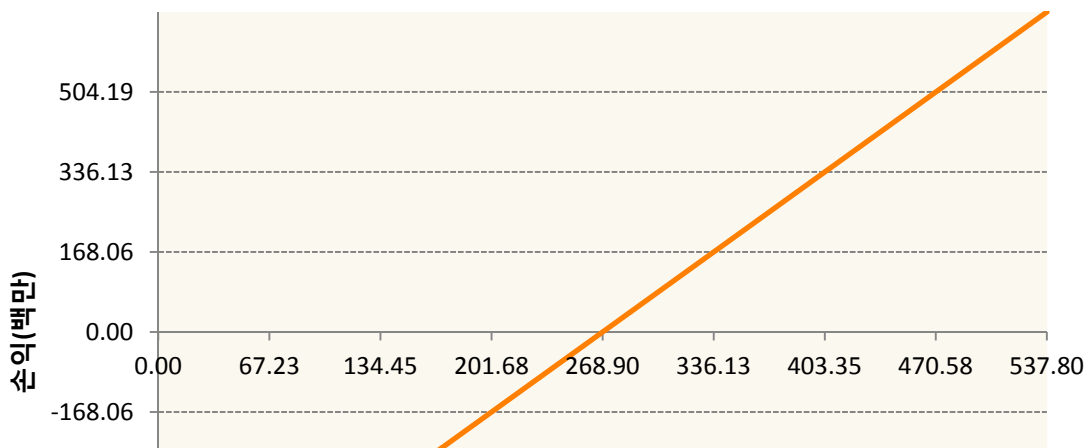
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	671	671	0	장내
누계	유가증권	선물	1,344	0	1,344	장내

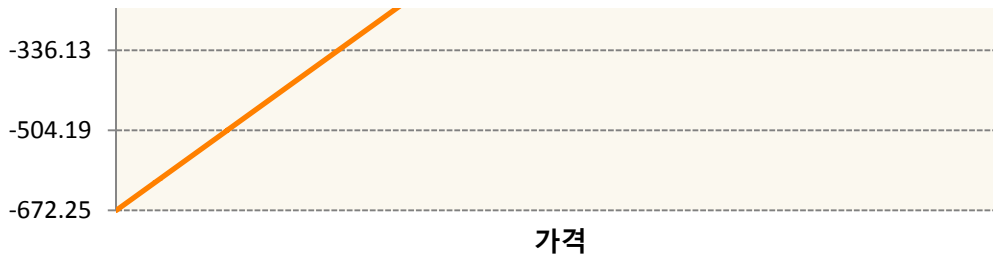
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						54
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54	
-5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	
-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%	36	36	36	36	36	36	36	
8.00%	54	54	54	54	54	54	54	
KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						54
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54	
-5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	
-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%	36	36	36	36	36	36	36	
8.00%	54	54	54	54	54	54	54	

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

93

공시일	2019-09-11
기준일	2019-09-10

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

1,170

* 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	2019-09-11
기준일	2019-09-10

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	6,772	0	6,772	장외
누계	지수	스왑	6,772	0	6,772	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(1)	396
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	145

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

862

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-11
기준일	2019-09-10

유로인덱스모(주식-파생형)

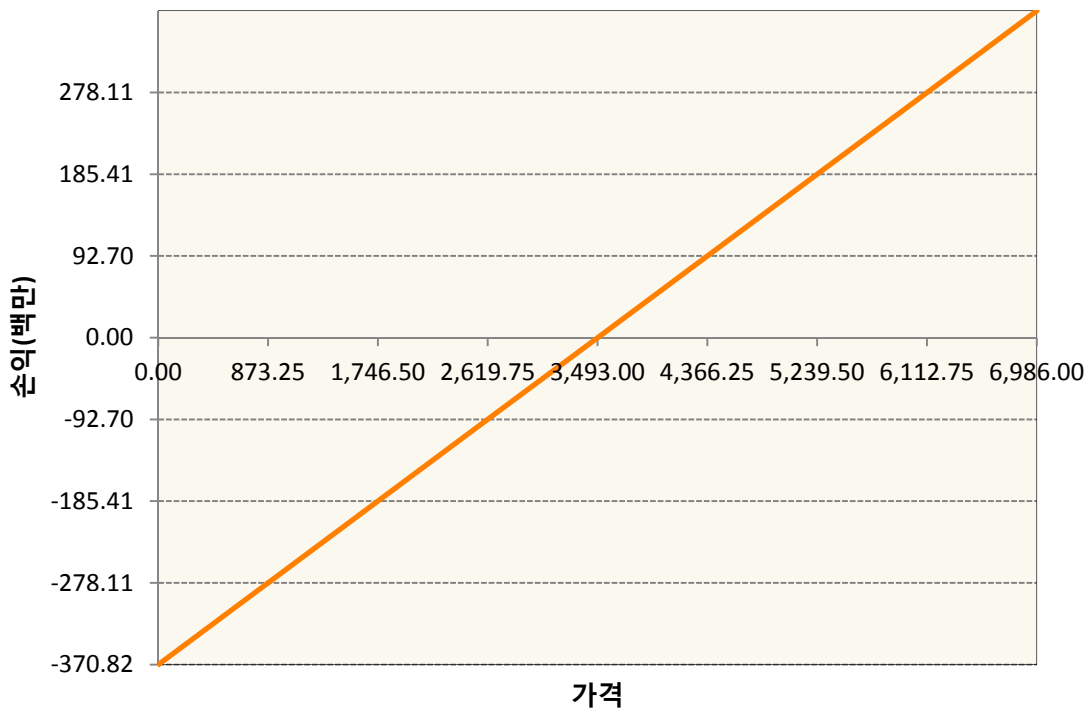
1. 계약금액

(단위:백만원)

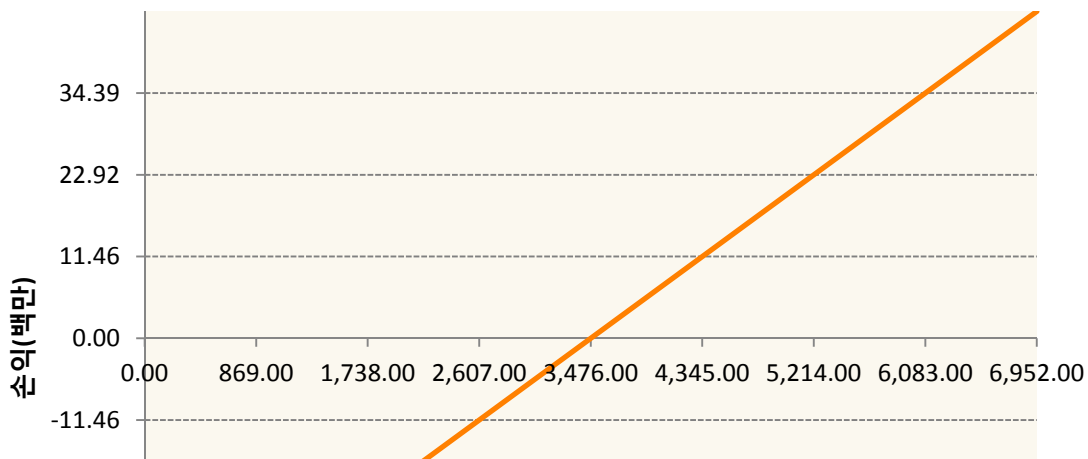
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	417	0	417	

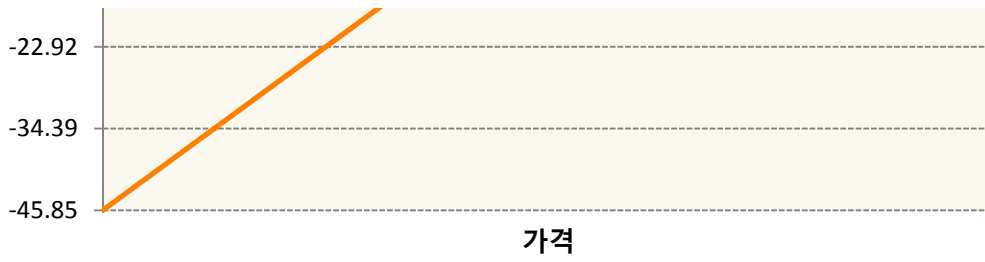
2. 만기시점의 손익구조

VGU9-EURO STOXX 50 Sep19



VGZ9-EURO STOXX 50 Dec19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

VGU9	EURO STOXX 50 Sep19	30
VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	4

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

23

공시일	2019-09-11
기준일	2019-09-10

차이나인덱스모(주식-파생형)

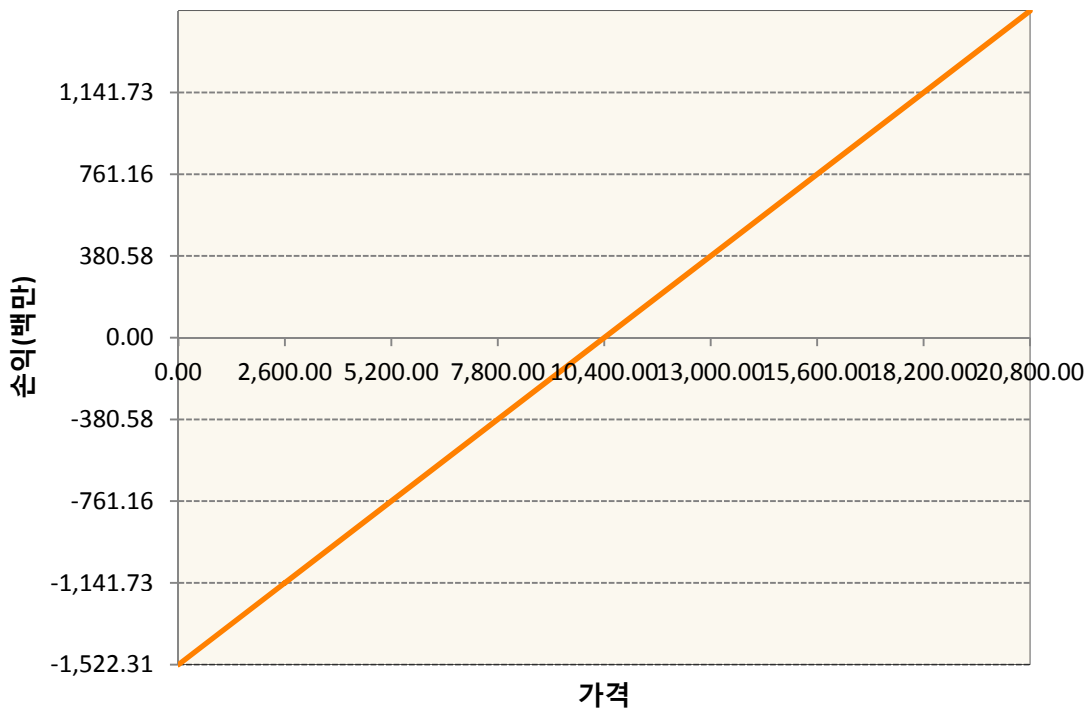
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,522	0	1,522	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCU9-HSCEI Futures Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU9	HSCEI Futures Sep19	122
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

114

공시일	2019-09-11
기준일	2019-09-10

커버드콜모(주식혼합-파생형)

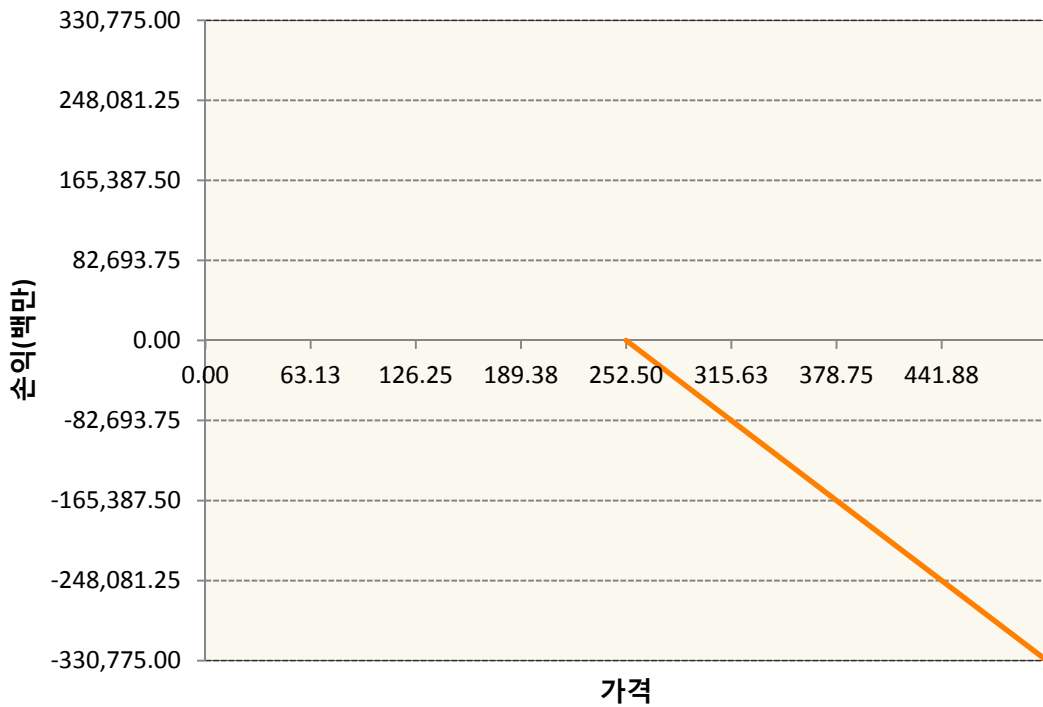
1. 계약금액

(단위:백만원)

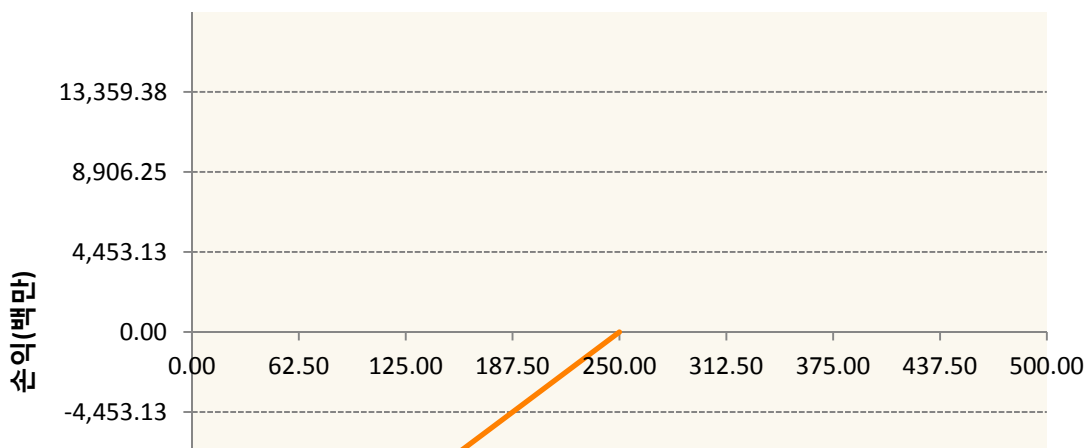
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	494,722	-494,722	장내

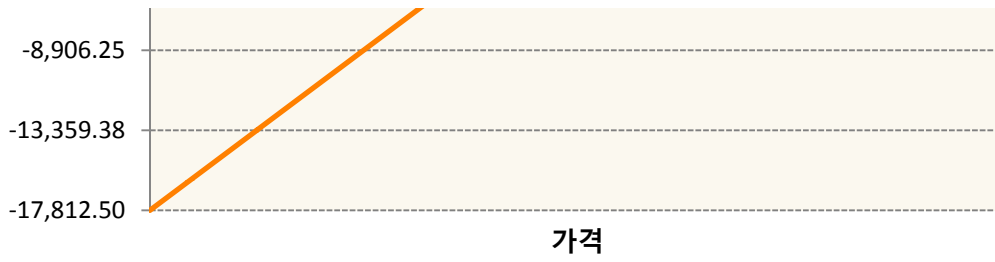
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P92526-2019-09 콜252.5

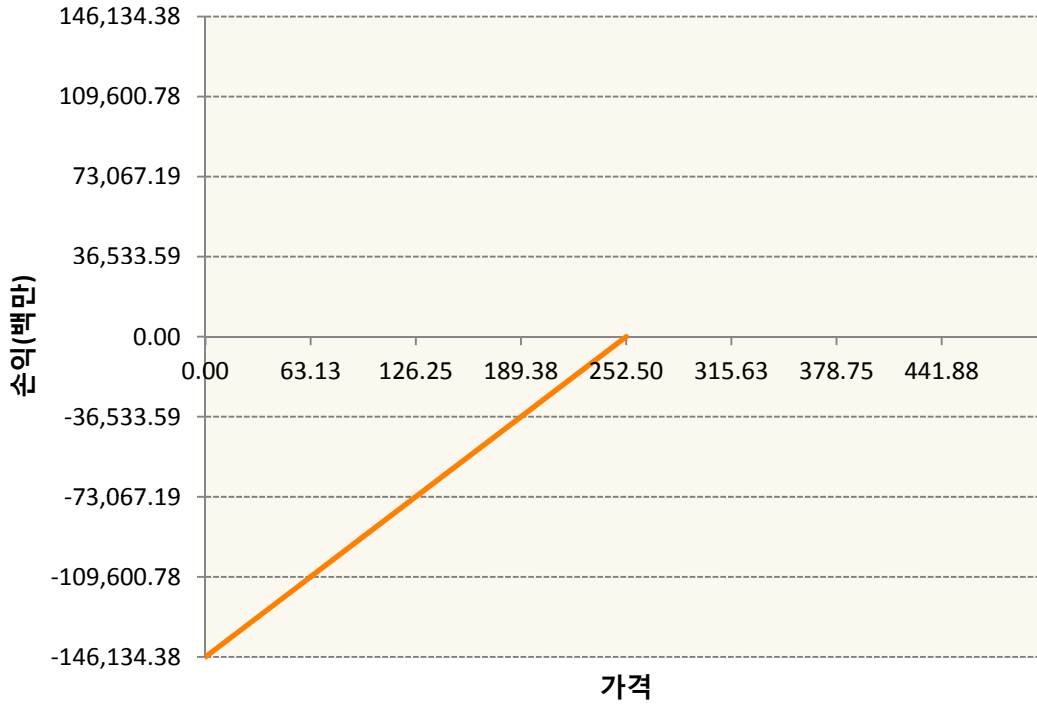


KR4301P92508-2019-09 풋250





KR4301P92524-2019-09 풋252.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P92526		2019-09 콜252.5					28,164
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	21,259	21,233	21,198	21,153	21,099	21,036	20,966
-5.33%	18,294	18,171	18,043	17,911	17,776	17,638	17,498
-2.67%	9,388	9,387	9,384	9,379	9,371	9,358	9,340
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-9,388	-9,388	-9,388	-9,388	-9,388	-9,388	-9,388
5.33%	-18,776	-18,776	-18,776	-18,776	-18,776	-18,776	-18,776
8.00%	-28,164	-28,164	-28,164	-28,164	-28,164	-28,164	-28,164
KR4301P92508		2019-09 풋250					206
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-197	-198	-199	-200	-202	-204	-206

-5.33%	0	0	0	-1	-1	-1	-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							3,045
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,038	-3,038	-3,038	-3,039	-3,040	-3,042	-3,045
-5.33%	-37	-54	-73	-95	-119	-144	-171
-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)

28,205

공시일	2019-09-11
기준일	2019-09-10

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

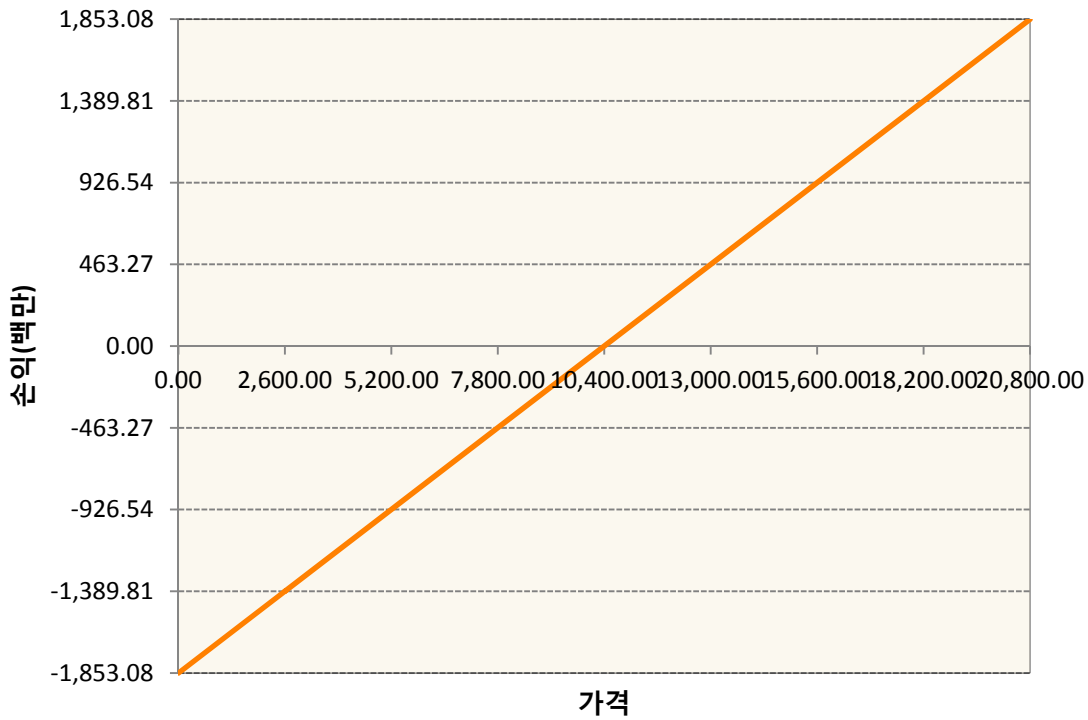
1. 계약금액

(단위:백만원)

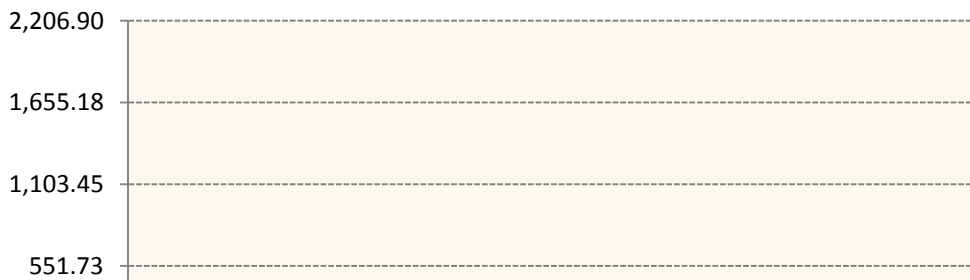
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,853	0	1,853	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,791	-4,791	장내
누계	통화	선도	76	2,828	-2,752	장외

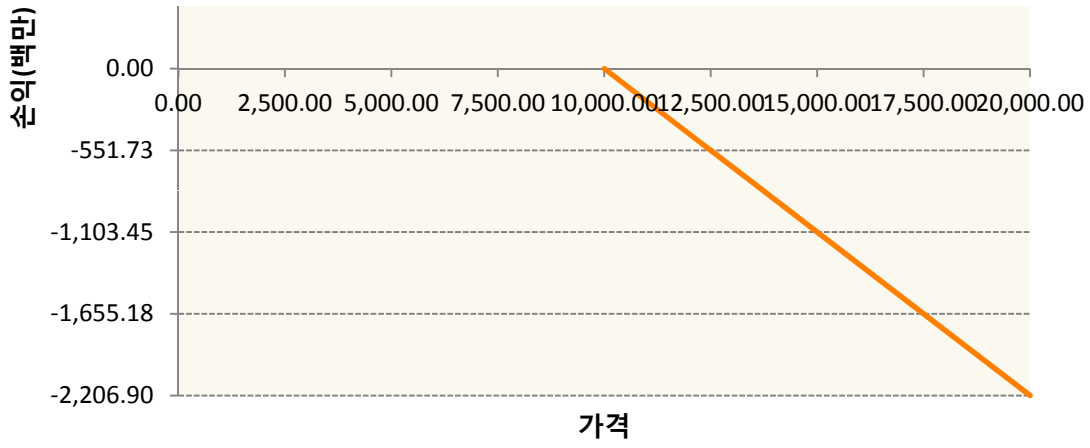
2. 만기시점의 손익구조

HCU9-HSCEI Futures Sep19

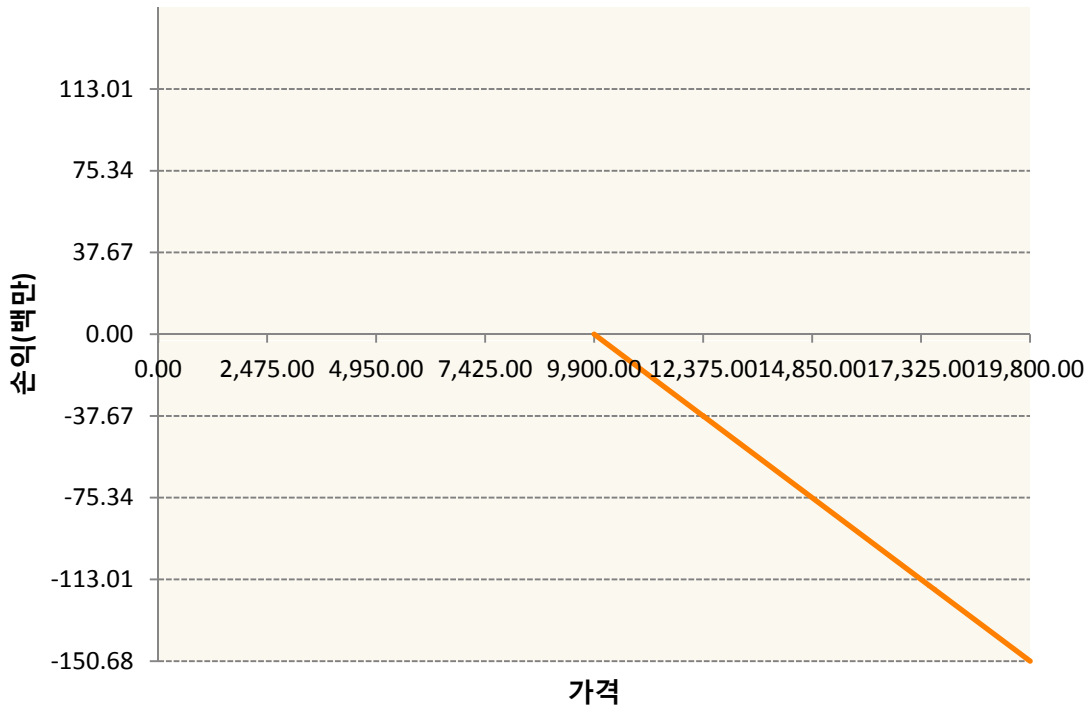


OHHIU9-C100-HSCEI

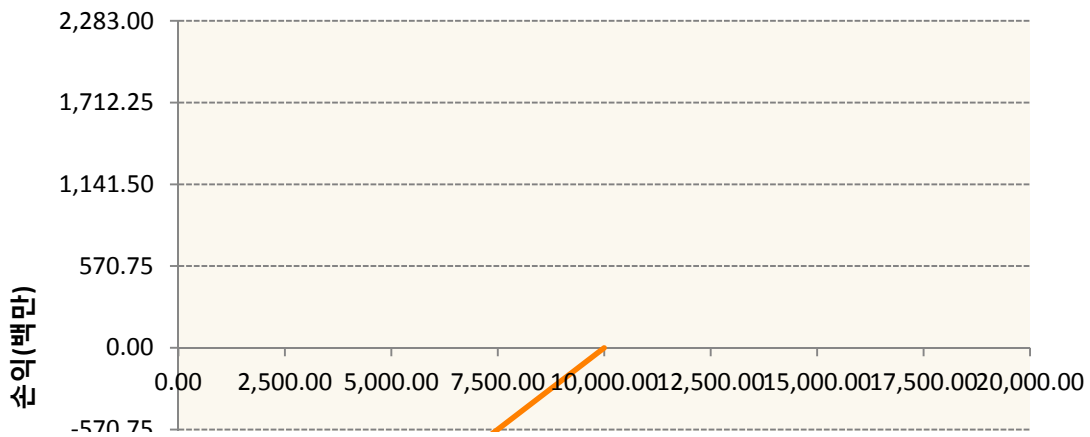


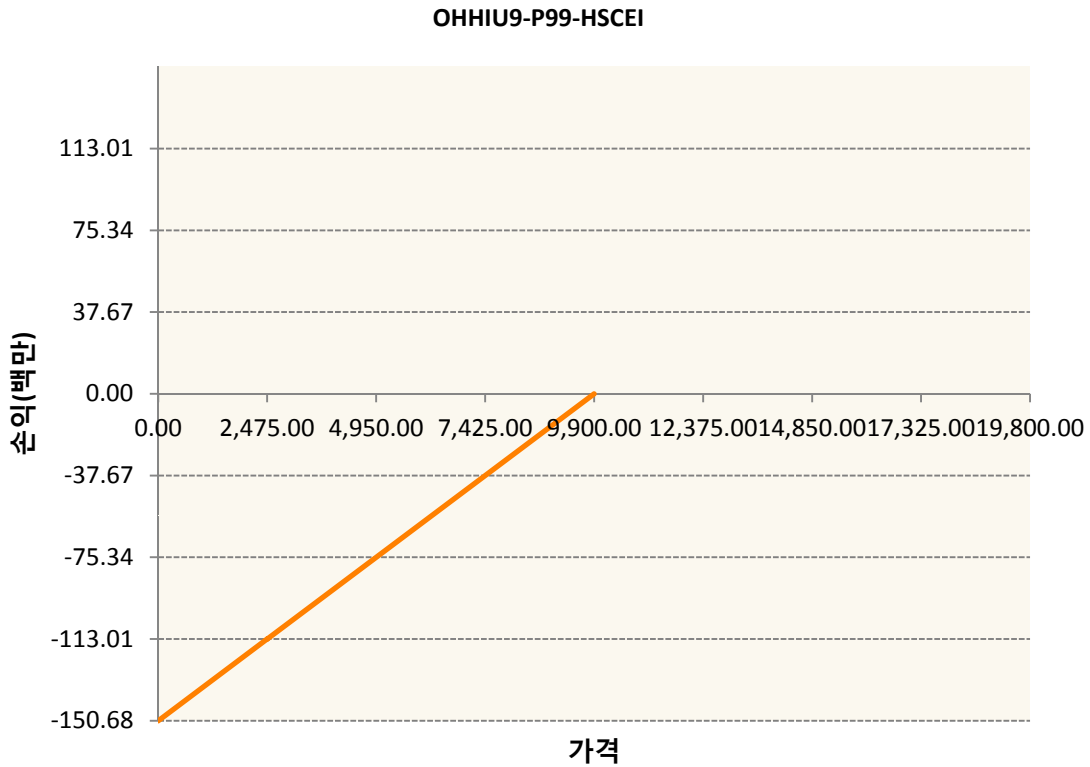


OHHIU9-C99-HSCEI



OHHIU9-P100-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E		226
FX21019U00 HKD/KRW 22-11-19E		6
HCU9 HSCEI Futures Sep19		148
OHHIU9-C1(HSCEI		177
OHHIU9-C9(HSCEI		12
OHHIU9-P1(HSCEI		183
OHHIU9-P9(HSCEI		12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	573

공시일	2019-09-11
기준일	2019-09-10

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

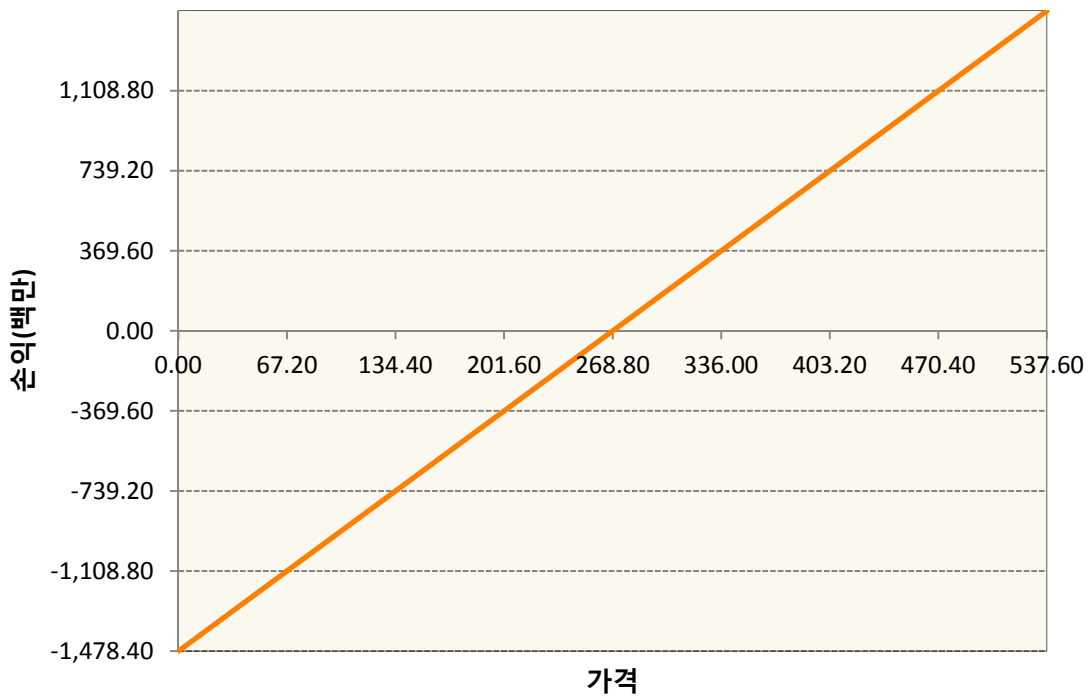
1. 계약금액

(단위:백만원)

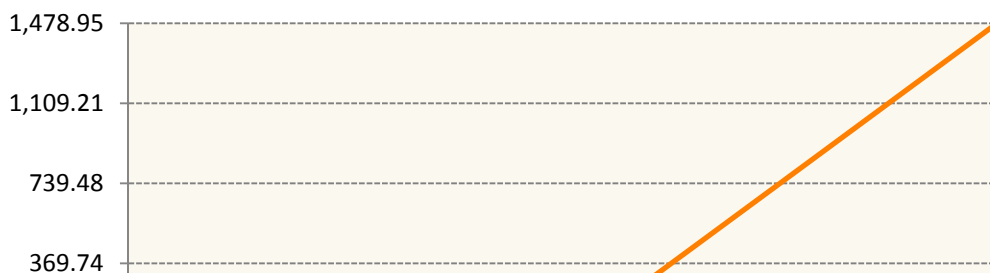
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,477	1,476	1	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,957	0	2,957	장내
누계	유가증권	스왑	14,125	0	14,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,198	-14,198	장내

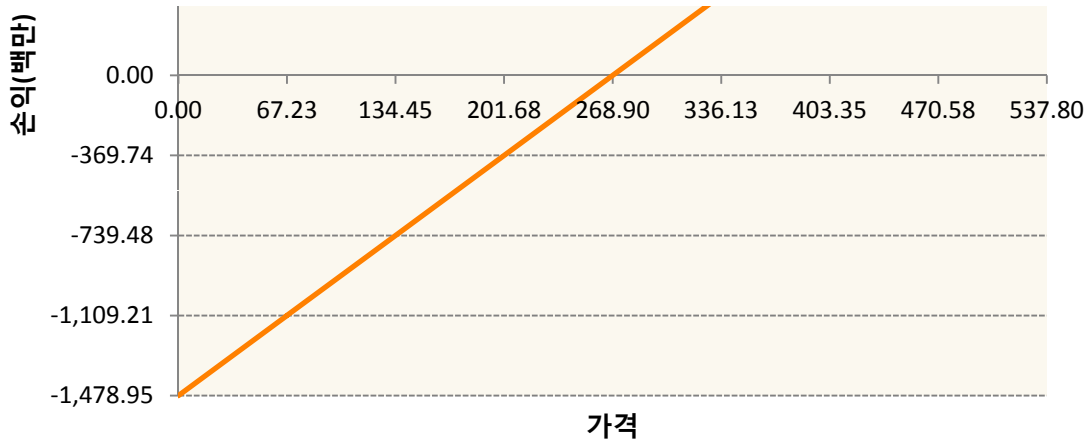
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

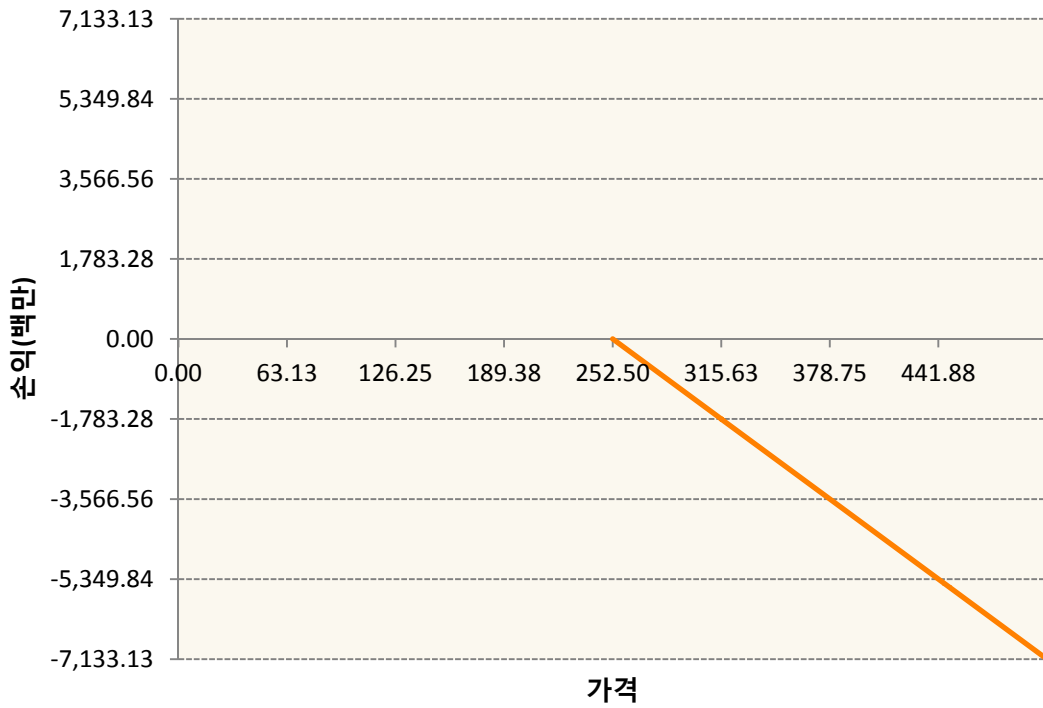


KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

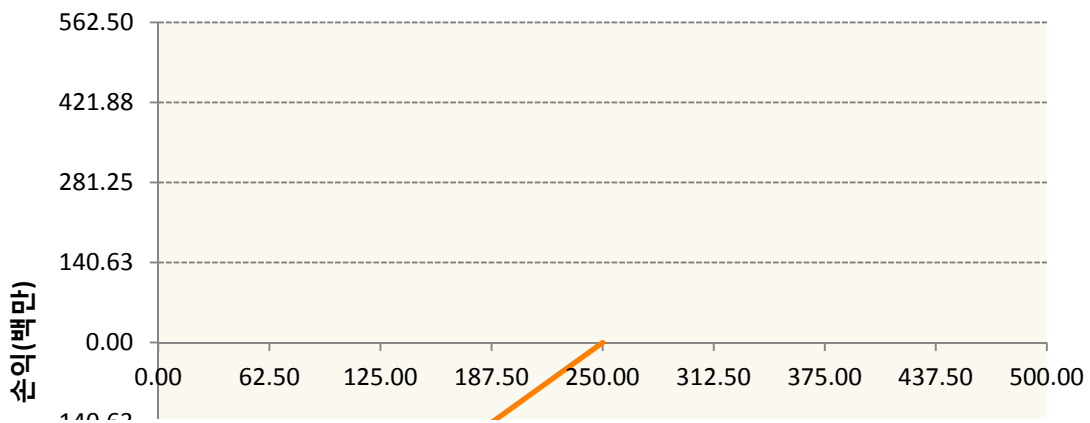




KR4201P92526-2019-09 콜252.5

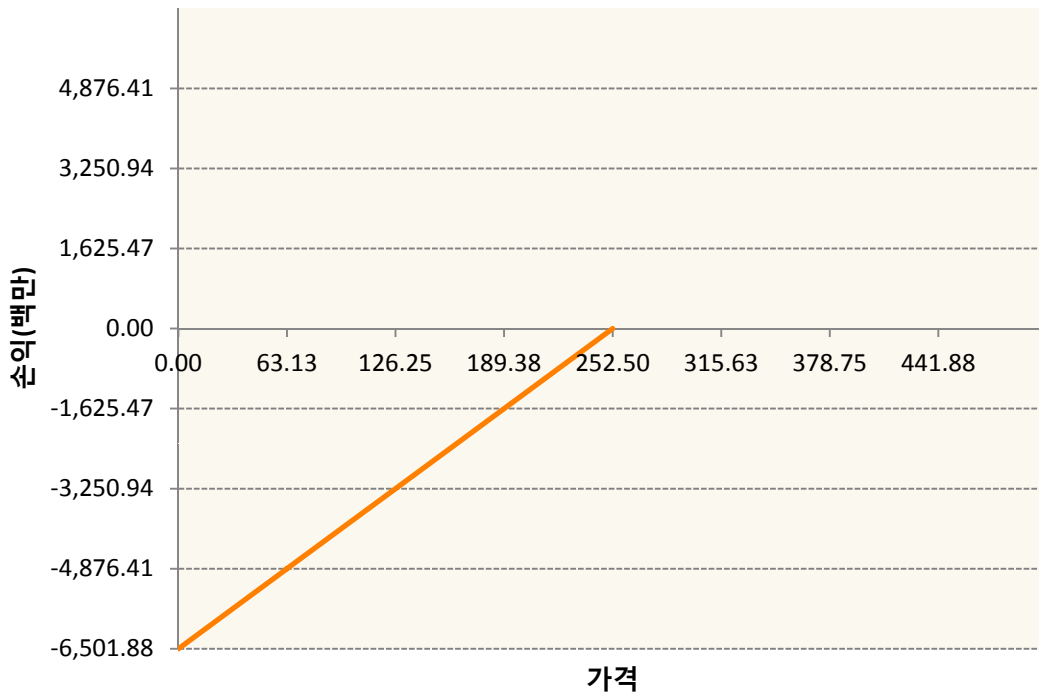


KR4301P92508-2019-09 풋250





KR4301P92524-2019-09 풋252.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16				1,215
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,215	-1,215	-1,215	-1,215	-1,215	-1,215	-1,215
-5.33%	-810	-810	-810	-810	-810	-810	-810
-2.67%	-405	-405	-405	-405	-405	-405	-405
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	405	405	405	405	405	405	405
5.33%	810	810	810	810	810	810	810
8.00%	1,215	1,215	1,215	1,215	1,215	1,215	1,215
	KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물				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

KR4101PC0002 2019-12 코스피200지수선물 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

KR4201P92526 2019-09 콜252.5 607

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	458	458	457	456	455	454	452
-5.33%	394	392	389	386	383	380	377
-2.67%	202	202	202	202	202	202	201
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-202	-202	-202	-202	-202	-202	-202
5.33%	-405	-405	-405	-405	-405	-405	-405
8.00%	-607	-607	-607	-607	-607	-607	-607

KR4301P92508 2019-09 풋250 7

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-7
-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

KR4301P92524 2019-09 풋252.5 135

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-135	-135	-135	-135	-135	-135	-135
-5.33%	-2	-2	-3	-4	-5	-6	-8
-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)

2,027

공시일	2019-09-11
기준일	2019-09-10

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

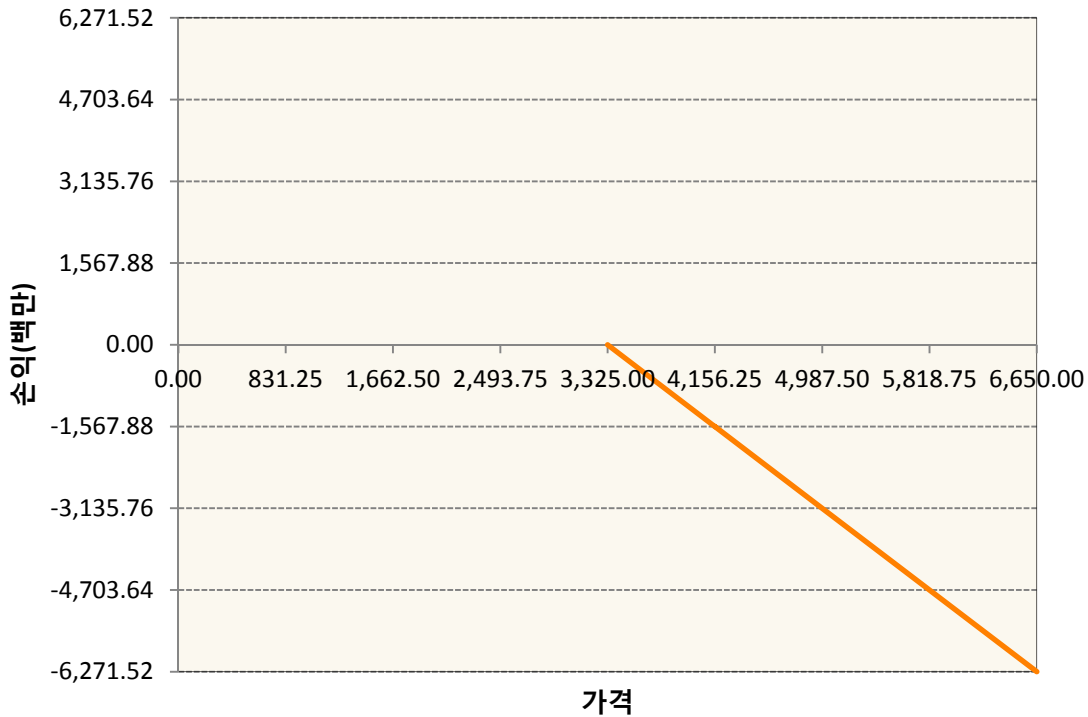
1. 계약금액

(단위:백만원)

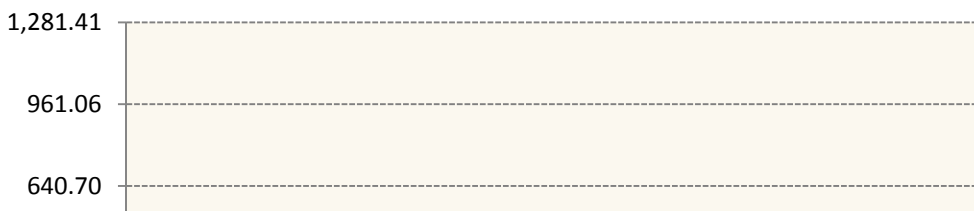
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,130	0	5,130	
누계	유가증권	스왑	24,002	0	24,002	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,106	-15,106	장내
누계	통화	선도	8,969	17,147	-8,178	장외

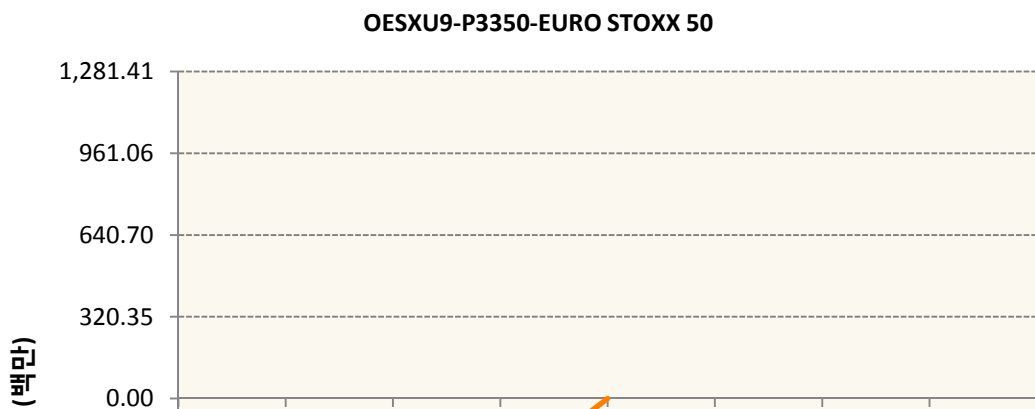
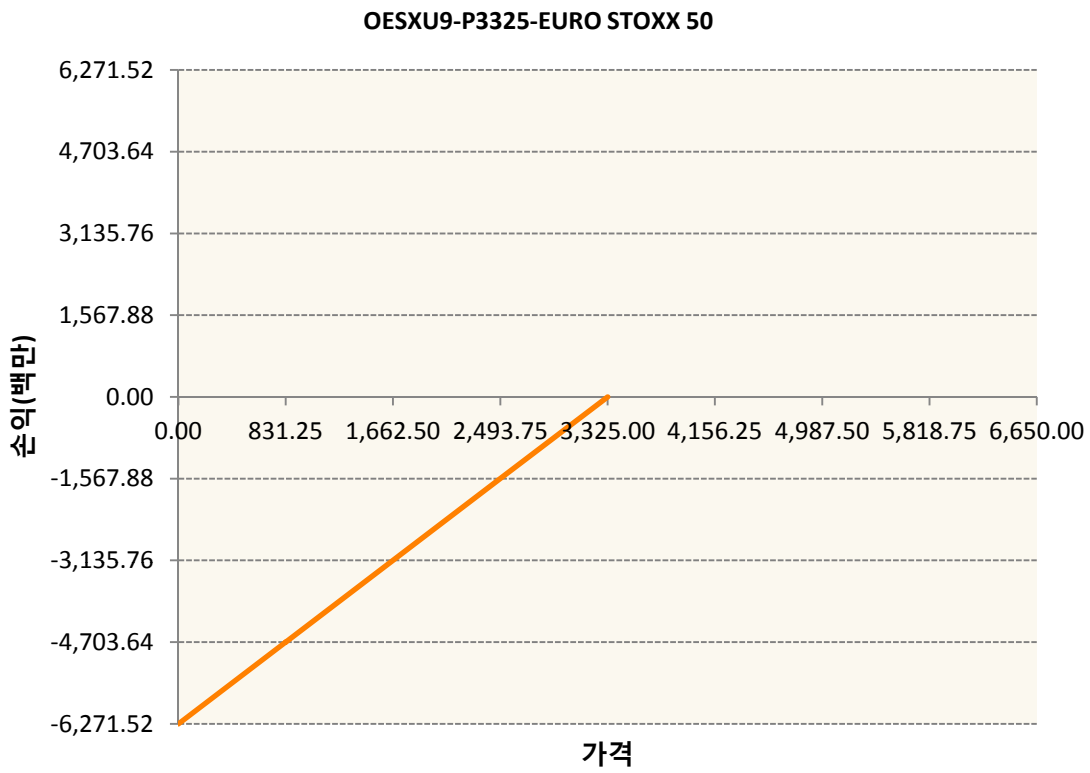
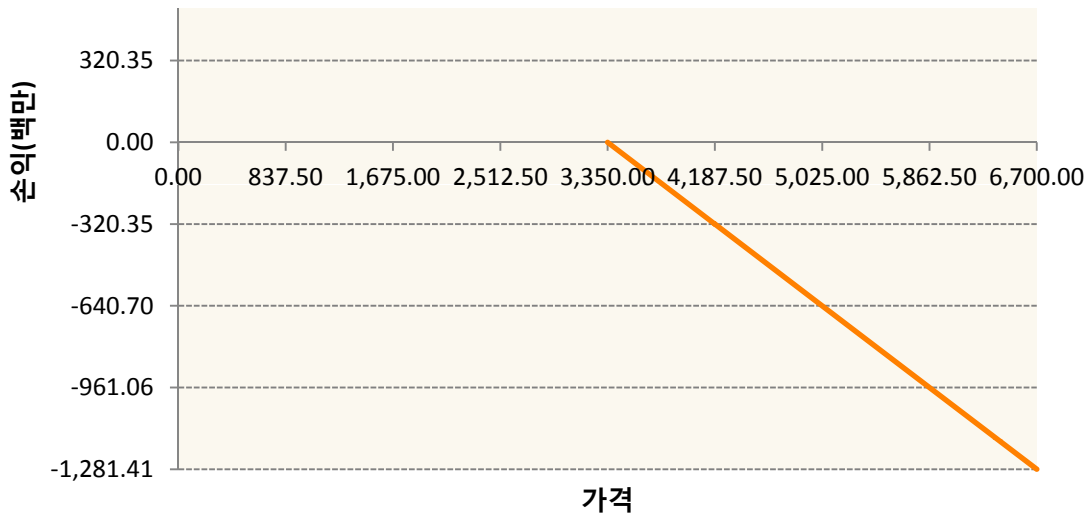
2. 만기시점의 손익구조

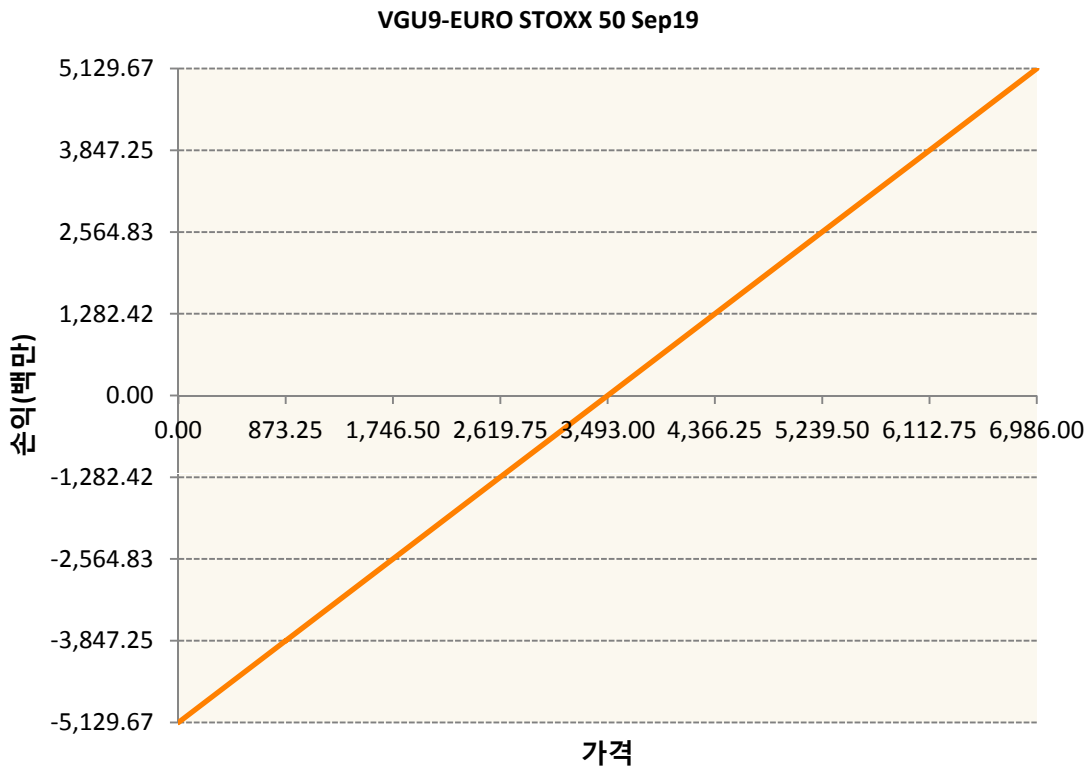
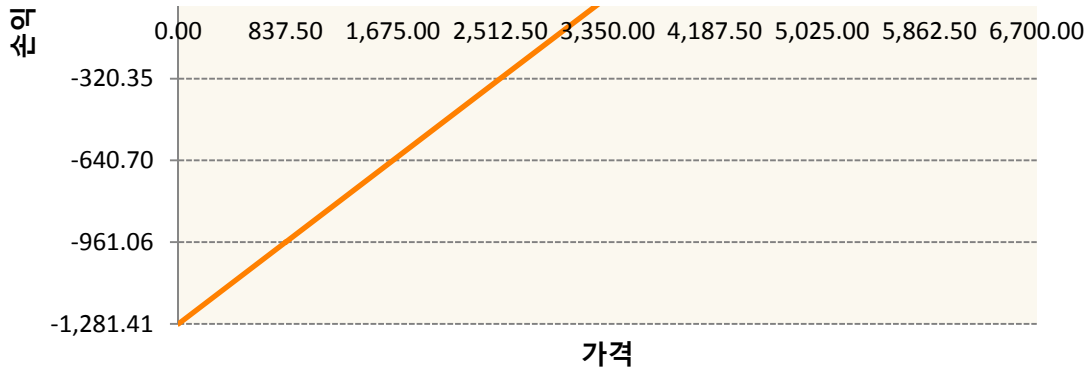
OESXU9-C3325-EURO STOXX 50



OESXU9-C3350-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	19
FX21019M0< KRW/EUR 27-09-19E	1,055
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	410

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

(단위:백만원)

2,133

공시일	2019-09-11
기준일	2019-09-10

ETF스마트레버리지목표전환형8호

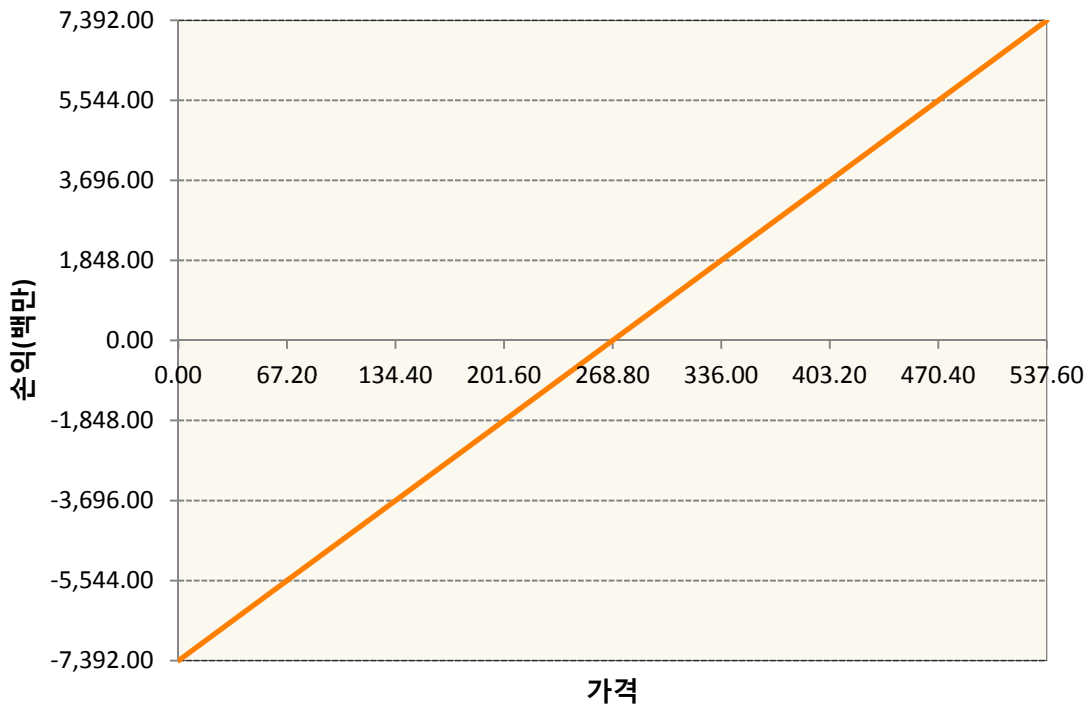
1. 계약금액

(단위:백만원)

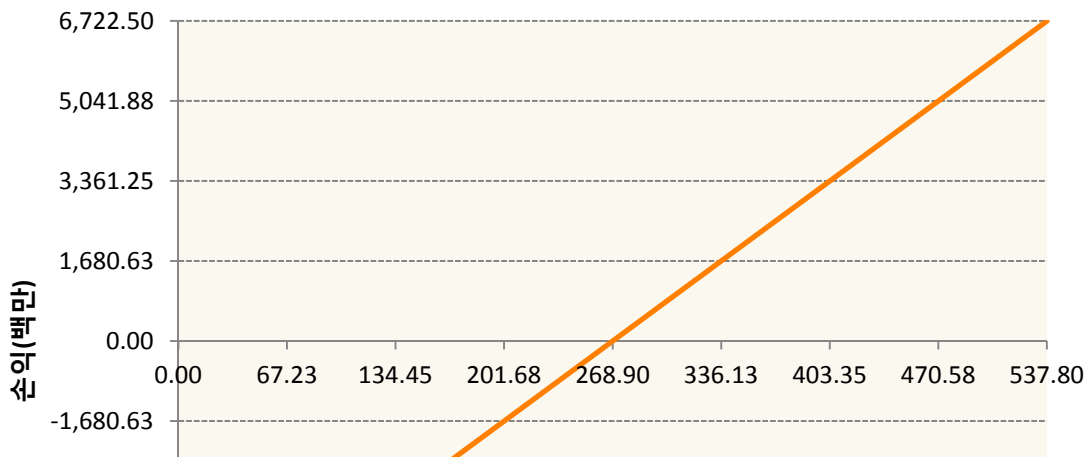
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3,356	3,353	2	장내
누계	유가증권	선물	20,835	6,720	14,115	장내

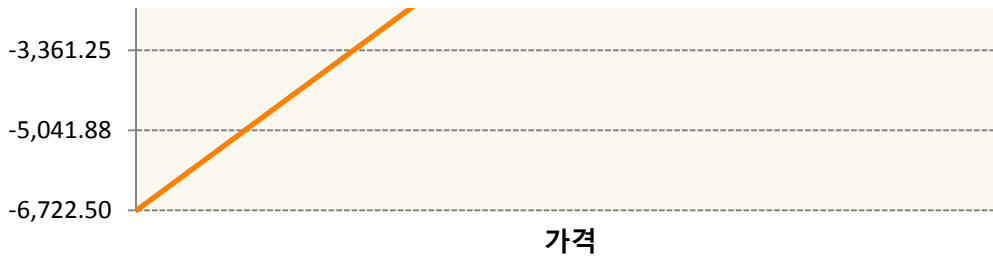
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						591
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-591	-591	-591	-591	-591	-591	-591	
-5.33%	-394	-394	-394	-394	-394	-394	-394	
-2.67%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	197	197	197	197	197	197	197	
5.33%	394	394	394	394	394	394	394	
8.00%	591	591	591	591	591	591	591	
KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						538
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-538	-538	-538	-538	-538	-538	-538	
-5.33%	-358	-358	-358	-358	-358	-358	-358	
-2.67%	-179	-179	-179	-179	-179	-179	-179	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	179	179	179	179	179	179	179	
5.33%	358	358	358	358	358	358	358	
8.00%	538	538	538	538	538	538	538	

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

975

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

(단위:백만원)

84

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

(단위:백만원)

130

공시일	2019-09-11
기준일	2019-09-10

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

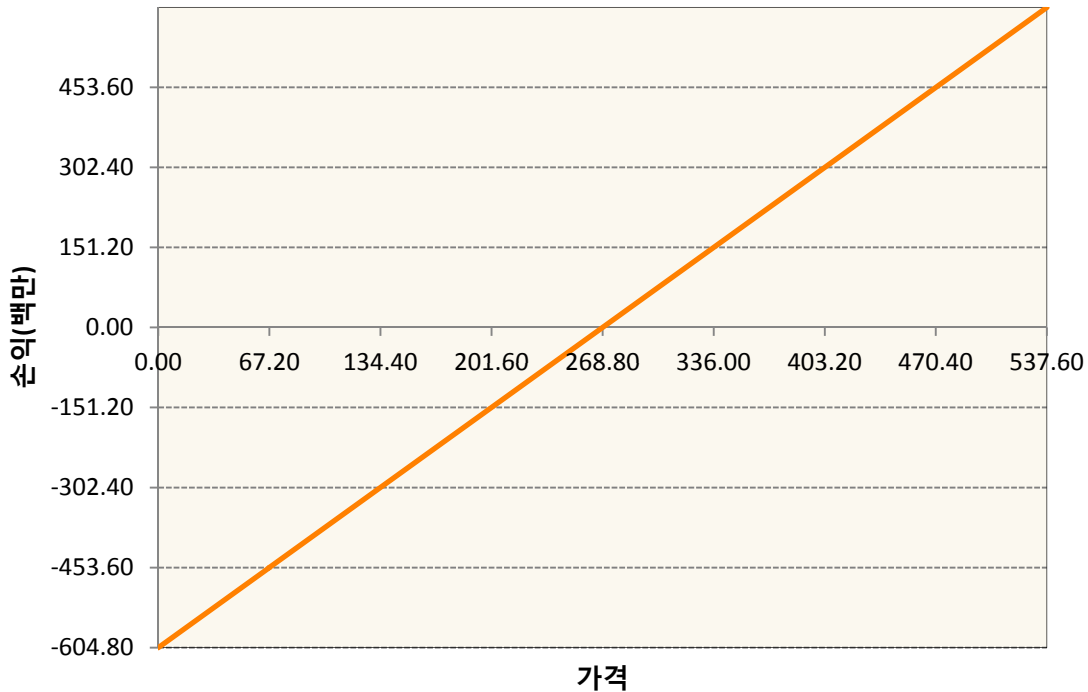
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	605	0	605	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						48
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48	
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
-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%	32	32	32	32	32	32	32	
8.00%	48	48	48	48	48	48	48	

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

(단위:백만원)

42

공시일	2019-09-11
기준일	2019-09-10

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

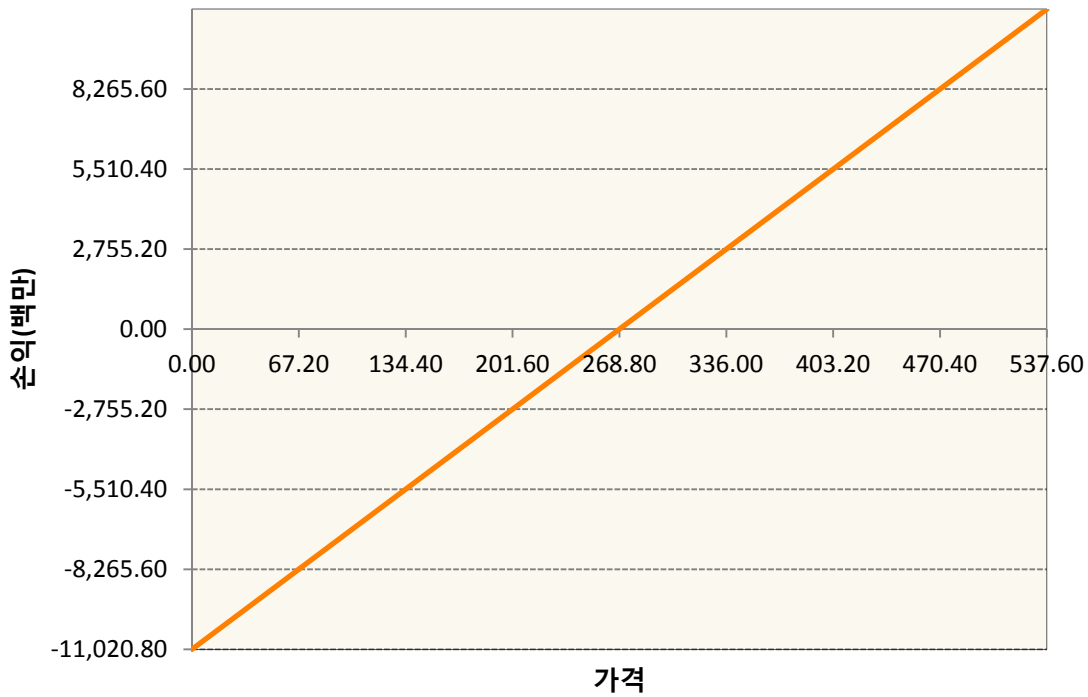
1. 계약금액

(단위:백만원)

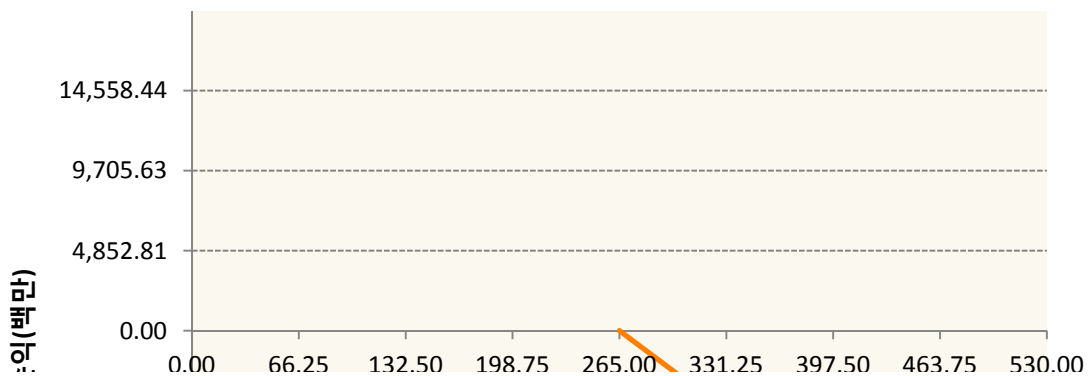
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	134	-134	장내
신규	유가증권	옵션	131	0	131	장내
누계	유가증권	선물	11,021	0	11,021	장내
누계	유가증권	옵션	3,596	19,545	-15,949	장내

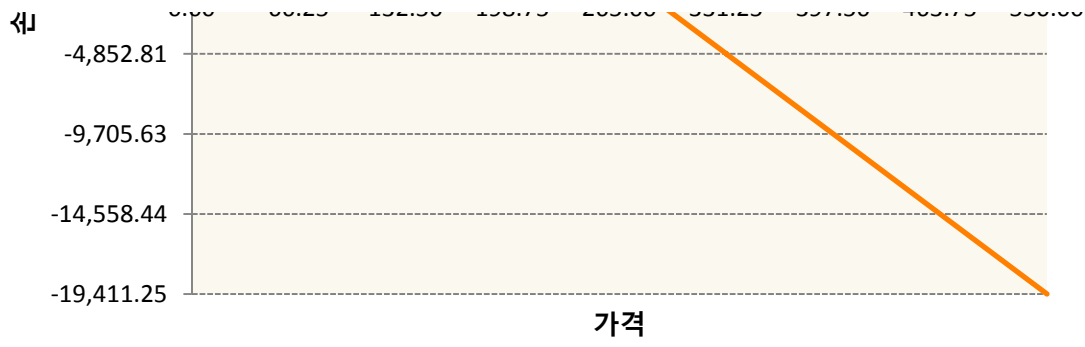
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

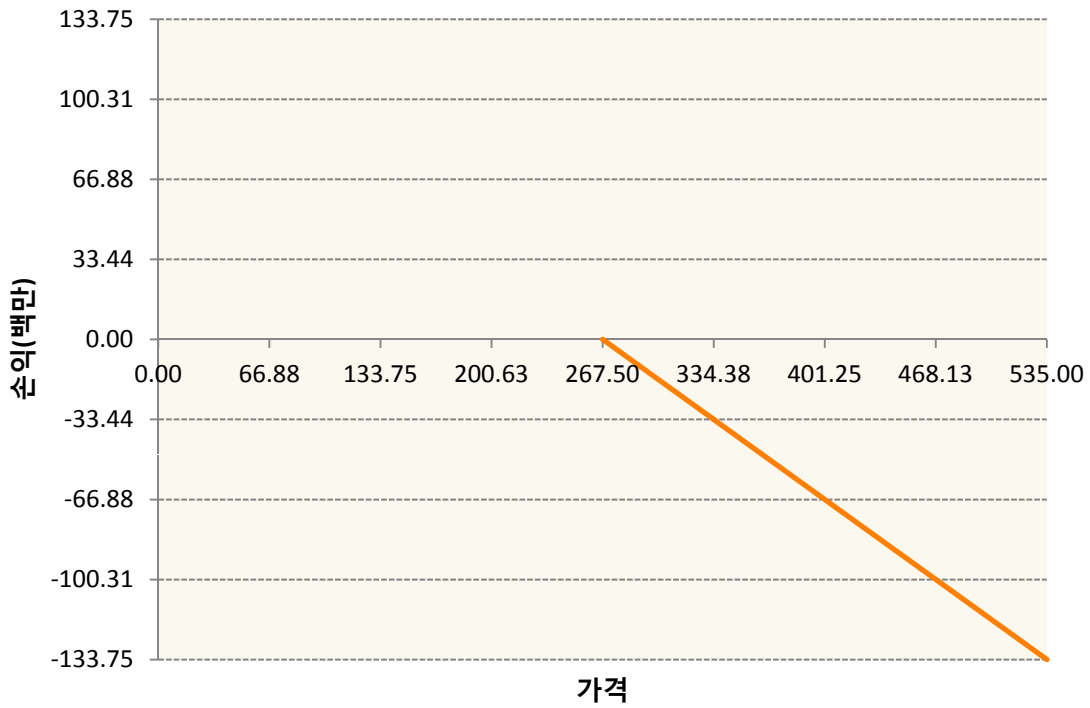


KR4201P92658-2019-09 콜265

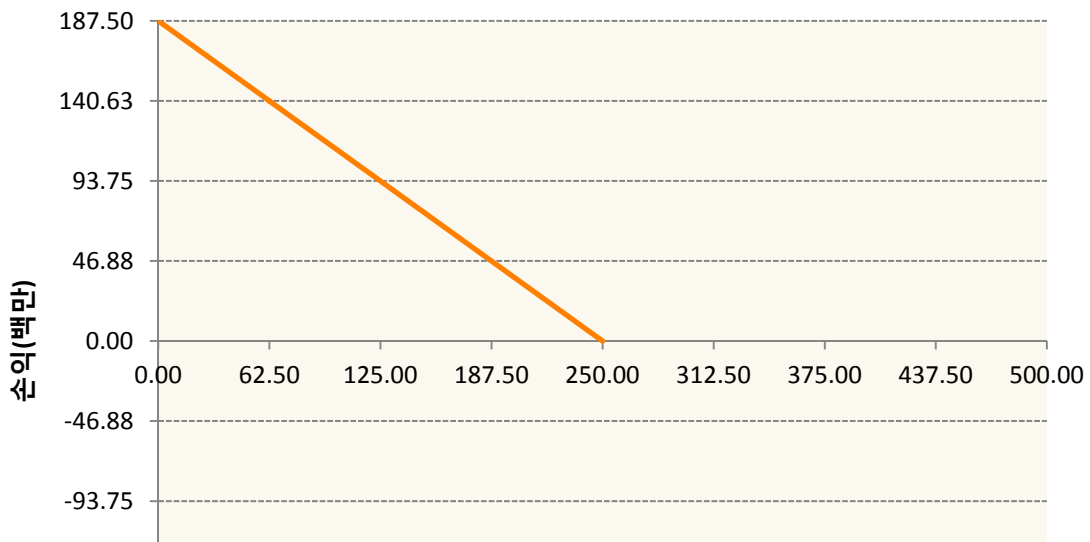


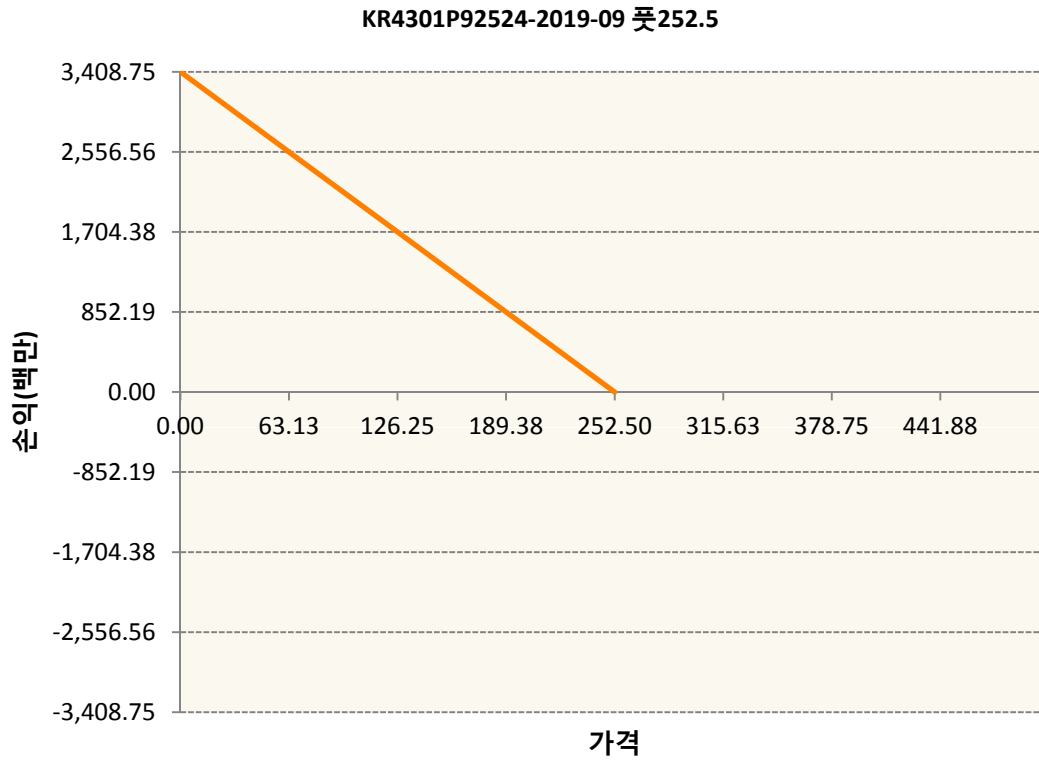
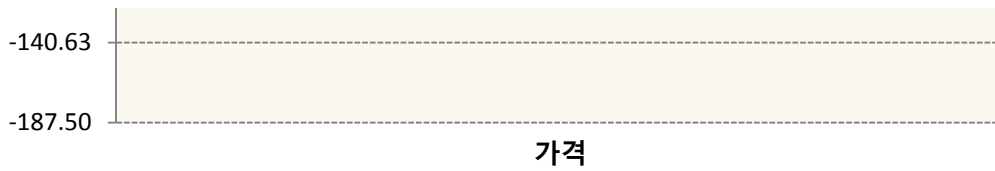


KR4201P92674-2019-09 콜267.5



KR4301P92508-2019-09 풋250





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						1,552
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	297	297	297	297	297	297	297	
-5.33%	297	297	297	297	297	297	296	
-2.67%	287	282	277	272	266	259	252	

0%	14	10	5	0	-6	-12	-18
2.67%	-502	-502	-502	-502	-503	-503	-503
5.33%	-1,027	-1,027	-1,027	-1,027	-1,027	-1,027	-1,027
8.00%	-1,552	-1,552	-1,552	-1,552	-1,552	-1,552	-1,552

KR4201P92674 2019-09 콜267.5 10

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%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10

KR4301P92508 2019-09 풋250 2

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2	2	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

KR4301P92524 2019-09 풋252.5 71

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	71	71	71	71	71	71	71
-5.33%	1	1	2	2	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

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

(단위:백만원)

2,928

공시일	2019-09-11
기준일	2019-09-10

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,580	0	3,580	
누계	유가증권	수익증권	83,955	0	83,955	

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	2019-09-11
기준일	2019-09-10

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,790	0	1,790	
누계	유가증권	수익증권	105,591	0	105,591	

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	2019-09-11
기준일	2019-09-10

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,387	0	2,387	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	475,811	0	475,811	
누계	통화	선도	0	460,733	-460,733	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		1,718
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,100
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		134
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		286
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		3,150
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		2,138
FX21019Q01 KRW/USD 16-09-19E		95
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,914
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,532
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,616
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,969
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		955
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		955
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E		955
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E		1,718
FX21019Q04 KRW/USD 30-09-19E		191
FX21019Q04 KRW/USD 24-09-19E		2,100
FX21019Q04 KRW/USD 24-09-19E		2,673
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E		191
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E		286
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E		286
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E		191
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E		1,375
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E		2,043
FX21019U01 KRW/USD 10-10-19E		286

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

(단위:백만원)

12,165

공시일	2019-09-11
기준일	2019-09-10

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

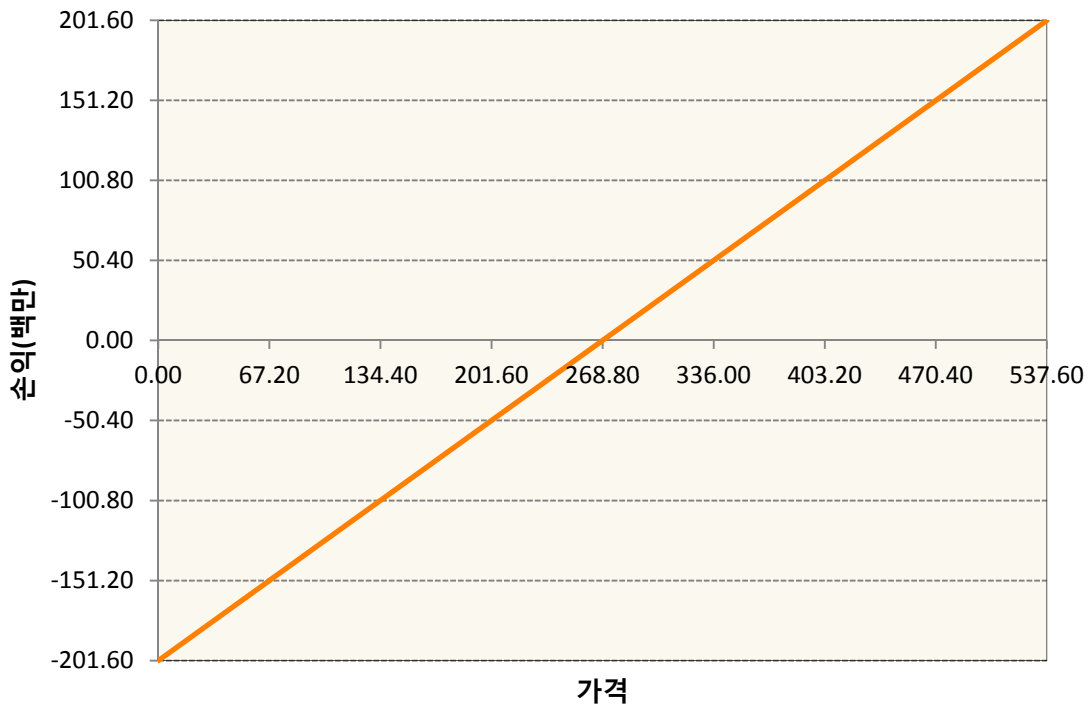
1. 계약금액

(단위:백만원)

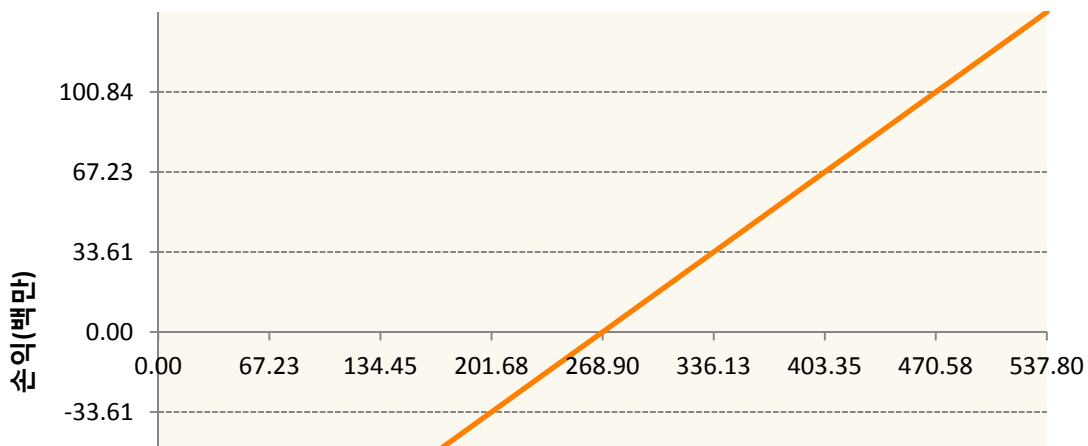
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,701	1,709	-8	장내
누계	유가증권	선물	2,542	638	1,904	장내

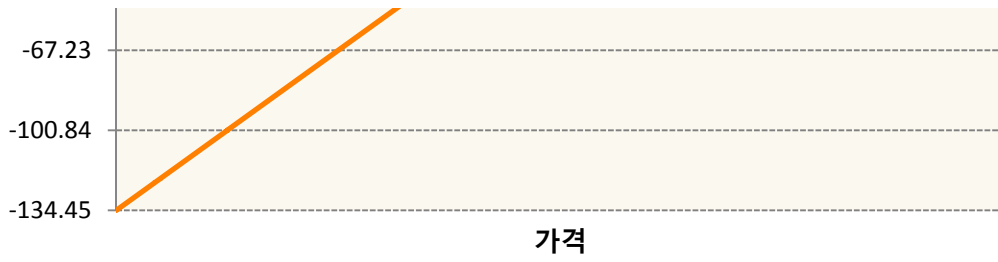
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

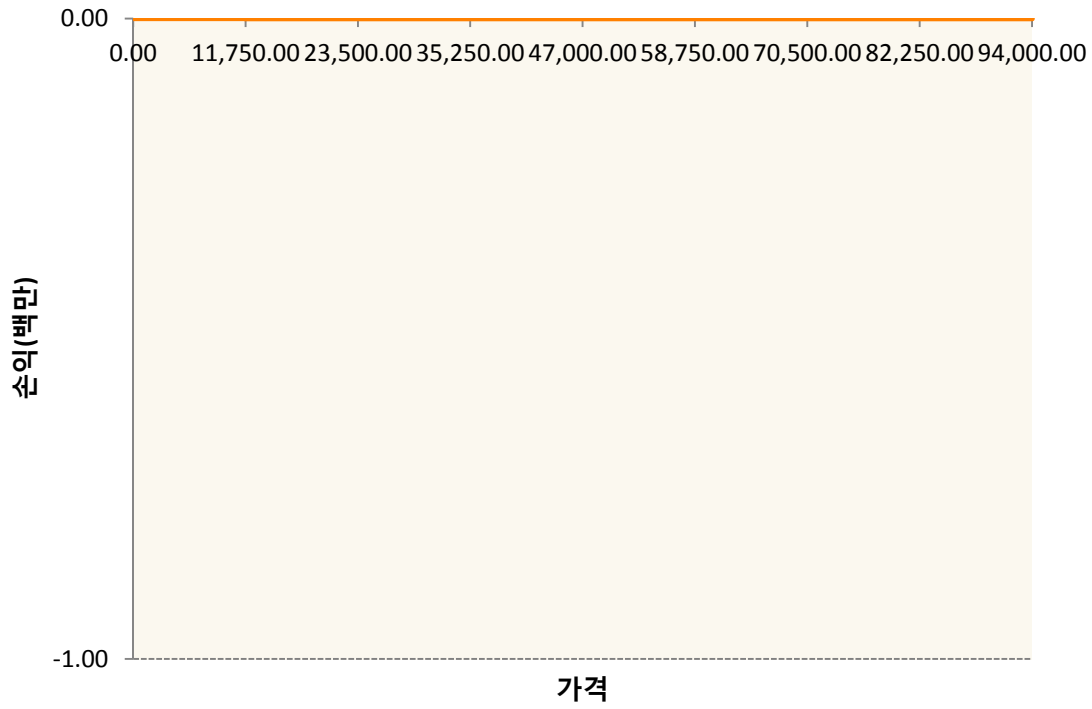


KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

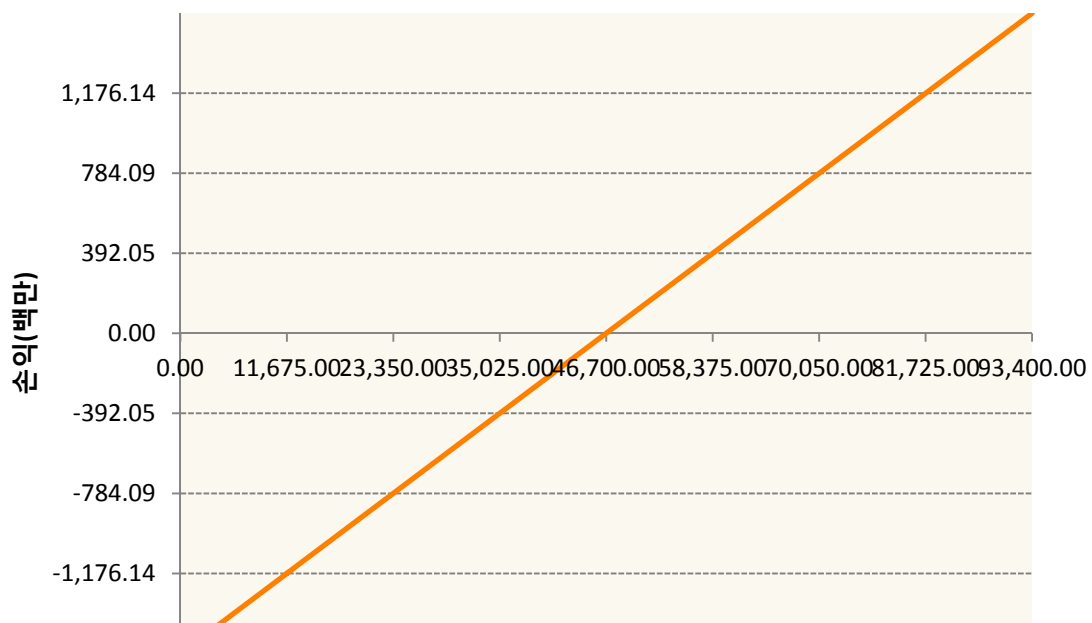




KR4111P90000-2019-09 삼성전자개별선물



KR4111PA0002-2019-10 삼성전자개별선물



5.33%	84	84	84	84	84	84	84
8.00%	126	126	126	126	126	126	126

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

(단위:백만원)

181

공시일	2019-09-11
기준일	2019-09-10

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

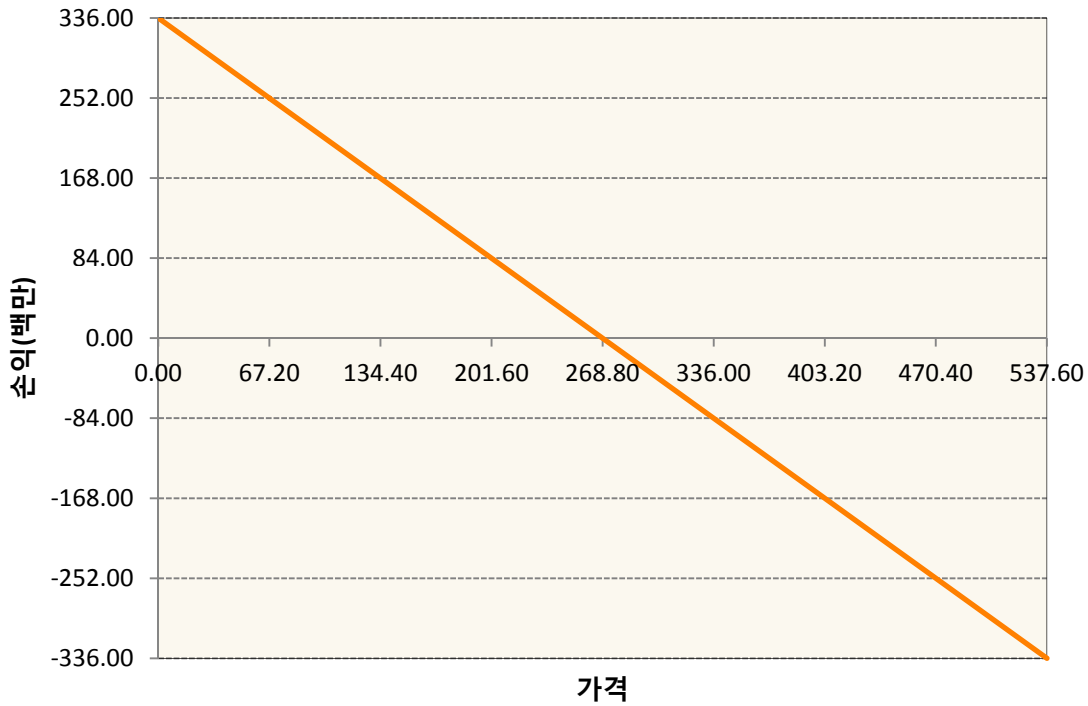
1. 계약금액

(단위:백만원)

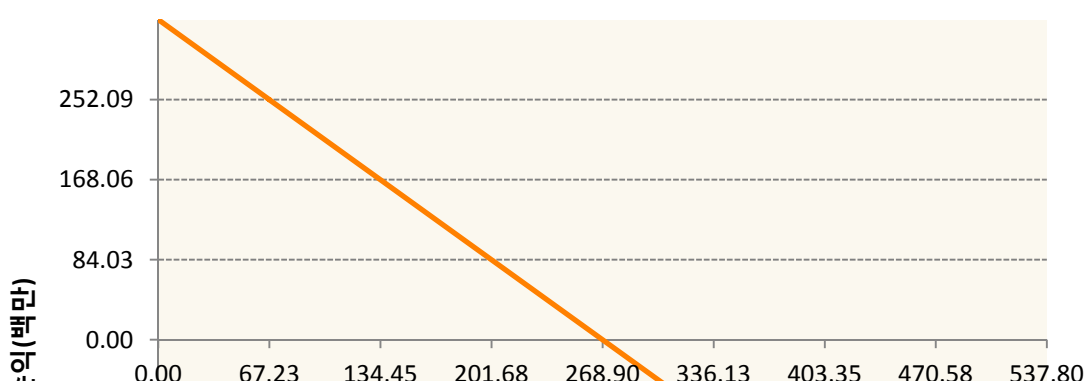
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	336	336	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	672	-672	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,611	-3,611	장내

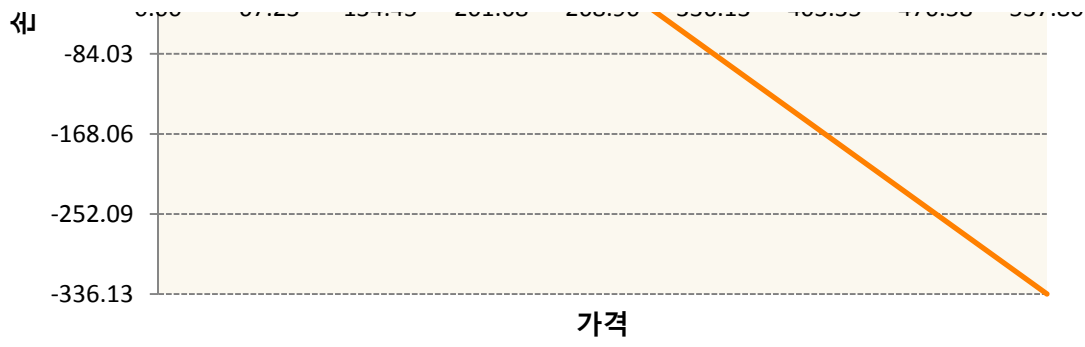
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

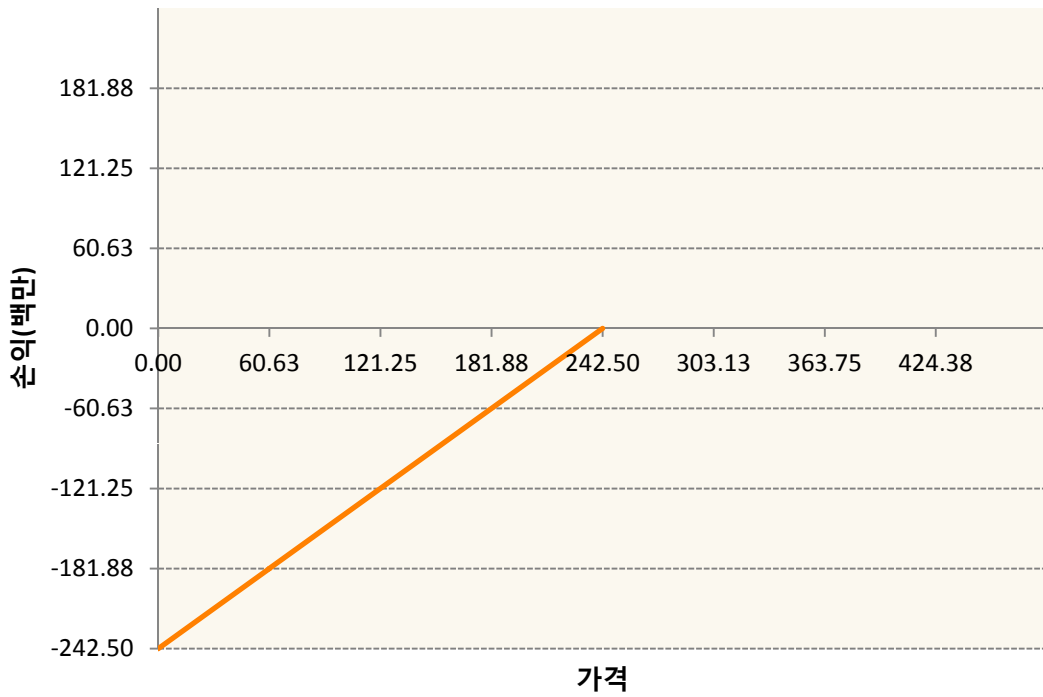


KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

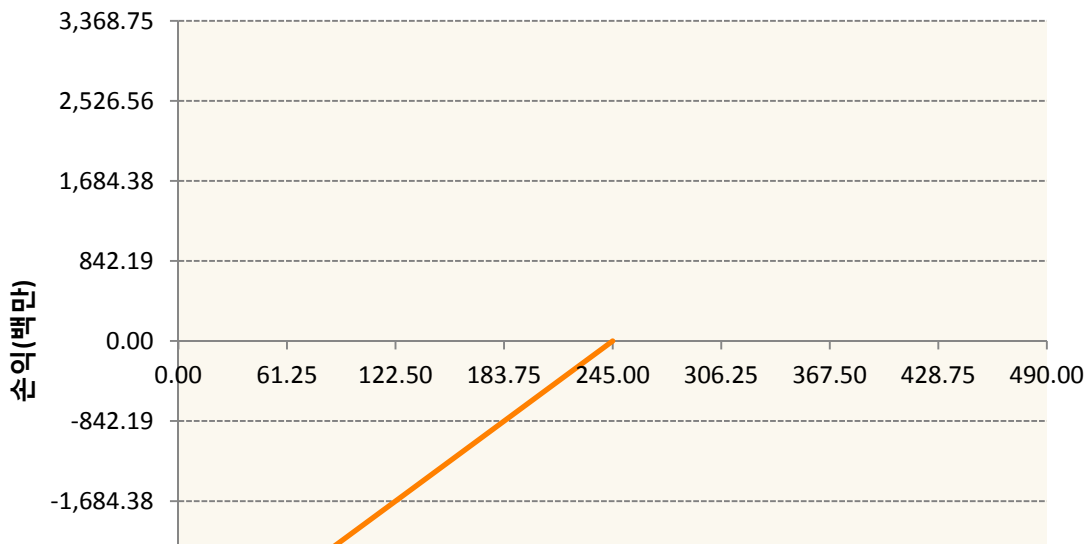


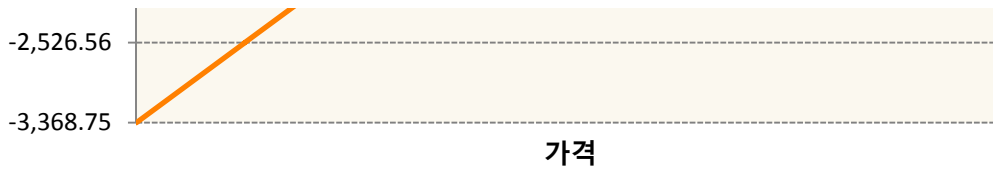


KR4301P92425-2019-09 풋242.5



KR4301P92458-2019-09 풋245





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	
KR4101PC0002		2019-12 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	
KR4301P92425		2019-09 풋242.5						0
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0	
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0	
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	0	0	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						3
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	0	-1	-1	-1	-2	-2	-3	
-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

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

(단위:백만원)

46

공시일	2019-09-11
기준일	2019-09-10

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	19,374	0	19,374	
누계	통화	선도	119	18,973	-18,854	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		162
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		477
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		516
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		38
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		325
FX21019U02 USD/KRW 19-09-19E		10

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

(단위:백만원)

504

공시일	2019-09-11
기준일	2019-09-10

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	2019-09-11
기준일	2019-09-10

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

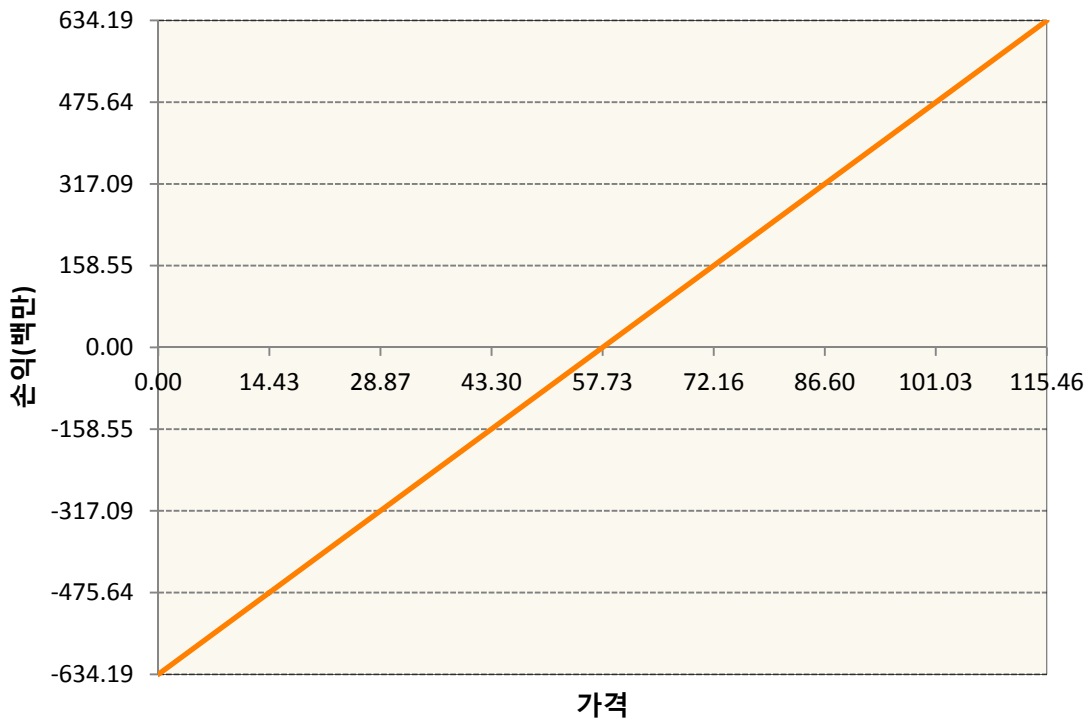
1. 계약금액

(단위:백만원)

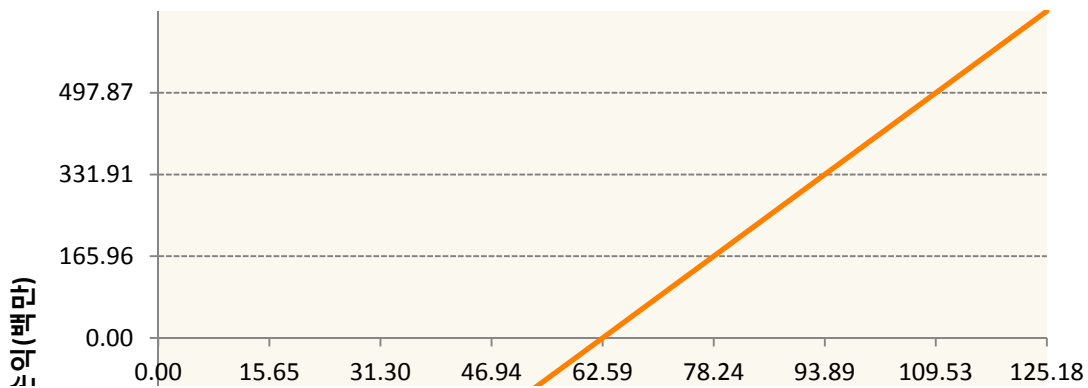
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,395	298	2,097	
누계	유가증권	선물	198	0	198	장내

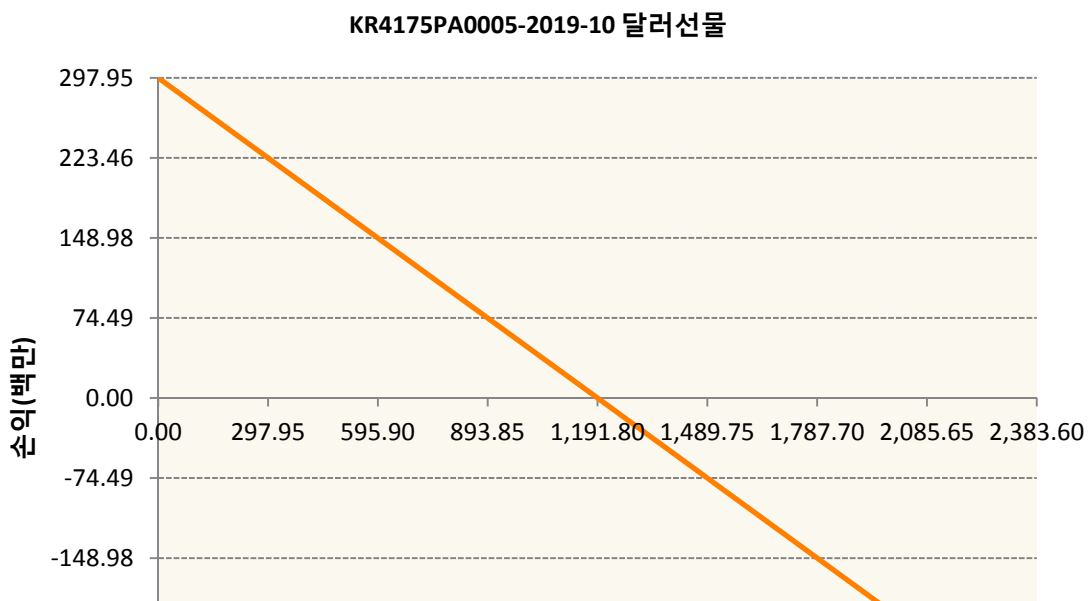
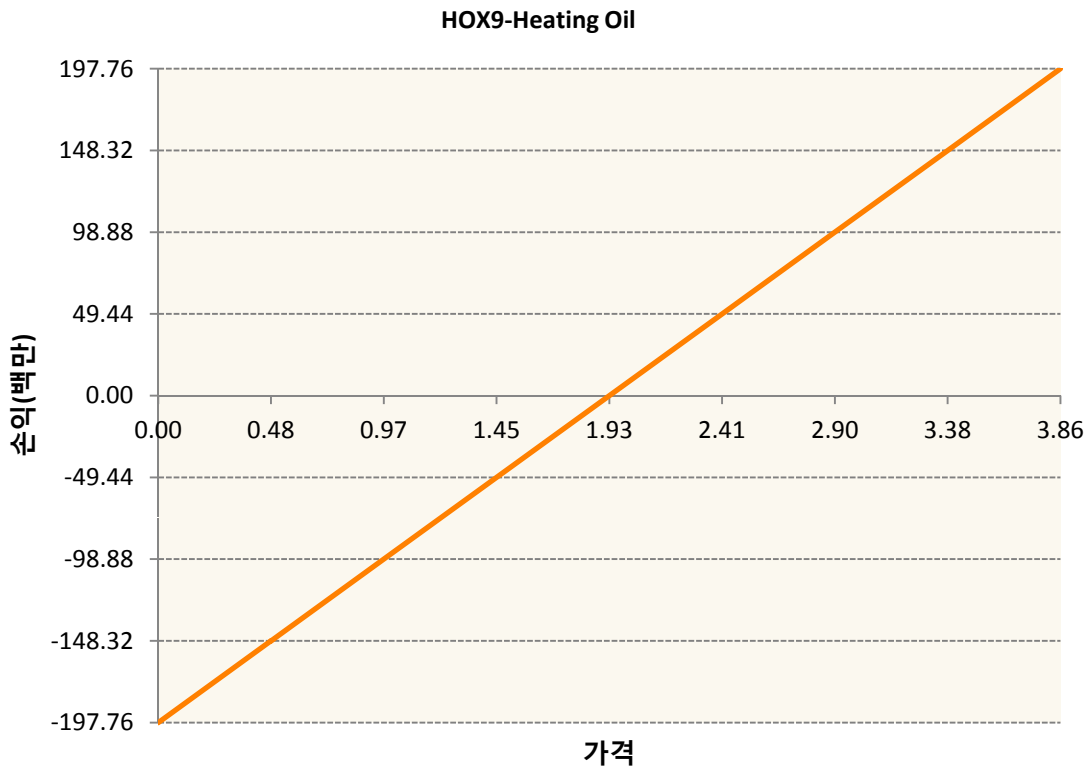
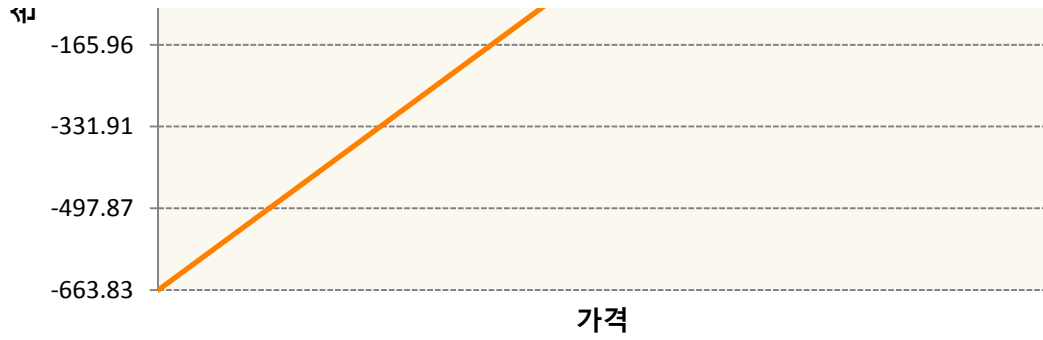
2. 만기시점의 손익구조

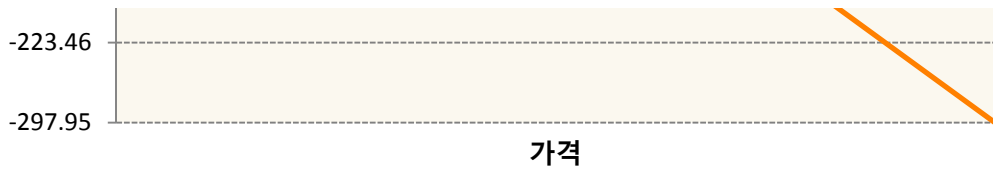
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19



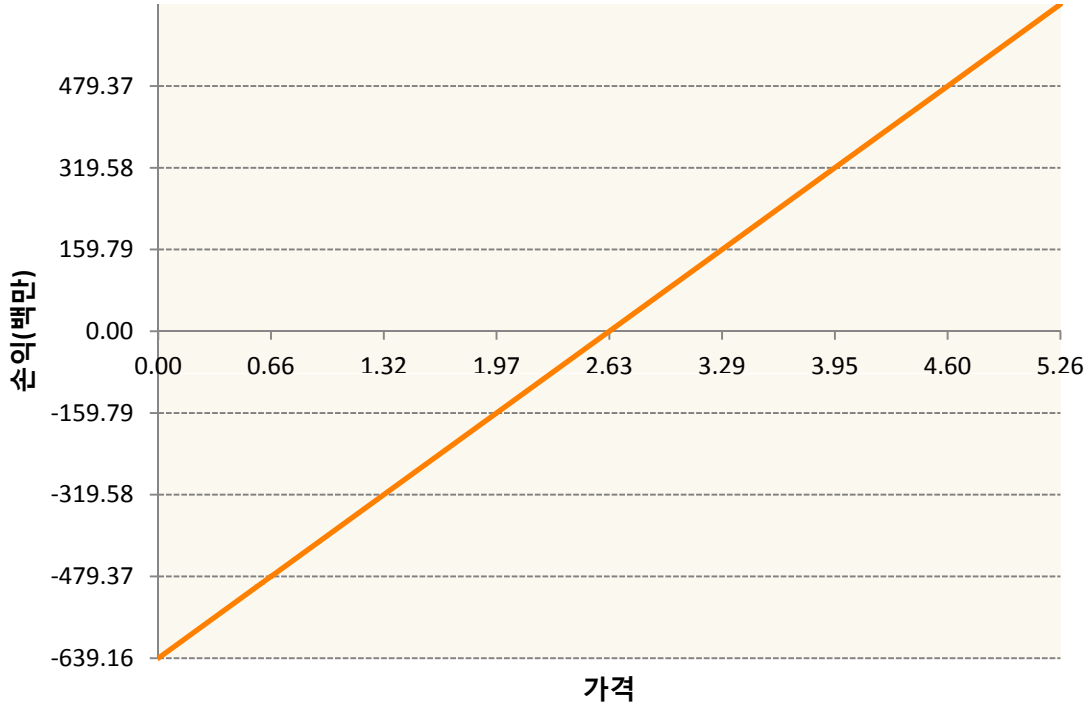
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19



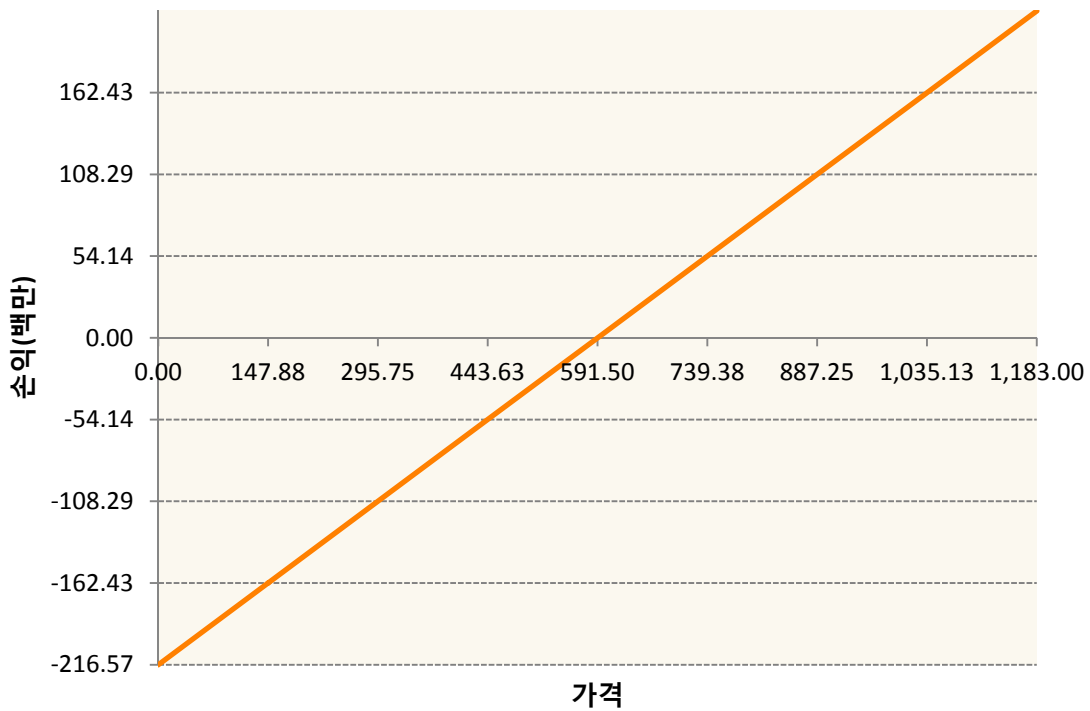


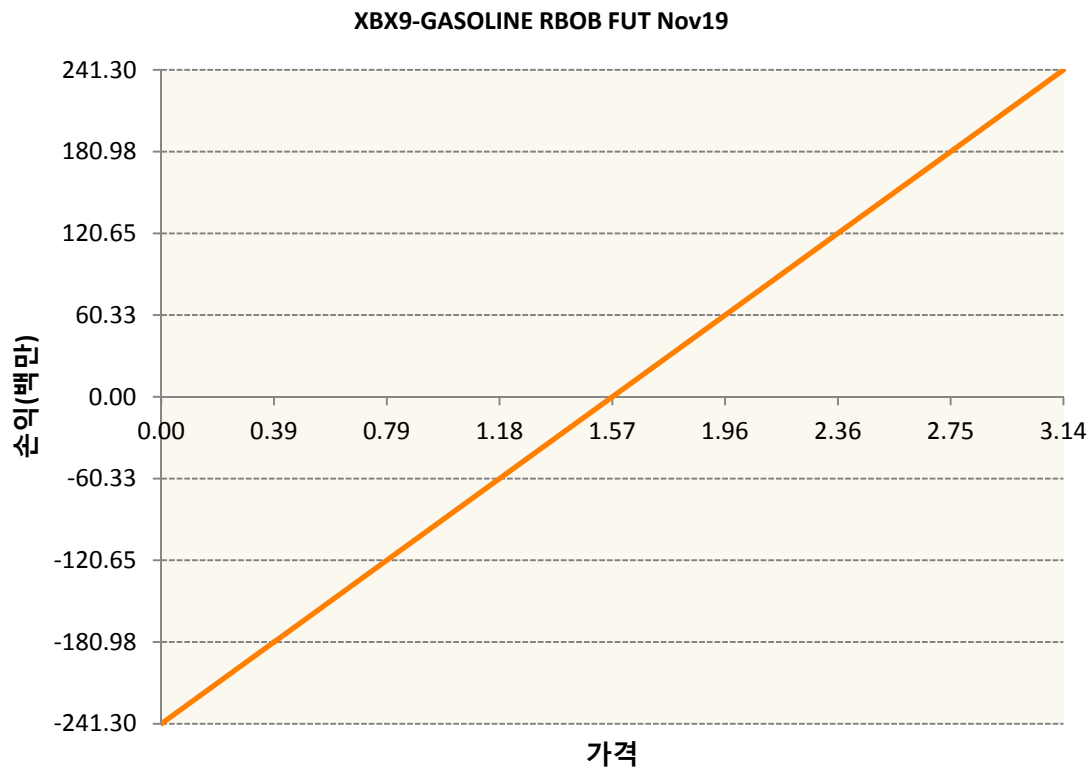


NGX19-NATURAL GAS FUTR Nov19



QSX9-Low Su Gasoil G Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX9	WTI CRUDE FUTURE Nov19	51
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	53
HOX9	Heating Oil	16
KR4175PA00	2019-10 달러선물	24
NGX19	NATURAL GAS FUTR Nov19	51
QSX9	Low Su Gasoil G Nov19	17
XBX9	GASOLINE RBOB FUT Nov19	19

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	410

공시일	2019-09-11
기준일	2019-09-10

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

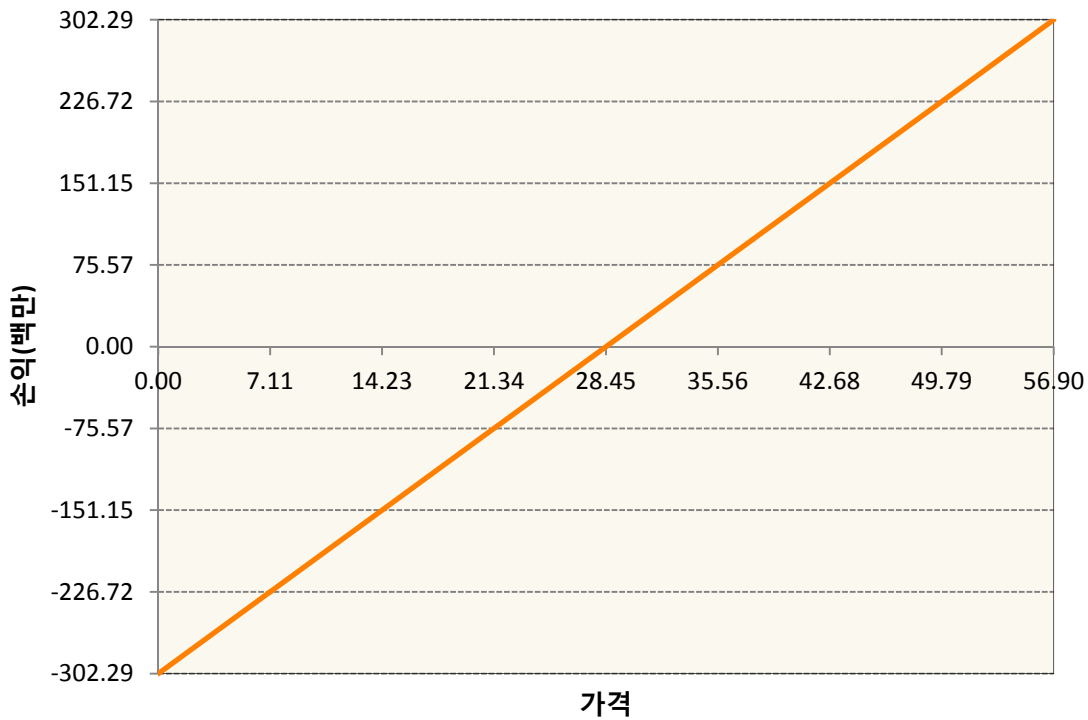
1. 계약금액

(단위:백만원)

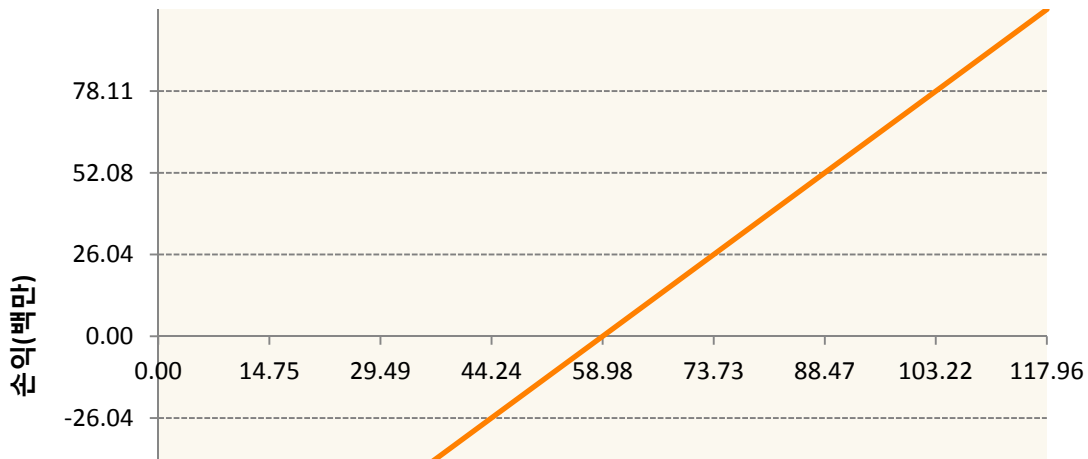
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,689	95	2,593	

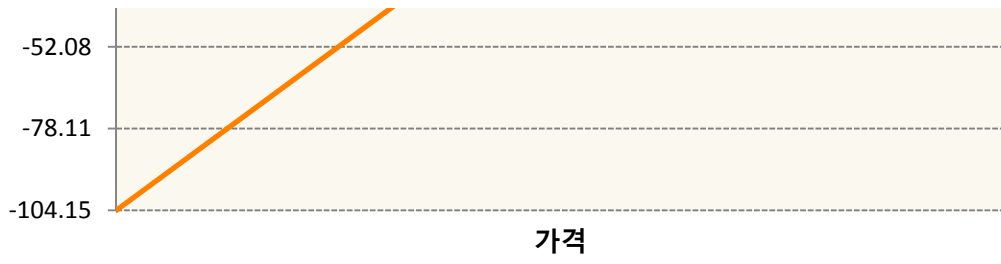
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

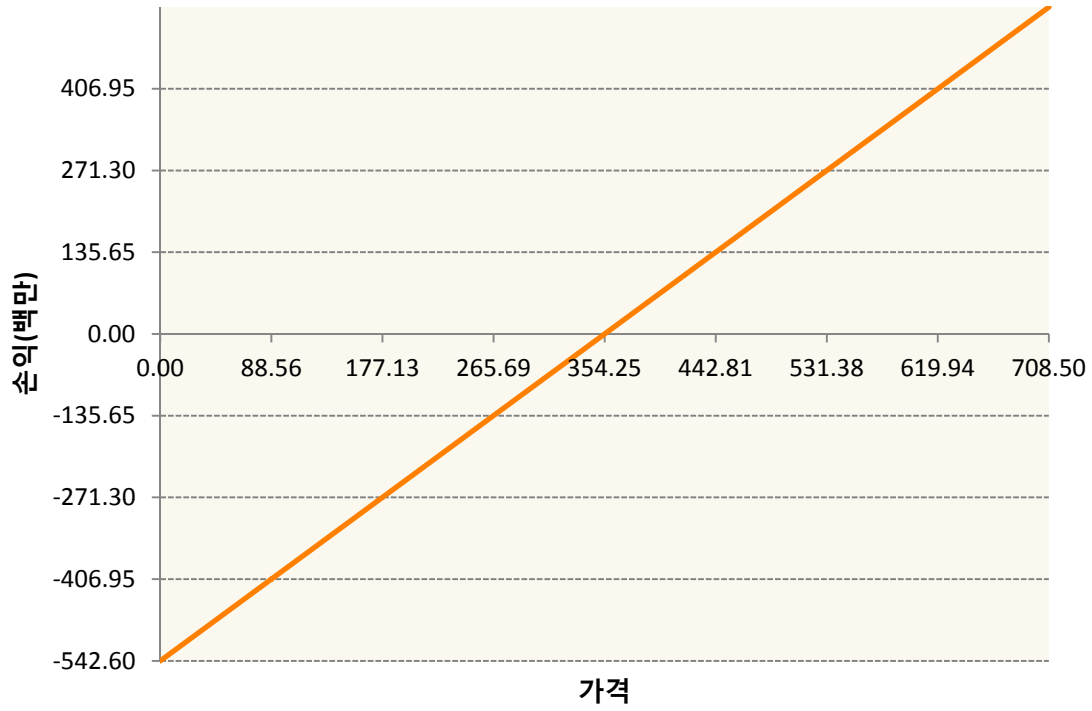


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

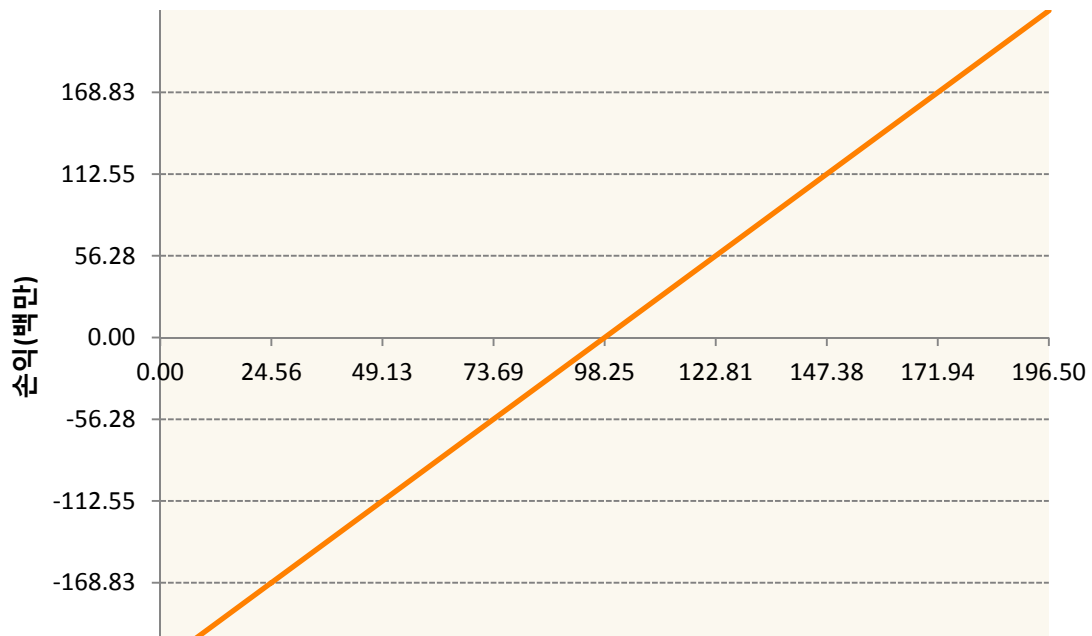


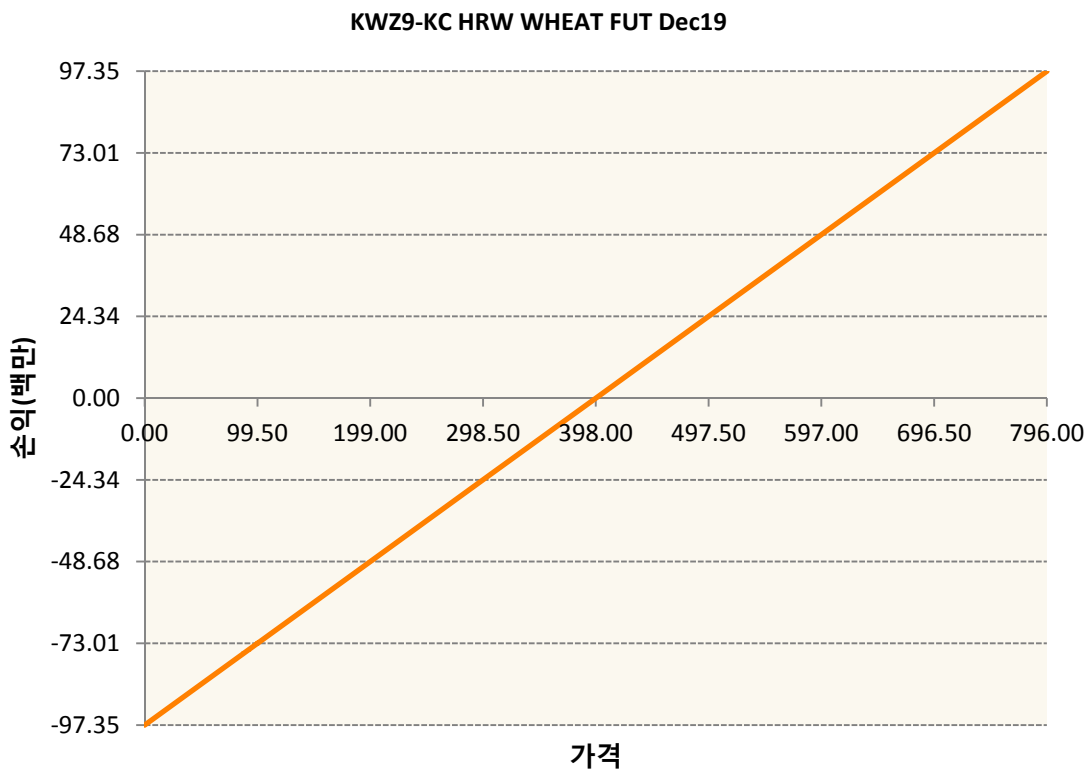
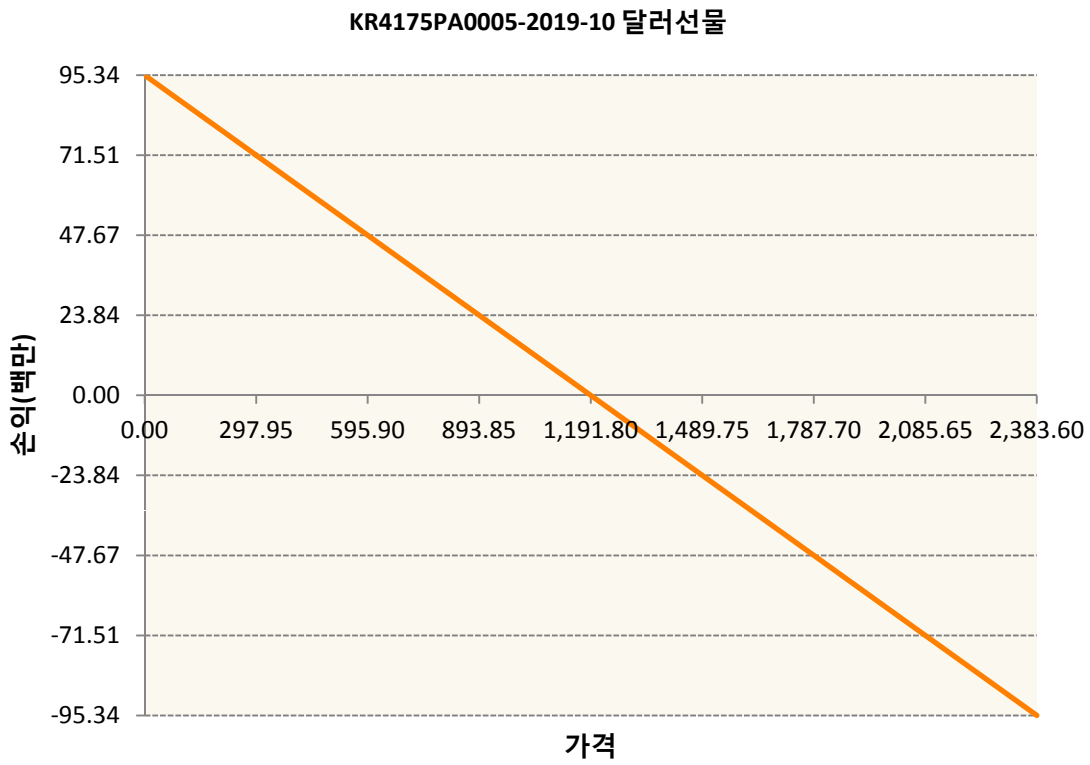
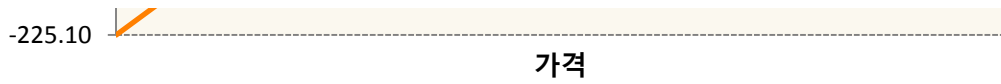


CZ9-CORN FUTURE Dec19

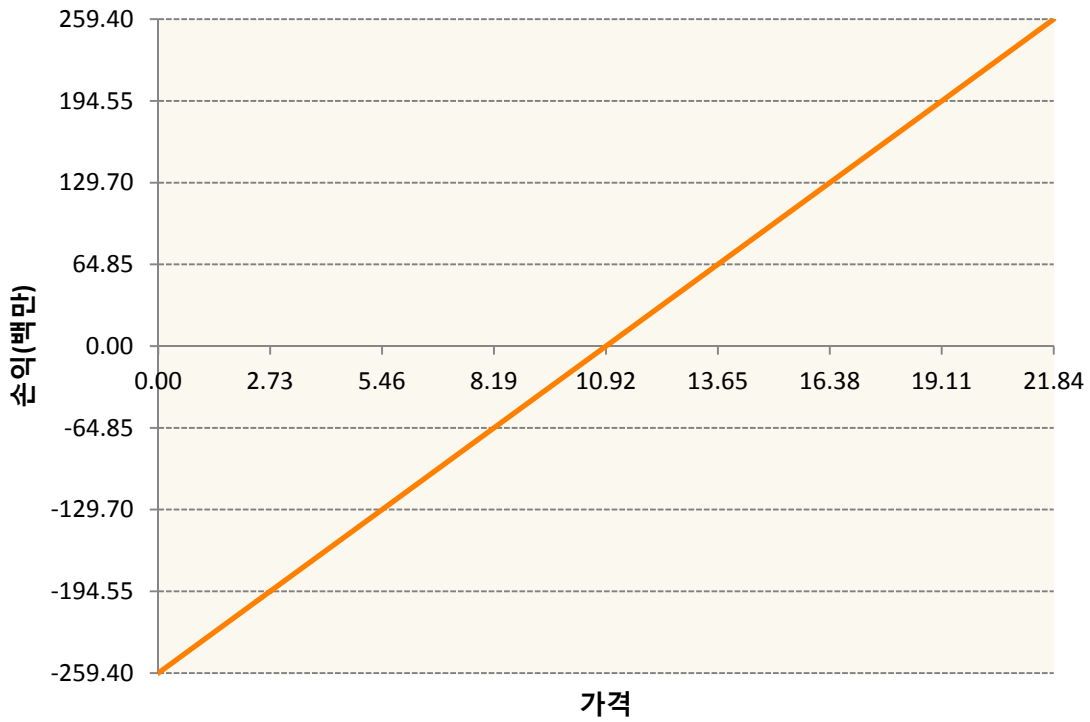


KCZ9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19

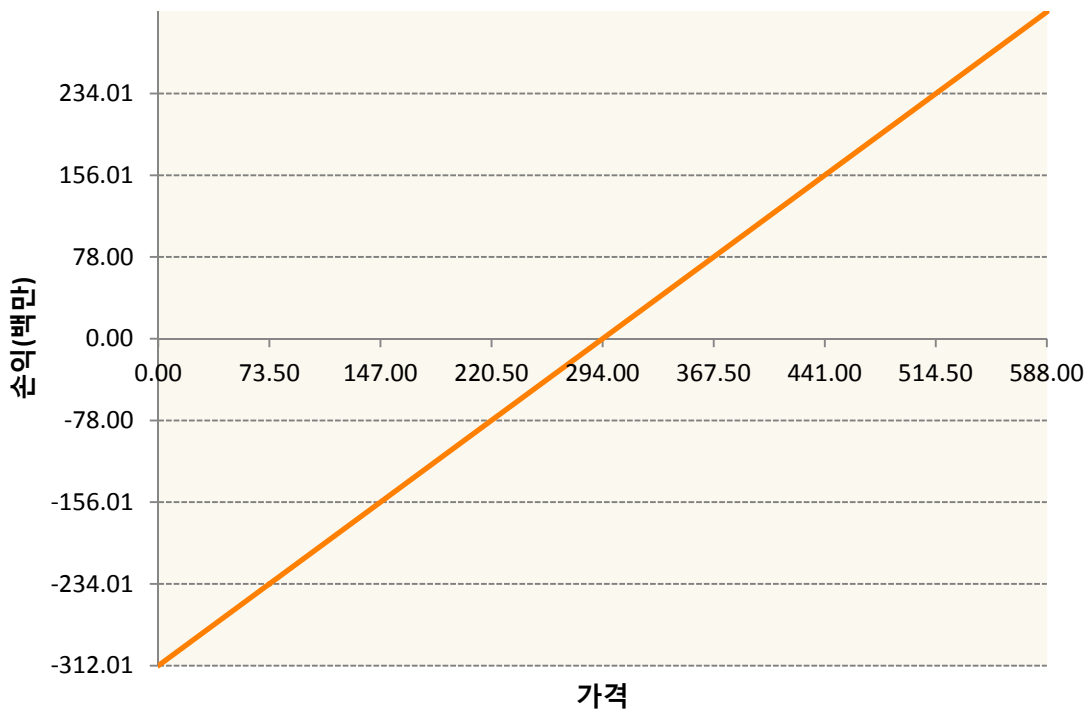




SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

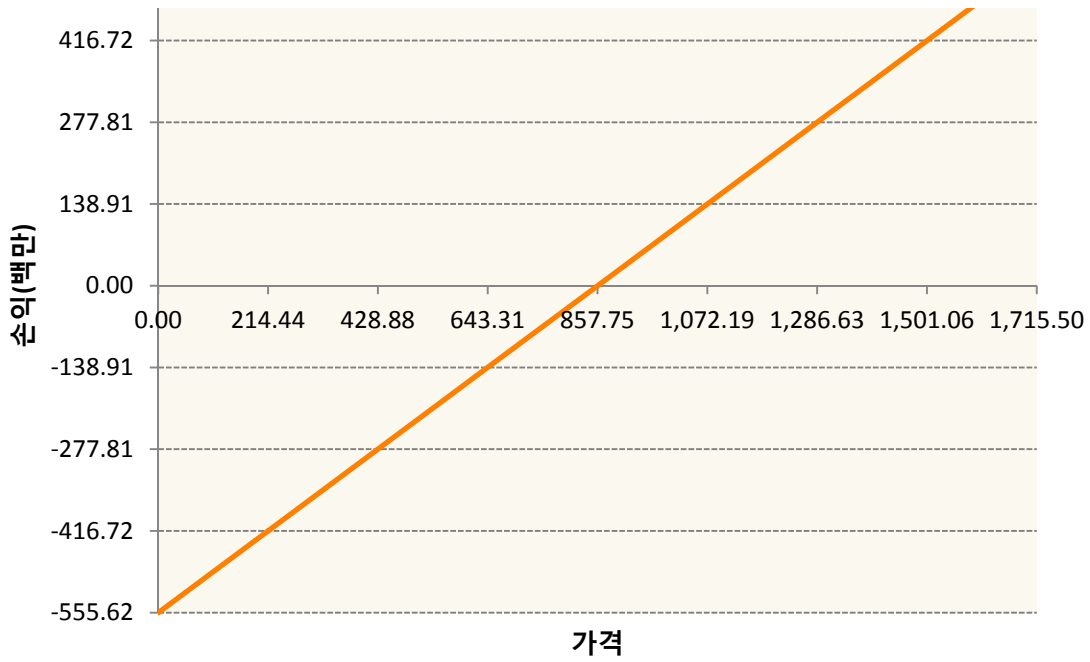


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

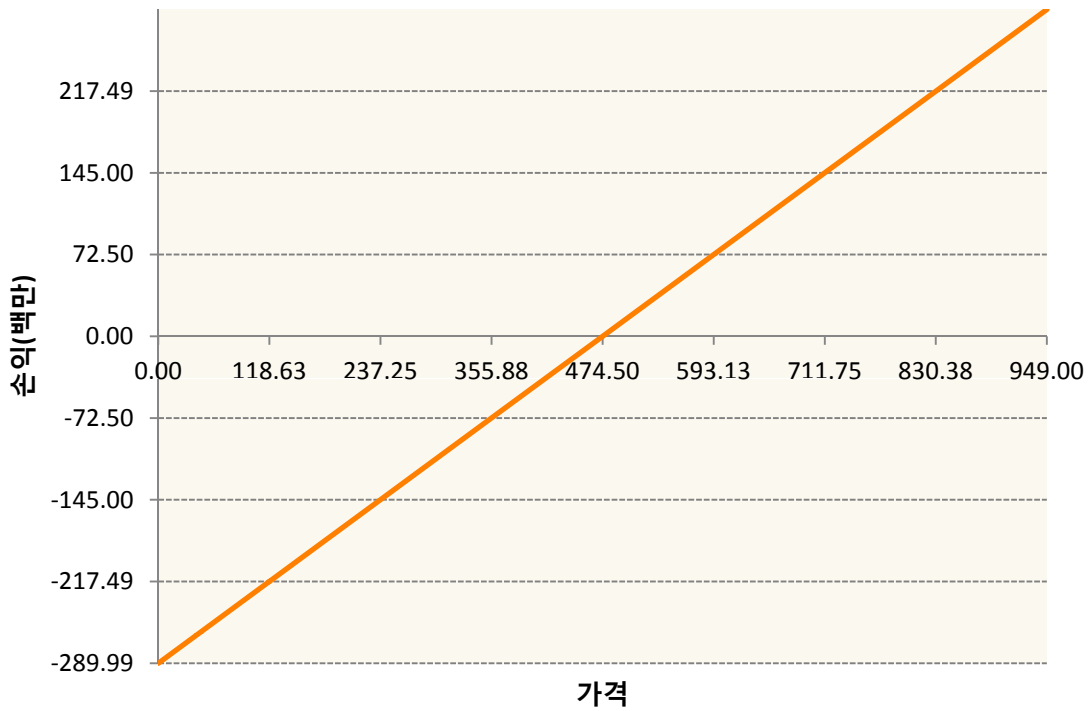


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





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	43
KCZ9	COFFEE 'C' FUTURE Dec19	18
KR4175PA00	2019-10 달러선물	8

KWZ9	KC HRW WHEAT FUT Dec19	8
SBV9	SUGAR #11 (WORLD) Oct19	21
SMZ9	SOYBEAN MEAL FUTR Dec19	25
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	44
WZ9	WHEAT FUTURE(CBT) Dec19	23

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

(단위:백만원)

237