

공시일	2019-09-16
기준일	2019-09-11

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)

93

공시일	2019-09-16
기준일	2019-09-11

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

1,171

* 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	2019-09-16
기준일	2019-09-11

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	6,772	0	6,772	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(1)	394
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	144

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

855

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-16
기준일	2019-09-11

유로인덱스모(주식-파생형)

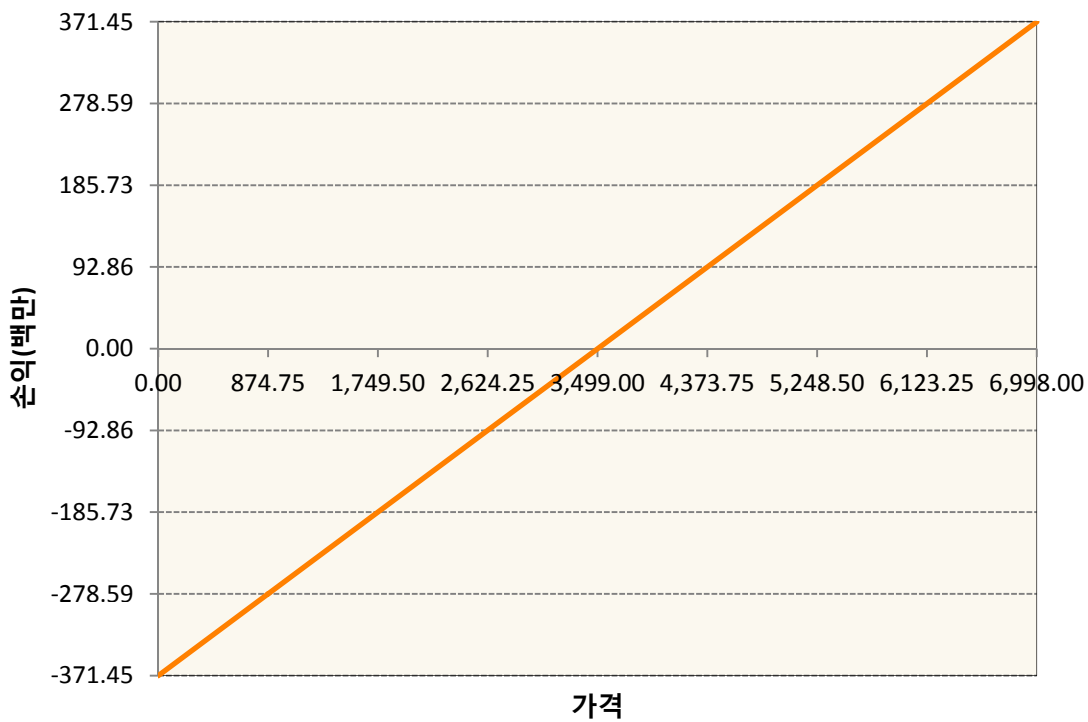
1. 계약금액

(단위:백만원)

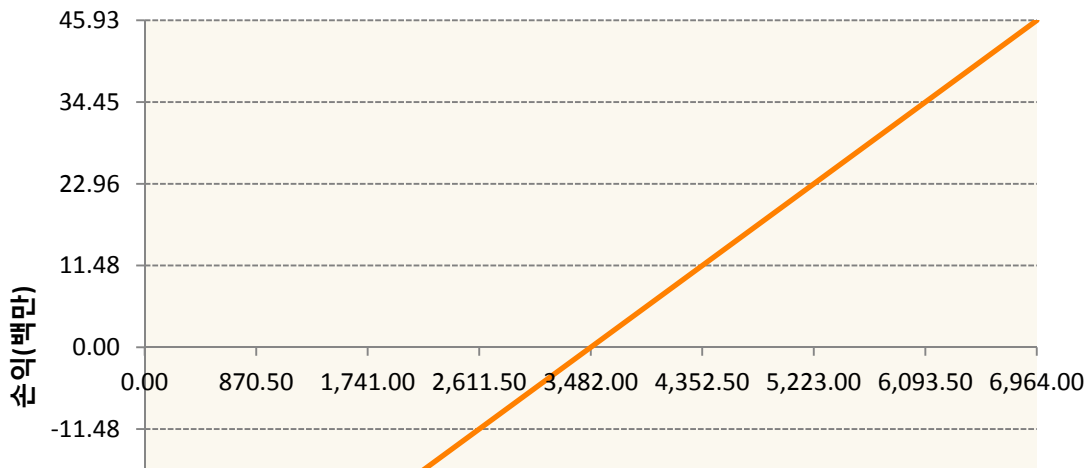
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	417	0	417	

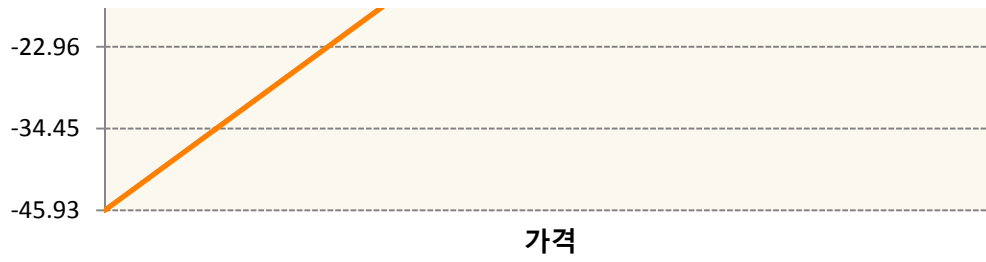
2. 만기시점의 손익구조

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	2019-09-16
기준일	2019-09-11

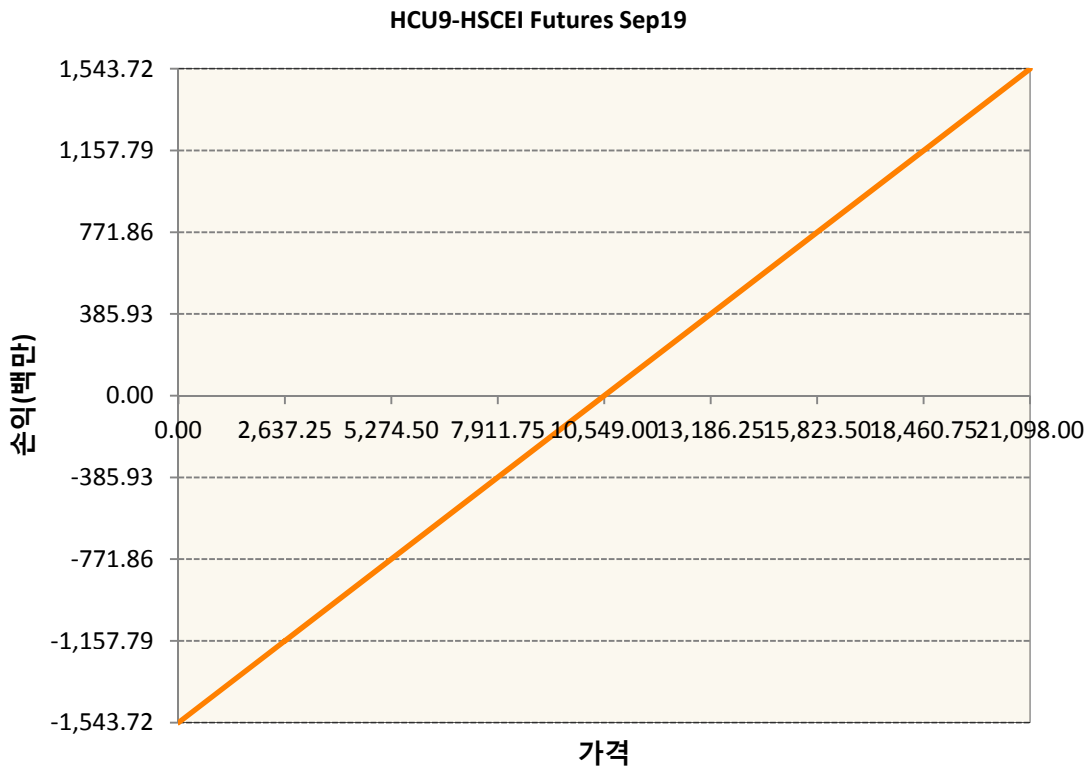
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,544	0	1,544	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU9	HSCEI Futures Sep19	124
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

115

공시일	2019-09-16
기준일	2019-09-11

커버드콜모(주식혼합-파생형)

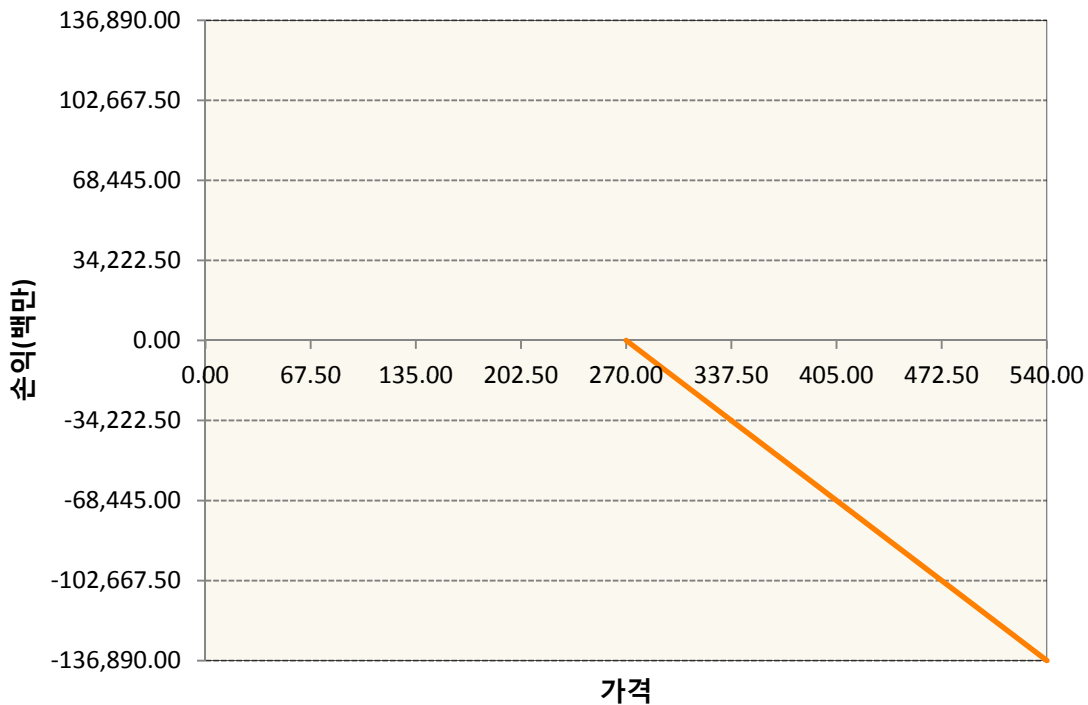
1. 계약금액

(단위:백만원)

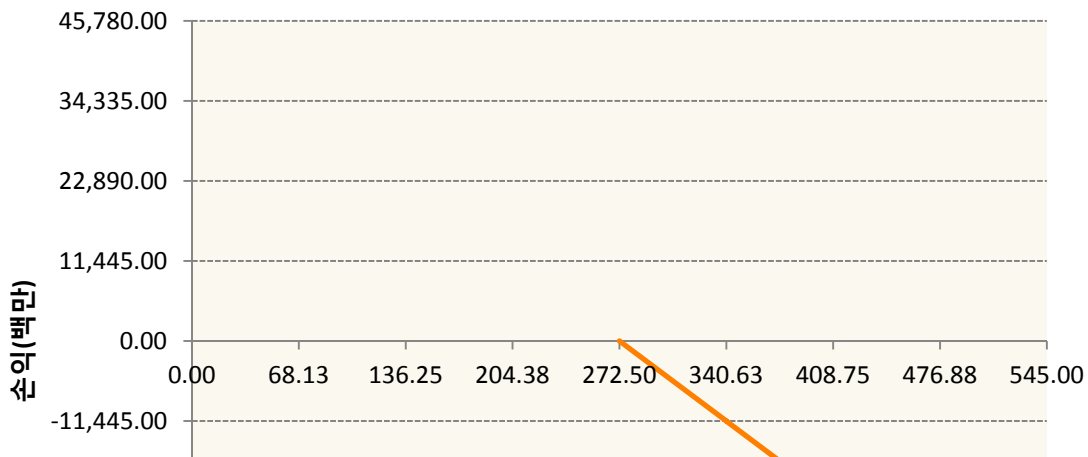
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	185,036	-185,036	장내
누계	유가증권	옵션	0	182,670	-182,670	장내

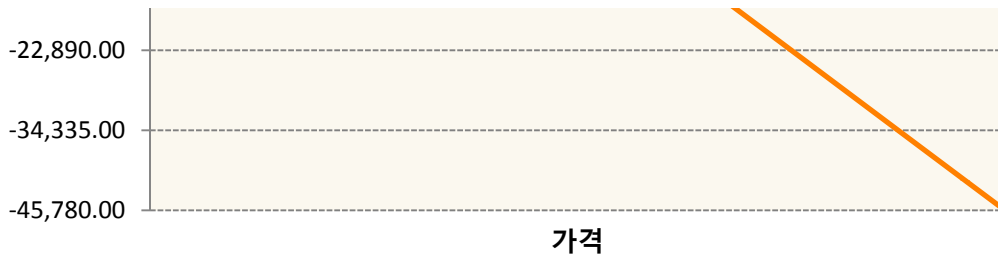
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PA2702-2019-10 콜270



KR4201PA2728-2019-10 콜272.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PA2702		2019-10 콜270						8,497
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,997	3,869	3,717	3,545	3,355	3,149	2,931	
-5.33%	3,539	3,315	3,075	2,822	2,558	2,285	2,006	
-2.67%	2,601	2,293	1,980	1,664	1,344	1,022	699	
0%	1,022	681	341	0	-341	-681	-1,022	
2.67%	-1,235	-1,543	-1,857	-2,176	-2,499	-2,825	-3,154	
5.33%	-4,070	-4,300	-4,549	-4,812	-5,087	-5,371	-5,664	
8.00%	-7,307	-7,453	-7,624	-7,816	-8,028	-8,256	-8,497	
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5						2,690
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,151	1,117	1,075	1,026	971	910	843	
-5.33%	1,037	973	902	826	745	661	574	
-2.67%	786	691	593	493	391	288	184	
0%	338	226	113	0	-113	-226	-339	
2.67%	-333	-442	-552	-663	-774	-886	-999	
5.33%	-1,210	-1,297	-1,389	-1,485	-1,584	-1,685	-1,787	
8.00%	-2,241	-2,300	-2,366	-2,440	-2,519	-2,602	-2,690	

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

10,566

공시일	2019-09-16
기준일	2019-09-11

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

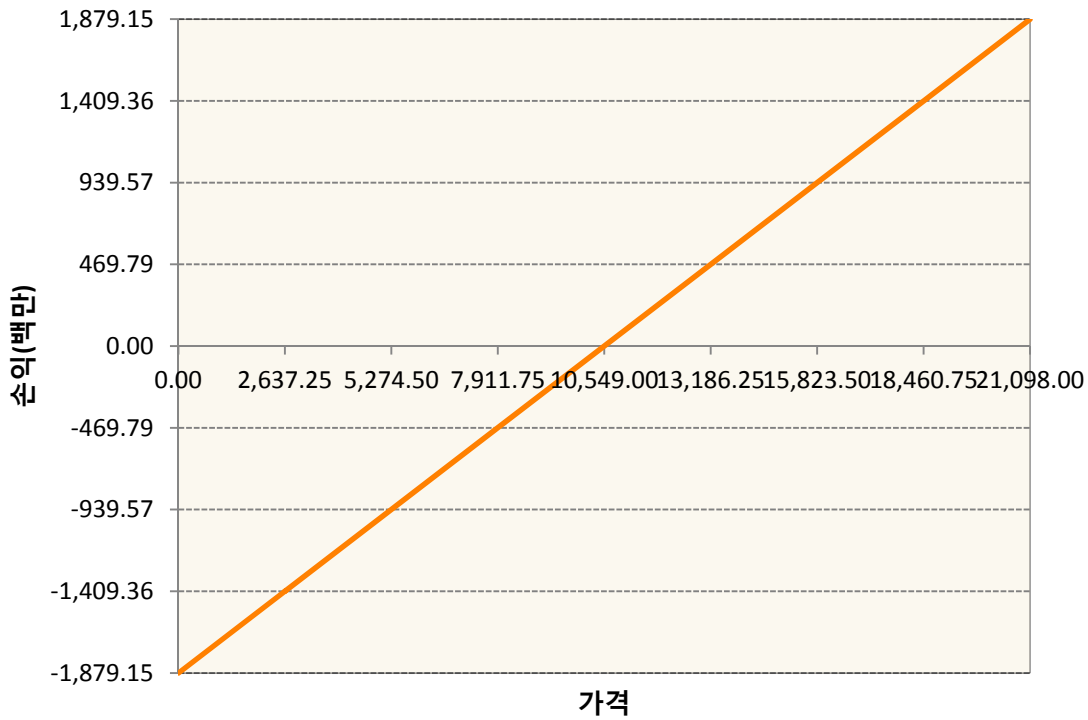
1. 계약금액

(단위:백만원)

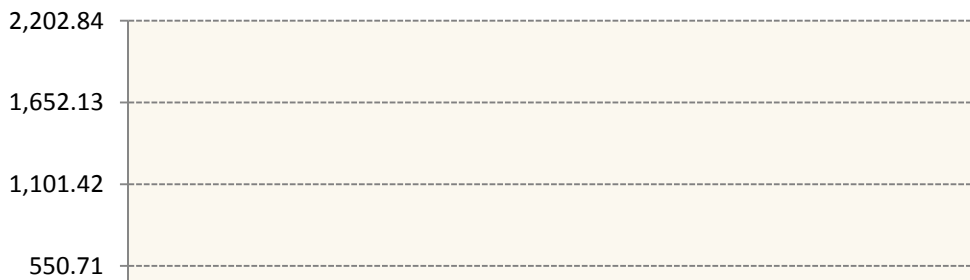
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,879	0	1,879	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,782	-4,782	장내
누계	통화	선도	684	2,822	-2,139	장외

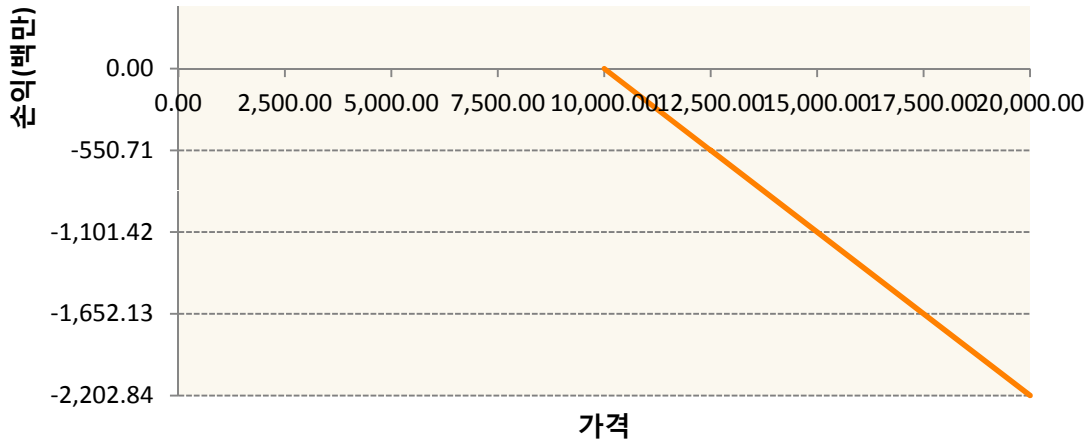
2. 만기시점의 손익구조

HCU9-HSCEI Futures Sep19

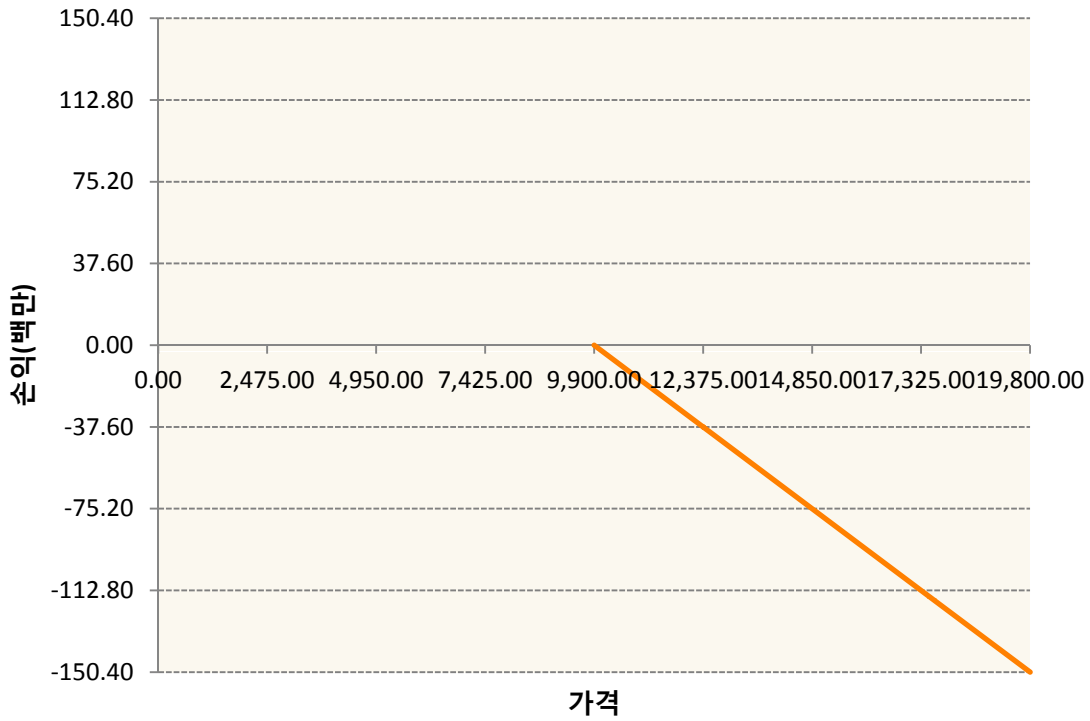


OHHIU9-C100-HSCEI

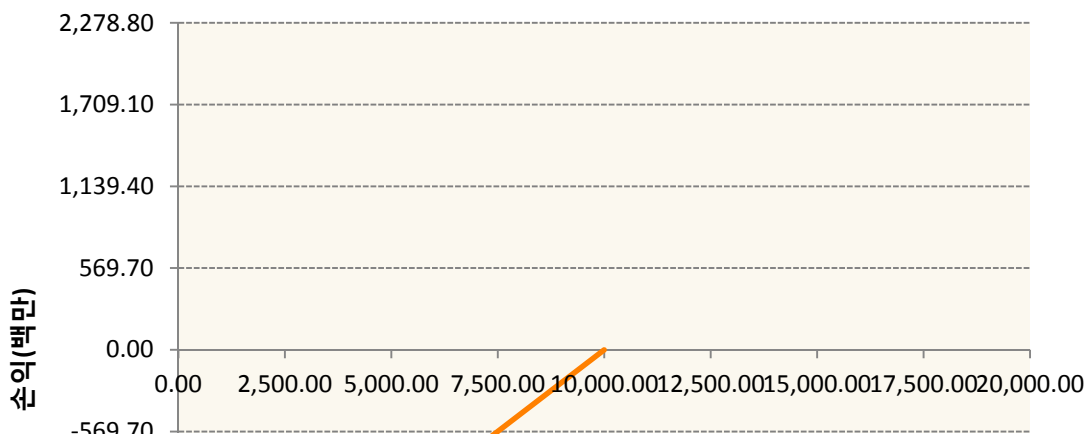


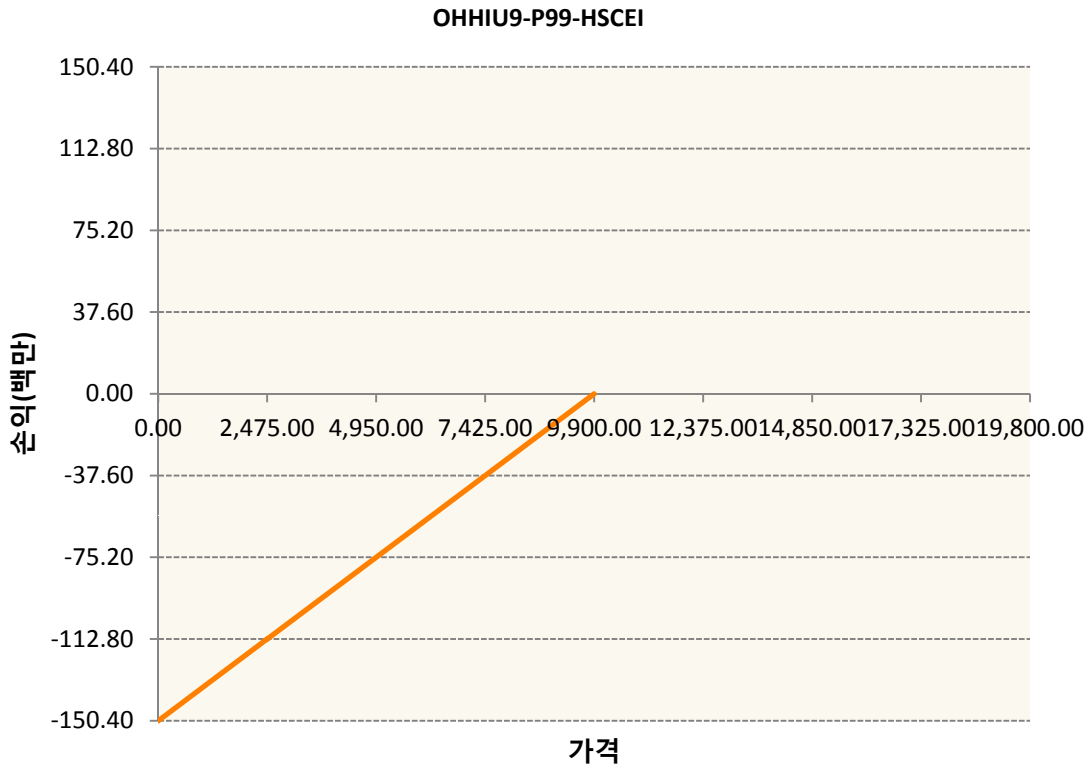


OHHIU9-C99-HSCEI



OHHIU9-P100-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	226
FX21019U00 HKD/KRW 22-11-19E	6
FX21019U02 HKD/KRW 22-11-19E	49
HCU9 HSCEI Futures Sep19	150
OHHIU9-C1(HSCEI	176
OHHIU9-C9(HSCEI	12
OHHIU9-P1(HSCEI	182
OHHIU9-P9(HSCEI	12

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

5.33%	809	809	809	809	809	809	809
8.00%	1,214	1,214	1,214	1,214	1,214	1,214	1,214
KR4101PC0002 2019-12 코스피200지수선물							238
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-238	-238	-238	-238	-238	-238	-238
-5.33%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
-2.67%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	79	79	79	79	79	79	79
5.33%	159	159	159	159	159	159	159
8.00%	238	238	238	238	238	238	238

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

(단위:백만원)

1,420

공시일	2019-09-16
기준일	2019-09-11

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

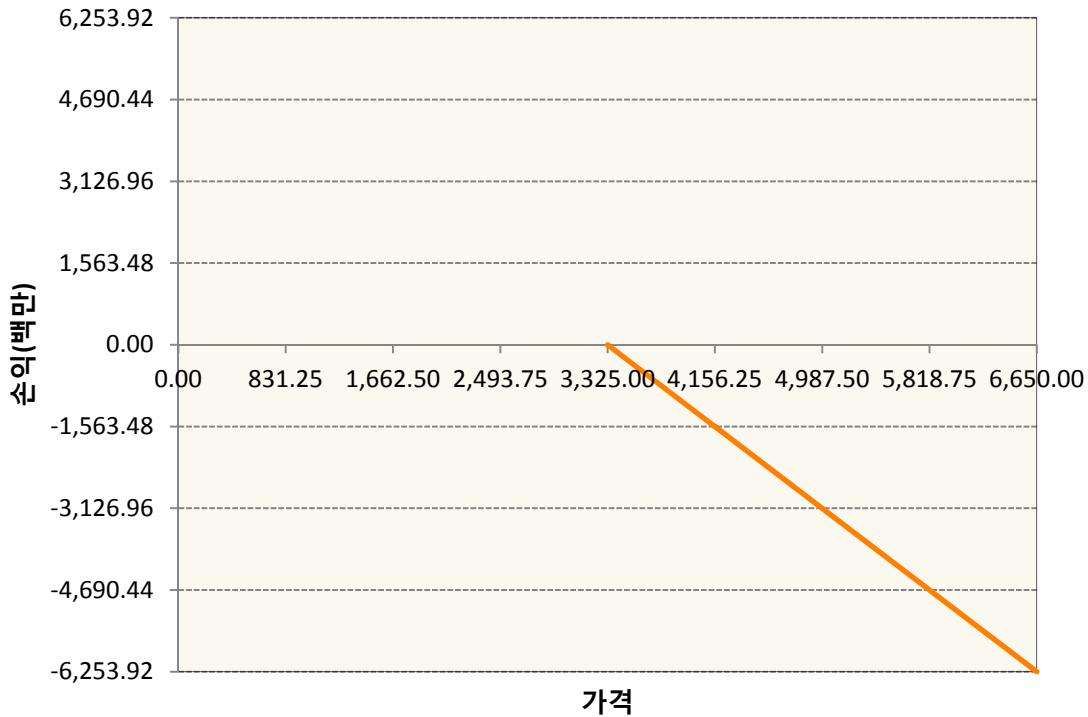
1. 계약금액

(단위:백만원)

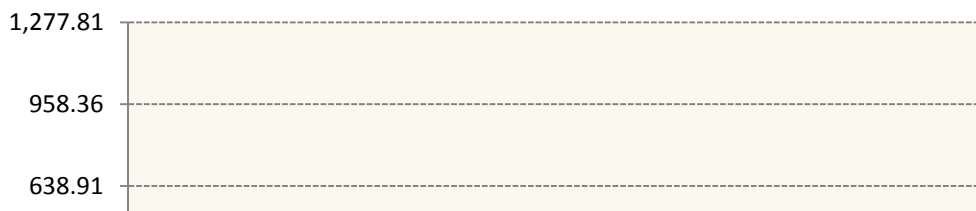
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,138	0	5,138	
누계	유가증권	스왑	23,935	0	23,935	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,063	-15,063	장내
누계	통화	선도	10,917	17,099	-6,182	장외

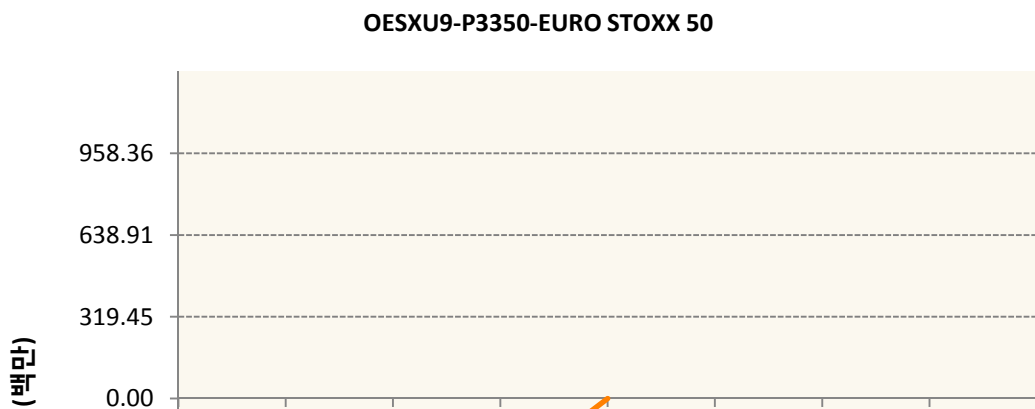
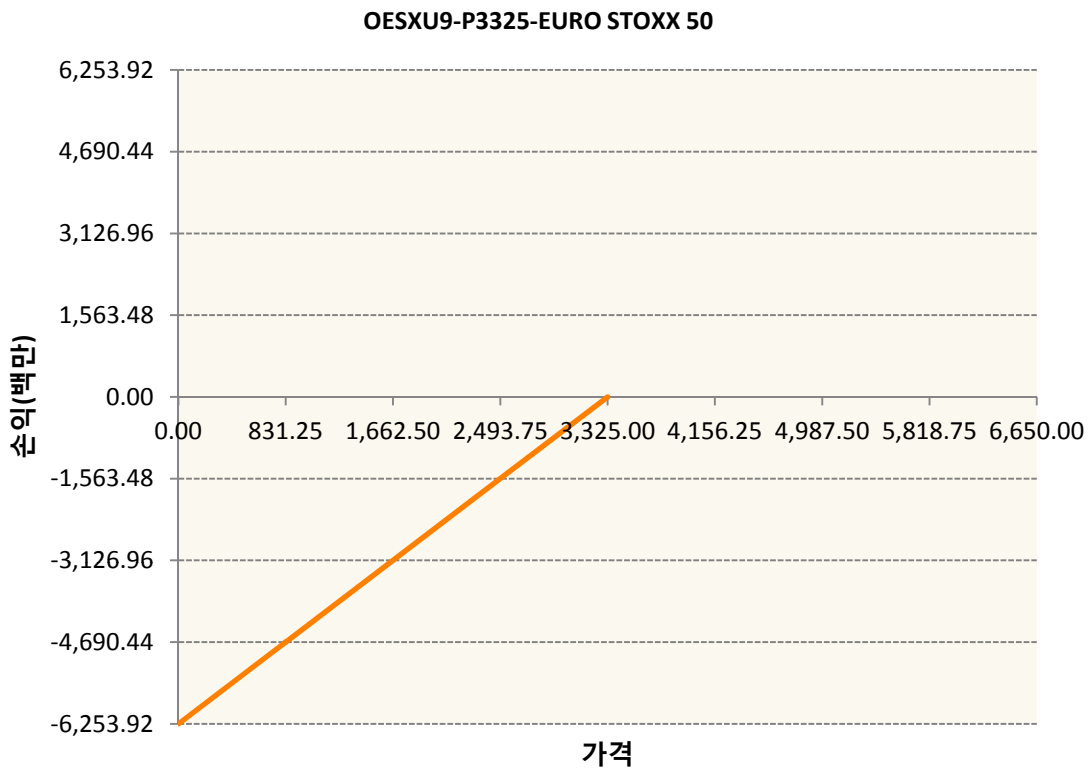
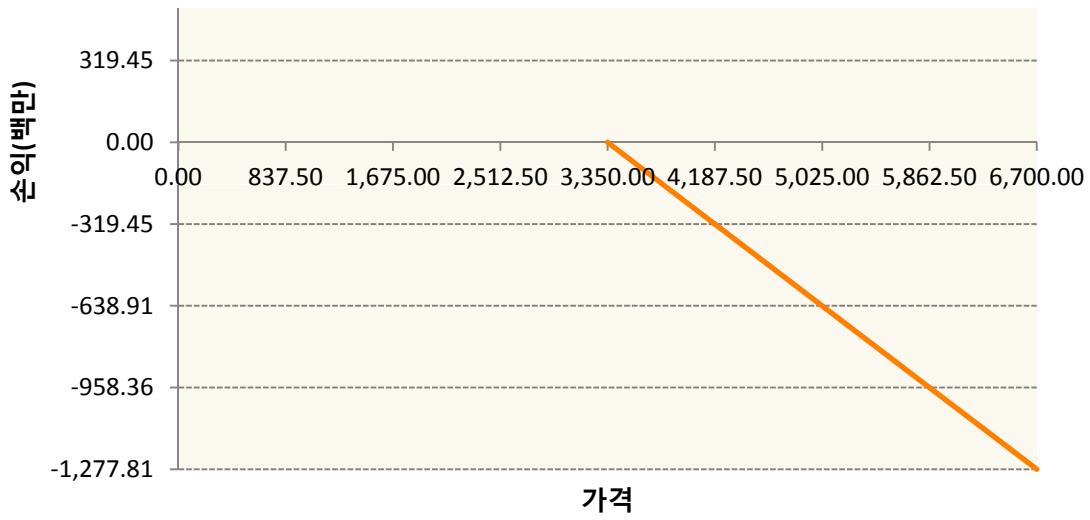
2. 만기시점의 손익구조

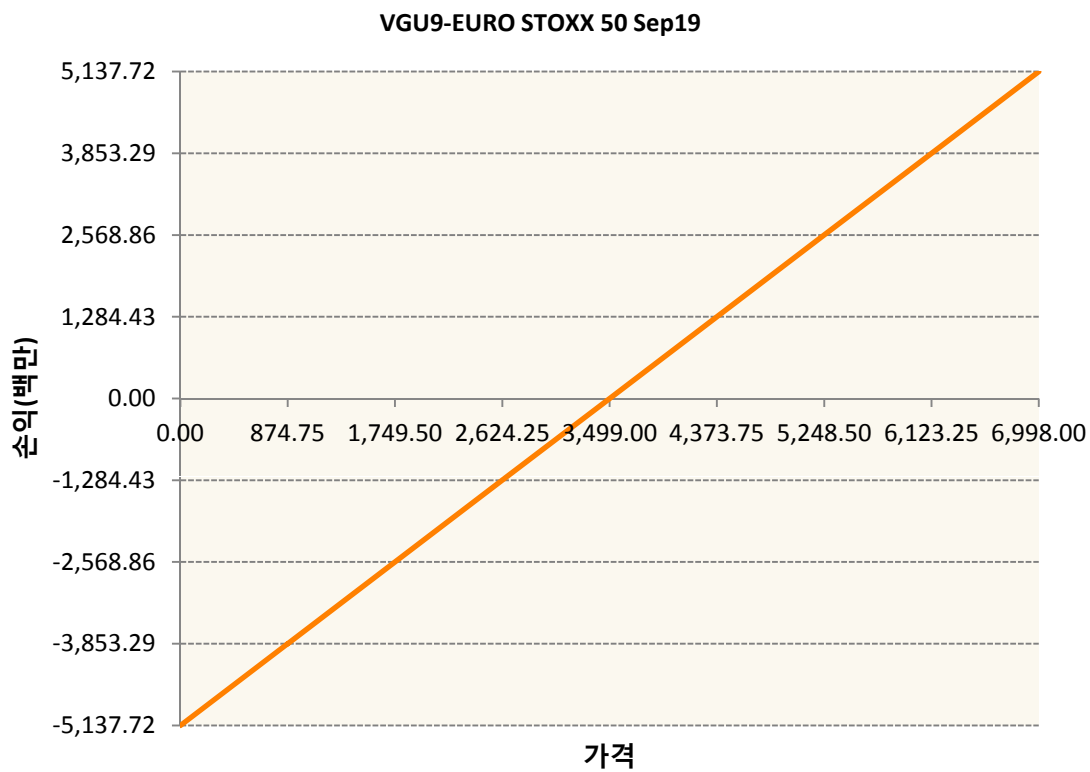
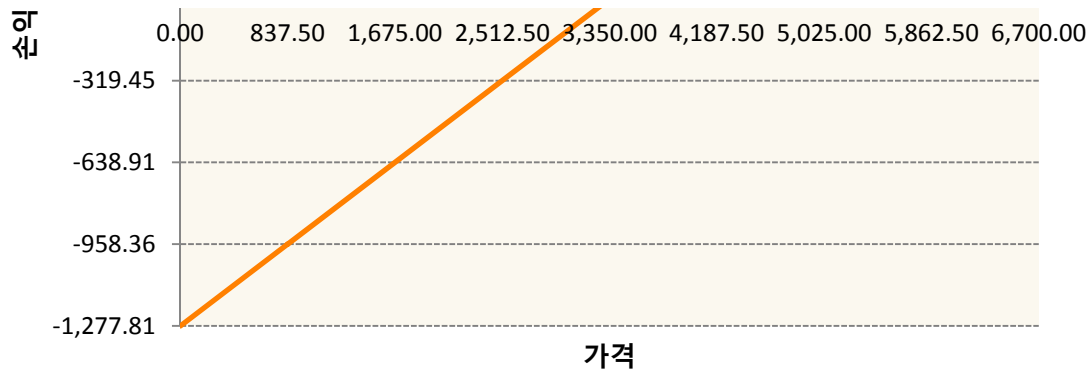
OESXU9-C3325-EURO STOXX 50



OESXU9-C3350-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	19
FX21019M0< KRW/EUR 27-09-19E	1,052
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	316
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E	316
FX21019N04 EUR/KRW 27-09-19E	231
FX21019Q00 EUR/KRW 27-09-19E	168
FX21019U02 EUR/KRW 27-09-19E	158
OESXU9-C3< EURO STOXX 50	500
OESXU9-C3< EURO STOXX 50	102
OESXU9-P3< EURO STOXX 50	500
OESXU9-P3< EURO STOXX 50	102

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

(단위:백만원)

2,203

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

(단위:백만원)

980

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

(단위:백만원)

84

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

(단위:백만원)

131

공시일	2019-09-16
기준일	2019-09-11

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

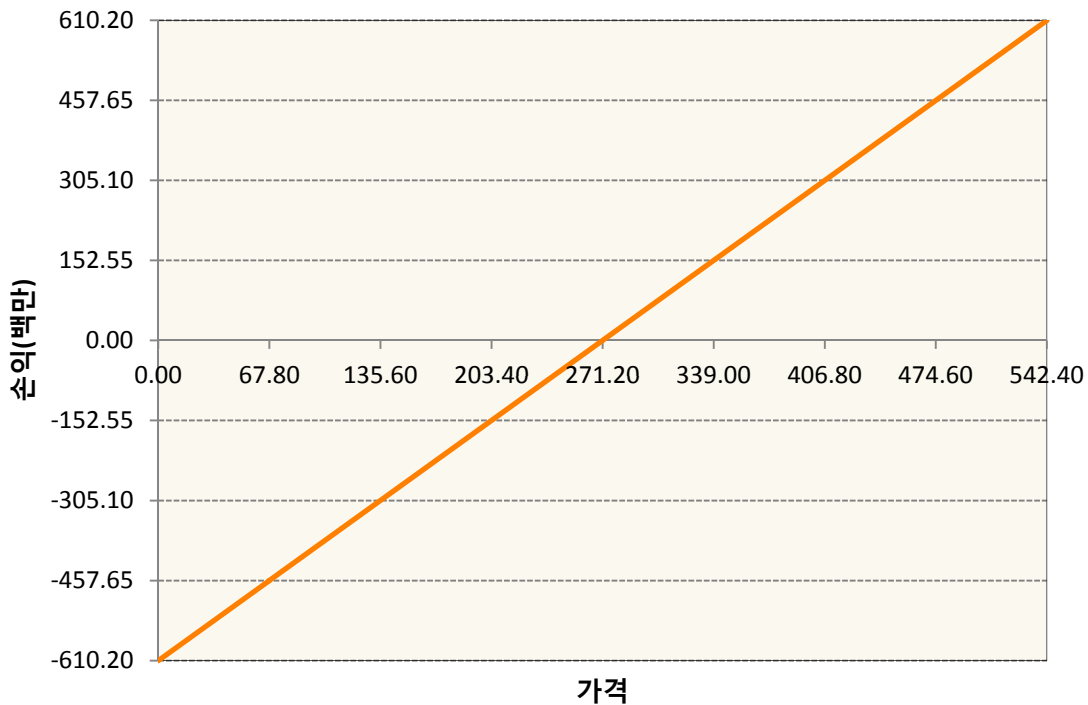
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	609	0	609	장내
누계	유가증권	선물	610	0	610	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002 2019-12 코스피200지수선물 49

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-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%	33	33	33	33	33	33	33
8.00%	49	49	49	49	49	49	49

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

(단위:백만원)

42

공시일	2019-09-16
기준일	2019-09-11

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

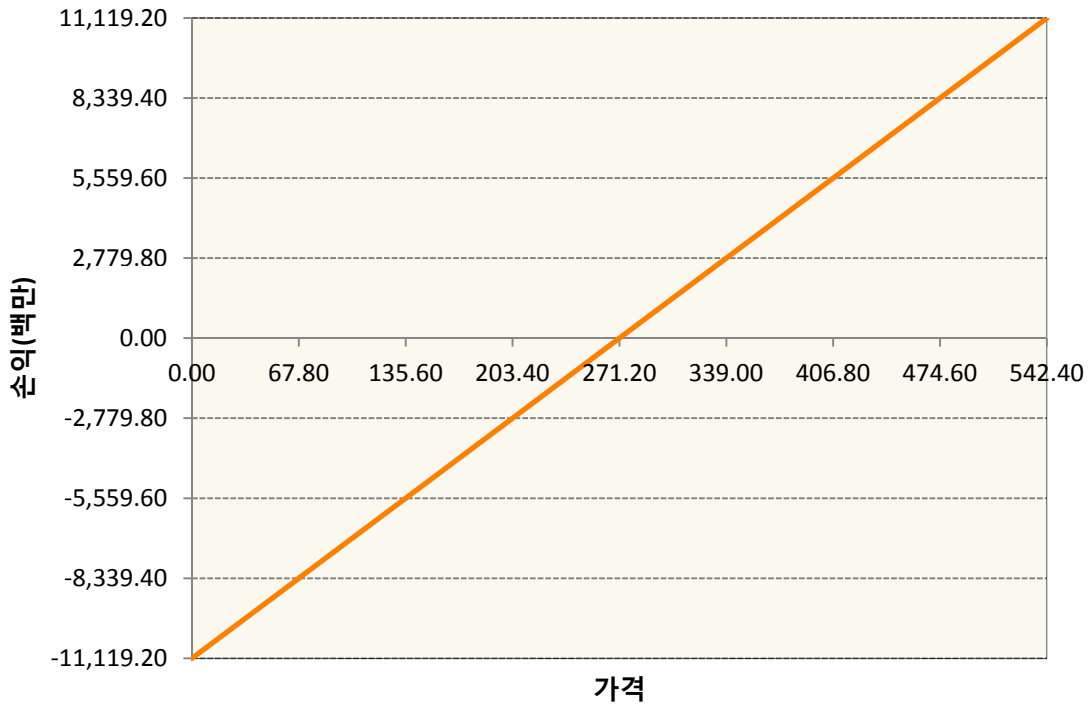
1. 계약금액

(단위:백만원)

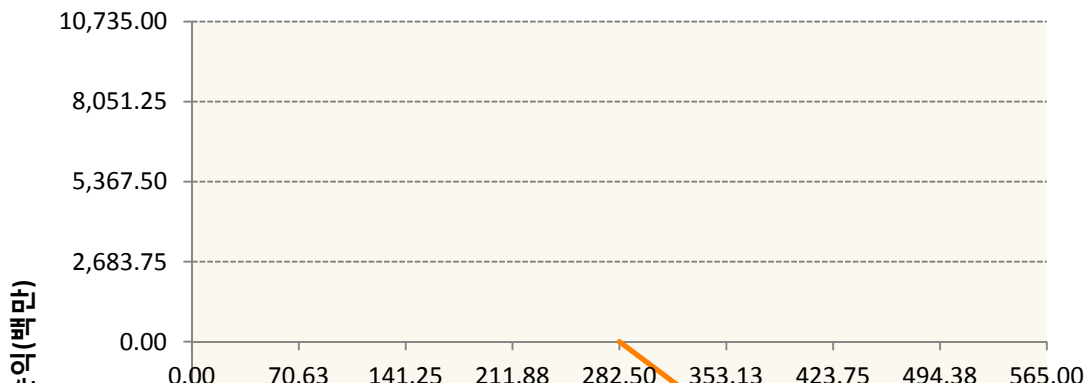
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	11,094	0	11,094	장내
신규	유가증권	옵션	1,598	20,875	-19,277	장내
누계	유가증권	선물	11,119	0	11,119	장내
누계	유가증권	옵션	1,621	20,853	-19,232	장내

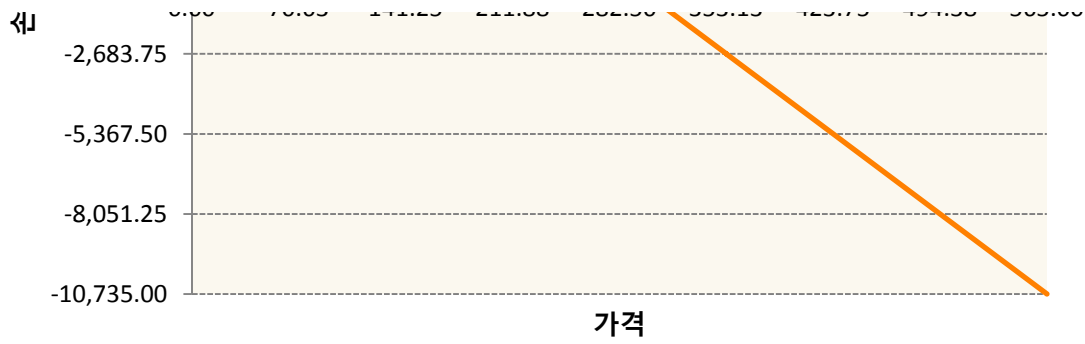
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

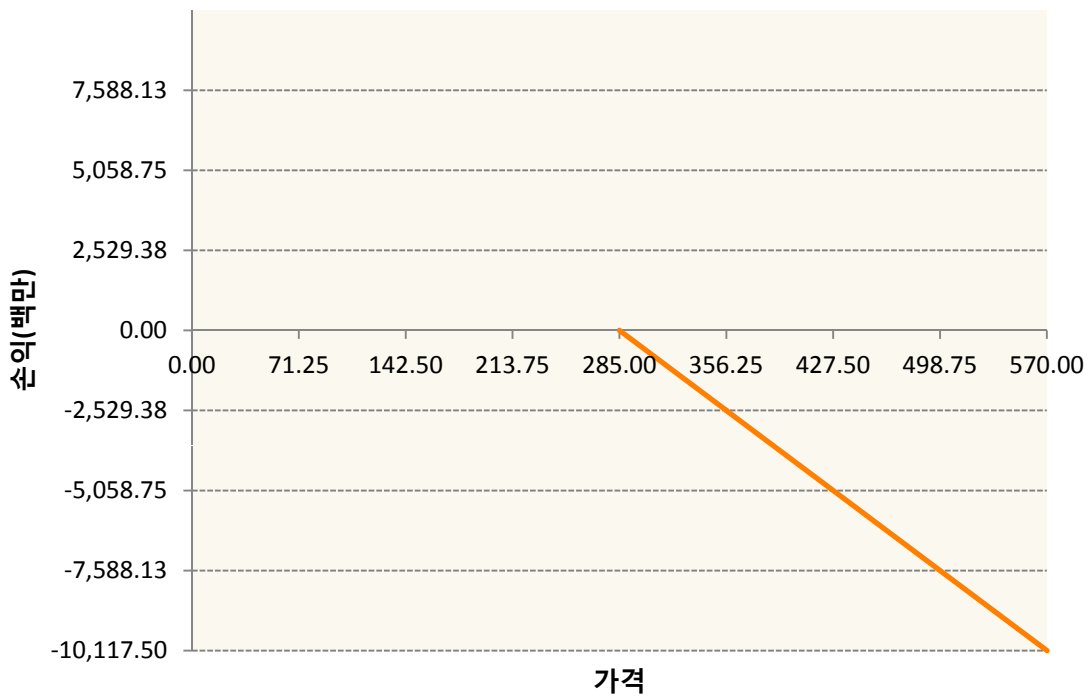


KR4201PA2827-2019-10 콜282.5

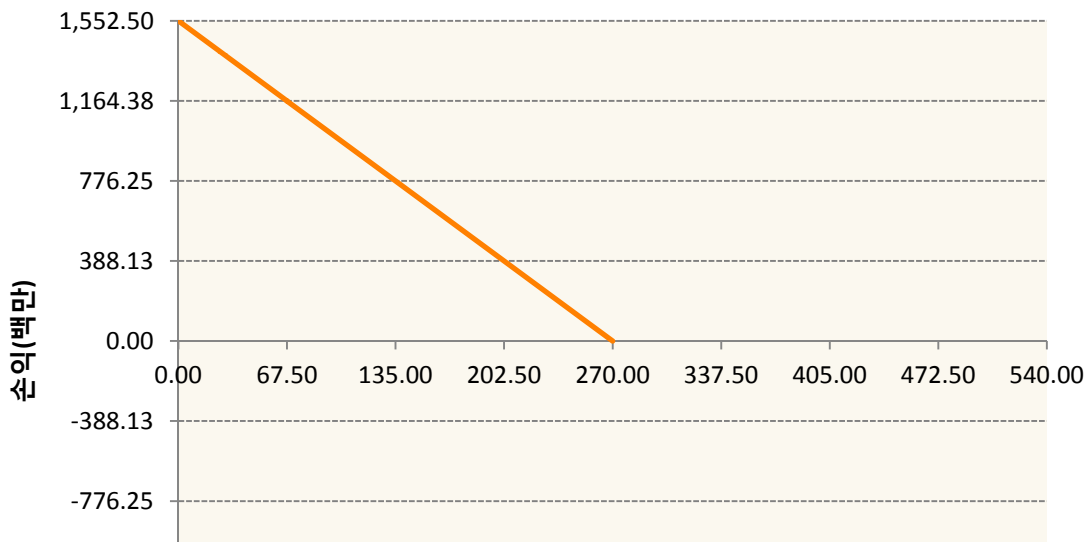


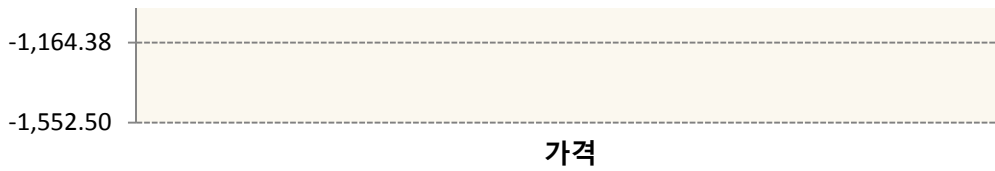


KR4201PA2850-2019-10 콜285

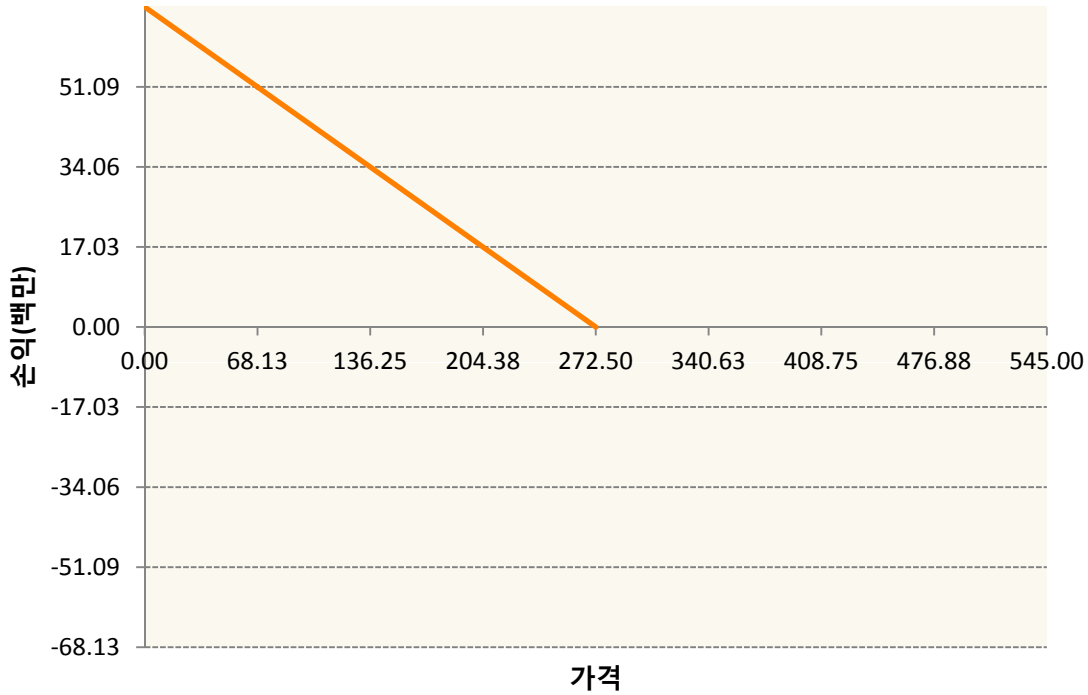


KR4301PA2701-2019-10 풋270





KR4301PA2727-2019-10 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						888
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-888	-888	-888	-888	-888	-888	-888	
-5.33%	-592	-592	-592	-592	-592	-592	-592	
-2.67%	-296	-296	-296	-296	-296	-296	-296	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	296	296	296	296	296	296	296	
5.33%	592	592	592	592	592	592	592	
8.00%	888	888	888	888	888	888	888	
KR4201PA2827		2019-10 콜282.5						480
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	136	133	129	124	117	109	100	
-5.33%	129	122	114	104	92	79	65	
-2.67%	108	96	81	65	48	30	11	

0%	63	43	22	0	-22	-45	-69
2.67%	-22	-47	-73	-99	-124	-150	-176
5.33%	-154	-181	-207	-234	-261	-287	-314
8.00%	-334	-357	-381	-405	-430	-455	-480
KR4201PA2850 2019-10 콜285							417
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	105	104	101	97	92	85	77
-5.33%	101	96	90	82	72	62	50
-2.67%	87	77	65	52	38	22	5
0%	53	37	19	0	-20	-40	-61
2.67%	-12	-35	-58	-81	-105	-128	-152
5.33%	-120	-145	-170	-196	-221	-246	-271
8.00%	-273	-297	-320	-344	-369	-393	-417
KR4301PA2701 2019-10 풋270							101
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	100	100	100	100	100	100	101
-5.33%	59	59	59	60	61	62	63
-2.67%	21	22	24	25	27	28	30
0%	-6	-4	-2	0	2	4	6
2.67%	-18	-17	-15	-14	-12	-11	-9
5.33%	-21	-21	-20	-20	-19	-18	-17
8.00%	-21	-21	-21	-21	-21	-20	-20
KR4301PA2727 2019-10 풋272.5							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%	3	3	3	3	3	3	3
-2.67%	1	1	1	1	1	1	1
0%	0	0	0	0	0	0	0
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)

1,556

공시일	2019-09-16
기준일	2019-09-11

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,382	0	2,382	
누계	유가증권	수익증권	86,149	0	86,149	

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	2019-09-16
기준일	2019-09-11

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,573	0	3,573	
누계	유가증권	수익증권	108,927	0	108,927	

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	2019-09-16
기준일	2019-09-11

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	474,734	0	474,734	
누계	통화	선도	0	512,726	-512,726	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		1,715
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,096
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		133
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		286
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		3,144
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		2,134
FX21019Q01 KRW/USD 16-09-19E		95
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,906
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,525
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,611
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,963
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		953
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		953
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E		953
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E		1,715
FX21019Q04 KRW/USD 30-09-19E		191
FX21019Q04 KRW/USD 24-09-19E		2,096
FX21019Q04 KRW/USD 24-09-19E		2,668
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		1,372
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E		2,039
FX21019U01 KRW/USD 10-10-19E		286
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E		191

FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E

2,325

FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E

1,715

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

(단위:백만원)

13,539

공시일	2019-09-16
기준일	2019-09-11

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

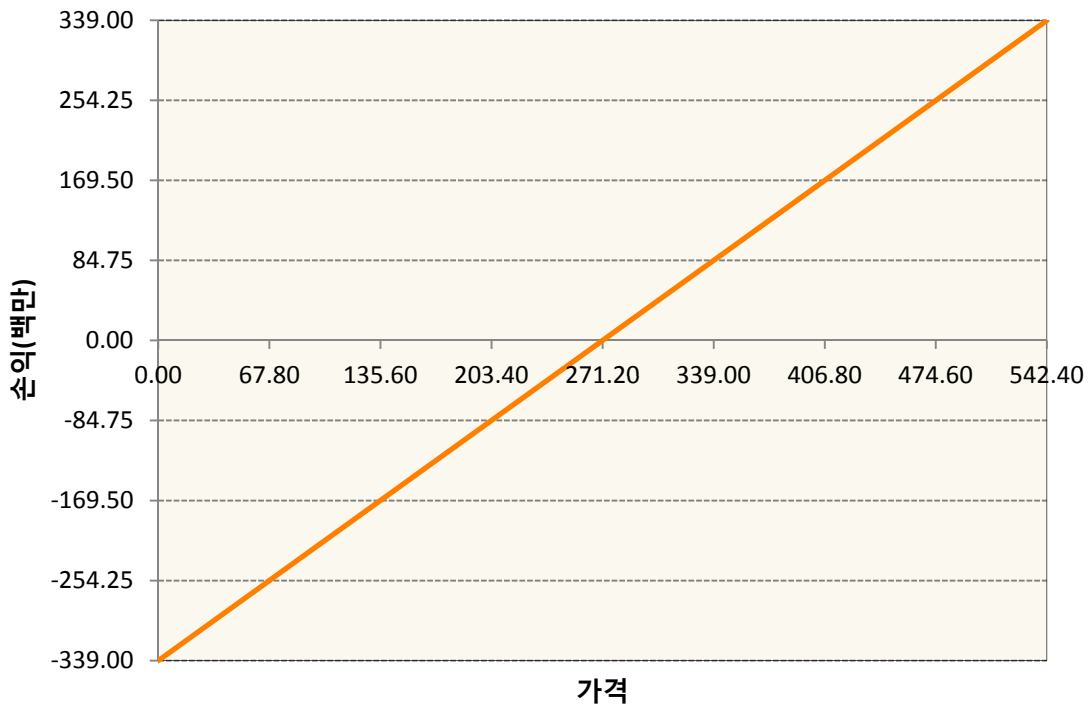
1. 계약금액

(단위:백만원)

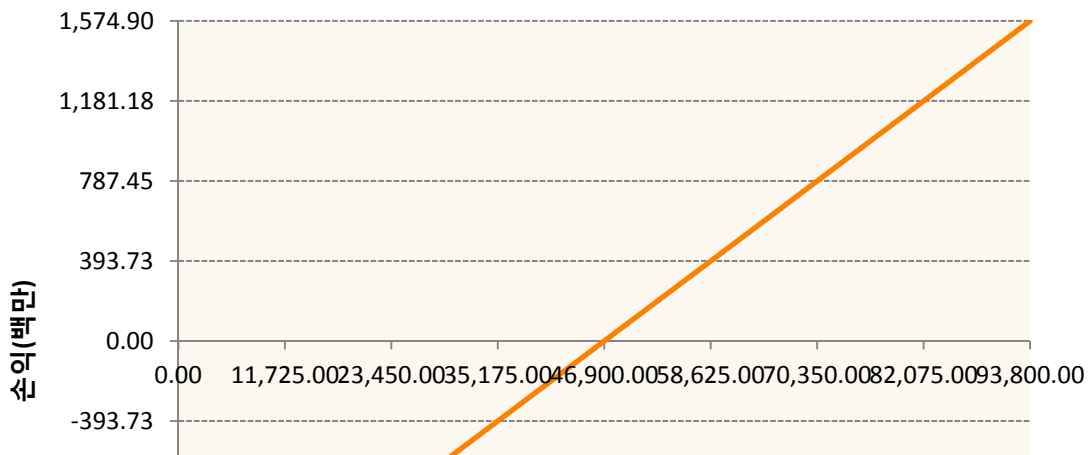
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	203	0	203	장내
누계	유가증권	선물	1,914	0	1,914	장내

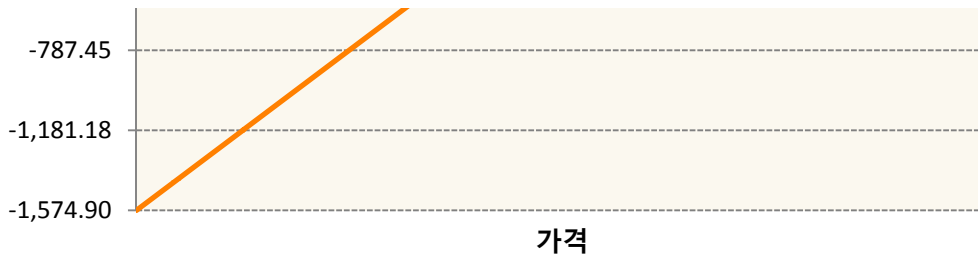
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



KR4111PA0002-2019-10 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

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	
KR4111PA0002		2019-10 삼성전자개별선물						127
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127	
-5.33%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84	
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	42	42	42	42	42	42	42	
5.33%	84	84	84	84	84	84	84	
8.00%	127	127	127	127	127	127	127	

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

182

공시일	2019-09-16
기준일	2019-09-11

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

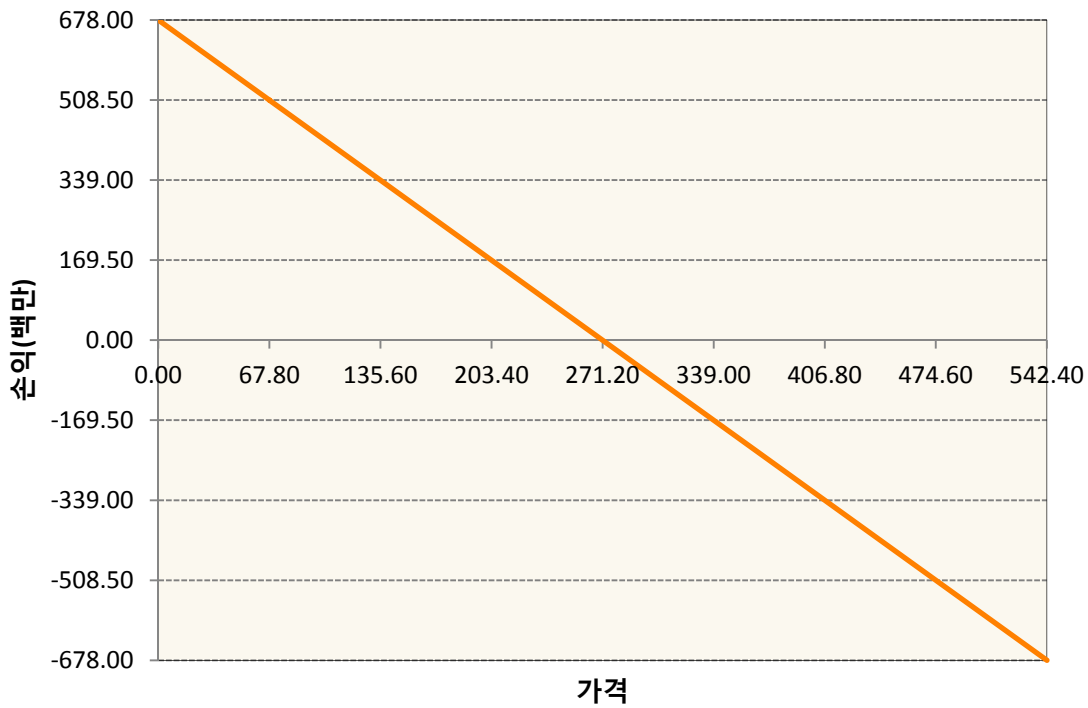
1. 계약금액

(단위:백만원)

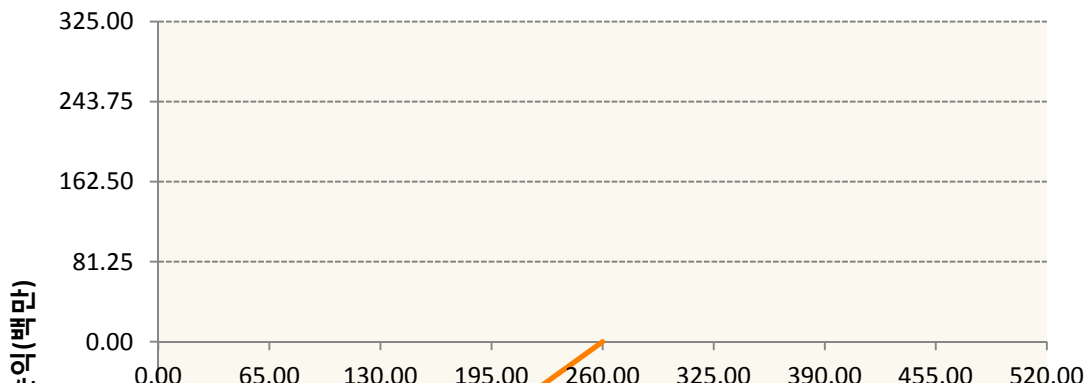
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	338	-338	장내
신규	유가증권	옵션	0	3,889	-3,889	장내
누계	유가증권	선물	0	678	-678	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,869	-3,869	장내

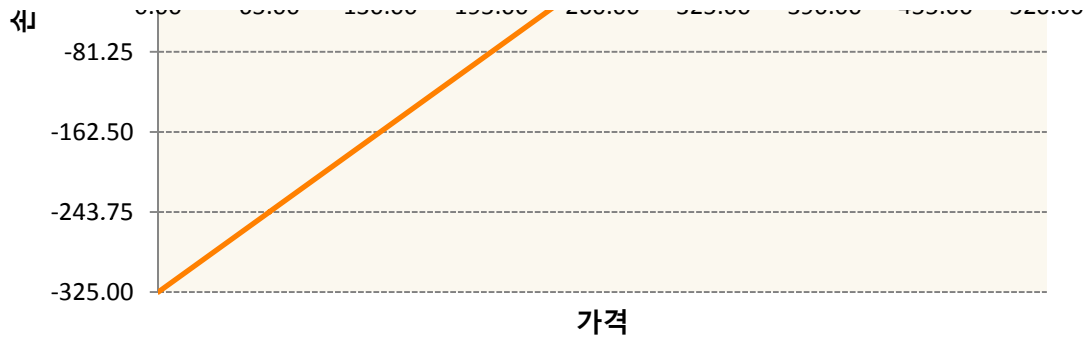
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

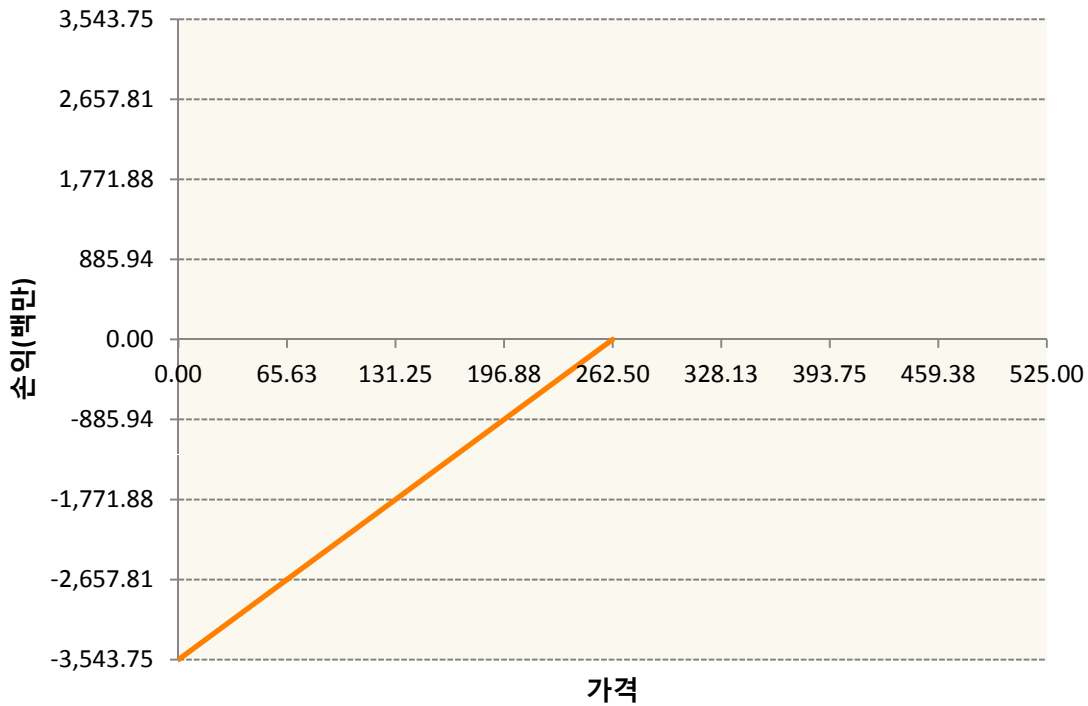


KR4301PA2602-2019-10 풋260





KR4301PA2628-2019-10 풋262.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

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	
KR4301PA2602		2019-10 풋260						14
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-13	-13	-13	-14	-14	-14	-14
-5.33%	-6	-6	-6	-7	-7	-7	-8
-2.67%	-1	-1	-2	-2	-3	-3	-3
0%	1	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	1	1	1	1	1	0	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1
KR4301PA2628 2019-10 풋262.5							177
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-168	-169	-170	-172	-173	-175	-177
-5.33%	-80	-83	-86	-90	-93	-97	-101
-2.67%	-18	-23	-27	-31	-36	-40	-44
0%	9	6	3	0	-3	-7	-10
2.67%	15	14	13	12	10	9	7
5.33%	16	16	15	15	15	14	13
8.00%	16	16	16	16	16	15	15

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

(단위:백만원)

211

공시일	2019-09-16
기준일	2019-09-11

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	19,330	0	19,330	
누계	통화	선도	119	18,937	-18,818	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		476
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		515
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		38
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		324
FX21019U02 USD/KRW 19-09-19E		10

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

(단위:백만원)

503

공시일	2019-09-16
기준일	2019-09-11

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	379	0	379	장외
누계	통화	선도	92	111	-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)

35

공시일	2019-09-16
기준일	2019-09-11

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

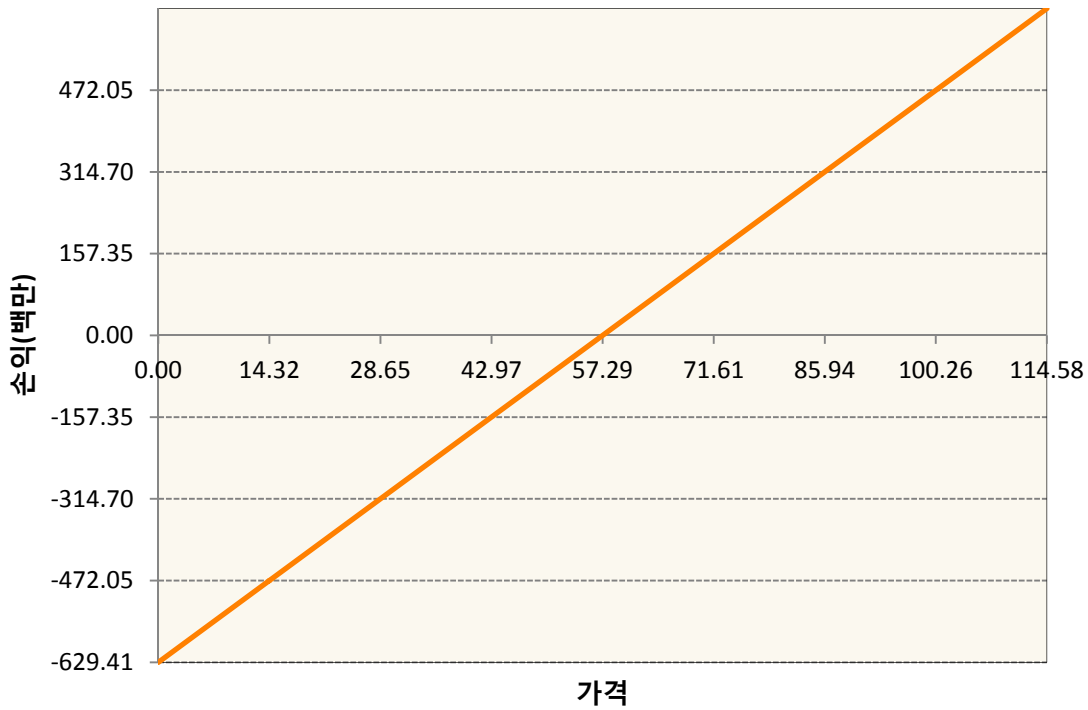
1. 계약금액

(단위:백만원)

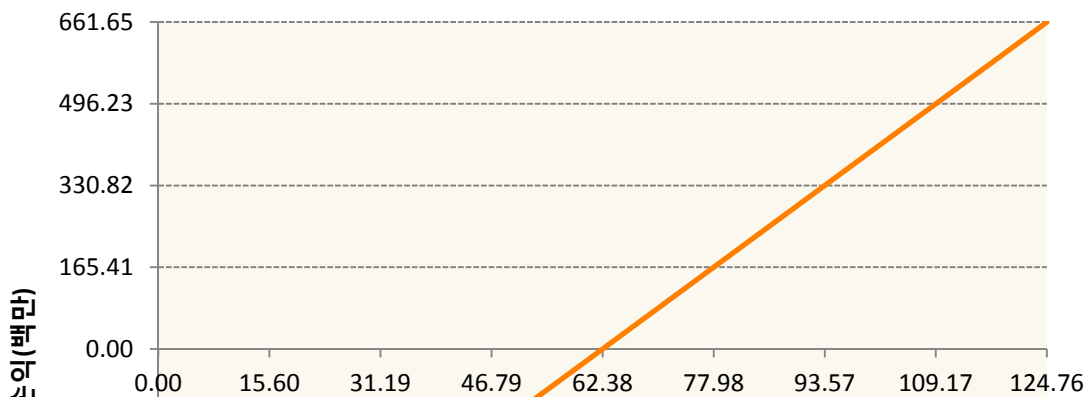
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,390	297	2,093	
누계	유가증권	선물	198	0	198	장내

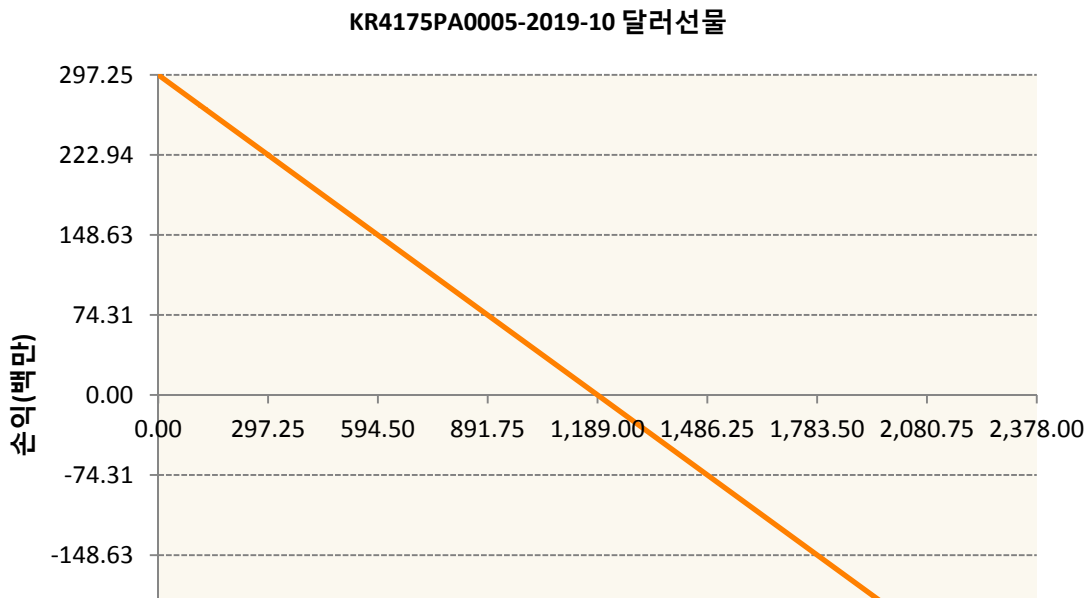
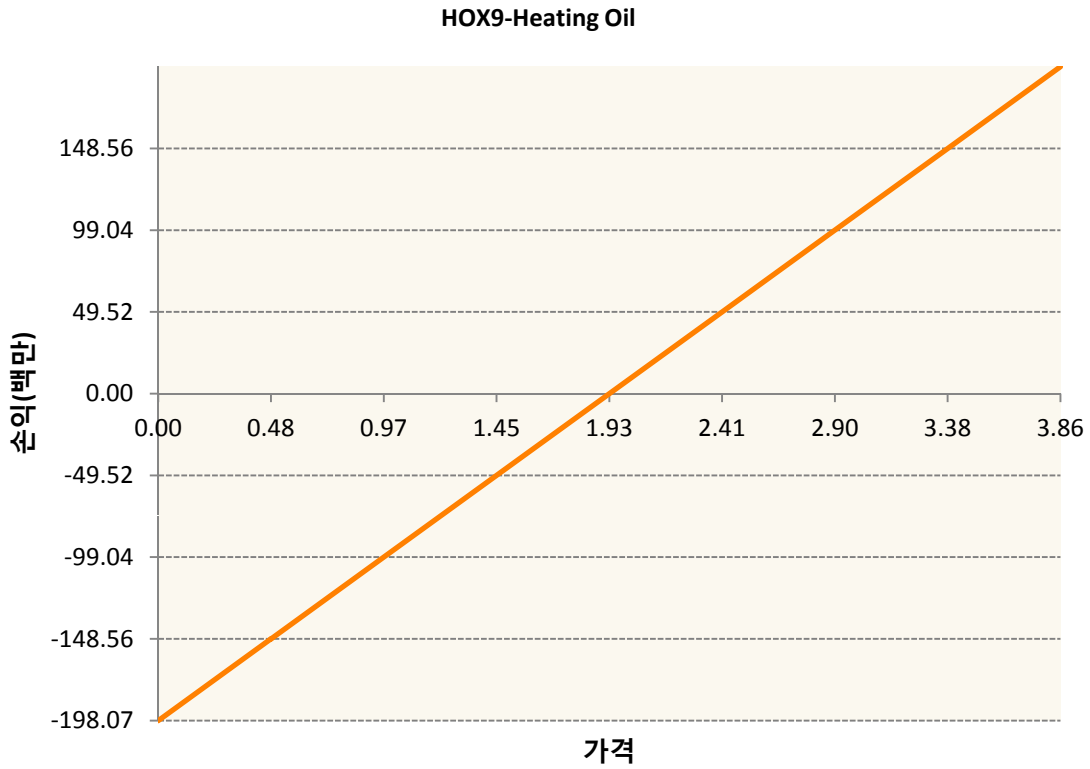
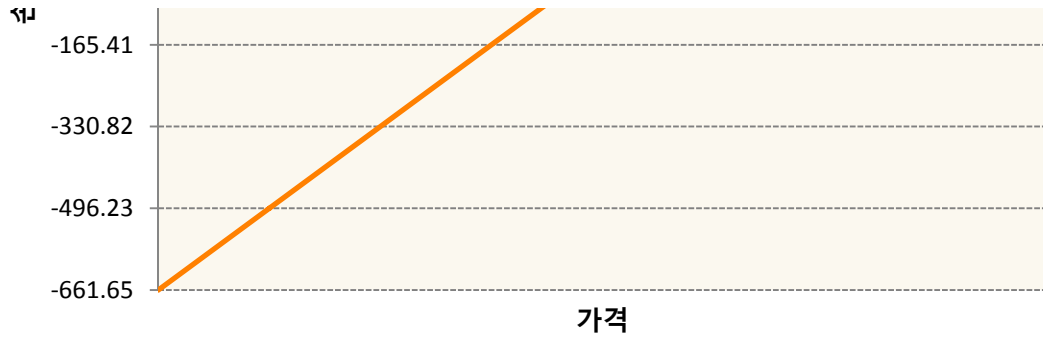
2. 만기시점의 손익구조

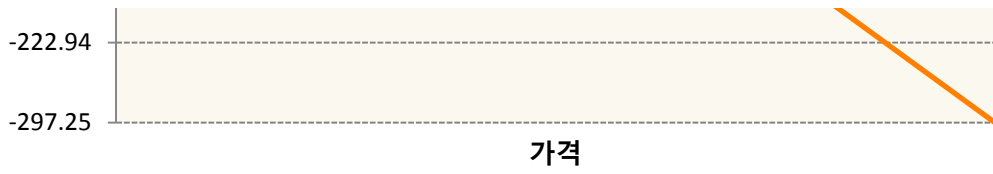
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19



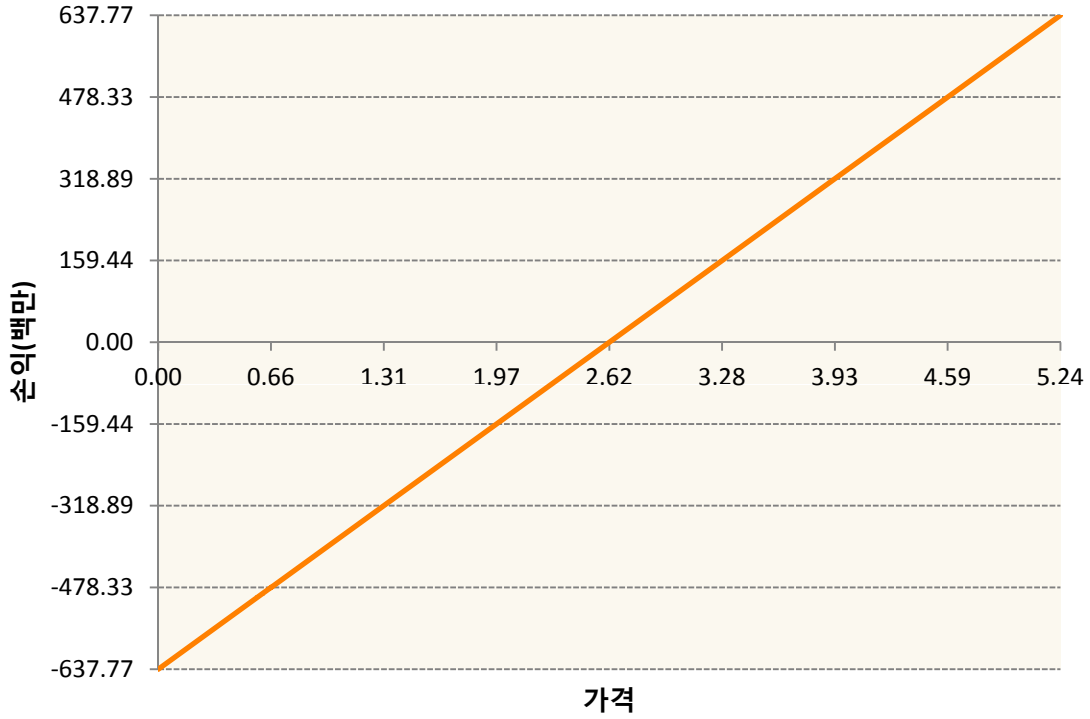
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19



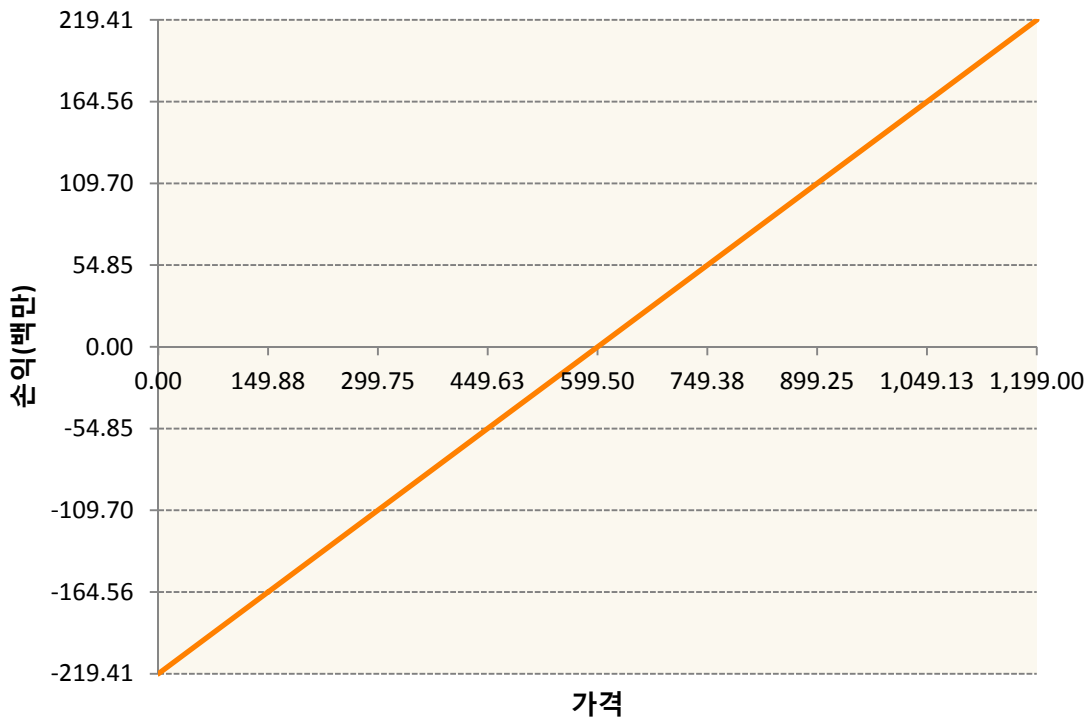


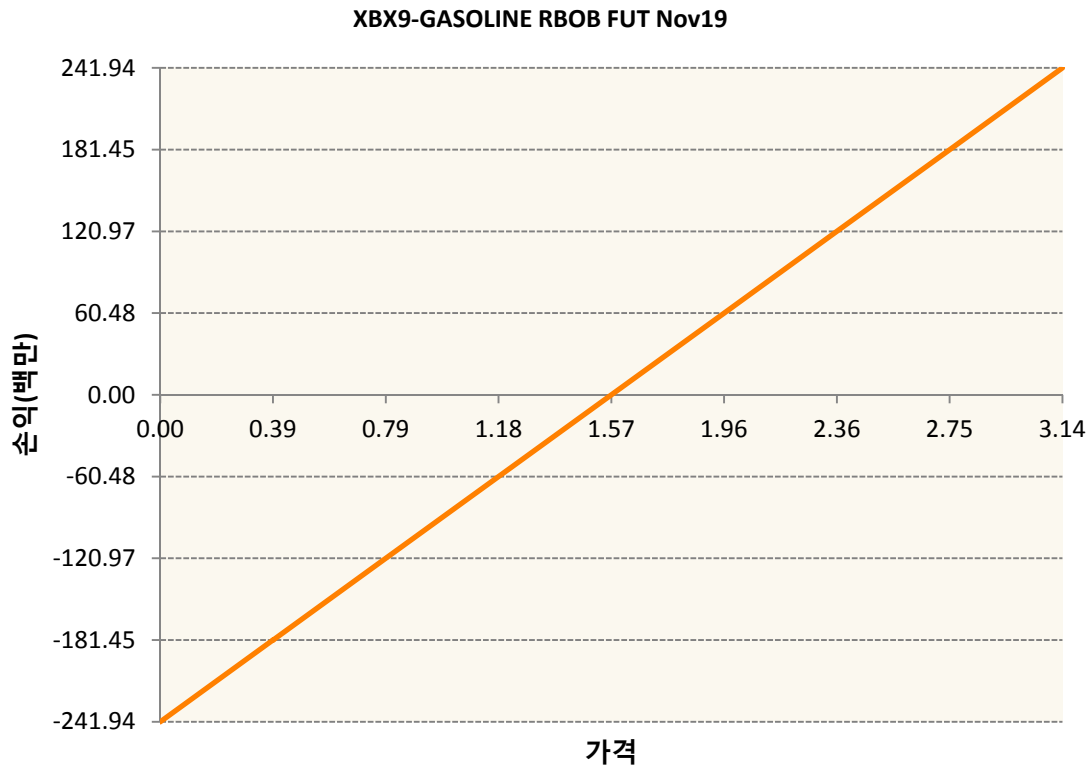


NGX19-NATURAL GAS FUTR Nov19



QSX9-Low Su Gasoil G Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX9	WTI CRUDE FUTURE Nov19	50
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	18
XBX9	GASOLINE RBOB FUT Nov19	19

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	409

공시일	2019-09-16
기준일	2019-09-11

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

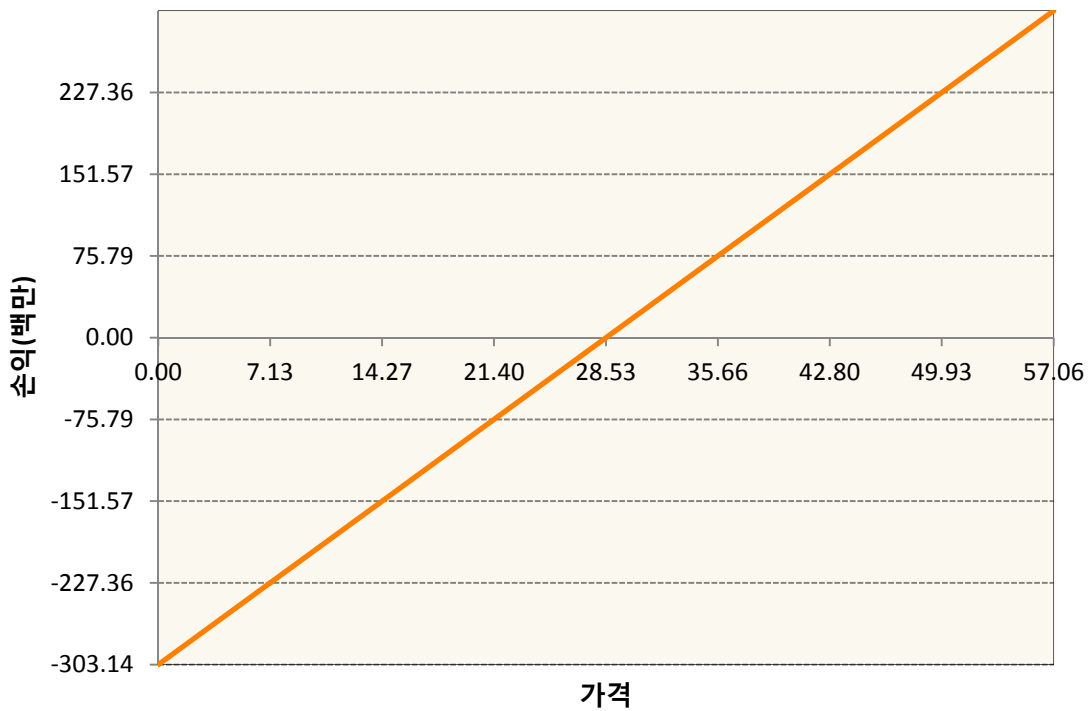
1. 계약금액

(단위:백만원)

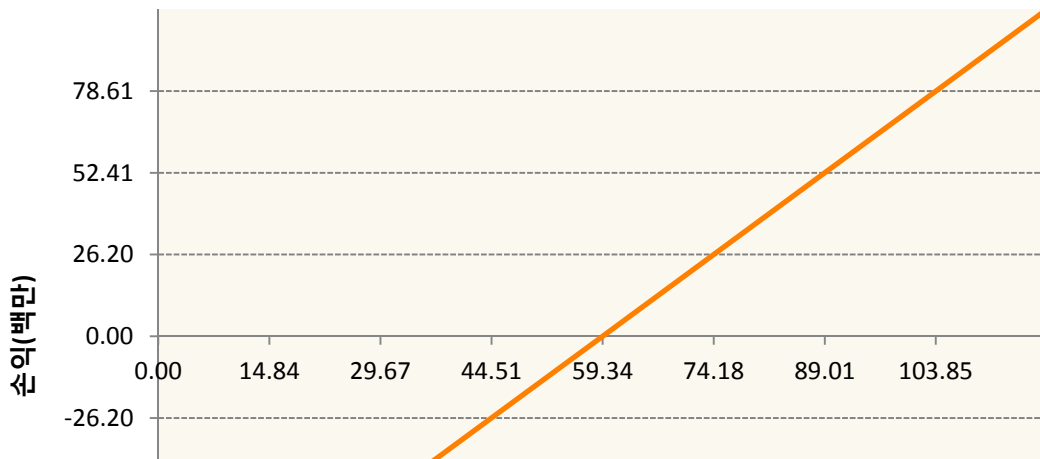
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,727	95	2,632	

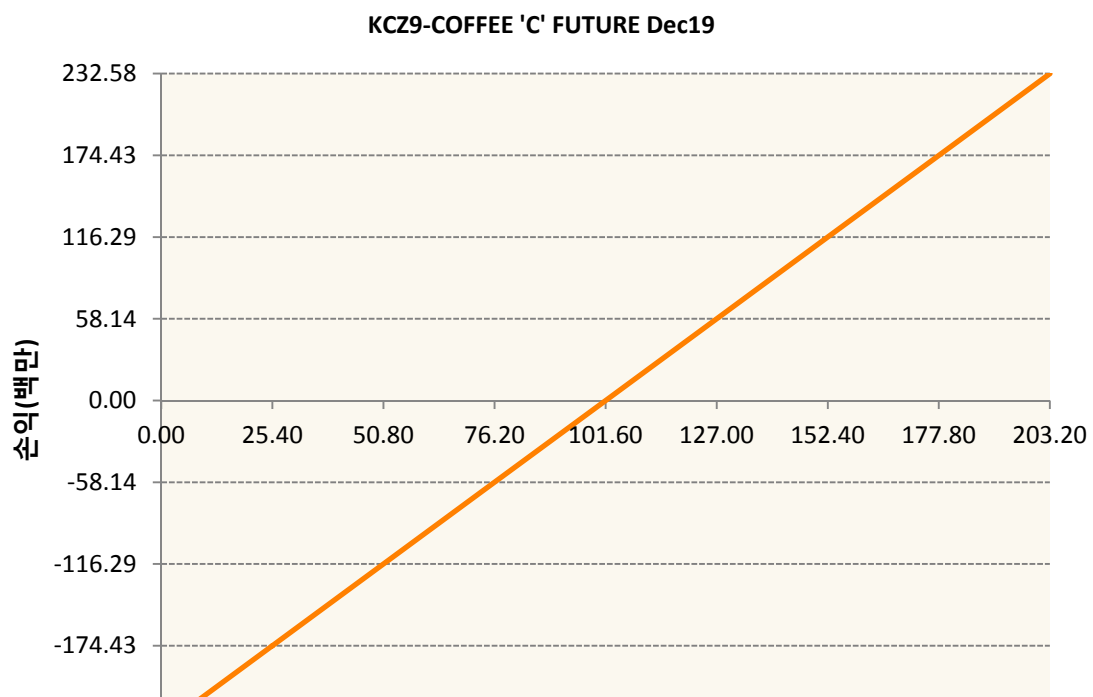
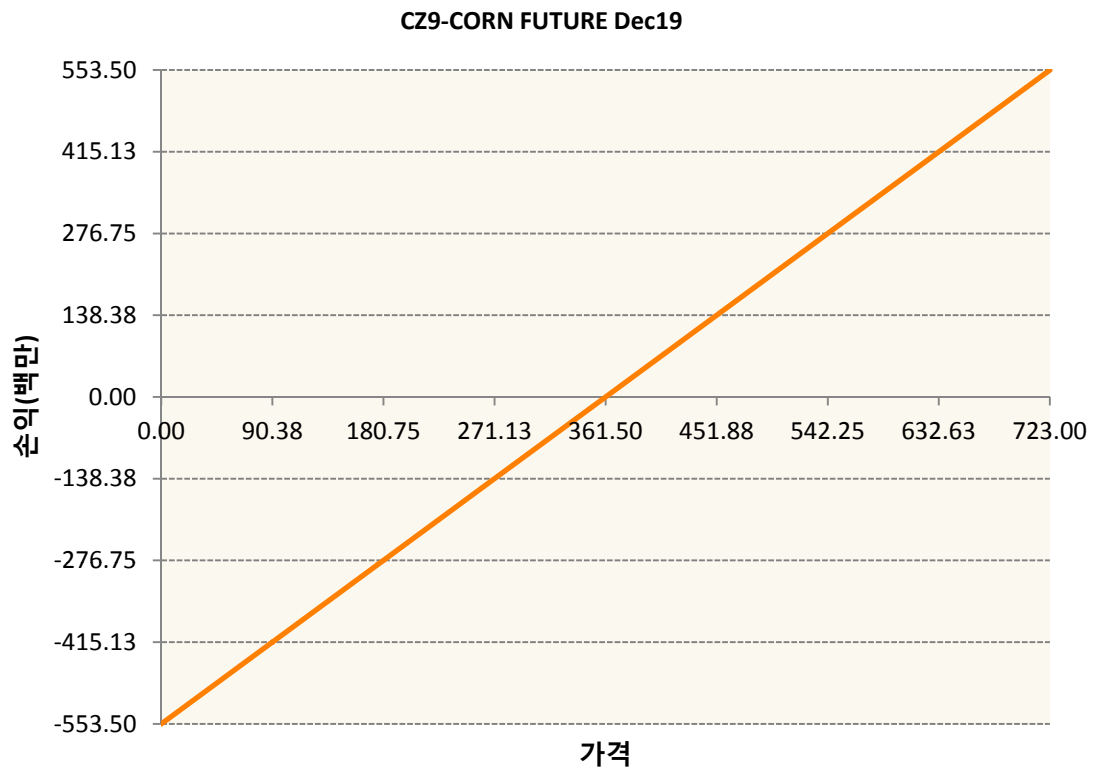
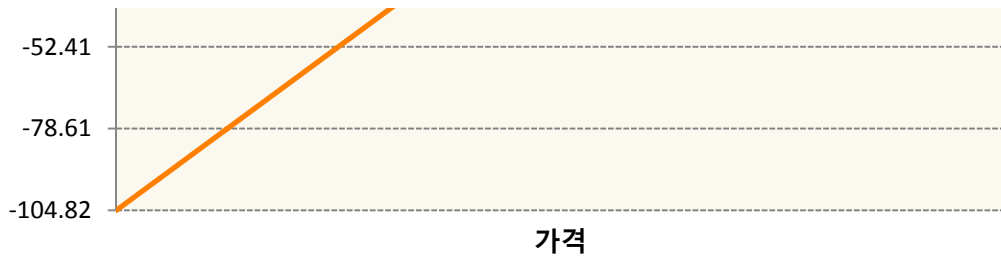
2. 만기시점의 손익구조

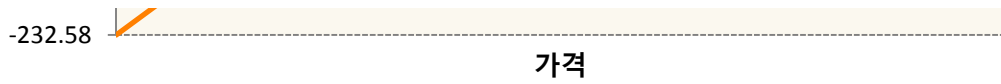
BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19



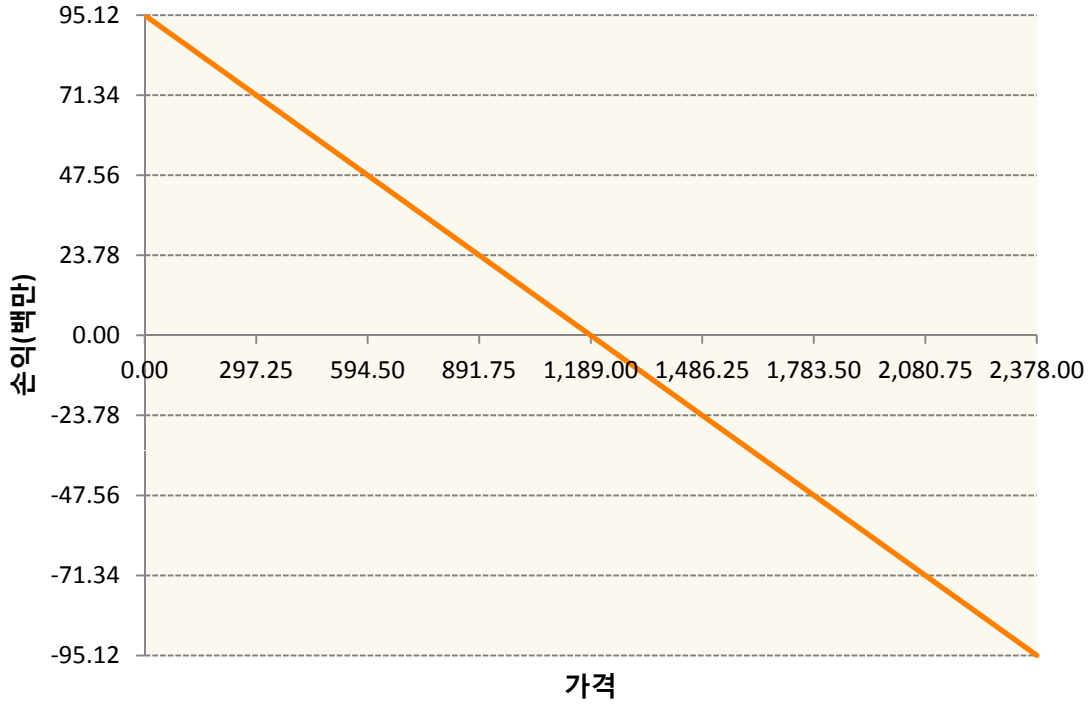
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



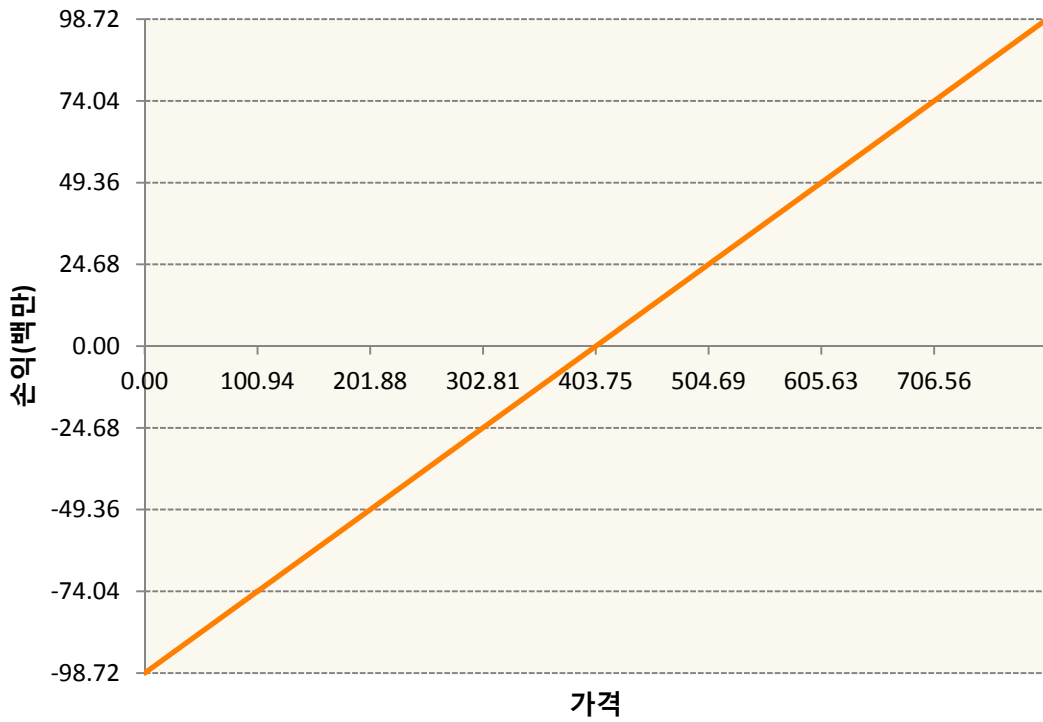




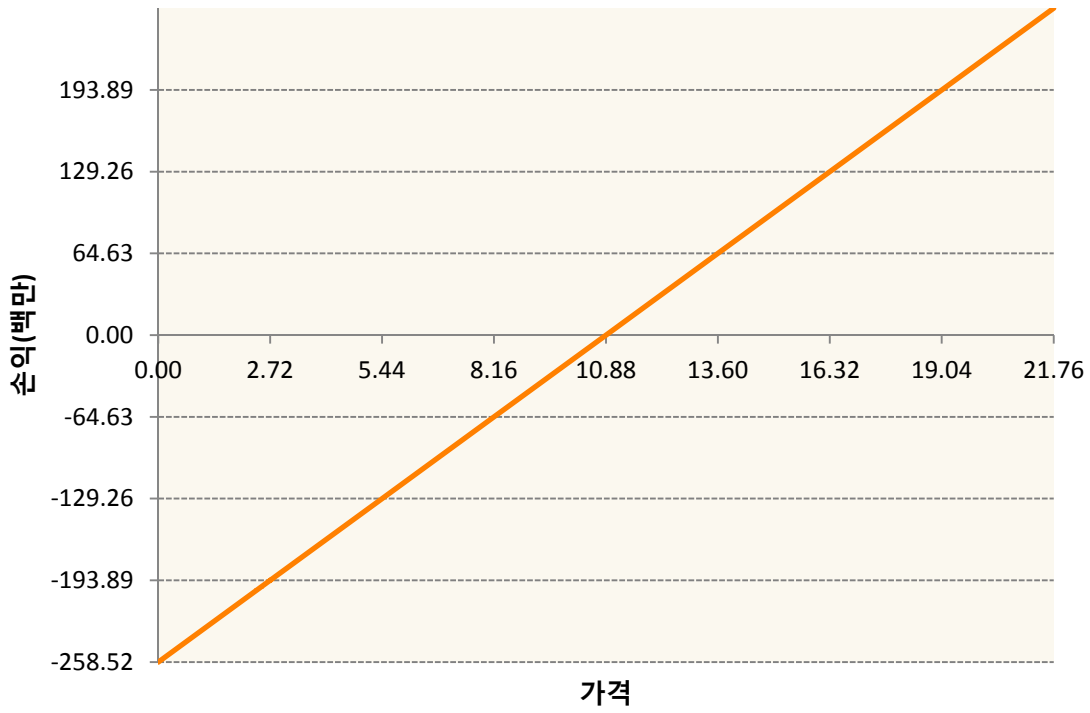
KR4175PA0005-2019-10 달러선물



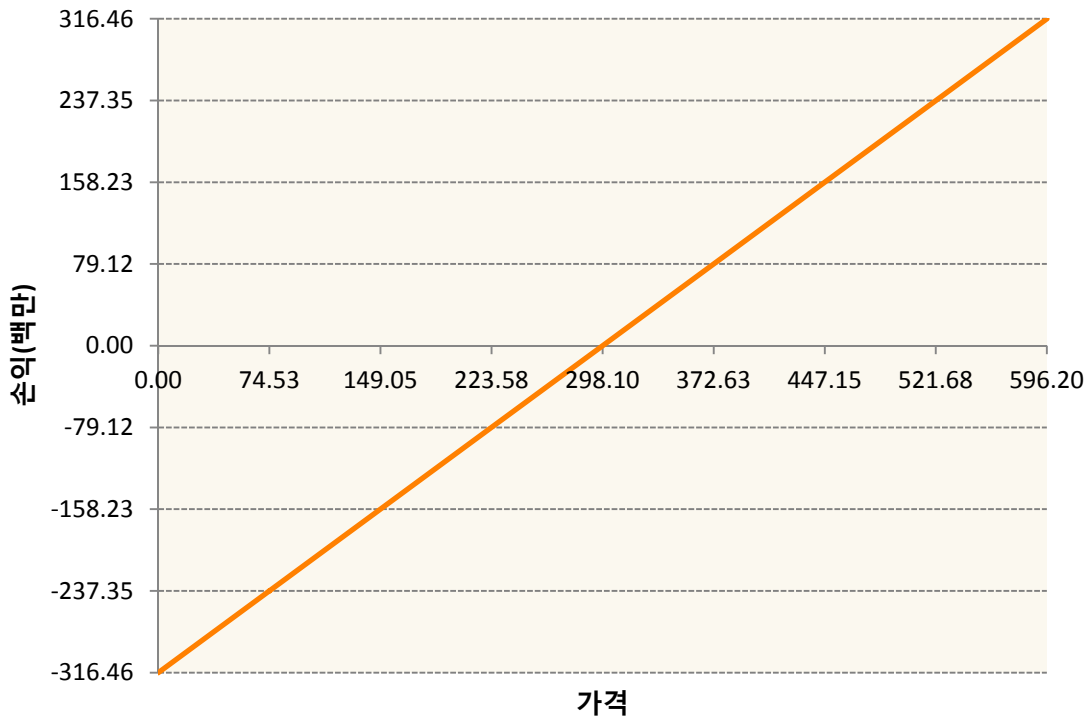
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

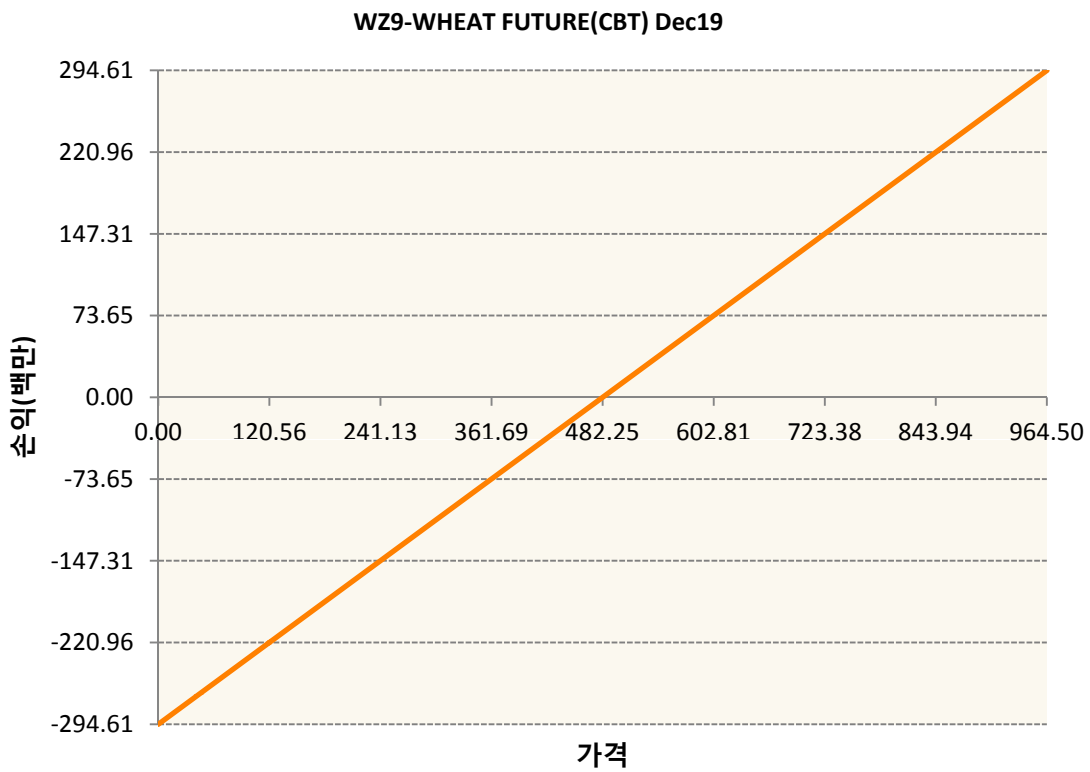
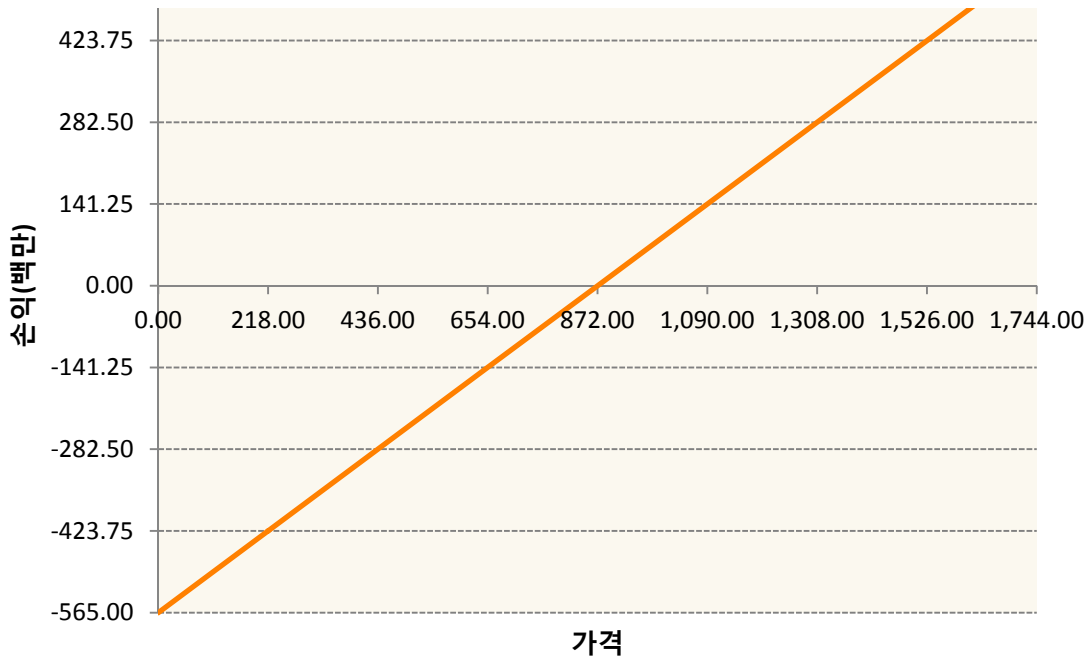


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	24
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	8
CZ9	CORN FUTURE Dec19	44
KCZ9	COFFEE 'C' FUTURE Dec19	19
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	45
WZ9	WHEAT FUTURE(CBT) Dec19	24

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

(단위:백만원)

240