

공시일	2019-09-17
기준일	2019-09-16

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)

94

공시일	2019-09-17
기준일	2019-09-16

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

1,185

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

679

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-17
기준일	2019-09-16

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)	399
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	146

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

867

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-17
기준일	2019-09-16

유로인덱스모(주식-파생형)

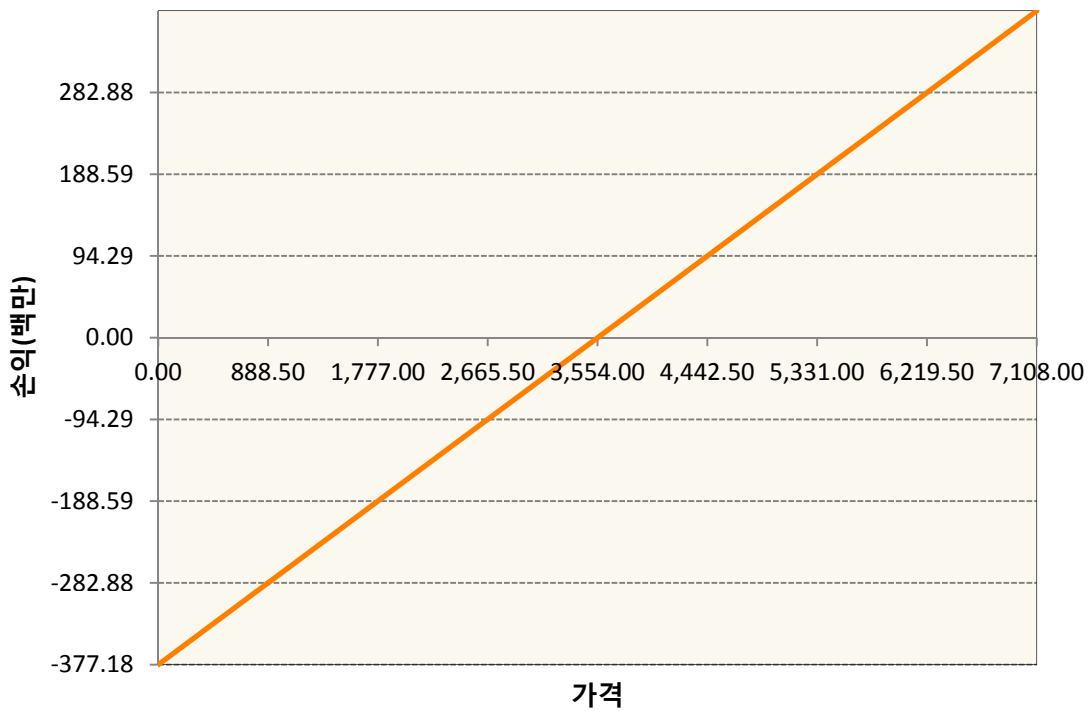
1. 계약금액

(단위:백만원)

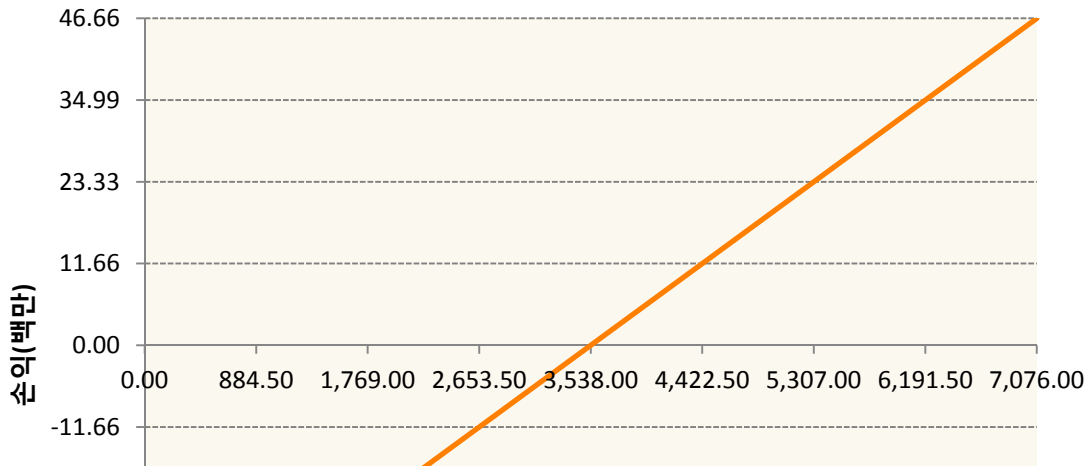
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	424	0	424	

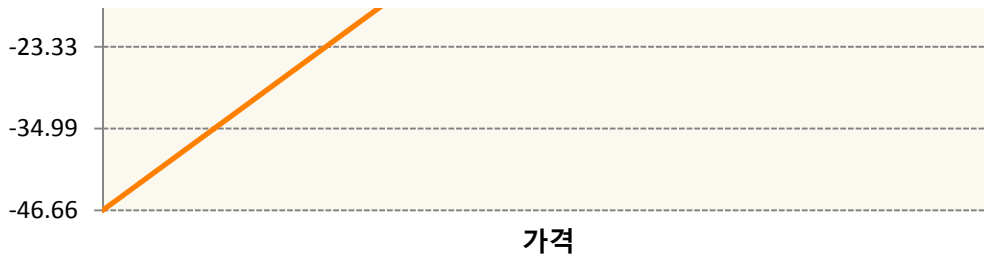
2. 만기시점의 손익구조

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	2019-09-17
기준일	2019-09-16

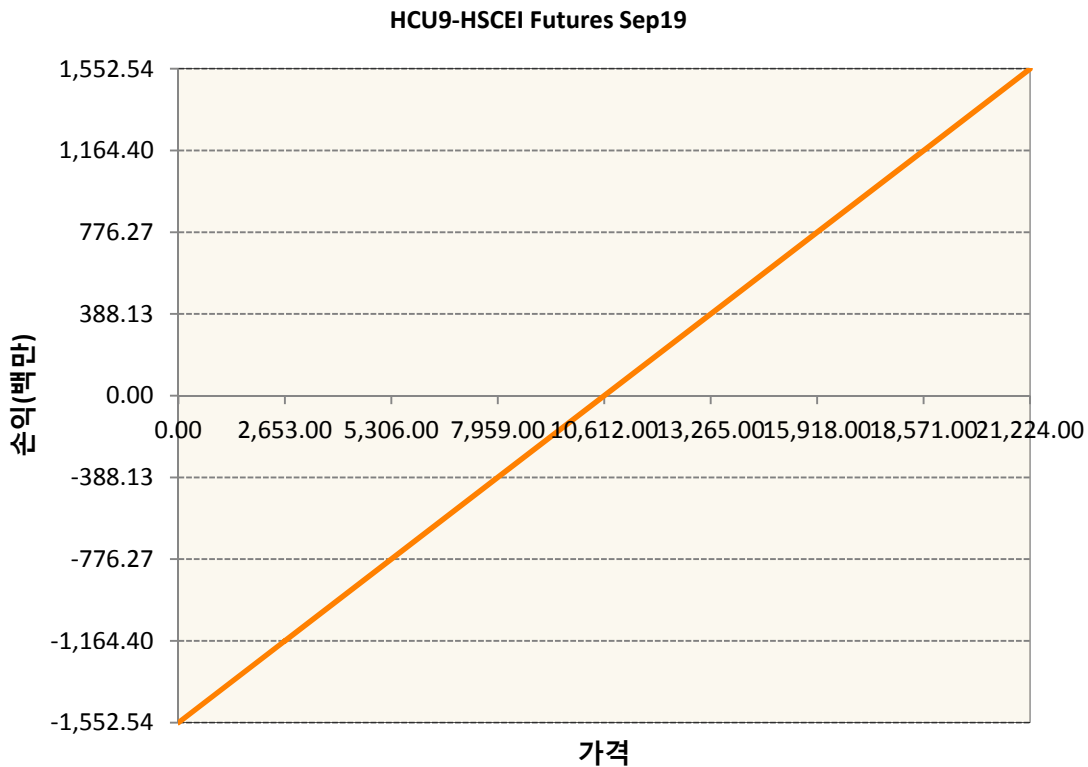
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,553	0	1,553	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	2019-09-17
기준일	2019-09-16

커버드콜모(주식혼합-파생형)

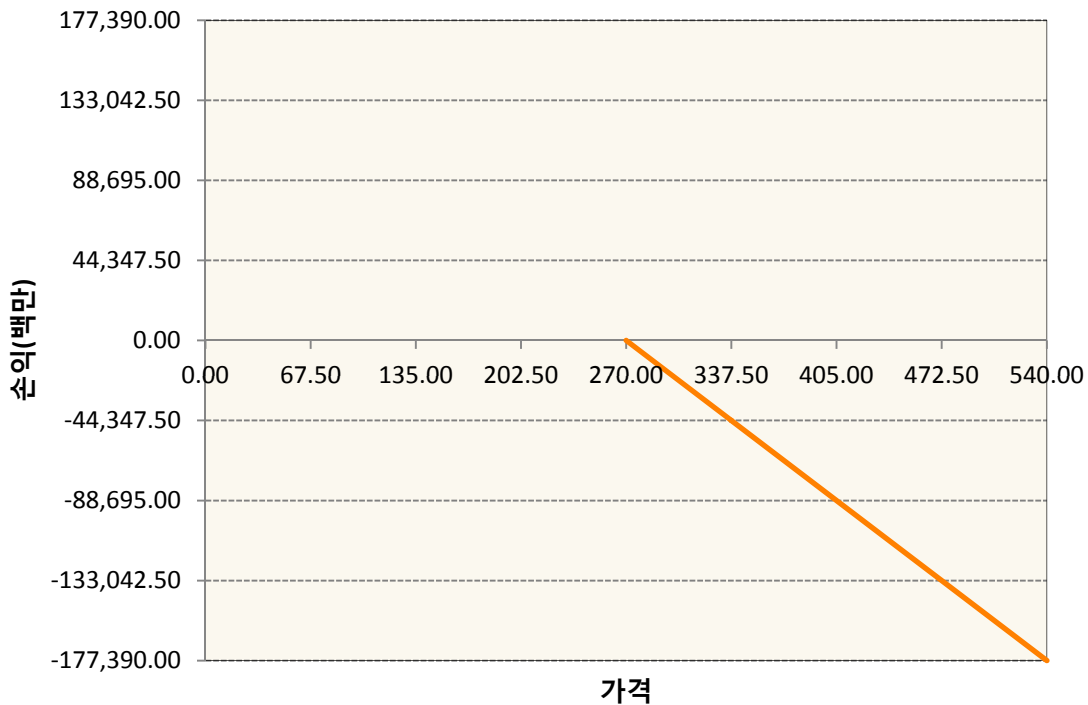
1. 계약금액

(단위:백만원)

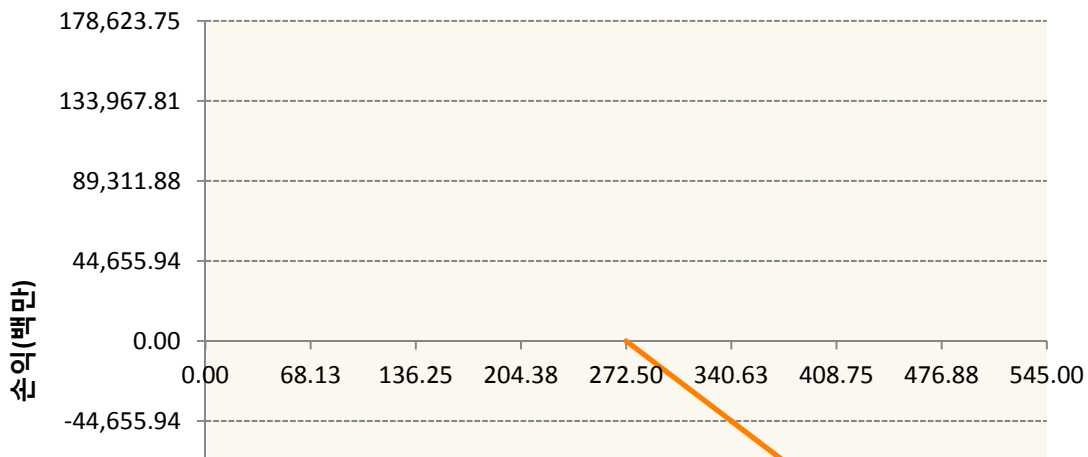
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	346,271	-346,271	장내
누계	유가증권	옵션	0	524,764	-524,764	장내

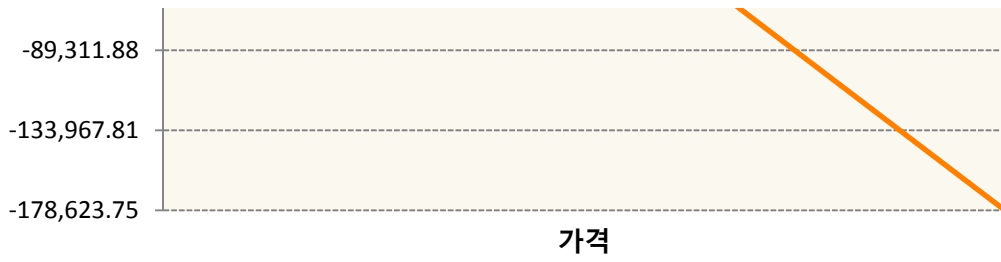
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PA2702-2019-10 콜270

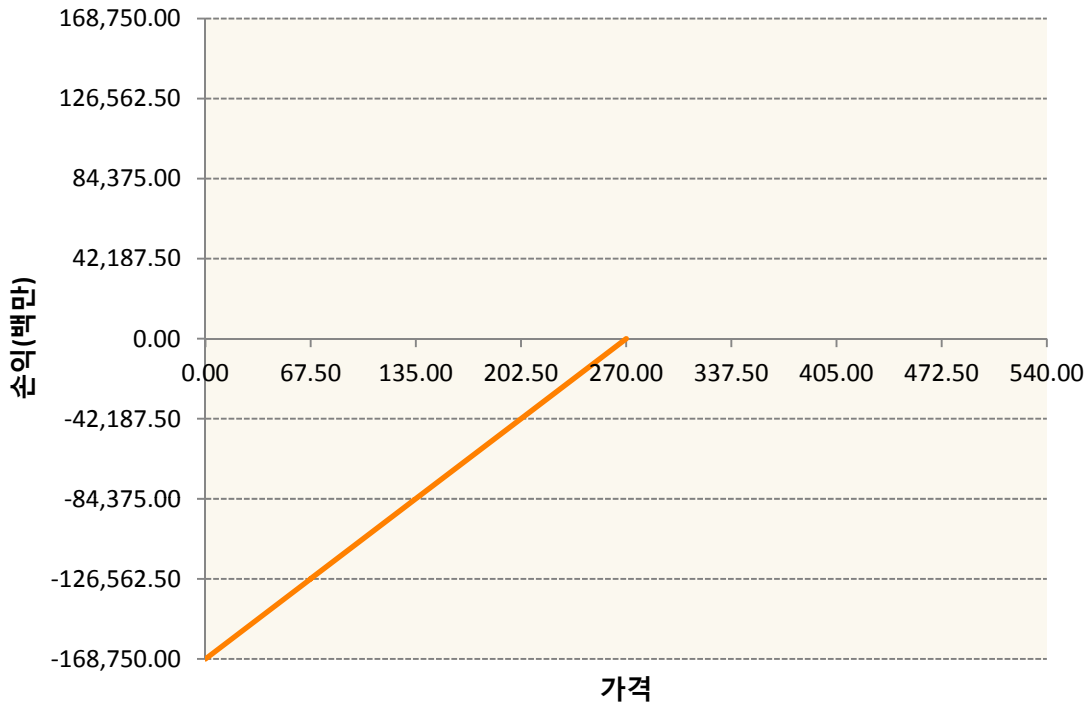


KR4201PA2728-2019-10 콜272.5





KR4301PA2701-2019-10 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PA2702		2019-10 콜270					11,364
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,220	5,077	4,905	4,709	4,491	4,254	4,001
-5.33%	4,646	4,380	4,094	3,793	3,479	3,154	2,822
-2.67%	3,389	3,016	2,639	2,258	1,874	1,489	1,101
0%	1,208	806	403	0	-403	-807	-1,210
2.67%	-1,926	-2,267	-2,620	-2,982	-3,350	-3,725	-4,104
5.33%	-5,820	-6,052	-6,309	-6,588	-6,885	-7,196	-7,519
8.00%	-10,192	-10,320	-10,479	-10,666	-10,878	-11,111	-11,364
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5					10,827
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,481	4,370	4,230	4,064	3,876	3,666	3,439

-5.33%	4,059	3,833	3,583	3,314	3,027	2,728	2,417
-2.67%	3,065	2,719	2,364	2,002	1,635	1,263	887
0%	1,217	811	406	0	-406	-811	-1,217
2.67%	-1,591	-1,965	-2,345	-2,730	-3,119	-3,511	-3,906
5.33%	-5,236	-5,511	-5,807	-6,121	-6,449	-6,788	-7,137
8.00%	-9,455	-9,619	-9,814	-10,036	-10,281	-10,546	-10,827
KR4301PA2701 2019-10 풋270							10,633
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10,488	-10,494	-10,506	-10,525	-10,552	-10,588	-10,633
-5.33%	-6,033	-6,085	-6,151	-6,231	-6,323	-6,425	-6,538
-2.67%	-2,052	-2,212	-2,380	-2,553	-2,731	-2,912	-3,096
0%	608	406	204	0	-204	-409	-614
2.67%	1,692	1,582	1,458	1,322	1,177	1,024	865
5.33%	1,932	1,904	1,863	1,809	1,743	1,665	1,576
8.00%	1,959	1,956	1,948	1,935	1,915	1,887	1,850

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

(단위:백만원)

32,807

공시일	2019-09-17
기준일	2019-09-16

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

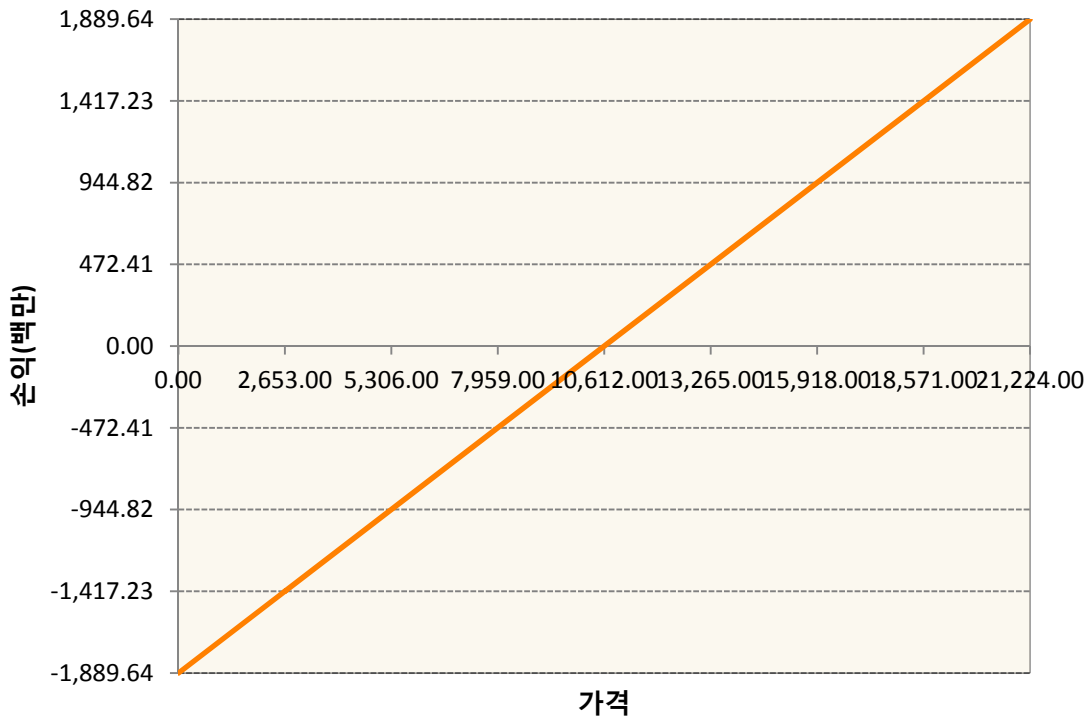
1. 계약금액

(단위:백만원)

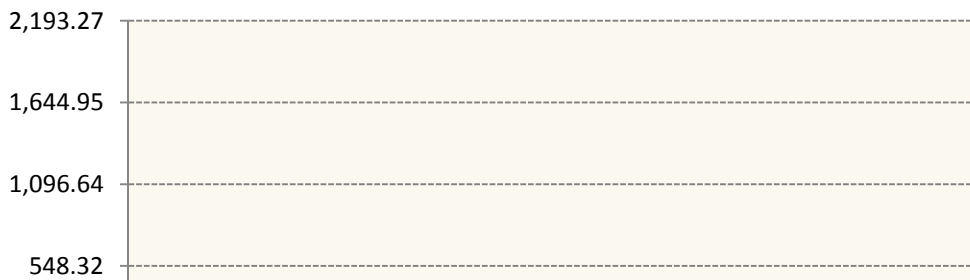
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,890	0	1,890	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,762	-4,762	장내
누계	통화	선도	681	2,810	-2,130	장외

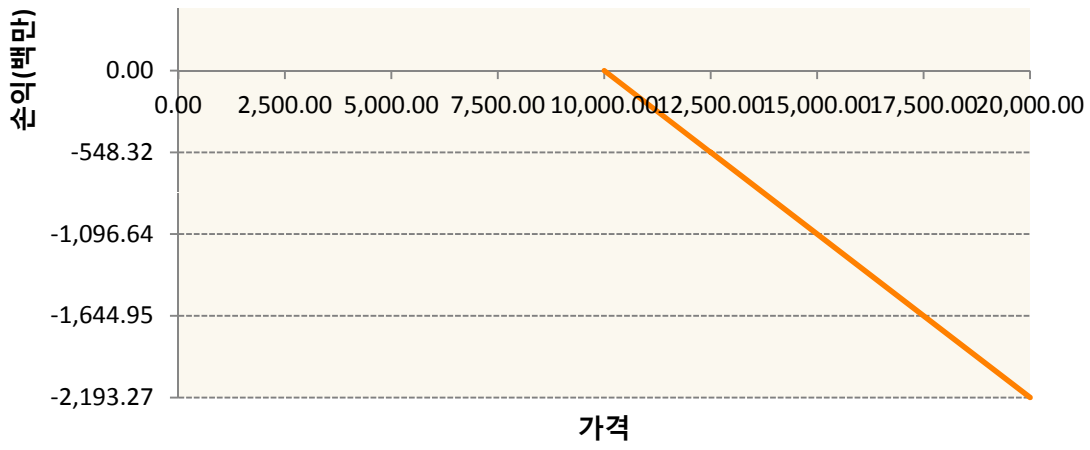
2. 만기시점의 손익구조

HCU9-HSCEI Futures Sep19

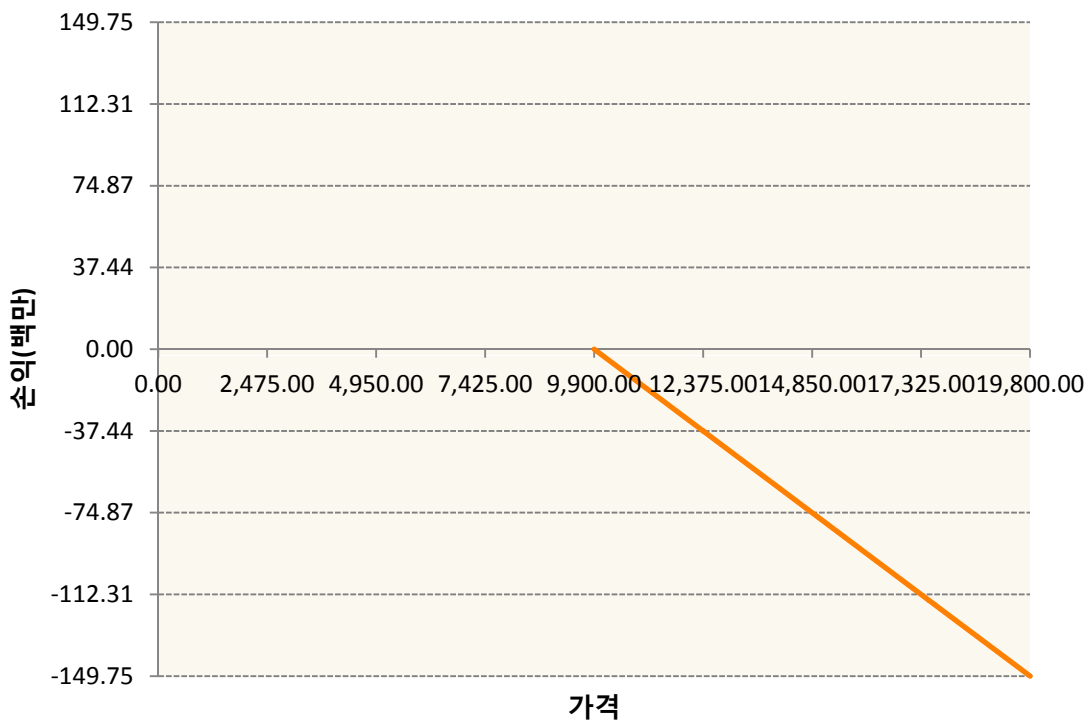


OHHIU9-C100-HSCEI

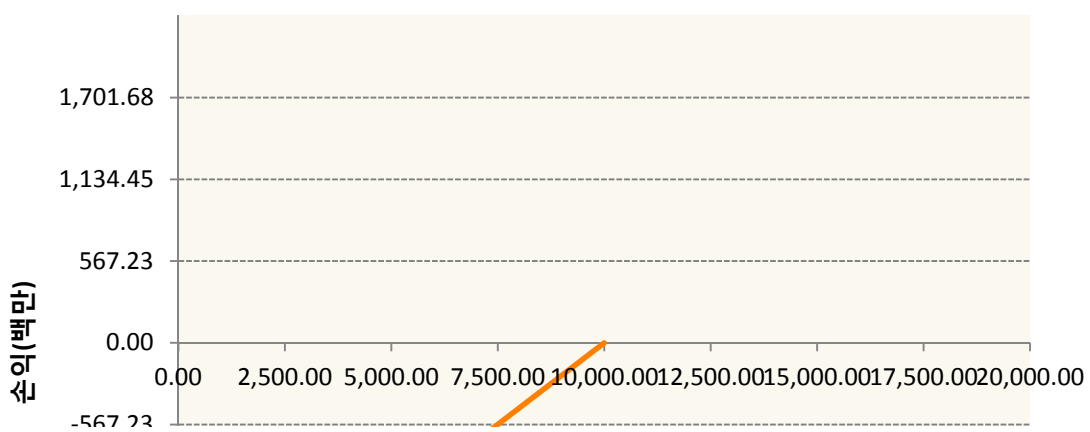


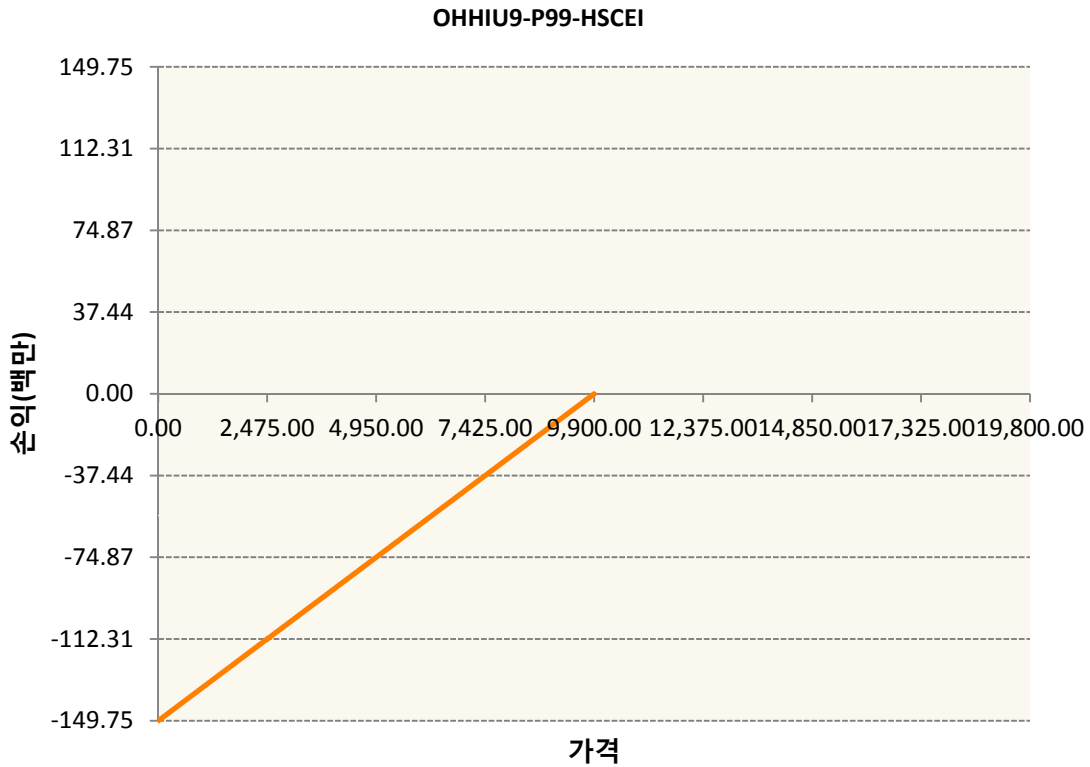


OHHIU9-C99-HSCEI



OHHIU9-P100-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	225
FX21019U00 HKD/KRW 22-11-19E	6
FX21019U02 HKD/KRW 22-11-19E	48
HCU9 HSCEI Futures Sep19	151
OHHIU9-C1(HSCEI	175
OHHIU9-C9(HSCEI	12
OHHIU9-P1(HSCEI	182
OHHIU9-P9(HSCEI	12

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

공시일	2019-09-17
기준일	2019-09-16

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

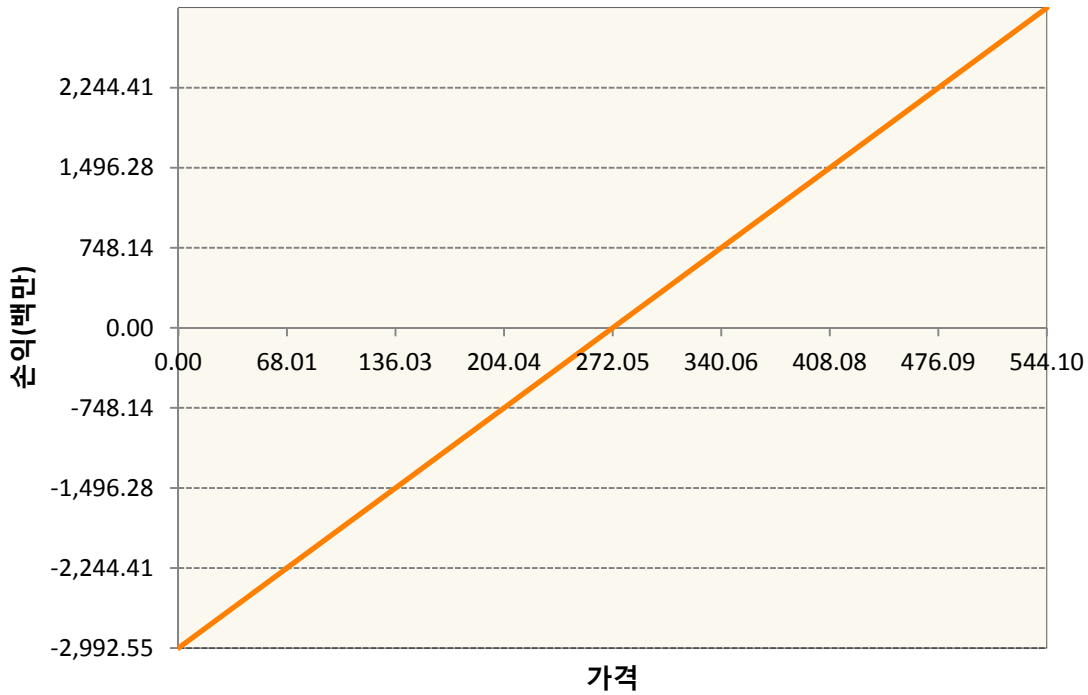
1. 계약금액

(단위:백만원)

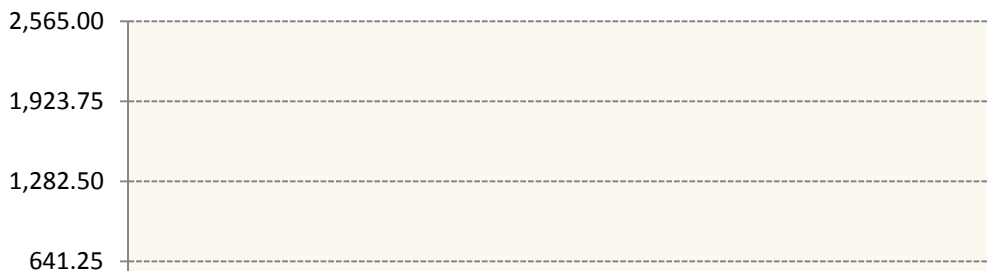
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	15,218	-15,218	장내
누계	유가증권	선물	2,993	0	2,993	장내
누계	유가증권	스왑	14,125	0	14,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,032	-15,032	장내

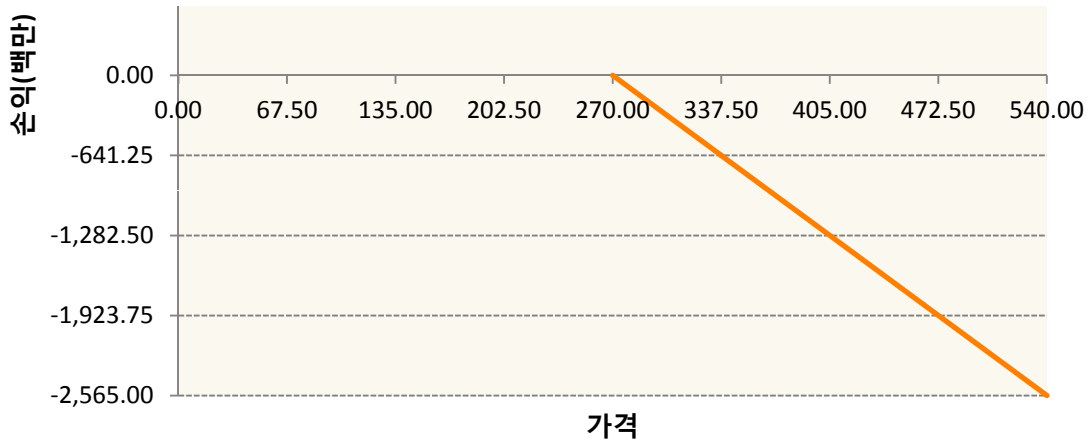
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

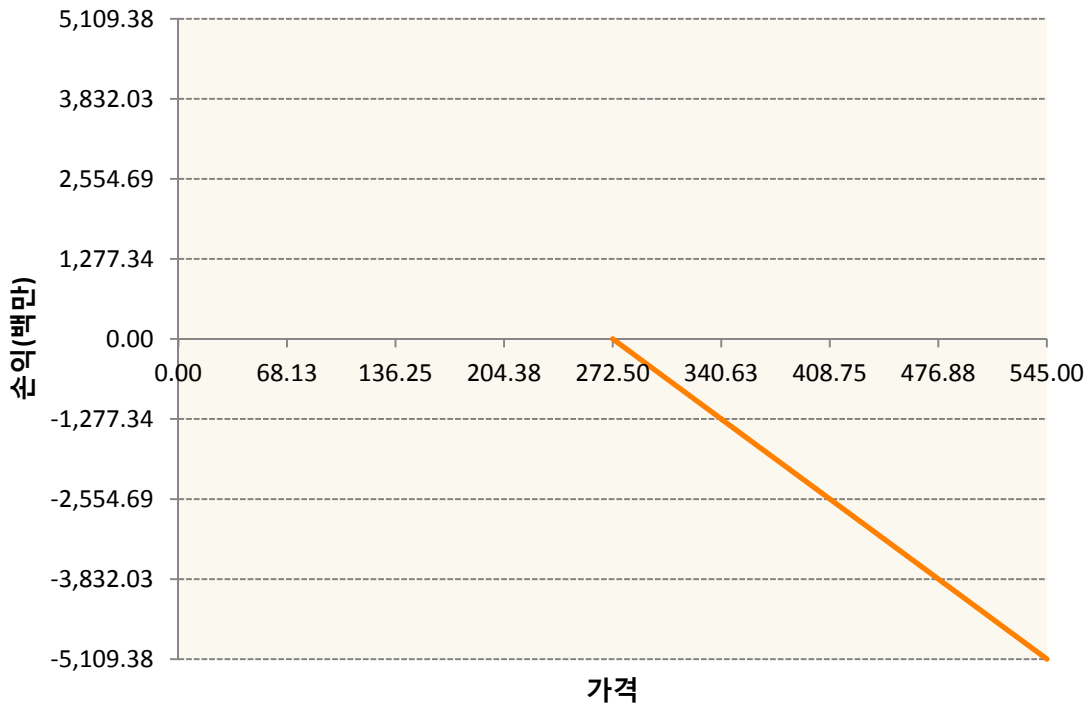


KR4201PA2702-2019-10 콜270

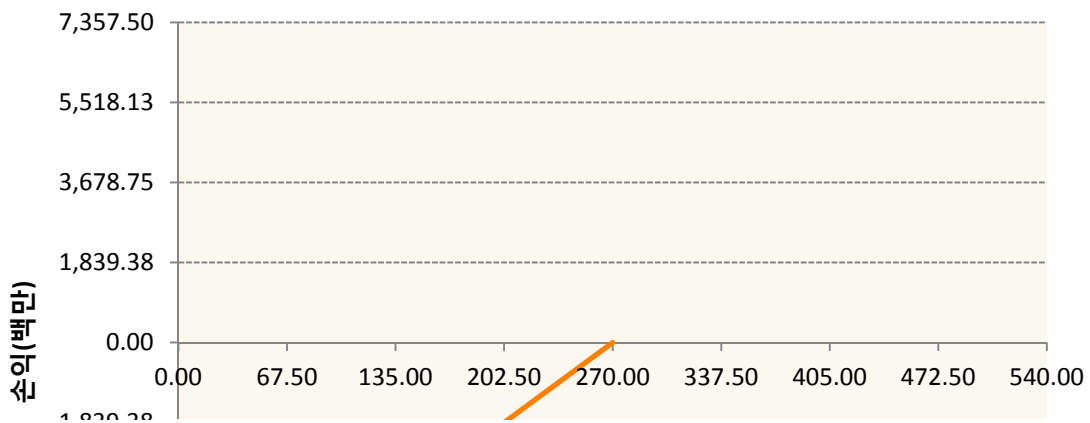


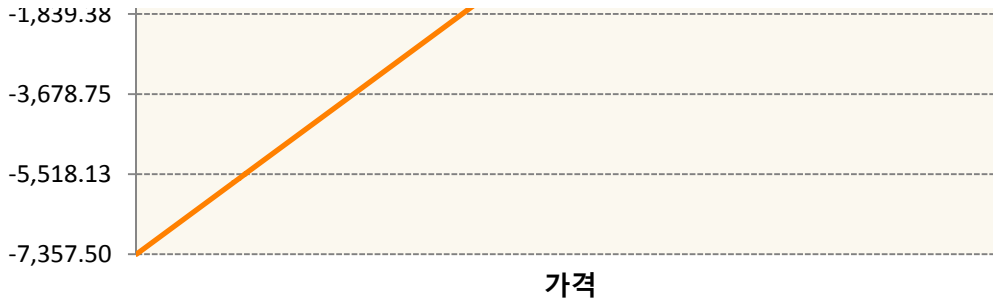


KR4201PA2728-2019-10 콜272.5



KR4301PA2701-2019-10 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						1,218
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,218	-1,218	-1,218	-1,218	-1,218	-1,218	-1,218	
-5.33%	-812	-812	-812	-812	-812	-812	-812	
-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%	812	812	812	812	812	812	812	
8.00%	1,218	1,218	1,218	1,218	1,218	1,218	1,218	
KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						239
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-239	-239	-239	-239	-239	-239	-239	
-5.33%	-160	-160	-160	-160	-160	-160	-160	
-2.67%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	80	80	80	80	80	80	80	
5.33%	160	160	160	160	160	160	160	
8.00%	239	239	239	239	239	239	239	
KR4201PA2702		2019-10 콜270						164
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	75	73	71	68	65	62	58	
-5.33%	67	63	59	55	50	46	41	
-2.67%	49	44	38	33	27	22	16	
0%	17	12	6	0	-6	-12	-18	
2.67%	-28	-33	-38	-43	-48	-54	-59	
5.33%	-84	-88	-91	-95	-100	-104	-109	
8.00%	-147	-149	-152	-154	-157	-161	-164	
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5						310
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	128	125	121	116	111	105	98
-5.33%	116	110	102	95	87	78	69
-2.67%	88	78	68	57	47	36	25
0%	35	23	12	0	-12	-23	-35
2.67%	-46	-56	-67	-78	-89	-100	-112
5.33%	-150	-158	-166	-175	-184	-194	-204
8.00%	-270	-275	-281	-287	-294	-302	-310
KR4301PA2701 2019-10 풋270							464
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-457	-458	-458	-459	-460	-462	-464
-5.33%	-263	-265	-268	-272	-276	-280	-285
-2.67%	-89	-96	-104	-111	-119	-127	-135
0%	27	18	9	0	-9	-18	-27
2.67%	74	69	64	58	51	45	38
5.33%	84	83	81	79	76	73	69
8.00%	85	85	85	84	83	82	81

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

(단위:백만원)

2,376

공시일	2019-09-17
기준일	2019-09-16

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

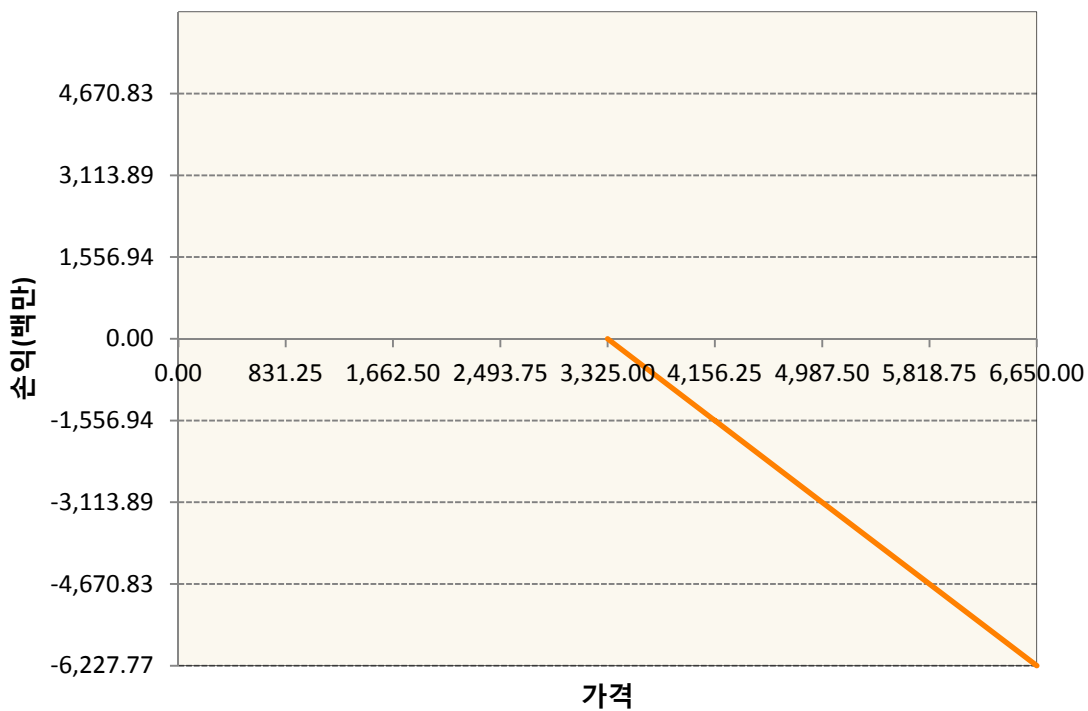
1. 계약금액

(단위:백만원)

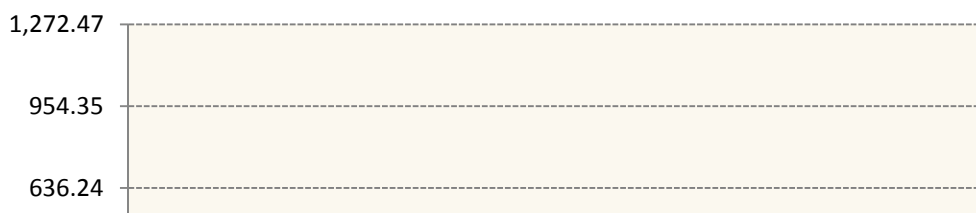
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,215	0	5,215	
누계	유가증권	스왑	23,834	0	23,834	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,000	-15,000	장내
누계	통화	선도	10,871	17,028	-6,156	장외

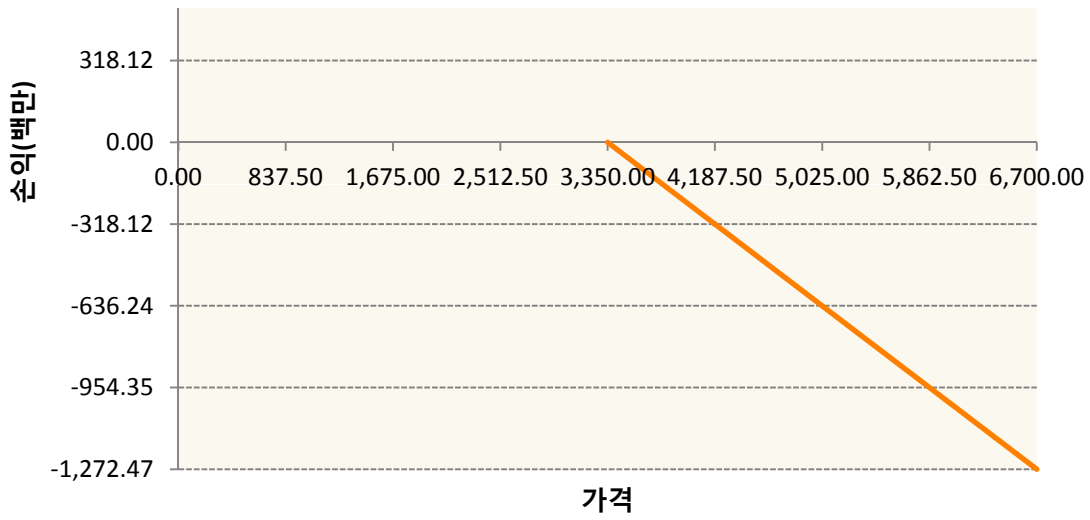
2. 만기시점의 손익구조

OESXU9-C3325-EURO STOXX 50

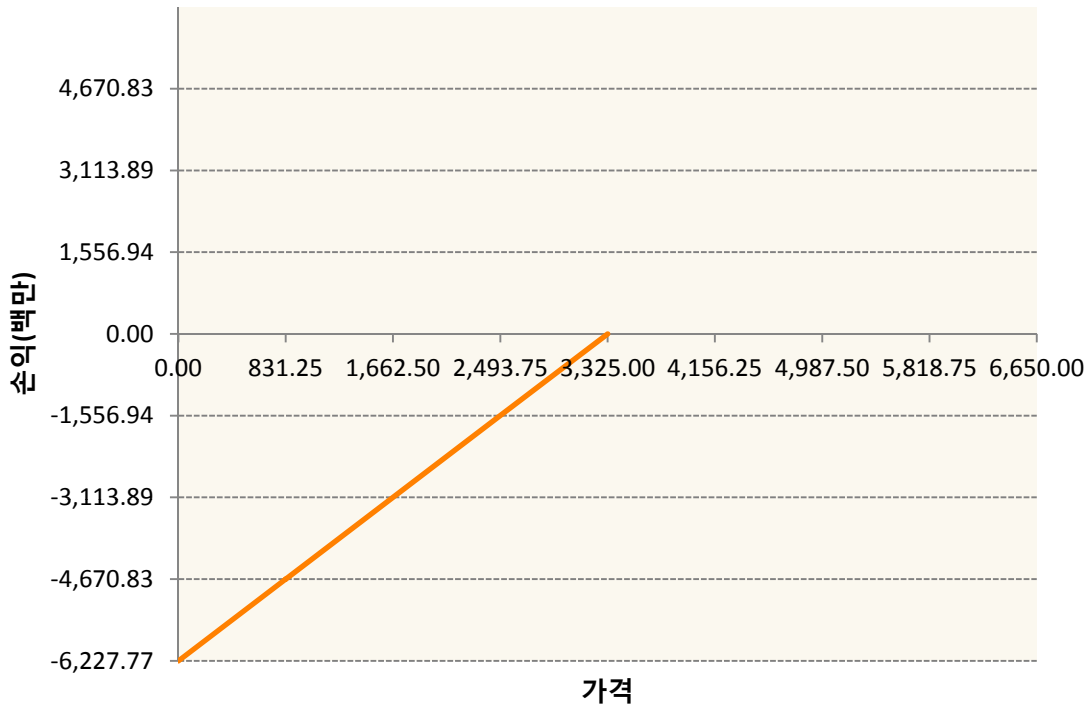


OESXU9-C3350-EURO STOXX 50

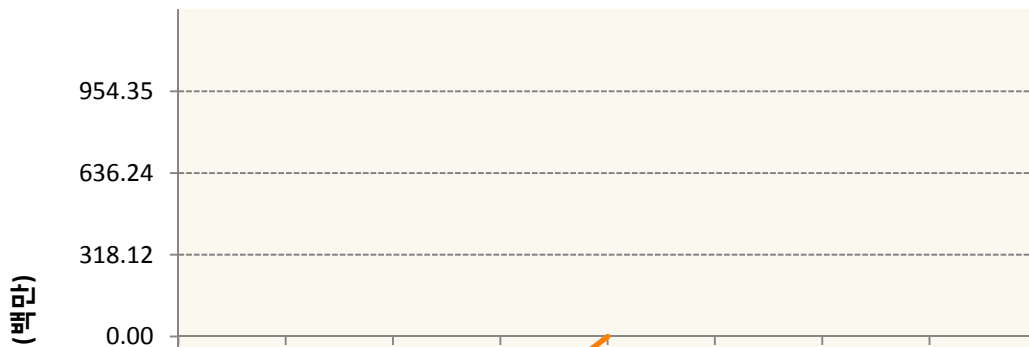


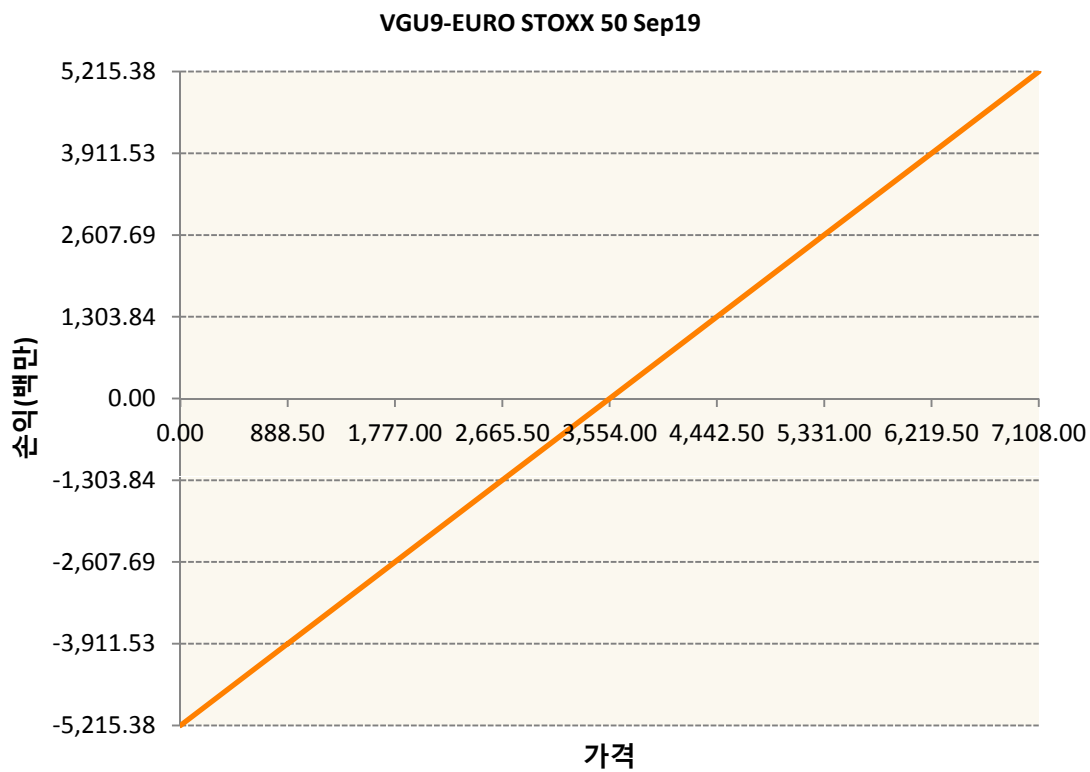
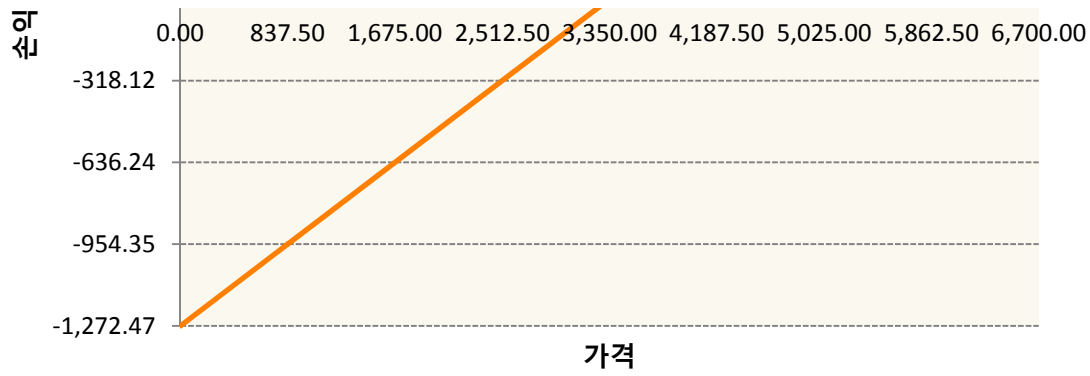


OESXU9-P3325-EURO STOXX 50



OESXU9-P3350-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	18
FX21019M0< KRW/EUR 27-09-19E	1,048
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	314
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E	314
FX21019N04 EUR/KRW 27-09-19E	231
FX21019Q00 EUR/KRW 27-09-19E	168
FX21019U02 EUR/KRW 27-09-19E	157
OESXU9-C3< EURO STOXX 50	498
OESXU9-C3< EURO STOXX 50	102
OESXU9-P3< EURO STOXX 50	498
OESXU9-P3< EURO STOXX 50	102

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

(단위:백만원)

2,194

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

(단위:백만원)

985

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

(단위:백만원)

84

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

(단위:백만원)

131

공시일	2019-09-17
기준일	2019-09-16

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

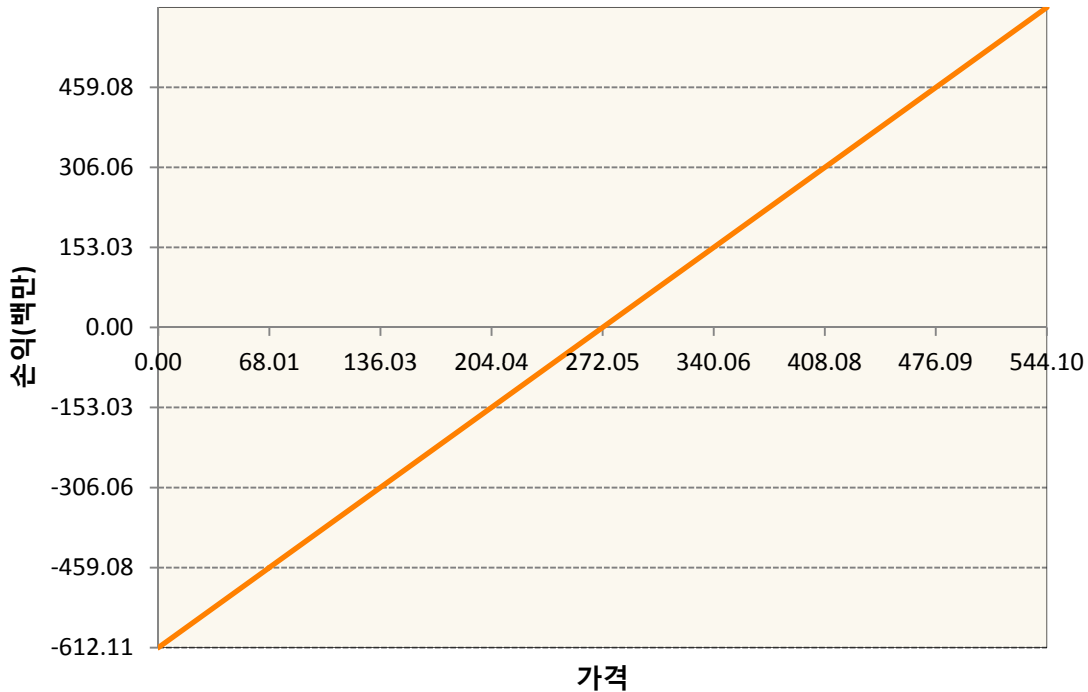
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	612	0	612	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						49
기초자산의 변동성								
가격	-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	2019-09-17
기준일	2019-09-16

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

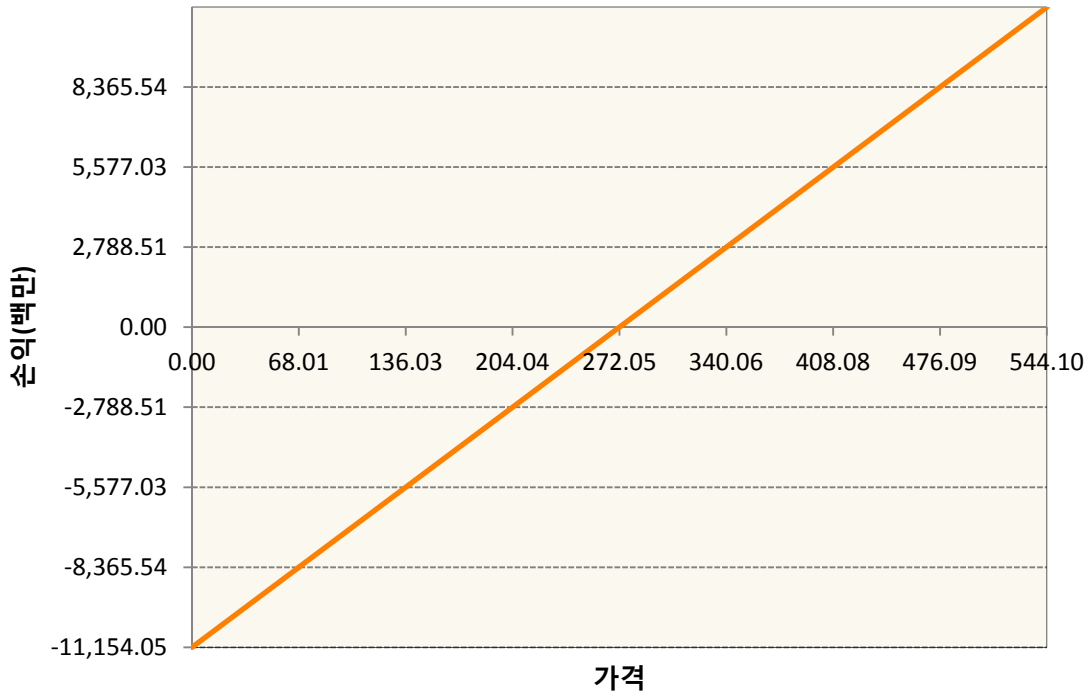
1. 계약금액

(단위:백만원)

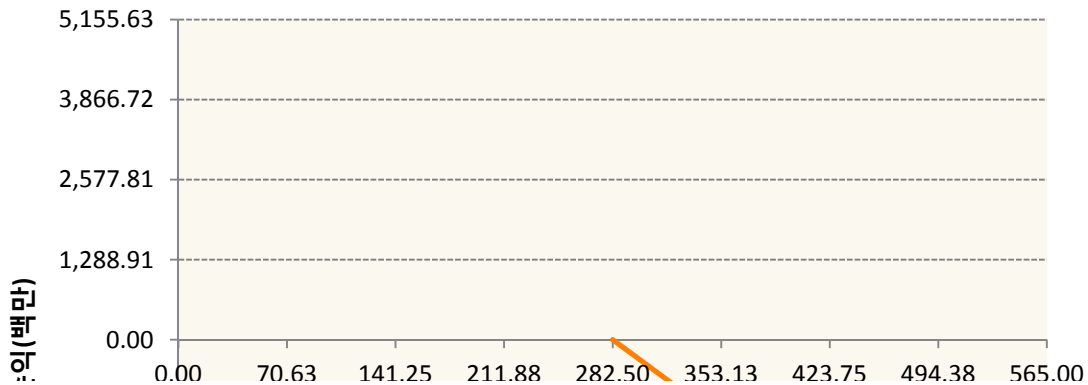
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	5,973	6,248	-275	장내
누계	유가증권	선물	11,154	0	11,154	장내
누계	유가증권	옵션	1,422	20,902	-19,480	장내

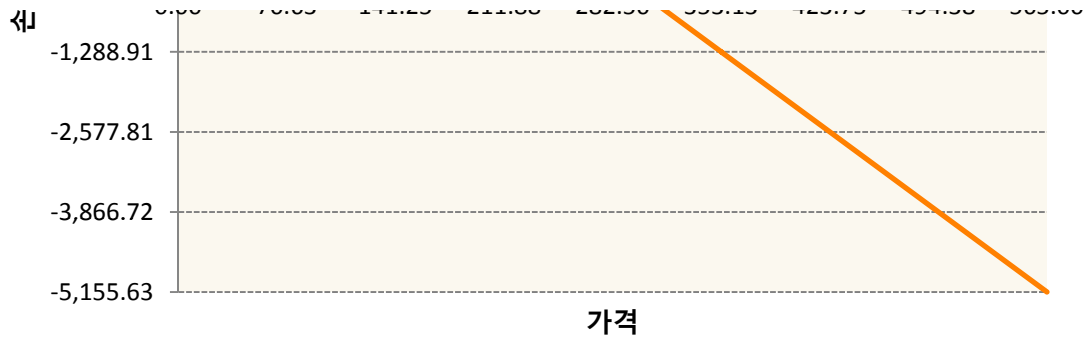
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

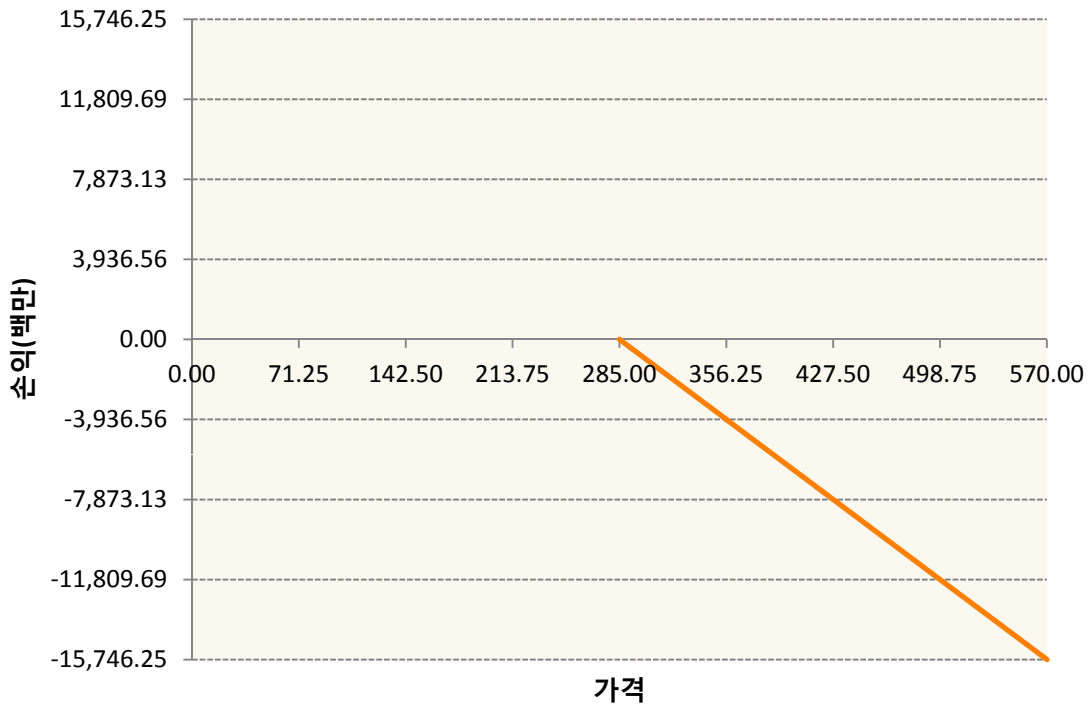


KR4201PA2827-2019-10 콜282.5

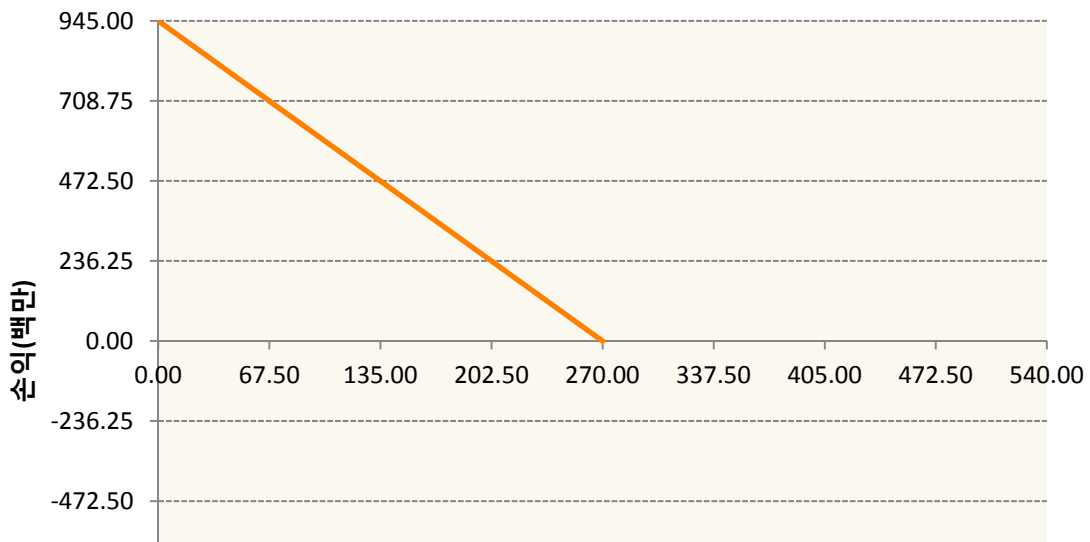


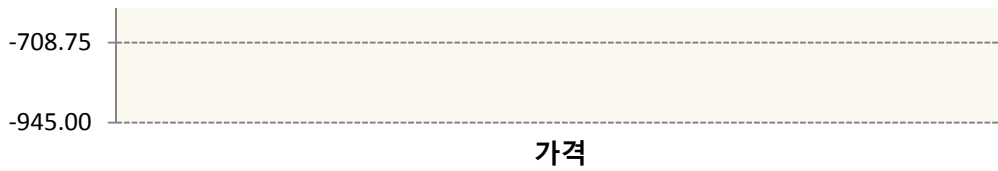


KR4201PA2850-2019-10 콜285

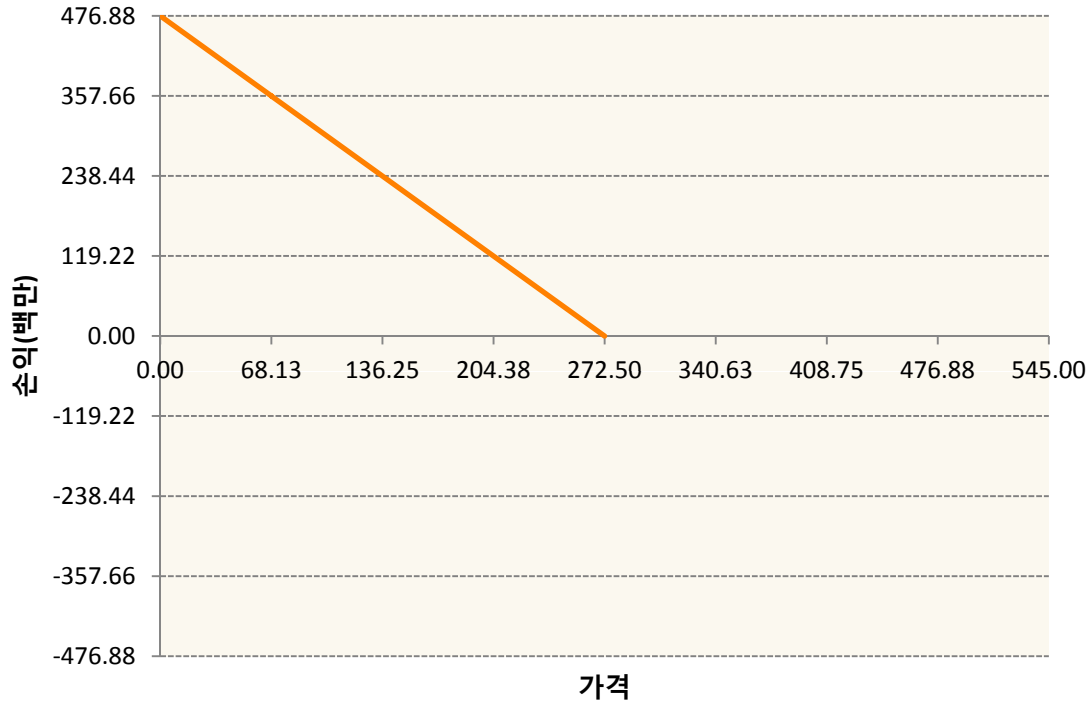


KR4301PA2701-2019-10 풋270





KR4301PA2727-2019-10 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						892
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-892	-892	-892	-892	-892	-892	-892	
-5.33%	-595	-595	-595	-595	-595	-595	-595	
-2.67%	-297	-297	-297	-297	-297	-297	-297	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	297	297	297	297	297	297	297	
5.33%	595	595	595	595	595	595	595	
8.00%	892	892	892	892	892	892	892	
KR4201PA2827		2019-10 콜282.5						236
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	61	60	59	57	54	51	48	
-5.33%	59	56	53	49	44	38	33	
-2.67%	50	44	38	31	24	16	8	

0%	28	19	10	0	-10	-20	-30
2.67%	-15	-26	-37	-49	-60	-72	-83
5.33%	-83	-94	-106	-117	-129	-140	-152
8.00%	-175	-185	-194	-204	-215	-225	-236
KR4201PA2850 2019-10 콜285							662
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	151	150	146	142	136	128	118
-5.33%	146	140	132	122	110	96	80
-2.67%	127	114	98	79	59	38	15
0%	76	53	27	0	-28	-57	-87
2.67%	-29	-62	-95	-129	-163	-197	-231
5.33%	-208	-244	-280	-316	-351	-387	-423
8.00%	-464	-495	-527	-560	-594	-627	-662
KR4301PA2701 2019-10 풋270							60
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	59	59	59	59	59	59	60
-5.33%	34	34	34	35	35	36	37
-2.67%	11	12	13	14	15	16	17
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-9	-9	-8	-7	-7	-6	-5
5.33%	-11	-11	-10	-10	-10	-9	-9
8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-10
KR4301PA2727 2019-10 풋272.5							32
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	32	32	32	32	32	32	32
-5.33%	19	19	19	19	20	20	20
-2.67%	7	8	8	8	9	9	10
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-6	-6	-5	-5	-4	-4	-3
5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-6	-6
8.00%	-8	-8	-8	-7	-7	-7	-7

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

(단위:백만원)

1,559

공시일	2019-09-17
기준일	2019-09-16

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	4,732	0	4,732	
누계	유가증권	수익증권	90,730	0	90,730	

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	2019-09-17
기준일	2019-09-16

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	6,507	0	6,507	
누계	유가증권	수익증권	115,227	0	115,227	

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	2019-09-17
기준일	2019-09-16

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	474,798	0	474,798	
누계	통화	선도	0	459,161	-459,161	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		284
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		3,123
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		2,120
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,881
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,502
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,593
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,944
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		946
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		946
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E		946
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E		1,704
FX21019Q04 KRW/USD 30-09-19E		189
FX21019Q04 KRW/USD 24-09-19E		2,082
FX21019Q04 KRW/USD 24-09-19E		2,650
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E		189
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E		284
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E		284
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E		189
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E		1,363
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E		2,025
FX21019U01 KRW/USD 10-10-19E		284
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E		189
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E		2,309
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E		1,704

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

(단위:백만원)

12,111

공시일	2019-09-17
기준일	2019-09-16

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

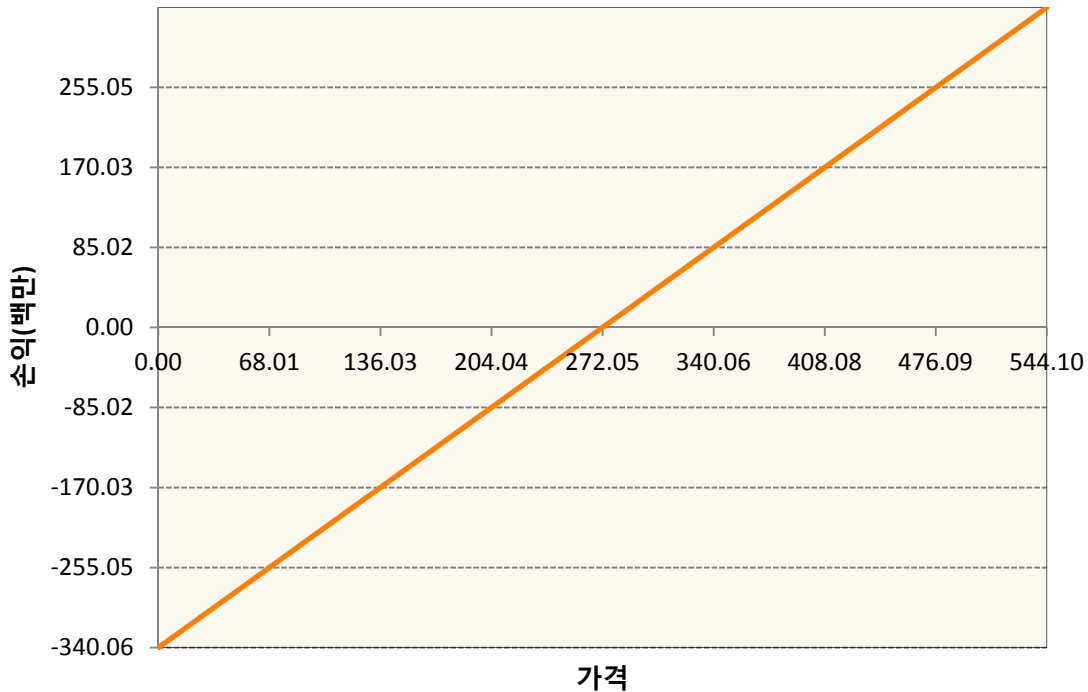
1. 계약금액

(단위:백만원)

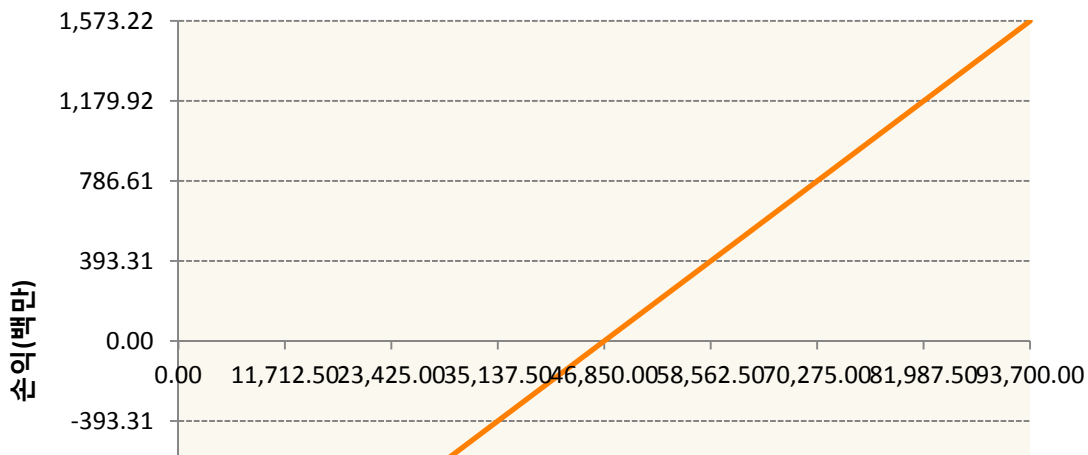
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,913	0	1,913	장내

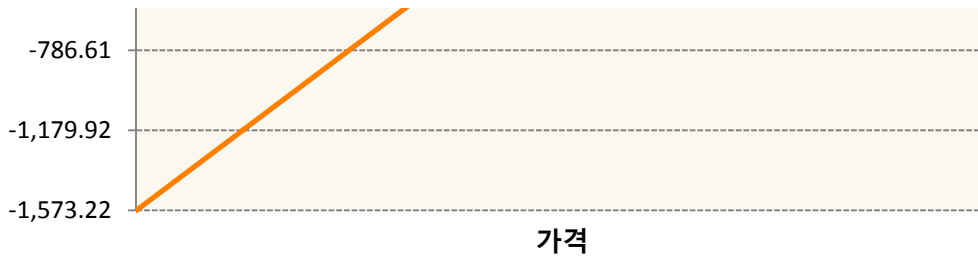
2. 만기시점의 손익구조

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)

181

공시일	2019-09-17
기준일	2019-09-16

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

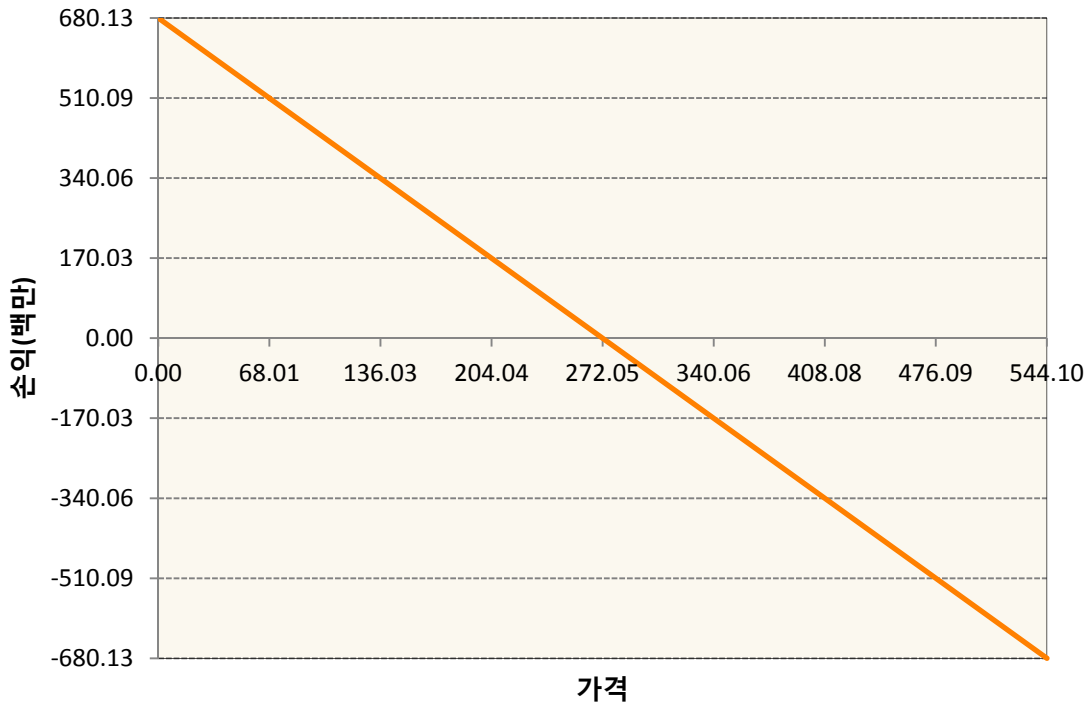
1. 계약금액

(단위:백만원)

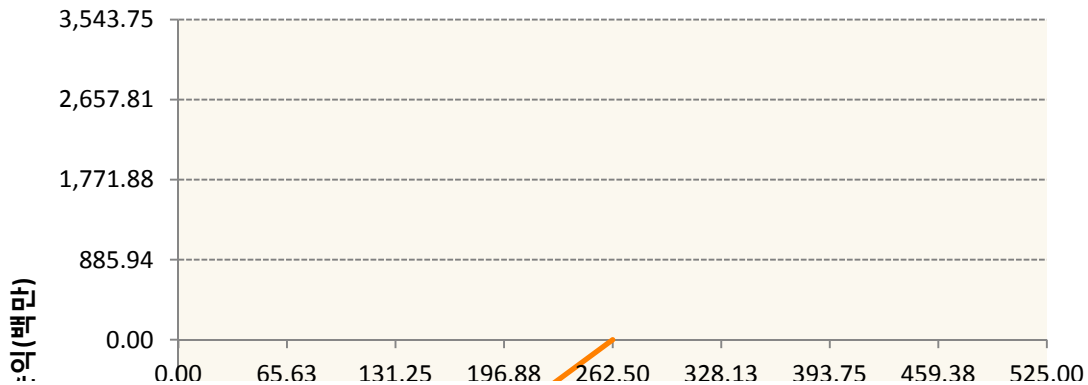
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	334	-334	장내
누계	유가증권	선물	0	680	-680	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,875	-3,875	장내

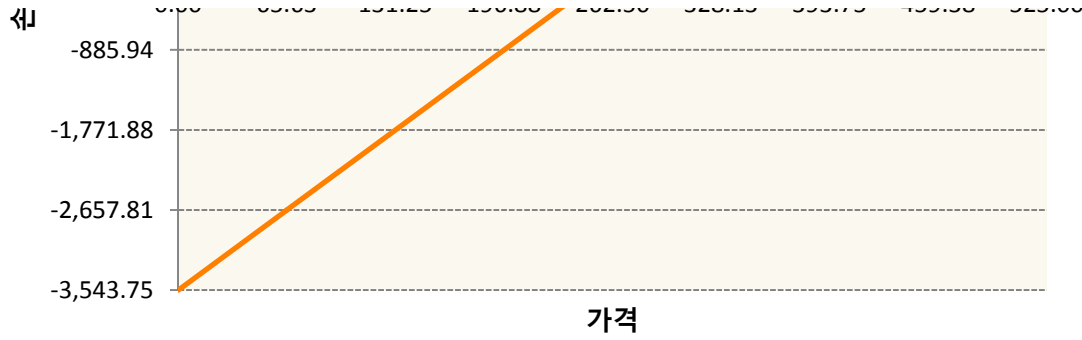
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

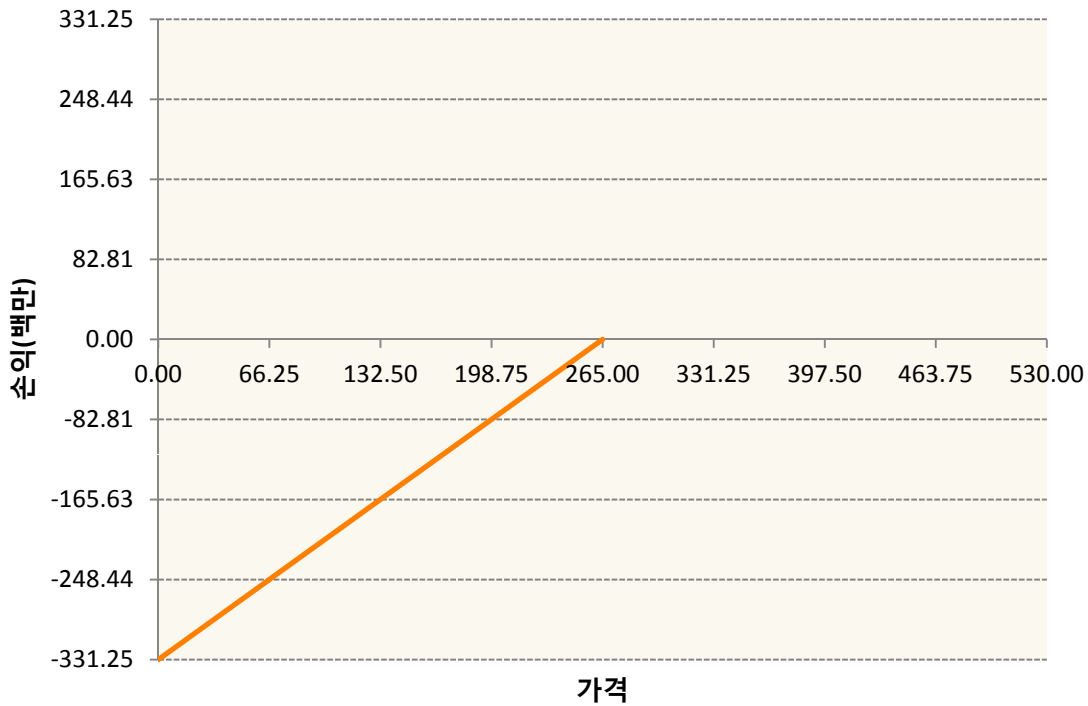


KR4301PA2628-2019-10 풋262.5





KR4301PA2651-2019-10 풋265



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	
KR4301PA2628		2019-10 풋262.5						167
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-157	-158	-159	-161	-163	-165	-167
-5.33%	-71	-74	-78	-82	-85	-89	-93
-2.67%	-15	-19	-23	-27	-32	-36	-40
0%	7	5	3	0	-3	-6	-9
2.67%	12	11	11	10	8	7	5
5.33%	12	12	12	12	11	11	10
8.00%	12	12	12	12	12	12	12
KR4301PA2651 2019-10 풋265							18
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-18
-5.33%	-8	-9	-9	-9	-10	-10	-10
-2.67%	-2	-3	-3	-3	-4	-4	-5
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	2	2	1	1	1	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	1
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

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

(단위:백만원)

199

공시일	2019-09-17
기준일	2019-09-16

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	780	-780	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	18,553	0	18,553	
누계	통화	선도	118	18,811	-18,693	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		161
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		473
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		511
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		38
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		322
FX21019U02 USD/KRW 19-09-19E		9

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

(단위:백만원)

499

공시일	2019-09-17
기준일	2019-09-16

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	377	0	377	장외
누계	통화	선도	91	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	2019-09-17
기준일	2019-09-16

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

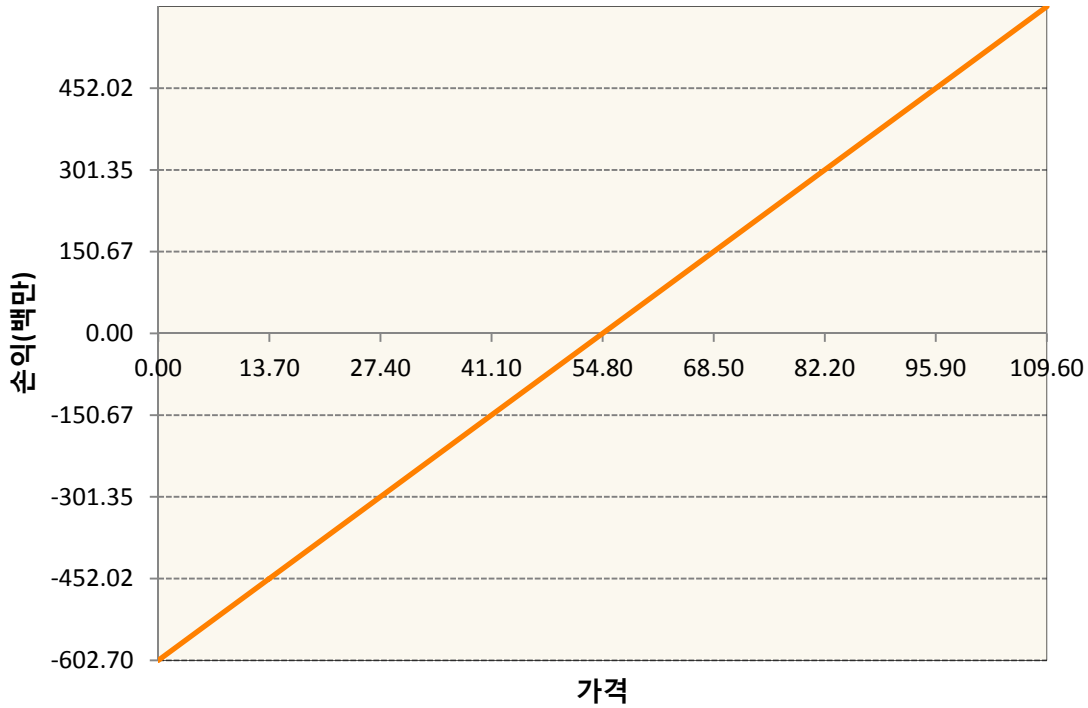
1. 계약금액

(단위:백만원)

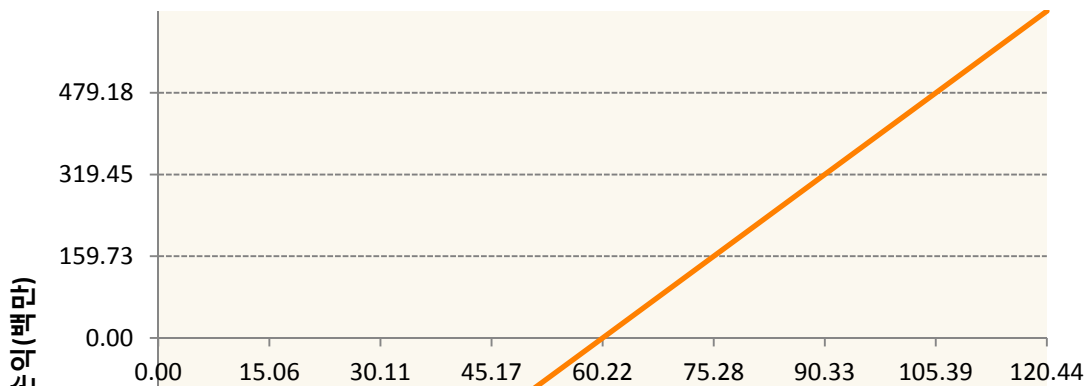
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,333	295	2,038	
누계	유가증권	선물	192	0	192	장내

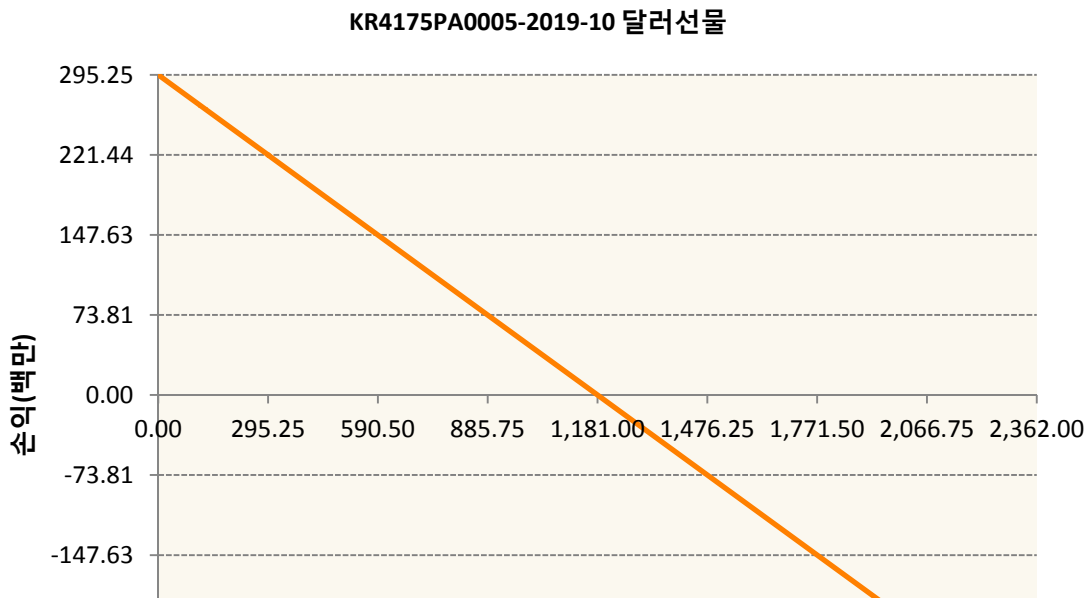
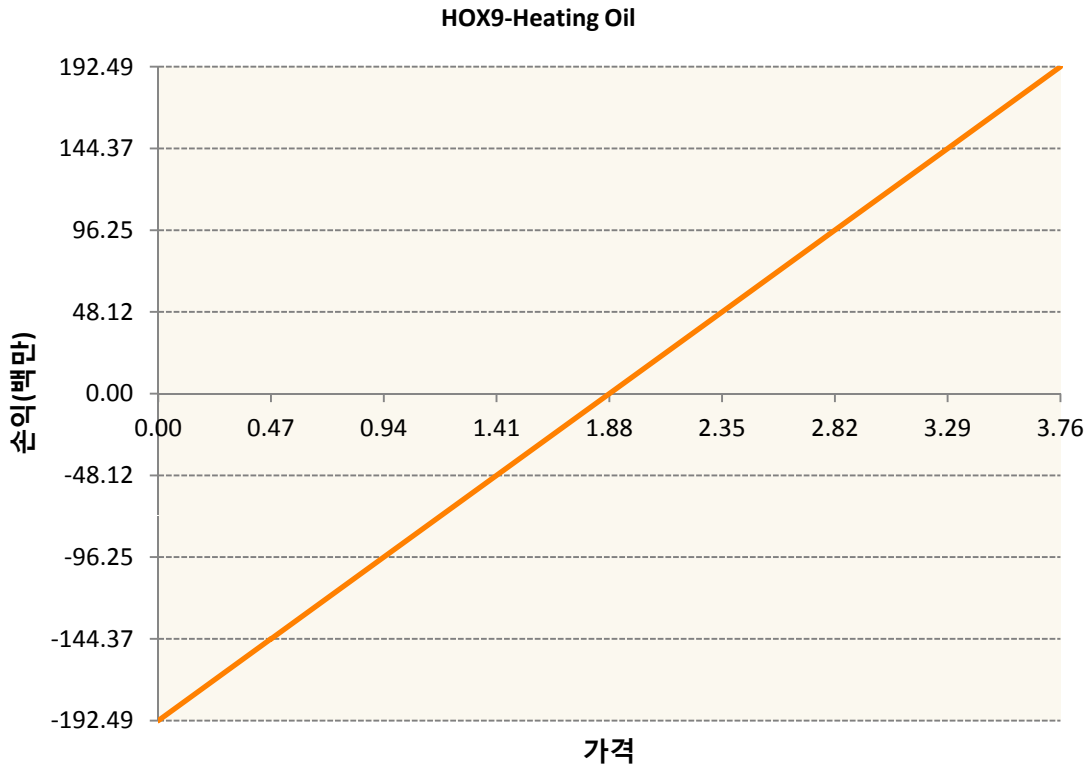
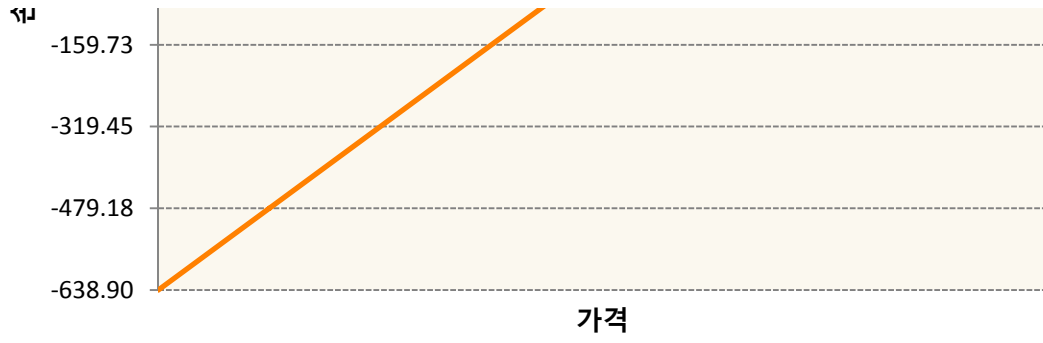
2. 만기시점의 손익구조

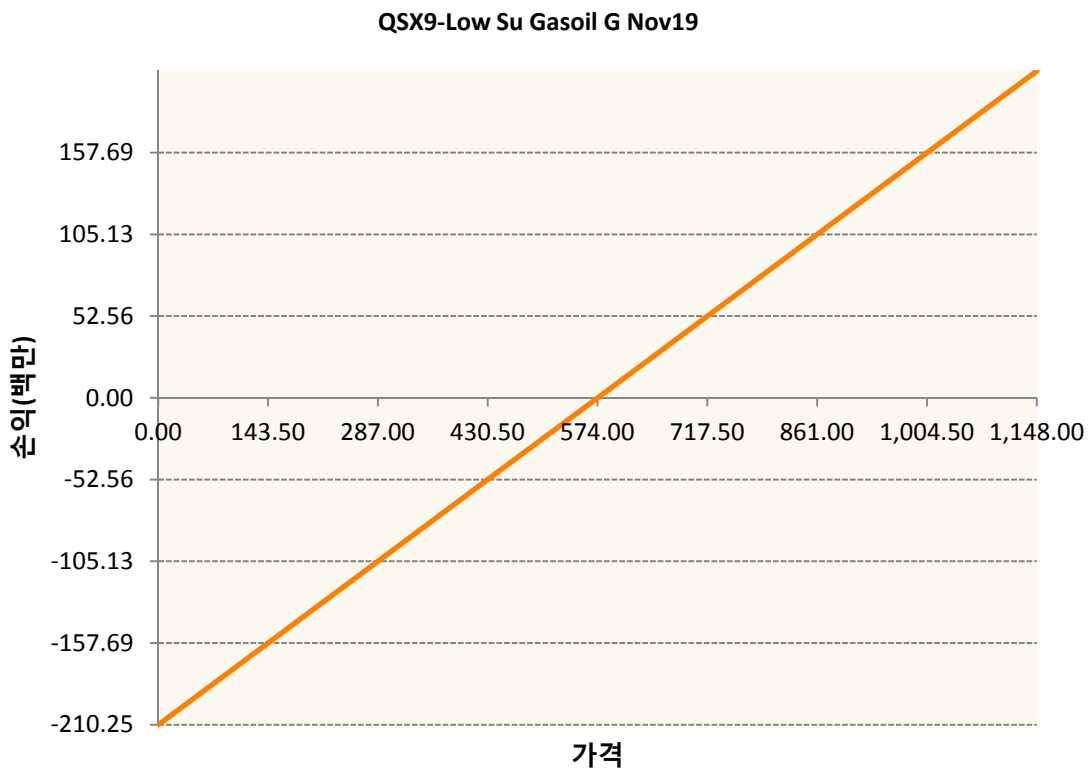
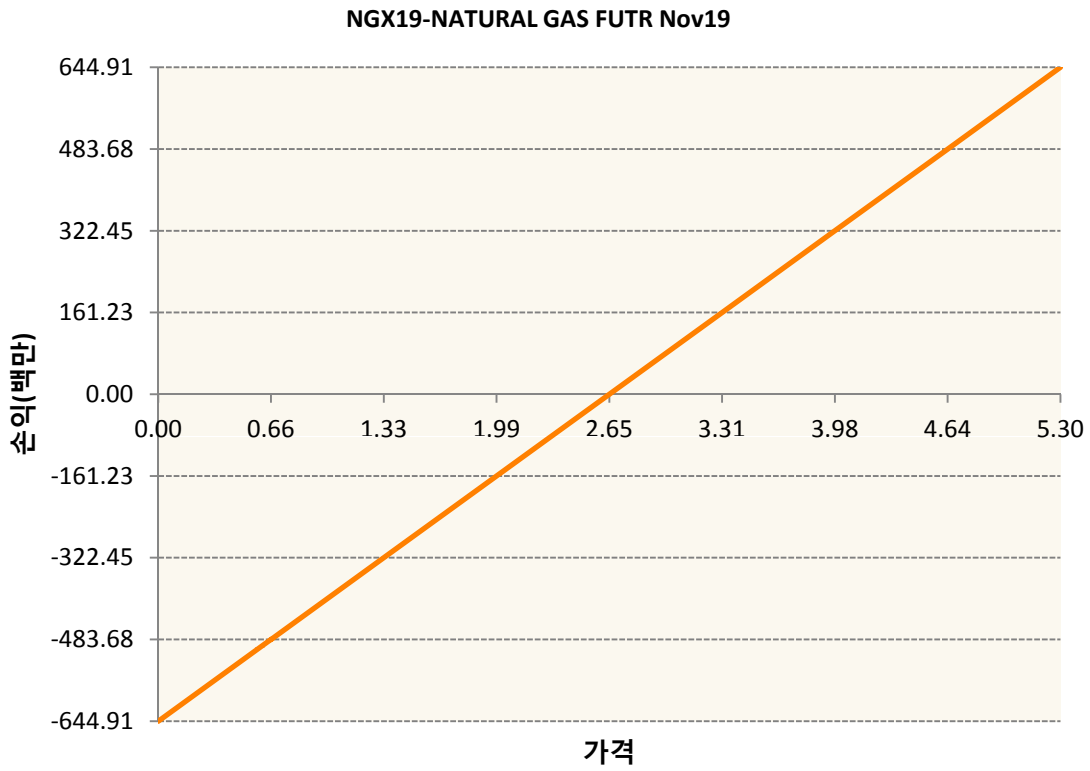
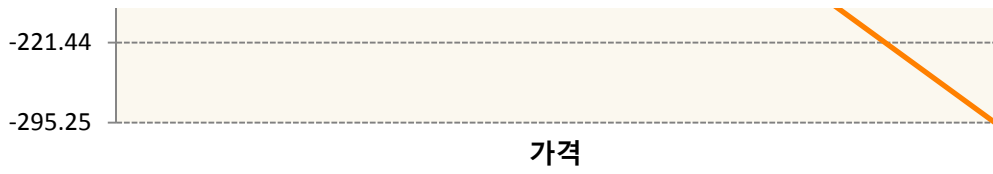
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19

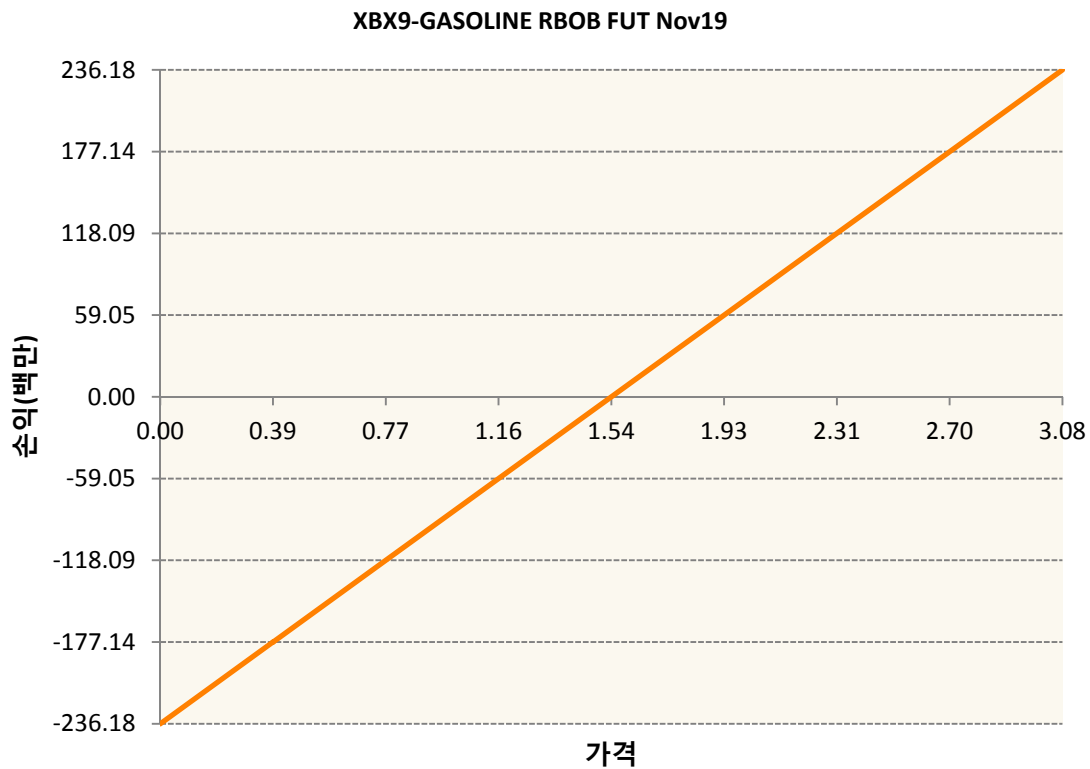


COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLX9	WTI CRUDE FUTURE Nov19	48
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	51
HOX9	Heating Oil	15
KR4175PA00	2019-10 달러선물	24
NGX19	NATURAL GAS FUTR Nov19	52
QSX9	Low Su Gasoil G Nov19	17
XBX9	GASOLINE RBOB FUT Nov19	19

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

400

공시일	2019-09-17
기준일	2019-09-16

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

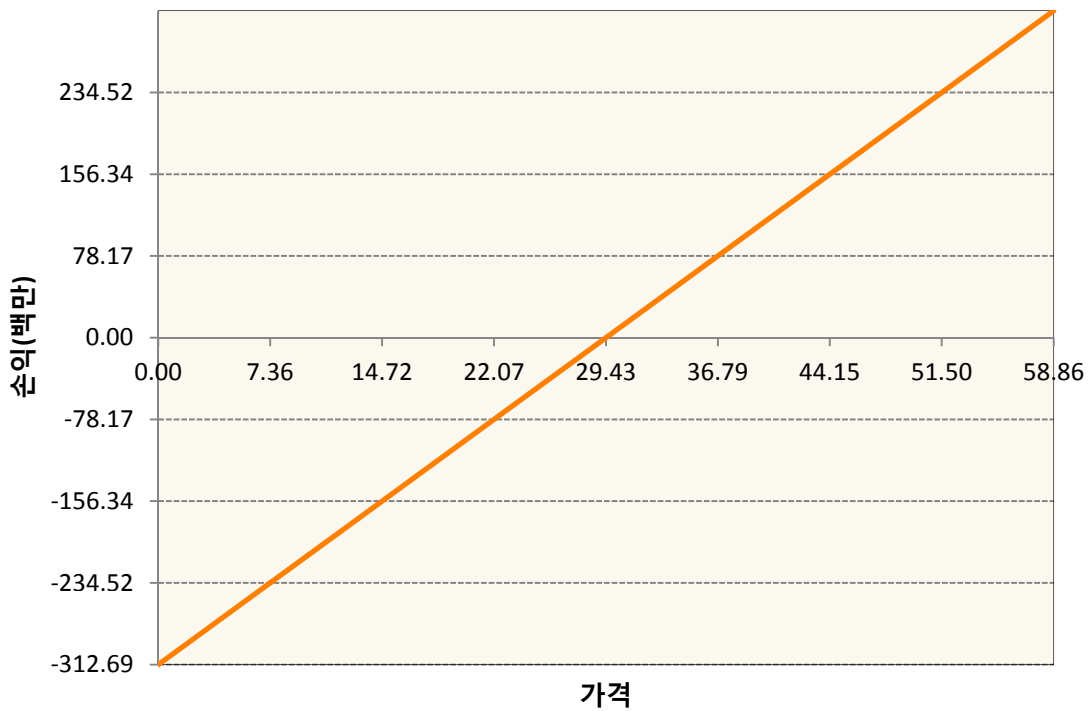
1. 계약금액

(단위:백만원)

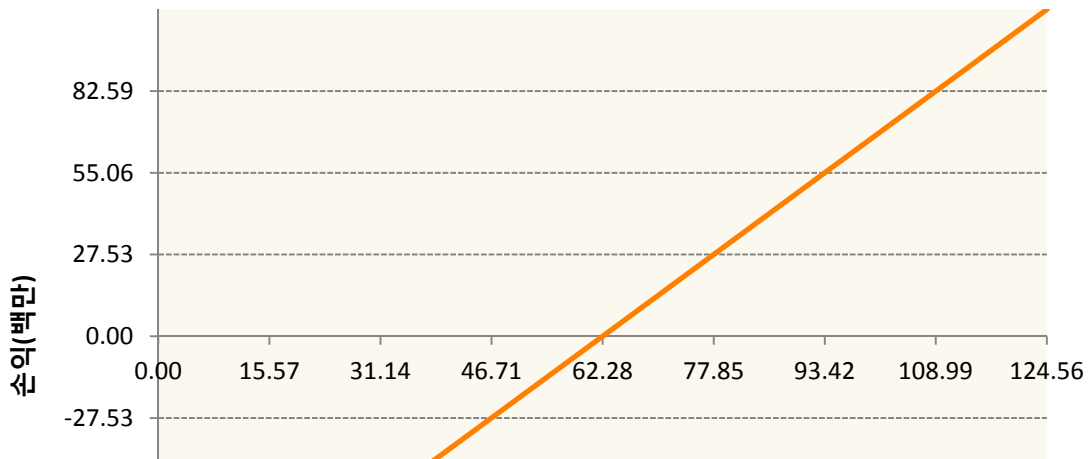
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,777	94	2,683	

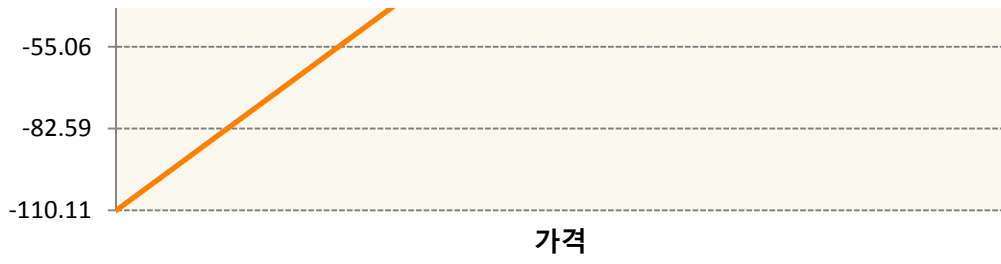
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

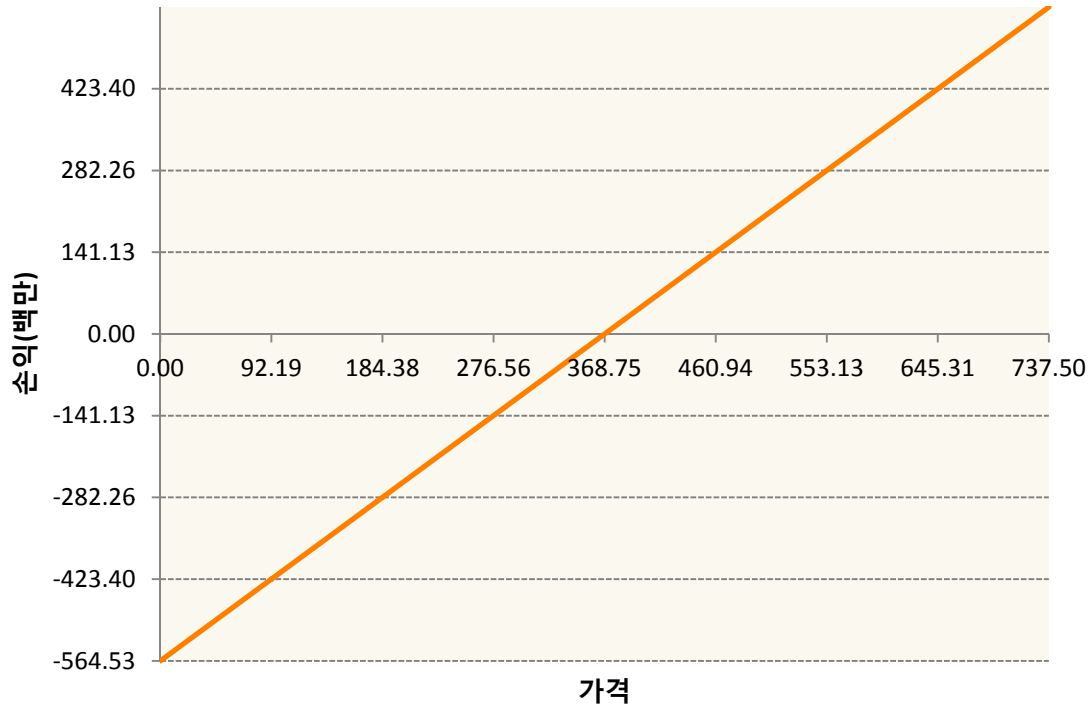


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

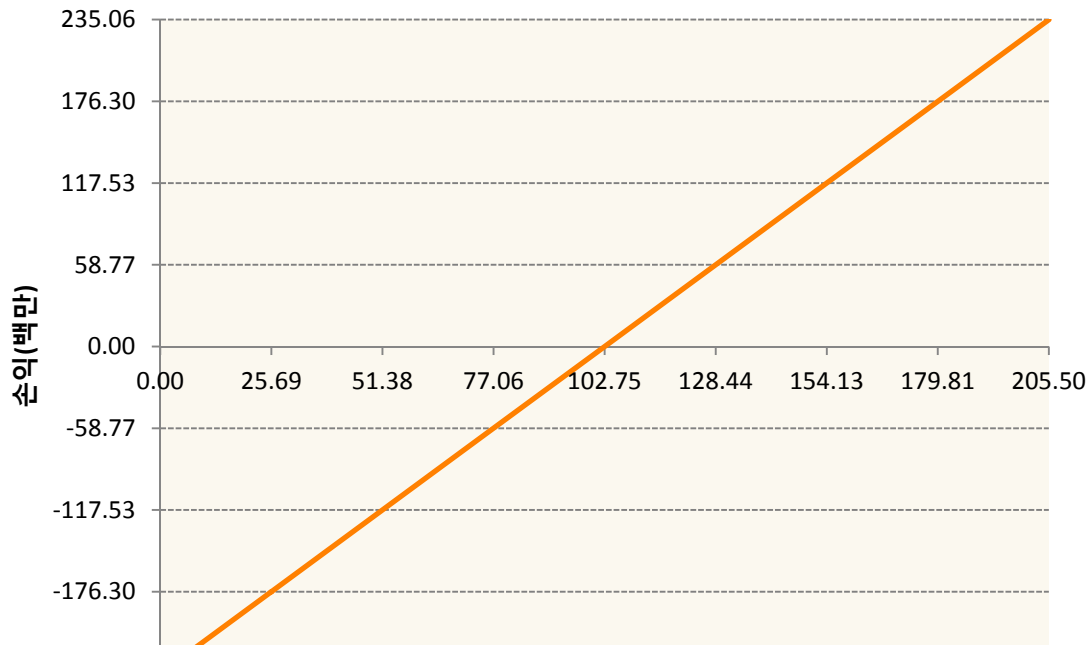


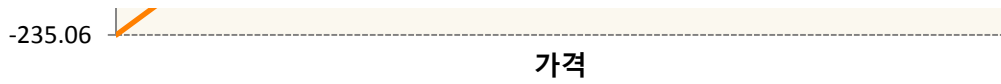


CZ9-CORN FUTURE Dec19

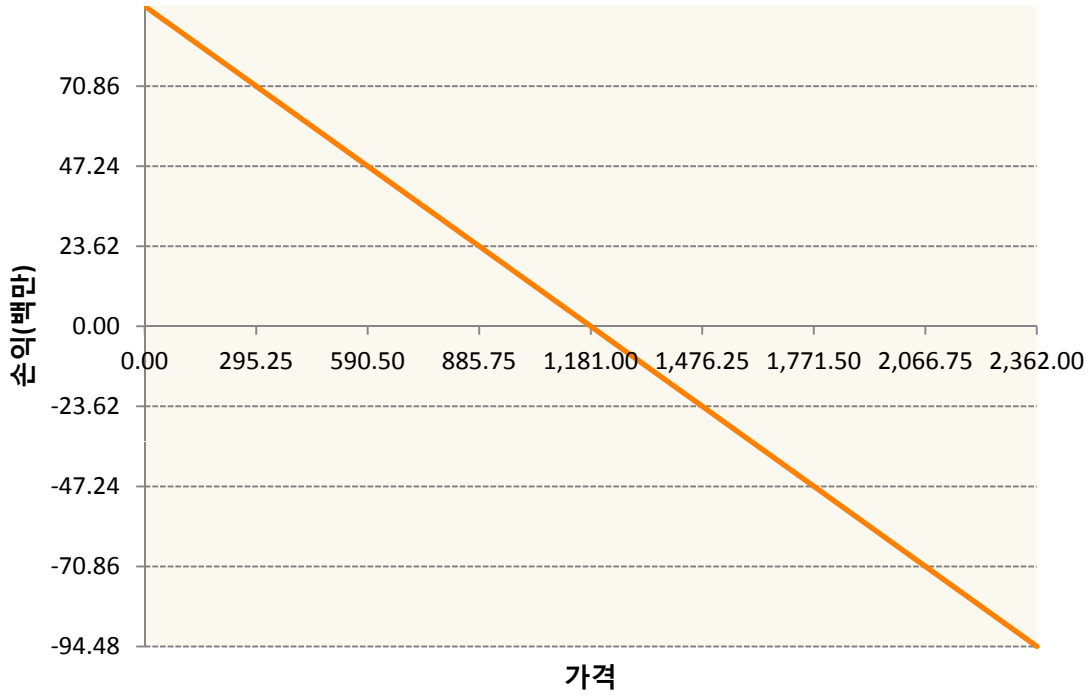


KCZ9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19

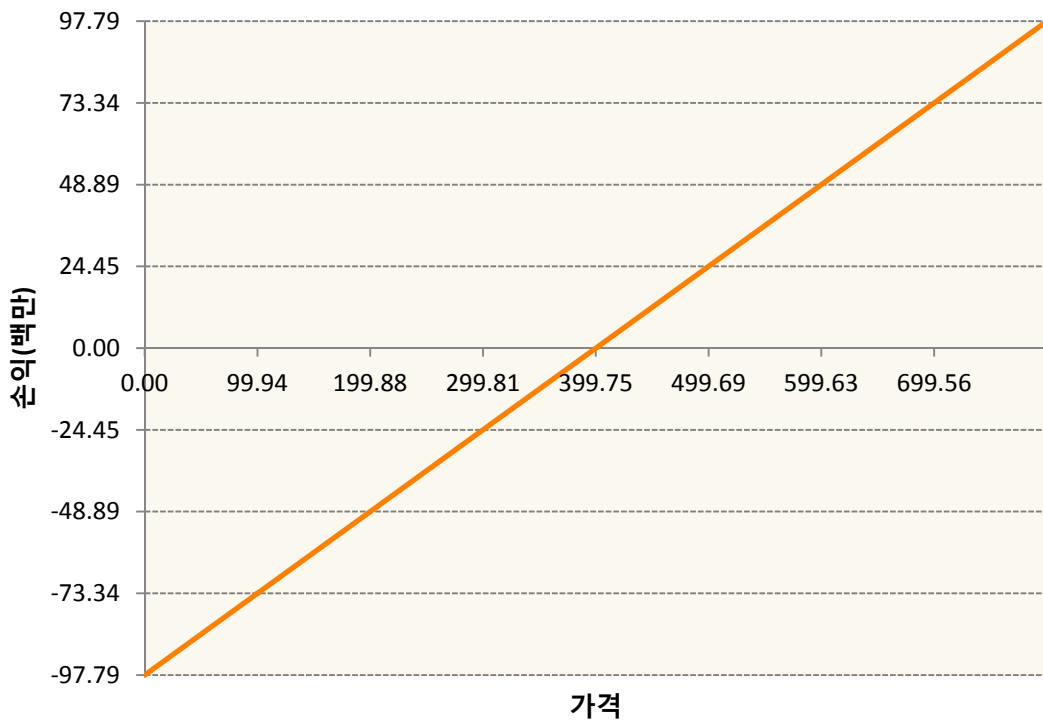




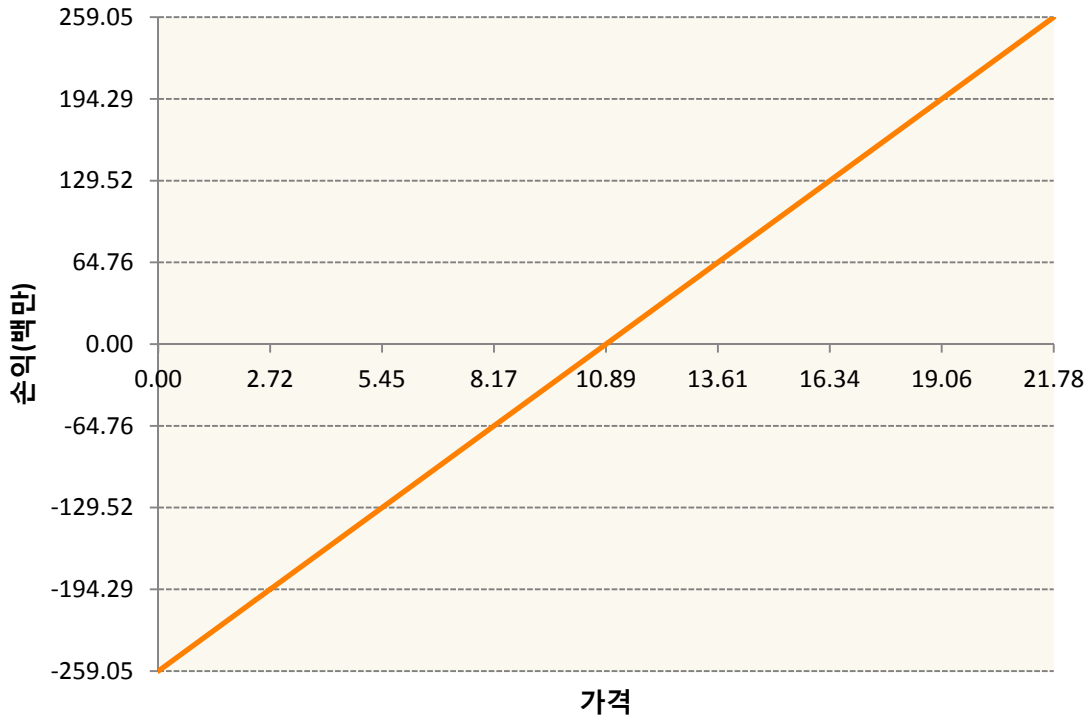
KR4175PA0005-2019-10 달러선물



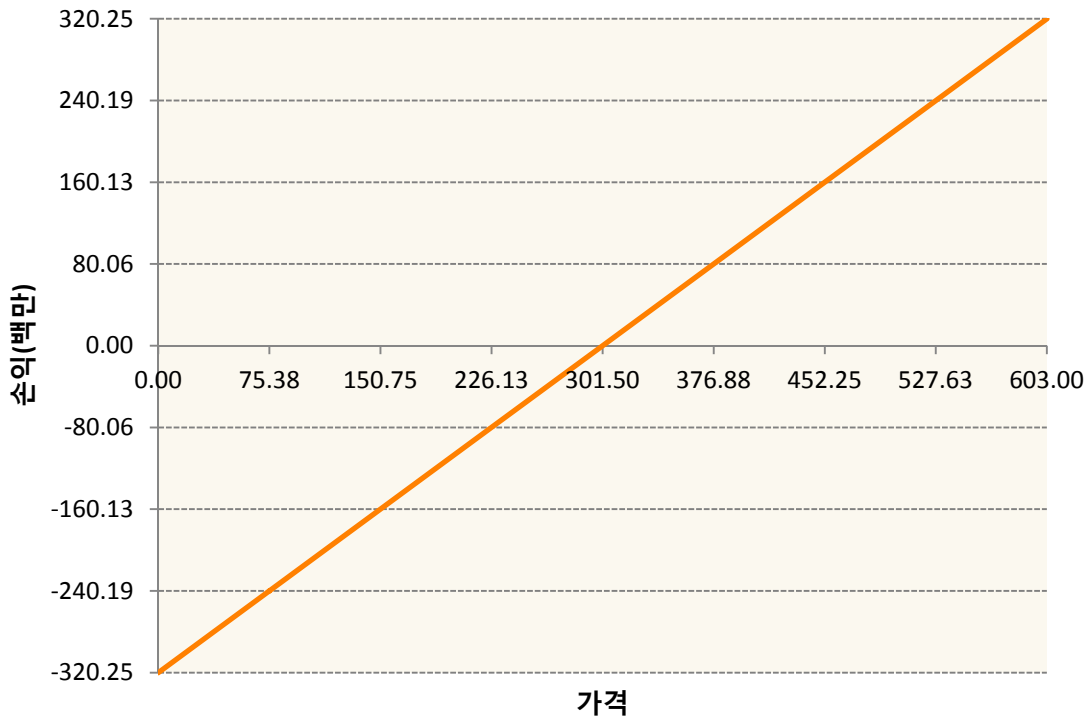
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

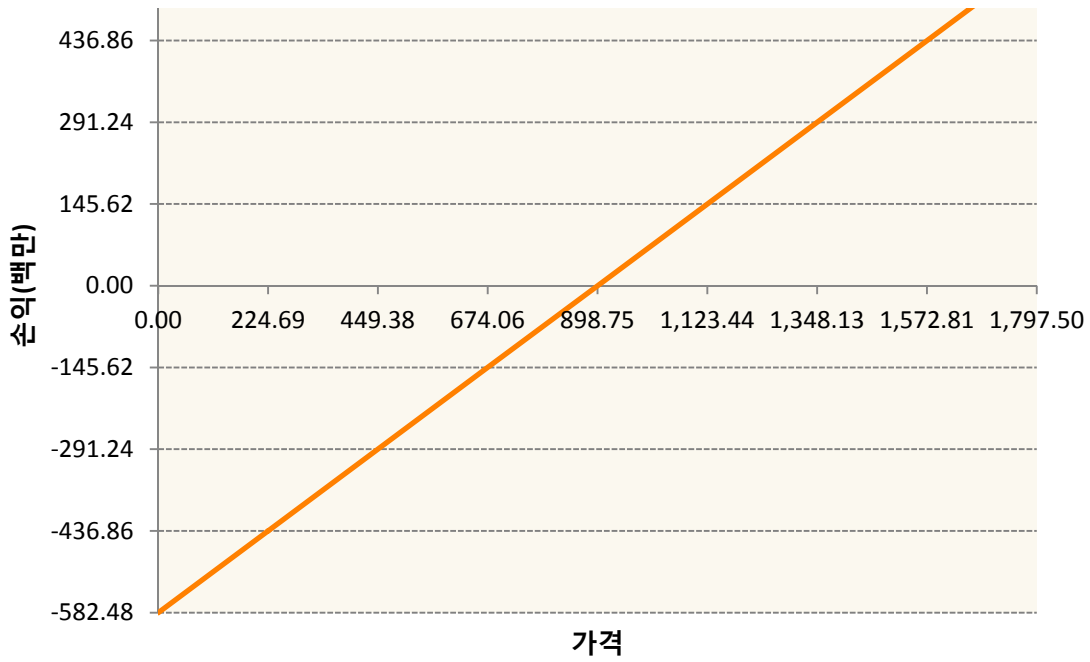


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

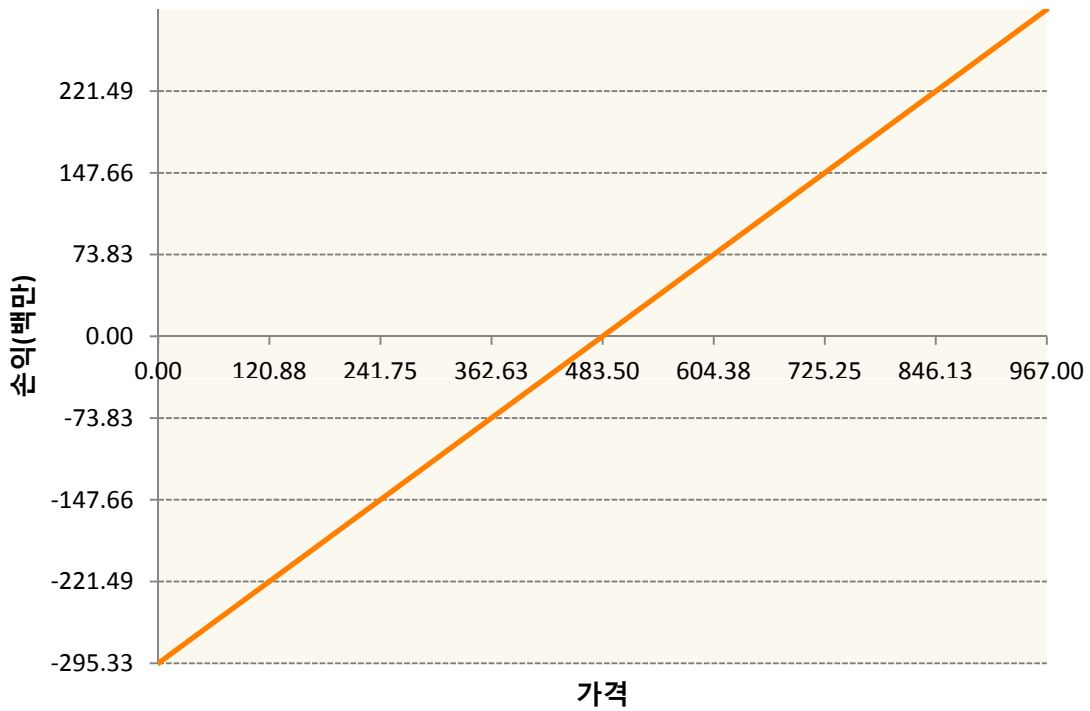


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





WZ9-WHEAT FUTURE(CBT) Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	25
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	9
CZ9	CORN FUTURE Dec19	45
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	26
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	47
WZ9	WHEAT FUTURE(CBT) Dec19	24

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

(단위:백만원)

245