

공시일	2019-09-18
기준일	2019-09-17

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	2019-09-18
기준일	2019-09-17

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

1,180

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

676

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-18
기준일	2019-09-17

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)	390
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	143

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

847

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-18
기준일	2019-09-17

유로인덱스모(주식-파생형)

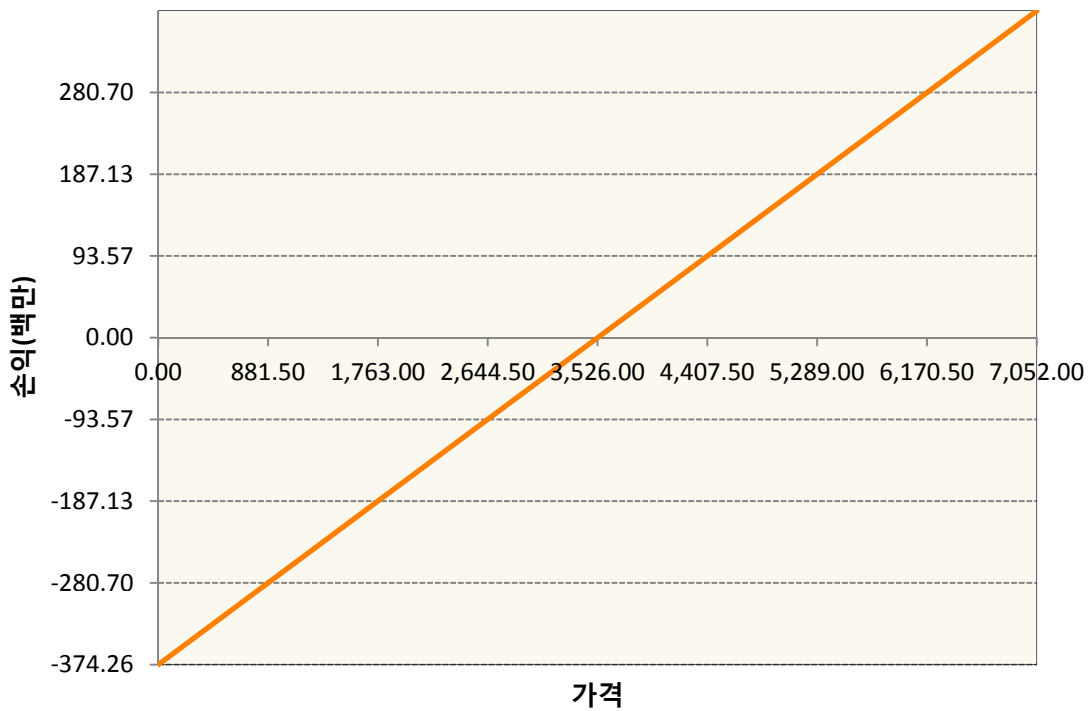
1. 계약금액

(단위:백만원)

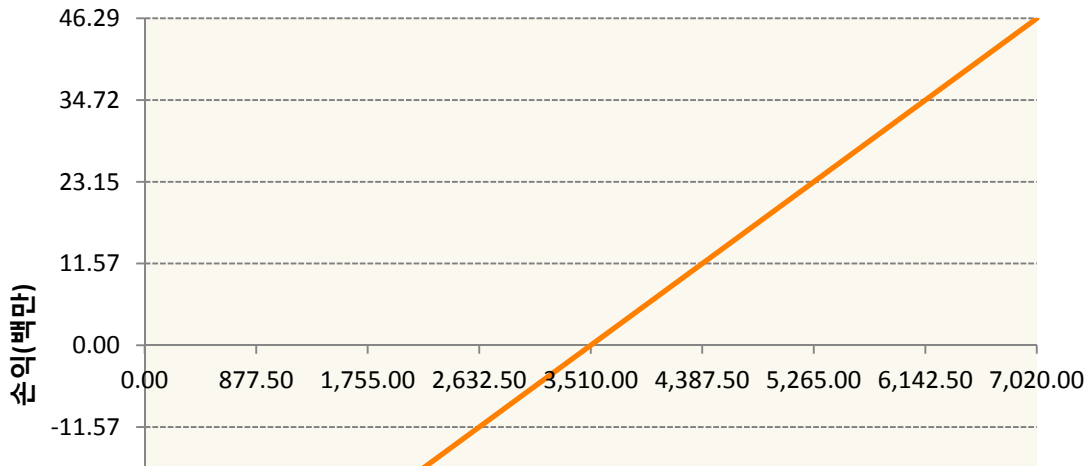
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	421	0	421	

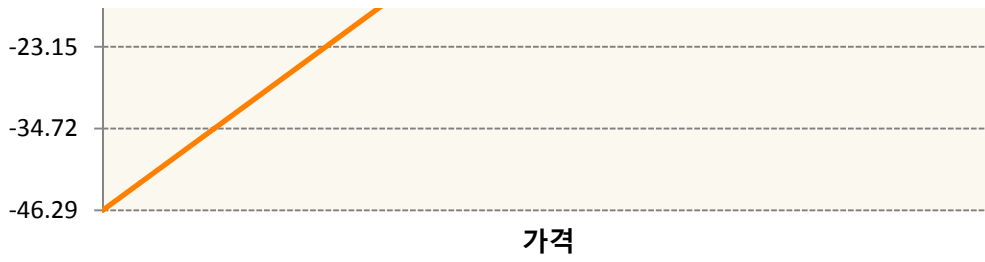
2. 만기시점의 손익구조

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	2019-09-18
기준일	2019-09-17

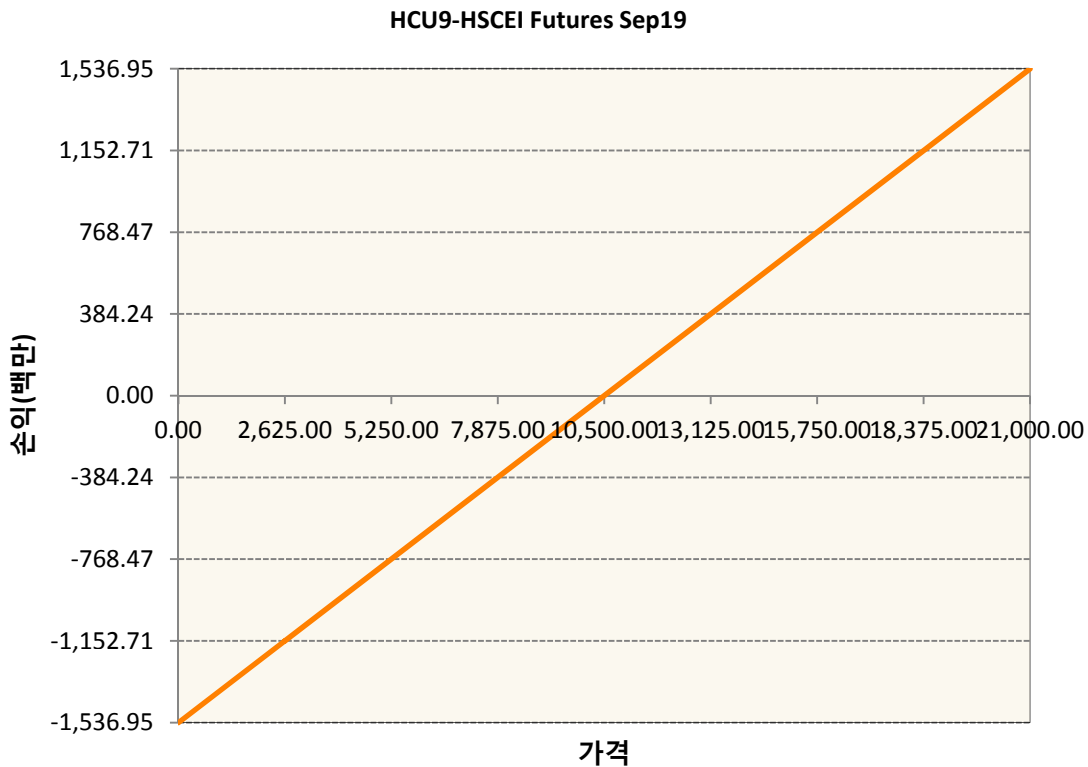
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,537	0	1,537	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU9	HSCEI Futures Sep19	123
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

114

공시일	2019-09-18
기준일	2019-09-17

커버드콜모(주식혼합-파생형)

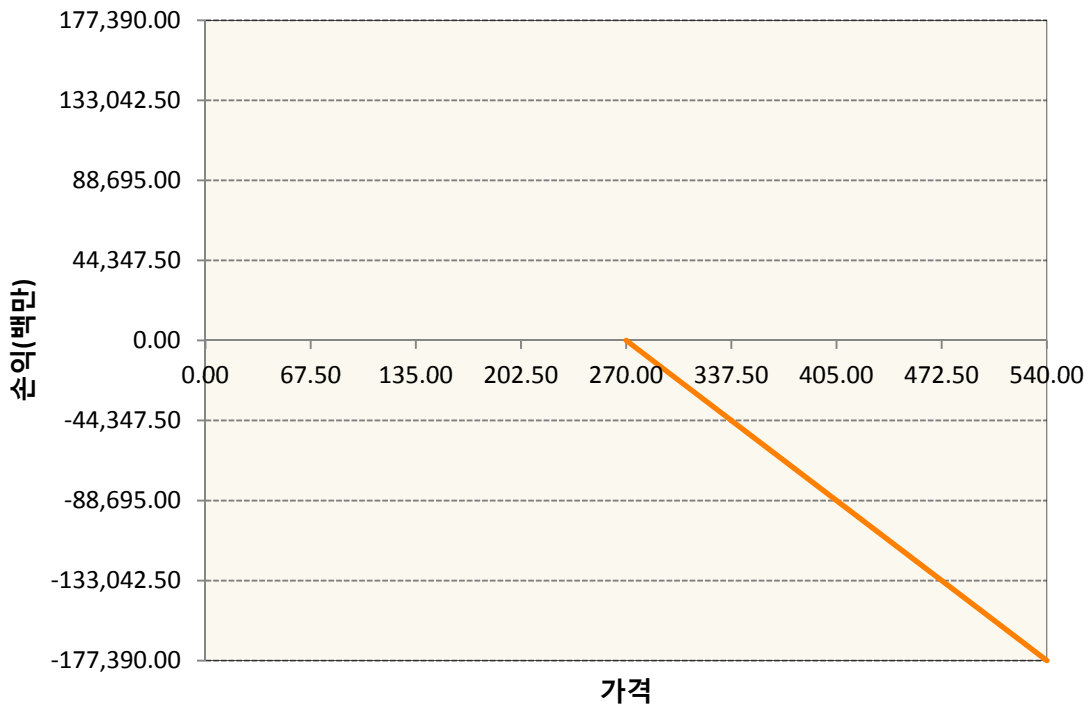
1. 계약금액

(단위:백만원)

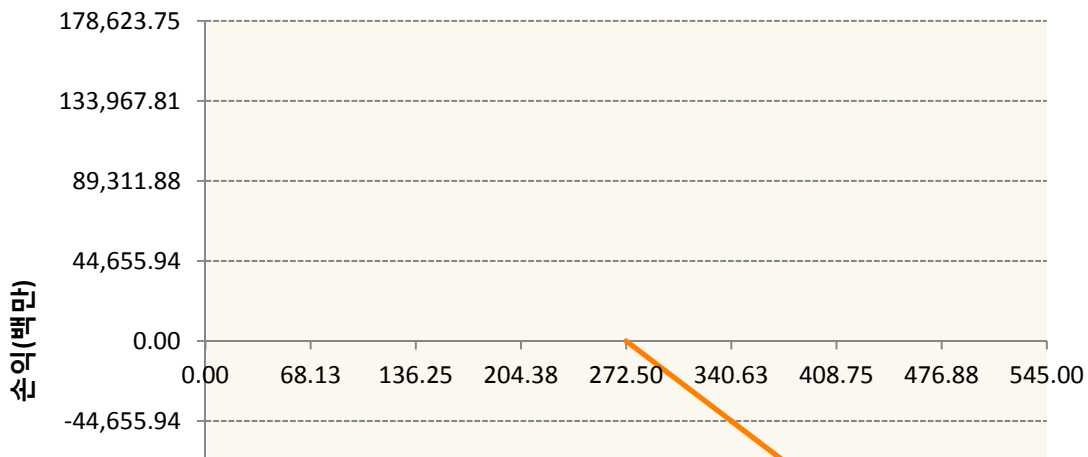
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	524,764	-524,764	장내

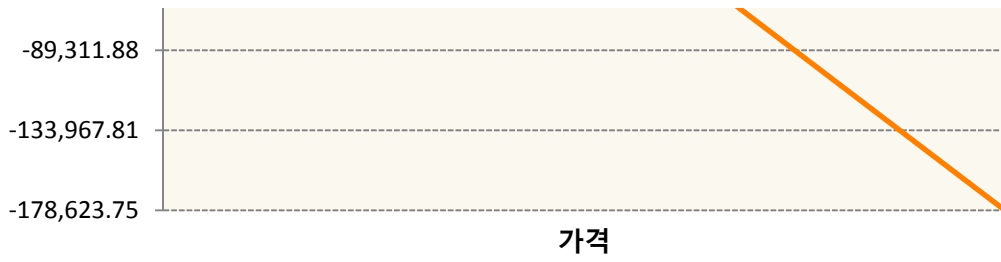
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PA2702-2019-10 콜270

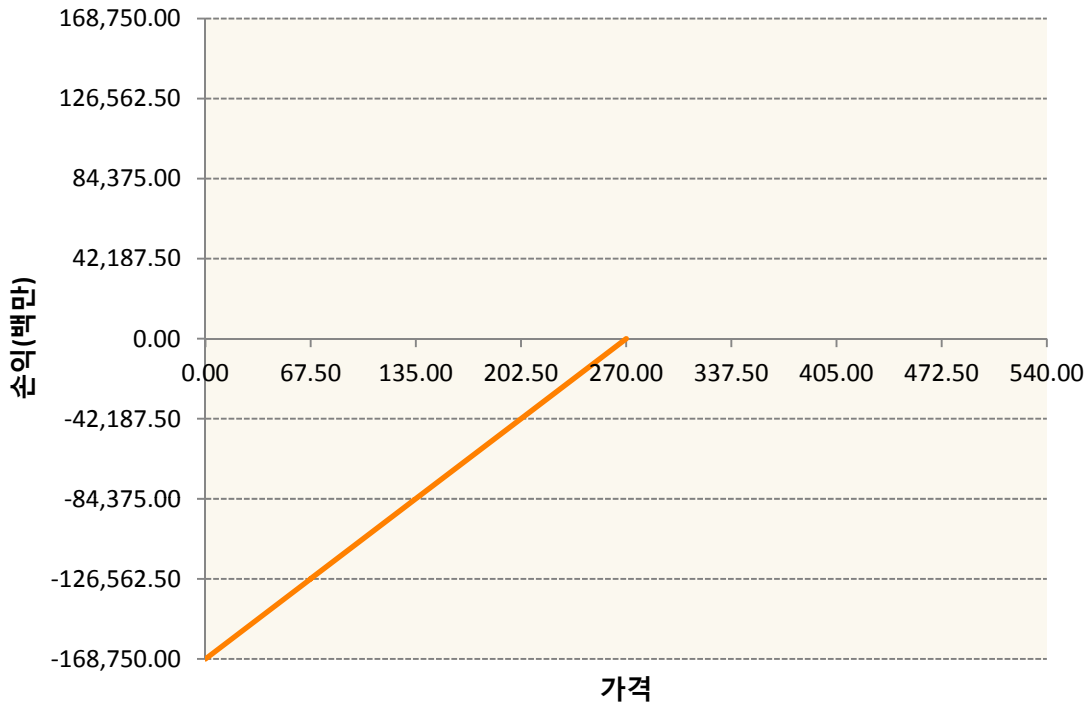


KR4201PA2728-2019-10 콜272.5





KR4301PA2701-2019-10 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PA2702		2019-10 콜270					11,304
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,036	4,906	4,749	4,566	4,362	4,139	3,899
-5.33%	4,508	4,258	3,987	3,699	3,399	3,087	2,767
-2.67%	3,312	2,951	2,586	2,216	1,843	1,468	1,090
0%	1,184	790	395	0	-395	-790	-1,186
2.67%	-1,917	-2,253	-2,600	-2,955	-3,317	-3,685	-4,056
5.33%	-5,799	-6,025	-6,277	-6,550	-6,840	-7,145	-7,461
8.00%	-10,168	-10,292	-10,446	-10,627	-10,832	-11,059	-11,304
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5					10,754
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,298	4,199	4,072	3,920	3,745	3,549	3,335

-5.33%	3,917	3,706	3,471	3,216	2,943	2,657	2,359
-2.67%	2,979	2,647	2,306	1,956	1,600	1,240	875
0%	1,190	793	397	0	-397	-794	-1,190
2.67%	-1,578	-1,945	-2,319	-2,698	-3,080	-3,465	-3,852
5.33%	-5,204	-5,474	-5,765	-6,073	-6,394	-6,726	-7,068
8.00%	-9,418	-9,578	-9,768	-9,984	-10,222	-10,480	-10,754
KR4301PA2701 2019-10 풋270							10,737
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10,604	-10,610	-10,620	-10,637	-10,661	-10,695	-10,737
-5.33%	-6,145	-6,192	-6,254	-6,328	-6,415	-6,513	-6,621
-2.67%	-2,125	-2,279	-2,441	-2,610	-2,783	-2,960	-3,140
0%	609	406	203	0	-204	-408	-612
2.67%	1,747	1,633	1,505	1,367	1,220	1,065	904
5.33%	2,004	1,974	1,931	1,876	1,808	1,728	1,637
8.00%	2,033	2,030	2,022	2,008	1,987	1,958	1,920

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

(단위:백만원)

32,920

공시일	2019-09-18
기준일	2019-09-17

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

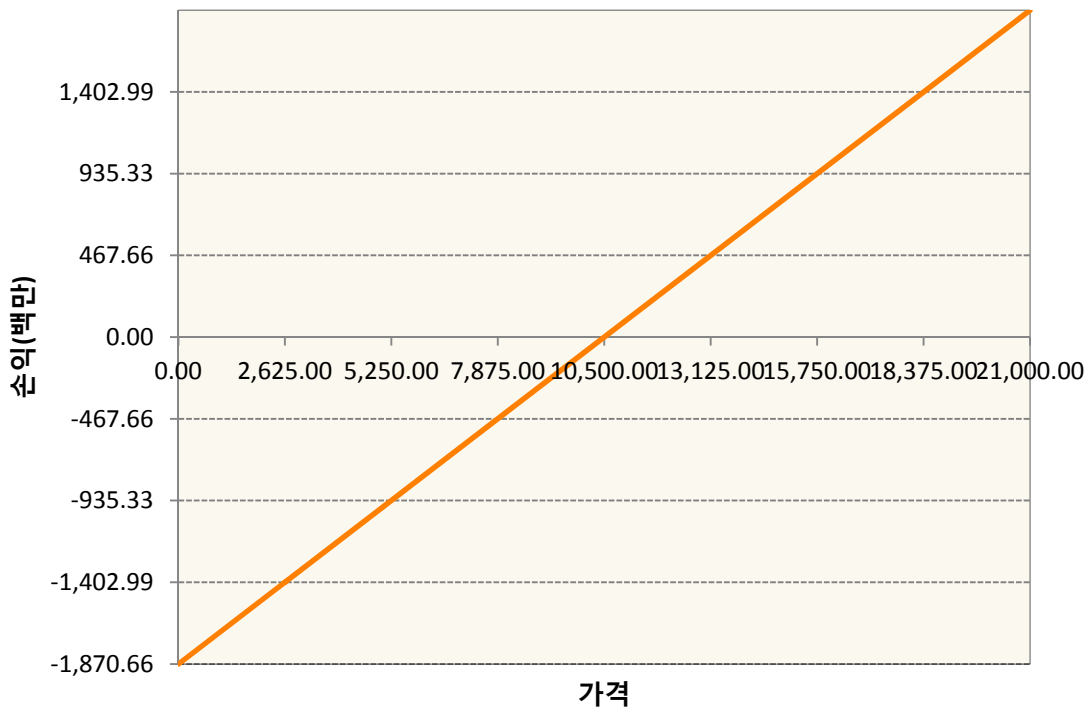
1. 계약금액

(단위:백만원)

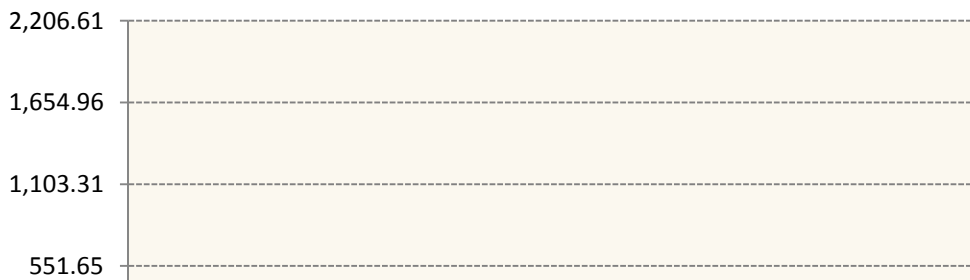
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,871	0	1,871	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,791	-4,791	장내
누계	통화	선도	685	2,828	-2,143	장외

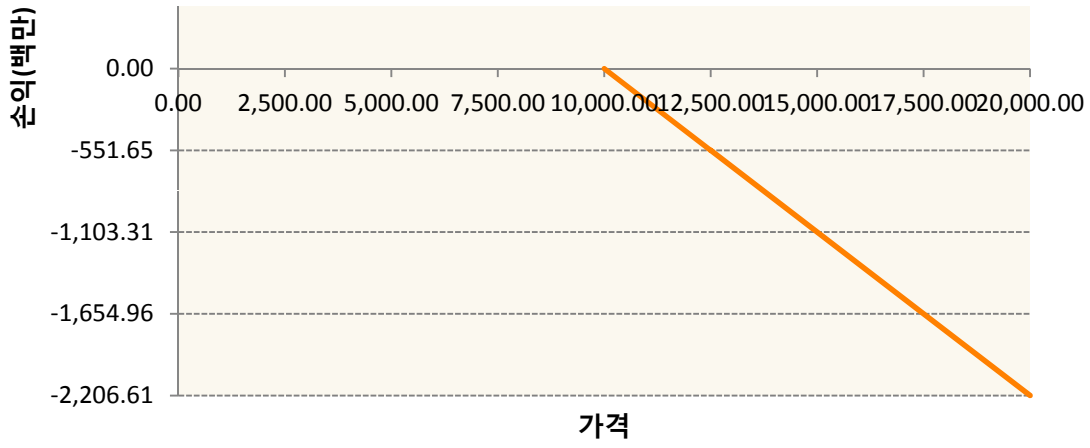
2. 만기시점의 손익구조

HCU9-HSCEI Futures Sep19

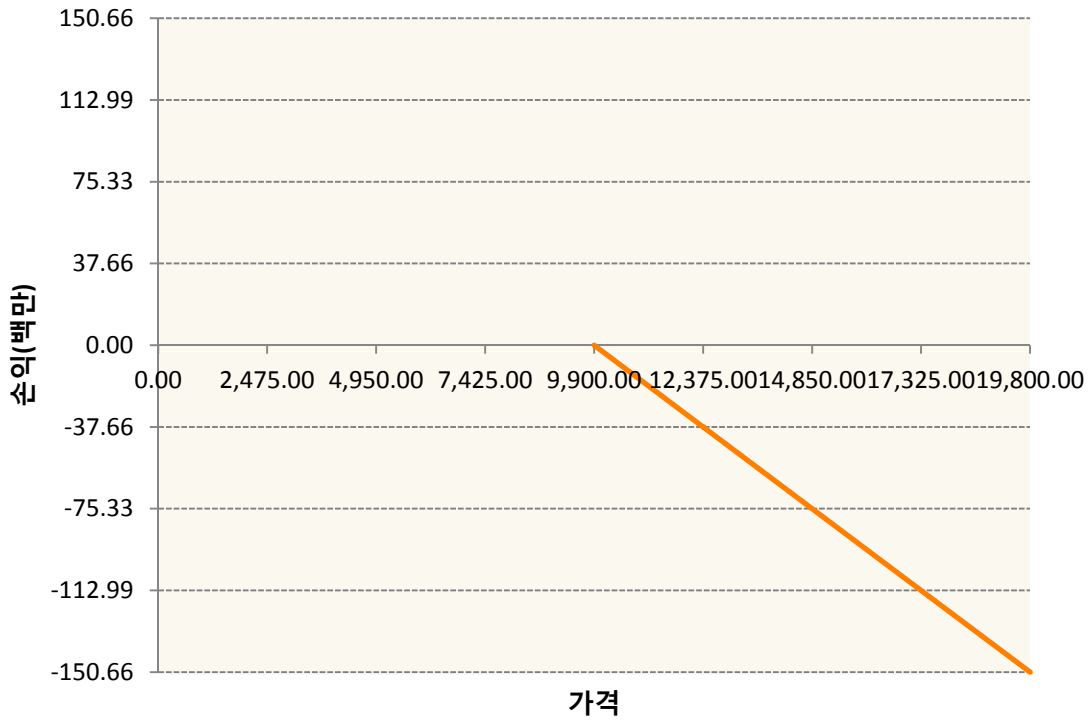


OHHIU9-C100-HSCEI

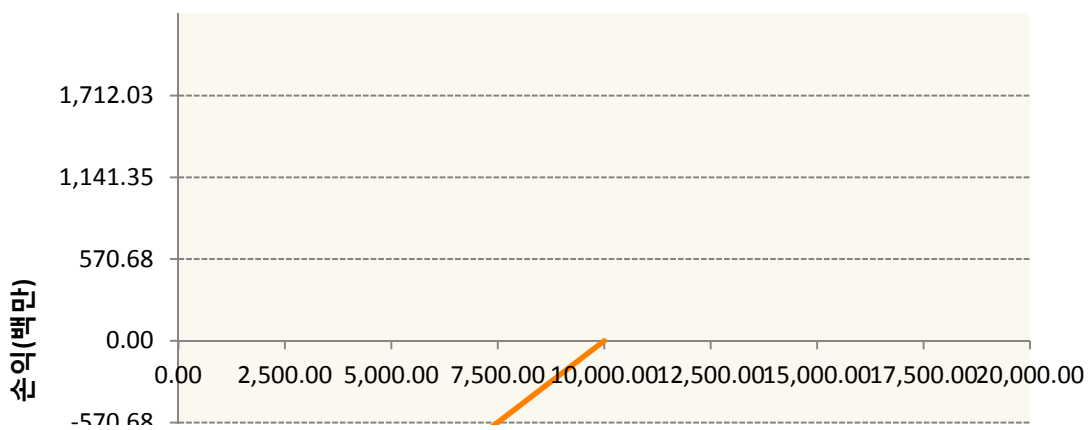


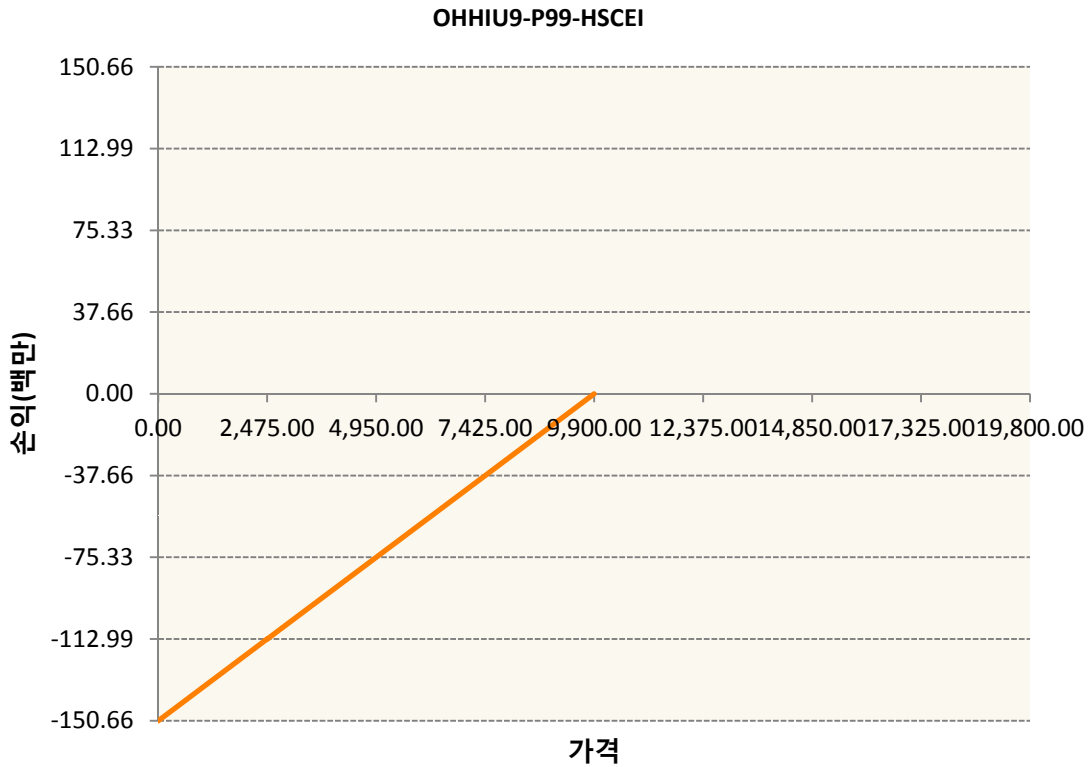


OHHIU9-C99-HSCEI



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	177
OHHIU9-C9(HSCEI	12
OHHIU9-P1(HSCEI	183
OHHIU9-P9(HSCEI	12

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

공시일	2019-09-18
기준일	2019-09-17

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

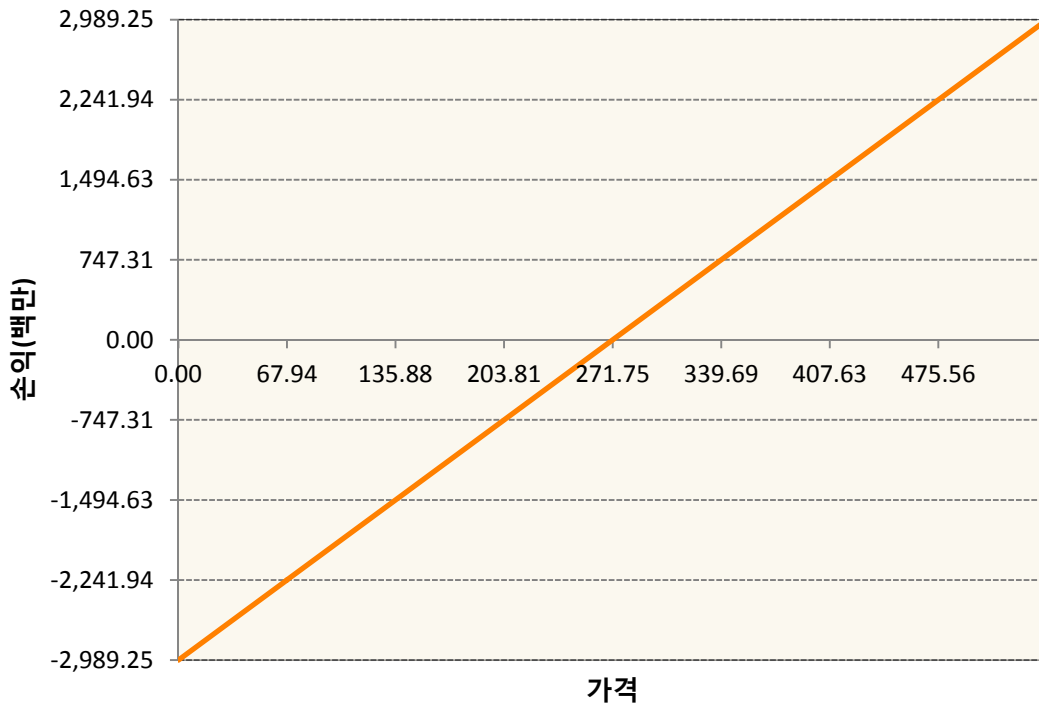
1. 계약금액

(단위:백만원)

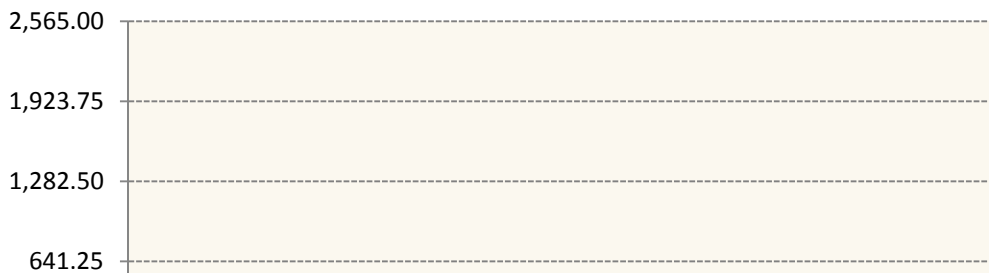
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,989	0	2,989	장내
누계	유가증권	스왑	14,125	0	14,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,032	-15,032	장내

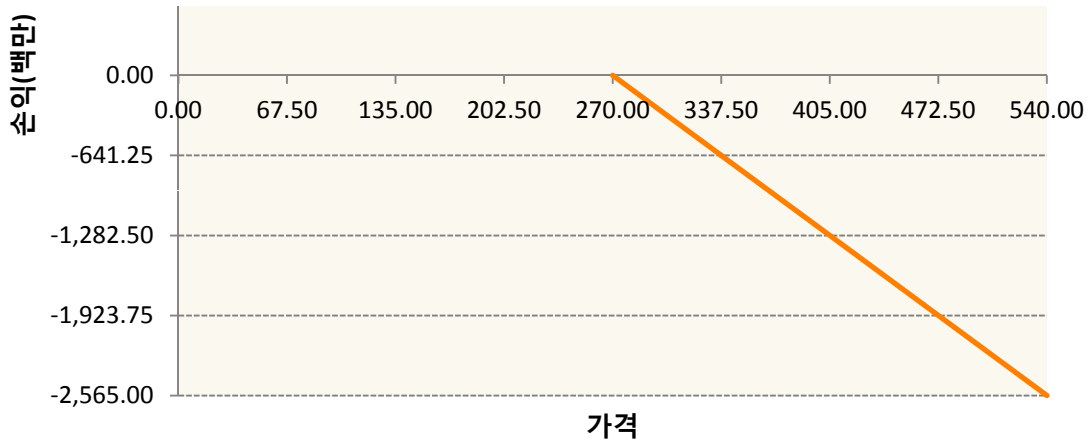
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

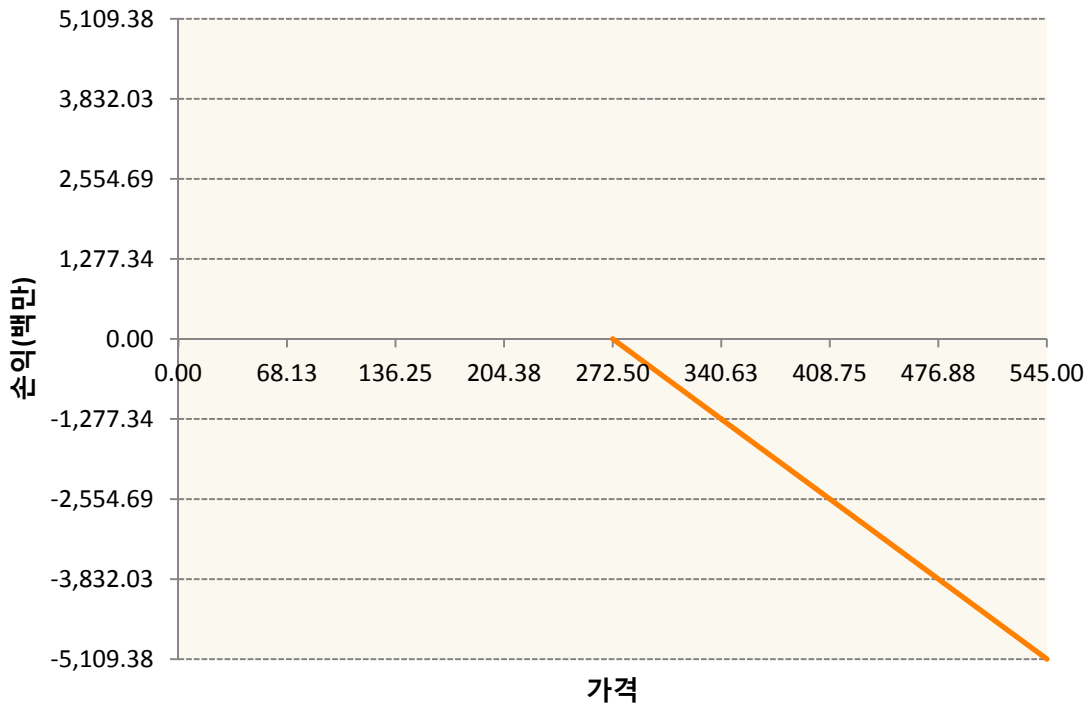


KR4201PA2702-2019-10 콜270

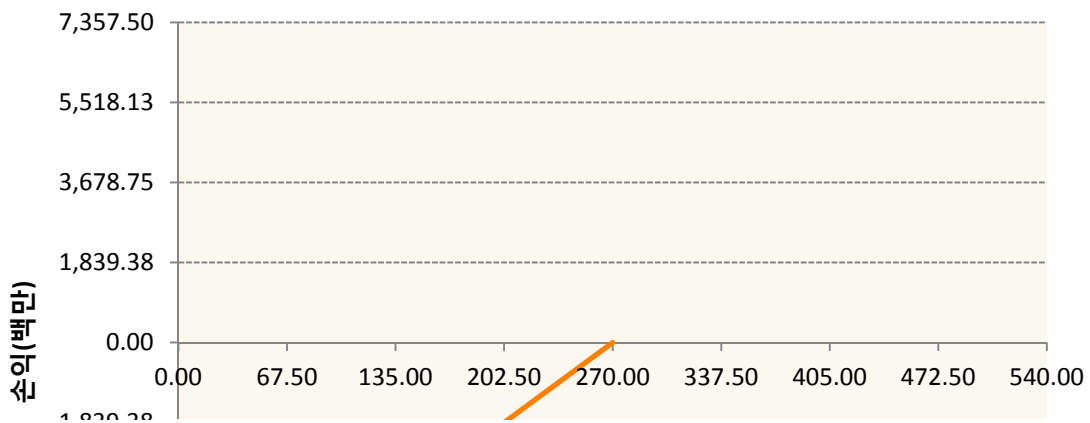


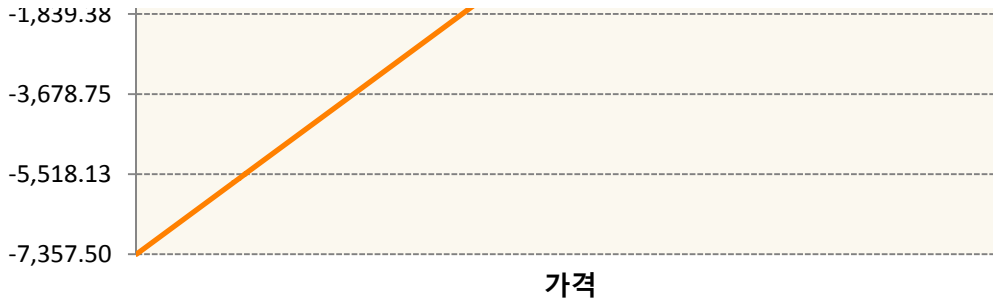


KR4201PA2728-2019-10 콜272.5



KR4301PA2701-2019-10 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						1,215
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	
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%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159	
-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%	159	159	159	159	159	159	159	
8.00%	239	239	239	239	239	239	239	
KR4201PA2702		2019-10 콜270						163
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	73	71	69	66	63	60	56	
-5.33%	65	62	58	53	49	45	40	
-2.67%	48	43	37	32	27	21	16	
0%	17	11	6	0	-6	-11	-17	
2.67%	-28	-33	-38	-43	-48	-53	-59	
5.33%	-84	-87	-91	-95	-99	-103	-108	
8.00%	-147	-149	-151	-154	-157	-160	-163	
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5						308
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	123	120	116	112	107	102	95
-5.33%	112	106	99	92	84	76	67
-2.67%	85	76	66	56	46	35	25
0%	34	23	11	0	-11	-23	-34
2.67%	-45	-56	-66	-77	-88	-99	-110
5.33%	-149	-157	-165	-174	-183	-192	-202
8.00%	-269	-274	-279	-286	-292	-300	-308
KR4301PA2701 2019-10 풋270							468
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-462	-463	-463	-464	-465	-466	-468
-5.33%	-268	-270	-273	-276	-280	-284	-289
-2.67%	-93	-99	-106	-114	-121	-129	-137
0%	27	18	9	0	-9	-18	-27
2.67%	76	71	66	60	53	46	39
5.33%	87	86	84	82	79	75	71
8.00%	89	88	88	88	87	85	84

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

(단위:백만원)

2,379

공시일	2019-09-18
기준일	2019-09-17

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

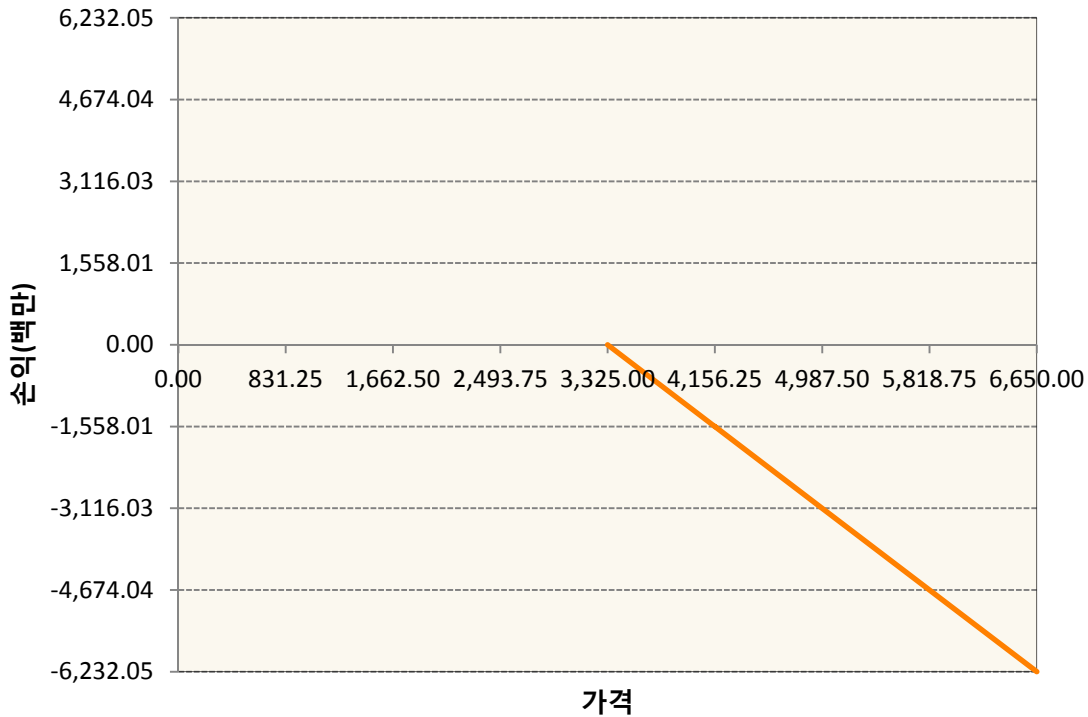
1. 계약금액

(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	5,175	0	5,175	
누계	유가증권	스왑	23,851	0	23,851	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,011	-15,011	장내
누계	통화	선도	10,879	17,039	-6,160	장외

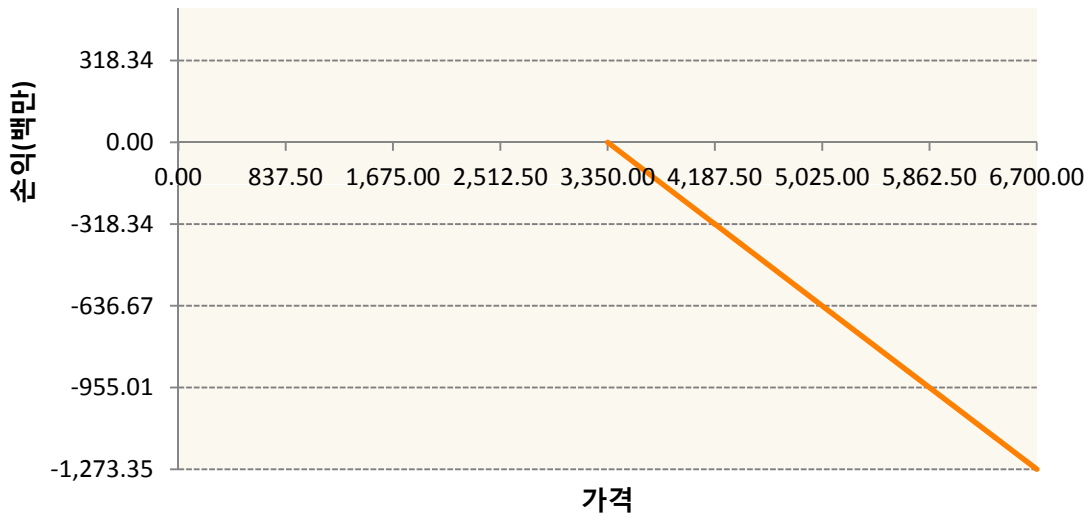
2. 만기시점의 손익구조

OESXU9-C3325-EURO STOXX 50

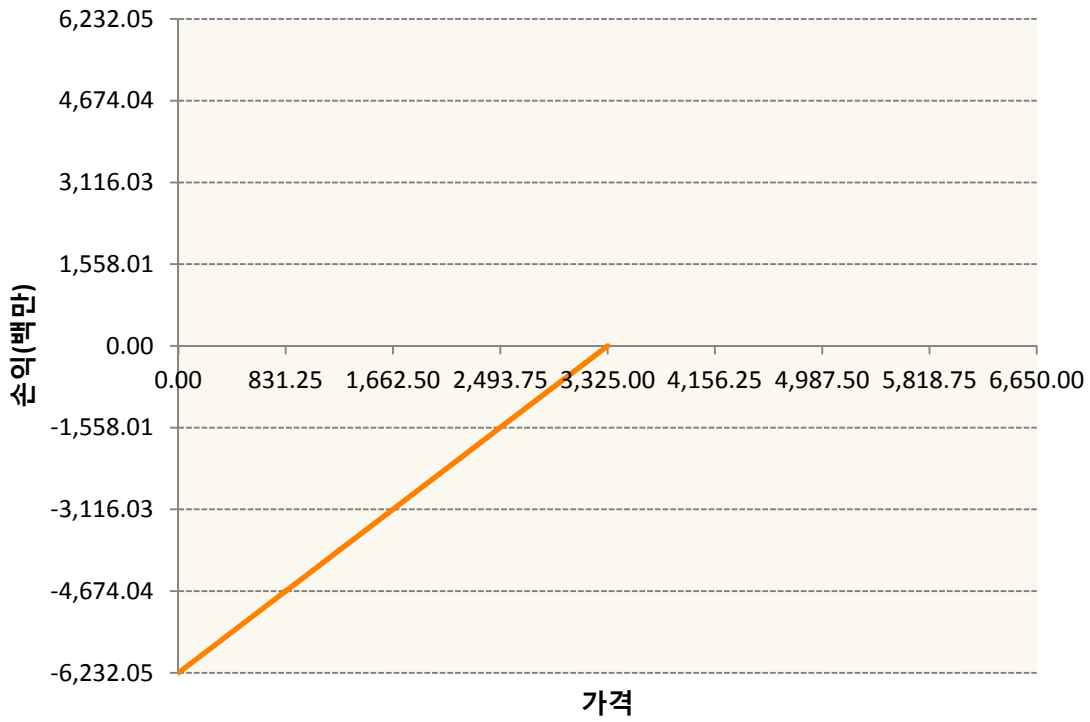


OESXU9-C3350-EURO STOXX 50

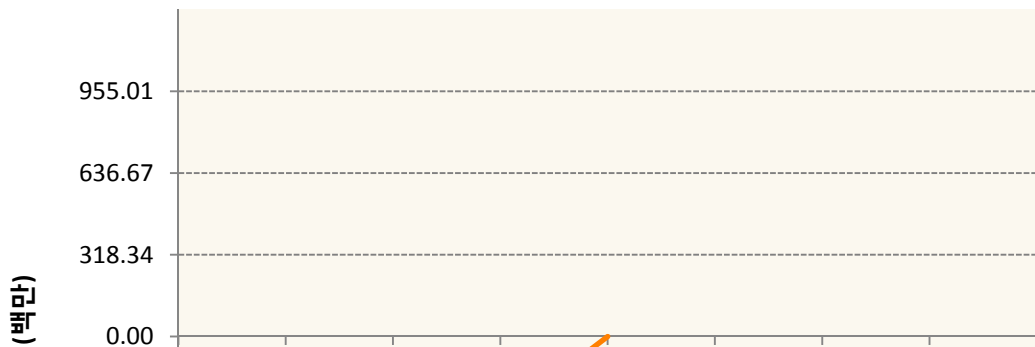


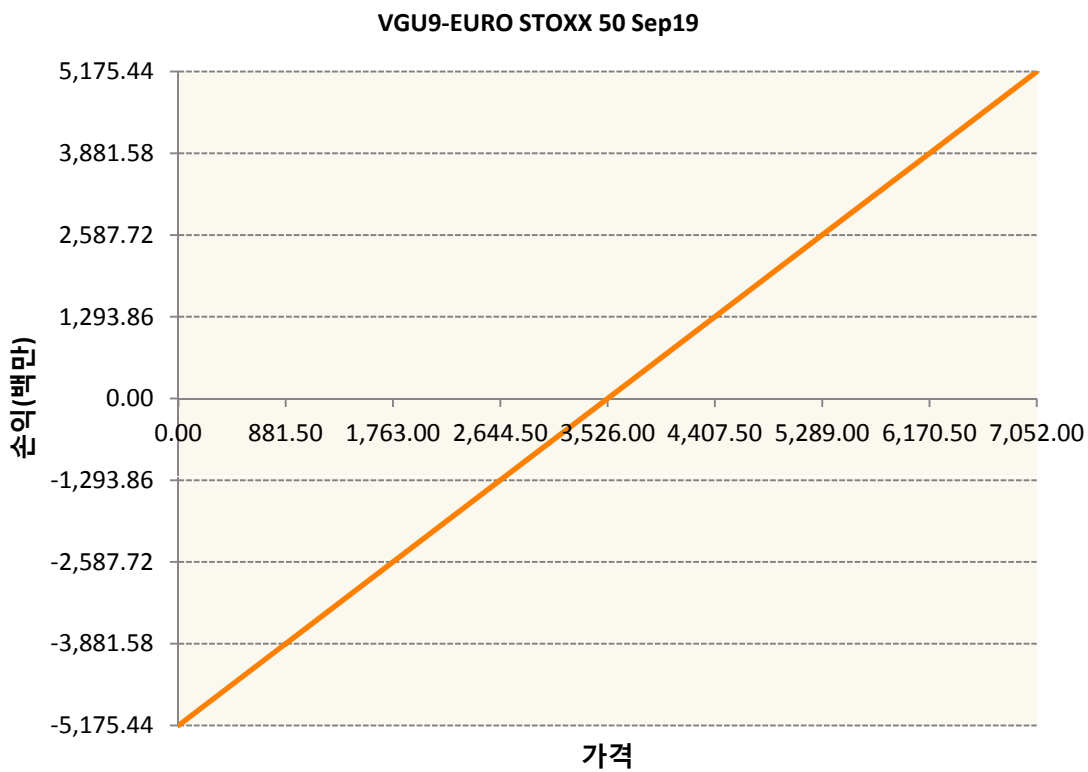
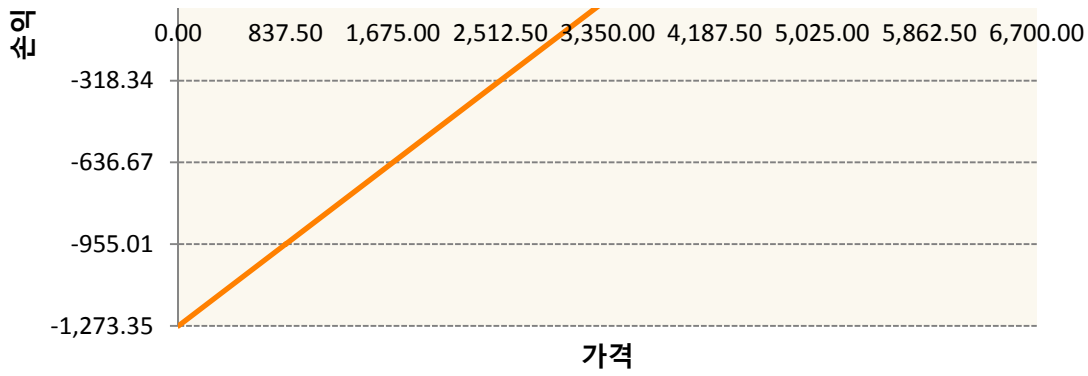


OESXU9-P3325-EURO STOXX 50



OESXU9-P3350-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	18
FX21019M0< KRW/EUR 27-09-19E	1,049
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	315
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E	315
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	499
OESXU9-C3< EURO STOXX 50	102
OESXU9-P3< EURO STOXX 50	499
OESXU9-P3< EURO STOXX 50	102

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

(단위:백만원)

2,206

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

(단위:백만원)

983

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

(단위:백만원)

84

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

(단위:백만원)

131

공시일	2019-09-18
기준일	2019-09-17

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

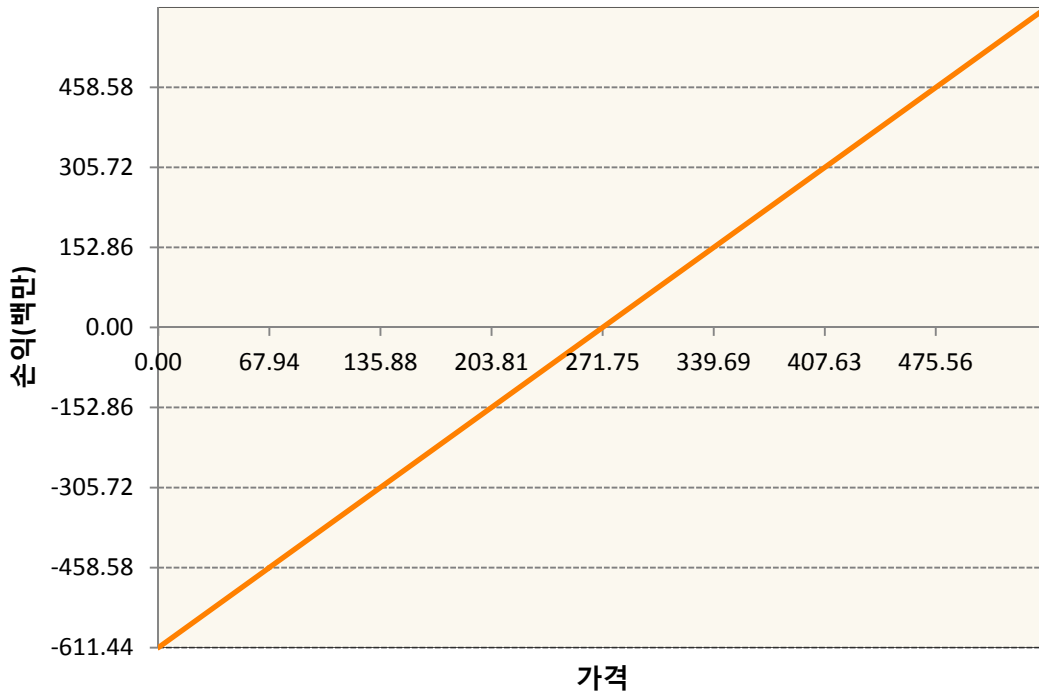
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	611	0	611	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	2019-09-18
기준일	2019-09-17

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

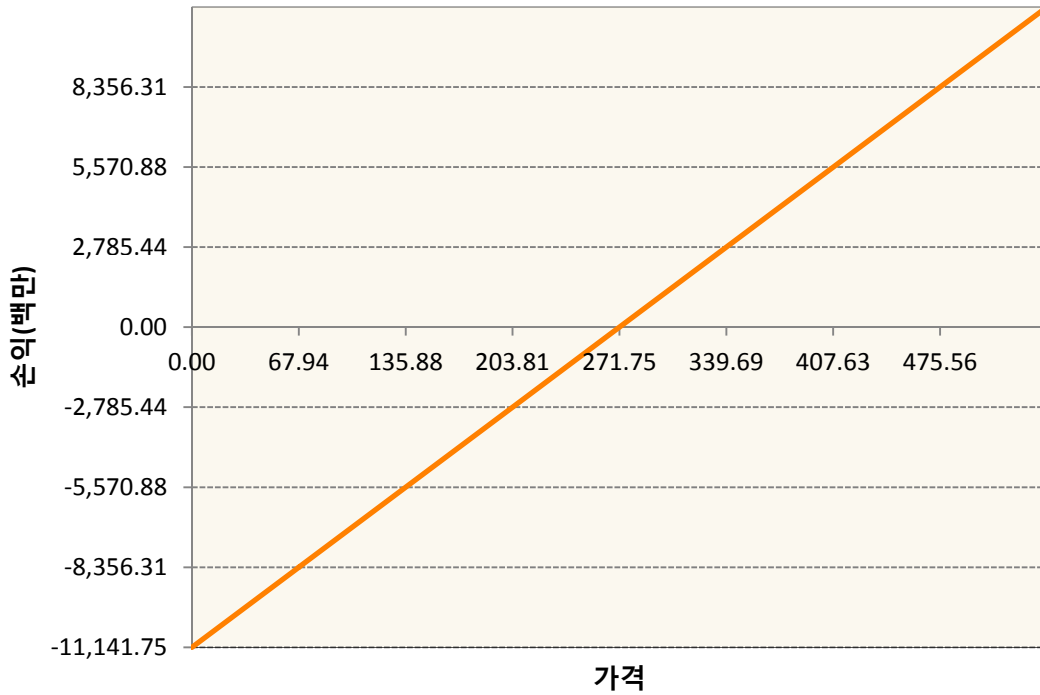
1. 계약금액

(단위:백만원)

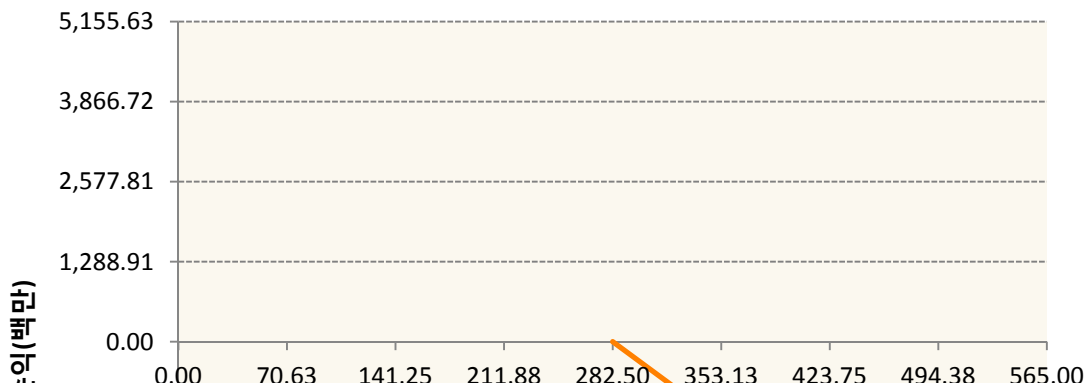
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,142	0	11,142	장내
누계	유가증권	옵션	1,422	20,902	-19,480	장내

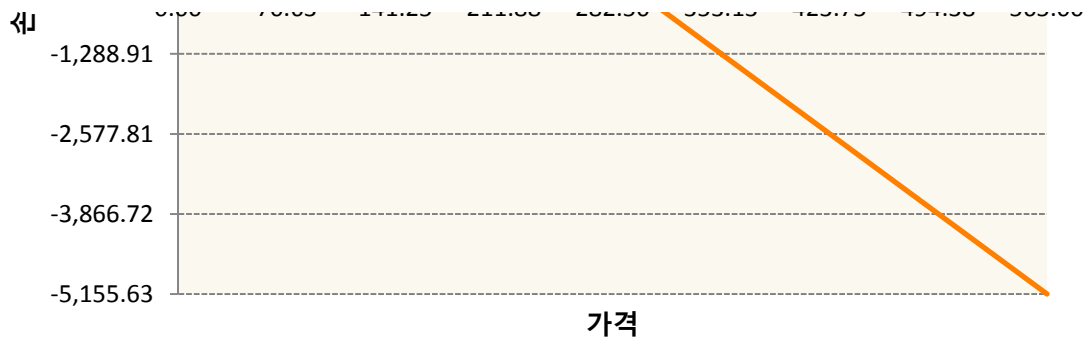
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

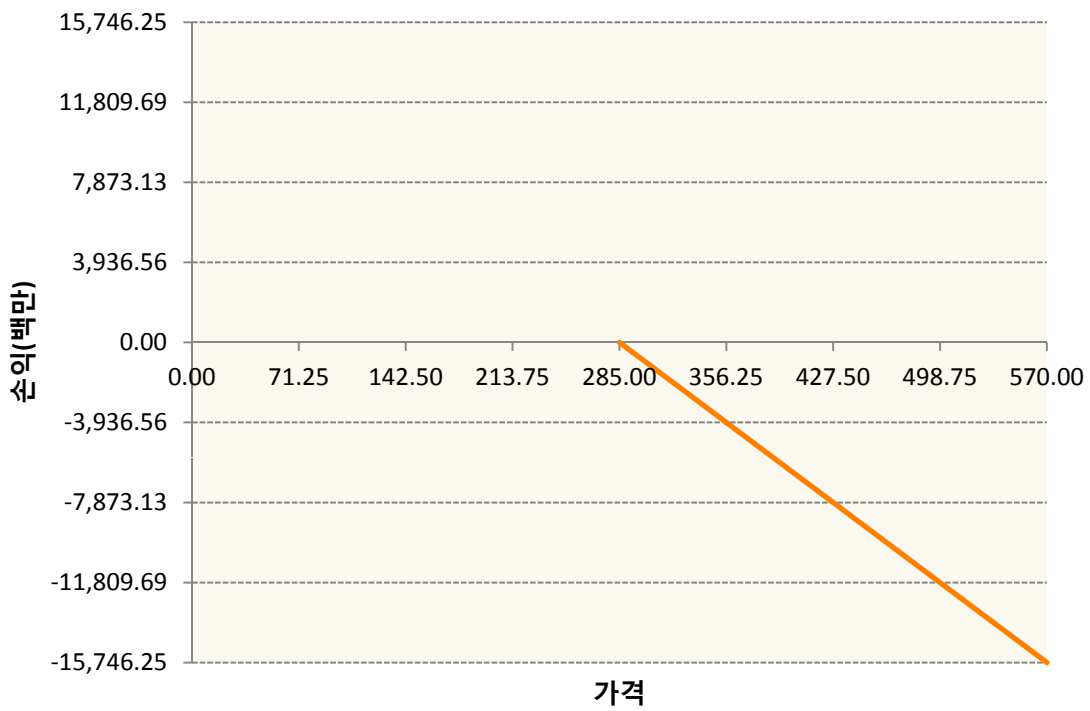


KR4201PA2827-2019-10 콜282.5

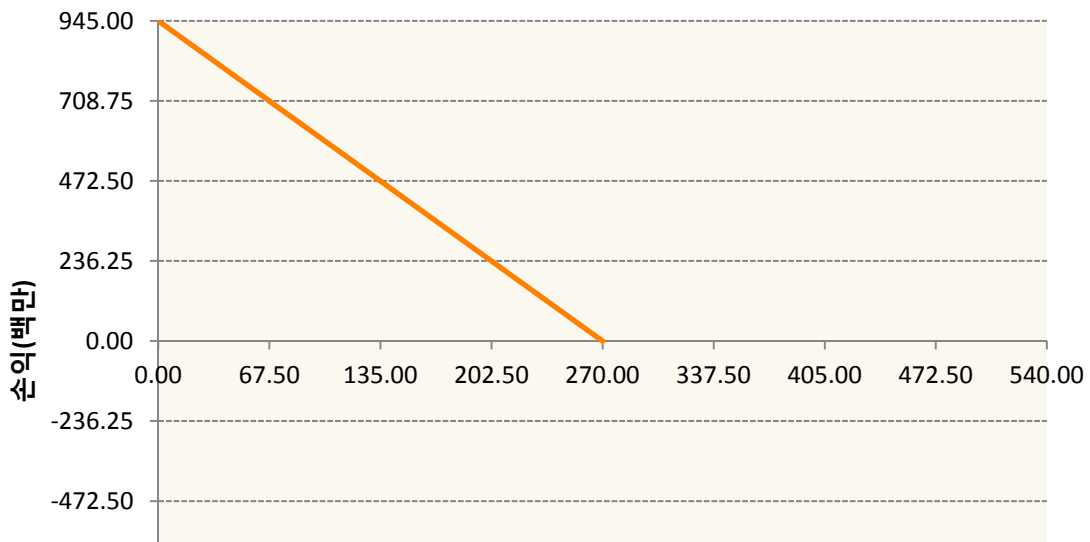


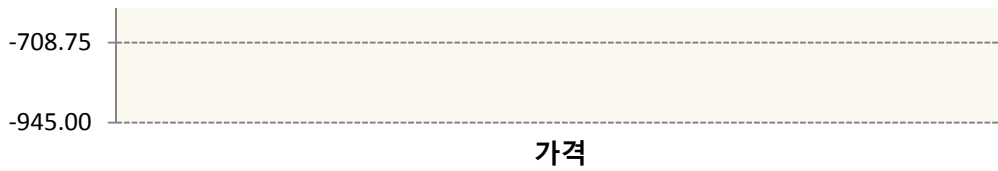


KR4201PA2850-2019-10 콜285

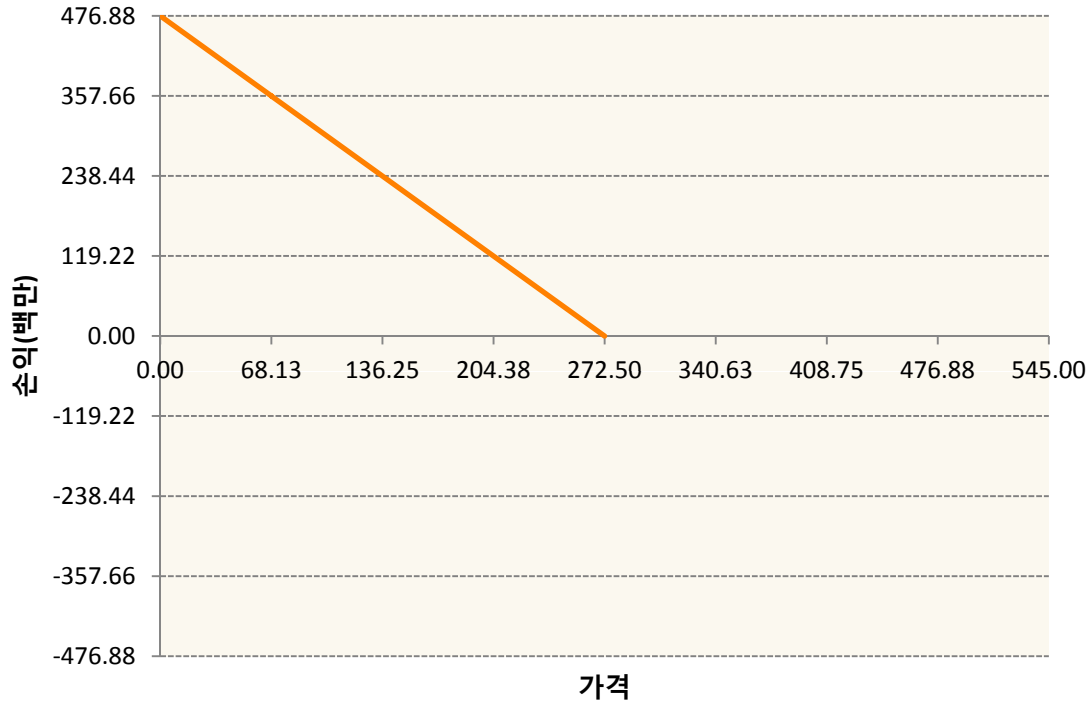


KR4301PA2701-2019-10 풋270





KR4301PA2727-2019-10 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						891
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-891	-891	-891	-891	-891	-891	-891	
-5.33%	-594	-594	-594	-594	-594	-594	-594	
-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%	594	594	594	594	594	594	594	
8.00%	891	891	891	891	891	891	891	
KR4201PA2827		2019-10 콜282.5						232
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	57	57	55	54	51	48	45	
-5.33%	55	53	50	46	42	37	31	
-2.67%	47	42	36	30	23	15	7	

0%	27	18	9	0	-10	-19	-29
2.67%	-14	-25	-36	-47	-59	-70	-81
5.33%	-81	-92	-103	-115	-126	-138	-149
8.00%	-173	-182	-191	-201	-211	-222	-232
KR4201PA2850 2019-10 콜285							649
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	140	139	136	132	127	120	111
-5.33%	136	131	124	115	103	90	76
-2.67%	119	107	92	75	56	36	14
0%	73	50	26	0	-27	-55	-83
2.67%	-28	-60	-92	-125	-158	-191	-224
5.33%	-202	-238	-273	-308	-343	-378	-413
8.00%	-455	-486	-518	-550	-583	-616	-649
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	60	60	60	60
-5.33%	34	35	35	35	36	36	37
-2.67%	12	13	14	15	16	17	18
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-10	-9	-8	-8	-7	-6	-5
5.33%	-11	-11	-11	-11	-10	-10	-9
8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
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	20	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%	-8	-8	-7	-7	-7	-7	-6
8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-7

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

(단위:백만원)

1,542

공시일	2019-09-18
기준일	2019-09-17

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	91,345	0	91,345	

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	2019-09-18
기준일	2019-09-17

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	116,005	0	116,005	

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	2019-09-18
기준일	2019-09-17

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	478,271	0	478,271	
누계	통화	선도	0	494,736	-494,736	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		286
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		3,143
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		2,134
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,905
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,524
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,610
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,962
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		2,667
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		2,038
FX21019U01 KRW/USD 10-10-19E		286
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E		191
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E		2,324
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E		1,715
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E		191
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E		953

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

(단위:백만원)

13,116

공시일	2019-09-18
기준일	2019-09-17

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

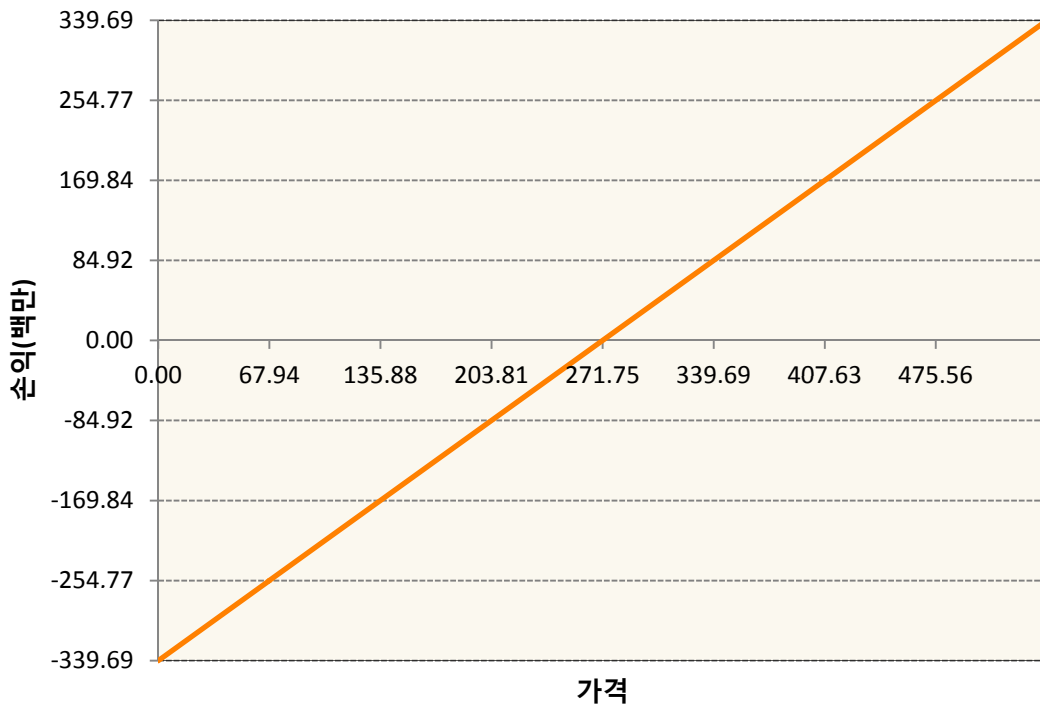
1. 계약금액

(단위:백만원)

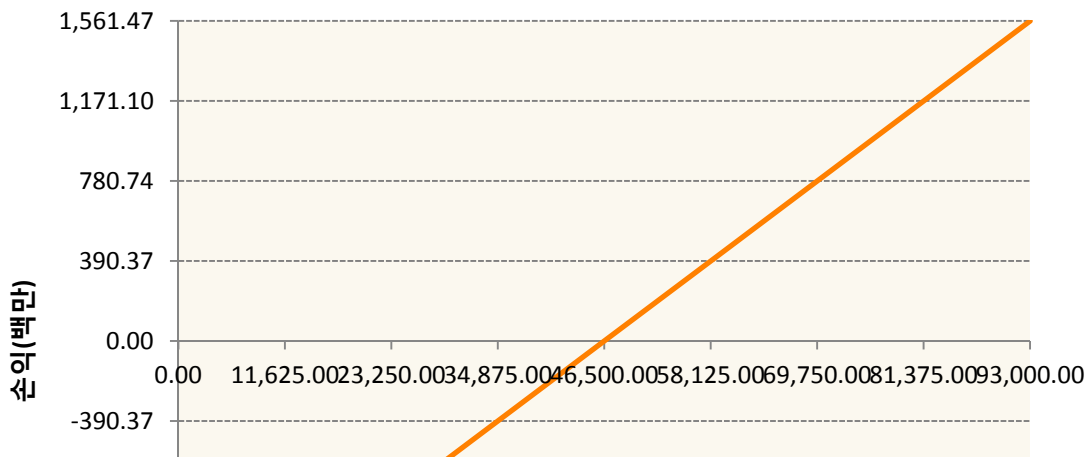
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,901	0	1,901	장내

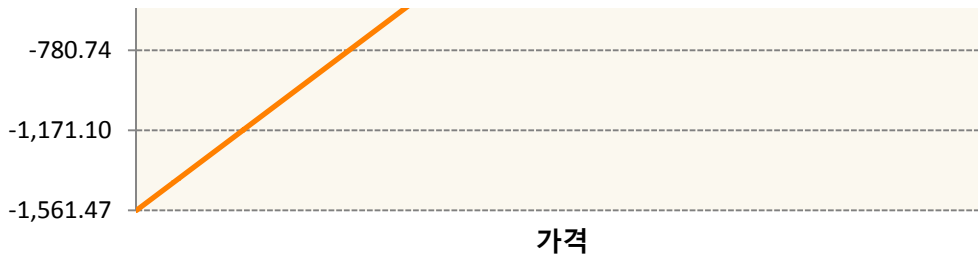
2. 만기시점의 손익구조

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						126
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126	
-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%	126	126	126	126	126	126	126	

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

181

공시일	2019-09-18
기준일	2019-09-17

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

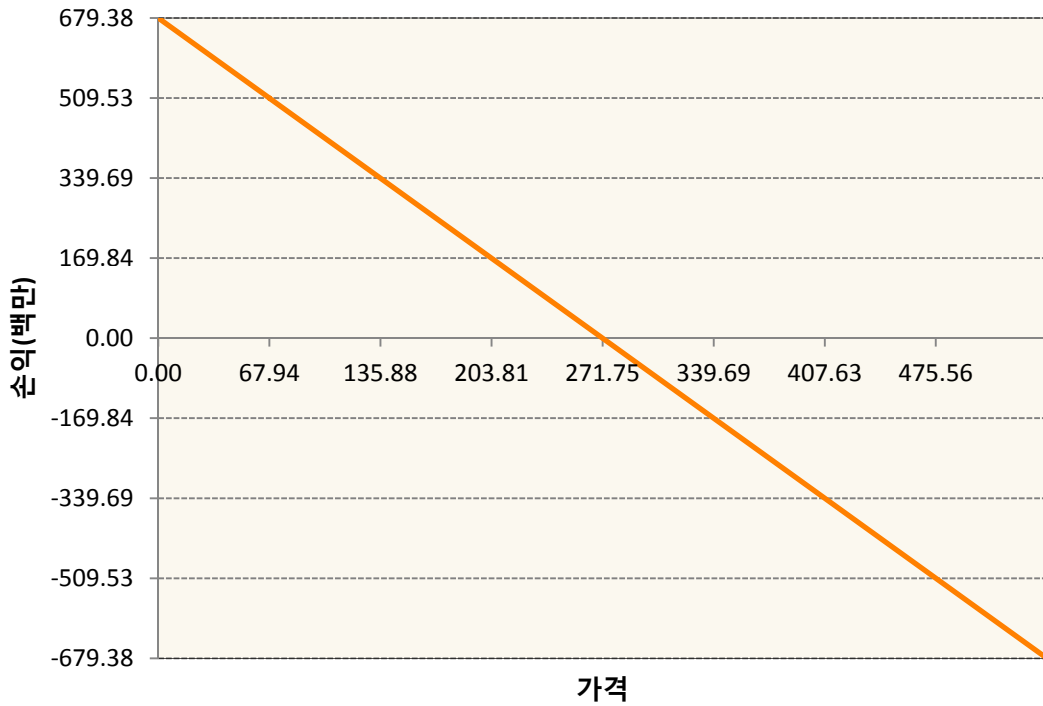
1. 계약금액

(단위:백만원)

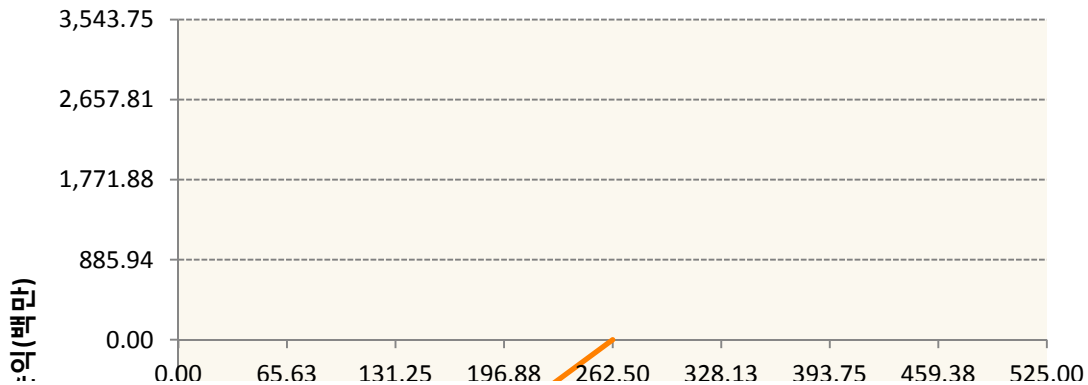
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	679	-679	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,875	-3,875	장내

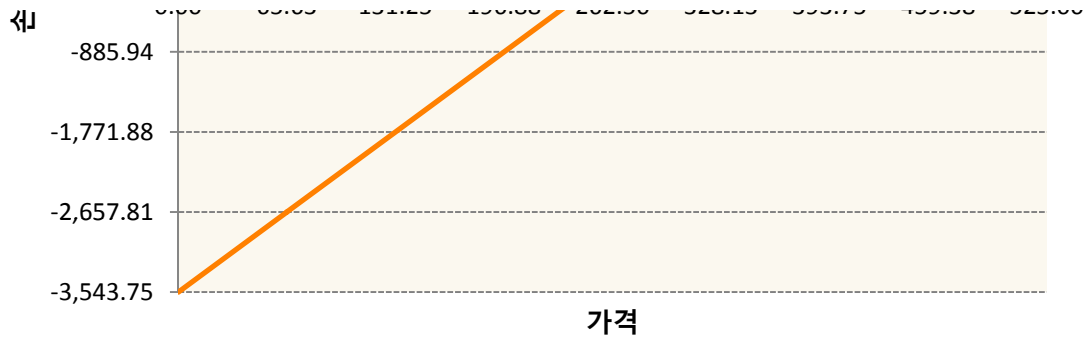
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

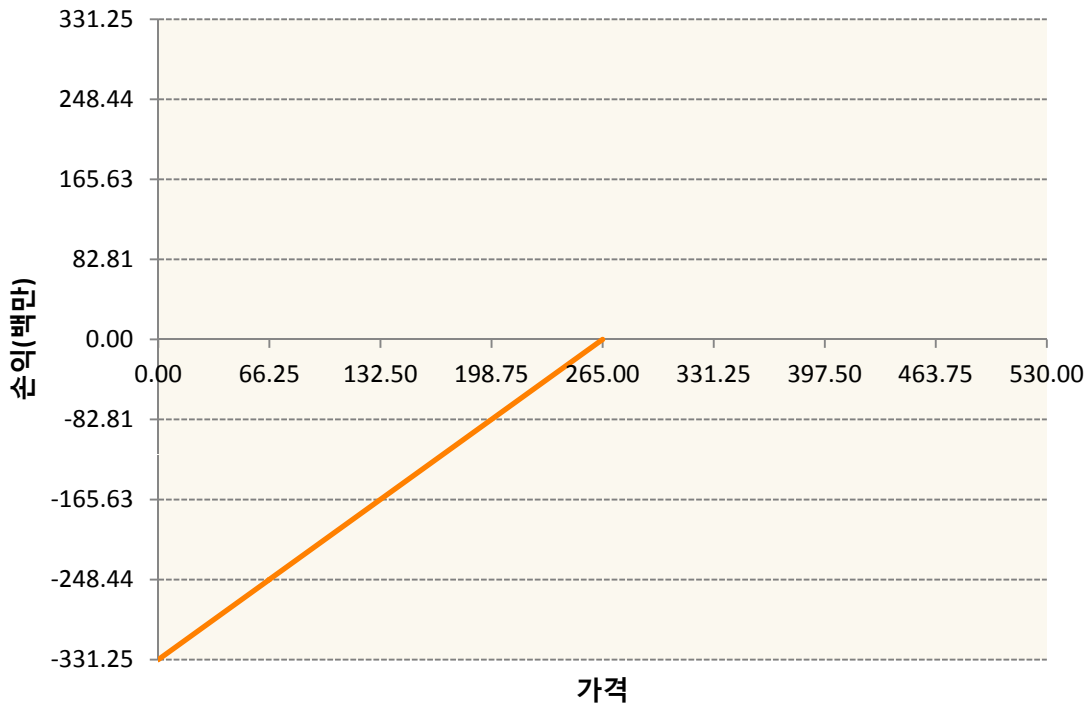


KR4301PA2628-2019-10 풋262.5





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						170
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-160	-161	-163	-164	-166	-168	-170
-5.33%	-74	-77	-80	-84	-87	-91	-95
-2.67%	-15	-20	-24	-28	-32	-37	-41
0%	8	5	3	0	-3	-6	-9
2.67%	12	12	11	10	9	7	5
5.33%	13	13	13	12	12	11	11
8.00%	13	13	13	13	13	13	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	-18	-18	-18
-5.33%	-9	-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	2	1	1	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

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

(단위:백만원)

204

공시일	2019-09-18
기준일	2019-09-17

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	18,690	0	18,690	
누계	통화	선도	119	18,932	-18,813	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		514
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)

505

공시일	2019-09-18
기준일	2019-09-17

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	131	-39	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
FX21019U02 KRW/EUR 22-11-19E	2

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

(단위:백만원)

36

공시일	2019-09-18
기준일	2019-09-17

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

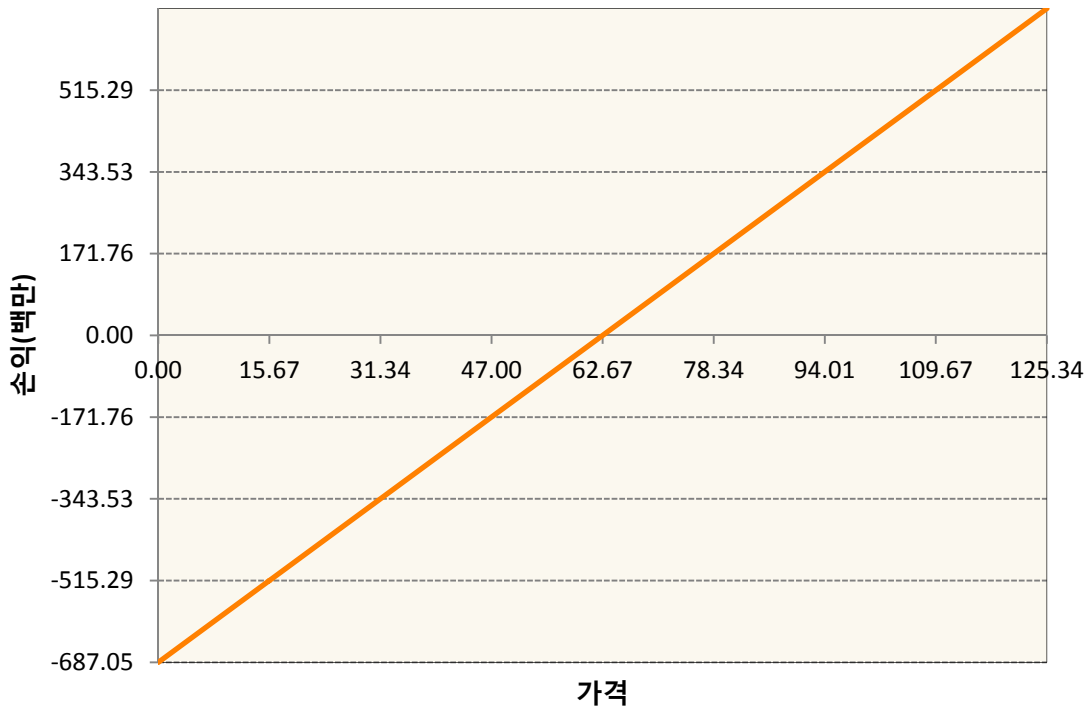
1. 계약금액

(단위:백만원)

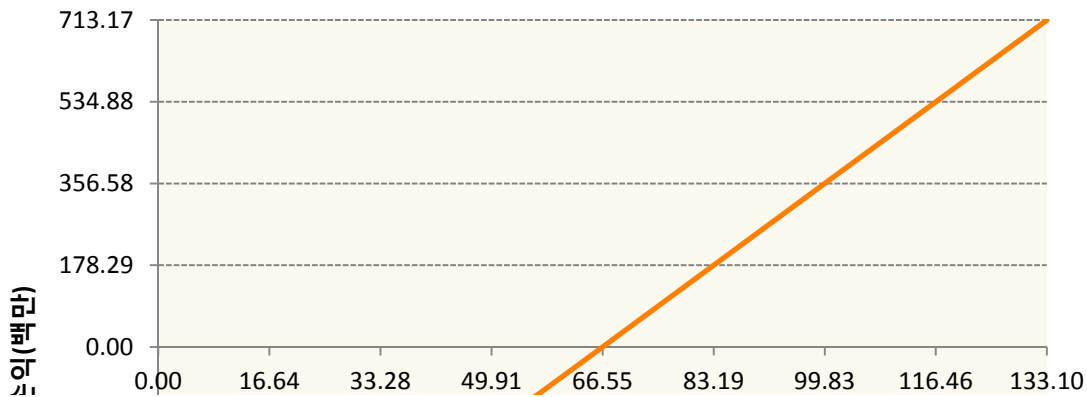
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,592	476	2,116	
누계	유가증권	선물	213	0	213	장내

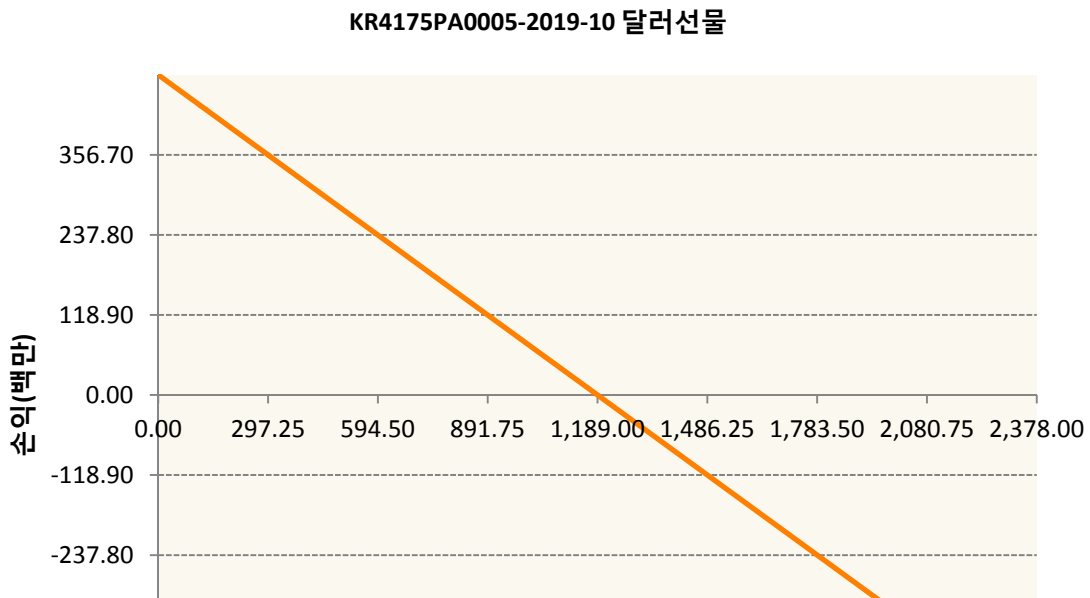
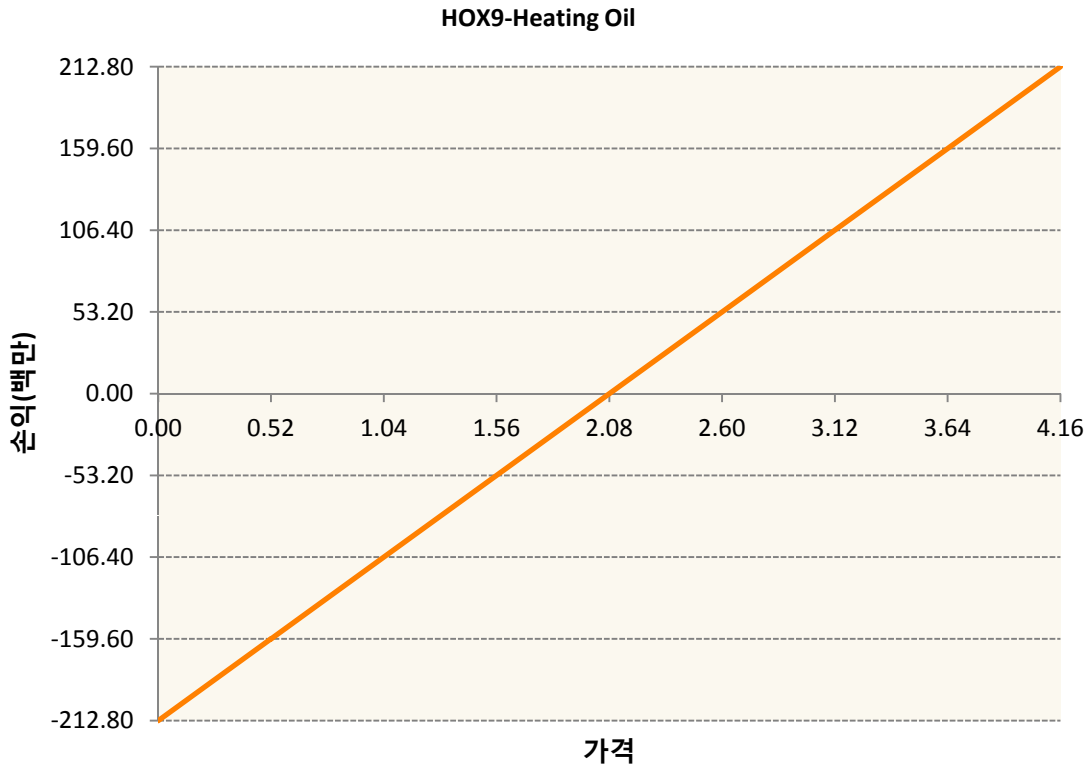
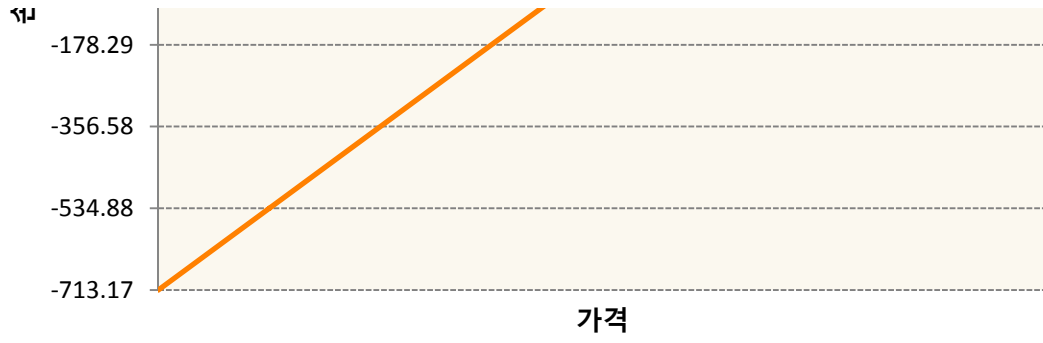
2. 만기시점의 손익구조

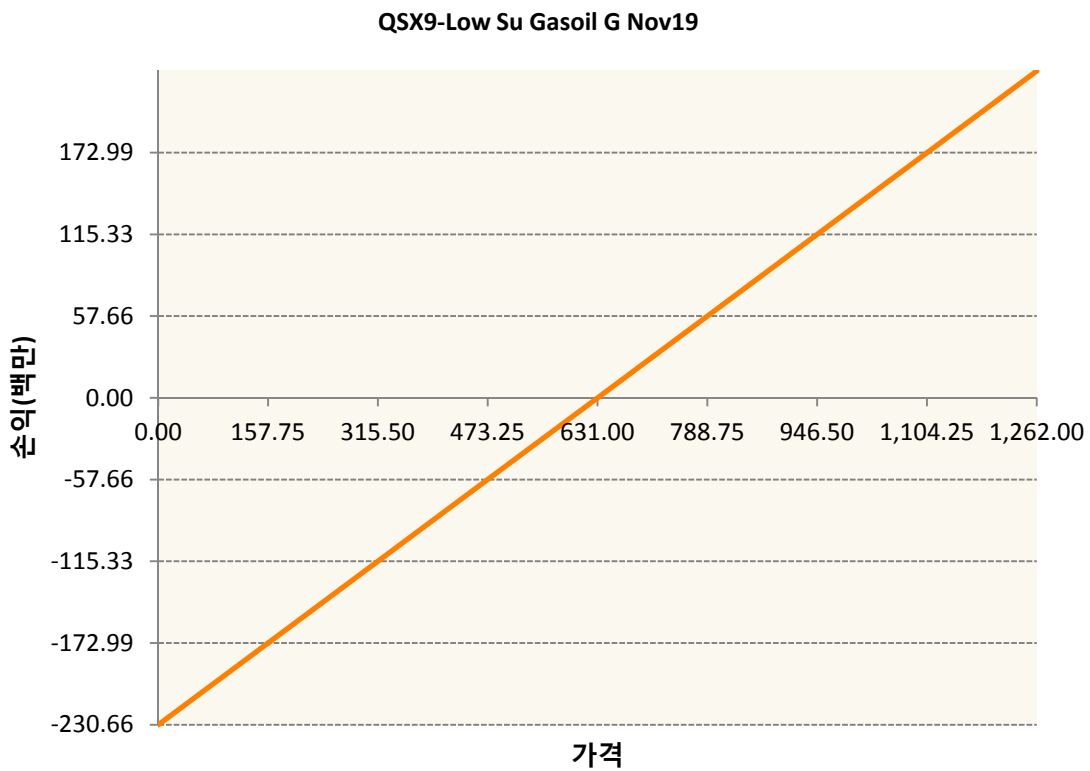
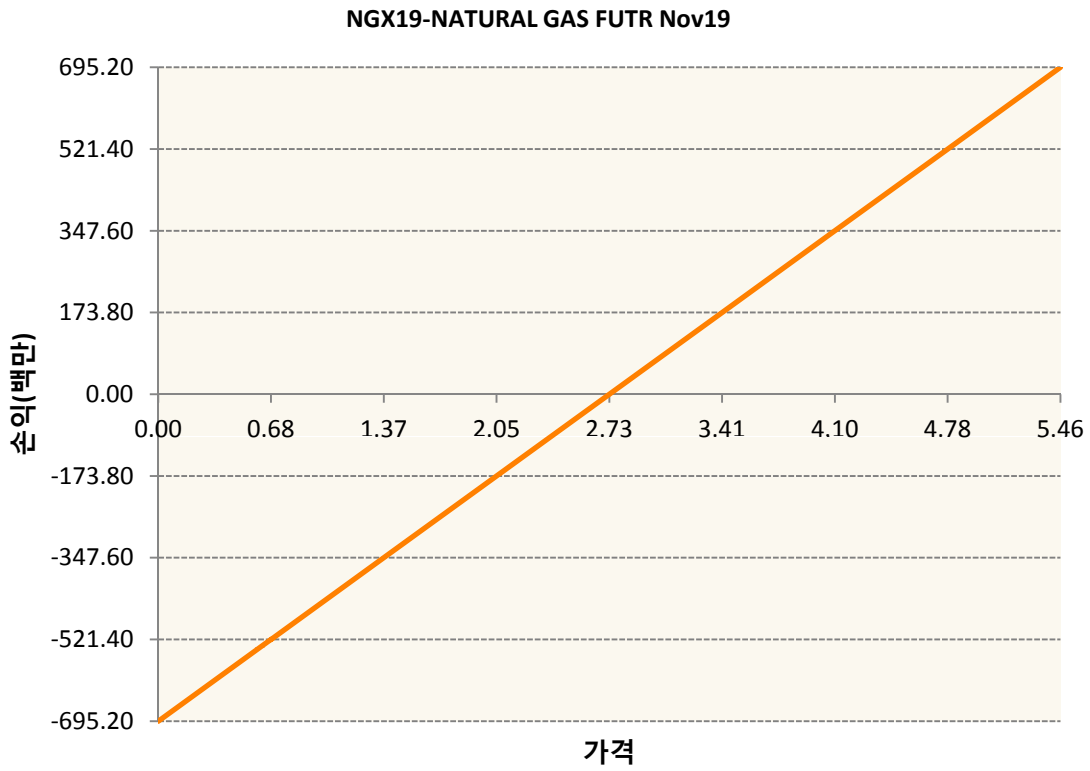
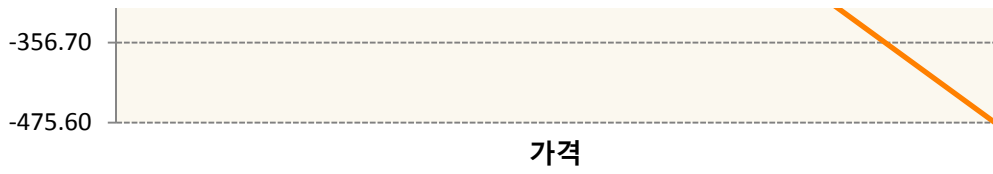
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19



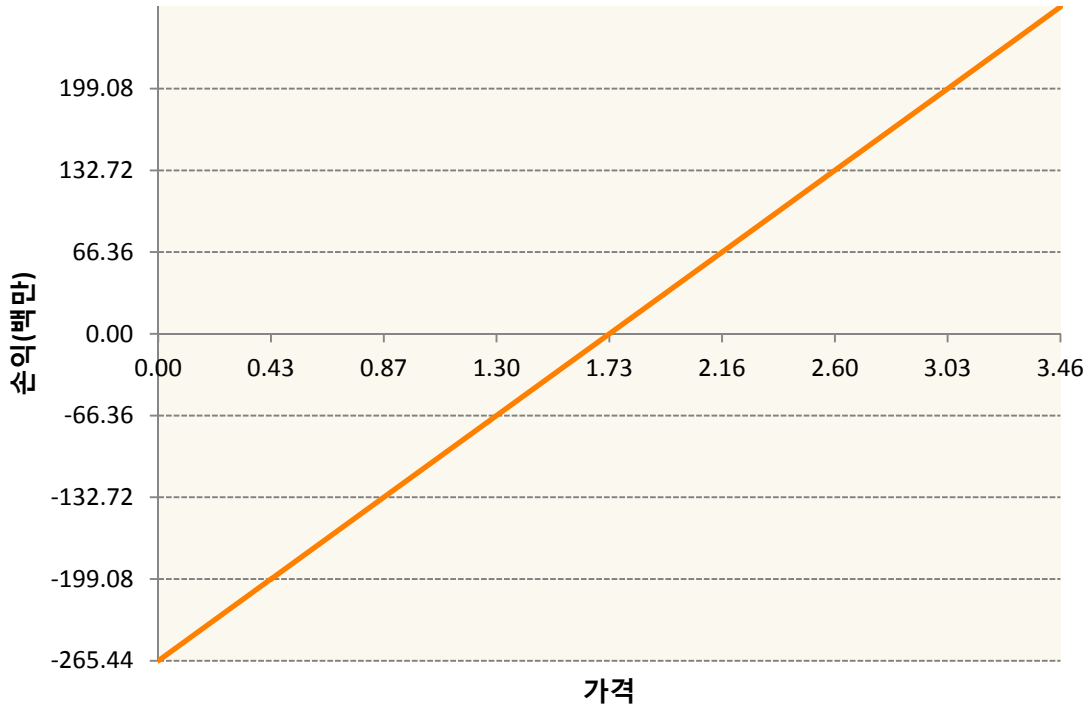
COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20







XBX9-GASOLINE RBOB FUT Nov19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLX9	WTI CRUDE FUTURE Nov19	55
COF0	BRENT CRUDE FUTR Jan20	57
HOX9	Heating Oil	17
KR4175PA00	2019-10 달러선물	38
NGX19	NATURAL GAS FUTR Nov19	56
QSX9	Low Su Gasoil G Nov19	18
XBX9	GASOLINE RBOB FUT Nov19	21

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

(단위:백만원)

466

공시일	2019-09-18
기준일	2019-09-17

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

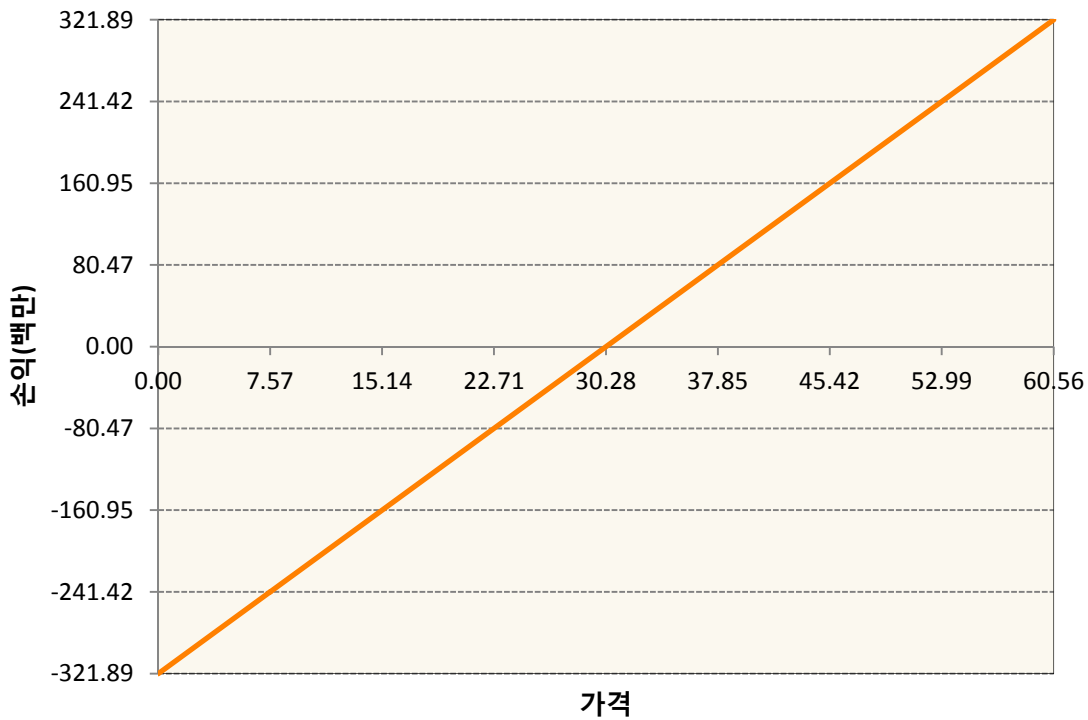
1. 계약금액

(단위:백만원)

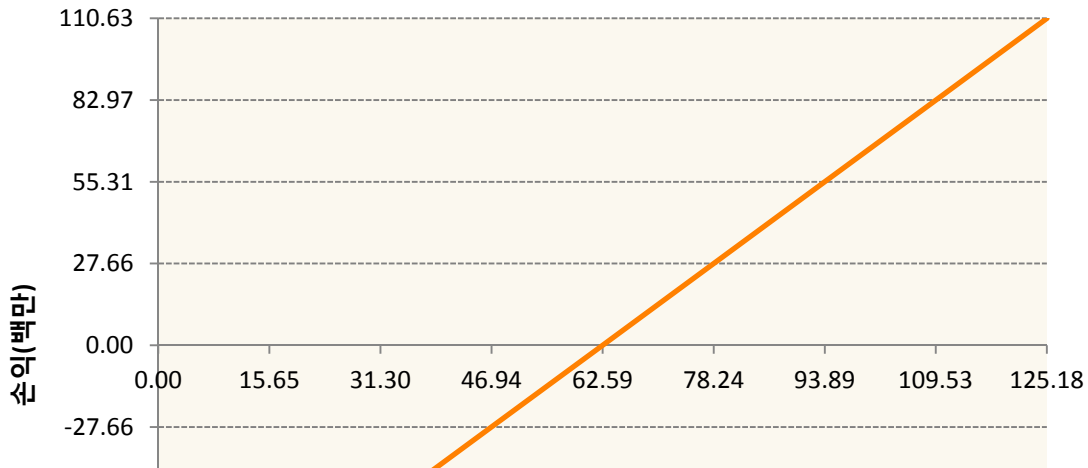
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,800	95	2,705	

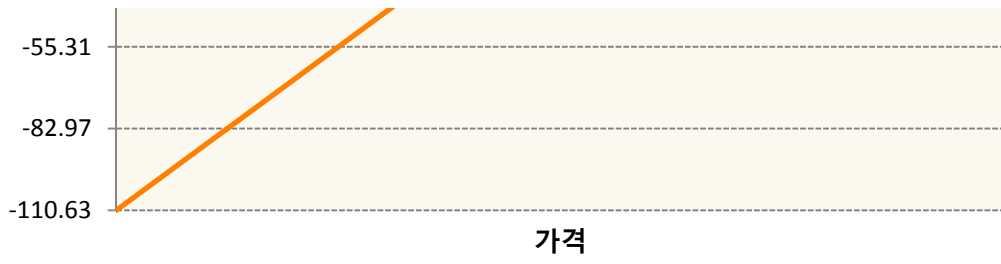
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

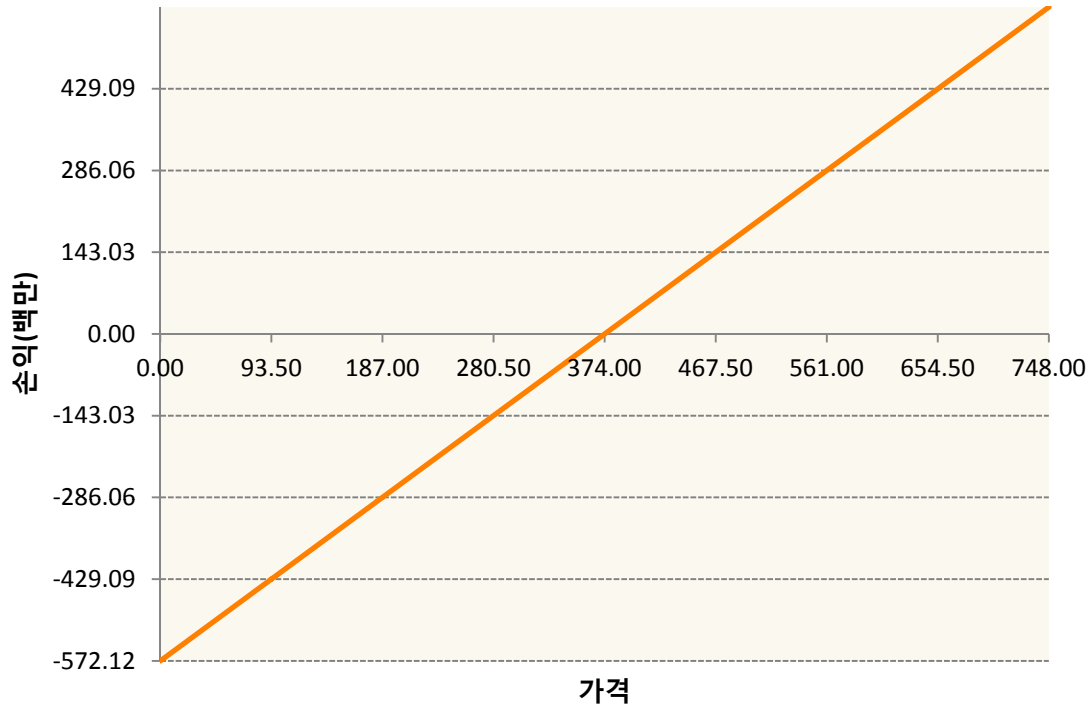


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

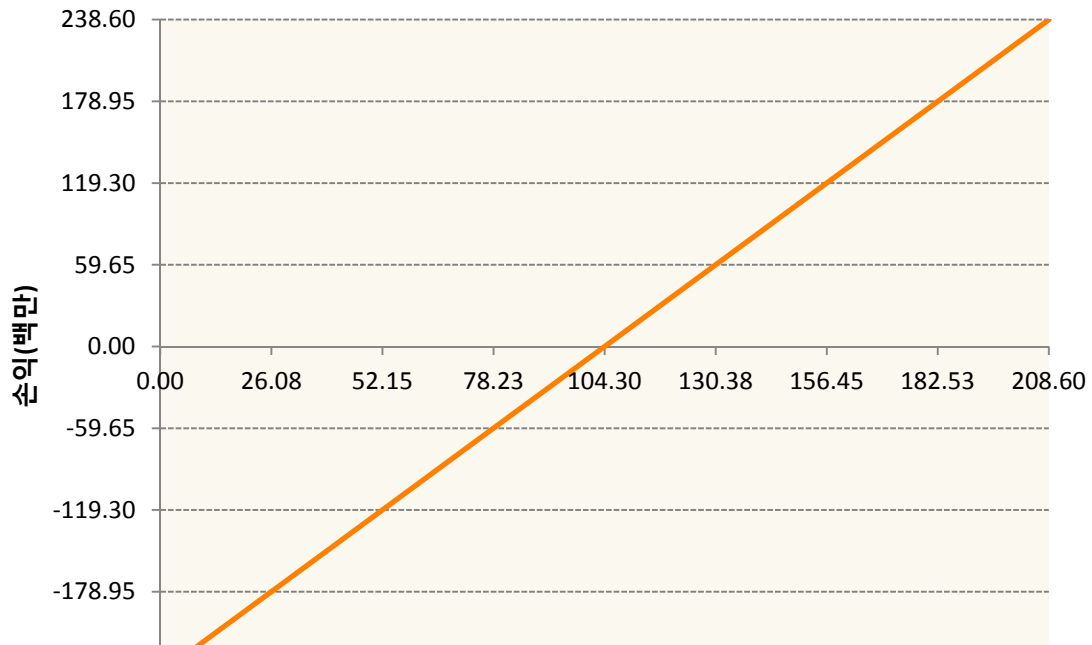


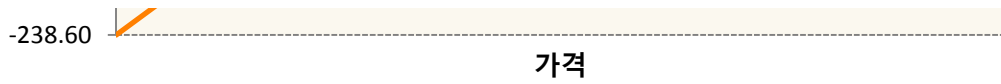


CZ9-CORN FUTURE Dec19

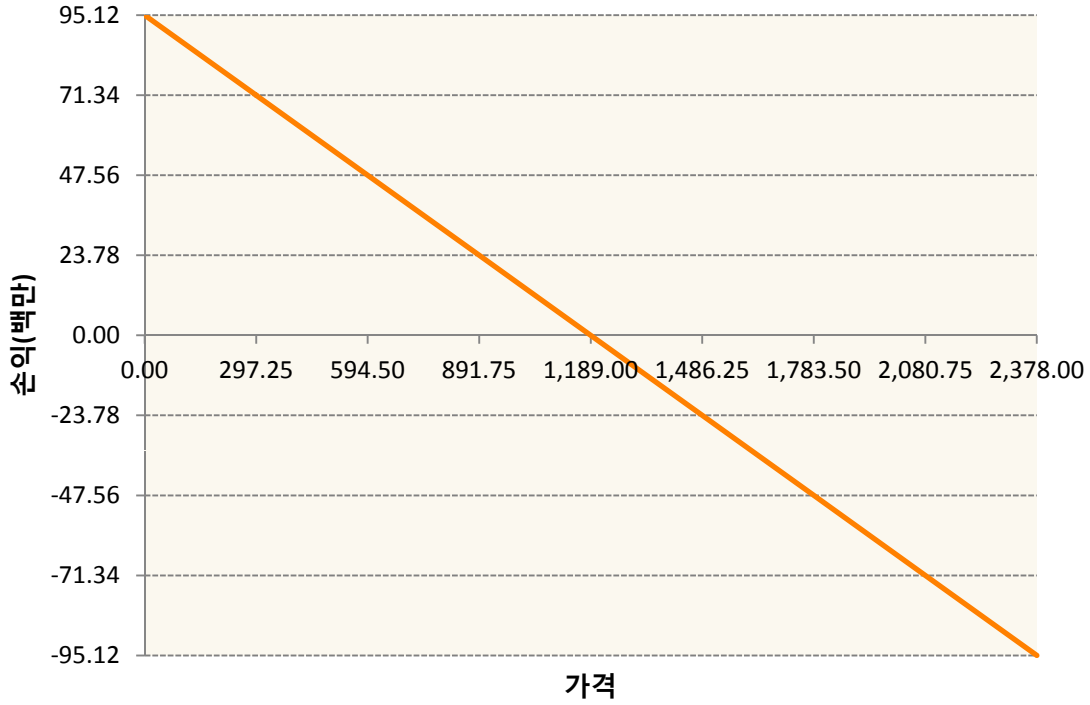


KC9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19

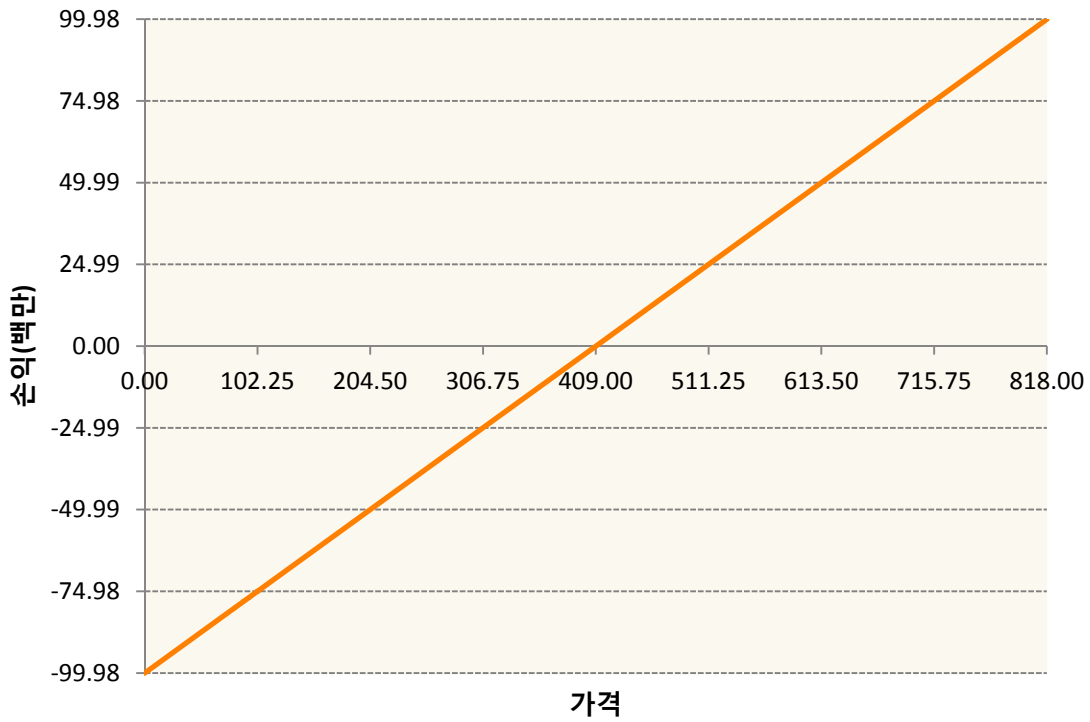




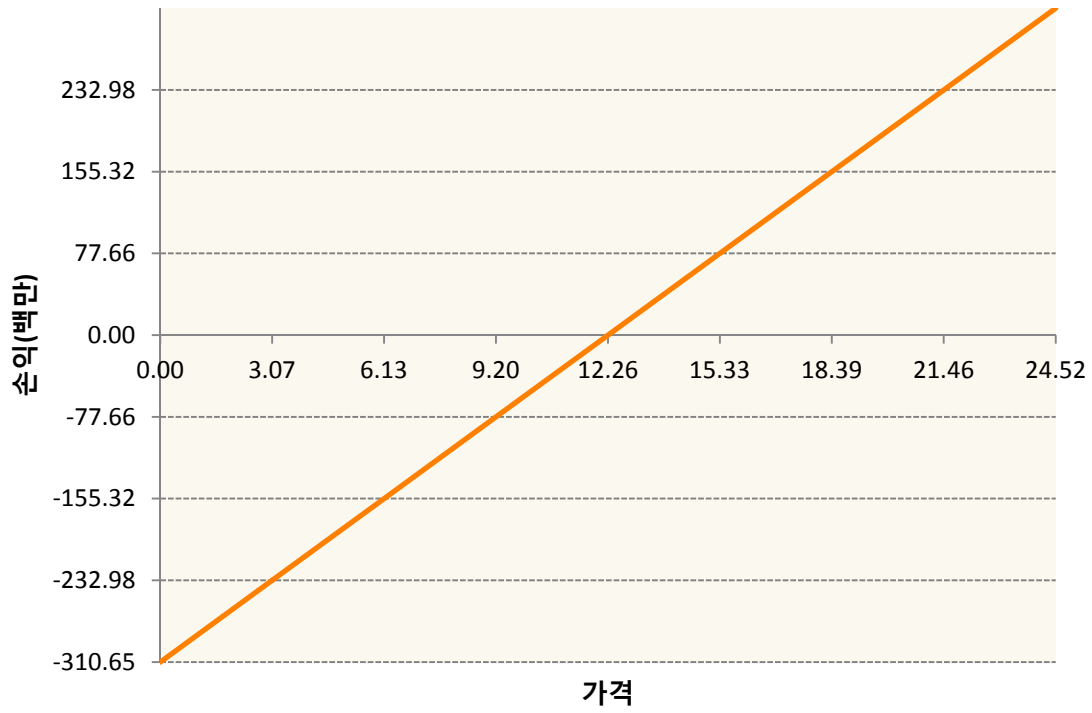
KR4175PA0005-2019-10 달러선물



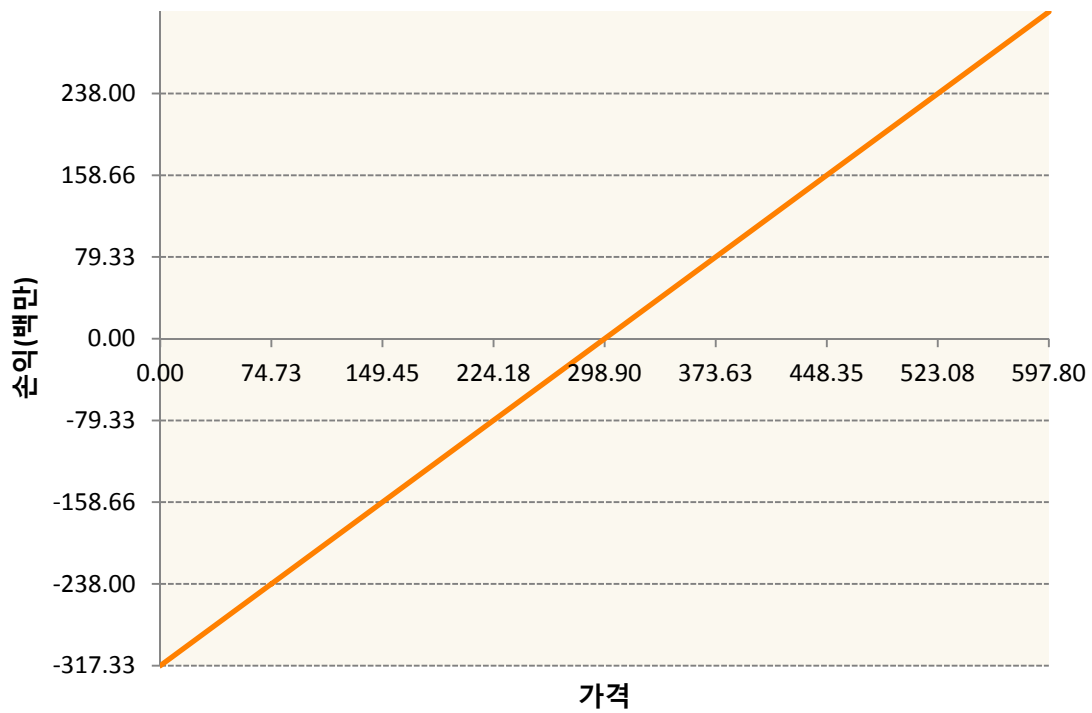
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



SBH0-Sugar Mar20

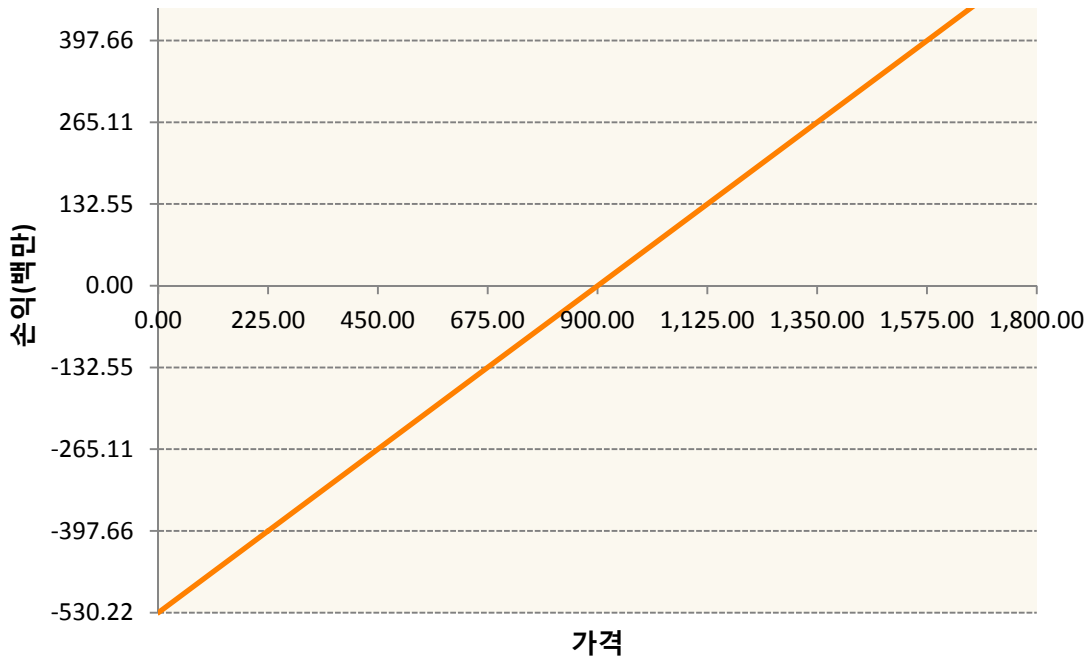


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

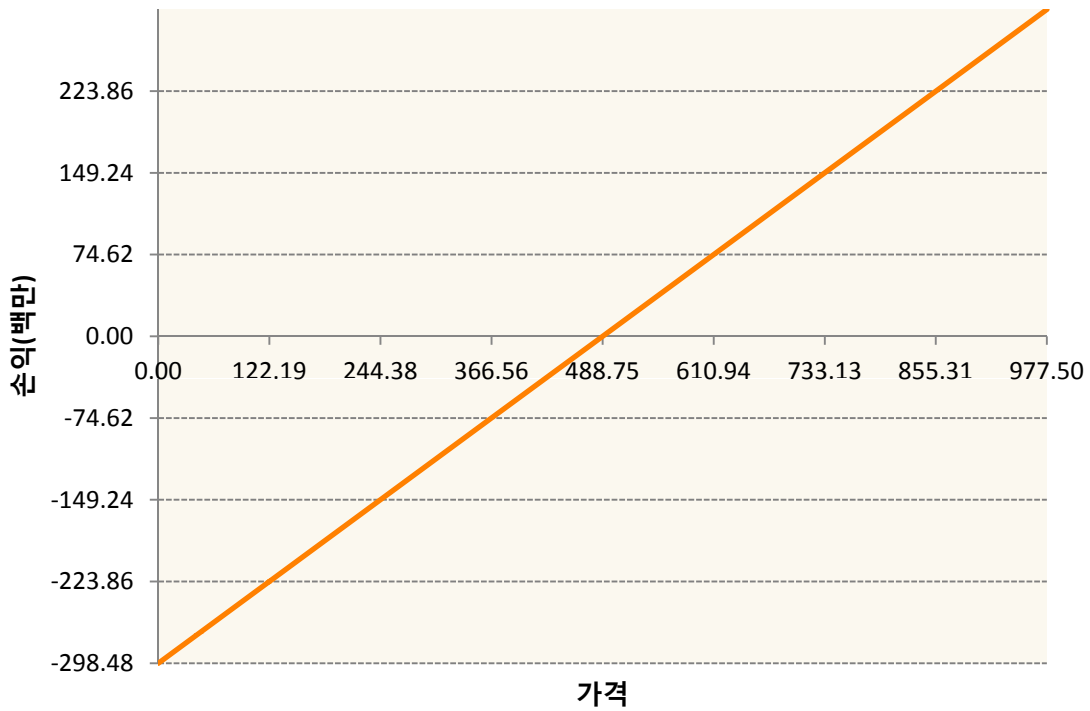


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





WZ9-WHEAT FUTURE(CBT) Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	26
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	9
CZ9	CORN FUTURE Dec19	46
KCZ9	COFFEE 'C' FUTURE Dec19	19
KR4175PA00	2019-10 달러선물	8

KWZ9	KC HRW WHEAT FUT Dec19	8
SBH0	Sugar Mar20	25
SMZ9	SOYBEAN MEAL FUTR Dec19	25
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	42
WZ9	WHEAT FUTURE(CBT) Dec19	24

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

(단위:백만원)

251