

공시일	2019-09-19
기준일	2019-09-18

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	2019-09-19
기준일	2019-09-18

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

1,183

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

678

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-19
기준일	2019-09-18

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)

849

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-19
기준일	2019-09-18

유로인덱스모(주식-파생형)

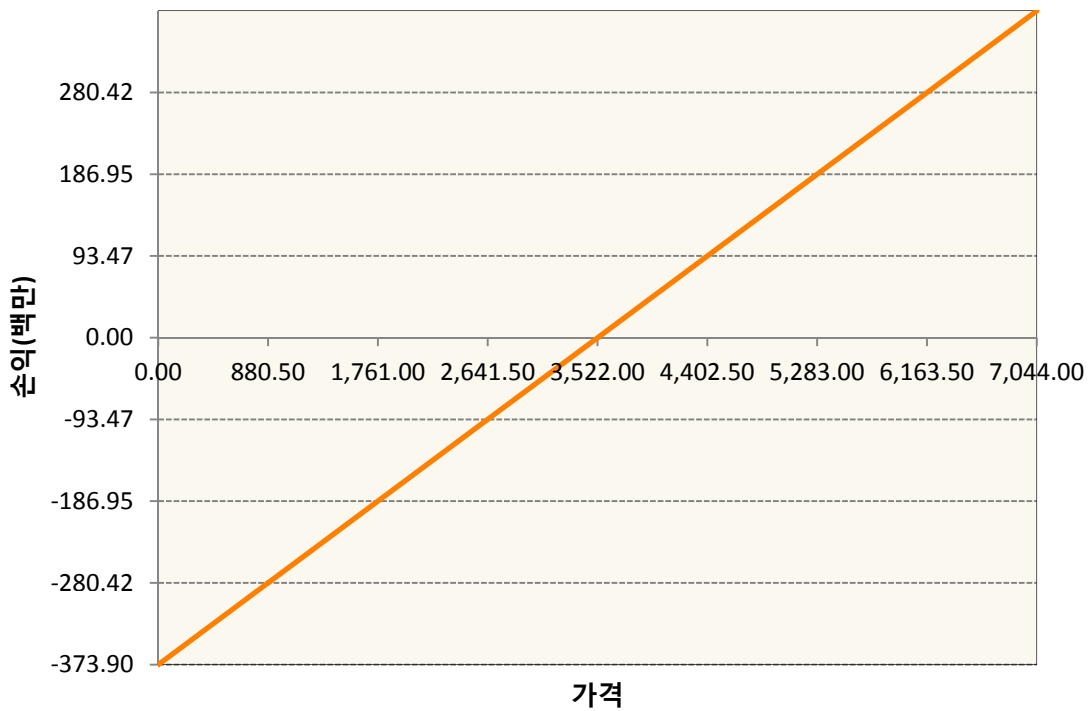
1. 계약금액

(단위:백만원)

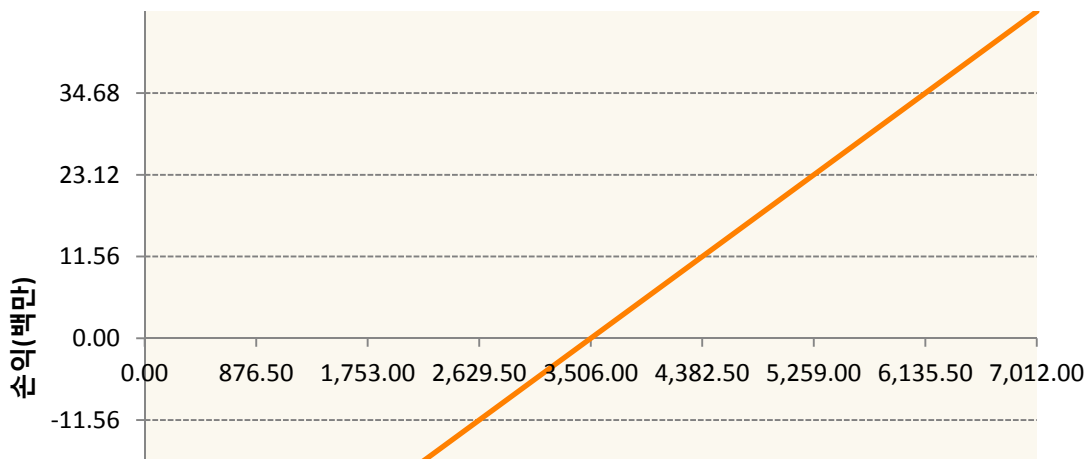
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	420	0	420	

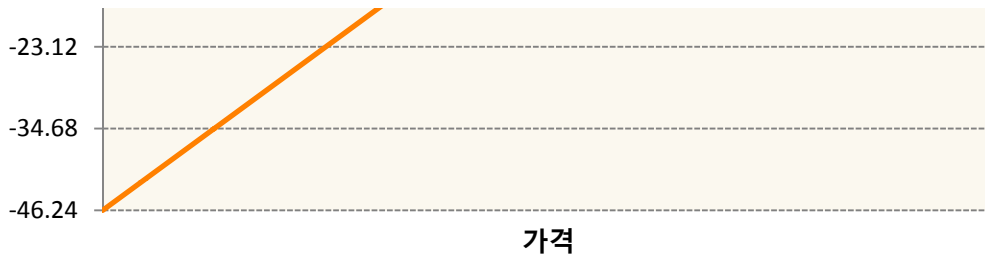
2. 만기시점의 손익구조

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	2019-09-19
기준일	2019-09-18

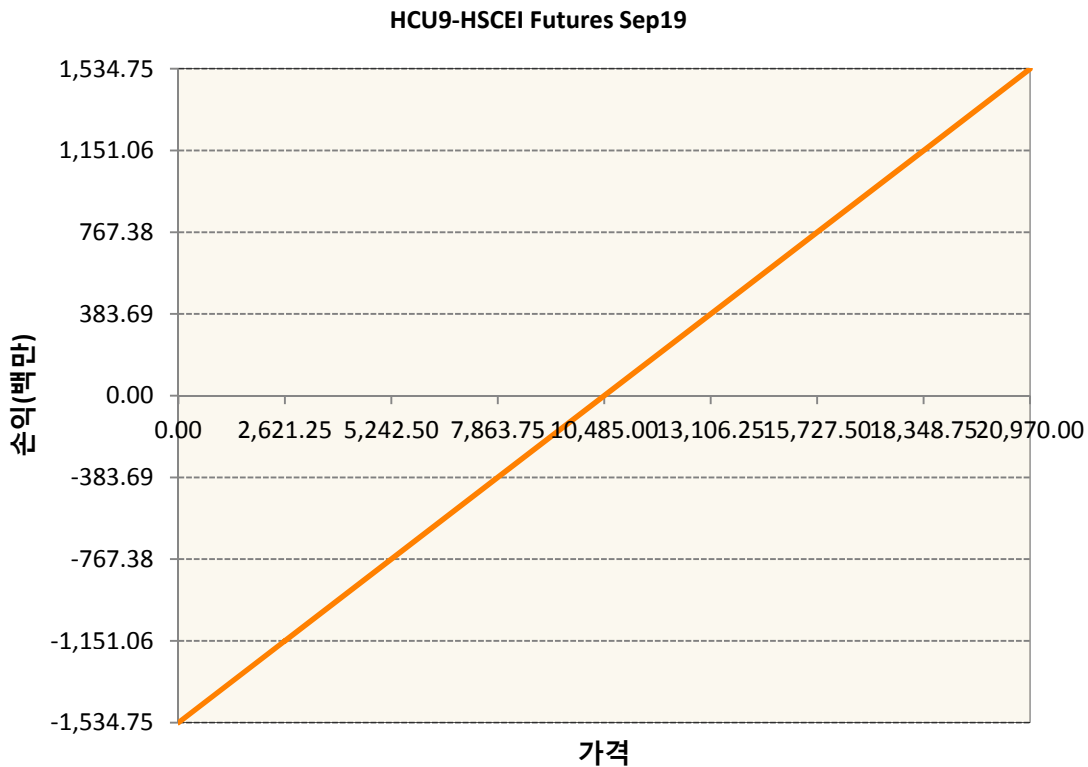
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,535	0	1,535	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	2019-09-19
기준일	2019-09-18

커버드콜모(주식혼합-파생형)

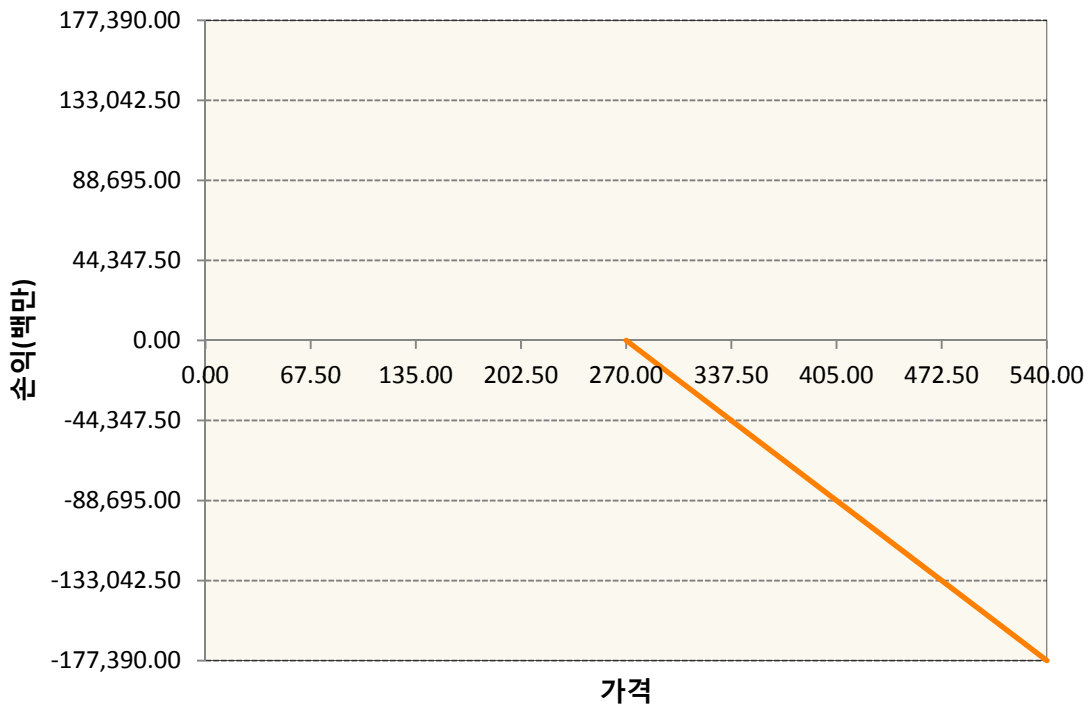
1. 계약금액

(단위:백만원)

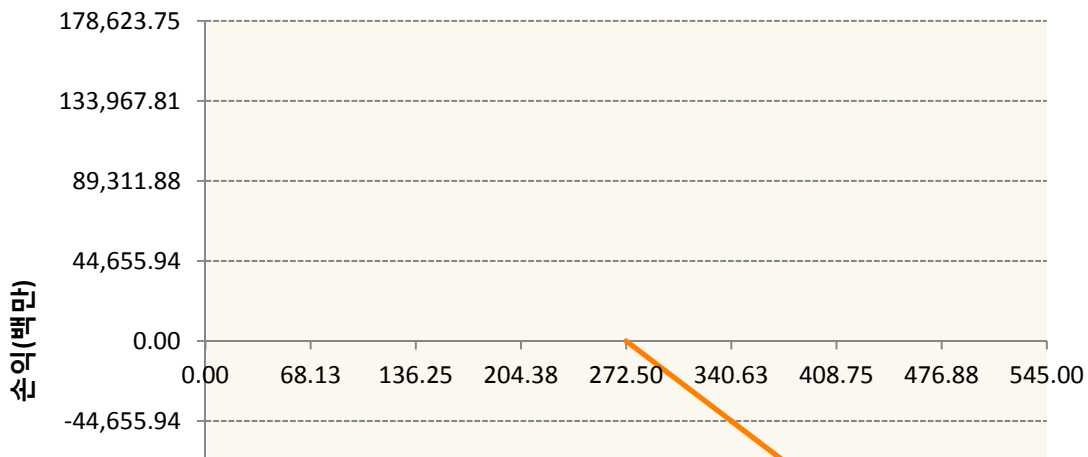
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	524,764	-524,764	장내

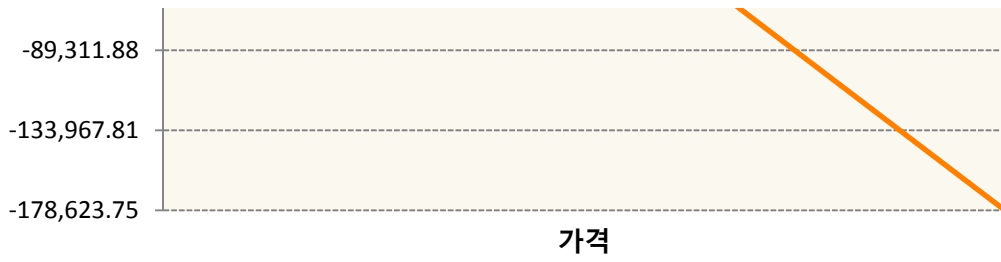
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PA2702-2019-10 콜270

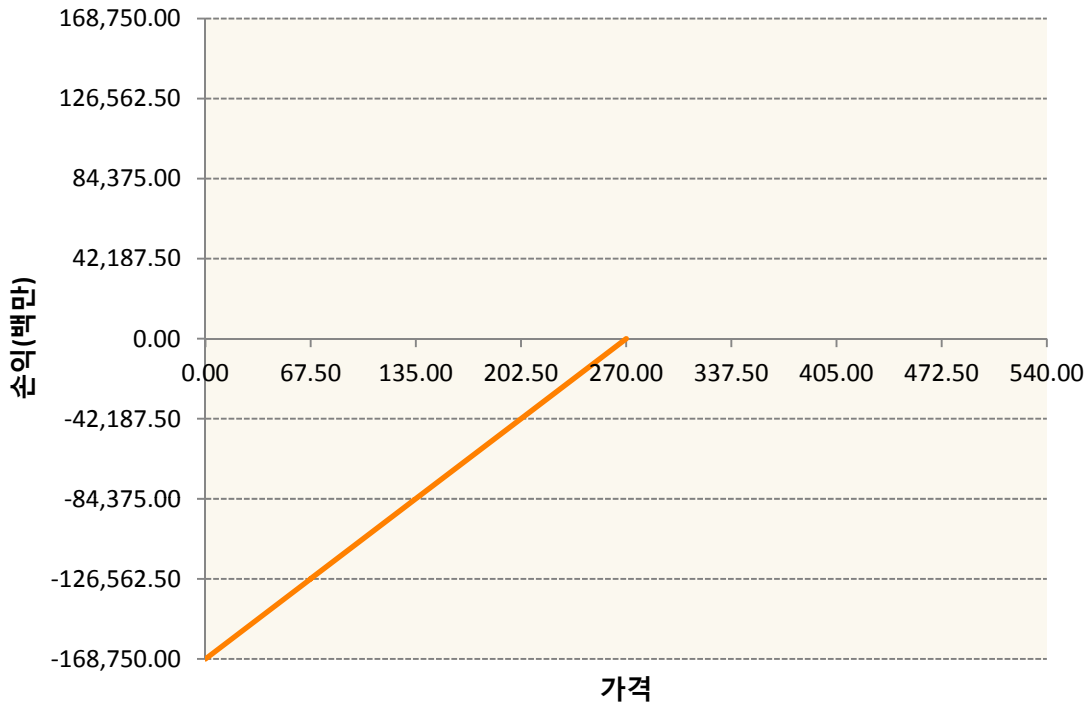


KR4201PA2728-2019-10 콜272.5





KR4301PA2701-2019-10 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PA2702		2019-10 콜270					11,659
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,416	5,275	5,108	4,917	4,705	4,475	4,230
-5.33%	4,813	4,549	4,267	3,972	3,664	3,348	3,024
-2.67%	3,473	3,108	2,739	2,368	1,995	1,621	1,245
0%	1,148	766	384	0	-385	-770	-1,155
2.67%	-2,158	-2,465	-2,786	-3,118	-3,459	-3,807	-4,161
5.33%	-6,203	-6,397	-6,618	-6,862	-7,125	-7,404	-7,697
8.00%	-10,681	-10,779	-10,906	-11,060	-11,238	-11,439	-11,659
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5					11,124
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,638	4,530	4,394	4,234	4,052	3,850	3,630

-5.33%	4,200	3,976	3,730	3,465	3,185	2,893	2,590
-2.67%	3,143	2,802	2,453	2,099	1,740	1,378	1,013
0%	1,170	780	390	0	-390	-780	-1,170
2.67%	-1,805	-2,148	-2,500	-2,859	-3,223	-3,592	-3,964
5.33%	-5,614	-5,850	-6,111	-6,390	-6,686	-6,994	-7,314
8.00%	-9,955	-10,086	-10,246	-10,433	-10,644	-10,875	-11,124
KR4301PA2701 2019-10 풋270							10,359
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10,200	-10,207	-10,221	-10,242	-10,272	-10,310	-10,359
-5.33%	-5,745	-5,805	-5,879	-5,966	-6,064	-6,173	-6,291
-2.67%	-1,858	-2,027	-2,202	-2,381	-2,563	-2,747	-2,934
0%	575	386	194	0	-195	-391	-588
2.67%	1,460	1,371	1,267	1,151	1,025	889	745
5.33%	1,627	1,608	1,579	1,539	1,487	1,423	1,349
8.00%	1,643	1,641	1,636	1,628	1,614	1,593	1,565

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

(단위:백만원)

33,264

공시일	2019-09-19
기준일	2019-09-18

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

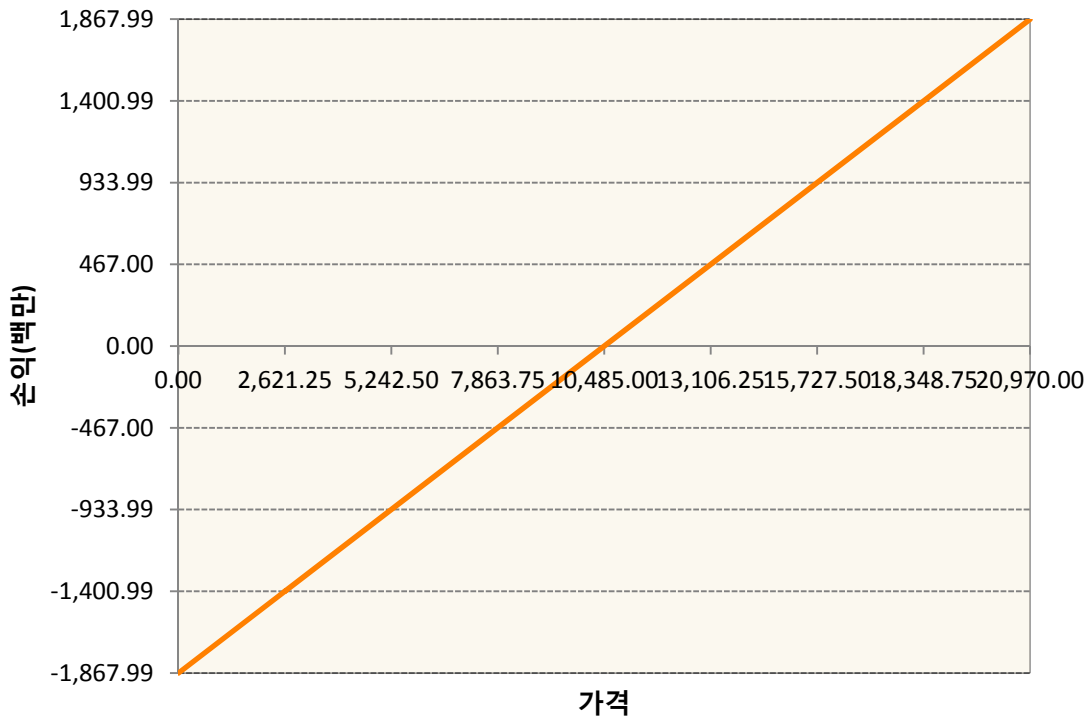
1. 계약금액

(단위:백만원)

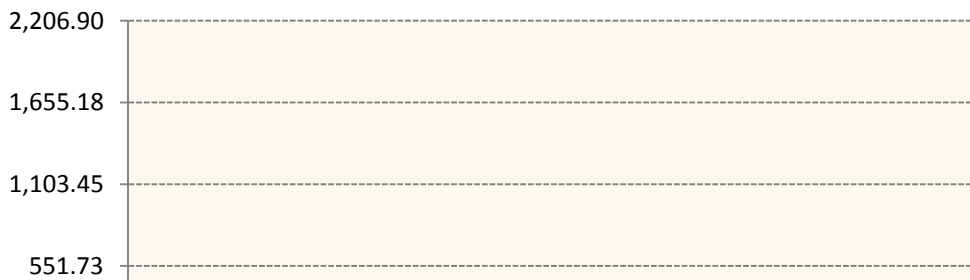
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,868	0	1,868	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,715	-4,715	장내
누계	통화	선도	685	2,828	-2,143	장외

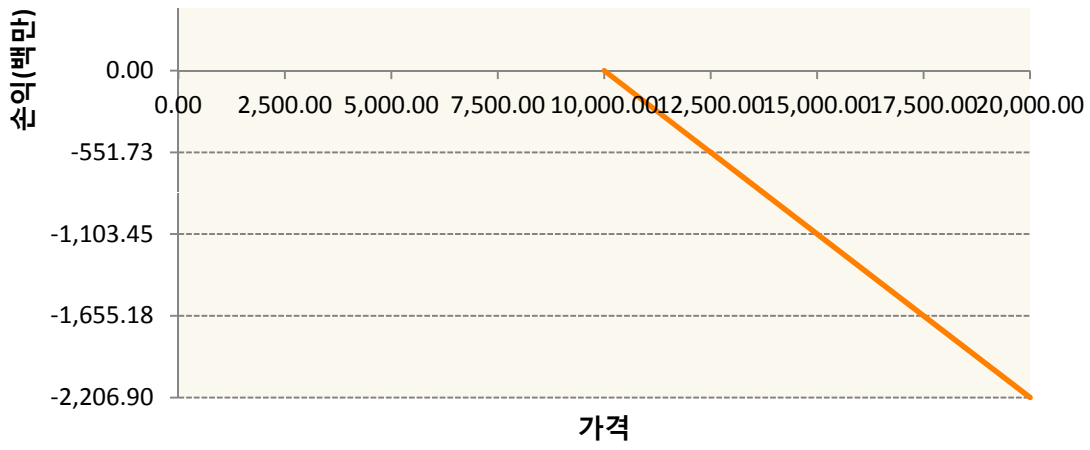
2. 만기시점의 손익구조

HCU9-HSCEI Futures Sep19

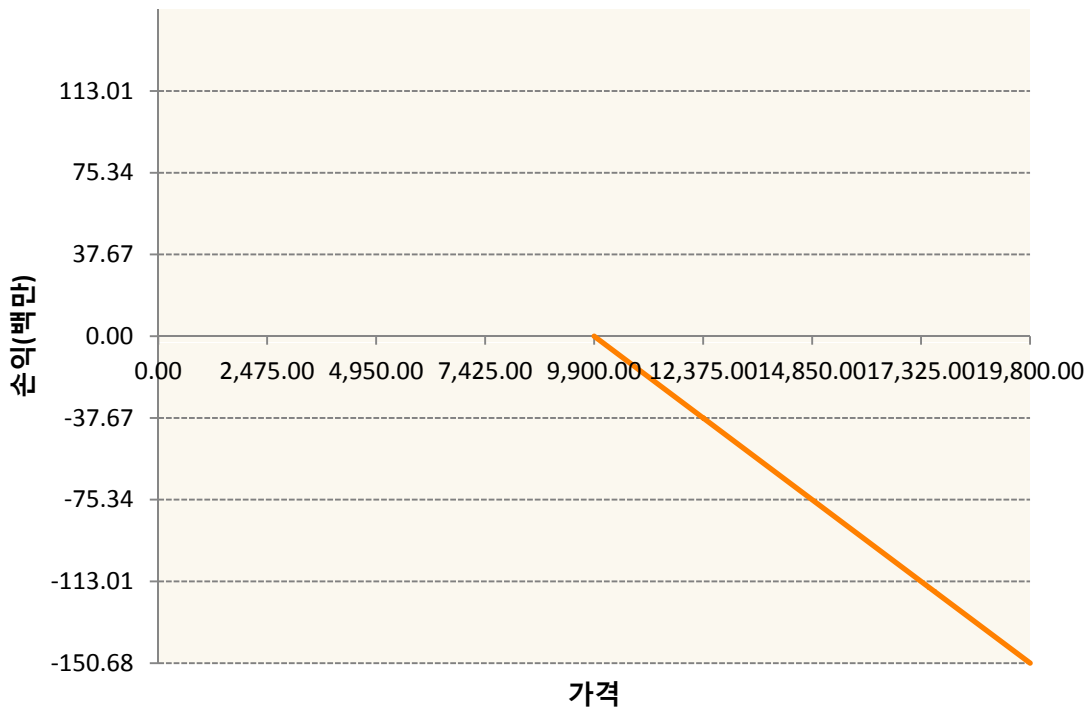


OHHIU9-C100-HSCEI

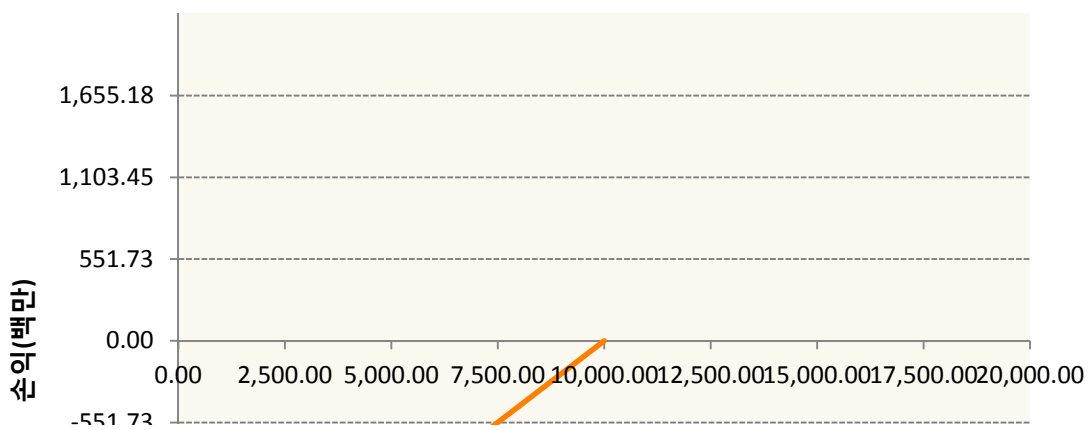


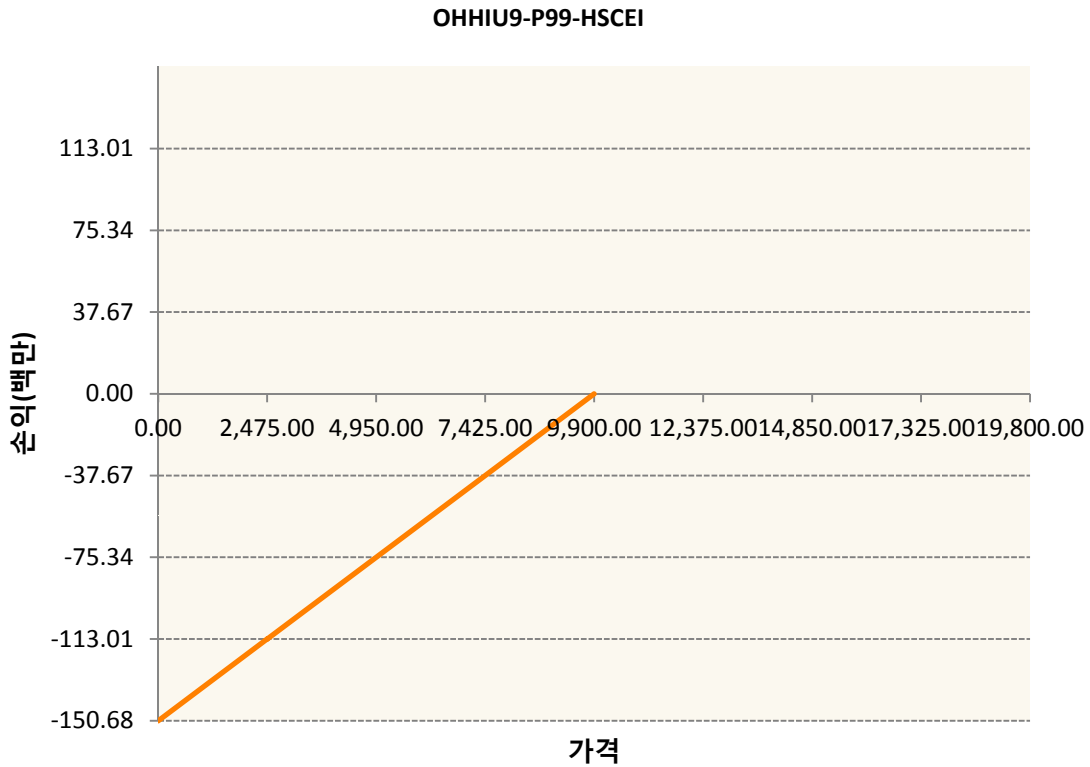


OHHIU9-C99-HSCEI



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	149
OHHIU9-C1(HSCEI	177
OHHIU9-C9(HSCEI	12
OHHIU9-P1(HSCEI	177
OHHIU9-P9(HSCEI	12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	580

공시일	2019-09-19
기준일	2019-09-18

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

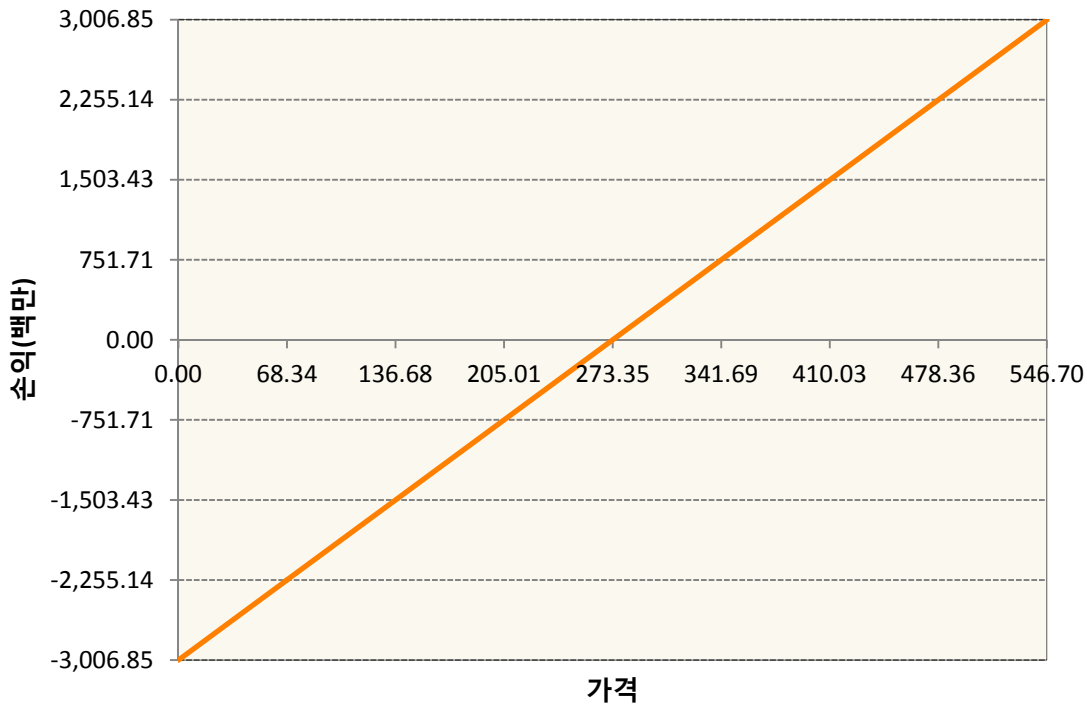
1. 계약금액

(단위:백만원)

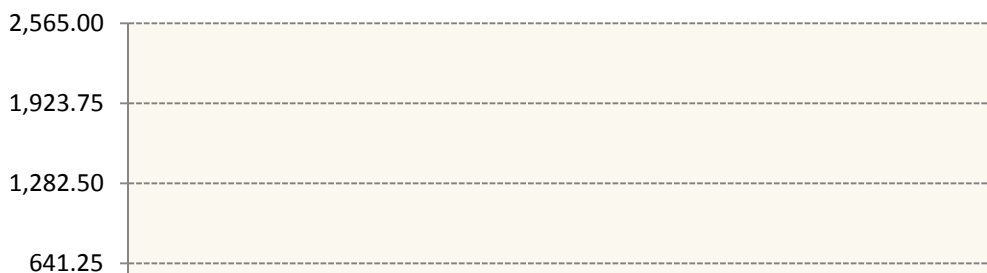
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,007	0	3,007	장내
누계	유가증권	스왑	14,125	0	14,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,032	-15,032	장내

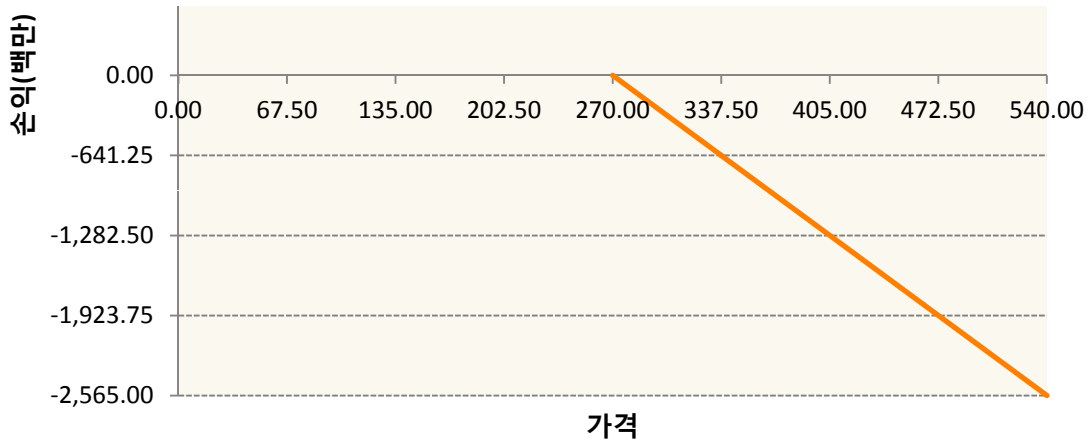
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

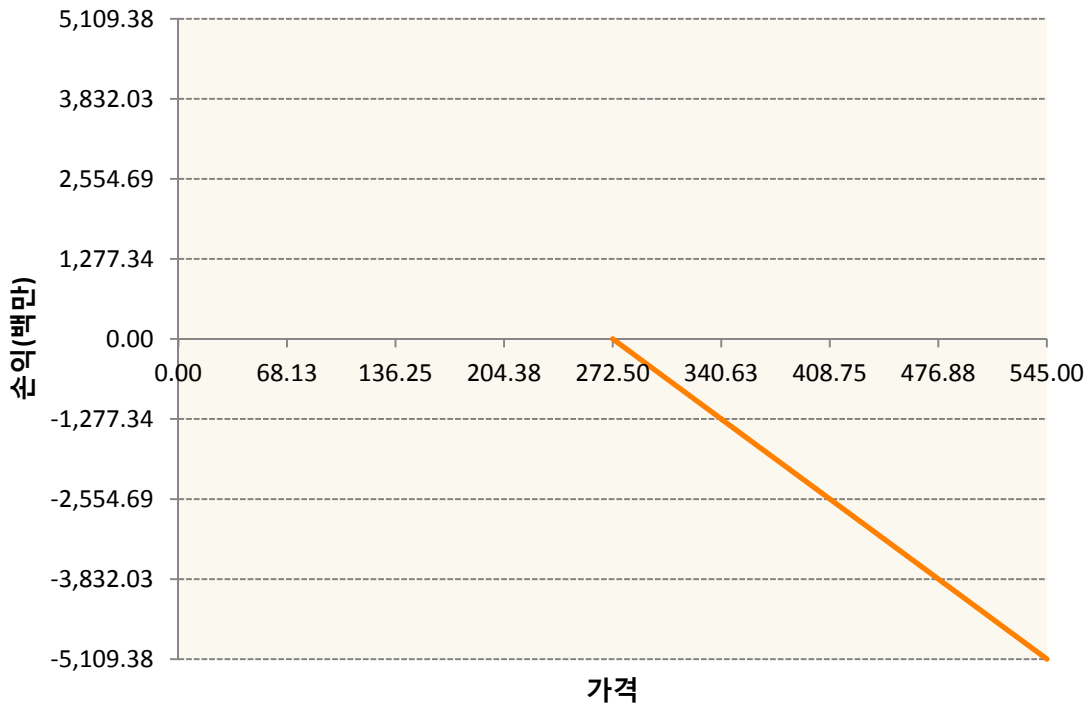


KR4201PA2702-2019-10 콜270

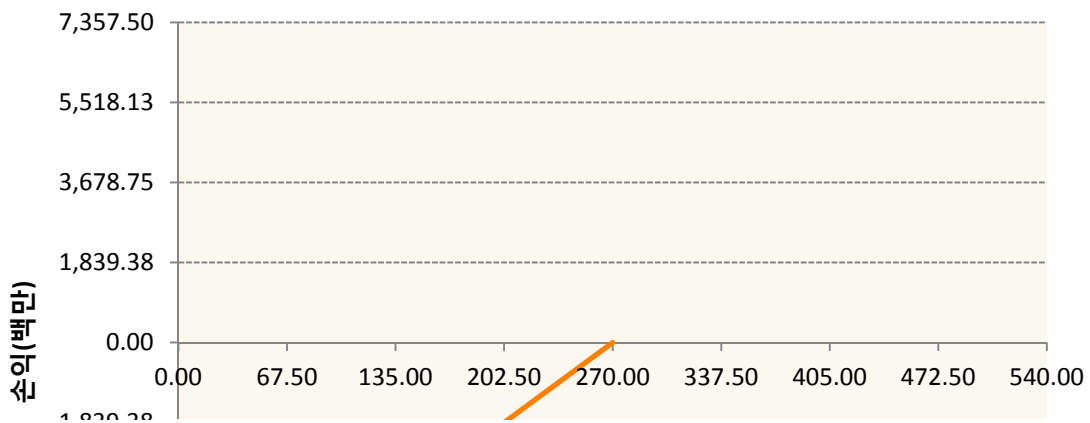




KR4201PA2728-2019-10 콜272.5



KR4301PA2701-2019-10 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						1,214
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,214	-1,214	-1,214	-1,214	-1,214	-1,214	-1,214	
-5.33%	-809	-809	-809	-809	-809	-809	-809	
-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%	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						240
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-240	-240	-240	-240	-240	-240	-240	
-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%	240	240	240	240	240	240	240	
KR4201PA2702		2019-10 콜270						169
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	78	76	74	71	68	65	61	
-5.33%	70	66	62	57	53	48	44	
-2.67%	50	45	40	34	29	23	18	
0%	17	11	6	0	-6	-11	-17	
2.67%	-31	-36	-40	-45	-50	-55	-60	
5.33%	-90	-93	-96	-99	-103	-107	-111	
8.00%	-154	-156	-158	-160	-162	-165	-169	
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5						318
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	133	130	126	121	116	110	104
-5.33%	120	114	107	99	91	83	74
-2.67%	90	80	70	60	50	39	29
0%	33	22	11	0	-11	-22	-33
2.67%	-52	-61	-72	-82	-92	-103	-113
5.33%	-161	-167	-175	-183	-191	-200	-209
8.00%	-285	-288	-293	-298	-304	-311	-318
KR4301PA2701 2019-10 풋270							452
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-445	-445	-446	-447	-448	-450	-452
-5.33%	-251	-253	-256	-260	-264	-269	-274
-2.67%	-81	-88	-96	-104	-112	-120	-128
0%	25	17	8	0	-9	-17	-26
2.67%	64	60	55	50	45	39	32
5.33%	71	70	69	67	65	62	59
8.00%	72	72	71	71	70	69	68

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

(단위:백만원)

2,371

공시일	2019-09-19
기준일	2019-09-18

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

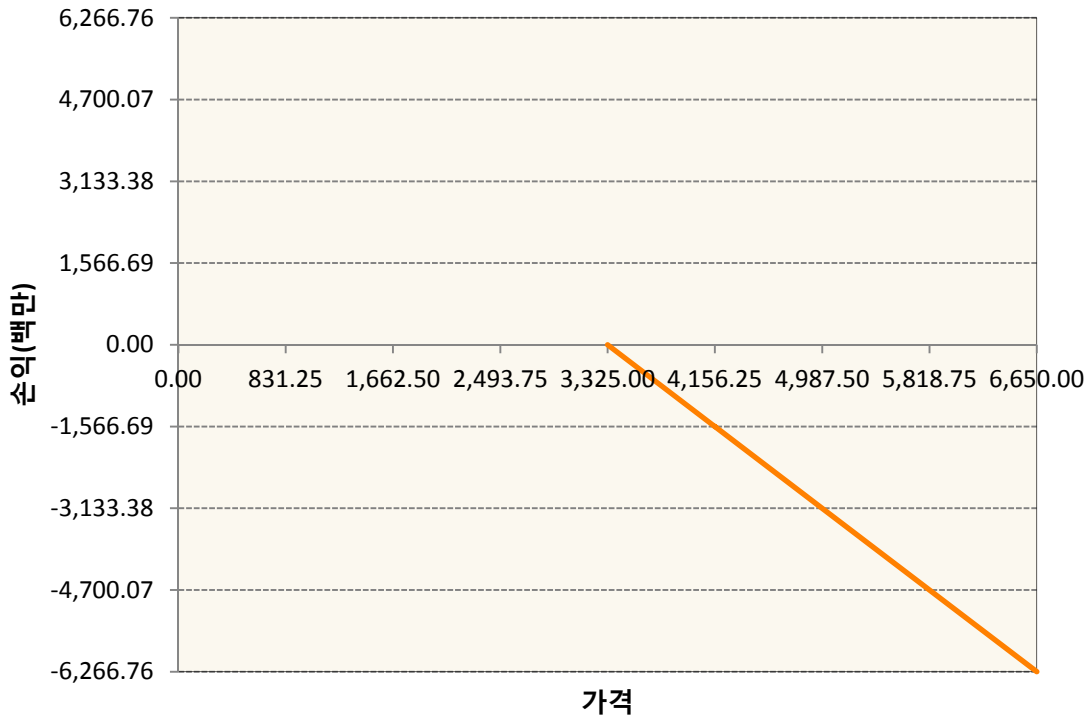
1. 계약금액

(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	5,171	0	5,171	
누계	유가증권	스왑	23,983	0	23,983	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,094	-15,094	장내
누계	통화	선도	10,939	17,134	-6,195	장외

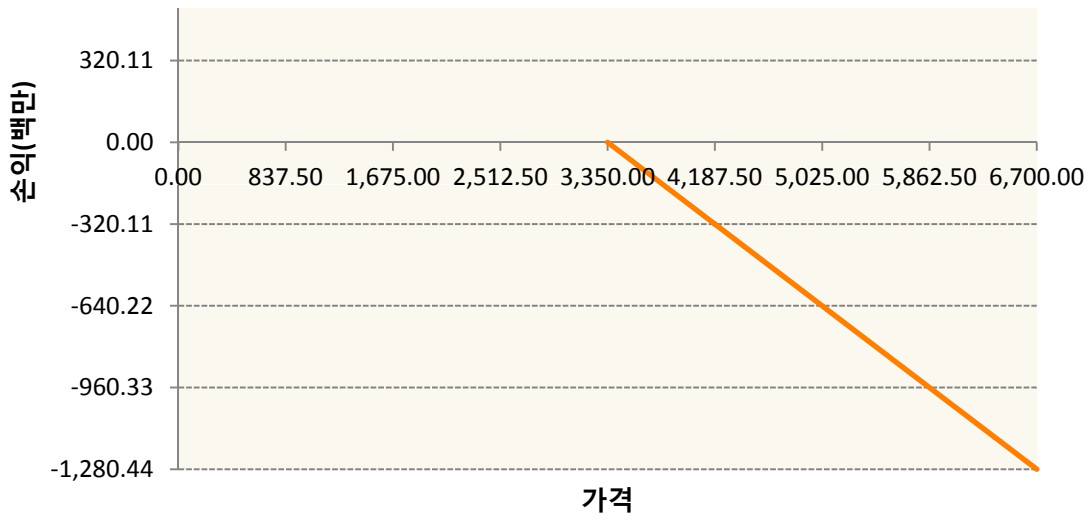
2. 만기시점의 손익구조

OESXU9-C3325-EURO STOXX 50

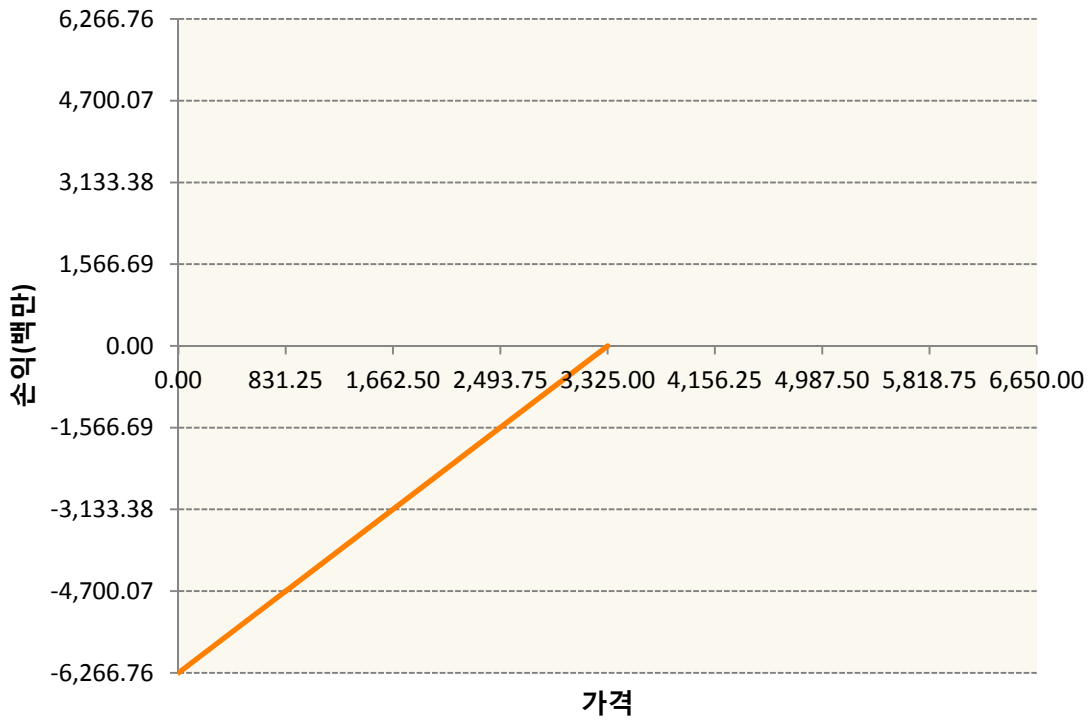


OESXU9-C3350-EURO STOXX 50

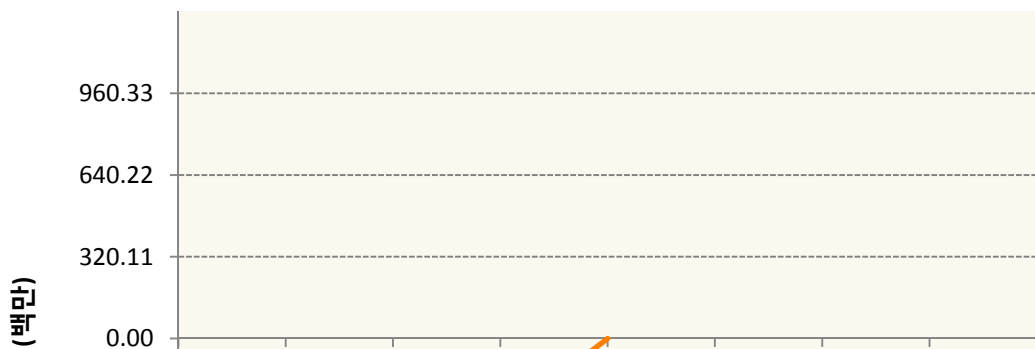


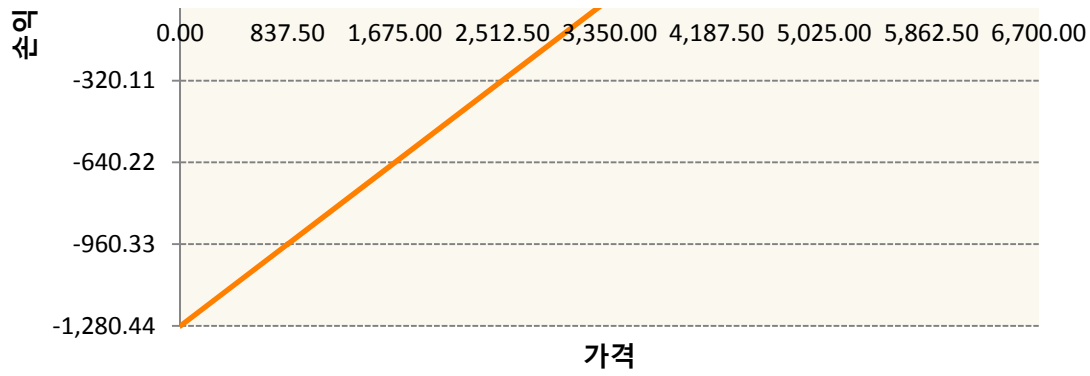


OESXU9-P3325-EURO STOXX 50

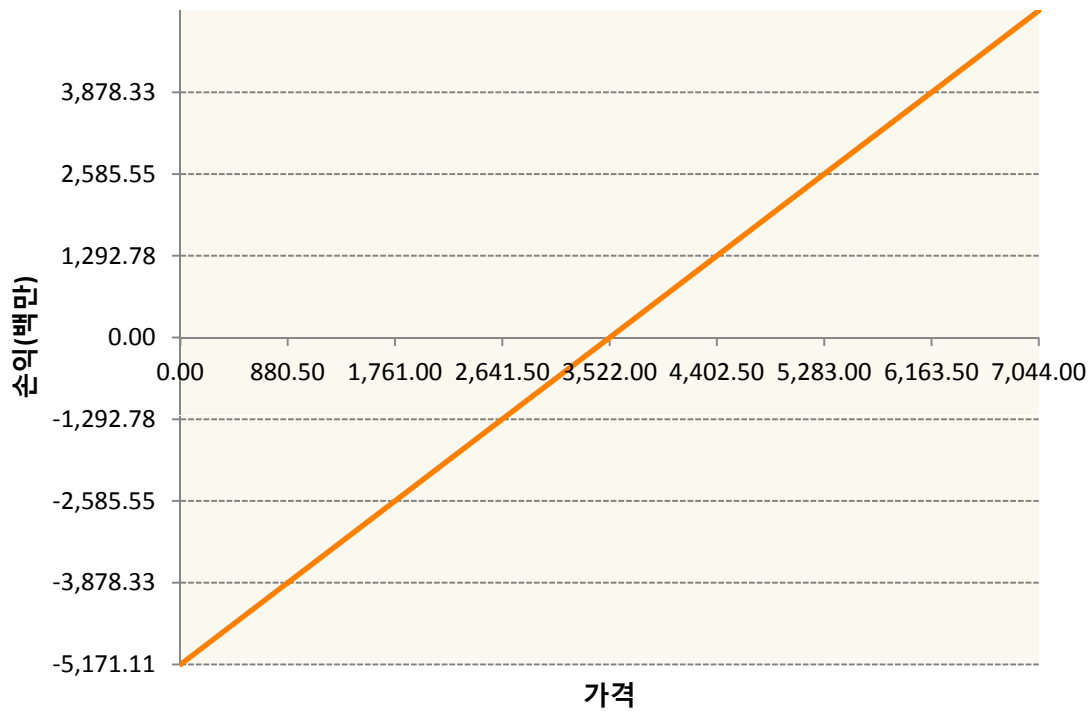


OESXU9-P3350-EURO STOXX 50





VGU9-EURO STOXX 50 Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	18
FX21019M0< KRW/EUR 27-09-19E	1,054
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	316
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E	316
FX21019N04 EUR/KRW 27-09-19E	232
FX21019Q00 EUR/KRW 27-09-19E	169
FX21019U02 EUR/KRW 27-09-19E	158
OESXU9-C3< EURO STOXX 50	501
OESXU9-C3< EURO STOXX 50	102
OESXU9-P3< EURO STOXX 50	501
OESXU9-P3< EURO STOXX 50	102

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

(단위:백만원)

2,222

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

(단위:백만원)

989

공시일	2019-09-19
기준일	2019-09-18

ETF스마트레버리지목표전환형9호

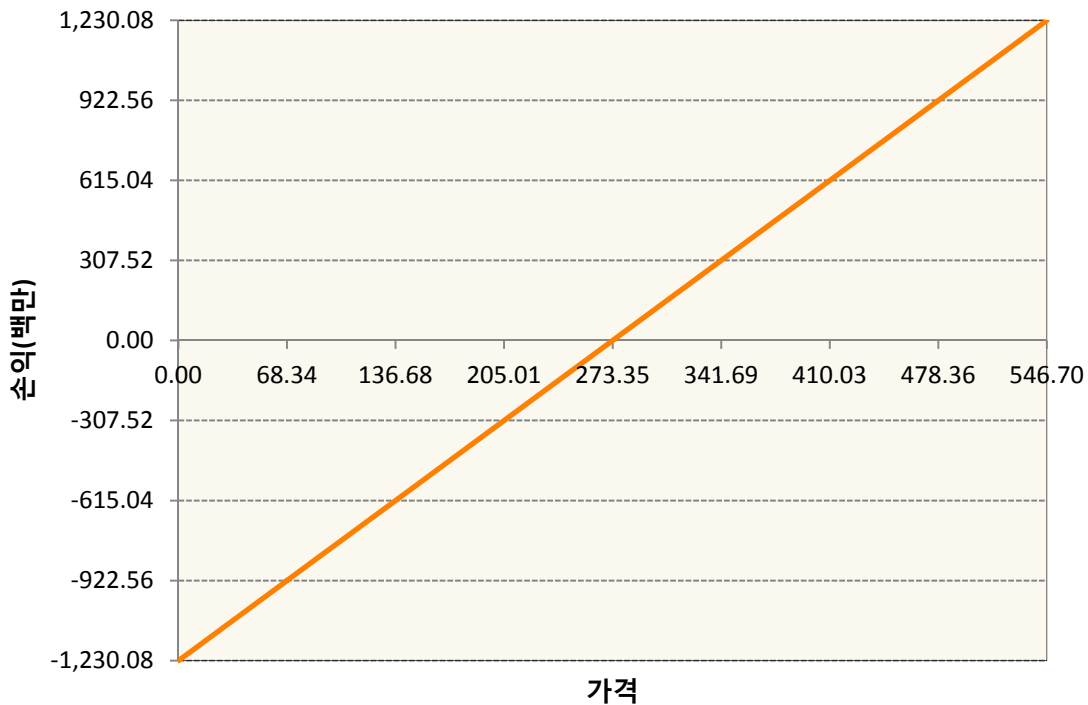
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,230	0	1,230	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						98
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98	
-5.33%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66	
-2.67%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	33	33	33	33	33	33	33	
5.33%	66	66	66	66	66	66	66	
8.00%	98	98	98	98	98	98	98	

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

(단위:백만원)

85

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

(단위:백만원)

132

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

(단위:백만원)

42

공시일	2019-09-19
기준일	2019-09-18

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

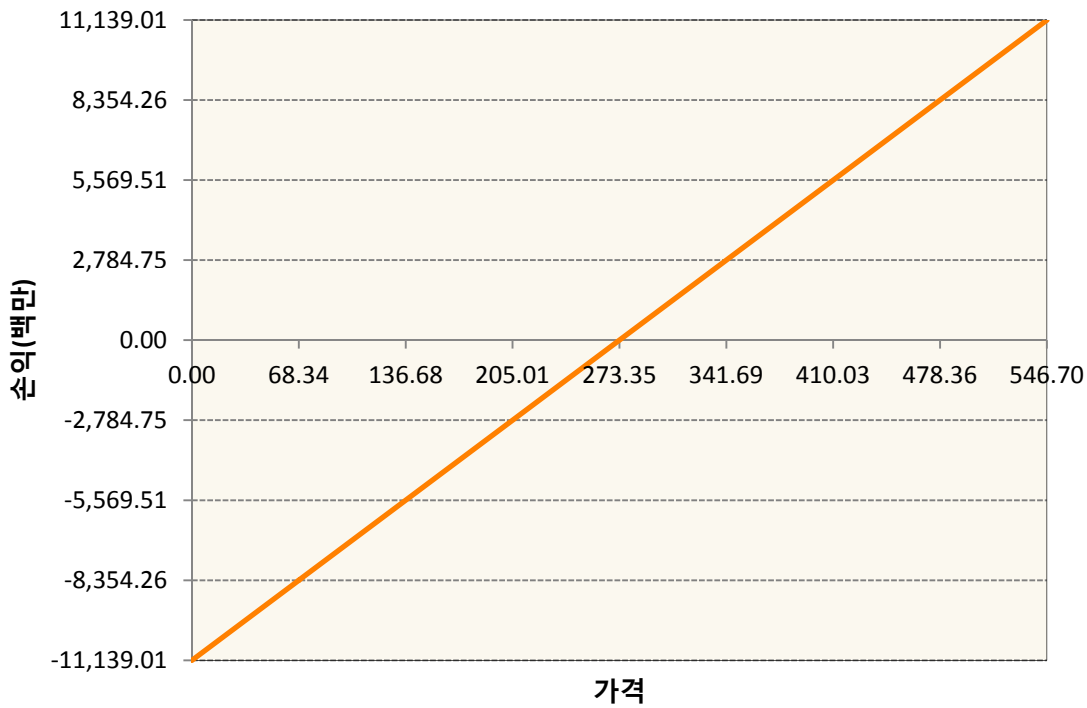
1. 계약금액

(단위:백만원)

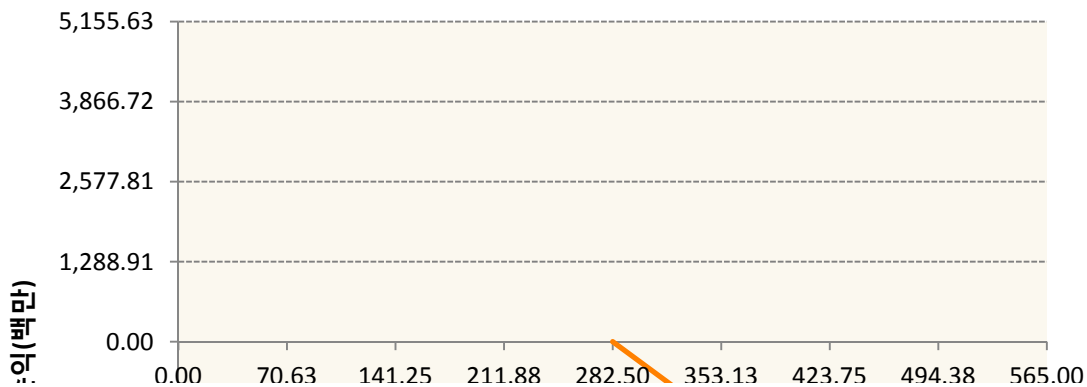
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	68	-68	장내
신규	유가증권	옵션	71	0	71	장내
누계	유가증권	선물	11,139	0	11,139	장내
누계	유가증권	옵션	1,422	20,831	-19,409	장내

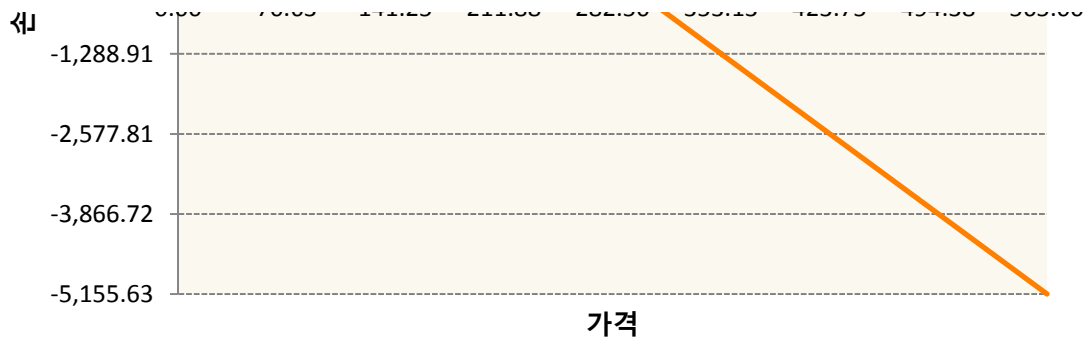
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

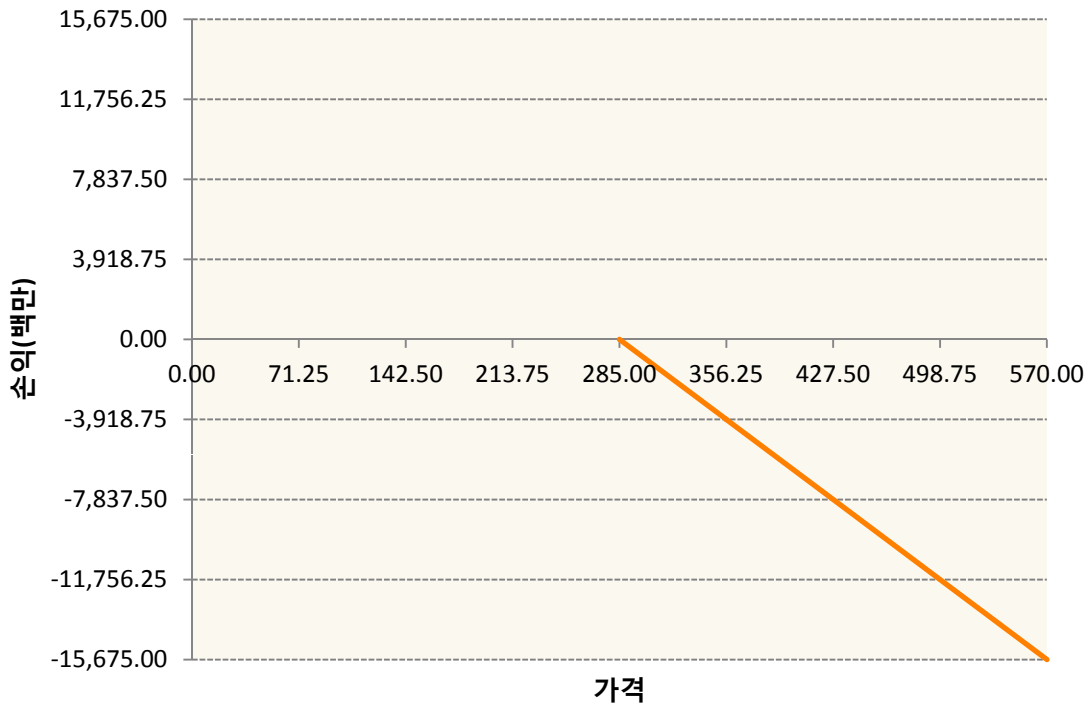


KR4201PA2827-2019-10 콜282.5

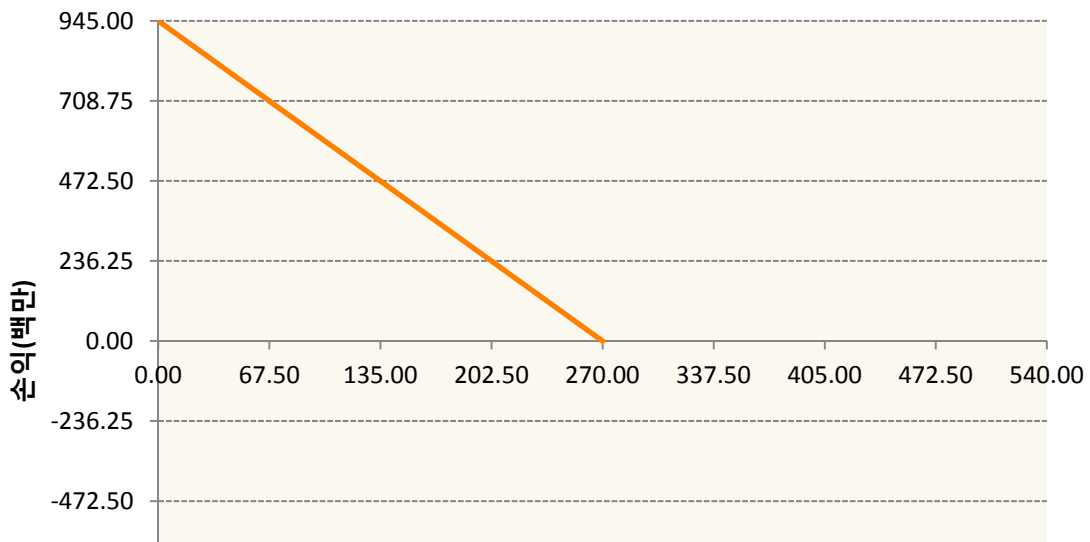


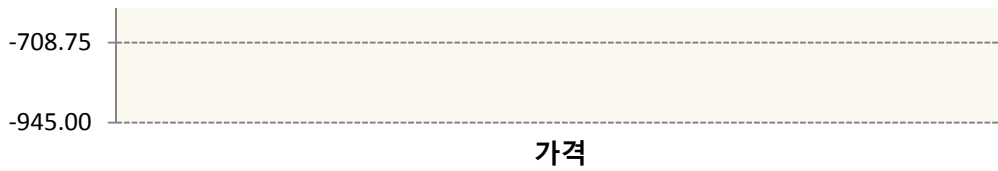


KR4201PA2850-2019-10 콜285

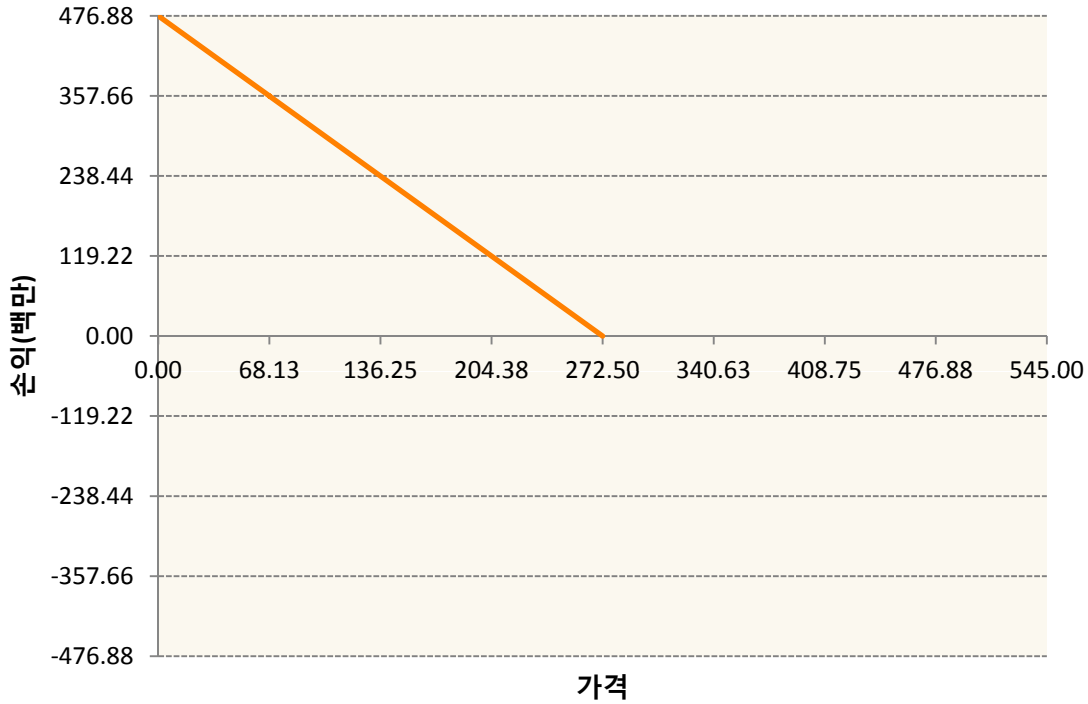


KR4301PA2701-2019-10 풋270





KR4301PA2727-2019-10 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						890
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-890	-890	-890	-890	-890	-890	-890	
-5.33%	-593	-593	-593	-593	-593	-593	-593	
-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%	593	593	593	593	593	593	593	
8.00%	890	890	890	890	890	890	890	
KR4201PA2827		2019-10 콜282.5						243
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	62	62	60	58	56	53	50	
-5.33%	60	57	54	50	46	40	35	
-2.67%	51	45	39	32	25	17	9	

0%	28	19	10	0	-10	-20	-30
2.67%	-18	-29	-40	-51	-62	-73	-85
5.33%	-90	-101	-112	-123	-134	-145	-156
8.00%	-188	-196	-205	-214	-223	-233	-243
KR4201PA2850 2019-10 콜285							678
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	152	151	148	144	138	131	122
-5.33%	147	142	134	124	113	99	84
-2.67%	128	115	99	82	62	41	19
0%	75	52	26	0	-27	-56	-84
2.67%	-37	-69	-102	-134	-167	-200	-233
5.33%	-227	-261	-295	-329	-363	-397	-431
8.00%	-496	-524	-554	-584	-615	-646	-678
KR4301PA2701 2019-10 풋270							58
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	57	57	57	57	58	58	58
-5.33%	32	33	33	33	34	35	35
-2.67%	10	11	12	13	14	15	16
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-8	-8	-7	-6	-6	-5	-4
5.33%	-9	-9	-9	-9	-8	-8	-8
8.00%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
KR4301PA2727 2019-10 풋272.5							31
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	31	31	31	31	31	31	31
-5.33%	18	18	19	19	19	19	19
-2.67%	7	7	7	8	8	9	9
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-5	-5	-5	-4	-4	-3	-3
5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-5
8.00%	-7	-7	-6	-6	-6	-6	-6

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

(단위:백만원)

1,588

공시일	2019-09-19
기준일	2019-09-18

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,383	0	2,383	
누계	유가증권	수익증권	94,015	0	94,015	

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	2019-09-19
기준일	2019-09-18

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,383	0	2,383	
누계	유가증권	수익증권	118,752	0	118,752	

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	2019-09-19
기준일	2019-09-18

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	479,717	0	479,717	
누계	통화	선도	0	494,985	-494,985	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		3,145
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		2,135
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,907
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,526
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,611
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,964
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		2,097
FX21019Q04 KRW/USD 24-09-19E		2,669
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		2,040
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
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E		191
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E		953

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

(단위:백만원)

13,142

공시일	2019-09-19
기준일	2019-09-18

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

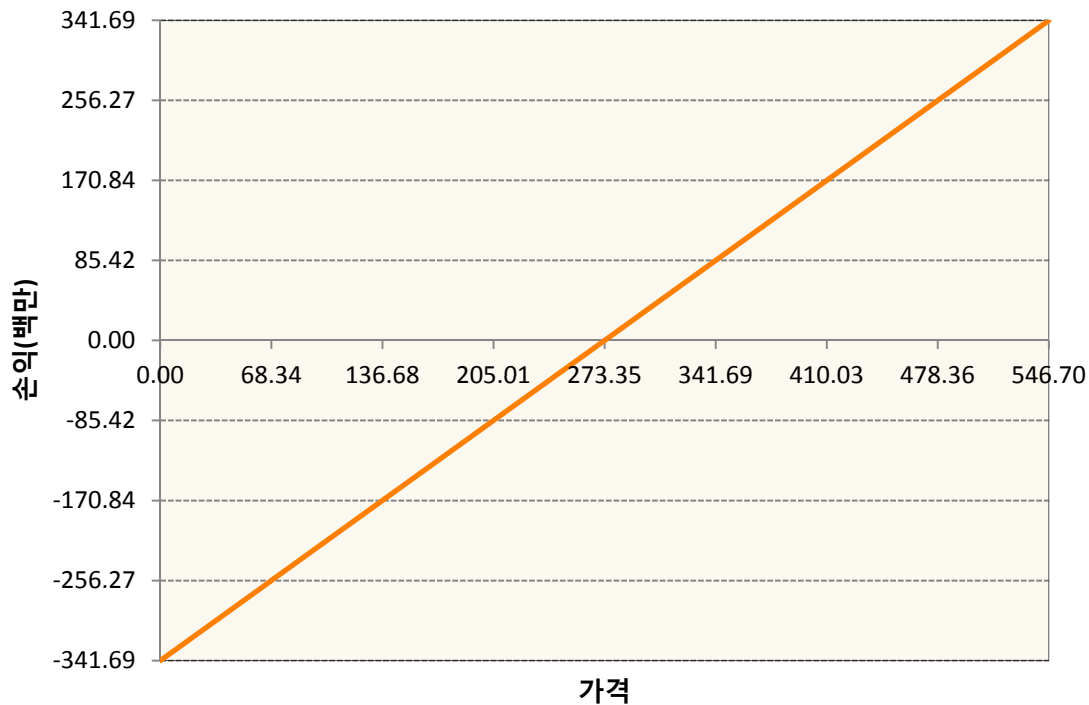
1. 계약금액

(단위:백만원)

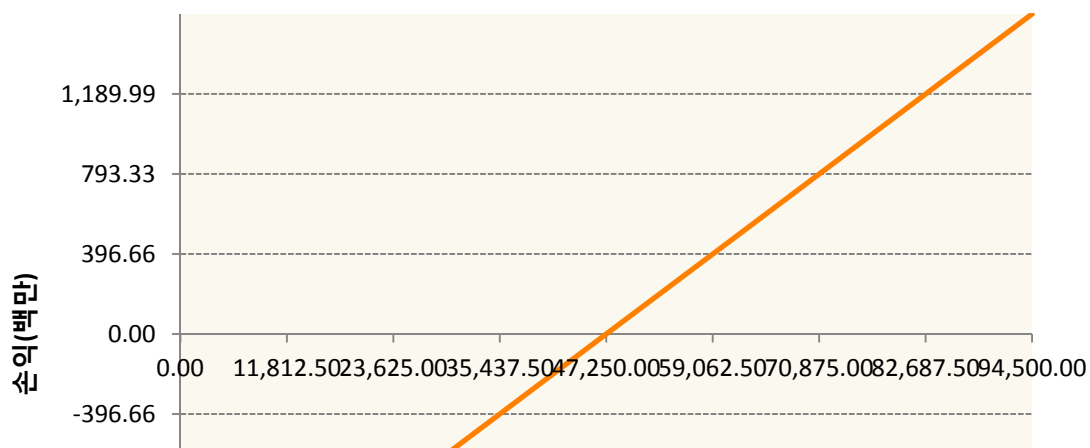
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,928	0	1,928	장내

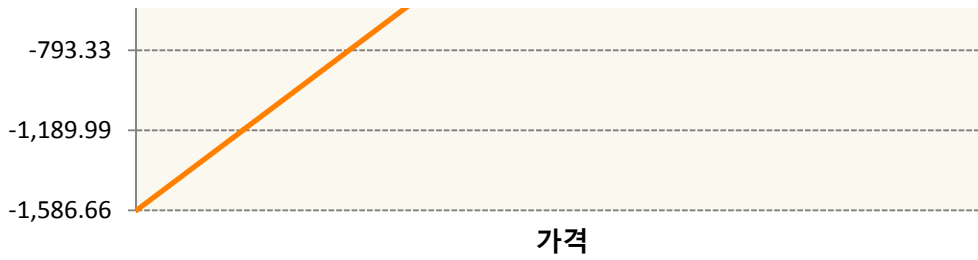
2. 만기시점의 손익구조

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						128
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128	
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85	
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	43	43	43	43	43	43	43	
5.33%	85	85	85	85	85	85	85	
8.00%	128	128	128	128	128	128	128	

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

184

공시일	2019-09-19
기준일	2019-09-18

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

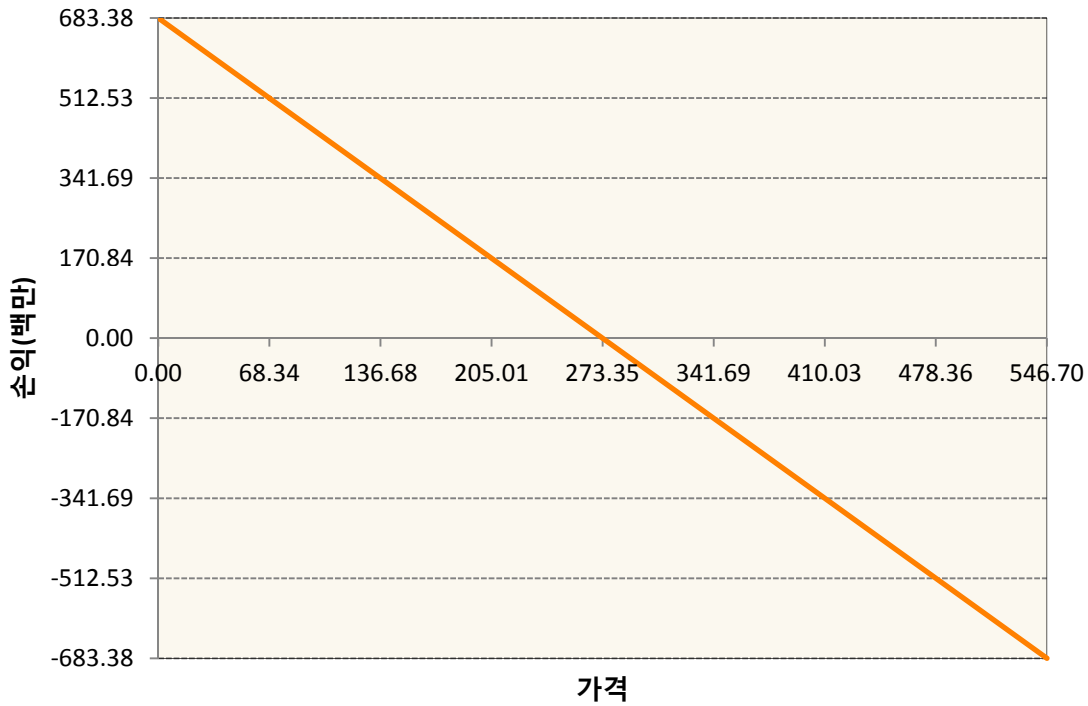
1. 계약금액

(단위:백만원)

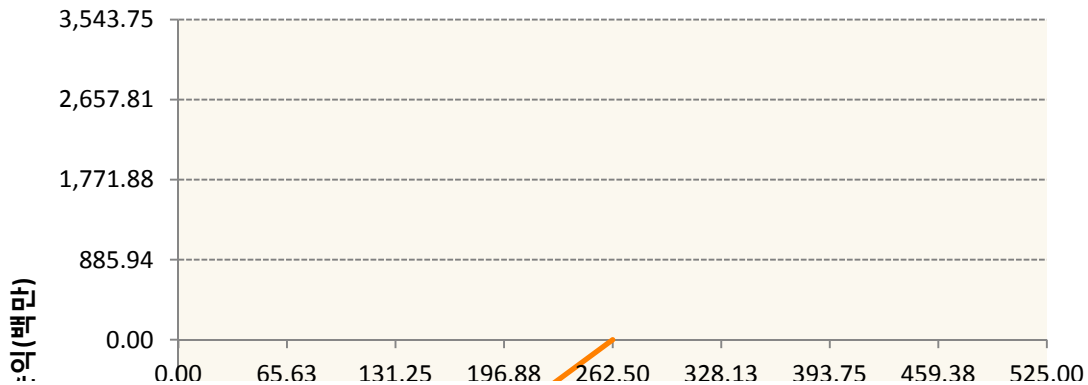
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	683	-683	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,875	-3,875	장내

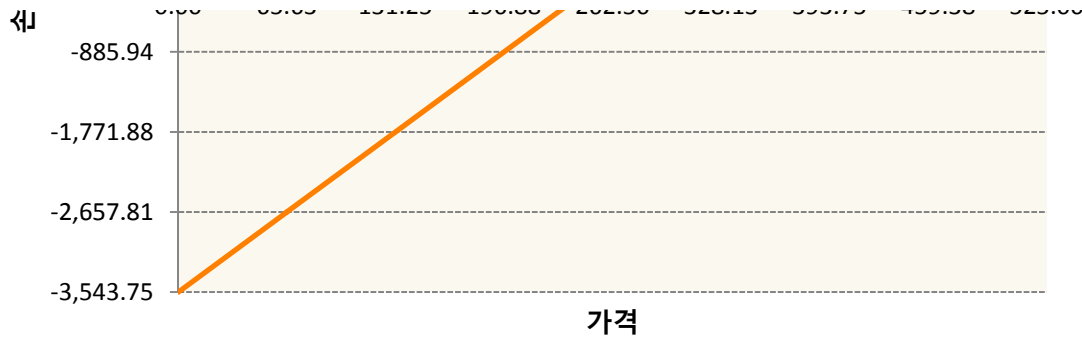
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

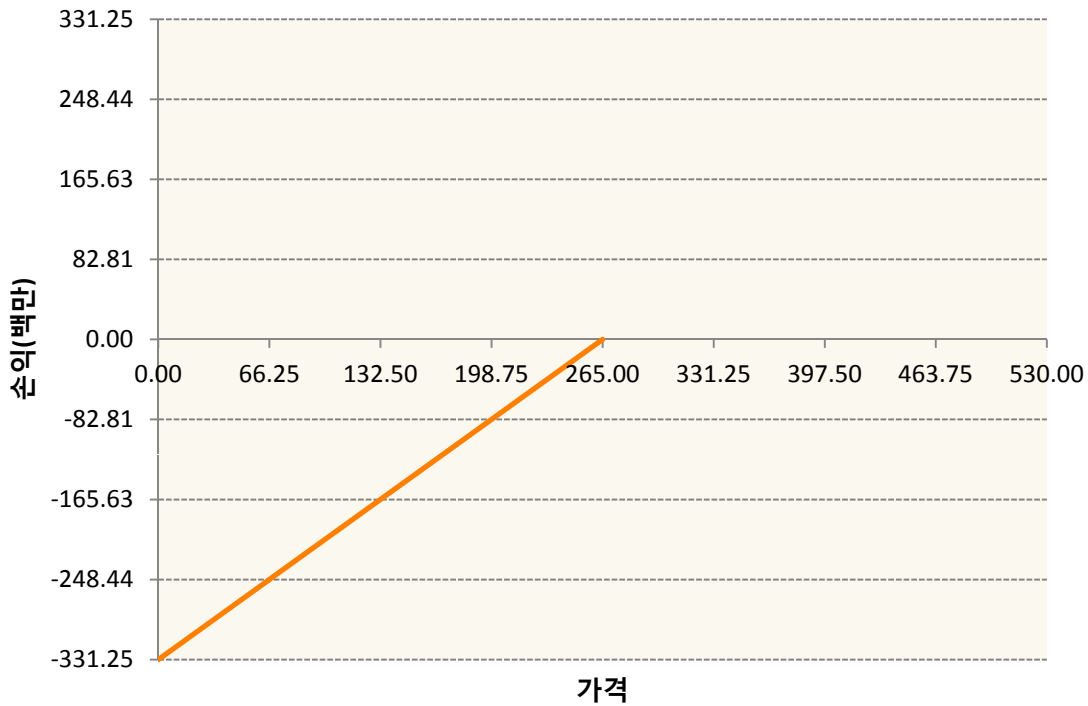


KR4301PA2628-2019-10 풋262.5





KR4301PA2651-2019-10 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						55
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	55	55	55	55	55	55	55	
-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%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55	
KR4301PA2628		2019-10 풋262.5						158
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-147	-148	-150	-152	-154	-156	-158
-5.33%	-63	-67	-70	-74	-78	-82	-86
-2.67%	-12	-16	-20	-24	-28	-32	-36
0%	6	4	2	0	-3	-5	-8
2.67%	9	9	8	8	7	5	4
5.33%	9	9	9	9	9	9	8
8.00%	9	9	9	9	9	9	9

KR4301PA2651

2019-10 풋265

17

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-16	-16	-16	-16	-16	-17	-17
-5.33%	-8	-8	-8	-9	-9	-9	-10
-2.67%	-2	-2	-3	-3	-3	-4	-4
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
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)

183

공시일	2019-09-19
기준일	2019-09-18

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	18,746	0	18,746	
누계	통화	선도	119	18,942	-18,823	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		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)

506

공시일	2019-09-19
기준일	2019-09-18

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	131	-40	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	2019-09-19
기준일	2019-09-18

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

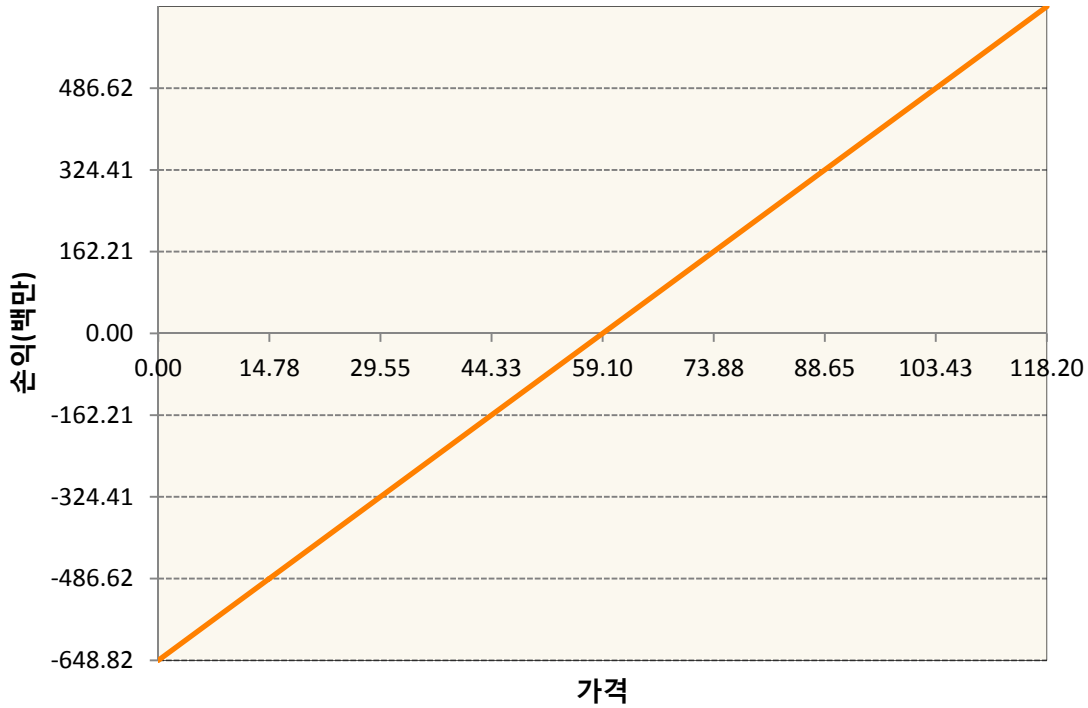
1. 계약금액

(단위:백만원)

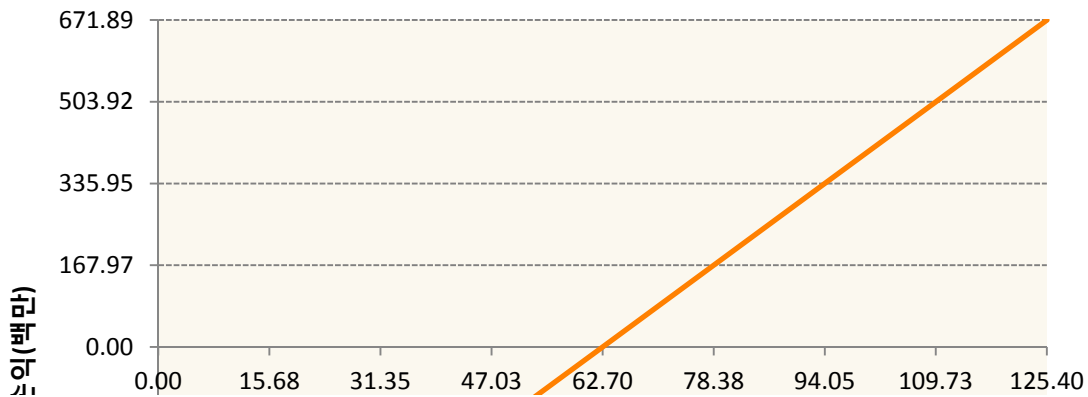
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,488	476	2,012	
누계	유가증권	선물	204	0	204	장내

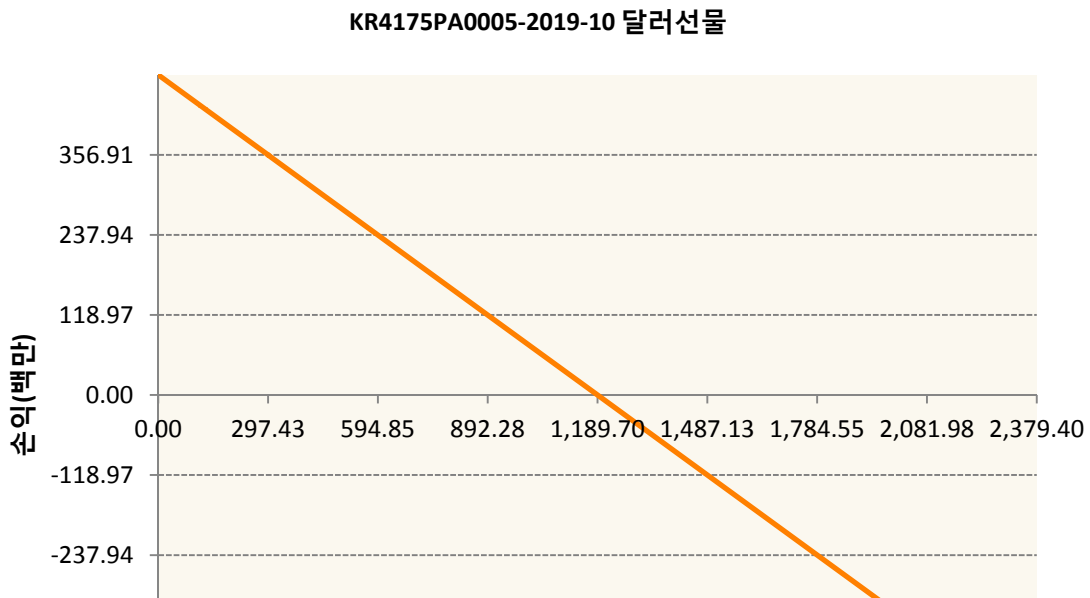
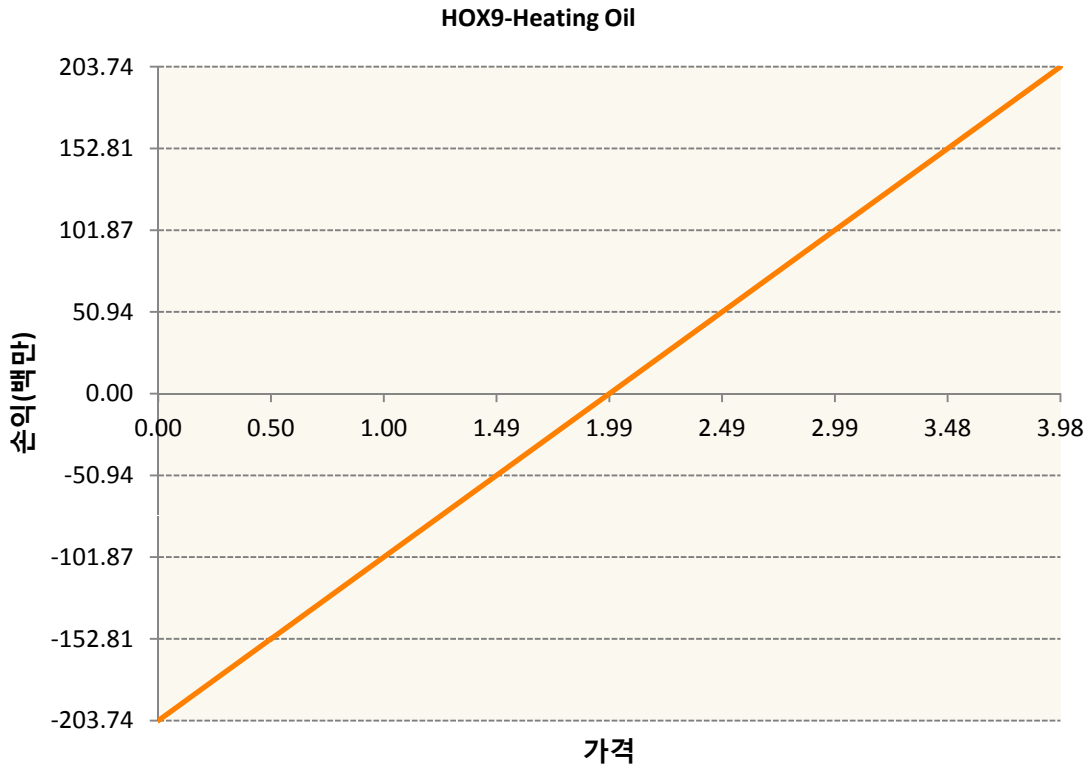
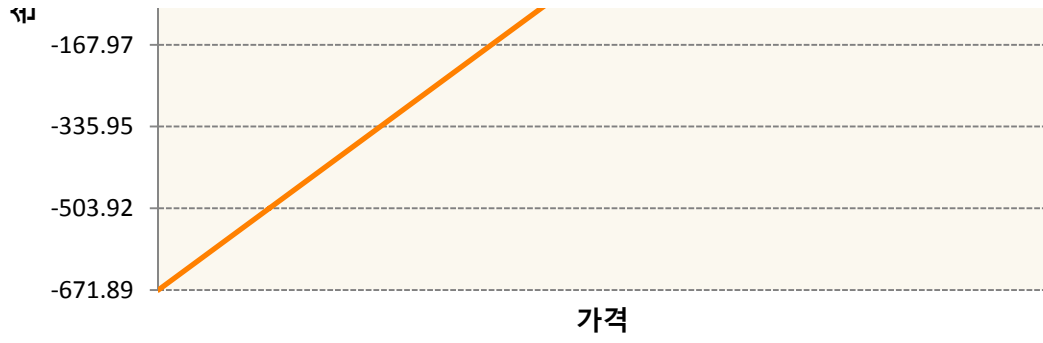
2. 만기시점의 손익구조

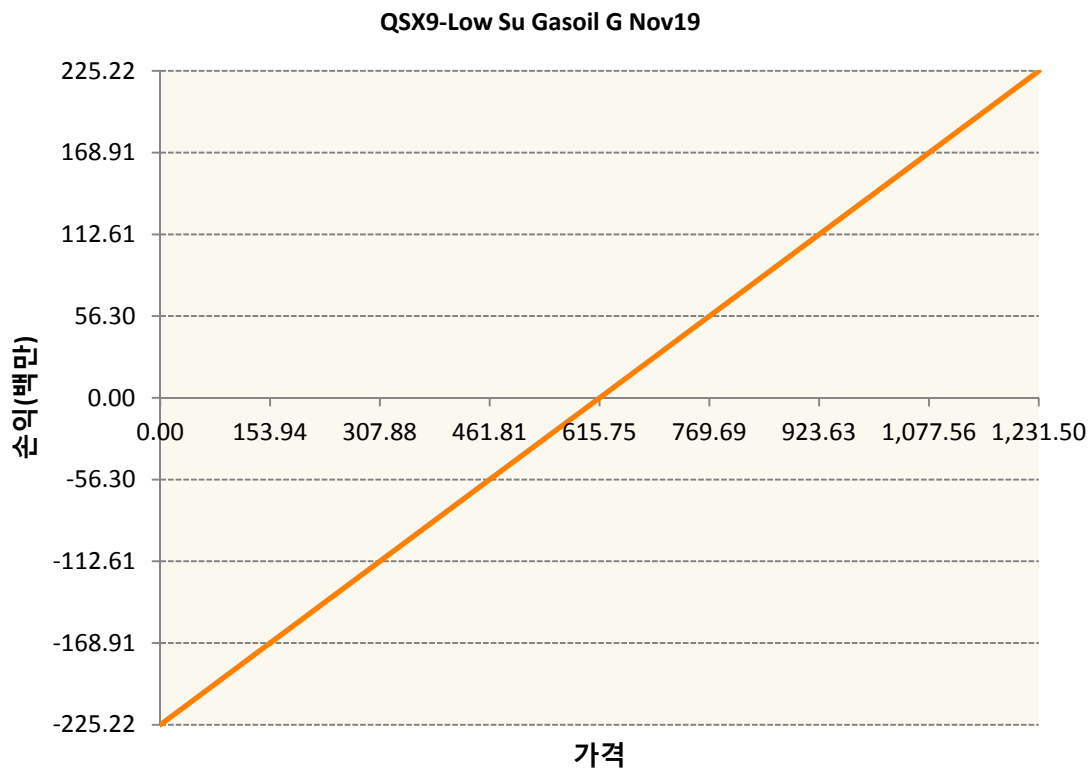
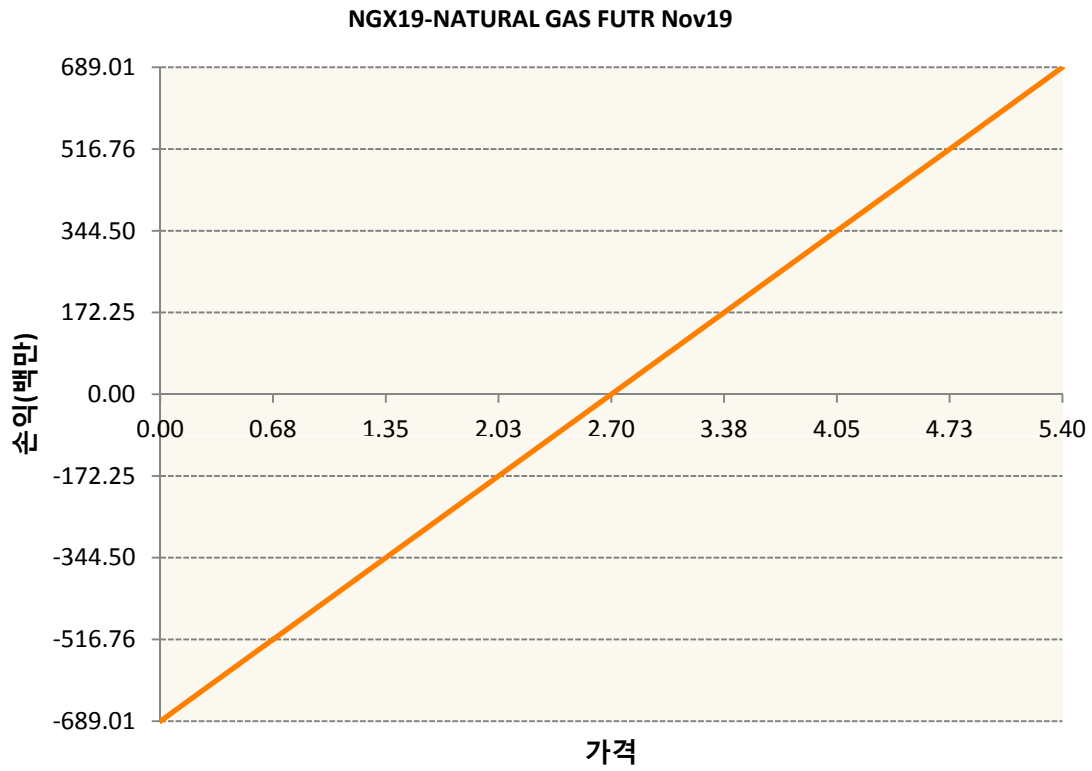
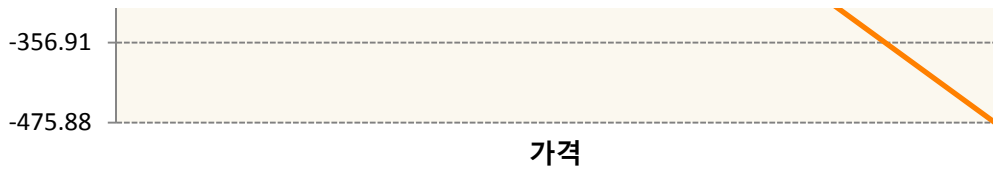
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19

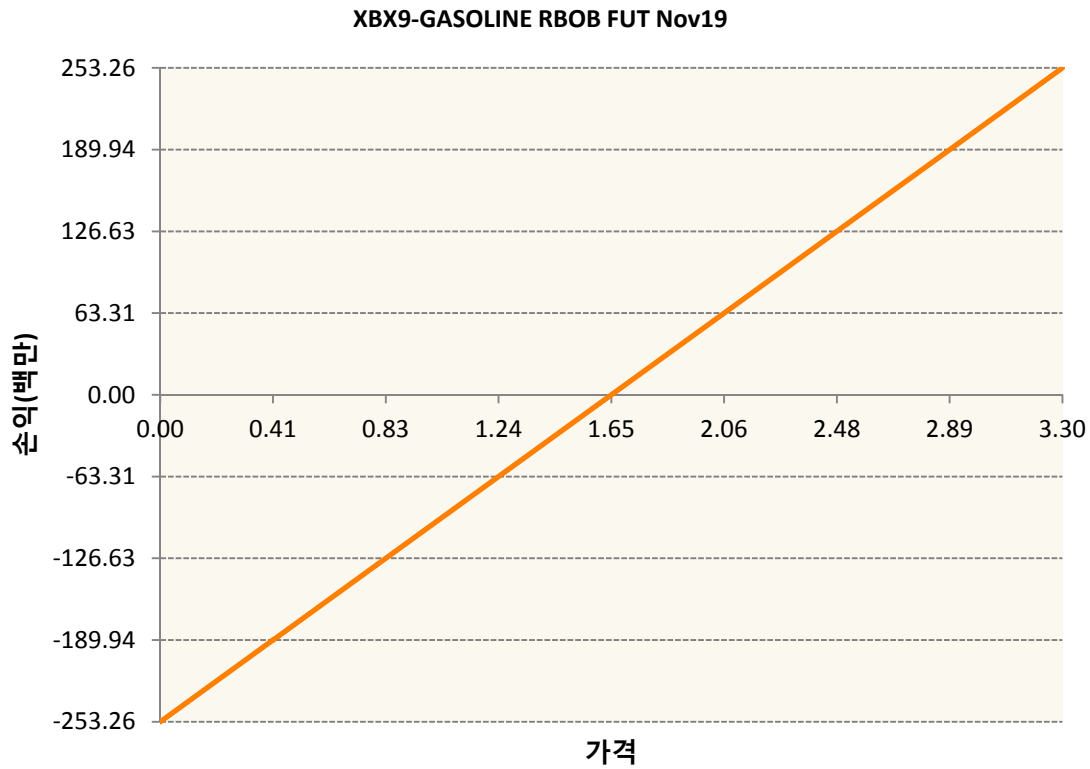


COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX9	WTI CRUDE FUTURE Nov19	52
COF0	BRENT CRUDE FUTR Jan20	54
HOX9	Heating Oil	16
KR4175PA00	2019-10 달러선물	38
NGX19	NATURAL GAS FUTR Nov19	55
QSX9	Low Su Gasoil G Nov19	18
XBX9	GASOLINE RBOB FUT Nov19	20

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	452

공시일	2019-09-19
기준일	2019-09-18

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

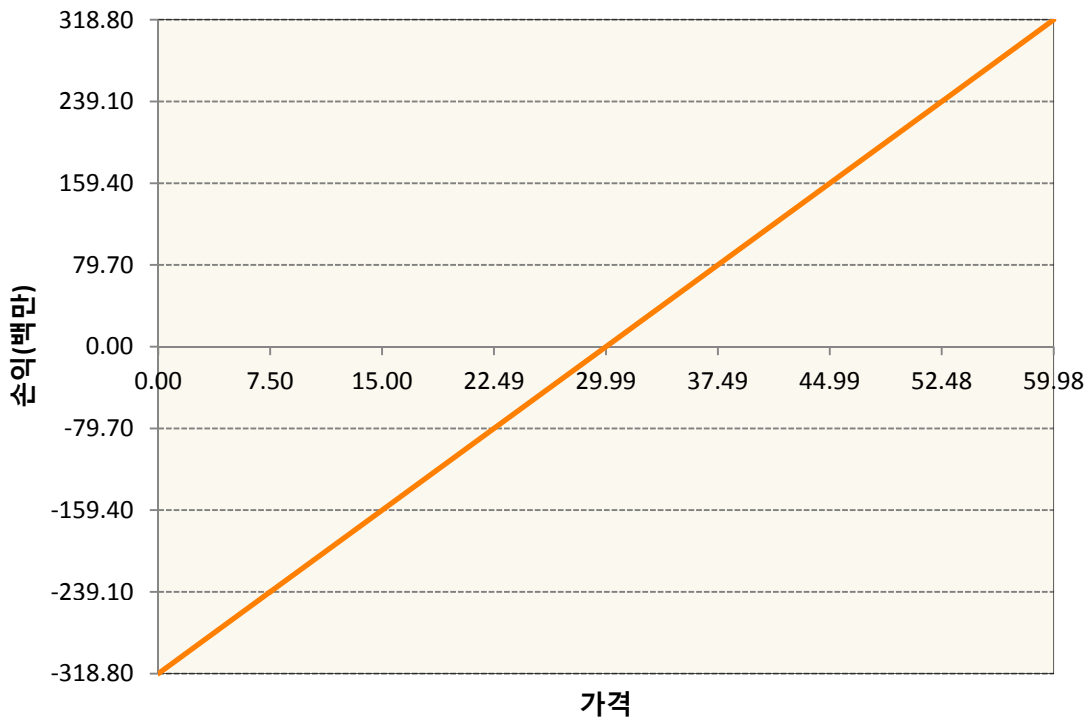
1. 계약금액

(단위:백만원)

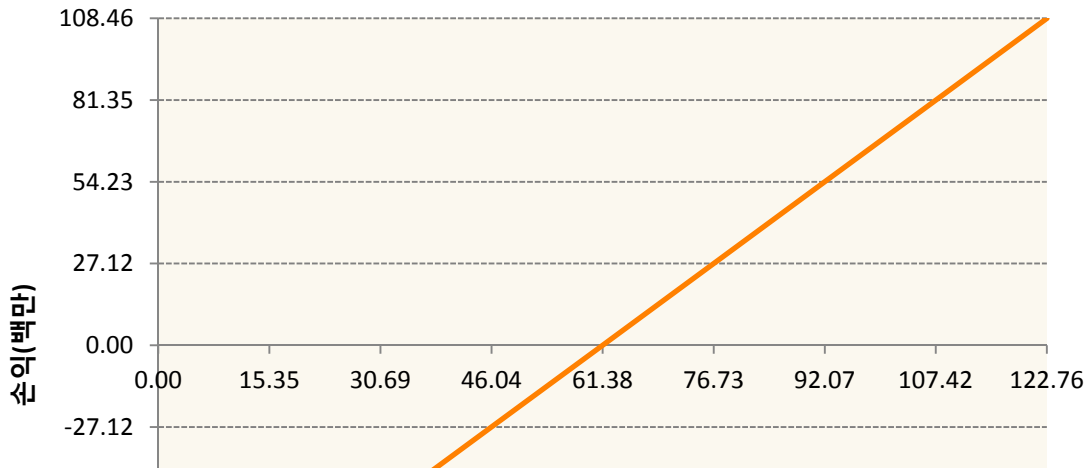
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,764	95	2,668	

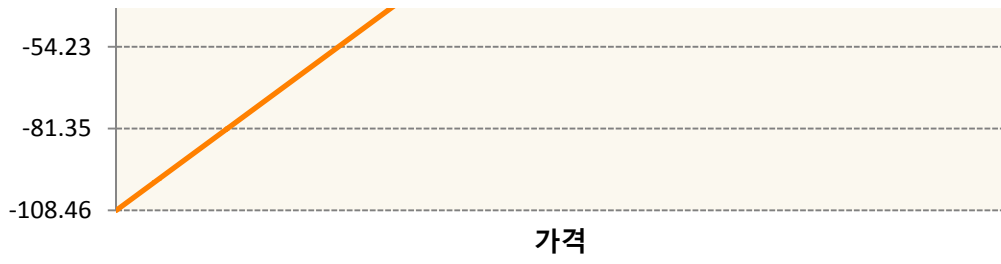
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

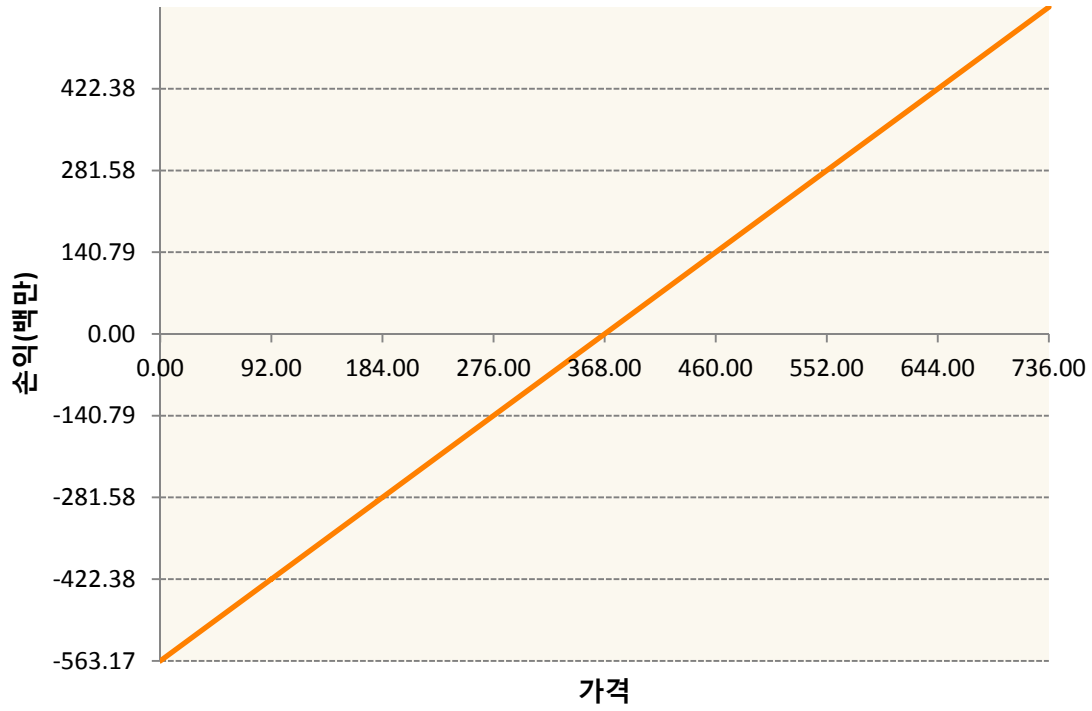


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

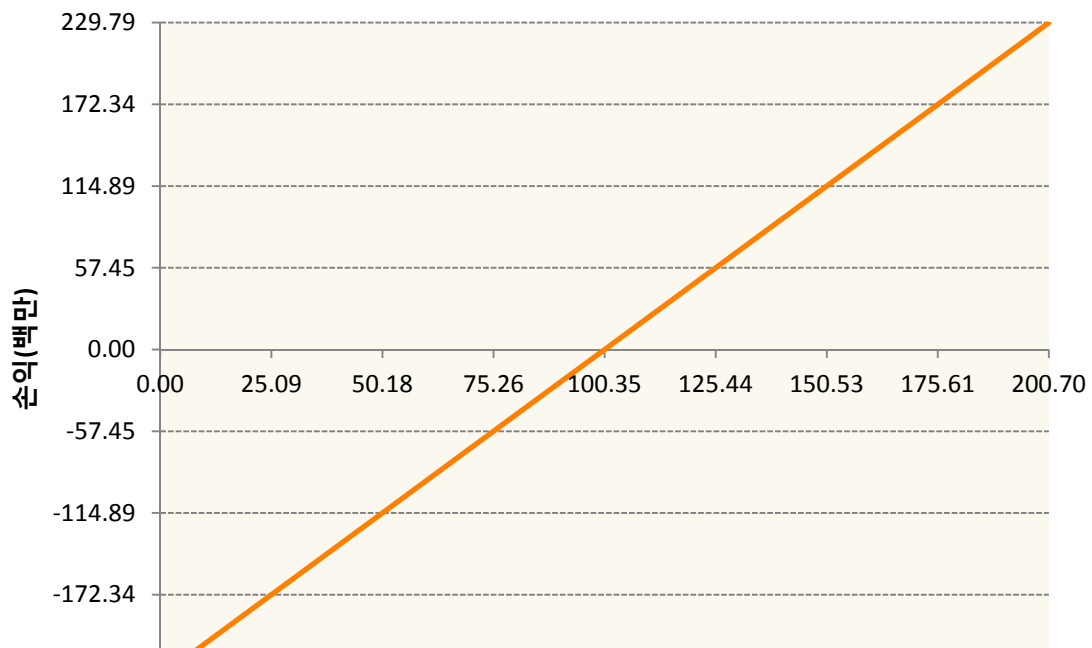


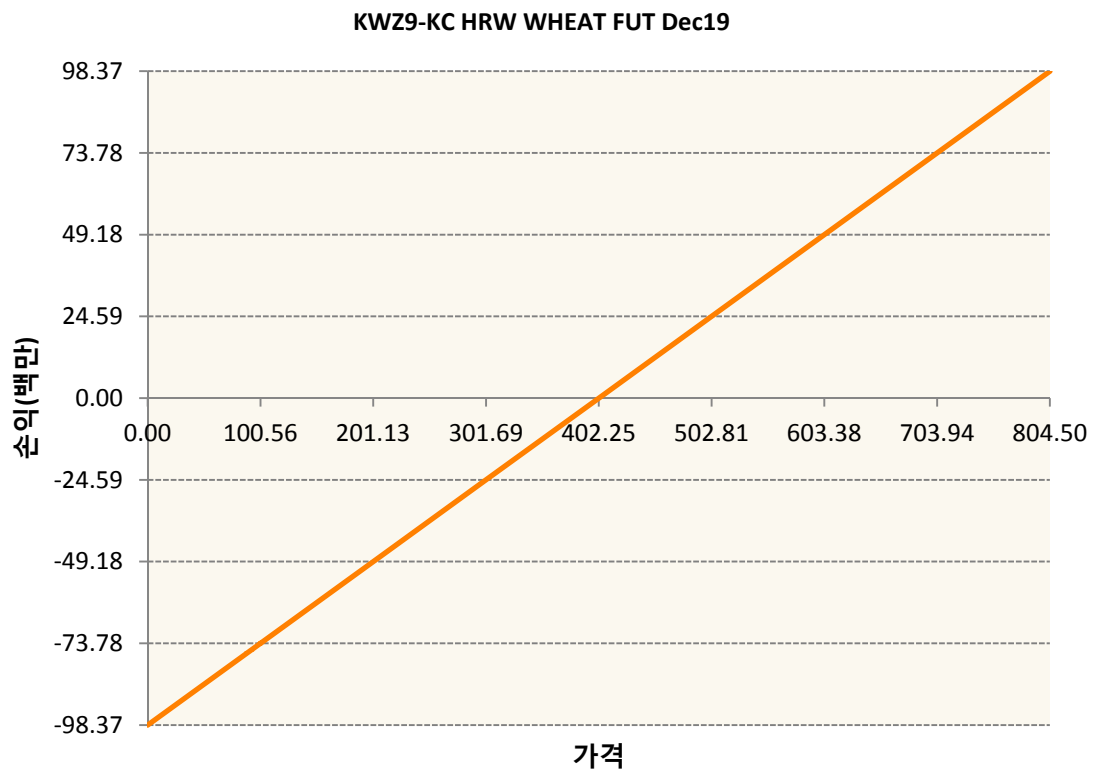
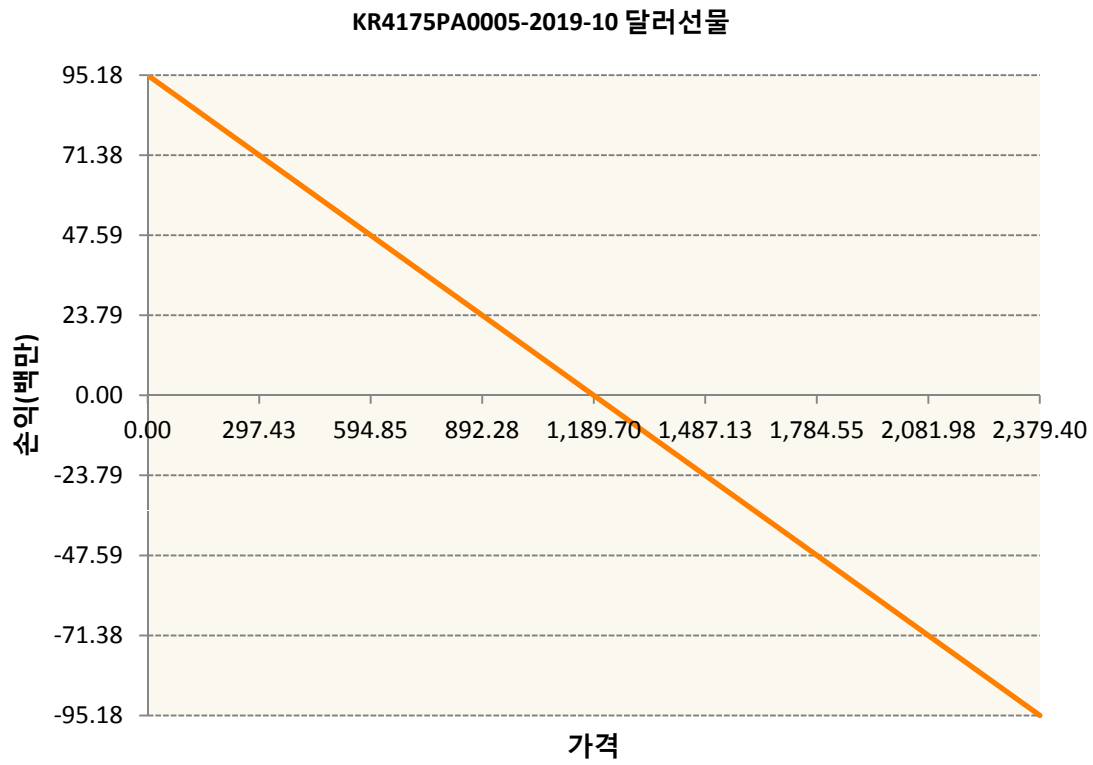
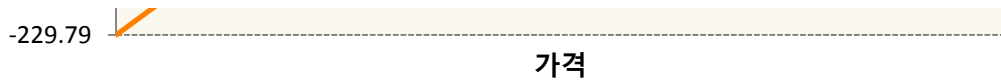


CZ9-CORN FUTURE Dec19

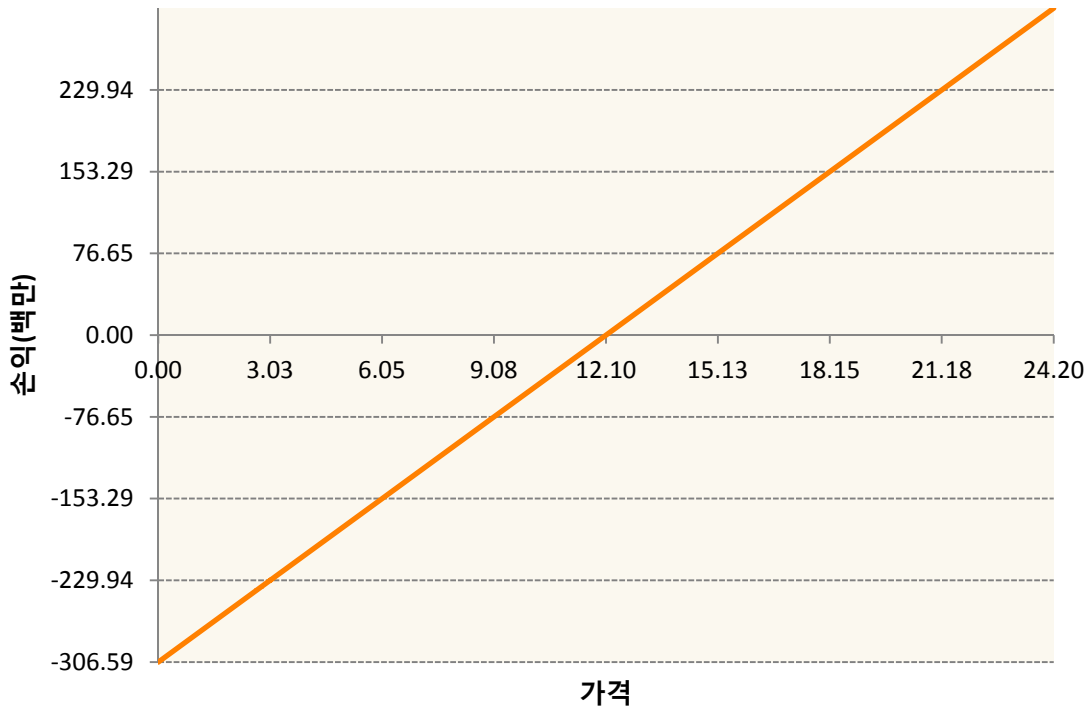


KC9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19

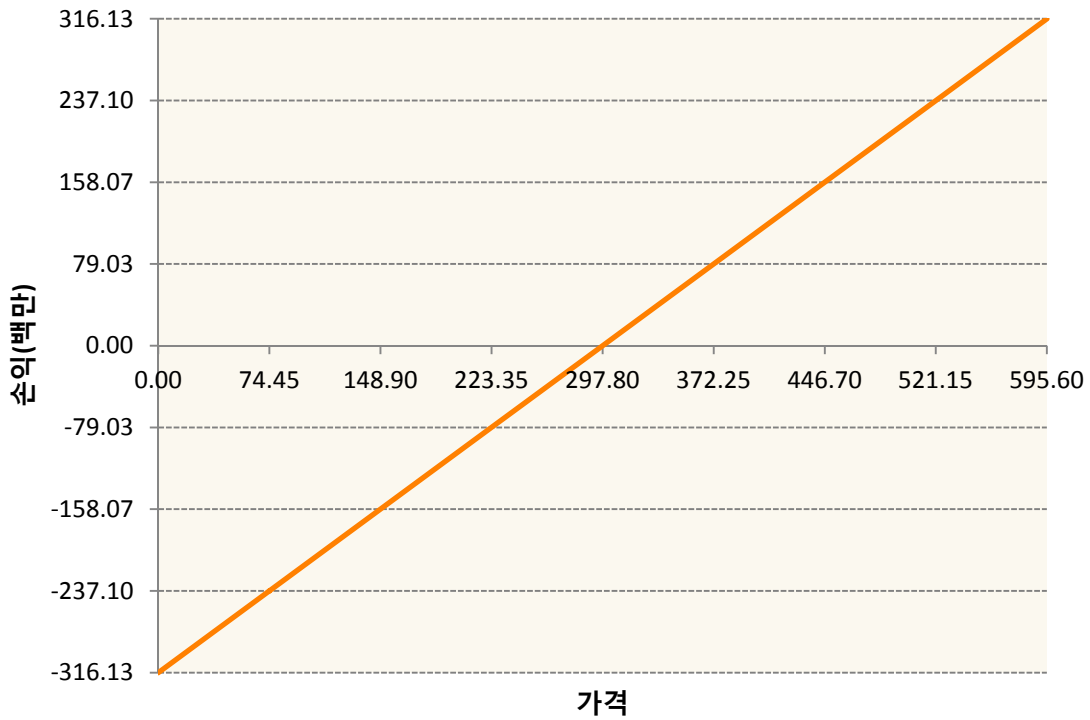




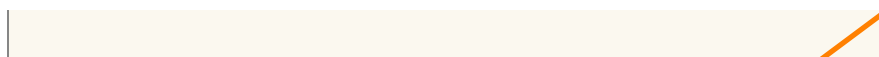
SBH0-Sugar Mar20

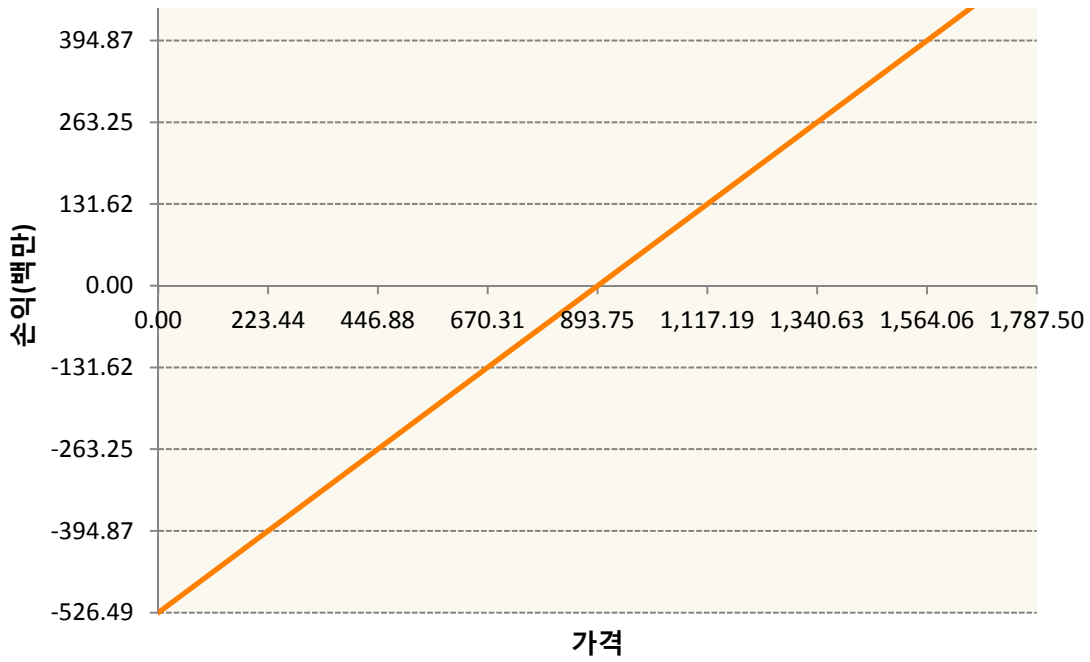


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

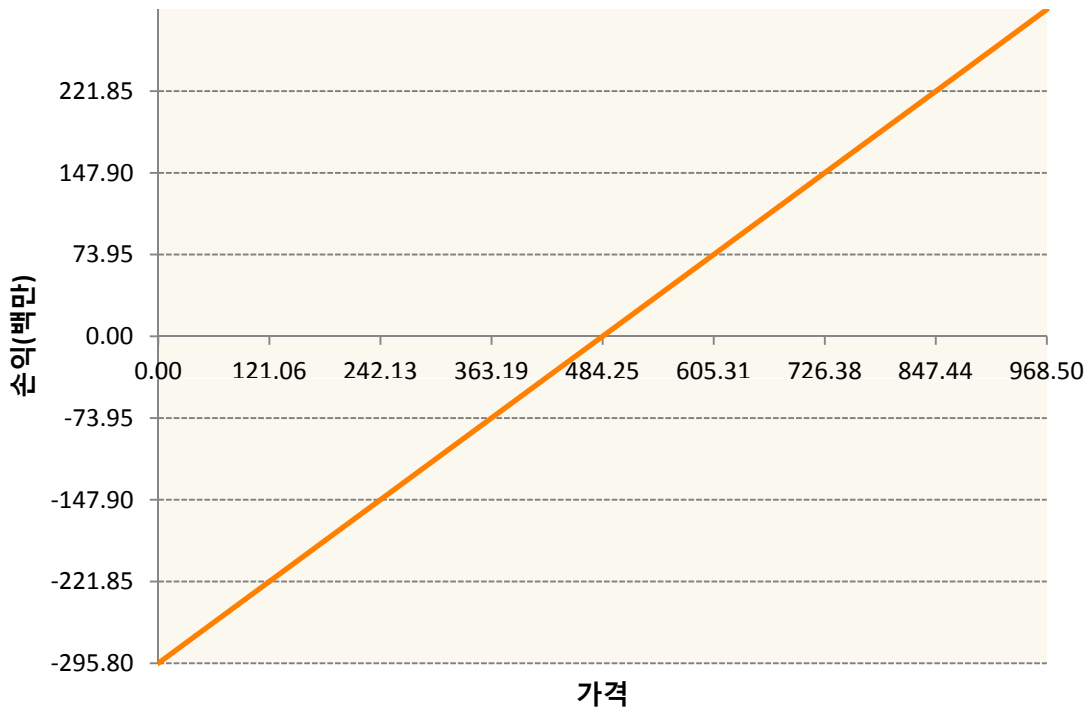


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





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	45
KCZ9	COFFEE 'C' FUTURE Dec19	18
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)

247