

공시일	2019-09-23
기준일	2019-09-20

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)

95

공시일	2019-09-23
기준일	2019-09-20

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

1,184

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

677

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-23
기준일	2019-09-20

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)	395
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	145

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

859

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-23
기준일	2019-09-20

유로인덱스모(주식-파생형)

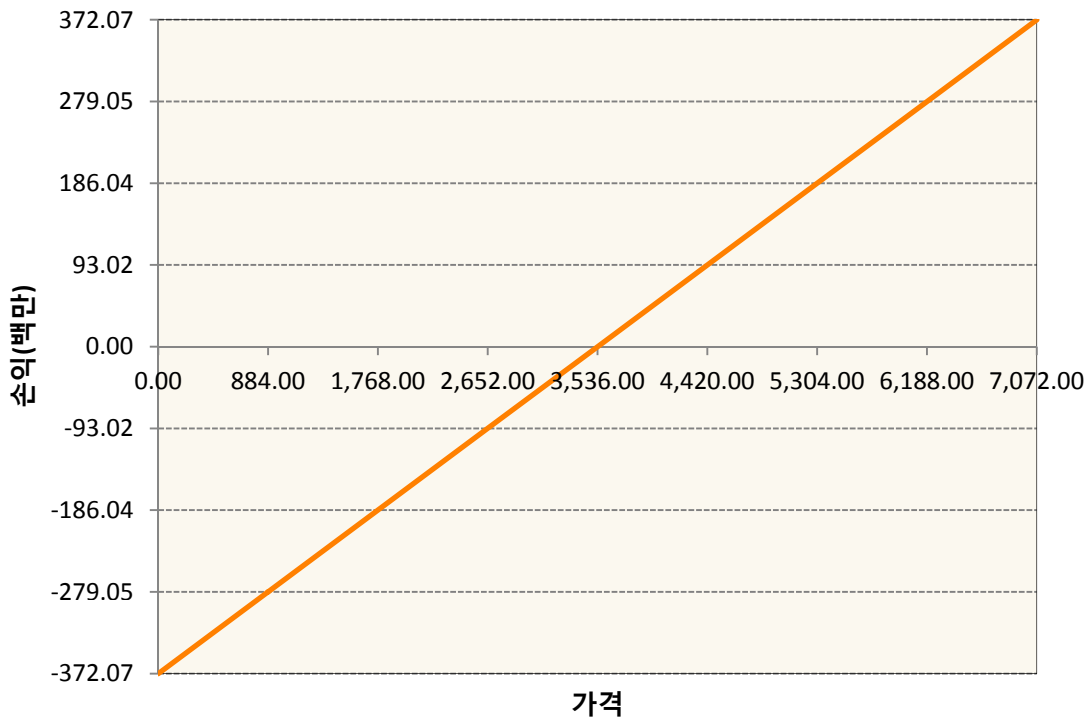
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	372	0	372	

2. 만기시점의 손익구조

VGZ9-EURO STOXX 50 Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	30
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

21

공시일	2019-09-23
기준일	2019-09-20

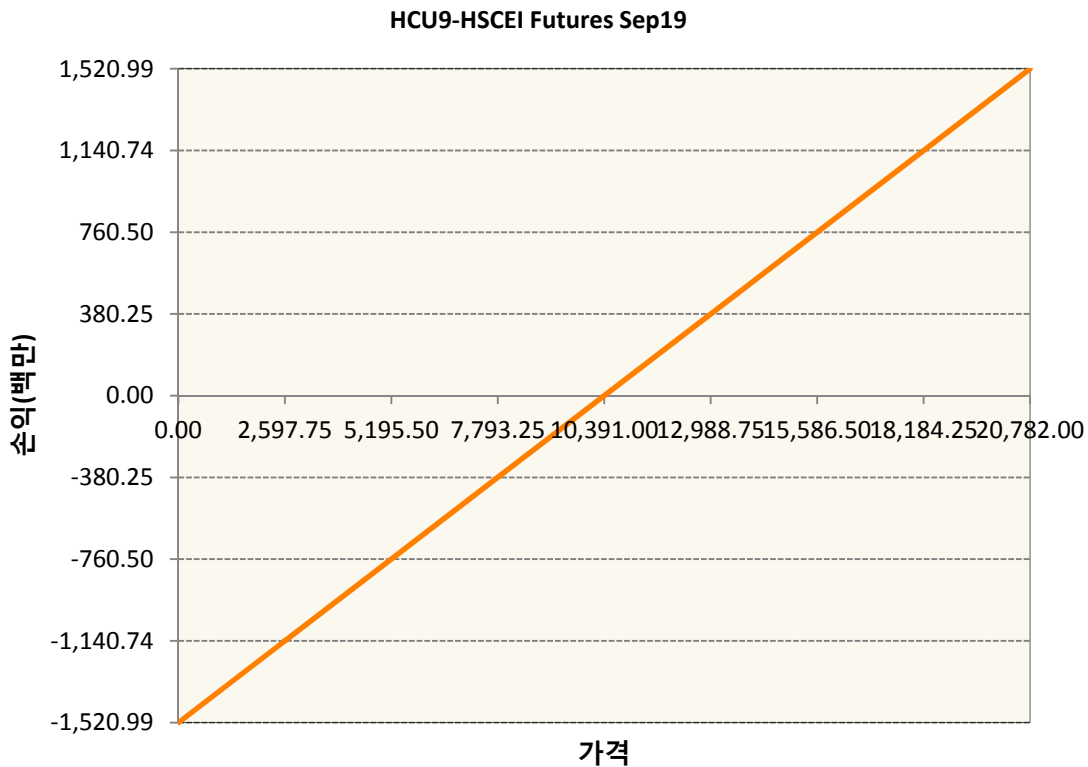
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,521	0	1,521	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

112

공시일	2019-09-23
기준일	2019-09-20

커버드콜모(주식혼합-파생형)

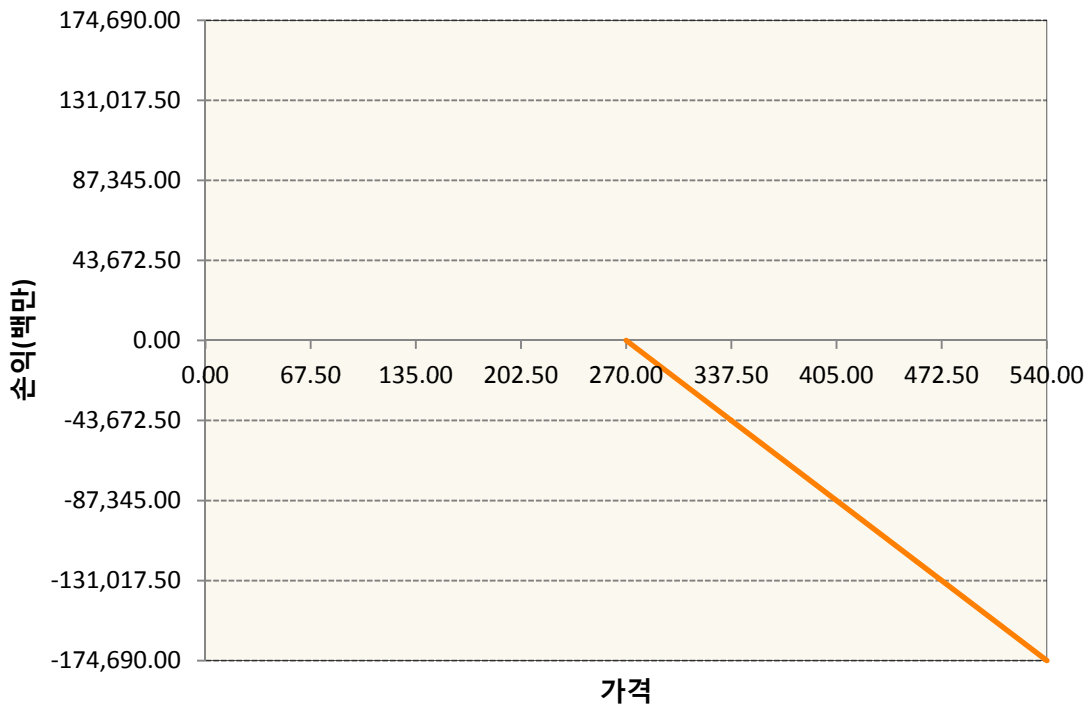
1. 계약금액

(단위:백만원)

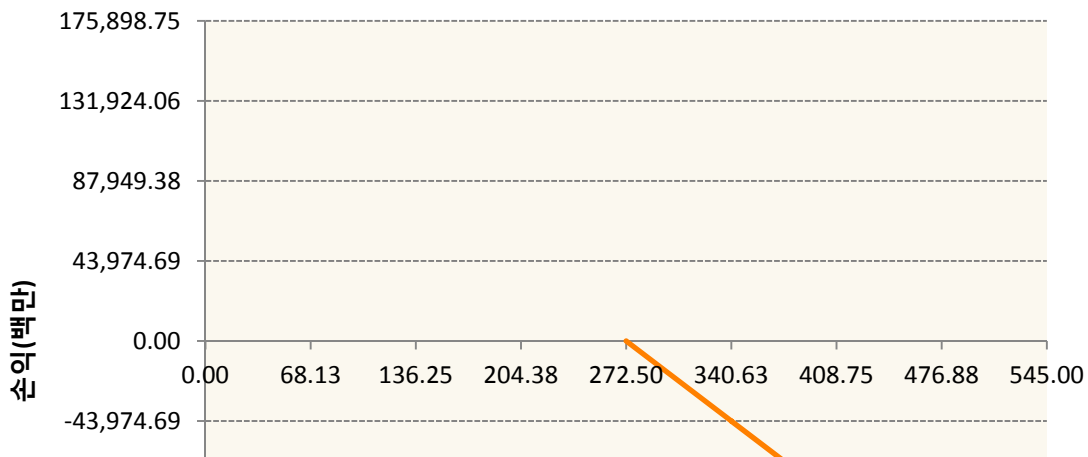
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	519,339	-519,339	장내

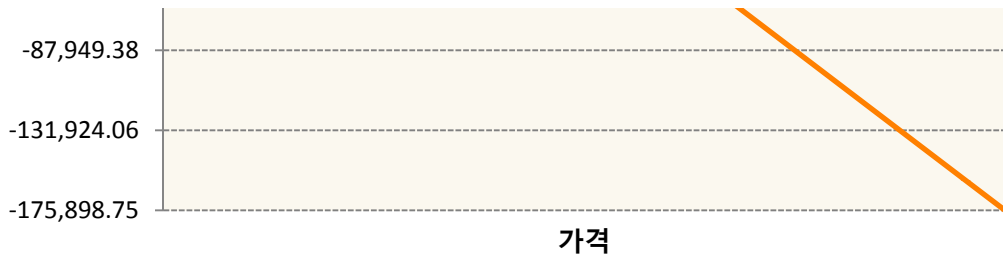
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PA2702-2019-10 콜270

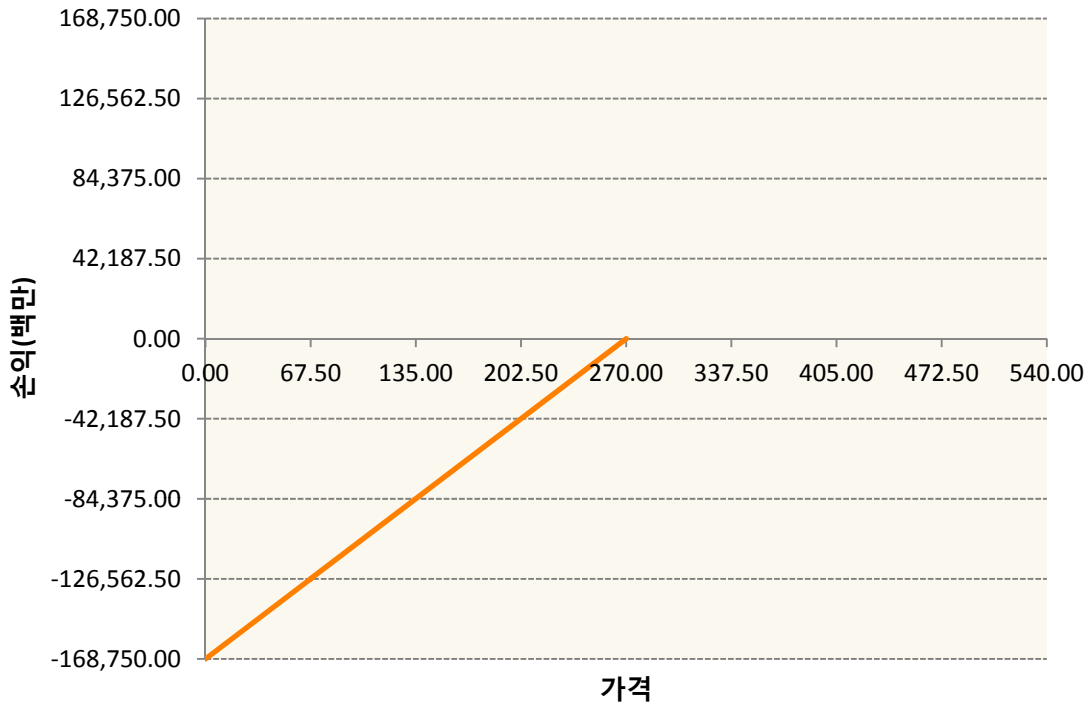


KR4201PA2728-2019-10 콜272.5





KR4301PA2701-2019-10 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PA2702		2019-10 콜270					12,332
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,307	6,147	5,964	5,760	5,539	5,303	5,055
-5.33%	5,506	5,223	4,929	4,626	4,316	4,001	3,682
-2.67%	3,793	3,439	3,085	2,730	2,375	2,020	1,665
0%	985	663	334	0	-338	-679	-1,022
2.67%	-2,767	-2,985	-3,224	-3,481	-3,752	-4,035	-4,328
5.33%	-7,113	-7,225	-7,365	-7,529	-7,715	-7,920	-8,142
8.00%	-11,739	-11,784	-11,851	-11,939	-12,050	-12,181	-12,332
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5					11,852
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,438	5,314	5,164	4,992	4,801	4,593	4,370

-5.33%	4,852	4,606	4,344	4,068	3,782	3,488	3,187
-2.67%	3,479	3,136	2,791	2,443	2,095	1,745	1,394
0%	1,048	701	351	0	-353	-707	-1,062
2.67%	-2,402	-2,662	-2,939	-3,229	-3,530	-3,839	-4,155
5.33%	-6,568	-6,716	-6,891	-7,090	-7,308	-7,544	-7,794
8.00%	-11,109	-11,175	-11,265	-11,379	-11,517	-11,675	-11,852
KR4301PA2701 2019-10 풋270							9,307
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,119	-9,130	-9,148	-9,174	-9,209	-9,254	-9,307
-5.33%	-4,688	-4,770	-4,865	-4,970	-5,084	-5,206	-5,334
-2.67%	-1,218	-1,397	-1,576	-1,755	-1,935	-2,114	-2,294
0%	394	271	139	0	-145	-295	-450
2.67%	742	712	672	619	556	481	398
5.33%	773	770	765	755	739	716	686
8.00%	774	774	774	773	770	766	759

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

(단위:백만원)

33,433

공시일	2019-09-23
기준일	2019-09-20

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

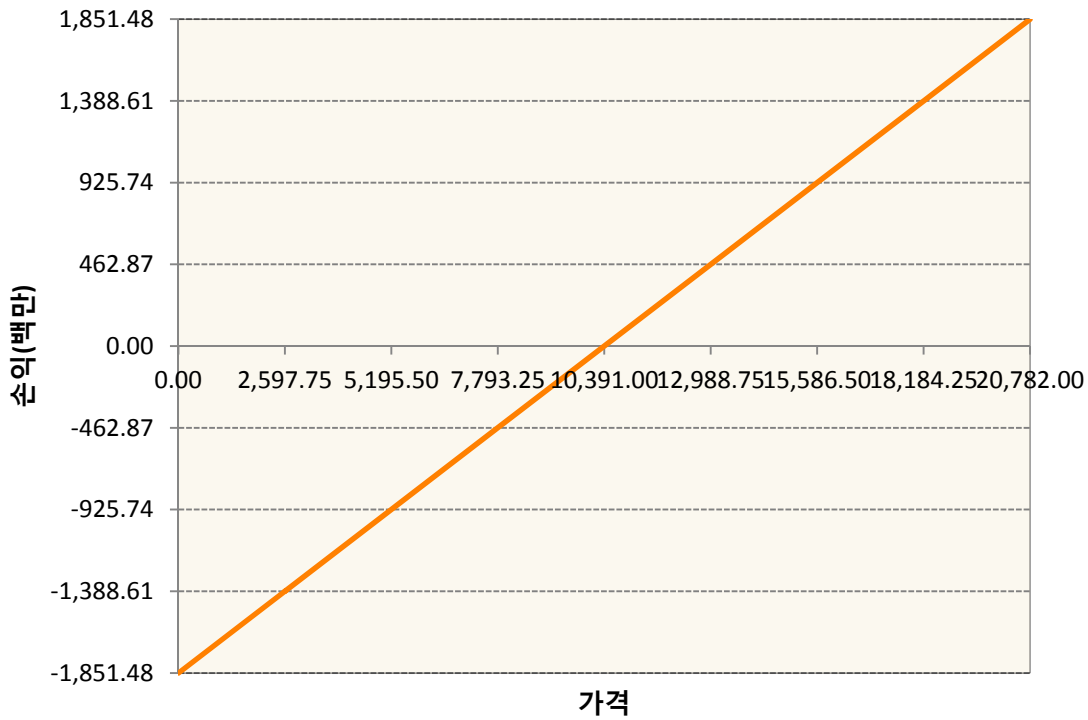
1. 계약금액

(단위:백만원)

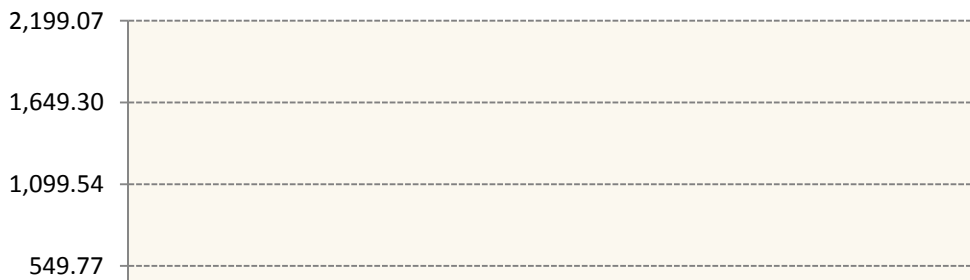
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,851	0	1,851	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,698	-4,698	장내
누계	통화	선도	683	2,818	-2,136	장외

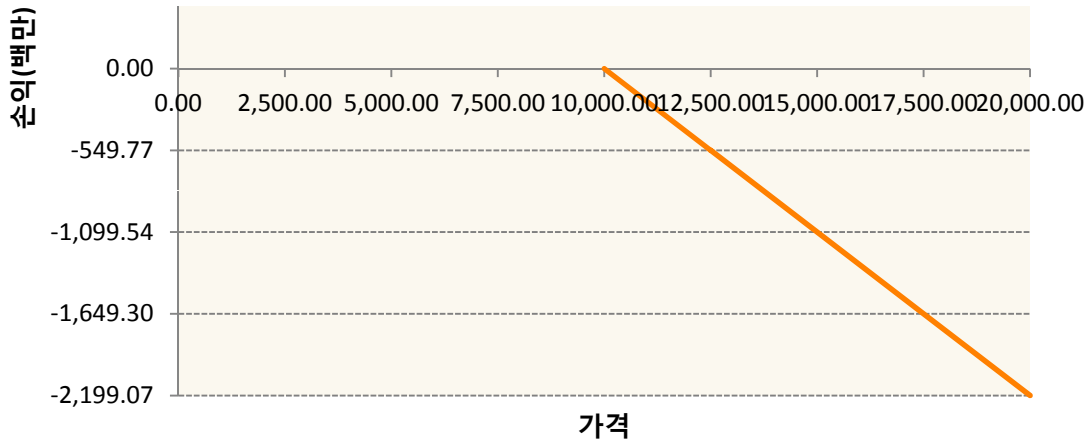
2. 만기시점의 손익구조

HCU9-HSCEI Futures Sep19

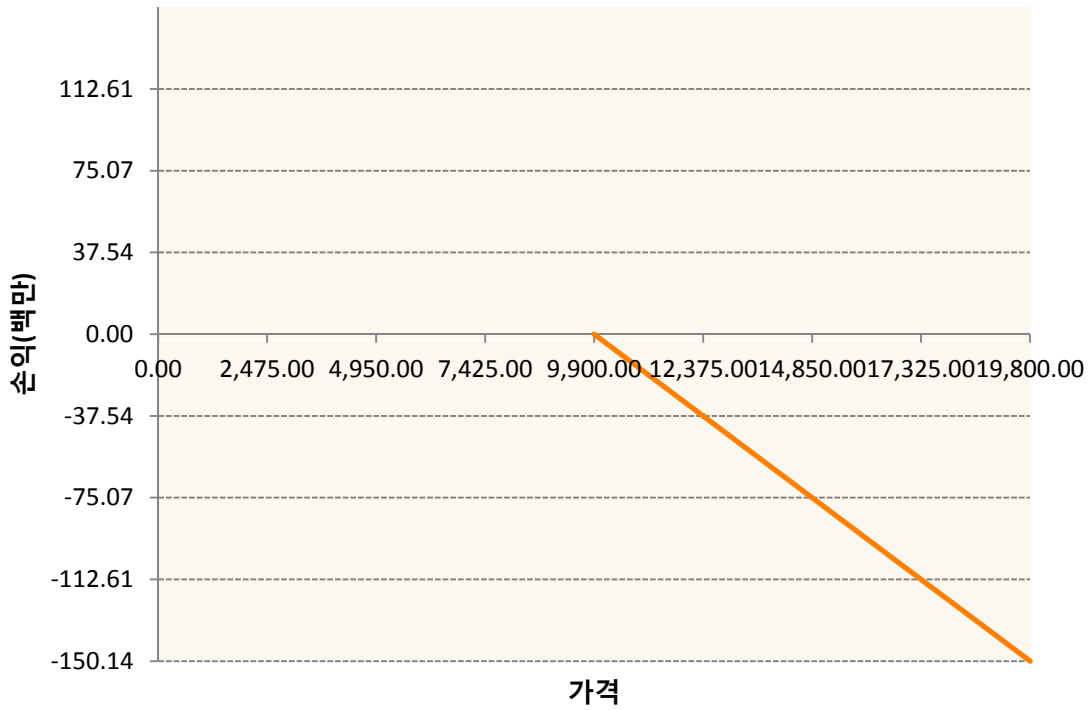


OHHIU9-C100-HSCEI

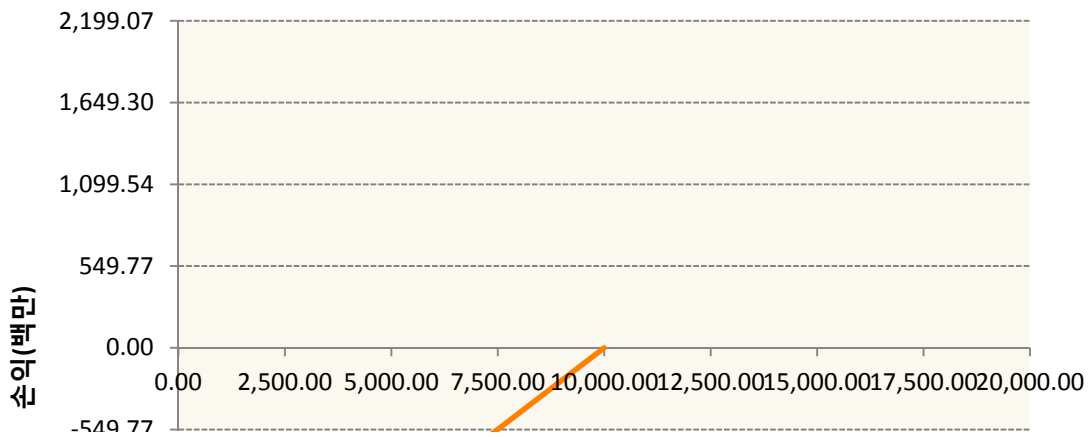


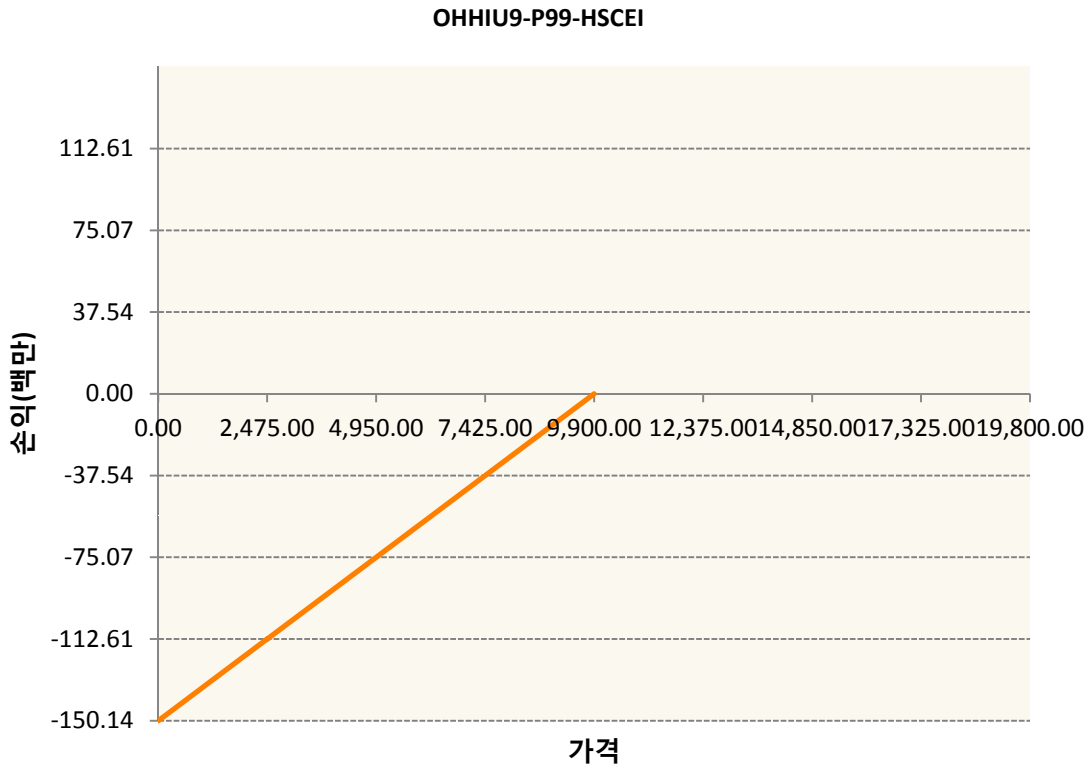


OHHIU9-C99-HSCEI



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	49
HCU9 HSCEI Futures Sep19	148
OHHIU9-C1(HSCEI	176
OHHIU9-C9(HSCEI	12
OHHIU9-P1(HSCEI	176
OHHIU9-P9(HSCEI	12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	575

공시일	2019-09-23
기준일	2019-09-20

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

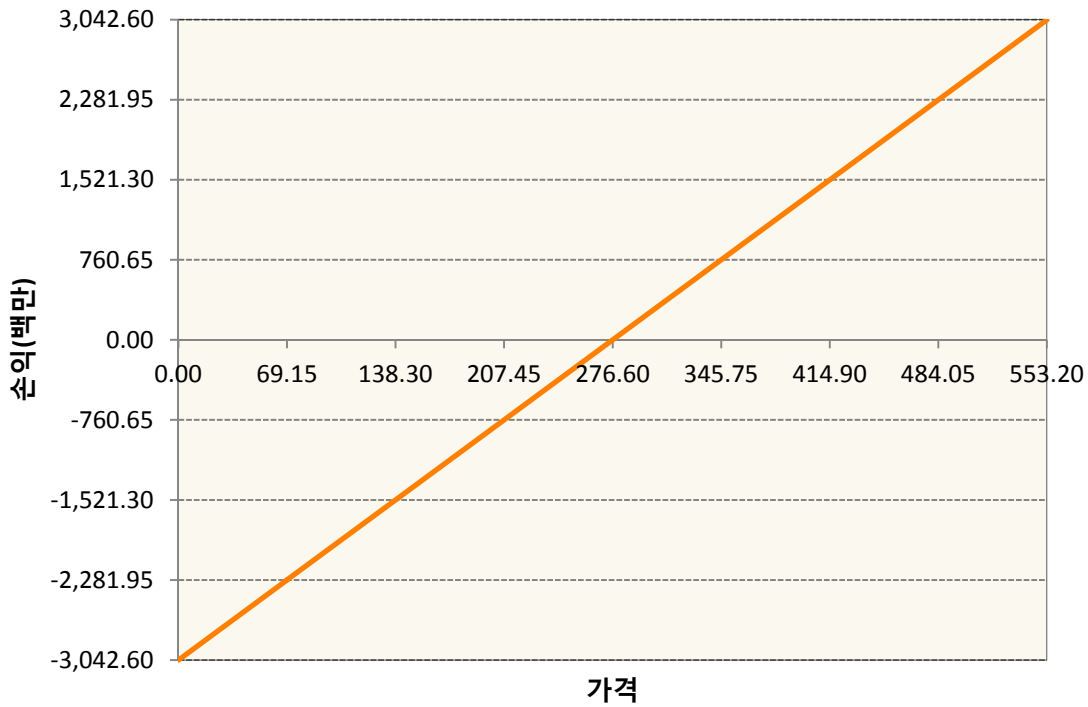
1. 계약금액

(단위:백만원)

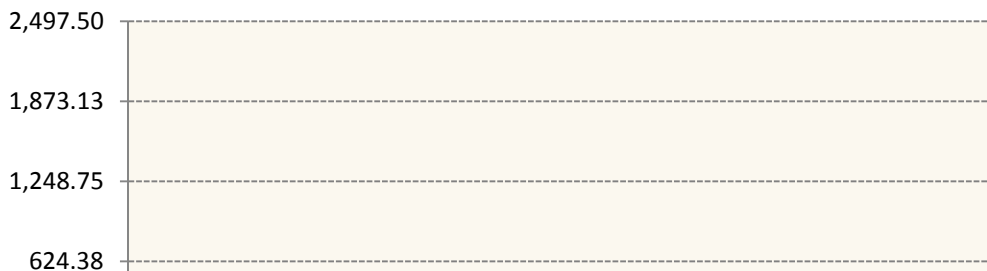
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,043	0	3,043	장내
누계	유가증권	스왑	14,125	0	14,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,828	-14,828	장내

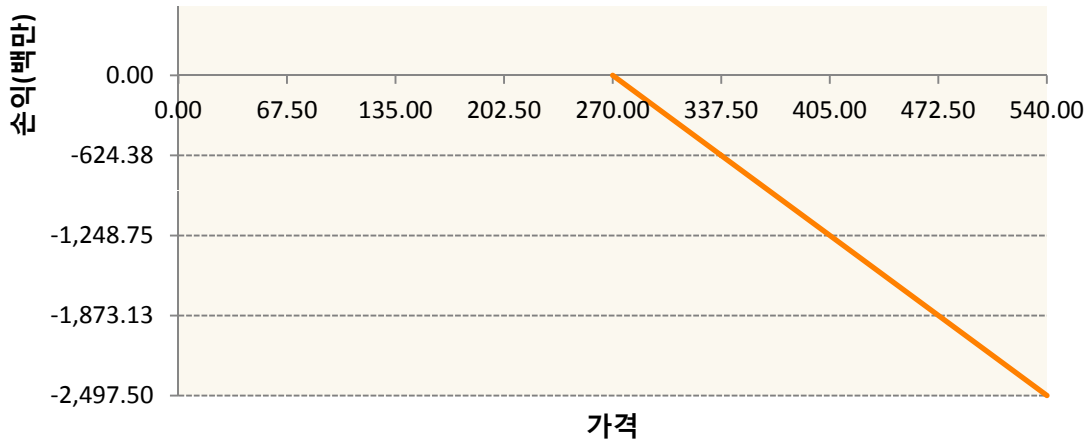
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

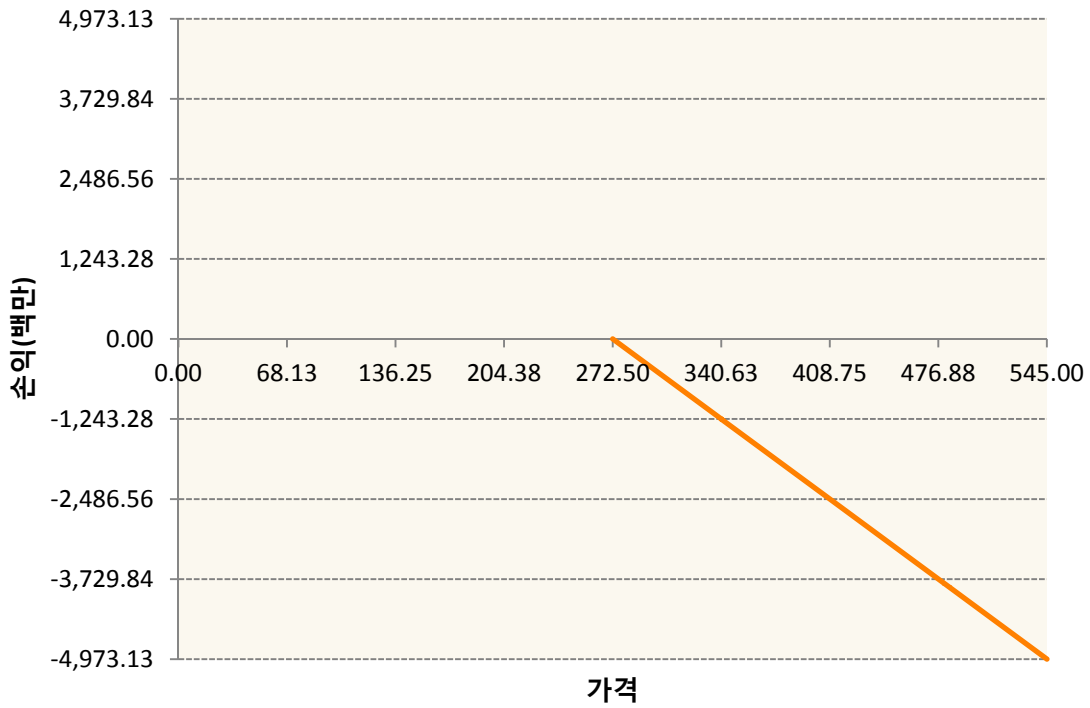


KR4201PA2702-2019-10 콜270

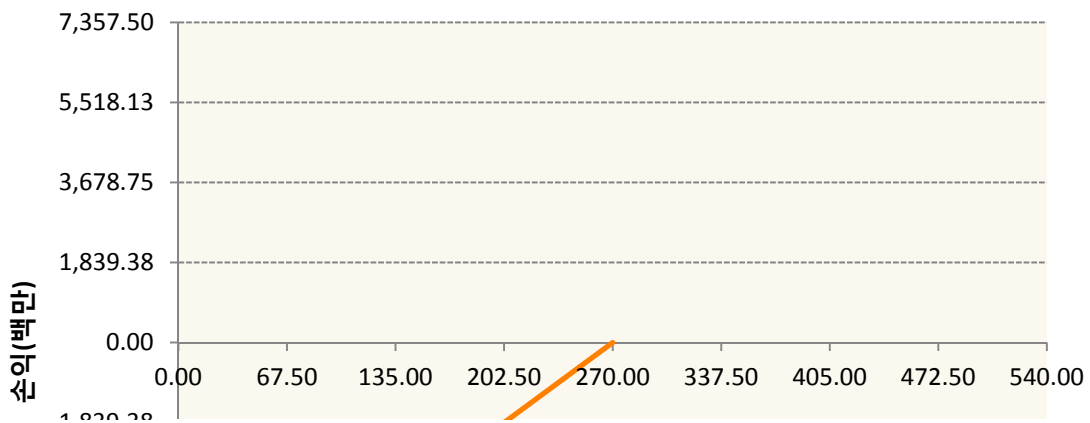




KR4201PA2728-2019-10 콜272.5



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						243
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-243	-243	-243	-243	-243	-243	-243	
-5.33%	-162	-162	-162	-162	-162	-162	-162	
-2.67%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	81	81	81	81	81	81	81	
5.33%	162	162	162	162	162	162	162	
8.00%	243	243	243	243	243	243	243	
KR4201PA2702		2019-10 콜270						176
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	90	88	85	82	79	76	72	
-5.33%	79	75	70	66	62	57	53	
-2.67%	54	49	44	39	34	29	24	
0%	14	9	5	0	-5	-10	-15	
2.67%	-40	-43	-46	-50	-54	-58	-62	
5.33%	-102	-103	-105	-108	-110	-113	-116	
8.00%	-168	-168	-169	-171	-172	-174	-176	
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5						335
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	154	150	146	141	136	130	124
-5.33%	137	130	123	115	107	99	90
-2.67%	98	89	79	69	59	49	39
0%	30	20	10	0	-10	-20	-30
2.67%	-68	-75	-83	-91	-100	-109	-117
5.33%	-186	-190	-195	-200	-207	-213	-220
8.00%	-314	-316	-318	-322	-326	-330	-335
KR4301PA2701 2019-10 풋270							406
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-398	-398	-399	-400	-402	-403	-406
-5.33%	-204	-208	-212	-217	-222	-227	-233
-2.67%	-53	-61	-69	-77	-84	-92	-100
0%	17	12	6	0	-6	-13	-20
2.67%	32	31	29	27	24	21	17
5.33%	34	34	33	33	32	31	30
8.00%	34	34	34	34	34	33	33

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

(단위:백만원)

2,326

공시일	2019-09-23
기준일	2019-09-20

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

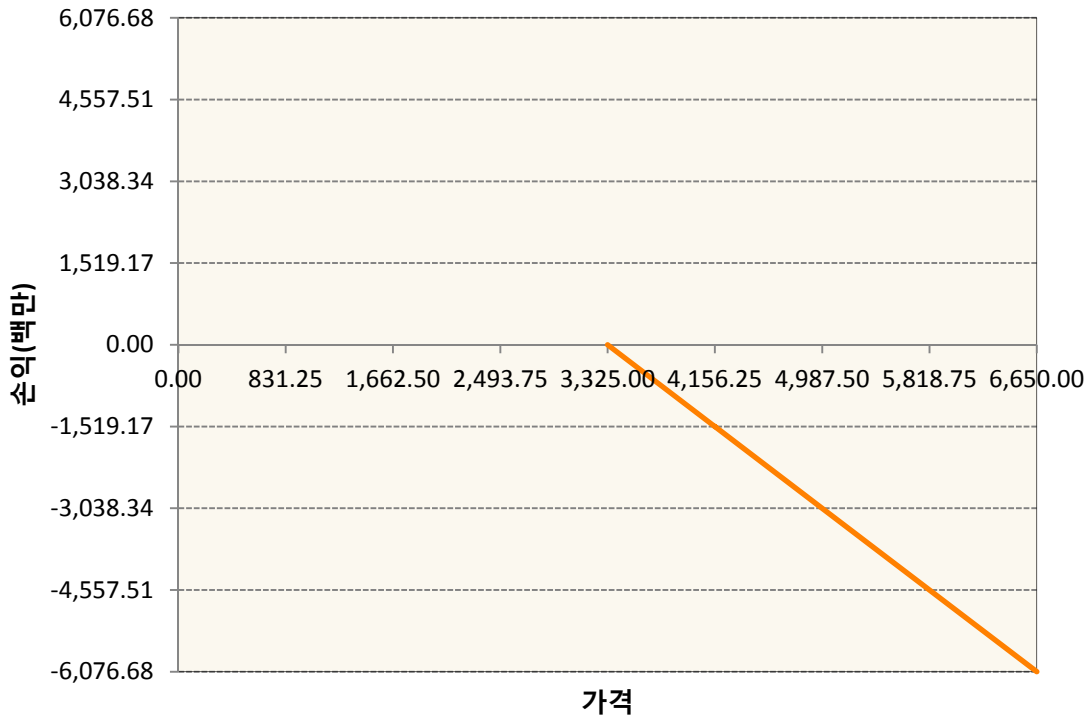
1. 계약금액

(단위:백만원)

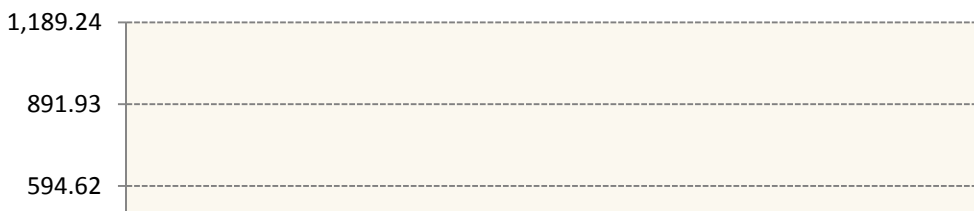
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,925	0	4,925	
누계	유가증권	스왑	23,924	0	23,924	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,532	-14,532	장내
누계	통화	선도	10,913	17,092	-6,179	장외

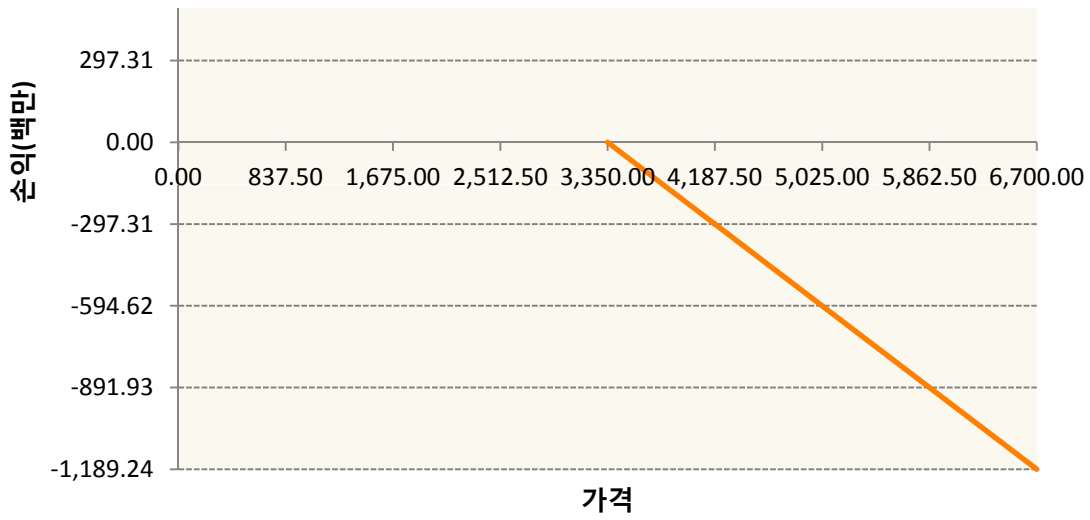
2. 만기시점의 손익구조

OESXU9-C3325-EURO STOXX 50

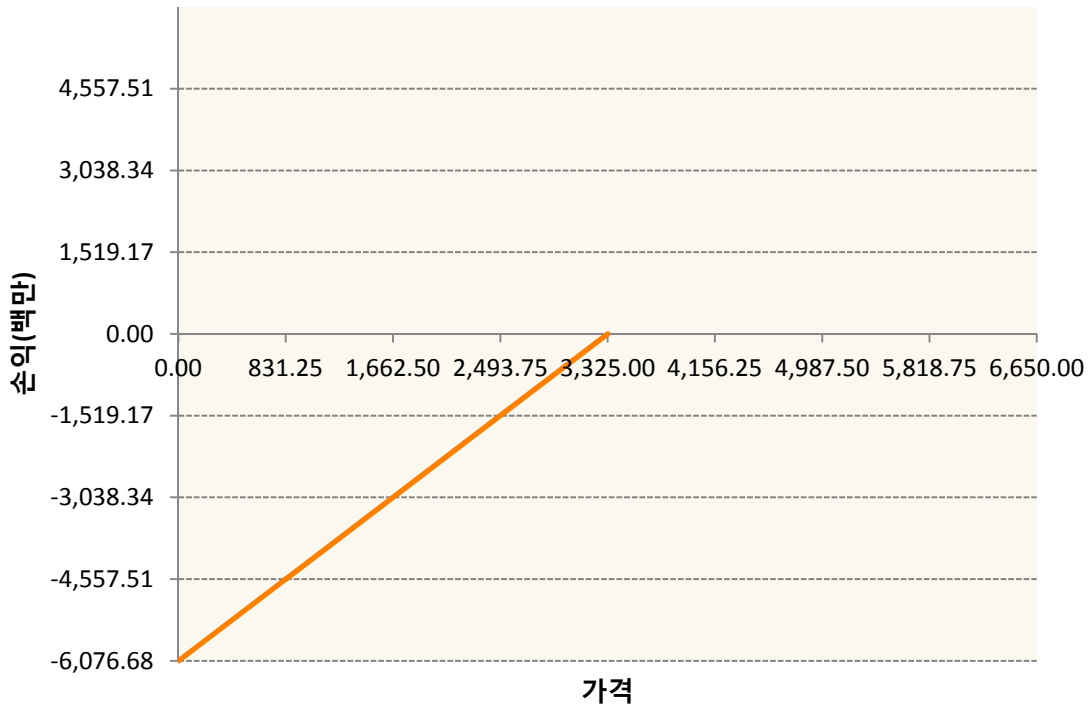


OESXU9-C3350-EURO STOXX 50

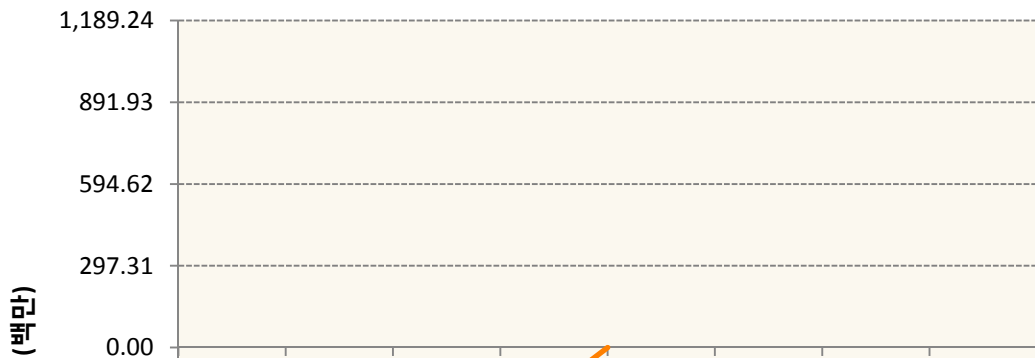


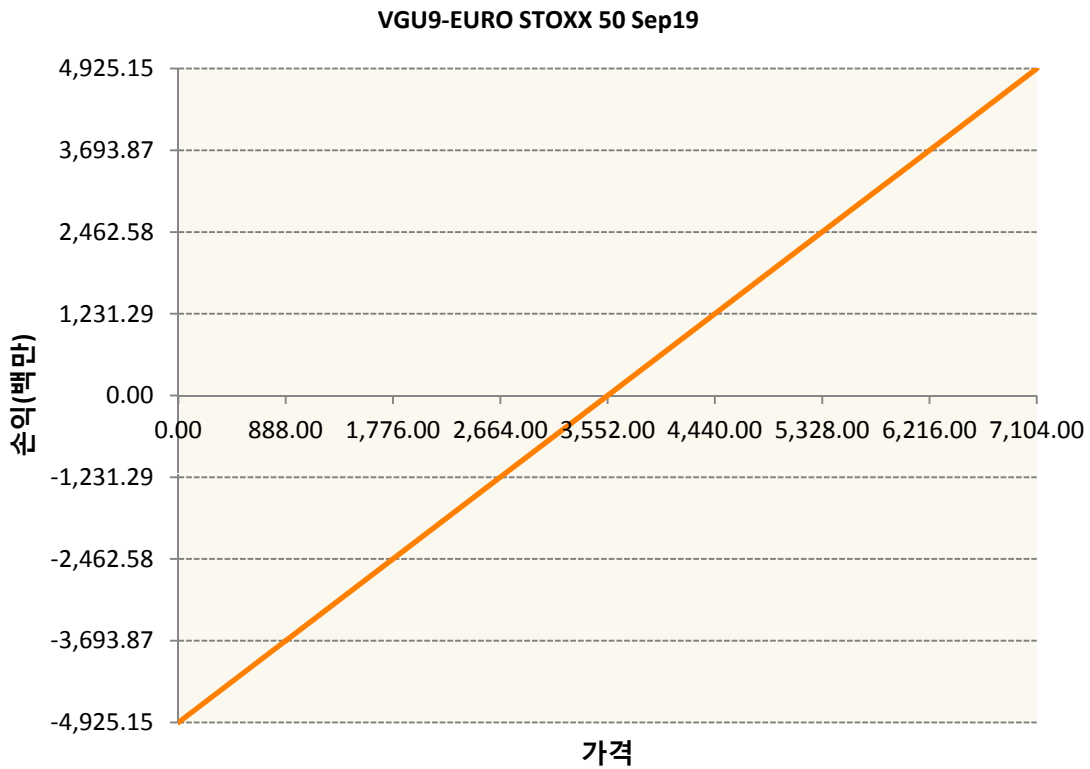
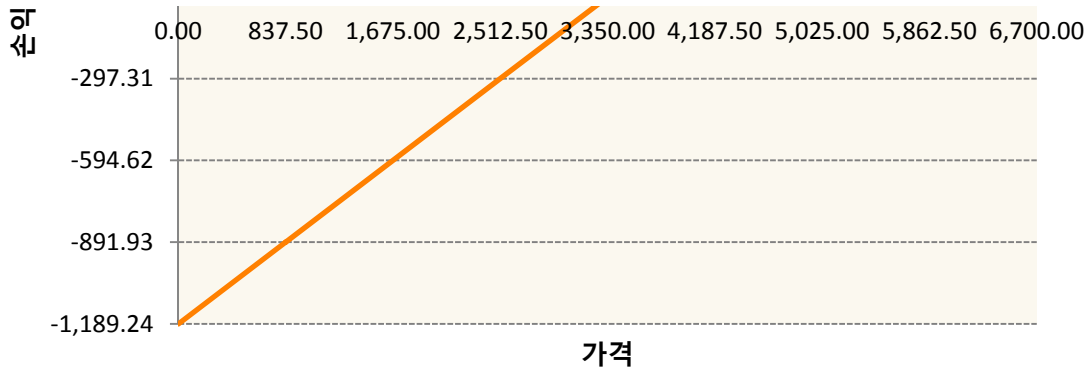


OESXU9-P3325-EURO STOXX 50



OESXU9-P3350-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	18
FX21019M0< KRW/EUR 27-09-19E	1,052
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	486
OESXU9-C3< EURO STOXX 50	95
OESXU9-P3< EURO STOXX 50	486
OESXU9-P3< EURO STOXX 50	95

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

(단위:백만원)

2,172

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

(단위:백만원)

1,003

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

(단위:백만원)

86

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

(단위:백만원)

134

공시일	2019-09-23
기준일	2019-09-20

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

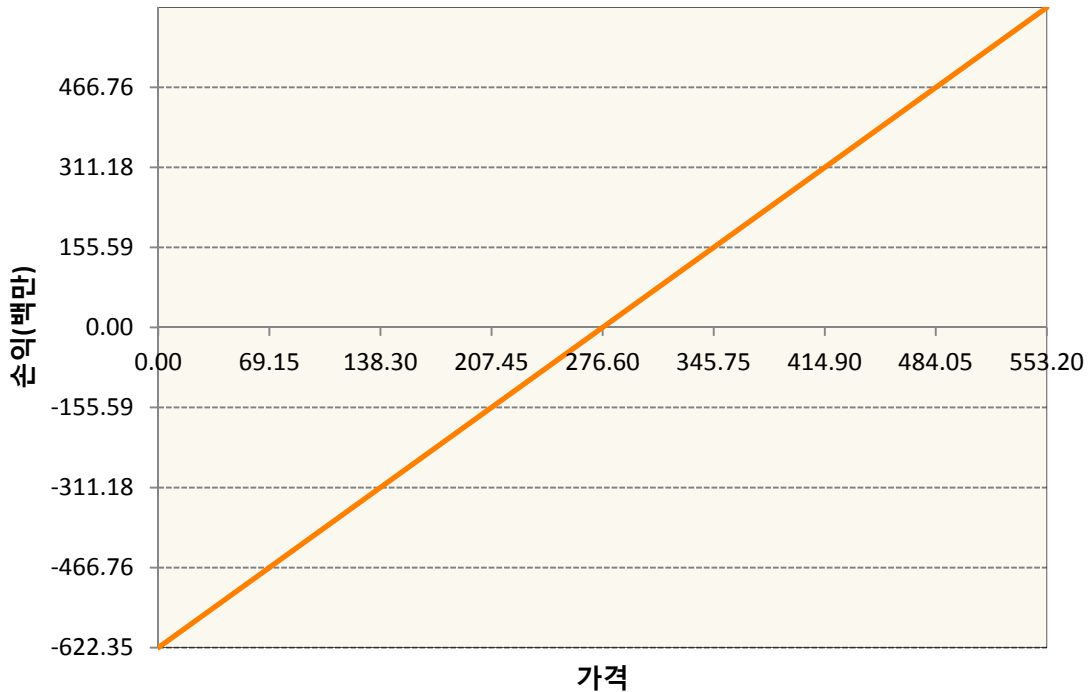
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	622	0	622	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						50
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	17	17	17	17	17	17	17	
5.33%	33	33	33	33	33	33	33	
8.00%	50	50	50	50	50	50	50	

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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-09-23
기준일	2019-09-20

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

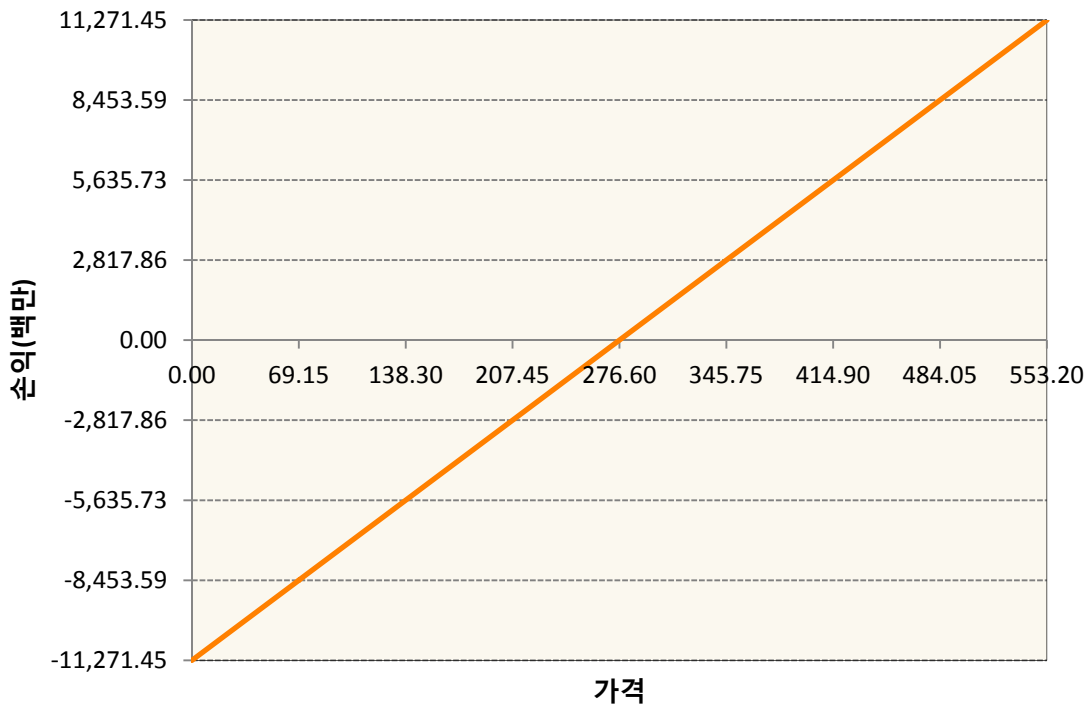
1. 계약금액

(단위:백만원)

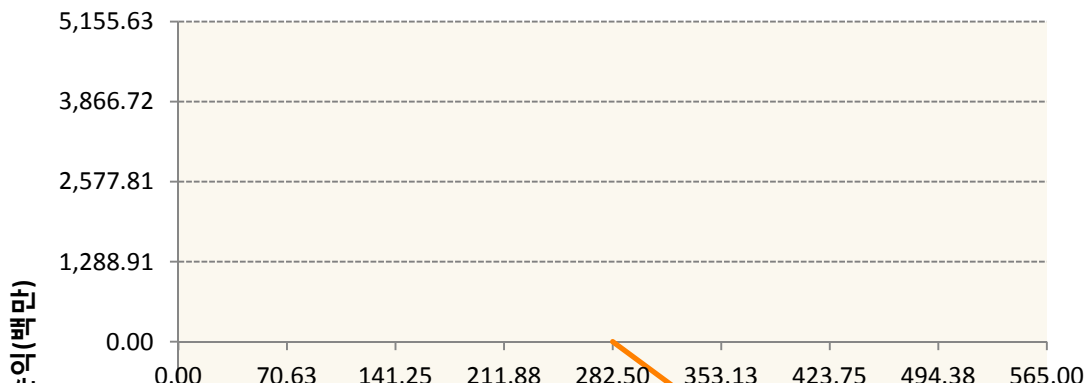
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,271	0	11,271	장내
누계	유가증권	옵션	1,422	20,831	-19,409	장내

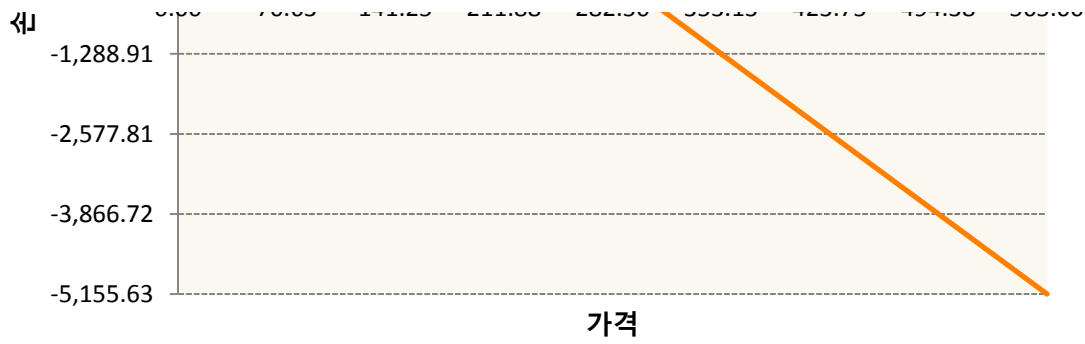
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

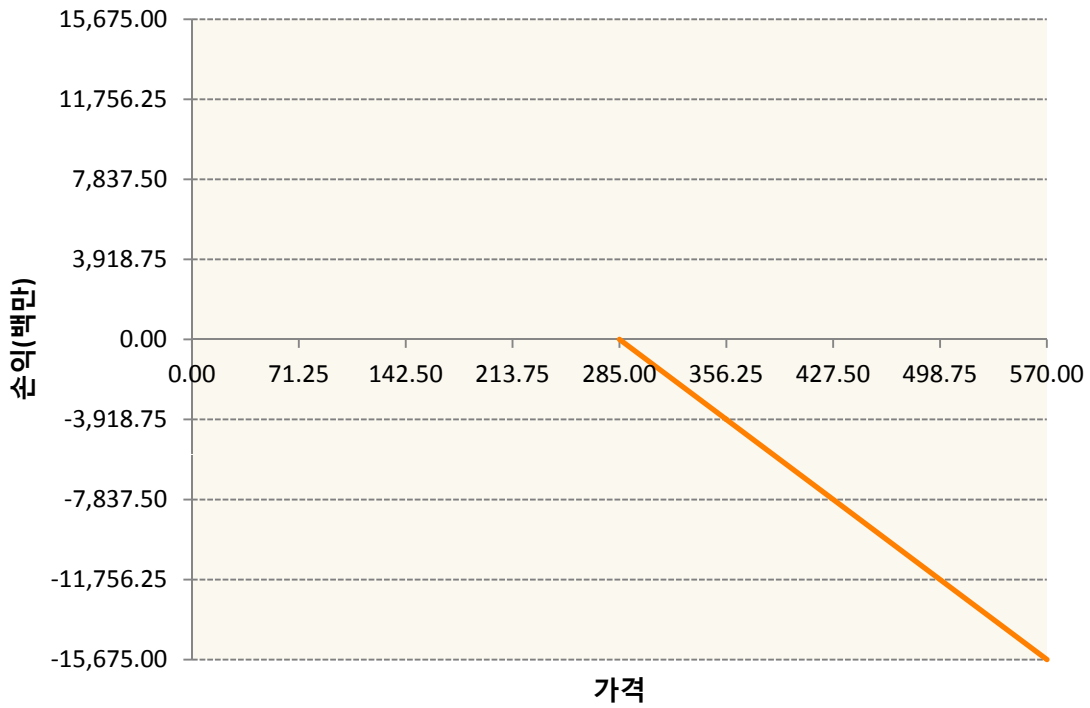


KR4201PA2827-2019-10 콜282.5

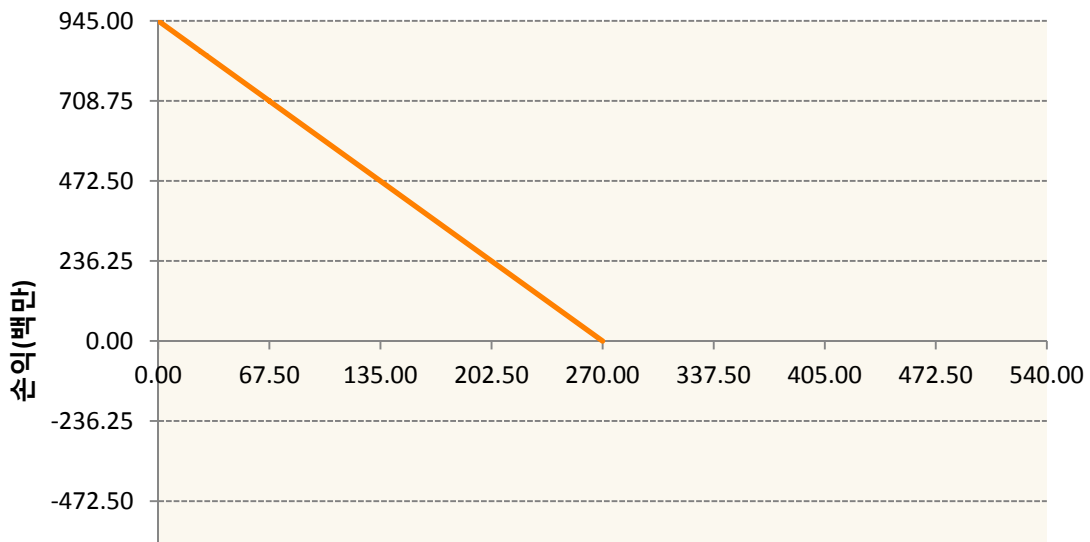


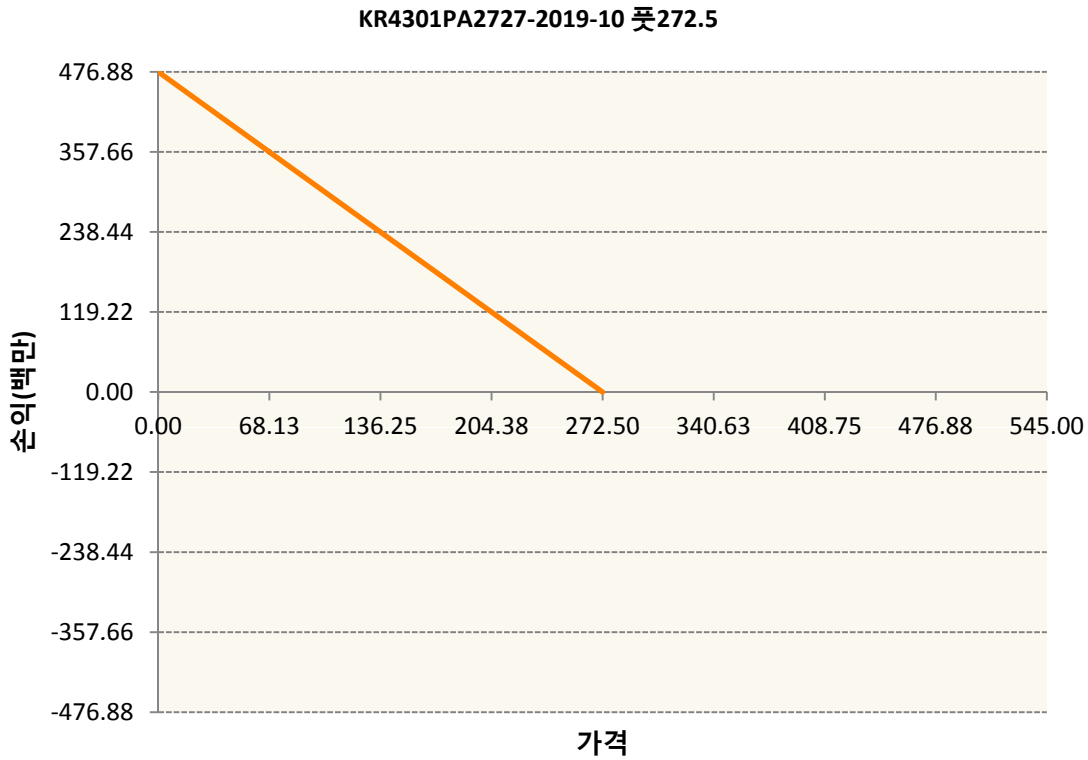
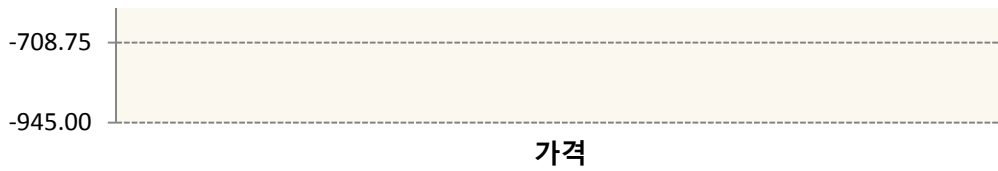


KR4201PA2850-2019-10 콜285



KR4301PA2701-2019-10 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						901
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-901	-901	-901	-901	-901	-901	-901	
-5.33%	-601	-601	-601	-601	-601	-601	-601	
-2.67%	-300	-300	-300	-300	-300	-300	-300	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	300	300	300	300	300	300	300	
5.33%	601	601	601	601	601	601	601	
8.00%	901	901	901	901	901	901	901	
KR4201PA2827		2019-10 콜282.5						270
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	75	74	73	71	68	65	62	
-5.33%	72	69	65	61	56	51	45	
-2.67%	59	53	46	39	32	24	15	

0%	29	19	10	0	-10	-20	-30
2.67%	-29	-40	-50	-61	-71	-82	-93
5.33%	-117	-126	-135	-144	-154	-164	-173
8.00%	-227	-233	-240	-247	-254	-262	-270
KR4201PA2850 2019-10 콜285							758
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	184	182	179	174	168	161	151
-5.33%	177	171	162	152	139	125	109
-2.67%	151	136	118	99	79	57	34
0%	80	54	27	0	-28	-56	-85
2.67%	-66	-98	-129	-161	-193	-225	-257
5.33%	-300	-329	-359	-390	-420	-451	-482
8.00%	-612	-633	-655	-680	-705	-731	-758
KR4301PA2701 2019-10 풋270							52
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	51	51	51	51	52	52	52
-5.33%	26	27	27	28	28	29	30
-2.67%	7	8	9	10	11	12	13
0%	-2	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-4	-4	-4	-3	-3	-3	-2
5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
KR4301PA2727 2019-10 풋272.5							29
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	29	29	29	29	29	29	29
-5.33%	16	16	16	16	17	17	17
-2.67%	5	5	6	6	7	7	8
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-3	-3	-3	-3	-2	-2	-2
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3

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

(단위:백만원)

1,731

공시일	2019-09-23
기준일	2019-09-20

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	95,448	0	95,448	

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	2019-09-23
기준일	2019-09-20

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,782	0	1,782	
누계	유가증권	수익증권	123,064	0	123,064	

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	2019-09-23
기준일	2019-09-20

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	13,049	-13,049	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	464,859	0	464,859	
누계	통화	선도	0	581,645	-581,645	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 21-10-19E		3,897
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,516
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,604
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,956
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		950
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		950
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E		950
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E		1,711
FX21019Q04 KRW/USD 30-09-19E		190
FX21019Q04 KRW/USD 24-09-19E		2,091
FX21019Q04 KRW/USD 24-09-19E		2,661
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E		190
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E		285
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E		285
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E		190
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E		1,369
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E		2,034
FX21019U01 KRW/USD 10-10-19E		285
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E		190
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E		2,319
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E		1,711
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E		190
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E		950
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E		1,464
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		2,956
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		3,136

FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E

2,604
1,901
1,996

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

(단위:백만원)

15,433

공시일	2019-09-23
기준일	2019-09-20

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

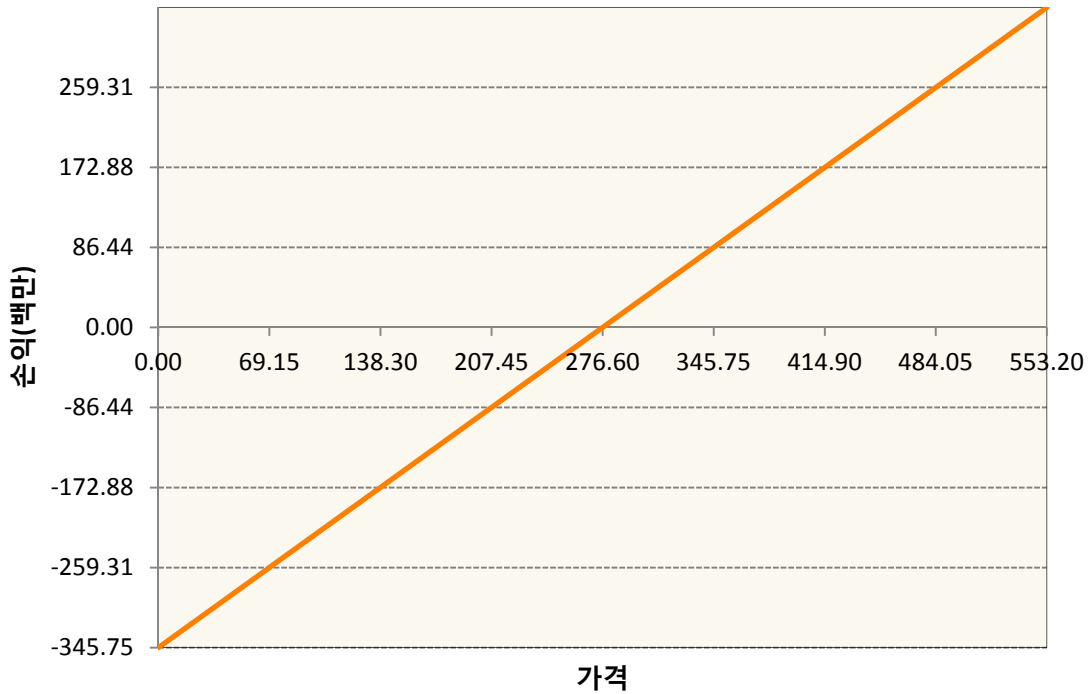
1. 계약금액

(단위:백만원)

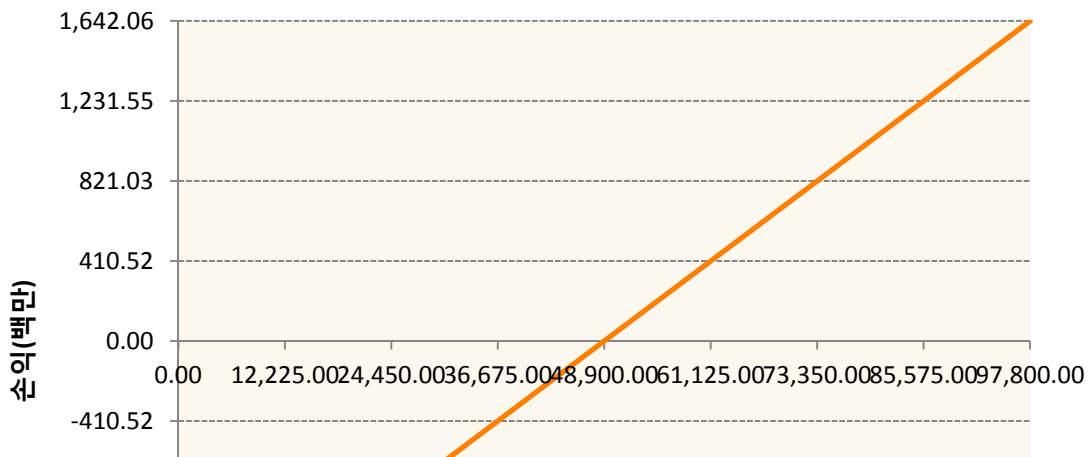
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,988	0	1,988	장내

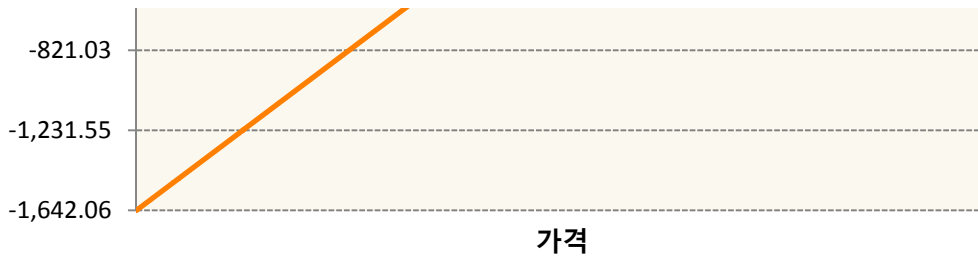
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



KR4111PA0002-2019-10 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						28
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28	
-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%	28	28	28	28	28	28	28	
KR4111PA0002		2019-10 삼성전자개별선물						132
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132	
-5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88	
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	44	44	44	44	44	44	44	
5.33%	88	88	88	88	88	88	88	
8.00%	132	132	132	132	132	132	132	

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

191

공시일	2019-09-23
기준일	2019-09-20

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

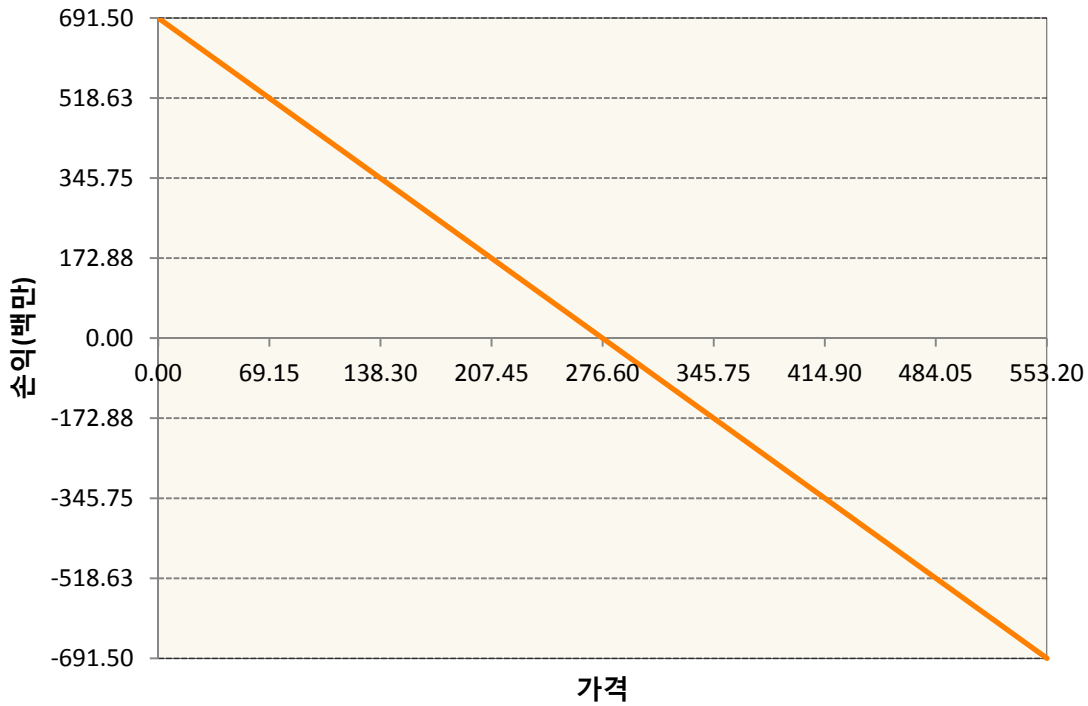
1. 계약금액

(단위:백만원)

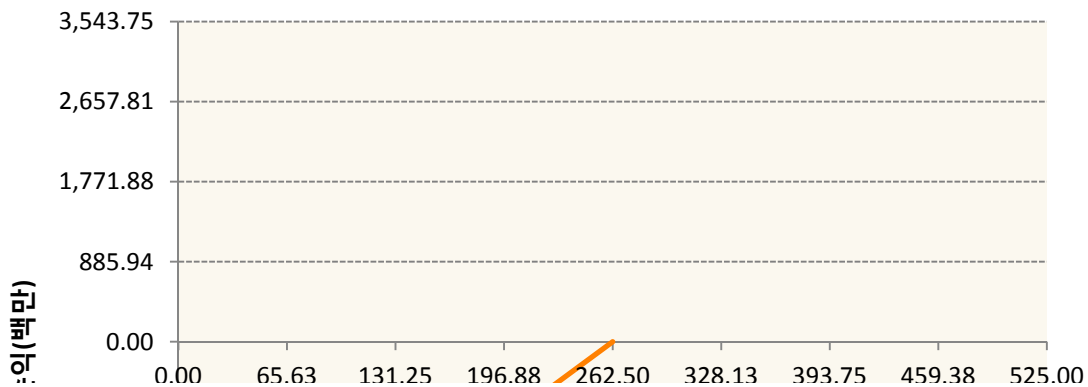
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	692	-692	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,875	-3,875	장내

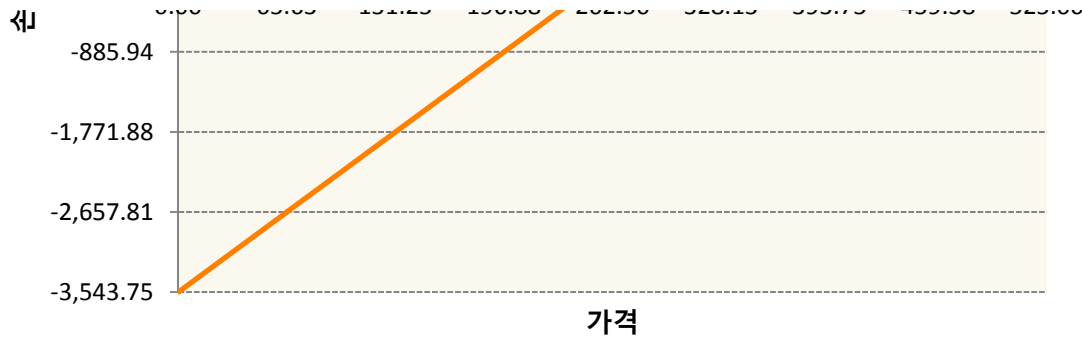
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

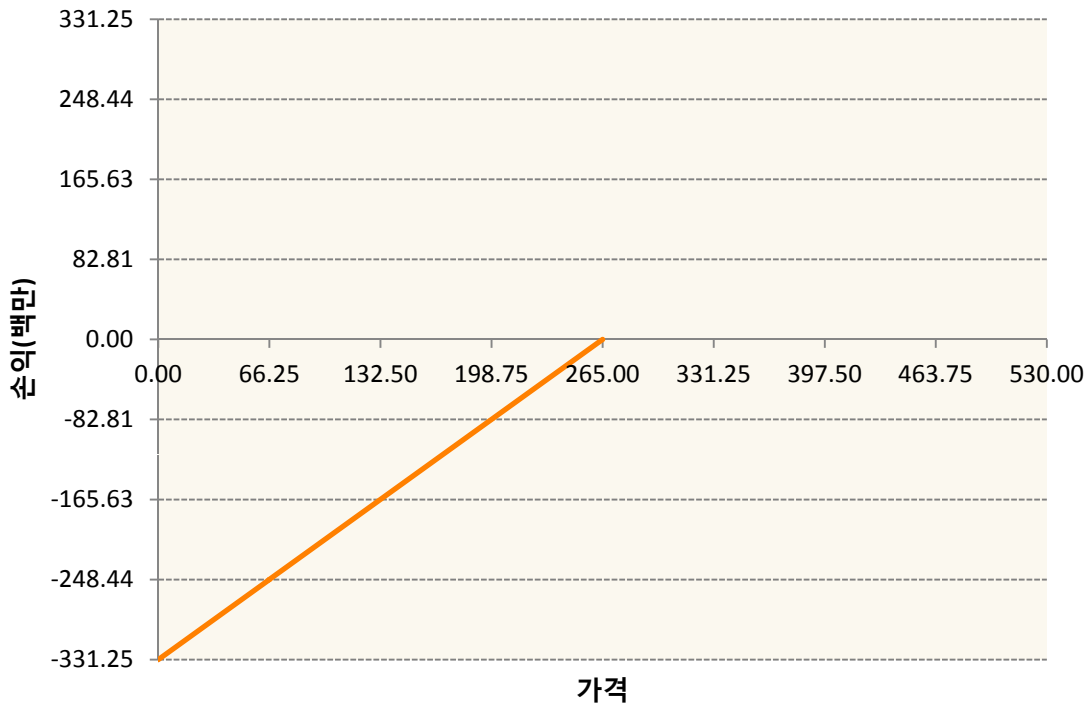


KR4301PA2628-2019-10 풋262.5





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%	37	37	37	37	37	37	37	
-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%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37	
8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55	
KR4301PA2628		2019-10 풋262.5						126
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-113	-115	-117	-119	-121	-124	-126
-5.33%	-38	-42	-46	-50	-53	-57	-61
-2.67%	-4	-7	-10	-12	-15	-19	-22
0%	2	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	3	3	3	3	2	2	1
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

KR4301PA2651 2019-10 풋265 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%	-5	-6	-6	-6	-7	-7	-7
-2.67%	-1	-1	-1	-2	-2	-2	-3
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	1	0	0	0	0	0	0
5.33%	1	1	1	1	0	0	0
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

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

(단위:백만원)

127

공시일	2019-09-23
기준일	2019-09-20

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	527	-527	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	18,148	0	18,148	
누계	통화	선도	0	18,176	-18,176	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		323
FX21019U03 KRW/USD 18-10-19E		475
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		608
FX21019U03 KRW/USD 25-09-19E		48

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

(단위:백만원)

482

공시일	2019-09-23
기준일	2019-09-20

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	378	0	378	장외
누계	통화	선도	92	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	2019-09-23
기준일	2019-09-20

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

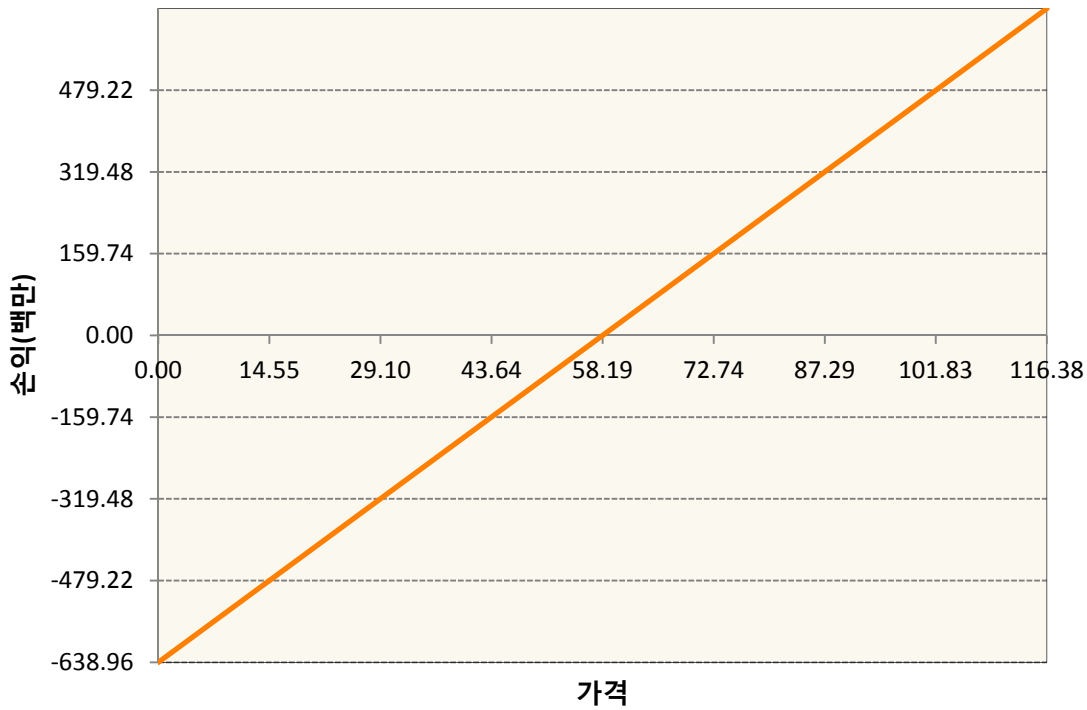
1. 계약금액

(단위:백만원)

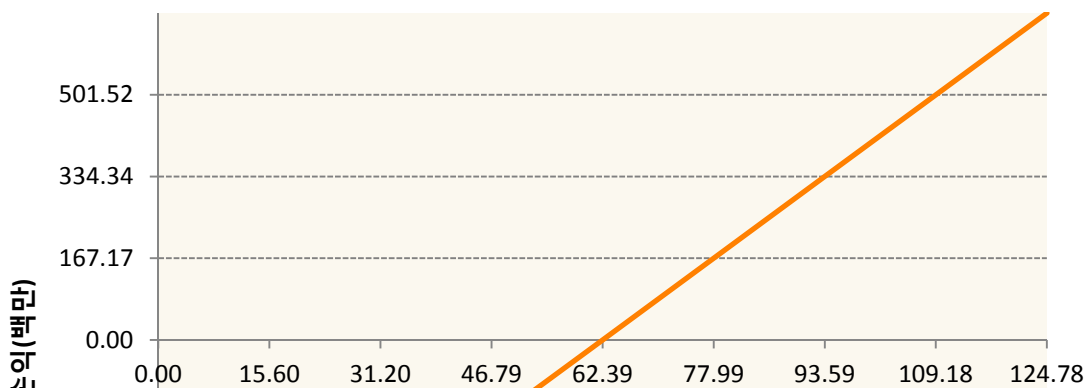
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,442	475	1,968	
누계	유가증권	선물	205	0	205	장내

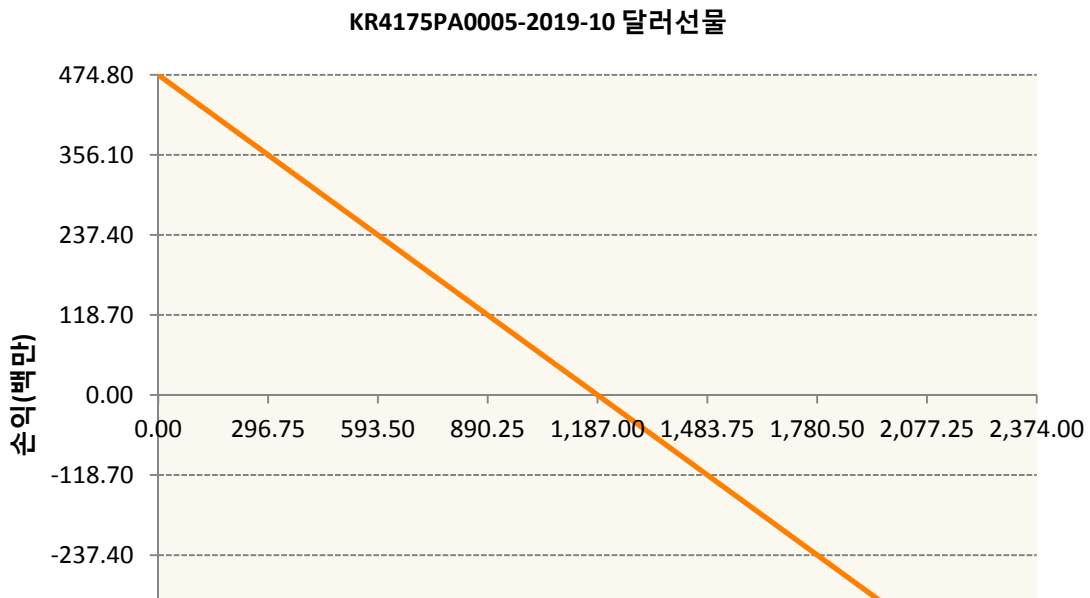
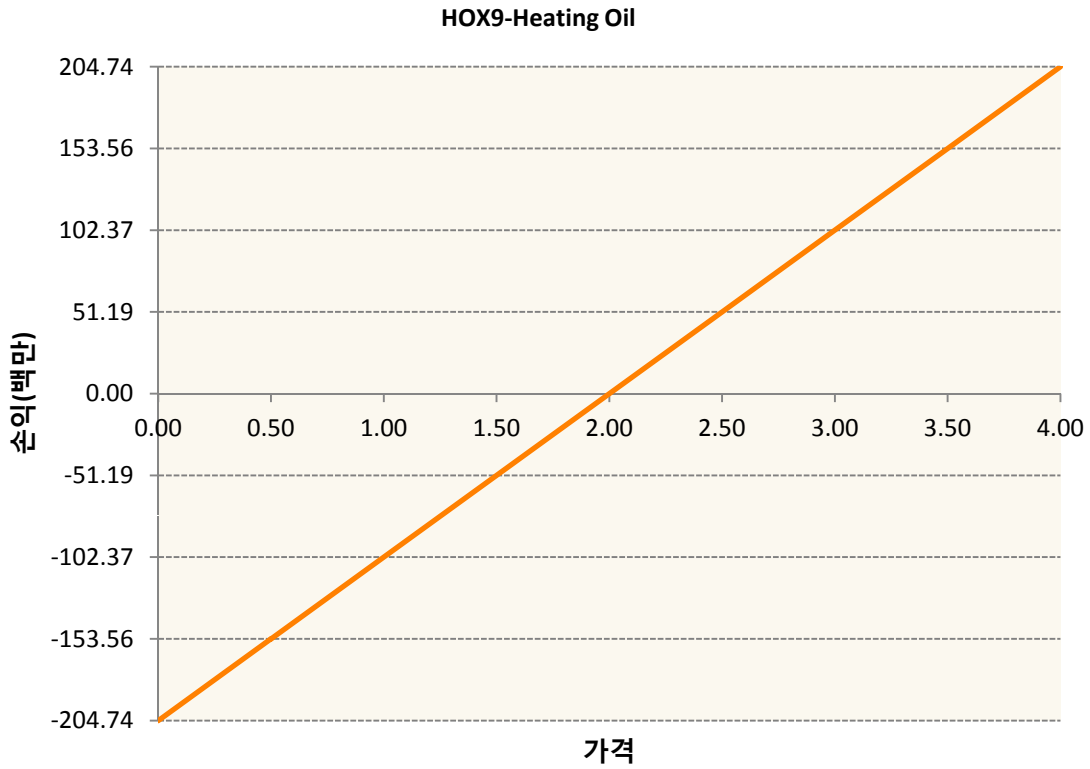
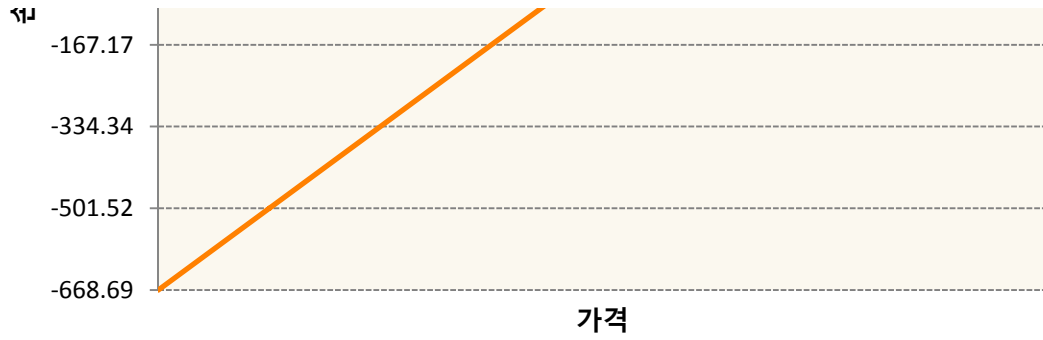
2. 만기시점의 손익구조

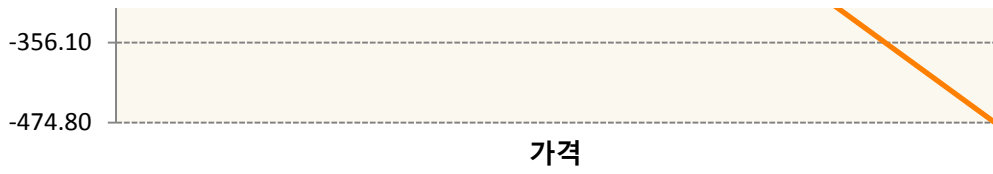
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19



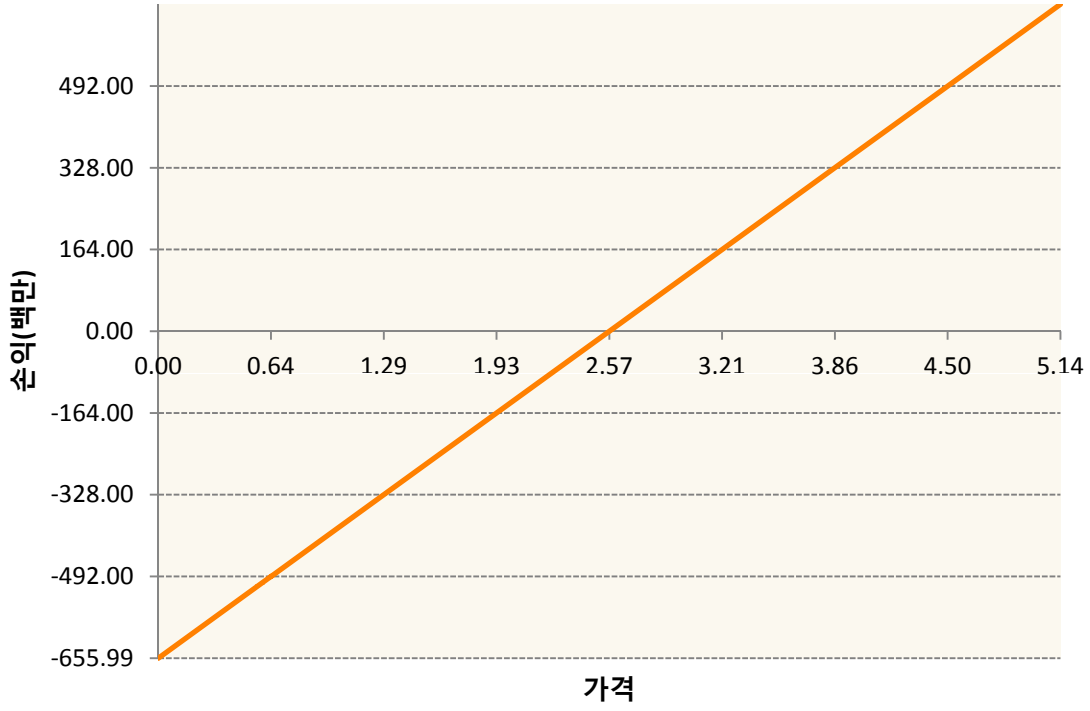
COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20



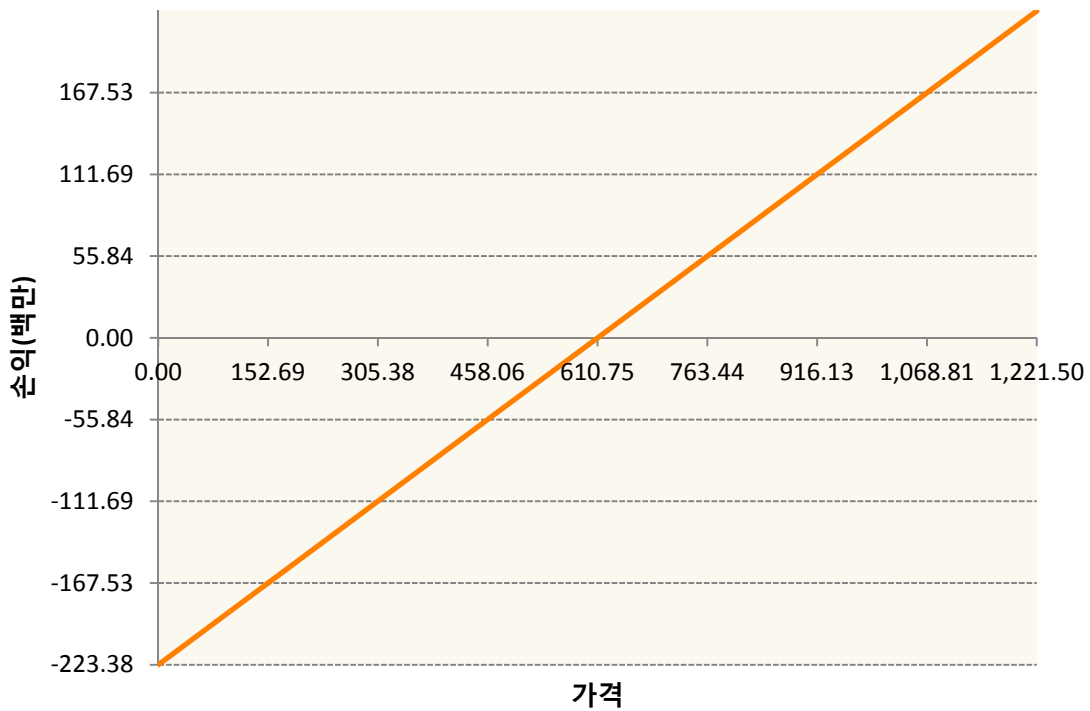


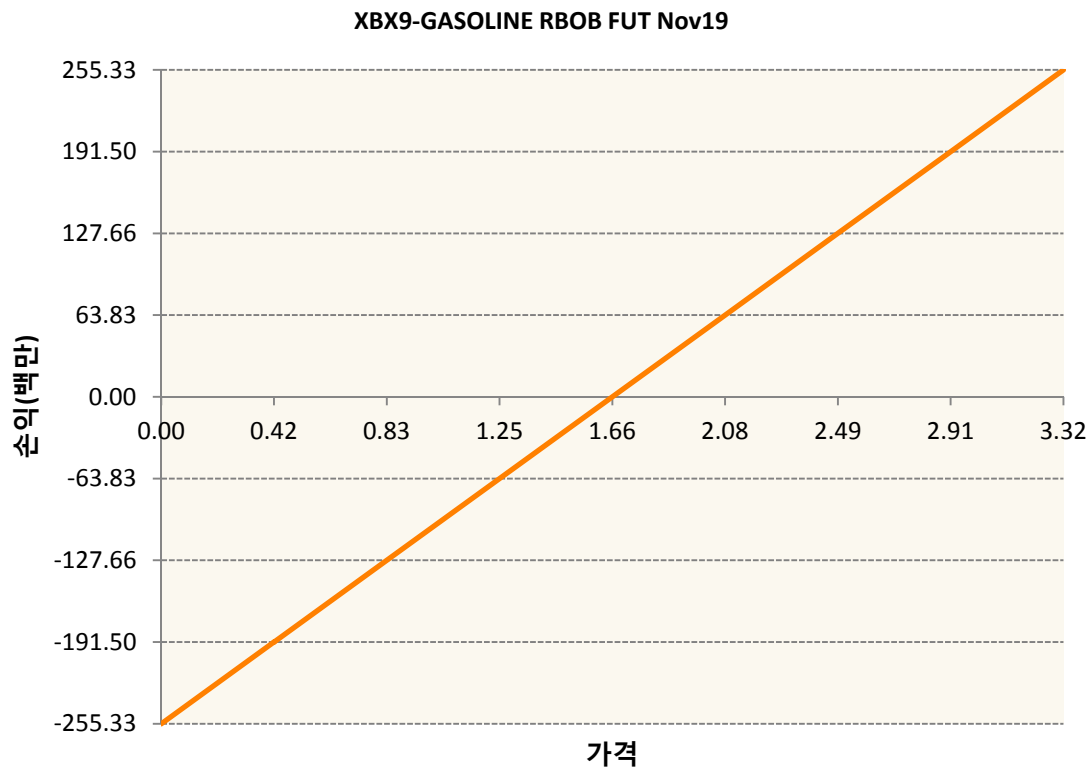


NGX19-NATURAL GAS FUTR Nov19



QSX9-Low Su Gasoil G Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLX9	WTI CRUDE FUTURE Nov19	51
COF0	BRENT CRUDE FUTR Jan20	53
HOX9	Heating Oil	16
KR4175PA00	2019-10 달러선물	38
NGX19	NATURAL GAS FUTR Nov19	52
QSX9	Low Su Gasoil G Nov19	18
XBX9	GASOLINE RBOB FUT Nov19	20

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

443

공시일	2019-09-23
기준일	2019-09-20

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

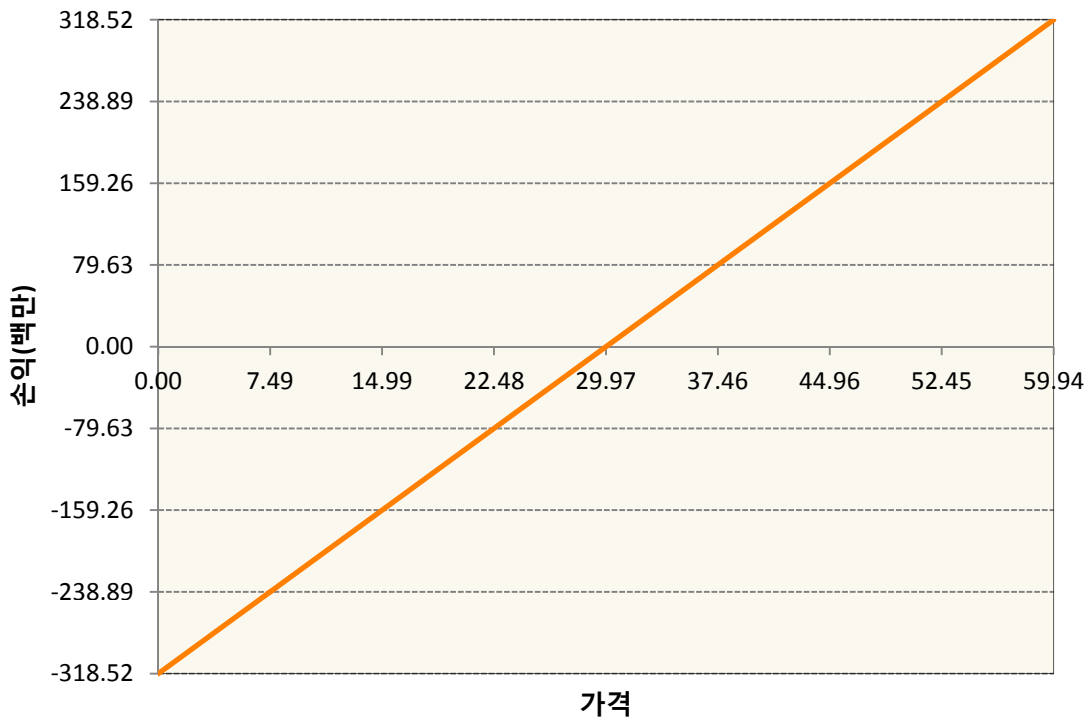
1. 계약금액

(단위:백만원)

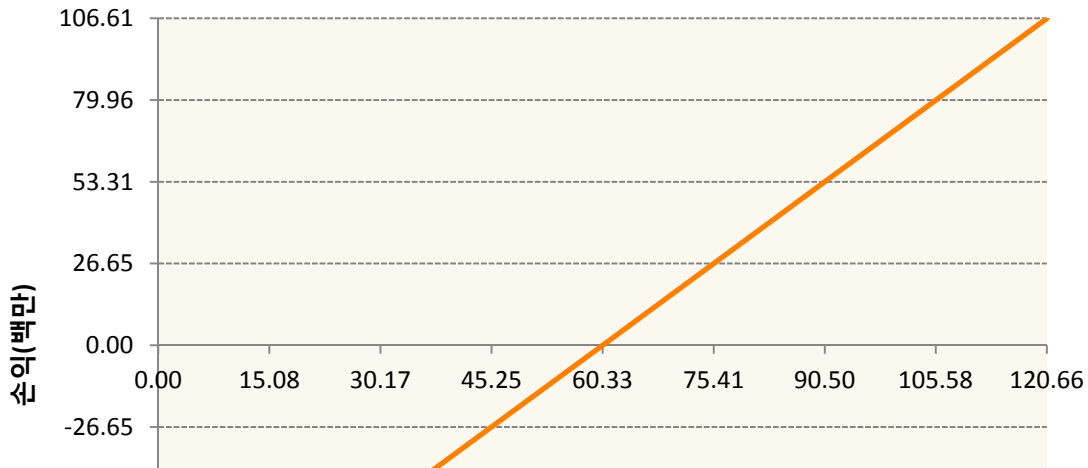
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,763	95	2,668	

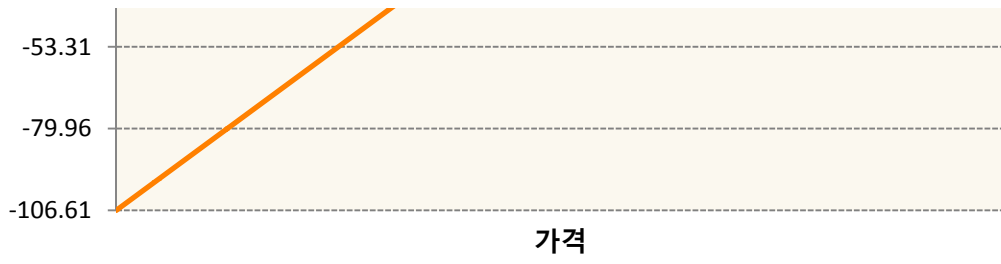
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

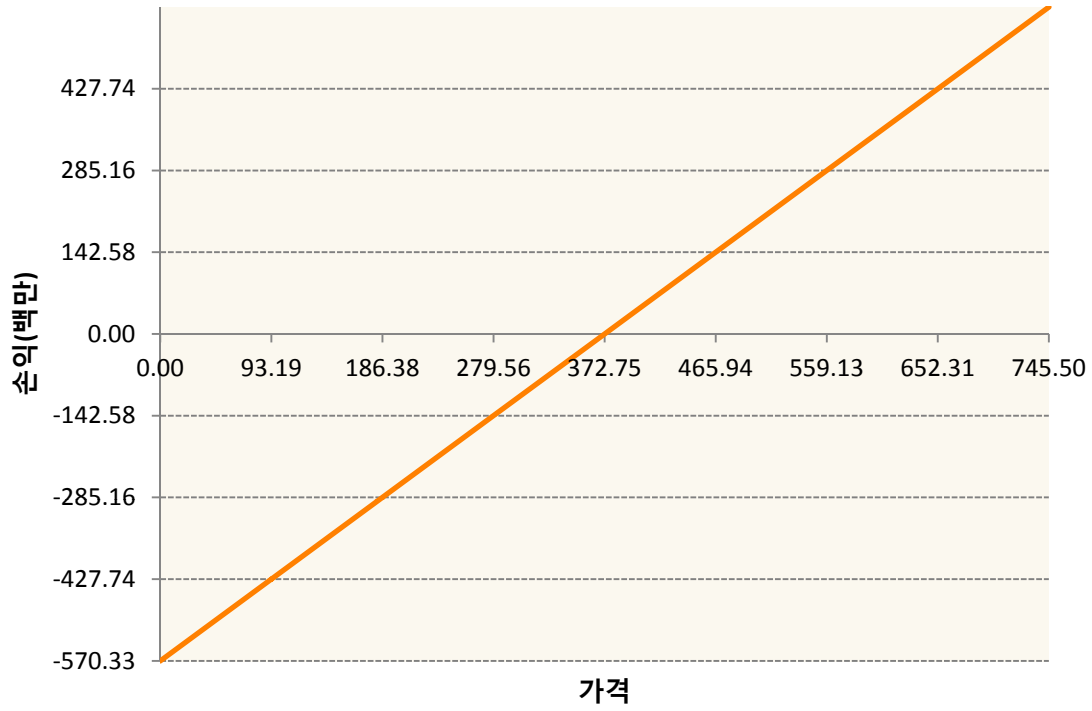


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

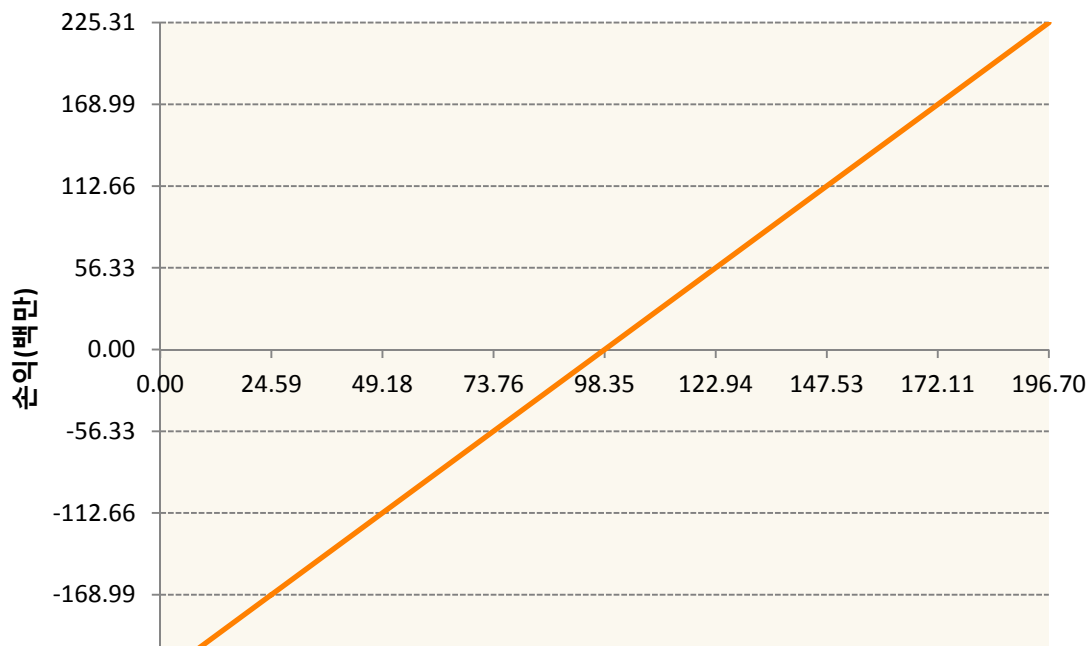


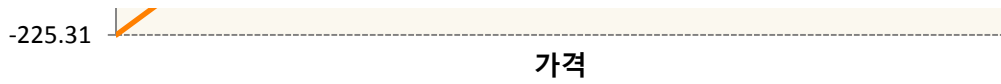


CZ9-CORN FUTURE Dec19

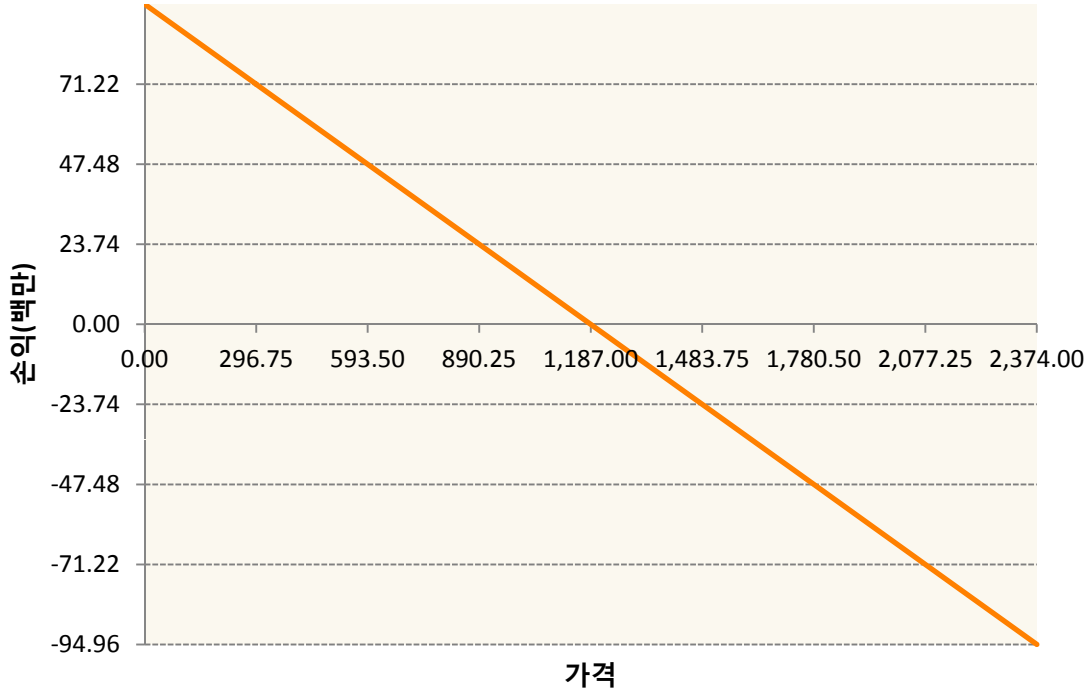


KCZ9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19

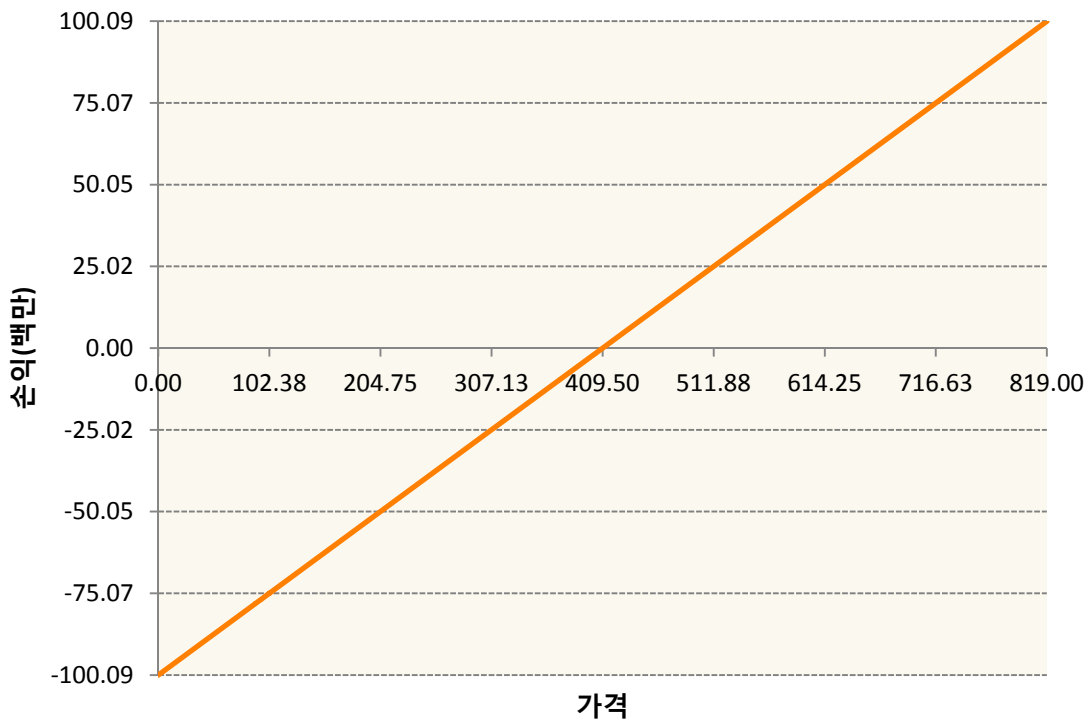




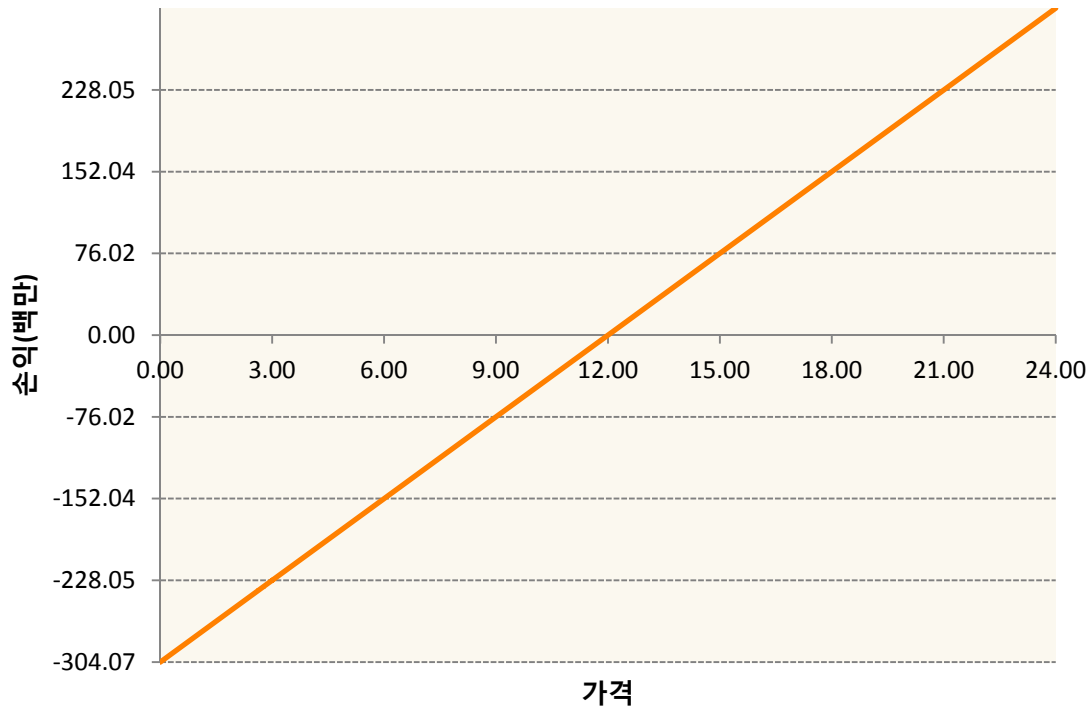
KR4175PA0005-2019-10 달러선물



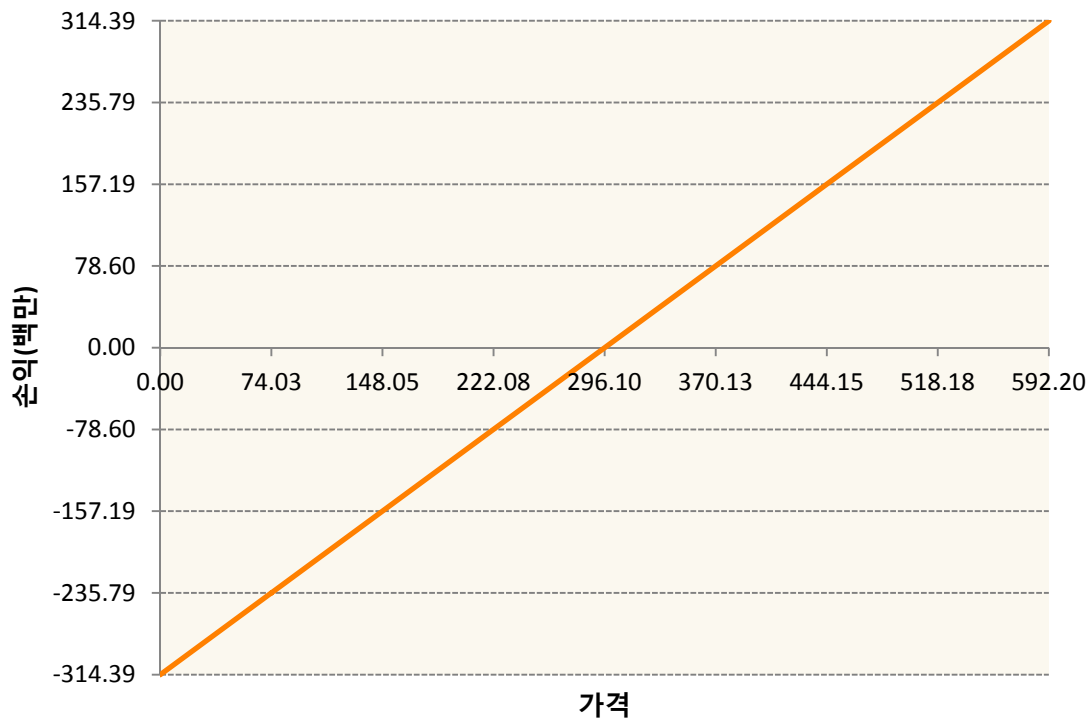
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



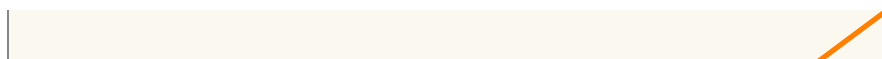
SBH0-Sugar Mar20

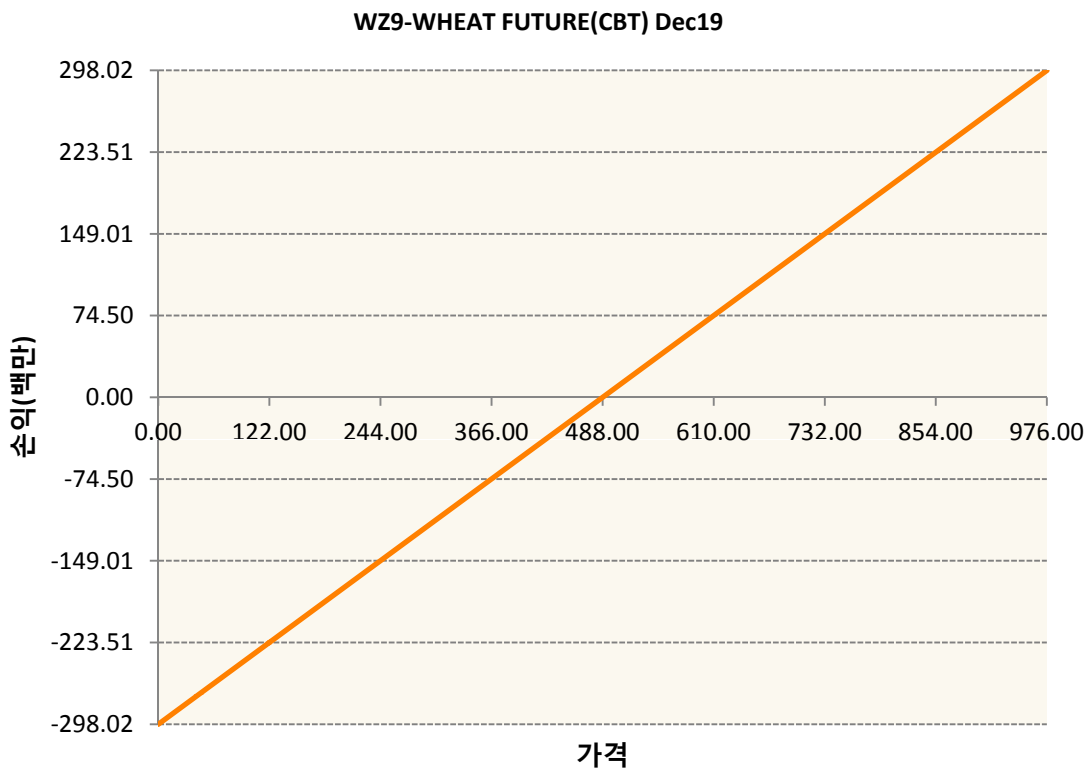
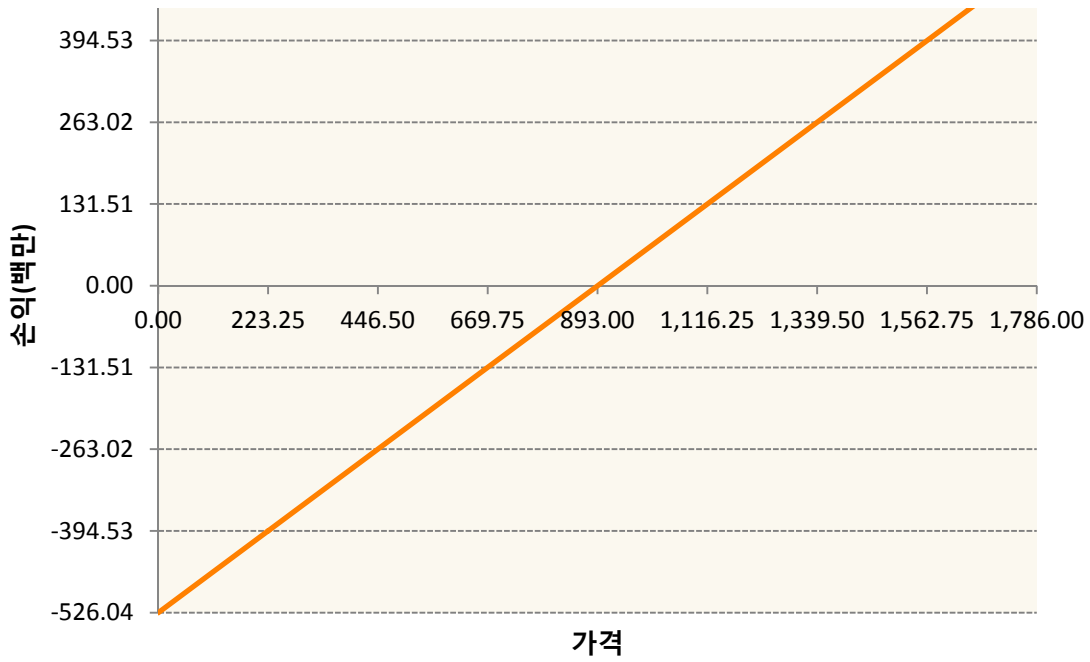


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	25
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	9
CZ9	CORN FUTURE Dec19	46
KCZ9	COFFEE 'C' FUTURE Dec19	18
KR4175PA00	2019-10 달러선물	8

KWZ9	KC HRW WHEAT FUT Dec19	8
SBH0	Sugar Mar20	24
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