

공시일	2019-09-05
기준일	2019-09-04

## 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)

90

공시일	2019-09-05
기준일	2019-09-04

## 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

1,143

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

653

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-05
기준일	2019-09-04

## 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	6,210	0	6,210	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(1)	386
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	141

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

837
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-05
기준일	2019-09-04

## 유로인덱스모(주식-파생형)

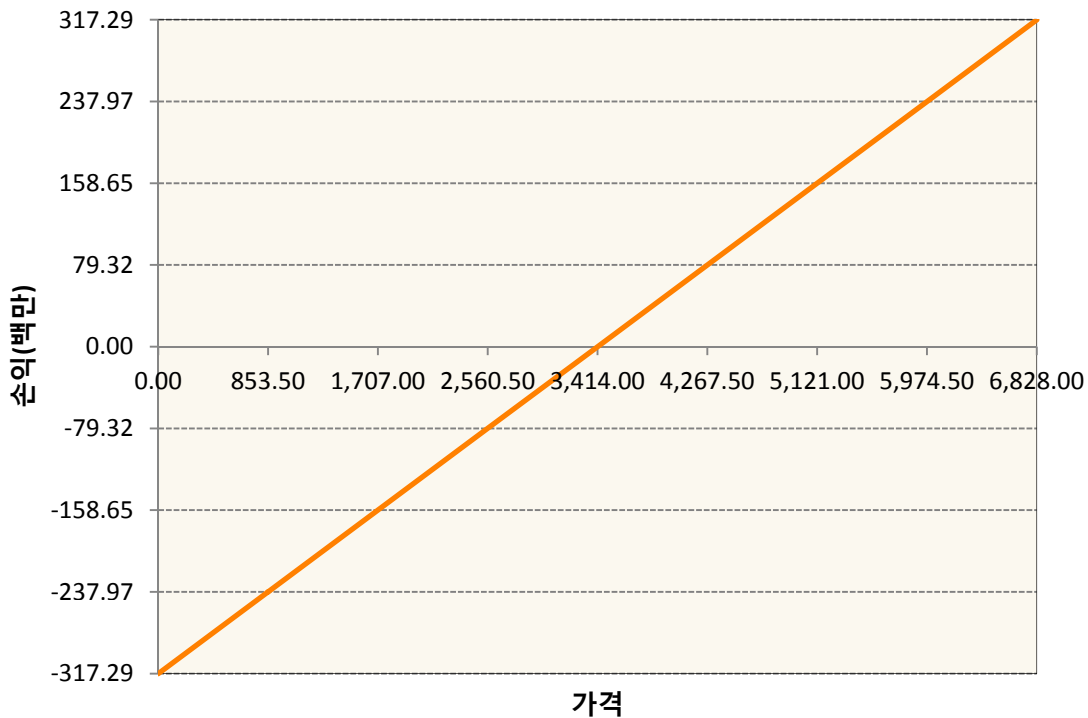
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	317	0	317	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGU9-EURO STOXX 50 Sep19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU9	EURO STOXX 50 Sep19	25
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

18
----

공시일	2019-09-05
기준일	2019-09-04

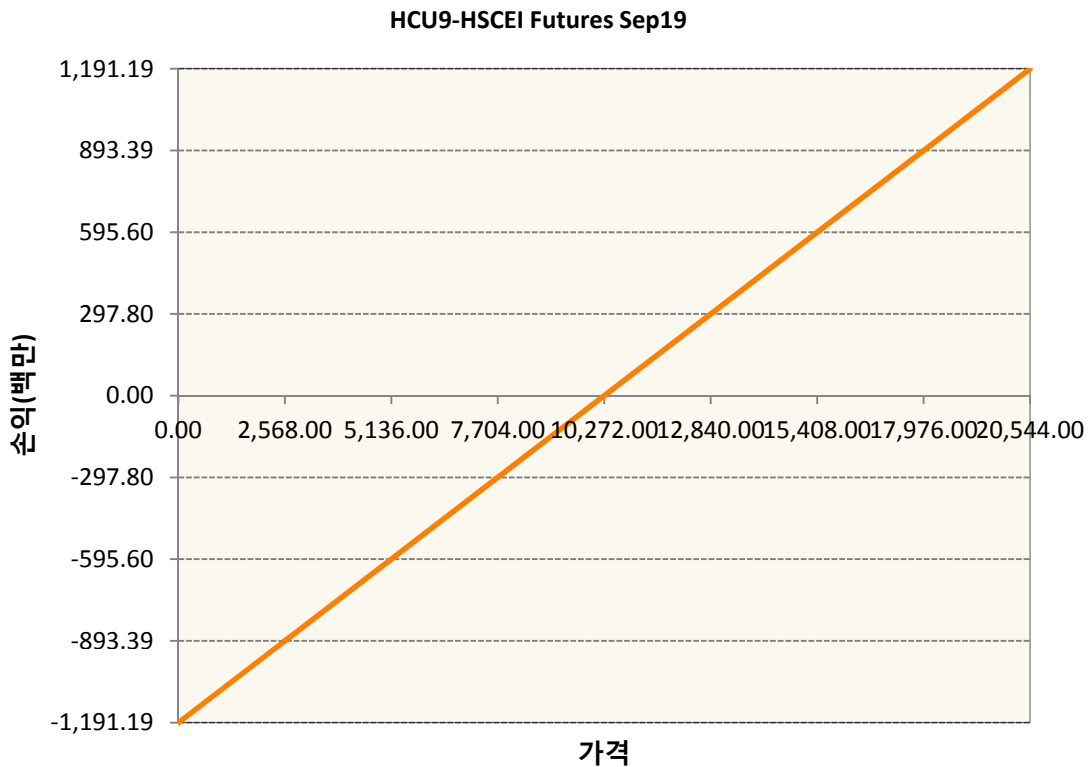
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,191	0	1,191	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU9	HSCEI Futures Sep19	95
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

89
----

공시일	2019-09-05
기준일	2019-09-04

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

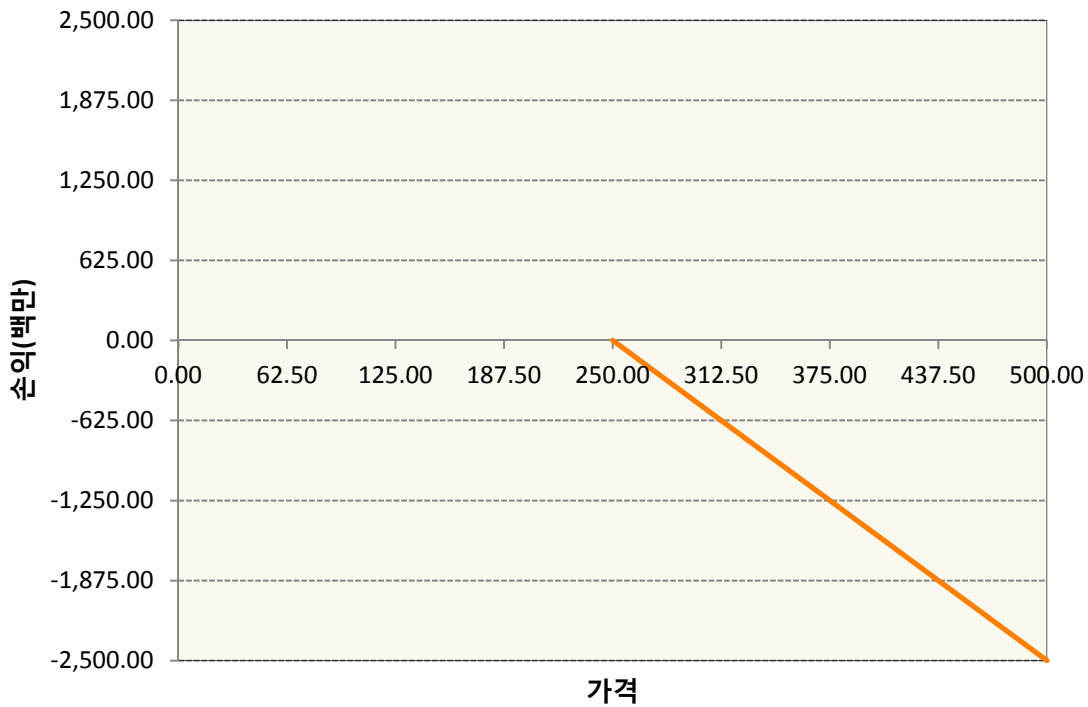
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

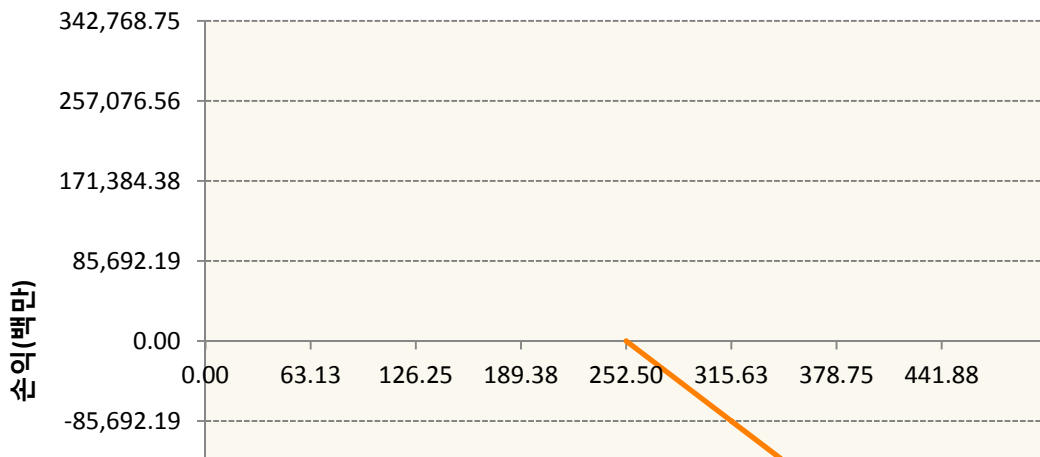
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	512,363	-512,363	장내

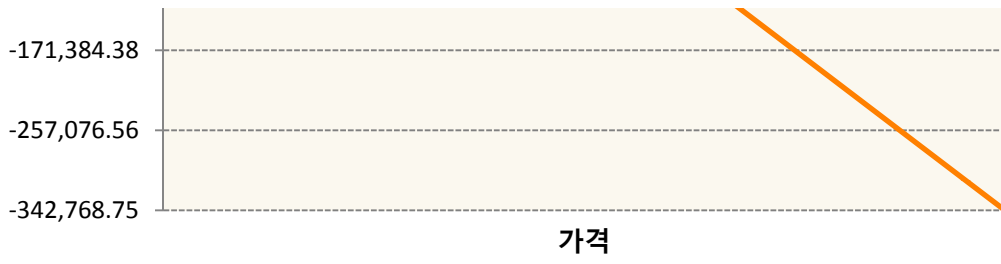
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P92500-2019-09 콜250

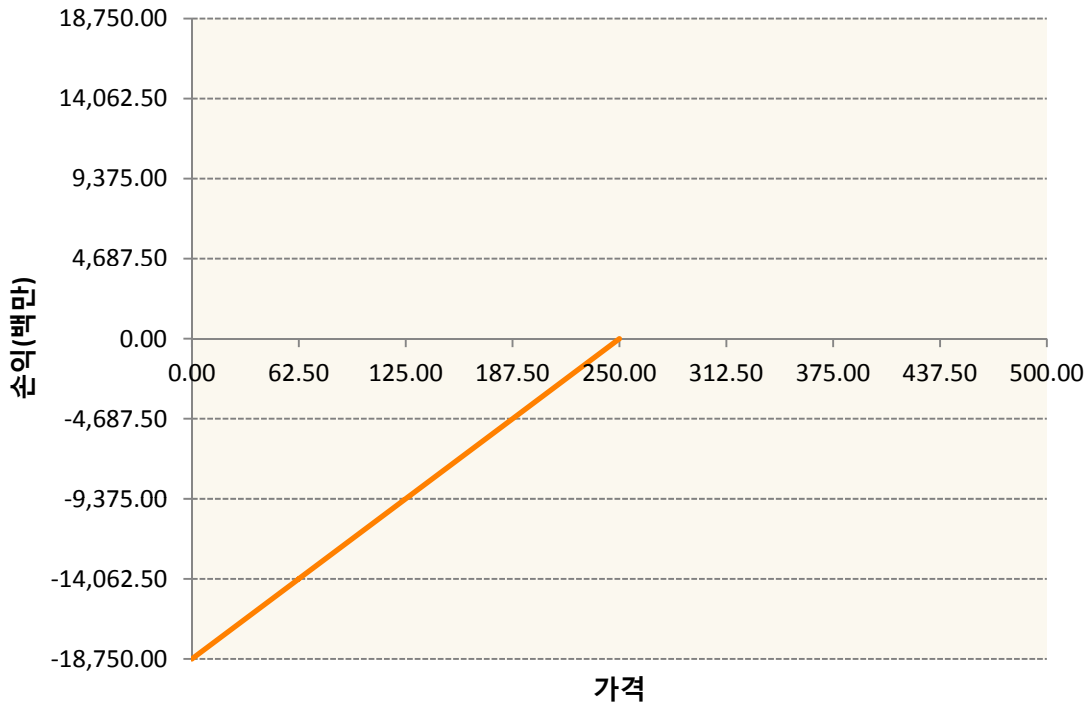


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

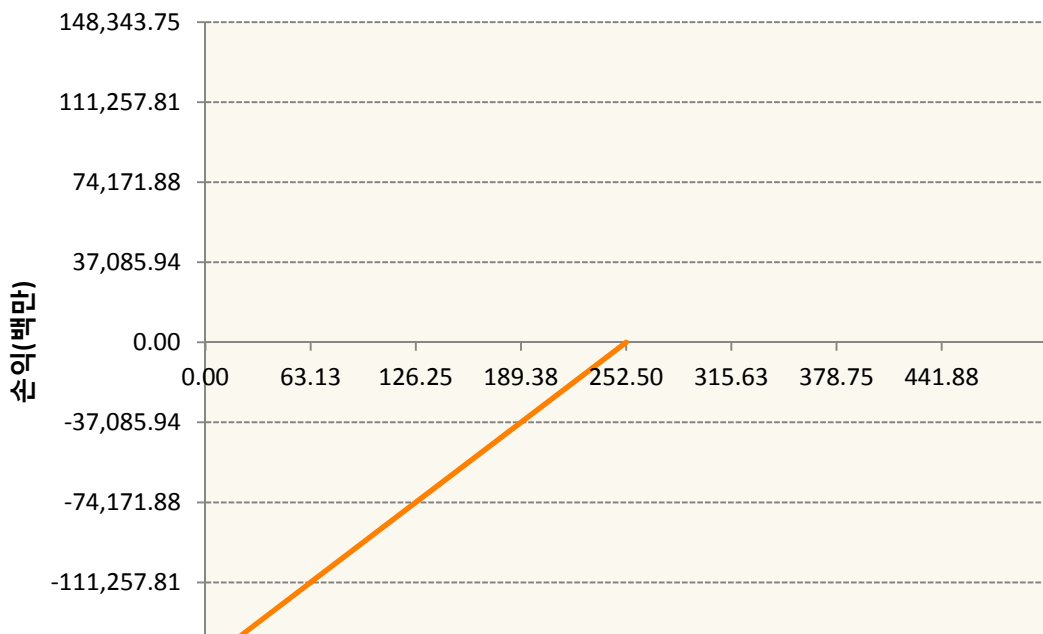




**KR4301P92508-2019-09 풋250**



**KR4301P92524-2019-09 풋252.5**



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P92500 2019-09 콜250							205
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	118	117	116	114	112	110	108
-5.33%	104	101	98	95	92	89	86
-2.67%	64	62	59	56	54	51	48
0%	3	2	1	0	-2	-3	-5
2.67%	-65	-65	-65	-66	-66	-67	-68
5.33%	-135	-135	-135	-135	-135	-135	-135
8.00%	-204	-204	-204	-204	-205	-205	-205
KR4201P92526 2019-09 콜252.5							27,325
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13,353	13,250	13,119	12,959	12,776	12,570	12,345
-5.33%	12,186	11,857	11,514	11,160	10,798	10,429	10,055
-2.67%	8,107	7,707	7,304	6,898	6,491	6,082	5,672
0%	680	481	253	0	-274	-565	-871
2.67%	-8,391	-8,435	-8,501	-8,591	-8,705	-8,843	-9,004
5.33%	-17,822	-17,826	-17,836	-17,856	-17,887	-17,932	-17,993
8.00%	-27,288	-27,289	-27,290	-27,292	-27,298	-27,308	-27,325
KR4301P92508 2019-09 풋250							721
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-694	-697	-700	-704	-708	-714	-721
-5.33%	-235	-249	-262	-276	-290	-305	-319
-2.67%	-23	-32	-43	-54	-66	-78	-91
0%	5	4	2	0	-3	-7	-12
2.67%	6	6	6	5	5	5	4
5.33%	6	6	6	6	6	6	6
8.00%	6	6	6	6	6	6	6
KR4301P92524 2019-09 풋252.5							6,924
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,819	-6,824	-6,834	-6,848	-6,868	-6,893	-6,924
-5.33%	-2,918	-2,990	-3,069	-3,153	-3,242	-3,335	-3,431
-2.67%	-451	-560	-672	-785	-899	-1,014	-1,129
0%	91	69	38	0	-46	-99	-158
2.67%	118	118	116	112	106	96	82

5.33%	119	119	119	119	118	117	116
8.00%	119	119	119	119	119	119	119

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

(단위:백만원)

**35,814**

공시일	2019-09-05
기준일	2019-09-04

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

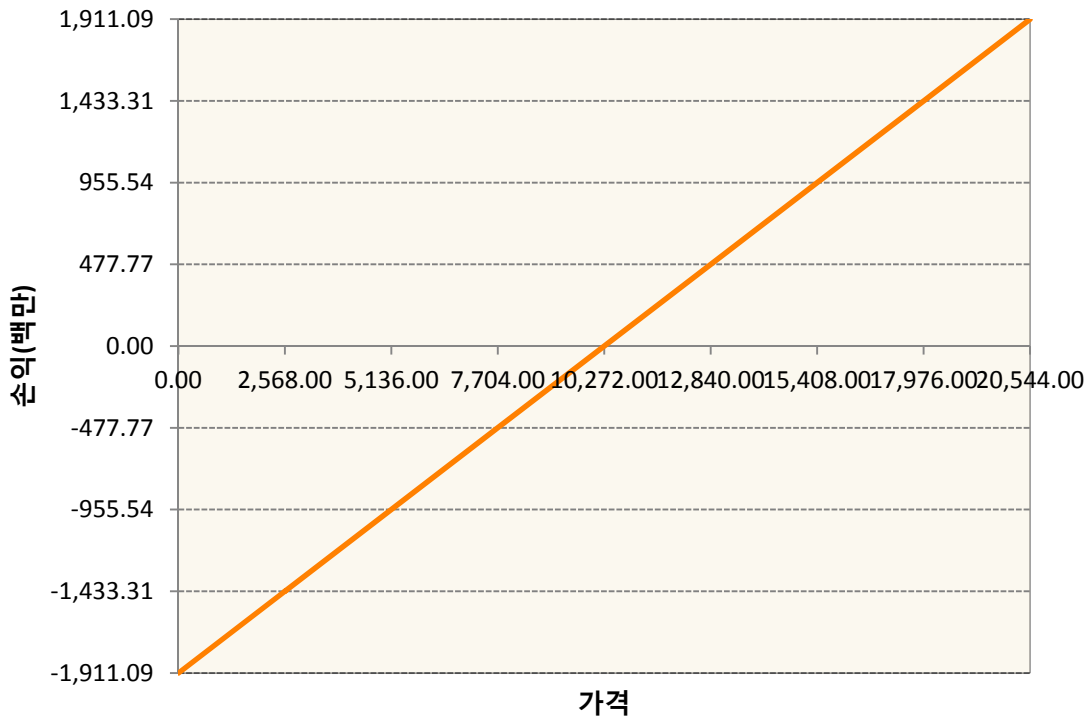
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

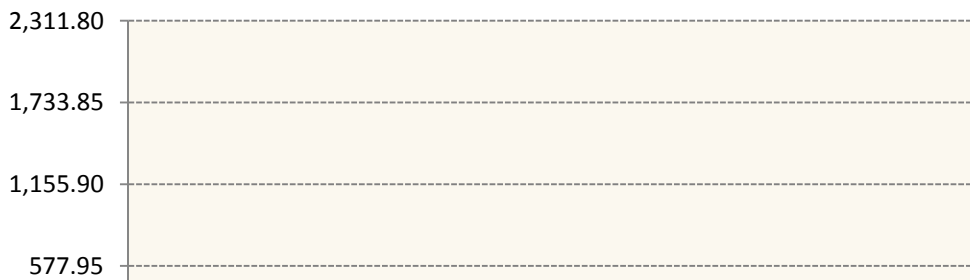
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,911	0	1,911	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,929	-4,929	장내
누계	통화	선도	77	2,863	-2,786	장외

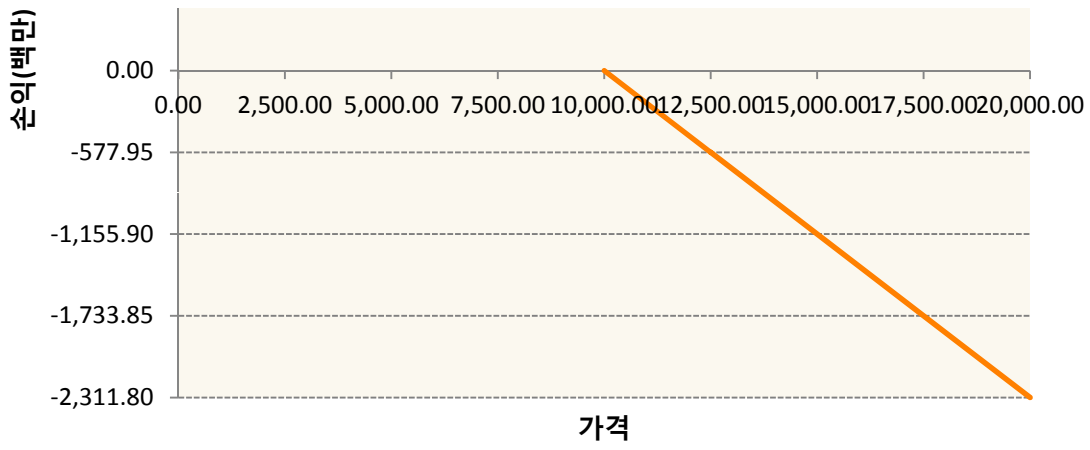
### 2. 만기시점의 손익구조

HCU9-HSCEI Futures Sep19

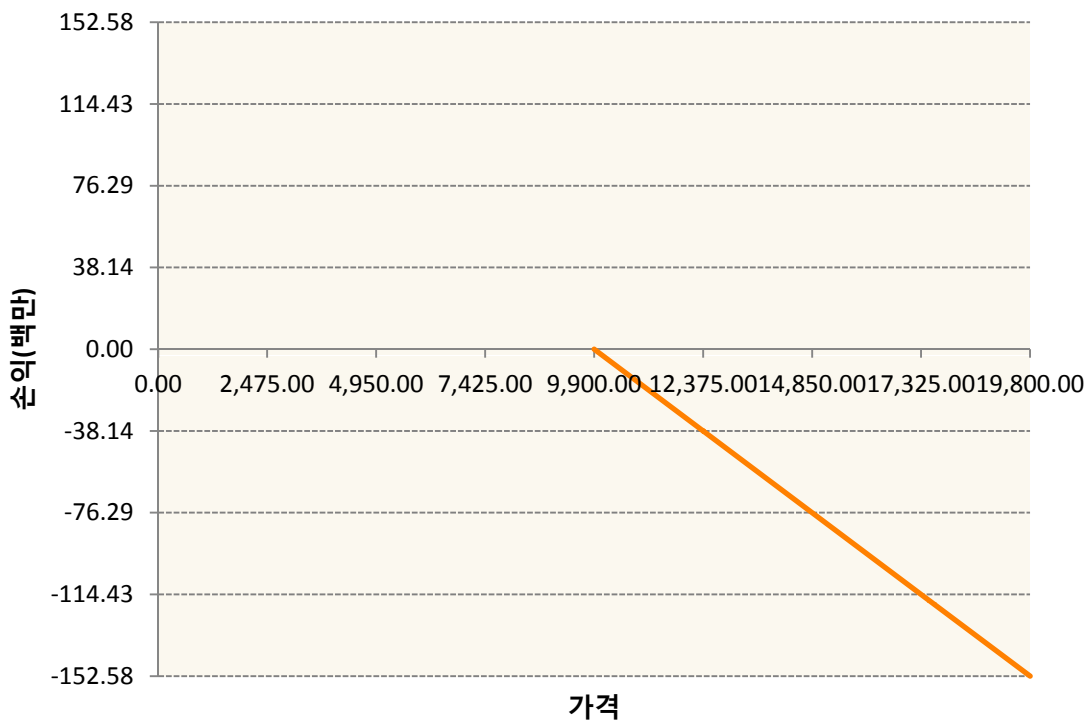


OHHIU9-C100-HSCEI

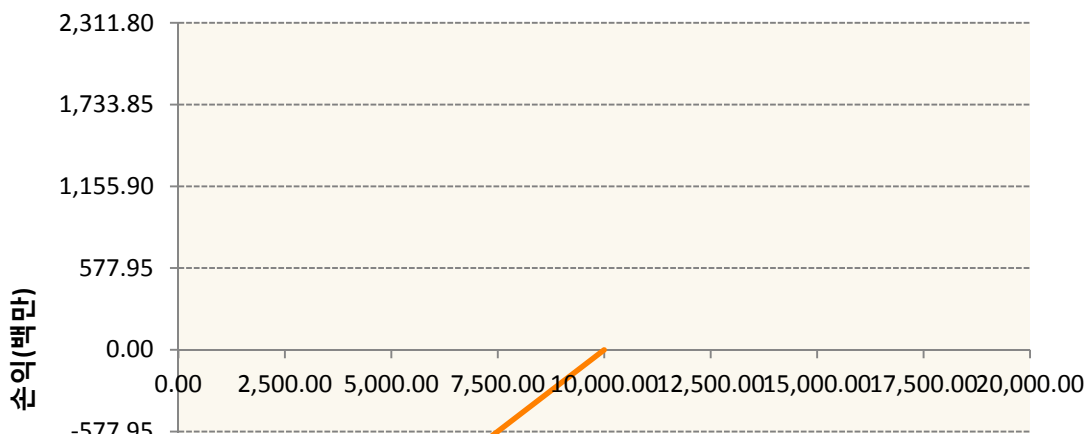


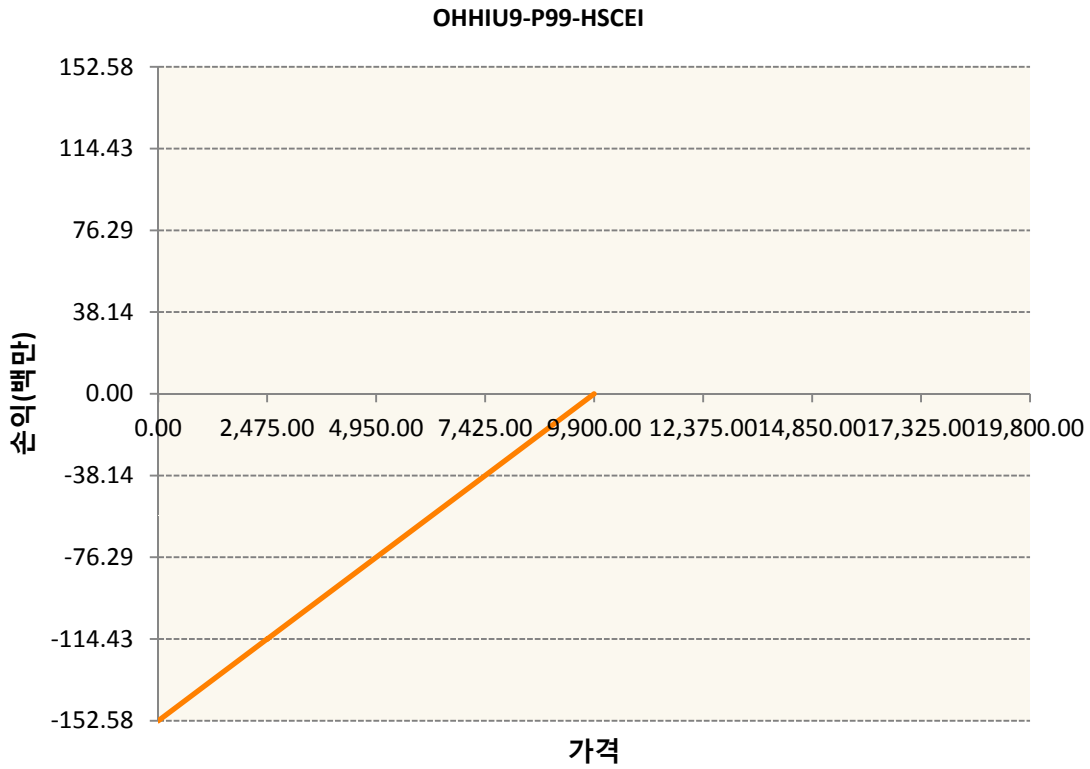


**OHHIU9-C99-HSCEI**



**OHHIU9-P100-HSCEI**





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	229
FX21019U00 HKD/KRW 22-11-19E	6
HCU9 HSCEI Futures Sep19	153
OHHIU9-C1( HSCEI	185
OHHIU9-C9( HSCEI	12
OHHIU9-P1( HSCEI	185
OHHIU9-P9( HSCEI	12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	<b>585</b>

공시일	2019-09-05
기준일	2019-09-04

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

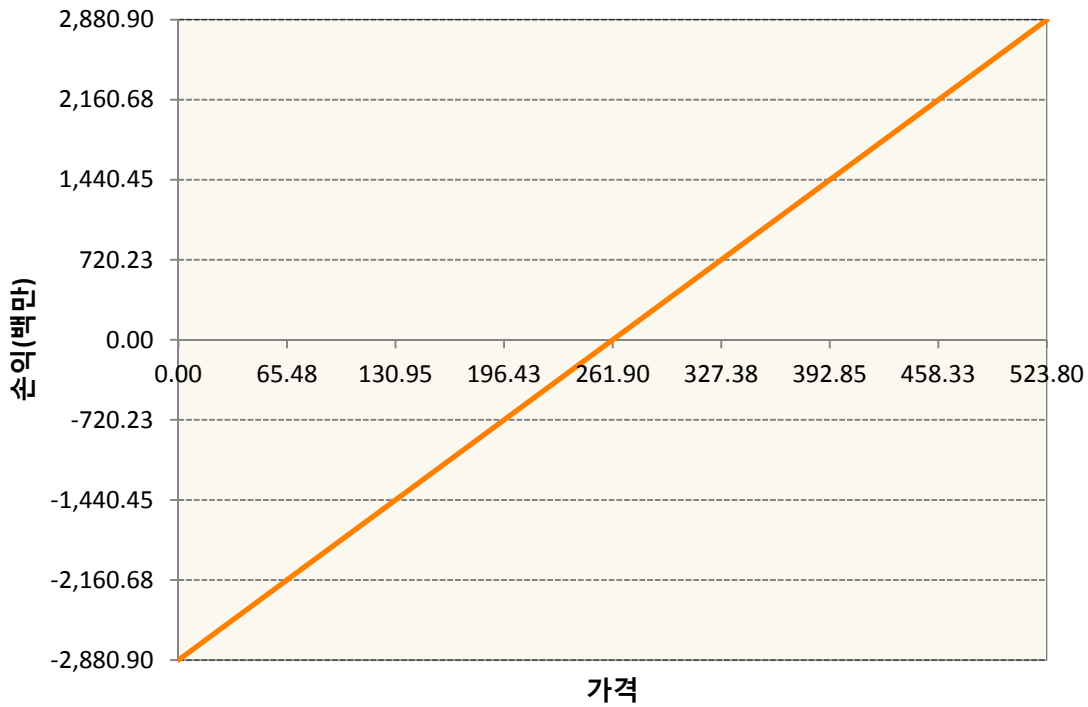
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

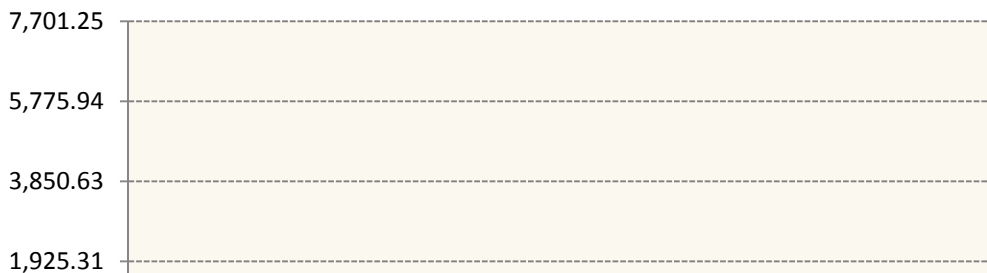
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,881	0	2,881	장내
누계	유가증권	스왑	14,125	0	14,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,829	-14,829	장내

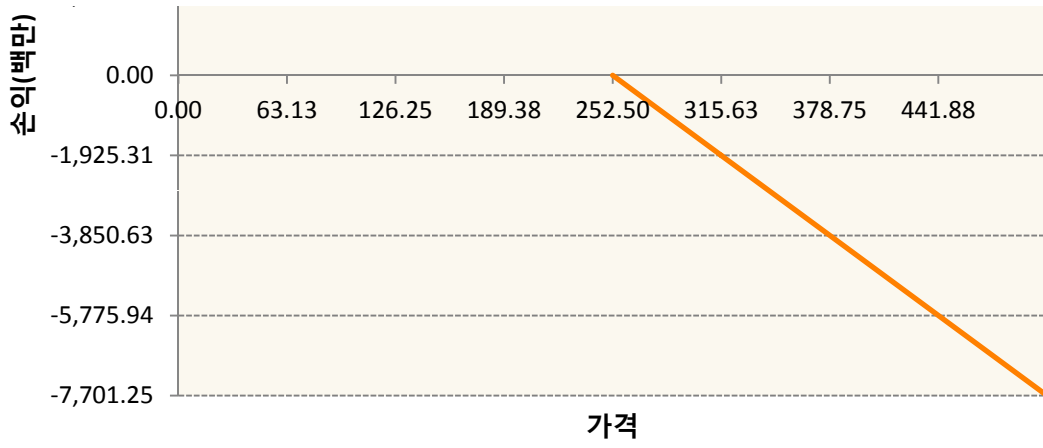
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

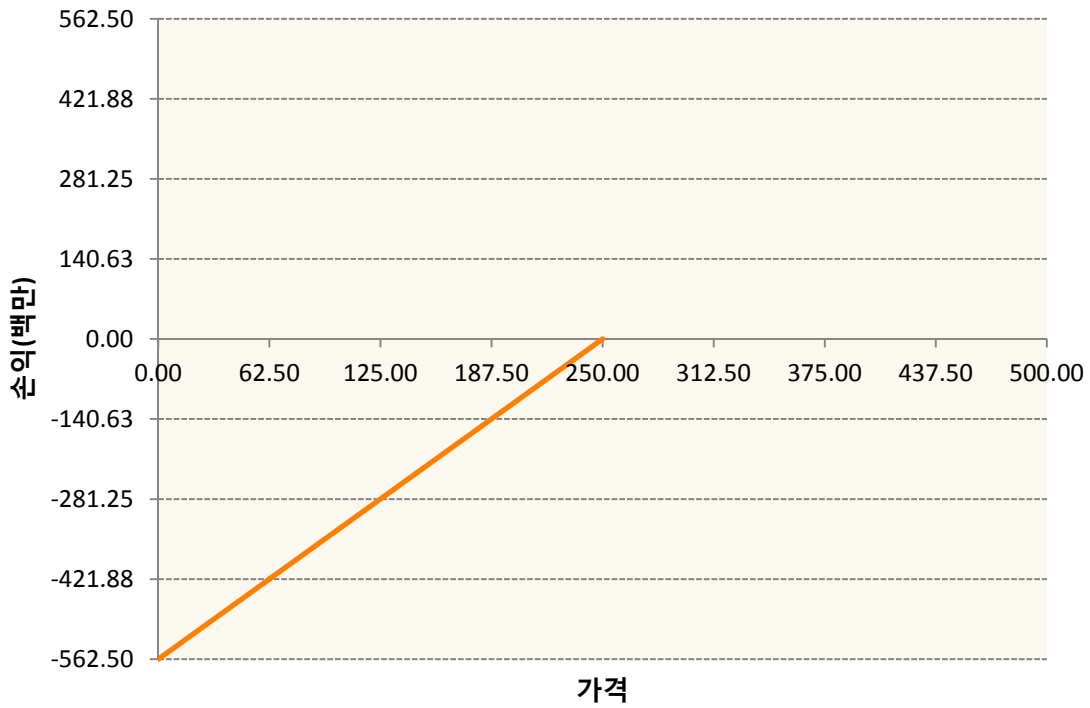


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

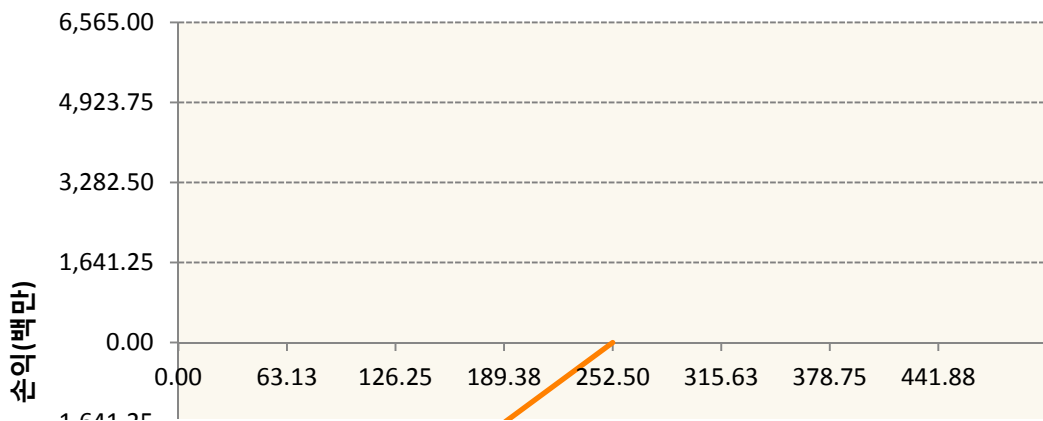




**KR4301P92508-2019-09 풋250**



**KR4301P92524-2019-09 풋252.5**





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						1,230
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,230	-1,230	-1,230	-1,230	-1,230	-1,230	-1,230	
-5.33%	-820	-820	-820	-820	-820	-820	-820	
-2.67%	-410	-410	-410	-410	-410	-410	-410	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	410	410	410	410	410	410	410	
5.33%	820	820	820	820	820	820	820	
8.00%	1,230	1,230	1,230	1,230	1,230	1,230	1,230	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						230
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-230	-230	-230	-230	-230	-230	-230	
-5.33%	-154	-154	-154	-154	-154	-154	-154	
-2.67%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	77	77	77	77	77	77	77	
5.33%	154	154	154	154	154	154	154	
8.00%	230	230	230	230	230	230	230	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5						614
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	300	298	295	291	287	282	277	
-5.33%	274	266	259	251	243	234	226	
-2.67%	182	173	164	155	146	137	127	
0%	15	11	6	0	-6	-13	-20	
2.67%	-189	-190	-191	-193	-196	-199	-202	
5.33%	-400	-401	-401	-401	-402	-403	-404	
8.00%	-613	-613	-613	-613	-613	-614	-614	
KR4301P92508		2019-09 풋250						22
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-22
-5.33%	-7	-7	-8	-8	-9	-9	-10
-2.67%	-1	-1	-1	-2	-2	-2	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0
KR4301P92524      2019-09 풋252.5							306
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-302	-302	-302	-303	-304	-305	-306
-5.33%	-129	-132	-136	-140	-143	-148	-152
-2.67%	-20	-25	-30	-35	-40	-45	-50
0%	4	3	2	0	-2	-4	-7
2.67%	5	5	5	5	5	4	4
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

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

(단위:백만원)

**2,329**

공시일	2019-09-05
기준일	2019-09-04

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

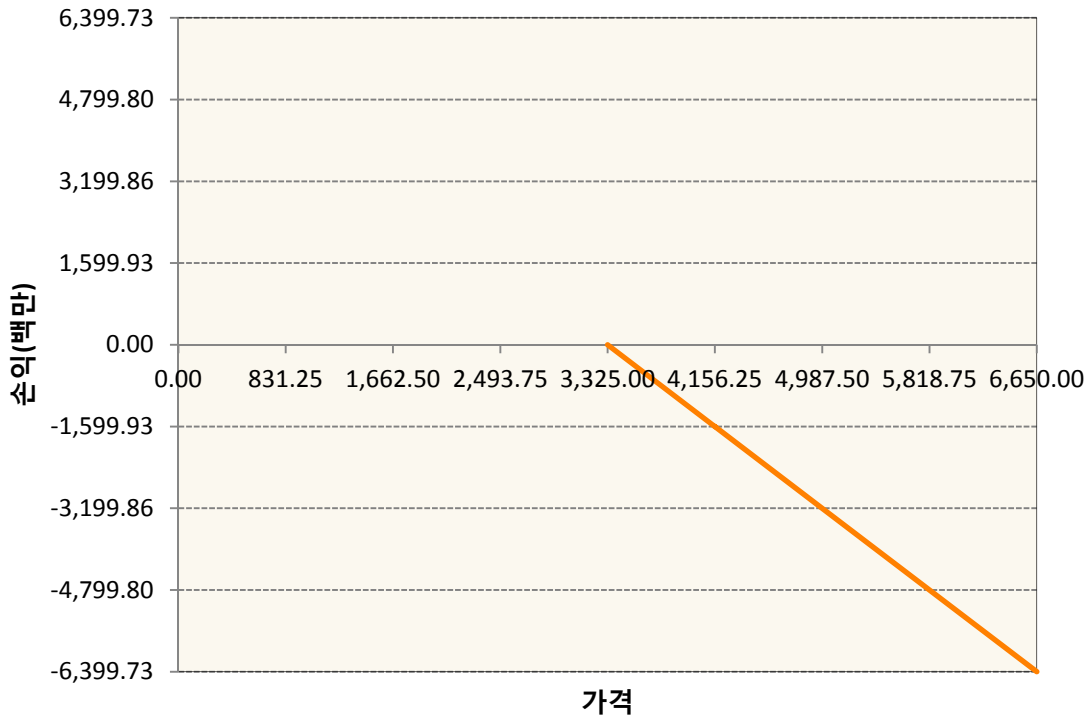
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

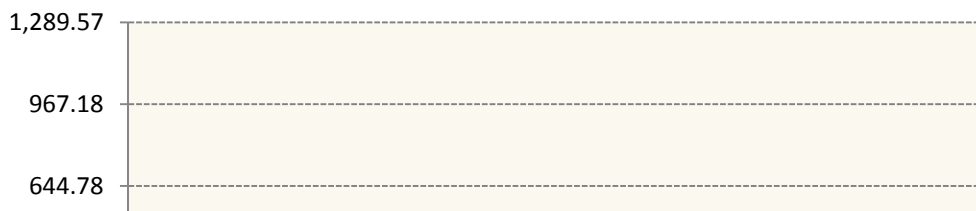
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,109	0	5,109	
누계	유가증권	옵션	0	15,379	-15,379	장내
누계	지수	스왑	24,155	0	24,155	장외
누계	통화	선도	9,027	17,257	-8,230	장외

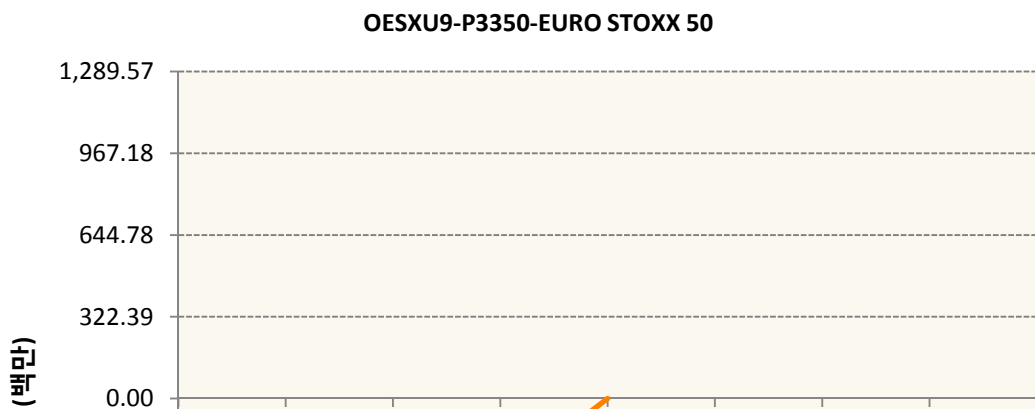
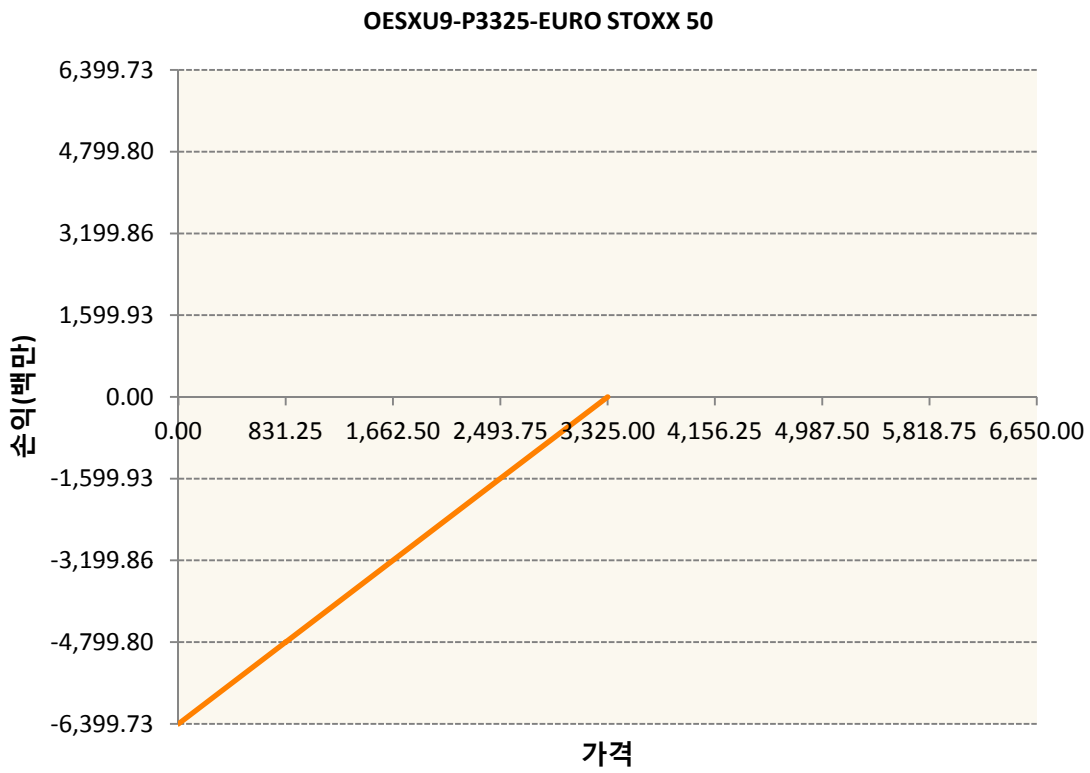
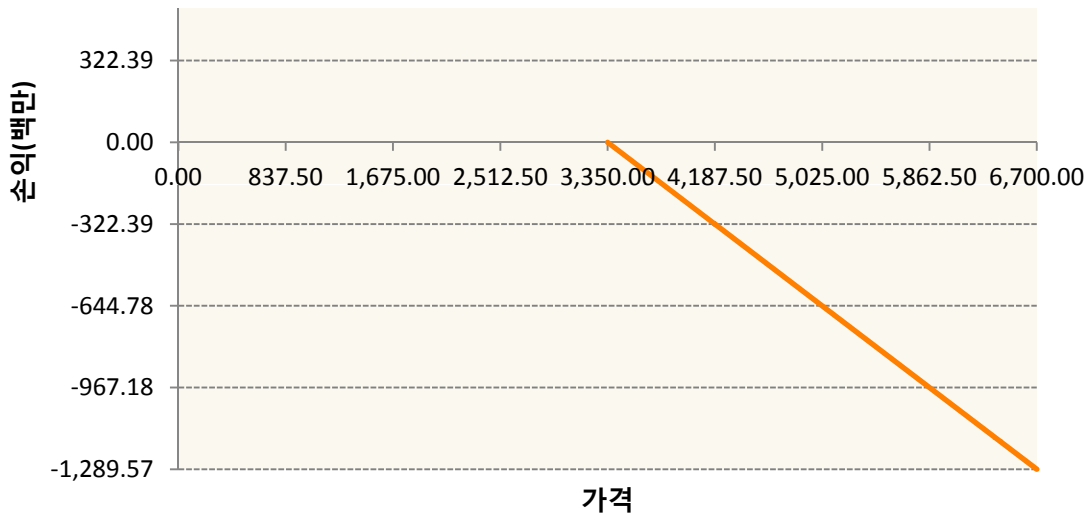
### 2. 만기시점의 손익구조

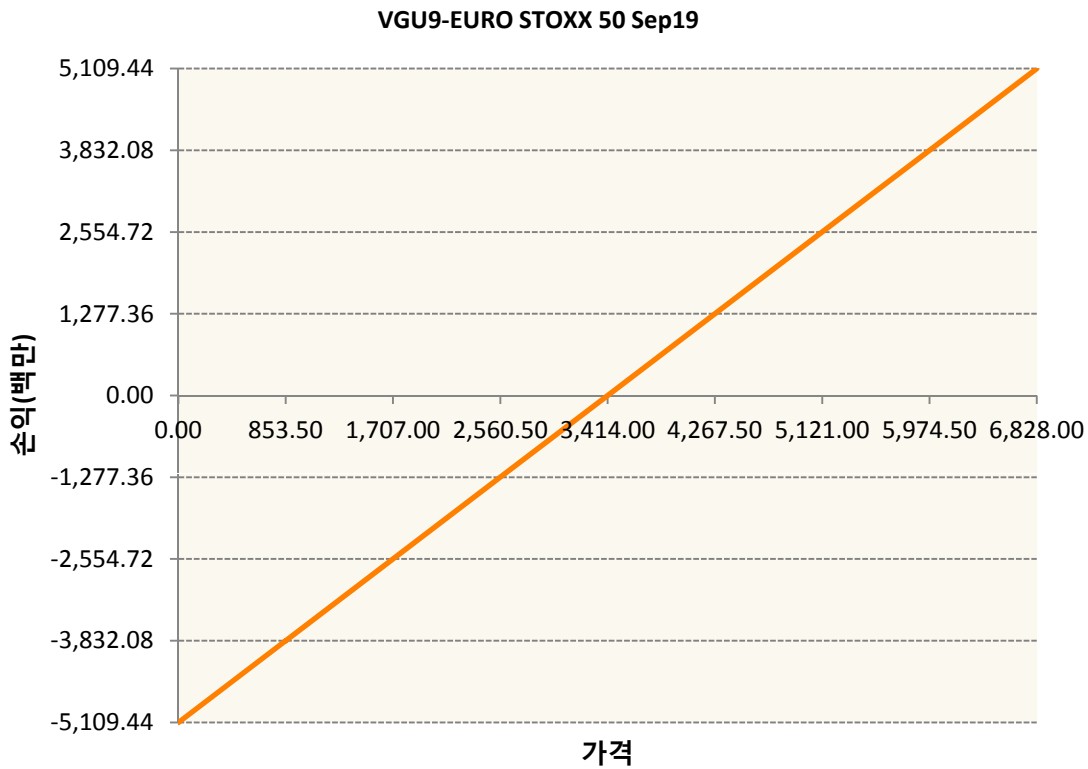
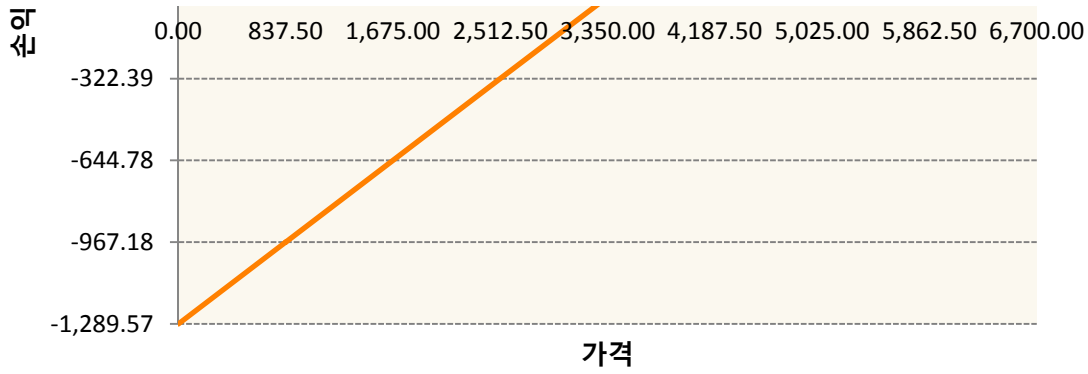
OESXU9-C3325-EURO STOXX 50



OESXU9-C3350-EURO STOXX 50







**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	29
FX21019M0< KRW/EUR 27-09-19E	1,062
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	319
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E	319
FX21019N04 EUR/KRW 27-09-19E	234
FX21019Q00 EUR/KRW 27-09-19E	170
OESXU9-C3< EURO STOXX 50	512
OESXU9-C3< EURO STOXX 50	103
OESXU9-P3< EURO STOXX 50	512
OESXU9-P3< EURO STOXX 50	103
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	409

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

(단위:백만원)

2,159



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

(단위:백만원)

947

공시일	2019-09-05
기준일	2019-09-04

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

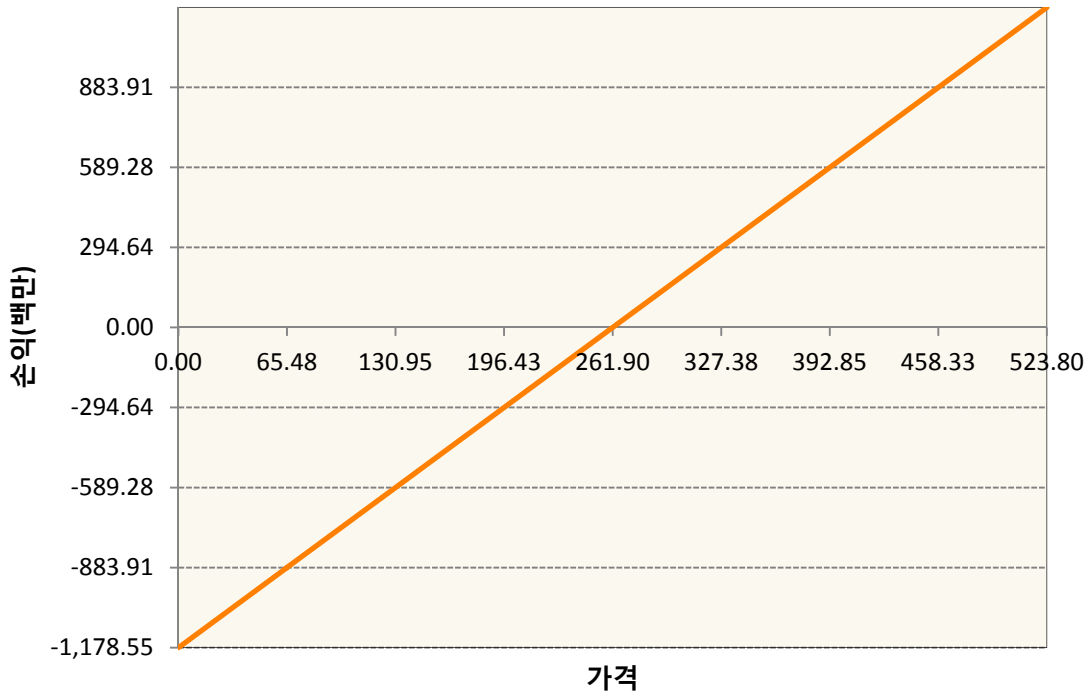
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,179	0	1,179	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						94
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94	
-5.33%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63	
-2.67%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	31	31	31	31	31	31	31	
5.33%	63	63	63	63	63	63	63	
8.00%	94	94	94	94	94	94	94	

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

(단위:백만원)

81



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

(단위:백만원)

126

공시일	2019-09-05
기준일	2019-09-04

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

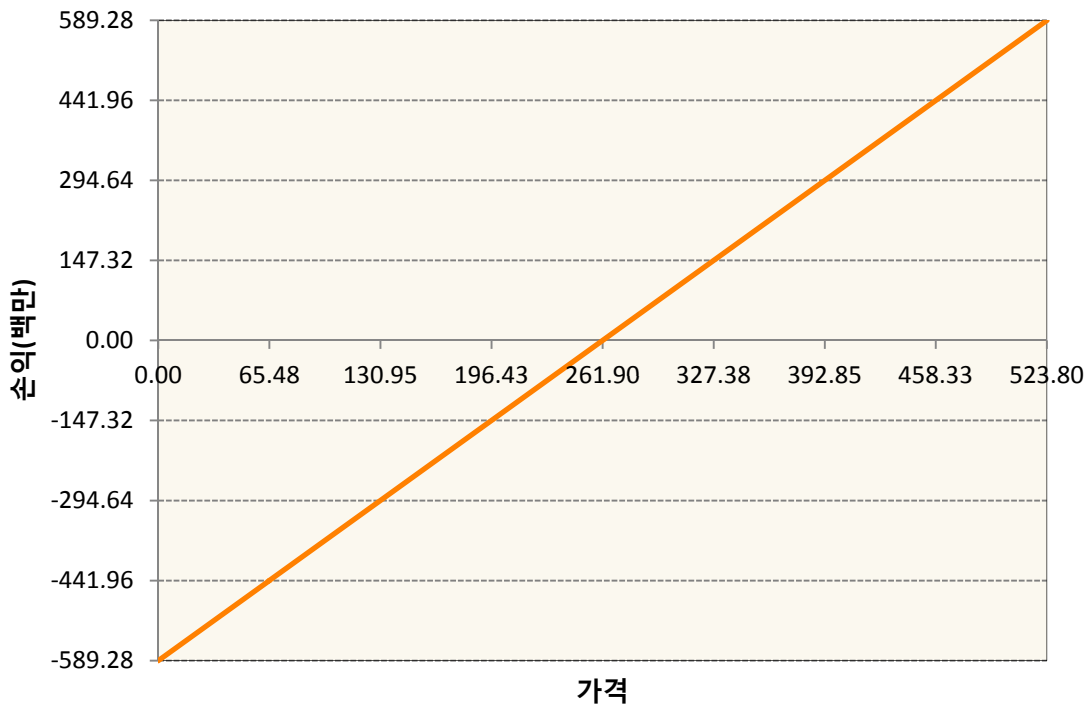
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	589	0	589	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						47
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47	
-5.33%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31	
-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%	31	31	31	31	31	31	31	
8.00%	47	47	47	47	47	47	47	

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-09-05
기준일	2019-09-04

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

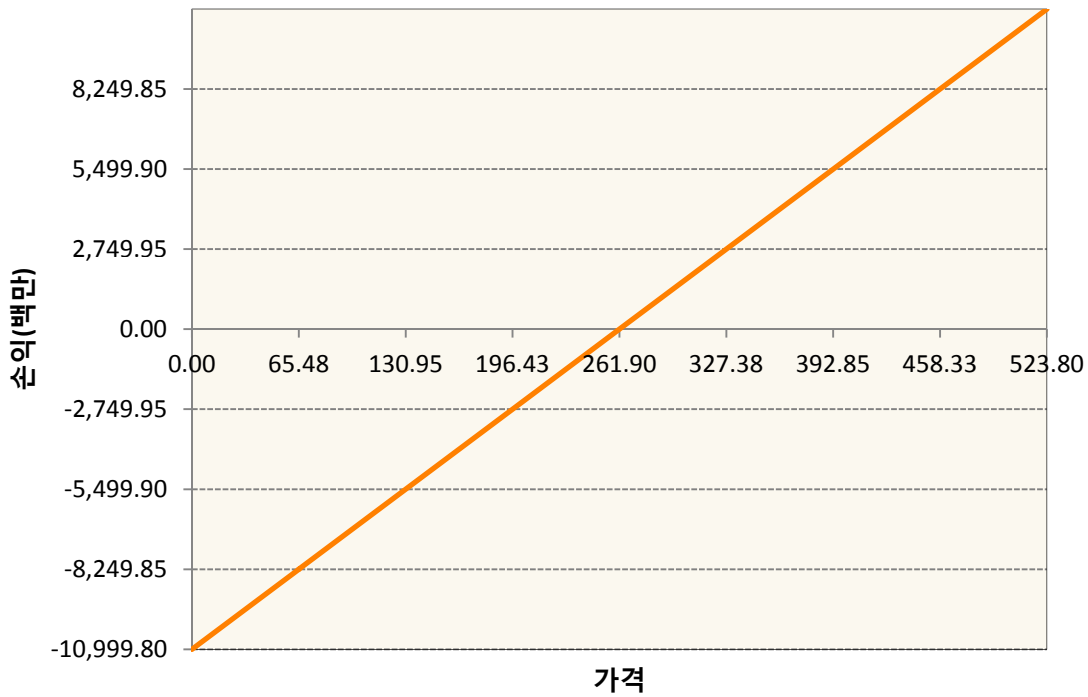
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

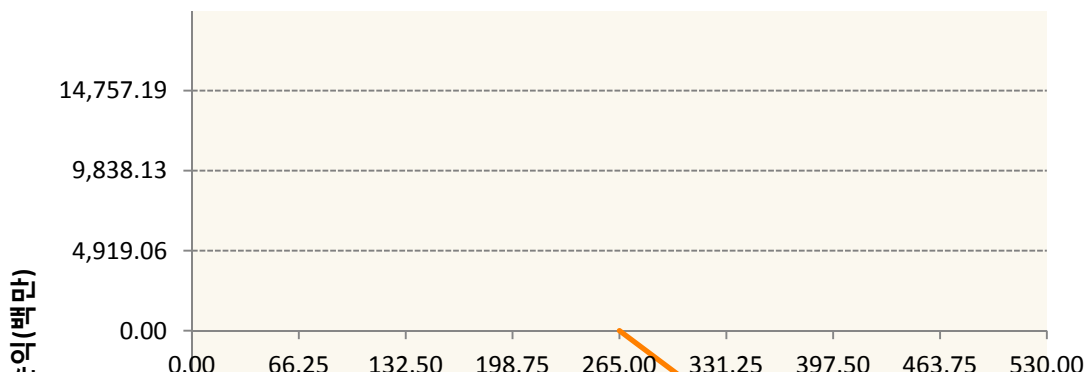
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,000	0	11,000	장내
누계	유가증권	옵션	3,659	19,810	-16,151	장내

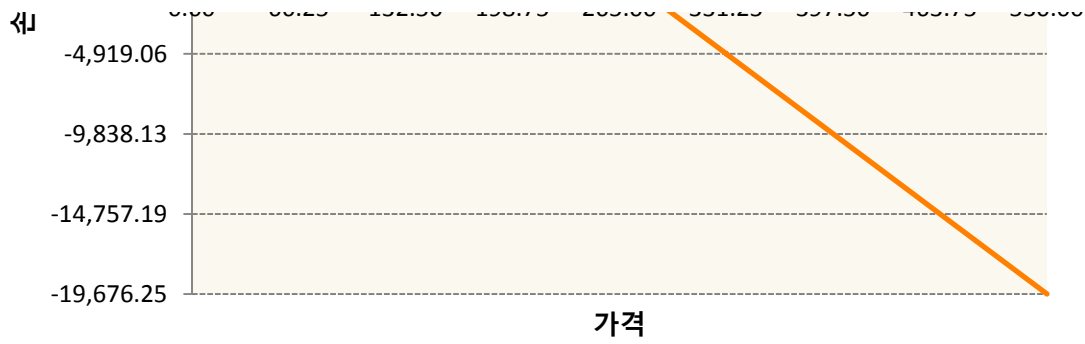
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

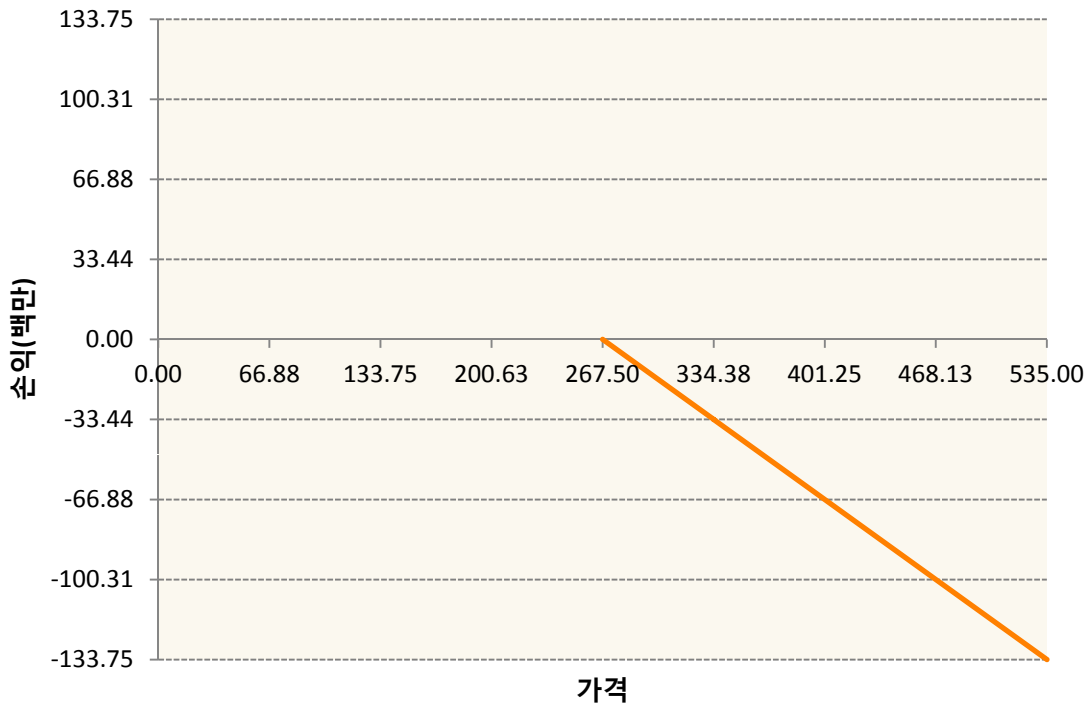


KR4201P92658-2019-09 콜265

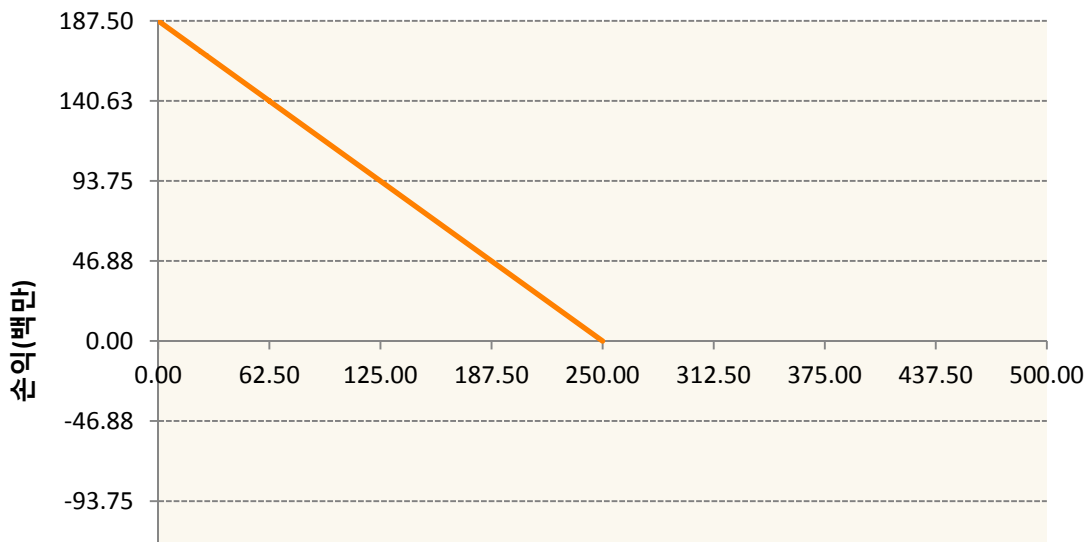


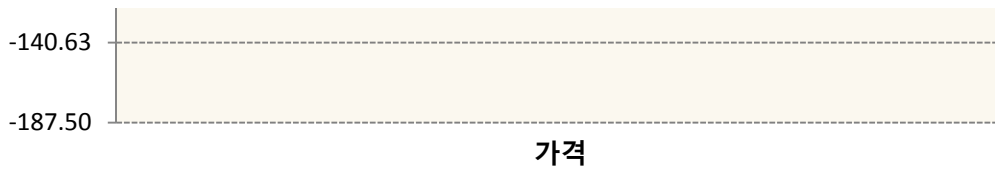


KR4201P92674-2019-09 콜267.5

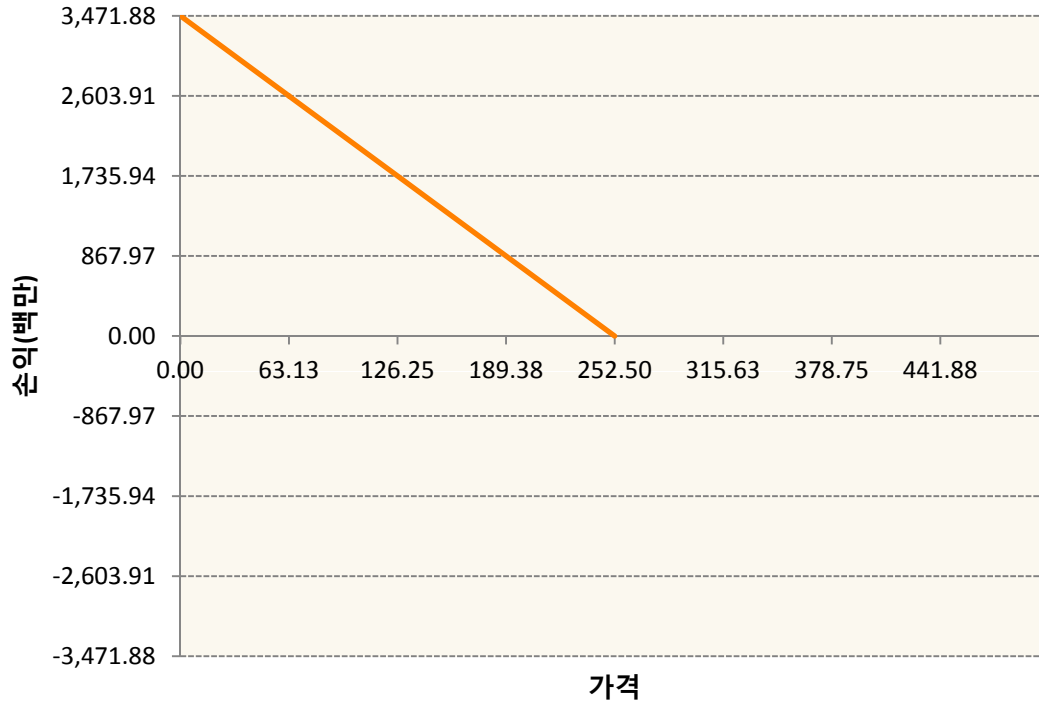


KR4301P92508-2019-09 풋250





KR4301P92524-2019-09 풋252.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						879
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-879	-879	-879	-879	-879	-879	-879	
-5.33%	-586	-586	-586	-586	-586	-586	-586	
-2.67%	-293	-293	-293	-293	-293	-293	-293	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	293	293	293	293	293	293	293	
5.33%	586	586	586	586	586	586	586	
8.00%	879	879	879	879	879	879	879	
KR4201P92658		2019-09 콜265						1,160
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	177	177	176	176	175	173	171	
-5.33%	176	174	172	168	163	157	150	
-2.67%	160	151	140	128	114	100	84	

0%	66	44	22	0	-22	-45	-68
2.67%	-199	-221	-243	-265	-287	-310	-333
5.33%	-627	-637	-649	-662	-676	-691	-708
8.00%	-1,128	-1,130	-1,134	-1,138	-1,144	-1,151	-1,160

KR4201P92674                      2019-09 콜267.5                      7

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1
-2.67%	1	1	1	1	1	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-1	-1	-1	-1	-2	-2	-2
5.33%	-3	-4	-4	-4	-4	-4	-4
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7

KR4301P92508                      2019-09 풋250                      7

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7	7	7	7	7	7	7
-5.33%	2	2	3	3	3	3	3
-2.67%	0	0	0	1	1	1	1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

KR4301P92524                      2019-09 풋252.5                      162

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	160	160	160	160	161	161	162
-5.33%	68	70	72	74	76	78	80
-2.67%	11	13	16	18	21	24	26
0%	-2	-2	-1	0	1	2	4
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)

**2,004**

공시일	2019-09-05
기준일	2019-09-04

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	4,833	0	4,833	
누계	유가증권	수익증권	79,492	0	79,492	

### 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	2019-09-05
기준일	2019-09-04

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	6,041	0	6,041	
누계	유가증권	수익증권	99,407	0	99,407	

### 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	2019-09-05
기준일	2019-09-04

## 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	475,312	0	475,312	
누계	통화	선도	0	460,445	-460,445	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		1,740
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,126
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		135
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		290
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		97
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		715
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		715
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		290
FX21019N03 KRW/USD 09-09-19E		677
FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E		483
FX21019Q00 KRW/USD 09-09-19E		193
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		290
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		3,190
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		2,165
FX21019Q01 KRW/USD 16-09-19E		97
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,963
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,576
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,648
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		3,006
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		967
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		967
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E		967
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E		1,740
FX21019Q04 KRW/USD 30-09-19E		193
FX21019Q04 KRW/USD 24-09-19E		2,126
FX21019Q04 KRW/USD 24-09-19E		2,706

FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E  
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E  
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E

193
290
290

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

(단위:백만원)

**11,954**

공시일	2019-09-05
기준일	2019-09-04

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

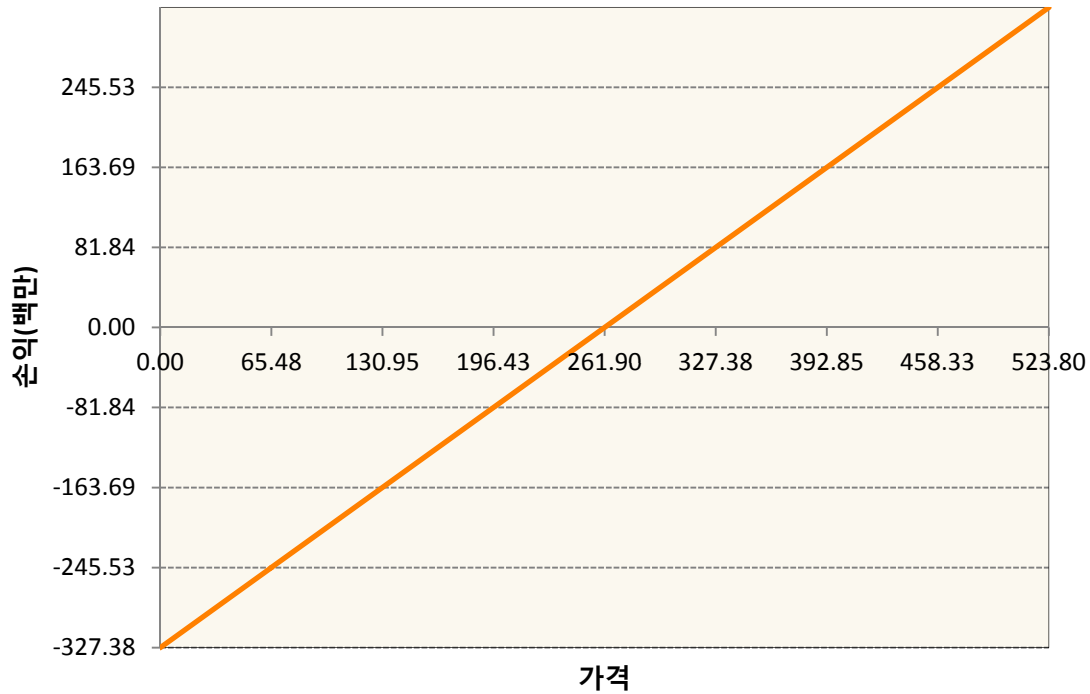
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

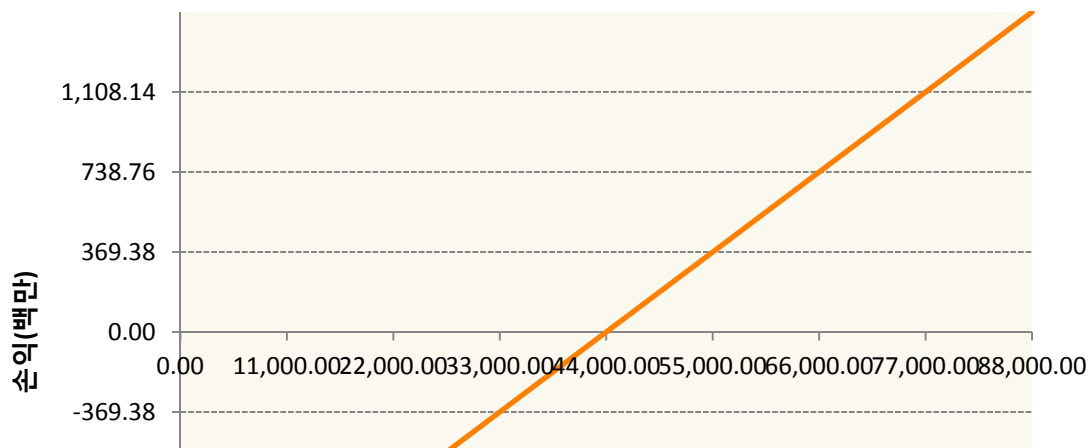
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,805	0	1,805	장내

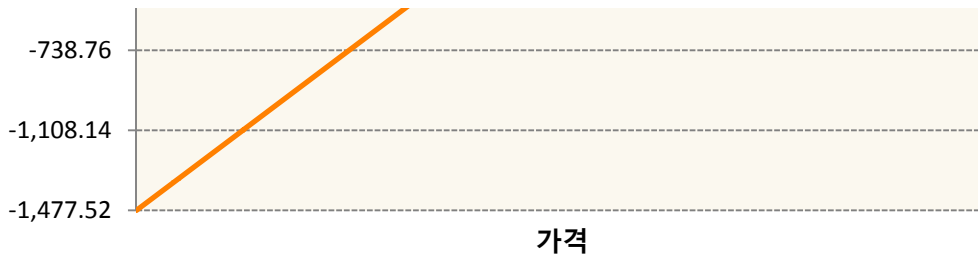
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P90000-2019-09 삼성전자개별선물





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						26
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26	
-5.33%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
-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%	17	17	17	17	17	17	17	
8.00%	26	26	26	26	26	26	26	
KR4111P90000		2019-09 삼성전자개별선물						118
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118	
-5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79	
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	39	39	39	39	39	39	39	
5.33%	79	79	79	79	79	79	79	
8.00%	118	118	118	118	118	118	118	

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

**169**

공시일	2019-09-05
기준일	2019-09-04

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

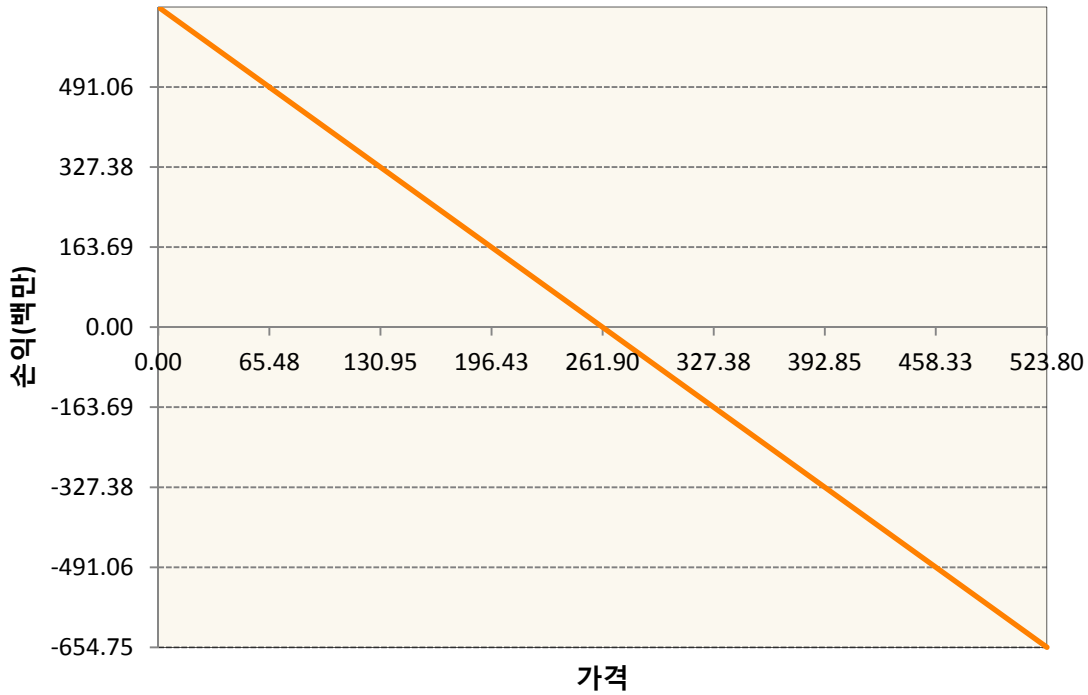
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

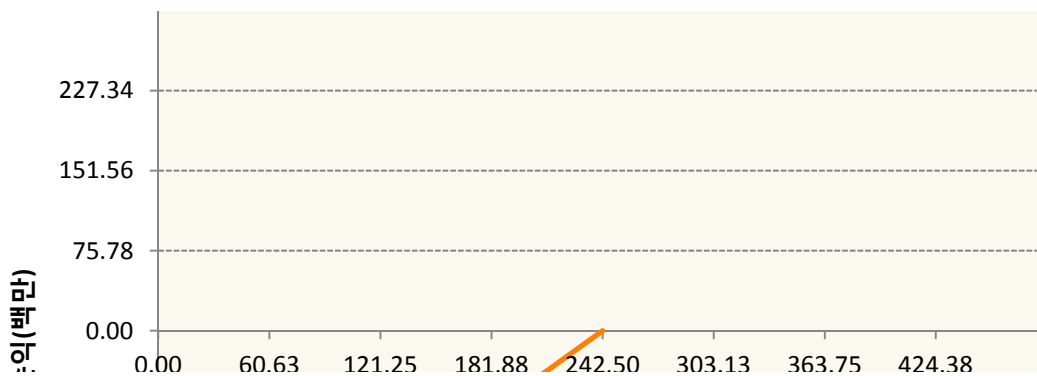
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	61	-61	장내
누계	유가증권	선물	0	655	-655	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,733	-3,733	장내

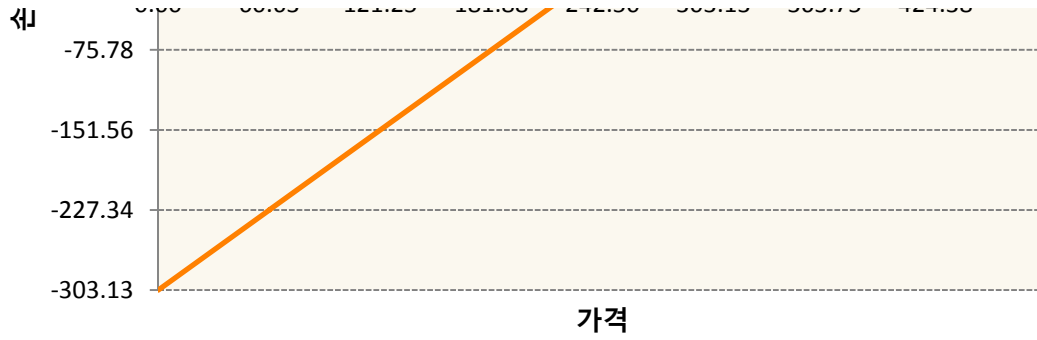
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

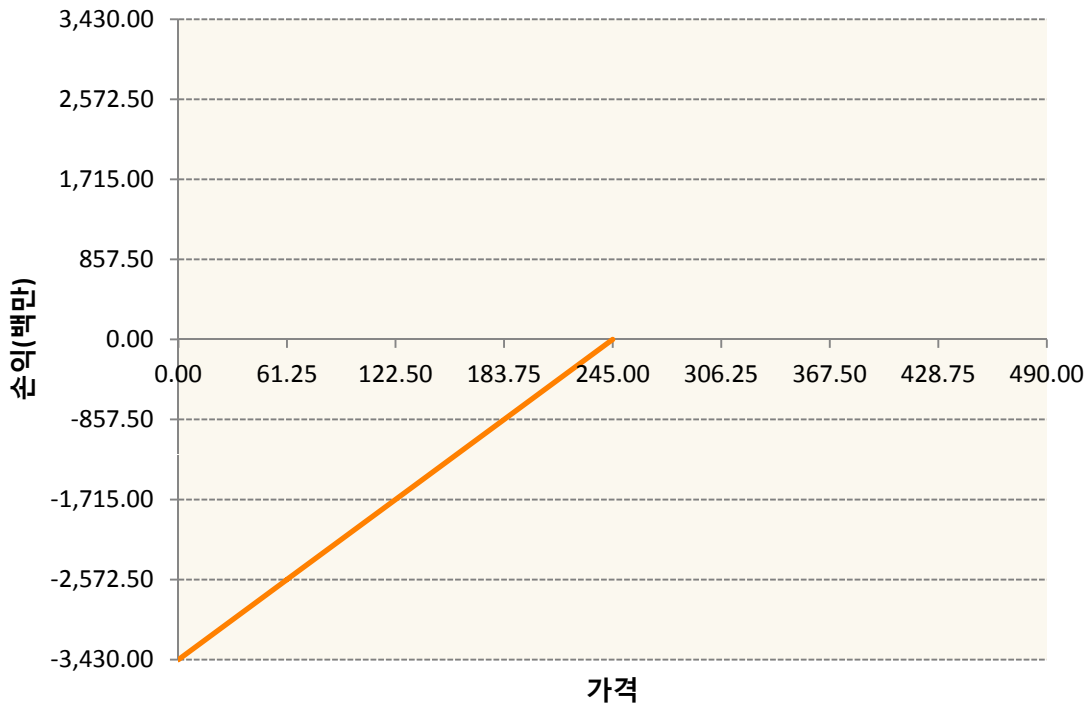


KR4301P92425-2019-09 풋242.5





KR4301P92458-2019-09 풋245



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						52
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	52	52	52	52	52	52	52	
-5.33%	35	35	35	35	35	35	35	
-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%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	
8.00%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52	
KR4301P92425		2019-09 풋242.5						5
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-5	-5
-5.33%	0	0	-1	-1	-1	-1	-1
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

KR4301P92458

2019-09 풋245

78

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-66	-67	-69	-71	-74	-76	-78
-5.33%	-11	-13	-15	-18	-21	-23	-26
-2.67%	0	-1	-1	-2	-3	-4	-5
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

59

공시일	2019-09-05
기준일	2019-09-04

## H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	19,681	0	19,681	
누계	통화	선도	0	19,210	-19,210	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		164
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		483
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		522
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		39
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		329

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

(단위:백만원)

<b>499</b>
------------

공시일	2019-09-05
기준일	2019-09-04

## 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	382	0	382	장외
누계	통화	선도	93	112	-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)

36
----

공시일	2019-09-05
기준일	2019-09-04

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

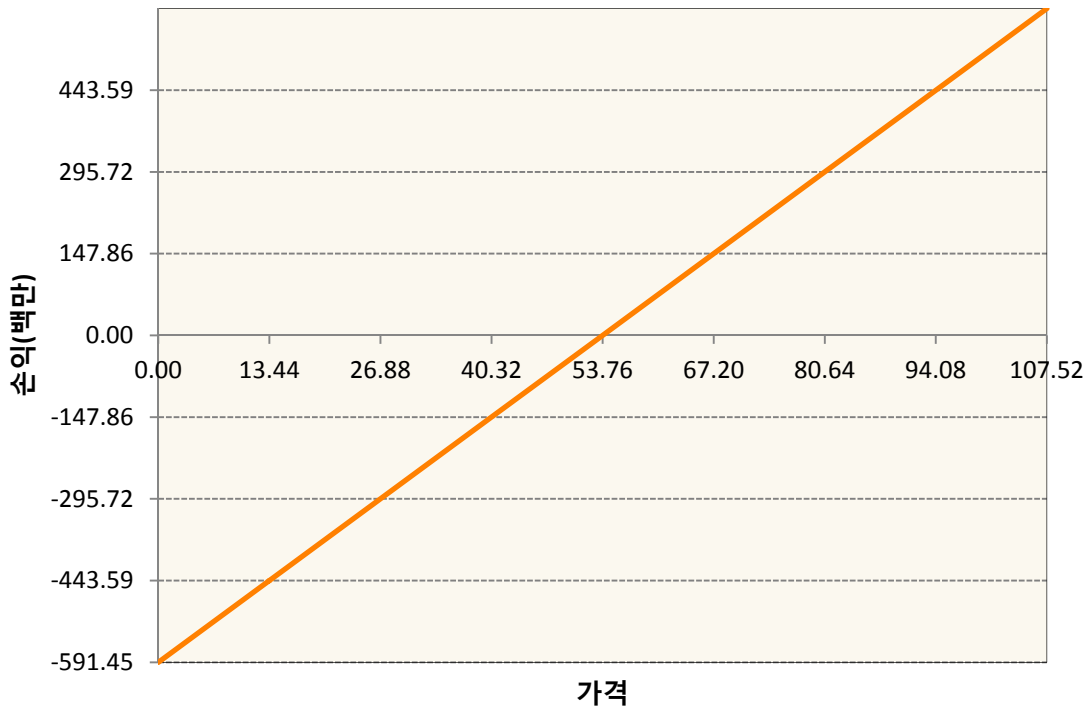
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

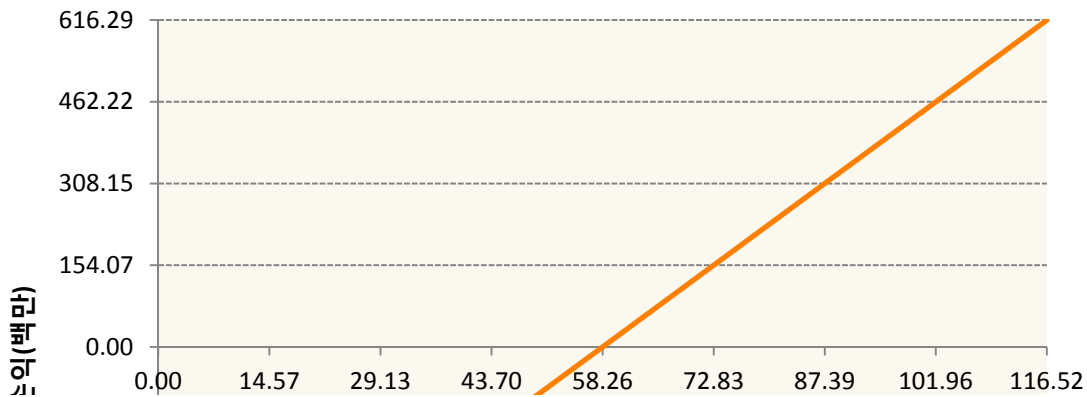
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,219	121	2,098	
누계	유가증권	선물	185	0	185	장내

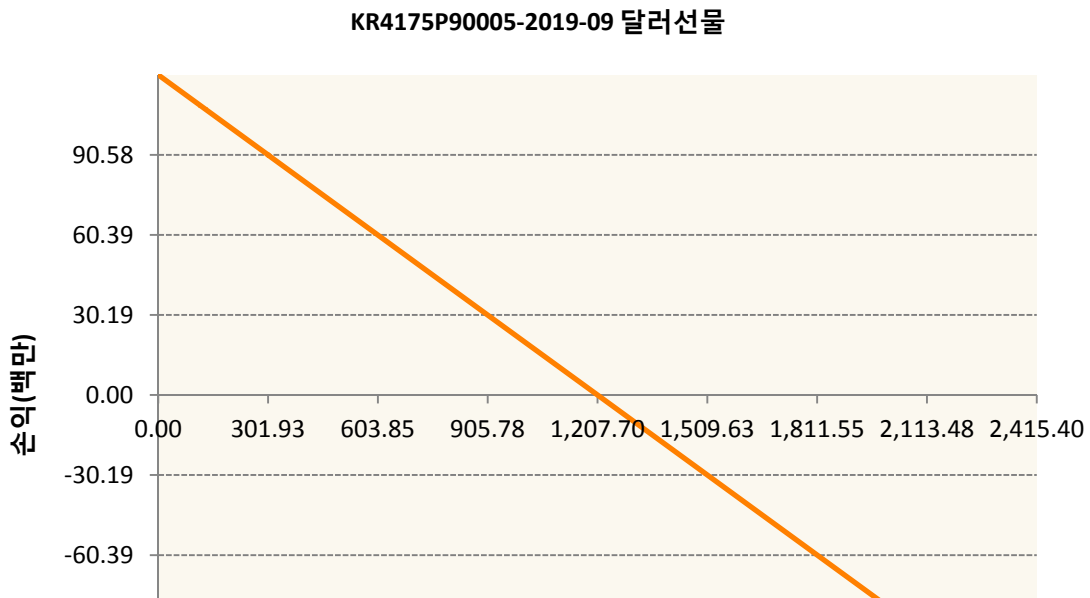
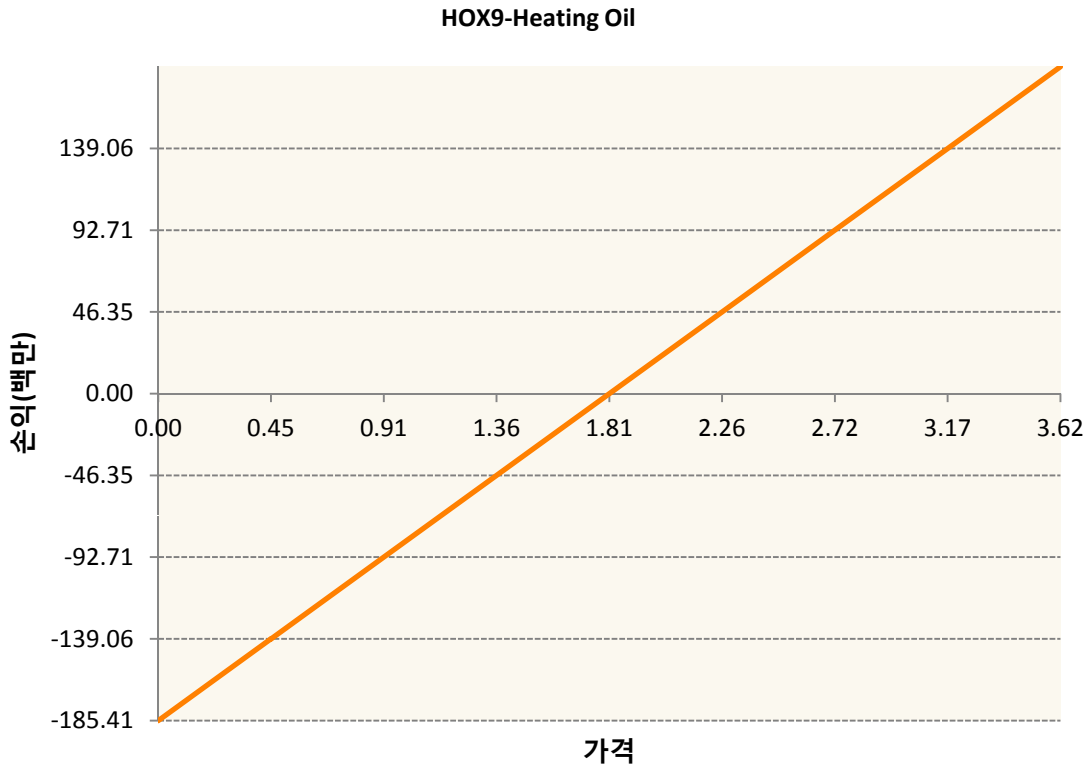
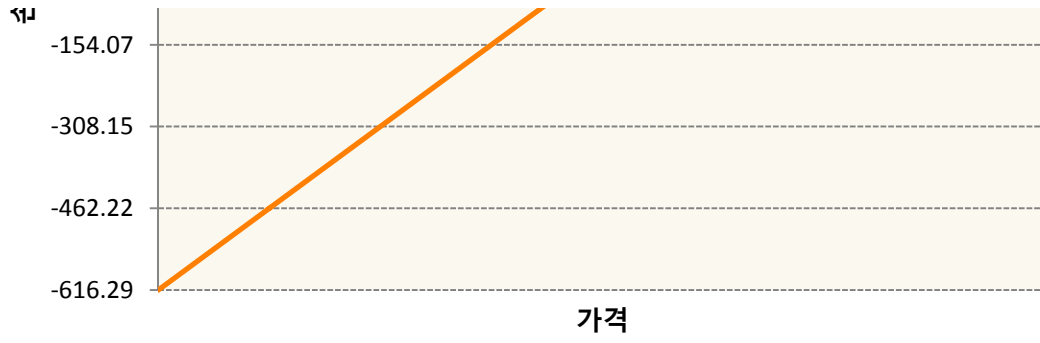
### 2. 만기시점의 손익구조

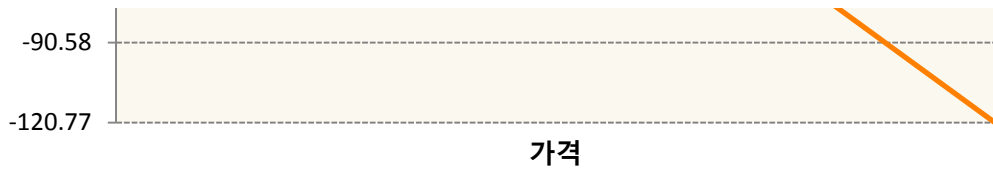
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19



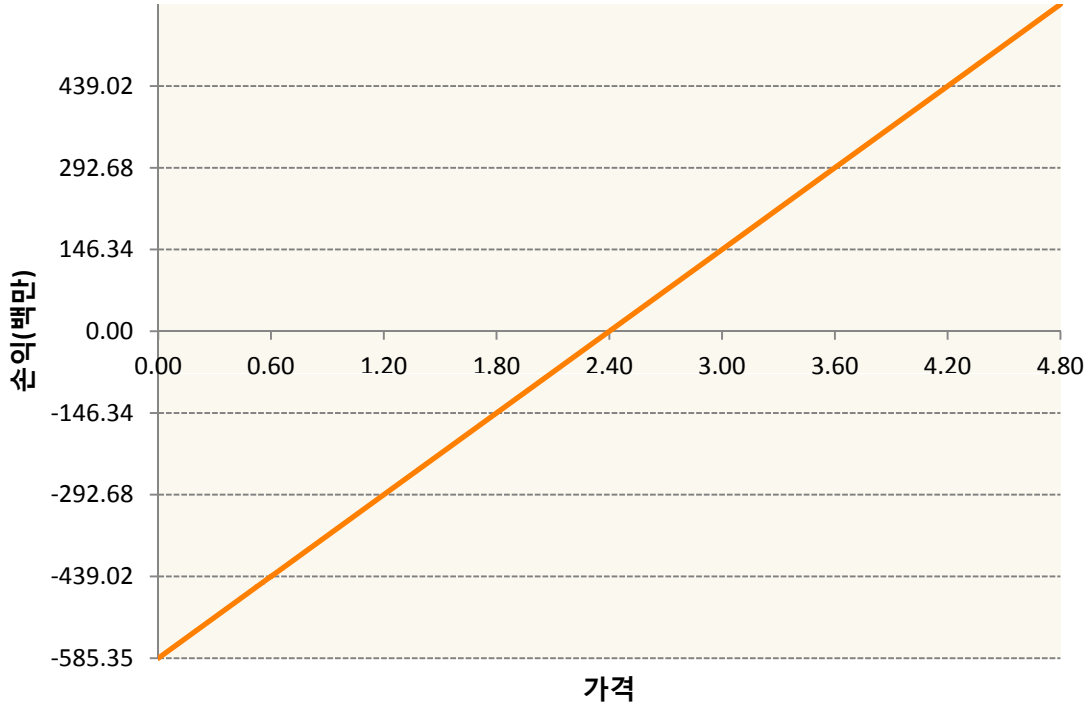
COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19



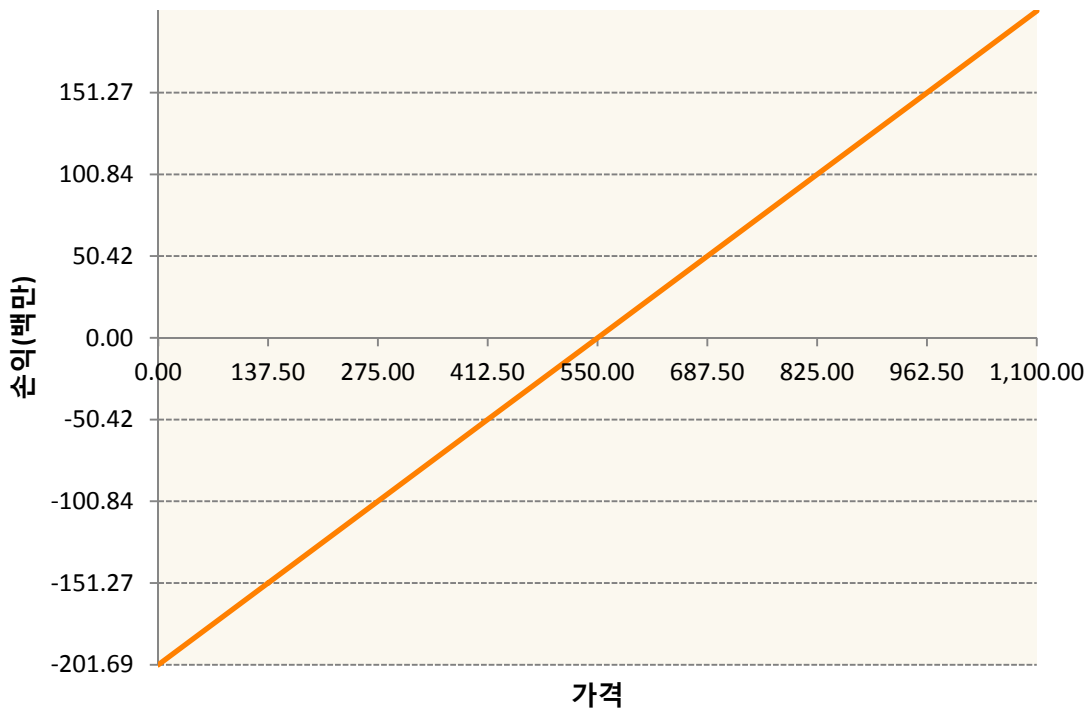


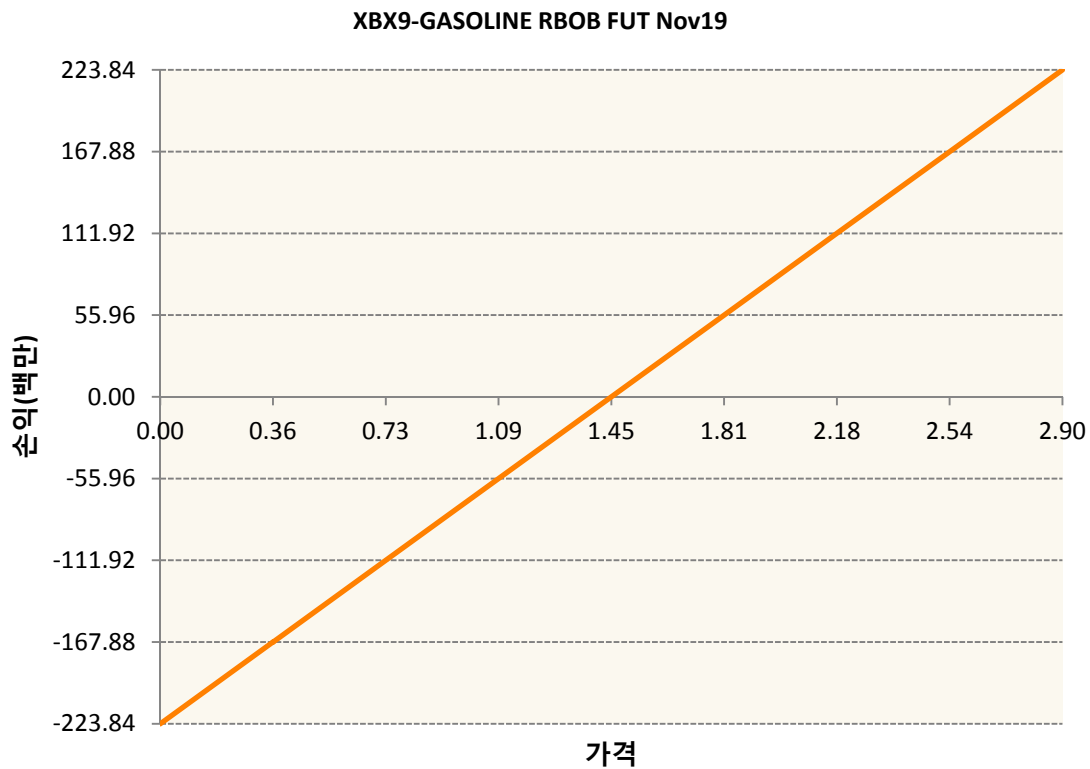


NGX19-NATURAL GAS FUTR Nov19



QSX9-Low Su Gasoil G Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX9	WTI CRUDE FUTURE Nov19	47
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	49
HOX9	Heating Oil	15
KR4175P900	2019-09 달러선물	10
NGX19	NATURAL GAS FUTR Nov19	47
QSX9	Low Su Gasoil G Nov19	16
XBX9	GASOLINE RBOB FUT Nov19	18

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	373

공시일	2019-09-05
기준일	2019-09-04

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

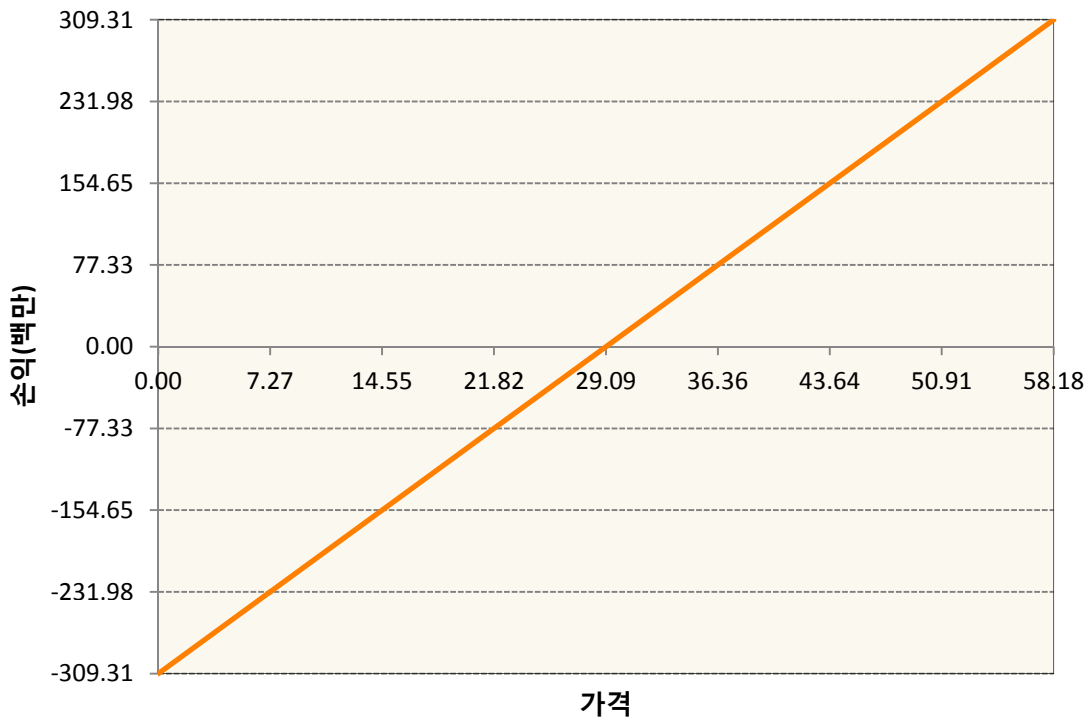
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

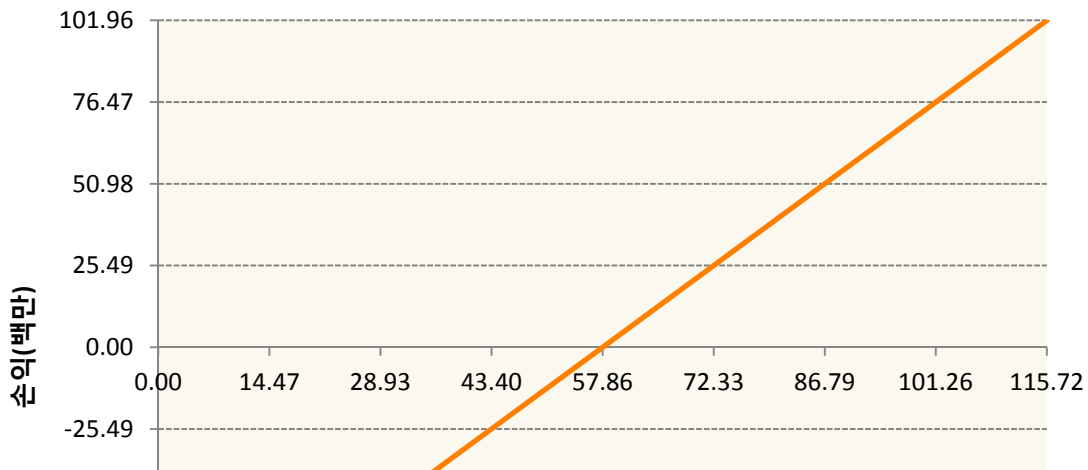
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,693	157	2,536	

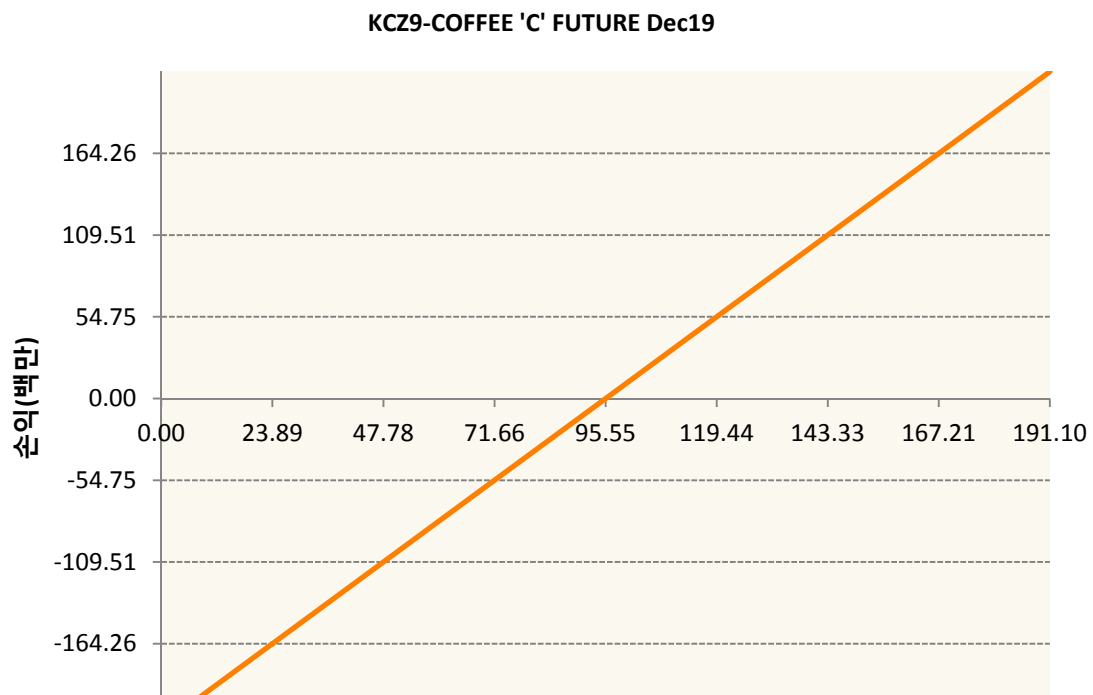
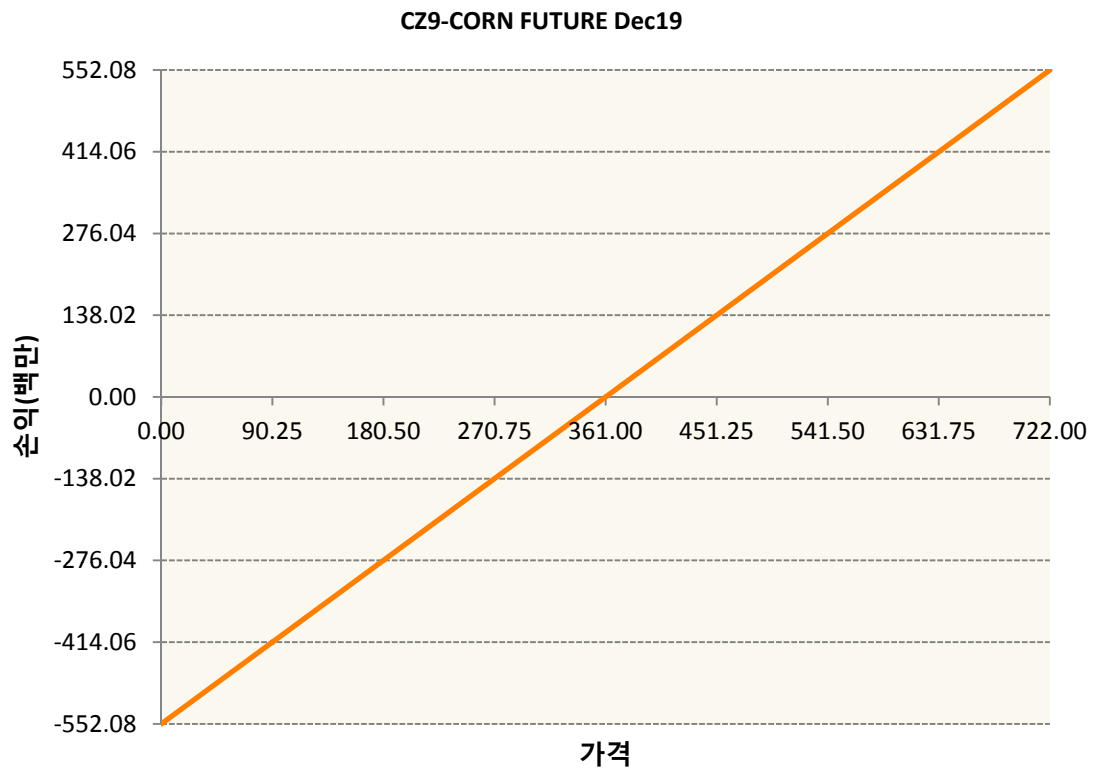
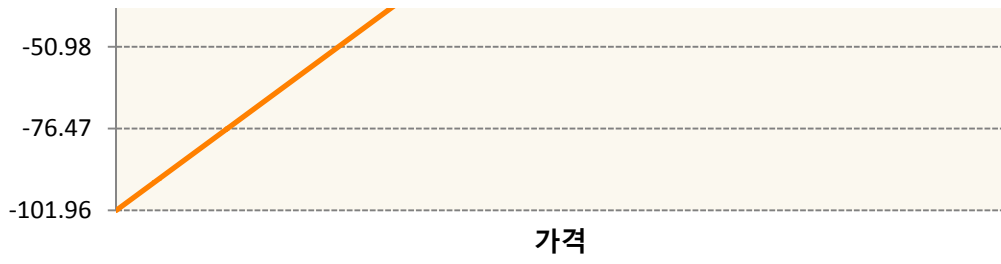
### 2. 만기시점의 손익구조

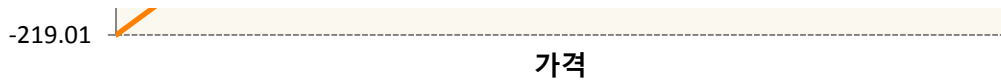
**BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19**



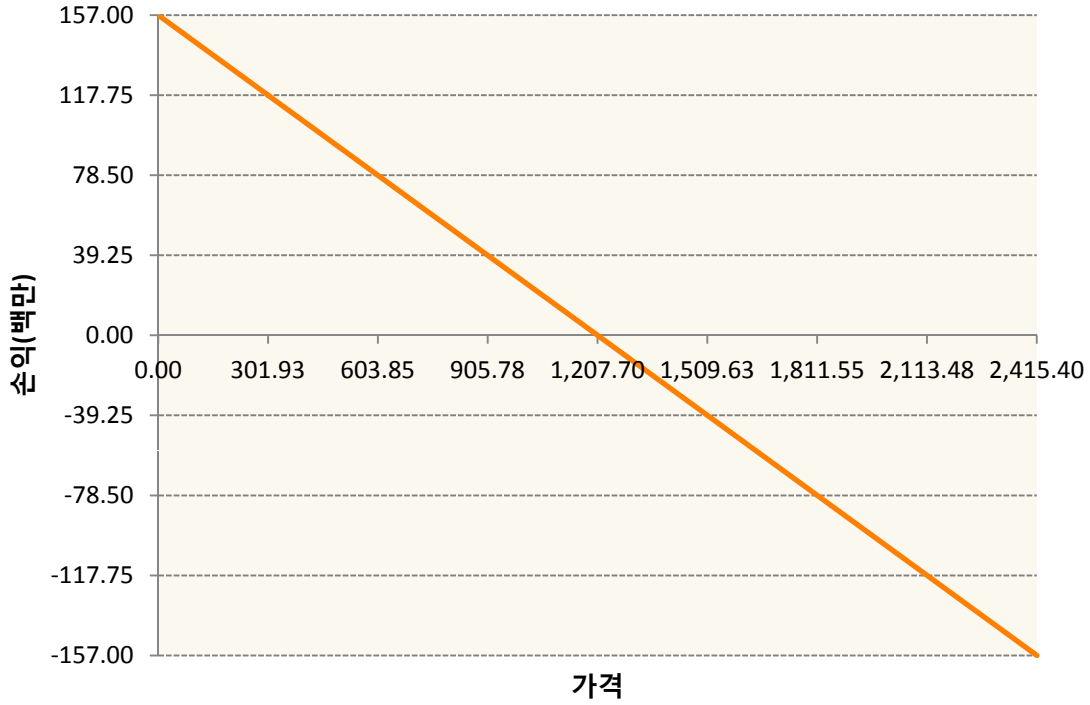
**CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19**



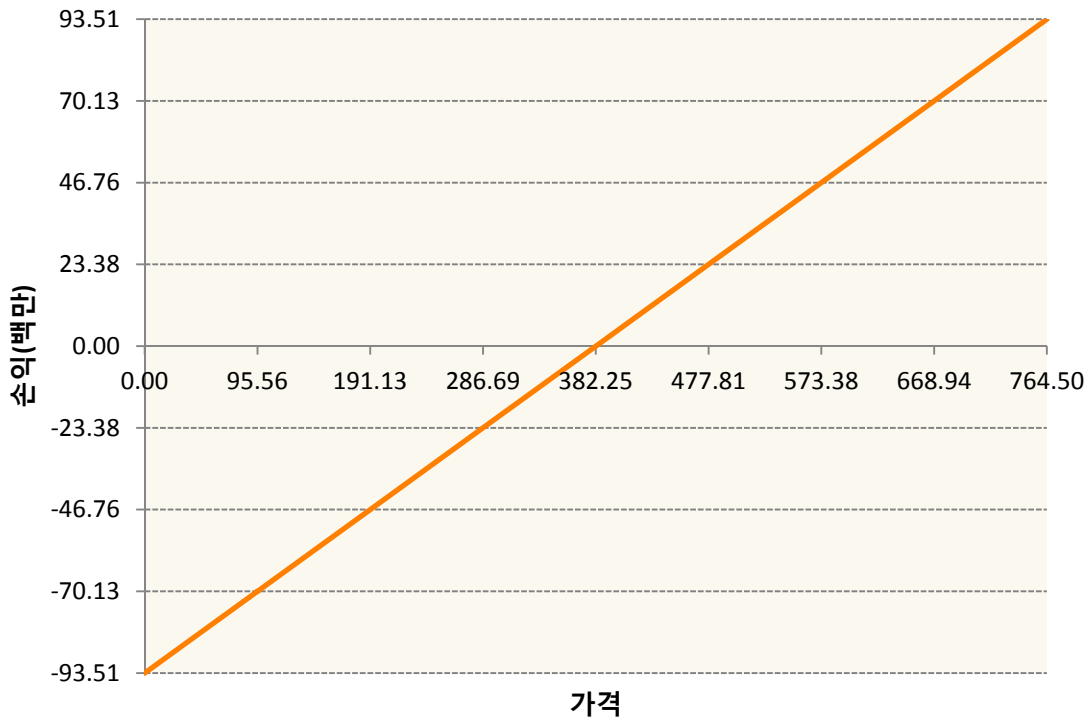




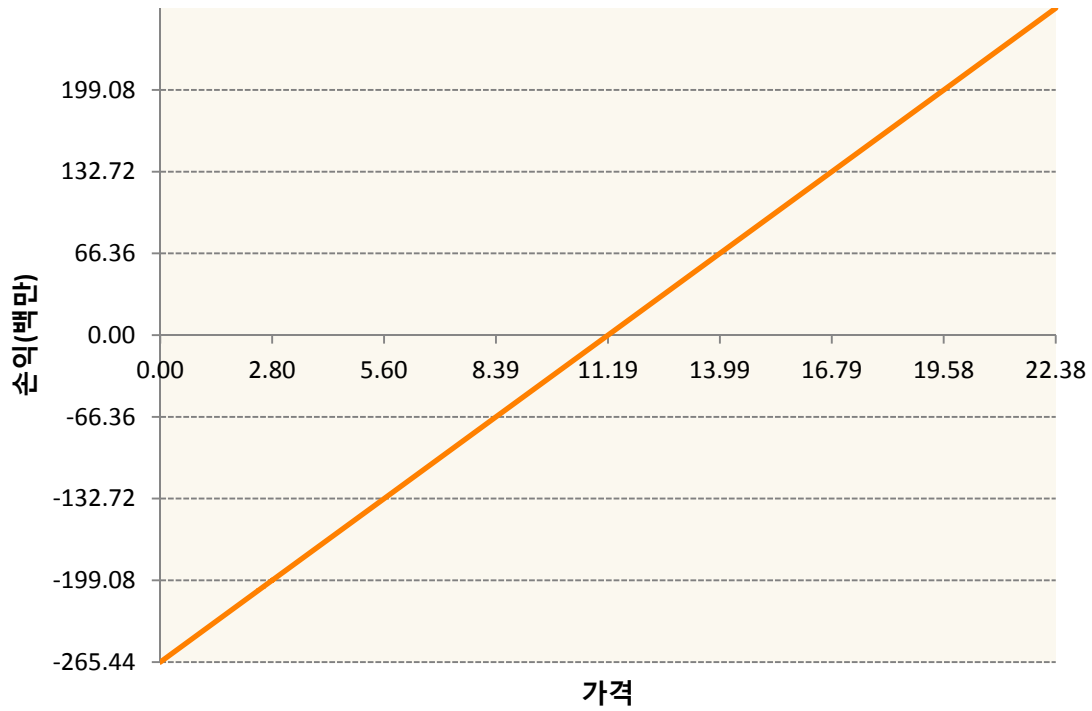
KR4175P90005-2019-09 달러선물



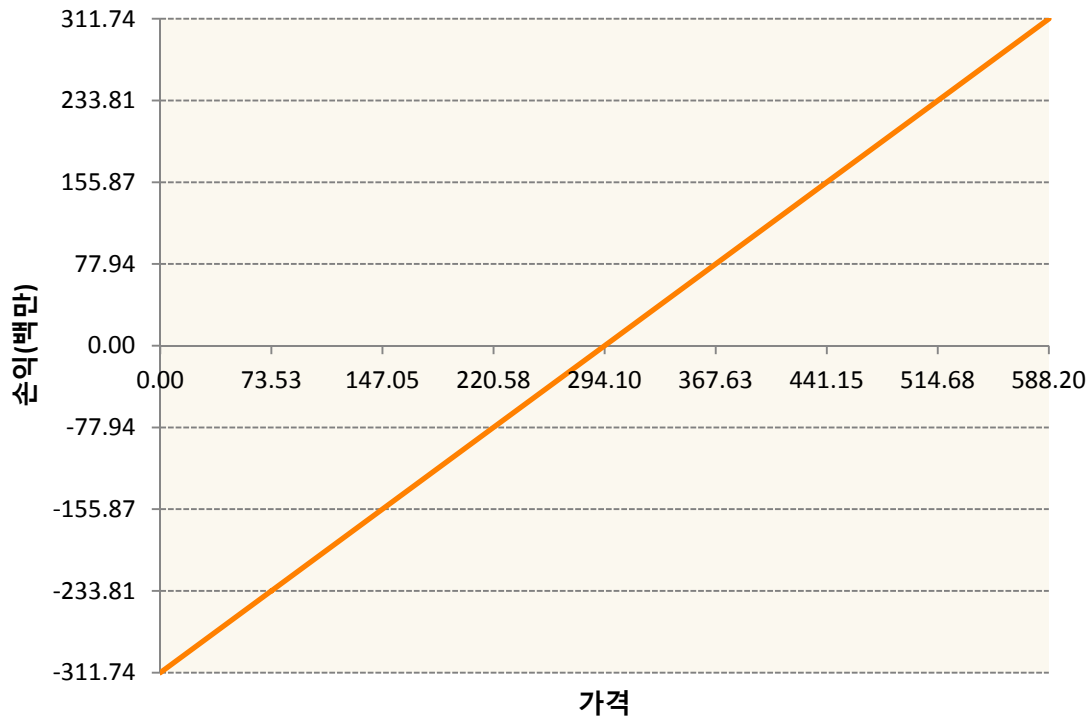
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

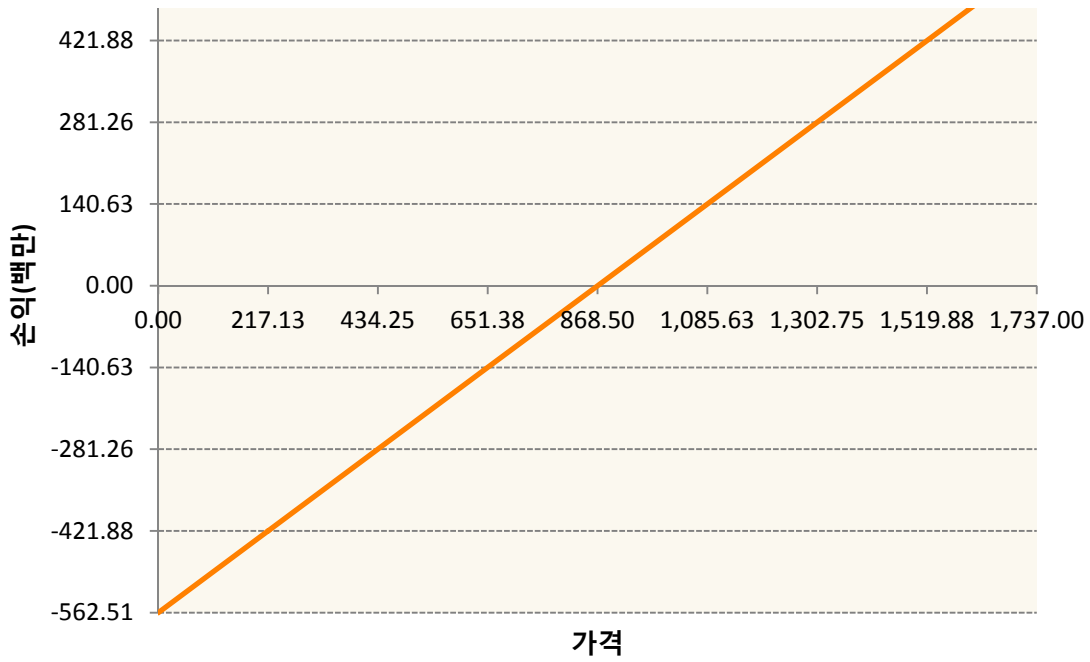


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

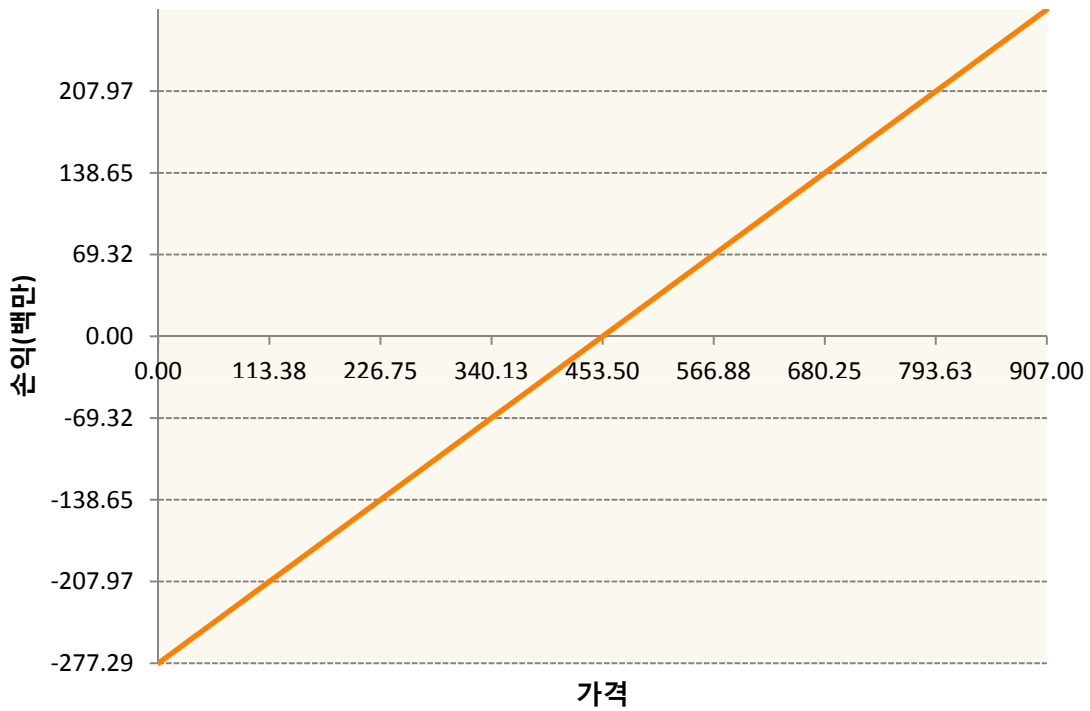


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





WZ9-WHEAT FUTURE(CBT) Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	25
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	8
CZ9	CORN FUTURE Dec19	44
KCZ9	COFFEE 'C' FUTURE Dec19	18
KR4175P900	2019-09 달러선물	13

KWZ9	KC HRW WHEAT FUT Dec19	7
SBV9	SUGAR #11 (WORLD) Oct19	21
SMZ9	SOYBEAN MEAL FUTR Dec19	25
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	45
WZ9	WHEAT FUTURE(CBT) Dec19	22

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

(단위:백만원)

**238**