

공시일	2019-09-10
기준일	2019-09-09

## 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)

92

공시일	2019-09-10
기준일	2019-09-09

## 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

1,171

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

672

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-10
기준일	2019-09-09

## 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)

399

SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)

145

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

863

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-10
기준일	2019-09-09

## 유로인덱스모(주식-파생형)

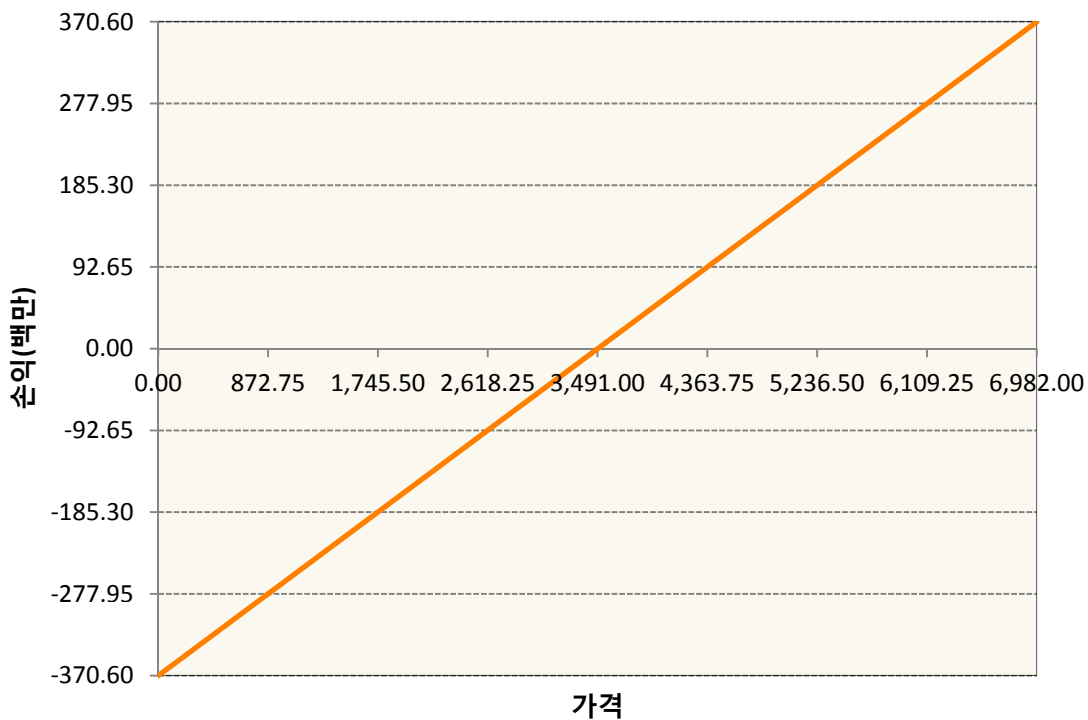
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	371	0	371	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGU9-EURO STOXX 50 Sep19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU9	EURO STOXX 50 Sep19	30
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

21
----

공시일	2019-09-10
기준일	2019-09-09

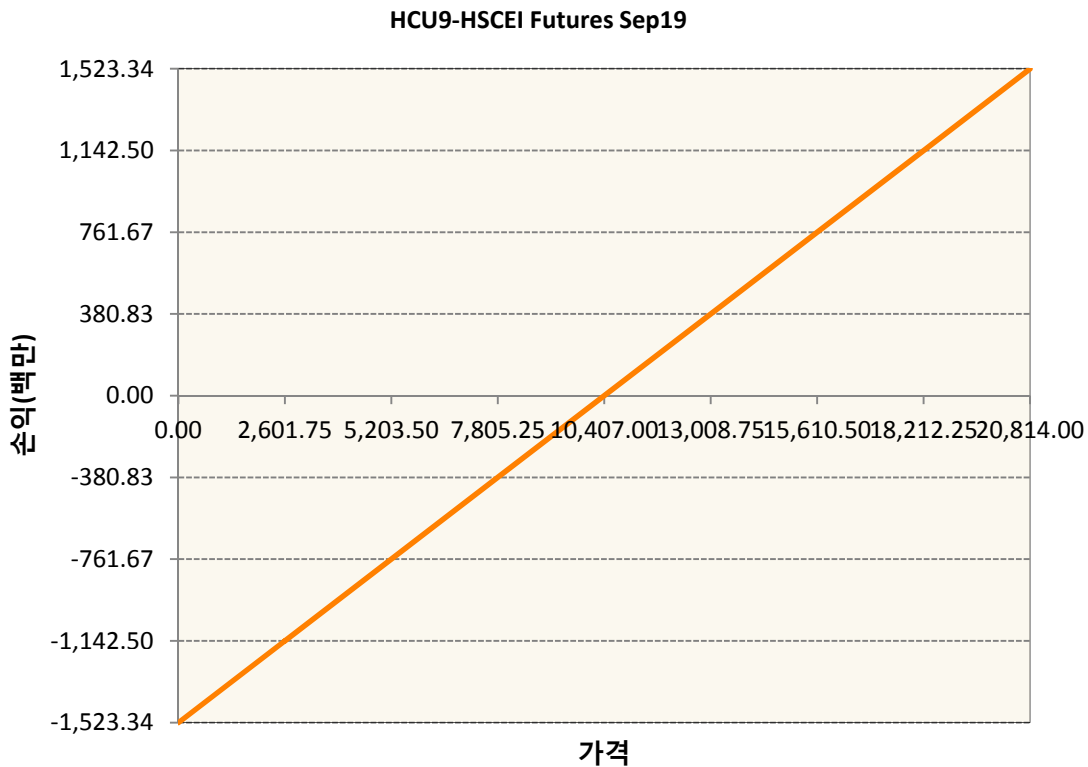
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,523	0	1,523	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

<b>114</b>
------------

공시일	2019-09-10
기준일	2019-09-09

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

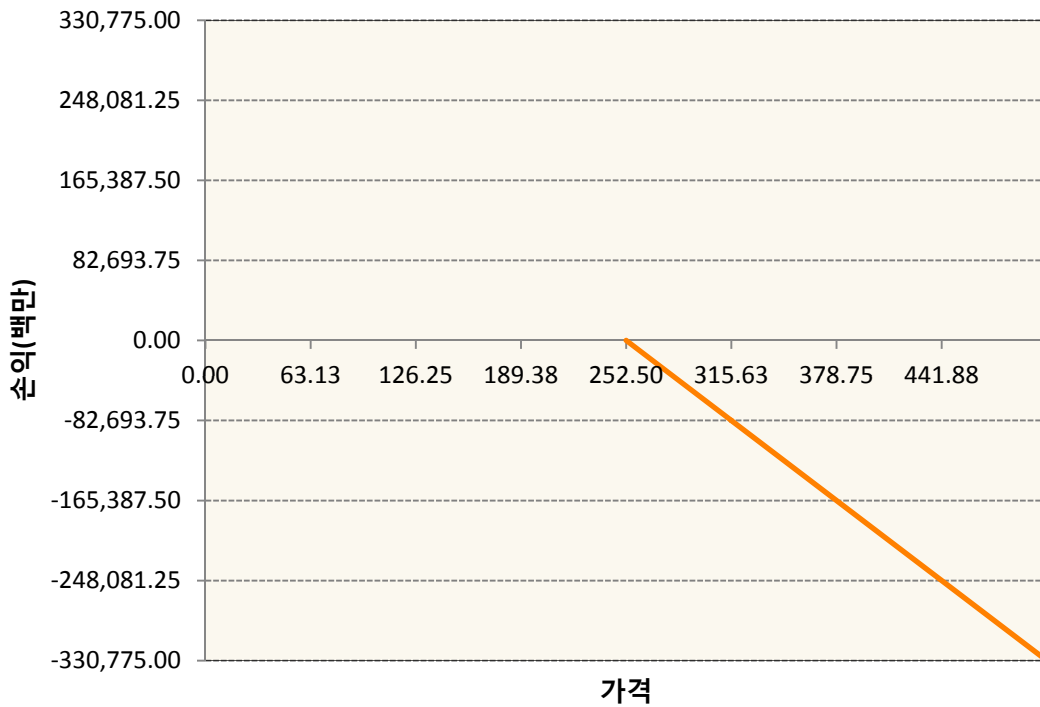
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

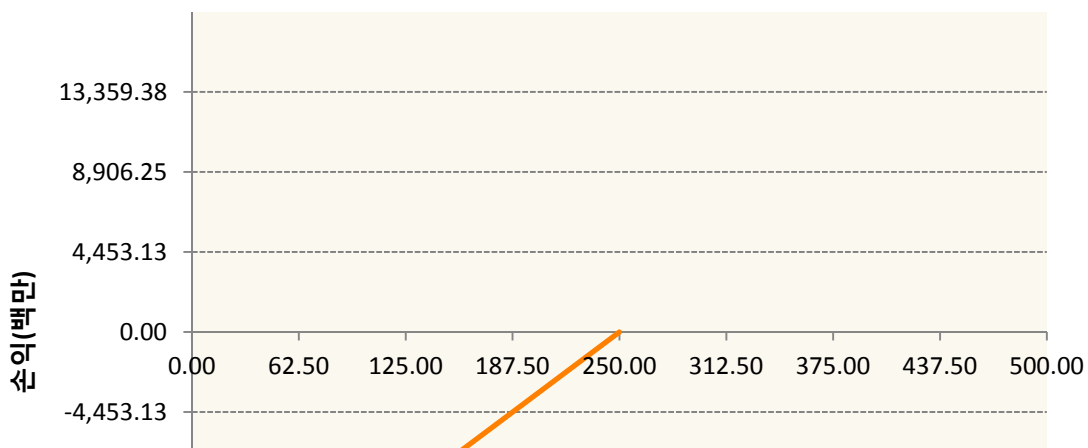
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	5,938	0	5,938	장내
누계	유가증권	옵션	0	494,722	-494,722	장내

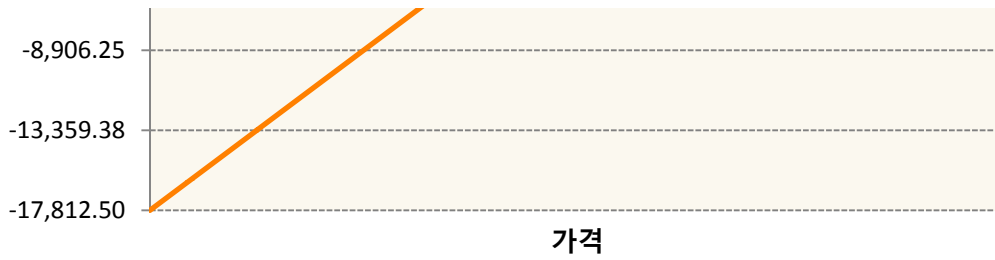
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P92526-2019-09 콜252.5

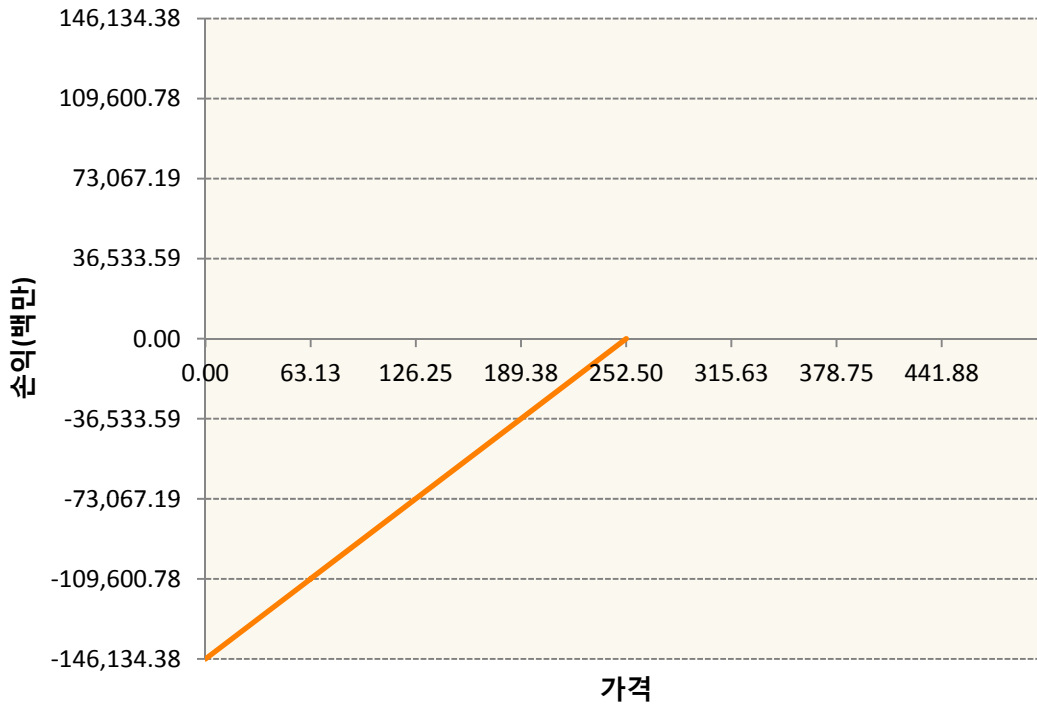


KR4301P92508-2019-09 풋250





KR4301P92524-2019-09 풋252.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P92526		2019-09 콜252.5					28,016
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19,421	19,367	19,298	19,214	19,118	19,009	18,891
-5.33%	17,100	16,885	16,669	16,453	16,236	16,019	15,802
-2.67%	9,305	9,271	9,222	9,160	9,084	8,996	8,897
0%	4	3	2	0	-5	-13	-26
2.67%	-9,336	-9,336	-9,336	-9,336	-9,336	-9,336	-9,337
5.33%	-18,676	-18,676	-18,676	-18,676	-18,676	-18,676	-18,676
8.00%	-28,016	-28,016	-28,016	-28,016	-28,016	-28,016	-28,016
KR4301P92508		2019-09 풋250					300
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-287	-288	-290	-292	-294	-297	-300

-5.33%	-4	-7	-10	-13	-17	-21	-25
-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
KR4301P92524      2019-09 풋252.5							3,790
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,767	-3,768	-3,769	-3,772	-3,776	-3,782	-3,790
-5.33%	-328	-380	-432	-485	-538	-591	-644
-2.67%	0	0	-1	-2	-3	-6	-11
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

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

(단위:백만원)

**28,614**

공시일	2019-09-10
기준일	2019-09-09

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

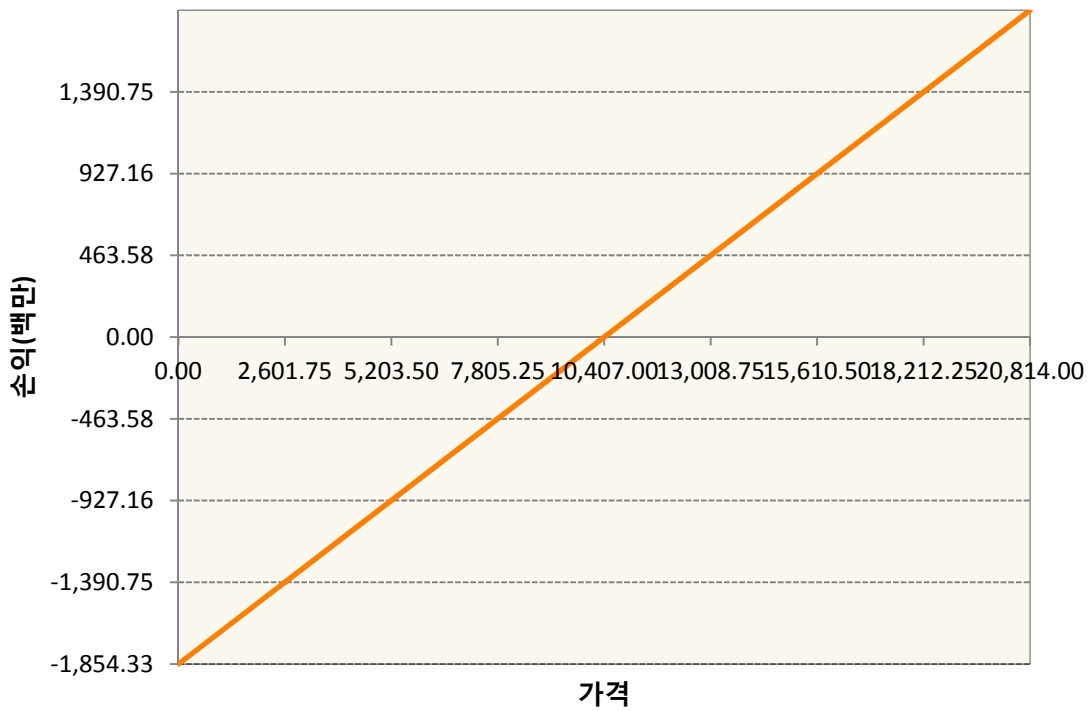
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

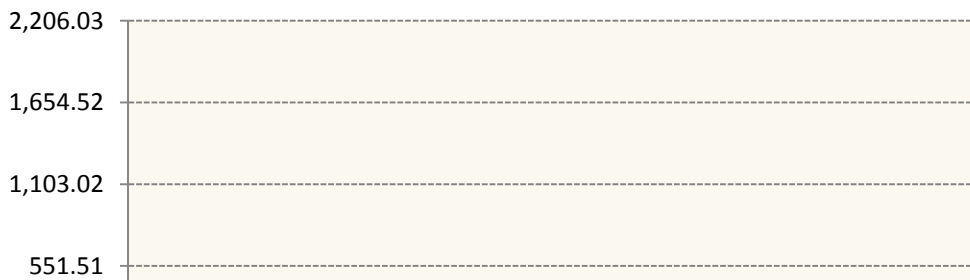
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,854	0	1,854	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,713	-4,713	장내
누계	통화	선도	76	2,827	-2,751	장외

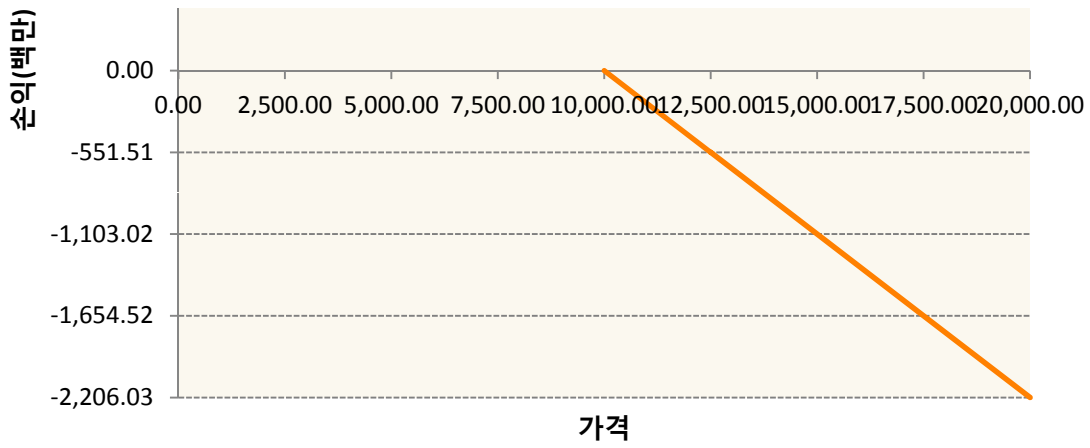
### 2. 만기시점의 손익구조

HCU9-HSCEI Futures Sep19

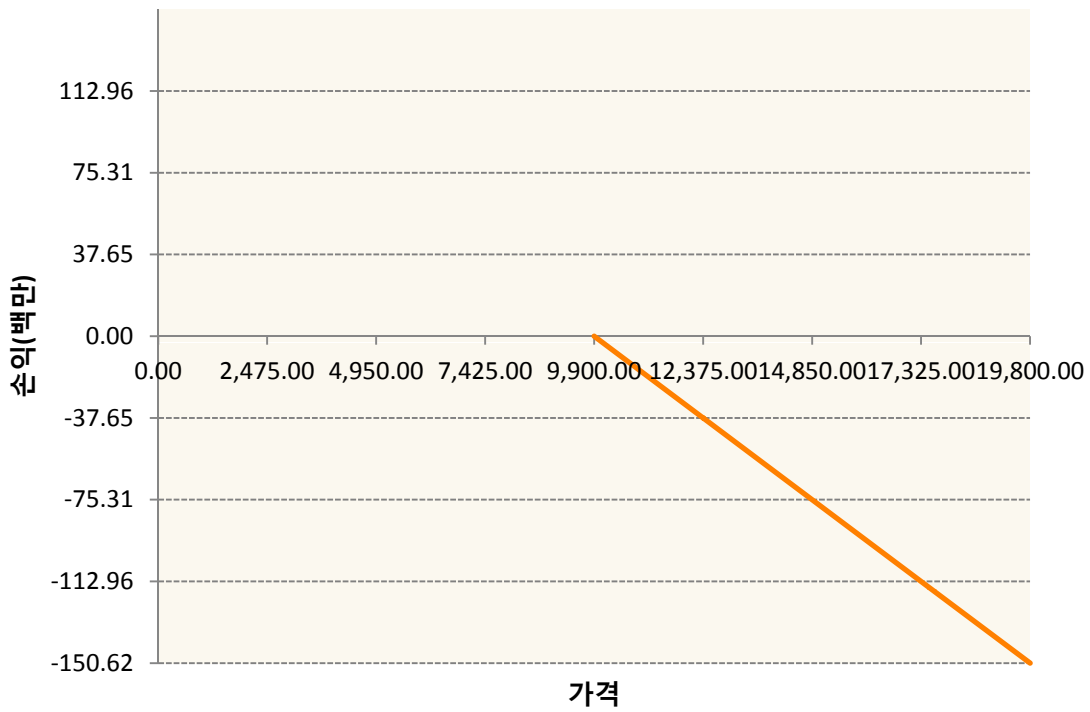


OHHIU9-C100-HSCEI

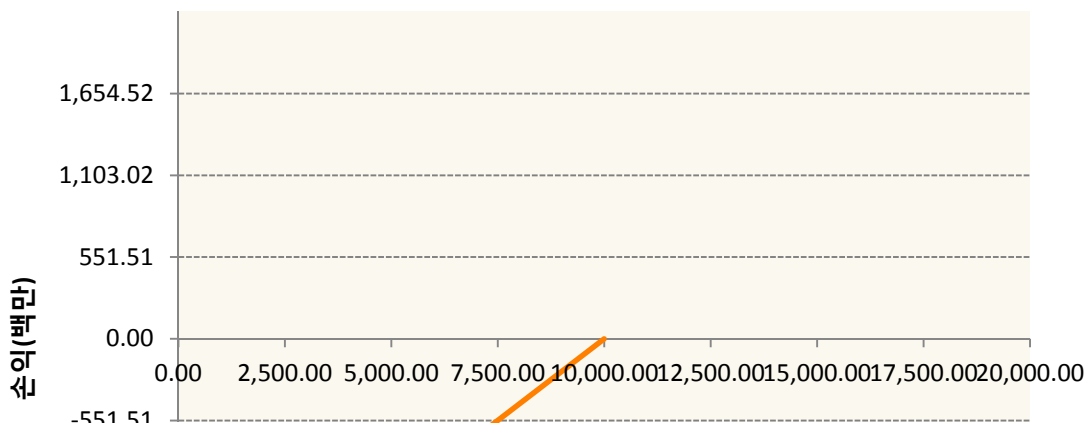


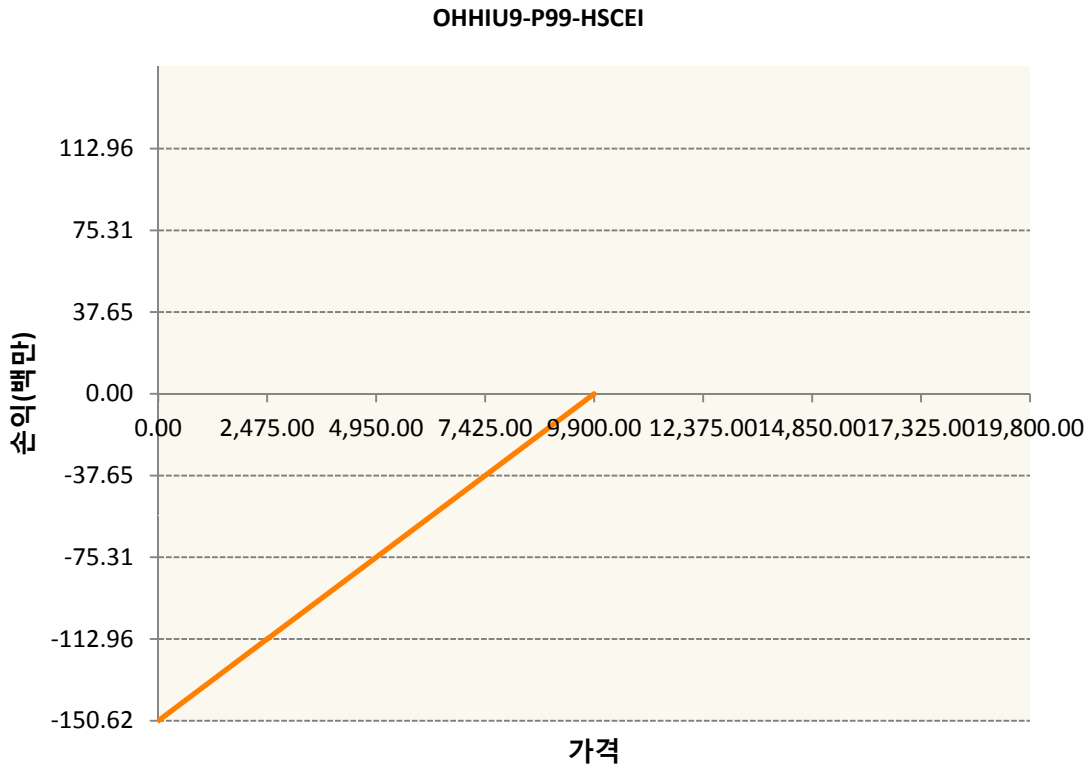


OHHIU9-C99-HSCEI



OHHIU9-P100-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	226
FX21019U00 HKD/KRW 22-11-19E	6
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)
	<b>567</b>

공시일	2019-09-10
기준일	2019-09-09

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

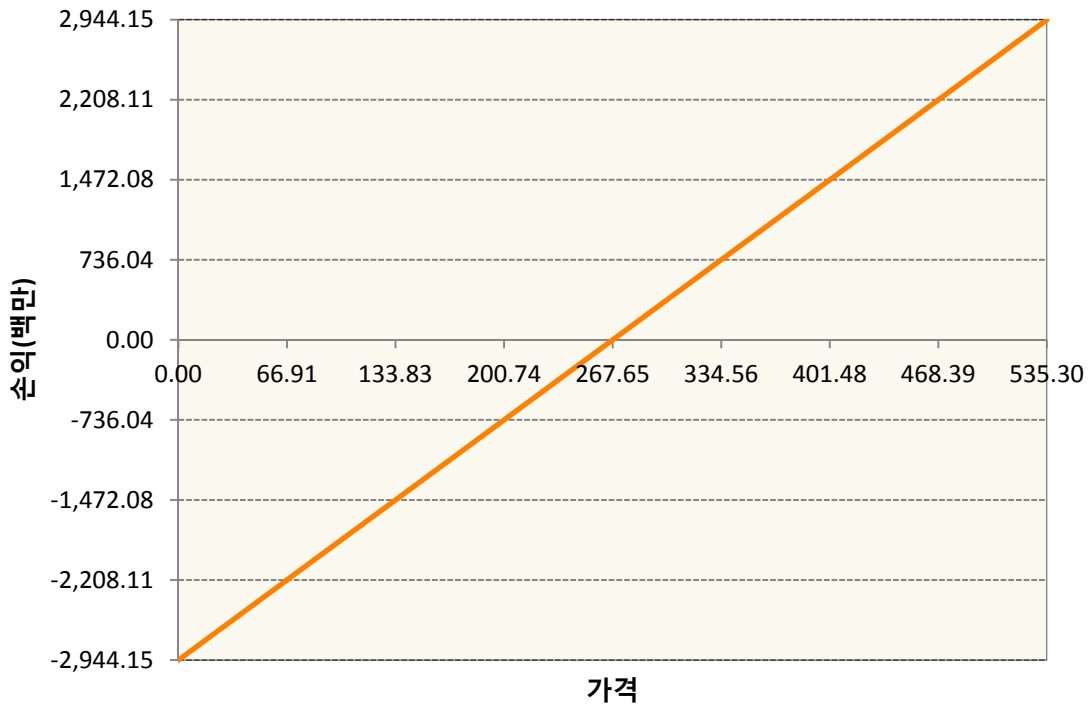
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

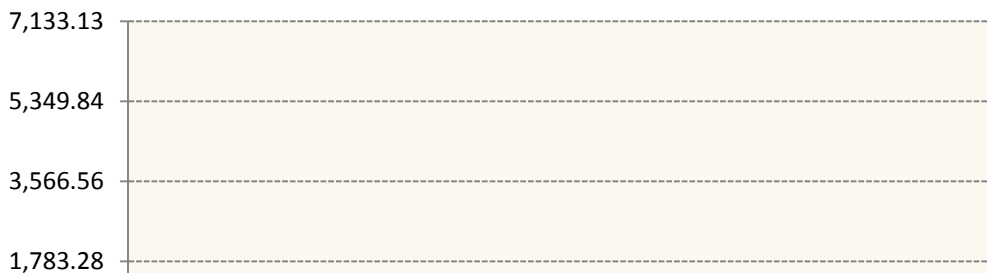
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	119	0	119	장내
누계	유가증권	선물	2,944	0	2,944	장내
누계	유가증권	스왑	14,125	0	14,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,198	-14,198	장내

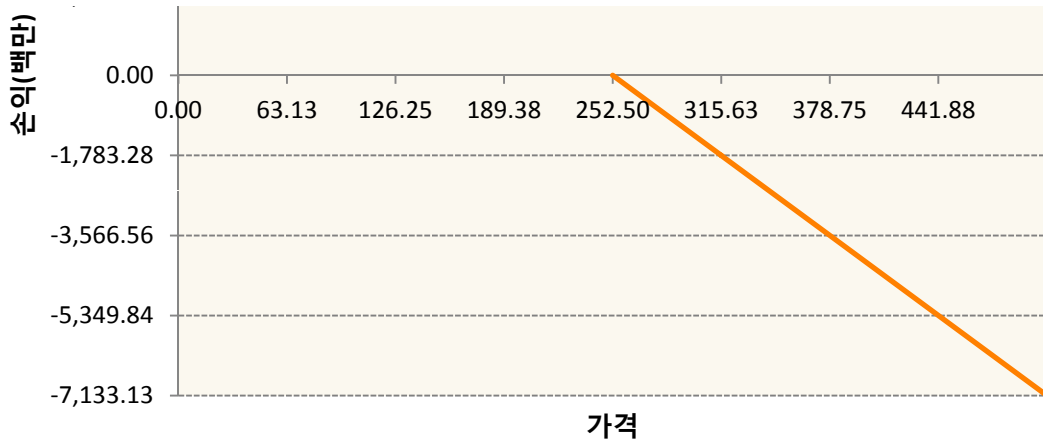
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

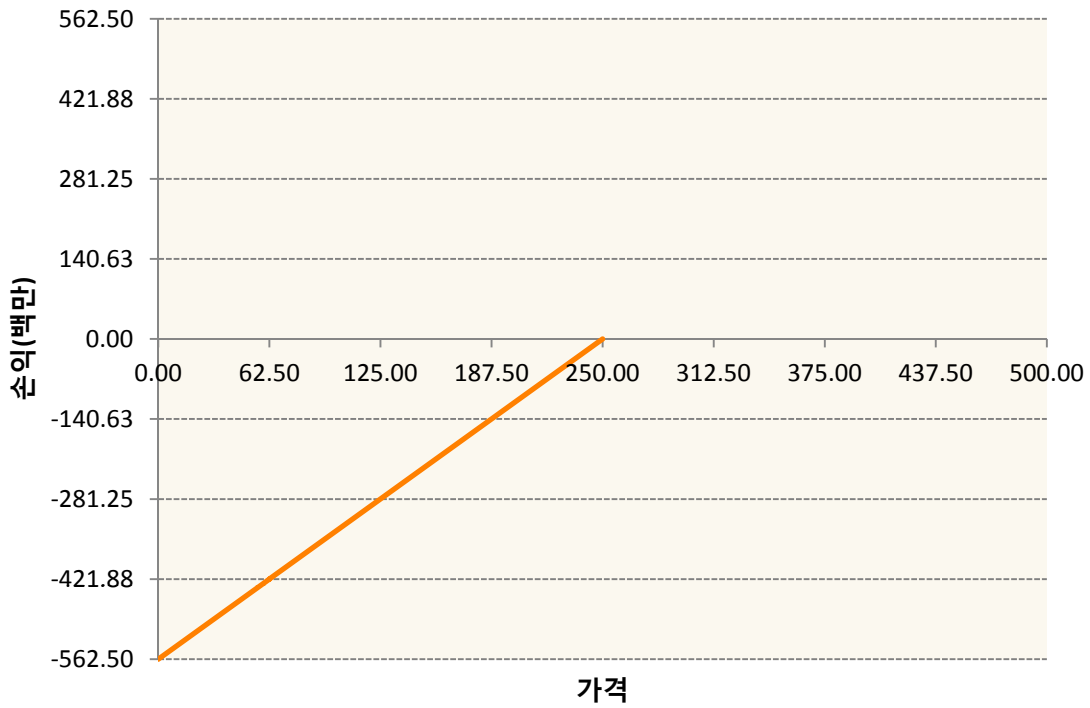


KR4201P92526-2019-09 콜252.5

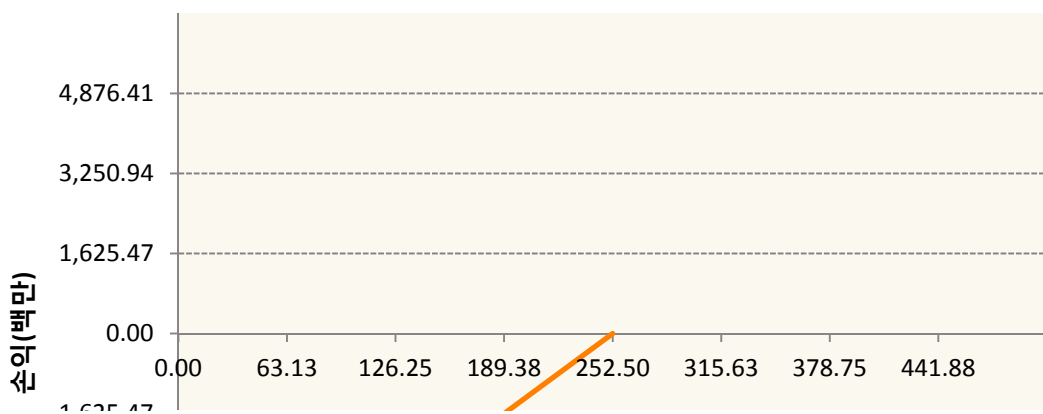




KR4301P92508-2019-09 풋250



KR4301P92524-2019-09 풋252.5





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						1,215
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	
KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						235
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-235	-235	-235	-235	-235	-235	-235	
-5.33%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157	
-2.67%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	78	78	78	78	78	78	78	
5.33%	157	157	157	157	157	157	157	
8.00%	235	235	235	235	235	235	235	
KR4201P92526		2019-09 콜252.5						604
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	419	418	416	414	412	410	407	
-5.33%	369	364	359	355	350	345	341	
-2.67%	201	200	199	198	196	194	192	
0%	0	0	0	0	0	0	-1	
2.67%	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-201	
5.33%	-403	-403	-403	-403	-403	-403	-403	
8.00%	-604	-604	-604	-604	-604	-604	-604	
KR4301P92508		2019-09 풋250						9
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
-5.33%	0	0	0	0	-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
KR4301P92524      2019-09 풋252.5							169
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-169
-5.33%	-15	-17	-19	-22	-24	-26	-29
-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

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

(단위:백만원)

**2,036**

공시일	2019-09-10
기준일	2019-09-09

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

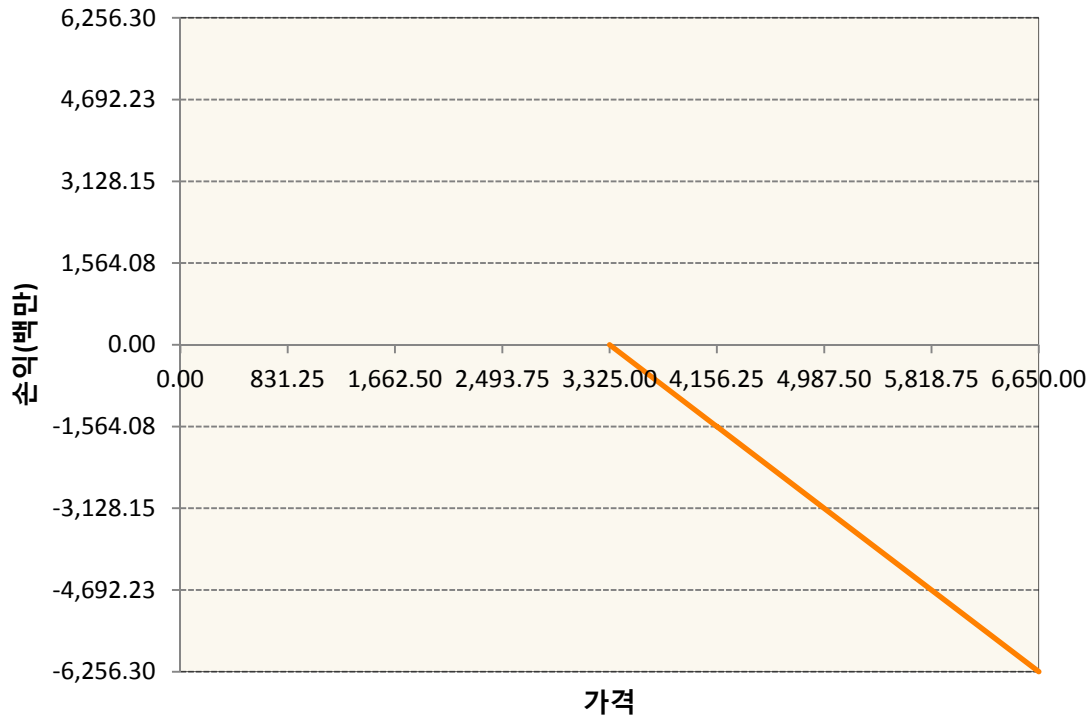
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

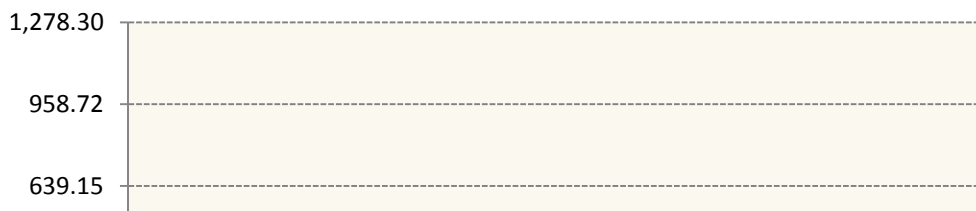
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,126	0	5,126	
누계	유가증권	옵션	0	15,069	-15,069	장내
누계	지수	스왑	23,943	0	23,943	장외
누계	통화	선도	8,947	17,105	-8,158	장외

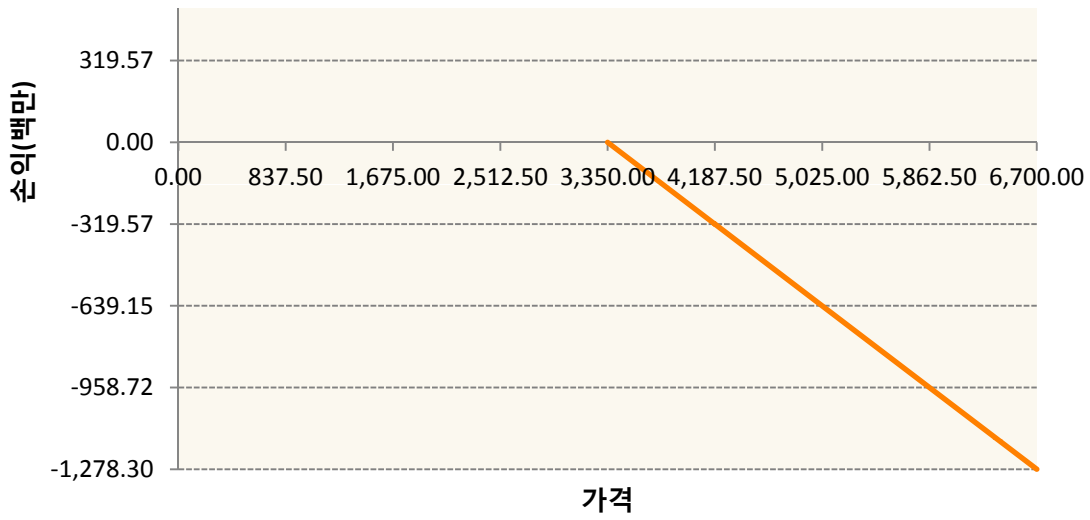
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXU9-C3325-EURO STOXX 50**

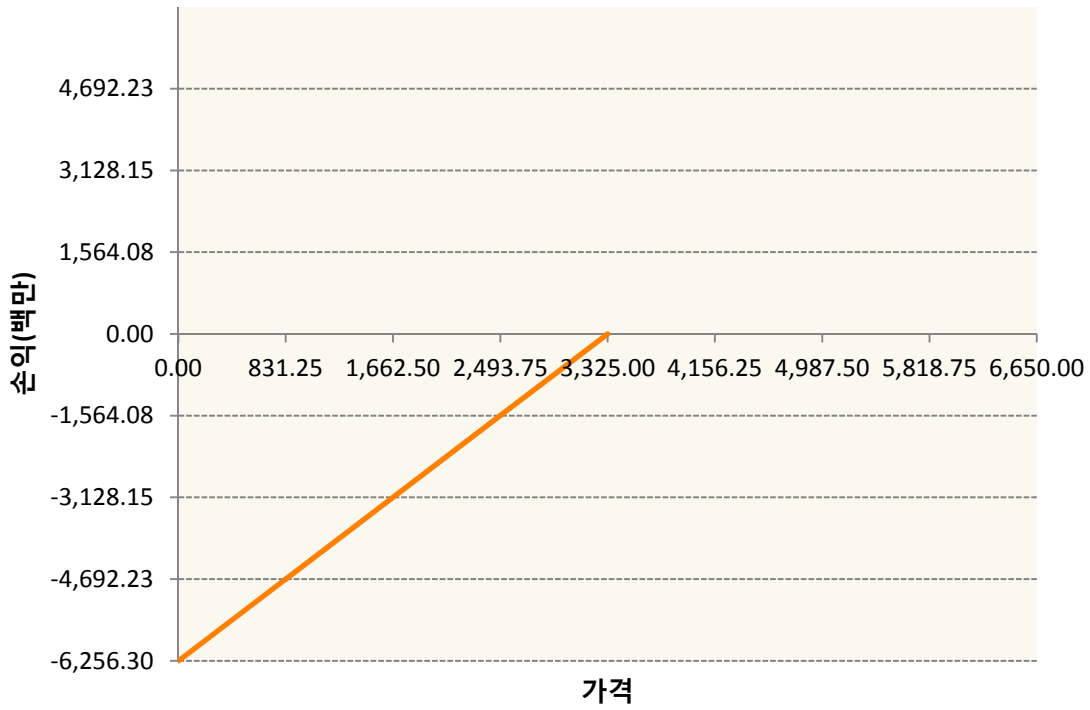


**OESXU9-C3350-EURO STOXX 50**

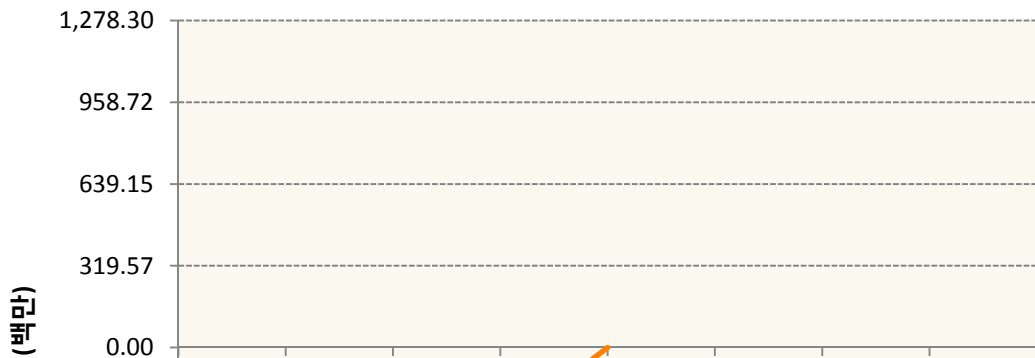


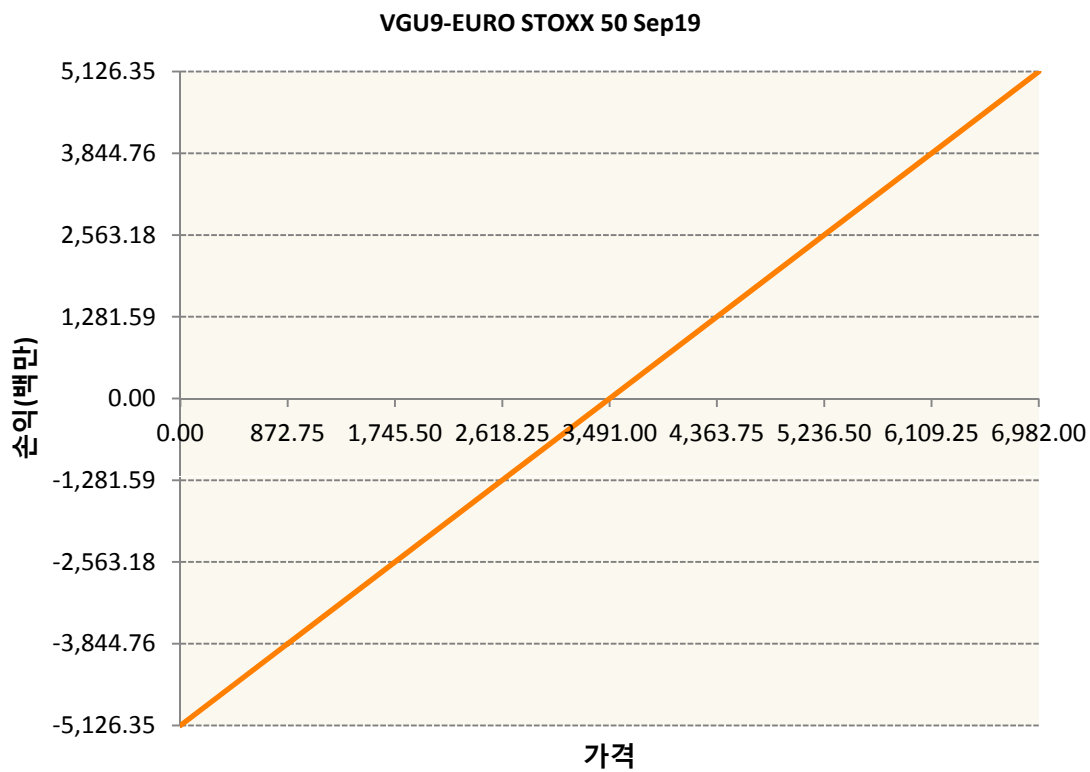
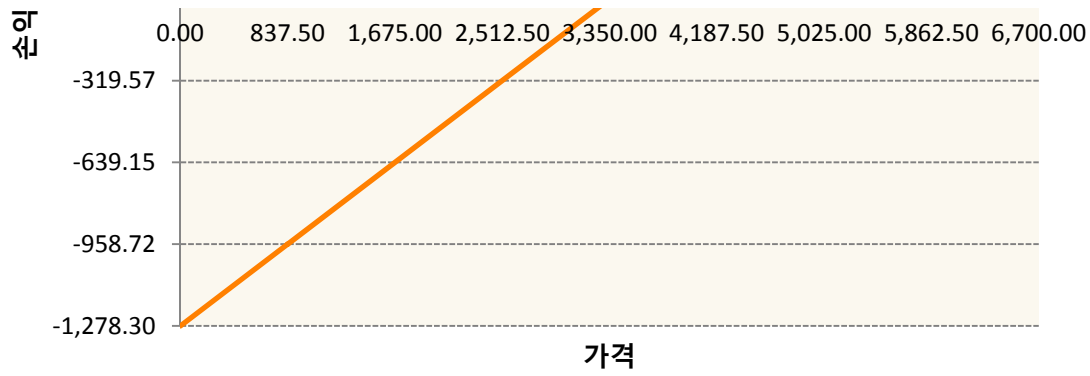


OESXU9-P3325-EURO STOXX 50



OESXU9-P3350-EURO STOXX 50





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	19
FX21019M0< KRW/EUR 27-09-19E	1,053
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	168
OESXU9-C3€ EURO STOXX 50	500
OESXU9-C3€ EURO STOXX 50	102
OESXU9-P3€ EURO STOXX 50	500
OESXU9-P3€ EURO STOXX 50	102
VGU9 EURO STOXX 50 Sep19	410

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

(단위:백만원)

2,129

공시일	2019-09-10
기준일	2019-09-09

## ETF스마트레버리지목표전환형8호

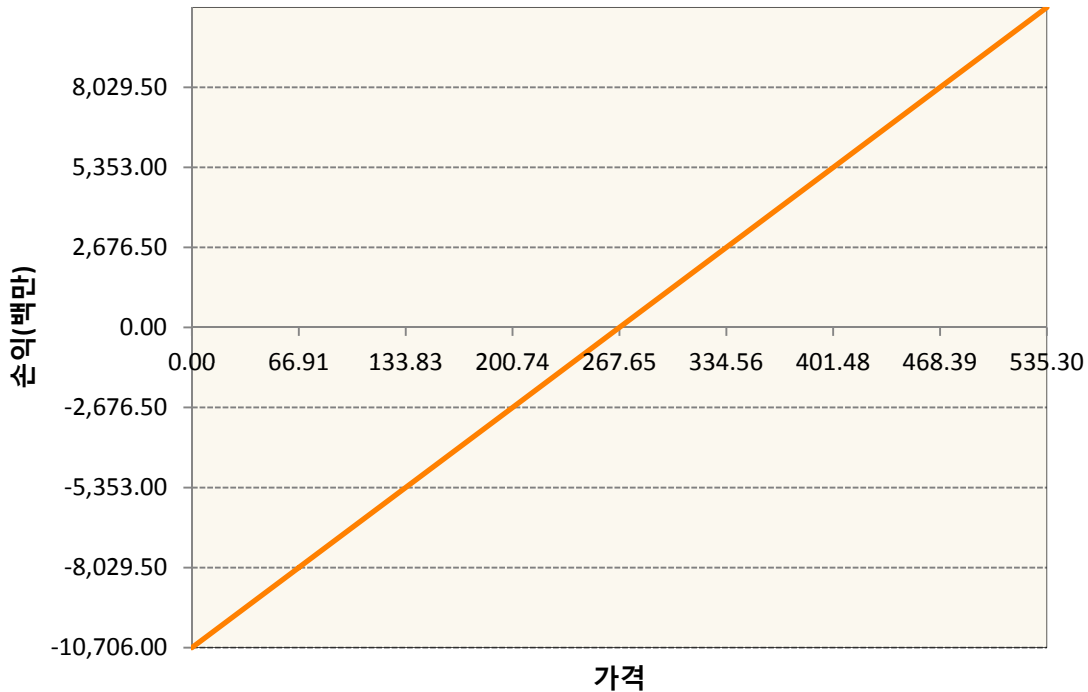
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

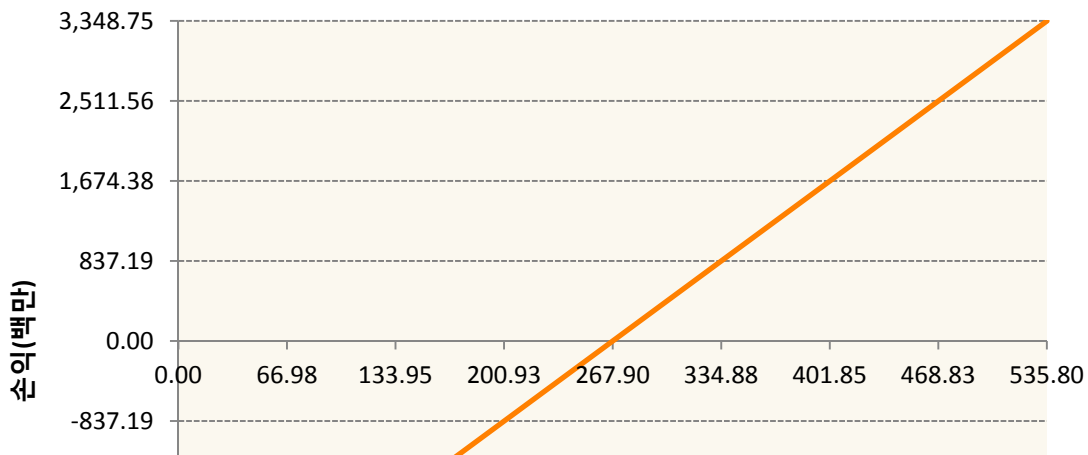
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3,345	3,343	3	장내
누계	유가증권	선물	17,400	3,346	14,055	장내

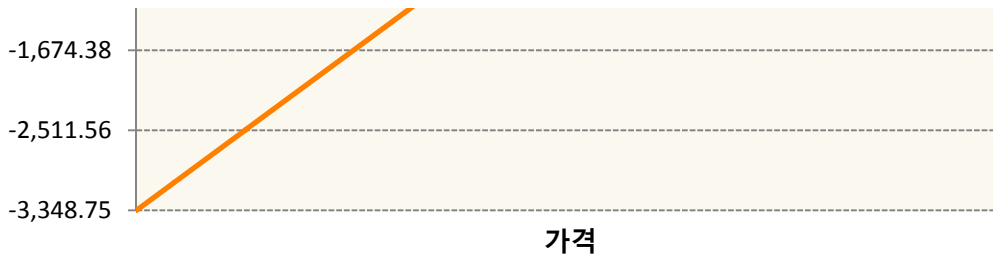
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물





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

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						856
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-856	-856	-856	-856	-856	-856	-856	
-5.33%	-570	-570	-570	-570	-570	-570	-570	
-2.67%	-285	-285	-285	-285	-285	-285	-285	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	285	285	285	285	285	285	285	
5.33%	570	570	570	570	570	570	570	
8.00%	856	856	856	856	856	856	856	
KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						267
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-267	-267	-267	-267	-267	-267	-267	
-5.33%	-178	-178	-178	-178	-178	-178	-178	
-2.67%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	89	89	89	89	89	89	89	
5.33%	178	178	178	178	178	178	178	
8.00%	267	267	267	267	267	267	267	

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

**970**

공시일	2019-09-10
기준일	2019-09-09

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

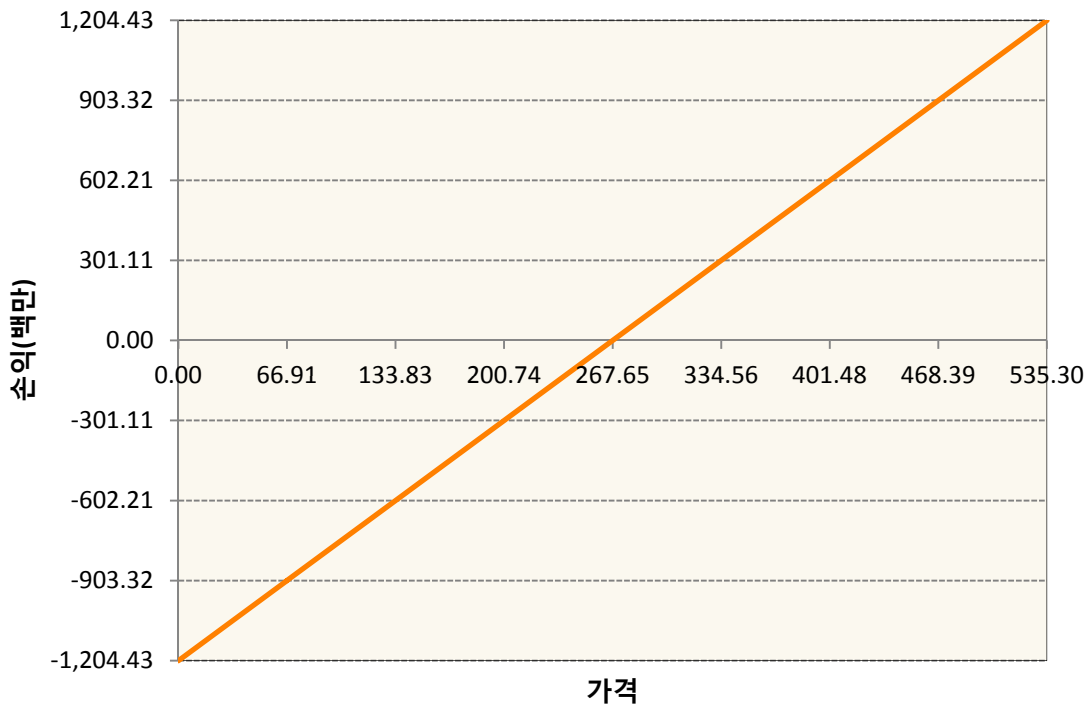
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

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

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						96
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96	
-5.33%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64	
-2.67%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	32	32	32	32	32	32	32	
5.33%	64	64	64	64	64	64	64	
8.00%	96	96	96	96	96	96	96	

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

(단위:백만원)

83



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

(단위:백만원)

129

공시일	2019-09-10
기준일	2019-09-09

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

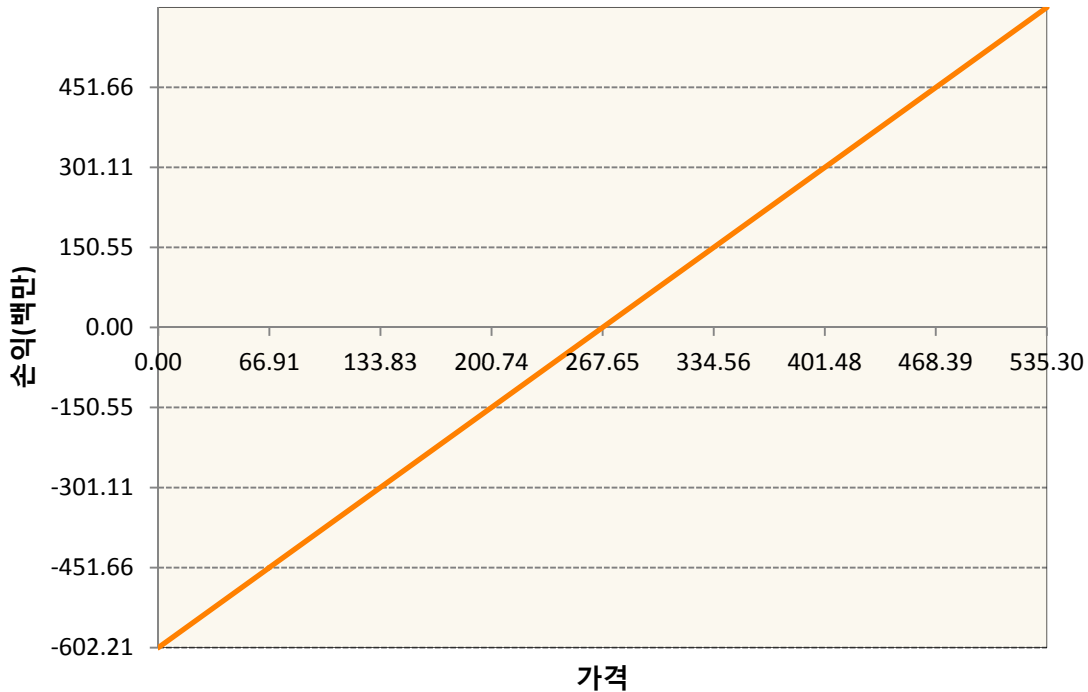
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	602	0	602	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						48
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48	
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
-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%	32	32	32	32	32	32	32	
8.00%	48	48	48	48	48	48	48	

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

(단위:백만원)

42

공시일	2019-09-10
기준일	2019-09-09

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

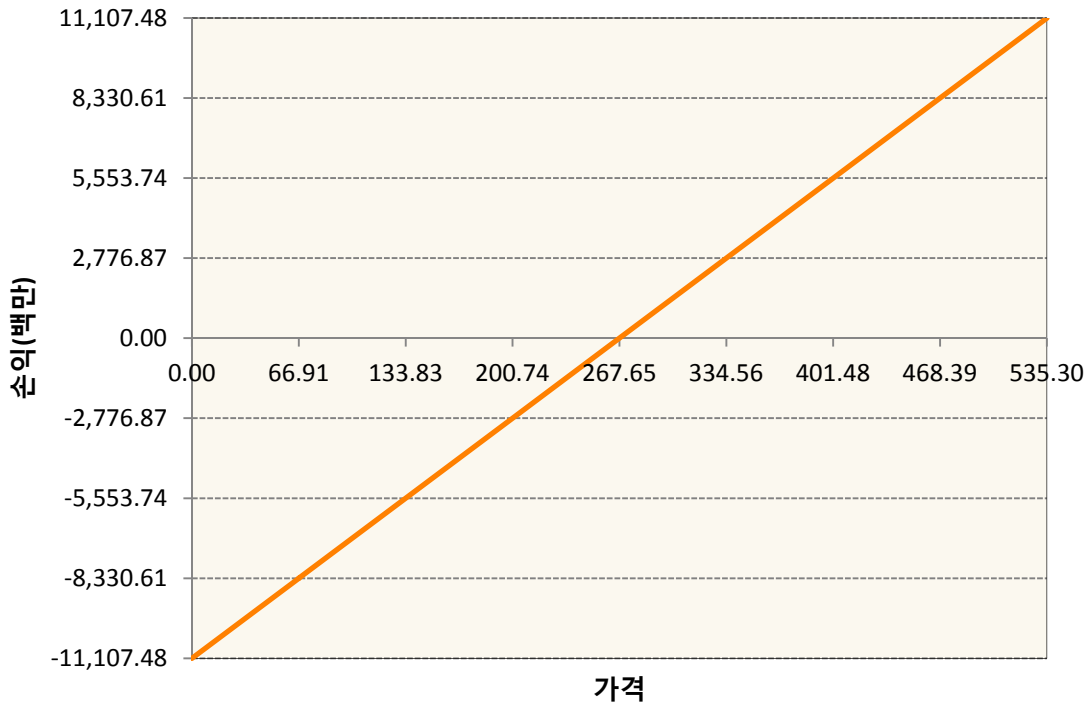
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

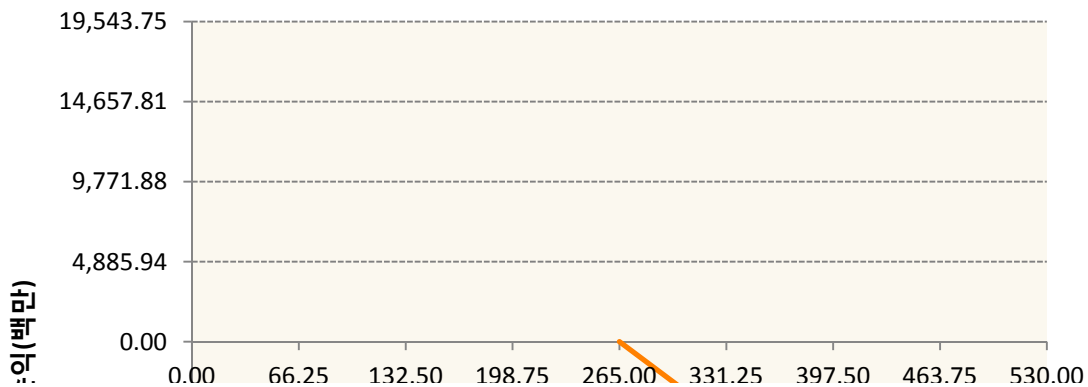
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,107	0	11,107	장내
누계	유가증권	옵션	3,596	19,678	-16,081	장내

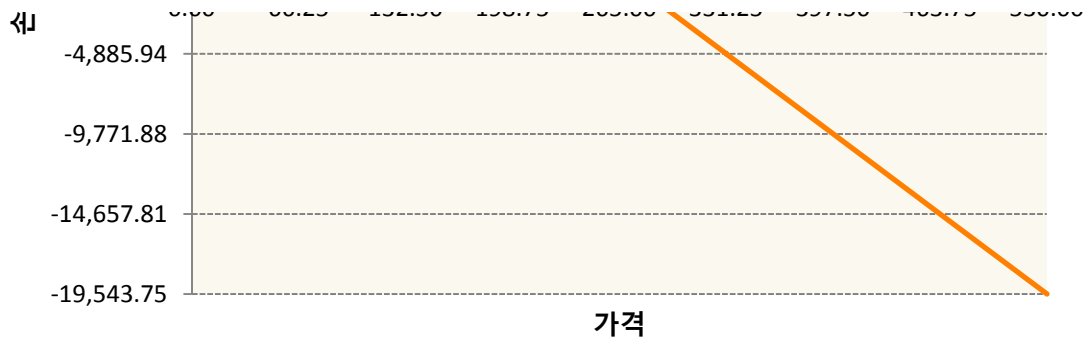
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

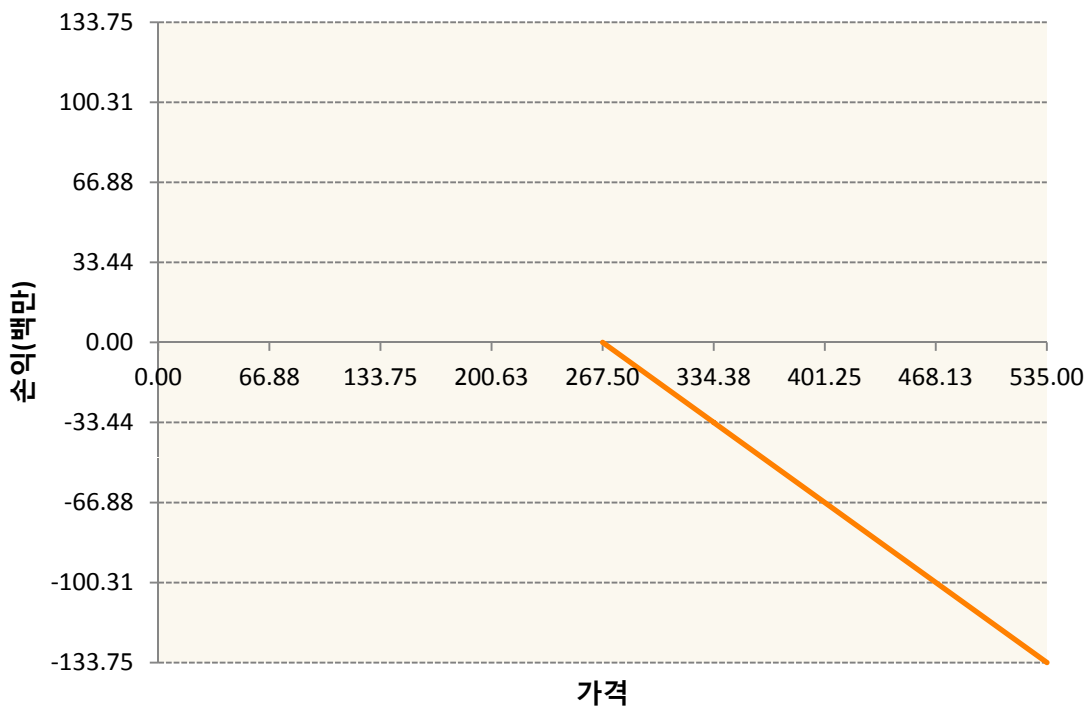


KR4201P92658-2019-09 콜265

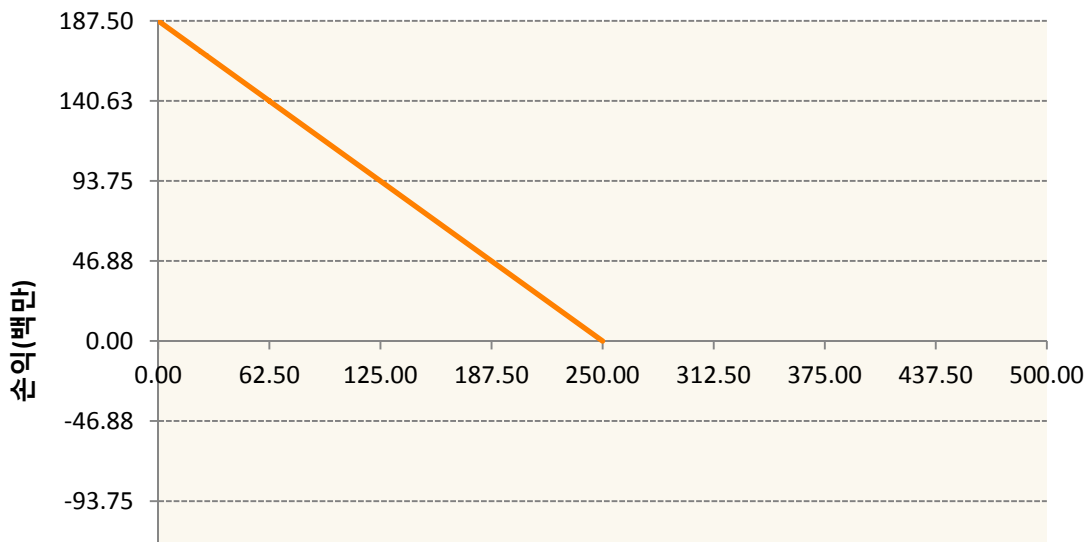


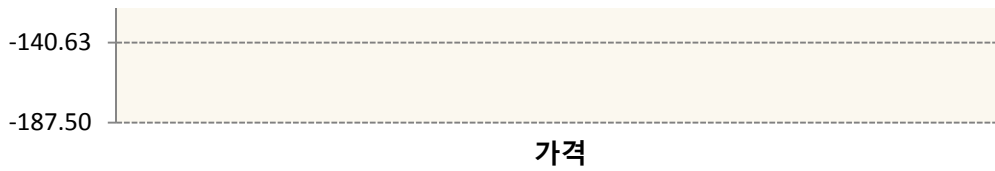


KR4201P92674-2019-09 콜267.5

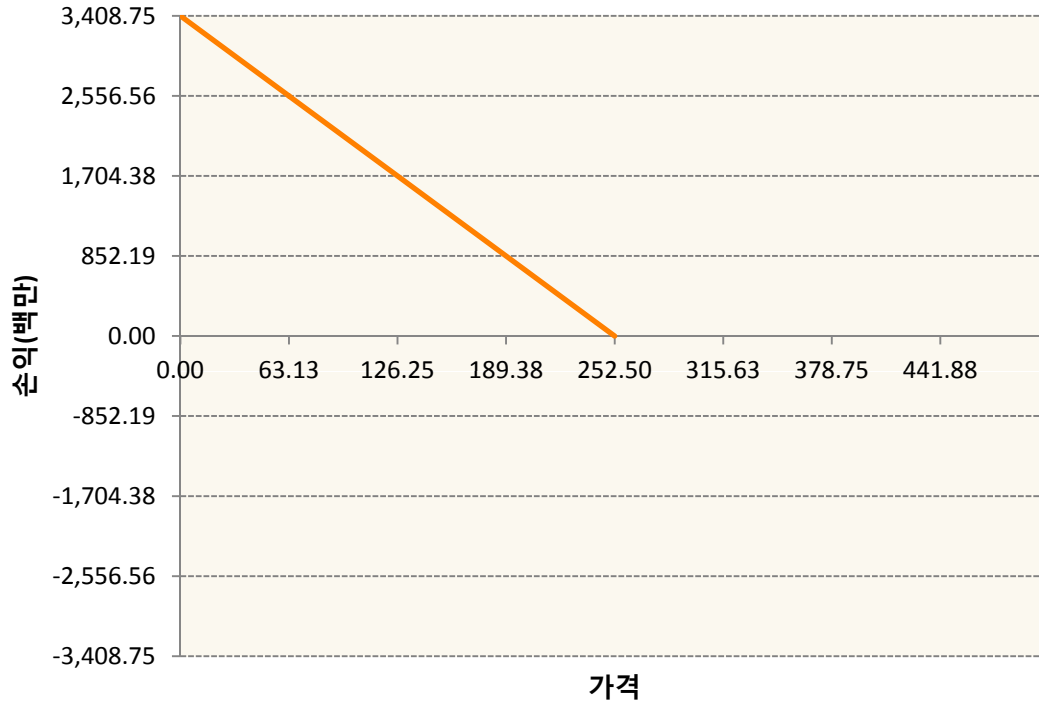


KR4301P92508-2019-09 풋250





KR4301P92524-2019-09 풋252.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						888
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-888	-888	-888	-888	-888	-888	-888	
-5.33%	-592	-592	-592	-592	-592	-592	-592	
-2.67%	-296	-296	-296	-296	-296	-296	-296	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	296	296	296	296	296	296	296	
5.33%	592	592	592	592	592	592	592	
8.00%	888	888	888	888	888	888	888	
KR4201P92658		2019-09 콜265						1,495
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	259	259	259	259	259	259	258	
-5.33%	259	258	258	257	256	255	253	
-2.67%	243	236	229	221	212	203	193	

0%	34	23	12	0	-12	-24	-36
2.67%	-444	-445	-446	-449	-452	-456	-460
5.33%	-969	-969	-969	-969	-969	-969	-970
8.00%	-1,495	-1,495	-1,495	-1,495	-1,495	-1,495	-1,495

KR4201P92674                      2019-09 콜267.5                      10

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	1	1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10

KR4301P92508                      2019-09 풋250                      3

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3	3	3	3	3	3	3
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-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

KR4301P92524                      2019-09 풋252.5                      88

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	88	88	88	88	88	88	88
-5.33%	8	9	10	11	13	14	15
-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

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

(단위:백만원)

**2,771**

공시일	2019-09-10
기준일	2019-09-09

## 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	80,239	0	80,239	

### 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	2019-09-10
기준일	2019-09-09

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,193	0	1,193	
누계	유가증권	수익증권	103,629	0	103,629	

### 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	2019-09-10
기준일	2019-09-09

## 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	472,629	0	472,629	
누계	통화	선도	0	460,617	-460,617	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		1,718
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		2,100
FX21019N01 KRW/USD 16-09-19E		134
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		286
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		3,150
FX21019Q01 KRW/USD 19-09-19E		2,138
FX21019Q01 KRW/USD 16-09-19E		95
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,913
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,531
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,615
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,968
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		954
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		954
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E		954
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E		1,718
FX21019Q04 KRW/USD 30-09-19E		191
FX21019Q04 KRW/USD 24-09-19E		2,100
FX21019Q04 KRW/USD 24-09-19E		2,672
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		1,374
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E		2,042
FX21019U01 KRW/USD 10-10-19E		286

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

(단위:백만원)

12,131

공시일	2019-09-10
기준일	2019-09-09

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

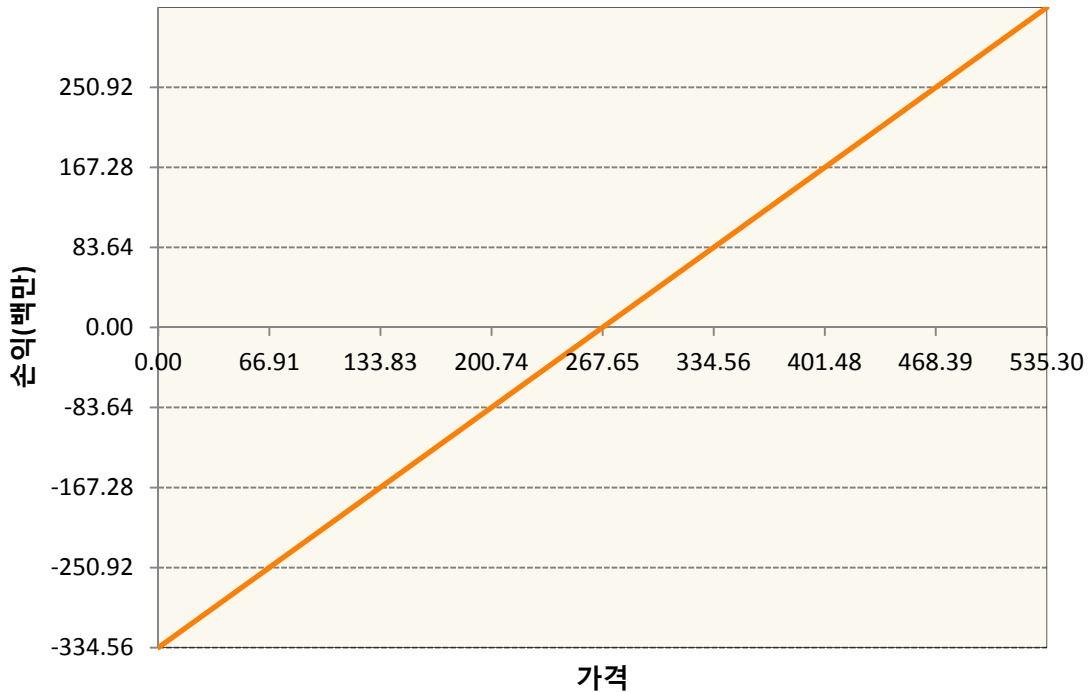
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

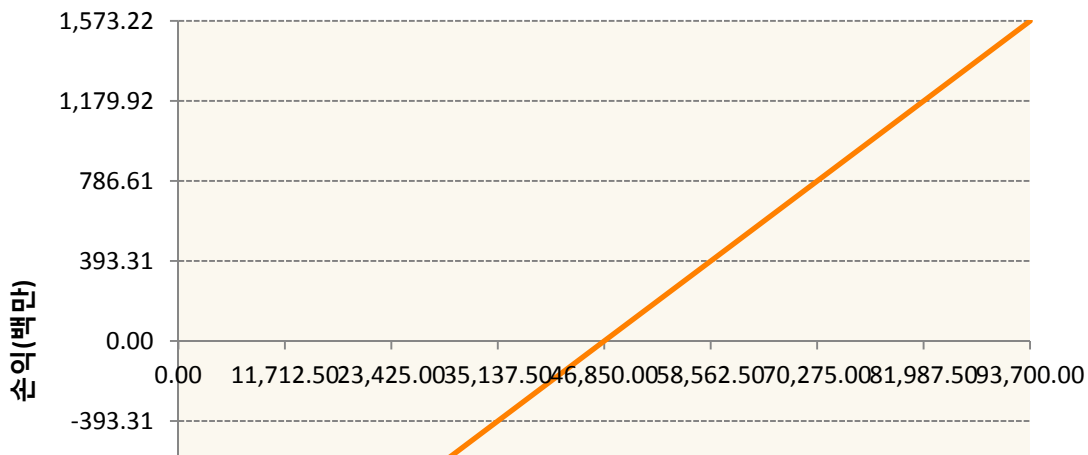
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,908	0	1,908	장내

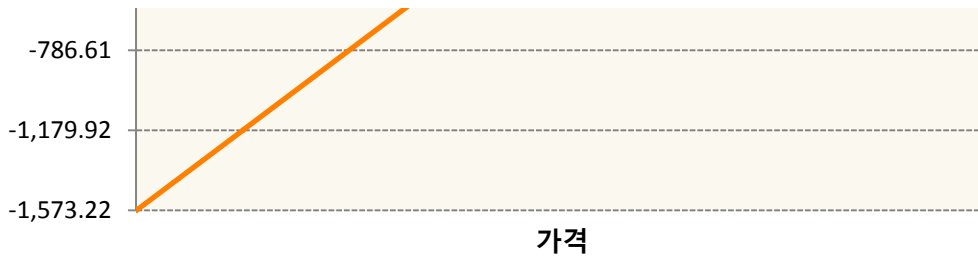
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P90000-2019-09 삼성전자개별선물





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

KR4101P90001		2019-09 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	
KR4111P90000		2019-09 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	2019-09-10
기준일	2019-09-09

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

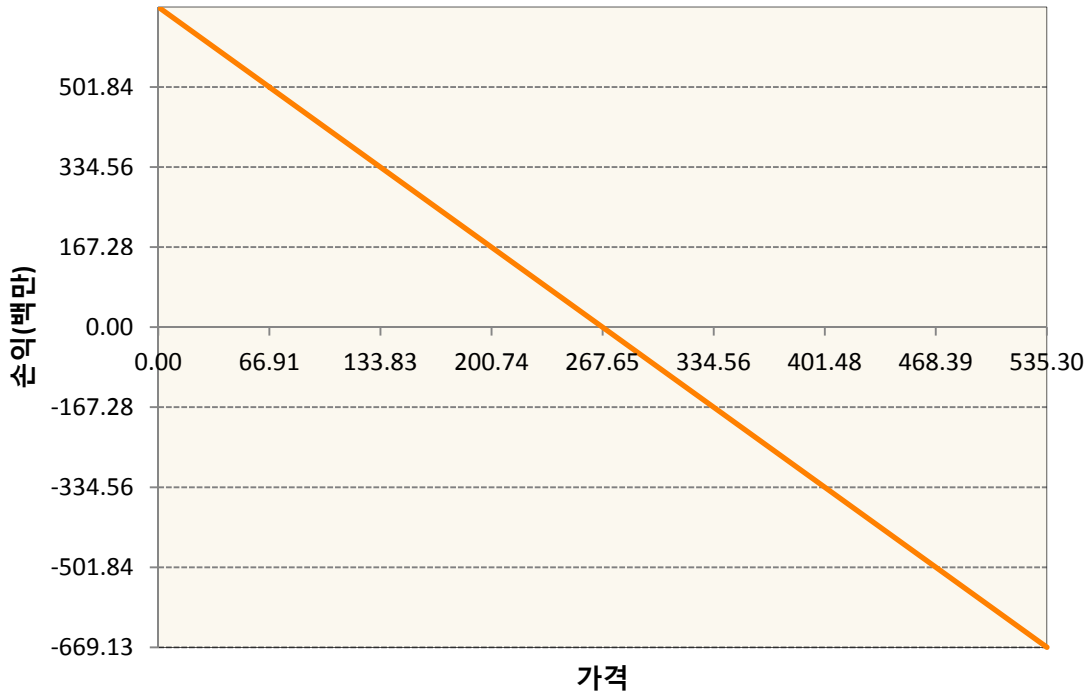
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

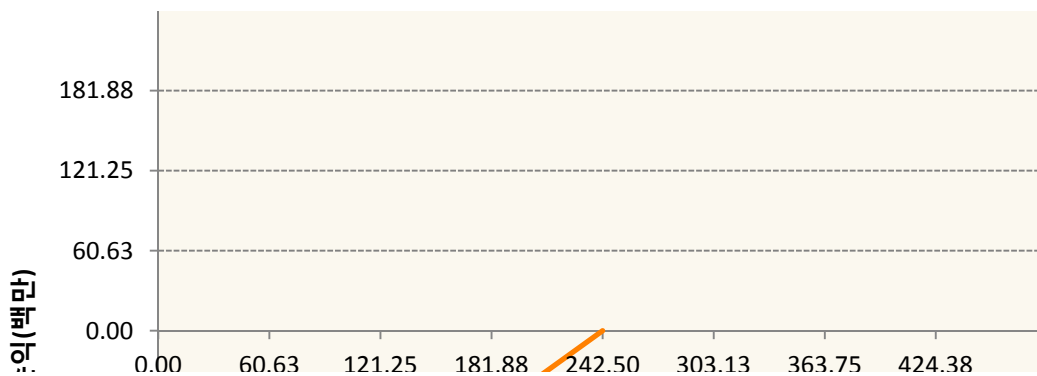
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	669	-669	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,611	-3,611	장내

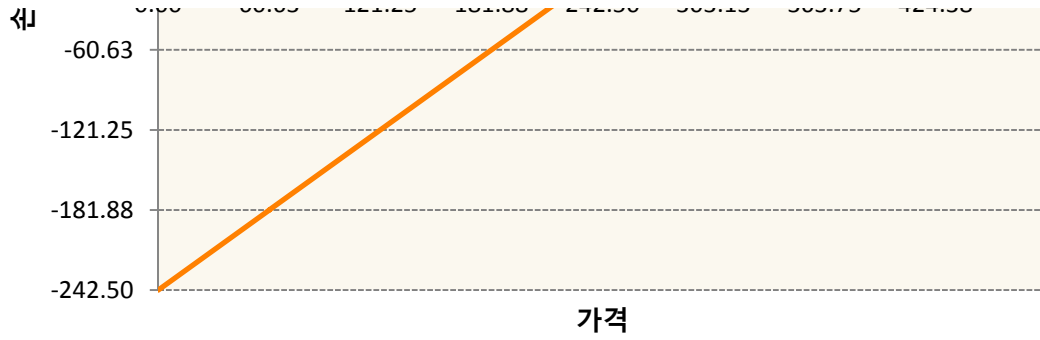
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

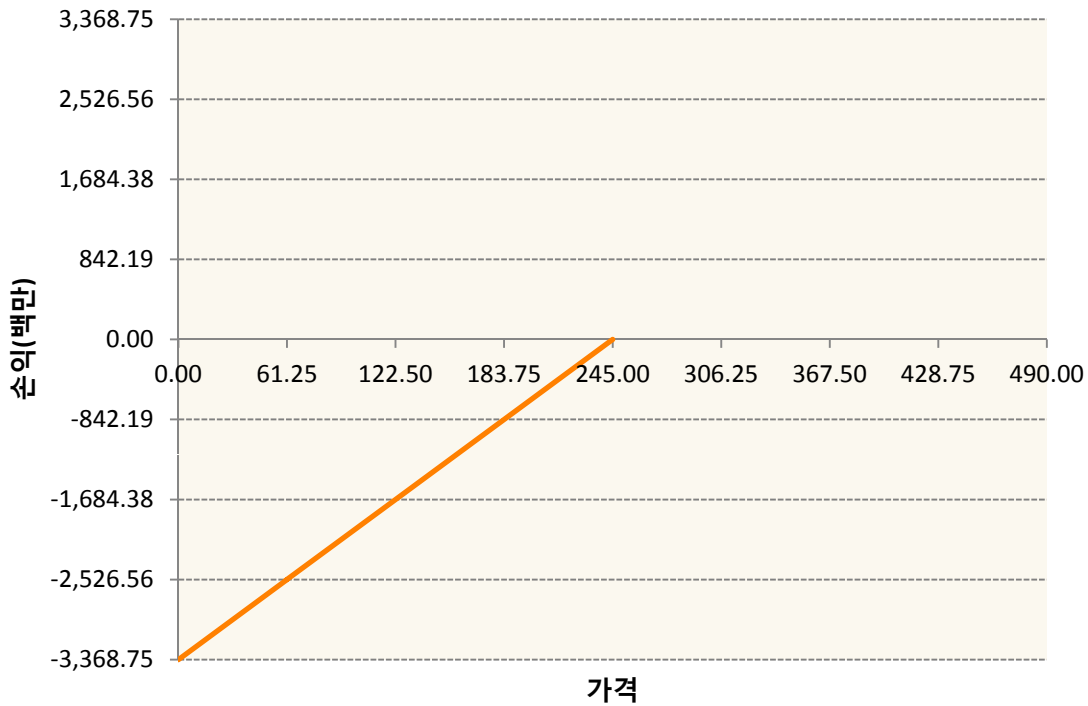


KR4301P92425-2019-09 풋242.5





KR4301P92458-2019-09 풋245



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						53
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	53	53	53	53	53	53	53	
-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%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53	
KR4301P92425		2019-09 풋242.5						0
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-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

13

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6	-7	-8	-9	-10	-11	-13
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-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

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

(단위:백만원)

46

공시일	2019-09-10
기준일	2019-09-09

## 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	19,342	0	19,342	
누계	통화	선도	0	18,969	-18,969	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

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

(단위:백만원)

500
-----

공시일	2019-09-10
기준일	2019-09-09

## 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	111	-20	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	18
2.55E+11 E1VFN30 VN ETF	12
FX21019N01 KRW/EUR 25-10-19E	4
FX21019Q00 KRW/EUR 25-10-19E	3
FX21019Q03 EUR/KRW 25-10-19E	7
FX21019U00 KRW/EUR 22-11-19E	2

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

(단위:백만원)

36
----

공시일	2019-09-10
기준일	2019-09-09

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

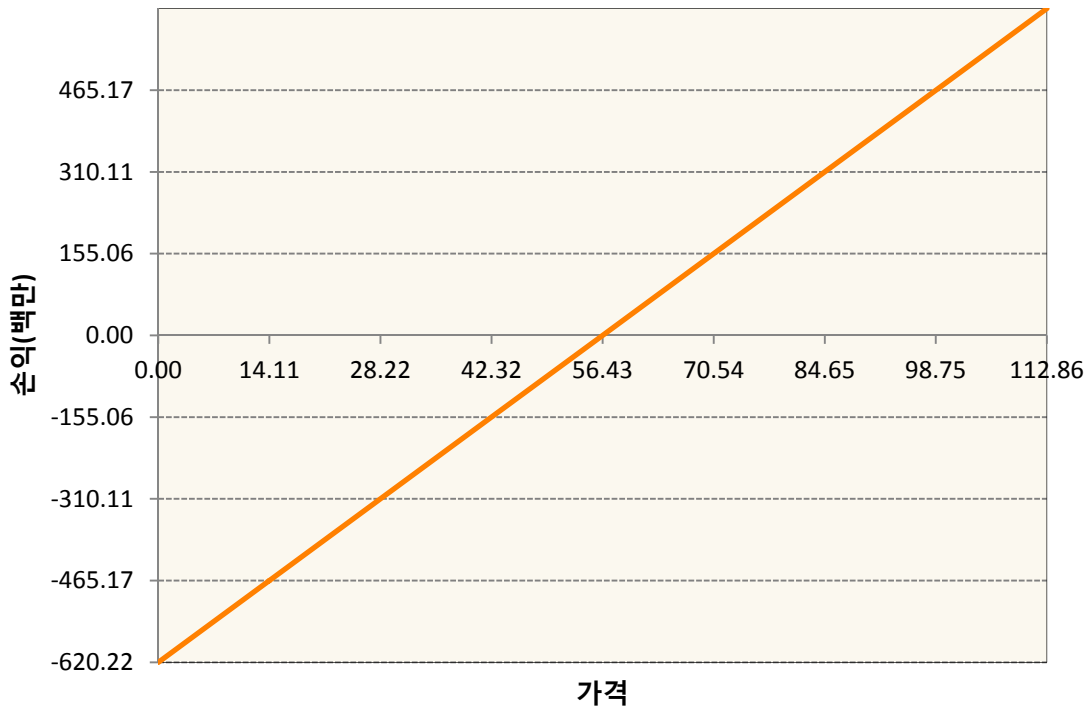
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

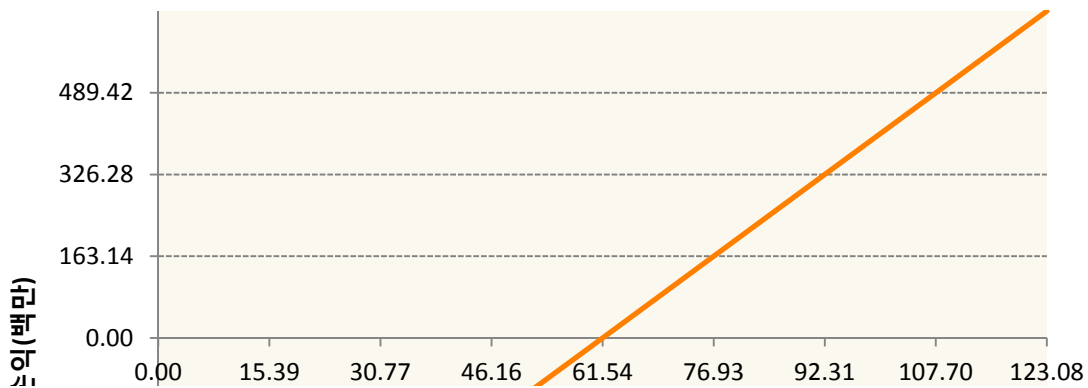
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,344	298	2,047	
누계	유가증권	선물	195	0	195	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19

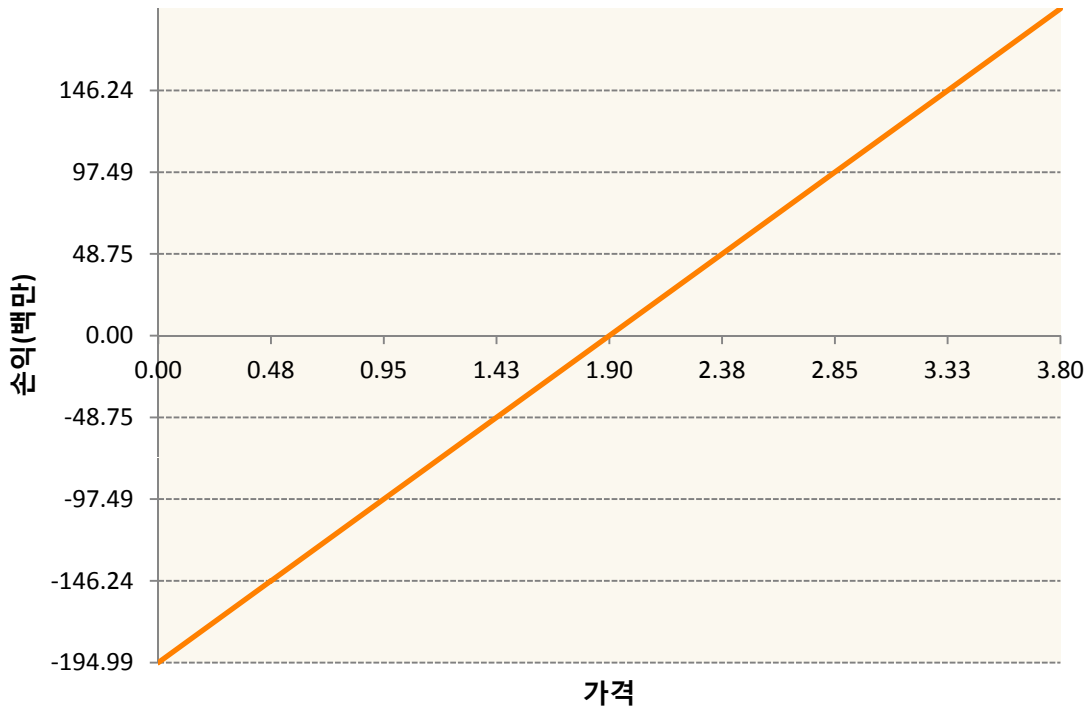


COX9-BRENT CRUDE FUTR Nov19

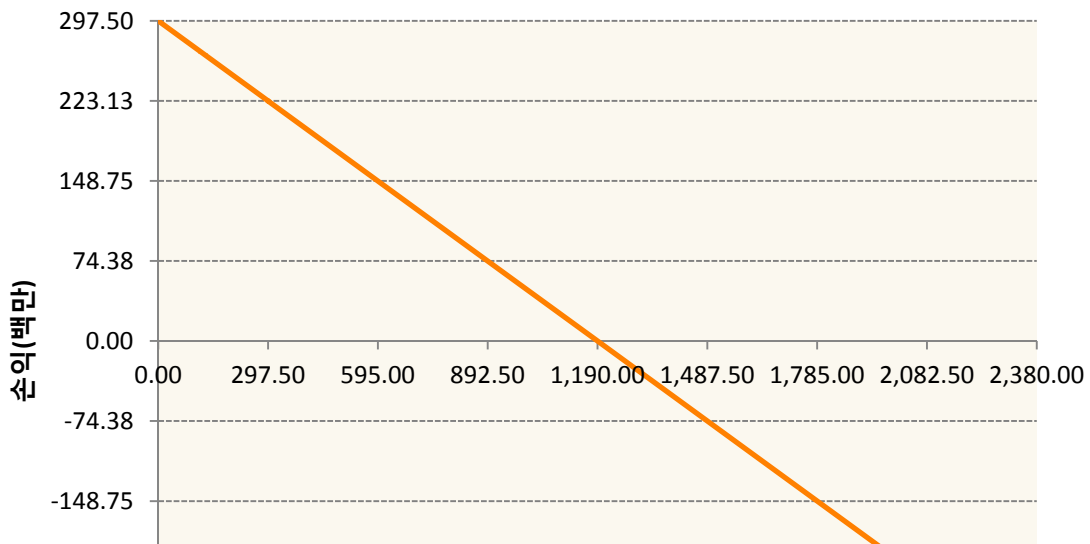


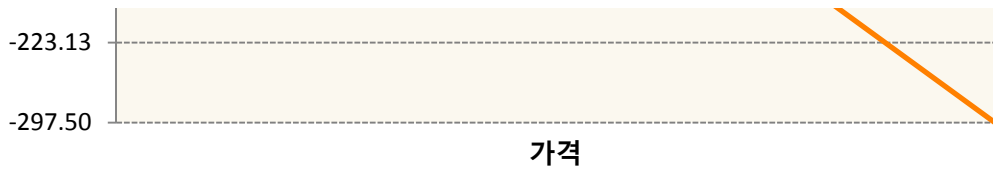


HOX9-Heating Oil

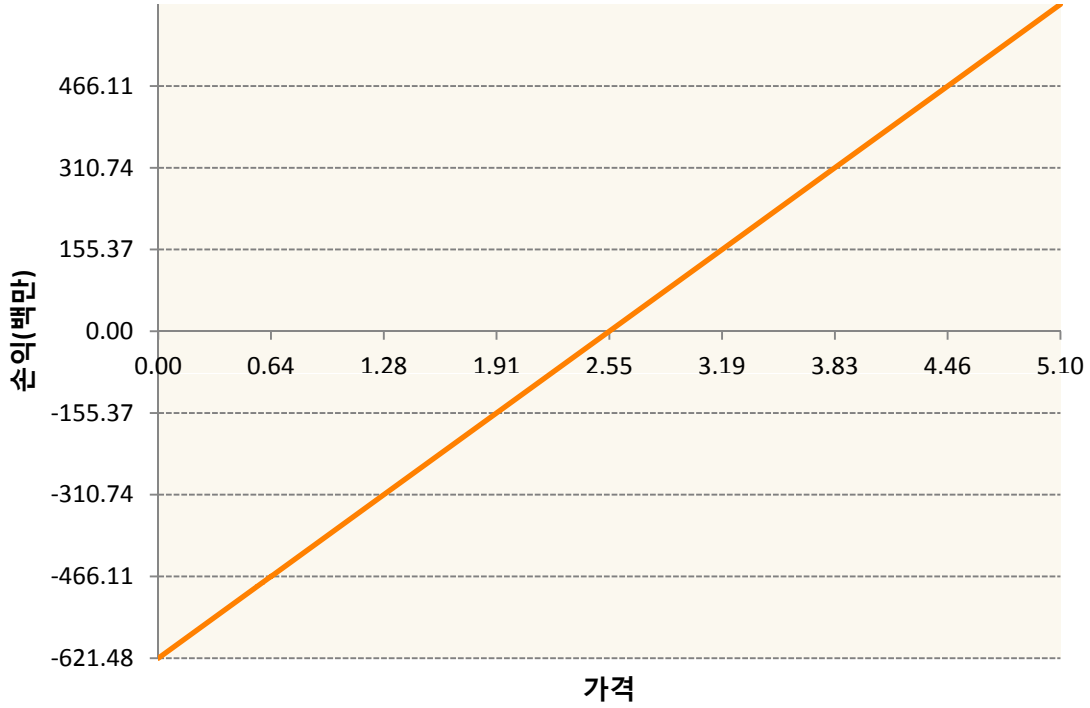


KR4175PA0005-2019-10 달러선물

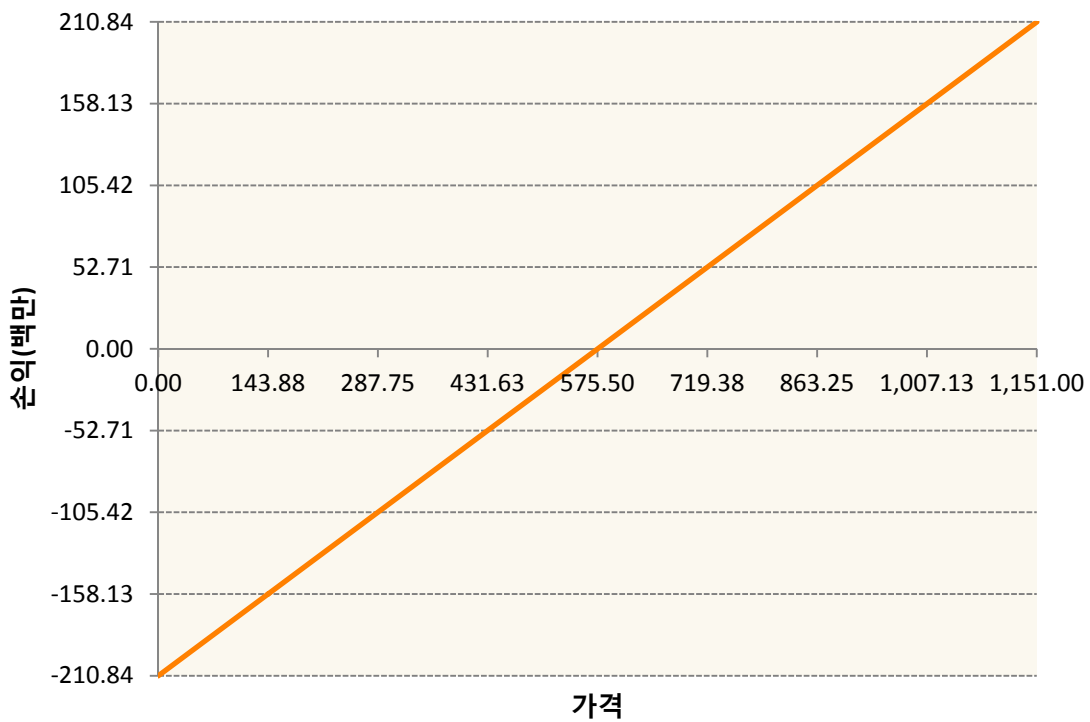




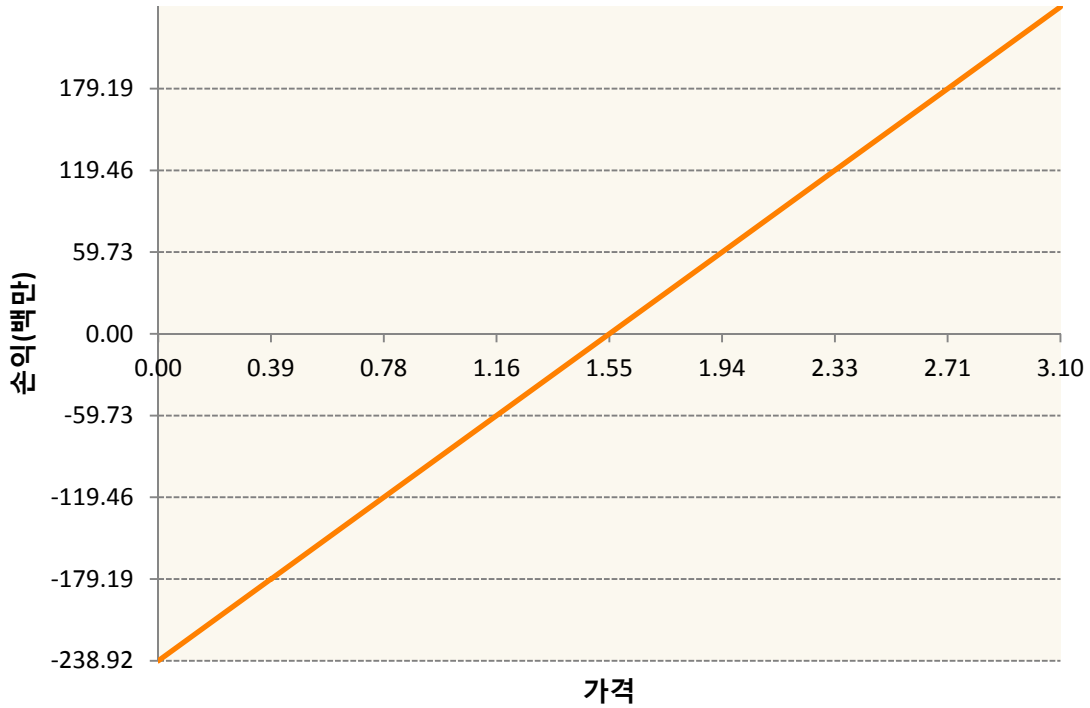
NGX19-NATURAL GAS FUTR Nov19



QSX9-Low Su Gasoil G Nov19



**XBX9-GASOLINE RBOB FUT Nov19**



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

CLX9	WTI CRUDE FUTURE Nov19	50
COX9	BRENT CRUDE FUTR Nov19	52
HOX9	Heating Oil	16
KR4175PA00	2019-10 달러선물	24
NGX19	NATURAL GAS FUTR Nov19	50
QSX9	Low Su Gasoil G Nov19	17
XBX9	GASOLINE RBOB FUT Nov19	19

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

(단위:백만원)

**401**

공시일	2019-09-10
기준일	2019-09-09

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

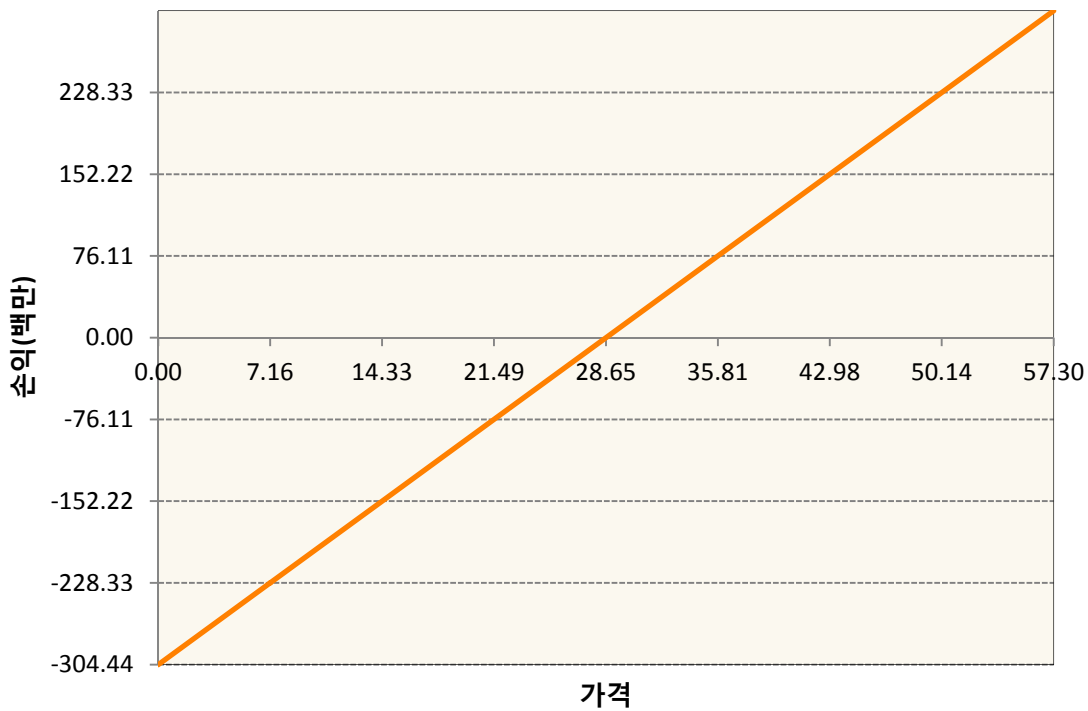
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

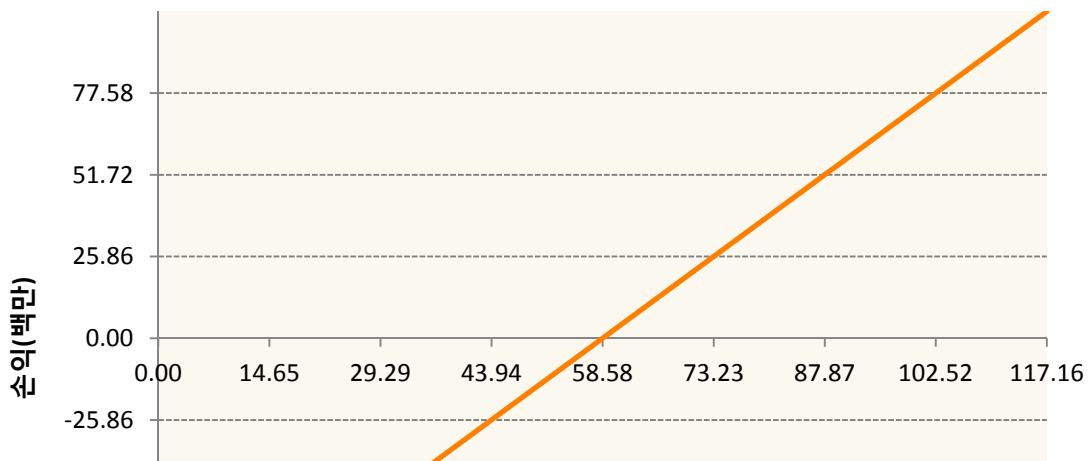
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,683	95	2,588	

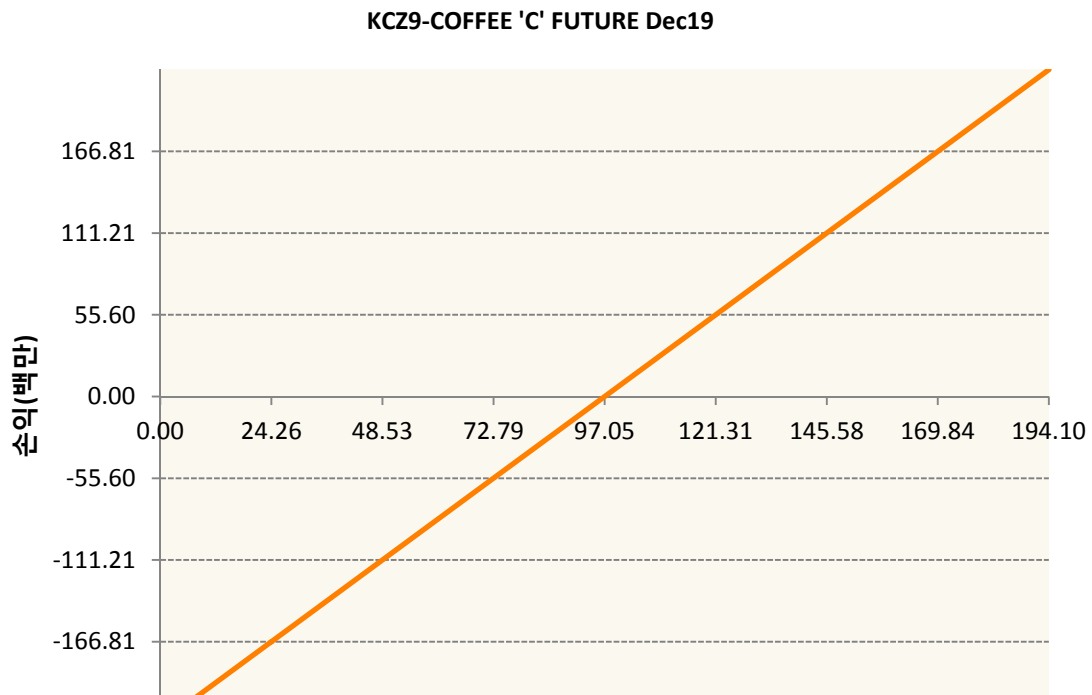
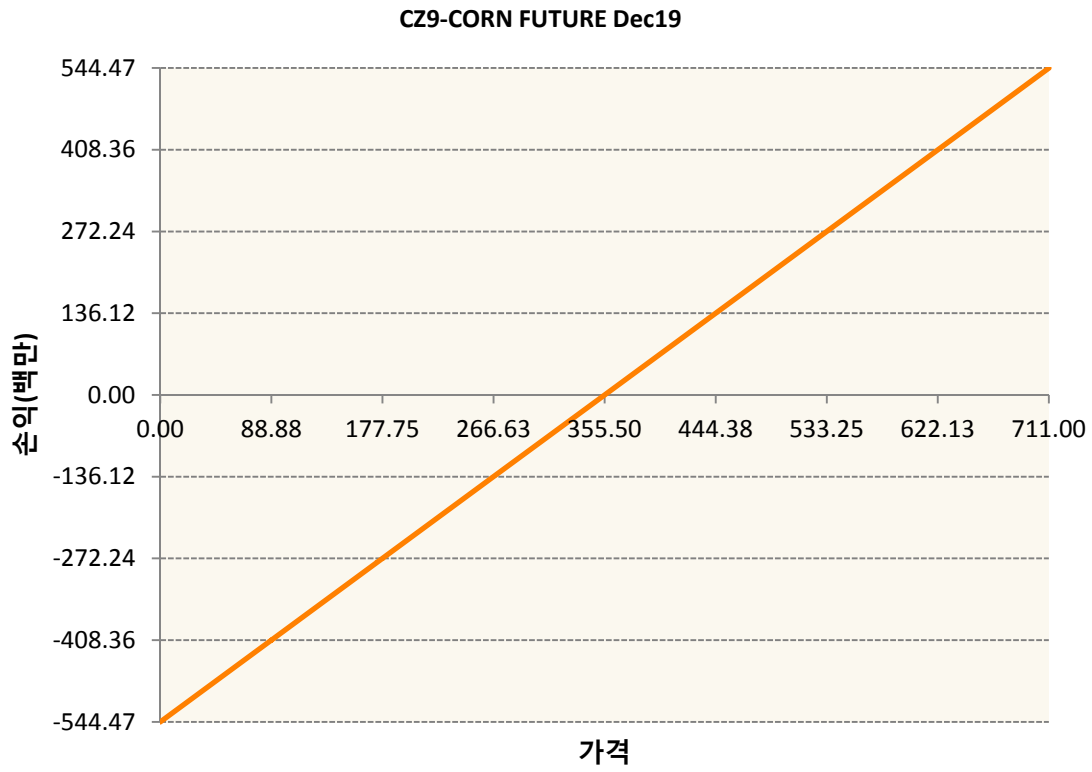
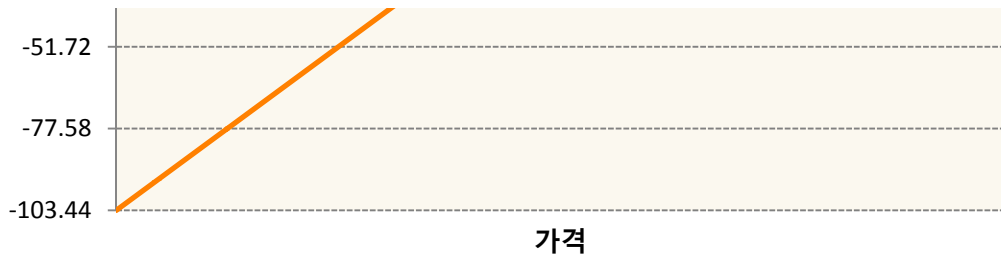
### 2. 만기시점의 손익구조

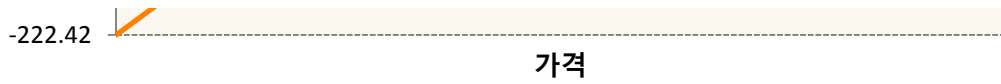
BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19



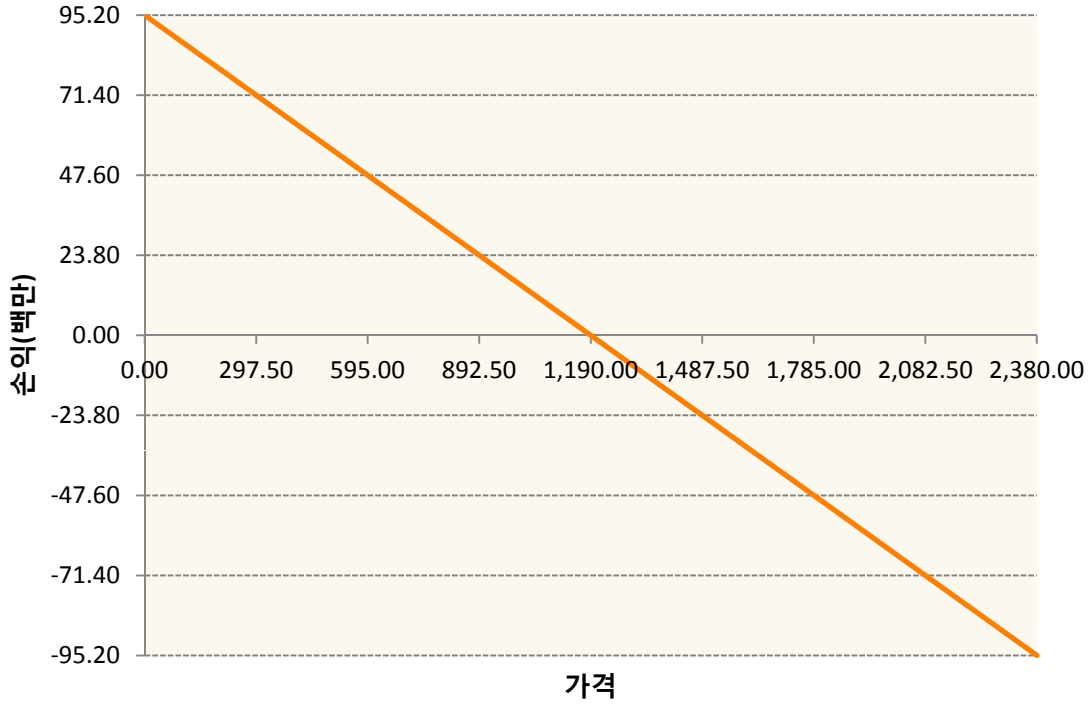
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



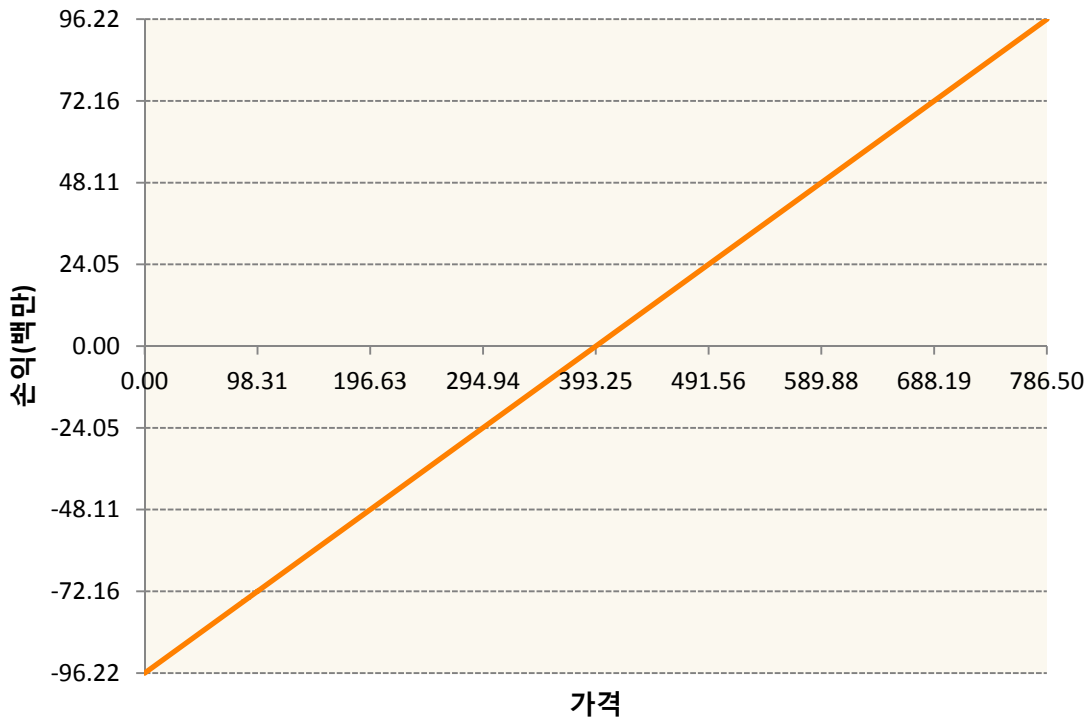




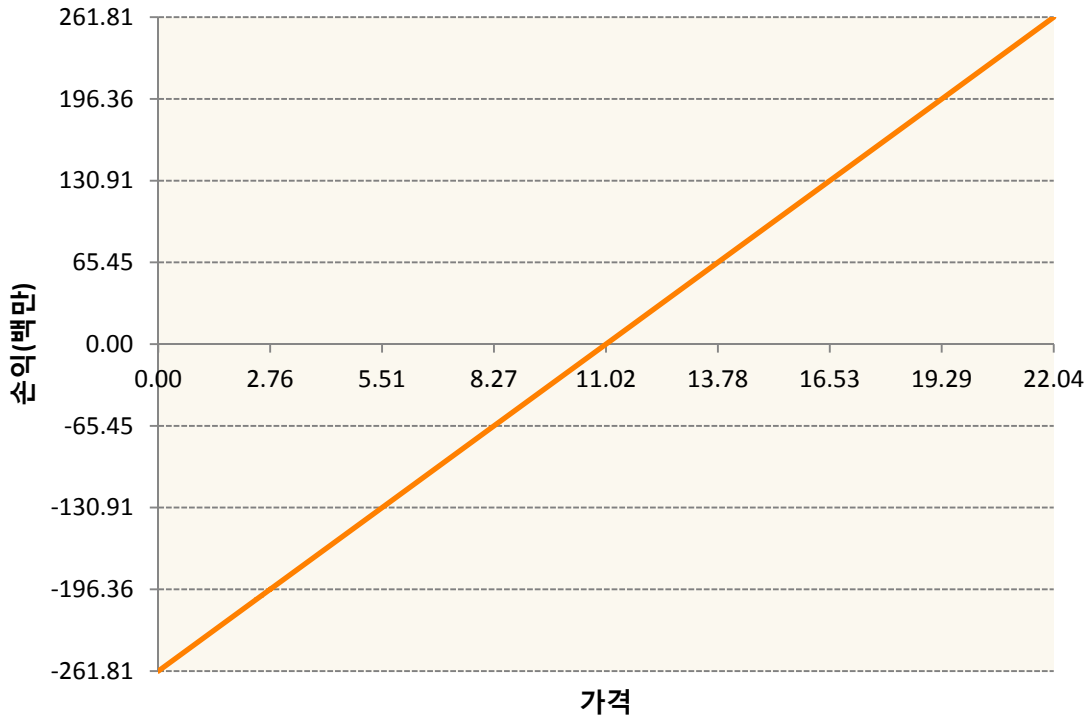
**KR4175PA0005-2019-10 달러선물**



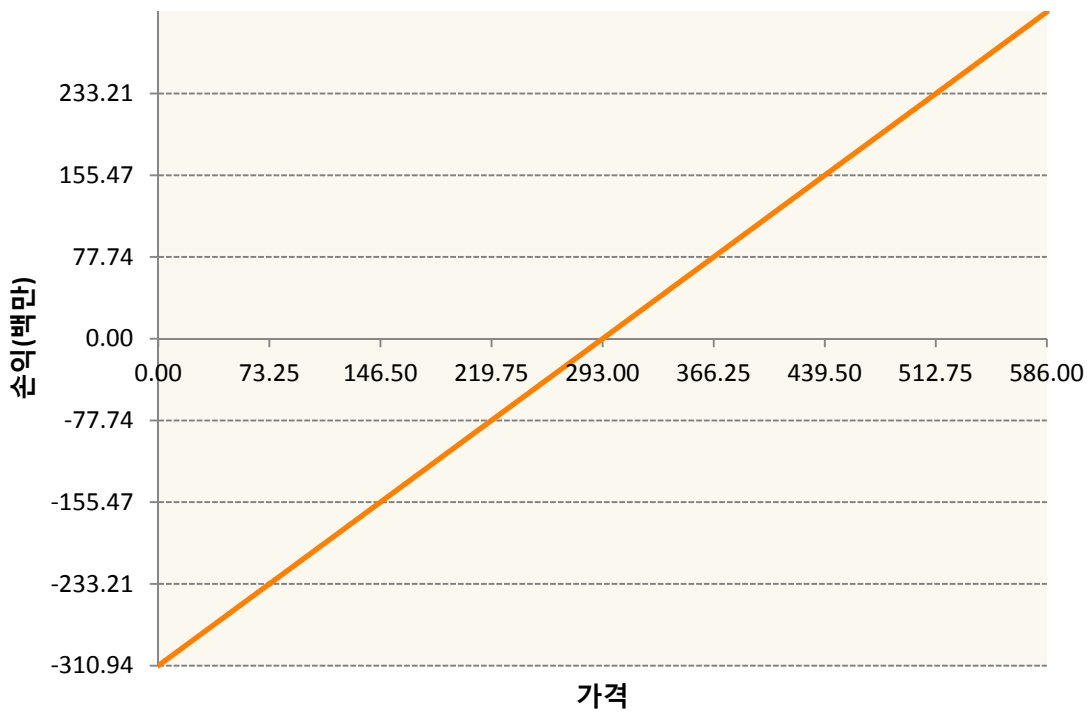
**KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19**



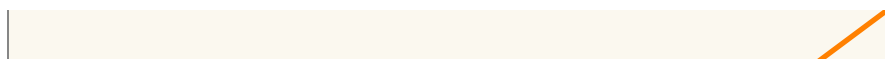
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

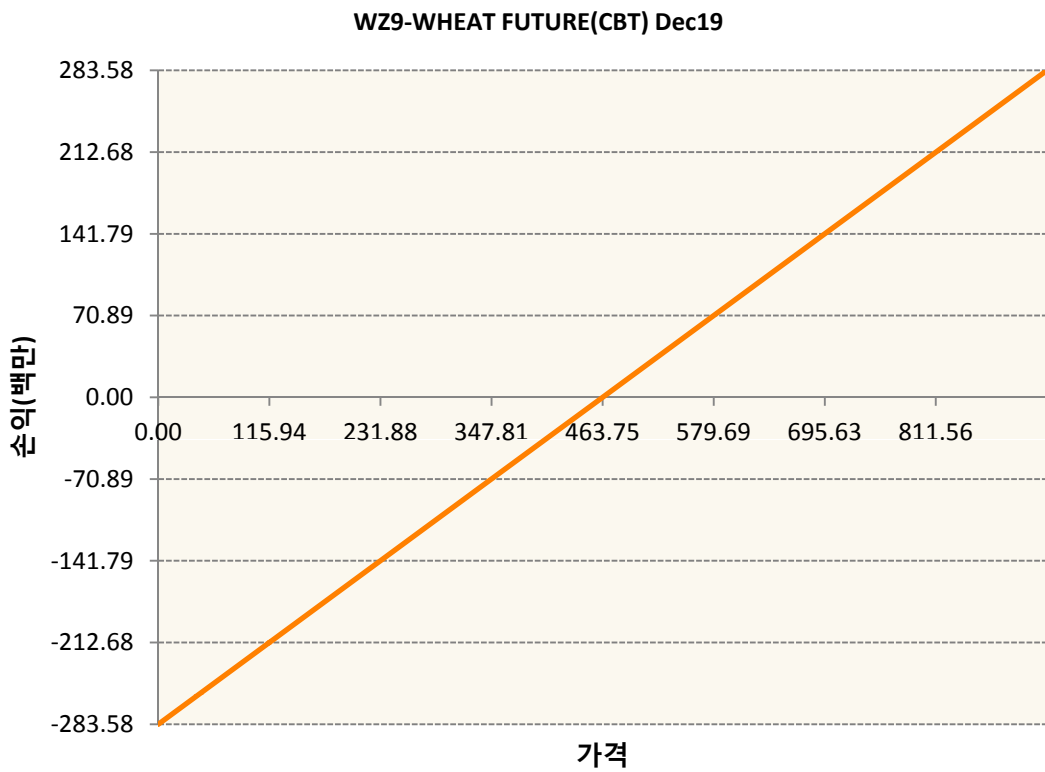
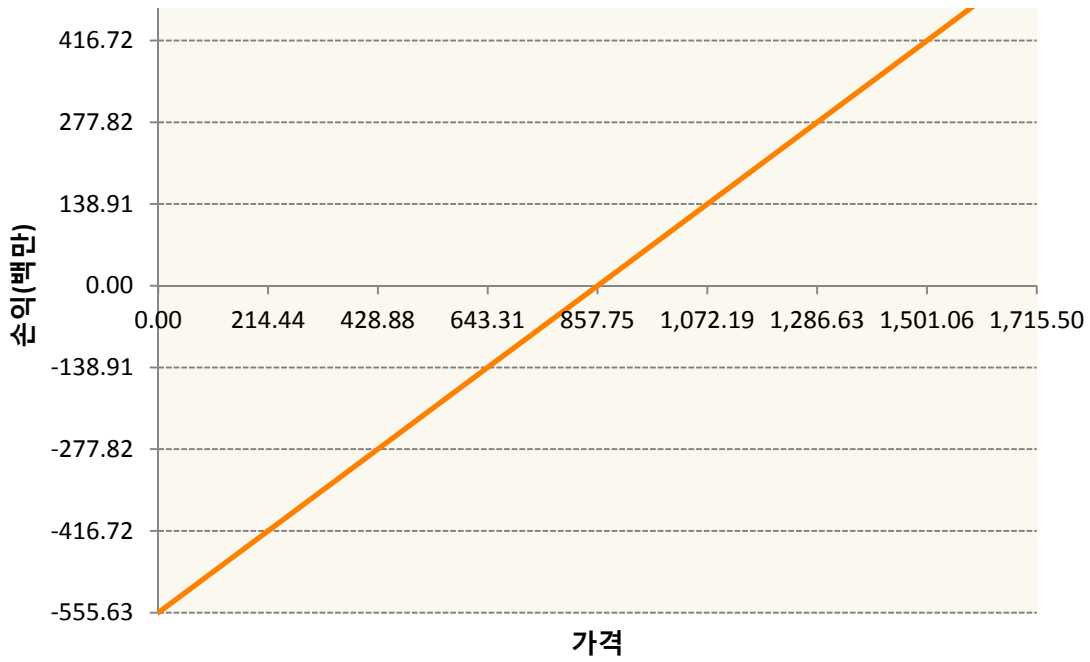


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	24
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	8
CZ9	CORN FUTURE Dec19	44
KCZ9	COFFEE 'C' FUTURE Dec19	18
KR4175PA00	2019-10 달러선물	8

KWZ9	KC HRW WHEAT FUT Dec19	8
SBV9	SUGAR #11 (WORLD) Oct19	21
SMZ9	SOYBEAN MEAL FUTR Dec19	25
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	44
WZ9	WHEAT FUTURE(CBT) Dec19	23

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

(단위:백만원)

**236**