

공시일	2019-09-20
기준일	2019-09-19

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	2019-09-20
기준일	2019-09-19

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	2019-09-20
기준일	2019-09-19

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)	393
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	144

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

855

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-20
기준일	2019-09-19

유로인덱스모(주식-파생형)

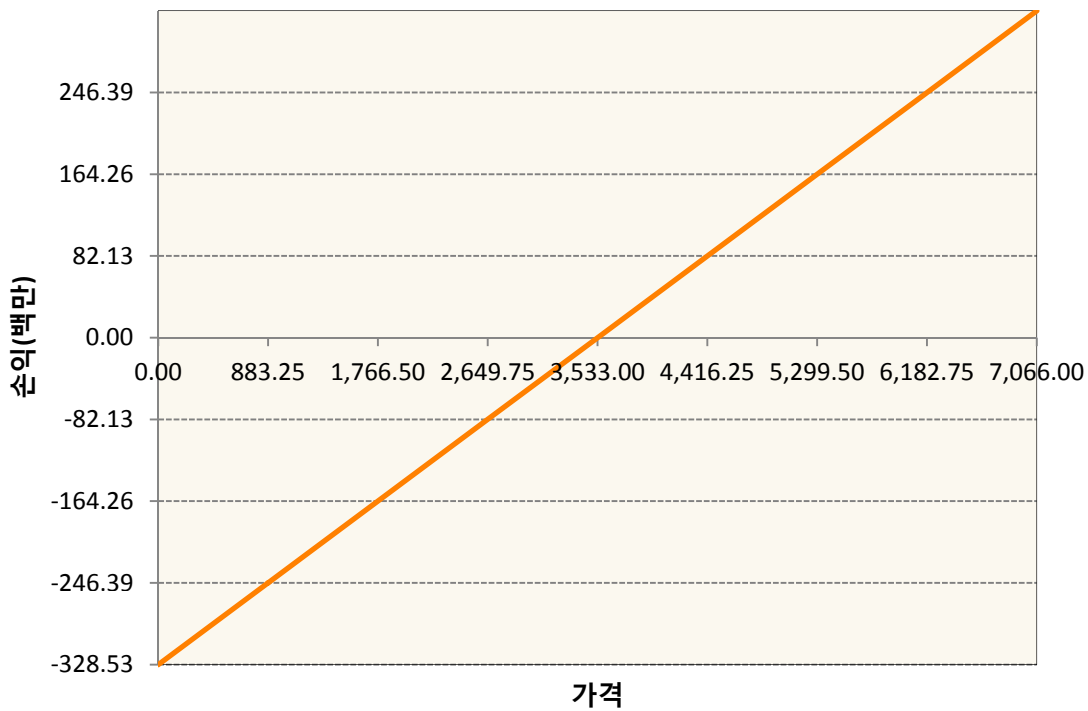
1. 계약금액

(단위:백만원)

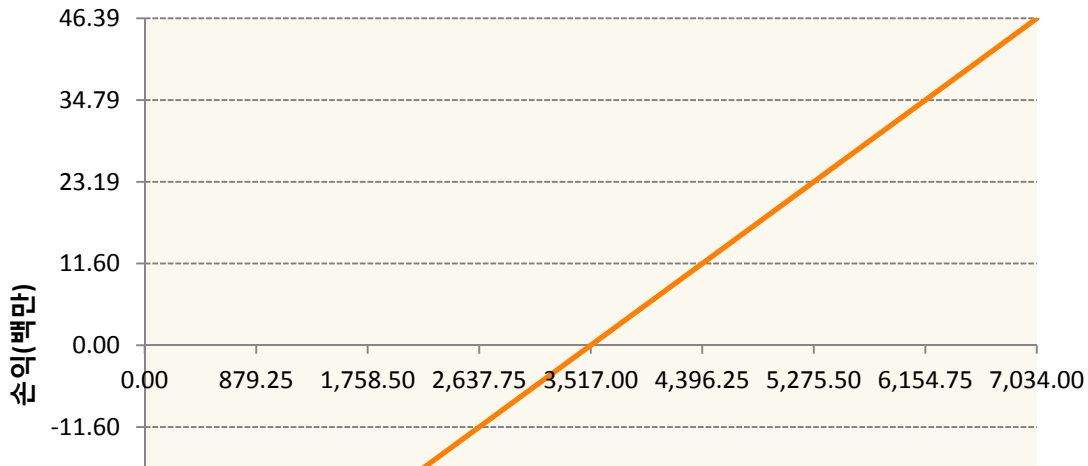
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	375	0	375	

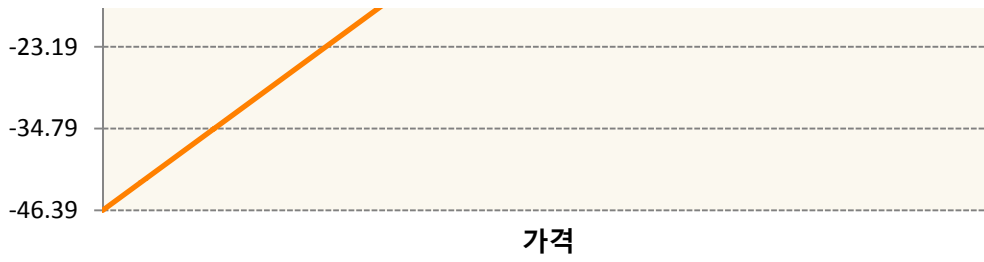
2. 만기시점의 손익구조

VGU9-EURO STOXX 50 Sep19



VGZ9-EURO STOXX 50 Dec19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

VGU9	EURO STOXX 50 Sep19	26
VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	4

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

21

공시일	2019-09-20
기준일	2019-09-19

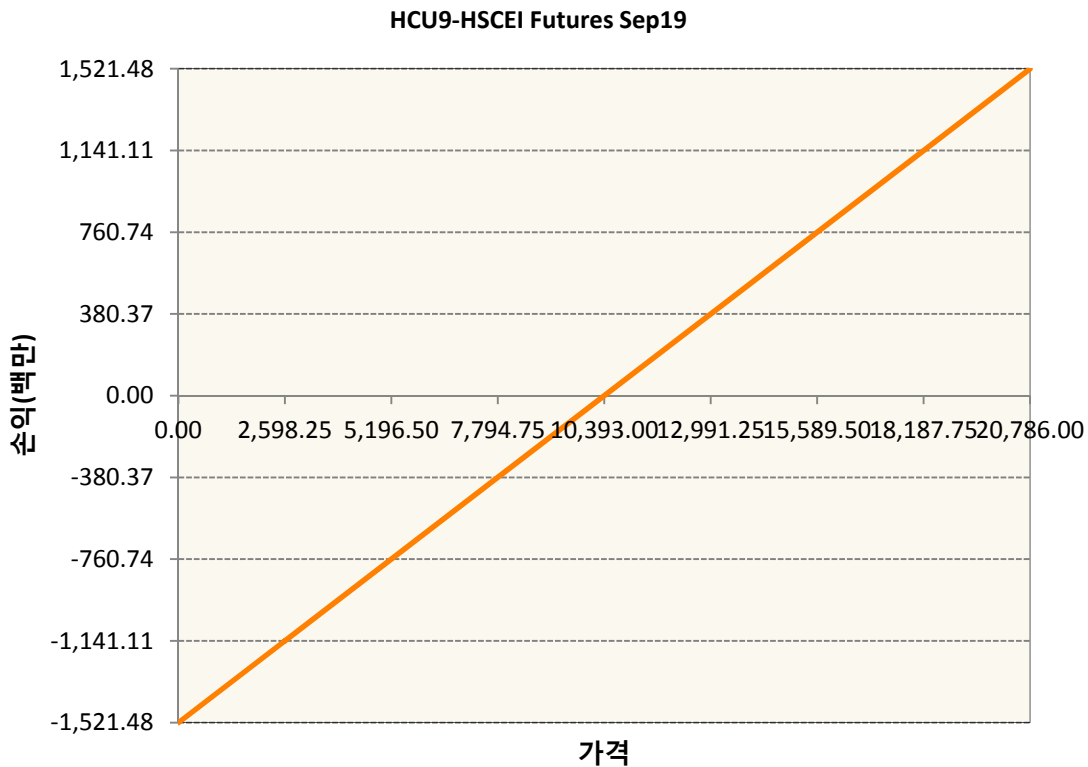
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2019-09-20
기준일	2019-09-19

커버드콜모(주식혼합-파생형)

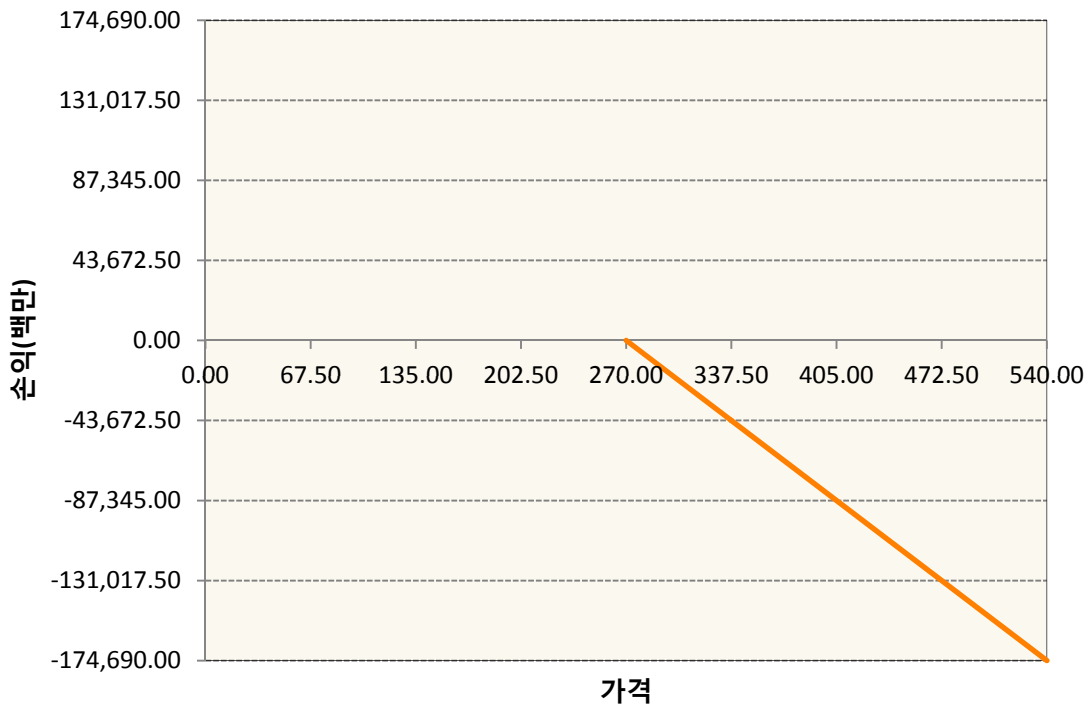
1. 계약금액

(단위:백만원)

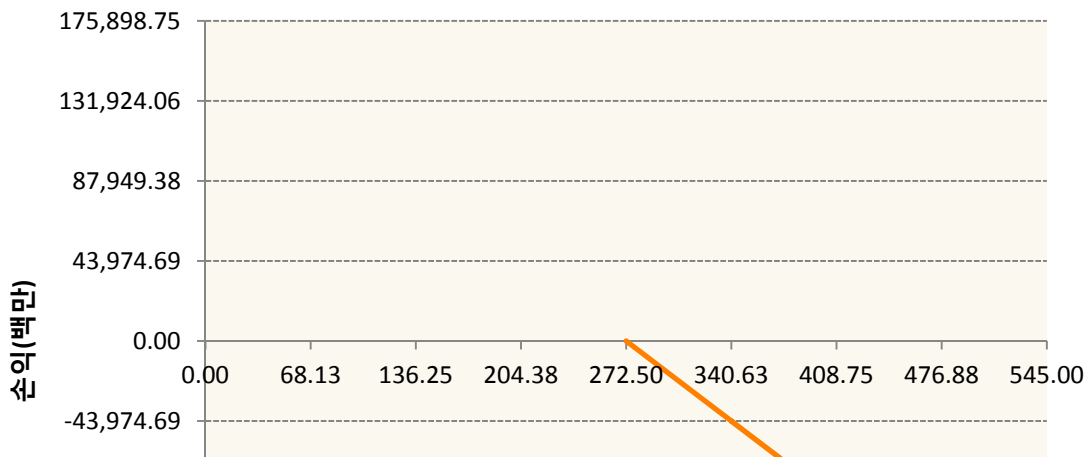
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	5,321	0	5,321	장내
누계	유가증권	옵션	0	519,339	-519,339	장내

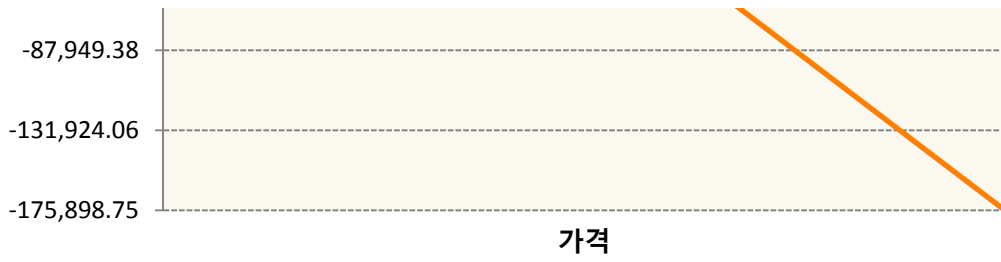
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PA2702-2019-10 콜270

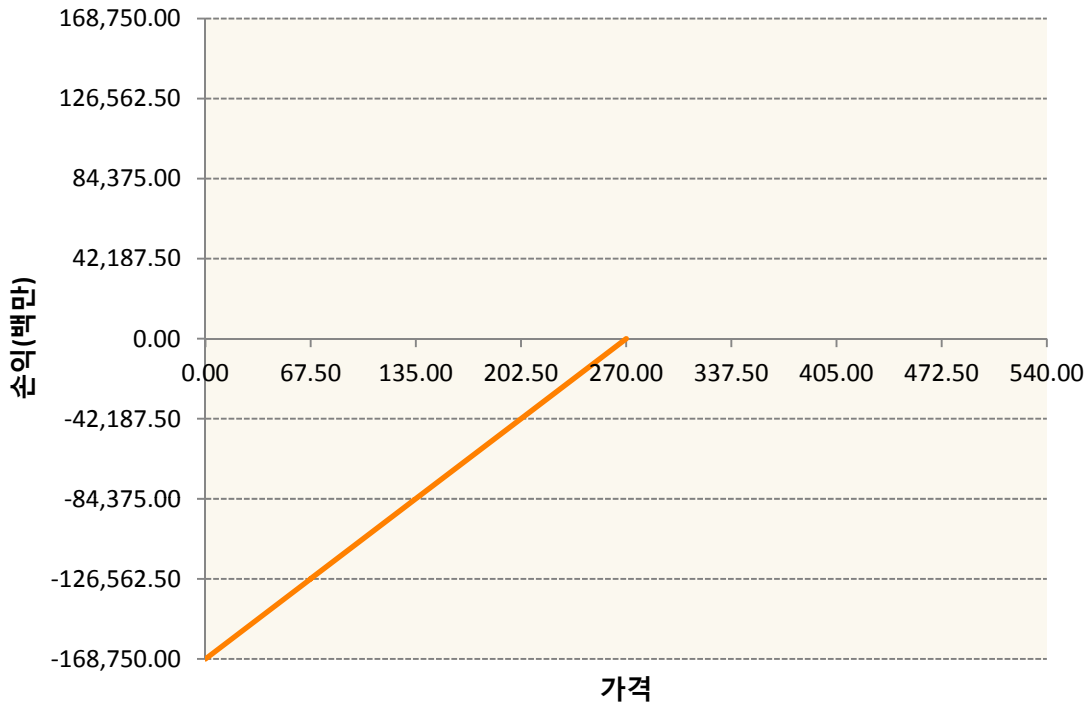


KR4201PA2728-2019-10 콜272.5





KR4301PA2701-2019-10 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201PA2702		2019-10 콜270					11,939
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,880	5,726	5,547	5,346	5,126	4,890	4,640
-5.33%	5,169	4,891	4,600	4,298	3,986	3,668	3,344
-2.67%	3,636	3,273	2,909	2,544	2,179	1,813	1,446
0%	1,069	716	360	0	-362	-725	-1,090
2.67%	-2,452	-2,714	-2,993	-3,287	-3,593	-3,908	-4,232
5.33%	-6,634	-6,785	-6,963	-7,165	-7,389	-7,630	-7,887
8.00%	-11,165	-11,234	-11,328	-11,447	-11,590	-11,754	-11,939
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5					11,438
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,062	4,942	4,796	4,626	4,436	4,227	4,003

-5.33%	4,541	4,302	4,044	3,770	3,484	3,188	2,884
-2.67%	3,318	2,972	2,623	2,269	1,914	1,556	1,196
0%	1,114	743	372	0	-372	-745	-1,118
2.67%	-2,094	-2,396	-2,710	-3,035	-3,367	-3,706	-4,050
5.33%	-6,070	-6,260	-6,476	-6,714	-6,970	-7,242	-7,526
8.00%	-10,493	-10,588	-10,711	-10,859	-11,032	-11,225	-11,438
KR4301PA2701 2019-10 풋270							9,806
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,622	-9,632	-9,649	-9,674	-9,709	-9,753	-9,806
-5.33%	-5,180	-5,254	-5,342	-5,442	-5,552	-5,671	-5,798
-2.67%	-1,505	-1,686	-1,869	-2,053	-2,238	-2,425	-2,612
0%	493	334	169	0	-173	-349	-528
2.67%	1,066	1,012	943	861	767	662	549
5.33%	1,144	1,136	1,122	1,100	1,069	1,029	979
8.00%	1,149	1,149	1,147	1,144	1,137	1,127	1,111

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

(단위:백만원)

33,218

공시일	2019-09-20
기준일	2019-09-19

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

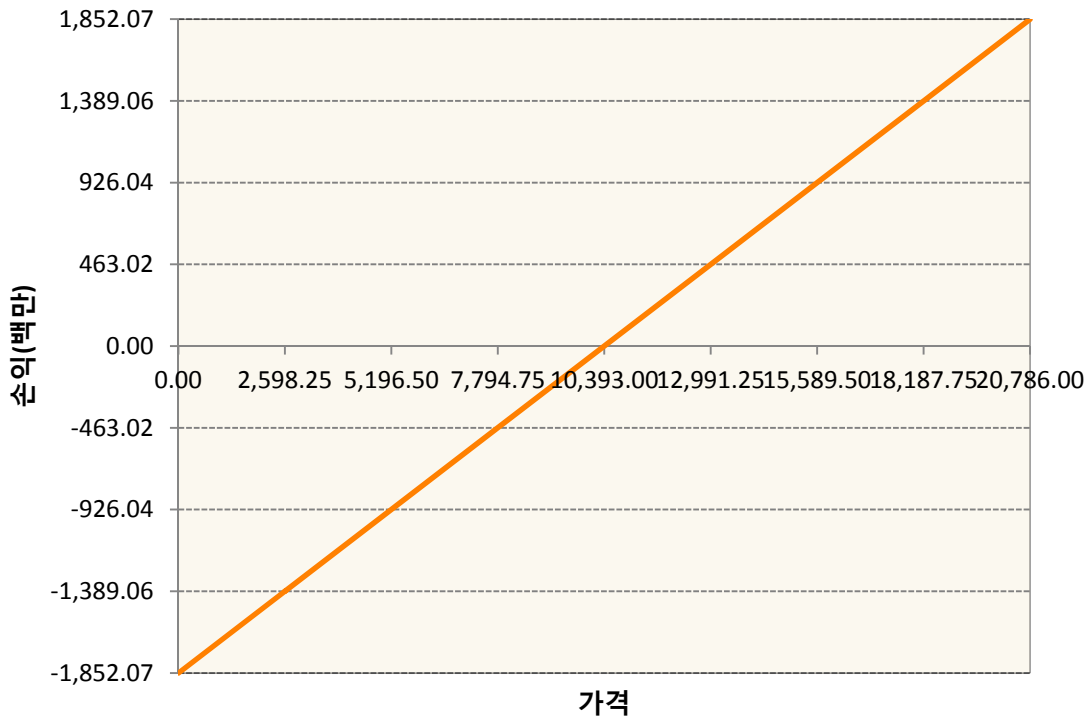
1. 계약금액

(단위:백만원)

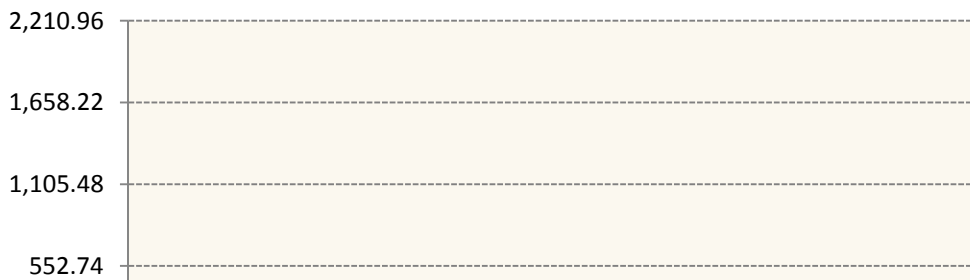
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,852	0	1,852	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,724	-4,724	장내
누계	통화	선도	686	2,833	-2,147	장외

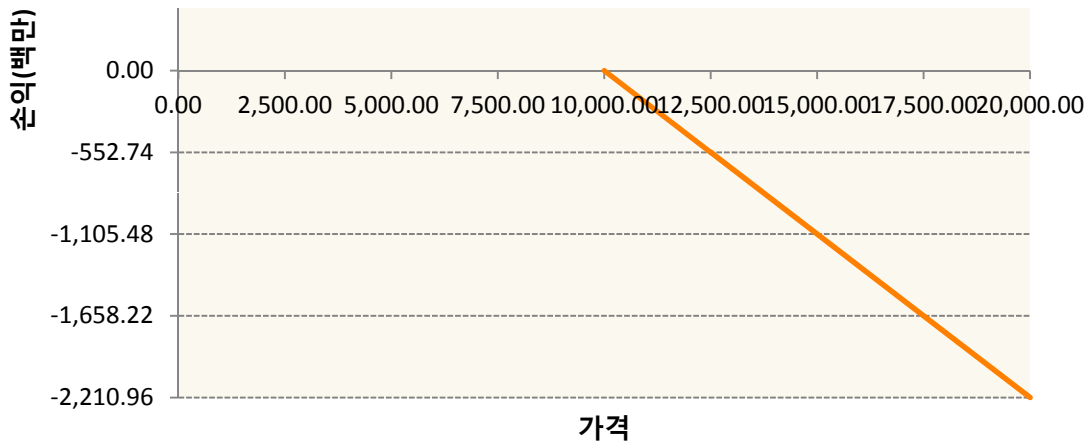
2. 만기시점의 손익구조

HCU9-HSCEI Futures Sep19

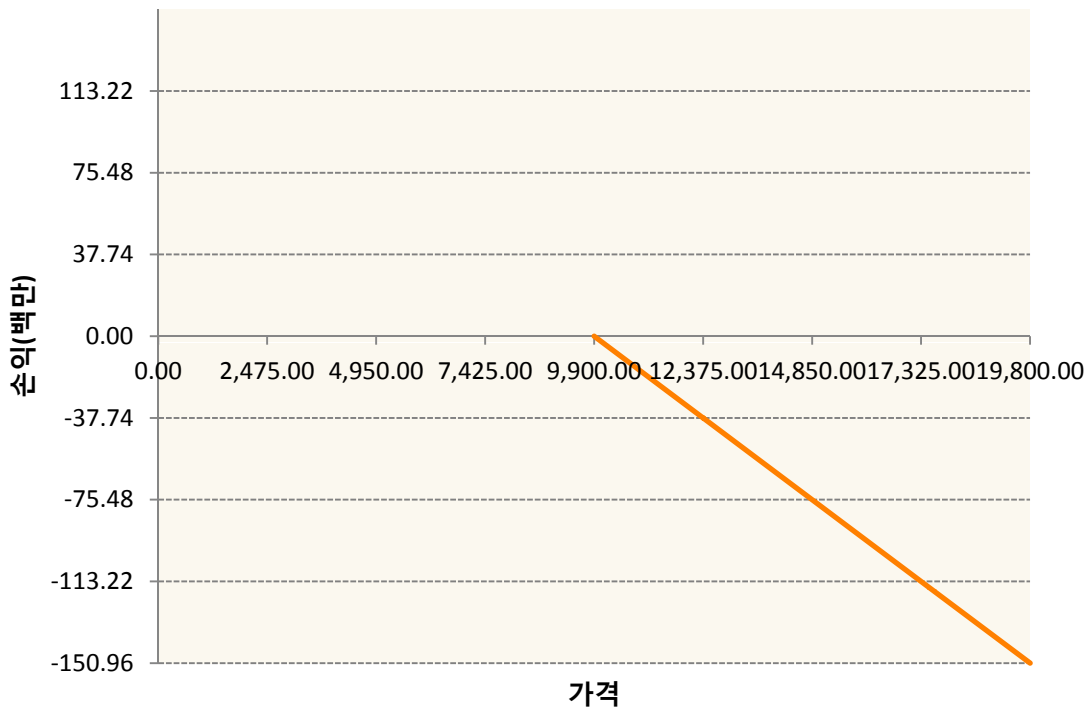


OHHIU9-C100-HSCEI

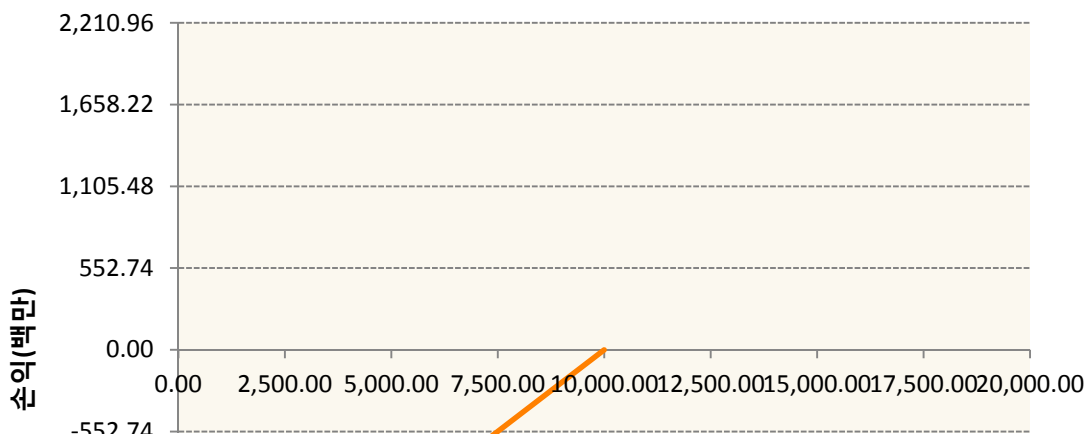


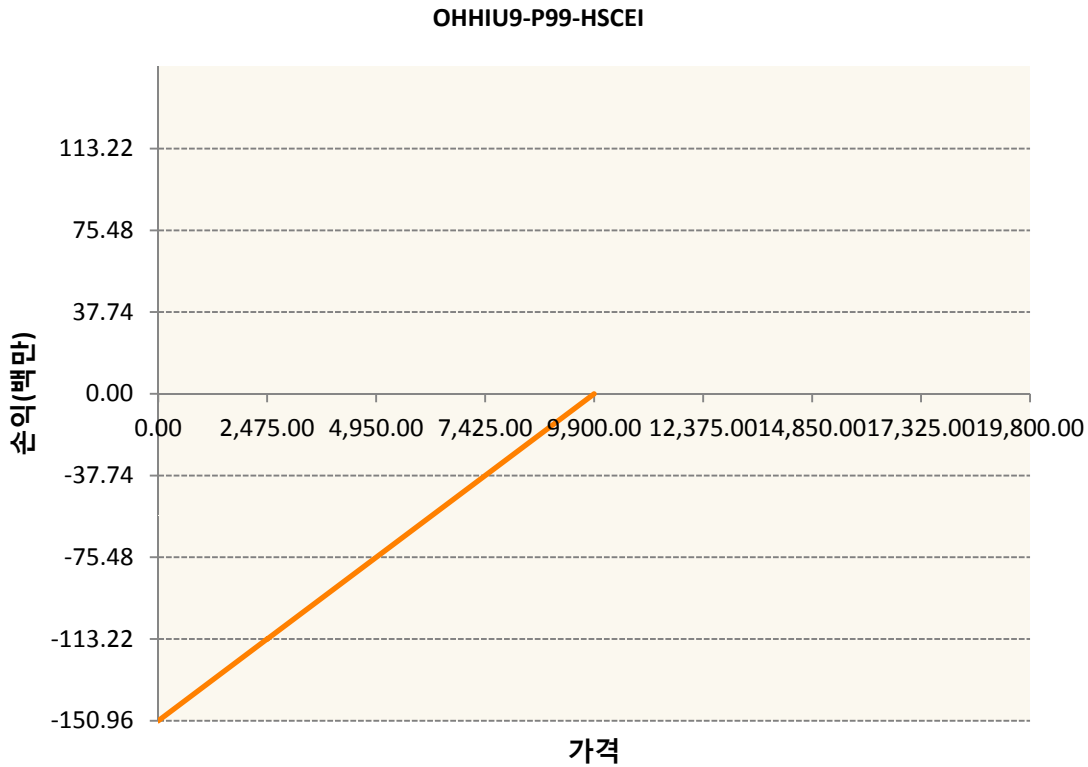


OHHIU9-C99-HSCEI



OHHIU9-P100-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	227
FX21019U00 HKD/KRW 22-11-19E	6
FX21019U02 HKD/KRW 22-11-19E	49
HCU9 HSCEI Futures Sep19	148
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)
	577

공시일	2019-09-20
기준일	2019-09-19

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

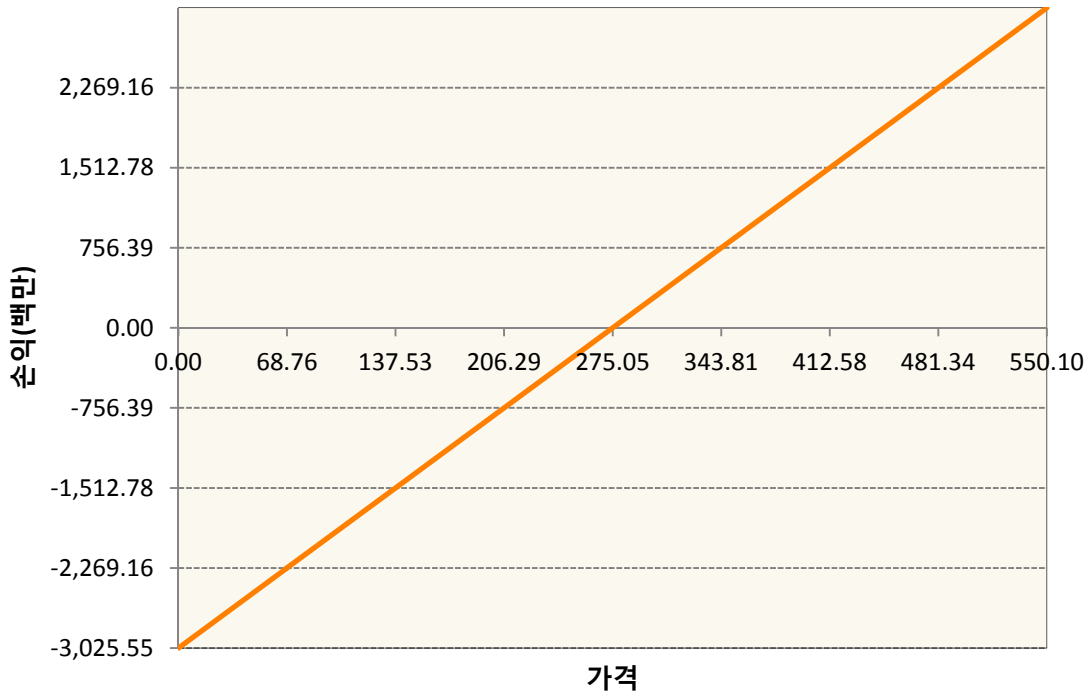
1. 계약금액

(단위:백만원)

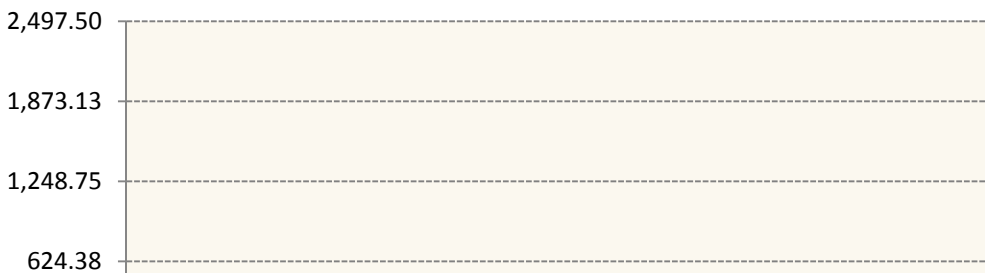
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	200	0	200	장내
누계	유가증권	선물	3,026	0	3,026	장내
누계	유가증권	스왑	14,125	0	14,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,828	-14,828	장내

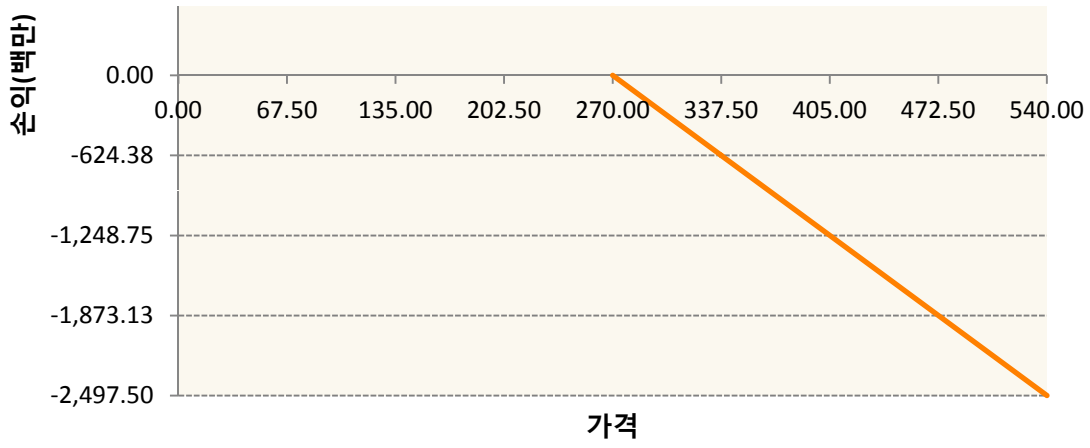
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

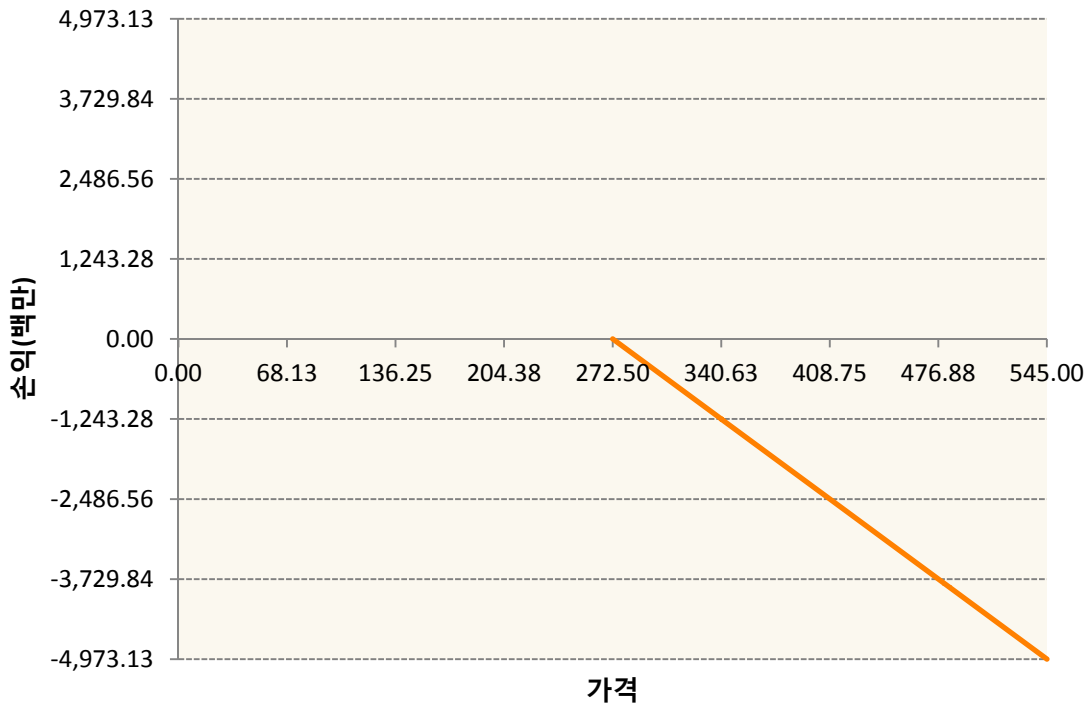


KR4201PA2702-2019-10 콜270

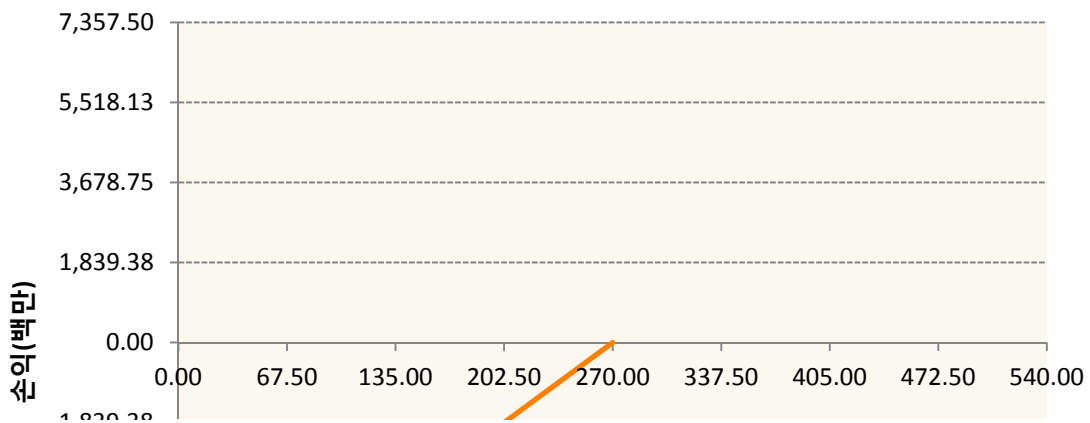




KR4201PA2728-2019-10 콜272.5



KR4301PA2701-2019-10 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						1,218
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,218	-1,218	-1,218	-1,218	-1,218	-1,218	-1,218	
-5.33%	-812	-812	-812	-812	-812	-812	-812	
-2.67%	-406	-406	-406	-406	-406	-406	-406	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	406	406	406	406	406	406	406	
5.33%	812	812	812	812	812	812	812	
8.00%	1,218	1,218	1,218	1,218	1,218	1,218	1,218	
KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						242
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-242	-242	-242	-242	-242	-242	-242	
-5.33%	-161	-161	-161	-161	-161	-161	-161	
-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%	161	161	161	161	161	161	161	
8.00%	242	242	242	242	242	242	242	
KR4201PA2702		2019-10 콜270						171
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	84	82	79	76	73	70	66	
-5.33%	74	70	66	61	57	52	48	
-2.67%	52	47	42	36	31	26	21	
0%	15	10	5	0	-5	-10	-16	
2.67%	-35	-39	-43	-47	-51	-56	-60	
5.33%	-95	-97	-100	-102	-106	-109	-113	
8.00%	-160	-161	-162	-164	-166	-168	-171	
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5						323
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	143	140	136	131	125	120	113
-5.33%	128	122	114	107	99	90	82
-2.67%	94	84	74	64	54	44	34
0%	31	21	11	0	-11	-21	-32
2.67%	-59	-68	-77	-86	-95	-105	-115
5.33%	-172	-177	-183	-190	-197	-205	-213
8.00%	-297	-299	-303	-307	-312	-317	-323
KR4301PA2701 2019-10 풋270							428
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-420	-420	-421	-422	-423	-425	-428
-5.33%	-226	-229	-233	-237	-242	-247	-253
-2.67%	-66	-74	-81	-90	-98	-106	-114
0%	22	15	7	0	-8	-15	-23
2.67%	46	44	41	38	33	29	24
5.33%	50	50	49	48	47	45	43
8.00%	50	50	50	50	50	49	48

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

(단위:백만원)

2,346

공시일	2019-09-20
기준일	2019-09-19

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

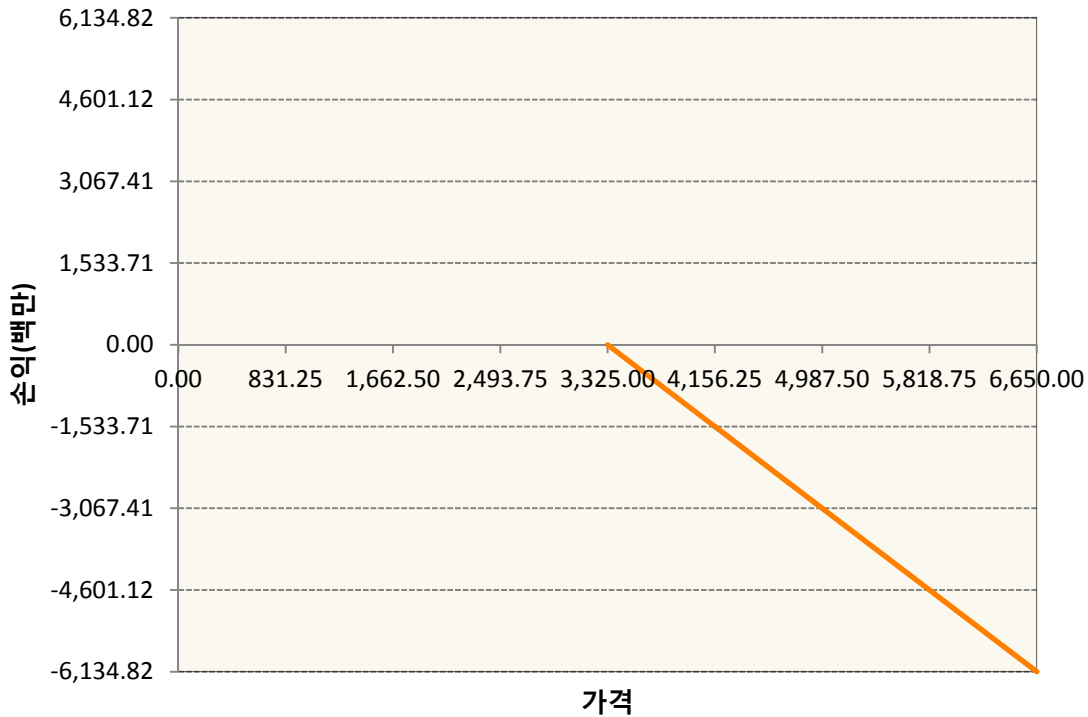
1. 계약금액

(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	4,996	0	4,996	
누계	유가증권	스왑	23,981	0	23,981	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,742	-14,742	장내
누계	통화	선도	10,938	17,132	-6,194	장외

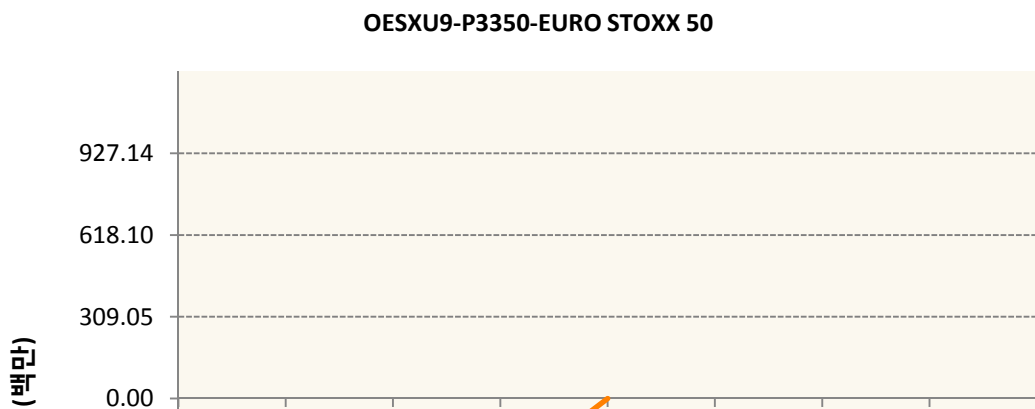
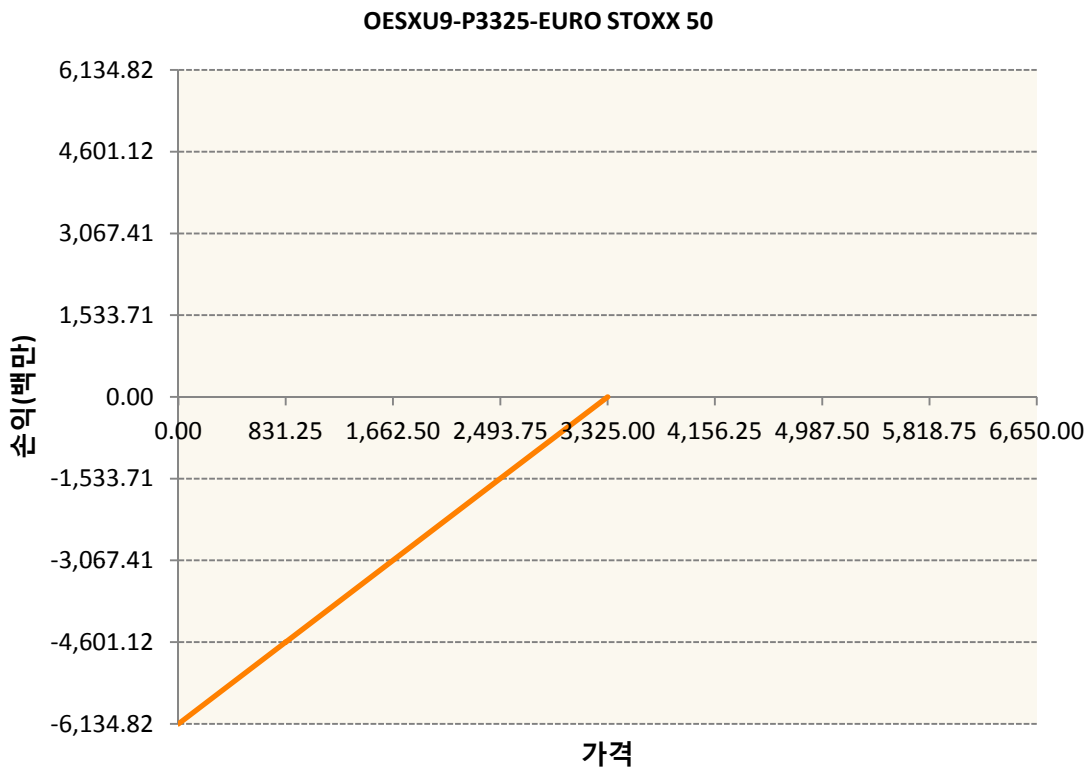
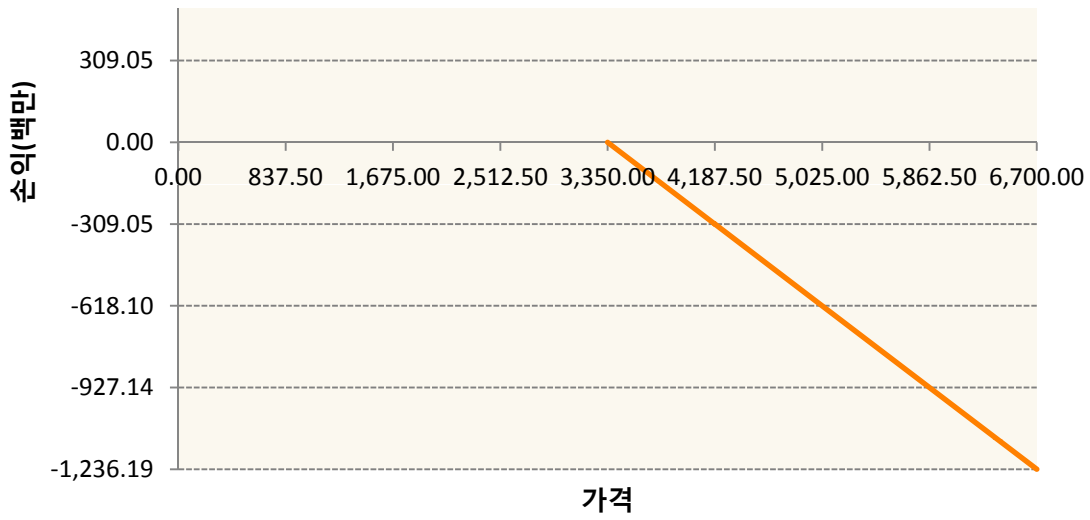
2. 만기시점의 손익구조

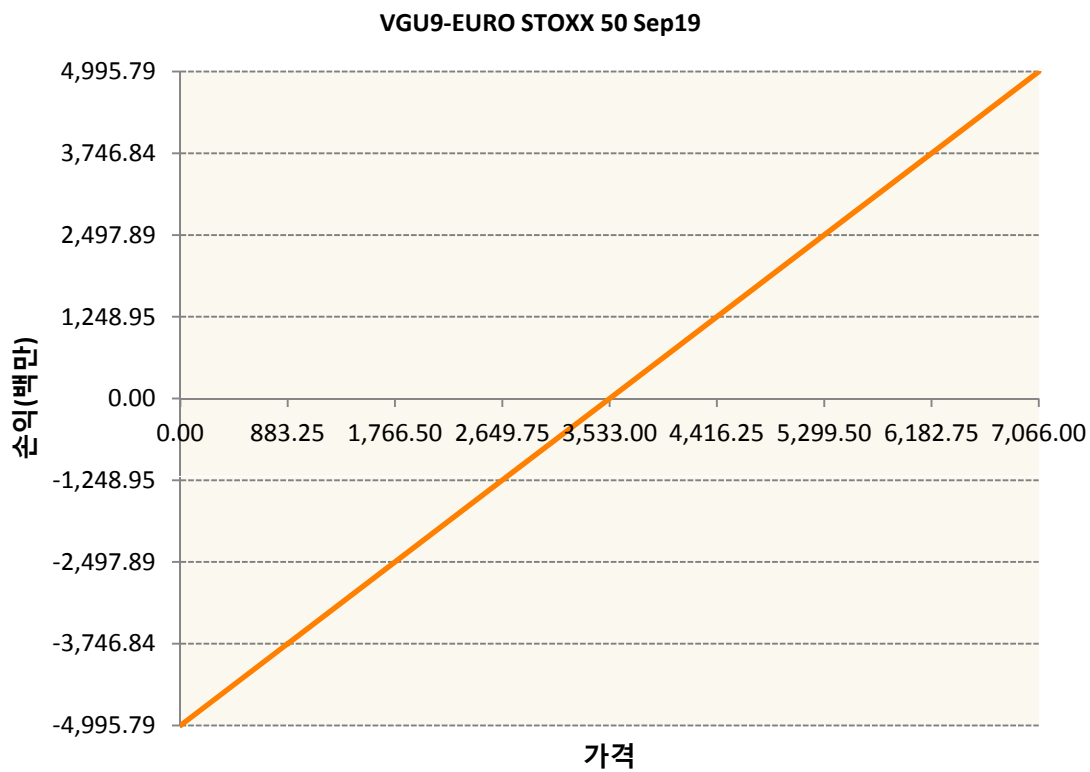
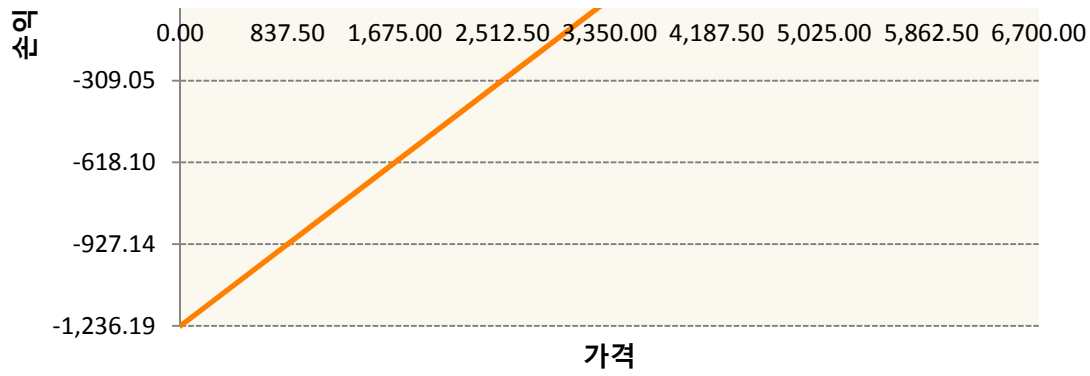
OESXU9-C3325-EURO STOXX 50



OESXU9-C3350-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	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	491
OESXU9-C3< EURO STOXX 50	99
OESXU9-P3< EURO STOXX 50	491
OESXU9-P3< EURO STOXX 50	99

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

(단위:백만원)

2,188

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

(단위:백만원)

996

공시일	2019-09-20
기준일	2019-09-19

ETF스마트레버리지목표전환형9호

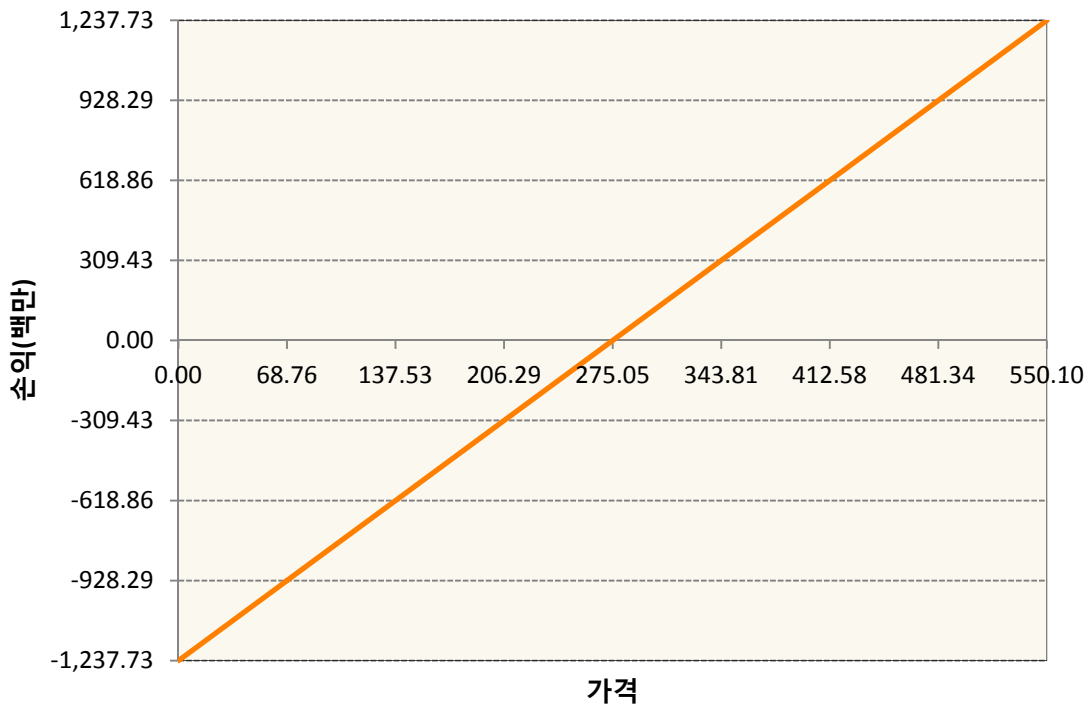
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,238	0	1,238	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						99
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99	
-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%	99	99	99	99	99	99	99	

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

(단위:백만원)

85

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

(단위:백만원)

133

공시일	2019-09-20
기준일	2019-09-19

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

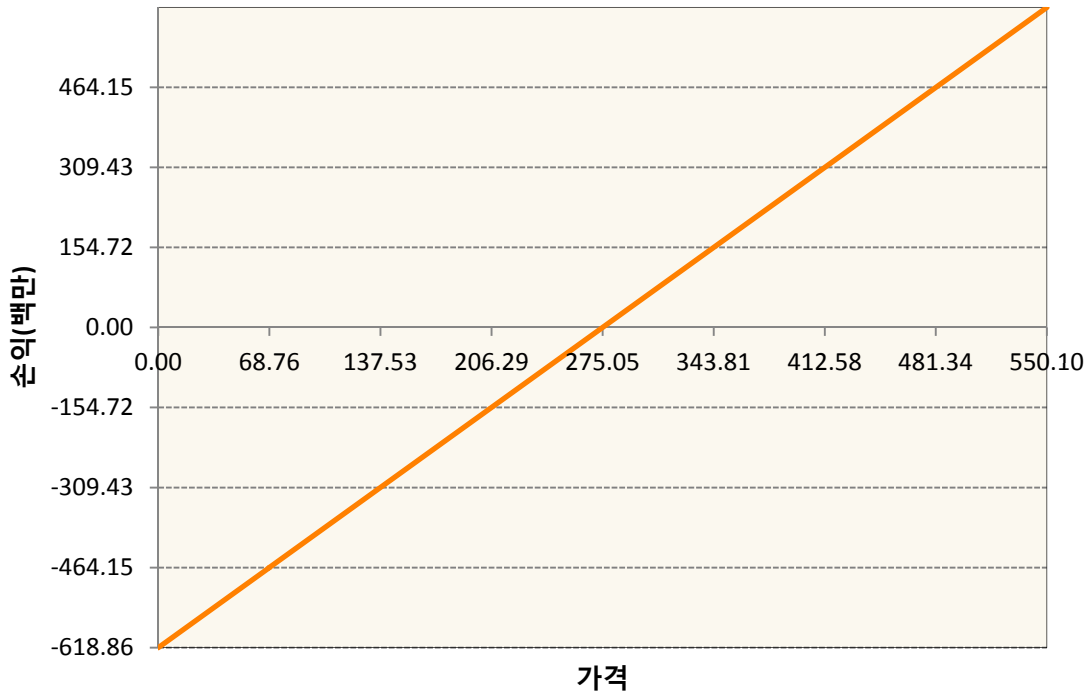
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	619	0	619	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						49
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	16	16	16	16	16	16	16	
5.33%	33	33	33	33	33	33	33	
8.00%	49	49	49	49	49	49	49	

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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-09-20
기준일	2019-09-19

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

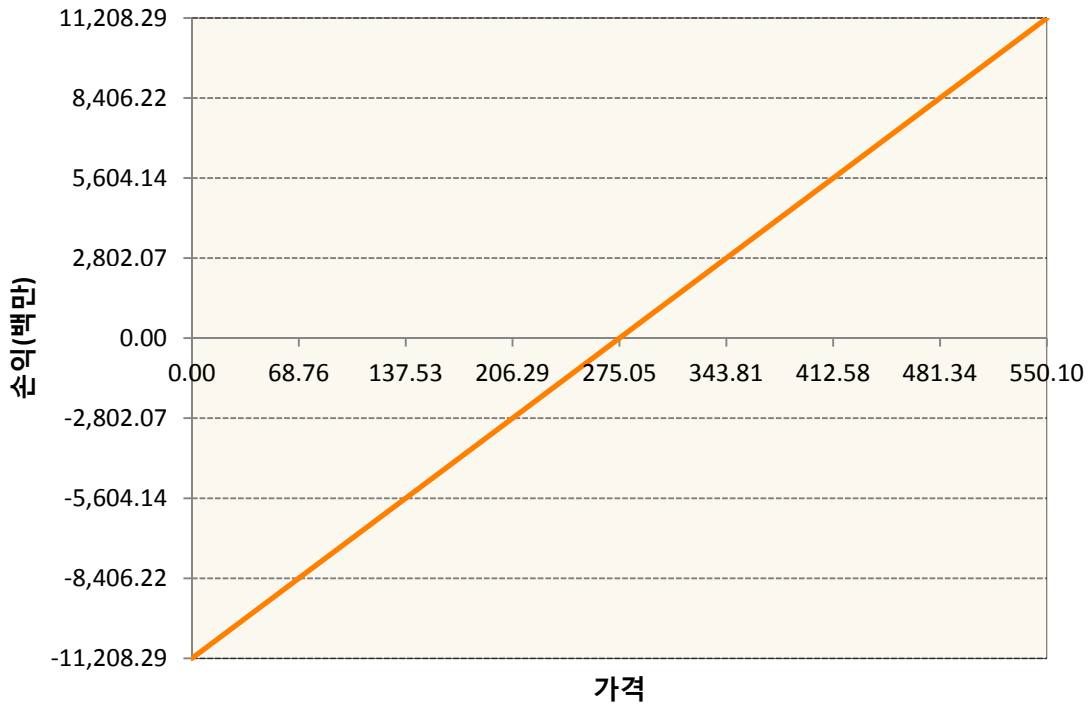
1. 계약금액

(단위:백만원)

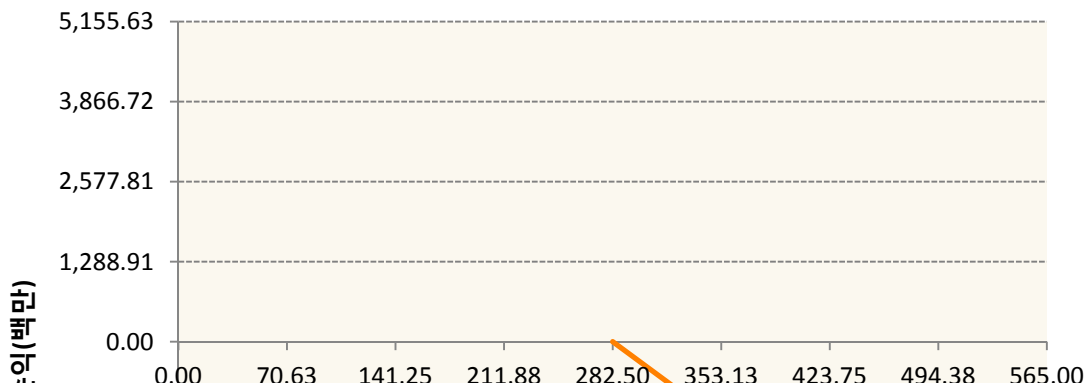
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,208	0	11,208	장내
누계	유가증권	옵션	1,422	20,831	-19,409	장내

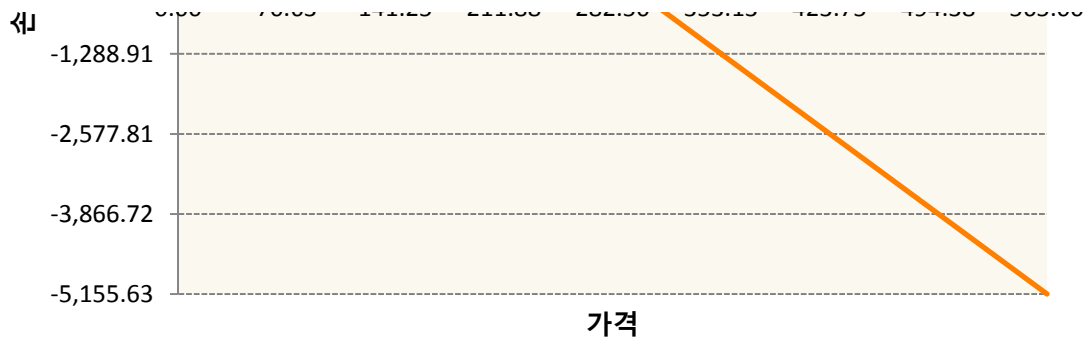
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

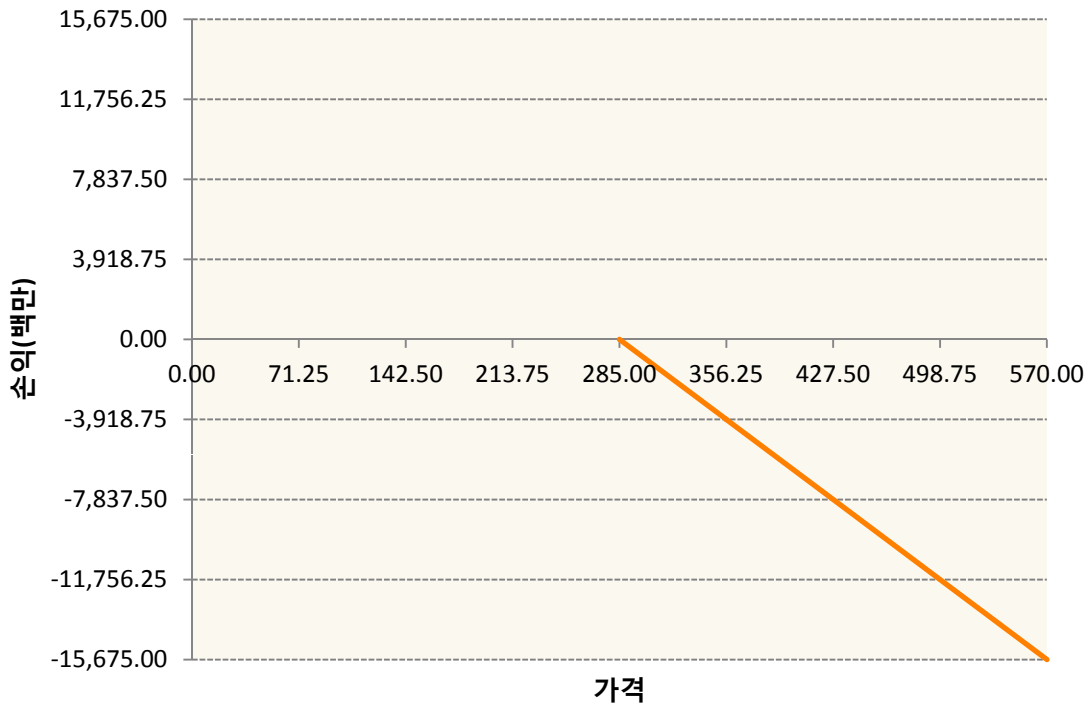


KR4201PA2827-2019-10 콜282.5

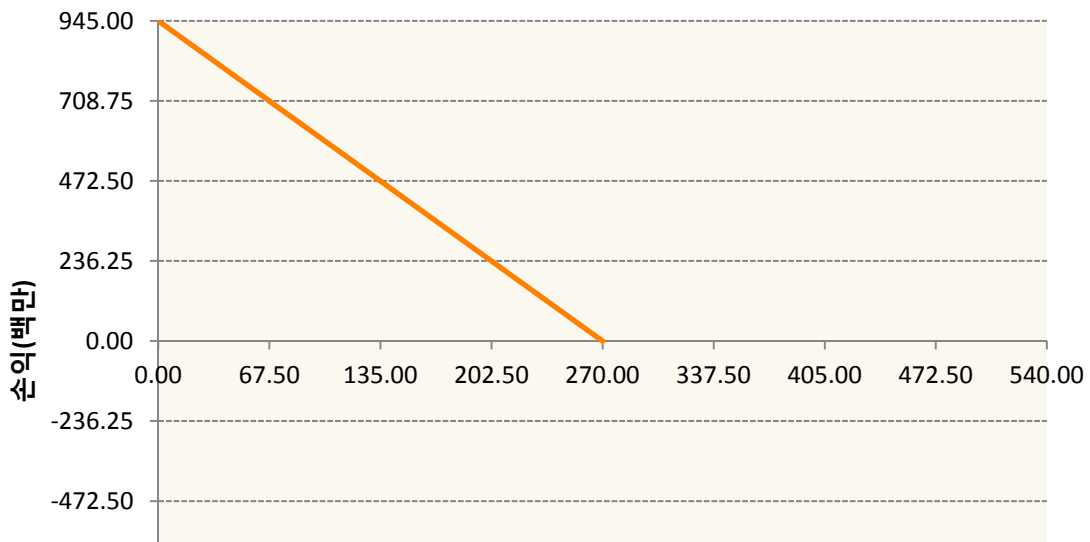


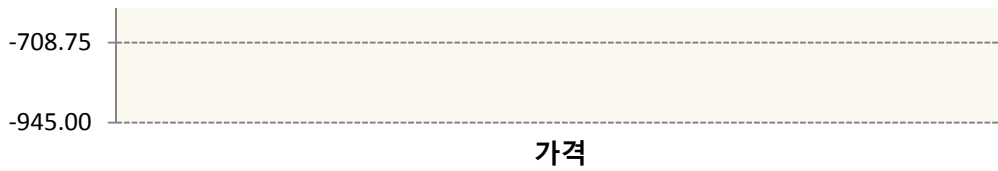


KR4201PA2850-2019-10 콜285

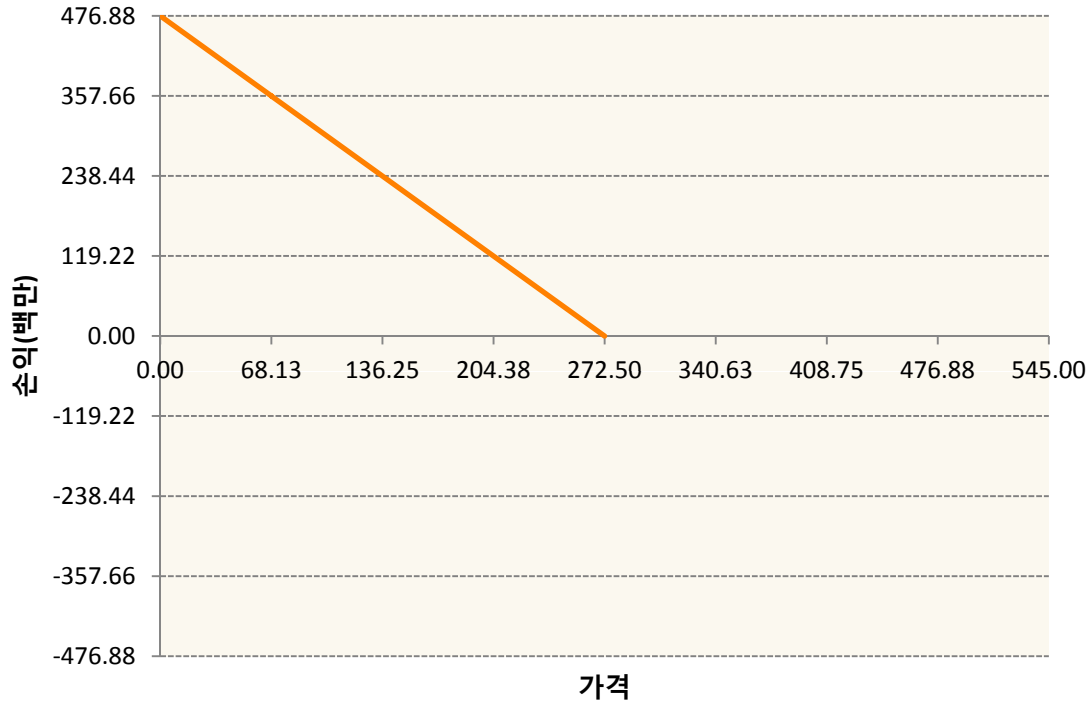


KR4301PA2701-2019-10 풋270





KR4301PA2727-2019-10 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						896
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-896	-896	-896	-896	-896	-896	-896	
-5.33%	-597	-597	-597	-597	-597	-597	-597	
-2.67%	-299	-299	-299	-299	-299	-299	-299	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	299	299	299	299	299	299	299	
5.33%	597	597	597	597	597	597	597	
8.00%	896	896	896	896	896	896	896	
KR4201PA2827		2019-10 콜282.5						258
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	70	69	68	66	63	60	56	
-5.33%	67	64	61	56	52	46	40	
-2.67%	56	50	43	36	29	21	12	

0%	29	19	10	0	-10	-20	-30
2.67%	-24	-35	-46	-56	-67	-78	-89
5.33%	-104	-114	-124	-134	-145	-155	-166
8.00%	-209	-216	-223	-231	-240	-249	-258
KR4201PA2850 2019-10 콜285							722
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	172	170	167	162	156	148	139
-5.33%	166	159	151	141	128	114	98
-2.67%	142	128	111	92	71	50	27
0%	79	54	27	0	-28	-57	-86
2.67%	-51	-84	-116	-149	-182	-215	-247
5.33%	-265	-297	-329	-362	-394	-427	-460
8.00%	-557	-582	-608	-635	-663	-692	-722
KR4301PA2701 2019-10 풋270							55
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	54	54	54	54	54	55	55
-5.33%	29	29	30	30	31	32	32
-2.67%	8	9	10	11	13	14	15
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-6	-6	-5	-5	-4	-4	-3
5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-5
8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
KR4301PA2727 2019-10 풋272.5							30
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	30	30	30	30	30	30	30
-5.33%	17	17	17	18	18	18	18
-2.67%	6	6	7	7	8	8	9
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-4	-4	-4	-3	-3	-3	-2
5.33%	-5	-5	-5	-5	-4	-4	-4
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5

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

(단위:백만원)

1,664

공시일	2019-09-20
기준일	2019-09-19

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,790	0	1,790	
누계	유가증권	수익증권	95,932	0	95,932	

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	2019-09-20
기준일	2019-09-19

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,984	0	2,984	
누계	유가증권	수익증권	121,896	0	121,896	

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	2019-09-20
기준일	2019-09-19

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	480,323	0	480,323	
누계	통화	선도	0	535,449	-535,449	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		3,915
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,533
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,616
FX21019Q02 KRW/USD 23-09-19E		2,970
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		955
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		955
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E		955
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E		1,719
FX21019Q04 KRW/USD 30-09-19E		191
FX21019Q04 KRW/USD 24-09-19E		2,101
FX21019Q04 KRW/USD 24-09-19E		2,674
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		1,375
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E		2,043
FX21019U01 KRW/USD 10-10-19E		286
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E		191
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E		2,330
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E		1,719
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E		191
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E		955
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E		1,471
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		2,970
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		3,151

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

(단위:백만원)

14,183

공시일	2019-09-20
기준일	2019-09-19

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

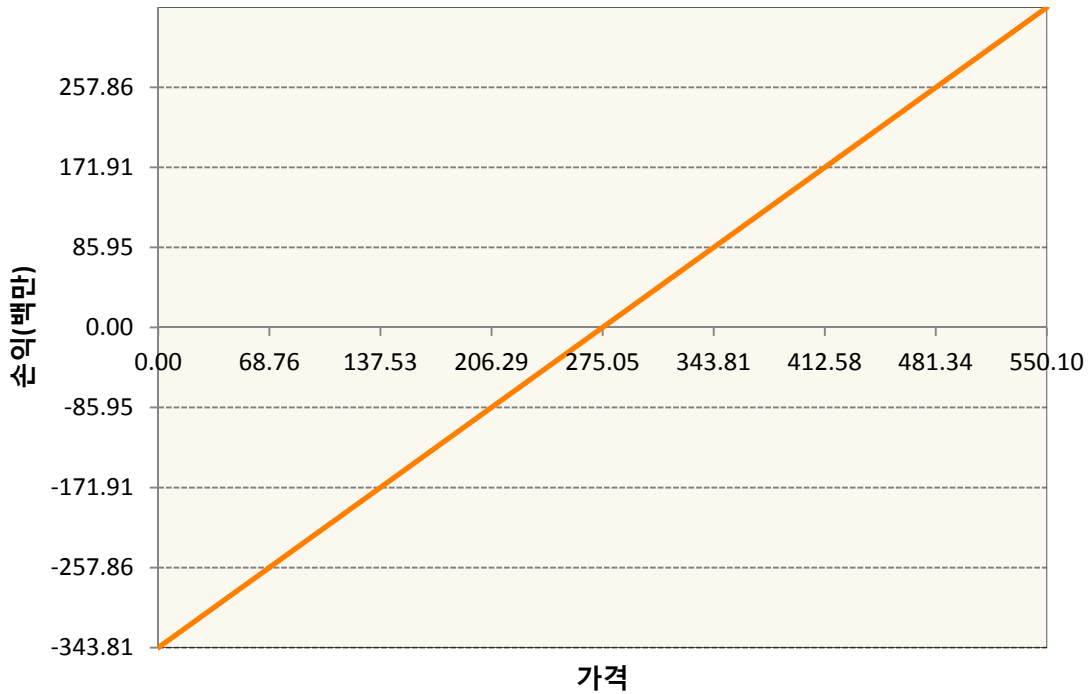
1. 계약금액

(단위:백만원)

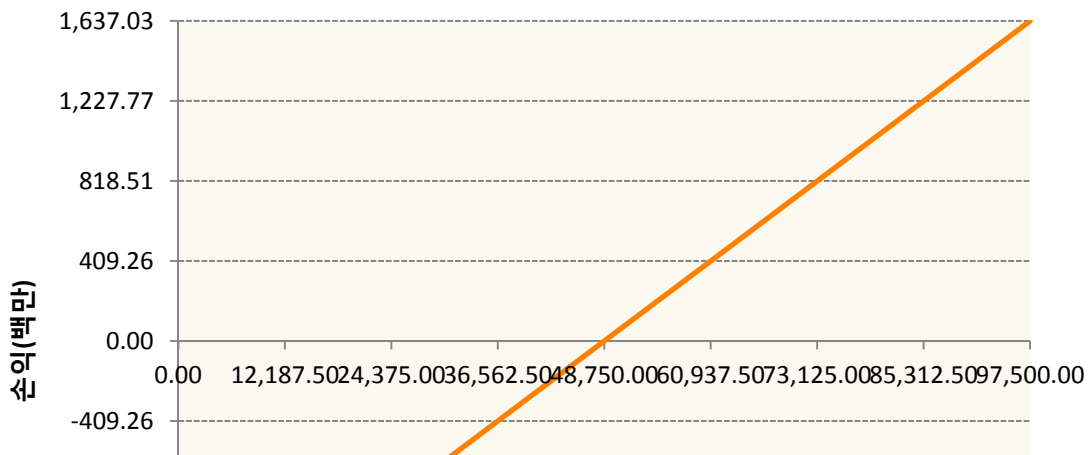
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,981	0	1,981	장내

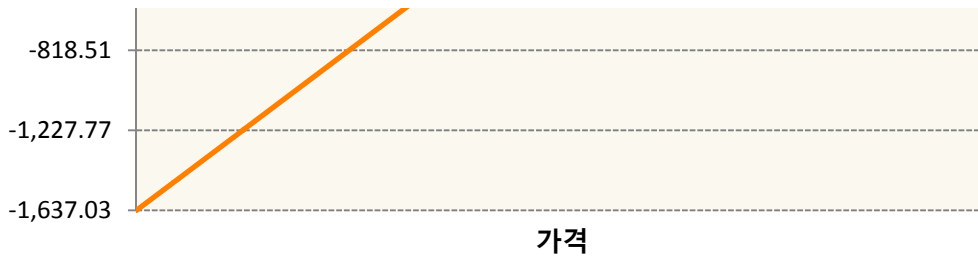
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



KR4111PA0002-2019-10 삼성전자개별선물





3. 시나리오 별 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						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	2019-09-20
기준일	2019-09-19

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

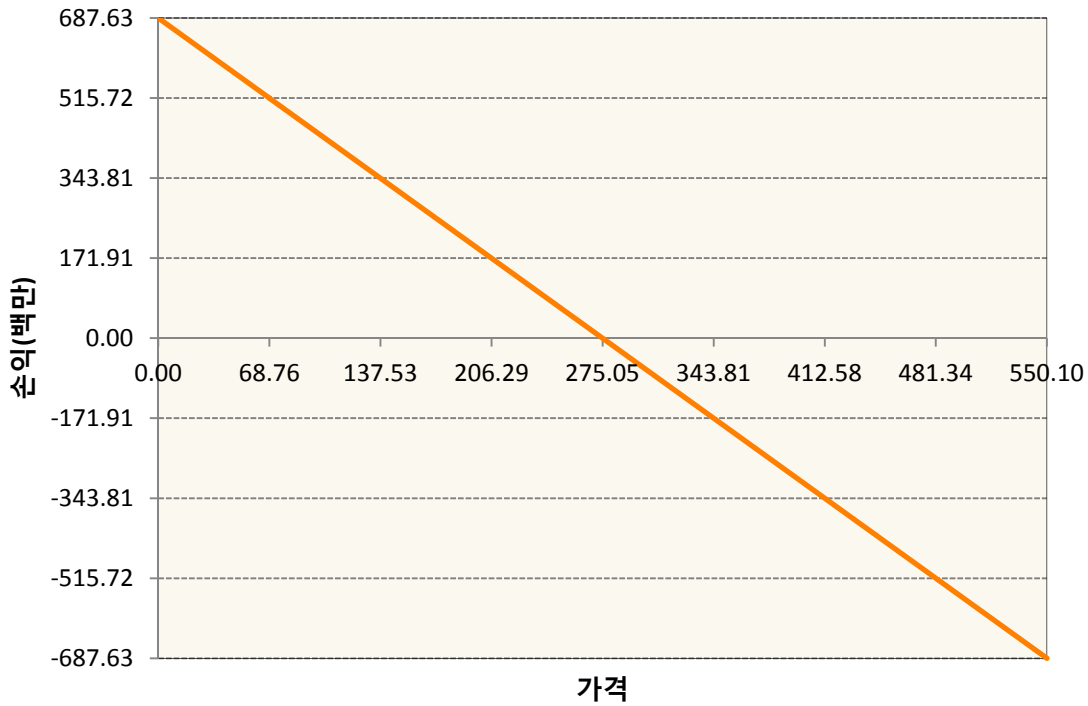
1. 계약금액

(단위:백만원)

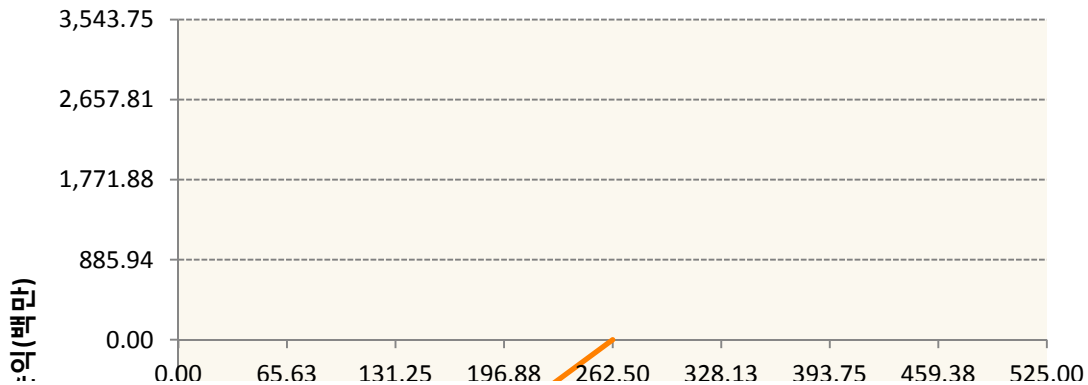
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	688	-688	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,875	-3,875	장내

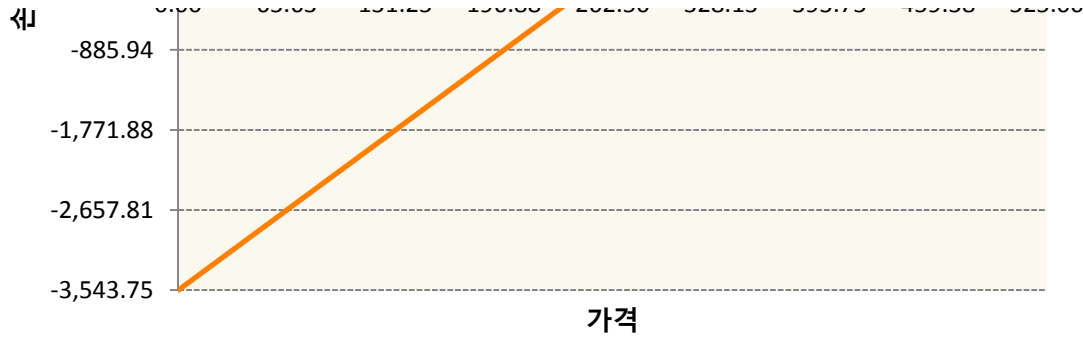
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

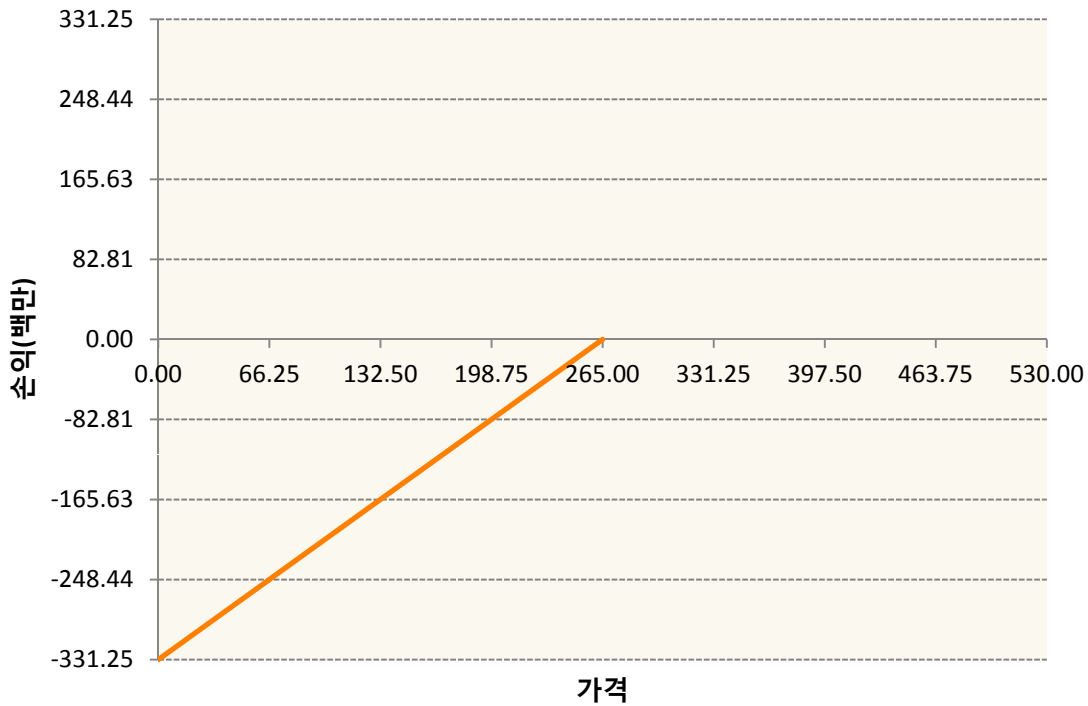


KR4301PA2628-2019-10 풋262.5





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						142
기초자산의 변동성								

공시일	2019-09-20
기준일	2019-09-19

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	18,770	0	18,770	
누계	통화	선도	0	18,262	-18,262	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		325
FX21019U03 KRW/USD 18-10-19E		477
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		611
FX21019U03 KRW/USD 25-09-19E		48

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

(단위:백만원)

484

공시일	2019-09-20
기준일	2019-09-19

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	2019-09-20
기준일	2019-09-19

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

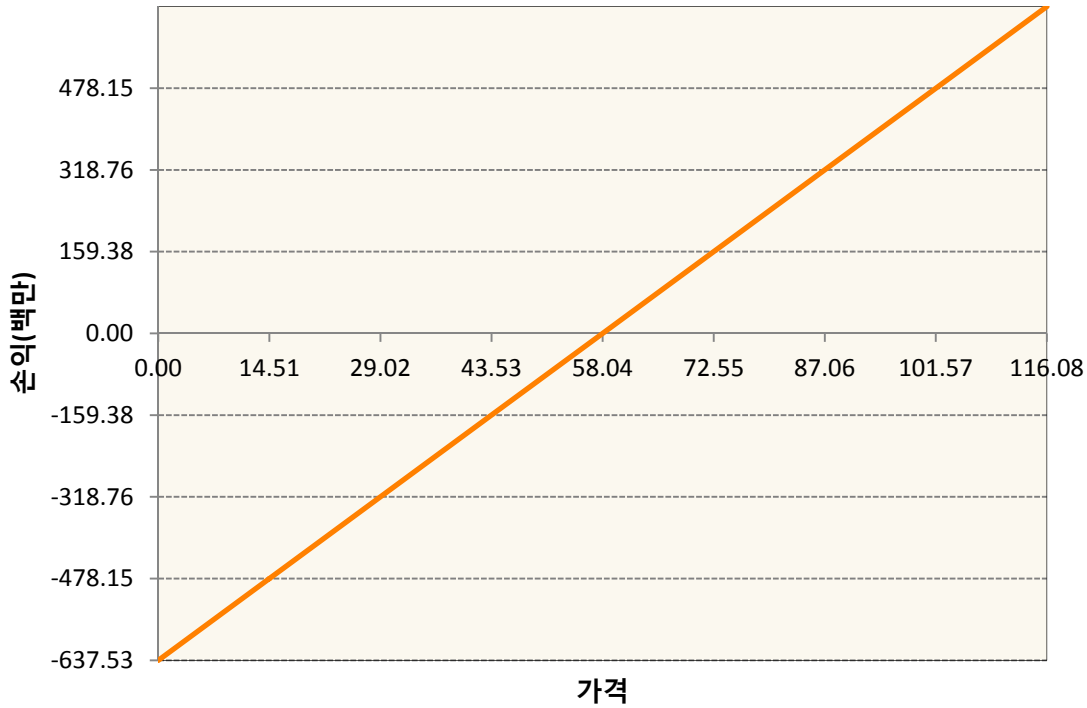
1. 계약금액

(단위:백만원)

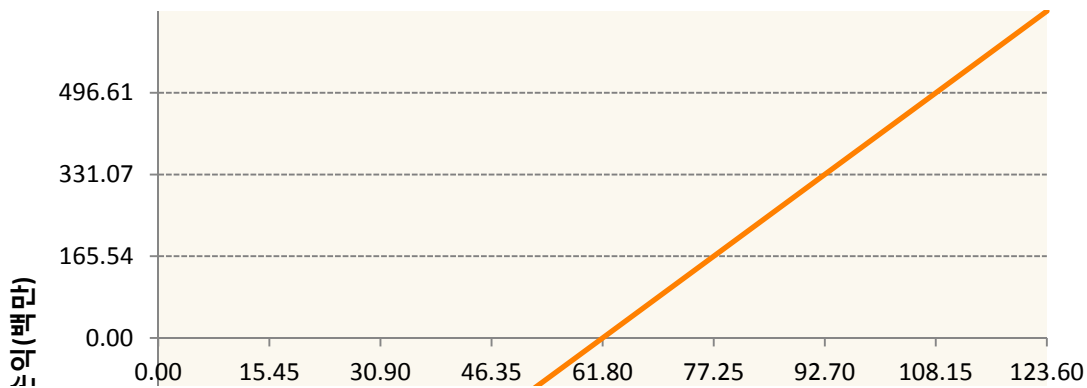
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,452	477	1,975	
누계	유가증권	선물	202	0	202	장내

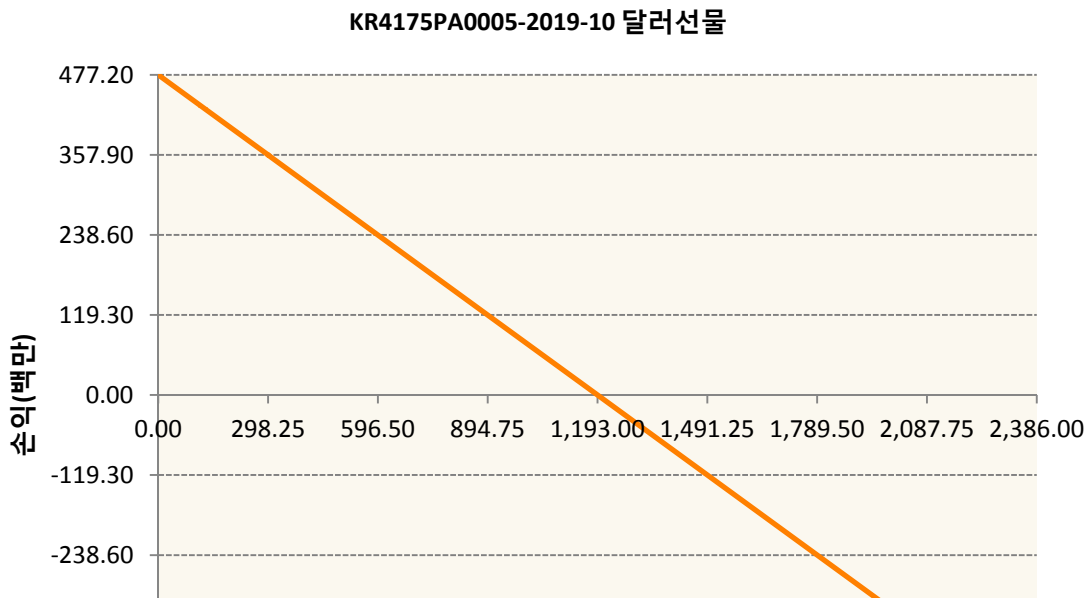
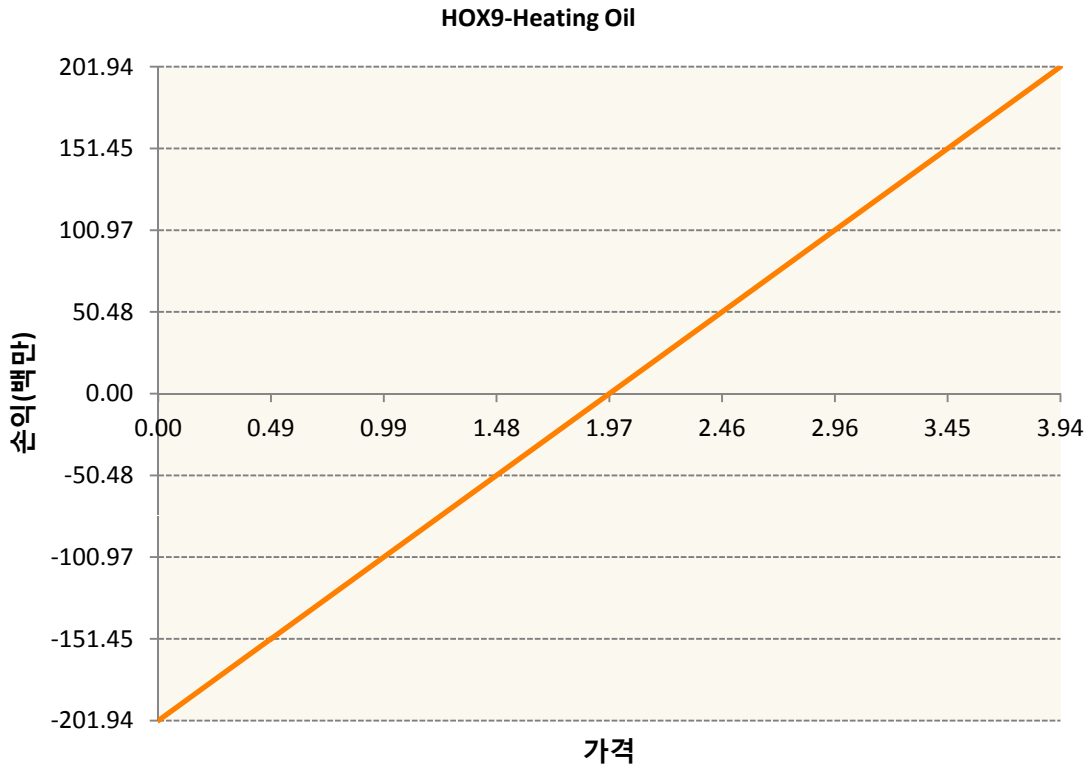
2. 만기시점의 손익구조

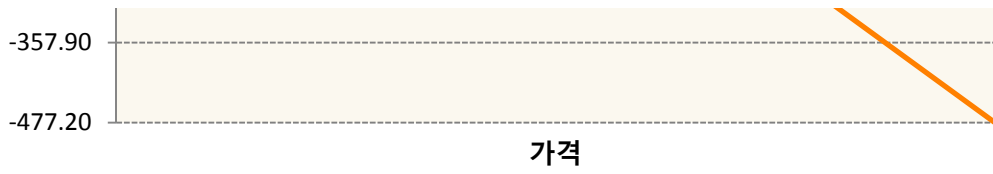
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19



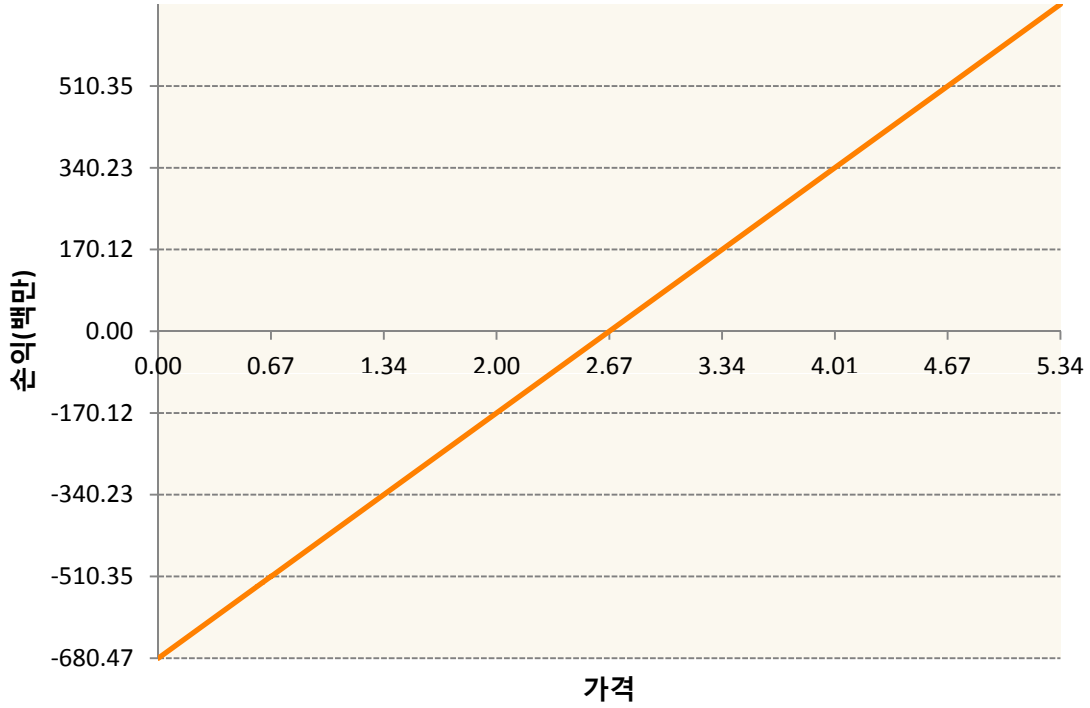
COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20



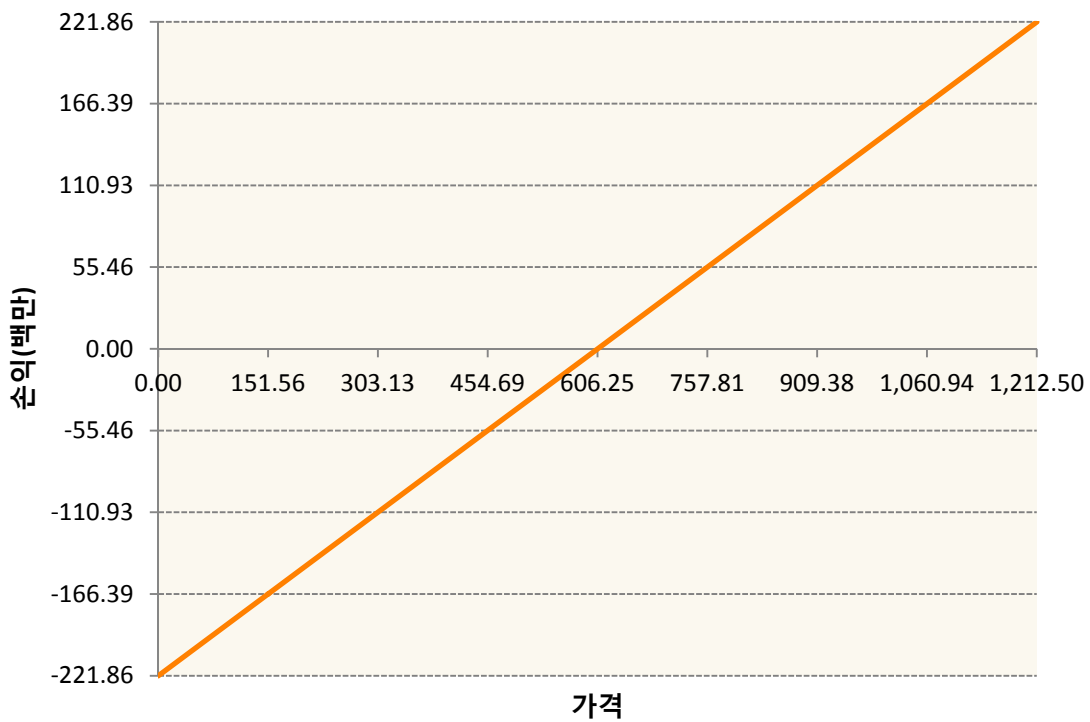




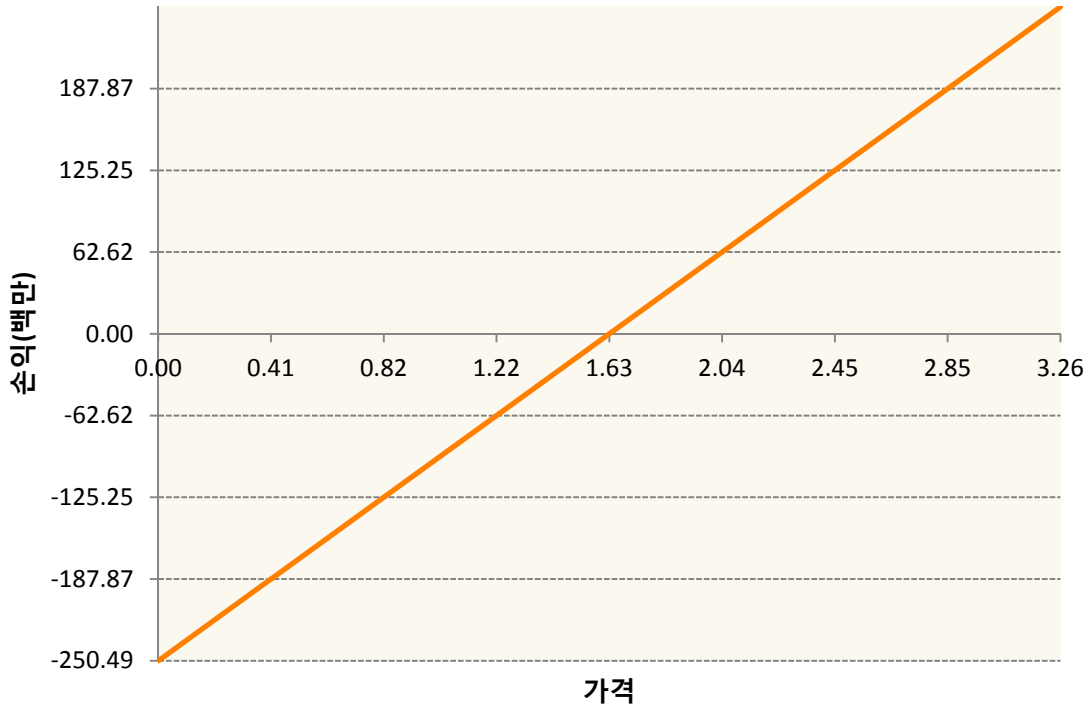
NGX19-NATURAL GAS FUTR Nov19



QSX9-Low Su Gasoil G Nov19



XBX9-GASOLINE RBOB FUT 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	54
QSX9	Low Su Gasoil G Nov19	18
XBX9	GASOLINE RBOB FUT Nov19	20

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	445

공시일	2019-09-20
기준일	2019-09-19

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

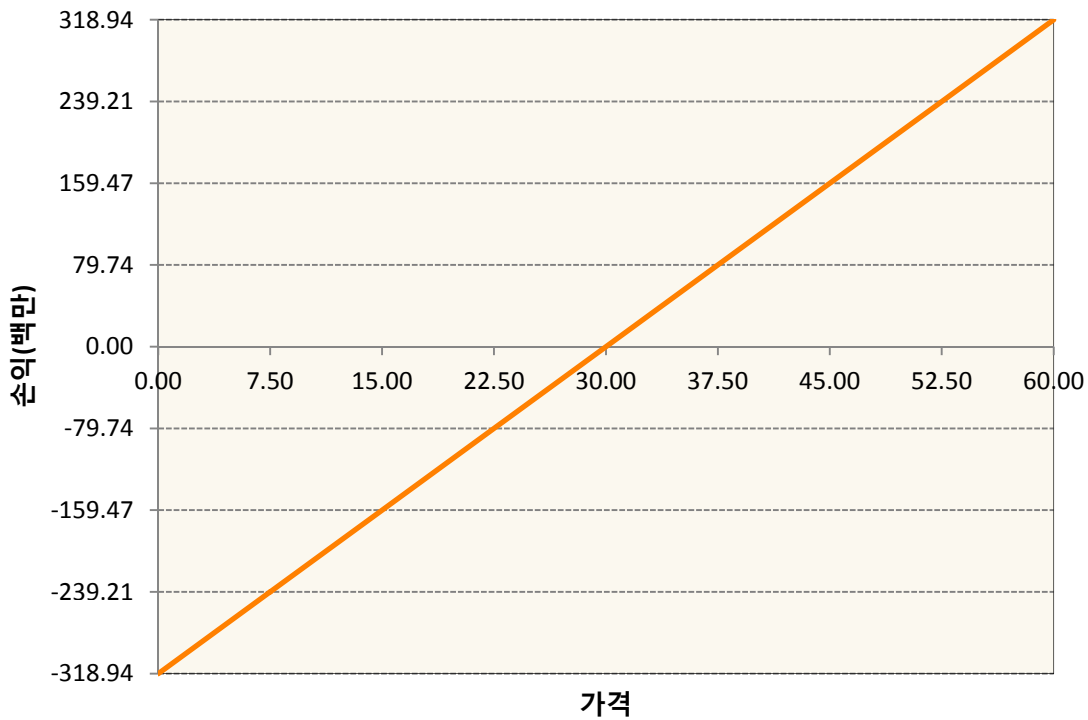
1. 계약금액

(단위:백만원)

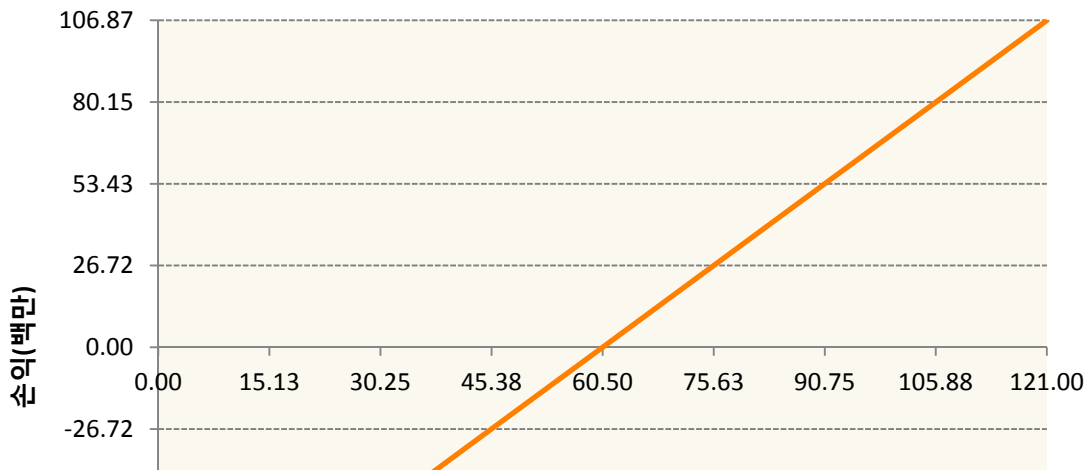
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,766	95	2,670	

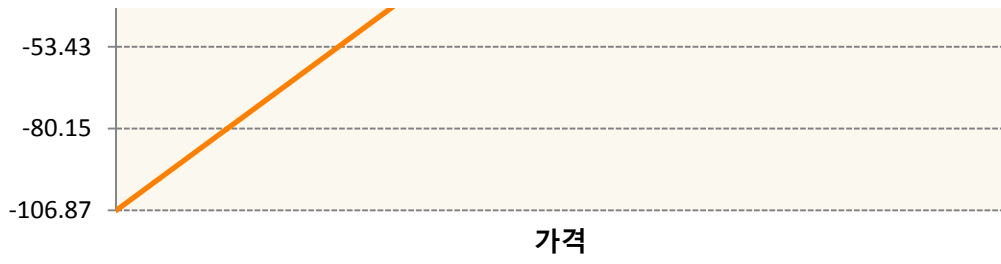
2. 만기시점의 손익구조

BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19

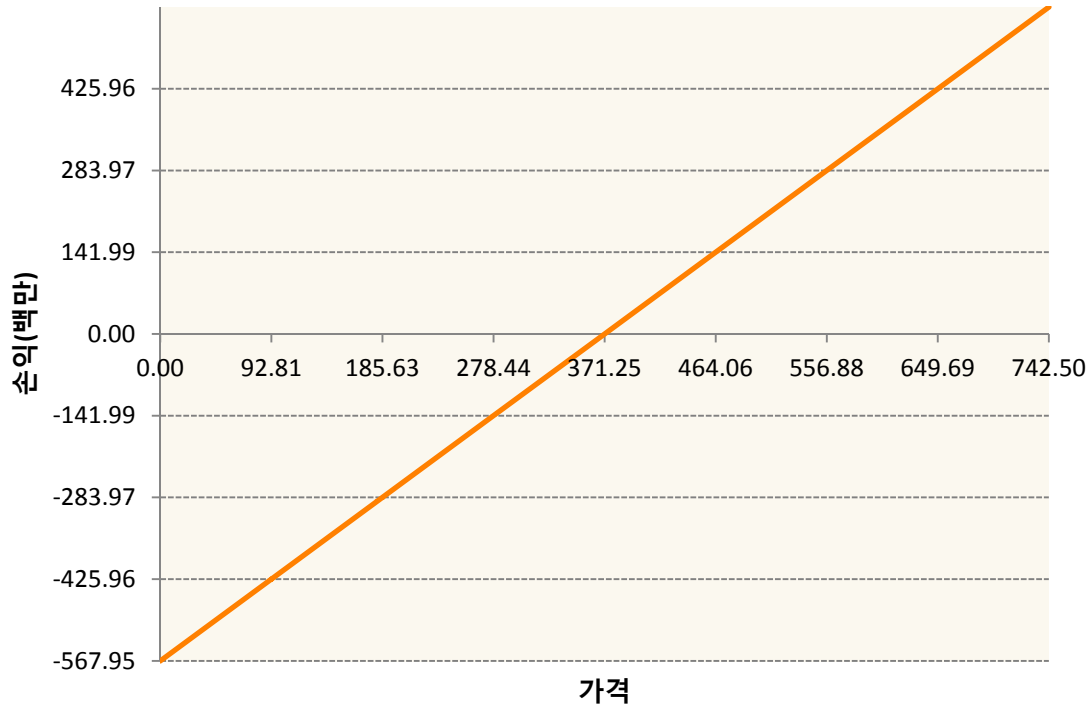


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

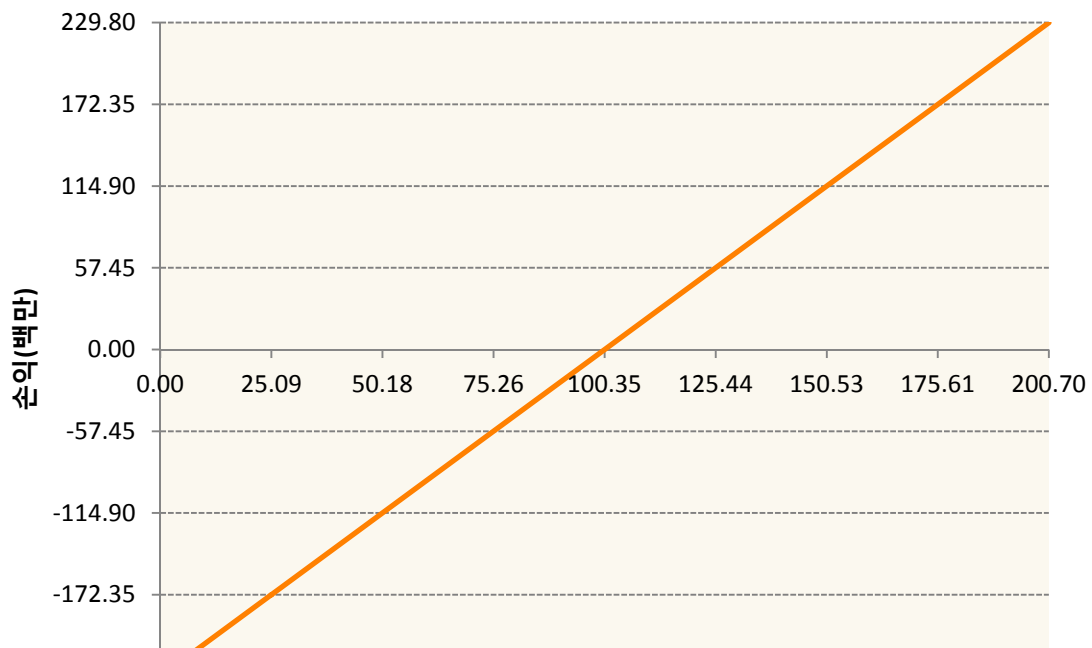


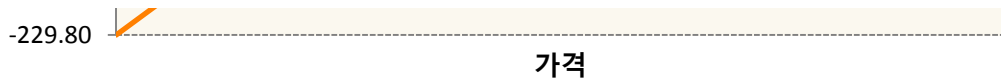


CZ9-CORN FUTURE Dec19

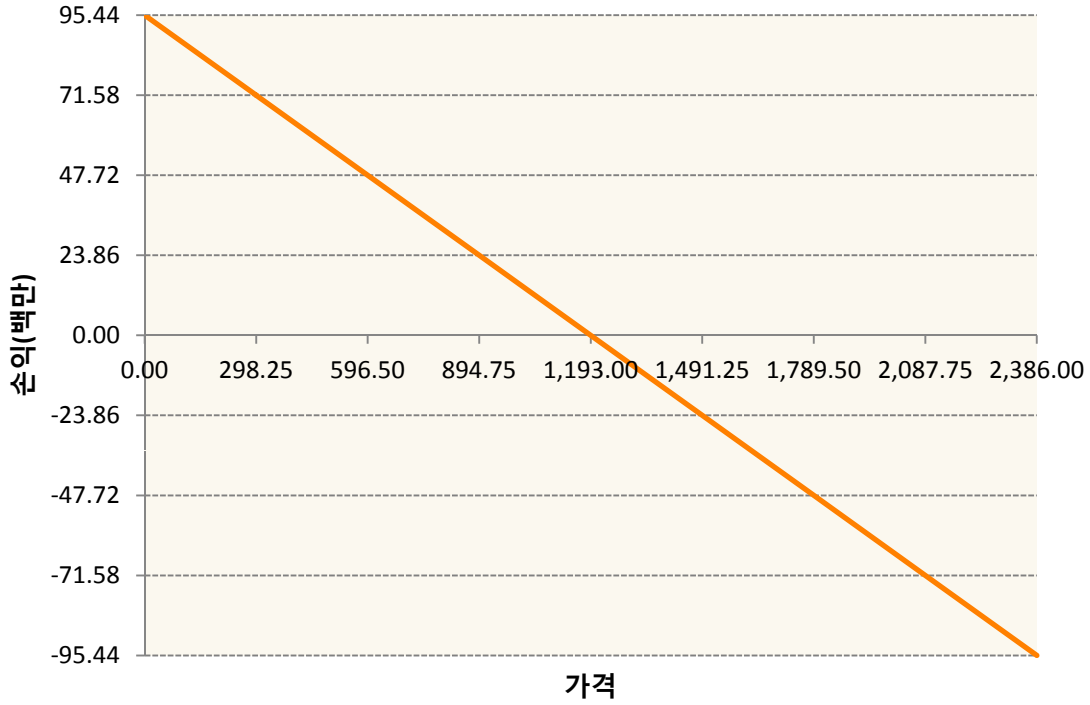


KC9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19

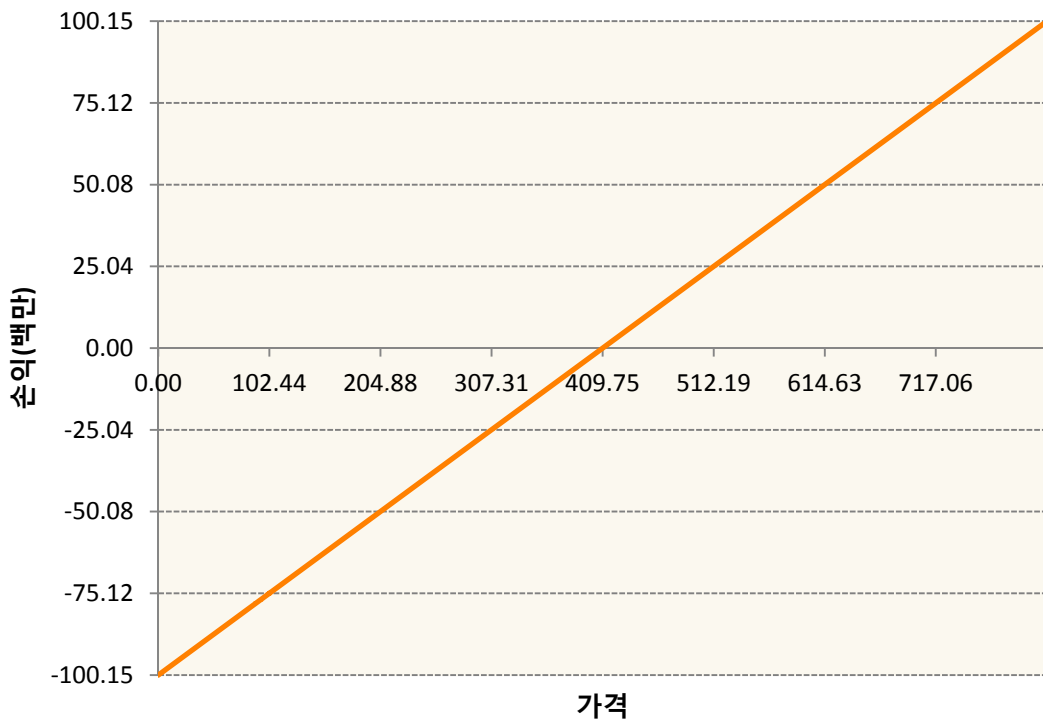




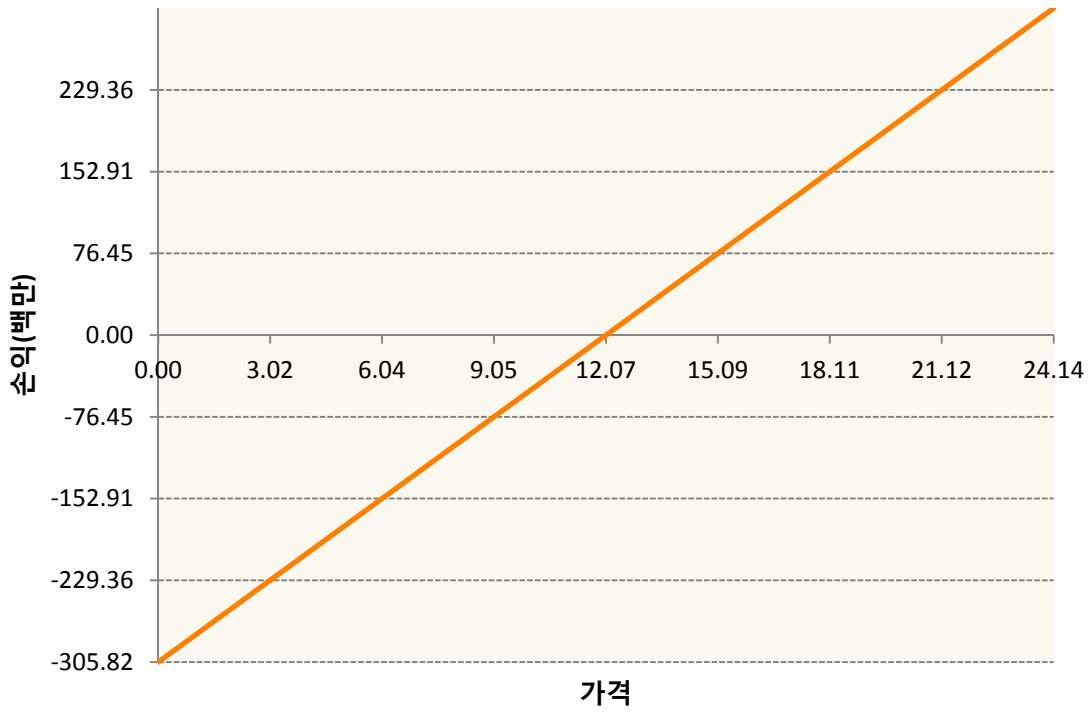
KR4175PA0005-2019-10 달러선물



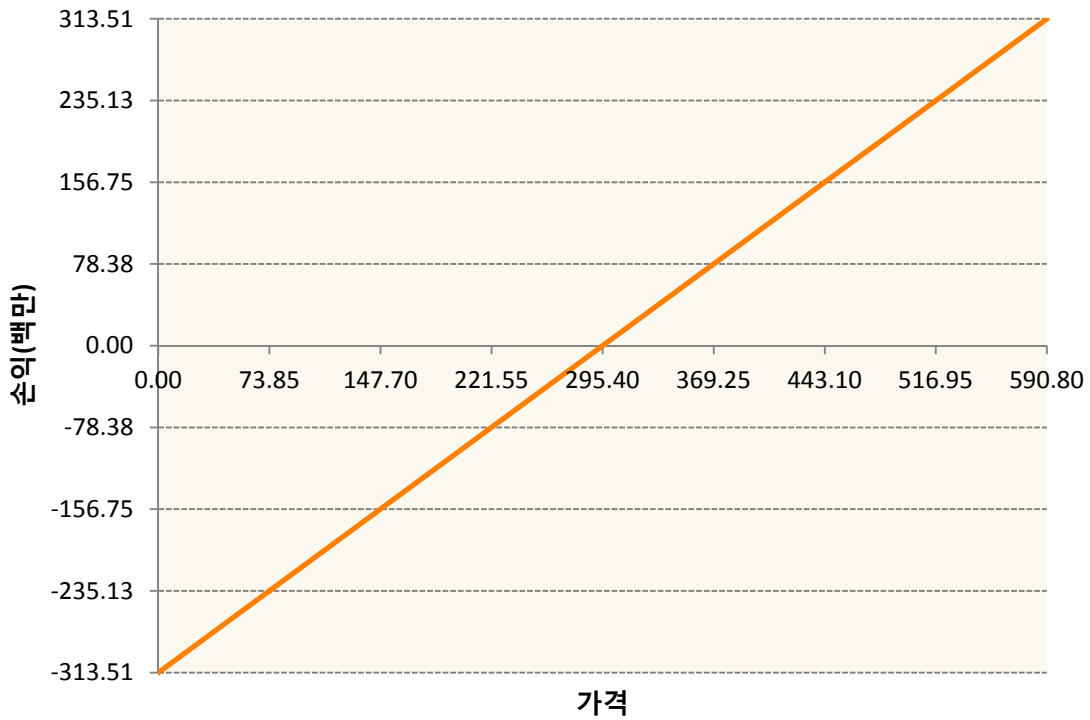
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



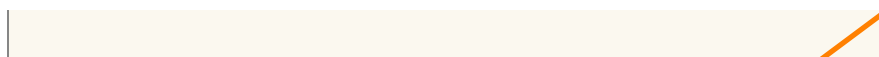
SBH0-Sugar Mar20

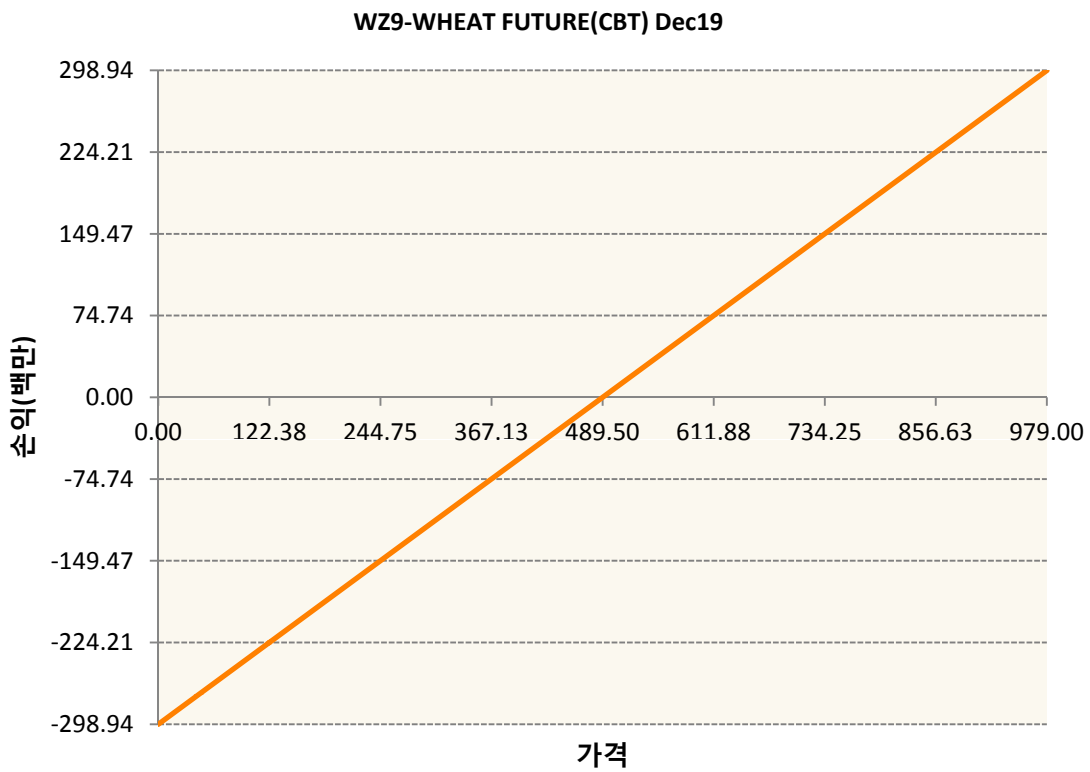
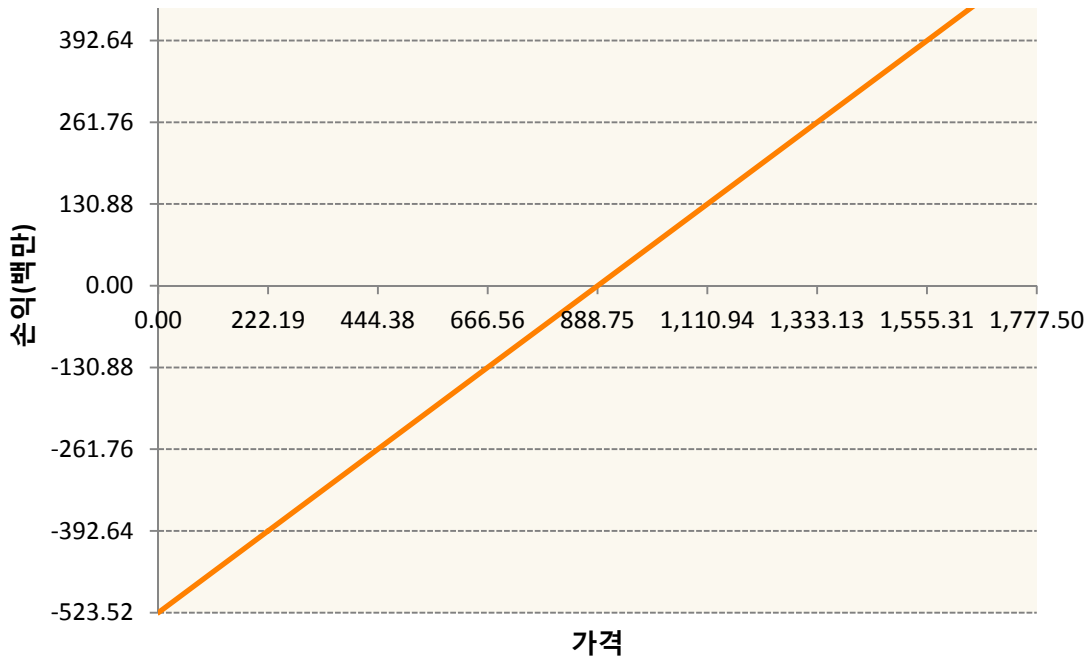


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





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	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)

248