

공시일	2019-09-24
기준일	2019-09-23

## 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)

96

공시일	2019-09-24
기준일	2019-09-23

## 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

1,181

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

675

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-24
기준일	2019-09-23

## 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)	391
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	143

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

850

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-24
기준일	2019-09-23

## 유로인덱스모(주식-파생형)

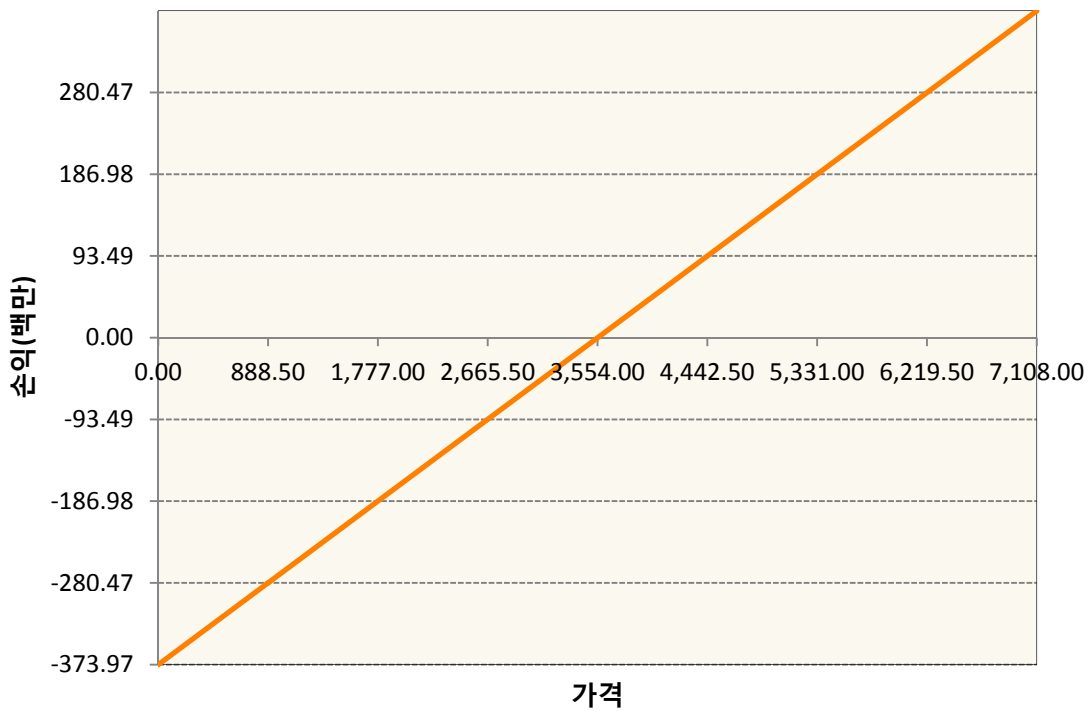
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	374	0	374	

### 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	2019-09-24
기준일	2019-09-23

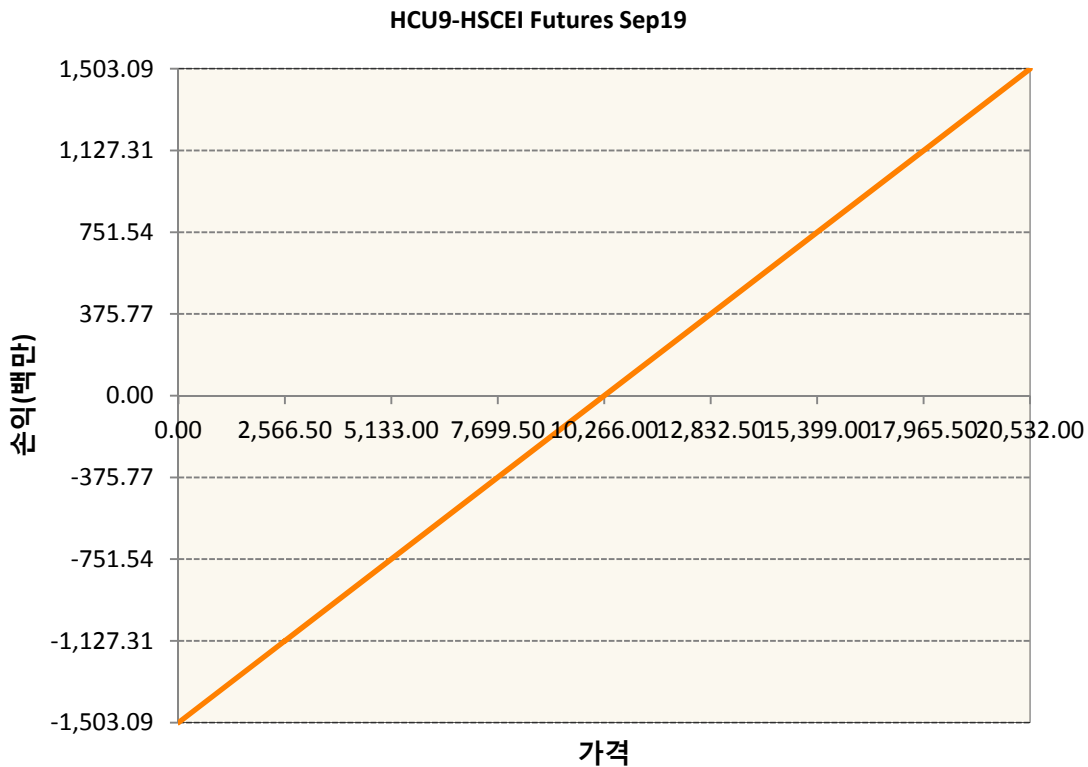
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,503	0	1,503	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU9	HSCEI Futures Sep19	120
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

<b>111</b>
------------

공시일	2019-09-24
기준일	2019-09-23

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

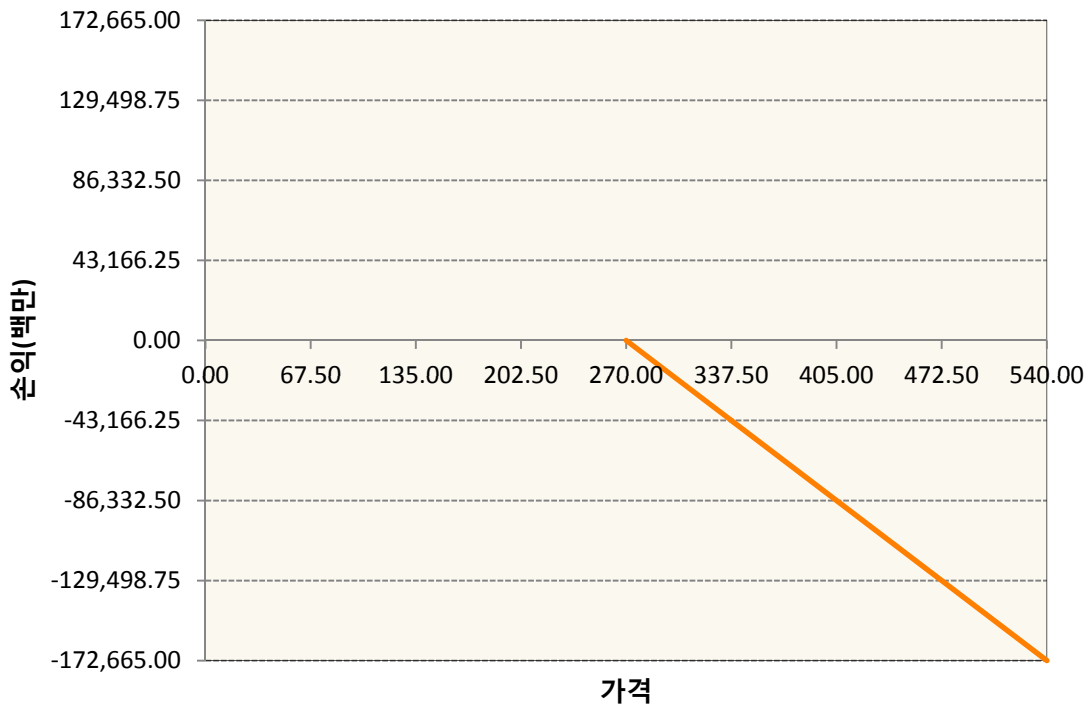
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

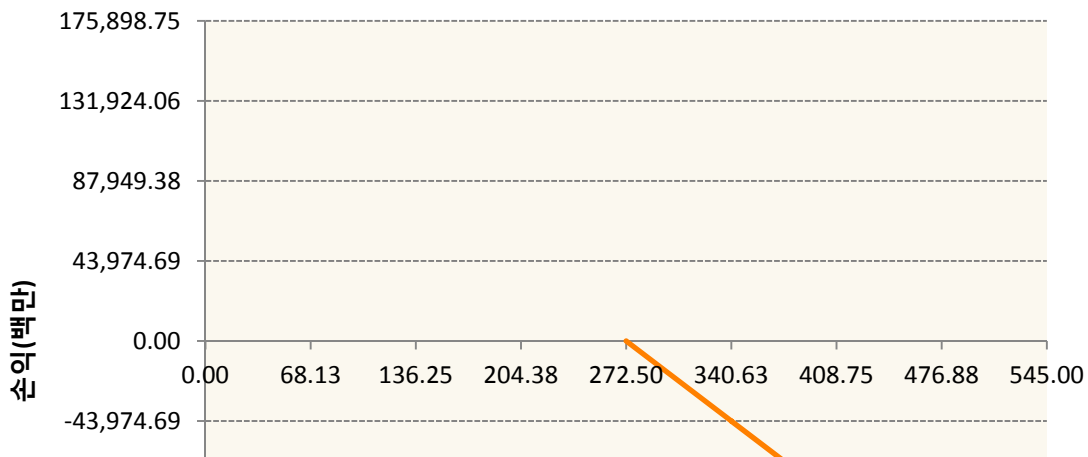
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	1,971	0	1,971	장내
누계	유가증권	옵션	0	517,314	-517,314	장내

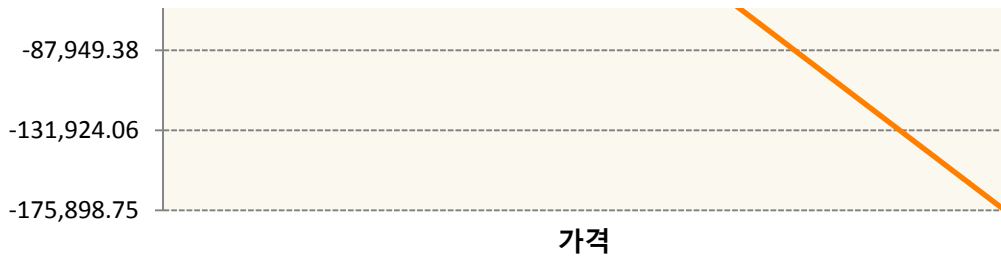
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201PA2702-2019-10 콜270**

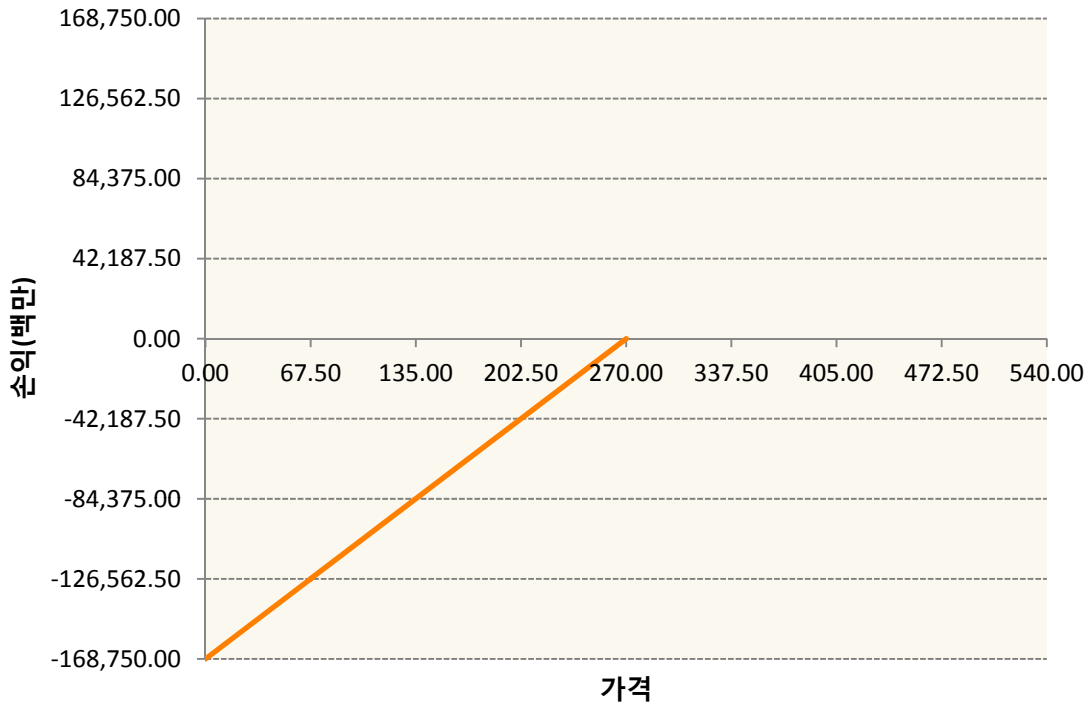


**KR4201PA2728-2019-10 콜272.5**





KR4301PA2701-2019-10 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PA2702		2019-10 콜270					12,380	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	6,104	5,975	5,823	5,651	5,463	5,260	5,045	
-5.33%	5,386	5,135	4,873	4,602	4,325	4,041	3,754	
-2.67%	3,716	3,394	3,071	2,748	2,425	2,102	1,779	
0%	874	589	298	0	-302	-608	-916	
2.67%	-2,948	-3,125	-3,323	-3,539	-3,770	-4,014	-4,267	
5.33%	-7,337	-7,417	-7,521	-7,647	-7,794	-7,959	-8,141	
8.00%	-11,960	-11,987	-12,030	-12,090	-12,169	-12,266	-12,380	
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5					12,036	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5,259	5,161	5,040	4,898	4,737	4,559	4,368	

-5.33%	4,747	4,531	4,299	4,054	3,798	3,533	3,261
-2.67%	3,423	3,107	2,790	2,470	2,149	1,828	1,505
0%	954	639	321	0	-322	-646	-971
2.67%	-2,603	-2,824	-3,063	-3,316	-3,581	-3,854	-4,136
5.33%	-6,875	-6,988	-7,126	-7,286	-7,466	-7,663	-7,875
8.00%	-11,483	-11,526	-11,588	-11,671	-11,774	-11,896	-12,036
KR4301PA2701 2019-10 풋270							9,250
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,087	-9,096	-9,111	-9,133	-9,164	-9,203	-9,250
-5.33%	-4,638	-4,715	-4,804	-4,903	-5,010	-5,125	-5,246
-2.67%	-1,174	-1,346	-1,518	-1,690	-1,862	-2,035	-2,208
0%	356	246	127	0	-134	-272	-416
2.67%	647	625	593	551	498	435	362
5.33%	669	667	663	657	645	628	605
8.00%	669	669	669	668	667	664	659

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

(단위:백만원)

**33,981**

공시일	2019-09-24
기준일	2019-09-23

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

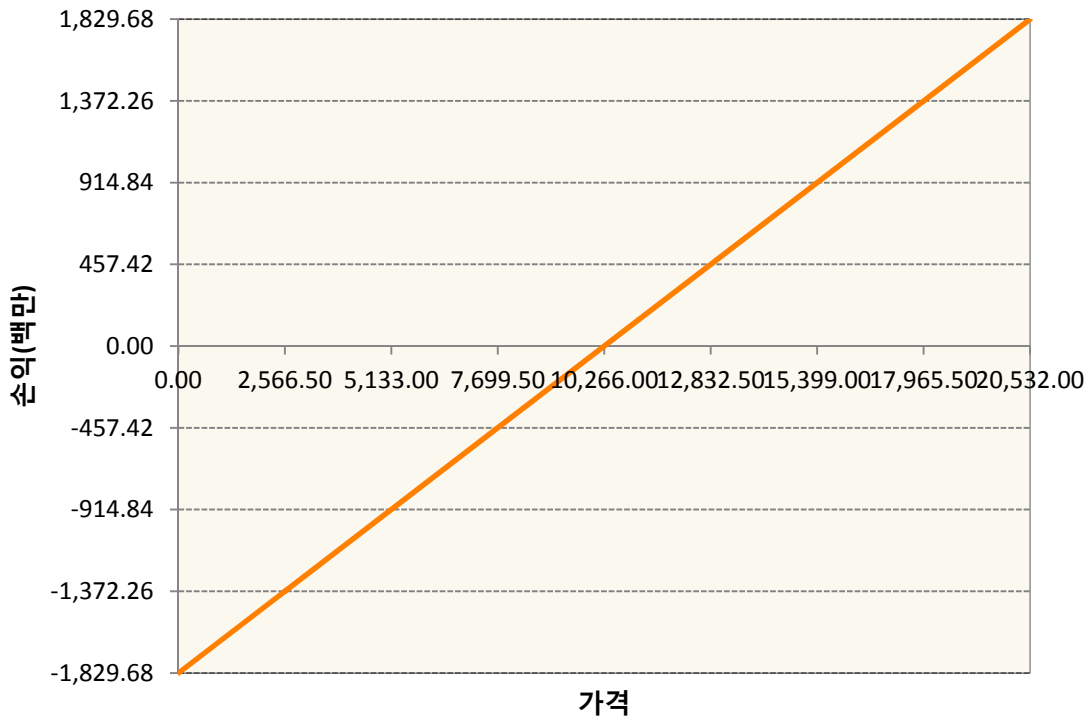
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

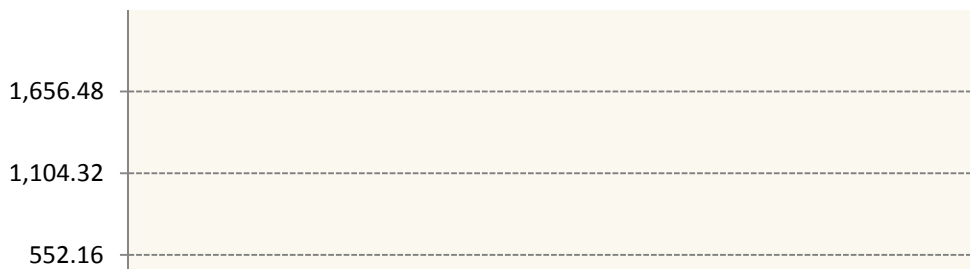
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,830	0	1,830	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,719	-4,719	장내
누계	통화	선도	685	2,830	-2,145	장외

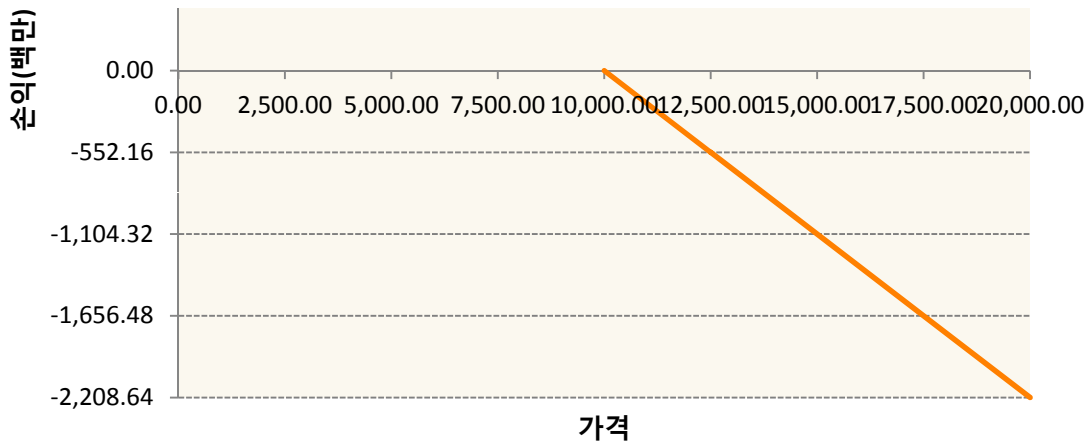
### 2. 만기시점의 손익구조

HCU9-HSCEI Futures Sep19

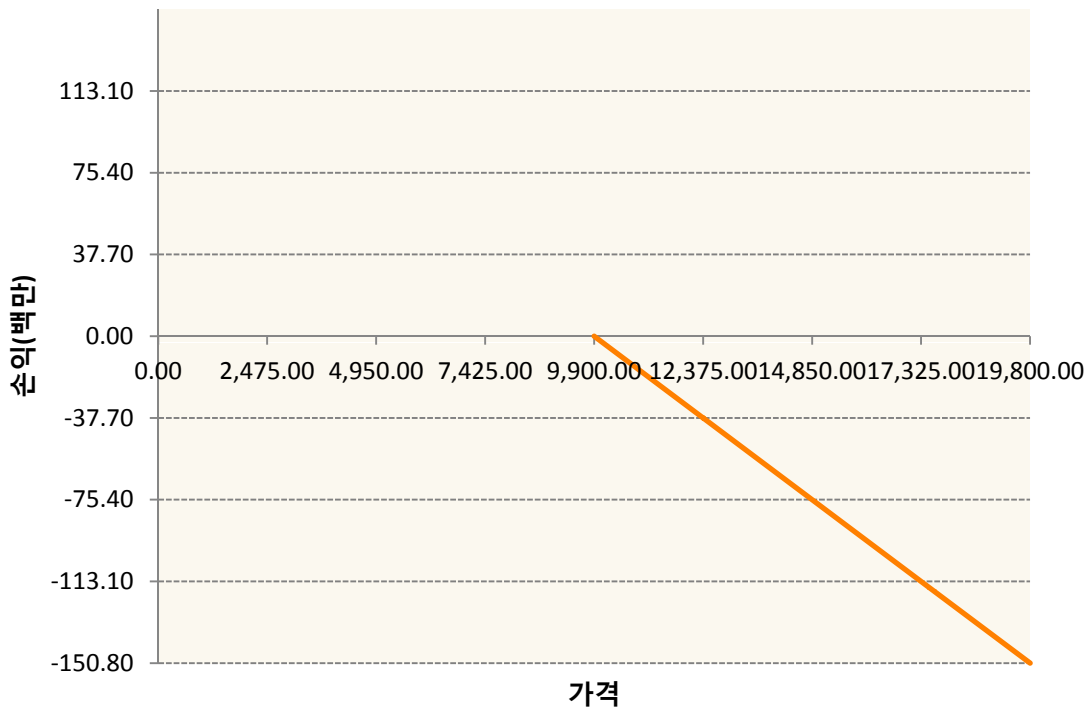


OHHIU9-C100-HSCEI

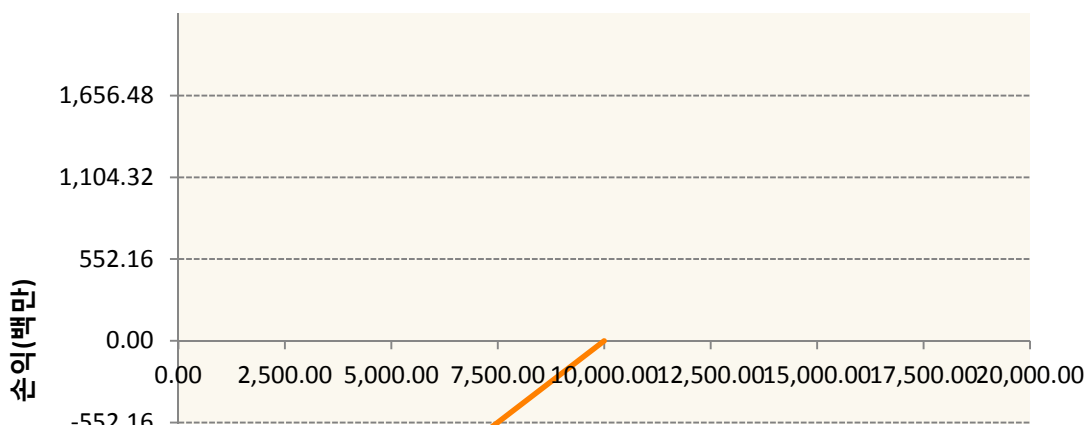


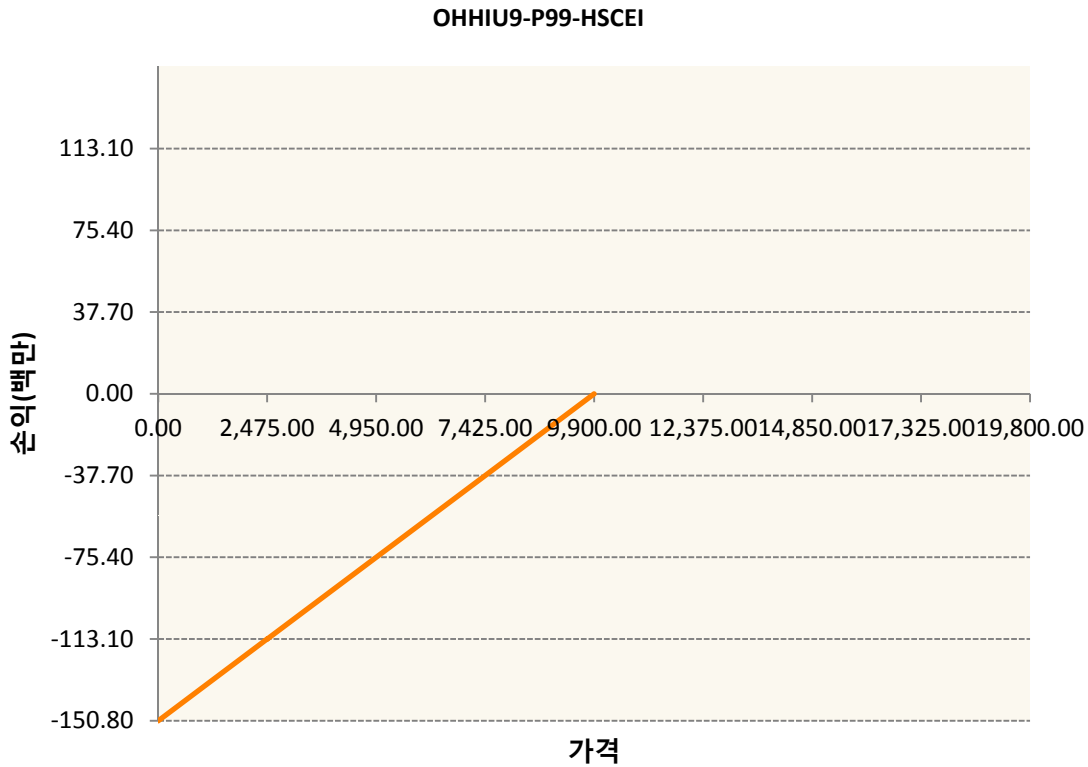


OHHIU9-C99-HSCEI



OHHIU9-P100-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	226
FX21019U00 HKD/KRW 22-11-19E	6
FX21019U02 HKD/KRW 22-11-19E	49
HCU9 HSCEI Futures Sep19	146
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)
	575

공시일	2019-09-24
기준일	2019-09-23

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

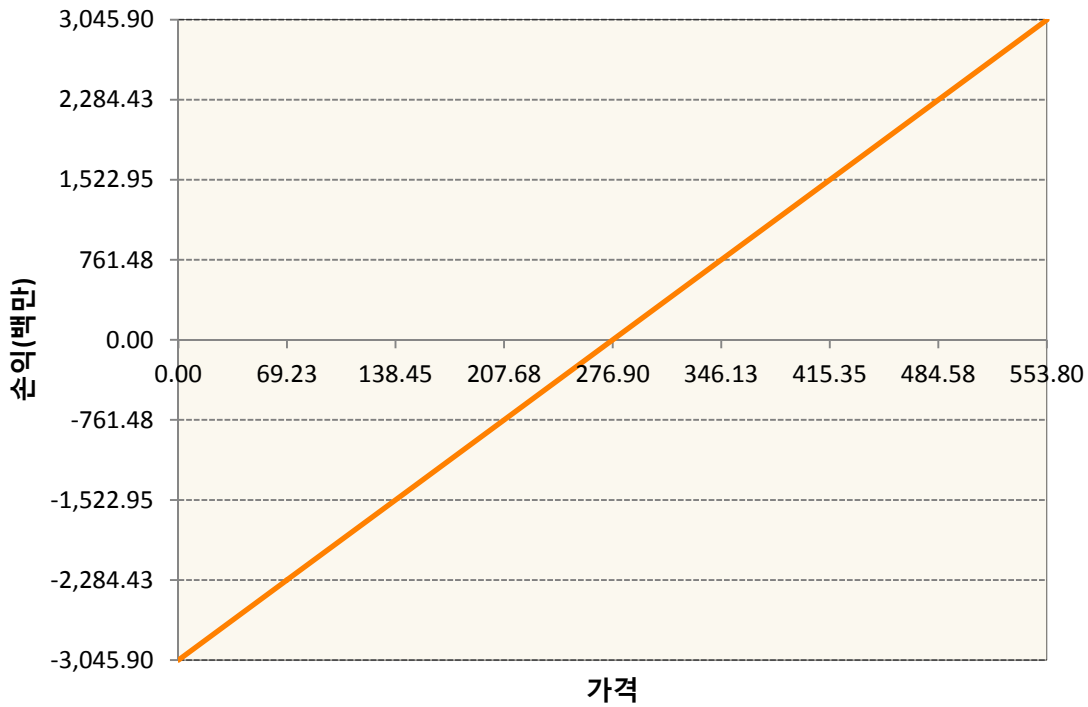
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

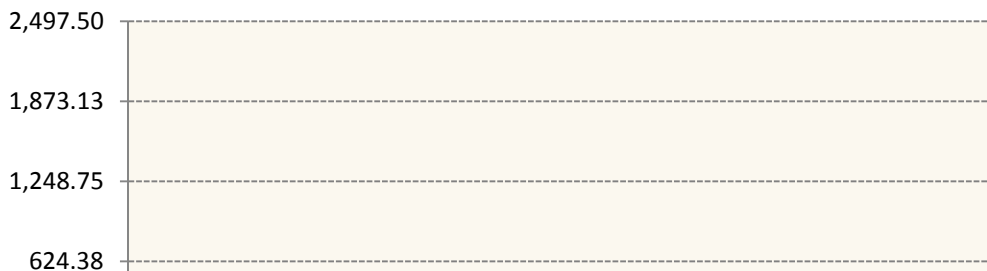
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,046	0	3,046	장내
누계	유가증권	스왑	14,125	0	14,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,828	-14,828	장내

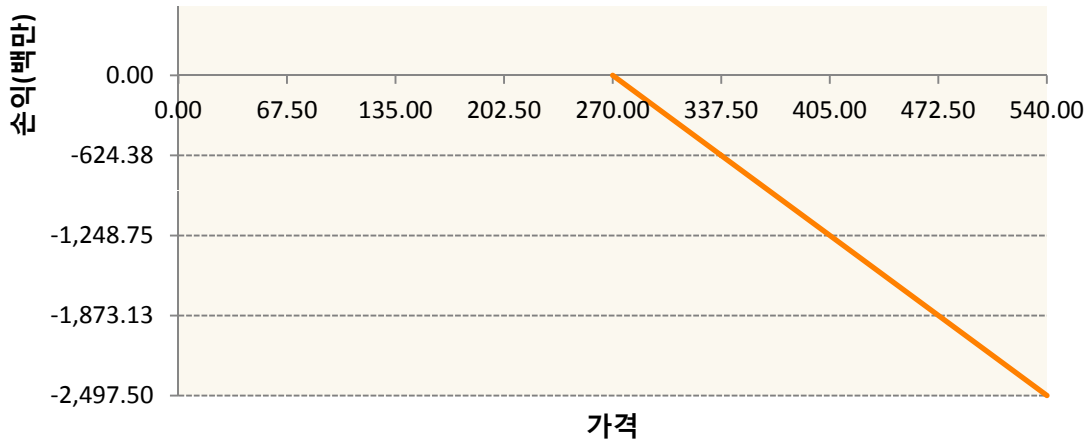
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

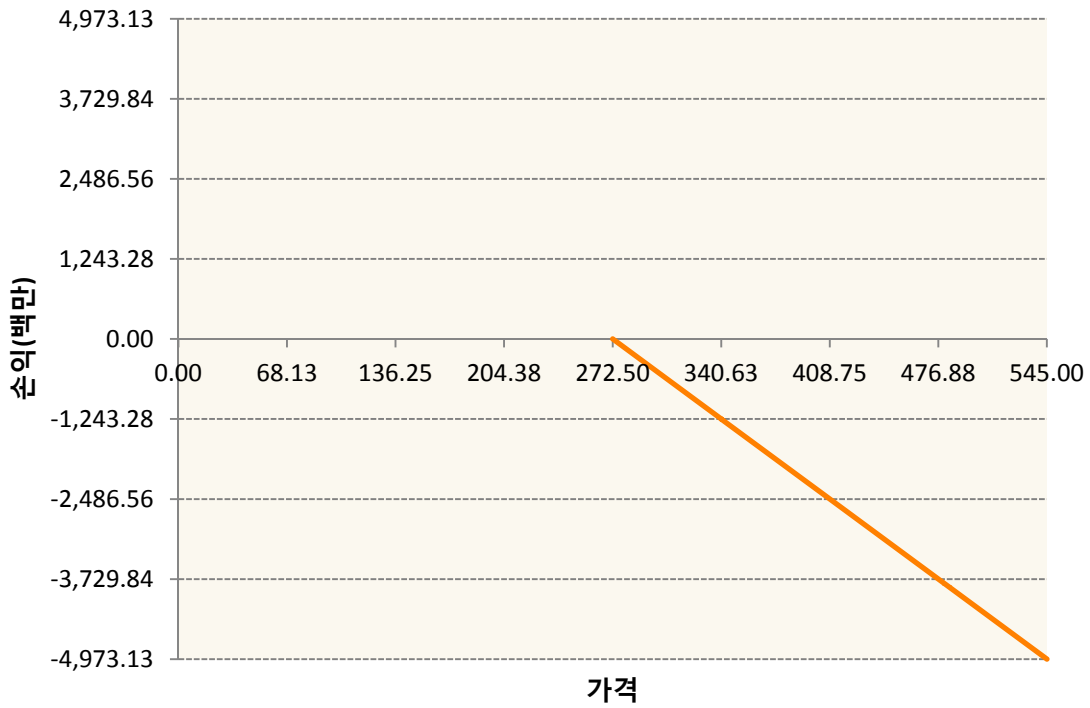


KR4201PA2702-2019-10 콜270

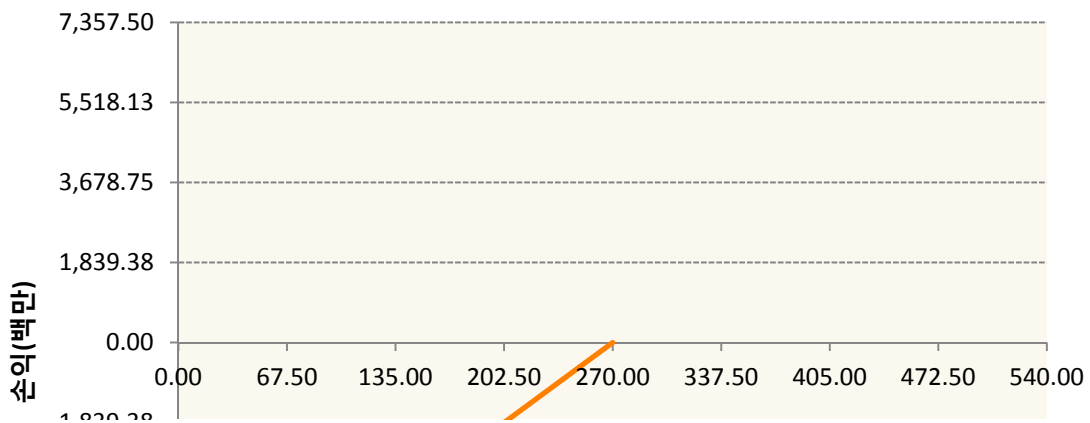




KR4201PA2728-2019-10 콜272.5



KR4301PA2701-2019-10 풋270





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						1,216
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,216	-1,216	-1,216	-1,216	-1,216	-1,216	-1,216	
-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%	1,216	1,216	1,216	1,216	1,216	1,216	1,216	
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						179
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	88	86	84	82	79	76	73	
-5.33%	78	74	70	67	63	58	54	
-2.67%	54	49	44	40	35	30	26	
0%	13	9	4	0	-4	-9	-13	
2.67%	-43	-45	-48	-51	-55	-58	-62	
5.33%	-106	-107	-109	-111	-113	-115	-118	
8.00%	-173	-173	-174	-175	-176	-177	-179	
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5						340
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	149	146	142	138	134	129	123
-5.33%	134	128	122	115	107	100	92
-2.67%	97	88	79	70	61	52	43
0%	27	18	9	0	-9	-18	-27
2.67%	-74	-80	-87	-94	-101	-109	-117
5.33%	-194	-198	-201	-206	-211	-217	-223
8.00%	-325	-326	-328	-330	-333	-336	-340
KR4301PA2701                      2019-10 풋270							403
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-396	-397	-397	-398	-400	-401	-403
-5.33%	-202	-206	-209	-214	-218	-223	-229
-2.67%	-51	-59	-66	-74	-81	-89	-96
0%	16	11	6	0	-6	-12	-18
2.67%	28	27	26	24	22	19	16
5.33%	29	29	29	29	28	27	26
8.00%	29	29	29	29	29	29	29

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

(단위:백만원)

**2,339**

공시일	2019-09-24
기준일	2019-09-23

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

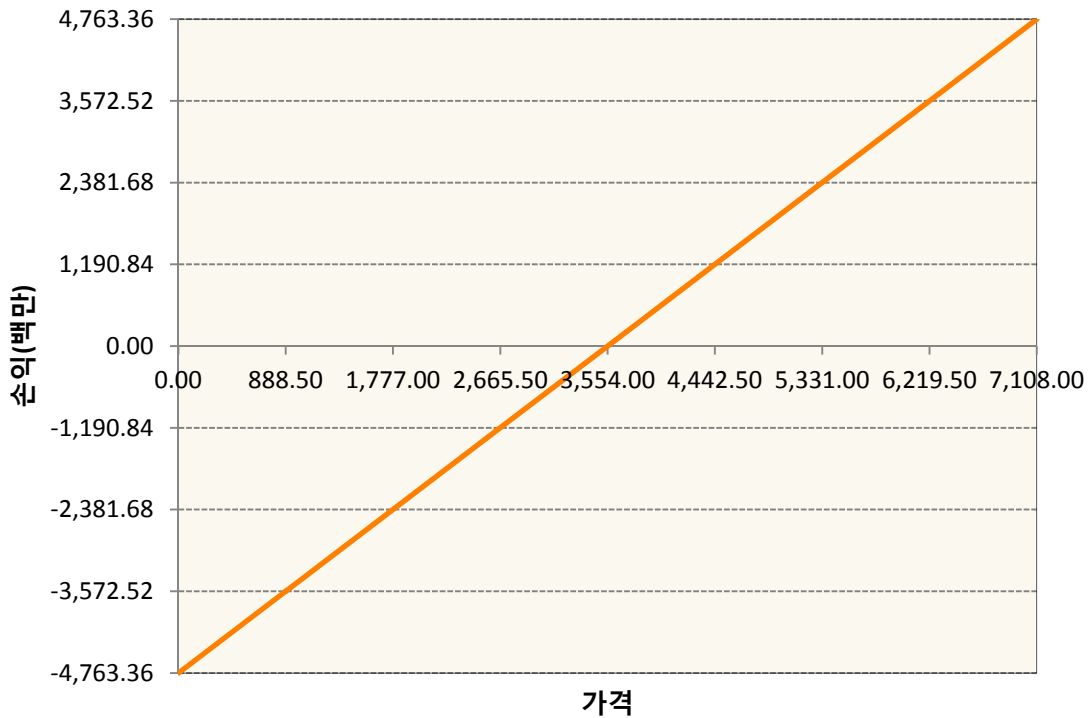
### 1. 계약금액

(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	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,763	0	4,763	
누계	유가증권	스왑	23,910	0	23,910	장외
누계	통화	선도	10,906	17,082	-6,176	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

VGZ9-EURO STOXX 50 Dec19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	18
FX21019M02 KRW/EUR 27-09-19E	1,051
FX21019N00 KRW/EUR 27-09-19E	315
FX21019N03 EUR/KRW 27-09-19E	315
FX21019N04 EUR/KRW 27-09-19E	231
FX21019Q00 EUR/KRW 27-09-19E	168

FX21019U02 EUR/KRW 27-09-19E  
VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19

158
381

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

(단위:백만원)

<b>1,361</b>
--------------



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



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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-09-24
기준일	2019-09-23

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

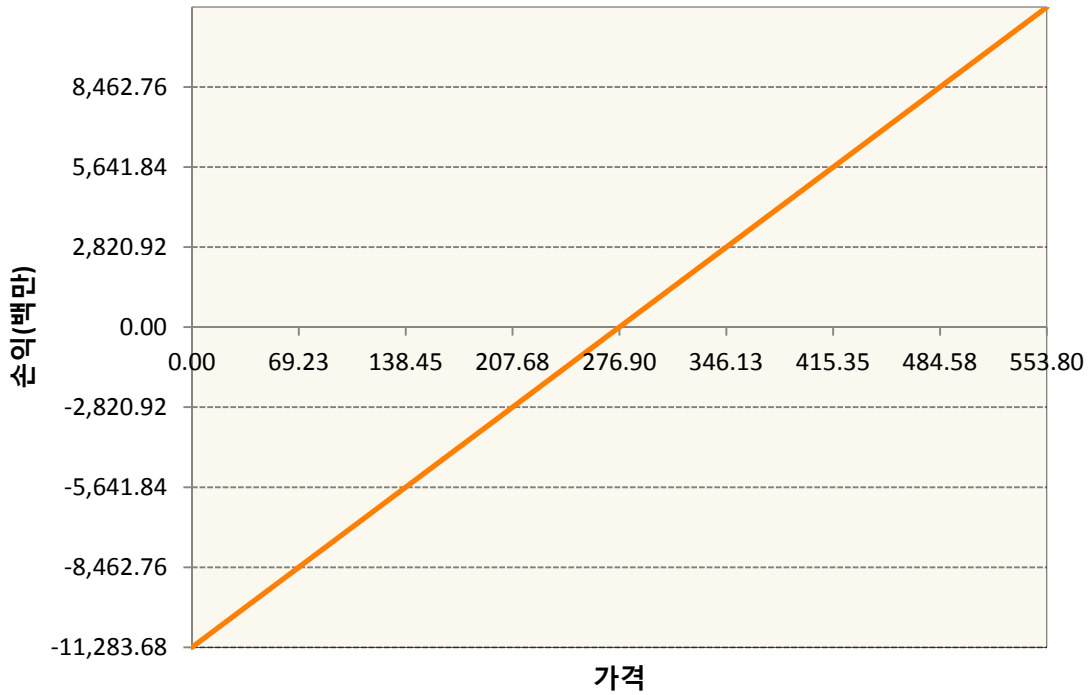
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

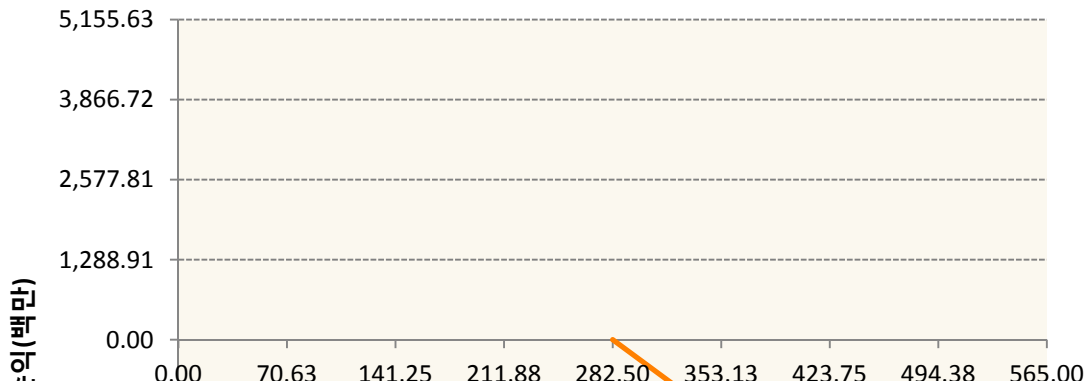
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,284	0	11,284	장내
누계	유가증권	옵션	1,422	20,831	-19,409	장내

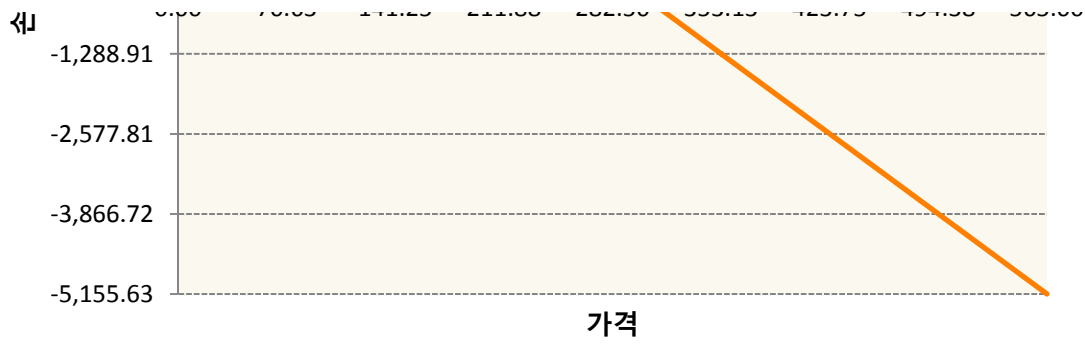
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

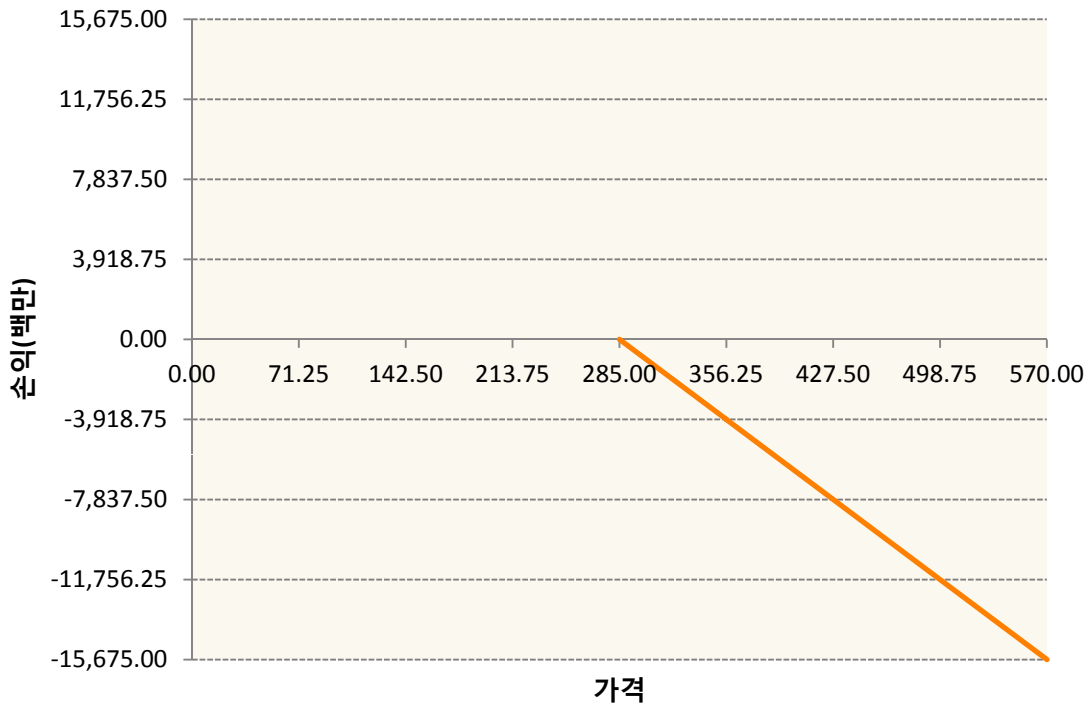


KR4201PA2827-2019-10 콜282.5

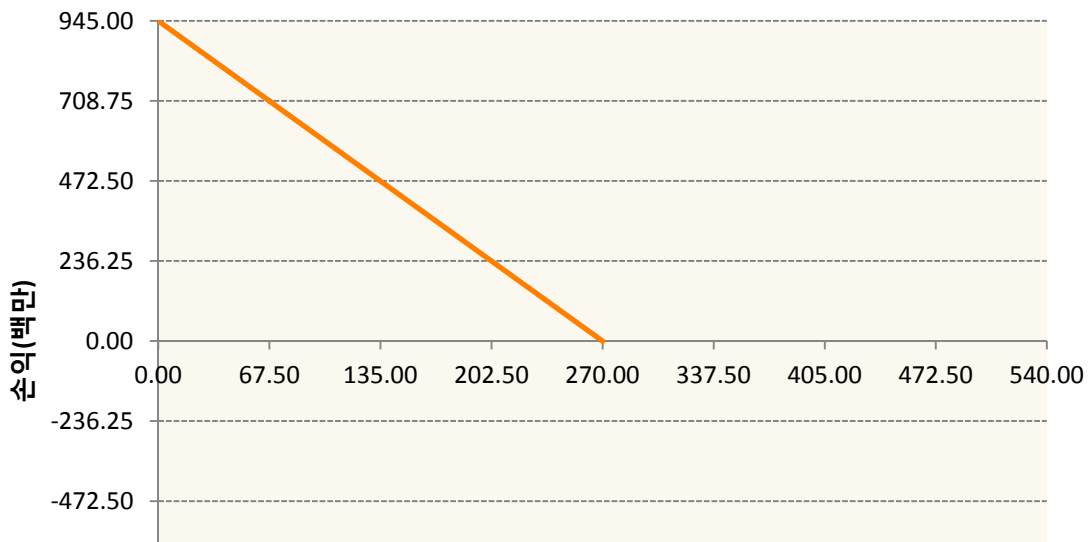


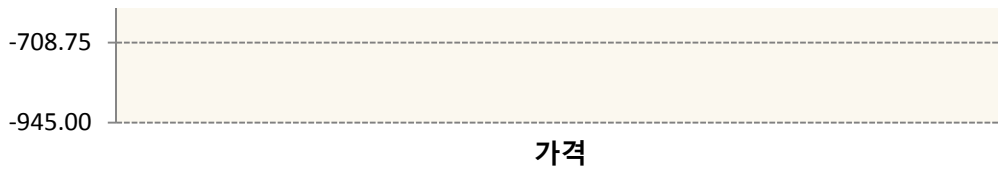


**KR4201PA2850-2019-10 콜285**

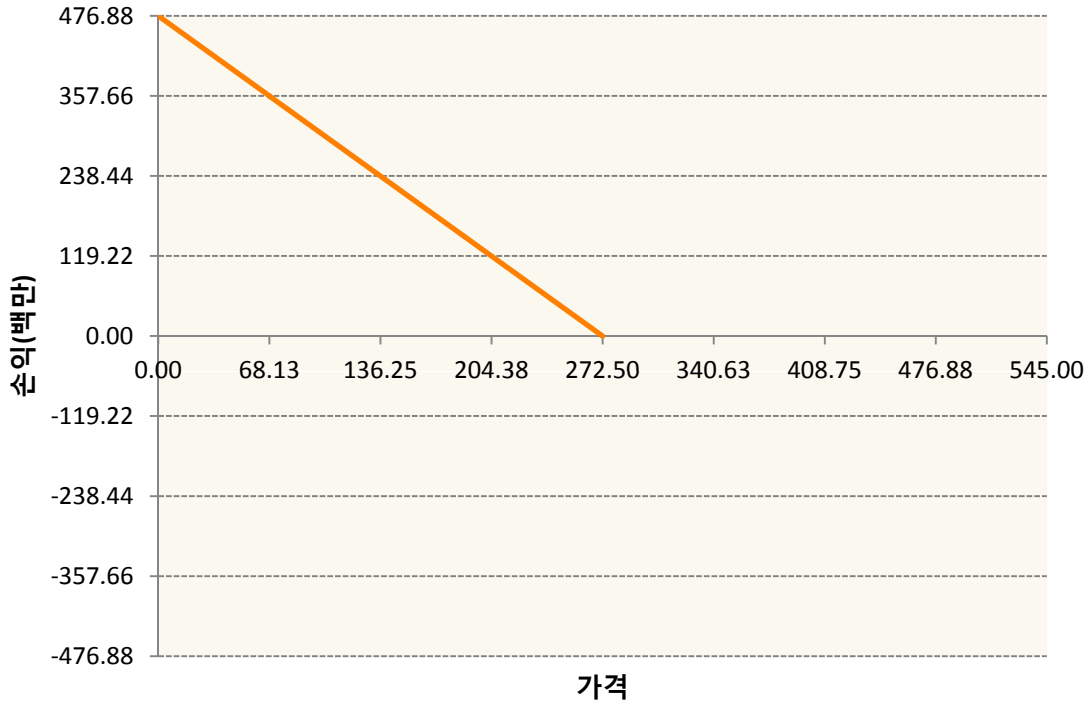


**KR4301PA2701-2019-10 풋270**





KR4301PA2727-2019-10 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						902
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-902	-902	-902	-902	-902	-902	-902	
-5.33%	-601	-601	-601	-601	-601	-601	-601	
-2.67%	-301	-301	-301	-301	-301	-301	-301	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	301	301	301	301	301	301	301	
5.33%	601	601	601	601	601	601	601	
8.00%	902	902	902	902	902	902	902	
KR4201PA2827		2019-10 콜282.5						272
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	68	67	66	65	63	61	58	
-5.33%	65	63	60	57	53	48	43	
-2.67%	55	50	44	38	31	24	17	

0%	26	18	9	0	-9	-18	-27
2.67%	-32	-42	-51	-61	-71	-80	-90
5.33%	-122	-130	-138	-146	-155	-163	-172
8.00%	-236	-240	-246	-252	-258	-265	-272
KR4201PA2850 2019-10 콜285							759
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	162	161	159	156	152	146	139
-5.33%	158	153	147	139	129	117	104
-2.67%	137	124	110	93	76	56	36
0%	72	49	25	0	-25	-51	-78
2.67%	-72	-101	-130	-159	-189	-218	-247
5.33%	-311	-337	-364	-392	-420	-448	-476
8.00%	-633	-650	-669	-690	-712	-735	-759
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	51	52	52
-5.33%	26	26	27	27	28	29	29
-2.67%	7	8	9	9	10	11	12
0%	-2	-1	-1	0	1	2	2
2.67%	-4	-4	-3	-3	-3	-2	-2
5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-3
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	-2	-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)

1,743

공시일	2019-09-24
기준일	2019-09-23

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,388	0	2,388	
누계	유가증권	수익증권	98,493	0	98,493	

### 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	2019-09-24
기준일	2019-09-23

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,582	0	3,582	
누계	유가증권	수익증권	127,494	0	127,494	

### 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	2019-09-24
기준일	2019-09-23

## 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	460,270	0	460,270	
누계	통화	선도	0	514,733	-514,733	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,916
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,534
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	2,675
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E	191
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E	287
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E	287
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E	191
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E	1,375
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E	2,044
FX21019U01 KRW/USD 10-10-19E	287
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E	191
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E	2,331
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	2,971
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	3,152
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	2,617
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E	1,910
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E	2,006

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

(단위:백만원)

13,685

공시일	2019-09-24
기준일	2019-09-23

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

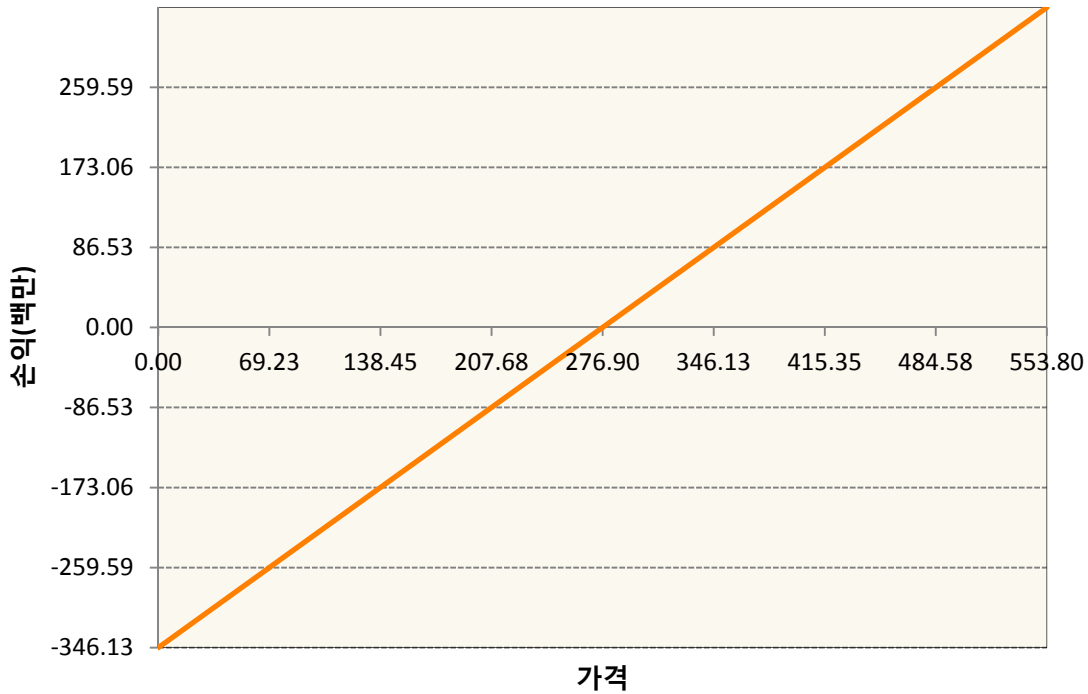
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

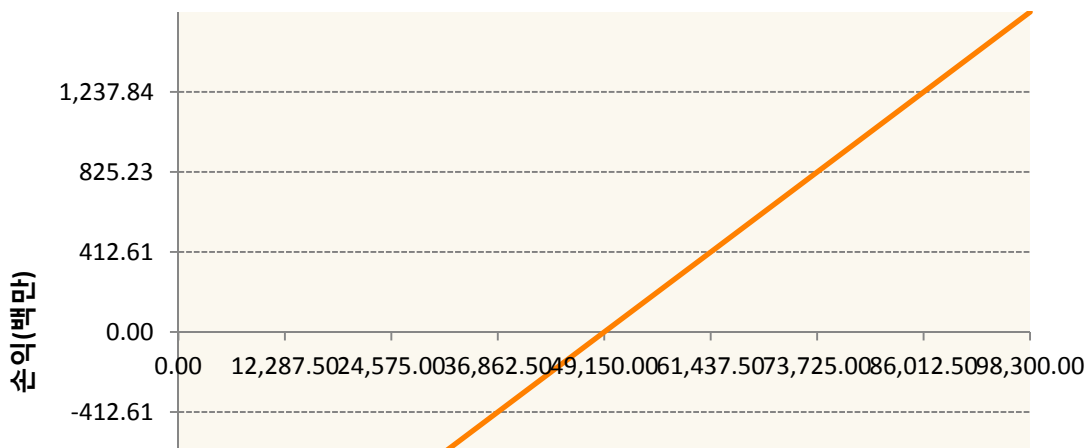
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,997	0	1,997	장내

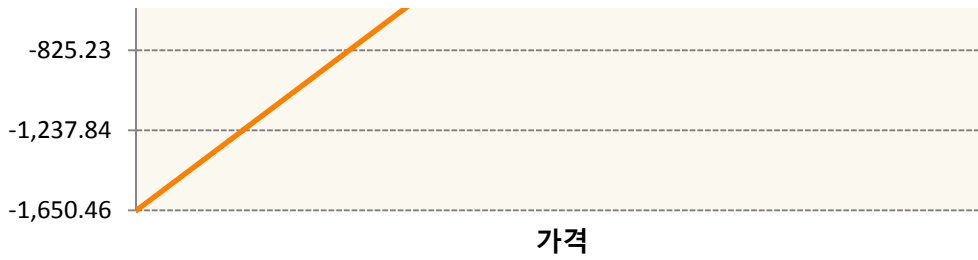
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



KR4111PA0002-2019-10 삼성전자개별선물





**3. 시나리오 별 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	2019-09-24
기준일	2019-09-23

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

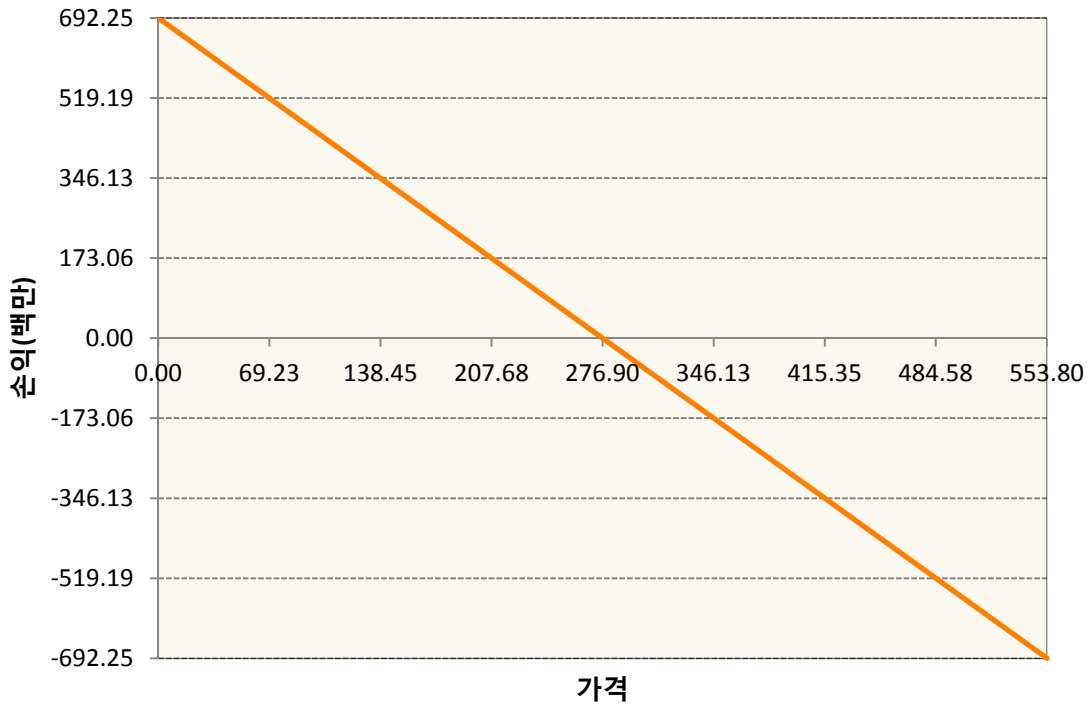
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

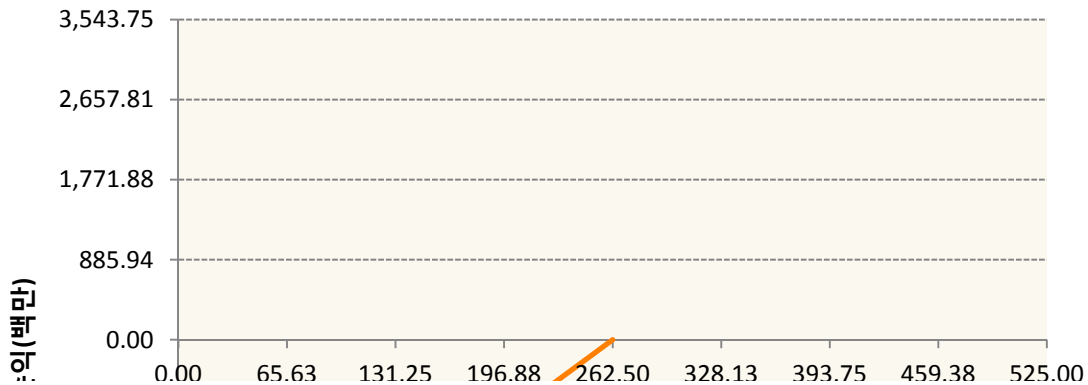
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	66	-66	장내
누계	유가증권	선물	0	692	-692	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,941	-3,941	장내

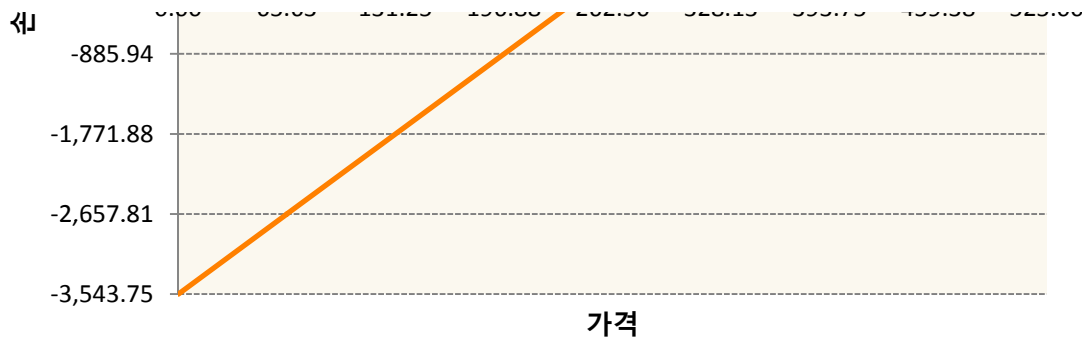
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

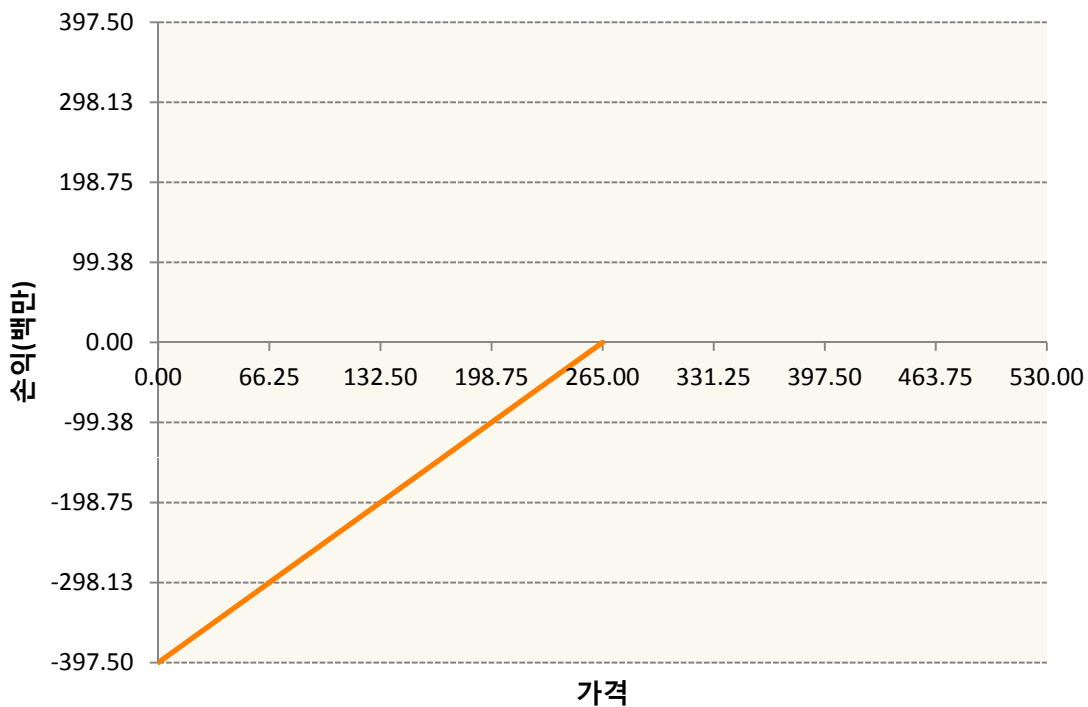


KR4301PA2628-2019-10 풋262.5





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						123
	기초자산의 변동성							



공시일	2019-09-24
기준일	2019-09-23

## 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	18,272	0	18,272	
누계	통화	선도	0	18,268	-18,268	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		478
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		611
FX21019U03 KRW/USD 25-09-19E		48

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

(단위:백만원)

<b>486</b>
------------

공시일	2019-09-24
기준일	2019-09-23

## 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	118	131	-13	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
FX21019U04 EUR/KRW 22-11-19E	2

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

(단위:백만원)

37
----

공시일	2019-09-24
기준일	2019-09-23

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

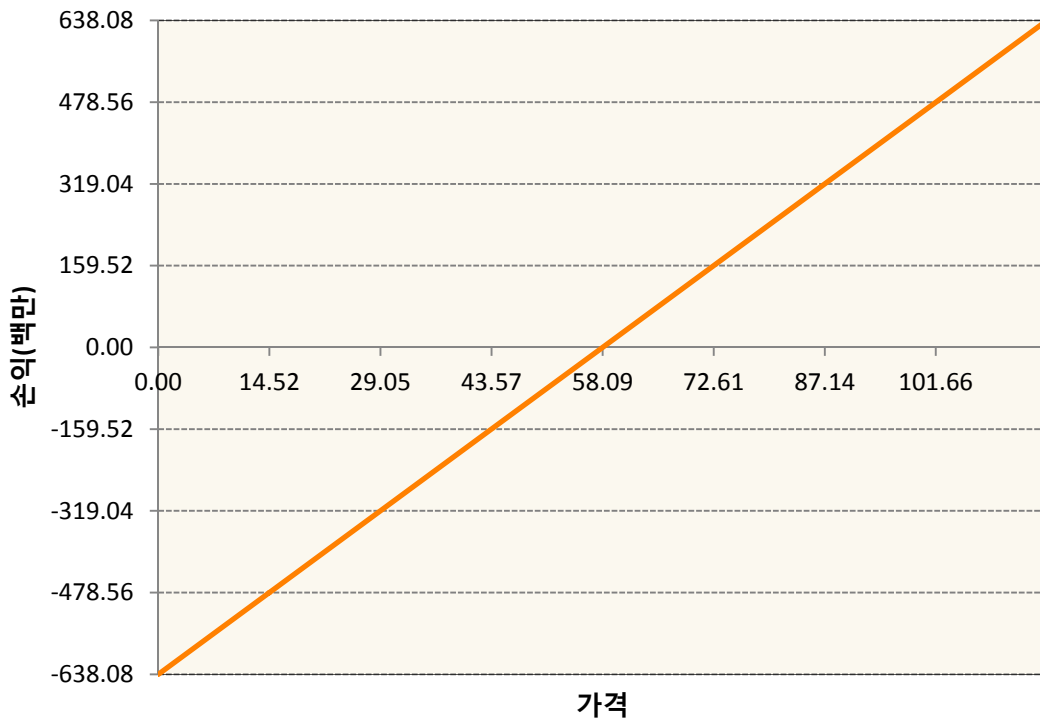
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

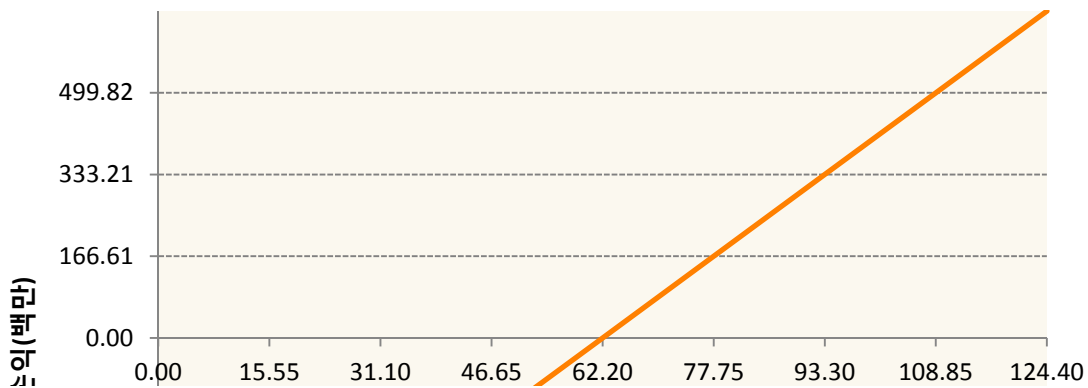
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,435	477	1,957	
누계	유가증권	선물	203	0	203	장내

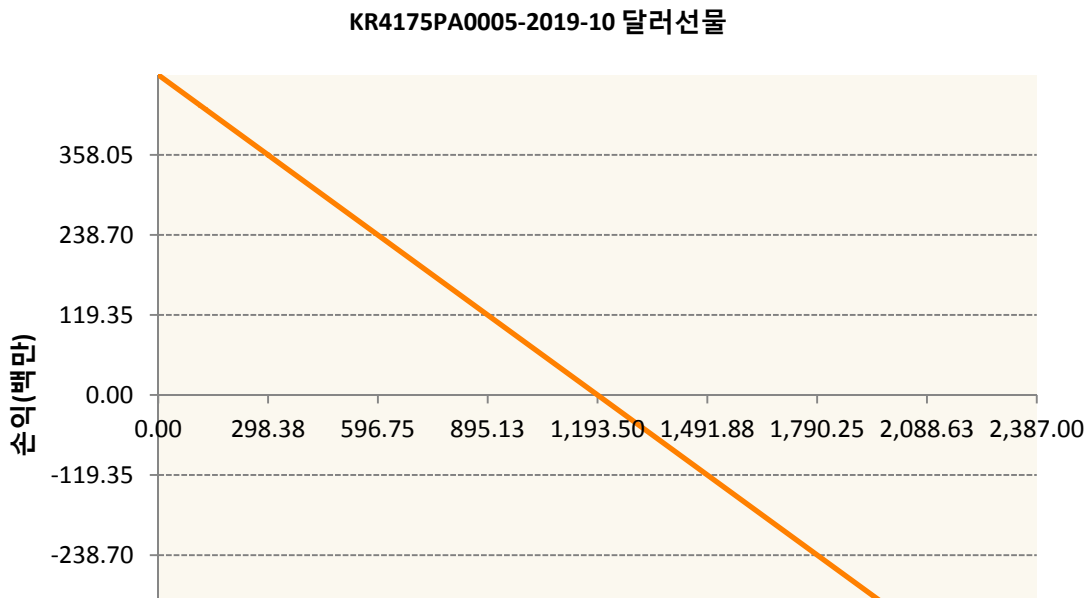
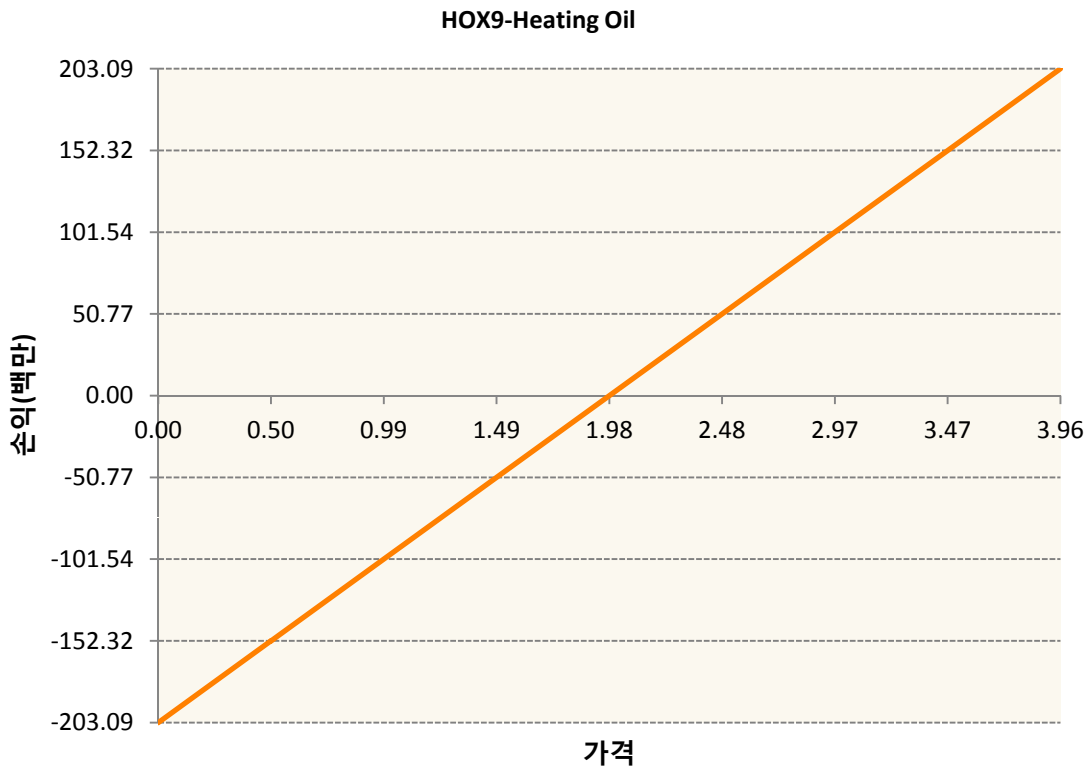
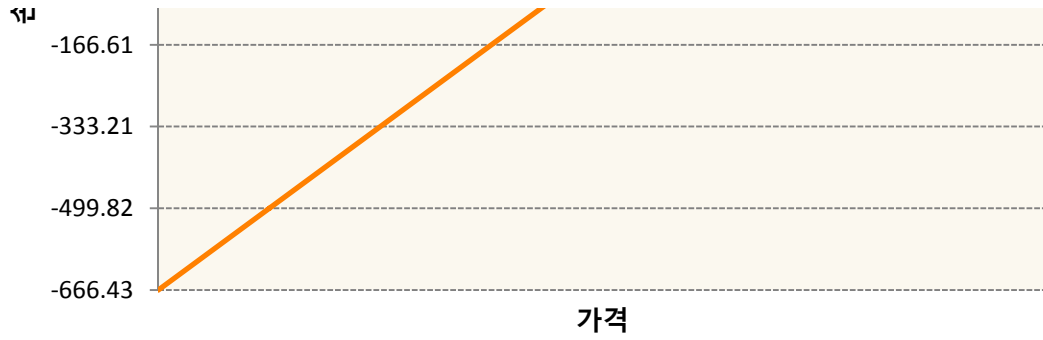
### 2. 만기시점의 손익구조

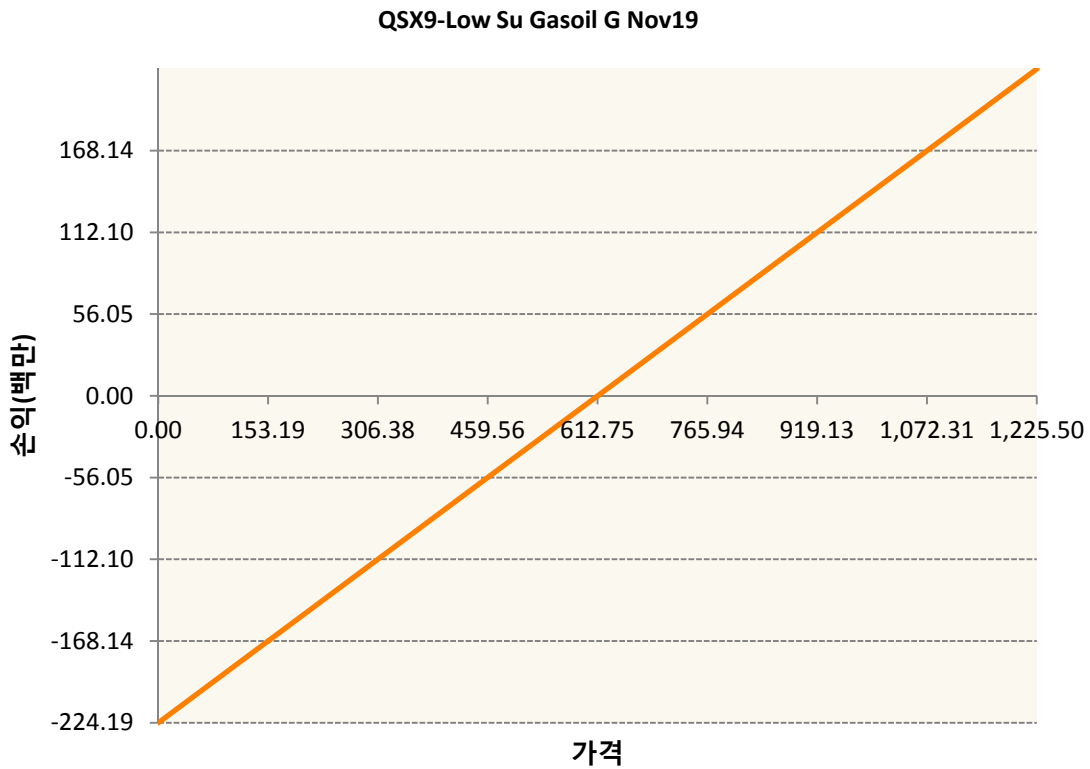
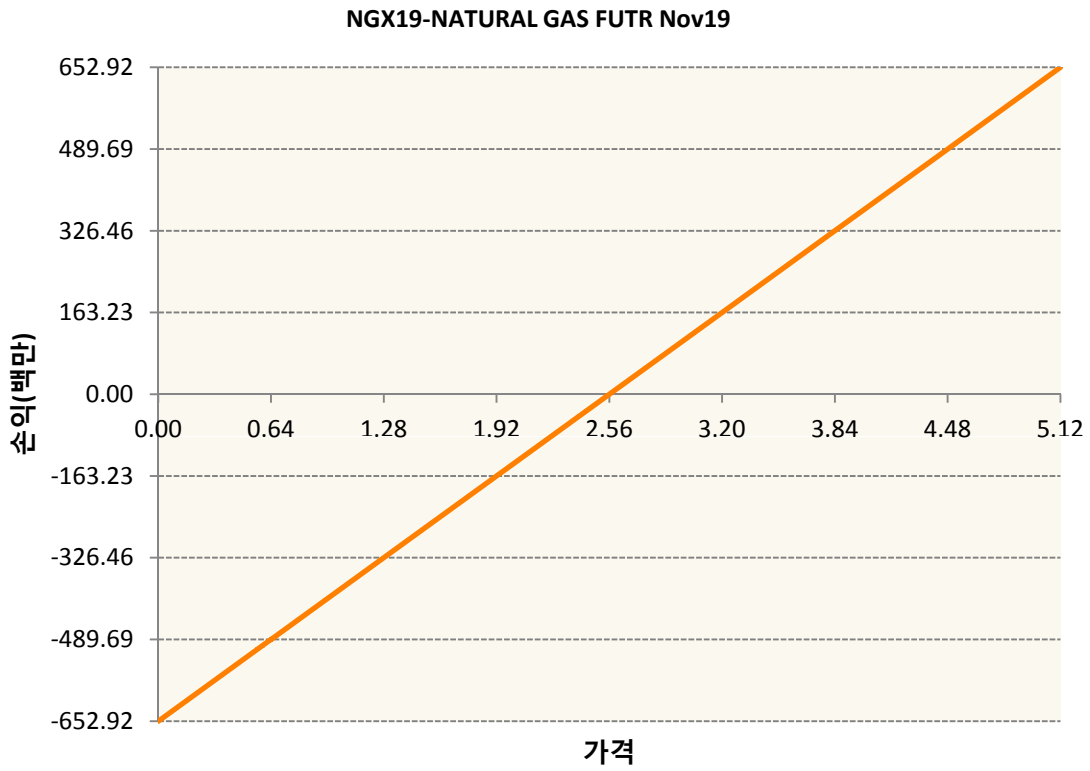
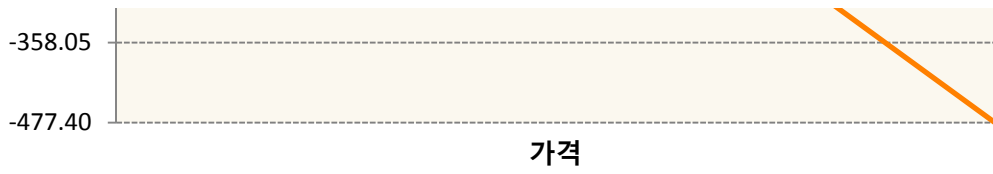
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19



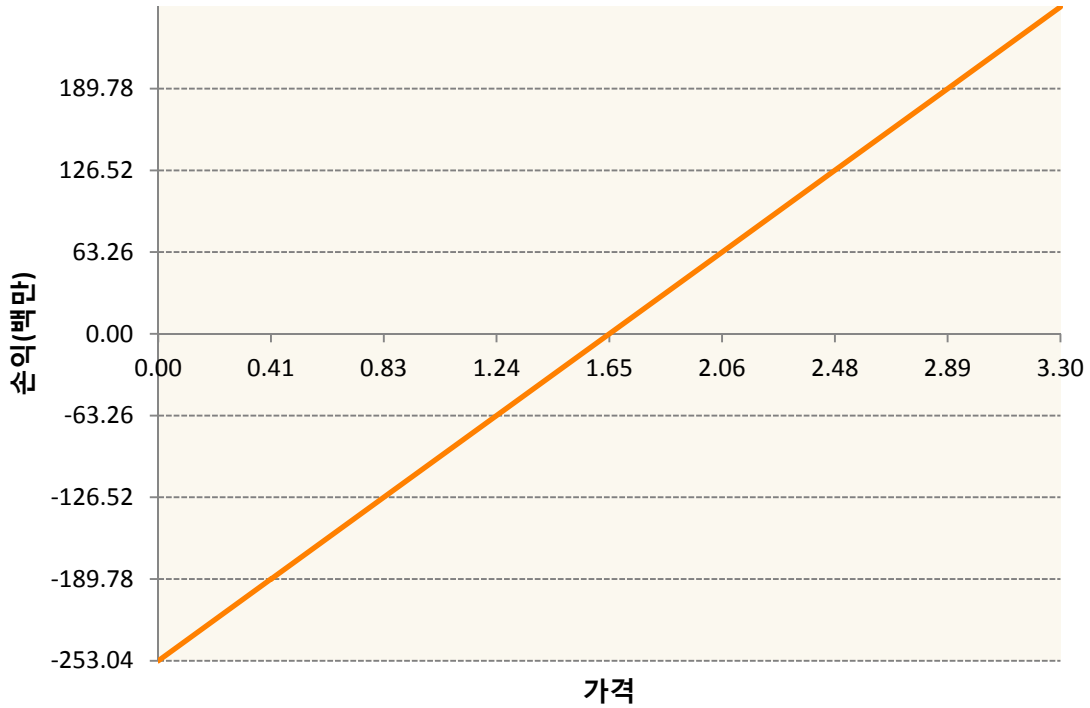
COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20







**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	52
QSX9	Low Su Gasoil G Nov19	18
XBX9	GASOLINE RBOB FUT Nov19	20

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

(단위:백만원)

**441**

공시일	2019-09-24
기준일	2019-09-23

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

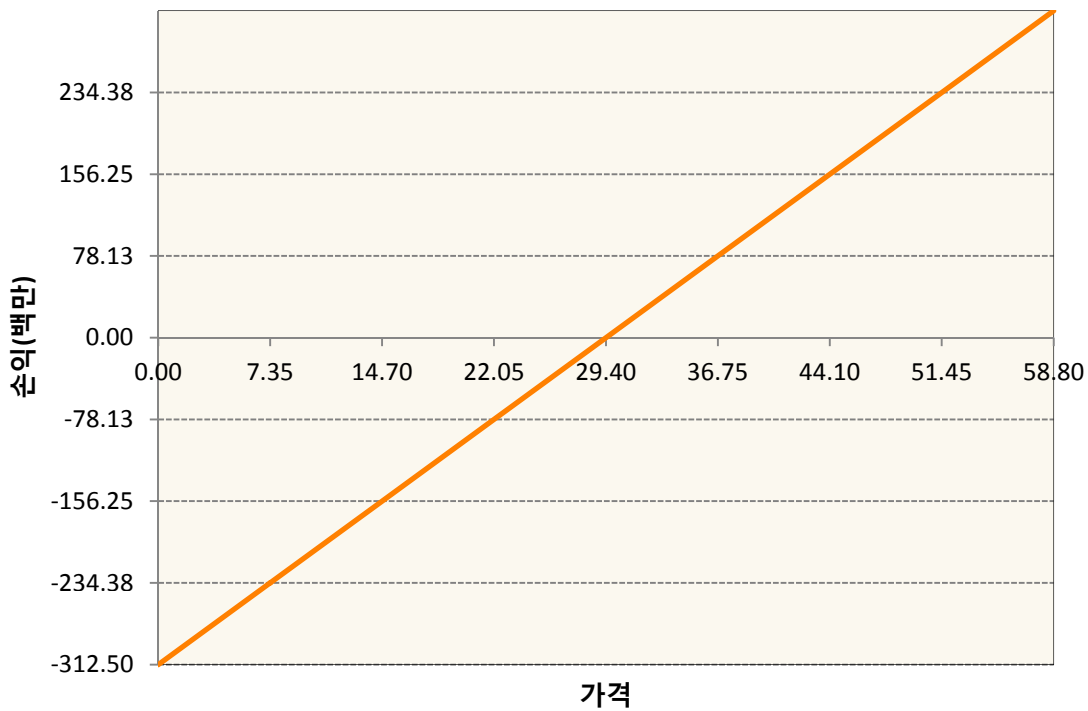
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

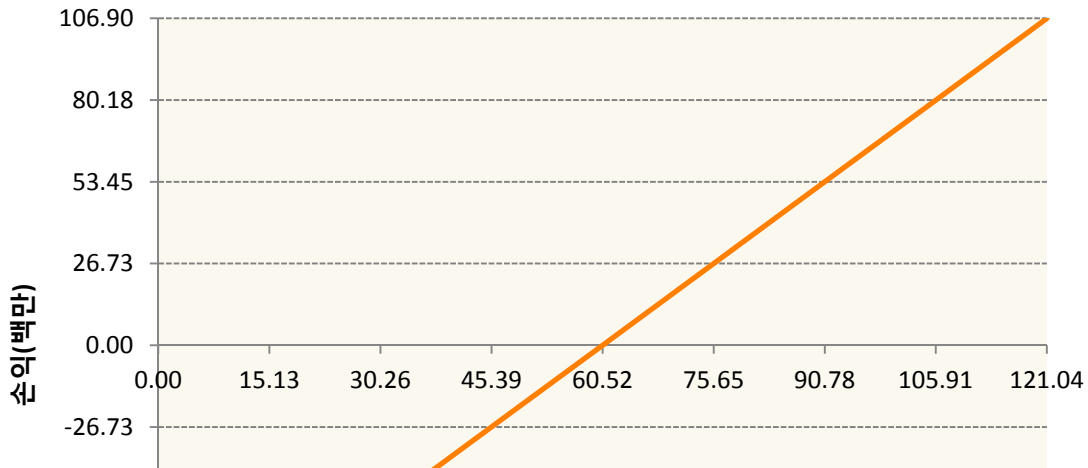
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,746	95	2,651	

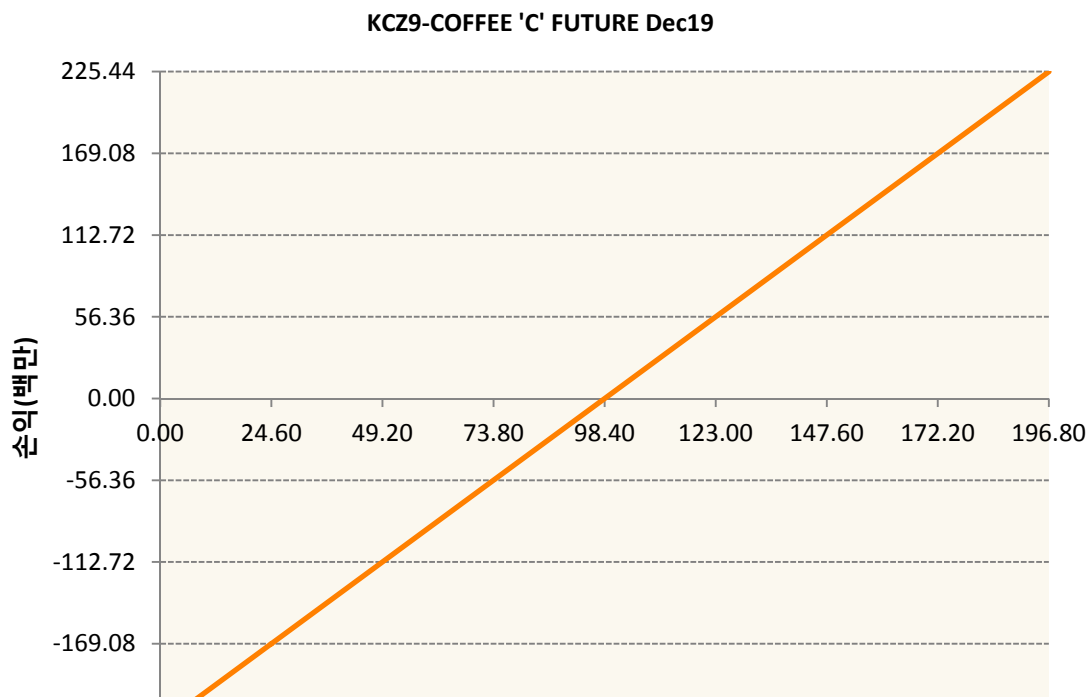
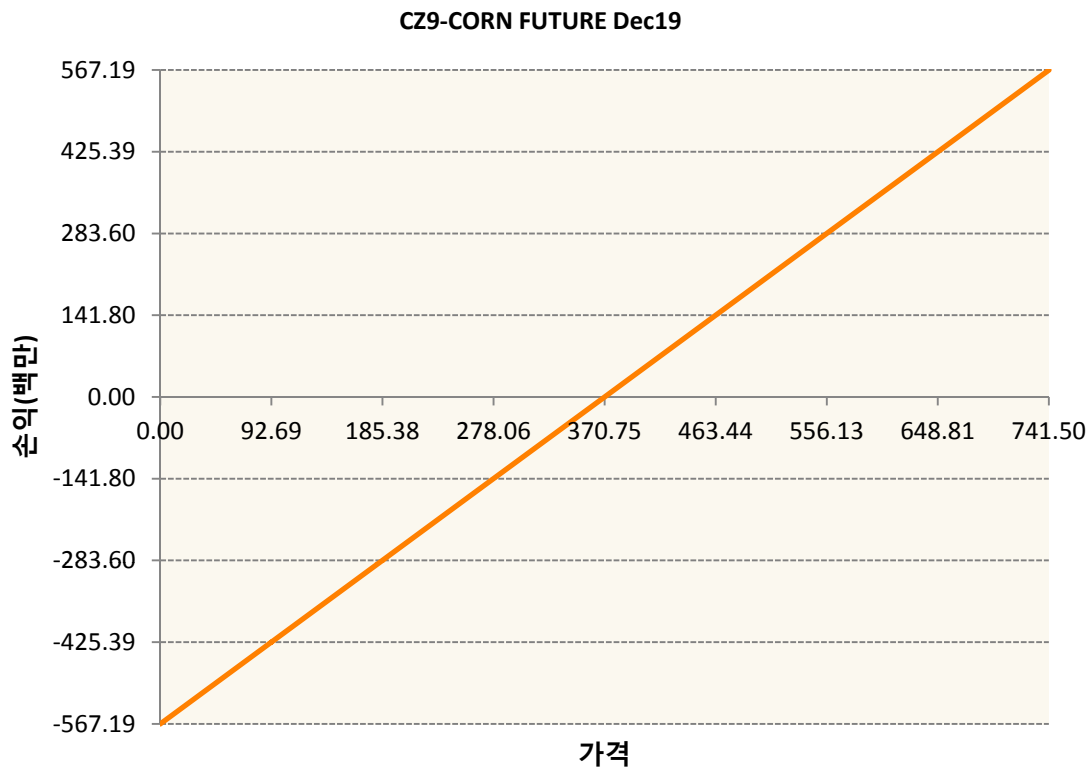
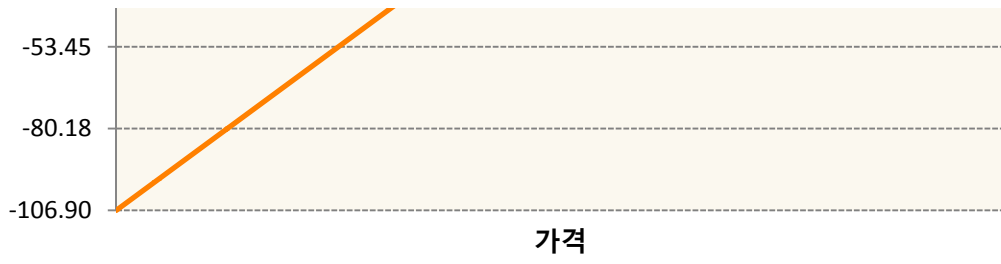
### 2. 만기시점의 손익구조

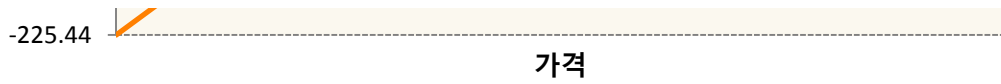
**BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19**



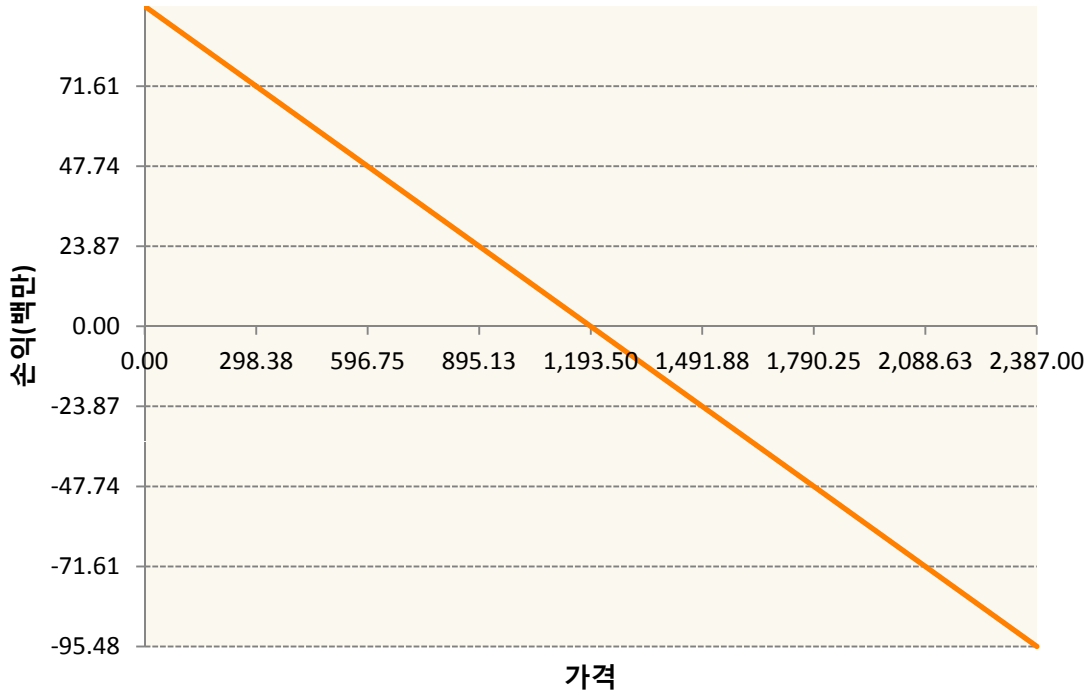
**CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19**



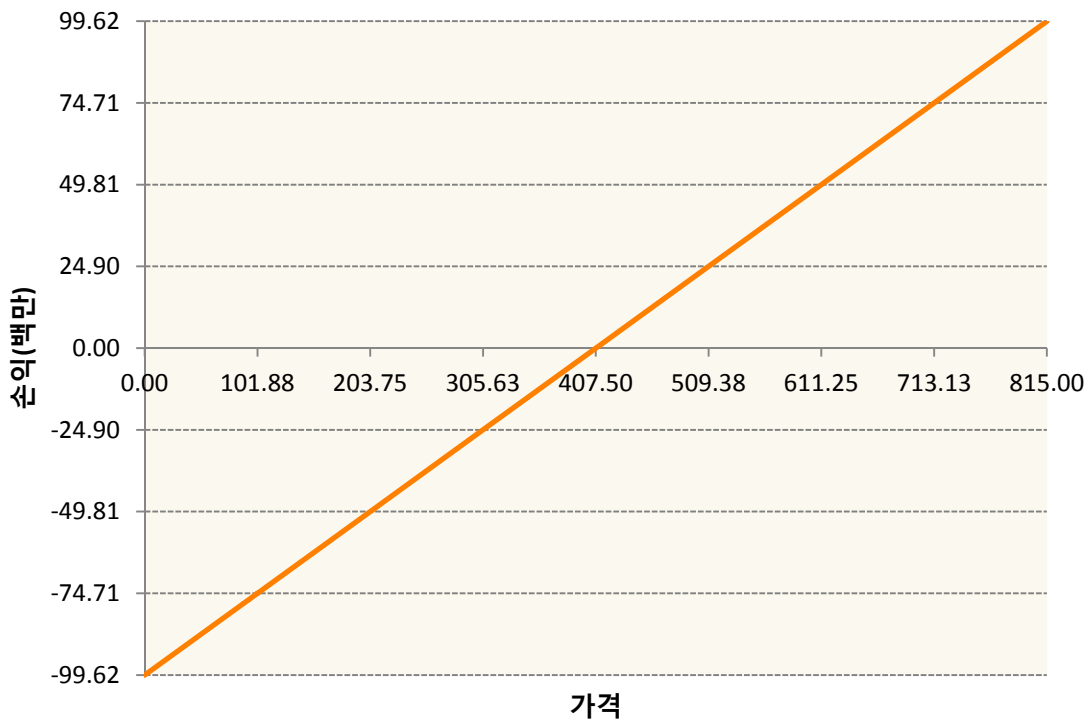




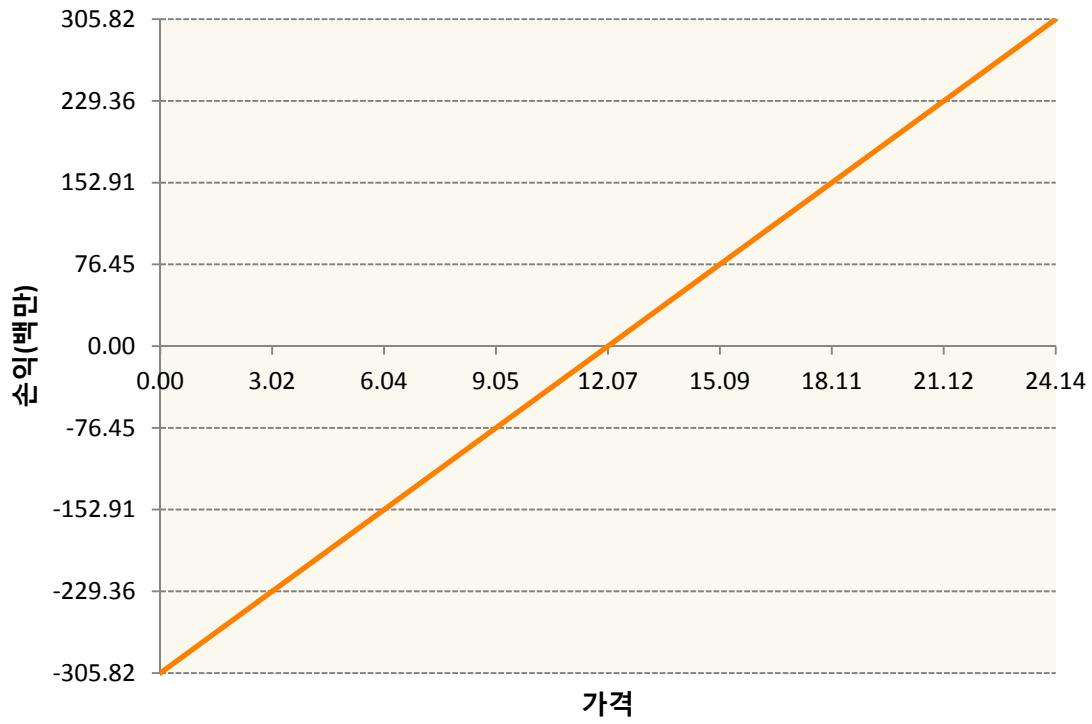
**KR4175PA0005-2019-10 달러선물**



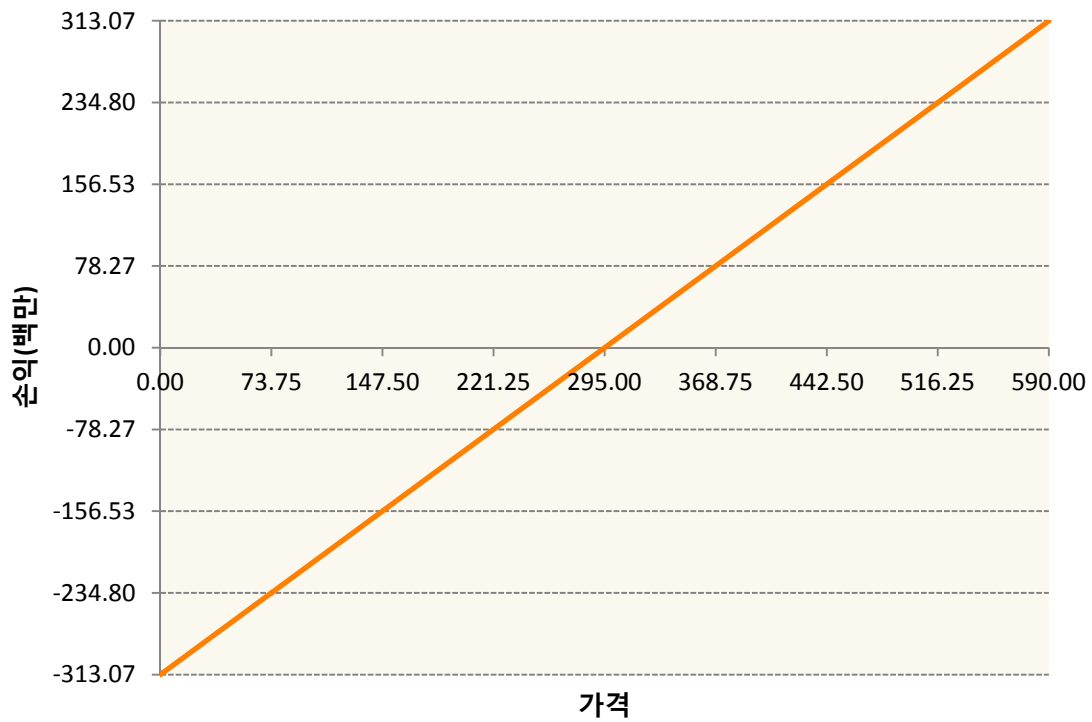
**KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19**



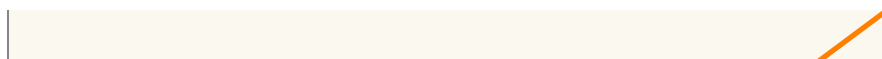
SBH0-Sugar Mar20

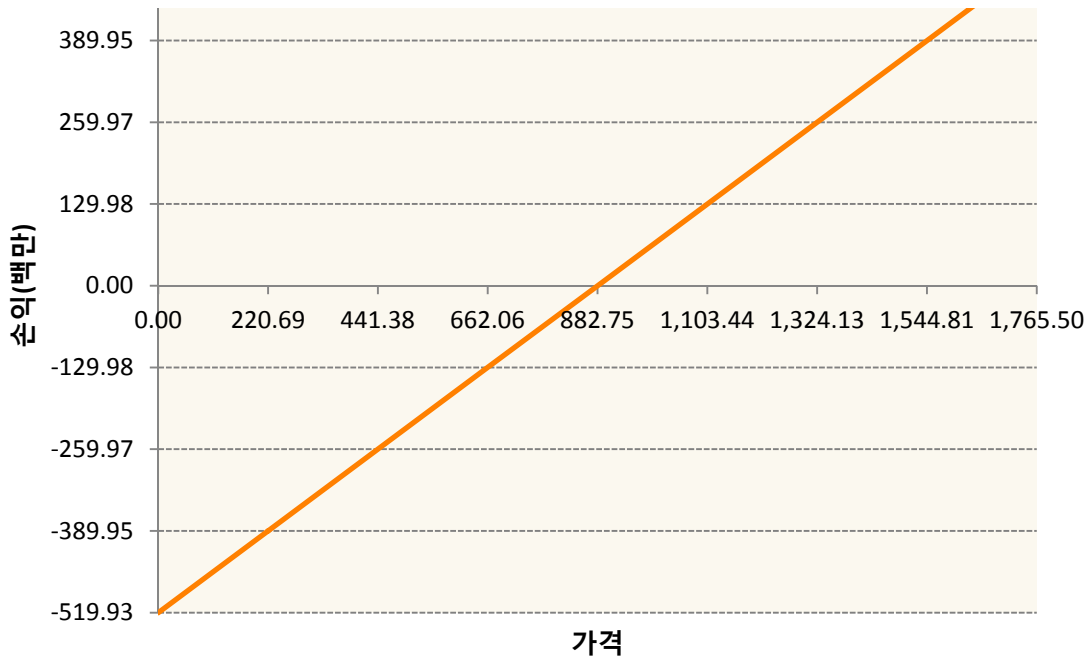


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

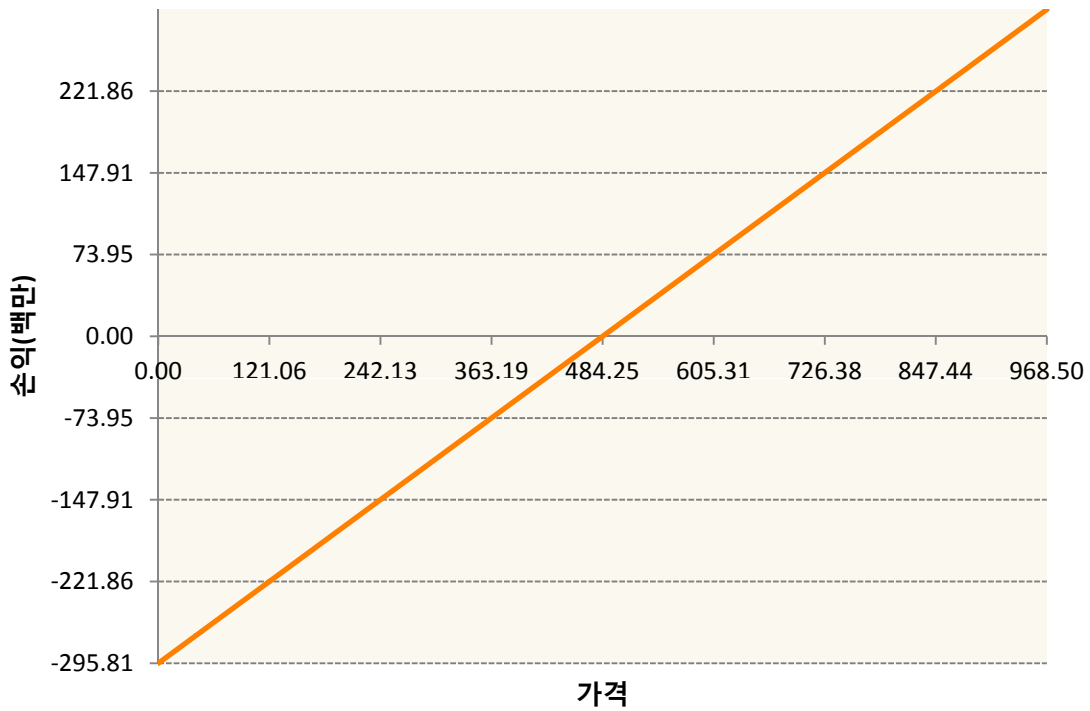


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





WZ9-WHEAT FUTURE(CBT) Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	25
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)

**246**