

공시일	2019-09-25
기준일	2019-09-24

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	2019-09-25
기준일	2019-09-24

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

1,179

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

674

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-25
기준일	2019-09-24

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)

854

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-25
기준일	2019-09-24

유로인덱스모(주식-파생형)

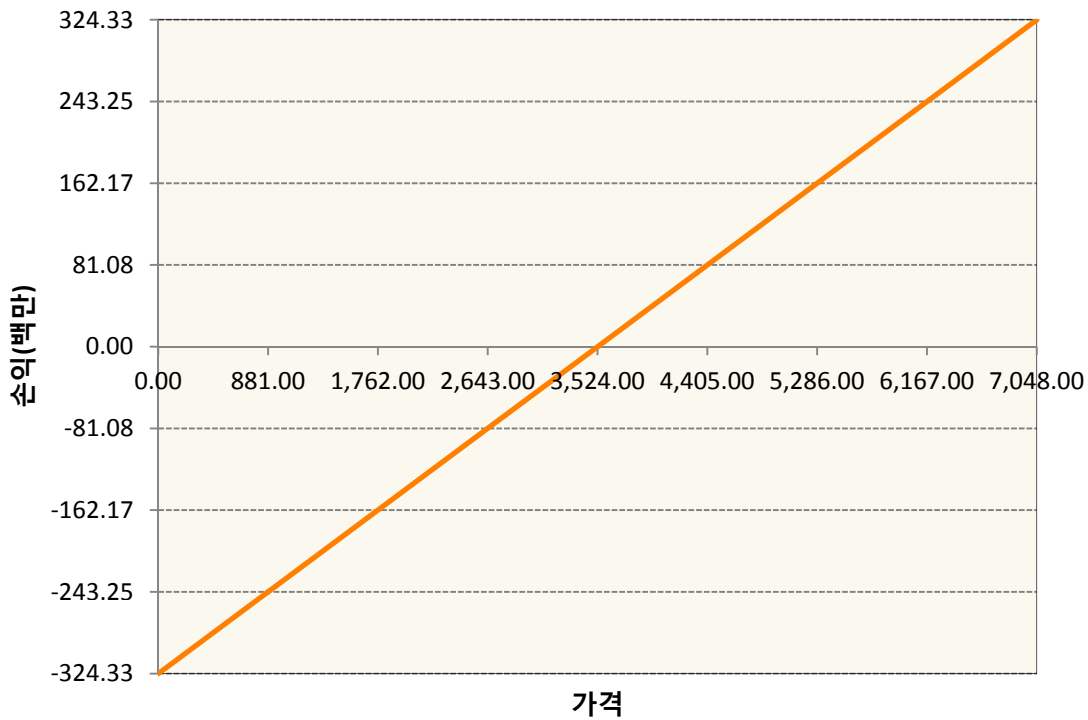
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	324	0	324	

2. 만기시점의 손익구조

VGZ9-EURO STOXX 50 Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	26
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

18

공시일	2019-09-25
기준일	2019-09-24

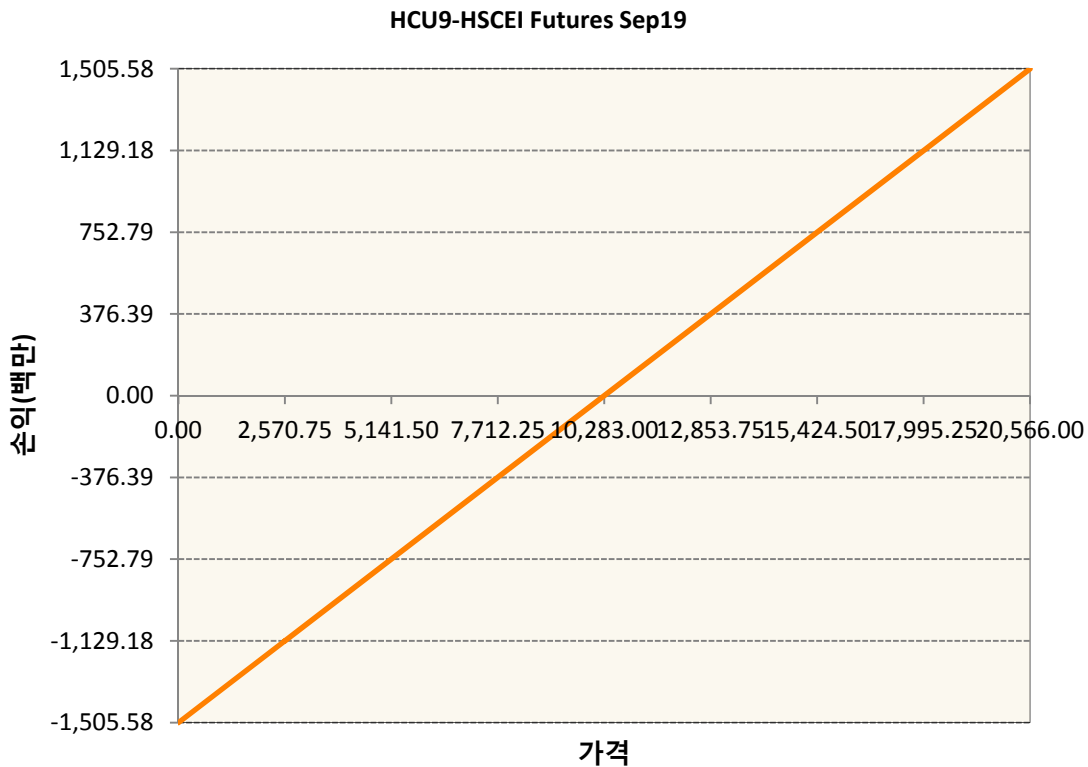
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,506	0	1,506	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

111

공시일	2019-09-25
기준일	2019-09-24

커버드콜모(주식혼합-파생형)

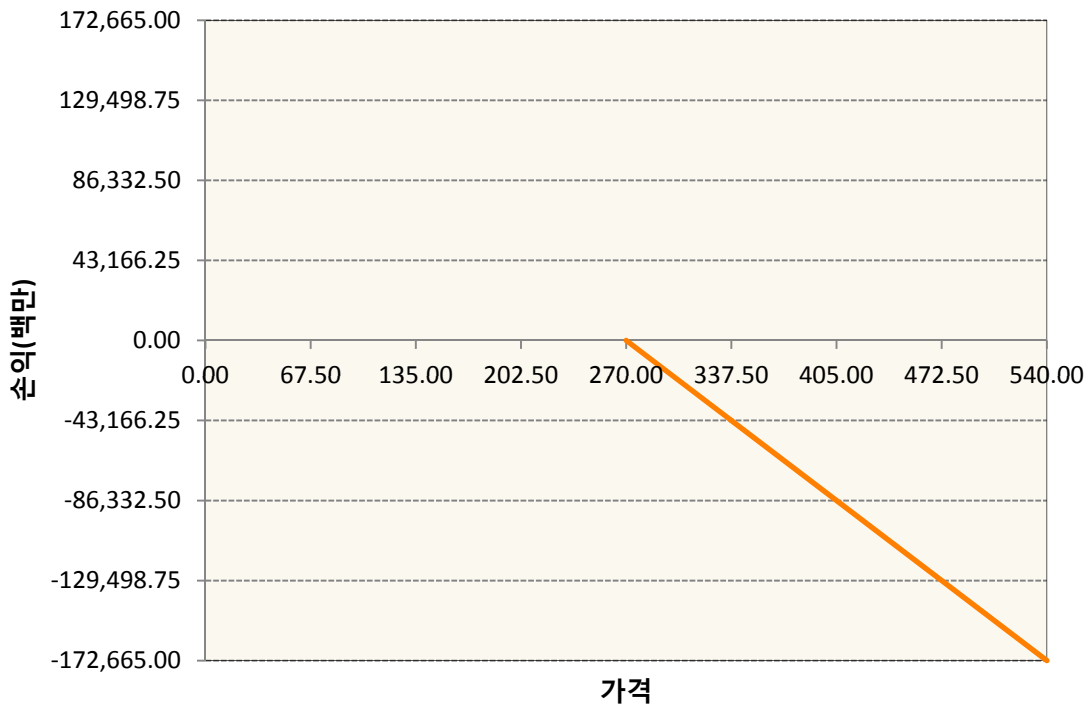
1. 계약금액

(단위:백만원)

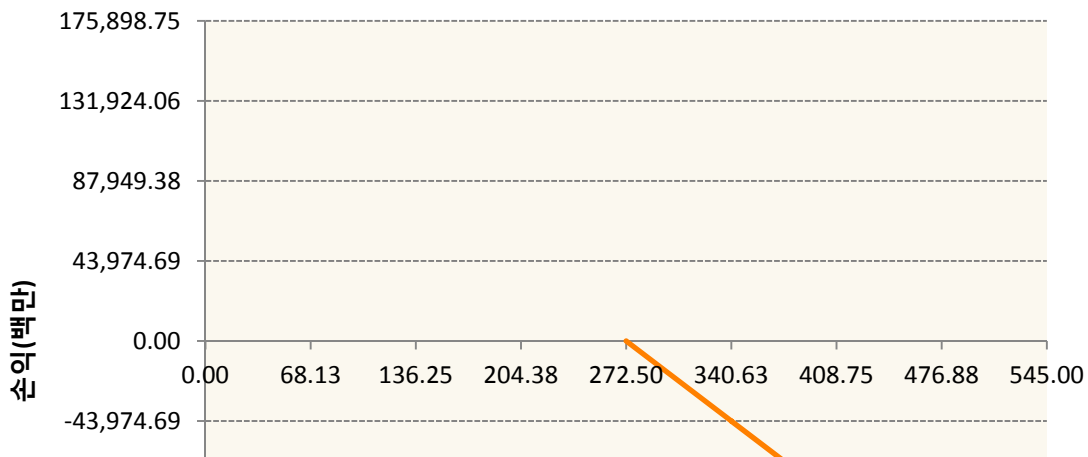
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	517,314	-517,314	장내

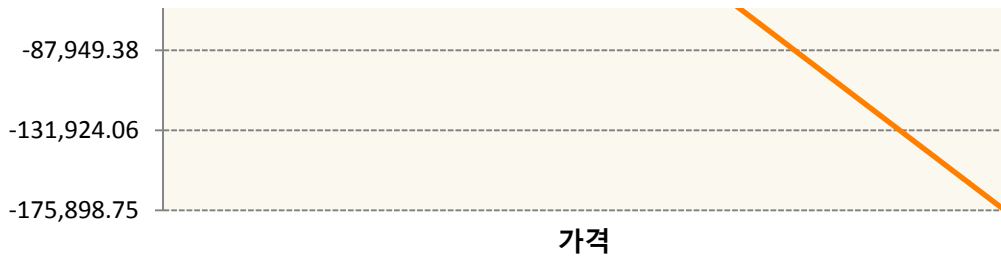
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PA2702-2019-10 콜270

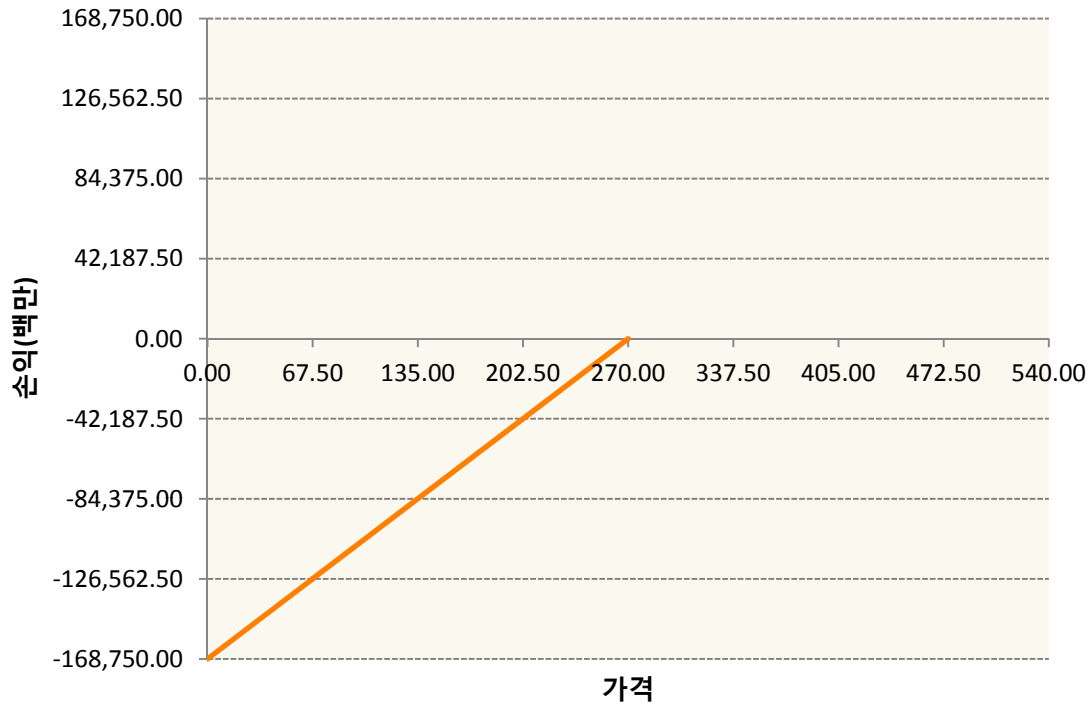


KR4201PA2728-2019-10 콜272.5





KR4301PA2701-2019-10 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PA2702		2019-10 콜270					12,688
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,573	6,432	6,269	6,087	5,890	5,681	5,460
-5.33%	5,743	5,481	5,210	4,933	4,650	4,363	4,073
-2.67%	3,877	3,559	3,242	2,924	2,606	2,288	1,971
0%	809	549	278	0	-285	-575	-868
2.67%	-3,188	-3,337	-3,508	-3,699	-3,906	-4,127	-4,360
5.33%	-7,678	-7,739	-7,822	-7,927	-8,051	-8,194	-8,354
8.00%	-12,353	-12,371	-12,403	-12,449	-12,512	-12,591	-12,688
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5					12,379
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,694	5,586	5,455	5,303	5,134	4,949	4,751

-5.33%	5,097	4,868	4,625	4,370	4,107	3,837	3,560
-2.67%	3,599	3,282	2,964	2,645	2,325	2,005	1,685
0%	903	607	306	0	-309	-620	-933
2.67%	-2,855	-3,047	-3,258	-3,487	-3,728	-3,981	-4,243
5.33%	-7,255	-7,344	-7,458	-7,593	-7,749	-7,923	-8,113
8.00%	-11,929	-11,960	-12,007	-12,072	-12,156	-12,259	-12,379
KR4301PA2701 2019-10 풋270							8,719
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,532	-8,544	-8,562	-8,588	-8,623	-8,667	-8,719
-5.33%	-4,120	-4,209	-4,310	-4,419	-4,535	-4,657	-4,785
-2.67%	-917	-1,085	-1,252	-1,420	-1,587	-1,755	-1,923
0%	279	197	103	0	-112	-230	-354
2.67%	453	442	422	395	359	313	259
5.33%	462	462	460	457	451	441	426
8.00%	462	462	462	462	462	460	458

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

(단위:백만원)

33,782

공시일	2019-09-25
기준일	2019-09-24

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

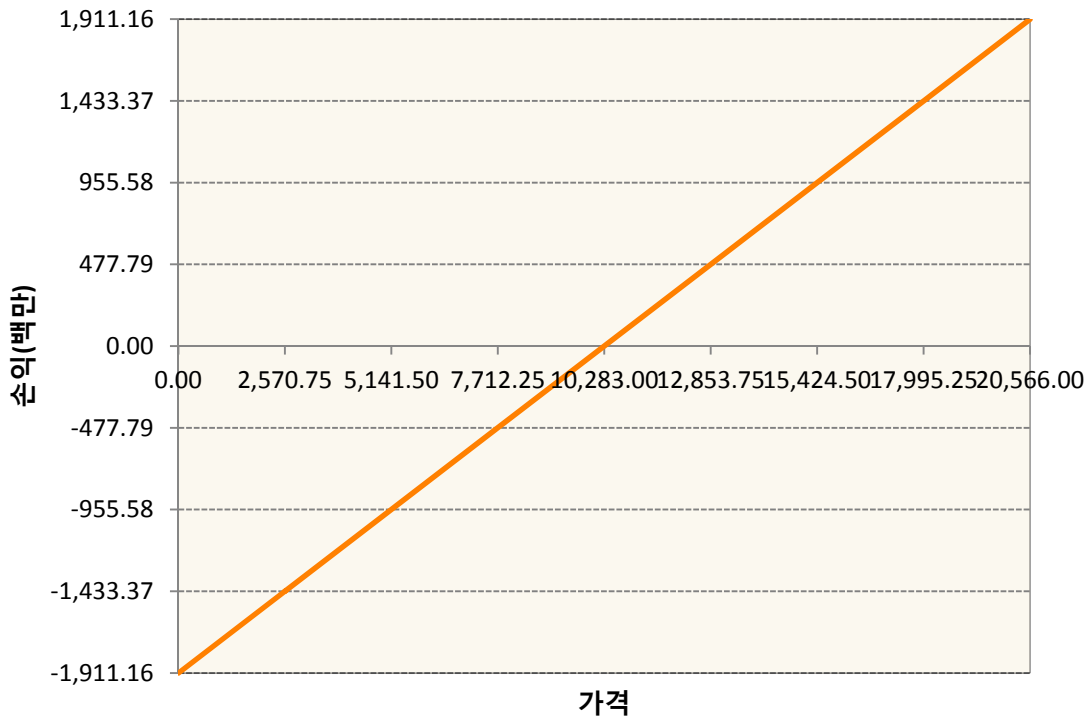
1. 계약금액

(단위:백만원)

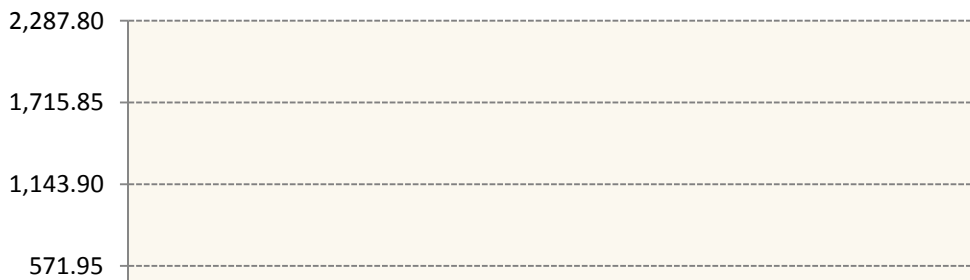
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,911	0	1,911	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,878	-4,878	장내
누계	통화	선도	686	2,834	-2,147	장외

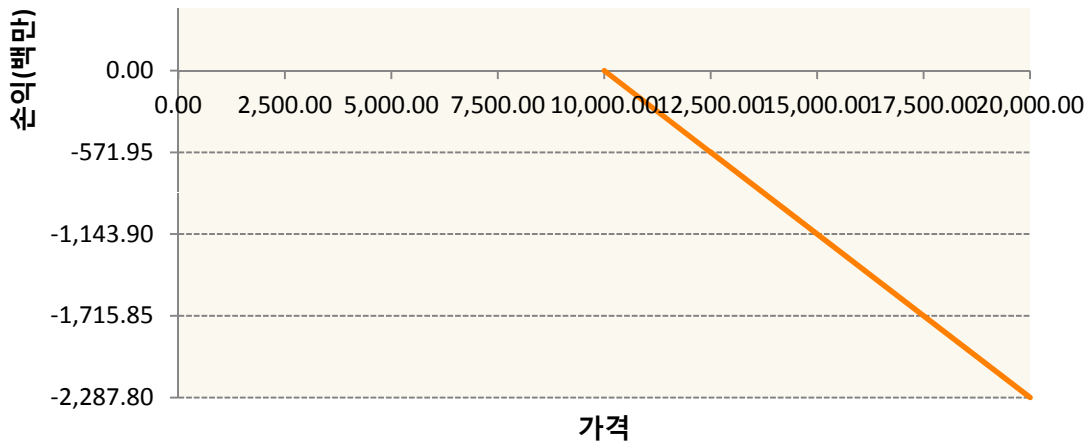
2. 만기시점의 손익구조

HCU9-HSCEI Futures Sep19

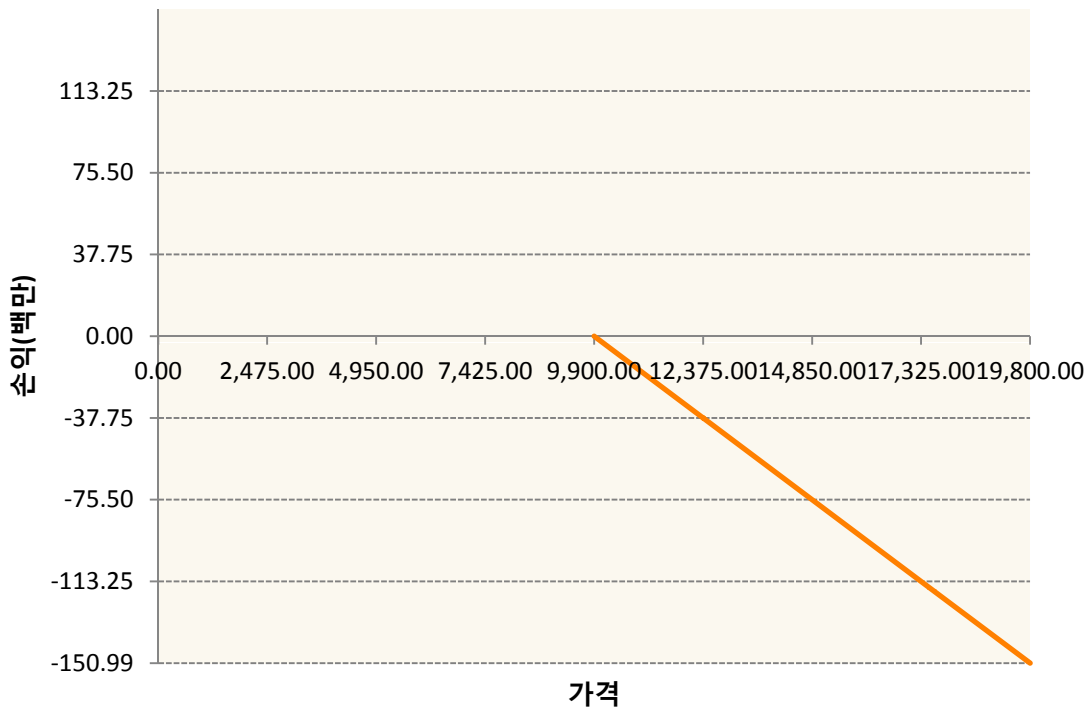


OHHIU9-C100-HSCEI

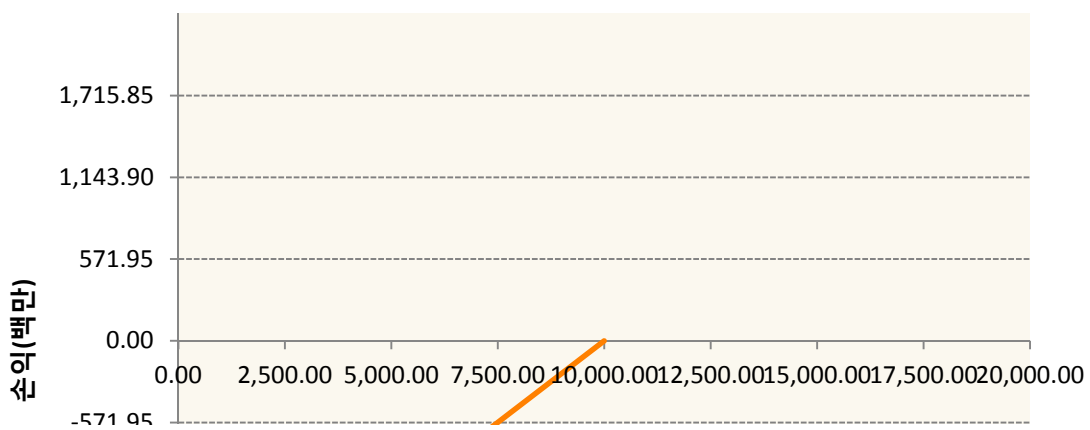


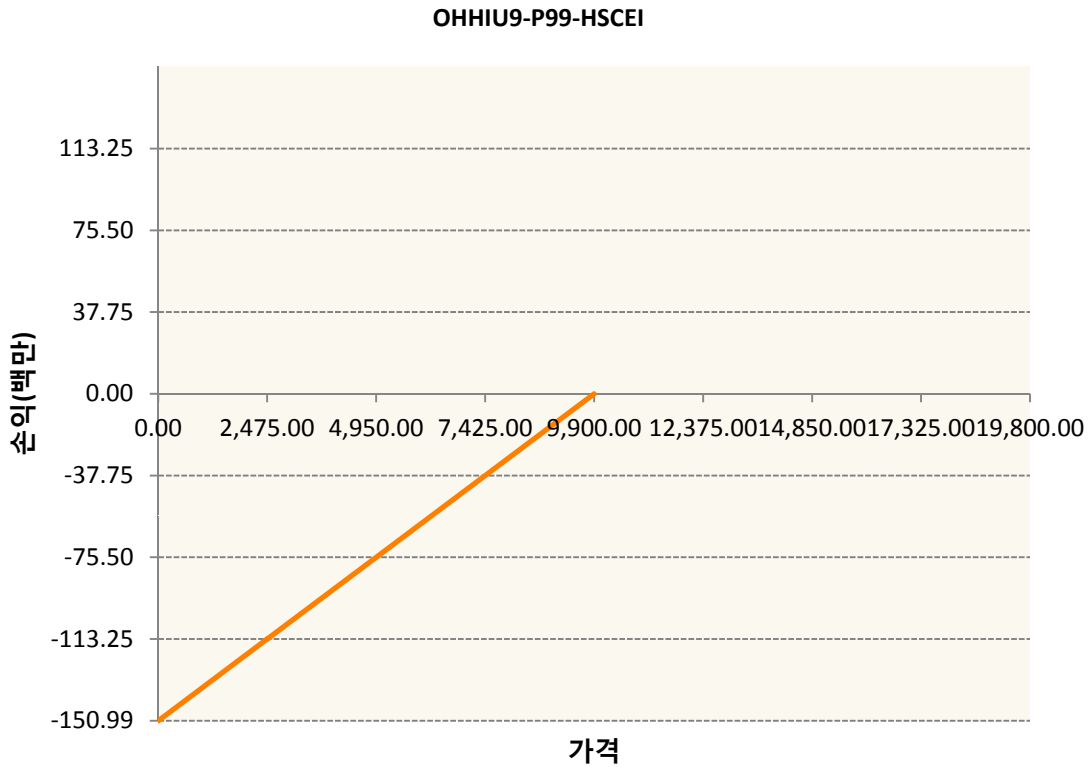


OHHIU9-C99-HSCEI



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	153
OHHIU9-C1(HSCEI	183
OHHIU9-C9(HSCEI	12
OHHIU9-P1(HSCEI	183
OHHIU9-P9(HSCEI	12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	591

공시일	2019-09-25
기준일	2019-09-24

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

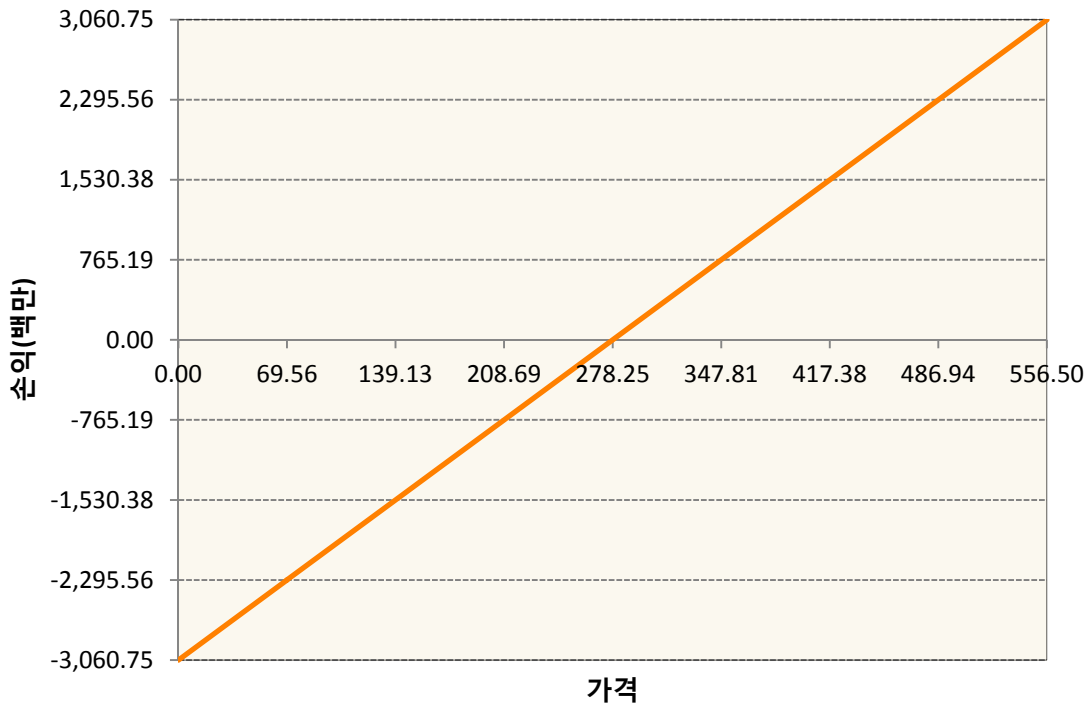
1. 계약금액

(단위:백만원)

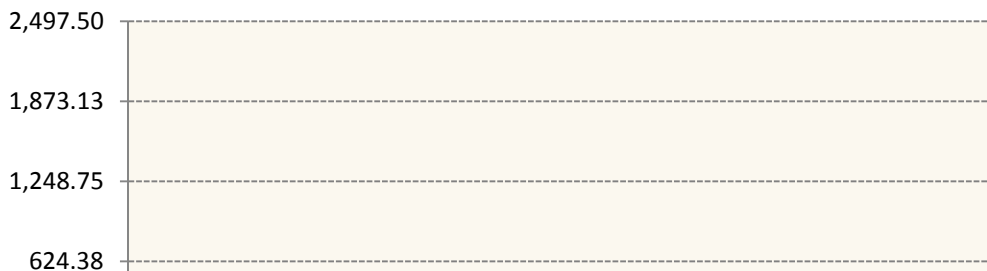
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,061	0	3,061	장내
누계	유가증권	스왑	14,125	0	14,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,828	-14,828	장내

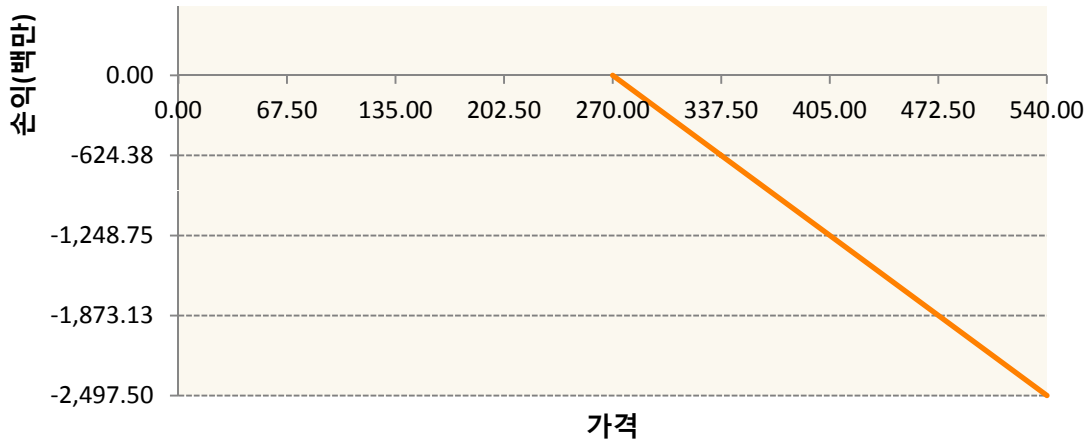
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

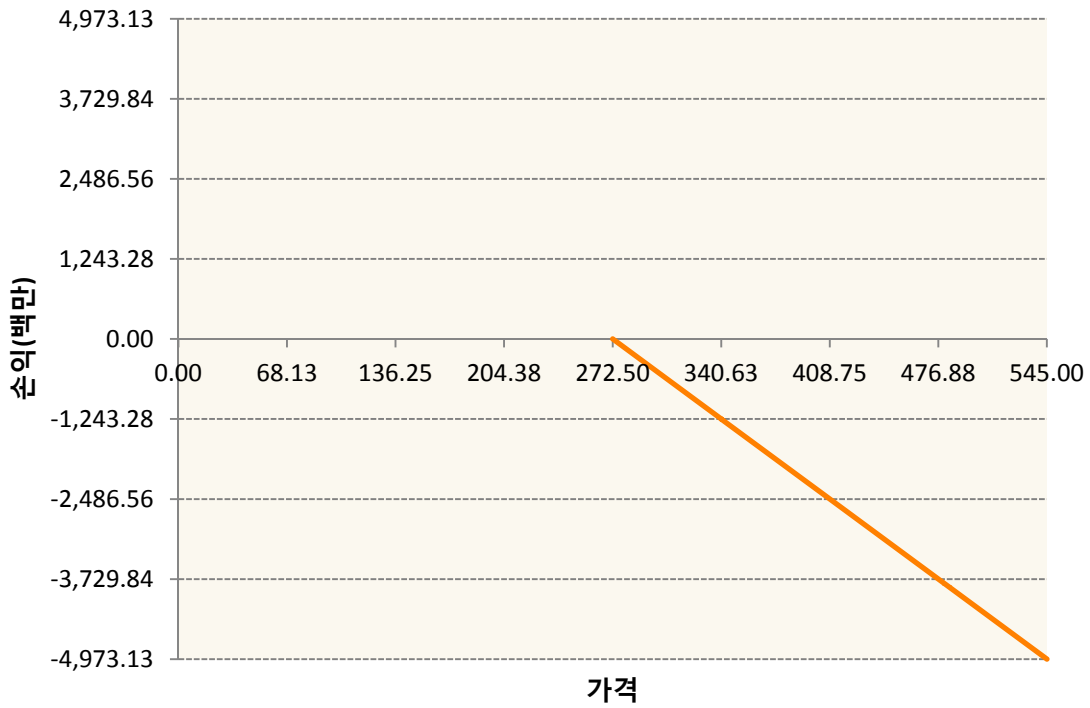


KR4201PA2702-2019-10 콜270

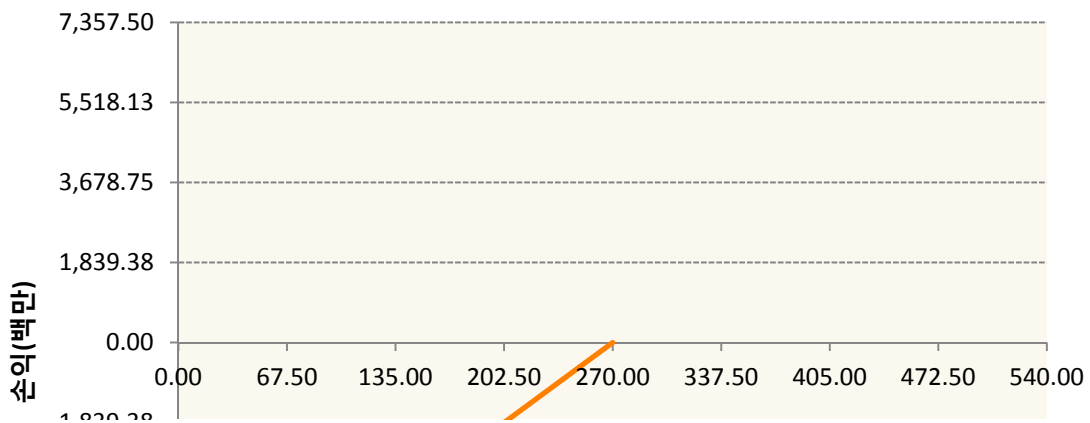




KR4201PA2728-2019-10 콜272.5



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						245
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-245	-245	-245	-245	-245	-245	-245	
-5.33%	-163	-163	-163	-163	-163	-163	-163	
-2.67%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	82	82	82	82	82	82	82	
5.33%	163	163	163	163	163	163	163	
8.00%	245	245	245	245	245	245	245	
KR4201PA2702		2019-10 콜270						184
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	95	93	91	88	85	82	79	
-5.33%	83	79	75	71	67	63	59	
-2.67%	56	51	47	42	38	33	29	
0%	12	8	4	0	-4	-8	-13	
2.67%	-46	-48	-51	-54	-57	-60	-63	
5.33%	-111	-112	-113	-115	-116	-119	-121	
8.00%	-179	-179	-179	-180	-181	-182	-184	
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5						350
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	161	158	154	150	145	140	134
-5.33%	144	138	131	124	116	108	101
-2.67%	102	93	84	75	66	57	48
0%	26	17	9	0	-9	-18	-26
2.67%	-81	-86	-92	-99	-105	-113	-120
5.33%	-205	-208	-211	-215	-219	-224	-229
8.00%	-337	-338	-339	-341	-344	-347	-350
KR4301PA2701 2019-10 풋270							380
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-372	-373	-373	-374	-376	-378	-380
-5.33%	-180	-184	-188	-193	-198	-203	-209
-2.67%	-40	-47	-55	-62	-69	-77	-84
0%	12	9	5	0	-5	-10	-15
2.67%	20	19	18	17	16	14	11
5.33%	20	20	20	20	20	19	19
8.00%	20	20	20	20	20	20	20

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

(단위:백만원)

2,312

공시일	2019-09-25
기준일	2019-09-24

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

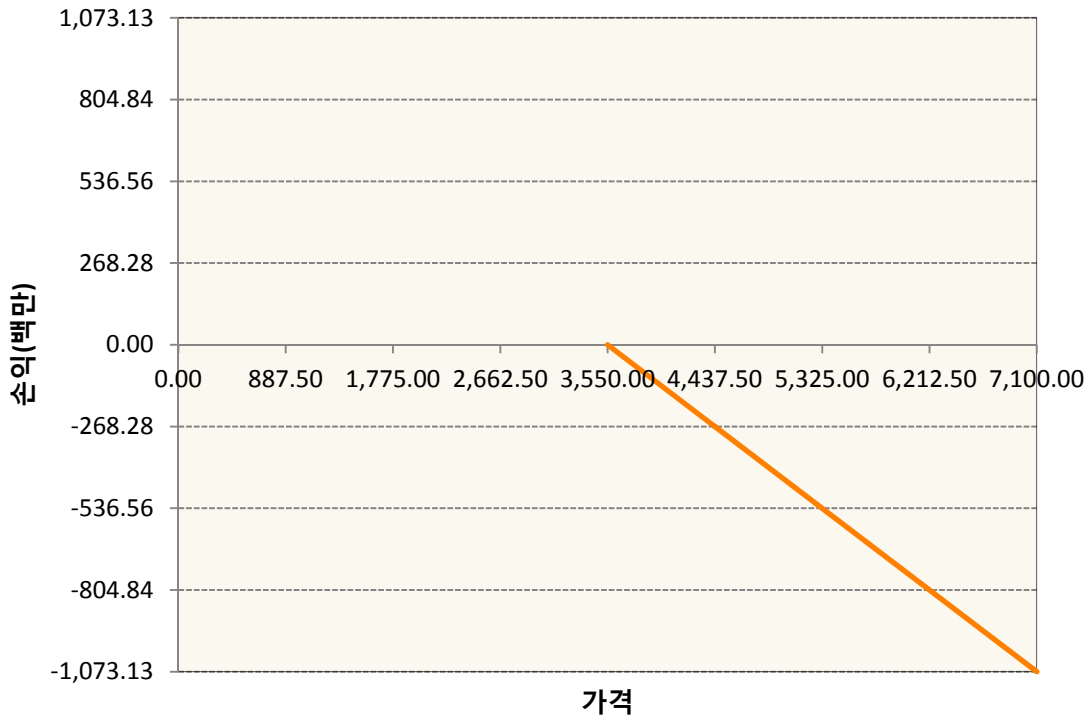
1. 계약금액

(단위:백만원)

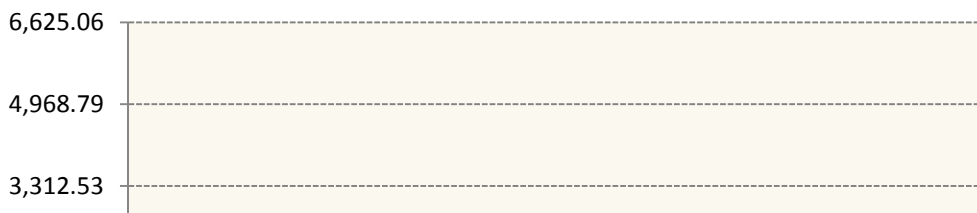
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,723	0	4,723	
누계	유가증권	스왑	23,915	0	23,915	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,396	-15,396	장내
누계	통화	선도	10,908	17,085	-6,177	장외

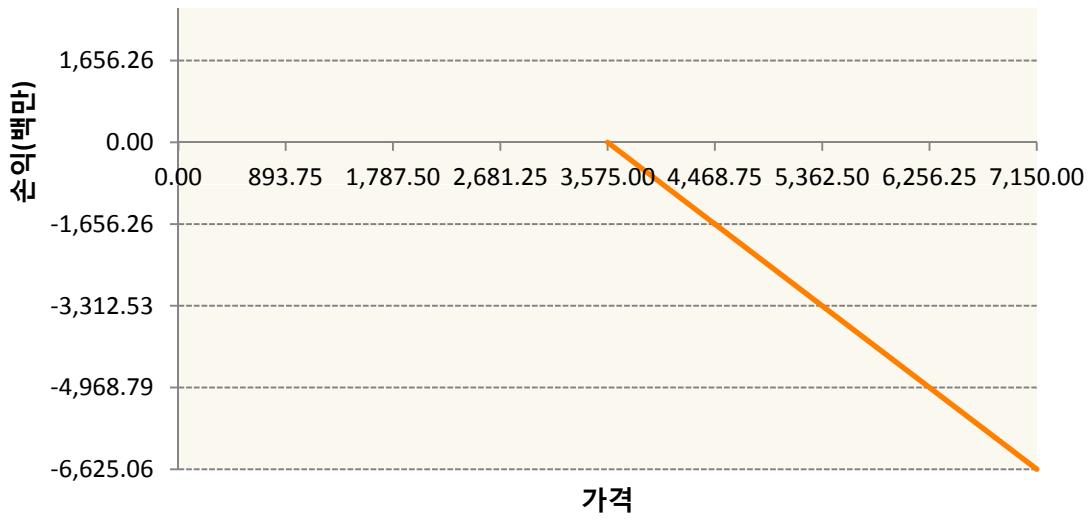
2. 만기시점의 손익구조

OESXV9-C3550-EURO STOXX 50

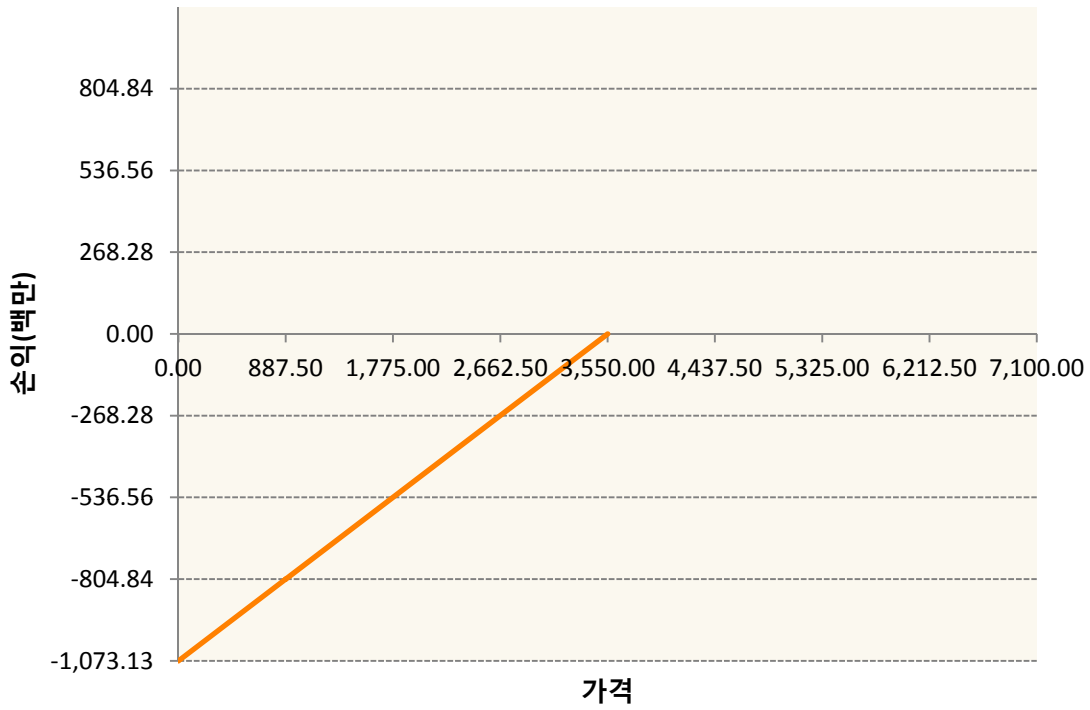


OESXV9-C3575-EURO STOXX 50

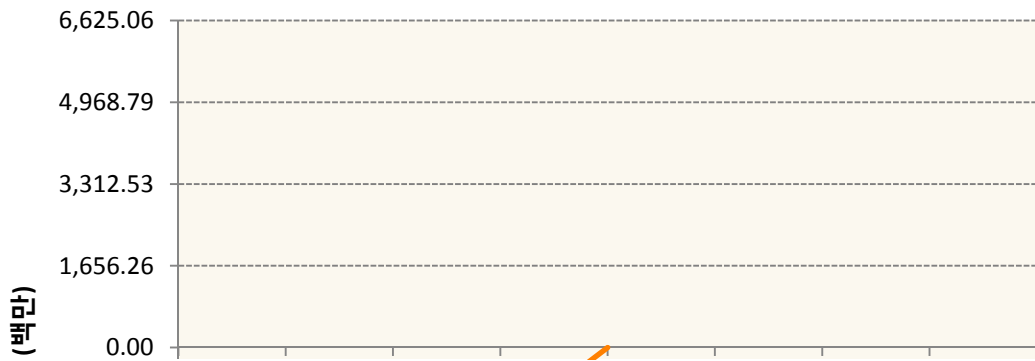


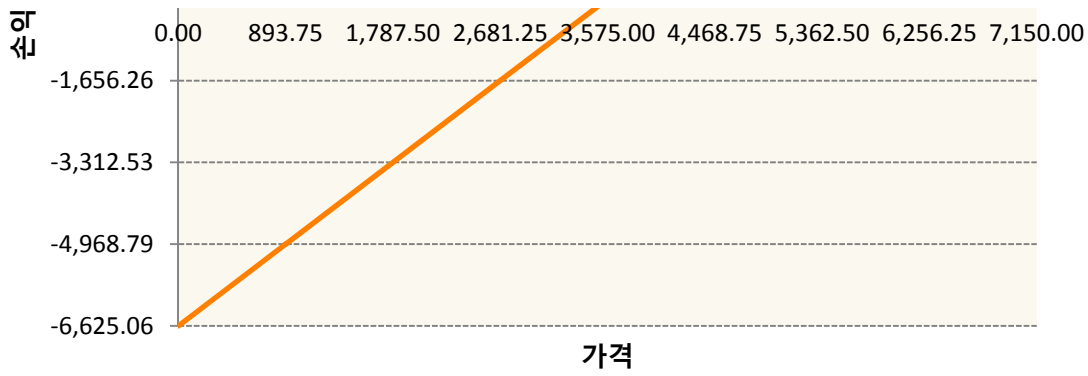


OESXV9-P3550-EURO STOXX 50

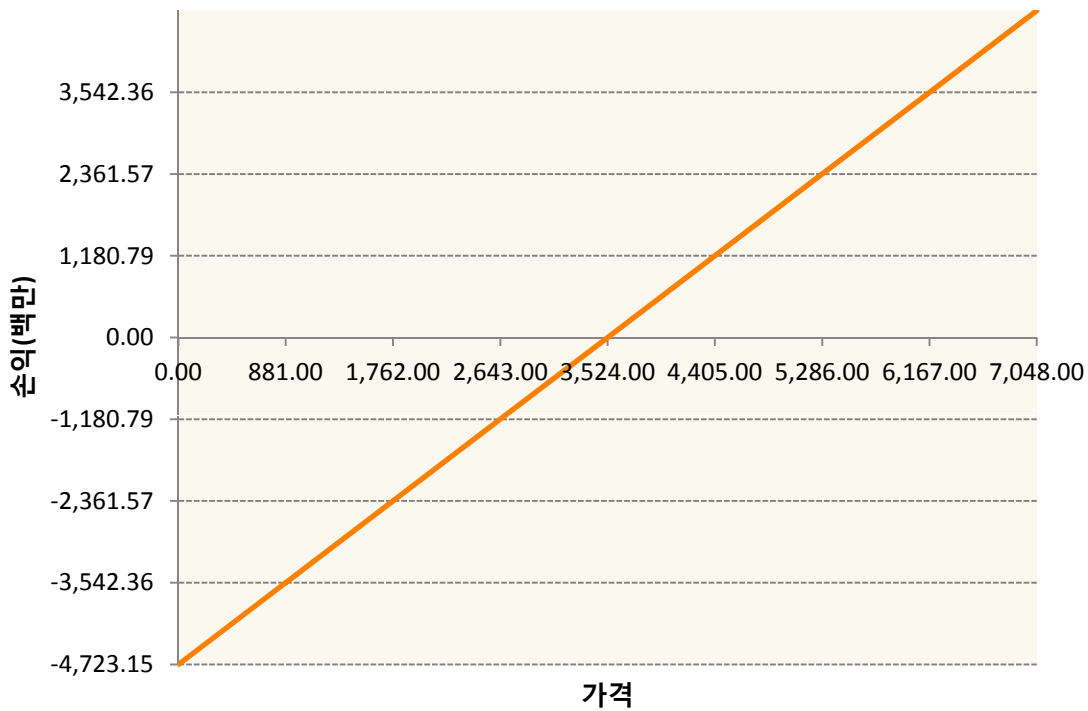


OESXV9-P3575-EURO STOXX 50





VGZ9-EURO STOXX 50 Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	28
FX21019M0< 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	158
OESXV9-C35 EURO STOXX 50	86
OESXV9-C35 EURO STOXX 50	530
OESXV9-P35 EURO STOXX 50	86
OESXV9-P35 EURO STOXX 50	530

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

(단위:백만원)

2,225

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

(단위:백만원)

1,002

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	2019-09-25
기준일	2019-09-24

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

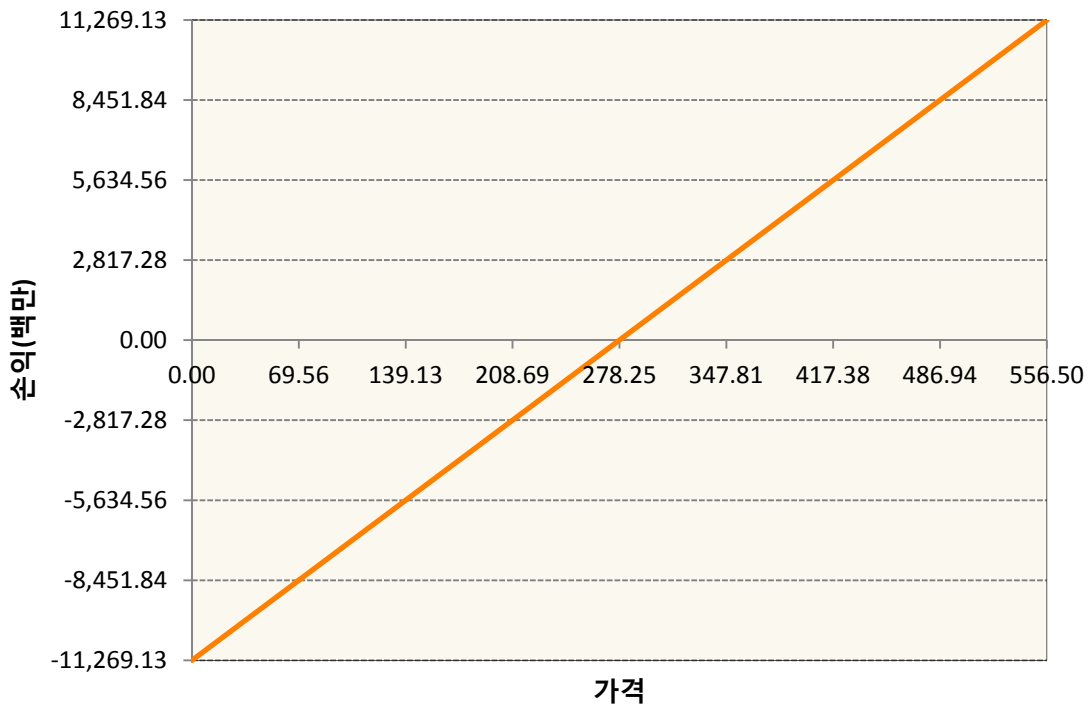
1. 계약금액

(단위:백만원)

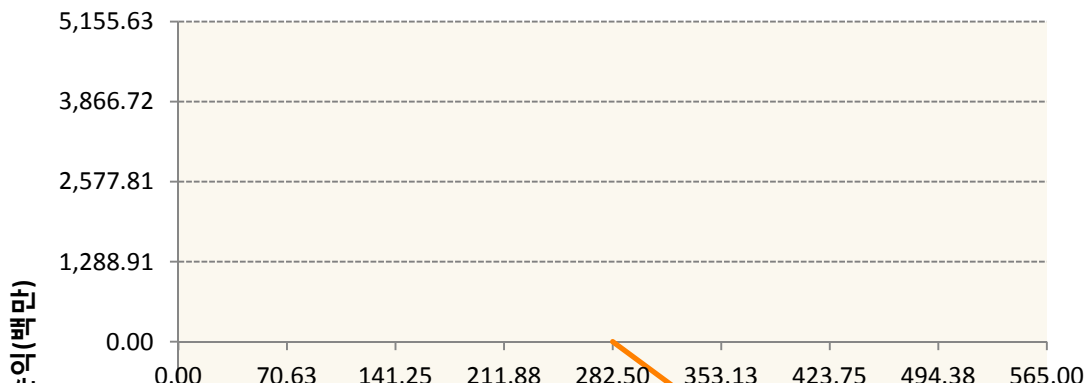
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	69	-69	장내
신규	유가증권	옵션	71	0	71	장내
누계	유가증권	선물	11,269	0	11,269	장내
누계	유가증권	옵션	1,422	20,759	-19,338	장내

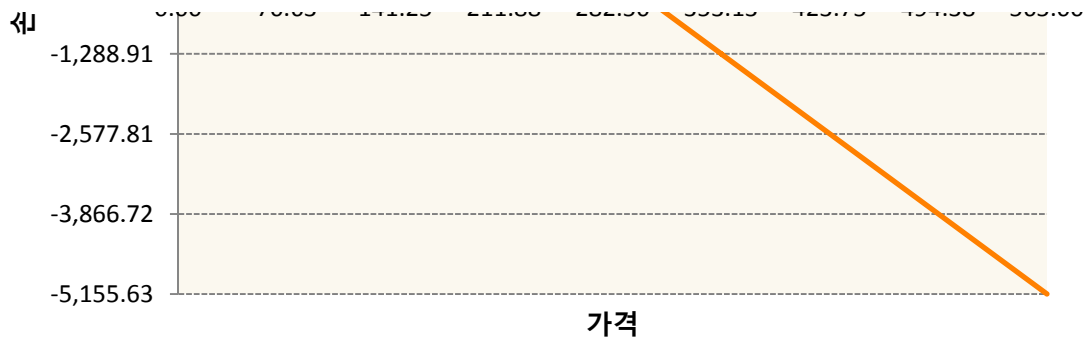
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

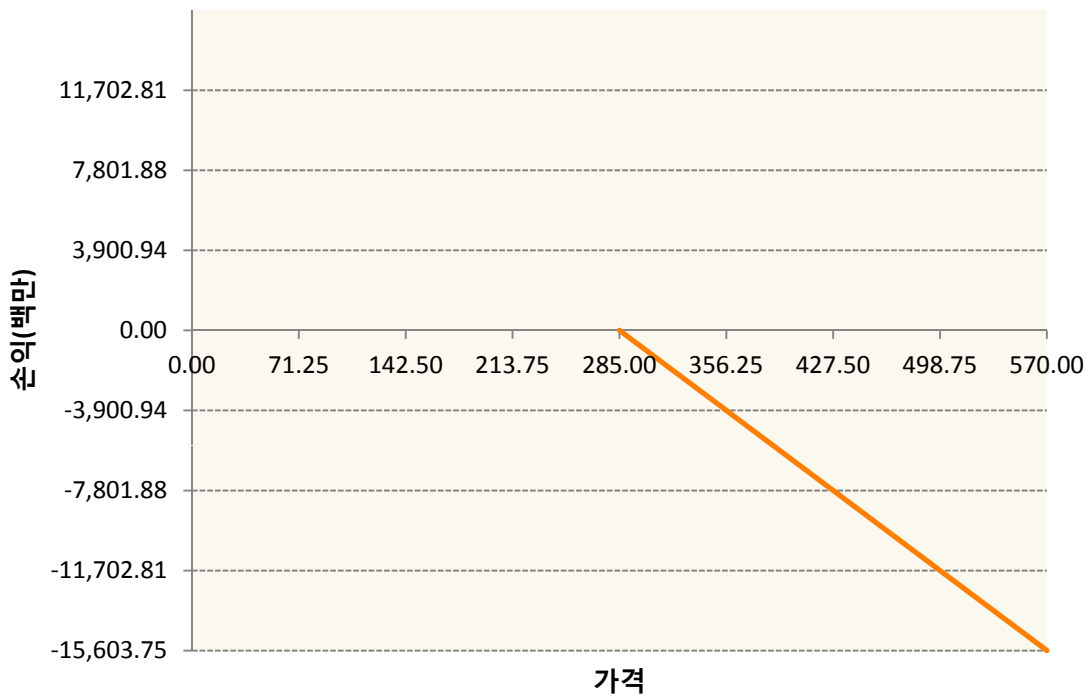


KR4201PA2827-2019-10 콜282.5

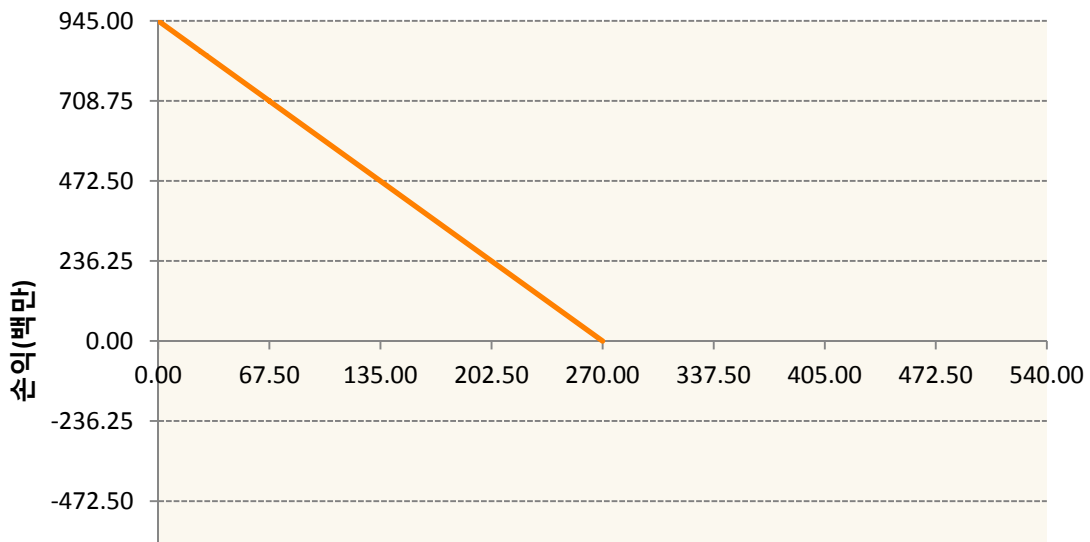


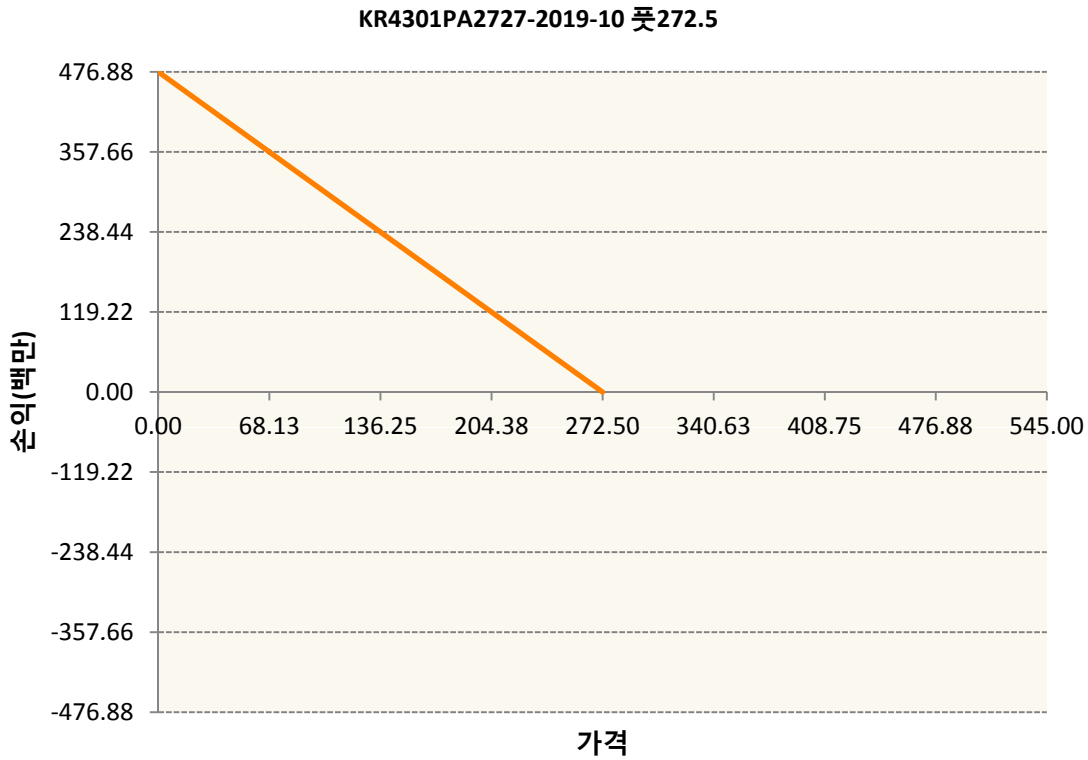
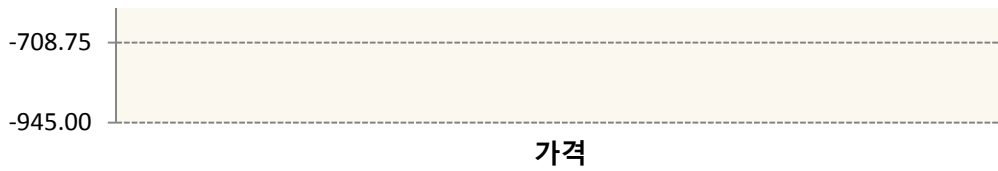


KR4201PA2850-2019-10 콜285



KR4301PA2701-2019-10 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						901
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-901	-901	-901	-901	-901	-901	-901	
-5.33%	-600	-600	-600	-600	-600	-600	-600	
-2.67%	-300	-300	-300	-300	-300	-300	-300	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	300	300	300	300	300	300	300	
5.33%	600	600	600	600	600	600	600	
8.00%	901	901	901	901	901	901	901	
KR4201PA2827		2019-10 콜282.5						284
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	75	74	73	72	70	67	64	
-5.33%	72	69	66	63	58	54	48	
-2.67%	60	54	48	41	34	27	19	

0%	27	18	9	0	-9	-18	-27
2.67%	-38	-47	-56	-66	-75	-85	-94
5.33%	-134	-141	-148	-156	-164	-172	-180
8.00%	-252	-256	-260	-266	-271	-277	-284
KR4201PA2850 2019-10 콜285							792
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	179	177	175	172	167	161	154
-5.33%	173	168	161	152	142	130	116
-2.67%	149	135	119	102	84	64	44
0%	74	50	25	0	-26	-52	-78
2.67%	-86	-115	-143	-172	-201	-229	-258
5.33%	-343	-368	-393	-418	-445	-471	-498
8.00%	-679	-694	-711	-729	-749	-770	-792
KR4301PA2701 2019-10 풋270							49
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	48	48	48	48	48	49	49
-5.33%	23	24	24	25	25	26	27
-2.67%	5	6	7	8	9	10	11
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-3	-2	-2	-2	-2	-2	-1
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-2	-2
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
KR4301PA2727 2019-10 풋272.5							28
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	27	27	27	27	27	28	28
-5.33%	15	15	15	15	15	16	16
-2.67%	4	5	5	5	6	6	7
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-1	-1
5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2

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

(단위:백만원)

1,797

공시일	2019-09-25
기준일	2019-09-24

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	98,435	0	98,435	

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	2019-09-25
기준일	2019-09-24

H2O글로벌본드(UH)(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	127,419	0	127,419	

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	2019-09-25
기준일	2019-09-24

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	459,961	0	459,961	
누계	통화	선도	0	455,681	-455,681	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,922
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,539
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E	957
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E	957
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E	957
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E	1,722
FX21019Q04 KRW/USD 30-09-19E	191
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	1,377
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E	2,047
FX21019U01 KRW/USD 10-10-19E	287
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E	191
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E	2,334
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E	1,722
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E	191
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E	957
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E	1,473
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	2,975
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	3,157
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	2,621
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E	1,913
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E	2,009

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

(단위:백만원)

12,059

공시일	2019-09-25
기준일	2019-09-24

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

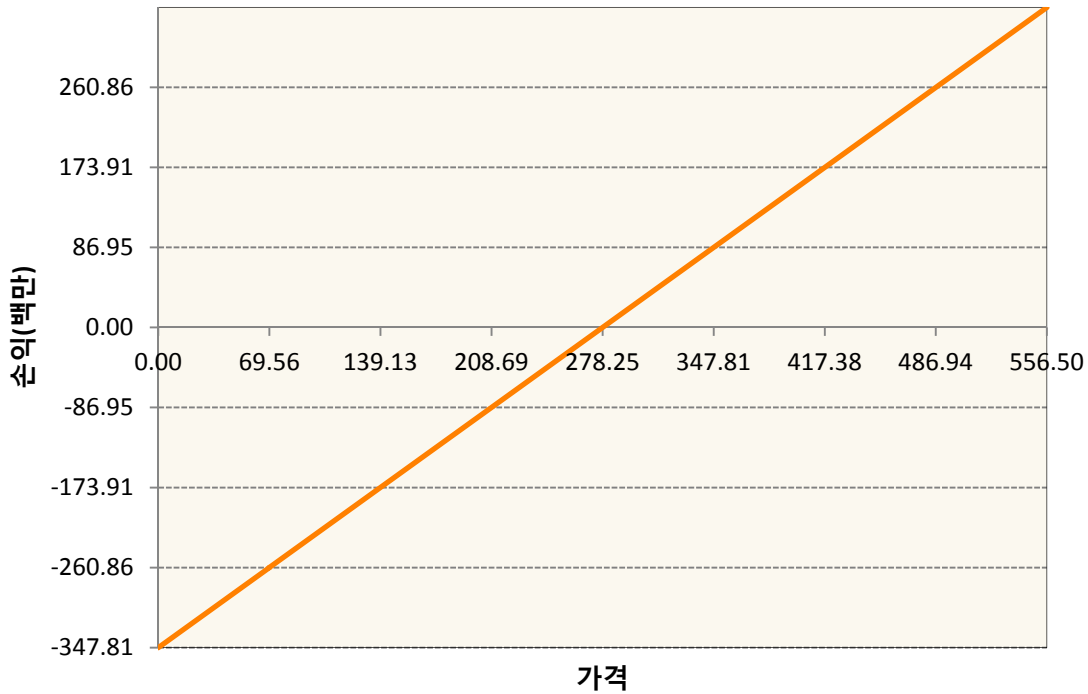
1. 계약금액

(단위:백만원)

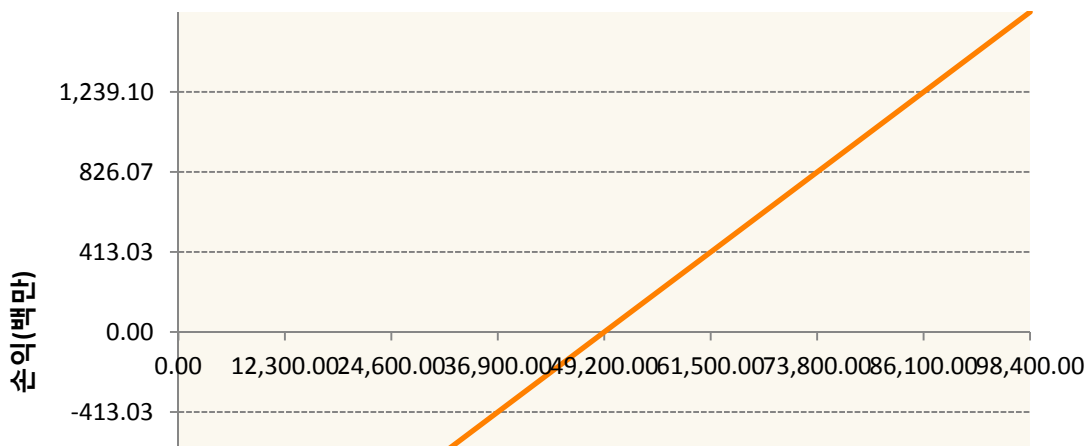
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,000	0	2,000	장내

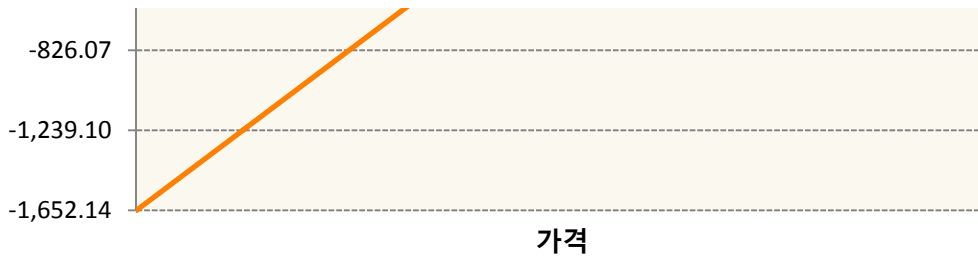
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



KR4111PA0002-2019-10 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						28
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28	
-5.33%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
-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%	19	19	19	19	19	19	19	
8.00%	28	28	28	28	28	28	28	
KR4111PA0002		2019-10 삼성전자개별선물						133
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133	
-5.33%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89	
-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%	89	89	89	89	89	89	89	
8.00%	133	133	133	133	133	133	133	

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

191

공시일	2019-09-25
기준일	2019-09-24

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

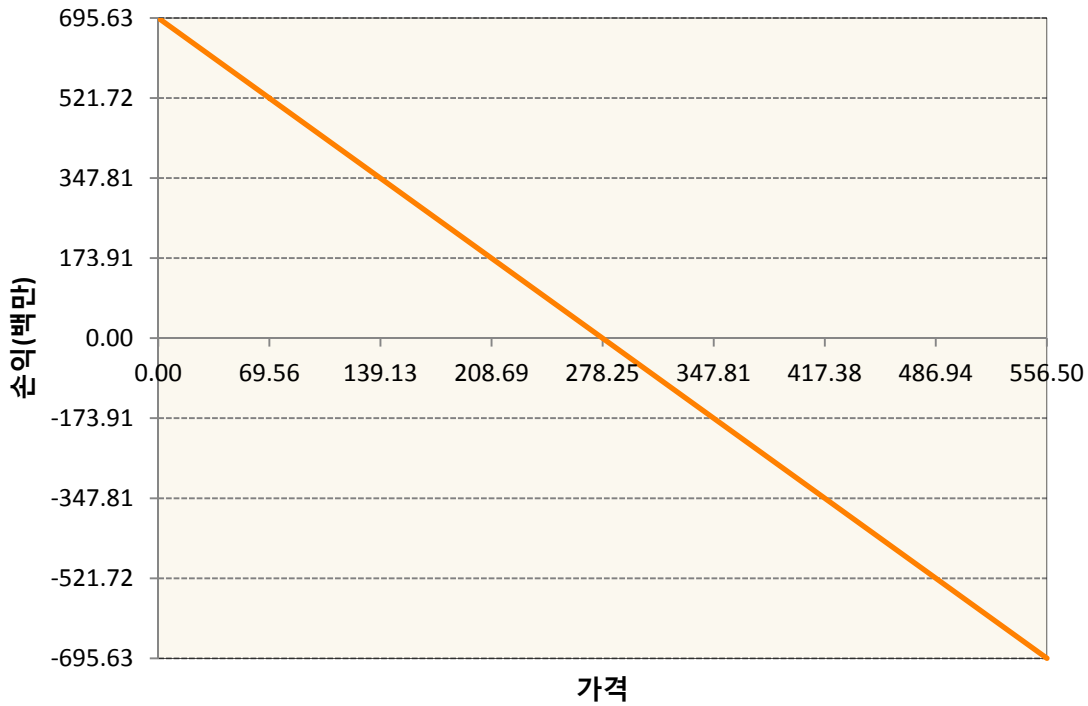
1. 계약금액

(단위:백만원)

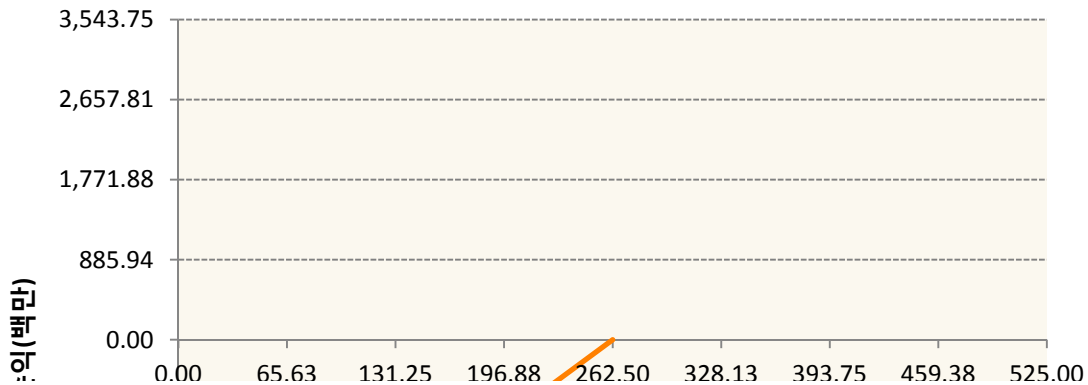
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	696	-696	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,941	-3,941	장내

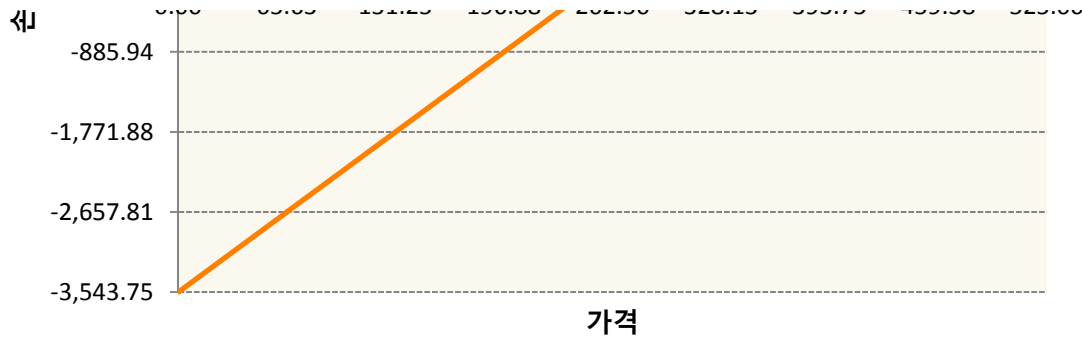
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

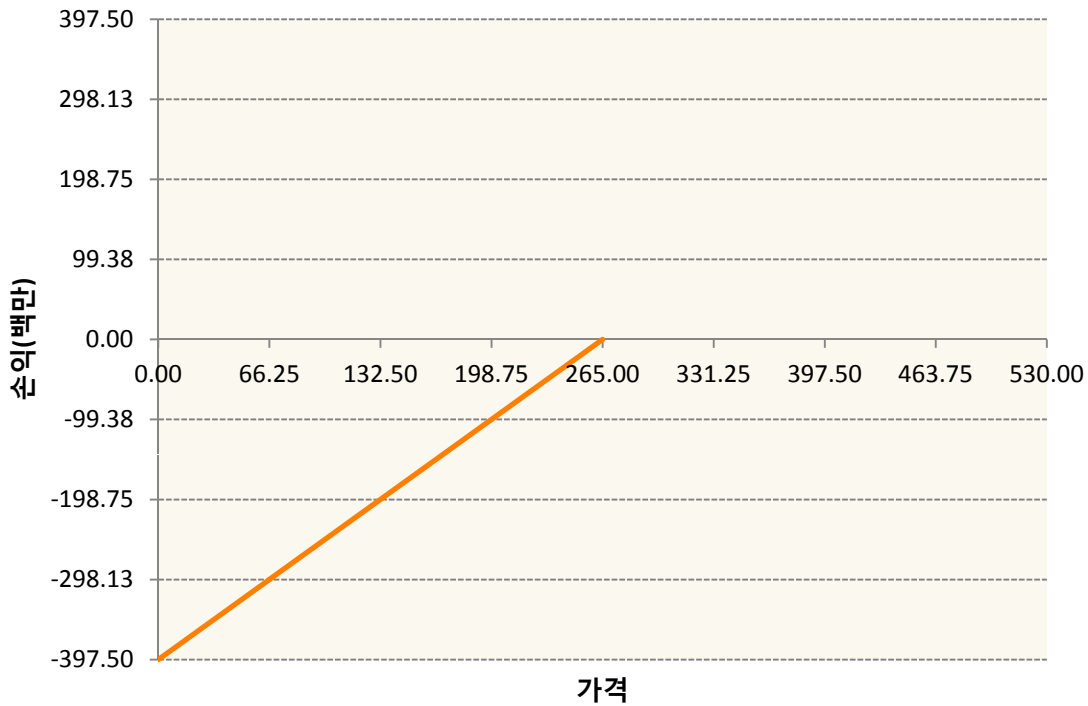


KR4301PA2628-2019-10 풋262.5





KR4301PA2651-2019-10 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						56
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	56	56	56	56	56	56	56	
-5.33%	37	37	37	37	37	37	37	
-2.67%	19	19	19	19	19	19	19	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
5.33%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37	
8.00%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56	
KR4301PA2628		2019-10 풋262.5						110
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-96	-98	-100	-102	-105	-107	-110
-5.33%	-27	-31	-34	-38	-41	-45	-48
-2.67%	-2	-4	-6	-8	-10	-13	-15
0%	1	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

KR4301PA2651

2019-10 풋265

15

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14	-14	-14	-14	-15	-15	-15
-5.33%	-5	-5	-6	-6	-6	-7	-7
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-2	-2	-2
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)

102

공시일	2019-09-25
기준일	2019-09-24

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	18,260	0	18,260	
누계	통화	선도	0	18,414	-18,414	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		612
FX21019U03 KRW/USD 25-09-19E		48
FX21019U04 KRW/USD 27-09-19E		10

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

(단위:백만원)

487

공시일	2019-09-25
기준일	2019-09-24

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	2019-09-25
기준일	2019-09-24

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

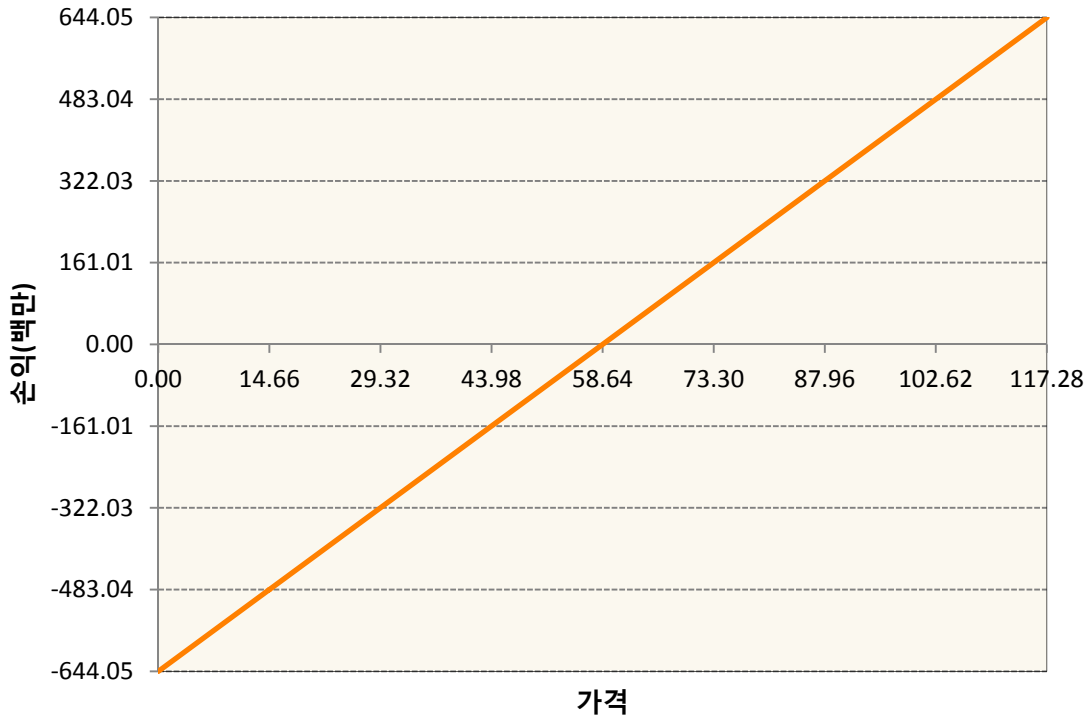
1. 계약금액

(단위:백만원)

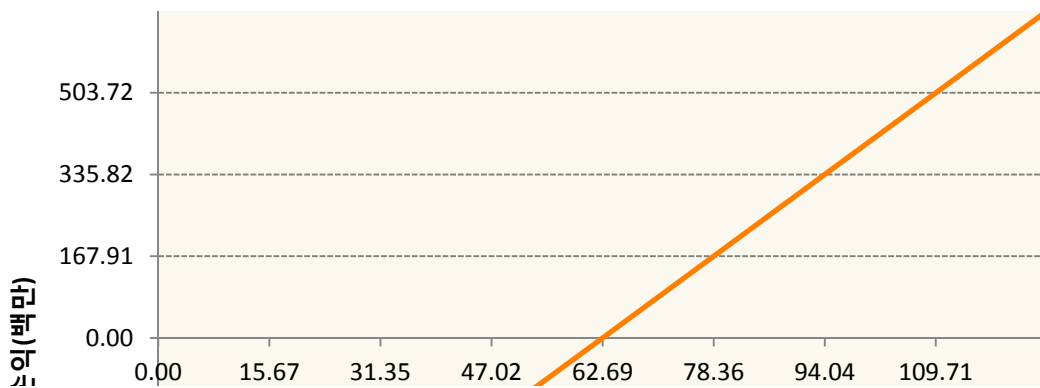
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,446	478	1,968	
누계	유가증권	선물	204	0	204	장내

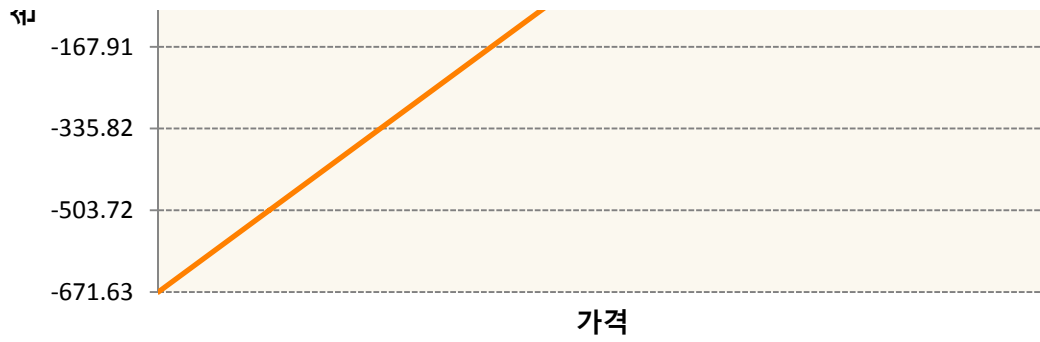
2. 만기시점의 손익구조

CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19

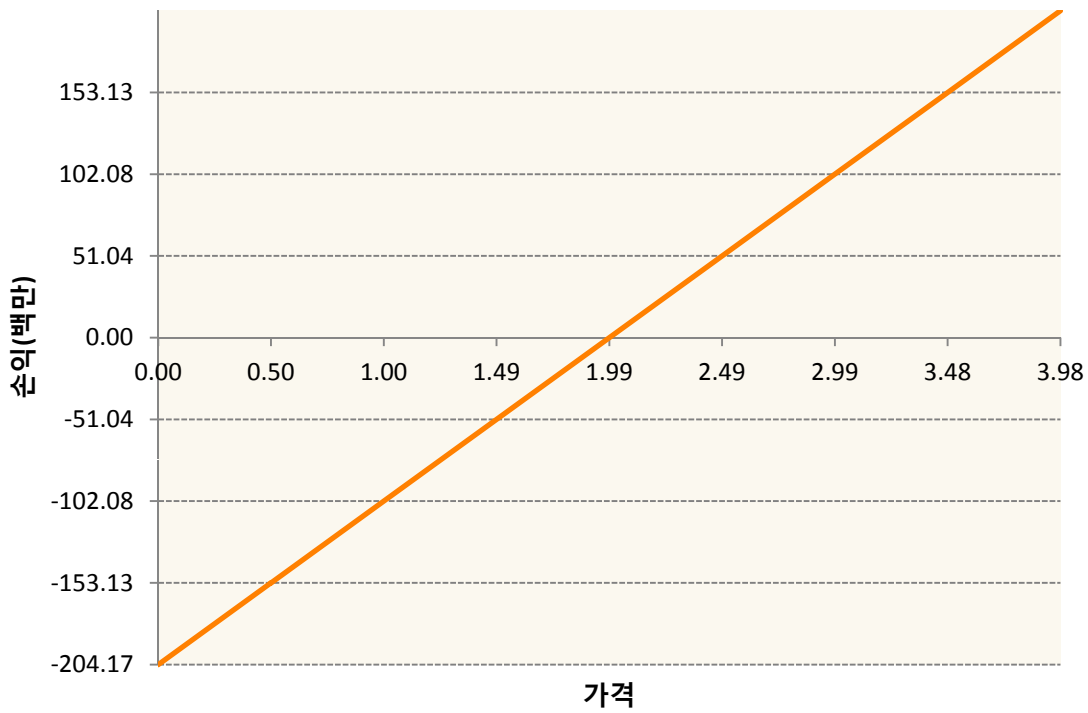


COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20

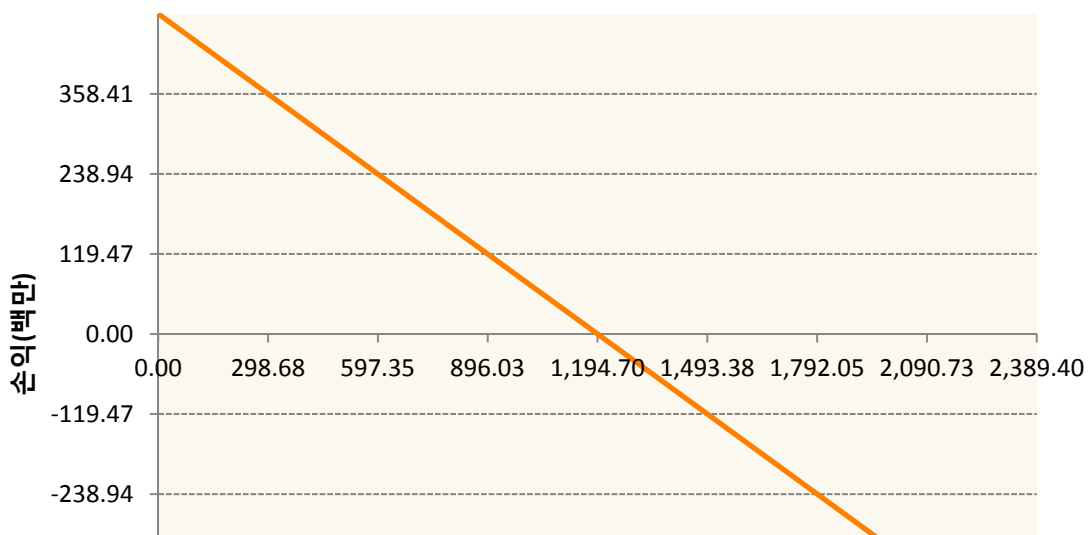


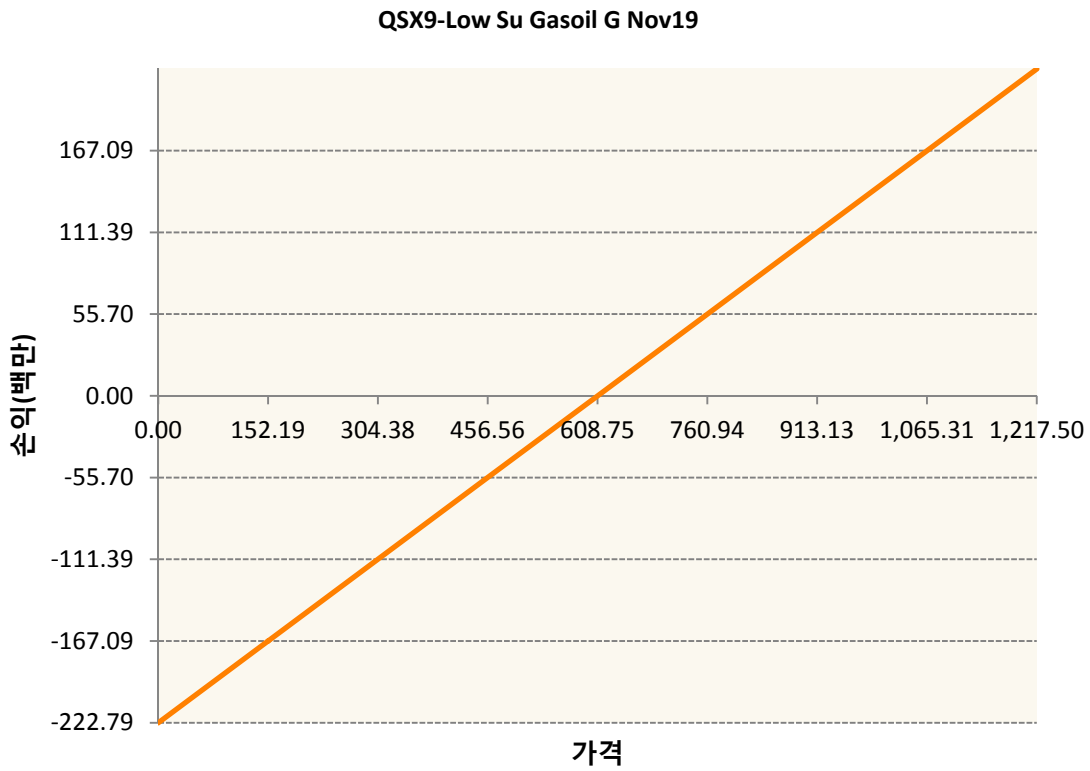
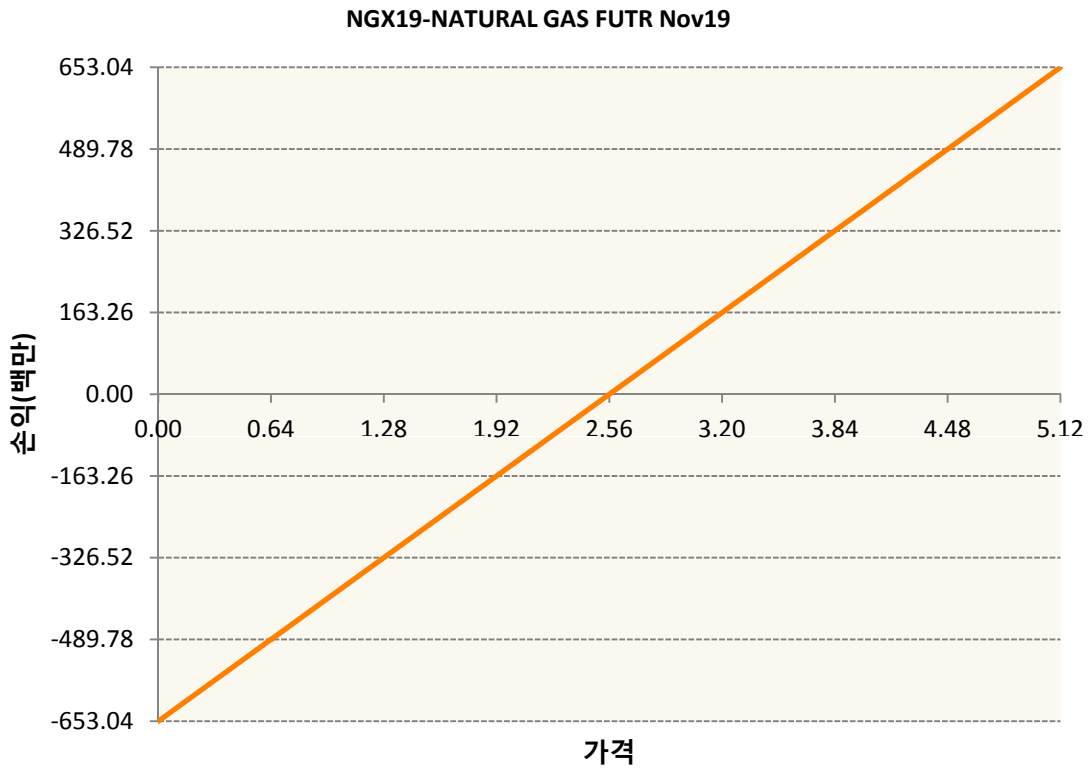
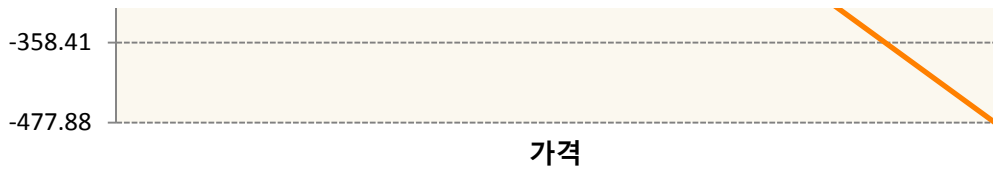


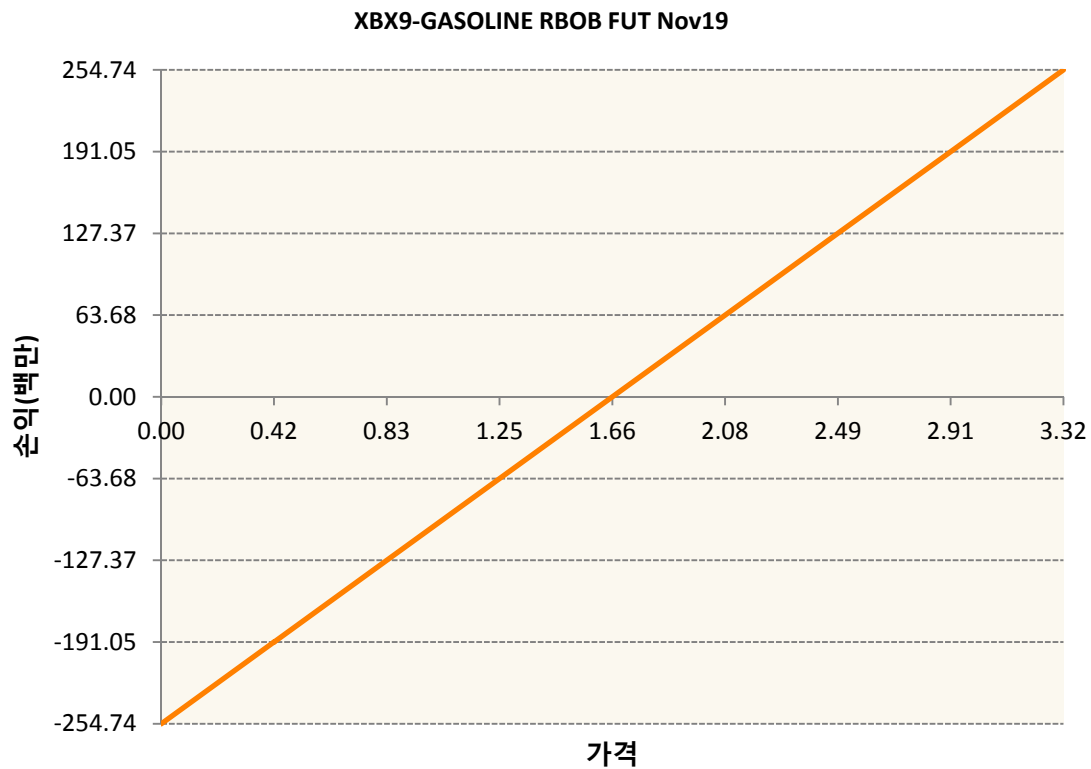
HOX9-Heating Oil



KR4175PA0005-2019-10 달러선물







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX9	WTI CRUDE FUTURE Nov19	52
COF0	BRENT CRUDE FUTR Jan20	54
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)
	444

공시일	2019-09-25
기준일	2019-09-24

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

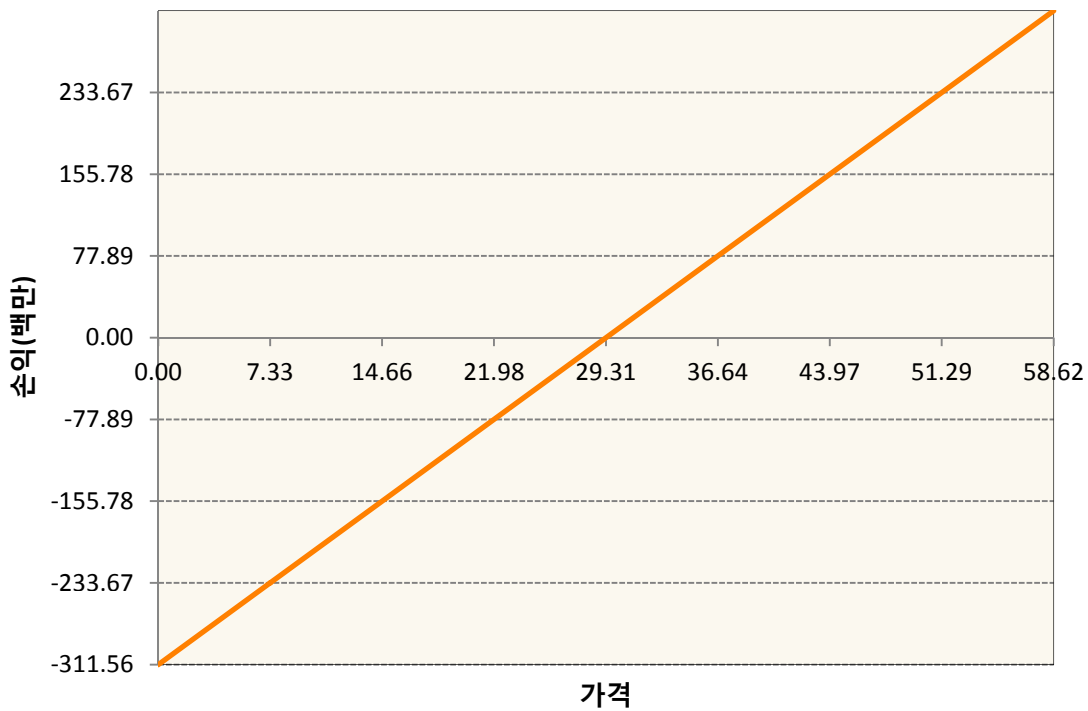
1. 계약금액

(단위:백만원)

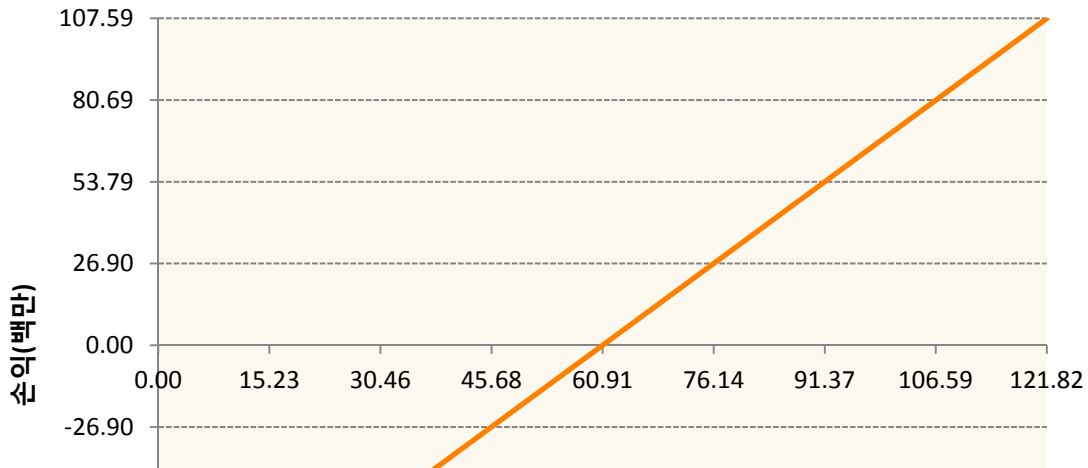
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,763	96	2,668	

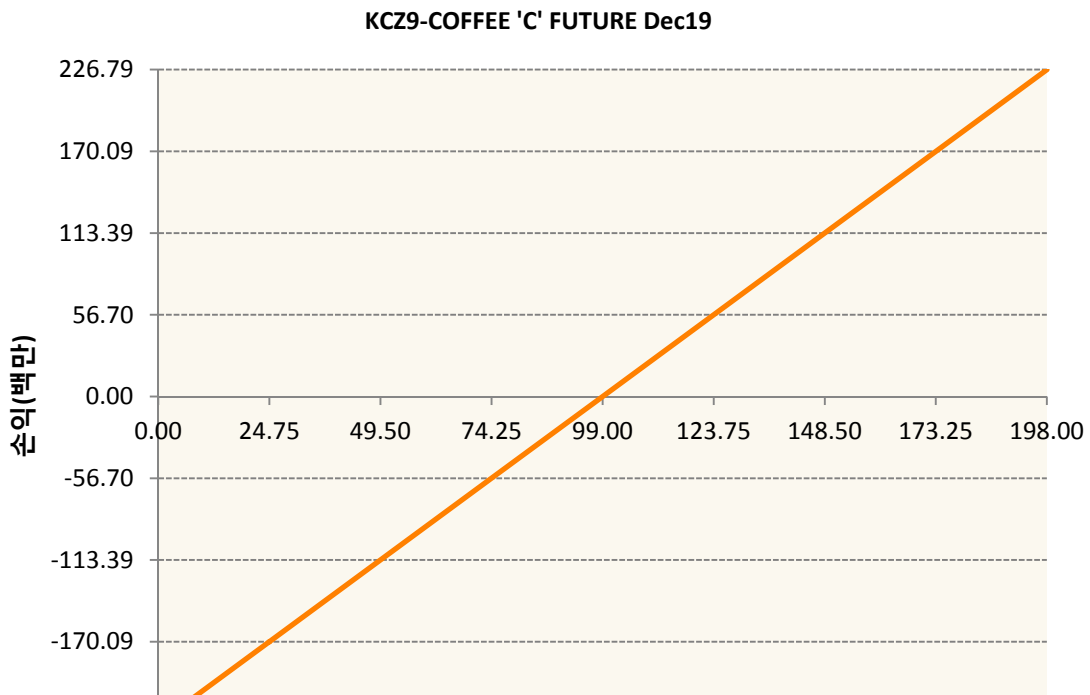
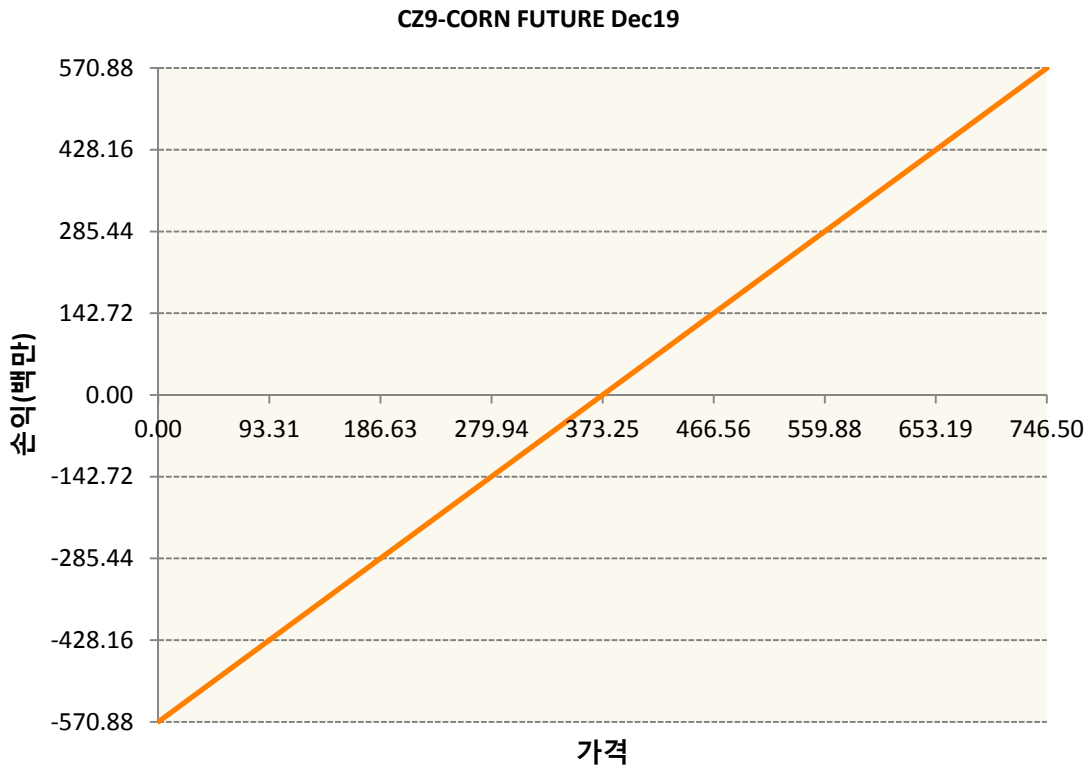
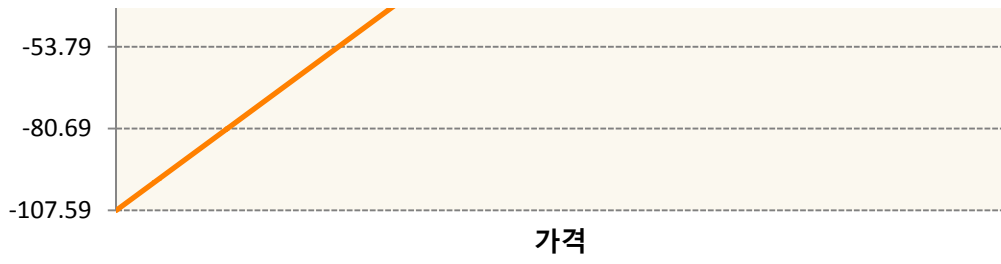
2. 만기시점의 손익구조

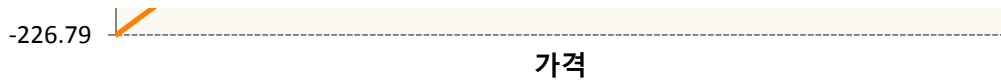
BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19



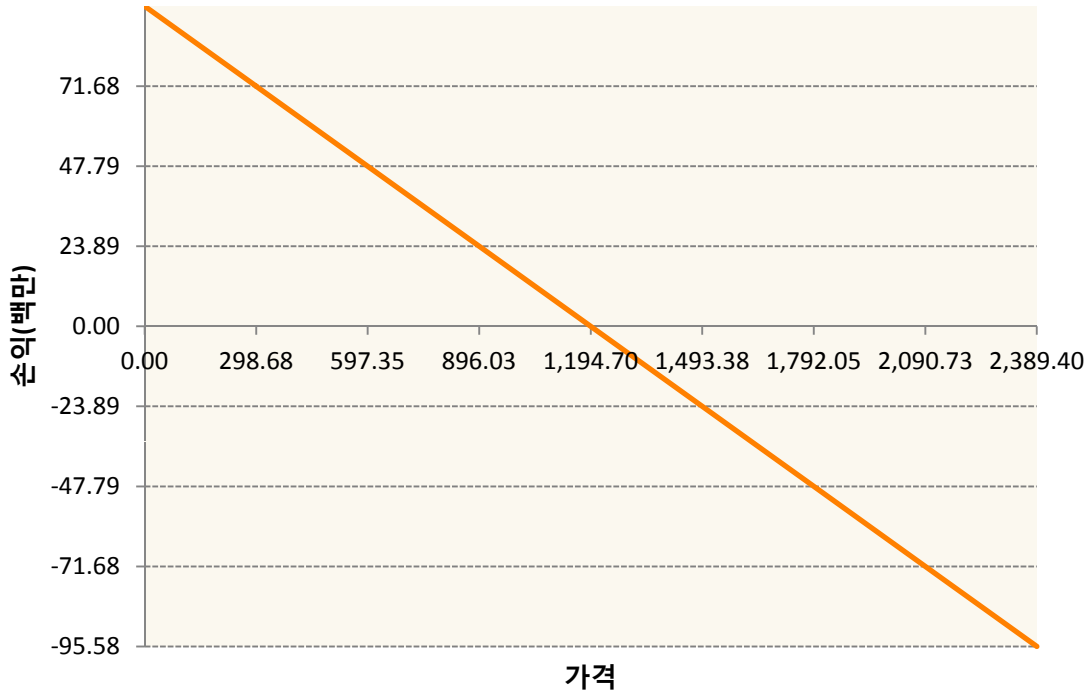
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



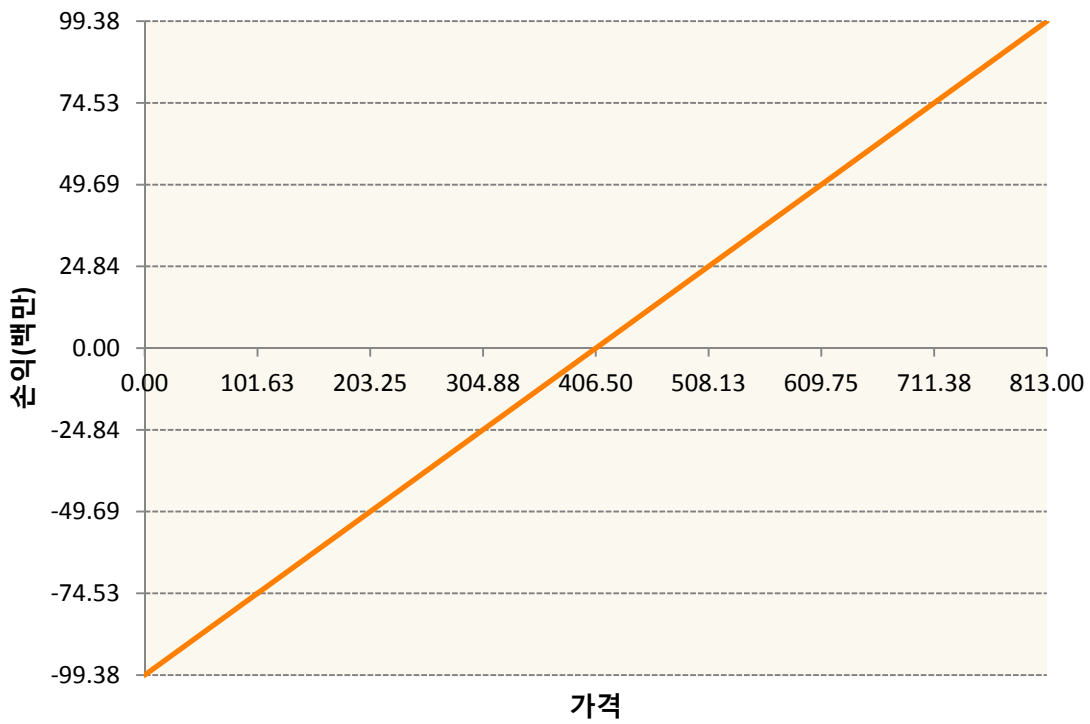




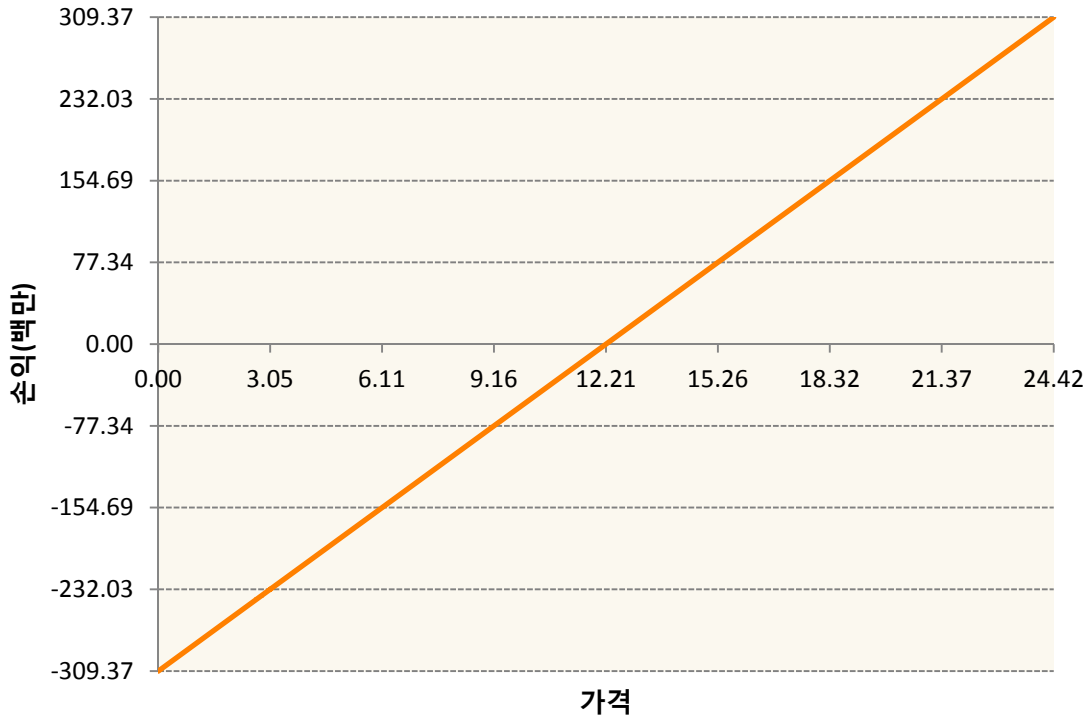
KR4175PA0005-2019-10 달러선물



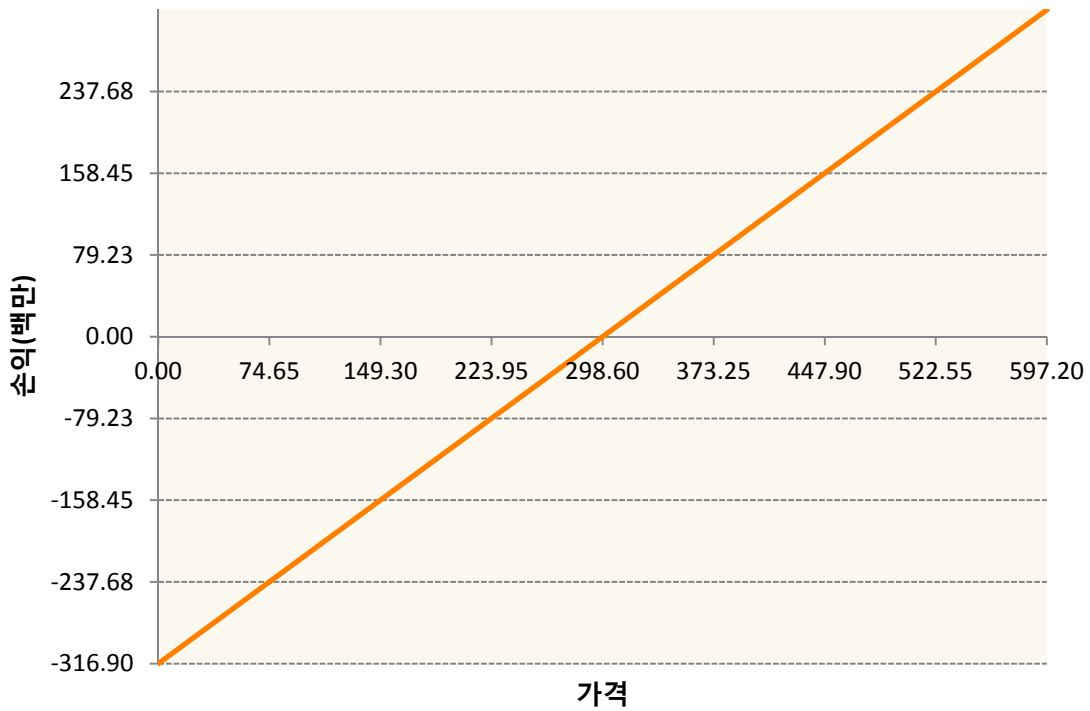
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



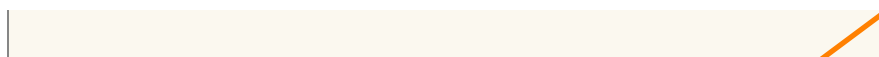
SBH0-Sugar Mar20

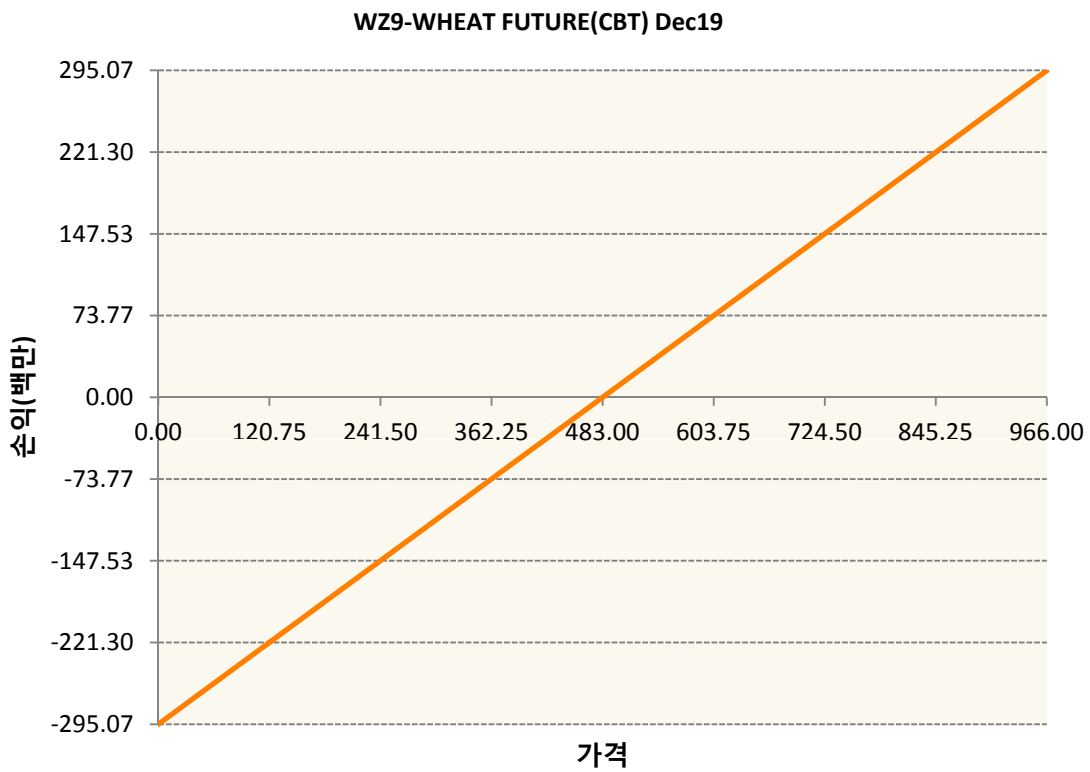
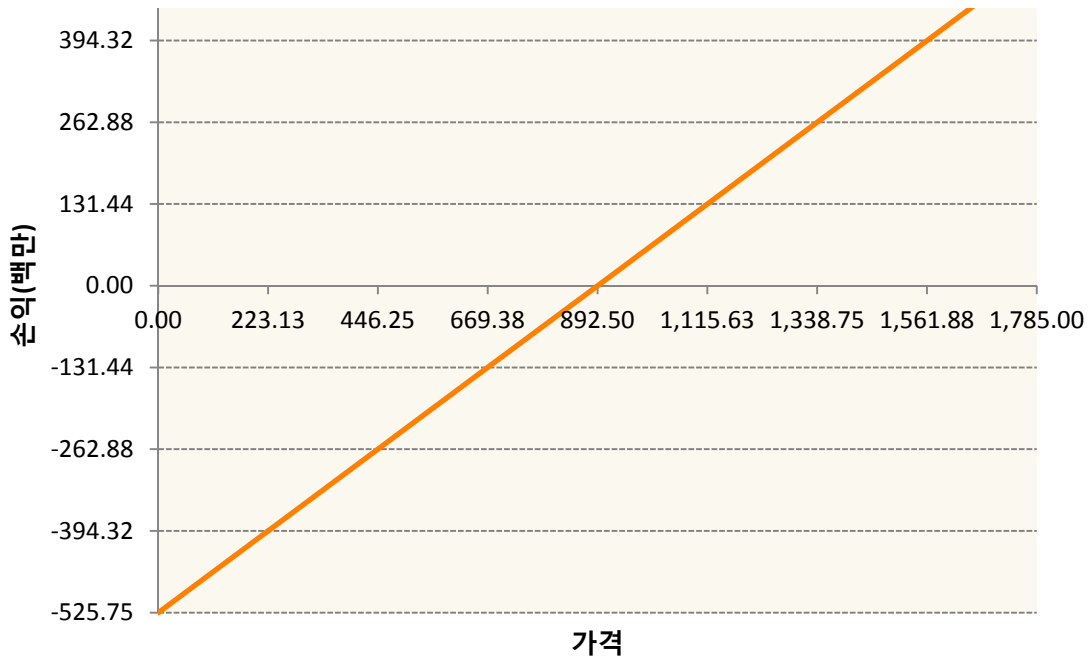


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	25
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	9
CZ9	CORN FUTURE Dec19	46
KCZ9	COFFEE 'C' FUTURE Dec19	18
KR4175PA00 2019-10 달러선물		8

KWZ9	KC HRW WHEAT FUT Dec19	8
SBH0	Sugar Mar20	25
SMZ9	SOYBEAN MEAL FUTR Dec19	25
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	42
WZ9	WHEAT FUTURE(CBT) Dec19	24

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

(단위:백만원)

247