

공시일	2019-09-26
기준일	2019-09-25

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)

94

공시일	2019-09-26
기준일	2019-09-25

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

1,172

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

670

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-26
기준일	2019-09-25

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)	384
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	141

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

834

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-26
기준일	2019-09-25

유로인덱스모(주식-파생형)

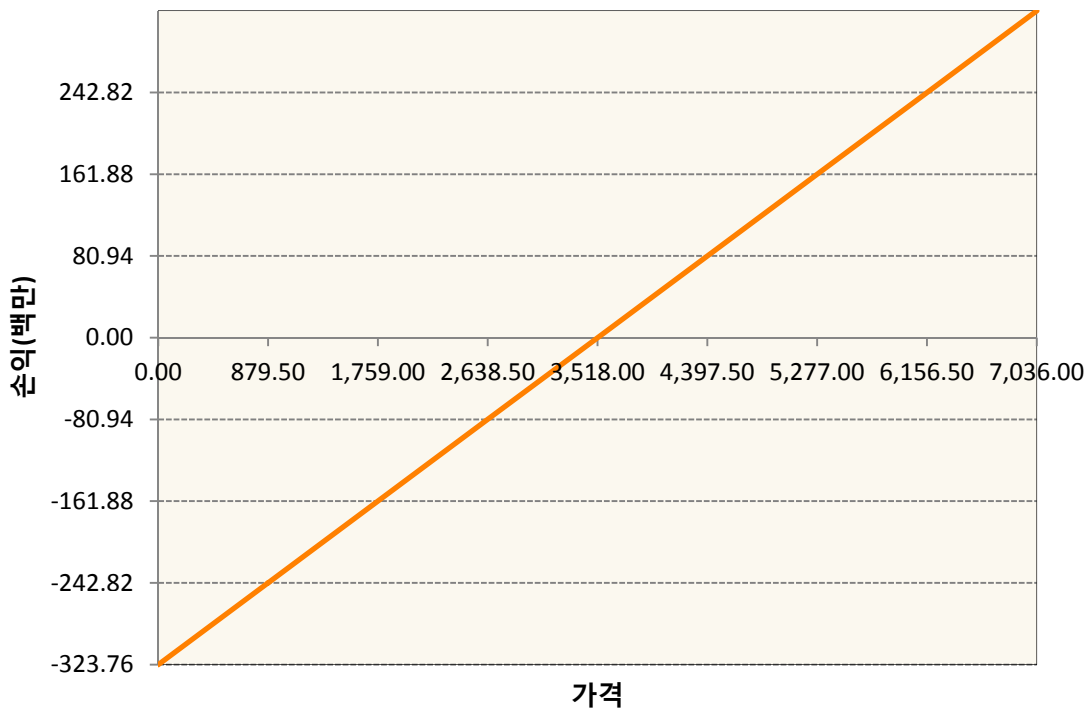
1. 계약금액

(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	2019-09-26
기준일	2019-09-25

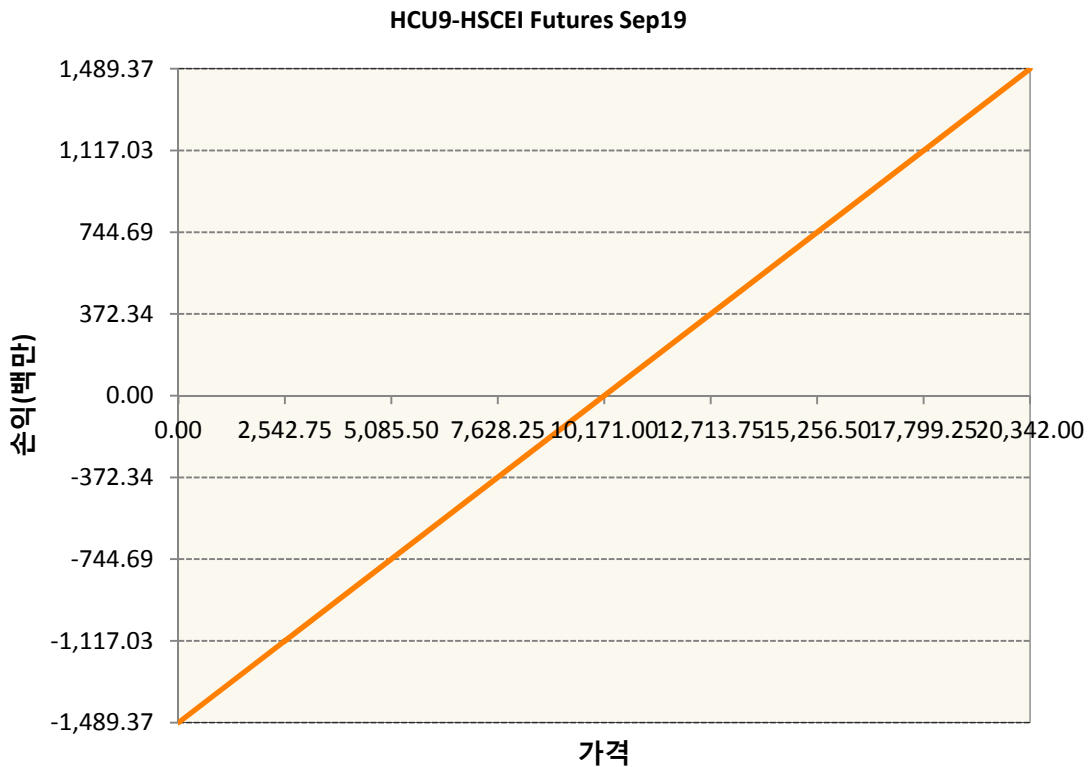
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,489	0	1,489	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU9	HSCEI Futures Sep19	119
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

110

공시일	2019-09-26
기준일	2019-09-25

커버드콜모(주식혼합-파생형)

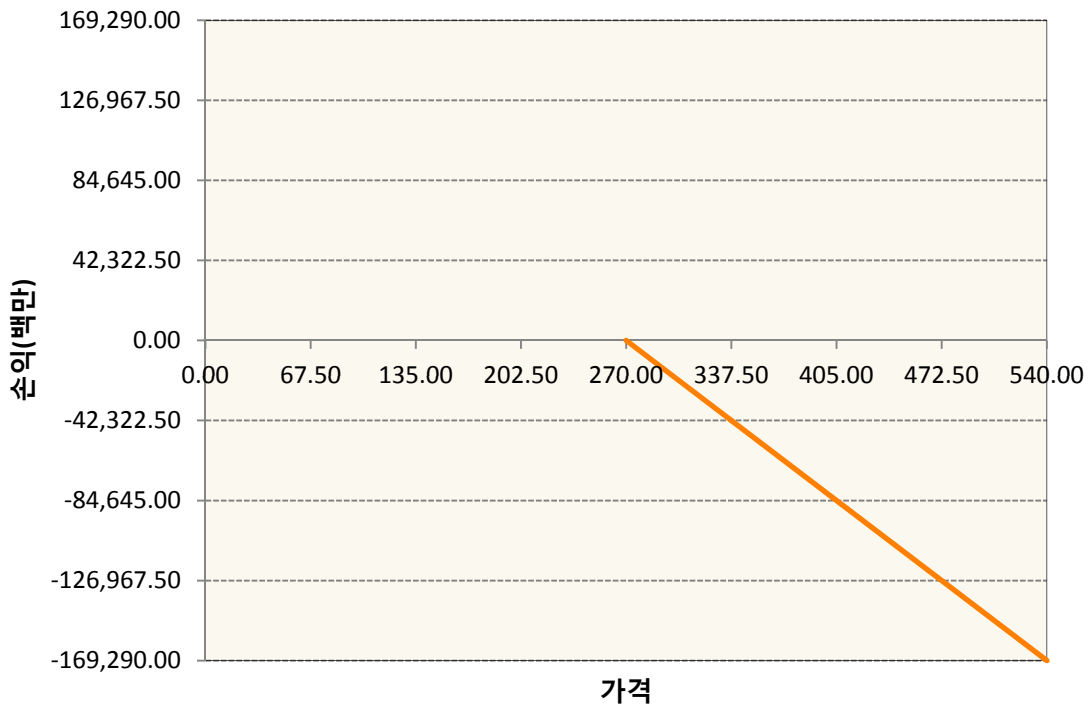
1. 계약금액

(단위:백만원)

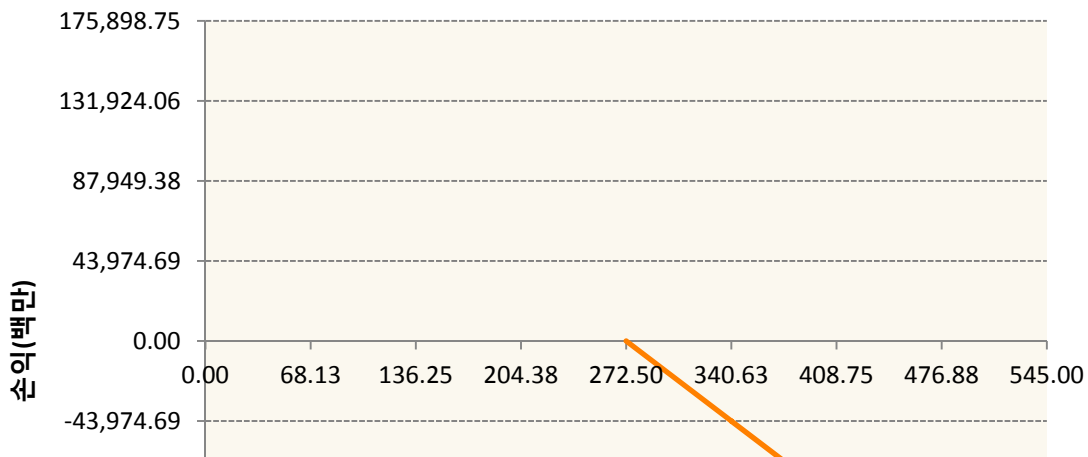
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	3,288	0	3,288	장내
누계	유가증권	옵션	0	513,939	-513,939	장내

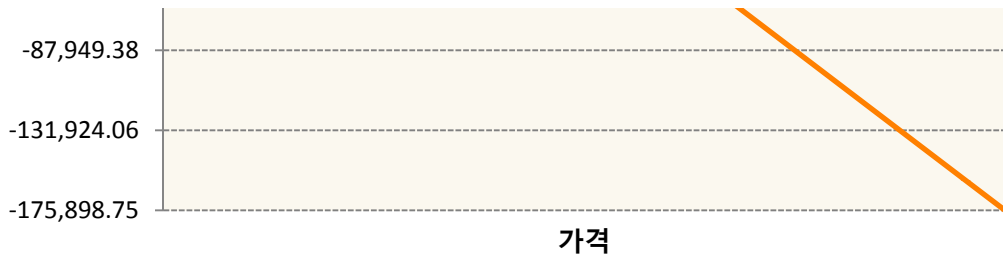
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PA2702-2019-10 콜270

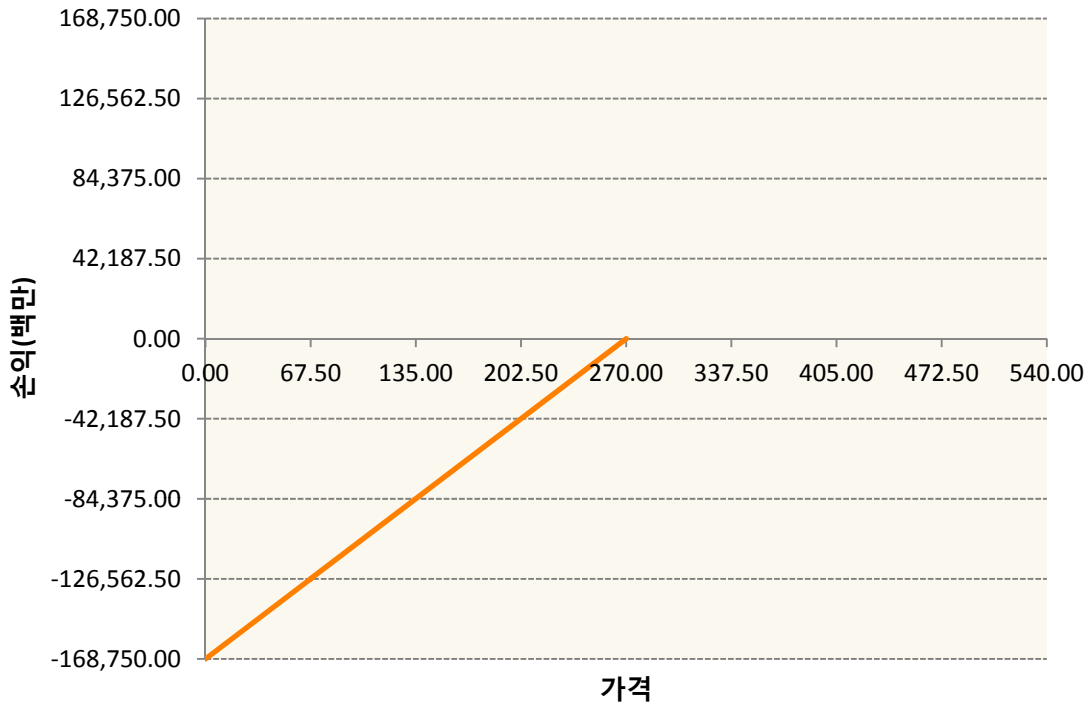


KR4201PA2728-2019-10 콜272.5





KR4301PA2701-2019-10 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PA2702		2019-10 콜270					11,741
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,032	4,949	4,845	4,722	4,581	4,425	4,255
-5.33%	4,567	4,373	4,163	3,941	3,708	3,468	3,220
-2.67%	3,295	3,005	2,713	2,419	2,125	1,830	1,534
0%	863	578	291	0	-293	-587	-883
2.67%	-2,650	-2,839	-3,046	-3,267	-3,499	-3,741	-3,991
5.33%	-6,837	-6,925	-7,036	-7,167	-7,317	-7,484	-7,665
8.00%	-11,312	-11,341	-11,387	-11,449	-11,529	-11,627	-11,741
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5					11,559
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,315	4,256	4,176	4,077	3,959	3,824	3,674

-5.33%	3,999	3,838	3,657	3,459	3,248	3,025	2,792
-2.67%	3,018	2,741	2,459	2,172	1,881	1,587	1,292
0%	936	624	312	0	-313	-626	-939
2.67%	-2,331	-2,568	-2,818	-3,078	-3,346	-3,621	-3,902
5.33%	-6,447	-6,572	-6,721	-6,891	-7,078	-7,280	-7,495
8.00%	-10,980	-11,027	-11,095	-11,183	-11,290	-11,416	-11,559
KR4301PA2701 2019-10 풋270							10,089
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,983	-9,987	-9,995	-10,009	-10,028	-10,055	-10,089
-5.33%	-5,489	-5,539	-5,601	-5,674	-5,758	-5,850	-5,951
-2.67%	-1,645	-1,802	-1,962	-2,125	-2,289	-2,454	-2,621
0%	447	303	154	0	-157	-316	-478
2.67%	983	941	887	820	743	656	560
5.33%	1,039	1,035	1,026	1,012	992	963	927
8.00%	1,041	1,041	1,041	1,039	1,036	1,030	1,021

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

(단위:백만원)

34,543

공시일	2019-09-26
기준일	2019-09-25

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

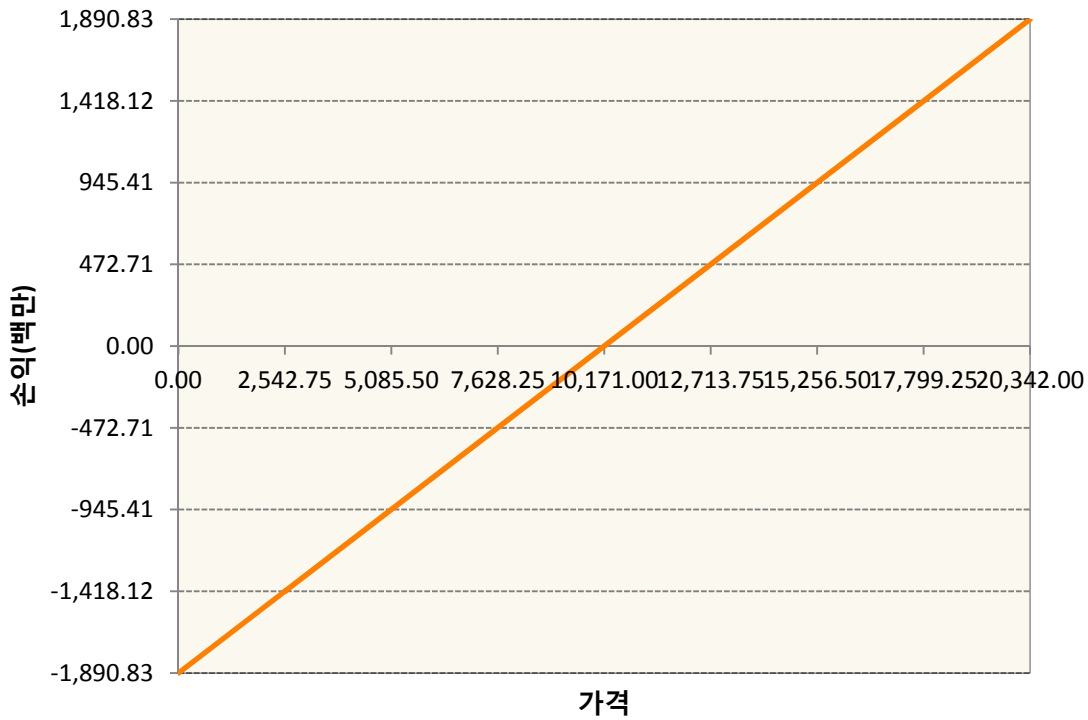
1. 계약금액

(단위:백만원)

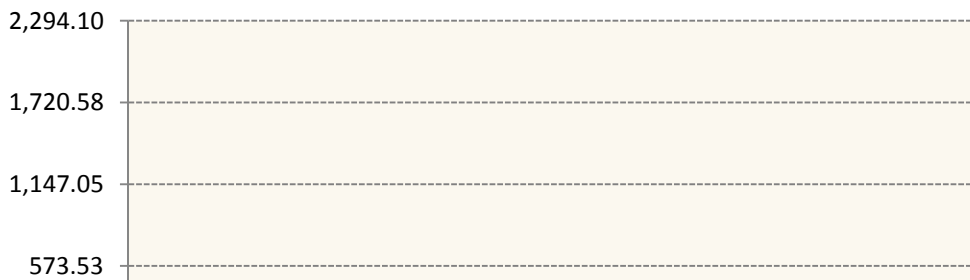
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,891	0	1,891	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,891	-4,891	장내
누계	통화	선도	688	2,841	-2,153	장외

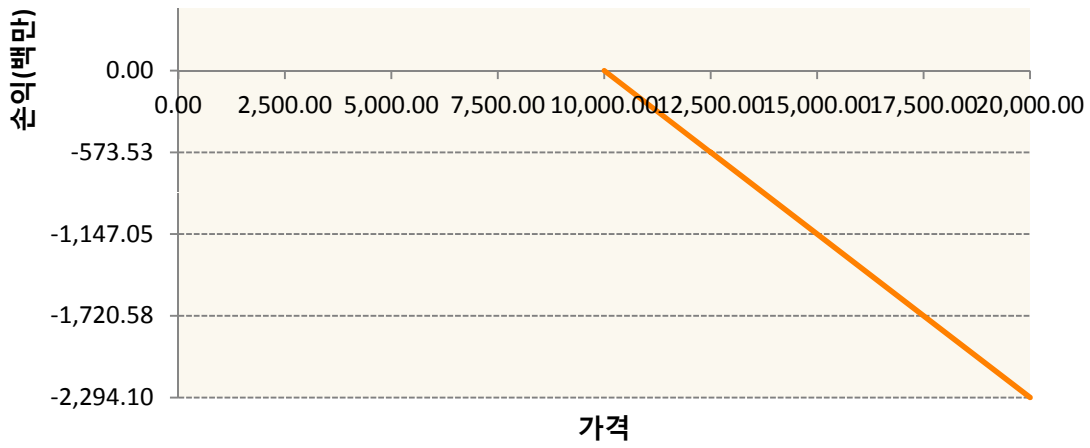
2. 만기시점의 손익구조

HCU9-HSCEI Futures Sep19

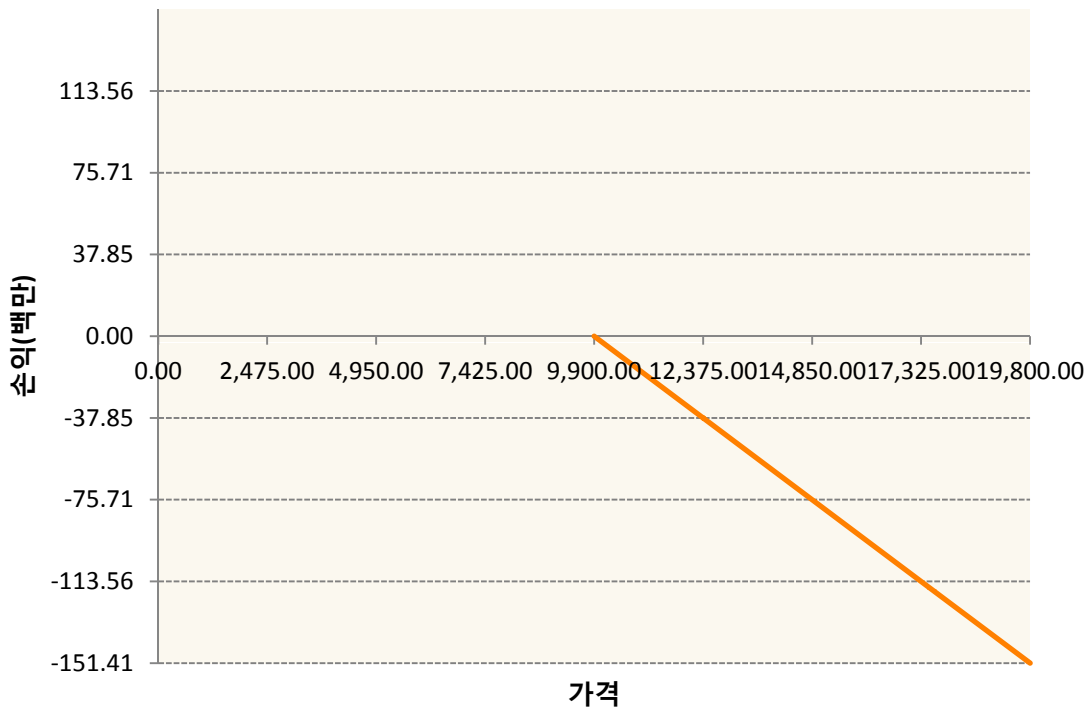


OHHIU9-C100-HSCEI

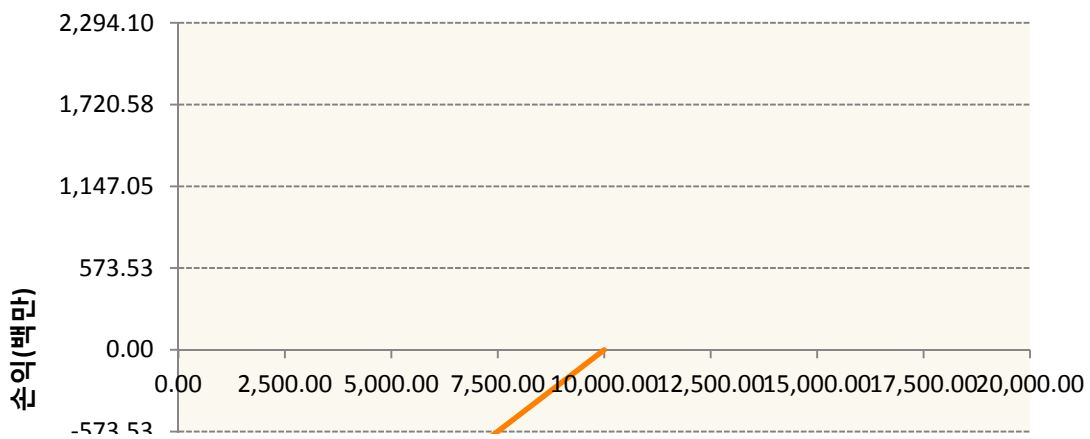


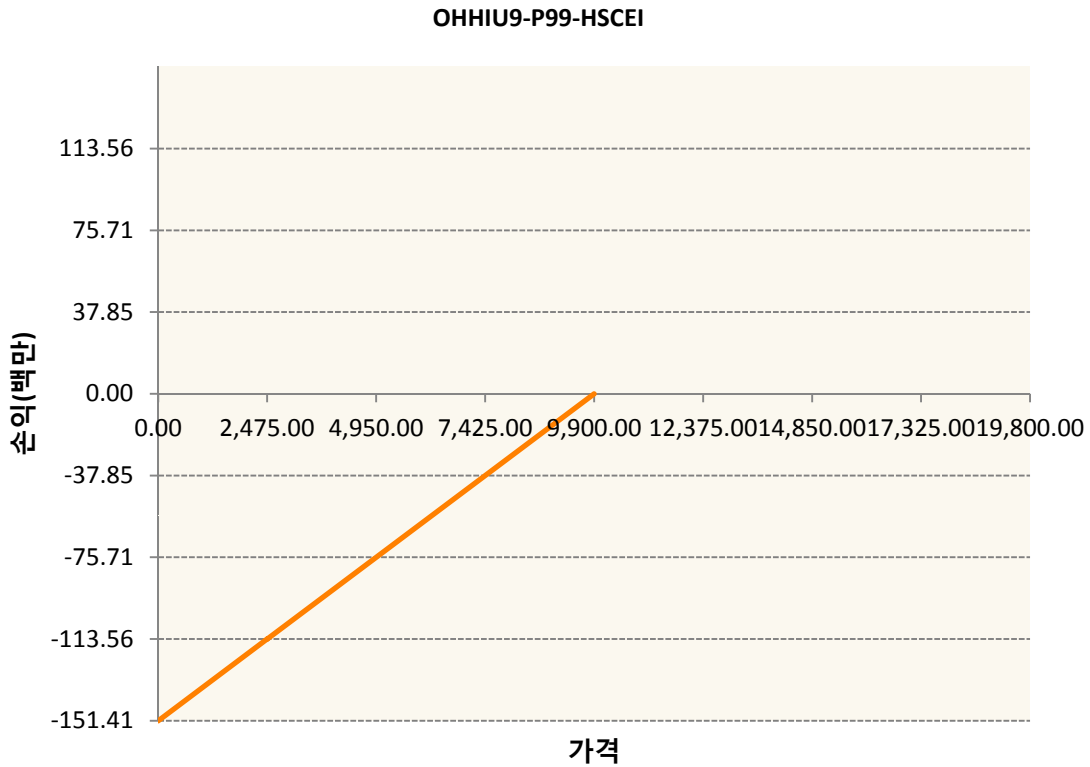


OHHIU9-C99-HSCEI



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	151
OHHIU9-C1(HSCEI	184
OHHIU9-C9(HSCEI	12
OHHIU9-P1(HSCEI	184
OHHIU9-P9(HSCEI	12

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

공시일	2019-09-26
기준일	2019-09-25

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

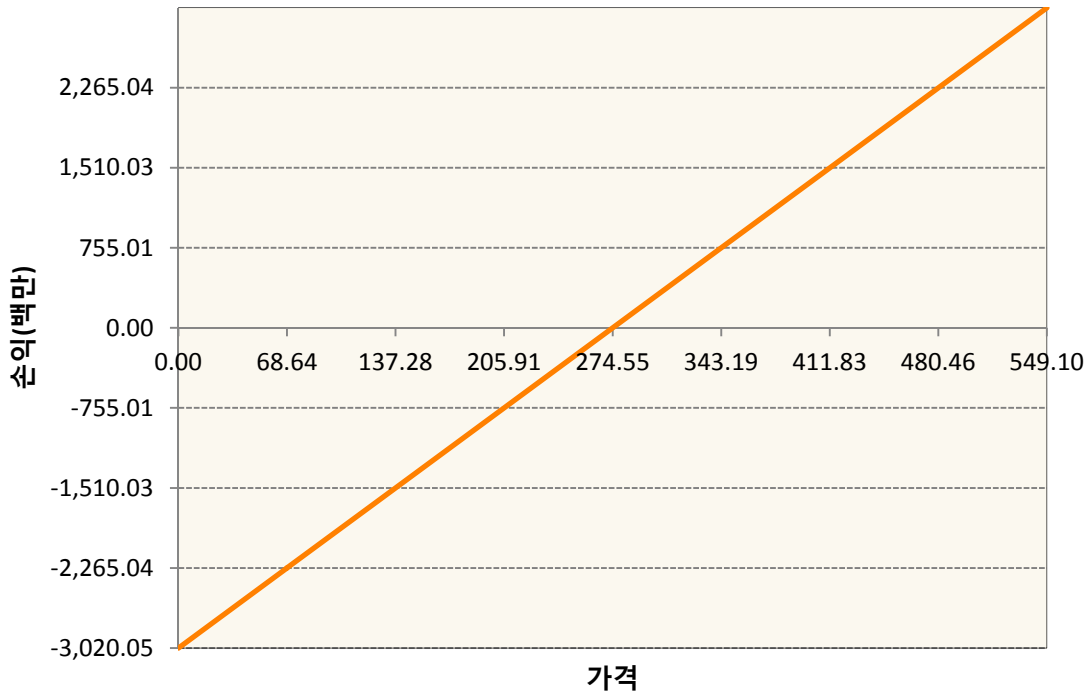
1. 계약금액

(단위:백만원)

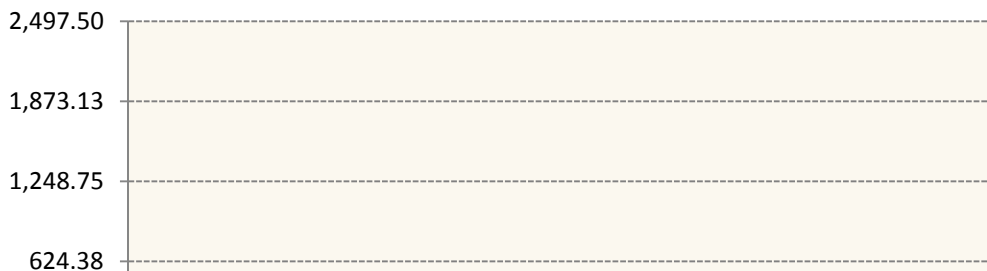
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,020	0	3,020	장내
누계	유가증권	스왑	14,125	0	14,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,828	-14,828	장내

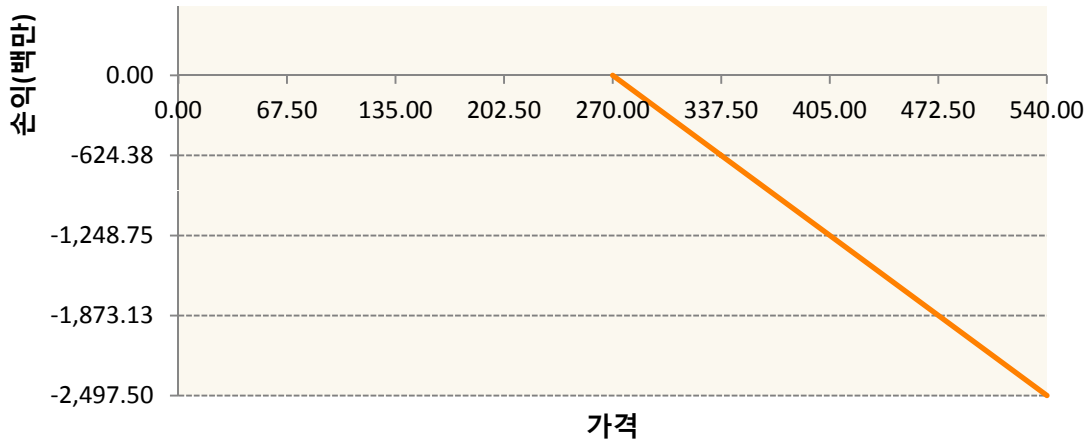
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

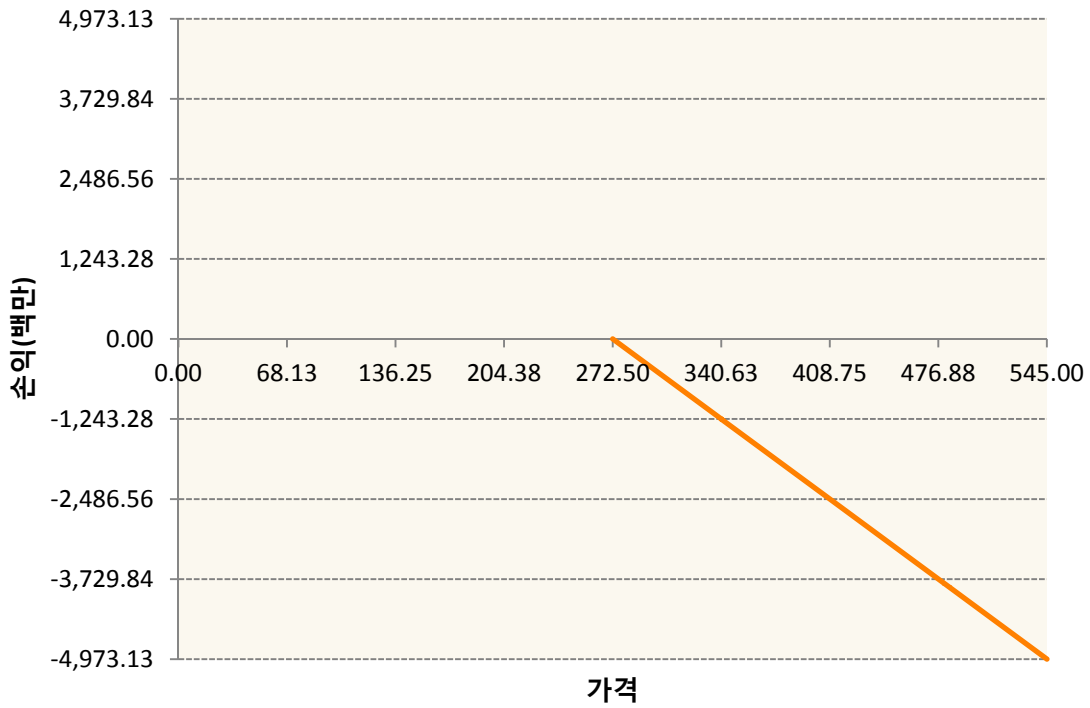


KR4201PA2702-2019-10 콜270

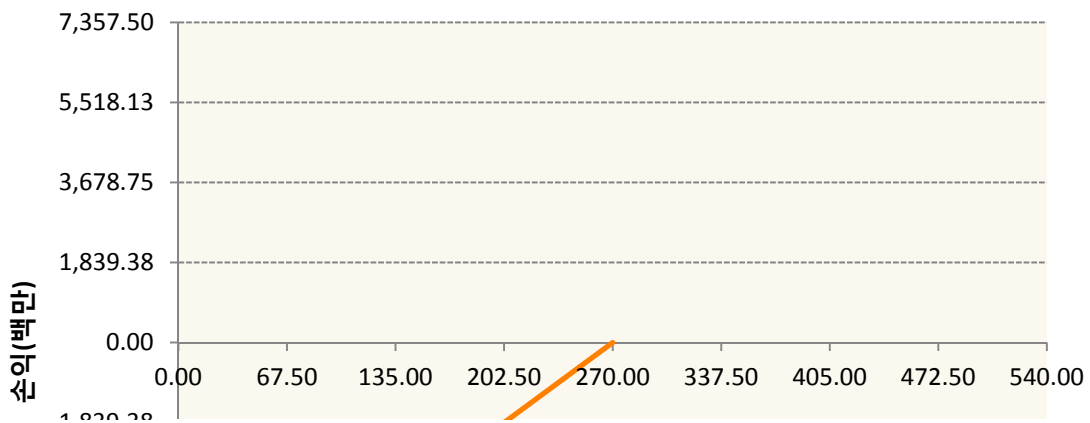




KR4201PA2728-2019-10 콜272.5



KR4301PA2701-2019-10 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						1,219
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,219	-1,219	-1,219	-1,219	-1,219	-1,219	-1,219	
-5.33%	-813	-813	-813	-813	-813	-813	-813	
-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%	813	813	813	813	813	813	813	
8.00%	1,219	1,219	1,219	1,219	1,219	1,219	1,219	
KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						241
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-241	-241	-241	-241	-241	-241	-241	
-5.33%	-161	-161	-161	-161	-161	-161	-161	
-2.67%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	80	80	80	80	80	80	80	
5.33%	161	161	161	161	161	161	161	
8.00%	241	241	241	241	241	241	241	
KR4201PA2702		2019-10 콜270						173
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	74	73	71	70	68	65	63	
-5.33%	67	65	61	58	55	51	48	
-2.67%	49	44	40	36	31	27	23	
0%	13	9	4	0	-4	-9	-13	
2.67%	-39	-42	-45	-48	-52	-55	-59	
5.33%	-101	-102	-104	-106	-108	-110	-113	
8.00%	-167	-167	-168	-169	-170	-172	-173	
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5						327
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	122	120	118	115	112	108	104
-5.33%	113	108	103	98	92	86	79
-2.67%	85	78	70	61	53	45	37
0%	26	18	9	0	-9	-18	-27
2.67%	-66	-73	-80	-87	-95	-102	-110
5.33%	-182	-186	-190	-195	-200	-206	-212
8.00%	-310	-312	-314	-316	-319	-323	-327
KR4301PA2701 2019-10 풋270							440
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-435	-435	-436	-436	-437	-438	-440
-5.33%	-239	-241	-244	-247	-251	-255	-259
-2.67%	-72	-79	-86	-93	-100	-107	-114
0%	19	13	7	0	-7	-14	-21
2.67%	43	41	39	36	32	29	24
5.33%	45	45	45	44	43	42	40
8.00%	45	45	45	45	45	45	45

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

(단위:백만원)

2,395

공시일	2019-09-26
기준일	2019-09-25

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

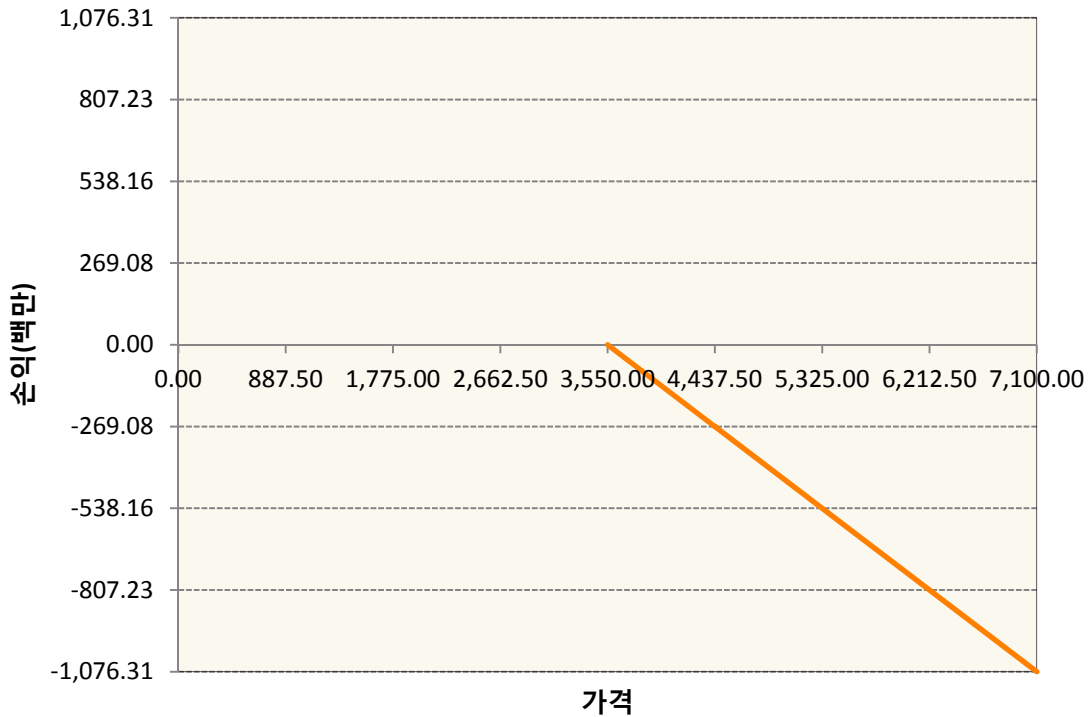
1. 계약금액

(단위:백만원)

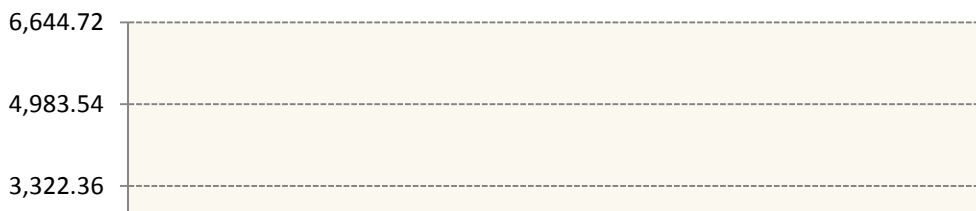
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,715	0	4,715	
누계	유가증권	스왑	23,987	0	23,987	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,442	-15,442	장내
누계	통화	선도	10,941	23,332	-12,391	장외

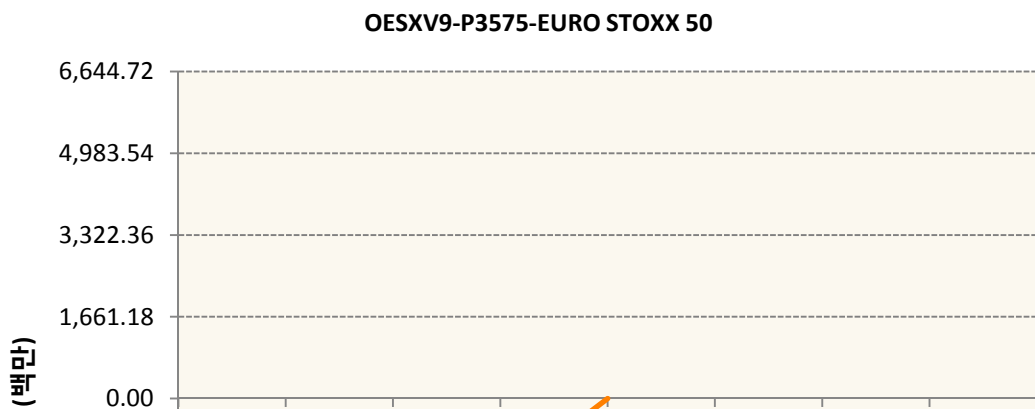
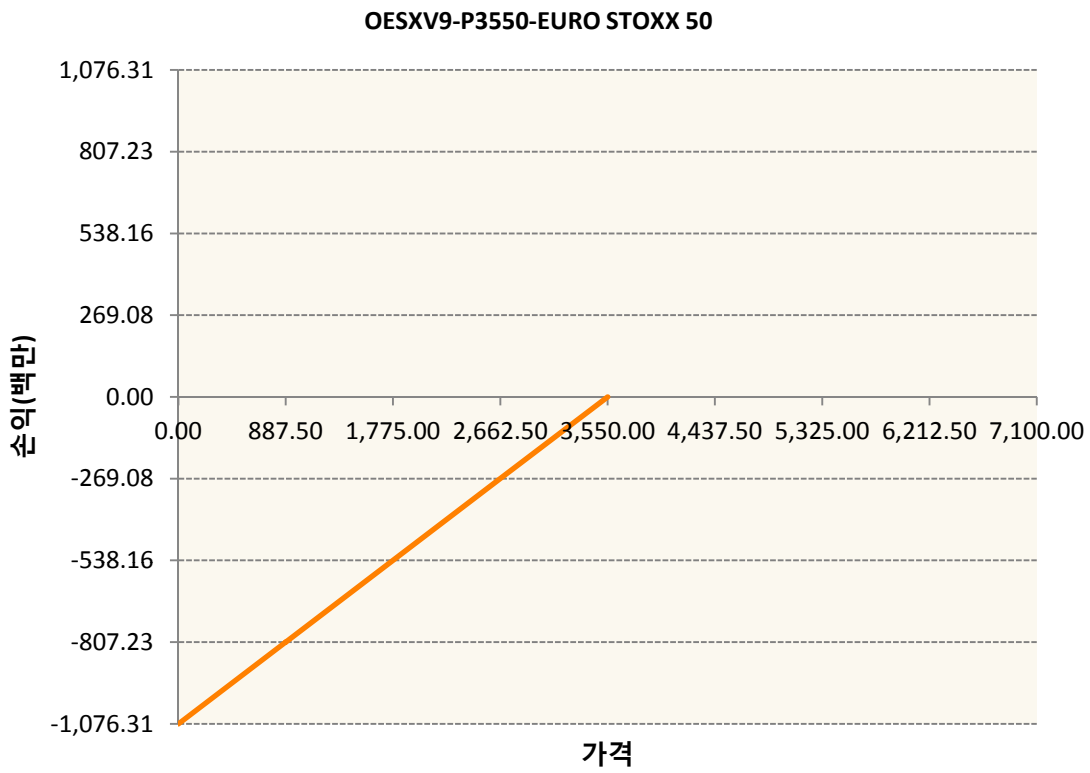
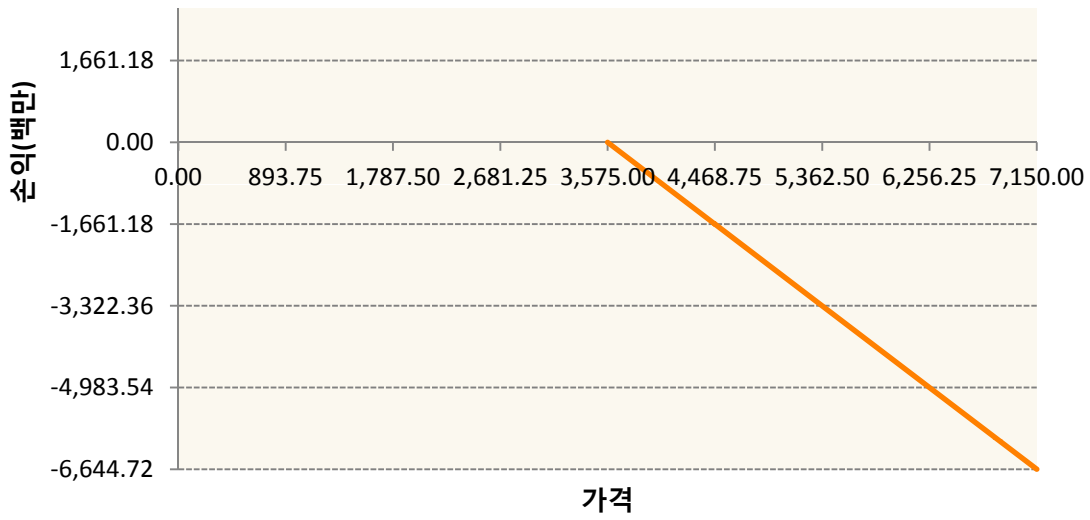
2. 만기시점의 손익구조

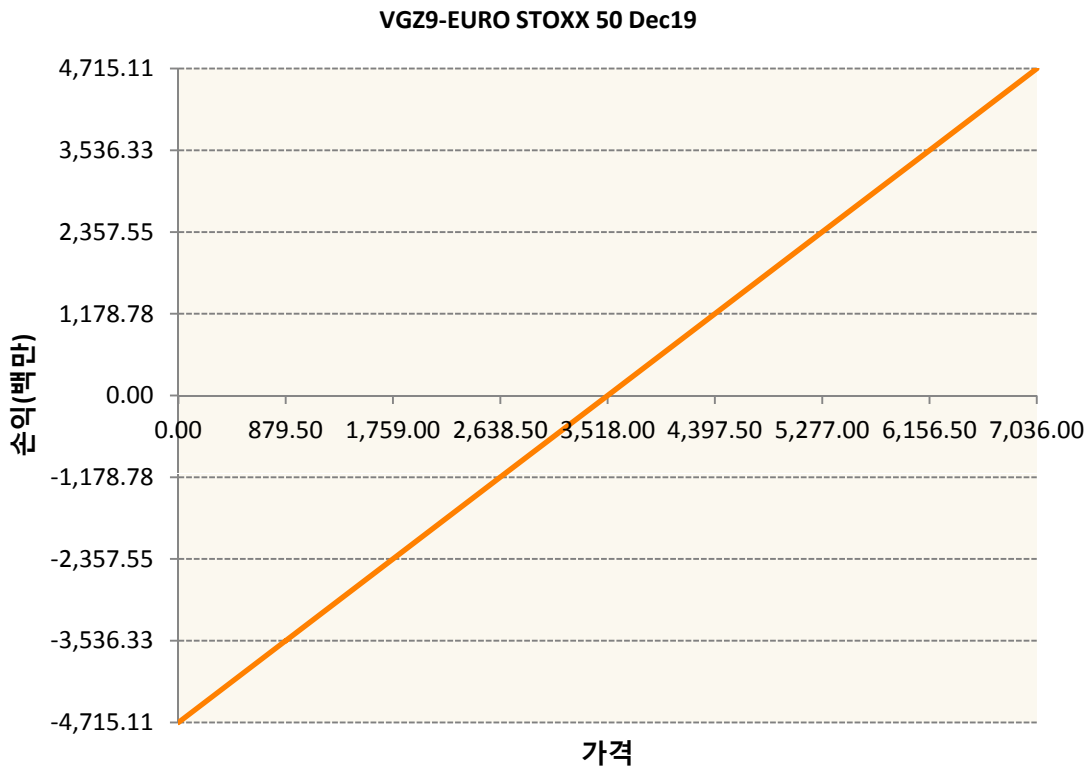
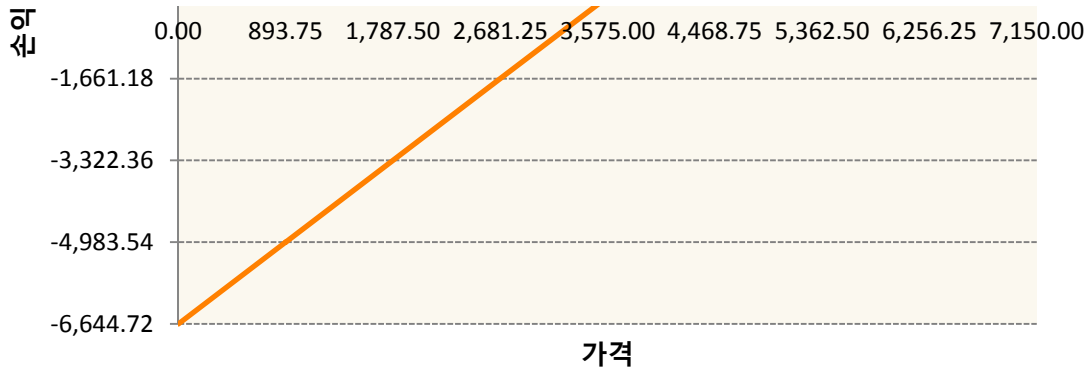
OESXV9-C3550-EURO STOXX 50



OESXV9-C3575-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		29
FX21019M0< KRW/EUR 27-09-19E		1,055
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
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E		496
OESXV9-C35 EURO STOXX 50		86
OESXV9-C35 EURO STOXX 50		532
OESXV9-P35 EURO STOXX 50		86

OESXV9-P35 EURO STOXX 50
VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19

532
377

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

(단위:백만원)

2,464

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

(단위:백만원)

992

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

(단위:백만원)

85

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

(단위:백만원)

132

공시일	2019-09-26
기준일	2019-09-25

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

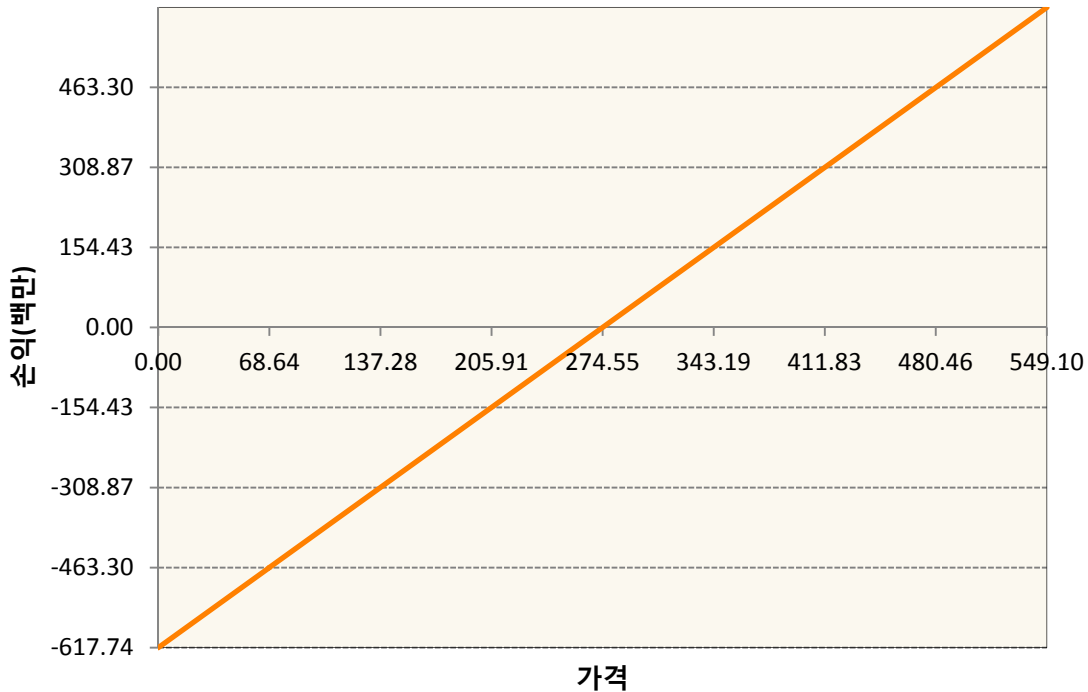
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	618	0	618	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	2019-09-26
기준일	2019-09-25

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

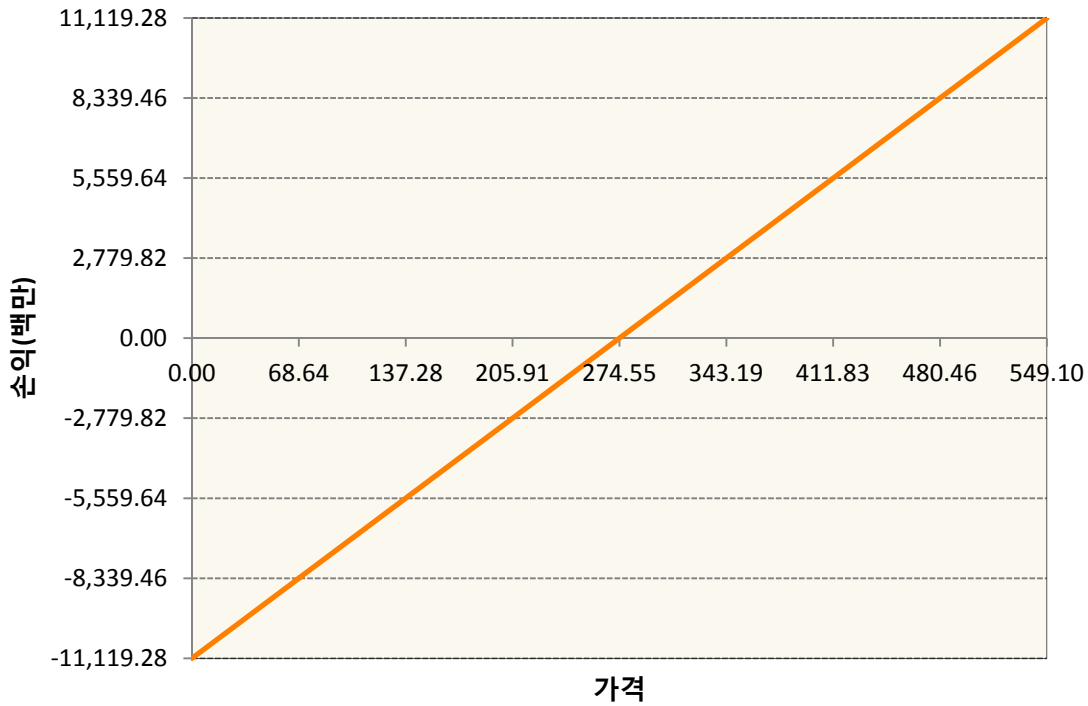
1. 계약금액

(단위:백만원)

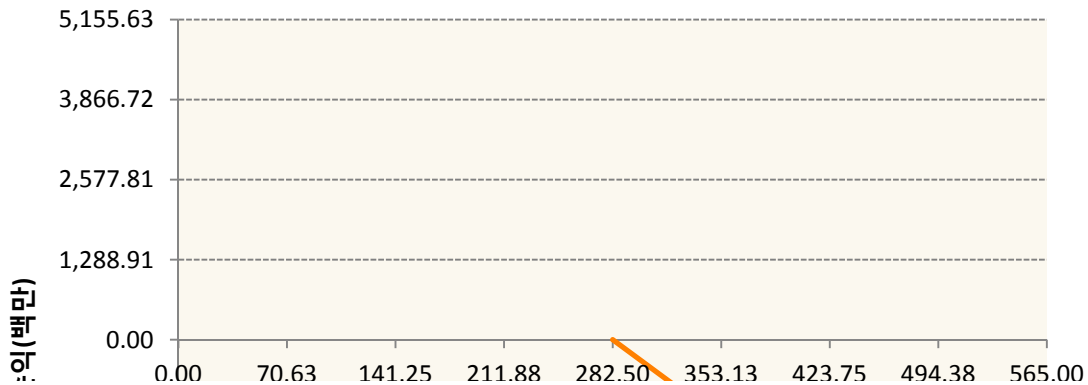
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,119	0	11,119	장내
누계	유가증권	옵션	1,422	20,759	-19,338	장내

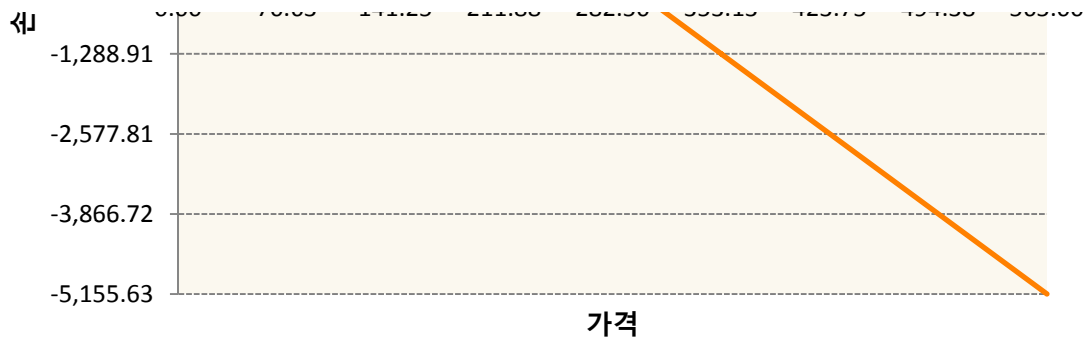
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

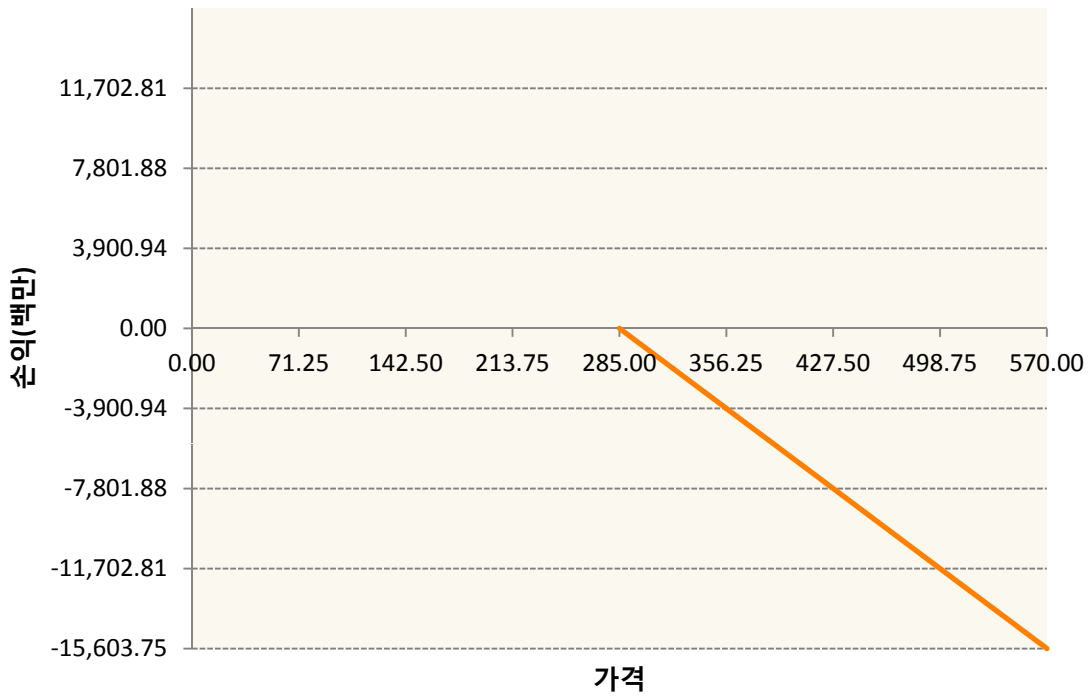


KR4201PA2827-2019-10 콜282.5

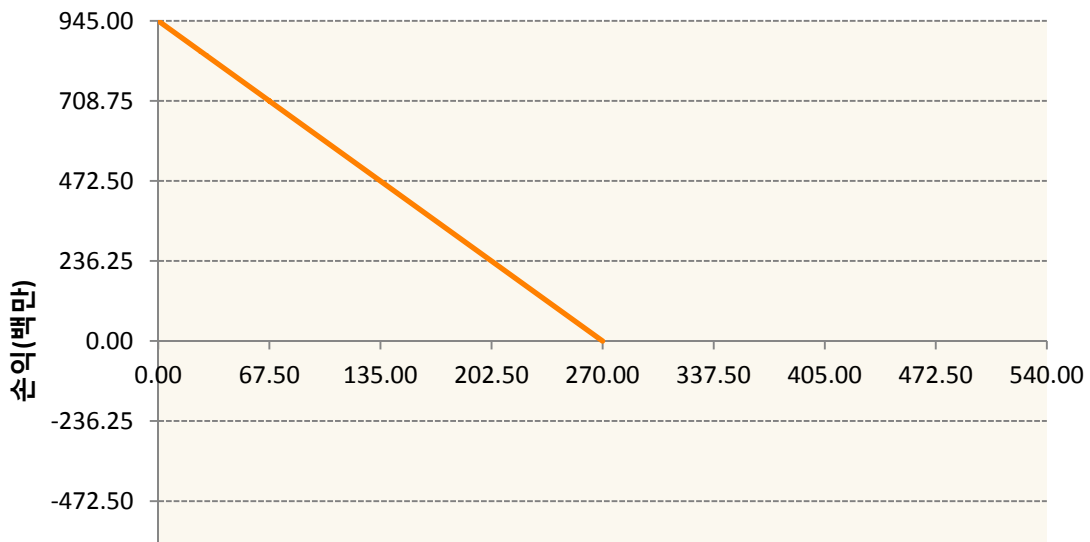


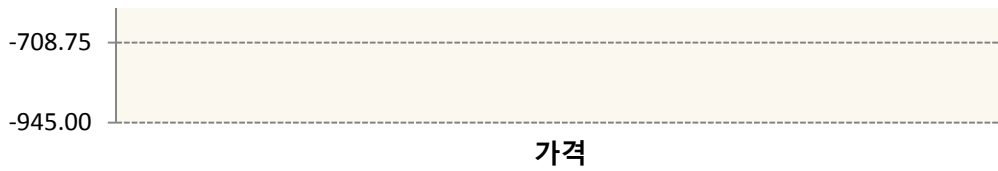


KR4201PA2850-2019-10 콜285

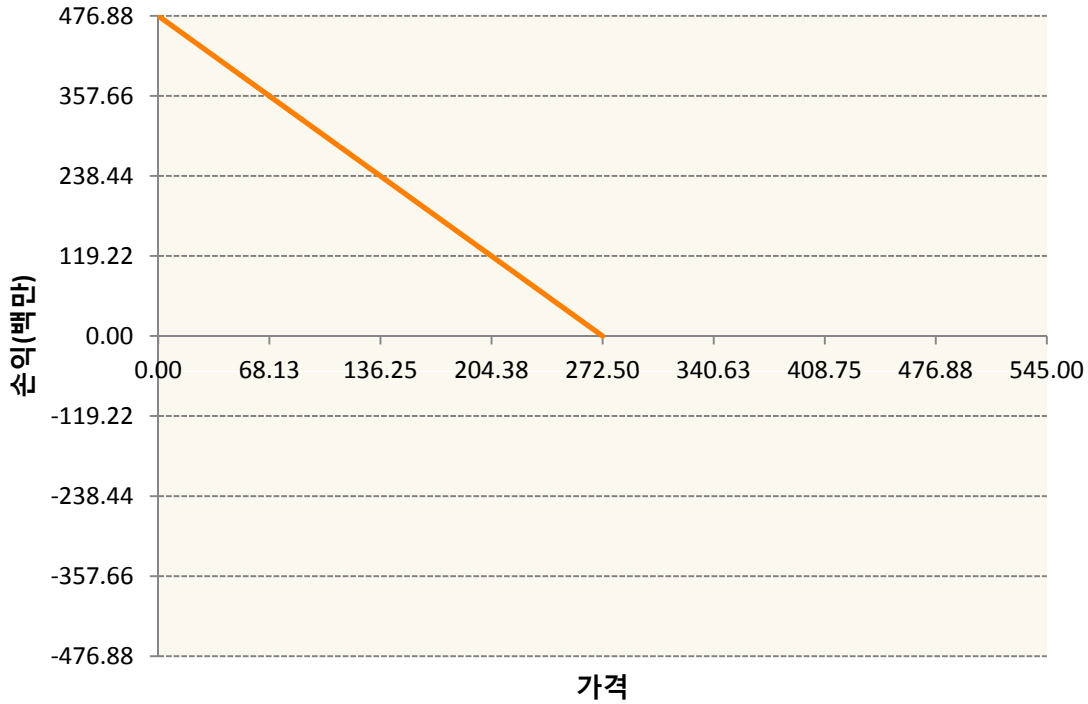


KR4301PA2701-2019-10 풋270





KR4301PA2727-2019-10 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						889
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-889	-889	-889	-889	-889	-889	-889	
-5.33%	-593	-593	-593	-593	-593	-593	-593	
-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%	593	593	593	593	593	593	593	
8.00%	889	889	889	889	889	889	889	
KR4201PA2827		2019-10 콜282.5						251
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	50	50	49	48	47	46	44	
-5.33%	49	47	46	43	41	37	33	
-2.67%	43	39	35	30	24	19	12	

0%	22	15	8	0	-8	-16	-24
2.67%	-25	-34	-43	-52	-62	-71	-80
5.33%	-105	-113	-122	-130	-139	-147	-156
8.00%	-213	-218	-224	-230	-237	-243	-251
KR4201PA2850 2019-10 콜285							687
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	115	114	113	112	109	106	101
-5.33%	113	110	107	102	95	87	77
-2.67%	102	93	83	71	57	42	26
0%	59	40	21	0	-22	-44	-67
2.67%	-52	-79	-106	-133	-160	-187	-214
5.33%	-259	-286	-313	-340	-367	-394	-422
8.00%	-558	-576	-597	-618	-640	-664	-687
KR4301PA2701 2019-10 풋270							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%	31	31	31	32	32	33	33
-2.67%	9	10	11	12	13	14	15
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-6	-5	-5	-5	-4	-4	-3
5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-5	-5
8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
KR4301PA2727 2019-10 풋272.5							31
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	31	31	31	31	31	31	31
-5.33%	18	18	18	18	18	19	19
-2.67%	6	7	7	7	8	8	9
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-4	-4	-4	-3	-3	-3	-2
5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
8.00%	-5	-5	-5	-5	-4	-4	-4

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

(단위:백만원)

1,618

공시일	2019-09-26
기준일	2019-09-25

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	7,792	0	7,792	
누계	유가증권	수익증권	106,542	0	106,542	

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	2019-09-26
기준일	2019-09-25

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	8,991	0	8,991	
누계	유가증권	수익증권	136,820	0	136,820	

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	2019-09-26
기준일	2019-09-25

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	40,764	-40,764	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	420,566	0	420,566	
누계	통화	선도	0	456,863	-456,863	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,932
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,548
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E	959
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E	959
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E	959
FX21019Q03 KRW/USD 26-09-19E	1,726
FX21019Q04 KRW/USD 30-09-19E	192
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E	192
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E	288
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E	288
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E	192
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E	1,381
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E	2,052
FX21019U01 KRW/USD 10-10-19E	288
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E	192
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E	2,340
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E	1,726
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E	192
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E	959
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E	1,477
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	2,983
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	3,165
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	2,628
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E	1,918
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E	2,014

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

(단위:백만원)

12,083

공시일	2019-09-26
기준일	2019-09-25

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

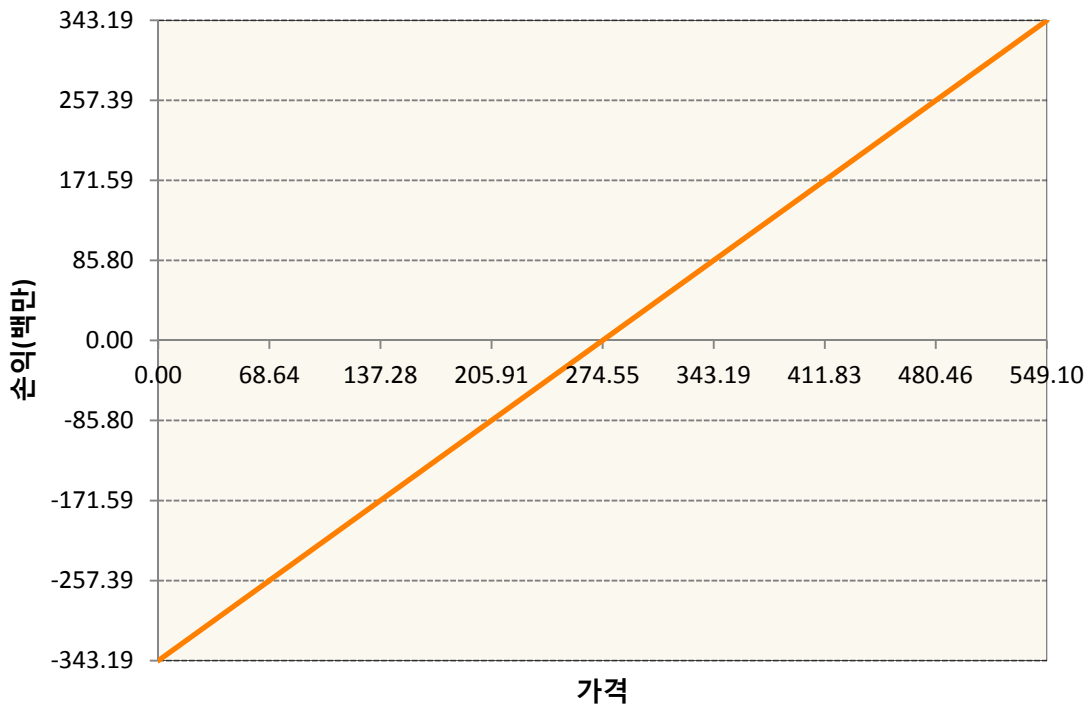
1. 계약금액

(단위:백만원)

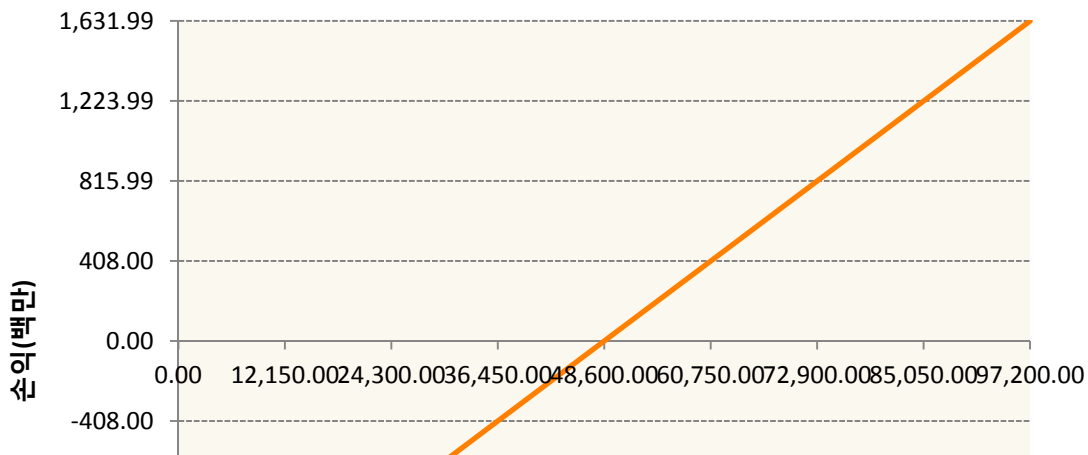
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,975	0	1,975	장내

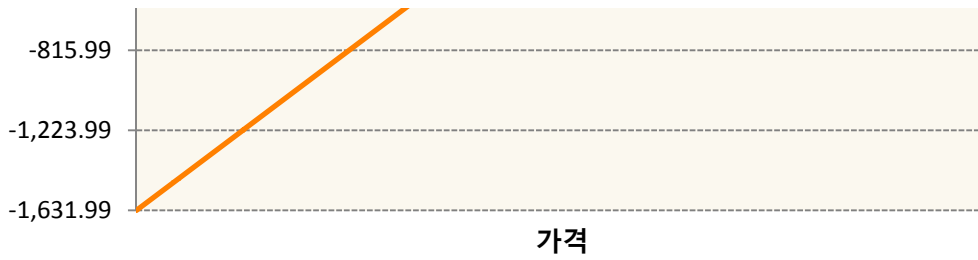
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



KR4111PA0002-2019-10 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 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						131
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131	
-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%	131	131	131	131	131	131	131	

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

191

공시일	2019-09-26
기준일	2019-09-25

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

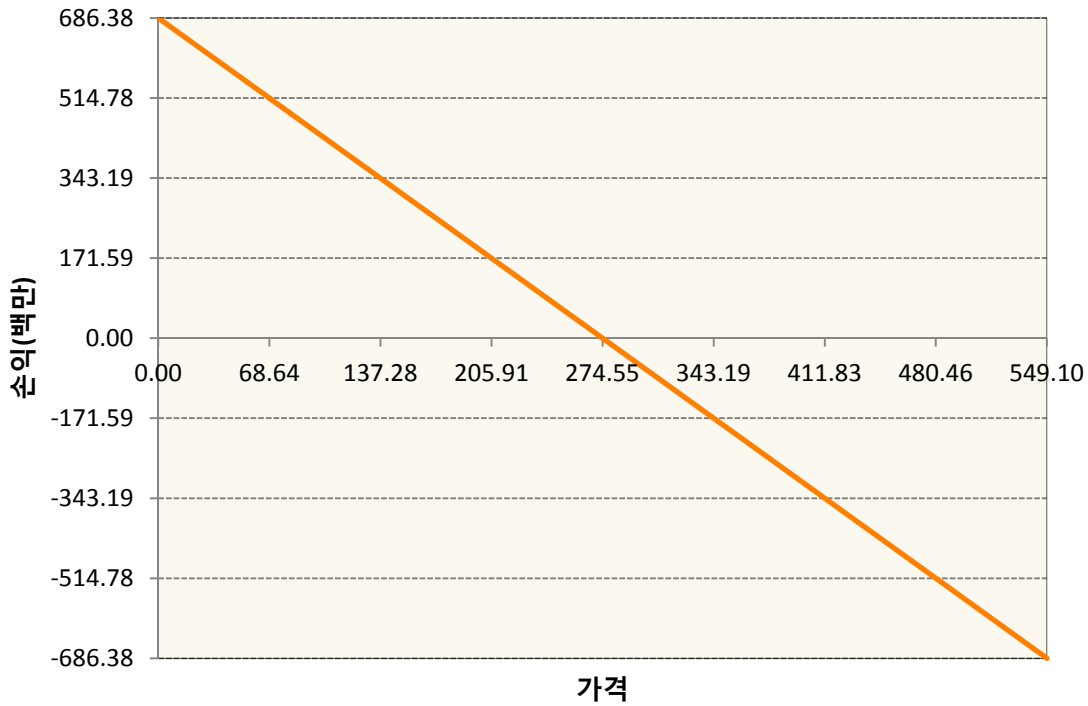
1. 계약금액

(단위:백만원)

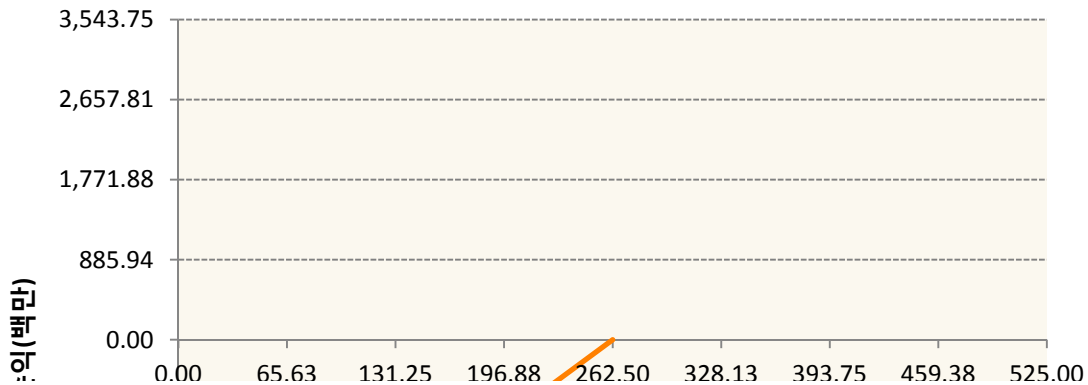
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	686	-686	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,941	-3,941	장내

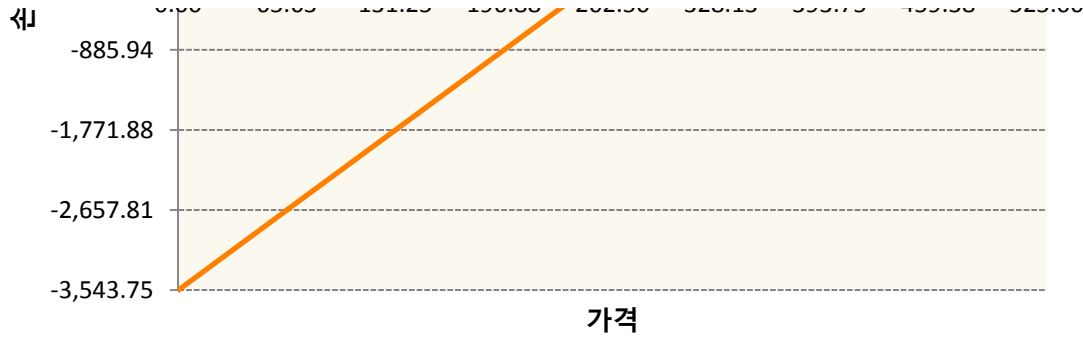
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

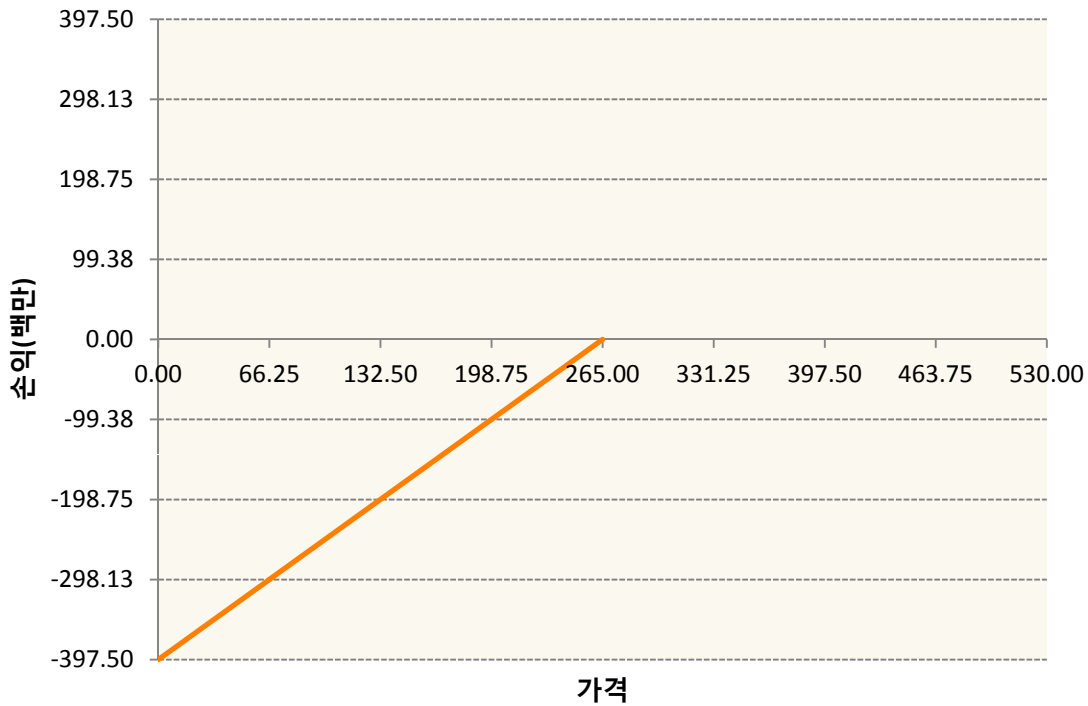


KR4301PA2628-2019-10 풋262.5





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						144
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-134	-135	-137	-138	-140	-142	-144
-5.33%	-51	-55	-58	-62	-65	-68	-72
-2.67%	-7	-10	-13	-17	-20	-23	-26
0%	3	2	1	0	-2	-3	-5
2.67%	4	4	4	4	3	3	2
5.33%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

KR4301PA2651

2019-10 풋265

19

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-18	-18	-18	-18	-19	-19	-19
-5.33%	-8	-8	-9	-9	-9	-10	-10
-2.67%	-2	-2	-2	-3	-3	-4	-4
0%	1	0	0	0	0	0	-1
2.67%	1	1	1	1	1	1	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

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

(단위:백만원)

153

공시일	2019-09-26
기준일	2019-09-25

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	532	-532	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	17,783	0	17,783	
누계	통화	선도	0	17,862	-17,862	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		326
FX21019U03 KRW/USD 18-10-19E		480
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		614
FX21019U04 KRW/USD 27-09-19E		10

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

(단위:백만원)

472

공시일	2019-09-26
기준일	2019-09-25

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	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	2019-09-26
기준일	2019-09-25

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

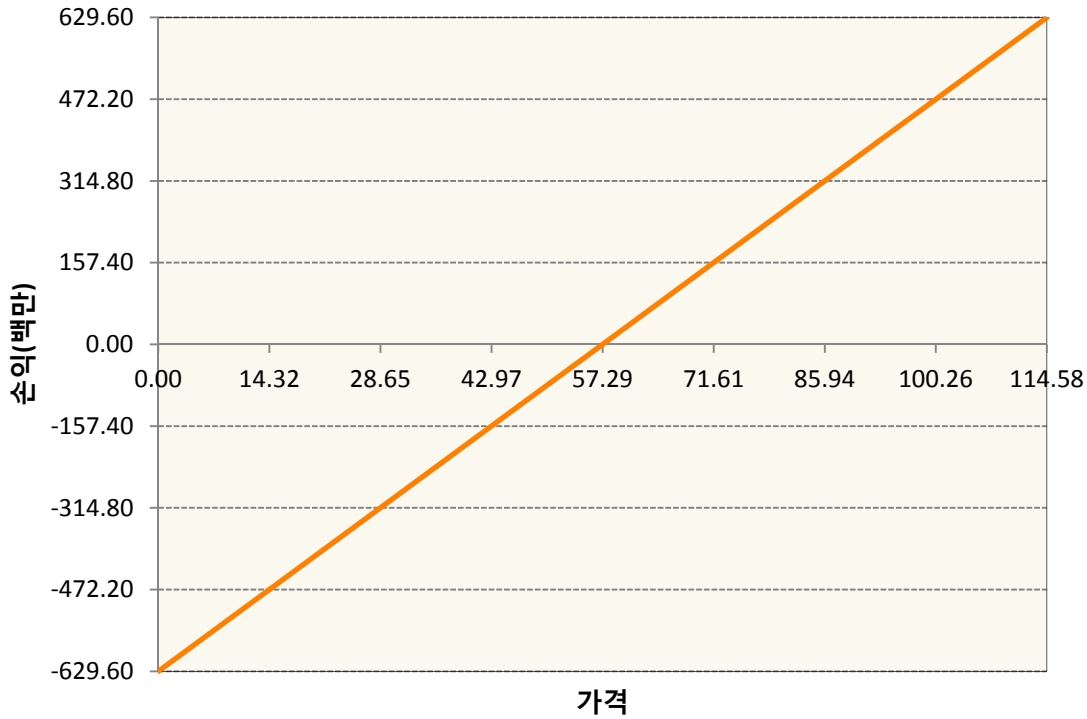
1. 계약금액

(단위:백만원)

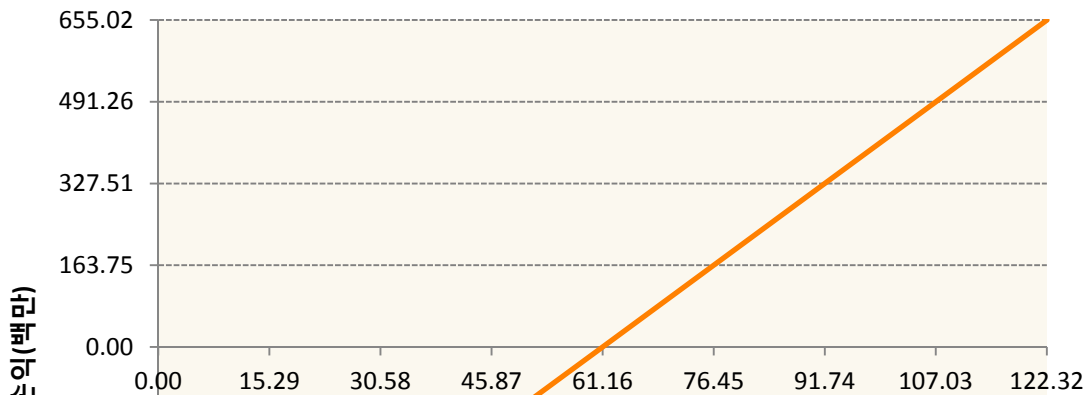
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,401	479	1,922	
누계	유가증권	선물	201	0	201	장내

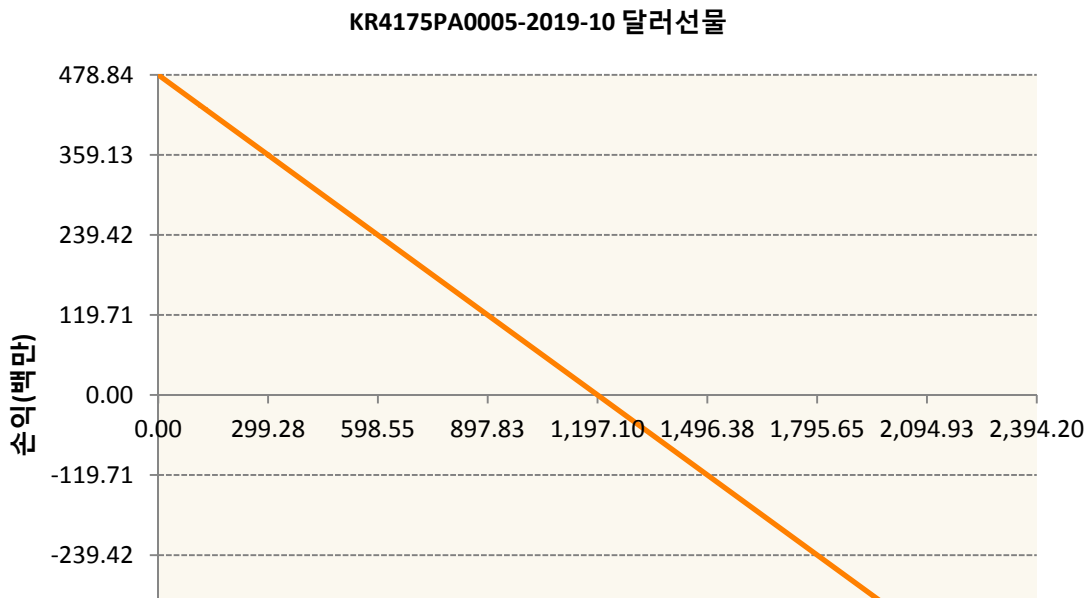
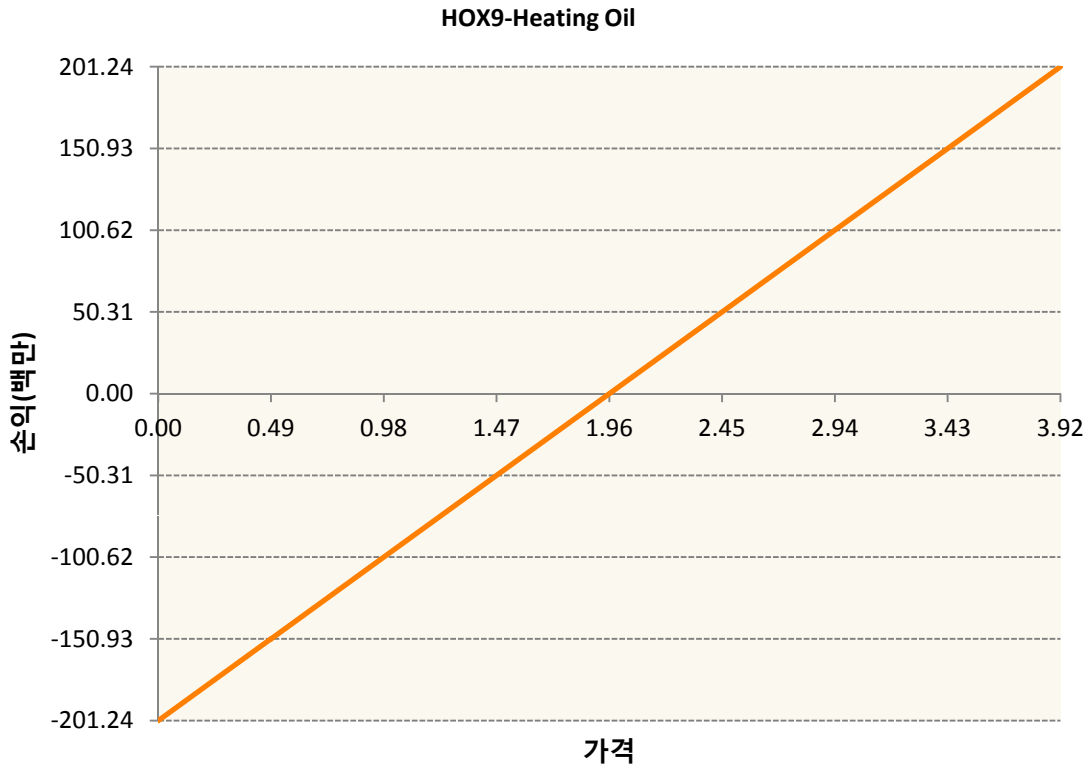
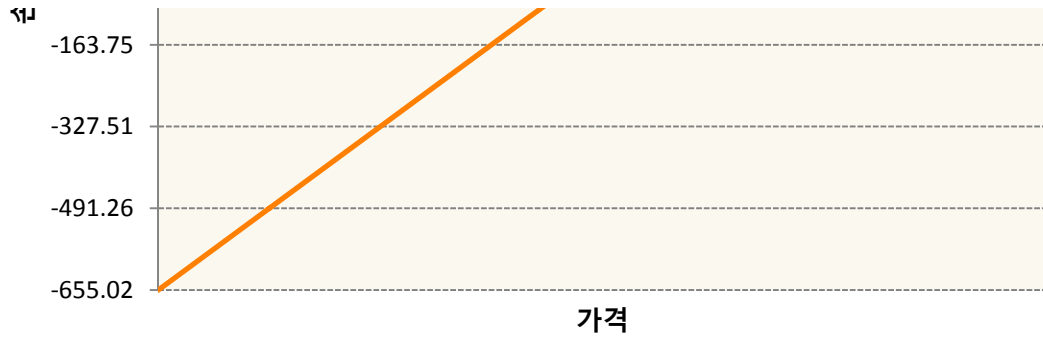
2. 만기시점의 손익구조

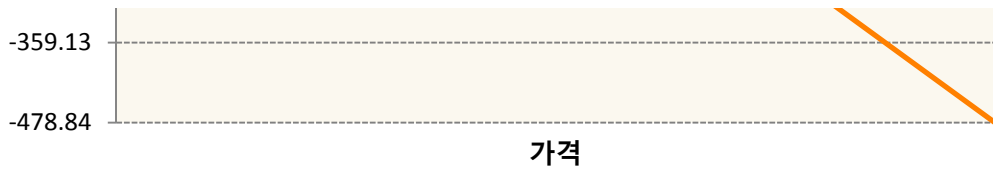
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19



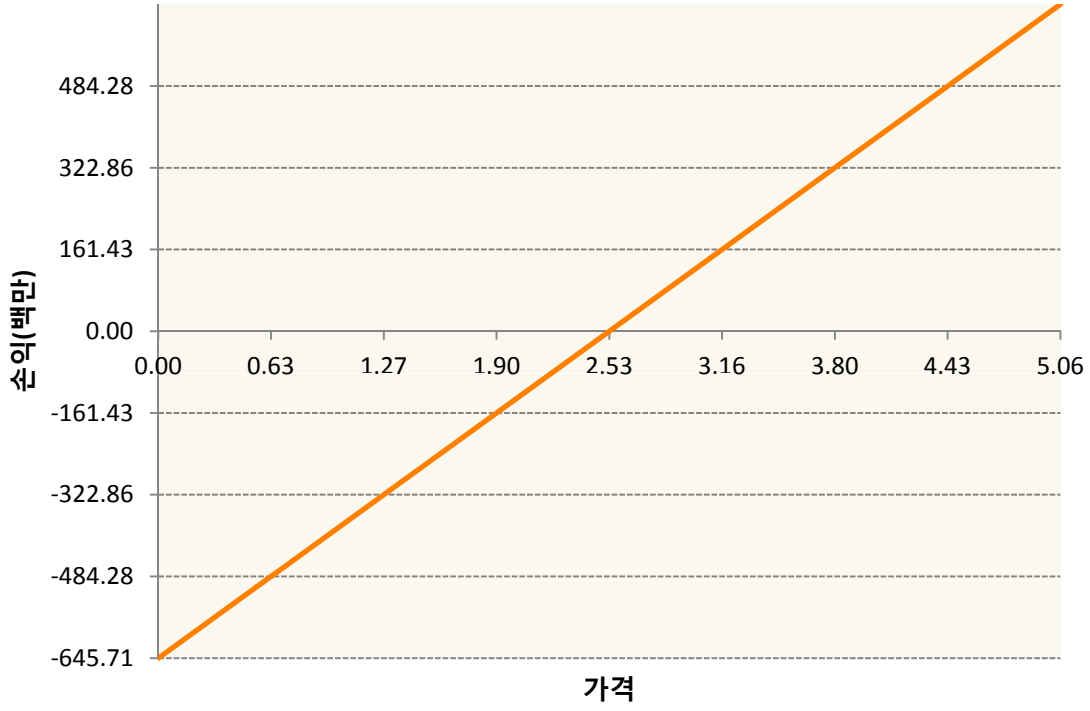
COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20



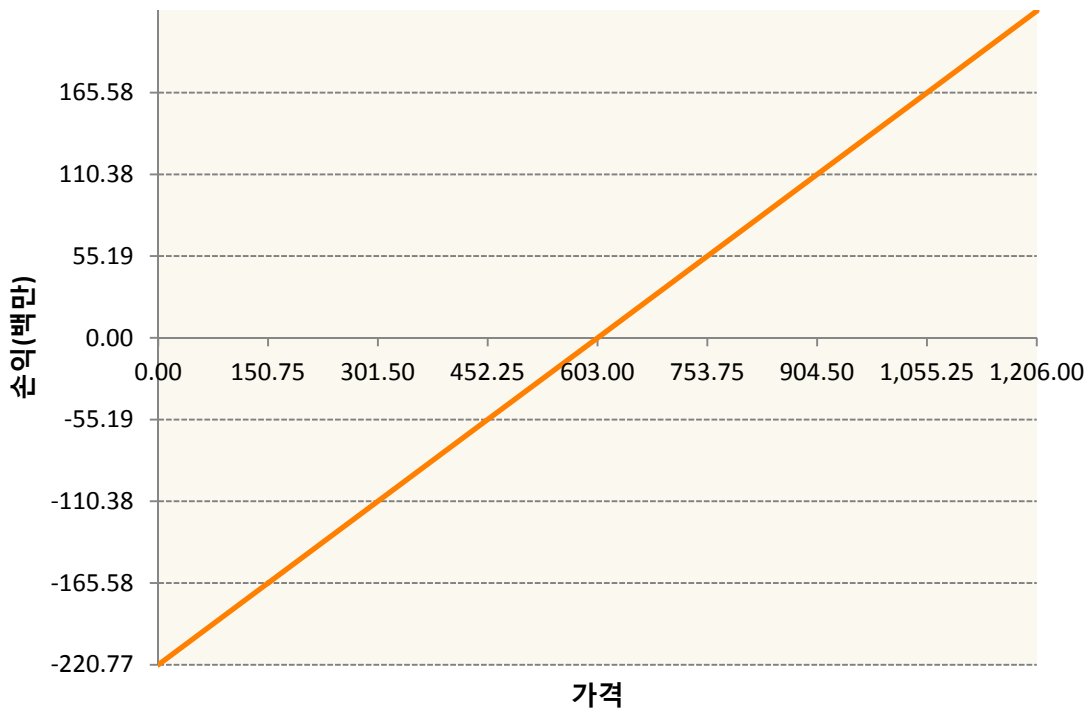


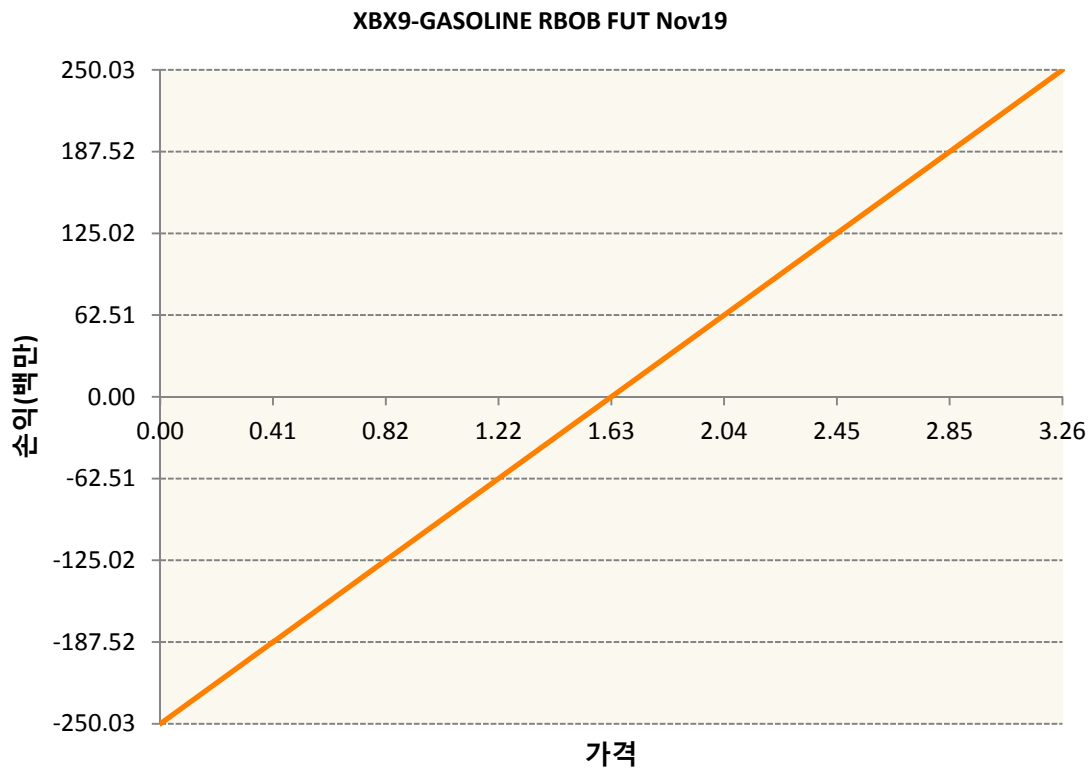


NGX19-NATURAL GAS FUTR Nov19



QSX9-Low Su Gasoil G Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX9	WTI CRUDE FUTURE Nov19	50
COF0	BRENT CRUDE FUTR Jan20	52
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)
	436

공시일	2019-09-26
기준일	2019-09-25

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

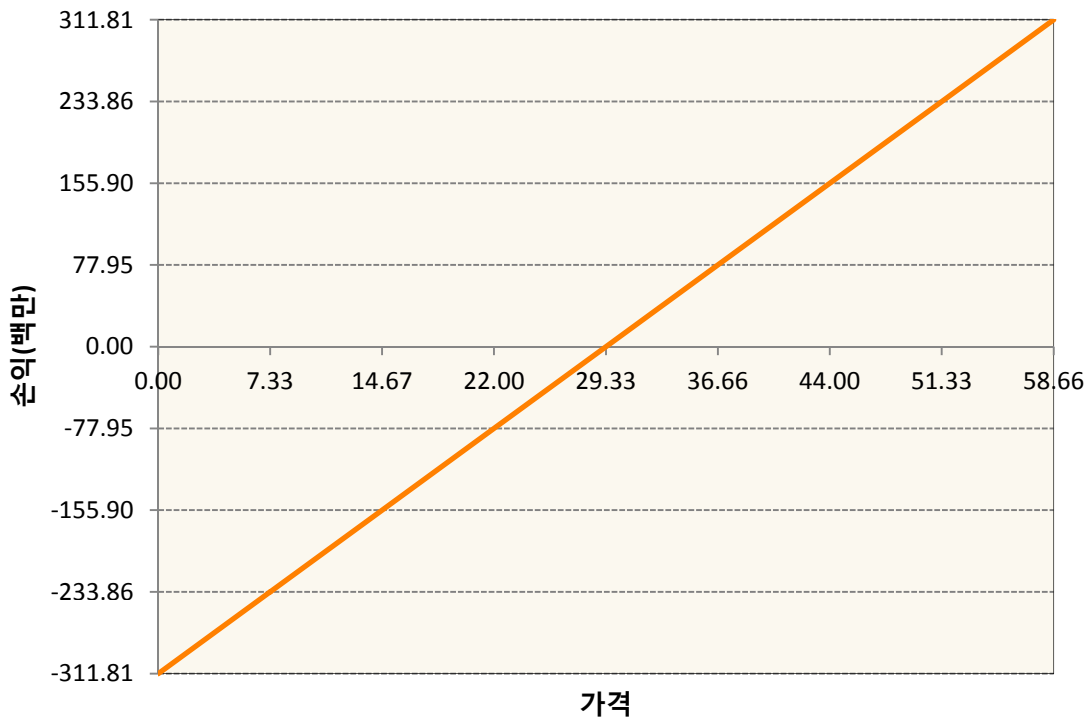
1. 계약금액

(단위:백만원)

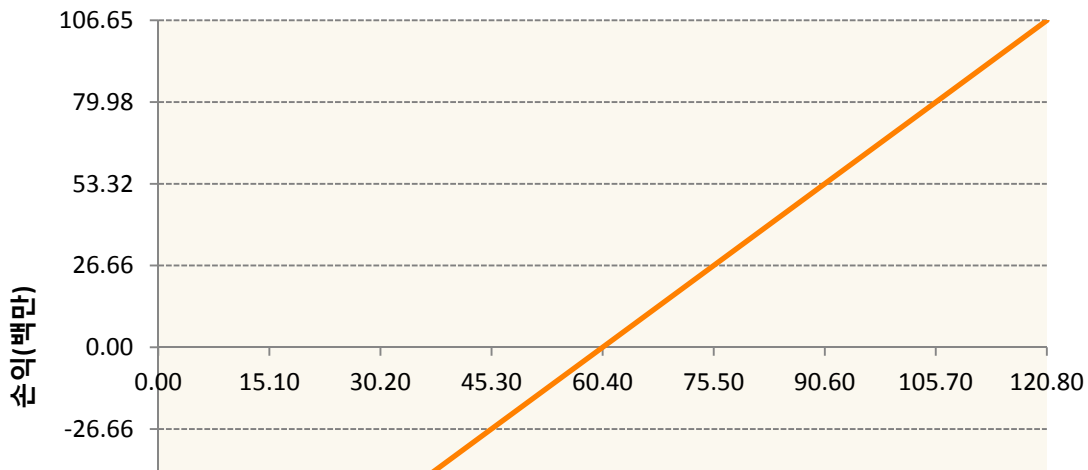
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,771	96	2,675	

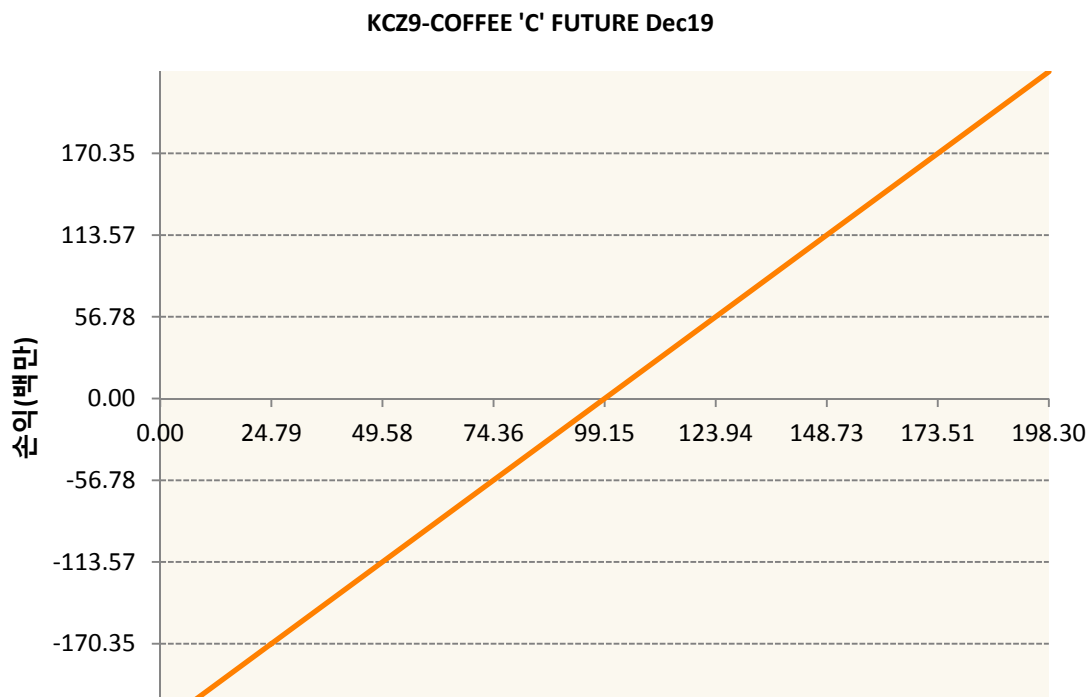
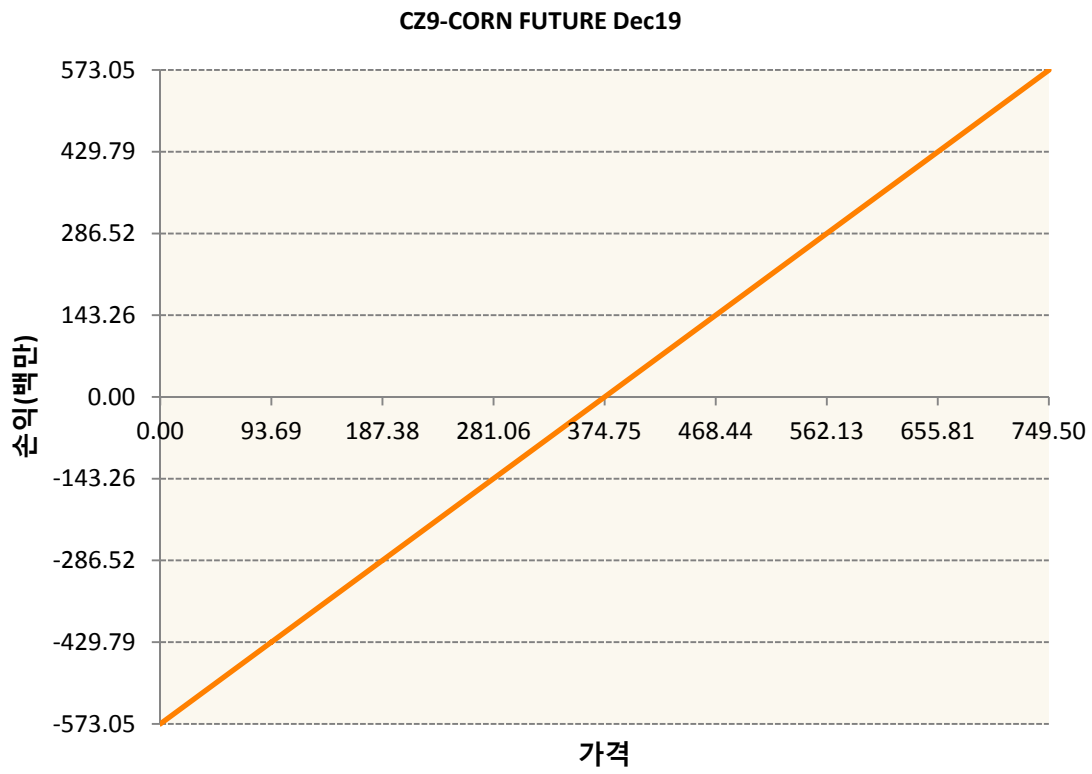
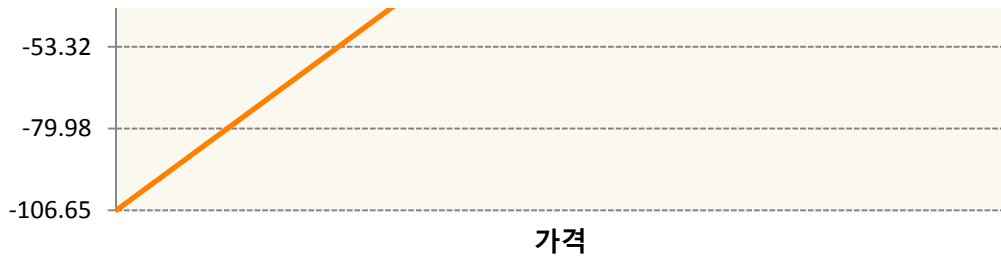
2. 만기시점의 손익구조

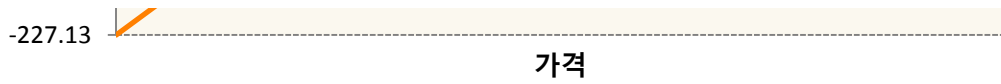
BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19



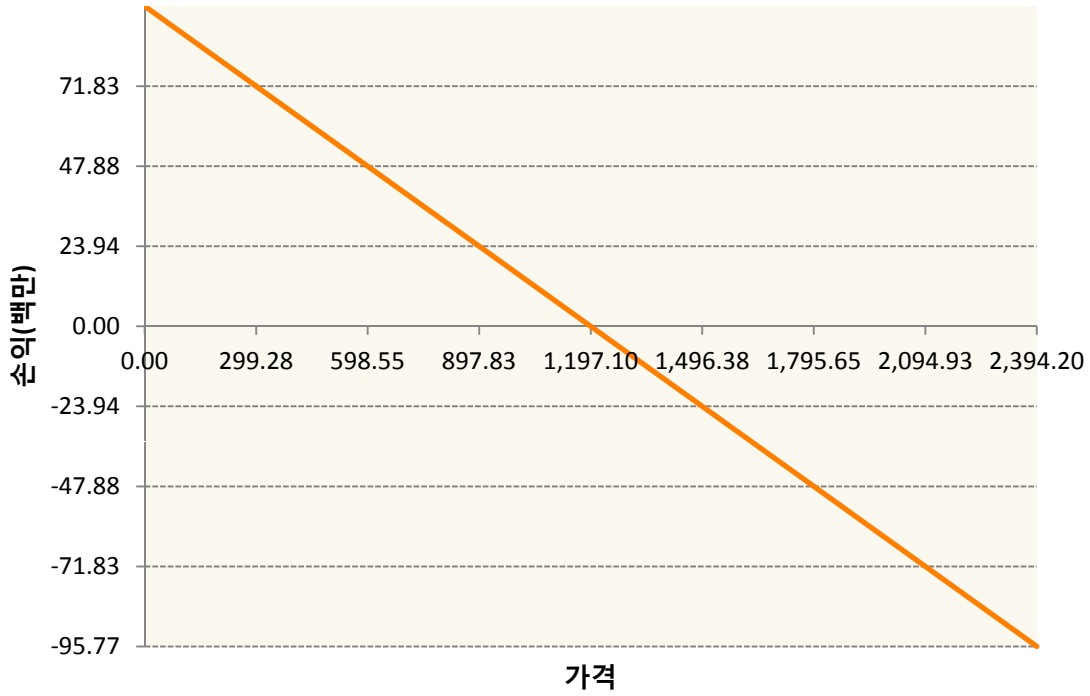
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



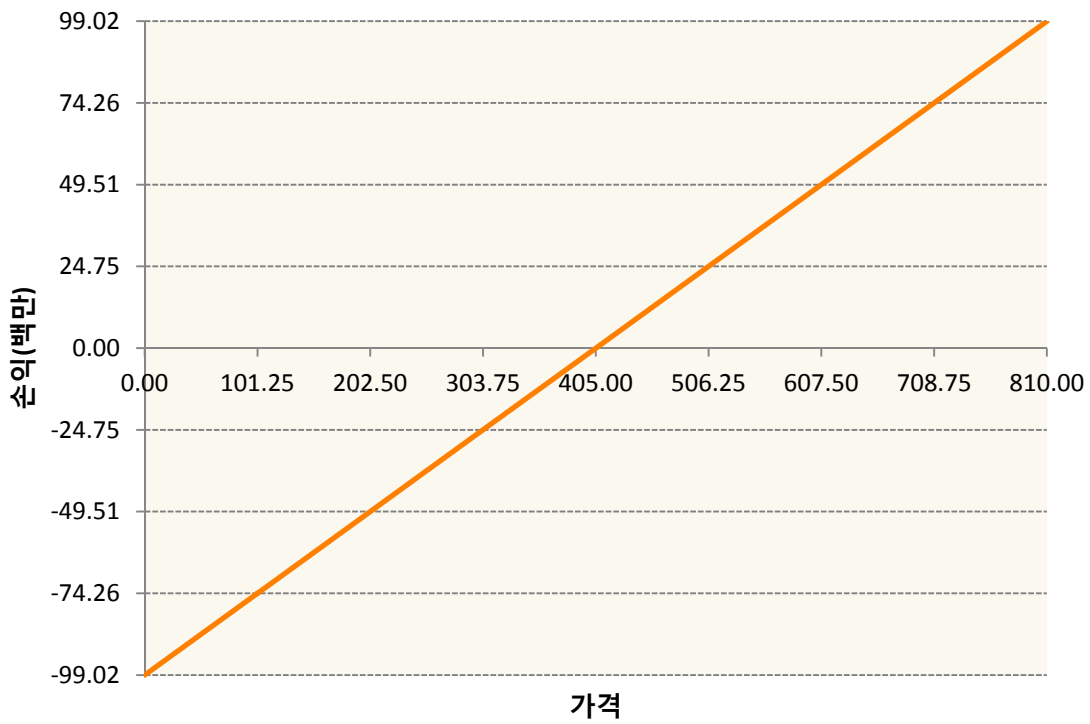




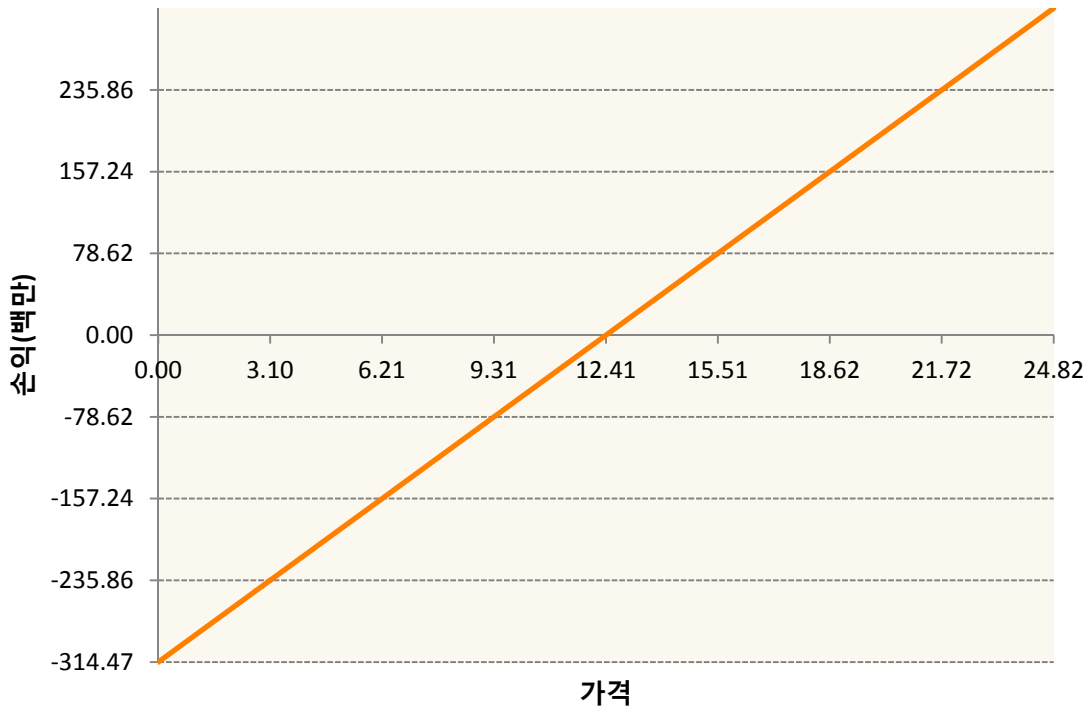
KR4175PA0005-2019-10 달러선물



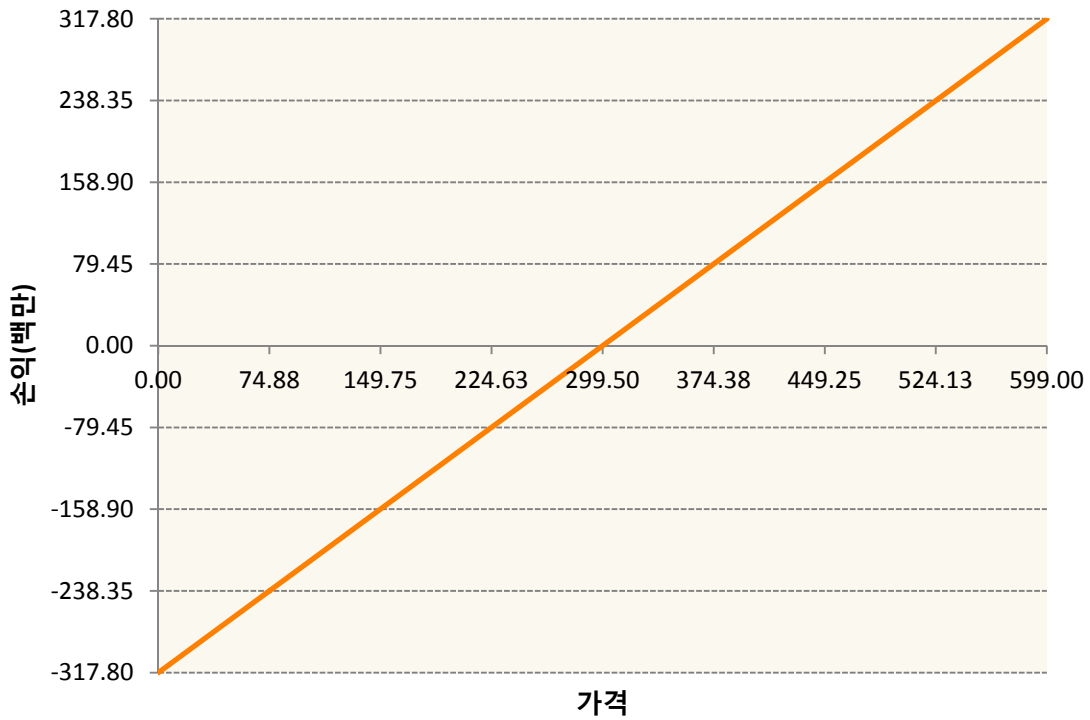
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



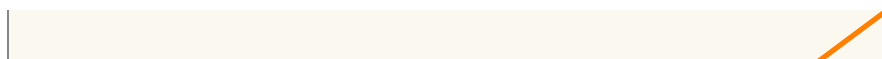
SBH0-Sugar Mar20

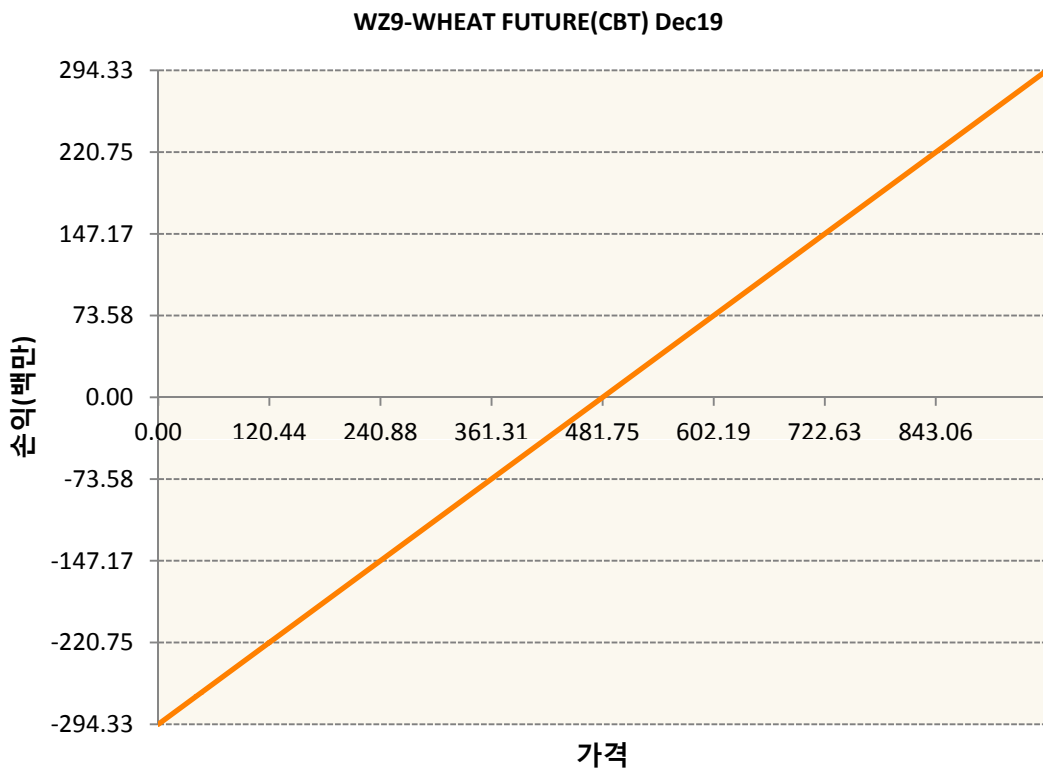
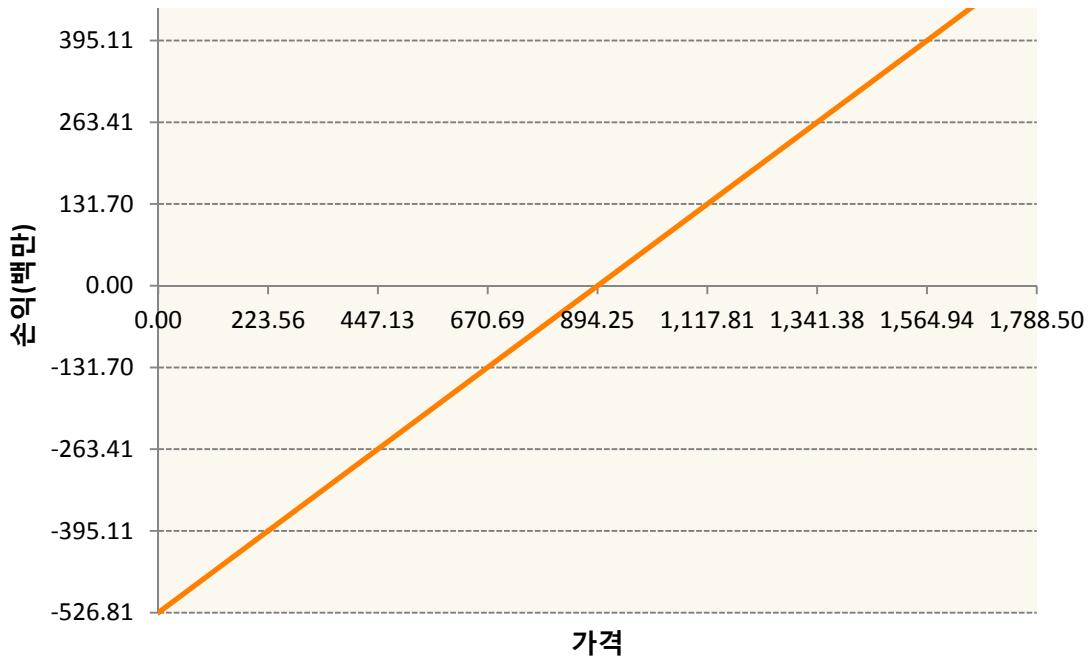


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



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)

248