

공시일	2019-09-27
기준일	2019-09-26

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	2019-09-27
기준일	2019-09-26

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

1,174

* 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	2019-09-27
기준일	2019-09-26

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)	376
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	138

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

815

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-27
기준일	2019-09-26

유로인덱스모(주식-파생형)

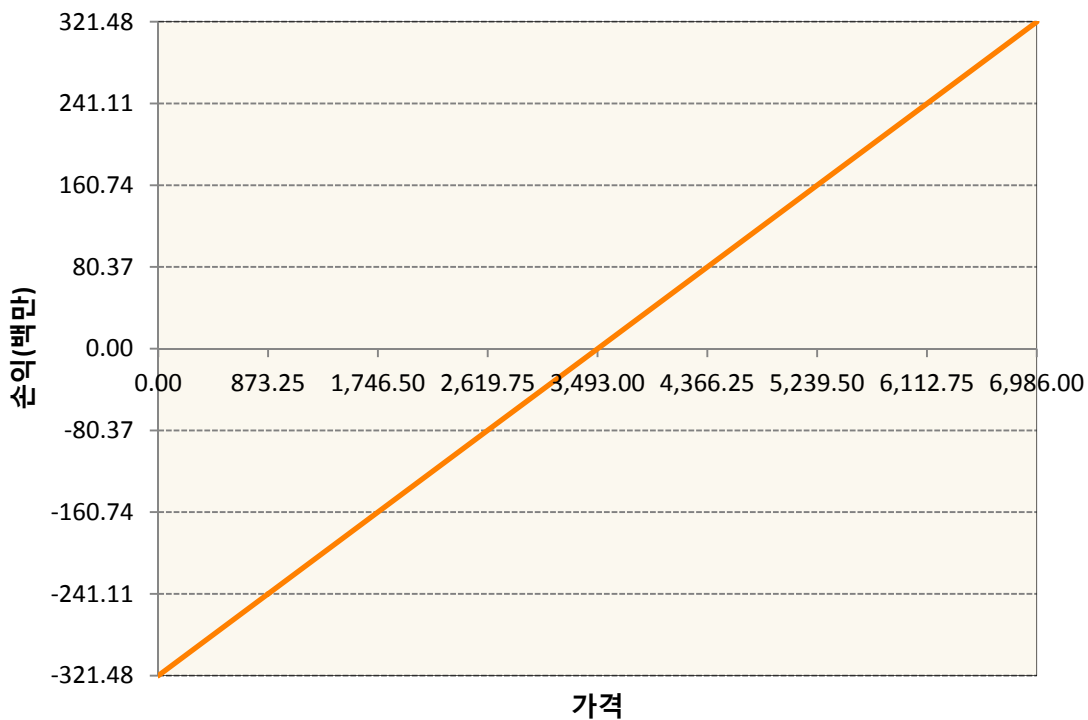
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	321	0	321	

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	2019-09-27
기준일	2019-09-26

차이나인덱스모(주식-파생형)

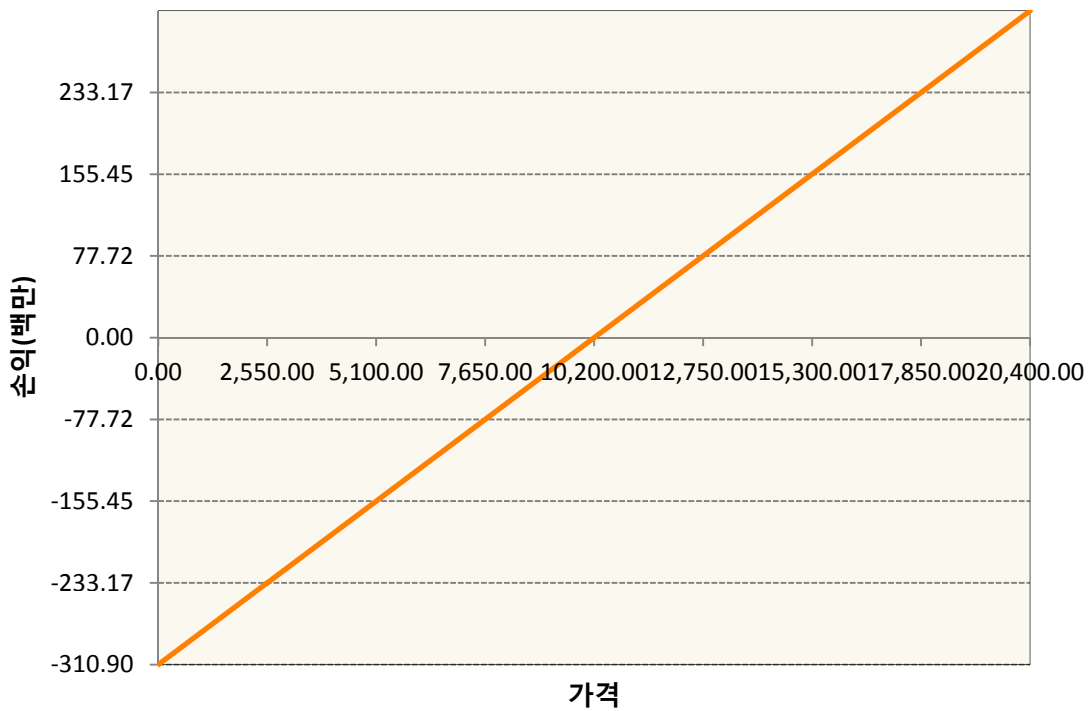
1. 계약금액

(단위:백만원)

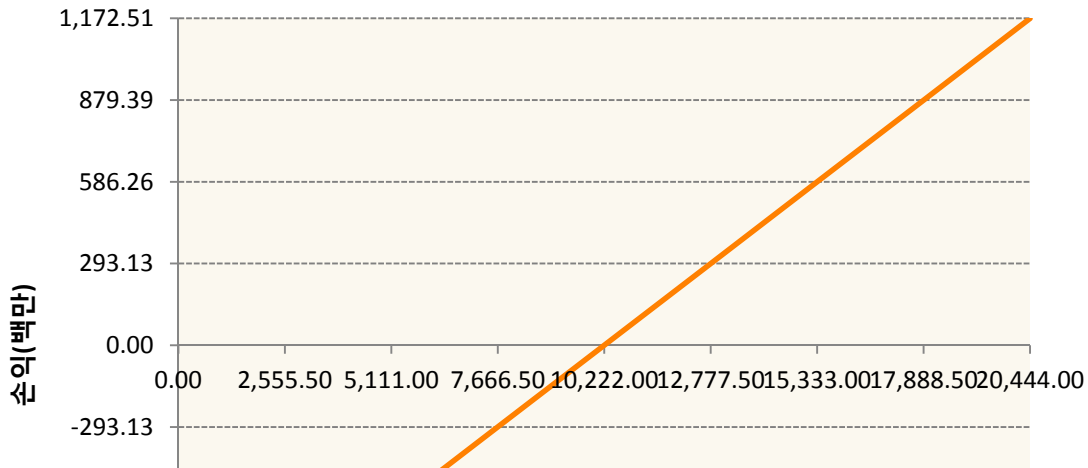
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,483	0	1,483	장내

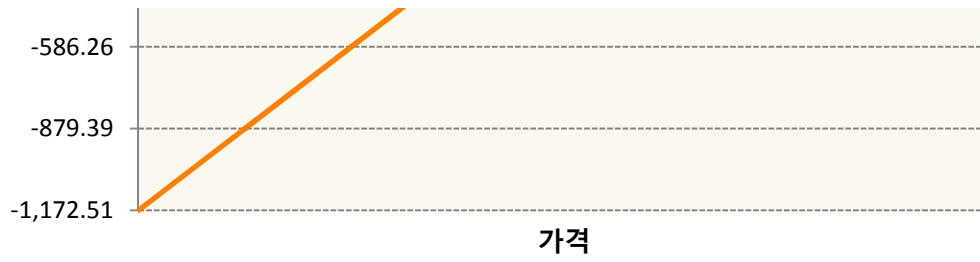
2. 만기시점의 손익구조

HCU9-HSCEI Futures Sep19



HCV9-HSCEI Futures Oct19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCU9	HSCEI Futures Sep19	25
HCV9	HSCEI Futures Oct19	94

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

109

공시일	2019-09-27
기준일	2019-09-26

커버드콜모(주식혼합-파생형)

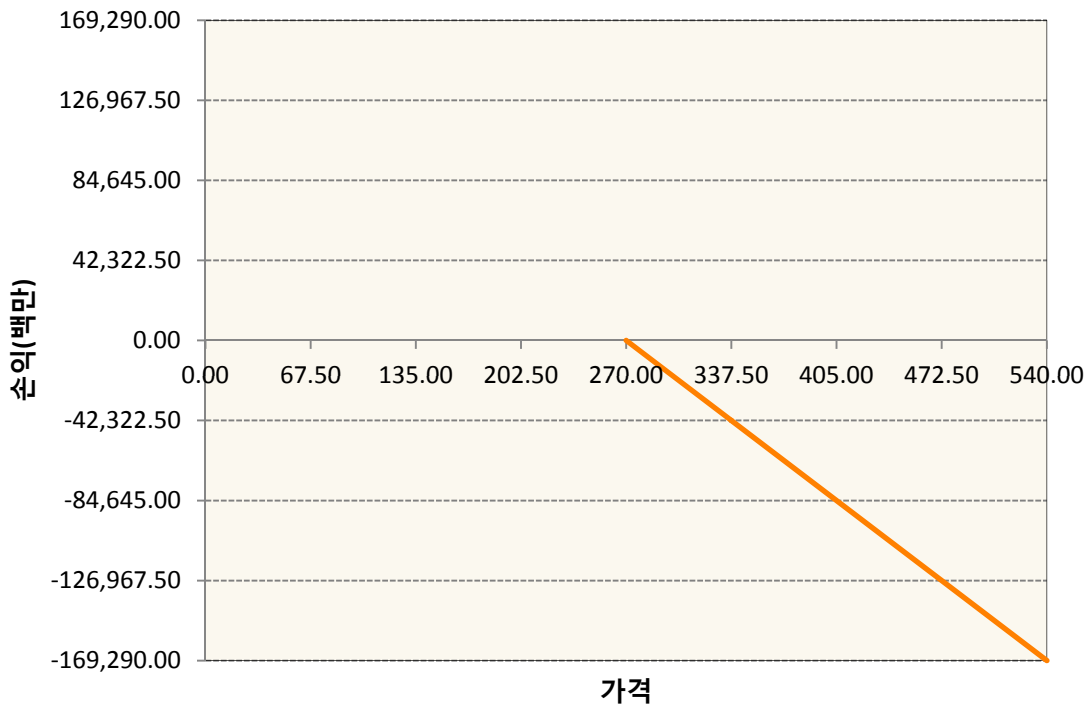
1. 계약금액

(단위:백만원)

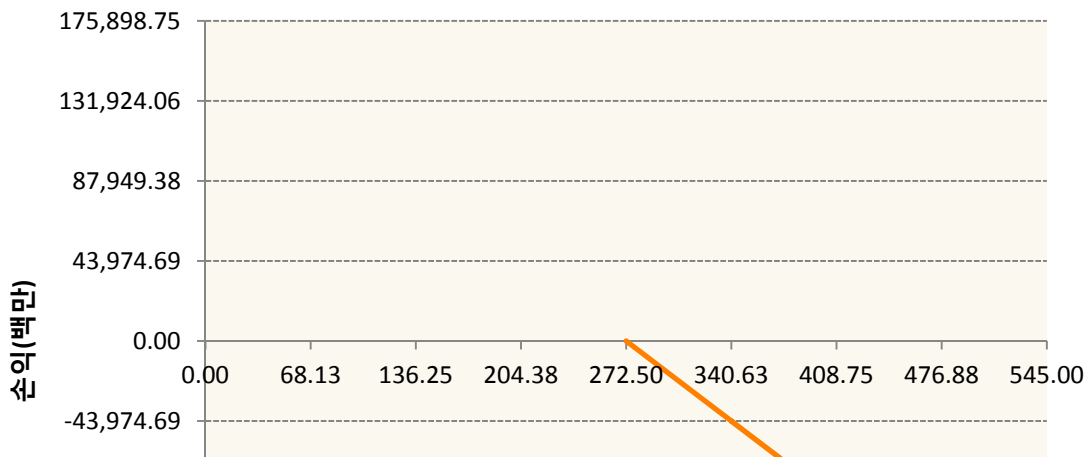
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	513,939	-513,939	장내

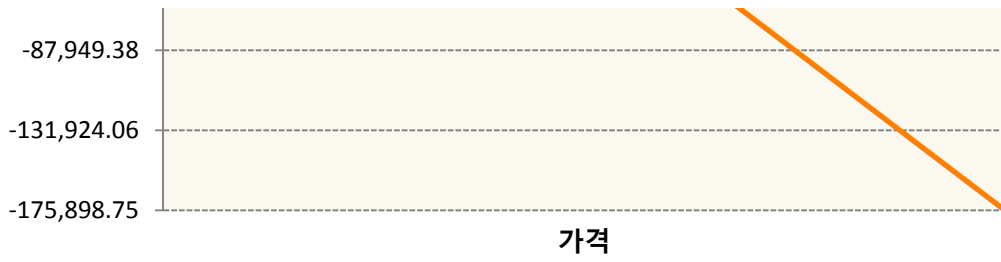
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PA2702-2019-10 콜270

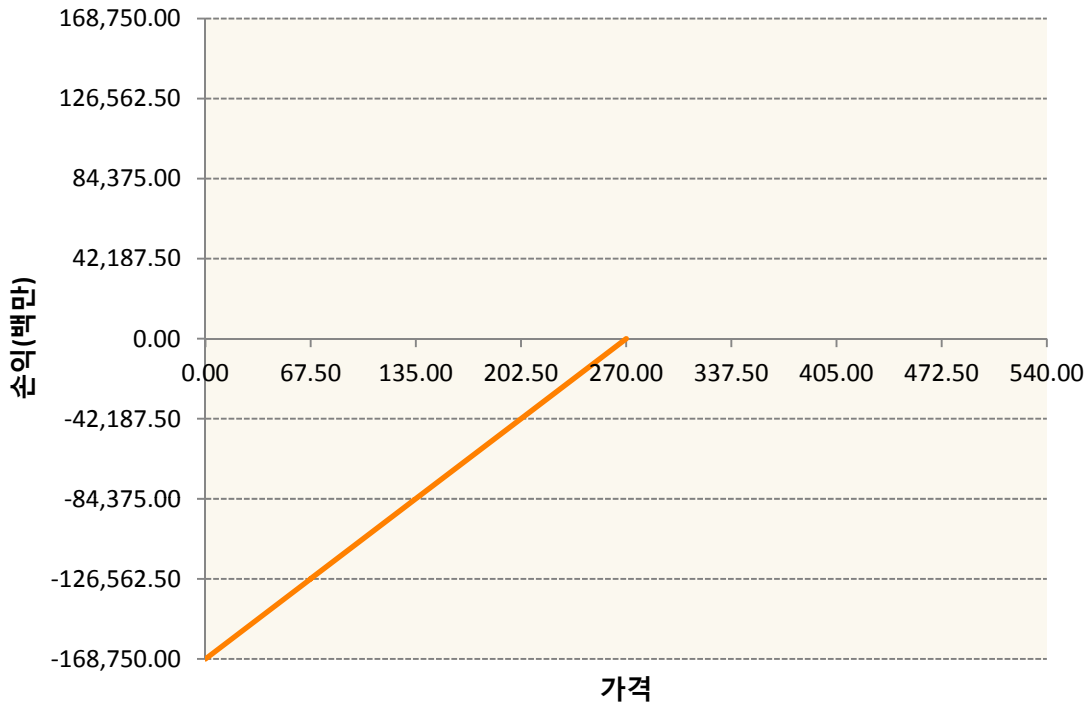


KR4201PA2728-2019-10 콜272.5





KR4301PA2701-2019-10 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201PA2702		2019-10 콜270					11,911
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,111	5,033	4,934	4,817	4,683	4,533	4,371
-5.33%	4,647	4,457	4,253	4,036	3,811	3,577	3,337
-2.67%	3,337	3,055	2,770	2,485	2,199	1,913	1,626
0%	818	550	277	0	-279	-561	-843
2.67%	-2,794	-2,962	-3,149	-3,351	-3,566	-3,790	-4,024
5.33%	-7,049	-7,121	-7,214	-7,328	-7,460	-7,609	-7,772
8.00%	-11,557	-11,579	-11,614	-11,664	-11,731	-11,813	-11,911
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5					11,741
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,368	4,313	4,238	4,145	4,034	3,906	3,764

-5.33%	4,056	3,900	3,725	3,534	3,329	3,114	2,889
-2.67%	3,054	2,783	2,508	2,228	1,945	1,660	1,372
0%	898	600	300	0	-301	-602	-904
2.67%	-2,473	-2,689	-2,919	-3,161	-3,412	-3,671	-3,936
5.33%	-6,673	-6,780	-6,909	-7,059	-7,226	-7,409	-7,606
8.00%	-11,252	-11,289	-11,343	-11,416	-11,507	-11,615	-11,741
KR4301PA2701 2019-10 풋270							9,957
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,858	-9,862	-9,869	-9,882	-9,900	-9,925	-9,957
-5.33%	-5,357	-5,406	-5,467	-5,539	-5,621	-5,712	-5,810
-2.67%	-1,551	-1,706	-1,864	-2,024	-2,184	-2,346	-2,509
0%	409	278	142	0	-146	-295	-447
2.67%	852	820	777	723	657	582	499
5.33%	890	888	882	872	857	836	807
8.00%	891	891	891	890	888	884	878

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

(단위:백만원)

34,874

공시일	2019-09-27
기준일	2019-09-26

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

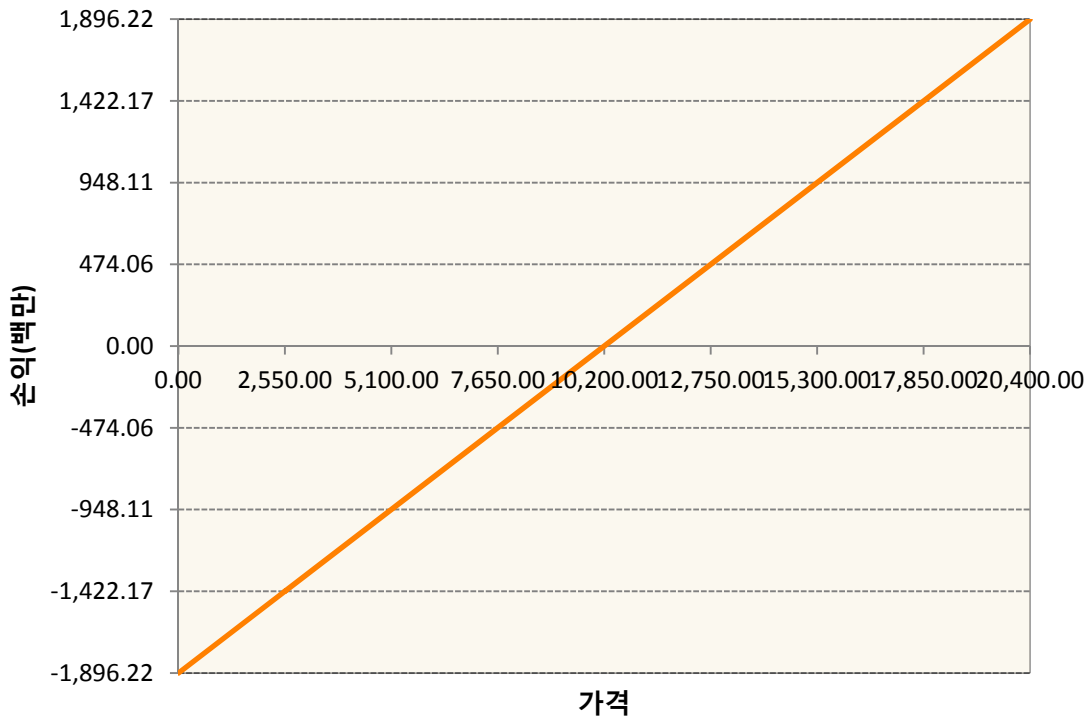
1. 계약금액

(단위:백만원)

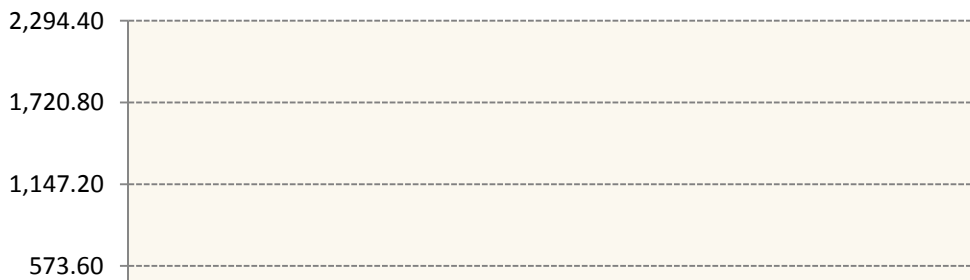
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,896	0	1,896	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,892	-4,892	장내
누계	통화	선도	688	2,842	-2,154	장외

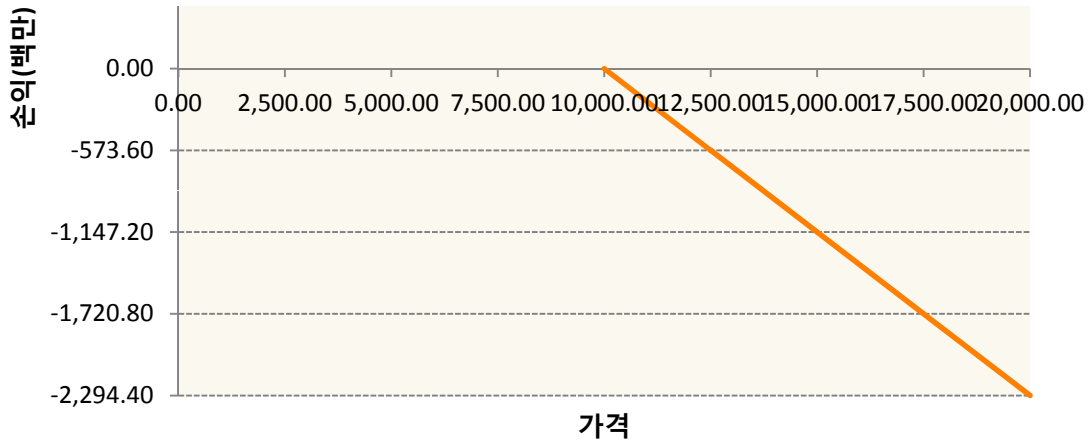
2. 만기시점의 손익구조

HCU9-HSCEI Futures Sep19

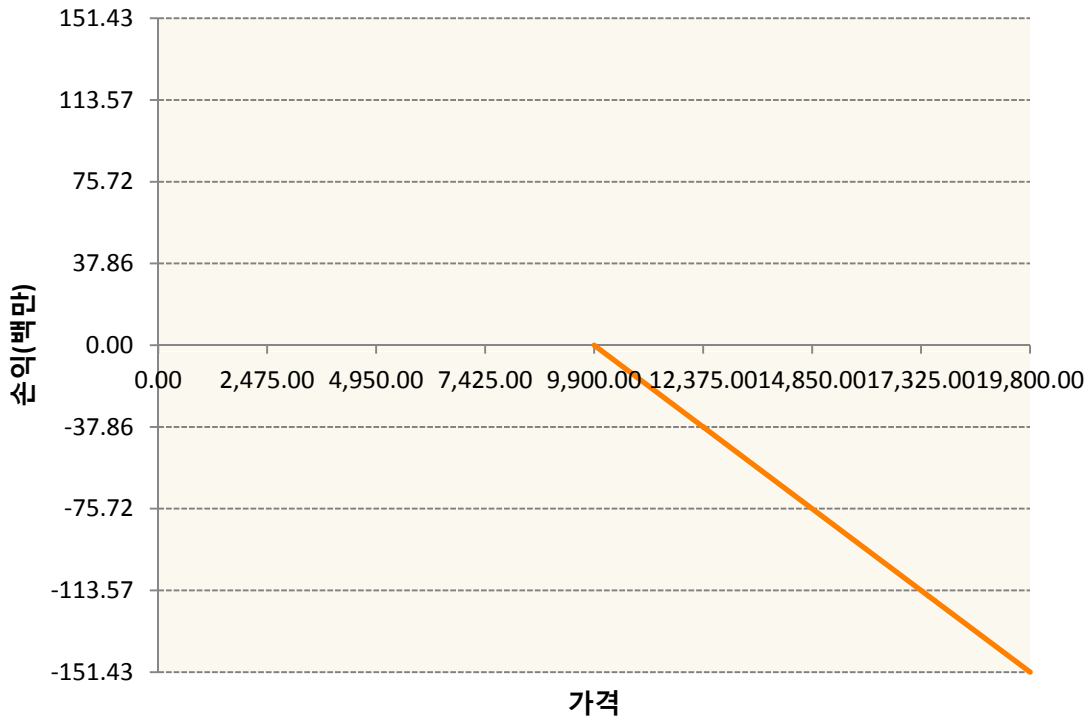


OHHIU9-C100-HSCEI

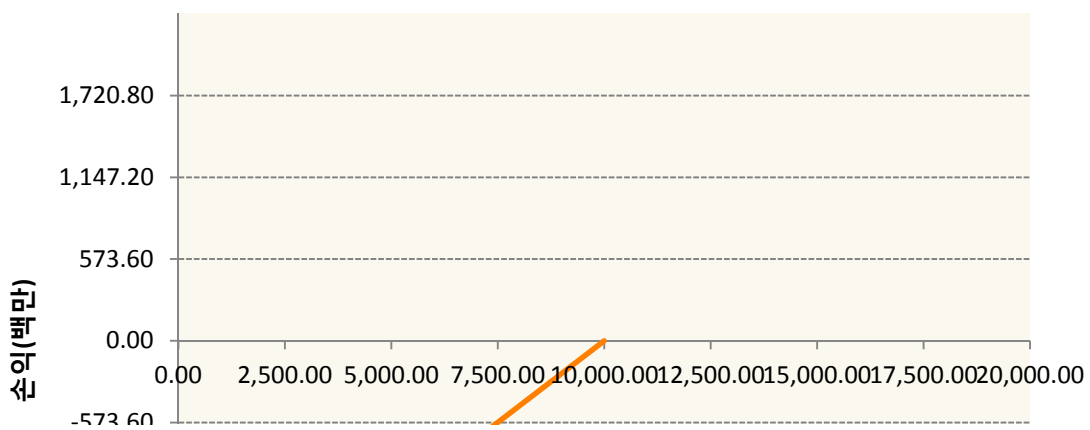


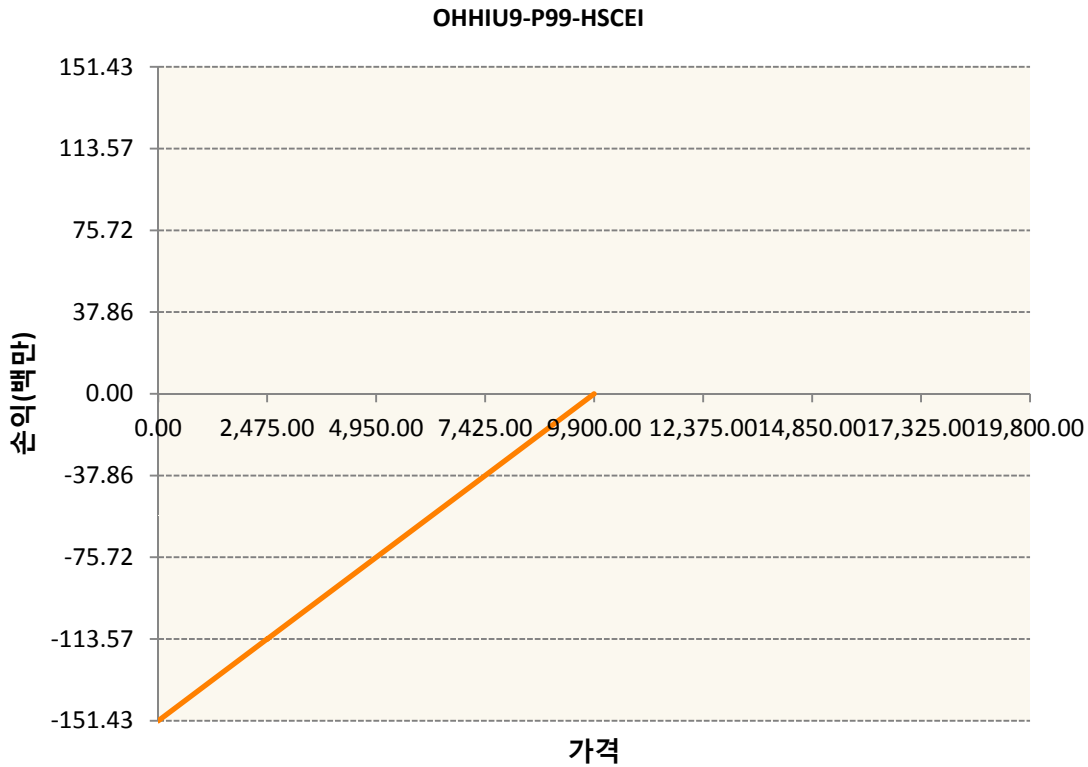


OHHIU9-C99-HSCEI



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	152
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	2019-09-27
기준일	2019-09-26

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

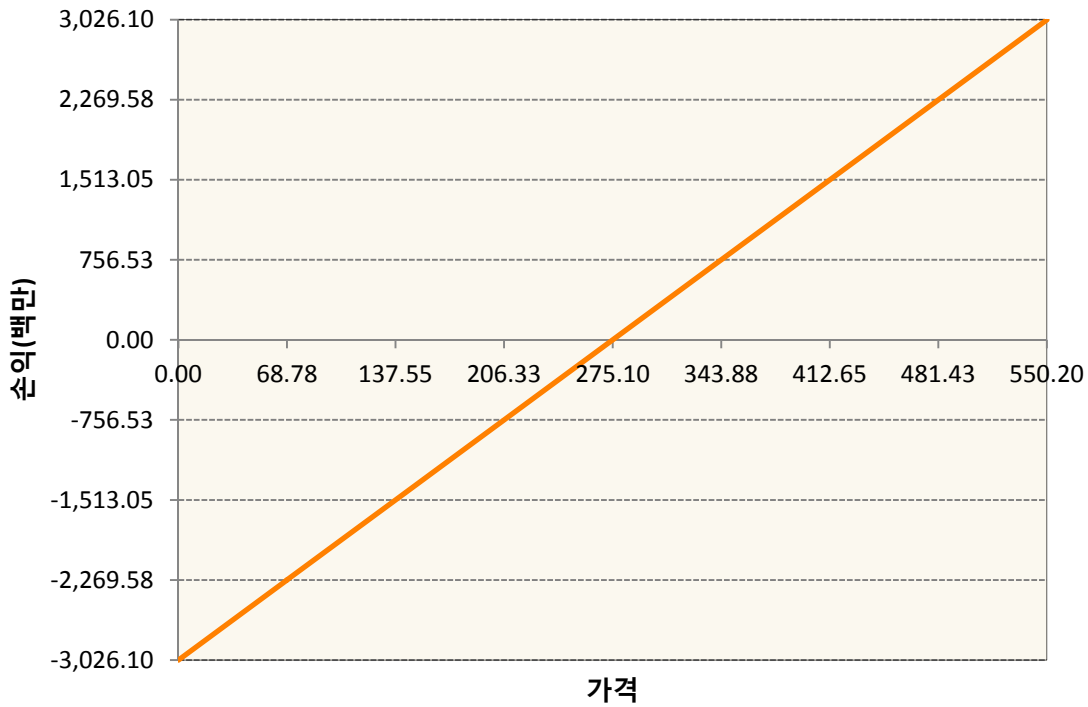
1. 계약금액

(단위:백만원)

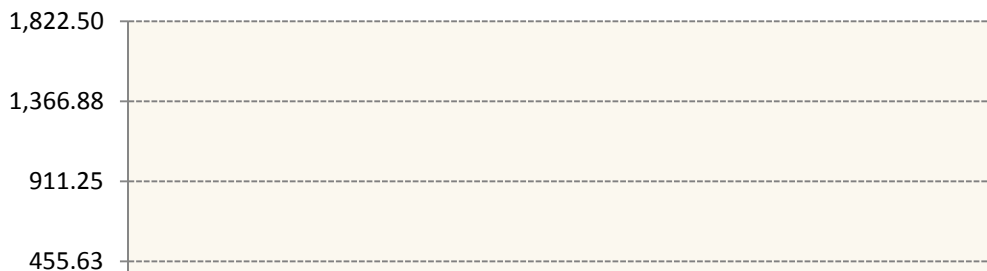
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	3,810	0	3,810	장내
누계	유가증권	선물	3,026	0	3,026	장내
누계	유가증권	스왑	14,125	0	14,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	10,968	-10,968	장내

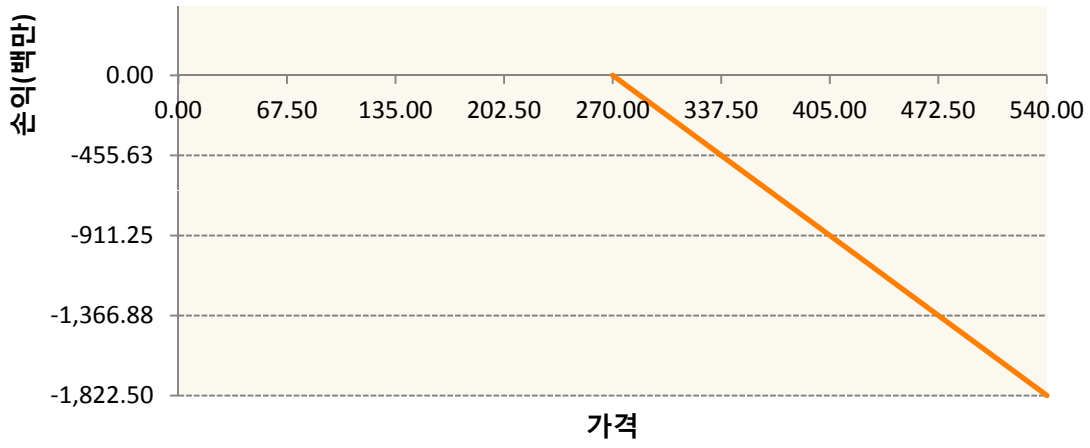
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

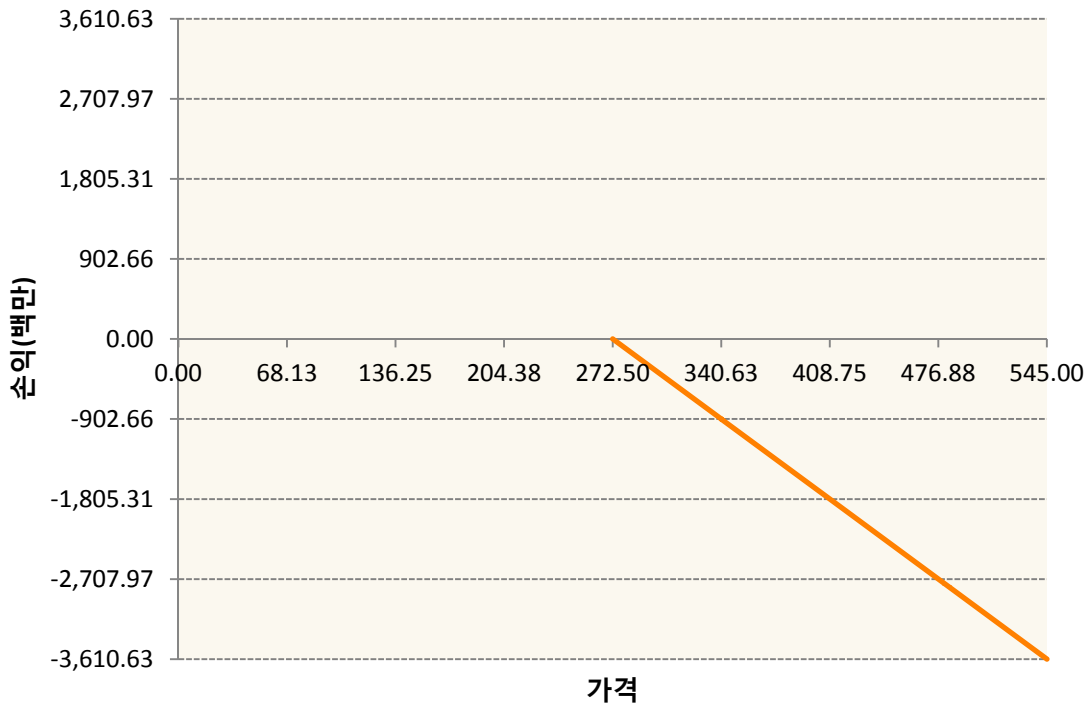


KR4201PA2702-2019-10 콜270

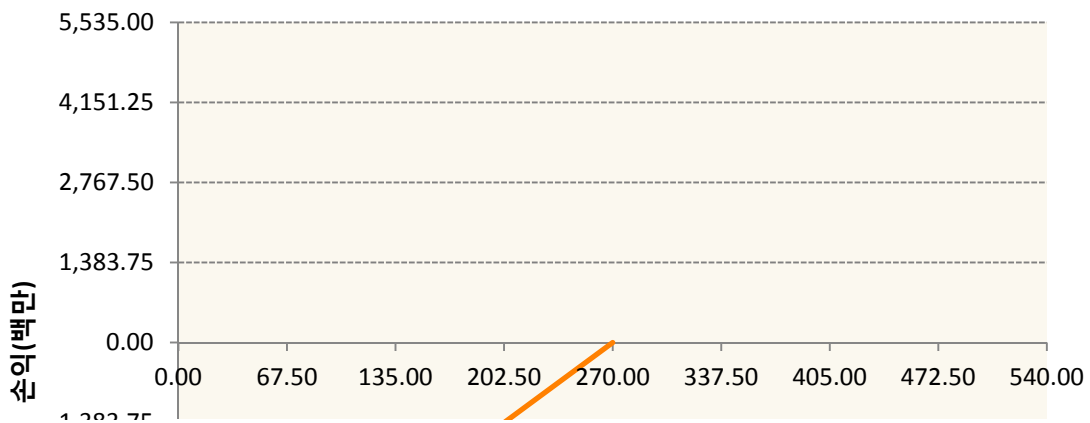




KR4201PA2728-2019-10 콜272.5



KR4301PA2701-2019-10 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						1,220
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,220	-1,220	-1,220	-1,220	-1,220	-1,220	-1,220	
-5.33%	-813	-813	-813	-813	-813	-813	-813	
-2.67%	-407	-407	-407	-407	-407	-407	-407	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	407	407	407	407	407	407	407	
5.33%	813	813	813	813	813	813	813	
8.00%	1,220	1,220	1,220	1,220	1,220	1,220	1,220	
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						128
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	55	54	53	52	50	49	47	
-5.33%	50	48	46	43	41	39	36	
-2.67%	36	33	30	27	24	21	18	
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9	
2.67%	-30	-32	-34	-36	-38	-41	-43	
5.33%	-76	-77	-78	-79	-80	-82	-84	
8.00%	-124	-125	-125	-126	-126	-127	-128	
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5						241
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	90	89	87	85	83	80	77
-5.33%	83	80	76	73	68	64	59
-2.67%	63	57	51	46	40	34	28
0%	18	12	6	0	-6	-12	-19
2.67%	-51	-55	-60	-65	-70	-75	-81
5.33%	-137	-139	-142	-145	-148	-152	-156
8.00%	-231	-232	-233	-234	-236	-238	-241
KR4301PA2701 2019-10 풋270							327
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-323	-323	-324	-324	-325	-326	-327
-5.33%	-176	-177	-179	-182	-184	-187	-191
-2.67%	-51	-56	-61	-66	-72	-77	-82
0%	13	9	5	0	-5	-10	-15
2.67%	28	27	25	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)

2,144

공시일	2019-09-27
기준일	2019-09-26

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

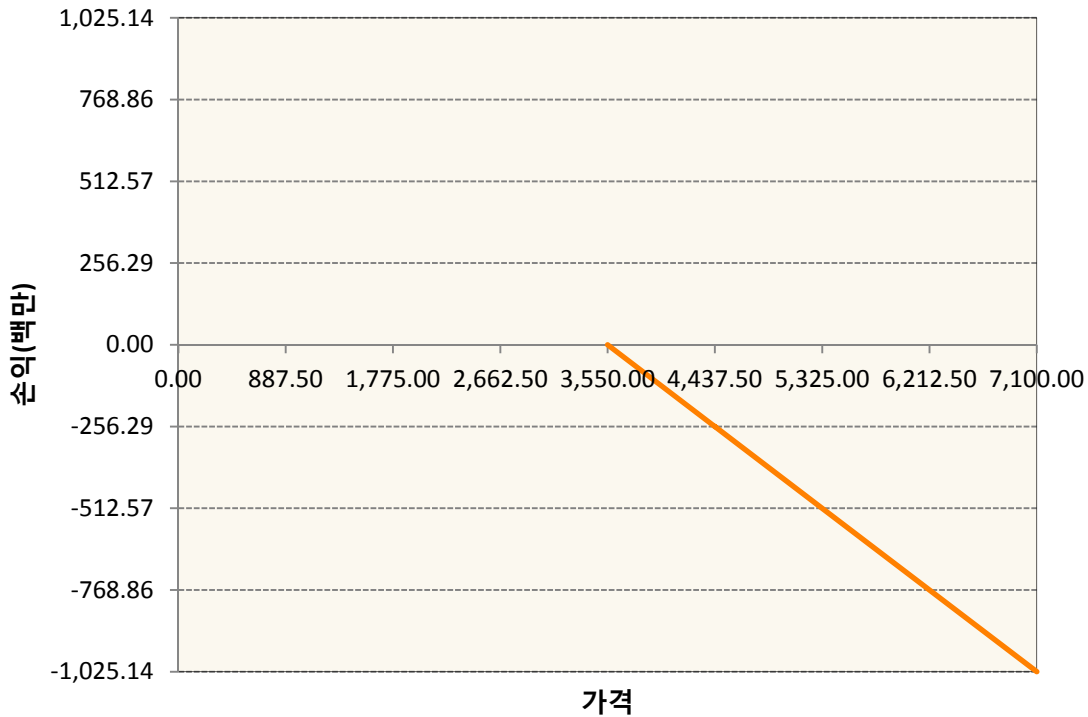
1. 계약금액

(단위:백만원)

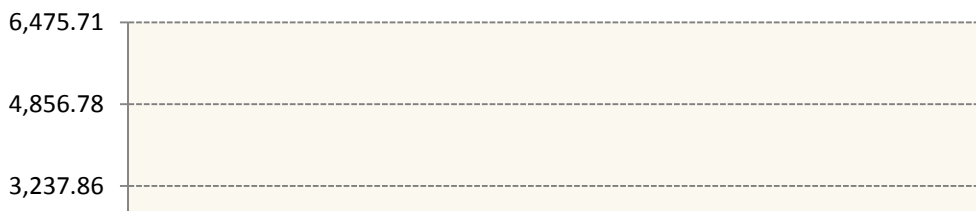
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,498	0	4,498	
누계	유가증권	스왑	23,884	0	23,884	장외
누계	유가증권	옵션	0	15,002	-15,002	장내
누계	통화	선도	10,894	23,232	-12,338	장외

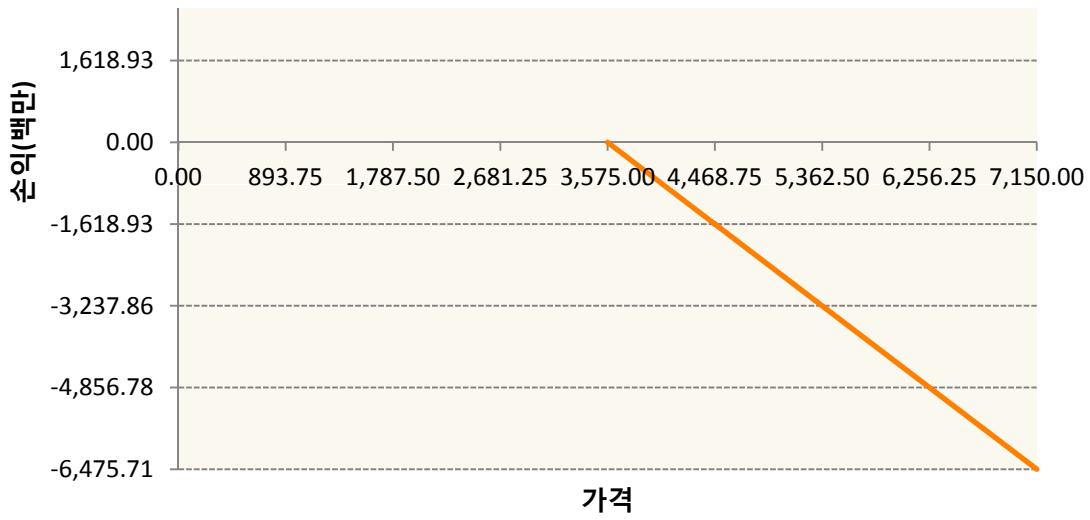
2. 만기시점의 손익구조

OESXV9-C3550-EURO STOXX 50

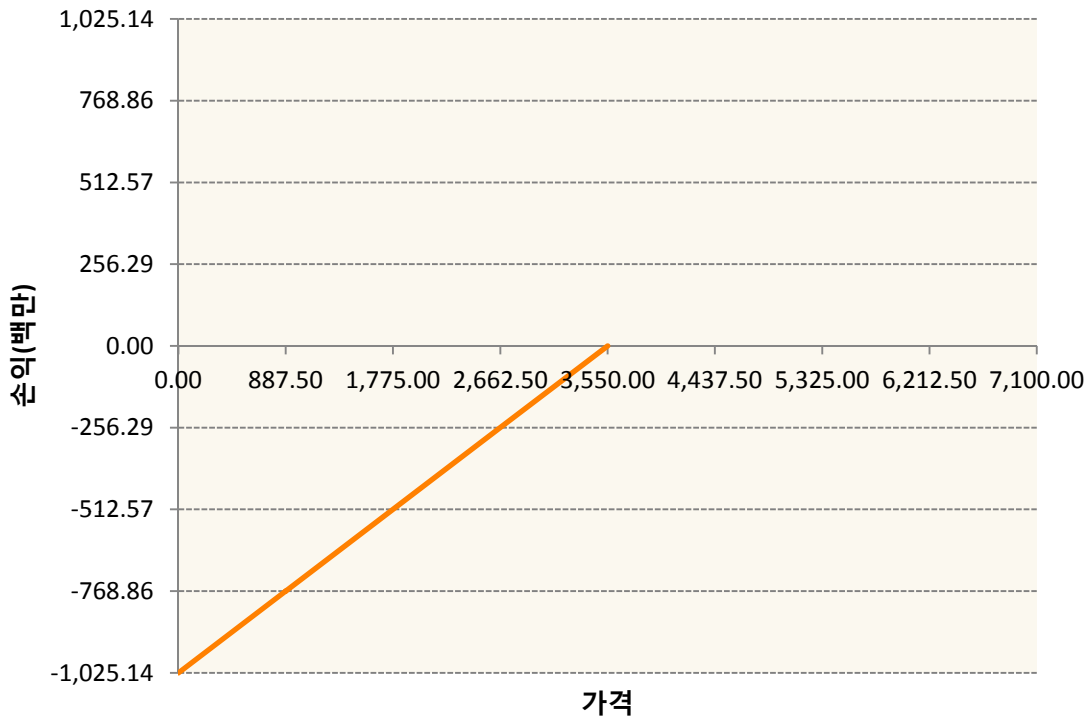


OESXV9-C3575-EURO STOXX 50

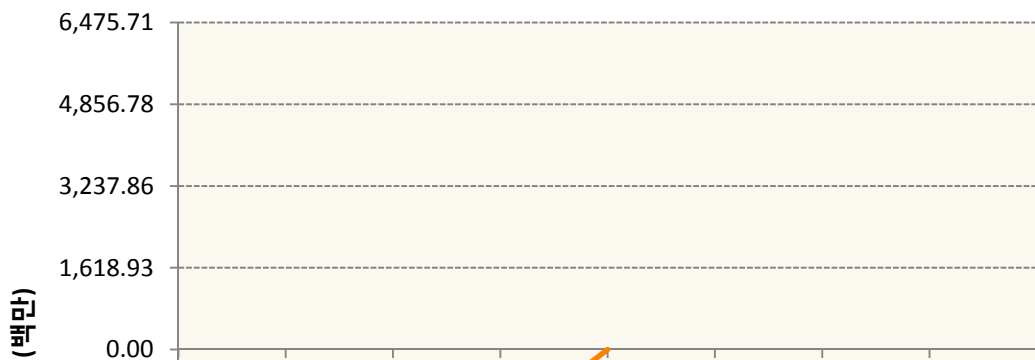


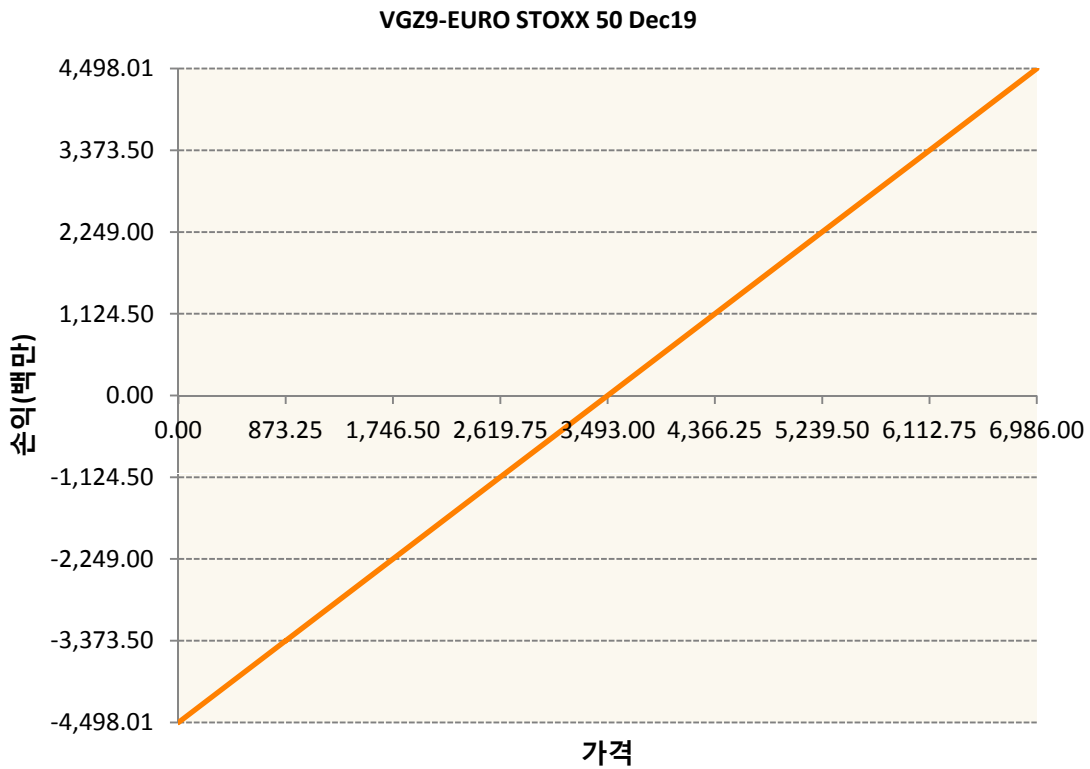
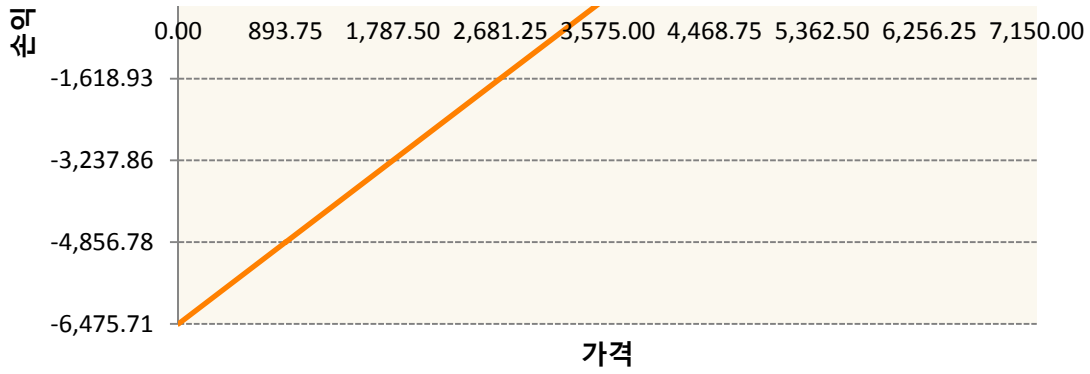


OESXV9-P3550-EURO STOXX 50



OESXV9-P3575-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		37
FX21019M0< KRW/EUR 27-09-19E		1,050
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
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E		494
OESXV9-C35 EURO STOXX 50		82
OESXV9-C35 EURO STOXX 50		518
OESXV9-P35 EURO STOXX 50		82

OESXV9-P35 EURO STOXX 50
VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19

518
360

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

(단위:백만원)

2,422

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

(단위:백만원)

994

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

(단위:백만원)

85

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

(단위:백만원)

132

공시일	2019-09-27
기준일	2019-09-26

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

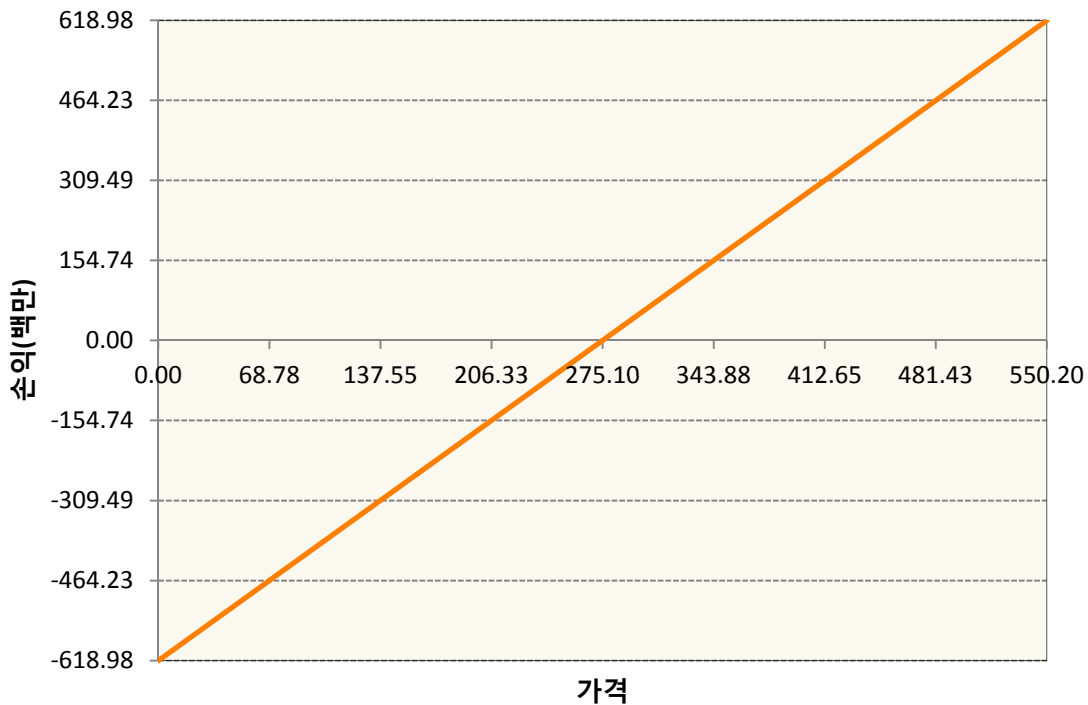
1. 계약금액

(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	2019-09-27
기준일	2019-09-26

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

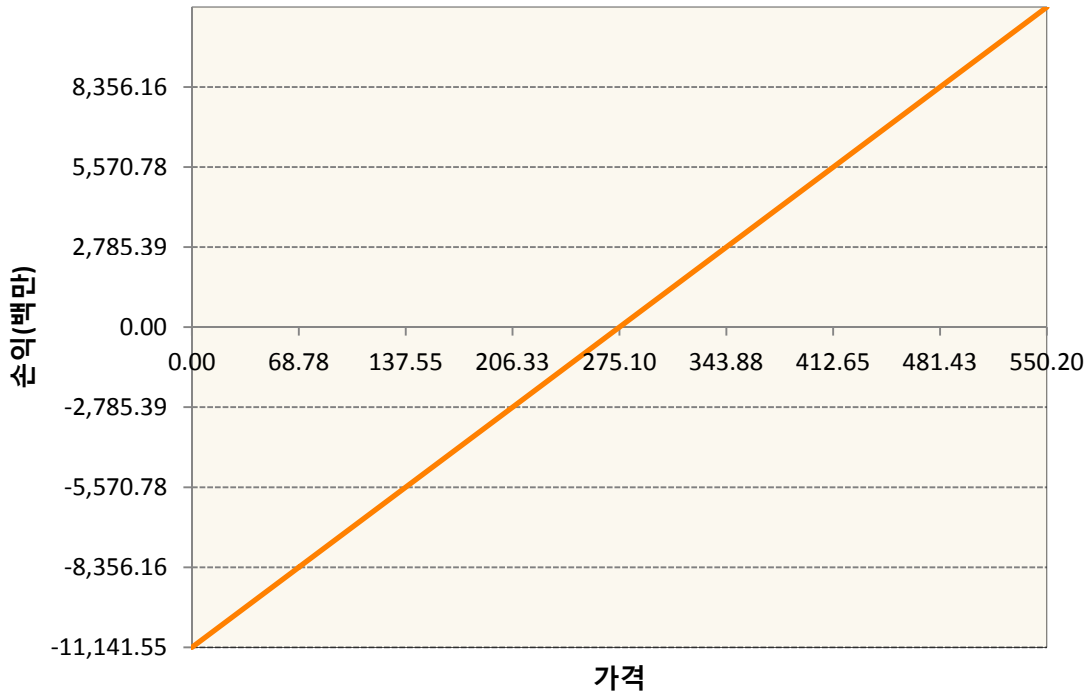
1. 계약금액

(단위:백만원)

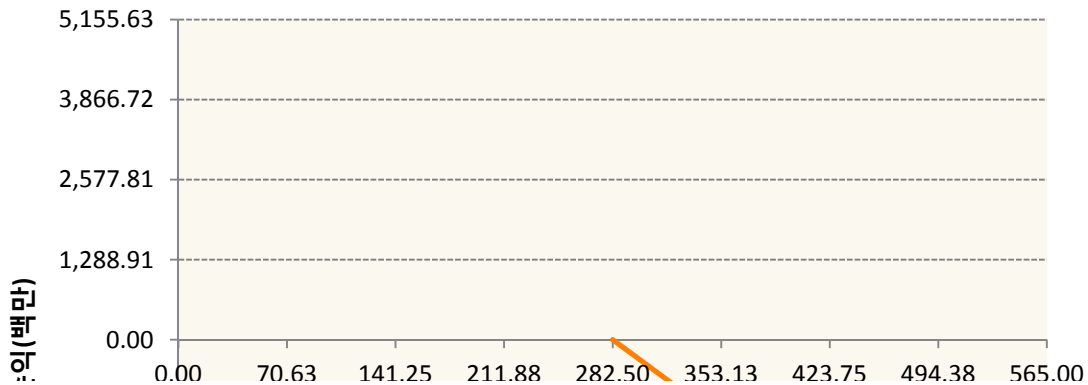
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,142	0	11,142	장내
누계	유가증권	옵션	1,422	20,759	-19,338	장내

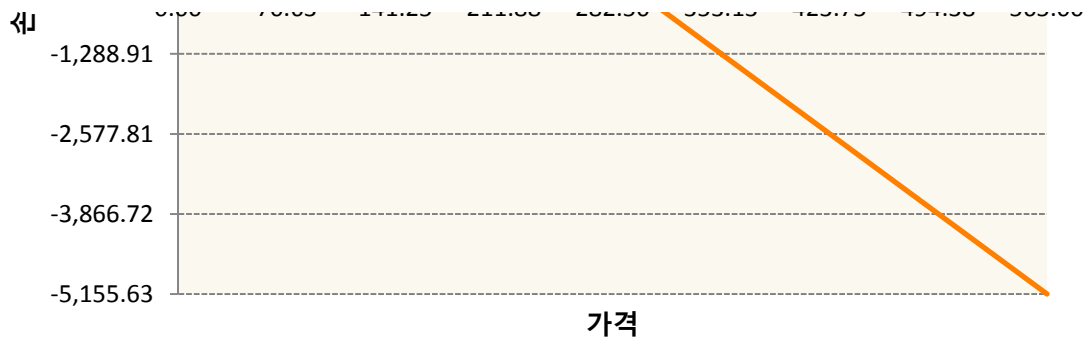
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

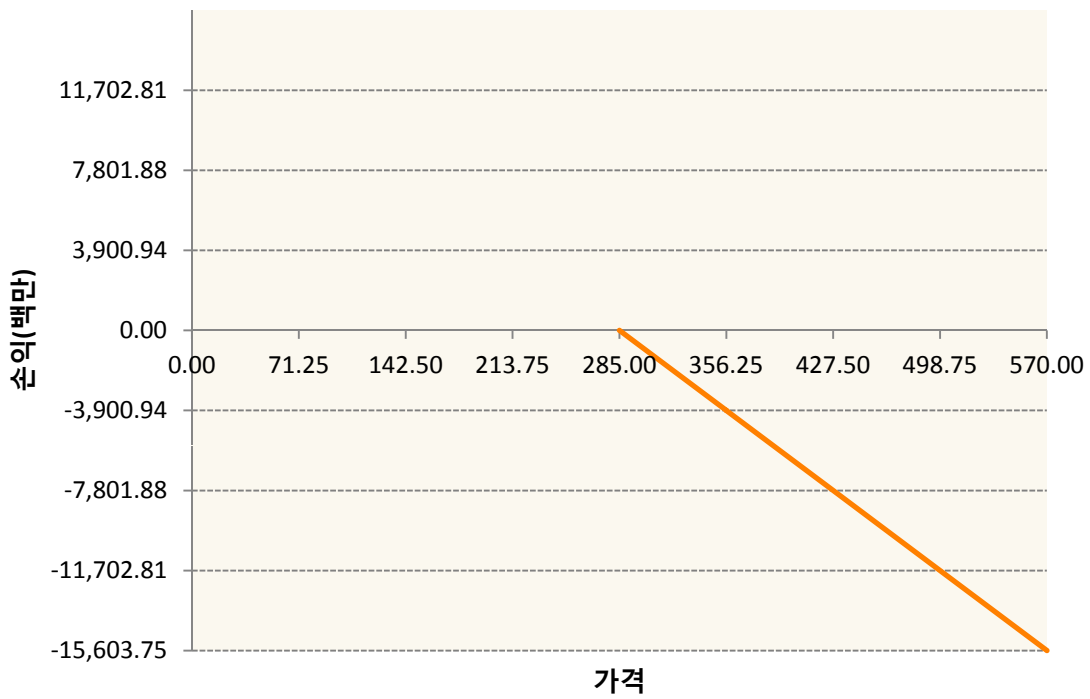


KR4201PA2827-2019-10 콜282.5

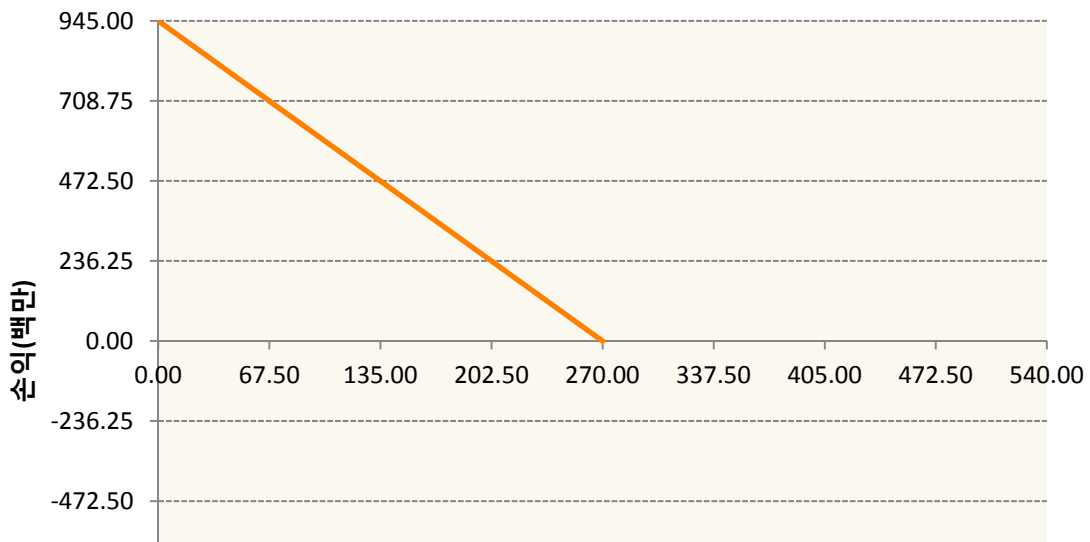


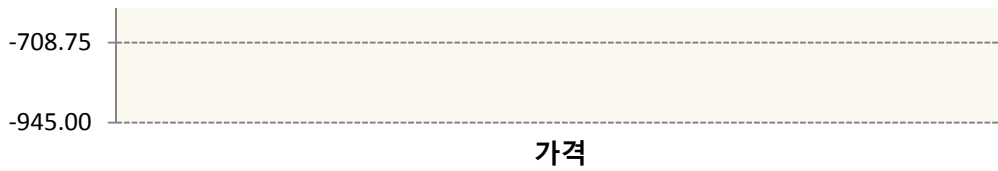


KR4201PA2850-2019-10 콜285

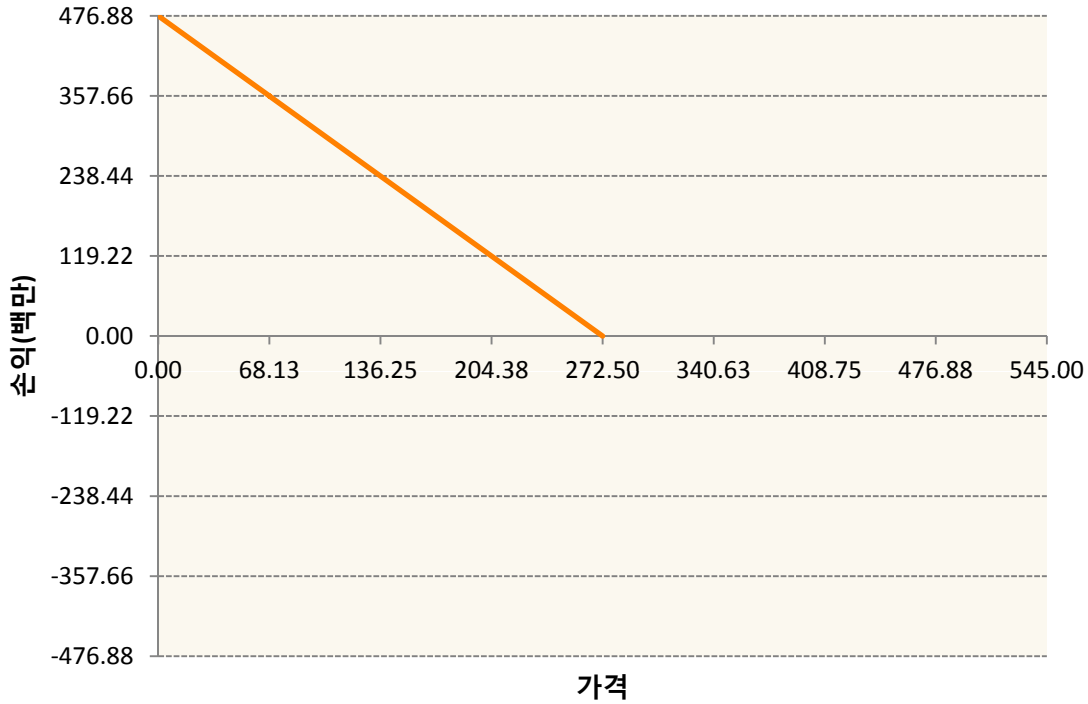


KR4301PA2701-2019-10 풋270





KR4301PA2727-2019-10 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						891
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-891	-891	-891	-891	-891	-891	-891	
-5.33%	-594	-594	-594	-594	-594	-594	-594	
-2.67%	-297	-297	-297	-297	-297	-297	-297	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	297	297	297	297	297	297	297	
5.33%	594	594	594	594	594	594	594	
8.00%	891	891	891	891	891	891	891	
KR4201PA2827		2019-10 콜282.5						255
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	49	49	49	48	47	46	44	
-5.33%	48	47	45	43	41	38	34	
-2.67%	42	39	35	30	25	19	13	

0%	22	15	8	0	-8	-16	-23
2.67%	-27	-36	-45	-54	-62	-71	-80
5.33%	-110	-118	-125	-133	-141	-150	-158
8.00%	-221	-225	-230	-236	-242	-248	-255
KR4201PA2850 2019-10 콜285							698
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	113	112	111	110	108	105	101
-5.33%	111	109	105	101	94	87	78
-2.67%	100	92	82	71	58	44	28
0%	57	39	20	0	-21	-43	-65
2.67%	-57	-83	-109	-135	-162	-188	-214
5.33%	-271	-297	-322	-348	-374	-400	-427
8.00%	-579	-596	-614	-634	-654	-676	-698
KR4301PA2701 2019-10 풋270							56
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	55	55	55	55	55	56	56
-5.33%	30	30	31	31	31	32	33
-2.67%	9	10	10	11	12	13	14
0%	-2	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-5	-5	-4	-4	-4	-3	-3
5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
KR4301PA2727 2019-10 풋272.5							31
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	30	30	30	31	31	31	31
-5.33%	18	18	18	18	18	18	19
-2.67%	6	6	7	7	8	8	8
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-4	-4	-3	-3	-3	-3	-2
5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4

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

(단위:백만원)

1,639

공시일	2019-09-27
기준일	2019-09-26

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,596	0	3,596	
누계	유가증권	수익증권	110,472	0	110,472	

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	2019-09-27
기준일	2019-09-26

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	4,795	0	4,795	
누계	유가증권	수익증권	142,046	0	142,046	

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	2019-09-27
기준일	2019-09-26

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	421,761	0	421,761	
누계	통화	선도	9,590	423,296	-413,706	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
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
FX21019U05 USD/KRW 04-10-19E		480
FX21019U05 USD/KRW 04-10-19E		288

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

(단위:백만원)

11,405

공시일	2019-09-27
기준일	2019-09-26

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

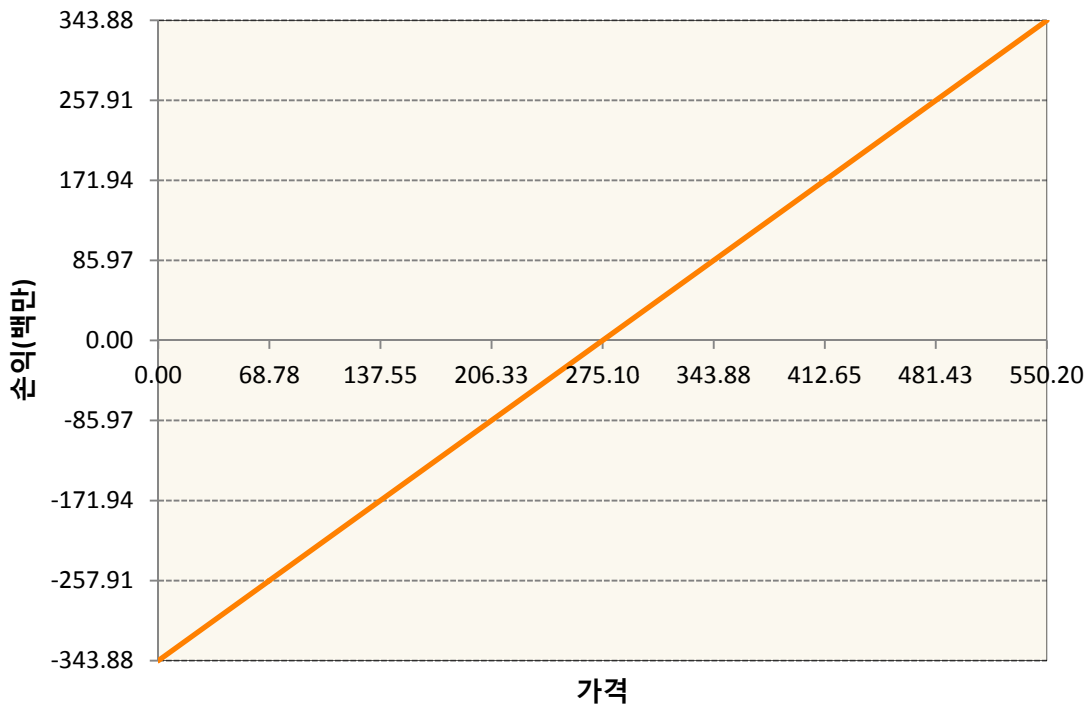
1. 계약금액

(단위:백만원)

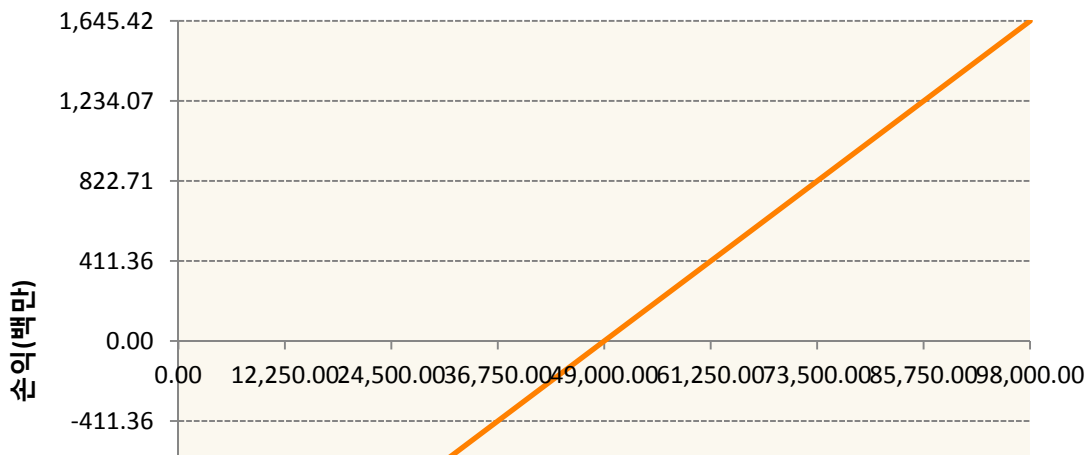
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,989	0	1,989	장내

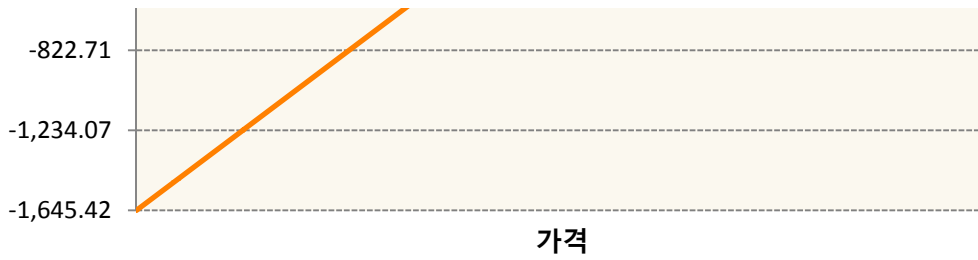
2. 만기시점의 손익구조

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	2019-09-27
기준일	2019-09-26

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

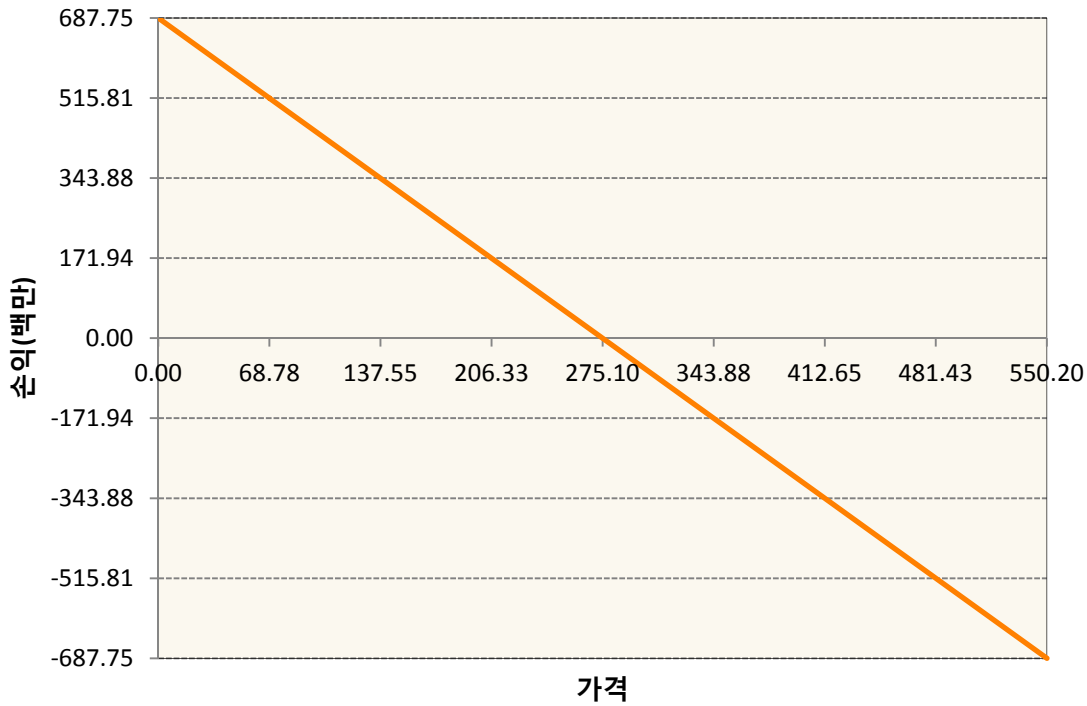
1. 계약금액

(단위:백만원)

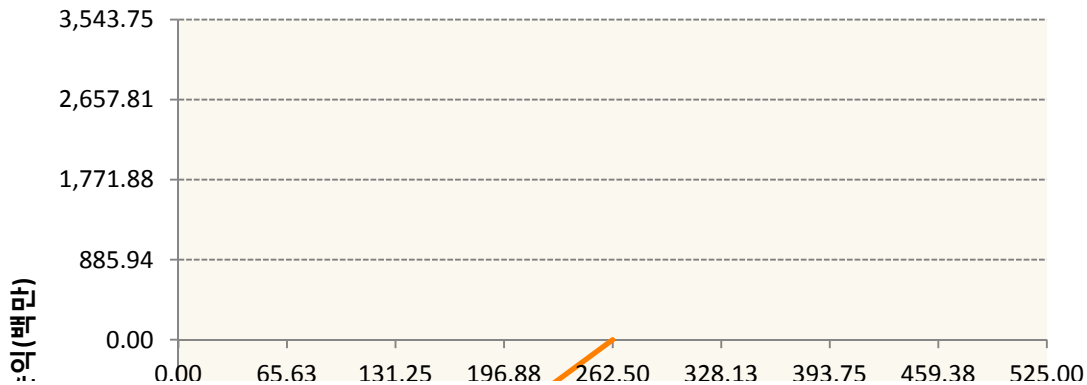
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	688	-688	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,941	-3,941	장내

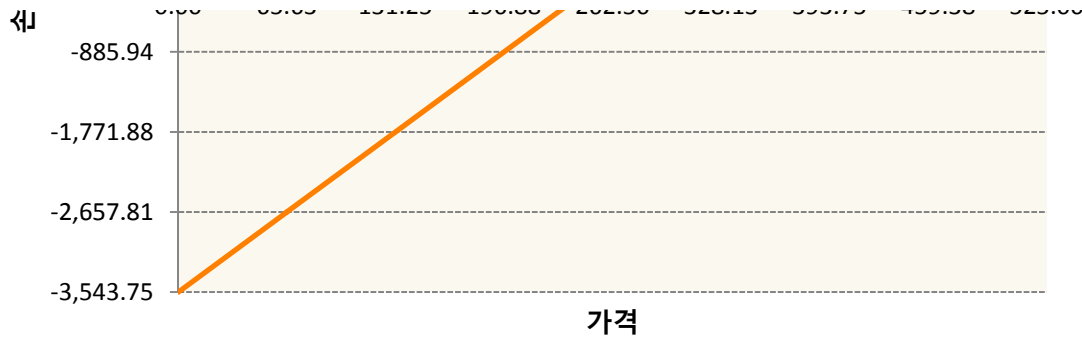
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

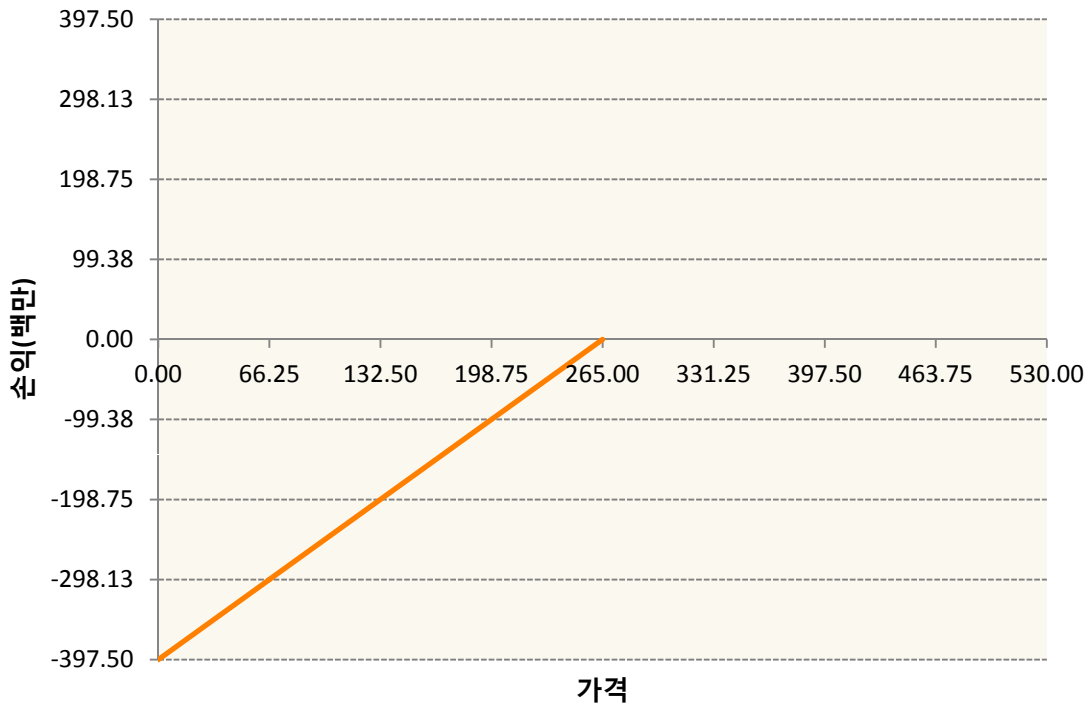


KR4301PA2628-2019-10 풋262.5





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						139
기초자산의 변동성								

공시일	2019-09-27
기준일	2019-09-26

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	17,833	0	17,833	
누계	통화	선도	240	17,862	-17,622	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
FX21019U05 USD/KRW 18-10-19E		19

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

(단위:백만원)

477

공시일	2019-09-27
기준일	2019-09-26

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	2019-09-27
기준일	2019-09-26

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

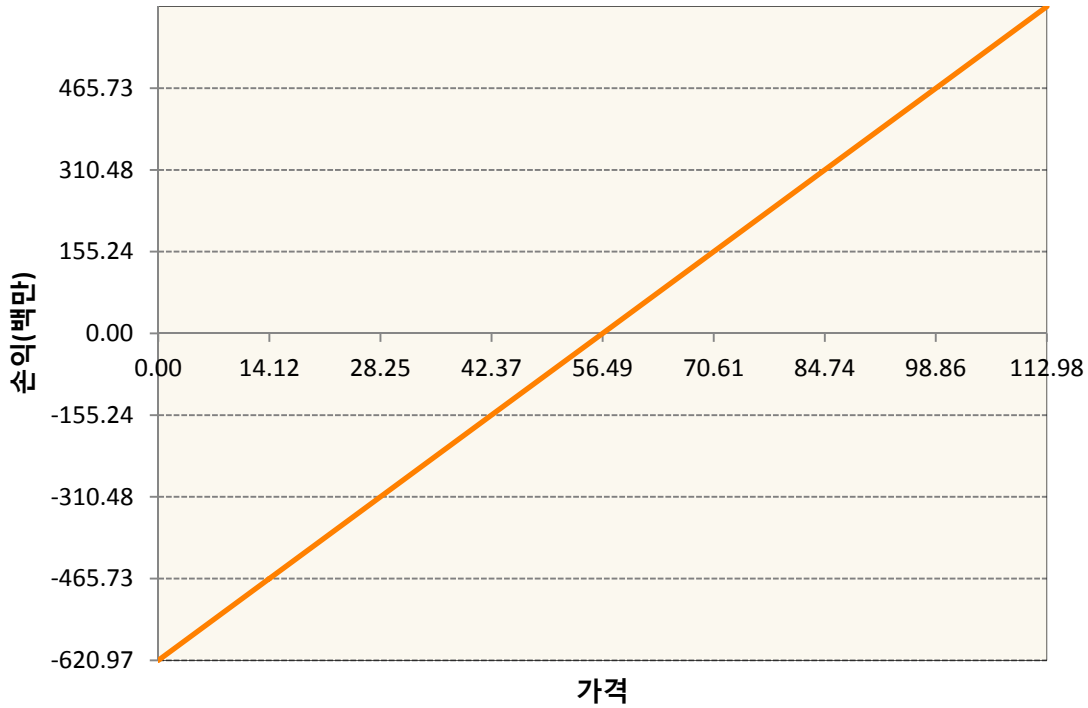
1. 계약금액

(단위:백만원)

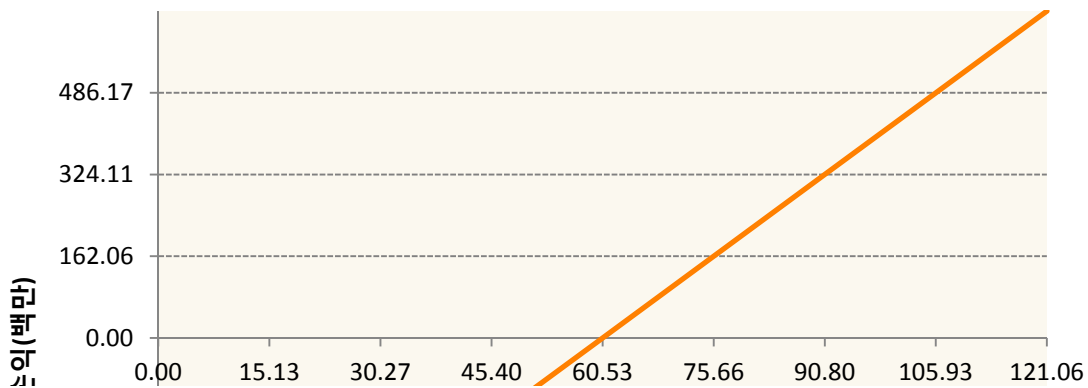
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,376	479	1,897	
누계	유가증권	선물	200	0	200	장내

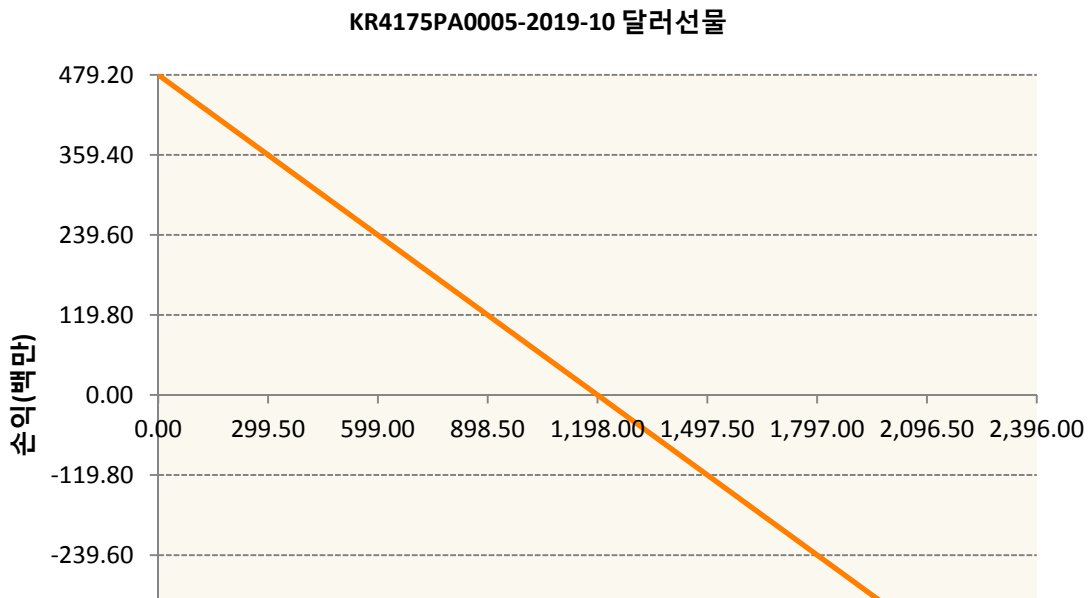
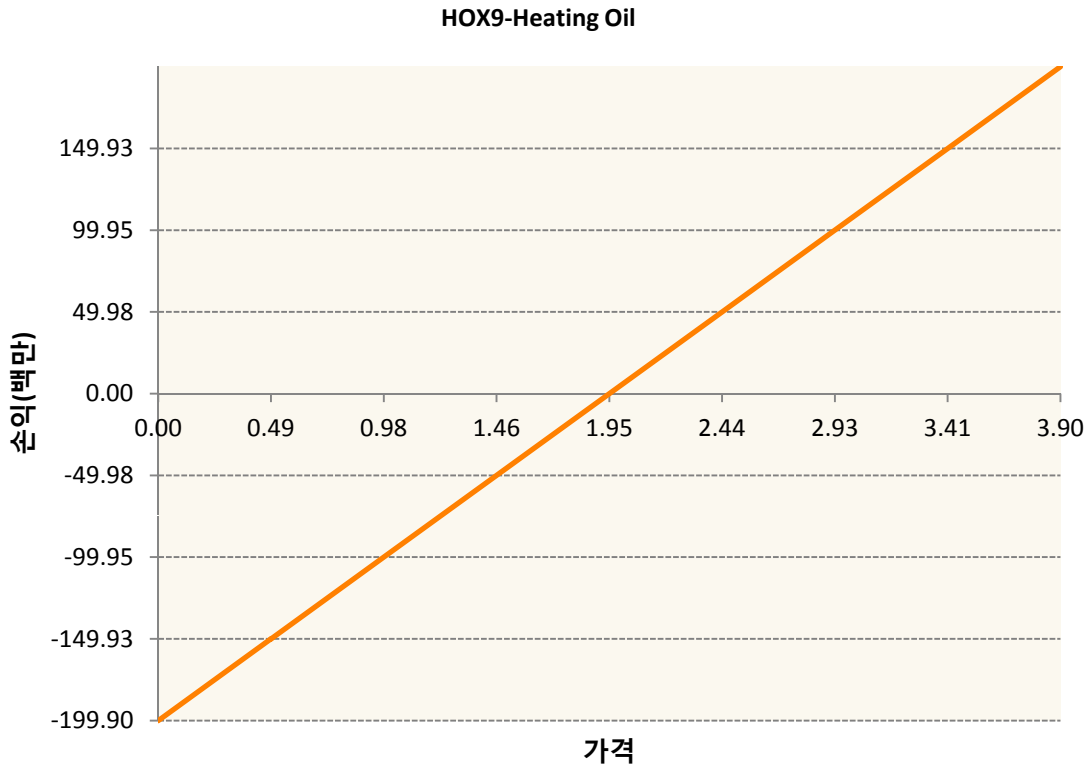
2. 만기시점의 손익구조

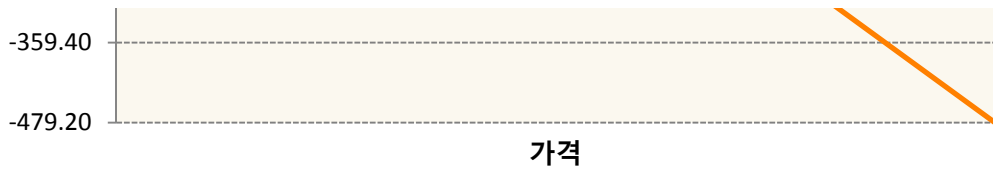
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19



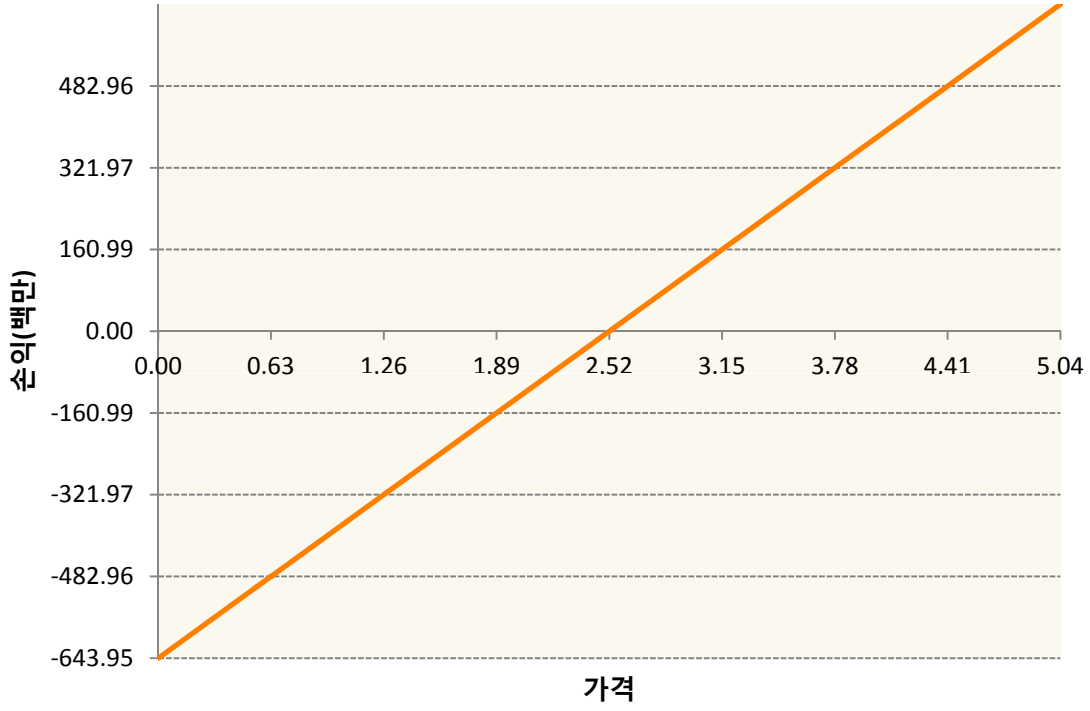
COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20



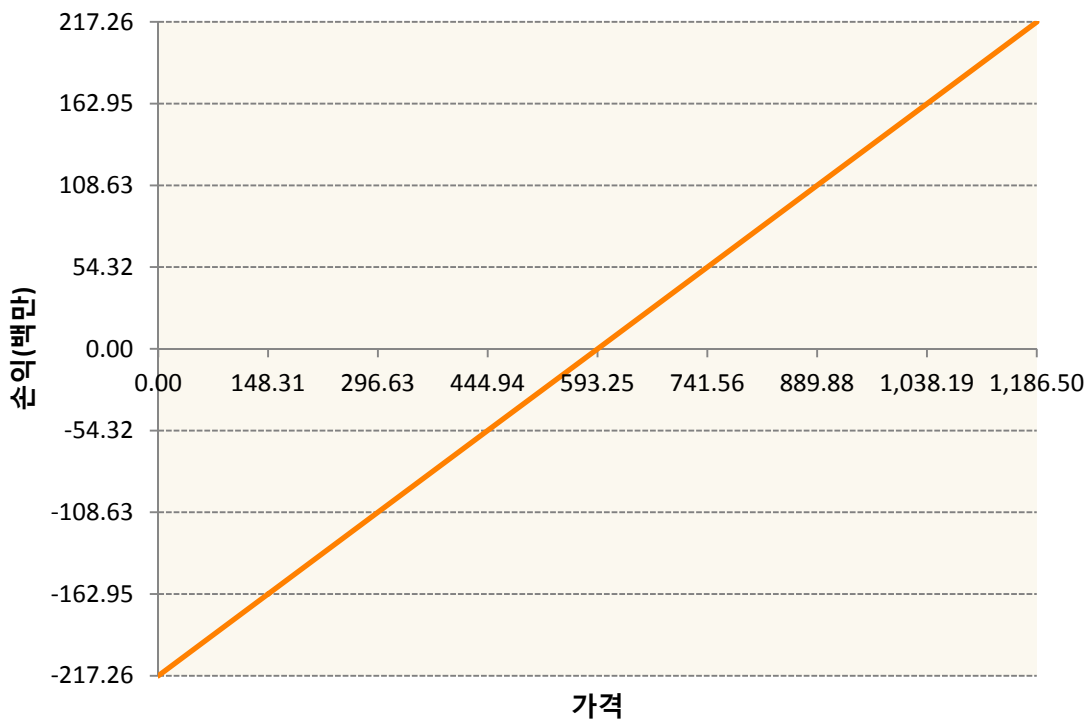


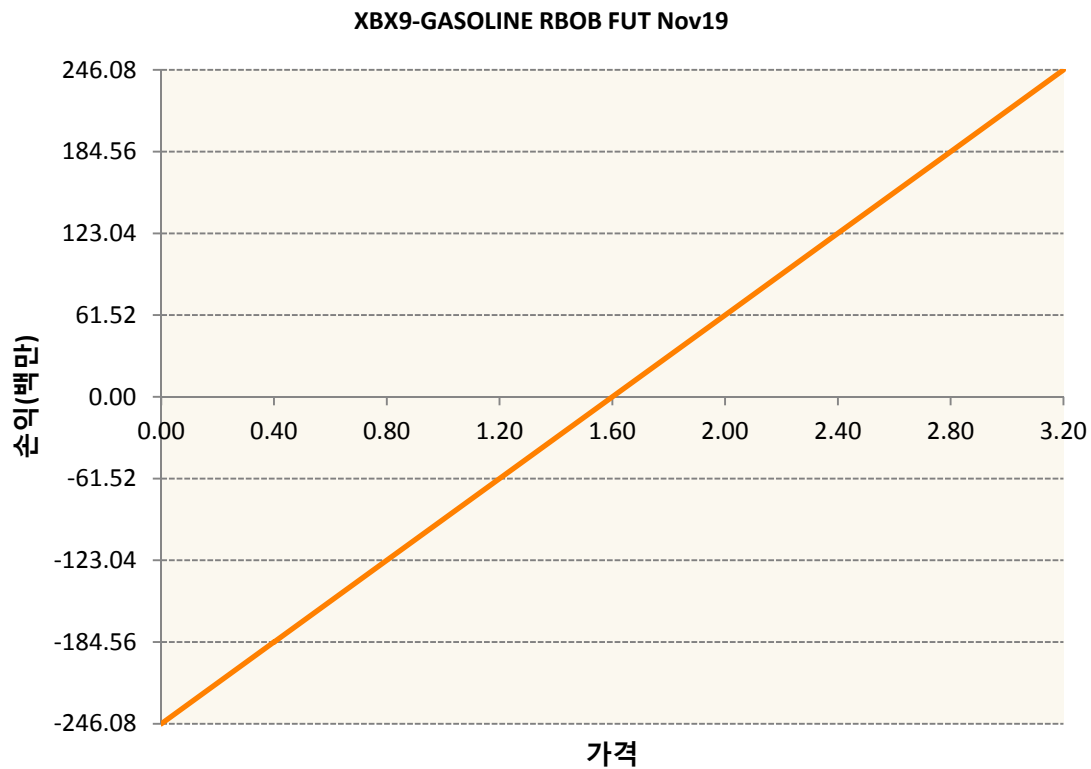


NGX19-NATURAL GAS FUTR Nov19



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	17
XBX9	GASOLINE RBOB FUT Nov19	20

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	432

공시일	2019-09-27
기준일	2019-09-26

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

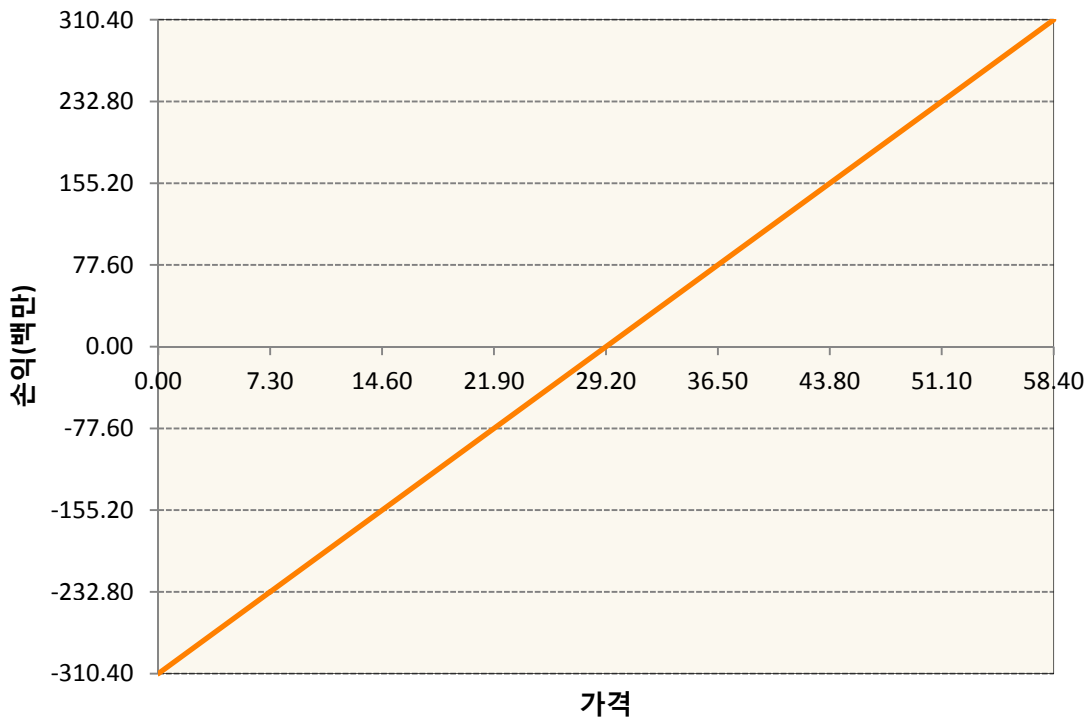
1. 계약금액

(단위:백만원)

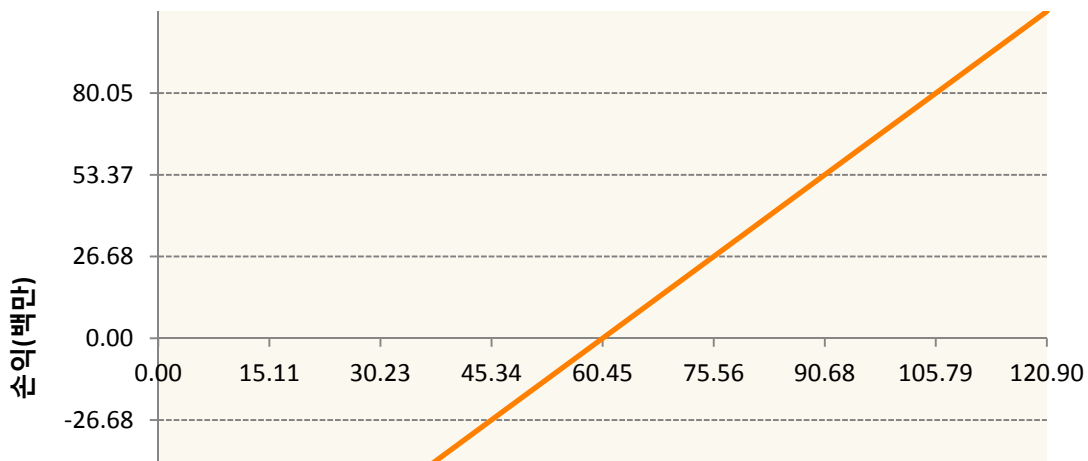
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,771	96	2,676	

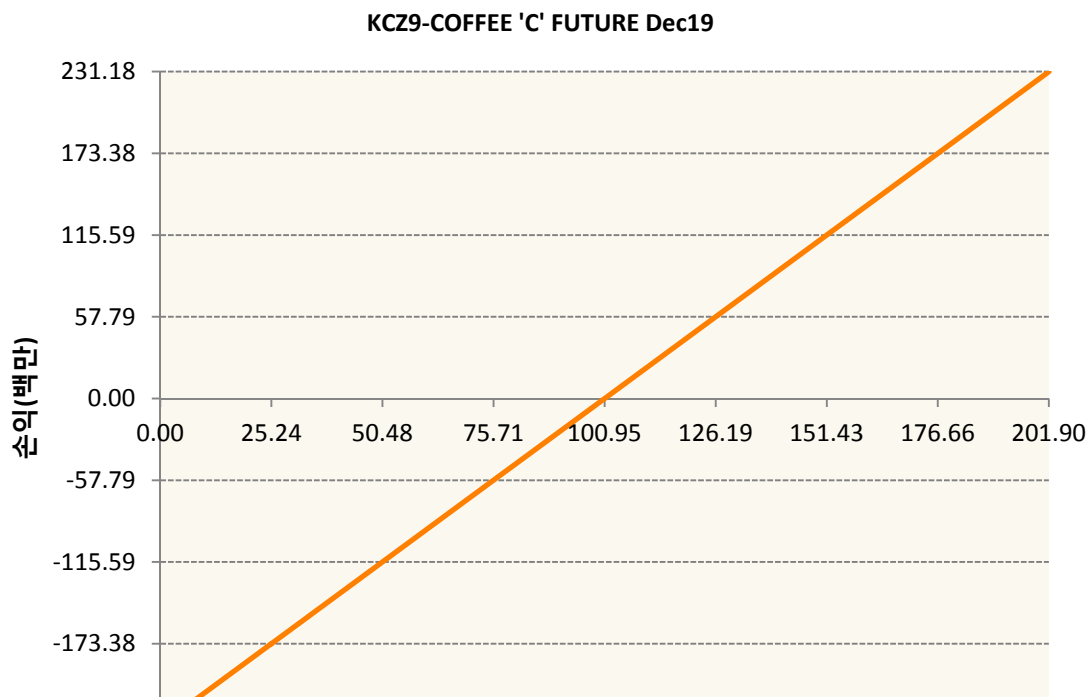
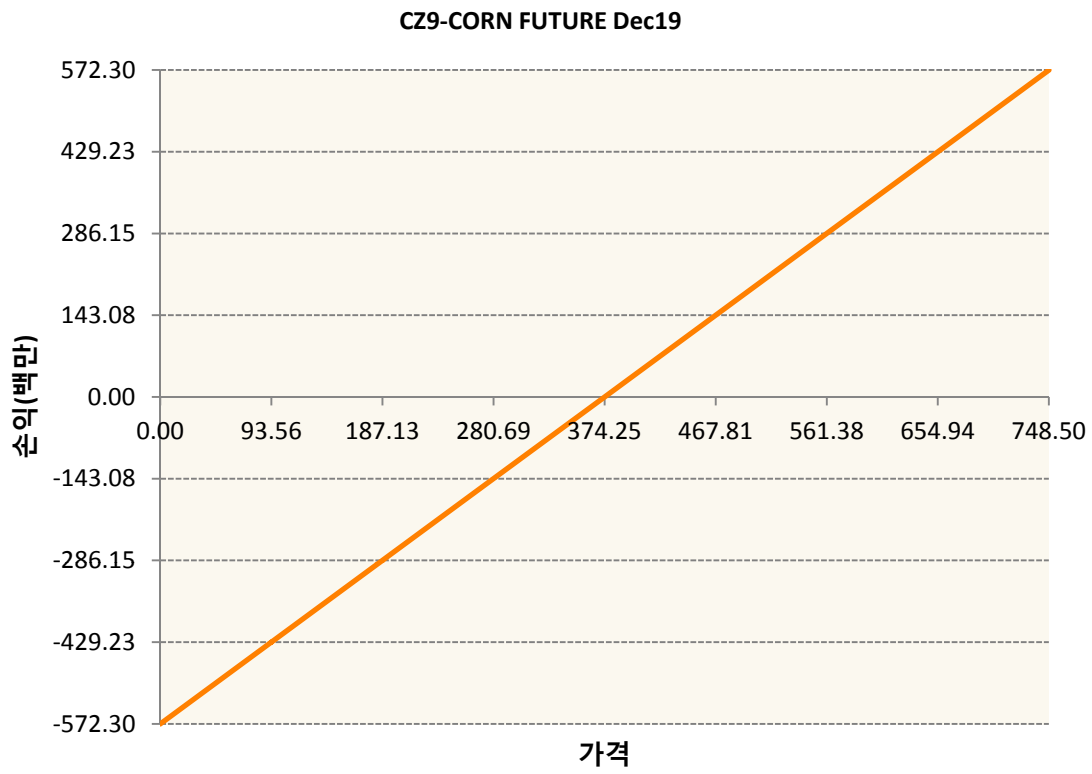
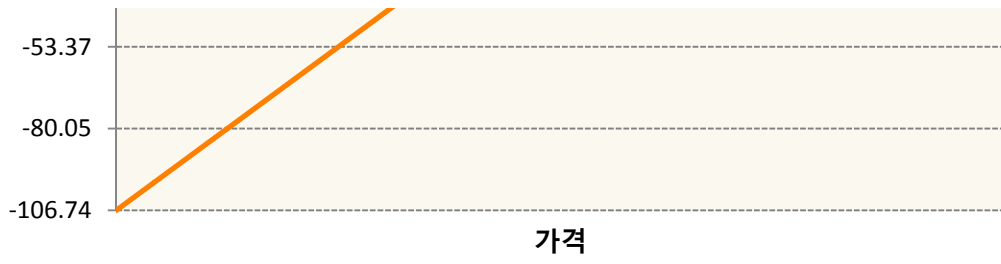
2. 만기시점의 손익구조

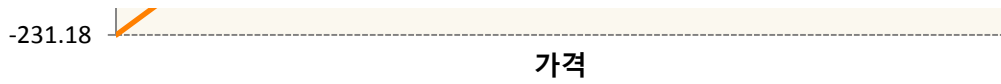
BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19



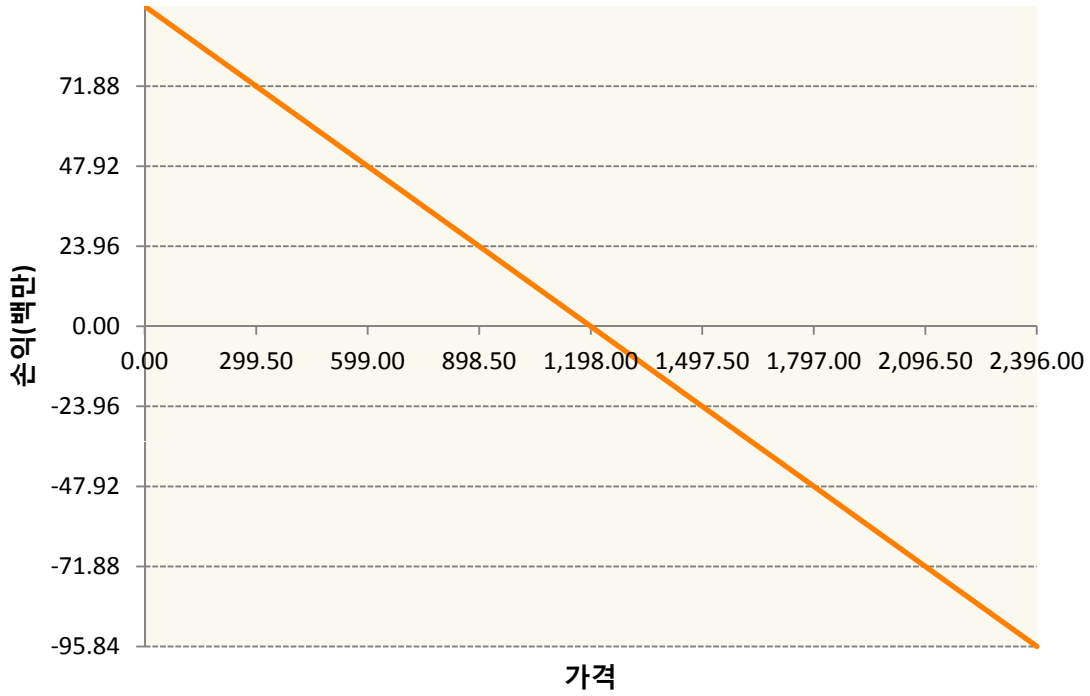
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



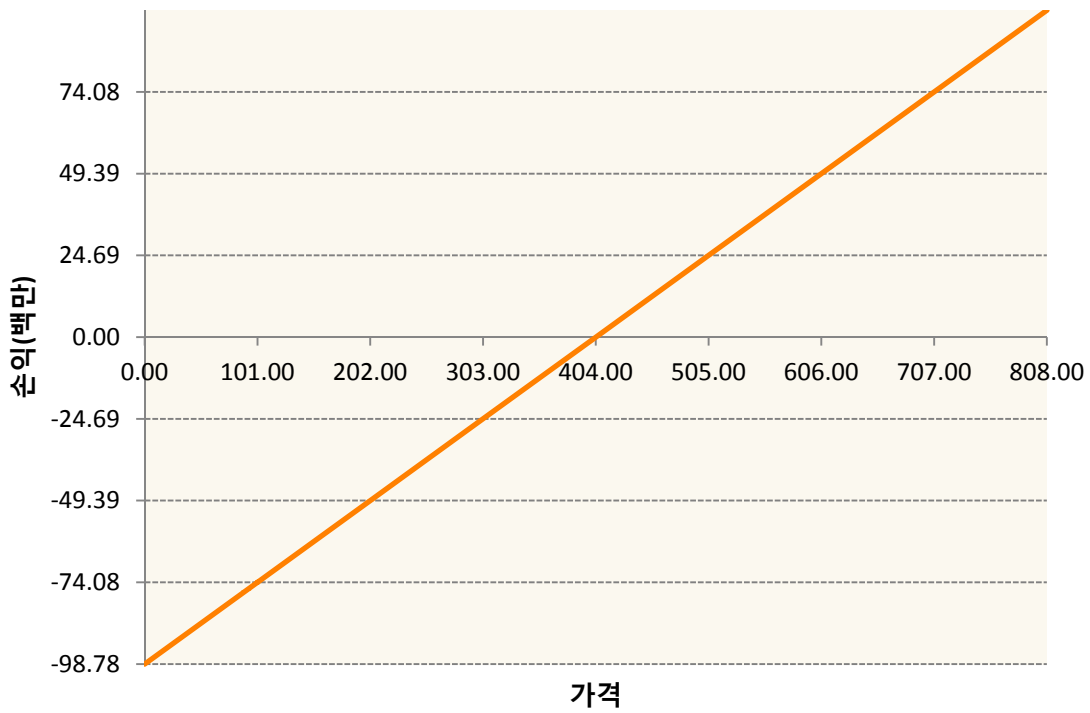




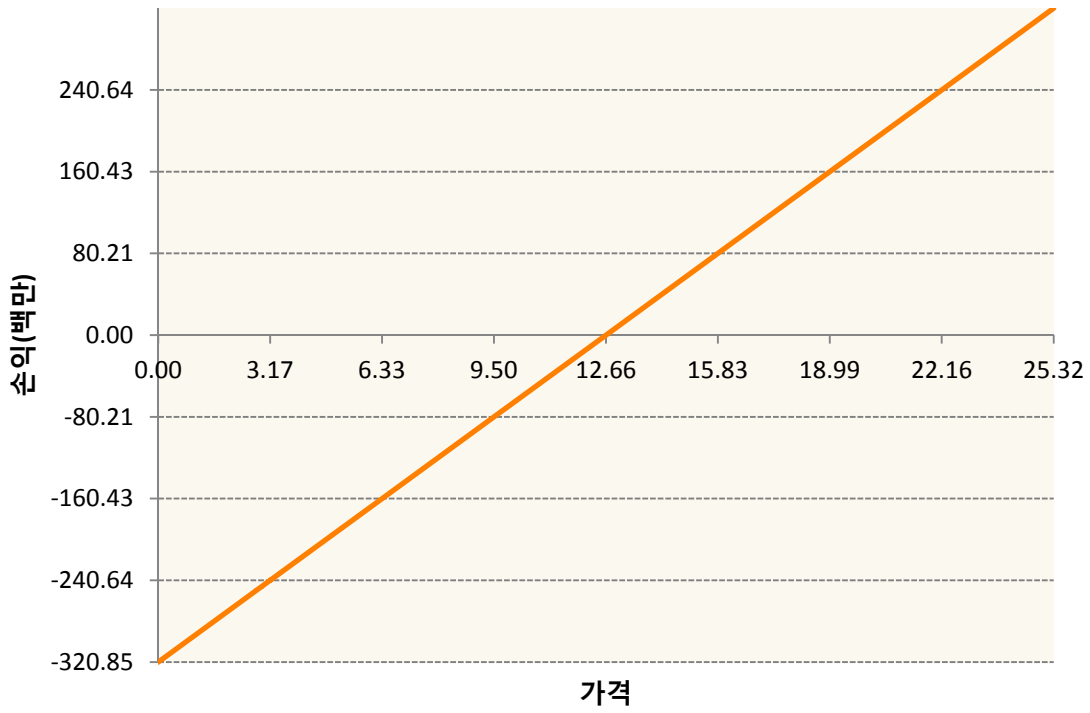
KR4175PA0005-2019-10 달러선물



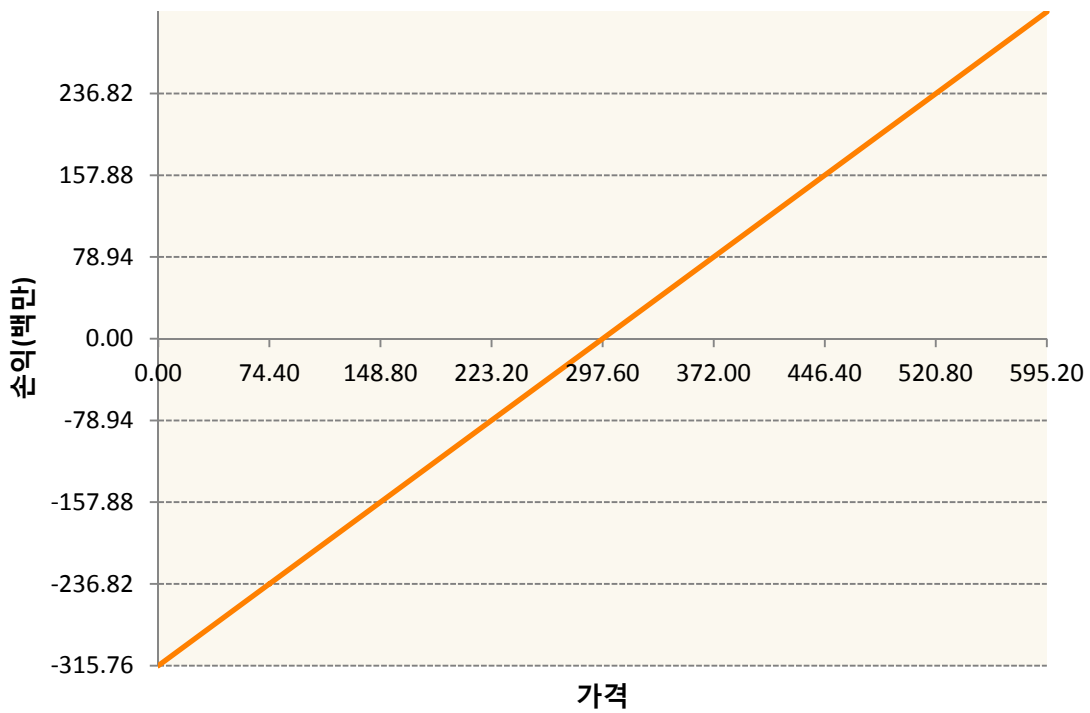
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



SBH0-Sugar Mar20

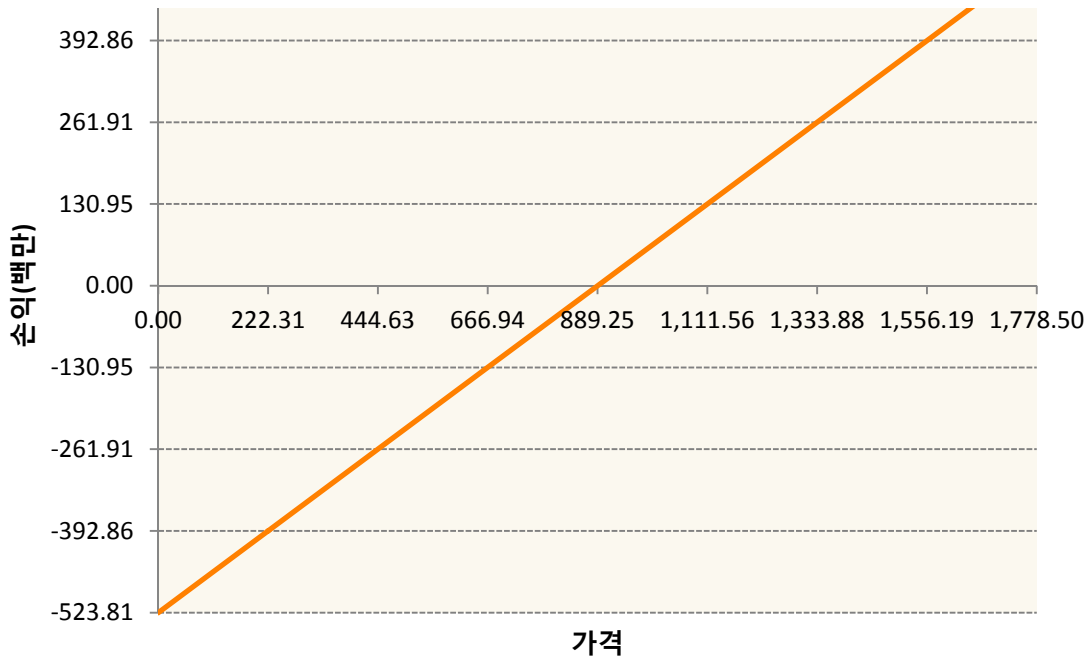


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

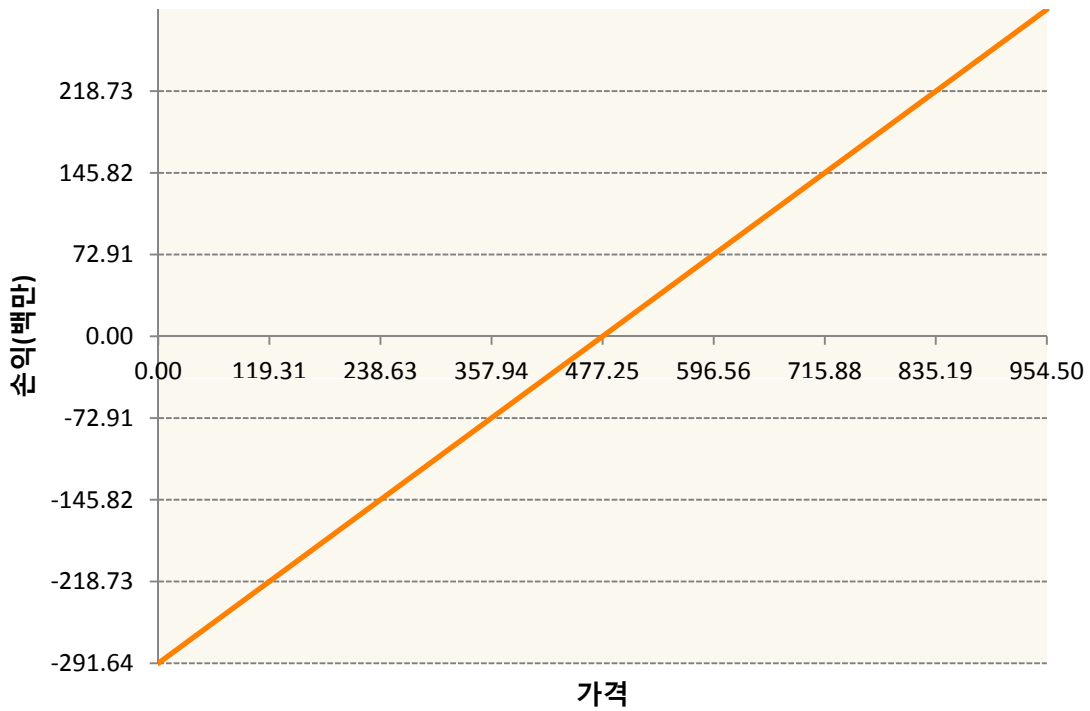


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





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	46
KCZ9	COFFEE 'C' FUTURE Dec19	18
KR4175PA00	2019-10 달러선물	8

KWZ9	KC HRW WHEAT FUT Dec19	8
SBH0	Sugar Mar20	26
SMZ9	SOYBEAN MEAL FUTR Dec19	25
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	42
WZ9	WHEAT FUTURE(CBT) Dec19	23

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

(단위:백만원)

248