

공시일	2019-09-30
기준일	2019-09-27

## 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	2019-09-30
기준일	2019-09-27

## 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

1,173

\* 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	2019-09-30
기준일	2019-09-27

## 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)	379
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	139

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

**824**

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-09-30
기준일	2019-09-27

## 유로인덱스모(주식-파생형)

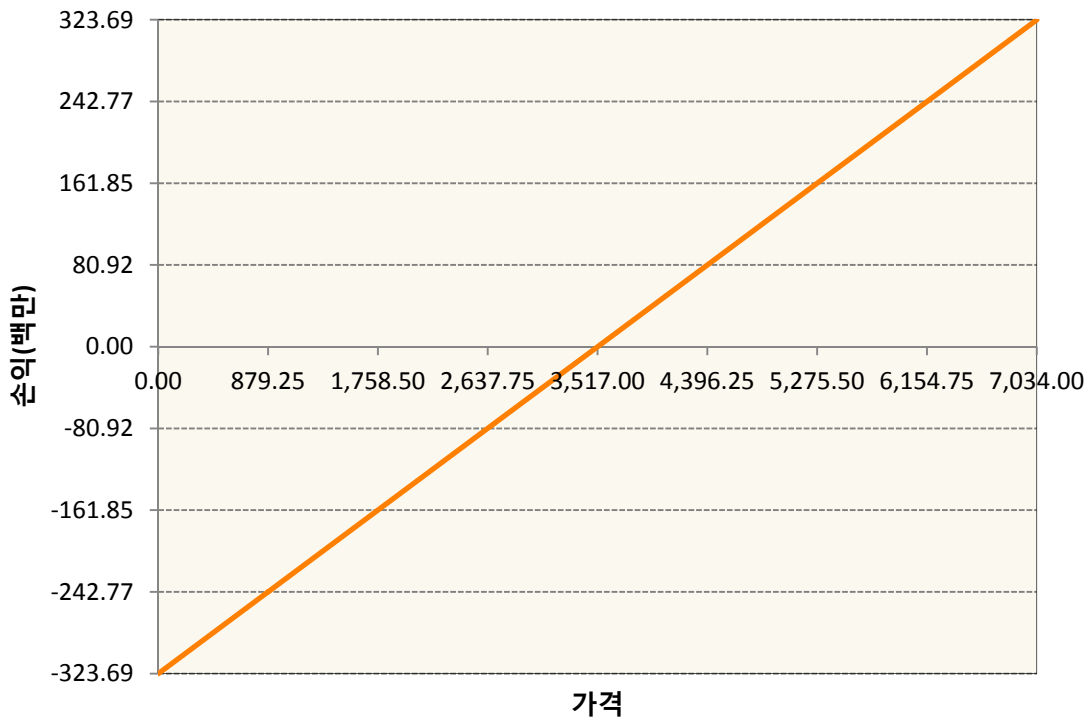
### 1. 계약금액

(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	2019-09-30
기준일	2019-09-27

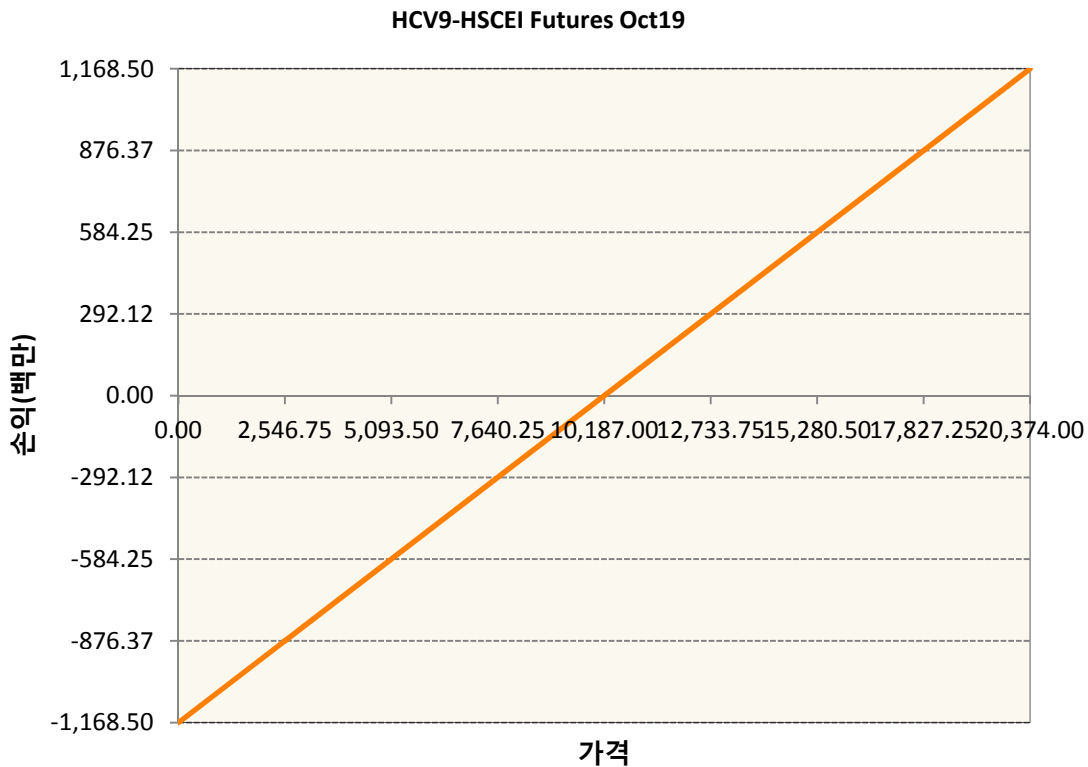
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,168	0	1,168	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV9	HSCEI Futures Oct19	93
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

86
----

공시일	2019-09-30
기준일	2019-09-27

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

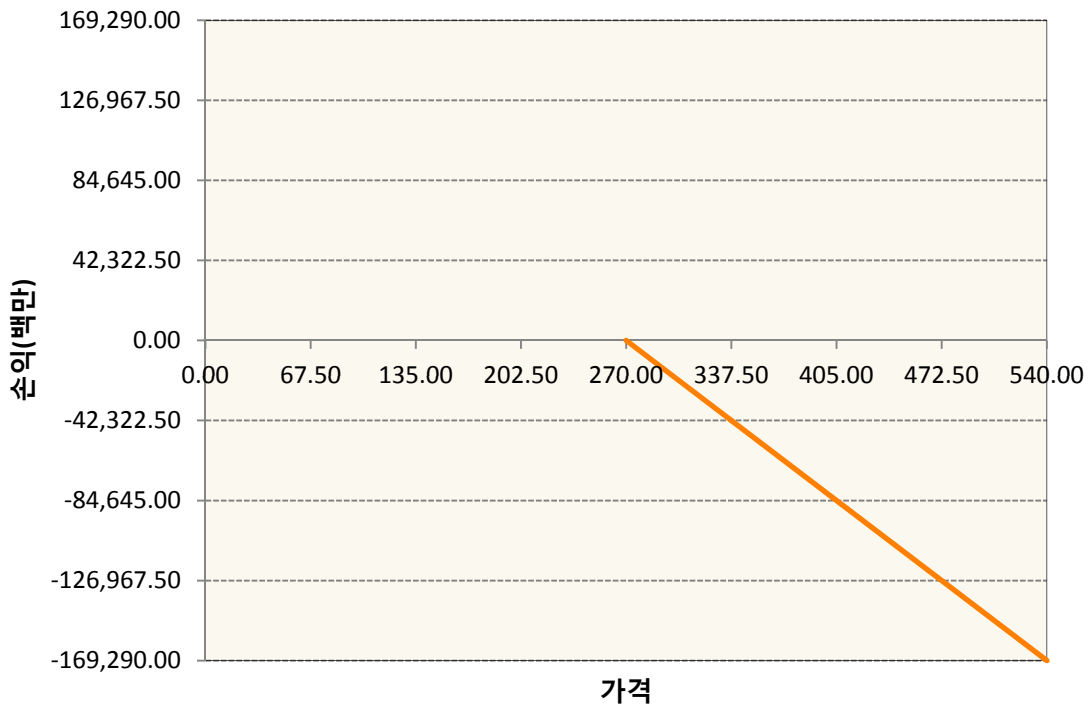
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

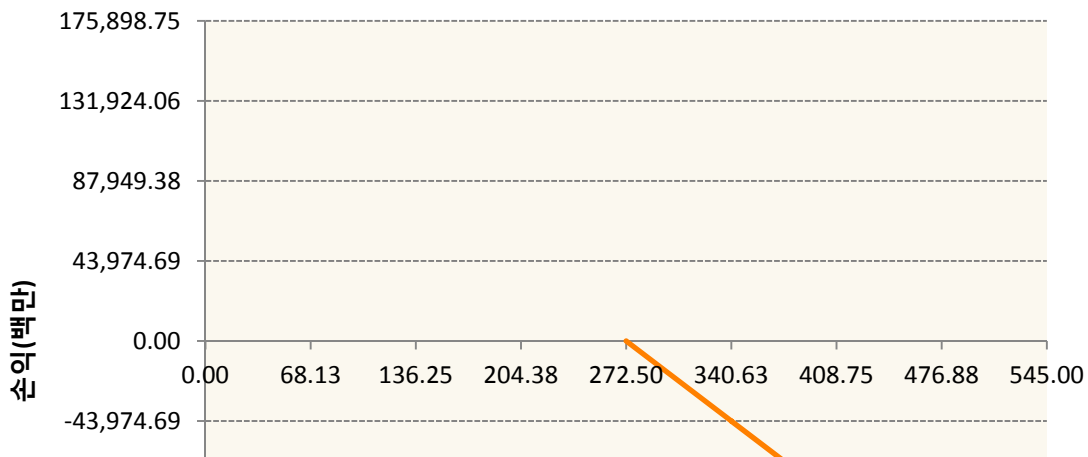
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	513,939	-513,939	장내

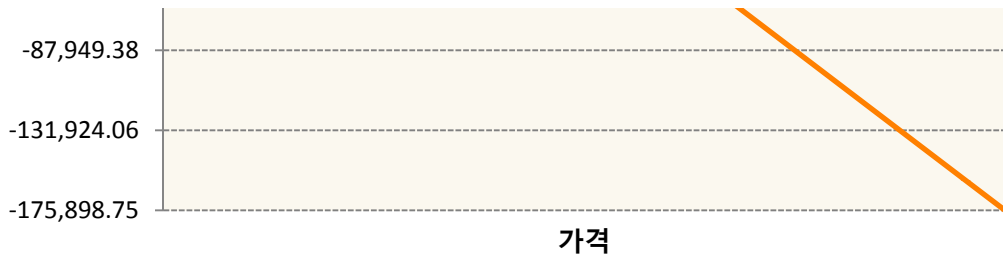
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201PA2702-2019-10 콜270**

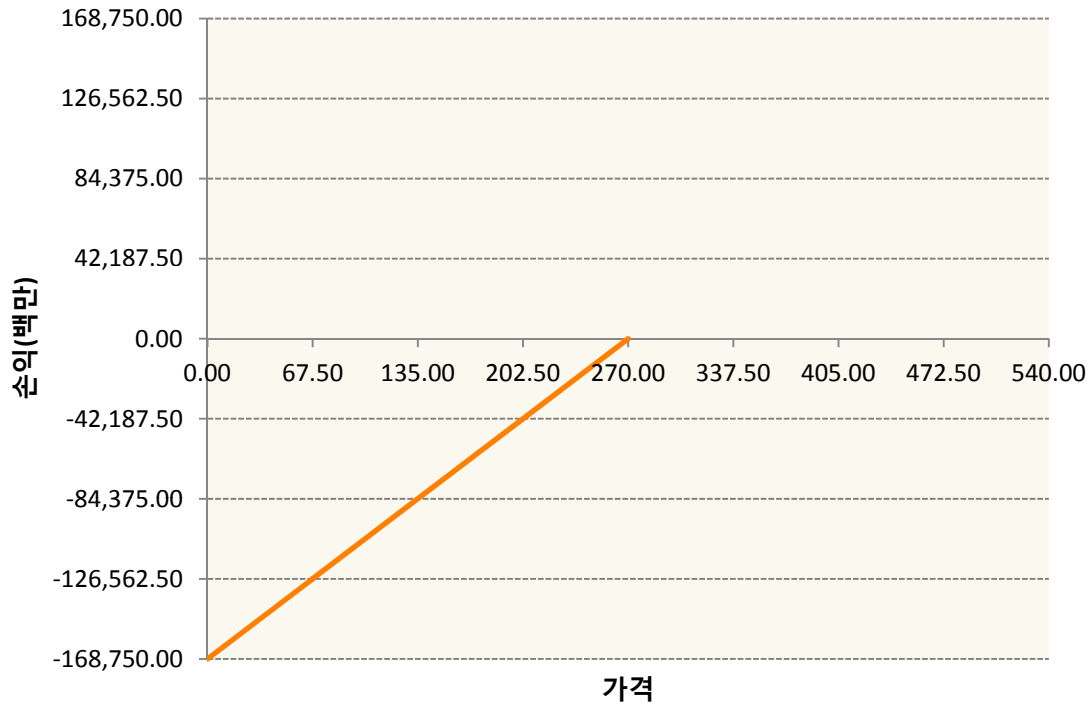


**KR4201PA2728-2019-10 콜272.5**





KR4301PA2701-2019-10 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PA2702		2019-10 콜270					11,094
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,717	3,681	3,629	3,562	3,478	3,379	3,266
-5.33%	3,503	3,384	3,245	3,089	2,920	2,738	2,547
-2.67%	2,712	2,478	2,237	1,990	1,739	1,485	1,228
0%	834	557	278	0	-279	-557	-836
2.67%	-2,276	-2,484	-2,704	-2,934	-3,171	-3,414	-3,662
5.33%	-6,260	-6,362	-6,485	-6,627	-6,785	-6,957	-7,141
8.00%	-10,644	-10,677	-10,727	-10,794	-10,878	-10,978	-11,094
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5					10,781
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,056	3,034	2,998	2,948	2,884	2,804	2,709

-5.33%	2,927	2,838	2,728	2,600	2,455	2,295	2,123
-2.67%	2,370	2,165	1,946	1,718	1,481	1,239	991
0%	863	575	288	0	-288	-576	-865
2.67%	-1,917	-2,169	-2,428	-2,692	-2,961	-3,233	-3,507
5.33%	-5,758	-5,902	-6,066	-6,247	-6,443	-6,650	-6,868
8.00%	-10,167	-10,222	-10,298	-10,392	-10,505	-10,635	-10,781
KR4301PA2701 2019-10 풋270							11,206
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11,173	-11,174	-11,175	-11,178	-11,184	-11,193	-11,206
-5.33%	-6,668	-6,684	-6,707	-6,739	-6,781	-6,831	-6,889
-2.67%	-2,428	-2,529	-2,640	-2,758	-2,882	-3,010	-3,143
0%	486	325	163	0	-163	-326	-489
2.67%	1,481	1,412	1,331	1,240	1,140	1,032	918
5.33%	1,612	1,603	1,588	1,566	1,535	1,496	1,449
8.00%	1,618	1,618	1,617	1,614	1,609	1,601	1,589

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

(단위:백만원)

35,342

공시일	2019-09-30
기준일	2019-09-27

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

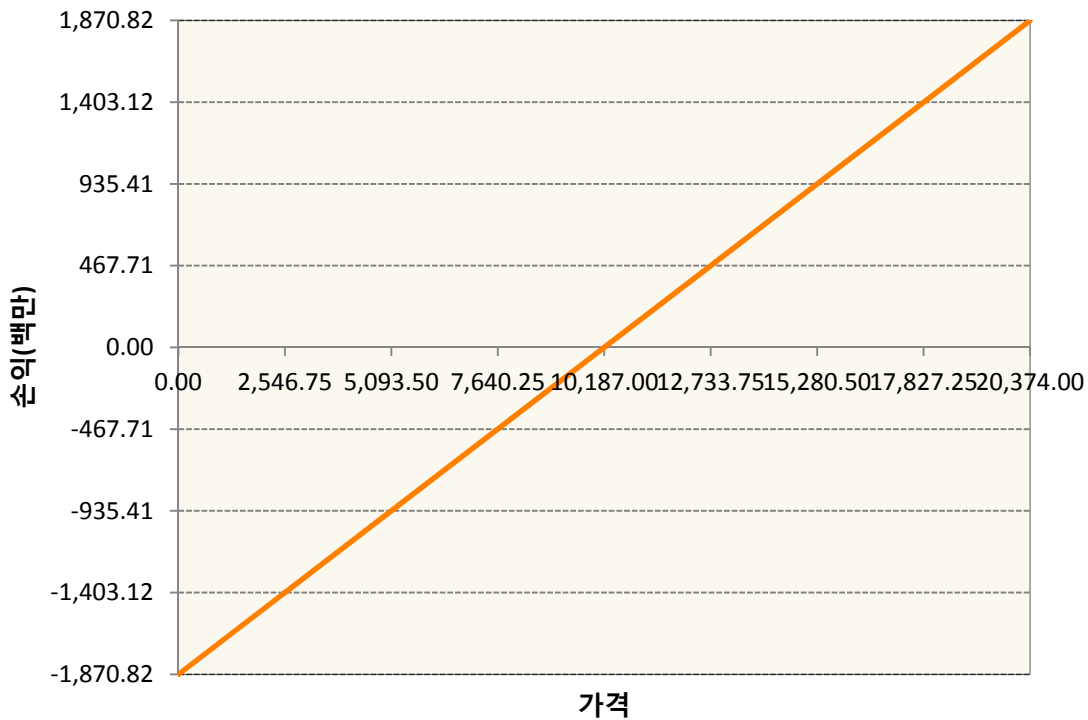
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,871	0	1,871	장내
누계	통화	선도	689	2,843	-2,155	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

HCV9-HSCEI Futures Oct19



### 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
HCV9 HSCEI Futures Oct19	150

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

(단위:백만원)



공시일	2019-09-30
기준일	2019-09-27

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

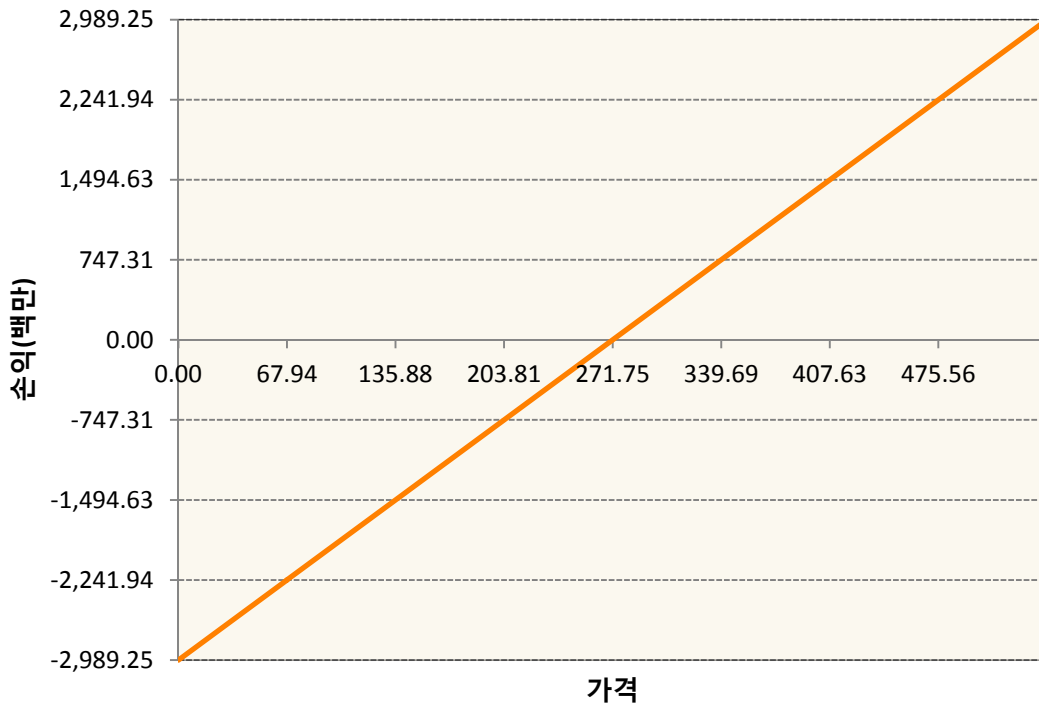
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

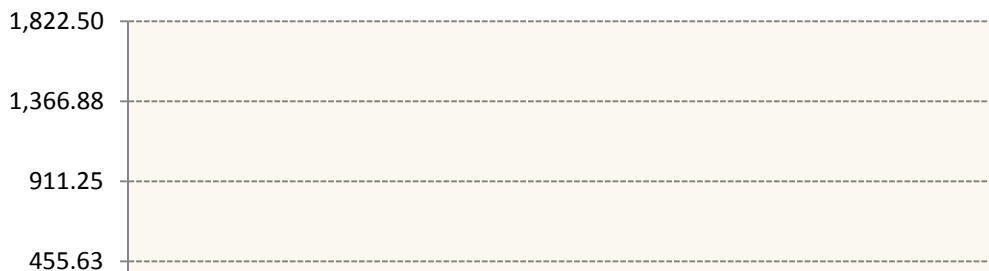
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,989	0	2,989	장내
누계	유가증권	스왑	14,125	0	14,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	10,968	-10,968	장내

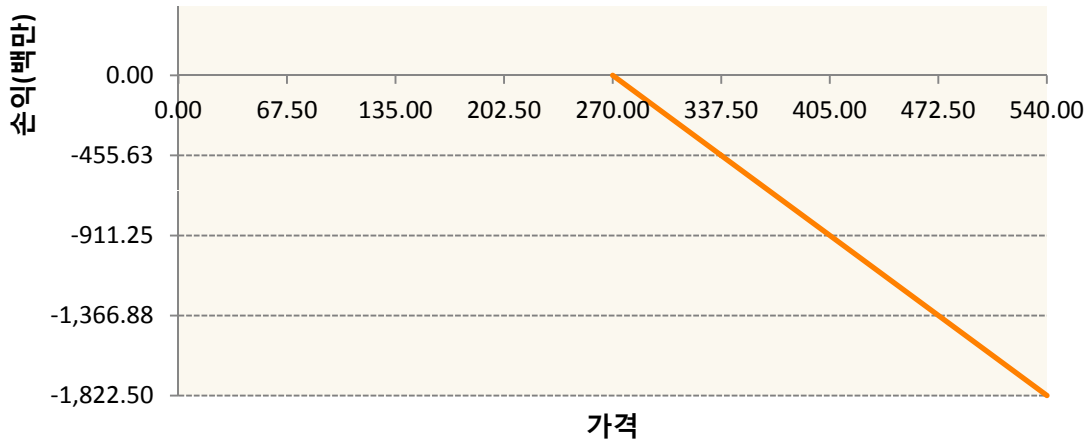
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

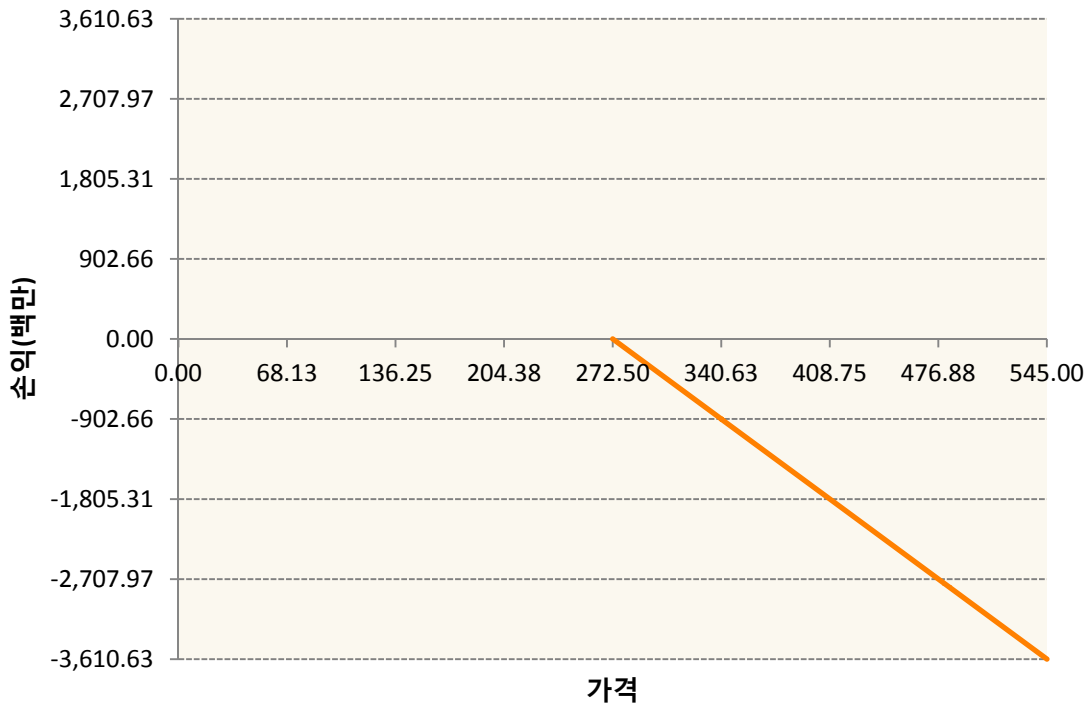


KR4201PA2702-2019-10 콜270

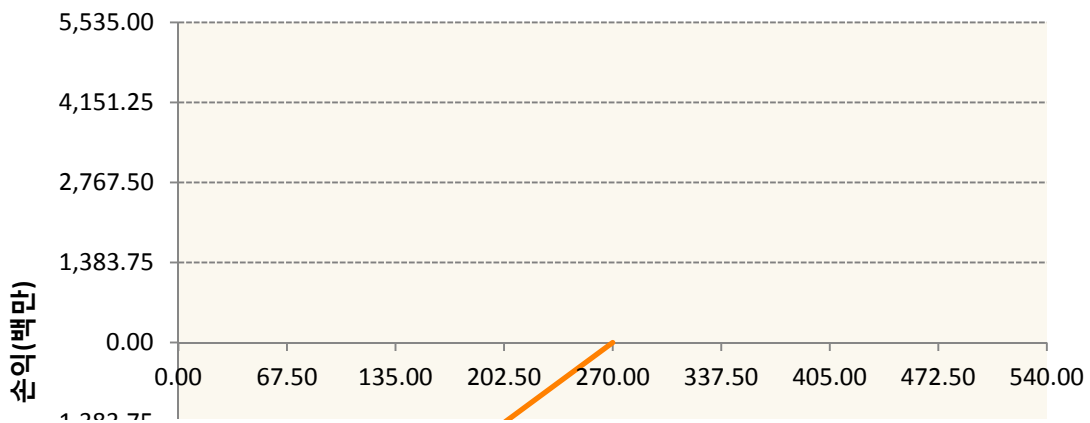




KR4201PA2728-2019-10 콜272.5



KR4301PA2701-2019-10 풋270





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						1,221
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,221	-1,221	-1,221	-1,221	-1,221	-1,221	-1,221	
-5.33%	-814	-814	-814	-814	-814	-814	-814	
-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%	814	814	814	814	814	814	814	
8.00%	1,221	1,221	1,221	1,221	1,221	1,221	1,221	
KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						239
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-239	-239	-239	-239	-239	-239	-239	
-5.33%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159	
-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%	159	159	159	159	159	159	159	
8.00%	239	239	239	239	239	239	239	
KR4201PA2702		2019-10 콜270						119
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	40	40	39	38	37	36	35	
-5.33%	38	36	35	33	31	29	27	
-2.67%	29	27	24	21	19	16	13	
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9	
2.67%	-24	-27	-29	-32	-34	-37	-39	
5.33%	-67	-68	-70	-71	-73	-75	-77	
8.00%	-115	-115	-115	-116	-117	-118	-119	
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5						221
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	63	62	62	61	59	58	56
-5.33%	60	58	56	53	50	47	44
-2.67%	49	44	40	35	30	25	20
0%	18	12	6	0	-6	-12	-18
2.67%	-39	-45	-50	-55	-61	-66	-72
5.33%	-118	-121	-125	-128	-132	-137	-141
8.00%	-209	-210	-211	-213	-216	-218	-221
KR4301PA2701                      2019-10 풋270							368
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-366	-366	-367	-367	-367	-367	-368
-5.33%	-219	-219	-220	-221	-222	-224	-226
-2.67%	-80	-83	-87	-90	-95	-99	-103
0%	16	11	5	0	-5	-11	-16
2.67%	49	46	44	41	37	34	30
5.33%	53	53	52	51	50	49	48
8.00%	53	53	53	53	53	53	52

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

(단위:백만원)

**2,196**

공시일	2019-09-30
기준일	2019-09-27

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

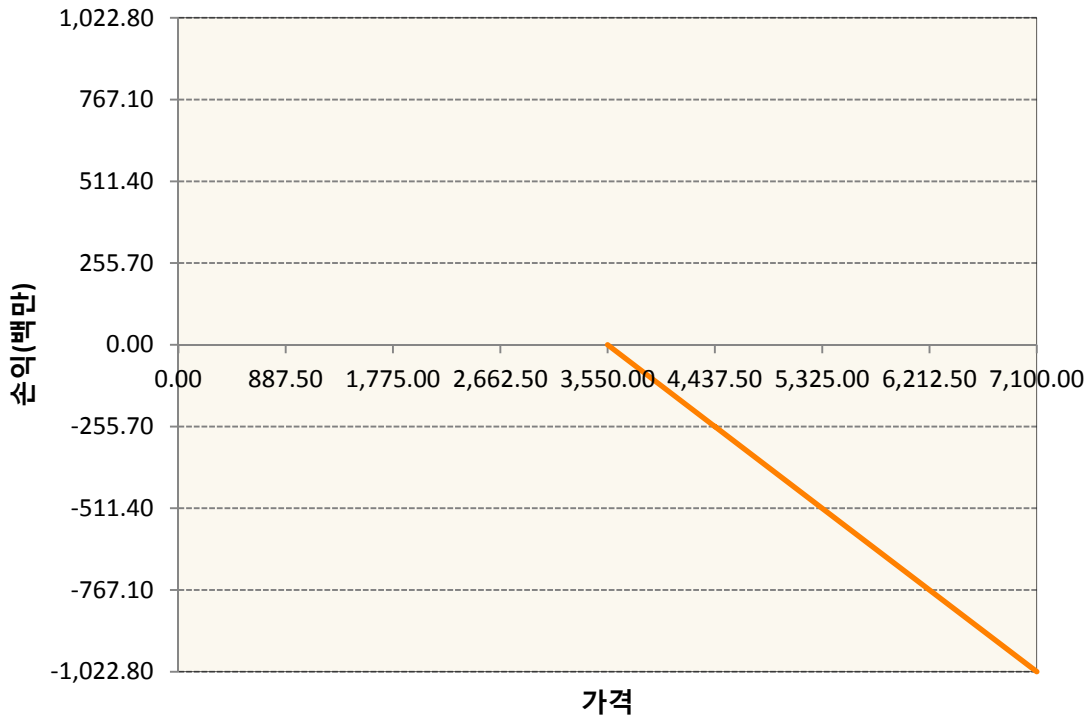
### 1. 계약금액

(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	4,344	0	4,344	
누계	유가증권	스왑	23,830	0	23,830	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,593	-14,593	장내
누계	통화	선도	0	6,155	-6,155	장외

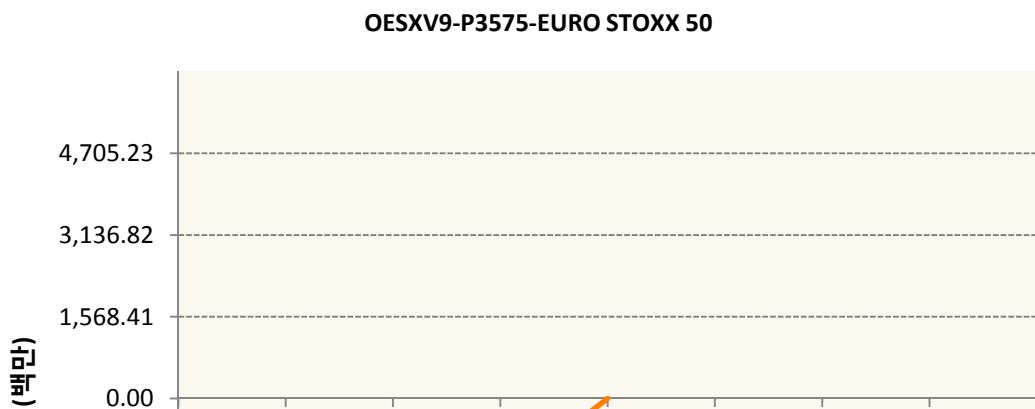
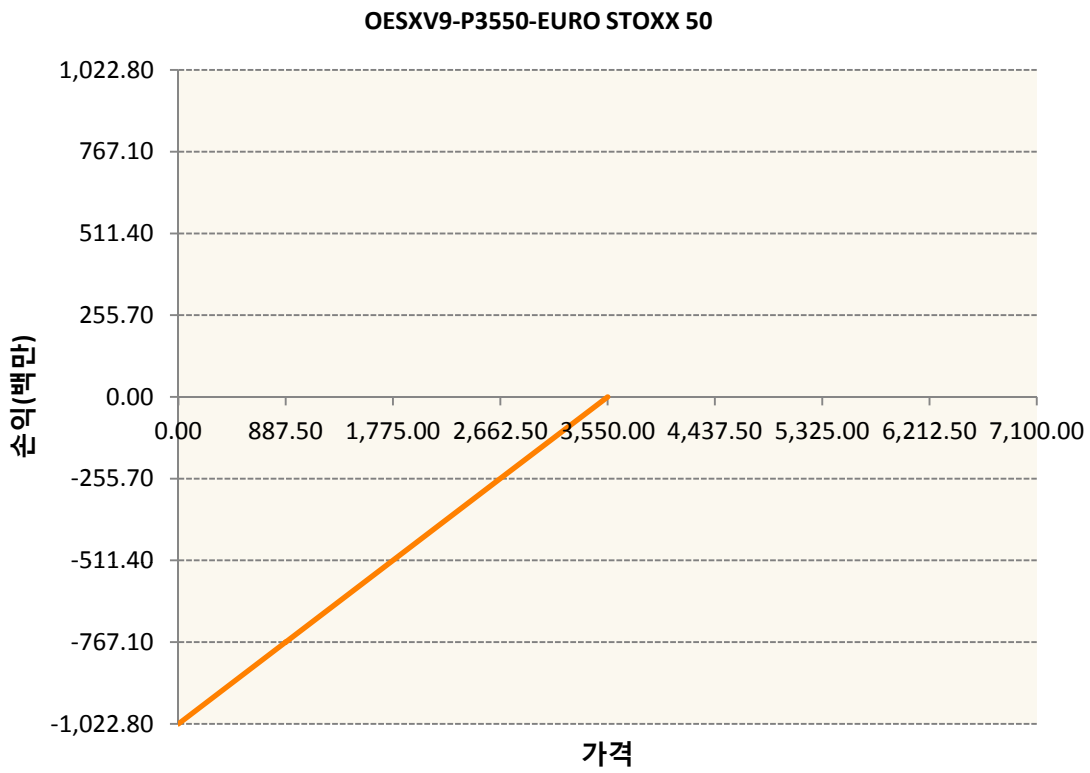
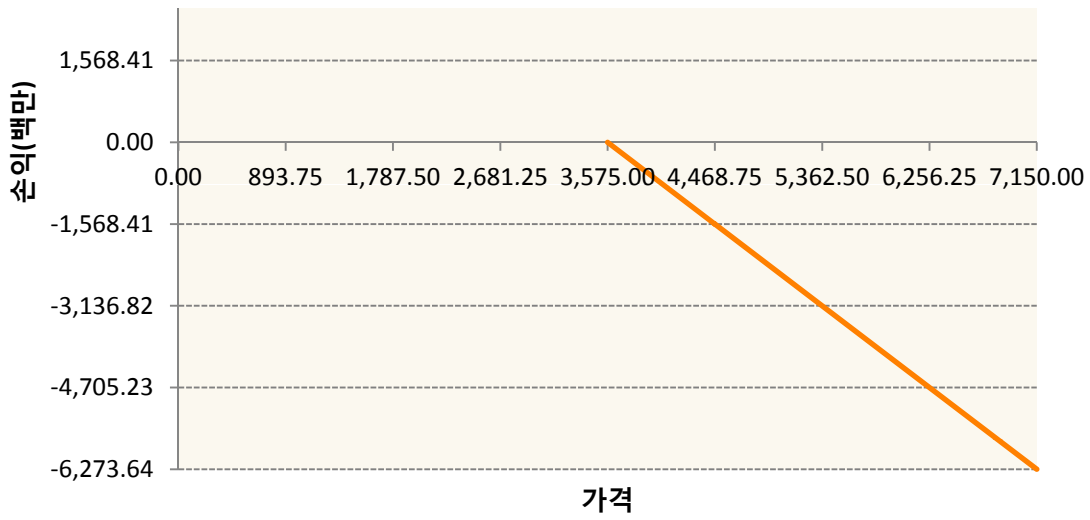
### 2. 만기시점의 손익구조

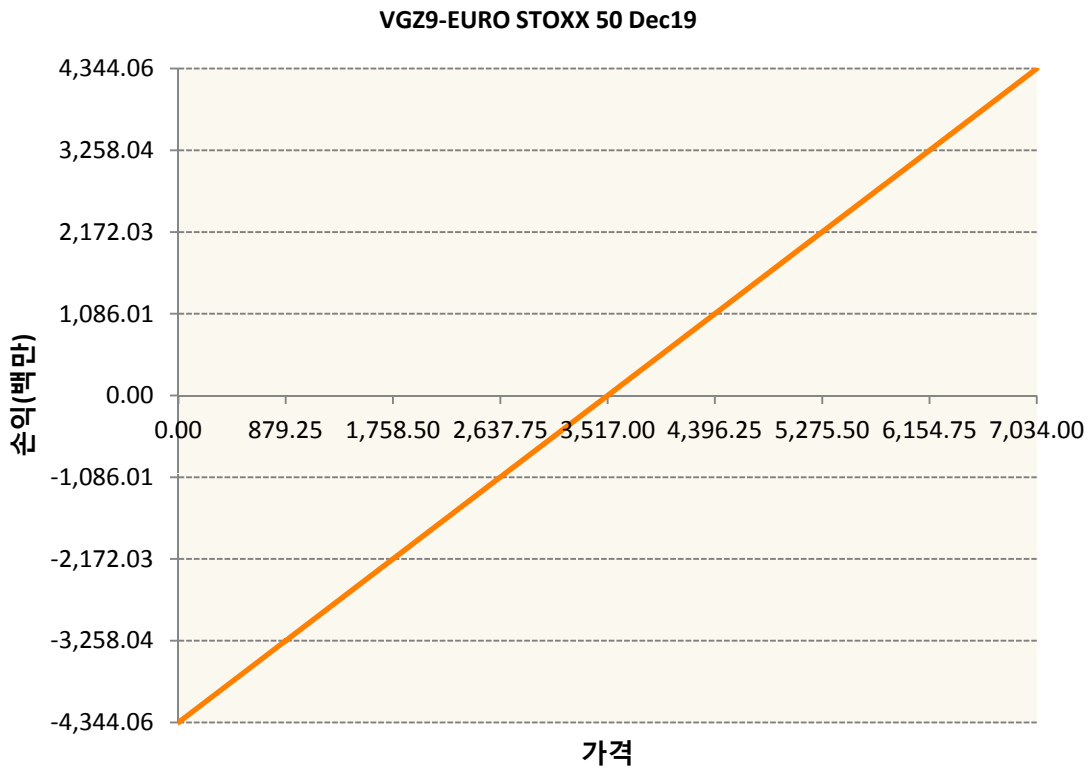
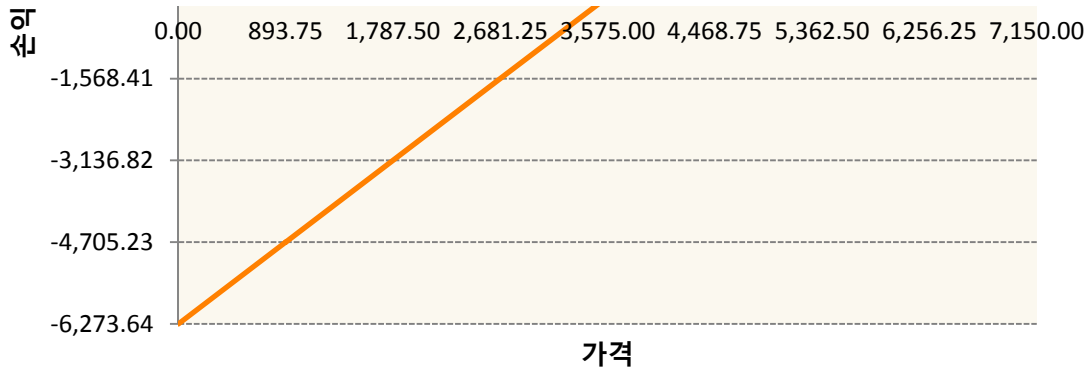
**OESXV9-C3550-EURO STOXX 50**



**OESXV9-C3575-EURO STOXX 50**







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		37
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E		492
OESXV9-C35 EURO STOXX 50		82
OESXV9-C35 EURO STOXX 50		502
OESXV9-P35 EURO STOXX 50		82
OESXV9-P35 EURO STOXX 50		502
VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	348

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





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

(단위:백만원)

984

공시일	2019-09-30
기준일	2019-09-27

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

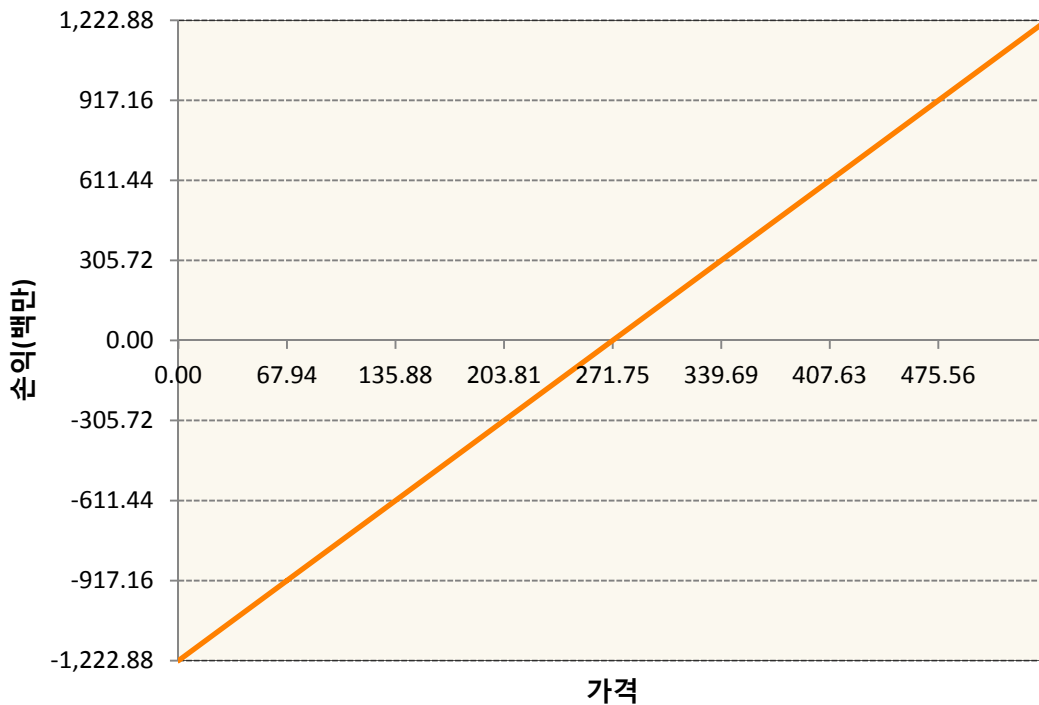
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,223	0	1,223	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						98
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98	
-5.33%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65	
-2.67%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	33	33	33	33	33	33	33	
5.33%	65	65	65	65	65	65	65	
8.00%	98	98	98	98	98	98	98	

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

(단위:백만원)

84



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

(단위:백만원)

131

공시일	2019-09-30
기준일	2019-09-27

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

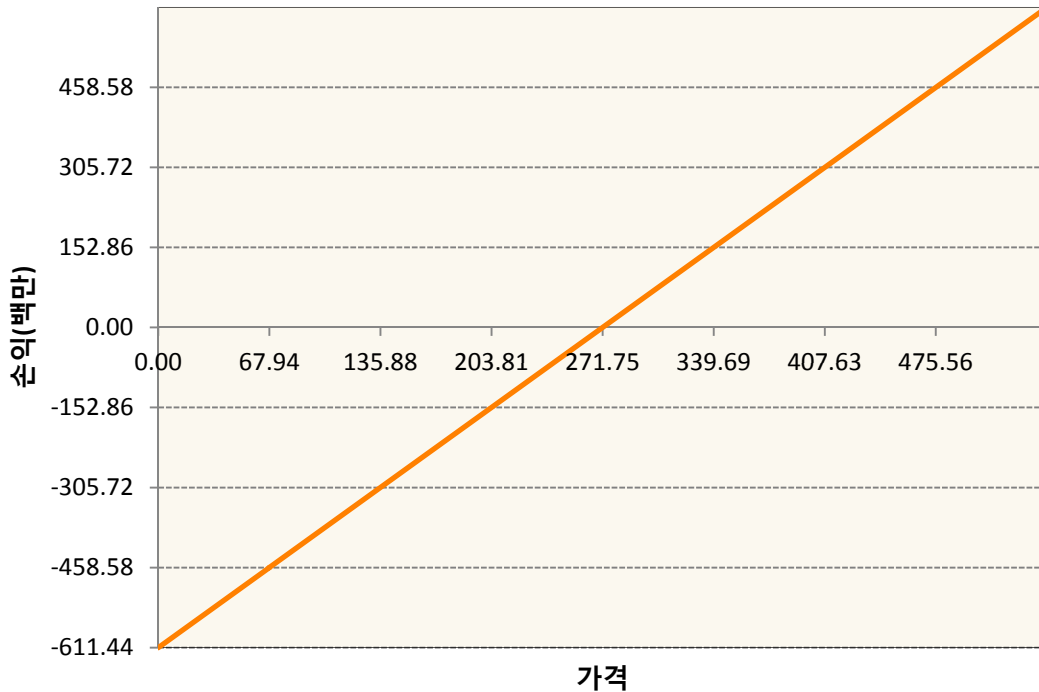
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	611	0	611	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)

42

공시일	2019-09-30
기준일	2019-09-27

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

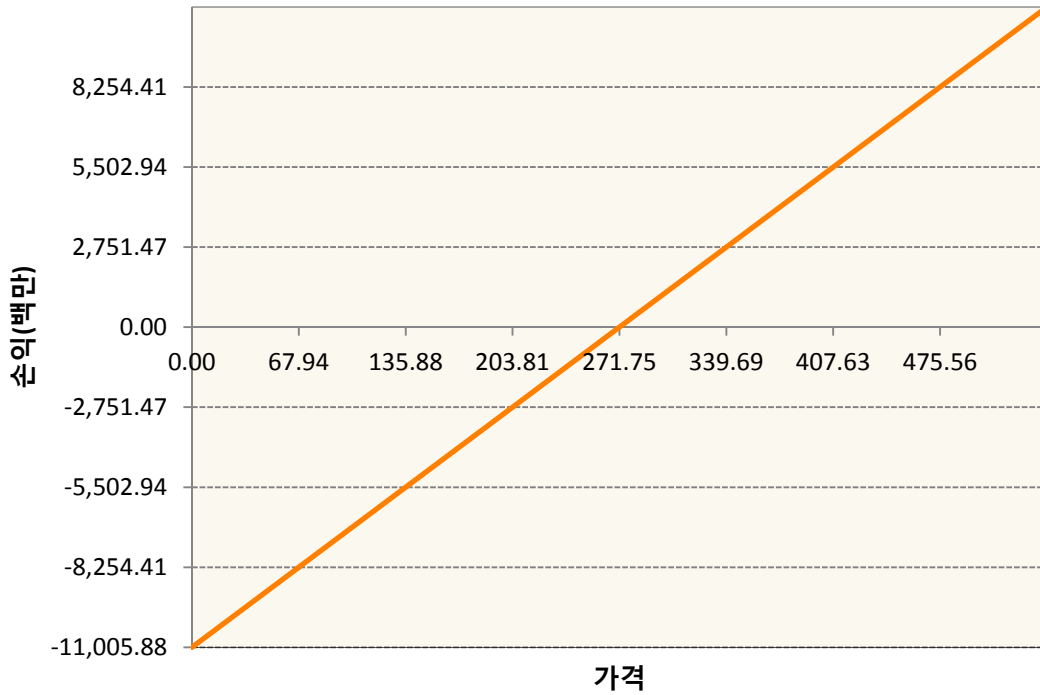
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

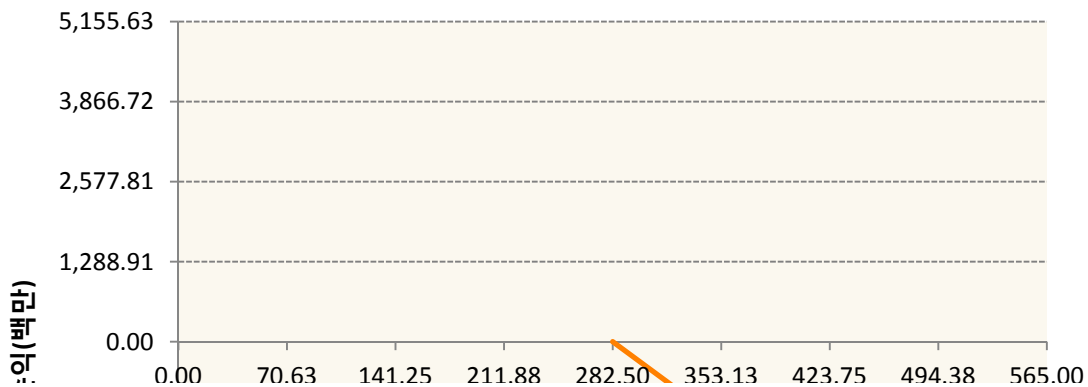
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,006	0	11,006	장내
누계	유가증권	옵션	1,422	20,759	-19,338	장내

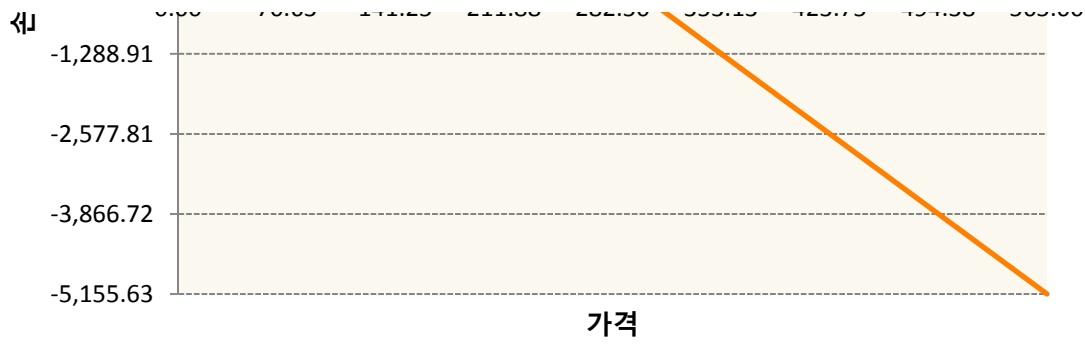
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

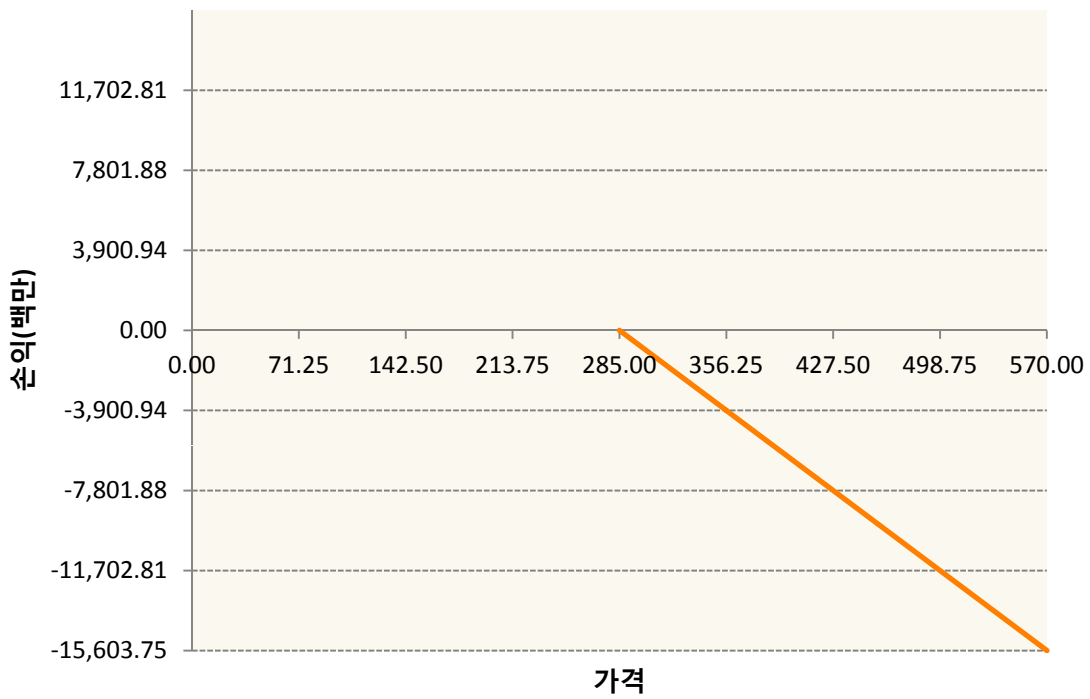


KR4201PA2827-2019-10 콜282.5

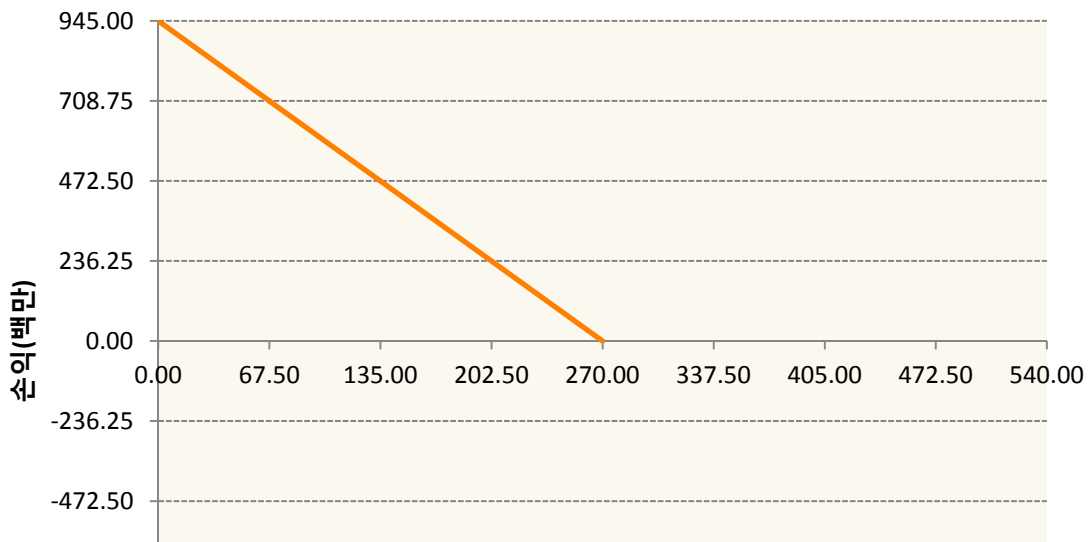


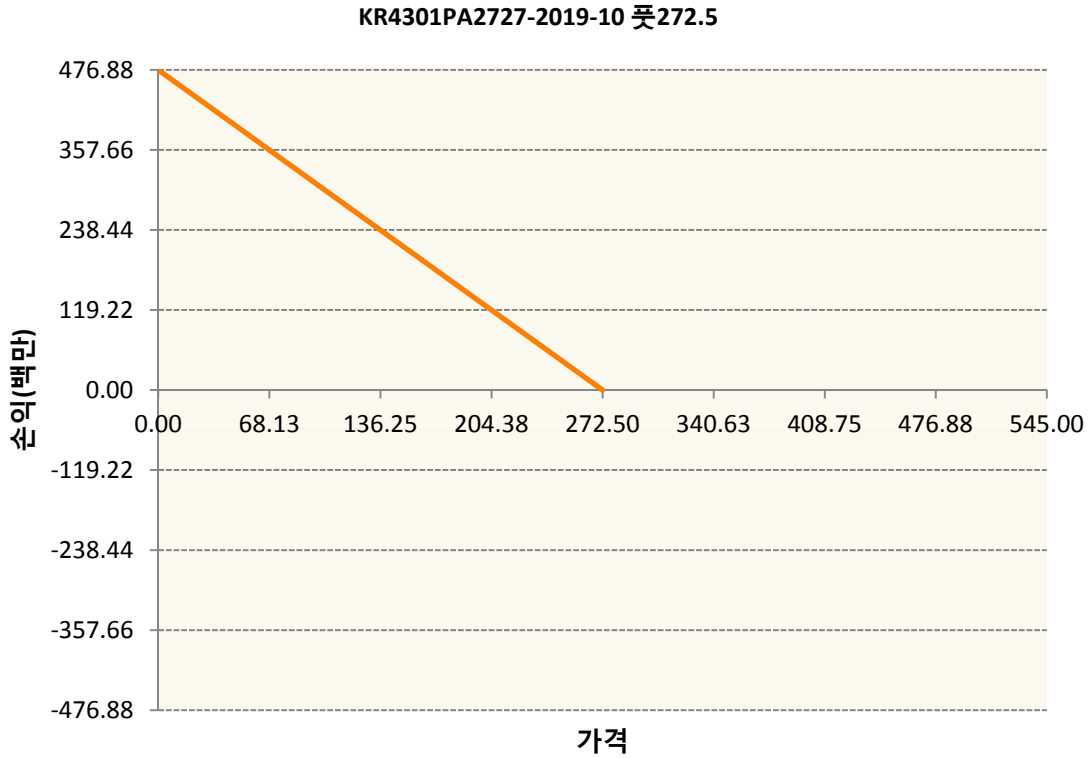
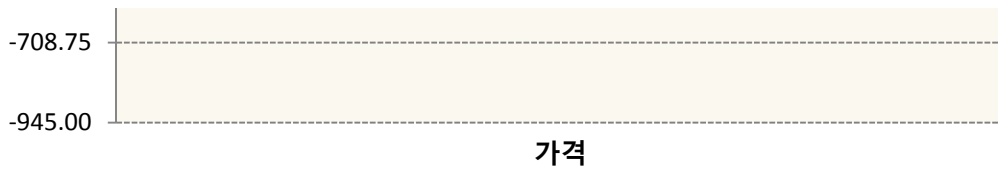


**KR4201PA2850-2019-10 콜285**



**KR4301PA2701-2019-10 풋270**





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

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						879
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-879	-879	-879	-879	-879	-879	-879	
-5.33%	-586	-586	-586	-586	-586	-586	-586	
-2.67%	-293	-293	-293	-293	-293	-293	-293	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	293	293	293	293	293	293	293	
5.33%	586	586	586	586	586	586	586	
8.00%	879	879	879	879	879	879	879	
KR4201PA2827		2019-10 콜282.5						217
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	29	29	29	29	28	27	26	
-5.33%	29	28	28	26	25	23	21	
-2.67%	27	25	22	19	16	12	8	

0%	16	11	6	0	-6	-12	-19
2.67%	-16	-24	-32	-40	-48	-56	-64
5.33%	-80	-89	-97	-105	-114	-122	-130
8.00%	-178	-184	-190	-196	-203	-210	-217
KR4201PA2850                      2019-10 콜285							582
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	63	63	63	62	61	60	58
-5.33%	63	62	61	58	55	51	46
-2.67%	59	55	50	43	35	25	14
0%	39	28	15	0	-16	-33	-51
2.67%	-30	-51	-73	-96	-119	-142	-166
5.33%	-188	-214	-239	-265	-291	-317	-342
8.00%	-449	-470	-491	-513	-536	-559	-582
KR4301PA2701                      2019-10 풋270							63
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	63	63	63	63	63	63	63
-5.33%	37	37	38	38	38	38	39
-2.67%	14	14	15	15	16	17	18
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-8	-8	-7	-7	-6	-6	-5
5.33%	-9	-9	-9	-9	-9	-8	-8
8.00%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
KR4301PA2727                      2019-10 풋272.5							33
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	33	33	33	33	33	33	33
-5.33%	21	21	21	21	21	21	21
-2.67%	8	9	9	9	9	10	10
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-6	-6	-5	-5	-4	-4	-4
5.33%	-7	-7	-7	-6	-6	-6	-6
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7

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

(단위:백만원)

**1,444**

공시일	2019-09-30
기준일	2019-09-27

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,600	0	3,600	
누계	유가증권	수익증권	114,165	0	114,165	

### 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	2019-09-30
기준일	2019-09-27

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	5,999	0	5,999	
누계	유가증권	수익증권	148,163	0	148,163	

### 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	2019-09-30
기준일	2019-09-27

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	8,009	-8,009	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	414,224	0	414,224	
누계	통화	선도	9,599	423,685	-414,085	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,936
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,552
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E	960
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E	960
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	1,382
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E	2,054
FX21019U01 KRW/USD 10-10-19E	288
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E	192
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E	2,342
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E	1,728
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E	192
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E	960
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E	1,478
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	2,985
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	3,168
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	2,630
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E	1,920
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E	2,016
FX21019U05 USD/KRW 04-10-19E	480
FX21019U05 USD/KRW 04-10-19E	288

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

(단위:백만원)

11,416

공시일	2019-09-30
기준일	2019-09-27

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

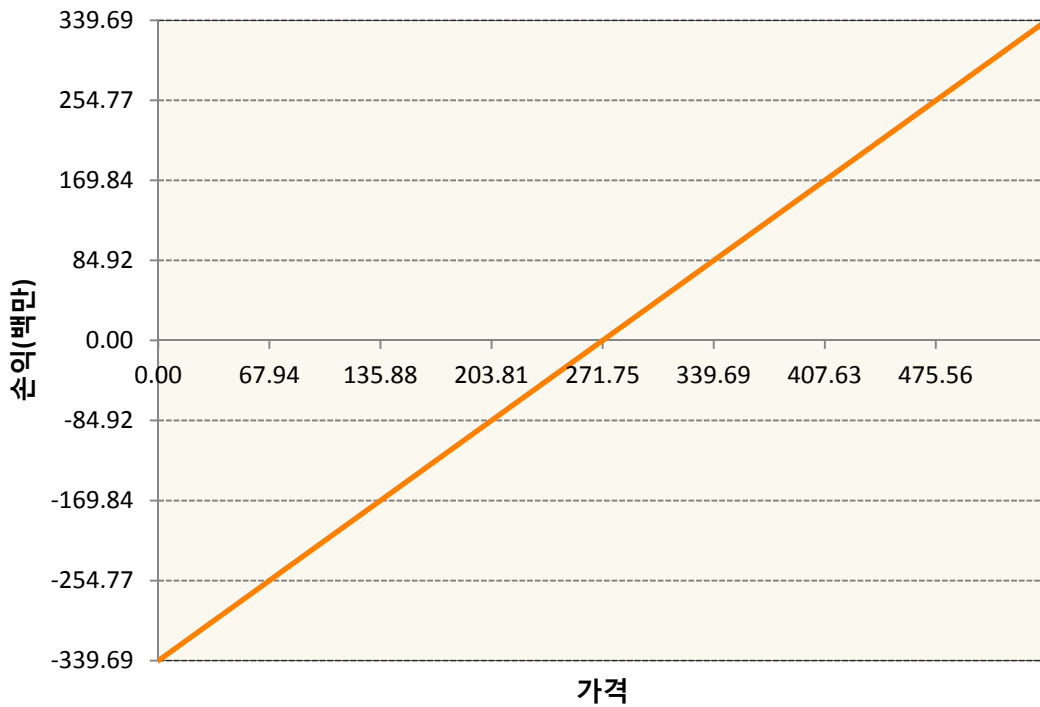
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

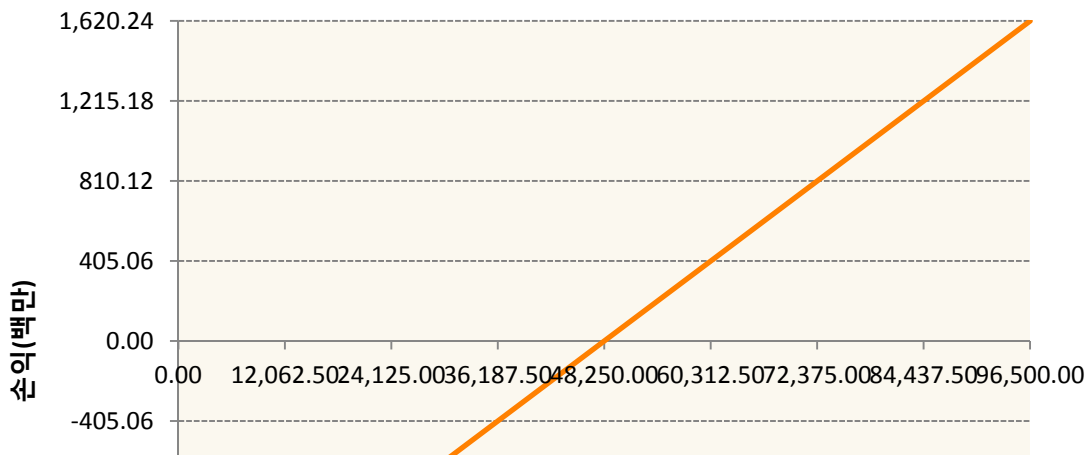
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,960	0	1,960	장내

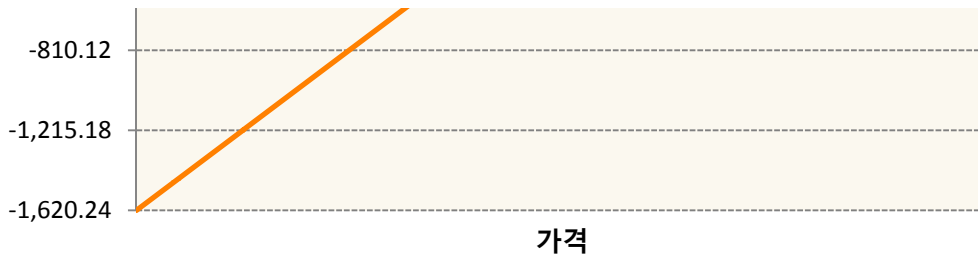
### 2. 만기시점의 손익구조

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						130
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130	
-5.33%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87	
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	43	43	43	43	43	43	43	
5.33%	87	87	87	87	87	87	87	
8.00%	130	130	130	130	130	130	130	

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

**189**

공시일	2019-09-30
기준일	2019-09-27

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

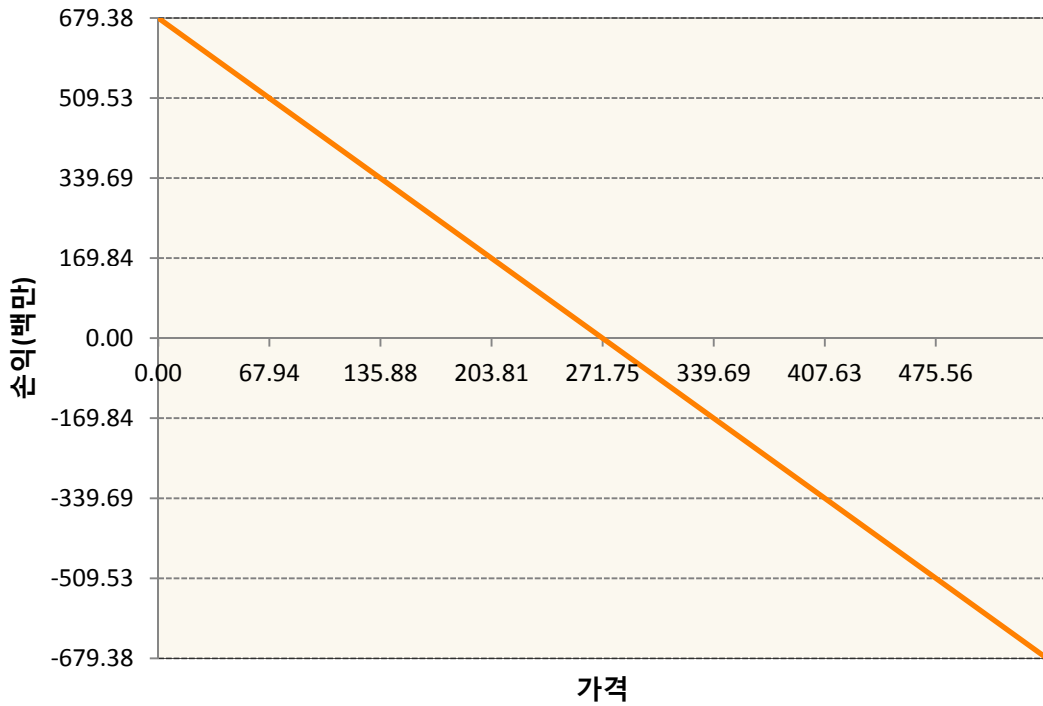
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

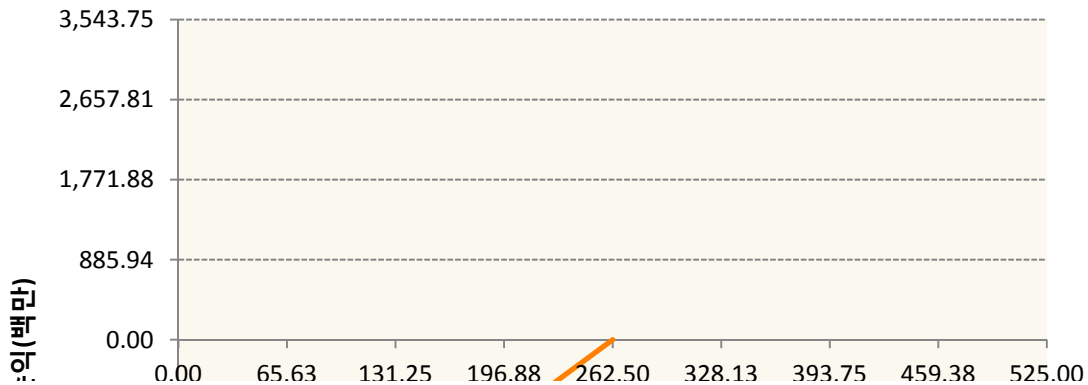
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	679	-679	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,941	-3,941	장내

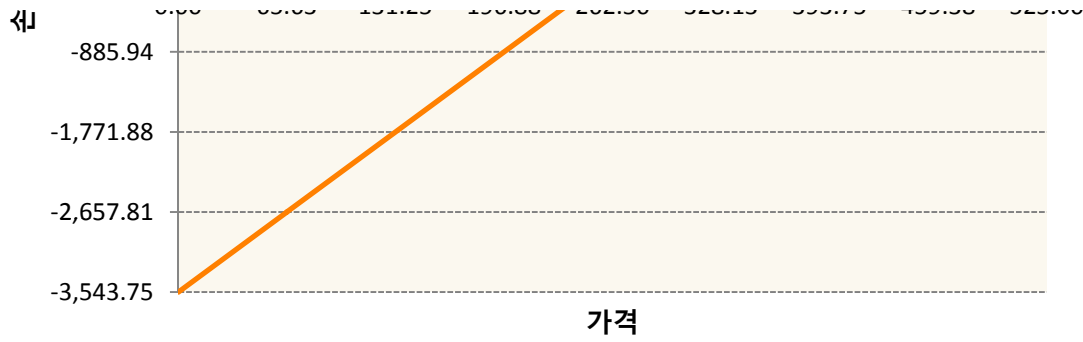
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

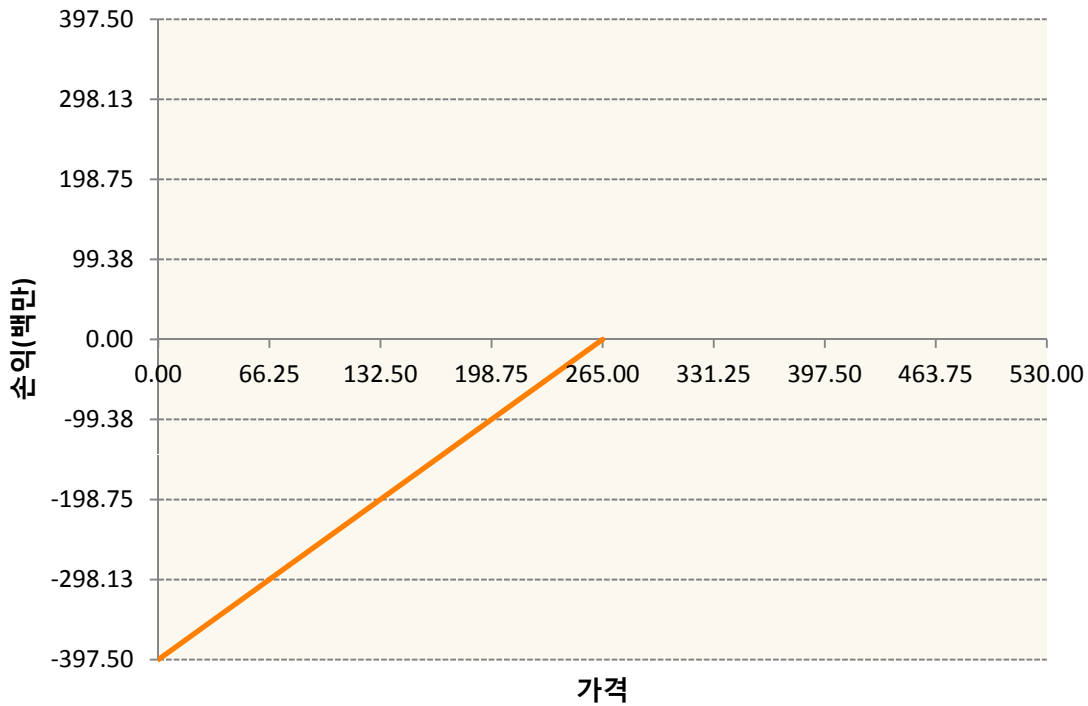


KR4301PA2628-2019-10 풋262.5





KR4301PA2651-2019-10 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						54
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	54	54	54	54	54	54	54	
-5.33%	36	36	36	36	36	36	36	
-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%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	
8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54	
KR4301PA2628		2019-10 풋262.5						173
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-168	-169	-169	-170	-171	-172	-173
-5.33%	-77	-79	-81	-84	-86	-89	-92
-2.67%	-15	-18	-22	-25	-29	-32	-35
0%	5	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	7	7	7	6	6	5	4
5.33%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	7	7	7	7	7	7	7

KR4301PA2651

2019-10 풋265

22

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
-5.33%	-11	-11	-12	-12	-12	-12	-12
-2.67%	-3	-3	-4	-4	-4	-5	-5
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
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

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

(단위:백만원)

203

공시일	2019-09-30
기준일	2019-09-27

## 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	17,853	0	17,853	
누계	통화	선도	240	17,759	-17,519	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
FX21019U05 USD/KRW 18-10-19E		19

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

(단위:백만원)

<b>474</b>
------------

공시일	2019-09-30
기준일	2019-09-27

## 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	377	0	377	장외
누계	통화	선도	117	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)

<b>36</b>
-----------

공시일	2019-09-30
기준일	2019-09-27

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

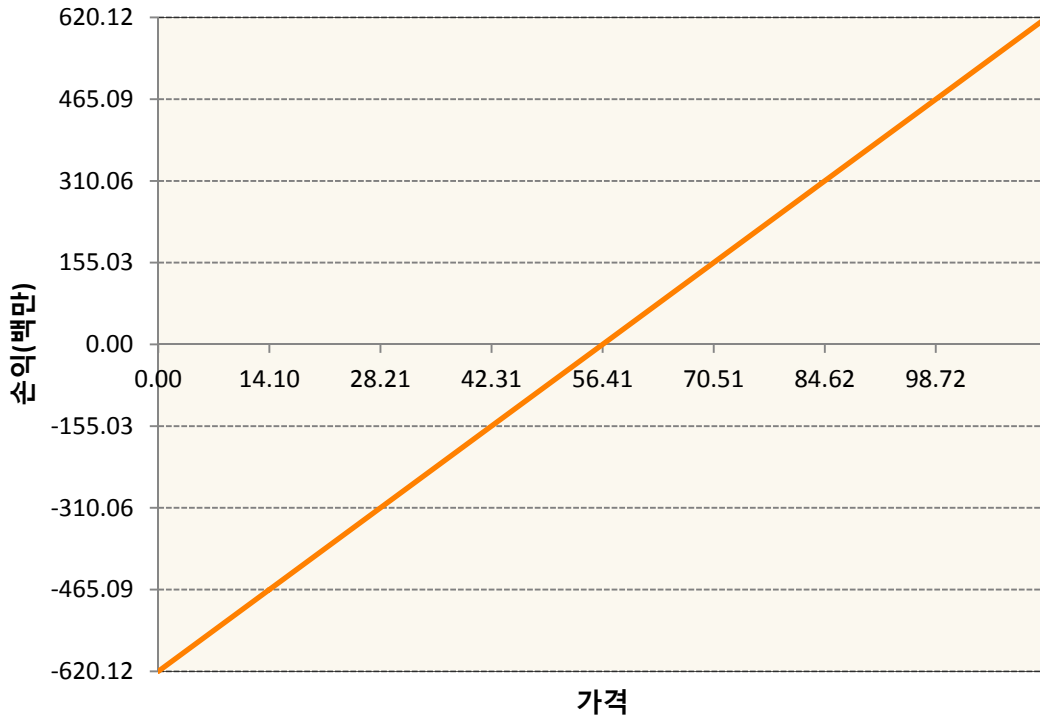
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

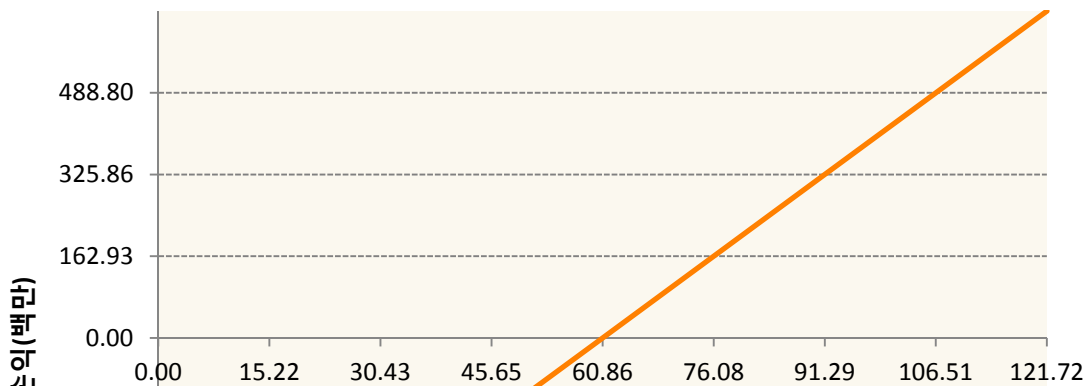
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,362	480	1,883	
누계	유가증권	선물	200	0	200	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19

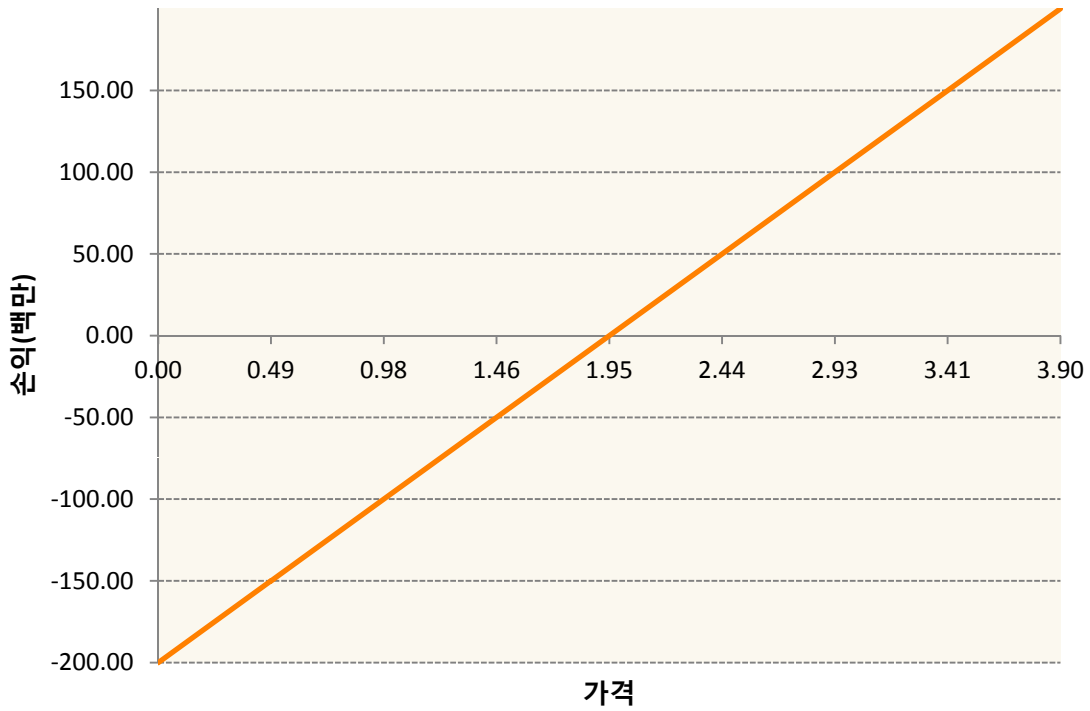


COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20

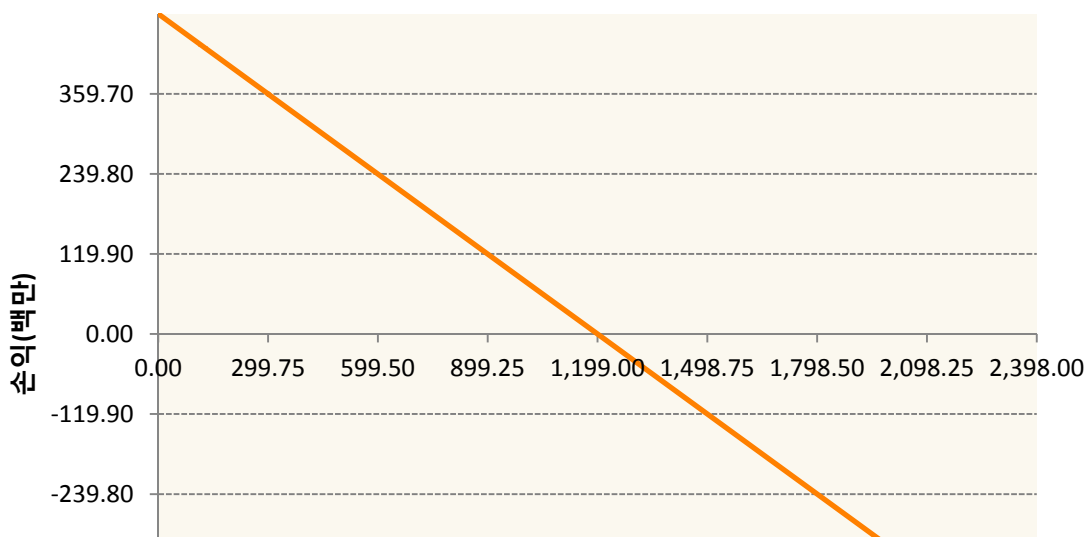


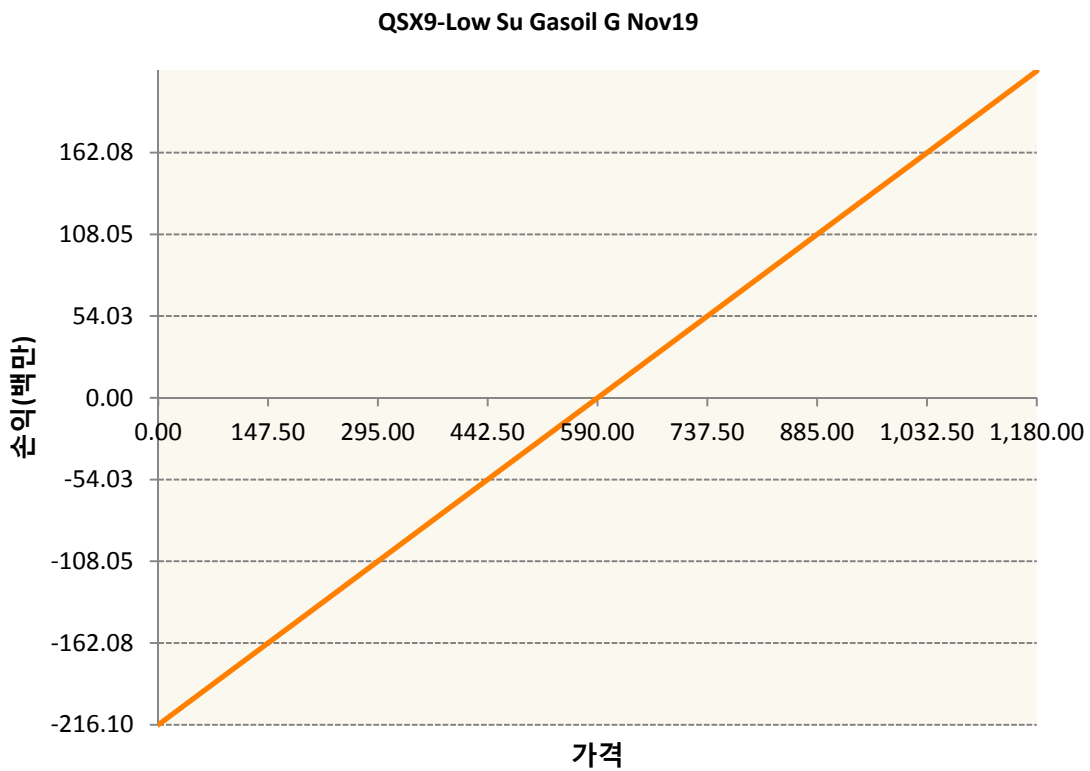
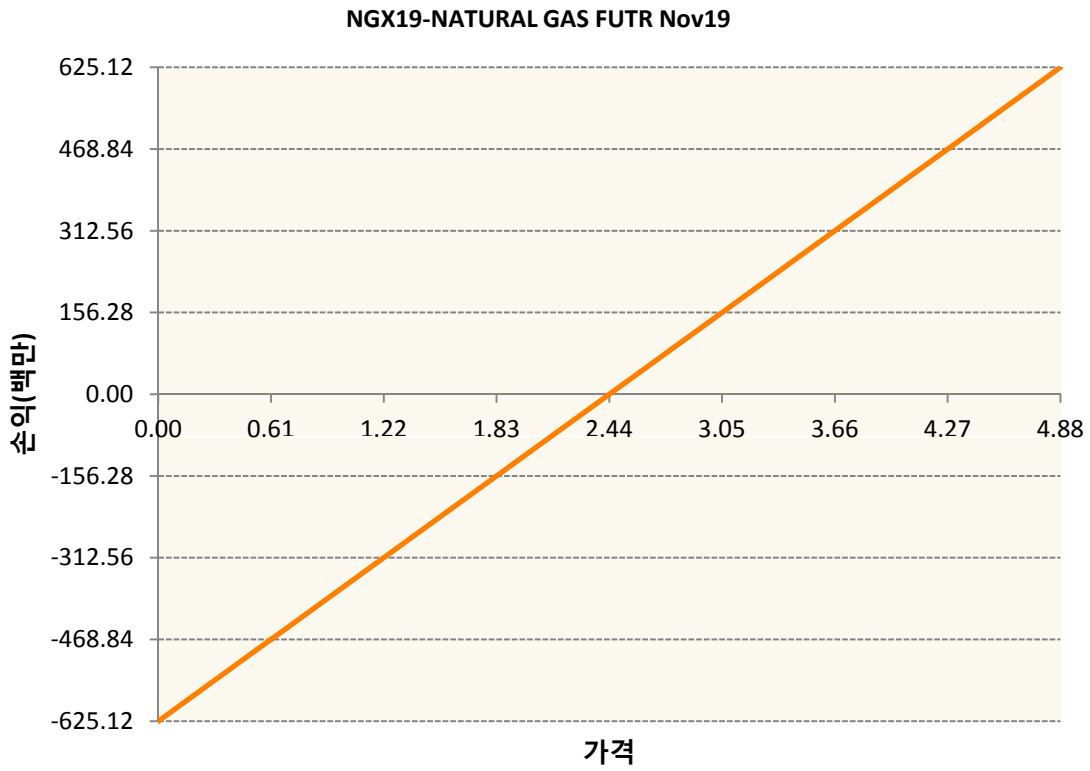
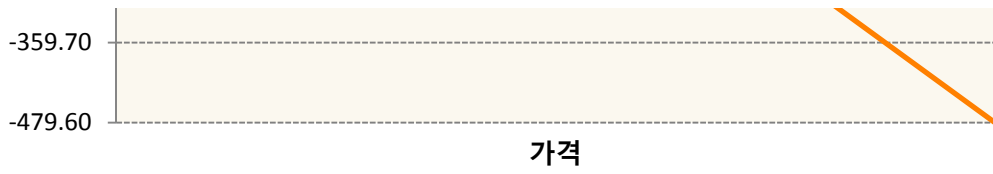


HOX9-Heating Oil

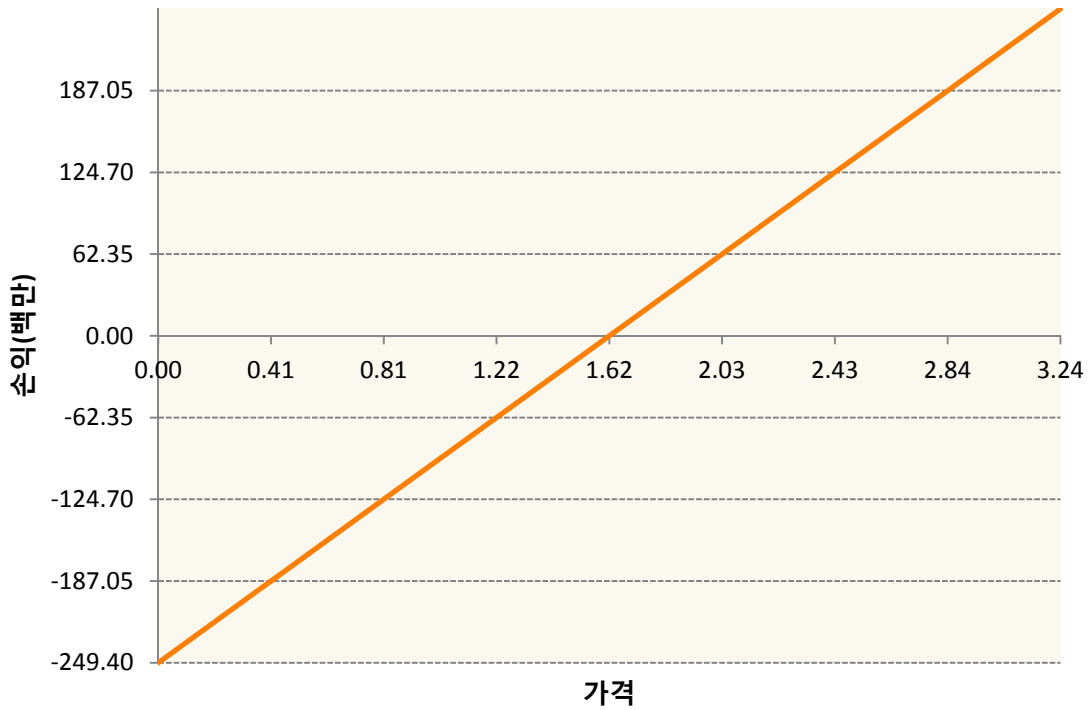


KR4175PA0005-2019-10 달러선물





**XBX9-GASOLINE RBOB FUT 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	50
QSX9	Low Su Gasoil G Nov19	17
XBX9	GASOLINE RBOB FUT Nov19	20

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

(단위:백만원)

**429**

공시일	2019-09-30
기준일	2019-09-27

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

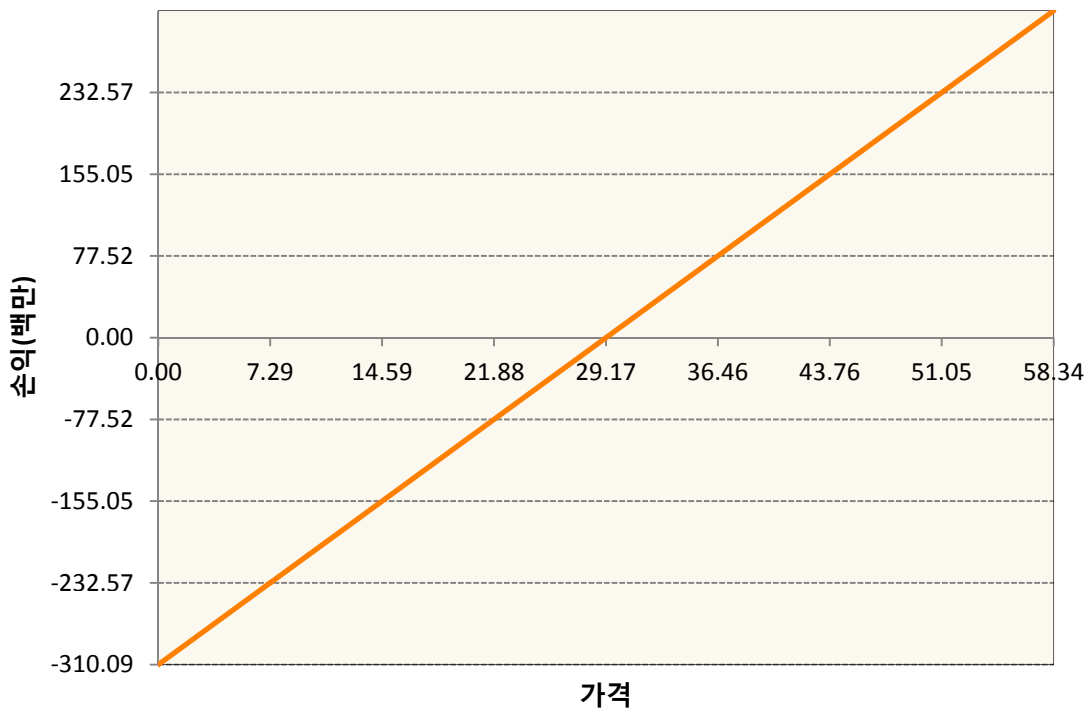
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

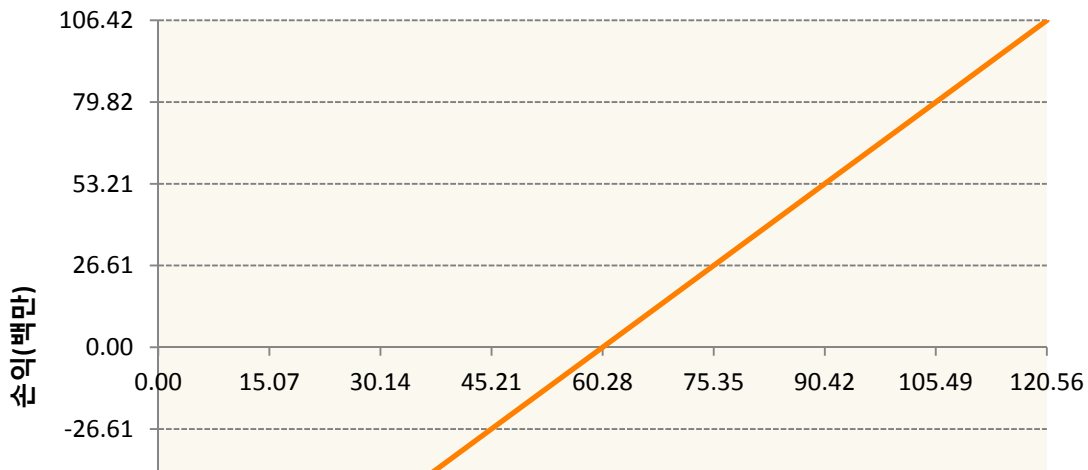
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,770	96	2,674	

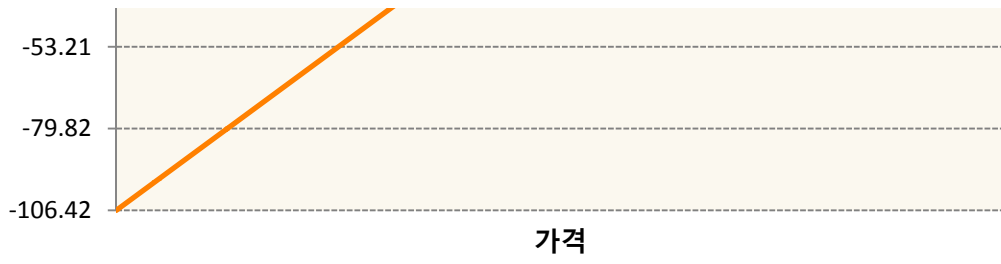
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19**

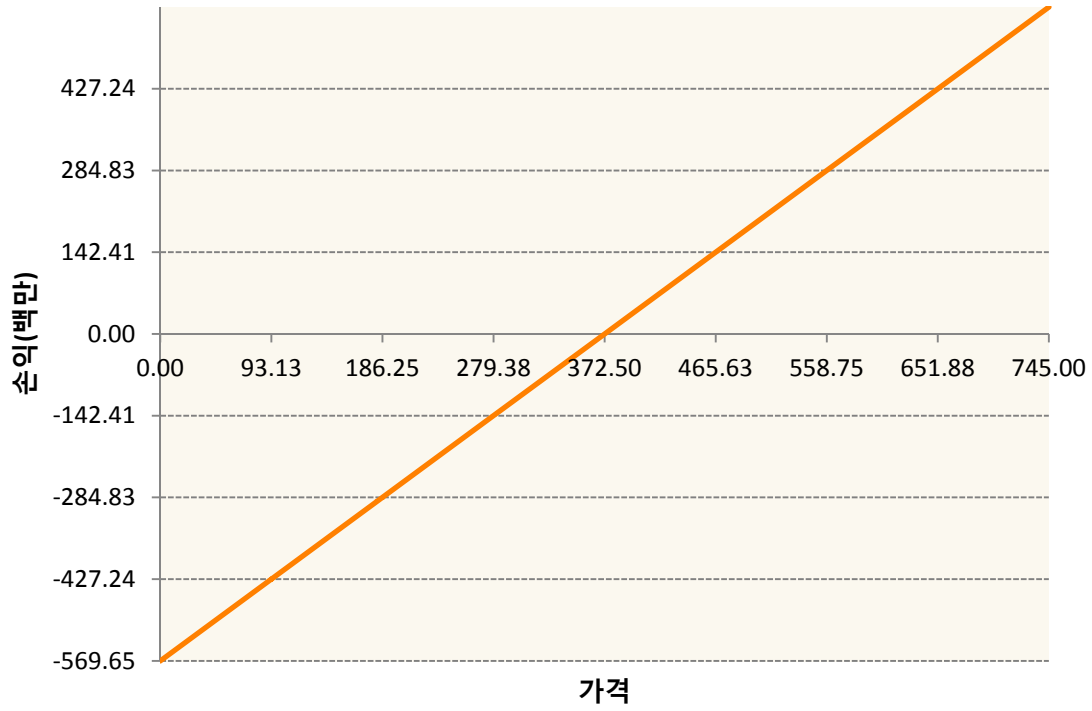


**CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19**

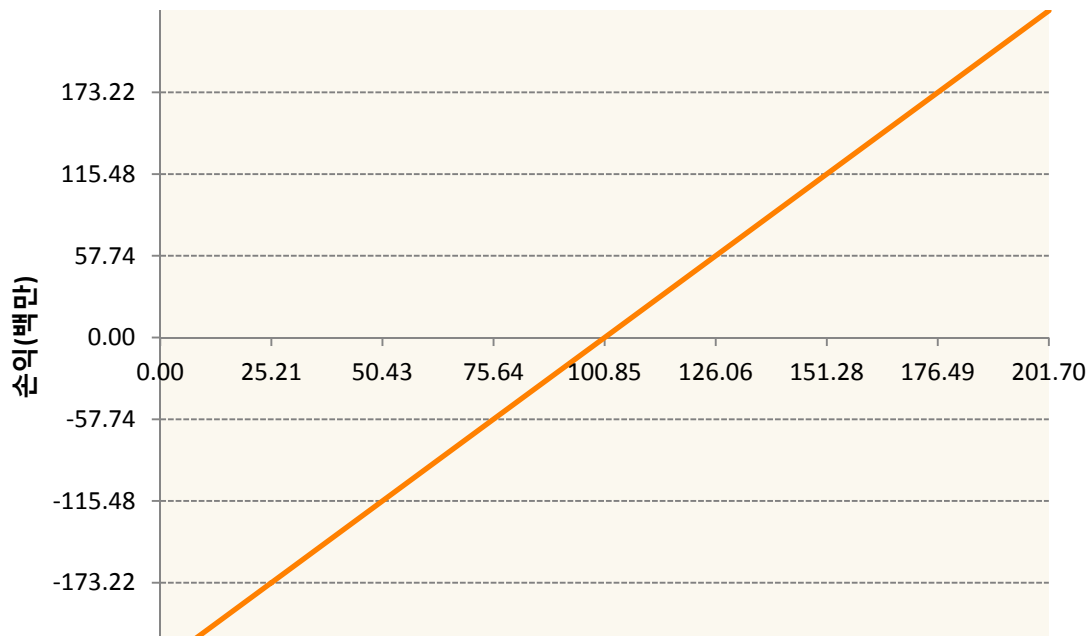


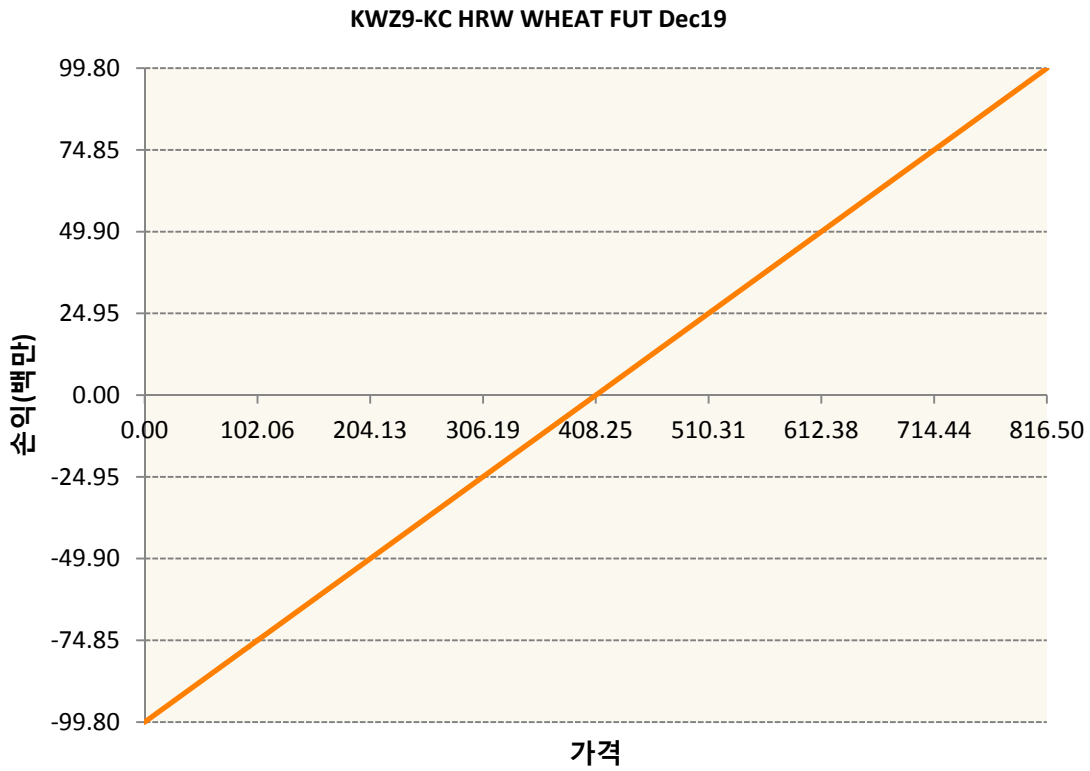
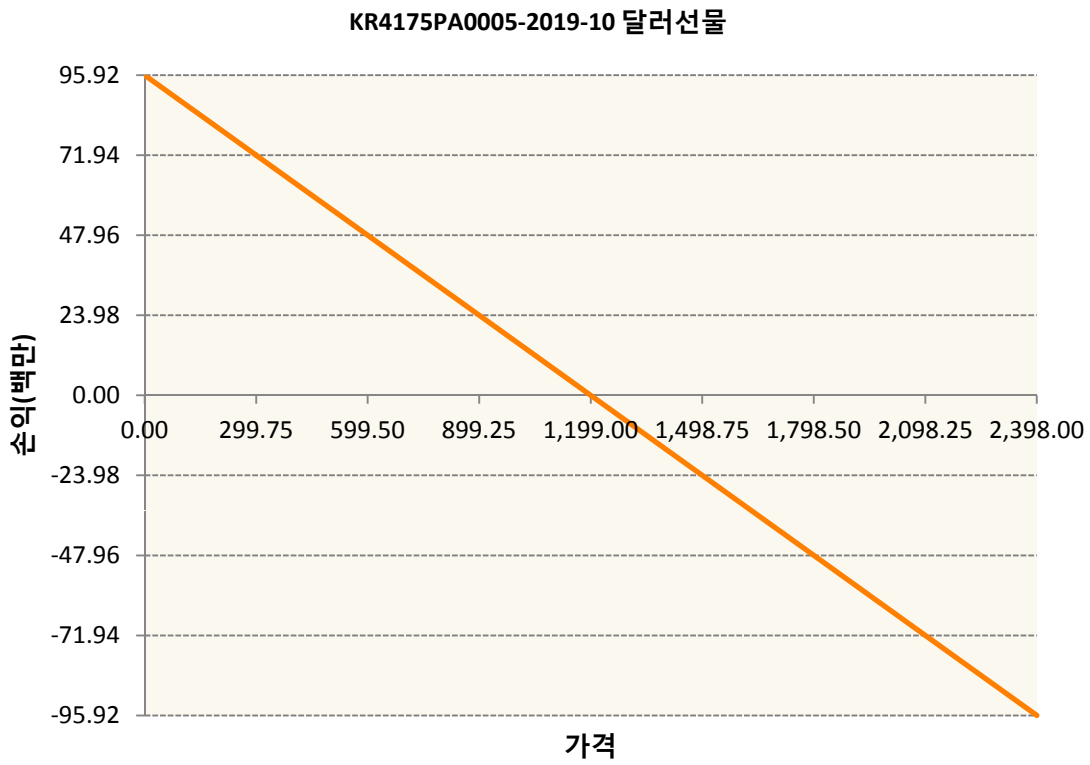
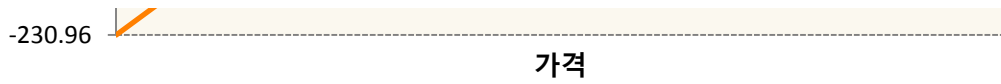


**CZ9-CORN FUTURE Dec19**

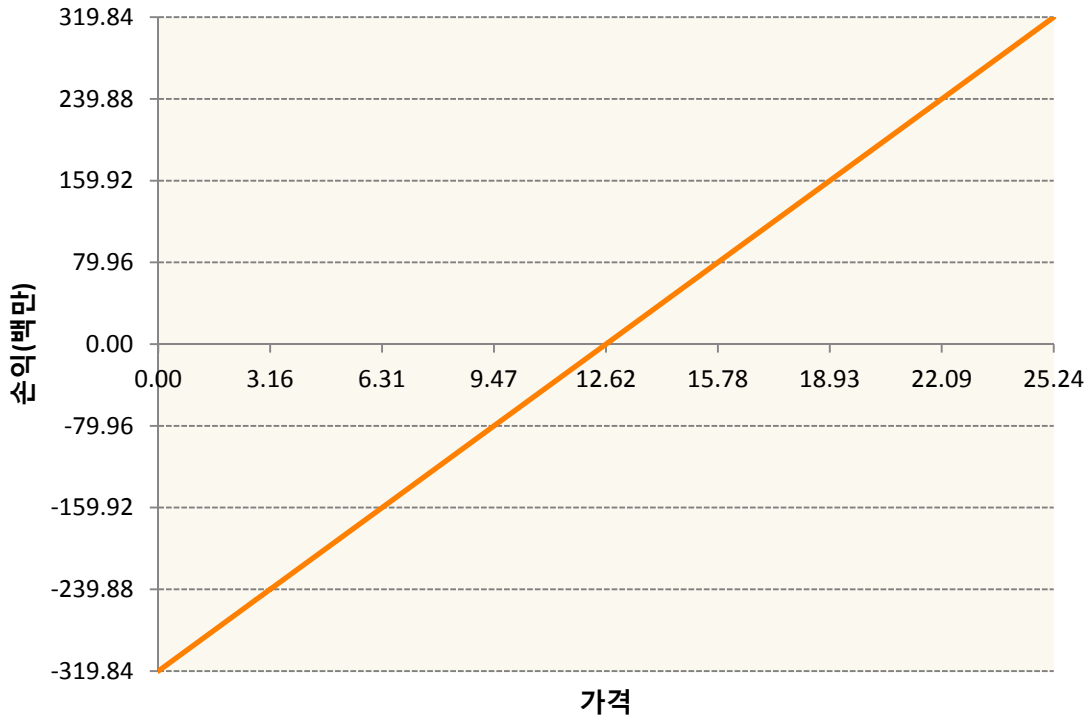


**KCZ9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19**

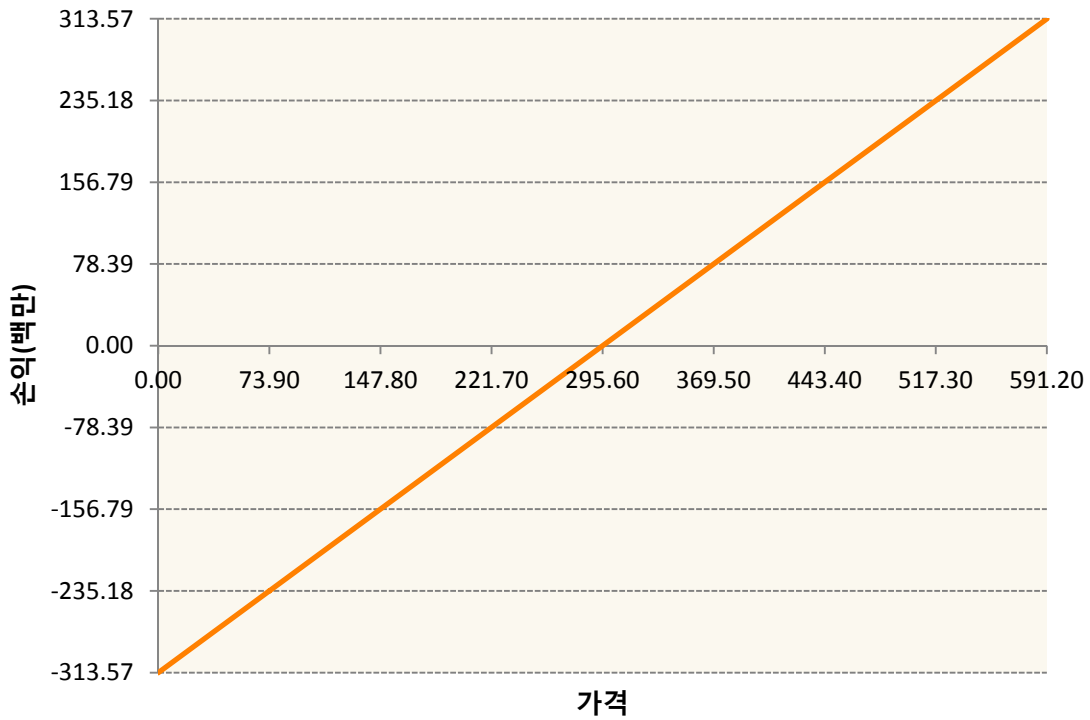




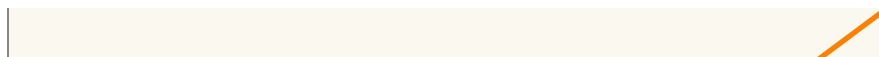
SBH0-Sugar Mar20

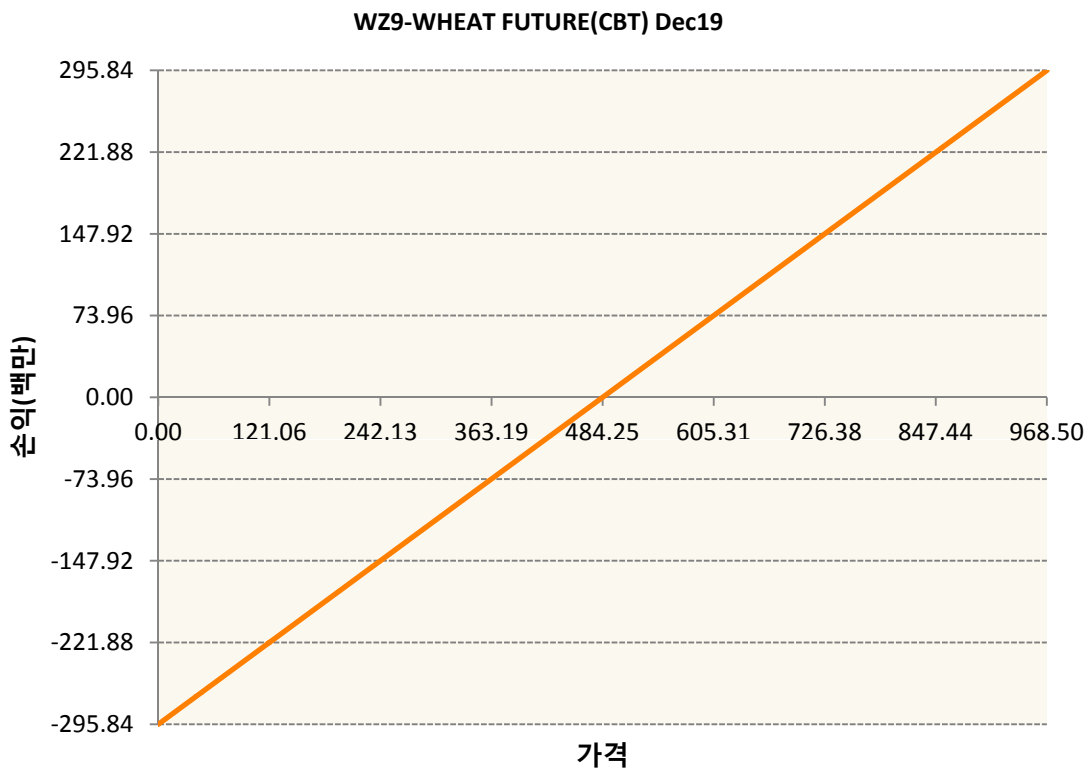
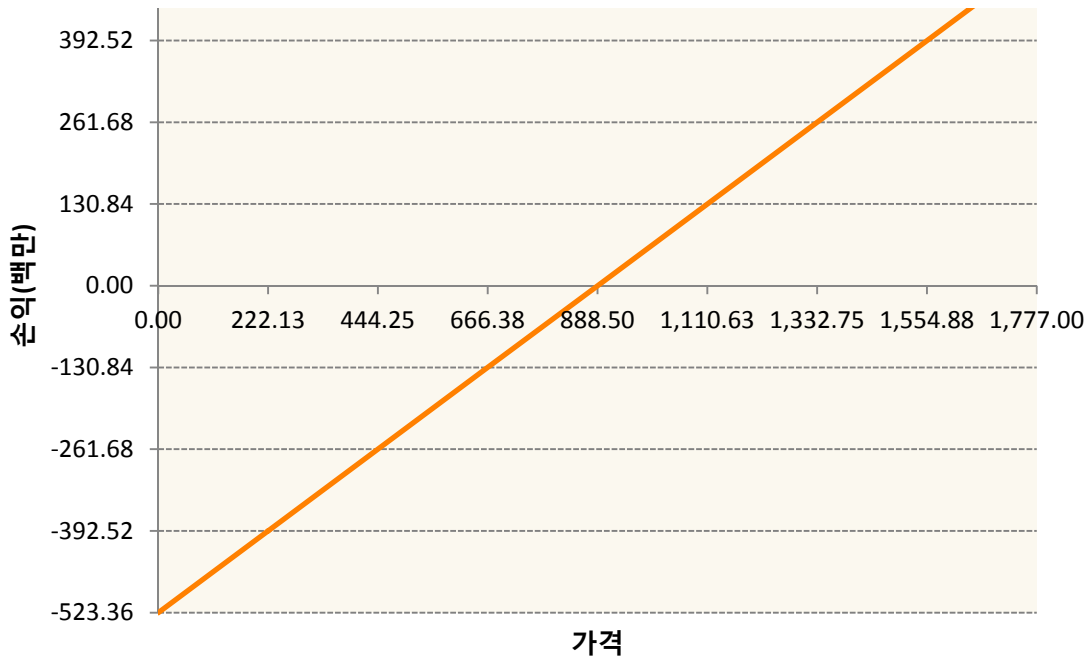


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



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	26
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**