

공시일	2019-10-04
기준일	2019-10-02

## 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	2019-10-04
기준일	2019-10-02

## 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

1,161

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

664

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-10-04
기준일	2019-10-02

## 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)

373

SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)

137

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

**811**

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-10-04
기준일	2019-10-02

## 유로인덱스모(주식-파생형)

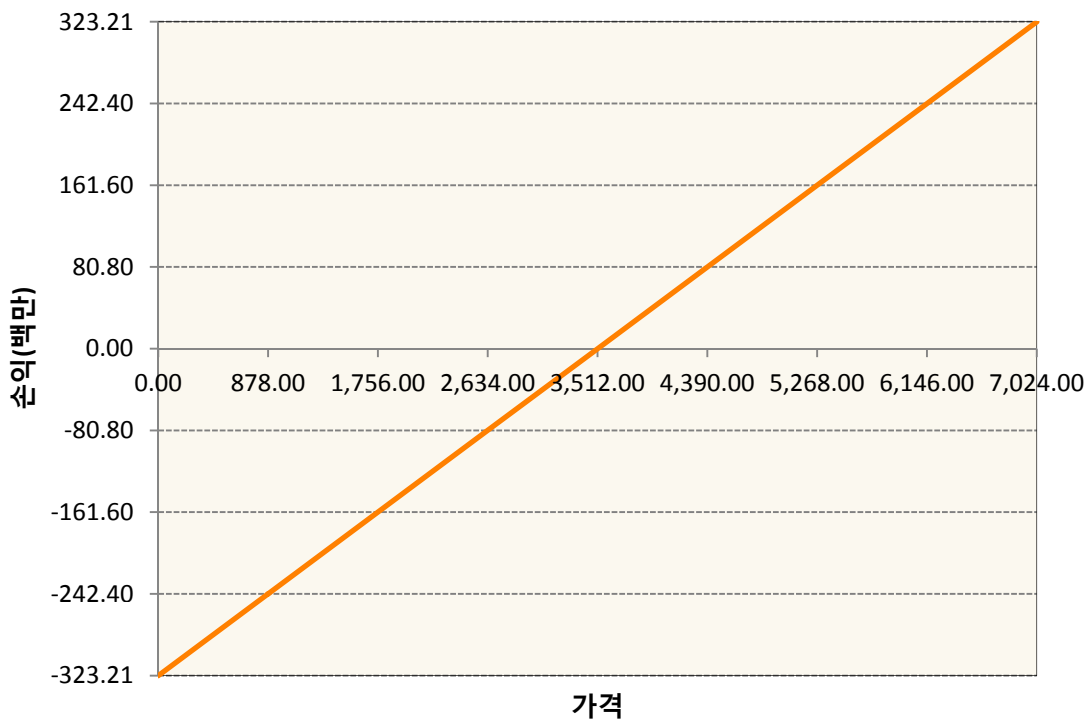
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	323	0	323	

### 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	2019-10-04
기준일	2019-10-02

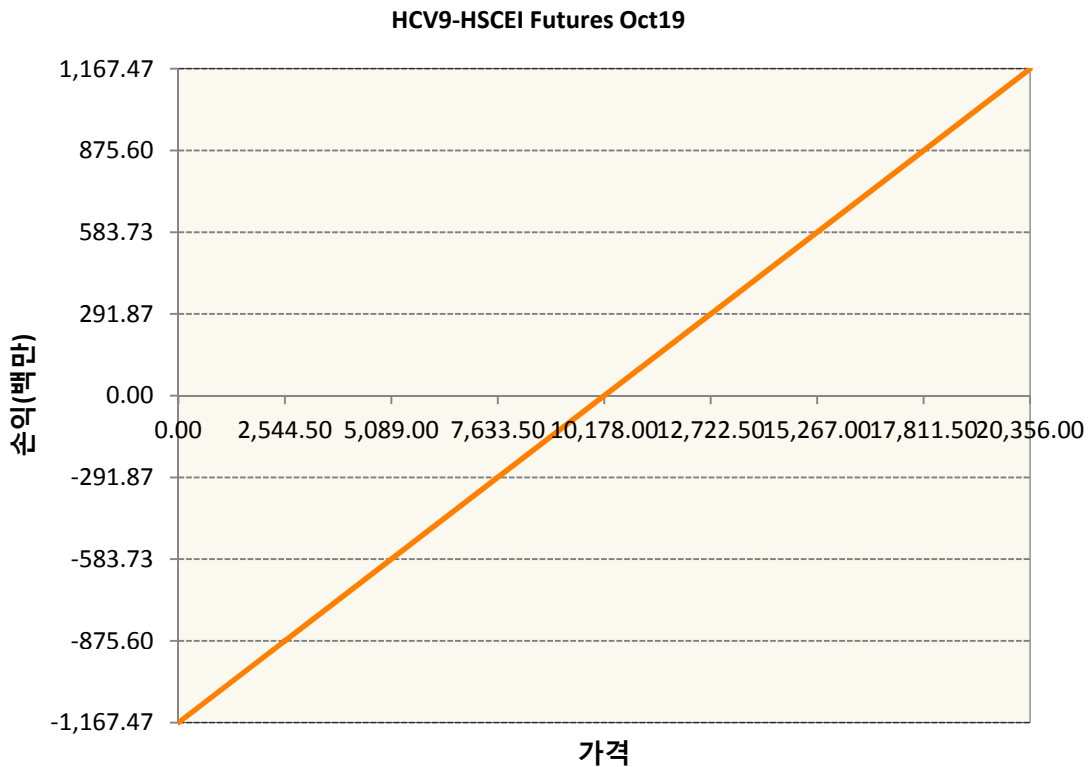
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,167	0	1,167	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

85
----

공시일	2019-10-04
기준일	2019-10-02

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

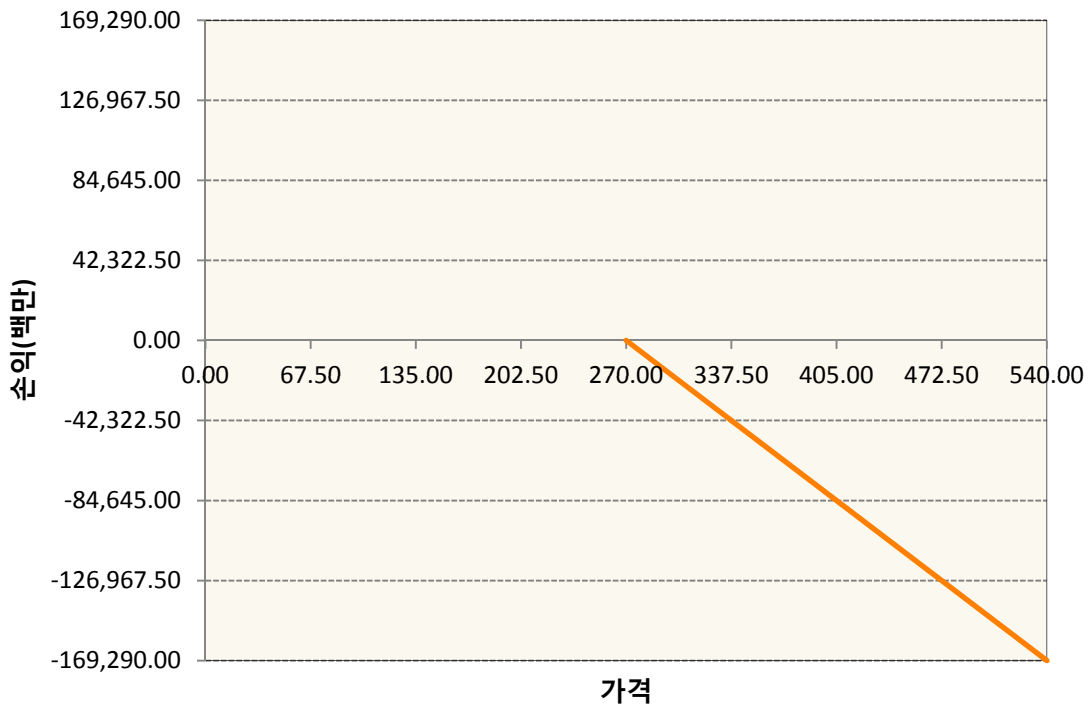
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

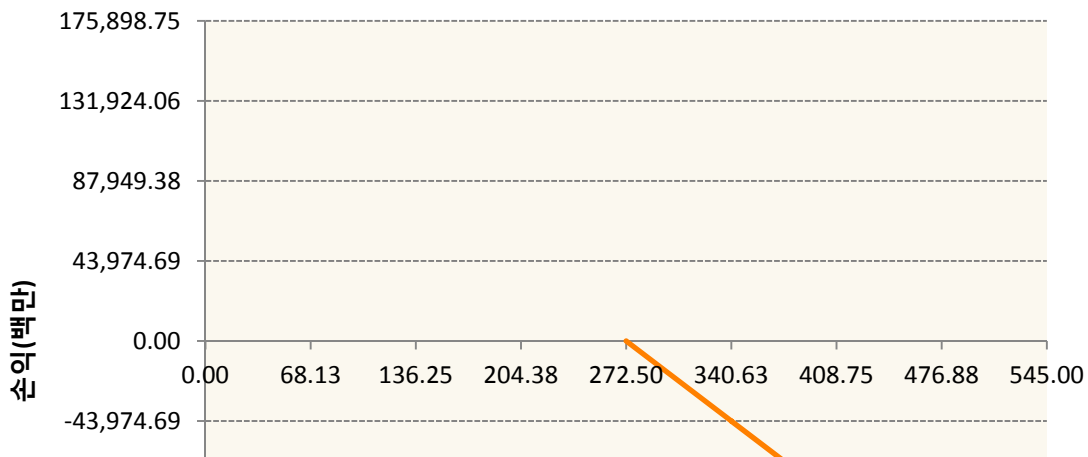
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	513,939	-513,939	장내

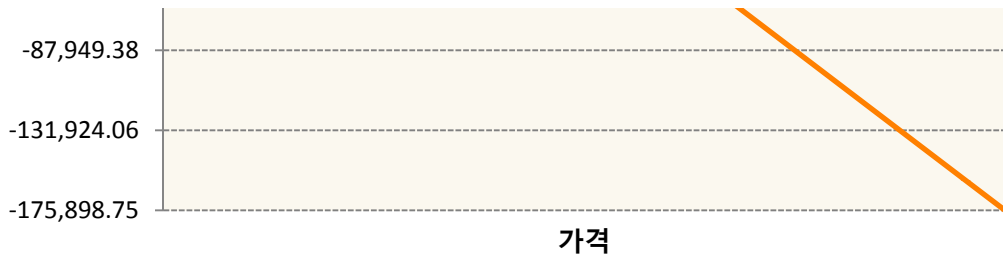
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201PA2702-2019-10 콜270**

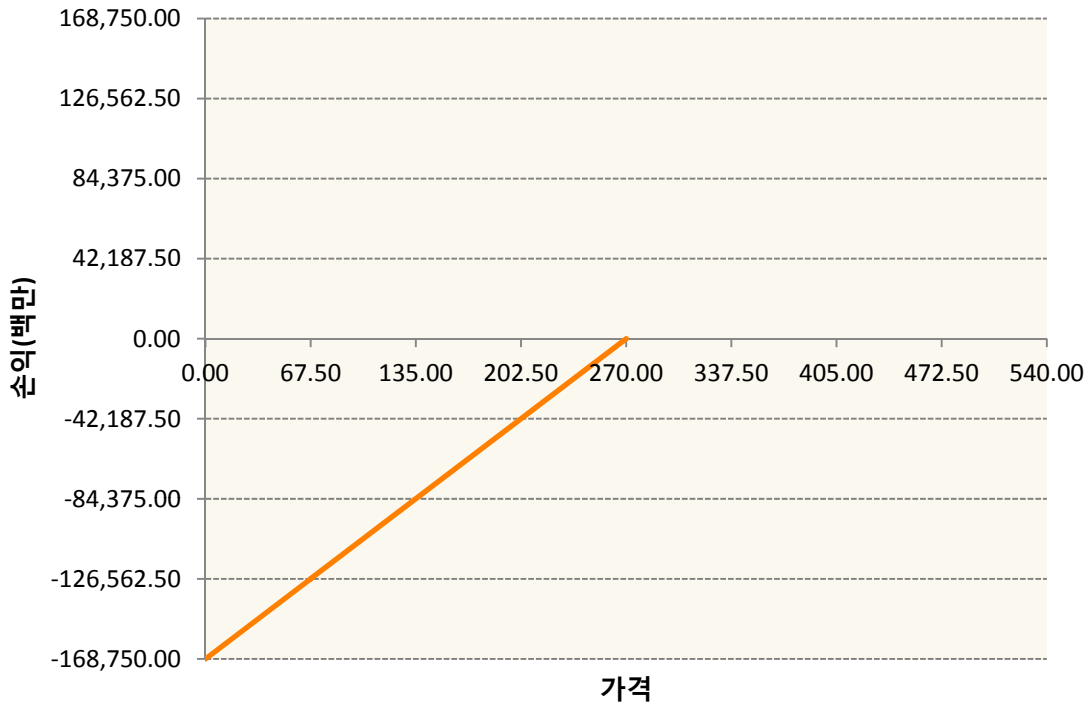


**KR4201PA2728-2019-10 콜272.5**





KR4301PA2701-2019-10 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PA2702		2019-10 콜270					10,606
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,190	2,186	2,179	2,166	2,147	2,119	2,083
-5.33%	2,156	2,124	2,079	2,021	1,949	1,866	1,771
-2.67%	1,863	1,739	1,601	1,452	1,295	1,130	960
0%	650	434	217	0	-218	-435	-654
2.67%	-2,064	-2,242	-2,427	-2,618	-2,814	-3,013	-3,215
5.33%	-5,966	-6,039	-6,130	-6,234	-6,353	-6,482	-6,621
8.00%	-10,342	-10,359	-10,385	-10,422	-10,472	-10,533	-10,606
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5					10,081
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,627	1,625	1,621	1,614	1,602	1,584	1,559

-5.33%	1,612	1,594	1,566	1,527	1,475	1,412	1,337
-2.67%	1,451	1,361	1,255	1,135	1,002	860	708
0%	620	417	210	0	-213	-427	-644
2.67%	-1,620	-1,835	-2,053	-2,272	-2,494	-2,716	-2,939
5.33%	-5,288	-5,401	-5,530	-5,673	-5,827	-5,990	-6,162
8.00%	-9,683	-9,715	-9,760	-9,820	-9,894	-9,981	-10,081
KR4301PA2701                      2019-10 풋270							12,279
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,278	-12,278	-12,278	-12,278	-12,278	-12,278	-12,279
-5.33%	-7,804	-7,805	-7,806	-7,810	-7,816	-7,825	-7,838
-2.67%	-3,366	-3,393	-3,429	-3,474	-3,527	-3,586	-3,652
0%	378	253	127	0	-127	-255	-383
2.67%	1,909	1,839	1,760	1,673	1,581	1,484	1,383
5.33%	2,079	2,074	2,063	2,047	2,026	1,997	1,962
8.00%	2,083	2,083	2,083	2,082	2,080	2,077	2,071

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

(단위:백만원)

**37,134**

공시일	2019-10-04
기준일	2019-10-02

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

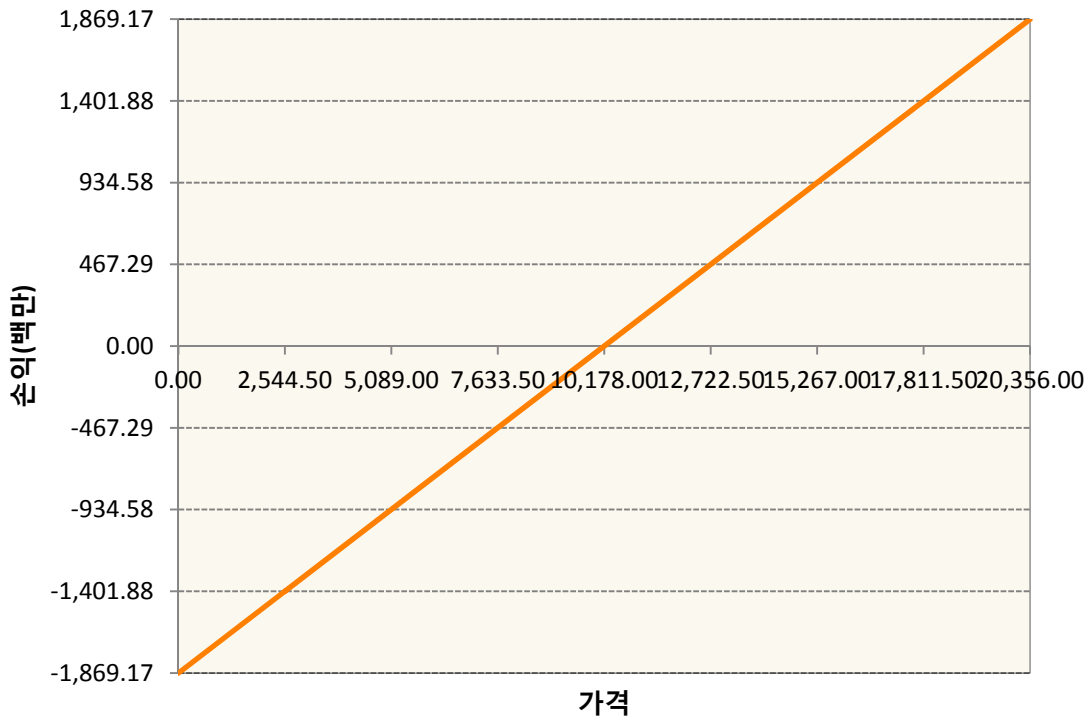
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

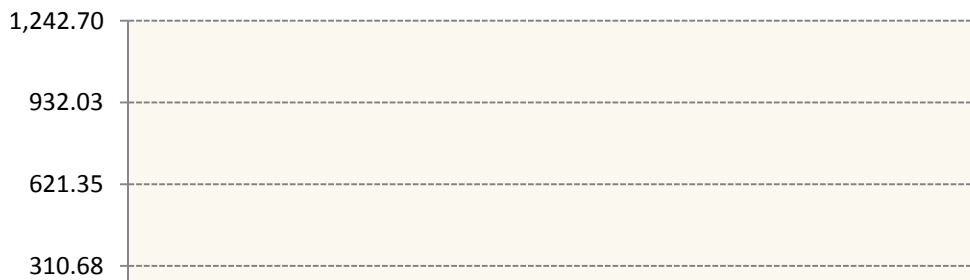
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,869	0	1,869	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,995	-4,995	장내
누계	통화	선도	692	2,858	-2,166	장외

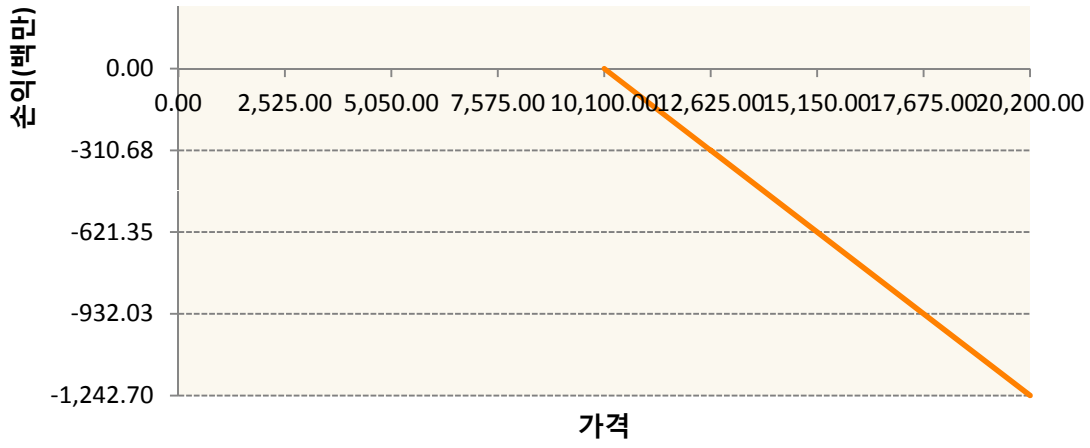
### 2. 만기시점의 손익구조

HCV9-HSCEI Futures Oct19

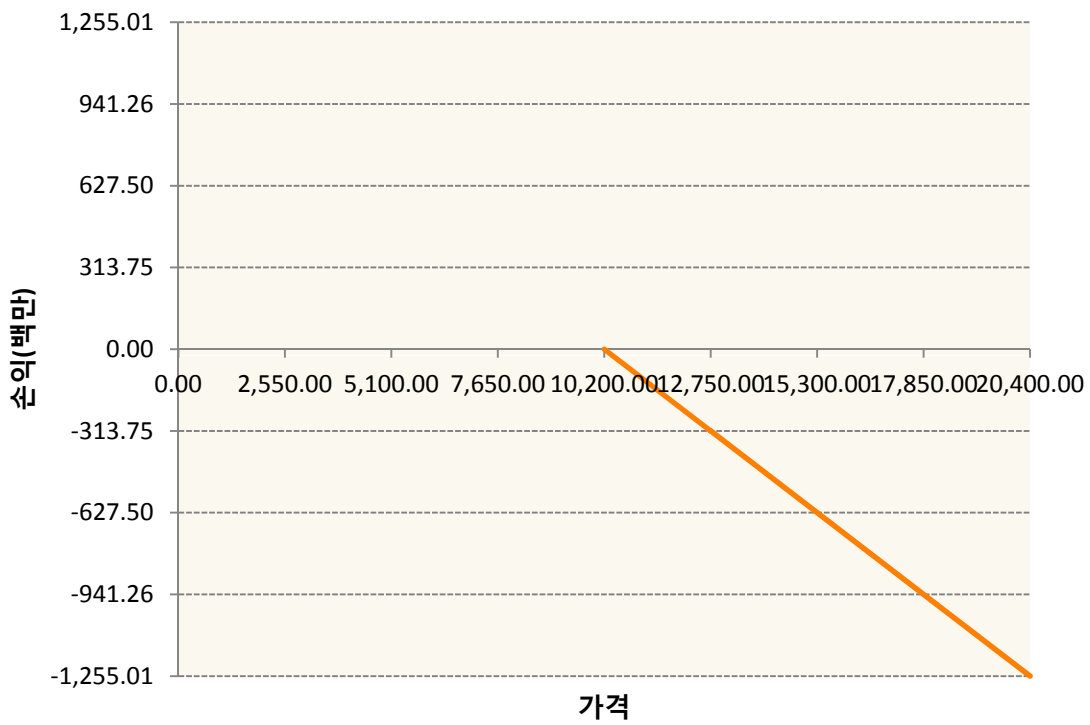


OHHIV9-C101-HSCEI

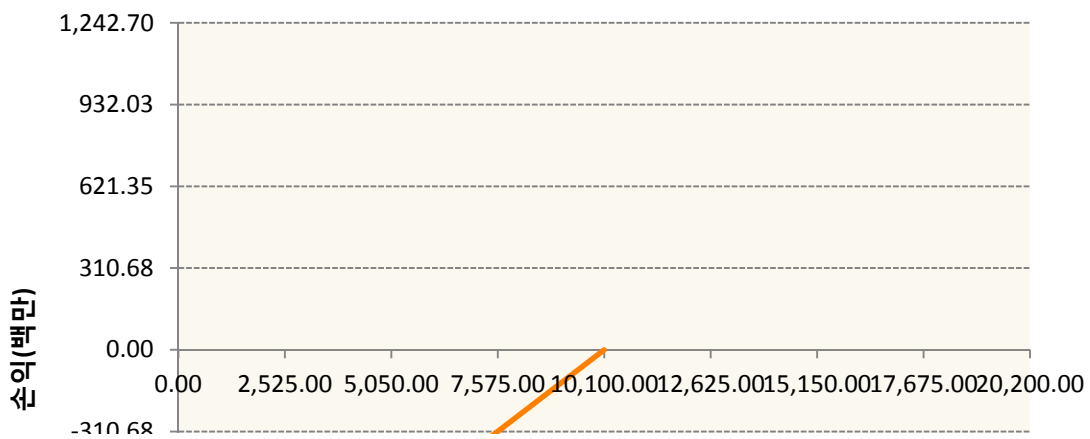


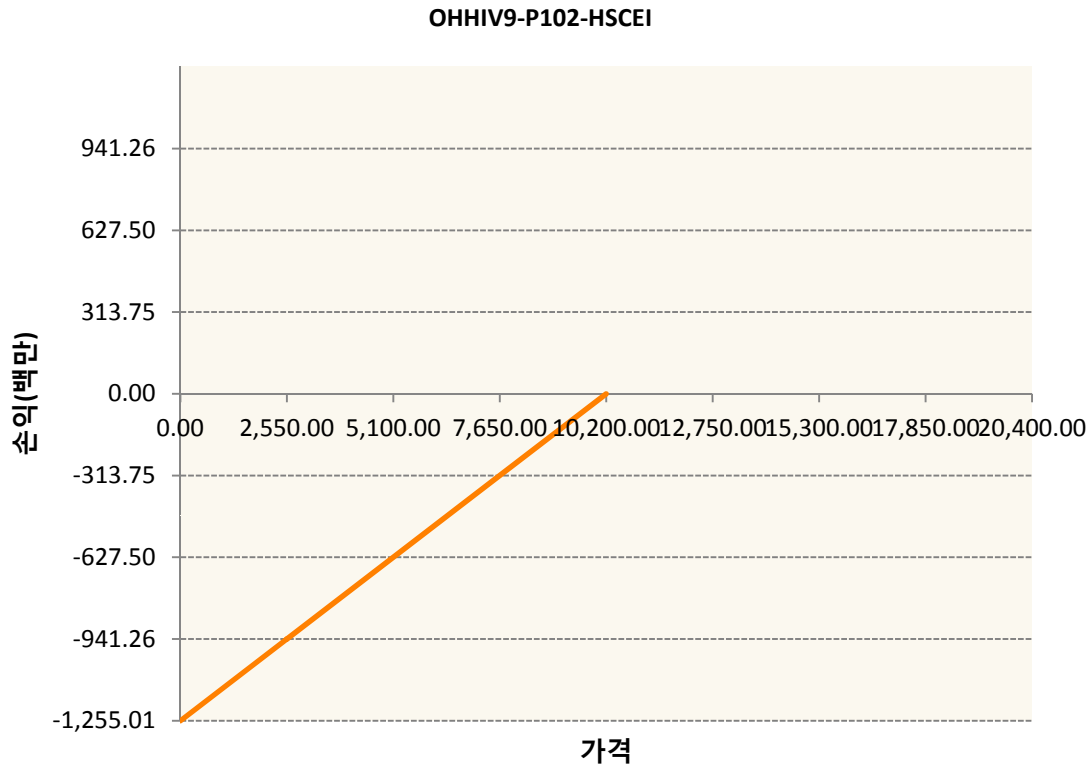


OHHIV9-C102-HSCEI



OHHIV9-P101-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	229
FX21019U00 HKD/KRW 22-11-19E	6
FX21019U02 HKD/KRW 22-11-19E	49
HCV9 HSCEI Futures Oct19	150
OHHIV9-C1C HSCEI	99
OHHIV9-C1C HSCEI	100
OHHIV9-P1C HSCEI	99
OHHIV9-P1C HSCEI	100

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	594

공시일	2019-10-04
기준일	2019-10-02

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

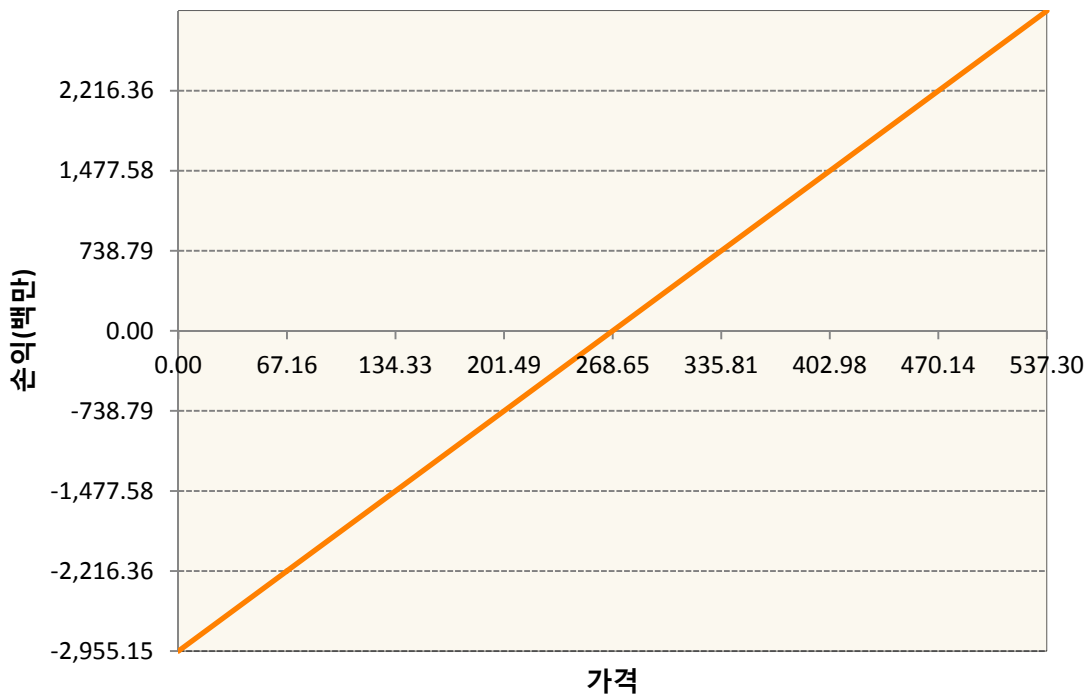
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

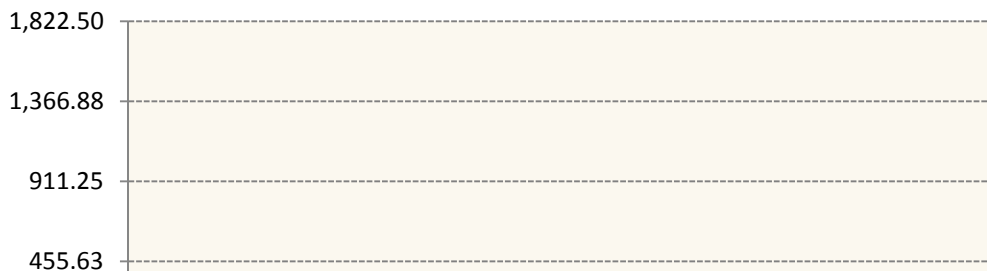
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,955	0	2,955	장내
누계	유가증권	스왑	10,625	0	10,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	10,968	-10,968	장내

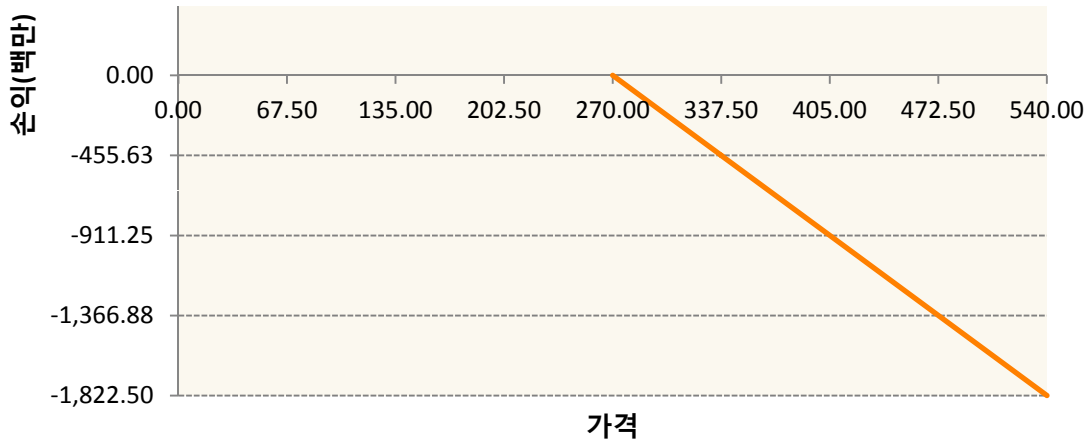
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

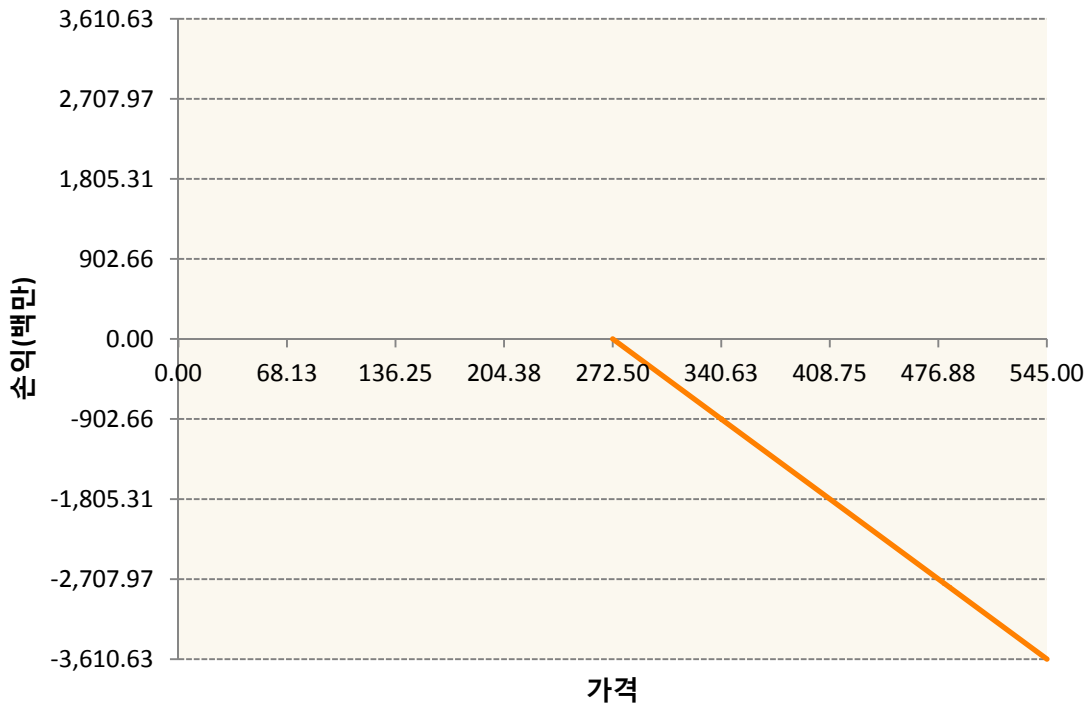


KR4201PA2702-2019-10 콜270

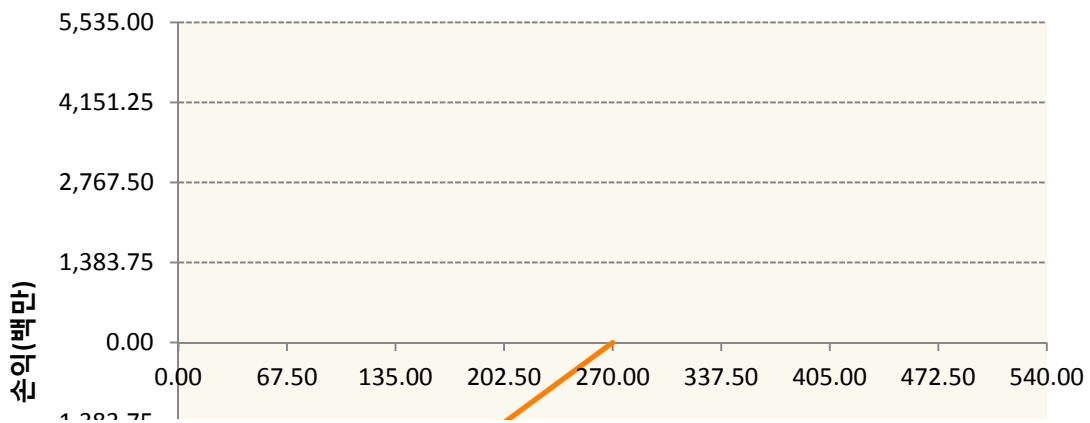


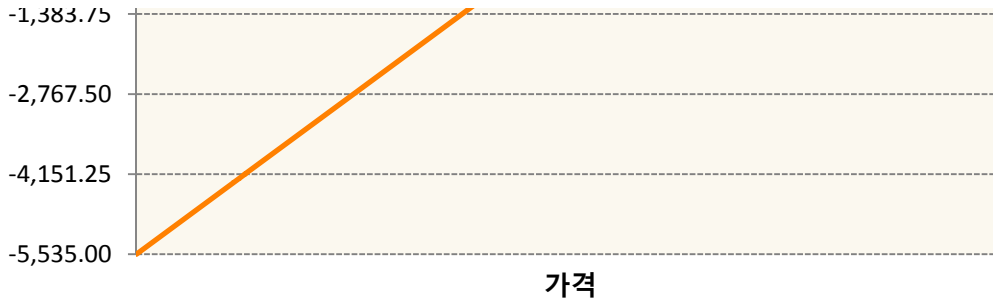


**KR4201PA2728-2019-10 콜272.5**



**KR4301PA2701-2019-10 풋270**





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						918
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-918	-918	-918	-918	-918	-918	-918	
-5.33%	-612	-612	-612	-612	-612	-612	-612	
-2.67%	-306	-306	-306	-306	-306	-306	-306	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	306	306	306	306	306	306	306	
5.33%	612	612	612	612	612	612	612	
8.00%	918	918	918	918	918	918	918	
KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						236
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-236	-236	-236	-236	-236	-236	-236	
-5.33%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158	
-2.67%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	79	79	79	79	79	79	79	
5.33%	158	158	158	158	158	158	158	
8.00%	236	236	236	236	236	236	236	
KR4201PA2702		2019-10 콜270						114
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	24	24	23	23	23	23	22	
-5.33%	23	23	22	22	21	20	19	
-2.67%	20	19	17	16	14	12	10	
0%	7	5	2	0	-2	-5	-7	
2.67%	-22	-24	-26	-28	-30	-32	-35	
5.33%	-64	-65	-66	-67	-68	-70	-71	
8.00%	-111	-112	-112	-112	-113	-113	-114	
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5						207
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	33	33	33	33	33	33	32
-5.33%	33	33	32	31	30	29	27
-2.67%	30	28	26	23	21	18	15
0%	13	9	4	0	-4	-9	-13
2.67%	-33	-38	-42	-47	-51	-56	-60
5.33%	-109	-111	-114	-116	-120	-123	-126
8.00%	-199	-199	-200	-202	-203	-205	-207
KR4301PA2701 2019-10 풋270							403
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-403	-403	-403	-403	-403	-403	-403
-5.33%	-256	-256	-256	-256	-256	-257	-257
-2.67%	-110	-111	-112	-114	-116	-118	-120
0%	12	8	4	0	-4	-8	-13
2.67%	63	60	58	55	52	49	45
5.33%	68	68	68	67	66	66	64
8.00%	68	68	68	68	68	68	68

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

(단위:백만원)

1,967

공시일	2019-10-04
기준일	2019-10-02

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

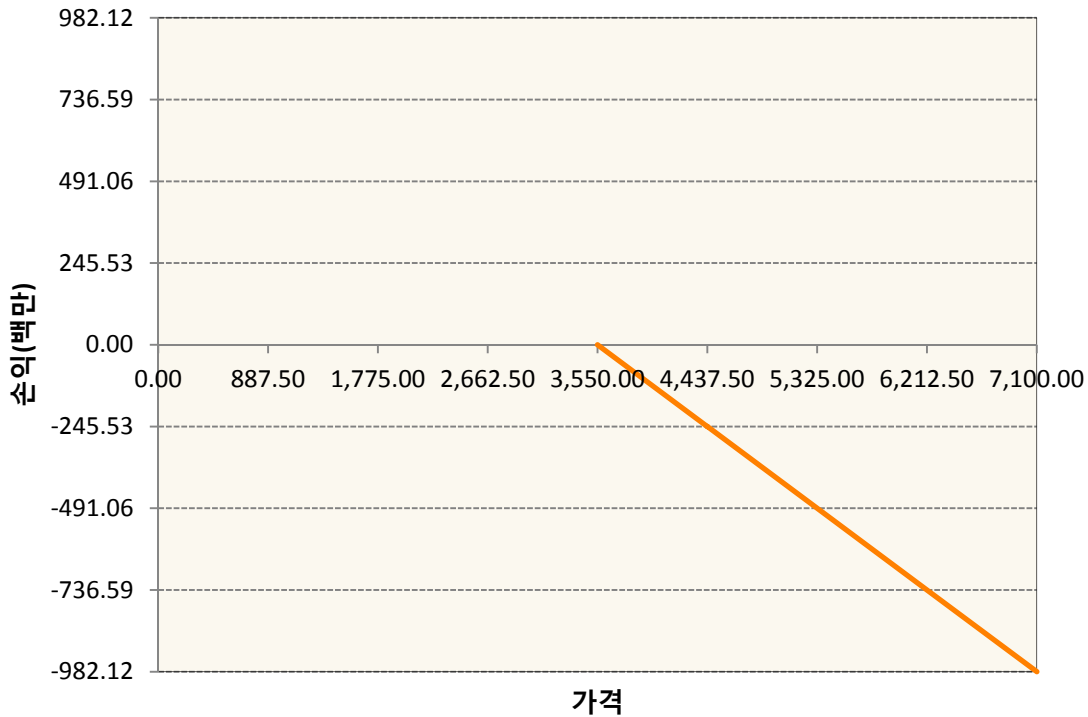
### 1. 계약금액

(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	4,153	0	4,153	
누계	유가증권	스왑	23,972	0	23,972	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,304	-14,304	장내
누계	통화	선도	0	6,192	-6,192	장외

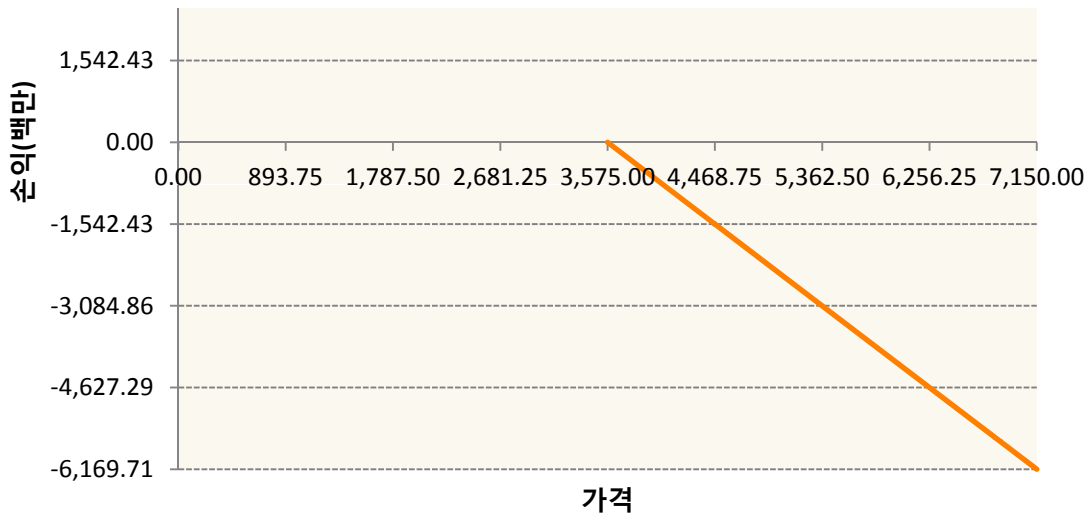
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXV9-C3550-EURO STOXX 50**

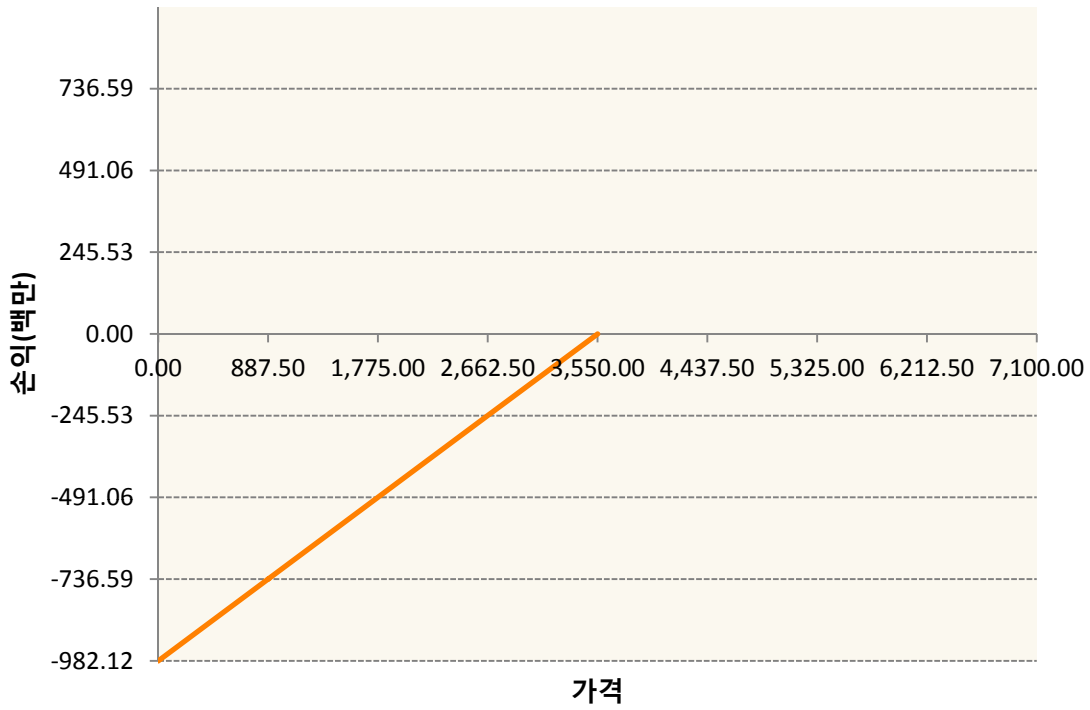


**OESXV9-C3575-EURO STOXX 50**

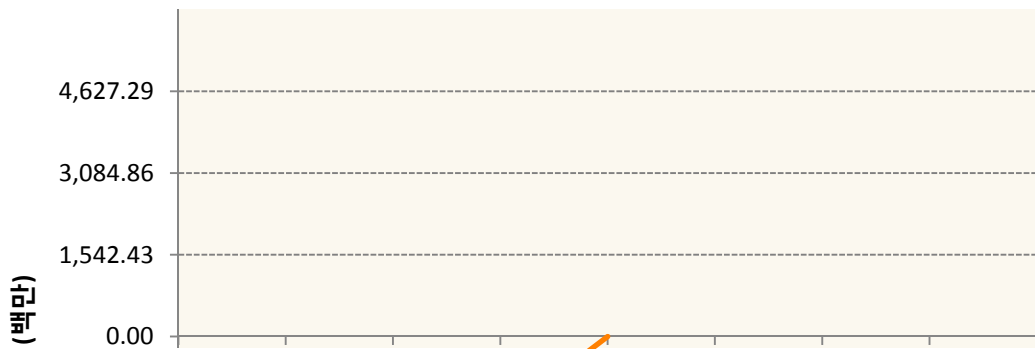


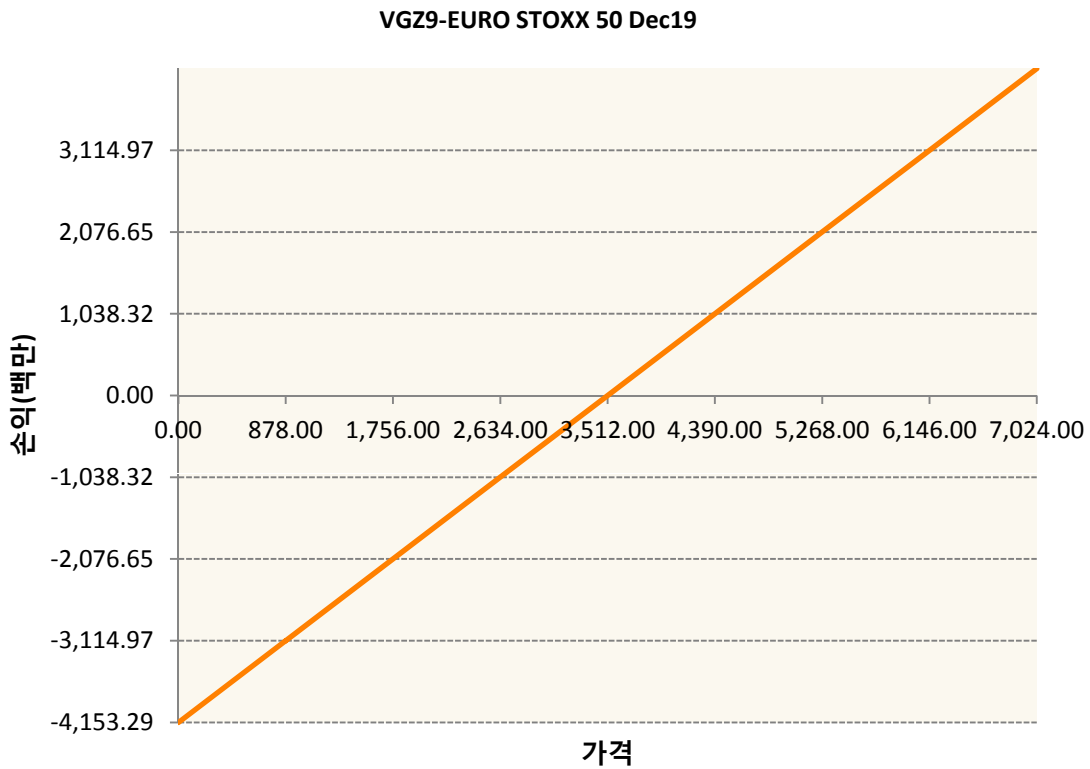
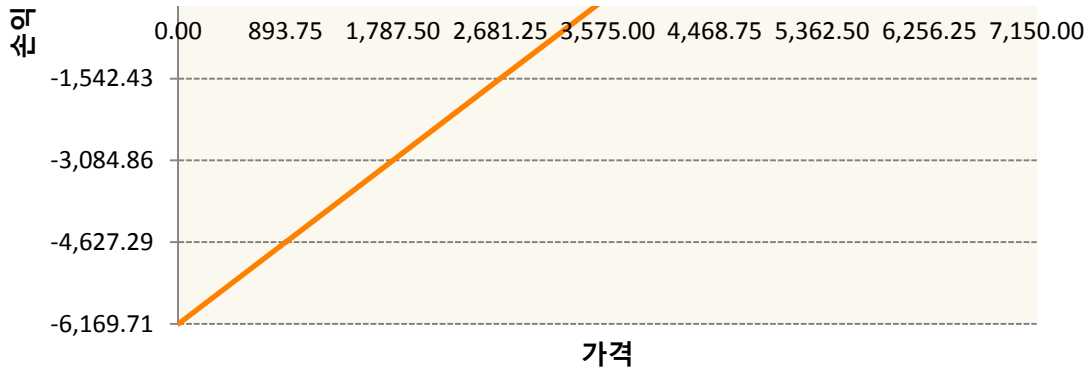


OESXV9-P3550-EURO STOXX 50



OESXV9-P3575-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		32
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E		495
OESXV9-C35 EURO STOXX 50		79
OESXV9-C35 EURO STOXX 50		494
OESXV9-P35 EURO STOXX 50		79
OESXV9-P35 EURO STOXX 50		494
VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	332

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





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

(단위:백만원)

983

공시일	2019-10-04
기준일	2019-10-02

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

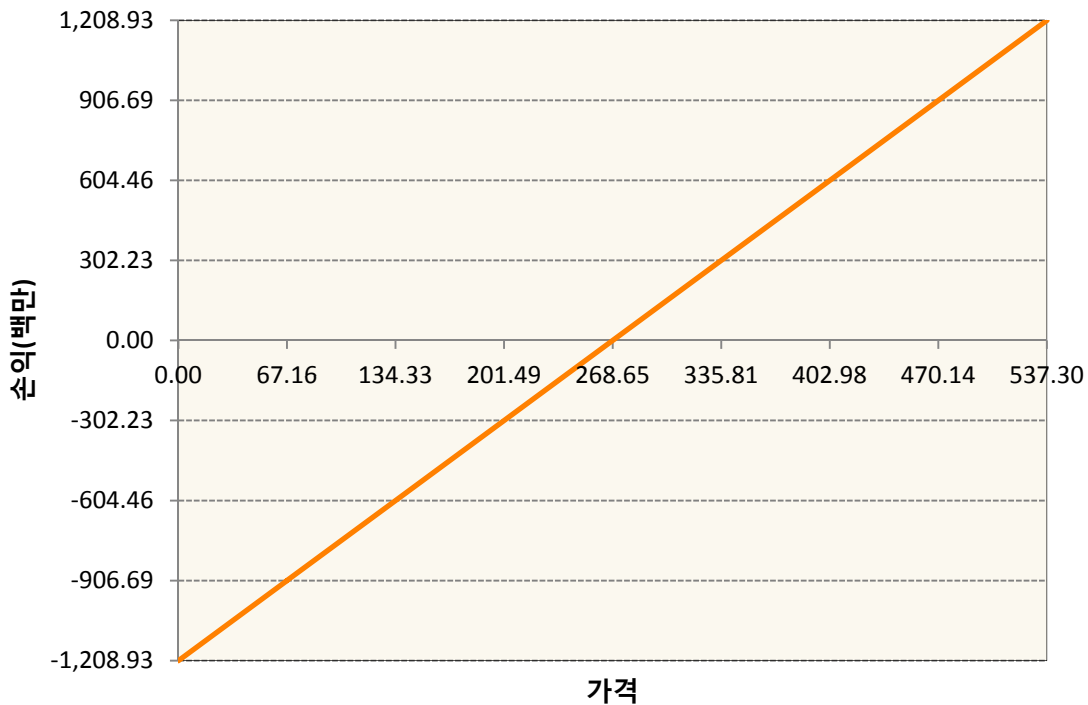
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,209	0	1,209	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						97
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97	
-5.33%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64	
-2.67%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	32	32	32	32	32	32	32	
5.33%	64	64	64	64	64	64	64	
8.00%	97	97	97	97	97	97	97	

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

(단위:백만원)

84



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

(단위:백만원)

131

공시일	2019-10-04
기준일	2019-10-02

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

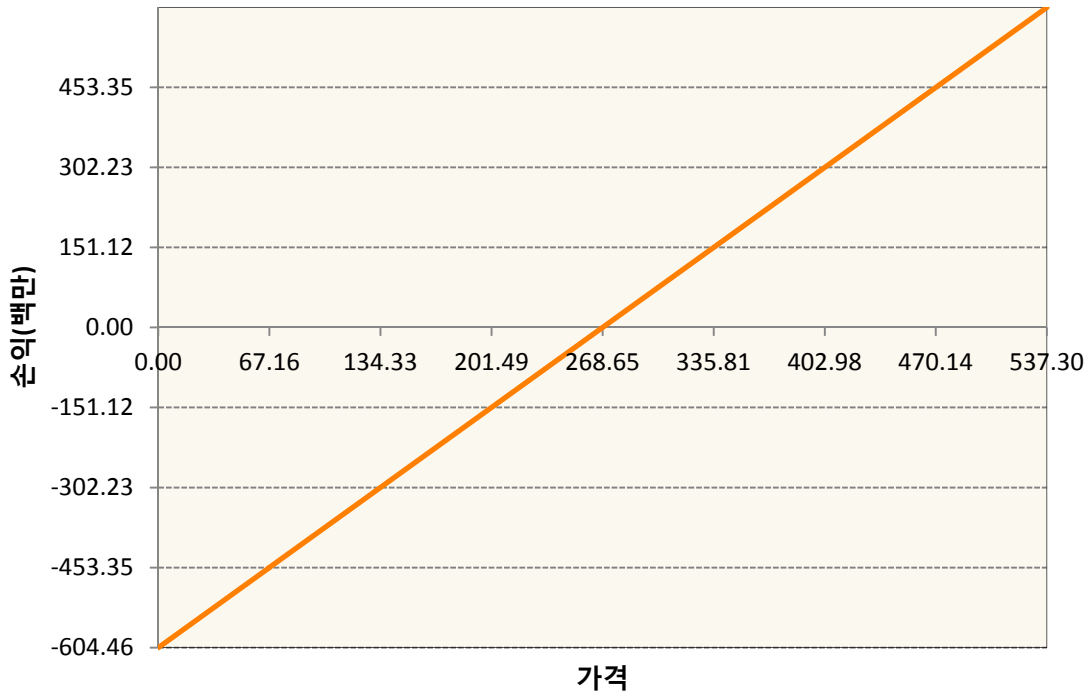
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	604	0	604	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						48
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48	
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
-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%	32	32	32	32	32	32	32	
8.00%	48	48	48	48	48	48	48	

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

(단위:백만원)

42

공시일	2019-10-04
기준일	2019-10-02

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

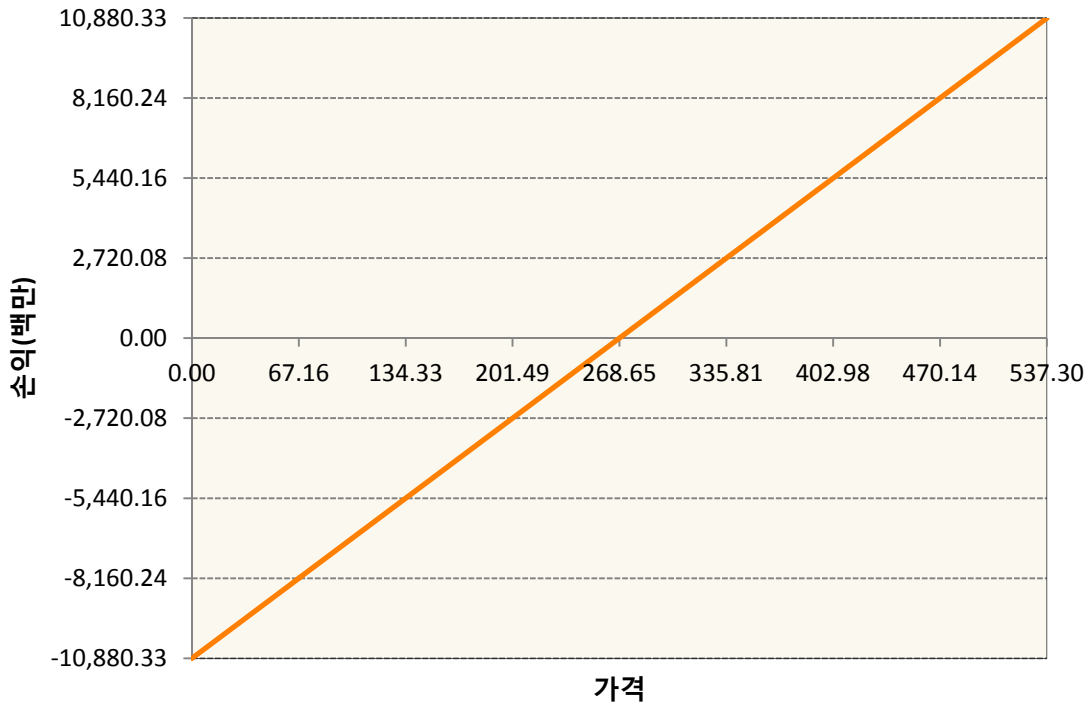
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

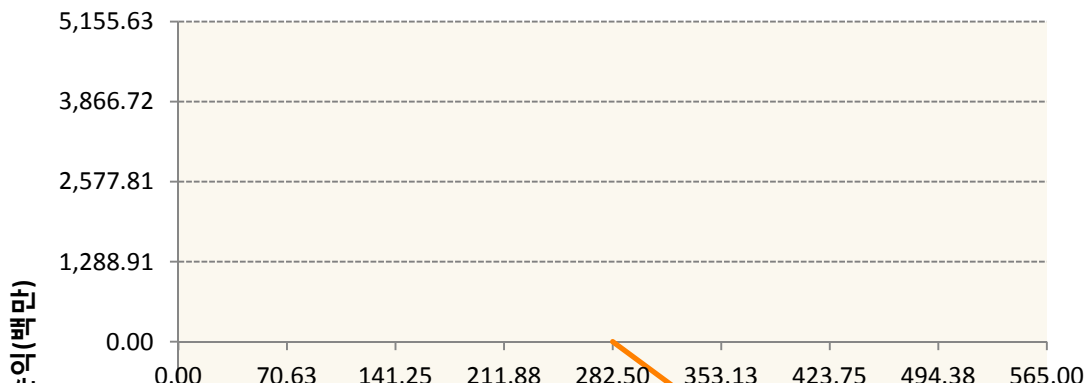
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,880	0	10,880	장내
누계	유가증권	옵션	1,422	20,759	-19,338	장내

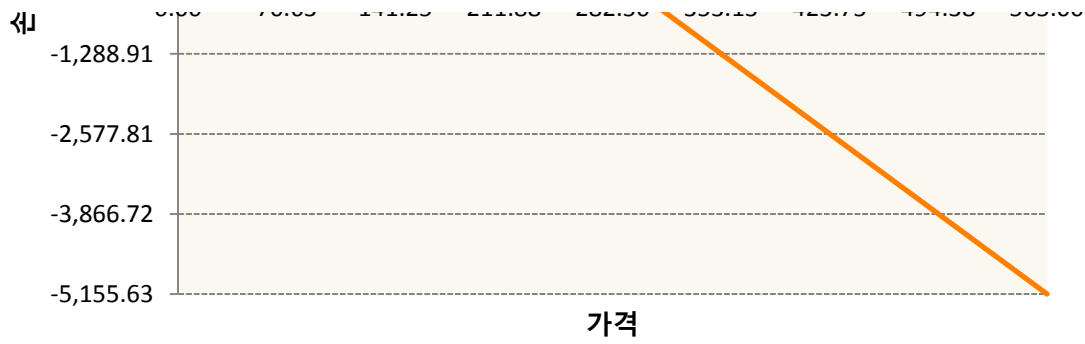
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

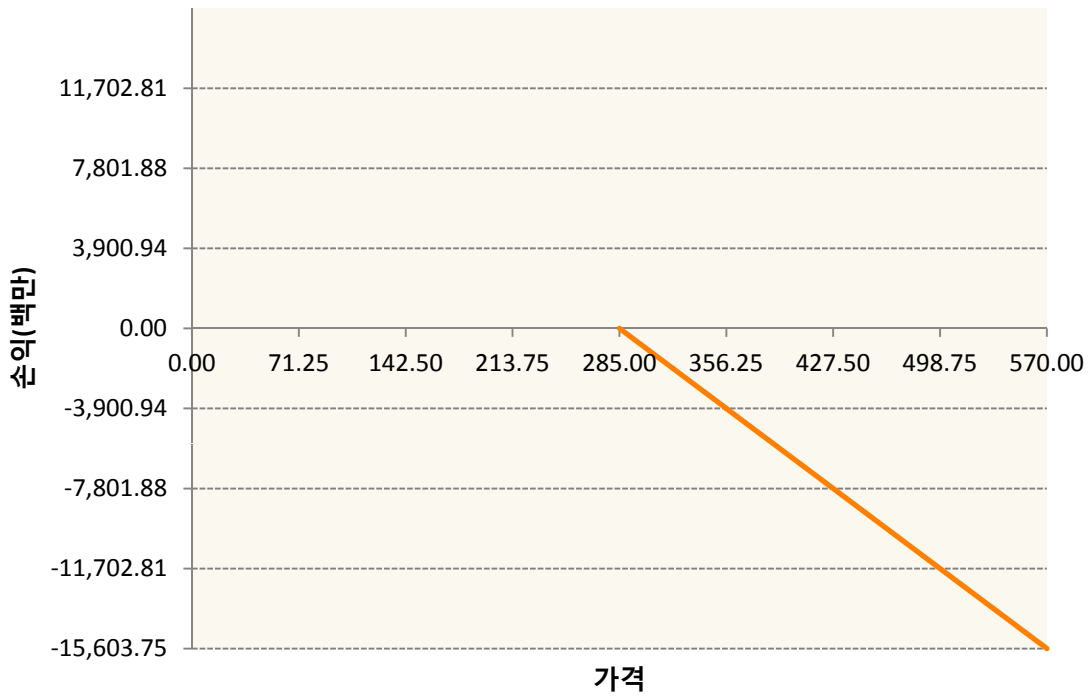


KR4201PA2827-2019-10 콜282.5

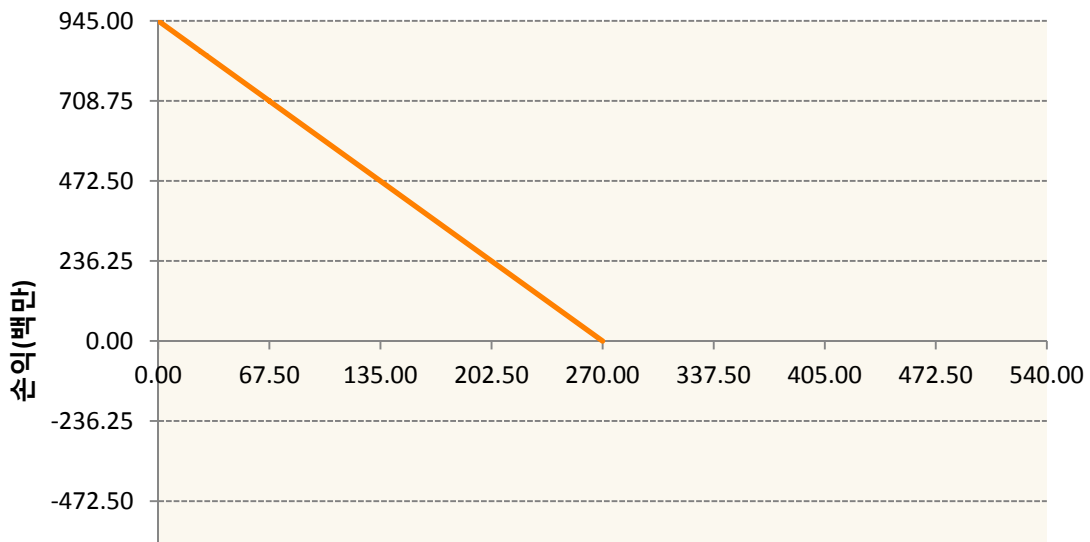


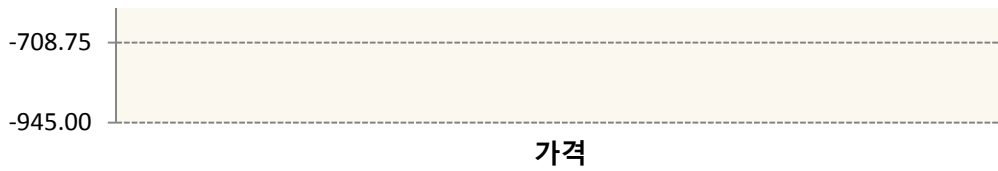


**KR4201PA2850-2019-10 콜285**

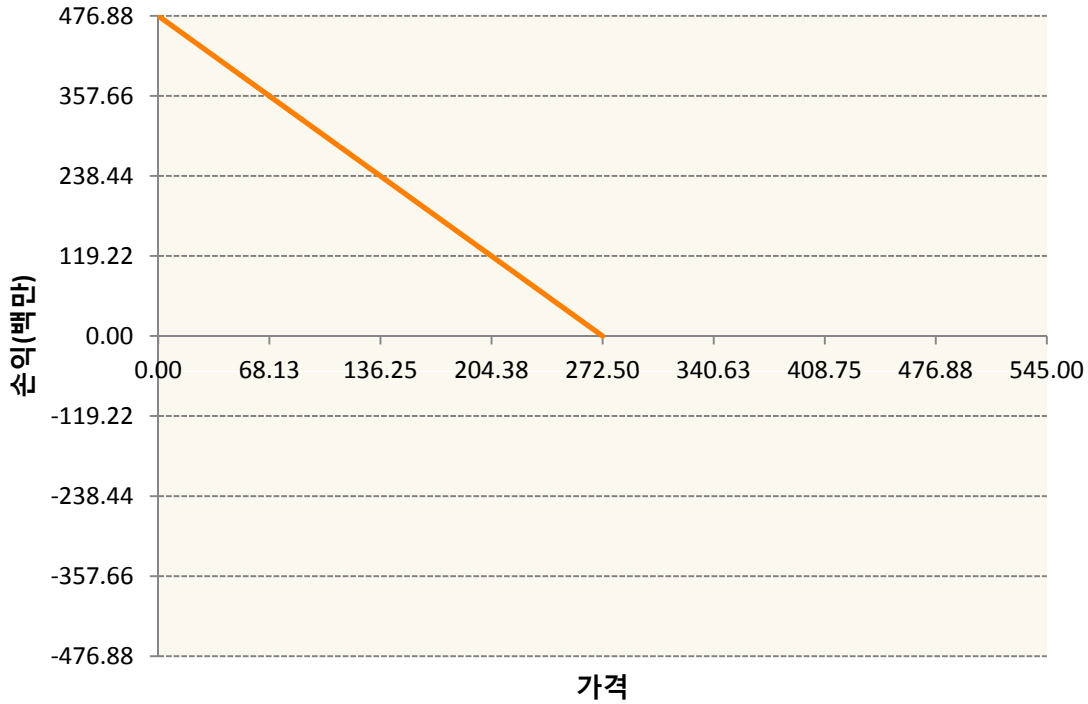


**KR4301PA2701-2019-10 풋270**





KR4301PA2727-2019-10 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						870
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-870	-870	-870	-870	-870	-870	-870	
-5.33%	-580	-580	-580	-580	-580	-580	-580	
-2.67%	-290	-290	-290	-290	-290	-290	-290	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	290	290	290	290	290	290	290	
5.33%	580	580	580	580	580	580	580	
8.00%	870	870	870	870	870	870	870	
KR4201PA2827		2019-10 콜282.5						175
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	9	9	9	9	9	9	9	
-5.33%	9	9	9	9	9	8	8	
-2.67%	9	9	8	7	6	5	3	

0%	6	5	3	0	-3	-6	-10
2.67%	-8	-13	-18	-23	-29	-34	-40
5.33%	-54	-61	-68	-74	-81	-88	-95
8.00%	-143	-148	-153	-158	-164	-170	-175
KR4201PA2850                      2019-10 콜285							446
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	16	16	16	16	16	16	16
-5.33%	16	16	16	16	16	15	14
-2.67%	16	16	15	14	12	9	5
0%	13	10	6	0	-7	-15	-24
2.67%	-12	-24	-36	-49	-64	-79	-94
5.33%	-112	-132	-151	-171	-191	-211	-231
8.00%	-335	-353	-371	-389	-408	-427	-446
KR4301PA2701                      2019-10 풋270							69
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	69	69	69	69	69	69	69
-5.33%	44	44	44	44	44	44	44
-2.67%	19	19	19	19	20	20	20
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-11	-10	-10	-9	-9	-8	-8
5.33%	-12	-12	-12	-11	-11	-11	-11
8.00%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
KR4301PA2727                      2019-10 풋272.5							36
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	36	36	36	36	36	36	36
-5.33%	23	23	23	23	23	23	23
-2.67%	11	11	11	11	11	11	11
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-7	-7	-7	-7	-6	-6	-6
5.33%	-9	-9	-9	-9	-8	-8	-8
8.00%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9

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

(단위:백만원)

1,208

공시일	2019-10-04
기준일	2019-10-02

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,618	0	3,618	
누계	유가증권	수익증권	125,748	0	125,748	

### 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	2019-10-04
기준일	2019-10-02

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,618	0	3,618	
누계	유가증권	수익증권	161,772	0	161,772	

### 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	2019-10-04
기준일	2019-10-02

## 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	416,807	0	416,807	
누계	통화	선도	9,648	423,427	-413,779	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,956
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,570
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E	965
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E	965
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E	193
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E	289
FX21019Q05 KRW/USD 04-10-19E	289
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E	193
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E	1,389
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E	2,065
FX21019U01 KRW/USD 10-10-19E	289
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E	193
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E	2,354
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E	1,737
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E	193
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E	965
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E	1,486
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	3,001
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	3,184
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	2,644
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E	1,930
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E	2,026
FX21019U05 USD/KRW 04-10-19E	482
FX21019U05 USD/KRW 04-10-19E	289

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

(단위:백만원)

11,371

공시일	2019-10-04
기준일	2019-10-02

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

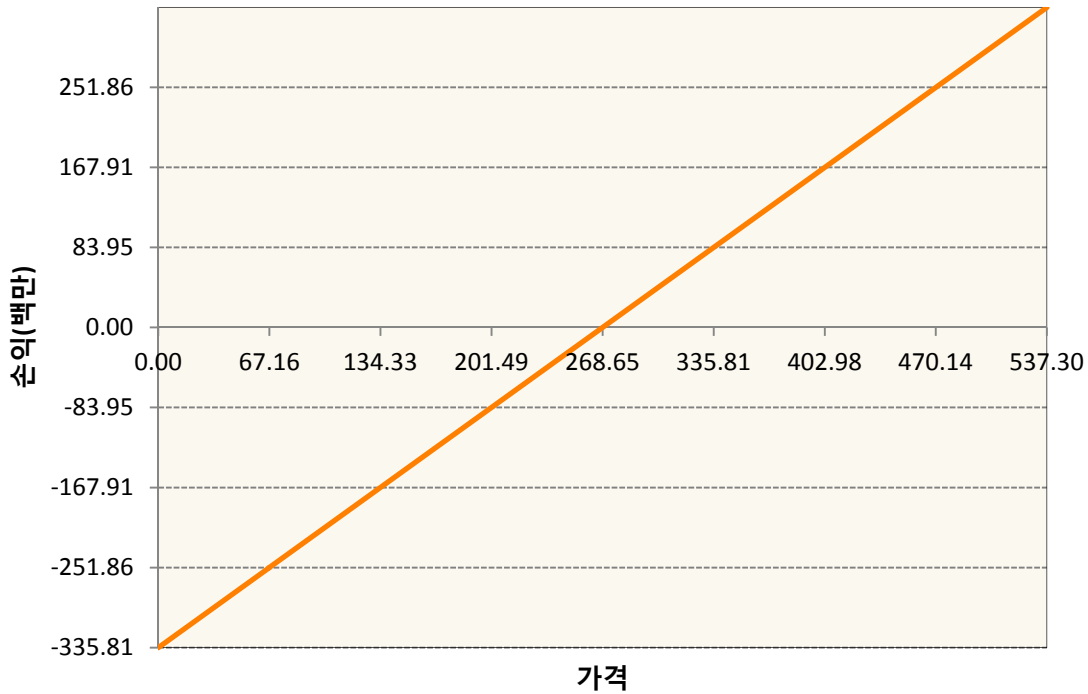
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

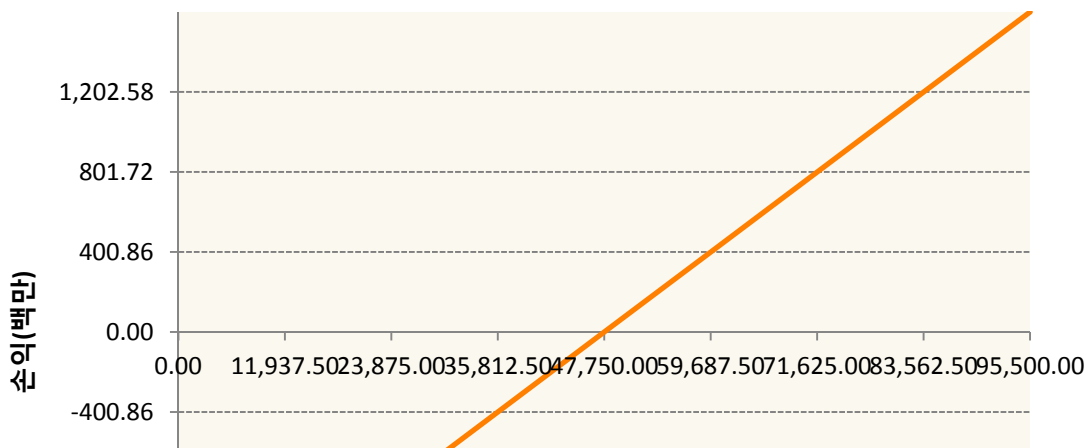
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,939	0	1,939	장내

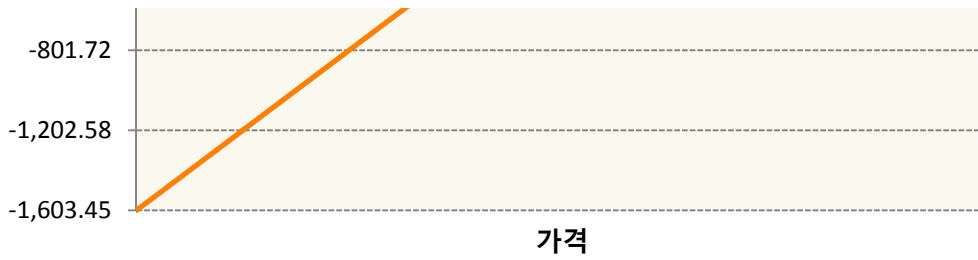
### 2. 만기시점의 손익구조

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						128
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128	
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85	
-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%	85	85	85	85	85	85	85	
8.00%	128	128	128	128	128	128	128	

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

**184**

공시일	2019-10-04
기준일	2019-10-02

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

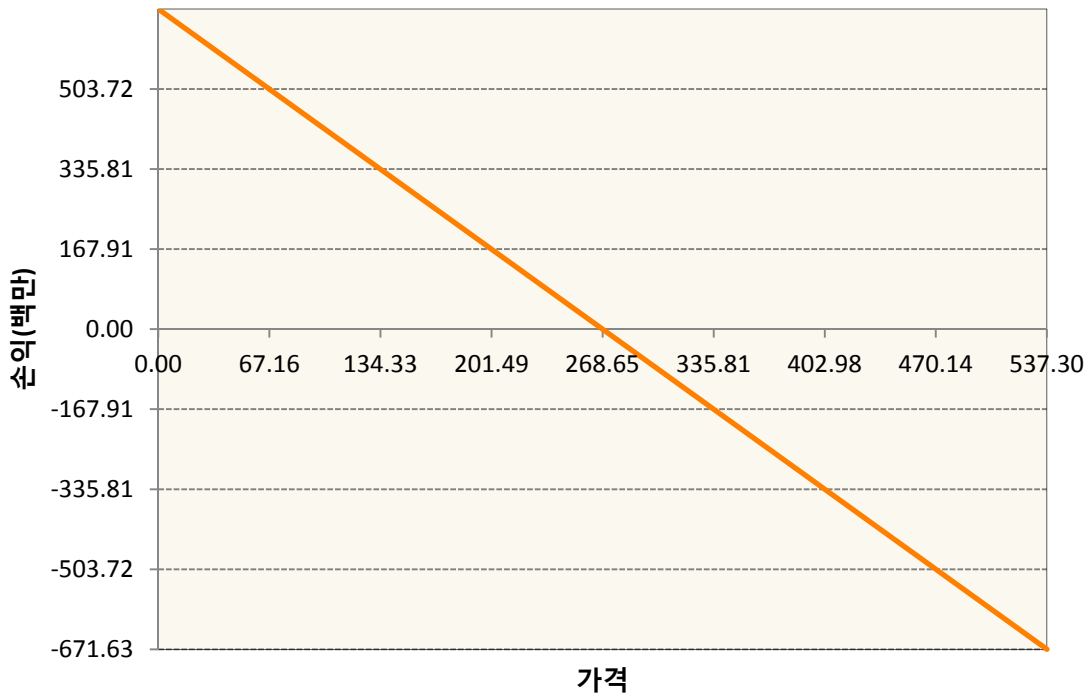
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

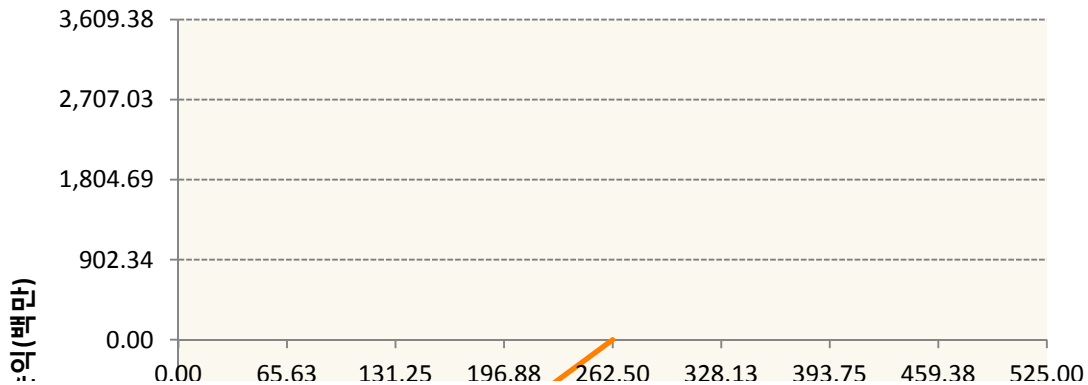
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	672	-672	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,007	-4,007	장내

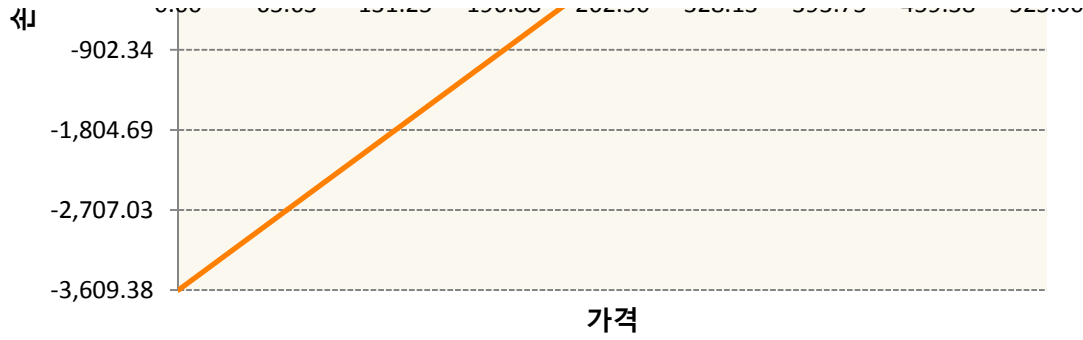
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

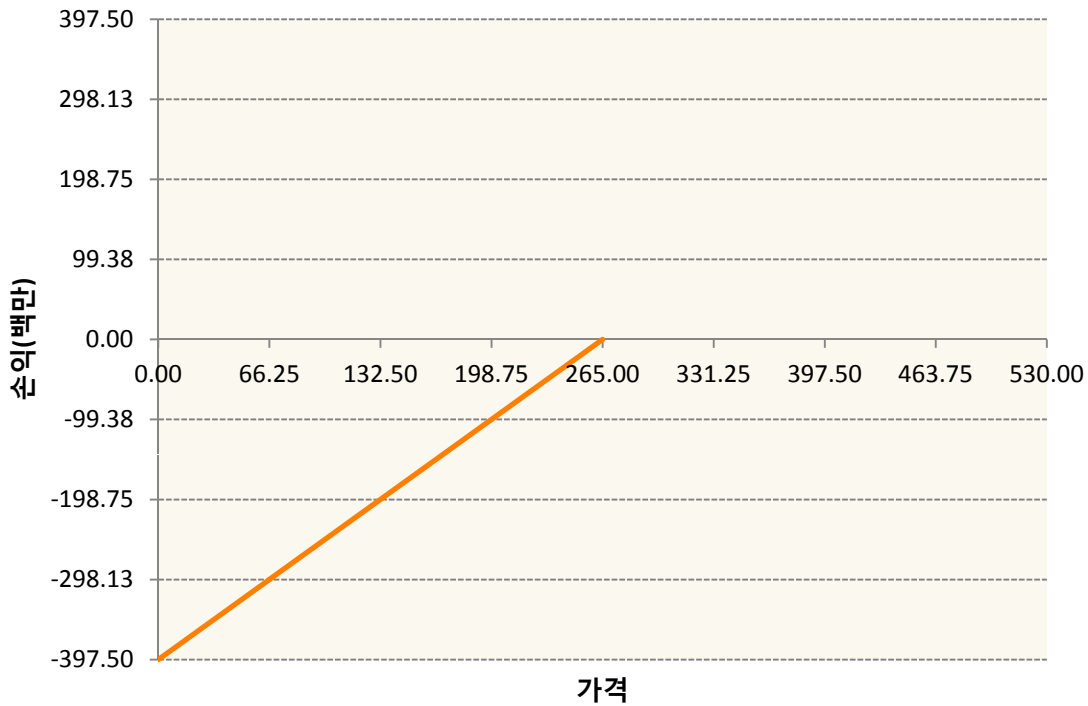


KR4301PA2628-2019-10 풋262.5





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						206
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-205	-205	-205	-205	-206	-206	-206
-5.33%	-108	-108	-109	-110	-111	-112	-114
-2.67%	-26	-29	-32	-35	-37	-40	-43
0%	5	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	8	7	7	7	7	6	5
5.33%	8	8	8	8	8	7	7
8.00%	8	8	8	8	8	8	8

KR4301PA2651

2019-10 풋265

25

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
-5.33%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
-2.67%	-5	-5	-5	-5	-6	-6	-6
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	2	2	2	2	1	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)

**264**

공시일	2019-10-04
기준일	2019-10-02

## 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	17,427	0	17,427	
누계	통화	선도	724	17,849	-17,125	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		328
FX21019U03 KRW/USD 18-10-19E		482
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		617
FX21019U05 USD/KRW 18-10-19E		19
FX21019V00 USD/KRW 18-10-19E		39

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

(단위:백만원)

488
-----

공시일	2019-10-04
기준일	2019-10-02

## 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	304	0	304	장외
누계	통화	선도	118	158	-40	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	12
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
FX21019V00 KRW/EUR 22-11-19E	2

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

(단위:백만원)

32
----

공시일	2019-10-04
기준일	2019-10-02

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

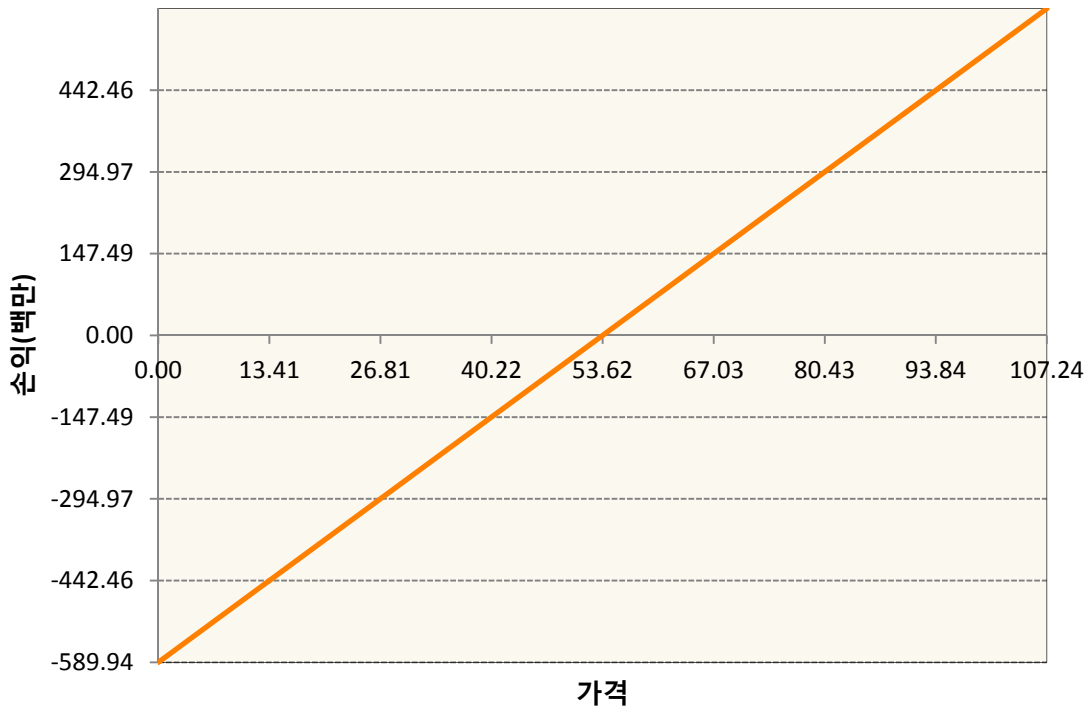
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

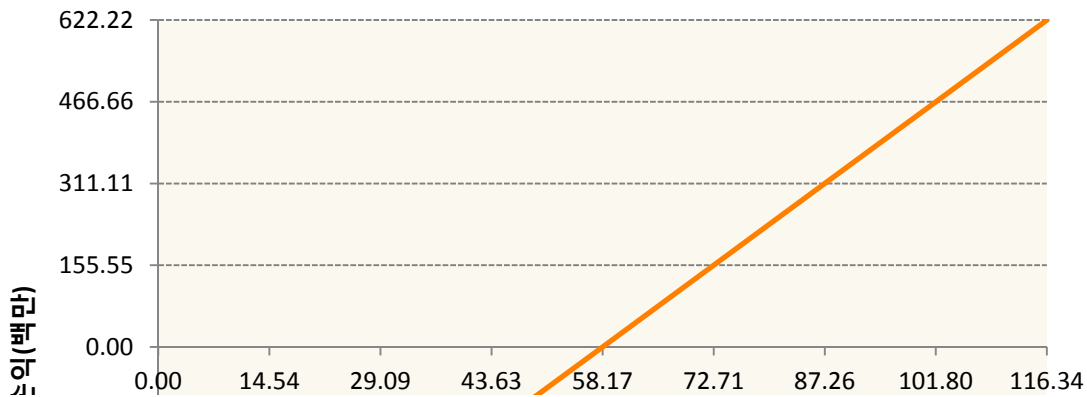
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,253	362	1,891	
누계	유가증권	선물	195	0	195	장내

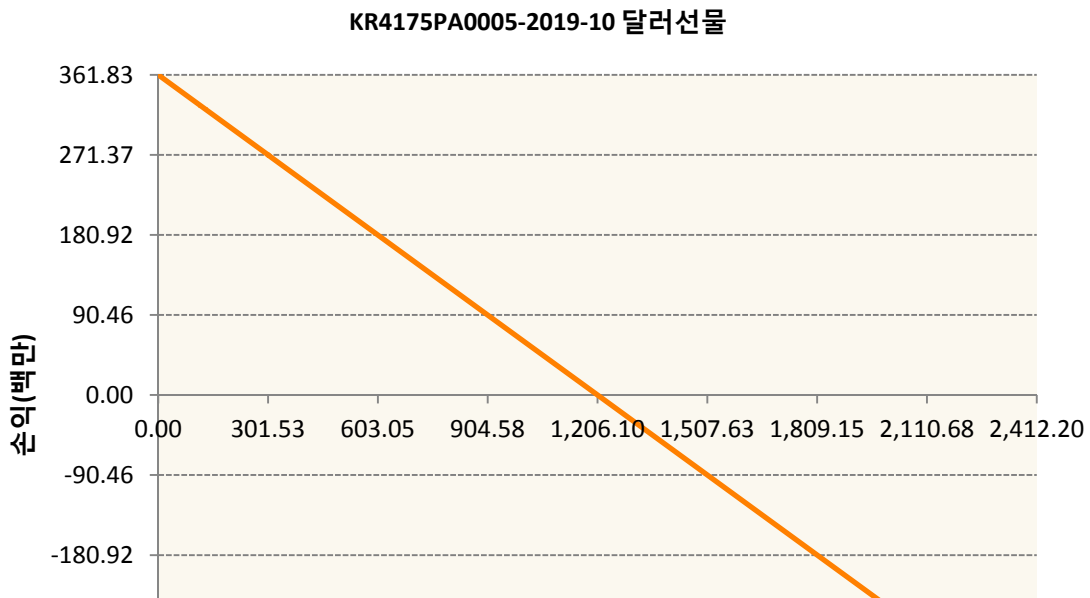
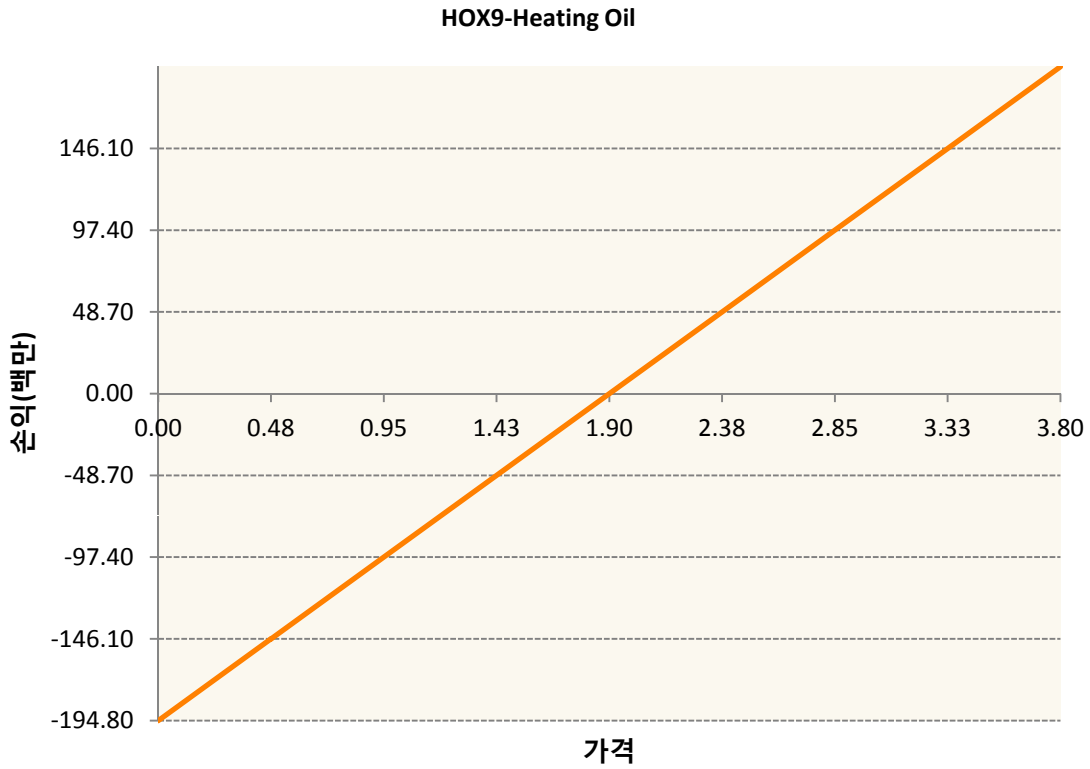
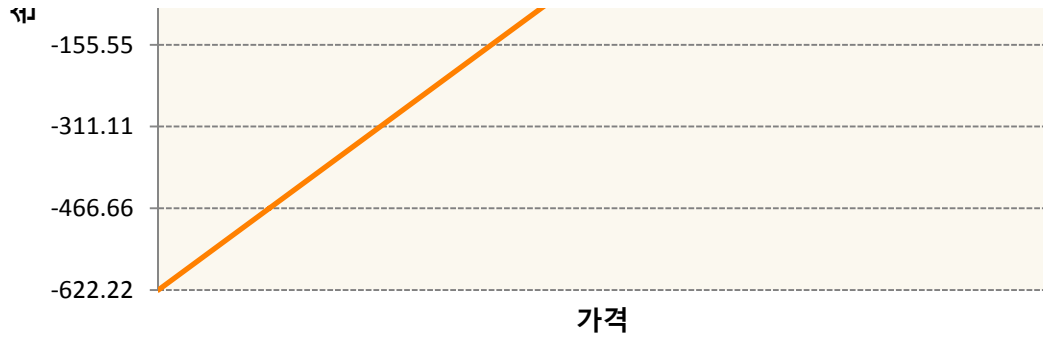
### 2. 만기시점의 손익구조

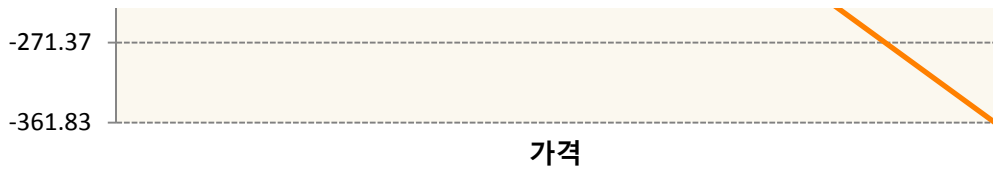
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19



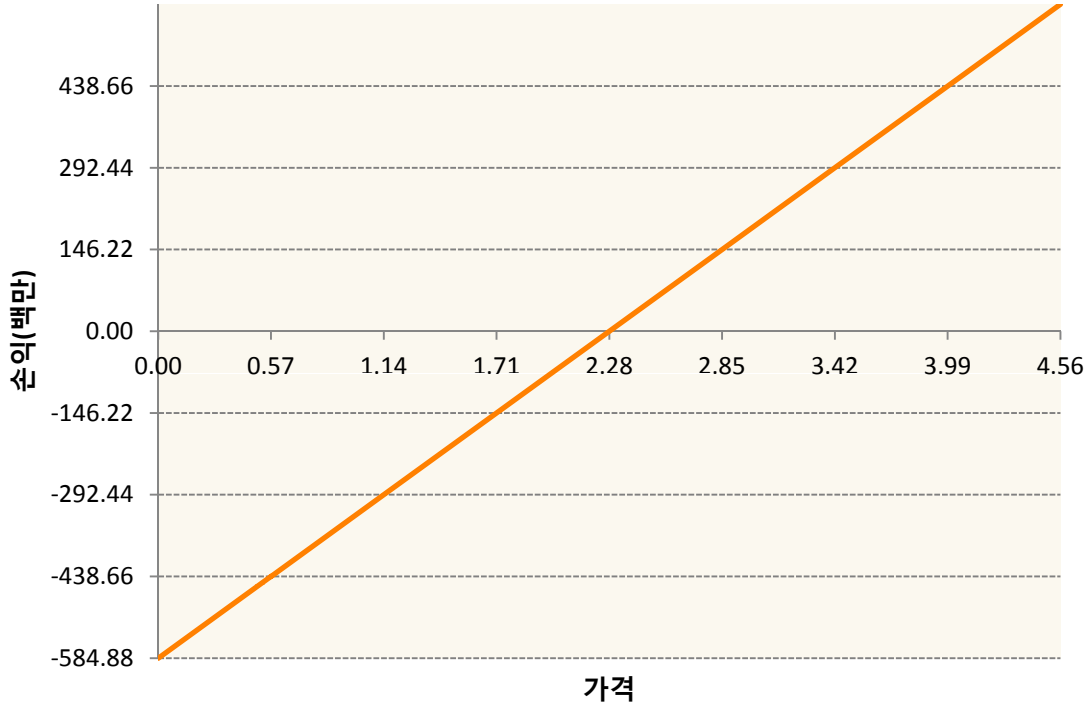
COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20



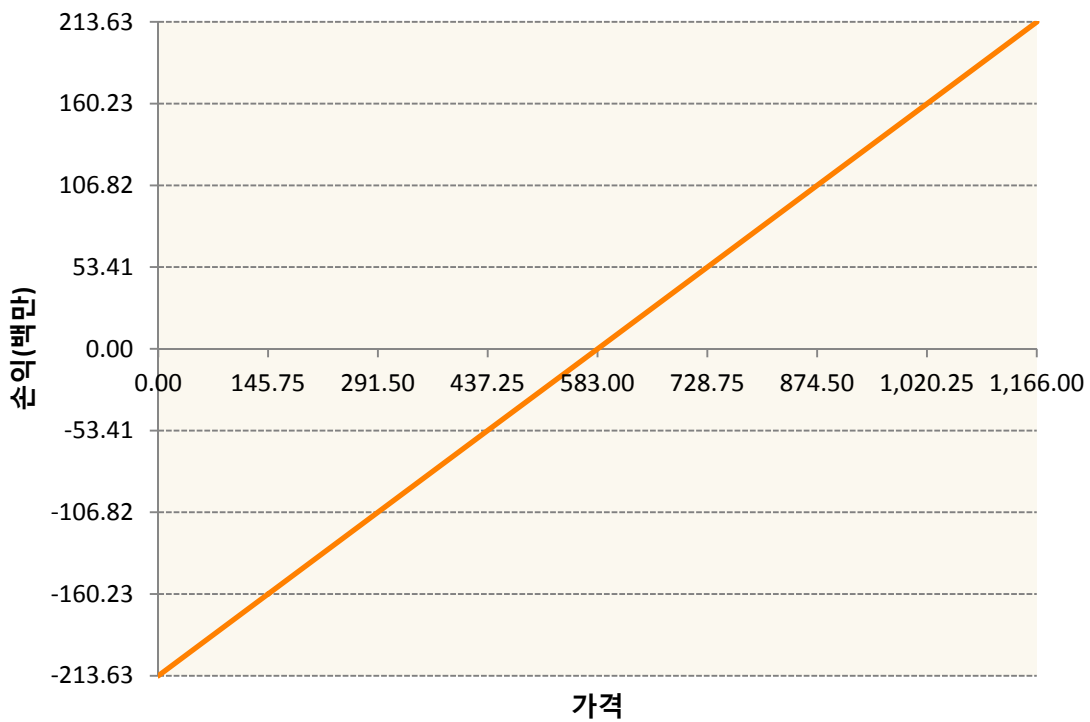




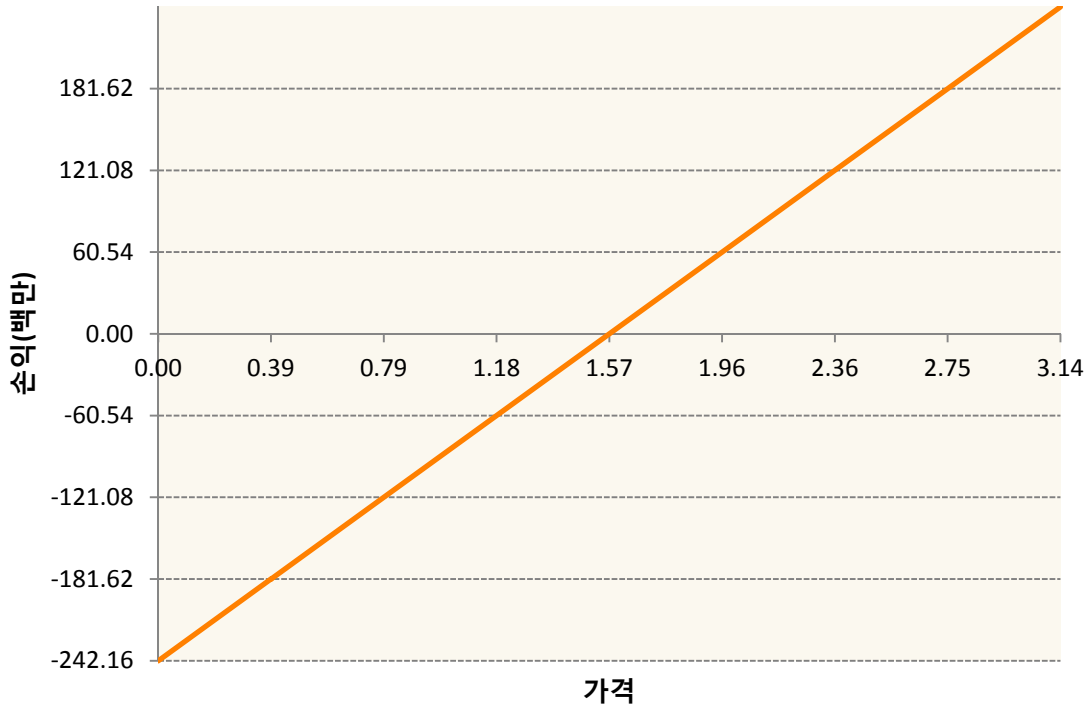
NGX19-NATURAL GAS FUTR Nov19



QSX9-Low Su Gasoil G Nov19



**XBX9-GASOLINE RBOB FUT Nov19**



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX9	WTI CRUDE FUTURE Nov19	47
COF0	BRENT CRUDE FUTR Jan20	50
HOX9	Heating Oil	16
KR4175PA00	2019-10 달러선물	29
NGX19	NATURAL GAS FUTR Nov19	47
QSX9	Low Su Gasoil G Nov19	17
XBX9	GASOLINE RBOB FUT Nov19	19

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	407

공시일	2019-10-04
기준일	2019-10-02

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

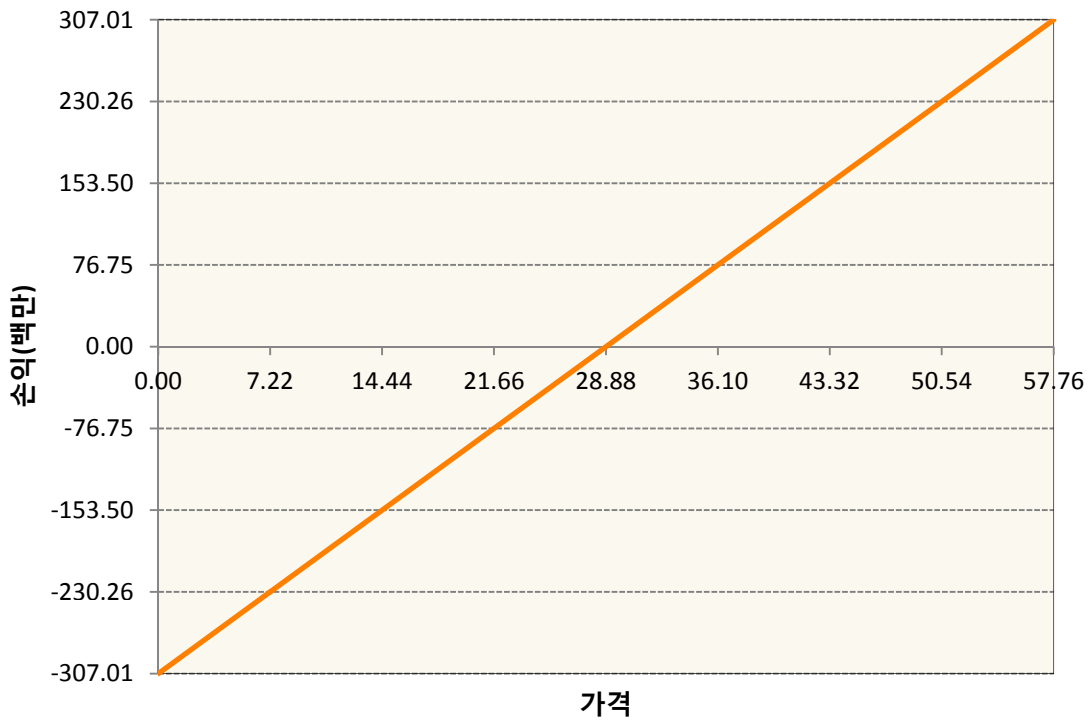
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

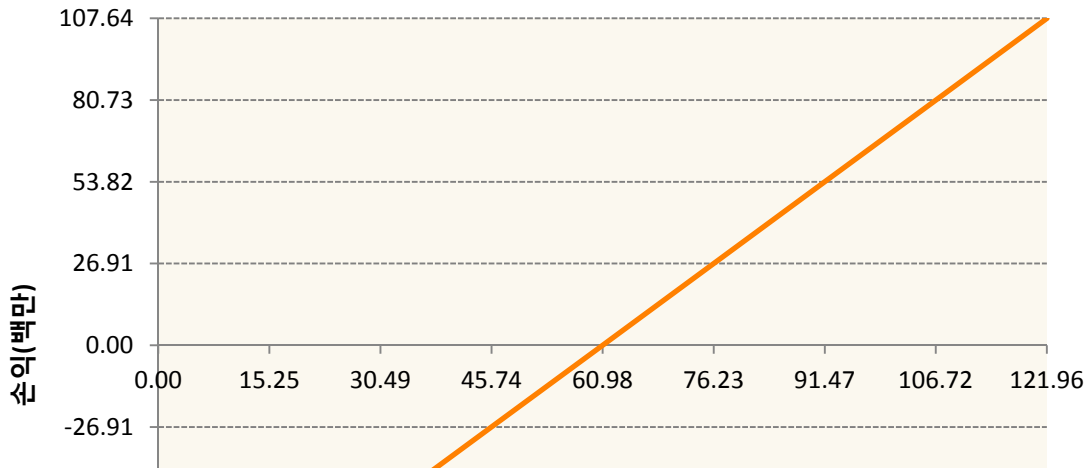
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,848	96	2,752	

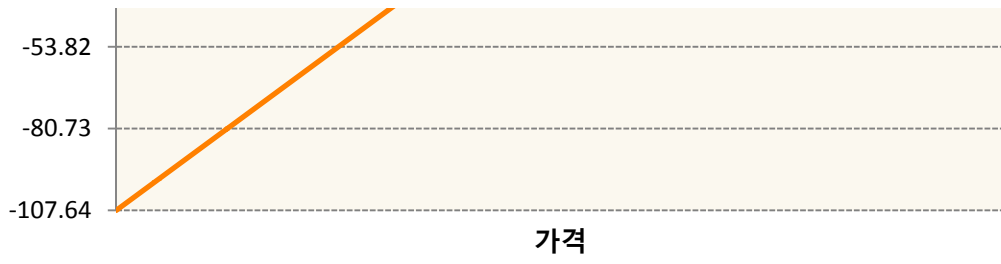
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19**

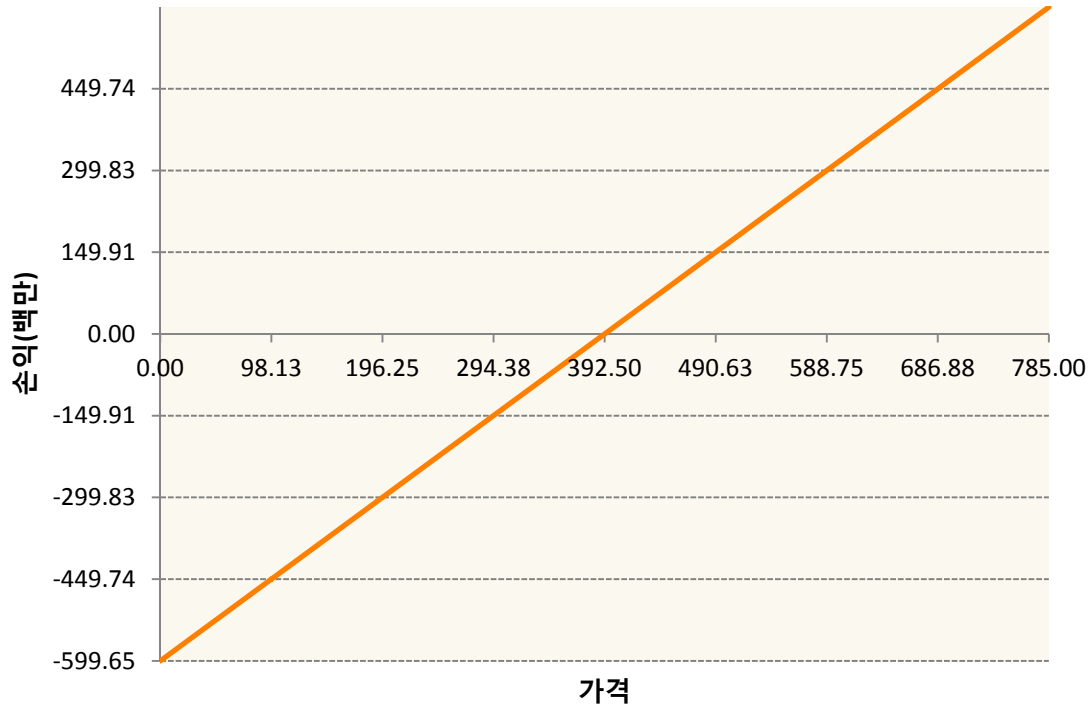


**CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19**

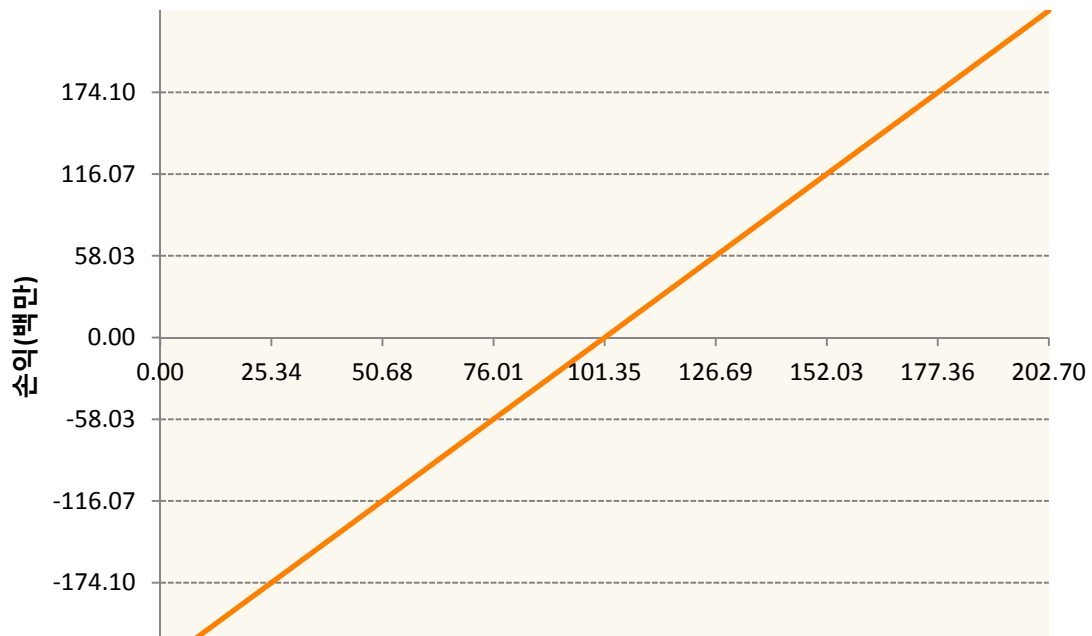


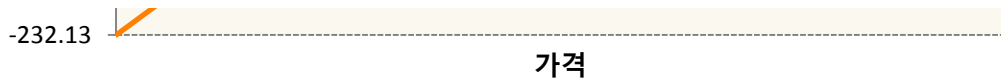


**CZ9-CORN FUTURE Dec19**

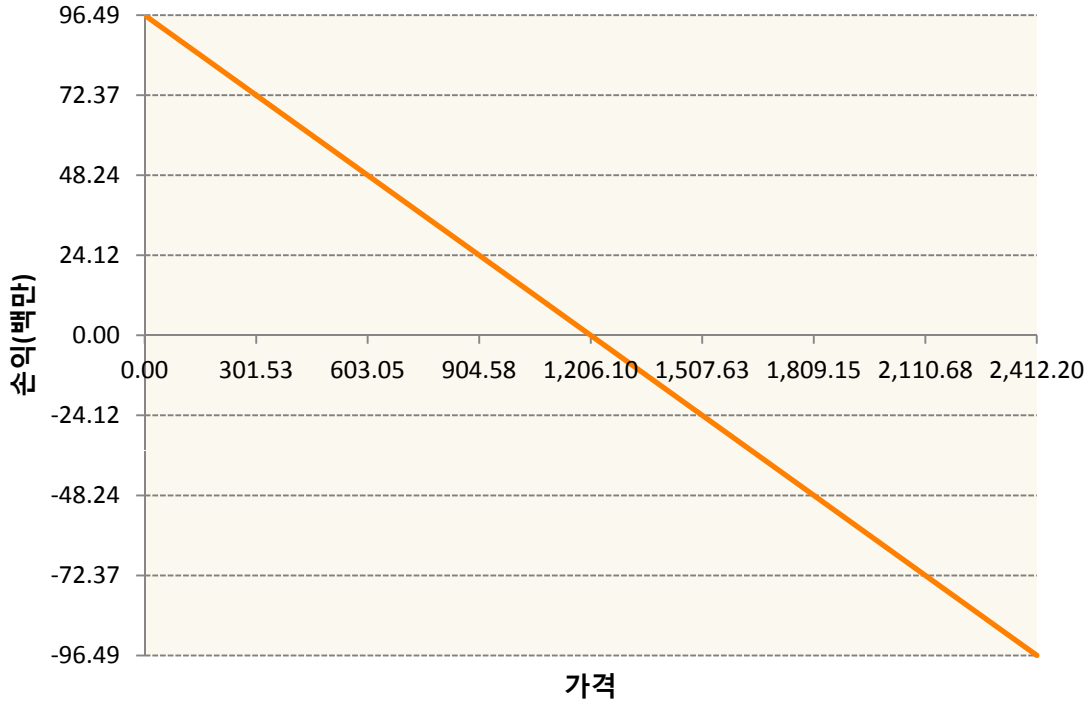


**KCZ9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19**

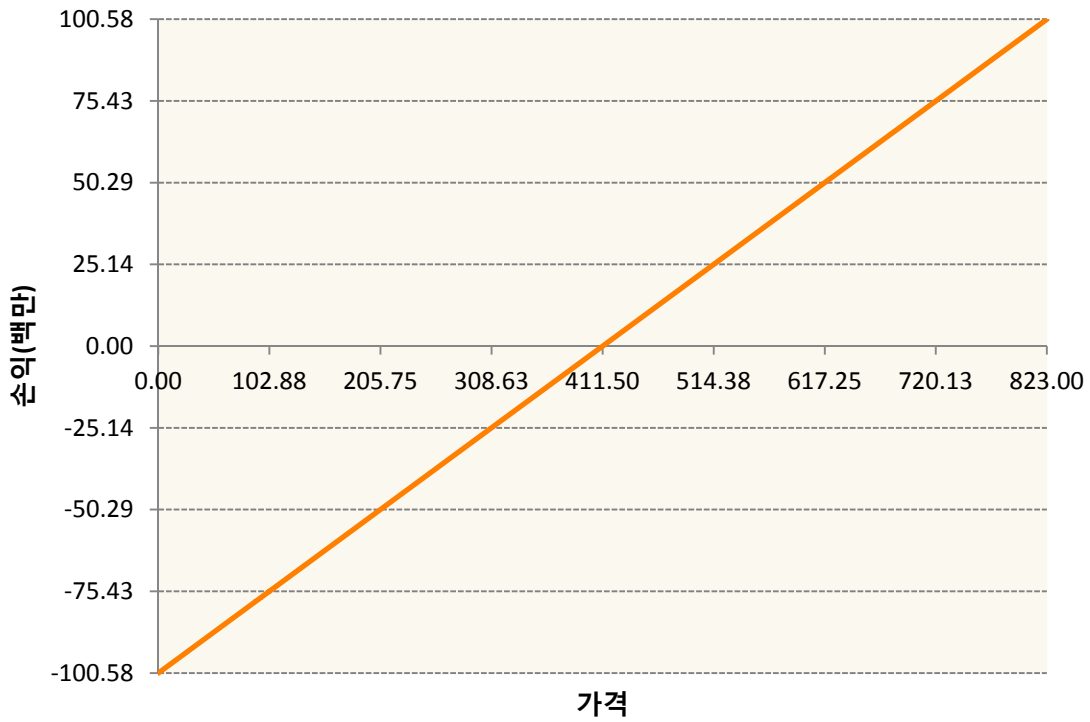




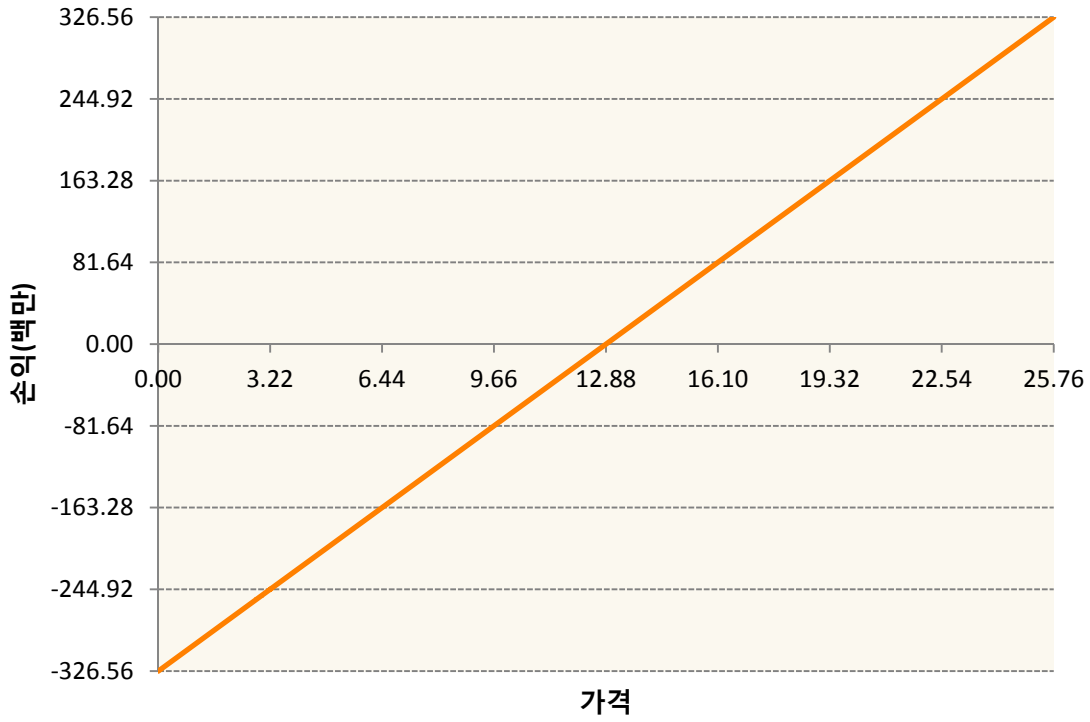
**KR4175PA0005-2019-10 달러선물**



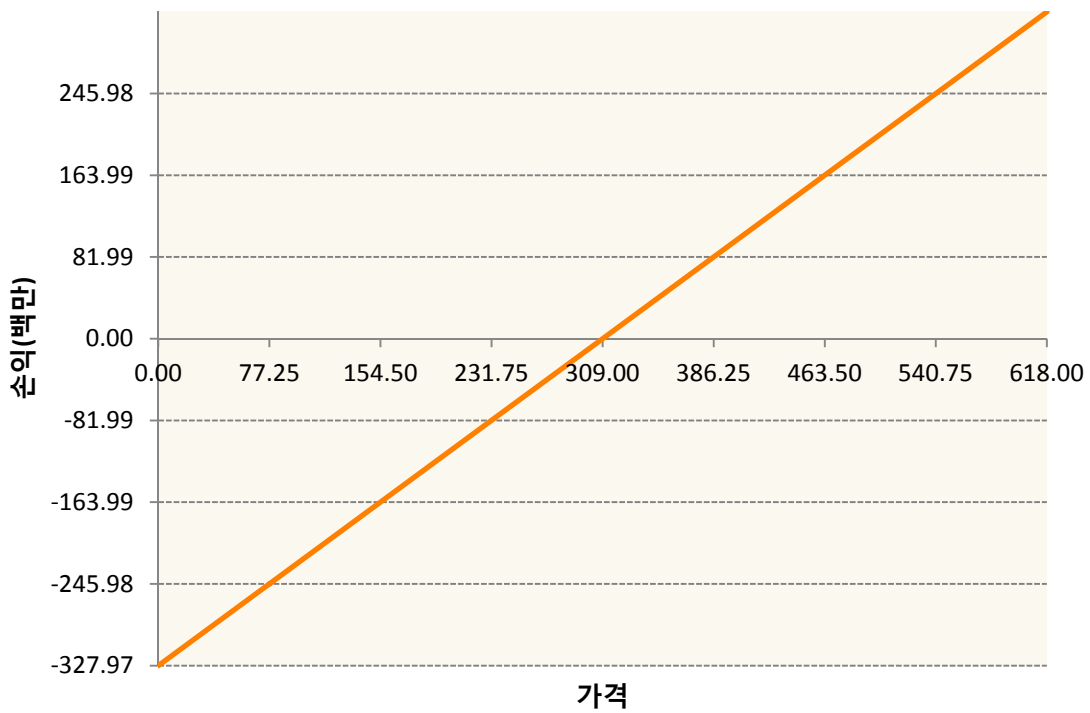
**KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19**



SBH0-Sugar Mar20

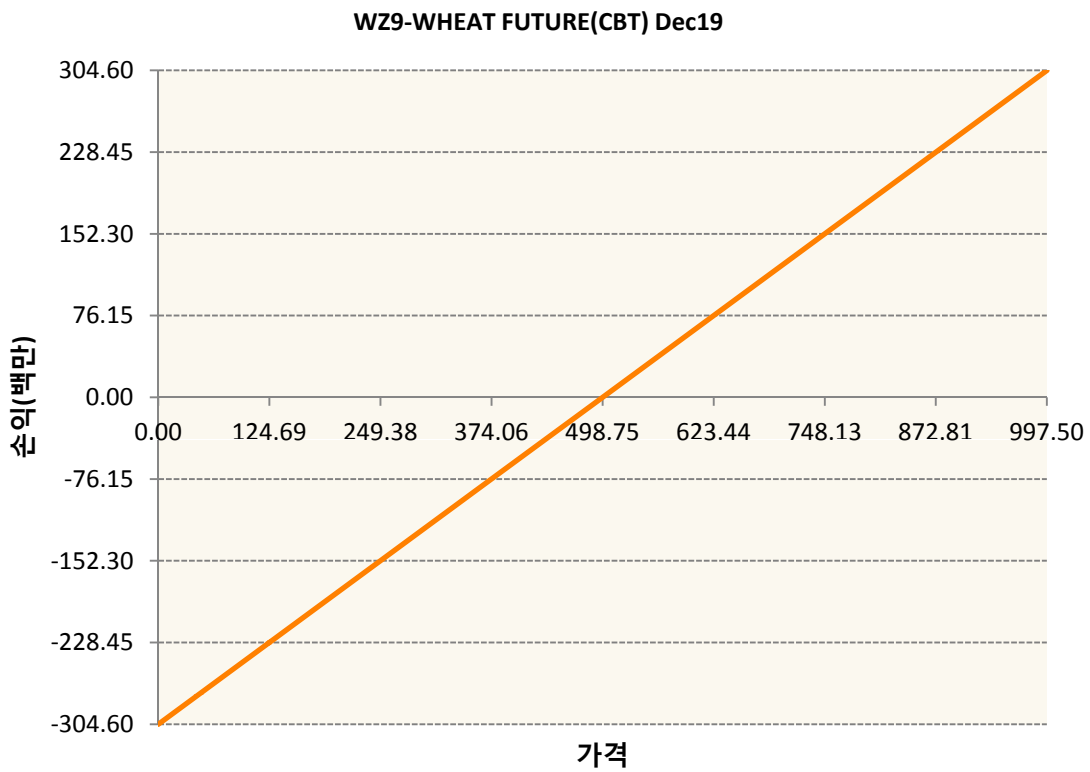
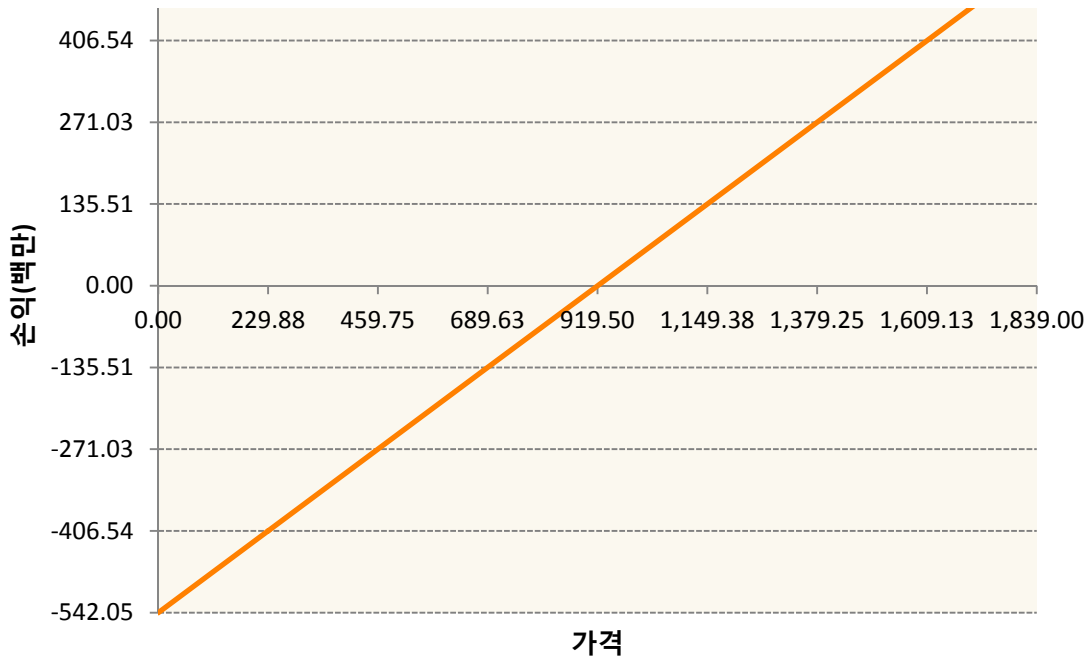


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



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	48
KCZ9	COFFEE 'C' FUTURE Dec19	19
KR4175PA00	2019-10 달러선물	8

KWZ9	KC HRW WHEAT FUT Dec19	8
SBH0	Sugar Mar20	26
SMZ9	SOYBEAN MEAL FUTR Dec19	26
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	43
WZ9	WHEAT FUTURE(CBT) Dec19	24

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

(단위:백만원)

**256**