

공시일	2019-10-07
기준일	2019-10-04

## 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)

93

공시일	2019-10-07
기준일	2019-10-04

## 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

1,146

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

660

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-10-07
기준일	2019-10-04

## 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)	374
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	137

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

<b>811</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-10-07
기준일	2019-10-04

## 유로인덱스모(주식-파생형)

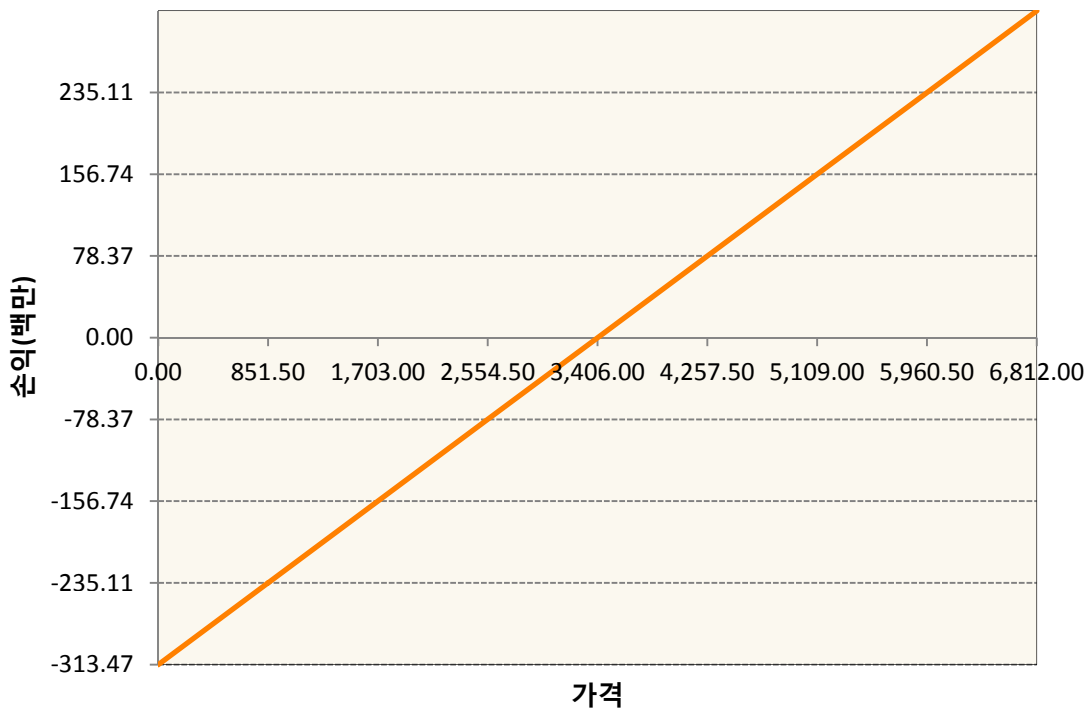
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	313	0	313	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGZ9-EURO STOXX 50 Dec19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	25
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

18
----

공시일	2019-10-07
기준일	2019-10-04

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

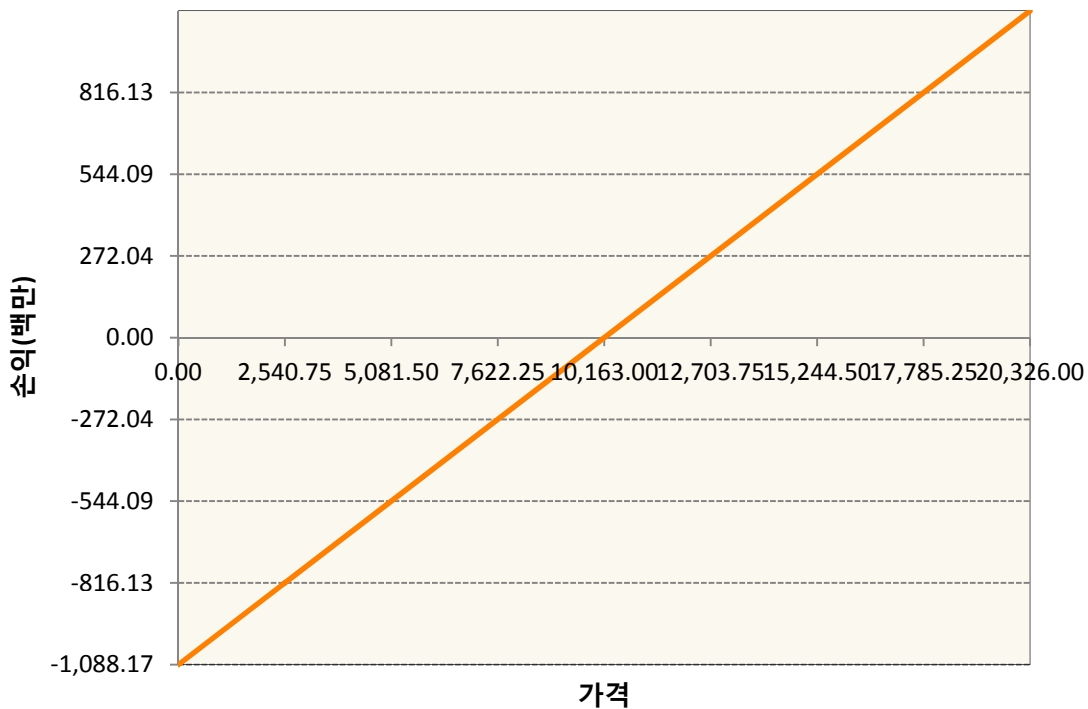
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,088	0	1,088	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCV9-HSCEI Futures Oct19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV9	HSCEI Futures Oct19	87
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

79
----

공시일	2019-10-07
기준일	2019-10-04

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

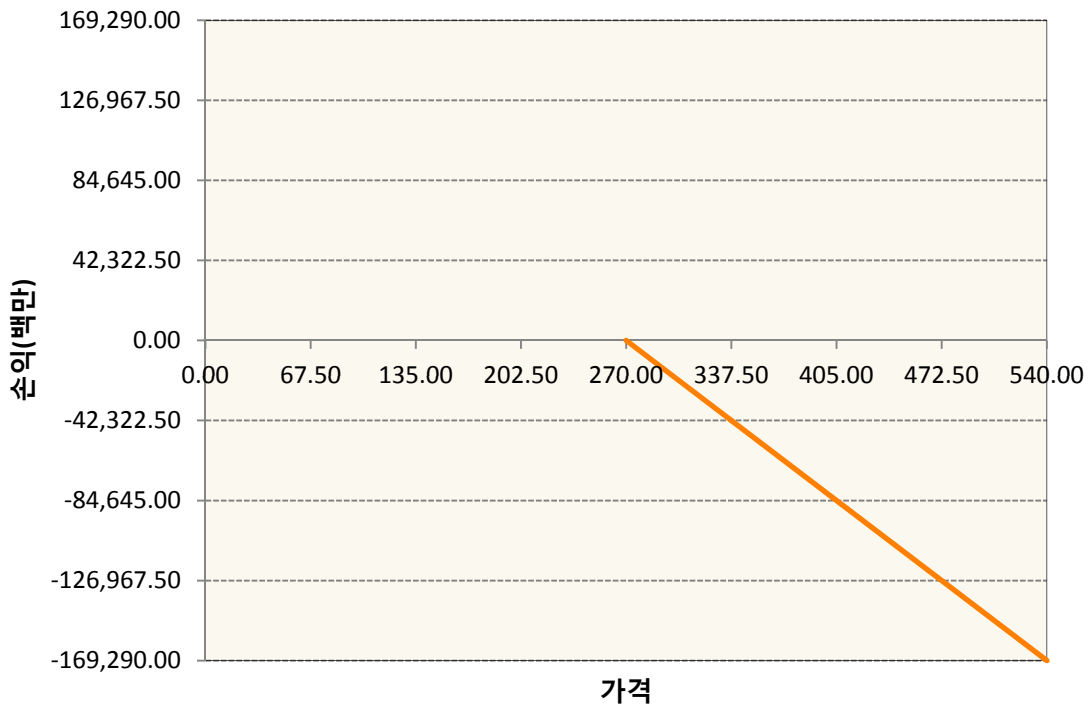
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

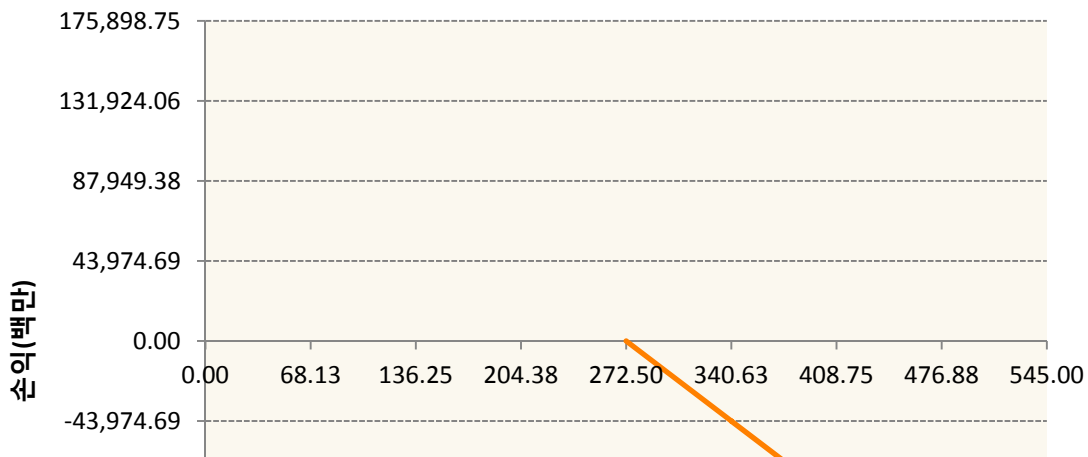
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	735	0	735	장내
누계	유가증권	옵션	0	513,196	-513,196	장내

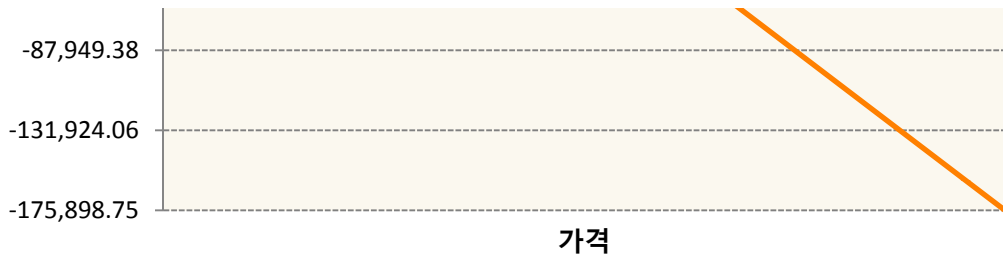
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201PA2702-2019-10 콜270**

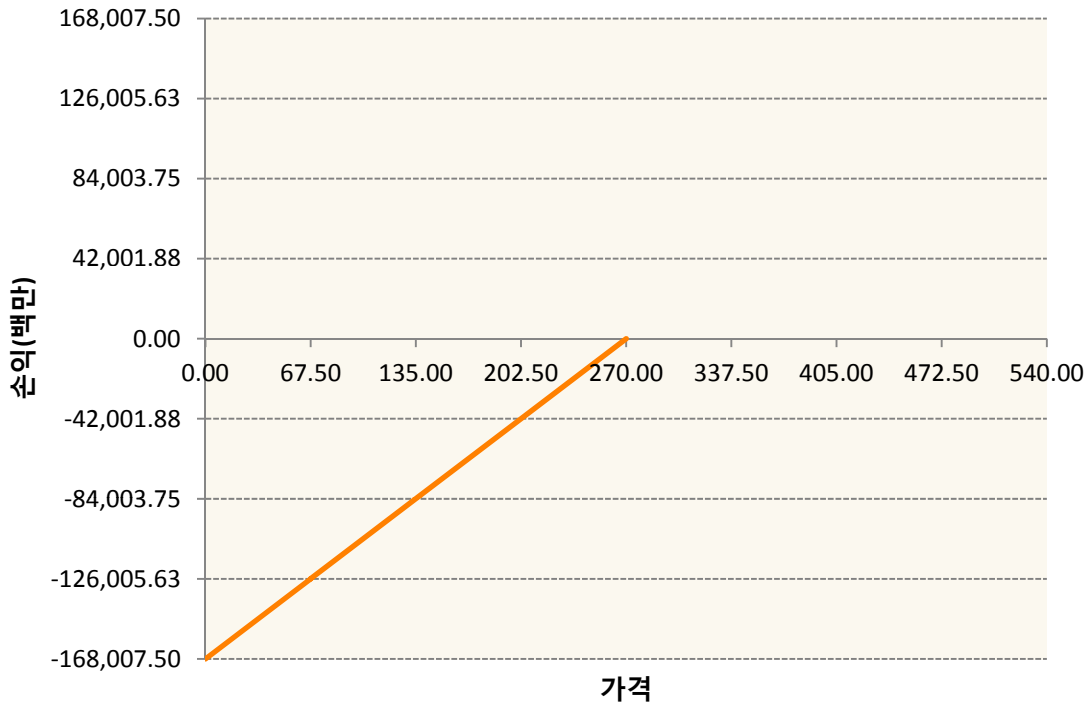


**KR4201PA2728-2019-10 콜272.5**





KR4301PA2701-2019-10 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PA2702		2019-10 콜270					10,377
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,549	1,549	1,547	1,544	1,538	1,529	1,515
-5.33%	1,542	1,531	1,514	1,488	1,453	1,408	1,355
-2.67%	1,409	1,336	1,249	1,150	1,041	923	797
0%	540	362	182	0	-183	-367	-552
2.67%	-1,939	-2,099	-2,265	-2,435	-2,608	-2,784	-2,962
5.33%	-5,817	-5,875	-5,947	-6,031	-6,128	-6,234	-6,350
8.00%	-10,201	-10,210	-10,226	-10,250	-10,283	-10,325	-10,377
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5					9,721
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,063	1,063	1,063	1,061	1,058	1,053	1,045

-5.33%	1,061	1,057	1,048	1,033	1,011	982	944
-2.67%	1,002	957	899	828	744	650	547
0%	479	326	166	0	-170	-344	-521
2.67%	-1,442	-1,634	-1,828	-2,023	-2,218	-2,414	-2,611
5.33%	-5,026	-5,122	-5,231	-5,353	-5,484	-5,624	-5,770
8.00%	-9,433	-9,453	-9,484	-9,526	-9,580	-9,645	-9,721
KR4301PA2701                      2019-10 풋270							12,573
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,573	-12,573	-12,573	-12,573	-12,573	-12,573	-12,573
-5.33%	-8,138	-8,138	-8,138	-8,139	-8,140	-8,143	-8,148
-2.67%	-3,711	-3,721	-3,737	-3,759	-3,787	-3,822	-3,862
0%	304	206	104	0	-106	-213	-322
2.67%	2,176	2,103	2,023	1,938	1,848	1,755	1,658
5.33%	2,380	2,375	2,366	2,352	2,333	2,308	2,277
8.00%	2,383	2,383	2,383	2,382	2,381	2,379	2,375

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

(단위:백만원)

**37,239**

공시일	2019-10-07
기준일	2019-10-04

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

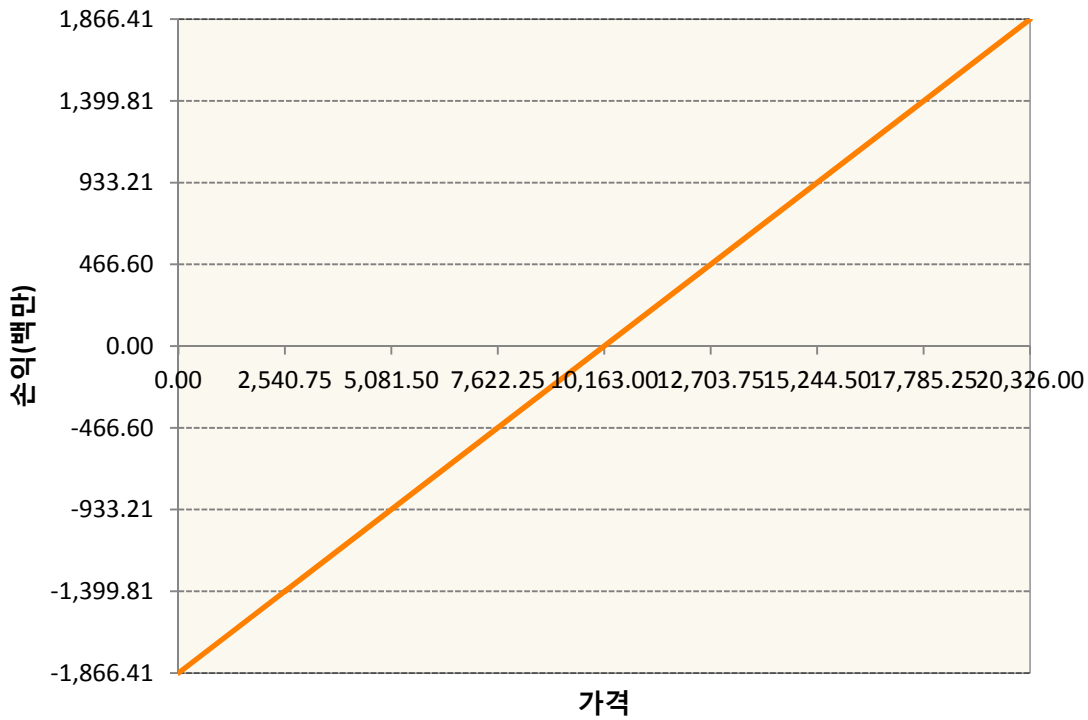
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

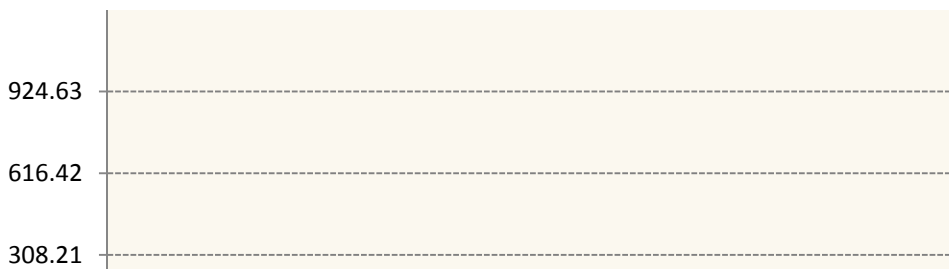
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,866	0	1,866	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,956	-4,956	장내
누계	통화	선도	687	2,835	-2,148	장외

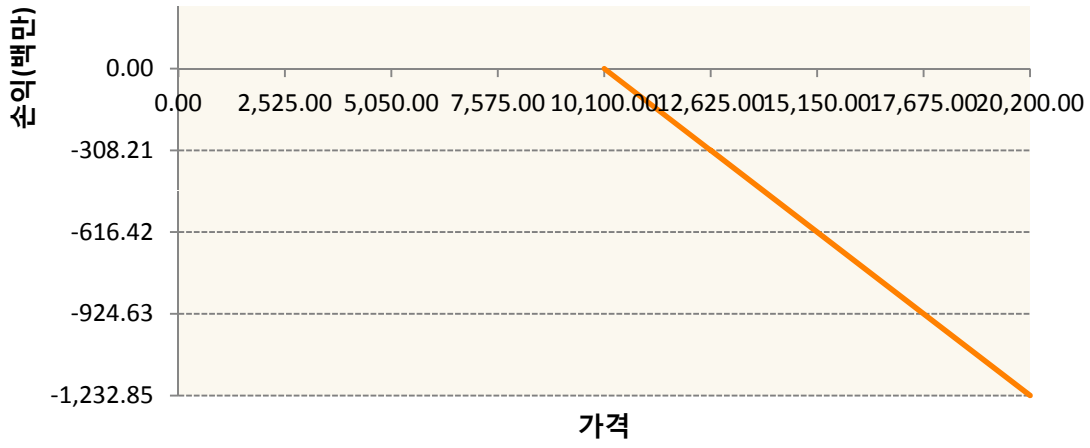
### 2. 만기시점의 손익구조

HCV9-HSCEI Futures Oct19

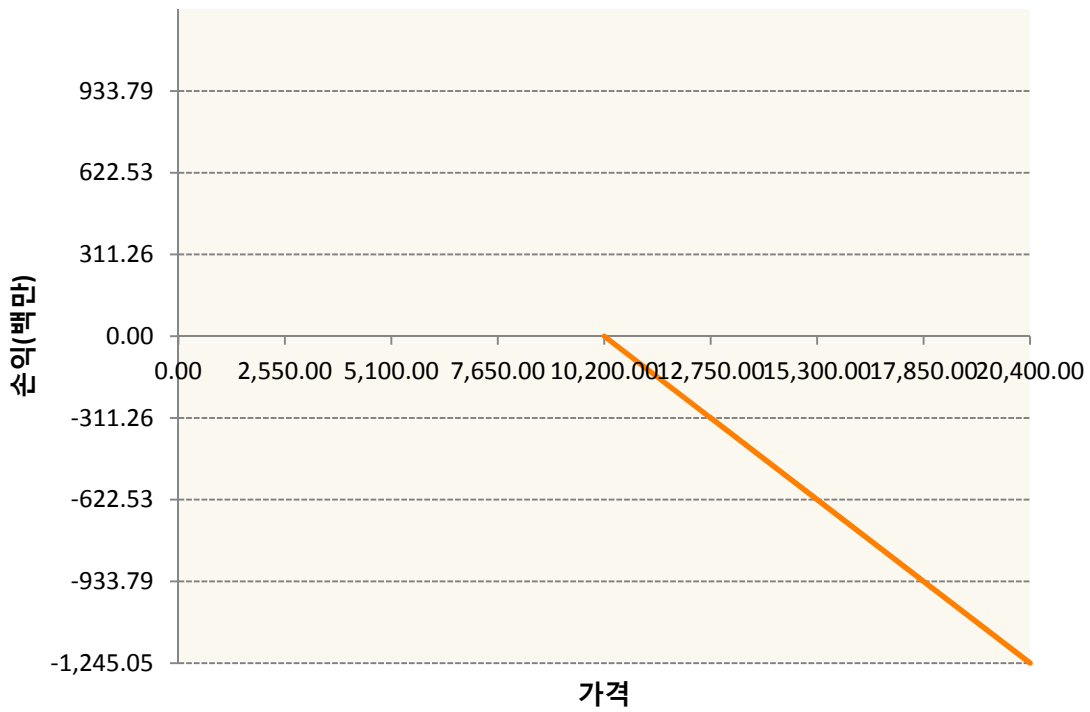


OHHIV9-C101-HSCEI

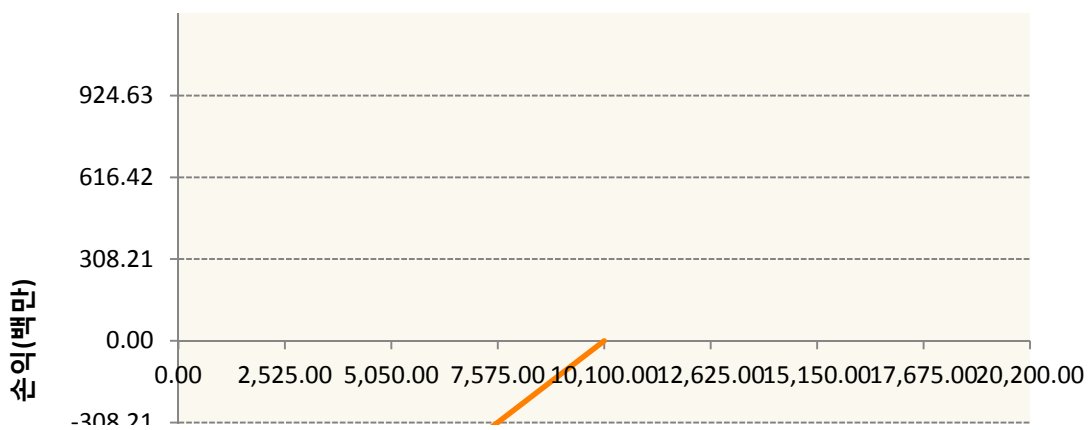


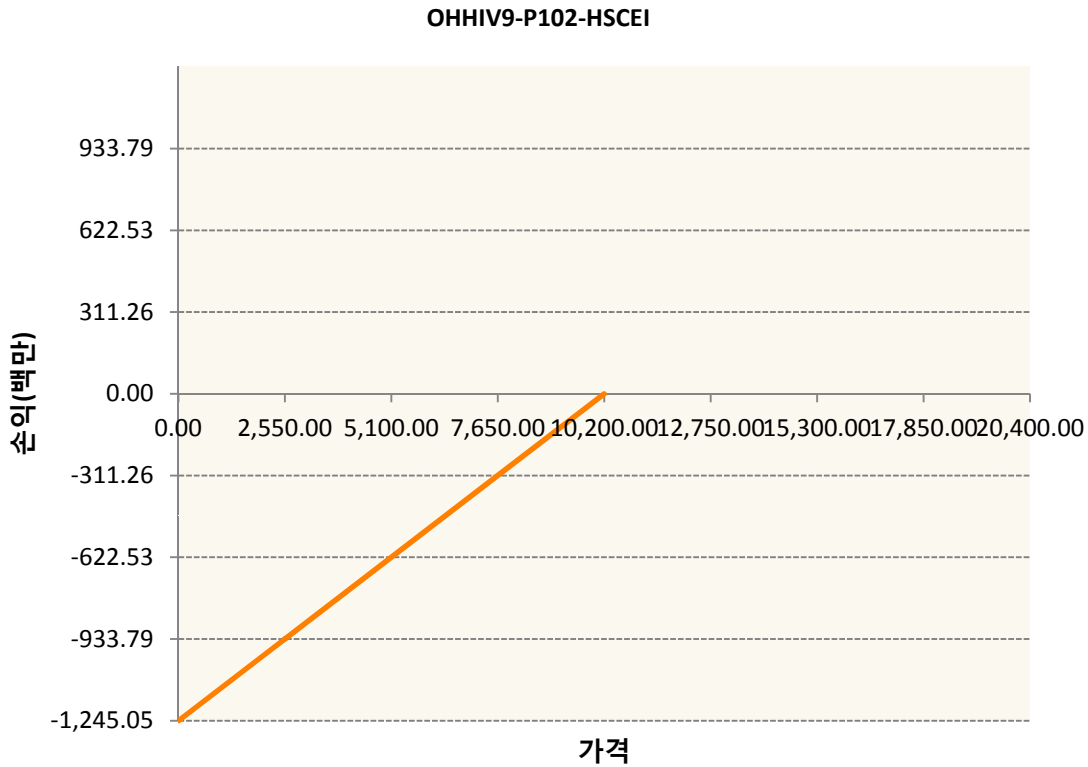
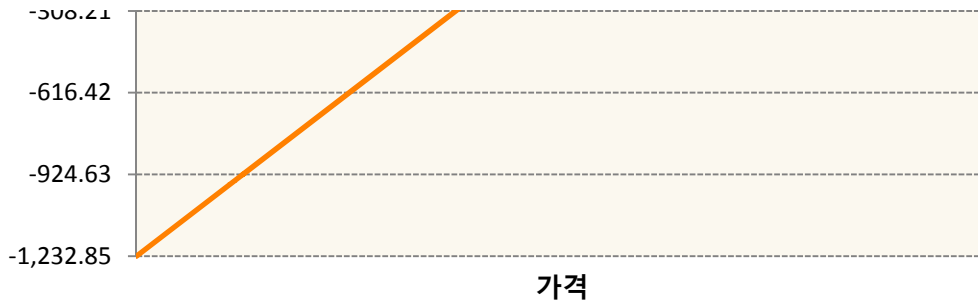


OHHIV9-C102-HSCEI



OHHIV9-P101-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	227
FX21019U00 HKD/KRW 22-11-19E	6
FX21019U02 HKD/KRW 22-11-19E	49
HCV9 HSCEI Futures Oct19	149
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)
	587

공시일	2019-10-07
기준일	2019-10-04

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

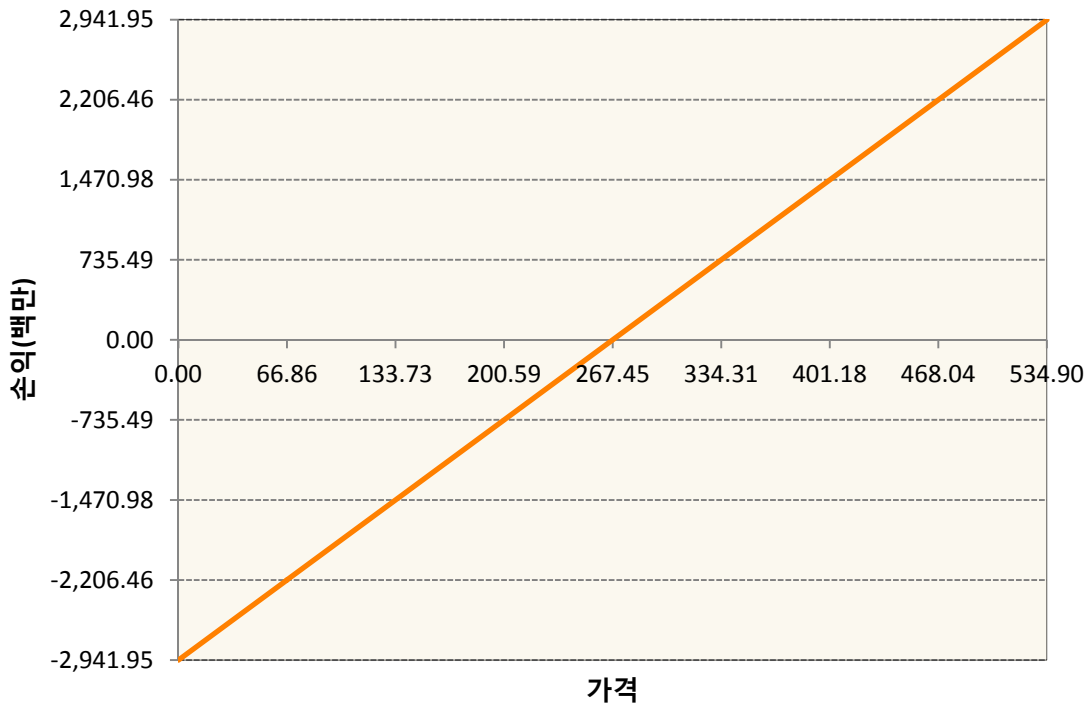
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

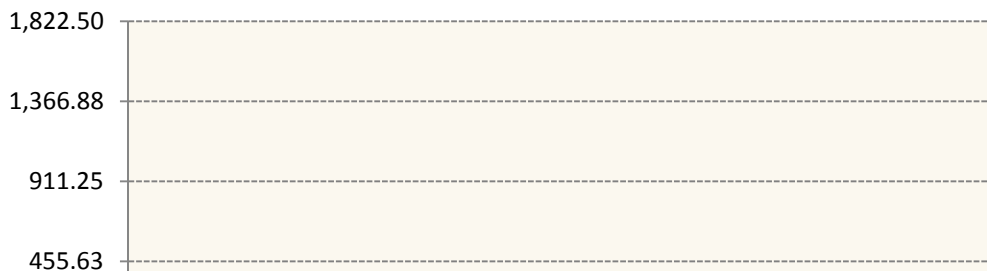
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,942	0	2,942	장내
누계	유가증권	스왑	10,625	0	10,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	10,968	-10,968	장내

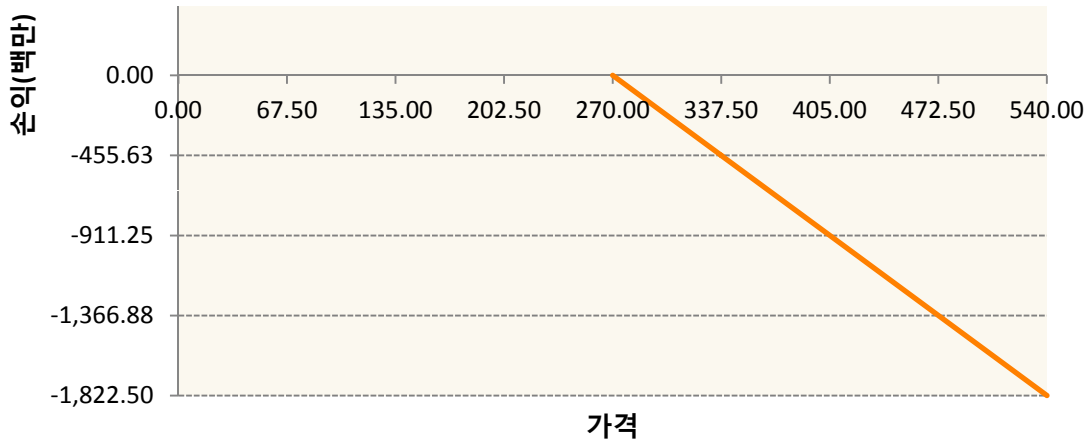
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

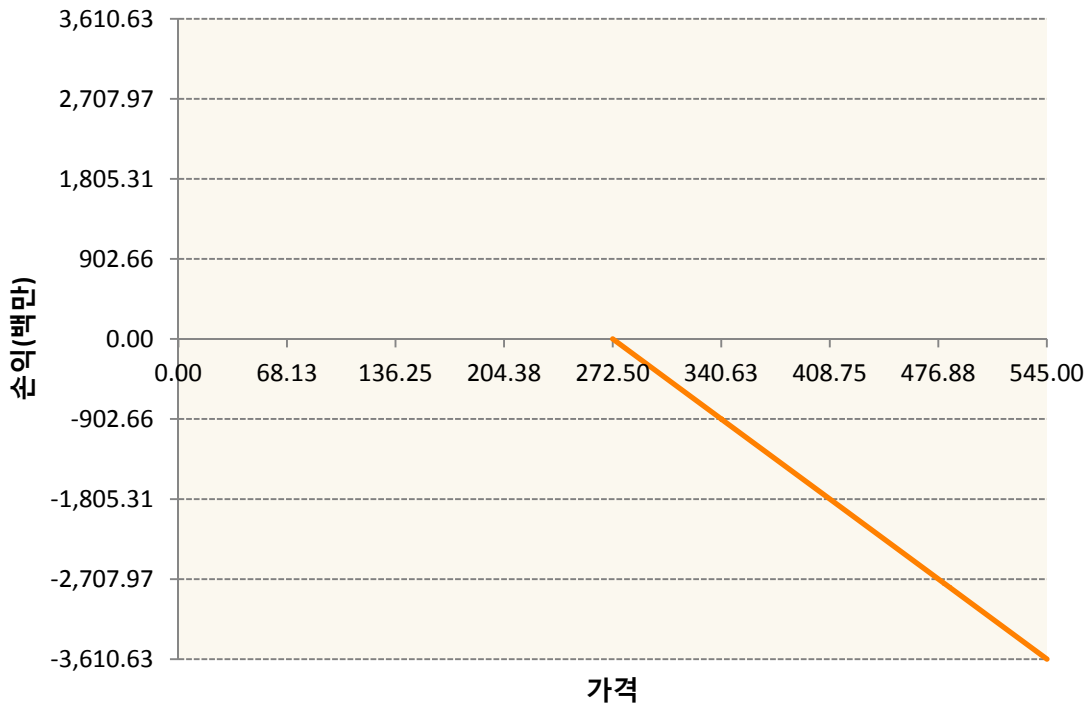


KR4201PA2702-2019-10 콜270

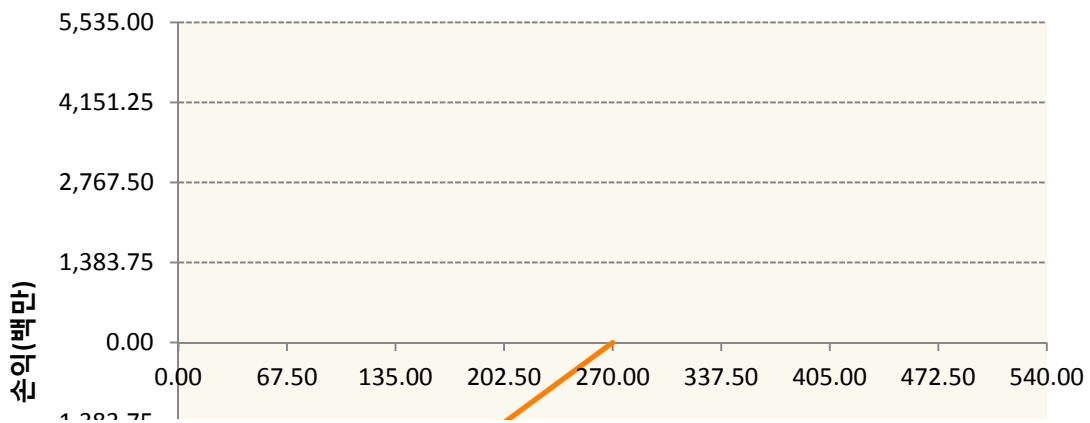


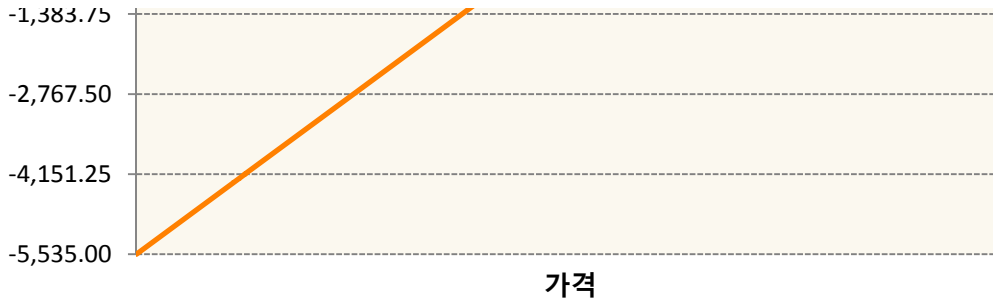


KR4201PA2728-2019-10 콜272.5



KR4301PA2701-2019-10 풋270





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						919
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-919	-919	-919	-919	-919	-919	-919	
-5.33%	-613	-613	-613	-613	-613	-613	-613	
-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%	613	613	613	613	613	613	613	
8.00%	919	919	919	919	919	919	919	
KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						235
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-235	-235	-235	-235	-235	-235	-235	
-5.33%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157	
-2.67%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	78	78	78	78	78	78	78	
5.33%	157	157	157	157	157	157	157	
8.00%	235	235	235	235	235	235	235	
KR4201PA2702		2019-10 콜270						112
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	17	17	17	17	17	16	16	
-5.33%	17	16	16	16	16	15	15	
-2.67%	15	14	13	12	11	10	9	
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6	
2.67%	-21	-23	-24	-26	-28	-30	-32	
5.33%	-63	-63	-64	-65	-66	-67	-68	
8.00%	-110	-110	-110	-110	-111	-111	-112	
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5						200
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	22	22	22	22	22	22	21
-5.33%	22	22	22	21	21	20	19
-2.67%	21	20	18	17	15	13	11
0%	10	7	3	0	-3	-7	-11
2.67%	-30	-34	-38	-42	-46	-50	-54
5.33%	-103	-105	-107	-110	-113	-115	-118
8.00%	-194	-194	-195	-196	-197	-198	-200
KR4301PA2701                      2019-10 풋270							414
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-414	-414	-414	-414	-414	-414	-414
-5.33%	-268	-268	-268	-268	-268	-268	-268
-2.67%	-122	-123	-123	-124	-125	-126	-127
0%	10	7	3	0	-3	-7	-11
2.67%	72	69	67	64	61	58	55
5.33%	78	78	78	77	77	76	75
8.00%	79	79	79	78	78	78	78

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

(단위:백만원)

**1,984**

공시일	2019-10-07
기준일	2019-10-04

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

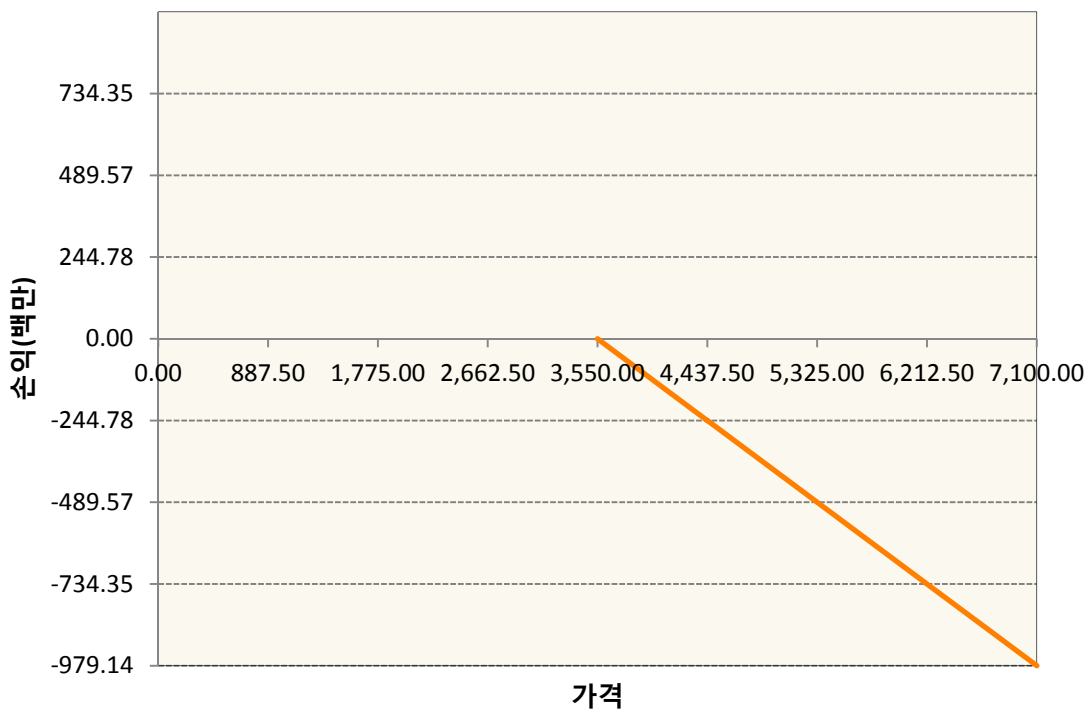
### 1. 계약금액

(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	4,028	0	4,028	
누계	유가증권	스왑	23,899	0	23,899	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,260	-14,260	장내
누계	통화	선도	0	6,173	-6,173	장외

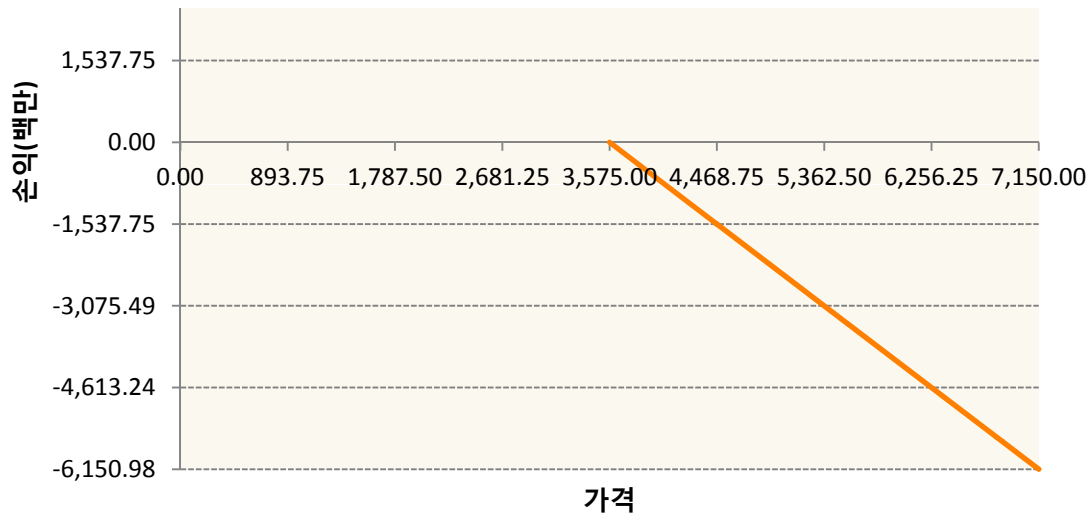
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXV9-C3550-EURO STOXX 50

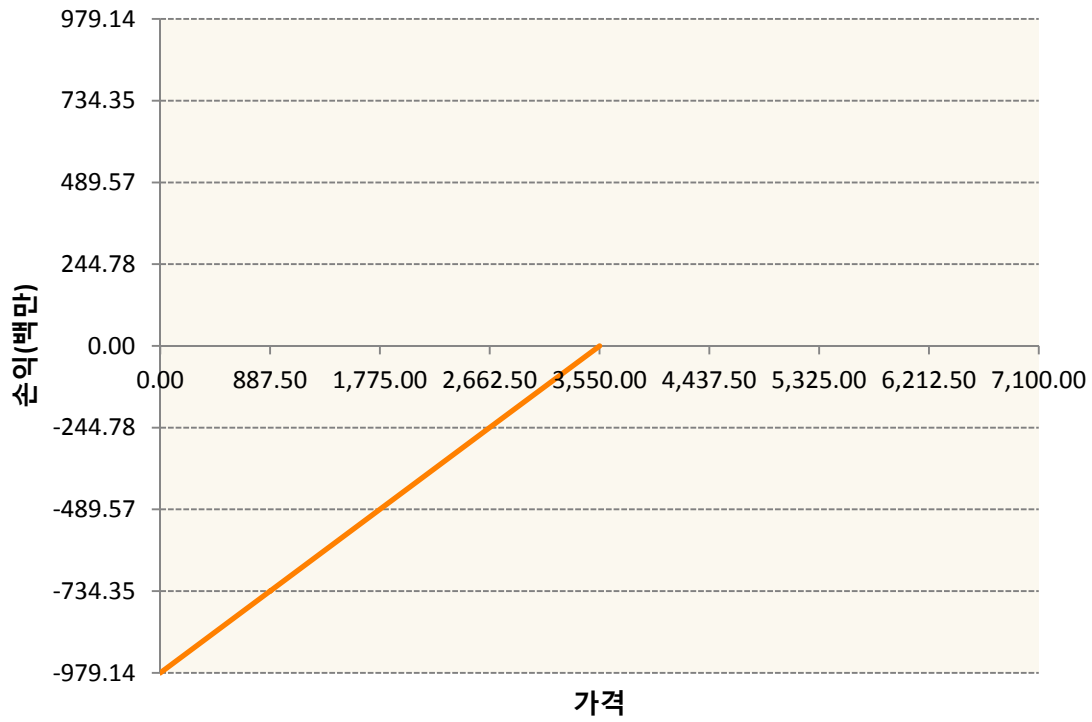


OESXV9-C3575-EURO STOXX 50

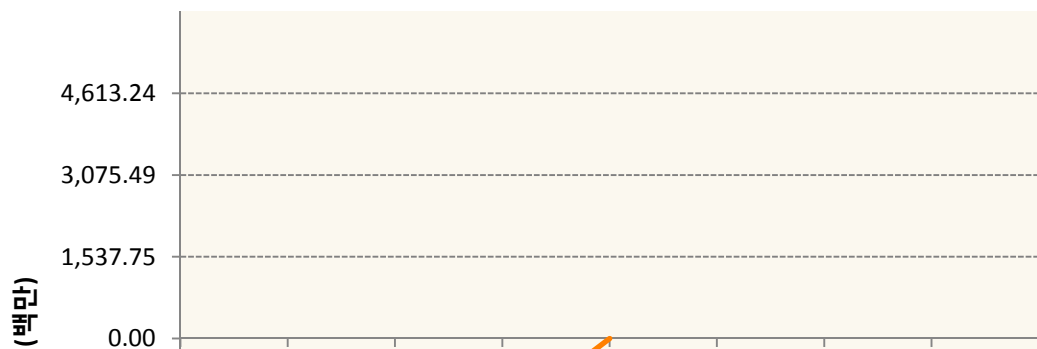


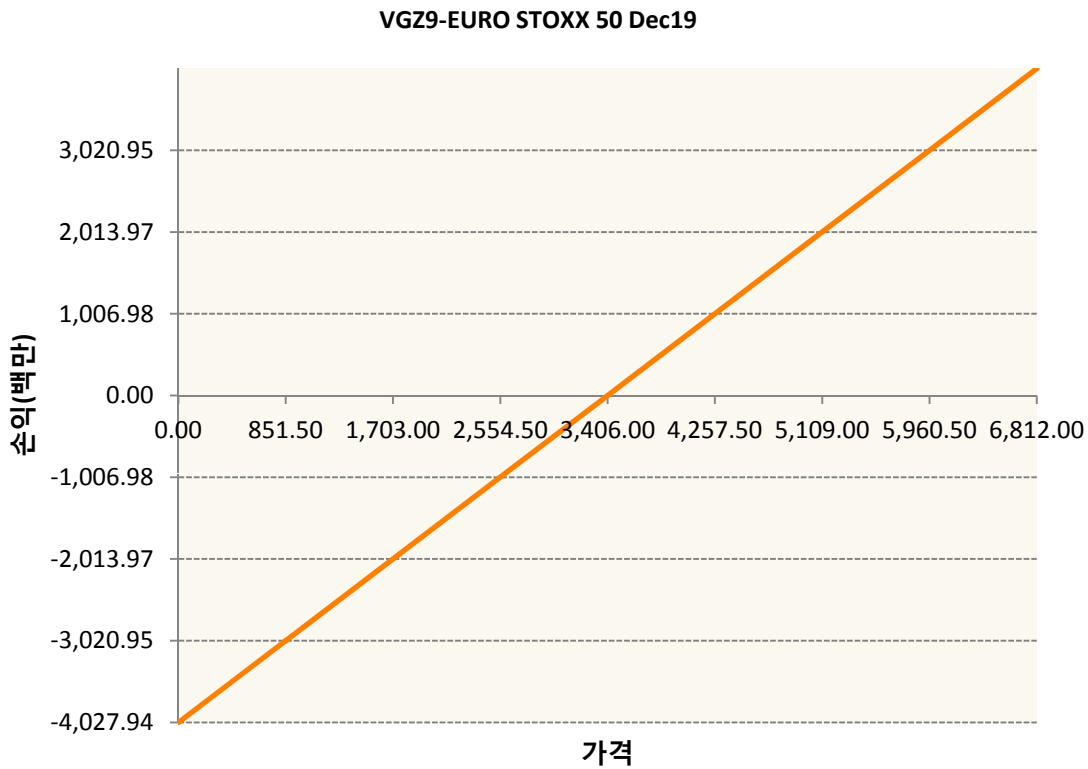
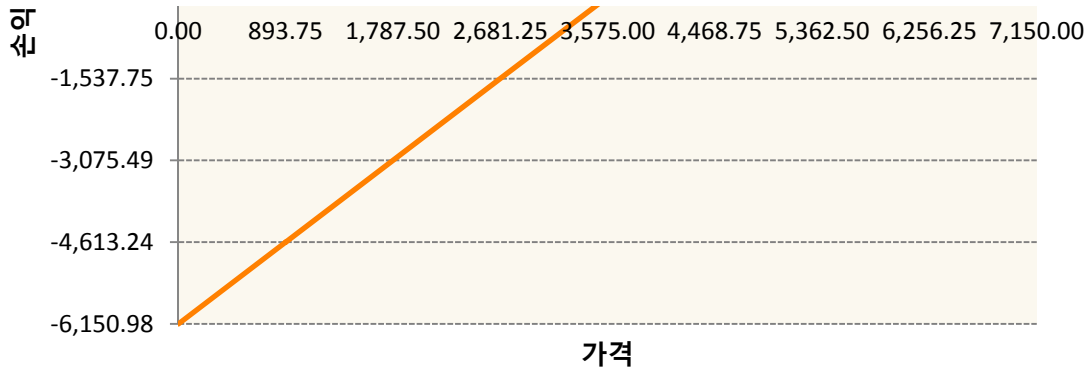


OESXV9-P3550-EURO STOXX 50



OESXV9-P3575-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		81
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E		494
OESXV9-C35 EURO STOXX 50		78
OESXV9-C35 EURO STOXX 50		492
OESXV9-P35 EURO STOXX 50		78
OESXV9-P35 EURO STOXX 50		492
VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	322

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





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

(단위:백만원)

973



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

(단위:백만원)

84



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

(단위:백만원)

130

공시일	2019-10-07
기준일	2019-10-04

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

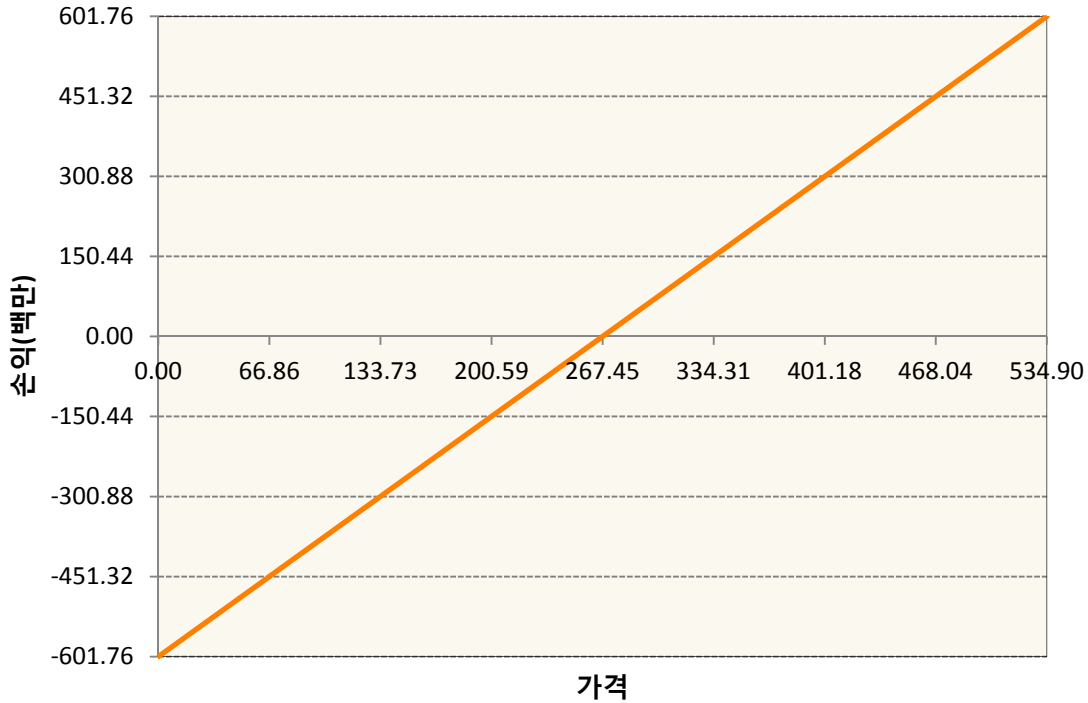
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	602	0	602	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	2019-10-07
기준일	2019-10-04

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

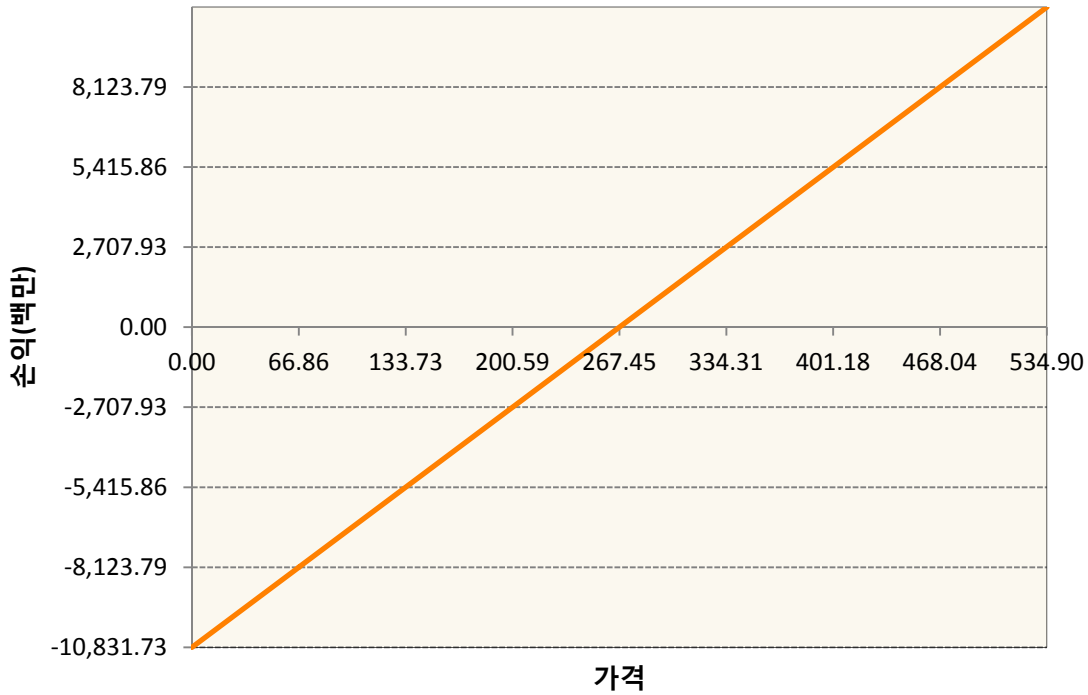
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

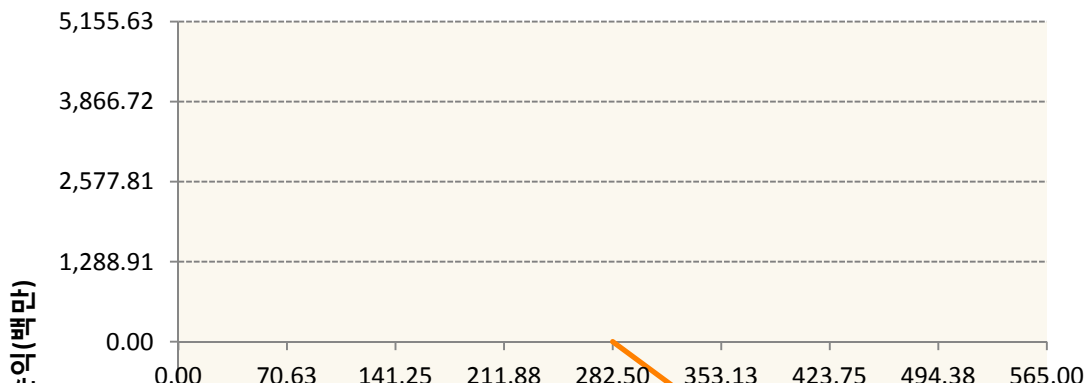
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,832	0	10,832	장내
누계	유가증권	옵션	1,422	20,759	-19,338	장내

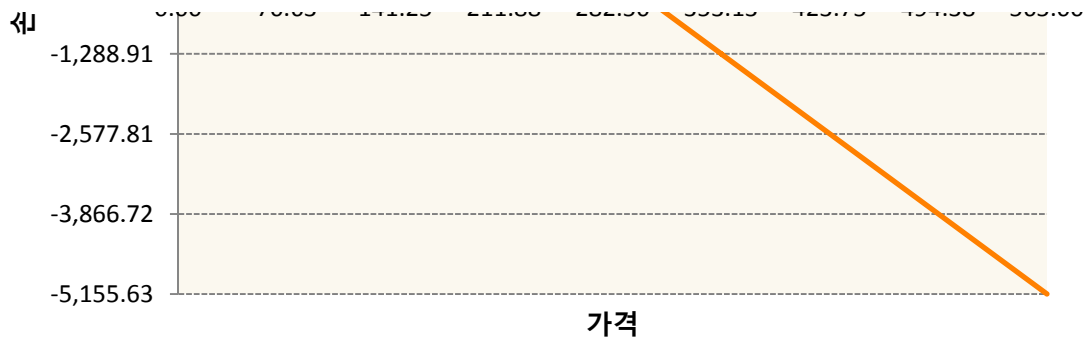
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

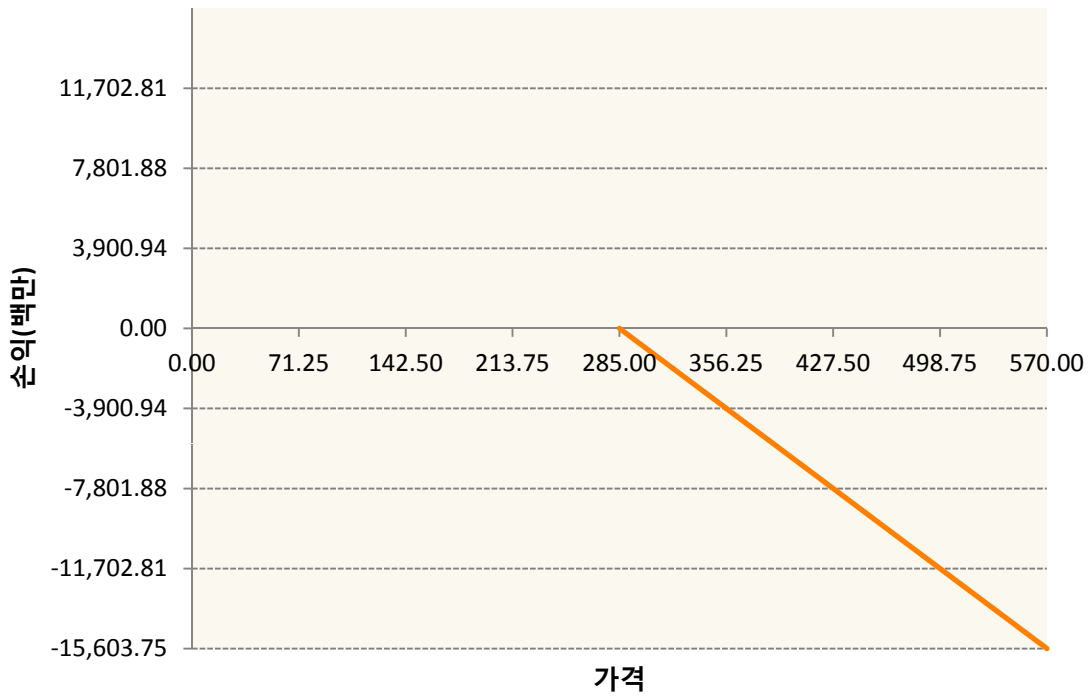


KR4201PA2827-2019-10 콜282.5

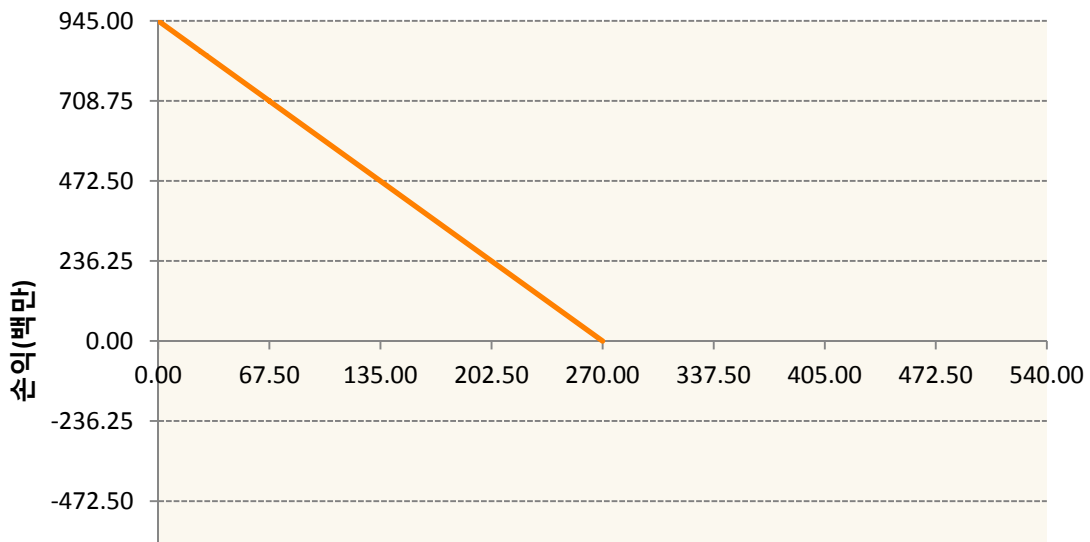


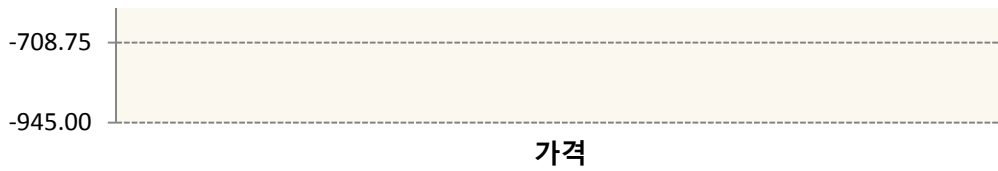


**KR4201PA2850-2019-10 콜285**

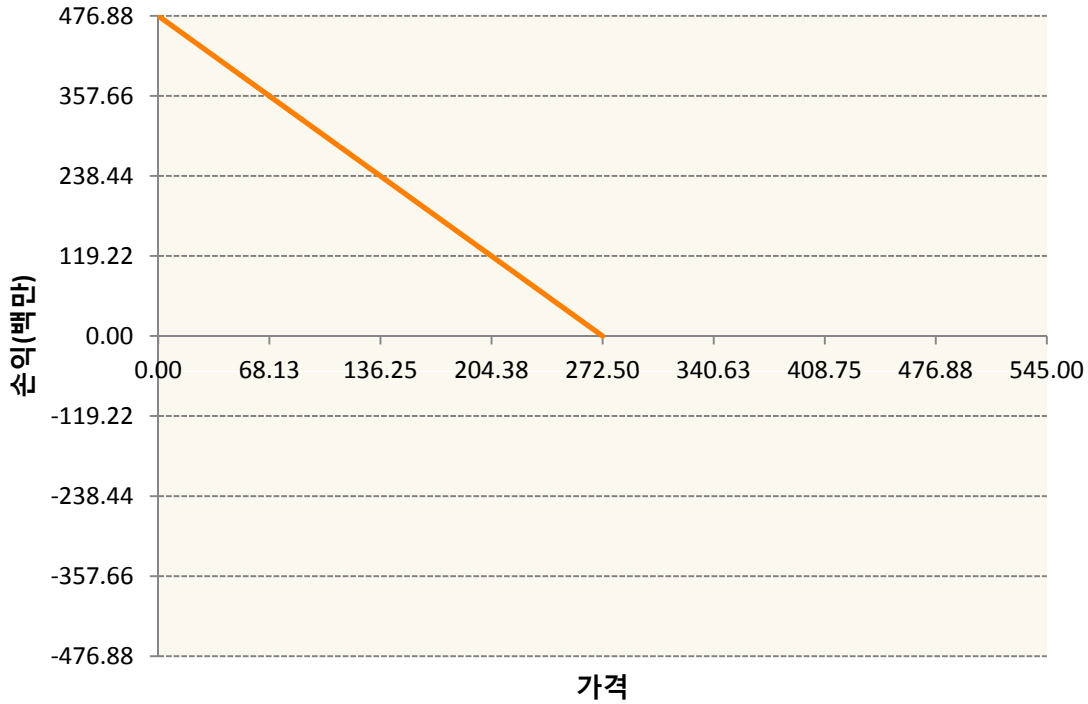


**KR4301PA2701-2019-10 풋270**





KR4301PA2727-2019-10 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						866
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-866	-866	-866	-866	-866	-866	-866	
-5.33%	-578	-578	-578	-578	-578	-578	-578	
-2.67%	-289	-289	-289	-289	-289	-289	-289	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	289	289	289	289	289	289	289	
5.33%	578	578	578	578	578	578	578	
8.00%	866	866	866	866	866	866	866	
KR4201PA2827		2019-10 콜282.5						153
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4	4	4	4	4	4	4	
-5.33%	4	4	4	4	4	4	3	
-2.67%	4	4	4	3	3	2	2	

0%	3	2	1	0	-2	-4	-6
2.67%	-5	-8	-11	-15	-19	-24	-28
5.33%	-41	-47	-52	-58	-64	-70	-76
8.00%	-124	-129	-133	-138	-143	-148	-153
KR4201PA2850 2019-10 콜285							375
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6	6	6	6	6	6	6
-5.33%	6	6	6	6	6	6	5
-2.67%	6	6	6	5	5	4	2
0%	5	4	2	0	-3	-8	-13
2.67%	-6	-13	-20	-29	-39	-50	-61
5.33%	-76	-92	-108	-124	-141	-158	-174
8.00%	-276	-292	-308	-325	-341	-358	-375
KR4301PA2701 2019-10 풋270							71
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	71	71	71	71	71	71	71
-5.33%	46	46	46	46	46	46	46
-2.67%	21	21	21	21	21	21	22
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-12	-12	-11	-11	-10	-10	-9
5.33%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
8.00%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
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%	24	24	24	24	24	24	24
-2.67%	11	11	12	12	12	12	12
0%	-1	0	0	0	0	0	1
2.67%	-8	-8	-8	-7	-7	-7	-7
5.33%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-9
8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10

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

(단위:백만원)

1,081

공시일	2019-10-07
기준일	2019-10-04

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	7,181	0	7,181	
누계	유가증권	수익증권	131,423	0	131,423	

### 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	2019-10-07
기준일	2019-10-04

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	11,968	0	11,968	
누계	유가증권	수익증권	171,805	0	171,805	

### 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	2019-10-07
기준일	2019-10-04

## 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	411,622	0	411,622	
누계	통화	선도	0	410,622	-410,622	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,926
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,543
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E	957
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E	957
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E	191
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E	1,379
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E	2,049
FX21019U01 KRW/USD 10-10-19E	287
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E	191
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E	2,336
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E	1,723
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E	191
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E	957
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E	1,474
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	2,978
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	3,160
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	2,623
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E	1,915
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E	2,011

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

(단위:백만원)

**10,788**

공시일	2019-10-07
기준일	2019-10-04

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

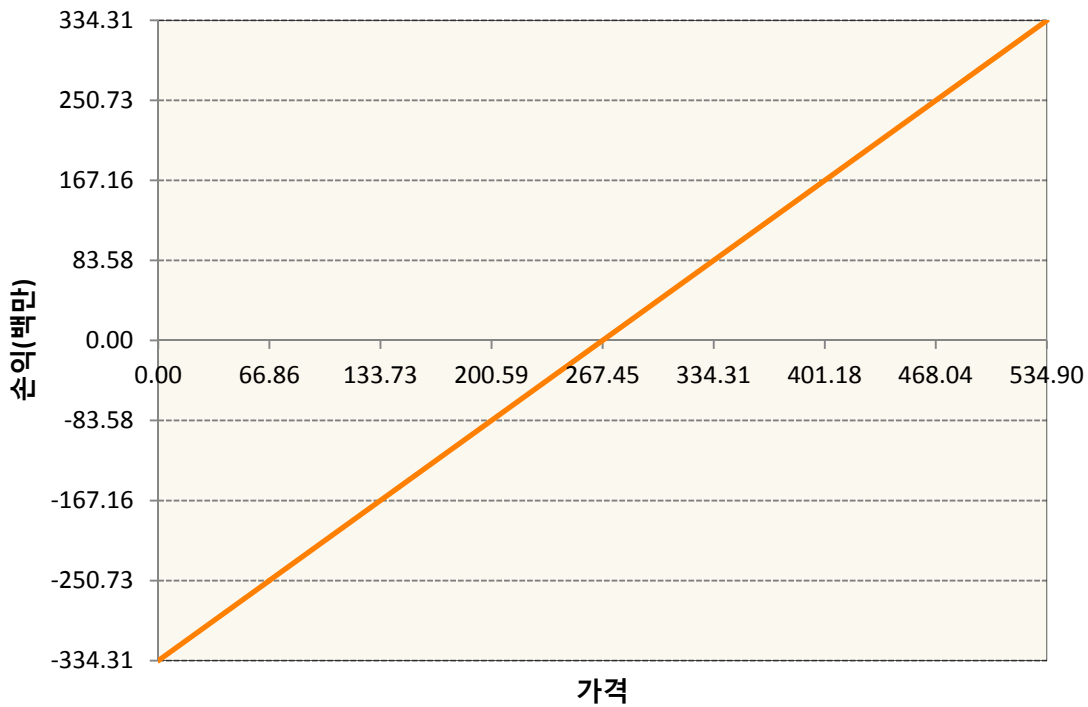
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

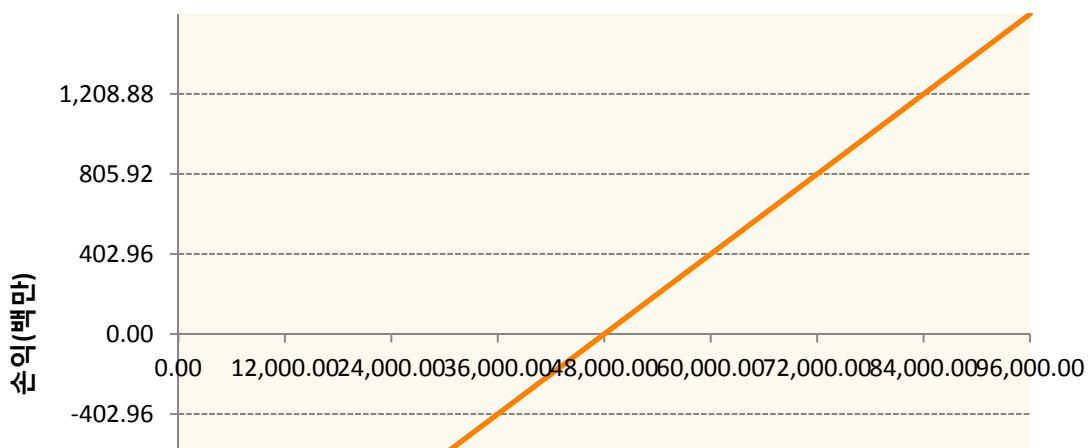
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,946	0	1,946	장내

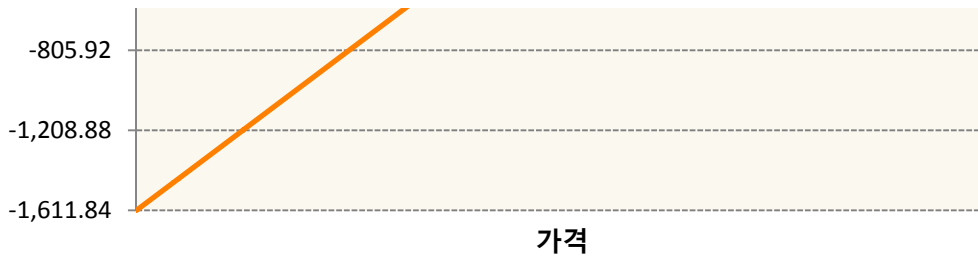
### 2. 만기시점의 손익구조

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						129
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-129	-129	-129	-129	-129	-129	-129	
-5.33%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86	
-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%	86	86	86	86	86	86	86	
8.00%	129	129	129	129	129	129	129	

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

**185**

공시일	2019-10-07
기준일	2019-10-04

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

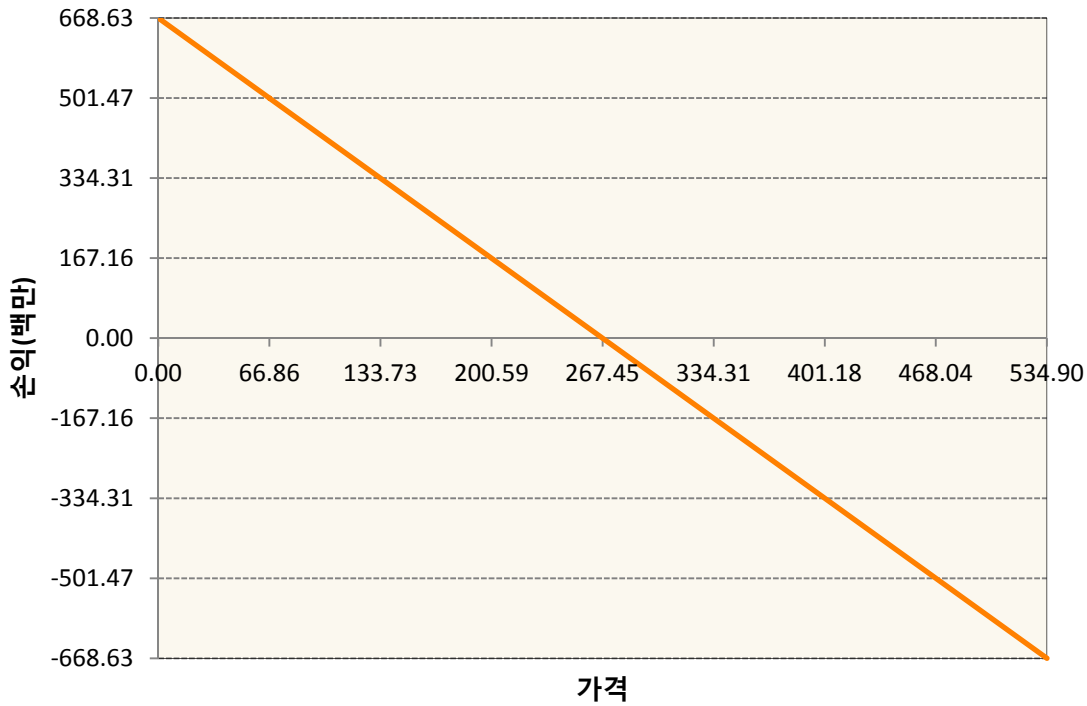
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

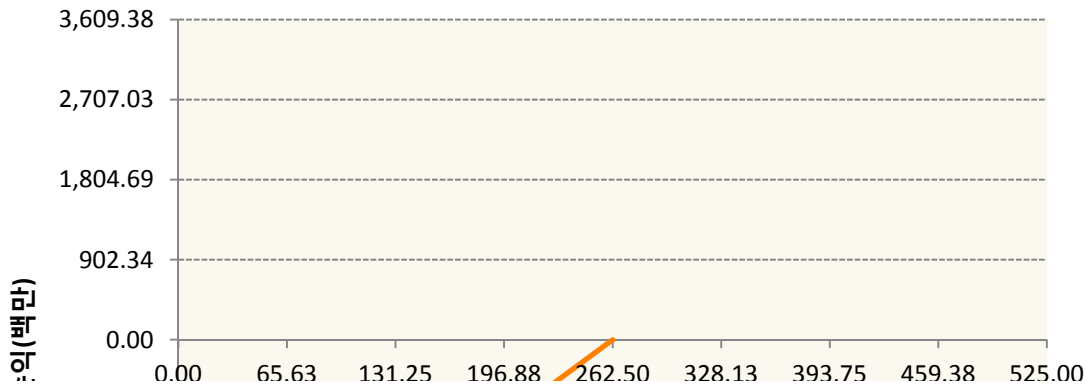
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	669	-669	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,007	-4,007	장내

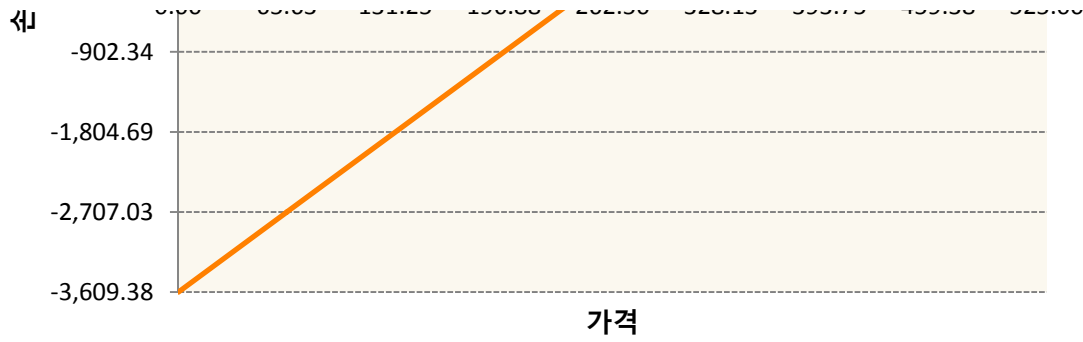
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

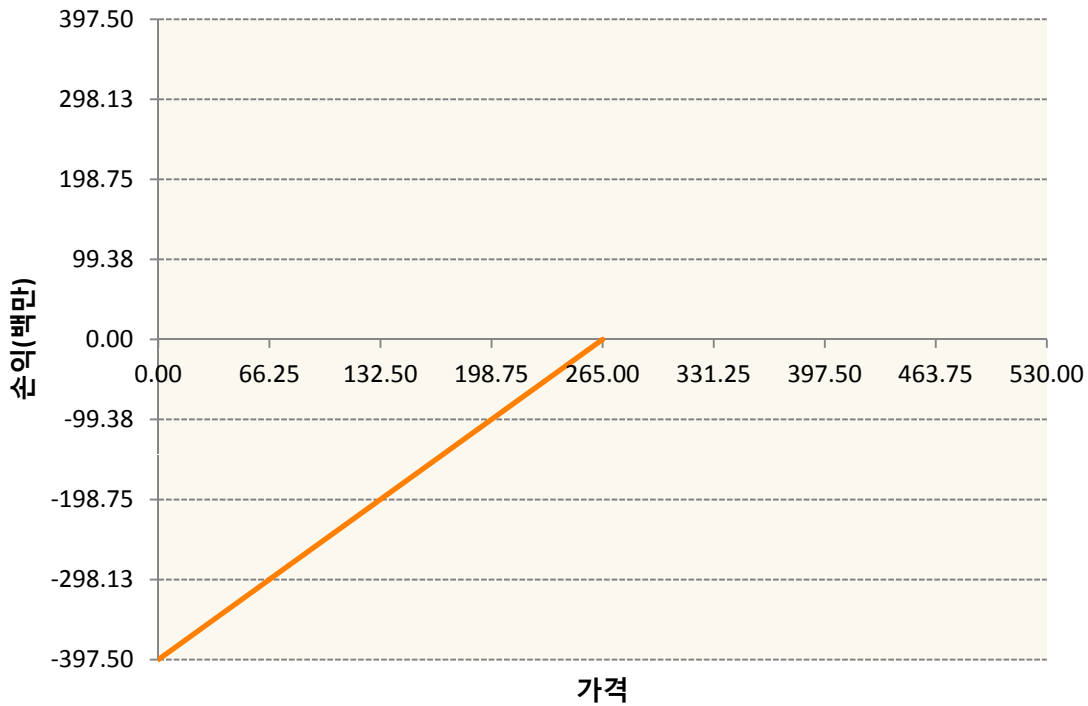


KR4301PA2628-2019-10 풋262.5





KR4301PA2651-2019-10 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						53
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	53	53	53	53	53	53	53	
-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%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53	
KR4301PA2628		2019-10 풋262.5						219
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-219	-219	-219	-219	-219	-219	-219
-5.33%	-121	-122	-122	-122	-123	-124	-125
-2.67%	-34	-36	-38	-40	-43	-45	-47
0%	5	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	8	8	8	8	7	7	6
5.33%	8	8	8	8	8	8	8
8.00%	8	8	8	8	8	8	8

KR4301PA2651

2019-10 풋265

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%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
-2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-7	-7
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	2	2	2	2	2	2	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)

299

공시일	2019-10-07
기준일	2019-10-04

## 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	17,211	0	17,211	
누계	통화	선도	718	17,713	-16,995	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		479
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		613
FX21019U05 USD/KRW 18-10-19E		19
FX21019V00 USD/KRW 18-10-19E		38

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

(단위:백만원)

484
-----

공시일	2019-10-07
기준일	2019-10-04

## 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	303	0	303	장외
누계	통화	선도	118	157	-39	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)

<b>31</b>
-----------

공시일	2019-10-07
기준일	2019-10-04

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

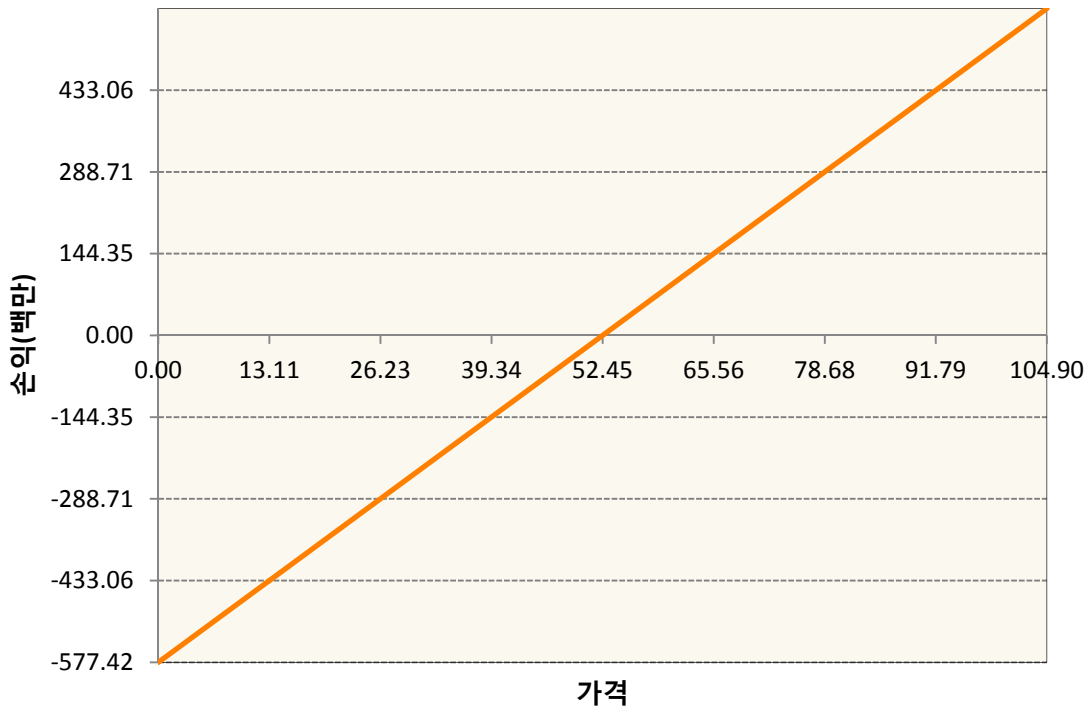
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

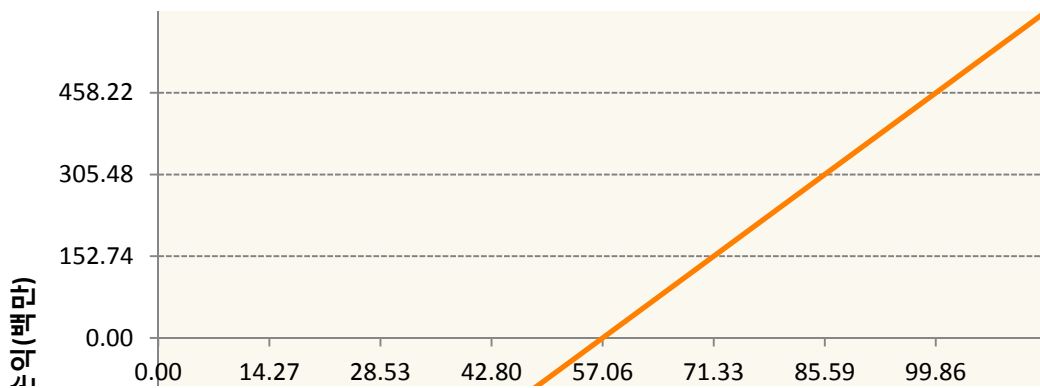
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,231	359	1,872	
누계	유가증권	선물	192	0	192	장내

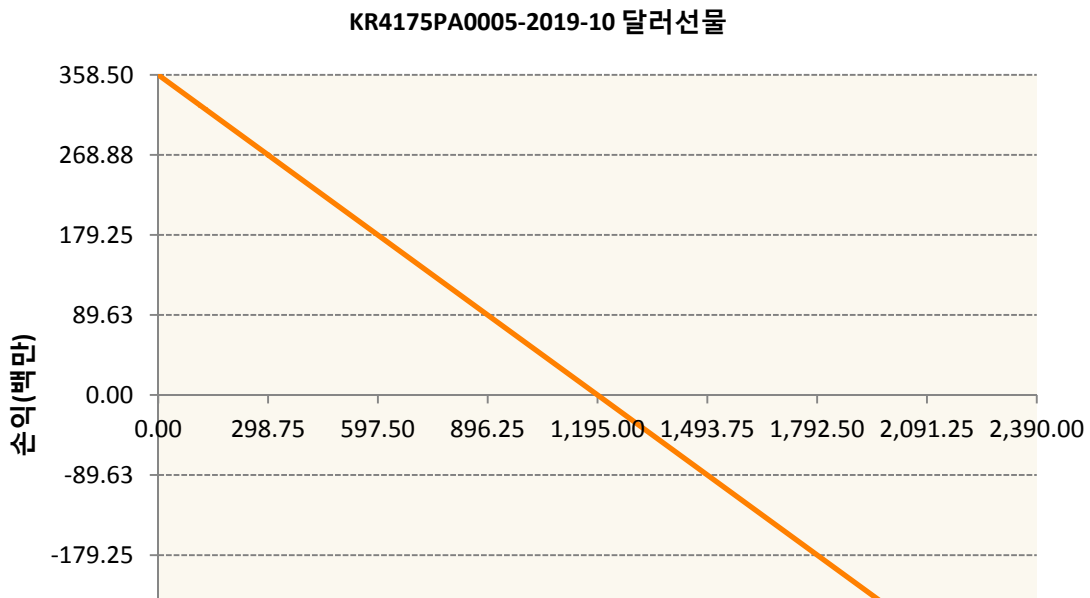
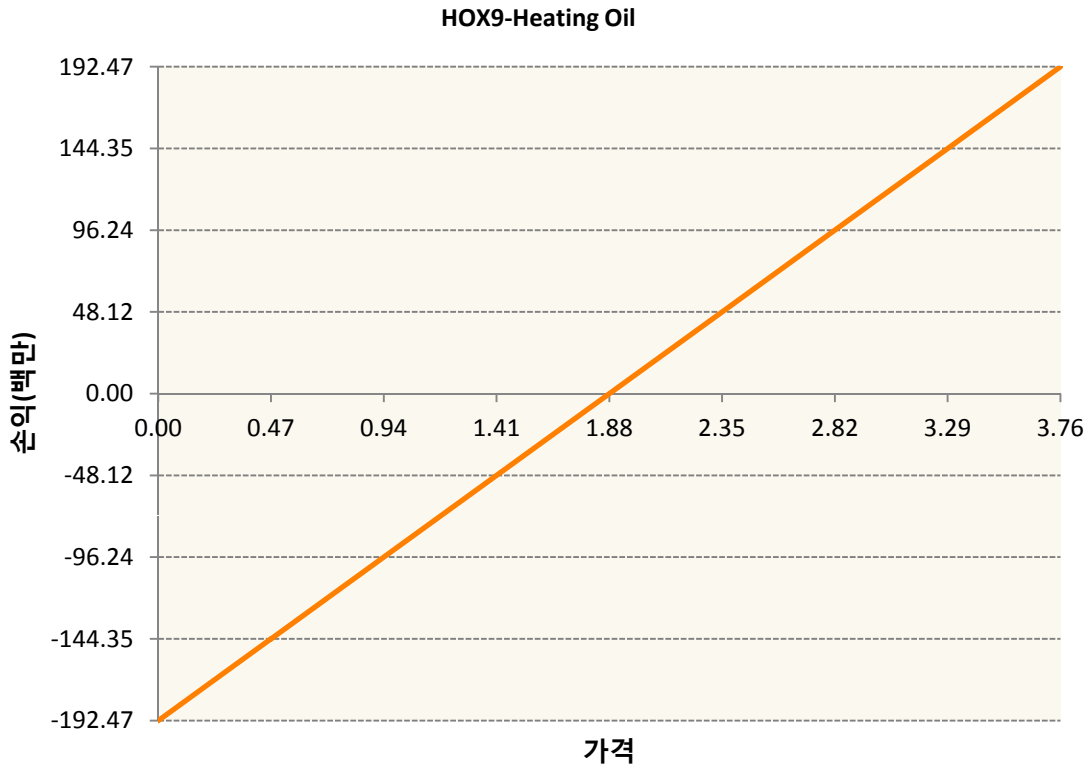
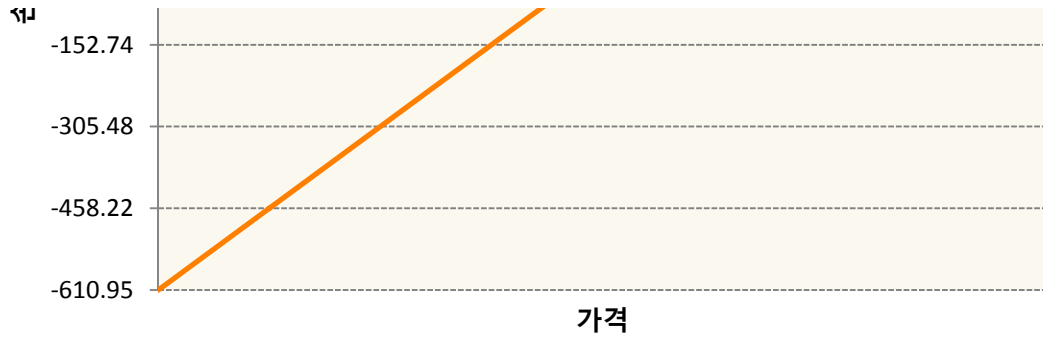
### 2. 만기시점의 손익구조

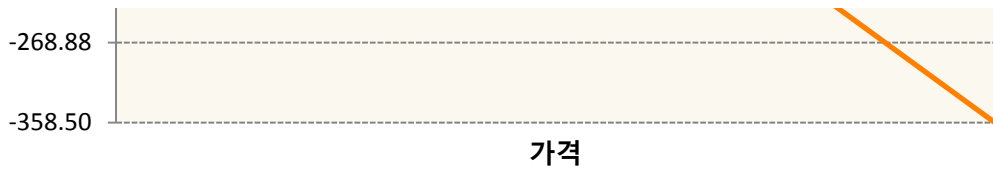
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19



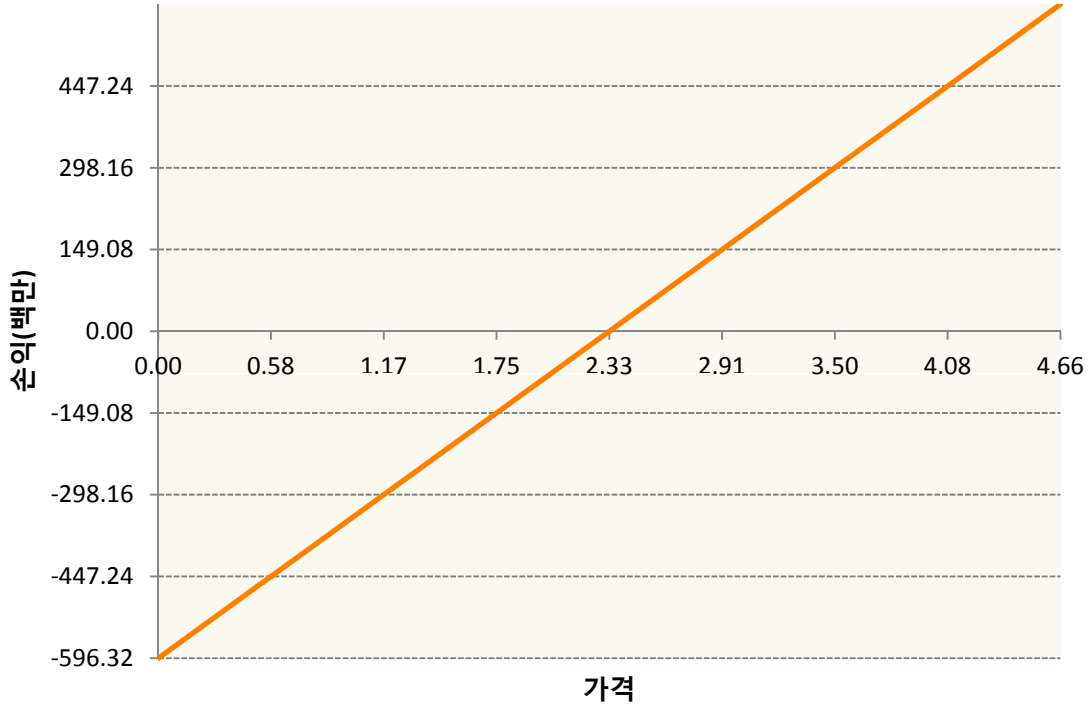
COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20



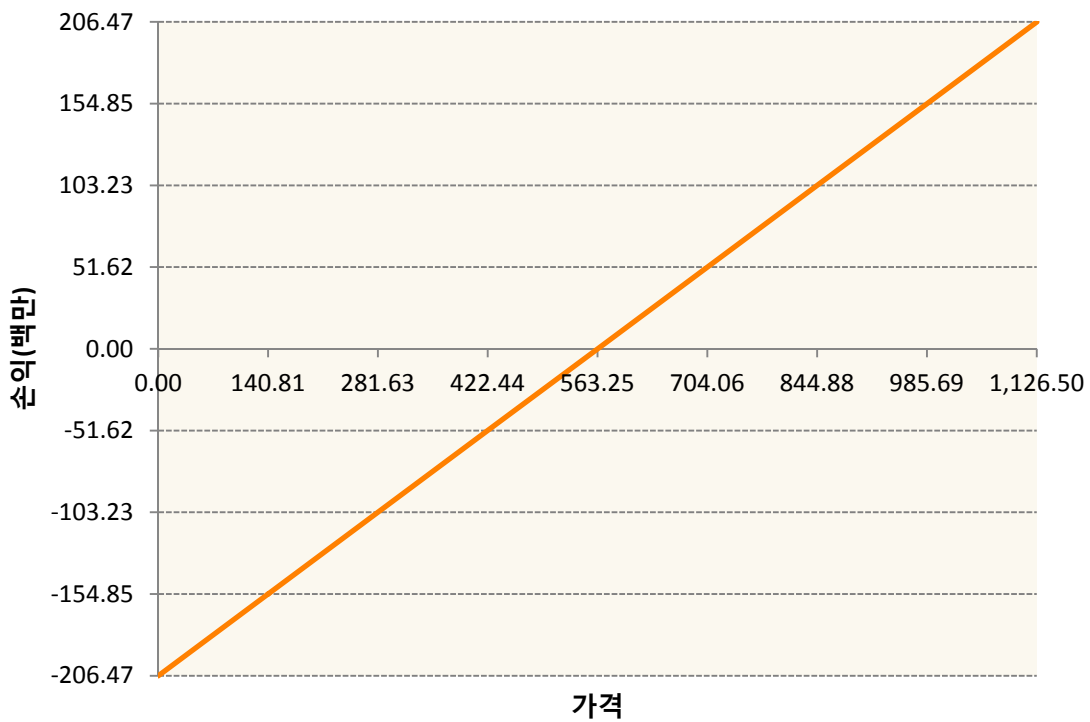


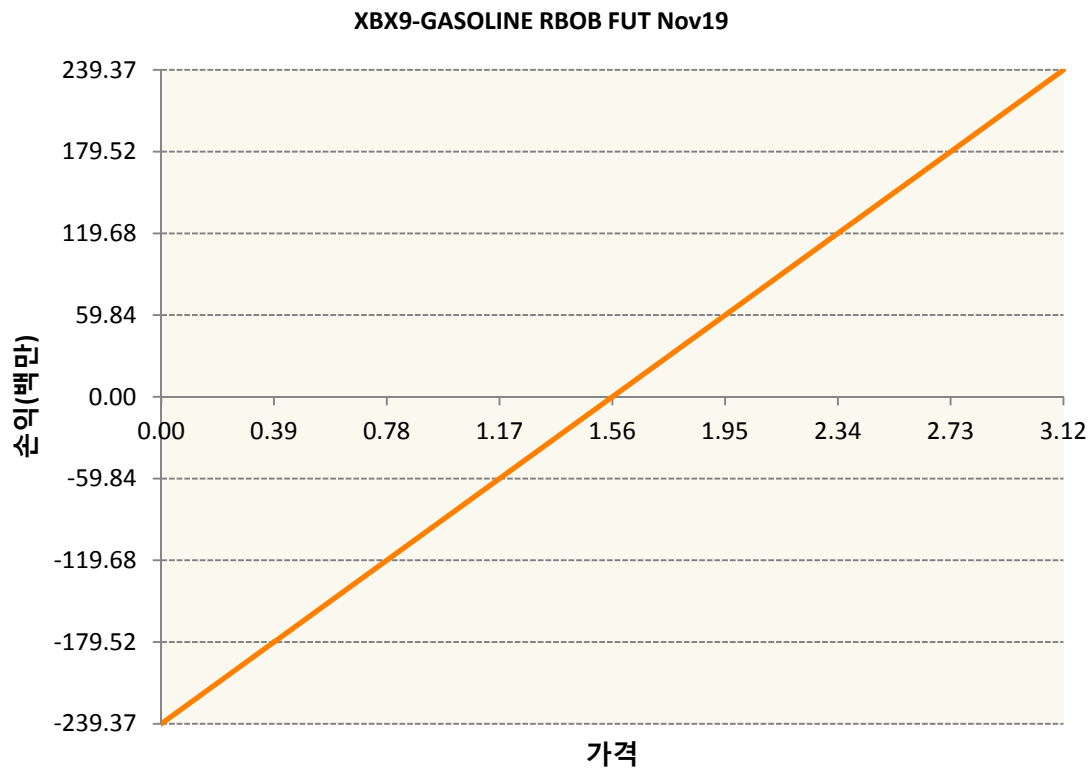


NGX19-NATURAL GAS FUTR Nov19



QSX9-Low Su Gasoil G Nov19





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

CLX9	WTI CRUDE FUTURE Nov19	46
COF0	BRENT CRUDE FUTR Jan20	49
HOX9	Heating Oil	15
KR4175PA00	2019-10 달러선물	29
NGX19	NATURAL GAS FUTR Nov19	48
QSX9	Low Su Gasoil G Nov19	17
XBX9	GASOLINE RBOB FUT Nov19	19

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

**404**

공시일	2019-10-07
기준일	2019-10-04

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

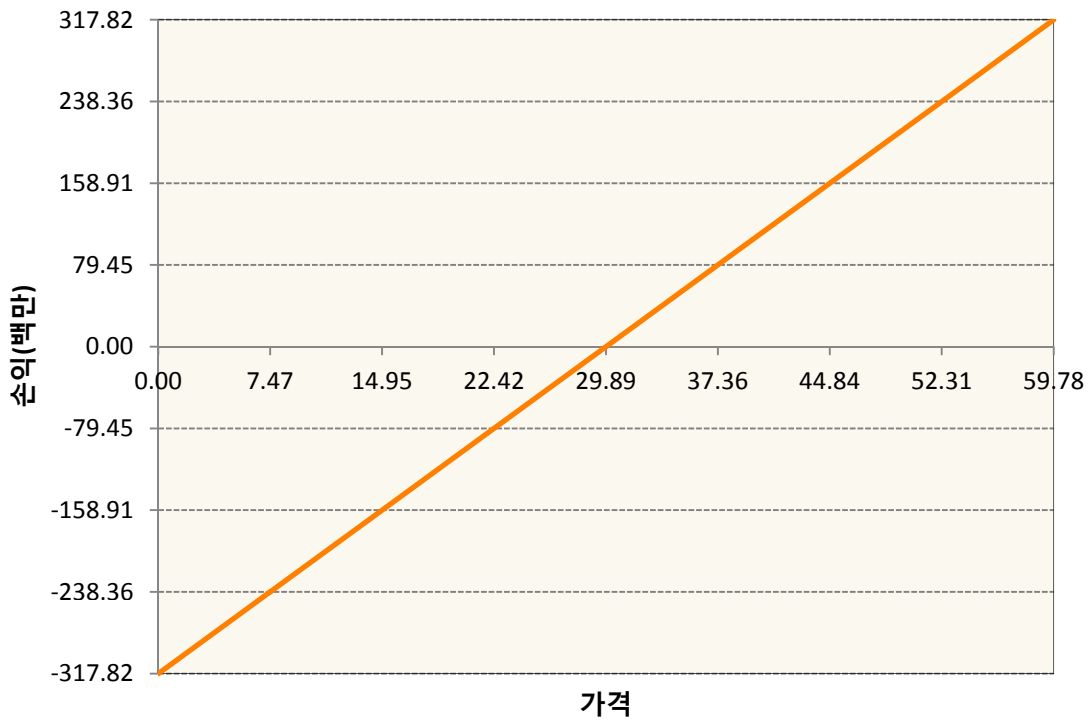
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

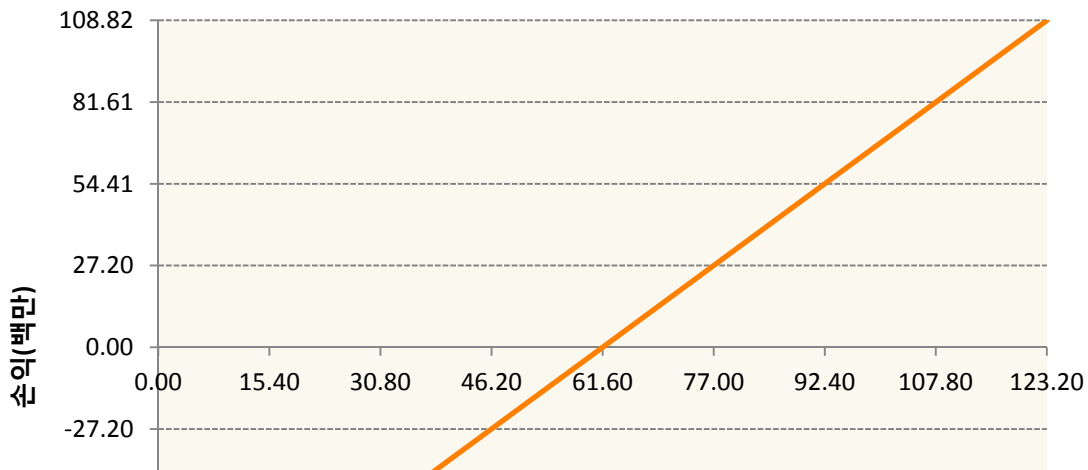
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,834	96	2,738	

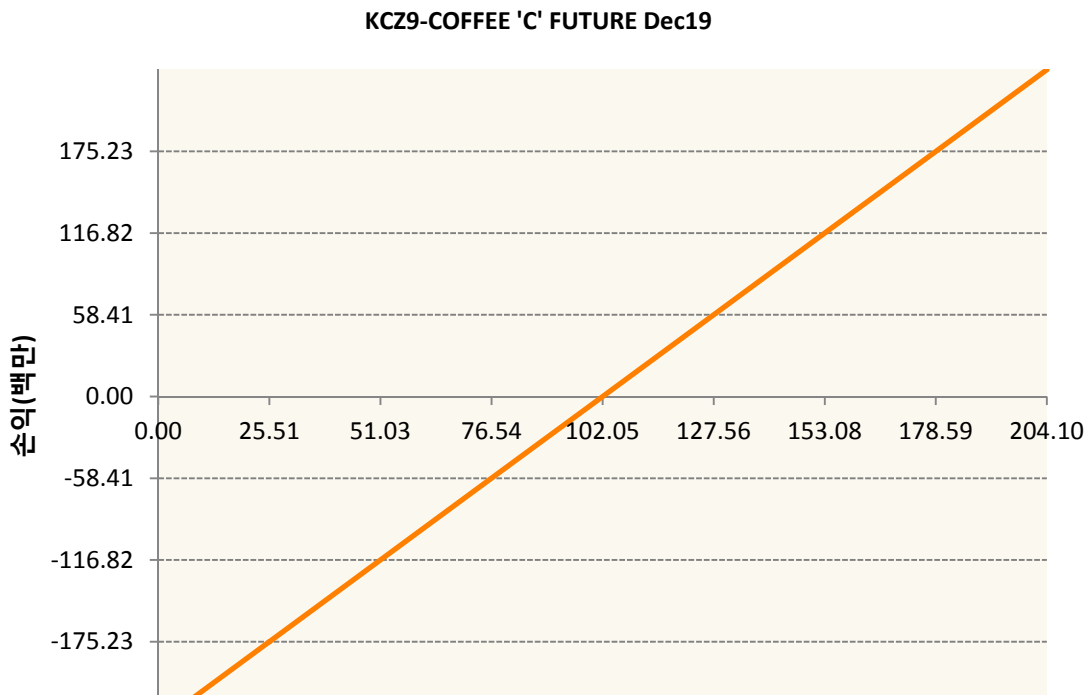
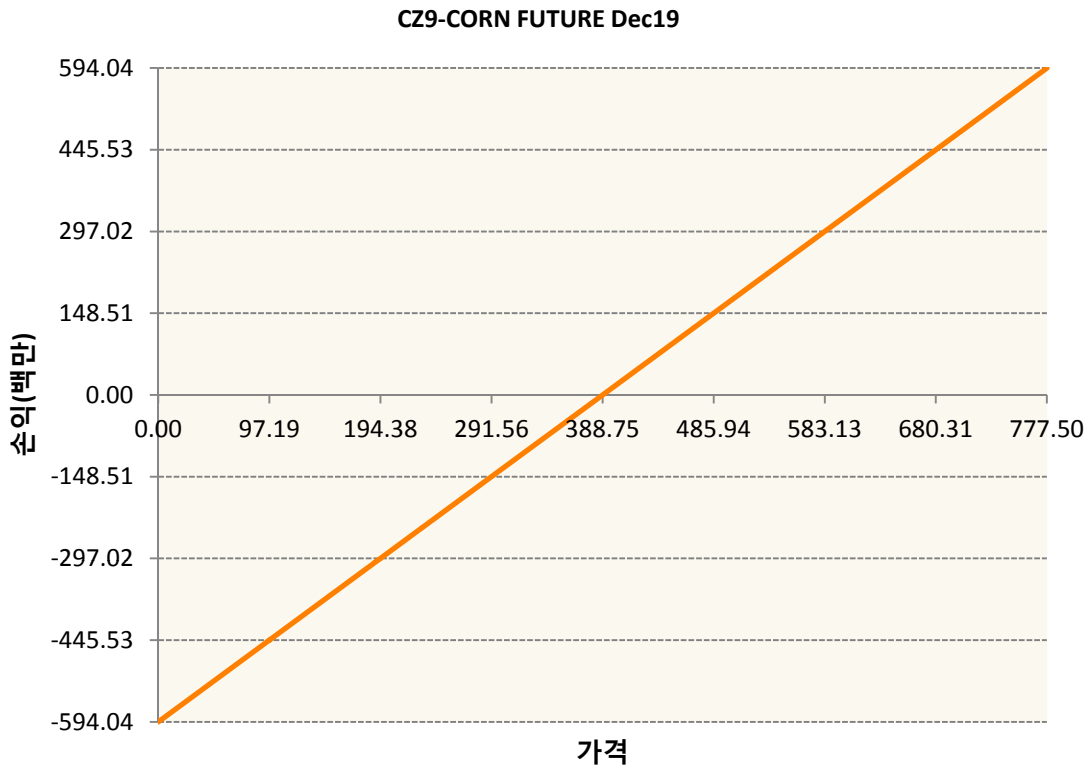
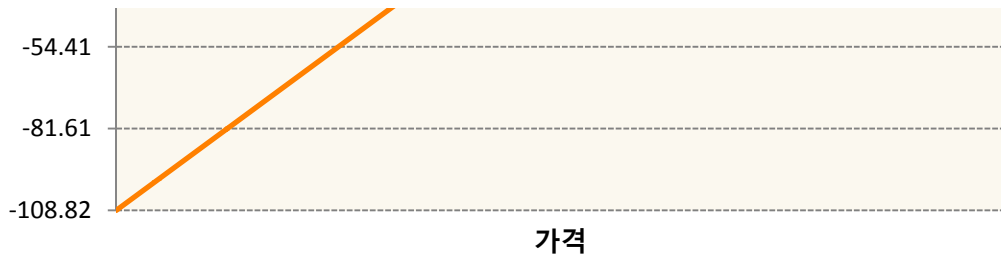
### 2. 만기시점의 손익구조

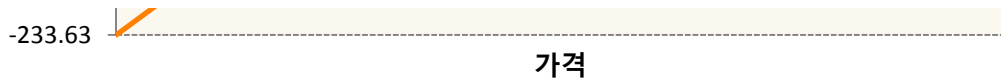
**BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19**



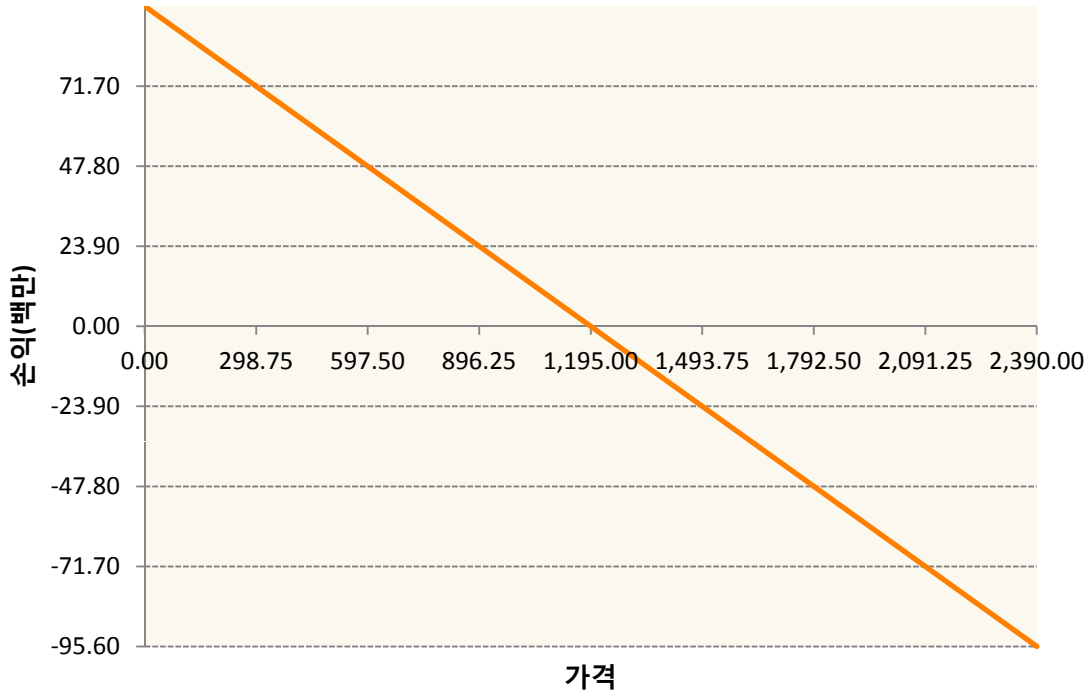
**CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19**



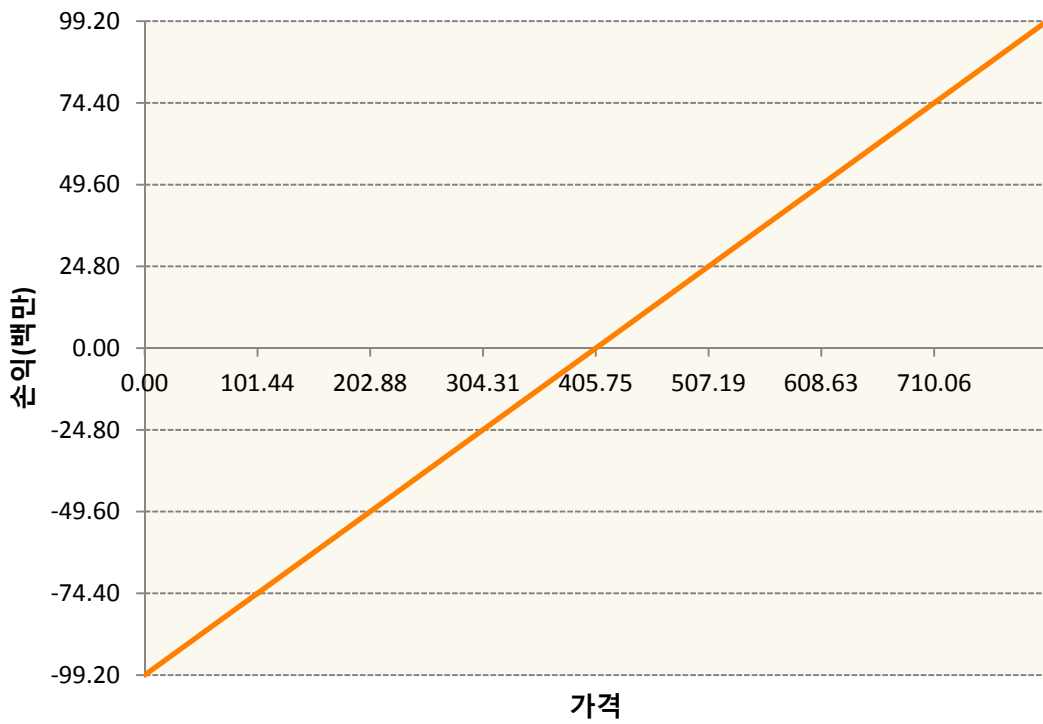




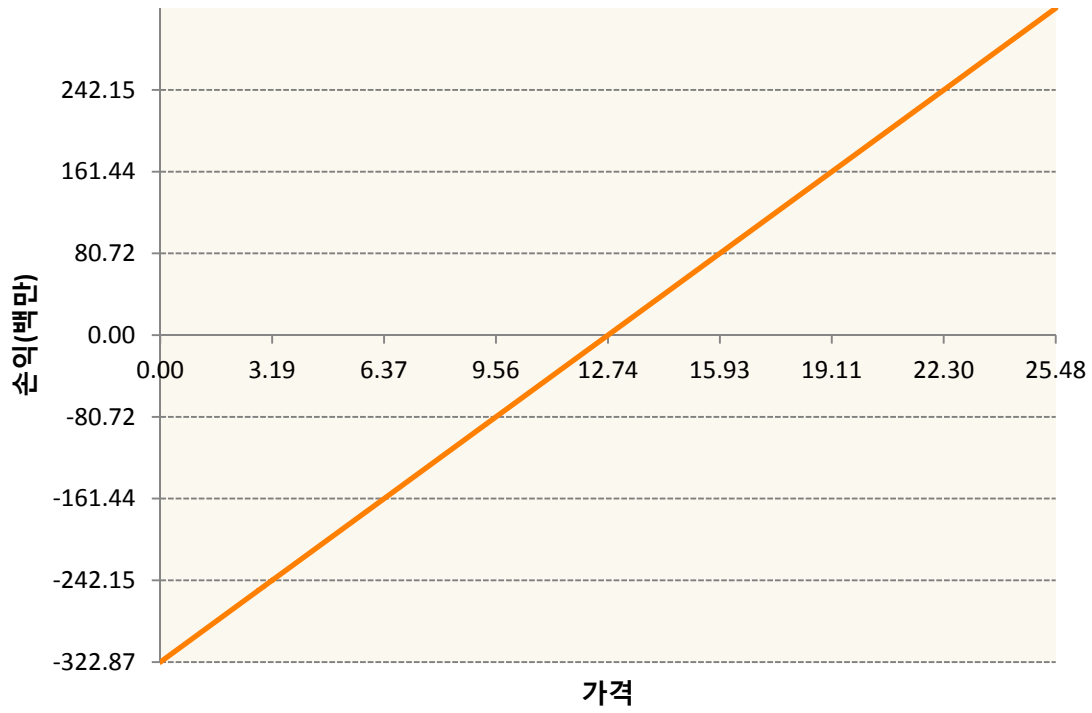
KR4175PA0005-2019-10 달러선물



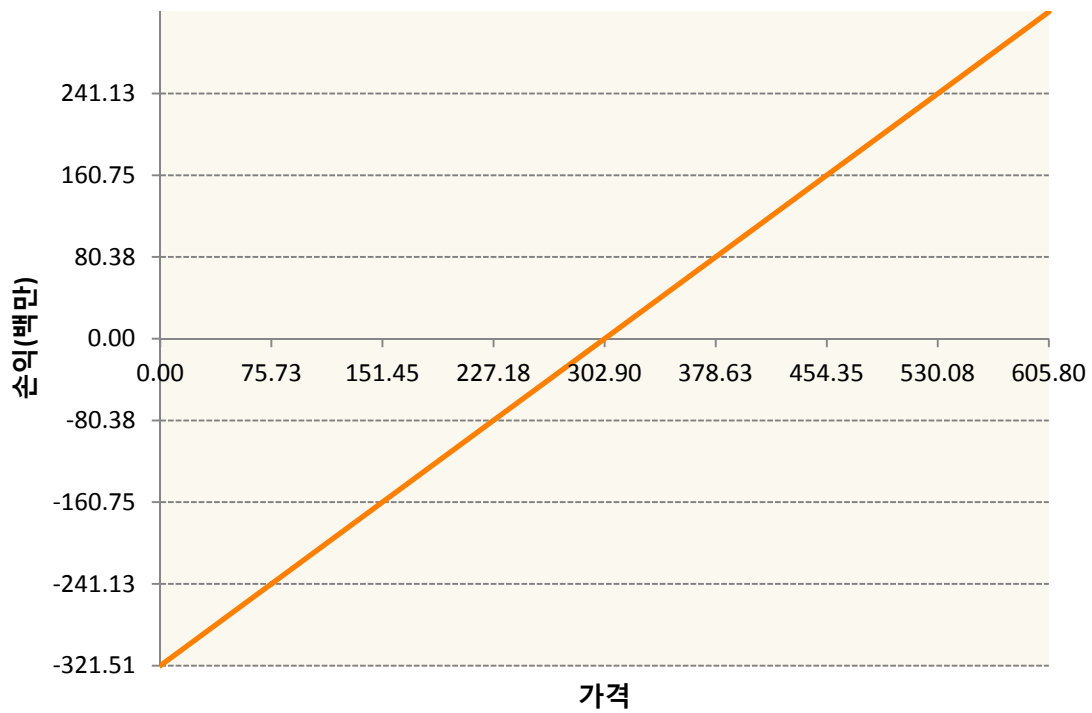
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



SBH0-Sugar Mar20

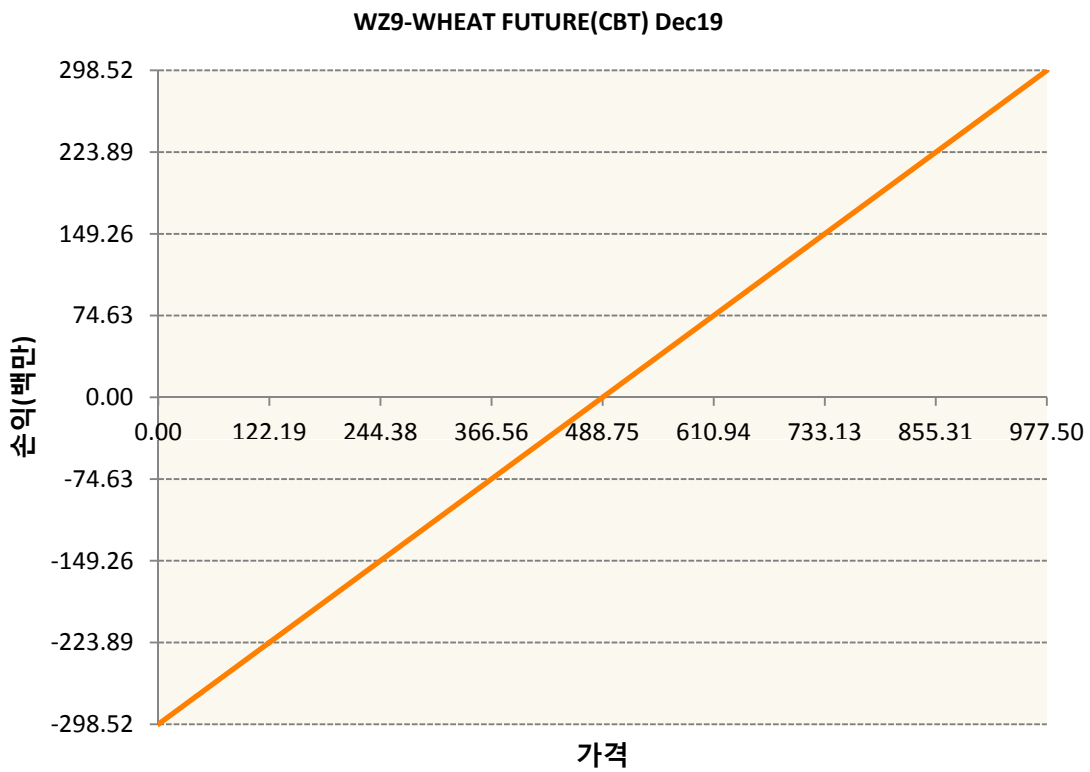
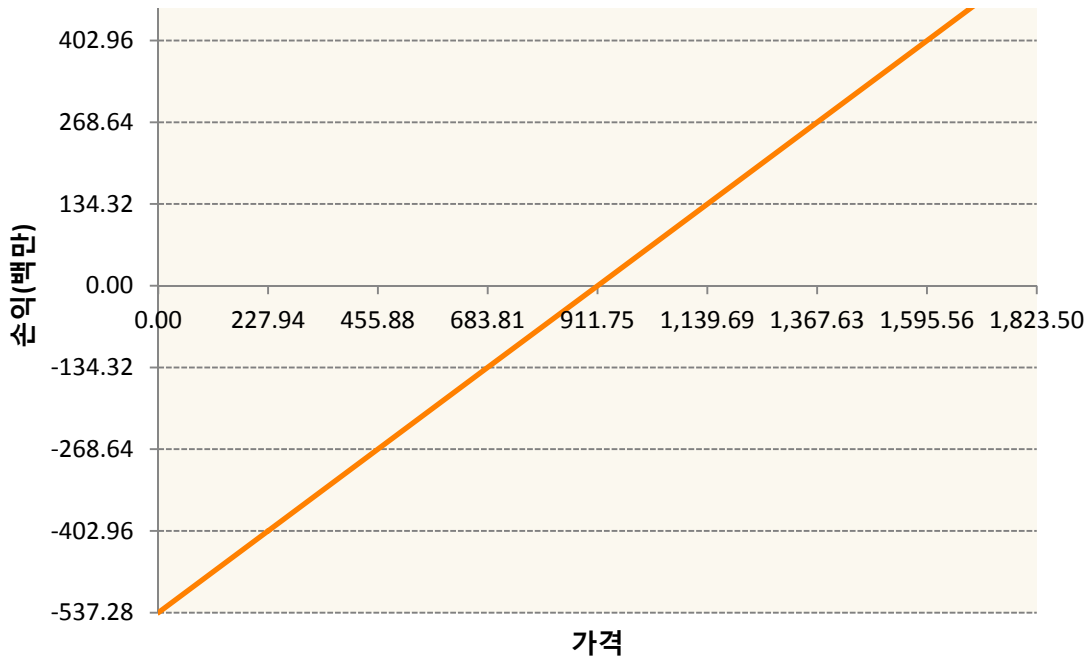


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



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	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)

**255**