

공시일	2019-10-08
기준일	2019-10-07

## 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	2019-10-08
기준일	2019-10-07

## 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

1,158

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

669

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-10-08
기준일	2019-10-07

## 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)

**811**

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-10-08
기준일	2019-10-07

## 유로인덱스모(주식-파생형)

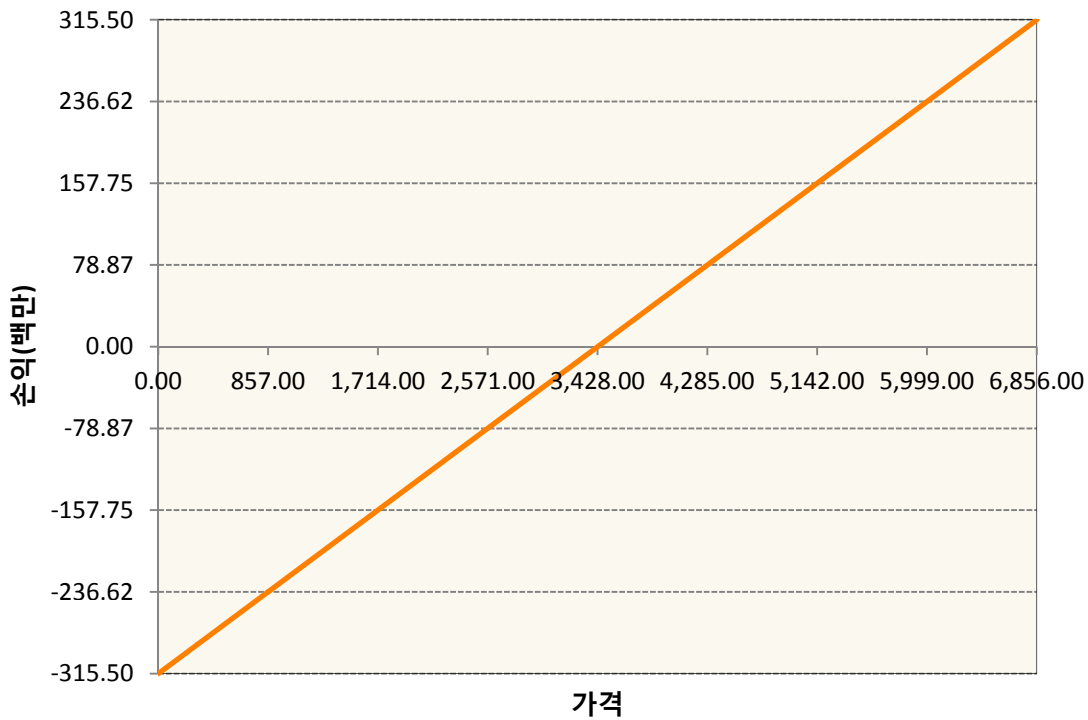
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	315	0	315	

### 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	2019-10-08
기준일	2019-10-07

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

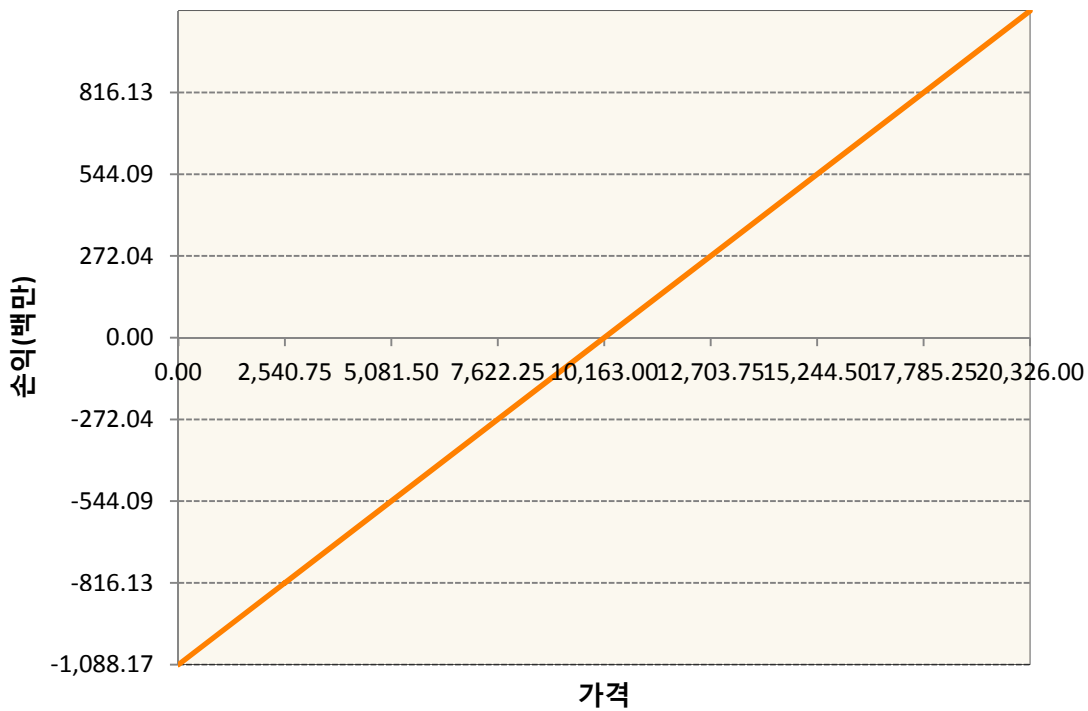
### 1. 계약금액

(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	2019-10-08
기준일	2019-10-07

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

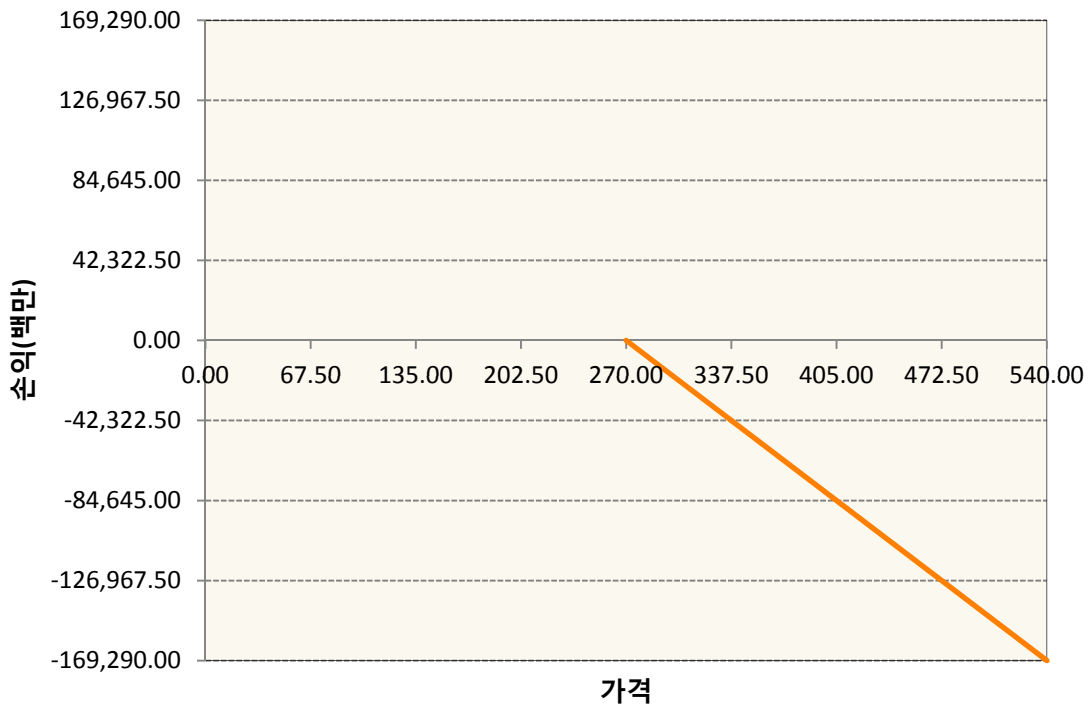
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

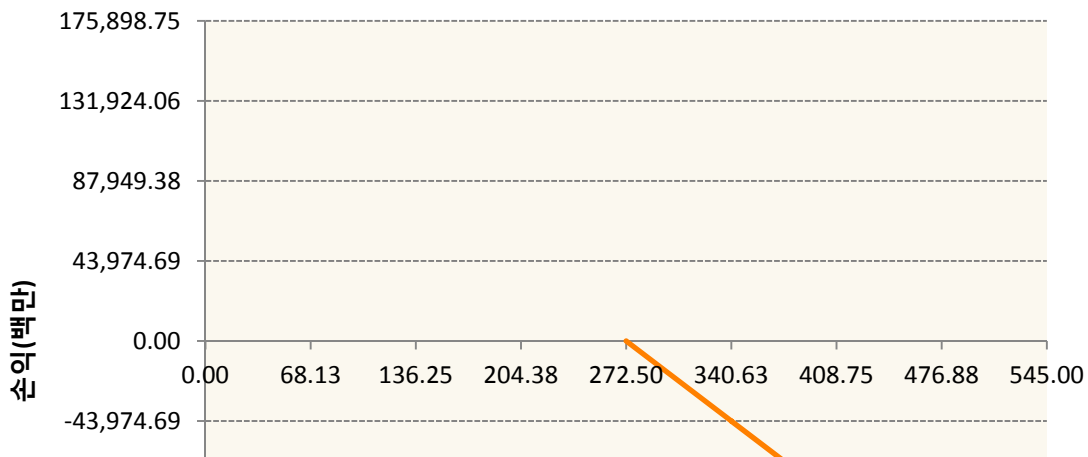
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	513,196	-513,196	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201PA2702-2019-10 콜270**



**KR4201PA2728-2019-10 콜272.5**





-5.33%	557	557	556	556	553	550	544
-2.67%	550	542	528	507	479	444	402
0%	290	201	103	0	-108	-221	-336
2.67%	-1,589	-1,718	-1,849	-1,982	-2,116	-2,251	-2,387
5.33%	-5,563	-5,592	-5,632	-5,680	-5,738	-5,803	-5,876
8.00%	-10,132	-10,134	-10,136	-10,142	-10,151	-10,165	-10,184
KR4301PA2701 2019-10 풋270							12,904
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,904	-12,904	-12,904	-12,904	-12,904	-12,904	-12,904
-5.33%	-8,464	-8,464	-8,464	-8,464	-8,464	-8,464	-8,464
-2.67%	-4,023	-4,024	-4,026	-4,029	-4,034	-4,042	-4,053
0%	194	132	67	0	-69	-140	-213
2.67%	1,837	1,810	1,778	1,740	1,697	1,650	1,599
5.33%	1,881	1,881	1,880	1,880	1,878	1,875	1,871
8.00%	1,881	1,881	1,881	1,881	1,881	1,881	1,881

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

(단위:백만원)

41,543

공시일	2019-10-08
기준일	2019-10-07

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

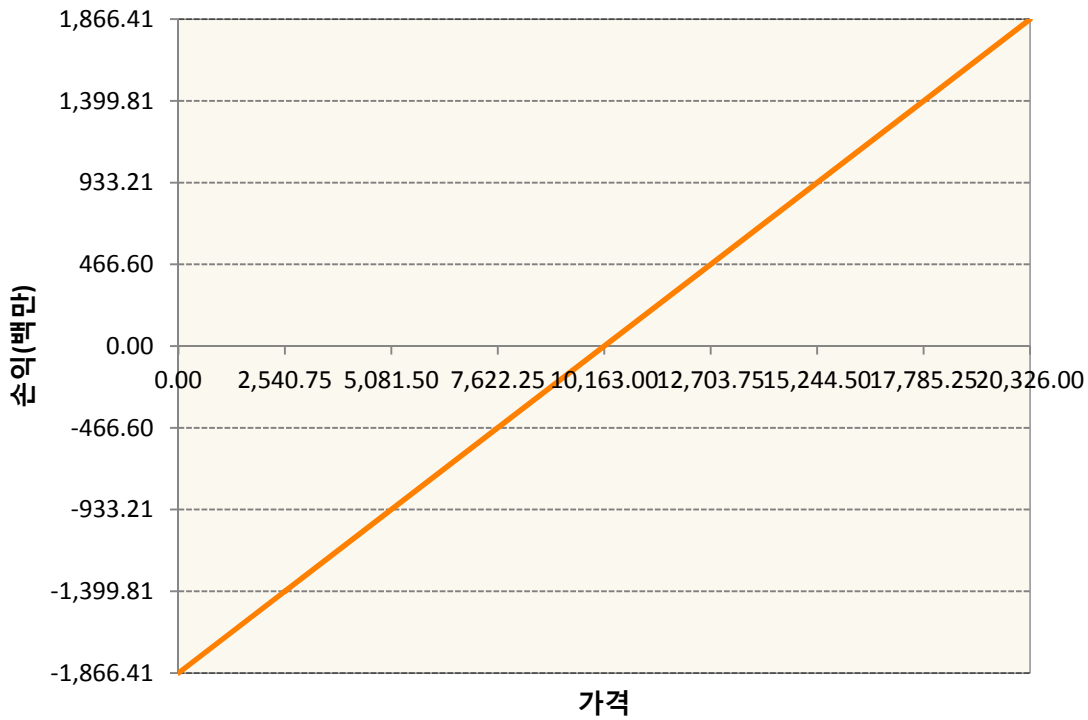
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

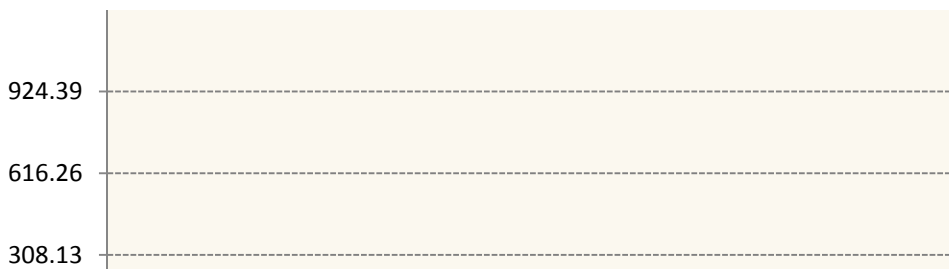
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,866	0	1,866	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,954	-4,954	장내
누계	통화	선도	686	2,834	-2,148	장외

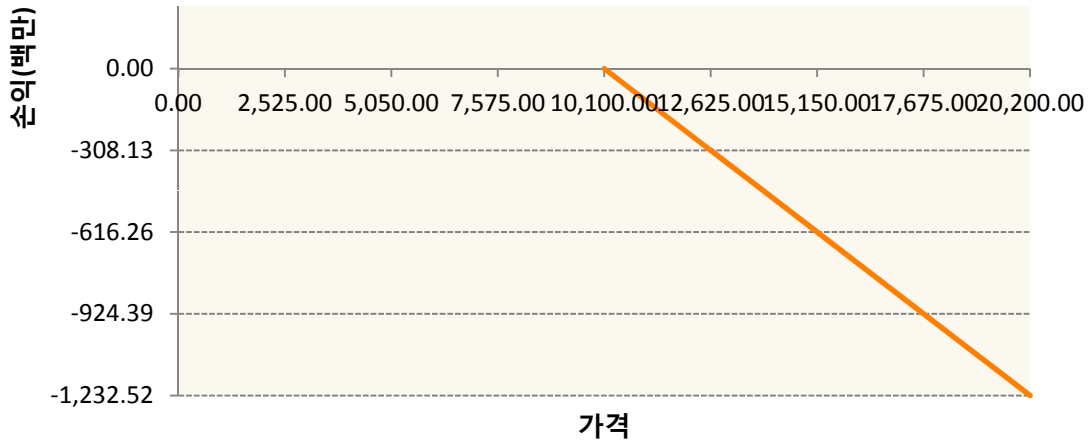
### 2. 만기시점의 손익구조

HCV9-HSCEI Futures Oct19

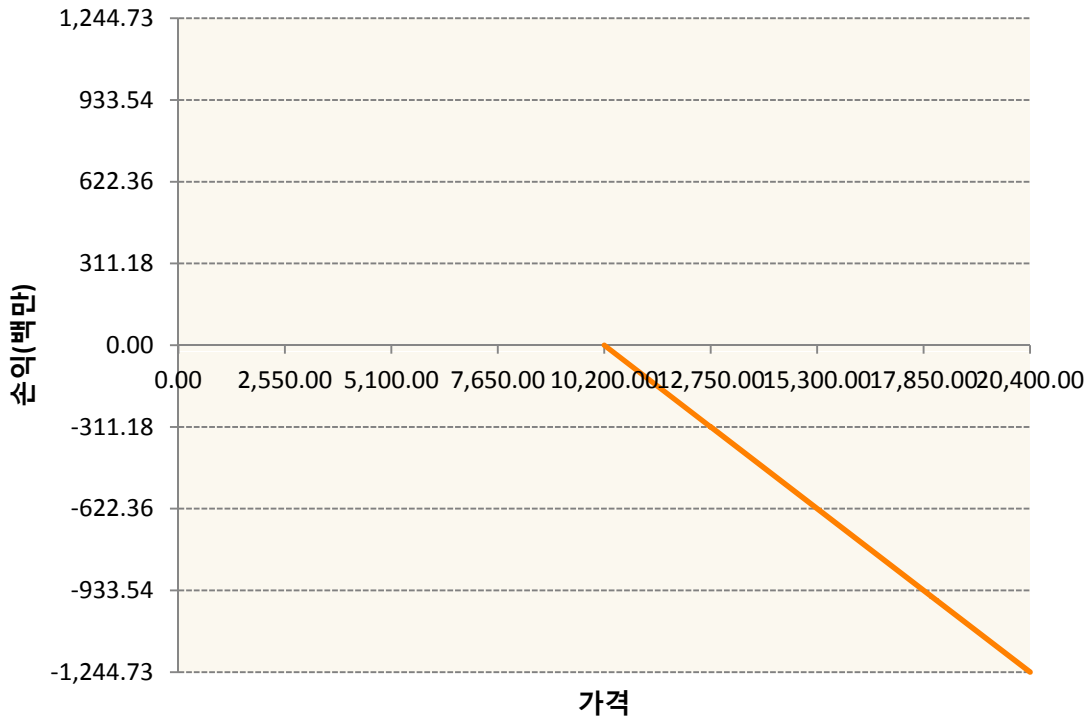


OHHIV9-C101-HSCEI

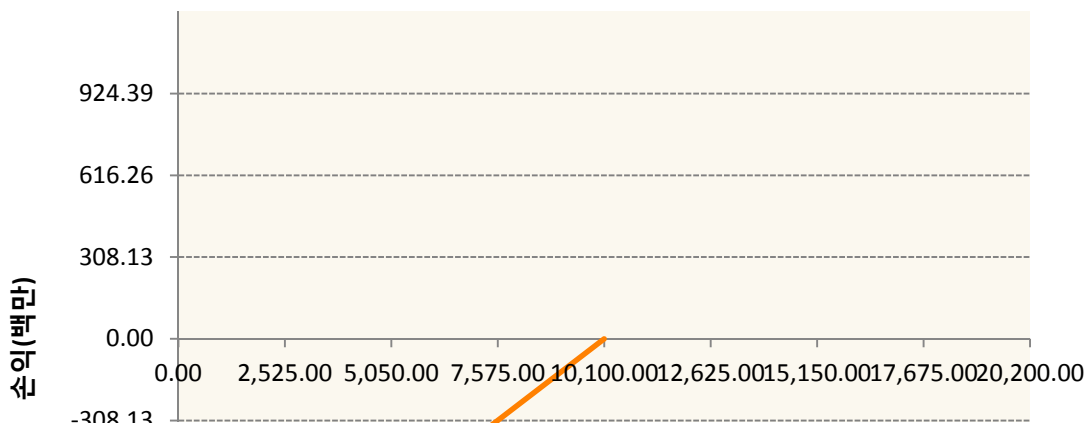


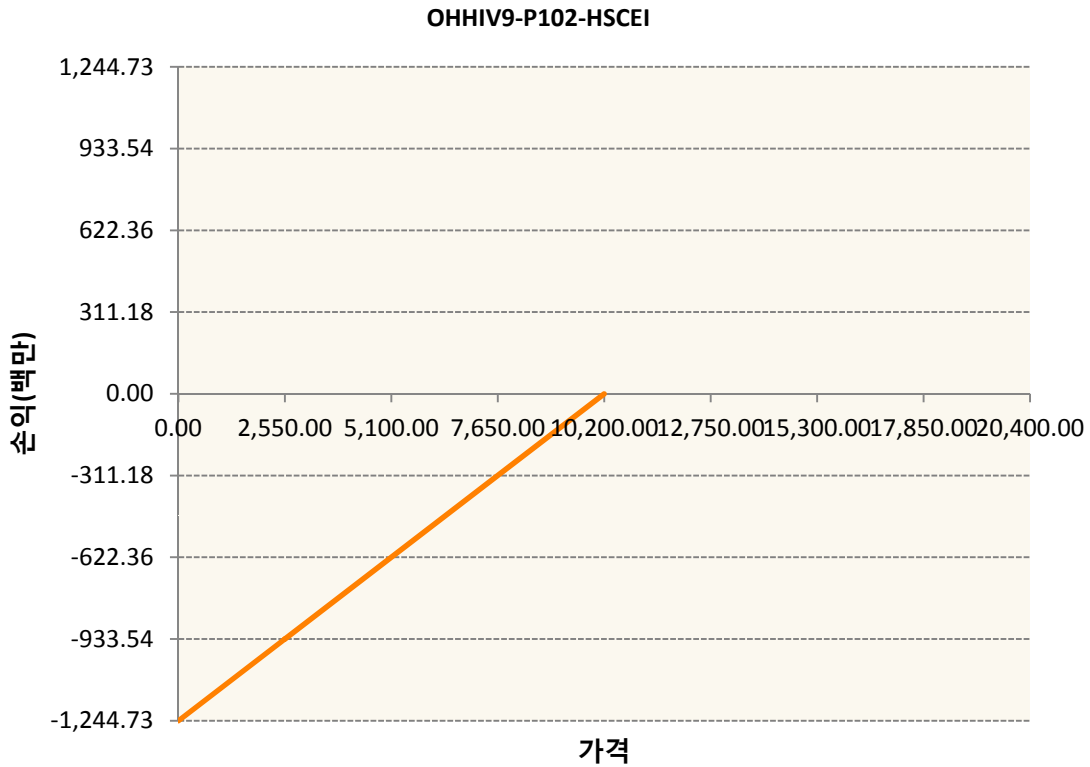


OHHIV9-C102-HSCEI



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)
	586

공시일	2019-10-08
기준일	2019-10-07

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

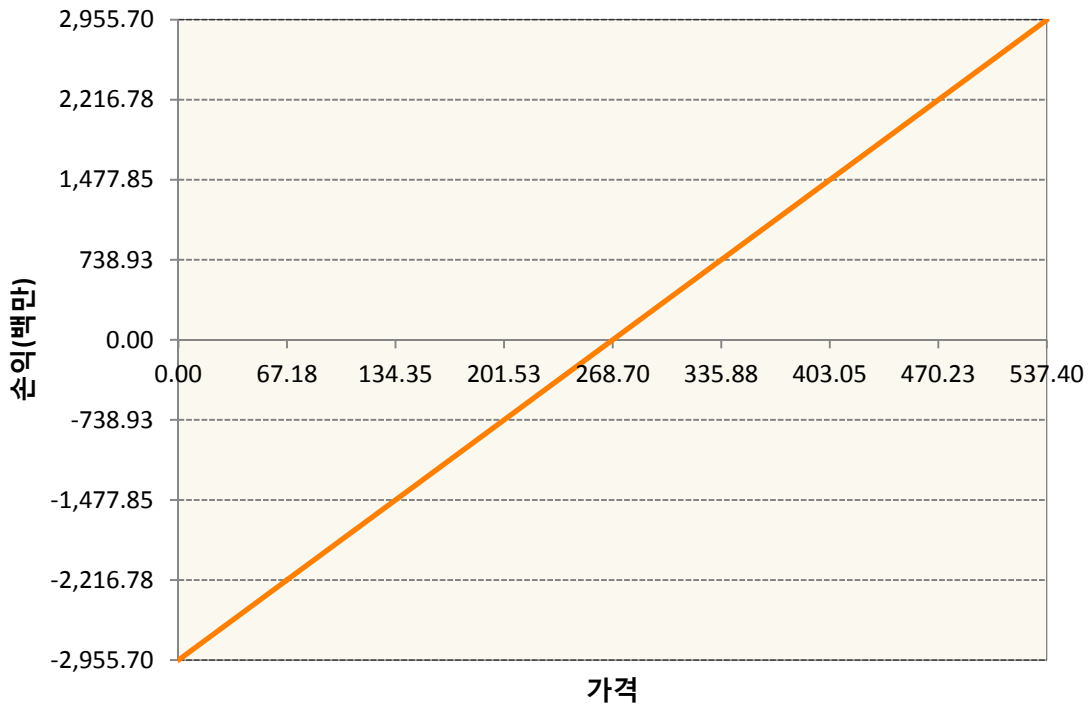
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

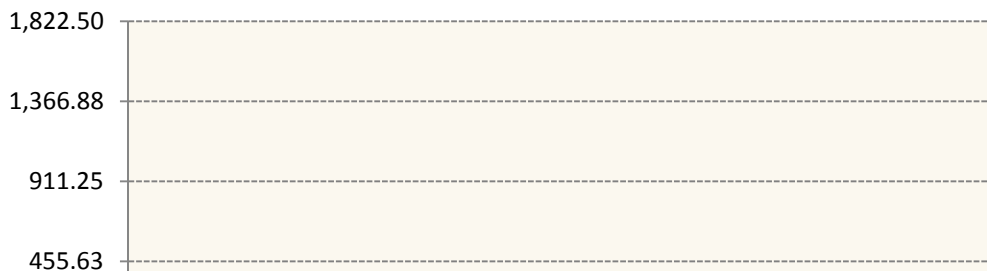
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,956	0	2,956	장내
누계	유가증권	스왑	10,625	0	10,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	10,968	-10,968	장내

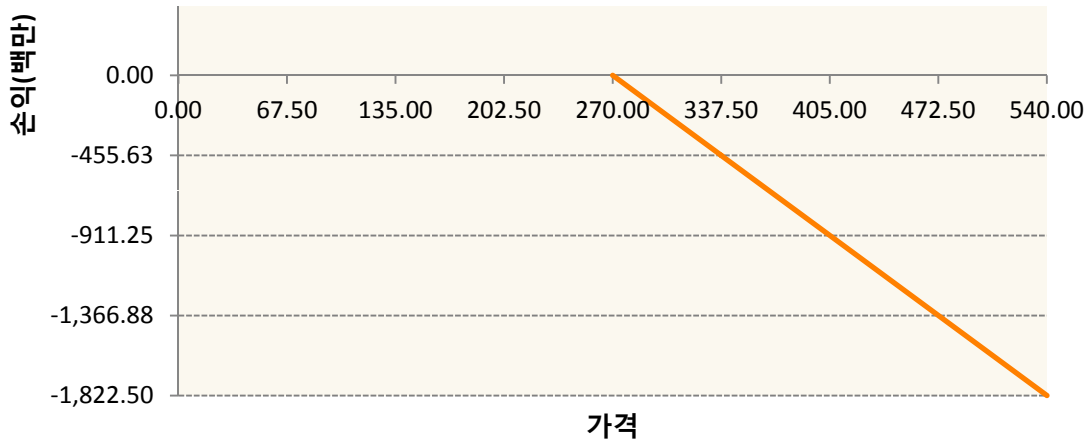
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

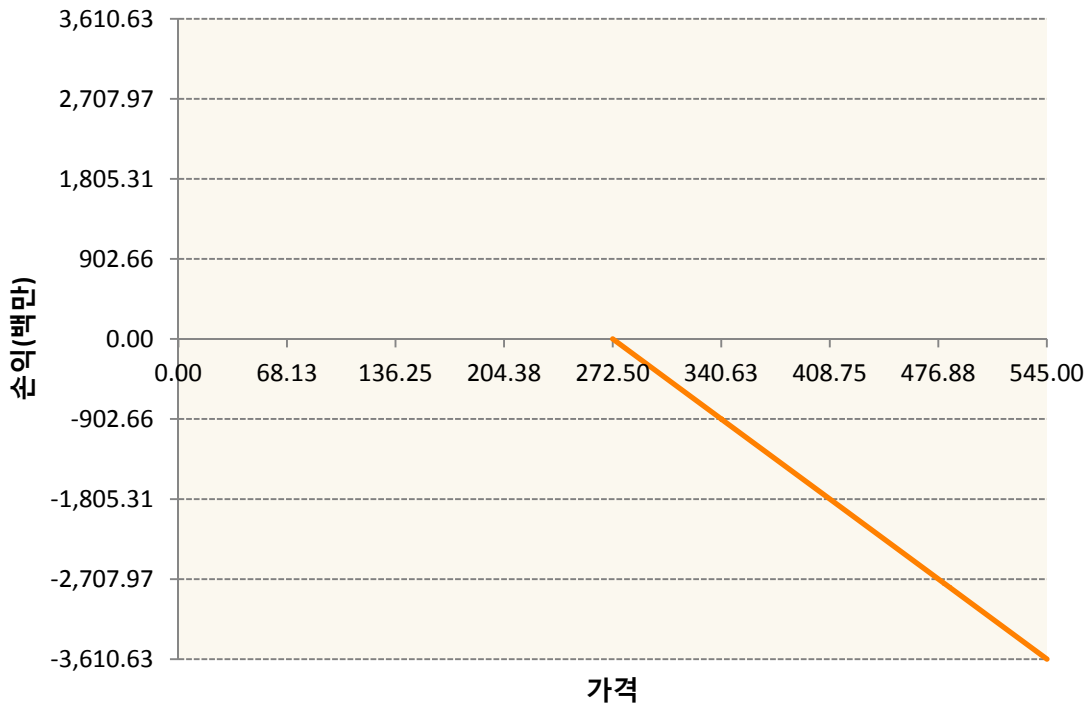


KR4201PA2702-2019-10 콜270

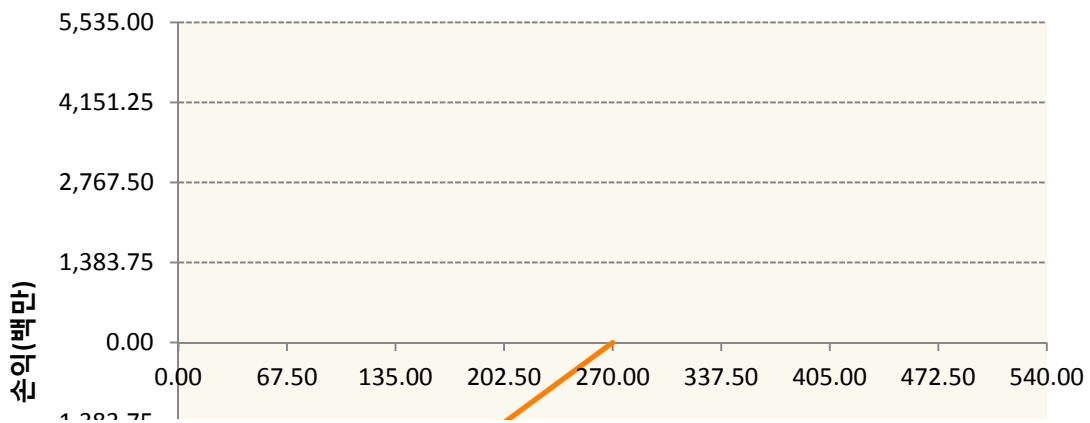


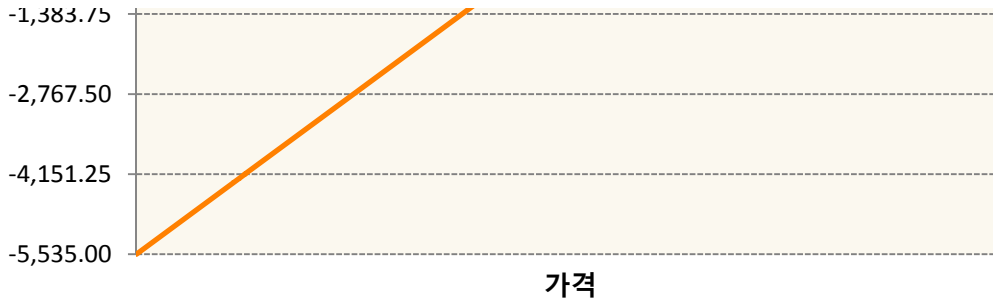


**KR4201PA2728-2019-10 콜272.5**



**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%	-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%	919	919	919	919	919	919	919	
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%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157	
-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%	157	157	157	157	157	157	157	
8.00%	236	236	236	236	236	236	236	
KR4201PA2702		2019-10 콜270						118
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	11	11	11	11	11	11	11	
-5.33%	11	11	11	11	11	10	10	
-2.67%	10	10	10	9	9	8	8	
0%	4	3	1	0	-1	-3	-4	
2.67%	-25	-26	-27	-28	-29	-30	-31	
5.33%	-70	-70	-70	-70	-71	-71	-72	
8.00%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118	
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5						209
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	11	11	11	11	11	11	11
-5.33%	11	11	11	11	11	11	11
-2.67%	11	11	11	10	10	9	8
0%	6	4	2	0	-2	-5	-7
2.67%	-33	-35	-38	-41	-43	-46	-49
5.33%	-114	-115	-116	-117	-118	-119	-121
8.00%	-208	-208	-208	-208	-208	-209	-209
KR4301PA2701                      2019-10 풋270							425
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-425	-425	-425	-425	-425	-425	-425
-5.33%	-279	-279	-279	-279	-279	-279	-279
-2.67%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-134
0%	6	4	2	0	-2	-5	-7
2.67%	61	60	59	57	56	54	53
5.33%	62	62	62	62	62	62	62
8.00%	62	62	62	62	62	62	62

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

(단위:백만원)

**2,081**

공시일	2019-10-08
기준일	2019-10-07

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

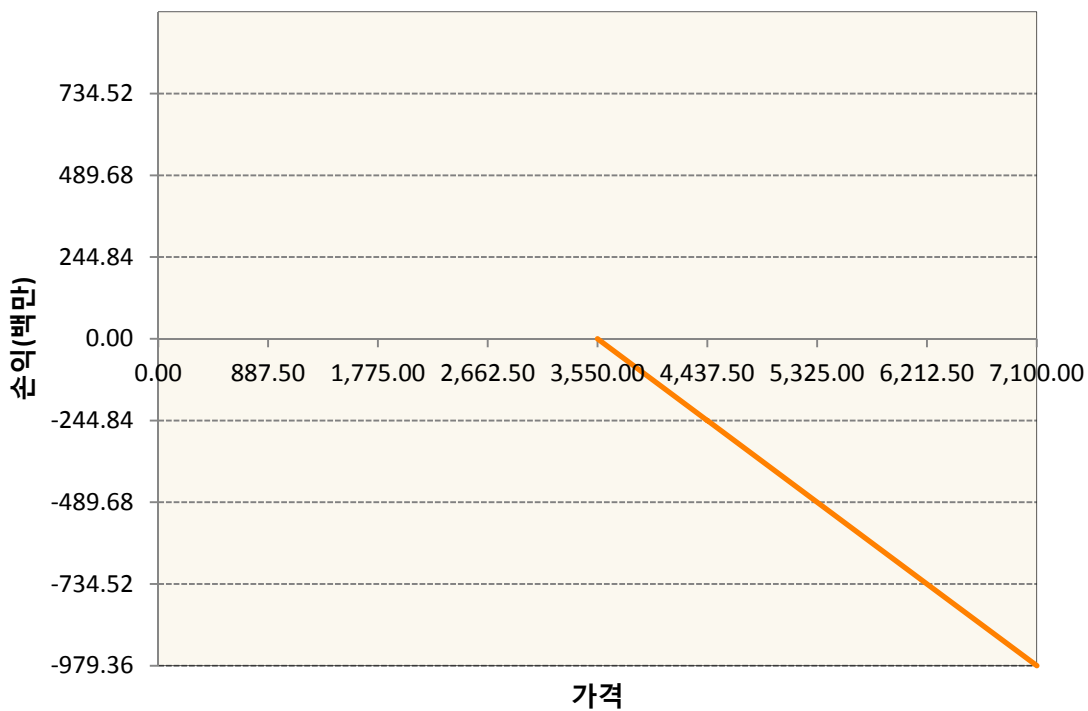
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

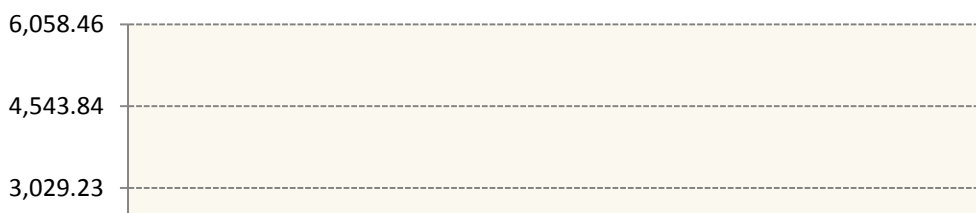
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,964	0	3,964	
누계	유가증권	스왑	23,905	0	23,905	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,076	-14,076	장내
누계	통화	선도	0	6,174	-6,174	장외

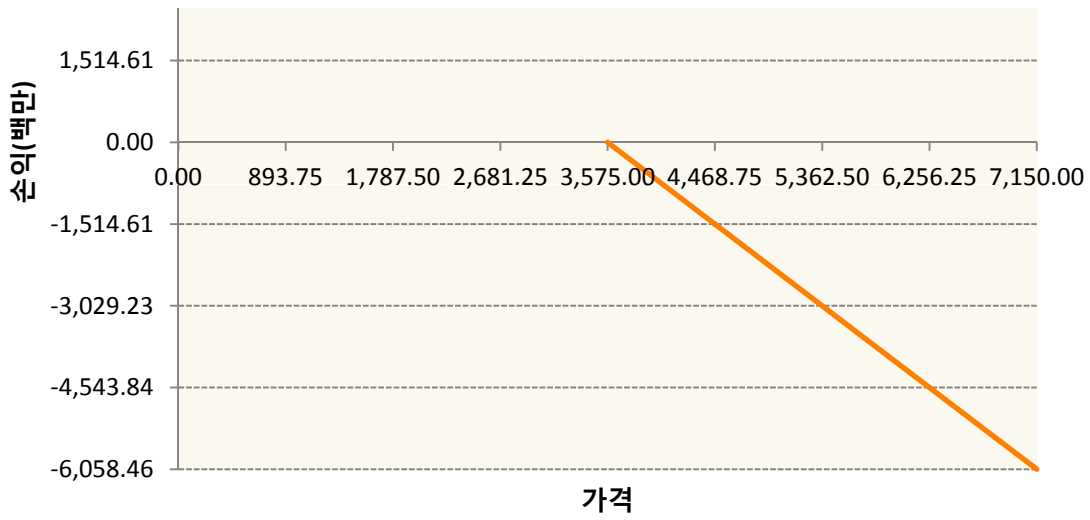
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXV9-C3550-EURO STOXX 50

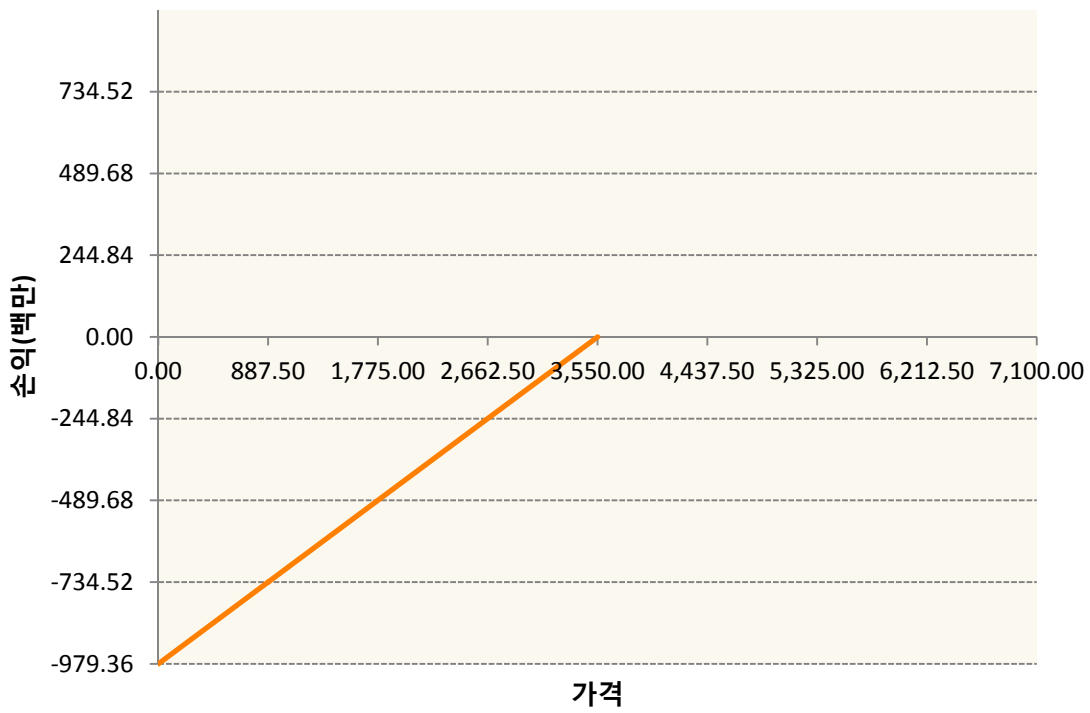


OESXV9-C3575-EURO STOXX 50

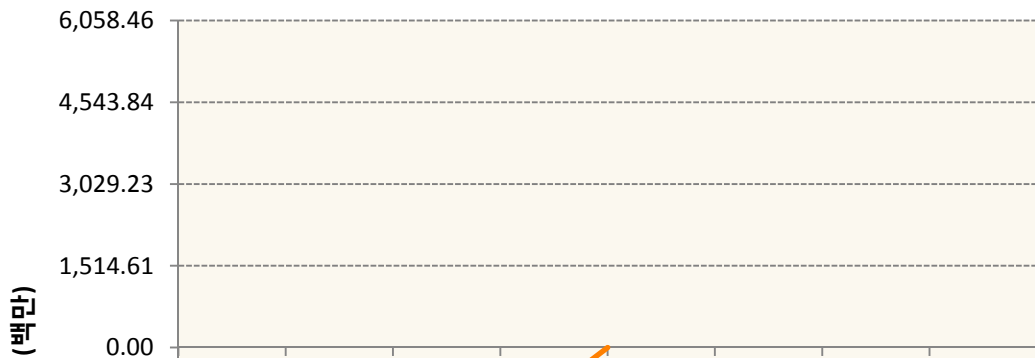


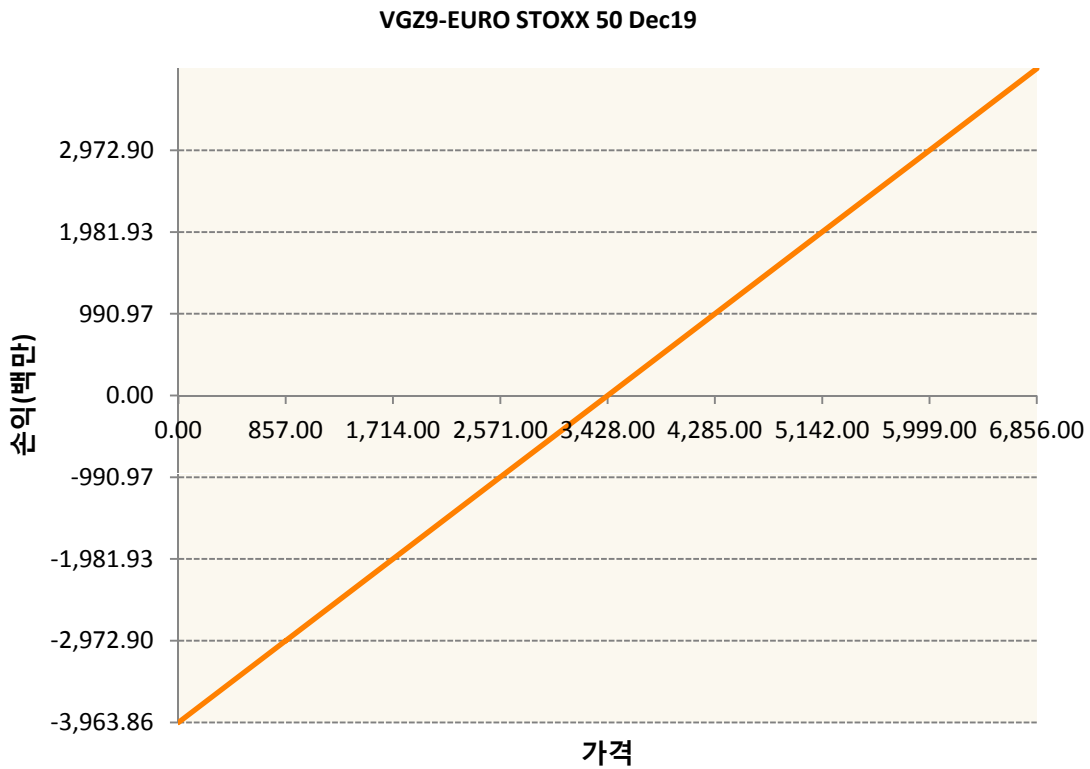
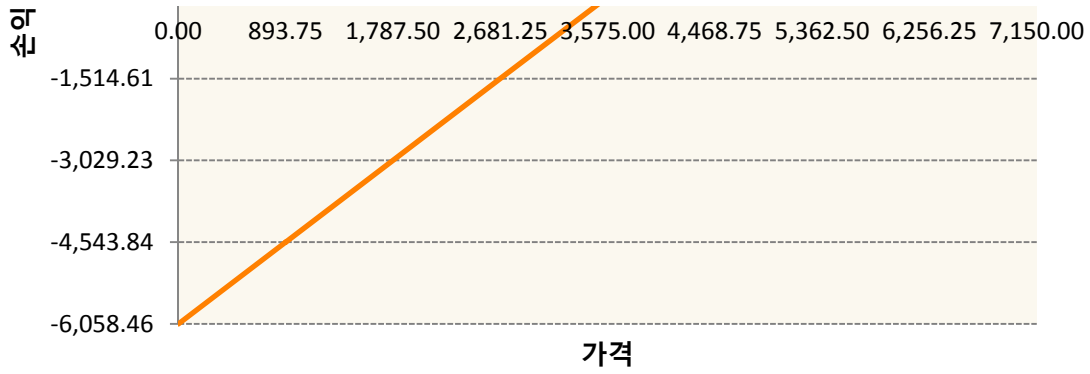


OESXV9-P3550-EURO STOXX 50



OESXV9-P3575-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		63
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E		494
OESXV9-C35 EURO STOXX 50		78
OESXV9-C35 EURO STOXX 50		485
OESXV9-P35 EURO STOXX 50		78
OESXV9-P35 EURO STOXX 50		485
VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	317

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





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

(단위:백만원)

974



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

(단위:백만원)

84



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

(단위:백만원)

131

공시일	2019-10-08
기준일	2019-10-07

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

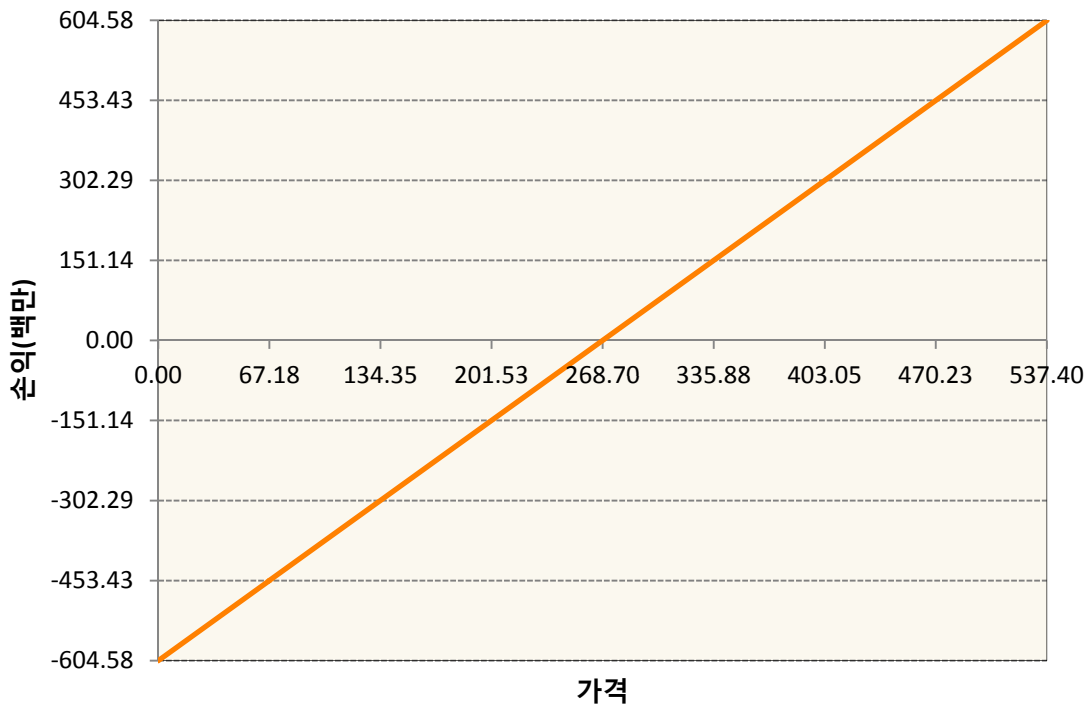
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	605	0	605	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	2019-10-08
기준일	2019-10-07

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

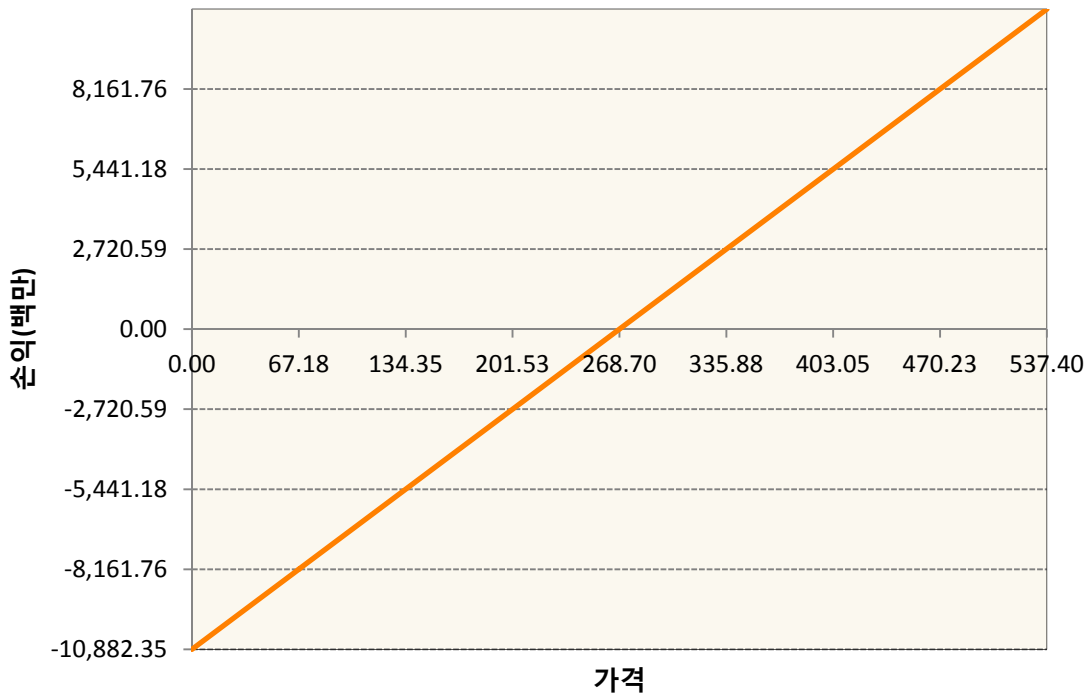
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

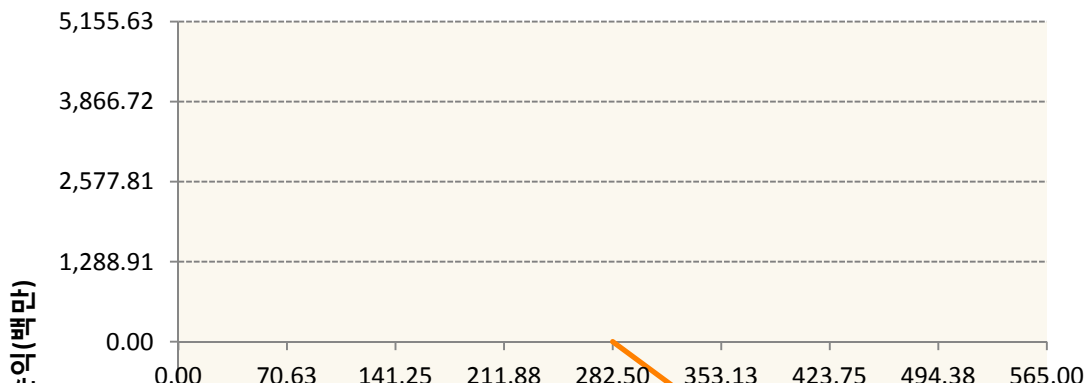
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,882	0	10,882	장내
누계	유가증권	옵션	1,422	20,759	-19,338	장내

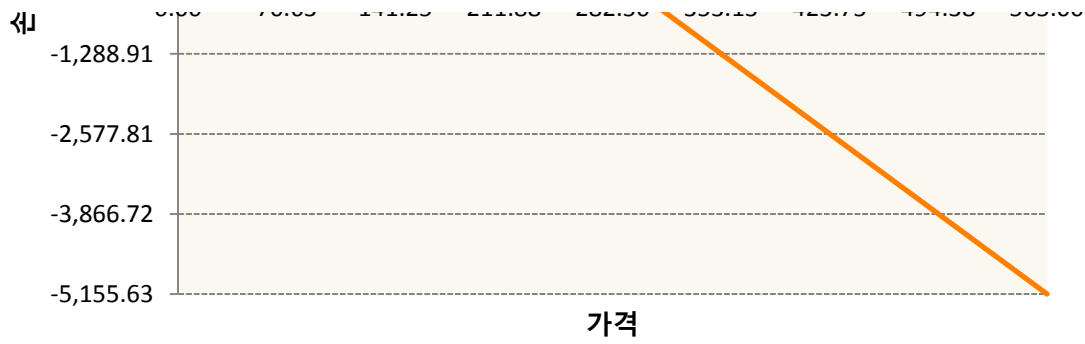
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

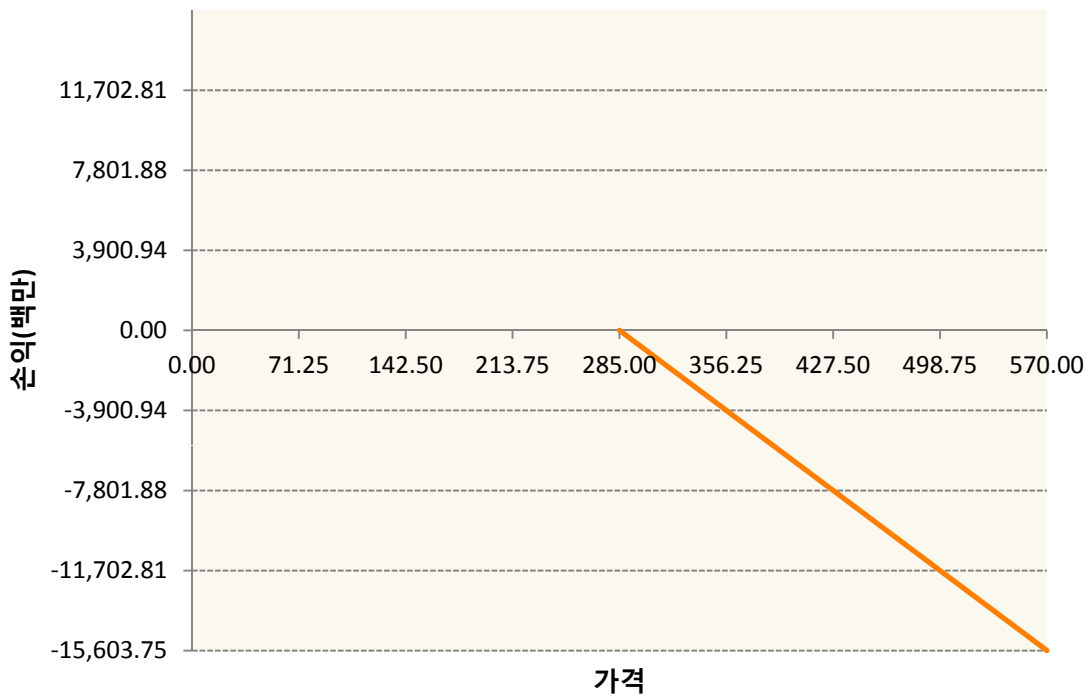


KR4201PA2827-2019-10 콜282.5

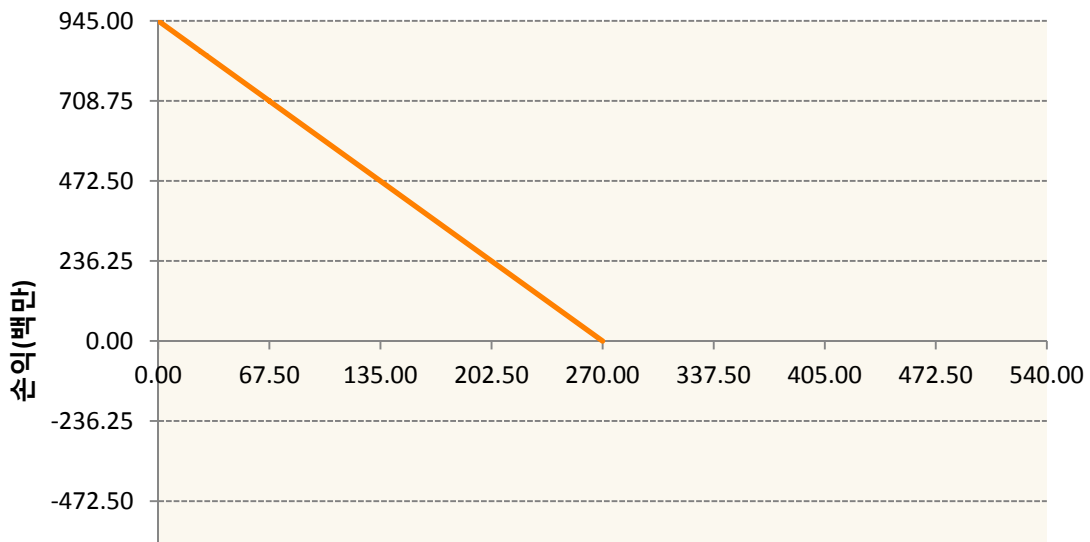


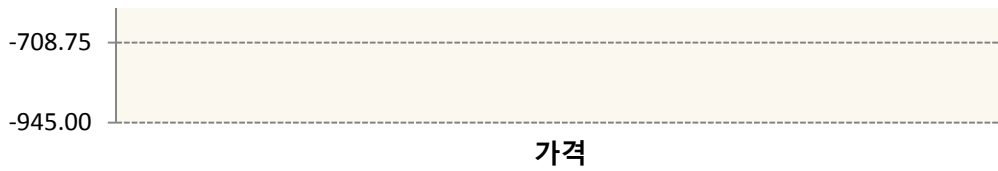


**KR4201PA2850-2019-10 콜285**

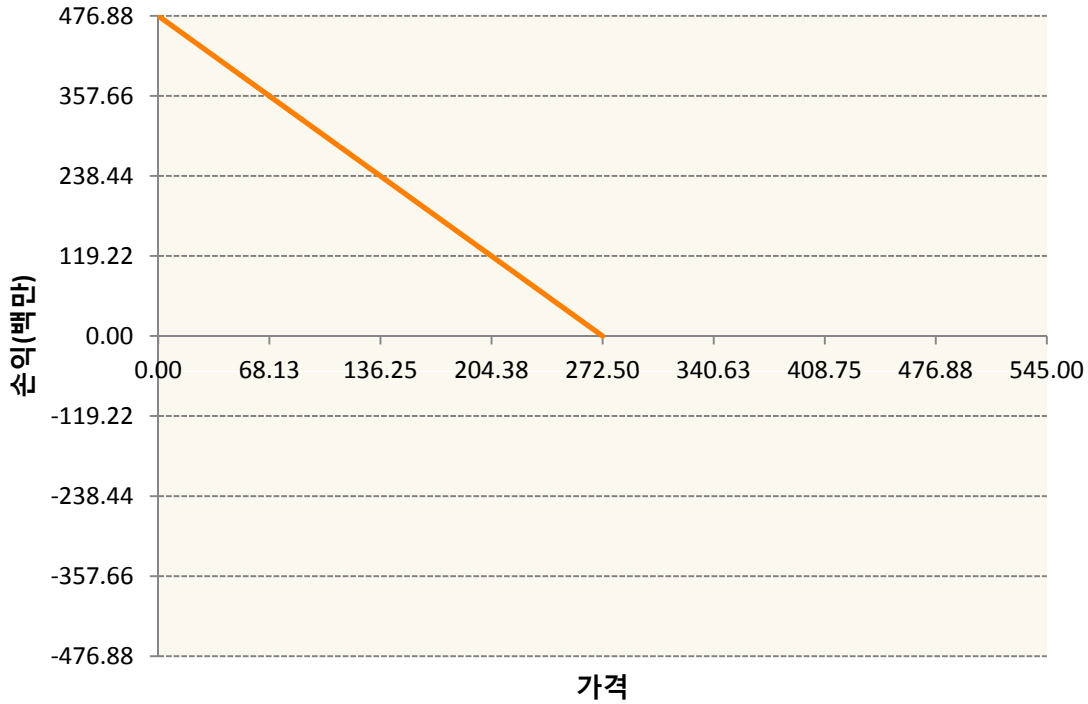


**KR4301PA2701-2019-10 풋270**





KR4301PA2727-2019-10 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						867
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-867	-867	-867	-867	-867	-867	-867	
-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%	867	867	867	867	867	867	867	
KR4201PA2827		2019-10 콜282.5						139
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1	
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1	
-2.67%	1	1	1	1	0	0	0	

0%	0	0	0	0	0	-1	-2
2.67%	-2	-3	-5	-7	-9	-12	-14
5.33%	-32	-36	-40	-44	-48	-52	-56
8.00%	-124	-126	-128	-131	-133	-136	-139
KR4201PA2850 2019-10 콜285							320
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1
-2.67%	1	1	1	1	0	0	0
0%	1	0	0	0	-1	-1	-3
2.67%	-2	-4	-6	-10	-14	-19	-25
5.33%	-47	-57	-68	-79	-91	-102	-114
8.00%	-257	-267	-277	-287	-298	-309	-320
KR4301PA2701 2019-10 풋270							73
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	73	73	73	73	73	73	73
-5.33%	48	48	48	48	48	48	48
-2.67%	23	23	23	23	23	23	23
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-9	-9
5.33%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
KR4301PA2727 2019-10 풋272.5							37
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	37	37	37	37	37	37	37
-5.33%	25	25	25	25	25	25	25
-2.67%	12	12	12	12	12	12	12
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-8	-8	-8	-8	-7	-7	-7
5.33%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
8.00%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9

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

(단위:백만원)

943

공시일	2019-10-08
기준일	2019-10-07

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	131,399	0	131,399	

### 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	2019-10-08
기준일	2019-10-07

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	171,777	0	171,777	

### 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	2019-10-08
기준일	2019-10-07

## 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	411,386	0	411,386	
누계	통화	선도	0	459,375	-459,375	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,925
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,542
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	1,378
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	2,977
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	3,159
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	2,623
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E	1,915
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E	2,010
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E	957
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E	670
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E	1,570
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E	708

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

(단위:백만원)



공시일	2019-10-08
기준일	2019-10-07

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

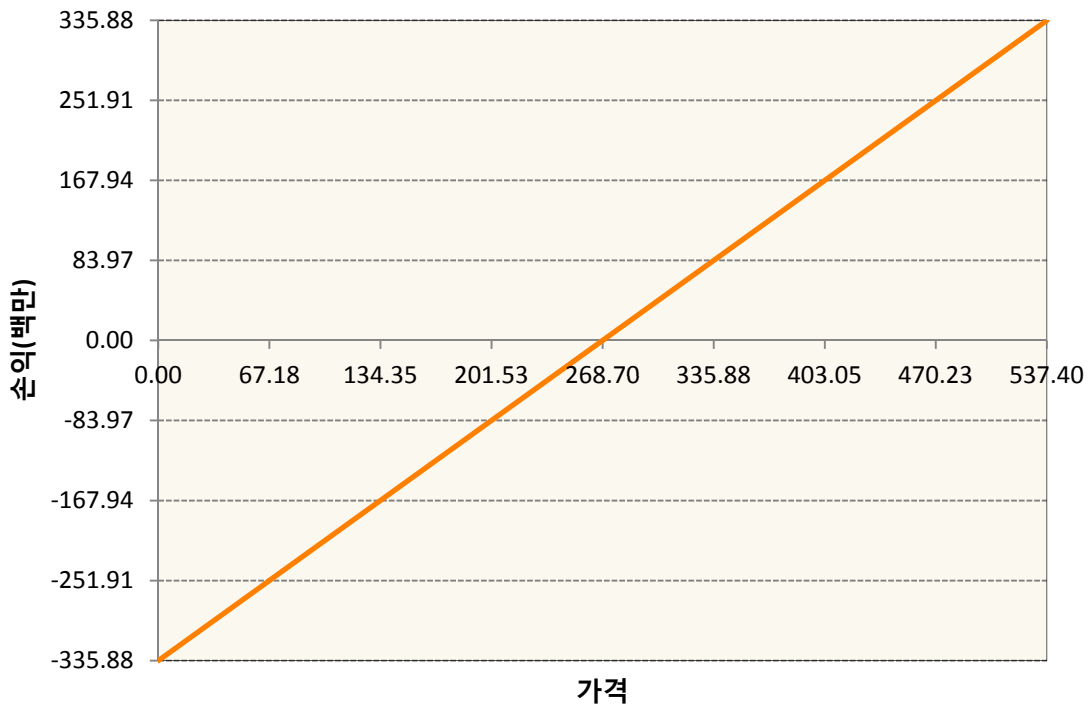
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

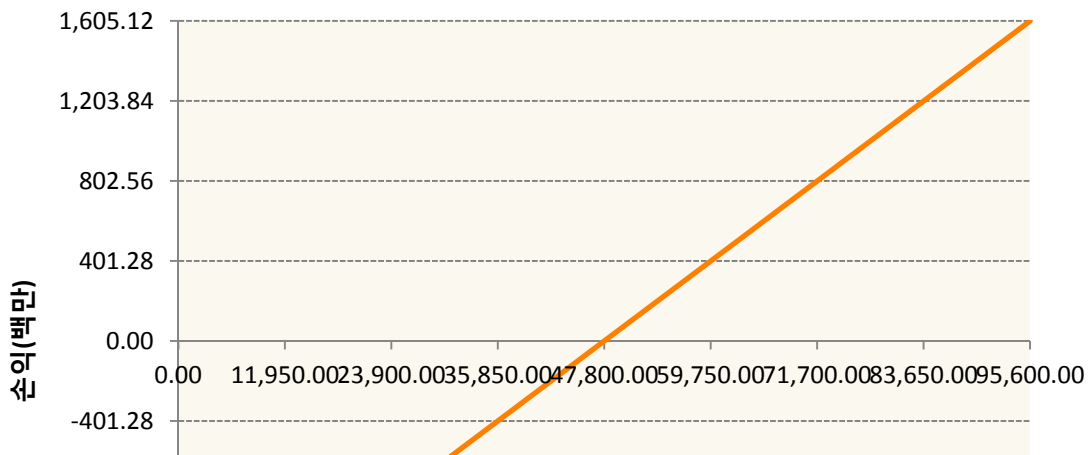
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,941	0	1,941	장내

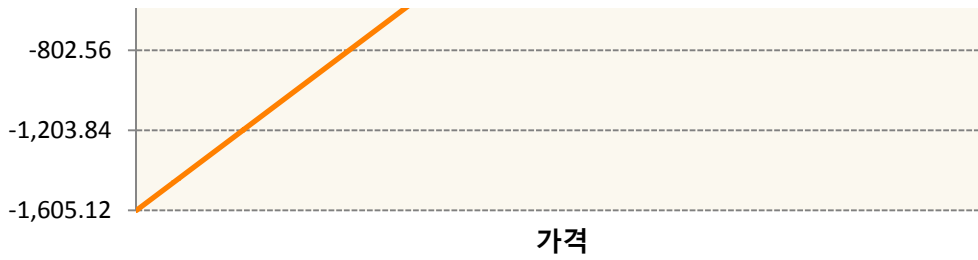
### 2. 만기시점의 손익구조

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%	-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%	128	128	128	128	128	128	128	

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

**183**

공시일	2019-10-08
기준일	2019-10-07

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

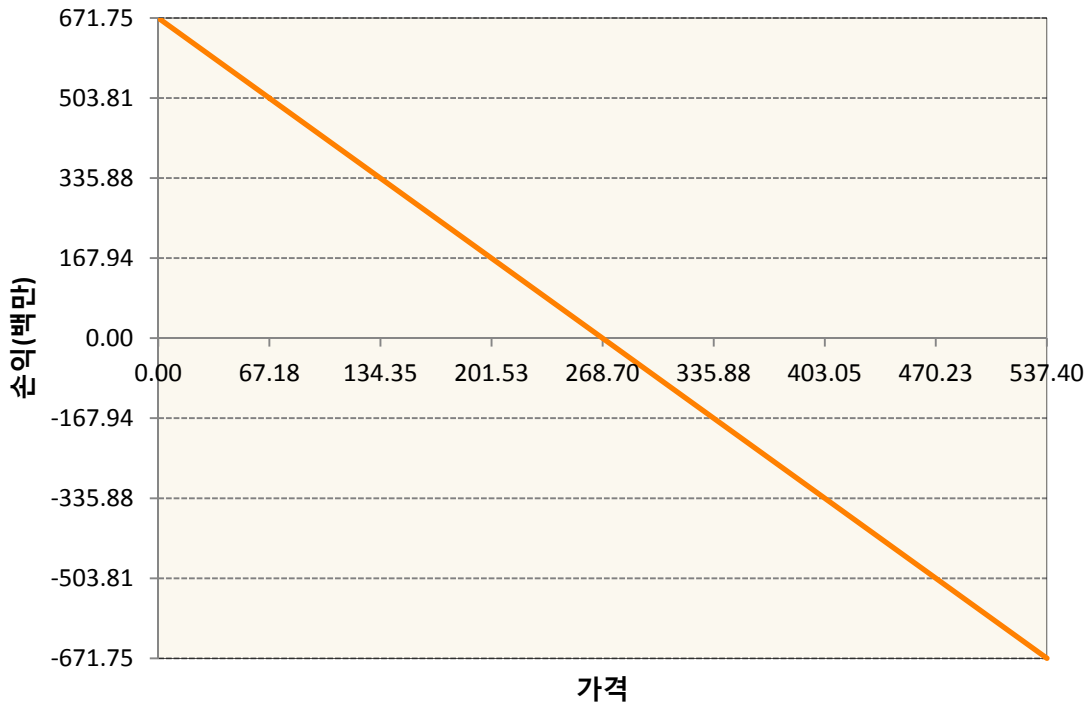
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

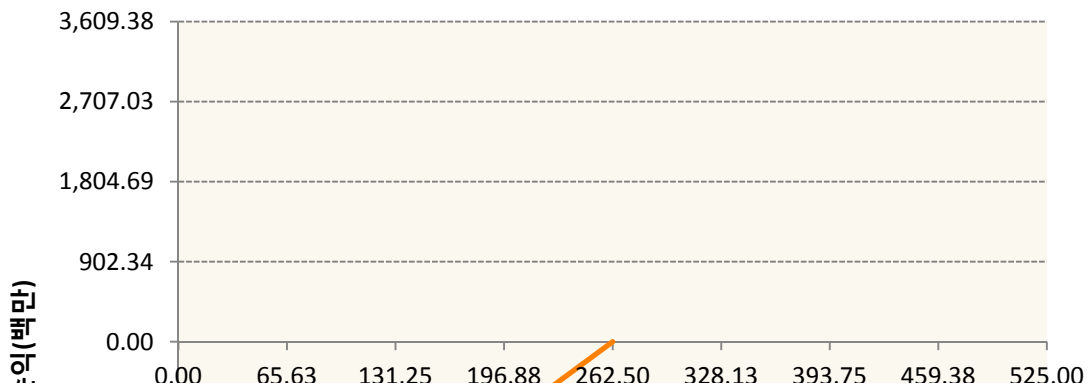
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	672	-672	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,007	-4,007	장내

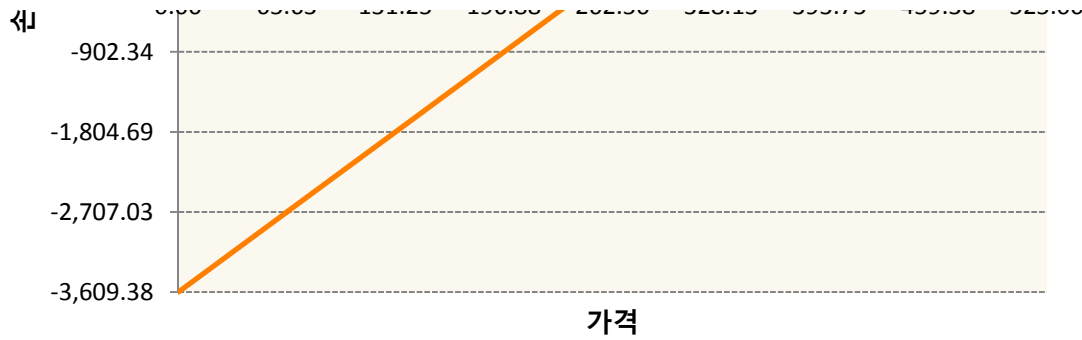
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

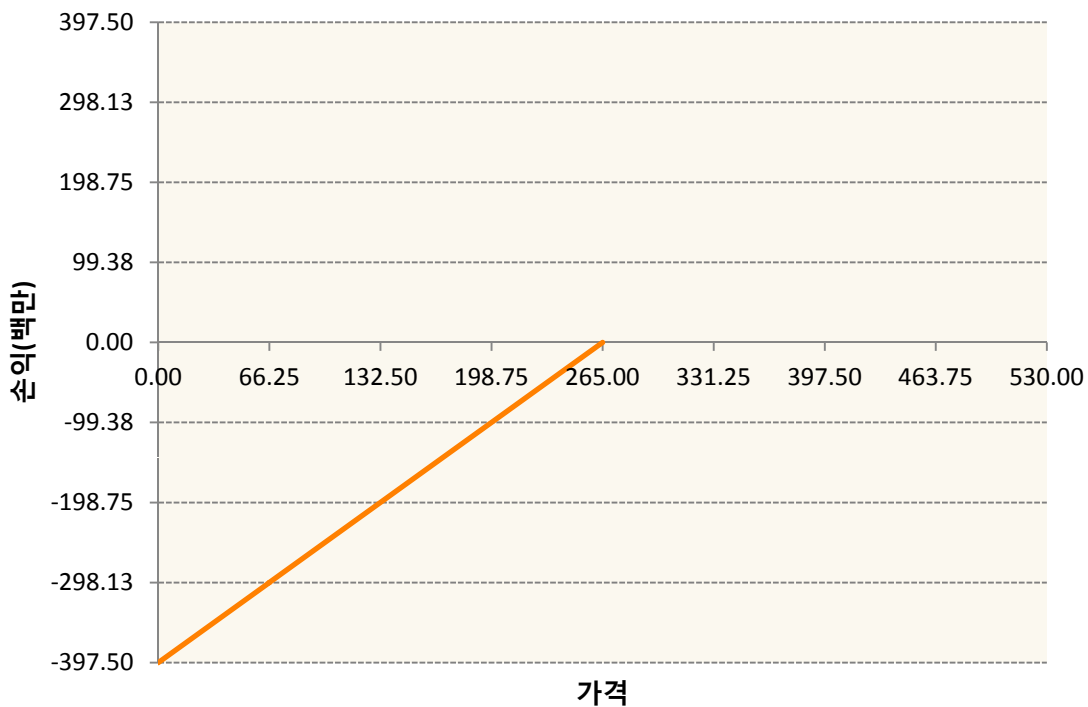


KR4301PA2628-2019-10 풋262.5





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						221
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-221	-221	-221	-221	-221	-221	-221
-5.33%	-123	-123	-123	-123	-123	-124	-124
-2.67%	-31	-32	-34	-35	-37	-38	-40
0%	2	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

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%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
-2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-7
0%	0	0	0	0	0	0	0
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)

292

공시일	2019-10-08
기준일	2019-10-07

## 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	17,201	0	17,201	
누계	통화	선도	718	17,710	-16,992	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		325
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)

486
-----

공시일	2019-10-08
기준일	2019-10-07

## 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	2019-10-08
기준일	2019-10-07

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

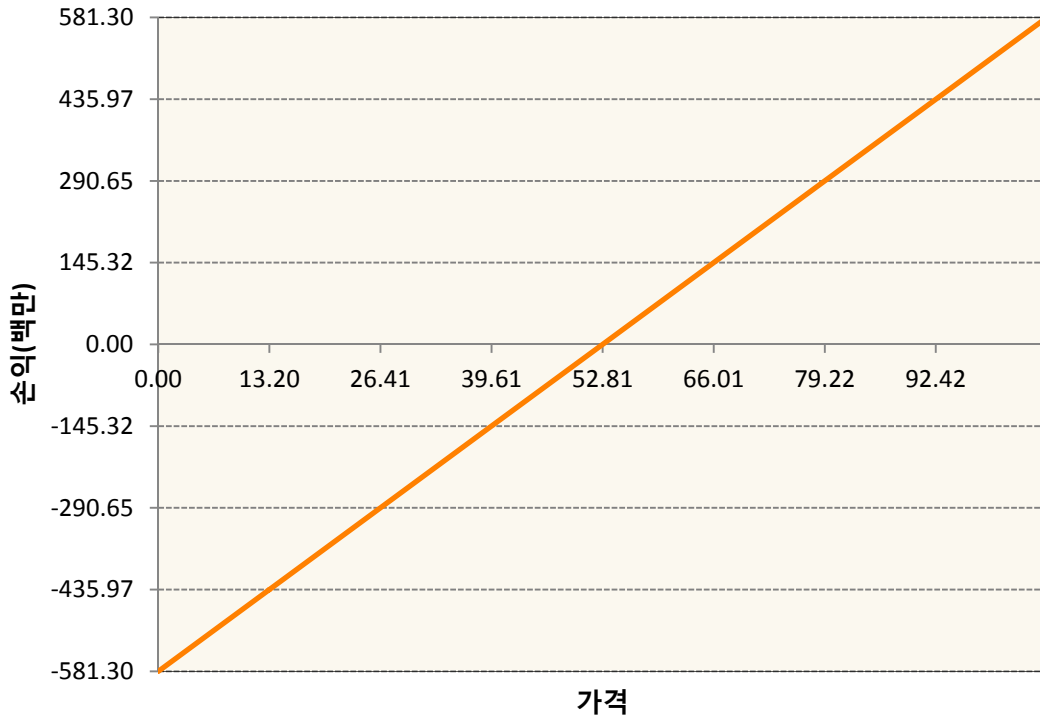
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

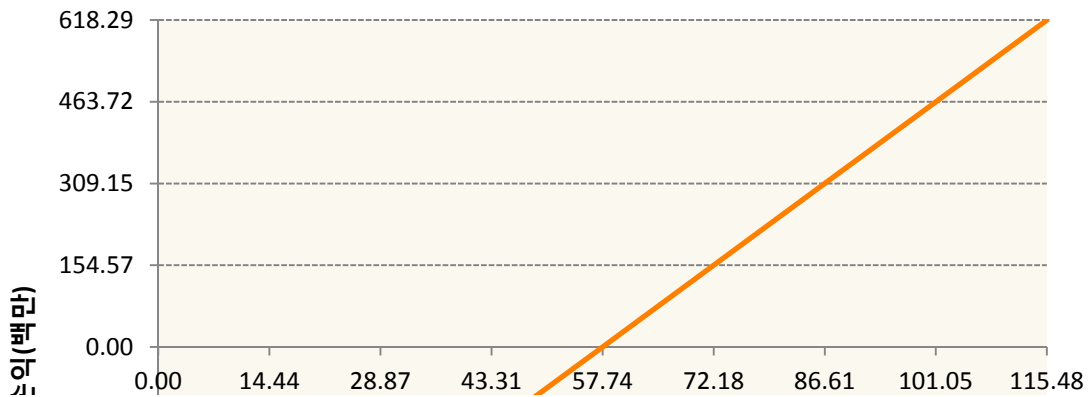
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,254	359	1,896	
누계	유가증권	선물	194	0	194	장내

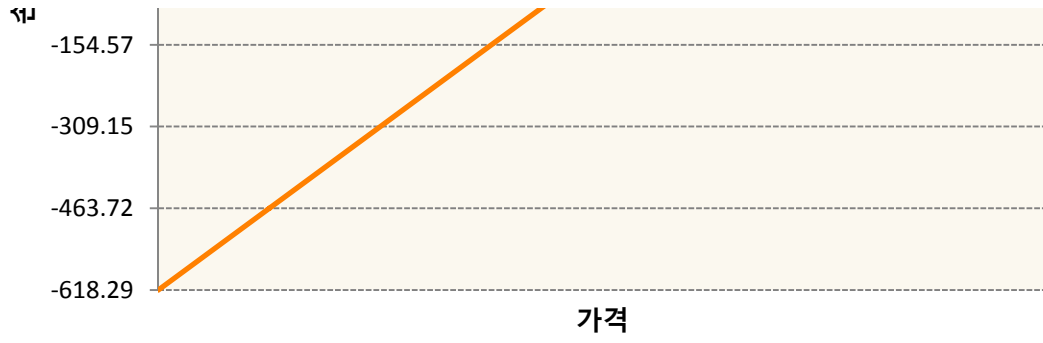
### 2. 만기시점의 손익구조

CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19

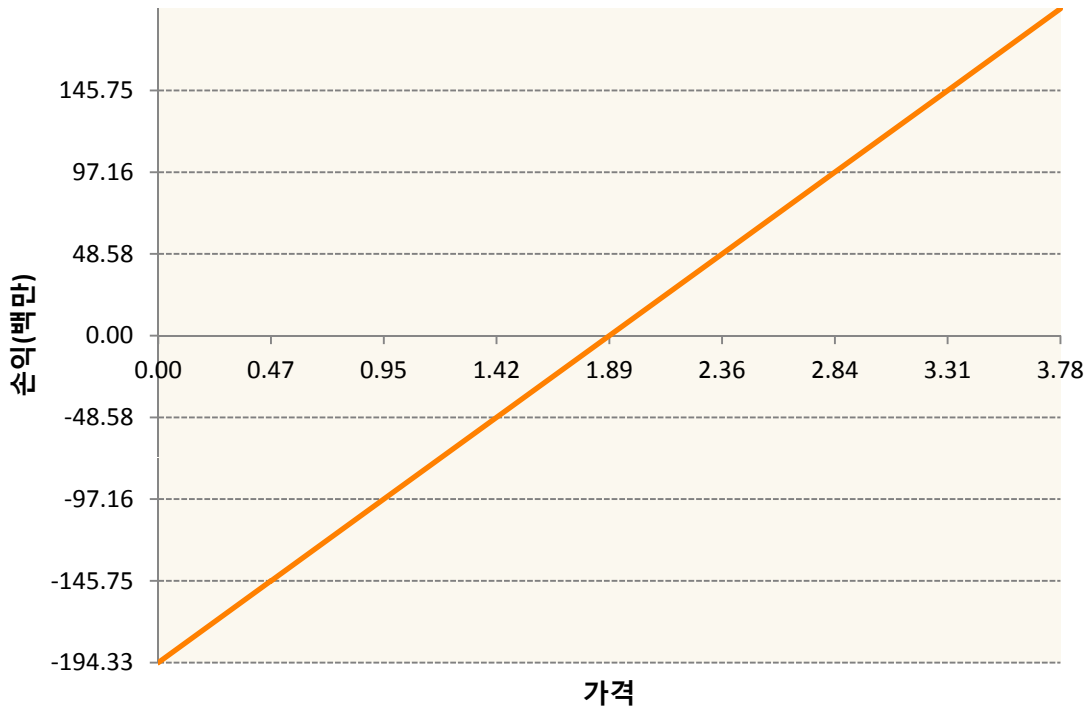


COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20

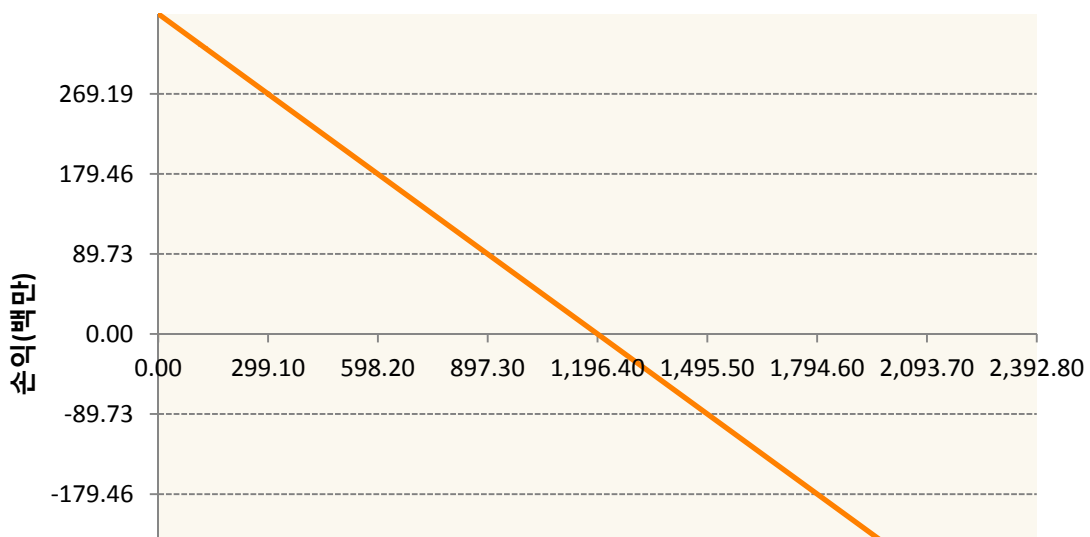


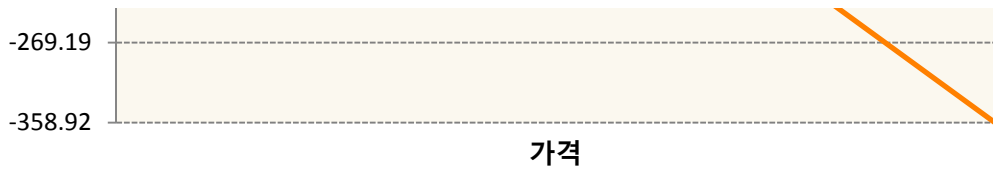


HOX9-Heating Oil

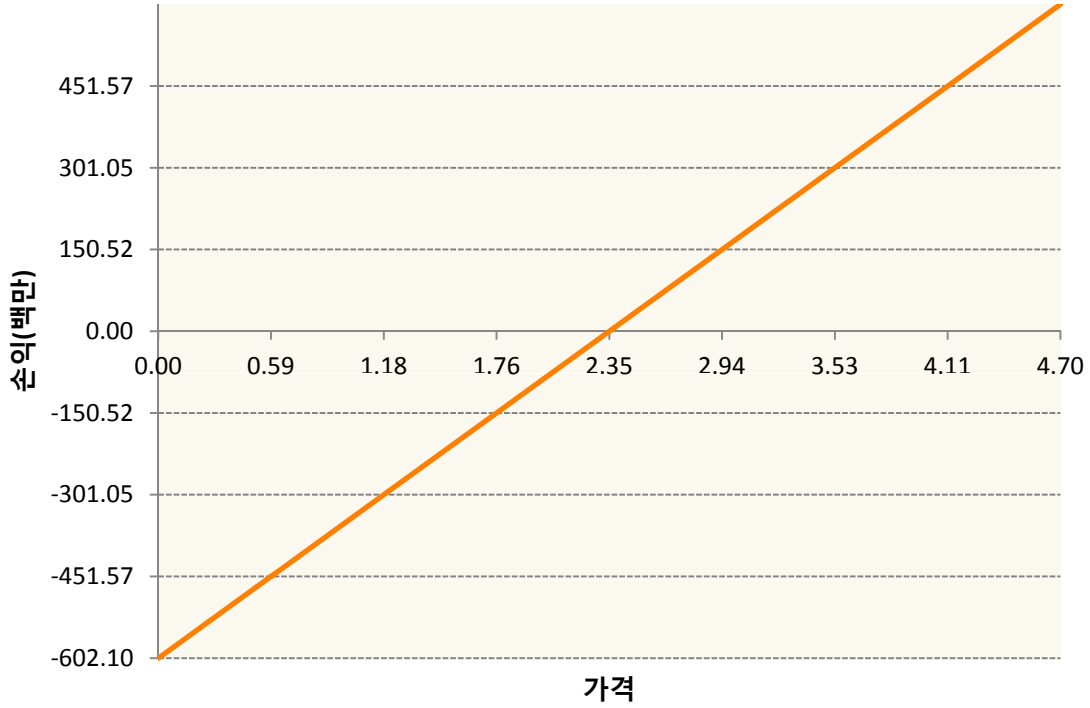


KR4175PA0005-2019-10 달러선물

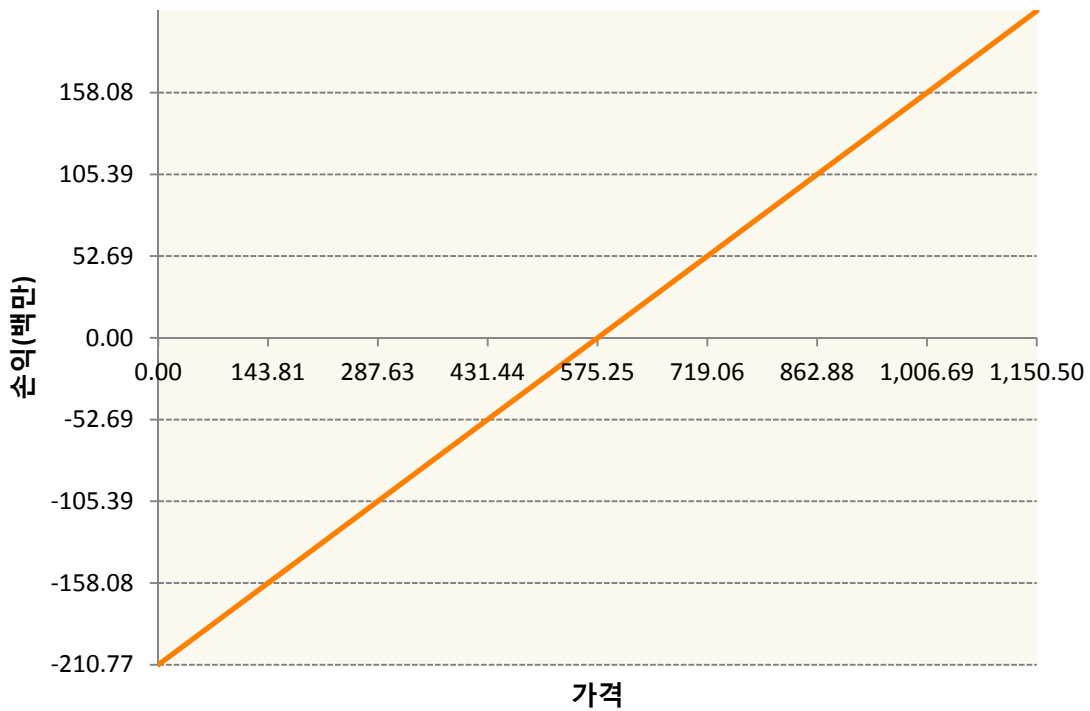


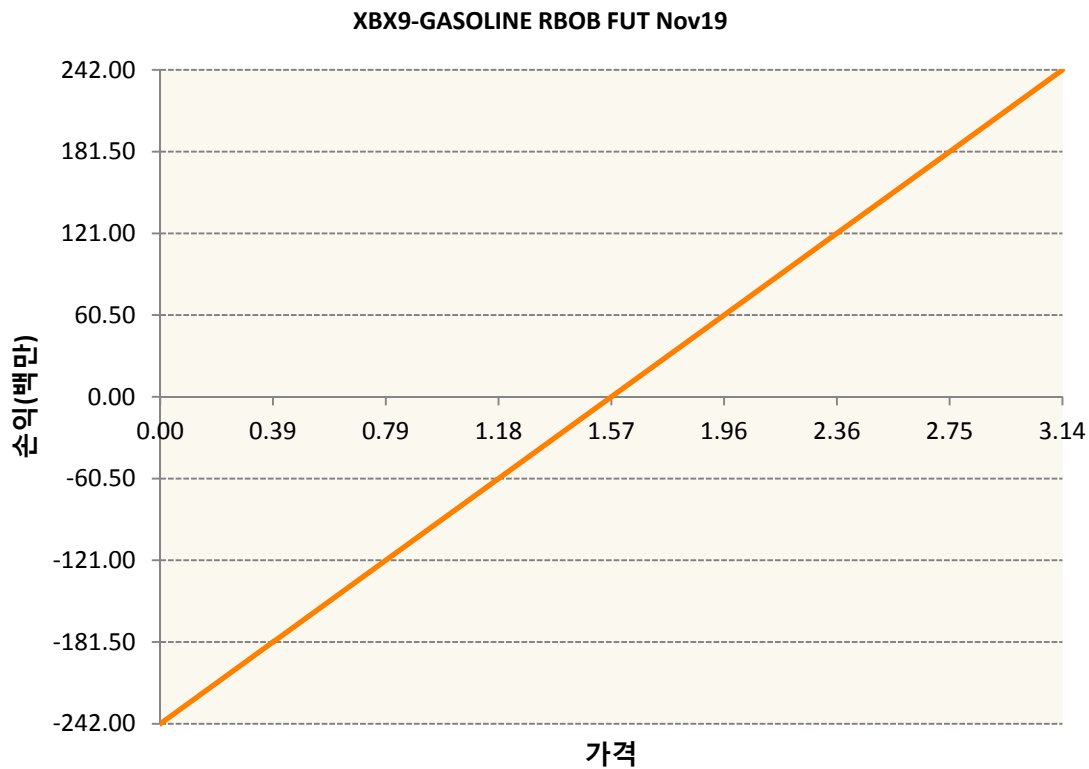


NGX19-NATURAL GAS FUTR Nov19



QSX9-Low Su Gasoil G Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX9	WTI CRUDE FUTURE Nov19	47
COF0	BRENT CRUDE FUTR Jan20	49
HOX9	Heating Oil	16
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)
	407

공시일	2019-10-08
기준일	2019-10-07

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

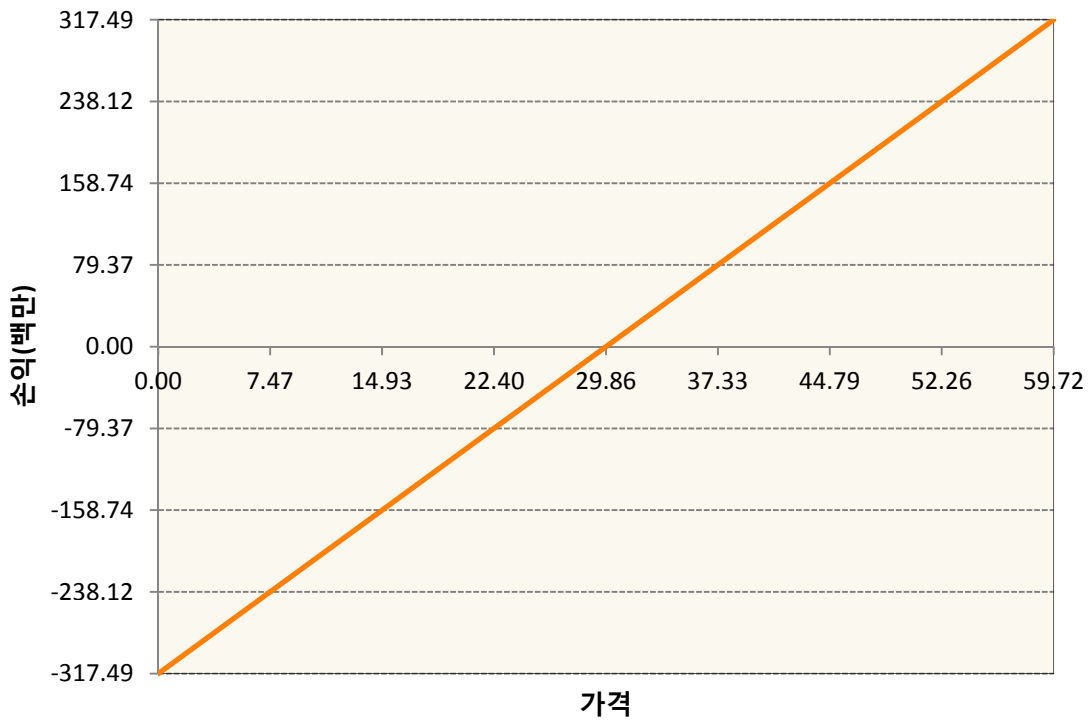
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

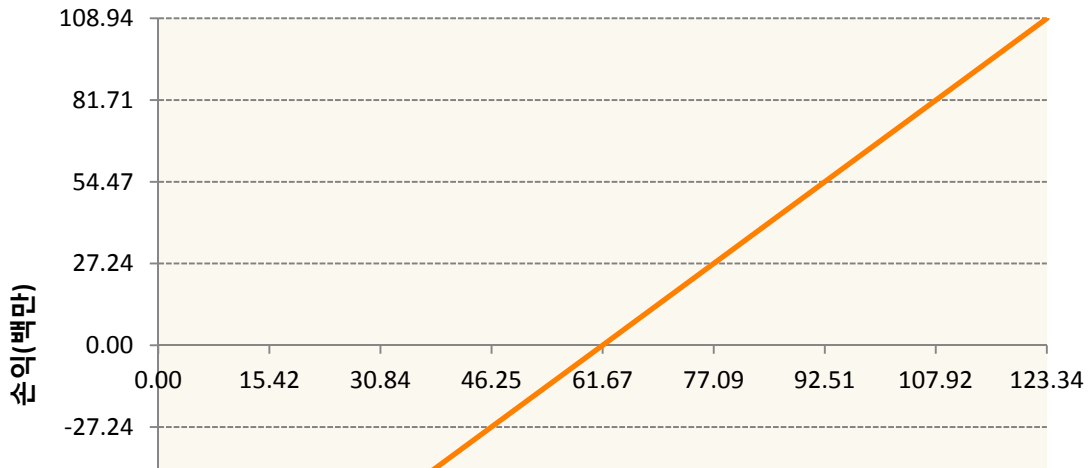
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,825	96	2,730	

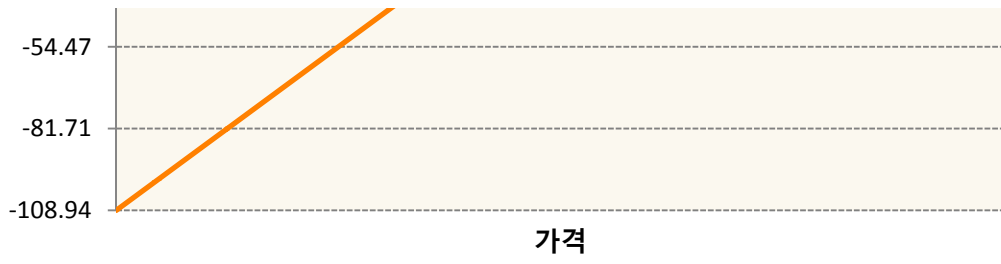
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19**

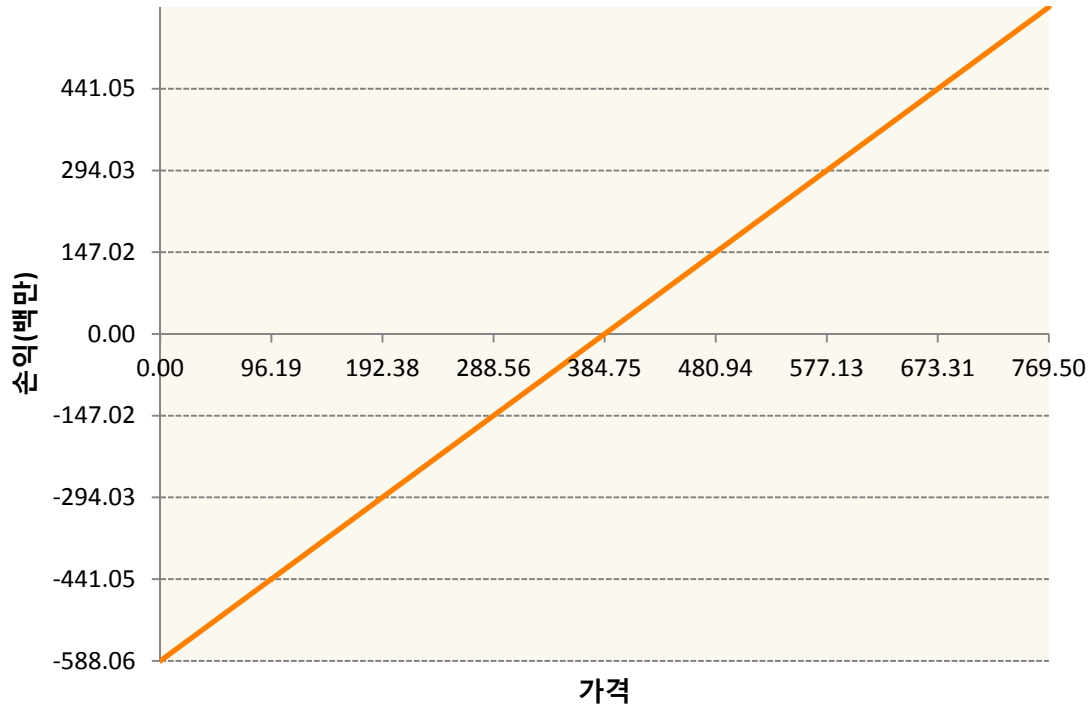


**CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19**

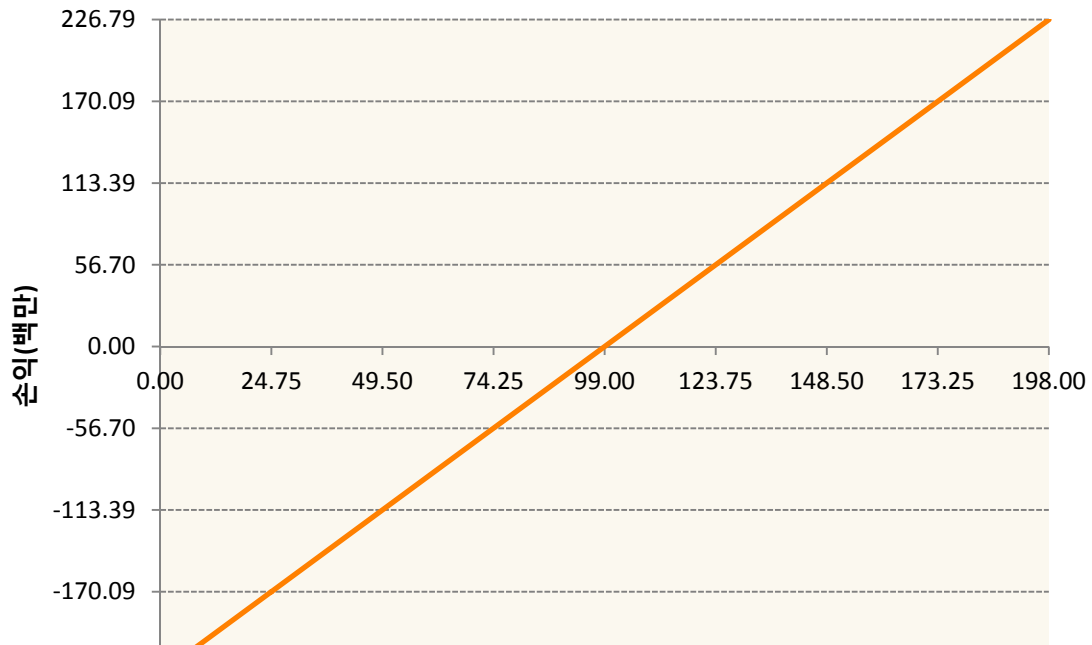


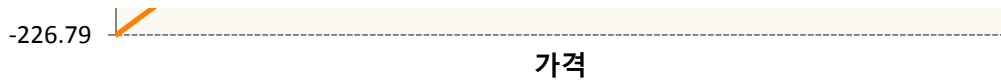


**CZ9-CORN FUTURE Dec19**

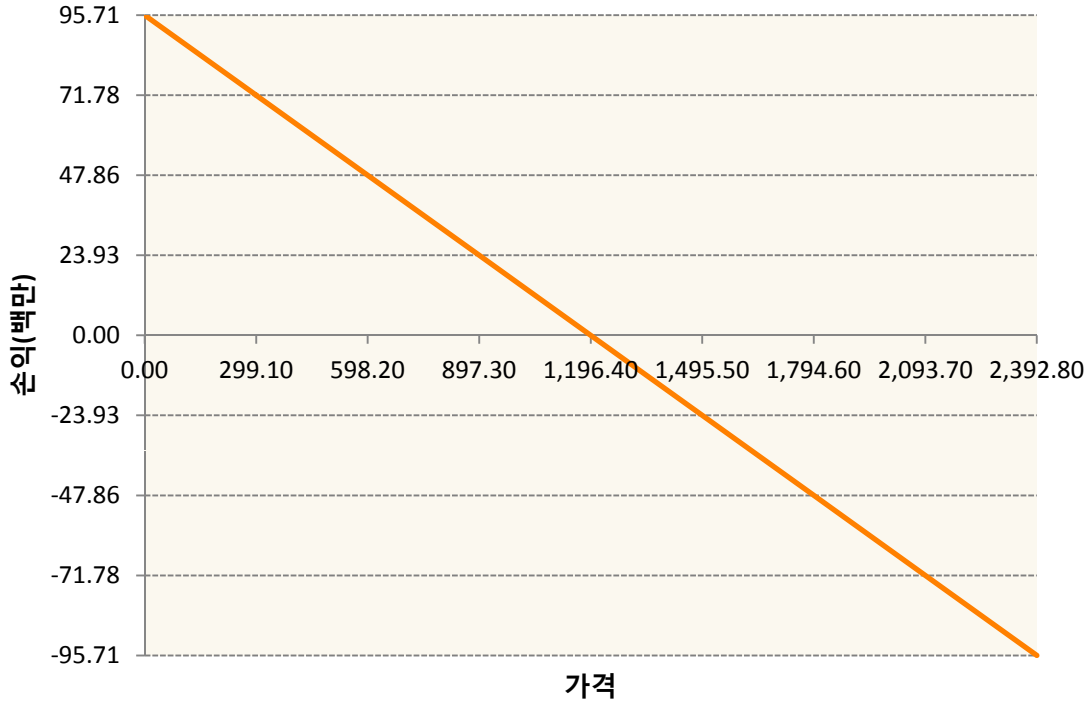


**KC9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19**

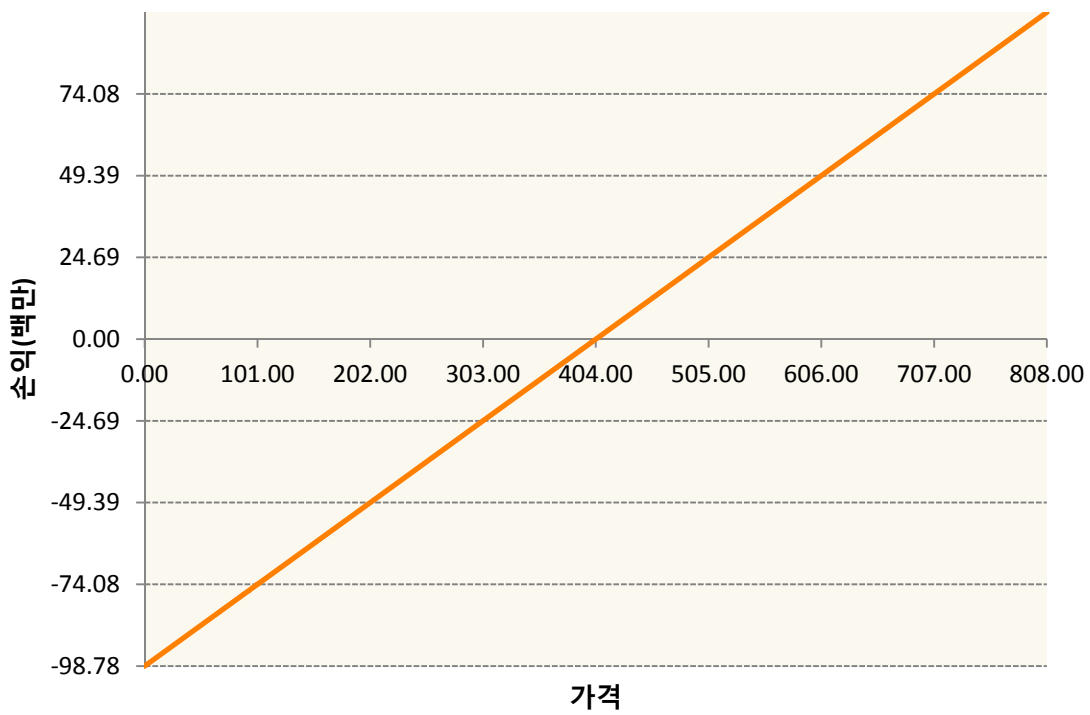




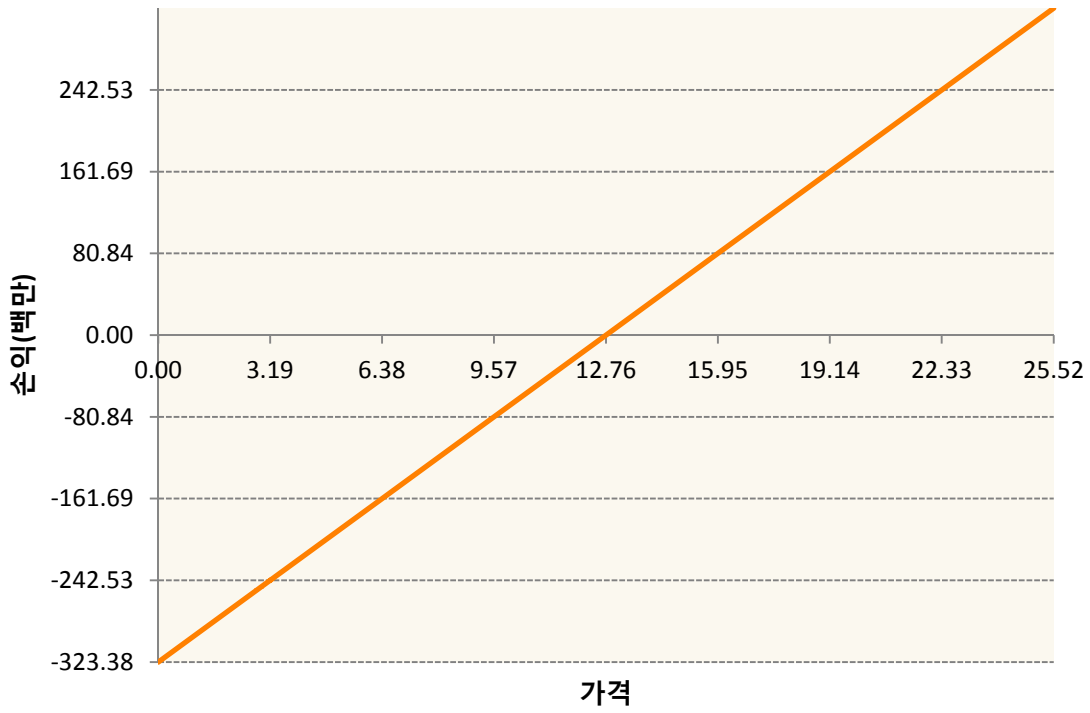
KR4175PA0005-2019-10 달러선물



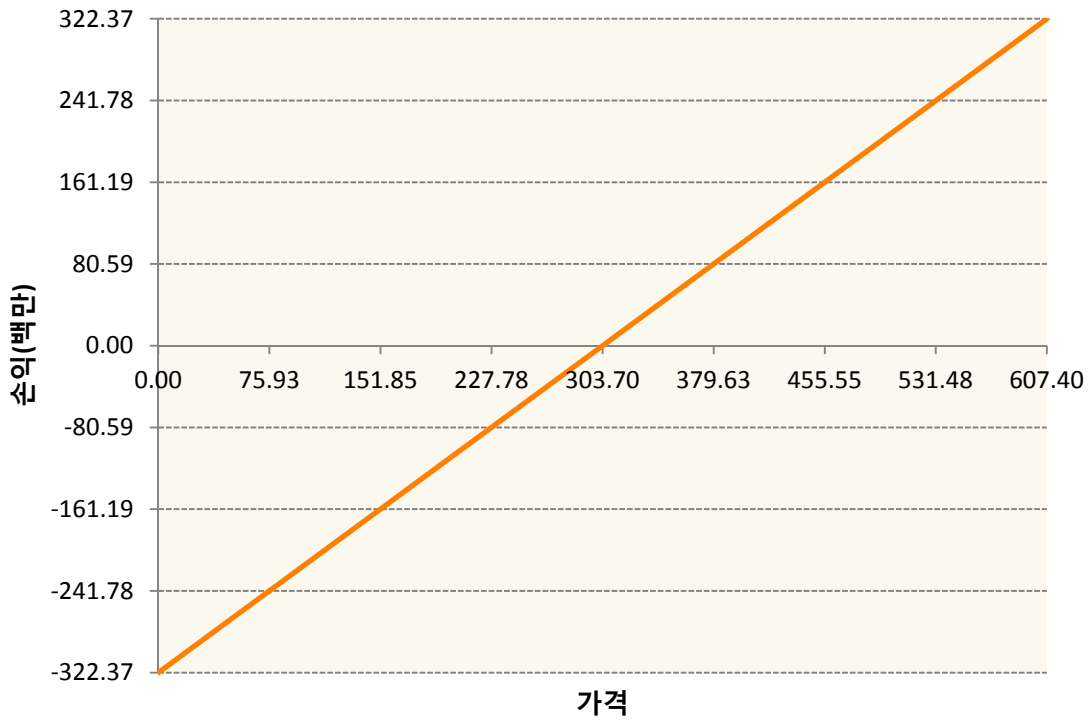
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



SBH0-Sugar Mar20

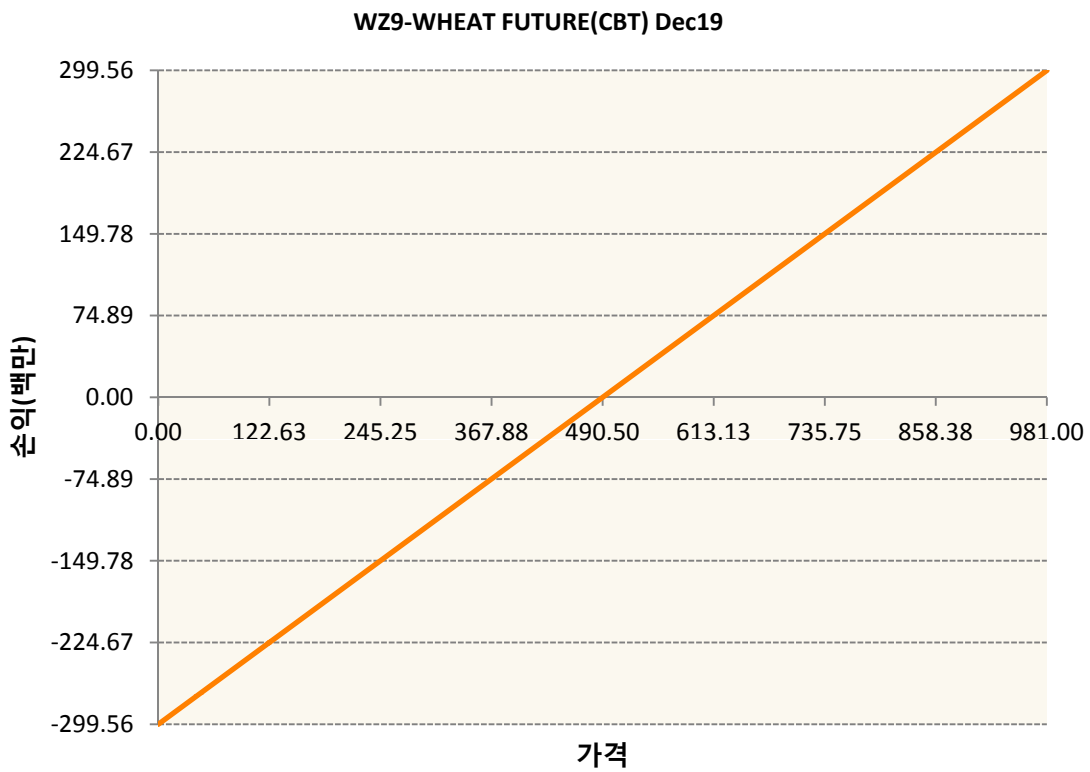
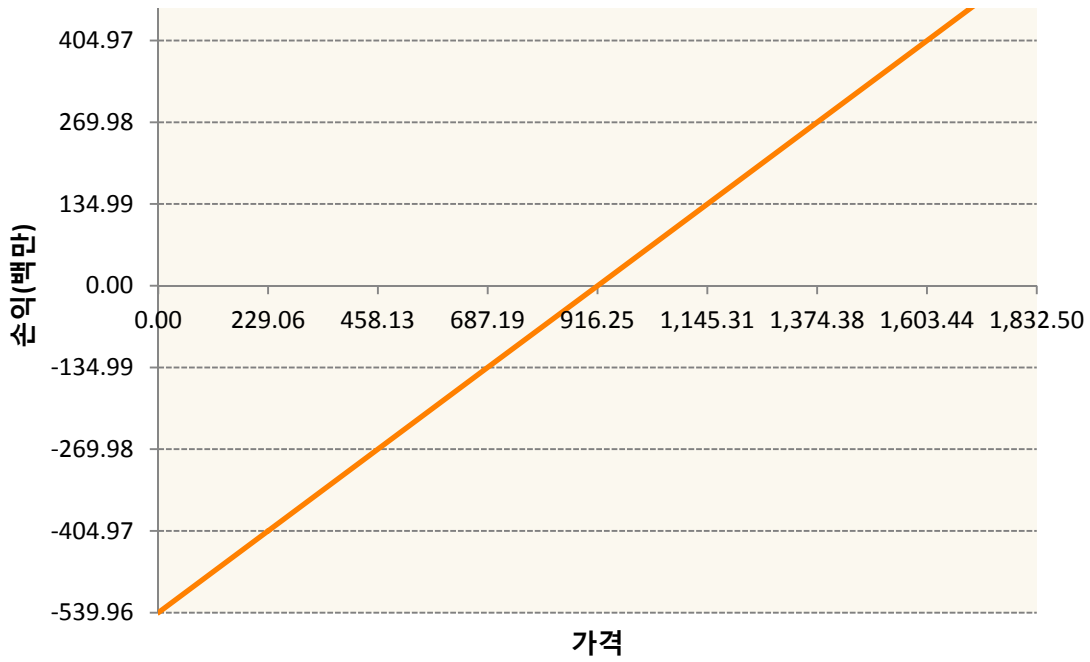


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



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	47
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	26
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	43
WZ9	WHEAT FUTURE(CBT) Dec19	24

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

(단위:백만원)

**254**