

공시일	2019-10-10
기준일	2019-10-08

## 포커스농산물모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	5	0	5	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음



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

(단위:백만원)

95

공시일	2019-10-10
기준일	2019-10-08

## 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

1,157

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

668

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-10-10
기준일	2019-10-08

## 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)	375
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	137

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

**813**

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-10-10
기준일	2019-10-08

## 유로인덱스모(주식-파생형)

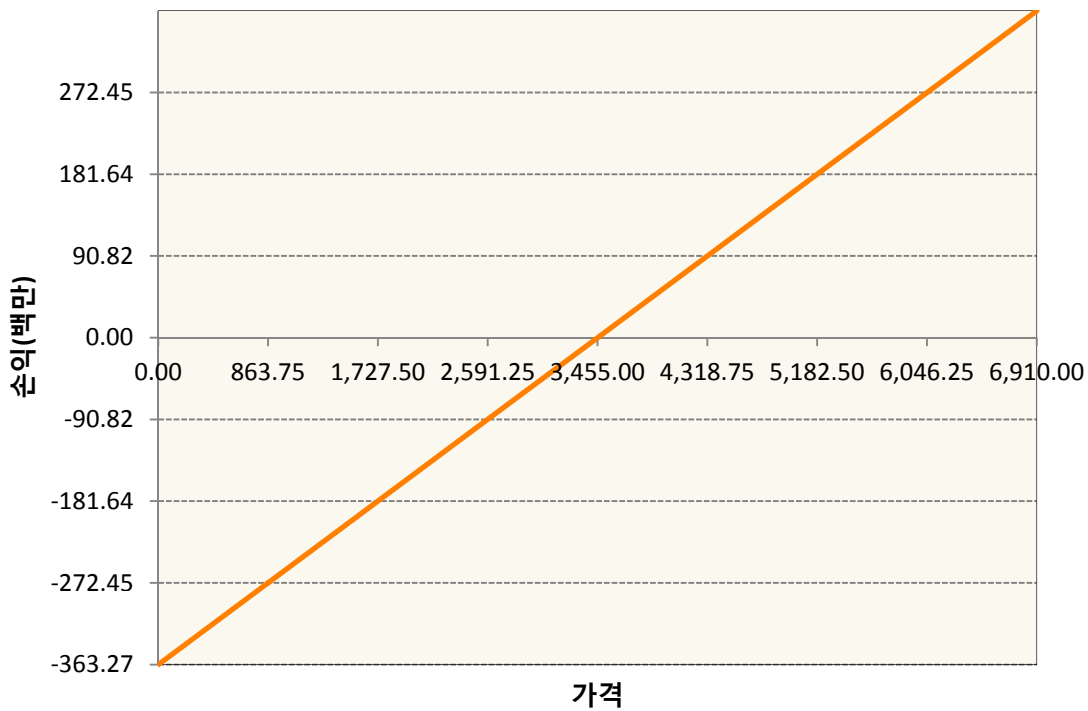
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	363	0	363	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGZ9-EURO STOXX 50 Dec19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	29
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

20
----

공시일	2019-10-10
기준일	2019-10-08

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

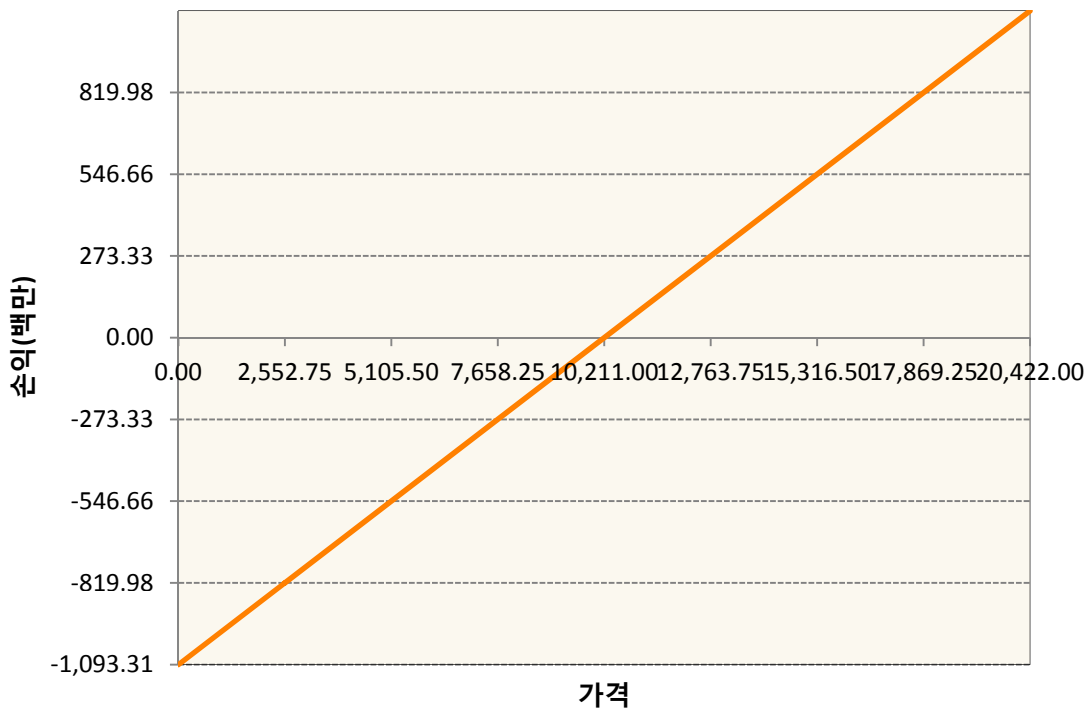
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,093	0	1,093	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	2019-10-10
기준일	2019-10-08

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

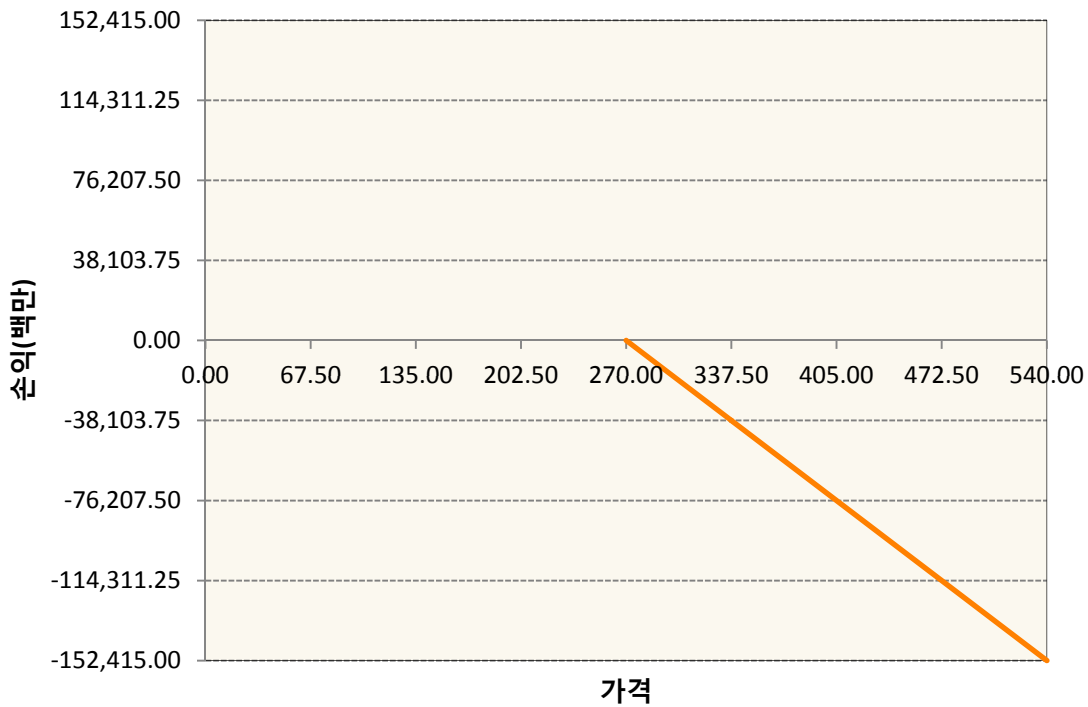
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

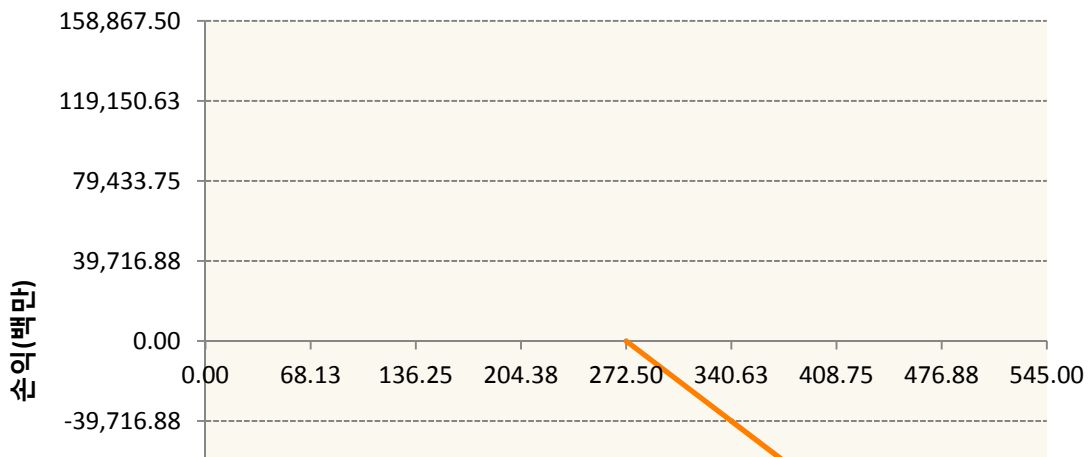
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	33,766	34,426	-660	장내
누계	유가증권	옵션	0	513,040	-513,040	장내

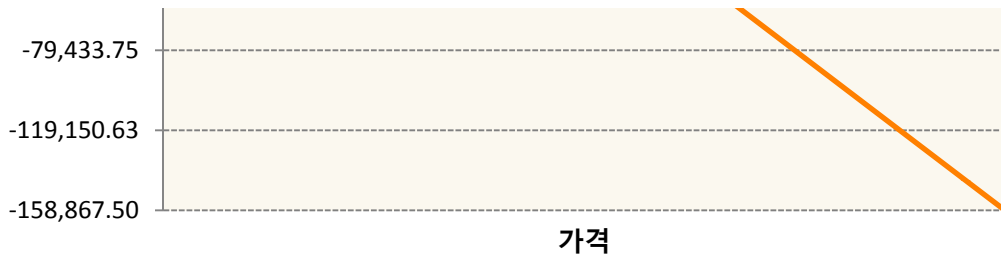
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201PA2702-2019-10 콜270**

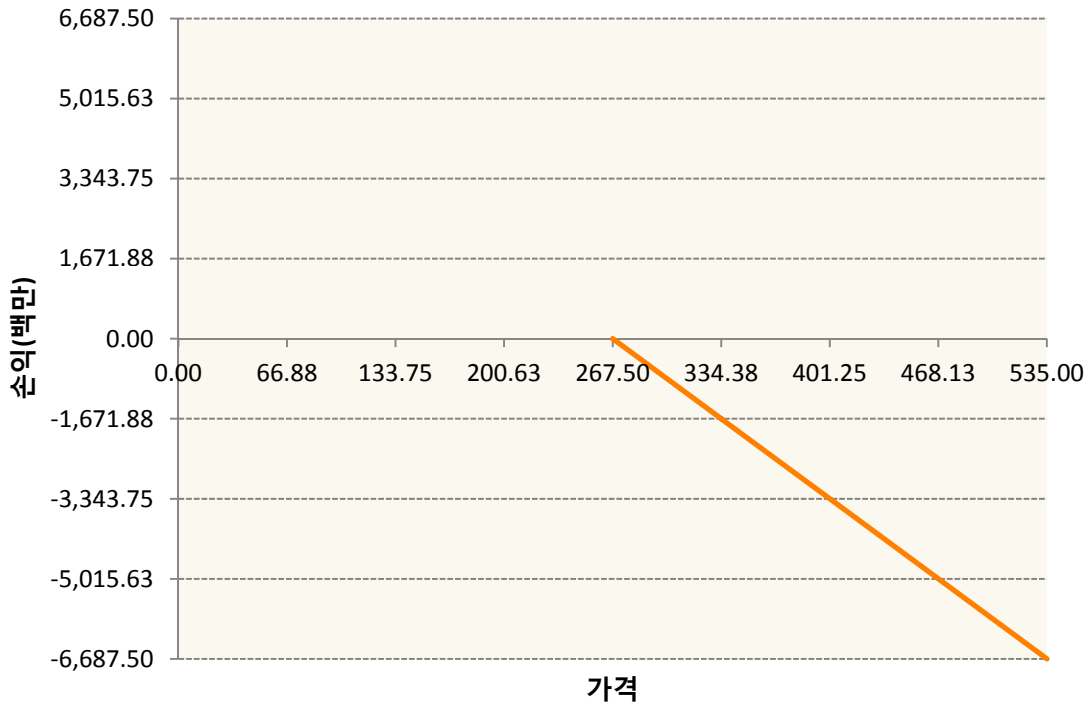


**KR4201PA2728-2019-10 콜272.5**

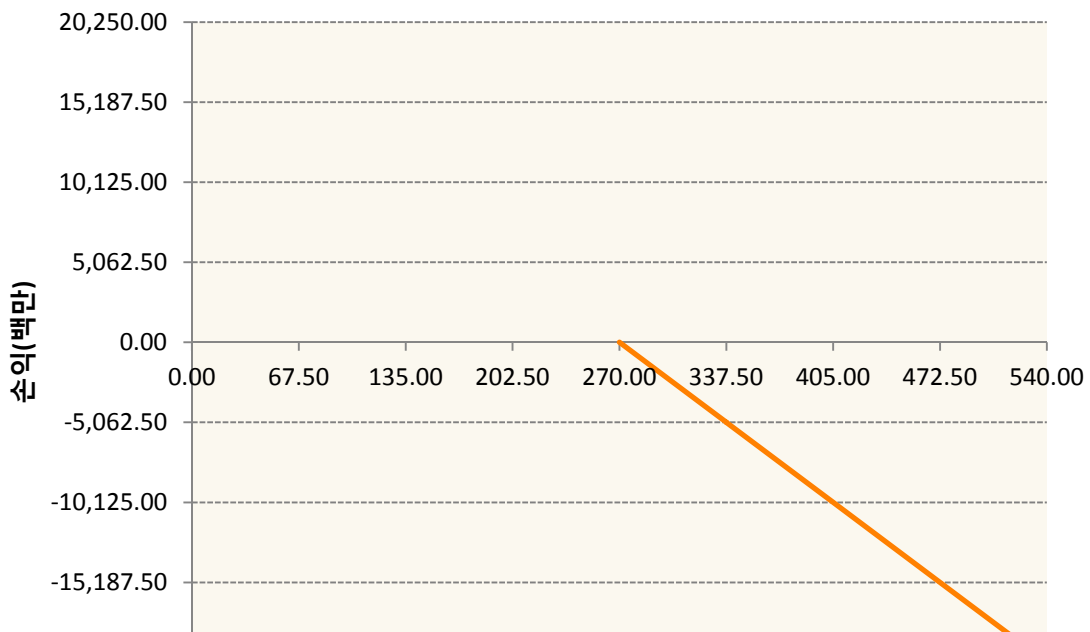


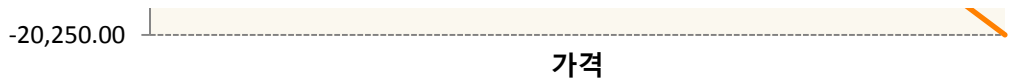


**KR4201PB2677-2019-11 콜267.5**

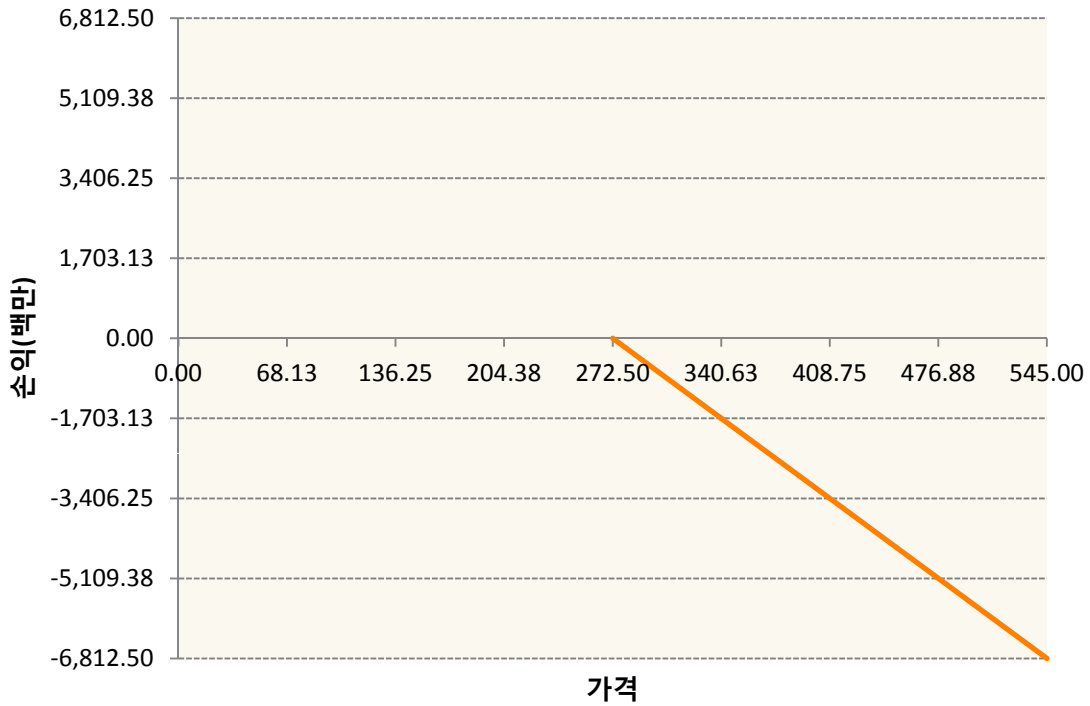


**KR4201PB2701-2019-11 콜270**

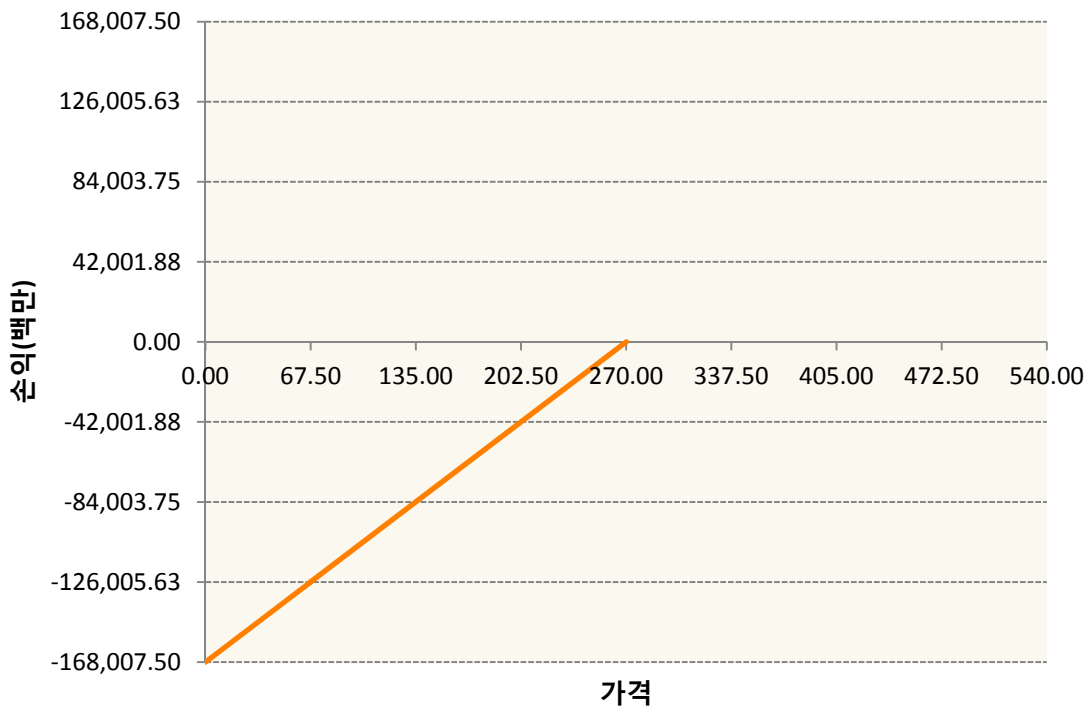




**KR4201PB2727-2019-11 콜 272.5**



**KR4301PA2701-2019-10 풋 270**



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

KR4201PA2702		2019-10 콜270						11,404
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,610	1,610	1,610	1,610	1,610	1,609	1,609	
-5.33%	1,609	1,609	1,607	1,605	1,600	1,592	1,582	
-2.67%	1,546	1,510	1,468	1,419	1,364	1,305	1,242	
0%	285	191	96	0	-96	-193	-290	
2.67%	-3,248	-3,261	-3,280	-3,305	-3,336	-3,372	-3,414	
5.33%	-7,319	-7,319	-7,320	-7,321	-7,323	-7,326	-7,332	
8.00%	-11,403	-11,403	-11,403	-11,403	-11,403	-11,404	-11,404	
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5						11,055
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	929	929	929	929	929	929	929	
-5.33%	929	929	928	928	926	923	919	
-2.67%	915	902	883	858	826	790	747	
0%	299	200	100	0	-101	-202	-303	
2.67%	-2,685	-2,723	-2,768	-2,820	-2,878	-2,941	-3,008	
5.33%	-6,835	-6,836	-6,839	-6,843	-6,850	-6,860	-6,873	
8.00%	-11,053	-11,053	-11,053	-11,053	-11,054	-11,054	-11,055	
KR4201PB2677		2019-11 콜267.5						438
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	246	236	224	212	199	185	171	
-5.33%	210	195	179	163	147	130	114	
-2.67%	148	130	111	93	75	57	38	
0%	55	37	19	0	-19	-37	-56	
2.67%	-66	-82	-99	-115	-133	-150	-168	
5.33%	-211	-223	-236	-250	-265	-280	-296	
8.00%	-373	-381	-390	-401	-412	-424	-438	
KR4201PB2701		2019-11 콜270						1,265
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	661	634	604	570	534	496	456	
-5.33%	574	532	489	444	397	350	301	
-2.67%	415	363	310	256	202	148	93	
0%	170	113	57	0	-57	-113	-170	
2.67%	-166	-217	-270	-324	-378	-432	-487	
5.33%	-578	-619	-663	-708	-756	-804	-854	
8.00%	-1,048	-1,076	-1,108	-1,143	-1,182	-1,222	-1,265	
KR4201PB2727		2019-11 콜272.5						405
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	196	188	179	169	159	147	134
-5.33%	173	160	147	133	118	103	88
-2.67%	128	112	95	77	60	42	25
0%	57	38	19	0	-19	-38	-57
2.67%	-45	-63	-82	-100	-119	-138	-156
5.33%	-174	-189	-205	-221	-238	-255	-273
8.00%	-324	-335	-348	-361	-375	-390	-405
KR4301PA2701                      2019-10 풋270							12,283
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,283	-12,283	-12,283	-12,283	-12,283	-12,283	-12,283
-5.33%	-7,780	-7,780	-7,780	-7,780	-7,780	-7,780	-7,780
-2.67%	-3,280	-3,282	-3,286	-3,292	-3,301	-3,313	-3,328
0%	159	107	54	0	-55	-111	-168
2.67%	386	386	386	385	384	382	378
5.33%	386	386	386	386	386	386	386
8.00%	386	386	386	386	386	386	386

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

(단위:백만원)

**49,287**

공시일	2019-10-10
기준일	2019-10-08

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

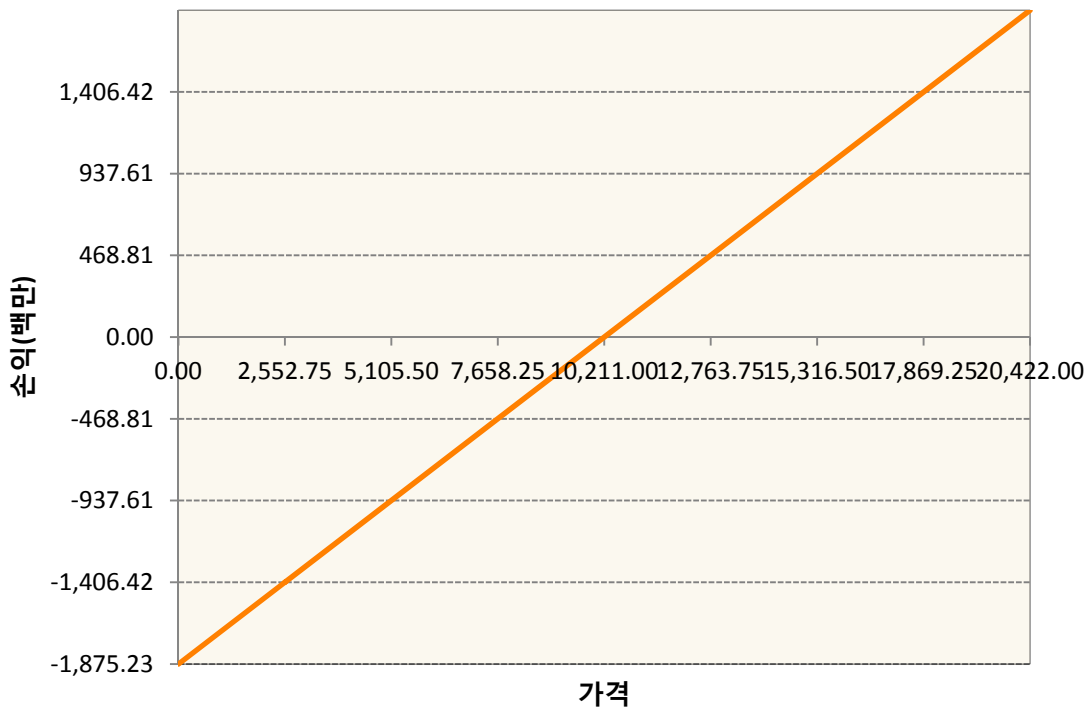
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

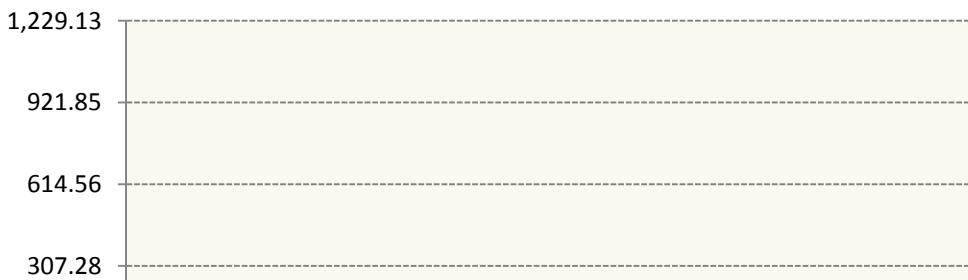
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,875	0	1,875	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,018	-5,018	장내
누계	통화	선도	685	2,826	-2,142	장외

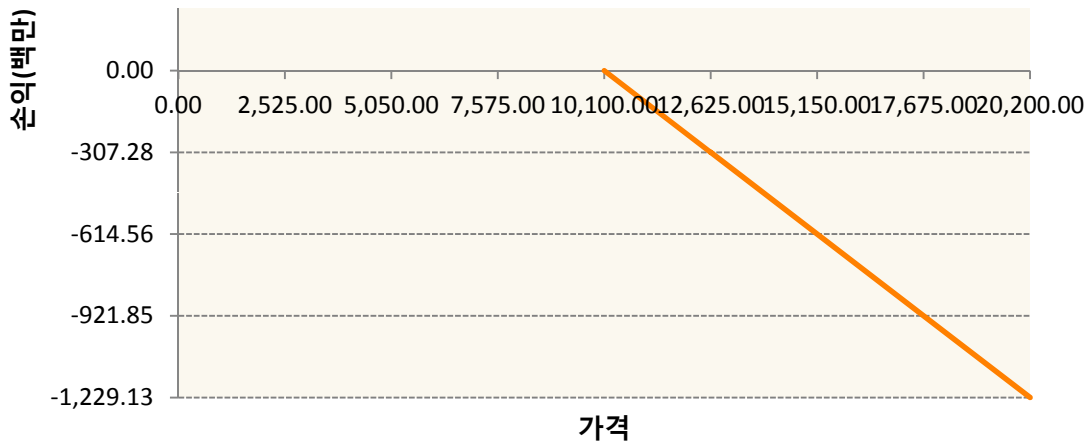
### 2. 만기시점의 손익구조

HCV9-HSCEI Futures Oct19

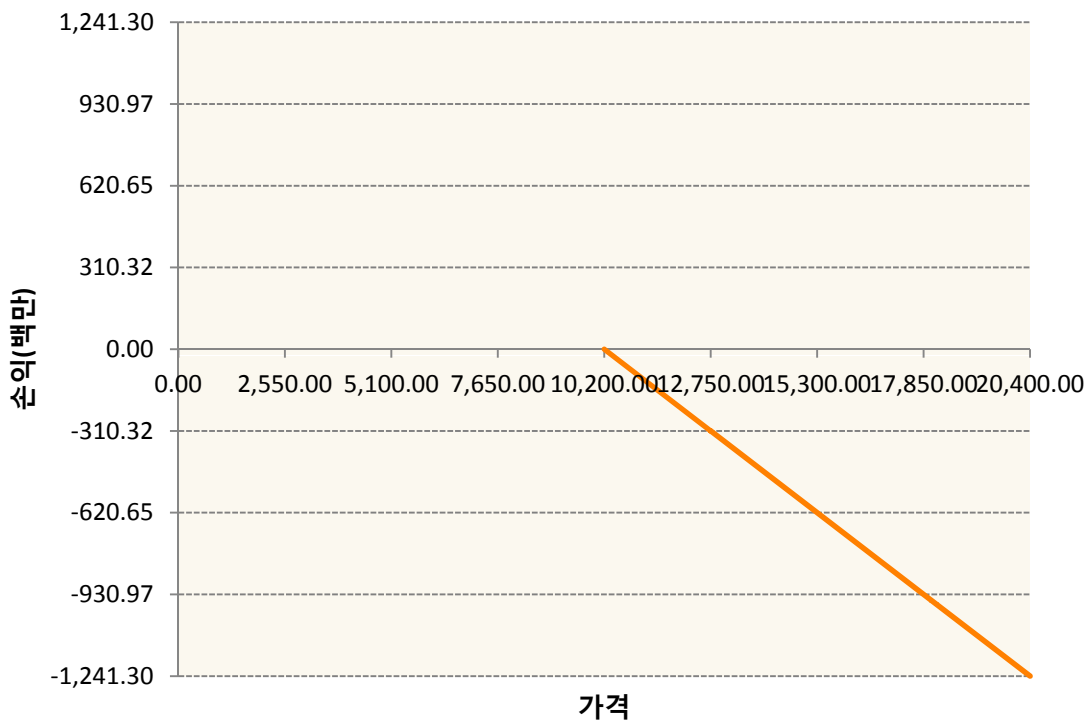


OHHIV9-C101-HSCEI

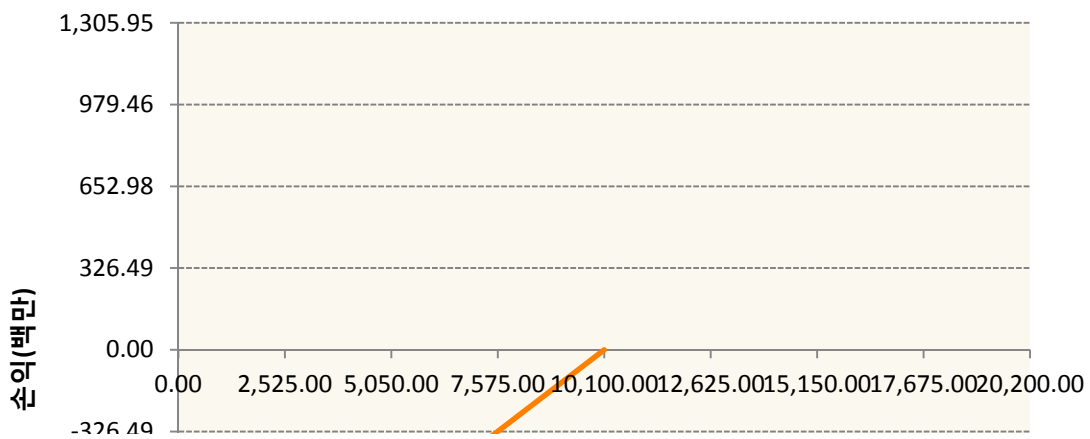


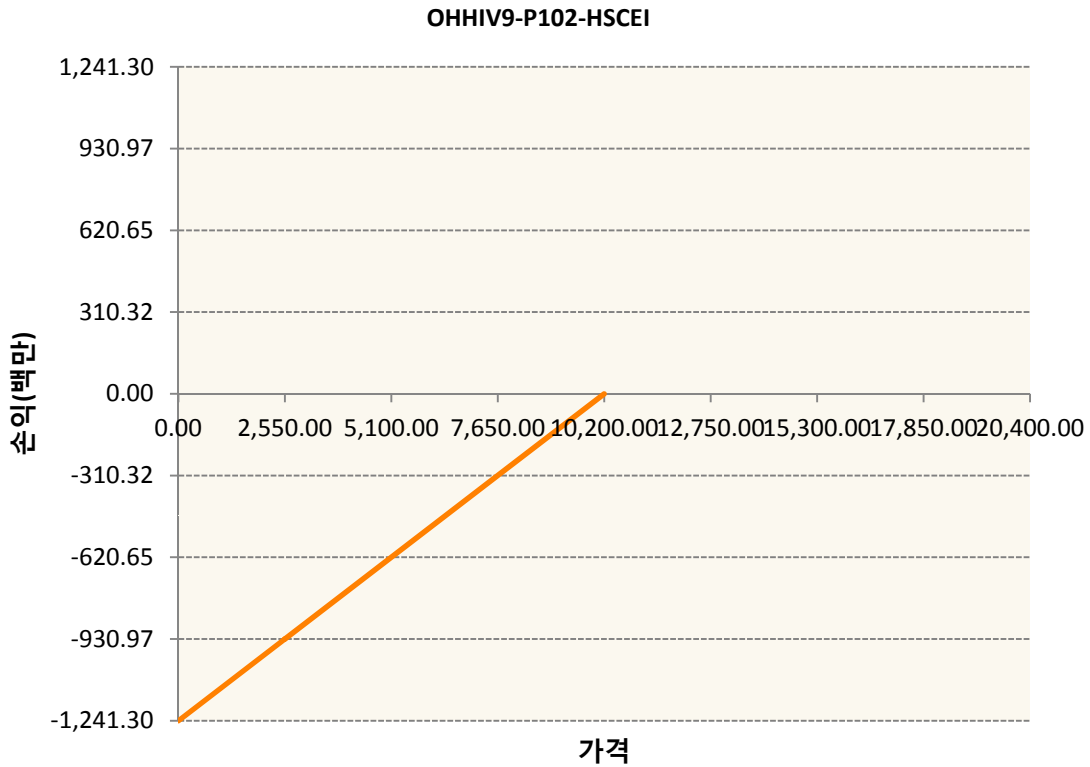


**OHHIV9-C102-HSCEI**



**OHHIV9-P101-HSCEI**





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	226
FX21019U00 HKD/KRW 22-11-19E	6
FX21019U02 HKD/KRW 22-11-19E	49
HCV9 HSCEI Futures Oct19	150
OHHIV9-C1C HSCEI	98
OHHIV9-C1C HSCEI	99
OHHIV9-P1C HSCEI	104
OHHIV9-P1C HSCEI	99

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	591

공시일	2019-10-10
기준일	2019-10-08

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

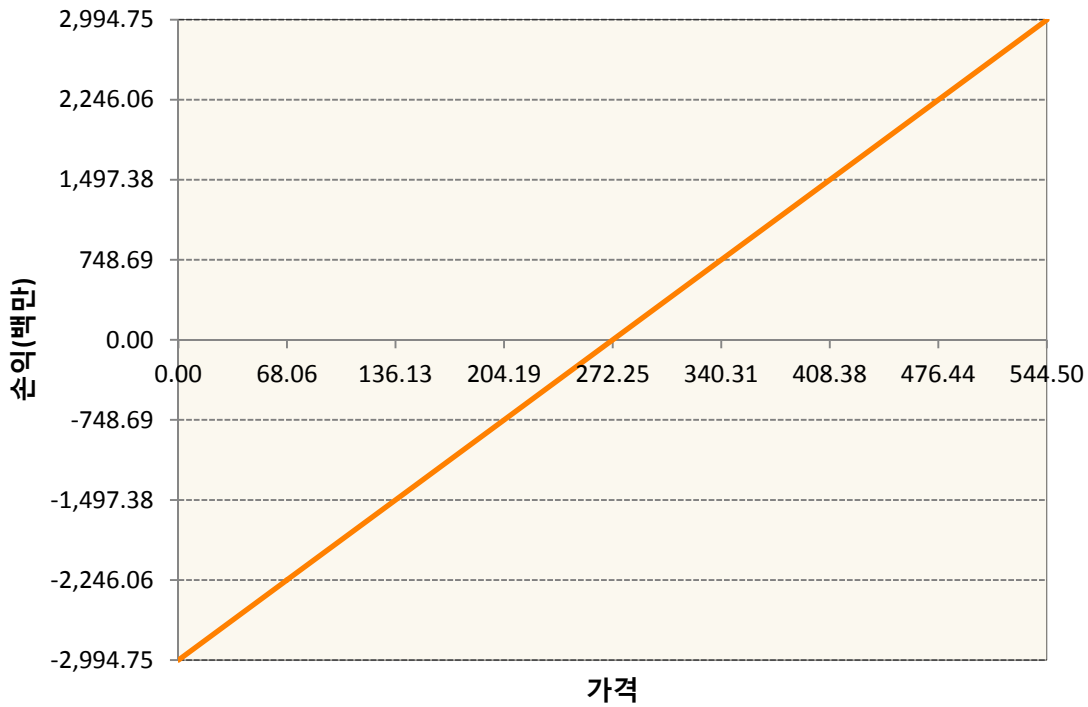
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

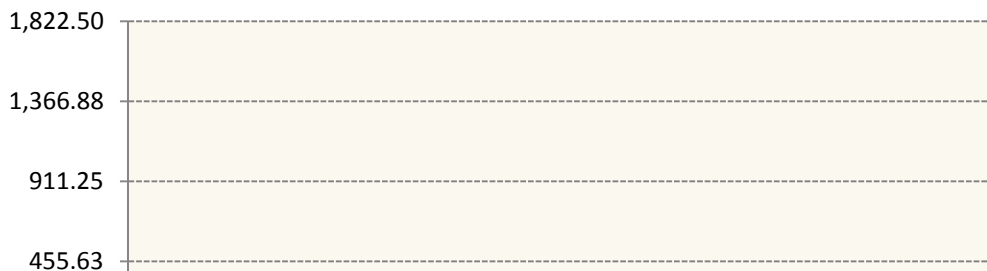
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,995	0	2,995	장내
누계	유가증권	스왑	10,625	0	10,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	10,968	-10,968	장내

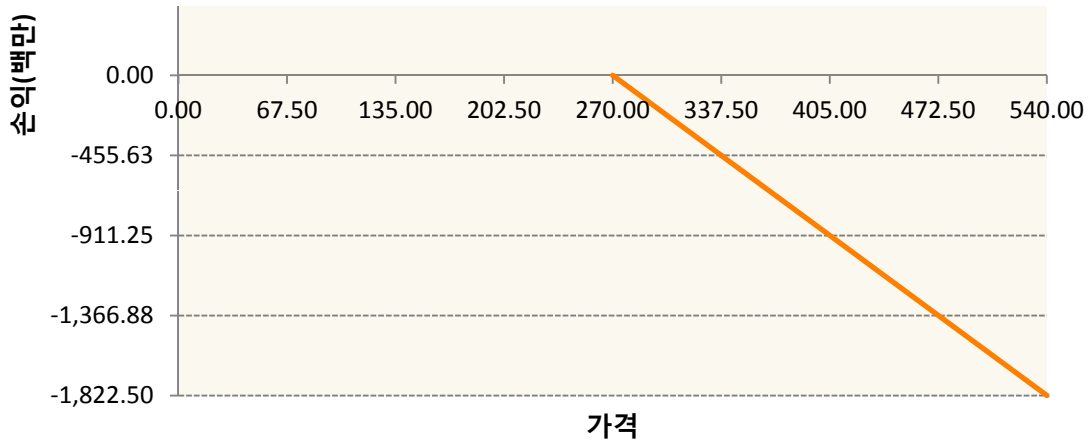
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

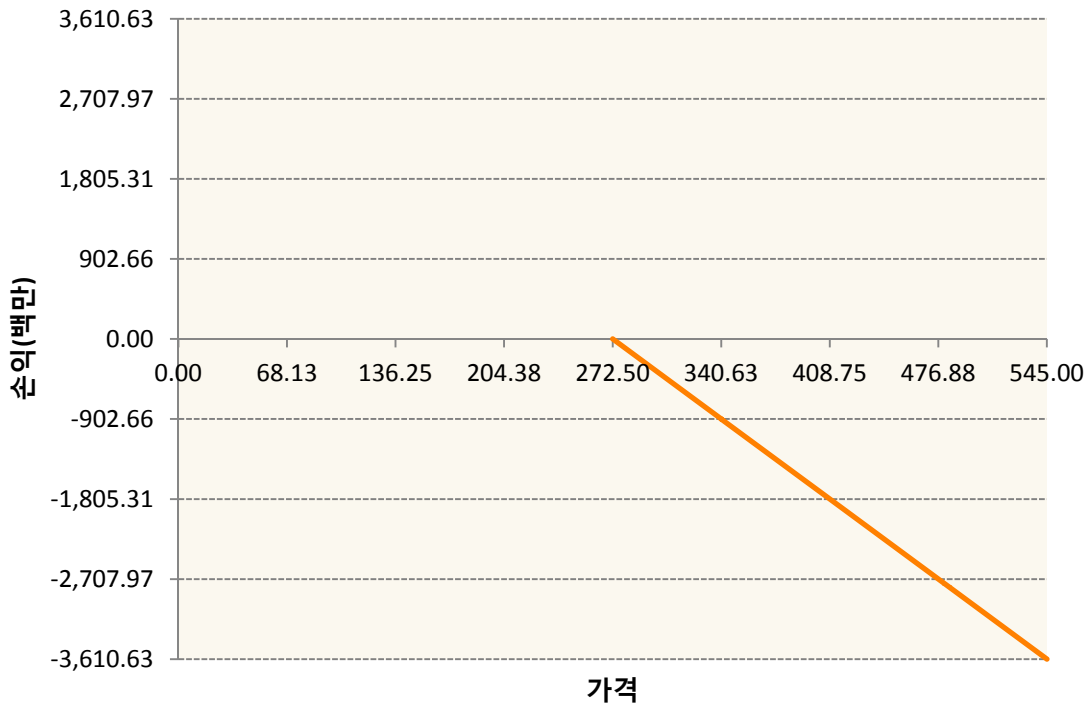


KR4201PA2702-2019-10 콜270

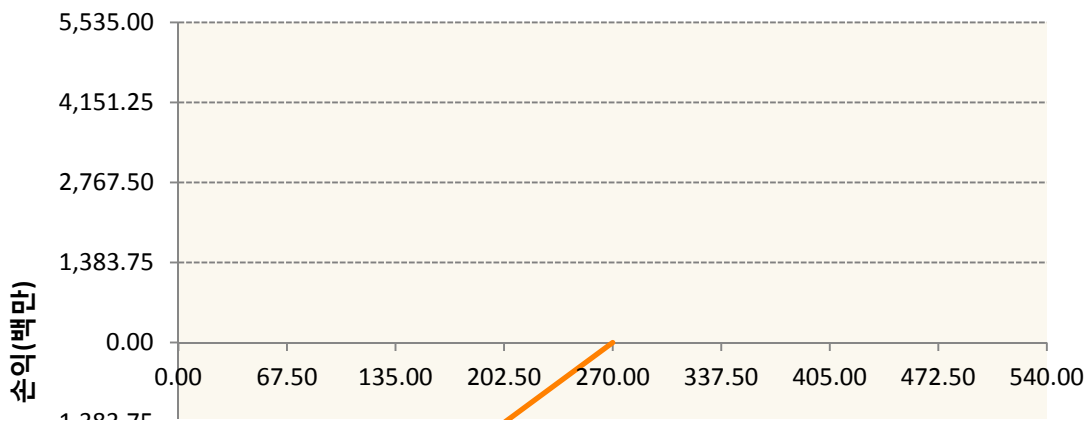




**KR4201PA2728-2019-10 콜272.5**



**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						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						136
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	19	19	19	19	19	19	19	
-5.33%	19	19	19	19	19	19	19	
-2.67%	18	18	18	17	16	16	15	
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3	
2.67%	-39	-39	-39	-40	-40	-40	-41	
5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88	
8.00%	-136	-136	-136	-136	-136	-136	-136	
KR4201PA2728		2019-10 콜272.5						251
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	21	21	21	21	21	21	21
-5.33%	21	21	21	21	21	21	21
-2.67%	21	21	20	19	19	18	17
0%	7	5	2	0	-2	-5	-7
2.67%	-61	-62	-63	-64	-65	-67	-68
5.33%	-155	-155	-155	-156	-156	-156	-156
8.00%	-251	-251	-251	-251	-251	-251	-251
KR4301PA2701                      2019-10 풋270							405
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-405	-405	-405	-405	-405	-405	-405
-5.33%	-256	-256	-256	-256	-256	-256	-256
-2.67%	-108	-108	-108	-108	-109	-109	-110
0%	5	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	13	13	13	13	13	13	12
5.33%	13	13	13	13	13	13	13
8.00%	13	13	13	13	13	13	13

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

(단위:백만원)

**2,222**

공시일	2019-10-10
기준일	2019-10-08

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

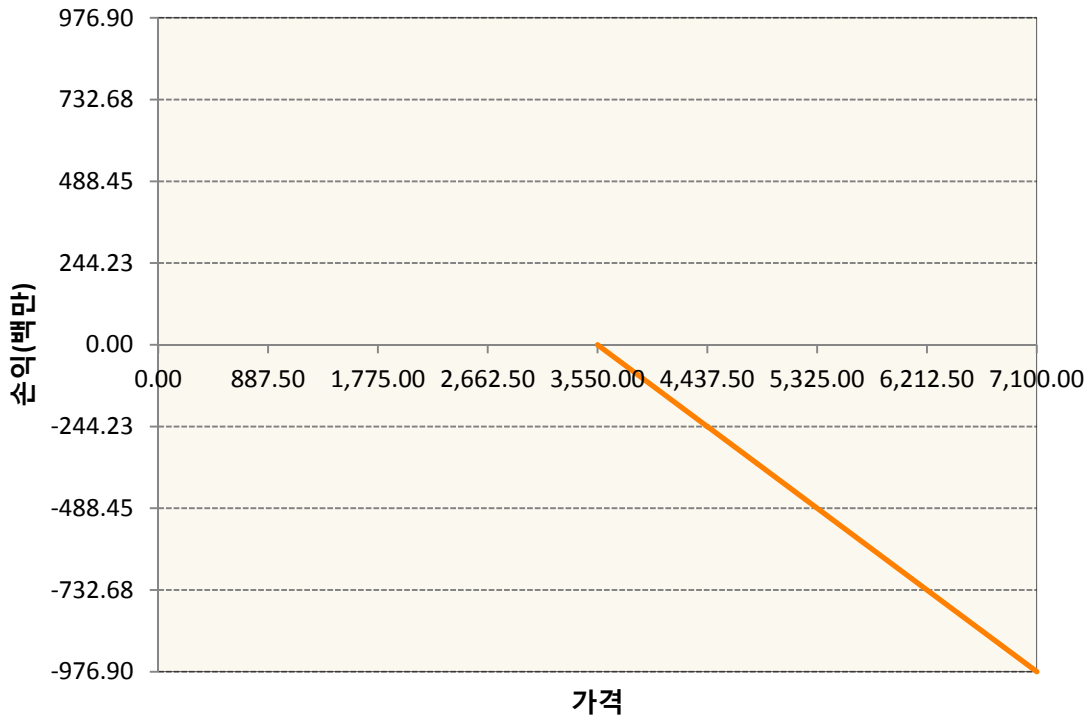
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

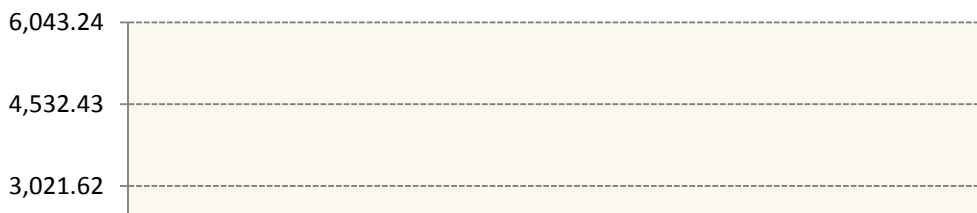
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,995	0	3,995	
누계	유가증권	스왑	23,845	0	23,845	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,040	-14,040	장내
누계	통화	선도	0	6,159	-6,159	장외

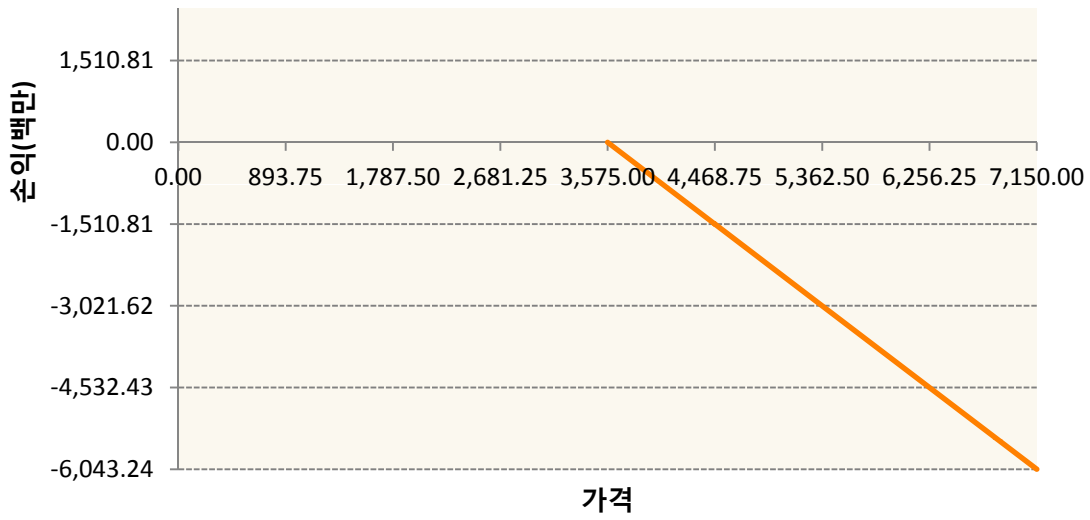
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXV9-C3550-EURO STOXX 50**

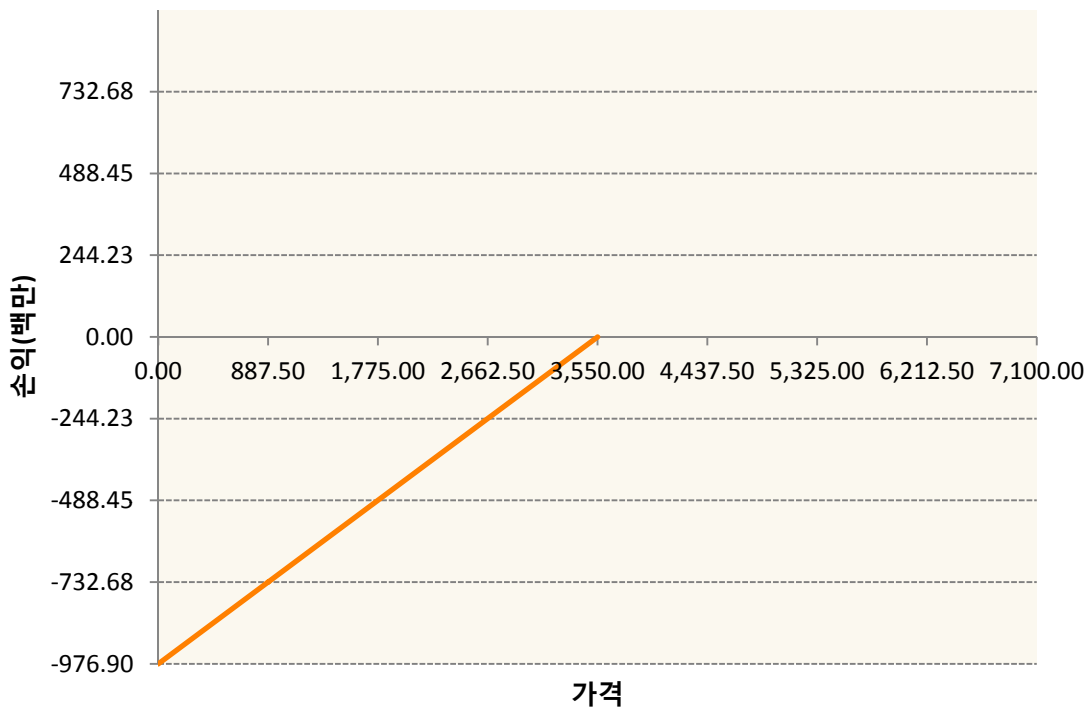


**OESXV9-C3575-EURO STOXX 50**

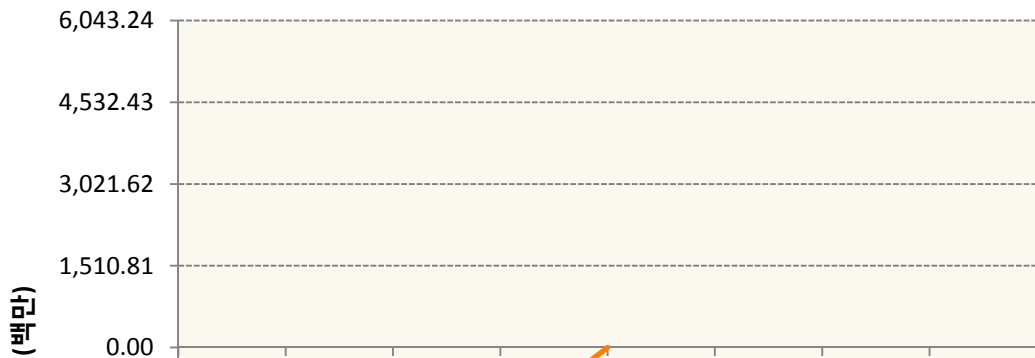


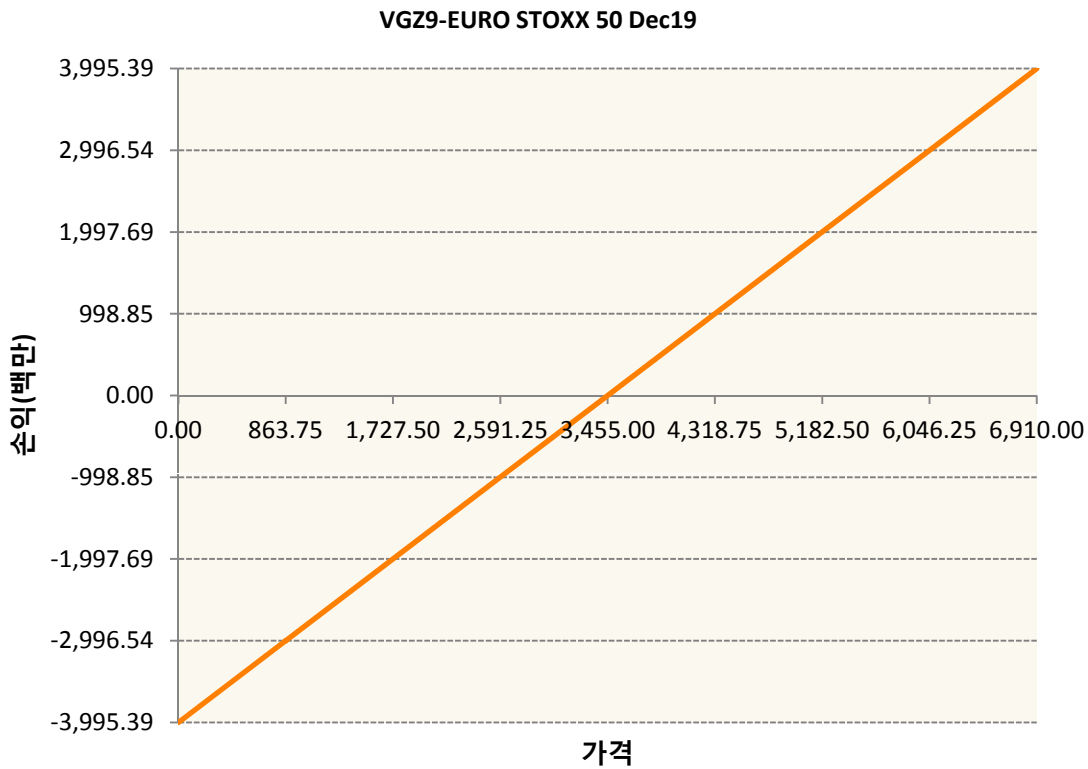
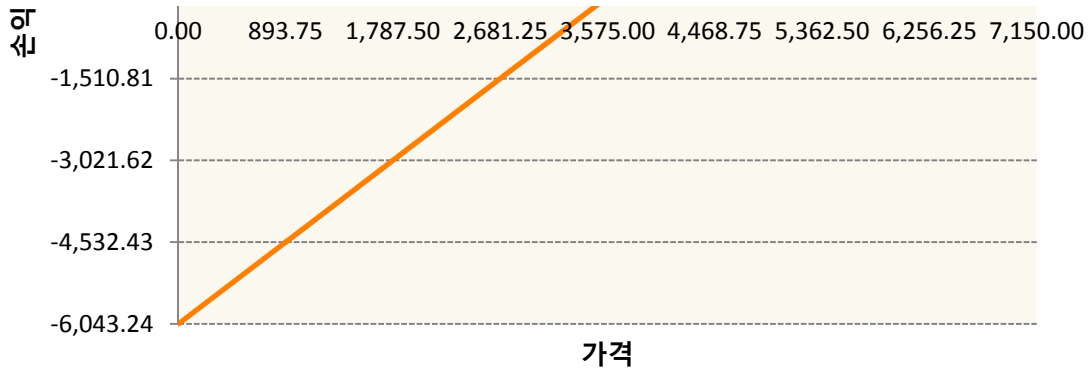


OESXV9-P3550-EURO STOXX 50



OESXV9-P3575-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		50
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E		493
OESXV9-C35 EURO STOXX 50		78
OESXV9-C35 EURO STOXX 50		483
OESXV9-P35 EURO STOXX 50		78
OESXV9-P35 EURO STOXX 50		483
VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	320

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





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

(단위:백만원)

989

공시일	2019-10-10
기준일	2019-10-08

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

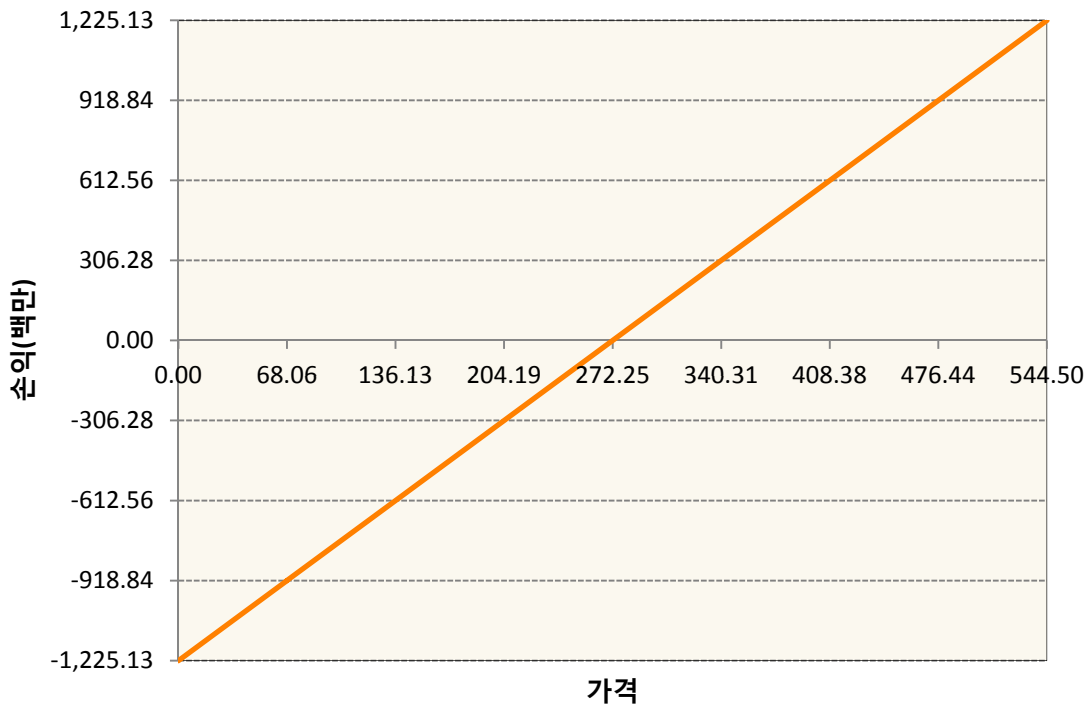
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,225	0	1,225	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)

85



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

(단위:백만원)

133

공시일	2019-10-10
기준일	2019-10-08

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

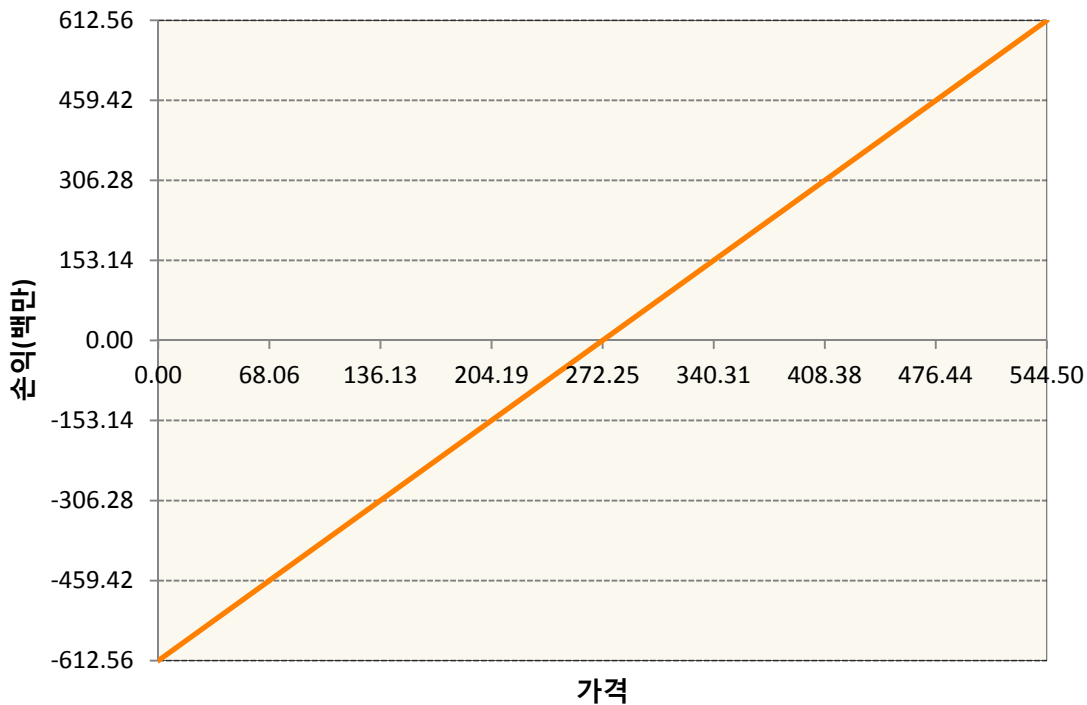
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	613	0	613	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						49
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	16	16	16	16	16	16	16	
5.33%	33	33	33	33	33	33	33	
8.00%	49	49	49	49	49	49	49	

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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-10-10
기준일	2019-10-08

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

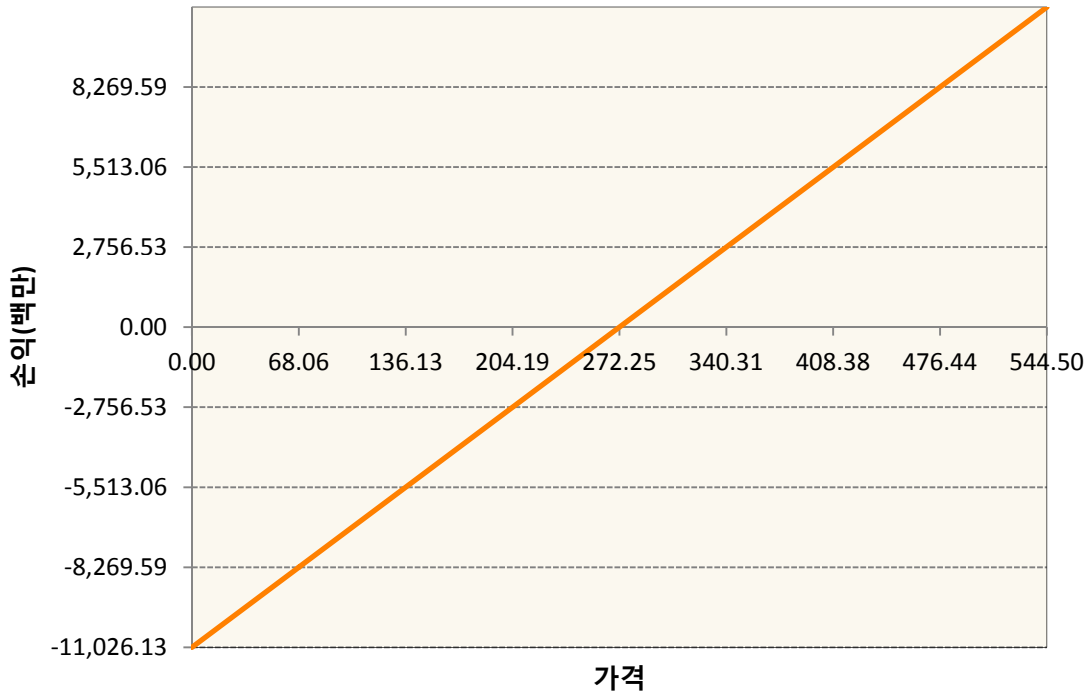
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

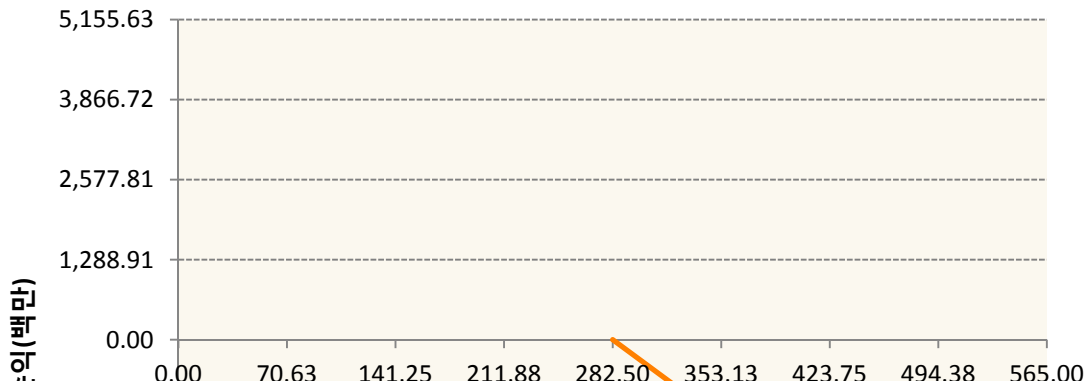
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,026	0	11,026	장내
누계	유가증권	옵션	1,422	20,759	-19,338	장내

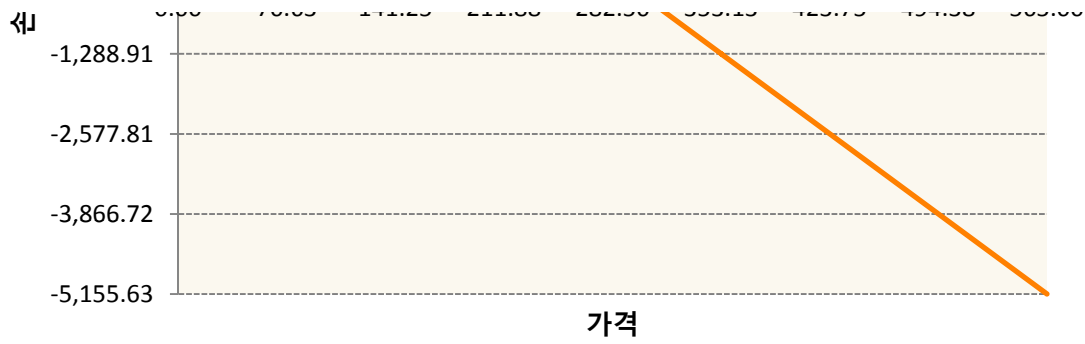
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

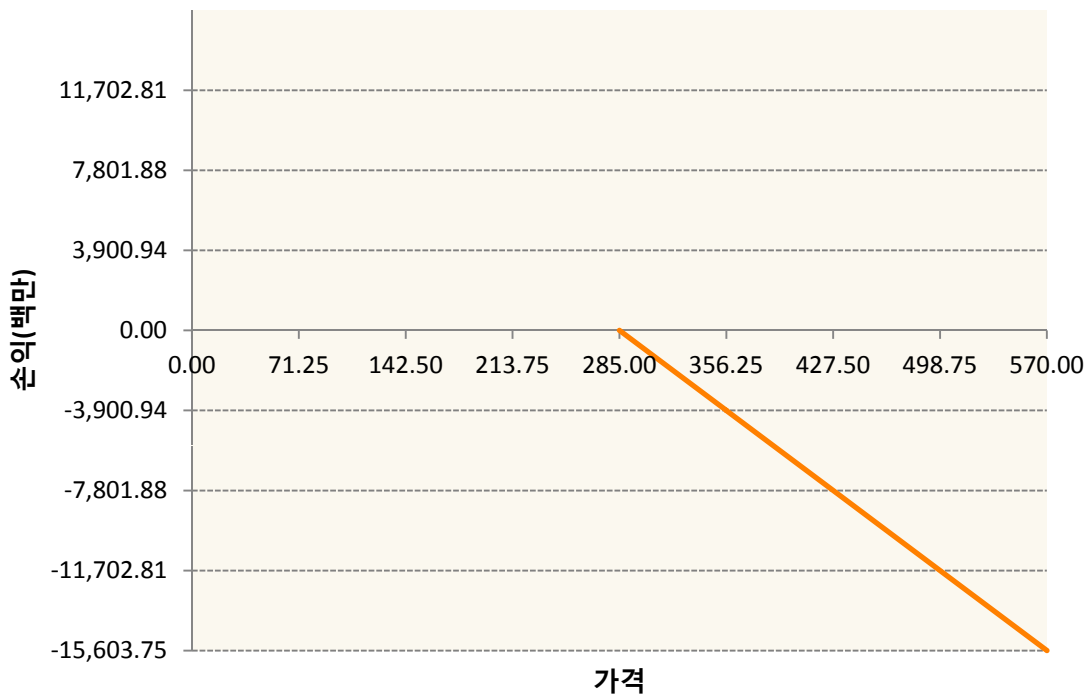


KR4201PA2827-2019-10 콜282.5

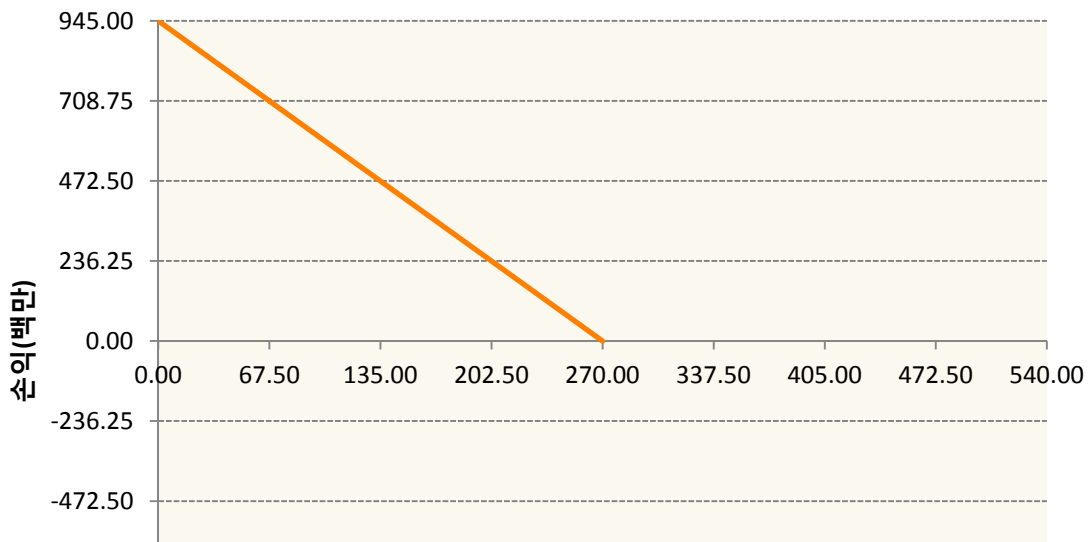




KR4201PA2850-2019-10 콜285



KR4301PA2701-2019-10 풋270





0%	1	1	0	0	0	-1	-2
2.67%	-6	-8	-11	-13	-16	-19	-21
5.33%	-69	-72	-74	-77	-80	-83	-86
8.00%	-192	-192	-193	-193	-194	-195	-196
KR4201PA2850 2019-10 콜285							465
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	1	1	0
0%	1	0	0	0	-1	-1	-3
2.67%	-5	-9	-13	-18	-23	-29	-35
5.33%	-115	-125	-135	-145	-155	-165	-175
8.00%	-443	-445	-448	-451	-455	-460	-465
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%	18	18	18	19	19	19	19
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
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
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%	24	24	24	24	24	24	24
-2.67%	11	11	11	11	11	11	11
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3

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

(단위:백만원)

1,024

공시일	2019-10-10
기준일	2019-10-08

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,193	0	1,193	
누계	유가증권	수익증권	131,901	0	131,901	

### 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	2019-10-10
기준일	2019-10-08

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,579	0	3,579	
누계	유가증권	수익증권	174,453	0	174,453	

### 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	2019-10-10
기준일	2019-10-08

## 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	409,183	0	409,183	
누계	통화	선도	0	458,031	-458,031	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,913
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,532
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E	954
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E	954
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E	191
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E	1,374
FX21019U00 KRW/USD 10-10-19E	2,043
FX21019U01 KRW/USD 10-10-19E	286
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E	191
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E	2,329
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E	1,718
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E	191
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E	954
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E	1,470
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	2,968
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	3,150
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	2,615
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E	1,909
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E	2,004
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E	954
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E	668
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E	1,565
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E	706

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

(단위:백만원)



공시일	2019-10-10
기준일	2019-10-08

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

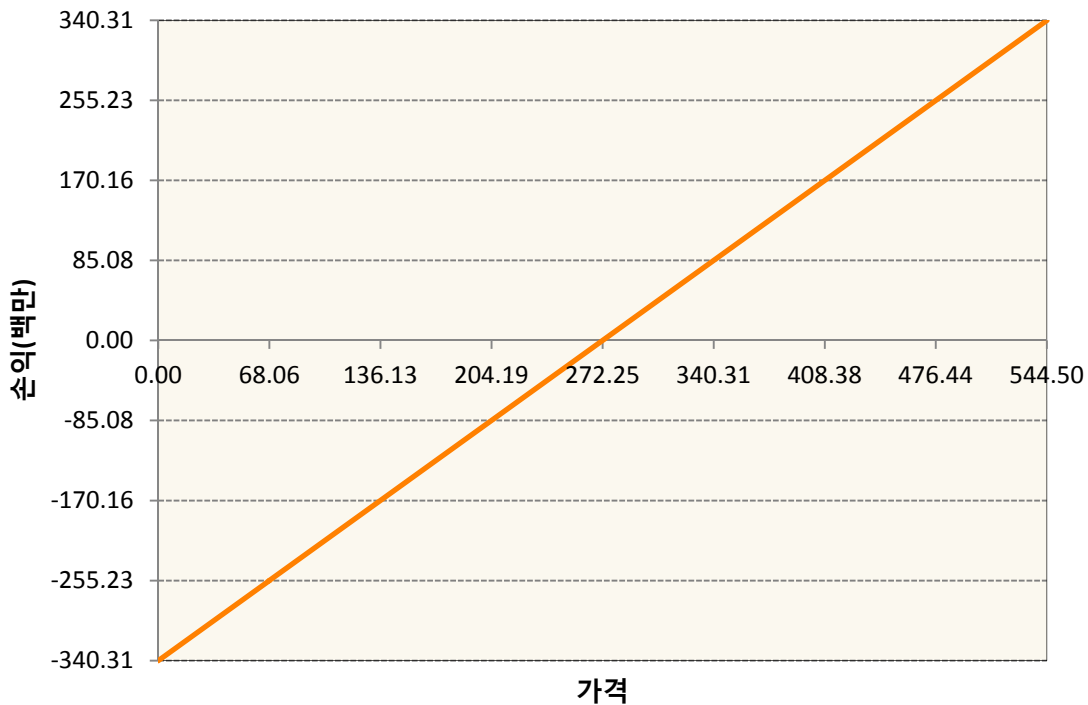
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

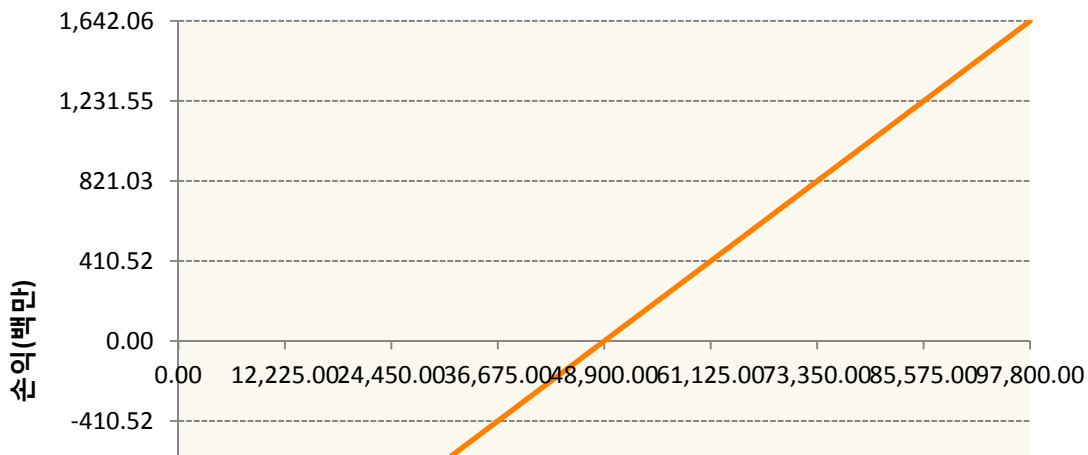
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,628	0	1,628	장내
누계	유가증권	선물	1,982	0	1,982	장내

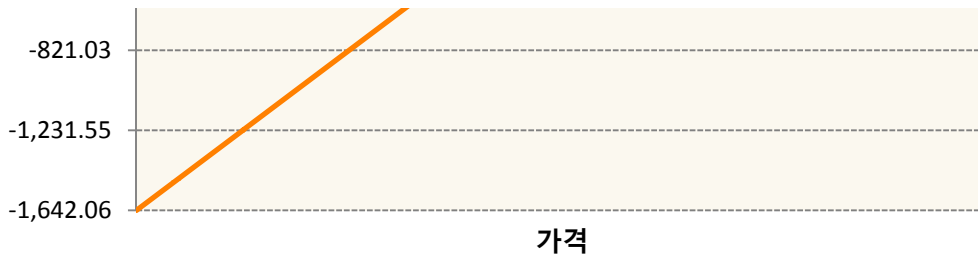
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



KR4111PB0001-2019-11 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	
KR4111PB0001		2019-11 삼성전자개별선물						131
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131	
-5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88	
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	44	44	44	44	44	44	44	
5.33%	88	88	88	88	88	88	88	
8.00%	131	131	131	131	131	131	131	

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

**188**

공시일	2019-10-10
기준일	2019-10-08

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

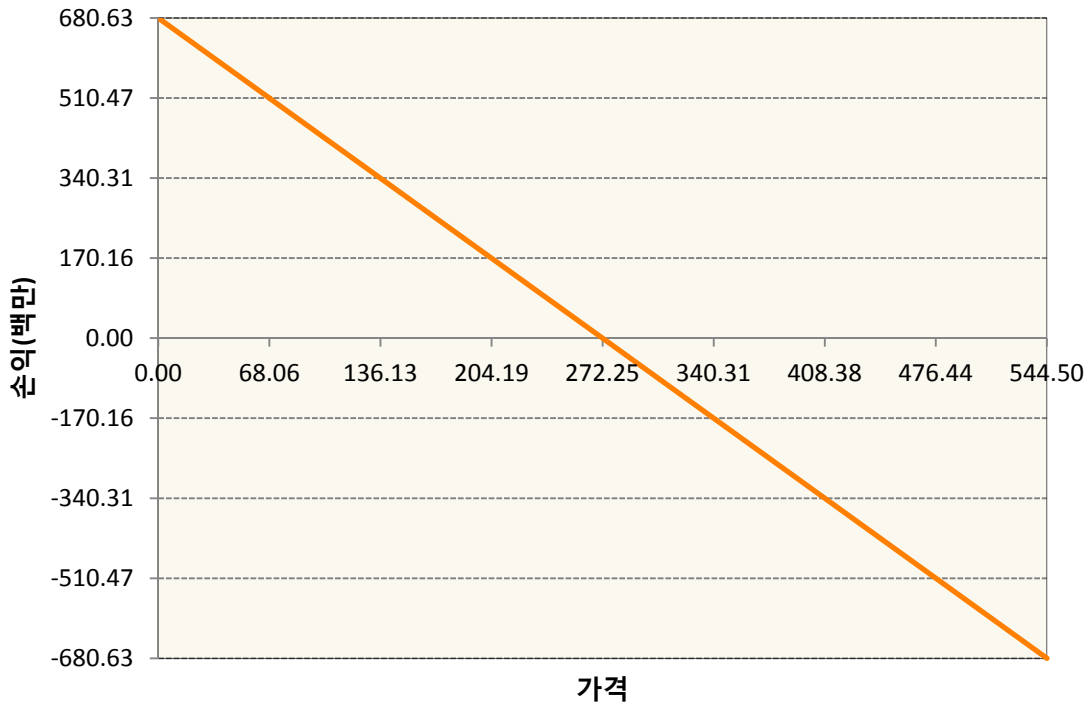
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

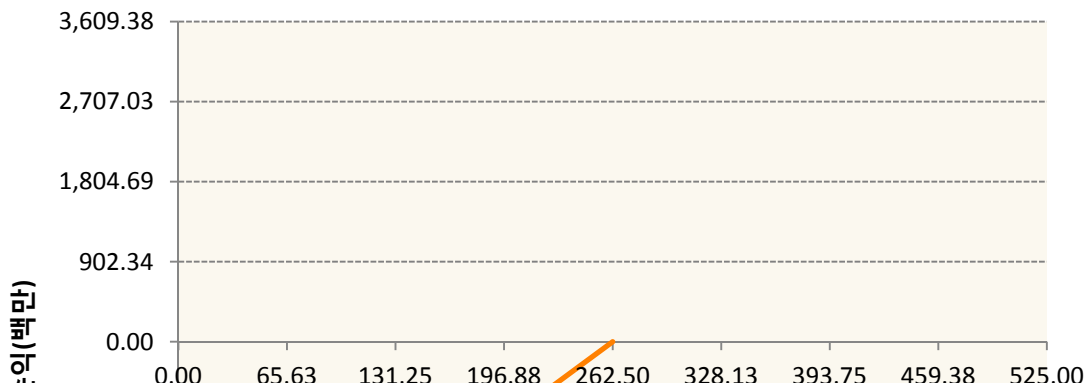
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	681	-681	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,007	-4,007	장내

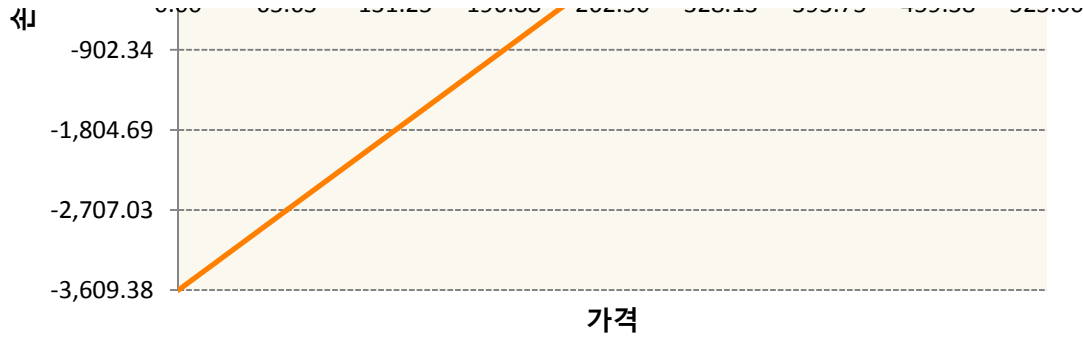
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

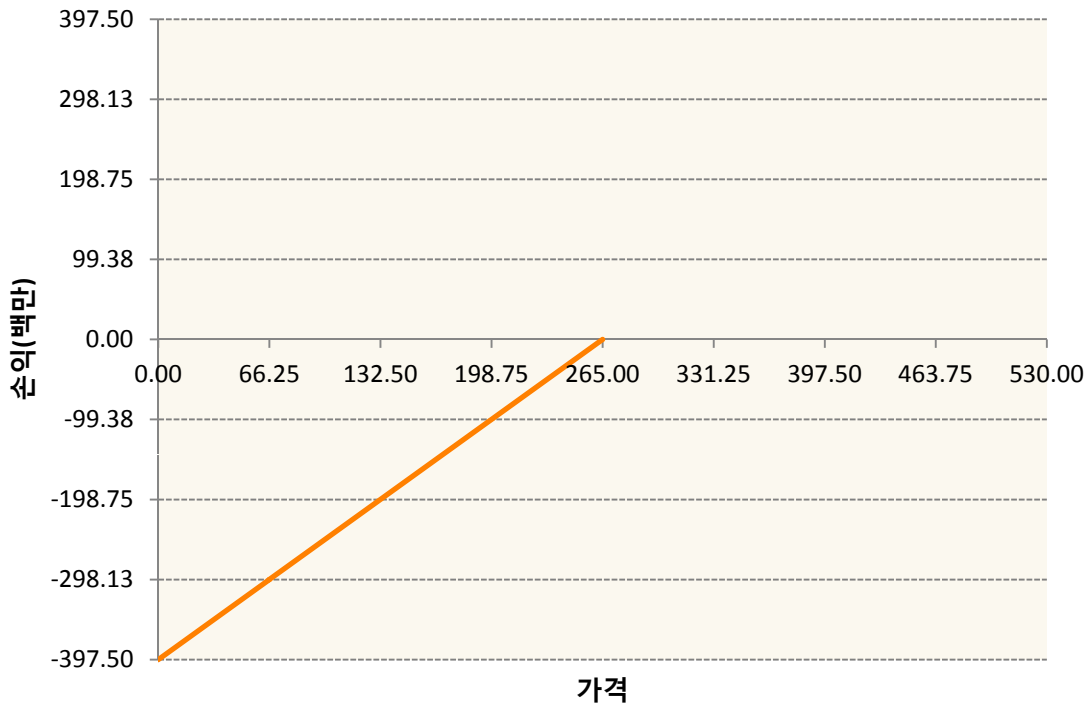


KR4301PA2628-2019-10 풋262.5





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						177
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-177	-177	-177	-177	-177	-177	-177
-5.33%	-77	-77	-78	-78	-78	-78	-78
-2.67%	-4	-5	-6	-7	-8	-9	-10
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

KR4301PA2651

2019-10 풋265

23

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
-5.33%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-3	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

119

공시일	2019-10-10
기준일	2019-10-08

## H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	527	-527	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	16,581	0	16,581	
누계	통화	선도	716	17,658	-16,942	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		477
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		611
FX21019U05 USD/KRW 18-10-19E		19
FX21019V00 USD/KRW 18-10-19E		38

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

(단위:백만원)

485

공시일	2019-10-10
기준일	2019-10-08

## 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	302	0	302	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	2019-10-10
기준일	2019-10-08

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

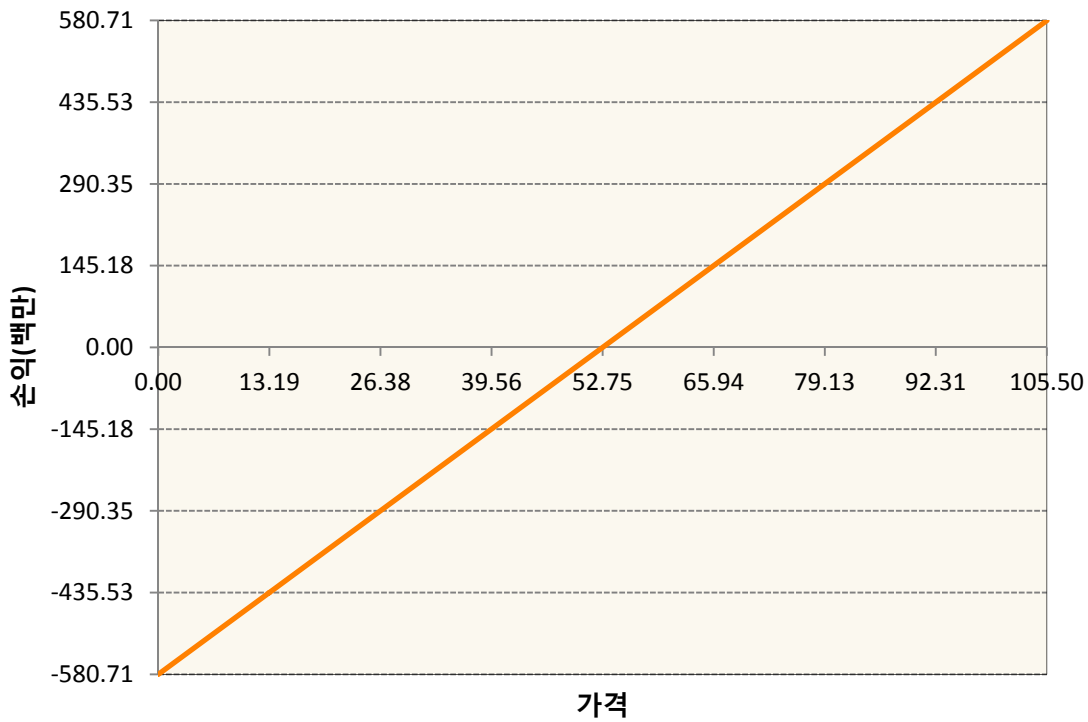
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

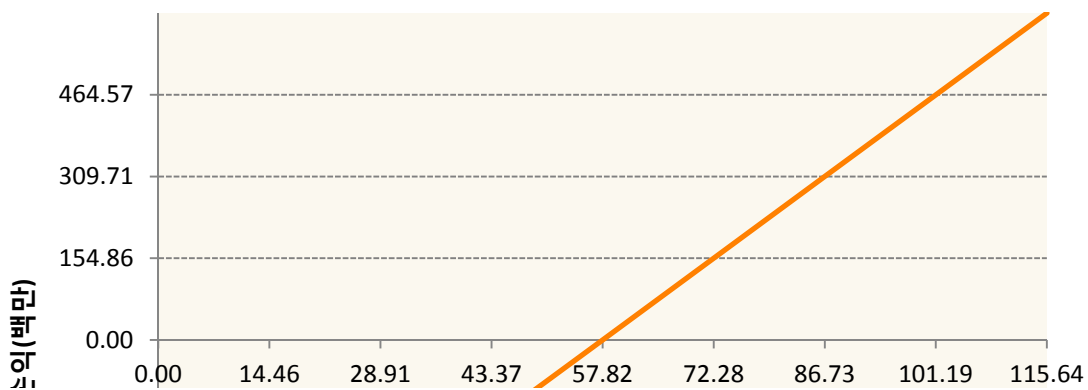
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,245	358	1,887	
누계	유가증권	선물	195	0	195	장내

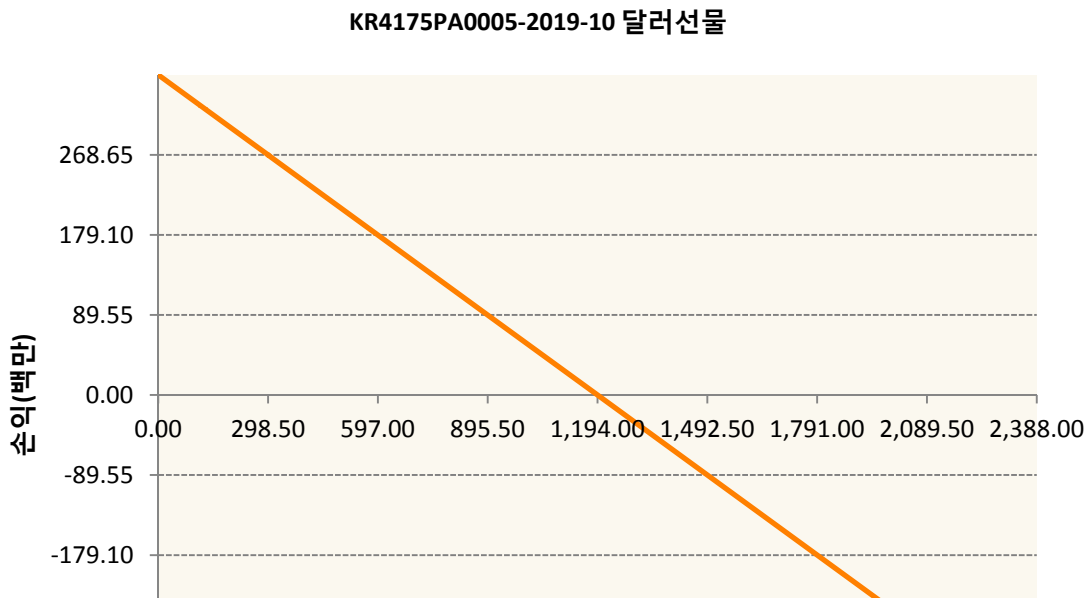
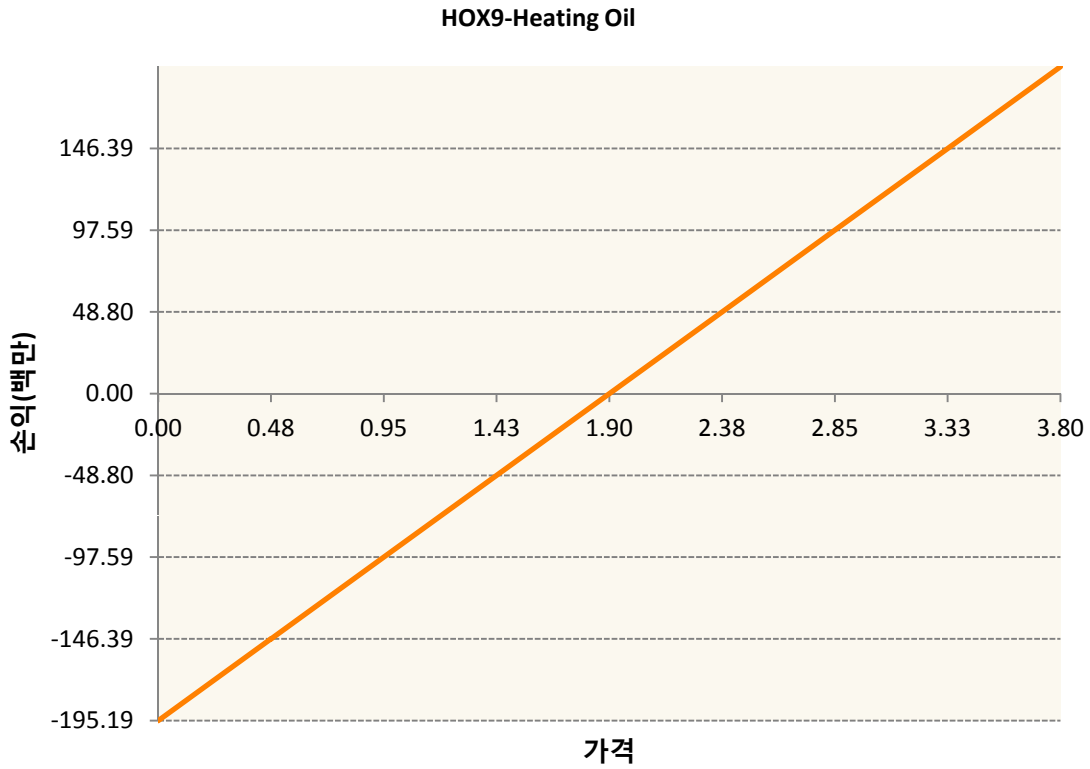
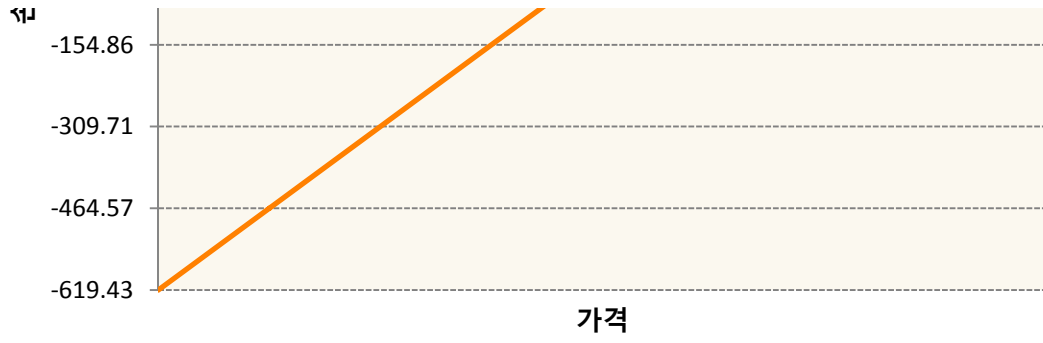
### 2. 만기시점의 손익구조

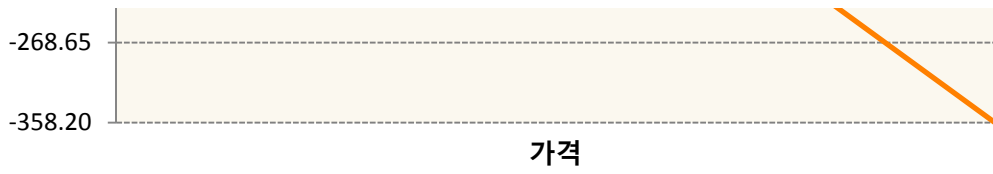
CLX9-WTI CRUDE FUTURE Nov19



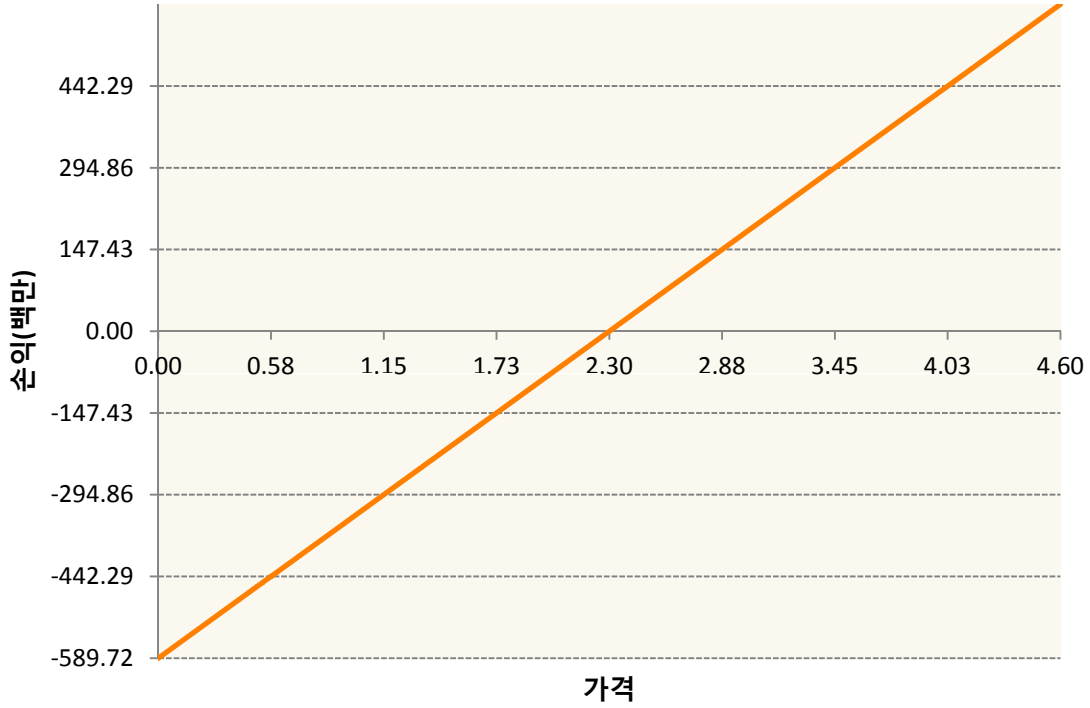
COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20



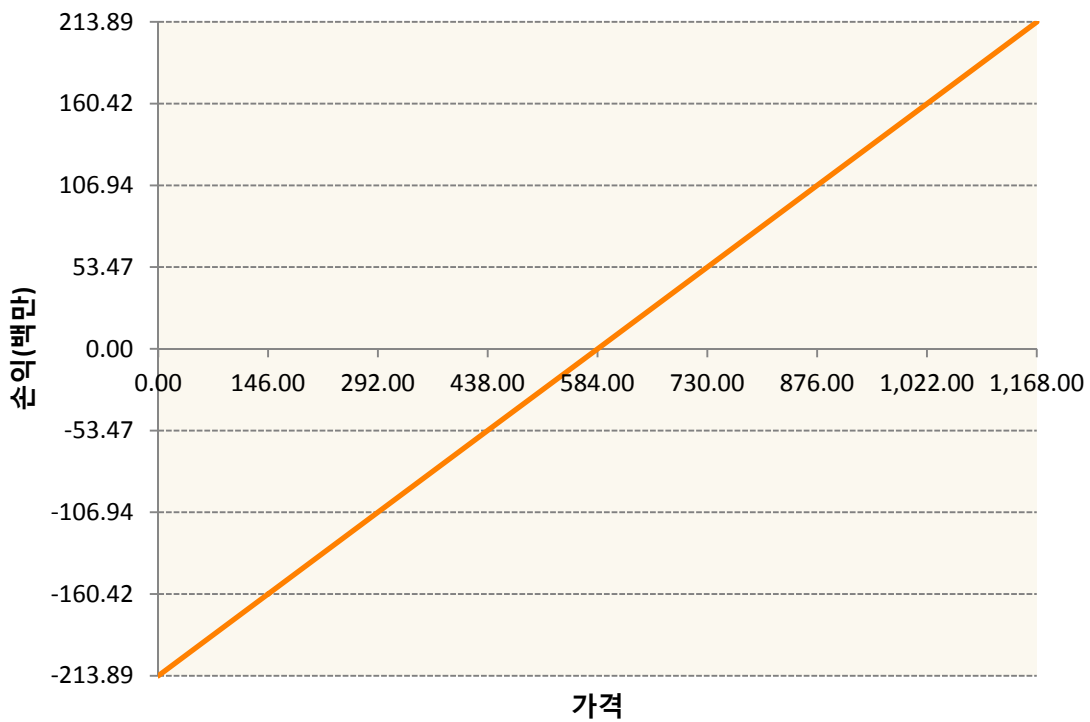


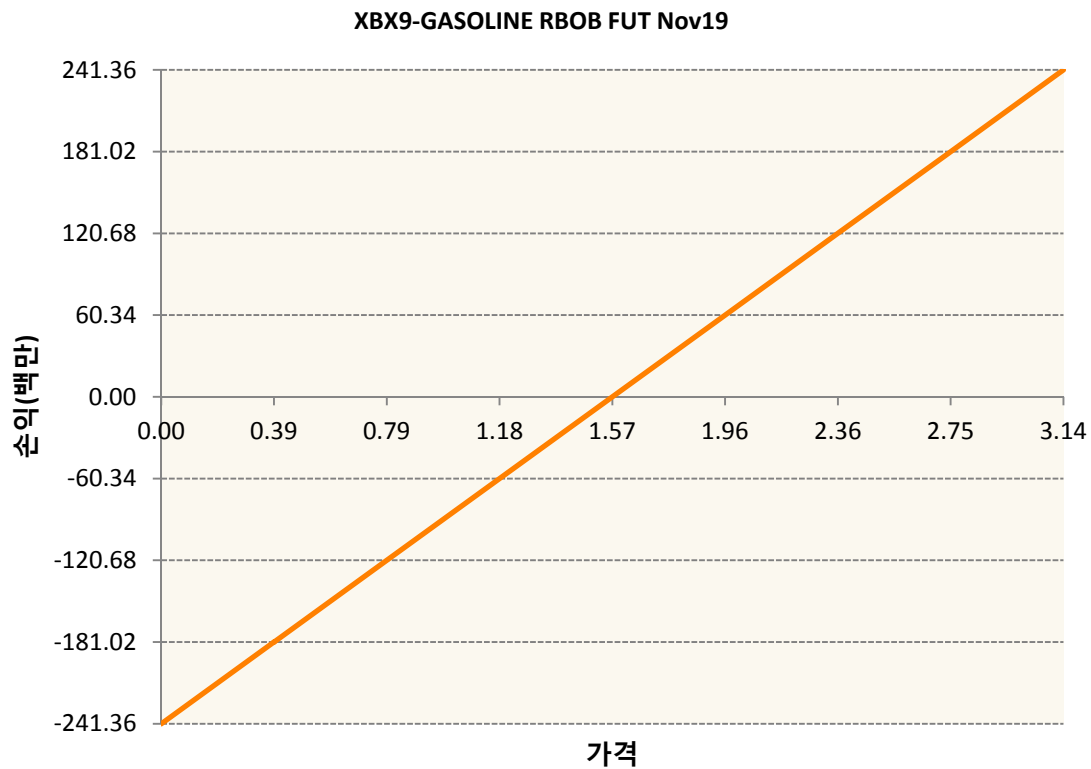


NGX19-NATURAL GAS FUTR Nov19



QSX9-Low Su Gasoil G Nov19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX9	WTI CRUDE FUTURE Nov19	46
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)
	405

공시일	2019-10-10
기준일	2019-10-08

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

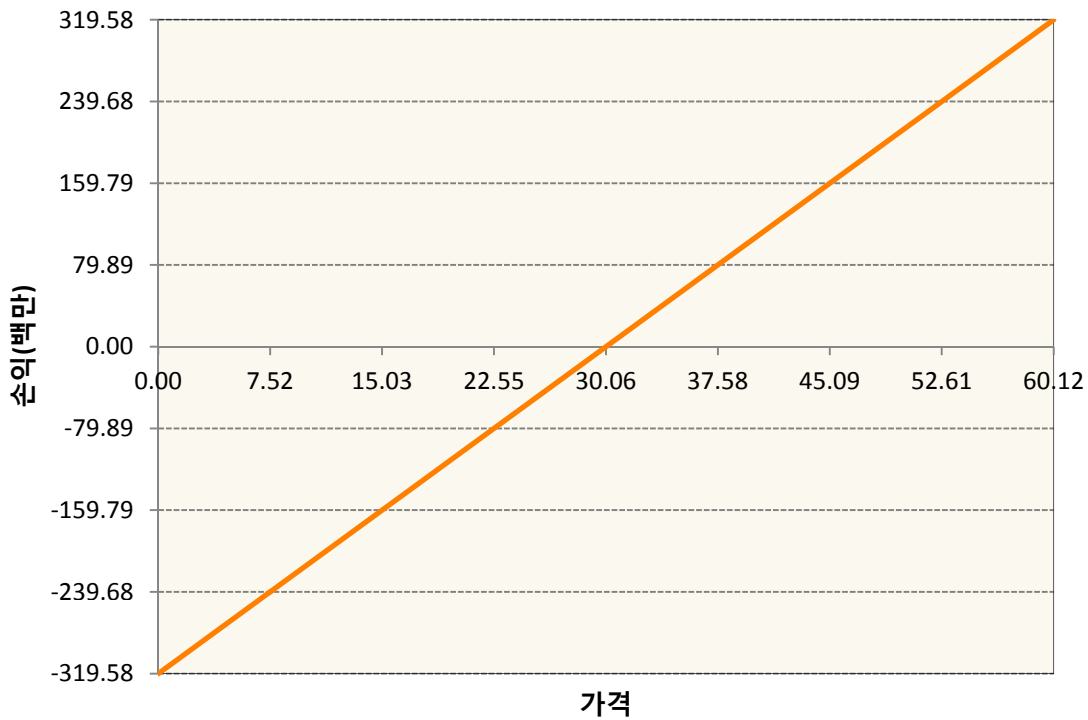
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

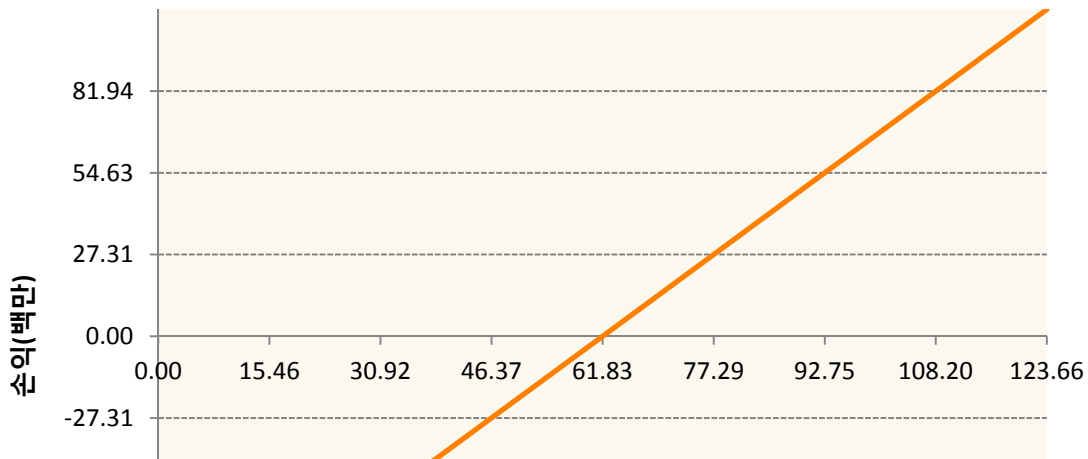
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,817	96	2,722	

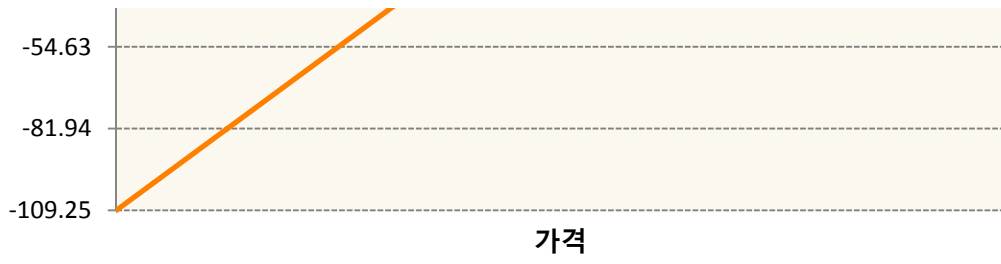
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19**

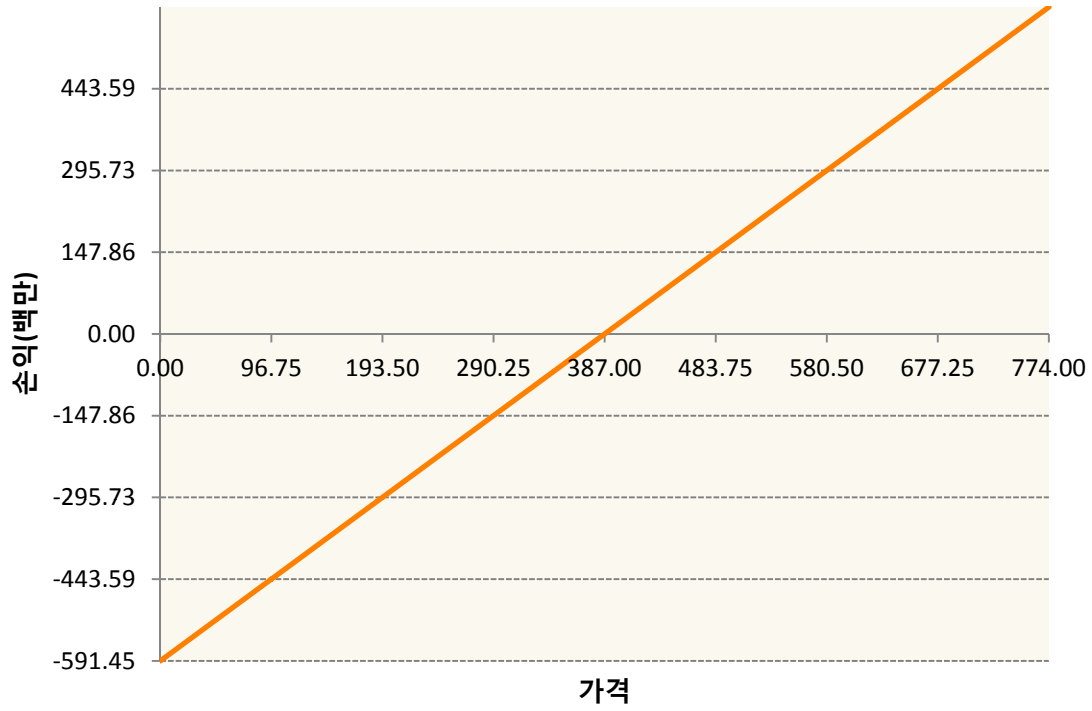


**CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19**

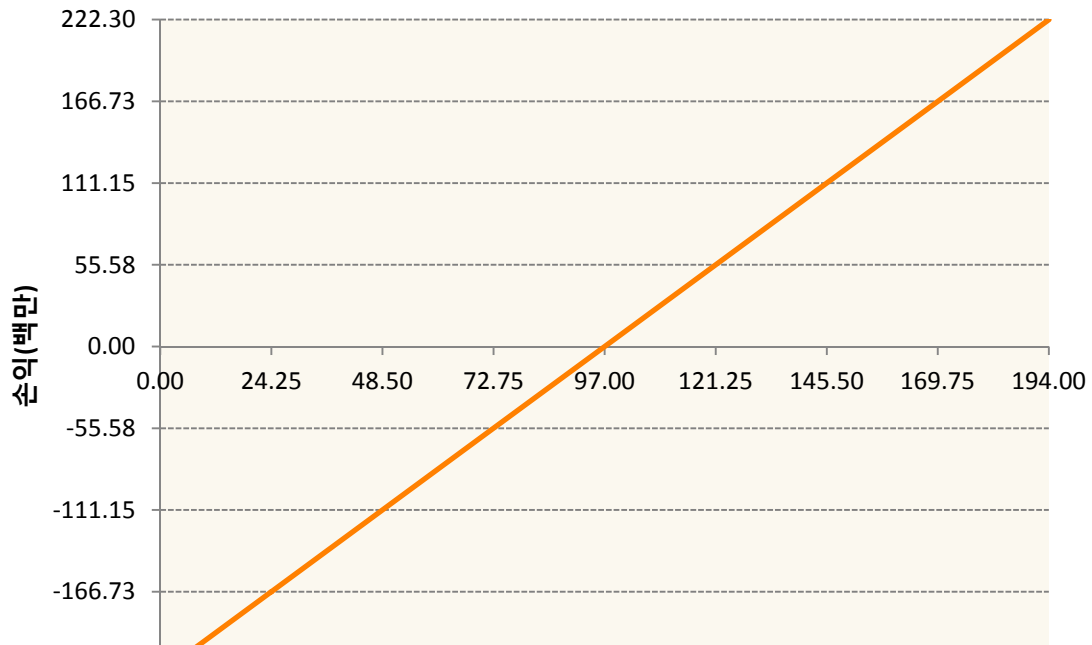


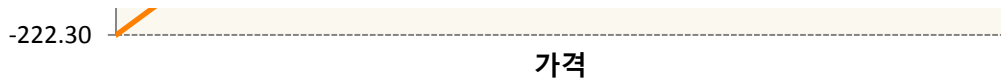


**CZ9-CORN FUTURE Dec19**

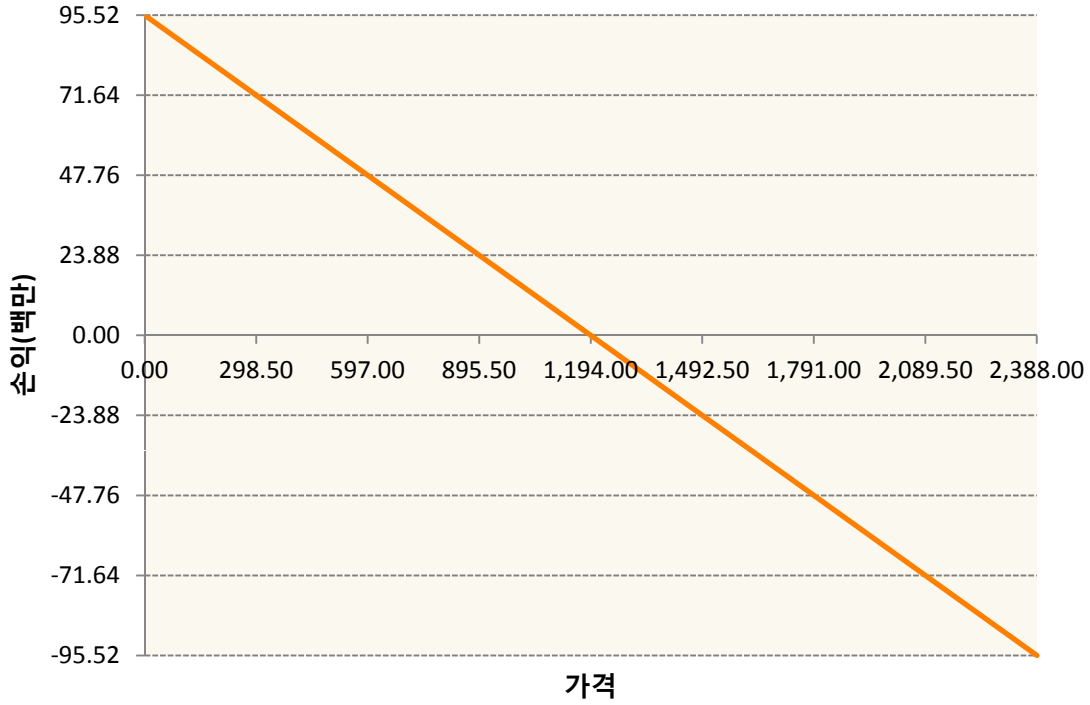


**KC9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19**

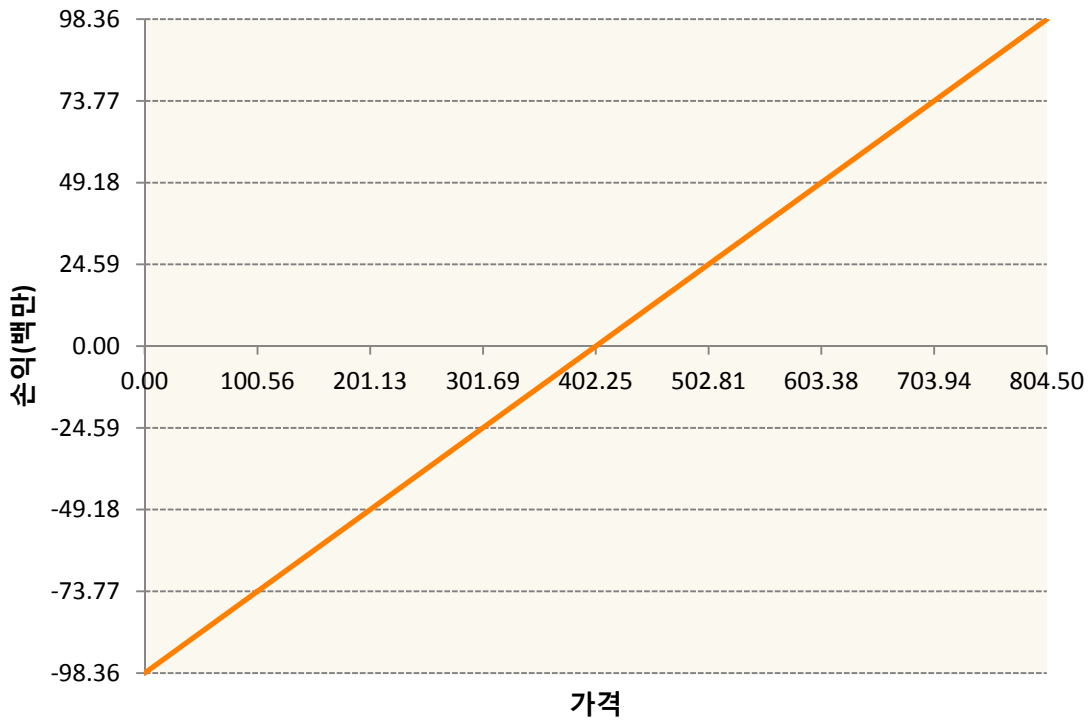




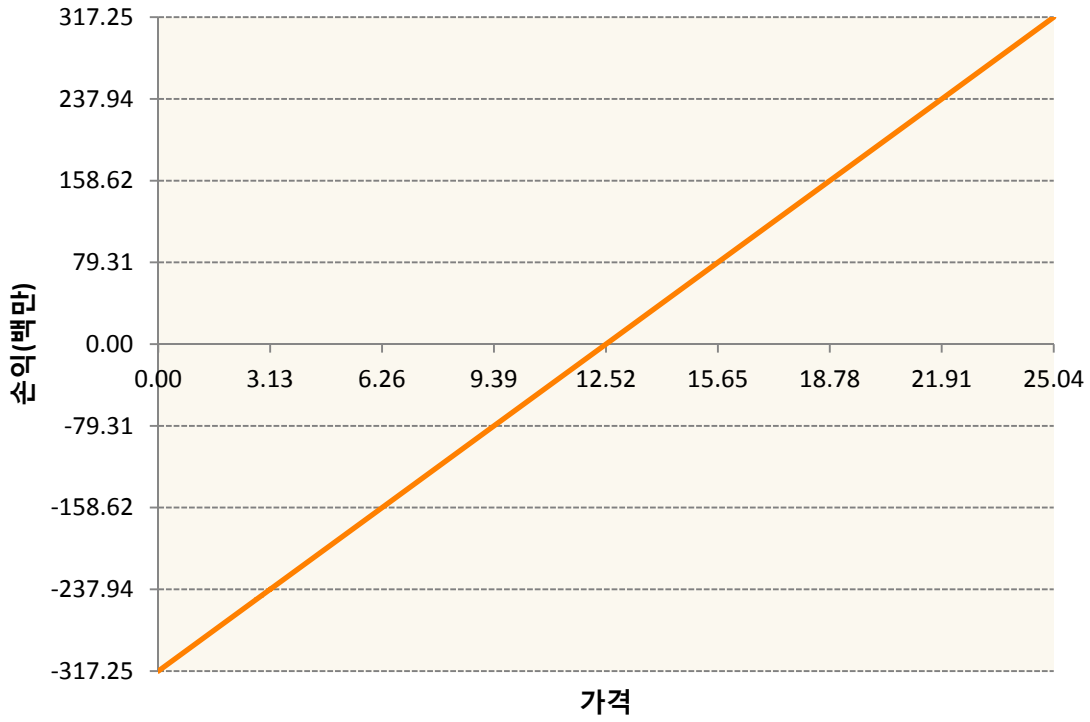
**KR4175PA0005-2019-10 달러선물**



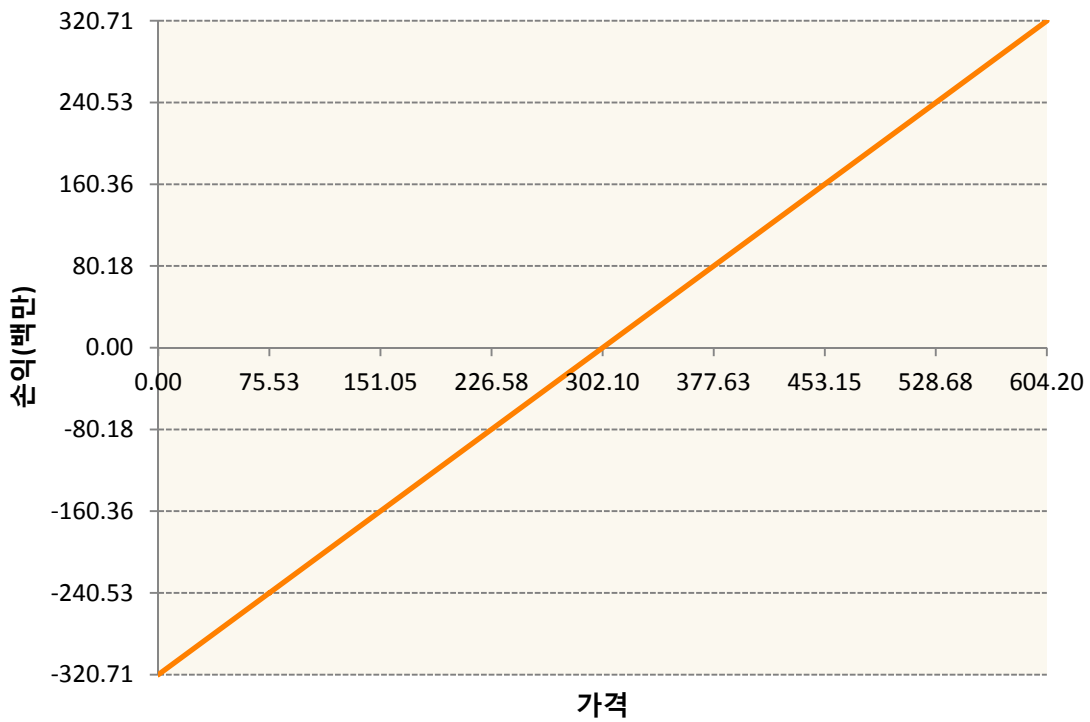
**KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19**



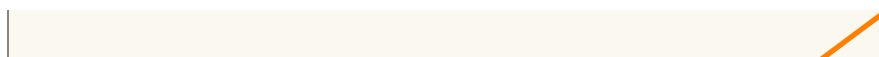
SBH0-Sugar Mar20

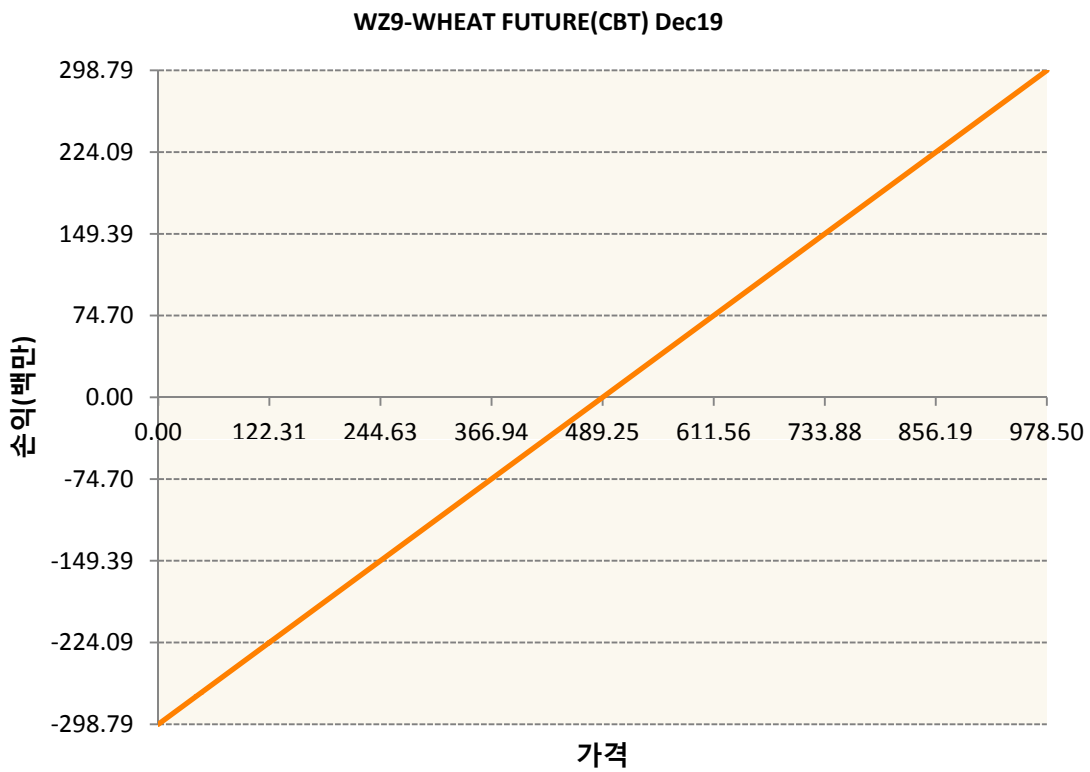
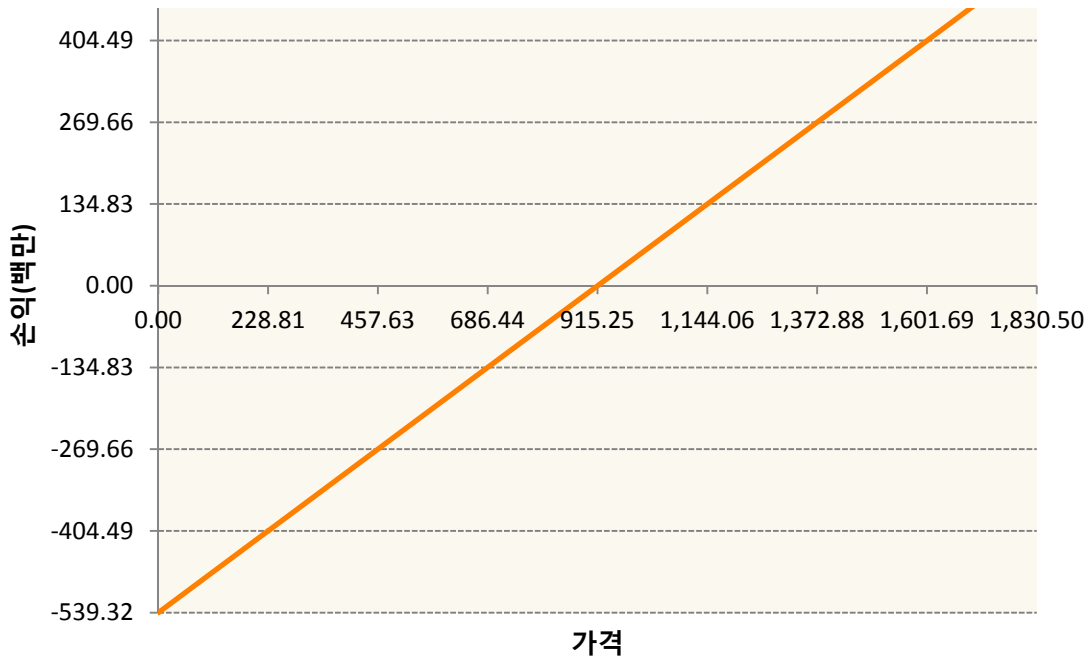


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19



SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	26
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	25
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)

**252**