

공시일	2019-10-14
기준일	2019-10-11

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)

85

공시일	2019-10-14
기준일	2019-10-11

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

1,156

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

672

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-10-14
기준일	2019-10-11

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)	384
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	140

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

837

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-10-14
기준일	2019-10-11

유로인덱스모(주식-파생형)

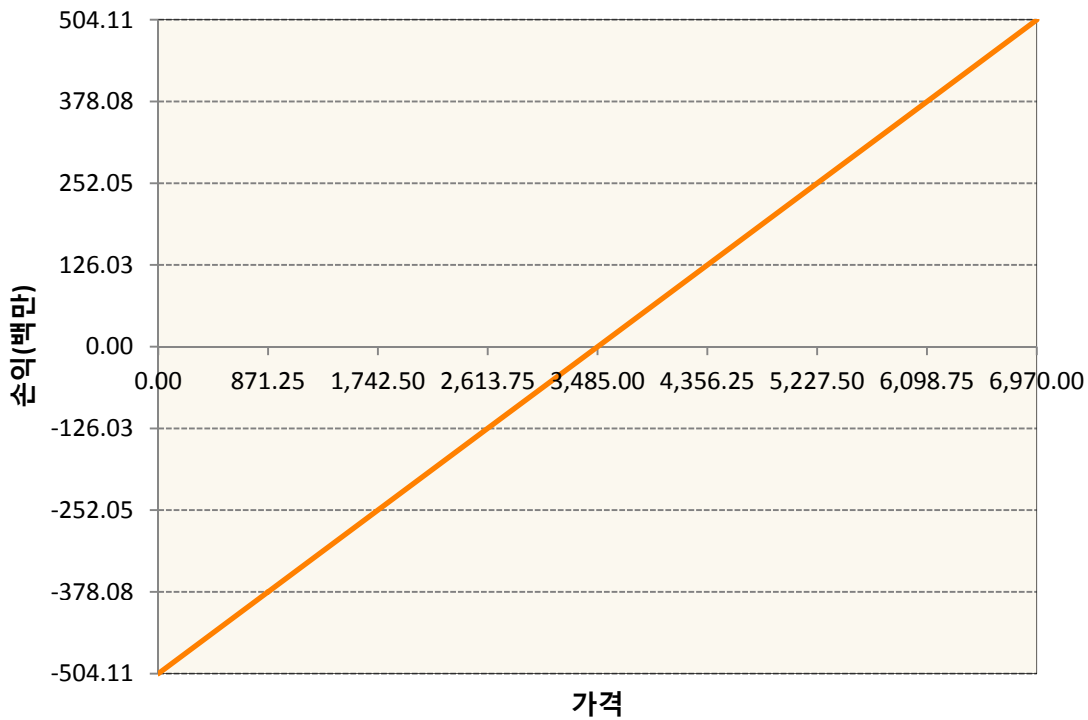
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	504	0	504	

2. 만기시점의 손익구조

VGZ9-EURO STOXX 50 Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	40
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

29

공시일	2019-10-14
기준일	2019-10-11

차이나인덱스모(주식-파생형)

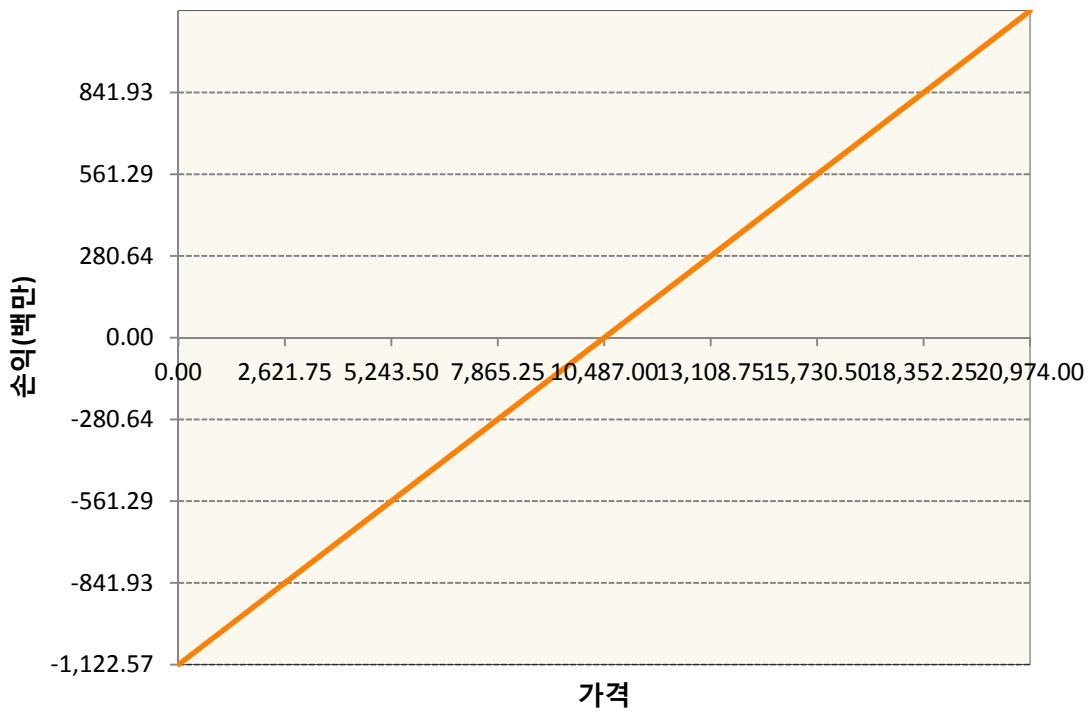
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,123	0	1,123	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCV9-HSCEI Futures Oct19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV9	HSCEI Futures Oct19	90
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

81

공시일	2019-10-14
기준일	2019-10-11

커버드콜모(주식혼합-파생형)

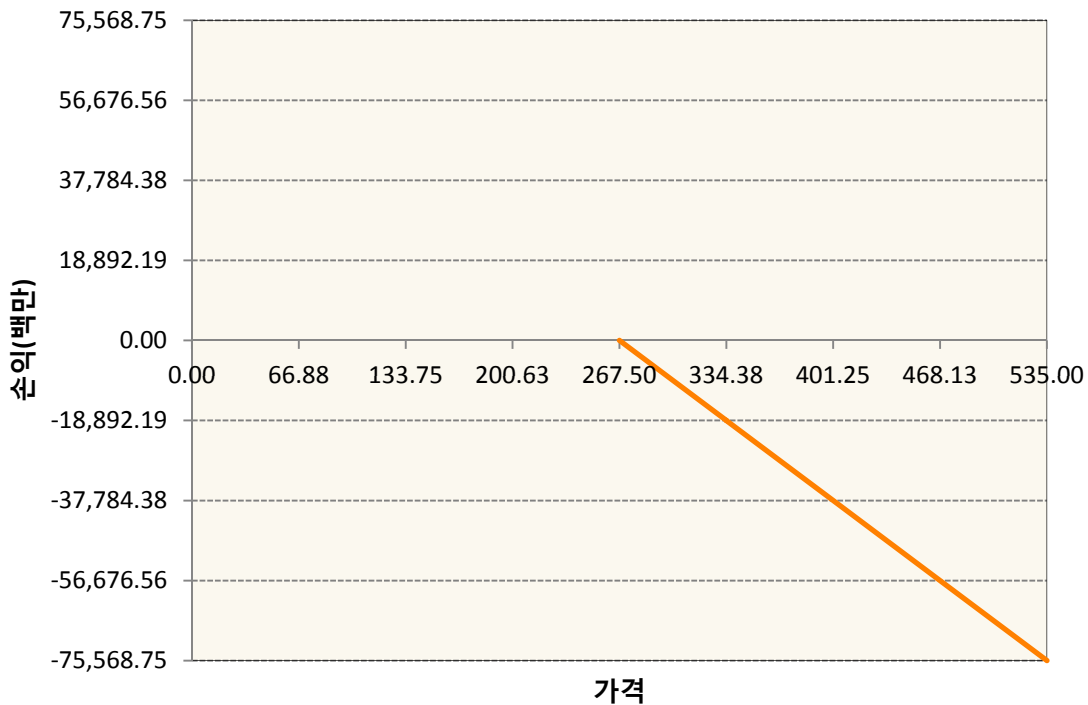
1. 계약금액

(단위:백만원)

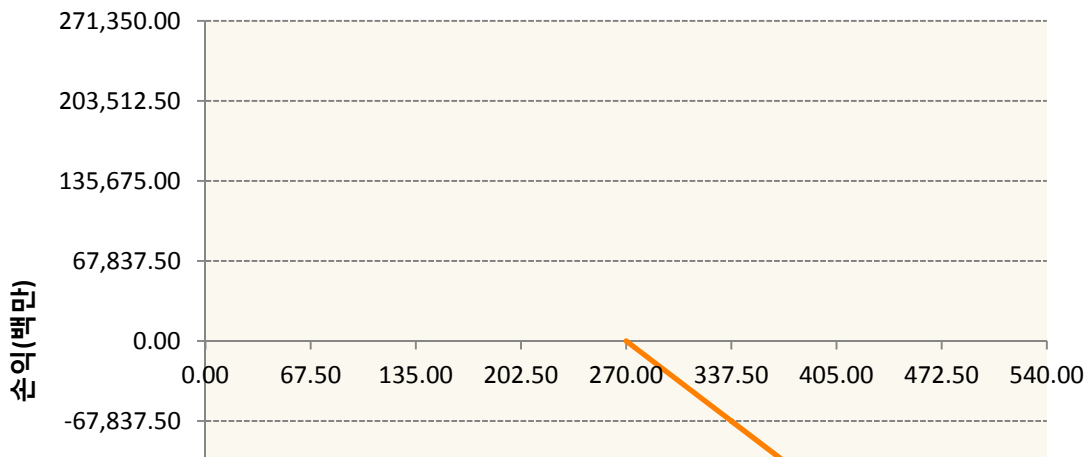
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	358,587	-358,587	장내
누계	유가증권	옵션	0	514,106	-514,106	장내

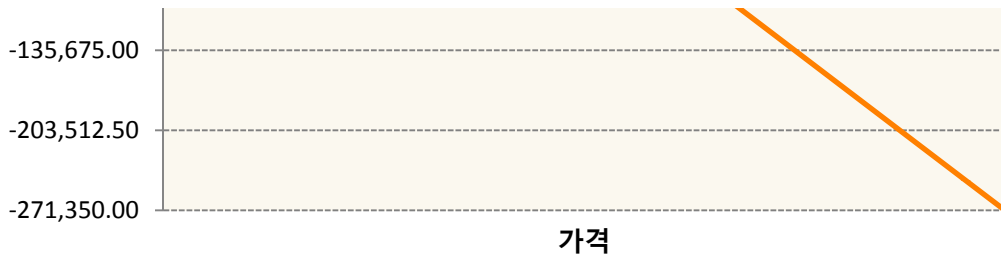
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PB2677-2019-11 콜267.5

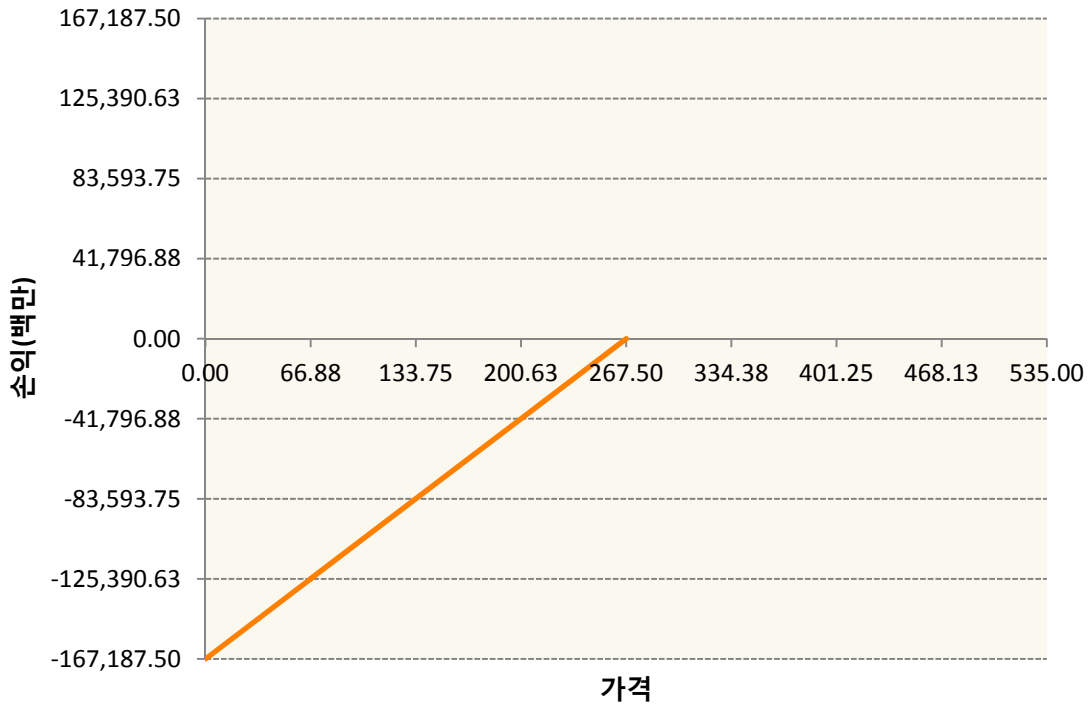


KR4201PB2701-2019-11 콜270





KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PB2677		2019-11 콜267.5					4,950
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,721	2,613	2,492	2,362	2,222	2,076	1,924
-5.33%	2,334	2,172	2,004	1,831	1,655	1,475	1,293
-2.67%	1,645	1,448	1,250	1,051	851	652	452
0%	604	403	202	0	-202	-405	-608
2.67%	-779	-950	-1,128	-1,310	-1,496	-1,685	-1,876
5.33%	-2,435	-2,561	-2,698	-2,846	-3,002	-3,165	-3,334
8.00%	-4,277	-4,356	-4,451	-4,560	-4,680	-4,811	-4,950
KR4201PB2701		2019-11 콜270					16,958
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,621	8,295	7,920	7,503	7,052	6,571	6,066

-5.33%	7,521	7,001	6,450	5,875	5,281	4,671	4,049
-2.67%	5,461	4,784	4,099	3,408	2,712	2,013	1,310
0%	2,193	1,462	731	0	-731	-1,462	-2,193
2.67%	-2,318	-2,982	-3,659	-4,347	-5,043	-5,744	-6,451
5.33%	-7,894	-8,409	-8,959	-9,539	-10,143	-10,765	-11,404
8.00%	-14,239	-14,583	-14,980	-15,422	-15,903	-16,417	-16,958
KR4301PB2676 2019-11 풋267.5							9,725
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,285	-9,322	-9,373	-9,440	-9,522	-9,617	-9,725
-5.33%	-5,034	-5,161	-5,304	-5,461	-5,629	-5,807	-5,993
-2.67%	-1,516	-1,749	-1,985	-2,224	-2,464	-2,706	-2,949
0%	721	483	243	0	-244	-490	-737
2.67%	1,712	1,571	1,414	1,243	1,062	871	672
5.33%	2,003	1,952	1,884	1,798	1,697	1,581	1,452
8.00%	2,058	2,047	2,026	1,995	1,952	1,896	1,827

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

(단위:백만원)

30,194

공시일	2019-10-14
기준일	2019-10-11

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

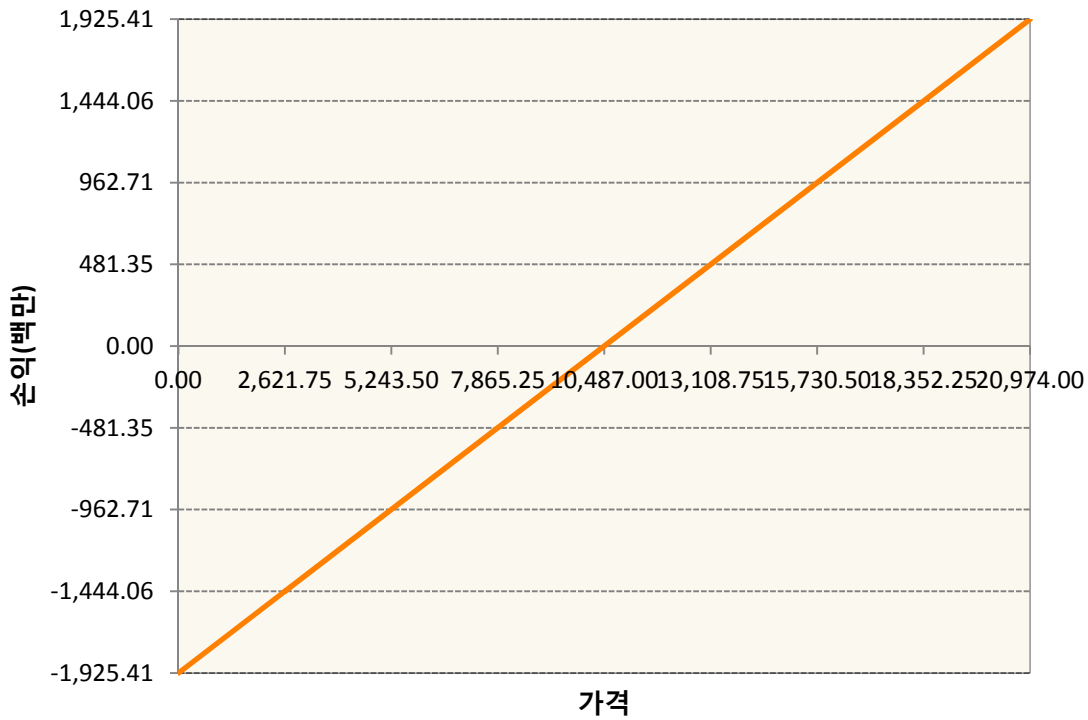
1. 계약금액

(단위:백만원)

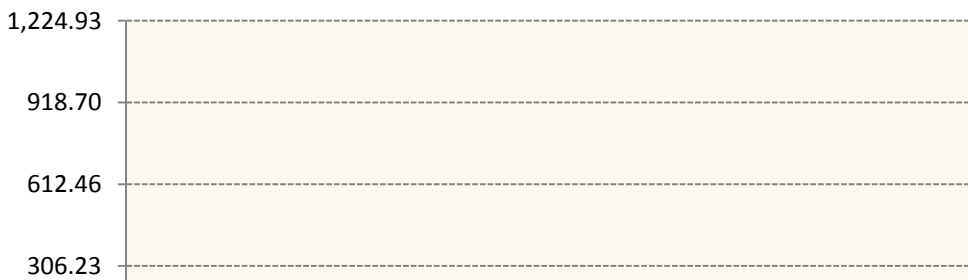
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,925	0	1,925	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,924	-4,924	장내
누계	통화	선도	682	2,817	-2,135	장외

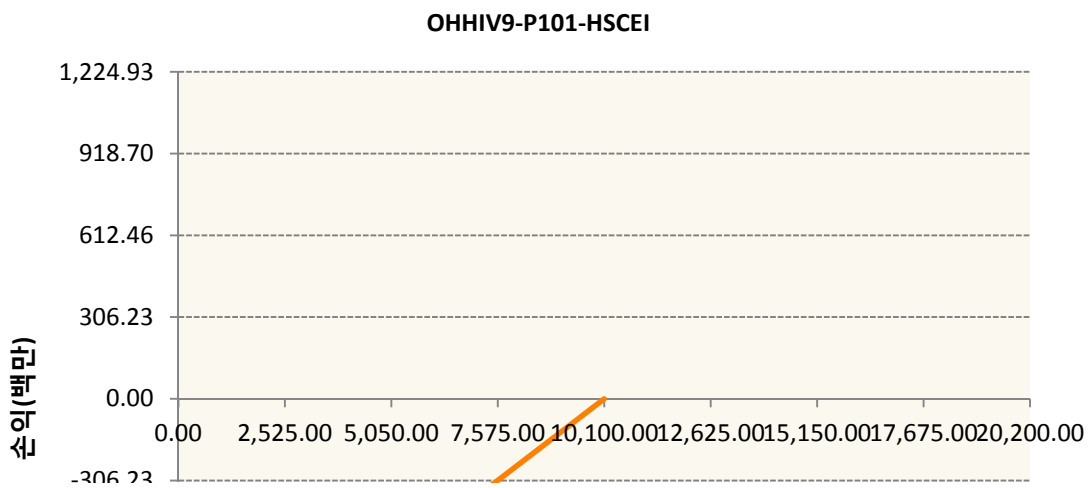
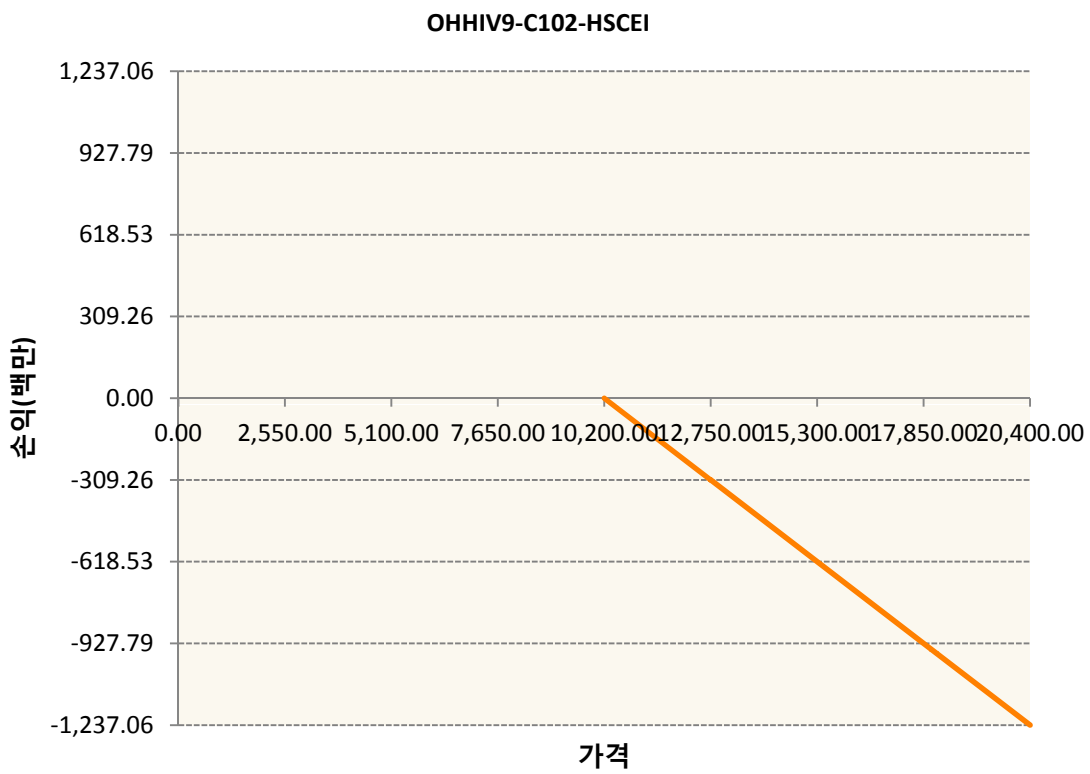
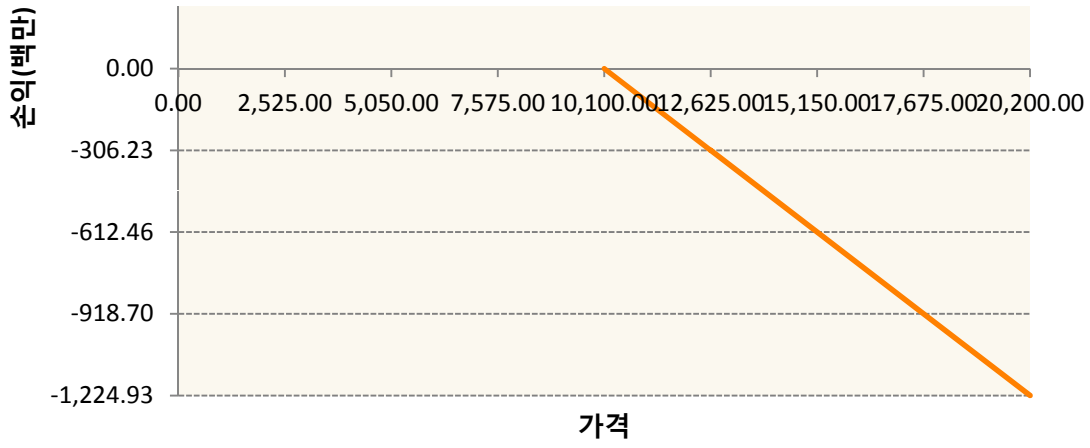
2. 만기시점의 손익구조

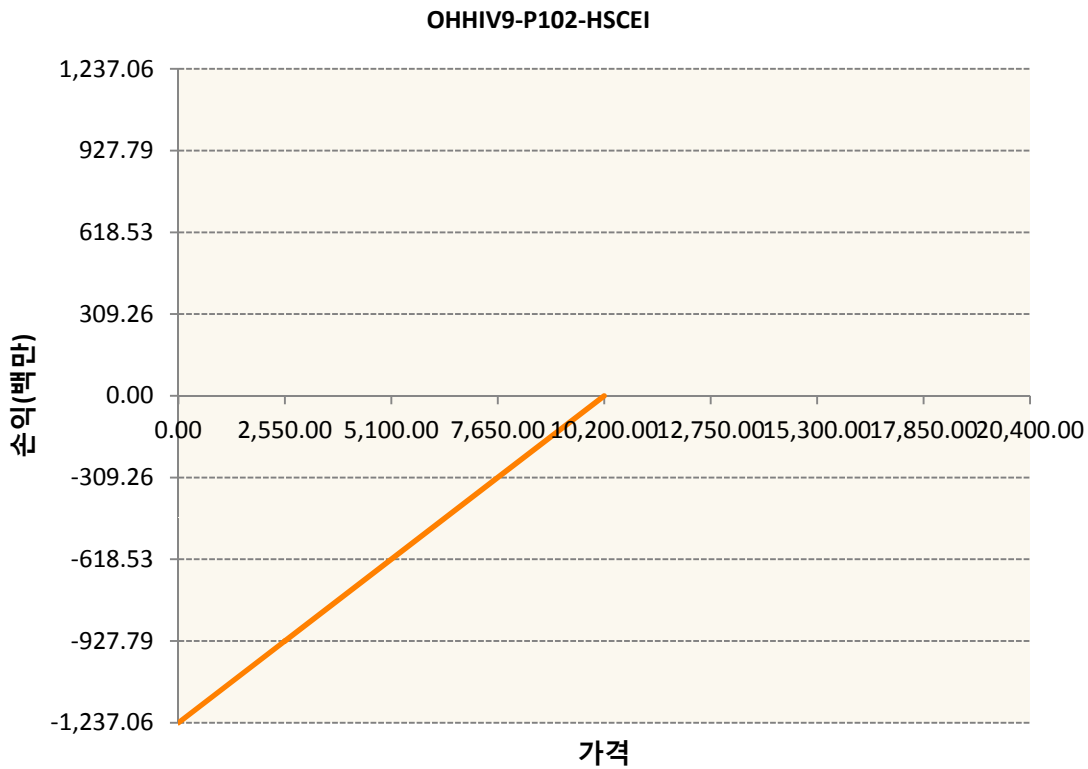
HCV9-HSCEI Futures Oct19



OHHIV9-C101-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	225
FX21019U00 HKD/KRW 22-11-19E	6
FX21019U02 HKD/KRW 22-11-19E	49
HCV9 HSCEI Futures Oct19	154
OHHIV9-C1C HSCEI	98
OHHIV9-C1C HSCEI	99
OHHIV9-P1C HSCEI	98
OHHIV9-P1C HSCEI	99

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	582

공시일	2019-10-14
기준일	2019-10-11

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

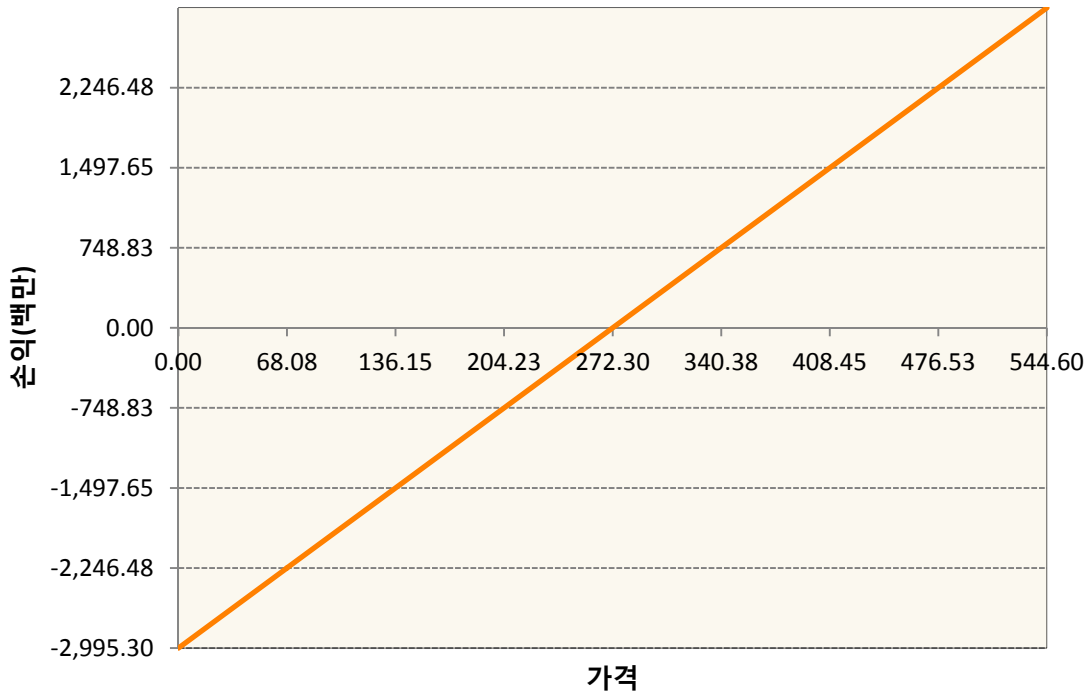
1. 계약금액

(단위:백만원)

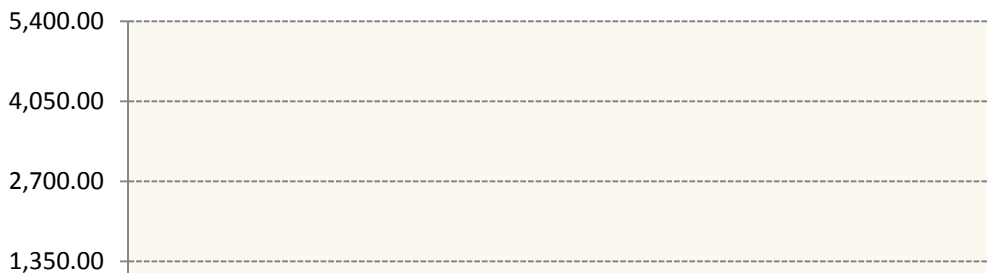
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	11,130	-11,130	장내
누계	유가증권	선물	2,995	0	2,995	장내
누계	유가증권	스왑	10,625	0	10,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	10,953	-10,953	장내

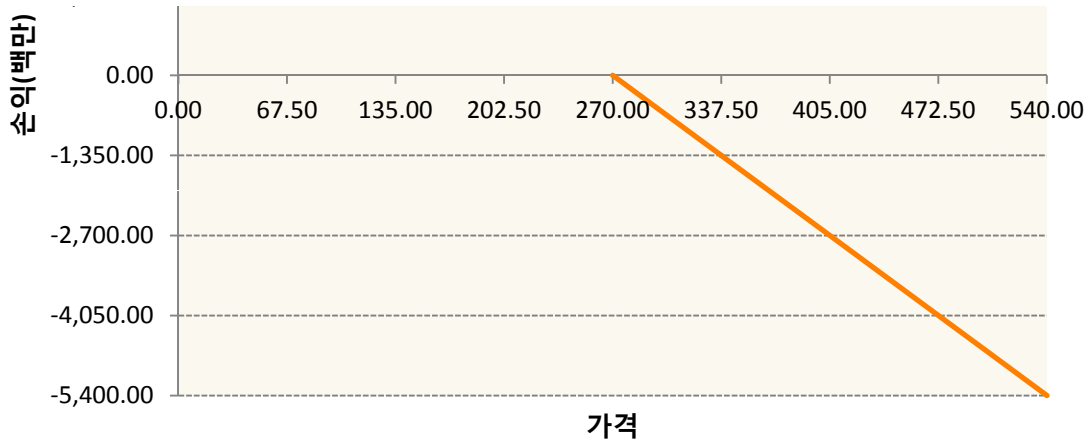
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

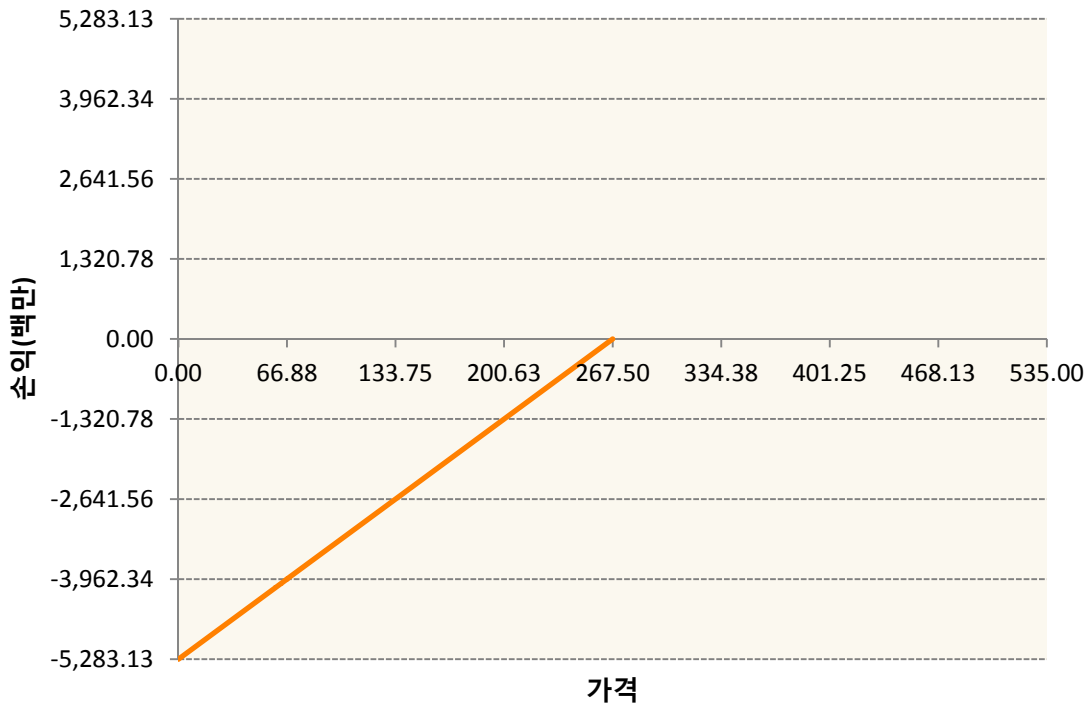


KR4201PB2701-2019-11 콜270

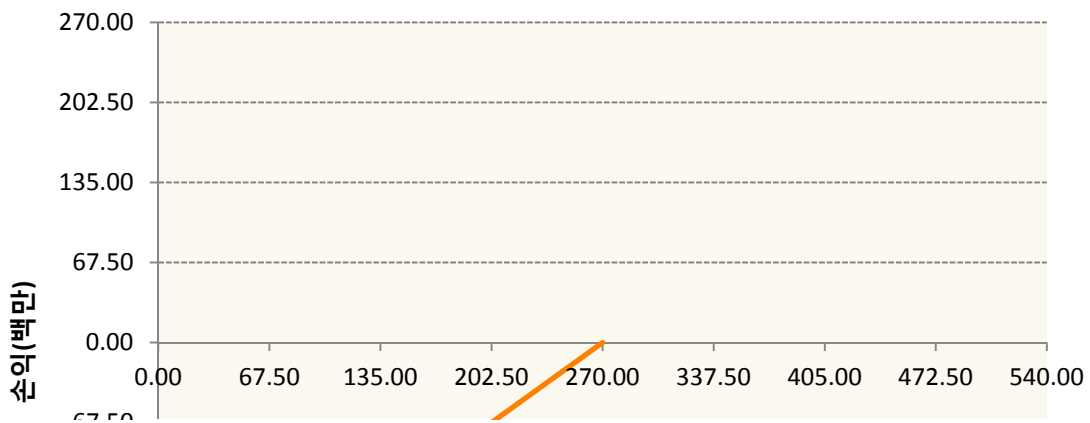




KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



KR4301PB2700-2019-11 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						920
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-920	-920	-920	-920	-920	-920	-920	
-5.33%	-613	-613	-613	-613	-613	-613	-613	
-2.67%	-307	-307	-307	-307	-307	-307	-307	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	307	307	307	307	307	307	307	
5.33%	613	613	613	613	613	613	613	
8.00%	920	920	920	920	920	920	920	
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	
KR4201PB2701		2019-11 콜270						337
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	172	165	158	149	140	131	121	
-5.33%	150	139	128	117	105	93	81	
-2.67%	109	95	82	68	54	40	26	
0%	44	29	15	0	-15	-29	-44	
2.67%	-46	-59	-73	-87	-100	-114	-128	
5.33%	-157	-167	-178	-190	-202	-214	-227	
8.00%	-283	-290	-298	-307	-316	-327	-337	
KR4301PB2676		2019-11 풋267.5						307
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-293	-295	-296	-298	-301	-304	-307
-5.33%	-159	-163	-168	-173	-178	-184	-189
-2.67%	-48	-55	-63	-70	-78	-86	-93
0%	23	15	8	0	-8	-15	-23
2.67%	54	50	45	39	34	28	21
5.33%	63	62	60	57	54	50	46
8.00%	65	65	64	63	62	60	58
KR4301PB2700 2019-11 풋270							17
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-16	-16	-16	-16	-16	-17	-17
-5.33%	-9	-9	-10	-10	-10	-10	-11
-2.67%	-3	-3	-4	-4	-4	-5	-5
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	3	3	3	3	2	2	1
5.33%	4	4	4	4	4	3	3
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

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

(단위:백만원)

1,764

공시일	2019-10-14
기준일	2019-10-11

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

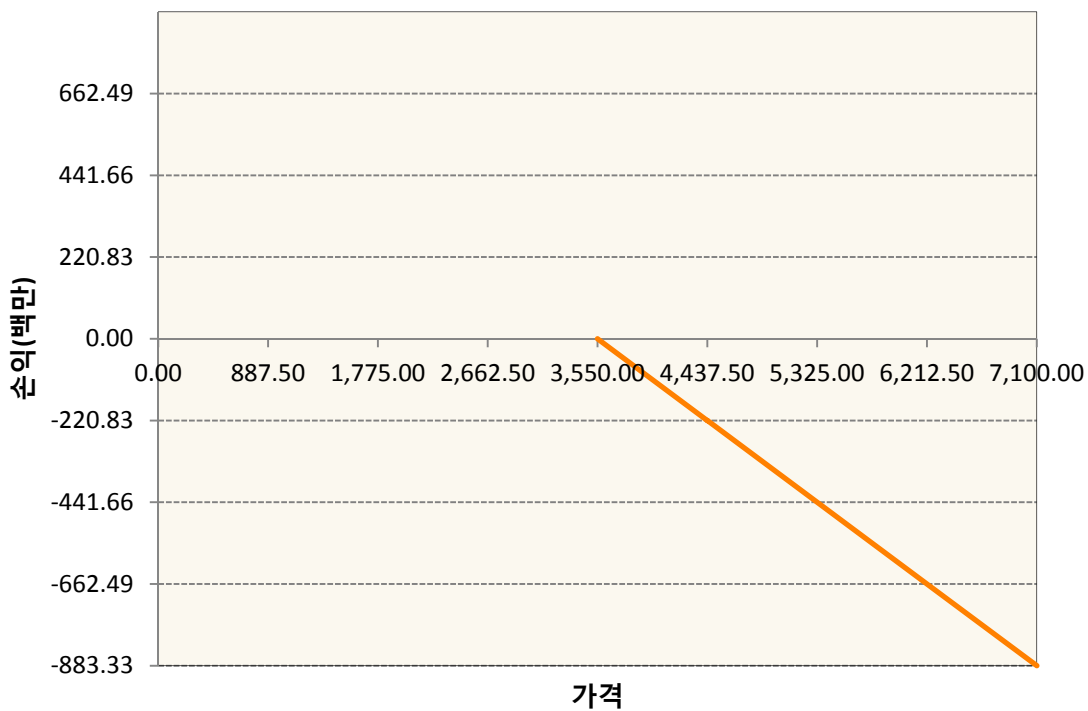
1. 계약금액

(단위:백만원)

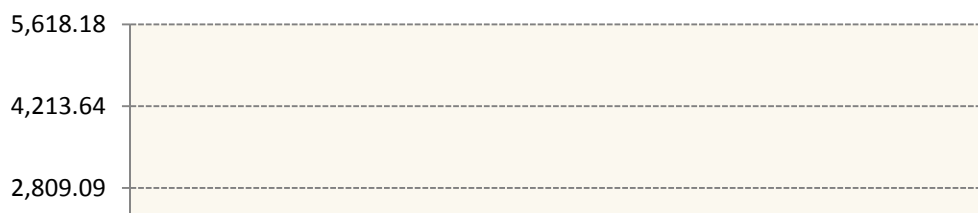
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,526	0	3,526	
누계	유가증권	스왑	23,830	0	23,830	장외
누계	유가증권	옵션	0	13,003	-13,003	장내
누계	통화	선도	0	6,155	-6,155	장외

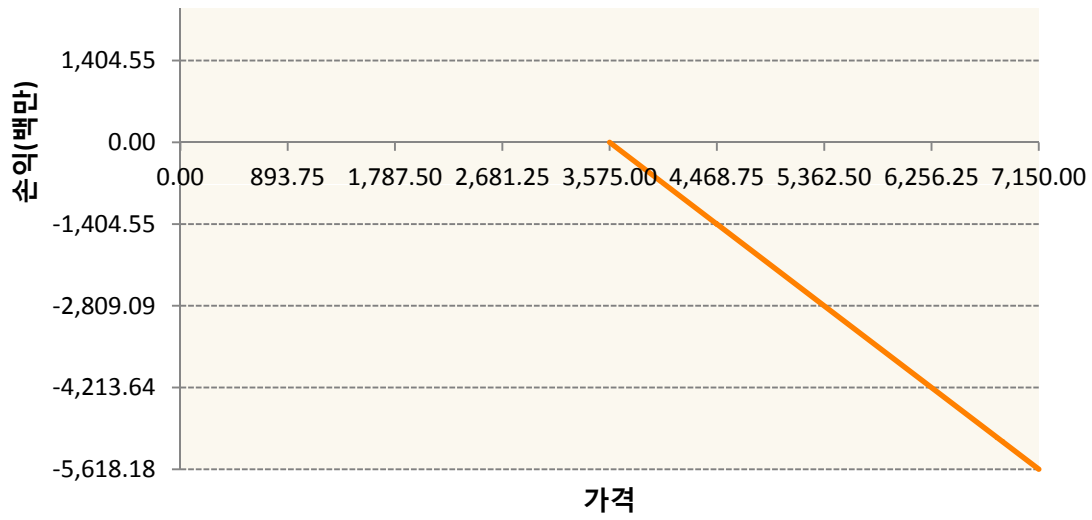
2. 만기시점의 손익구조

OESXV9-C3550-EURO STOXX 50

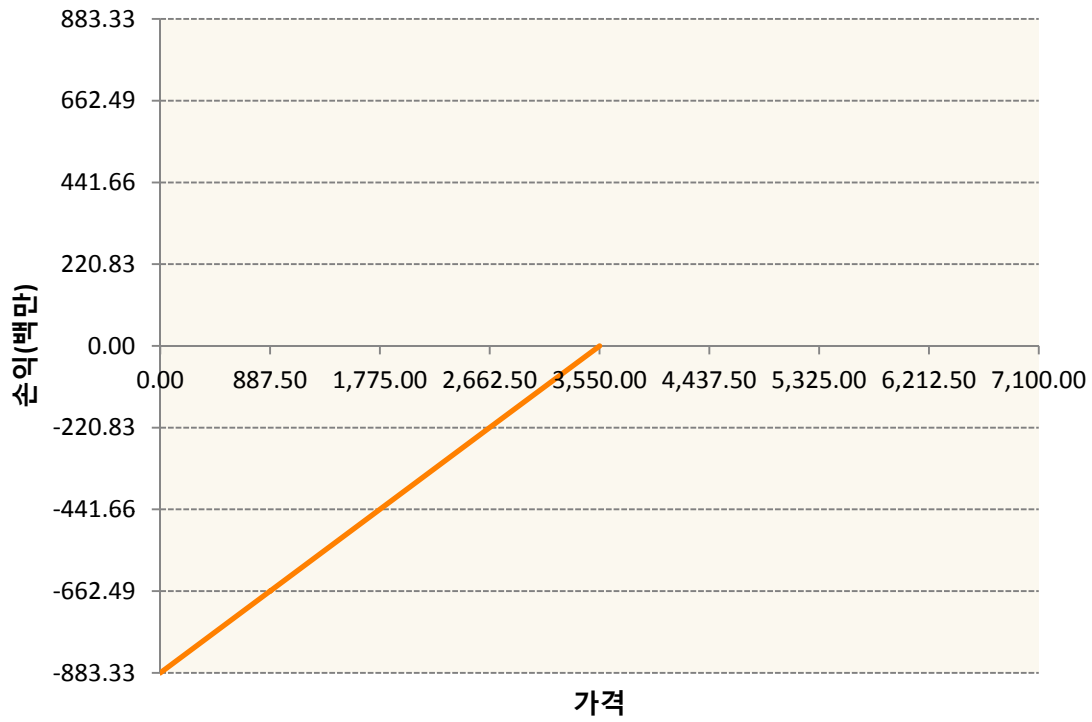


OESXV9-C3575-EURO STOXX 50

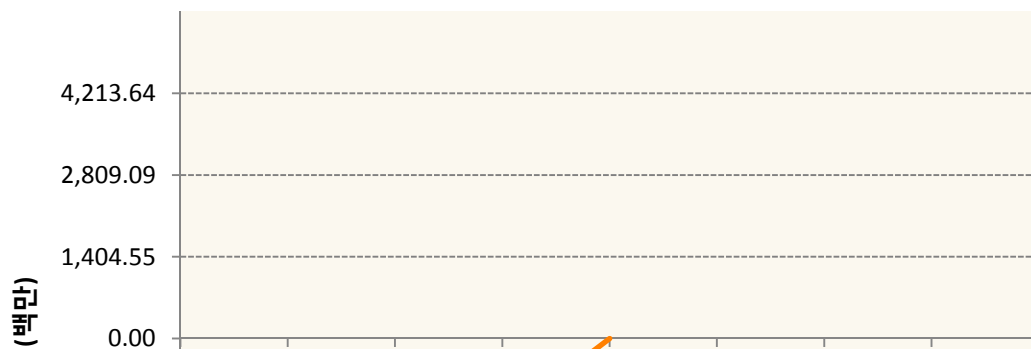


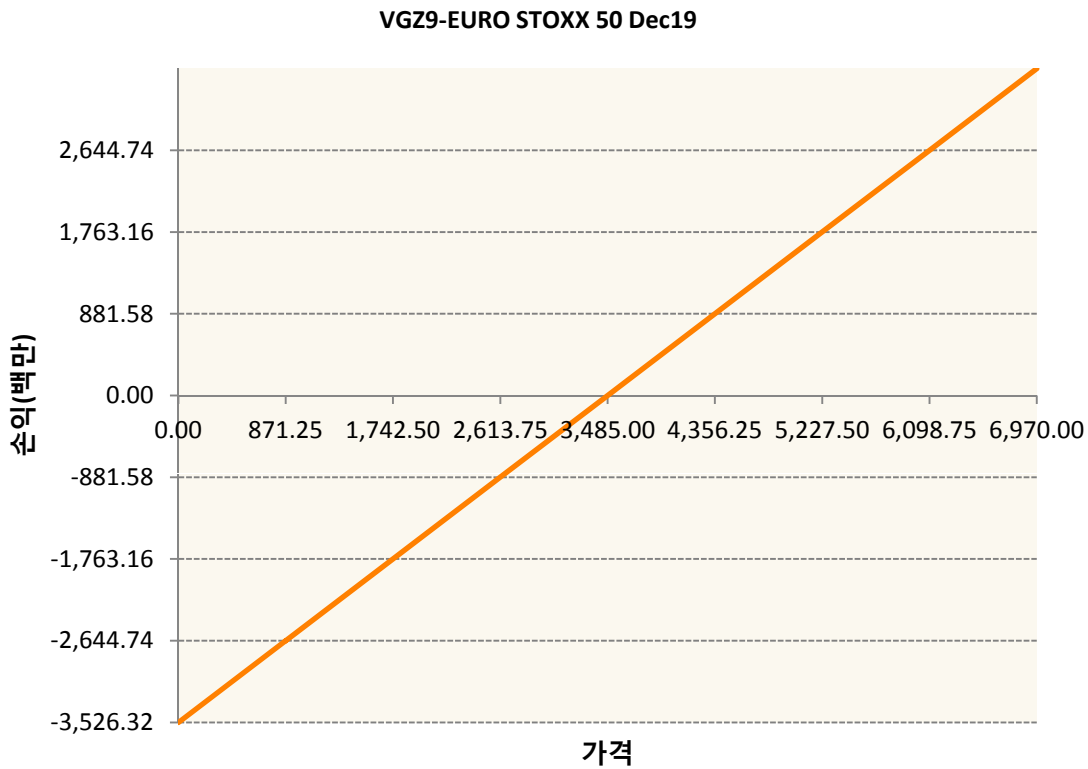
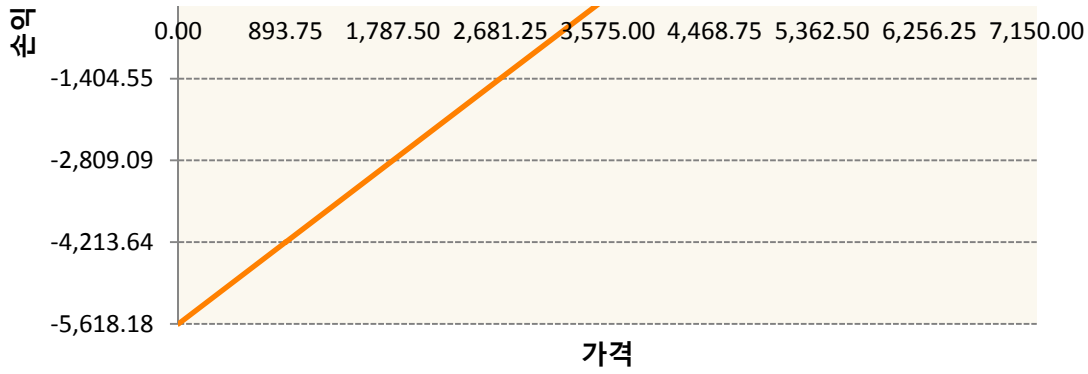


OESXV9-P3550-EURO STOXX 50



OESXV9-P3575-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	39
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E	492
OESXV9-C35 EURO STOXX 50	71
OESXV9-C35 EURO STOXX 50	449
OESXV9-P35 EURO STOXX 50	71
OESXV9-P35 EURO STOXX 50	449
VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19	282

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

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

(단위:백만원)

987

공시일	2019-10-14
기준일	2019-10-11

ETF스마트레버리지목표전환형9호

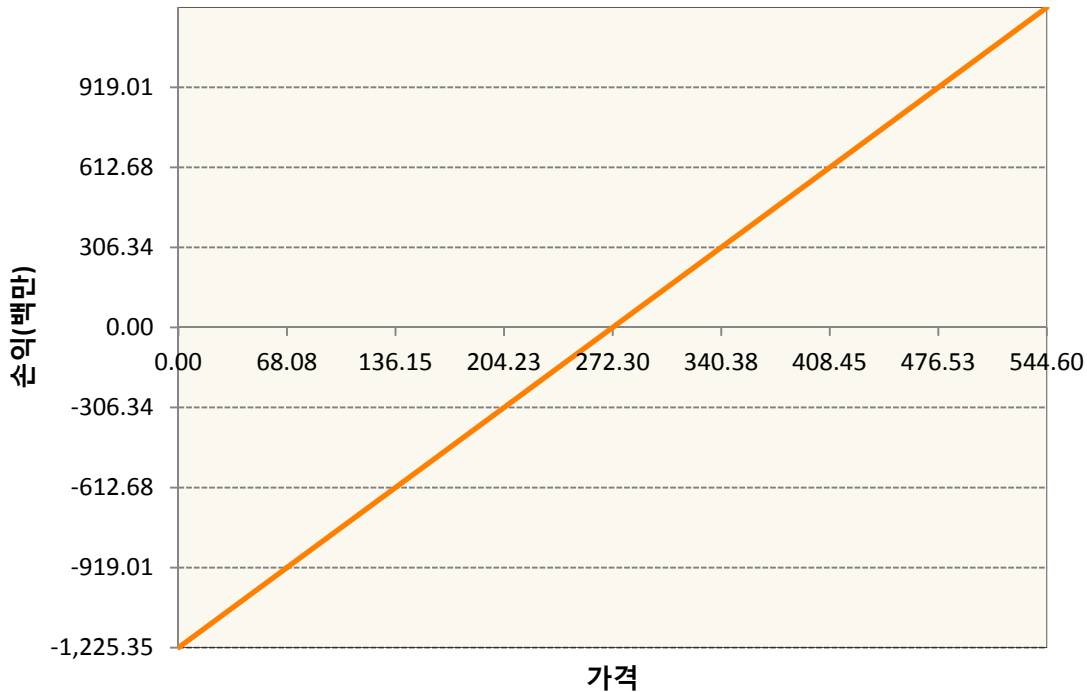
1. 계약금액

(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)

132

공시일	2019-10-14
기준일	2019-10-11

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

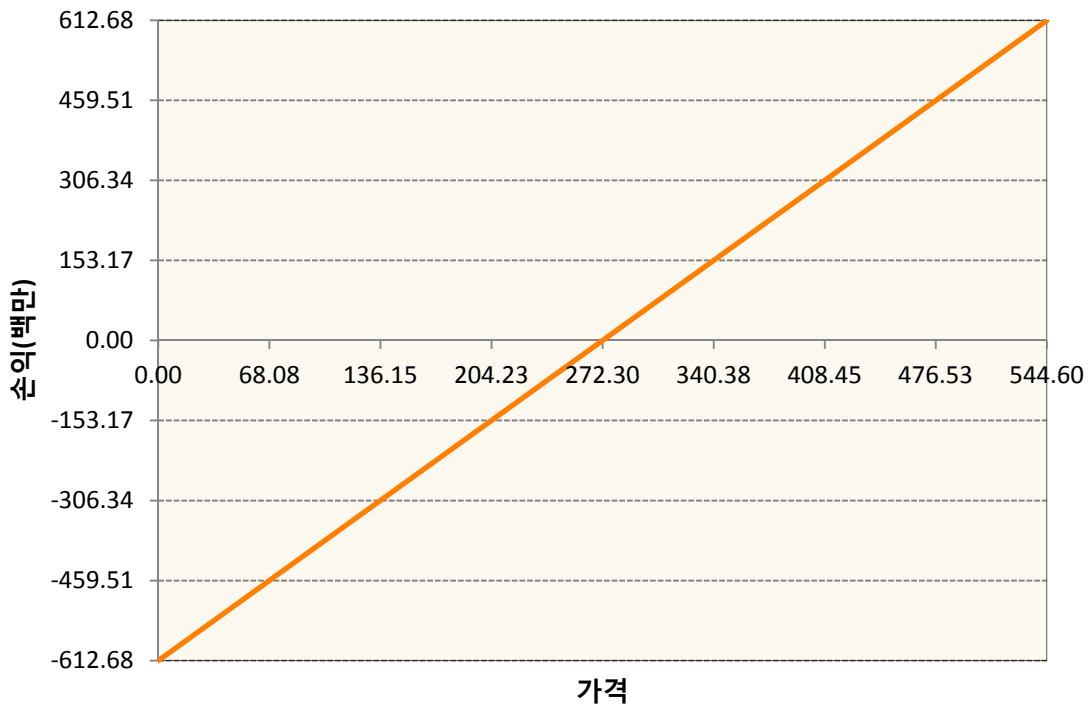
1. 계약금액

(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	2019-10-14
기준일	2019-10-11

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

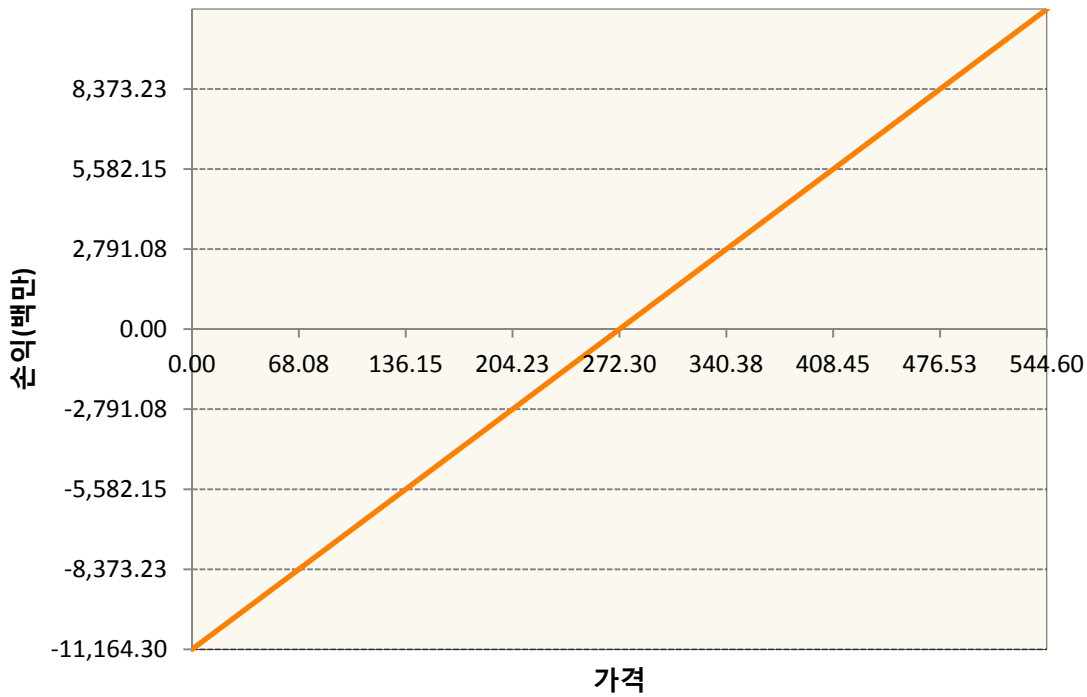
1. 계약금액

(단위:백만원)

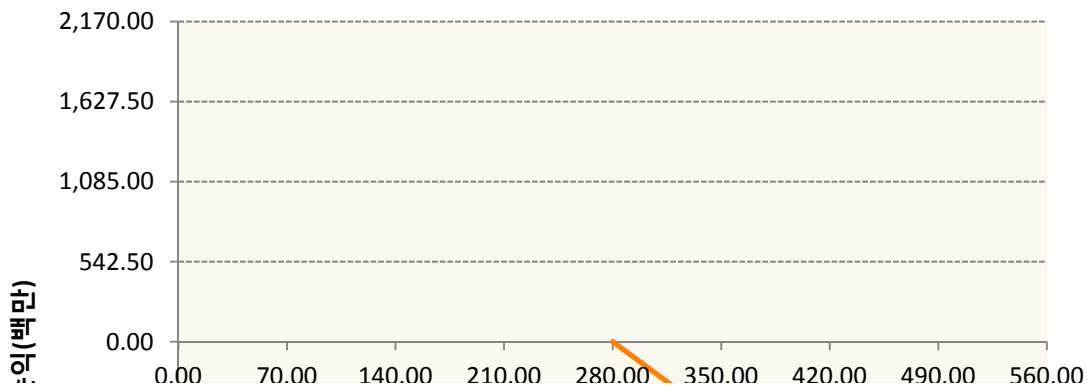
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	1,653	8,743	-7,090	장내
누계	유가증권	선물	11,164	0	11,164	장내
누계	유가증권	옵션	3,561	20,886	-17,324	장내

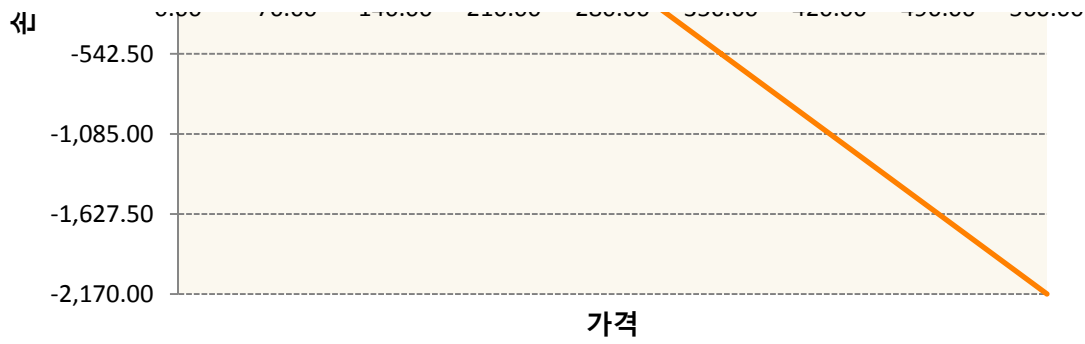
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

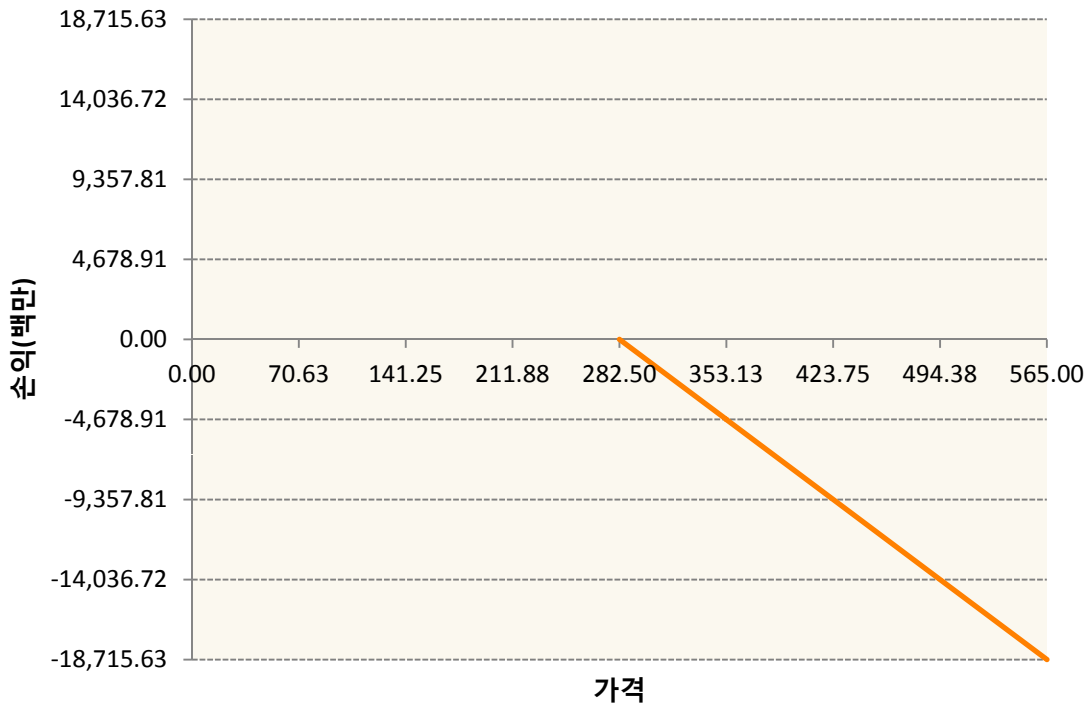


KR4201PB2800-2019-11 콜280

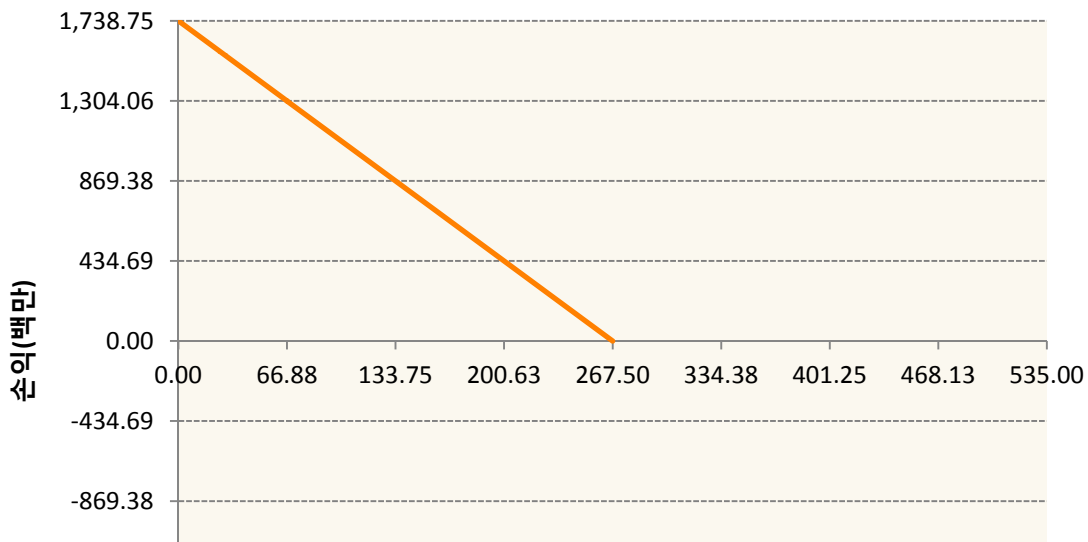


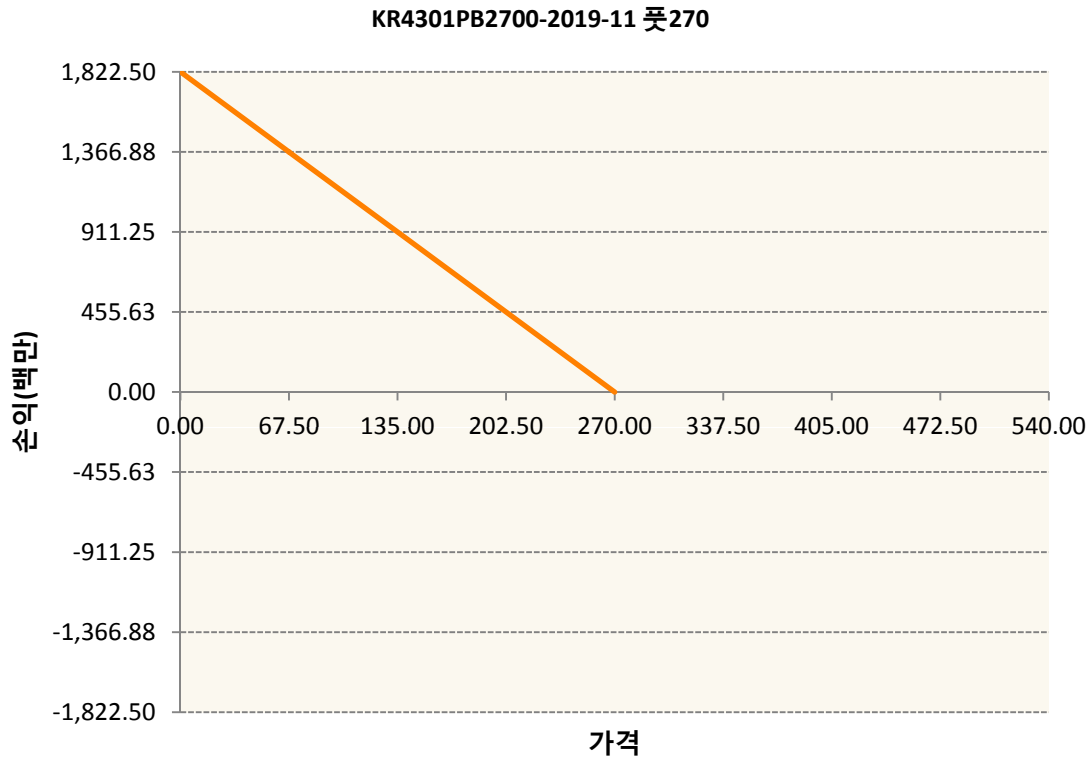
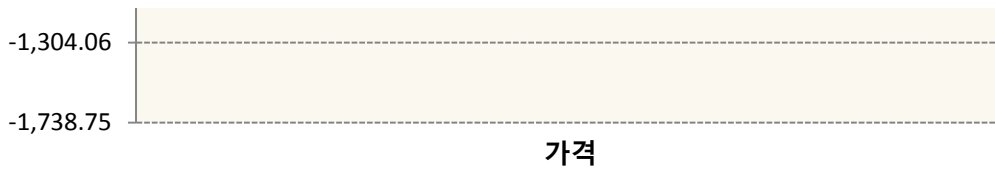


KR4201PB2826-2019-11 콜282.5



KR4301PB2676-2019-11 풋267.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						890
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-890	-890	-890	-890	-890	-890	-890	
-5.33%	-593	-593	-593	-593	-593	-593	-593	
-2.67%	-297	-297	-297	-297	-297	-297	-297	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	297	297	297	297	297	297	297	
5.33%	593	593	593	593	593	593	593	
8.00%	890	890	890	890	890	890	890	
KR4201PB2800		2019-11 콜280						108
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	39	37	36	34	32	30	27	
-5.33%	36	33	31	28	24	21	17	
-2.67%	29	25	21	17	12	8	3	

0%	16	10	5	0	-5	-11	-16
2.67%	-6	-12	-18	-24	-29	-35	-41
5.33%	-37	-43	-49	-54	-60	-66	-72
8.00%	-77	-82	-87	-92	-97	-102	-108
KR4201PB2826 2019-11 콜282.5							866
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	282	274	264	251	235	217	196
-5.33%	263	248	228	206	181	153	124
-2.67%	218	190	159	126	91	54	16
0%	125	85	43	0	-44	-88	-133
2.67%	-35	-84	-133	-182	-231	-281	-330
5.33%	-274	-324	-374	-424	-474	-524	-575
8.00%	-589	-633	-678	-724	-771	-818	-866
KR4301PB2676 2019-11 풋267.5							101
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	97	97	97	98	99	100	101
-5.33%	52	54	55	57	59	60	62
-2.67%	16	18	21	23	26	28	31
0%	-7	-5	-3	0	3	5	8
2.67%	-18	-16	-15	-13	-11	-9	-7
5.33%	-21	-20	-20	-19	-18	-16	-15
8.00%	-21	-21	-21	-21	-20	-20	-19
KR4301PB2700 2019-11 풋270							113
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	110	110	110	111	111	112	113
-5.33%	62	63	65	66	67	69	71
-2.67%	21	23	26	28	30	33	35
0%	-8	-5	-3	0	3	5	8
2.67%	-23	-21	-19	-17	-15	-12	-10
5.33%	-28	-27	-26	-25	-24	-22	-20
8.00%	-29	-29	-29	-28	-28	-27	-26

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

(단위:백만원)

1,703

공시일	2019-10-14
기준일	2019-10-11

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	144,557	0	144,557	

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	2019-10-14
기준일	2019-10-11

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	185,204	0	185,204	

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	2019-10-14
기준일	2019-10-11

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	408,040	0	408,040	
누계	통화	선도	0	407,877	-407,877	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,899
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,519
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E	951
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E	951
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E	190
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E	2,321
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E	1,712
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E	190
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E	951
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E	1,465
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	2,958
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	3,138
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	2,606
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E	1,902
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E	1,997
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E	951
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E	666
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E	1,560
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E	704

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

(단위:백만원)

10,552

공시일	2019-10-14
기준일	2019-10-11

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

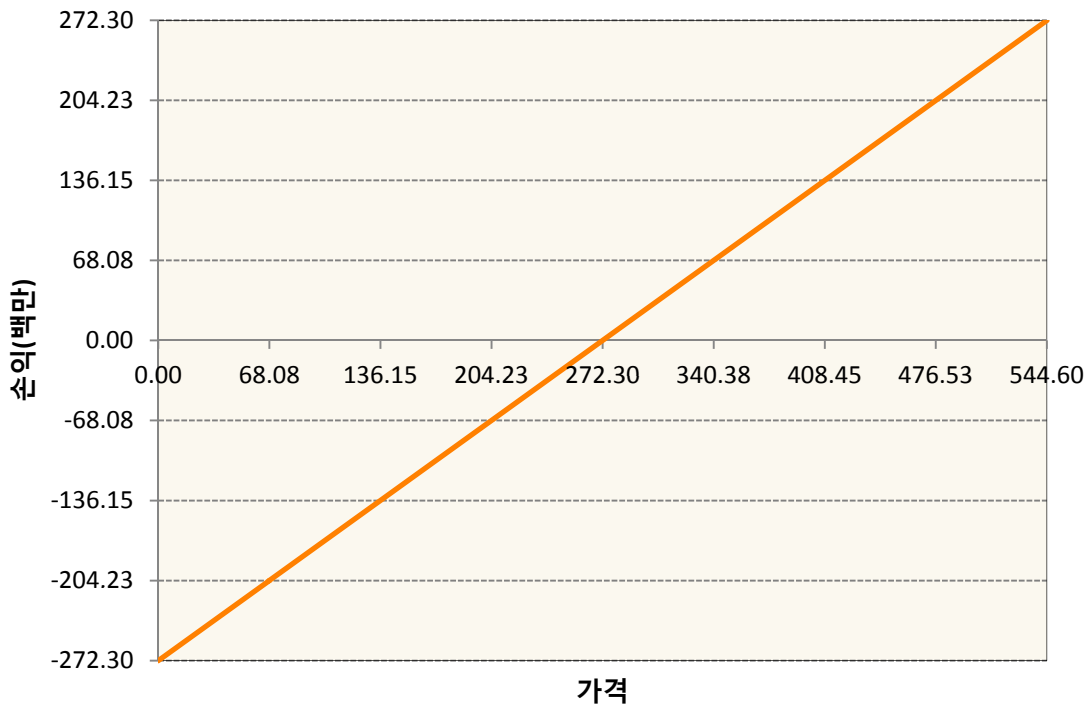
1. 계약금액

(단위:백만원)

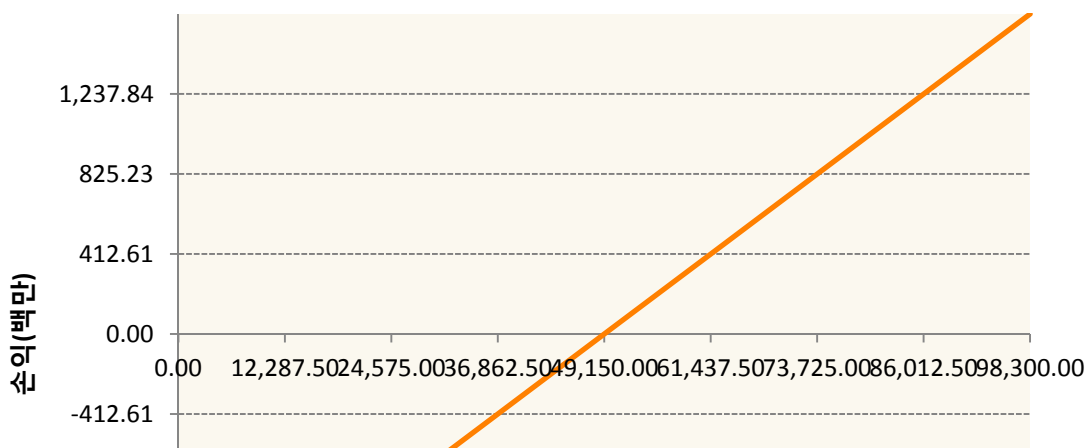
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,923	0	1,923	장내

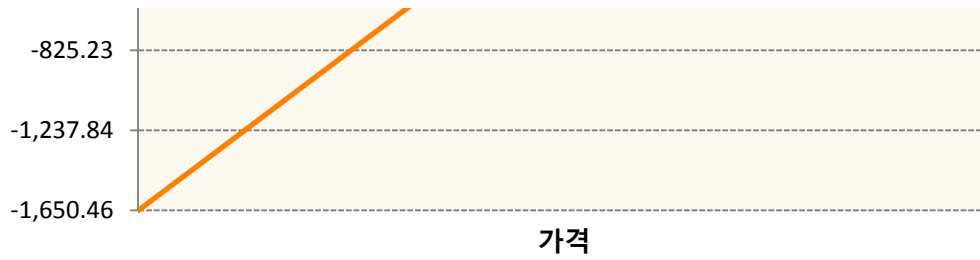
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



KR4111PB0001-2019-11 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						22
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22	
-5.33%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14	
-2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	7	7	7	7	7	7	7	
5.33%	14	14	14	14	14	14	14	
8.00%	22	22	22	22	22	22	22	
KR4111PB0001		2019-11 삼성전자개별선물						132
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132	
-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%	132	132	132	132	132	132	132	

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

184

공시일	2019-10-14
기준일	2019-10-11

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

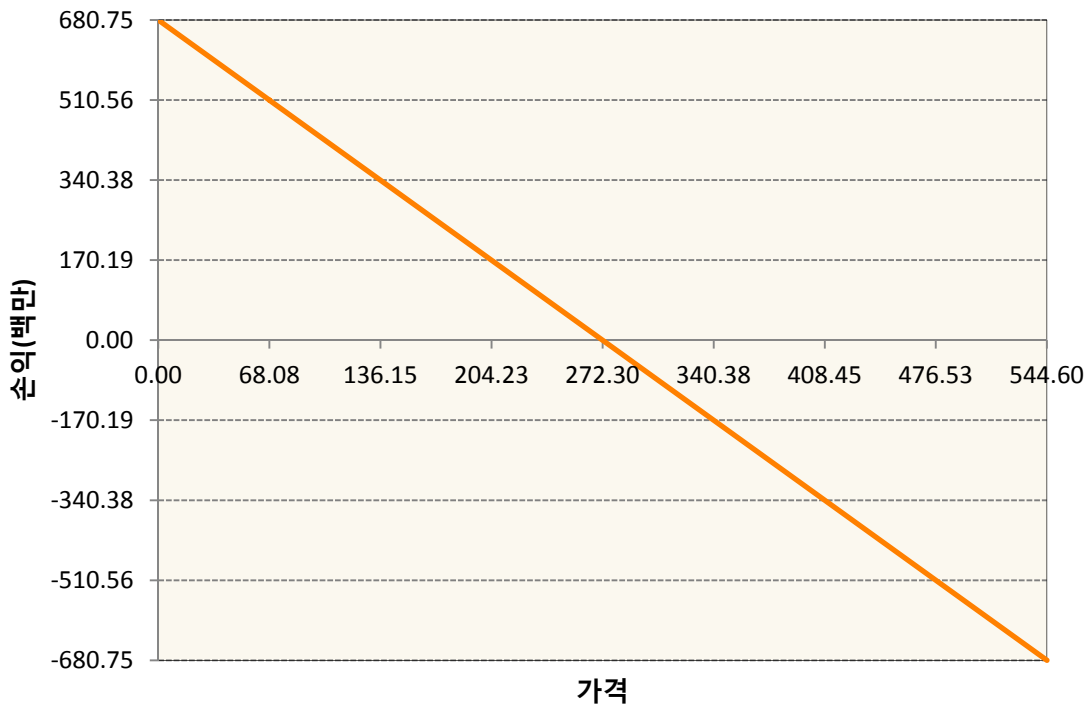
1. 계약금액

(단위:백만원)

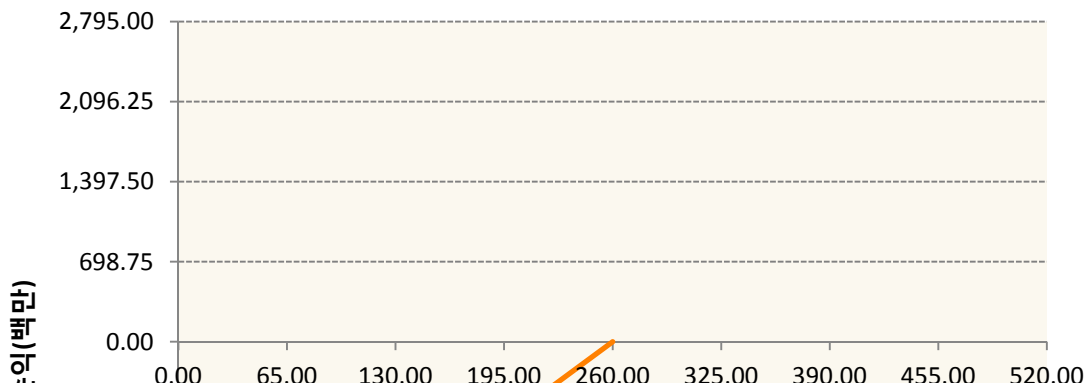
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	1,890	1,895	-4	장내
누계	유가증권	선물	0	681	-681	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,976	-3,976	장내

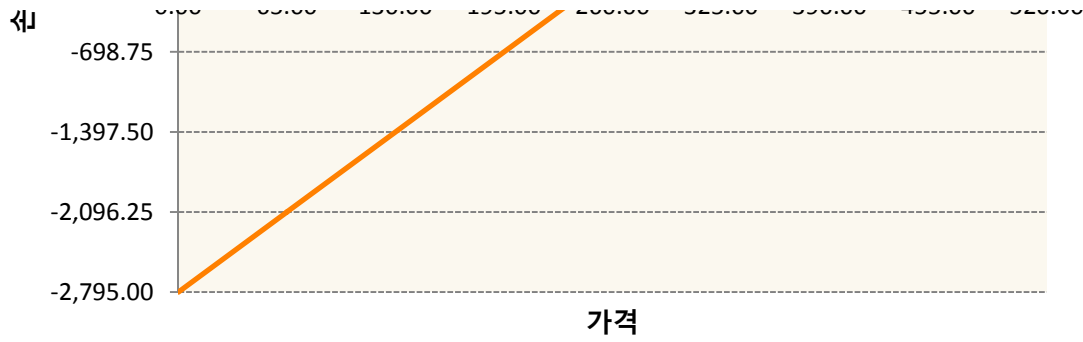
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

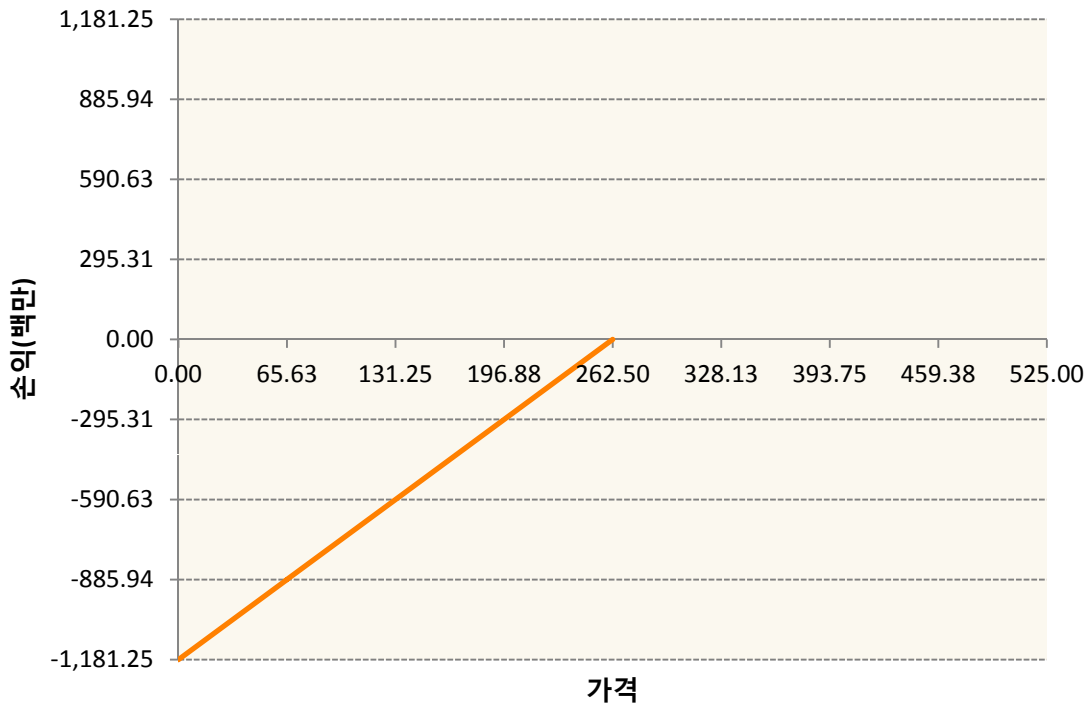


KR4301PB2601-2019-11 풋260





KR4301PB2627-2019-11 풋262.5



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	
KR4301PB2601		2019-11 풋260						122
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-106	-108	-111	-113	-116	-119	-122
-5.33%	-46	-50	-54	-58	-62	-66	-70
-2.67%	-9	-12	-16	-20	-24	-29	-33
0%	7	5	3	0	-3	-6	-9
2.67%	12	11	10	9	7	5	3
5.33%	13	12	12	12	11	10	9
8.00%	13	13	13	12	12	12	12
KR4301PB2627 2019-11 풋262.5							58
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-52	-53	-54	-55	-56	-57	-58
-5.33%	-25	-26	-28	-29	-31	-32	-34
-2.67%	-6	-7	-9	-11	-13	-14	-16
0%	4	3	1	0	-1	-3	-4
2.67%	7	6	6	5	4	3	2
5.33%	8	7	7	7	7	6	6
8.00%	8	8	8	8	7	7	7

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

(단위:백만원)

195

공시일	2019-10-14
기준일	2019-10-11

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	16,535	0	16,535	
누계	통화	선도	1,236	17,594	-16,358	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		323
FX21019U03 KRW/USD 18-10-19E		476
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		609
FX21019U05 USD/KRW 18-10-19E		19
FX21019V00 USD/KRW 18-10-19E		38
FX21019V01 USD/KRW 18-10-19E		42

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

(단위:백만원)

487

공시일	2019-10-14
기준일	2019-10-11

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	117	209	-92	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
FX21019V00 KRW/EUR 22-11-19E	2
FX21019V01 KRW/EUR 22-11-19E	2

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

(단위:백만원)

33

공시일	2019-10-14
기준일	2019-10-11

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

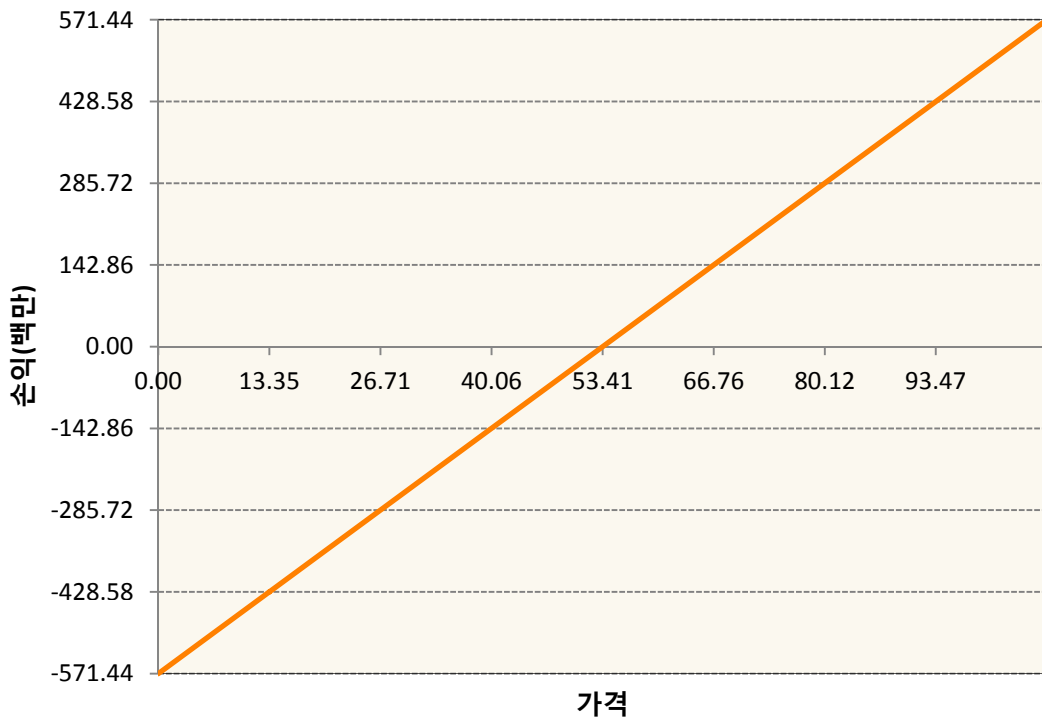
1. 계약금액

(단위:백만원)

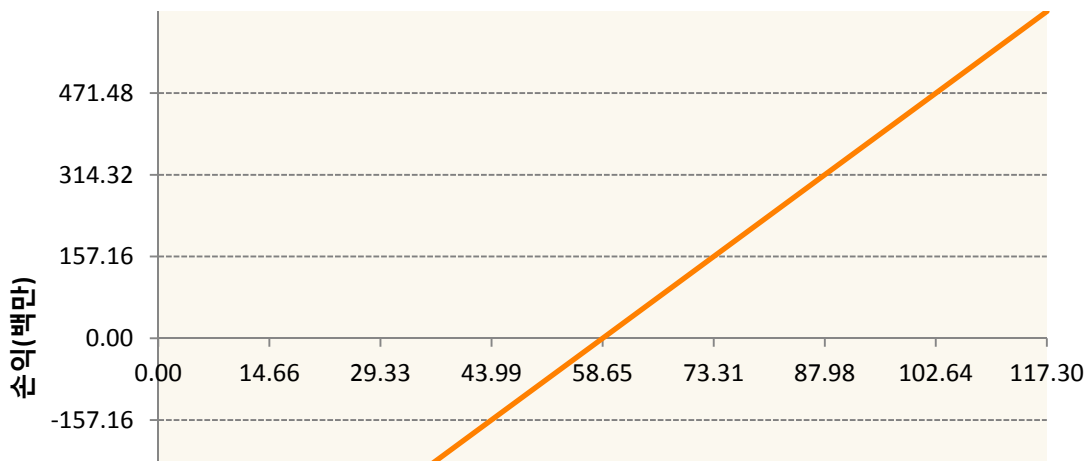
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,457	297	2,160	

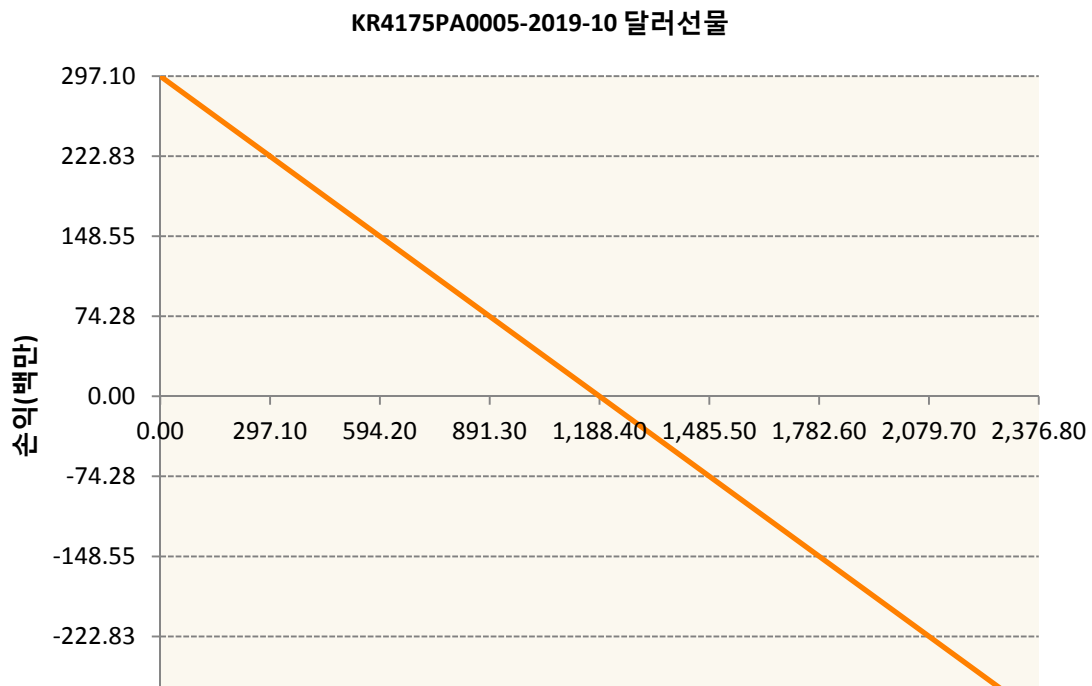
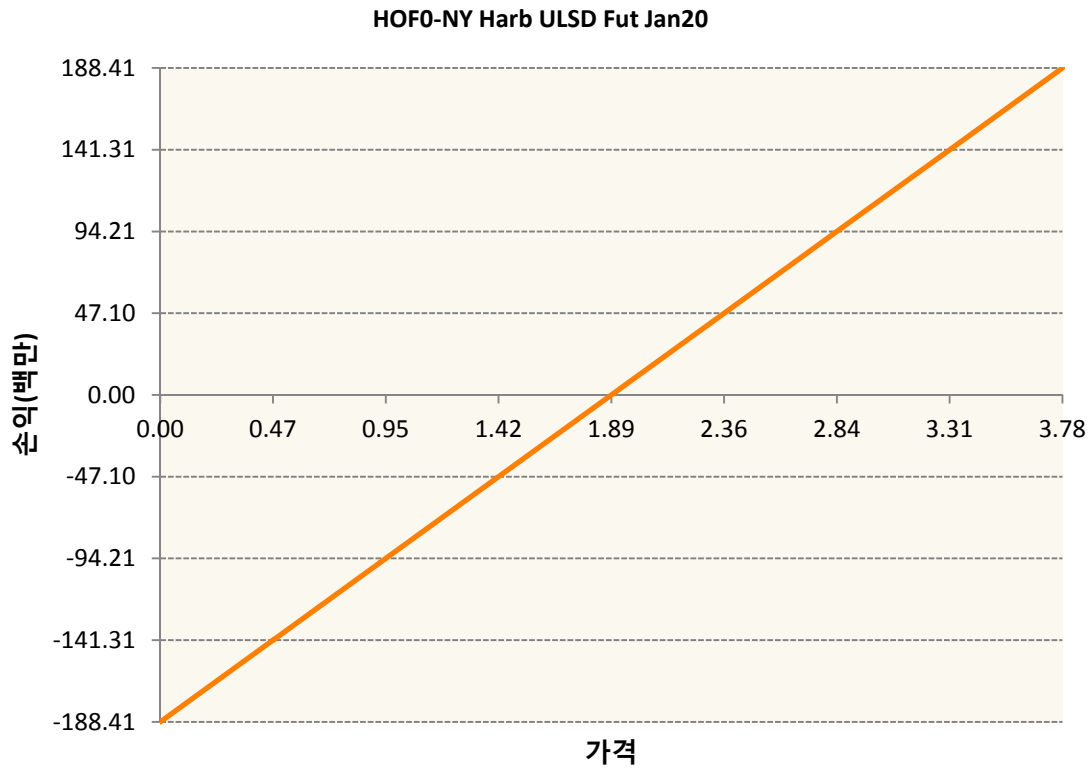
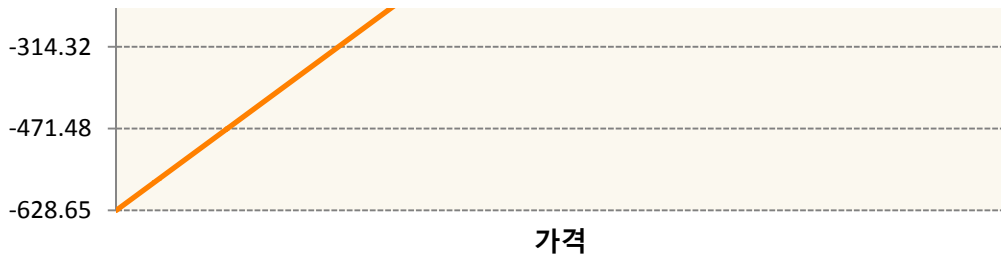
2. 만기시점의 손익구조

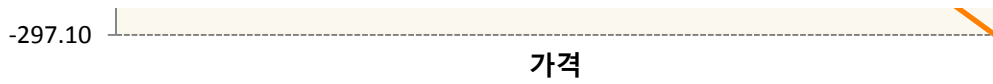
CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20



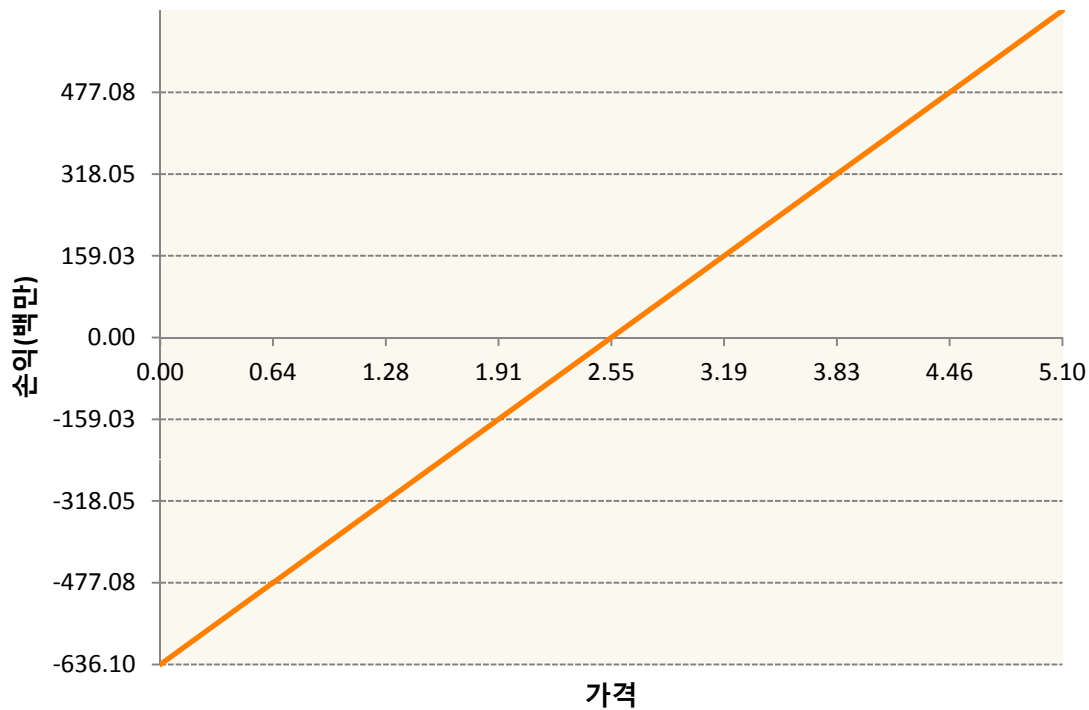
COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20



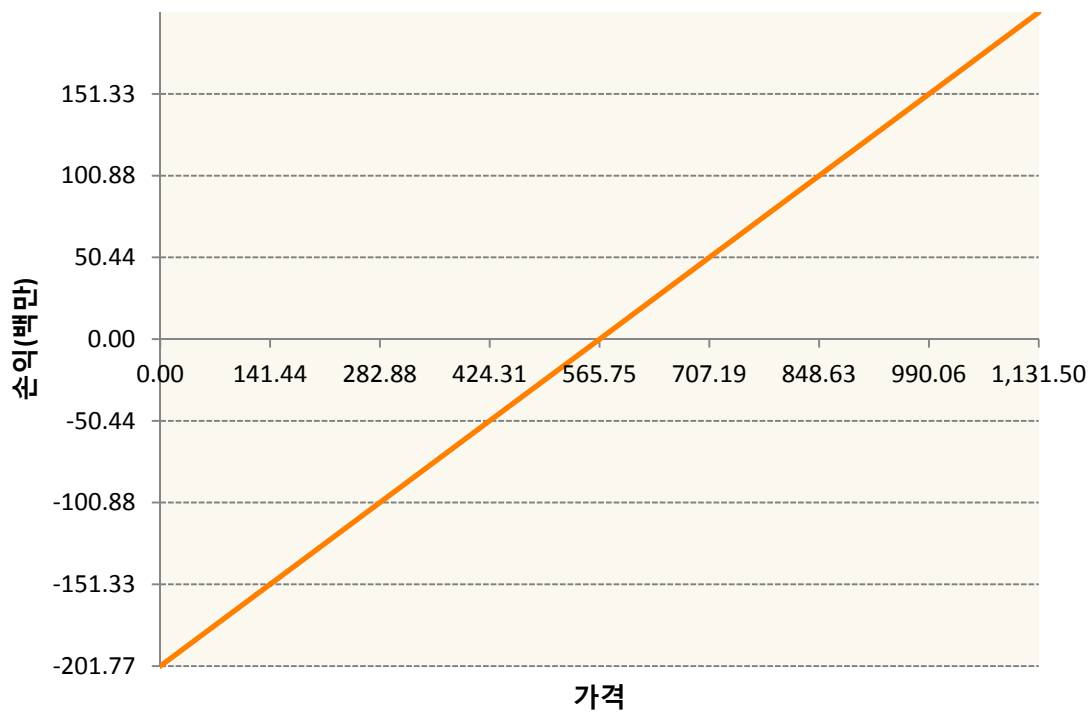




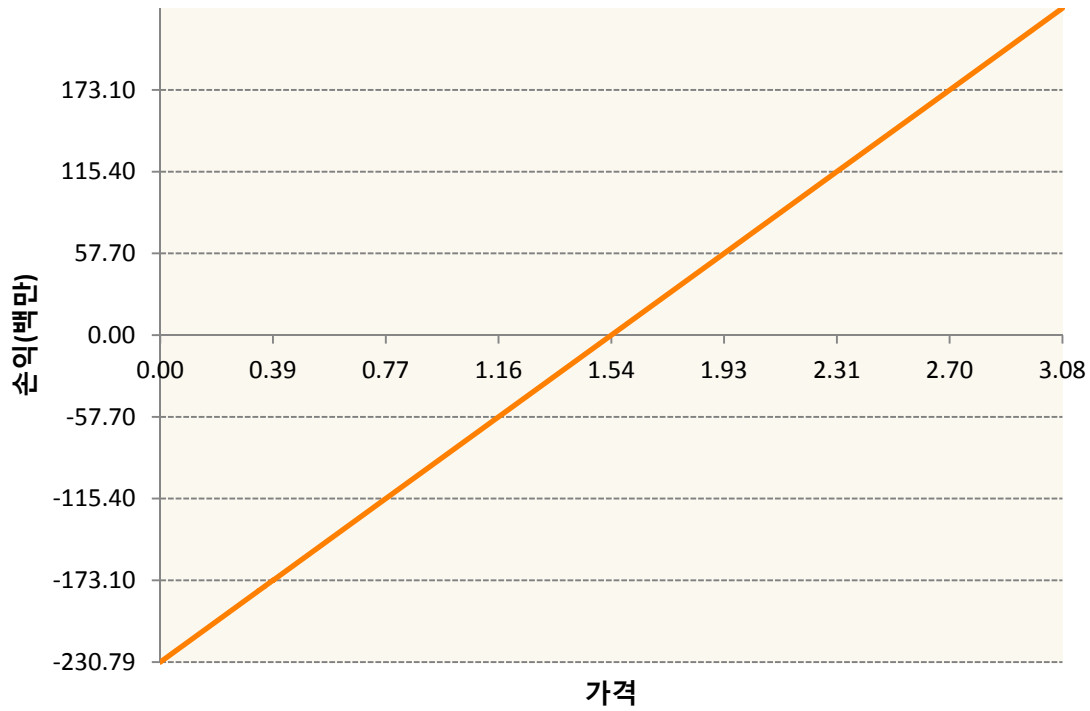
NGF20-NATURAL GAS FUTR Jan20



QSF0-Low Su Gasoil G Jan20



XBF0-GASOLINE RBOB FUT Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLF0	WTI CRUDE FUTURE Jan20	46
COF0	BRENT CRUDE FUTR Jan20	50
HOF0	NY Harb ULSD Fut Jan20	15
KR4175PA00	2019-10 달러선물	24
NGF20	NATURAL GAS FUTR Jan20	51
QSF0	Low Su Gasoil G Jan20	16
XBF0	GASOLINE RBOB FUT Jan20	18

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

(단위:백만원)

409

공시일	2019-10-14
기준일	2019-10-11

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

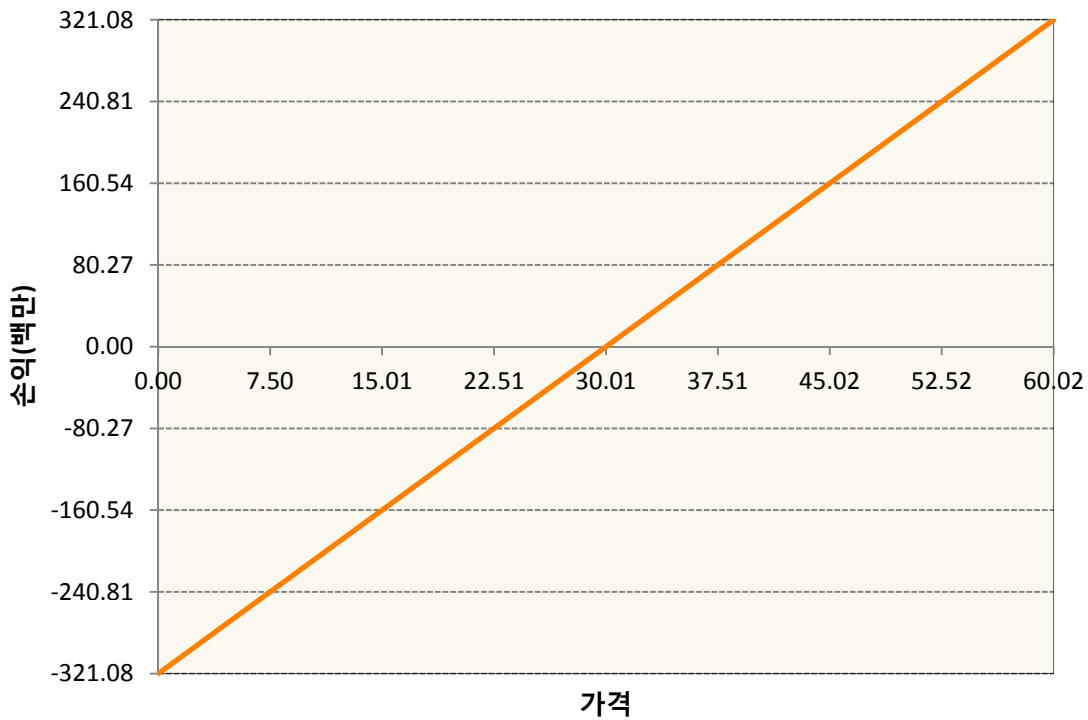
1. 계약금액

(단위:백만원)

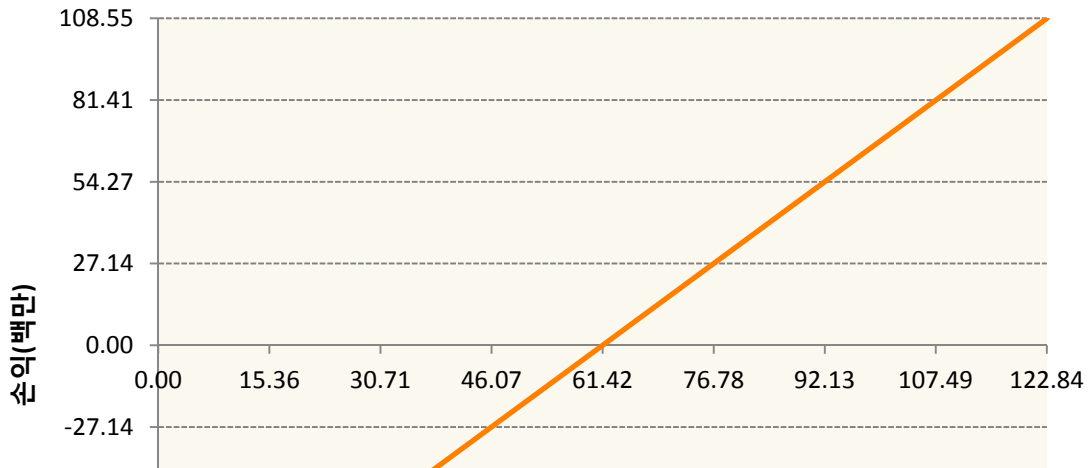
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,812	95	2,717	

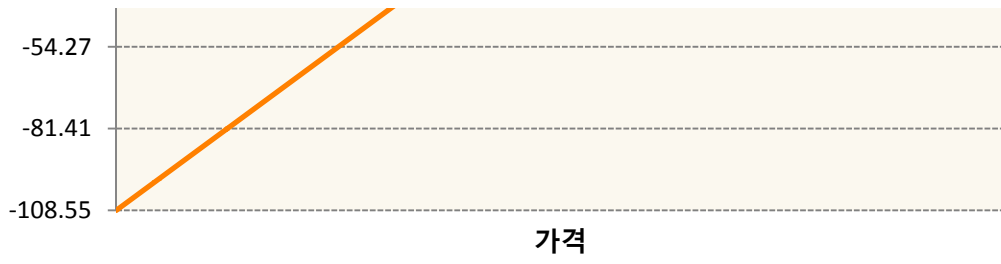
2. 만기시점의 손익구조

BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20

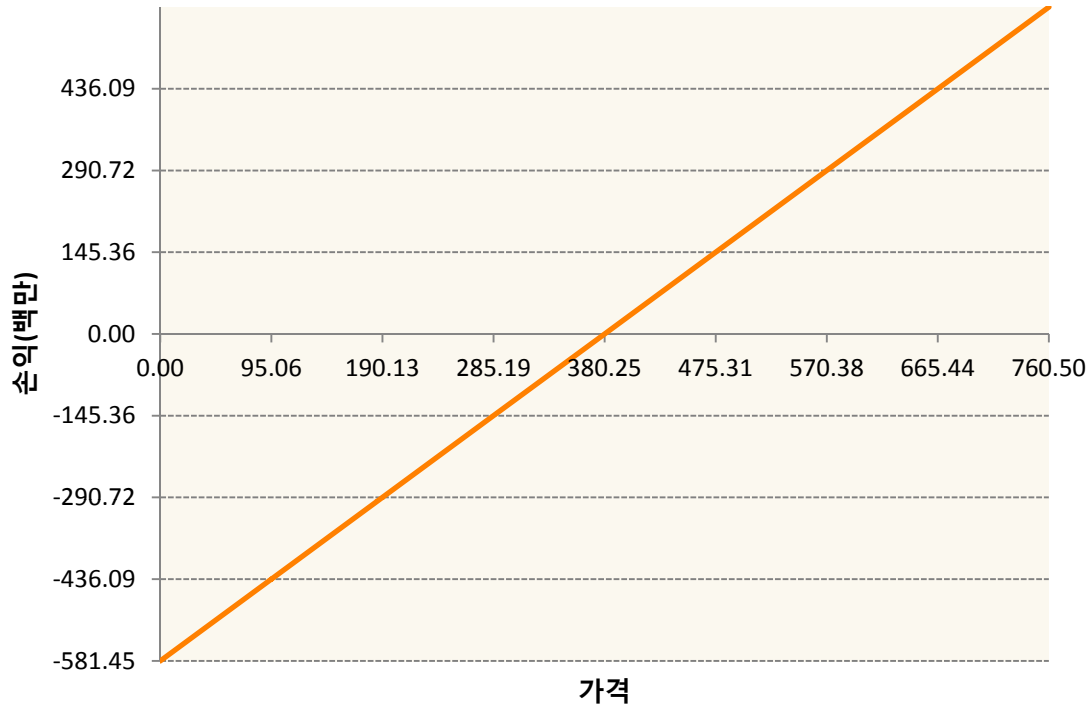


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

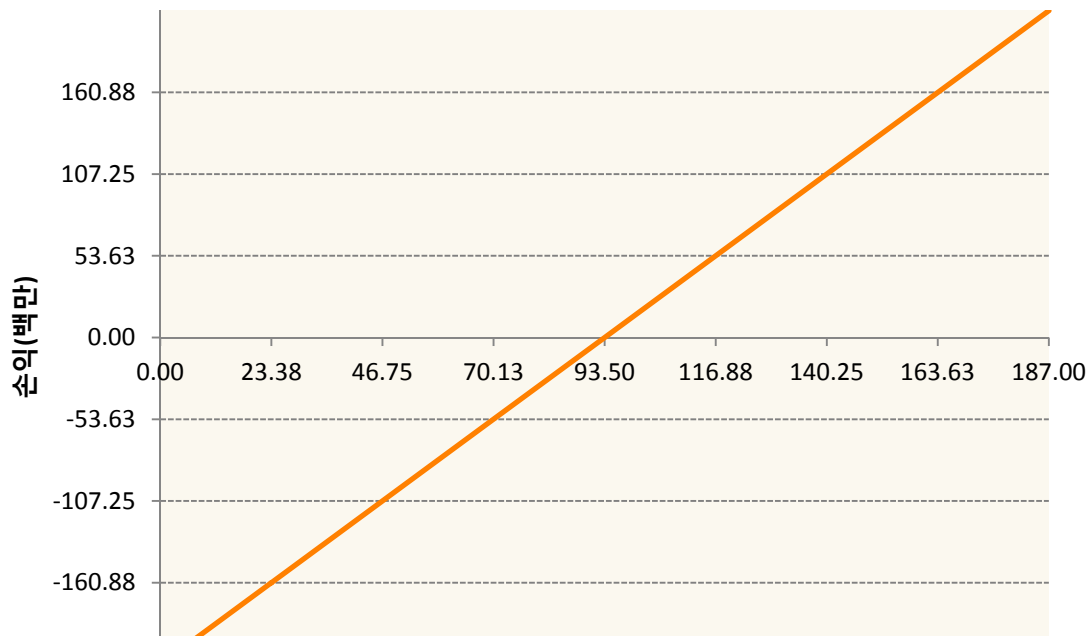


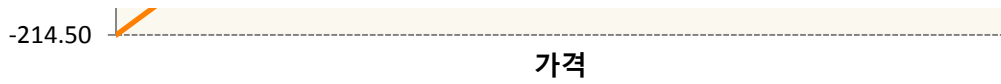


CZ9-CORN FUTURE Dec19

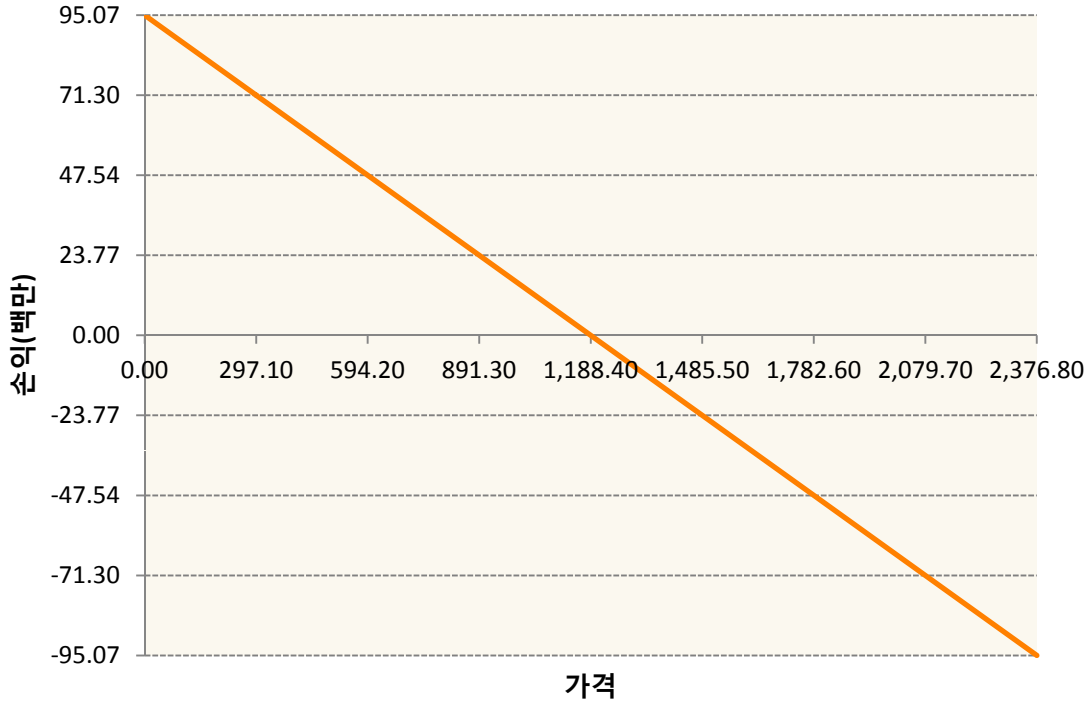


KCZ9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19

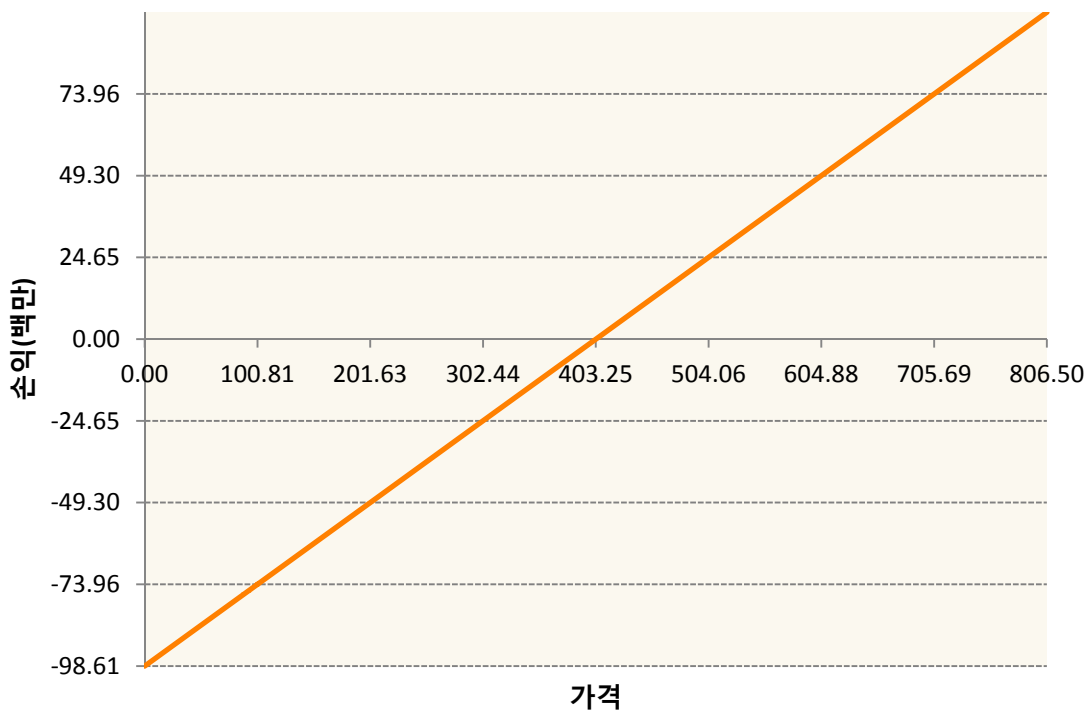




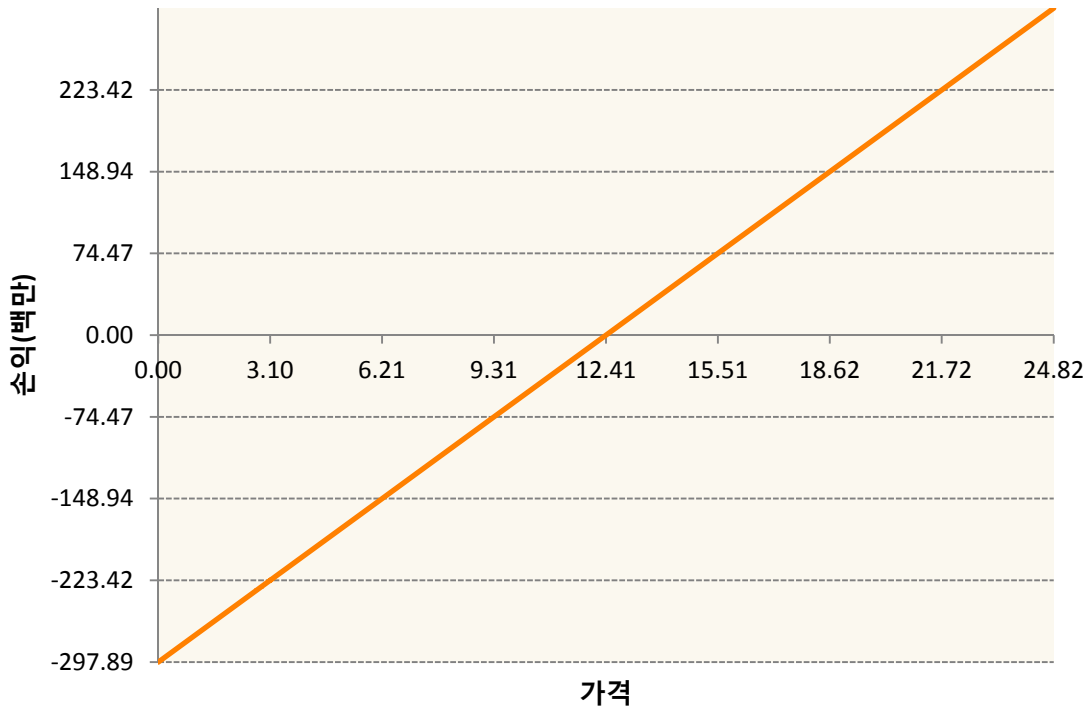
KR4175PA0005-2019-10 달러선물



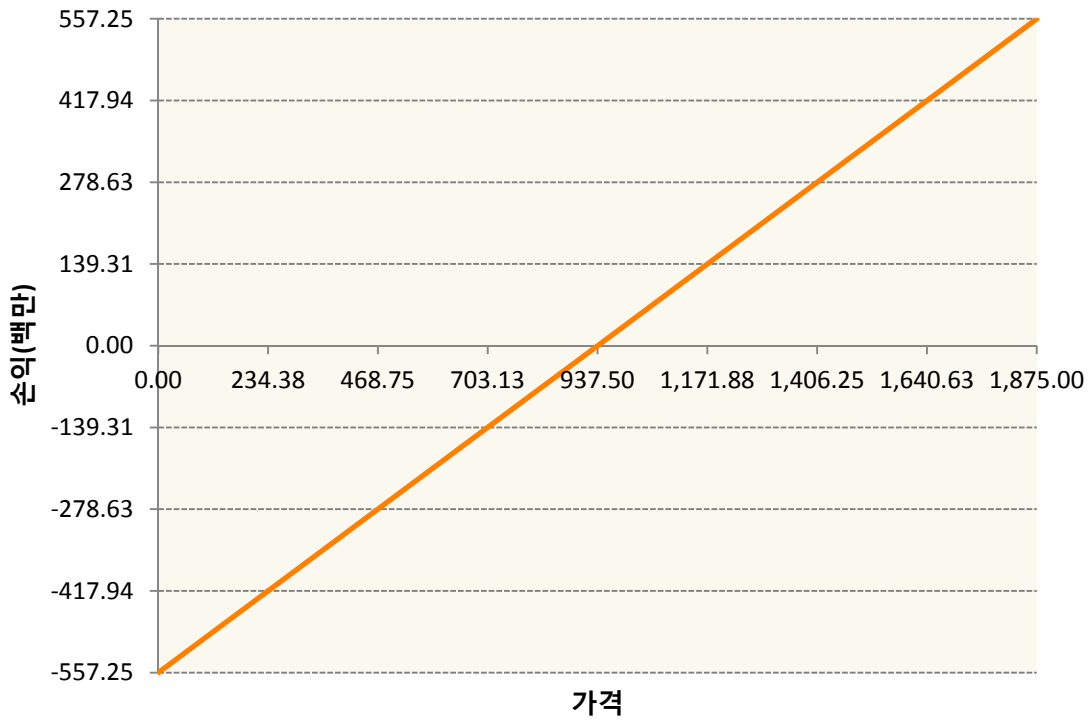
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



SBH0-Sugar Mar20

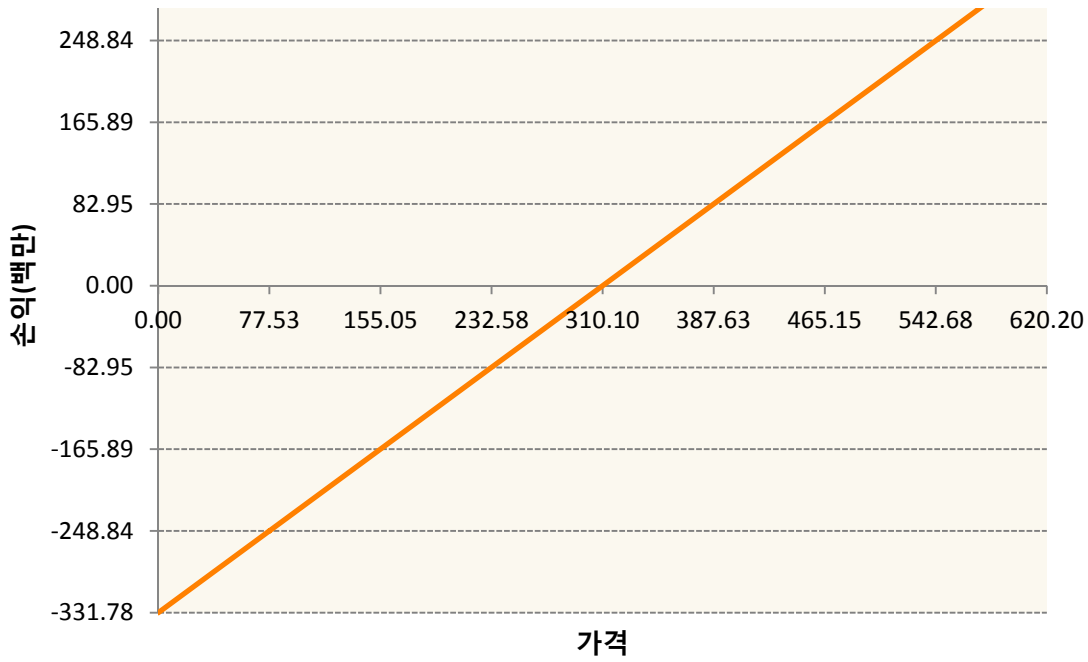


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20

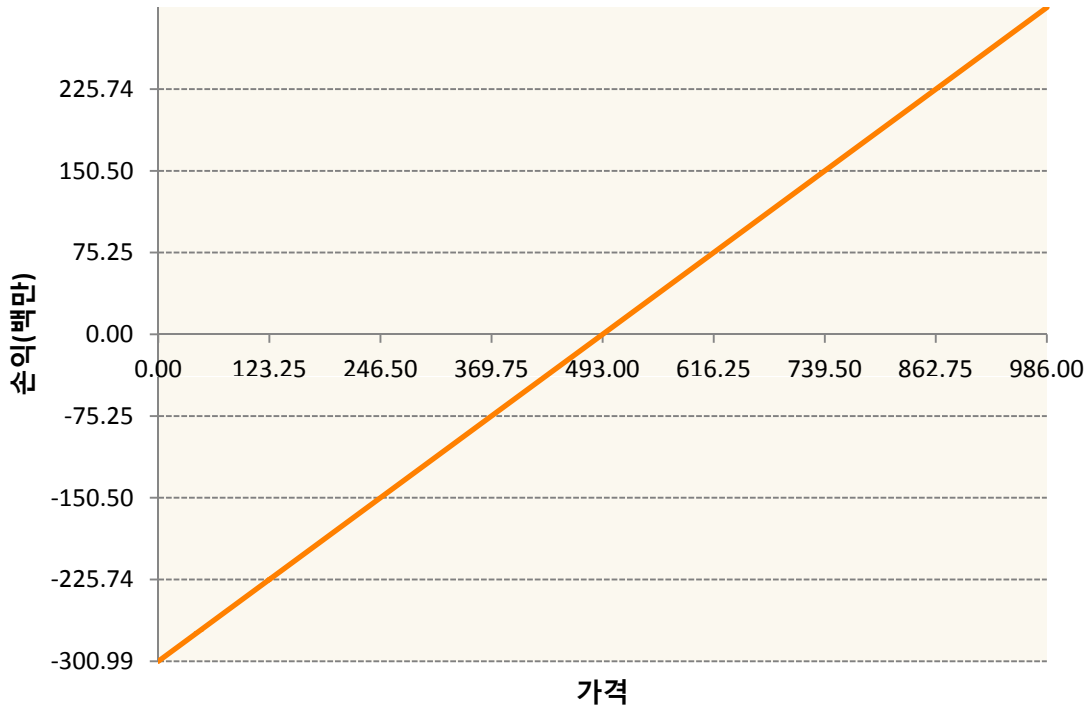


SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





WZ9-WHEAT FUTURE(CBT) Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF0	SOYBEAN OIL FUTR Jan20	26
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	9
CZ9	CORN FUTURE Dec19	47
KCZ9	COFFEE 'C' FUTURE Dec19	17
KR4175PA00	2019-10 달러선물	8

KWZ9	KC HRW WHEAT FUT Dec19	8
SBH0	Sugar Mar20	24
SF0	SOYBEAN FUTURE Jan20	45
SMF0	SOYBEAN MEAL FUTR Jan20	27
WZ9	WHEAT FUTURE(CBT) Dec19	24

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

(단위:백만원)

251