

공시일	2019-10-15
기준일	2019-10-14

## 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)

86

공시일	2019-10-15
기준일	2019-10-14

## 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

1,172

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

684

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-10-15
기준일	2019-10-14

## 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)	391
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	143

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

**844**

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-10-15
기준일	2019-10-14

## 유로인덱스모(주식-파생형)

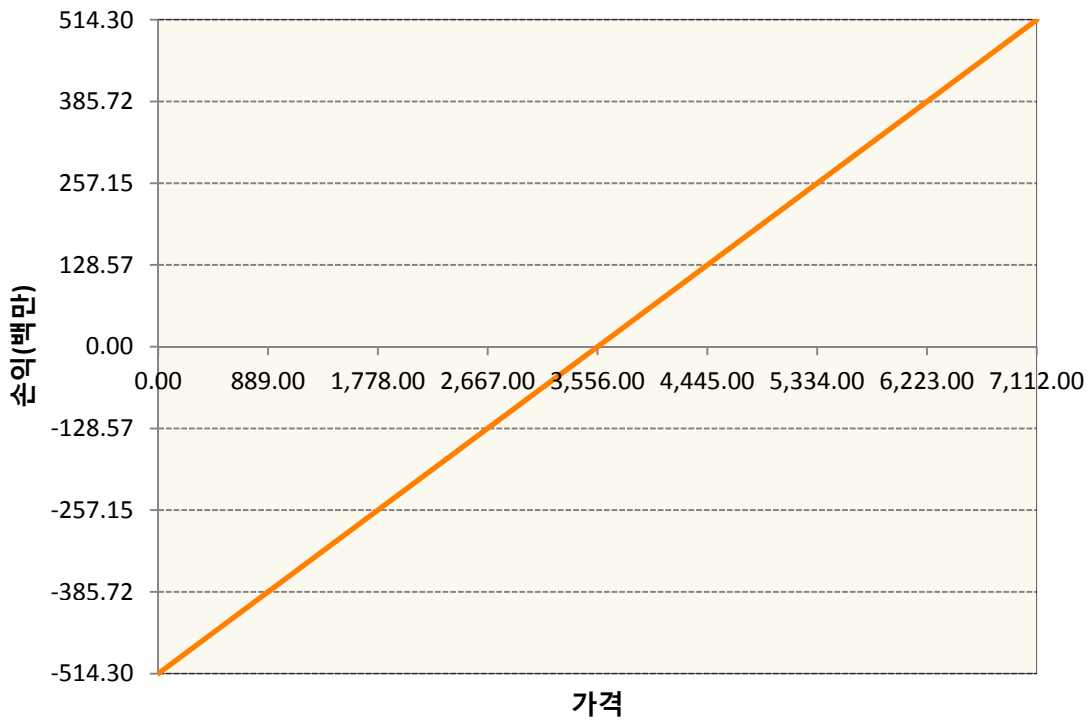
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	514	0	514	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGZ9-EURO STOXX 50 Dec19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	41
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

29
----

공시일	2019-10-15
기준일	2019-10-14

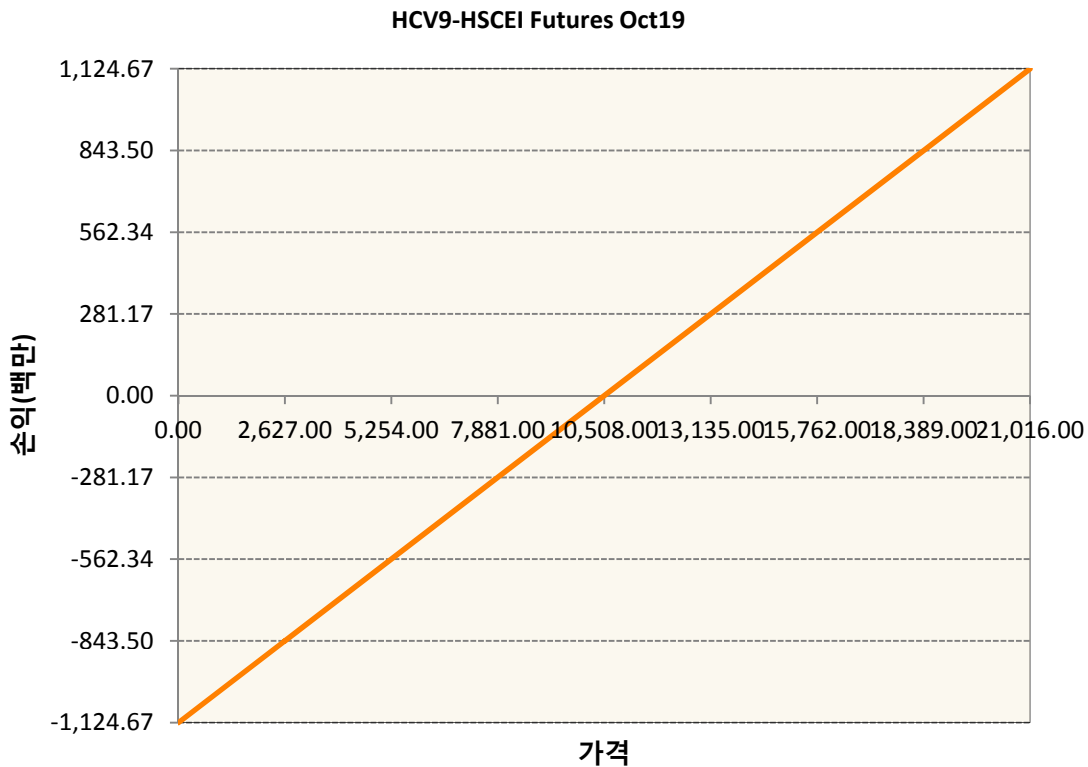
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,125	0	1,125	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

81

공시일	2019-10-15
기준일	2019-10-14

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

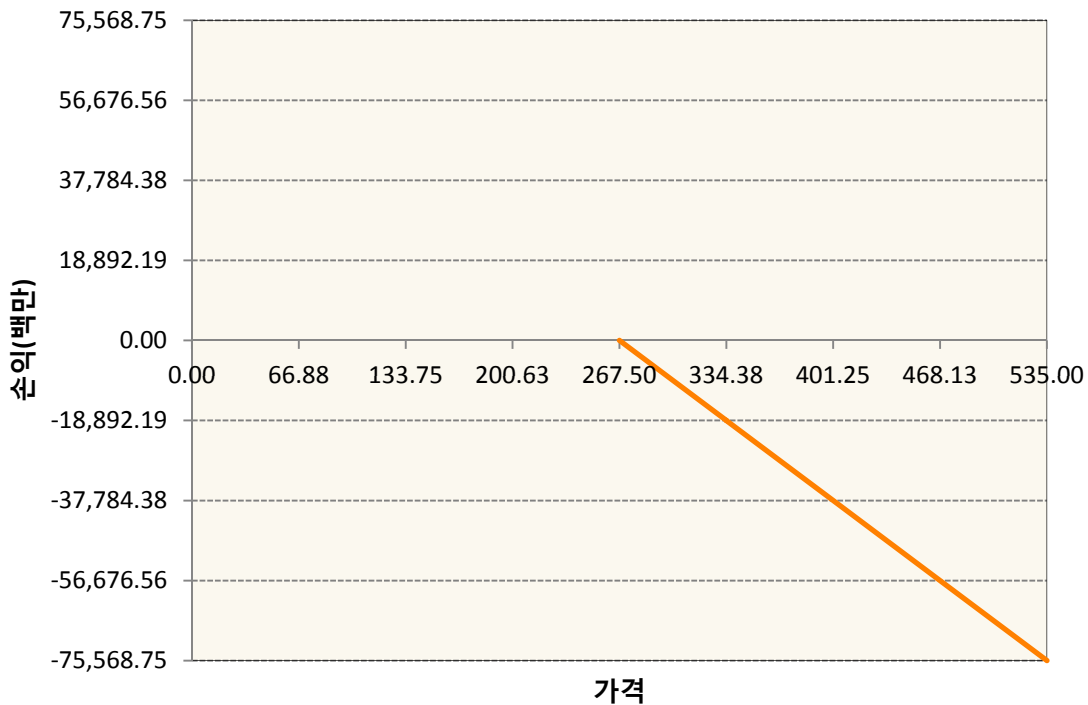
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

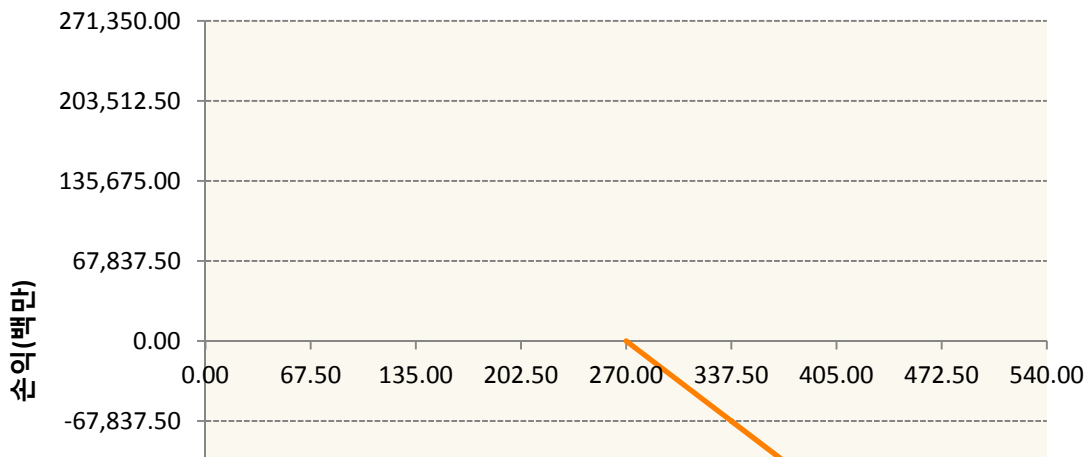
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	514,106	-514,106	장내

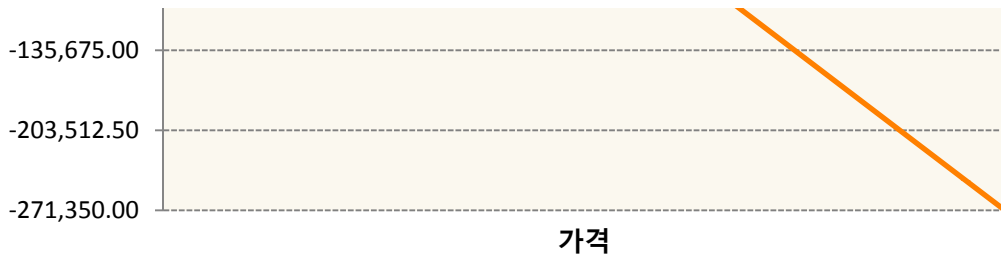
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201PB2677-2019-11 콜267.5**

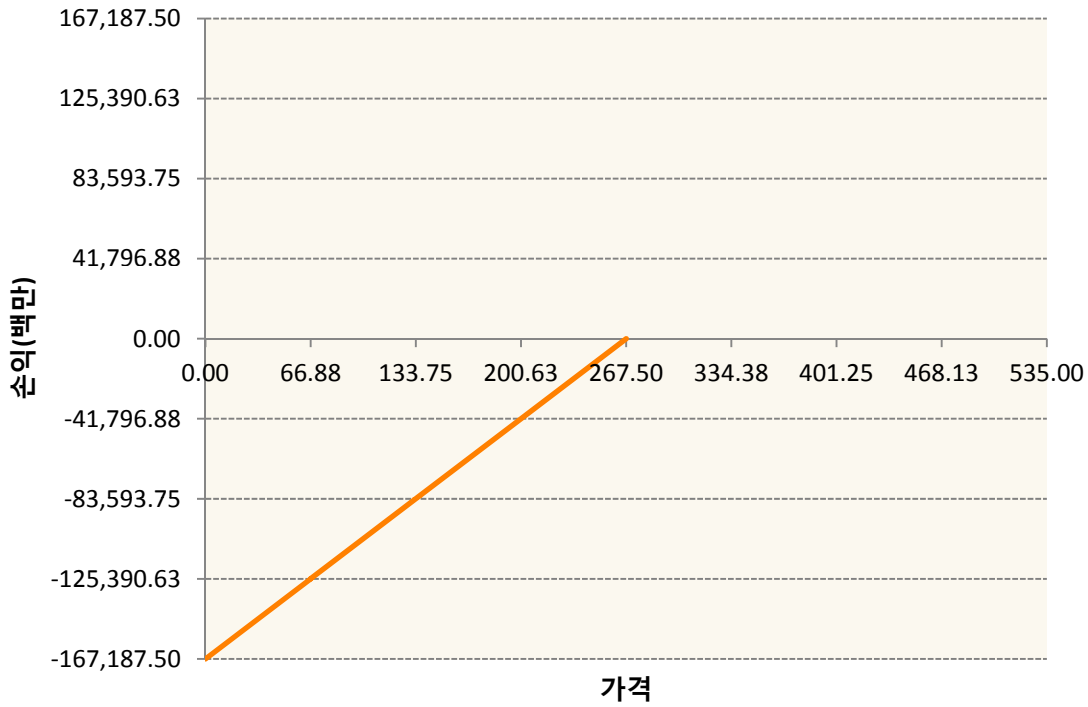


**KR4201PB2701-2019-11 콜270**





KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PB2677		2019-11 콜267.5					5,226	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,041	2,925	2,799	2,664	2,522	2,375	2,223	
-5.33%	2,570	2,404	2,233	2,060	1,884	1,706	1,527	
-2.67%	1,751	1,559	1,367	1,175	983	792	600	
0%	547	367	184	0	-186	-373	-561	
2.67%	-998	-1,138	-1,286	-1,442	-1,604	-1,770	-1,940	
5.33%	-2,789	-2,880	-2,985	-3,102	-3,229	-3,364	-3,507	
8.00%	-4,728	-4,779	-4,844	-4,922	-5,013	-5,115	-5,226	
KR4201PB2701		2019-11 콜270					17,976	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	9,668	9,316	8,920	8,489	8,028	7,542	7,035	

-5.33%	8,327	7,783	7,217	6,633	6,036	5,429	4,813
-2.67%	5,855	5,182	4,507	3,830	3,152	2,473	1,793
0%	2,036	1,361	682	0	-684	-1,369	-2,055
2.67%	-3,066	-3,626	-4,210	-4,813	-5,430	-6,059	-6,697
5.33%	-9,164	-9,554	-9,989	-10,461	-10,965	-11,493	-12,044
8.00%	-15,904	-16,135	-16,419	-16,750	-17,123	-17,534	-17,976
KR4301PB2676                      2019-11 풋267.5							8,904
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,383	-8,433	-8,499	-8,580	-8,676	-8,784	-8,904
-5.33%	-4,233	-4,388	-4,555	-4,732	-4,917	-5,108	-5,304
-2.67%	-1,094	-1,330	-1,567	-1,804	-2,041	-2,278	-2,515
0%	585	398	203	0	-208	-420	-636
2.67%	1,160	1,079	981	866	737	596	445
5.33%	1,281	1,261	1,229	1,185	1,127	1,056	972
8.00%	1,296	1,293	1,286	1,274	1,255	1,227	1,190

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

(단위:백만원)

**30,759**

공시일	2019-10-15
기준일	2019-10-14

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

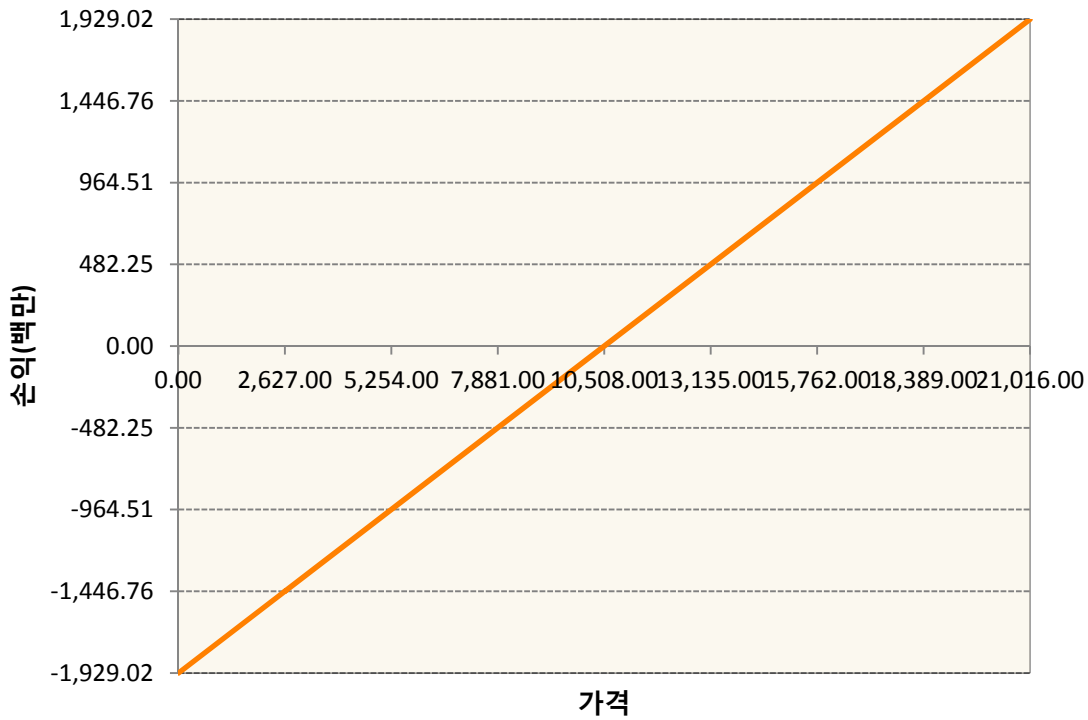
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

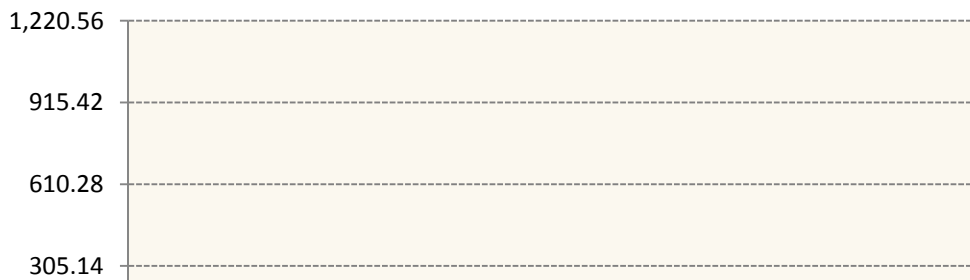
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,929	0	1,929	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,906	-4,906	장내
누계	통화	선도	680	2,807	-2,127	장외

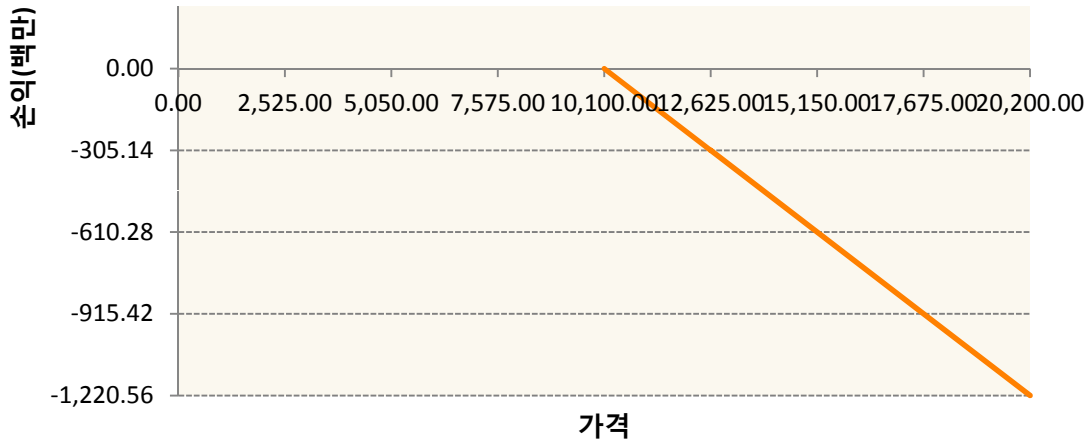
### 2. 만기시점의 손익구조

HCV9-HSCEI Futures Oct19

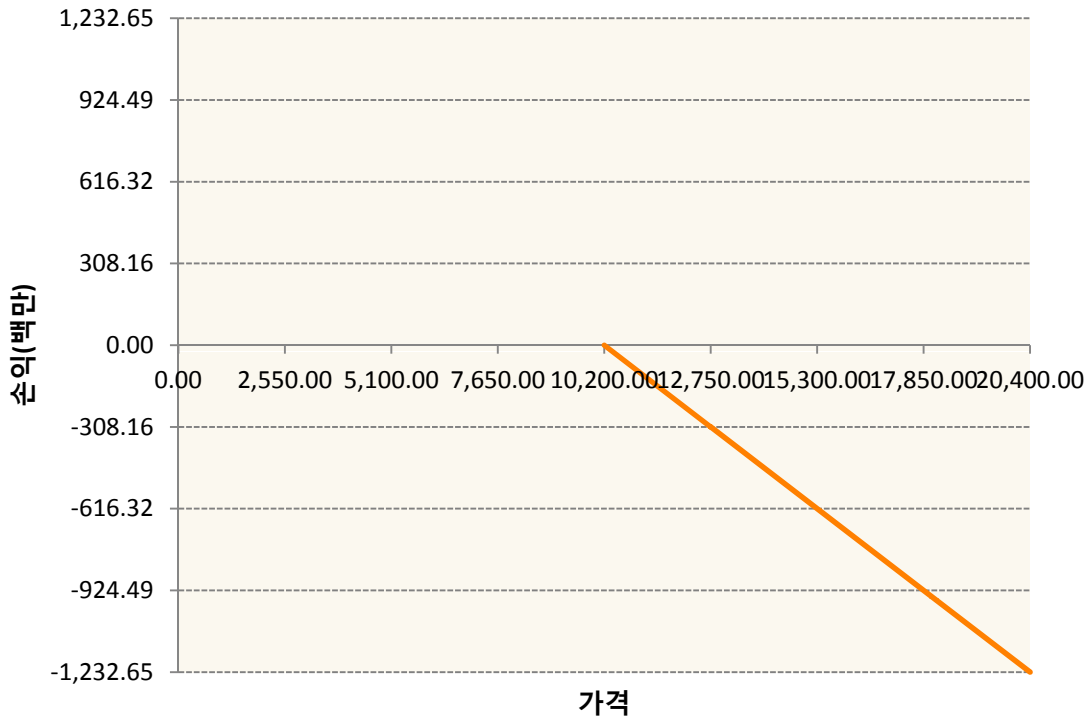


OHHIV9-C101-HSCEI

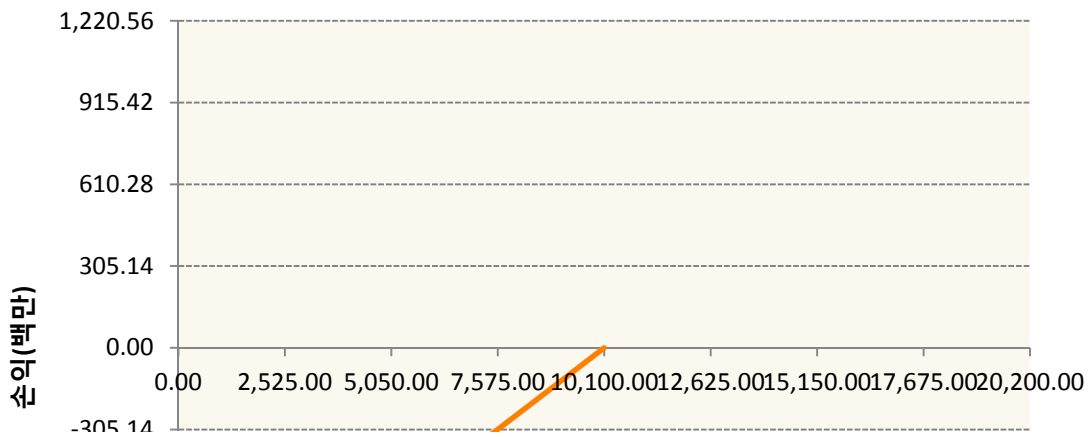


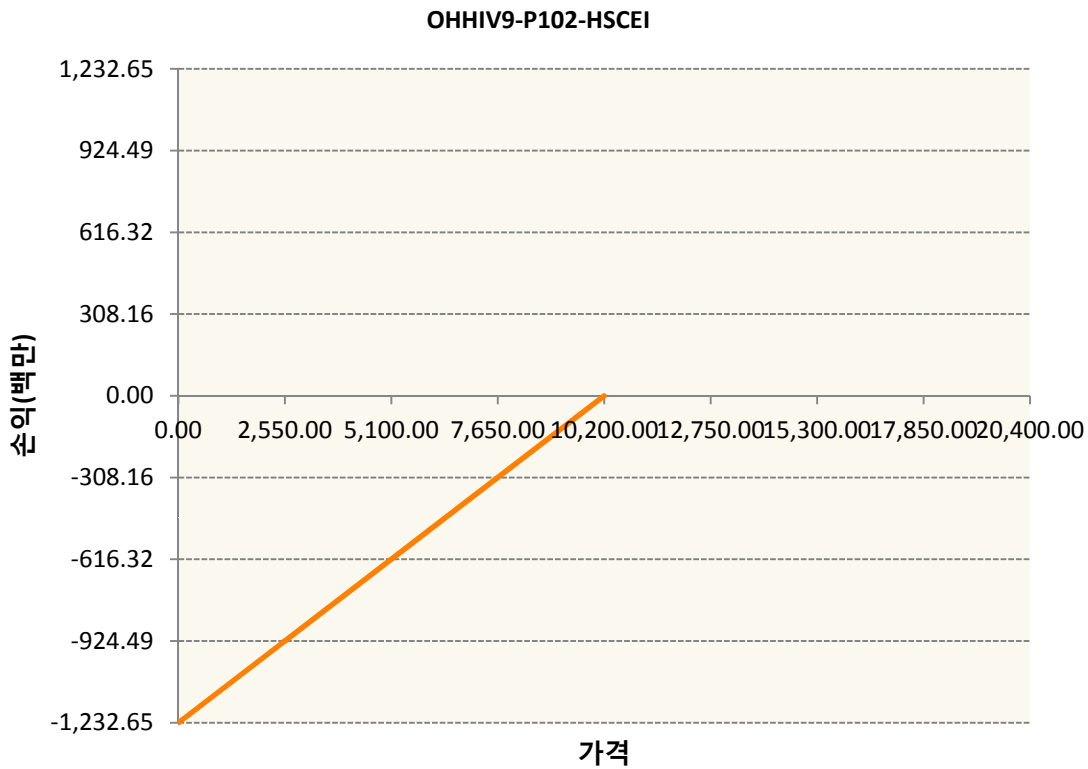


OHHIV9-C102-HSCEI



OHHIV9-P101-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	225
FX21019U00 HKD/KRW 22-11-19E	6
FX21019U02 HKD/KRW 22-11-19E	48
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)
	584

공시일	2019-10-15
기준일	2019-10-14

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

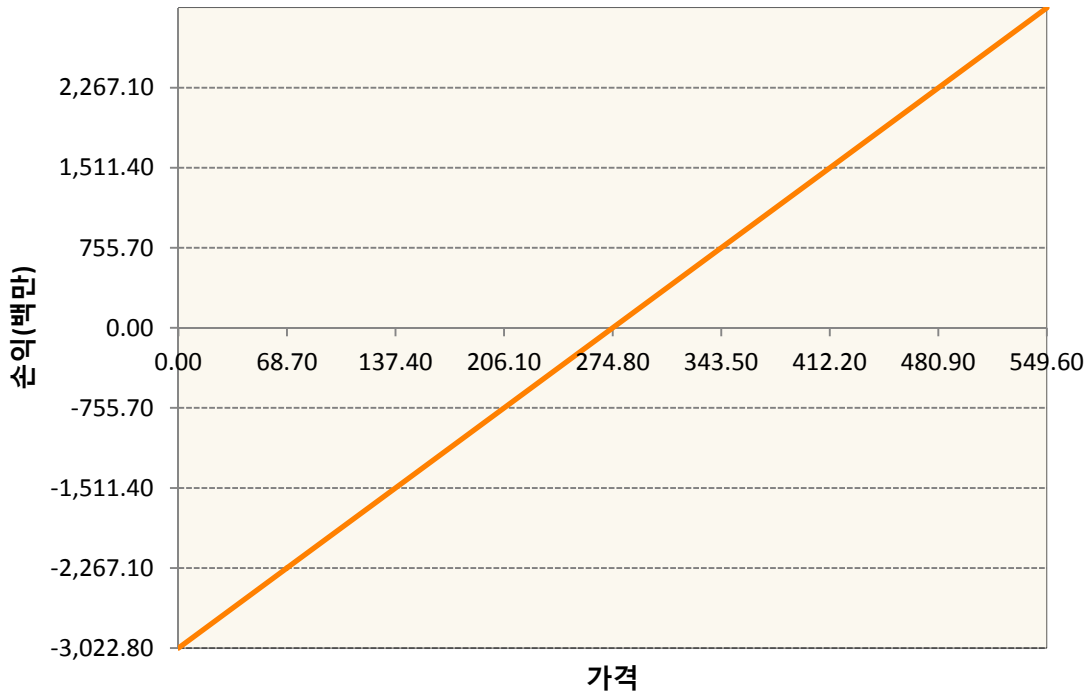
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

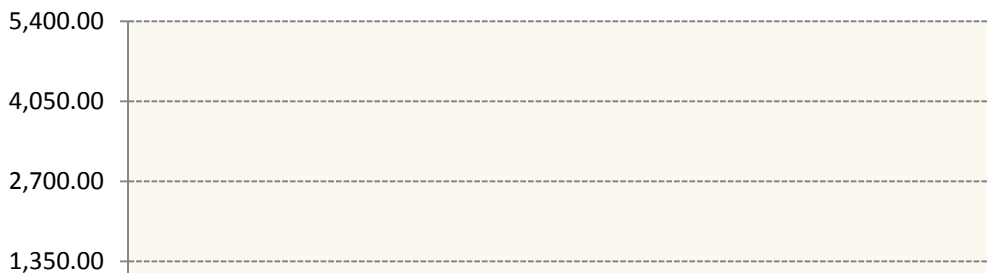
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,023	0	3,023	장내
누계	유가증권	스왑	10,625	0	10,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	10,953	-10,953	장내

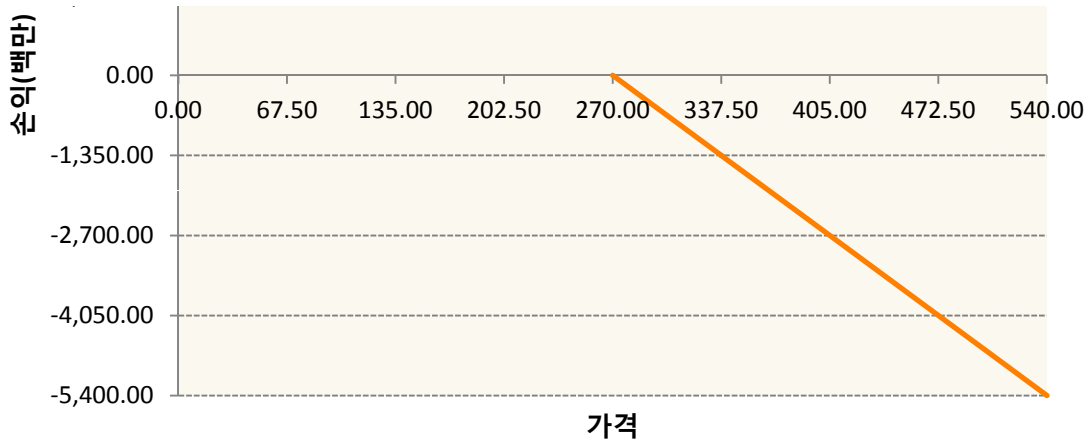
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

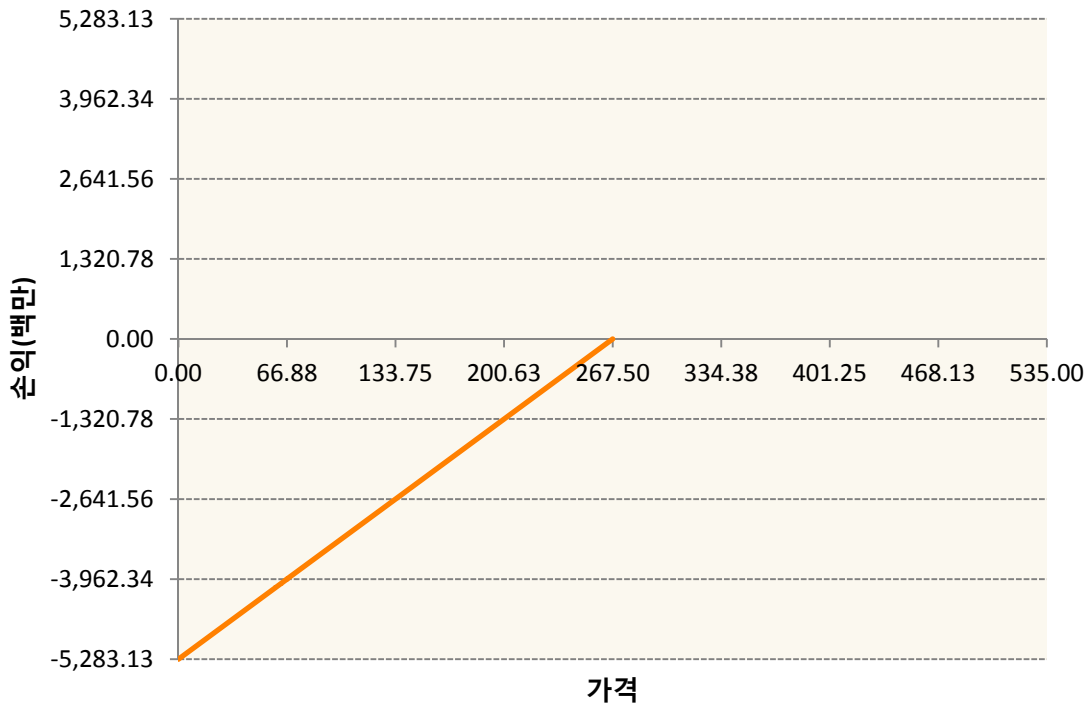


KR4201PB2701-2019-11 콜270

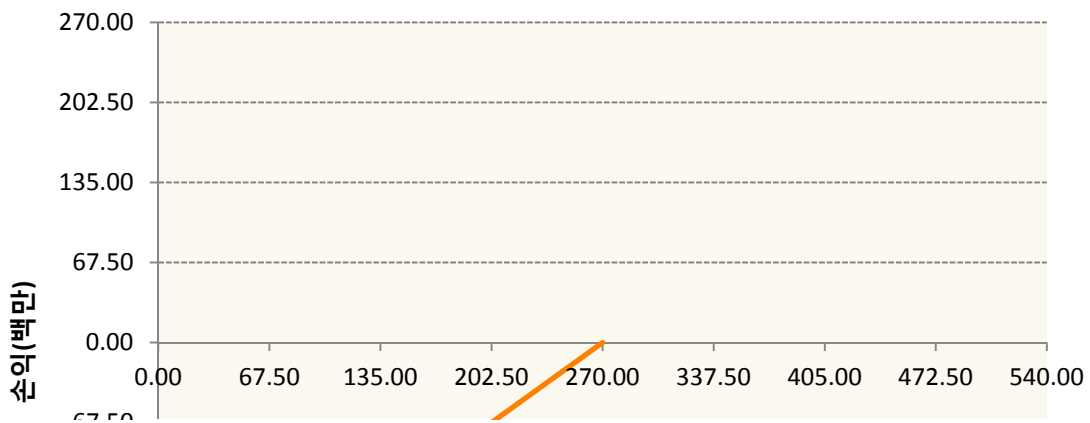


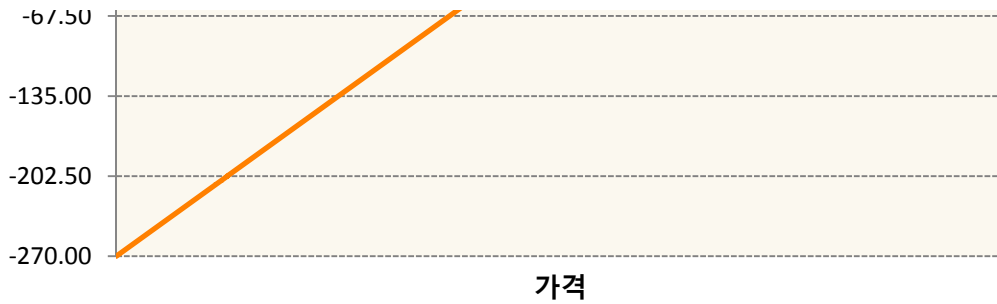


**KR4301PB2676-2019-11 풋267.5**



**KR4301PB2700-2019-11 풋270**





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						915
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-915	-915	-915	-915	-915	-915	-915	
-5.33%	-610	-610	-610	-610	-610	-610	-610	
-2.67%	-305	-305	-305	-305	-305	-305	-305	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	305	305	305	305	305	305	305	
5.33%	610	610	610	610	610	610	610	
8.00%	915	915	915	915	915	915	915	
KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						241
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-241	-241	-241	-241	-241	-241	-241	
-5.33%	-161	-161	-161	-161	-161	-161	-161	
-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%	161	161	161	161	161	161	161	
8.00%	241	241	241	241	241	241	241	
KR4201PB2701		2019-11 콜270						358
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	192	185	178	169	160	150	140	
-5.33%	166	155	144	132	120	108	96	
-2.67%	117	103	90	76	63	49	36	
0%	41	27	14	0	-14	-27	-41	
2.67%	-61	-72	-84	-96	-108	-121	-133	
5.33%	-182	-190	-199	-208	-218	-229	-240	
8.00%	-317	-321	-327	-333	-341	-349	-358	
KR4301PB2676		2019-11 풋267.5						281
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-265	-266	-269	-271	-274	-278	-281
-5.33%	-134	-139	-144	-150	-155	-161	-168
-2.67%	-35	-42	-50	-57	-64	-72	-79
0%	18	13	6	0	-7	-13	-20
2.67%	37	34	31	27	23	19	14
5.33%	40	40	39	37	36	33	31
8.00%	41	41	41	40	40	39	38
KR4301PB2700                      2019-11 풋270							16
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-16
-5.33%	-8	-8	-9	-9	-9	-9	-10
-2.67%	-2	-3	-3	-3	-4	-4	-5
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	2	2	2	2	2	1	1
5.33%	3	3	3	3	2	2	2
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

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

(단위:백만원)

**1,748**

공시일	2019-10-15
기준일	2019-10-14

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

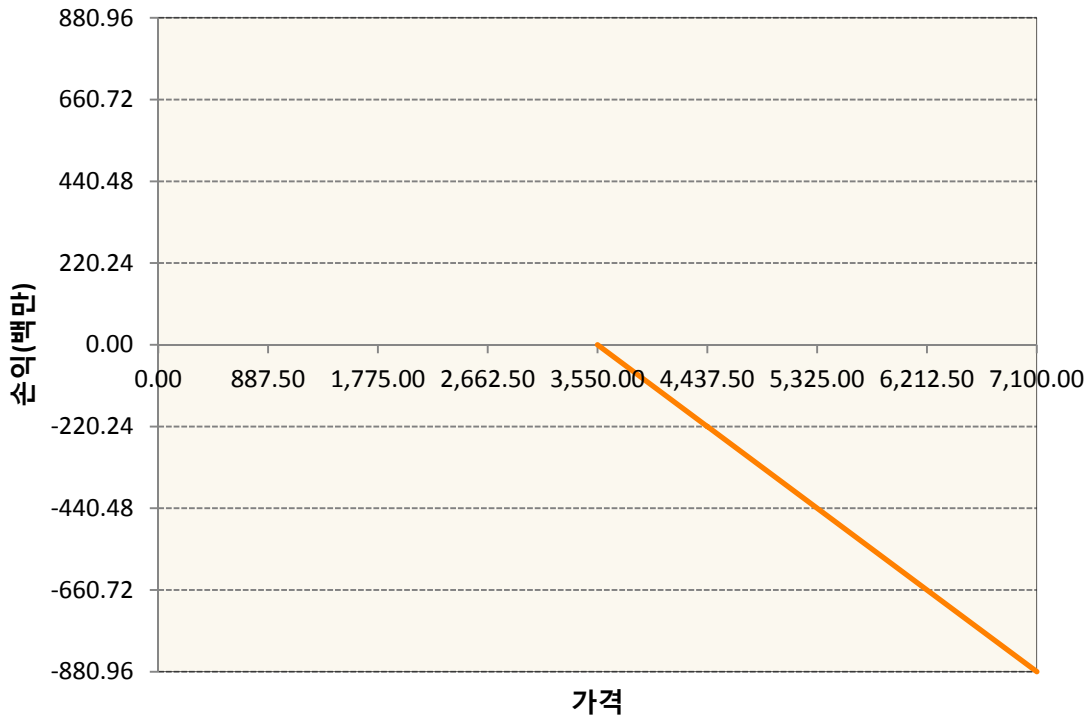
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

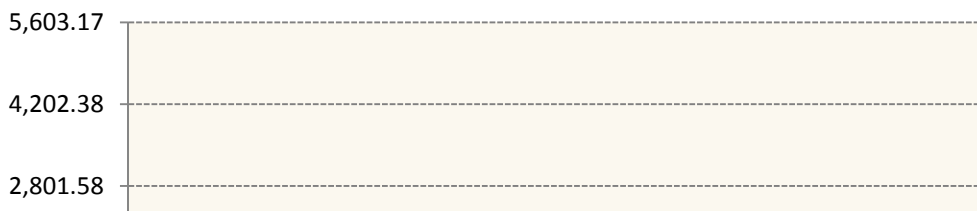
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,598	0	3,598	
누계	유가증권	스왑	23,767	0	23,767	장외
누계	유가증권	옵션	0	12,968	-12,968	장내
누계	통화	선도	0	6,139	-6,139	장외

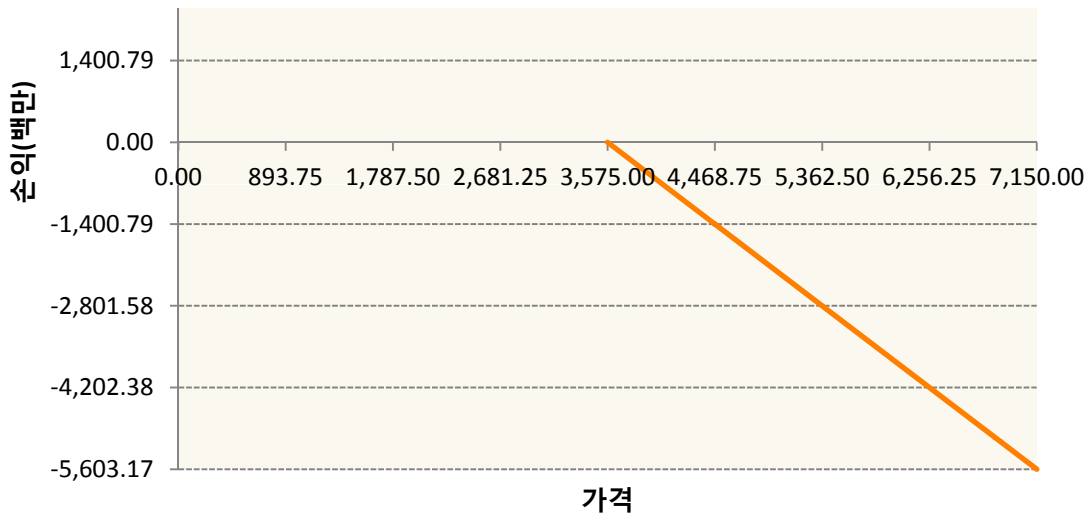
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXV9-C3550-EURO STOXX 50**

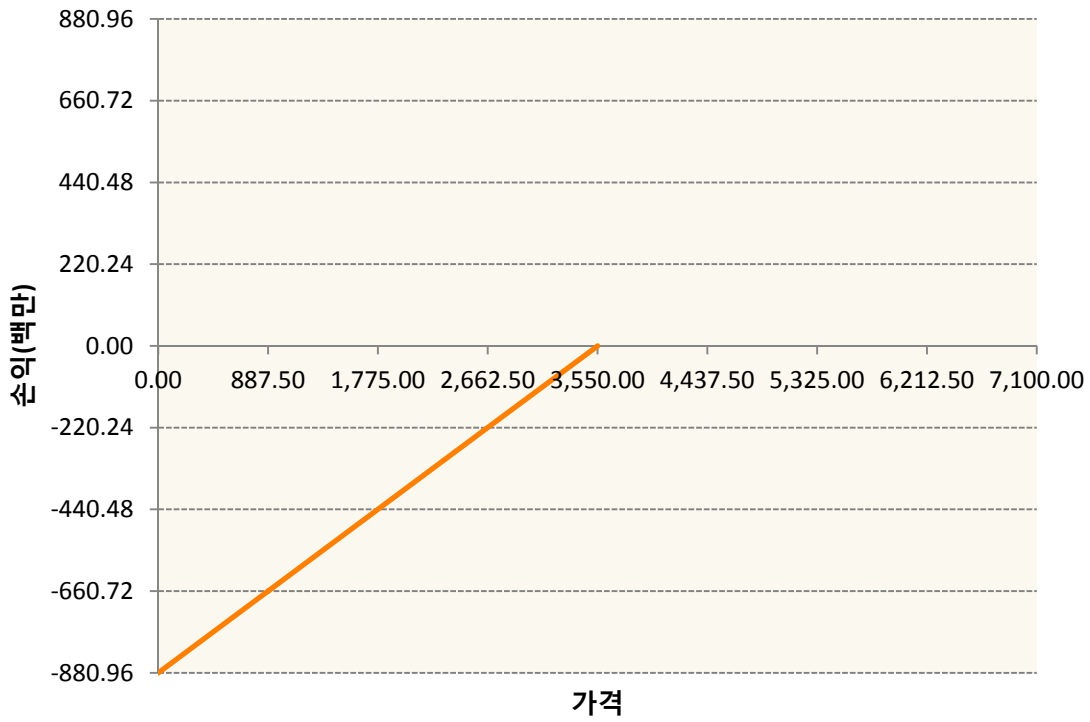


**OESXV9-C3575-EURO STOXX 50**

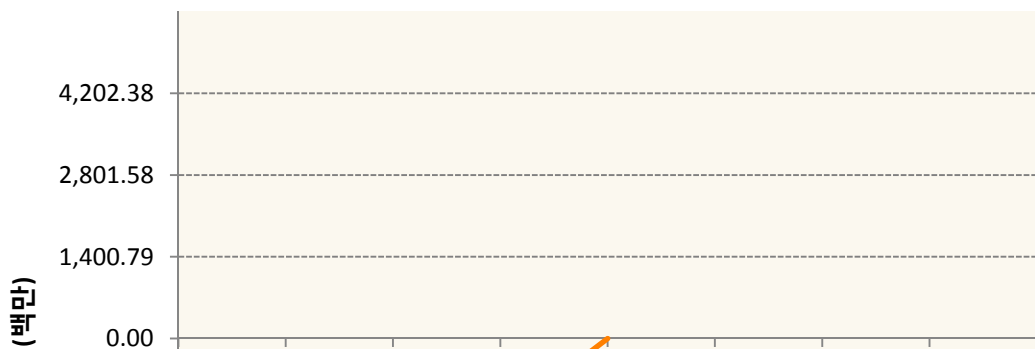


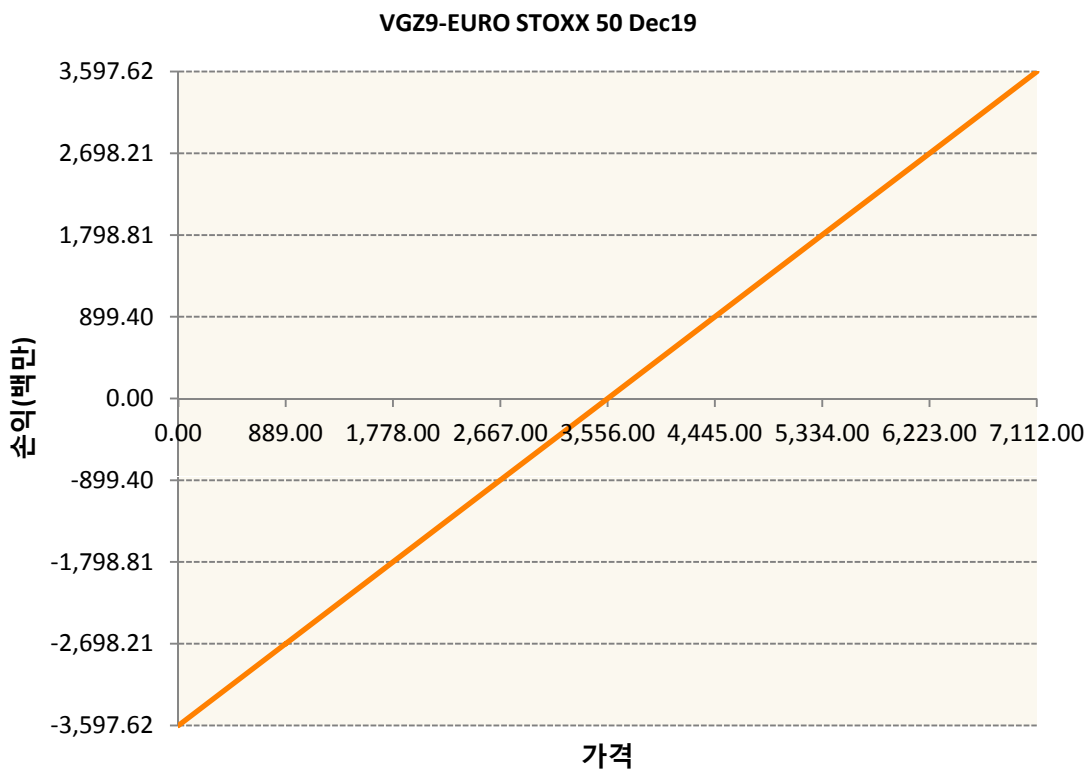
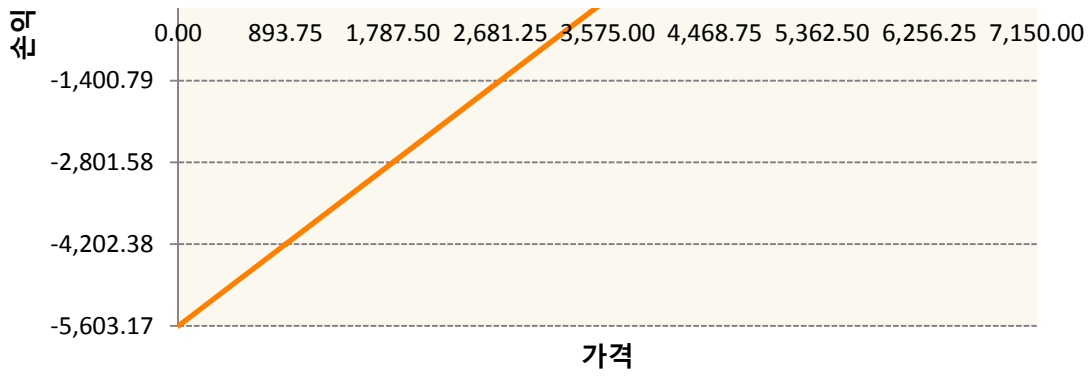


OESXV9-P3550-EURO STOXX 50



OESXV9-P3575-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		10
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E		491
OESXV9-C35 EURO STOXX 50		70
OESXV9-C35 EURO STOXX 50		448
OESXV9-P35 EURO STOXX 50		70
OESXV9-P35 EURO STOXX 50		448
VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	288

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





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

(단위:백만원)

995



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

(단위:백만원)

86



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

(단위:백만원)

134

공시일	2019-10-15
기준일	2019-10-14

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

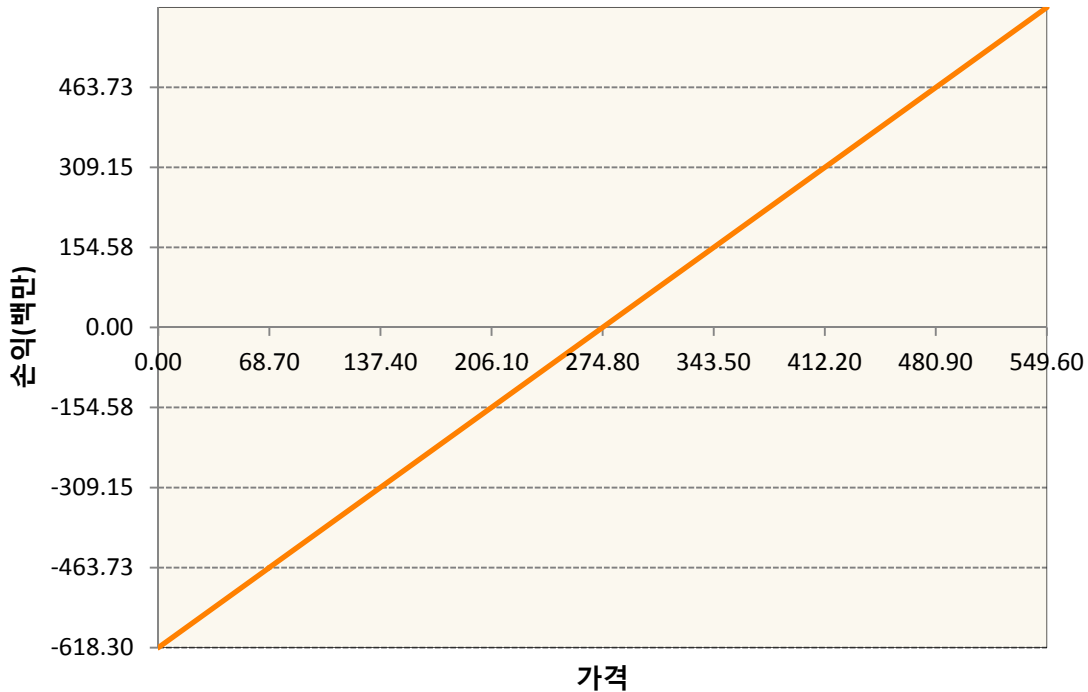
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	618	0	618	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002      2019-12 코스피200지수선물      49

가격	기초자산의 변동성						
	-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	2019-10-15
기준일	2019-10-14

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

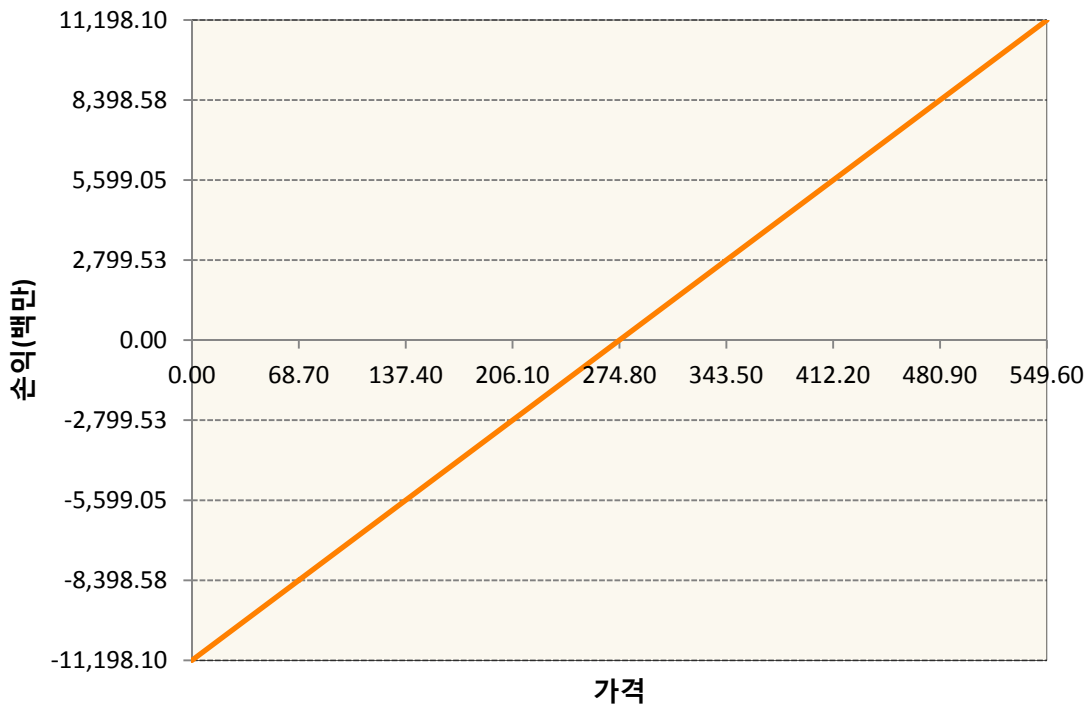
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

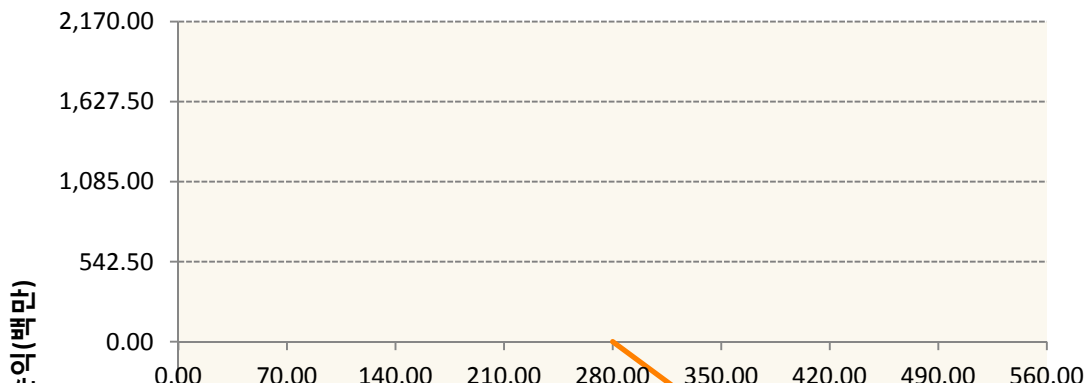
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	69	-69	장내
신규	유가증권	옵션	70	0	70	장내
누계	유가증권	선물	11,198	0	11,198	장내
누계	유가증권	옵션	3,561	20,815	-17,254	장내

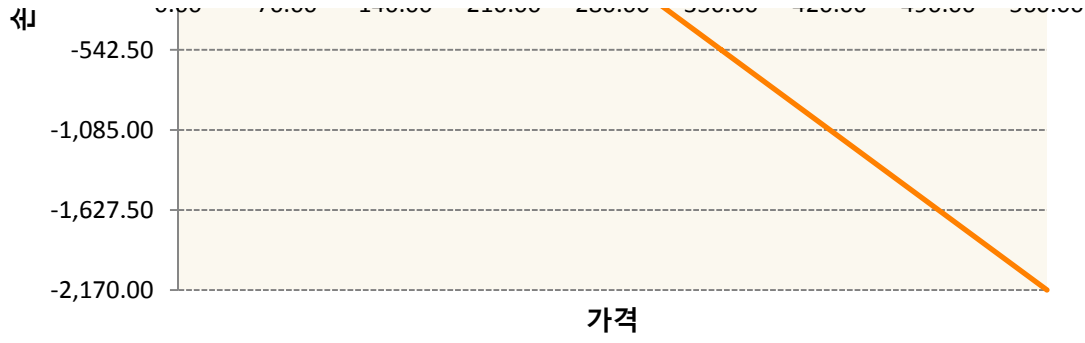
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

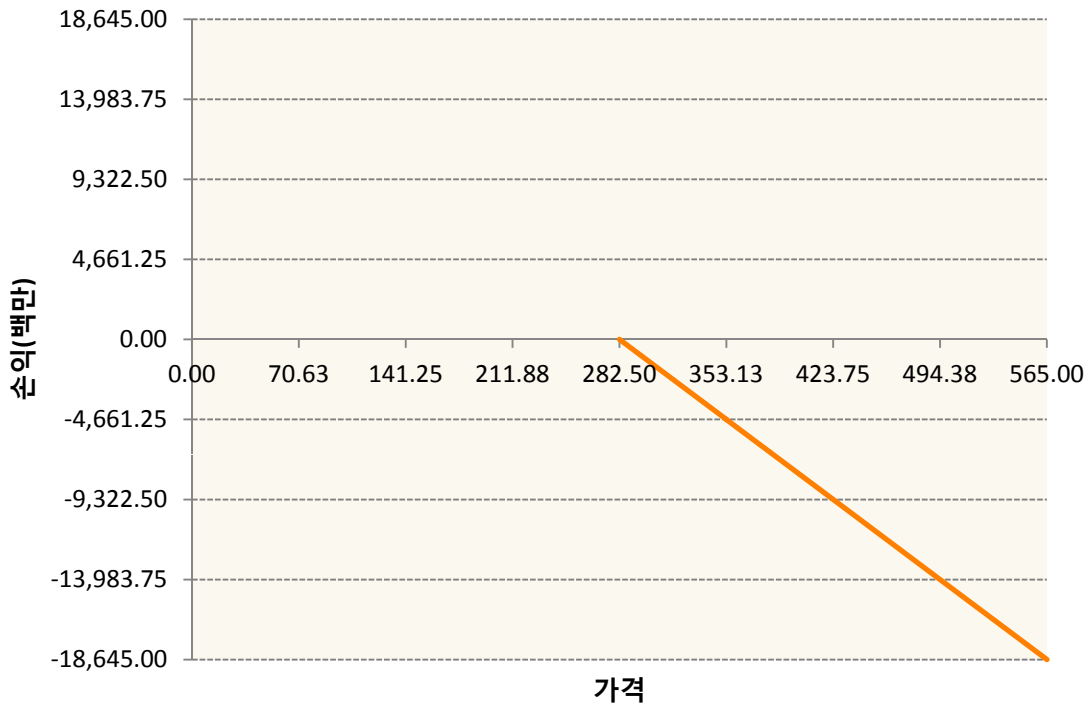


KR4201PB2800-2019-11 콜280

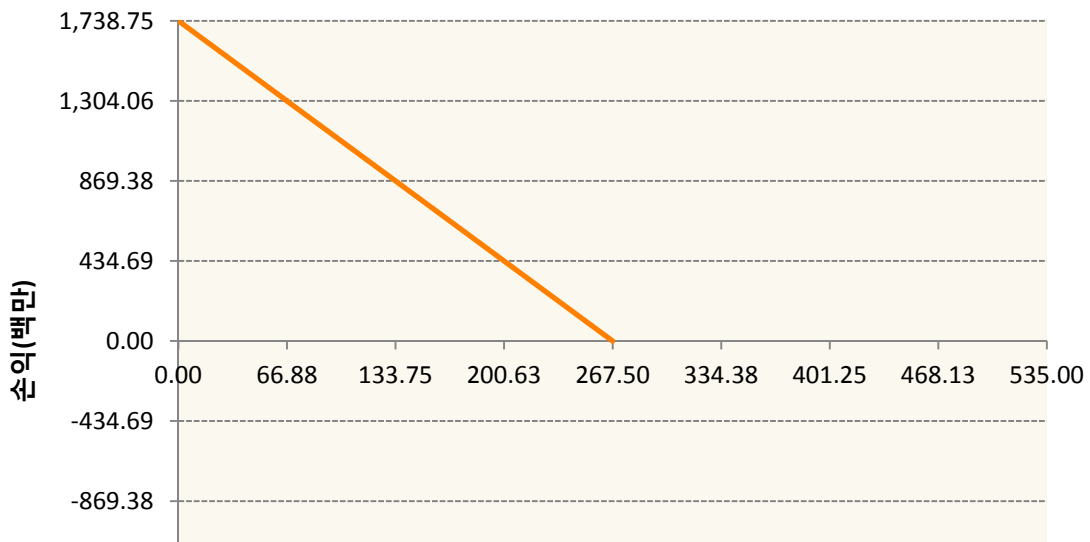


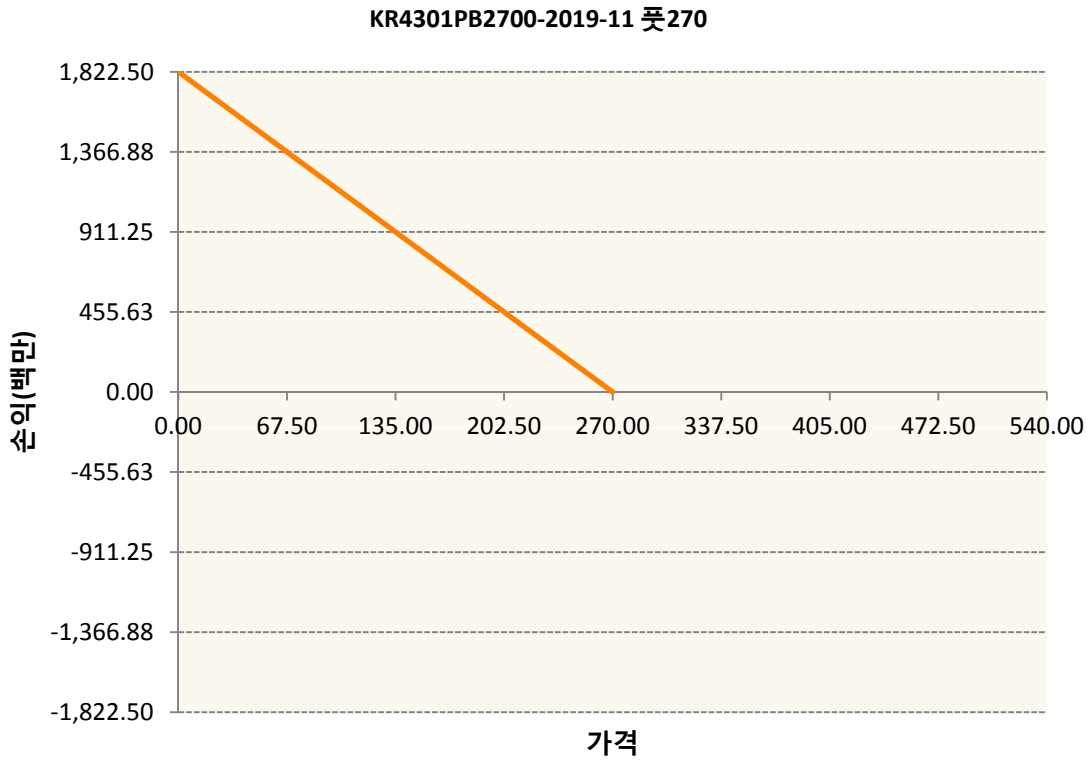
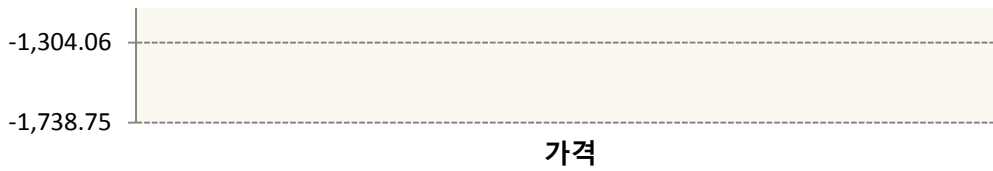


KR4201PB2826-2019-11 콜282.5



KR4301PB2676-2019-11 풋267.5





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

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						894
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-894	-894	-894	-894	-894	-894	-894	
-5.33%	-596	-596	-596	-596	-596	-596	-596	
-2.67%	-298	-298	-298	-298	-298	-298	-298	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	298	298	298	298	298	298	298	
5.33%	596	596	596	596	596	596	596	
8.00%	894	894	894	894	894	894	894	
KR4201PB2800		2019-11 콜280						116
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	43	42	41	39	37	34	31	
-5.33%	40	37	35	32	28	25	21	
-2.67%	32	28	23	19	15	10	5	

0%	16	10	5	0	-5	-11	-16
2.67%	-10	-16	-21	-27	-32	-38	-43
5.33%	-46	-51	-56	-61	-66	-71	-77
8.00%	-90	-94	-98	-102	-106	-111	-116
KR4201PB2826                      2019-11 콜282.5							931
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	316	308	298	284	268	249	228
-5.33%	294	277	257	234	208	180	150
-2.67%	239	209	177	143	108	71	33
0%	126	85	43	0	-43	-87	-132
2.67%	-64	-111	-158	-205	-253	-300	-347
5.33%	-339	-384	-429	-475	-522	-568	-615
8.00%	-691	-727	-765	-805	-846	-888	-931
KR4301PB2676                      2019-11 풋267.5							93
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	87	88	88	89	90	91	93
-5.33%	44	46	47	49	51	53	55
-2.67%	11	14	16	19	21	24	26
0%	-6	-4	-2	0	2	4	7
2.67%	-12	-11	-10	-9	-8	-6	-5
5.33%	-13	-13	-13	-12	-12	-11	-10
8.00%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-12
KR4301PB2700                      2019-11 풋270							106
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	101	102	102	103	104	104	106
-5.33%	55	56	57	59	61	62	64
-2.67%	16	19	21	24	26	29	31
0%	-7	-5	-2	0	2	5	7
2.67%	-17	-16	-14	-12	-11	-9	-7
5.33%	-19	-19	-18	-18	-17	-16	-14
8.00%	-20	-20	-19	-19	-19	-18	-18

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

(단위:백만원)

1,783

공시일	2019-10-15
기준일	2019-10-14

## 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	143,998	0	143,998	

### 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	2019-10-15
기준일	2019-10-14

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,555	0	3,555	
누계	유가증권	수익증권	188,040	0	188,040	

### 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	2019-10-15
기준일	2019-10-14

## 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	406,674	0	406,674	
누계	통화	선도	0	459,149	-459,149	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,886
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,507
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		948
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		948
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E		190
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E		2,313
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E		1,706
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E		190
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E		948
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E		1,460
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		2,948
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		3,128
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		2,597
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E		1,896
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E		1,991
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E		948
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		664
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E		1,555
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		701
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E		1,706
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		2,503

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

(단위:백만원)

**11,939**

공시일	2019-10-15
기준일	2019-10-14

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

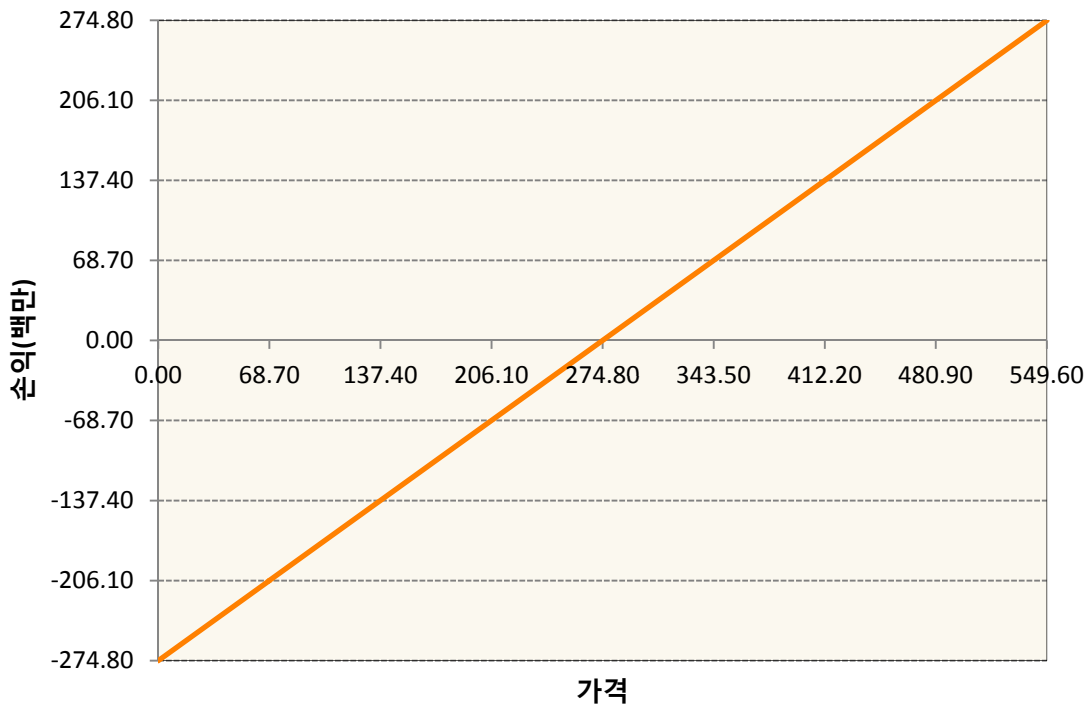
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

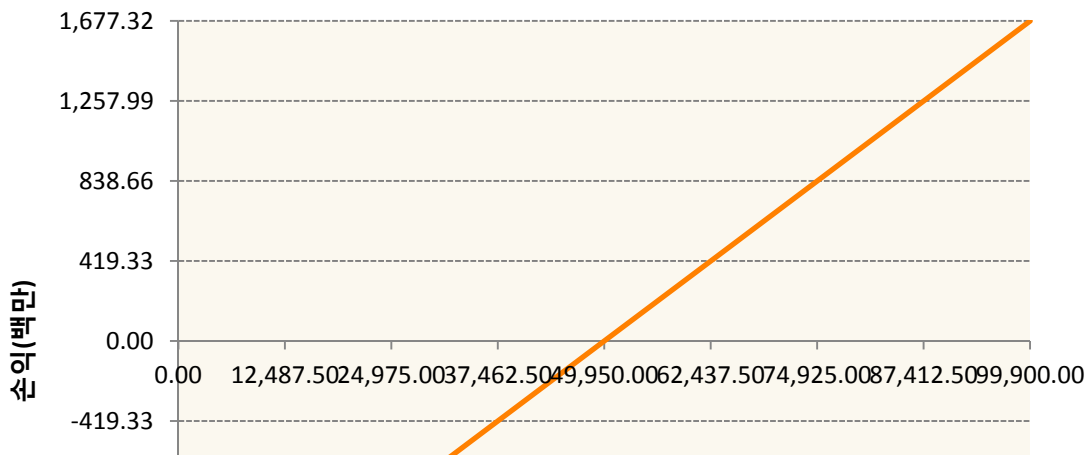
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,952	0	1,952	장내

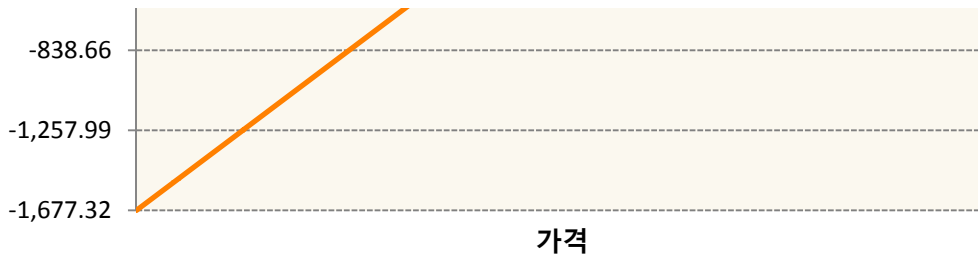
### 2. 만기시점의 손익구조

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%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	
-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%	15	15	15	15	15	15	15	
8.00%	22	22	22	22	22	22	22	
KR4111PB0001		2019-11 삼성전자개별선물						134
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-134	-134	-134	-134	-134	-134	-134	
-5.33%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90	
-2.67%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	45	45	45	45	45	45	45	
5.33%	90	90	90	90	90	90	90	
8.00%	134	134	134	134	134	134	134	

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

**187**

공시일	2019-10-15
기준일	2019-10-14

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

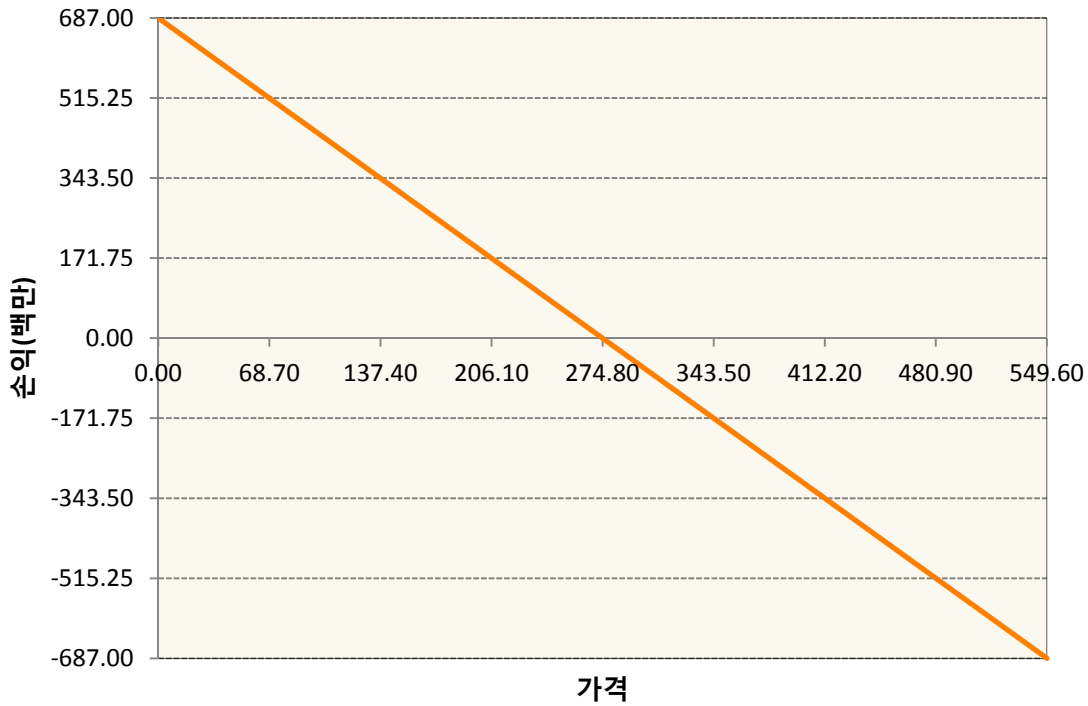
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

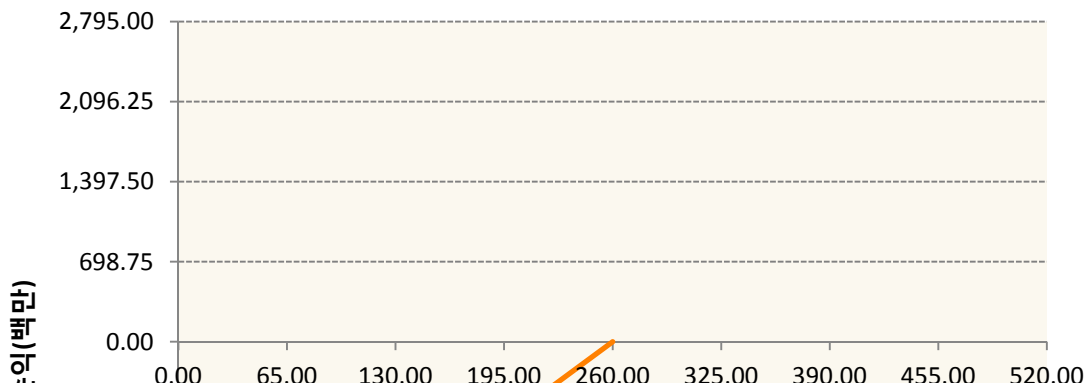
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	687	-687	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,976	-3,976	장내

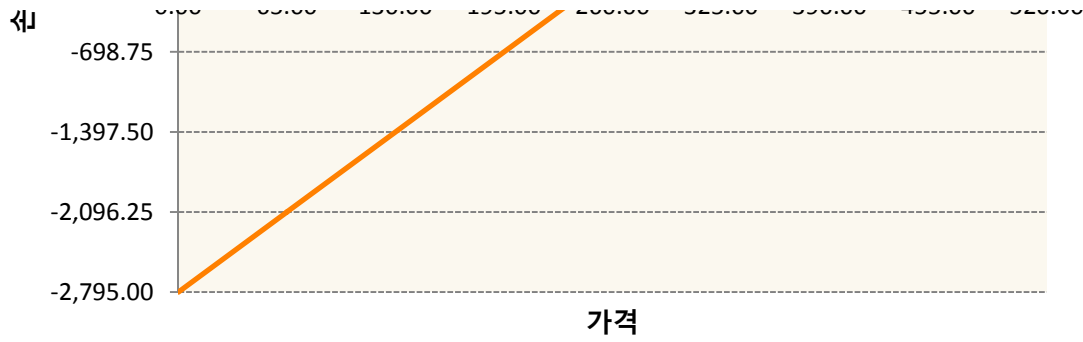
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

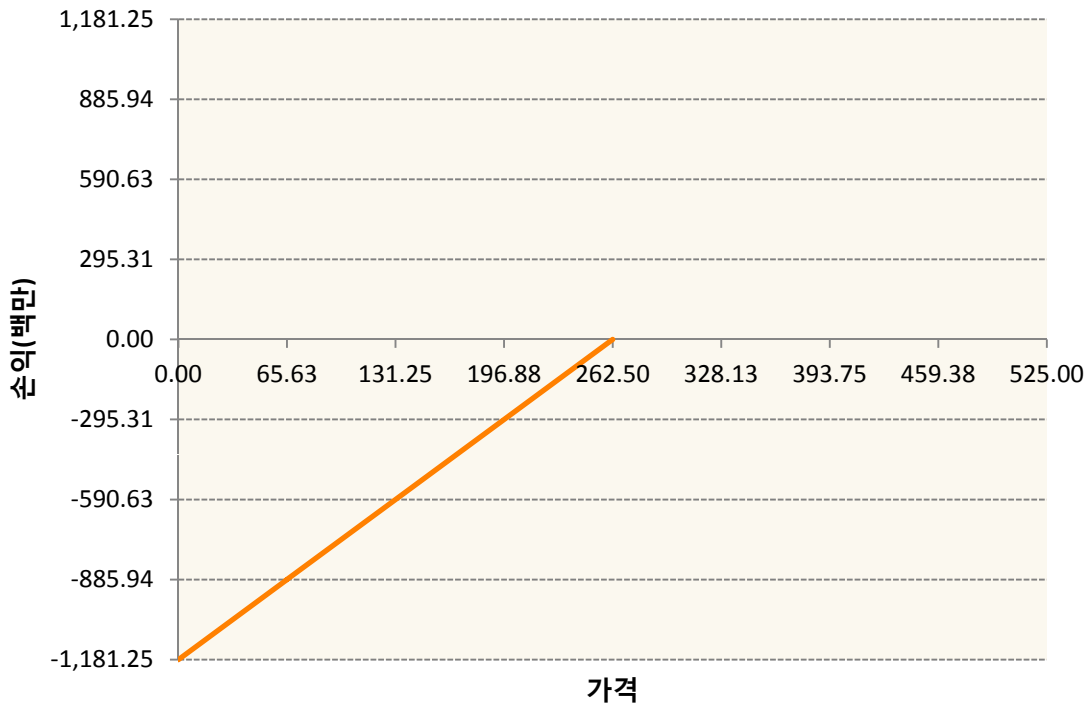


KR4301PB2601-2019-11 풋260





KR4301PB2627-2019-11 풋262.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						55
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	55	55	55	55	55	55	55	
-5.33%	37	37	37	37	37	37	37	
-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%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37	
8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55	
KR4301PB2601		2019-11 풋260						104
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-86	-89	-92	-95	-98	-101	-104
-5.33%	-32	-36	-40	-44	-48	-52	-56
-2.67%	-5	-8	-11	-14	-17	-21	-25
0%	5	3	2	0	-2	-4	-7
2.67%	6	6	6	5	4	3	2
5.33%	7	6	6	6	6	6	5
8.00%	7	7	7	6	6	6	6

KR4301PB2627

2019-11 풋262.5

51

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-44	-45	-46	-47	-48	-49	-51
-5.33%	-19	-20	-22	-23	-25	-27	-28
-2.67%	-3	-5	-6	-8	-10	-11	-13
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	4	4	4	3	3	2	1
5.33%	4	4	4	4	4	4	3
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

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

(단위:백만원)

157

공시일	2019-10-15
기준일	2019-10-14

## 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	16,480	0	16,480	
누계	통화	선도	1,232	17,537	-16,304	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		322
FX21019U03 KRW/USD 18-10-19E		474
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		607
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)

488
-----

공시일	2019-10-15
기준일	2019-10-14

## 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	301	0	301	장외
누계	통화	선도	117	209	-91	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)

<b>33</b>
-----------

공시일	2019-10-15
기준일	2019-10-14

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

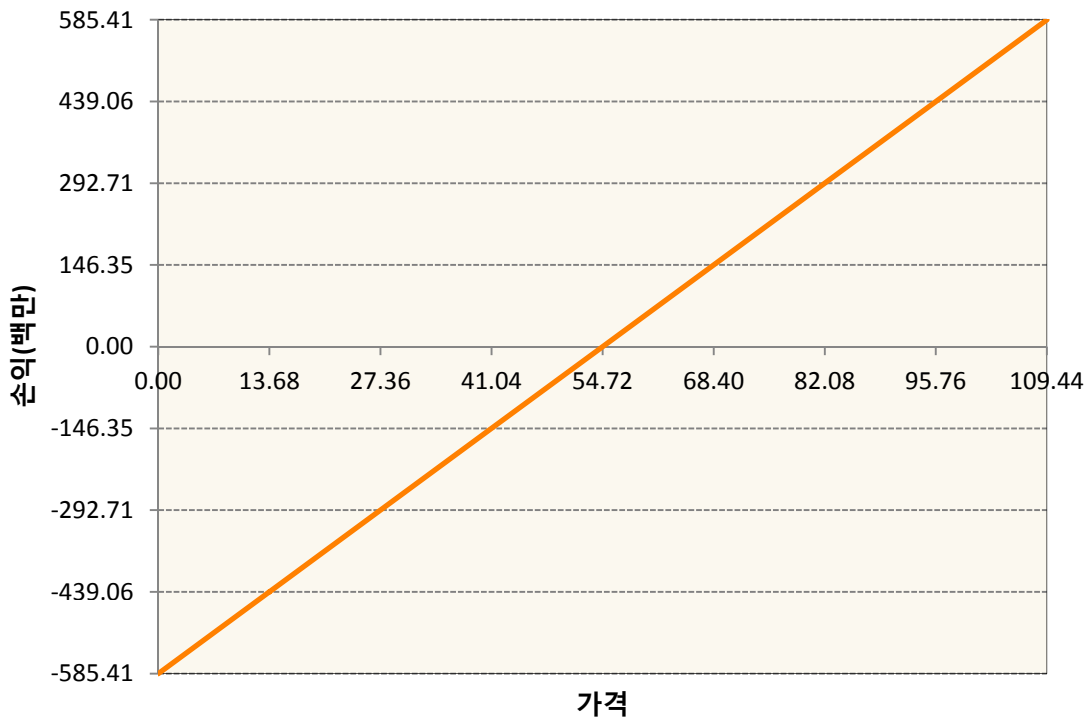
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

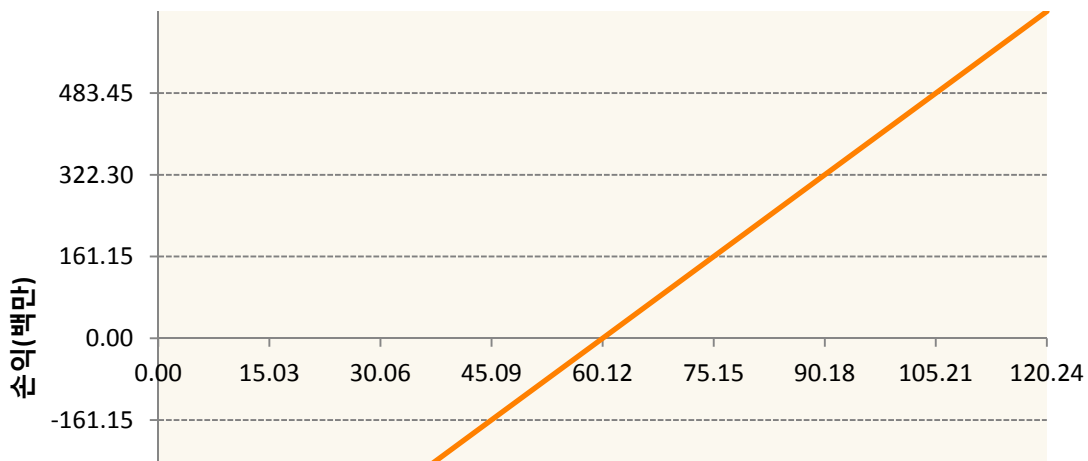
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,512	296	2,216	

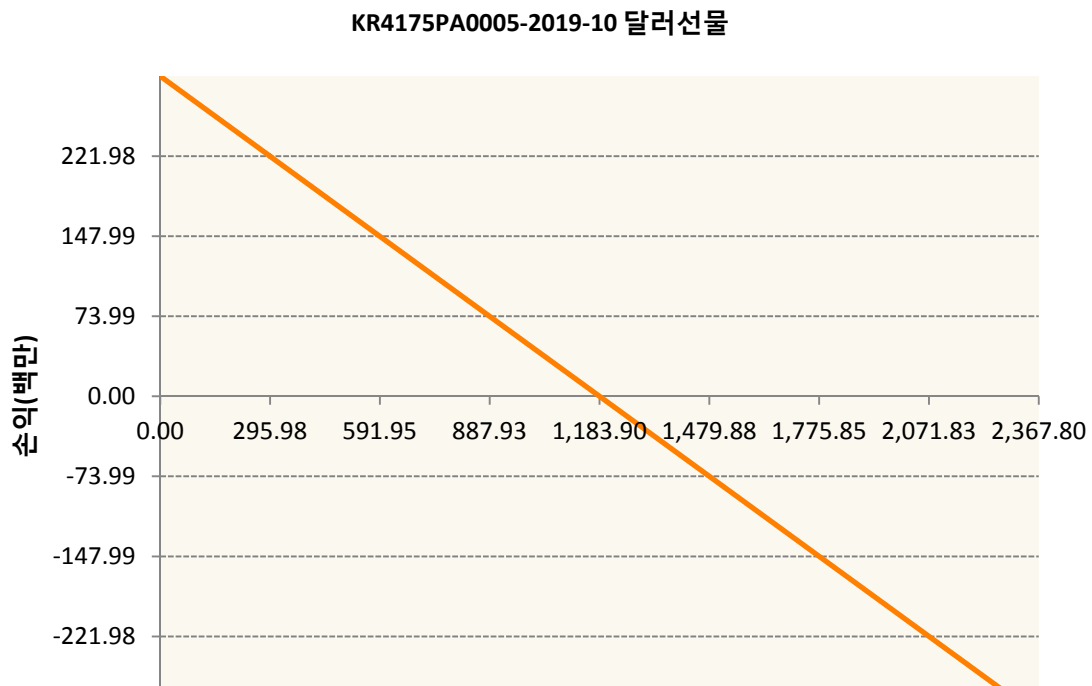
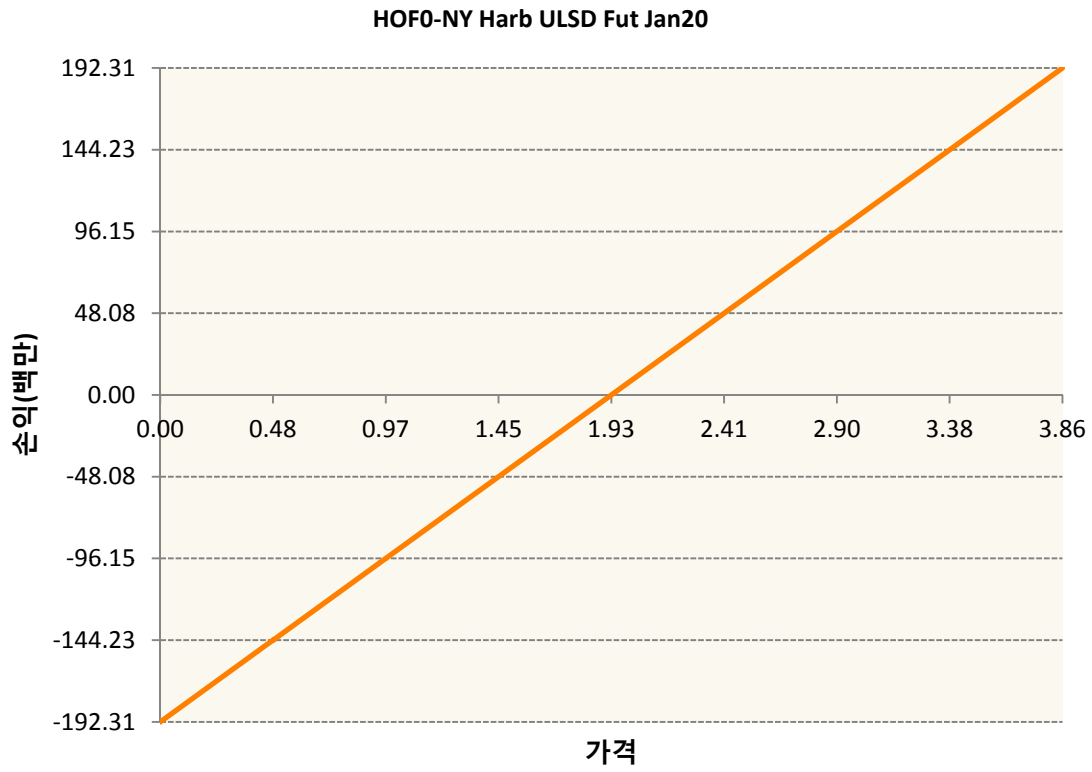
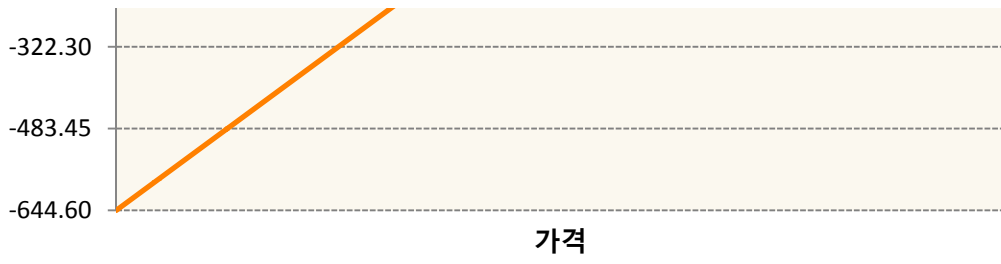
### 2. 만기시점의 손익구조

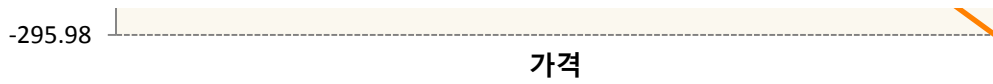
CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20



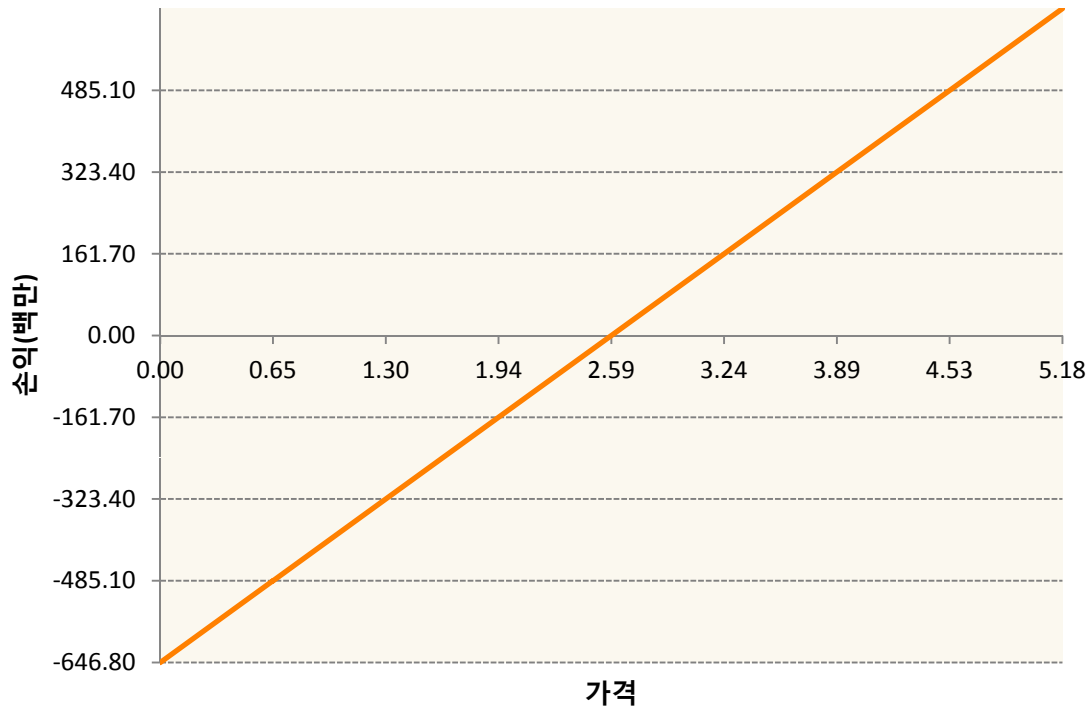
COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20



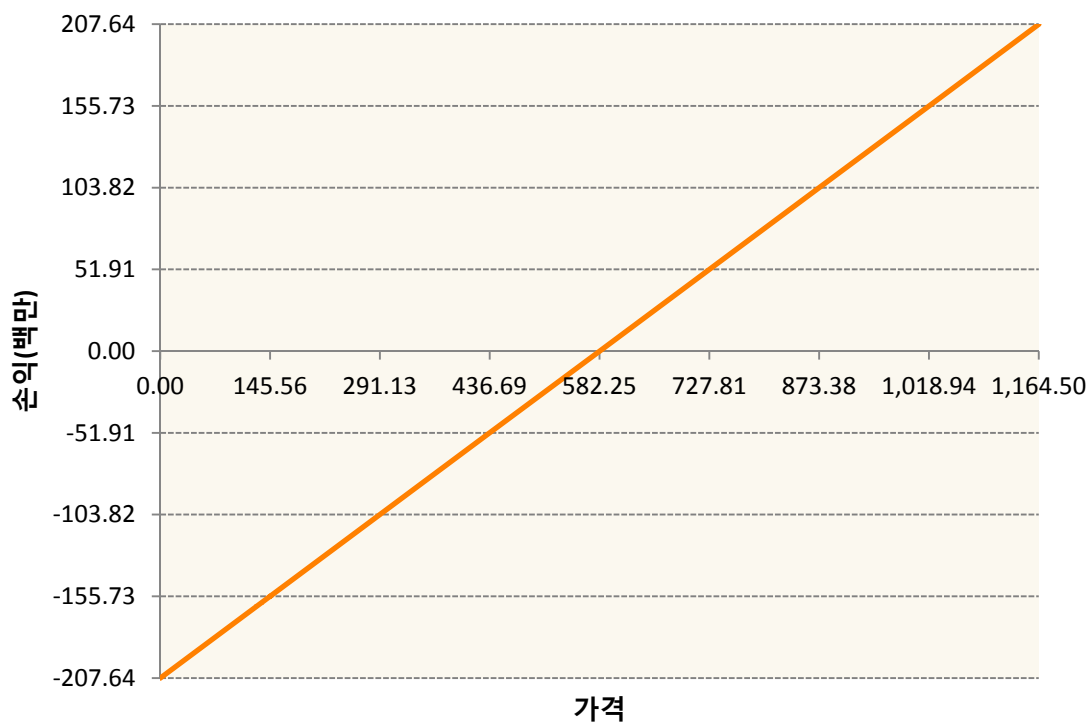




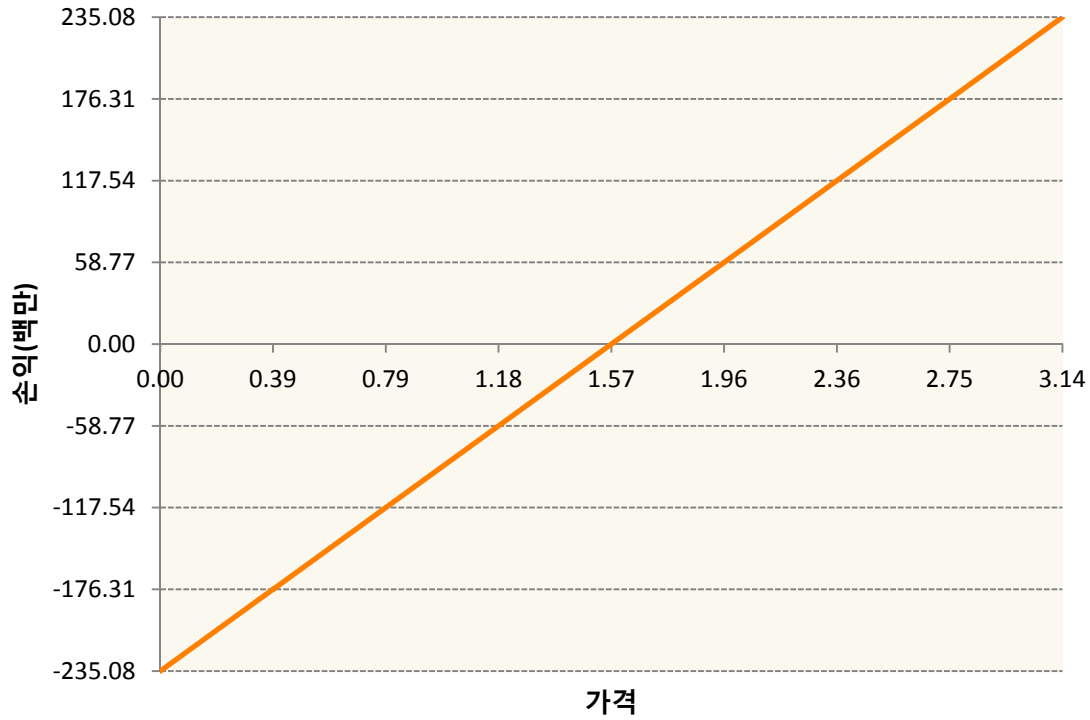
NGF20-NATURAL GAS FUTR Jan20



QSF0-Low Su Gasoil G Jan20



XBF0-GASOLINE RBOB FUT Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLF0	WTI CRUDE FUTURE Jan20	47
COF0	BRENT CRUDE FUTR Jan20	52
HOF0	NY Harb ULSD Fut Jan20	15
KR4175PA00	2019-10 달러선물	24
NGF20	NATURAL GAS FUTR Jan20	52
QSF0	Low Su Gasoil G Jan20	17
XBF0	GASOLINE RBOB FUT Jan20	19

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

(단위:백만원)

418

공시일	2019-10-15
기준일	2019-10-14

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

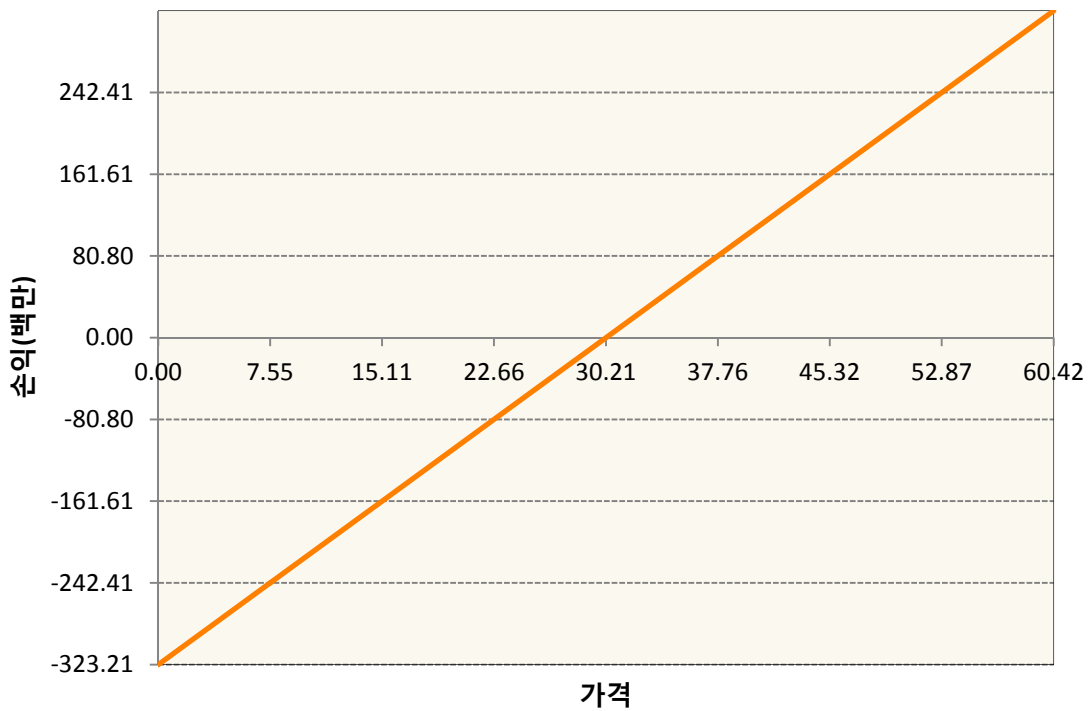
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

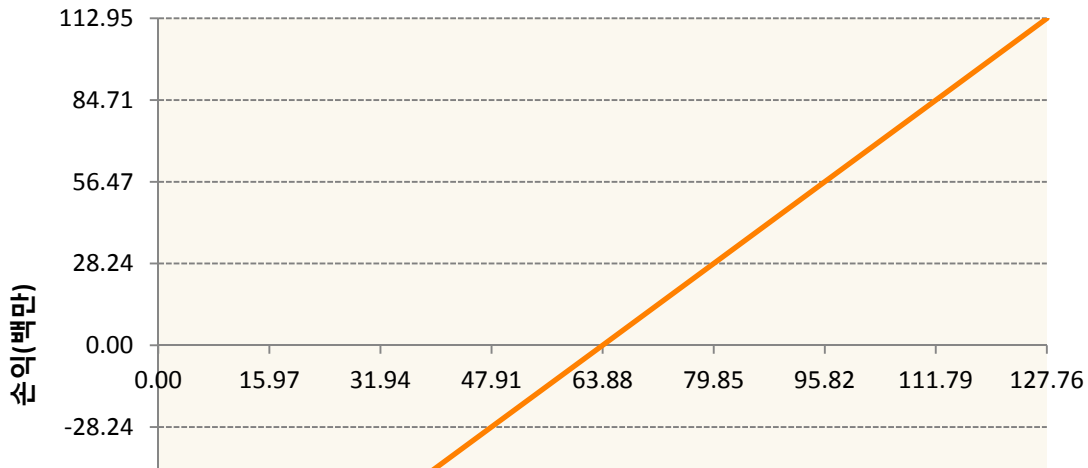
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,869	95	2,774	

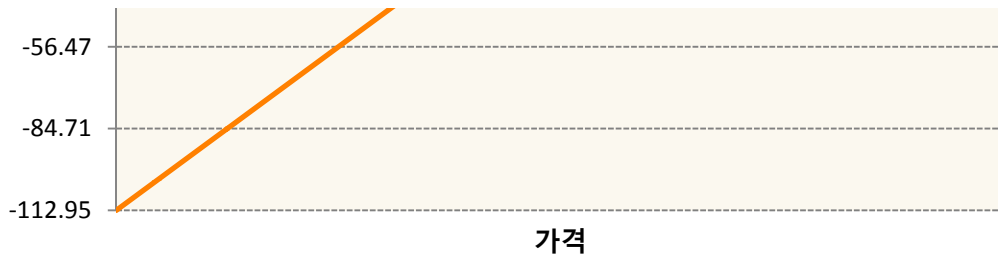
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20**

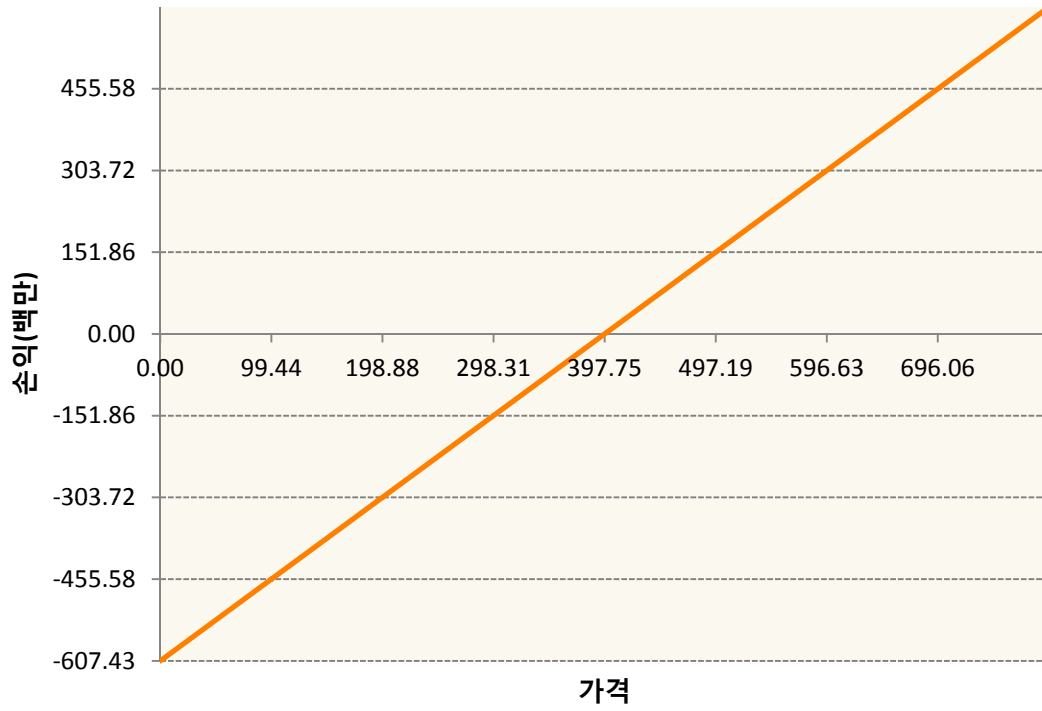


**CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19**

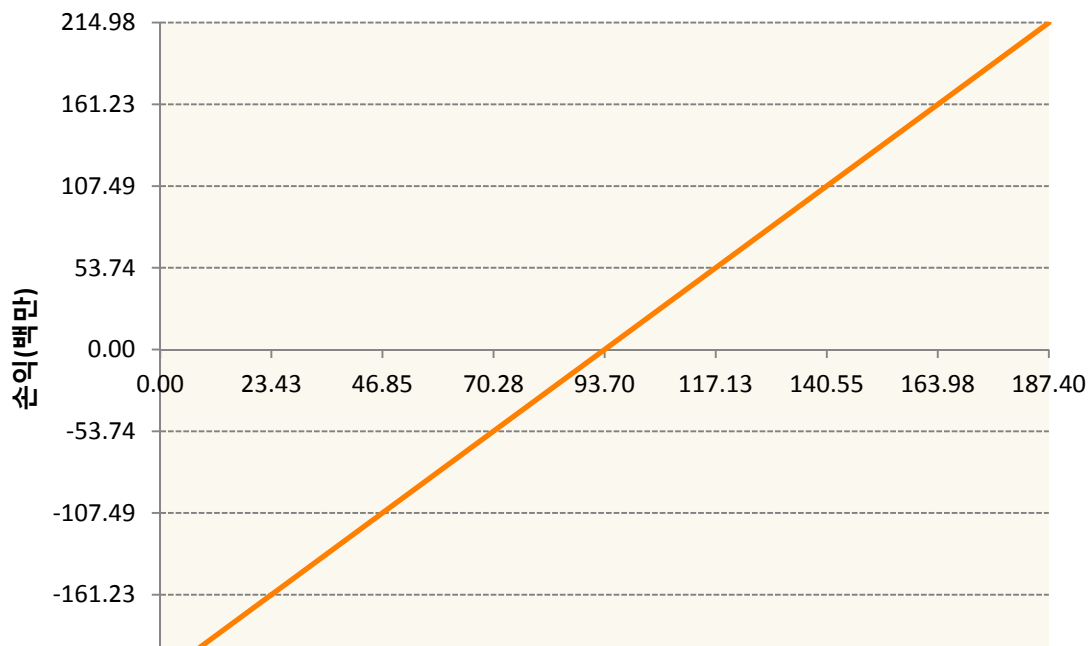


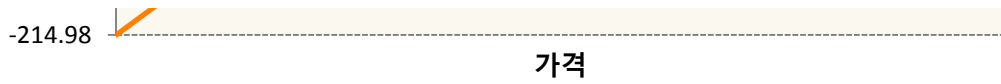


**CZ9-CORN FUTURE Dec19**

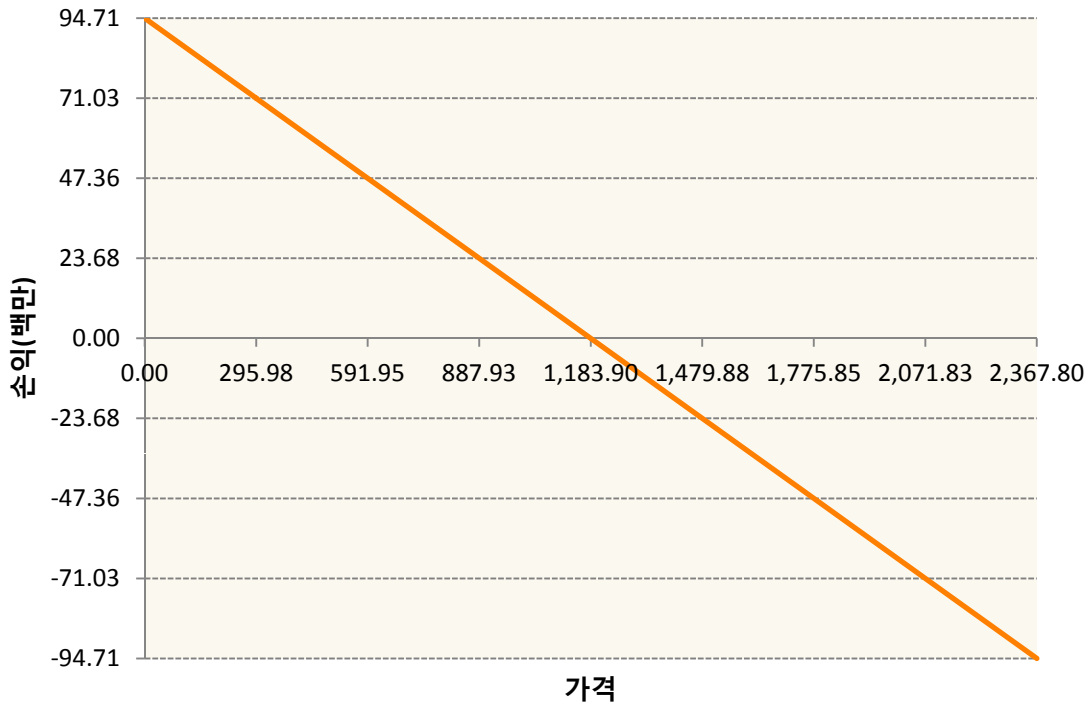


**KCZ9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19**

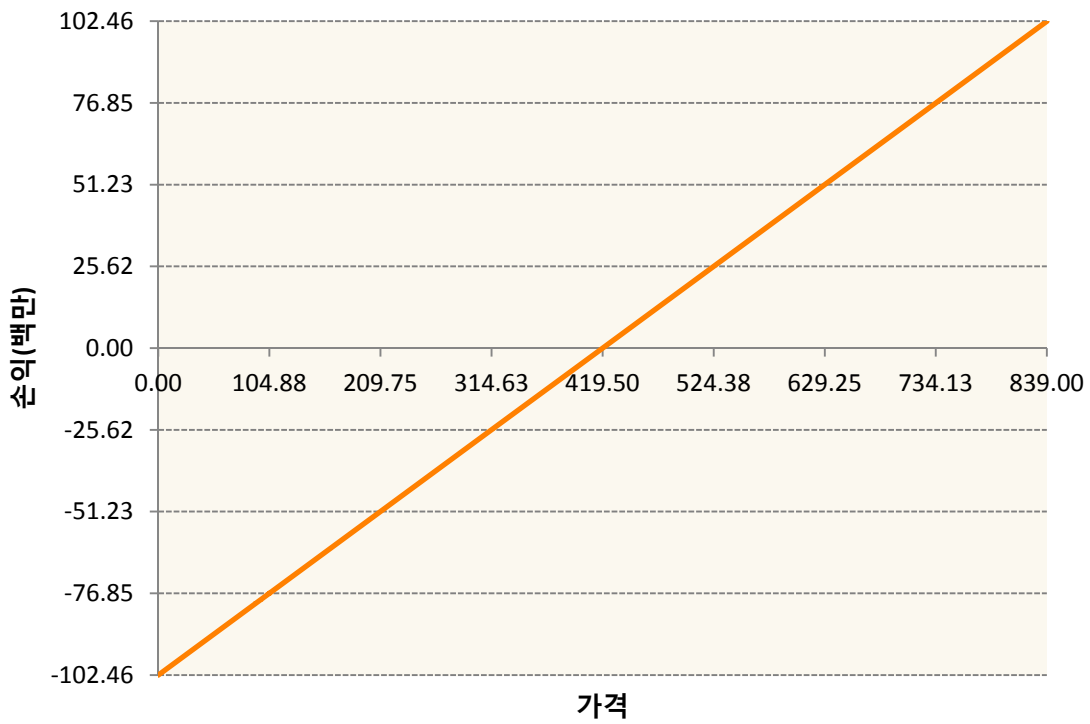




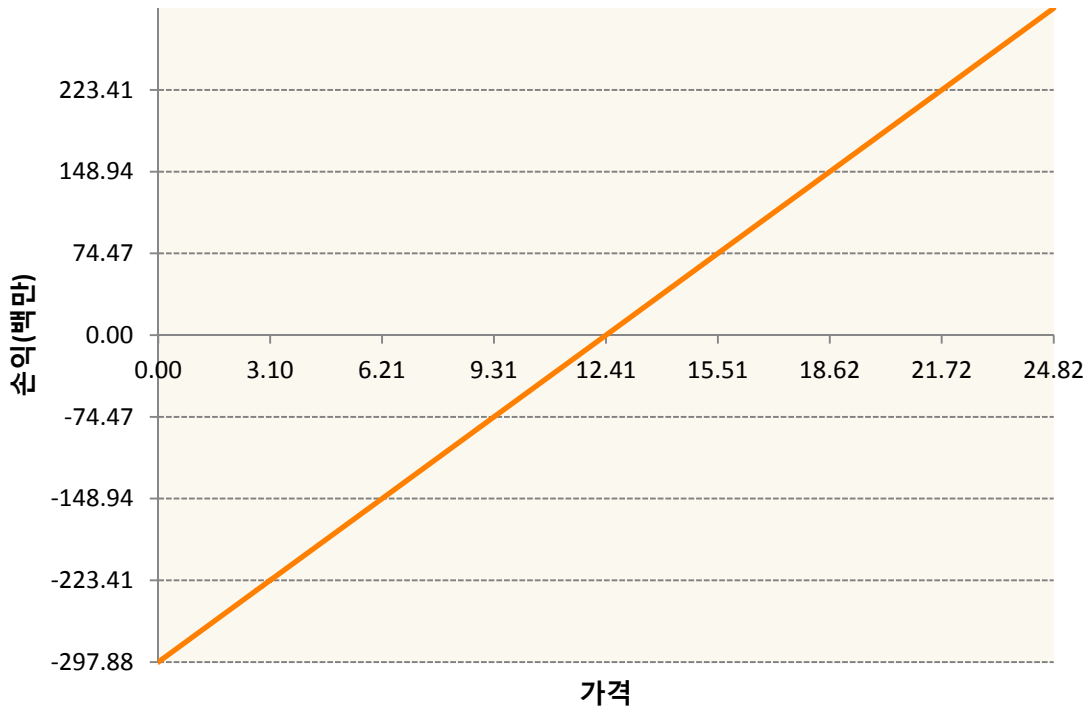
KR4175PA0005-2019-10 달러선물



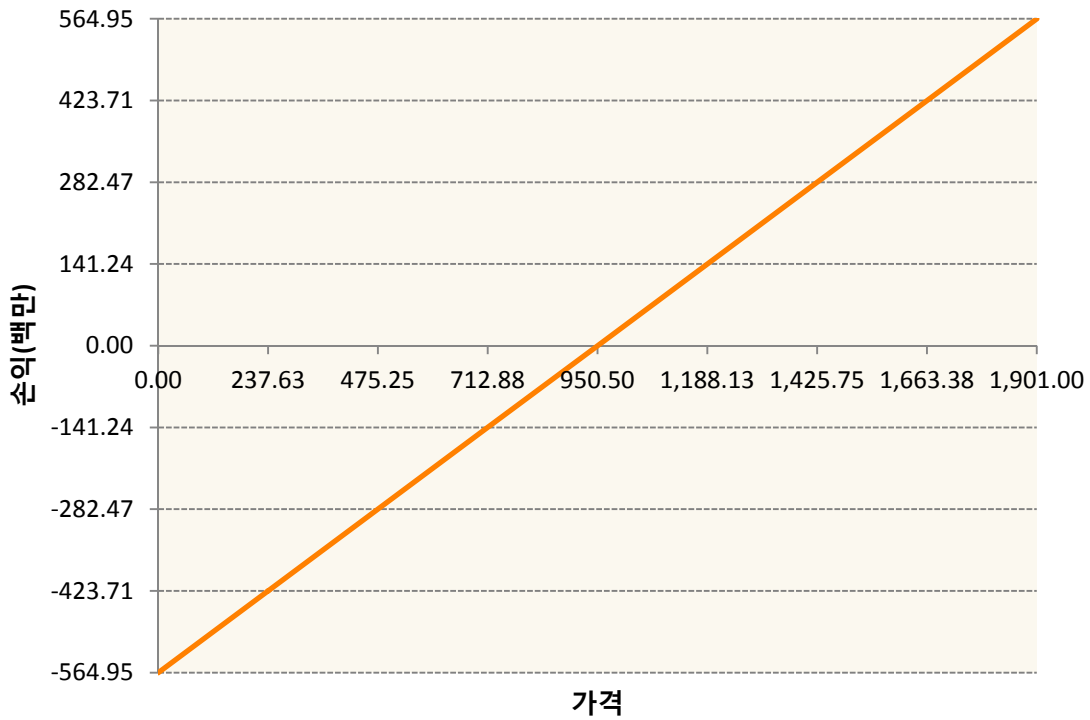
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



SBH0-Sugar Mar20

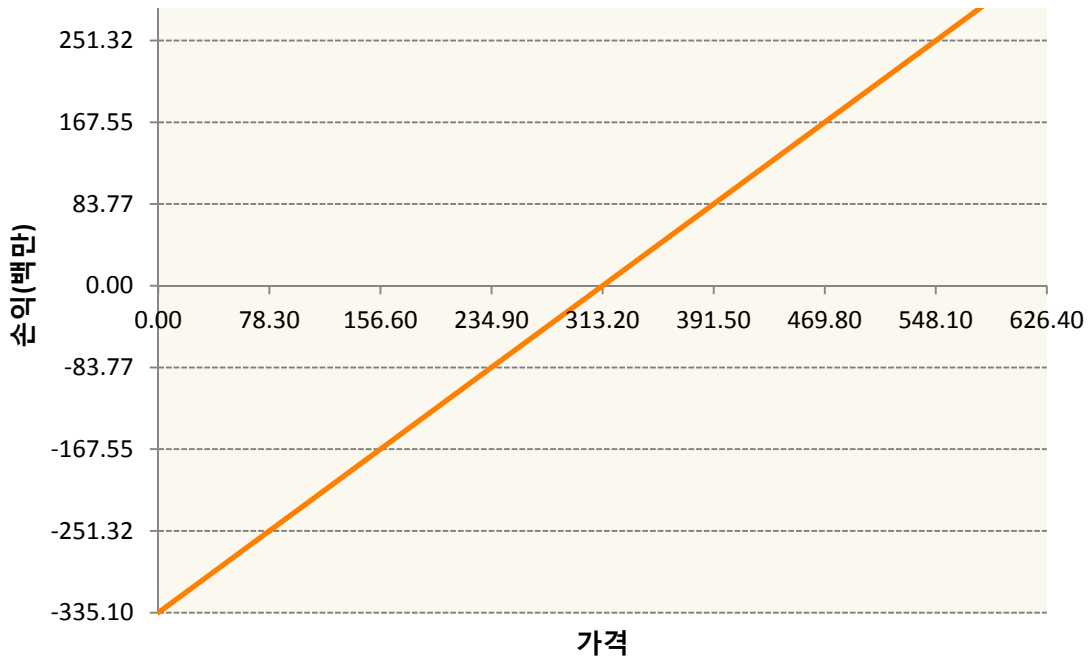


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20

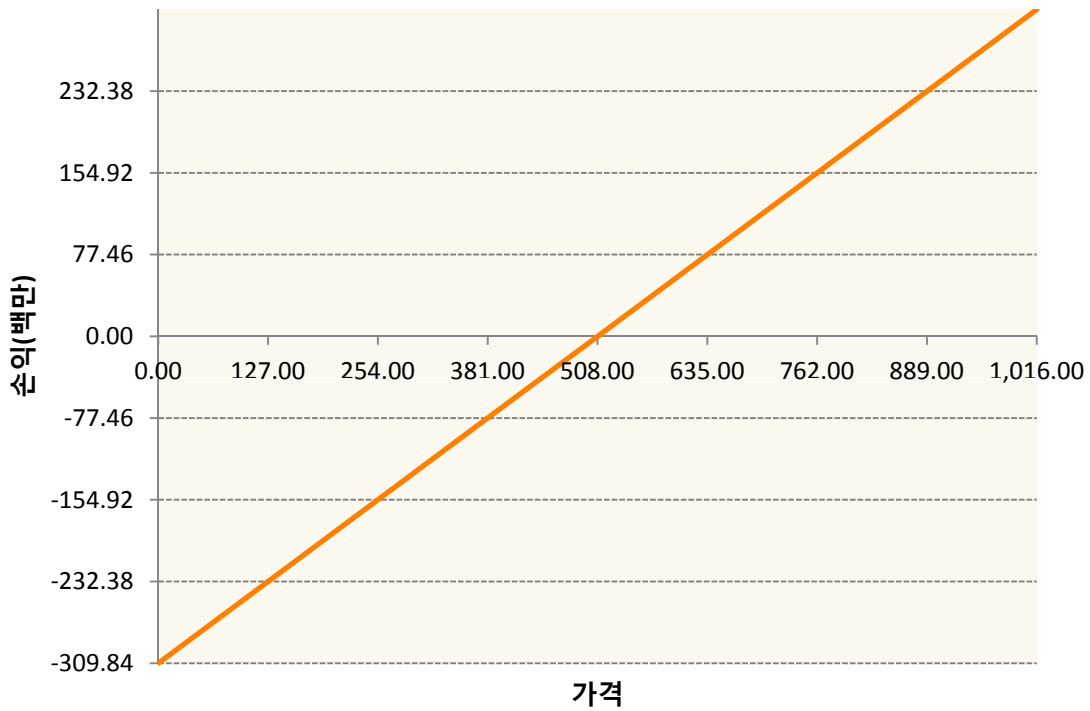


SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





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	49
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	25

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

(단위:백만원)

**257**