

공시일	2019-10-16
기준일	2019-10-15

## 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

공시일	2019-10-16
기준일	2019-10-15

## 스마트인덱스모

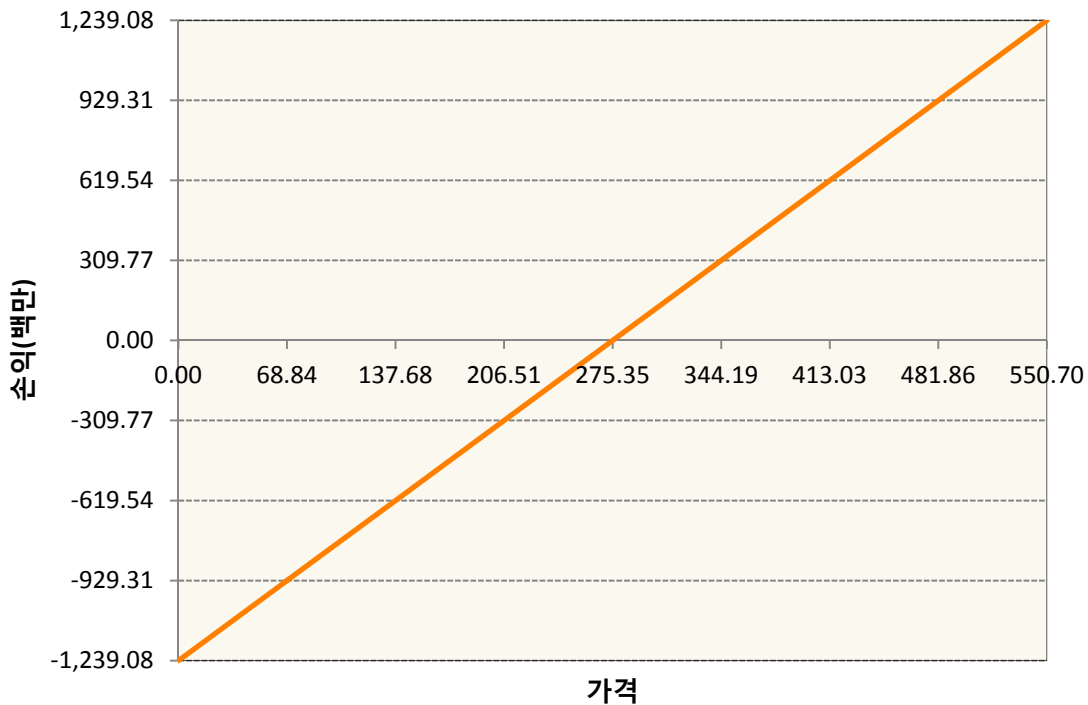
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,239	0	1,239	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						99
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99	
-5.33%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66	
-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%	66	66	66	66	66	66	66	
8.00%	99	99	99	99	99	99	99	

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

(단위:백만원)

86

공시일	2019-10-16
기준일	2019-10-15

## 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

1,169

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

682

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-10-16
기준일	2019-10-15

## 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)

386

SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)

141

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

836

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-10-16
기준일	2019-10-15

## 유로인덱스모(주식-파생형)

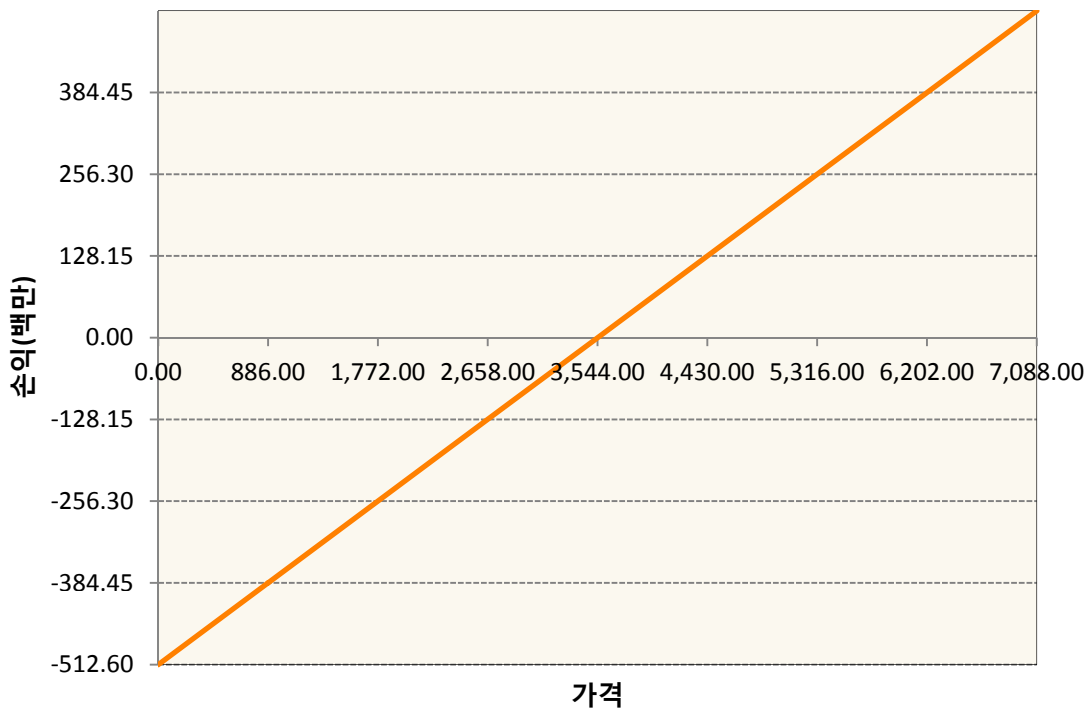
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	513	0	513	

### 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	2019-10-16
기준일	2019-10-15

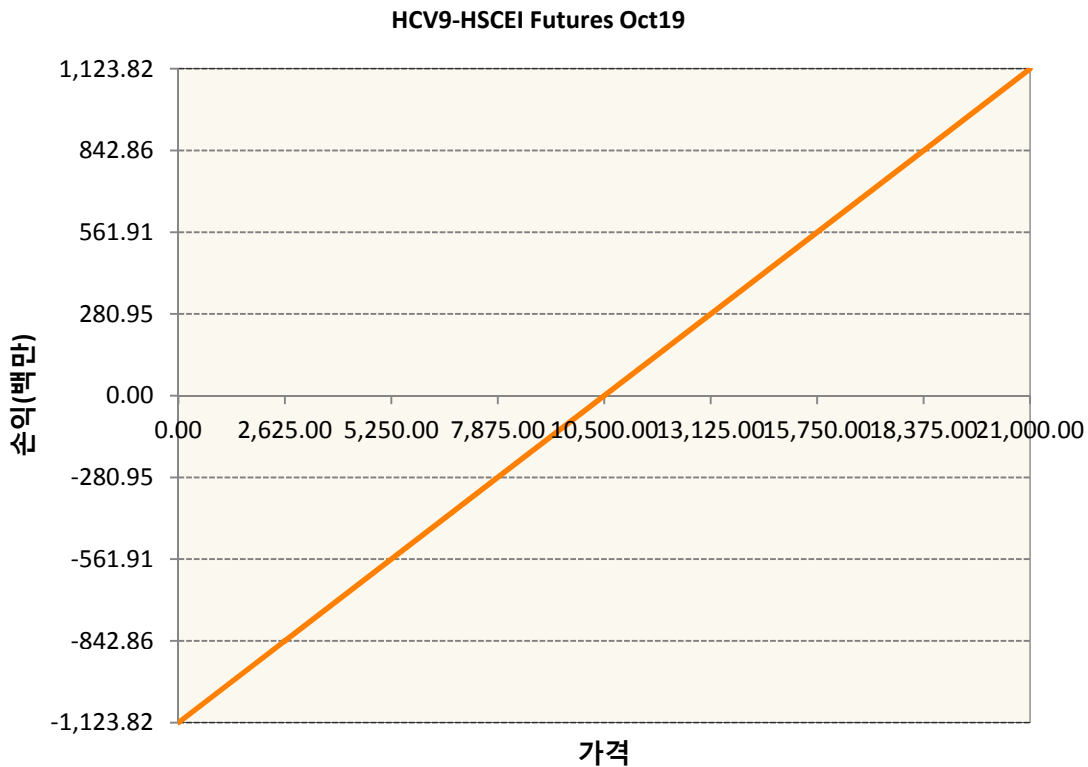
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,124	0	1,124	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

<b>81</b>
-----------

공시일	2019-10-16
기준일	2019-10-15

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

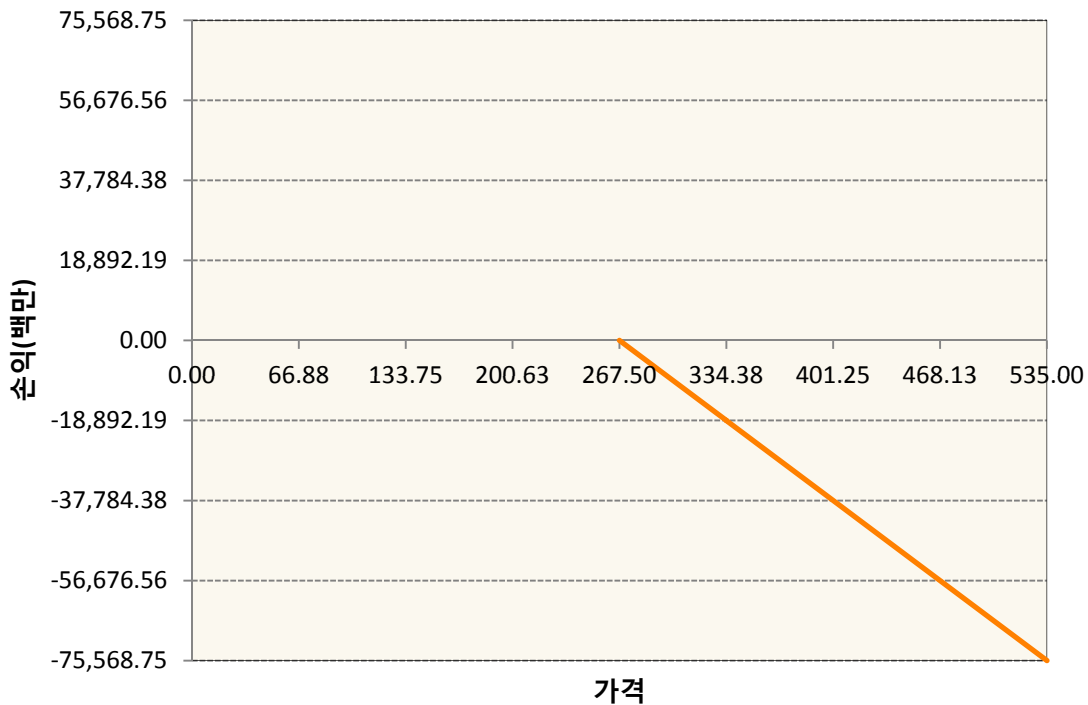
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

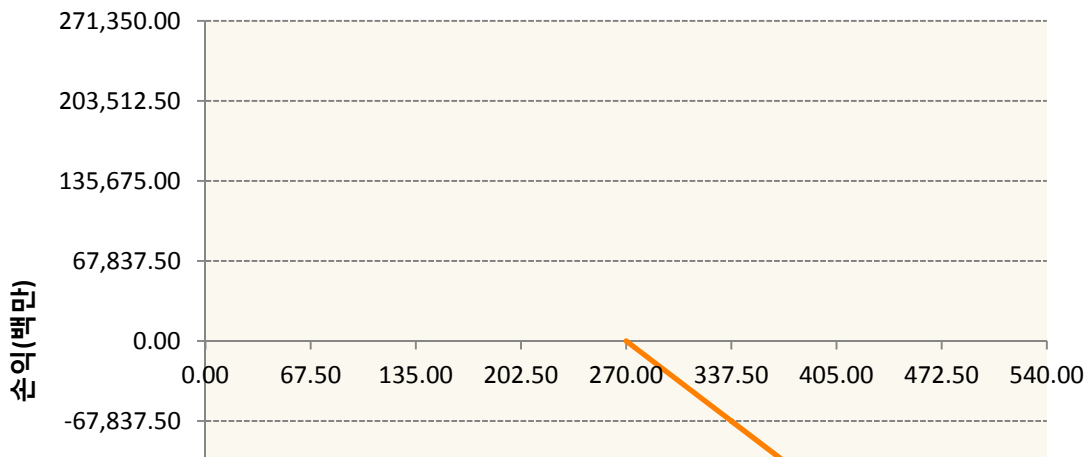
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	514,106	-514,106	장내

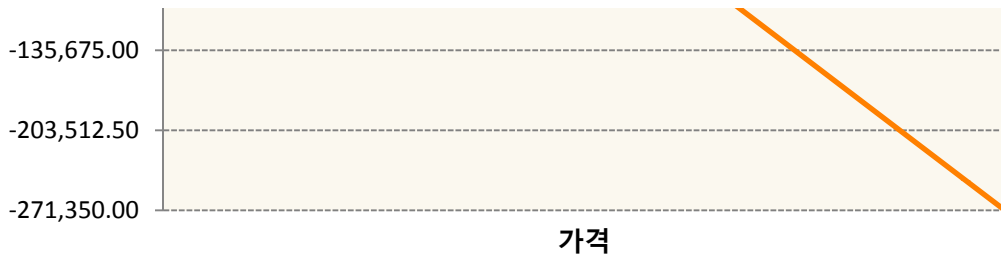
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201PB2677-2019-11 콜267.5**

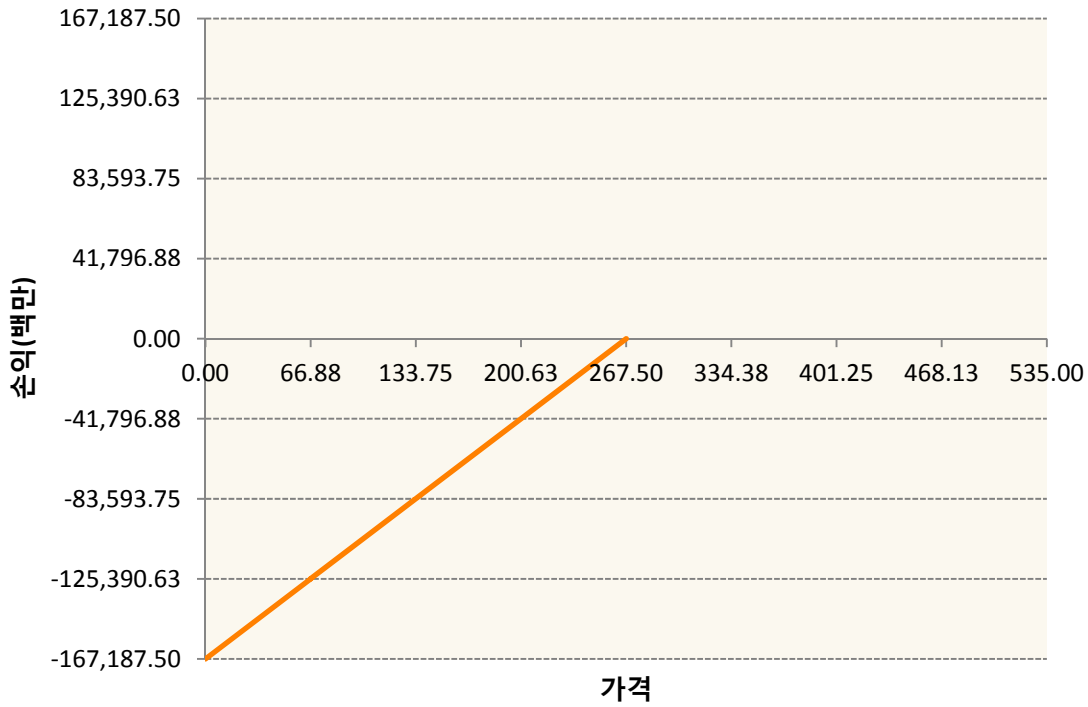


**KR4201PB2701-2019-11 콜270**





KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PB2677		2019-11 콜267.5					5,234
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,063	2,945	2,817	2,681	2,537	2,388	2,235
-5.33%	2,585	2,417	2,245	2,070	1,893	1,714	1,533
-2.67%	1,759	1,566	1,373	1,180	987	794	601
0%	549	368	185	0	-187	-375	-564
2.67%	-999	-1,139	-1,289	-1,445	-1,607	-1,774	-1,945
5.33%	-2,792	-2,884	-2,989	-3,107	-3,234	-3,370	-3,513
8.00%	-4,732	-4,783	-4,849	-4,928	-5,019	-5,122	-5,234
KR4201PB2701		2019-11 콜270					18,007
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,750	9,391	8,989	8,551	8,084	7,592	7,079

-5.33%	8,386	7,835	7,262	6,673	6,071	5,458	4,837
-2.67%	5,886	5,209	4,529	3,848	3,166	2,483	1,798
0%	2,044	1,366	685	0	-687	-1,375	-2,065
2.67%	-3,073	-3,634	-4,220	-4,825	-5,445	-6,076	-6,717
5.33%	-9,179	-9,570	-10,007	-10,481	-10,987	-11,518	-12,071
8.00%	-15,923	-16,155	-16,440	-16,774	-17,149	-17,562	-18,007
KR4301PB2676 2019-11 풋267.5							8,901
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,457	-8,497	-8,551	-8,620	-8,702	-8,796	-8,901
-5.33%	-4,260	-4,401	-4,553	-4,716	-4,887	-5,063	-5,246
-2.67%	-1,093	-1,317	-1,540	-1,764	-1,987	-2,211	-2,435
0%	533	364	186	0	-192	-388	-588
2.67%	1,039	974	892	795	684	561	428
5.33%	1,130	1,116	1,094	1,060	1,016	959	891
8.00%	1,139	1,137	1,133	1,126	1,113	1,093	1,066

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

(단위:백만원)

30,763

공시일	2019-10-16
기준일	2019-10-15

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

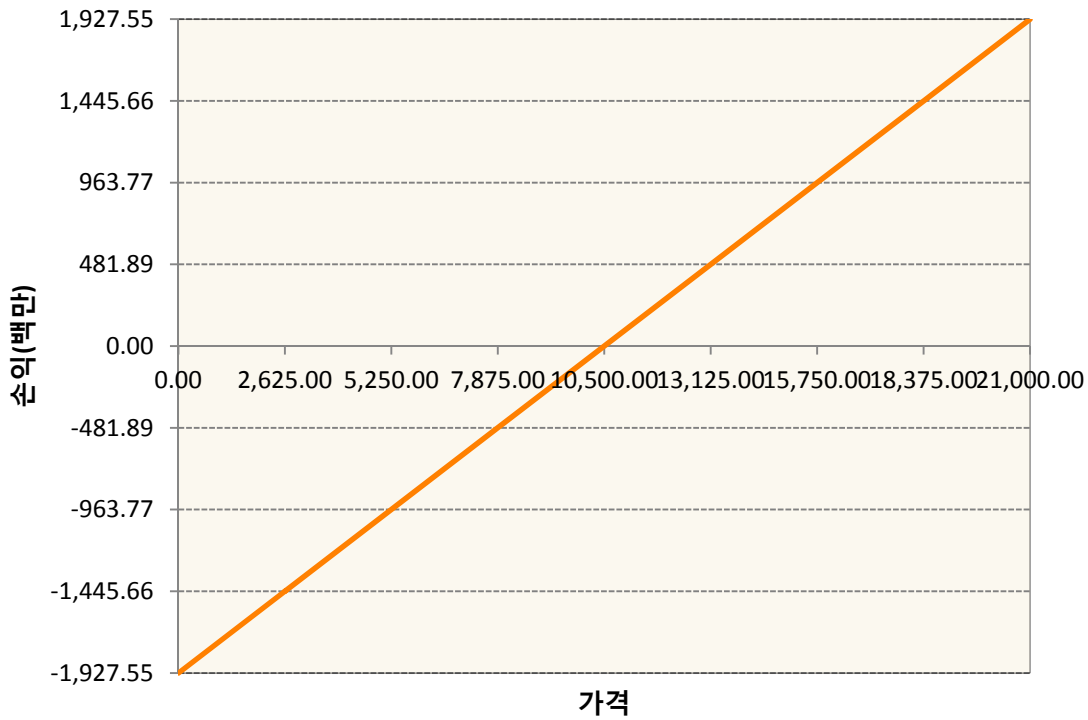
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

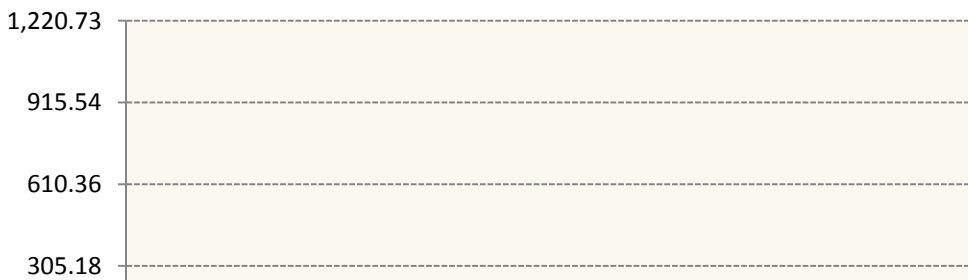
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,928	0	1,928	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,907	-4,907	장내
누계	통화	선도	680	2,807	-2,127	장외

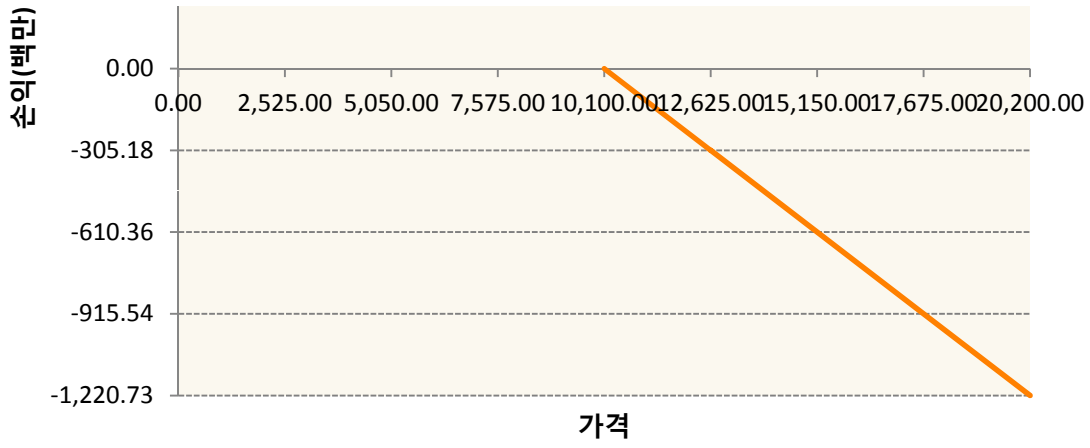
### 2. 만기시점의 손익구조

HCV9-HSCEI Futures Oct19

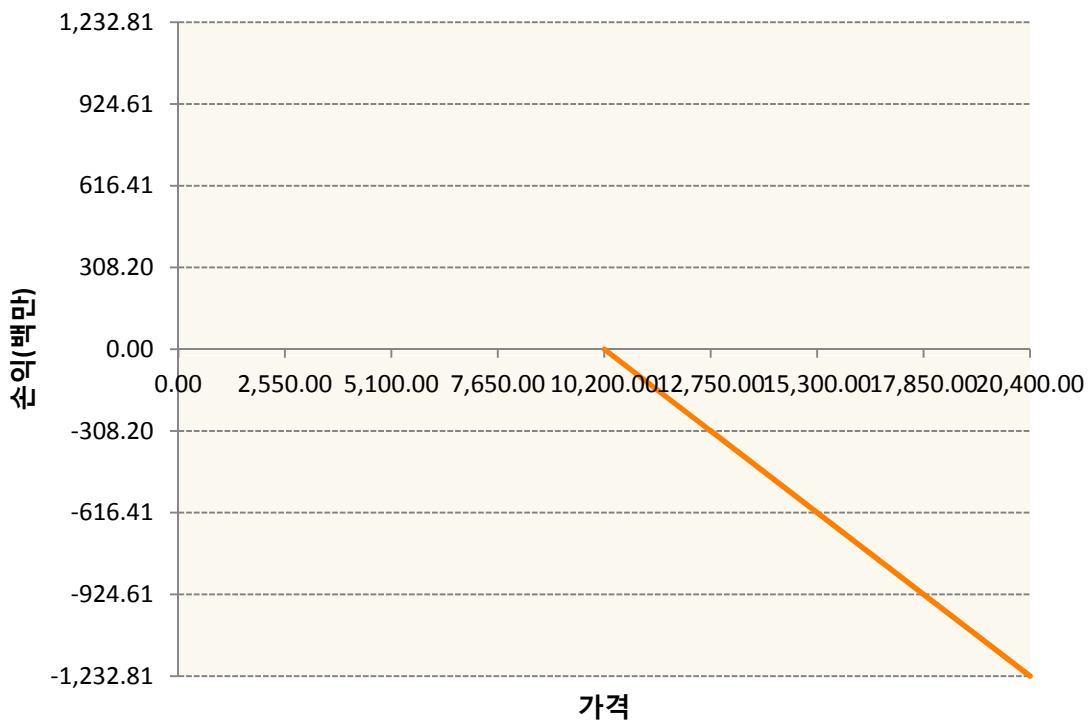


OHHIV9-C101-HSCEI

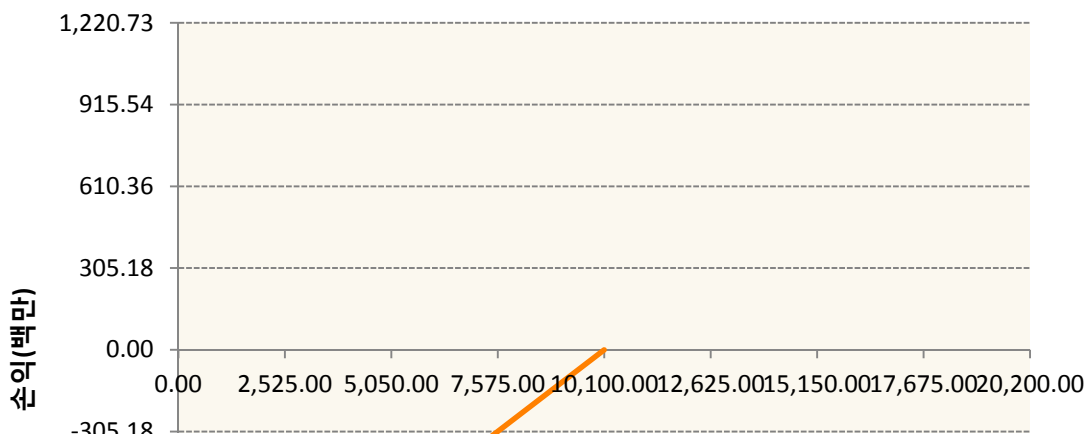


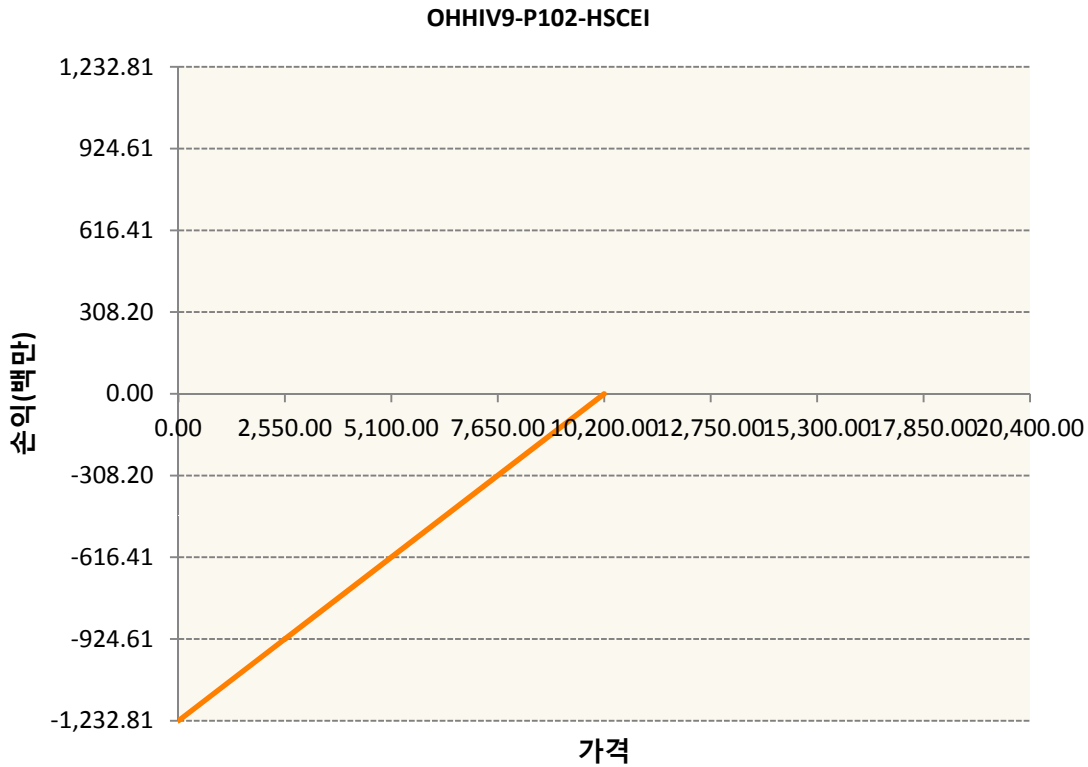


**OHHIV9-C102-HSCEI**



**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	2019-10-16
기준일	2019-10-15

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

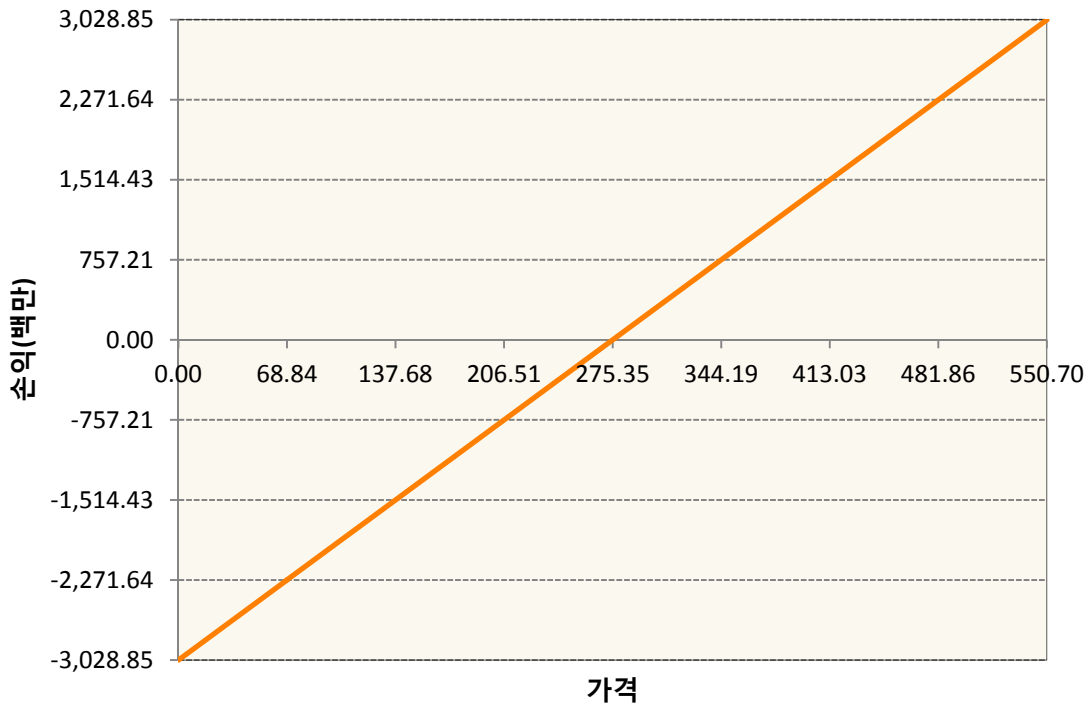
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

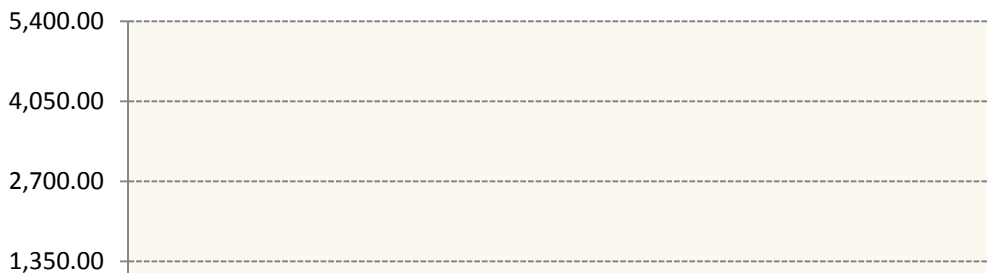
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,029	0	3,029	장내
누계	유가증권	스왑	10,625	0	10,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	10,953	-10,953	장내

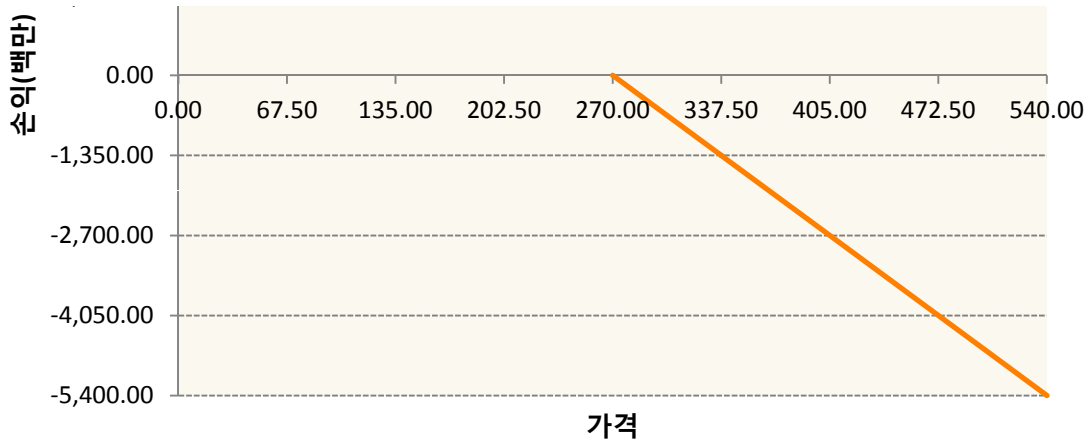
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

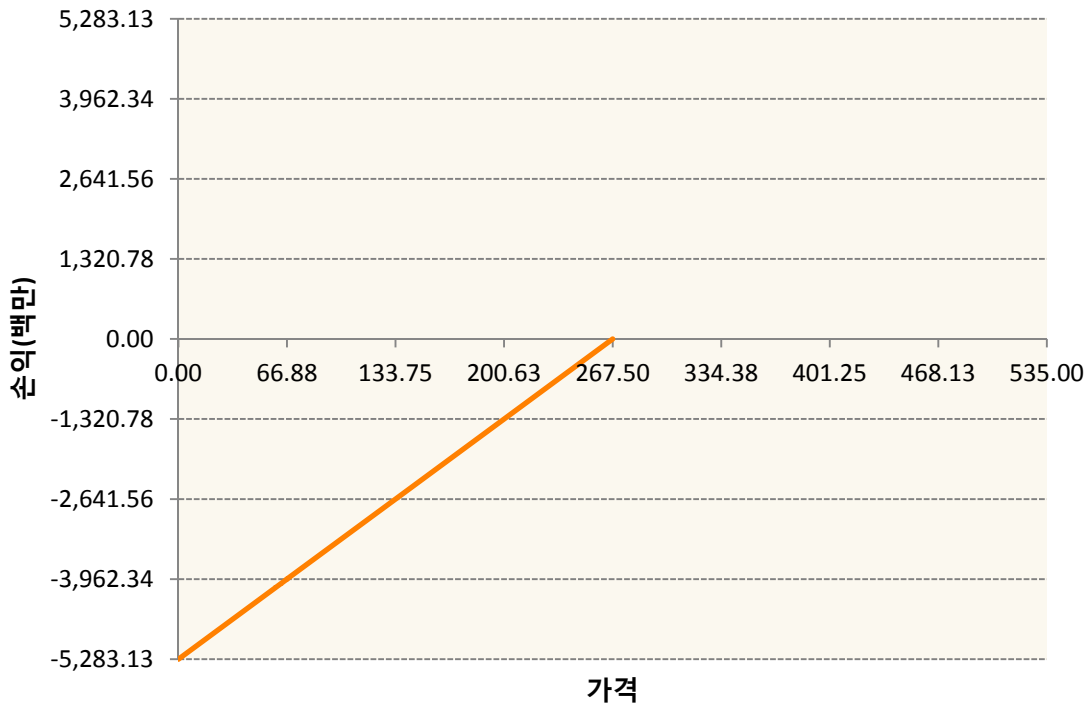


KR4201PB2701-2019-11 콜270

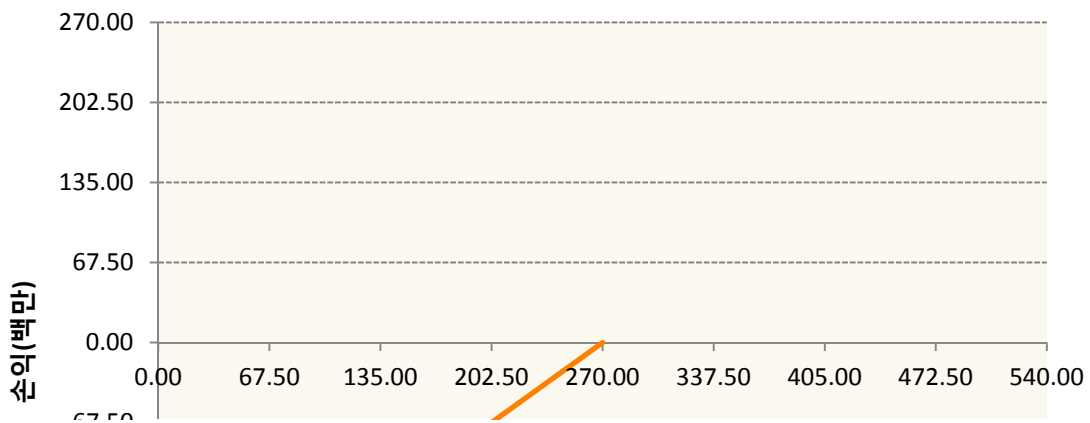


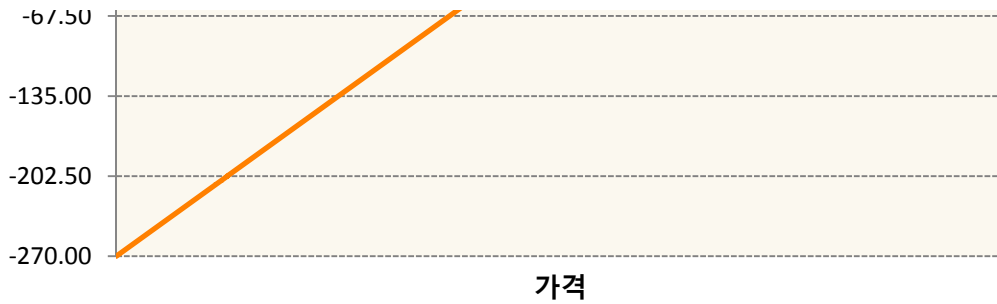


KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



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						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%	194	187	179	170	161	151	141	
-5.33%	167	156	145	133	121	109	96	
-2.67%	117	104	90	77	63	49	36	
0%	41	27	14	0	-14	-27	-41	
2.67%	-61	-72	-84	-96	-108	-121	-134	
5.33%	-183	-190	-199	-209	-219	-229	-240	
8.00%	-317	-321	-327	-334	-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%	-267	-269	-270	-272	-275	-278	-281
-5.33%	-135	-139	-144	-149	-154	-160	-166
-2.67%	-35	-42	-49	-56	-63	-70	-77
0%	17	12	6	0	-6	-12	-19
2.67%	33	31	28	25	22	18	14
5.33%	36	35	35	34	32	30	28
8.00%	36	36	36	36	35	35	34
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	-16	-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	2	2	2	2	2
8.00%	3	3	3	3	3	2	2

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

(단위:백만원)

**1,752**

공시일	2019-10-16
기준일	2019-10-15

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

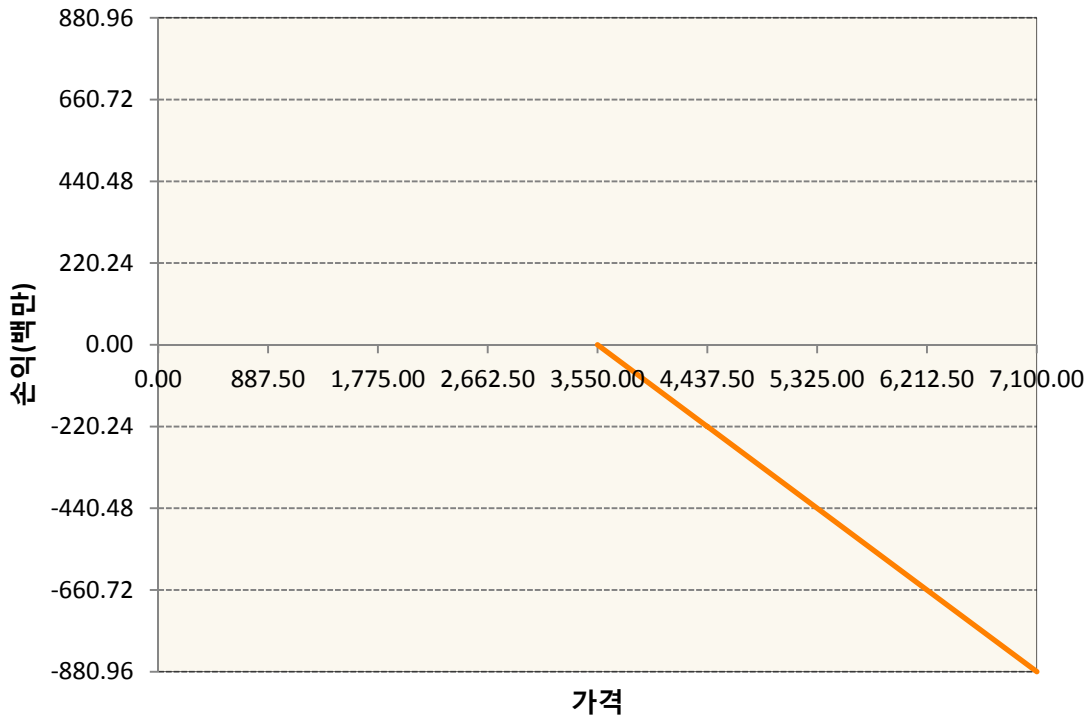
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

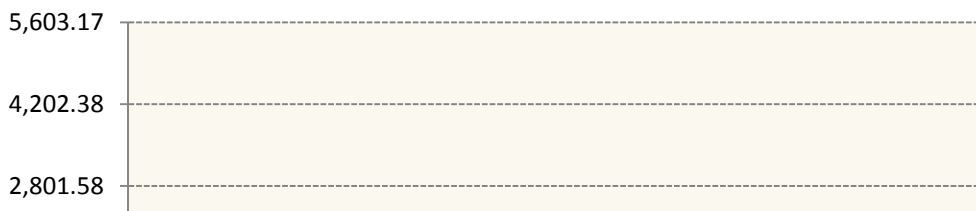
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,586	0	3,586	
누계	유가증권	스왑	23,767	0	23,767	장외
누계	유가증권	옵션	0	12,968	-12,968	장내
누계	통화	선도	0	6,139	-6,139	장외

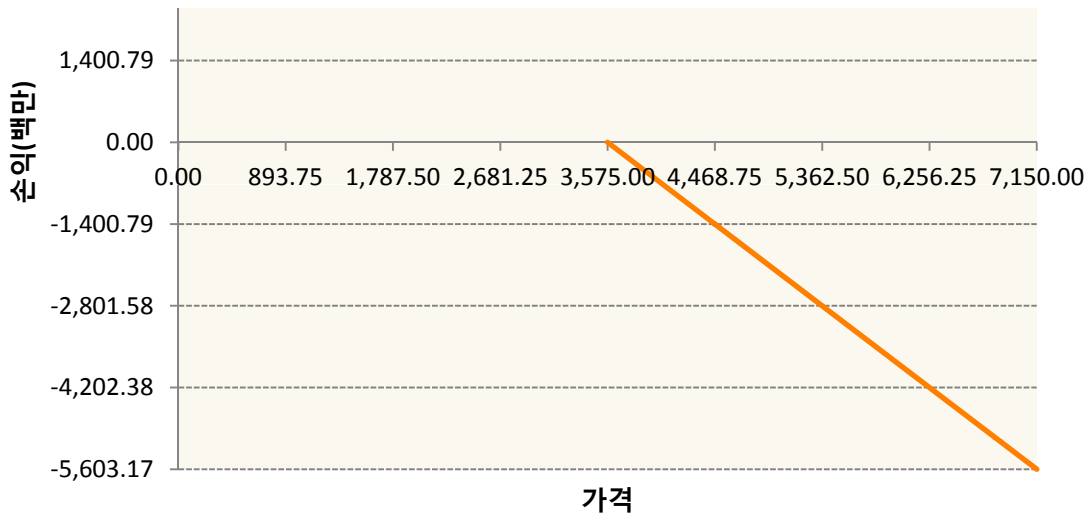
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXV9-C3550-EURO STOXX 50

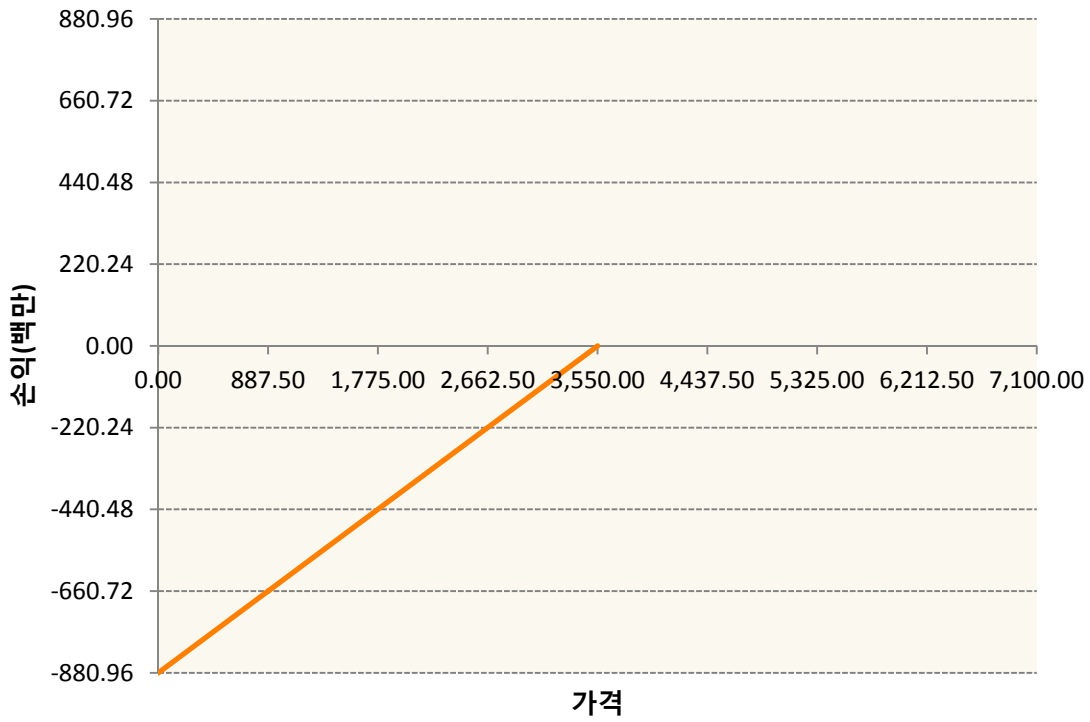


OESXV9-C3575-EURO STOXX 50

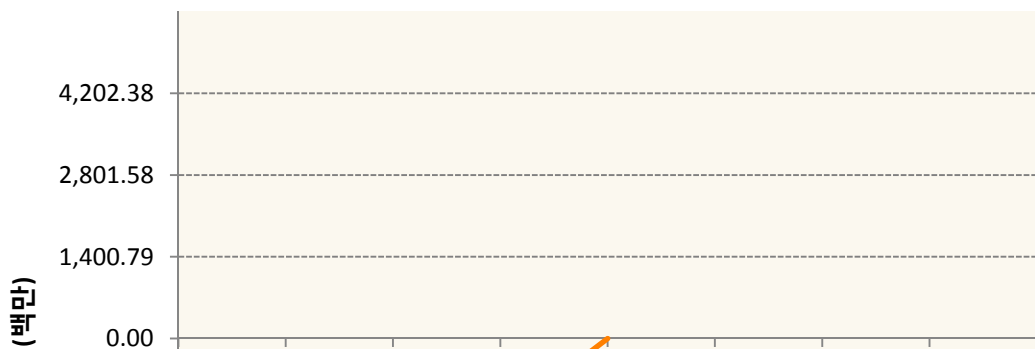


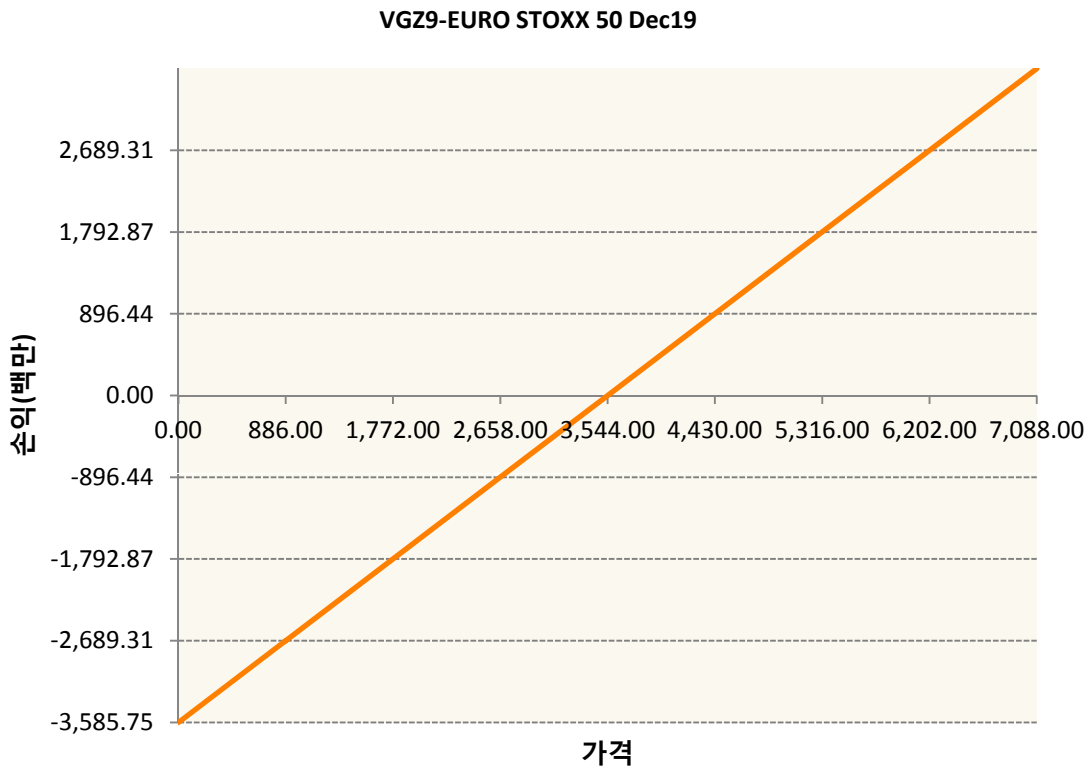
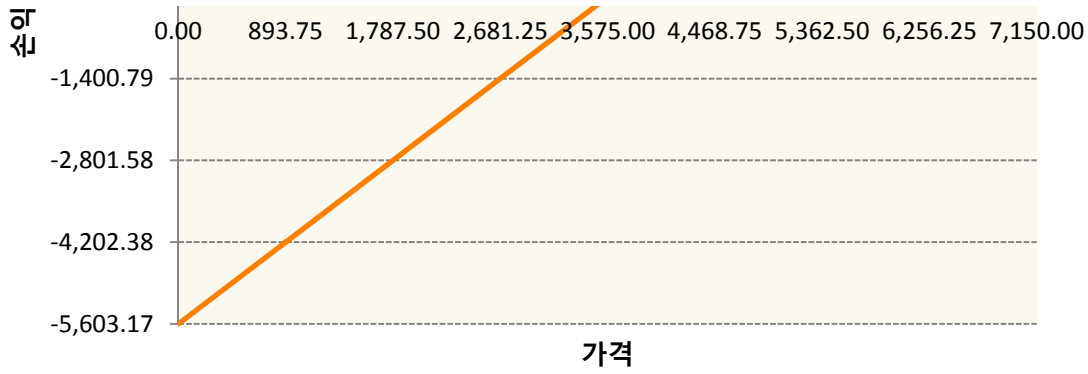


OESXV9-P3550-EURO STOXX 50



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	287

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





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

(단위:백만원)

995

공시일	2019-10-16
기준일	2019-10-15

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

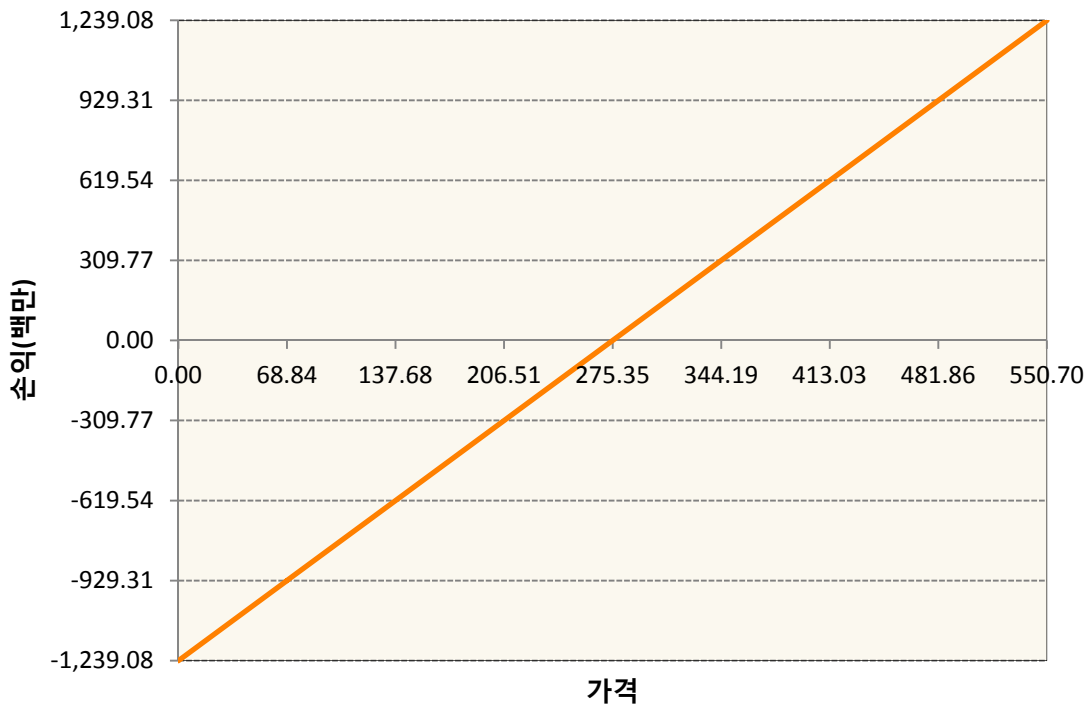
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,239	0	1,239	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						99
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99	
-5.33%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66	
-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%	66	66	66	66	66	66	66	
8.00%	99	99	99	99	99	99	99	

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

(단위:백만원)

86



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

(단위:백만원)

134



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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-10-16
기준일	2019-10-15

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

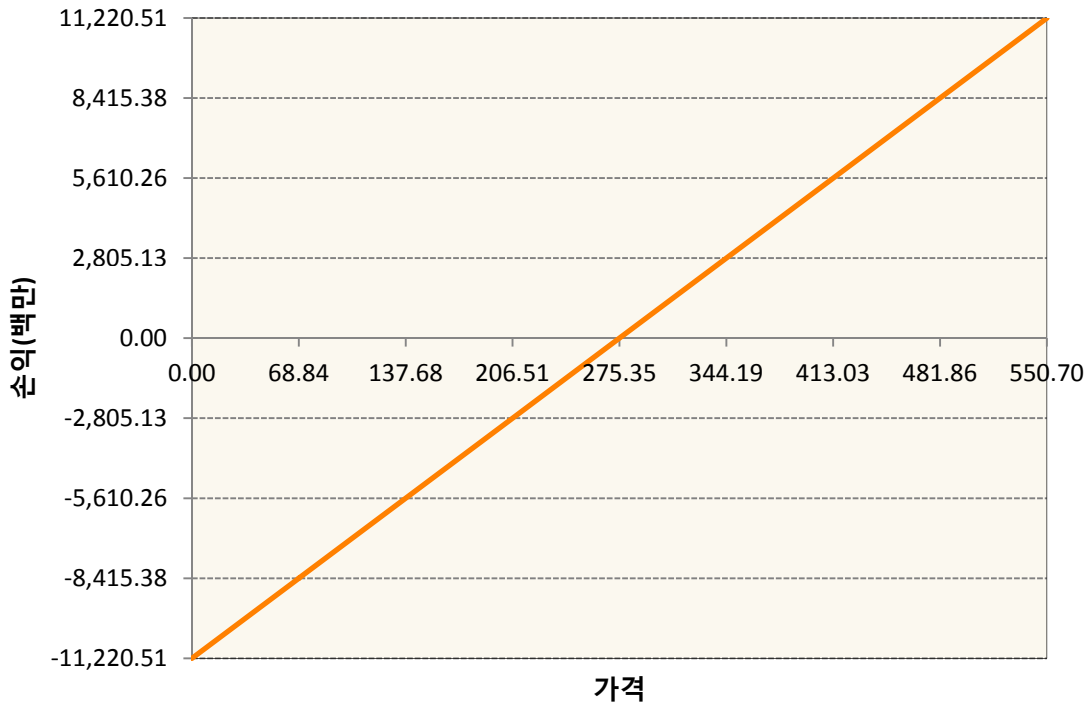
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

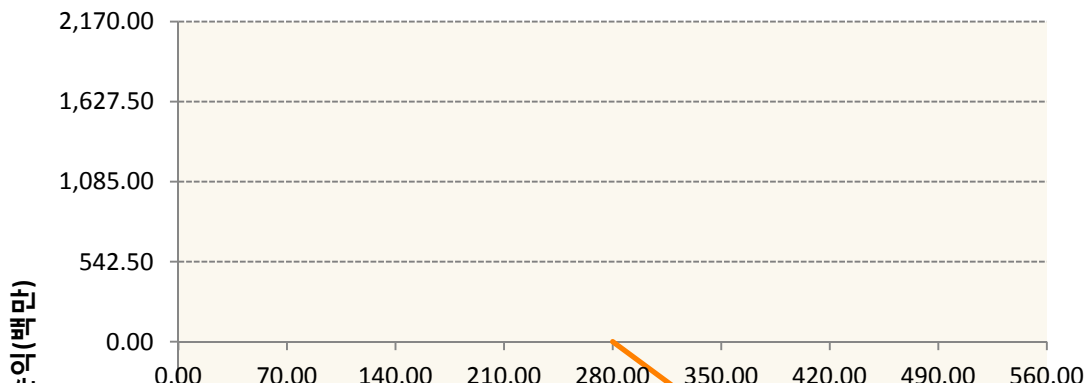
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,221	0	11,221	장내
누계	유가증권	옵션	3,561	20,815	-17,254	장내

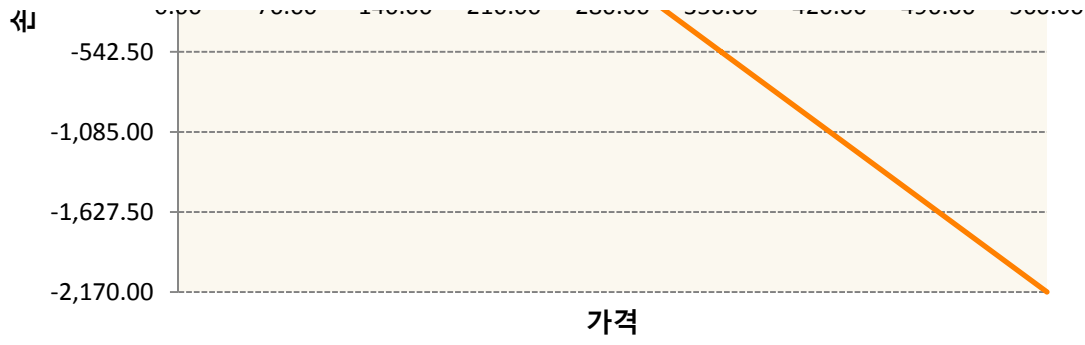
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

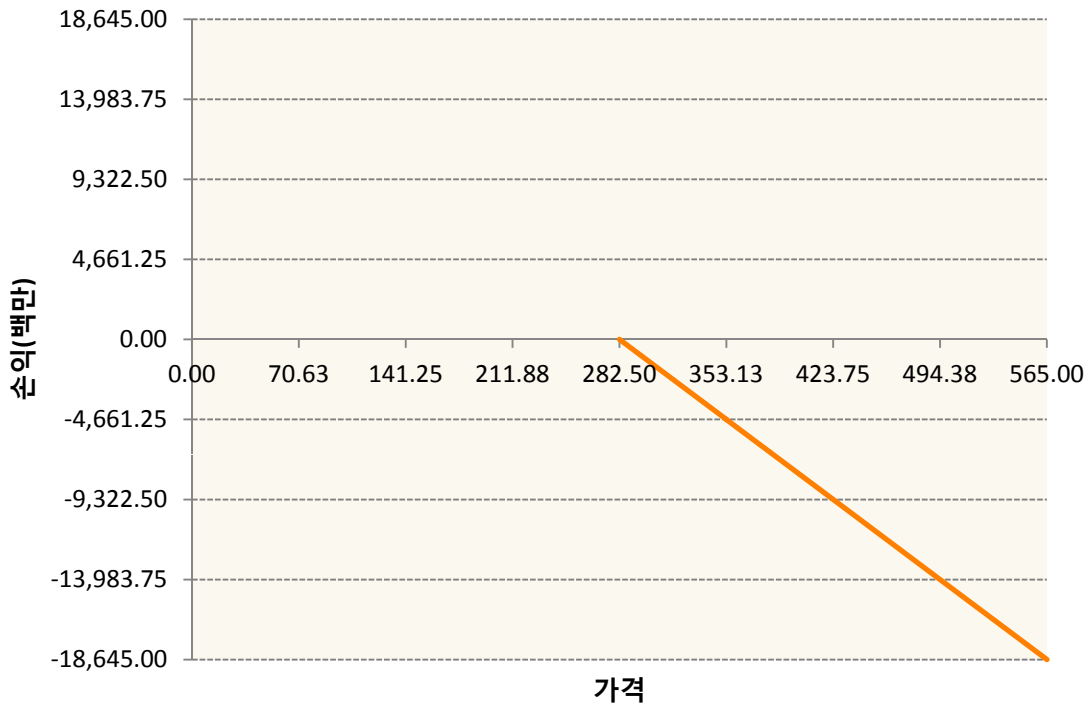


KR4201PB2800-2019-11 콜280

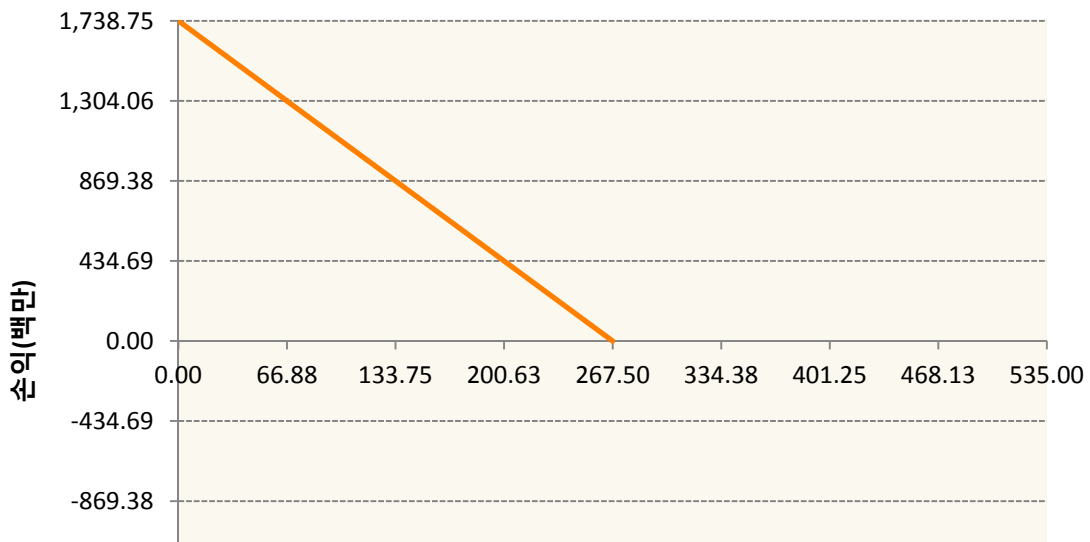


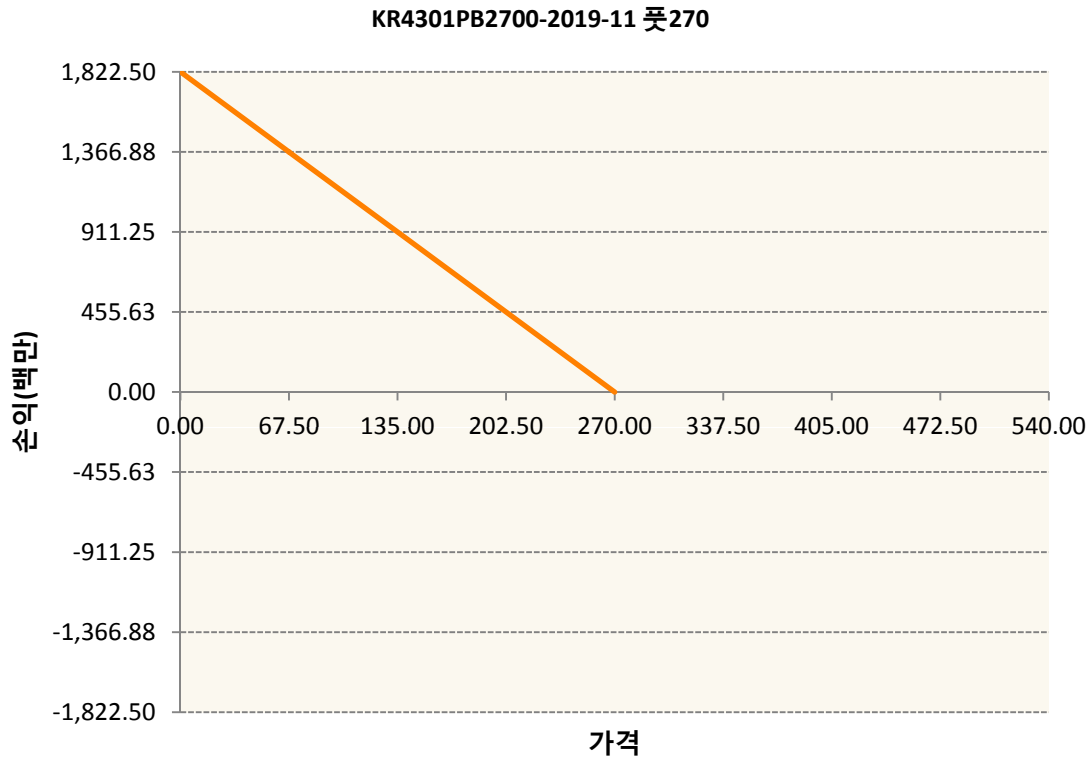
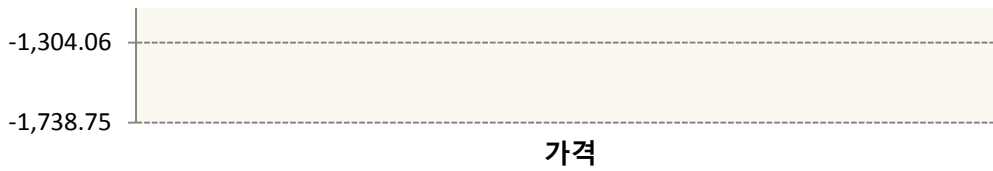


KR4201PB2826-2019-11 콜282.5



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%	44	43	41	39	37	35	32	
-5.33%	40	38	35	32	29	25	21	
-2.67%	32	28	24	19	15	10	5	

0%	16	10	5	0	-5	-11	-16
2.67%	-10	-16	-21	-27	-32	-38	-44
5.33%	-46	-51	-56	-61	-66	-72	-77
8.00%	-90	-94	-98	-102	-107	-111	-116
KR4201PB2826                      2019-11 콜282.5							934
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	321	313	302	288	272	253	231
-5.33%	298	281	260	237	210	182	152
-2.67%	241	212	179	145	109	72	33
0%	127	86	43	0	-44	-88	-133
2.67%	-64	-112	-159	-207	-254	-302	-349
5.33%	-341	-386	-432	-478	-524	-571	-618
8.00%	-694	-730	-768	-808	-849	-892	-934
KR4301PB2676                      2019-11 풋267.5							93
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	88	88	89	90	90	91	93
-5.33%	44	46	47	49	51	53	55
-2.67%	11	14	16	18	21	23	25
0%	-6	-4	-2	0	2	4	6
2.67%	-11	-10	-9	-8	-7	-6	-4
5.33%	-12	-12	-11	-11	-11	-10	-9
8.00%	-12	-12	-12	-12	-12	-11	-11
KR4301PB2700                      2019-11 풋270							106
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	103	103	103	104	104	105	106
-5.33%	55	57	58	59	61	62	64
-2.67%	17	19	21	23	26	28	30
0%	-7	-5	-2	0	2	5	7
2.67%	-15	-14	-13	-12	-10	-9	-7
5.33%	-17	-17	-17	-16	-15	-15	-14
8.00%	-18	-18	-18	-17	-17	-17	-16

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

(단위:백만원)

**1,784**

공시일	2019-10-16
기준일	2019-10-15

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,185	0	1,185	
누계	유가증권	수익증권	146,536	0	146,536	

### 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	2019-10-16
기준일	2019-10-15

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,370	0	2,370	
누계	유가증권	수익증권	192,167	0	192,167	

### 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	2019-10-16
기준일	2019-10-15

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,378	0	3,378	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	414,430	0	414,430	
누계	통화	선도	0	465,191	-465,191	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,887
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,508
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	2,314
FX21019U02 KRW/USD 16-10-19E	1,707
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	2,949
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	3,129
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	2,598
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	702
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E	1,707
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E	2,503
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E	474

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

(단위:백만원)

12,142

공시일	2019-10-16
기준일	2019-10-15

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

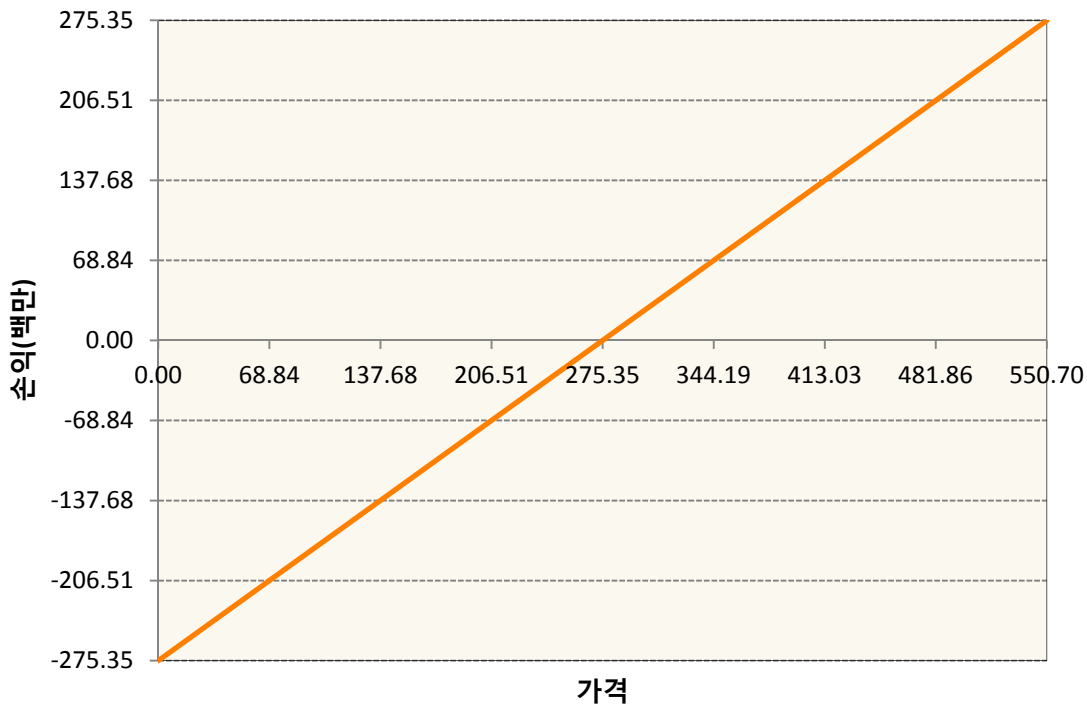
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

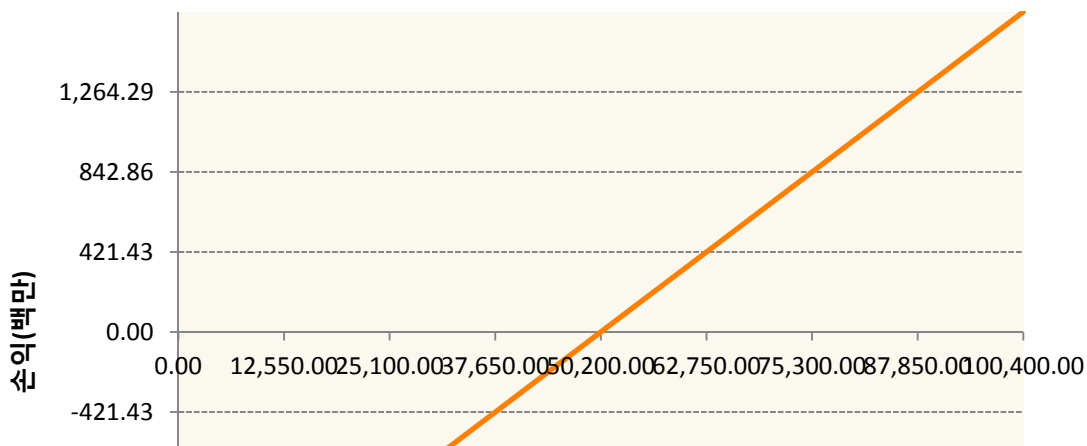
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,961	0	1,961	장내

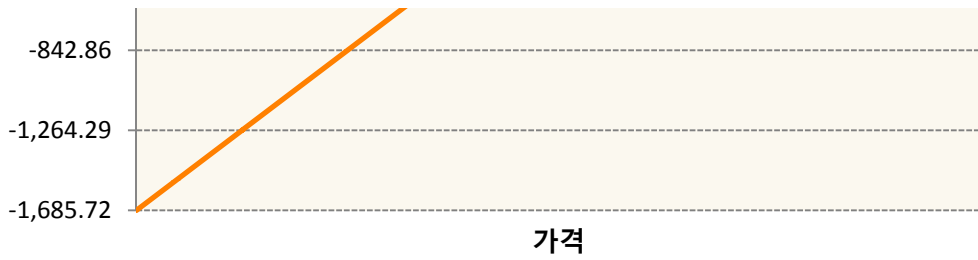
### 2. 만기시점의 손익구조

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						135
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-135	-135	-135	-135	-135	-135	-135	
-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%	135	135	135	135	135	135	135	

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

**187**

공시일	2019-10-16
기준일	2019-10-15

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

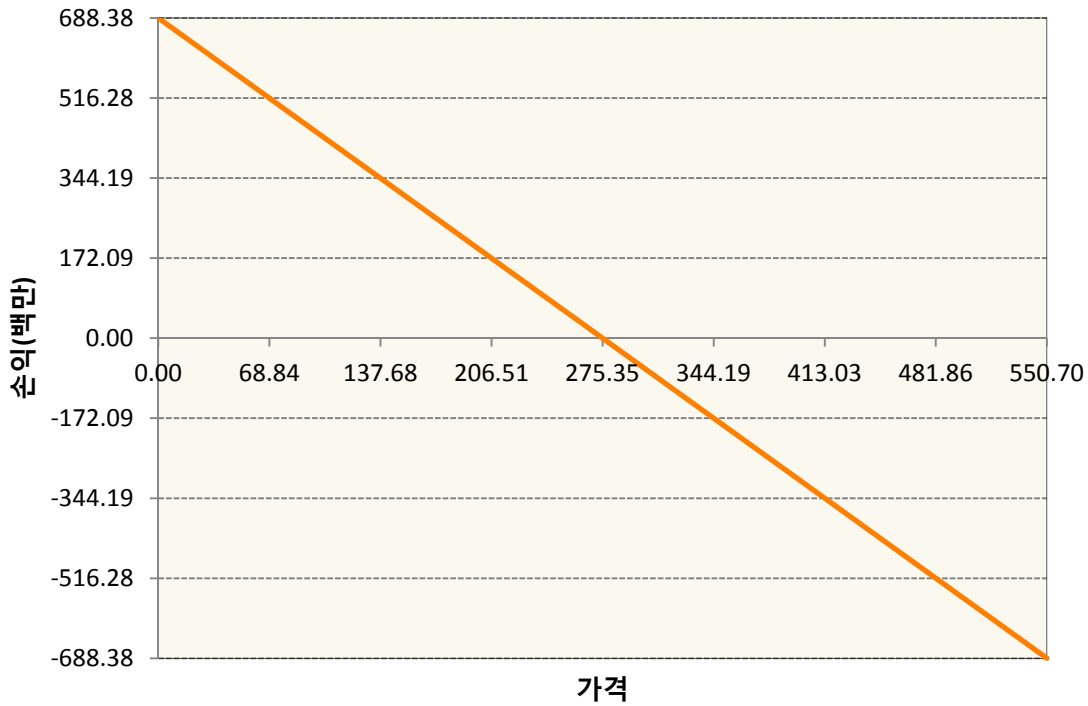
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

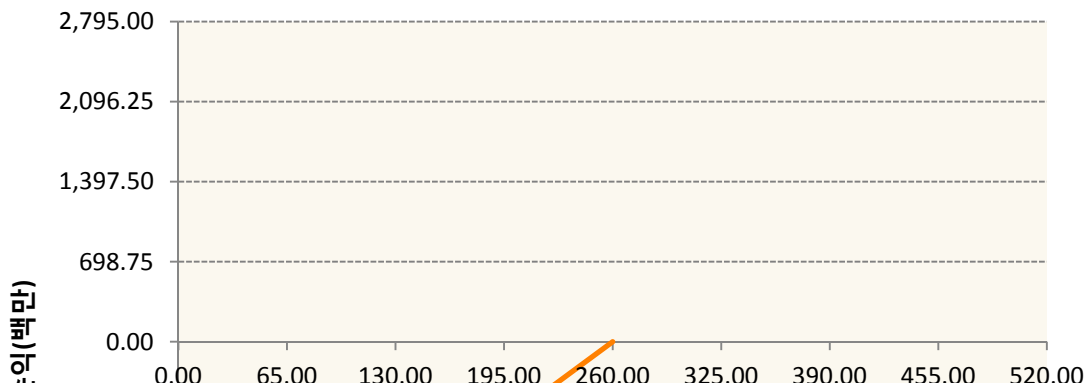
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	688	-688	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,976	-3,976	장내

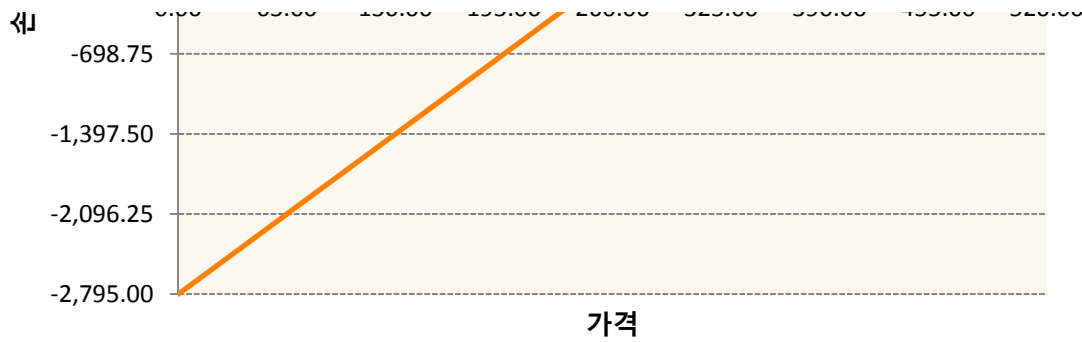
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

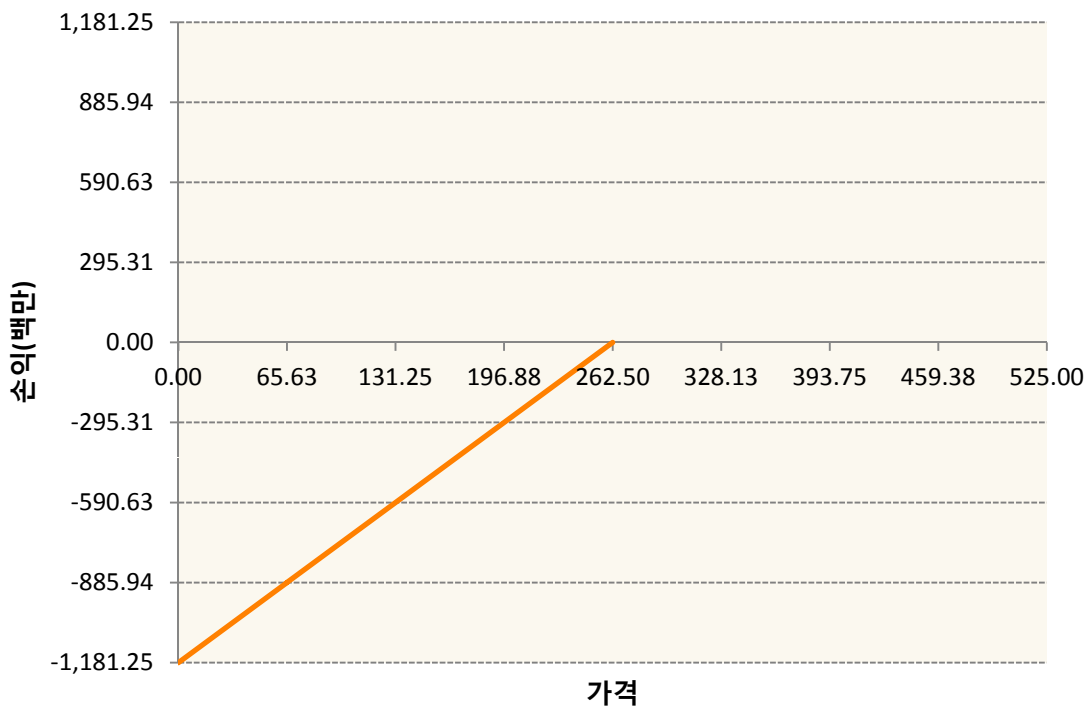


KR4301PB2601-2019-11 풋260





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						102
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-85	-88	-90	-93	-96	-99	-102
-5.33%	-31	-35	-39	-42	-46	-50	-54
-2.67%	-4	-7	-10	-13	-16	-19	-23
0%	4	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	5	5	5	4	3	3	1
5.33%	5	5	5	5	5	5	4
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

KR4301PB2627                      2019-11 풋262.5                      50

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-44	-45	-46	-47	-48	-49	-50
-5.33%	-18	-20	-21	-23	-24	-26	-27
-2.67%	-3	-5	-6	-7	-9	-10	-12
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	3	3	3	3	2	2	1
5.33%	4	3	3	3	3	3	3
8.00%	4	4	4	3	3	3	3

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

(단위:백만원)

**151**

공시일	2019-10-16
기준일	2019-10-15

## 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	16,657	0	16,657	
누계	통화	선도	1,233	17,541	-16,308	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)

<b>490</b>
------------

공시일	2019-10-16
기준일	2019-10-15

## 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	458	0	458	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
2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	13
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>43</b>
-----------

공시일	2019-10-16
기준일	2019-10-15

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

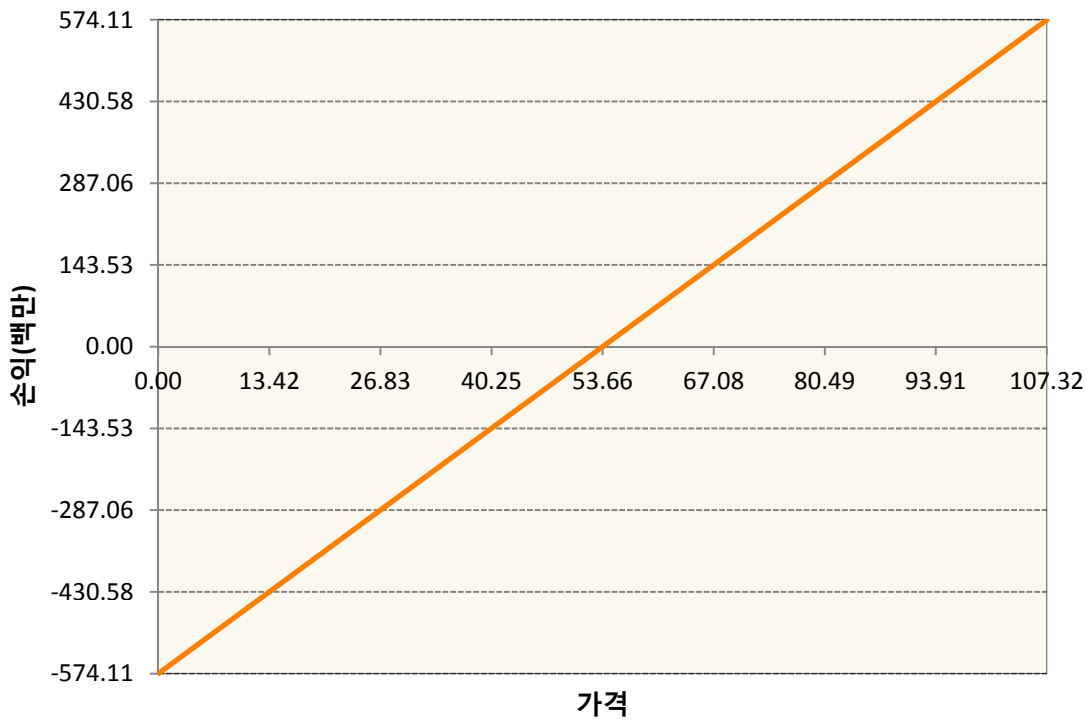
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

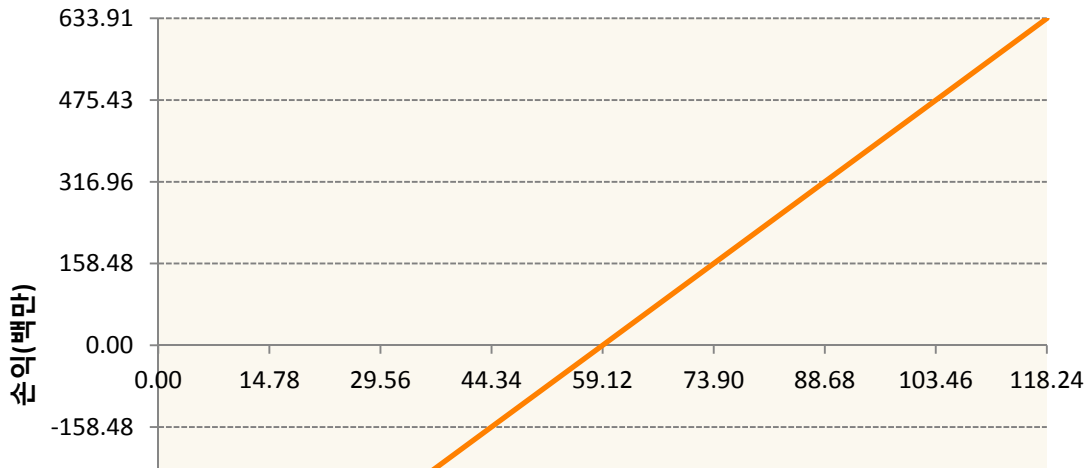
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,487	296	2,190	

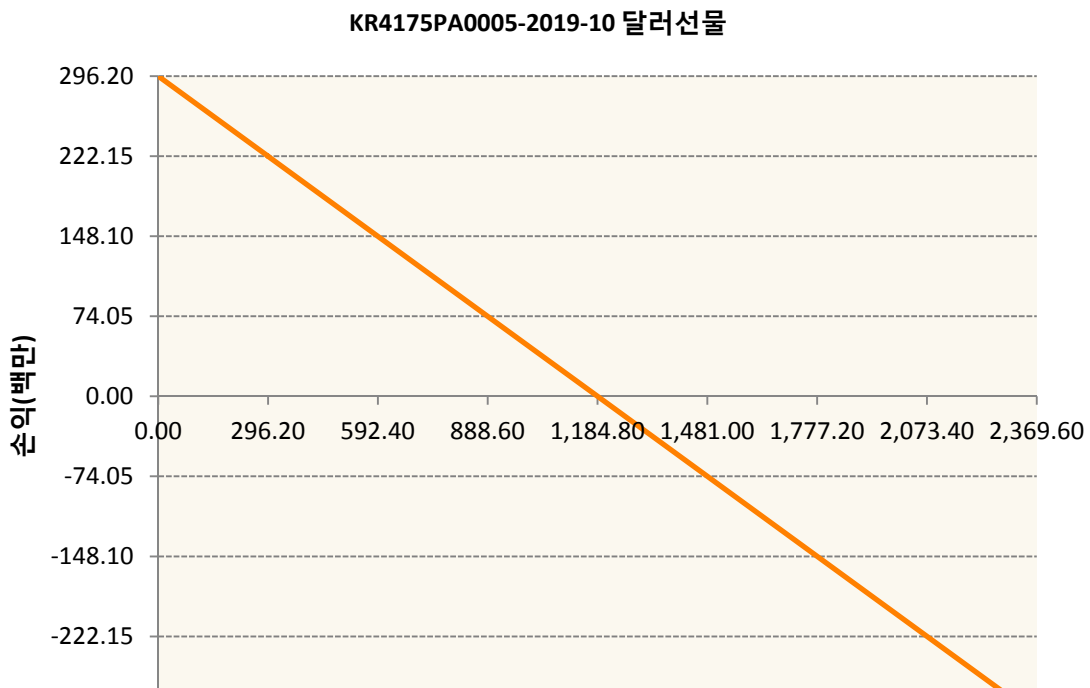
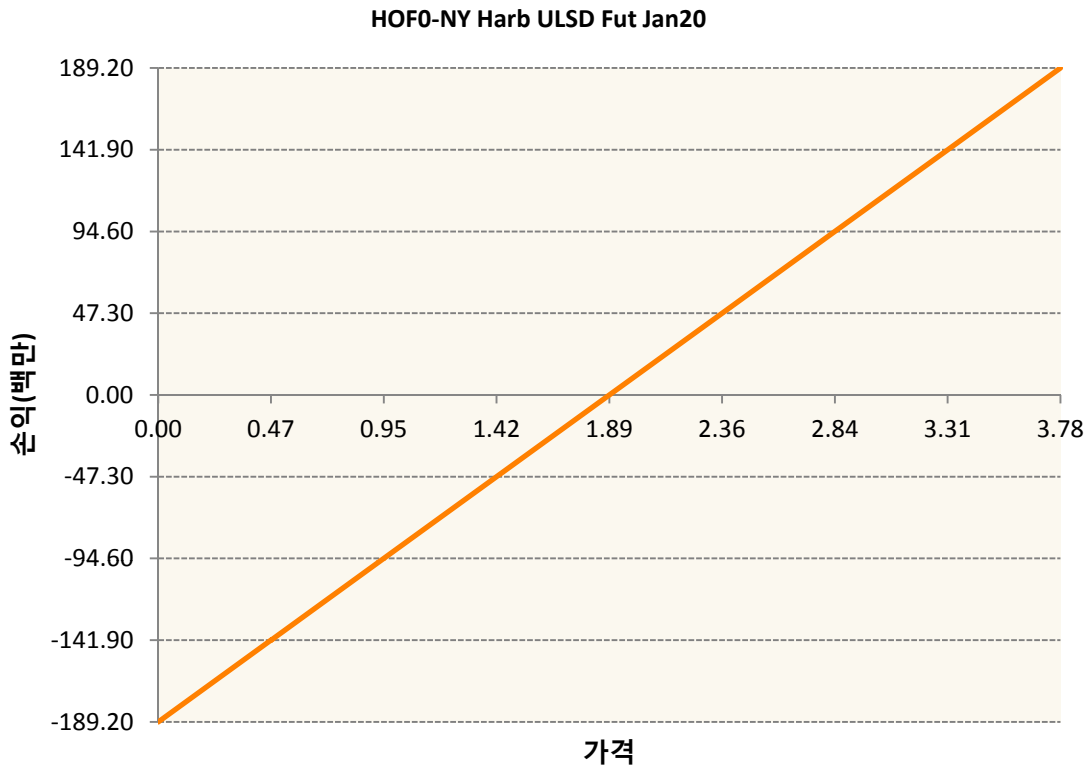
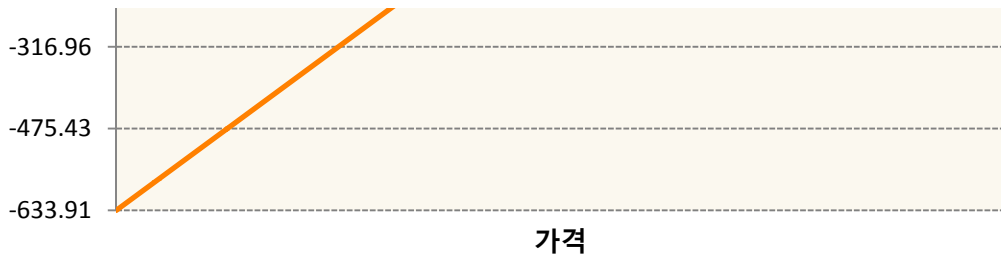
### 2. 만기시점의 손익구조

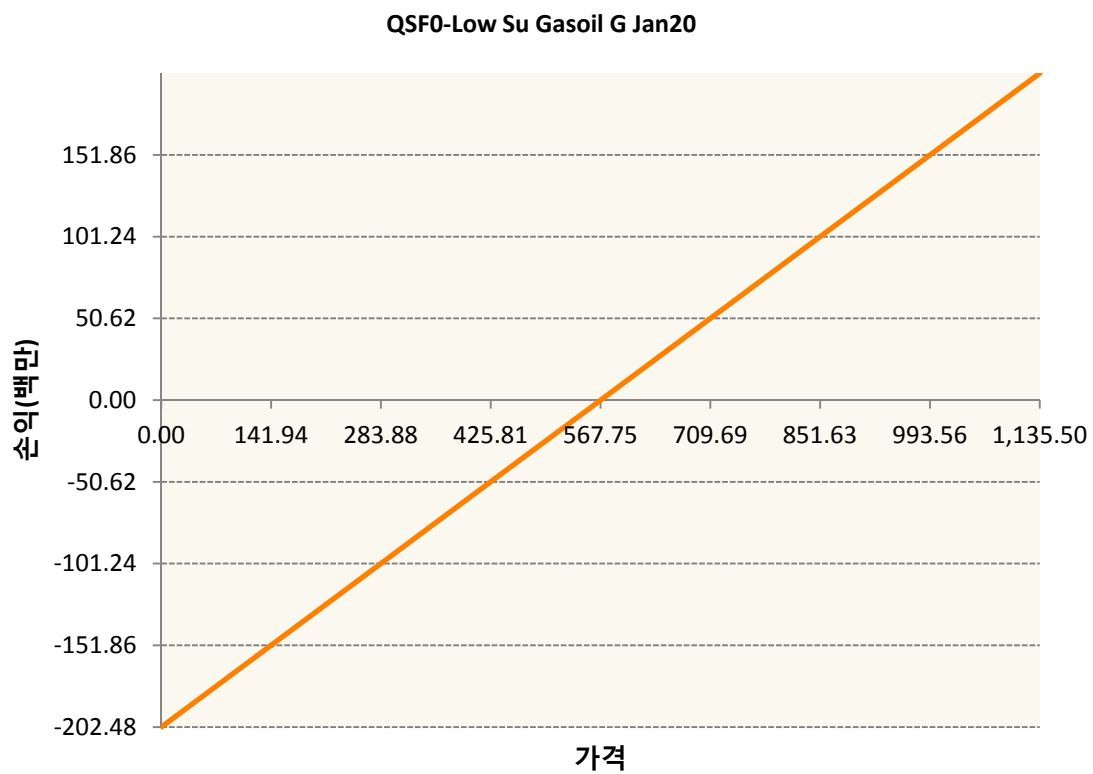
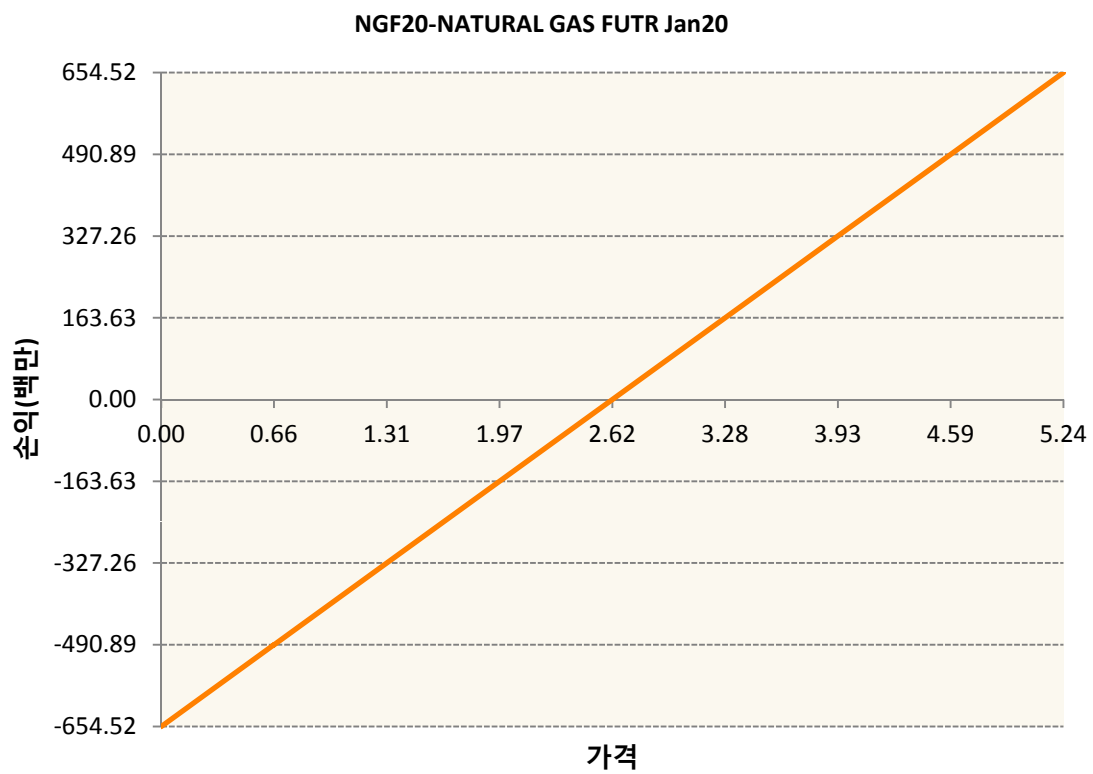
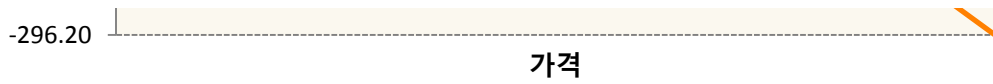
CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20



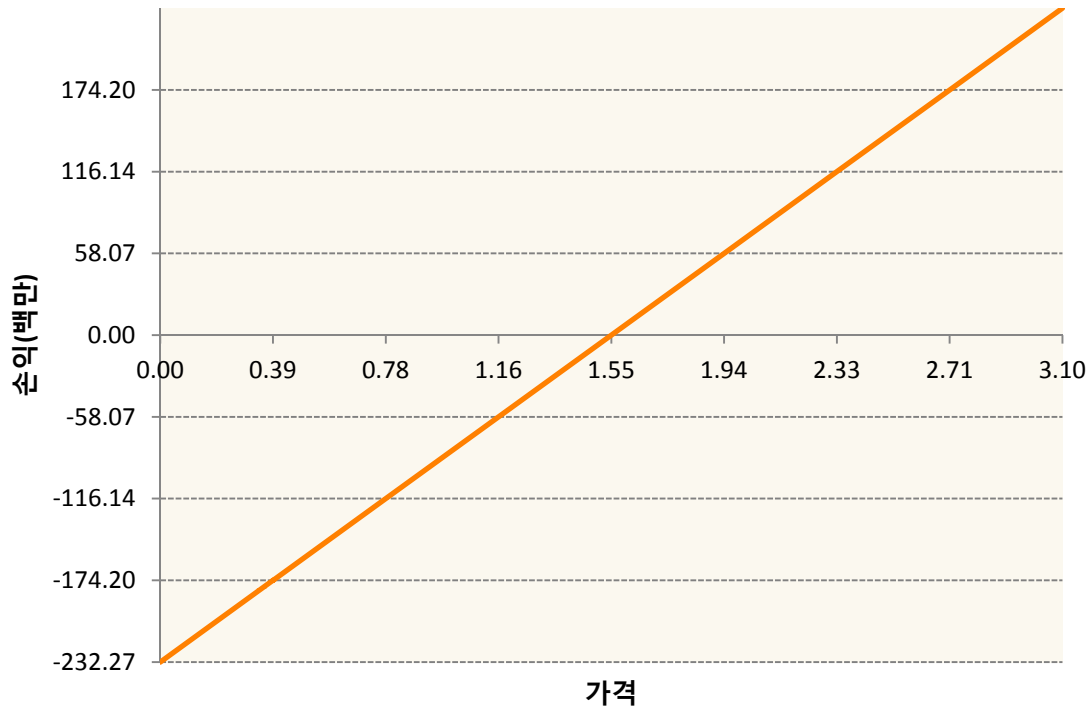
COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20







XBF0-GASOLINE RBOB FUT Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLF0	WTI CRUDE FUTURE Jan20	46
COF0	BRENT CRUDE FUTR Jan20	51
HOF0	NY Harb ULSD Fut Jan20	15
KR4175PA00	2019-10 달러선물	24
NGF20	NATURAL GAS FUTR Jan20	52
QSF0	Low Su Gasoil G Jan20	16
XBF0	GASOLINE RBOB FUT Jan20	19

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

(단위:백만원)

415

공시일	2019-10-16
기준일	2019-10-15

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

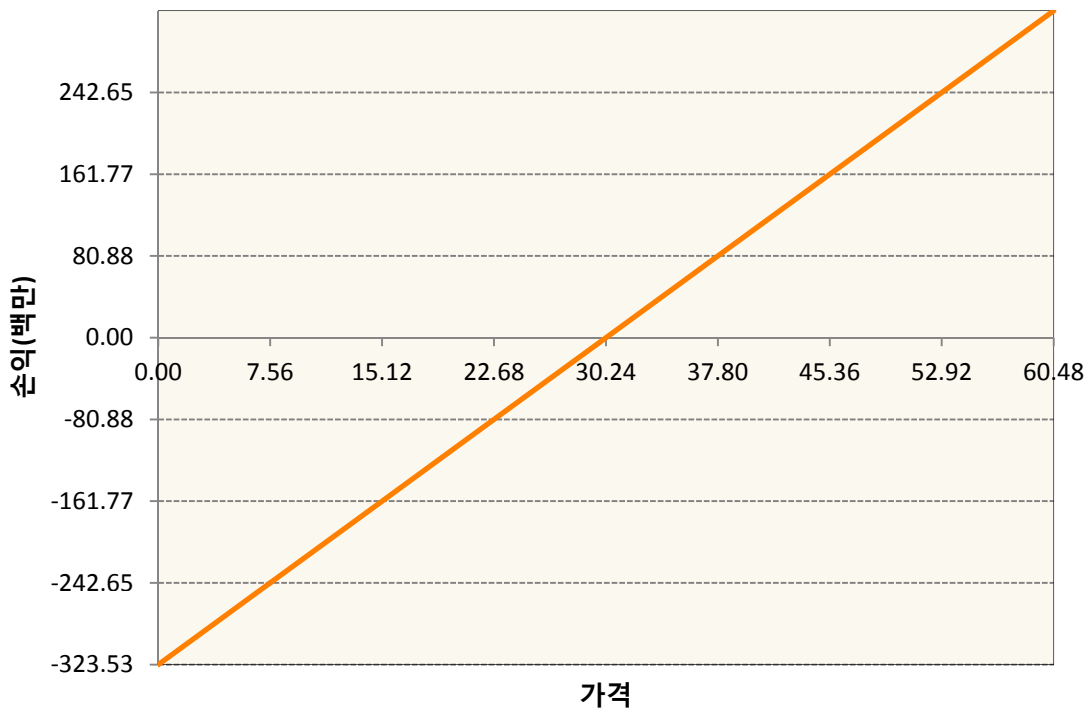
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

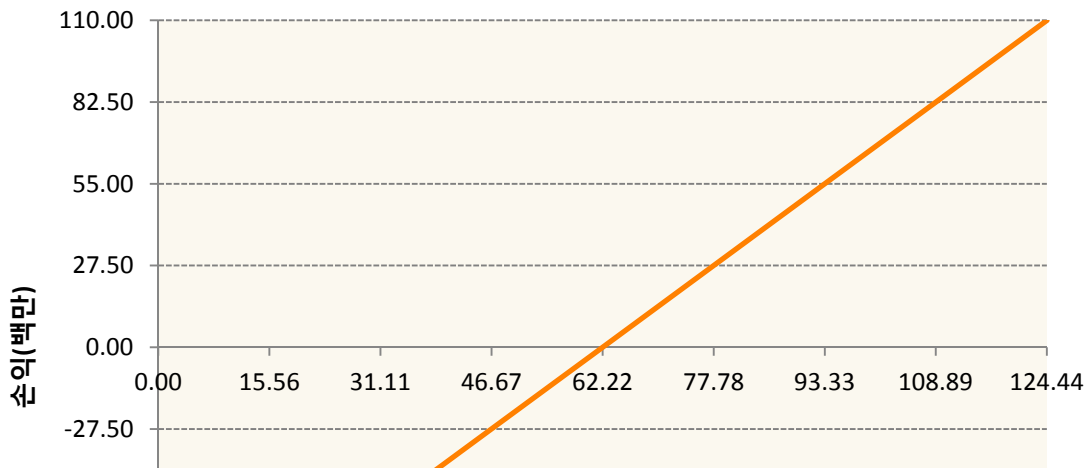
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,878	95	2,783	

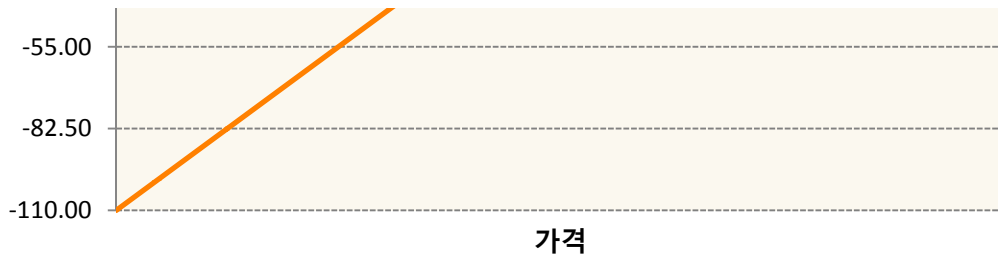
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20**

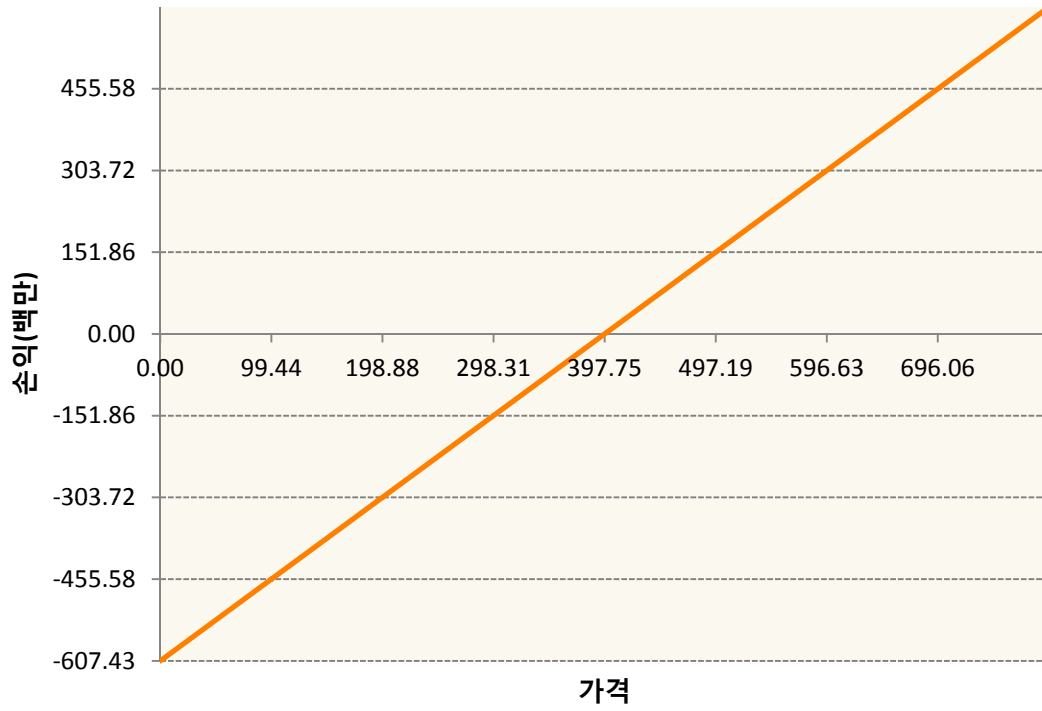


**CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19**

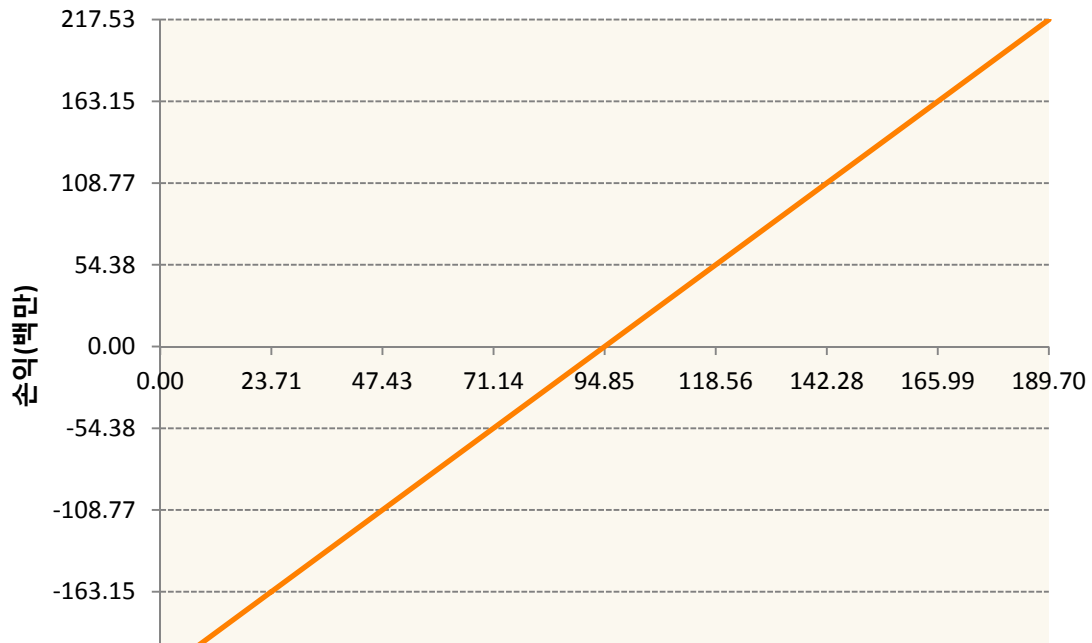


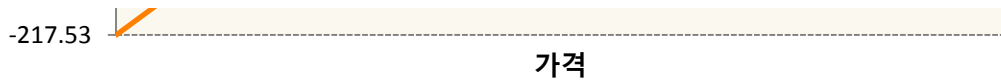


**CZ9-CORN FUTURE Dec19**

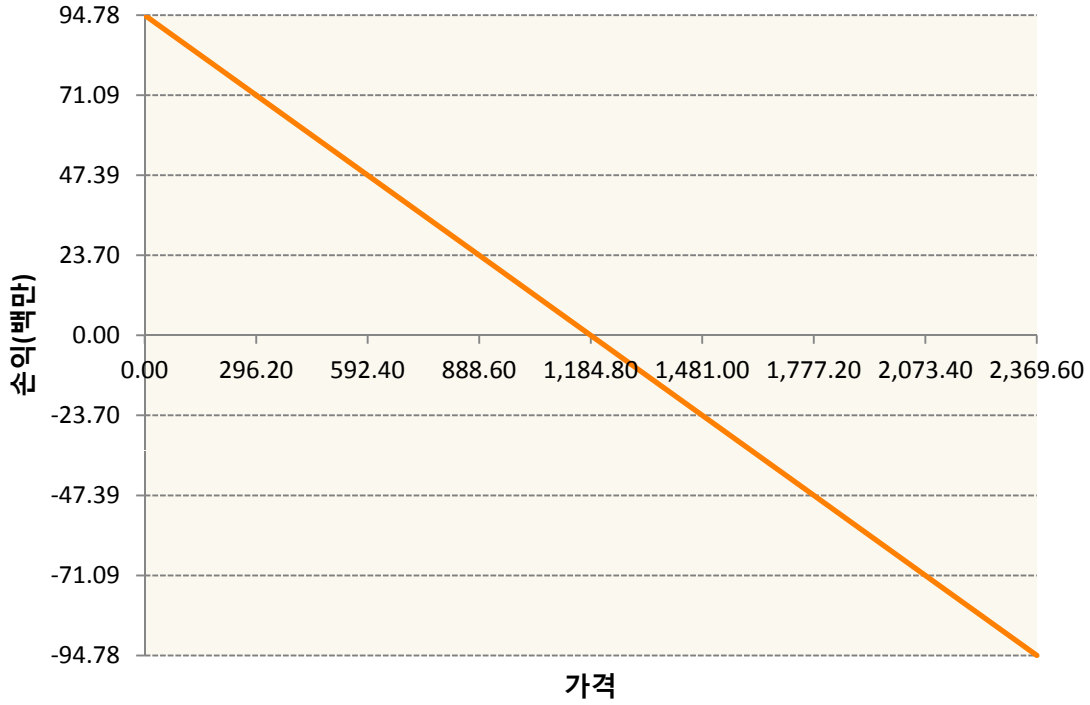


**KCZ9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19**

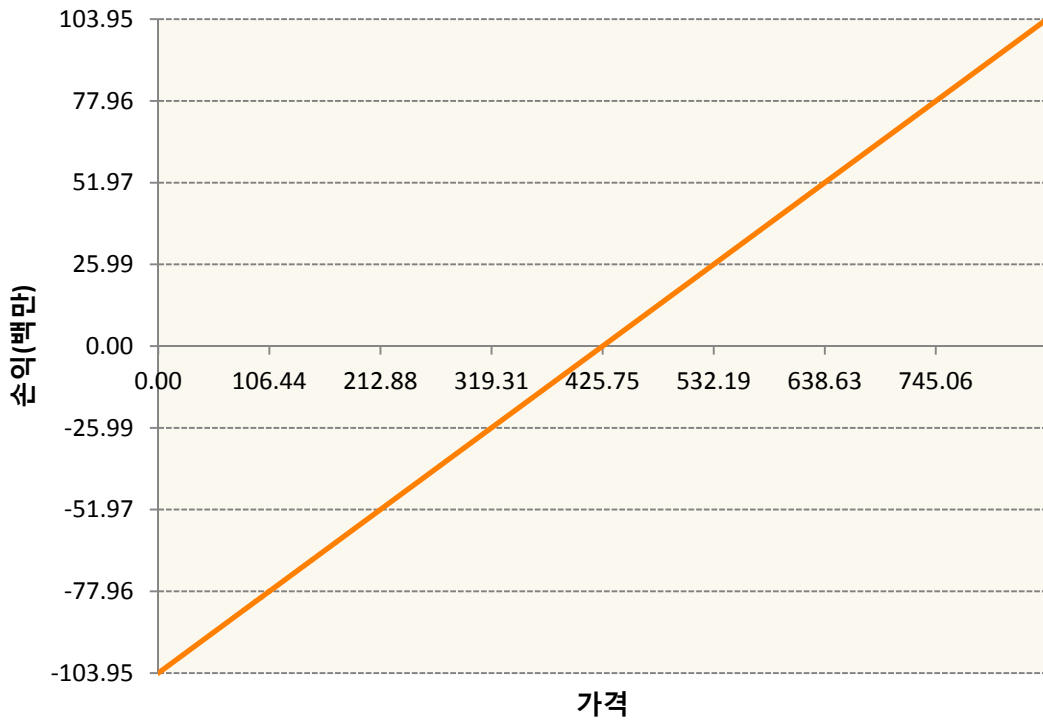




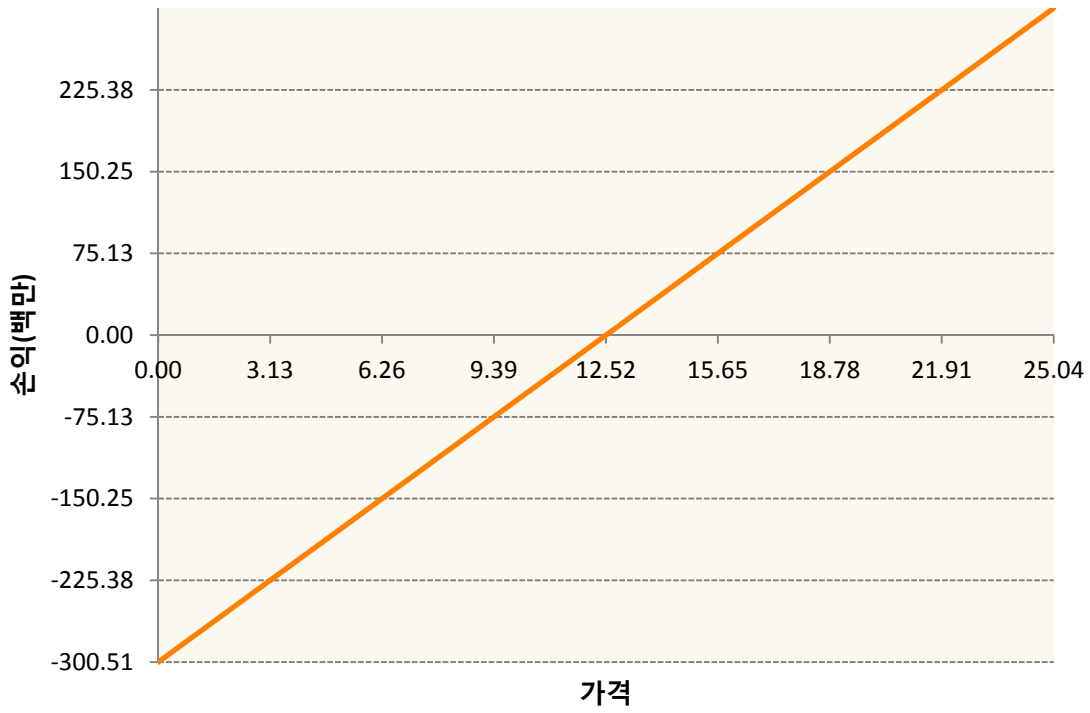
KR4175PA0005-2019-10 달러선물



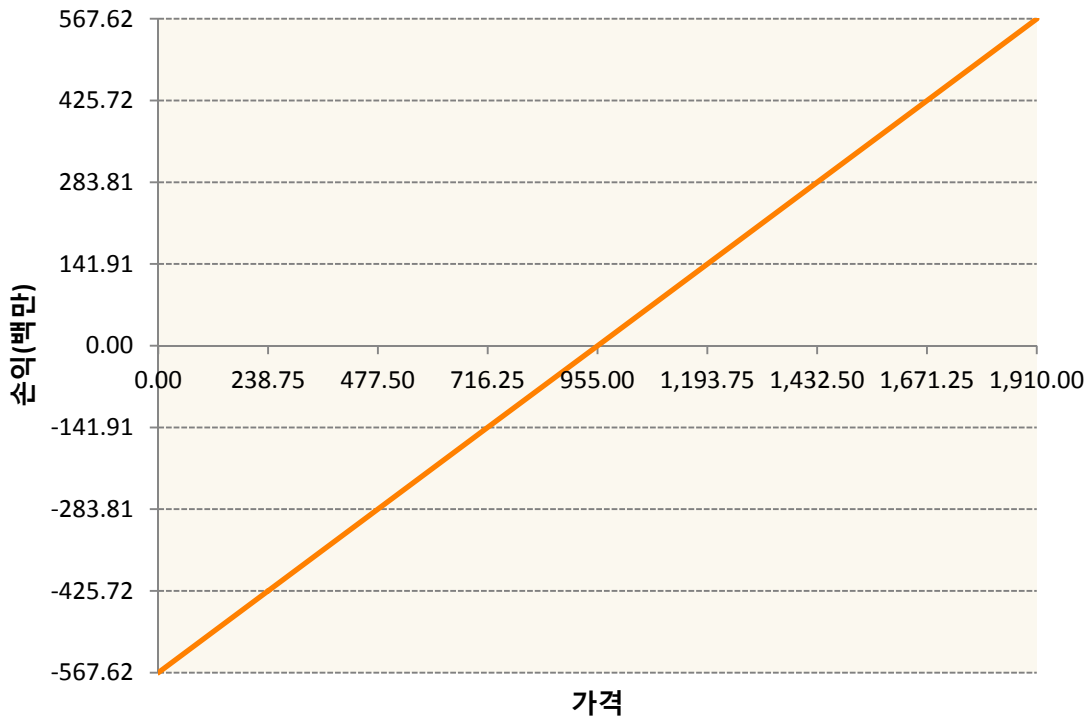
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



SBH0-Sugar Mar20

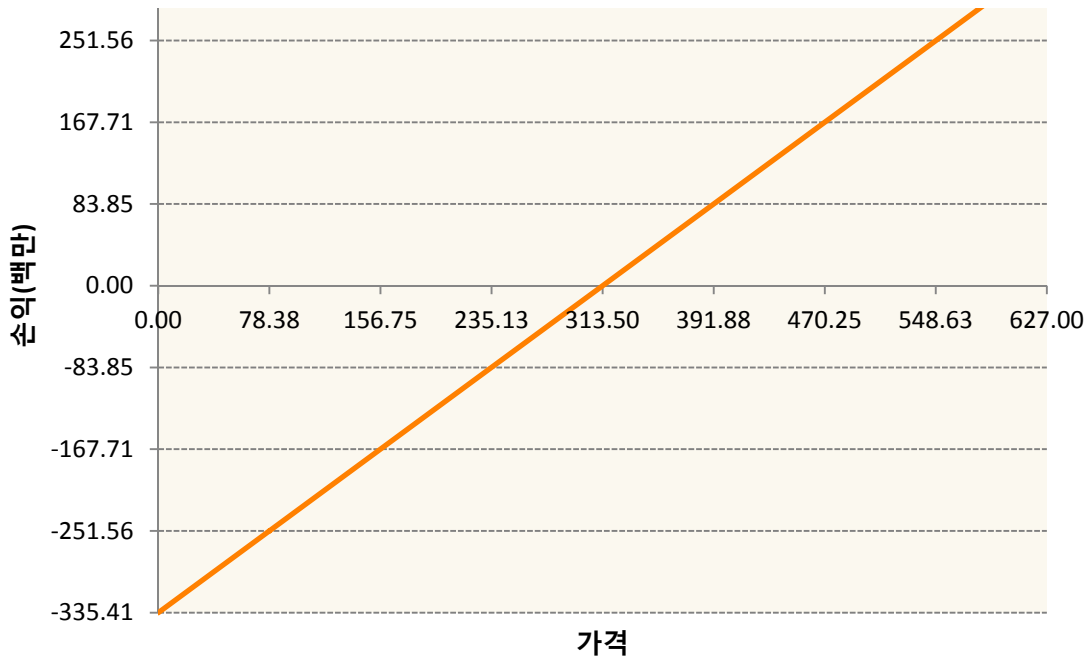


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20

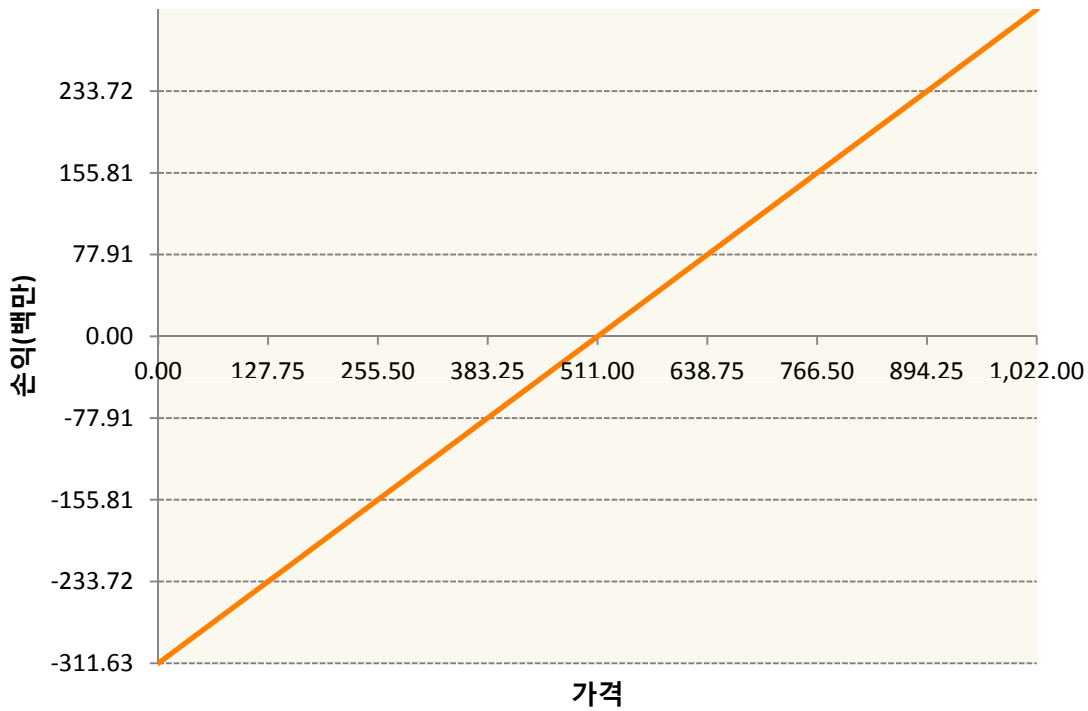


SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





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)

**258**