

공시일	2019-10-17
기준일	2019-10-16

## 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	2019-10-17
기준일	2019-10-16

## 스마트인덱스모

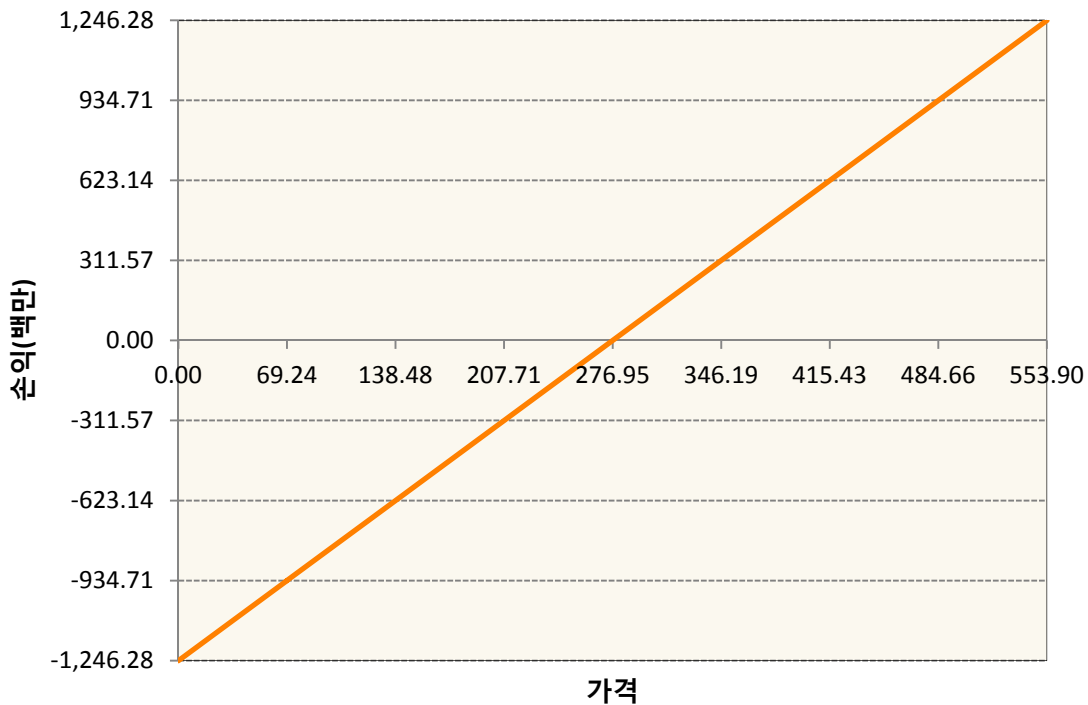
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,246	0	1,246	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						99
가격	기초자산의 변동성							
	-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)

83

공시일	2019-10-17
기준일	2019-10-16

## 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

1,181

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

687

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-10-17
기준일	2019-10-16

## 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)	383
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	140

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

799

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-10-17
기준일	2019-10-16

## 유로인덱스모(주식-파생형)

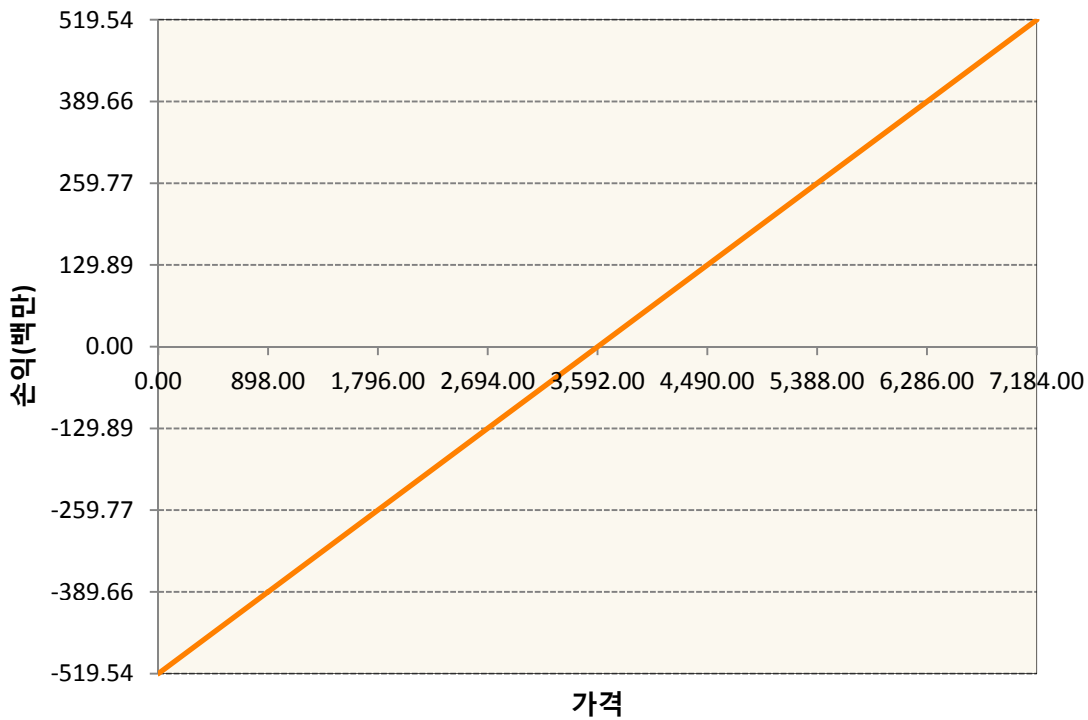
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	520	0	520	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGZ9-EURO STOXX 50 Dec19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	42
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

30
----

공시일	2019-10-17
기준일	2019-10-16

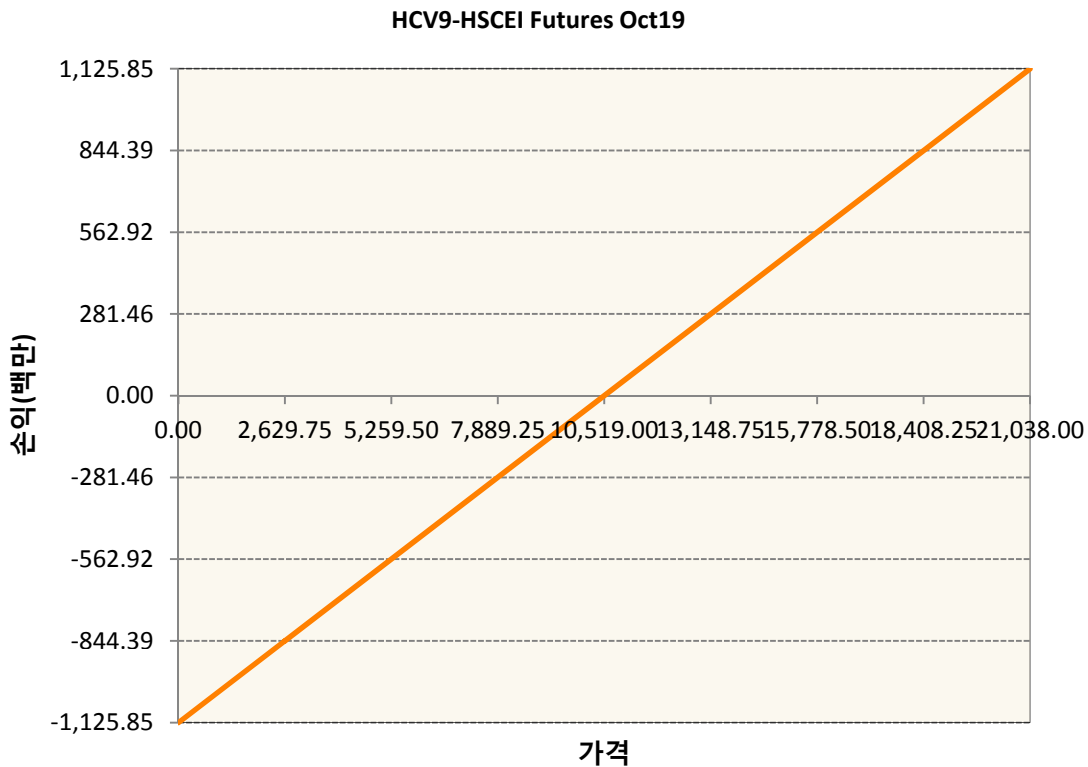
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,126	0	1,126	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	2019-10-17
기준일	2019-10-16

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

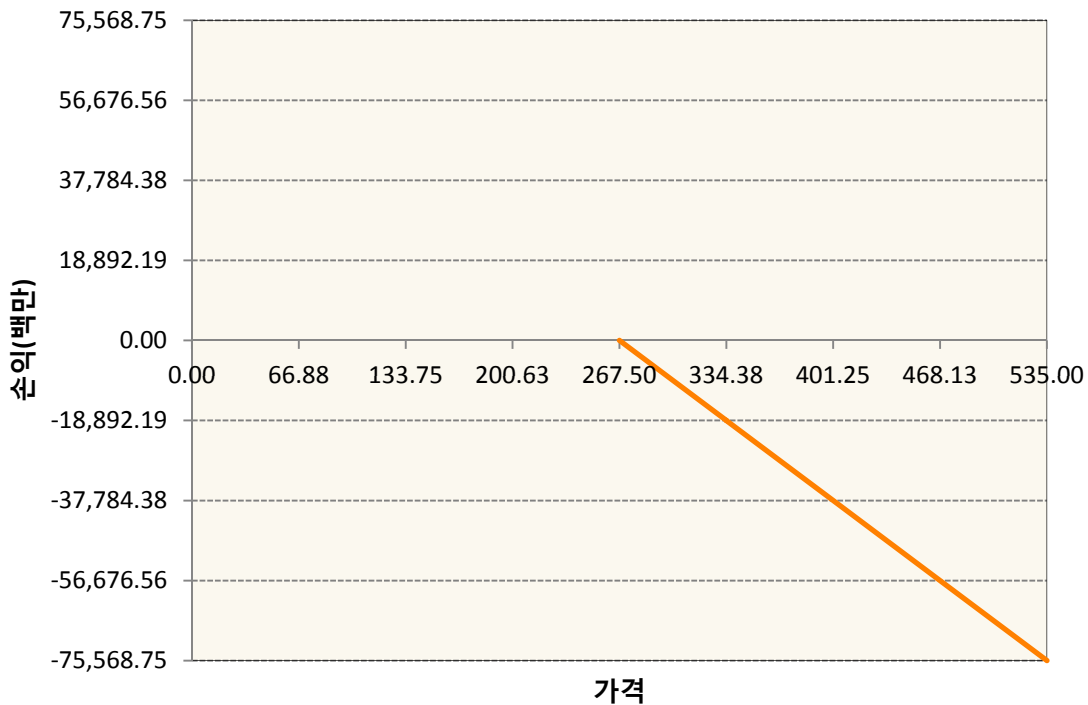
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

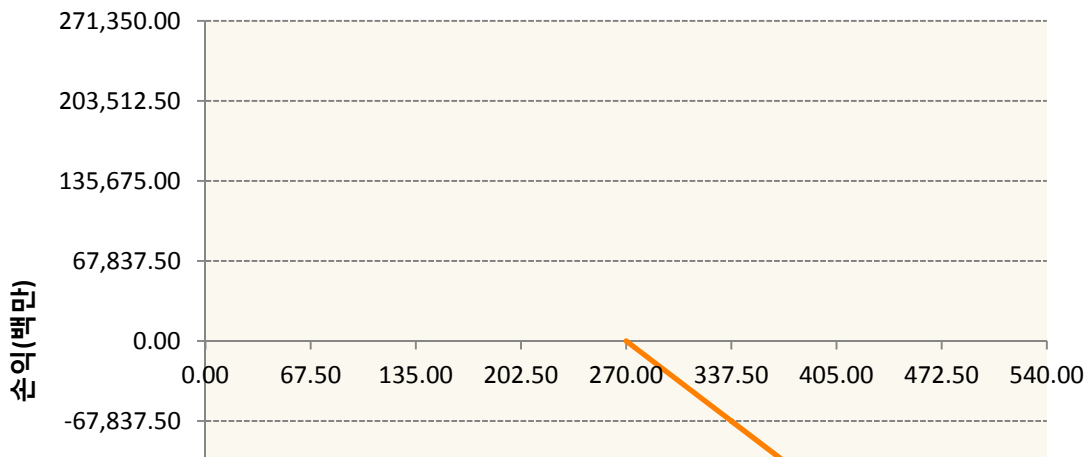
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	514,106	-514,106	장내

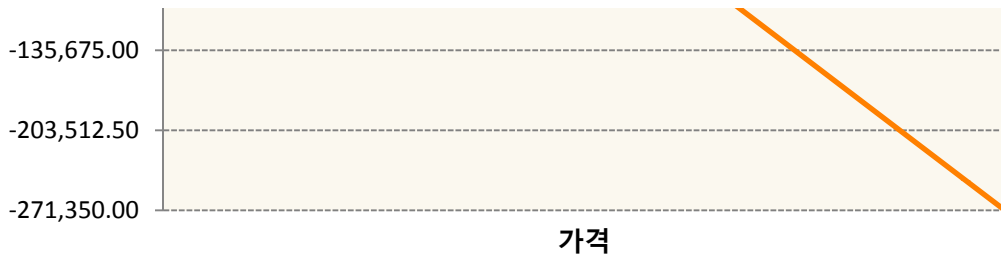
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201PB2677-2019-11 콜267.5**

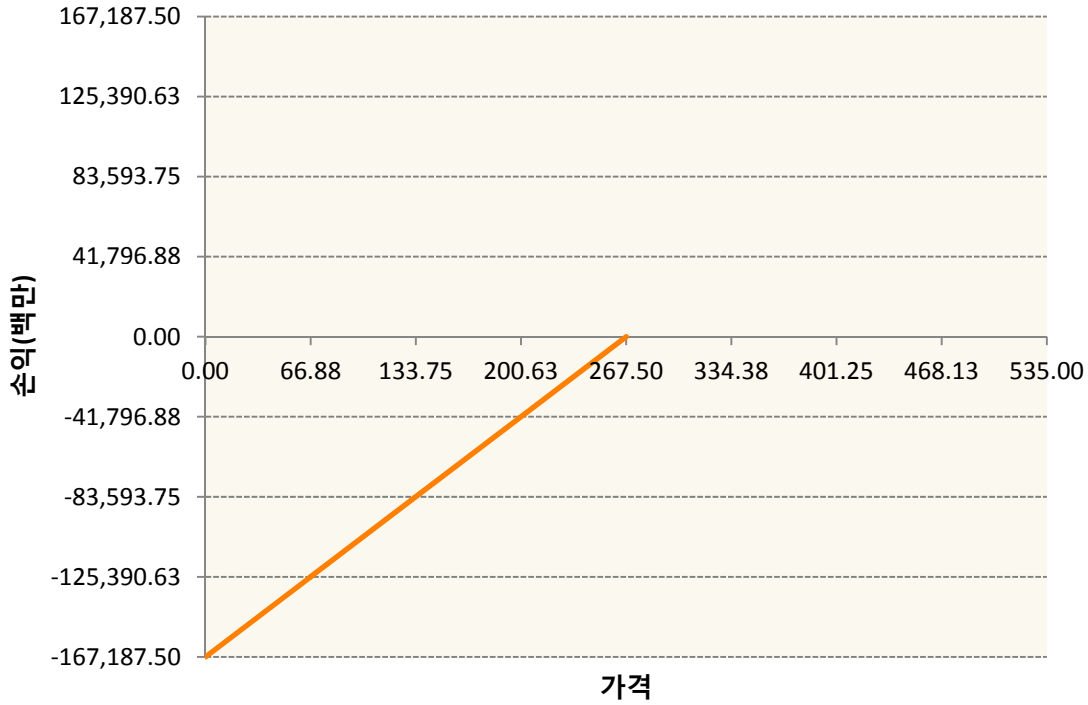


**KR4201PB2701-2019-11 콜270**





KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201PB2677		2019-11 콜267.5					5,404
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,323	3,196	3,059	2,915	2,765	2,611	2,453
-5.33%	2,768	2,593	2,416	2,238	2,058	1,877	1,695
-2.67%	1,837	1,647	1,457	1,266	1,076	886	696
0%	516	348	176	0	-178	-358	-540
2.67%	-1,129	-1,252	-1,385	-1,527	-1,677	-1,832	-1,992
5.33%	-2,994	-3,069	-3,158	-3,260	-3,373	-3,495	-3,626
8.00%	-4,981	-5,020	-5,072	-5,138	-5,215	-5,304	-5,404
KR4201PB2701		2019-11 콜270					18,651
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,641	10,246	9,812	9,347	8,855	8,343	7,813

-5.33%	9,038	8,457	7,861	7,253	6,636	6,011	5,380
-2.67%	6,192	5,513	4,833	4,154	3,474	2,794	2,114
0%	1,954	1,310	658	0	-663	-1,329	-1,999
2.67%	-3,533	-4,035	-4,569	-5,127	-5,705	-6,299	-6,905
5.33%	-9,928	-10,256	-10,634	-11,053	-11,507	-11,991	-12,500
8.00%	-16,869	-17,051	-17,284	-17,565	-17,890	-18,253	-18,651
KR4301PB2676                      2019-11 풋267.5							8,221
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,738	-7,786	-7,848	-7,924	-8,012	-8,112	-8,221
-5.33%	-3,635	-3,791	-3,956	-4,127	-4,303	-4,484	-4,669
-2.67%	-807	-1,016	-1,226	-1,436	-1,647	-1,858	-2,068
0%	407	284	147	0	-156	-319	-489
2.67%	694	660	612	551	476	389	291
5.33%	730	725	716	700	676	643	601
8.00%	732	732	731	728	723	714	700

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

(단위:백만원)

**30,681**

공시일	2019-10-17
기준일	2019-10-16

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

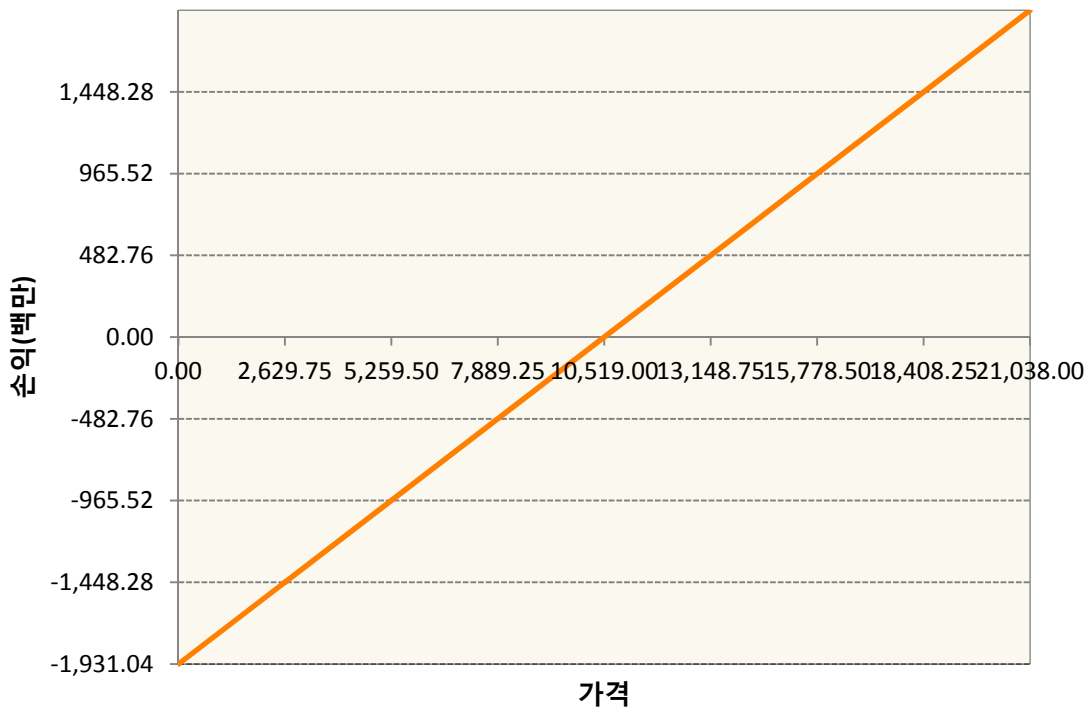
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

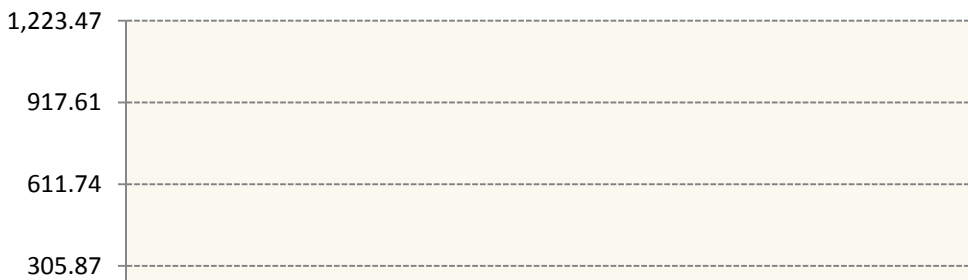
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,931	0	1,931	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,918	-4,918	장내
누계	통화	선도	681	2,813	-2,132	장외

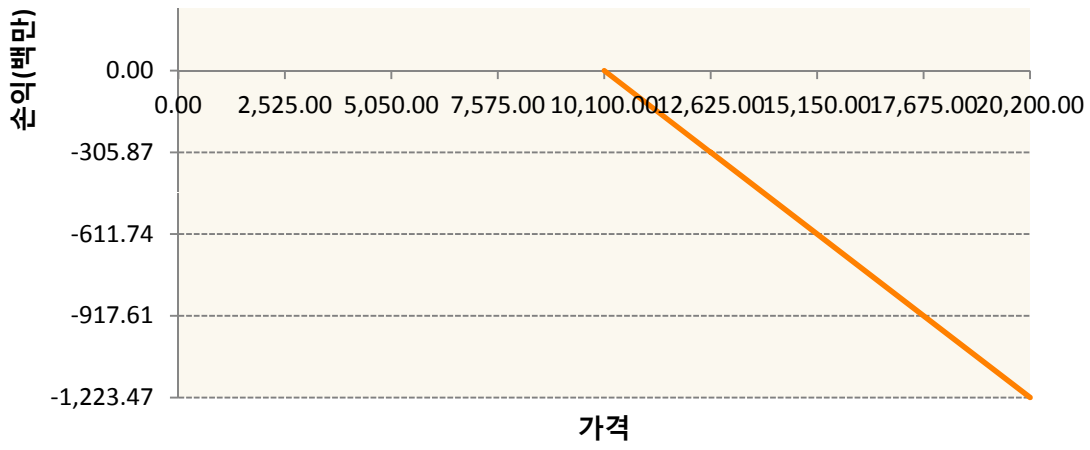
### 2. 만기시점의 손익구조

HCV9-HSCEI Futures Oct19

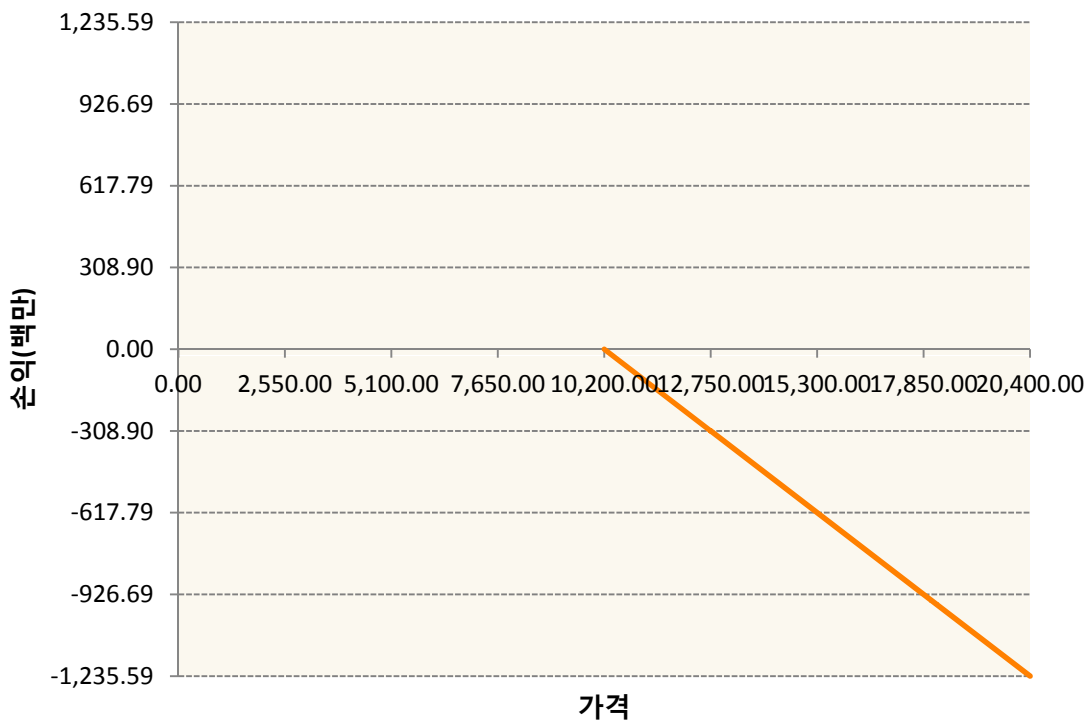


OHHIV9-C101-HSCEI

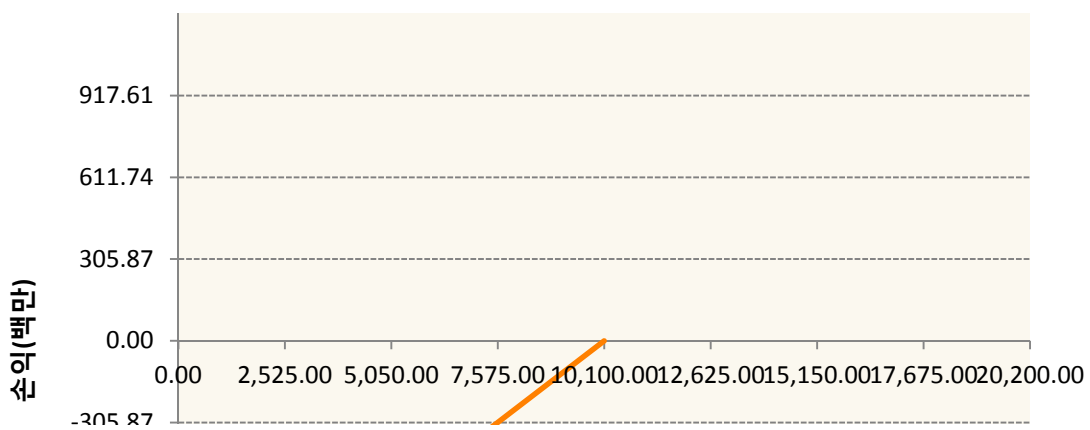


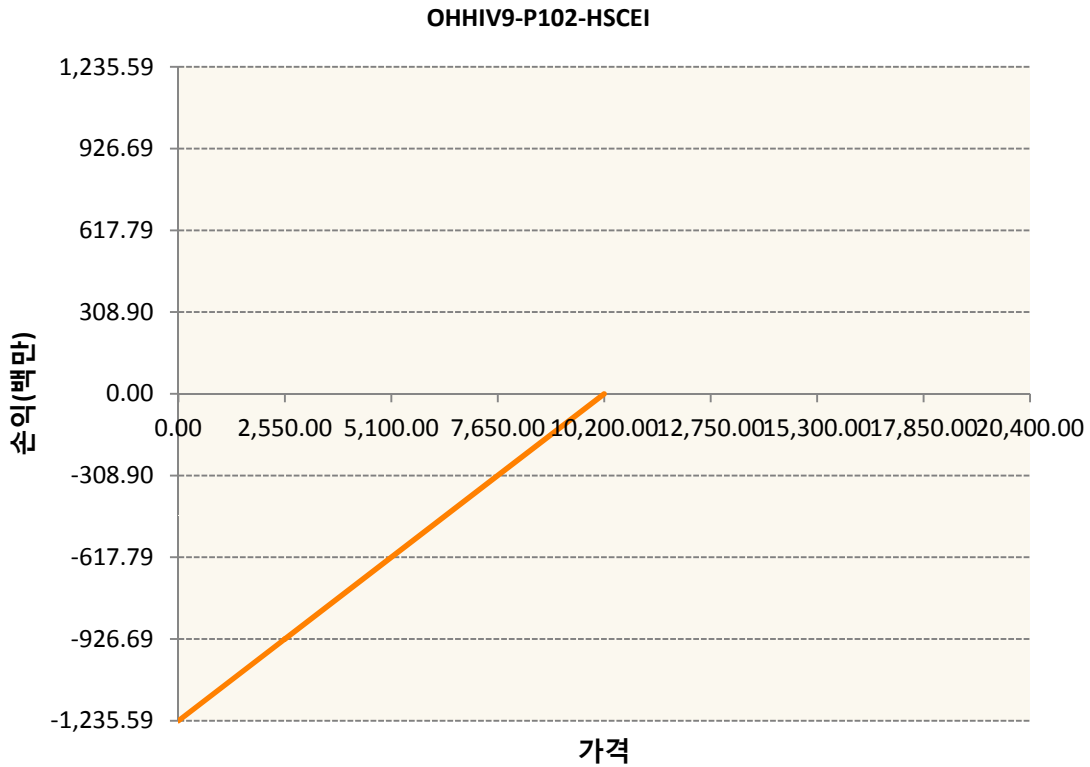


OHHIV9-C102-HSCEI



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)
	583

공시일	2019-10-17
기준일	2019-10-16

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

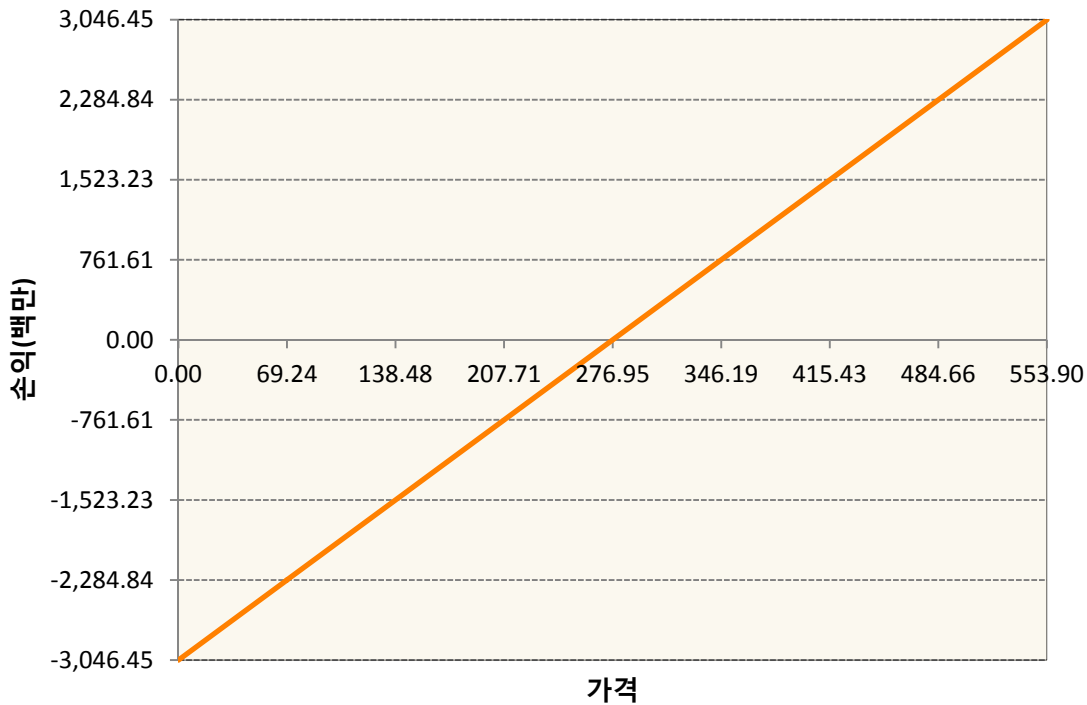
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

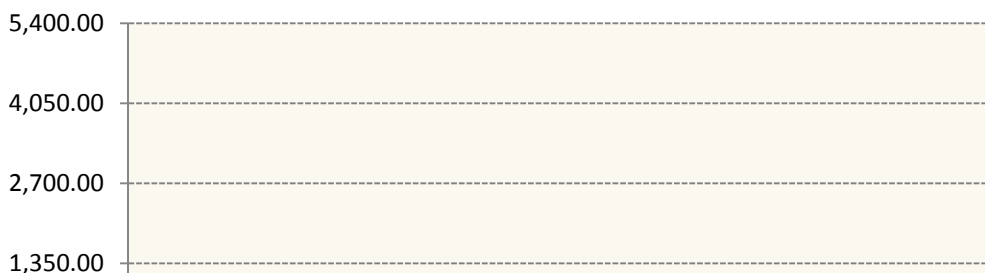
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	200	0	200	장내
누계	유가증권	선물	3,046	0	3,046	장내
누계	유가증권	스왑	10,625	0	10,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	10,752	-10,752	장내

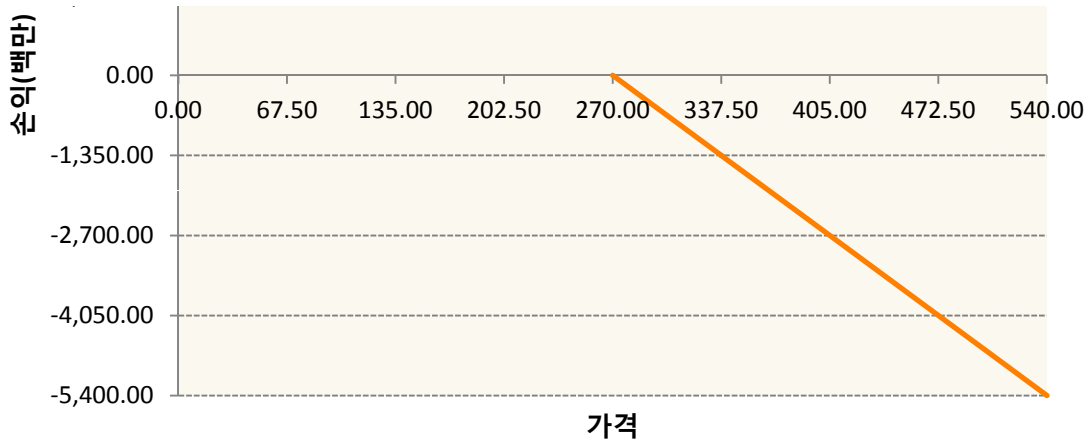
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

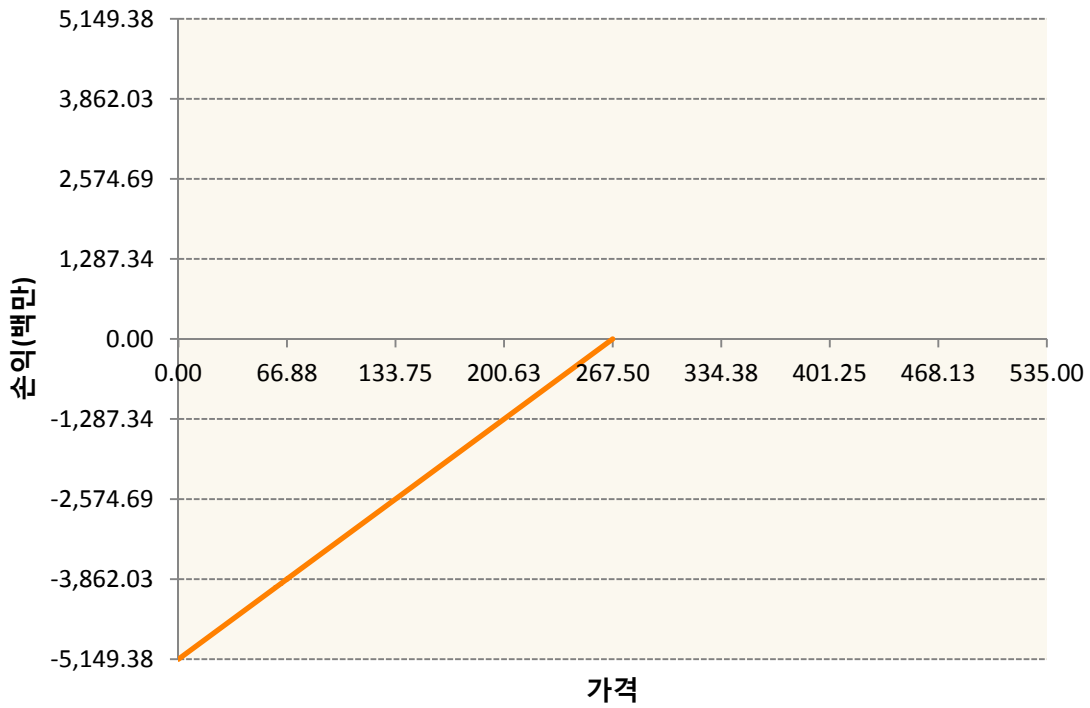


KR4201PB2701-2019-11 콜270

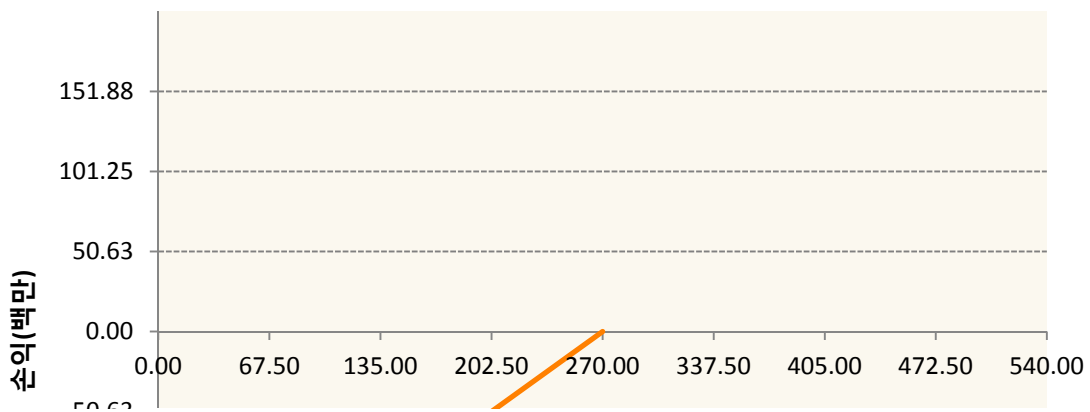


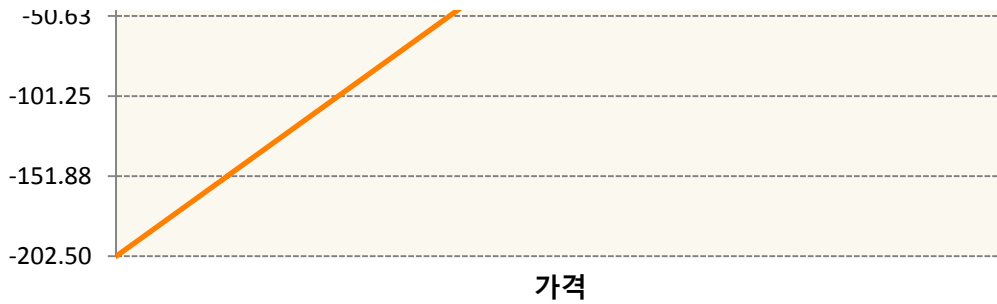


**KR4301PB2676-2019-11 풋267.5**



**KR4301PB2700-2019-11 풋270**





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						922
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-922	-922	-922	-922	-922	-922	-922	
-5.33%	-615	-615	-615	-615	-615	-615	-615	
-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%	615	615	615	615	615	615	615	
8.00%	922	922	922	922	922	922	922	
KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						243
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-243	-243	-243	-243	-243	-243	-243	
-5.33%	-162	-162	-162	-162	-162	-162	-162	
-2.67%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	81	81	81	81	81	81	81	
5.33%	162	162	162	162	162	162	162	
8.00%	243	243	243	243	243	243	243	
KR4201PB2701		2019-11 콜270						371
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	212	204	195	186	176	166	155	
-5.33%	180	168	156	144	132	120	107	
-2.67%	123	110	96	83	69	56	42	
0%	39	26	13	0	-13	-26	-40	
2.67%	-70	-80	-91	-102	-114	-125	-137	
5.33%	-198	-204	-212	-220	-229	-239	-249	
8.00%	-336	-339	-344	-350	-356	-363	-371	
KR4301PB2676		2019-11 풋267.5						253
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-238	-240	-242	-244	-247	-250	-253
-5.33%	-112	-117	-122	-127	-133	-138	-144
-2.67%	-25	-31	-38	-44	-51	-57	-64
0%	13	9	5	0	-5	-10	-15
2.67%	21	20	19	17	15	12	9
5.33%	22	22	22	22	21	20	19
8.00%	23	23	23	22	22	22	22
KR4301PB2700                      2019-11 풋270							11
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
-5.33%	-5	-6	-6	-6	-6	-6	-7
-2.67%	-1	-2	-2	-2	-2	-3	-3
0%	1	0	0	0	0	0	-1
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

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

(단위:백만원)

**1,716**

공시일	2019-10-17
기준일	2019-10-16

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

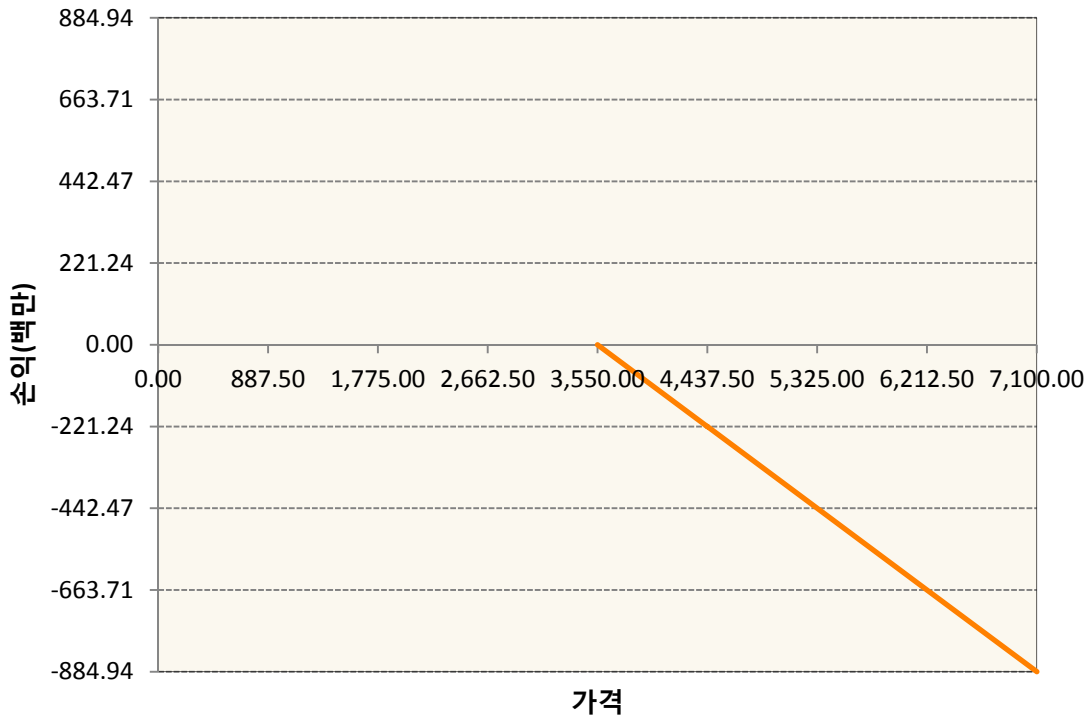
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

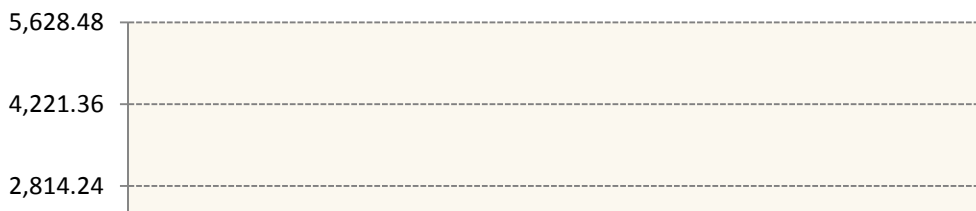
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,634	0	3,634	
누계	유가증권	스왑	23,875	0	23,875	장외
누계	유가증권	옵션	0	13,027	-13,027	장내
누계	통화	선도	0	6,167	-6,167	장외

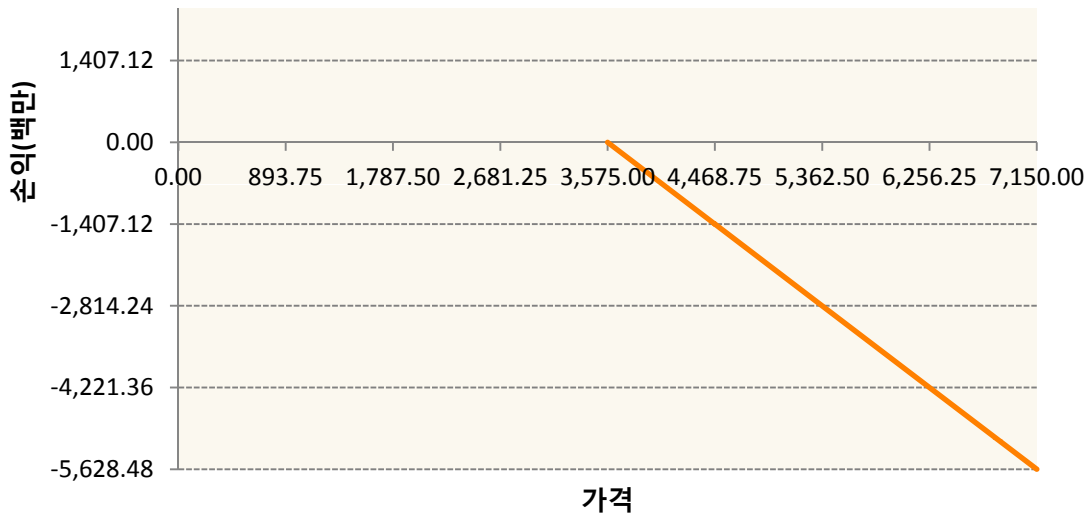
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXV9-C3550-EURO STOXX 50

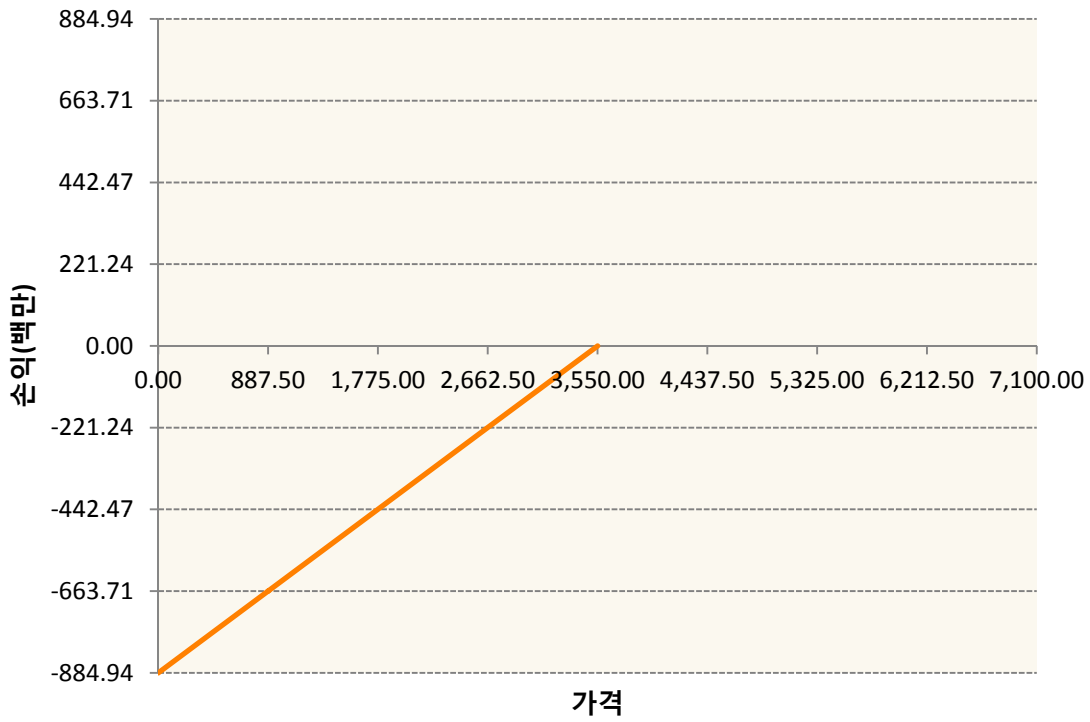


OESXV9-C3575-EURO STOXX 50

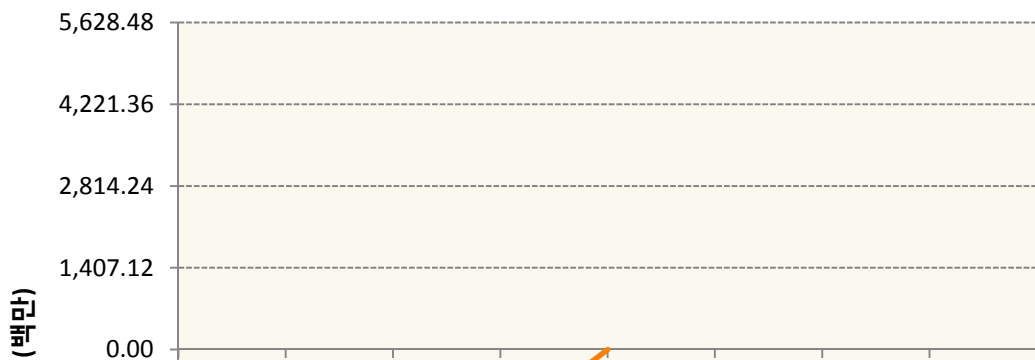


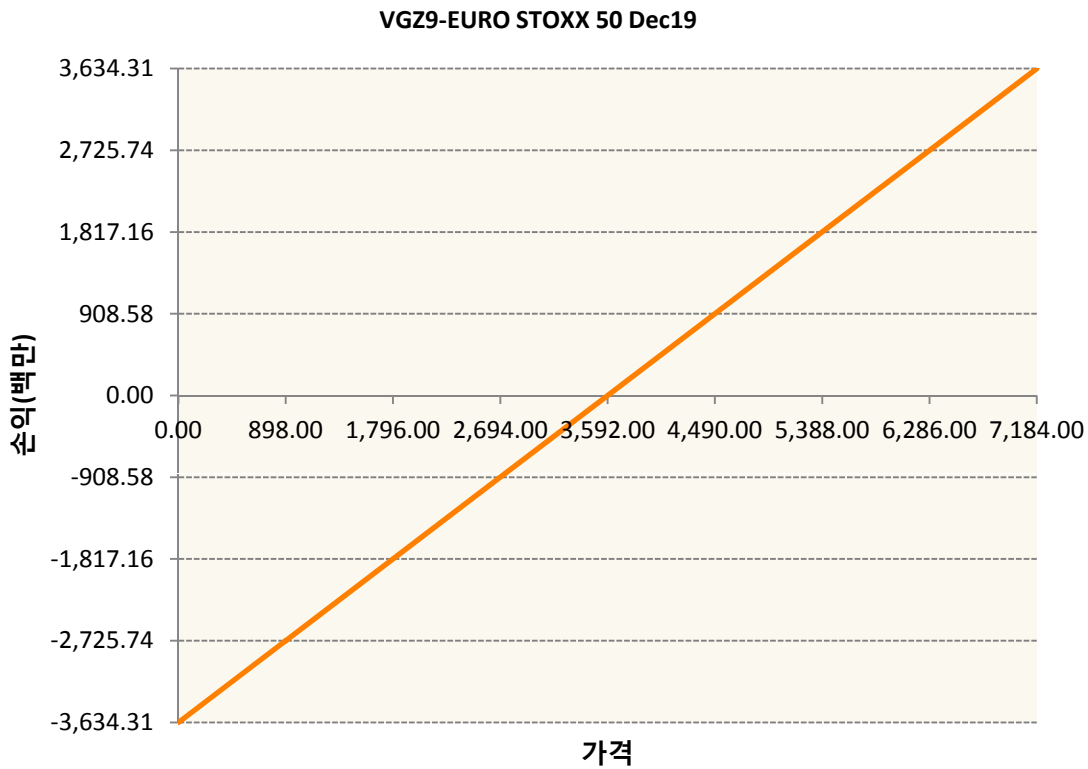
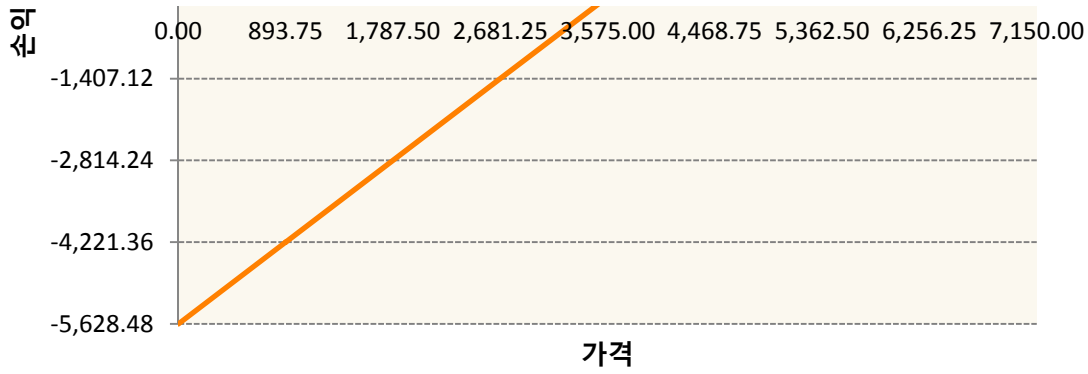


OESXV9-P3550-EURO STOXX 50



OESXV9-P3575-EURO STOXX 50





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	0.5
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E	493
OESXV9-C35 EURO STOXX 50	71
OESXV9-C35 EURO STOXX 50	450
OESXV9-P35 EURO STOXX 50	71
OESXV9-P35 EURO STOXX 50	450
VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19	291

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





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

(단위:백만원)

952

공시일	2019-10-17
기준일	2019-10-16

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

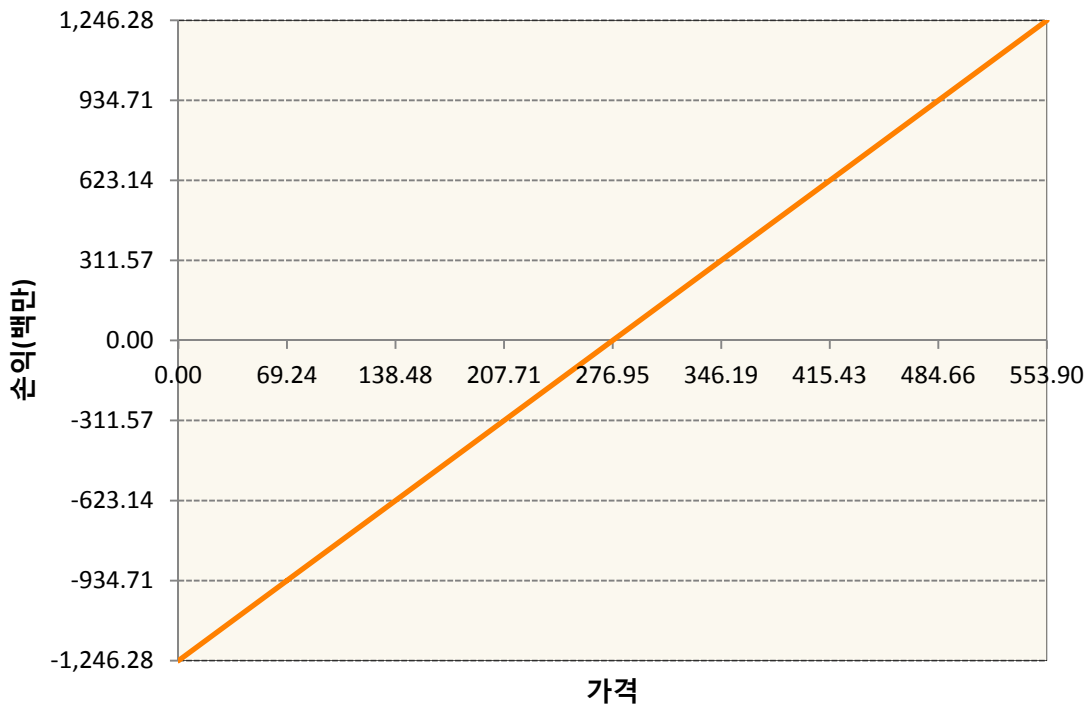
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,246	0	1,246	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						99
가격	기초자산의 변동성							
	-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)

83



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

(단위:백만원)

129

공시일	2019-10-17
기준일	2019-10-16

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

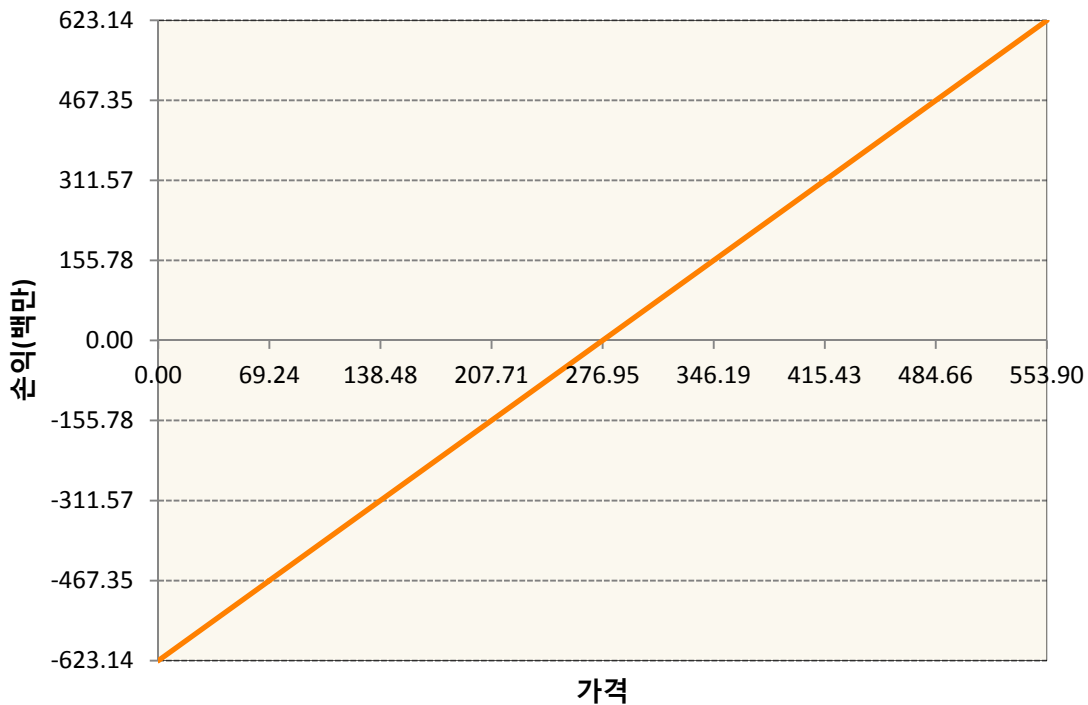
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	623	0	623	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						50
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	17	17	17	17	17	17	17	
5.33%	33	33	33	33	33	33	33	
8.00%	50	50	50	50	50	50	50	

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-10-17
기준일	2019-10-16

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

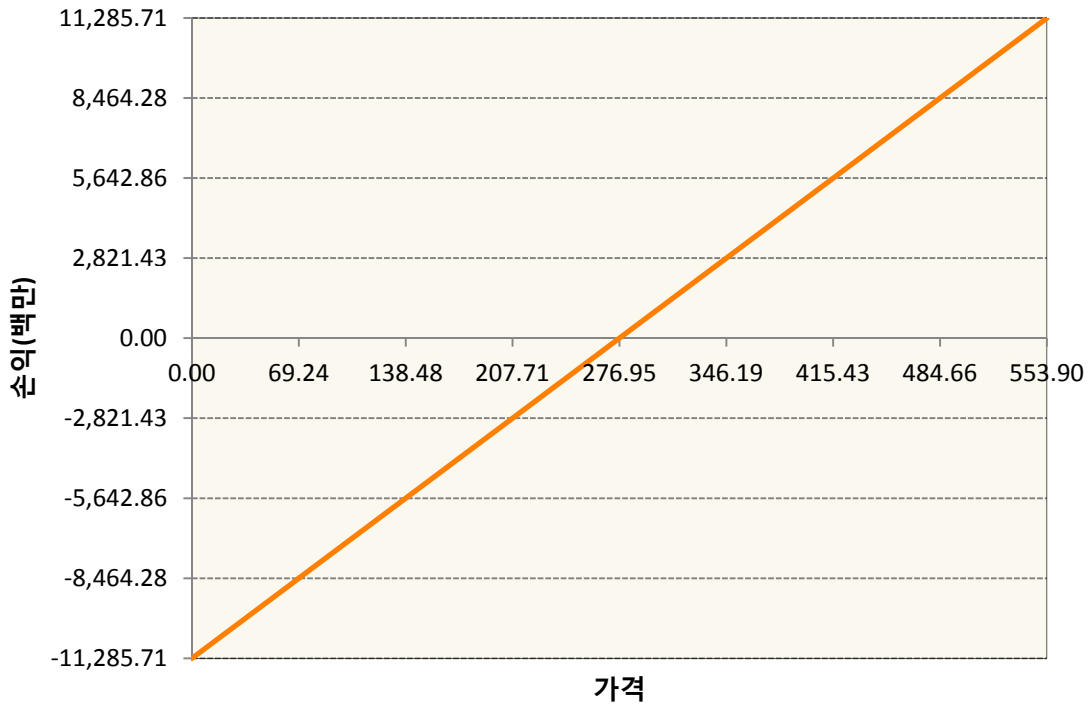
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

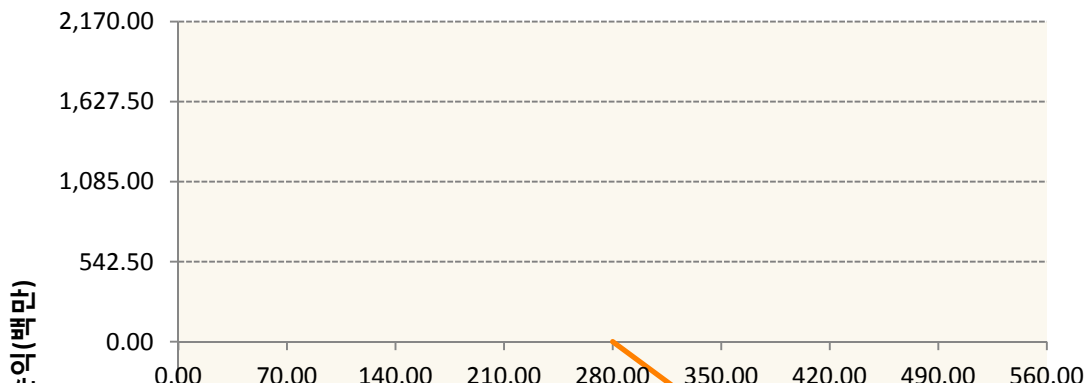
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,286	0	11,286	장내
누계	유가증권	옵션	3,561	20,815	-17,254	장내

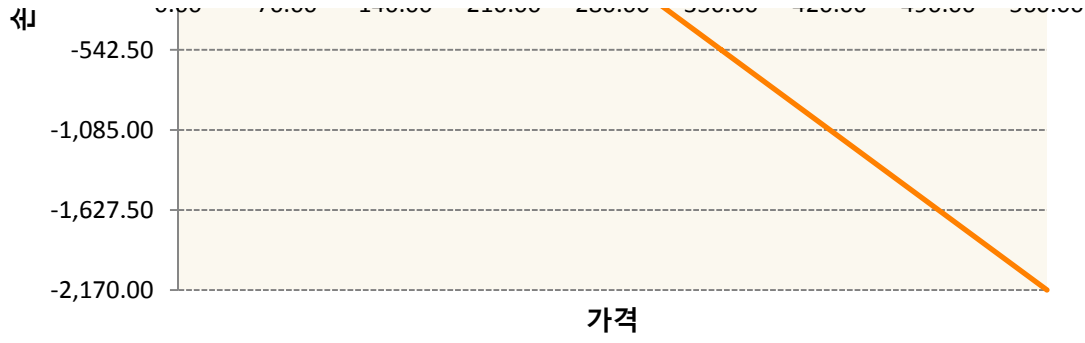
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

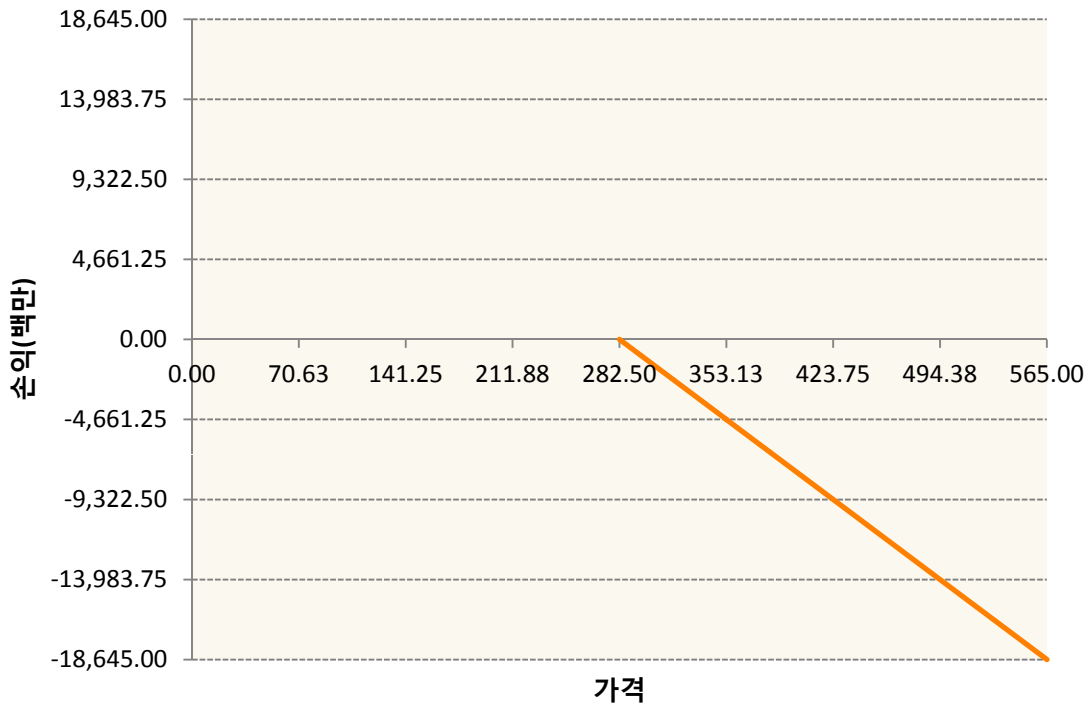


KR4201PB2800-2019-11 콜280

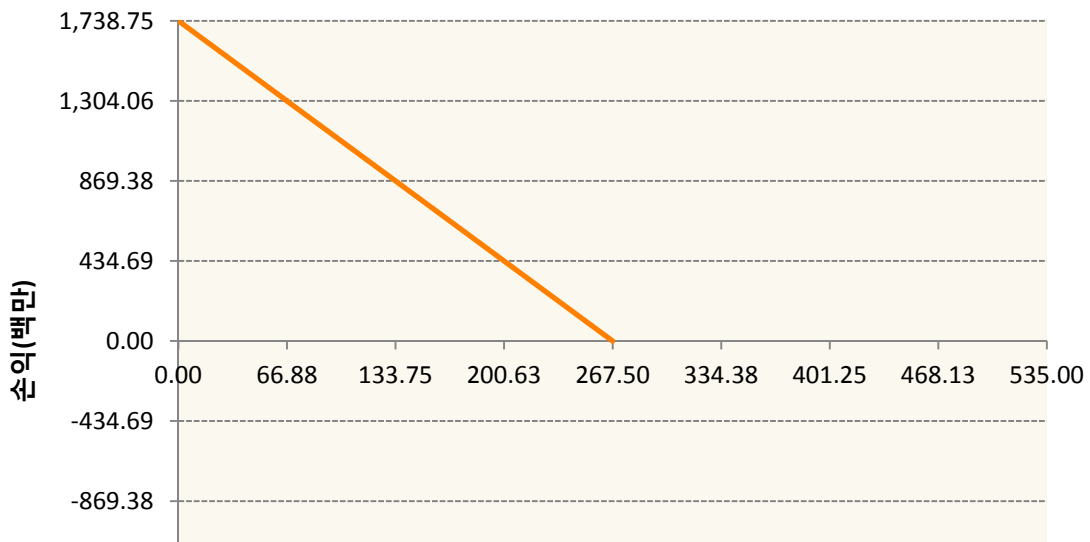


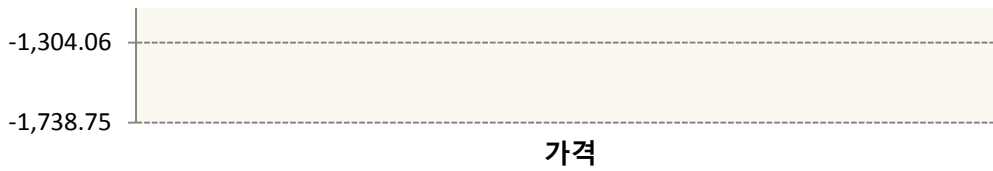


KR4201PB2826-2019-11 콜282.5

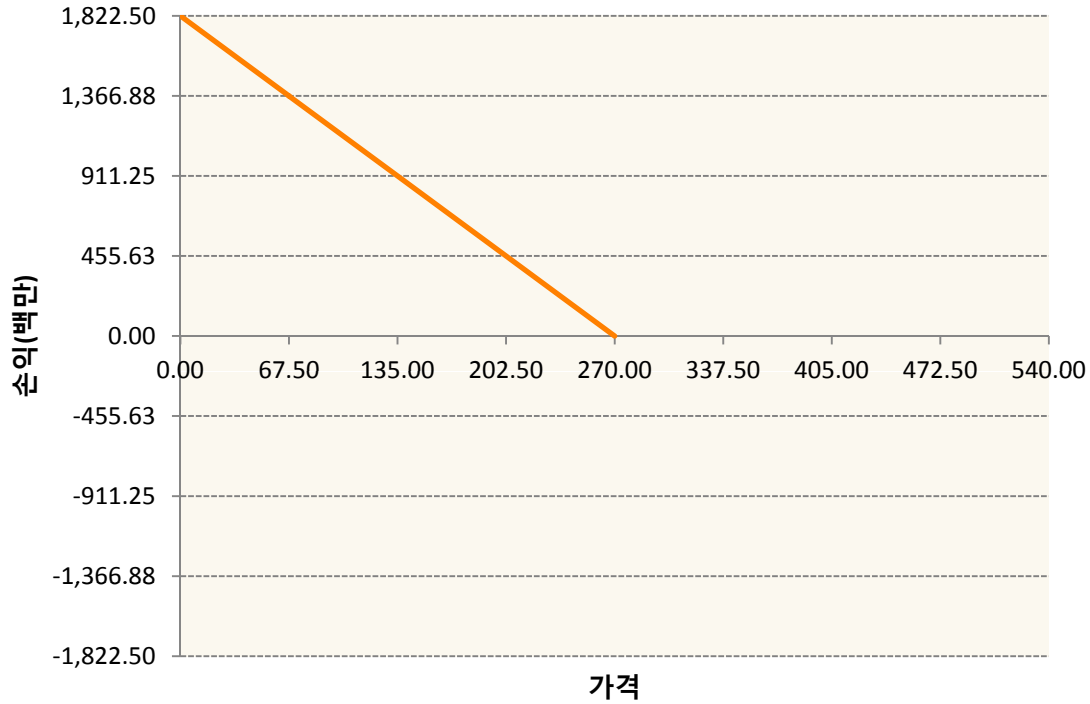


KR4301PB2676-2019-11 풋267.5





KR4301PB2700-2019-11 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						901
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-901	-901	-901	-901	-901	-901	-901	
-5.33%	-601	-601	-601	-601	-601	-601	-601	
-2.67%	-300	-300	-300	-300	-300	-300	-300	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	300	300	300	300	300	300	300	
5.33%	601	601	601	601	601	601	601	
8.00%	901	901	901	901	901	901	901	
KR4201PB2800		2019-11 콜280						122
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	49	48	46	44	41	39	36	
-5.33%	45	42	39	35	32	28	24	
-2.67%	35	30	26	21	17	12	7	

0%	16	11	5	0	-5	-11	-16
2.67%	-13	-18	-24	-29	-35	-40	-45
5.33%	-52	-56	-61	-66	-71	-76	-81
8.00%	-98	-102	-105	-109	-113	-118	-122
KR4201PB2826                      2019-11 콜282.5							985
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	360	350	338	323	305	284	262
-5.33%	331	312	289	264	236	206	175
-2.67%	264	231	197	161	123	84	45
0%	131	88	44	0	-44	-89	-134
2.67%	-85	-132	-179	-226	-273	-320	-366
5.33%	-387	-430	-473	-517	-561	-606	-651
8.00%	-764	-796	-830	-867	-905	-944	-985
KR4301PB2676                      2019-11 풋267.5							86
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	80	81	82	82	83	84	86
-5.33%	38	39	41	43	45	47	49
-2.67%	8	11	13	15	17	19	22
0%	-4	-3	-2	0	2	3	5
2.67%	-7	-7	-6	-6	-5	-4	-3
5.33%	-8	-8	-7	-7	-7	-7	-6
8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-7	-7
KR4301PB2700                      2019-11 풋270							100
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	96	96	97	97	98	99	100
-5.33%	49	51	52	53	55	57	59
-2.67%	13	15	18	20	22	25	27
0%	-6	-4	-2	0	2	4	6
2.67%	-11	-10	-10	-9	-8	-6	-5
5.33%	-12	-12	-12	-11	-11	-10	-10
8.00%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-11

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

(단위:백만원)

**1,810**

공시일	2019-10-17
기준일	2019-10-16

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	5,939	0	5,939	
누계	유가증권	수익증권	152,884	0	152,884	

### 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	2019-10-17
기준일	2019-10-16

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,376	0	2,376	
누계	유가증권	수익증권	195,079	0	195,079	

### 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	2019-10-17
기준일	2019-10-16

## 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	415,562	0	415,562	
누계	통화	선도	0	413,473	-413,473	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,896
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E	3,516
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E	950
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E	950
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E	190
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E	950
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E	1,463
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	2,955
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	3,136
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E	2,604
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E	1,900
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E	1,996
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E	950
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E	665
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E	1,558
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E	703
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E	1,710
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E	2,509
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E	475

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

(단위:백만원)

**10,792**

공시일	2019-10-17
기준일	2019-10-16

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

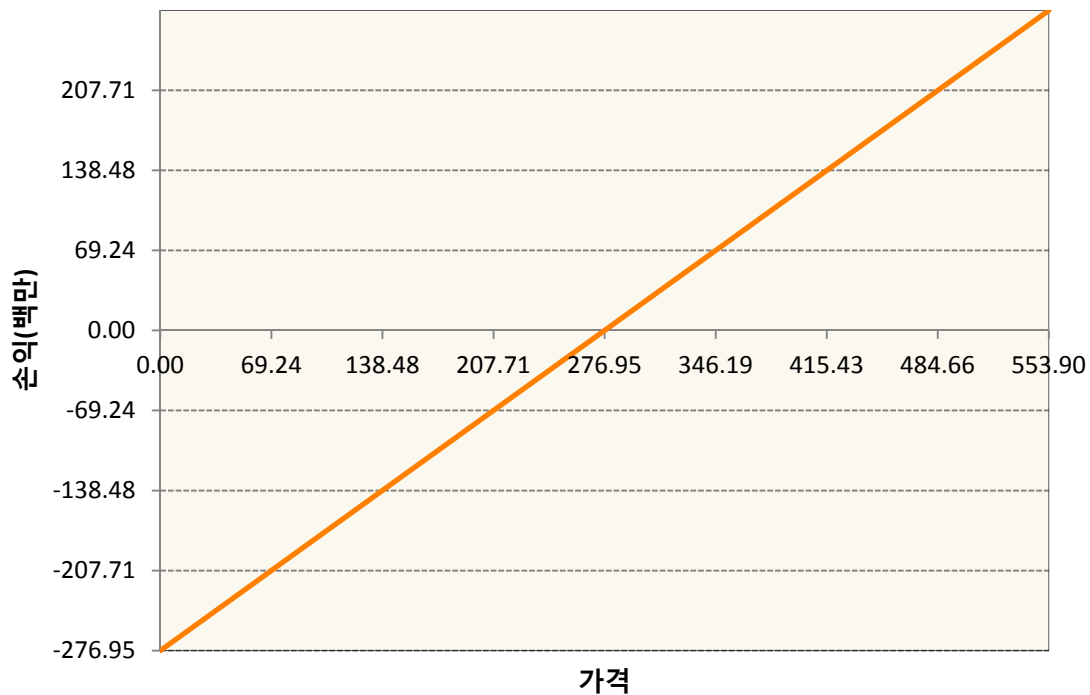
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

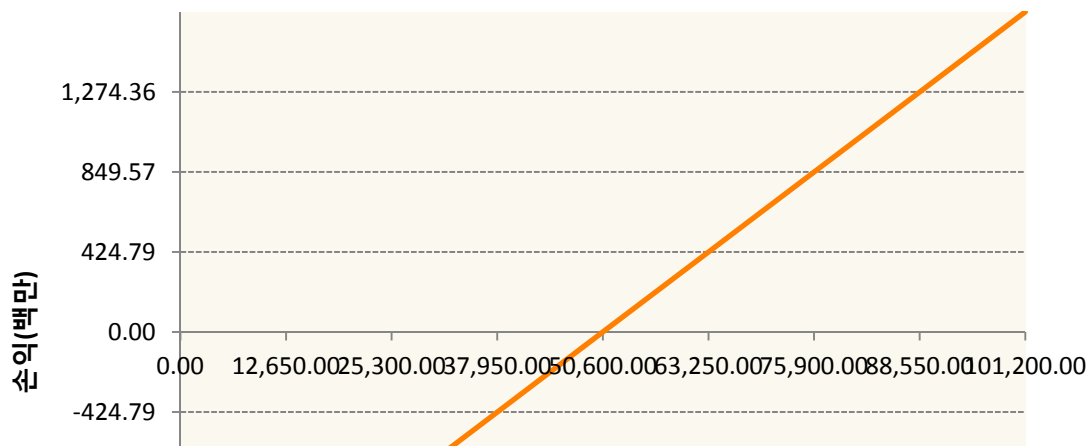
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,976	0	1,976	장내

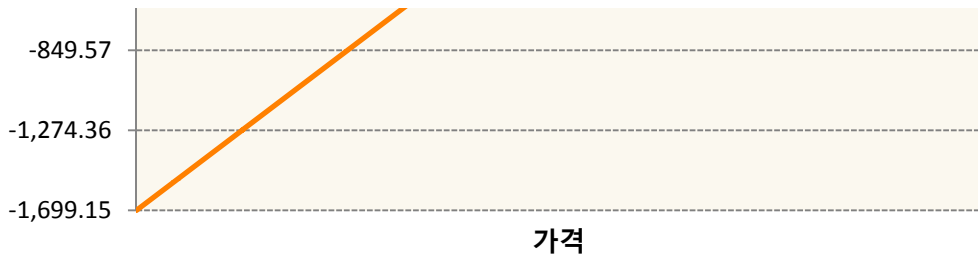
### 2. 만기시점의 손익구조

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						136
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-136	-136	-136	-136	-136	-136	-136	
-5.33%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91	
-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%	91	91	91	91	91	91	91	
8.00%	136	136	136	136	136	136	136	

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

**181**

공시일	2019-10-17
기준일	2019-10-16

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

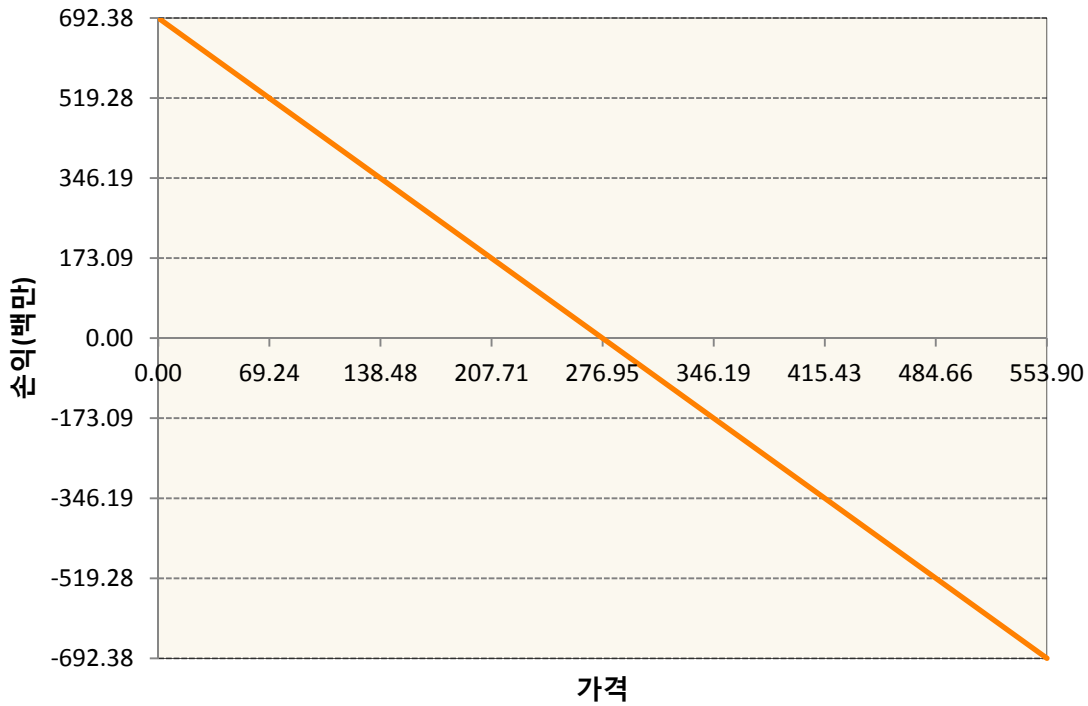
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

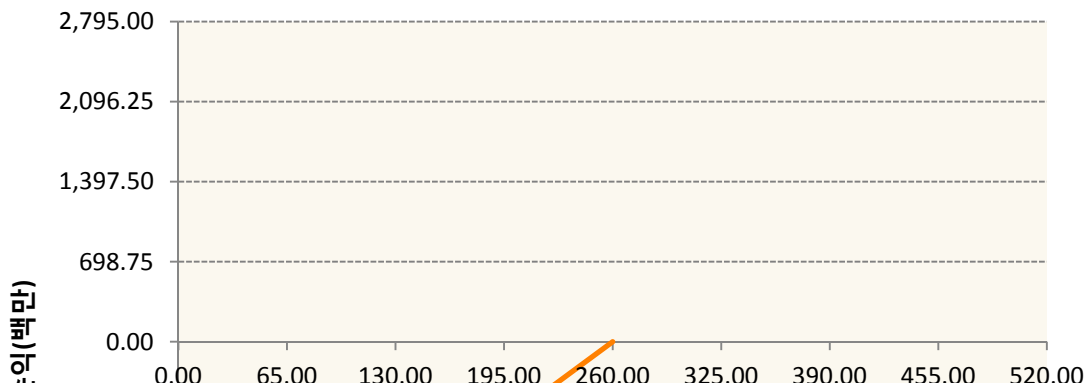
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	692	-692	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,976	-3,976	장내

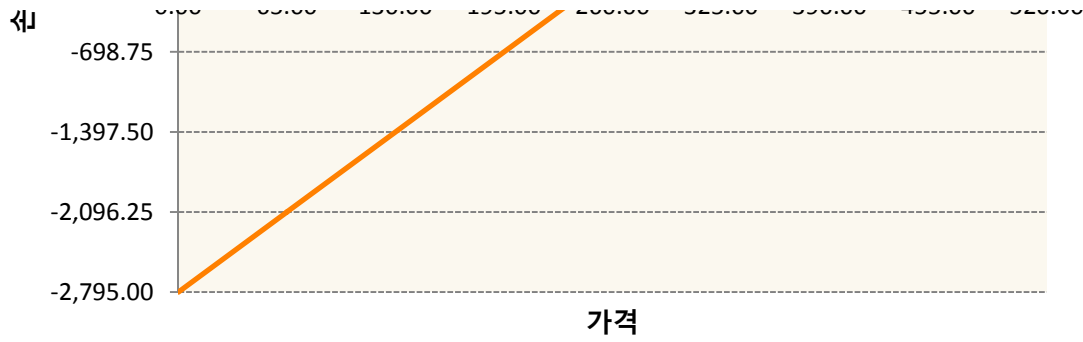
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

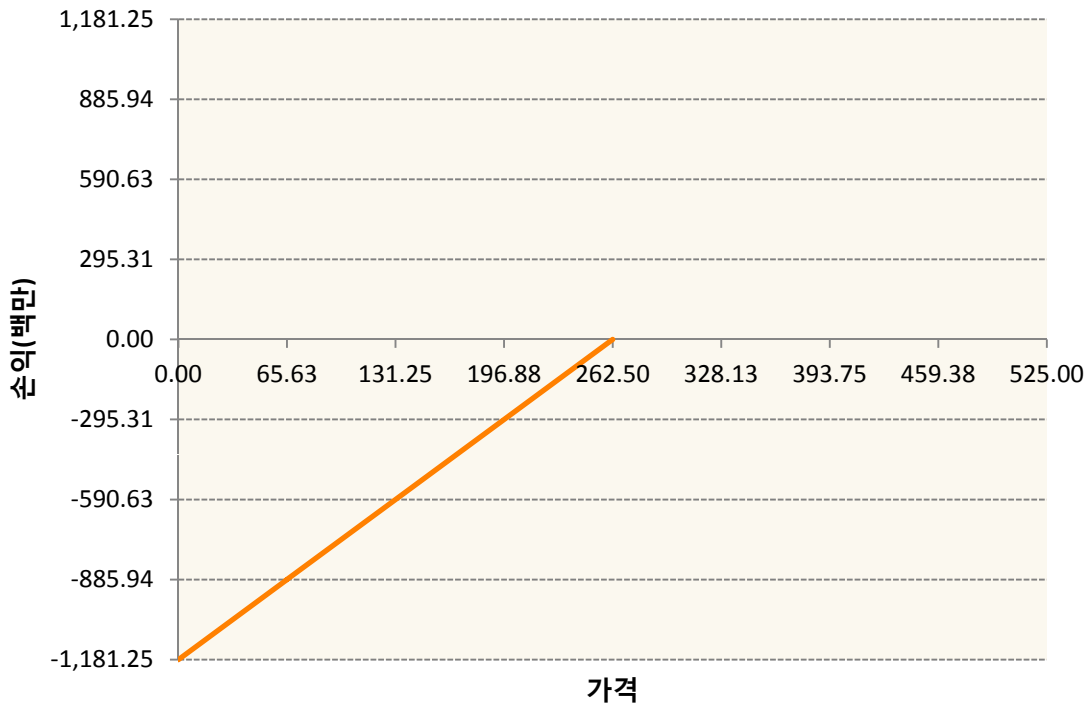


KR4301PB2601-2019-11 풋260





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						88
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-71	-73	-76	-79	-82	-85	-88
-5.33%	-22	-26	-29	-33	-36	-40	-43
-2.67%	-2	-4	-6	-9	-11	-14	-17
0%	2	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	3	3	2	2	2	1	1
5.33%	3	3	3	3	3	2	2
8.00%	3	3	3	3	3	3	3
KR4301PB2627                      2019-11 풋262.5							44
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-38	-39	-40	-41	-42	-43	-44
-5.33%	-14	-16	-17	-18	-20	-21	-23
-2.67%	-2	-3	-4	-5	-7	-8	-9
0%	1	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	2	2	2	2	1	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

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

(단위:백만원)

**122**

공시일	2019-10-17
기준일	2019-10-16

## 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	16,702	0	16,702	
누계	통화	선도	1,235	22,283	-21,048	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		475
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		608
FX21019U05 USD/KRW 18-10-19E		19
FX21019V00 USD/KRW 18-10-19E		38
FX21019V01 USD/KRW 18-10-19E		42
FX21019V01 KRW/USD 10-12-19E		376

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

(단위:백만원)

<b>614</b>
------------

공시일	2019-10-17
기준일	2019-10-16

## 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	460	0	460	장외
누계	통화	선도	118	239	-122	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
FX21019V01 KRW/EUR 22-11-19E	2

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

(단위:백만원)

44
----

공시일	2019-10-17
기준일	2019-10-16

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

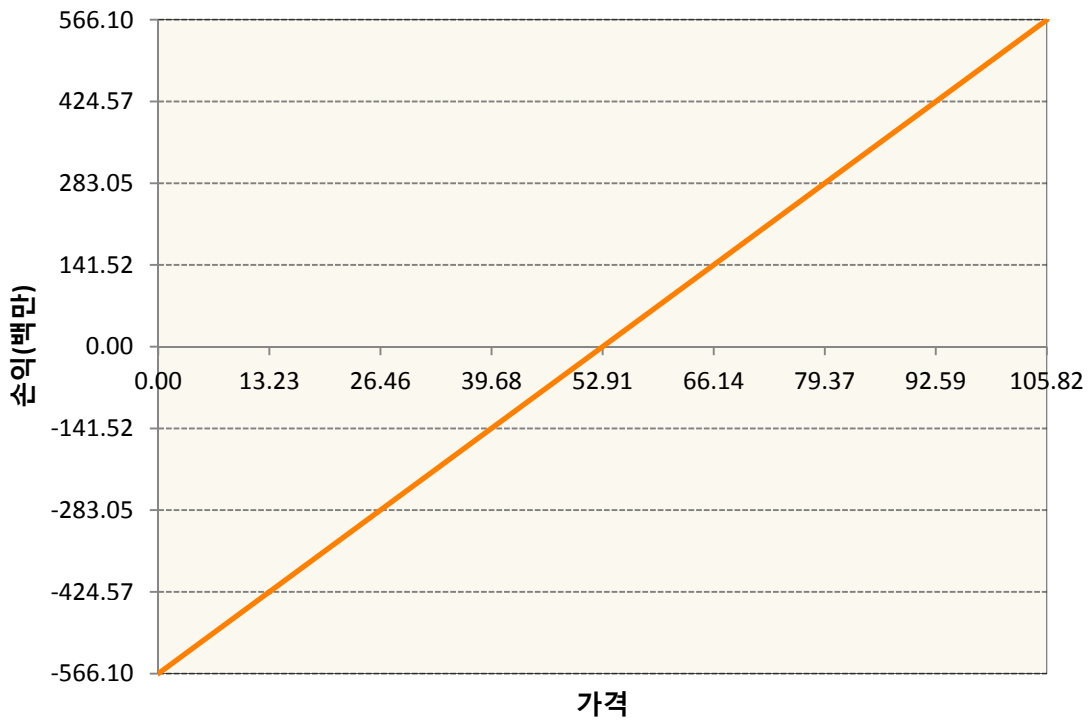
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

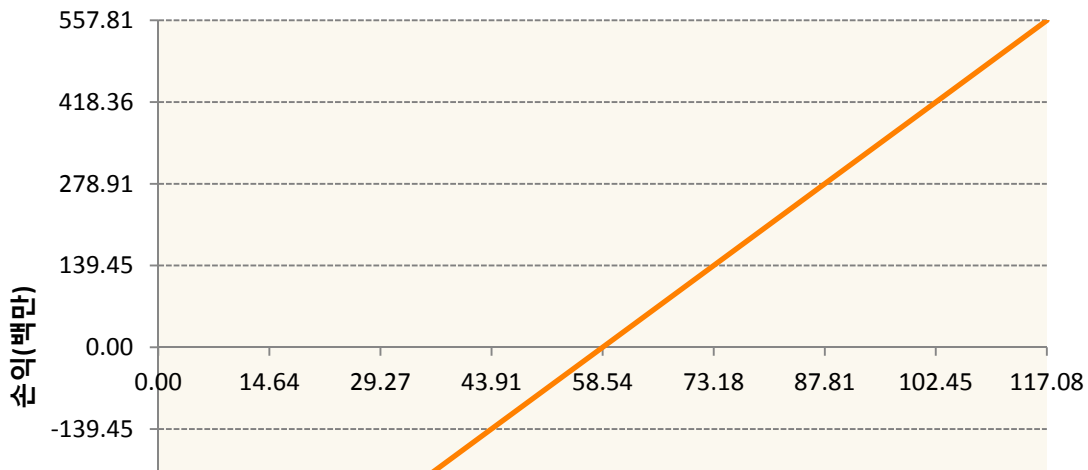
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,410	297	2,113	

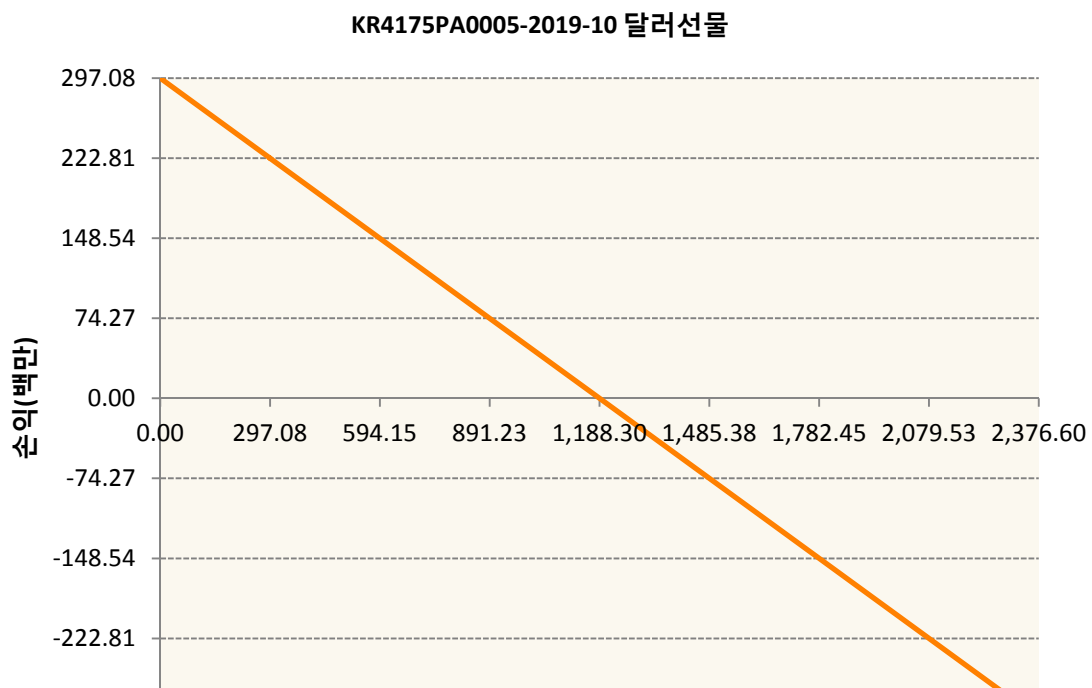
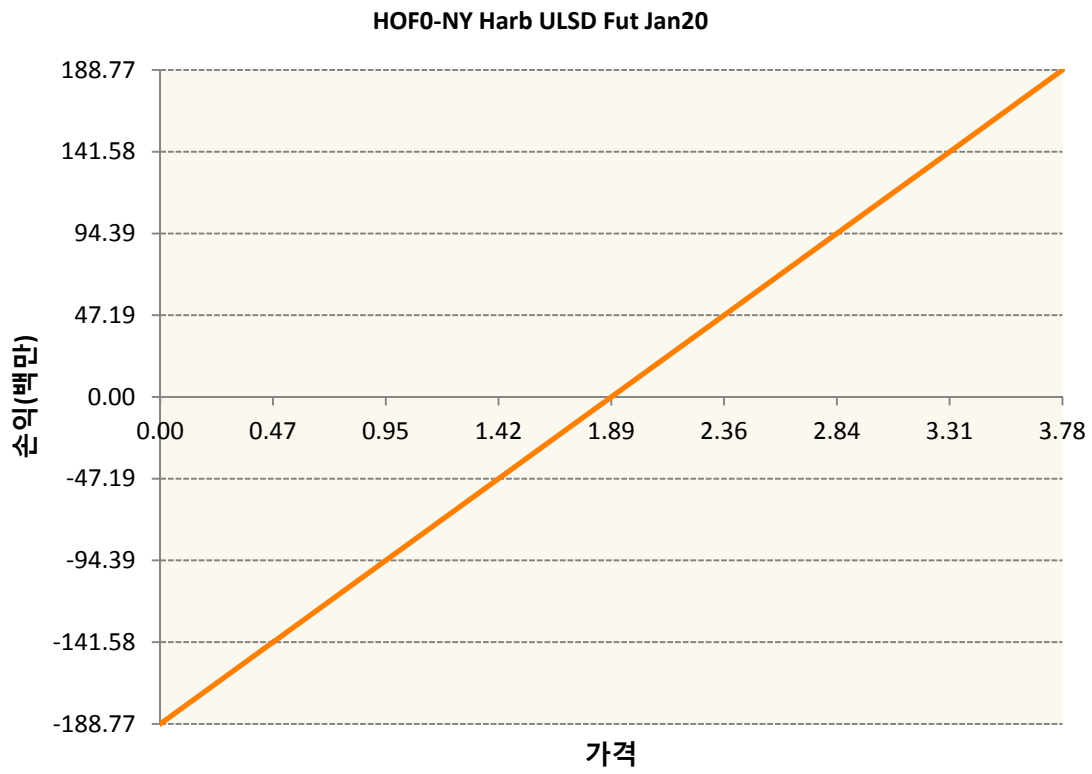
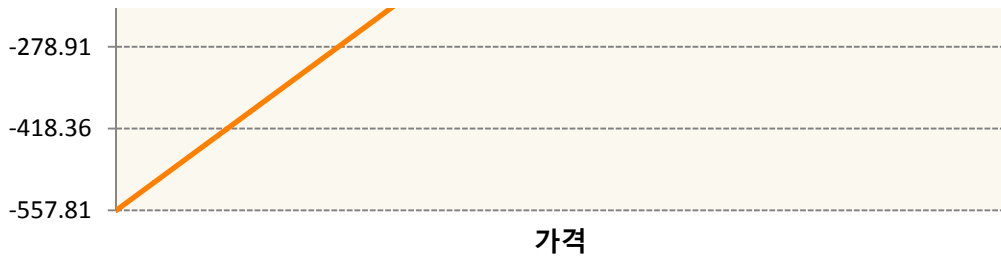
### 2. 만기시점의 손익구조

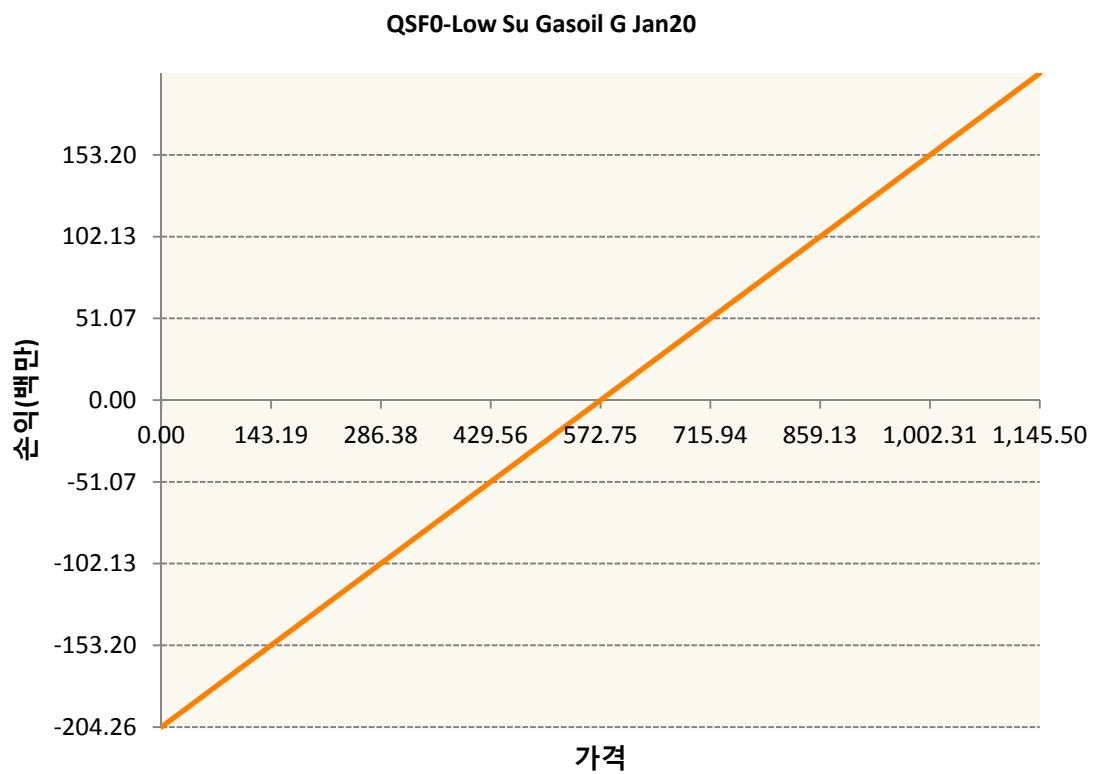
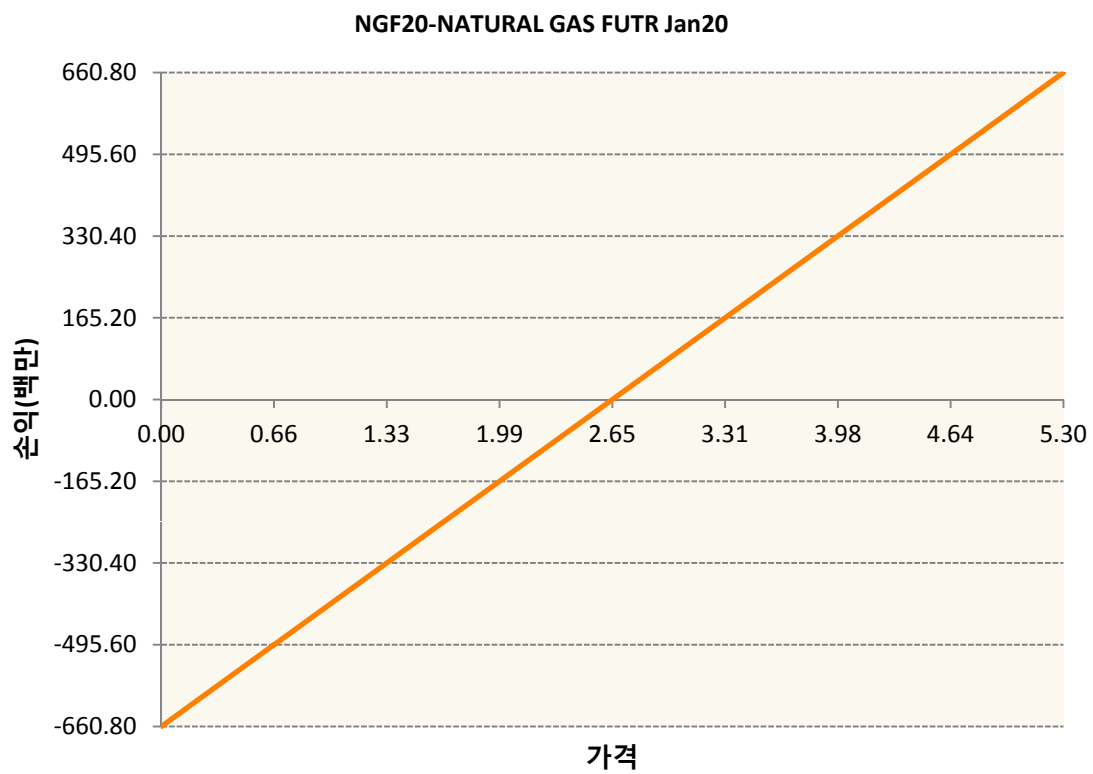
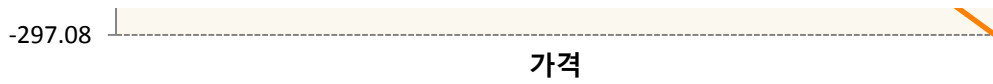
CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20



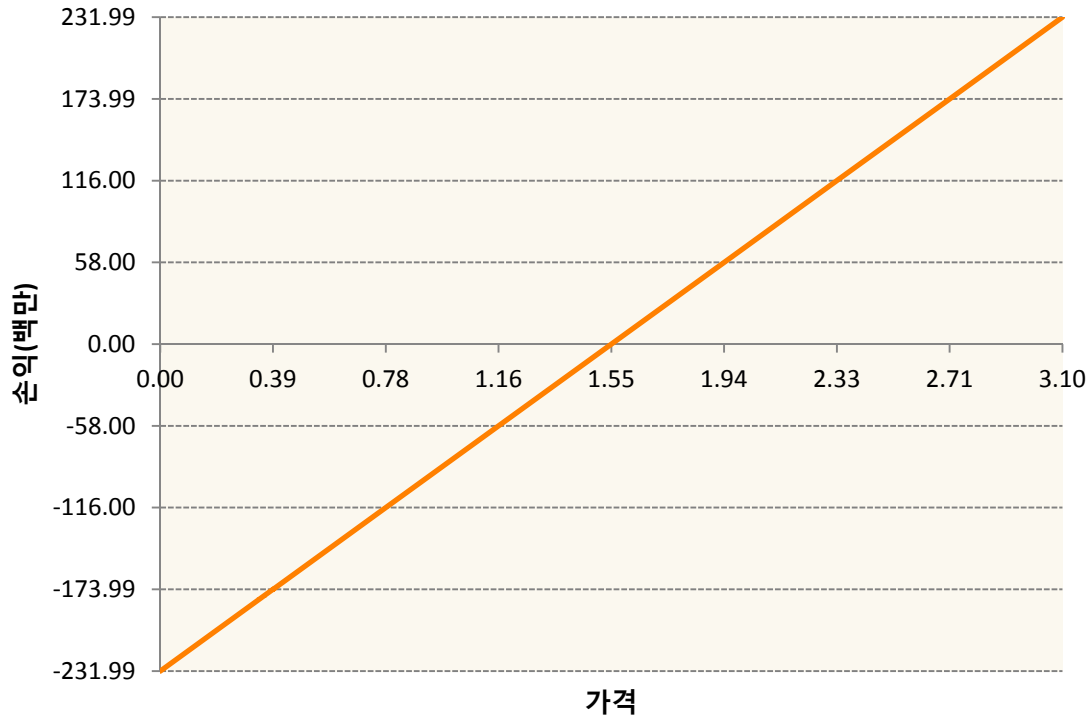
COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20







XBF0-GASOLINE RBOB FUT Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLF0	WTI CRUDE FUTURE Jan20	45
COF0	BRENT CRUDE FUTR Jan20	45
HOF0	NY Harb ULSD Fut Jan20	15
KR4175PA00	2019-10 달러선물	24
NGF20	NATURAL GAS FUTR Jan20	53
QSF0	Low Su Gasoil G Jan20	16
XBF0	GASOLINE RBOB FUT Jan20	19

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

(단위:백만원)

401

공시일	2019-10-17
기준일	2019-10-16

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

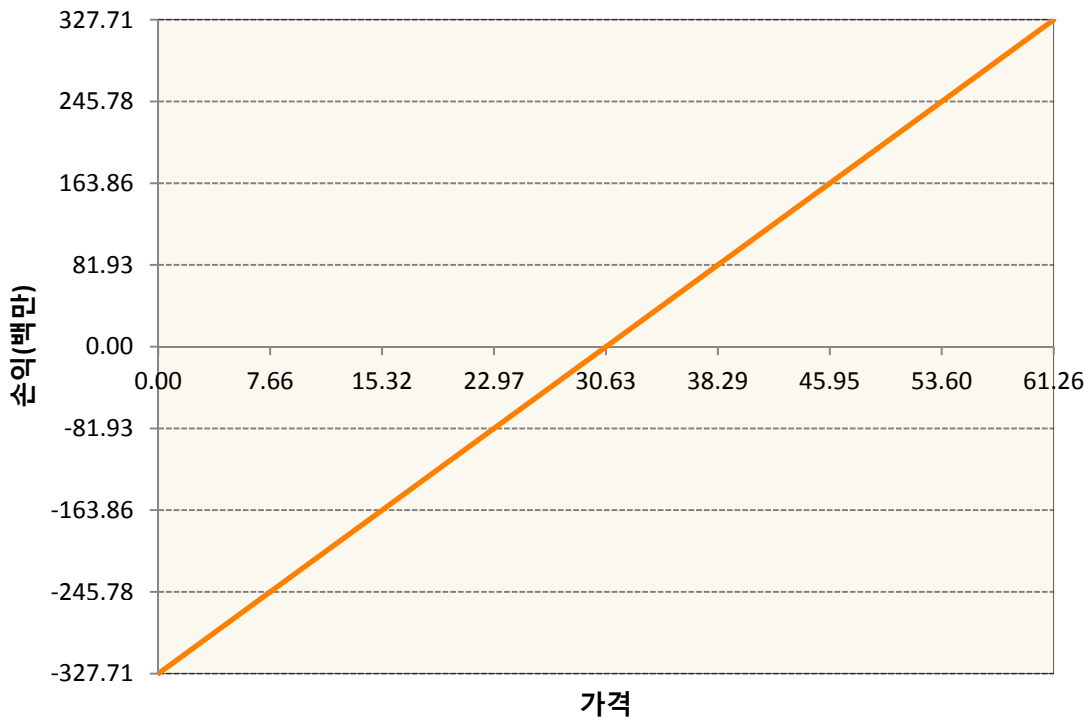
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

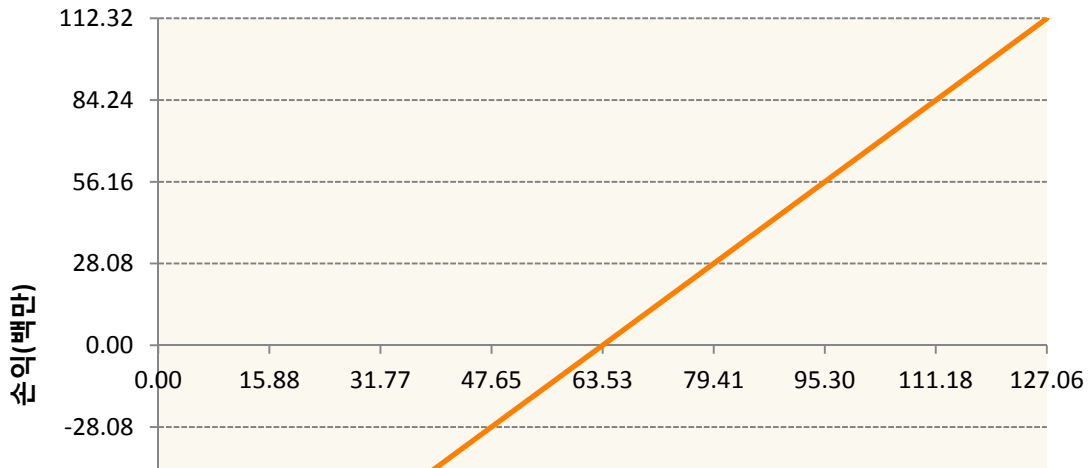
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,868	95	2,773	

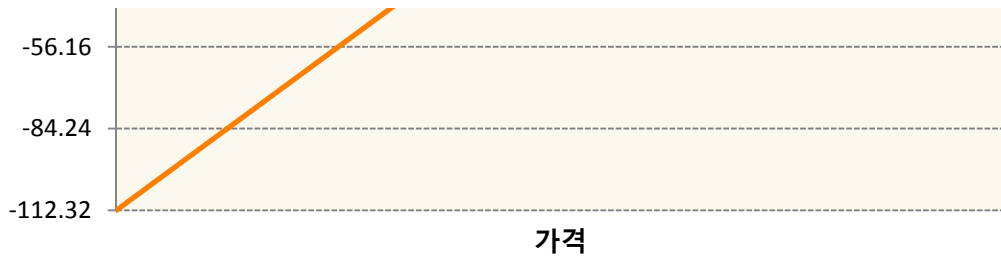
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20**

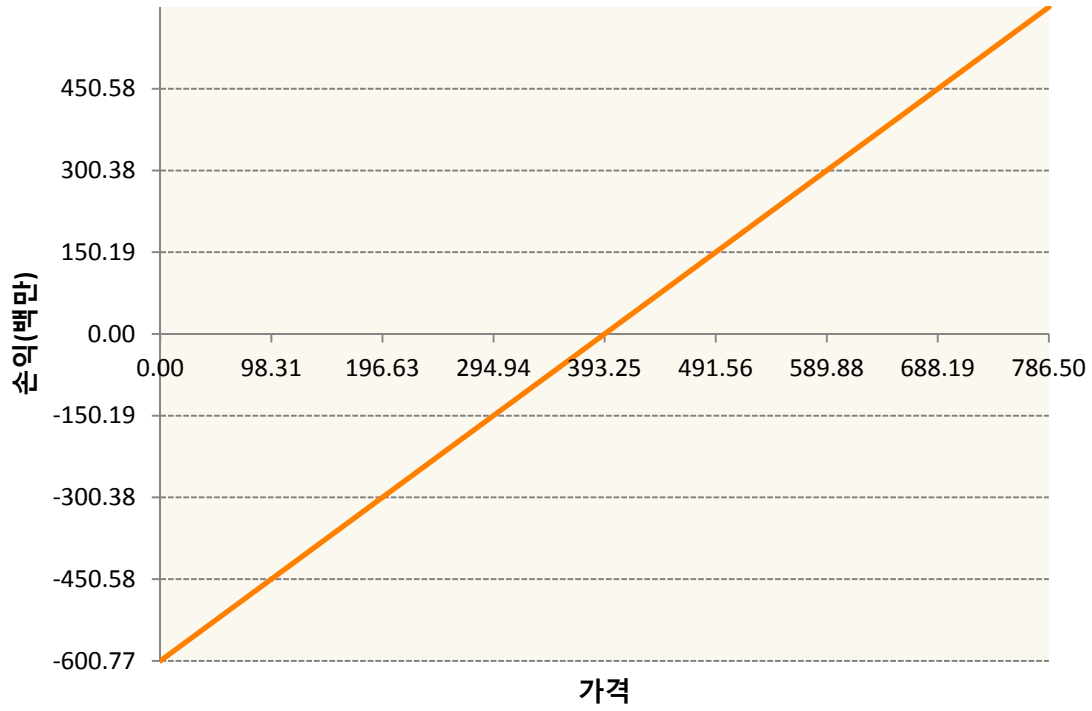


**CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19**

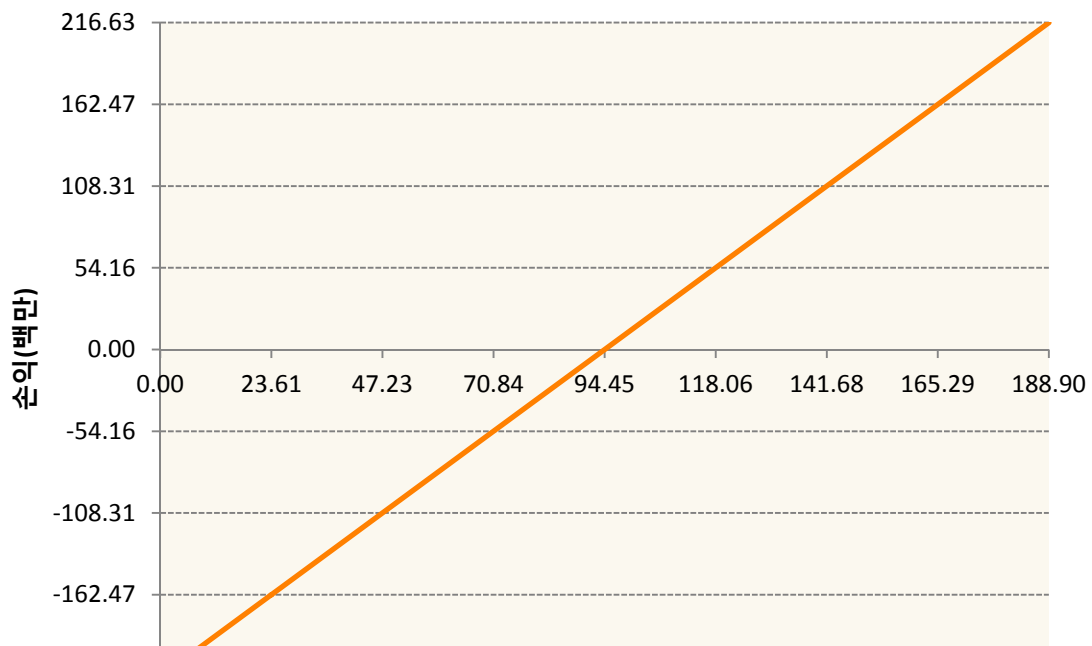


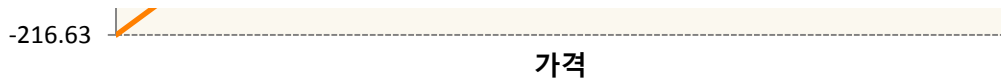


**CZ9-CORN FUTURE Dec19**

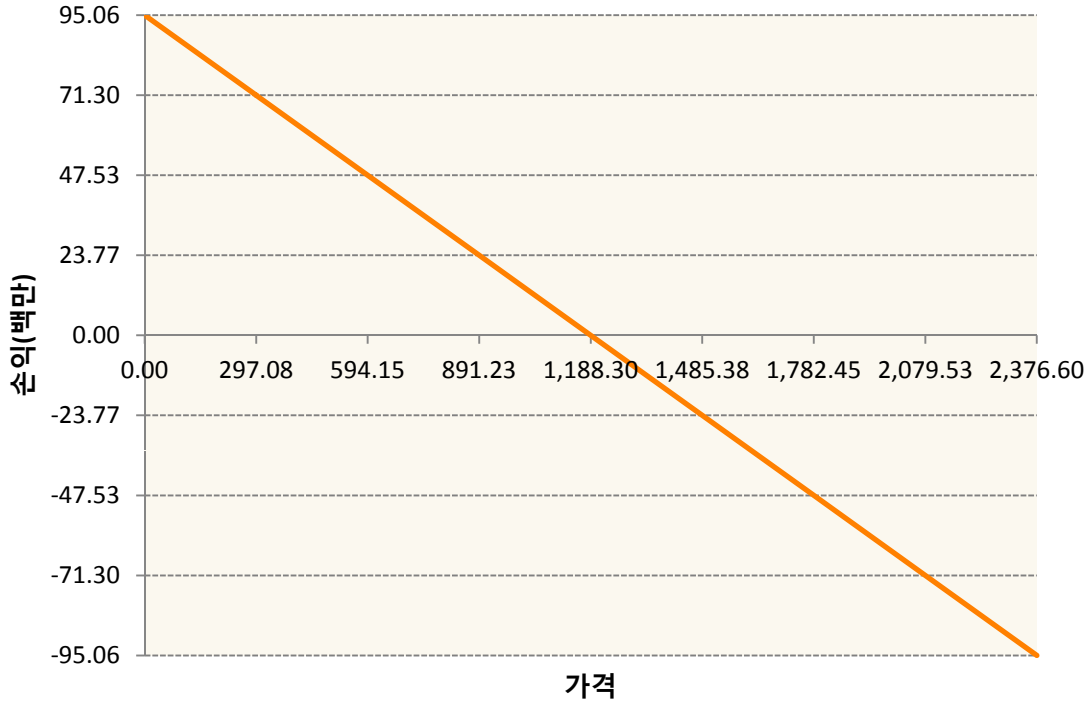


**KCZ9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19**

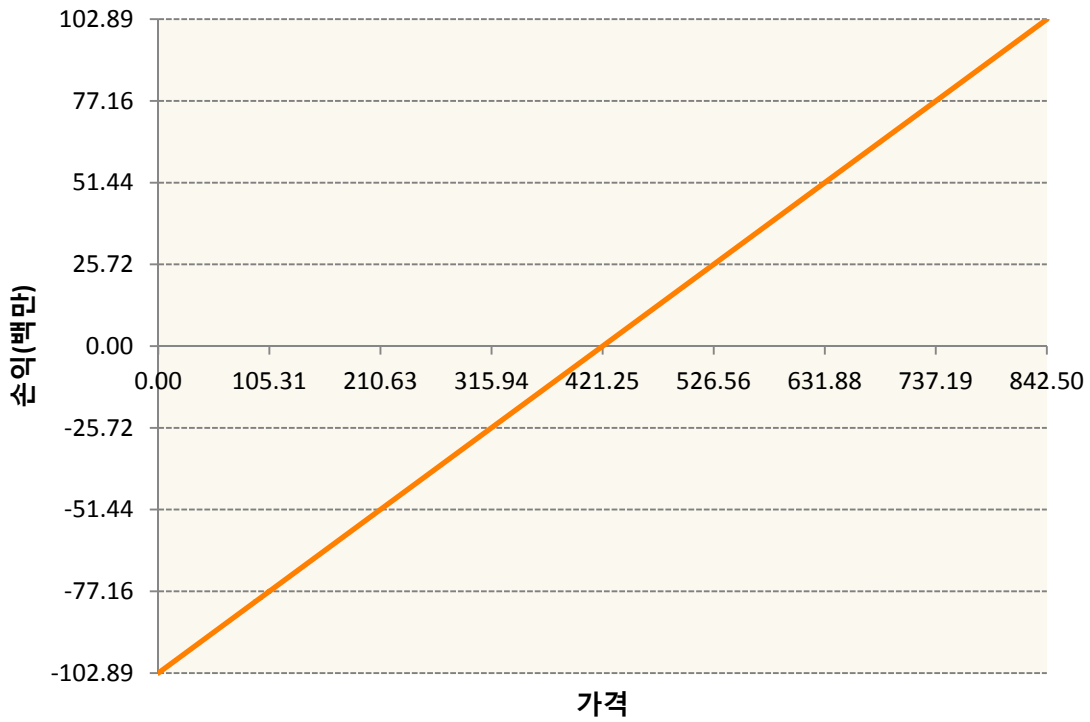




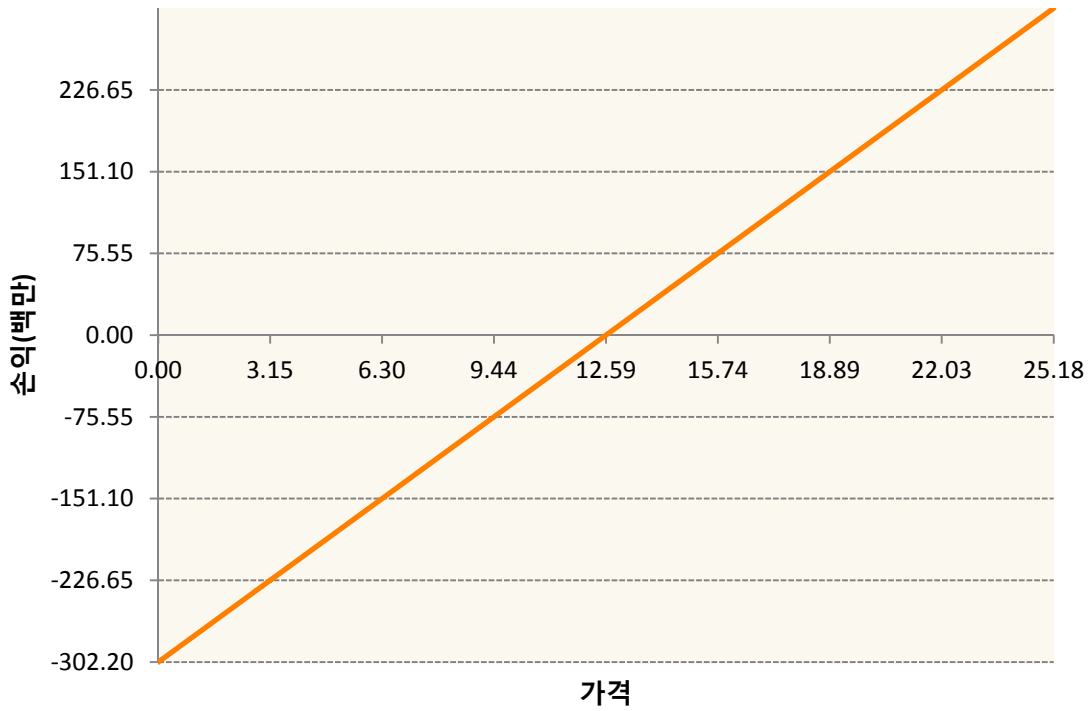
KR4175PA0005-2019-10 달러선물



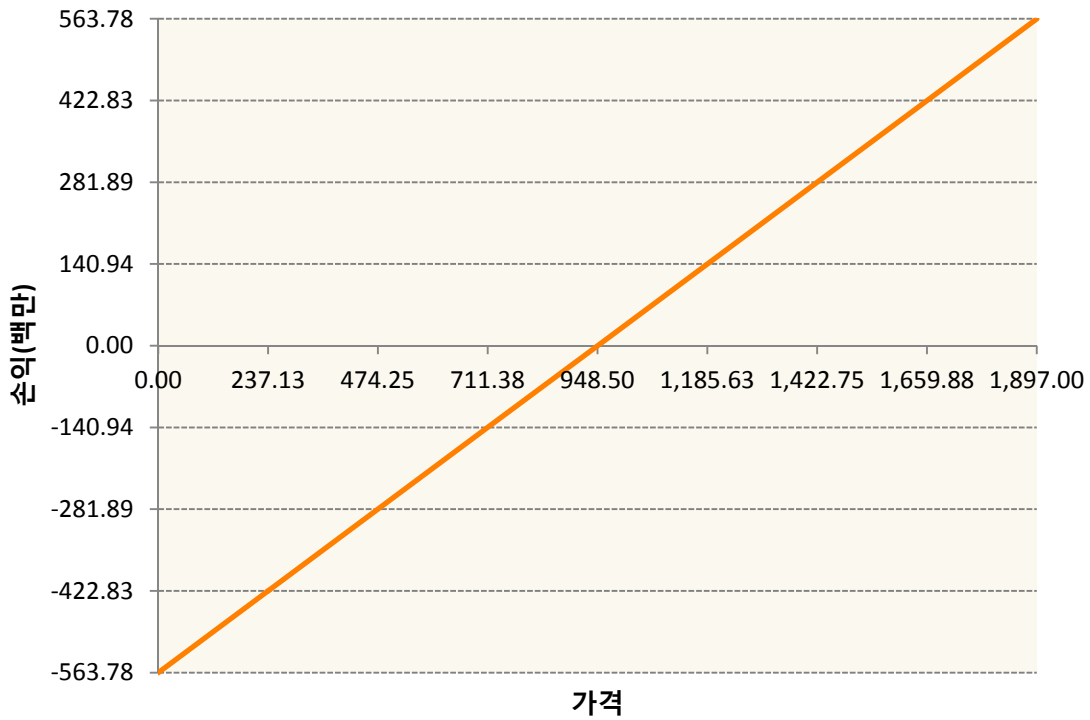
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



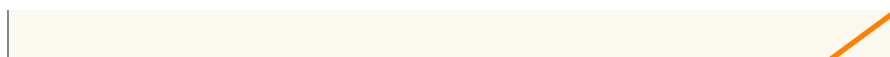
SBH0-Sugar Mar20

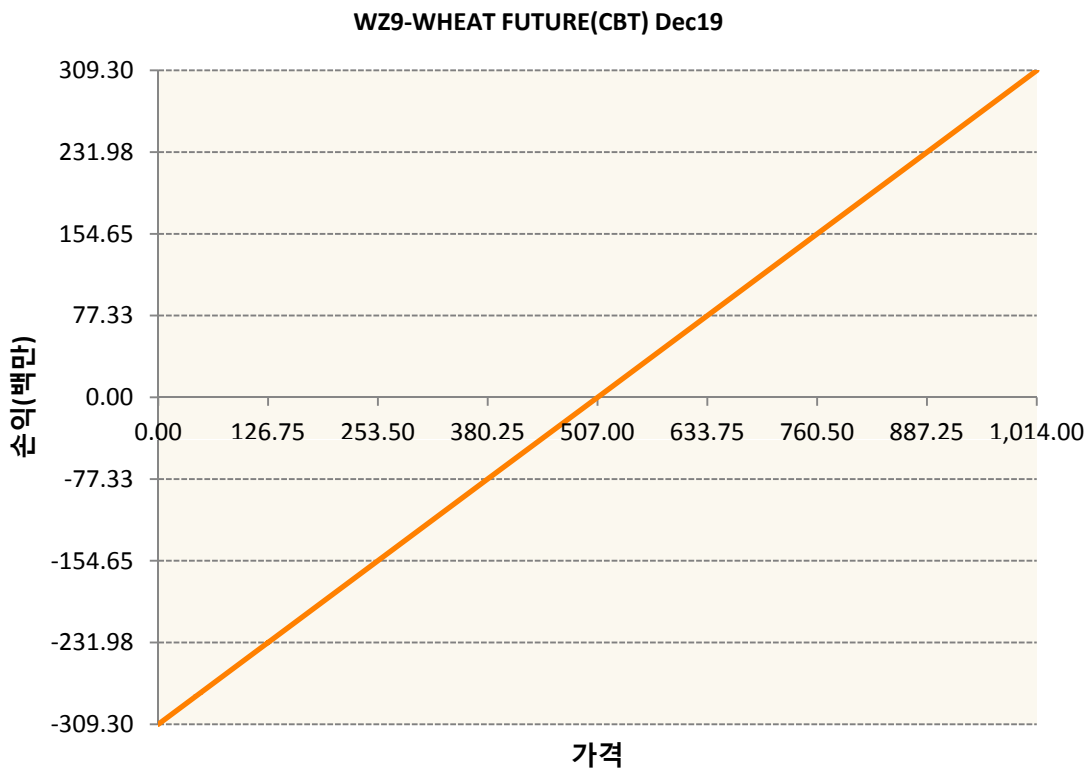
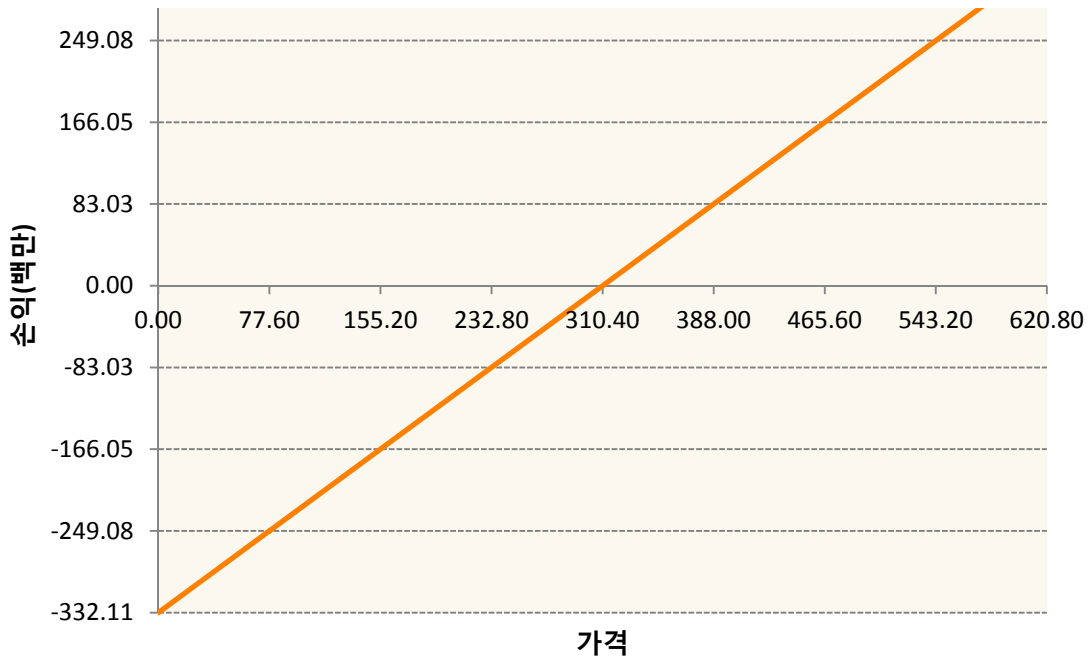


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20



SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BOF0	SOYBEAN OIL FUTR Jan20	26
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	9
CZ9	CORN FUTURE Dec19	48
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**