

공시일	2019-10-18
기준일	2019-10-17

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)

82

공시일	2019-10-18
기준일	2019-10-17

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

1,180

* 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	2019-10-18
기준일	2019-10-17

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)

800

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-10-18
기준일	2019-10-17

유로인덱스모(주식-파생형)

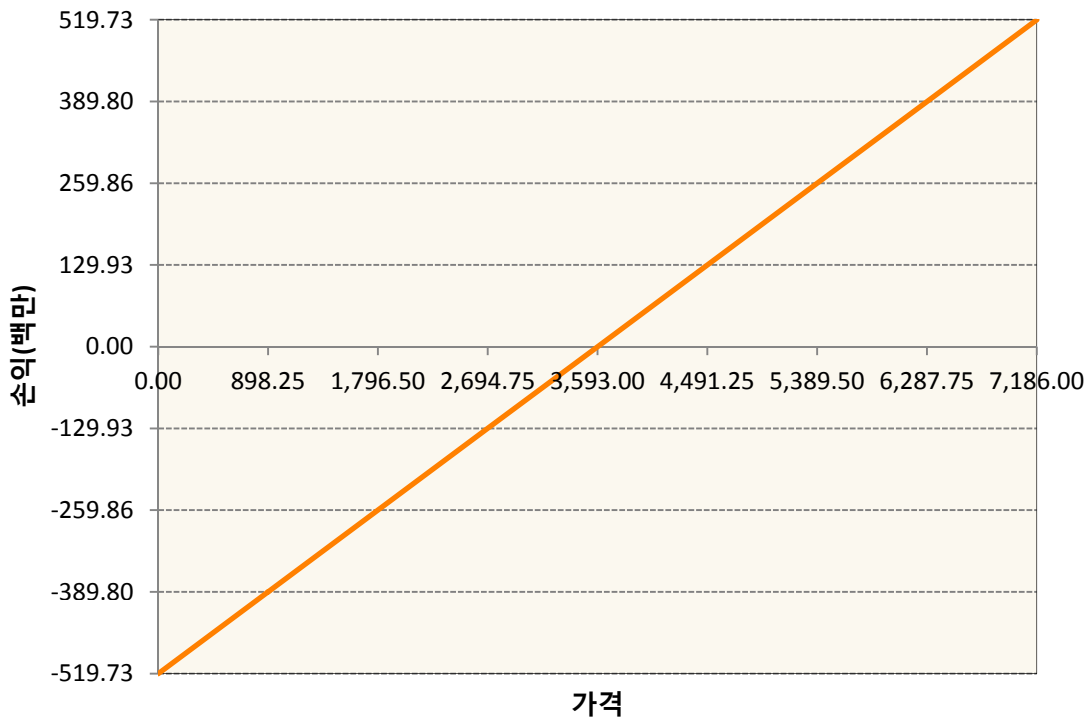
1. 계약금액

(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	2019-10-18
기준일	2019-10-17

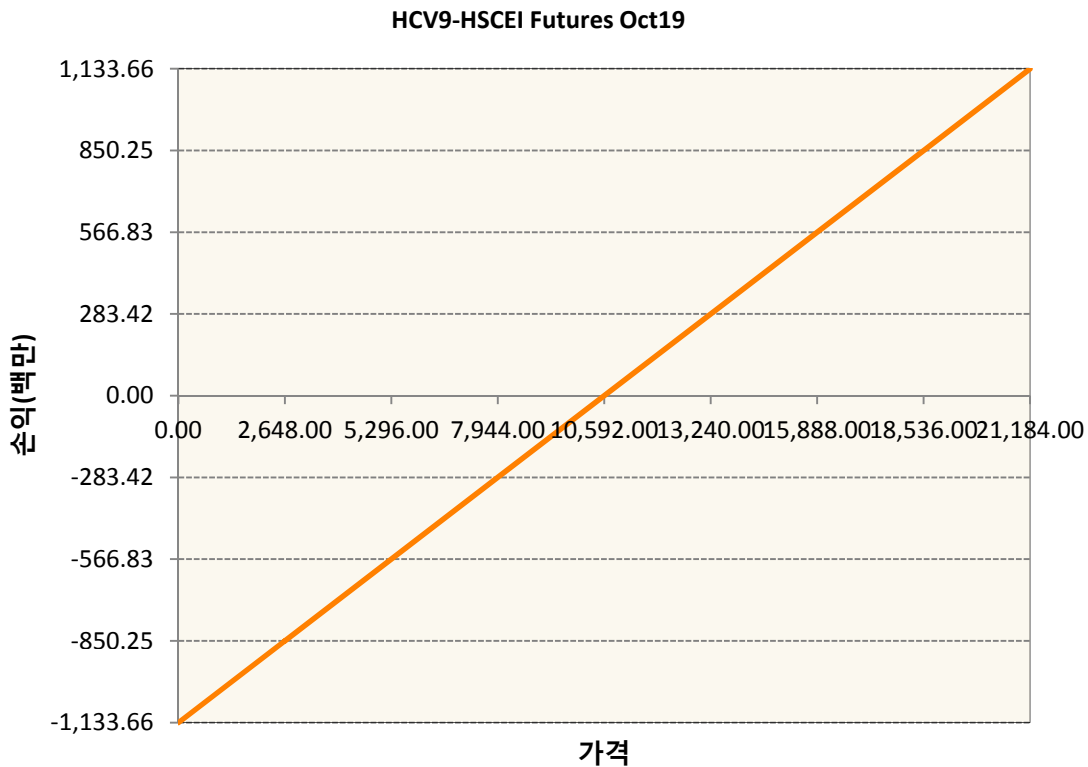
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,134	0	1,134	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV9	HSCEI Futures Oct19	91
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

82

공시일	2019-10-18
기준일	2019-10-17

커버드콜모(주식혼합-파생형)

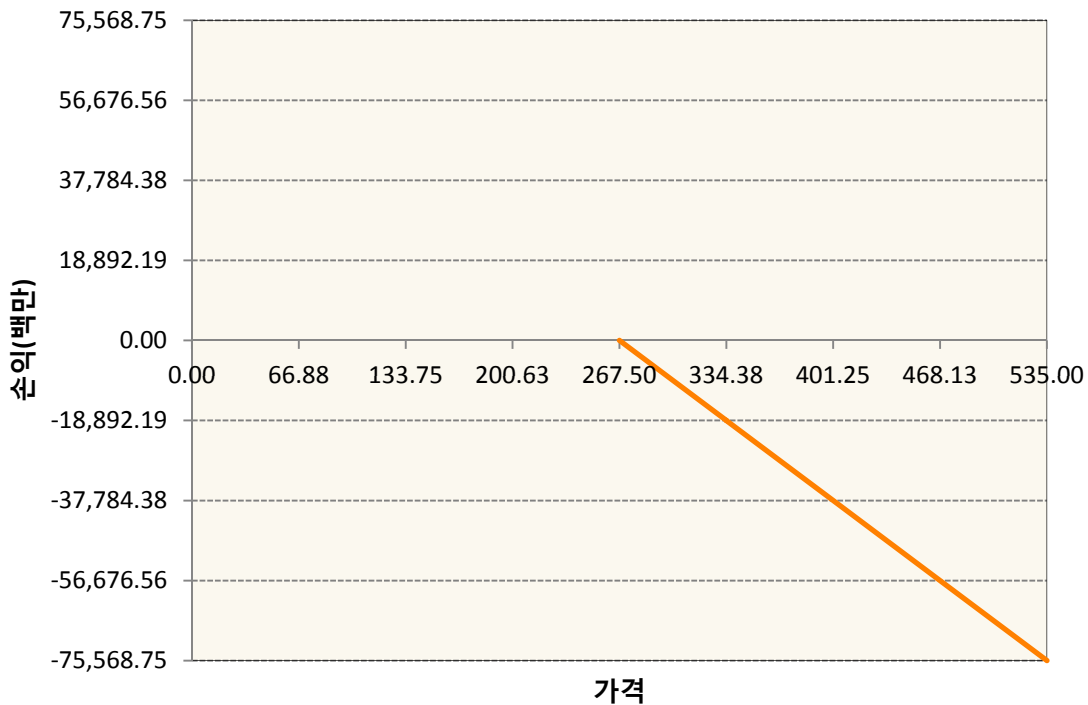
1. 계약금액

(단위:백만원)

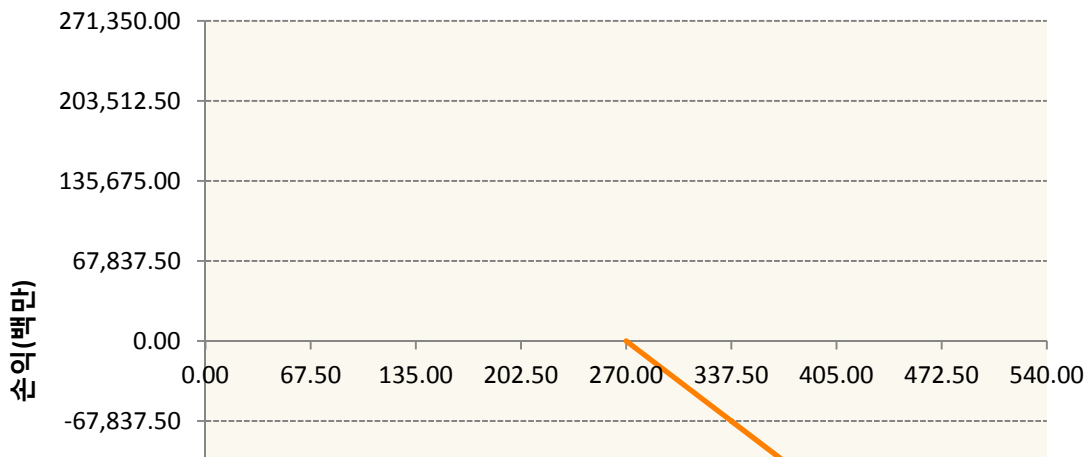
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	514,106	-514,106	장내

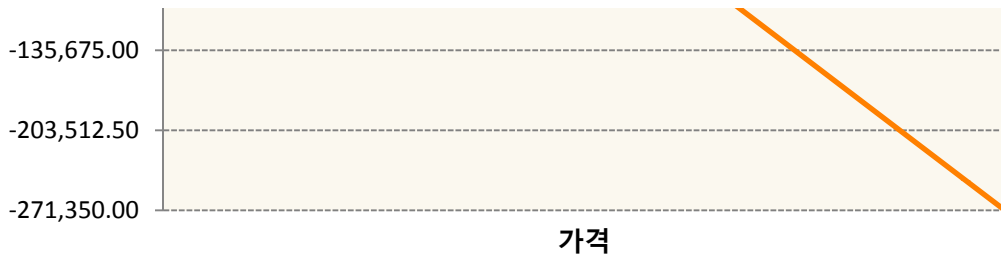
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PB2677-2019-11 콜267.5

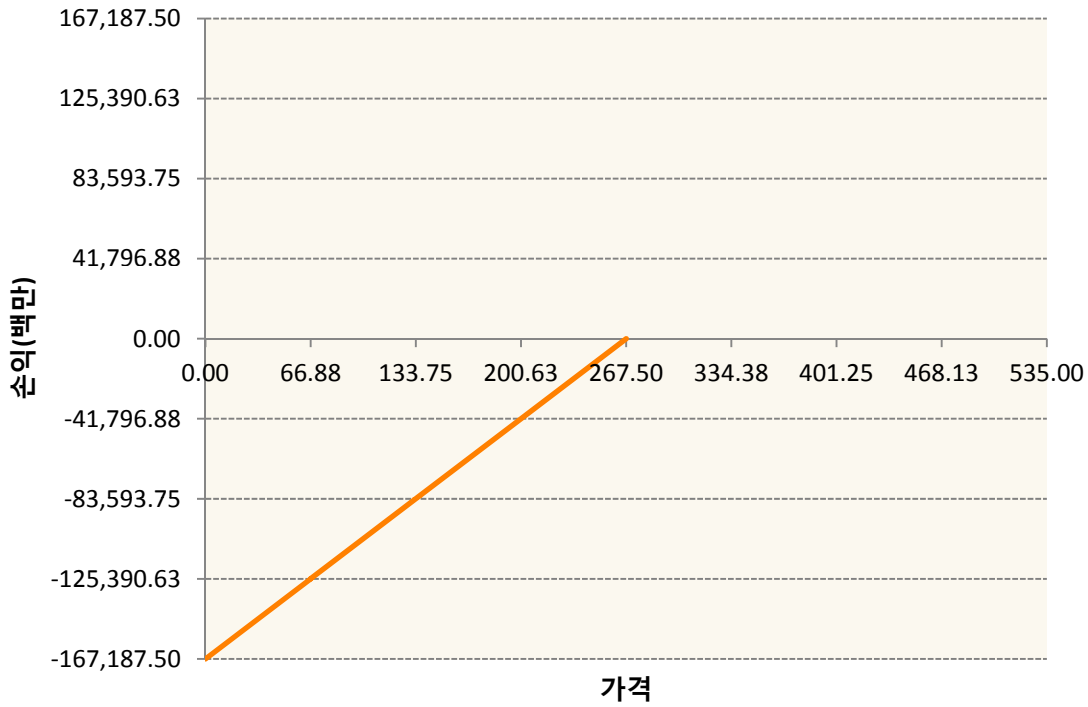


KR4201PB2701-2019-11 콜270





KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PB2677		2019-11 콜267.5					5,352
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,205	3,085	2,955	2,818	2,675	2,527	2,374
-5.33%	2,688	2,520	2,348	2,174	1,999	1,822	1,644
-2.67%	1,800	1,612	1,424	1,237	1,049	861	673
0%	517	348	175	0	-178	-357	-538
2.67%	-1,101	-1,226	-1,361	-1,504	-1,654	-1,809	-1,969
5.33%	-2,948	-3,025	-3,116	-3,219	-3,333	-3,456	-3,586
8.00%	-4,925	-4,965	-5,018	-5,084	-5,163	-5,252	-5,352
KR4201PB2701		2019-11 콜270					18,446
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,214	9,848	9,441	9,000	8,533	8,042	7,533

-5.33%	8,737	8,182	7,608	7,020	6,422	5,815	5,201
-2.67%	6,044	5,377	4,710	4,042	3,373	2,704	2,035
0%	1,950	1,306	655	0	-659	-1,321	-1,985
2.67%	-3,426	-3,936	-4,474	-5,035	-5,614	-6,207	-6,812
5.33%	-9,749	-10,084	-10,467	-10,891	-11,348	-11,834	-12,343
8.00%	-16,645	-16,832	-17,069	-17,354	-17,681	-18,047	-18,446
KR4301PB2676 2019-11 풋267.5							8,500
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,094	-8,130	-8,180	-8,243	-8,318	-8,404	-8,500
-5.33%	-3,906	-4,045	-4,193	-4,350	-4,513	-4,682	-4,855
-2.67%	-913	-1,119	-1,325	-1,531	-1,737	-1,943	-2,150
0%	419	290	150	0	-158	-322	-492
2.67%	739	703	653	590	514	426	327
5.33%	778	773	764	748	724	691	648
8.00%	781	781	779	777	772	763	749

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

(단위:백만원)

30,857

공시일	2019-10-18
기준일	2019-10-17

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

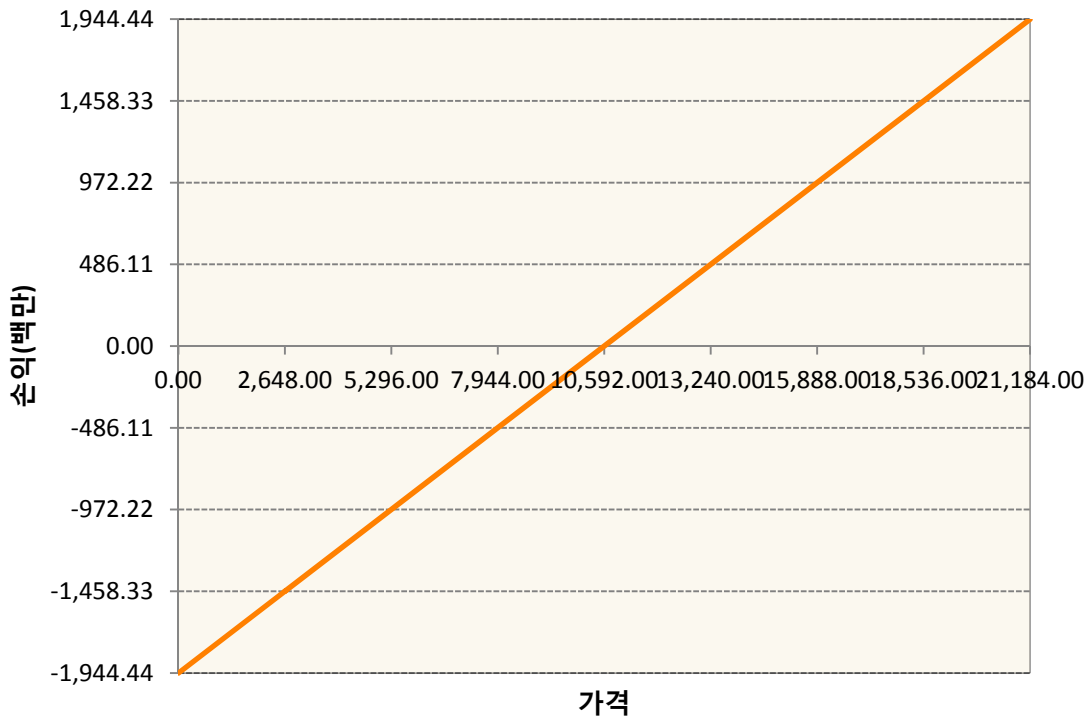
1. 계약금액

(단위:백만원)

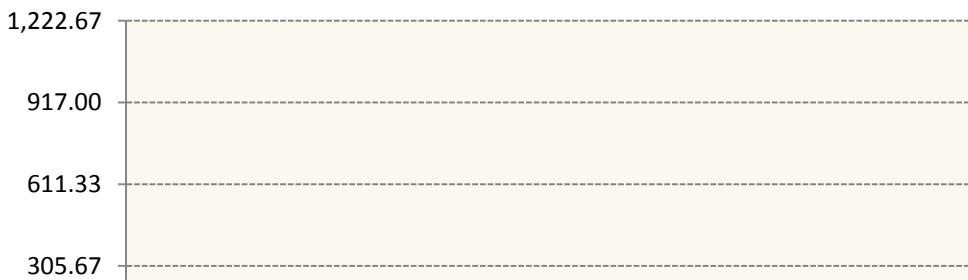
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,944	0	1,944	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,915	-4,915	장내
누계	통화	선도	681	2,812	-2,131	장외

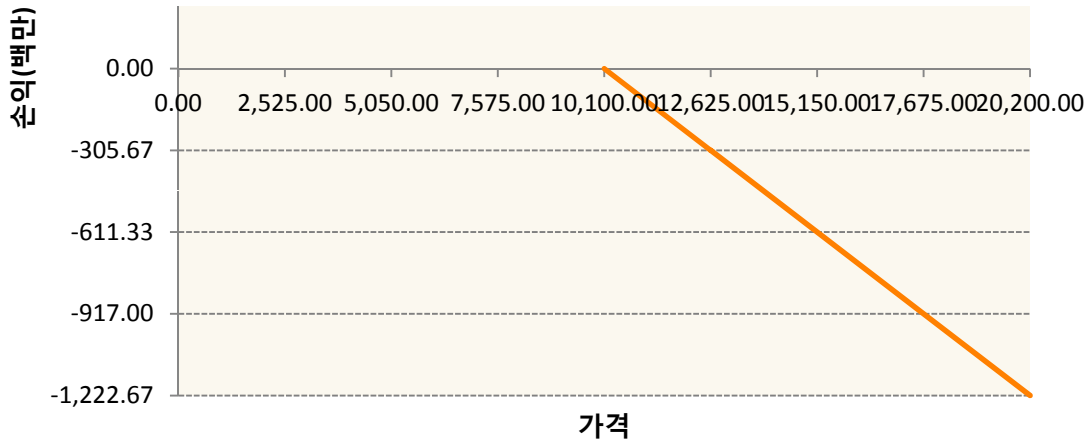
2. 만기시점의 손익구조

HCV9-HSCEI Futures Oct19

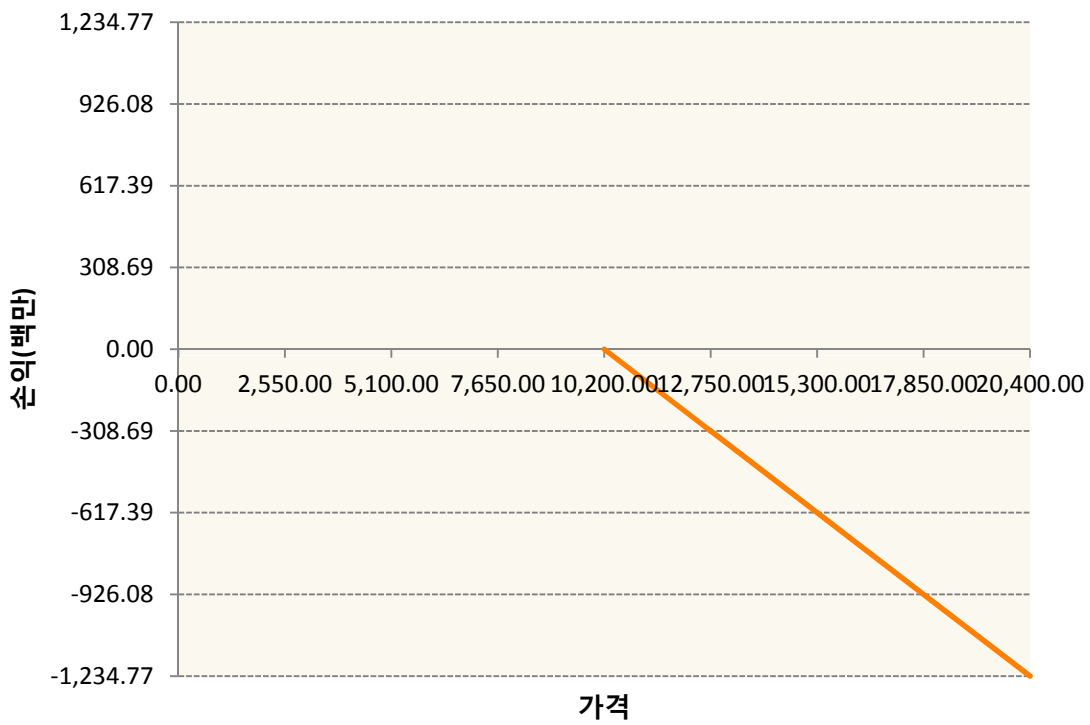


OHHIV9-C101-HSCEI

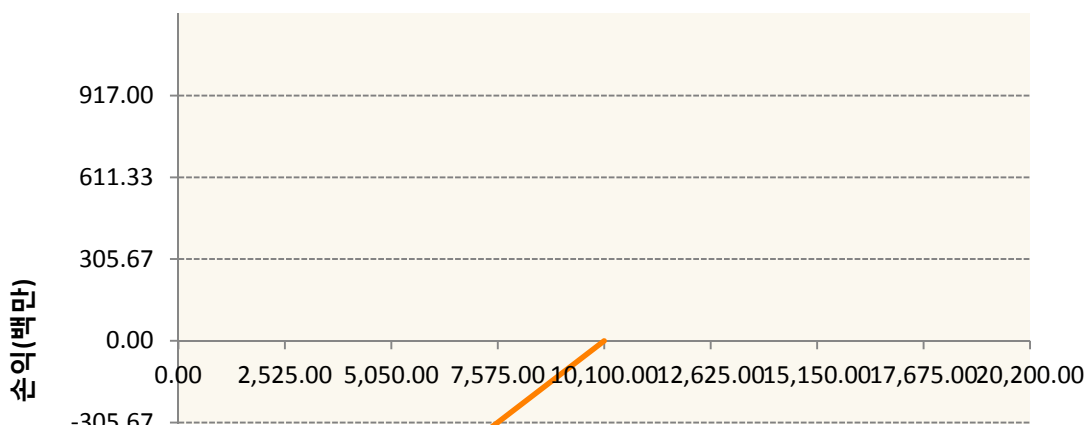


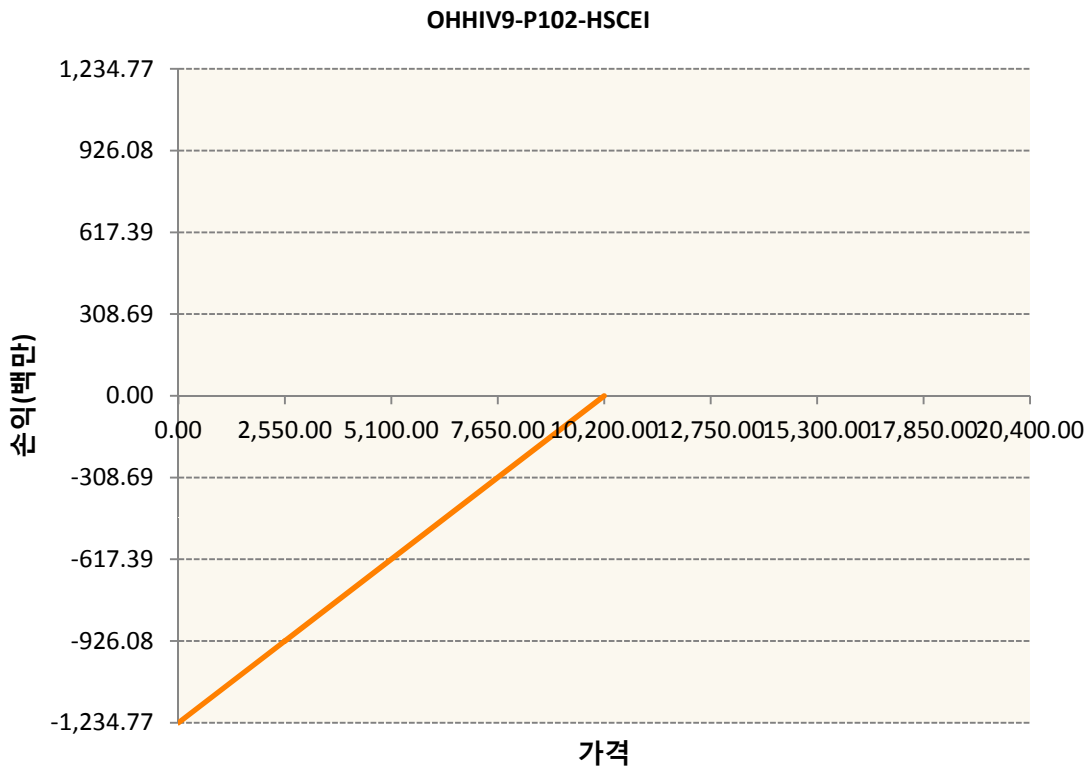


OHHIV9-C102-HSCEI



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	156
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	2019-10-18
기준일	2019-10-17

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

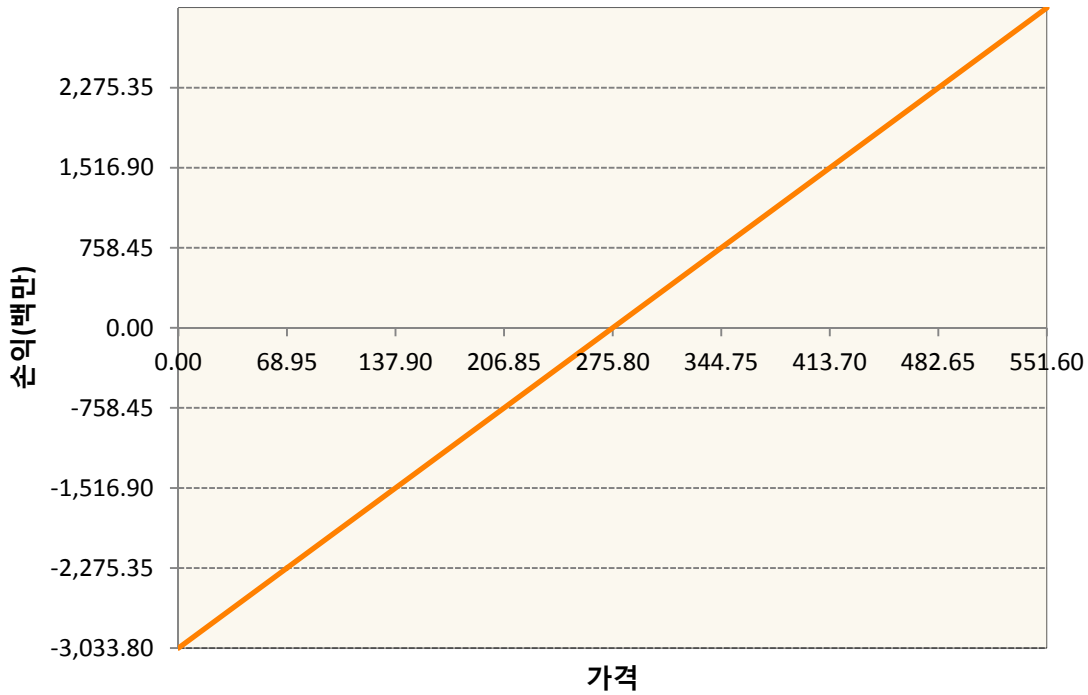
1. 계약금액

(단위:백만원)

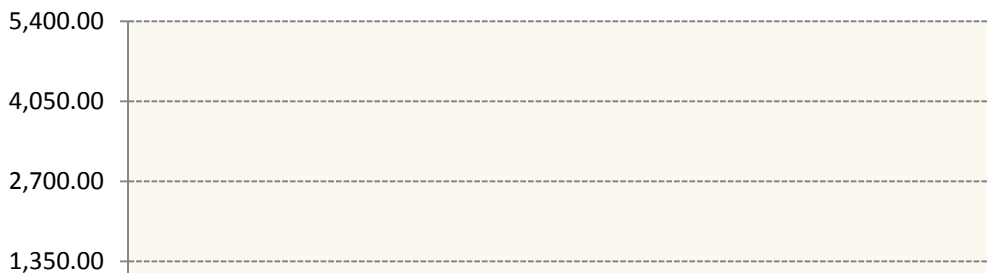
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,034	0	3,034	장내
누계	유가증권	스왑	10,625	0	10,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	10,752	-10,752	장내

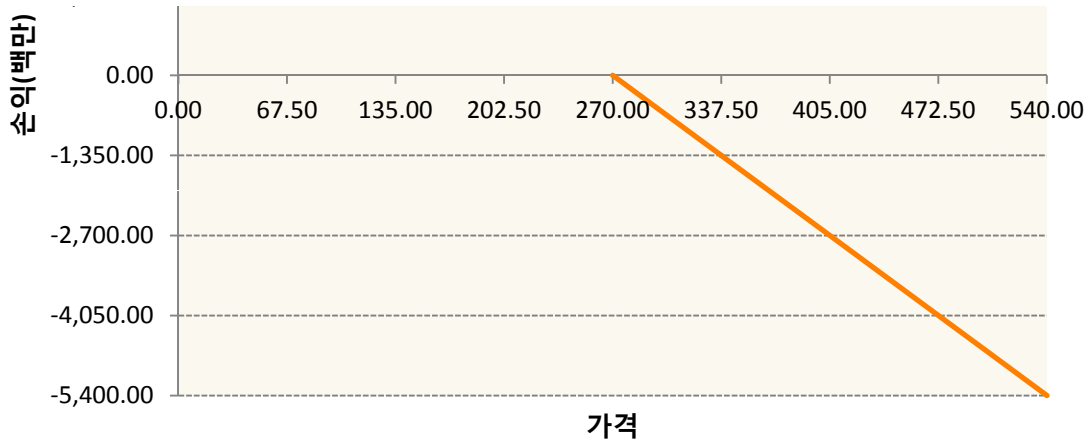
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

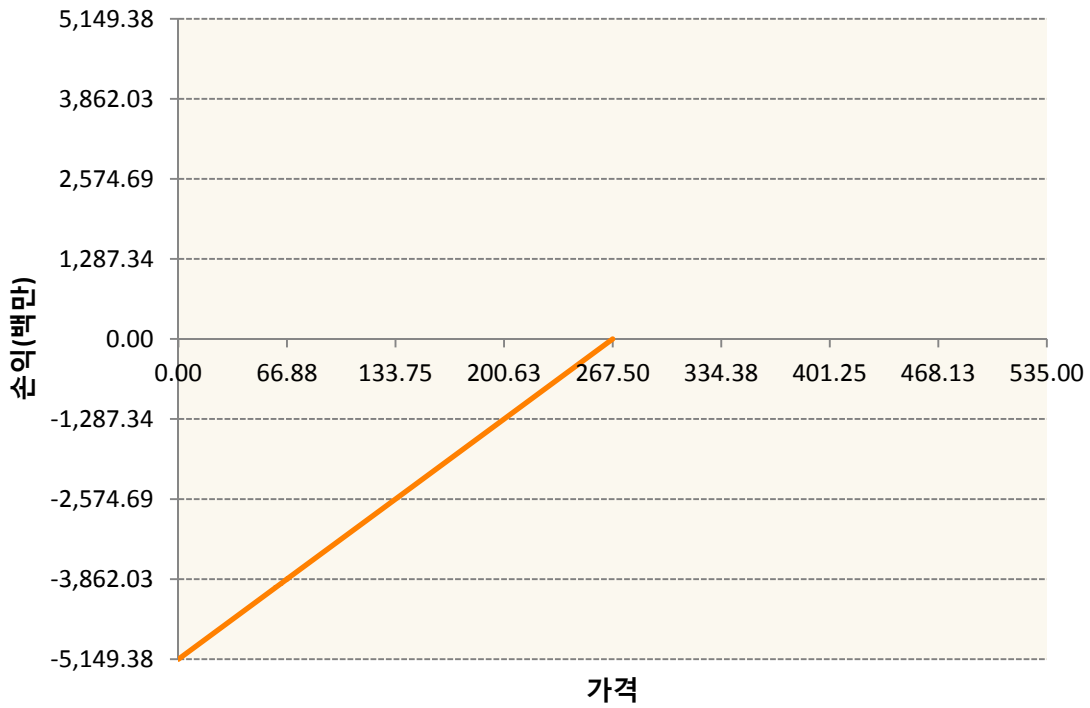


KR4201PB2701-2019-11 콜270

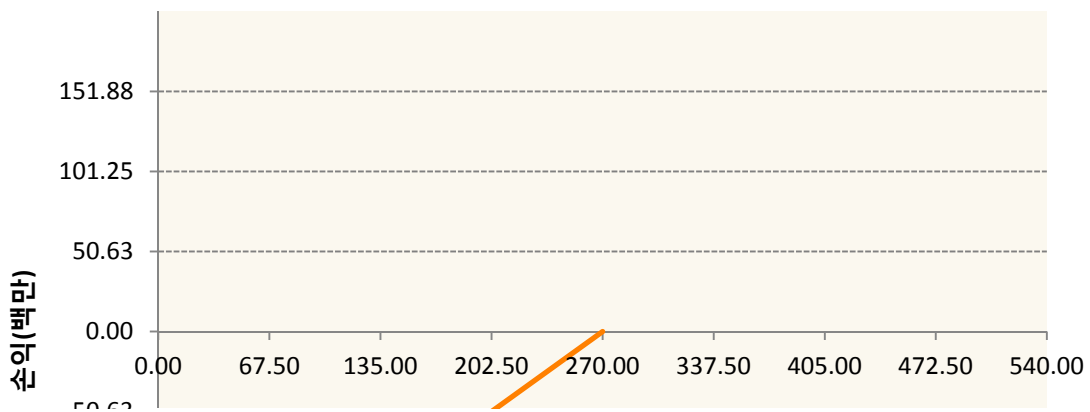




KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



KR4301PB2700-2019-11 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						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						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						367
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	203	196	188	179	170	160	150	
-5.33%	174	163	151	140	128	116	103	
-2.67%	120	107	94	80	67	54	41	
0%	39	26	13	0	-13	-26	-40	
2.67%	-68	-78	-89	-100	-112	-124	-136	
5.33%	-194	-201	-208	-217	-226	-235	-246	
8.00%	-331	-335	-340	-345	-352	-359	-367	
KR4301PB2676		2019-11 풋267.5						262
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-249	-250	-252	-254	-256	-259	-262
-5.33%	-120	-125	-129	-134	-139	-144	-150
-2.67%	-28	-34	-41	-47	-54	-60	-66
0%	13	9	5	0	-5	-10	-15
2.67%	23	22	20	18	16	13	10
5.33%	24	24	24	23	22	21	20
8.00%	24	24	24	24	24	23	23
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%	-6	-6	-6	-6	-6	-7	-7
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-3	-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)

1,721

공시일	2019-10-18
기준일	2019-10-17

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

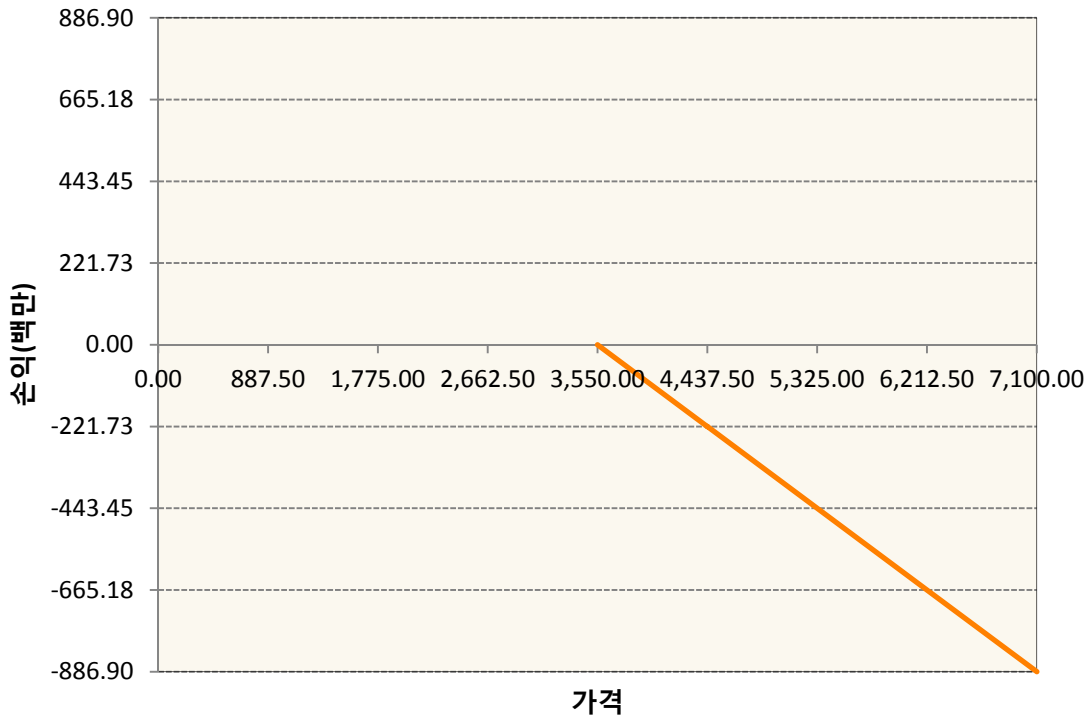
1. 계약금액

(단위:백만원)

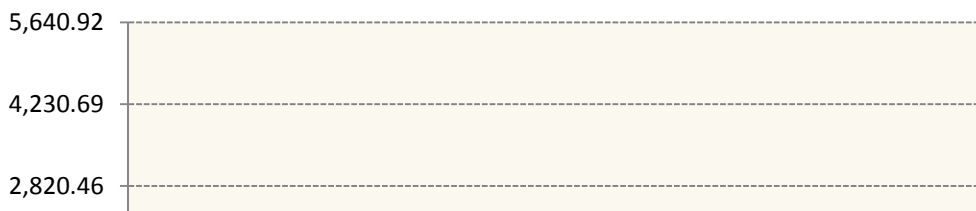
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,635	0	3,635	
누계	유가증권	스왑	23,927	0	23,927	장외
누계	유가증권	옵션	0	13,056	-13,056	장내
누계	통화	선도	0	6,180	-6,180	장외

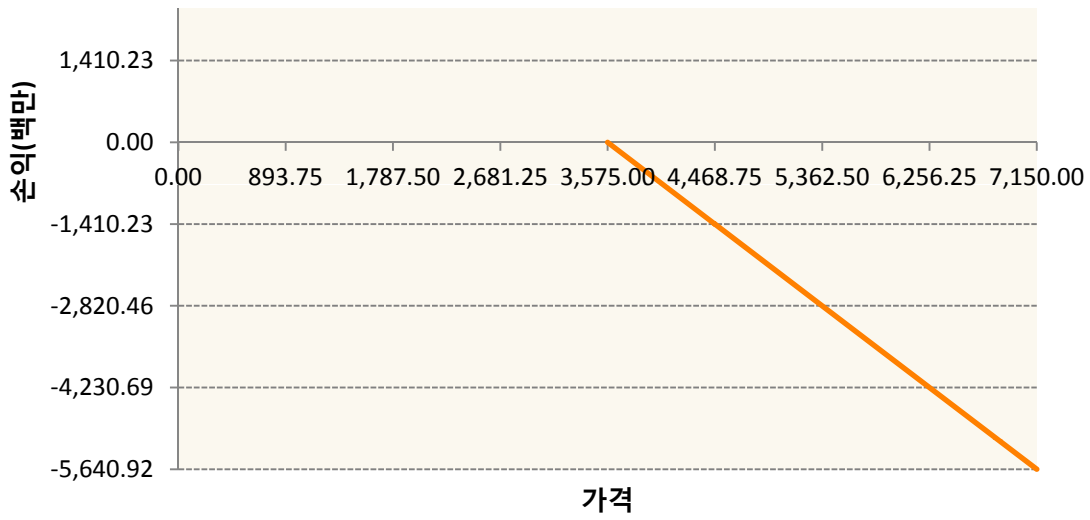
2. 만기시점의 손익구조

OESXV9-C3550-EURO STOXX 50

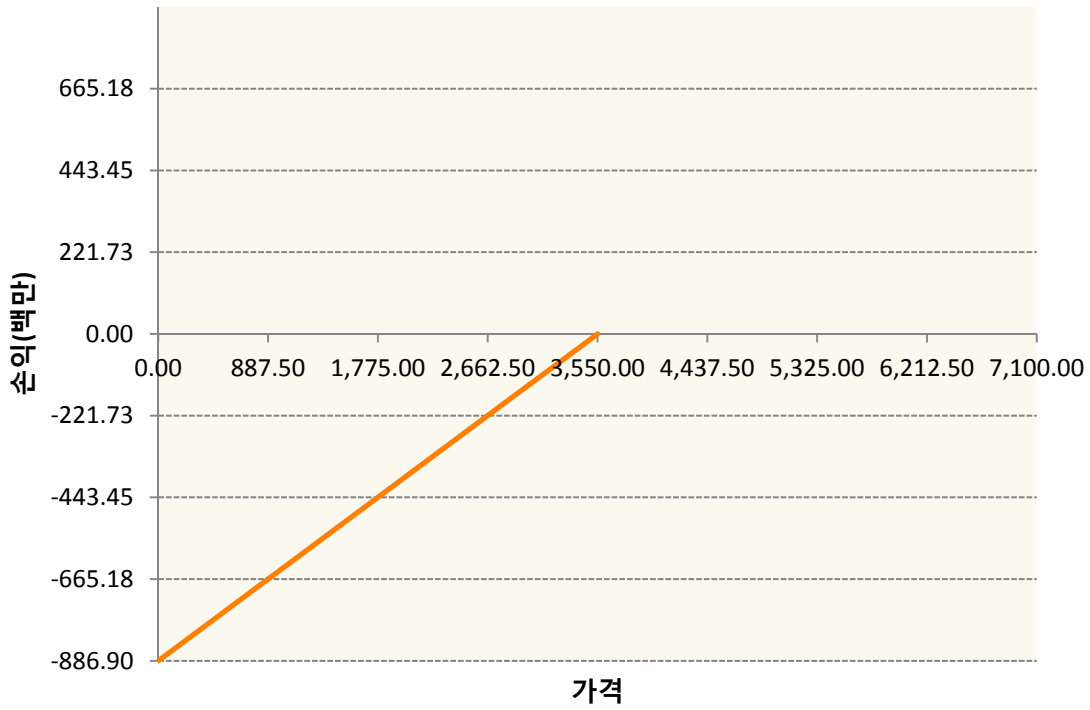


OESXV9-C3575-EURO STOXX 50

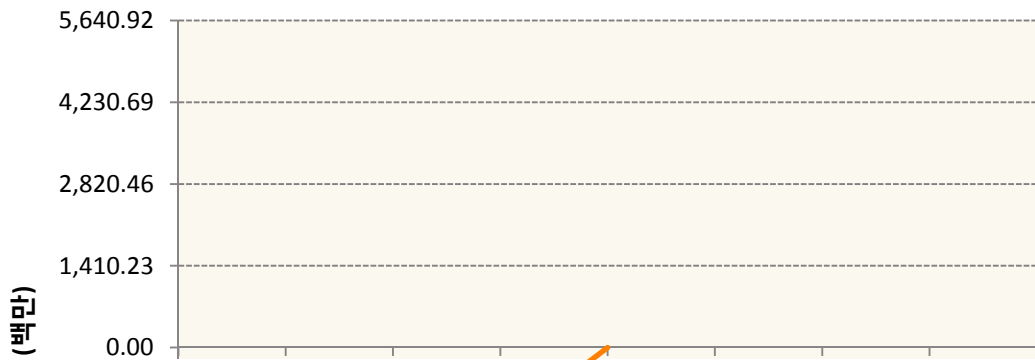


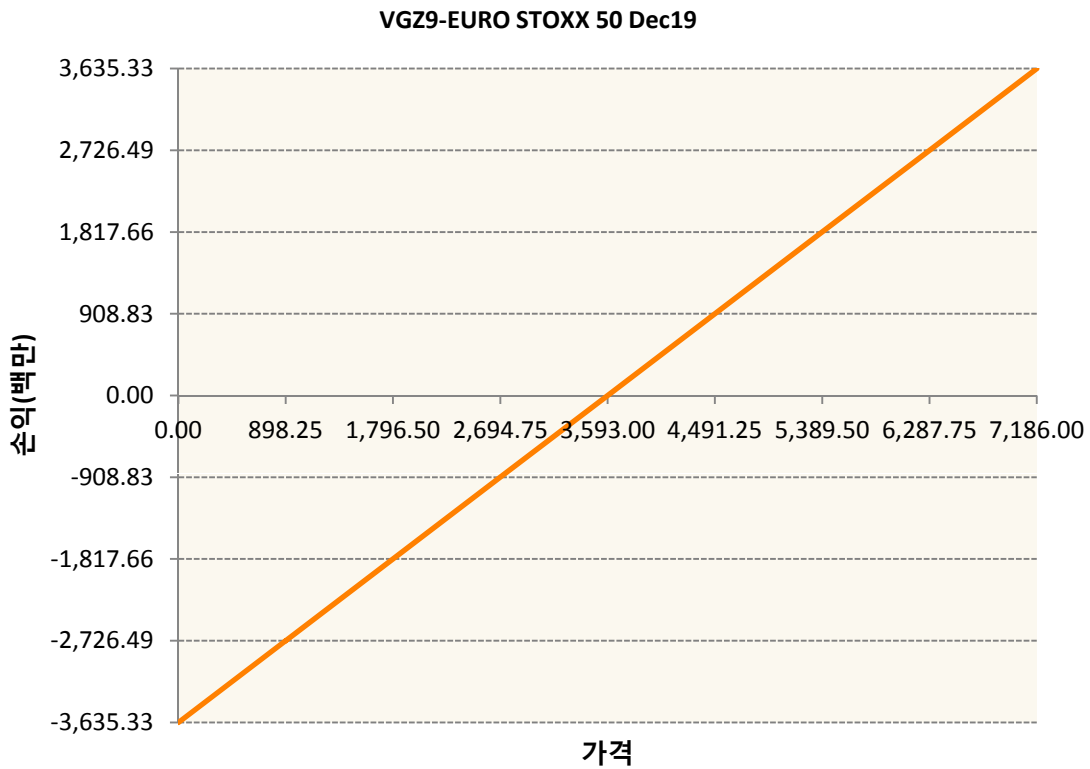
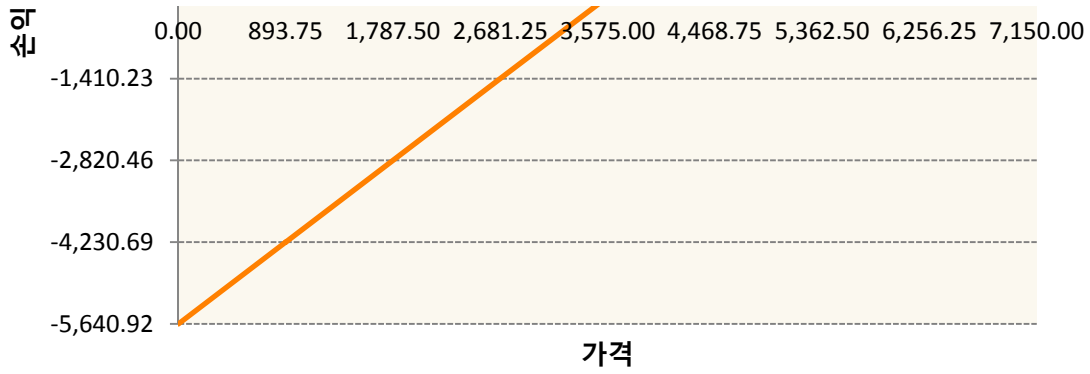


OESXV9-P3550-EURO STOXX 50



OESXV9-P3575-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		2
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E		494
OESXV9-C35 EURO STOXX 50		71
OESXV9-C35 EURO STOXX 50		451
OESXV9-P35 EURO STOXX 50		71
OESXV9-P35 EURO STOXX 50		451
VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	291

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

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

(단위:백만원)

944

공시일	2019-10-18
기준일	2019-10-17

ETF스마트레버리지목표전환형9호

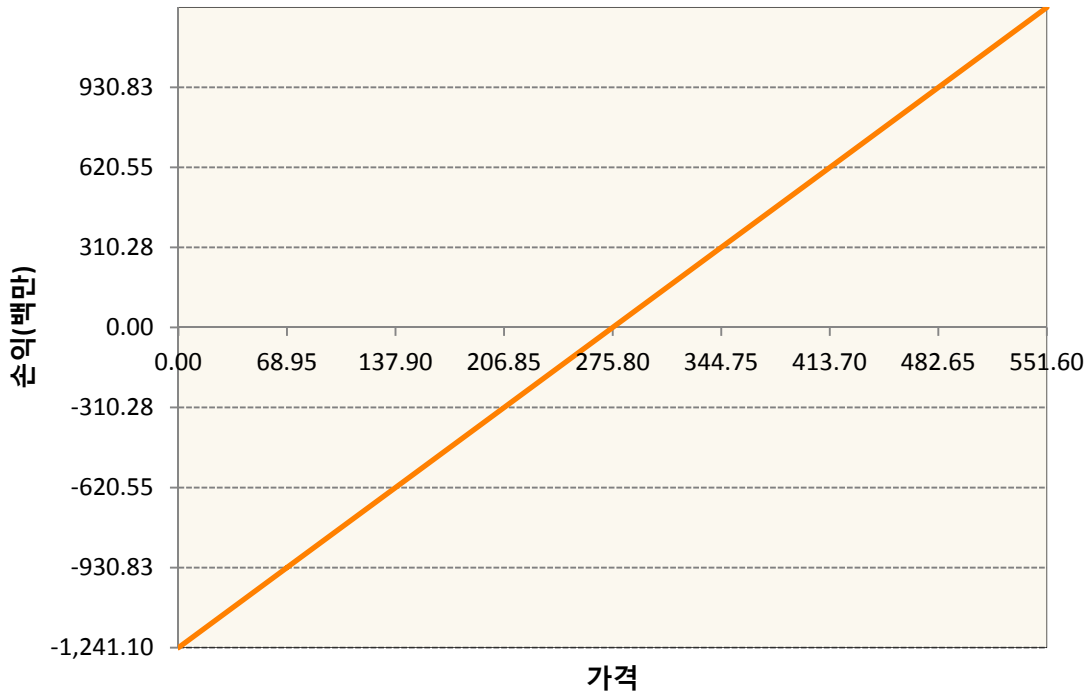
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,241	0	1,241	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)

82

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

(단위:백만원)

128

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-10-18
기준일	2019-10-17

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

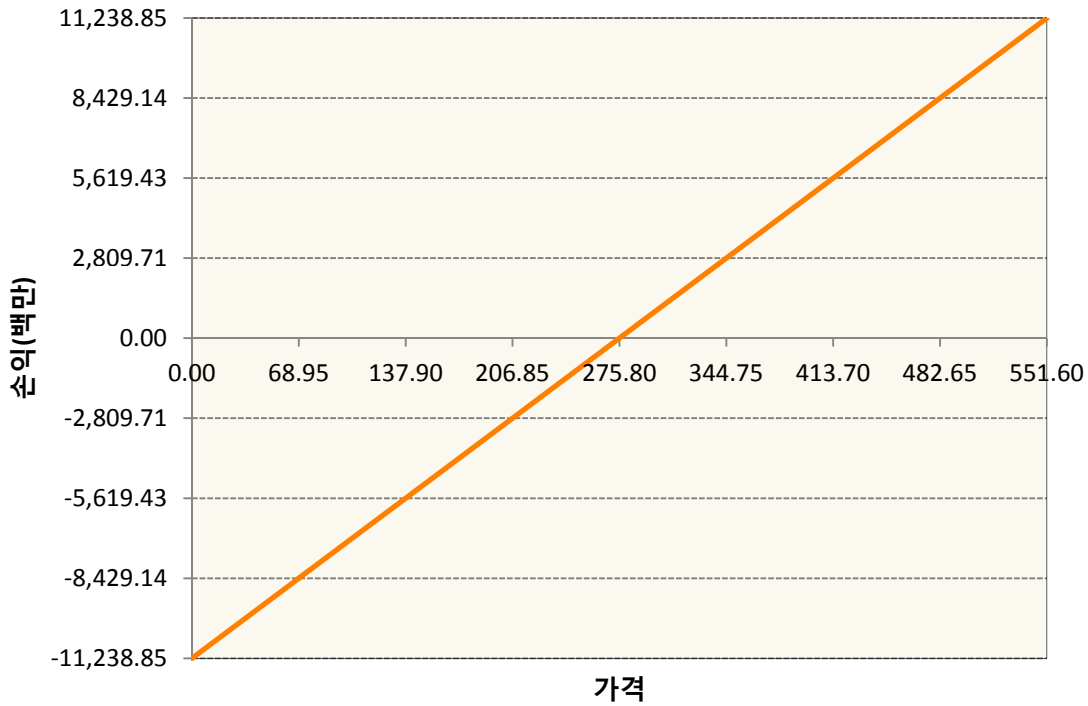
1. 계약금액

(단위:백만원)

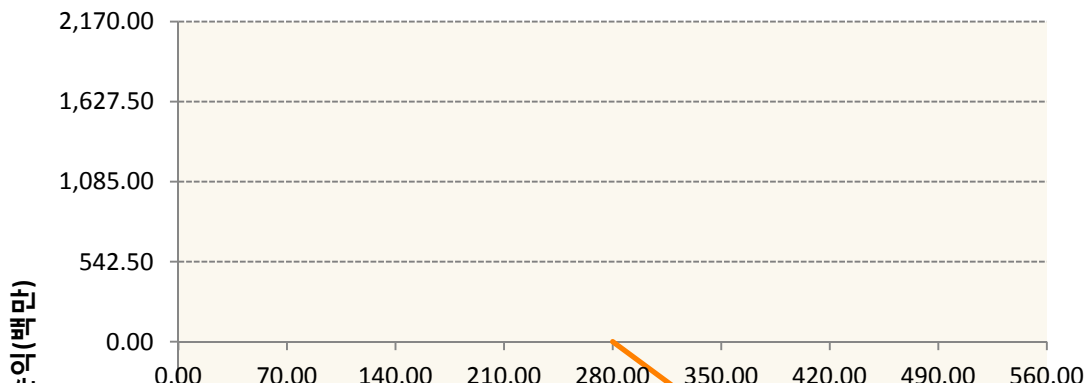
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,239	0	11,239	장내
누계	유가증권	옵션	3,561	20,815	-17,254	장내

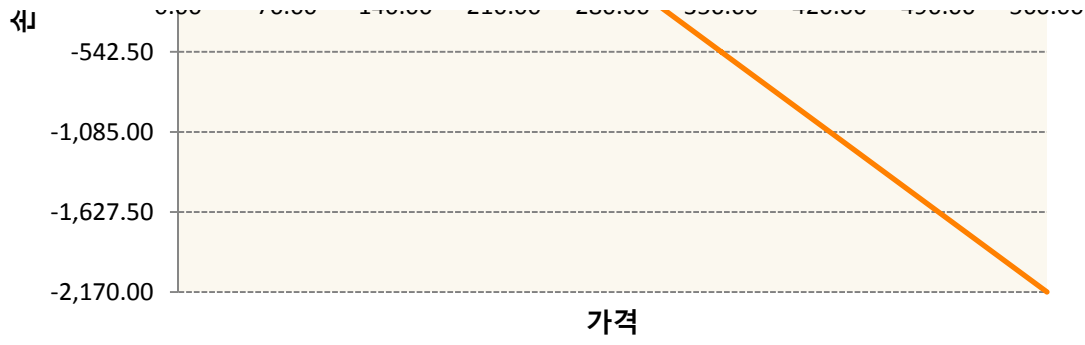
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

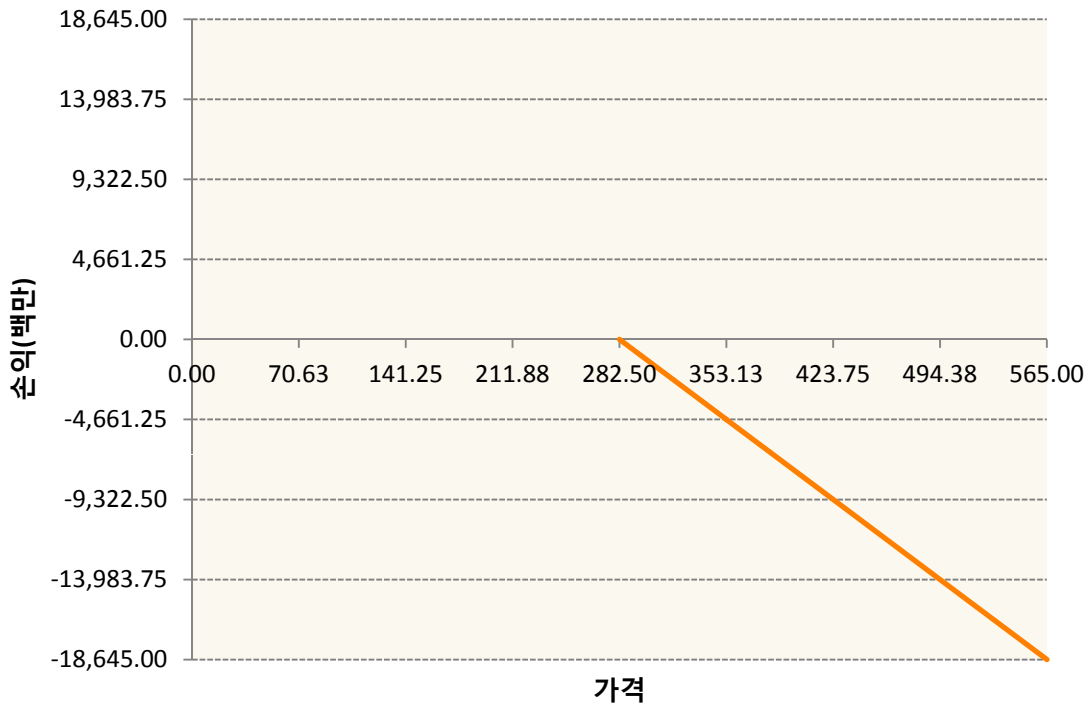


KR4201PB2800-2019-11 콜280

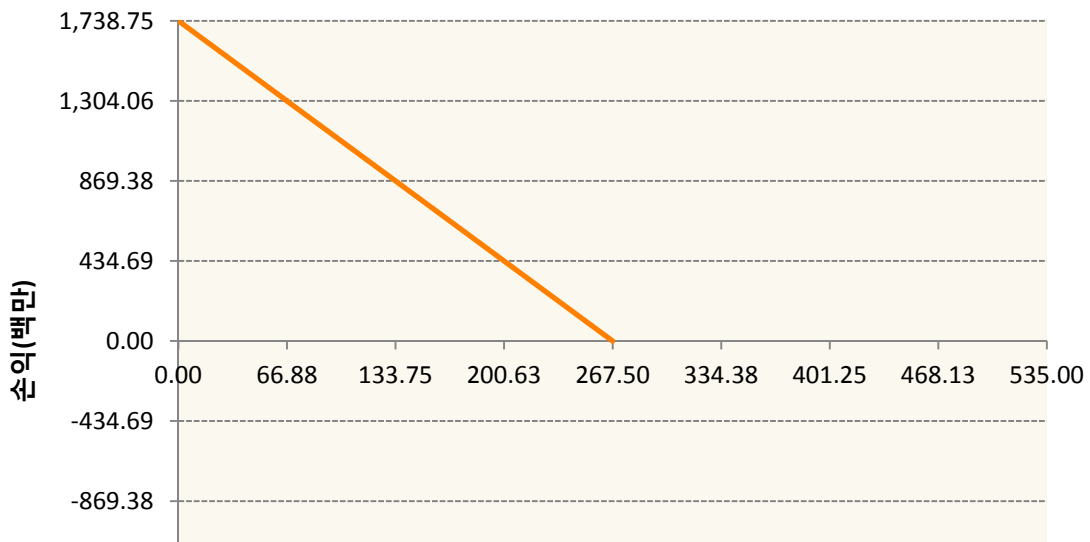


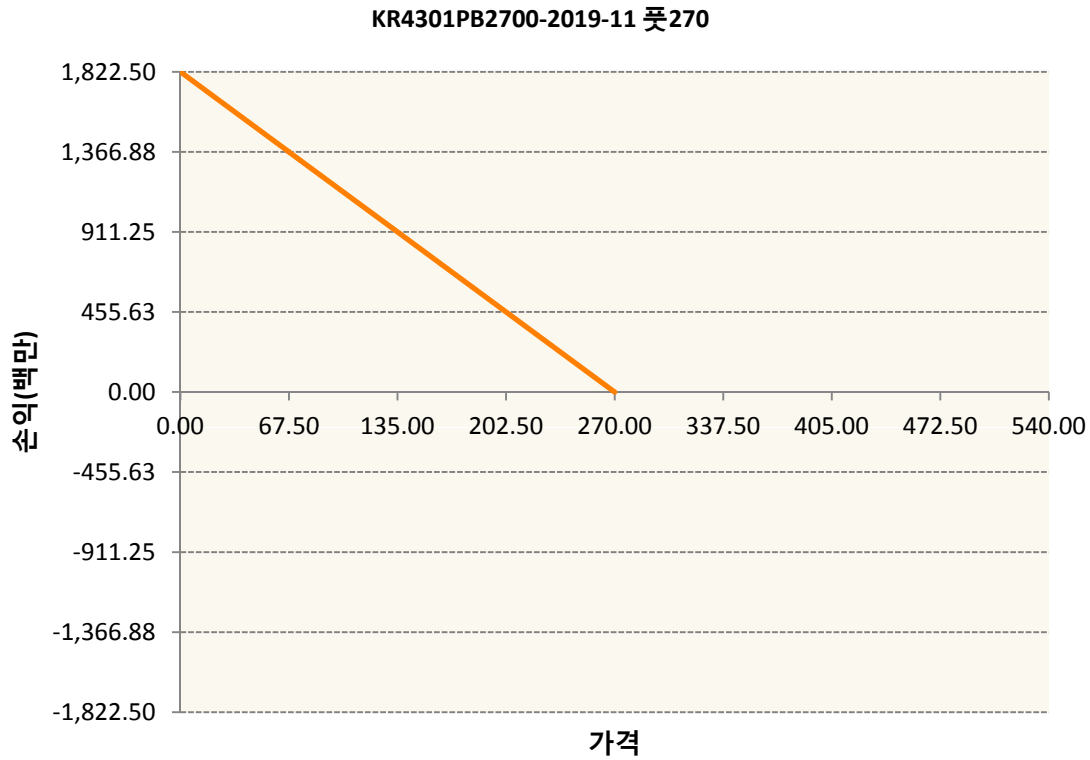
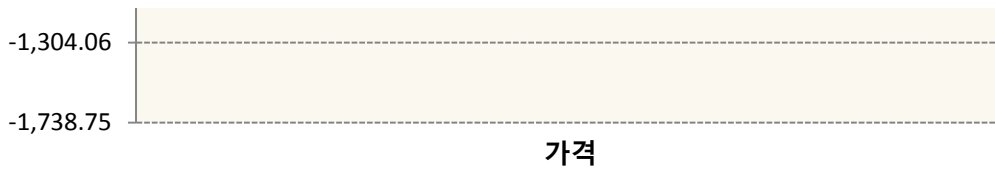


KR4201PB2826-2019-11 콜282.5



KR4301PB2676-2019-11 풋267.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						898
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-898	-898	-898	-898	-898	-898	-898	
-5.33%	-599	-599	-599	-599	-599	-599	-599	
-2.67%	-299	-299	-299	-299	-299	-299	-299	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	299	299	299	299	299	299	299	
5.33%	599	599	599	599	599	599	599	
8.00%	898	898	898	898	898	898	898	
KR4201PB2800		2019-11 콜280						120
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	46	45	43	41	39	37	34	
-5.33%	42	40	37	34	30	27	23	
-2.67%	33	29	25	20	16	11	7	

0%	16	10	5	0	-5	-10	-16
2.67%	-12	-18	-23	-28	-34	-39	-44
5.33%	-50	-55	-59	-64	-69	-74	-79
8.00%	-96	-99	-103	-107	-111	-115	-120
KR4201PB2826 2019-11 콜282.5							964
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	336	328	317	303	287	268	246
-5.33%	312	294	273	249	223	195	165
-2.67%	250	220	187	153	117	80	42
0%	127	85	43	0	-43	-87	-131
2.67%	-79	-125	-171	-218	-264	-310	-357
5.33%	-372	-415	-458	-502	-546	-591	-636
8.00%	-742	-775	-809	-846	-884	-924	-964
KR4301PB2676 2019-11 풋267.5							88
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	84	85	85	86	87	87	88
-5.33%	41	42	44	45	47	49	50
-2.67%	9	12	14	16	18	20	22
0%	-4	-3	-2	0	2	3	5
2.67%	-8	-7	-7	-6	-5	-4	-3
5.33%	-8	-8	-8	-8	-8	-7	-7
8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
KR4301PB2700 2019-11 풋270							103
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	100	100	100	101	101	102	103
-5.33%	52	53	55	56	57	59	61
-2.67%	15	17	19	21	23	26	28
0%	-6	-4	-2	0	2	4	6
2.67%	-12	-11	-10	-9	-8	-7	-6
5.33%	-13	-13	-12	-12	-12	-11	-11
8.00%	-13	-13	-13	-13	-13	-12	-12

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

(단위:백만원)

1,782

공시일	2019-10-18
기준일	2019-10-17

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,187	0	1,187	
누계	유가증권	수익증권	154,359	0	154,359	

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	2019-10-18
기준일	2019-10-17

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,374	0	2,374	
누계	유가증권	수익증권	197,818	0	197,818	

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	2019-10-18
기준일	2019-10-17

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	7,122	0	7,122	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	423,686	0	423,686	
누계	통화	선도	0	538,305	-538,305	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,893
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,514
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		1,462
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		2,953
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		3,134
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		2,602
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E		1,899
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E		1,994
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E		950
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		665
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E		1,557
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		703
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E		1,709
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		2,507
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		475
FX21019V02 KRW/USD 21-11-19E		5,166
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,843

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

(단위:백만원)

13,894

공시일	2019-10-18
기준일	2019-10-17

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

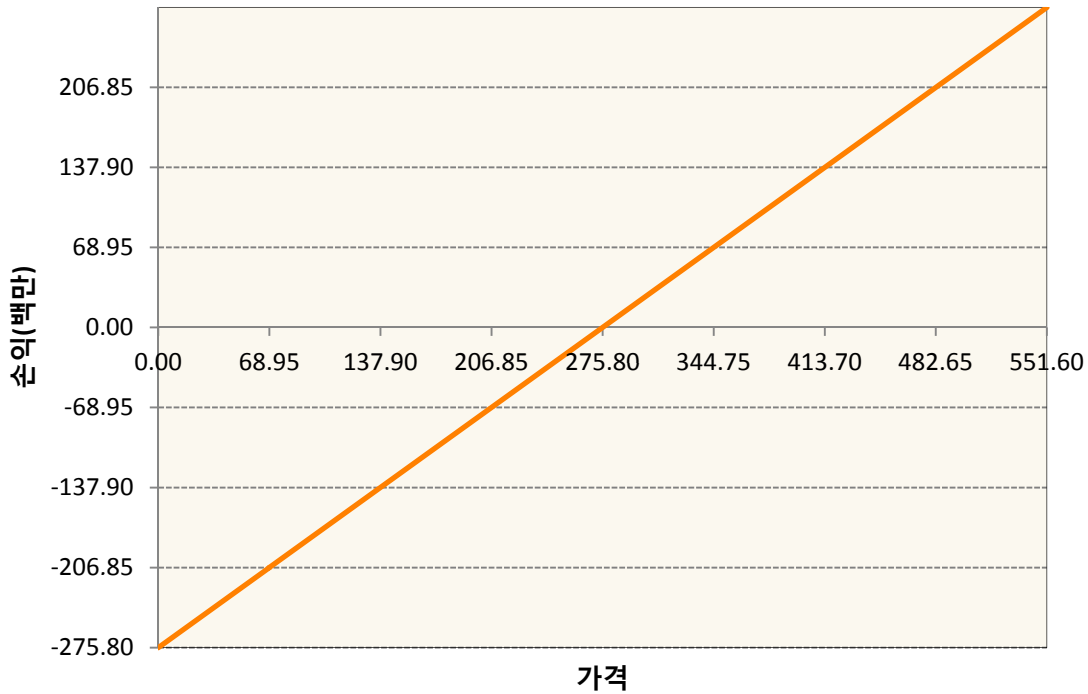
1. 계약금액

(단위:백만원)

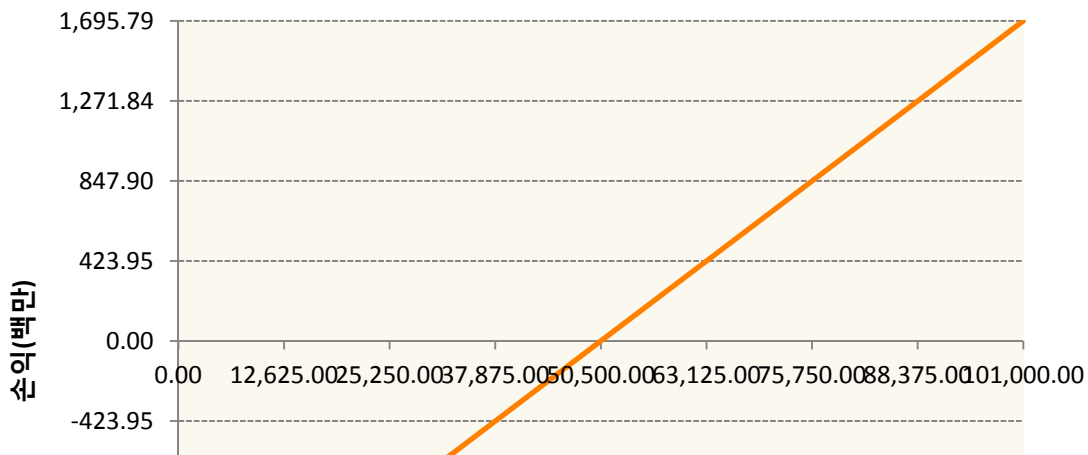
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,972	0	1,972	장내

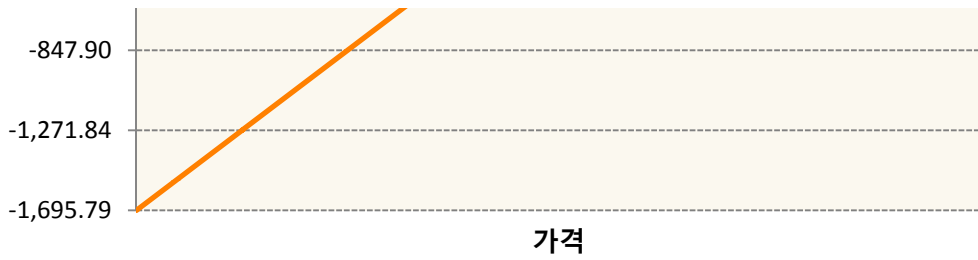
2. 만기시점의 손익구조

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%	-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%	136	136	136	136	136	136	136	

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

179

공시일	2019-10-18
기준일	2019-10-17

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

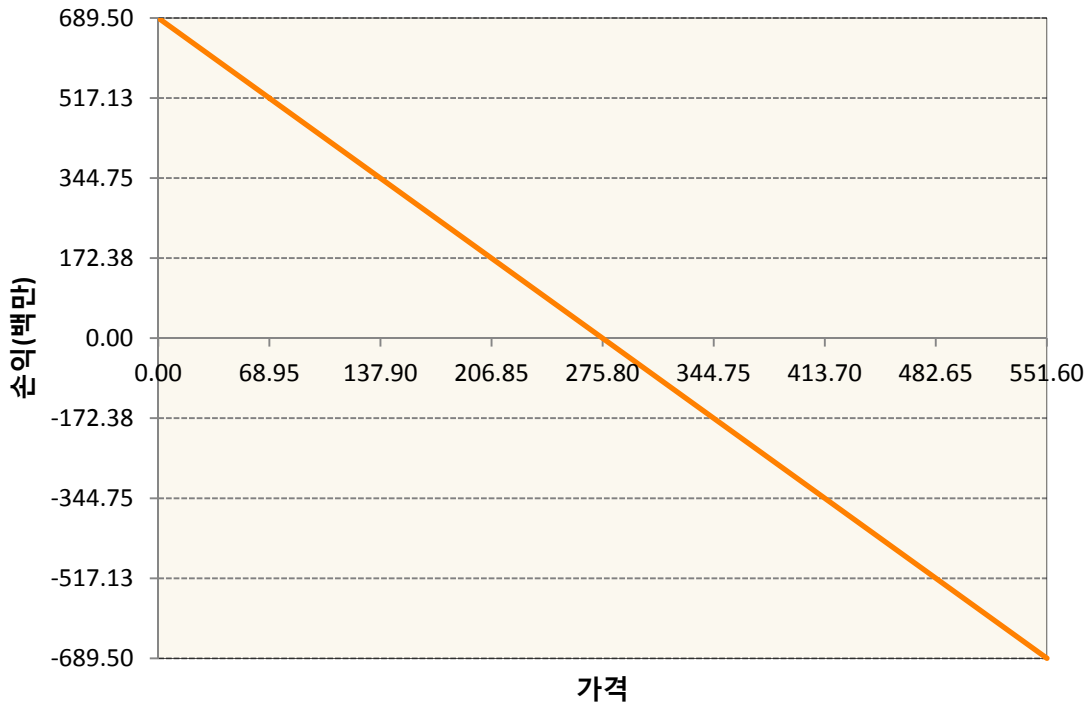
1. 계약금액

(단위:백만원)

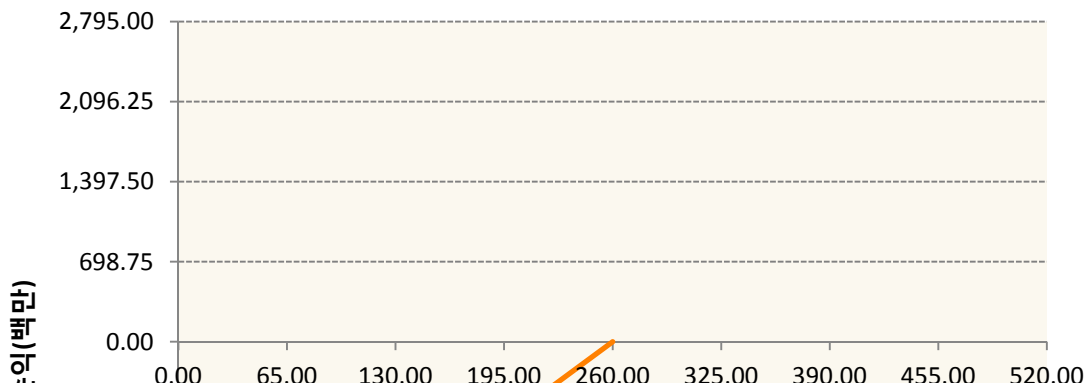
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	690	-690	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,976	-3,976	장내

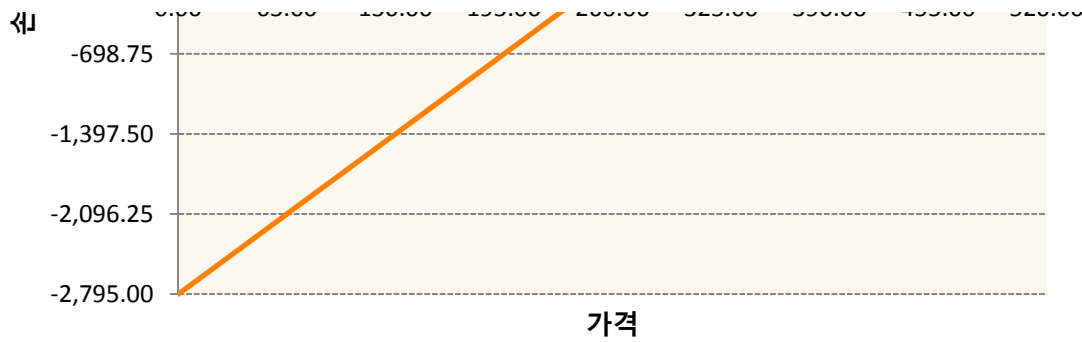
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

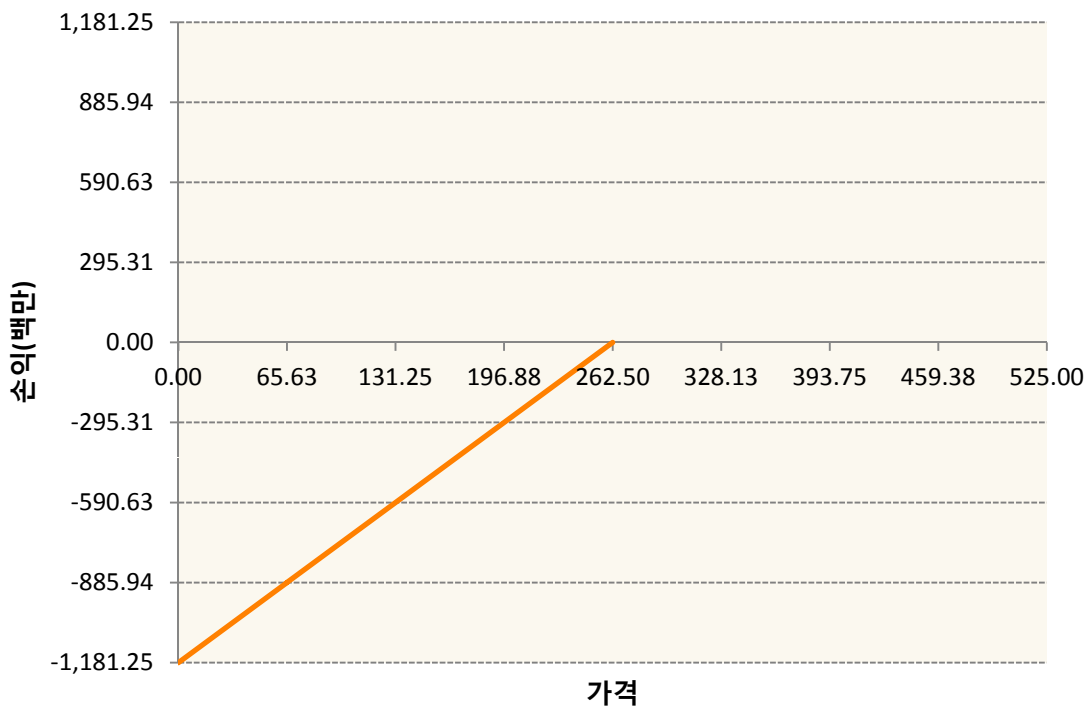


KR4301PB2601-2019-11 풋260





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						92
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-76	-78	-81	-83	-86	-89	-92
-5.33%	-25	-28	-32	-35	-38	-42	-45
-2.67%	-3	-5	-7	-9	-12	-15	-17
0%	2	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	3	3	3	2	2	2	1
5.33%	3	3	3	3	3	3	2
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

KR4301PB2627

2019-11 풋262.5

46

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-41	-41	-42	-43	-44	-45	-46
-5.33%	-15	-17	-18	-20	-21	-23	-24
-2.67%	-2	-3	-5	-6	-7	-8	-10
0%	2	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)

127

공시일	2019-10-18
기준일	2019-10-17

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	16,743	0	16,743	
누계	통화	선도	1,234	22,268	-21,034	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)

607

공시일	2019-10-18
기준일	2019-10-17

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	461	0	461	장외
누계	통화	선도	118	240	-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	2019-10-18
기준일	2019-10-17

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

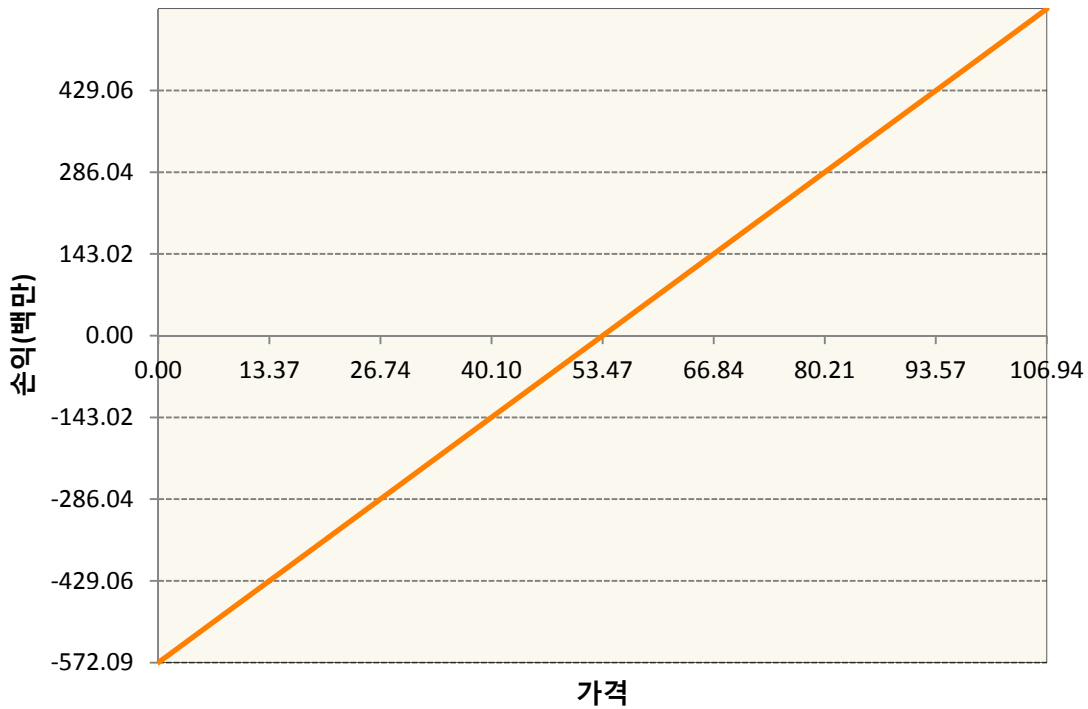
1. 계약금액

(단위:백만원)

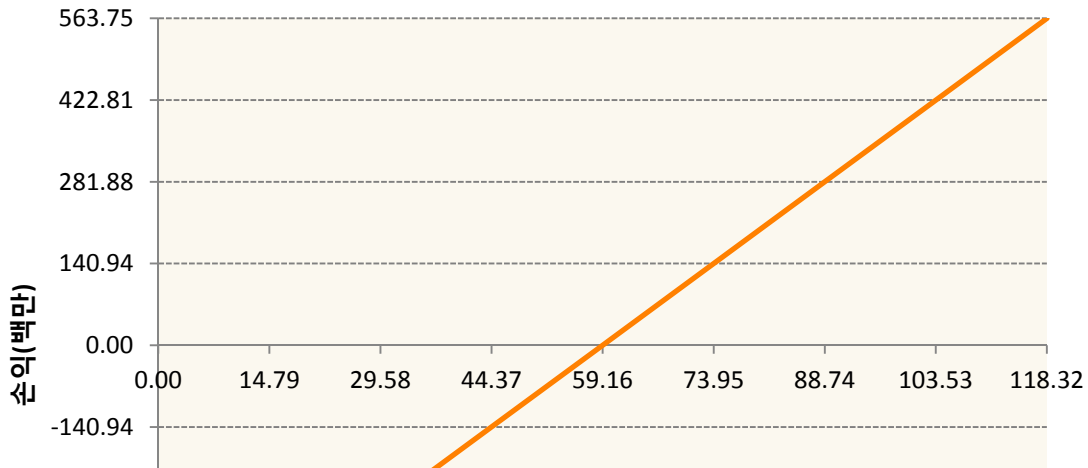
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,418	297	2,122	

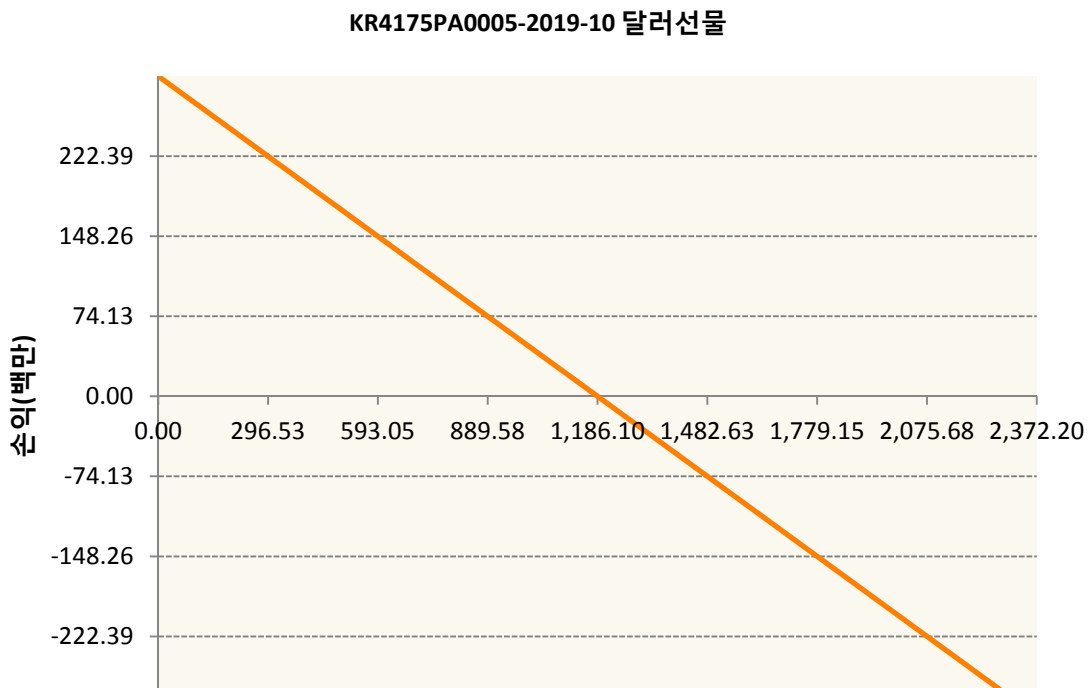
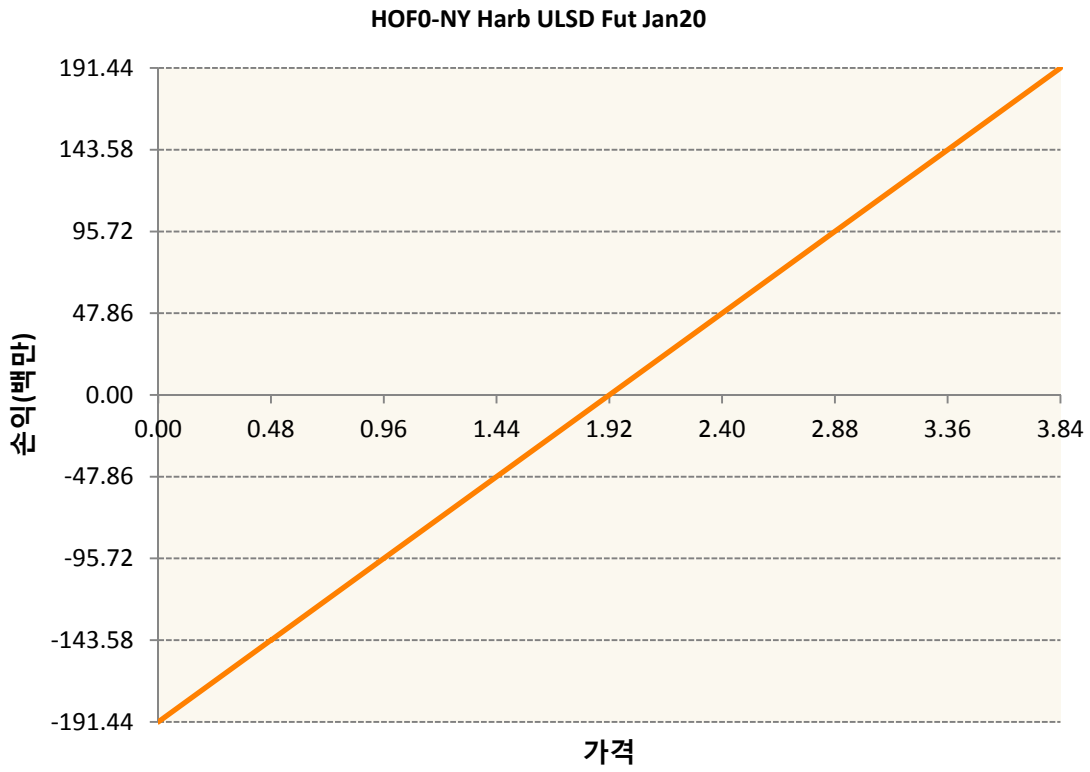
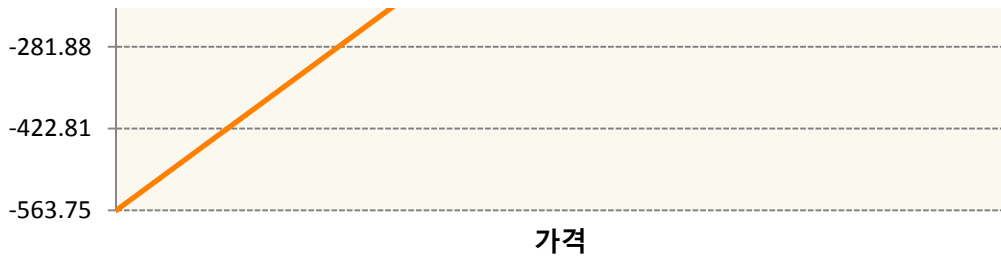
2. 만기시점의 손익구조

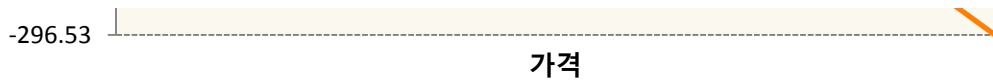
CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20



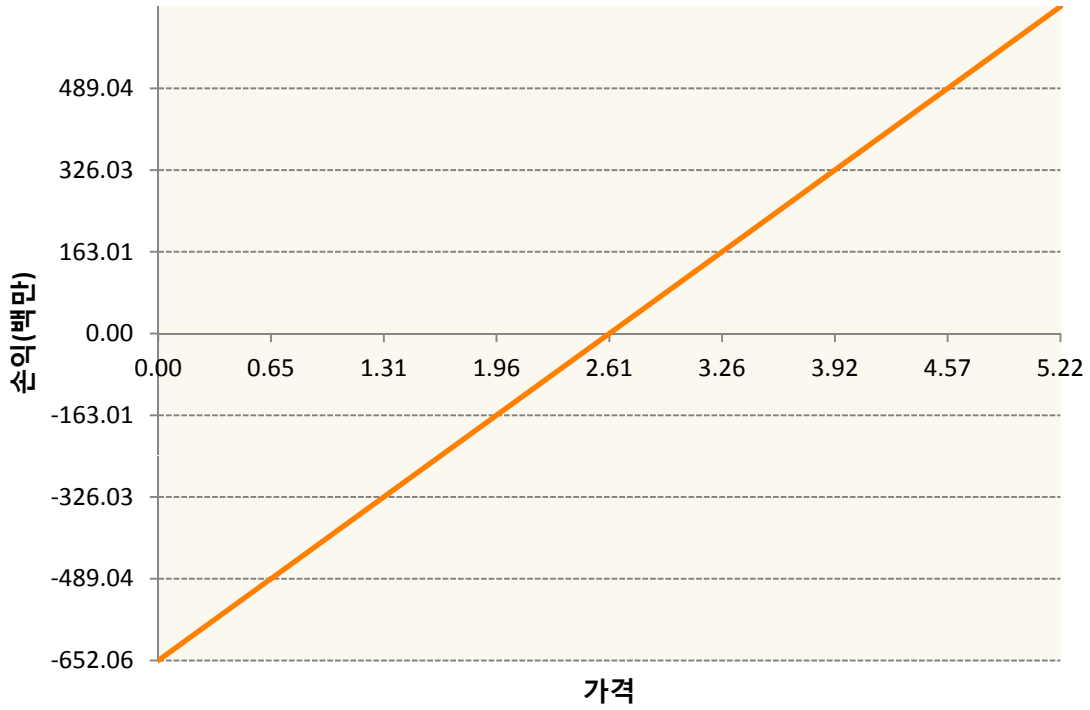
COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20



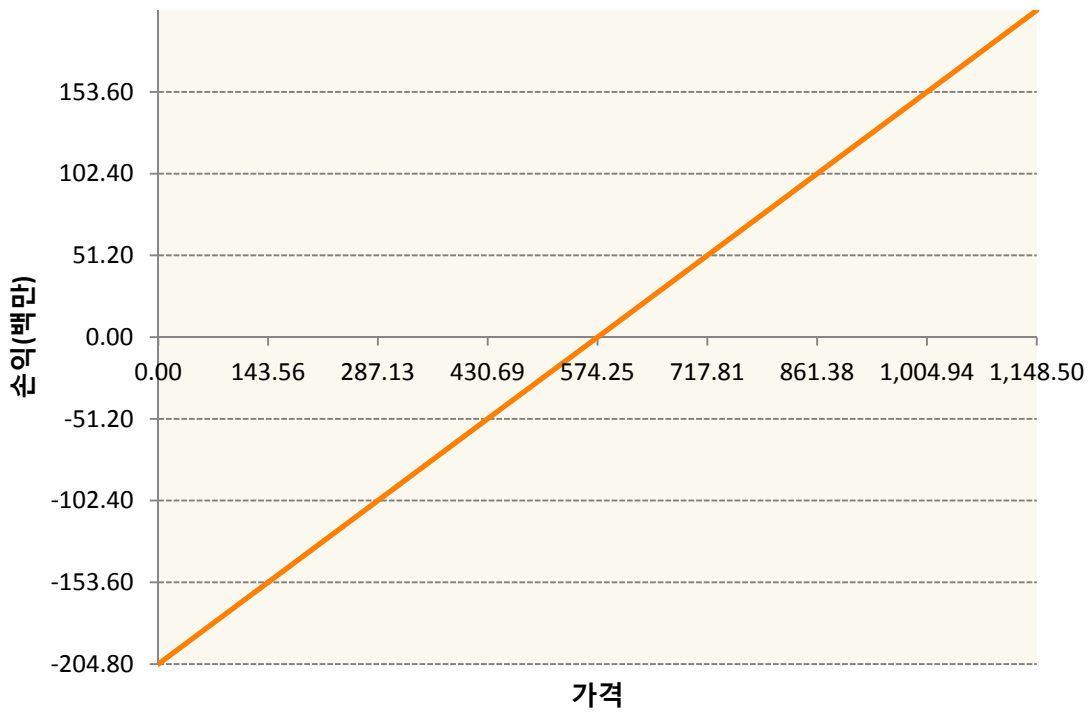




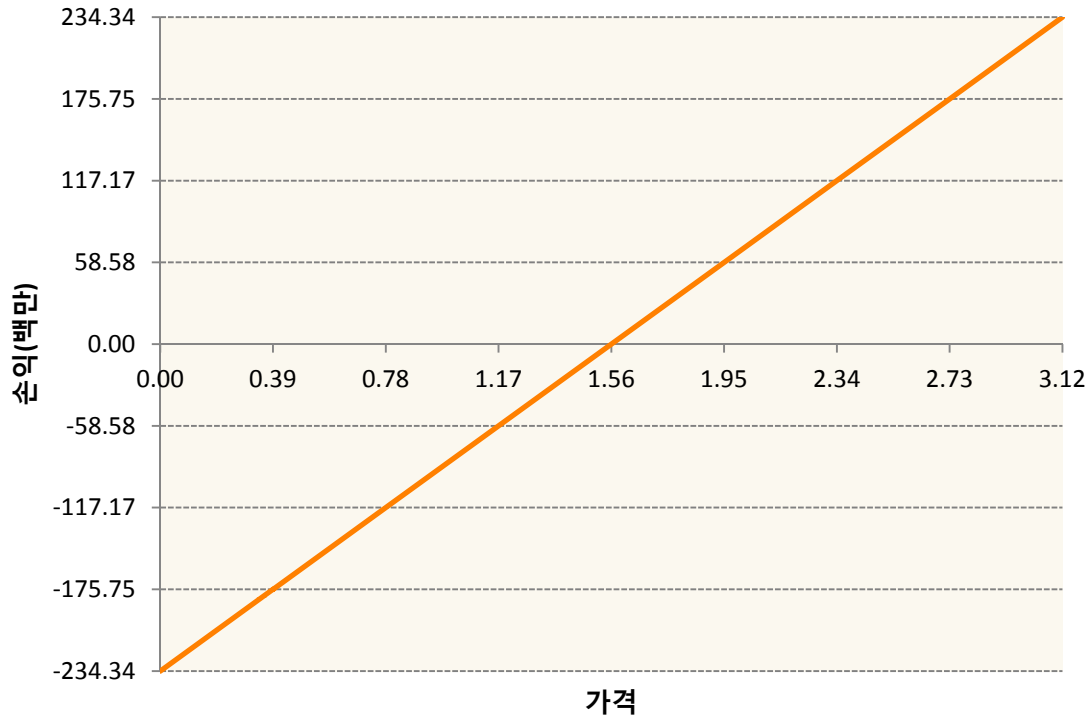
NGF20-NATURAL GAS FUTR Jan20



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	45
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)

402

공시일	2019-10-18
기준일	2019-10-17

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

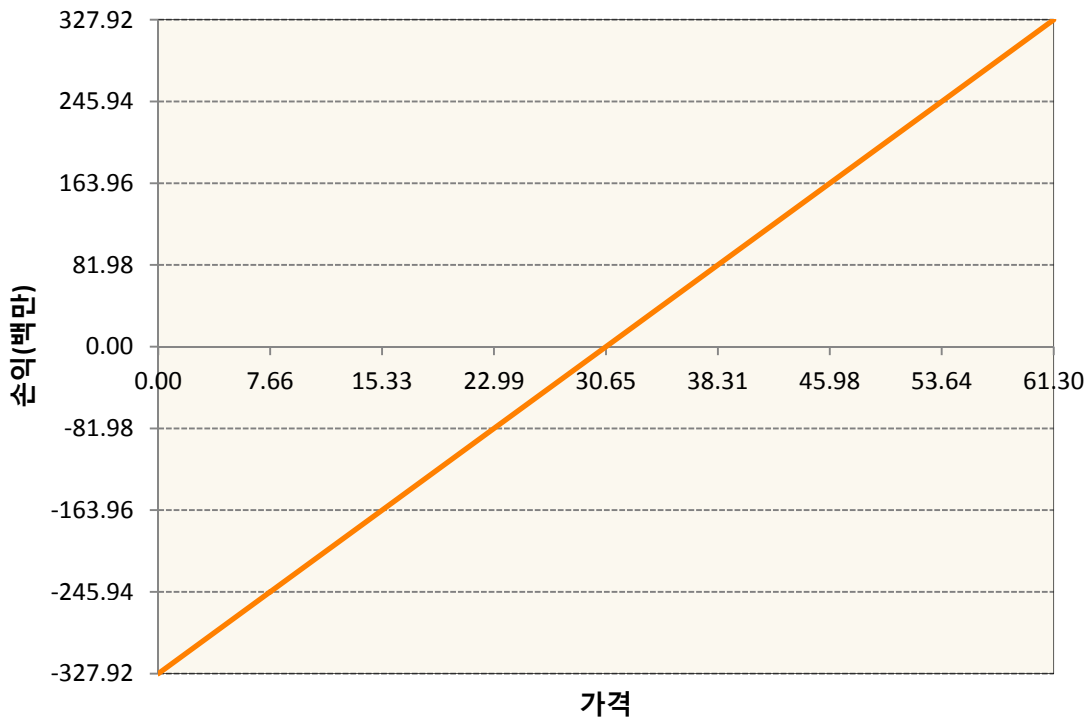
1. 계약금액

(단위:백만원)

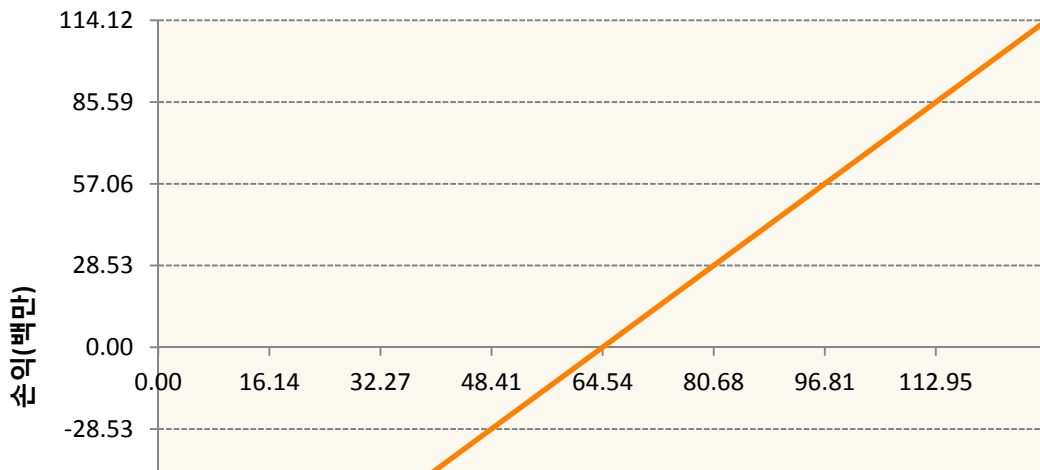
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,858	95	2,763	

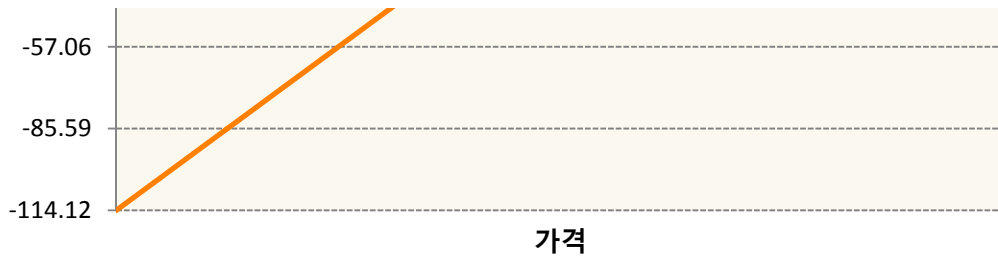
2. 만기시점의 손익구조

BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20

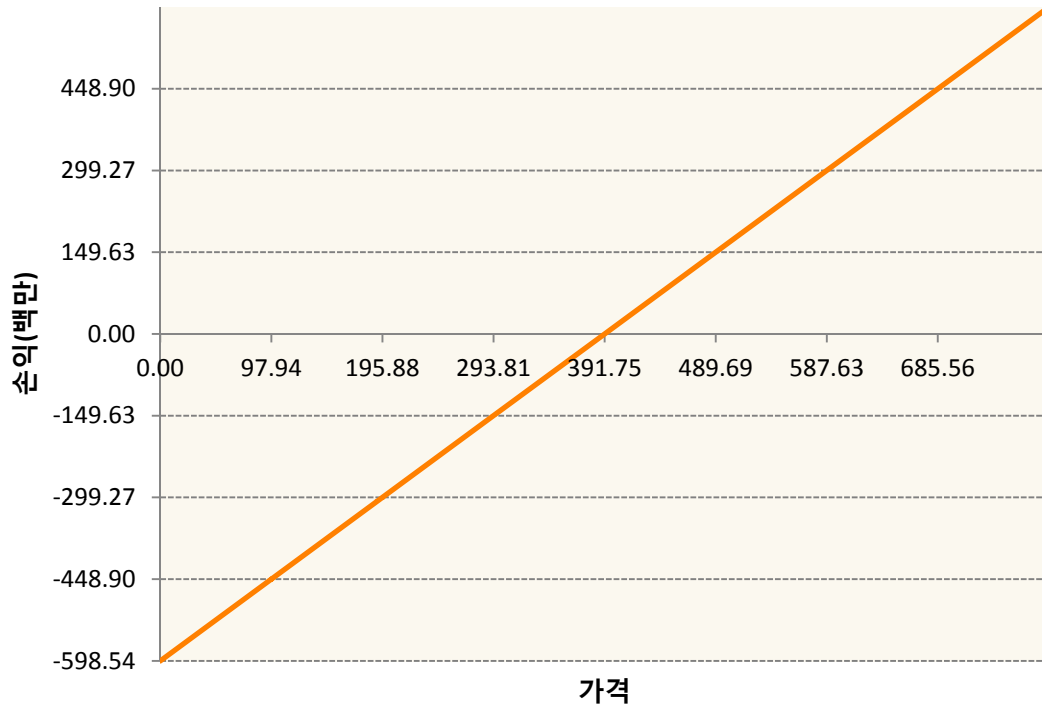


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

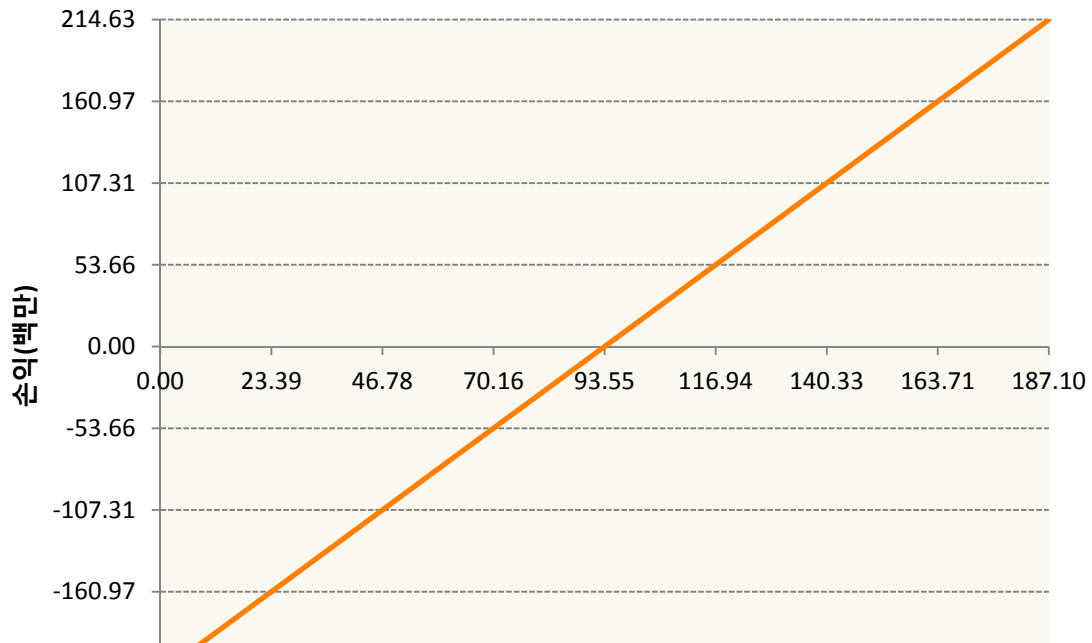


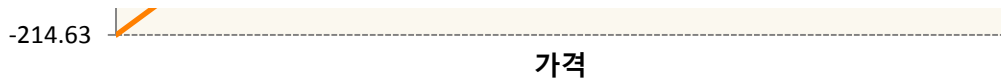


CZ9-CORN FUTURE Dec19

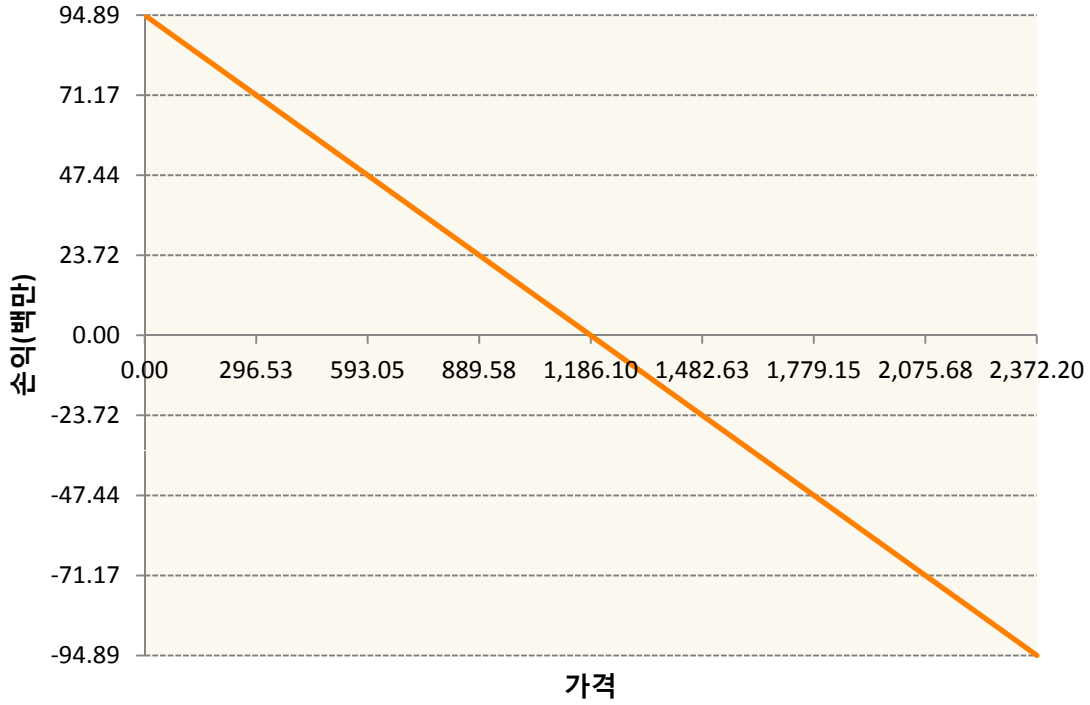


KCZ9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19

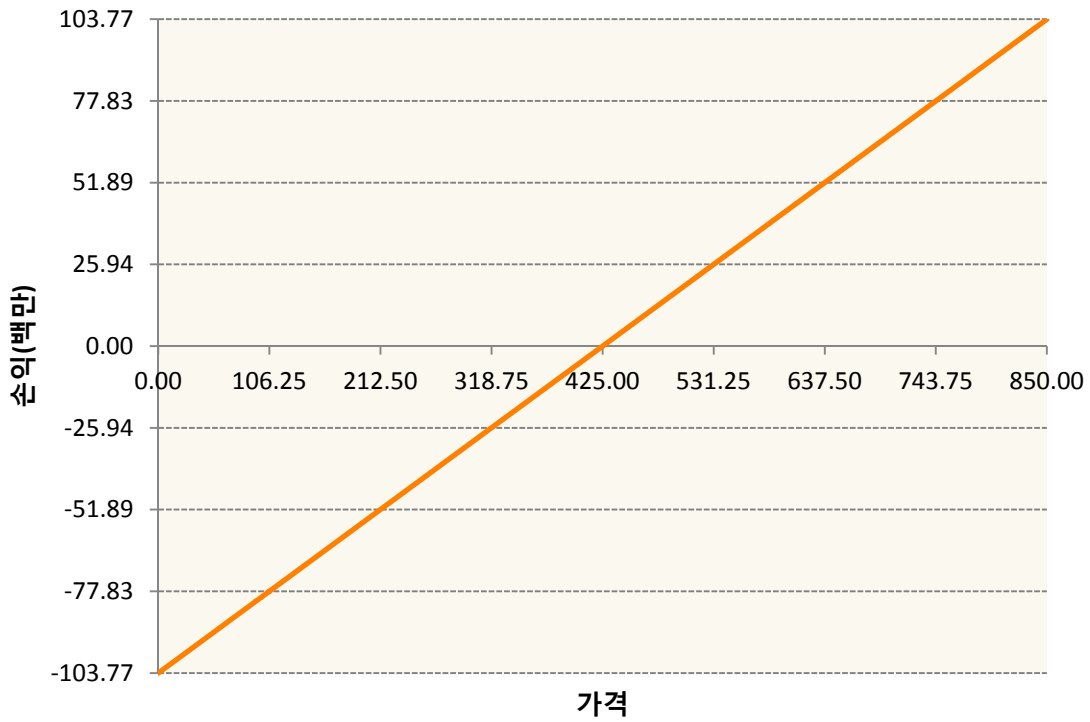




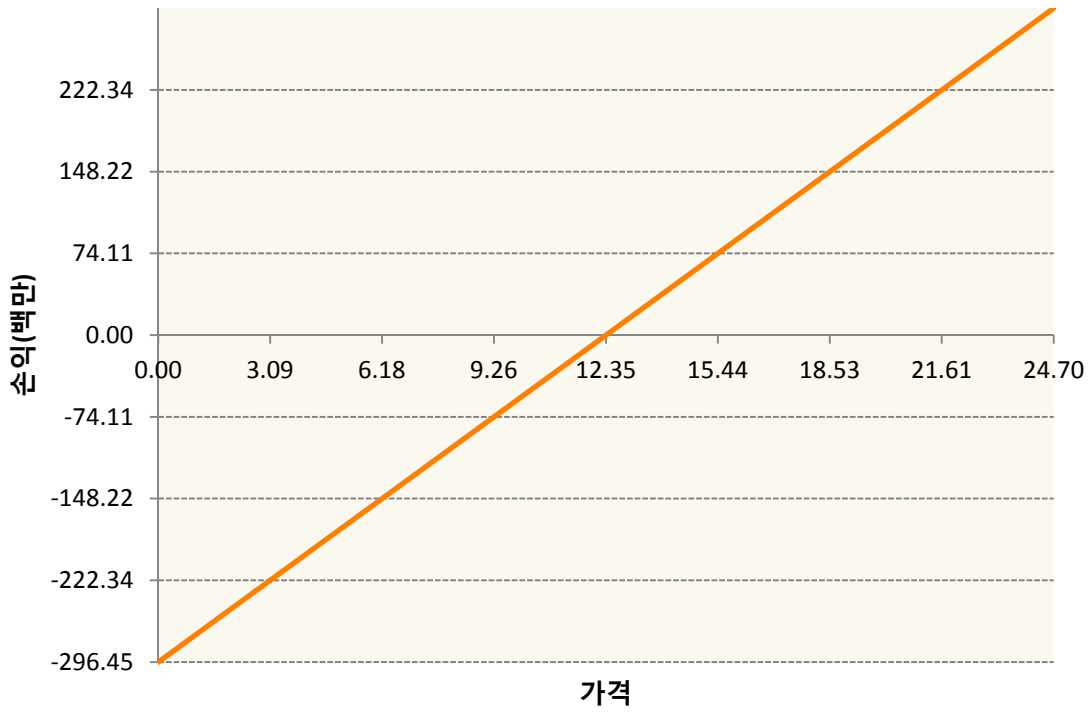
KR4175PA0005-2019-10 달러선물



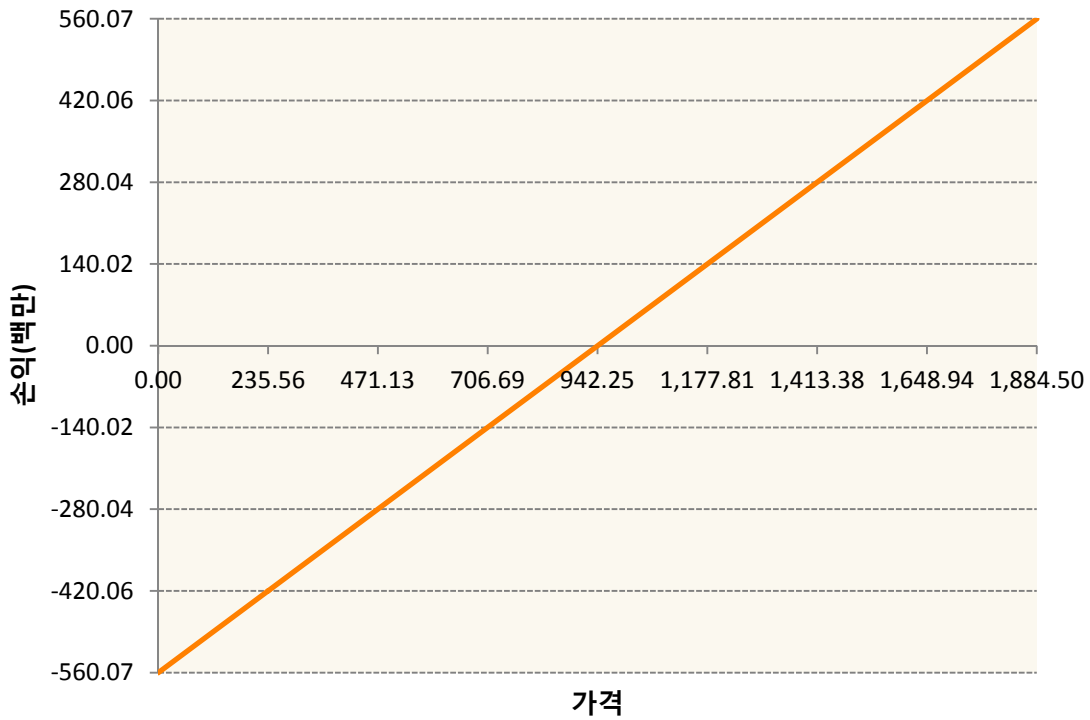
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



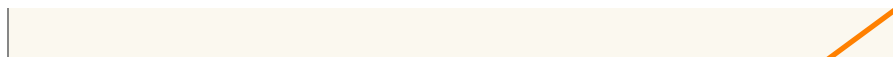
SBH0-Sugar Mar20

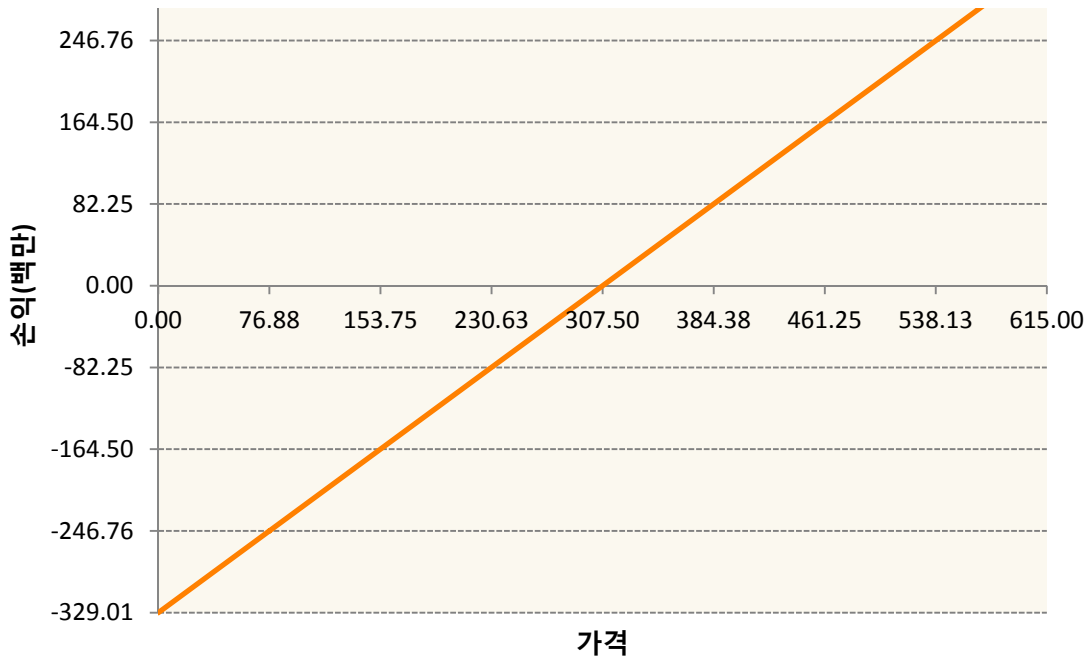


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20

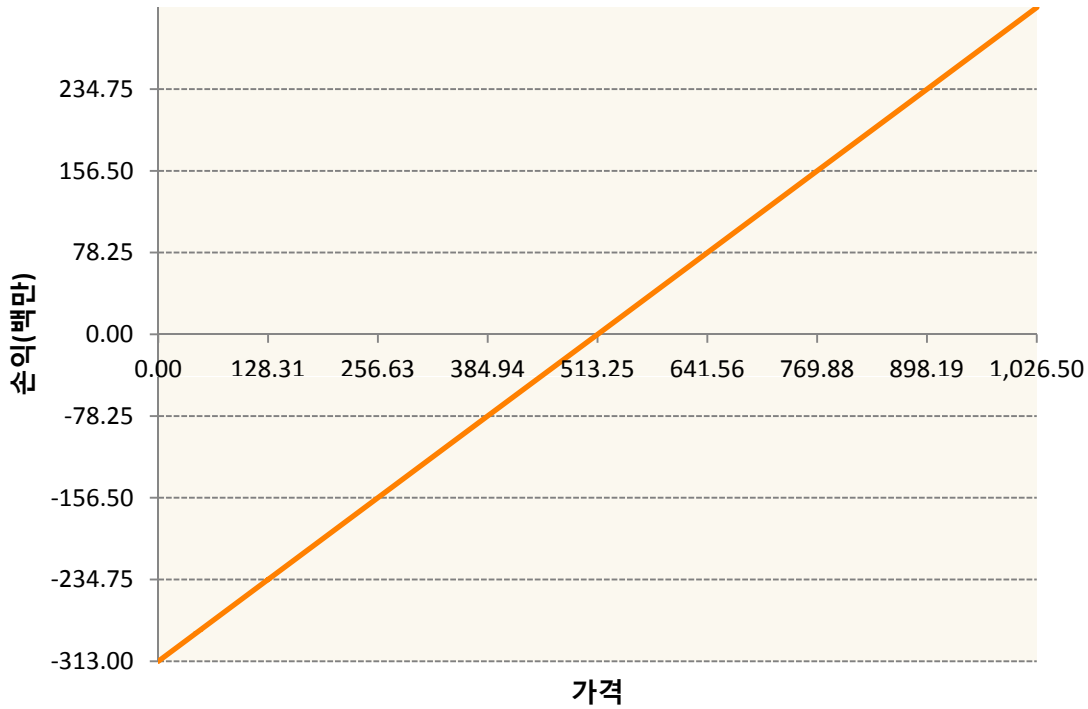


SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





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	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	26
WZ9	WHEAT FUTURE(CBT) Dec19	25

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

(단위:백만원)

256