

공시일	2019-10-21
기준일	2019-10-18

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	2019-10-21
기준일	2019-10-18

스마트인덱스모

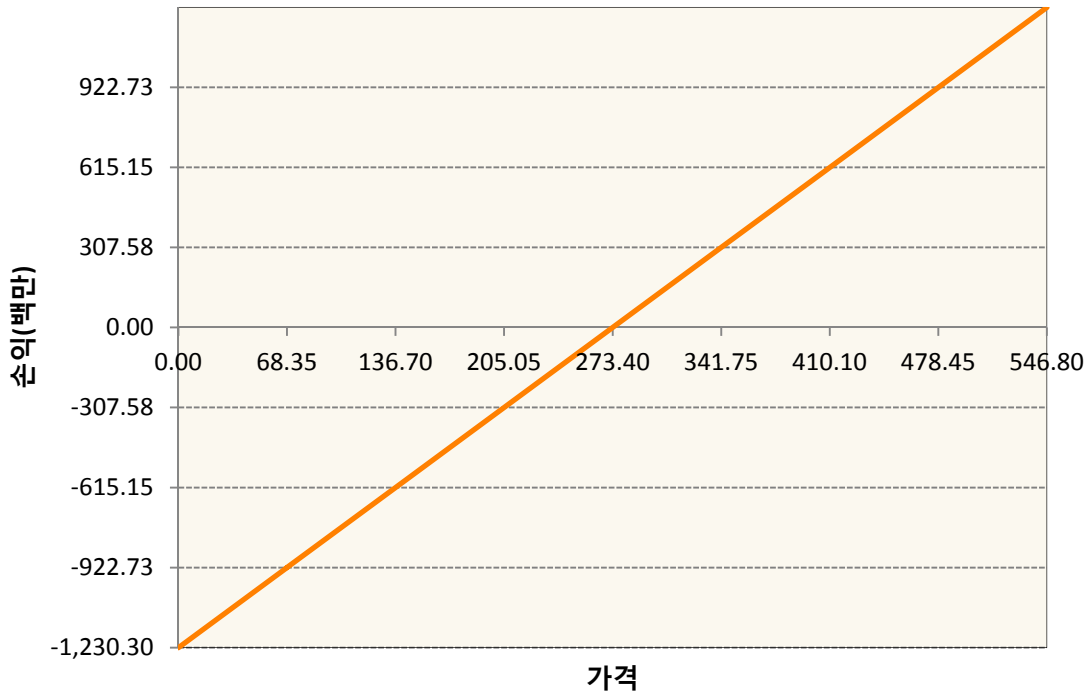
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,230	0	1,230	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						98
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98	
-5.33%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65	
-2.67%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	33	33	33	33	33	33	33	
5.33%	65	65	65	65	65	65	65	
8.00%	98	98	98	98	98	98	98	

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

(단위:백만원)

81

공시일	2019-10-21
기준일	2019-10-18

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

1,183

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

688

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-10-21
기준일	2019-10-18

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)	377
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	138

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

784

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-10-21
기준일	2019-10-18

유로인덱스모(주식-파생형)

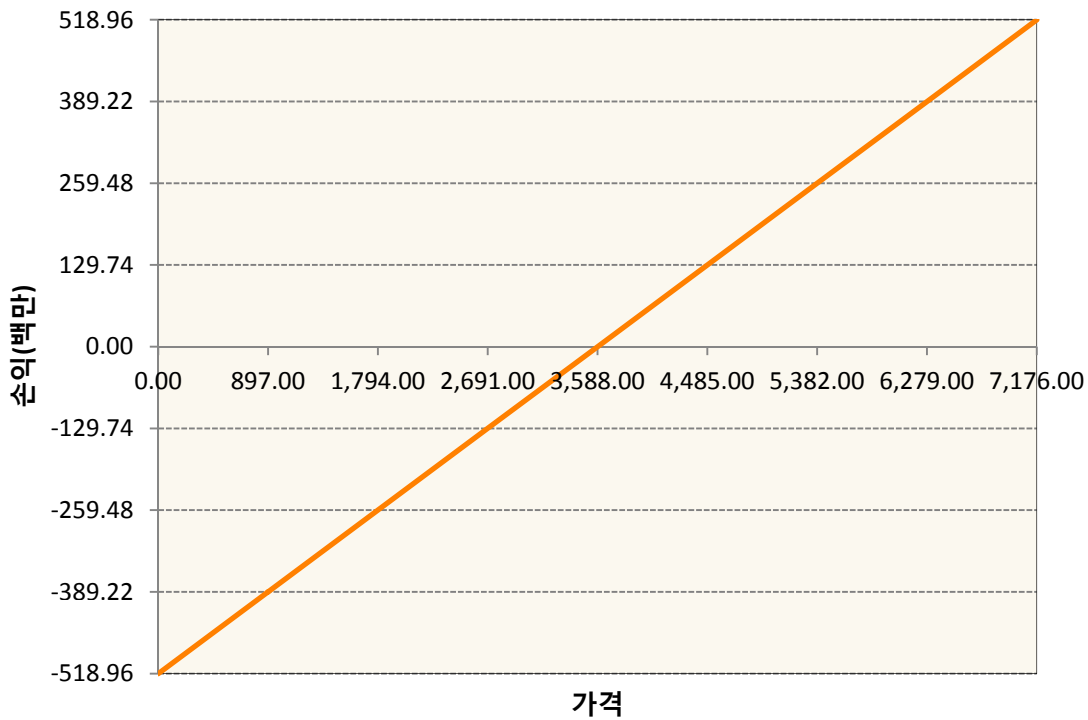
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	519	0	519	

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	2019-10-21
기준일	2019-10-18

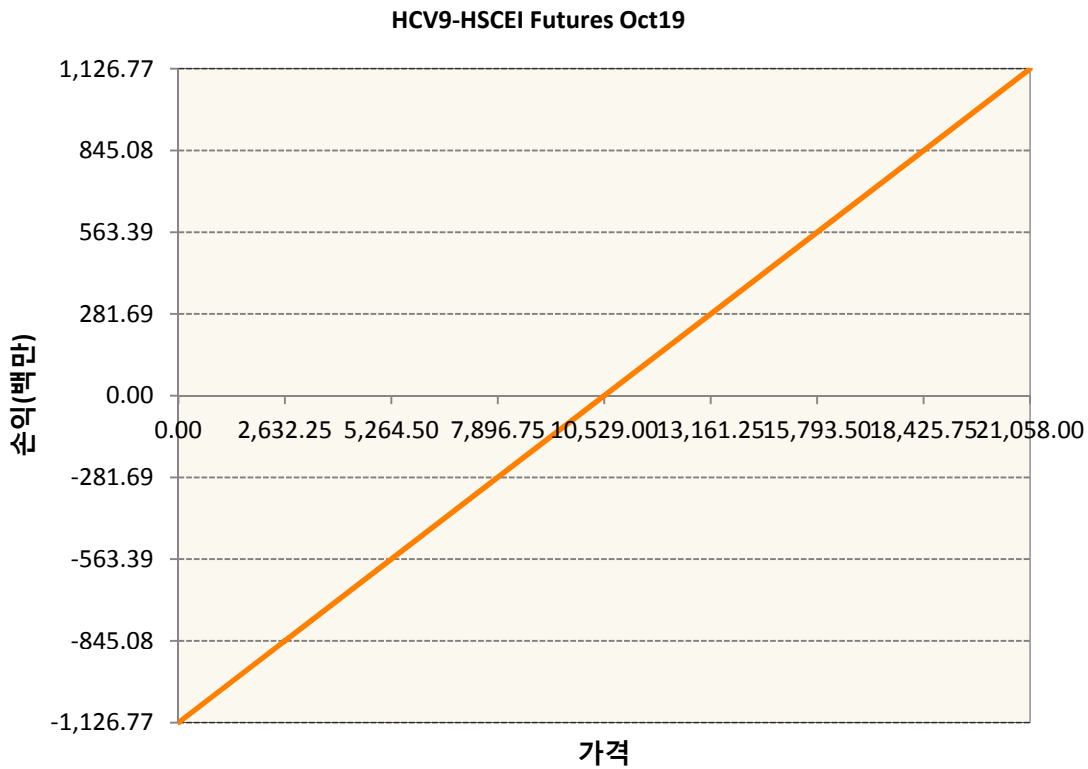
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,127	0	1,127	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	2019-10-21
기준일	2019-10-18

커버드콜모(주식혼합-파생형)

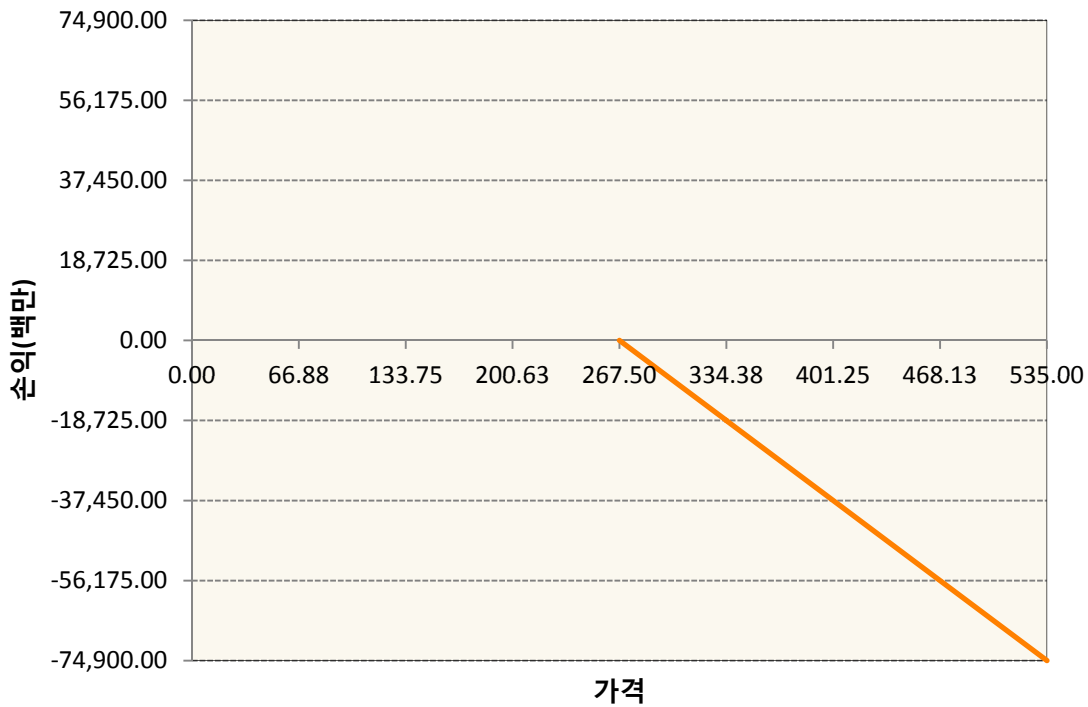
1. 계약금액

(단위:백만원)

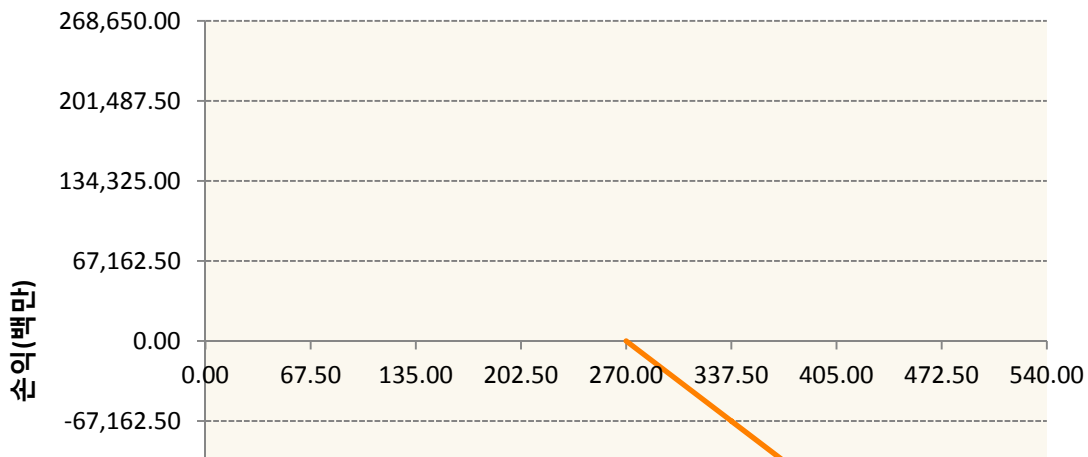
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	3,273	0	3,273	장내
누계	유가증권	옵션	0	510,738	-510,738	장내

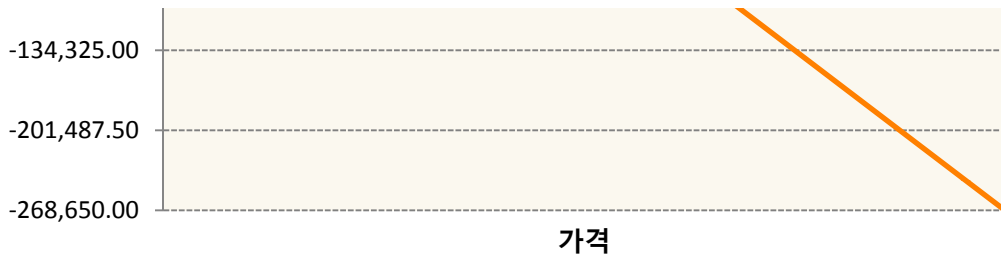
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PB2677-2019-11 콜267.5

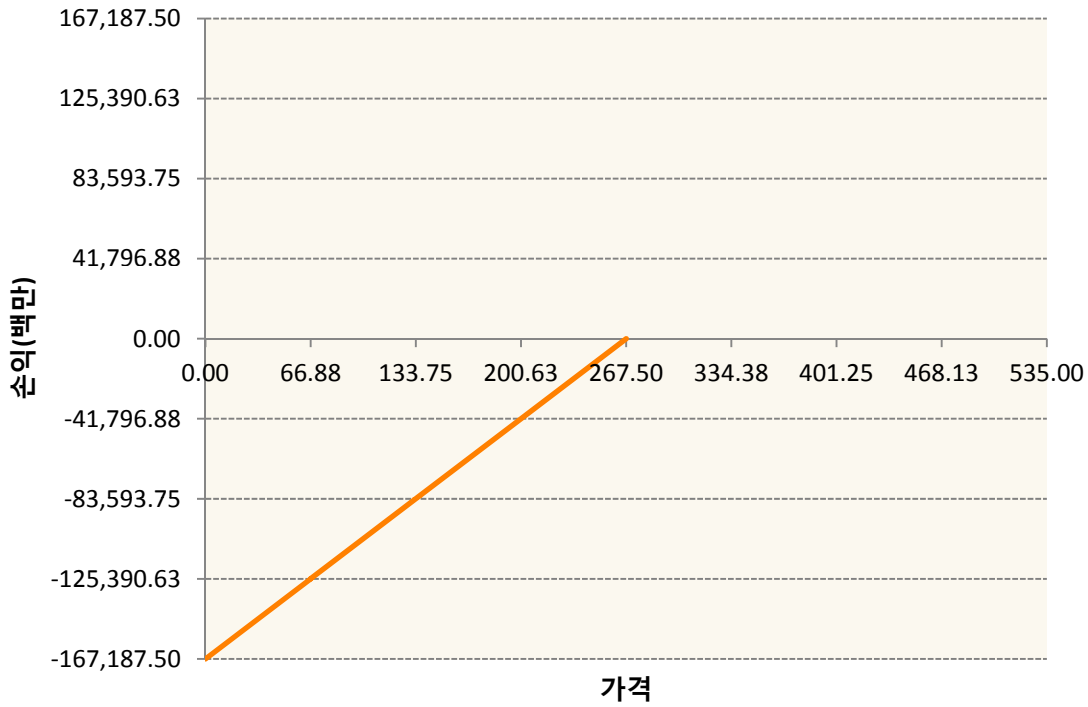


KR4201PB2701-2019-11 콜270





KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PB2677		2019-11 콜267.5					5,081
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,770	2,674	2,566	2,449	2,324	2,193	2,057
-5.33%	2,378	2,229	2,075	1,917	1,756	1,592	1,426
-2.67%	1,650	1,469	1,288	1,107	926	744	563
0%	531	355	178	0	-179	-359	-540
2.67%	-949	-1,087	-1,234	-1,386	-1,543	-1,704	-1,869
5.33%	-2,694	-2,784	-2,888	-3,002	-3,126	-3,257	-3,395
8.00%	-4,599	-4,648	-4,712	-4,788	-4,876	-4,974	-5,081
KR4201PB2701		2019-11 콜270					17,398
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,695	8,411	8,082	7,715	7,316	6,890	6,441

-5.33%	7,609	7,133	6,630	6,107	5,567	5,013	4,449
-2.67%	5,456	4,833	4,205	3,573	2,939	2,302	1,663
0%	1,957	1,306	654	0	-655	-1,310	-1,966
2.67%	-2,881	-3,433	-4,005	-4,592	-5,191	-5,799	-6,415
5.33%	-8,787	-9,174	-9,602	-10,064	-10,554	-11,067	-11,600
8.00%	-15,385	-15,612	-15,890	-16,212	-16,574	-16,971	-17,398
KR4301PB2676 2019-11 풋267.5							9,459
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,169	-9,189	-9,220	-9,263	-9,317	-9,383	-9,459
-5.33%	-4,842	-4,944	-5,060	-5,187	-5,324	-5,470	-5,622
-2.67%	-1,367	-1,569	-1,773	-1,978	-2,183	-2,389	-2,596
0%	540	366	185	0	-189	-382	-577
2.67%	1,149	1,080	995	896	784	662	529
5.33%	1,253	1,240	1,218	1,185	1,142	1,087	1,021
8.00%	1,263	1,262	1,258	1,251	1,240	1,222	1,197

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

(단위:백만원)

31,020

공시일	2019-10-21
기준일	2019-10-18

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

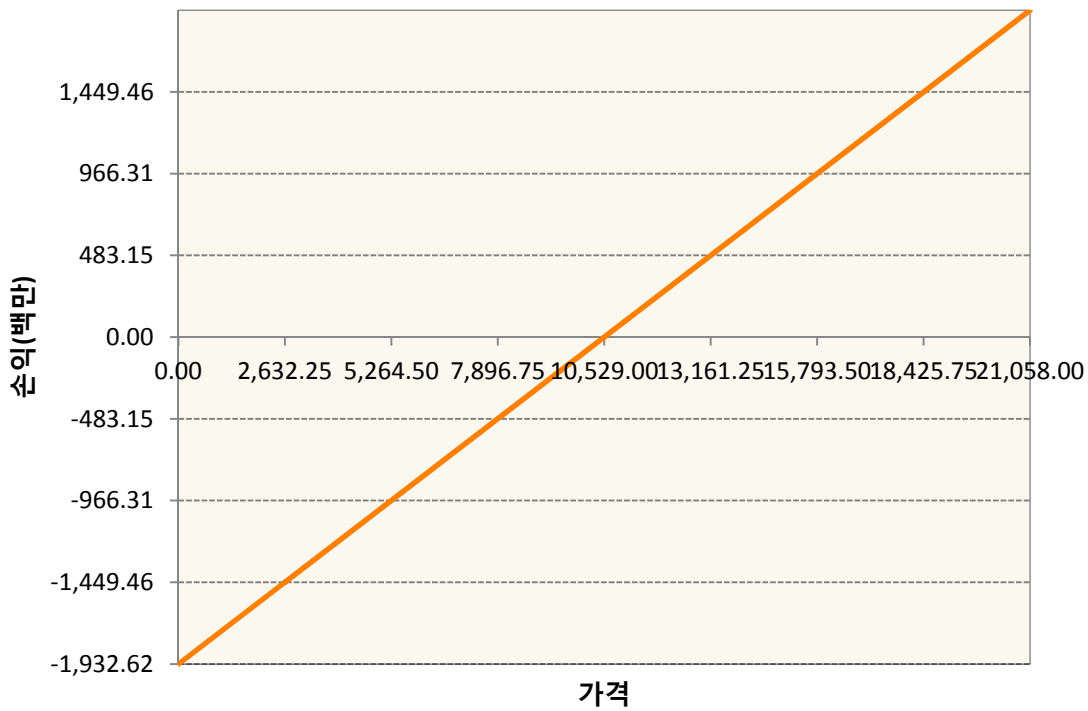
1. 계약금액

(단위:백만원)

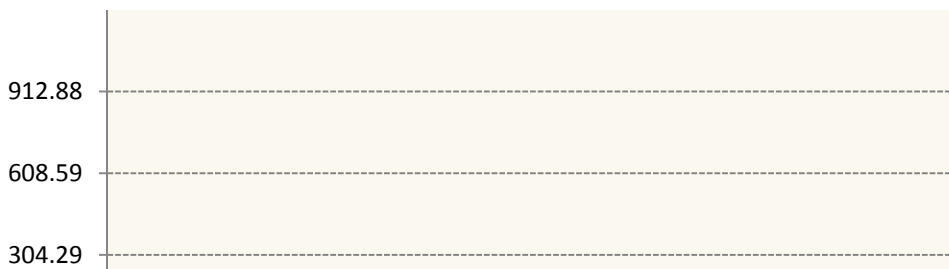
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,933	0	1,933	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,893	-4,893	장내
누계	통화	선도	678	2,799	-2,121	장외

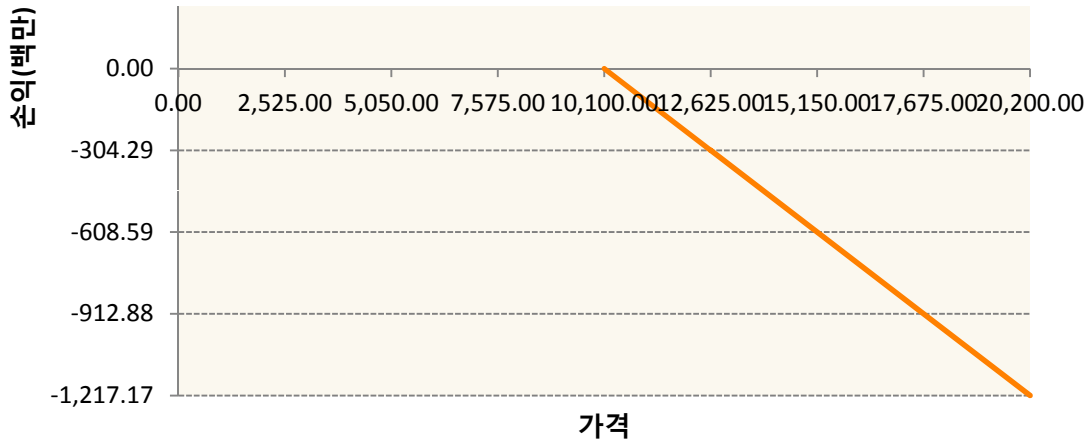
2. 만기시점의 손익구조

HCV9-HSCEI Futures Oct19

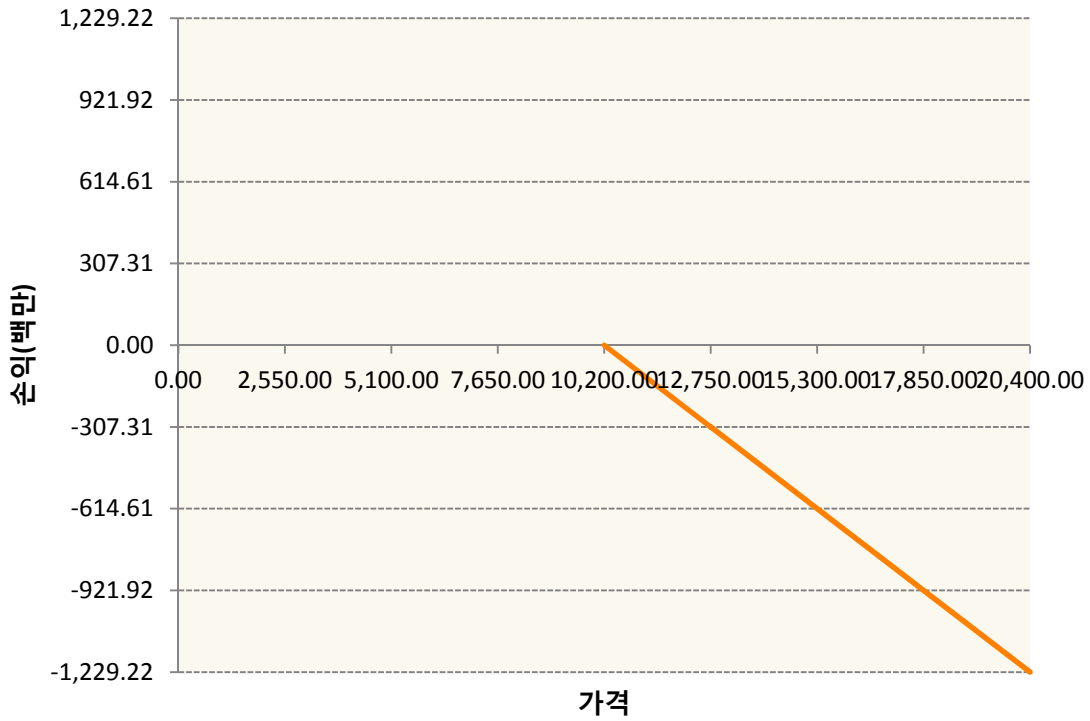


OHHIV9-C101-HSCEI

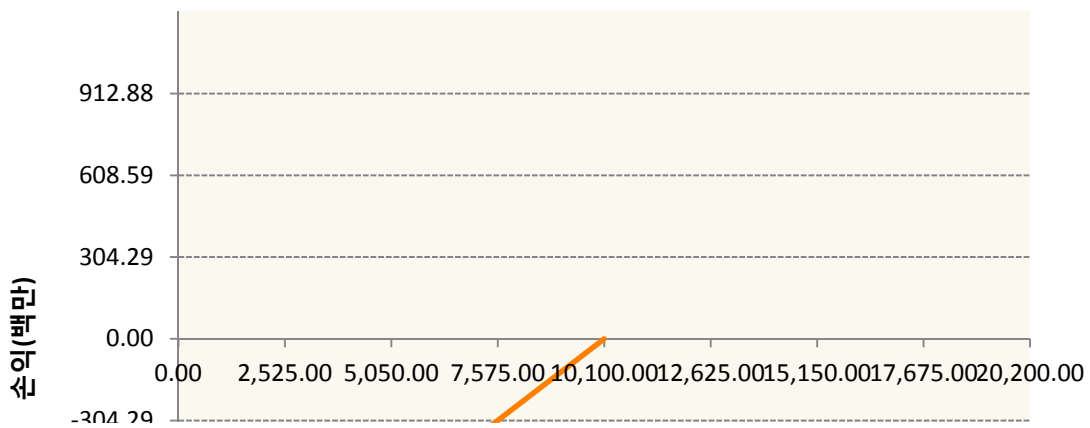


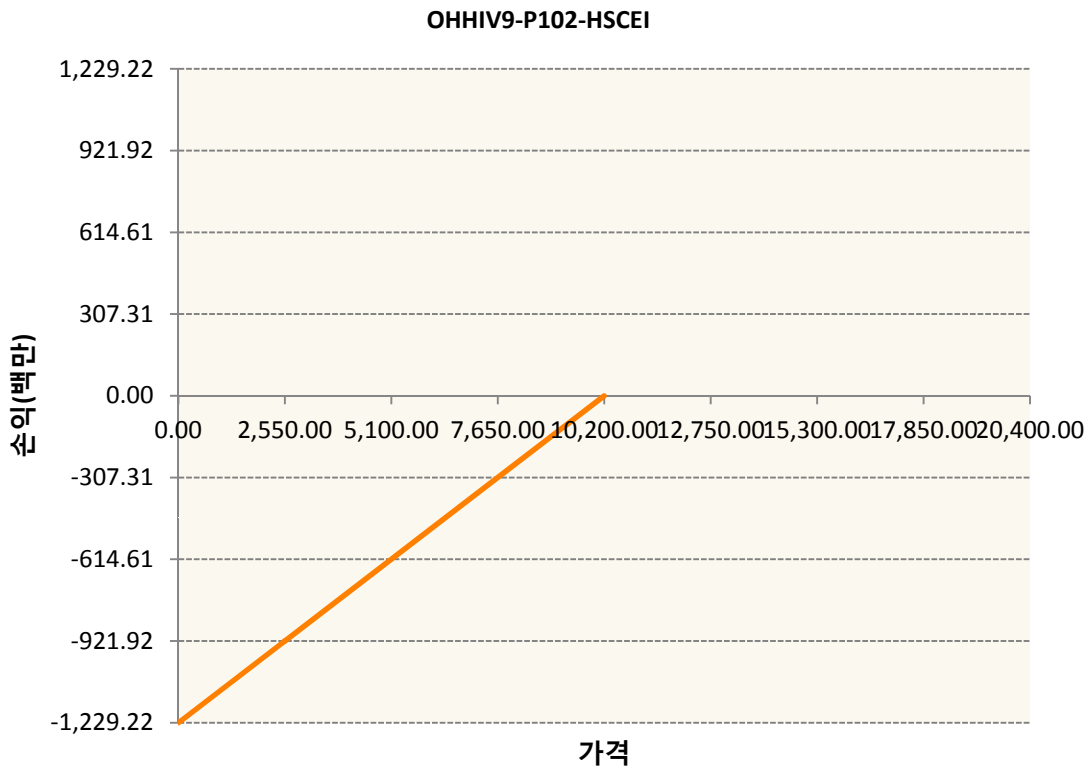


OHHIV9-C102-HSCEI



OHHIV9-P101-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	224
FX21019U00 HKD/KRW 22-11-19E	6
FX21019U02 HKD/KRW 22-11-19E	48
HCV9 HSCEI Futures Oct19	155
OHHIV9-C1C HSCEI	97
OHHIV9-C1C HSCEI	98
OHHIV9-P1C HSCEI	97
OHHIV9-P1C HSCEI	98

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	577

공시일	2019-10-21
기준일	2019-10-18

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

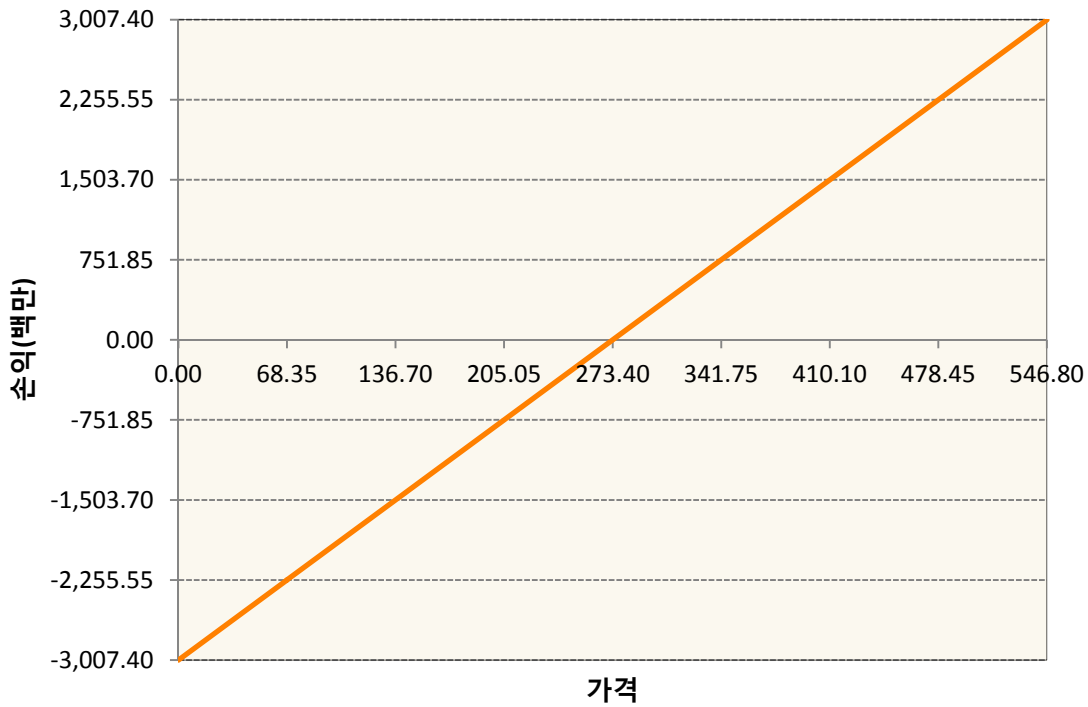
1. 계약금액

(단위:백만원)

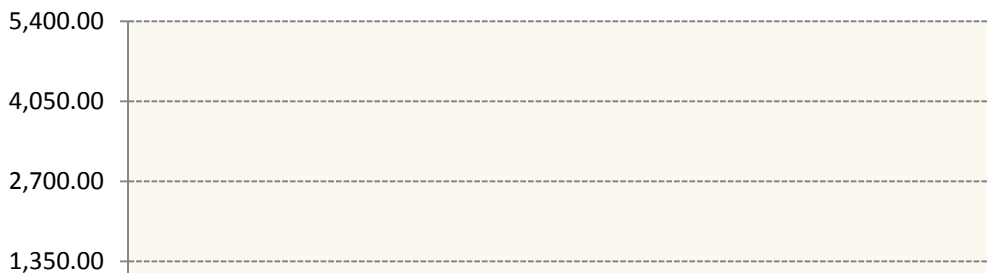
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,007	0	3,007	장내
누계	유가증권	스왑	10,625	0	10,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	10,752	-10,752	장내

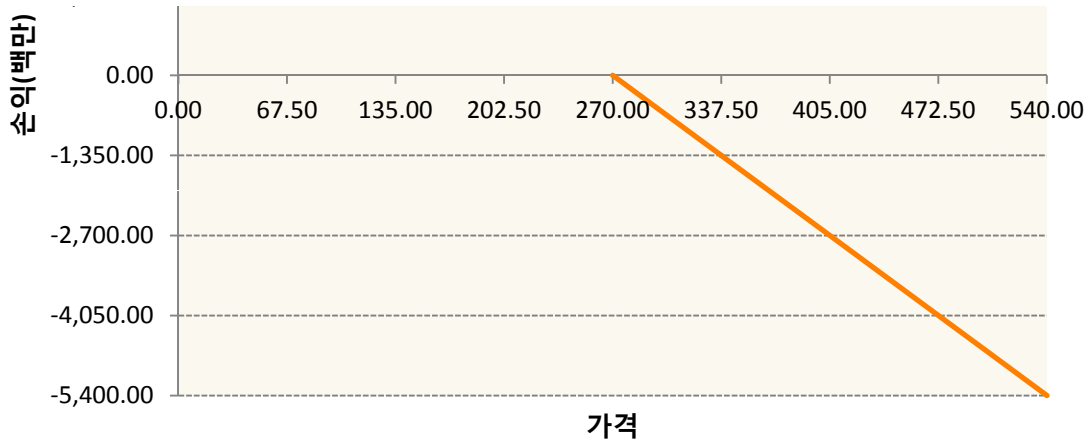
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

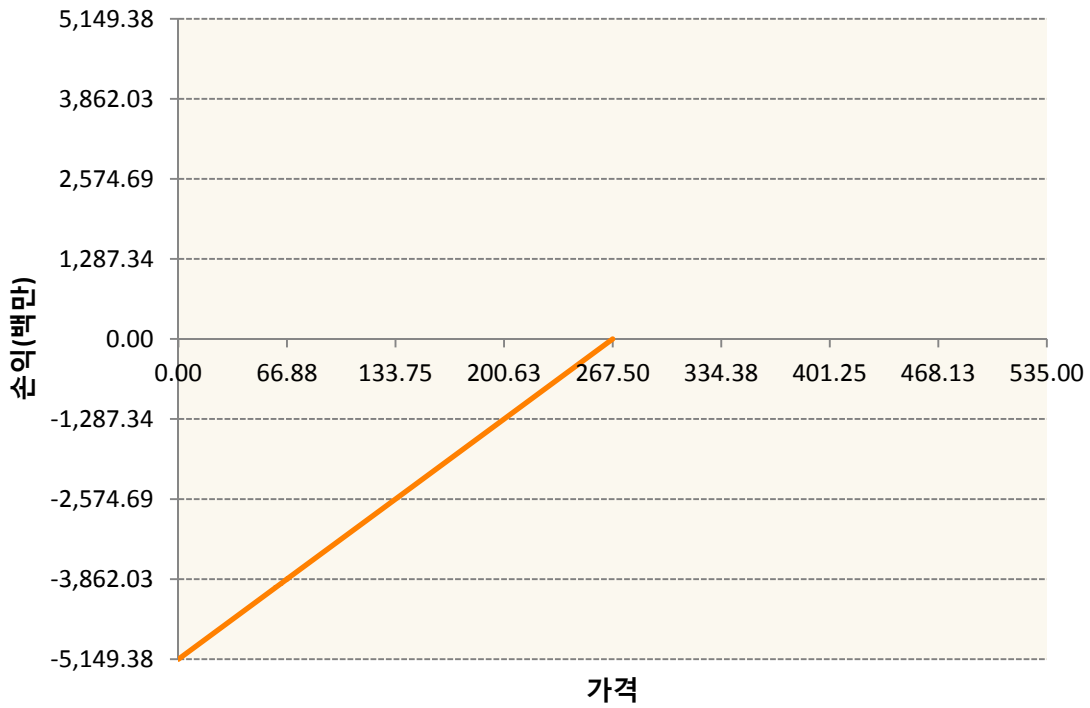


KR4201PB2701-2019-11 콜270

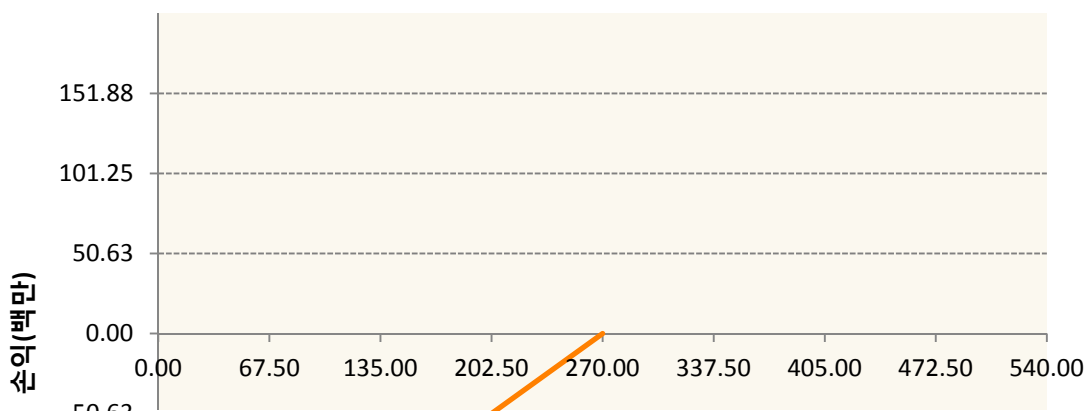


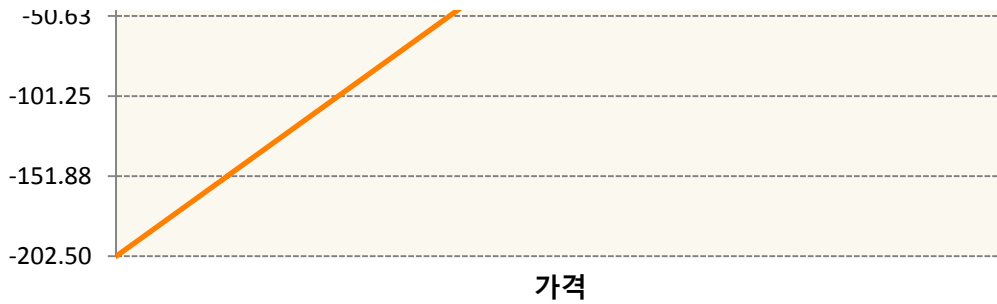


KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



KR4301PB2700-2019-11 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						913
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-913	-913	-913	-913	-913	-913	-913	
-5.33%	-609	-609	-609	-609	-609	-609	-609	
-2.67%	-304	-304	-304	-304	-304	-304	-304	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	304	304	304	304	304	304	304	
5.33%	609	609	609	609	609	609	609	
8.00%	913	913	913	913	913	913	913	
KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						240
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-240	-240	-240	-240	-240	-240	-240	
-5.33%	-160	-160	-160	-160	-160	-160	-160	
-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%	160	160	160	160	160	160	160	
8.00%	240	240	240	240	240	240	240	
KR4201PB2701		2019-11 콜270						350
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	175	169	162	155	147	138	129	
-5.33%	153	143	133	123	112	101	89	
-2.67%	110	97	85	72	59	46	33	
0%	39	26	13	0	-13	-26	-40	
2.67%	-58	-69	-81	-92	-104	-117	-129	
5.33%	-177	-184	-193	-202	-212	-222	-233	
8.00%	-309	-314	-319	-326	-333	-341	-350	
KR4301PB2676		2019-11 풋267.5						291
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-282	-283	-284	-285	-287	-289	-291
-5.33%	-149	-152	-156	-160	-164	-168	-173
-2.67%	-42	-48	-55	-61	-67	-74	-80
0%	17	11	6	0	-6	-12	-18
2.67%	35	33	31	28	24	20	16
5.33%	39	38	38	37	35	33	31
8.00%	39	39	39	39	38	38	37
KR4301PB2700 2019-11 풋270							12
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-8
-2.67%	-2	-2	-3	-3	-3	-3	-4
0%	1	0	0	0	0	0	-1
2.67%	2	2	2	1	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)

1,746

공시일	2019-10-21
기준일	2019-10-18

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

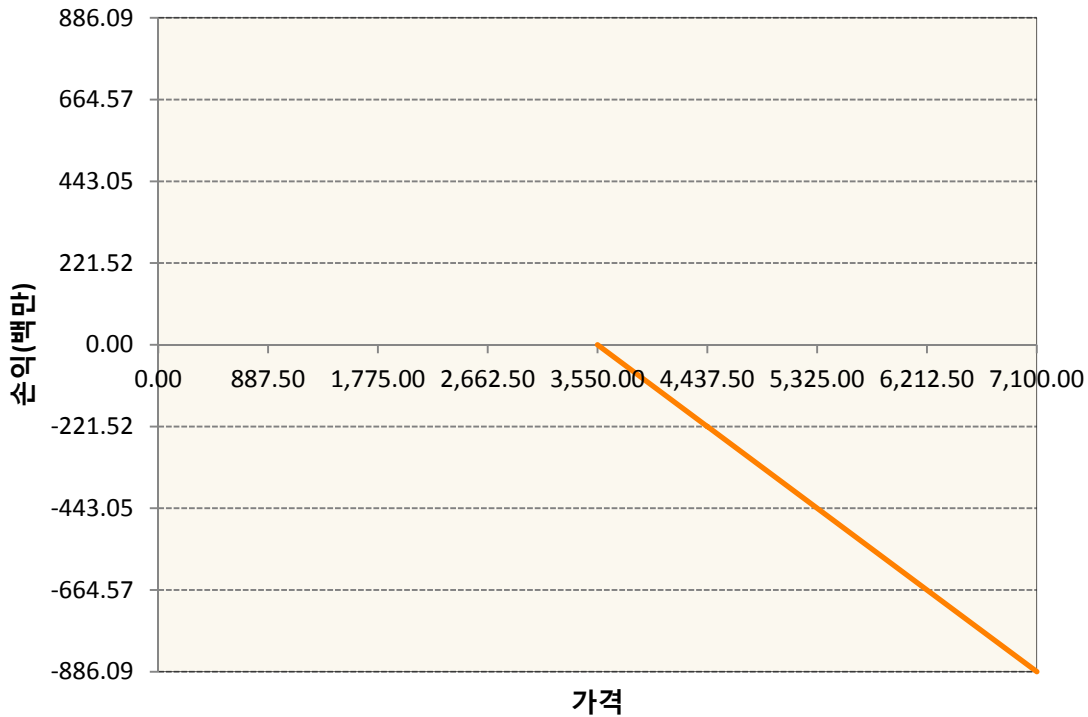
1. 계약금액

(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	3,630	0	3,630	
누계	유가증권	스왑	23,905	0	23,905	장외
누계	유가증권	옵션	0	13,044	-13,044	장내
누계	통화	선도	0	6,174	-6,174	장외

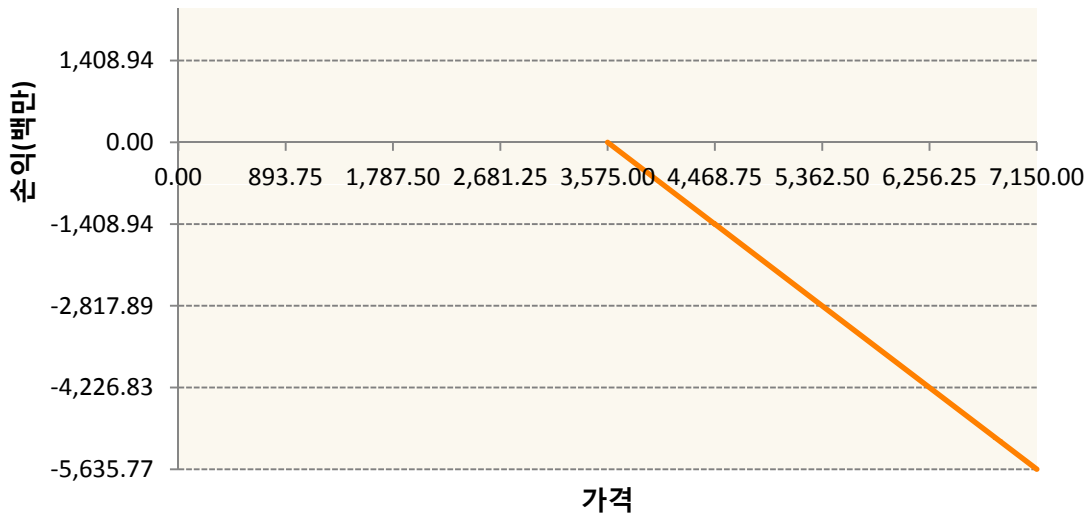
2. 만기시점의 손익구조

OESXV9-C3550-EURO STOXX 50

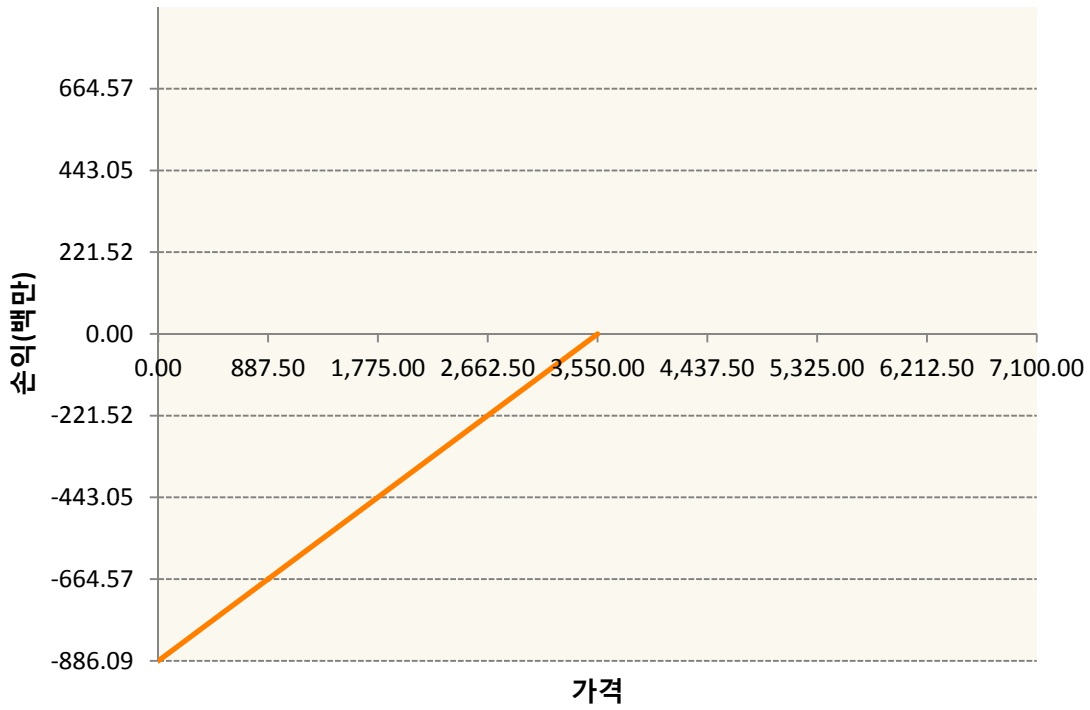


OESXV9-C3575-EURO STOXX 50

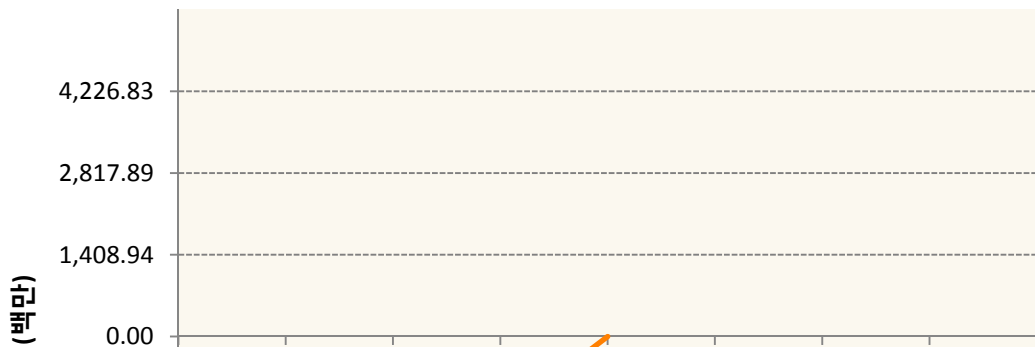


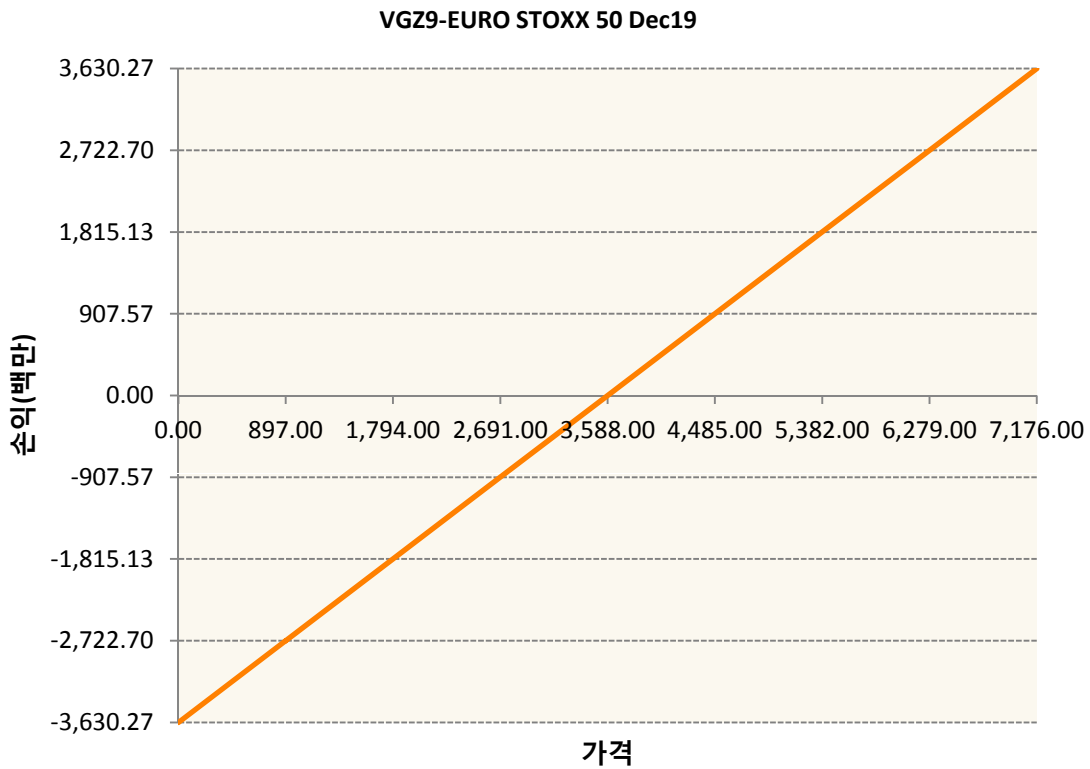
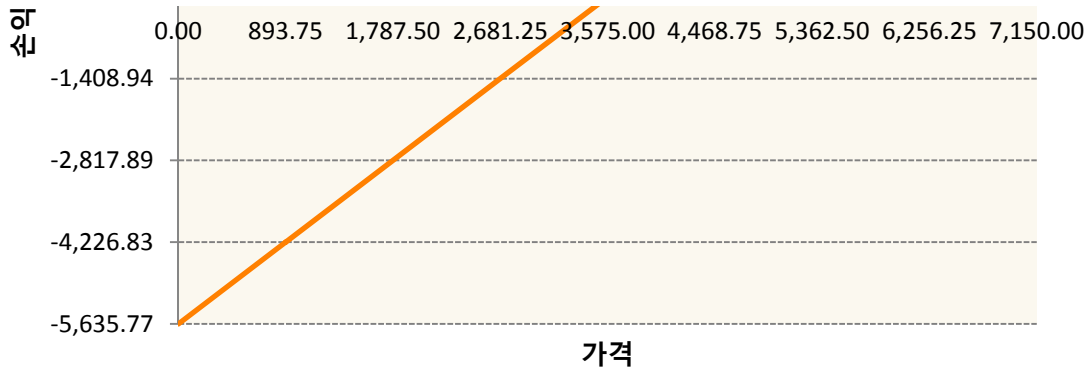


OESXV9-P3550-EURO STOXX 50



OESXV9-P3575-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	1
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	290

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

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

(단위:백만원)

936

공시일	2019-10-21
기준일	2019-10-18

ETF스마트레버리지목표전환형9호

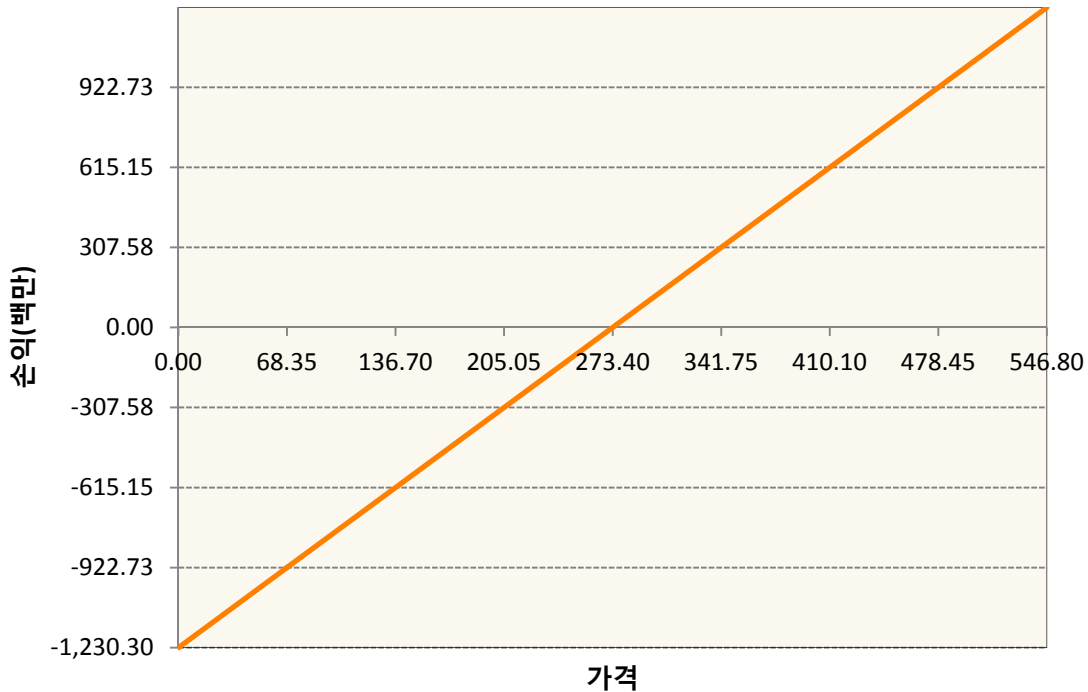
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,230	0	1,230	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						98
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98	
-5.33%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65	
-2.67%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	33	33	33	33	33	33	33	
5.33%	65	65	65	65	65	65	65	
8.00%	98	98	98	98	98	98	98	

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

(단위:백만원)

81

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

(단위:백만원)

127

공시일	2019-10-21
기준일	2019-10-18

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

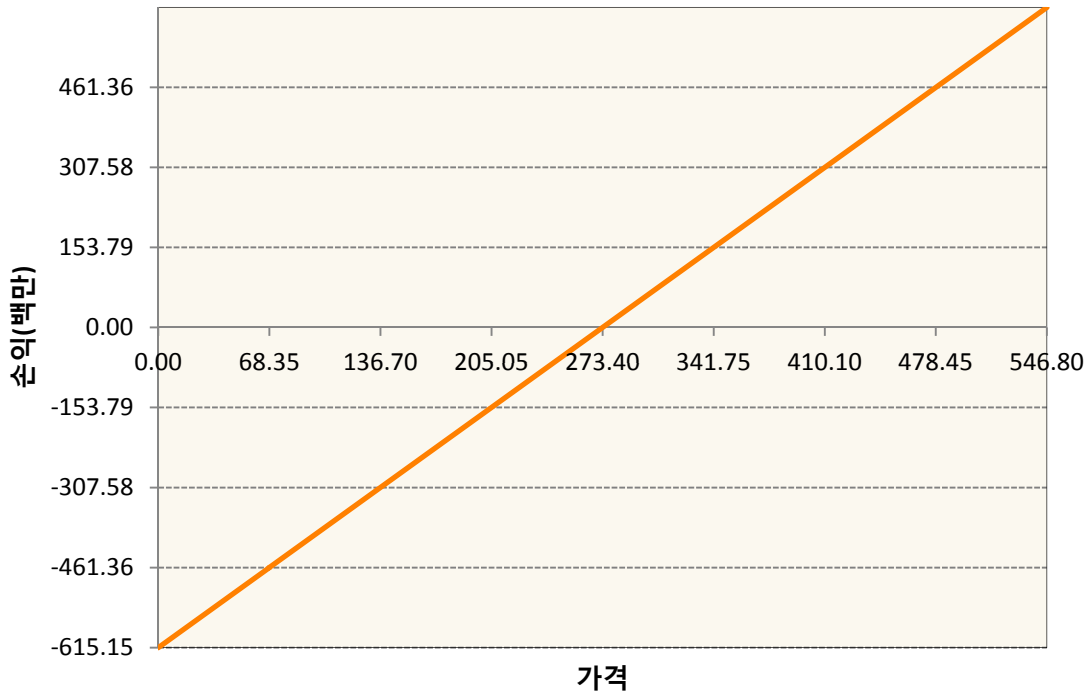
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	615	0	615	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						49
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	16	16	16	16	16	16	16	
5.33%	33	33	33	33	33	33	33	
8.00%	49	49	49	49	49	49	49	

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-10-21
기준일	2019-10-18

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

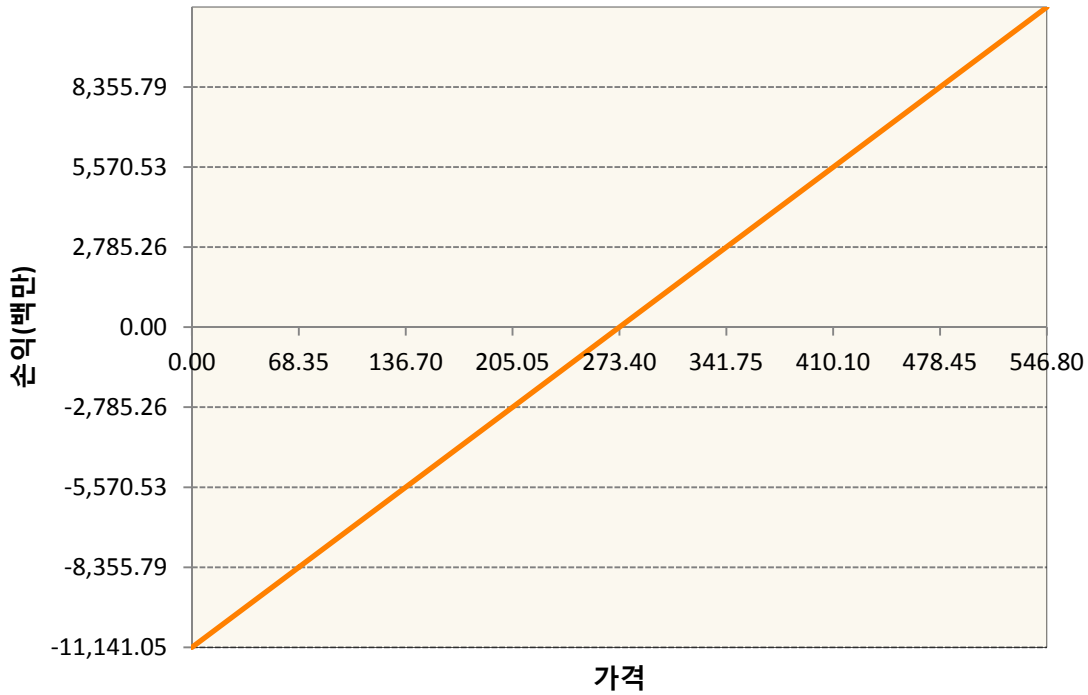
1. 계약금액

(단위:백만원)

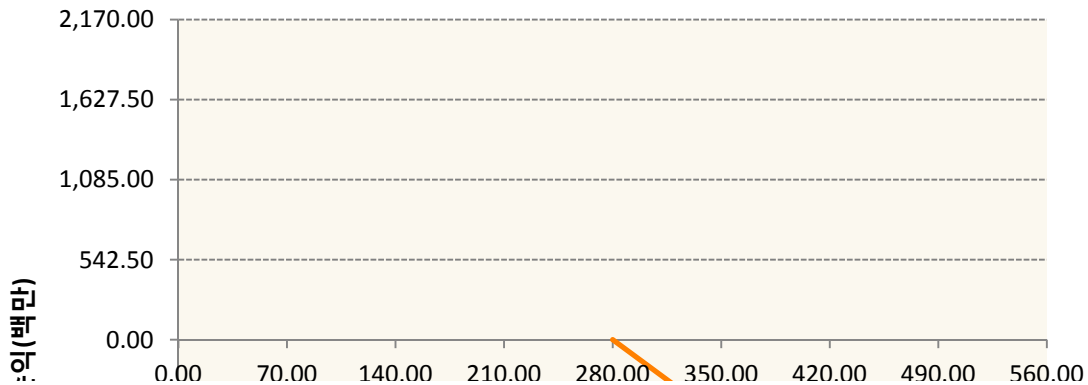
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,141	0	11,141	장내
누계	유가증권	옵션	3,561	20,815	-17,254	장내

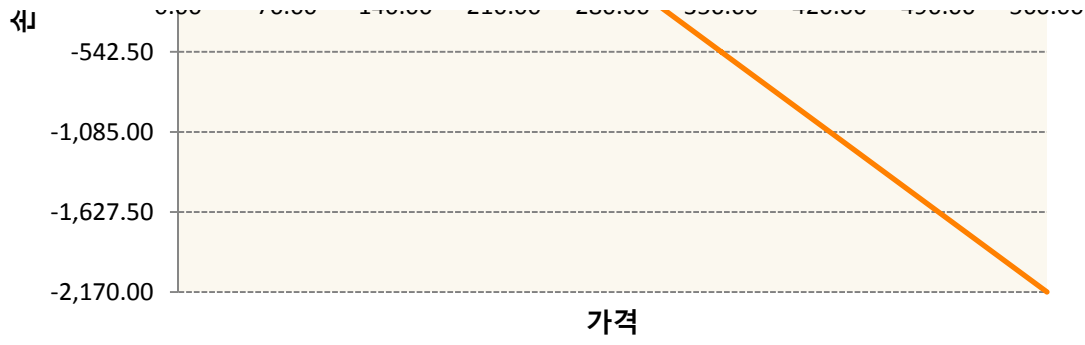
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

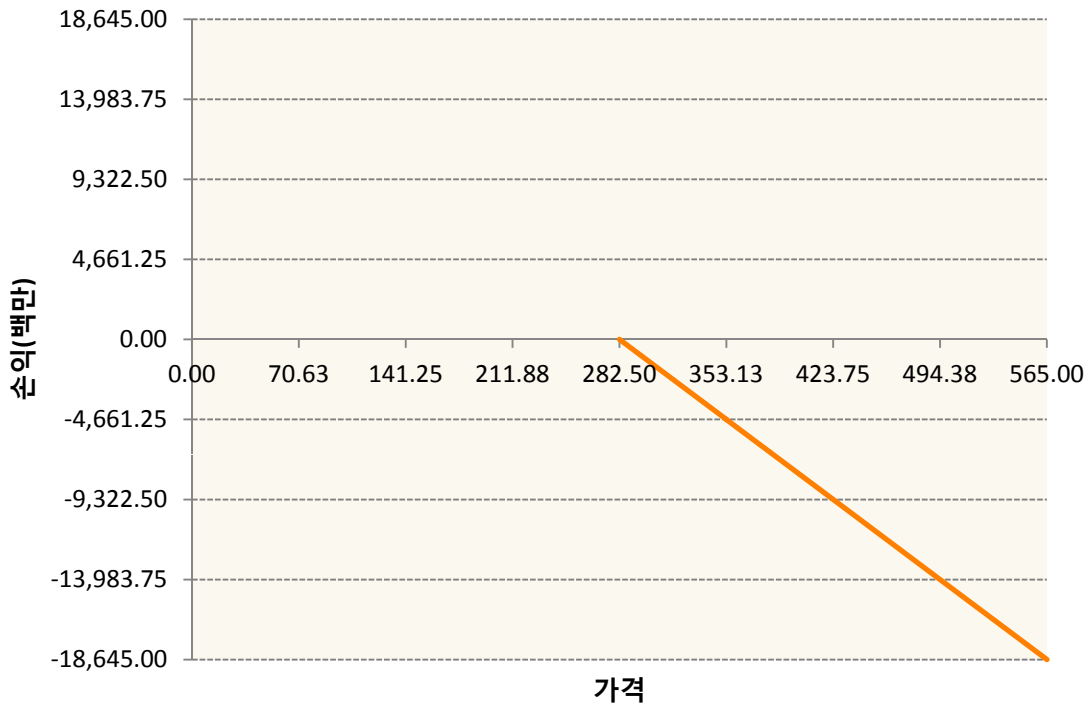


KR4201PB2800-2019-11 콜280

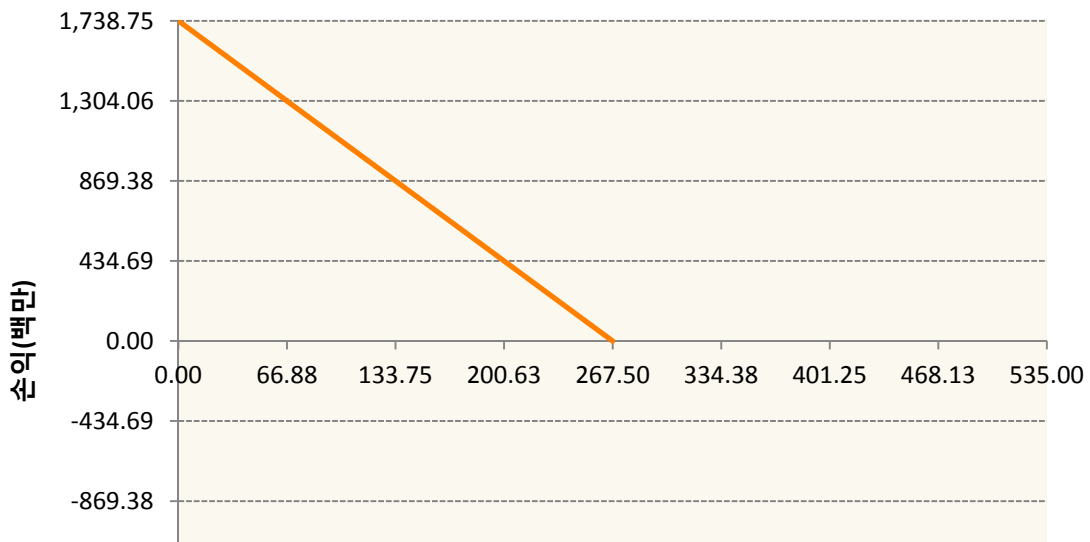


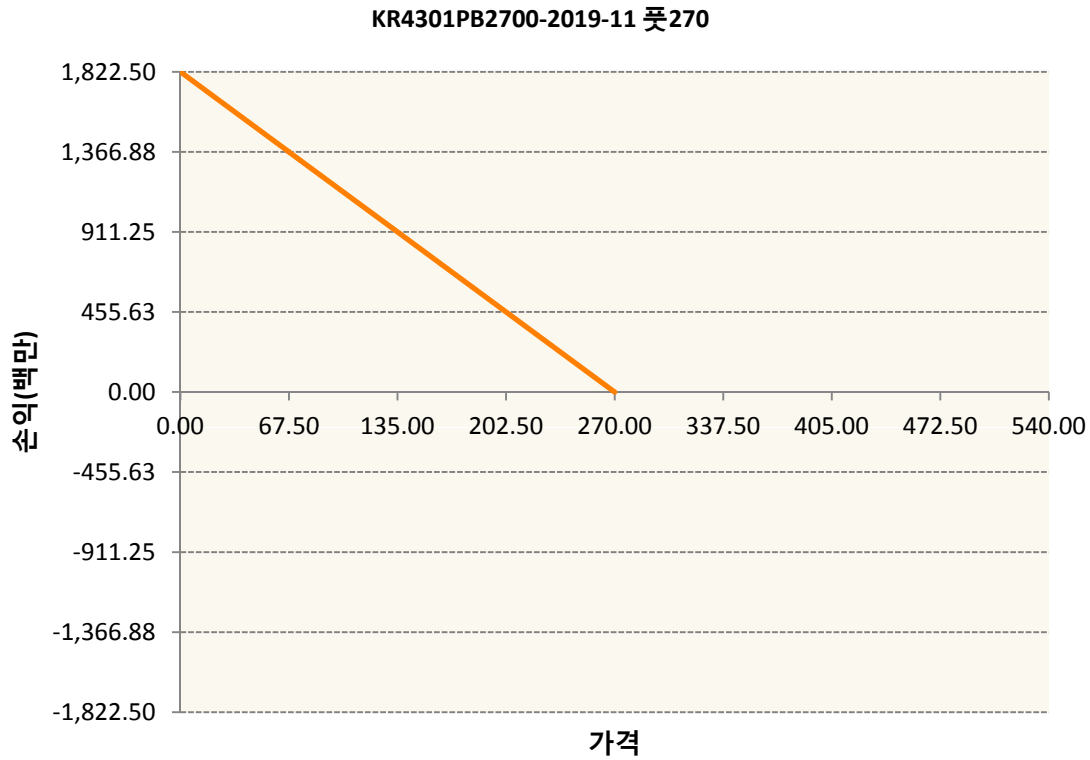
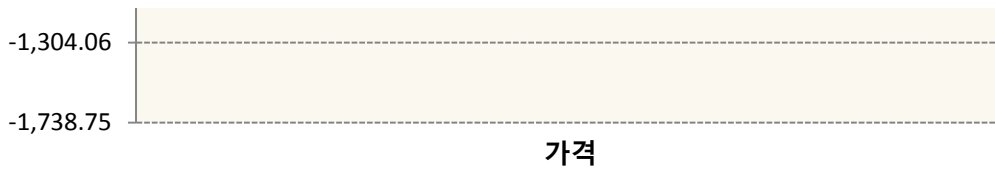


KR4201PB2826-2019-11 콜282.5



KR4301PB2676-2019-11 풋267.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						889
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-889	-889	-889	-889	-889	-889	-889	
-5.33%	-593	-593	-593	-593	-593	-593	-593	
-2.67%	-296	-296	-296	-296	-296	-296	-296	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	296	296	296	296	296	296	296	
5.33%	593	593	593	593	593	593	593	
8.00%	889	889	889	889	889	889	889	
KR4201PB2800		2019-11 콜280						111
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	37	37	35	34	32	30	28	
-5.33%	35	33	31	28	25	22	19	
-2.67%	28	25	21	17	13	9	5	

0%	14	10	5	0	-5	-10	-15
2.67%	-9	-14	-20	-25	-30	-36	-41
5.33%	-43	-48	-53	-58	-63	-68	-73
8.00%	-86	-89	-93	-98	-102	-106	-111
KR4201PB2826 2019-11 콜282.5							888
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	268	263	255	245	232	217	199
-5.33%	253	240	223	204	182	158	132
-2.67%	210	185	157	128	96	63	28
0%	115	78	39	0	-40	-81	-122
2.67%	-55	-100	-145	-190	-235	-280	-325
5.33%	-312	-356	-401	-446	-491	-536	-581
8.00%	-652	-688	-726	-765	-805	-846	-888
KR4301PB2676 2019-11 풋267.5							98
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	95	96	96	96	97	98	98
-5.33%	50	51	53	54	55	57	58
-2.67%	14	16	18	21	23	25	27
0%	-6	-4	-2	0	2	4	6
2.67%	-12	-11	-10	-9	-8	-7	-6
5.33%	-13	-13	-13	-12	-12	-11	-11
8.00%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-12
KR4301PB2700 2019-11 풋270							112
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	110	110	110	110	111	111	112
-5.33%	62	63	63	64	66	67	68
-2.67%	20	22	24	26	28	30	32
0%	-7	-4	-2	0	2	4	7
2.67%	-17	-16	-15	-13	-12	-10	-8
5.33%	-19	-19	-19	-18	-17	-17	-16
8.00%	-20	-20	-20	-19	-19	-19	-19

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

(단위:백만원)

1,696

공시일	2019-10-21
기준일	2019-10-18

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	153,279	0	153,279	

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	2019-10-21
기준일	2019-10-18

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	196,433	0	196,433	

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	2019-10-21
기준일	2019-10-18

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	420,763	0	420,763	
누계	통화	선도	0	535,810	-535,810	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		3,875
FX21019Q01 KRW/USD 21-10-19E		3,497
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		945
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		945
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E		189
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E		945
FX21019U02 KRW/USD 21-10-19E		1,456
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		2,940
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		3,119
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		2,590
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E		1,890
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E		1,985
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E		945
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		662
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E		1,550
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		699
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E		1,701
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		2,495
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		473
FX21019V02 KRW/USD 21-11-19E		5,142
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,821

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

(단위:백만원)

13,676

공시일	2019-10-21
기준일	2019-10-18

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

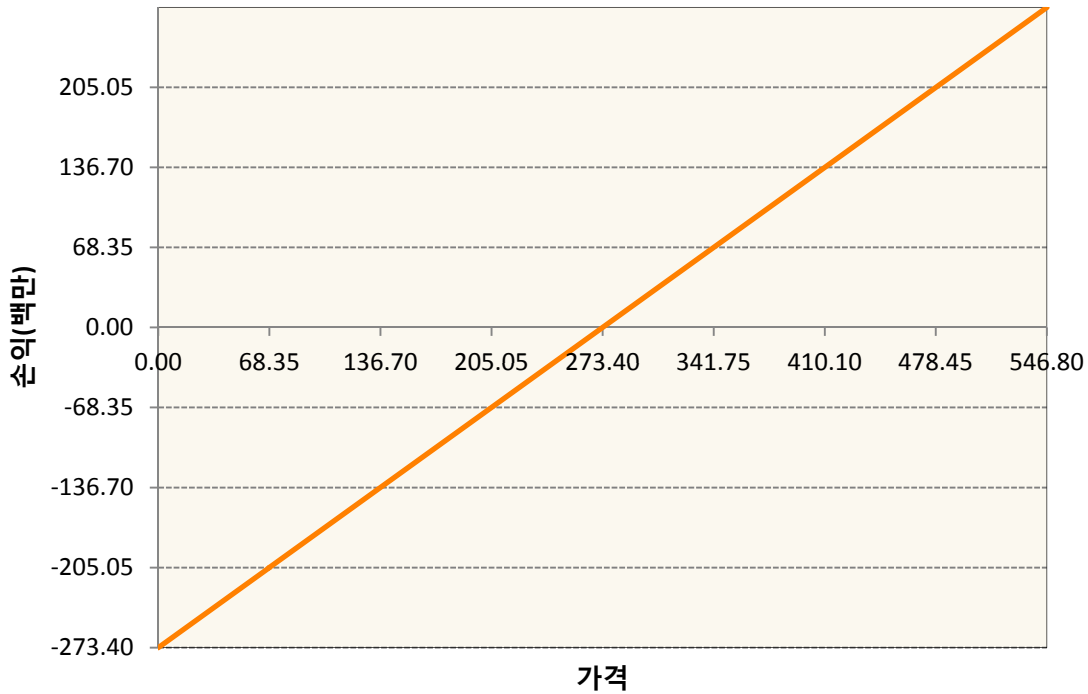
1. 계약금액

(단위:백만원)

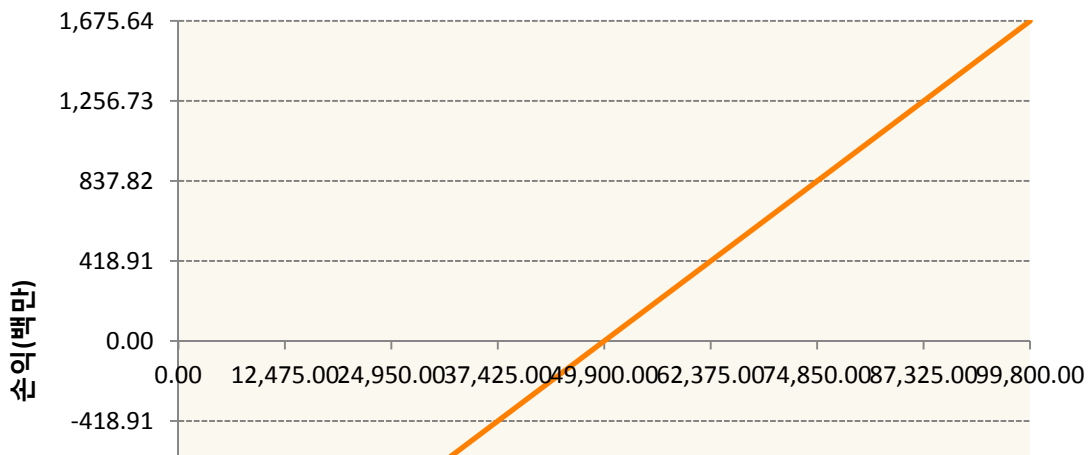
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,949	0	1,949	장내

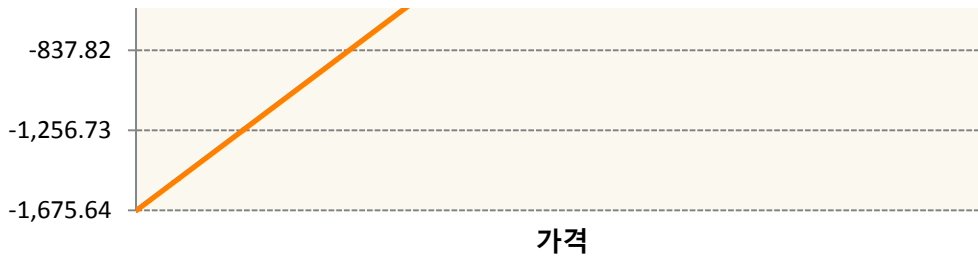
2. 만기시점의 손익구조

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%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89	
-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%	89	89	89	89	89	89	89	
8.00%	134	134	134	134	134	134	134	

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

177

공시일	2019-10-21
기준일	2019-10-18

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

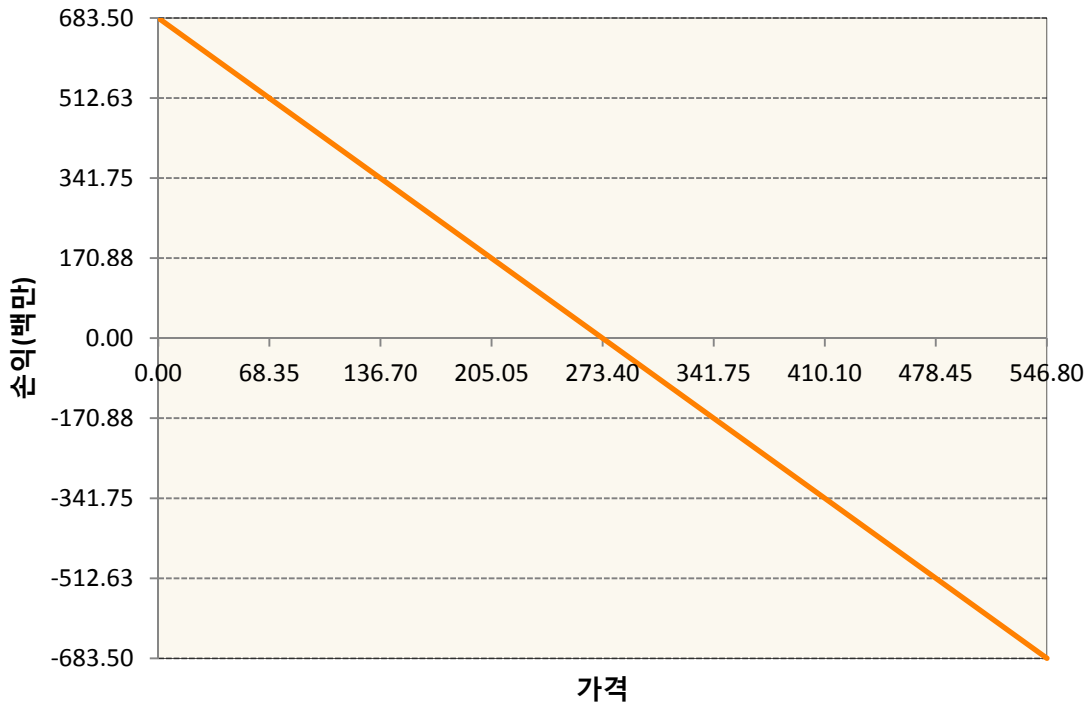
1. 계약금액

(단위:백만원)

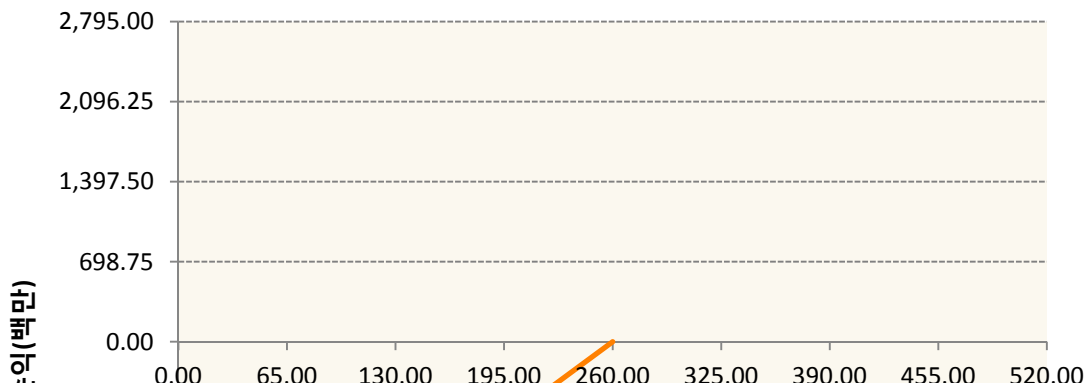
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	684	-684	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,976	-3,976	장내

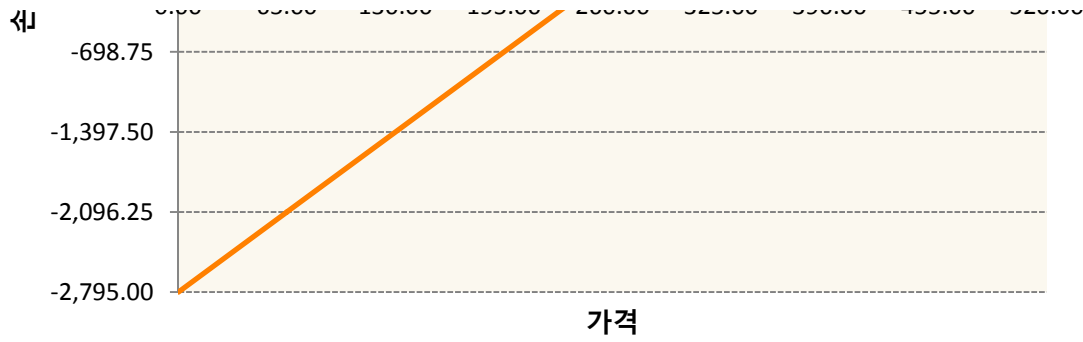
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

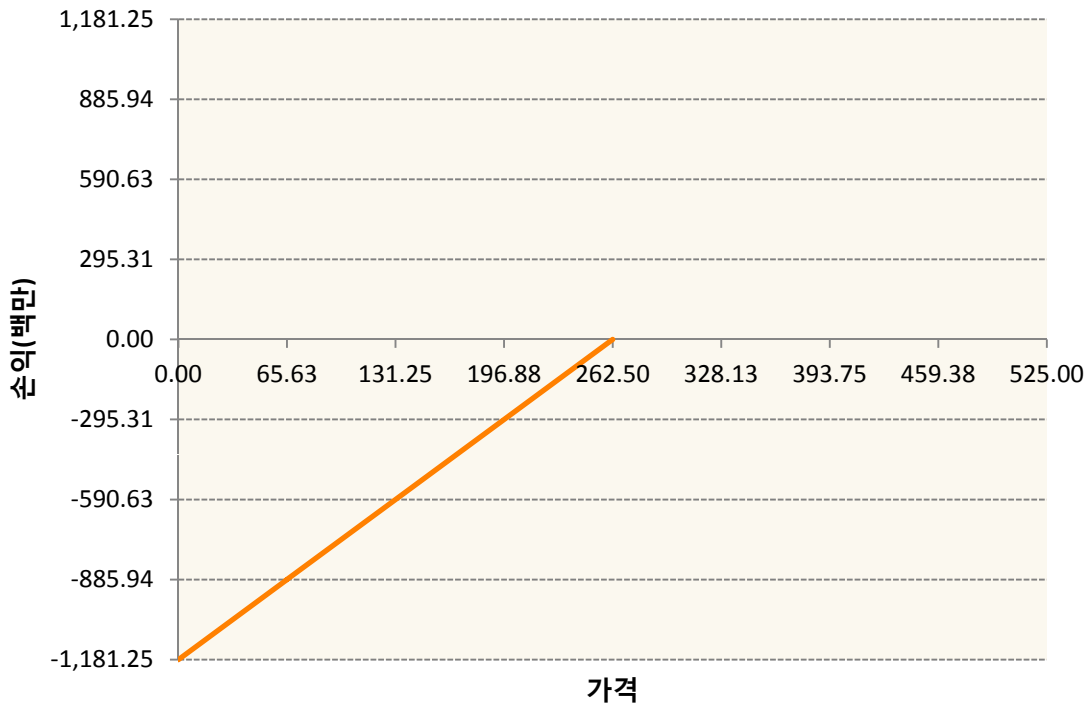


KR4301PB2601-2019-11 풋260





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%	36	36	36	36	36	36	36	
-2.67%	18	18	18	18	18	18	18	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	
8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55	
KR4301PB2601		2019-11 풋260						110
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-97	-99	-101	-103	-105	-107	-110
-5.33%	-37	-41	-44	-48	-51	-55	-58
-2.67%	-6	-8	-11	-14	-18	-21	-24
0%	4	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	5	5	5	4	4	3	2
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

KR4301PB2627 2019-11 풋262.5 54

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-49	-50	-50	-51	-52	-53	-54
-5.33%	-22	-23	-24	-26	-27	-28	-30
-2.67%	-4	-6	-7	-8	-10	-11	-13
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	4	4	3	3	3	2	1
5.33%	4	4	4	4	4	3	3
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

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

(단위:백만원)

162

공시일	2019-10-21
기준일	2019-10-18

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	16,627	0	16,627	
누계	통화	선도	0	16,257	-16,257	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		321
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		605
FX21019V01 KRW/USD 10-12-19E		374

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

(단위:백만원)

415

공시일	2019-10-21
기준일	2019-10-18

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	295	-178	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
FX21019V02 KRW/EUR 22-11-19E	4

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

(단위:백만원)

46

공시일	2019-10-21
기준일	2019-10-18

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

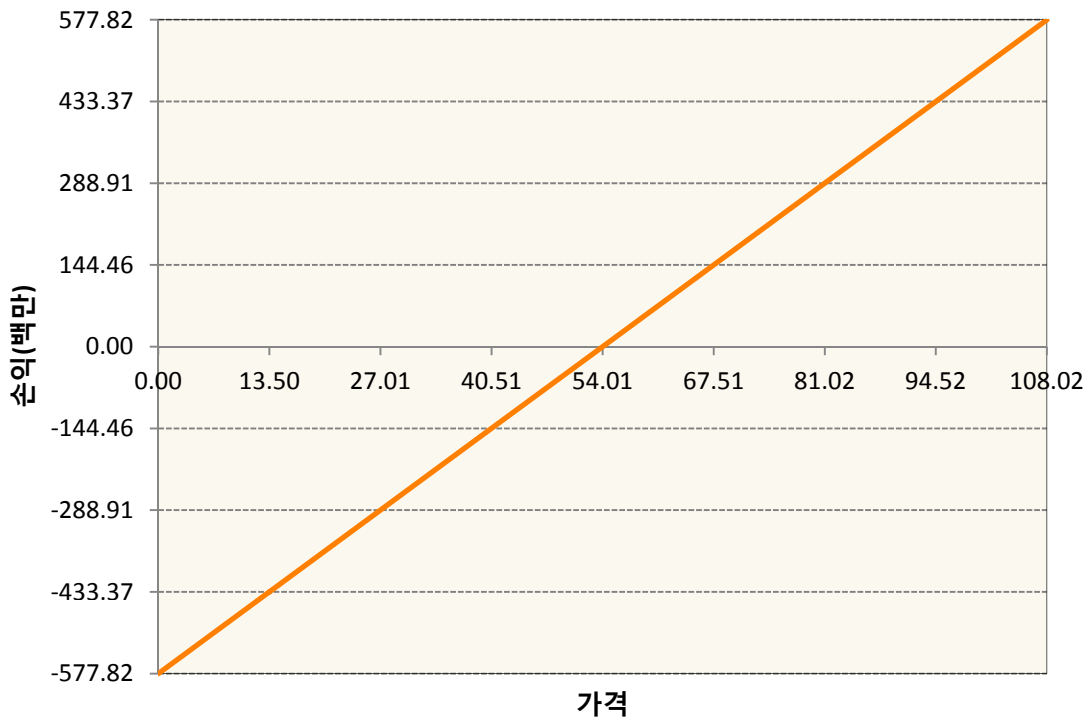
1. 계약금액

(단위:백만원)

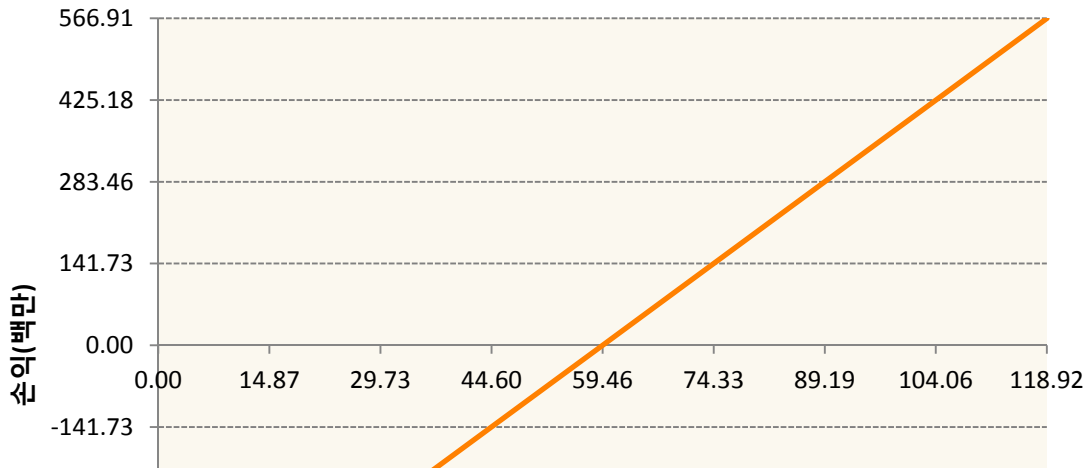
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,431	295	2,136	

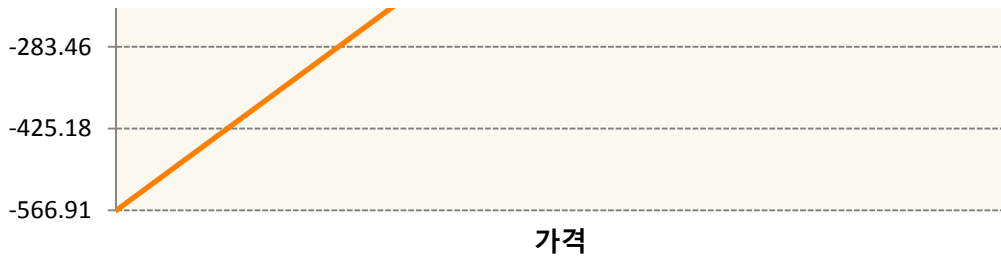
2. 만기시점의 손익구조

CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20

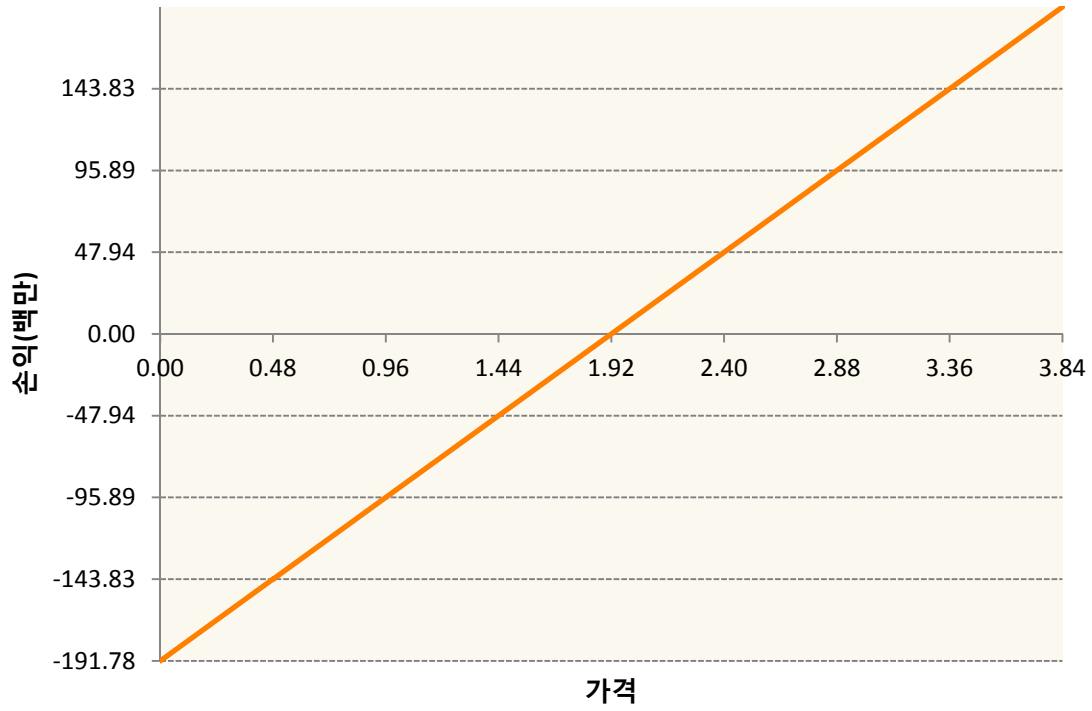


COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20

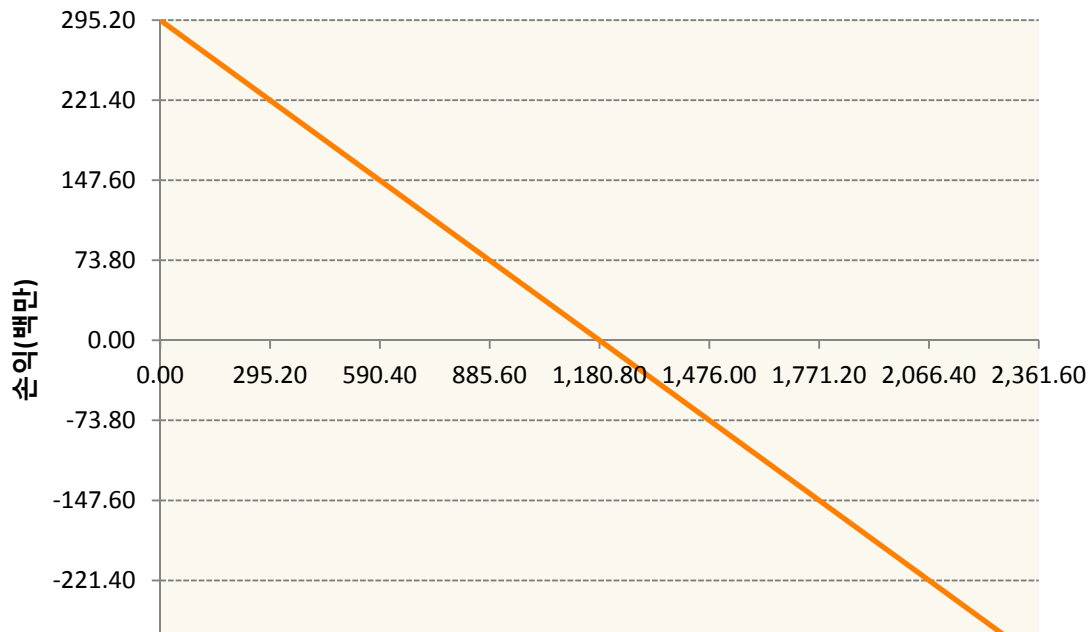


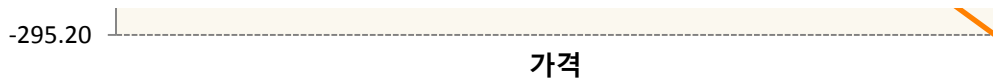


HOF0-NY Harb ULSD Fut Jan20

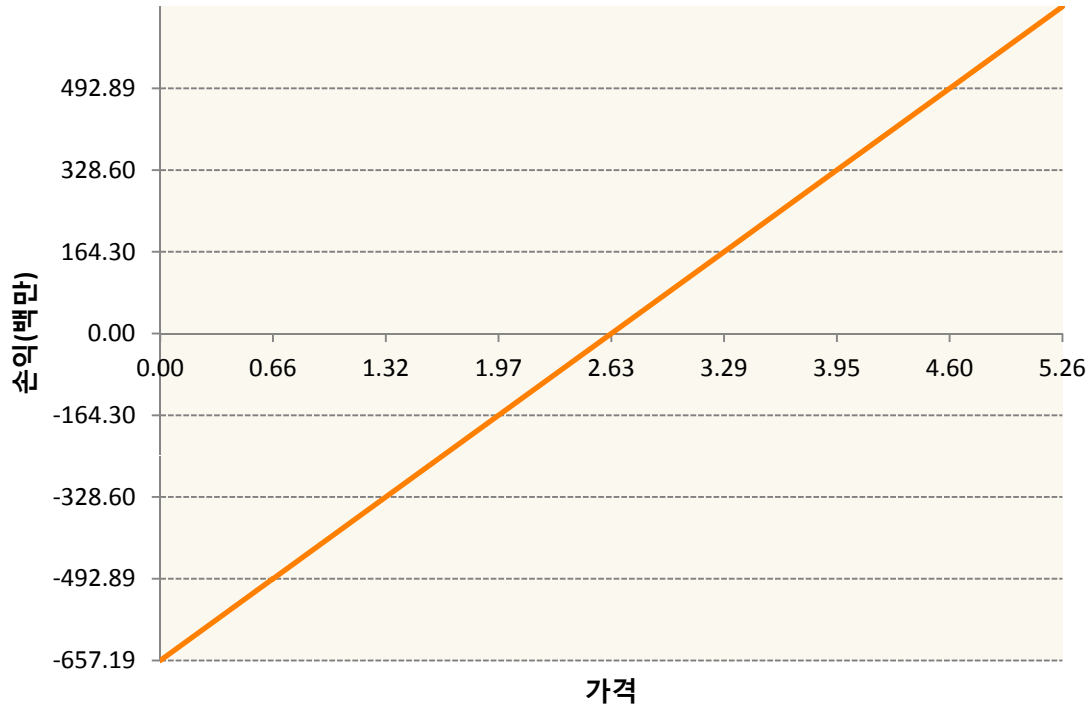


KR4175PB0004-2019-11 달러선물

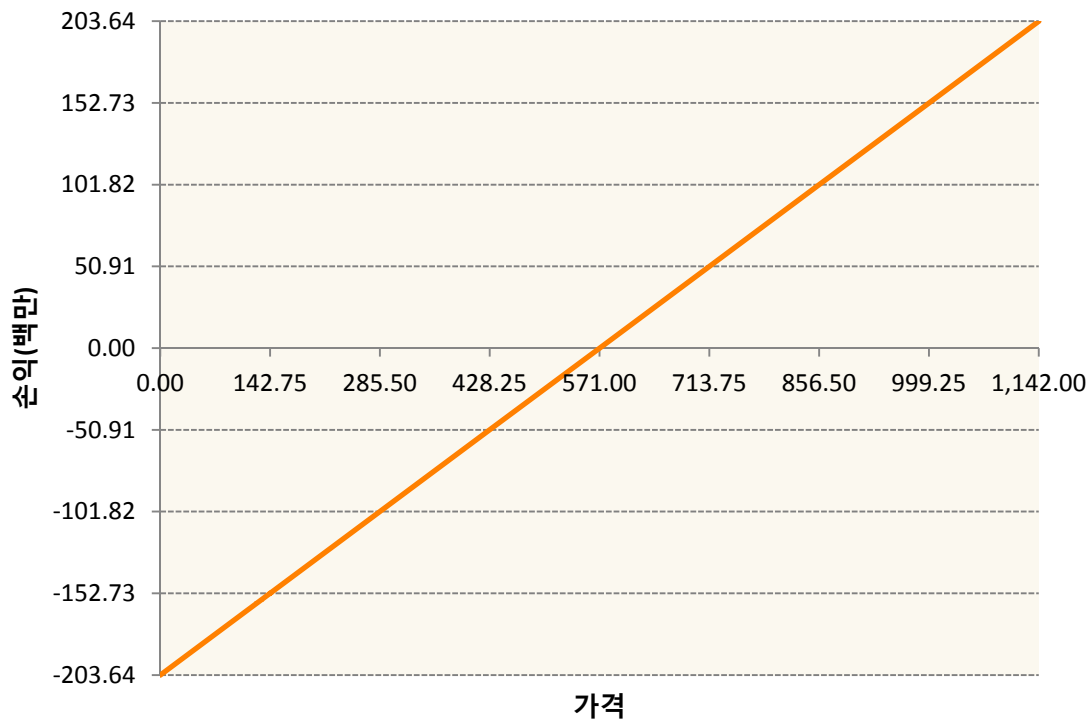




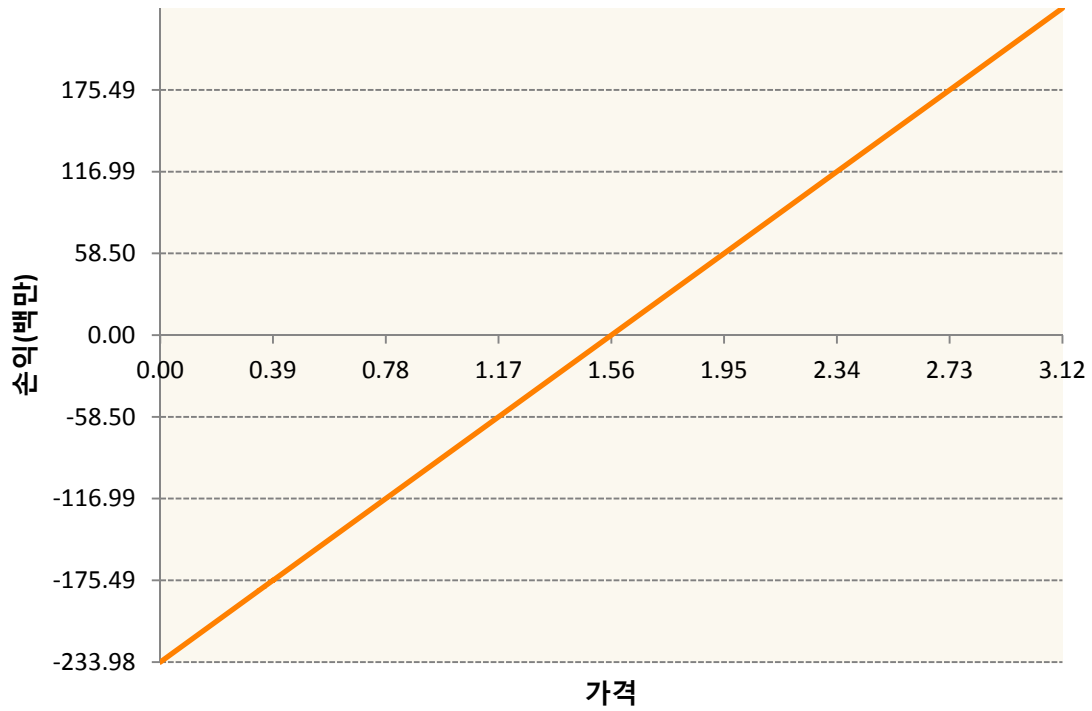
NGF20-NATURAL GAS FUTR Jan20



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
KR4175PB00	2019-11 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)

405

공시일	2019-10-21
기준일	2019-10-18

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

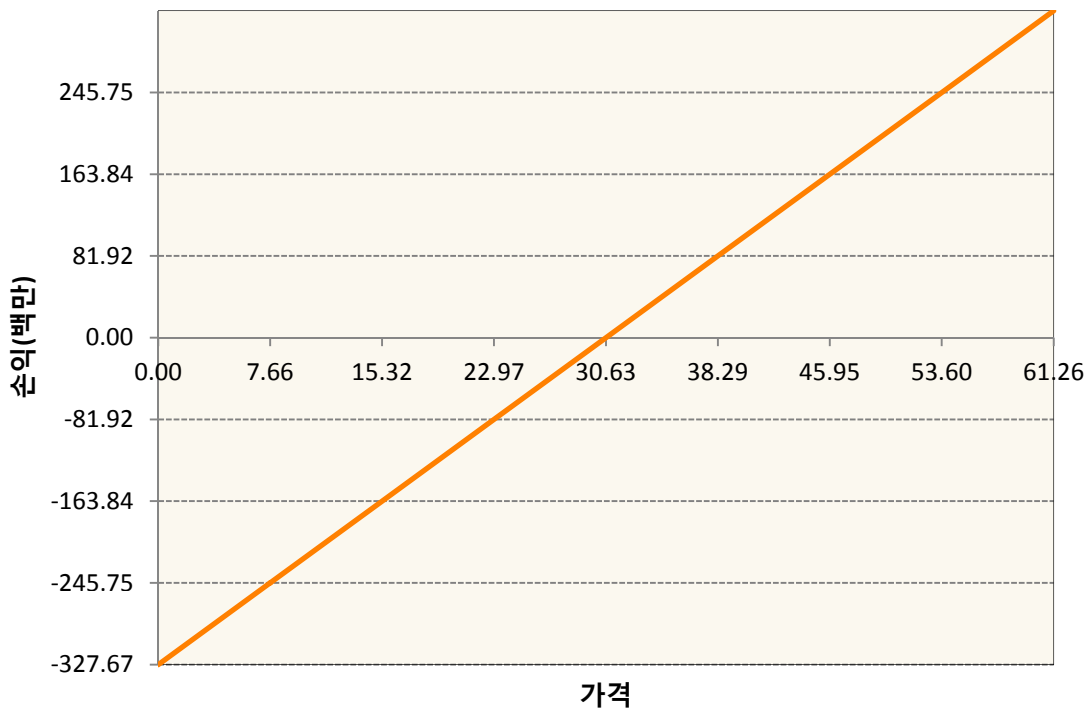
1. 계약금액

(단위:백만원)

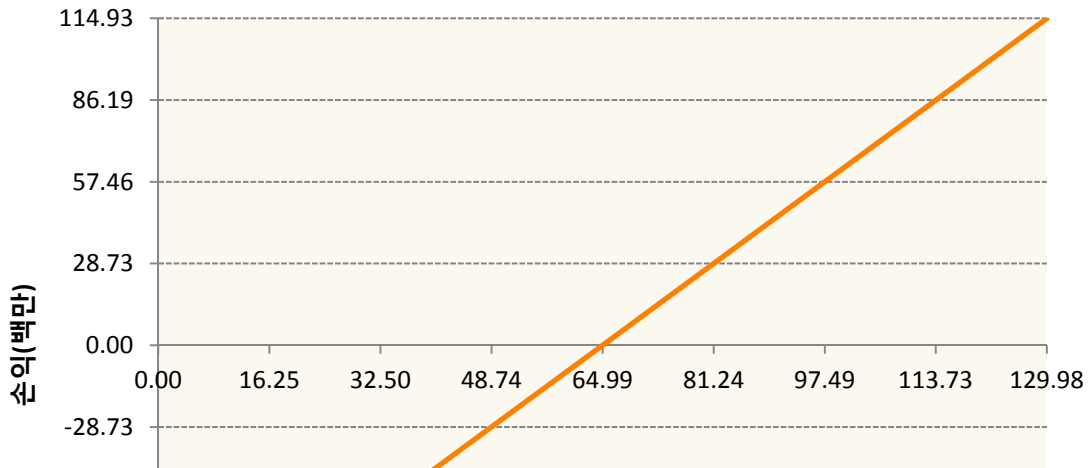
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,871	94	2,776	

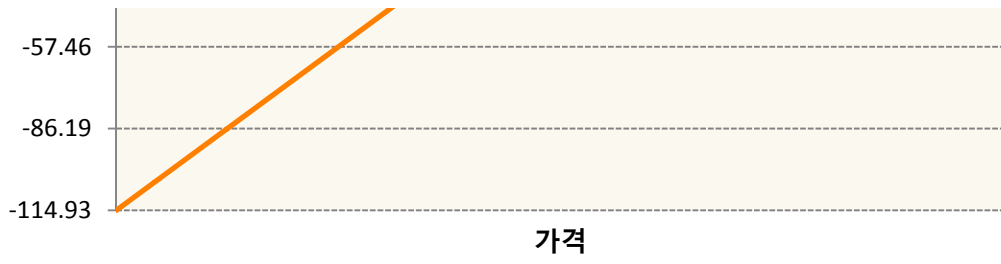
2. 만기시점의 손익구조

BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20

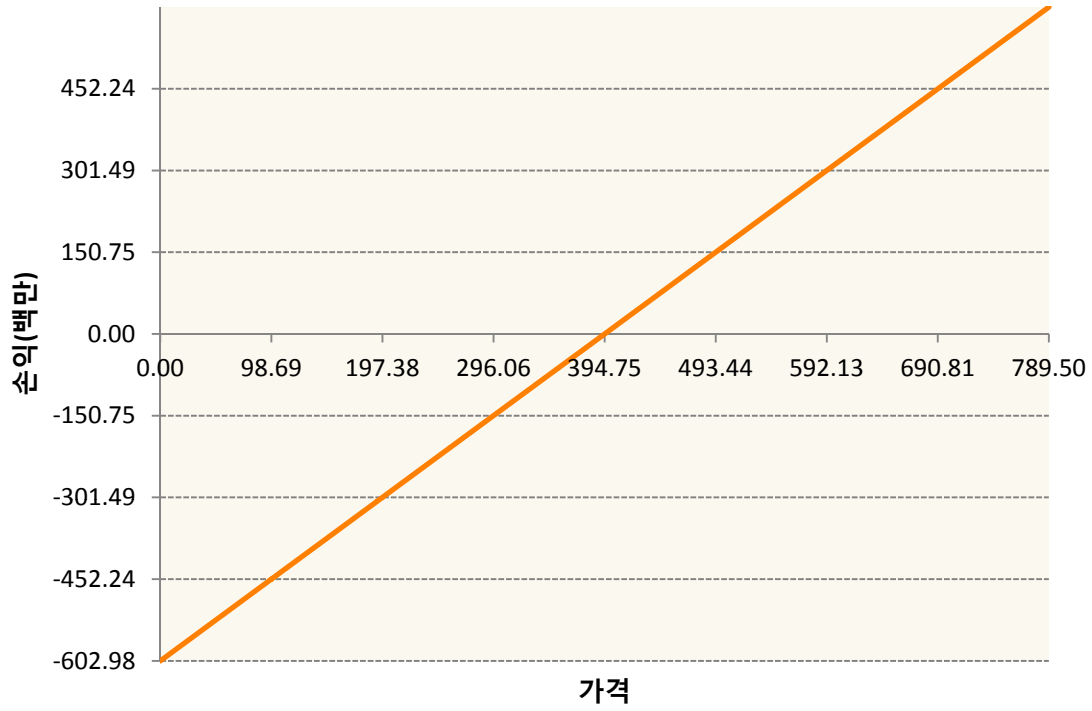


CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19

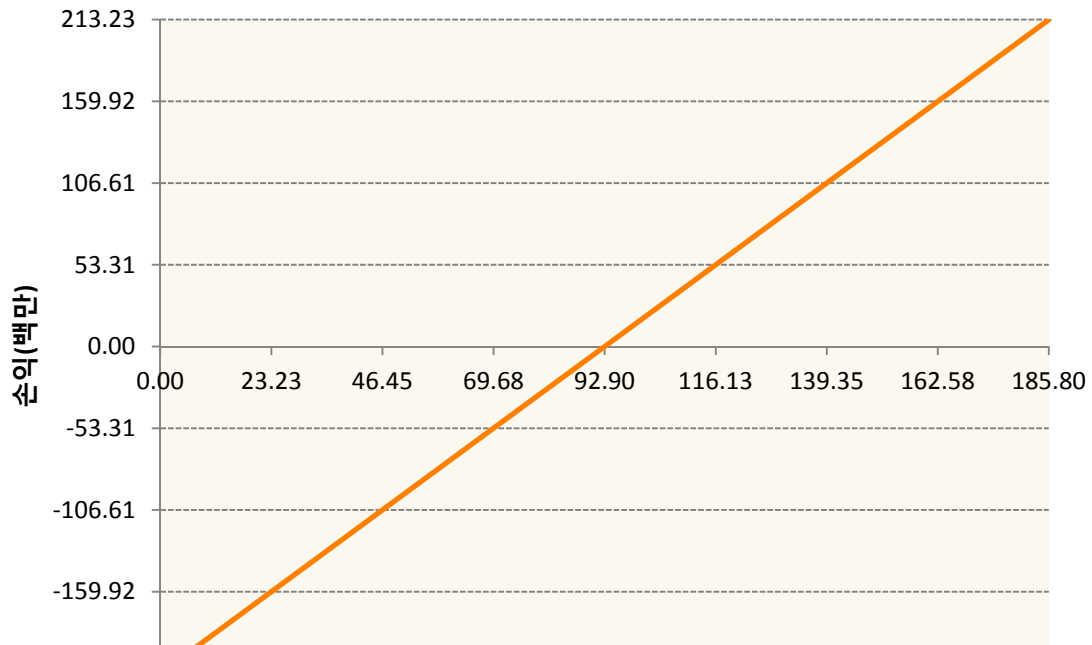


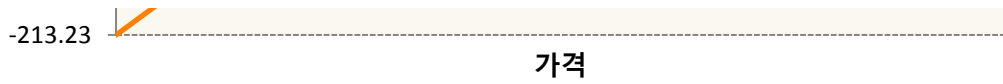


CZ9-CORN FUTURE Dec19

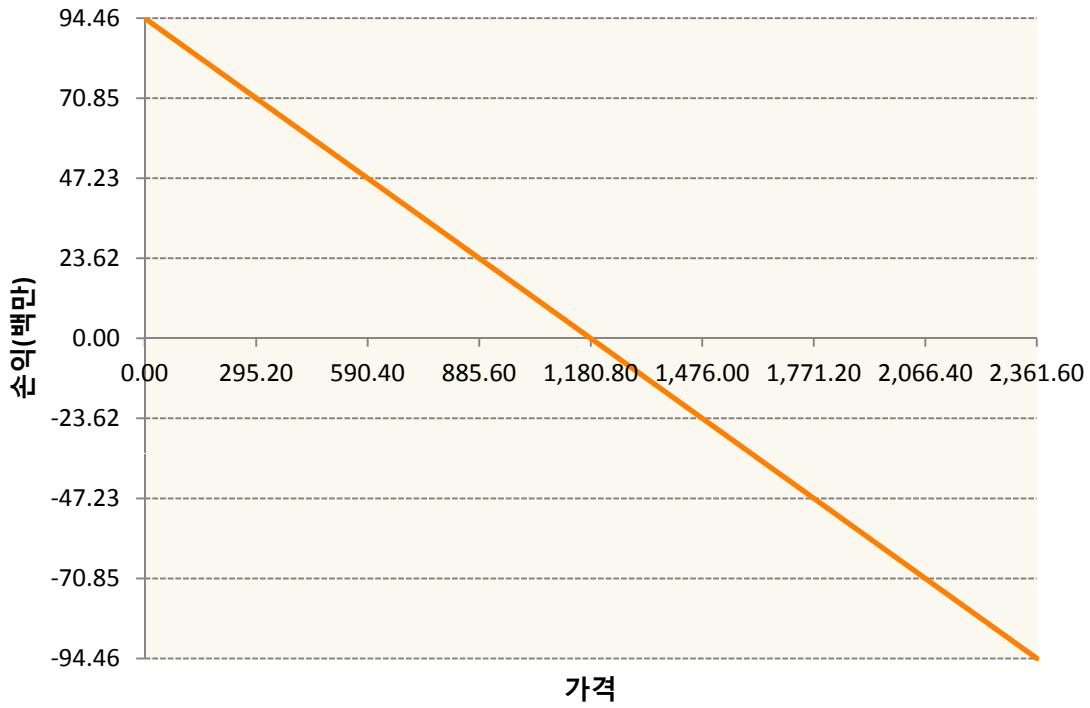


KC9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19

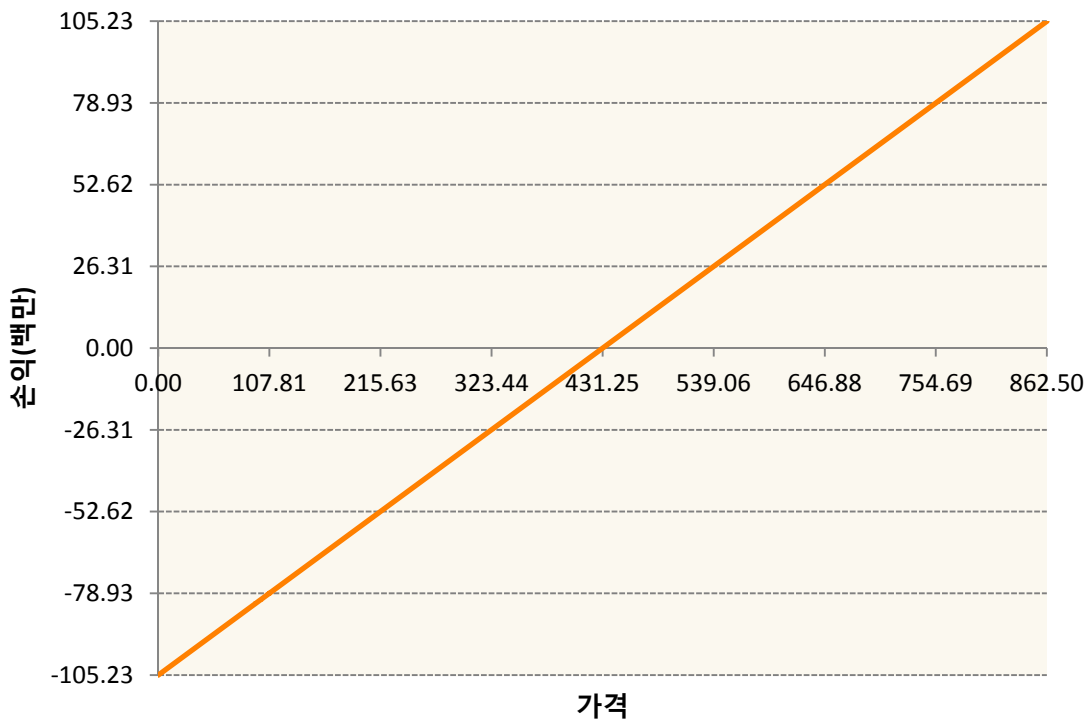




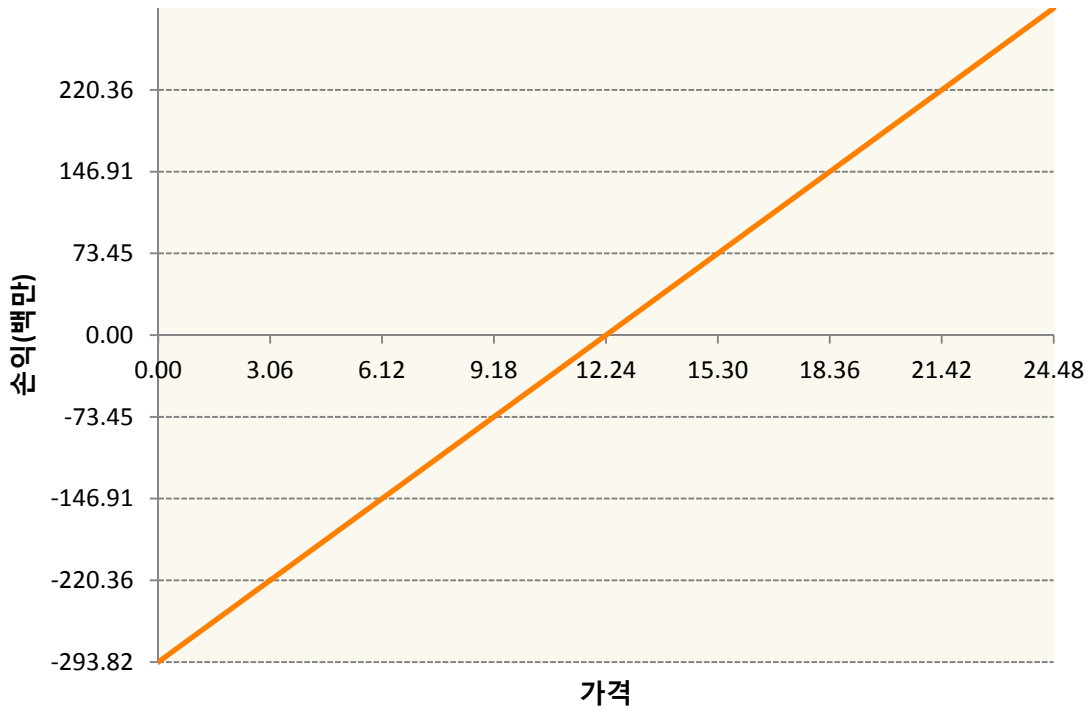
KR4175PB0004-2019-11 달러선물



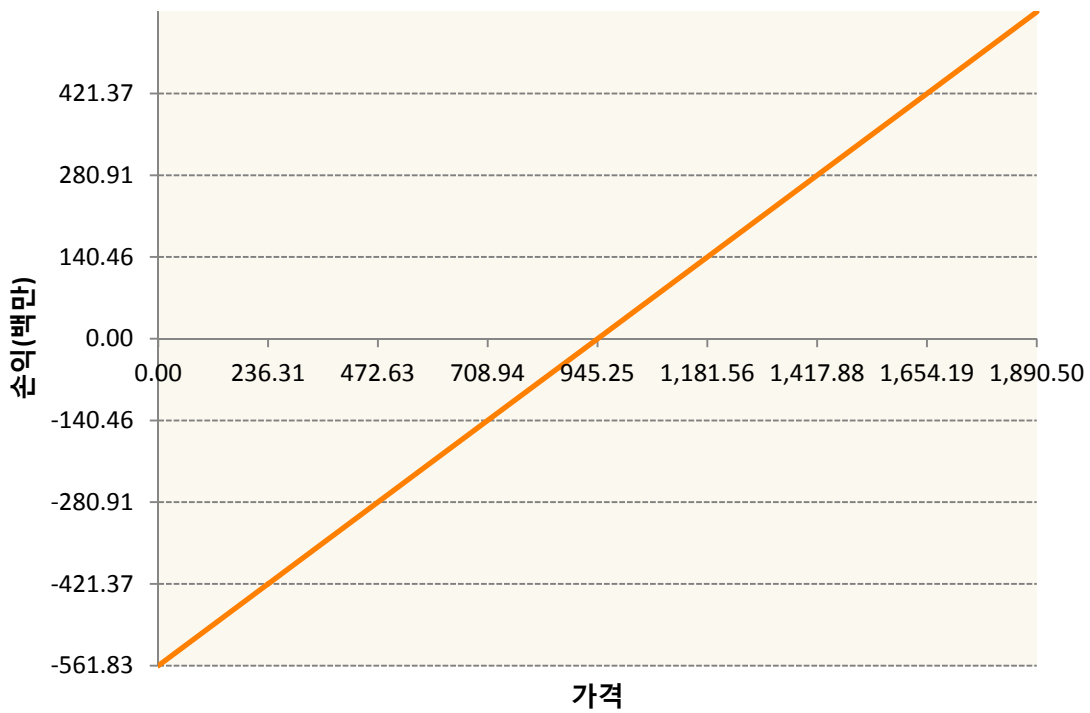
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



SBH0-Sugar Mar20

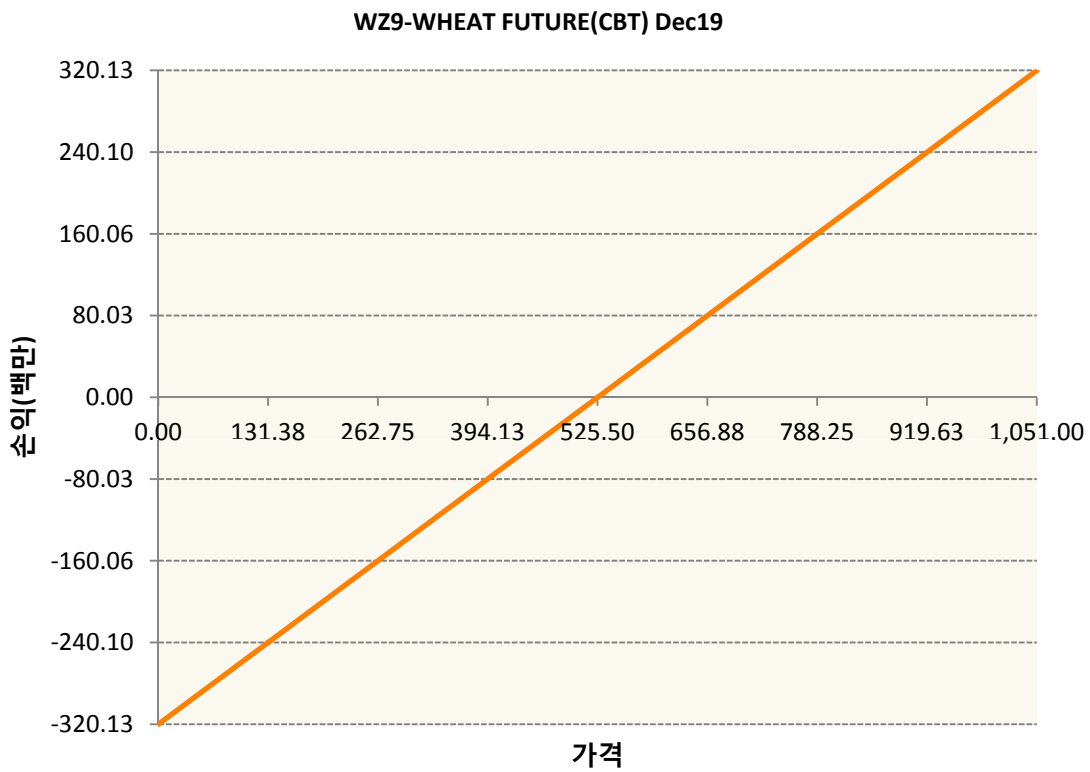
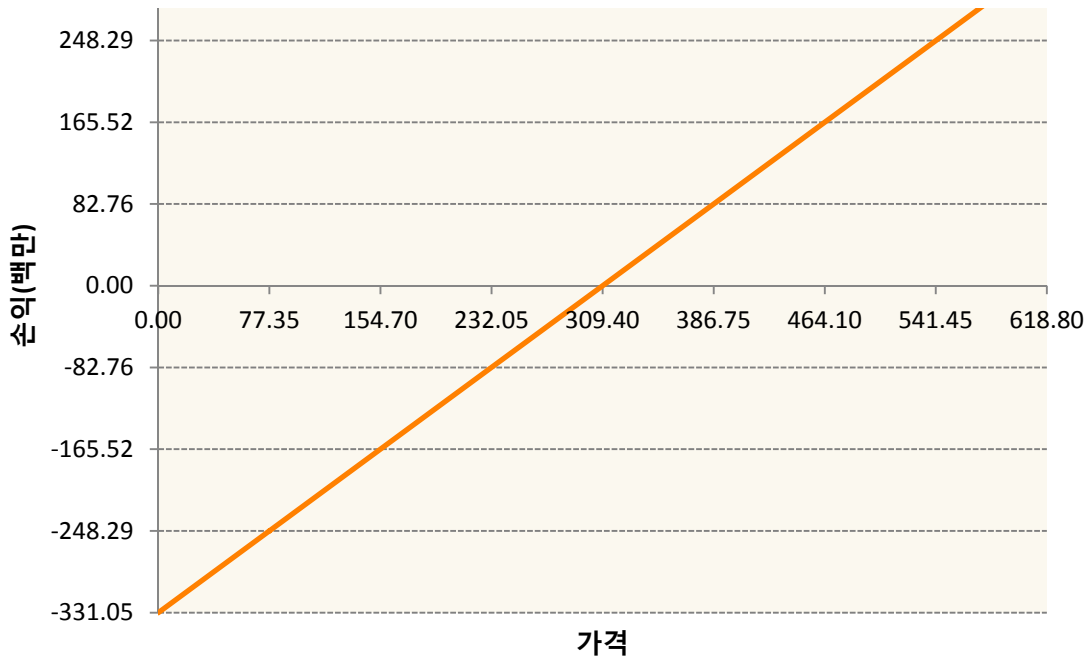


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20



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
KR4175PB00	2019-11 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	26

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

(단위:백만원)

257