

공시일	2019-10-22
기준일	2019-10-21

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	2019-10-22
기준일	2019-10-21

스마트인덱스모

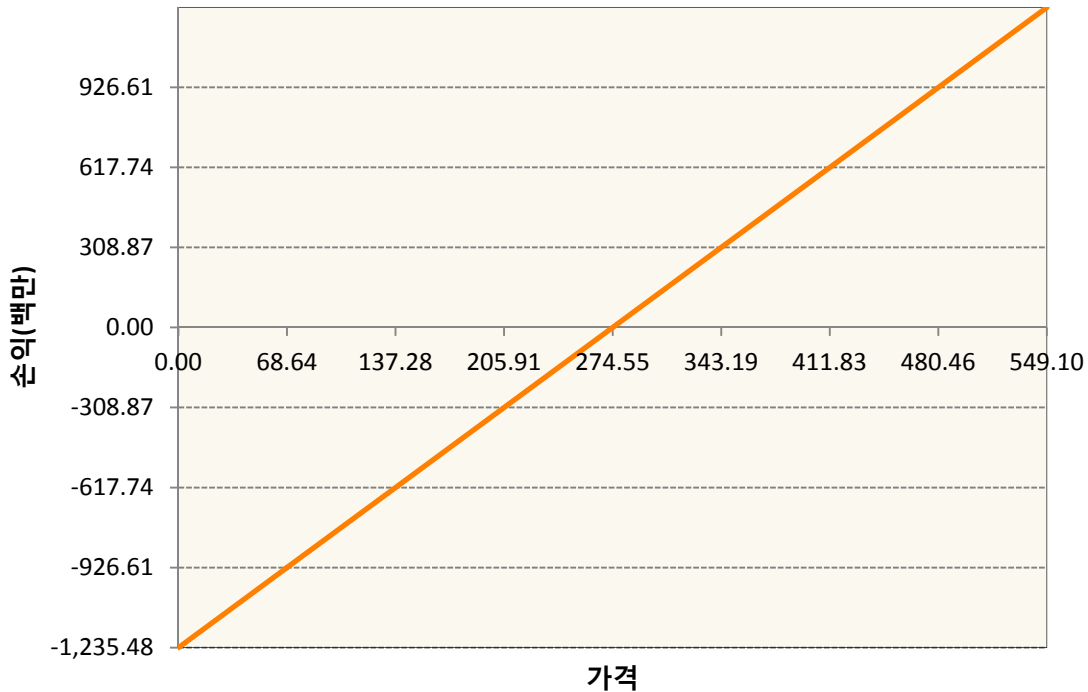
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,235	0	1,235	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

공시일	2019-10-22
기준일	2019-10-21

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)

685

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-10-22
기준일	2019-10-21

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)	378
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	2019-10-22
기준일	2019-10-21

유로인덱스모(주식-파생형)

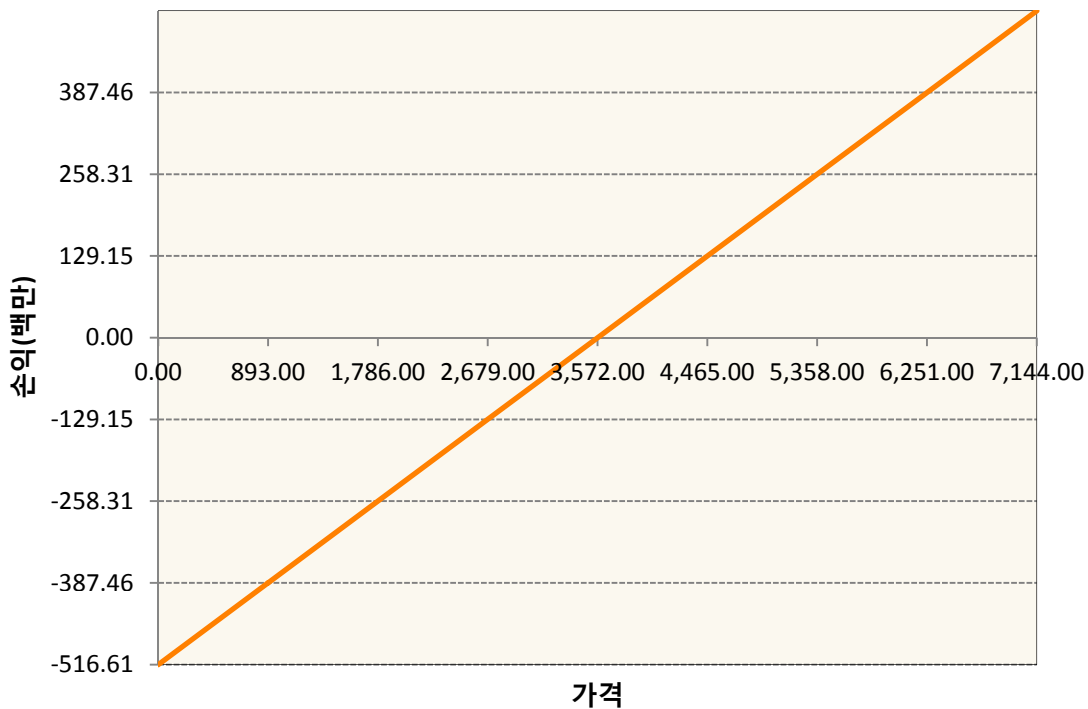
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	517	0	517	

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	2019-10-22
기준일	2019-10-21

차이나인덱스모(주식-파생형)

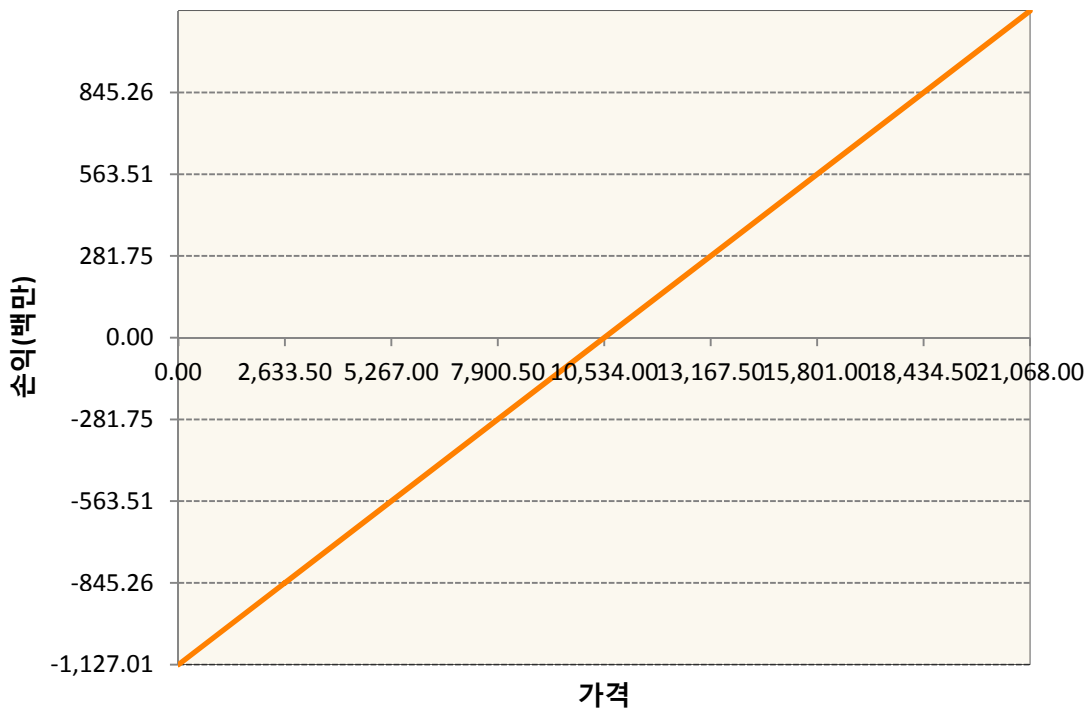
1. 계약금액

(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

HCV9-HSCEI Futures Oct19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

81

공시일	2019-10-22
기준일	2019-10-21

커버드콜모(주식혼합-파생형)

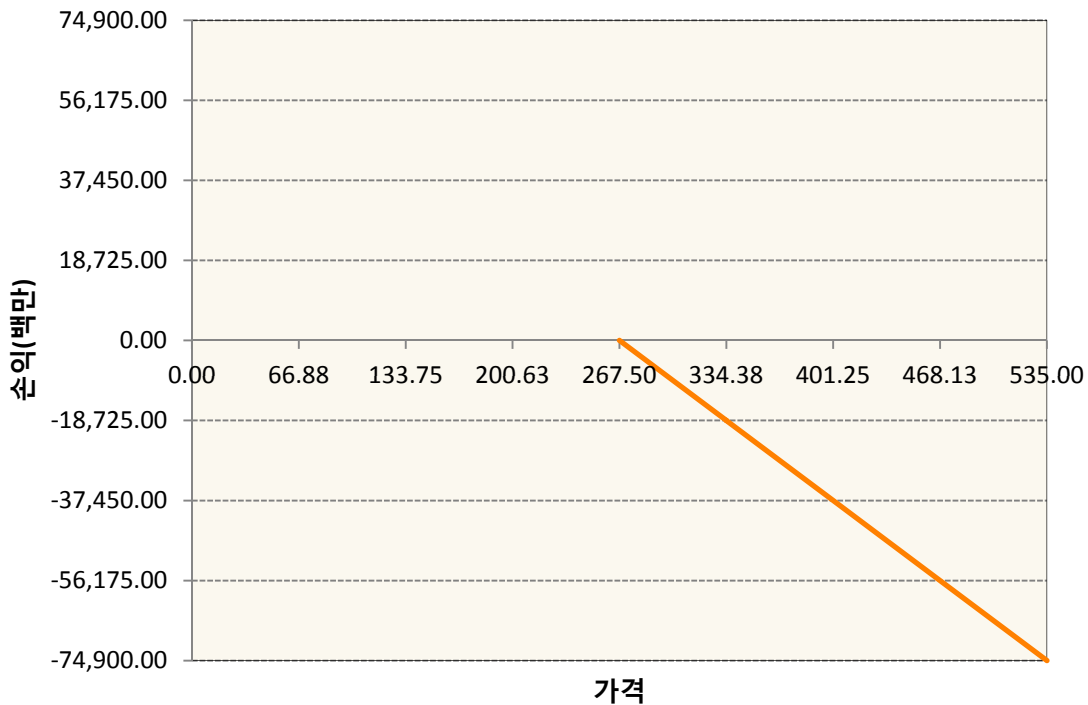
1. 계약금액

(단위:백만원)

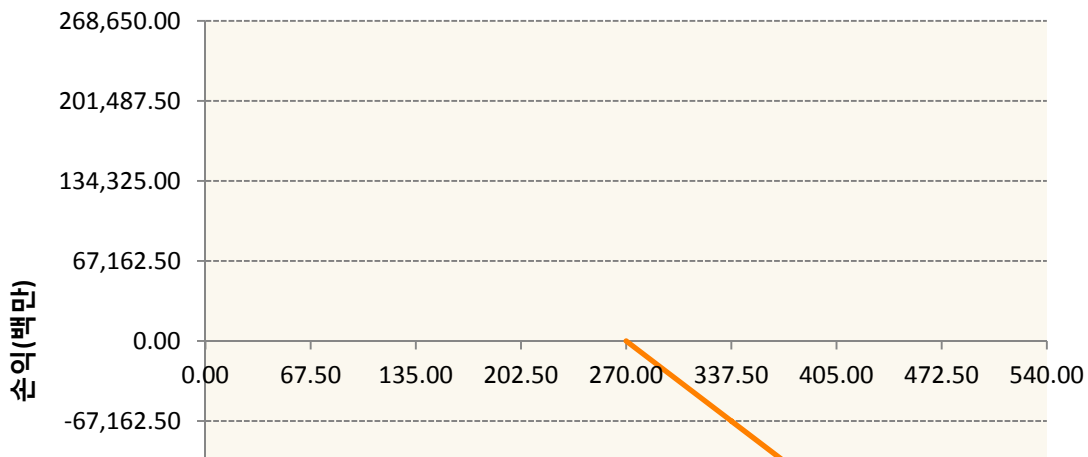
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	510,738	-510,738	장내

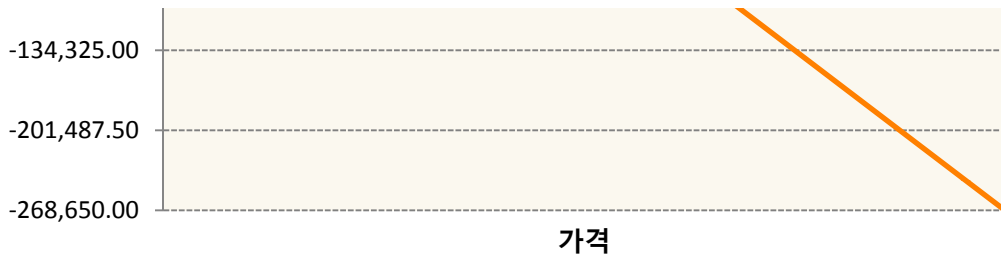
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PB2677-2019-11 콜267.5

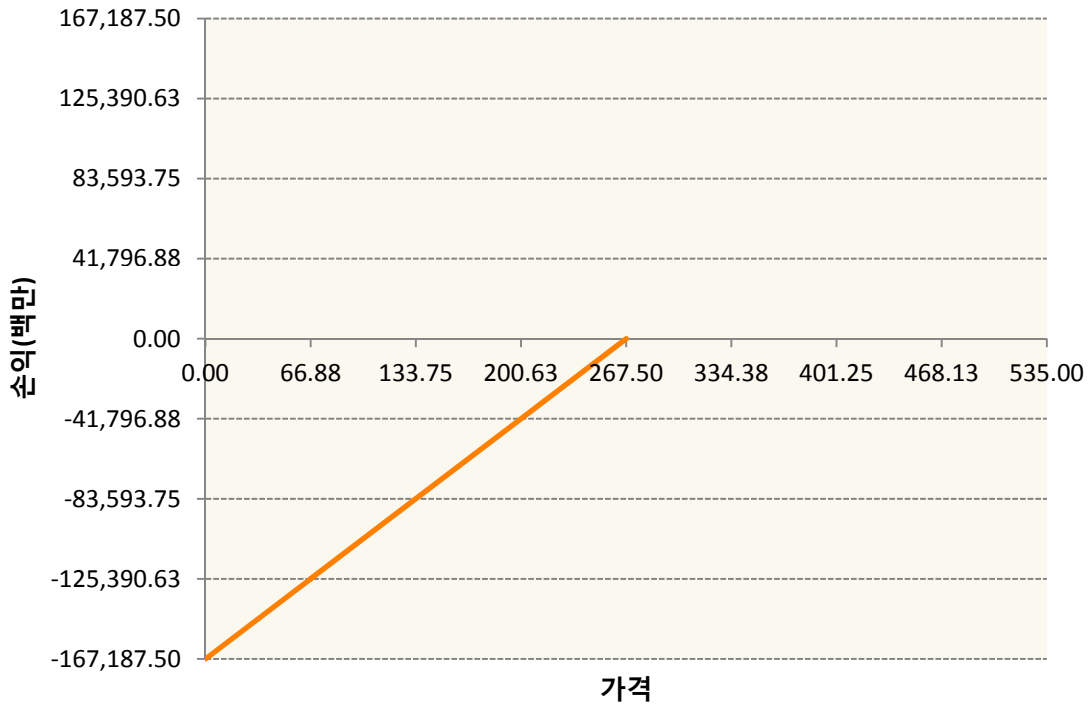


KR4201PB2701-2019-11 콜270





KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PB2677		2019-11 콜267.5					5,196
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,849	2,756	2,653	2,541	2,421	2,296	2,165
-5.33%	2,443	2,298	2,149	1,996	1,840	1,682	1,523
-2.67%	1,675	1,502	1,329	1,155	982	808	634
0%	493	331	166	0	-168	-337	-507
2.67%	-1,056	-1,177	-1,306	-1,443	-1,585	-1,733	-1,883
5.33%	-2,859	-2,932	-3,018	-3,116	-3,223	-3,338	-3,461
8.00%	-4,804	-4,840	-4,889	-4,950	-5,022	-5,104	-5,196
KR4201PB2701		2019-11 콜270					17,810
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,918	8,646	8,332	7,982	7,601	7,195	6,766

-5.33%	7,802	7,339	6,852	6,346	5,826	5,293	4,750
-2.67%	5,540	4,938	4,333	3,725	3,115	2,504	1,891
0%	1,842	1,231	617	0	-618	-1,238	-1,859
2.67%	-3,242	-3,735	-4,252	-4,787	-5,337	-5,898	-6,469
5.33%	-9,375	-9,697	-10,063	-10,464	-10,897	-11,354	-11,833
8.00%	-16,139	-16,313	-16,533	-16,797	-17,101	-17,440	-17,810
KR4301PB2676 2019-11 풋267.5							9,170
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,902	-8,921	-8,950	-8,989	-9,039	-9,100	-9,170
-5.33%	-4,572	-4,674	-4,788	-4,912	-5,045	-5,186	-5,333
-2.67%	-1,207	-1,401	-1,597	-1,792	-1,988	-2,184	-2,380
0%	457	313	160	0	-166	-336	-509
2.67%	893	849	790	718	634	538	433
5.33%	949	943	931	912	885	849	804
8.00%	952	952	951	948	942	933	918

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

(단위:백만원)

31,364

공시일	2019-10-22
기준일	2019-10-21

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

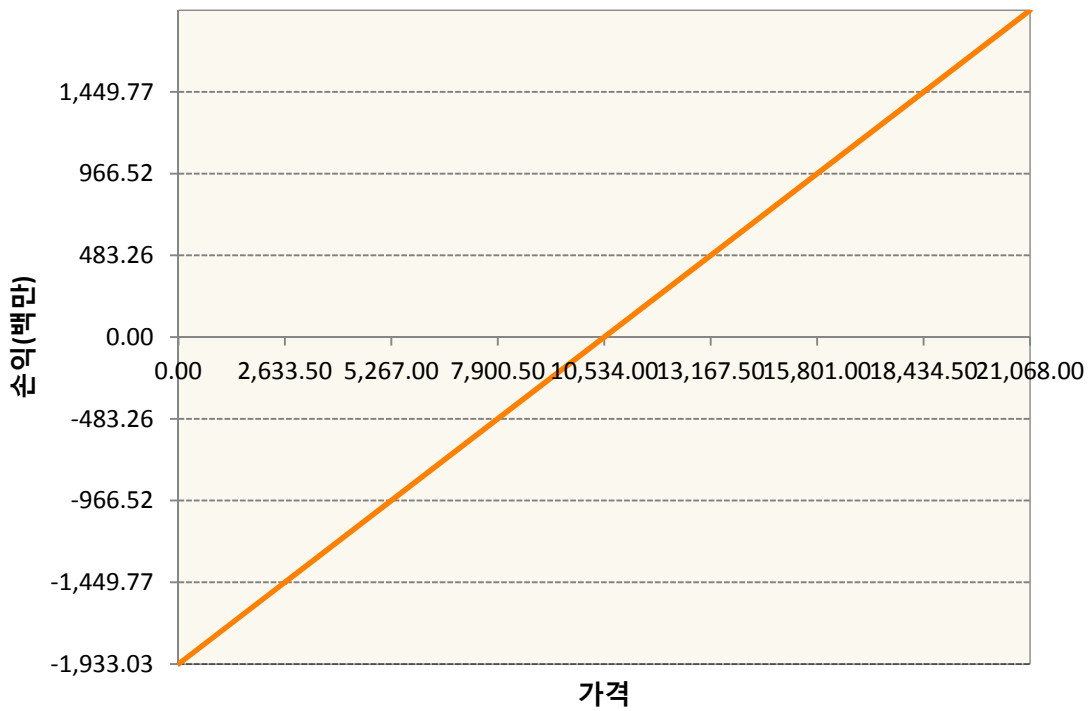
1. 계약금액

(단위:백만원)

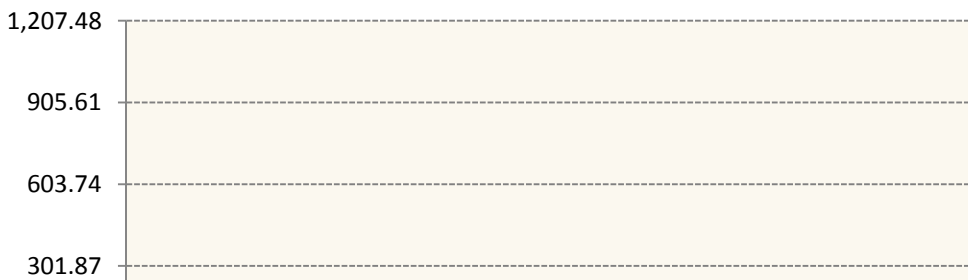
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,933	0	1,933	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,854	-4,854	장내
누계	통화	선도	672	2,777	-2,104	장외

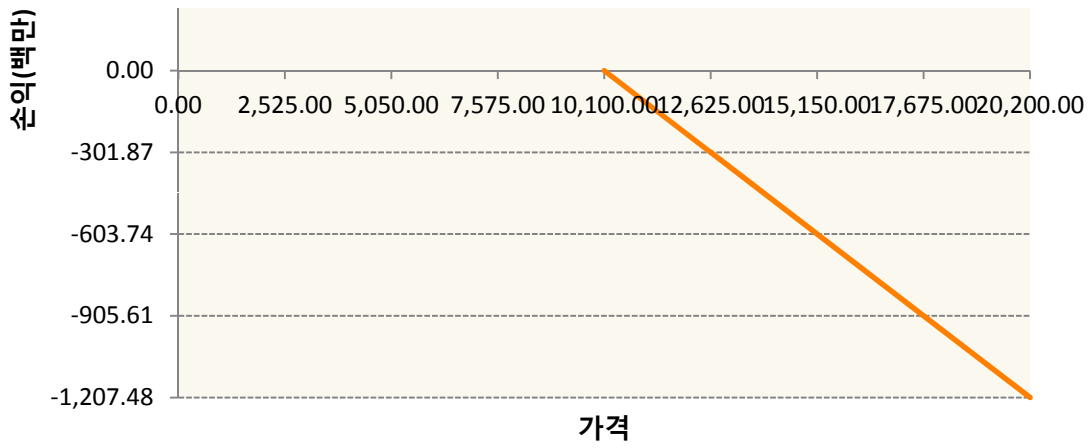
2. 만기시점의 손익구조

HCV9-HSCEI Futures Oct19

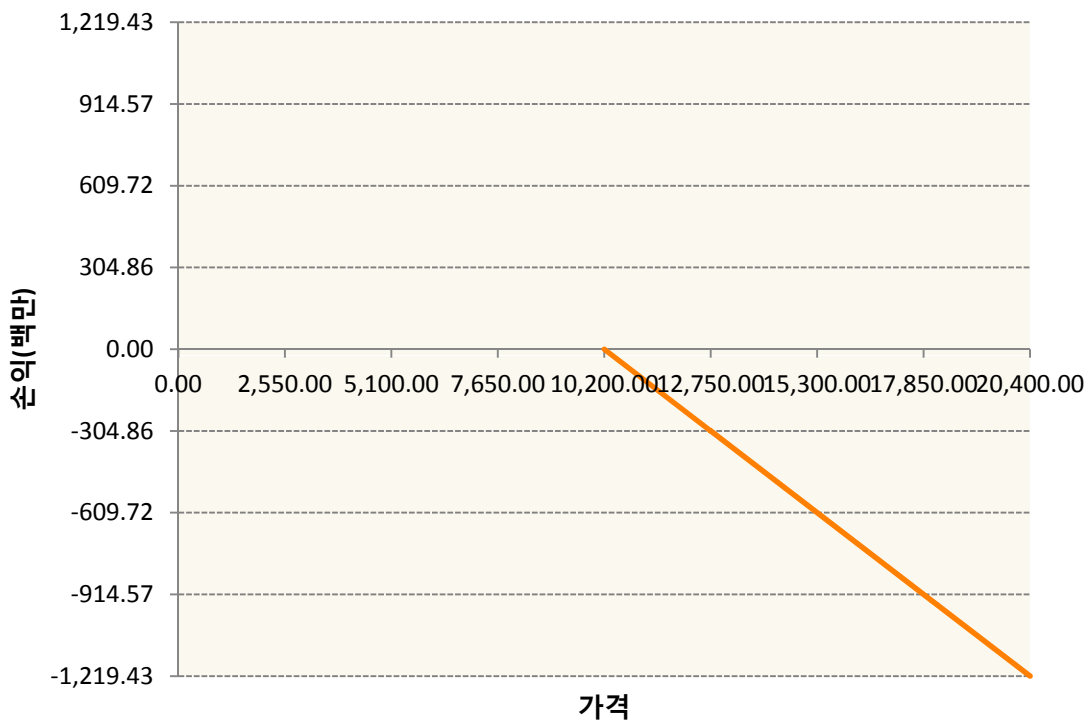


OHHIV9-C101-HSCEI

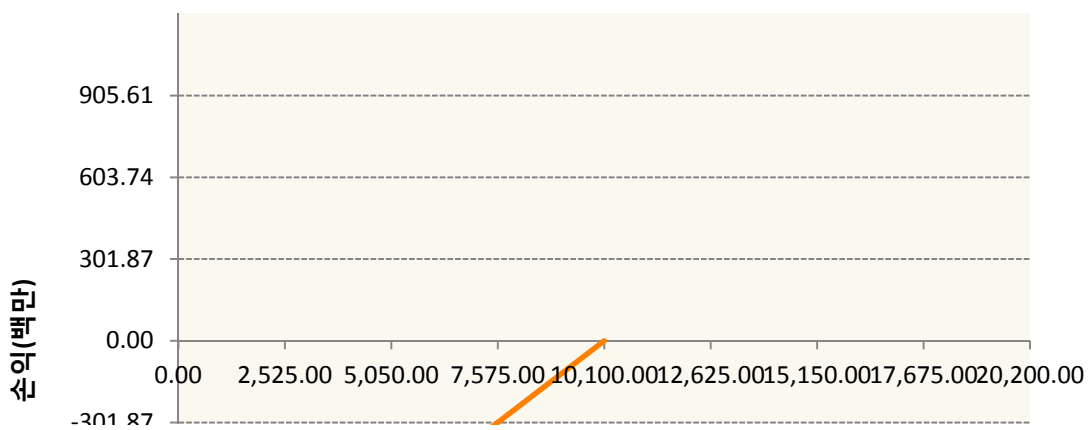


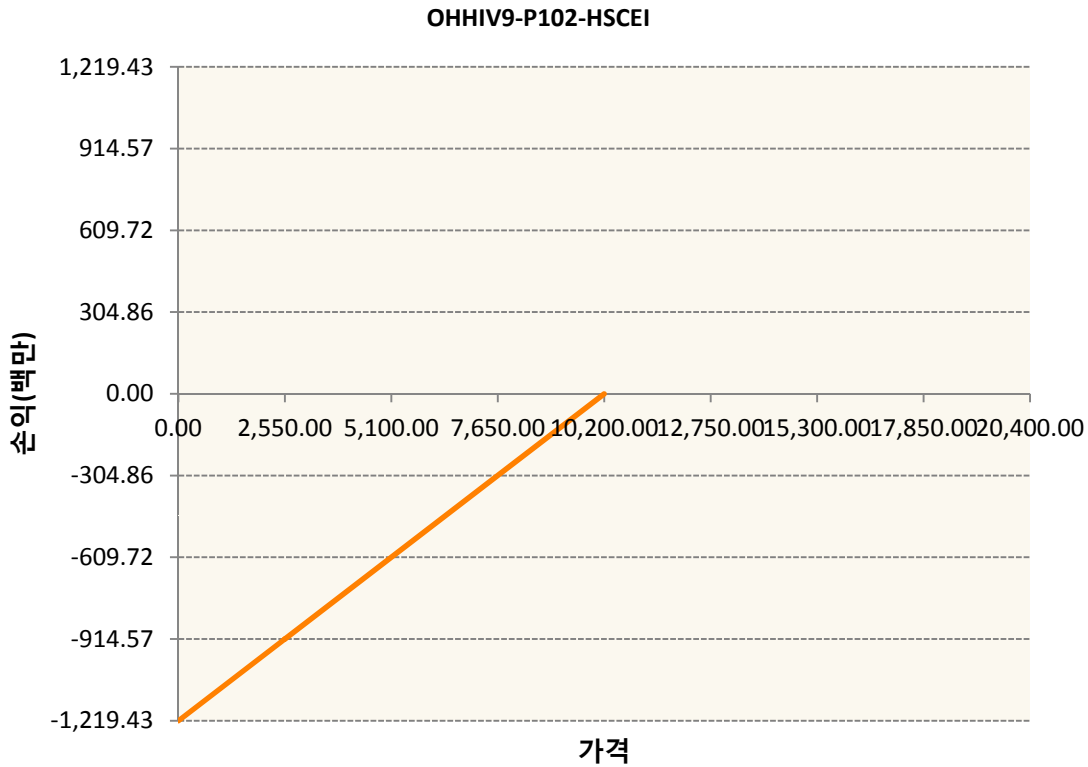


OHHIV9-C102-HSCEI



OHHIV9-P101-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	222
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)
	575

공시일	2019-10-22
기준일	2019-10-21

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

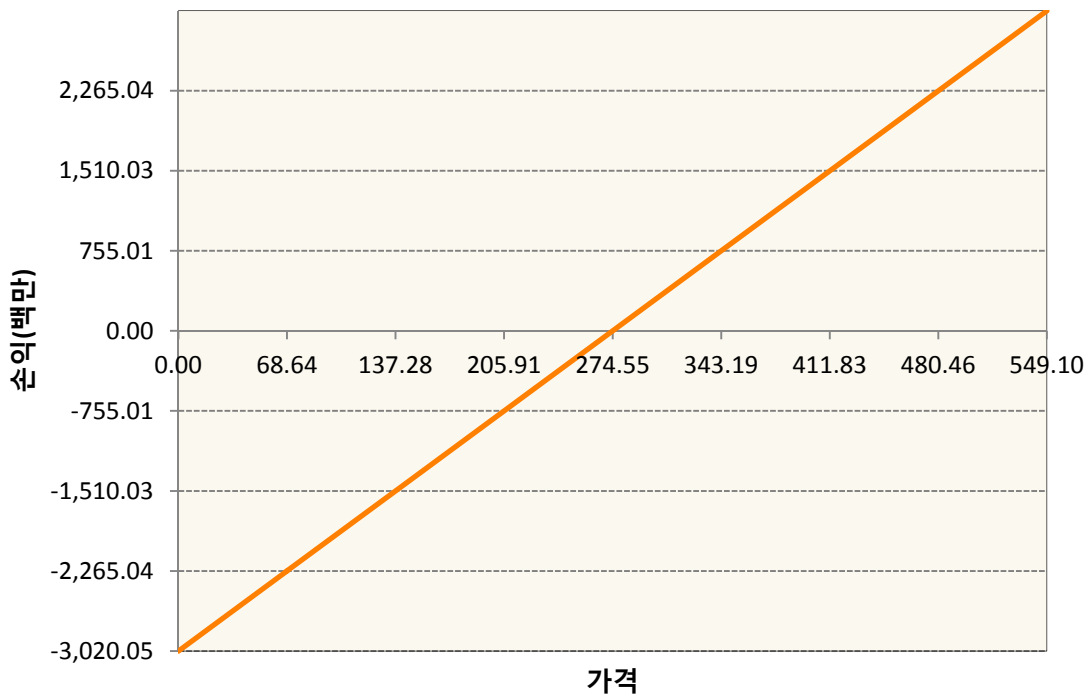
1. 계약금액

(단위:백만원)

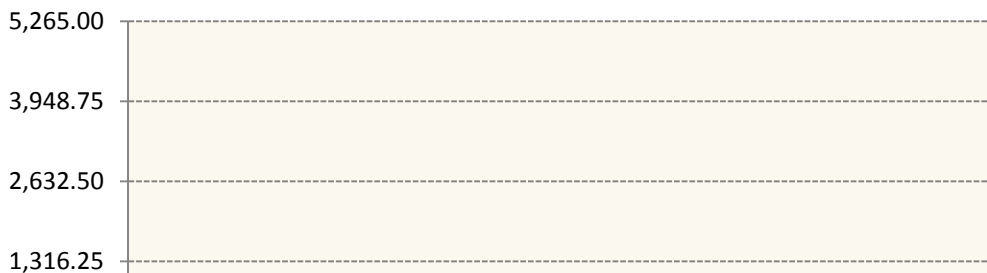
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	265	0	265	장내
누계	유가증권	선물	3,020	0	3,020	장내
누계	유가증권	스왑	10,625	0	10,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	10,483	-10,483	장내

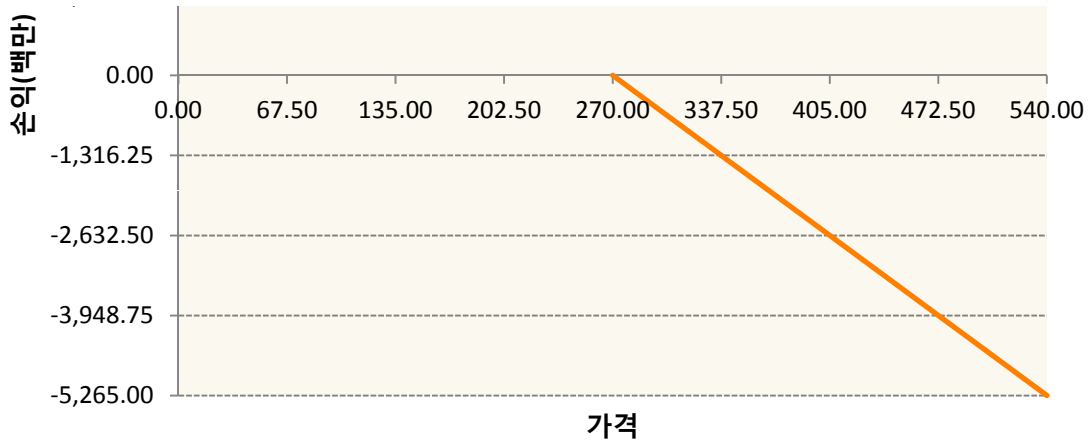
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

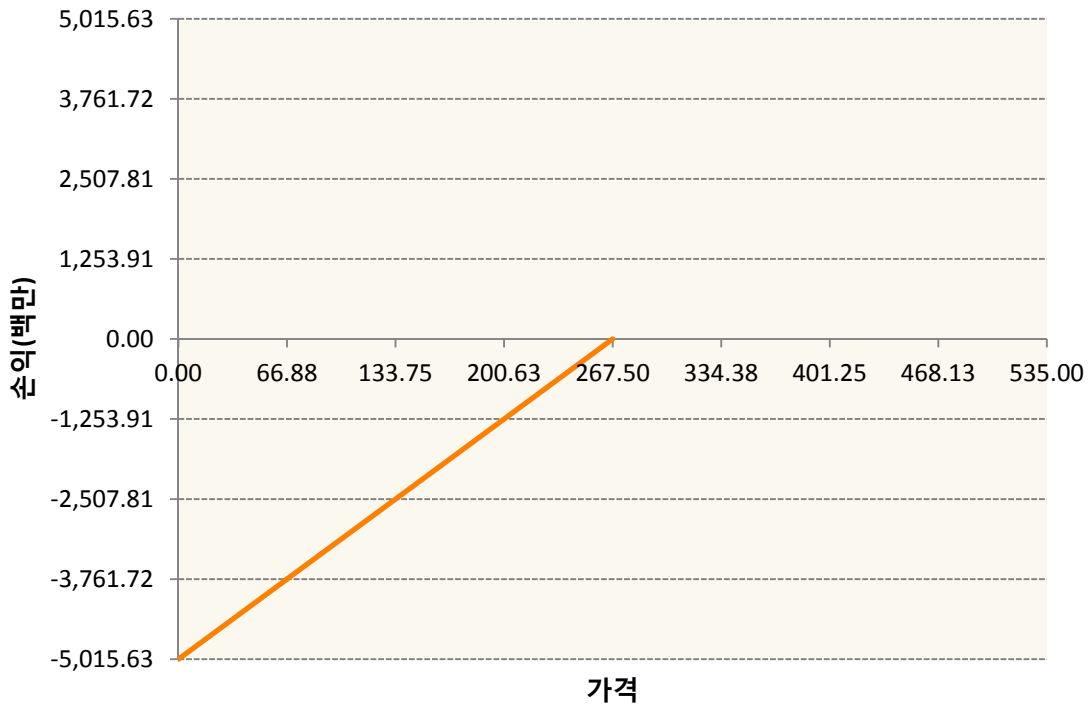


KR4201PB2701-2019-11 콜270

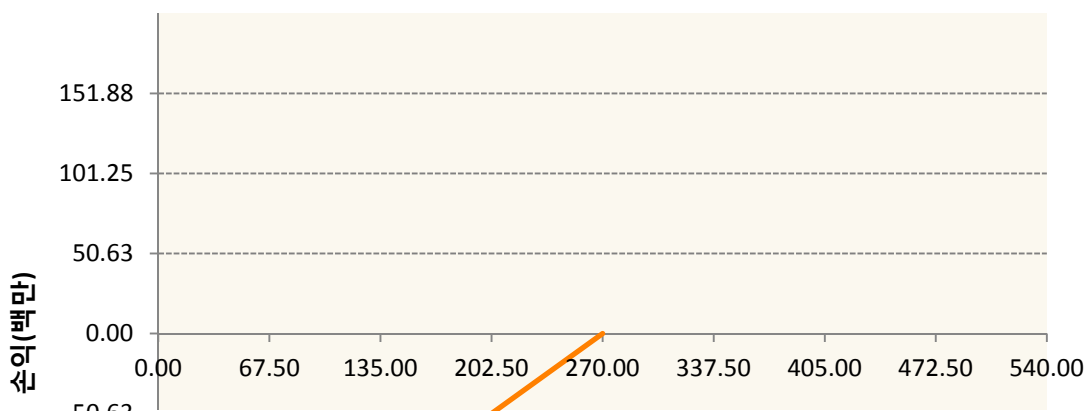




KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



KR4301PB2700-2019-11 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						917
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-917	-917	-917	-917	-917	-917	-917	
-5.33%	-611	-611	-611	-611	-611	-611	-611	
-2.67%	-306	-306	-306	-306	-306	-306	-306	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	306	306	306	306	306	306	306	
5.33%	611	611	611	611	611	611	611	
8.00%	917	917	917	917	917	917	917	
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						349
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	175	169	163	156	149	141	133	
-5.33%	153	144	134	124	114	104	93	
-2.67%	109	97	85	73	61	49	37	
0%	36	24	12	0	-12	-24	-36	
2.67%	-64	-73	-83	-94	-105	-116	-127	
5.33%	-184	-190	-197	-205	-214	-223	-232	
8.00%	-316	-320	-324	-329	-335	-342	-349	
KR4301PB2676		2019-11 풋267.5						275
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-267	-268	-268	-270	-271	-273	-275
-5.33%	-137	-140	-144	-147	-151	-156	-160
-2.67%	-36	-42	-48	-54	-60	-66	-71
0%	14	9	5	0	-5	-10	-15
2.67%	27	25	24	22	19	16	13
5.33%	28	28	28	27	27	25	24
8.00%	29	29	29	28	28	28	28
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	-7
-2.67%	-2	-2	-2	-3	-3	-3	-3
0%	1	0	0	0	0	0	-1
2.67%	2	1	1	1	1	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	1
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

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

(단위:백만원)

1,732

공시일	2019-10-22
기준일	2019-10-21

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

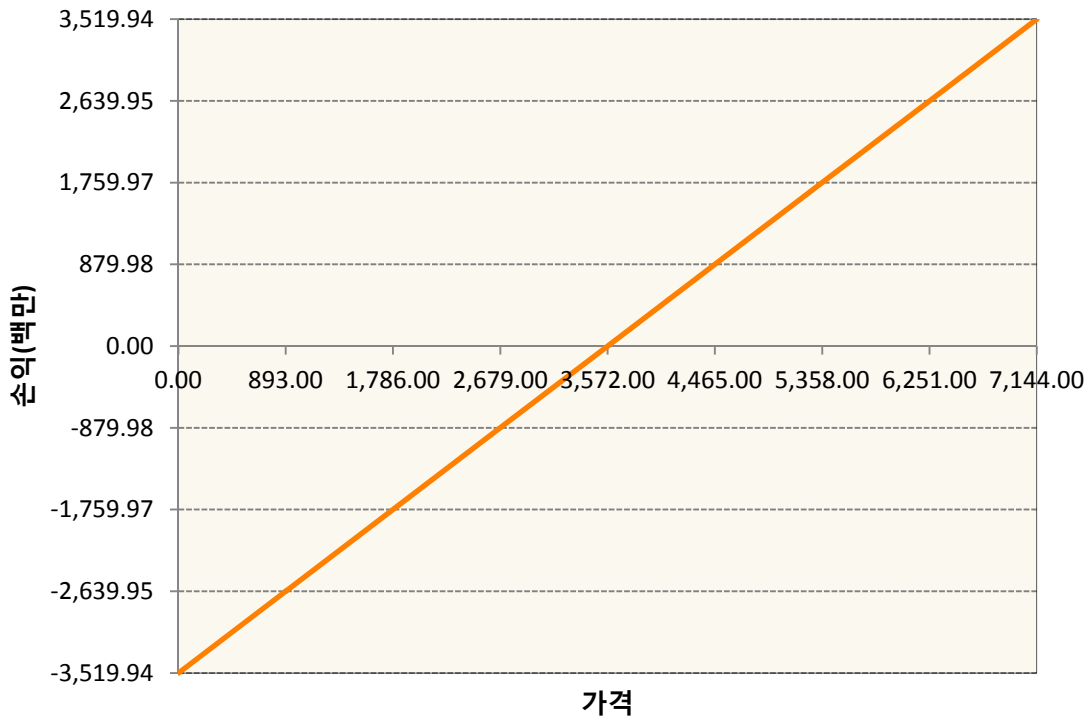
1. 계약금액

(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	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,520	0	3,520	
누계	유가증권	스왑	23,872	0	23,872	장외
누계	통화	선도	0	6,145	-6,145	장외

2. 만기시점의 손익구조

VGZ9-EURO STOXX 50 Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	0
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E	492
VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19	282

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

(단위:백만원)

424

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

(단위:백만원)

939

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

(단위:백만원)

82

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

(단위:백만원)

127

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-10-22
기준일	2019-10-21

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

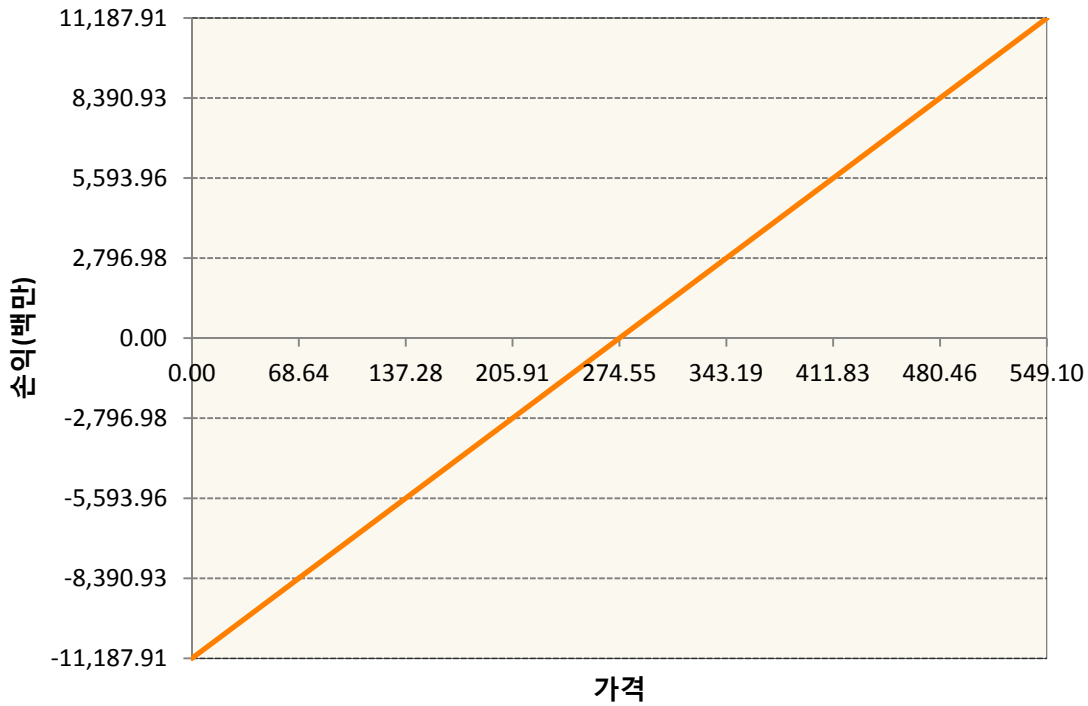
1. 계약금액

(단위:백만원)

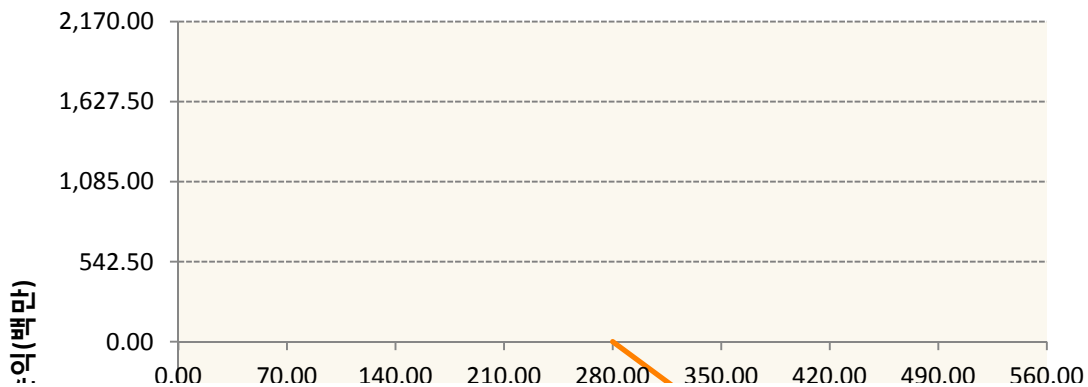
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,188	0	11,188	장내
누계	유가증권	옵션	3,561	20,815	-17,254	장내

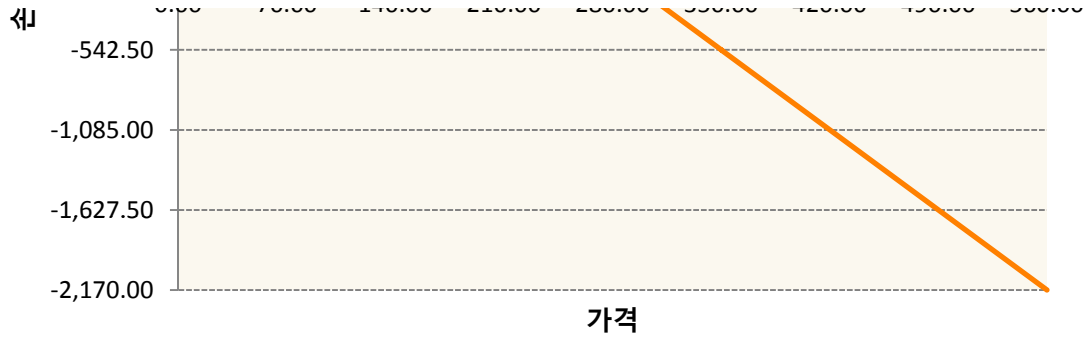
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

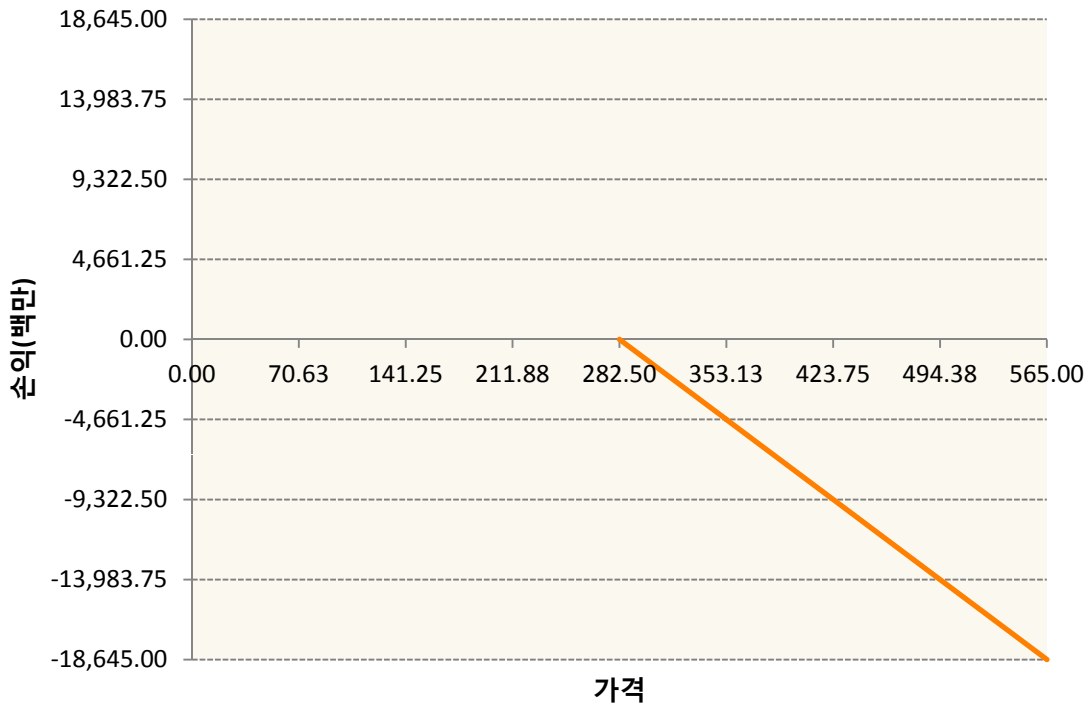


KR4201PB2800-2019-11 콜280

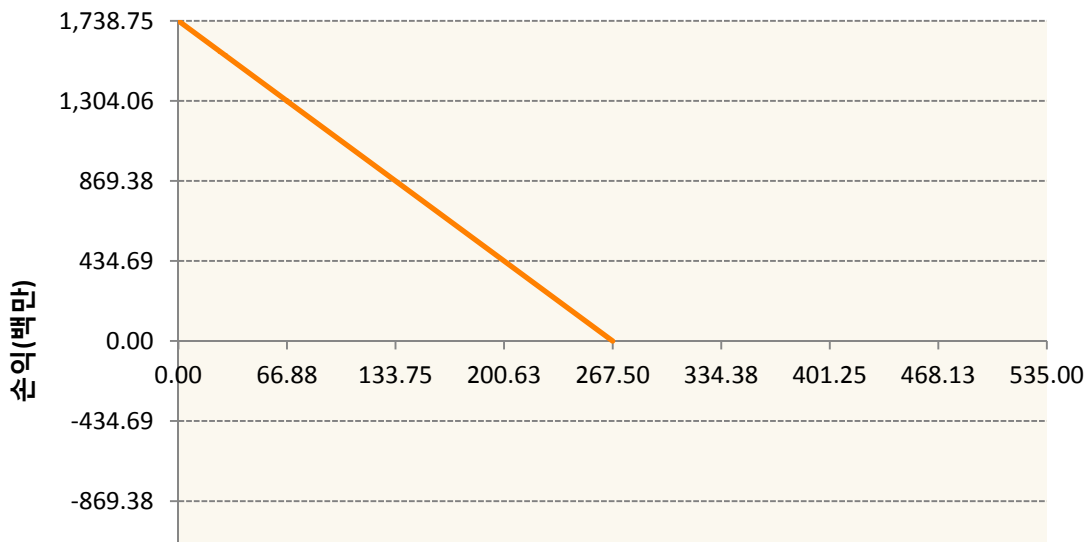


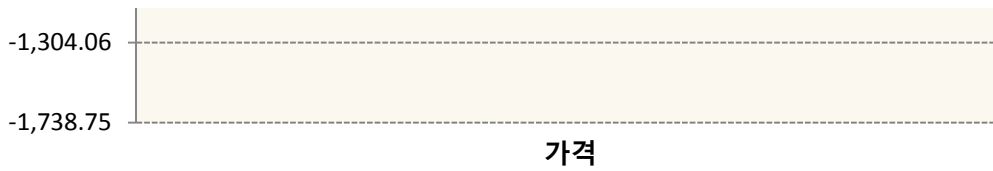


KR4201PB2826-2019-11 콜282.5

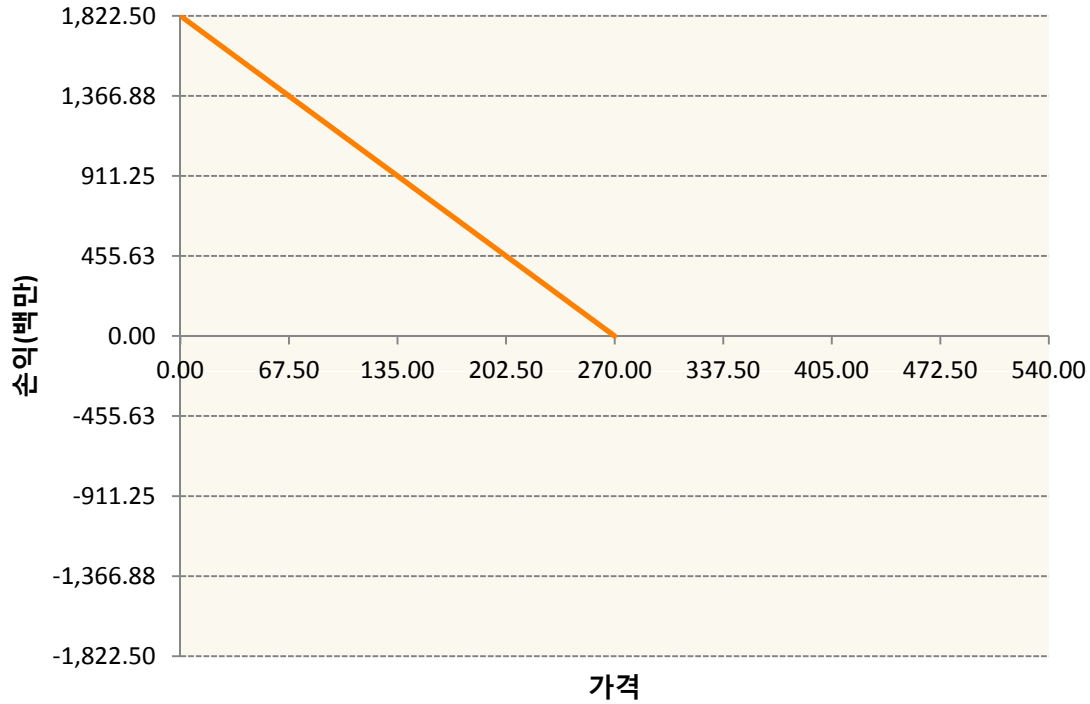


KR4301PB2676-2019-11 풋267.5





KR4301PB2700-2019-11 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						893
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-893	-893	-893	-893	-893	-893	-893	
-5.33%	-595	-595	-595	-595	-595	-595	-595	
-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%	595	595	595	595	595	595	595	
8.00%	893	893	893	893	893	893	893	
KR4201PB2800		2019-11 콜280						114
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	38	37	36	34	33	31	29	
-5.33%	35	33	31	29	26	23	20	
-2.67%	28	25	22	18	14	10	6	

0%	14	9	5	0	-5	-10	-14
2.67%	-11	-16	-21	-26	-31	-36	-41
5.33%	-46	-51	-55	-60	-65	-70	-74
8.00%	-91	-94	-98	-102	-105	-110	-114
KR4201PB2826 2019-11 콜282.5							909
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	268	263	256	247	235	221	205
-5.33%	253	241	225	207	187	164	140
-2.67%	210	186	159	131	100	68	35
0%	112	75	38	0	-39	-78	-118
2.67%	-68	-111	-154	-197	-240	-283	-326
5.33%	-340	-381	-422	-464	-506	-549	-591
8.00%	-695	-727	-761	-796	-833	-871	-909
KR4301PB2676 2019-11 풋267.5							95
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	93	93	93	93	94	95	95
-5.33%	48	49	50	51	52	54	55
-2.67%	13	15	17	19	21	23	25
0%	-5	-3	-2	0	2	3	5
2.67%	-9	-9	-8	-7	-7	-6	-4
5.33%	-10	-10	-10	-9	-9	-9	-8
8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
KR4301PB2700 2019-11 풋270							109
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	108	108	108	108	108	109	109
-5.33%	60	60	61	62	63	65	66
-2.67%	18	20	22	24	26	28	30
0%	-6	-4	-2	0	2	4	6
2.67%	-14	-13	-12	-11	-10	-9	-7
5.33%	-15	-15	-15	-15	-14	-14	-13
8.00%	-16	-16	-16	-15	-15	-15	-15

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

(단위:백만원)

1,726

공시일	2019-10-22
기준일	2019-10-21

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	152,510	0	152,510	

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	2019-10-22
기준일	2019-10-21

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,344	0	2,344	
누계	유가증권	수익증권	197,793	0	197,793	

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	2019-10-22
기준일	2019-10-21

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	418,639	0	418,639	
누계	통화	선도	0	515,211	-515,211	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		938
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		938
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		2,916
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		3,094
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		2,569
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E		1,875
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E		1,969
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E		938
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		656
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E		1,538
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		694
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E		1,688
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		2,475
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		469
FX21019V02 KRW/USD 21-11-19E		5,101
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,782
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,406
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,813
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,510
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,850

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

(단위:백만원)

13,212

공시일	2019-10-22
기준일	2019-10-21

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

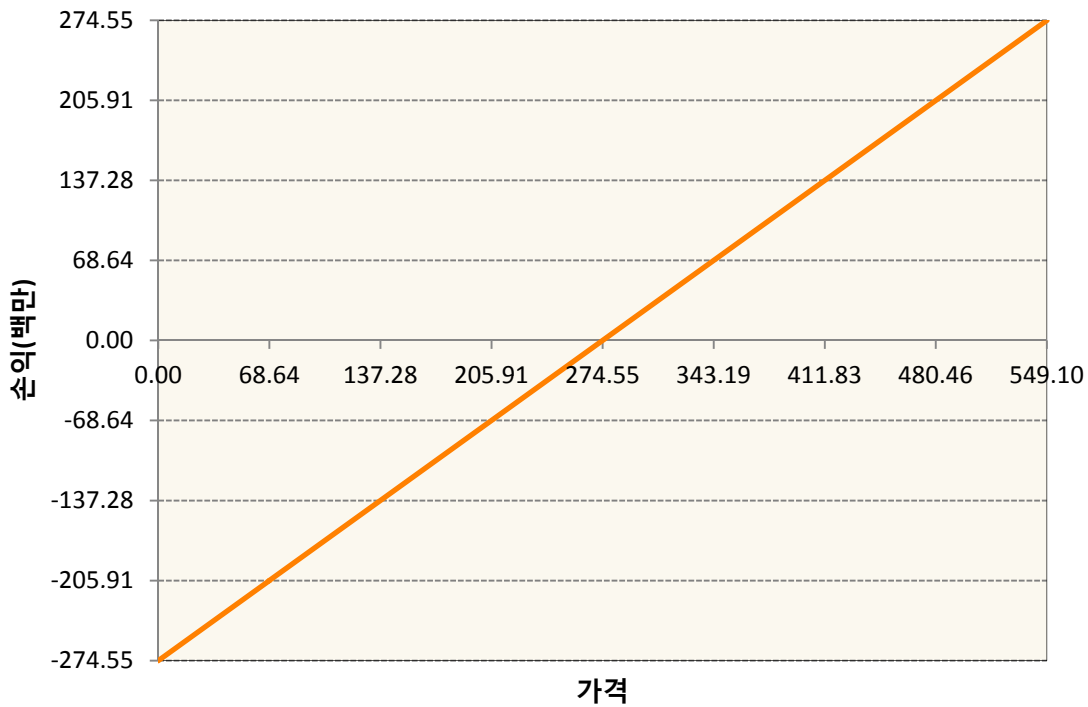
1. 계약금액

(단위:백만원)

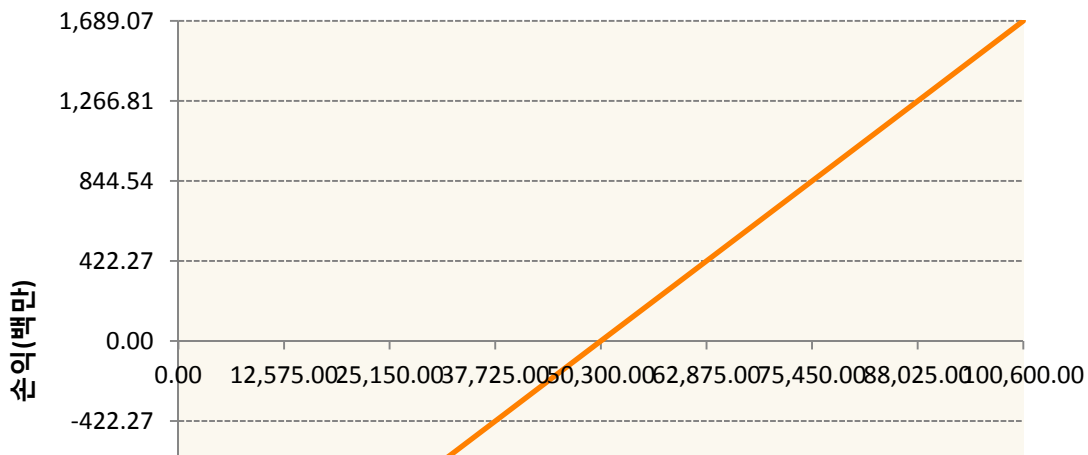
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,964	0	1,964	장내

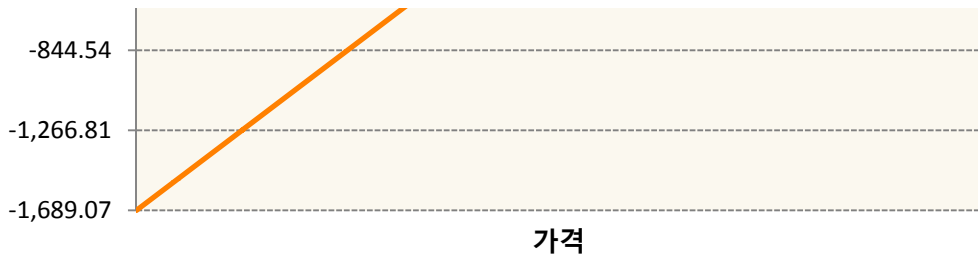
2. 만기시점의 손익구조

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)

178

공시일	2019-10-22
기준일	2019-10-21

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

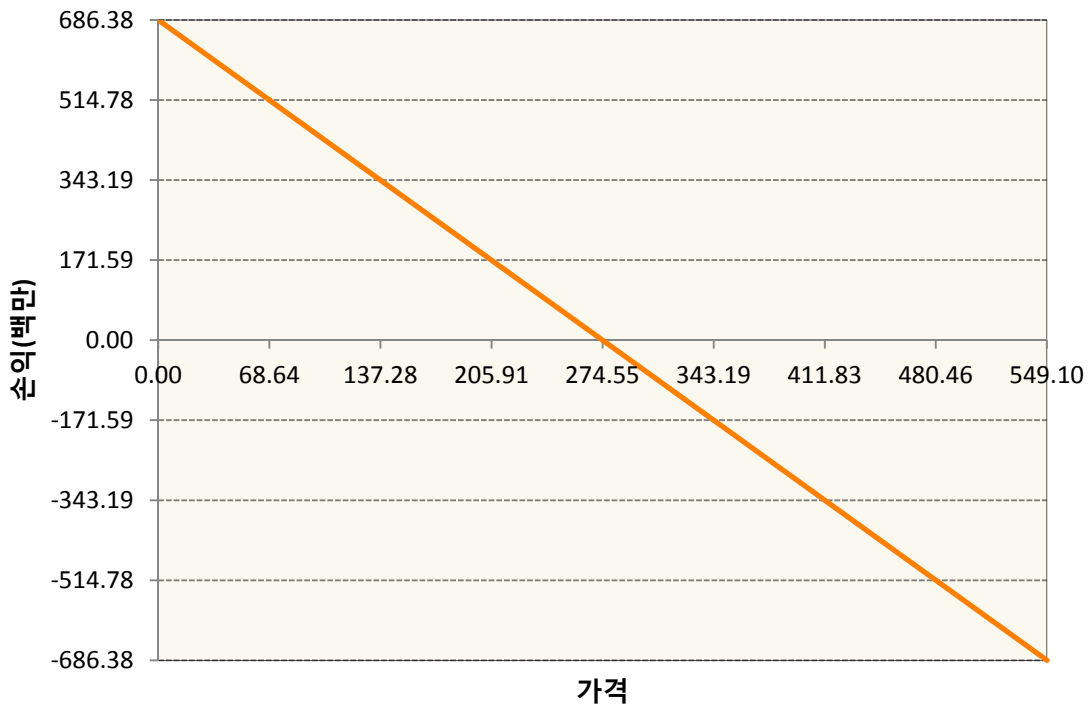
1. 계약금액

(단위:백만원)

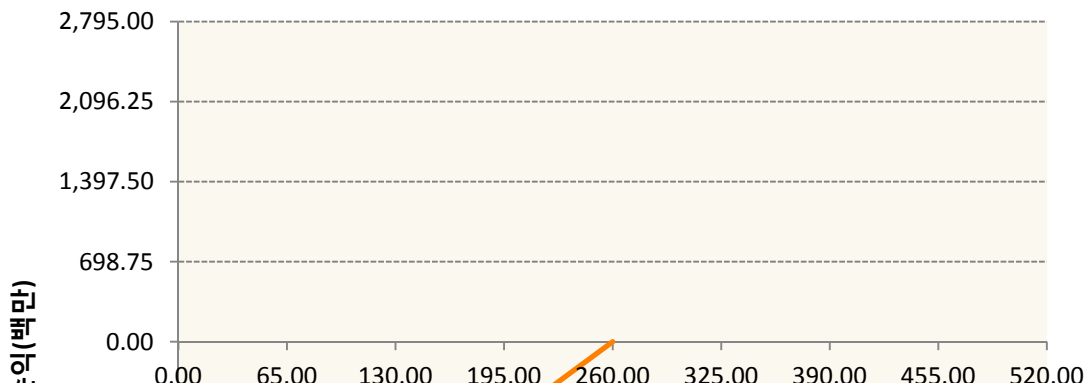
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	686	-686	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,976	-3,976	장내

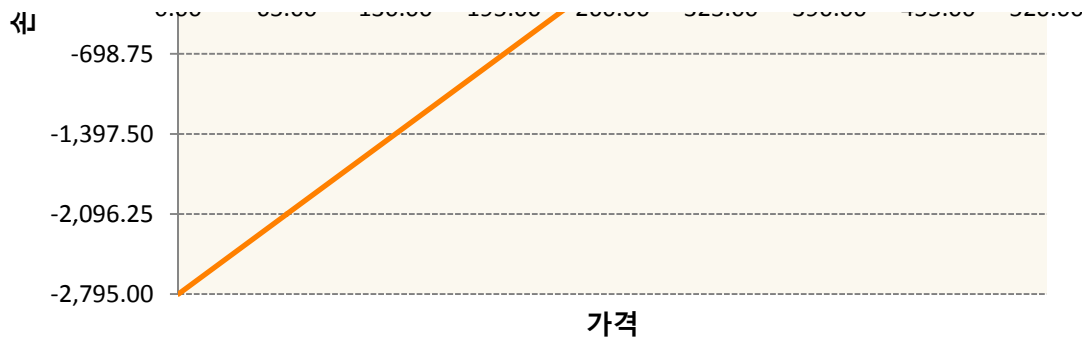
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

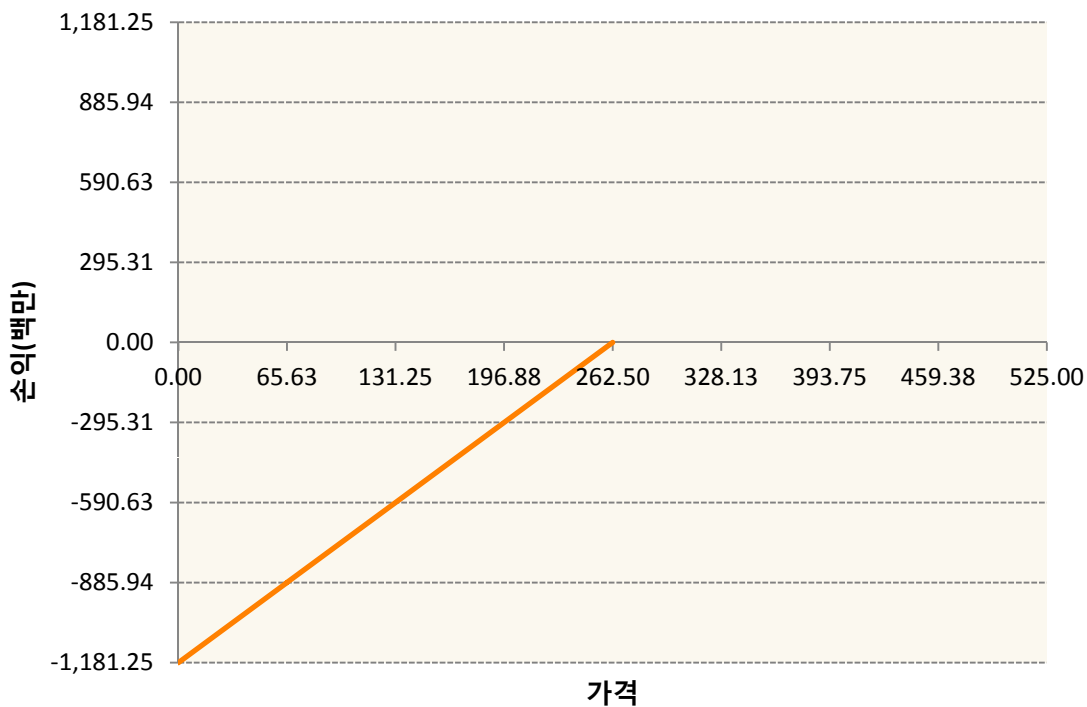


KR4301PB2601-2019-11 풋260





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%	-89	-91	-93	-95	-97	-99	-102
-5.33%	-32	-35	-38	-41	-45	-48	-51
-2.67%	-4	-6	-9	-11	-14	-17	-20
0%	3	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	3	3	3	3	3	2	1
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

KR4301PB2627

2019-11 풋262.5

51

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-47	-47	-48	-48	-49	-50	-51
-5.33%	-19	-20	-22	-23	-24	-26	-27
-2.67%	-3	-5	-6	-7	-8	-10	-11
0%	2	1	1	0	-1	-2	-2
2.67%	3	2	2	2	2	1	1
5.33%	3	3	3	3	2	2	2
8.00%	3	3	3	3	3	3	2

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

(단위:백만원)

144

공시일	2019-10-22
기준일	2019-10-21

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	16,543	0	16,543	
누계	통화	선도	0	16,127	-16,127	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		319
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		600
FX21019V01 KRW/USD 10-12-19E		371

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

(단위:백만원)

414

공시일	2019-10-22
기준일	2019-10-21

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	294	-177	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	2019-10-22
기준일	2019-10-21

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

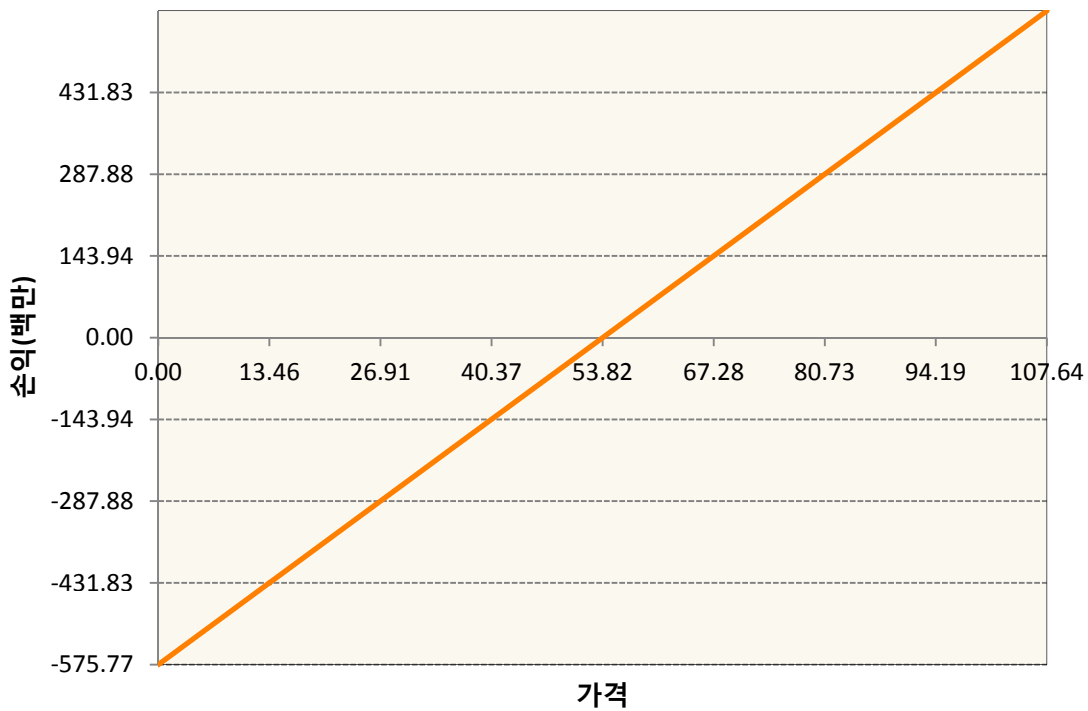
1. 계약금액

(단위:백만원)

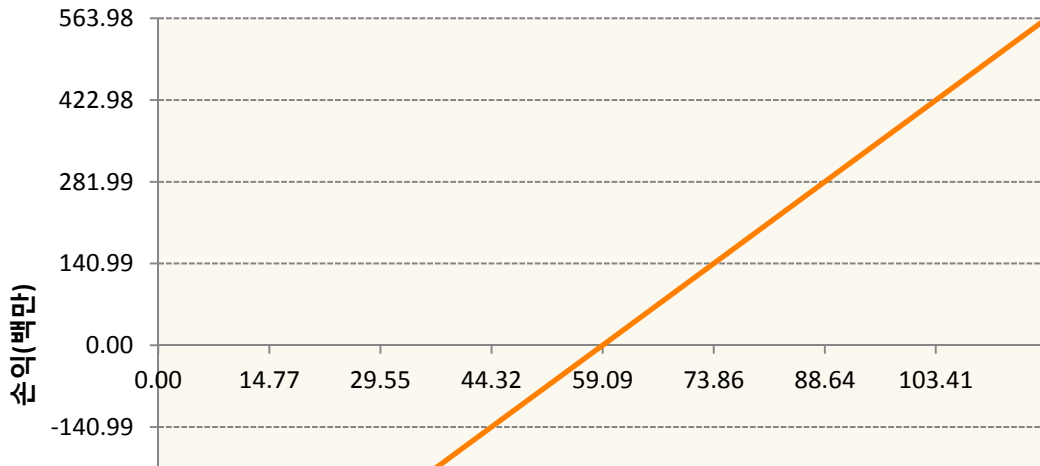
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,427	293	2,134	

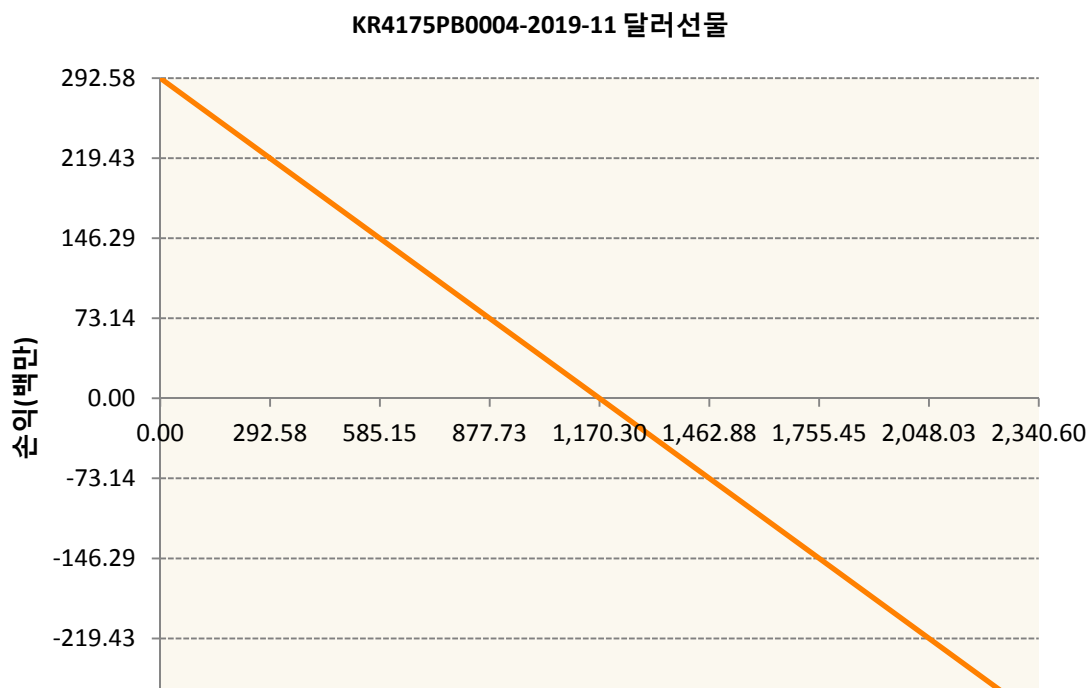
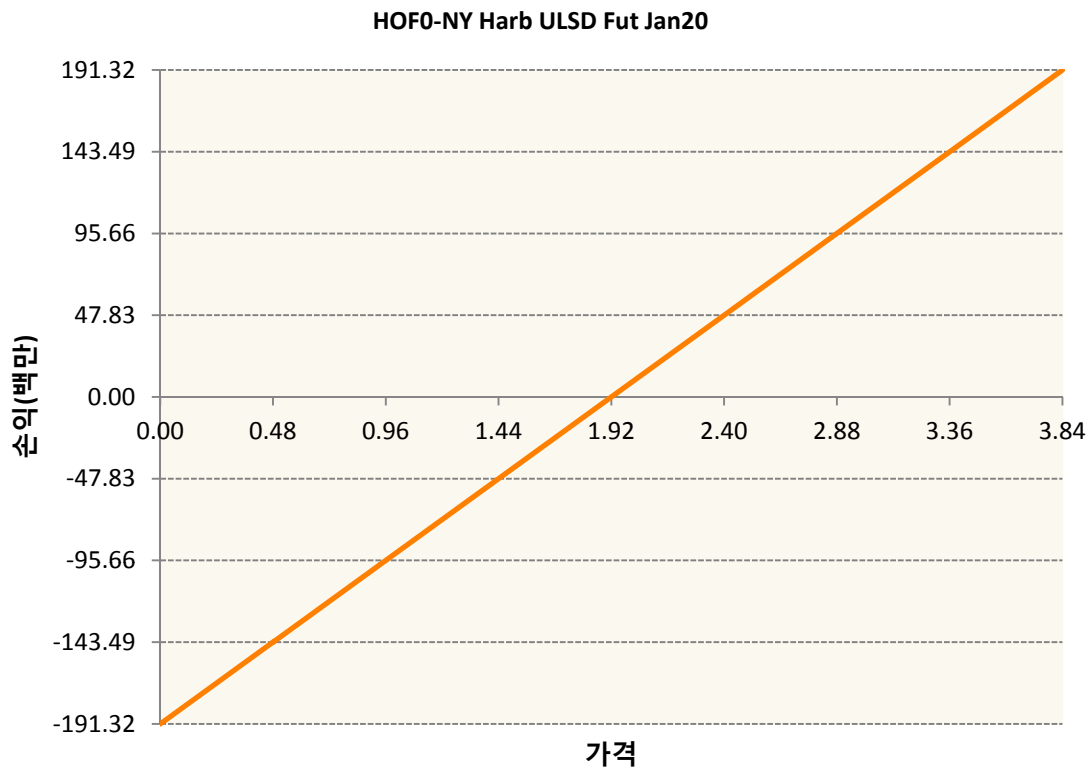
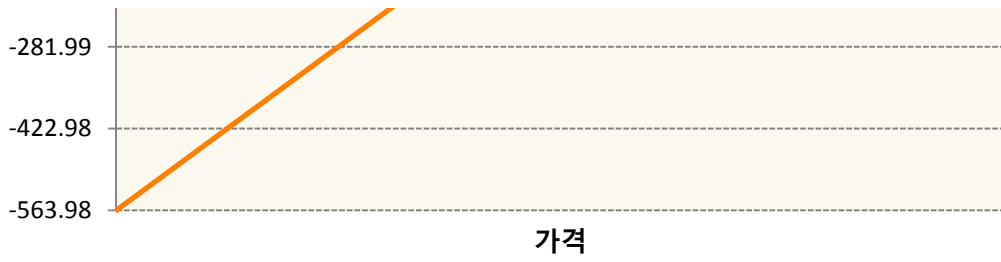
2. 만기시점의 손익구조

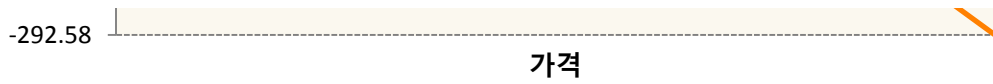
CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20



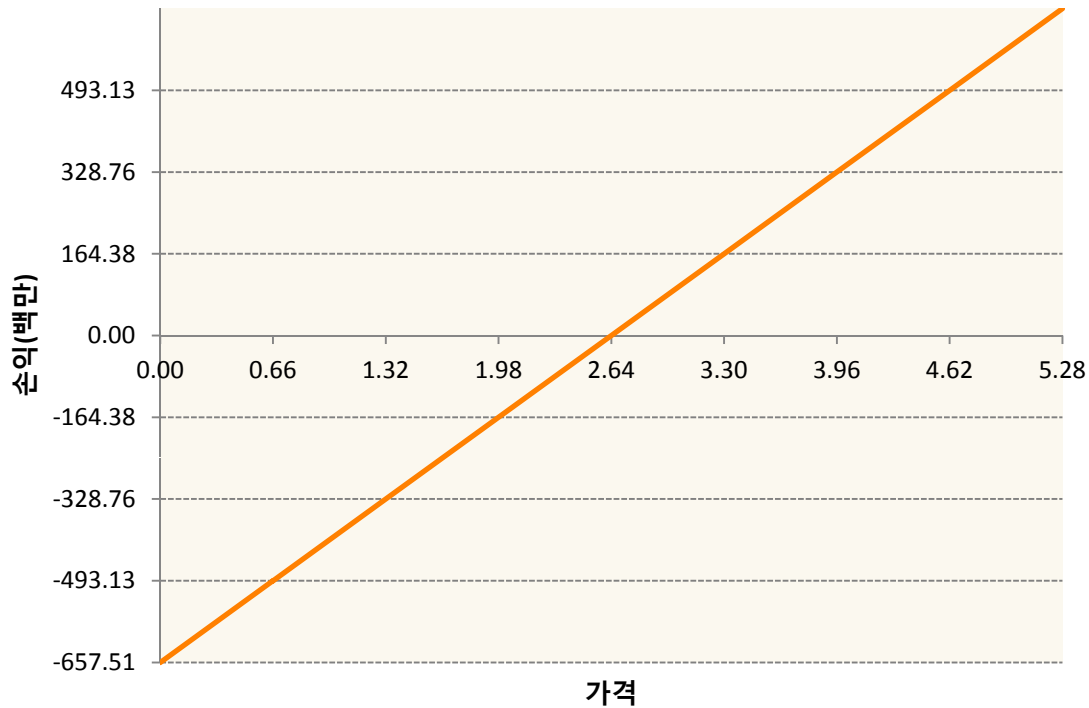
COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20



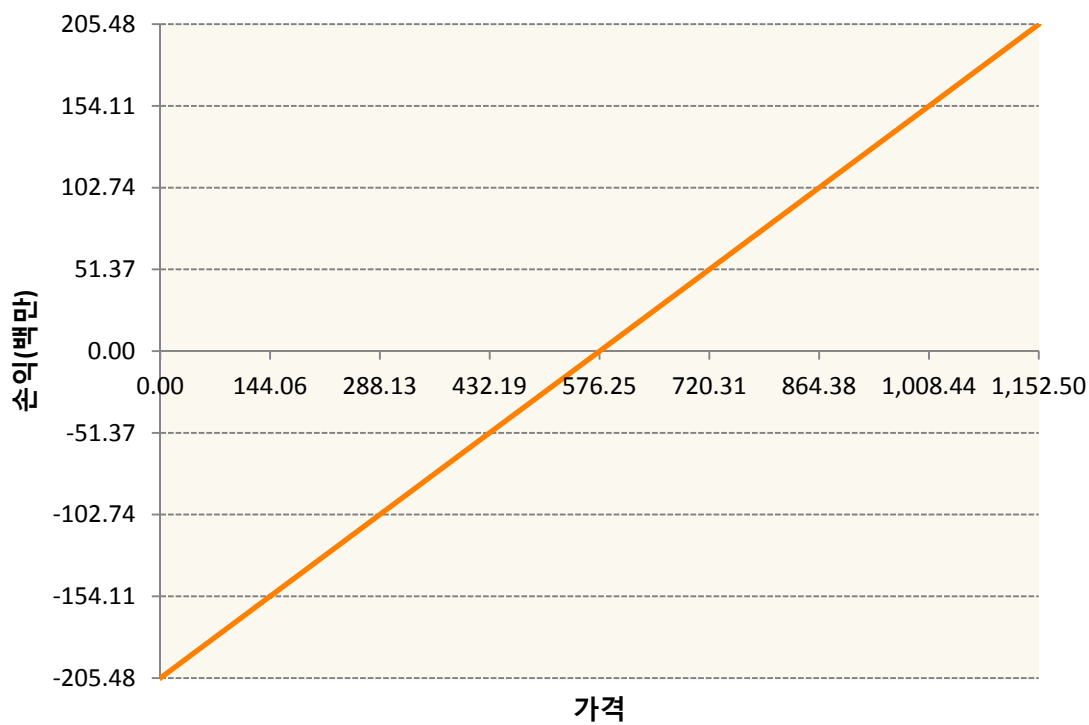




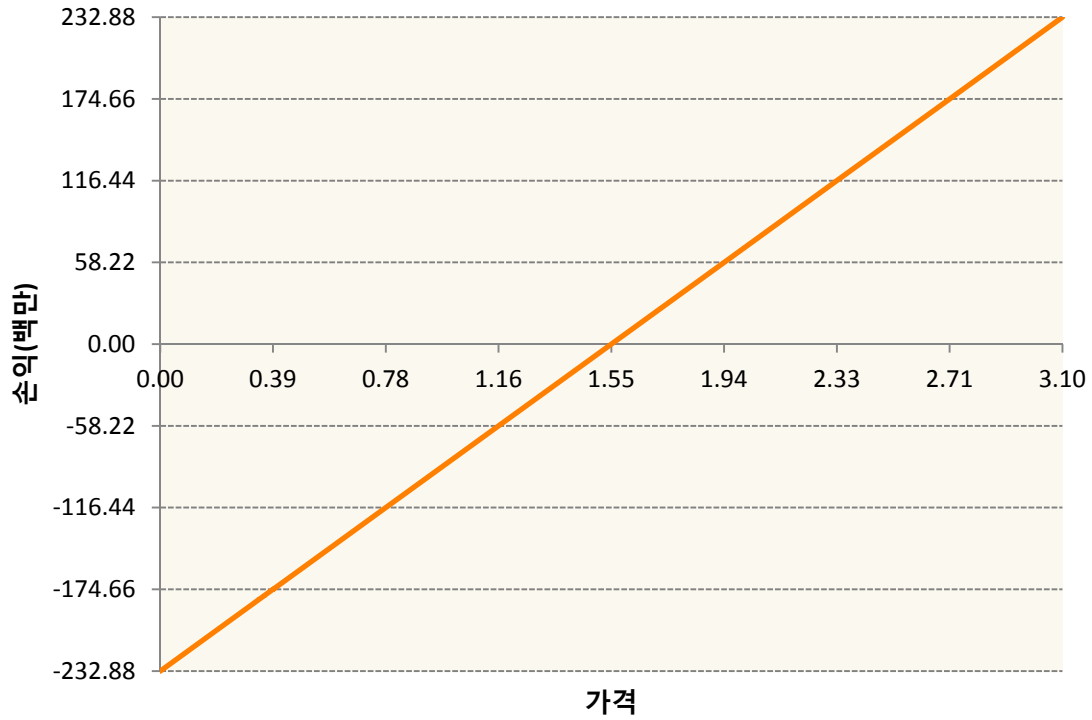
NGF20-NATURAL GAS FUTR Jan20



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
KR4175PB00	2019-11 달러선물	23
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)

404

공시일	2019-10-22
기준일	2019-10-21

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

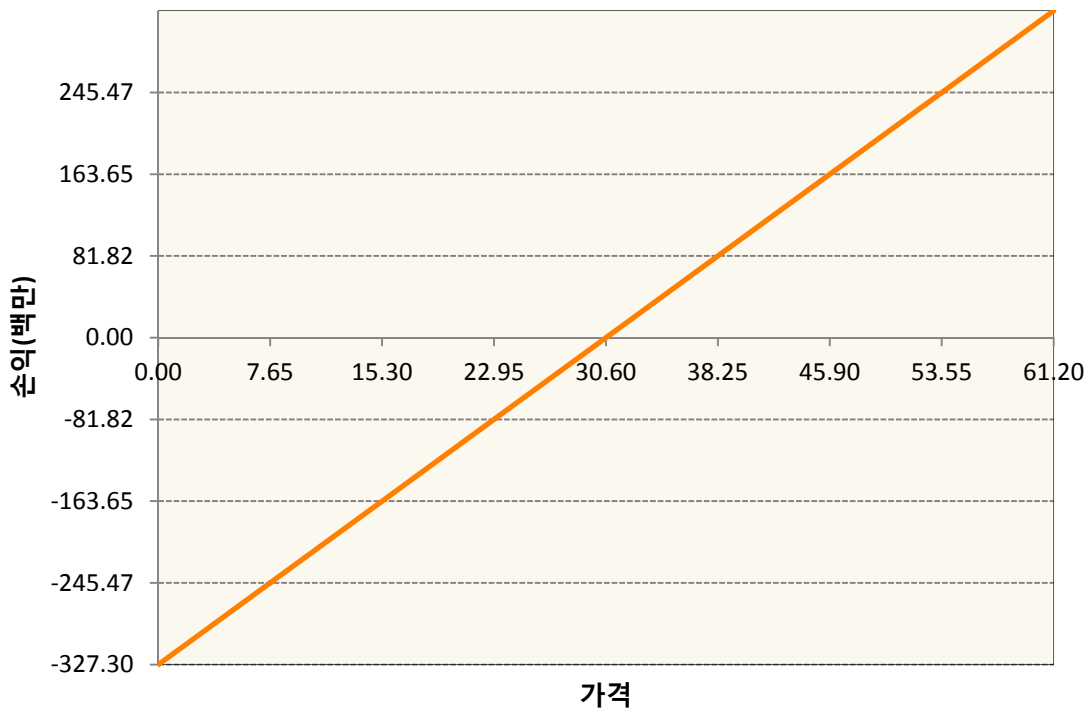
1. 계약금액

(단위:백만원)

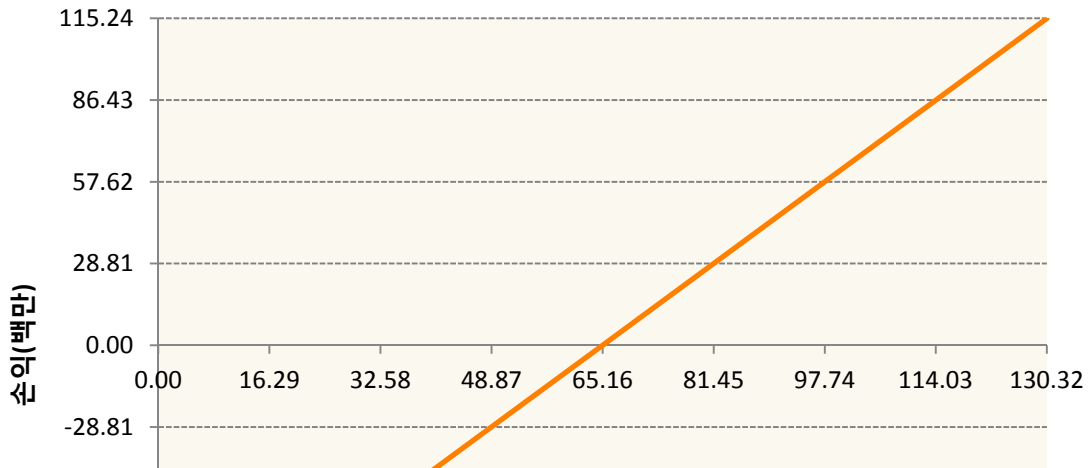
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,881	94	2,787	

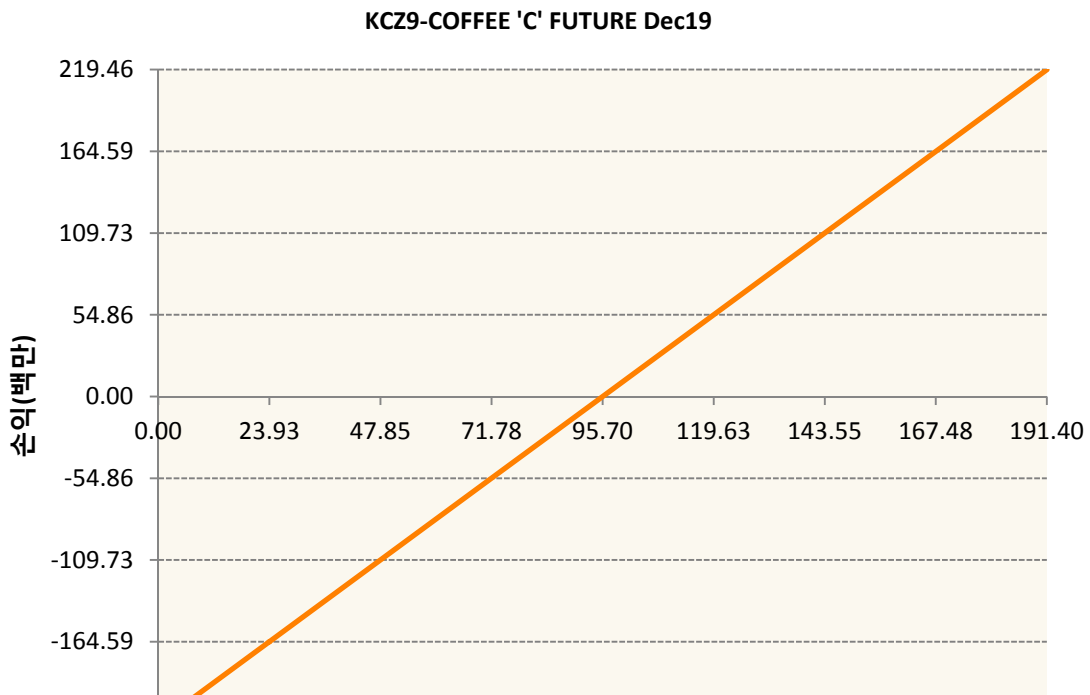
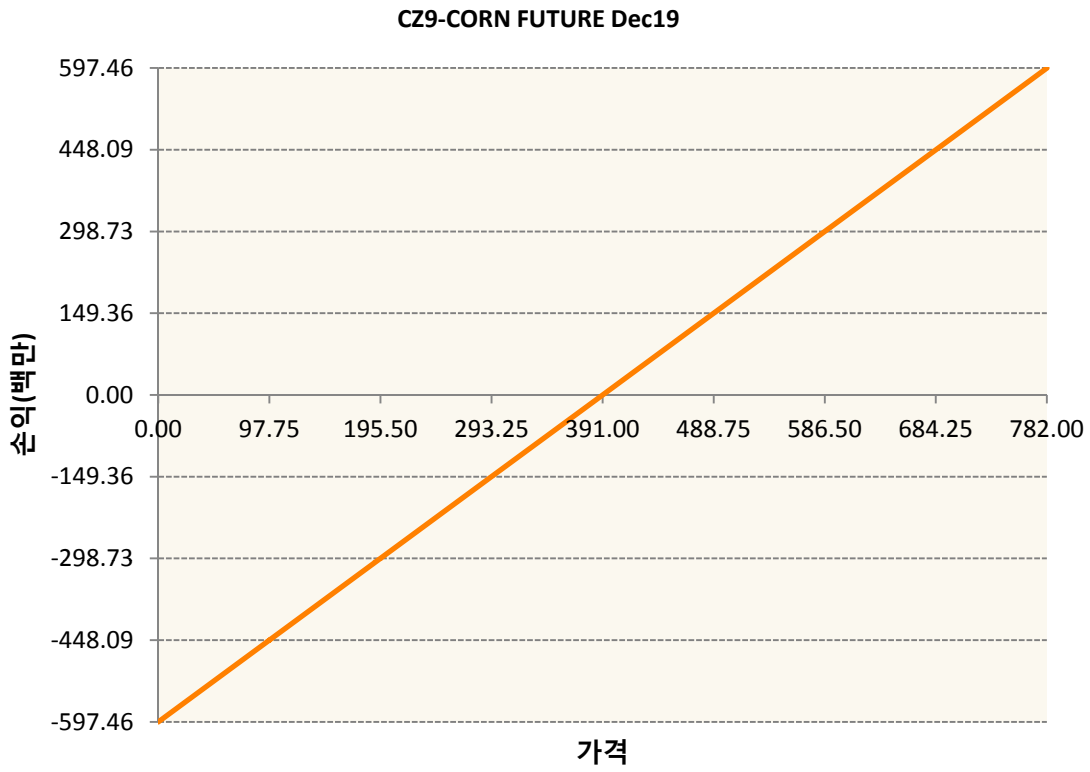
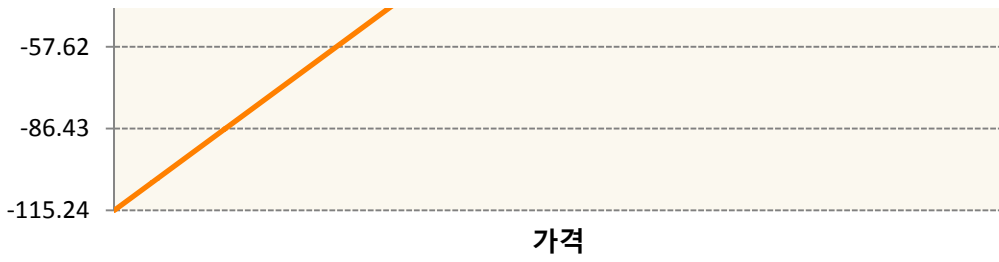
2. 만기시점의 손익구조

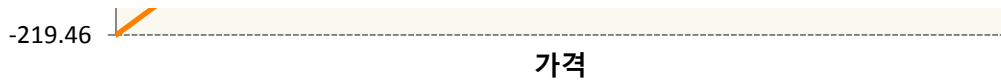
BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20



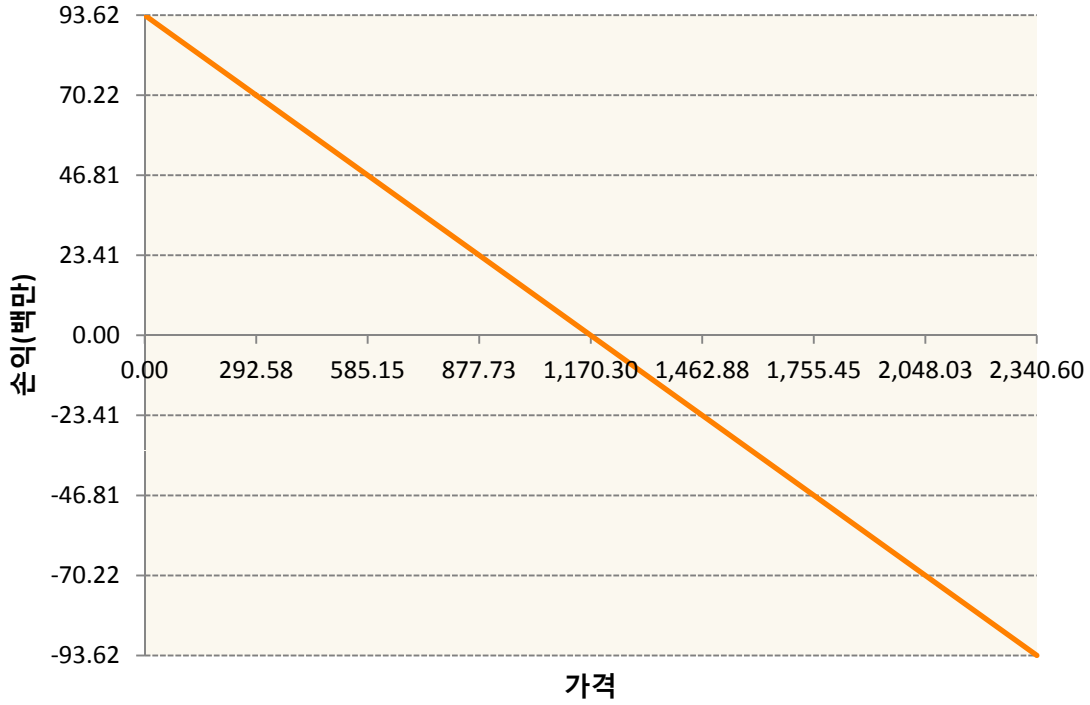
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



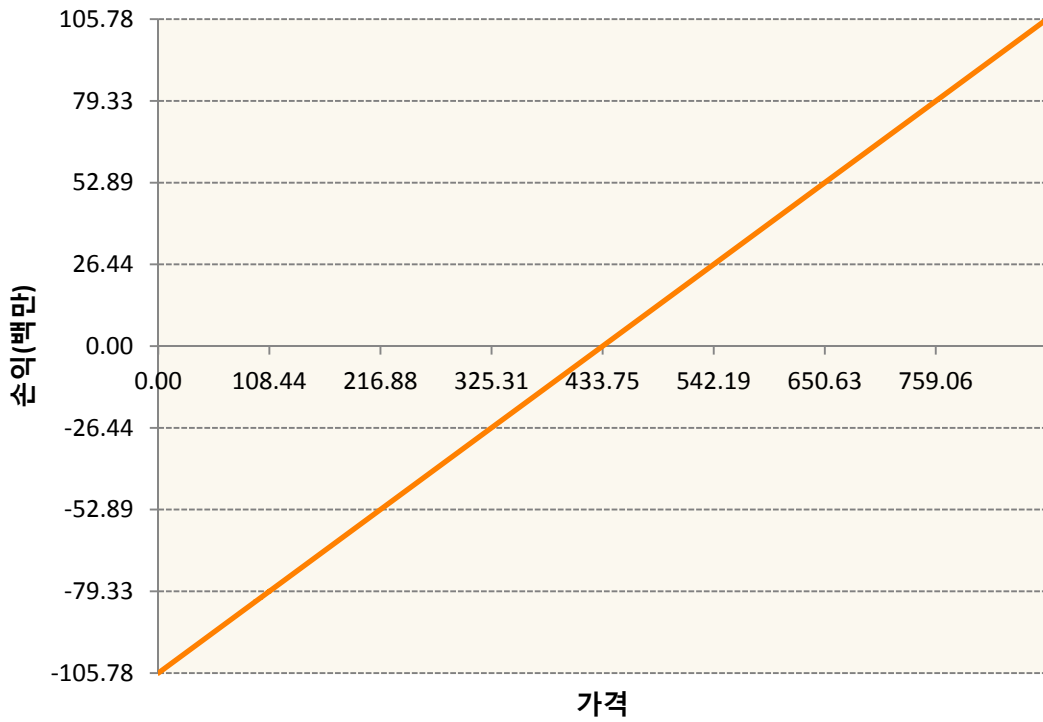




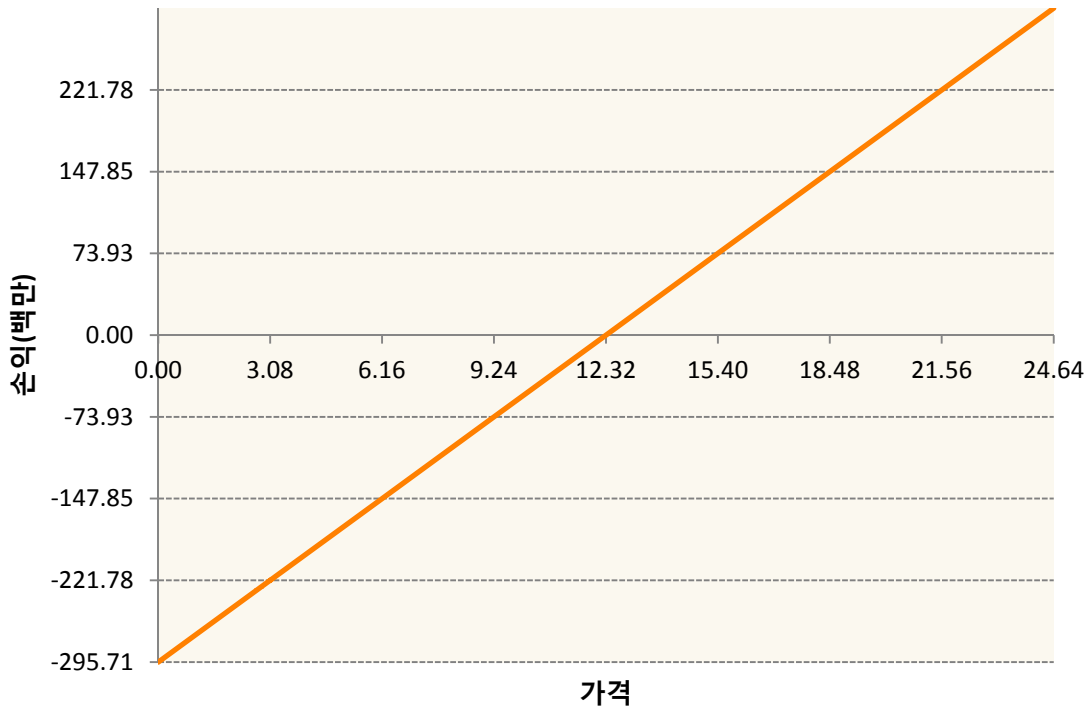
KR4175PB0004-2019-11 달러선물



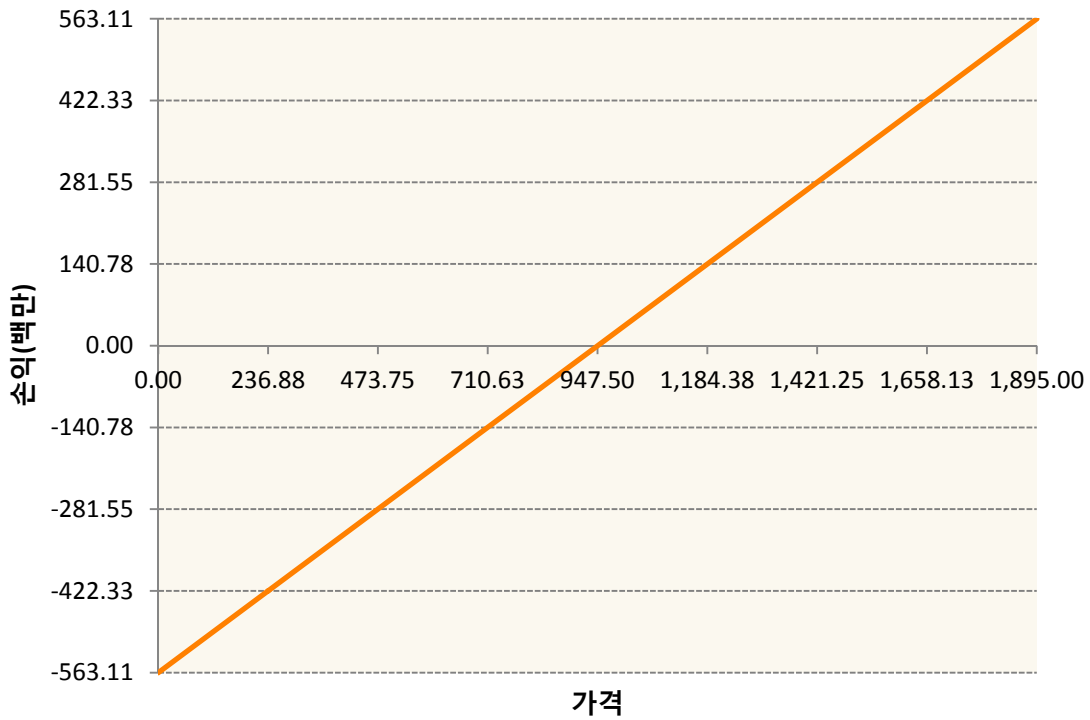
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



SBH0-Sugar Mar20

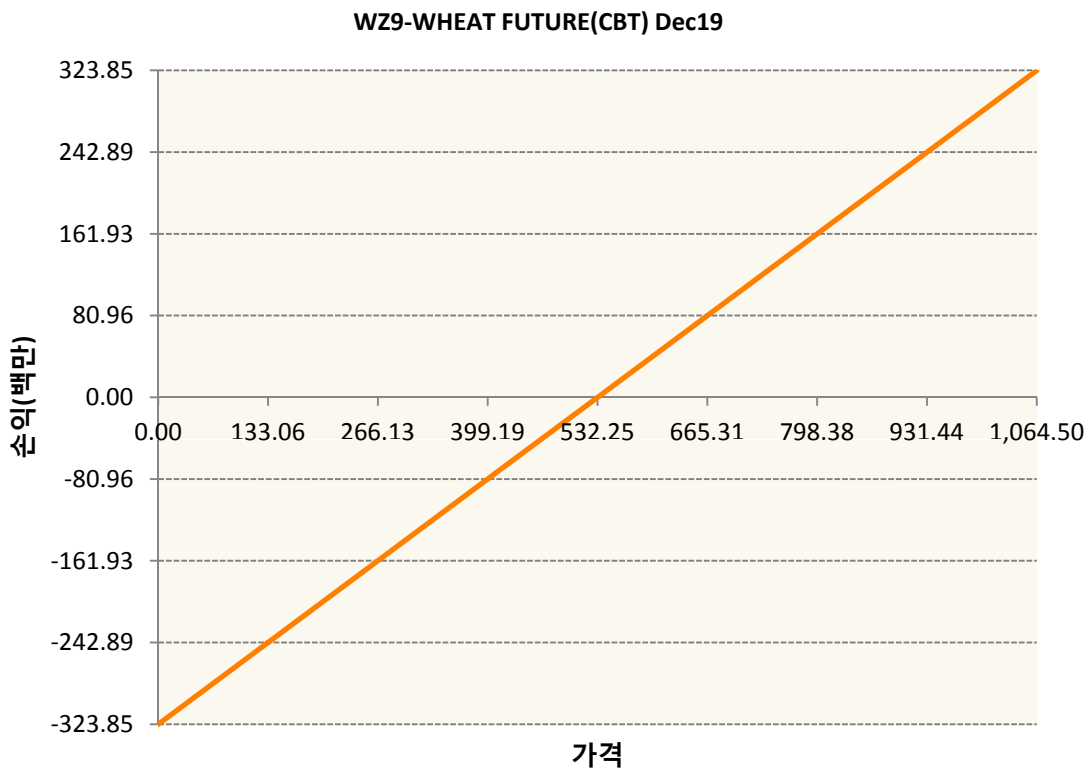
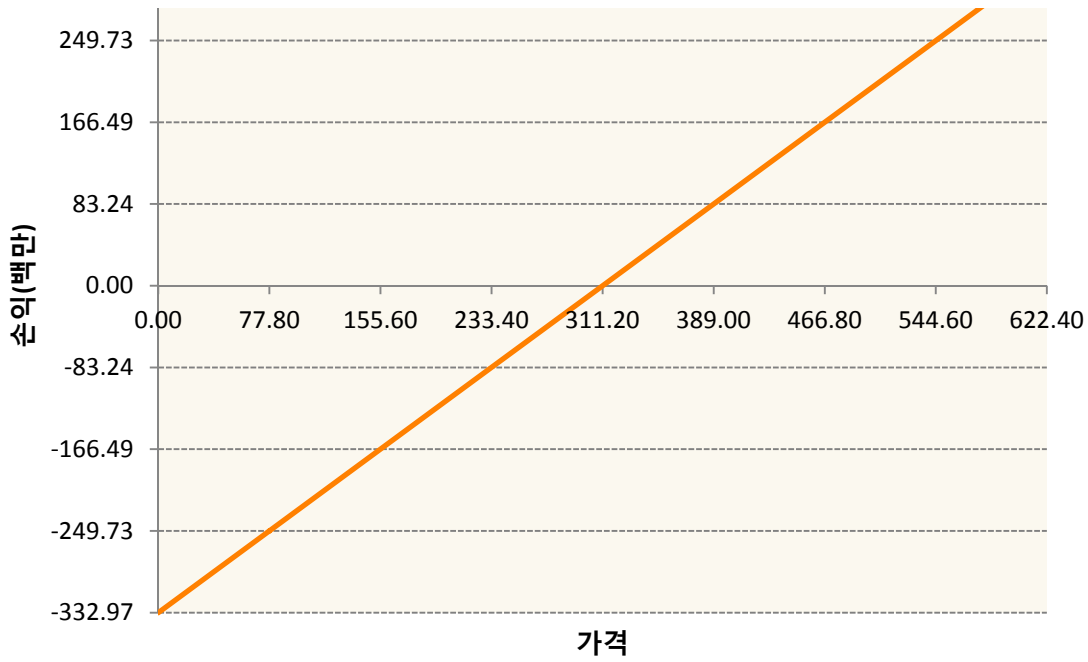


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20



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	18
KR4175PB00	2019-11 달러선물	7

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	26

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

(단위:백만원)

258