

공시일	2019-10-23
기준일	2019-10-22

## 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)

87

공시일	2019-10-23
기준일	2019-10-22

## 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

1,187

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

690

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-10-23
기준일	2019-10-22

## 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)	382
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	140

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

791

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-10-23
기준일	2019-10-22

## 유로인덱스모(주식-파생형)

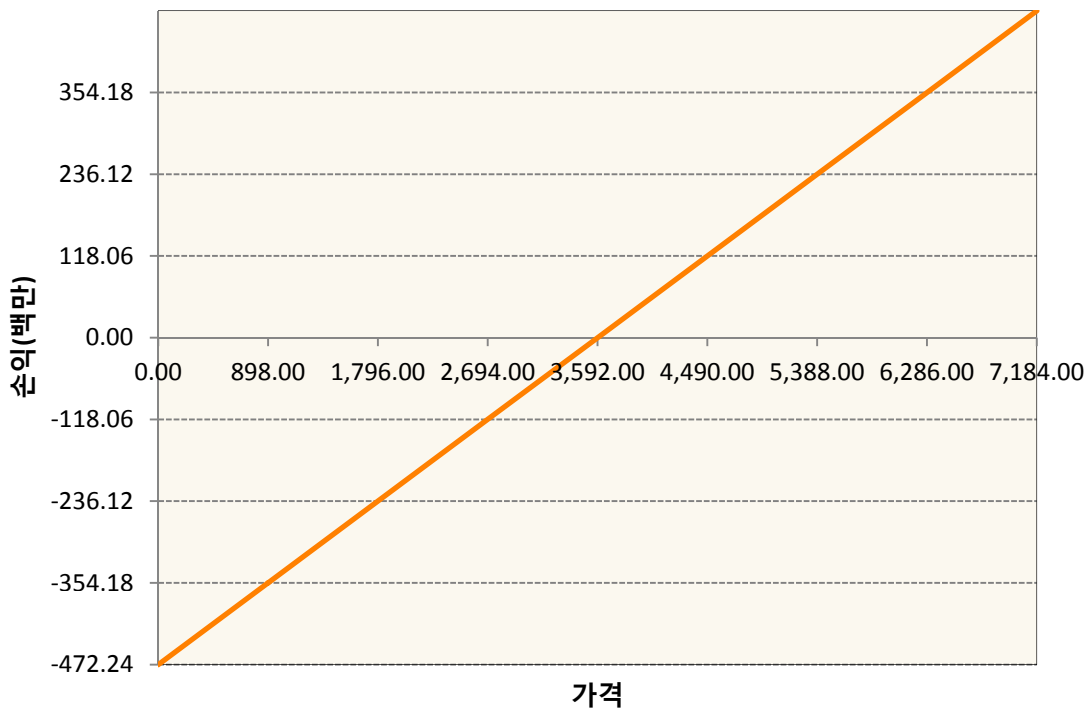
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	472	0	472	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGZ9-EURO STOXX 50 Dec19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	38
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

27
----

공시일	2019-10-23
기준일	2019-10-22

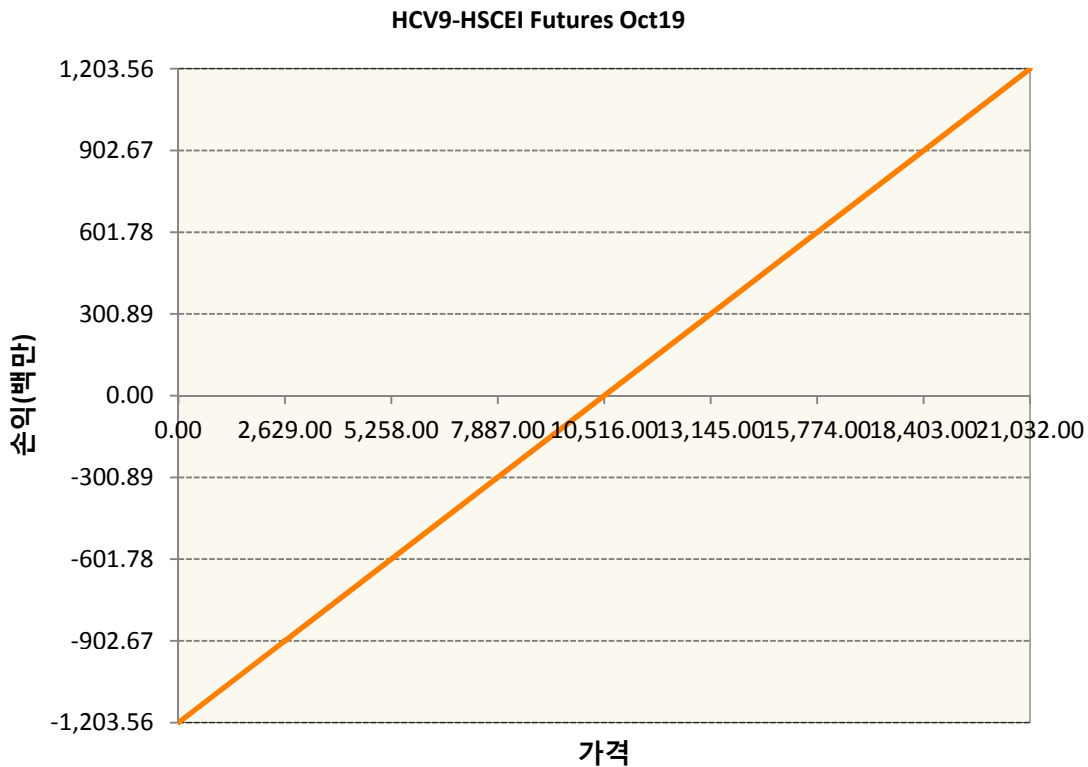
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,204	0	1,204	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV9	HSCEI Futures Oct19	96
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

86
----

공시일	2019-10-23
기준일	2019-10-22

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

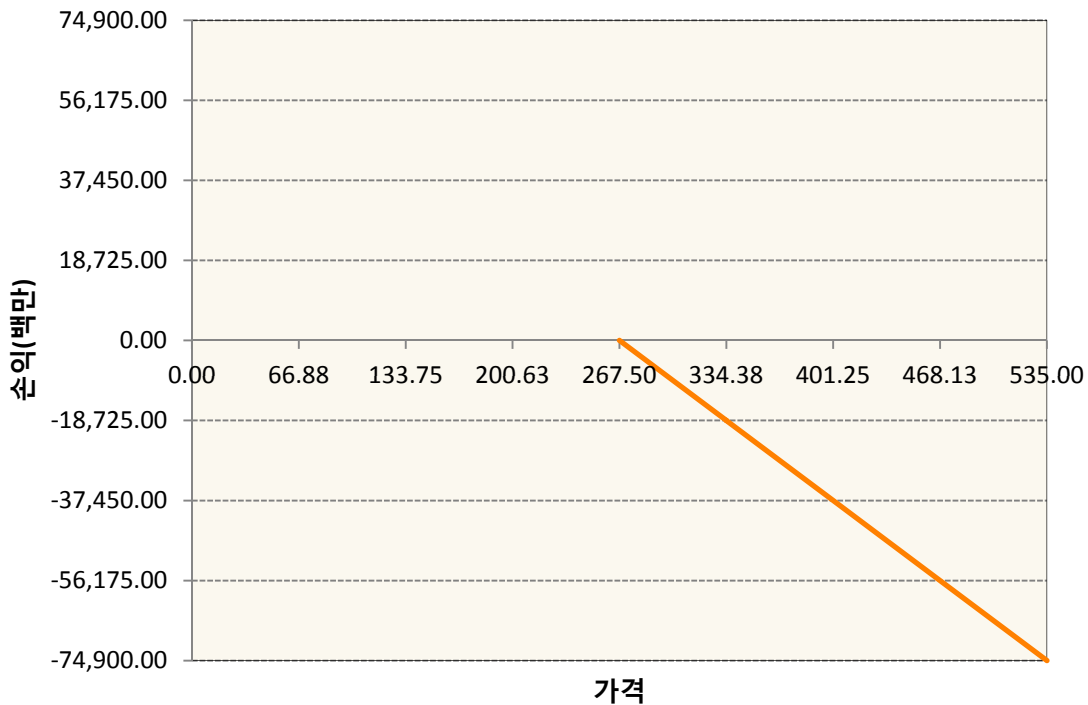
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

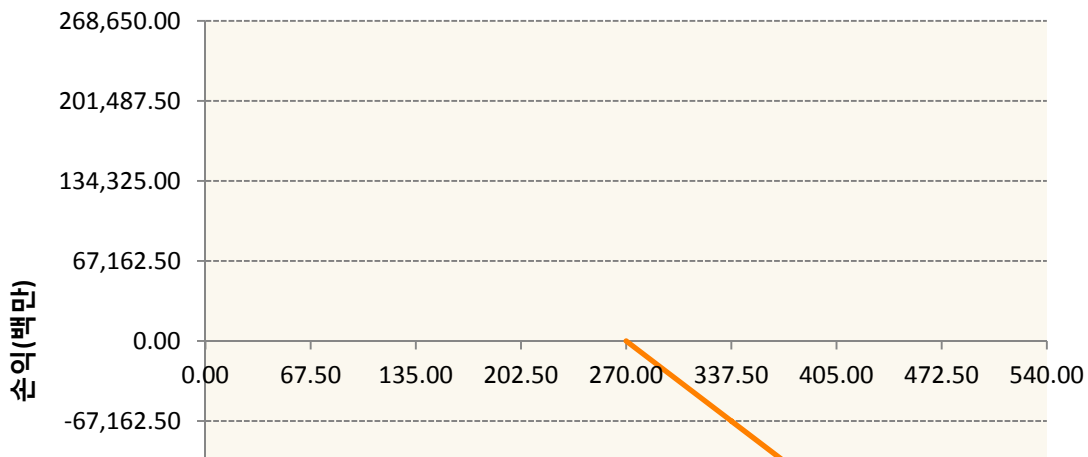
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	6,669	0	6,669	장내
누계	유가증권	옵션	0	504,050	-504,050	장내

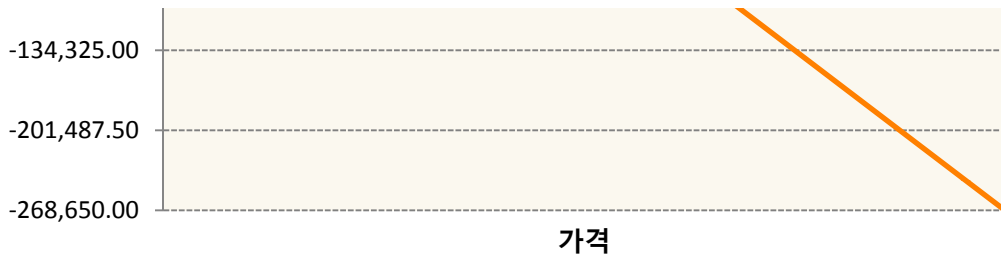
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201PB2677-2019-11 콜267.5**

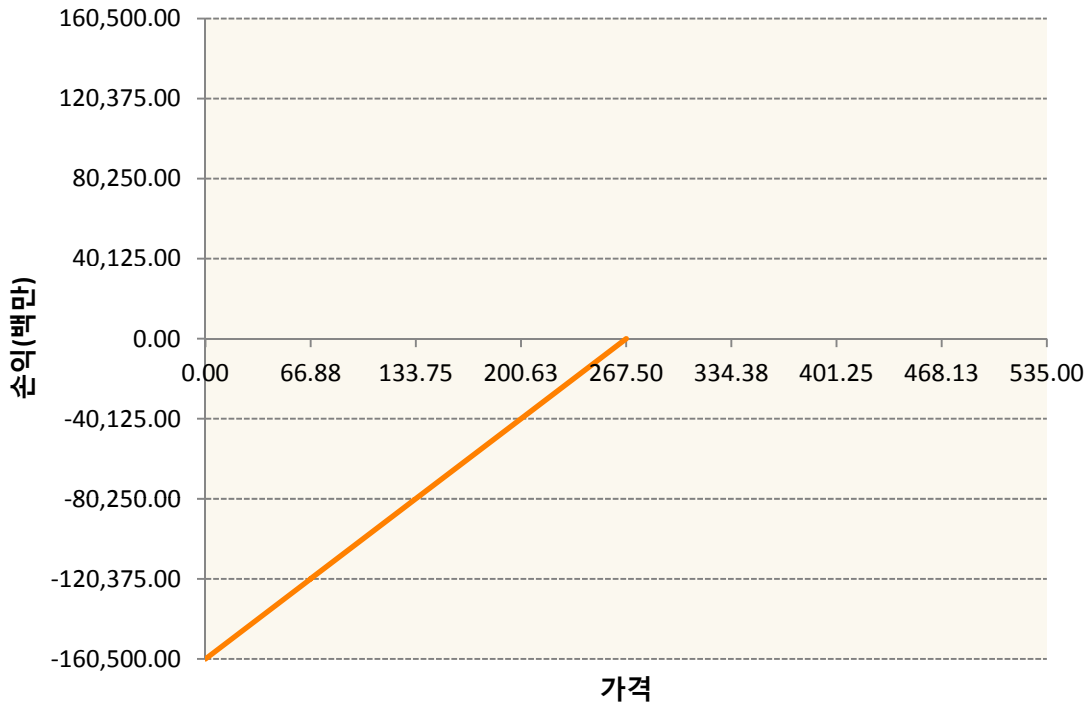


**KR4201PB2701-2019-11 콜270**





KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PB2677		2019-11 콜267.5					5,510	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,365	3,252	3,131	3,004	2,871	2,734	2,593	
-5.33%	2,807	2,649	2,489	2,327	2,165	2,001	1,838	
-2.67%	1,831	1,663	1,494	1,325	1,155	986	816	
0%	432	293	149	0	-152	-307	-465	
2.67%	-1,294	-1,385	-1,487	-1,598	-1,718	-1,844	-1,976	
5.33%	-3,218	-3,265	-3,326	-3,398	-3,481	-3,573	-3,674	
8.00%	-5,235	-5,256	-5,286	-5,327	-5,378	-5,439	-5,510	
KR4201PB2701		2019-11 콜270					19,018	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	10,677	10,336	9,959	9,553	9,123	8,672	8,205	

-5.33%	9,105	8,581	8,043	7,496	6,941	6,379	5,813
-2.67%	6,156	5,547	4,937	4,328	3,719	3,110	2,500
0%	1,676	1,128	569	0	-576	-1,158	-1,744
2.67%	-4,103	-4,490	-4,914	-5,365	-5,840	-6,333	-6,843
5.33%	-10,736	-10,956	-11,224	-11,533	-11,877	-12,253	-12,656
8.00%	-17,813	-17,916	-18,060	-18,244	-18,466	-18,725	-19,018
KR4301PB2676 2019-11 풋267.5							7,462
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,116	-7,147	-7,190	-7,243	-7,307	-7,380	-7,462
-5.33%	-3,133	-3,265	-3,402	-3,546	-3,693	-3,843	-3,996
-2.67%	-596	-761	-927	-1,095	-1,263	-1,433	-1,603
0%	239	172	91	0	-101	-211	-328
2.67%	358	348	331	306	273	230	179
5.33%	365	364	362	359	353	342	327
8.00%	365	365	365	364	364	362	359

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

(단위:백만원)

30,543

공시일	2019-10-23
기준일	2019-10-22

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

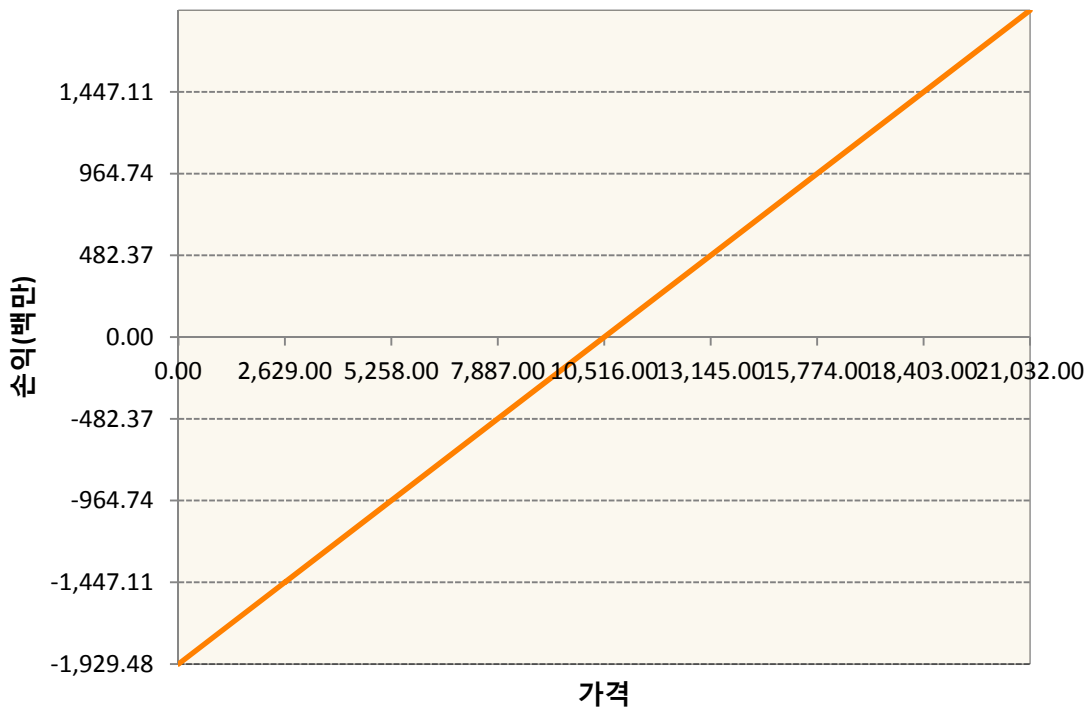
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

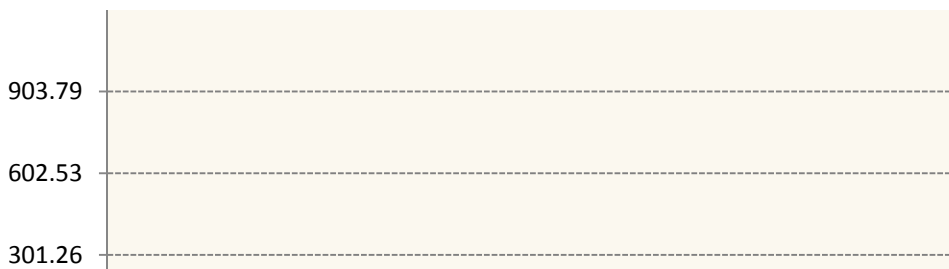
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,929	0	1,929	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,844	-4,844	장내
누계	통화	선도	671	2,771	-2,100	장외

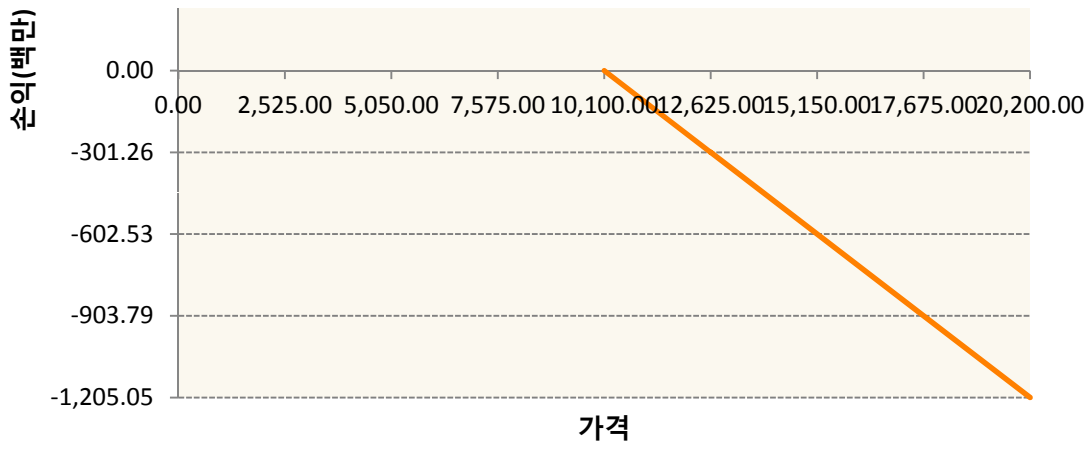
### 2. 만기시점의 손익구조

HCV9-HSCEI Futures Oct19

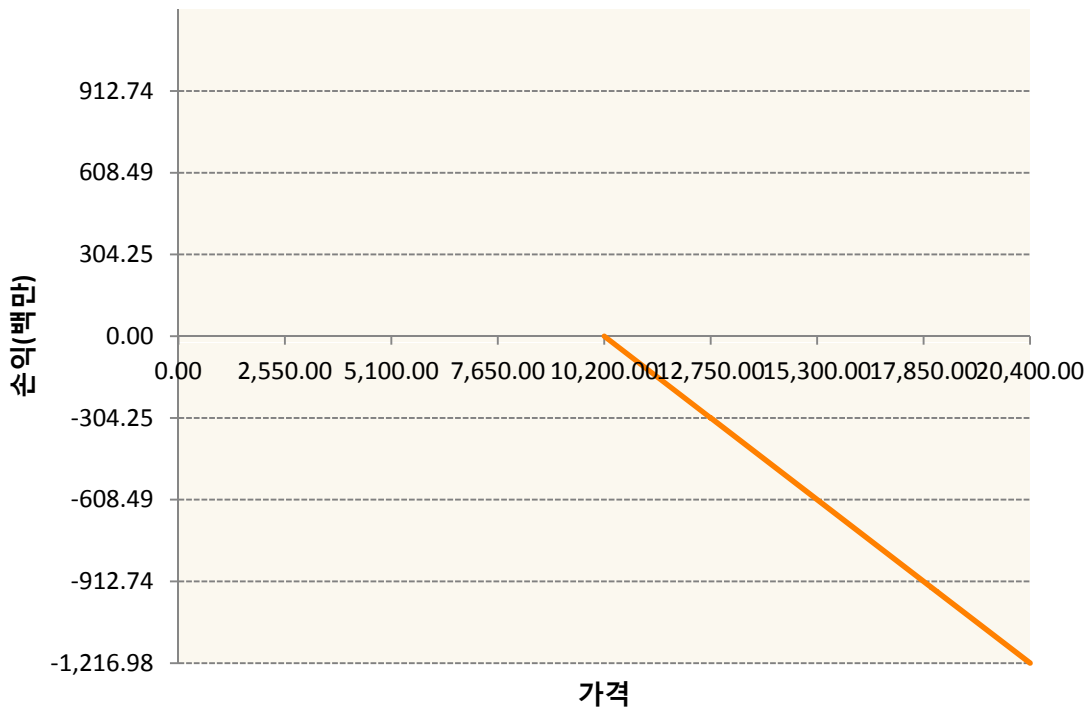


OHHIV9-C101-HSCEI

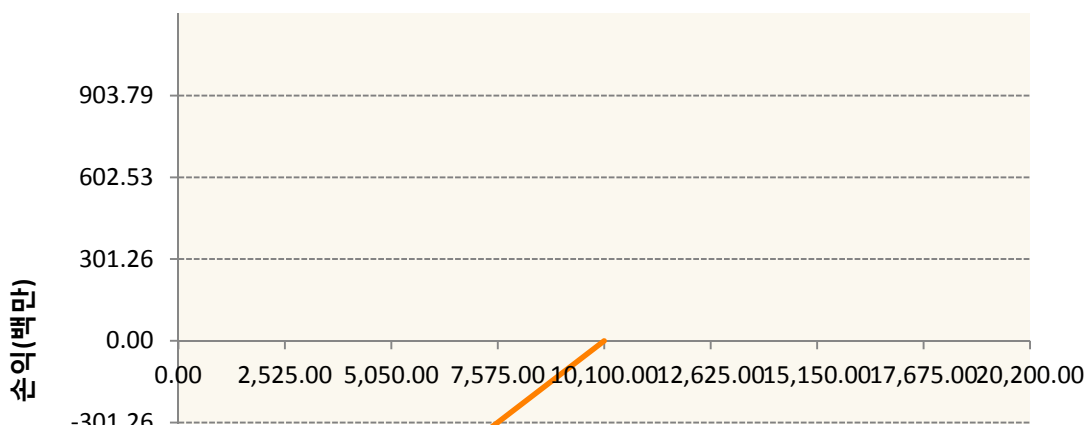


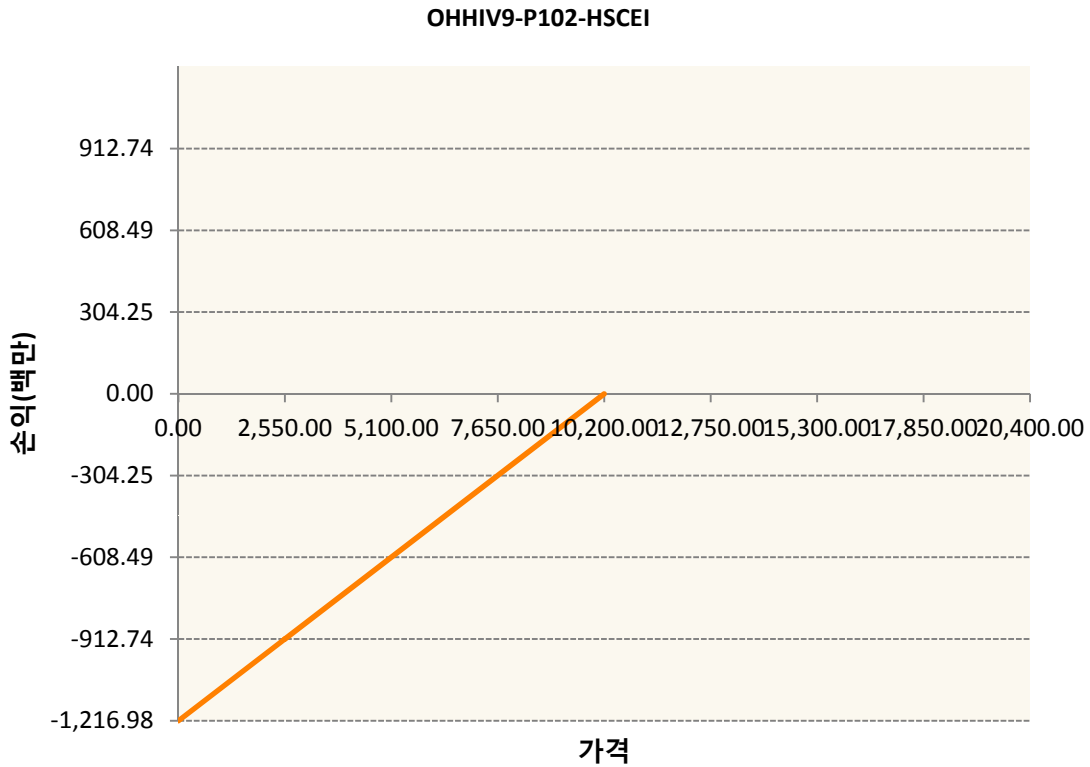


OHHIV9-C102-HSCEI



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	154
OHHIV9-C1C HSCEI	96
OHHIV9-C1C HSCEI	97
OHHIV9-P1C HSCEI	96
OHHIV9-P1C HSCEI	97

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	<b>572</b>

공시일	2019-10-23
기준일	2019-10-22

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

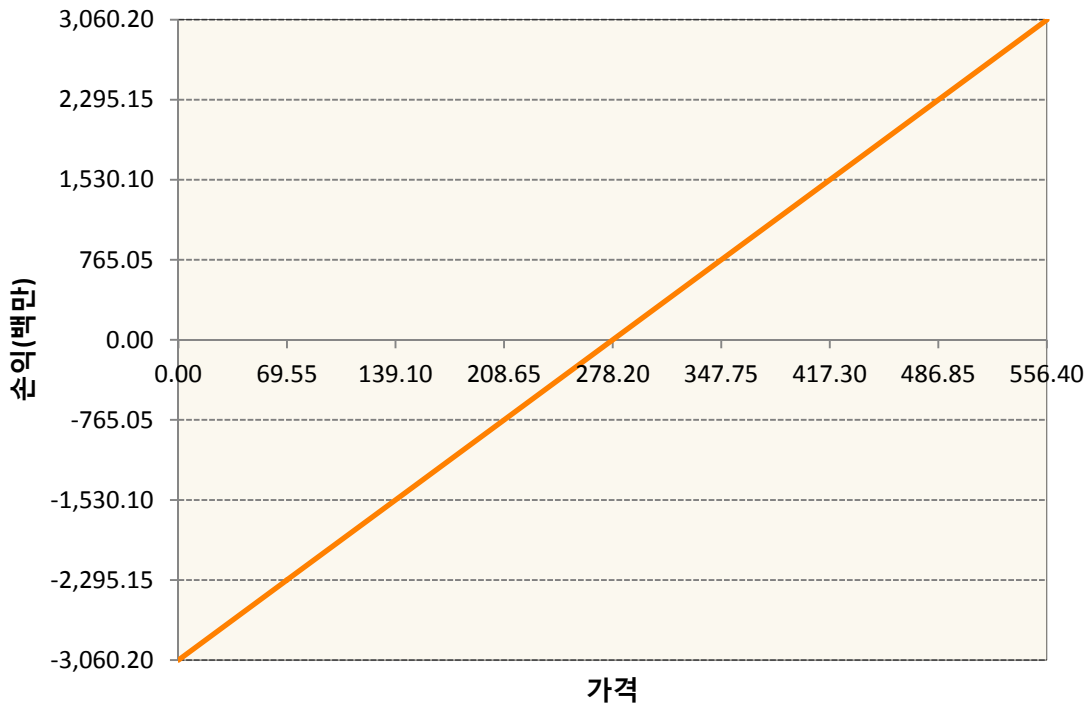
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

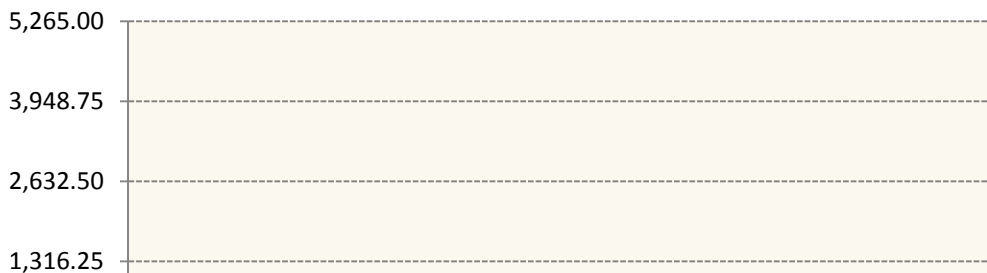
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,060	0	3,060	장내
누계	유가증권	스왑	10,625	0	10,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	10,483	-10,483	장내

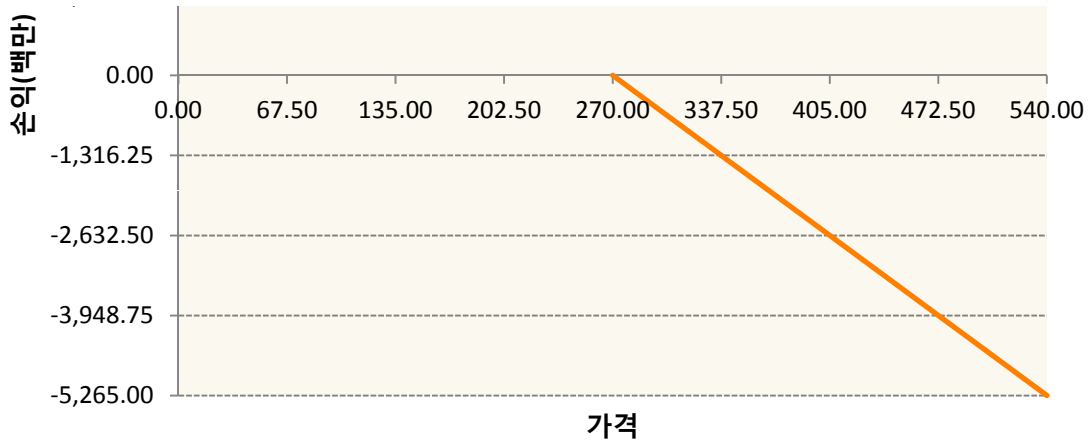
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

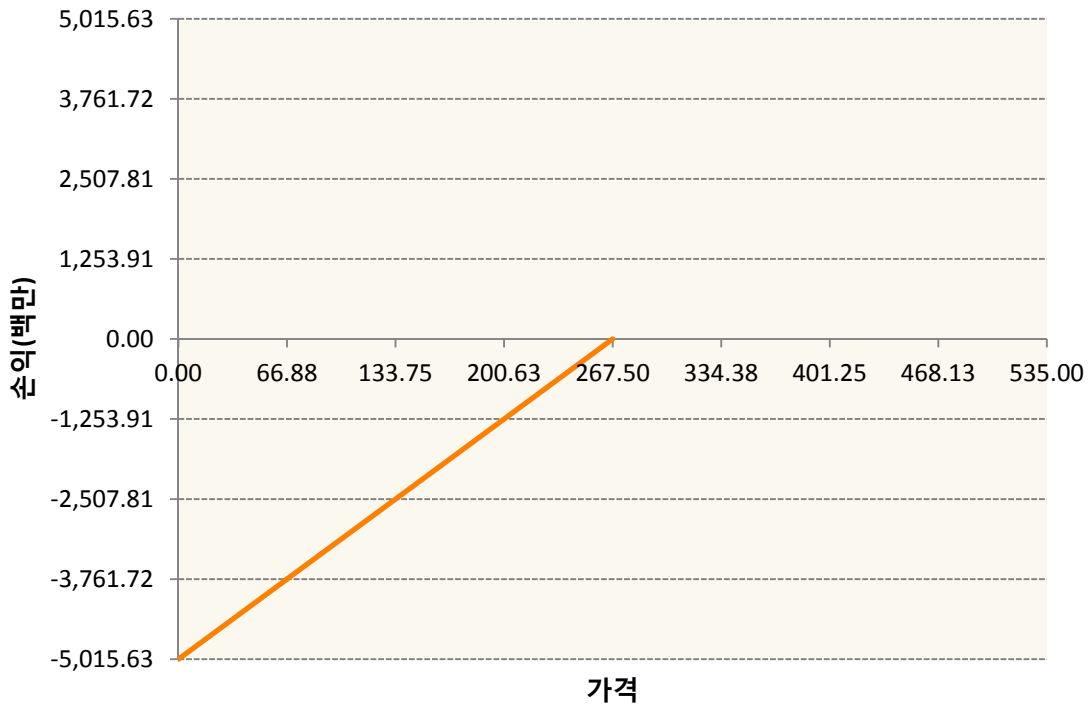


KR4201PB2701-2019-11 콜270

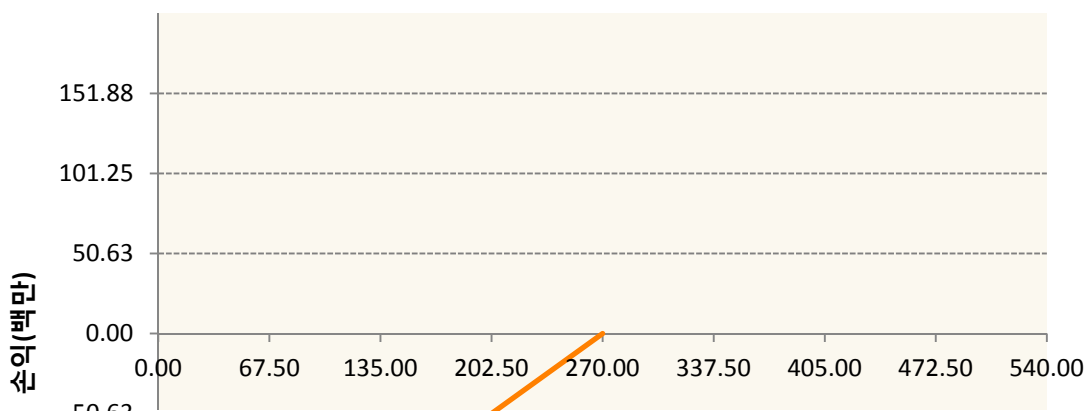




**KR4301PB2676-2019-11 풋267.5**



**KR4301PB2700-2019-11 풋270**





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						912
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-912	-912	-912	-912	-912	-912	-912	
-5.33%	-608	-608	-608	-608	-608	-608	-608	
-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%	608	608	608	608	608	608	608	
8.00%	912	912	912	912	912	912	912	
KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						244
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-244	-244	-244	-244	-244	-244	-244	
-5.33%	-163	-163	-163	-163	-163	-163	-163	
-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%	163	163	163	163	163	163	163	
8.00%	244	244	244	244	244	244	244	
KR4201PB2701		2019-11 콜270						373
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	209	203	195	187	179	170	161	
-5.33%	178	168	158	147	136	125	114	
-2.67%	121	109	97	85	73	61	49	
0%	33	22	11	0	-11	-23	-34	
2.67%	-80	-88	-96	-105	-114	-124	-134	
5.33%	-210	-215	-220	-226	-233	-240	-248	
8.00%	-349	-351	-354	-358	-362	-367	-373	
KR4301PB2676		2019-11 풋267.5						233
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-222	-223	-225	-226	-228	-231	-233
-5.33%	-98	-102	-106	-111	-115	-120	-125
-2.67%	-19	-24	-29	-34	-39	-45	-50
0%	7	5	3	0	-3	-7	-10
2.67%	11	11	10	10	9	7	6
5.33%	11	11	11	11	11	11	10
8.00%	11	11	11	11	11	11	11
KR4301PB2700                      2019-11 풋270							11
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10	-10	-10	-11	-11	-11	-11
-5.33%	-5	-5	-5	-6	-6	-6	-6
-2.67%	-1	-1	-2	-2	-2	-2	-3
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	1	1	1	1	1	0	0
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)

**1,680**

공시일	2019-10-23
기준일	2019-10-22

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

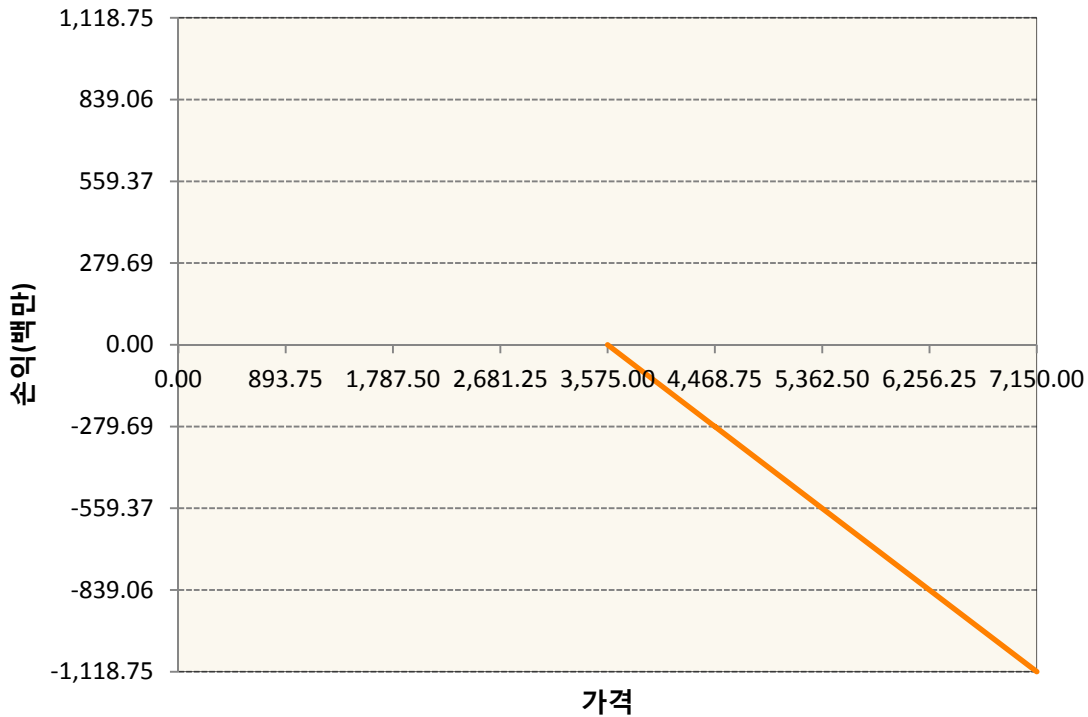
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

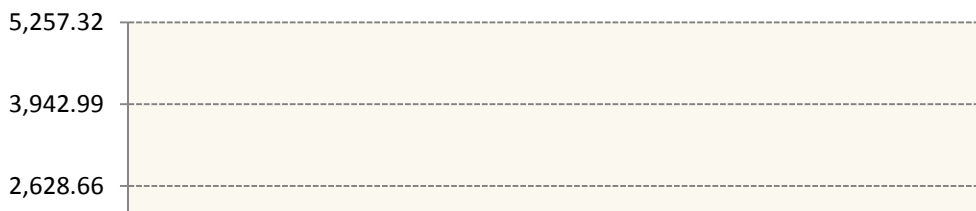
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,492	0	3,492	
누계	유가증권	스왑	23,807	0	23,807	장외
누계	유가증권	옵션	0	12,752	-12,752	장내
누계	통화	선도	0	6,128	-6,128	장외

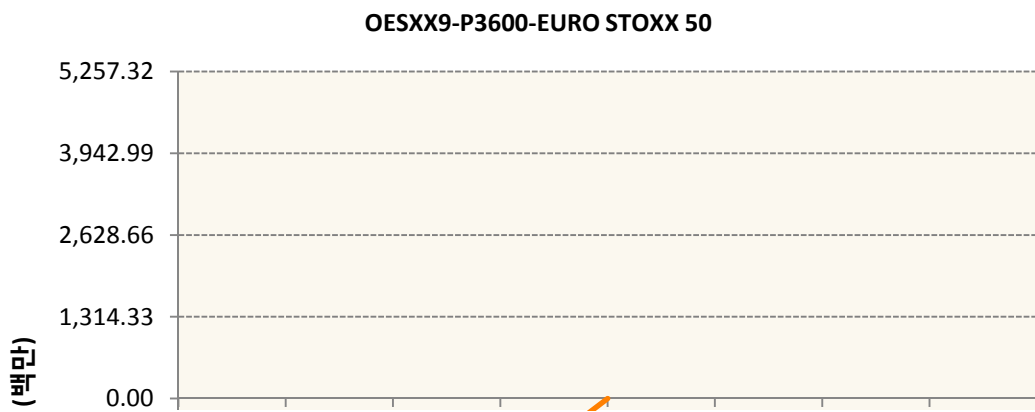
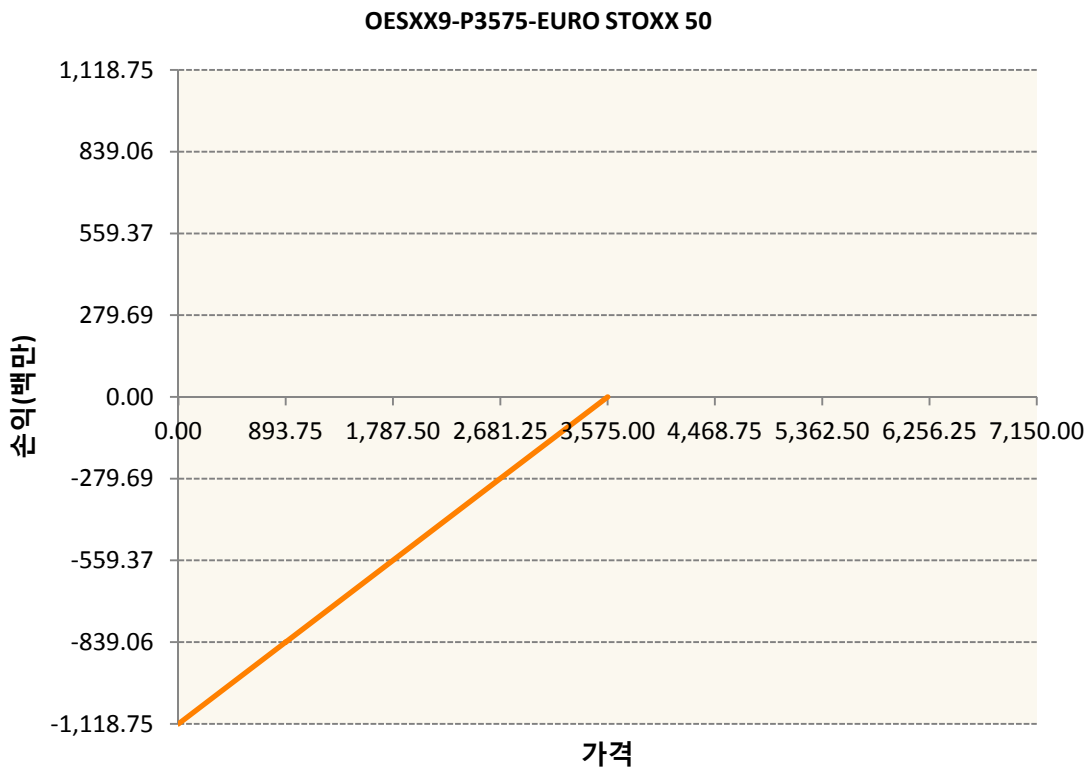
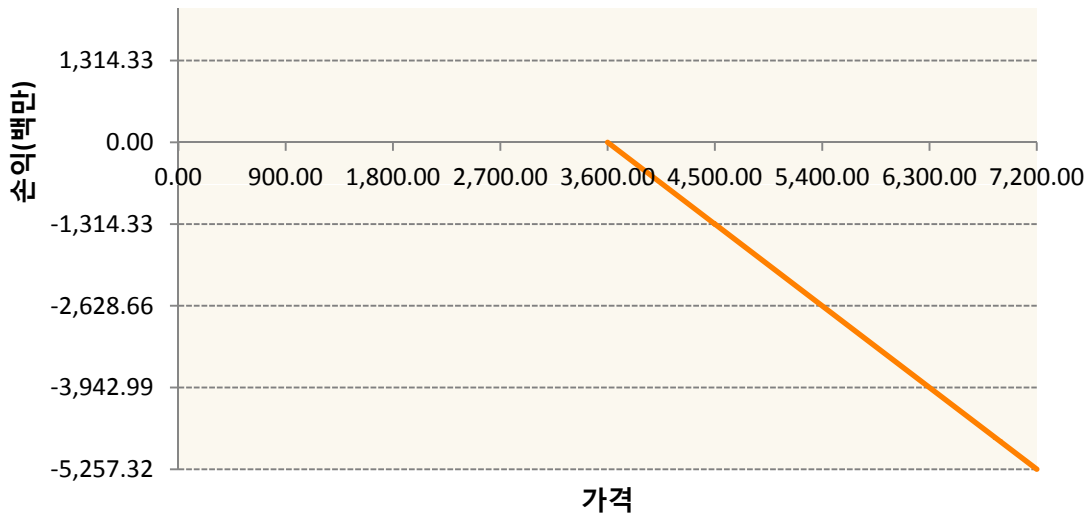
### 2. 만기시점의 손익구조

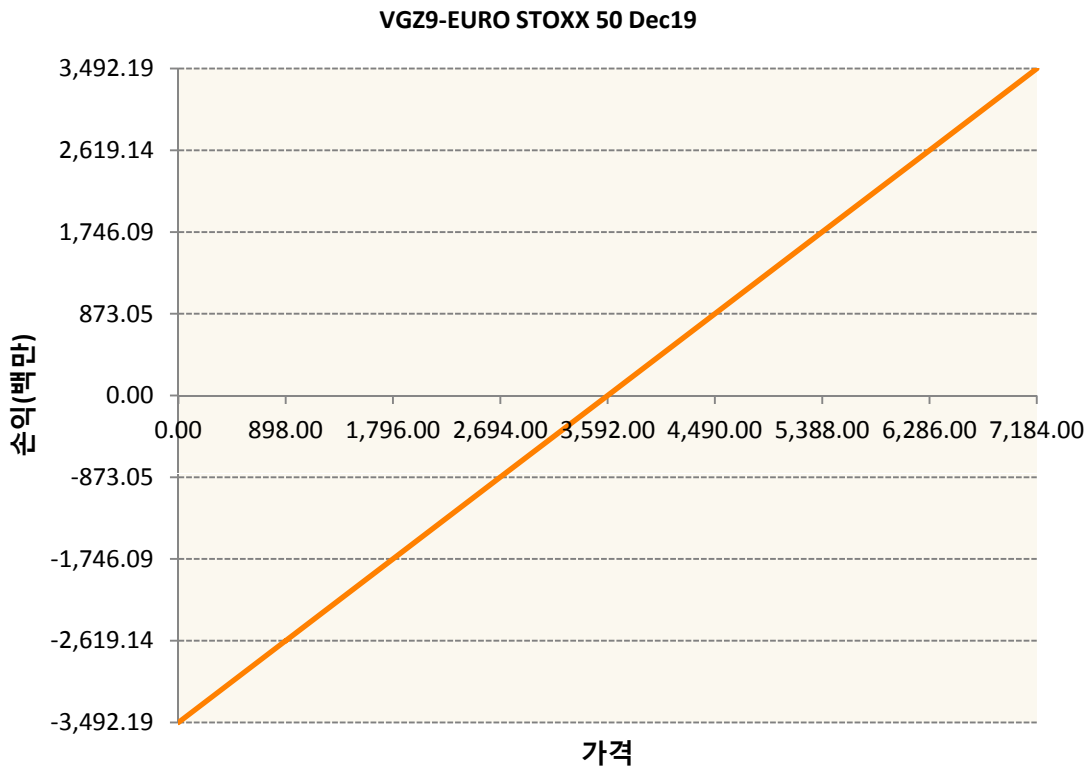
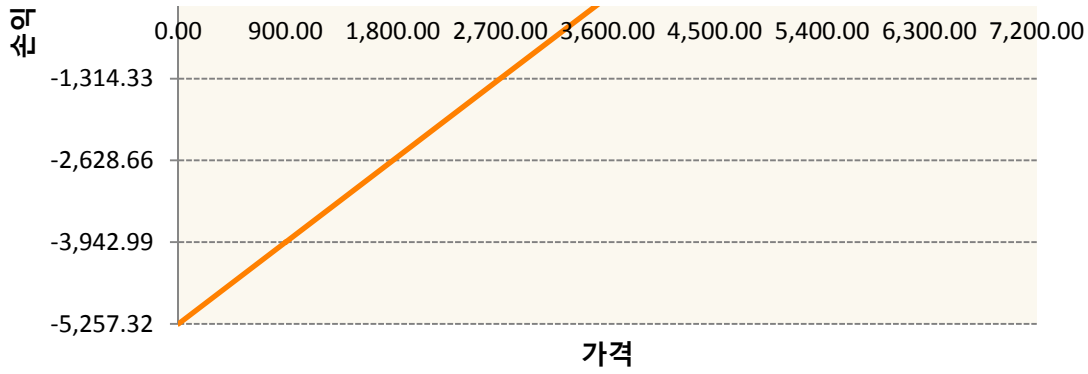
OESXX9-C3575-EURO STOXX 50



OESXX9-C3600-EURO STOXX 50







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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	7
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E	490
OESXX9-C35 EURO STOXX 50	89
OESXX9-C36 EURO STOXX 50	421
OESXX9-P35 EURO STOXX 50	89
OESXX9-P36 EURO STOXX 50	421
VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19	279

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





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

(단위:백만원)

953



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

(단위:백만원)

83



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

(단위:백만원)

129



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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-10-23
기준일	2019-10-22

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

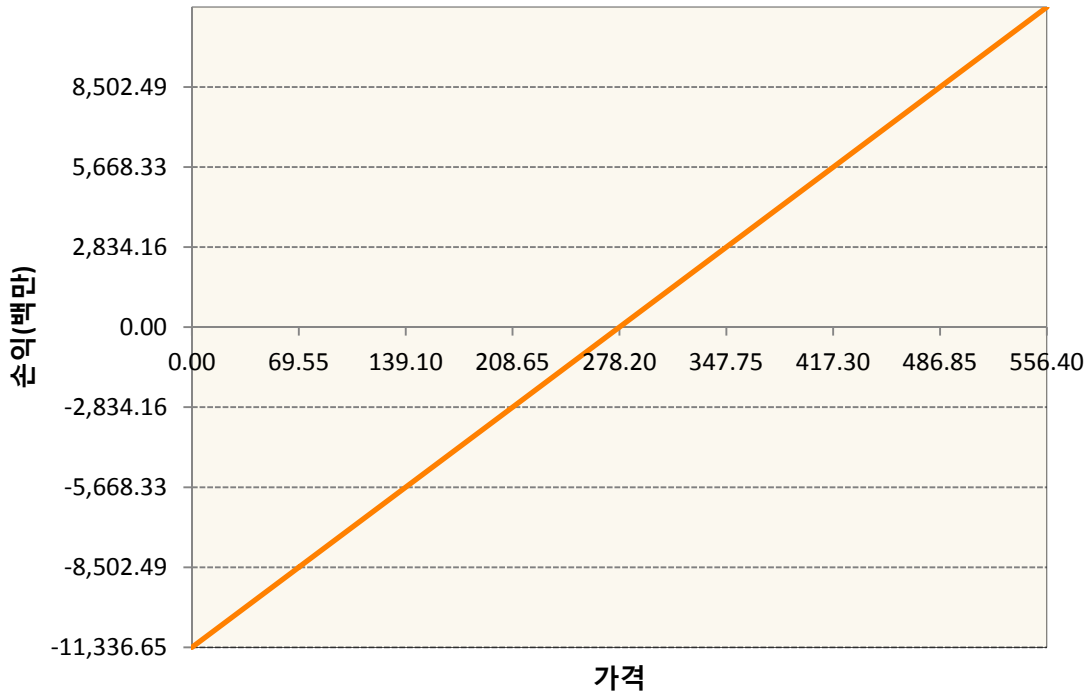
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

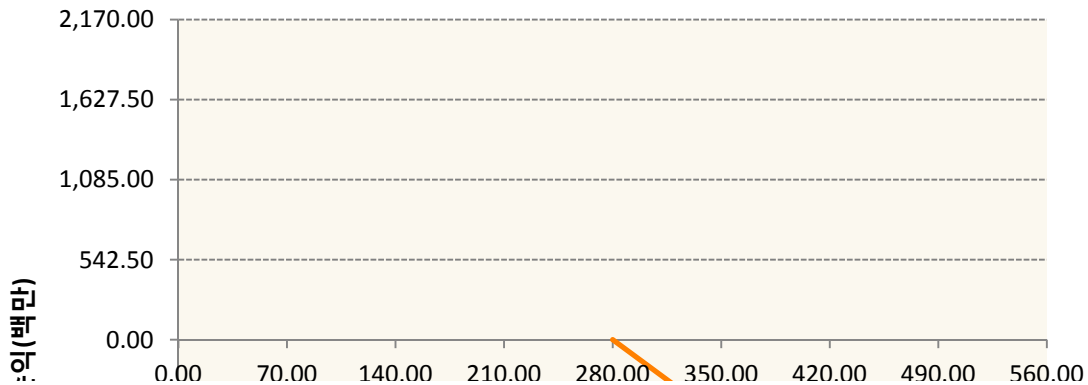
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,337	0	11,337	장내
누계	유가증권	옵션	3,561	20,815	-17,254	장내

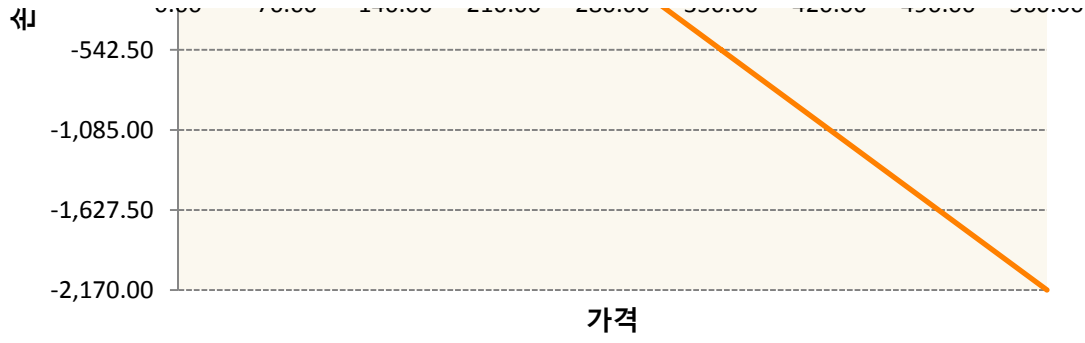
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

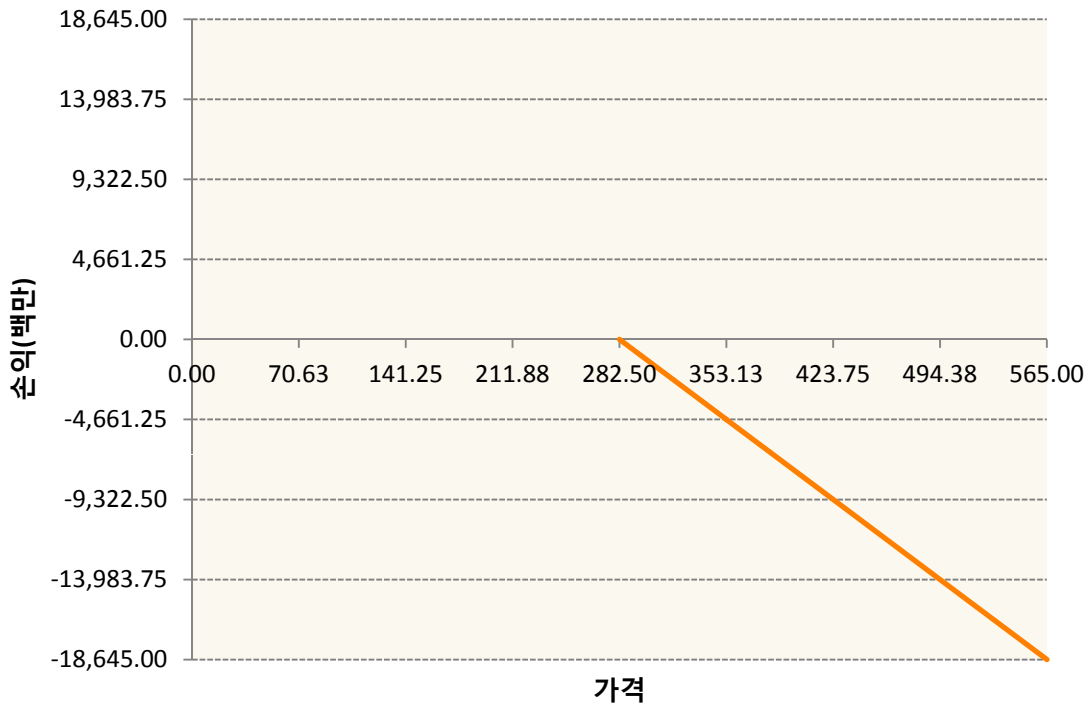


KR4201PB2800-2019-11 콜280

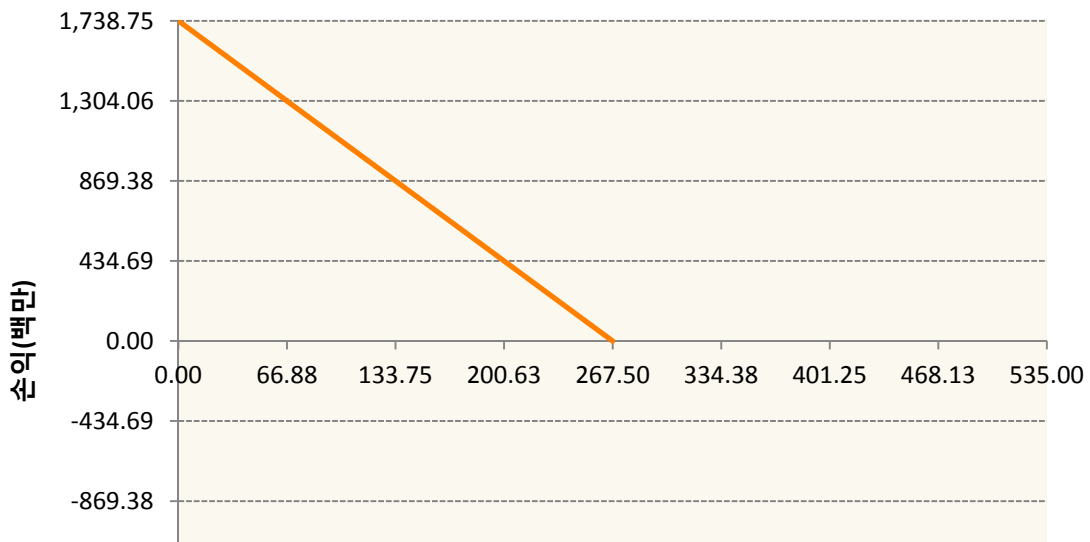


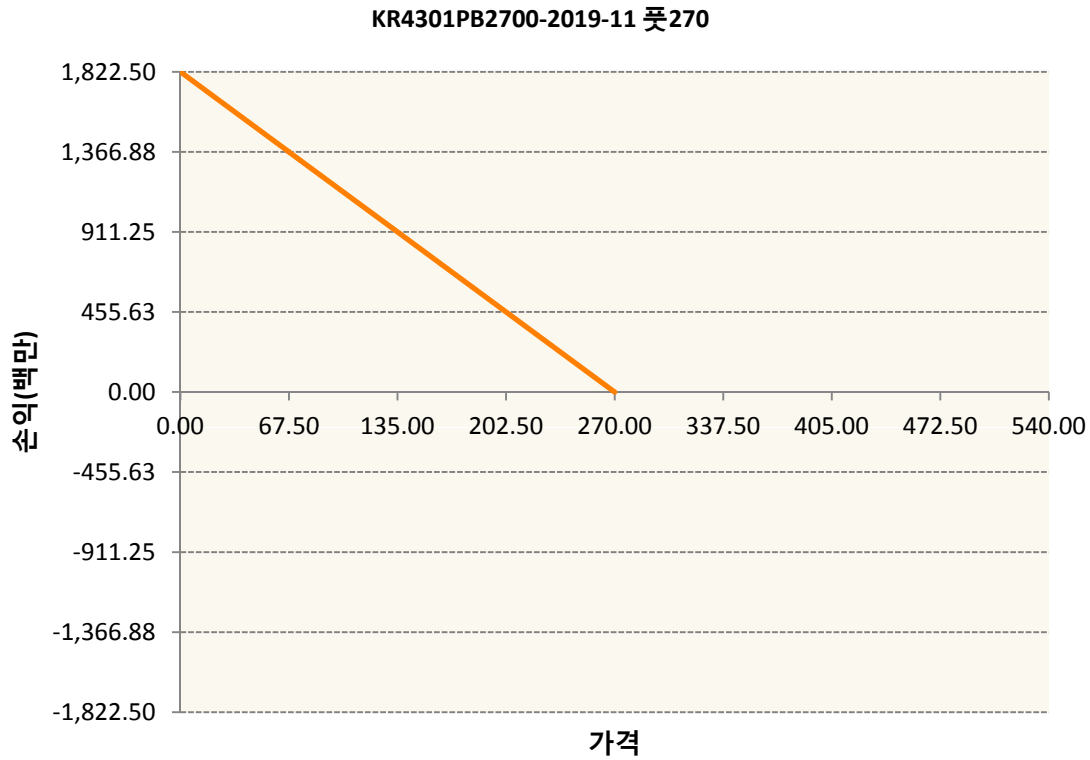
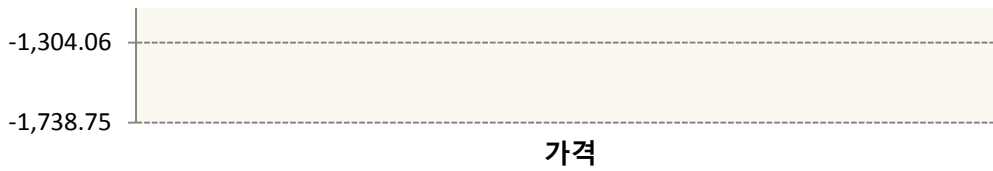


KR4201PB2826-2019-11 콜282.5



KR4301PB2676-2019-11 풋267.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						904
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-904	-904	-904	-904	-904	-904	-904	
-5.33%	-603	-603	-603	-603	-603	-603	-603	
-2.67%	-301	-301	-301	-301	-301	-301	-301	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	301	301	301	301	301	301	301	
5.33%	603	603	603	603	603	603	603	
8.00%	904	904	904	904	904	904	904	
KR4201PB2800		2019-11 콜280						125
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	47	46	45	43	41	39	36	
-5.33%	44	41	39	36	32	29	26	
-2.67%	34	30	26	22	18	13	9	

0%	14	10	5	0	-5	-10	-15
2.67%	-16	-21	-26	-31	-35	-40	-45
5.33%	-58	-61	-65	-69	-74	-78	-82
8.00%	-107	-109	-112	-115	-118	-122	-125
KR4201PB2826                      2019-11 콜282.5							1,010
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	341	335	325	313	299	282	264
-5.33%	318	302	283	261	237	211	184
-2.67%	254	225	194	162	128	94	58
0%	120	80	40	0	-40	-81	-122
2.67%	-109	-151	-193	-235	-277	-319	-362
5.33%	-432	-467	-504	-542	-581	-620	-659
8.00%	-831	-855	-883	-912	-943	-976	-1,010
KR4301PB2676                      2019-11 풋267.5							81
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	77	77	78	78	79	80	81
-5.33%	34	35	37	38	40	42	43
-2.67%	6	8	10	12	14	16	17
0%	-3	-2	-1	0	1	2	4
2.67%	-4	-4	-4	-3	-3	-2	-2
5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
KR4301PB2700                      2019-11 풋270							96
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	94	94	94	95	95	96	96
-5.33%	46	47	49	50	51	53	54
-2.67%	11	13	15	17	19	21	23
0%	-4	-3	-1	0	1	3	5
2.67%	-7	-7	-6	-6	-5	-4	-4
5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-6
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7

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

(단위:백만원)

**1,851**

공시일	2019-10-23
기준일	2019-10-22

## 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	152,125	0	152,125	

### 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	2019-10-23
기준일	2019-10-22

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,339	0	2,339	
누계	유가증권	수익증권	199,633	0	199,633	

### 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	2019-10-23
기준일	2019-10-22

## 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	417,566	0	417,566	
누계	통화	선도	0	514,200	-514,200	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		936
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		936
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		2,910
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		3,088
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		2,564
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E		1,872
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E		1,965
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E		936
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		655
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E		1,535
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		692
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E		1,684
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		2,470
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		468
FX21019V02 KRW/USD 21-11-19E		5,091
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,772
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,404
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,807
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,507
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,845

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

(단위:백만원)

**13,179**

공시일	2019-10-23
기준일	2019-10-22

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

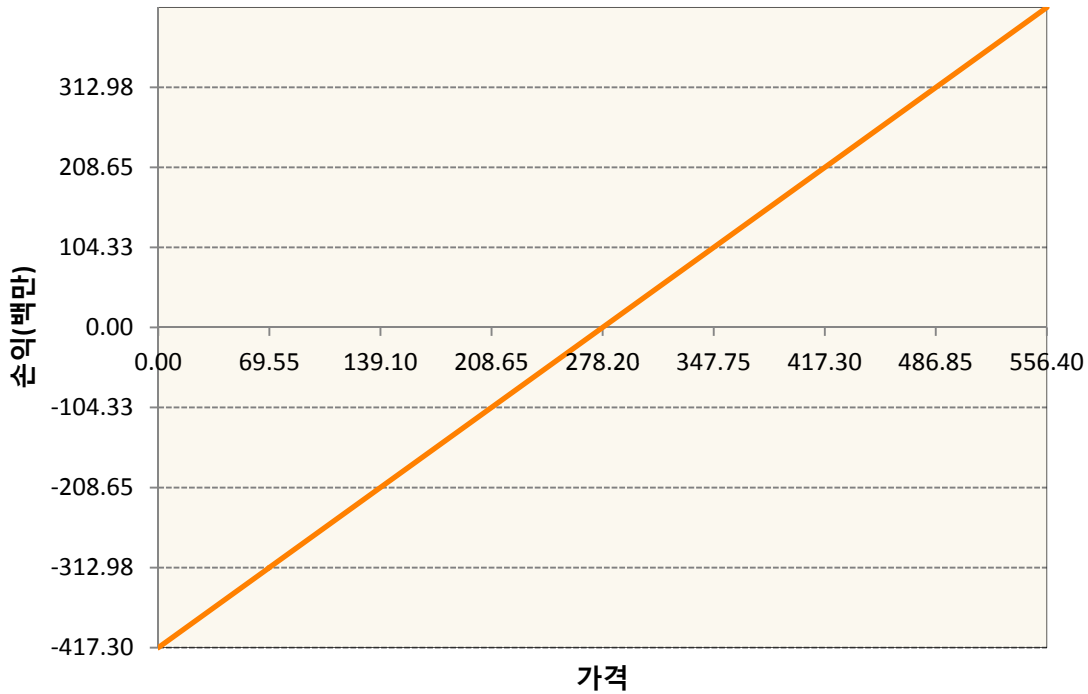
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

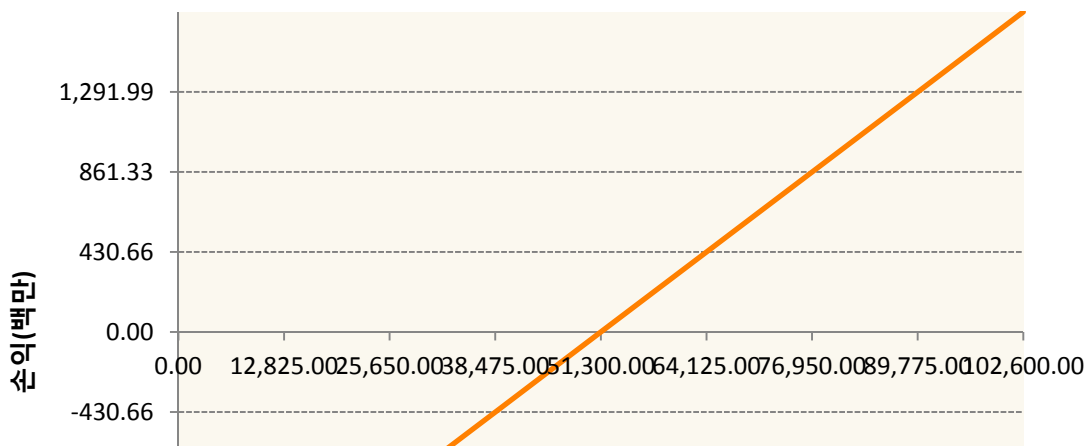
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	139	0	139	장내
누계	유가증권	선물	2,140	0	2,140	장내

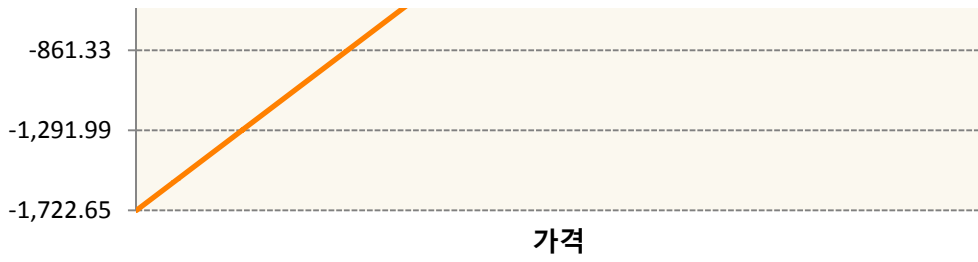
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



KR4111PB0001-2019-11 삼성전자개별선물





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

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						33
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
-5.33%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22	
-2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	11	11	11	11	11	11	11	
5.33%	22	22	22	22	22	22	22	
8.00%	33	33	33	33	33	33	33	
KR4111PB0001		2019-11 삼성전자개별선물						138
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-138	-138	-138	-138	-138	-138	-138	
-5.33%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92	
-2.67%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	46	46	46	46	46	46	46	
5.33%	92	92	92	92	92	92	92	
8.00%	138	138	138	138	138	138	138	

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

**188**

공시일	2019-10-23
기준일	2019-10-22

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

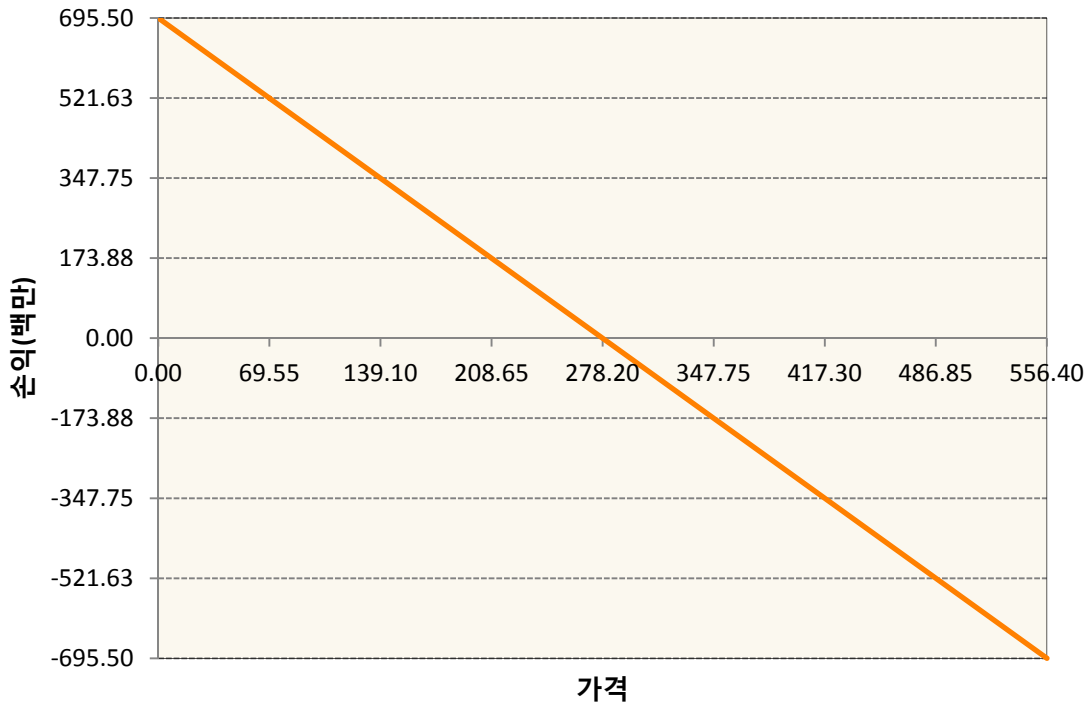
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

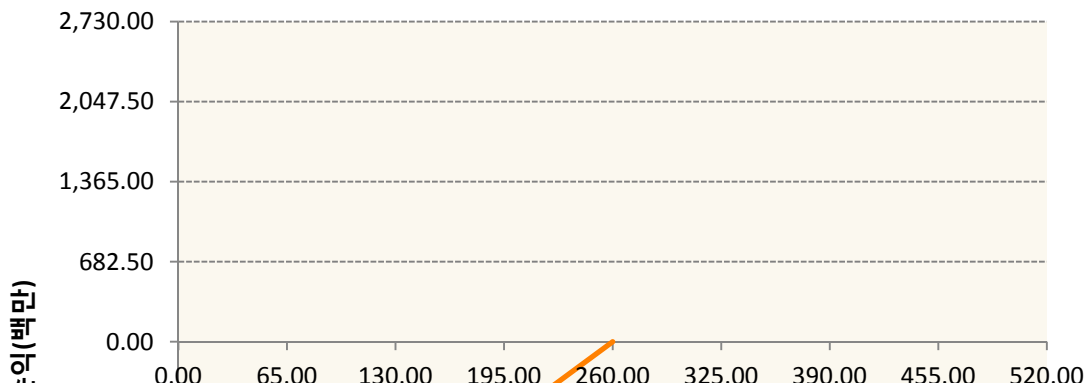
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	131	0	131	장내
누계	유가증권	선물	0	696	-696	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,846	-3,846	장내

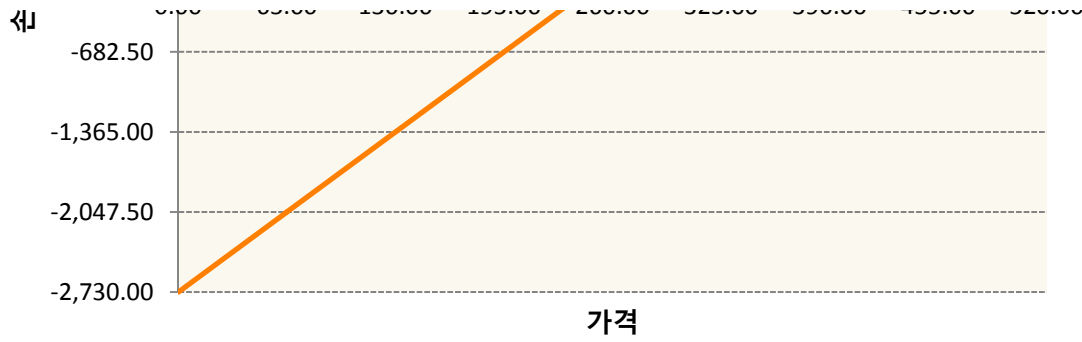
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

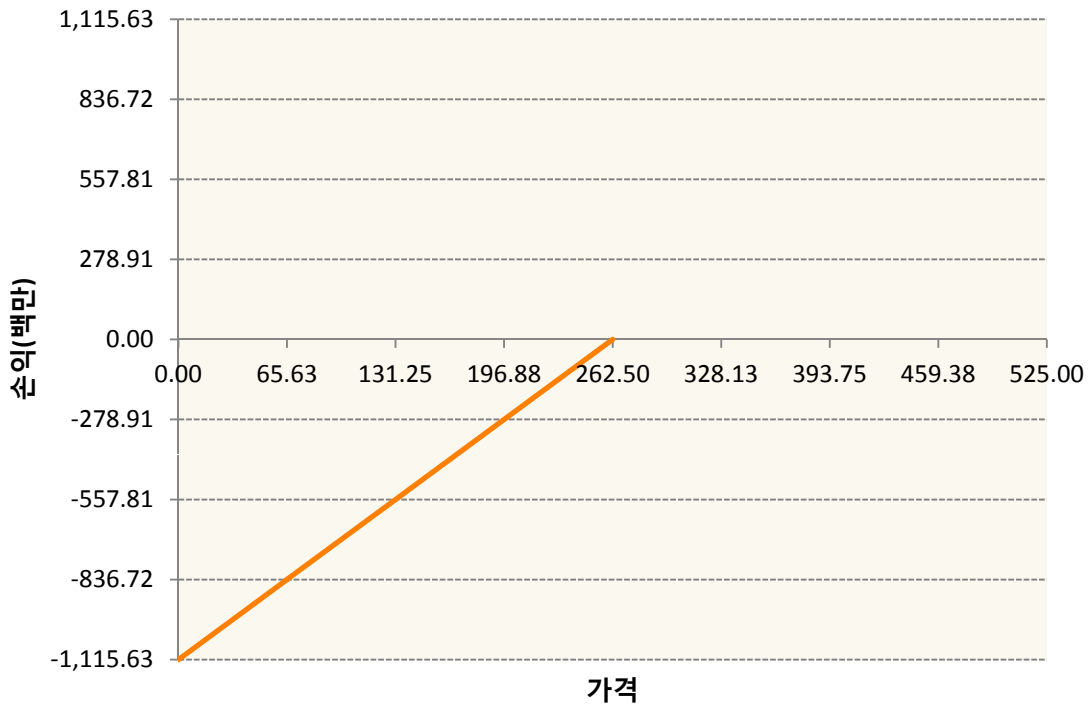


KR4301PB2601-2019-11 풋260





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						74
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-59	-61	-64	-66	-68	-71	-74
-5.33%	-15	-18	-20	-23	-26	-29	-32
-2.67%	-1	-2	-3	-5	-7	-8	-10
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	1	1	1	1	1	1	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

KR4301PB2627

2019-11 풋262.5

37

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32	-33	-34	-35	-35	-36	-37
-5.33%	-10	-11	-13	-14	-15	-16	-17
-2.67%	-1	-2	-3	-3	-4	-5	-6
0%	1	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	1	1	1	1	1	0	0
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)

93

공시일	2019-10-23
기준일	2019-10-22

## 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	16,501	0	16,501	
누계	통화	선도	0	23,581	-23,581	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		318
FX21019U03 KRW/USD 23-10-19E		599
FX21019V01 KRW/USD 10-12-19E		371
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		318
FX21019V02 KRW/USD 13-11-19E		281

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

(단위:백만원)

604
-----

공시일	2019-10-23
기준일	2019-10-22

## 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	457	0	457	장외
누계	통화	선도	117	293	-176	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)	12
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	2019-10-23
기준일	2019-10-22

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

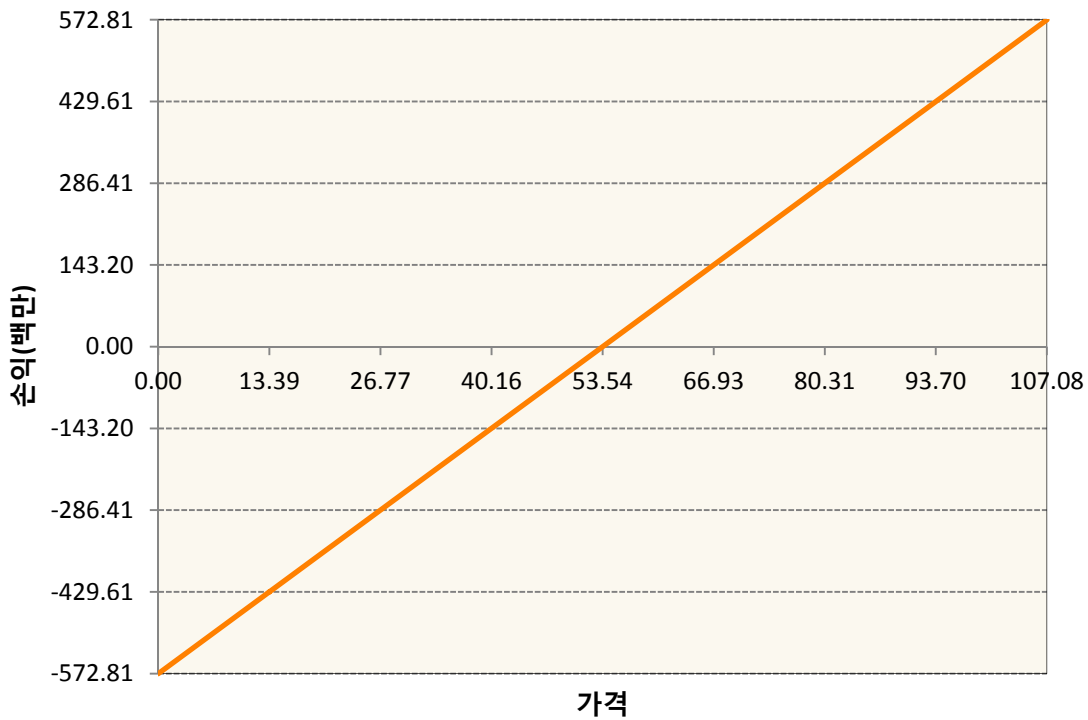
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

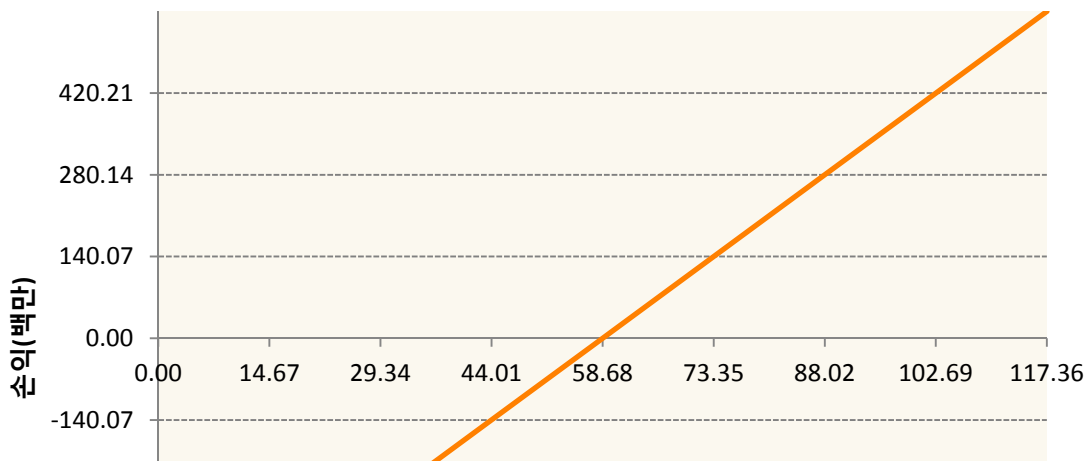
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,398	292	2,106	

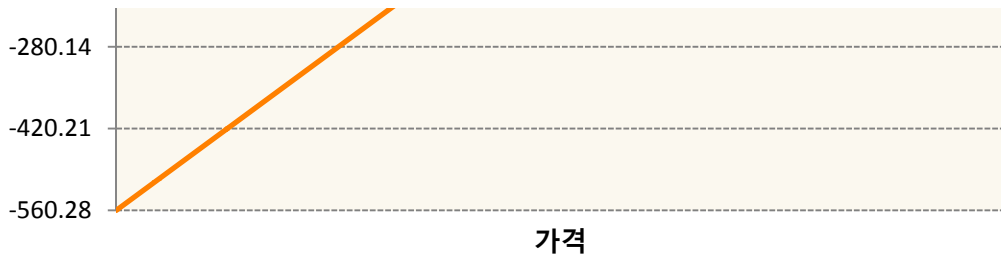
### 2. 만기시점의 손익구조

CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20

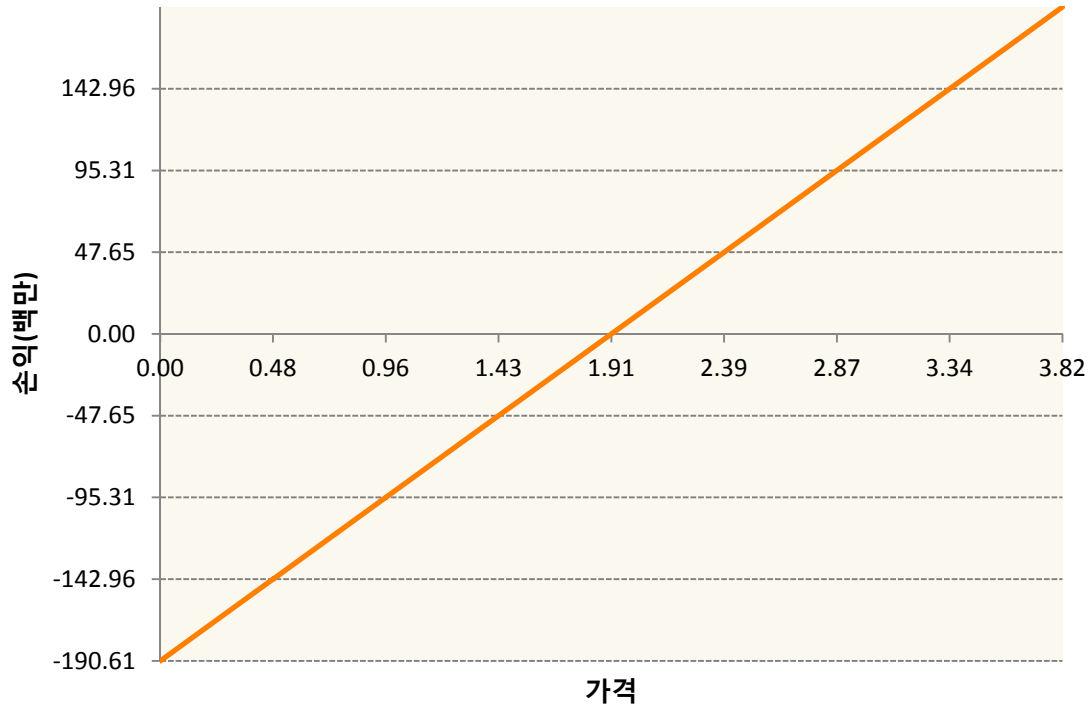


COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20

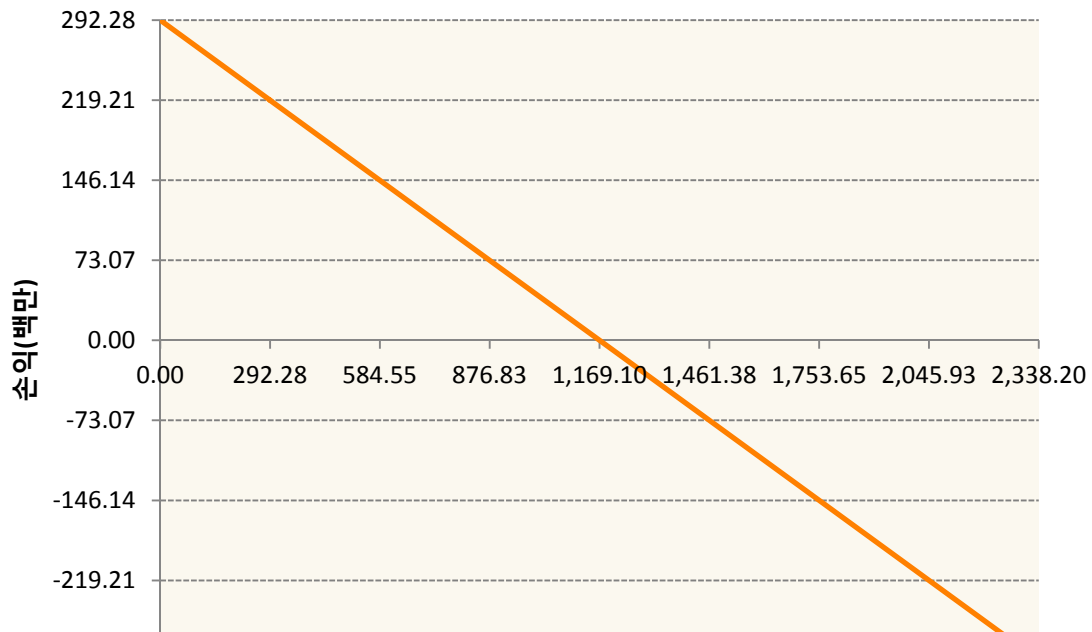


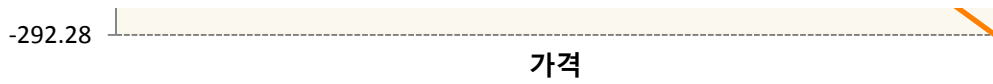


HOF0-NY Harb ULSD Fut Jan20

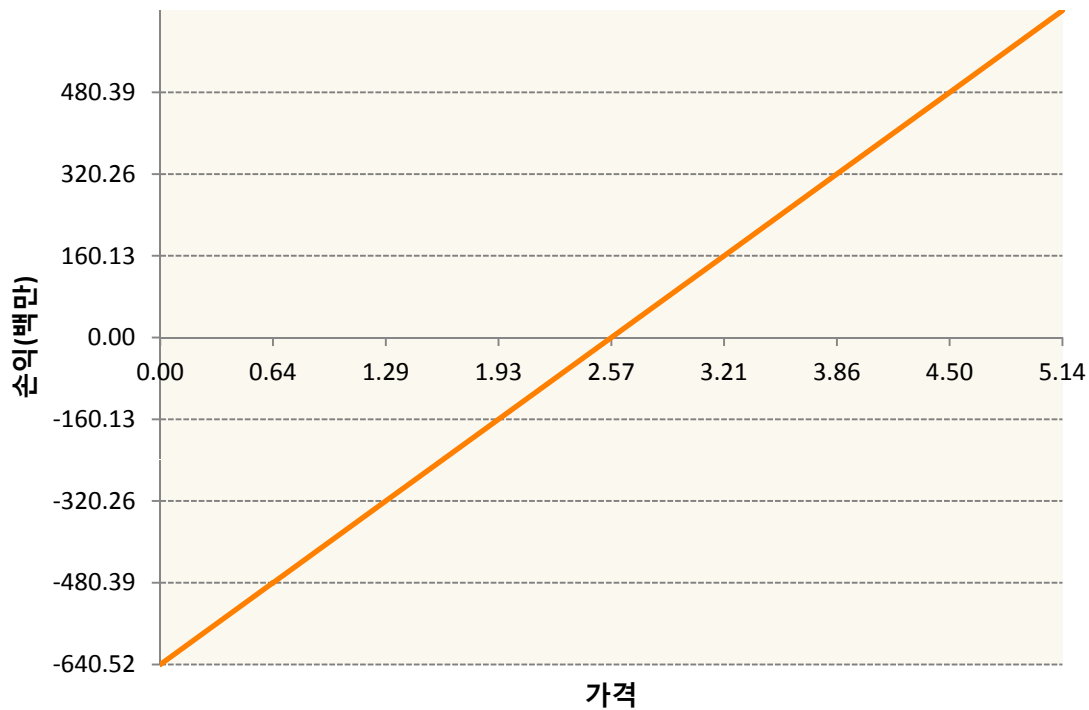


KR4175PB0004-2019-11 달러선물

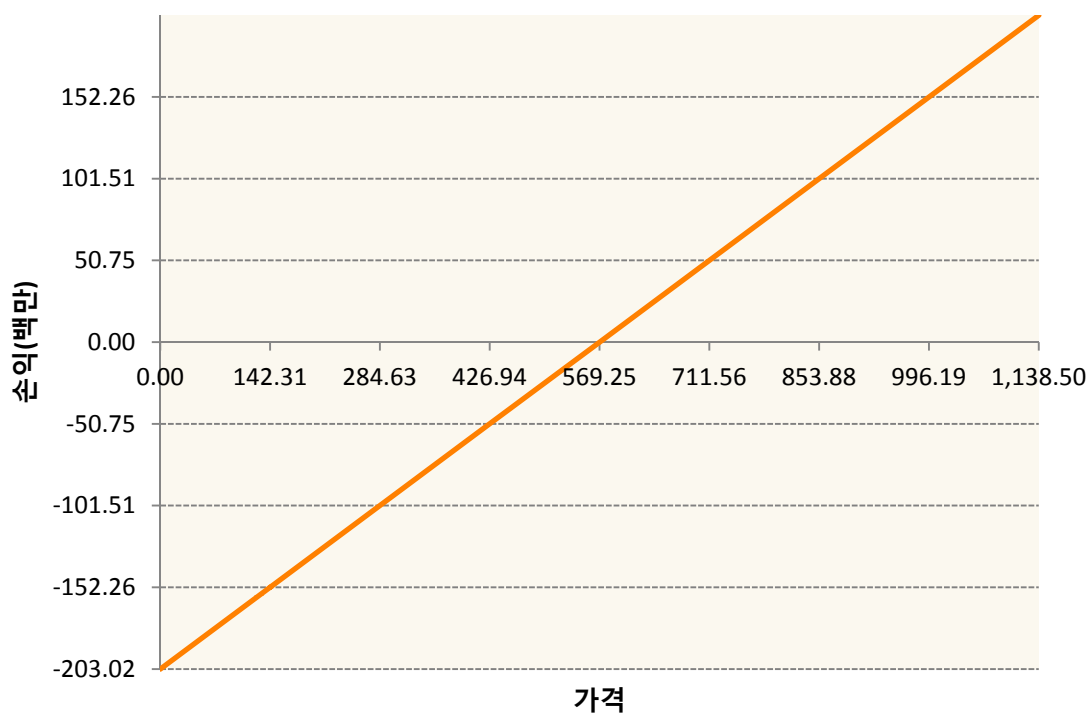




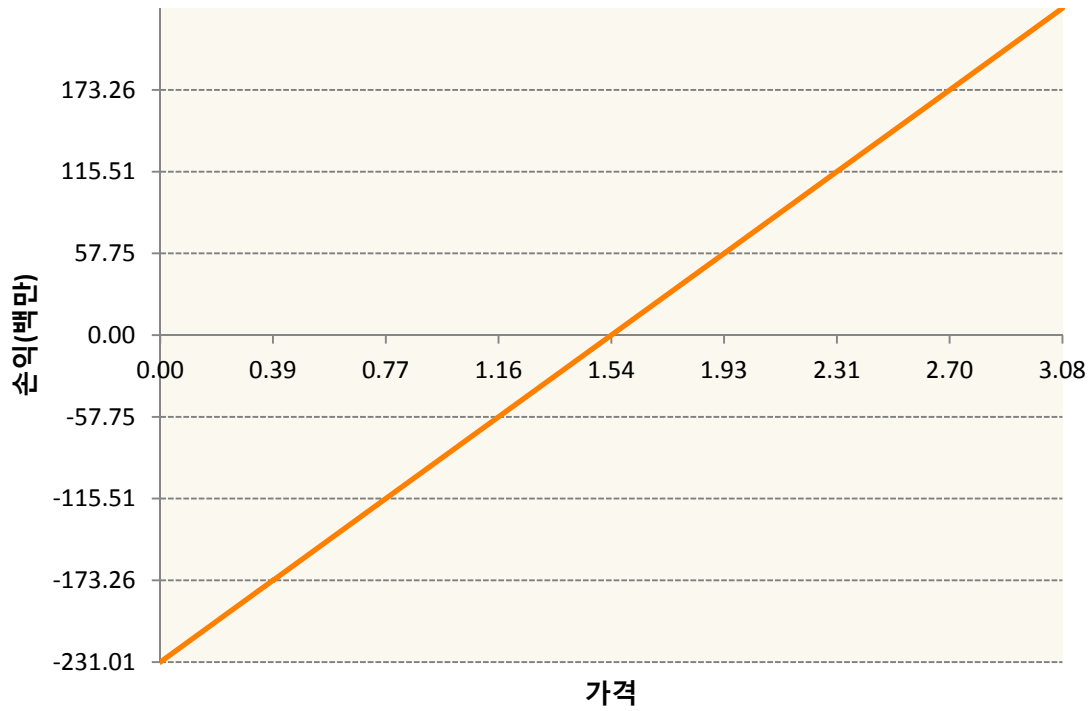
NGF20-NATURAL GAS FUTR Jan20



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	23
NGF20	NATURAL GAS FUTR Jan20	51
QSF0	Low Su Gasoil G Jan20	16
XBF0	GASOLINE RBOB FUT Jan20	18

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

(단위:백만원)

399

공시일	2019-10-23
기준일	2019-10-22

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

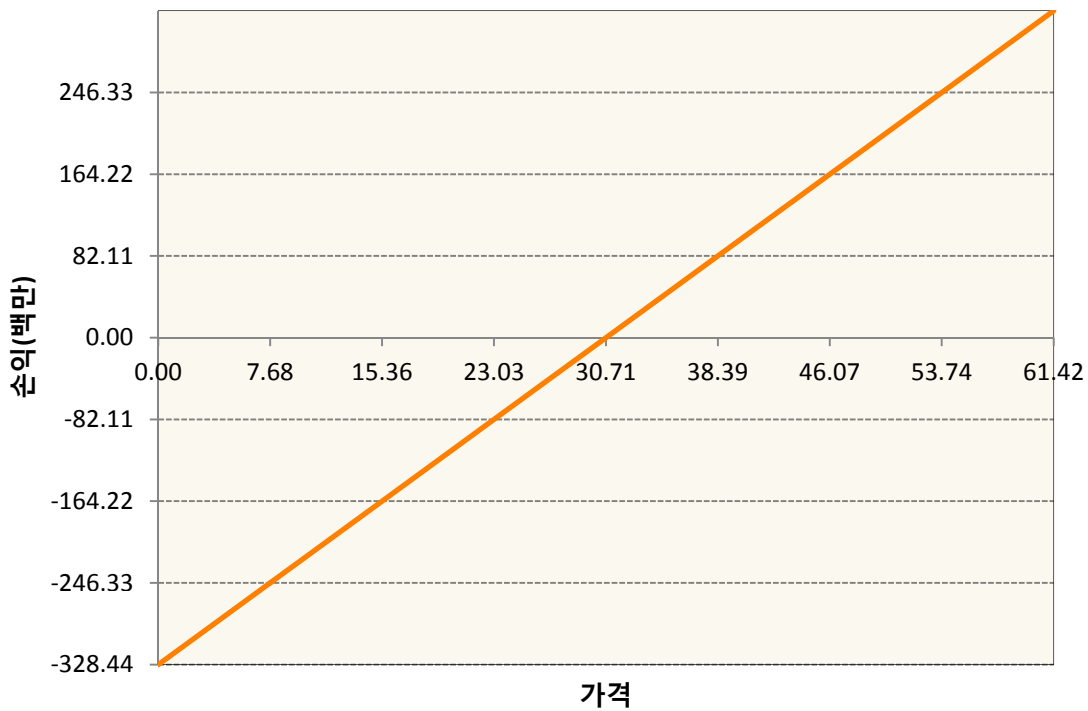
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

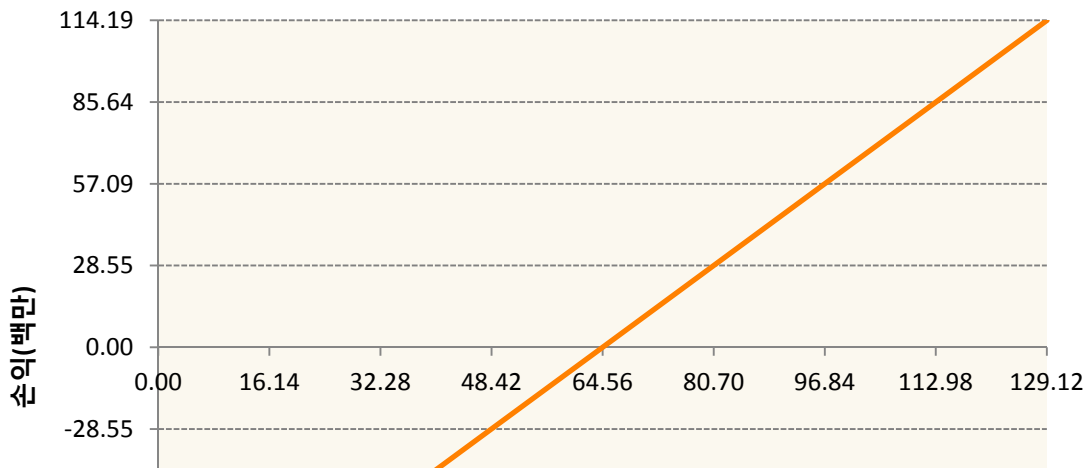
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,867	94	2,774	

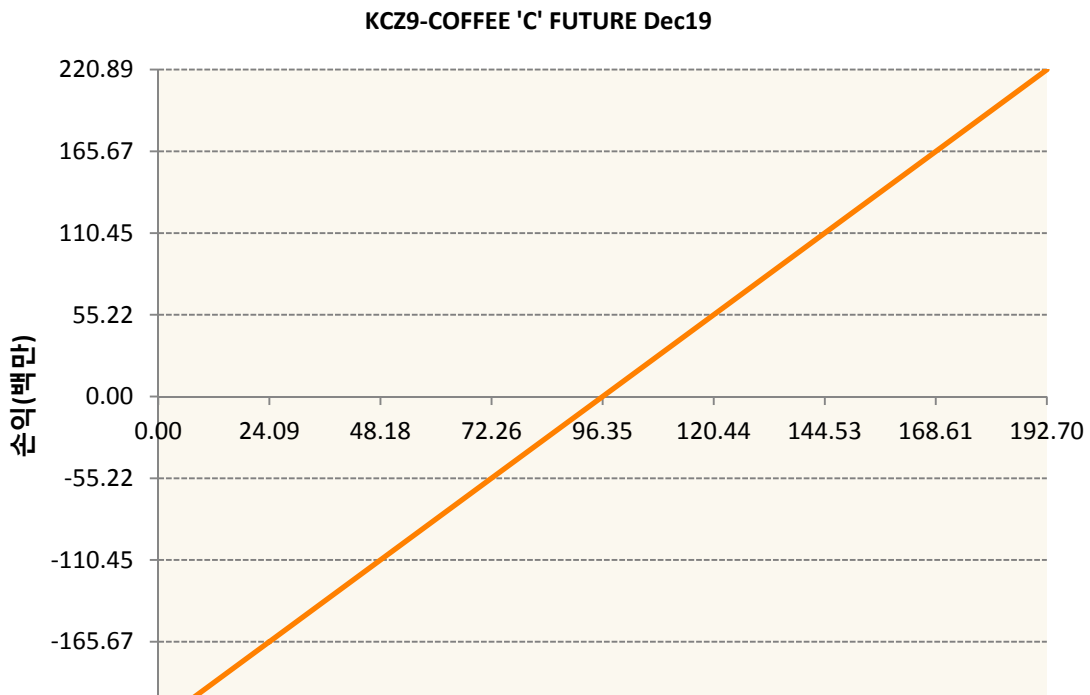
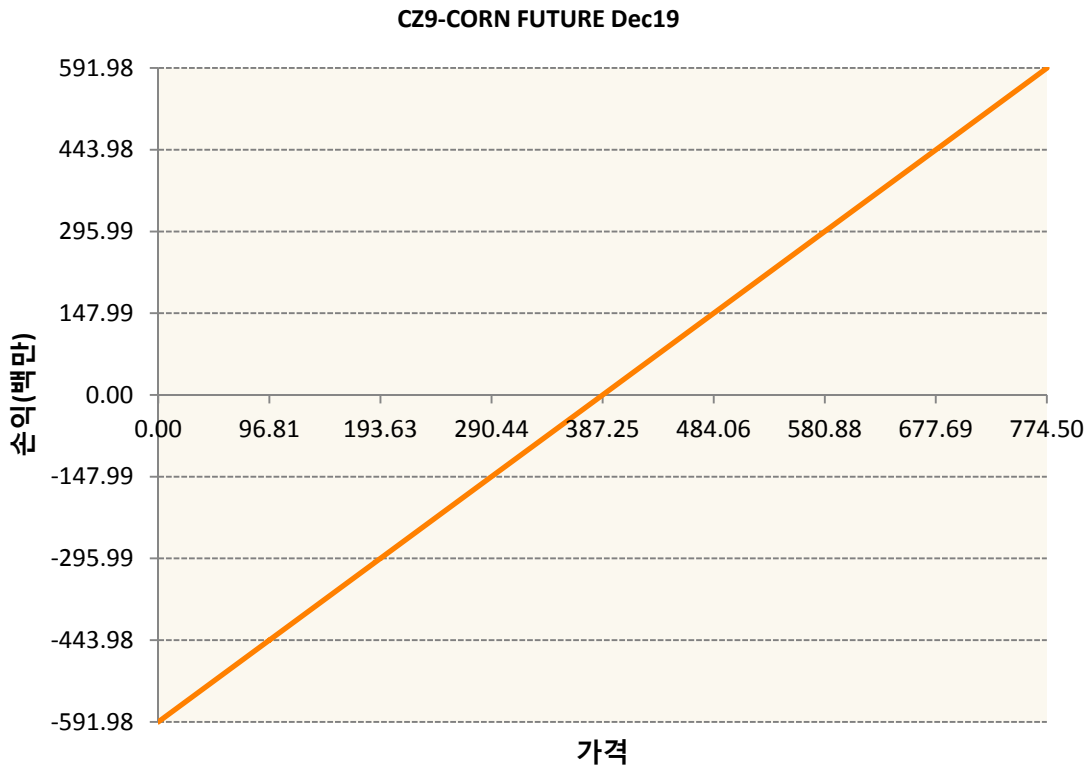
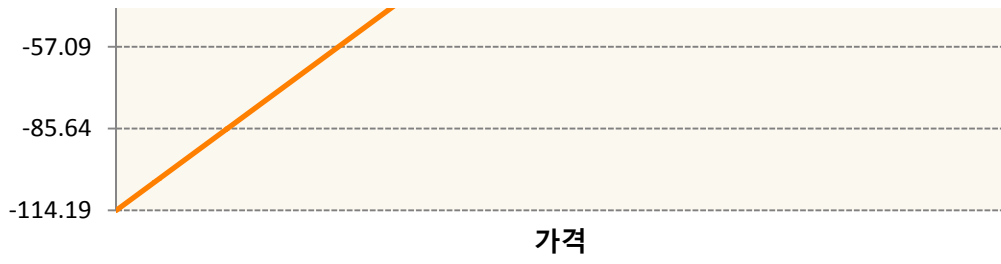
### 2. 만기시점의 손익구조

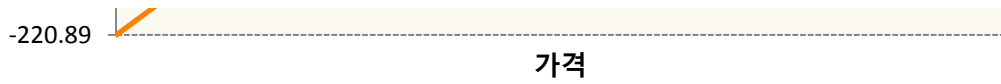
**BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20**



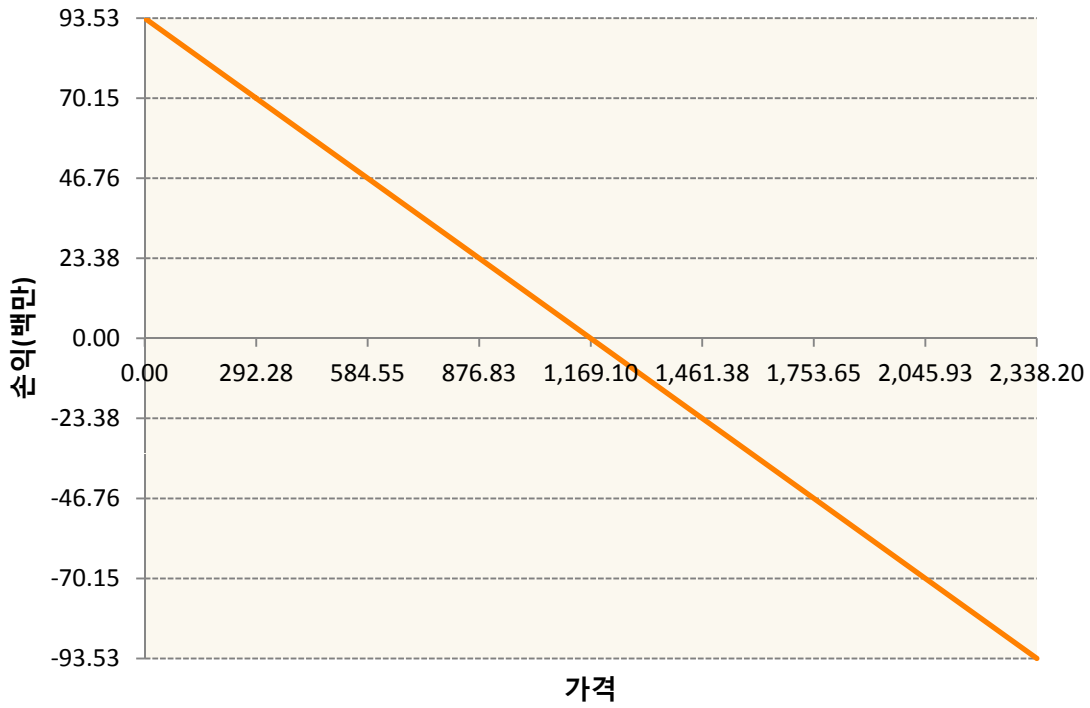
**CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19**



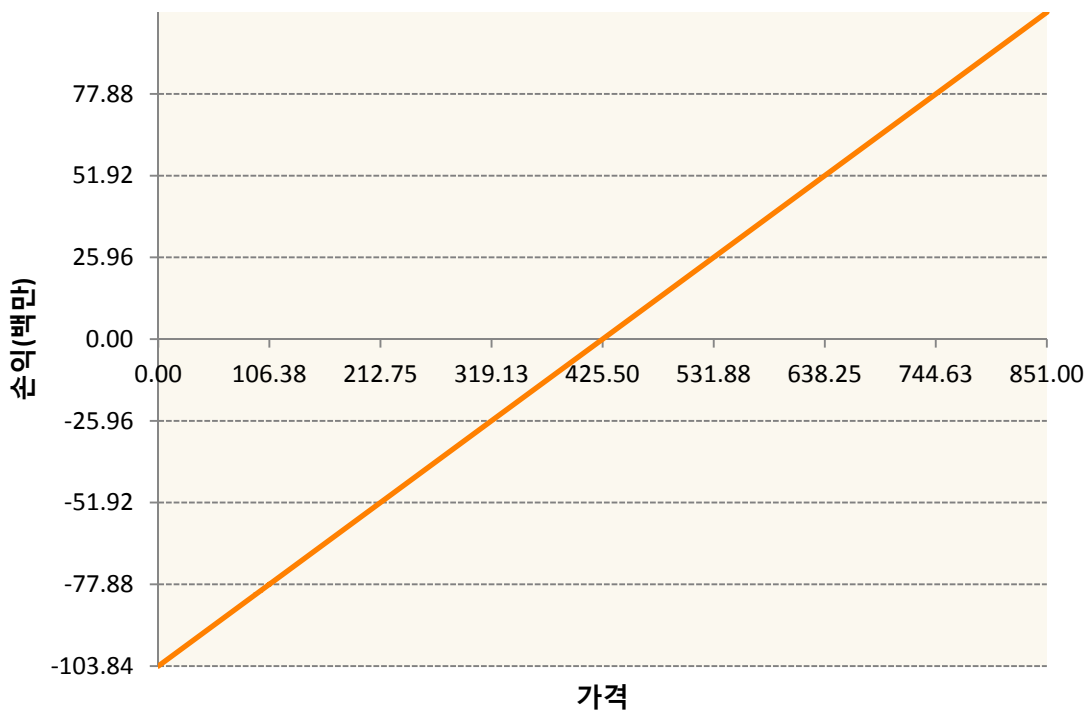




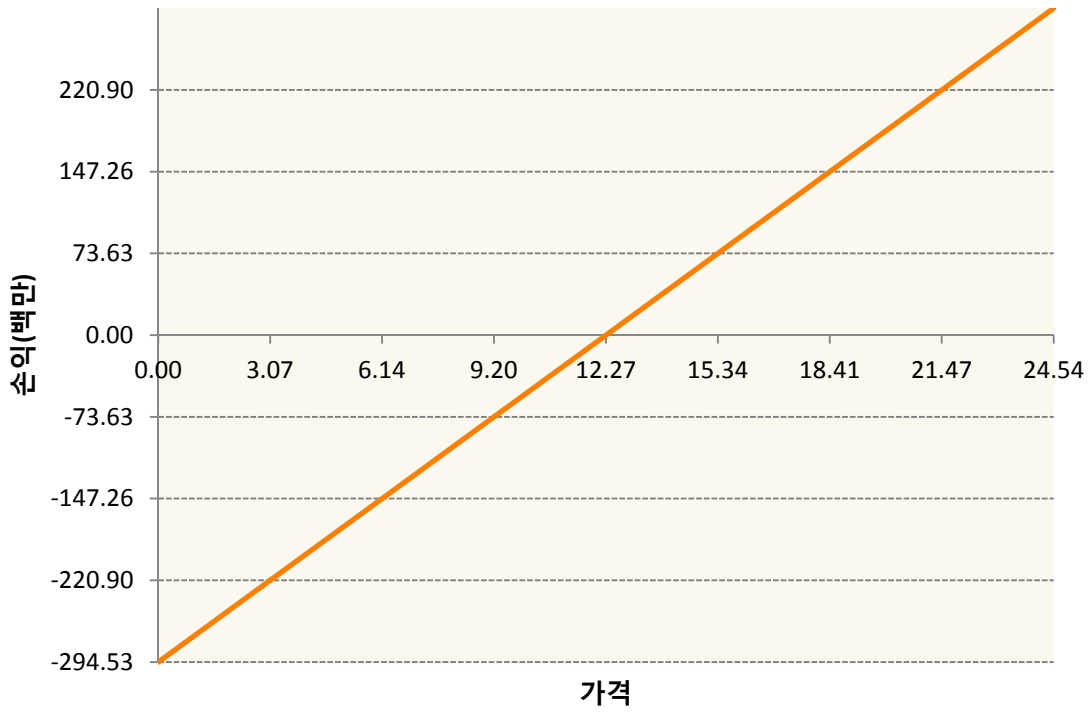
**KR4175PB0004-2019-11 달러선물**



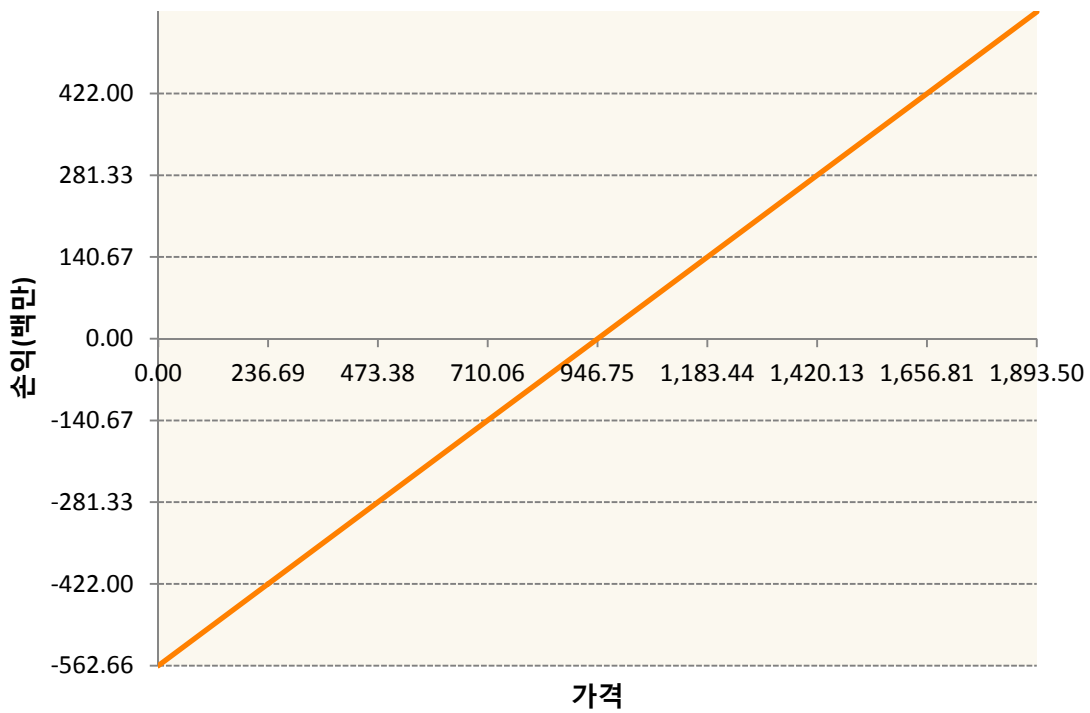
**KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19**



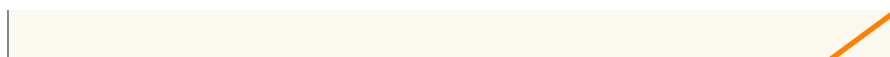
SBH0-Sugar Mar20

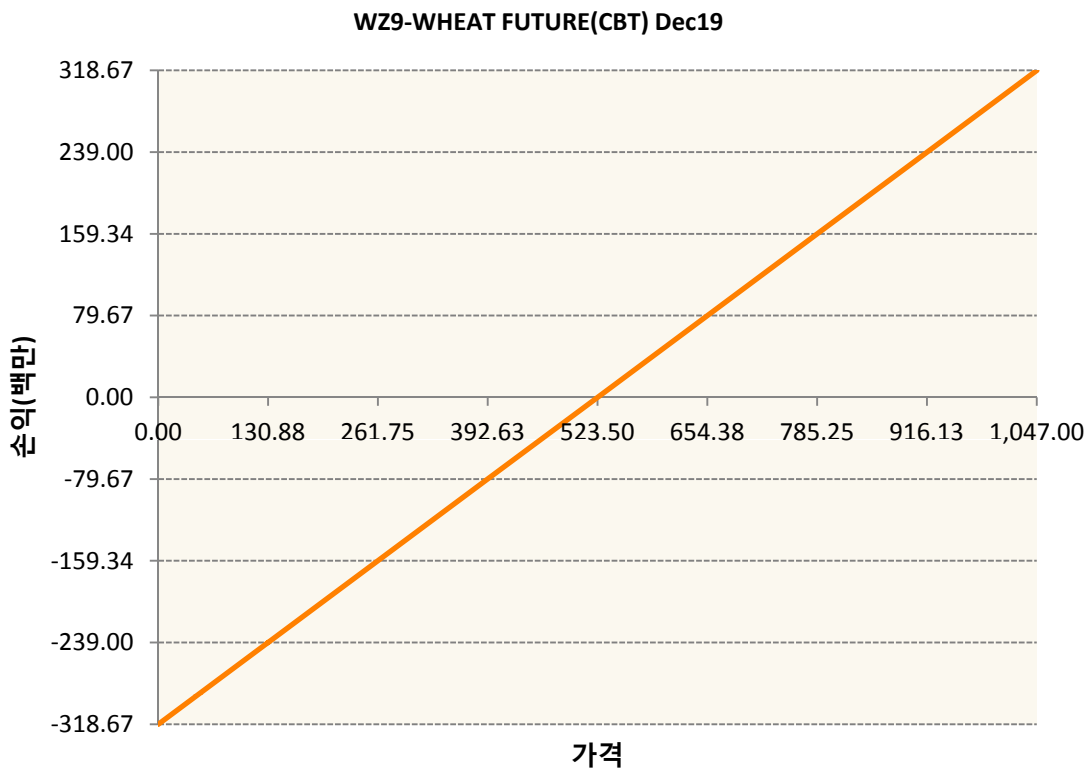
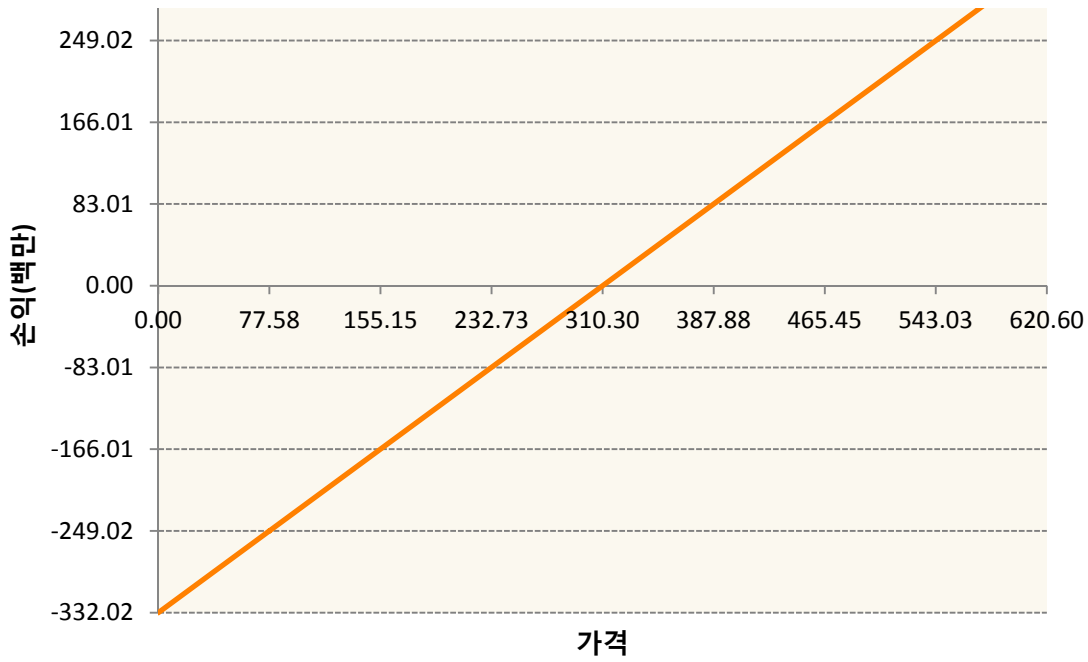


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20



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	47
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	25

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

(단위:백만원)

**256**