

공시일	2019-10-30
기준일	2019-10-29

## 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)

86

공시일	2019-10-30
기준일	2019-10-29

## 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

1,198

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

696

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-10-30
기준일	2019-10-29

## 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)	384
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	140

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

772
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-10-30
기준일	2019-10-29

## 유로인덱스모(주식-파생형)

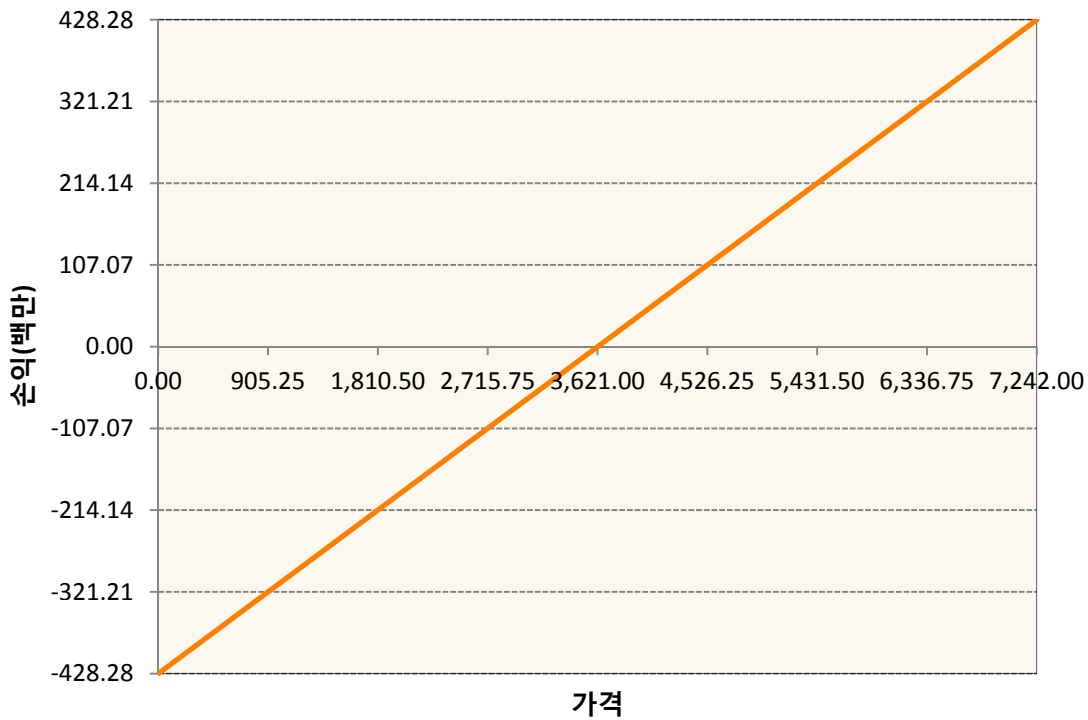
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	428	0	428	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGZ9-EURO STOXX 50 Dec19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	34
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

24
----

공시일	2019-10-30
기준일	2019-10-29

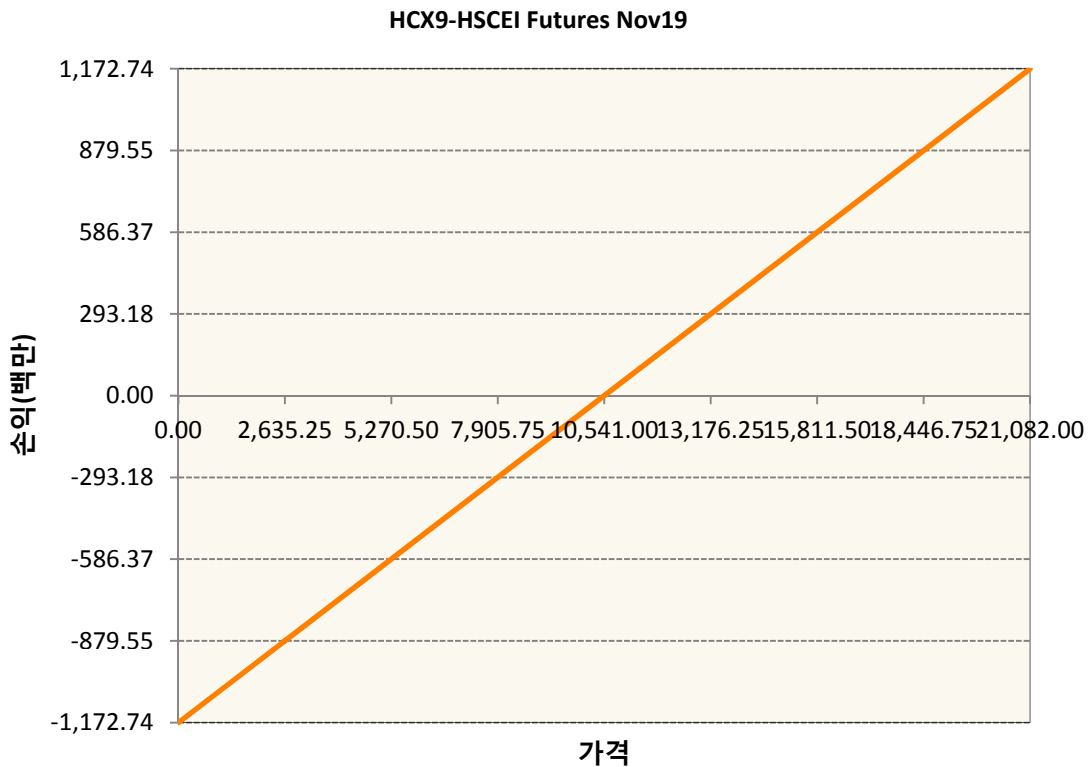
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,173	0	1,173	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HXC9	HSCEI Futures Nov19	94
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

84

공시일	2019-10-30
기준일	2019-10-29

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

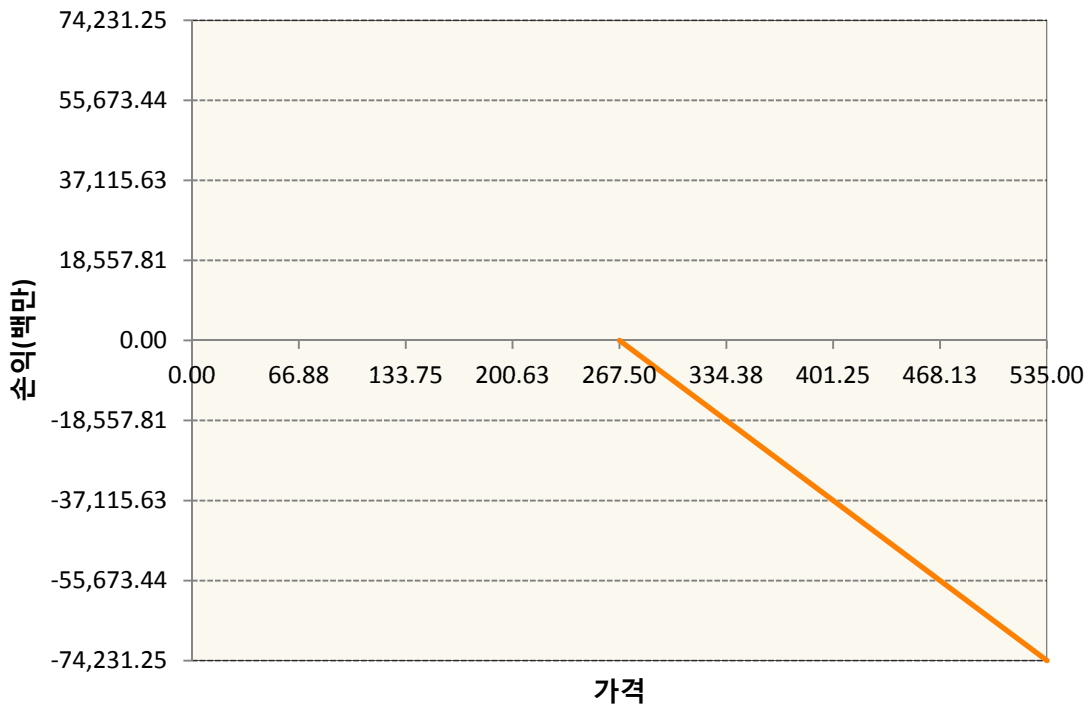
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

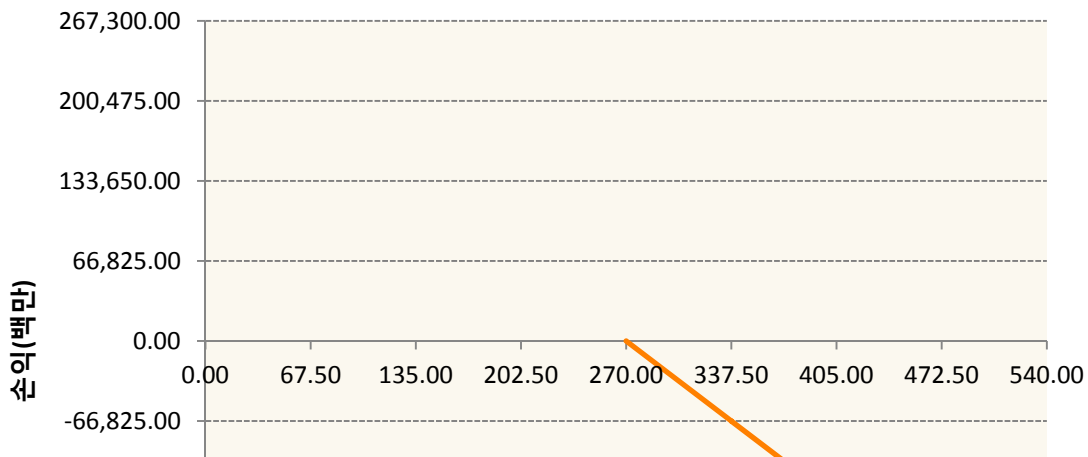
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	2,003	0	2,003	장내
누계	유가증권	옵션	0	500,025	-500,025	장내

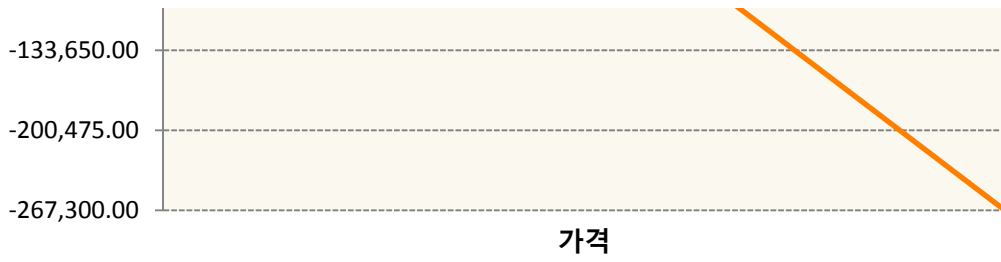
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201PB2677-2019-11 콜267.5**

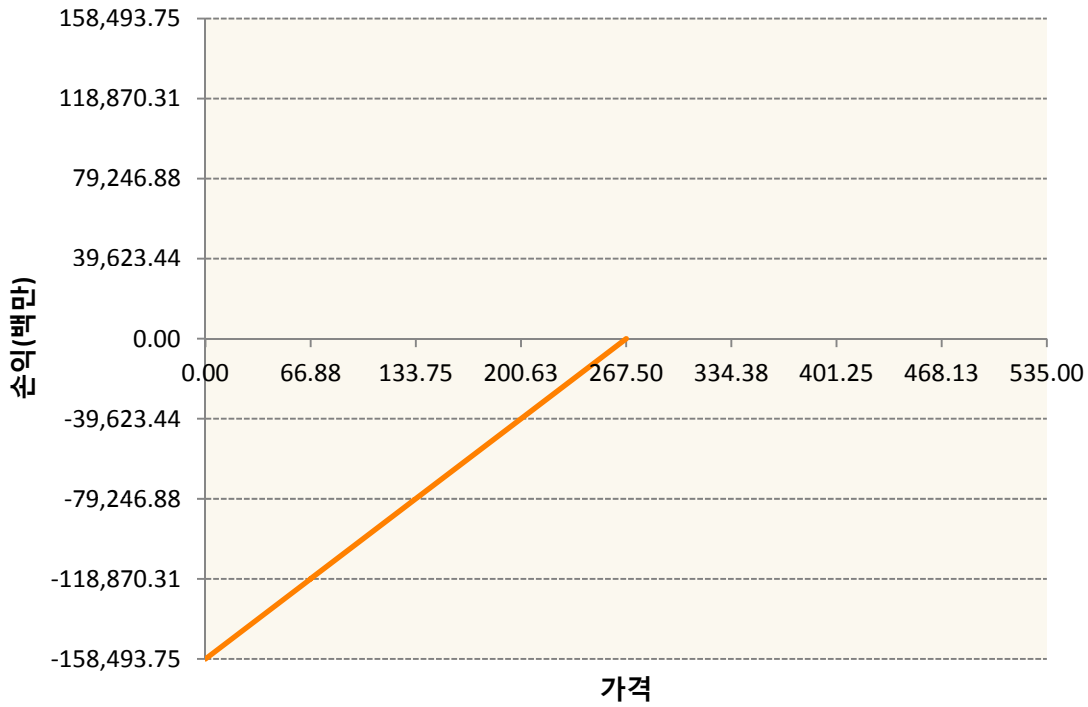


**KR4201PB2701-2019-11 콜270**





KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PB2677		2019-11 콜267.5					5,599
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,236	3,154	3,063	2,966	2,863	2,756	2,644
-5.33%	2,749	2,618	2,486	2,352	2,218	2,082	1,946
-2.67%	1,785	1,645	1,504	1,363	1,222	1,080	939
0%	334	228	117	0	-121	-245	-371
2.67%	-1,462	-1,520	-1,587	-1,665	-1,750	-1,842	-1,940
5.33%	-3,431	-3,454	-3,486	-3,528	-3,578	-3,637	-3,704
8.00%	-5,462	-5,469	-5,481	-5,500	-5,525	-5,558	-5,599
KR4201PB2701		2019-11 콜270					19,404
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,096	9,861	9,592	9,293	8,971	8,627	8,266

-5.33%	8,797	8,376	7,939	7,492	7,037	6,574	6,106
-2.67%	5,965	5,452	4,939	4,426	3,912	3,399	2,886
0%	1,346	910	461	0	-469	-946	-1,427
2.67%	-4,705	-4,970	-5,271	-5,601	-5,955	-6,331	-6,723
5.33%	-11,566	-11,686	-11,842	-12,034	-12,258	-12,512	-12,793
8.00%	-18,759	-18,800	-18,865	-18,957	-19,078	-19,227	-19,404
KR4301PB2676                      2019-11 풋267.5							7,272
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,054	-7,070	-7,094	-7,126	-7,167	-7,216	-7,272
-5.33%	-3,014	-3,119	-3,231	-3,348	-3,469	-3,593	-3,721
-2.67%	-510	-646	-785	-925	-1,066	-1,209	-1,352
0%	150	111	60	0	-70	-147	-232
2.67%	207	204	198	188	172	151	123
5.33%	209	209	208	208	206	203	197
8.00%	209	209	209	209	208	208	208

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

(단위:백만원)

**31,298**

공시일	2019-10-30
기준일	2019-10-29

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

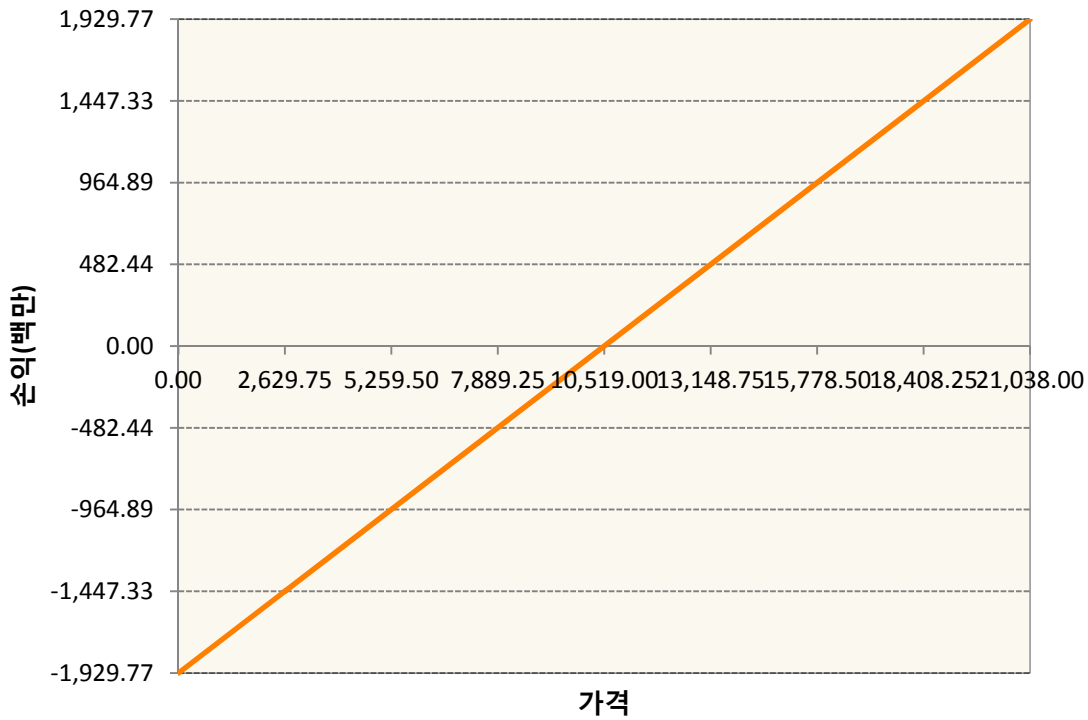
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

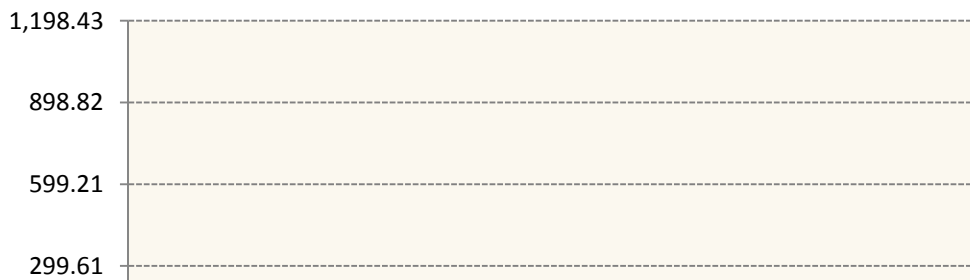
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,930	0	1,930	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,817	-4,817	장내
누계	통화	선도	667	2,756	-2,088	장외

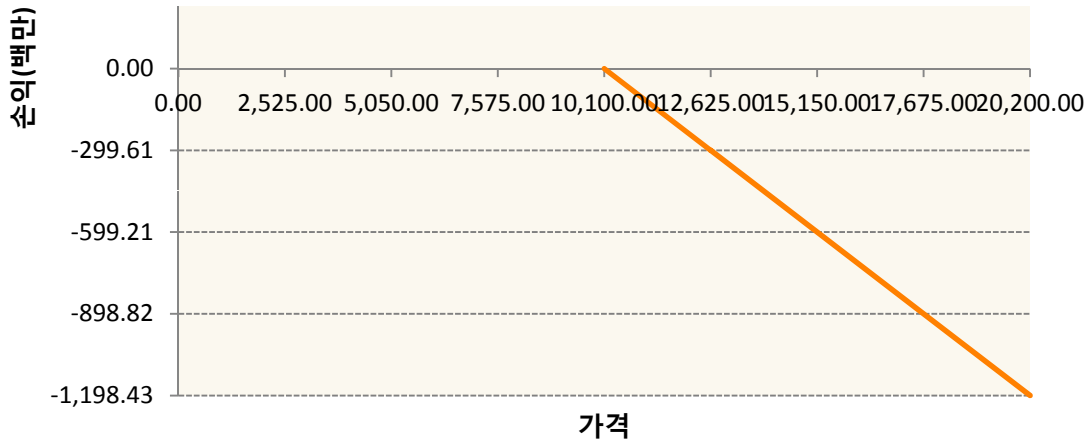
### 2. 만기시점의 손익구조

HCV9-HSCEI Futures Oct19

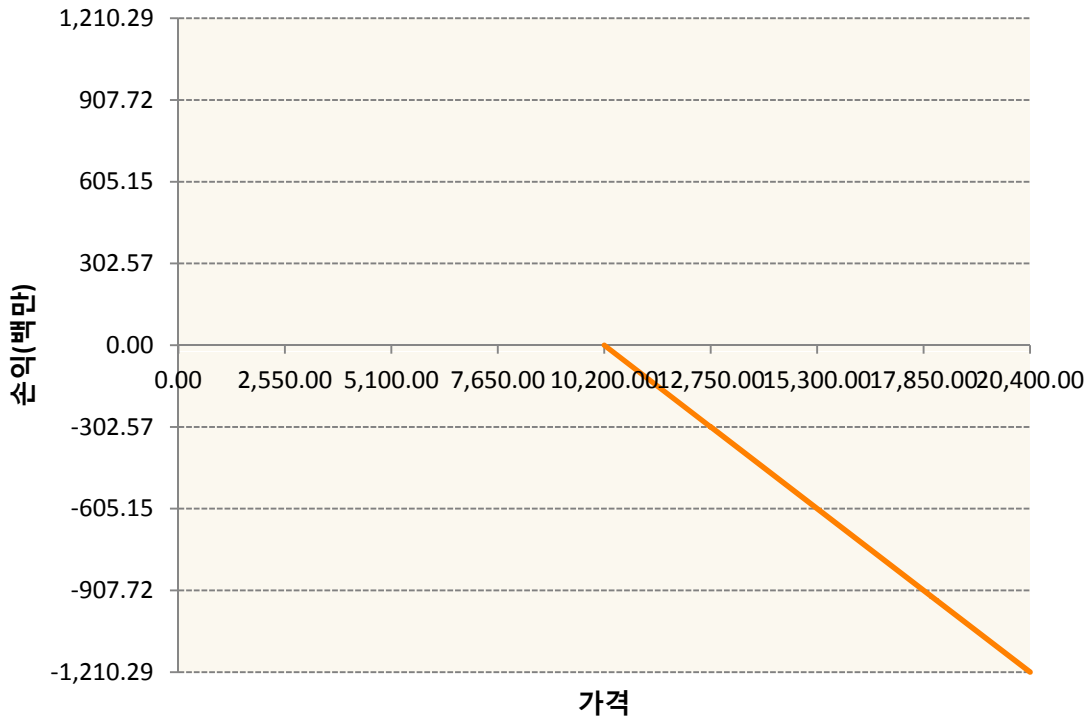


OHHIV9-C101-HSCEI

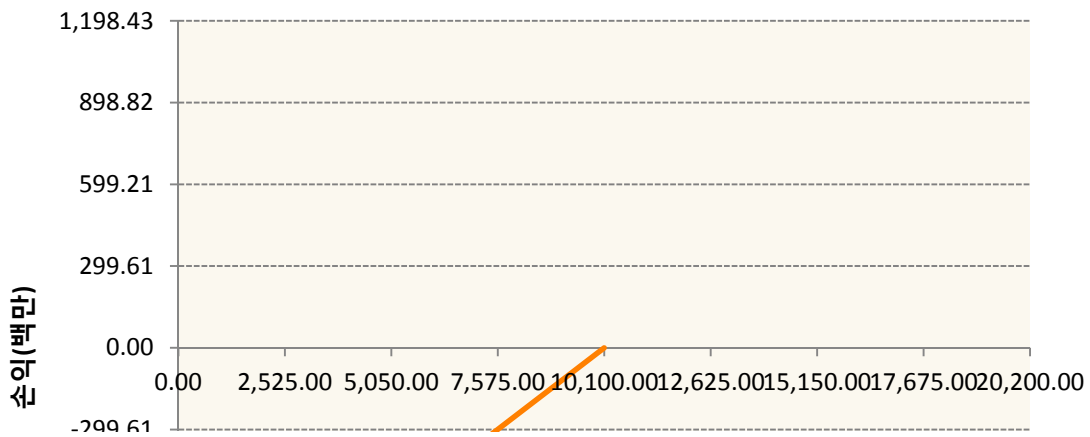


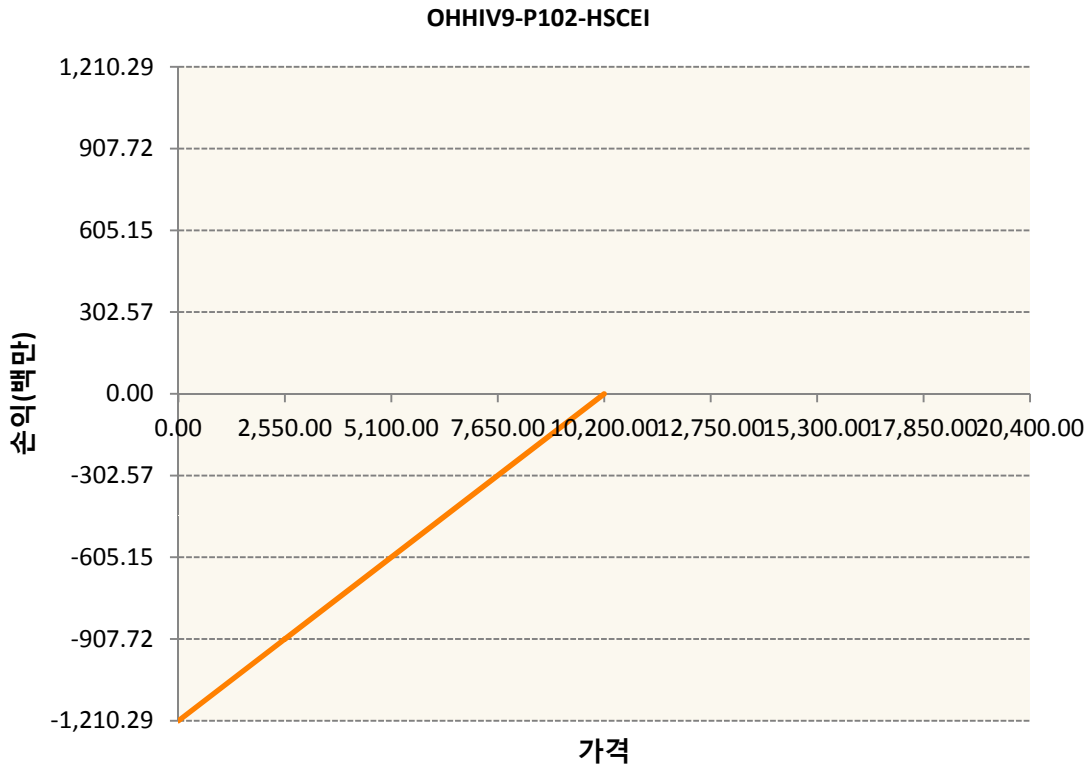


OHHIV9-C102-HSCEI



OHHIV9-P101-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	220
FX21019U00 HKD/KRW 22-11-19E	6
FX21019U02 HKD/KRW 22-11-19E	47
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)
	568

공시일	2019-10-30
기준일	2019-10-29

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

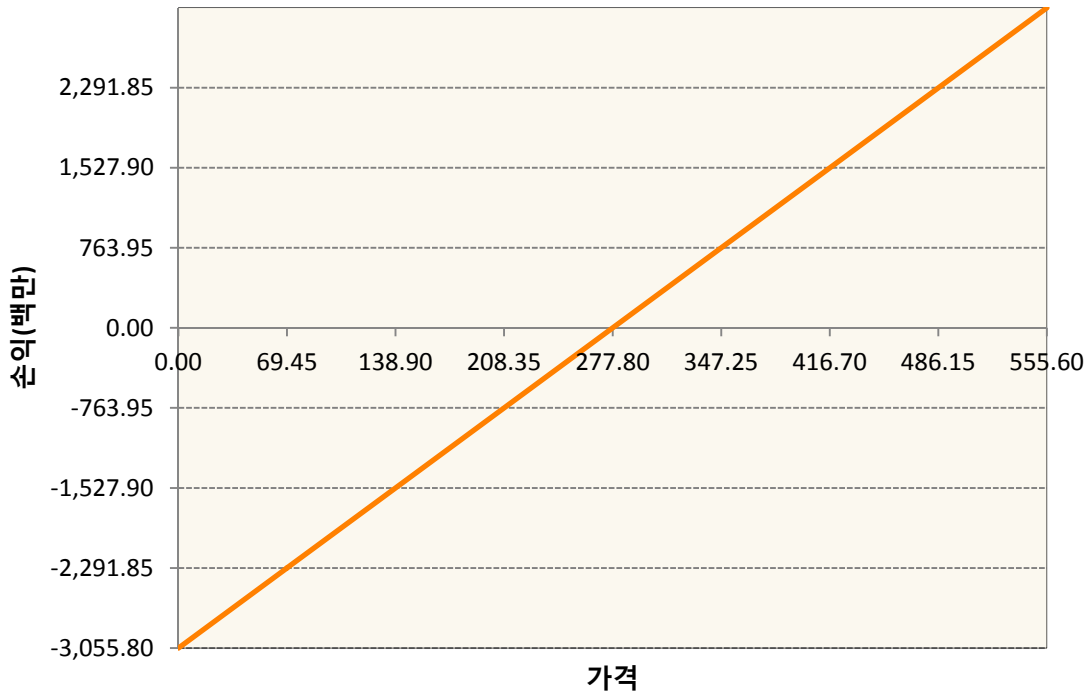
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

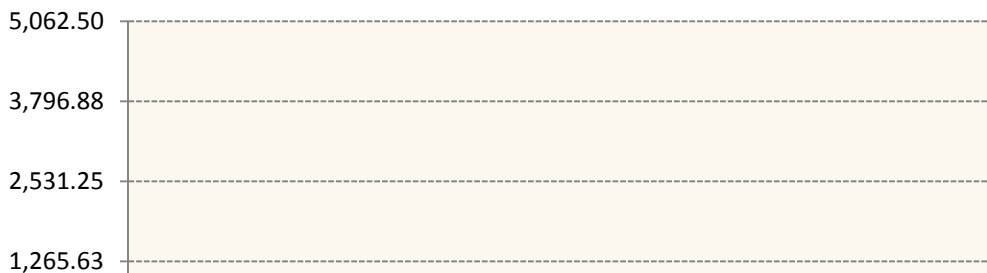
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,056	0	3,056	장내
누계	유가증권	스왑	10,625	0	10,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	10,013	-10,013	장내

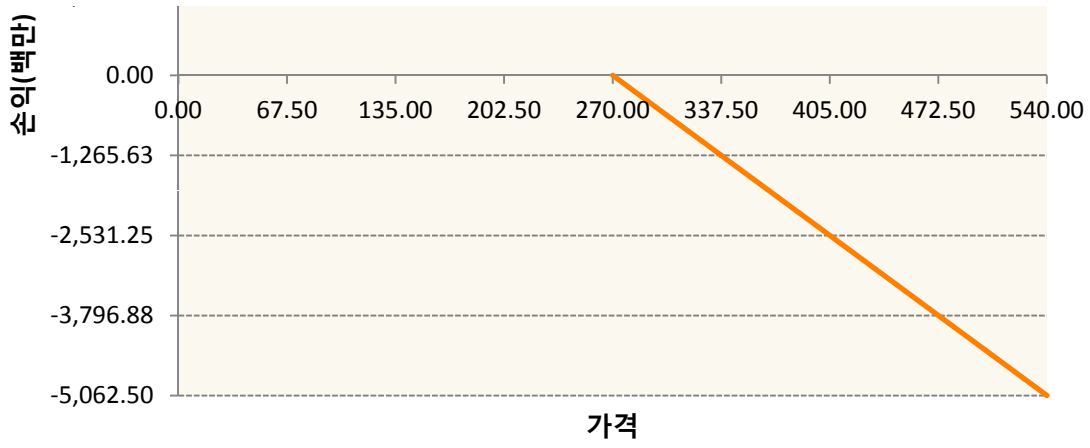
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

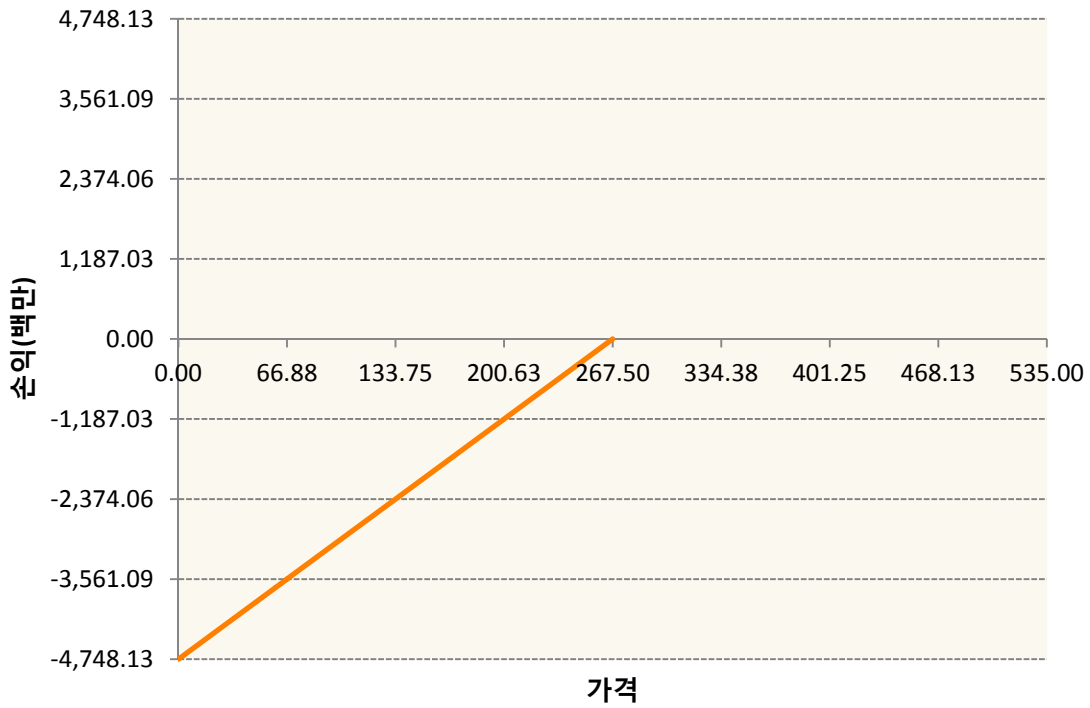


KR4201PB2701-2019-11 콜270

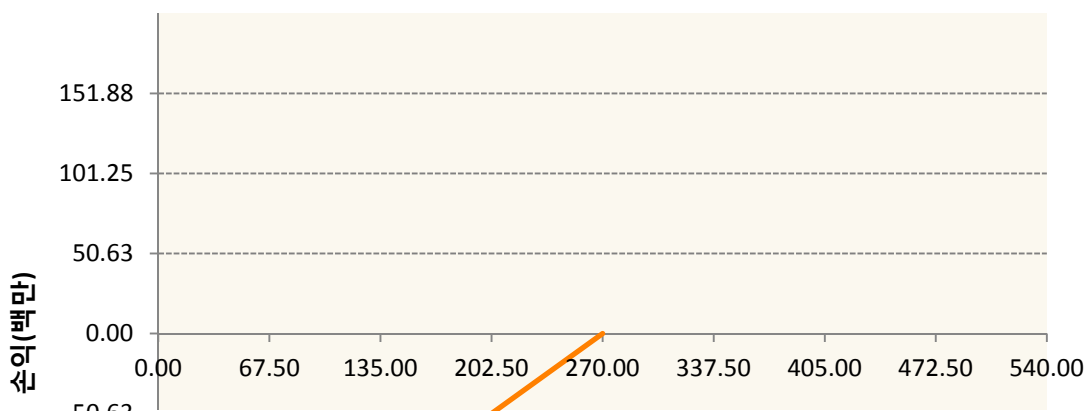




KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



KR4301PB2700-2019-11 풋270





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						911
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-911	-911	-911	-911	-911	-911	-911	
-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%	911	911	911	911	911	911	911	
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						368
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	191	187	182	176	170	163	157	
-5.33%	167	159	150	142	133	125	116	
-2.67%	113	103	94	84	74	64	55	
0%	25	17	9	0	-9	-18	-27	
2.67%	-89	-94	-100	-106	-113	-120	-127	
5.33%	-219	-221	-224	-228	-232	-237	-242	
8.00%	-355	-356	-357	-359	-361	-364	-368	
KR4301PB2676		2019-11 풋267.5						218
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-211	-212	-213	-213	-215	-216	-218
-5.33%	-90	-93	-97	-100	-104	-108	-111
-2.67%	-15	-19	-24	-28	-32	-36	-41
0%	5	3	2	0	-2	-4	-7
2.67%	6	6	6	6	5	5	4
5.33%	6	6	6	6	6	6	6
8.00%	6	6	6	6	6	6	6
KR4301PB2700                      2019-11 풋270							11
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
-5.33%	-5	-5	-5	-5	-6	-6	-6
-2.67%	-1	-1	-2	-2	-2	-2	-2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1	0	0	0	0	0	0
5.33%	1	1	1	1	1	0	0
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

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

(단위:백만원)

**1,657**

공시일	2019-10-30
기준일	2019-10-29

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

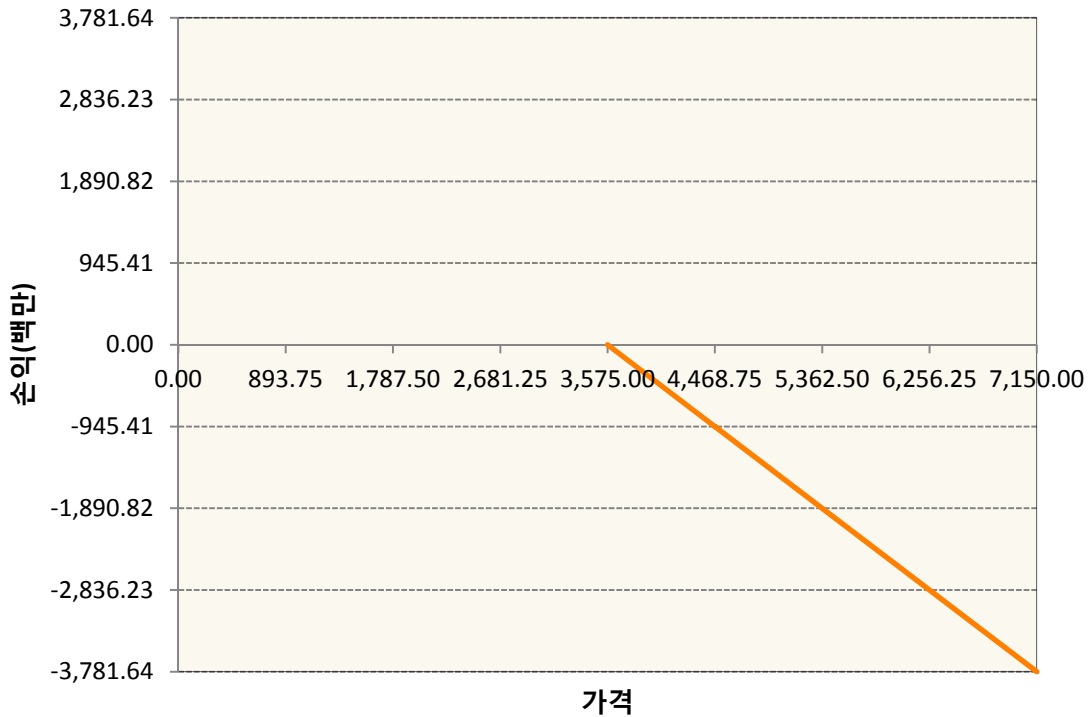
### 1. 계약금액

(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	1,855	0	1,855	
누계	유가증권	스왑	23,554	0	23,554	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,328	-9,328	장내
누계	통화	선도	2,033	6,063	-4,030	장외

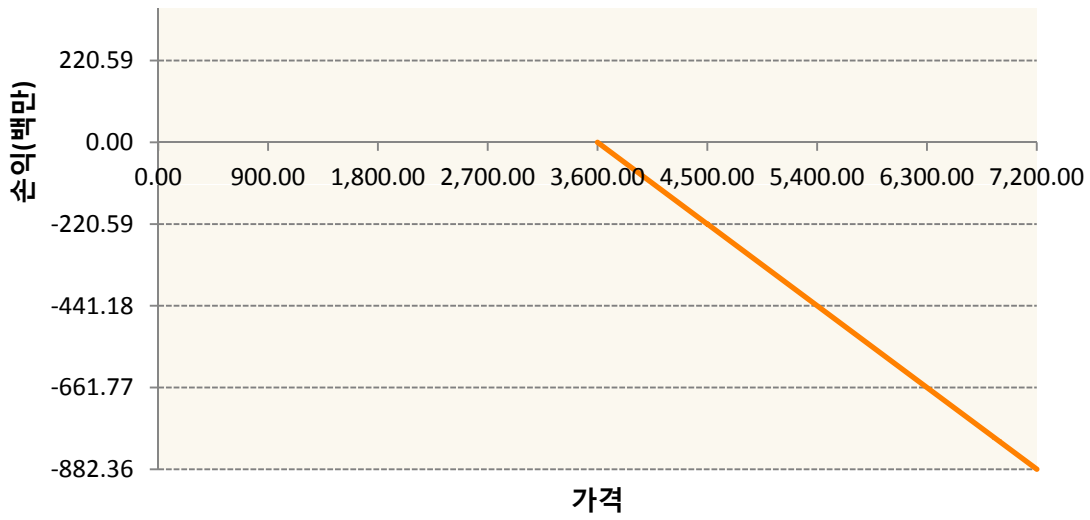
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXX9-C3575-EURO STOXX 50

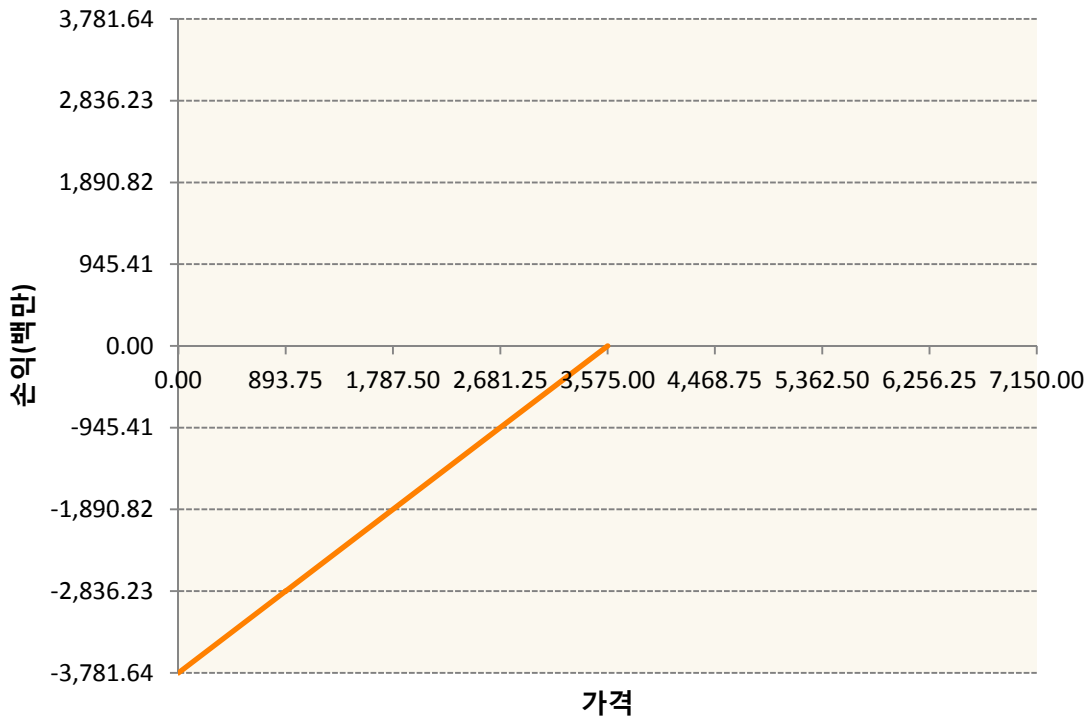


OESXX9-C3600-EURO STOXX 50

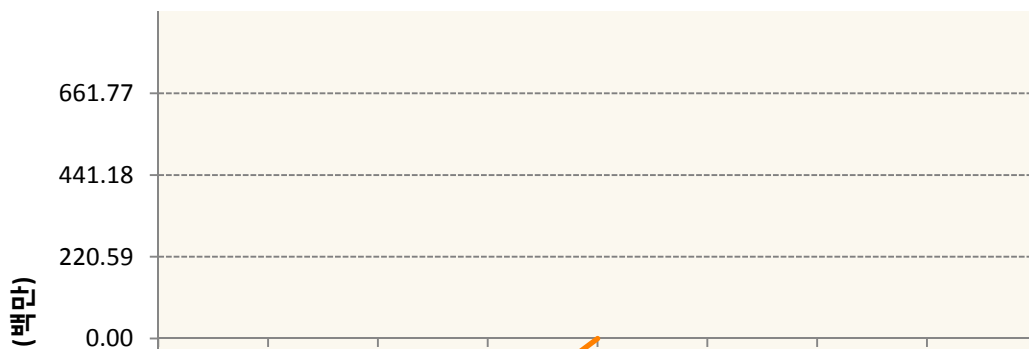


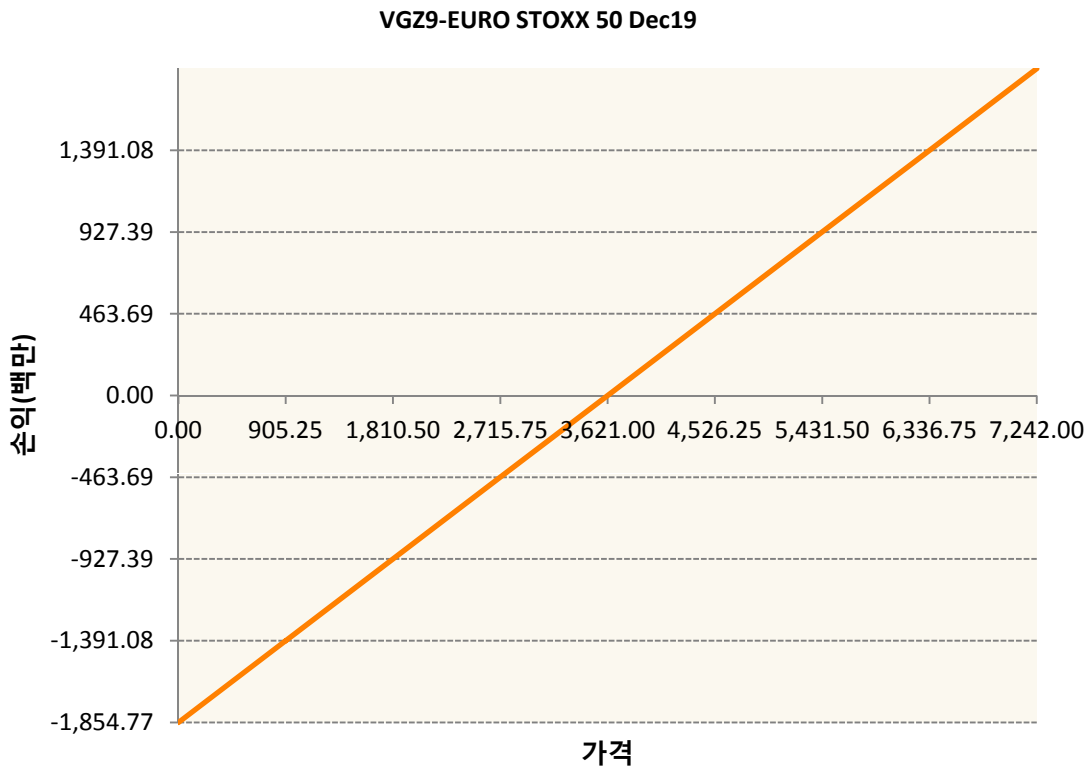
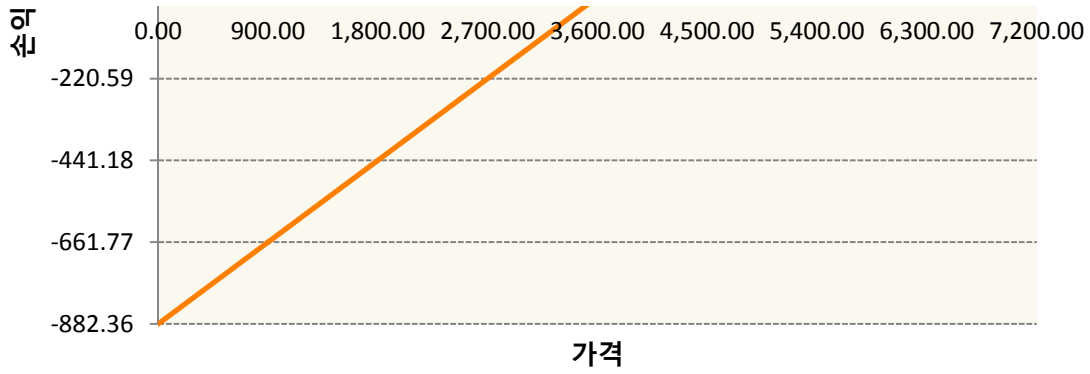


OESXX9-P3575-EURO STOXX 50



OESXX9-P3600-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		19
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E		485
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E		163
OESXX9-C35 EURO STOXX 50		303
OESXX9-C36 EURO STOXX 50		71
OESXX9-P35 EURO STOXX 50		303
OESXX9-P36 EURO STOXX 50		71
VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	148

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

(단위:백만원)

945



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

(단위:백만원)

936



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

(단위:백만원)

81



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

(단위:백만원)

127

공시일	2019-10-30
기준일	2019-10-29

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

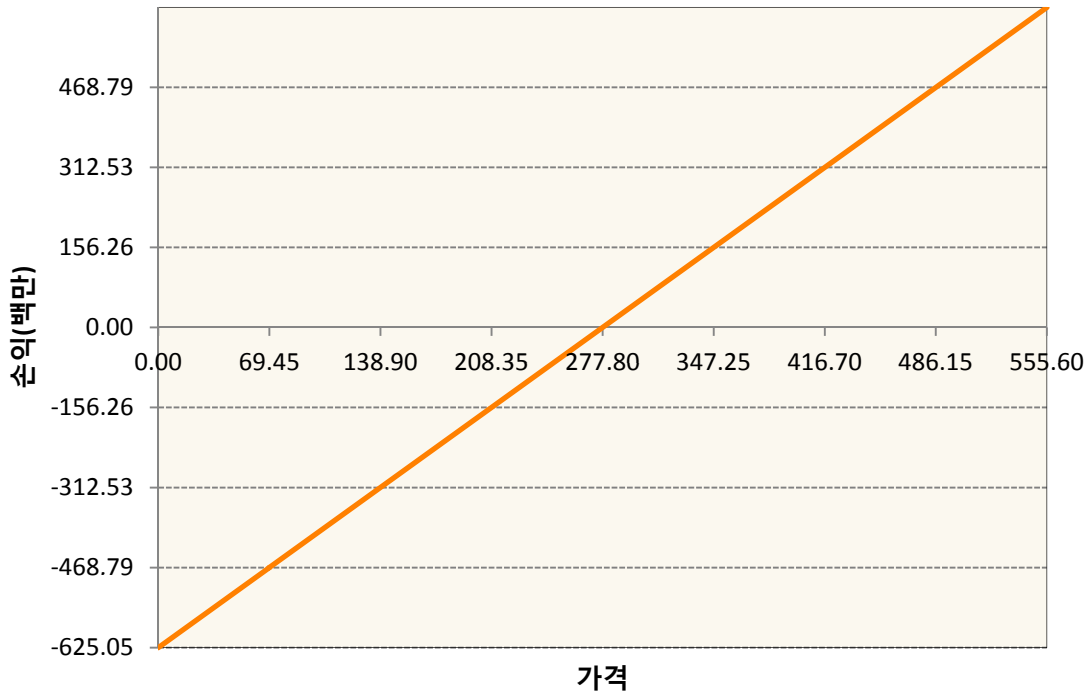
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	625	0	625	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-10-30
기준일	2019-10-29

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

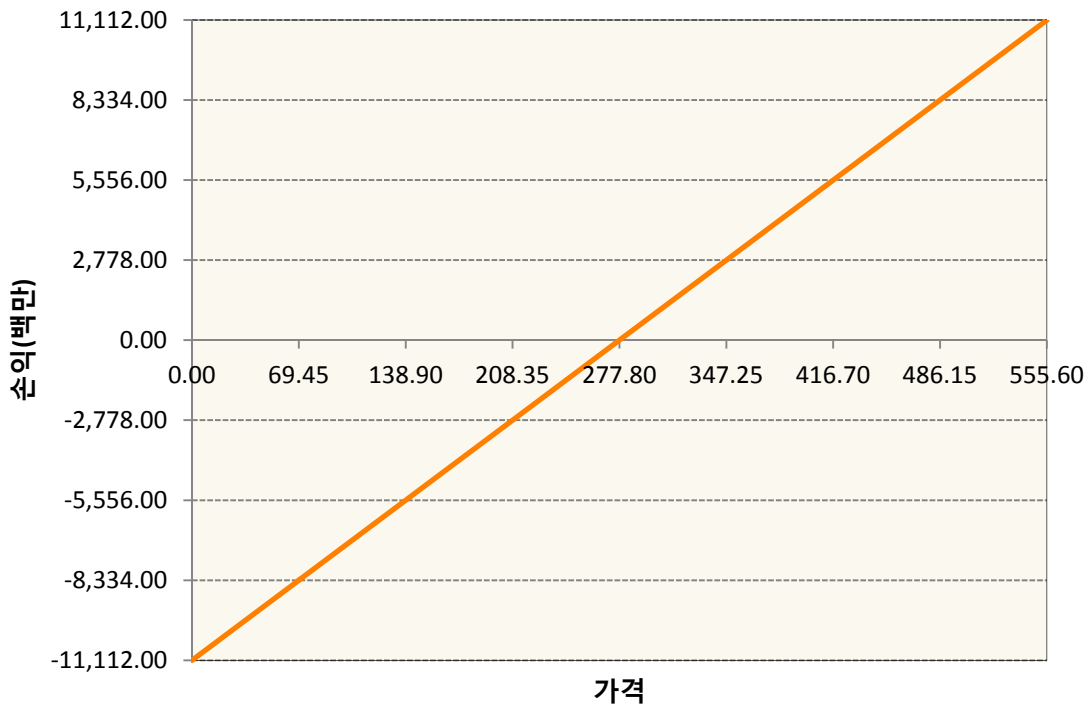
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

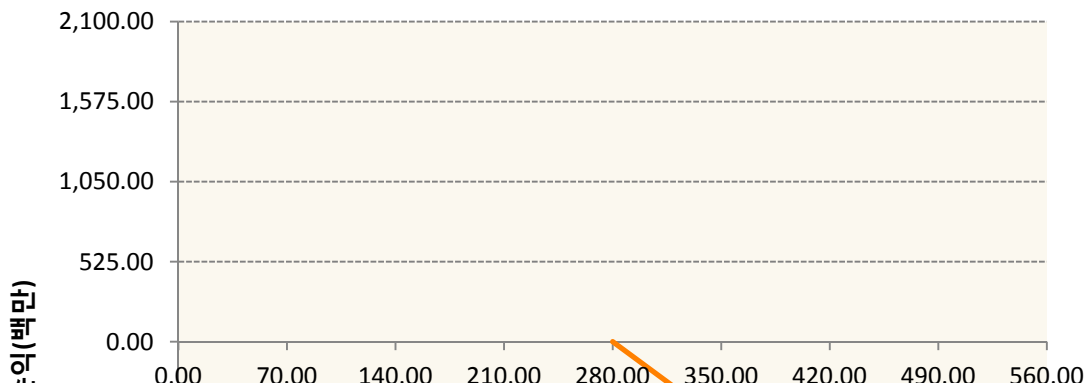
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,112	0	11,112	장내
누계	유가증권	옵션	3,561	20,604	-17,043	장내

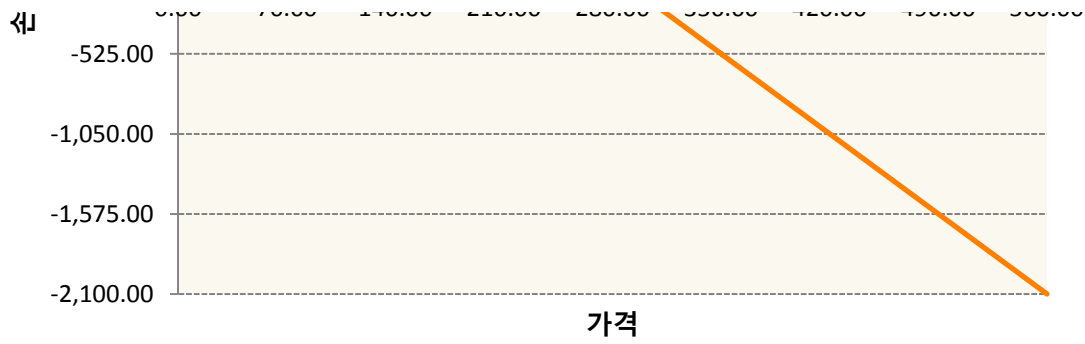
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

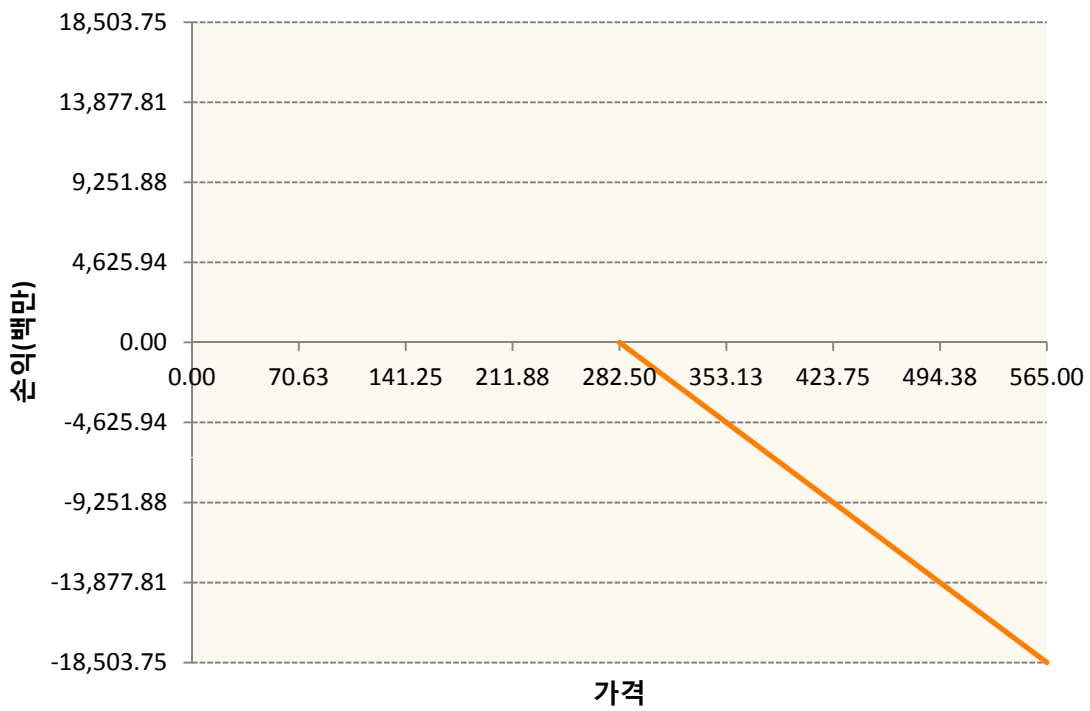


KR4201PB2800-2019-11 콜280

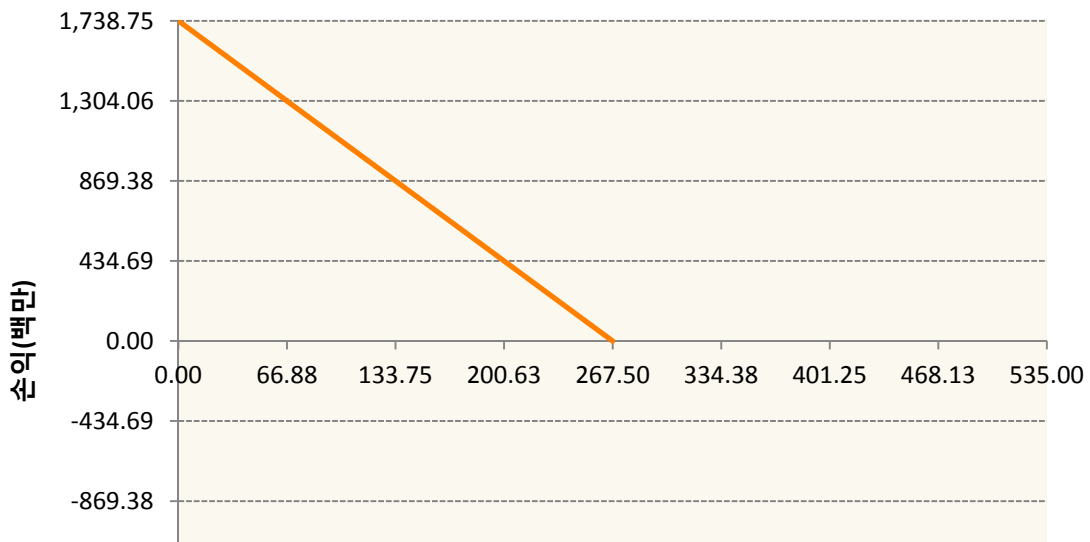


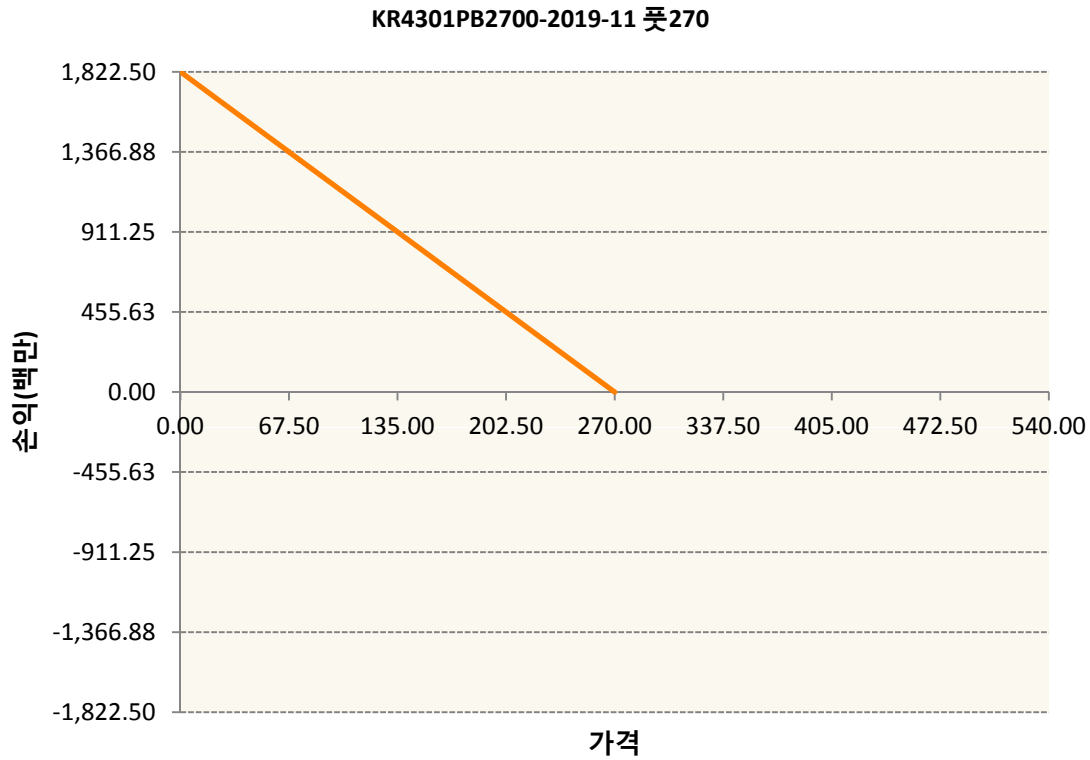
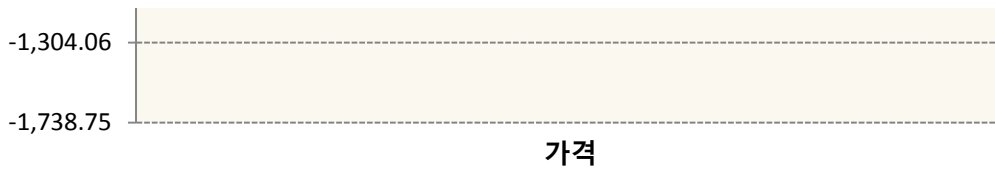


KR4201PB2826-2019-11 콜282.5



KR4301PB2676-2019-11 풋267.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						888
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-888	-888	-888	-888	-888	-888	-888	
-5.33%	-592	-592	-592	-592	-592	-592	-592	
-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%	592	592	592	592	592	592	592	
8.00%	888	888	888	888	888	888	888	
KR4201PB2800		2019-11 콜280						123
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	39	38	37	37	35	34	32	
-5.33%	36	35	33	31	29	27	24	
-2.67%	29	26	23	20	17	13	10	

0%	12	8	4	0	-4	-8	-12
2.67%	-18	-22	-26	-30	-34	-38	-42
5.33%	-61	-63	-66	-69	-72	-76	-79
8.00%	-110	-112	-114	-116	-118	-120	-123
KR4201PB2826                      2019-11 콜282.5							1,006
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	275	272	268	262	253	243	232
-5.33%	263	253	241	227	210	192	172
-2.67%	217	196	173	148	121	94	66
0%	99	66	33	0	-34	-68	-102
2.67%	-126	-161	-197	-232	-267	-303	-338
5.33%	-462	-489	-518	-548	-579	-610	-642
8.00%	-878	-894	-913	-933	-956	-980	-1,006
KR4301PB2676                      2019-11 풋267.5							80
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	77	78	78	78	79	79	80
-5.33%	33	34	35	37	38	39	41
-2.67%	6	7	9	10	12	13	15
0%	-2	-1	-1	0	1	2	3
2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-1
5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
KR4301PB2700                      2019-11 풋270							96
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	95	95	95	95	96	96	96
-5.33%	47	47	48	49	50	52	53
-2.67%	11	12	14	16	17	19	21
0%	-3	-2	-1	0	1	2	4
2.67%	-5	-4	-4	-4	-4	-3	-3
5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-4	-4
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5

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

(단위:백만원)

**1,842**

공시일	2019-10-30
기준일	2019-10-29

## 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	159,207	0	159,207	

### 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	2019-10-30
기준일	2019-10-29

## 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	206,554	0	206,554	

### 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	2019-10-30
기준일	2019-10-29

## 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	416,283	0	416,283	
누계	통화	선도	0	474,620	-474,620	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E		1,861
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E		1,954
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E		930
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		651
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E		1,526
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		688
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E		1,675
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		2,456
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		465
FX21019V02 KRW/USD 21-11-19E		5,061
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,745
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,396
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,791
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,498
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,828
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		930
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		930
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,861
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,861
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		930
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		930

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

(단위:백만원)

**12,092**

공시일	2019-10-30
기준일	2019-10-29

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

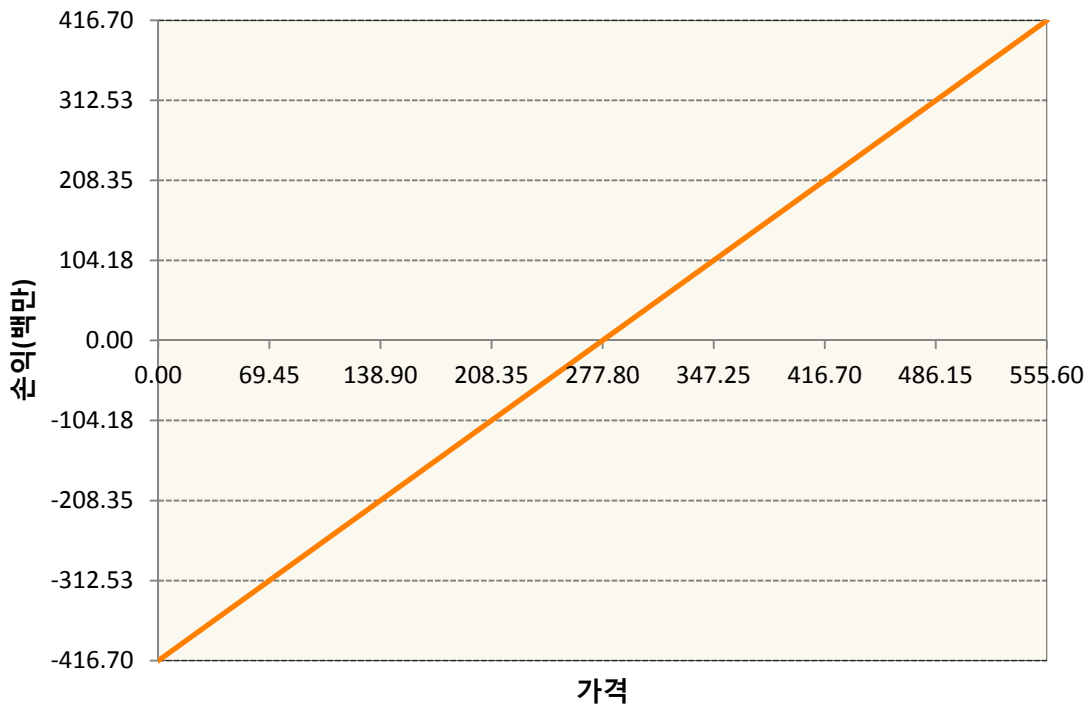
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

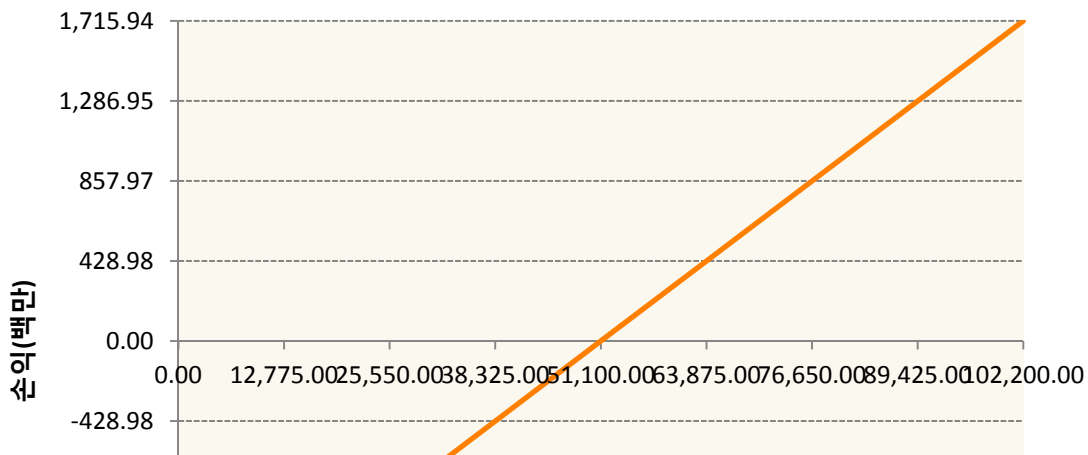
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,133	0	2,133	장내

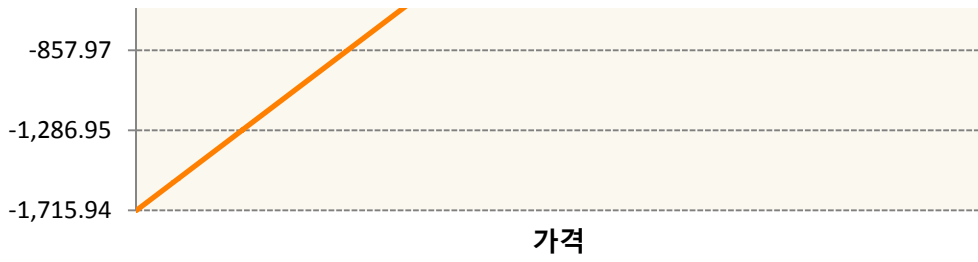
### 2. 만기시점의 손익구조

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						137
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-137	-137	-137	-137	-137	-137	-137	
-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%	137	137	137	137	137	137	137	

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

**184**

공시일	2019-10-30
기준일	2019-10-29

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

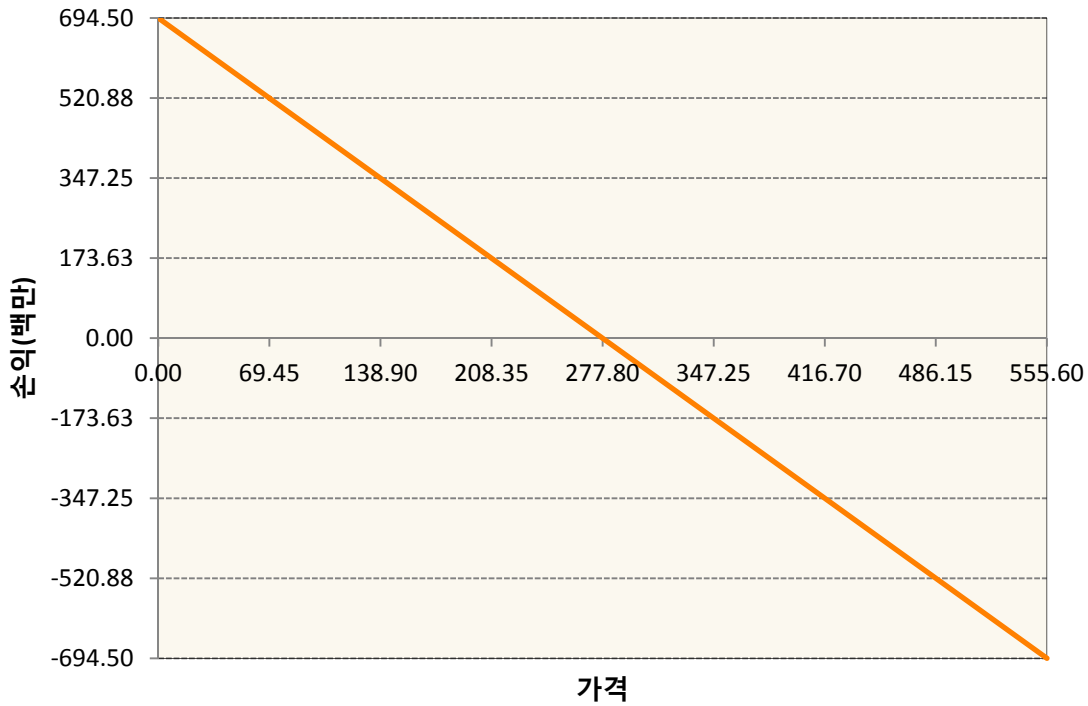
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

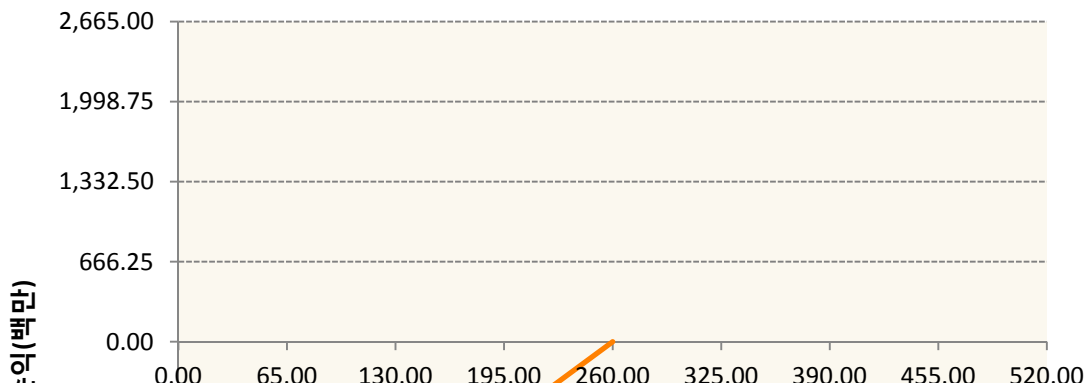
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	695	-695	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,715	-3,715	장내

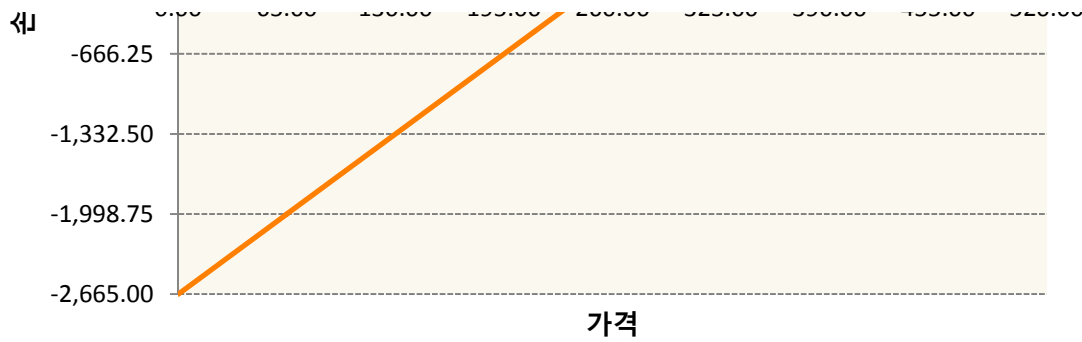
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

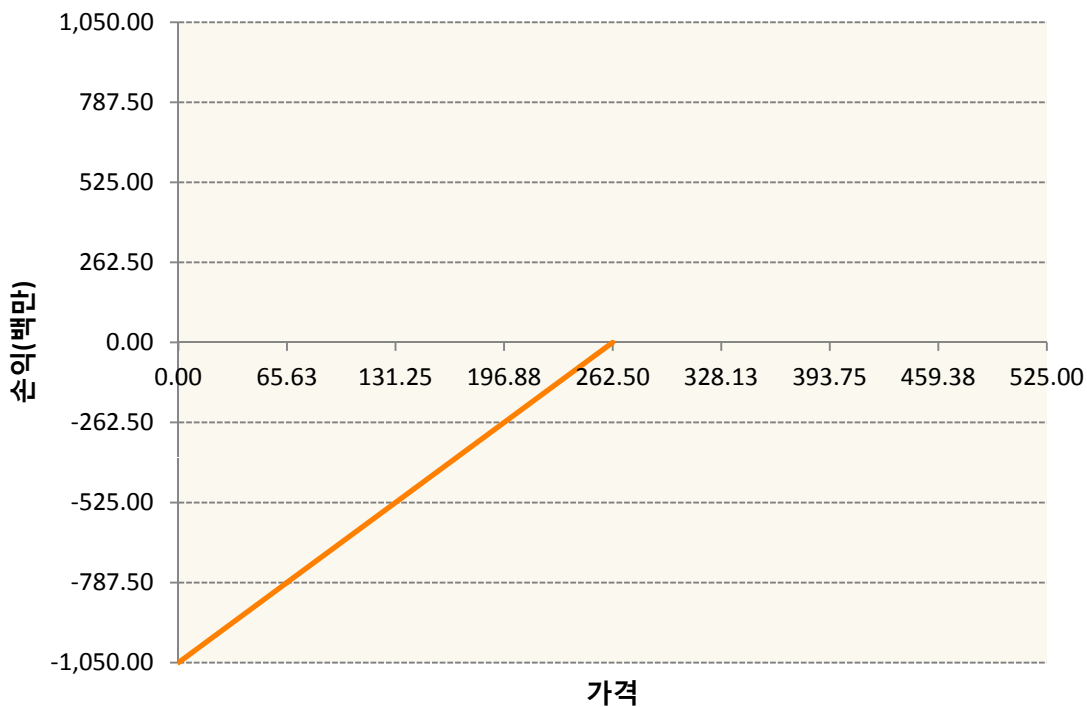


KR4301PB2601-2019-11 풋260





KR4301PB2627-2019-11 풋262.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						56
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	56	56	56	56	56	56	56	
-5.33%	37	37	37	37	37	37	37	
-2.67%	19	19	19	19	19	19	19	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
5.33%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37	
8.00%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56	
KR4301PB2601		2019-11 풋260						66
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-54	-56	-58	-60	-62	-64	-66
-5.33%	-11	-14	-16	-18	-21	-23	-25
-2.67%	-1	-1	-2	-3	-4	-5	-7
0%	0	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

KR4301PB2627

2019-11 풋262.5

33

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-30	-30	-31	-31	-32	-32	-33
-5.33%	-8	-9	-10	-11	-12	-13	-14
-2.67%	-1	-1	-2	-2	-3	-3	-4
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

76

공시일	2019-10-30
기준일	2019-10-29

## 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	16,276	0	16,276	
누계	통화	선도	0	16,003	-16,003	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019V01 KRW/USD 10-12-19E		368
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		316
FX21019V02 KRW/USD 13-11-19E		279
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		316

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

(단위:백만원)

<b>408</b>
------------

공시일	2019-10-30
기준일	2019-10-29

## 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	685	0	685	장외
누계	통화	선도	200	239	-39	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	36
2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	18
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
FX21019V03 EUR/KRW 22-11-19E	14
FX21019V04 KRW/EUR 31-01-20E	3

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

(단위:백만원)

<b>60</b>
-----------

공시일	2019-10-30
기준일	2019-10-29

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

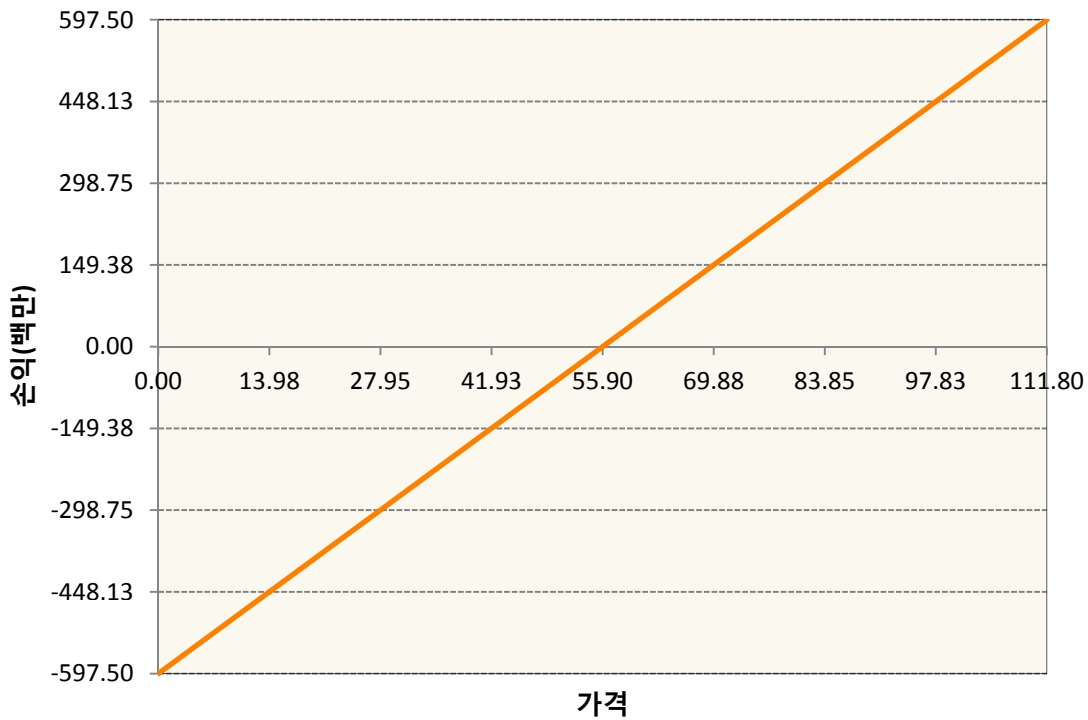
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

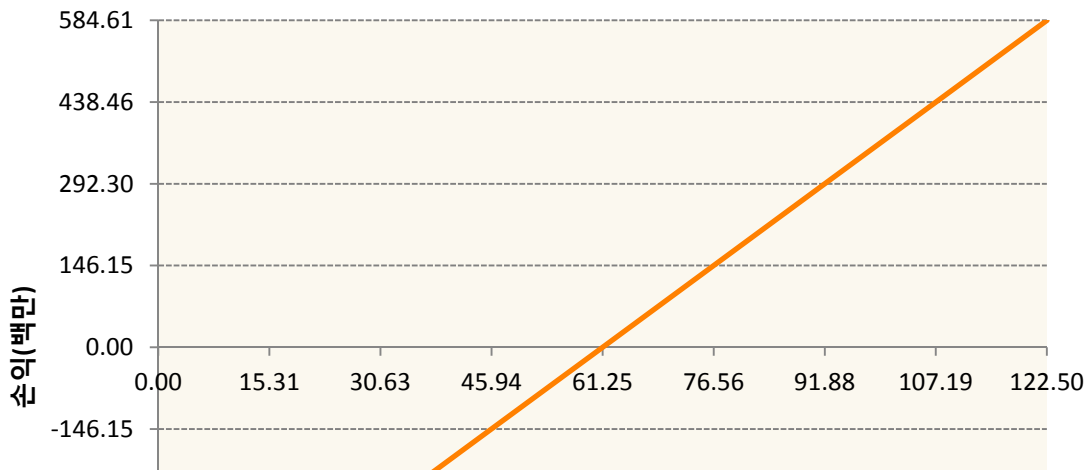
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,486	291	2,196	

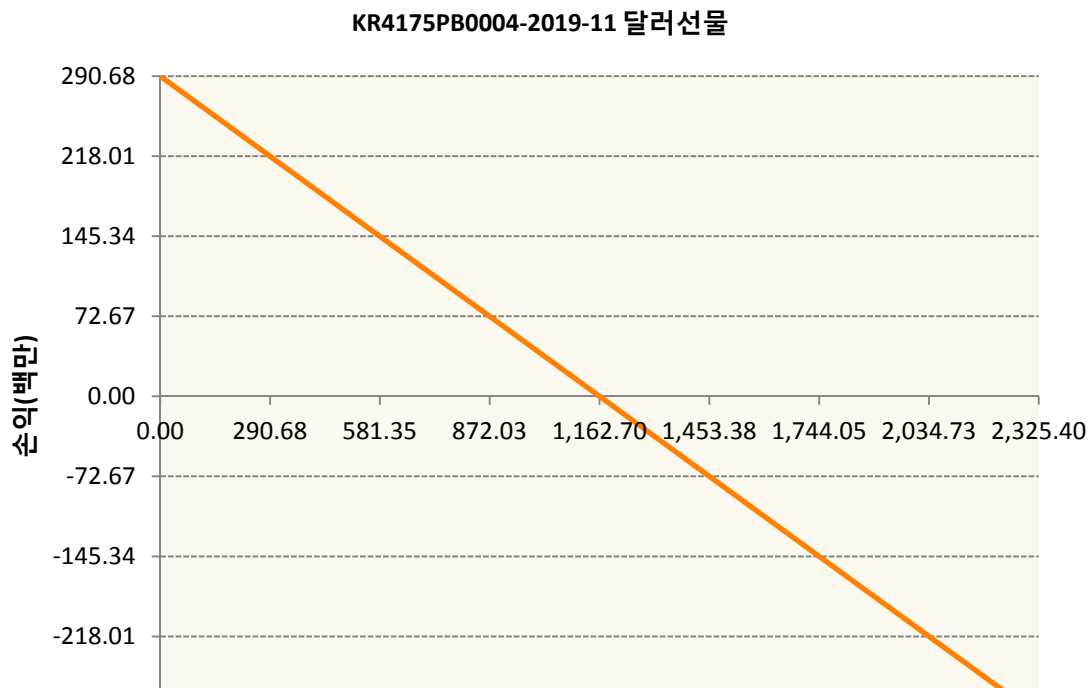
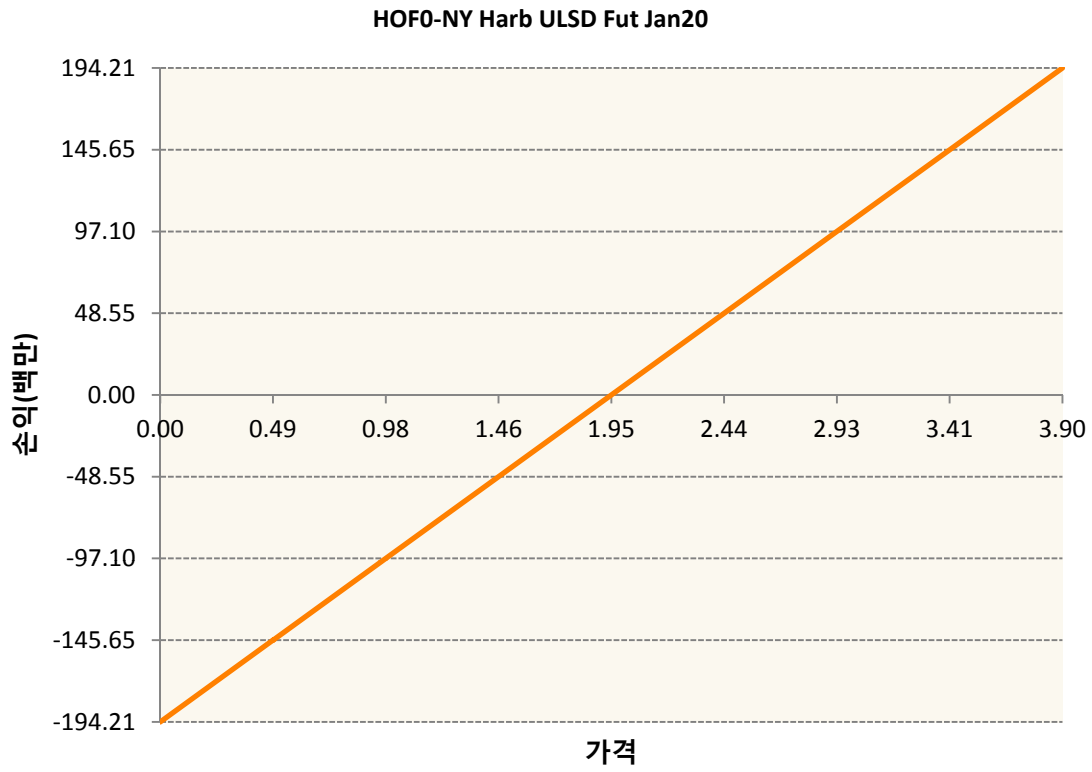
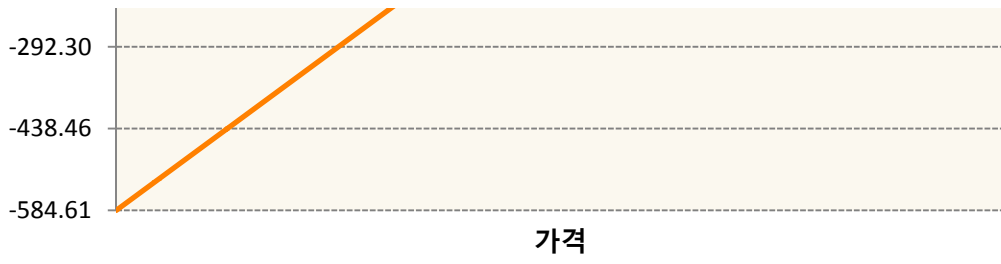
### 2. 만기시점의 손익구조

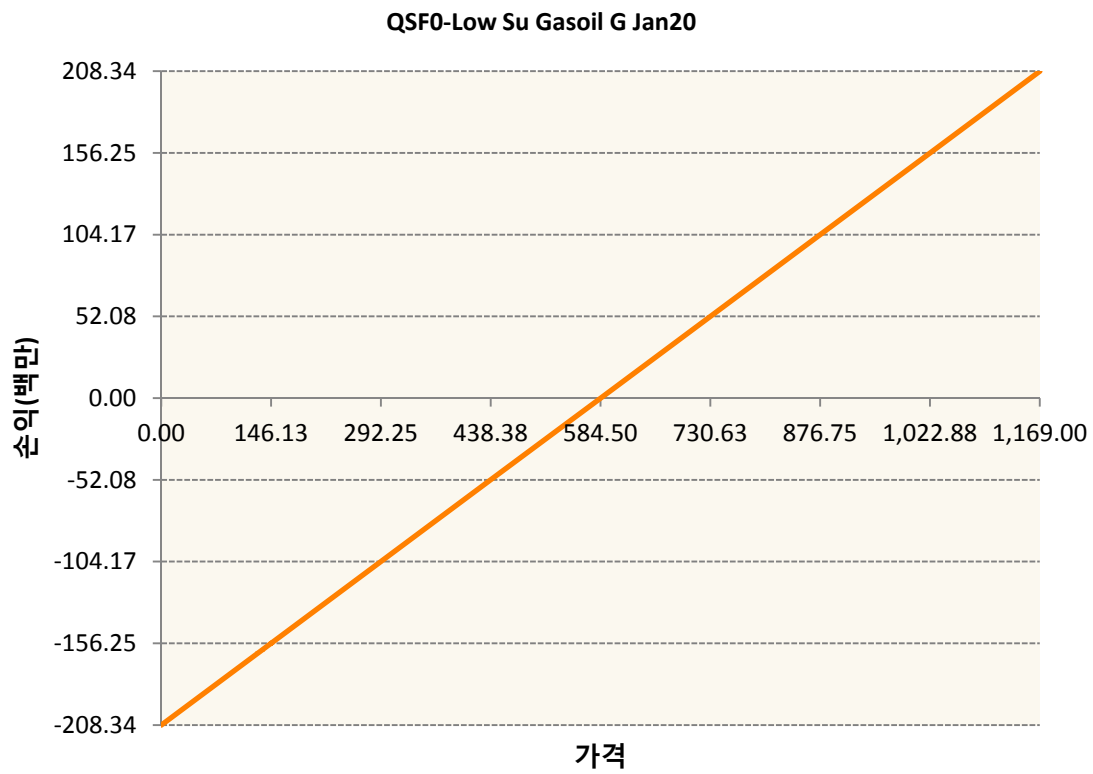
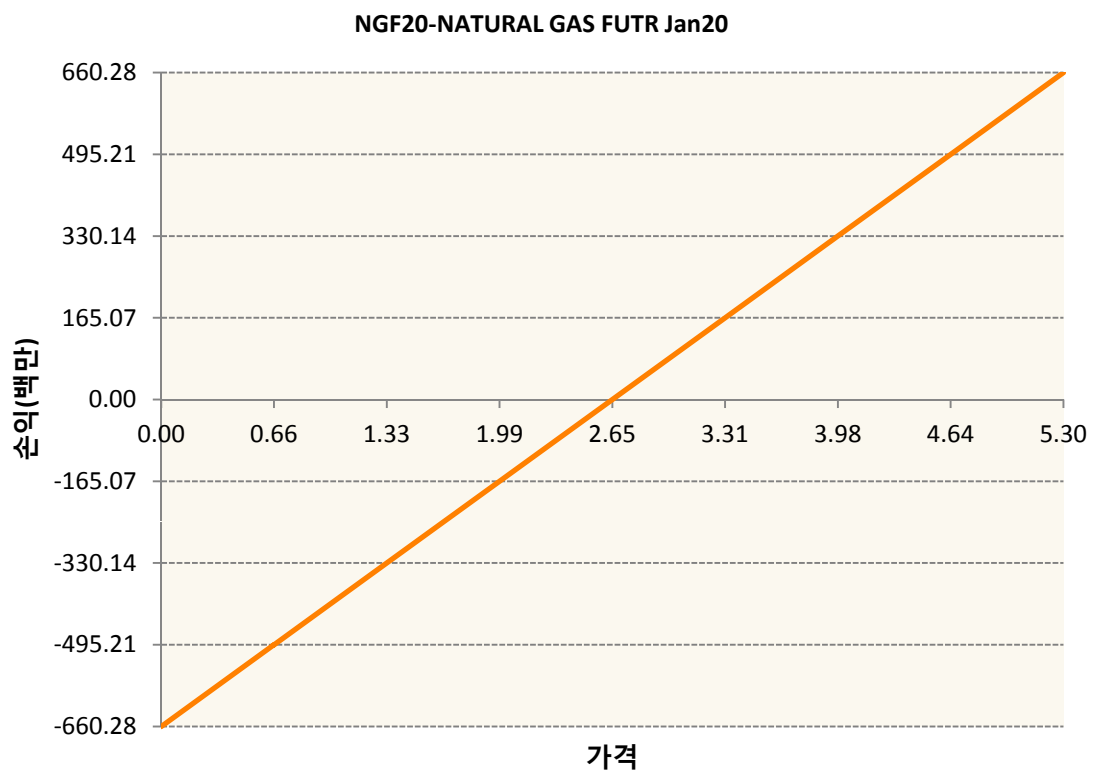
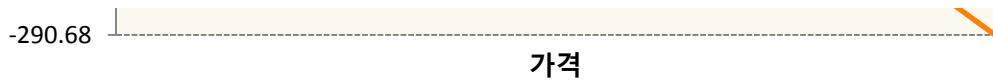
CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20



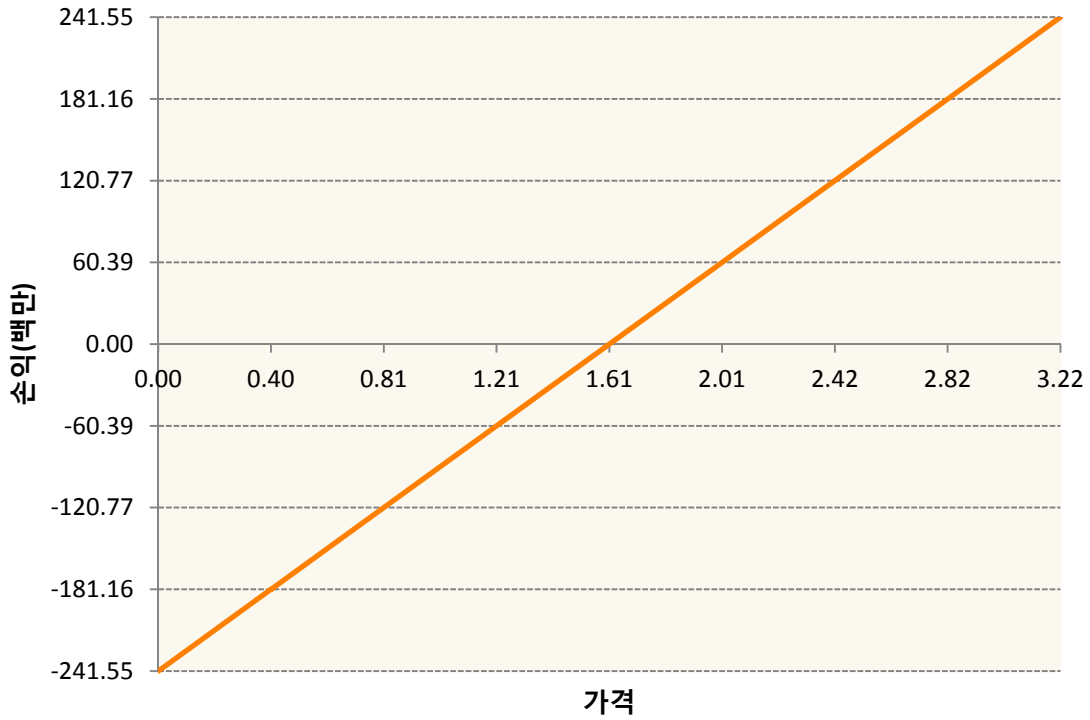
COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20







XBF0-GASOLINE RBOB FUT Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF0	WTI CRUDE FUTURE Jan20	48
COF0	BRENT CRUDE FUTR Jan20	47
HOF0	NY Harb ULSD Fut Jan20	16
KR4175PB00	2019-11 달러선물	23
NGF20	NATURAL GAS FUTR Jan20	53
QSF0	Low Su Gasoil G Jan20	17
XBF0	GASOLINE RBOB FUT Jan20	19

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

413

공시일	2019-10-30
기준일	2019-10-29

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

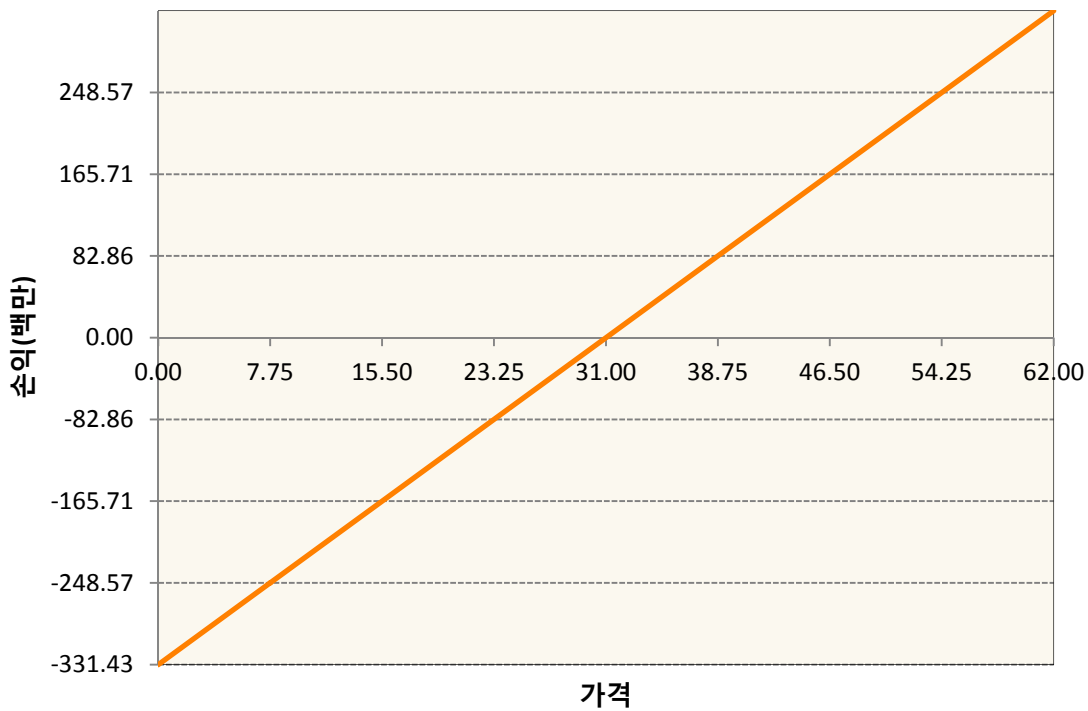
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

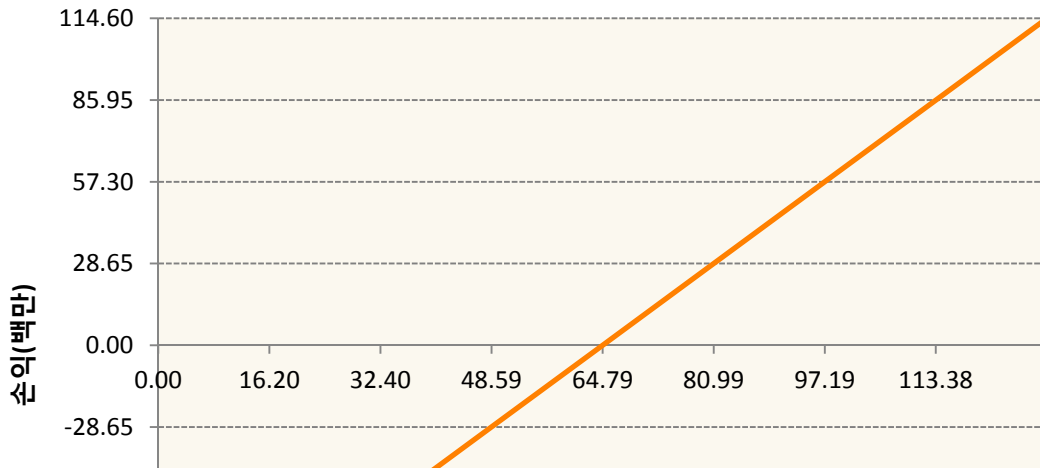
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,862	93	2,769	

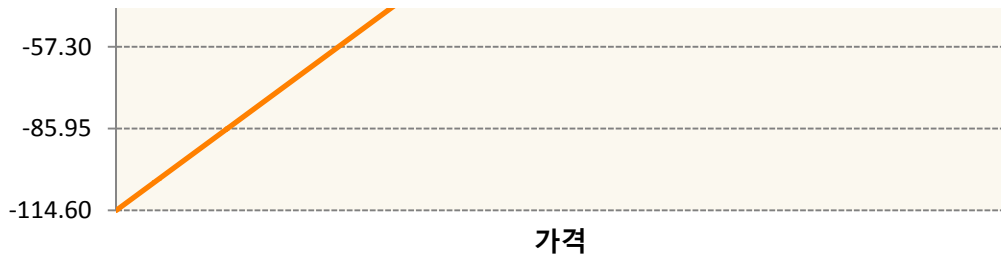
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20**

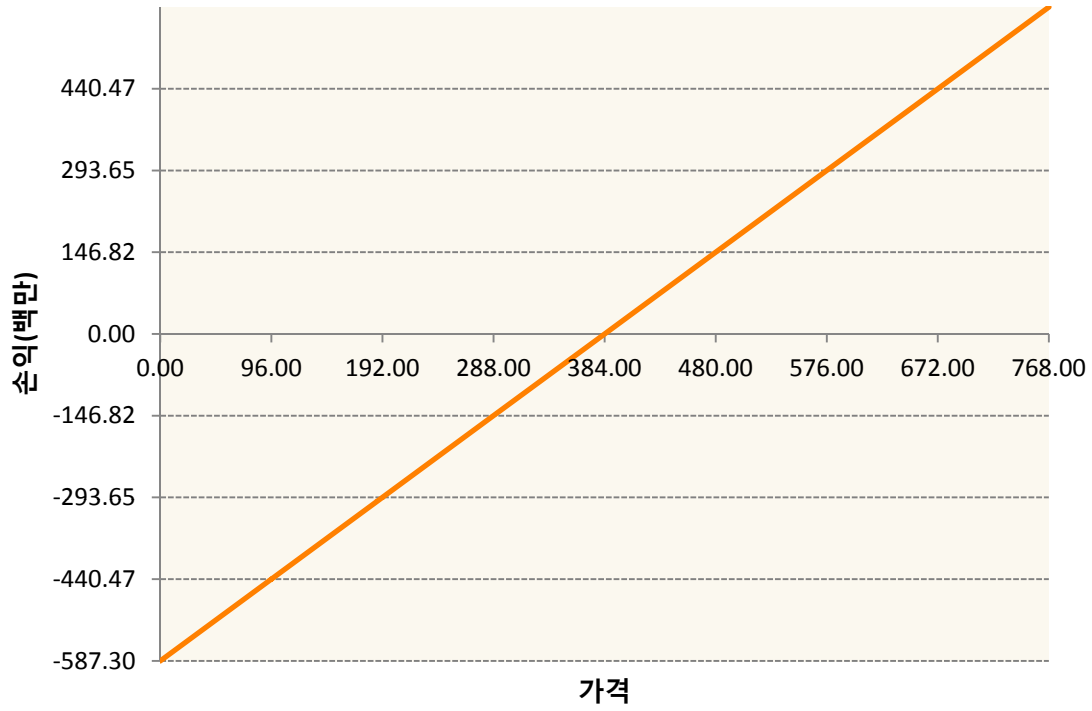


**CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19**

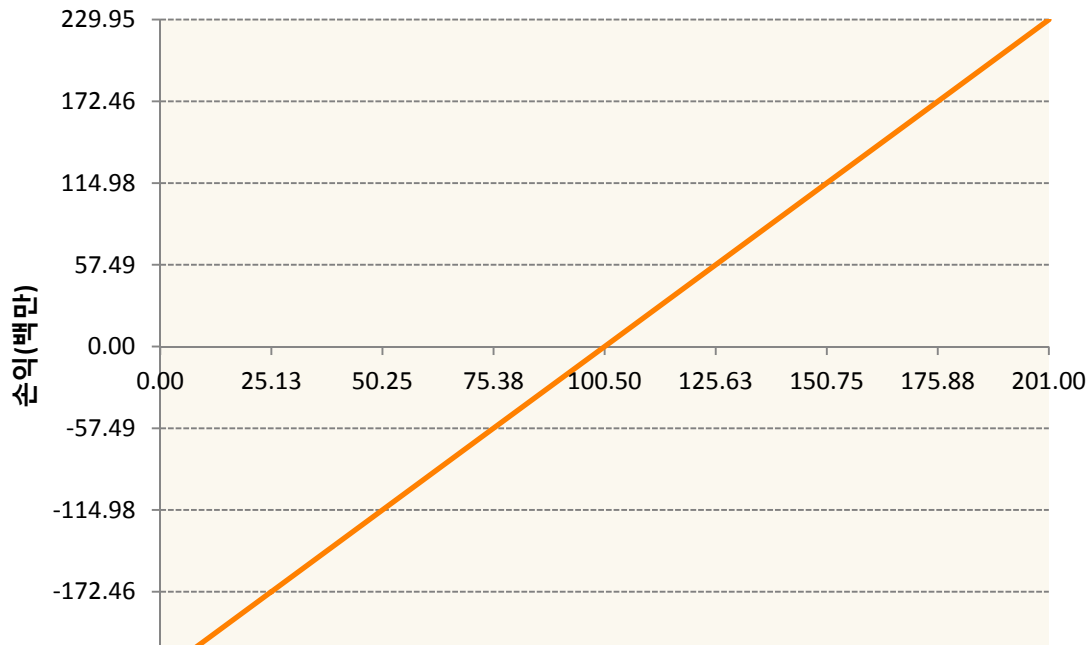


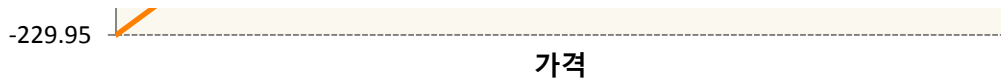


**CZ9-CORN FUTURE Dec19**

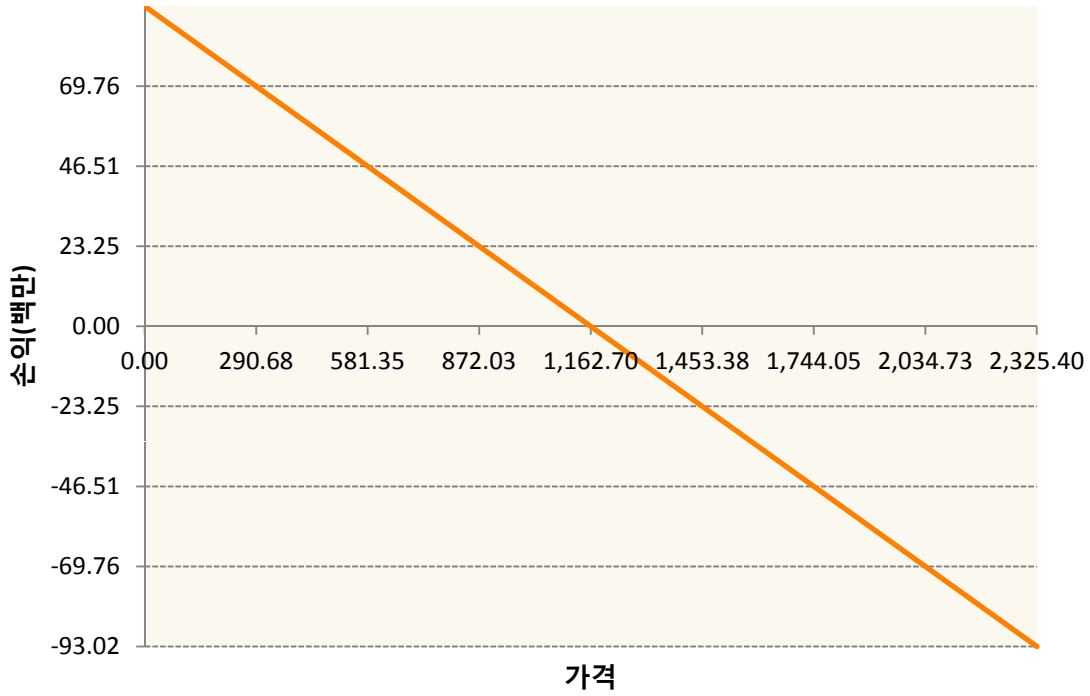


**KC9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19**

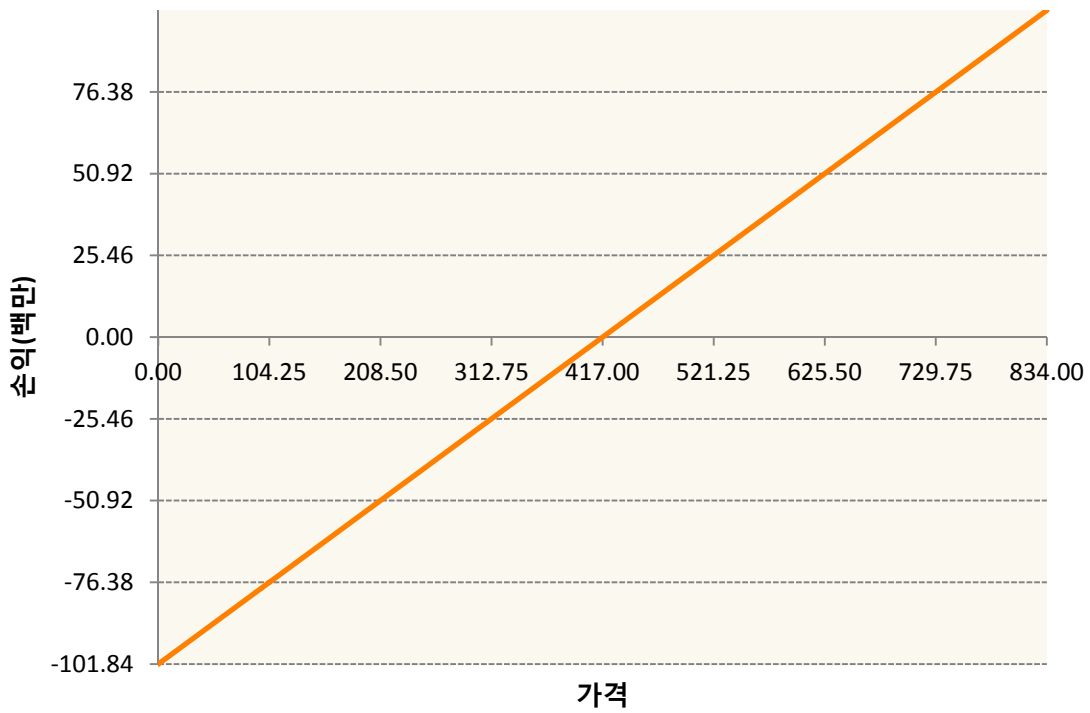




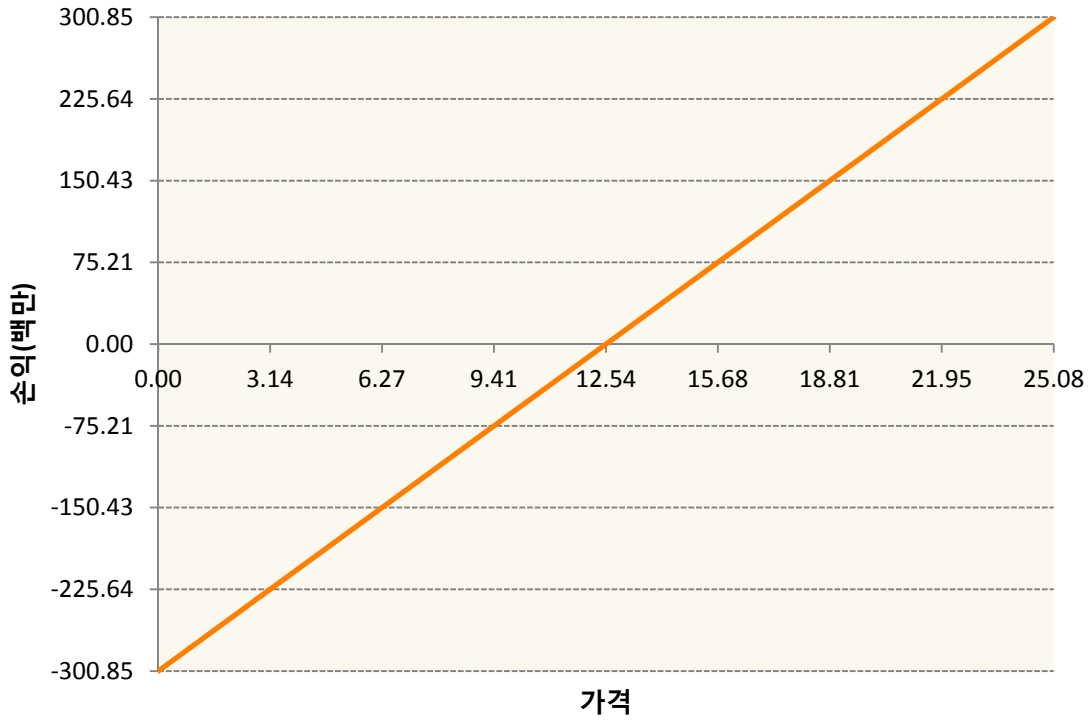
**KR4175PB0004-2019-11 달러선물**



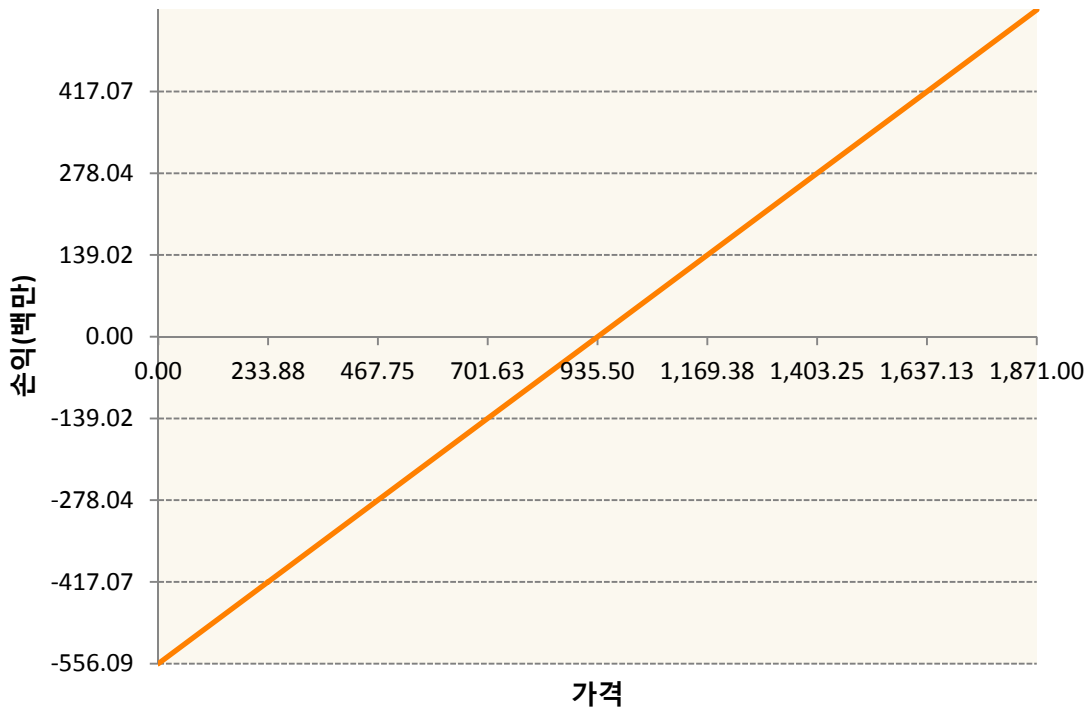
**KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19**



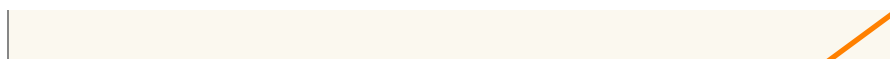
SBH0-Sugar Mar20

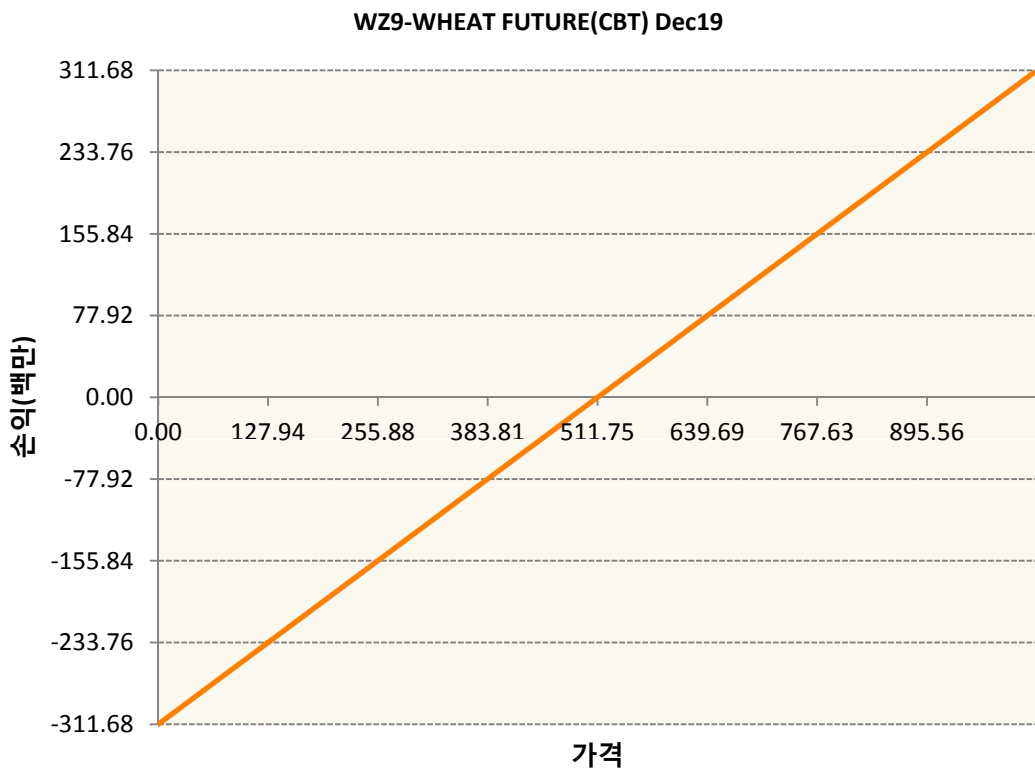
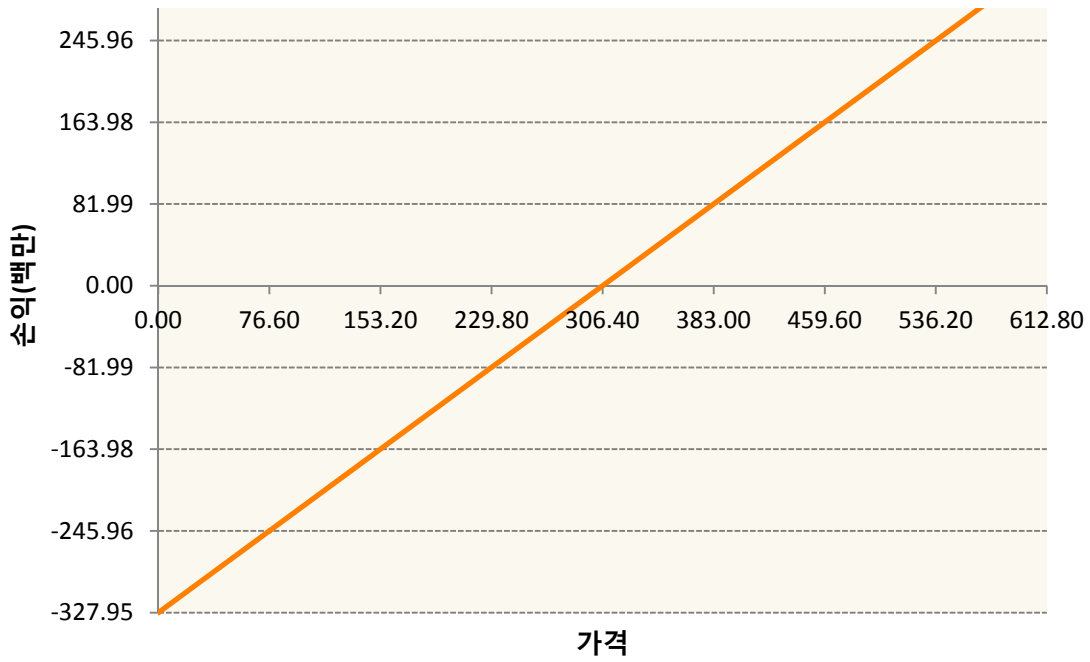


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20



SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BOF0	SOYBEAN OIL FUTR Jan20	27
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	44
SMF0	SOYBEAN MEAL FUTR Jan20	26
WZ9	WHEAT FUTURE(CBT) Dec19	25

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

(단위:백만원)

**255**